공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3	0	3	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	12,516	0	12,516	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S200522	1,078

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,289

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,304	0	7,304	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S200610	604

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

874

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

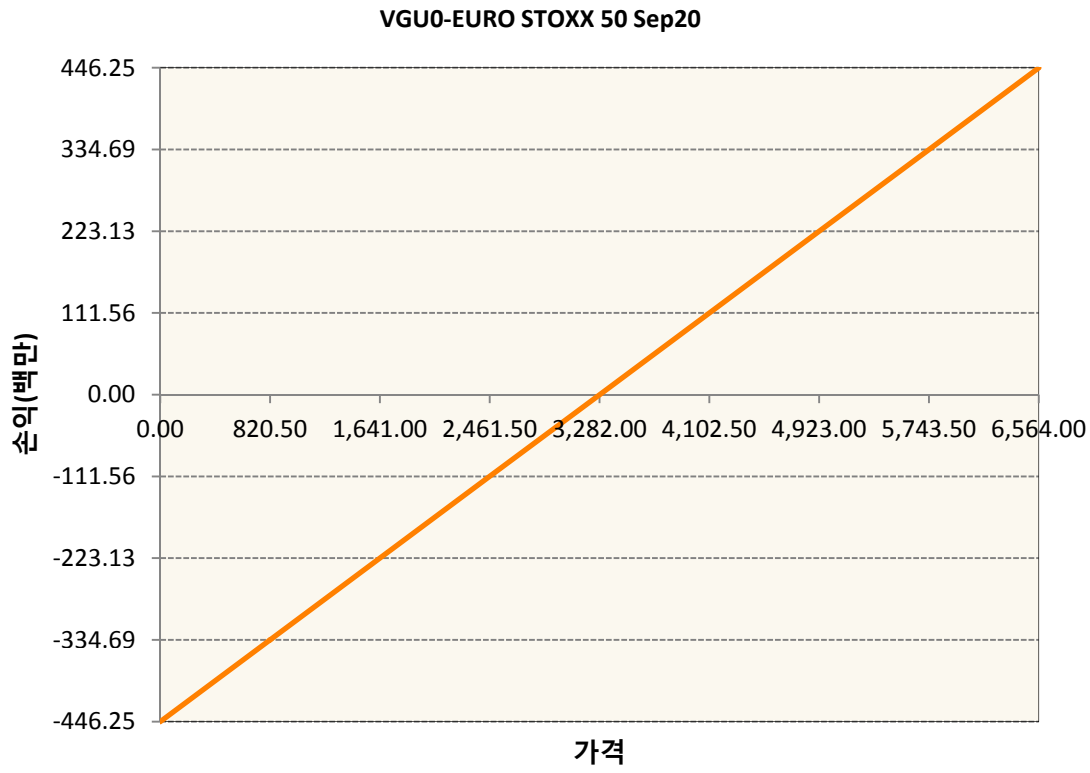
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	446	0	446	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU0	EURO STOXX 50 Sep20	36

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

48

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

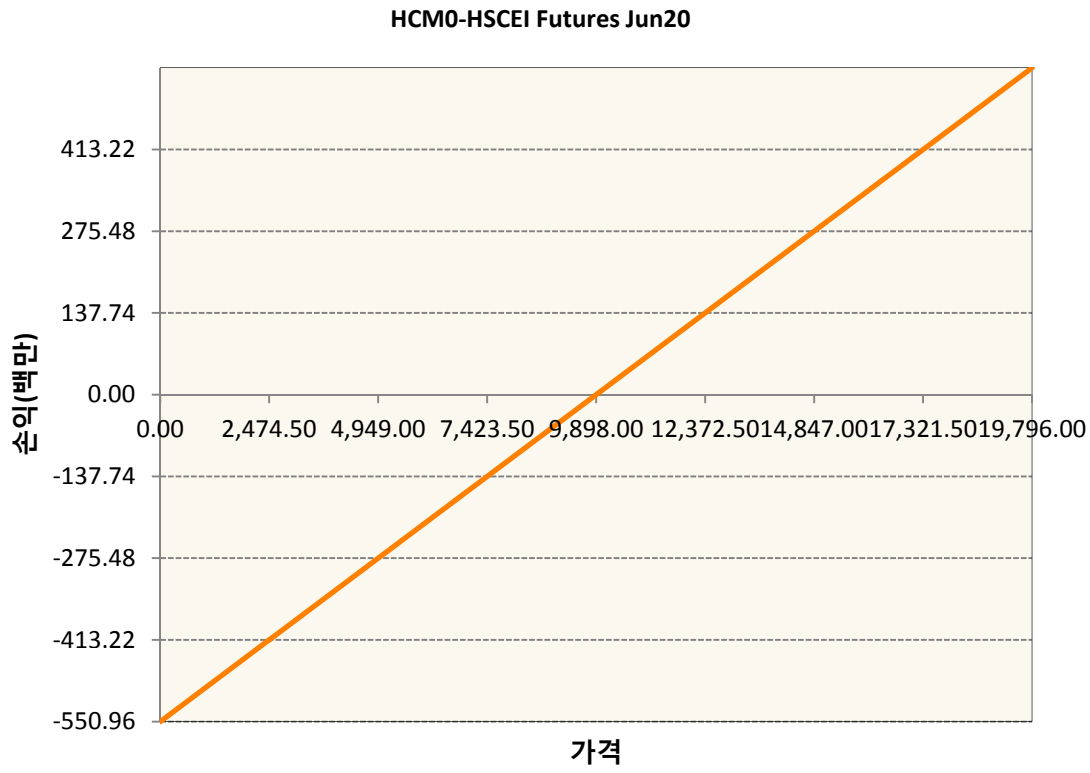
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	551	0	551	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM0	HSCEI Futures Jun20	44

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

48

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

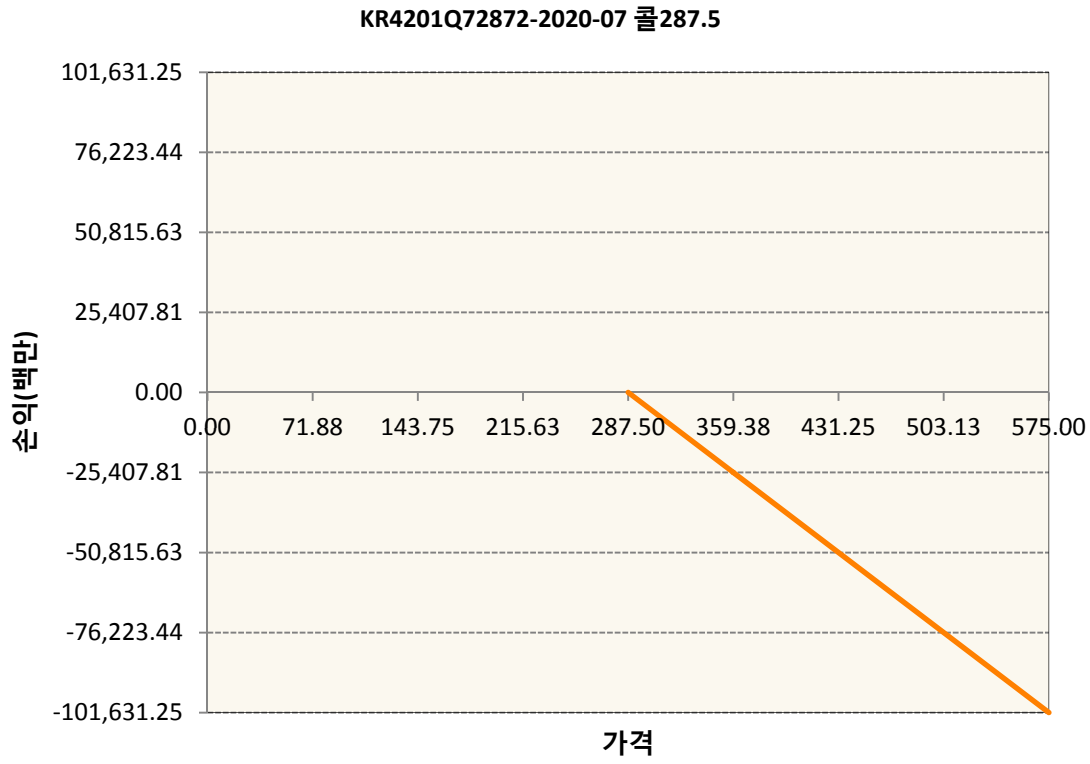
커버드콜모(주식혼합-파생형)

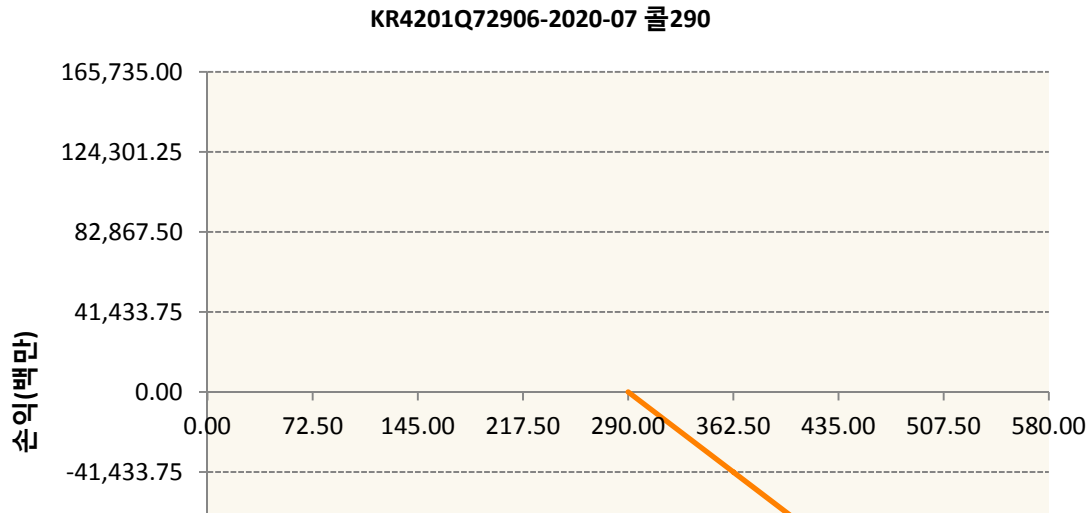
1. 계약금액

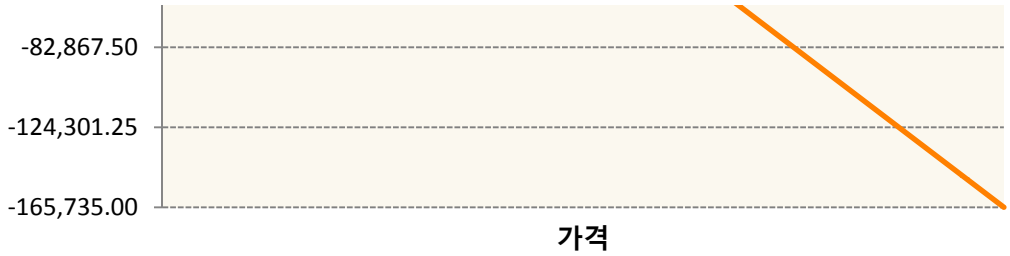
(단위:백만원)

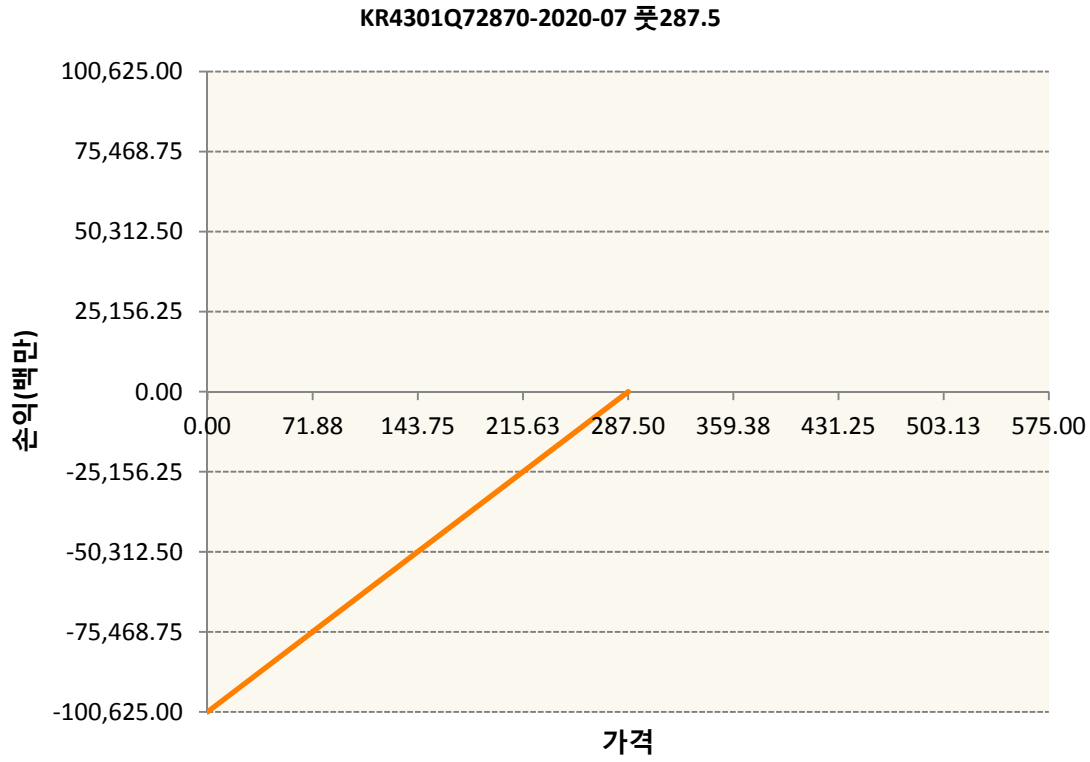
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872	2020-07 콜287.5						6,119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,241	3,091	2,921	2,735	2,534	2,322	2,099
-5.33%	2,811	2,588	2,353	2,107	1,853	1,592	1,326
-2.67%	2,068	1,784	1,496	1,205	911	615	318
0%	938	626	313	0	-313	-626	-938
2.67%	-598	-900	-1,205	-1,512	-1,821	-2,130	-2,441
5.33%	-2,507	-2,766	-3,034	-3,311	-3,595	-3,883	-4,175
8.00%	-4,715	-4,912	-5,128	-5,359	-5,603	-5,857	-6,119
KR4201Q72906	2020-07 콜290						9,527
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,727	4,517	4,273	3,999	3,699	3,378	3,039

-5.33%	4,155	3,828	3,476	3,103	2,714	2,311	1,897
-2.67%	3,126	2,691	2,244	1,789	1,327	860	388
0%	1,508	1,006	504	0	-504	-1,009	-1,514
2.67%	-762	-1,268	-1,775	-2,284	-2,793	-3,303	-3,814
5.33%	-3,657	-4,108	-4,570	-5,042	-5,521	-6,006	-6,496
8.00%	-7,076	-7,434	-7,818	-8,223	-8,645	-9,080	-9,527
KR4301Q72870			2020-07 풋287.5				6,205

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,777	-5,817	-5,870	-5,937	-6,016	-6,105	-6,205
-5.33%	-3,274	-3,371	-3,483	-3,605	-3,737	-3,877	-4,024
-2.67%	-1,076	-1,243	-1,415	-1,592	-1,773	-1,957	-2,143
0%	615	410	205	0	-205	-410	-615
2.67%	1,707	1,520	1,330	1,137	942	745	547
5.33%	2,283	2,155	2,014	1,864	1,706	1,541	1,371
8.00%	2,528	2,460	2,376	2,278	2,168	2,046	1,915

