

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

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	2020-06-29
기준일	2020-06-26

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

1,058

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,270

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

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

607

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

877

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

유로인덱스모(주식-파생형)

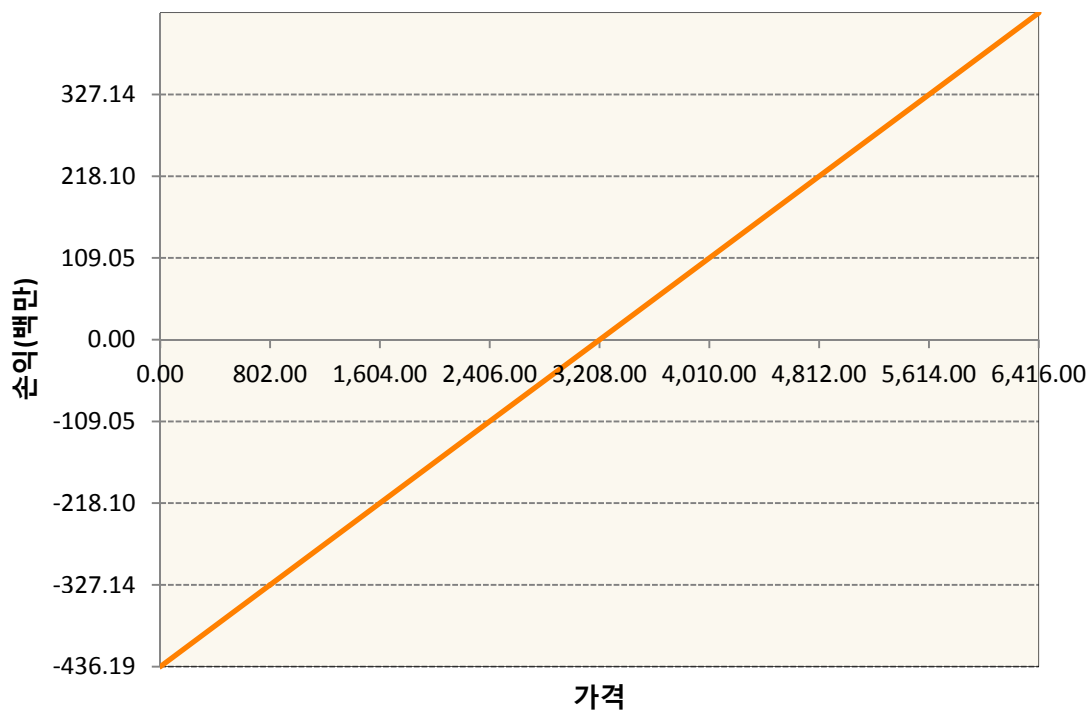
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	436	0	436	

2. 만기시점의 손익구조

VGU0-EURO STOXX 50 Sep20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU0 EURO STOXX 50 Sep20

35

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

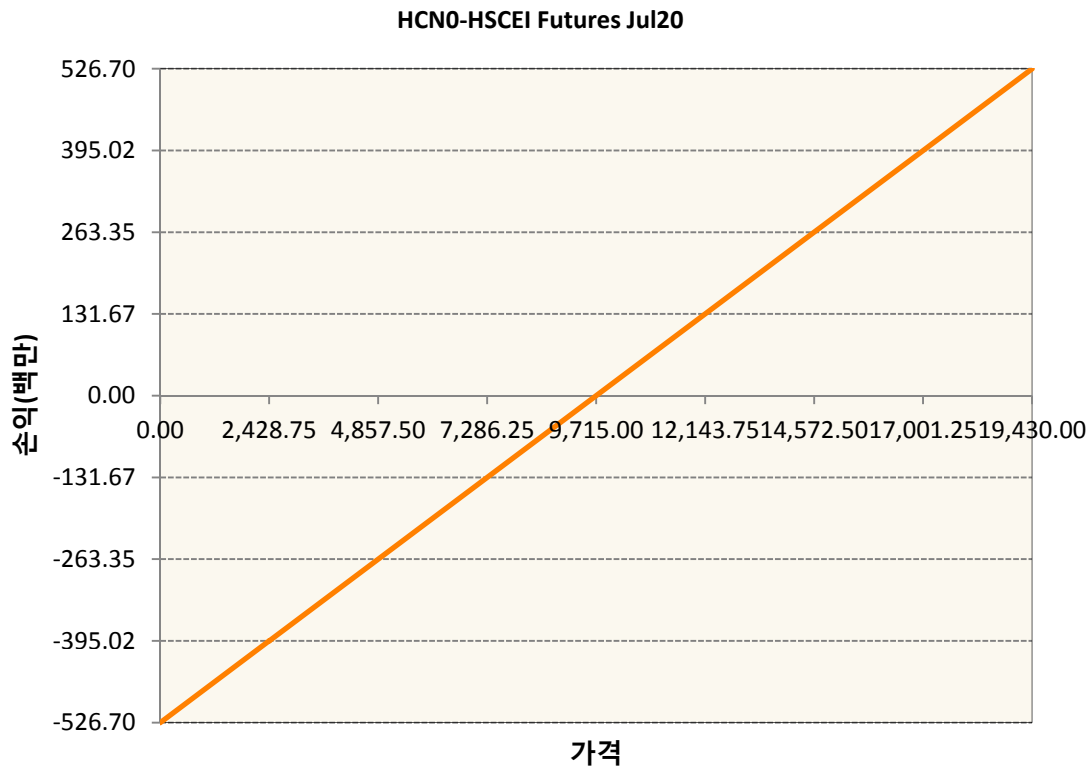
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	527	0	527	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN0	HSCEI Futures Jul20	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

46

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

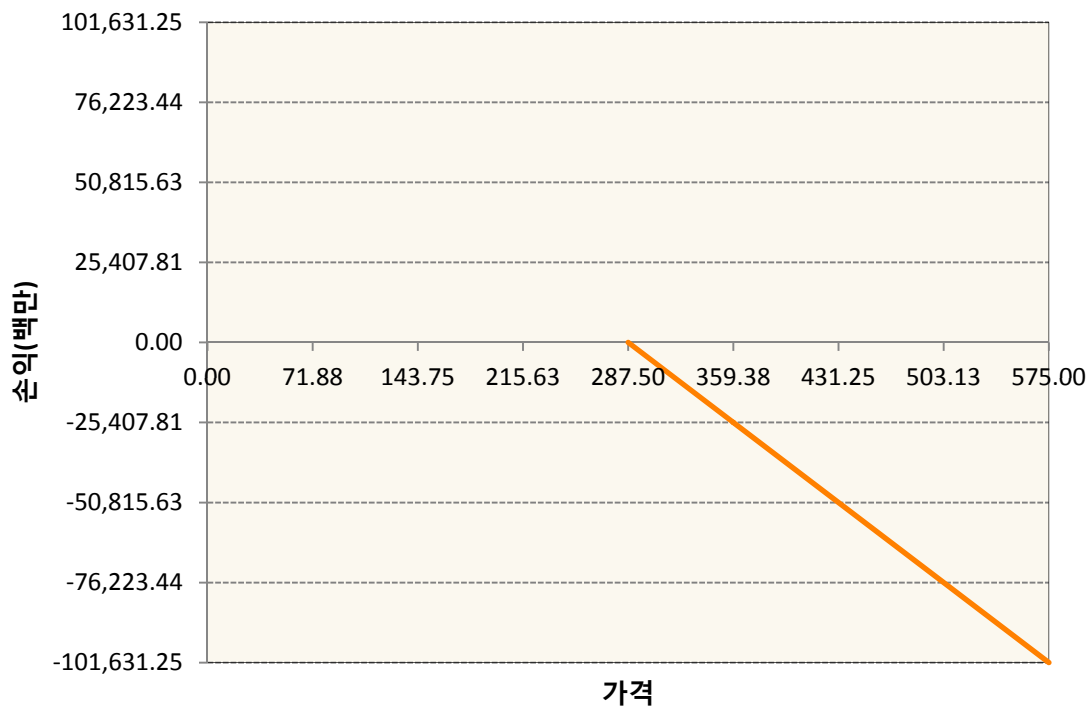
1. 계약금액

(단위:백만원)

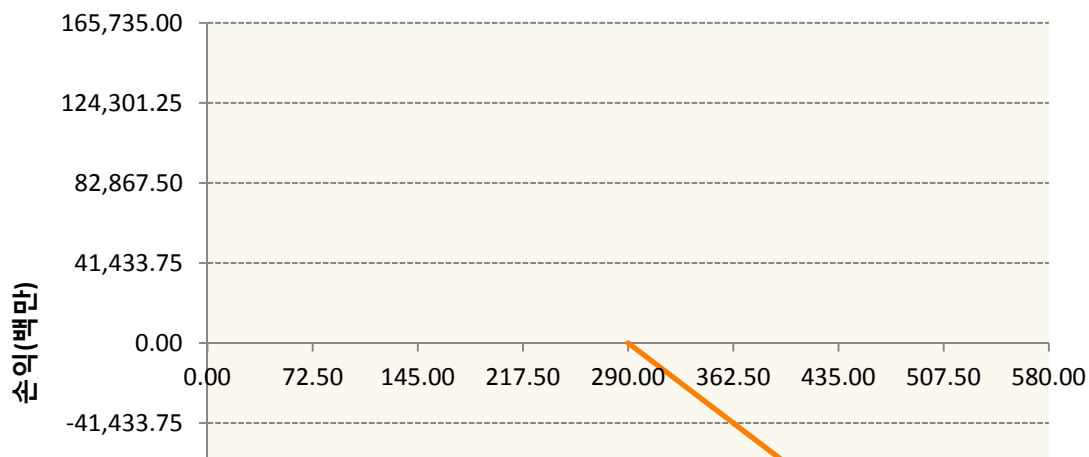
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