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

19,951

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

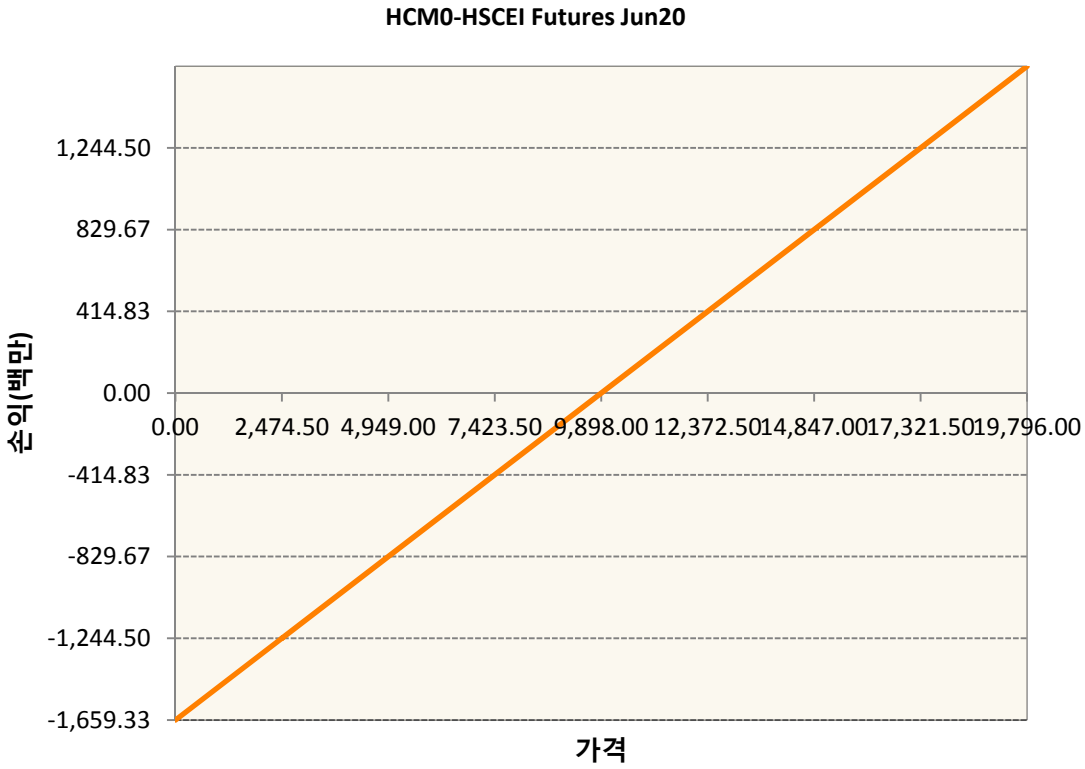
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

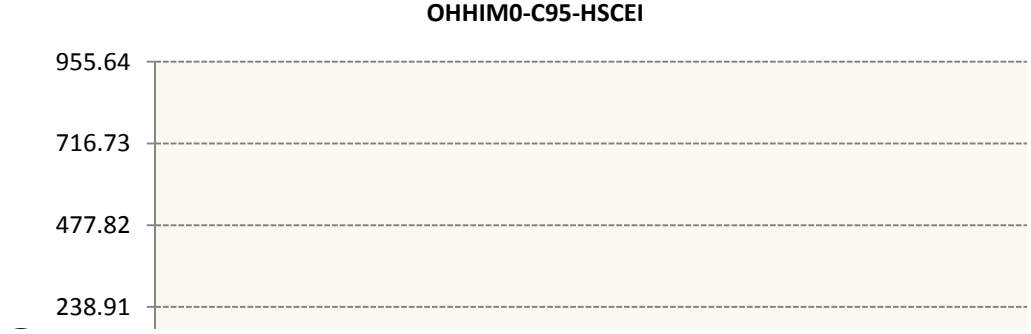
1. 계약금액

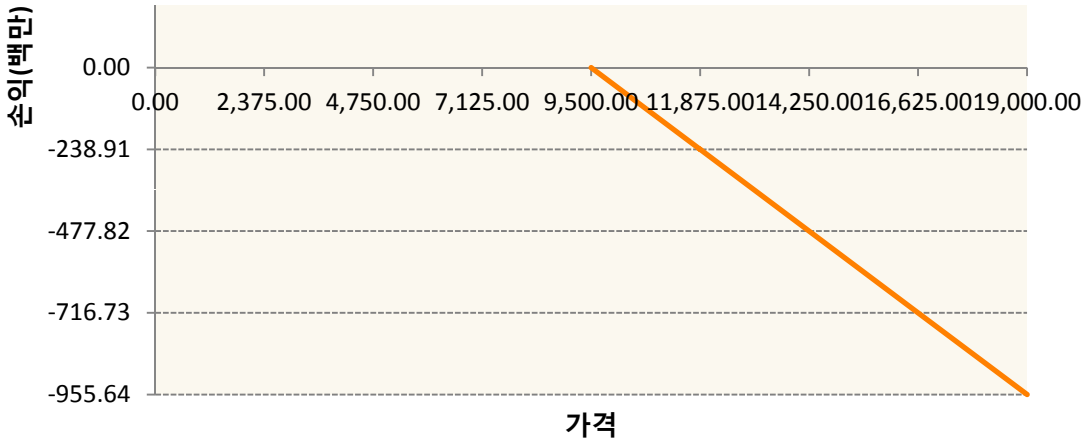
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,659	0	1,659	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,214	-4,214	장내
누계	유가증권	선도	0	1,498	-1,498	장외

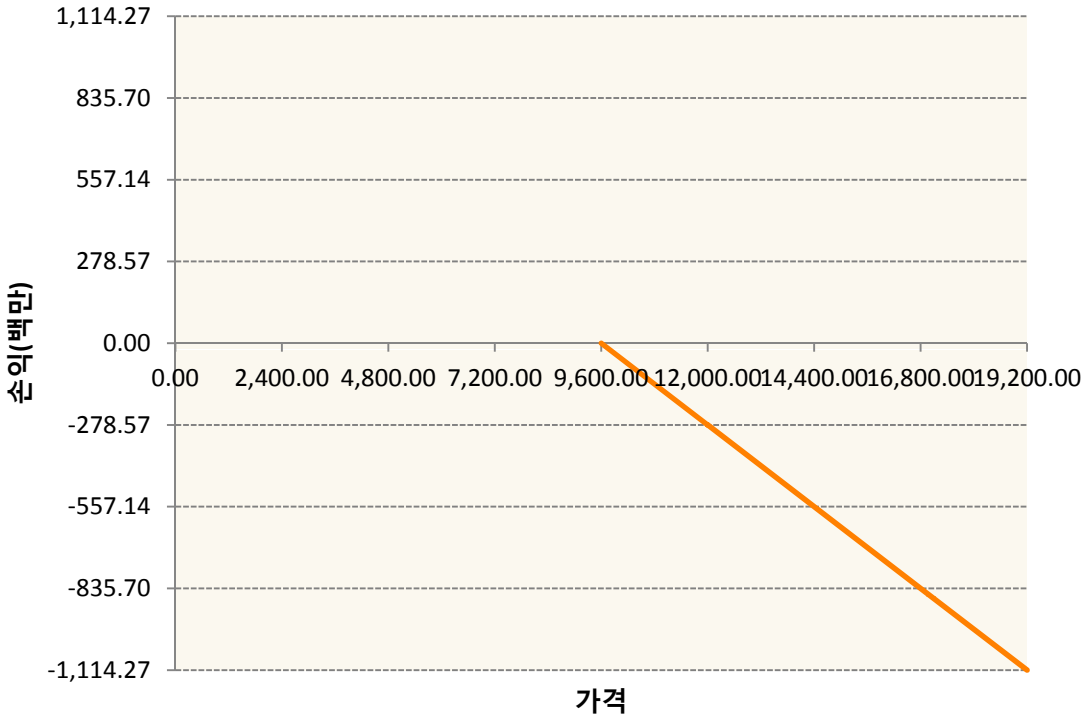
2. 만기시점의 손익구조



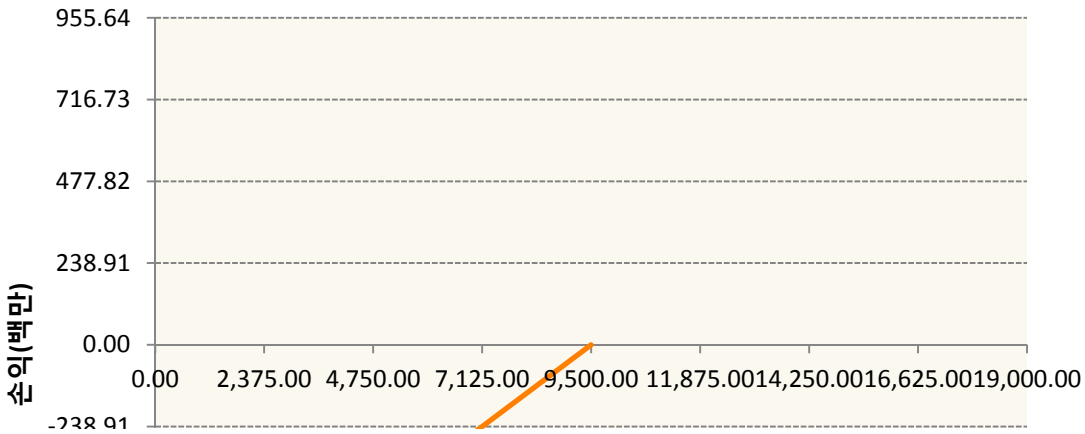


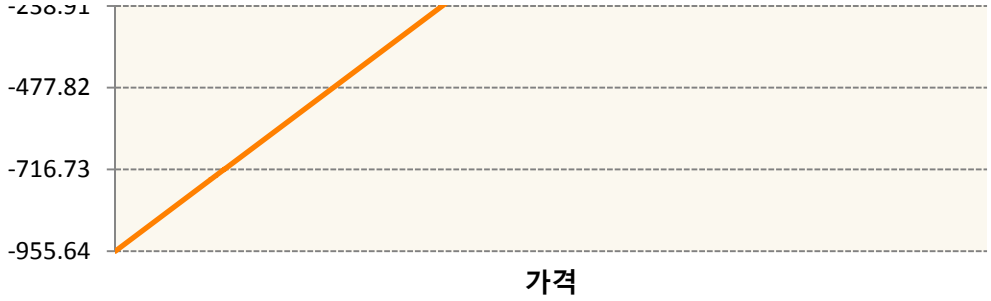


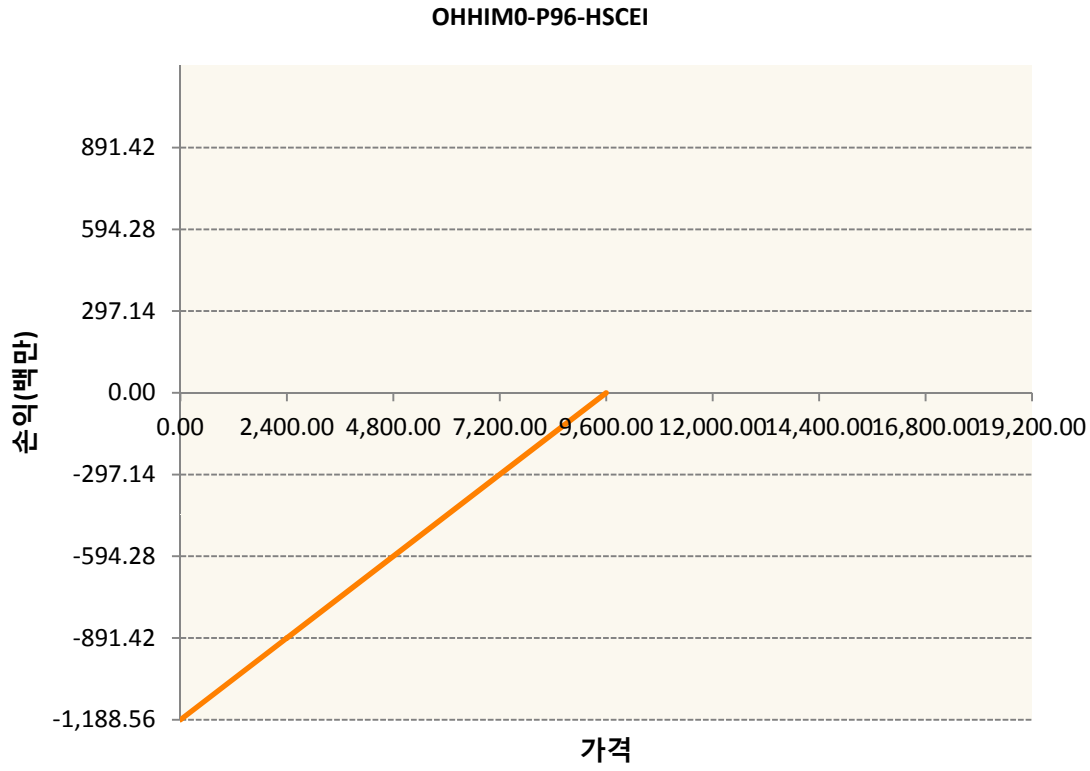
OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	120
HCM0 HSCEI Futures Jun20	133
OHHIM0-C9 HSCEI	76
OHHIM0-C9 HSCEI	89
OHHIM0-P9 HSCEI	76
OHHIM0-P9 HSCEI	95

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	570

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

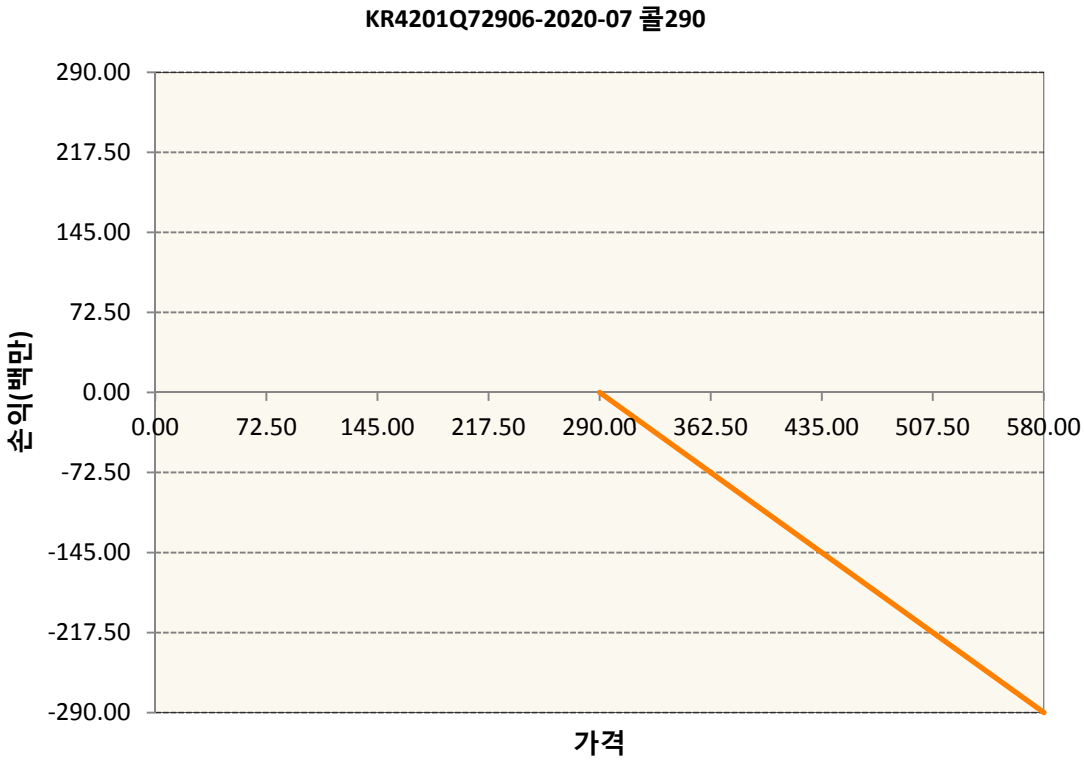
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

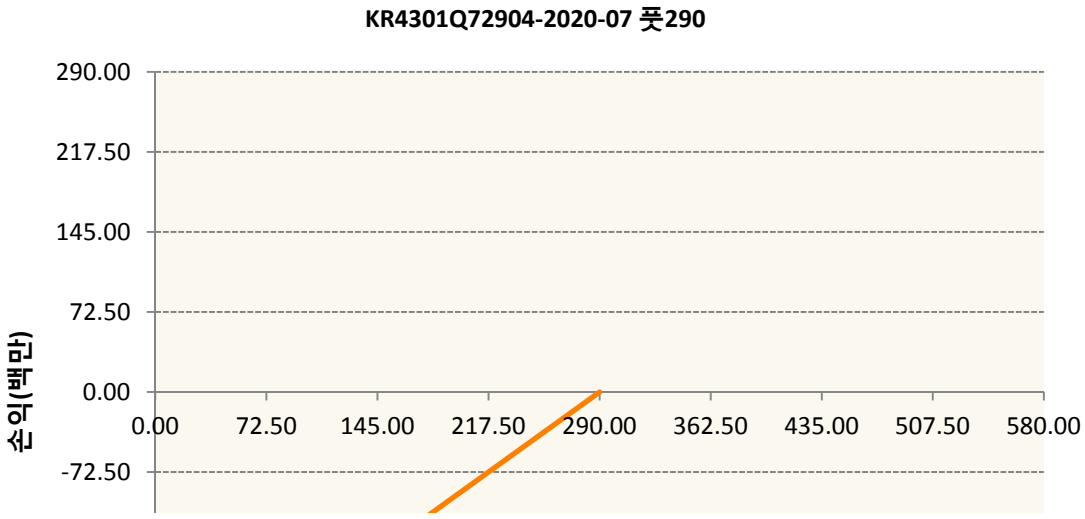
1. 계약금액

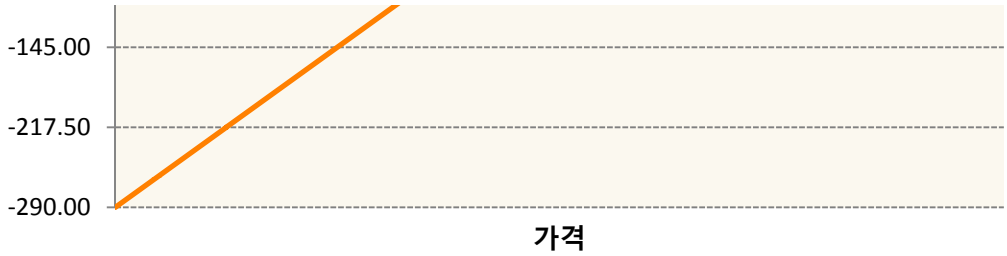
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72906	2020-07 콜290						17
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	7	7	6	6	5
-5.33%	7	7	6	5	5	4	3
-2.67%	5	5	4	3	2	2	1
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7
5.33%	-6	-7	-8	-9	-10	-11	-11
8.00%	-12	-13	-14	-14	-15	-16	-17
KR4301Q72904	2020-07 풋290						19
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-19
-5.33%	-10	-10	-11	-11	-11	-12	-12
-2.67%	-4	-4	-4	-5	-5	-6	-6
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	5	4	4	3	3	2
5.33%	7	7	7	6	6	5	5
8.00%	8	8	8	8	7	7	6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

33

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

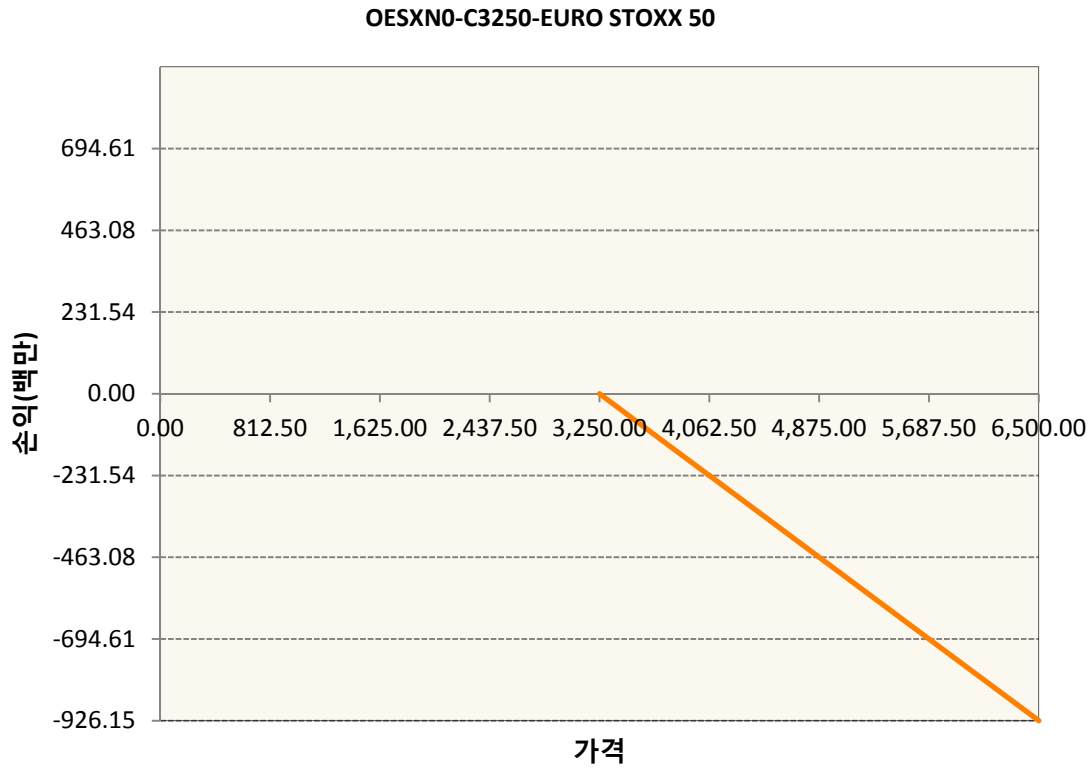
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

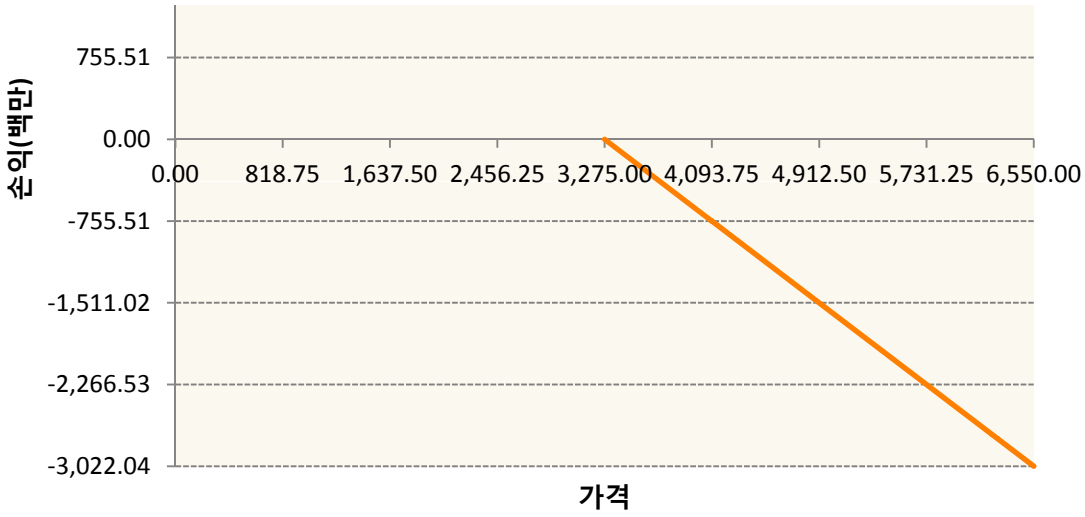
1. 계약금액

(단위:백만원)

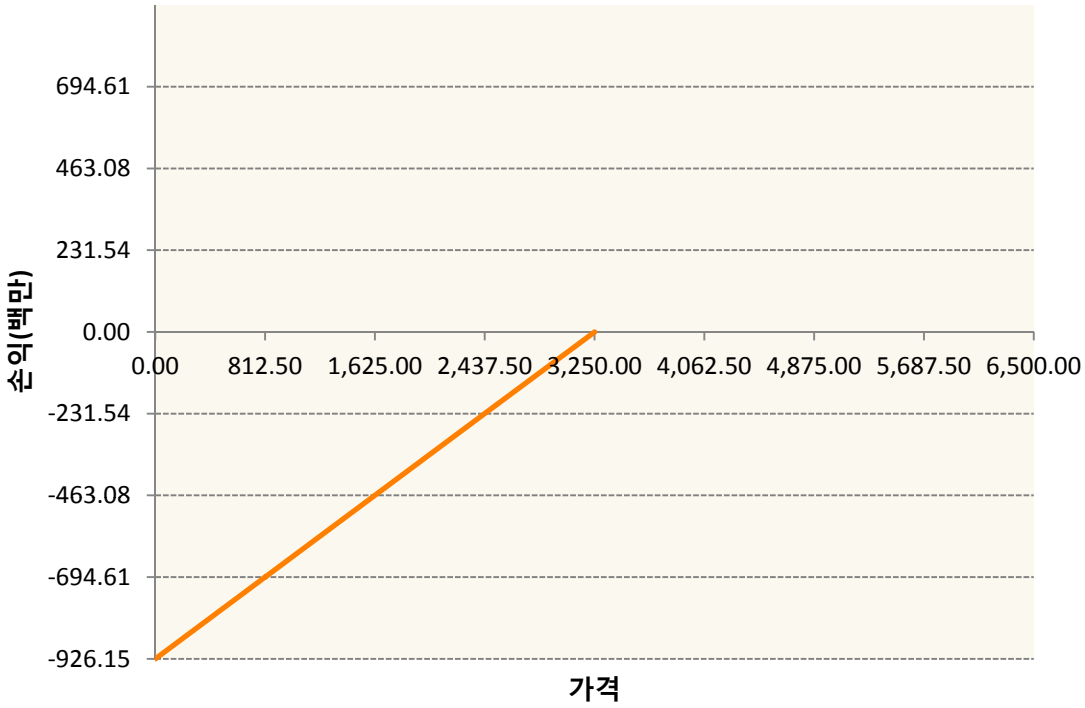
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,340	0	1,340	
누계	유가증권	스왑	8,093	0	8,093	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,896	-7,896	장내
누계	통화	선도	0	5,873	-5,873	장외

2. 만기시점의 손익구조

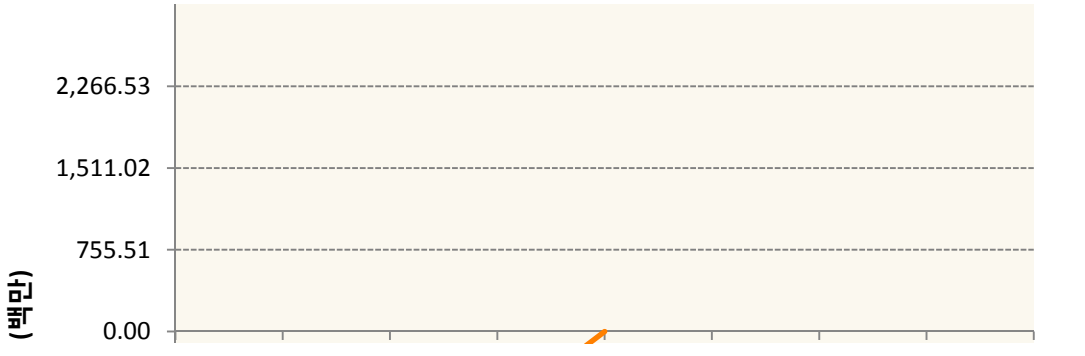


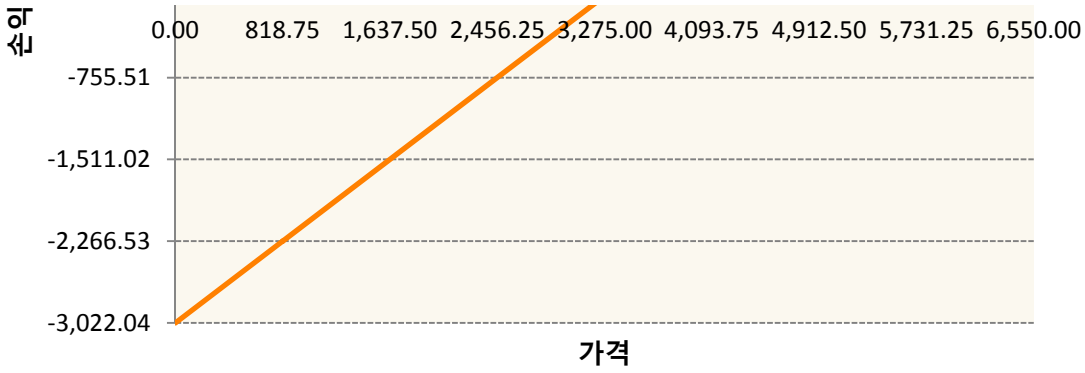


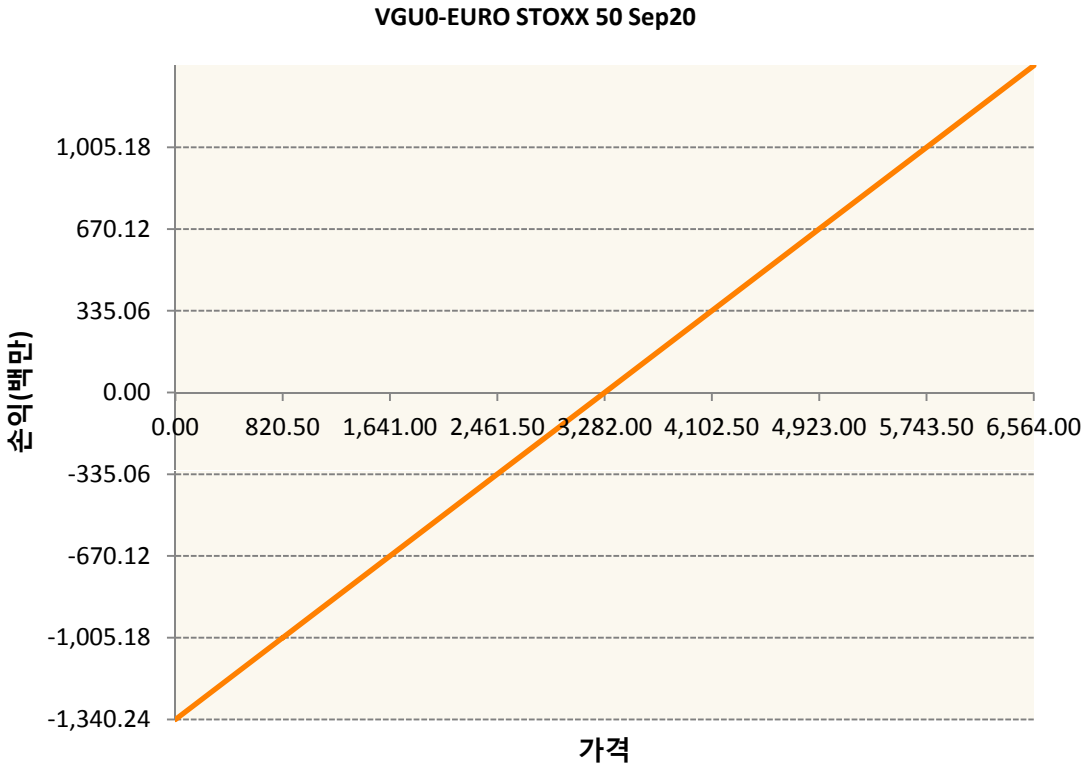
OESXN0-P3250-EURO STOXX 50



OESXN0-P3275-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	27
FX21020H09	KRW/EUR 26-06-20E	220
FX21020K02	KRW/EUR 26-06-20E	15
FX21020M0(	KRW/EUR 25-09-20E	235
OESXN0-C3:	EURO STOXX 50	74
OESXN0-C3:	EURO STOXX 50	242
OESXN0-P3:	EURO STOXX 50	74
OESXN0-P3:	EURO STOXX 50	242
VGU0	EURO STOXX 50 Sep20	107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