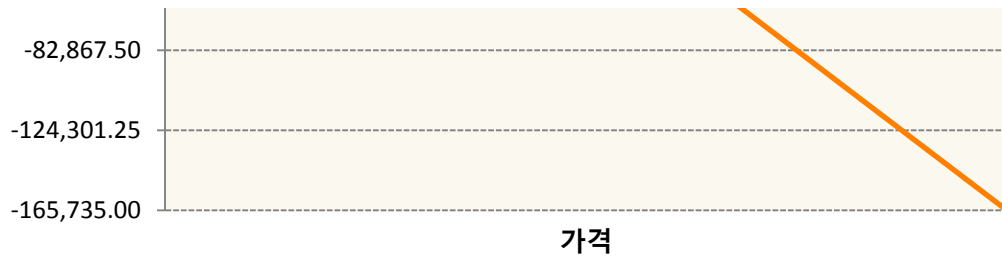
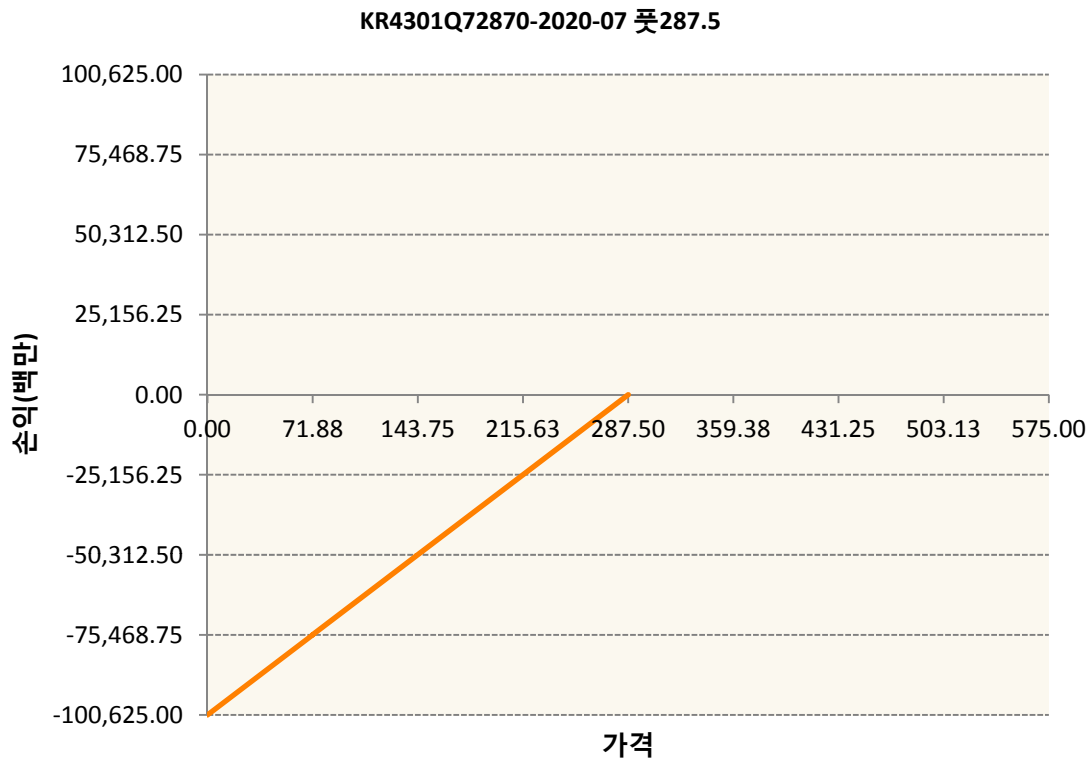
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872			2020-07 콜287.5				5,716
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,605	2,505	2,385	2,247	2,093	1,925	1,746
-5.33%	2,323	2,154	1,969	1,770	1,561	1,342	1,116
-2.67%	1,772	1,535	1,289	1,037	779	518	254
0%	855	571	286	0	-287	-574	-861
2.67%	-485	-776	-1,067	-1,359	-1,651	-1,943	-2,236
5.33%	-2,236	-2,494	-2,759	-3,029	-3,303	-3,581	-3,861
8.00%	-4,331	-4,532	-4,748	-4,977	-5,215	-5,462	-5,716
KR4201Q72906			2020-07 콜290				8,829
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,724	3,590	3,423	3,225	3,001	2,753	2,485

-5.33%	3,363	3,124	2,856	2,562	2,247	1,915	1,568
-2.67%	2,627	2,273	1,900	1,514	1,116	710	296
0%	1,347	903	453	0	-456	-914	-1,374
2.67%	-592	-1,070	-1,548	-2,025	-2,503	-2,981	-3,459
5.33%	-3,207	-3,652	-4,104	-4,561	-5,022	-5,487	-5,953
8.00%	-6,418	-6,781	-7,165	-7,564	-7,976	-8,398	-8,829
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,572
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,310	-6,329	-6,357	-6,395	-6,444	-6,503	-6,572
-5.33%	-3,747	-3,806	-3,878	-3,963	-4,059	-4,164	-4,278
-2.67%	-1,387	-1,511	-1,646	-1,788	-1,937	-2,091	-2,249
0%	552	369	185	0	-186	-374	-561
2.67%	1,893	1,704	1,514	1,324	1,132	940	748
5.33%	2,645	2,502	2,351	2,193	2,030	1,862	1,690
8.00%	2,978	2,898	2,803	2,696	2,578	2,451	2,316

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

(단위:백만원)

19,420

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

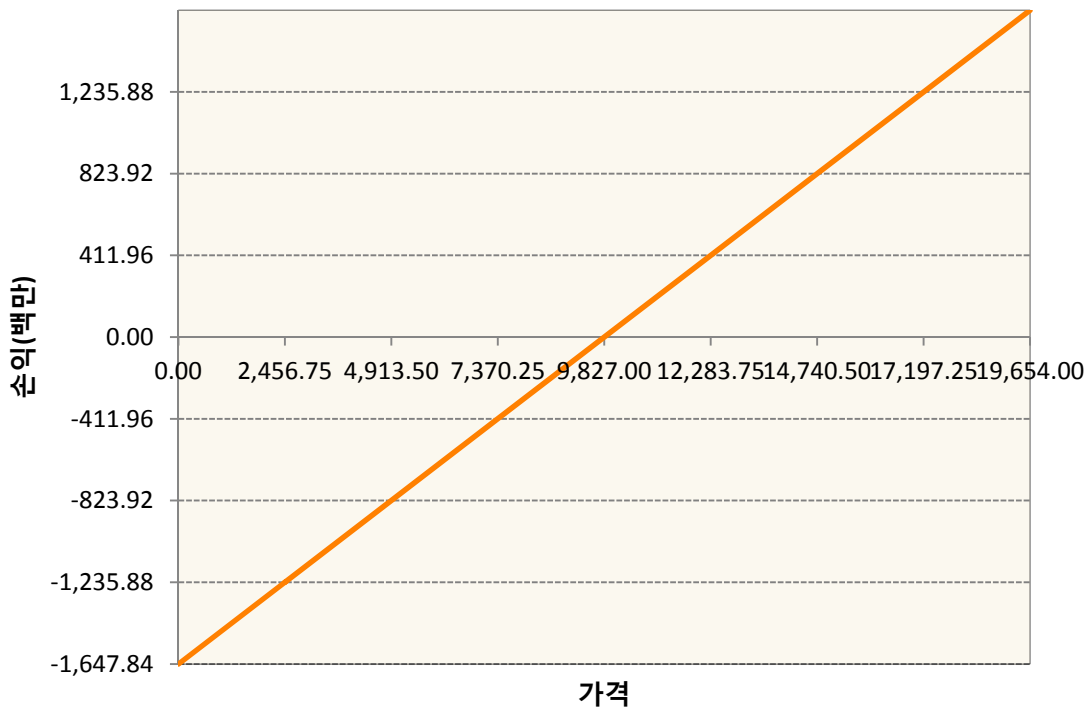
1. 계약금액

(단위:백만원)

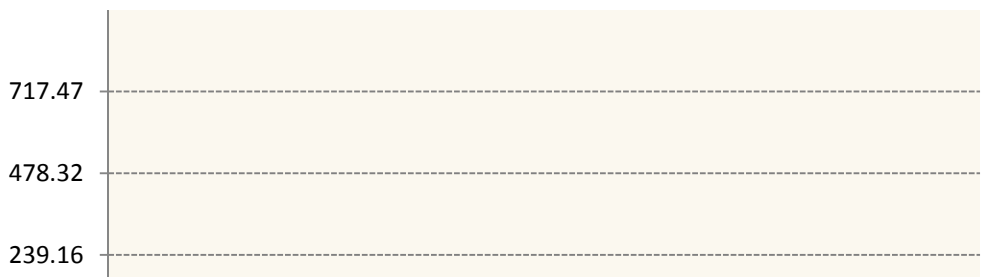
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,648	0	1,648	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,218	-4,218	장내
누계	통화	선도	0	1,500	-1,500	장외