1,328

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

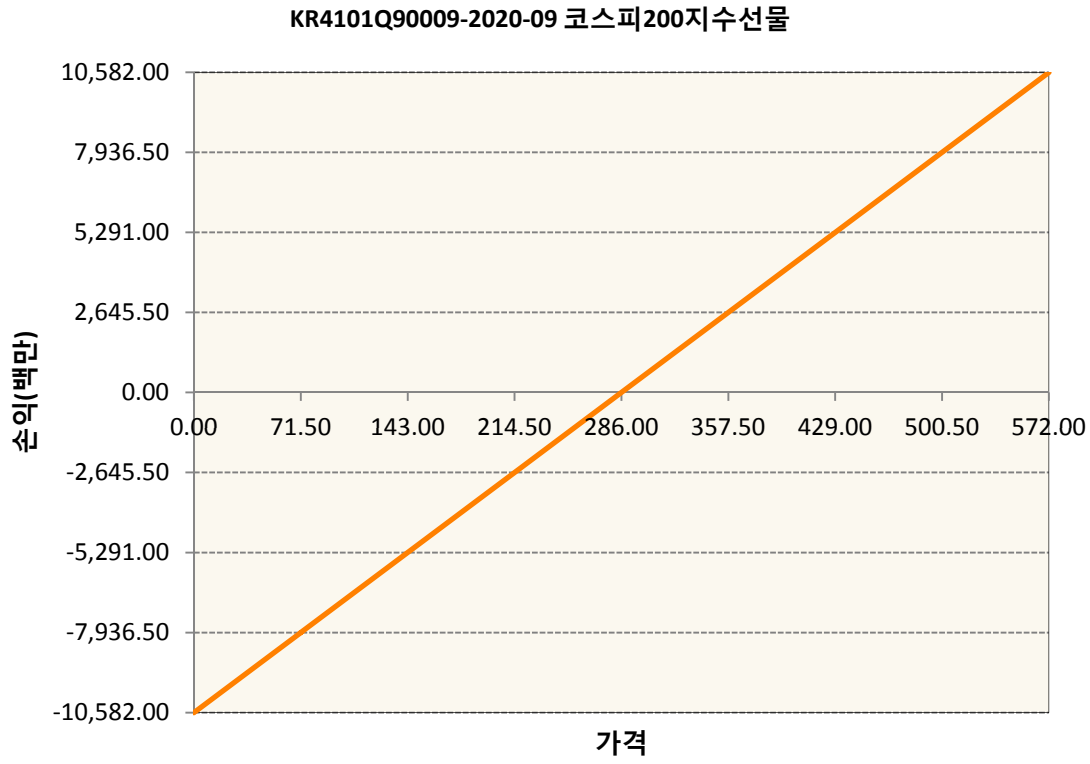
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,582	0	10,582	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						849
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-849	-849	-849	-849	-849	-849	-849
-5.33%	-566	-566	-566	-566	-566	-566	-566
-2.67%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	283	283	283	283	283	283	283
5.33%	566	566	566	566	566	566	566
8.00%	849	849	849	849	849	849	849

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

1,335

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

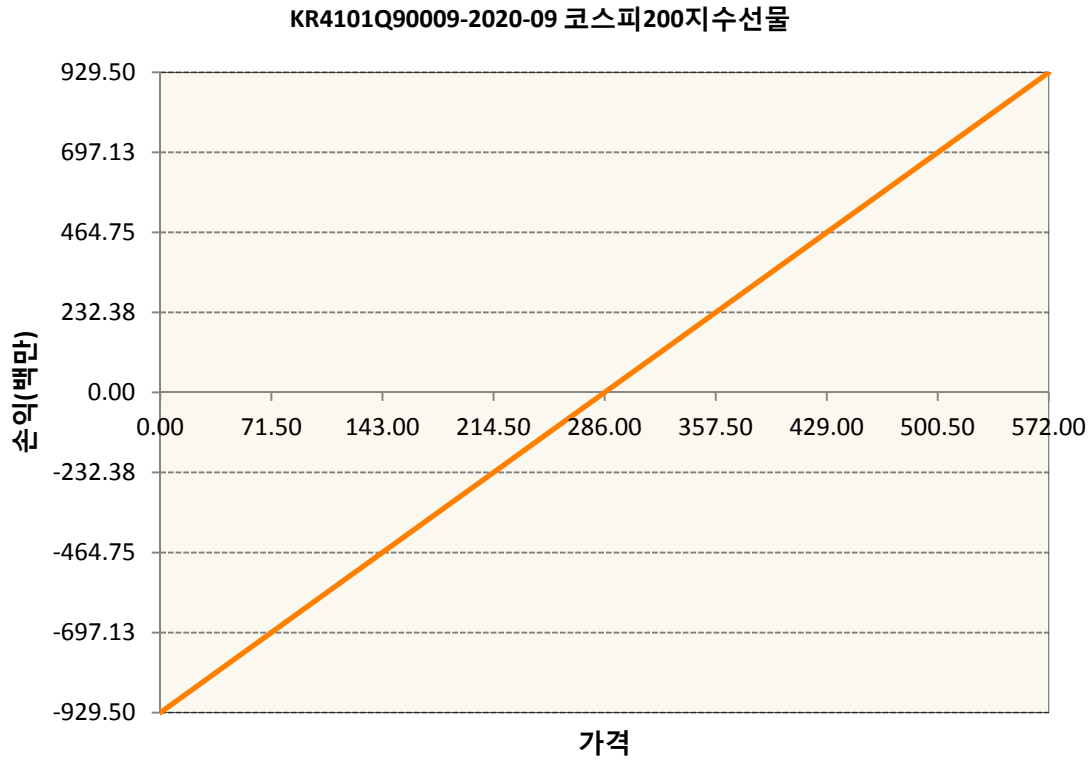
ETF스마트레버리지목표전환형9호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	930	0	930	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						75
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	75	75	75	75	75	75	75

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

117

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

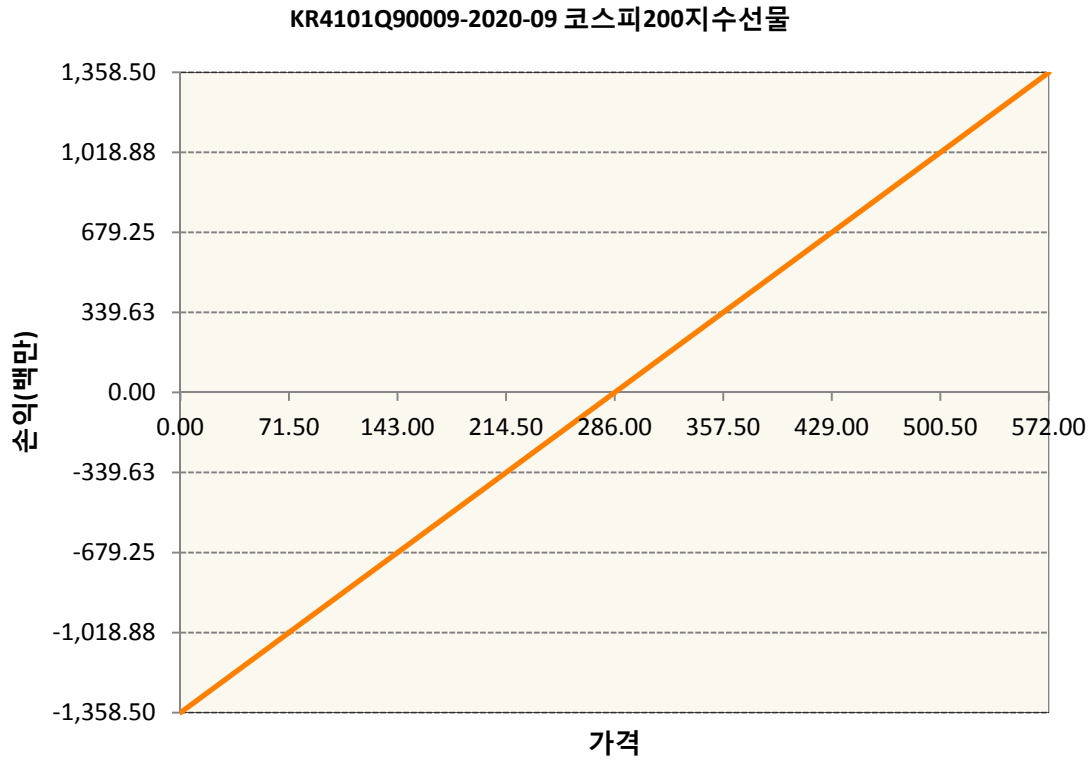
ETF스마트레버리지목표전환형10호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,359	0	1,359	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109
-5.33%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	73	73	73	73	73	73	73
8.00%	109	109	109	109	109	109	109

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

171

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

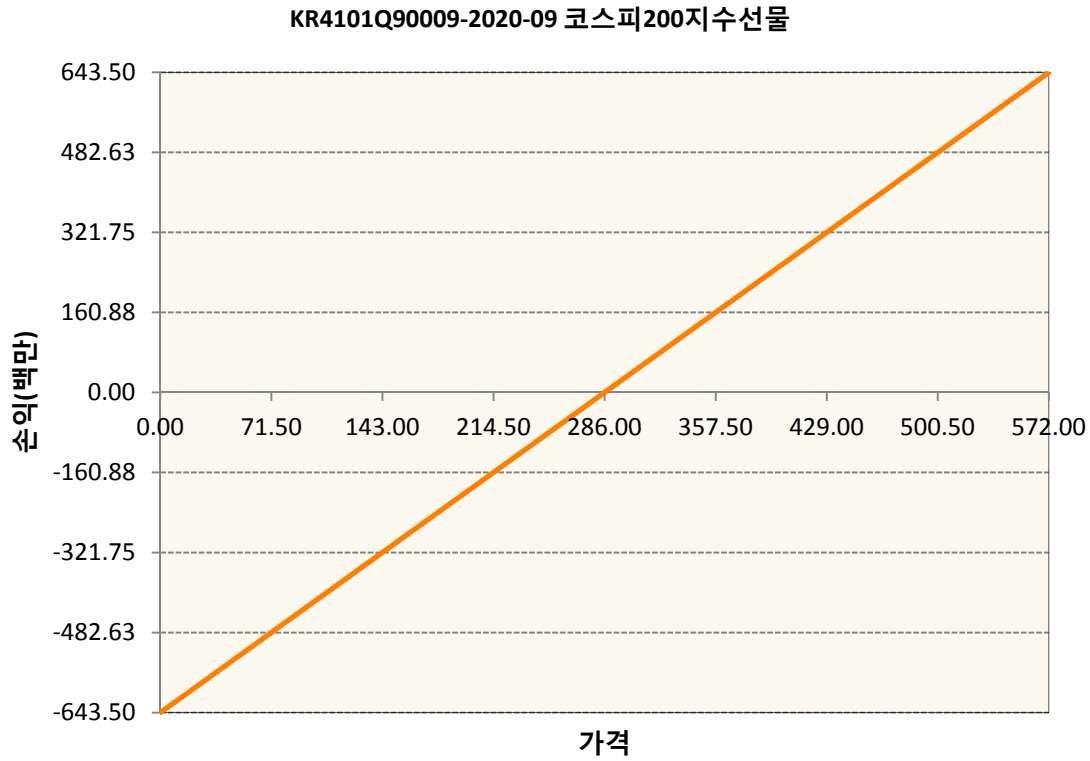
스마트KRX300인덱스목표전환형1호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	644	0	644	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						52
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	52	52	52	52	52	52	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

81

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

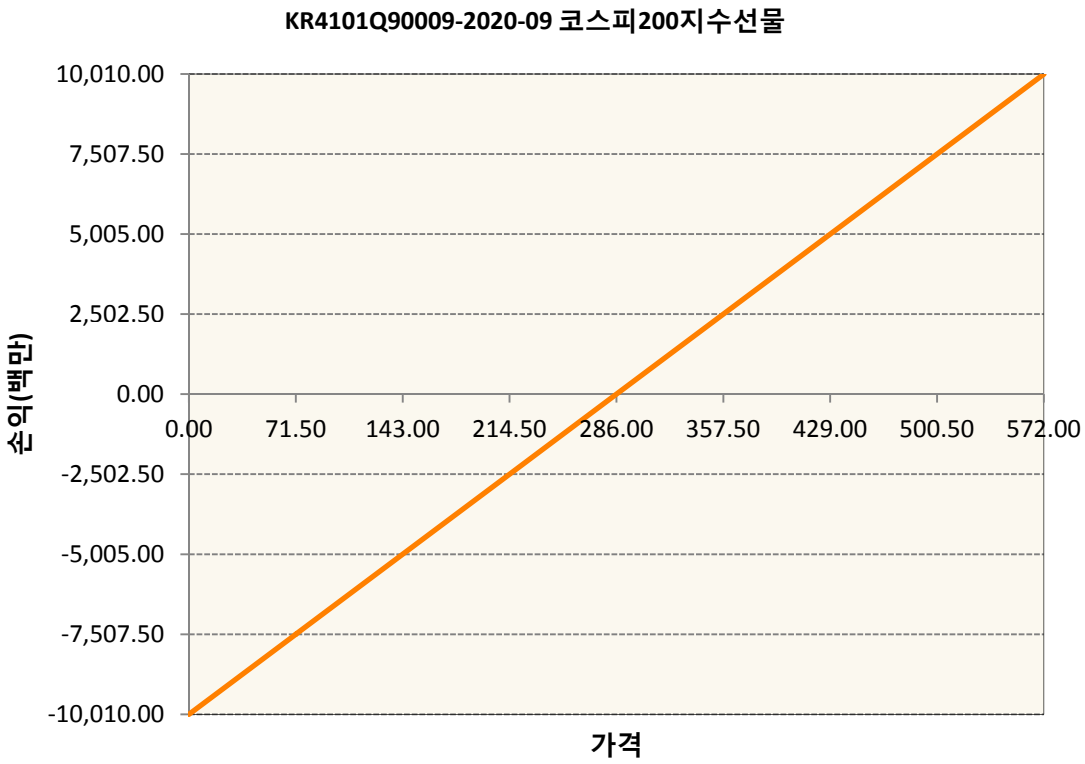
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

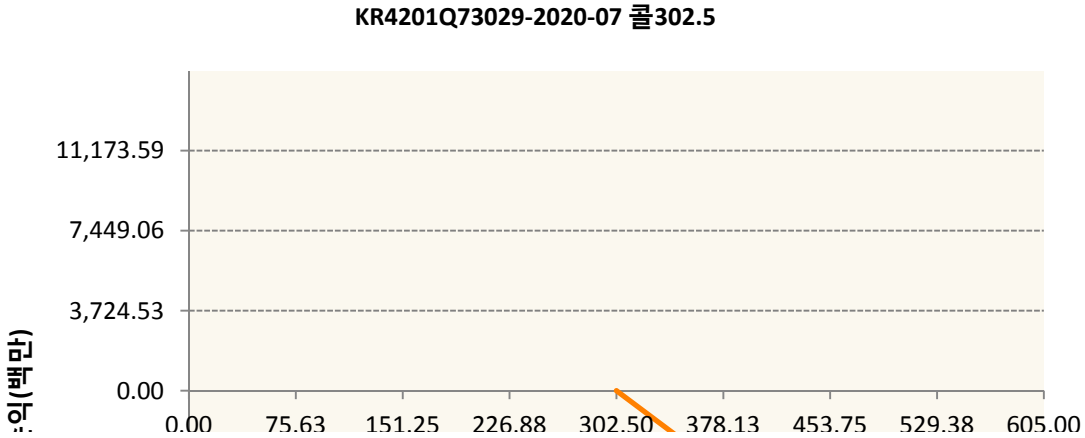
1. 계약금액

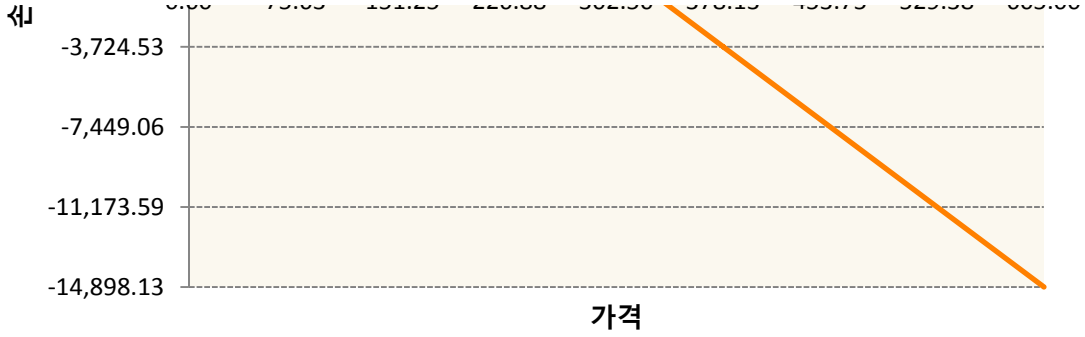
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,010	0	10,010	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

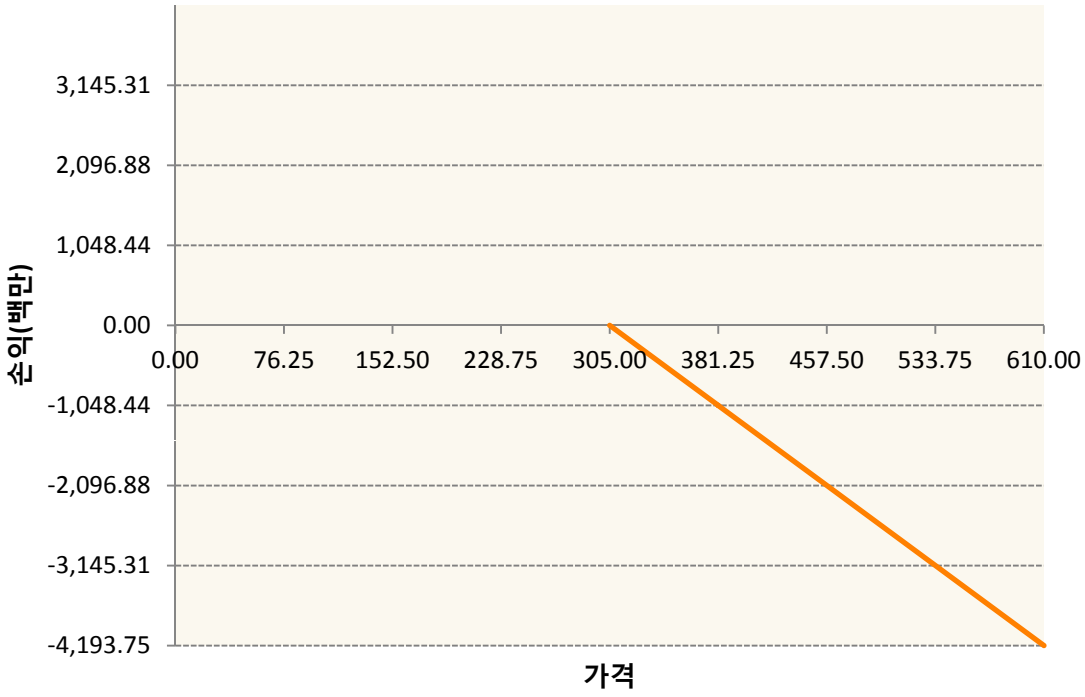
2. 만기시점의 손익구조



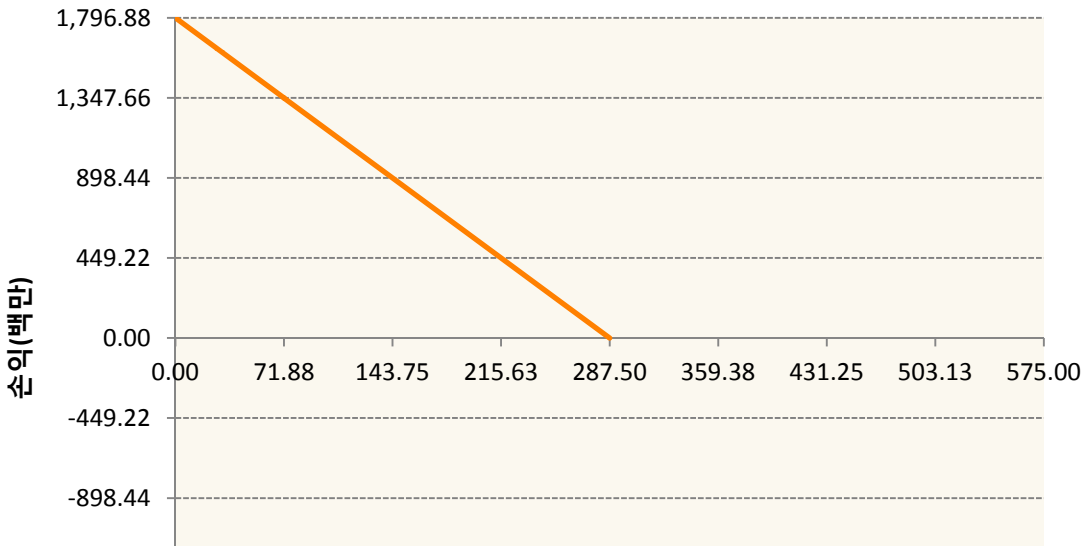


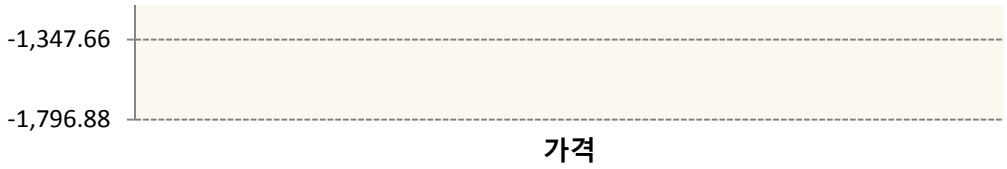


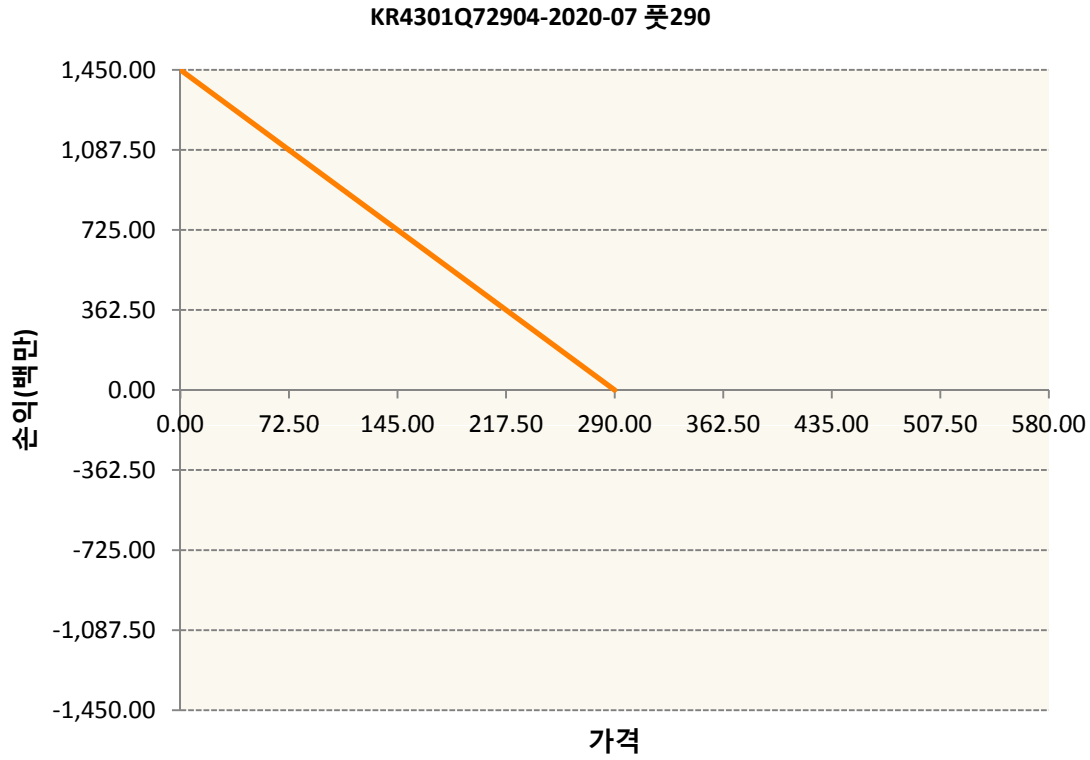
KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						803
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-803	-803	-803	-803	-803	-803	-803
-5.33%	-535	-535	-535	-535	-535	-535	-535
-2.67%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	268	268	268	268	268	268	268
5.33%	535	535	535	535	535	535	535
8.00%	803	803	803	803	803	803	803
KR4201Q73029	2020-07 콜302.5						649
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	224	217	206	193	178	160	140
-5.33%	208	194	176	155	132	107	80
-2.67%	173	149	122	93	62	30	-4

0%	107	73	37	0	-38	-77	-117
2.67%	-2	-45	-87	-130	-174	-218	-261
5.33%	-163	-209	-255	-301	-347	-393	-439
8.00%	-378	-423	-468	-513	-558	-603	-649
	KR4201Q73052		2020-07 콜305				171
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	53	51	47	44	39	34
-5.33%	51	48	43	38	32	26	19
-2.67%	43	37	31	23	15	7	-2
0%	28	19	10	0	-10	-21	-31
2.67%	1	-10	-21	-33	-45	-57	-69
5.33%	-39	-52	-64	-77	-90	-103	-115
8.00%	-94	-107	-120	-132	-145	-158	-171
	KR4301Q72870		2020-07 풋287.5				111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	104	105	106	107	109	111
-5.33%	58	60	62	64	67	69	72
-2.67%	19	22	25	28	32	35	38
0%	-11	-7	-4	0	4	7	11
2.67%	-30	-27	-24	-20	-17	-13	-10
5.33%	-41	-38	-36	-33	-30	-28	-24
8.00%	-45	-44	-42	-41	-39	-37	-34
	KR4301Q72904		2020-07 풋290				93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	88	88	89	89	90	91	93
-5.33%	51	52	54	55	57	59	60
-2.67%	18	20	22	25	27	30	32
0%	-9	-6	-3	0	3	6	9
2.67%	-27	-24	-21	-18	-15	-13	-10
5.33%	-37	-35	-33	-31	-28	-26	-23
8.00%	-42	-41	-40	-38	-36	-34	-32

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

2,034

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	3,583	-3,583	
누계	유가증권	수익증권	136,686	0	136,686	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	98,833	0	98,833	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	460,472	0	460,472	
누계	통화	선도	0	439,460	-439,460	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J03	KRW/USD 24-07-20E	2,159
FX21020J04	KRW/USD 24-07-20E	1,727
FX21020J04	KRW/USD 24-07-20E	1,919
FX21020K01	KRW/USD 18-08-20E	2,341
FX21020K01	KRW/USD 18-08-20E	960
FX21020K03	KRW/USD 26-08-20E	1,007
FX21020K03	KRW/USD 26-08-20E	1,593
FX21020K05	KRW/USD 03-08-20E	3,358
FX21020K05	KRW/USD 03-08-20E	6,813
FX21020M0(	KRW/USD 26-08-20E	576
FX21020M01	KRW/USD 26-08-20E	4,702
FX21020M02	KRW/USD 14-09-20E	1,996
FX21020M02	KRW/USD 14-09-20E	2,418
FX21020M05	KRW/USD 22-09-20E	998
FX21020M05	KRW/USD 22-09-20E	2,591
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

18,106

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

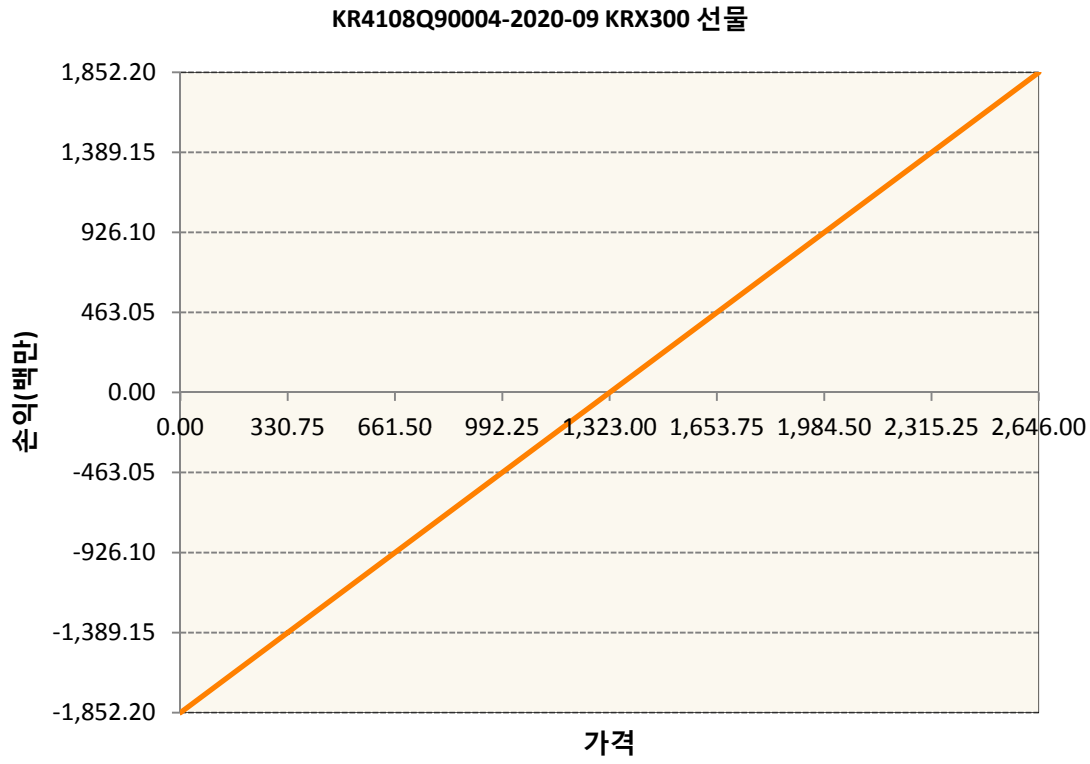
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,852	0	1,852	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108Q90004	2020-09 KRX300 선물	149

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
-5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	50	50	50	50	50	50	50
5.33%	99	99	99	99	99	99	99
8.00%	149	149	149	149	149	149	149

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

234

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	7,590	0	7,590	
누계	통화	선도	0	7,448	-7,448	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	38
FX21020K04 KRW/USD 27-07-20E	96
FX21020K04 KRW/USD 30-06-20E	36
FX21020K04 KRW/USD 20-07-20E	77
FX21020M0(KRW/USD 20-07-20E	10
FX21020M02 KRW/USD 20-07-20E	14
FX21020M03 KRW/USD 06-07-20E	48
FX21020M03 KRW/USD 15-07-20E	221
FX21020M03 KRW/USD 20-07-20E	56

IE00BD8RGM75 * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

307

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

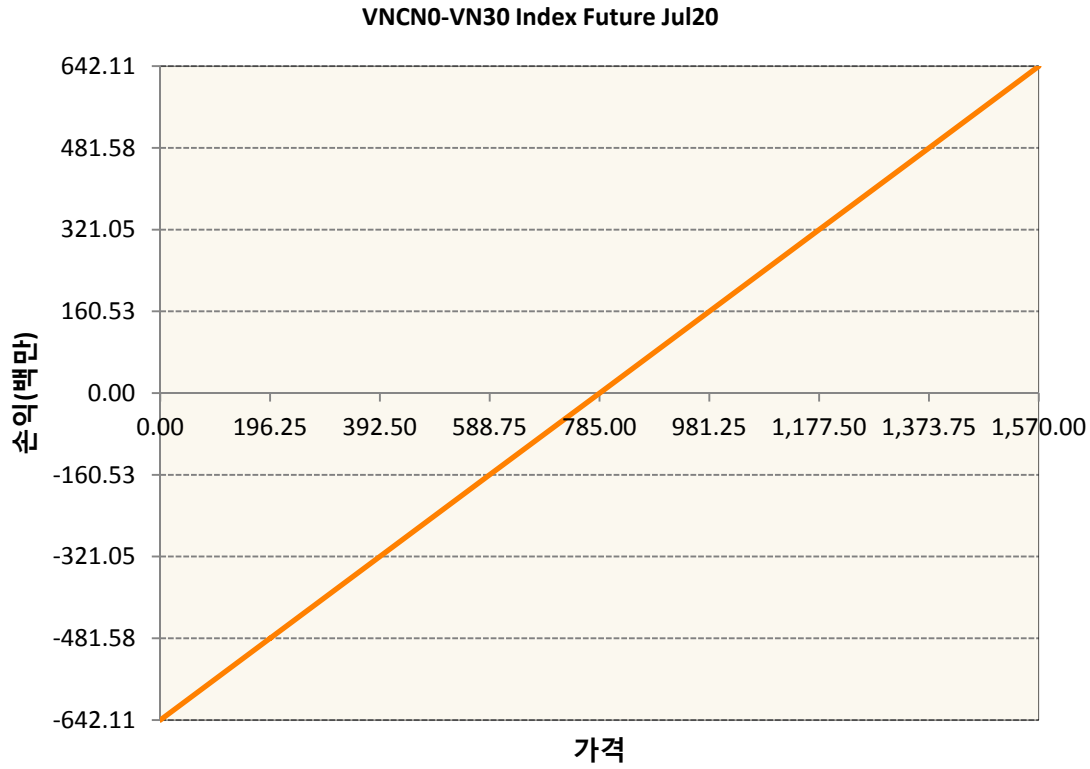
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	642	0	642	
누계	유가증권	스왑	984	0	984	장외
누계	통화	선도	209	887	-679	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	79
FX21020G05 KRW/EUR 26-06-20E	12
FX21020H09 EUR/KRW 26-06-20E	8
FX21020H11 EUR/KRW 26-06-20E	9
FX21020J00 KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J00 KRW/EUR 24-07-20E	5