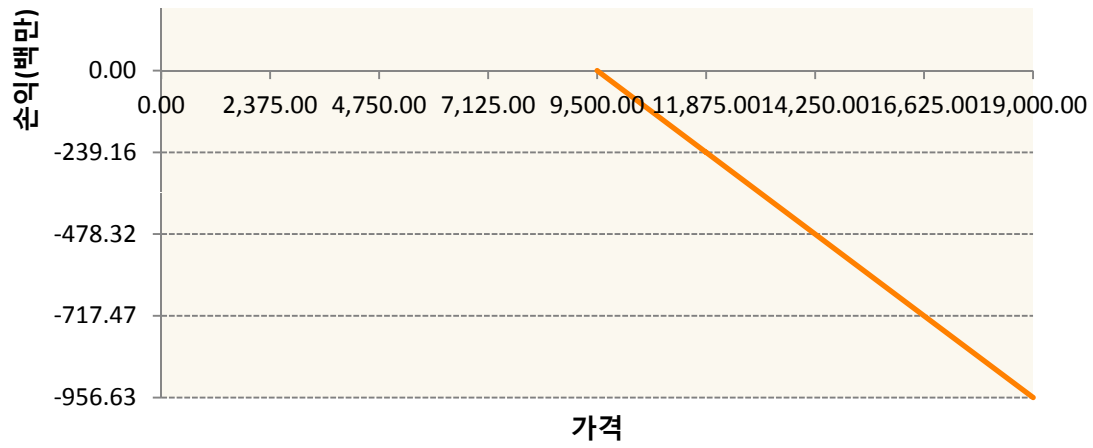
2. 만기시점의 손익구조

HCM0-HSCEI Futures Jun20

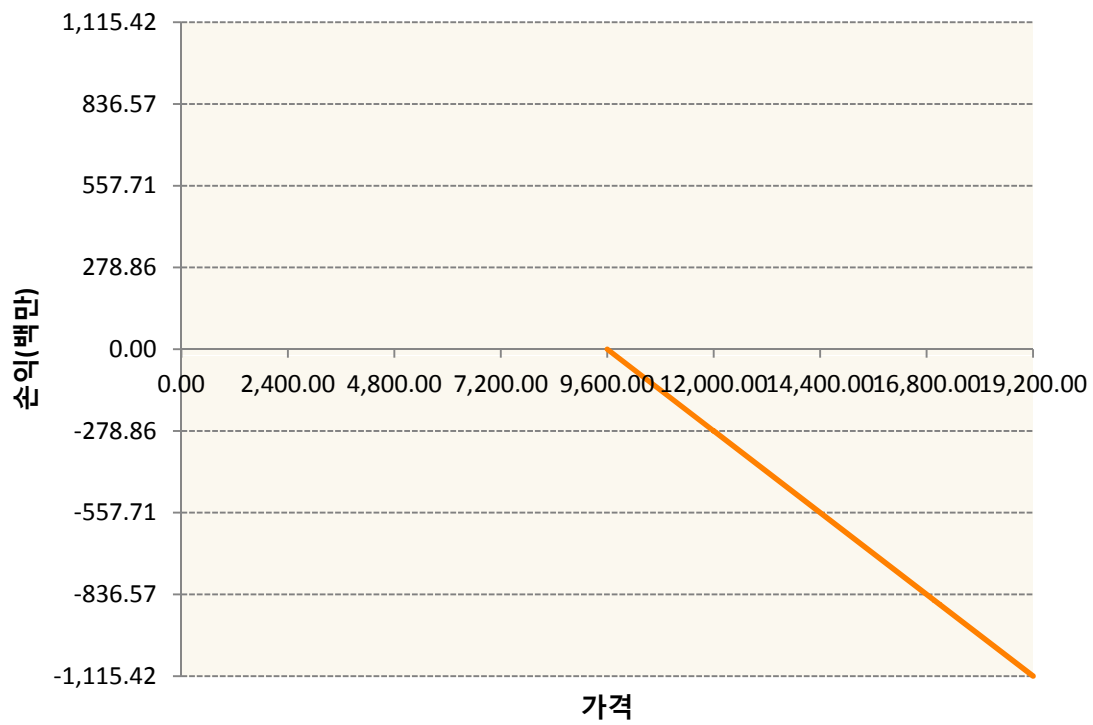


OHHIM0-C95-HSCEI

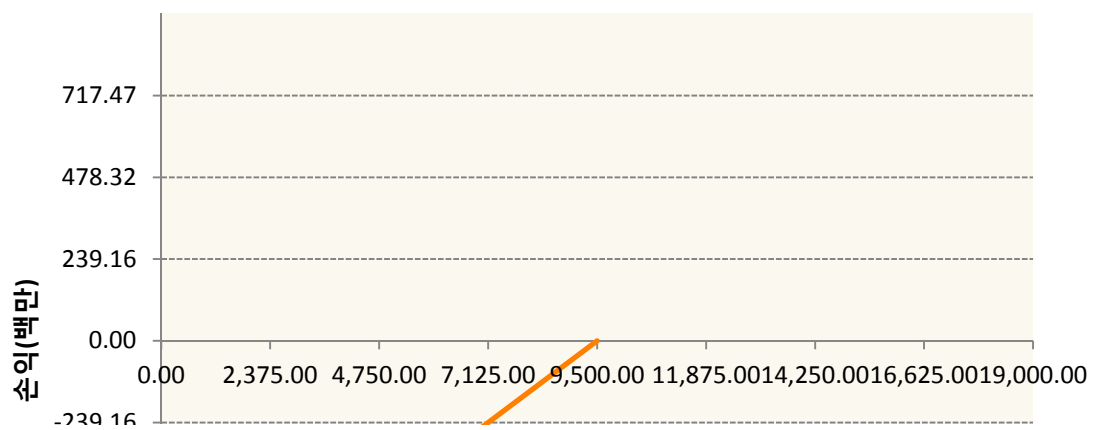


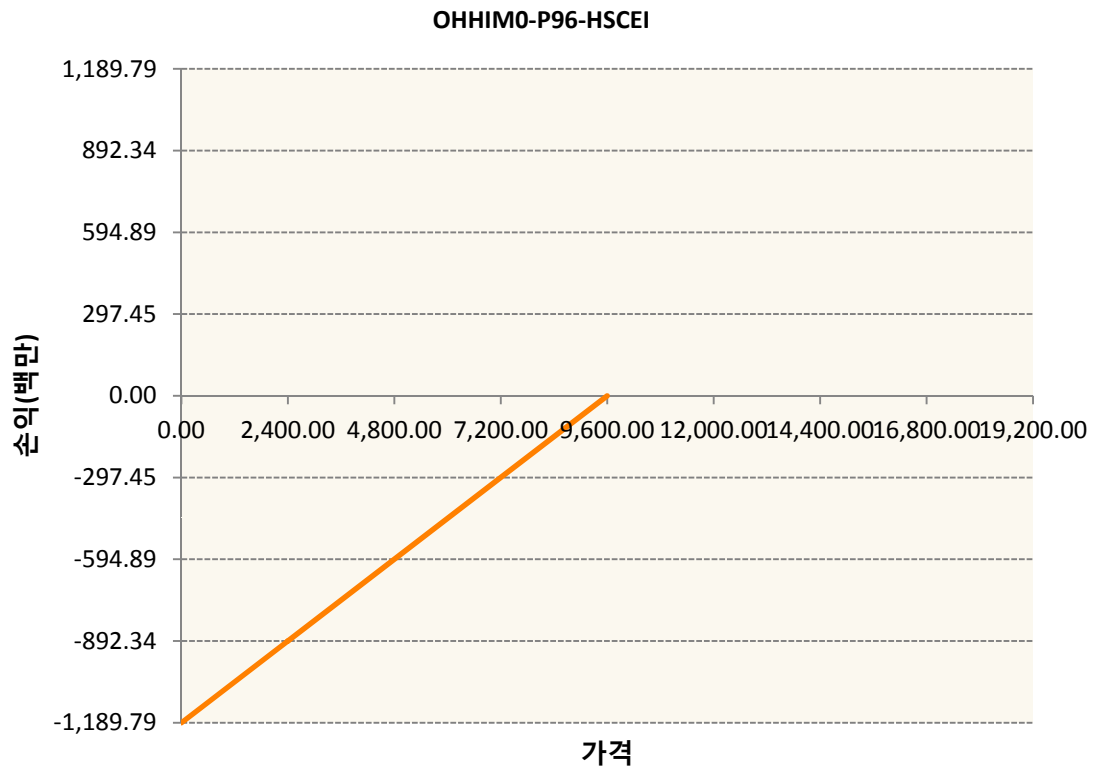


OHHIM0-C96-HSCEI



OHHIM0-P95-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		120
HCM0 HSCEI Futures Jun20		132
OHHIM0-C9 HSCEI		77
OHHIM0-C9 HSCEI		89
OHHIM0-P9 HSCEI		77
OHHIM0-P9 HSCEI		95

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

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

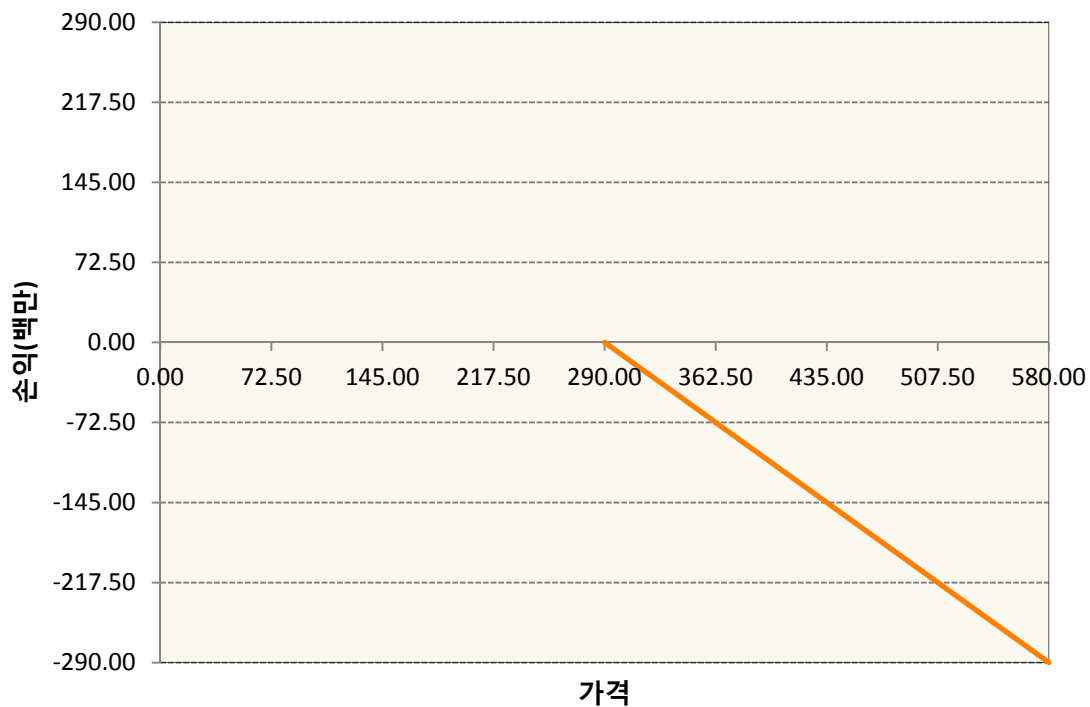
1. 계약금액

(단위:백만원)