FX21020J018	KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J029	KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J033	KRW/EUR 26-06-20E	5
FX21020J038	KRW/EUR 24-07-20E	1
FX21020K00	KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020K01	KRW/EUR 24-07-20E	9
FX21020K03	KRW/EUR 28-08-20E	22
VNCN0	VN30 Index Future Jul20	51

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

173

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

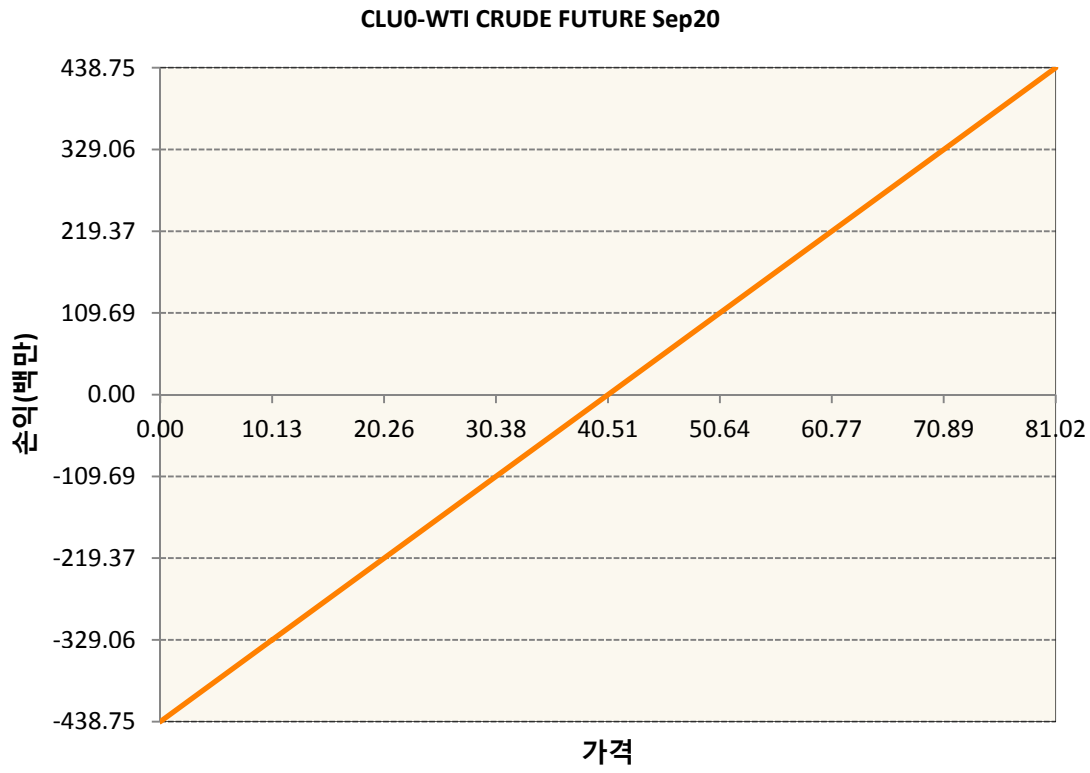
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

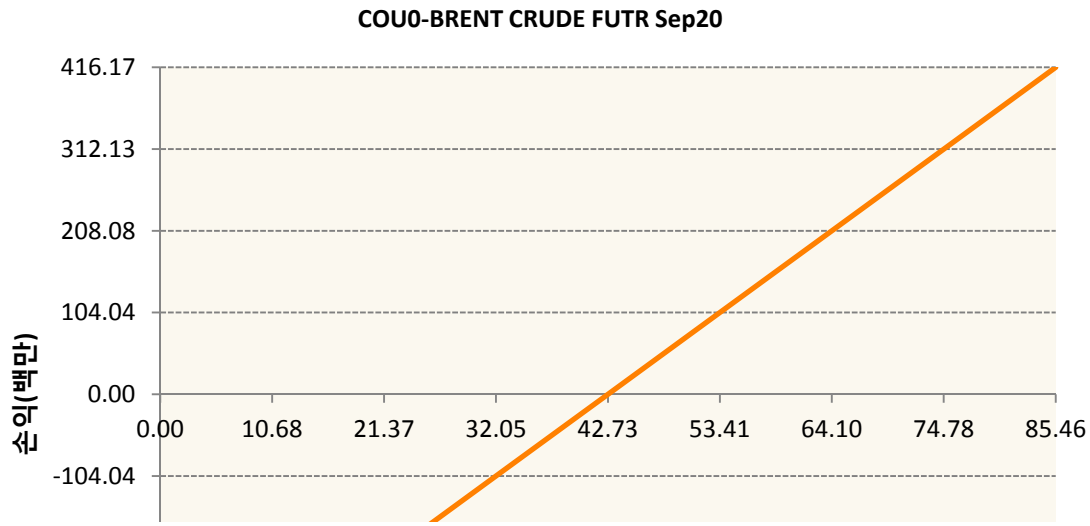
1. 계약금액

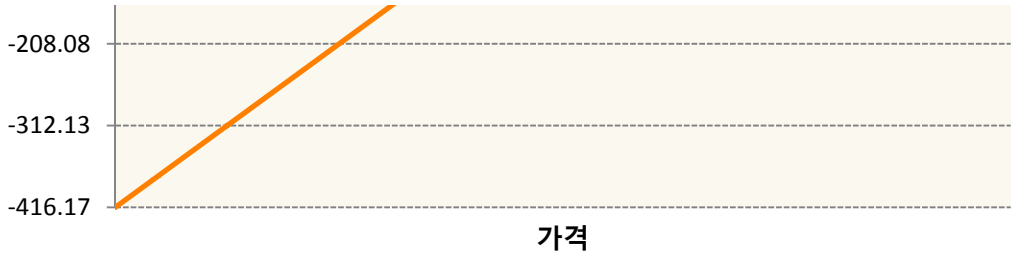
(단위:백만원)

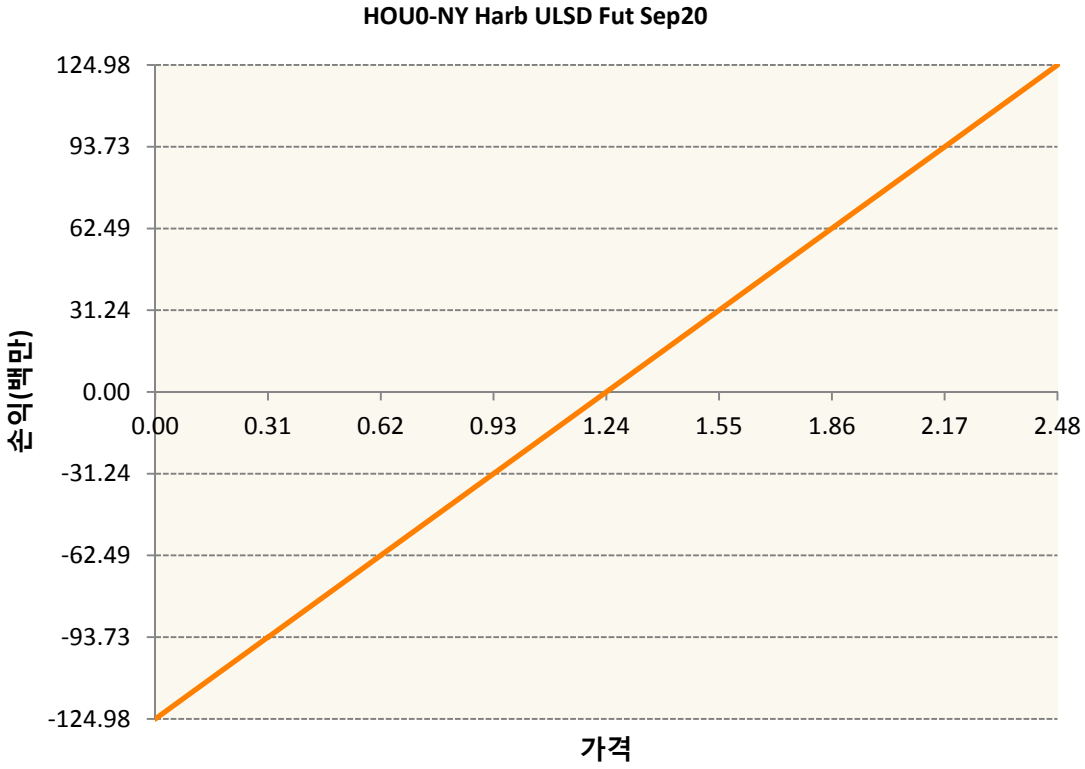
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,939	360	1,579	