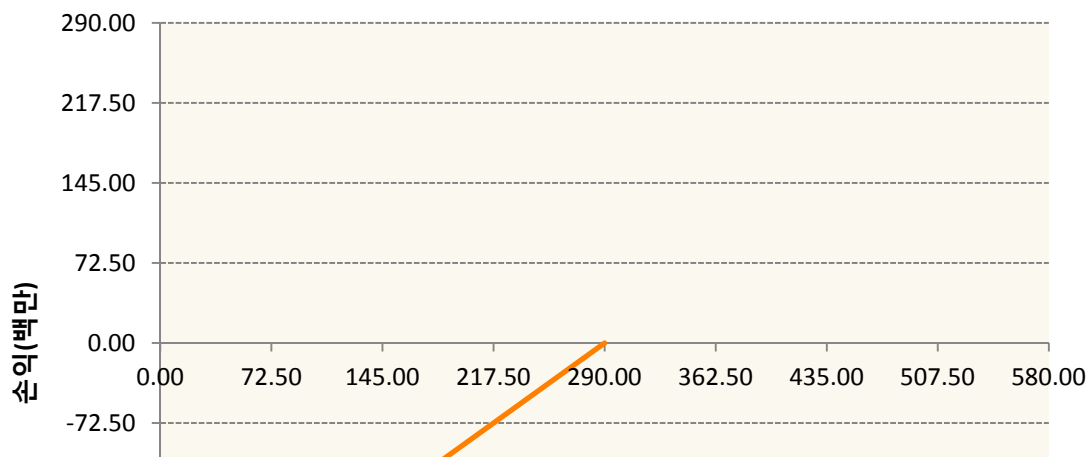
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	580	-580	장내

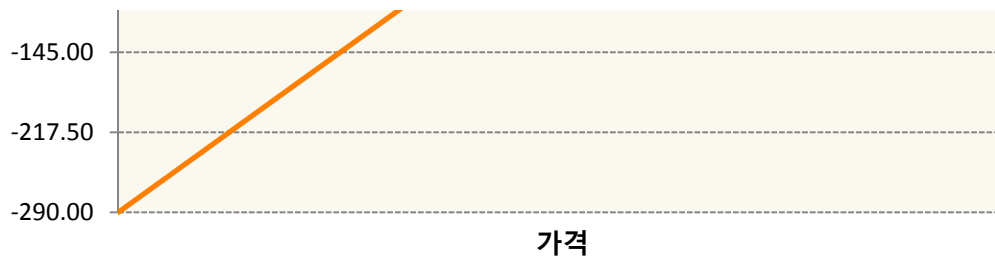
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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

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

34

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

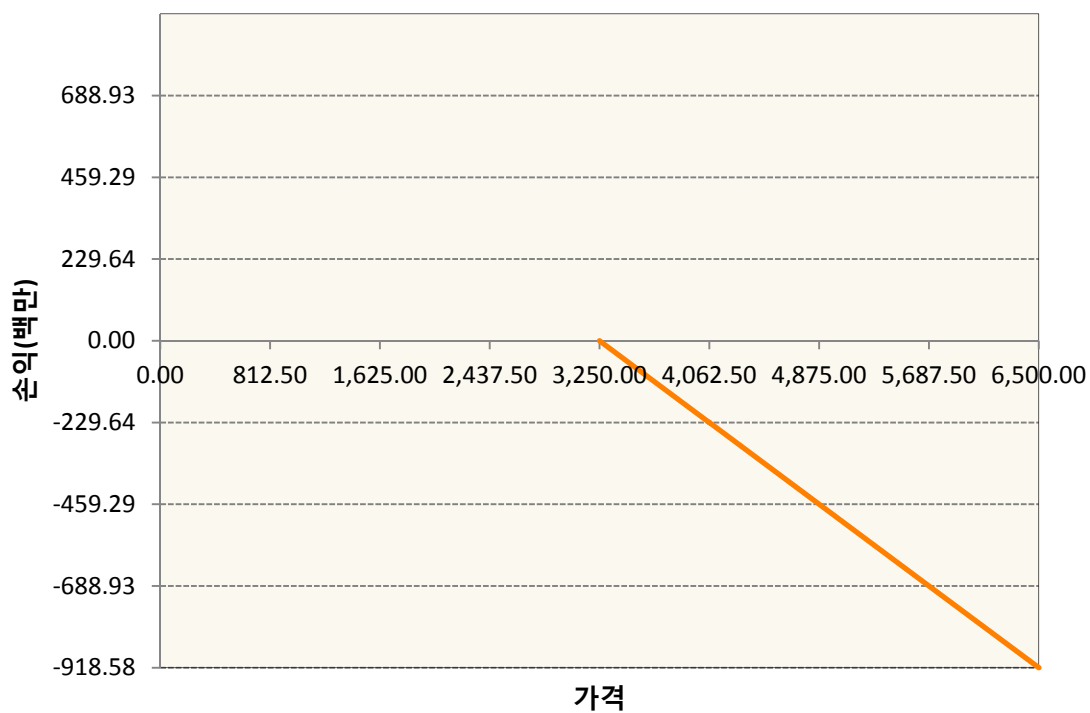
1. 계약금액

(단위:백만원)

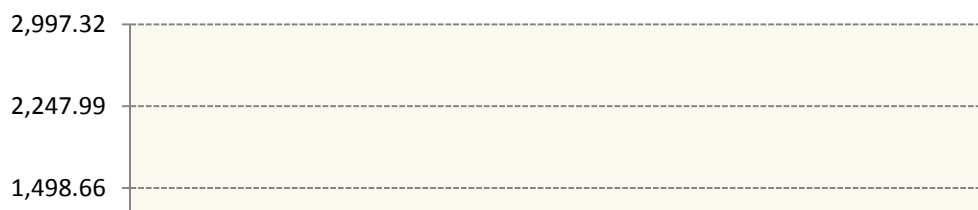
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,310	0	1,310	
누계	유가증권	스왑	8,027	0	8,027	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,832	-7,832	장내
누계	통화	선도	0	2,912	-2,912	장외

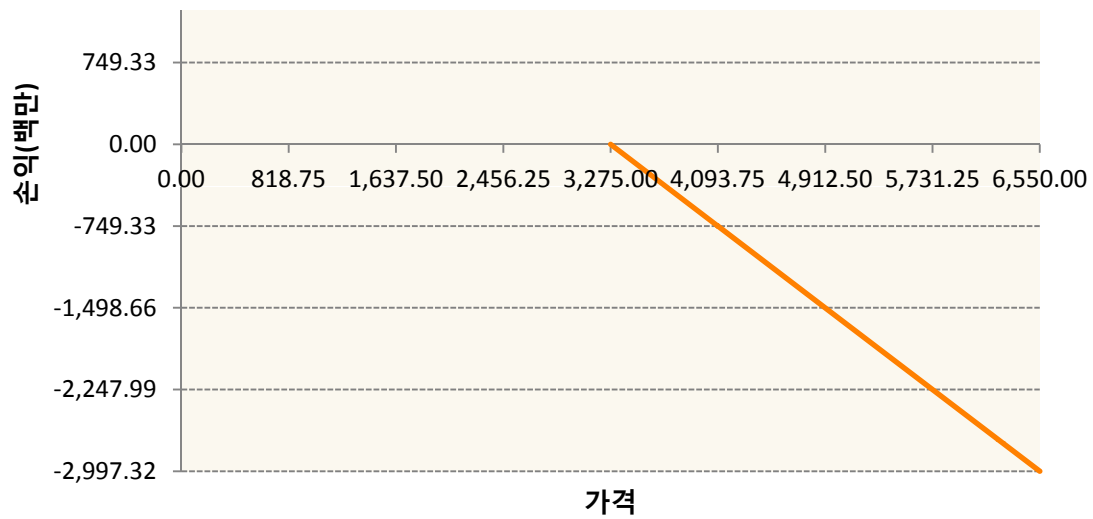
2. 만기시점의 손익구조

OESXN0-C3250-EURO STOXX 50

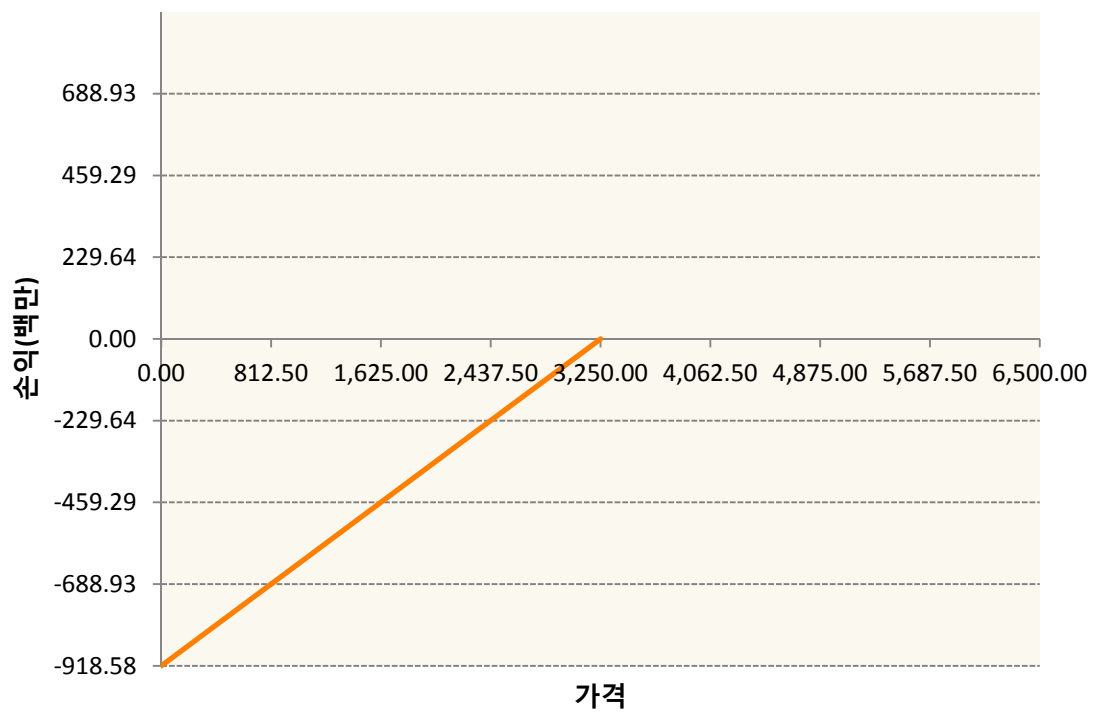


OESXN0-C3275-EURO STOXX 50

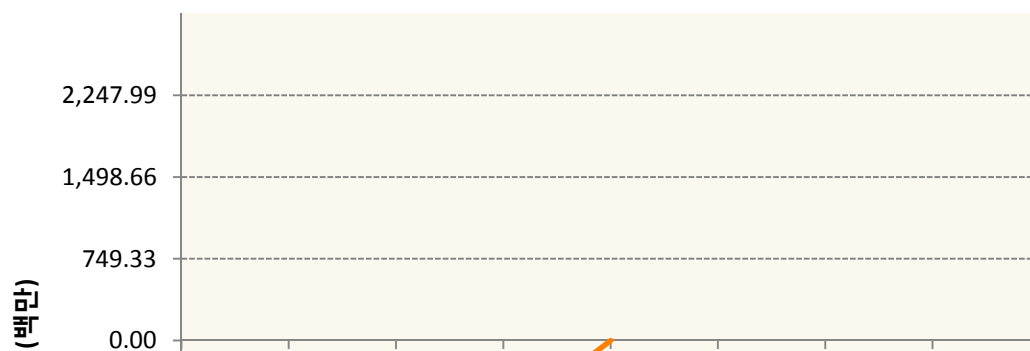


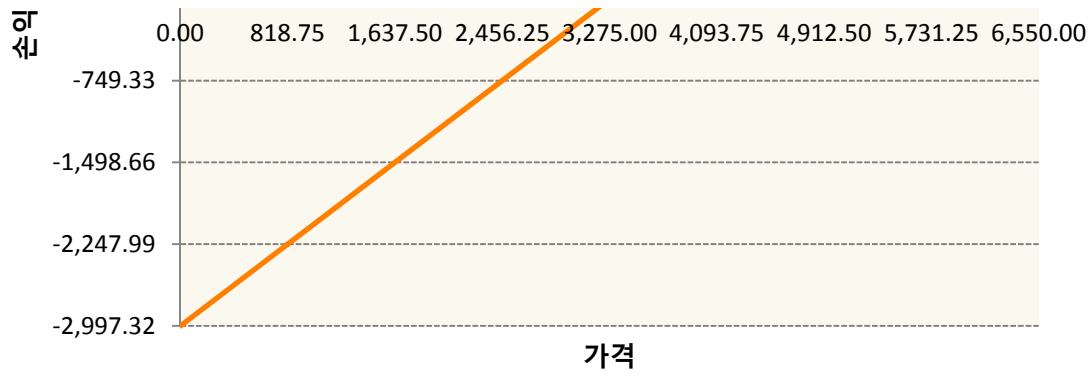
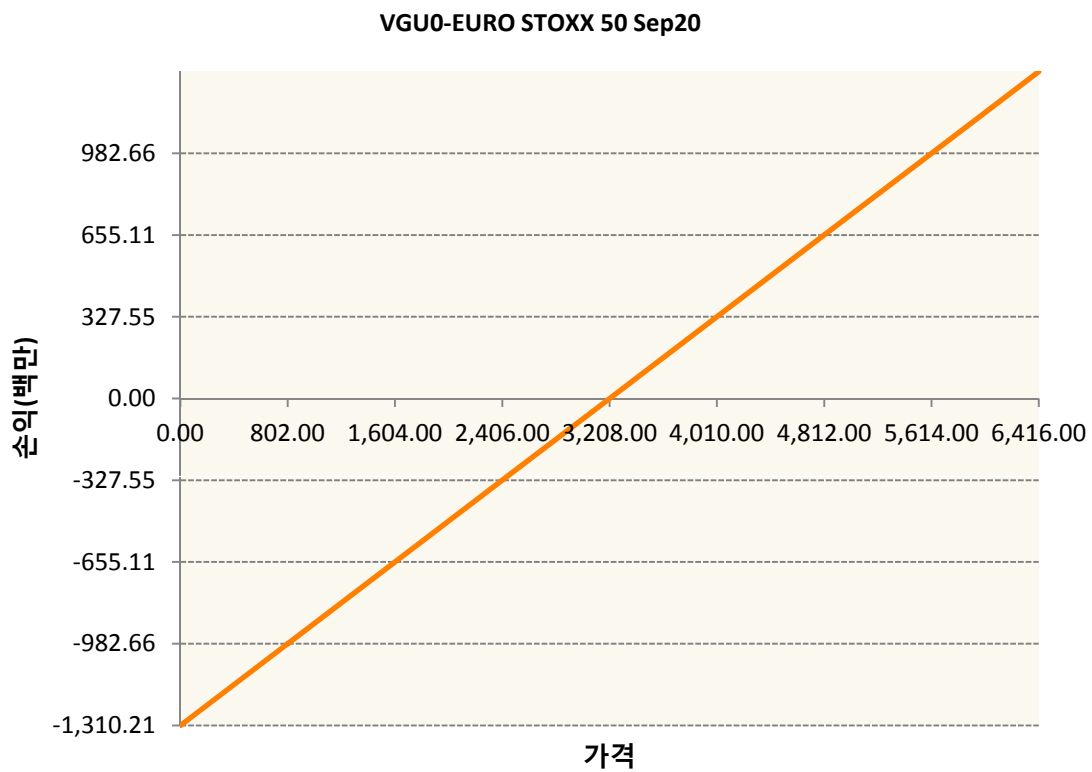


OESXN0-P3250-EURO STOXX 50



OESXN0-P3275-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		18
FX21020M0₩KRW/EUR 25-09-20E		233
OESXN0-C3₩EURO STOXX 50		73
OESXN0-C3₩EURO STOXX 50		240
OESXN0-P3₩EURO STOXX 50		73
OESXN0-P3₩EURO STOXX 50		240
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20		105

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

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

ETF스마트레버리지목표전환형8호

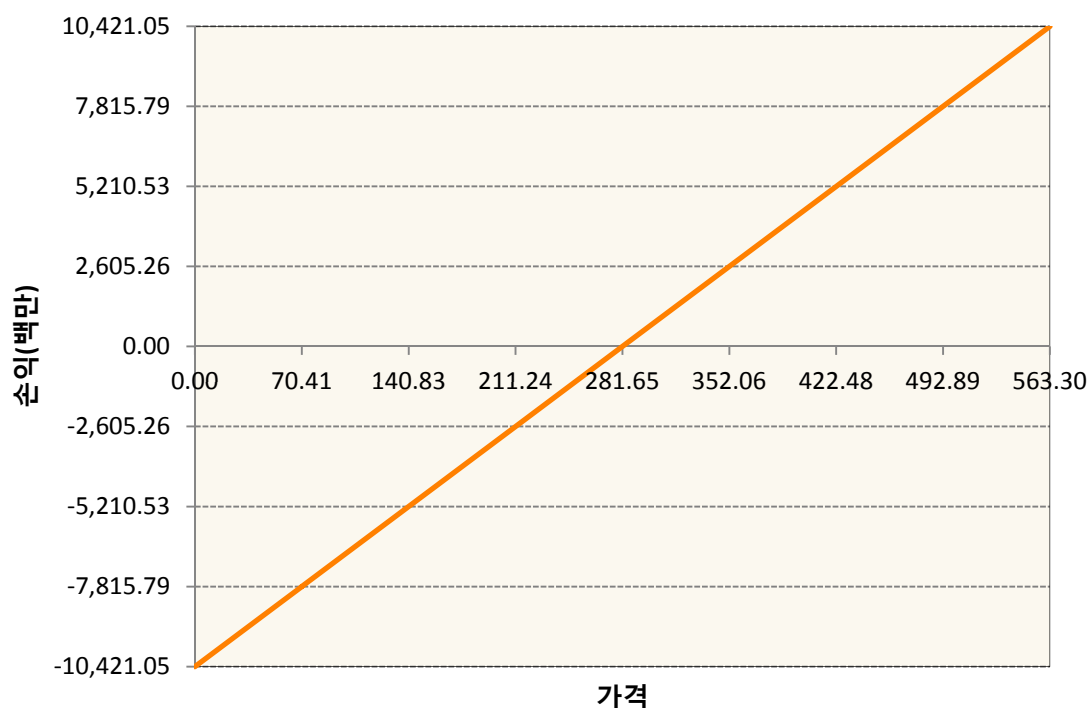
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,421	0	10,421	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물	839
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-839	-839	-839	-839	-839	-839	-839	
-5.33%	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-559	
-2.67%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	280	280	280	280	280	280	280	
5.33%	559	559	559	559	559	559	559	
8.00%	839	839	839	839	839	839	839	

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

(단위:백만원)

1,327

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

ETF스마트레버리지목표전환형9호

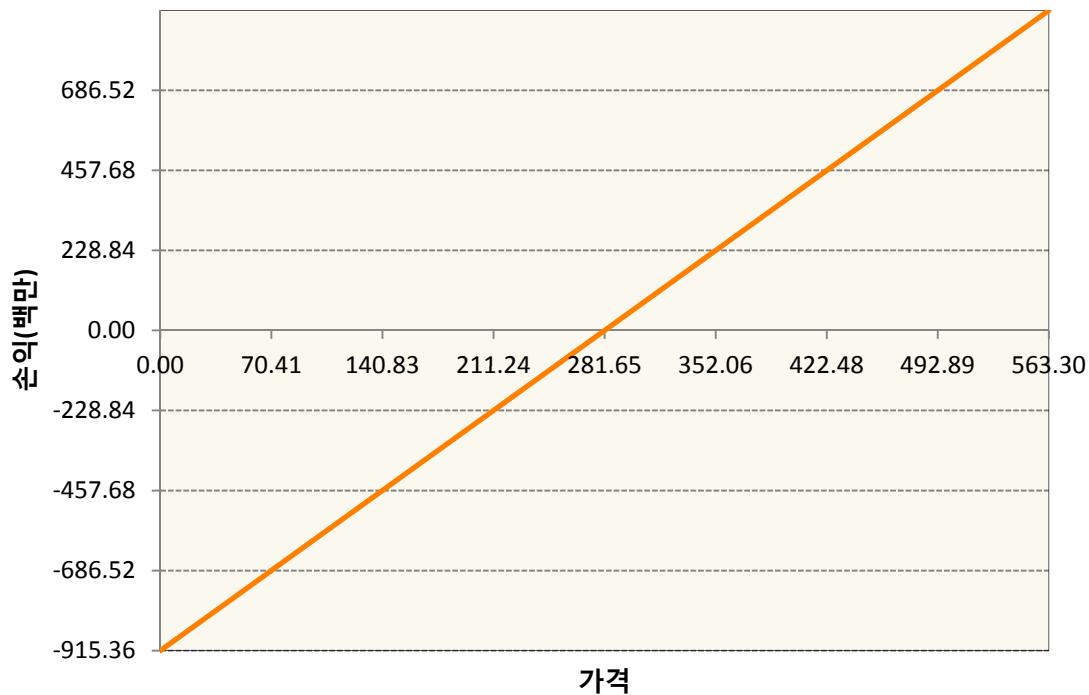
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	915	0	915	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		74
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	49	49	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	74	74	74	74	74	74	74	74	74