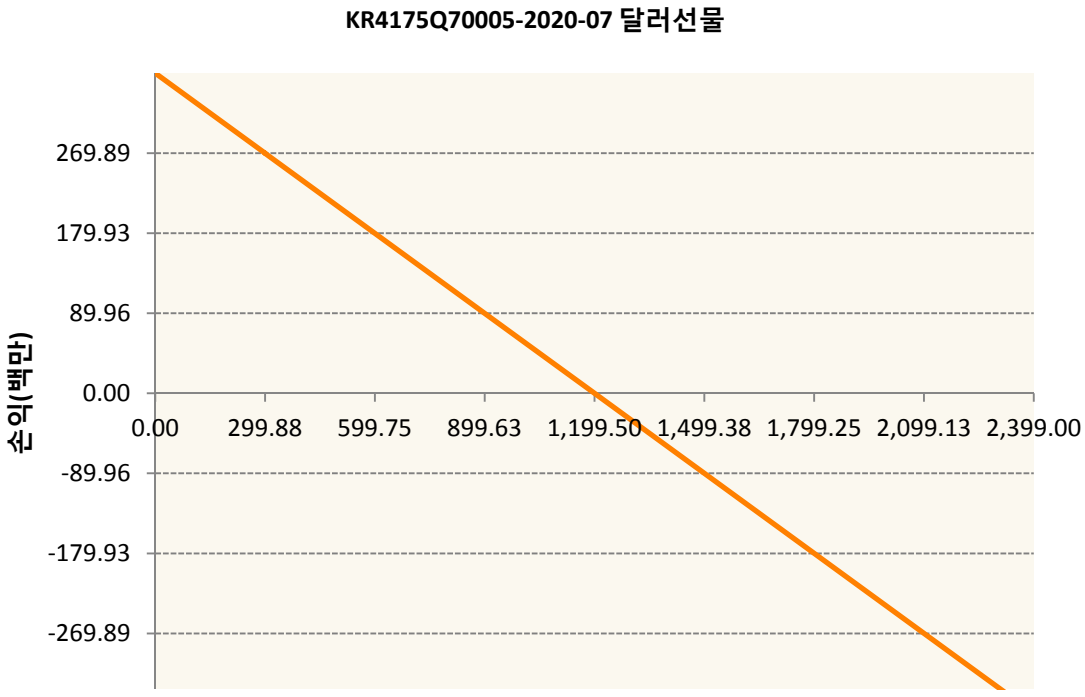
2. 만기시점의 손익구조

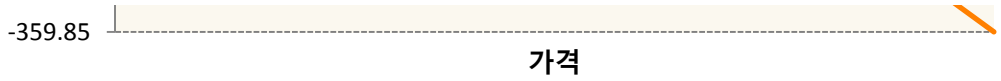


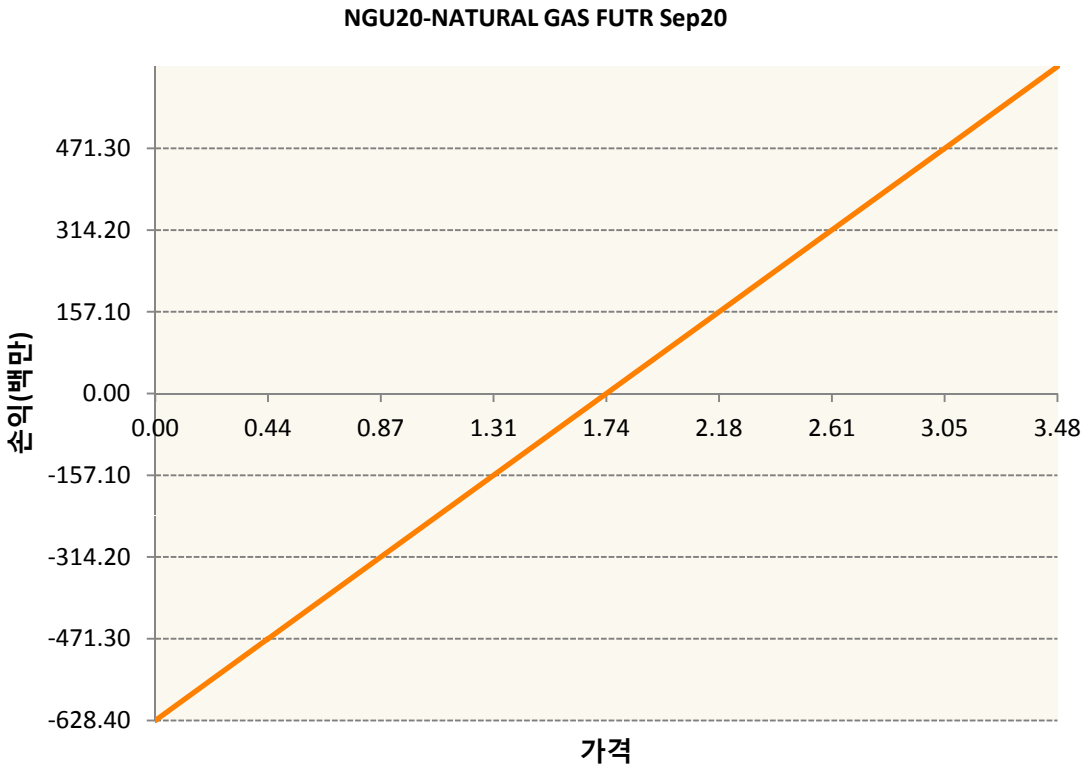


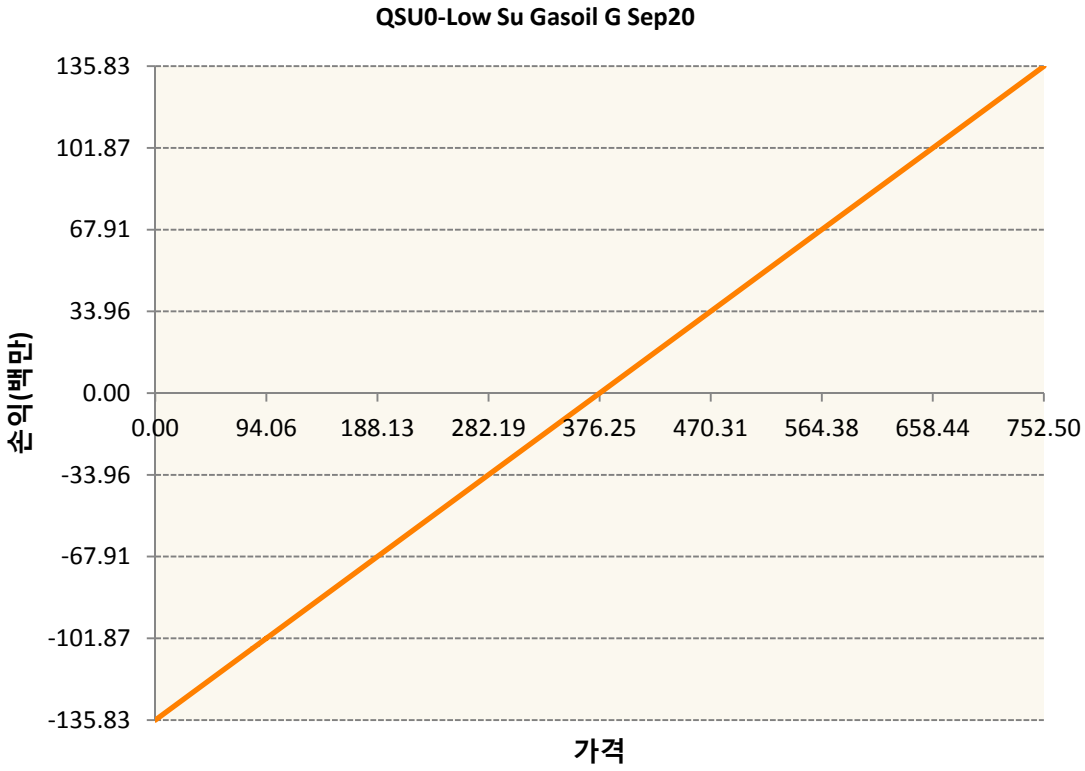

-208.08
-312.13
-416.17
가격

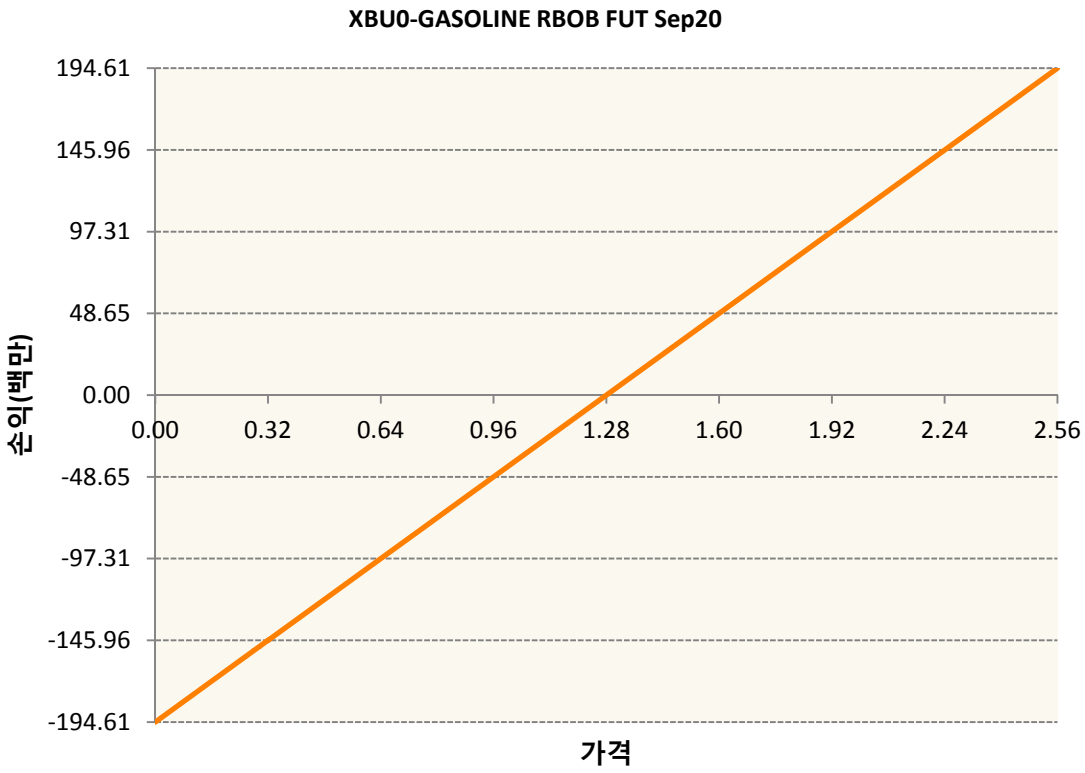

HOU0-NY Harb ULSD Fut Sep20
124.98
93.73
62.49
31.24
0.00
-31.24
-62.49
-93.73
-124.98
0.00
0.31
0.62
0.93
1.24
1.55
1.86
2.17
2.48
손익(백만)
가격


KR4175Q70005-2020-07 달러선물
269.89
179.93
89.96
0.00
-89.96
-179.93
-269.89
0.00
299.88
599.75
899.63
1,199.50
1,499.38
1,799.25
2,099.13
2,399.00
손익(백만)


-359.85
가격


NGU20-NATURAL GAS FUTR Sep20
손익(백만)
471.30
314.20
157.10
0.00
-157.10
-314.20
-471.30
-628.40
0.00
0.44
0.87
1.31
1.74
2.18
2.61
3.05
3.48
가격


QSU0-Low Su Gasoil G Sep20
손익(백만)
135.83
101.87
67.91
33.96
0.00
-33.96
-67.91
-101.87
-135.83
0.00
94.06
188.13
282.19
376.25
470.31
564.38
658.44
752.50
가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20	35
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	33
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20	10
KR4175Q70(	2020-07 달러선물	29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20	50
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20	11
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20	16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	997

공시일	2020-06-25
기준일	2020-06-24

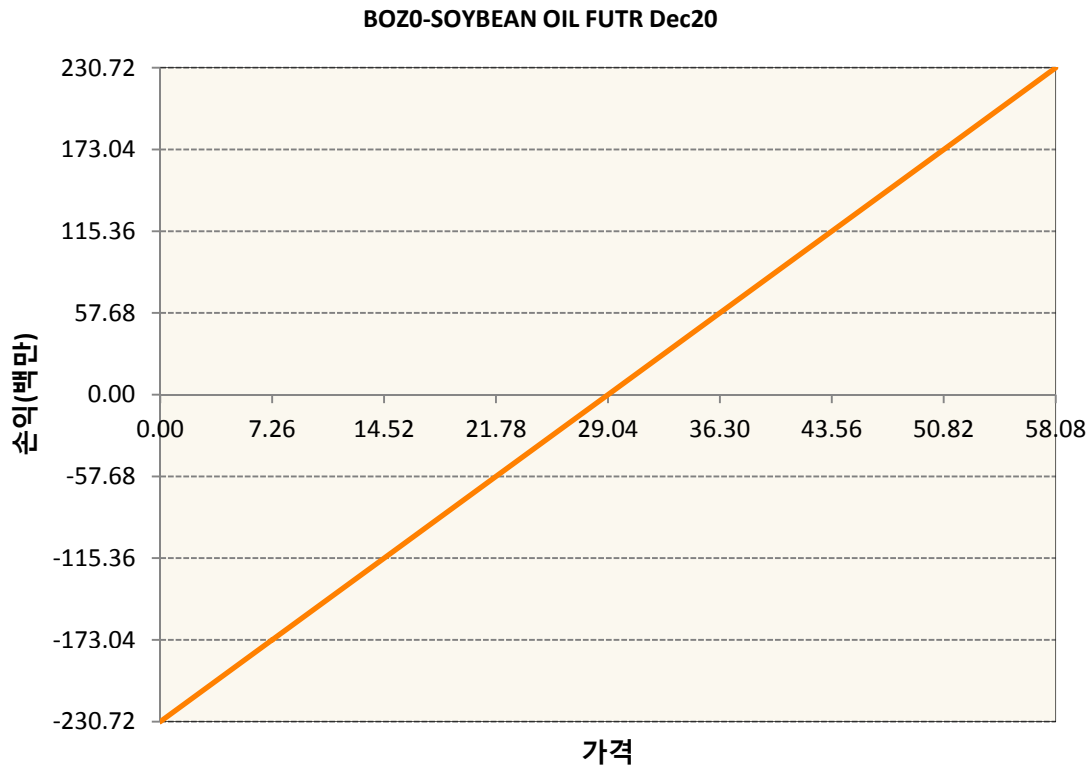
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

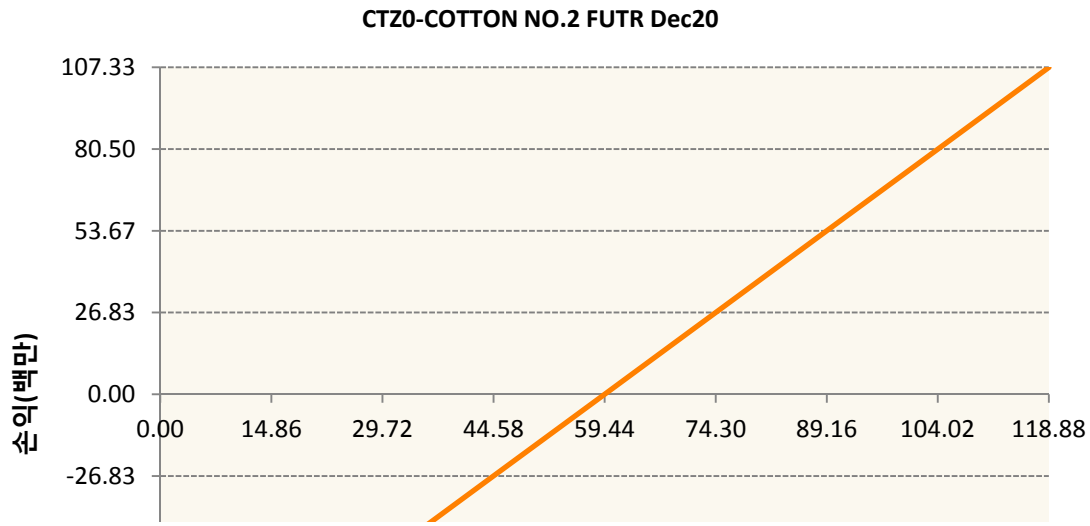
1. 계약금액

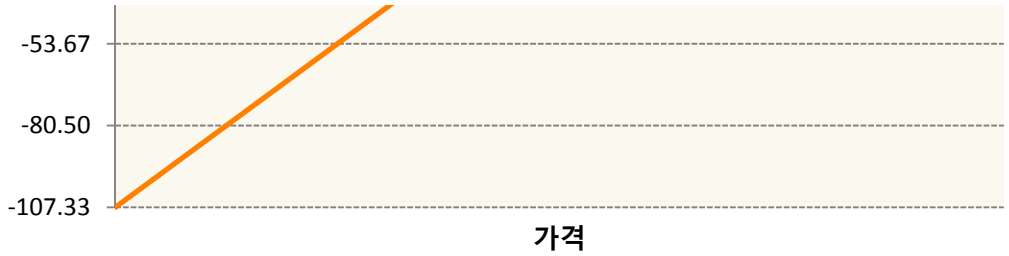
(단위:백만원)

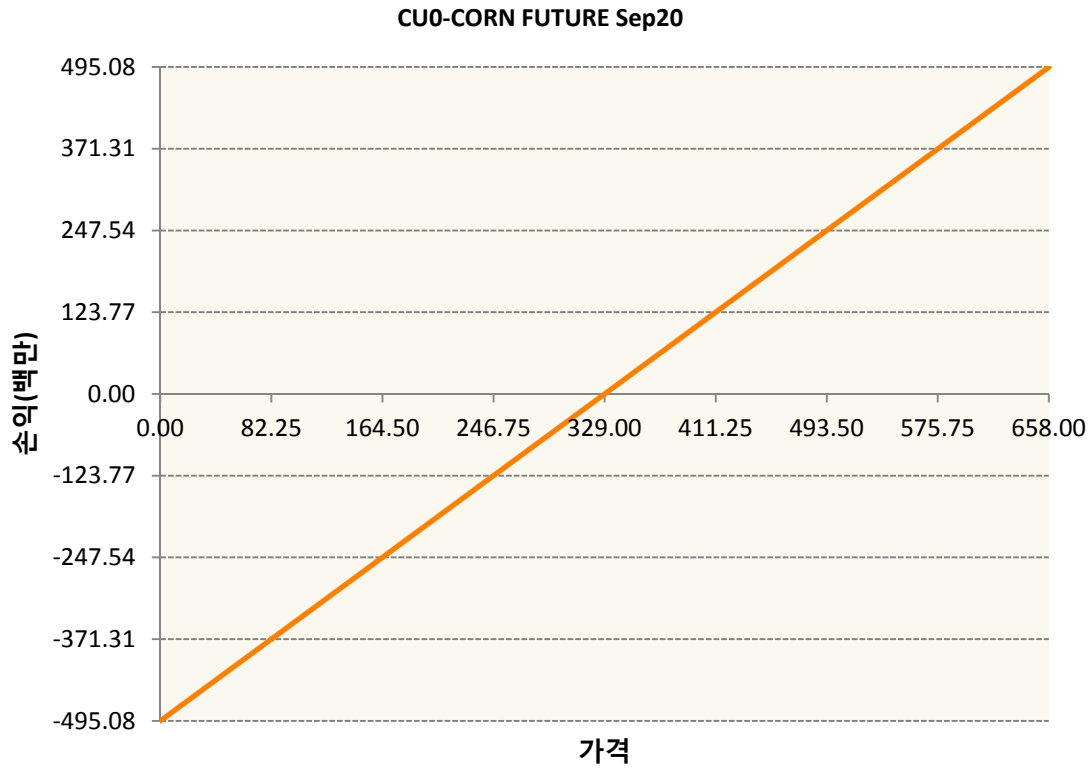
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,554	72	2,482	