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

(단위:백만원)

117

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

(단위:백만원)

170

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

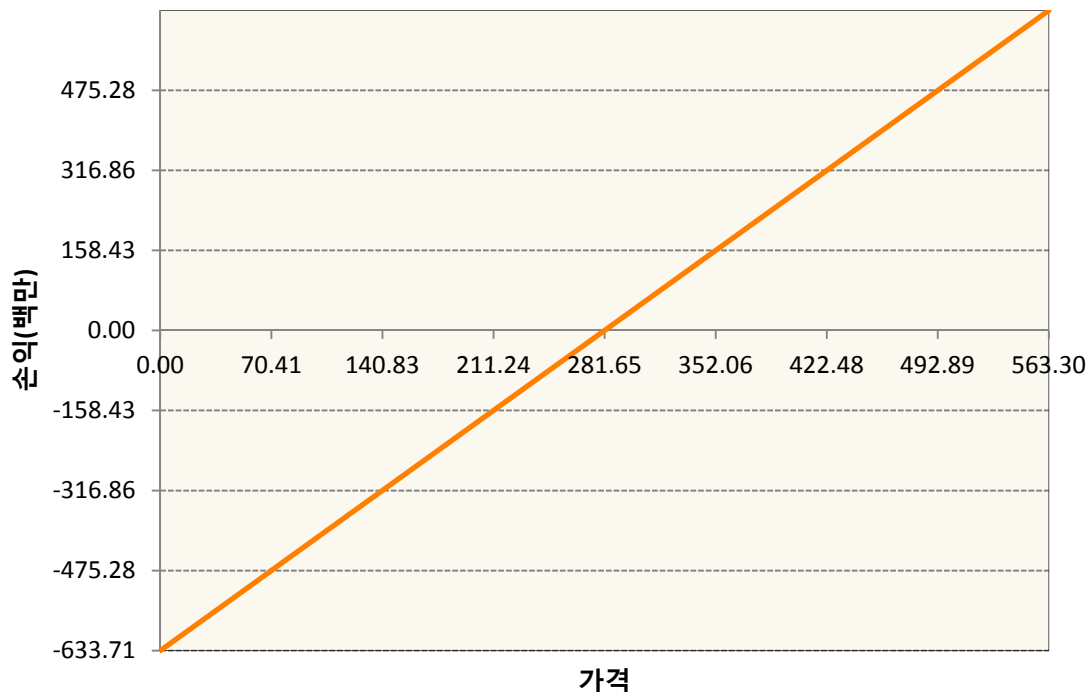
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	634	0	634	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		51
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	34	34	34	34	34	34	34	34	
8.00%	51	51	51	51	51	51	51	51	

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

(단위:백만원)

81

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

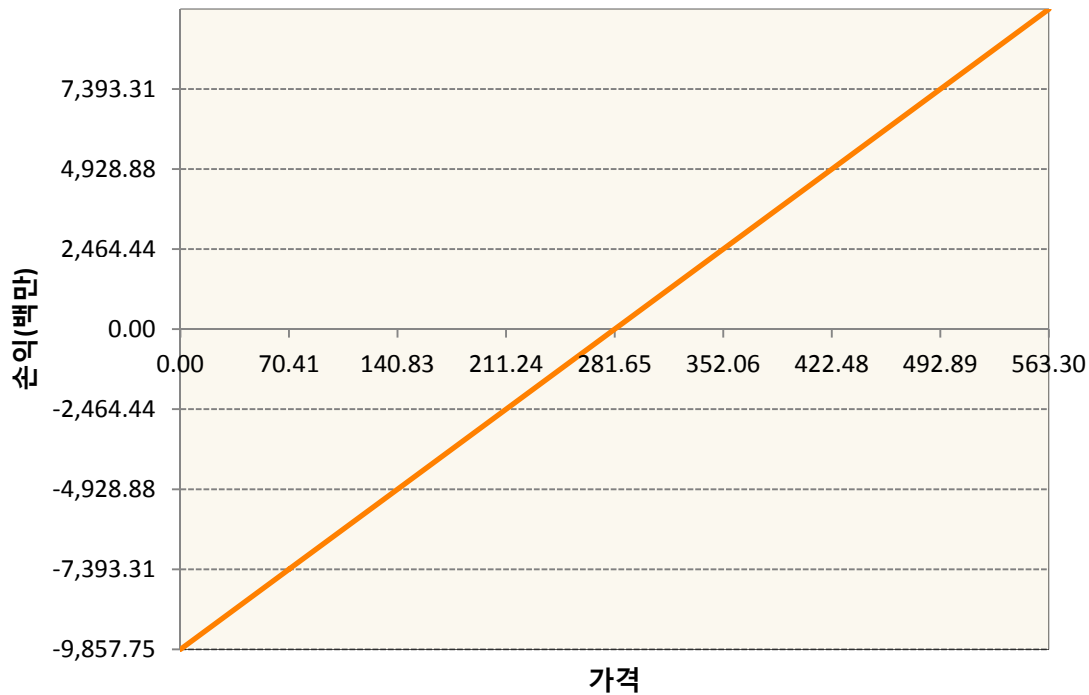
1. 계약금액

(단위:백만원)

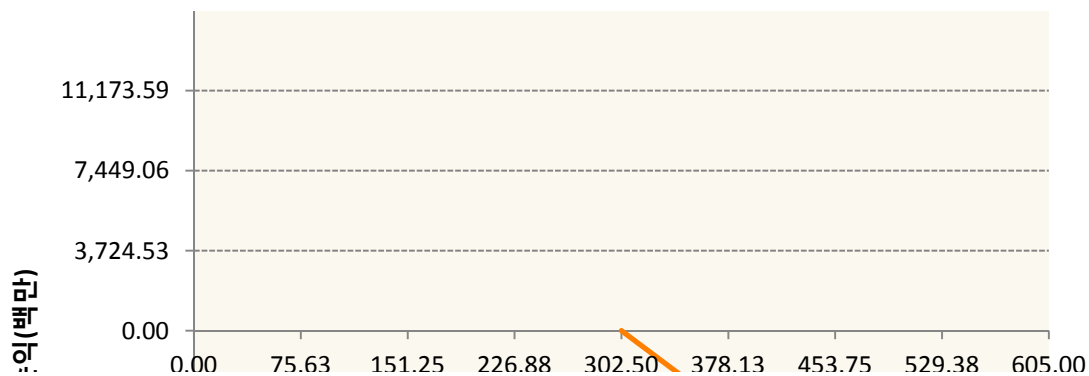
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,858	0	9,858	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

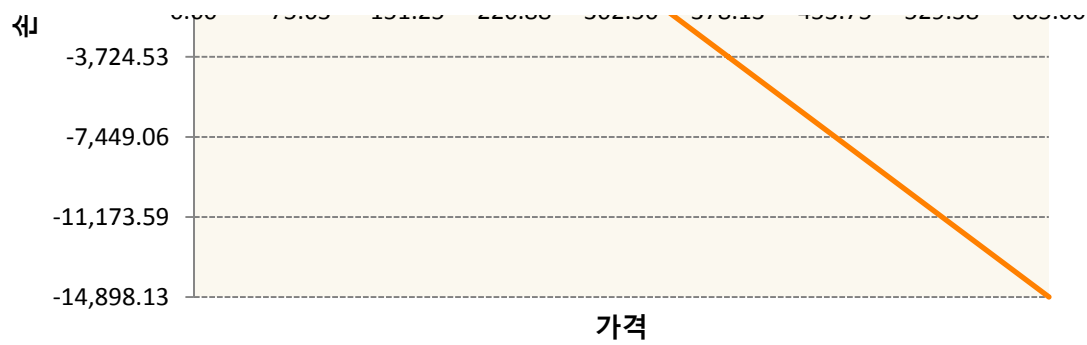
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