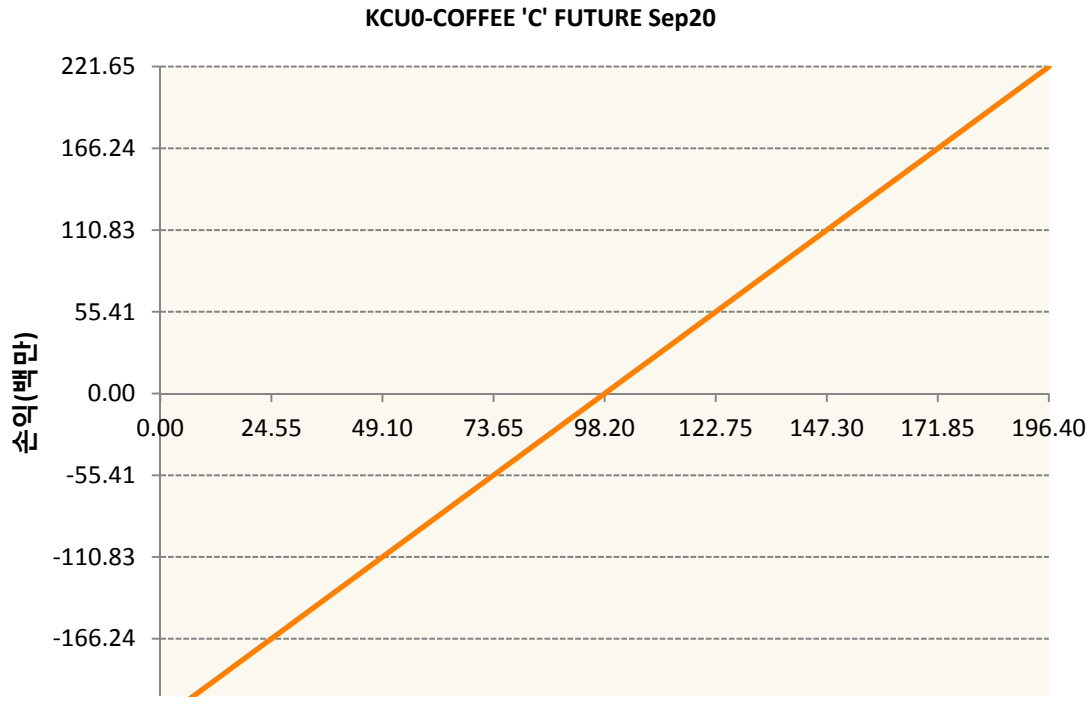
2. 만기시점의 손익구조

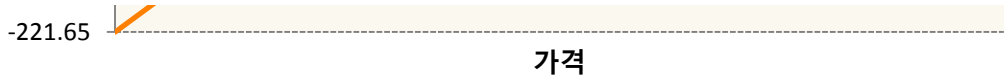


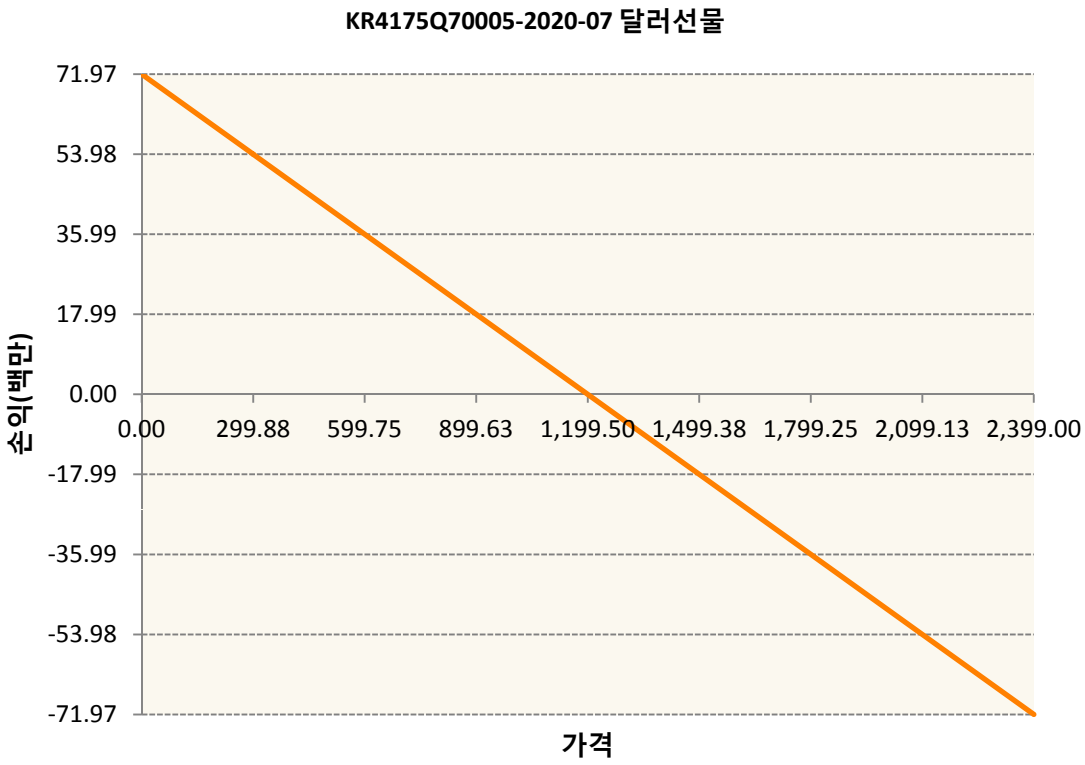


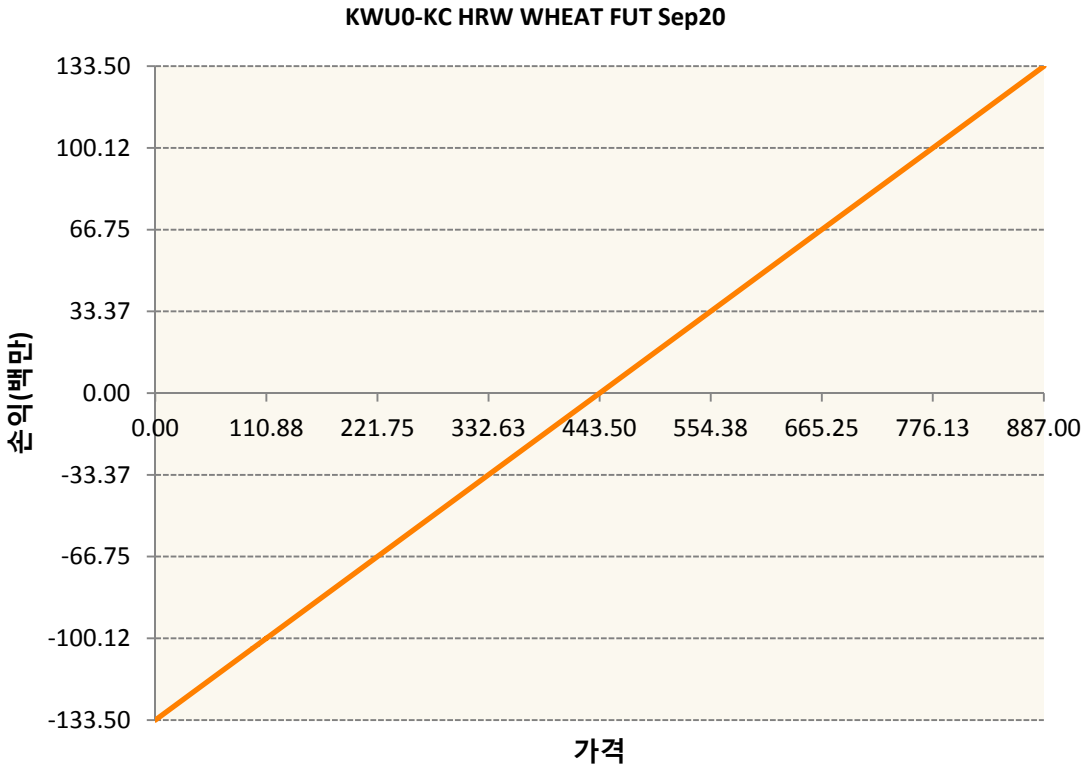

-53.67
-80.50
-107.33
가격

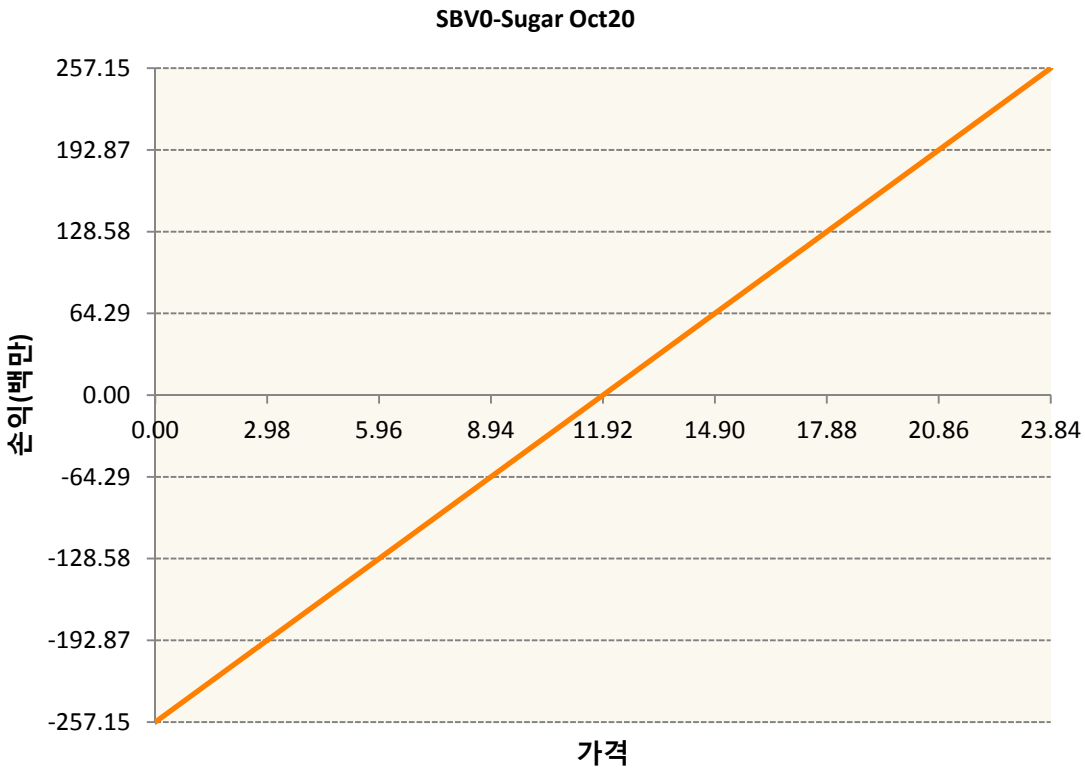

CU0-CORN FUTURE Sep20
495.08
371.31
247.54
123.77
0.00
-123.77
-247.54
-371.31
-495.08
손익(백만)
0.00
82.25
164.50
246.75
329.00
411.25
493.50
575.75
658.00
가격

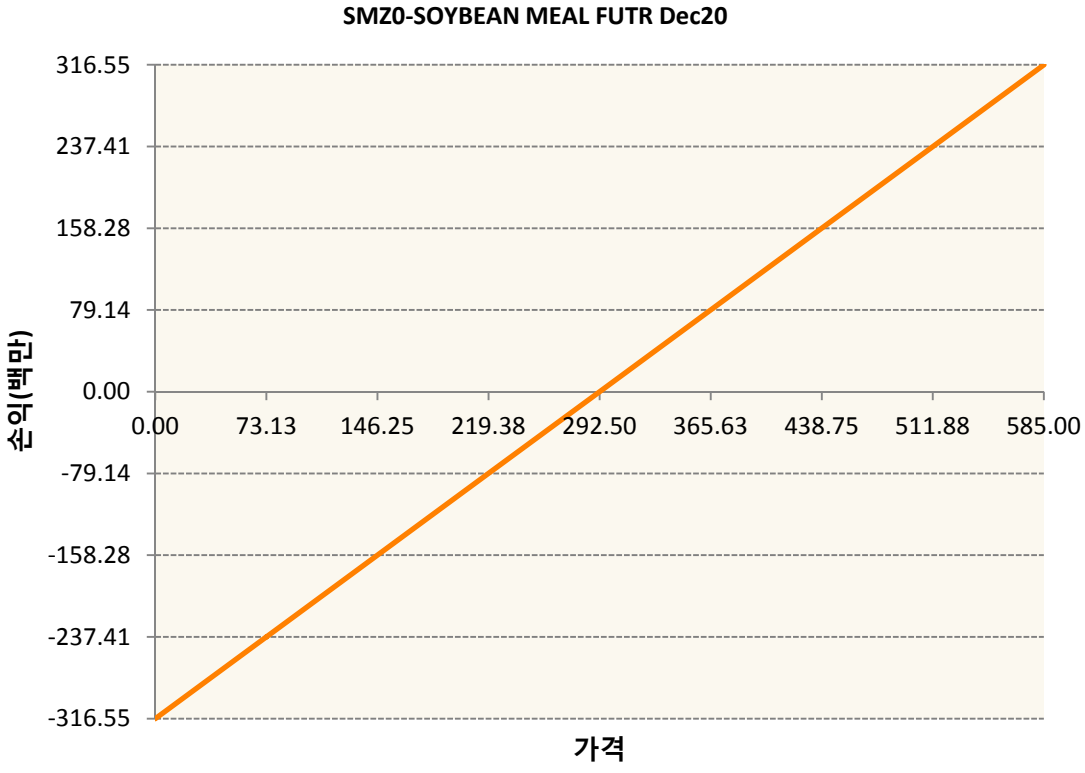

KCU0-COFFEE 'C' FUTURE Sep20
221.65
166.24
110.83
55.41
0.00
-55.41
-110.83
-166.24
손익(백만)
0.00
24.55
49.10
73.65
98.20
122.75
147.30
171.85
196.40

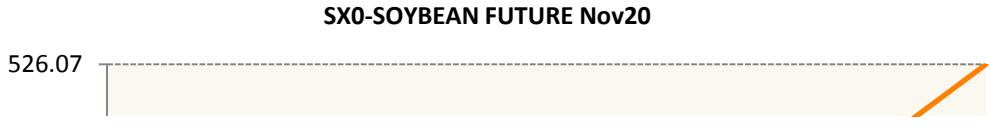

-221.65
가격

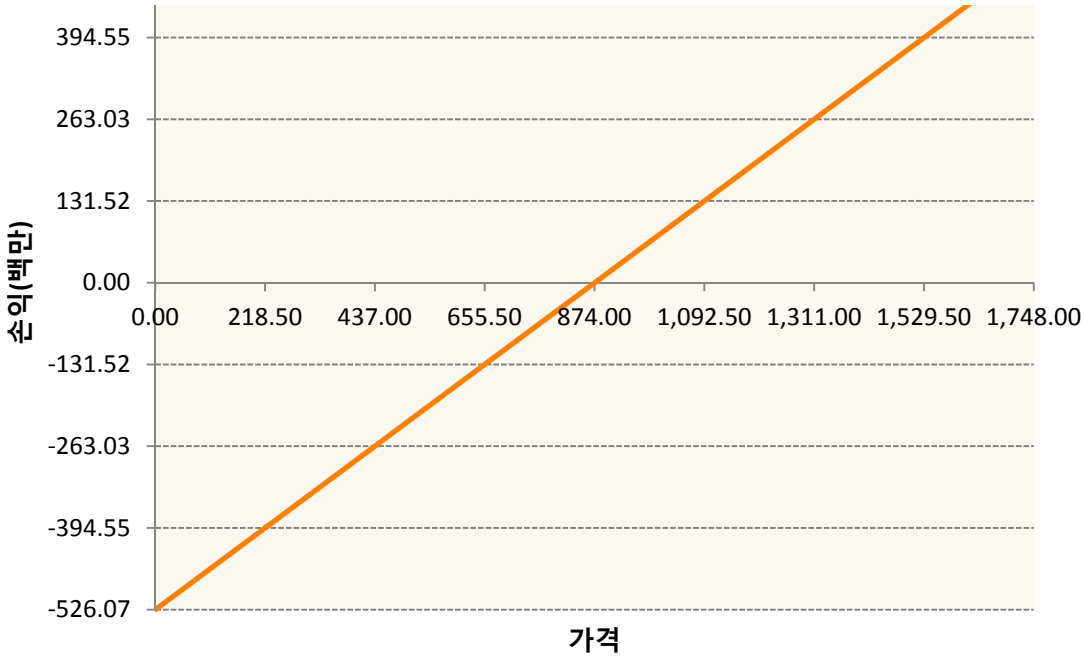

KR4175Q70005-2020-07 달러선물
71.97
53.98
35.99
17.99
0.00
-17.99
-35.99
-53.98
-71.97
0.00
299.88
599.75
899.63
1,199.50
1,499.38
1,799.25
2,099.13
2,399.00
손익(백만)
가격

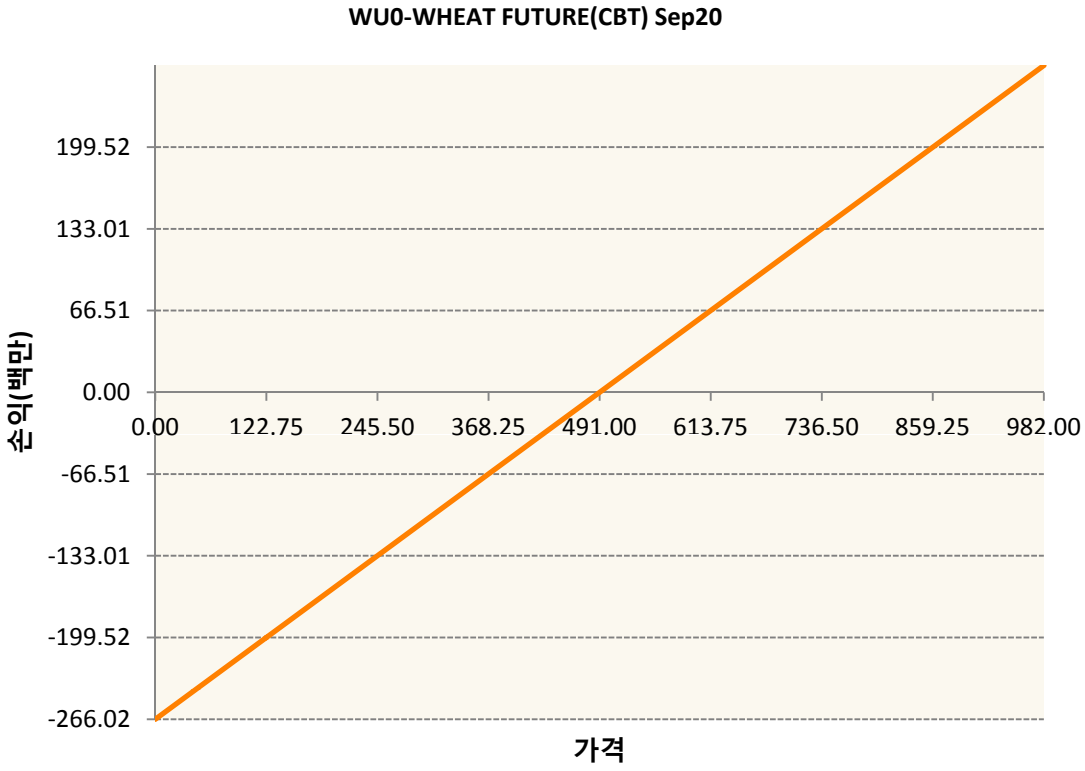

KWU0-KC HRW WHEAT FUT Sep20
133.50
100.12
66.75
33.37
0.00
-33.37
-66.75
-100.12
-133.50
0.00
110.88
221.75
332.63
443.50
554.38
665.25
776.13
887.00
손익(백만)
가격


SBV0-Sugar Oct20
257.15
192.87
128.58
64.29
0.00
-64.29
-128.58
-192.87
-257.15
0.00
2.98
5.96
8.94
11.92
14.90
17.88
20.86
23.84
손익(백만)
가격


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20
316.55
237.41
158.28
79.14
0.00
-79.14
-158.28
-237.41
-316.55
0.00
73.13
146.25
219.38
292.50
365.63
438.75
511.88
585.00
손익(백만)
가격


SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20
526.07





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ0	SOYBEAN OIL FUTR Dec20	18
CTZ0	COTTON NO.2 FUTR Dec20	9
CU0	CORN FUTURE Sep20	40
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	18
KR4175Q70(	2020-07 달러선물	6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	11
SBV0	Sugar Oct20	21
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	25
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	42
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	21

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

239