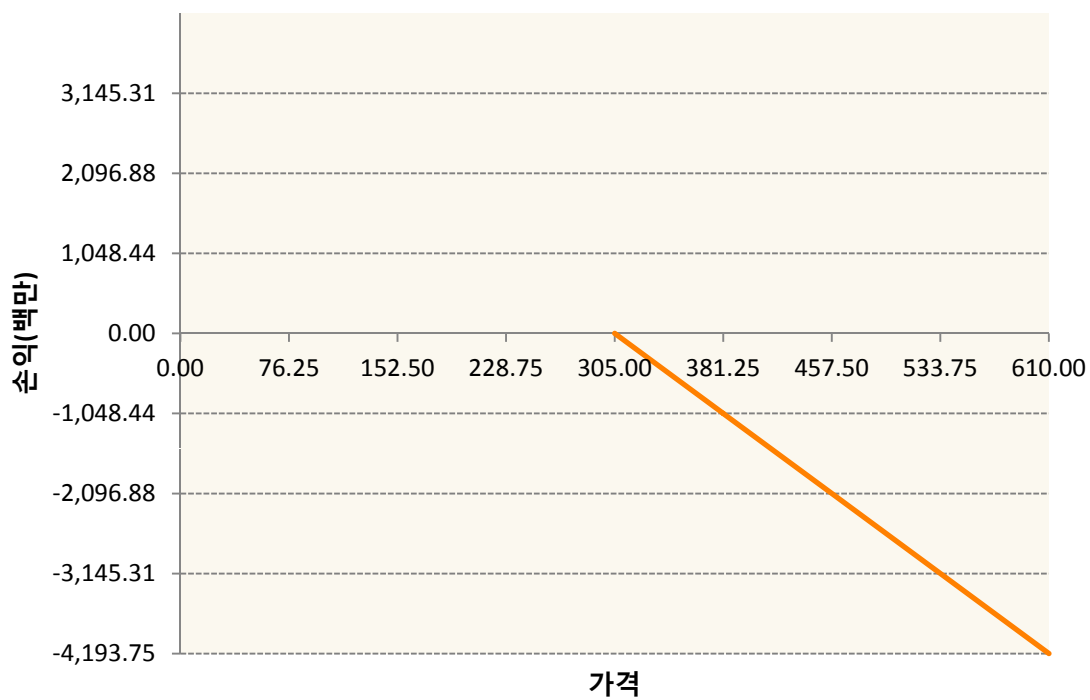


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

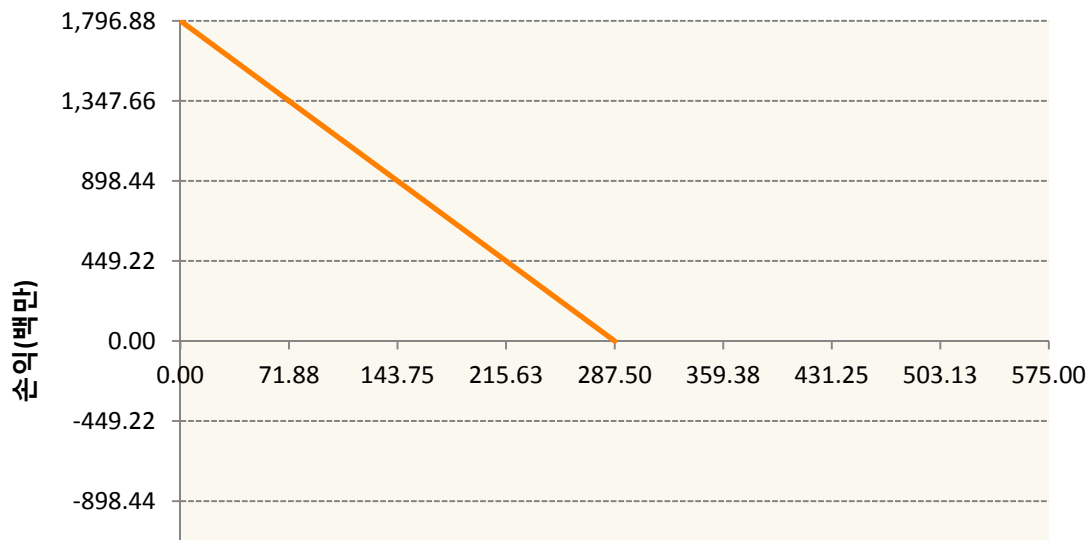


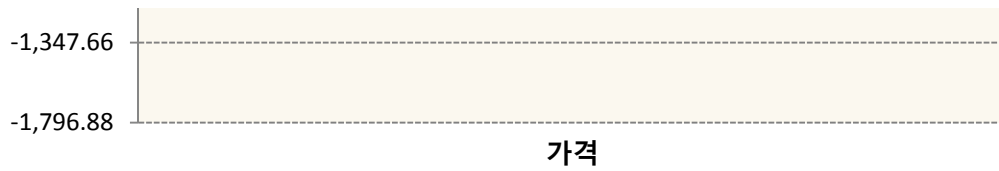
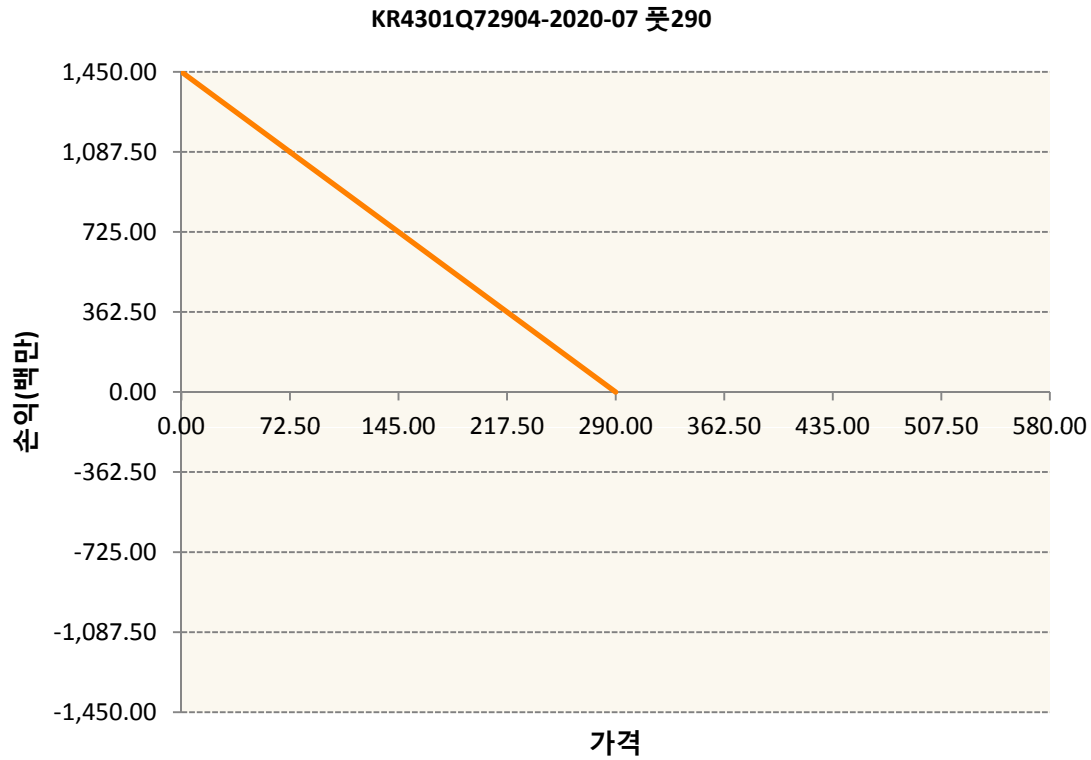


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009 2020-09 코스피200지수선물								793
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793
-5.33%	-529	-529	-529	-529	-529	-529	-529	-529
-2.67%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	264	264	264	264	264	264	264	264
5.33%	529	529	529	529	529	529	529	529
8.00%	793	793	793	793	793	793	793	793
KR4201Q73029 2020-07 콜302.5								573
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	158	154	148	140	130	118	103	
-5.33%	150	141	130	116	99	80	60	
-2.67%	129	113	94	72	48	22	-6	

0%	85	59	30	0	-32	-65	-99
2.67%	3	-33	-69	-107	-145	-184	-223
5.33%	-128	-170	-212	-254	-296	-338	-381
8.00%	-316	-359	-401	-444	-487	-530	-573
KR4201Q73052 2020-07 콜305							149
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	37	35	34	31	28	25
-5.33%	36	34	31	28	24	19	14
-2.67%	32	28	23	17	11	5	-3
0%	22	15	8	0	-8	-17	-26
2.67%	2	-7	-17	-27	-37	-47	-58
5.33%	-30	-41	-52	-64	-76	-87	-99
8.00%	-77	-89	-101	-113	-125	-137	-149
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							117
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	113	113	114	114	115	116	117
-5.33%	67	68	69	71	72	74	76
-2.67%	25	27	29	32	35	37	40
0%	-10	-7	-3	0	3	7	10
2.67%	-34	-30	-27	-24	-20	-17	-13
5.33%	-47	-45	-42	-39	-36	-33	-30
8.00%	-53	-52	-50	-48	-46	-44	-41
KR4301Q72904 2020-07 풋290							97
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	95	95	95	96	97	97
-5.33%	57	58	59	60	61	62	64
-2.67%	23	24	26	27	29	31	33
0%	-7	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-30	-27	-24	-21	-18	-16	-13
5.33%	-43	-41	-38	-36	-33	-31	-28
8.00%	-49	-48	-46	-44	-43	-40	-38

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

(단위:백만원)

1,946

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

H2O글로벌본드(USD)(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	136,932	0	136,932	

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	2020-06-29
기준일	2020-06-26

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	99,008	0	99,008	

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	2020-06-29
기준일	2020-06-26

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	461,282	0	461,282	
누계	통화	선도	0	439,900	-439,900	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J03: KRW/USD 24-07-20E	2,161
FX21020J04: KRW/USD 24-07-20E	1,729
FX21020J04: KRW/USD 24-07-20E	1,921
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,344
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	960
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,009
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,594
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,362
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,819
FX21020M0: KRW/USD 26-08-20E	576
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,706
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	1,998
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,420
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	999
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	2,593

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,125

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

(단위:백만원)

233

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

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	7,603	0	7,603	
누계	통화	선도	0	7,912	-7,912	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
FX21020M00 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
FX21020M07 KRW/USD 27-07-20E	36

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

326

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

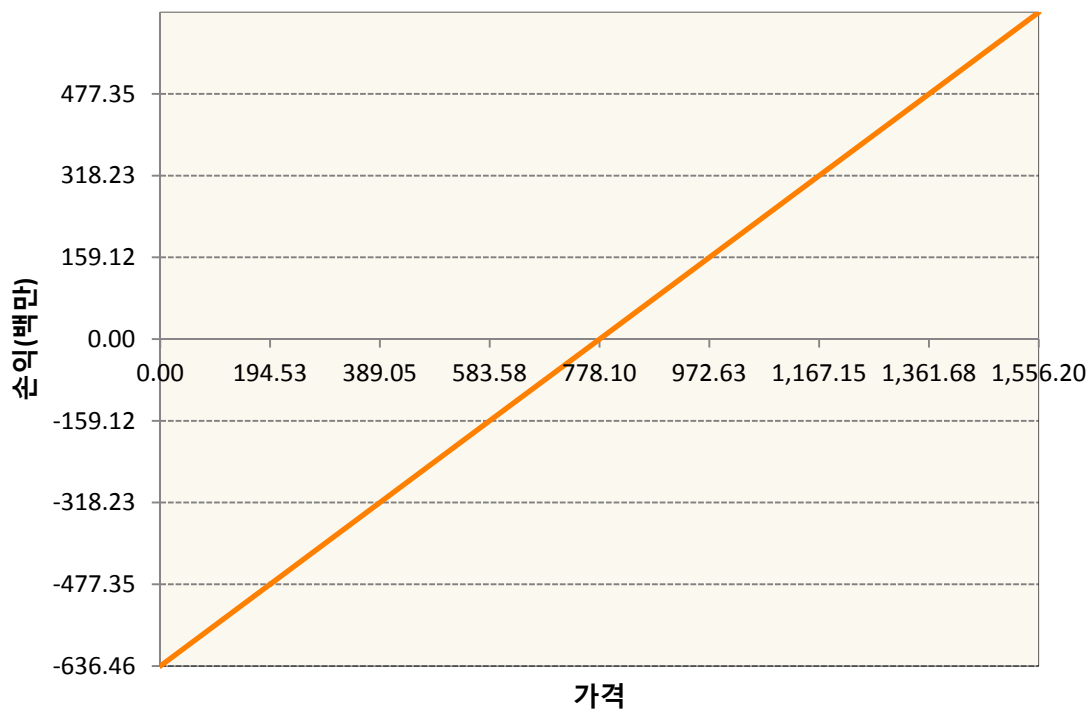
1. 계약금액

(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	636	0	636	
누계	유가증권	스왑	976	0	976	장외
누계	통화	선도	0	673	-673	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCN0-VN30 Index Future Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	78
FX21020J00€ KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J00\$ KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J01€ KRW/EUR 24-07-20E	3
FX21020J02\$ KRW/EUR 24-07-20E	5
FX21020J03€ KRW/EUR 24-07-20E	1

FX21020K00 KRW/EUR 24-07-20E
FX21020K01 KRW/EUR 24-07-20E
FX21020K03 KRW/EUR 28-08-20E
VNCN0 VN30 Index Future Jul20

5
9
22
51

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

(단위:백만원)

153

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

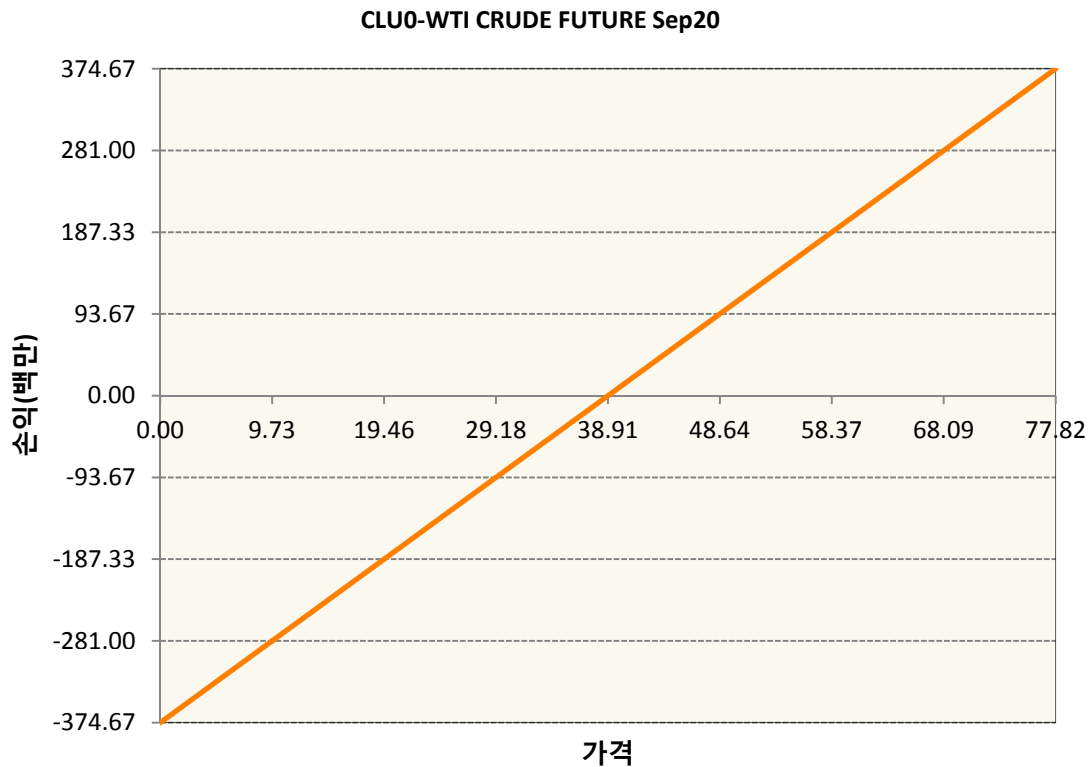
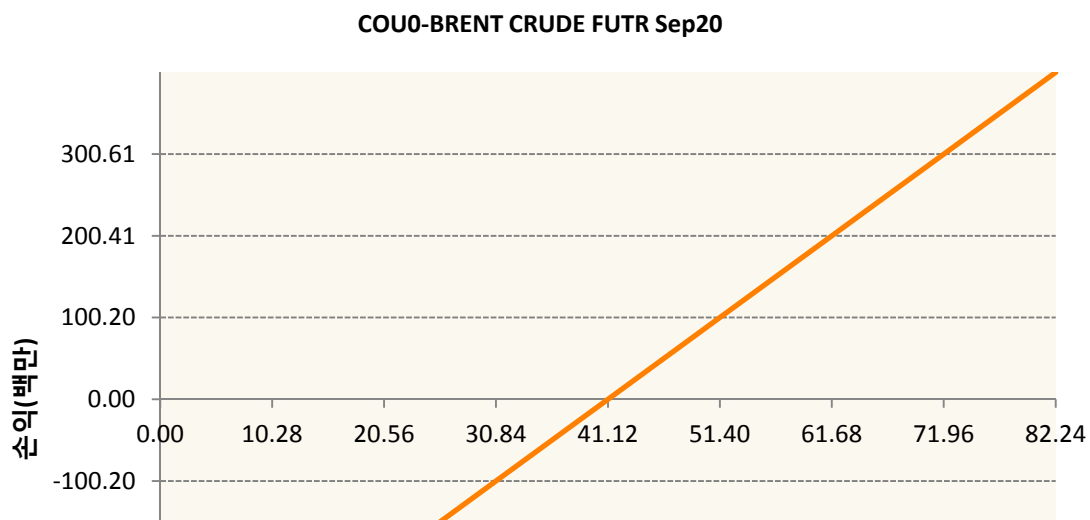
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

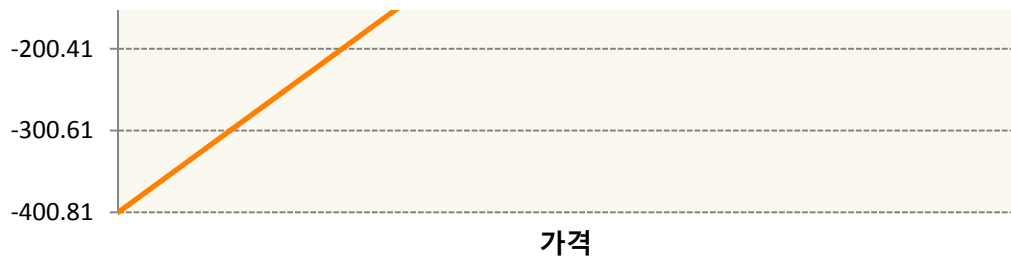
1. 계약금액

(단위:백만원)

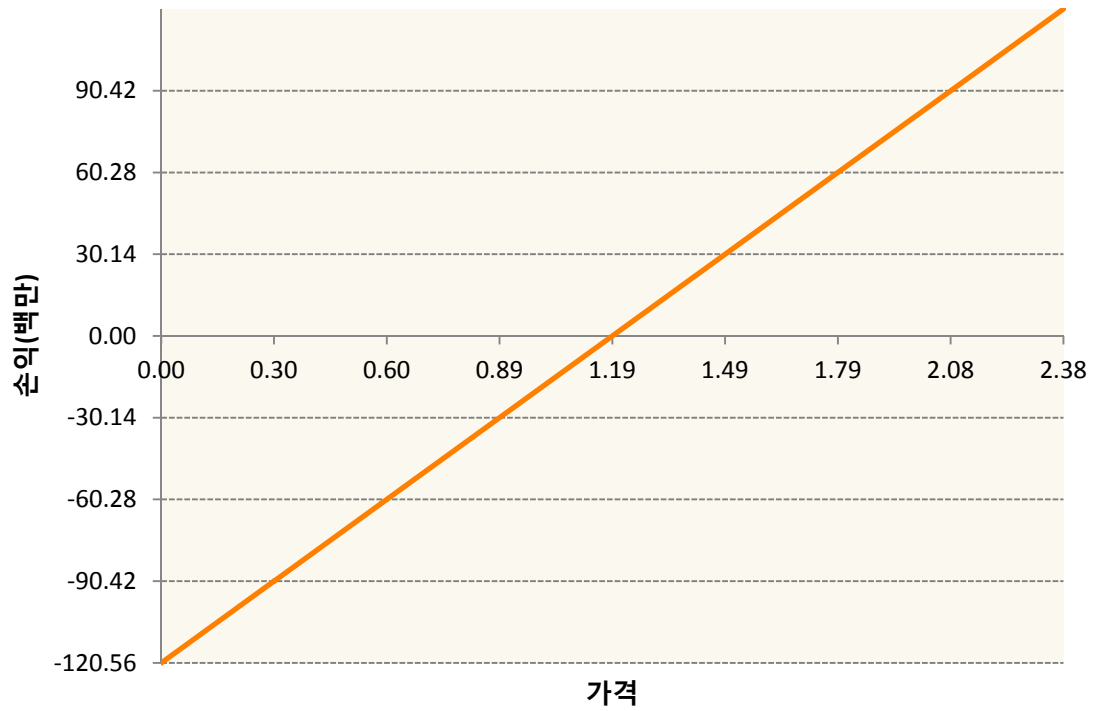
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,786	360	1,426	

2. 만기시점의 손익구조

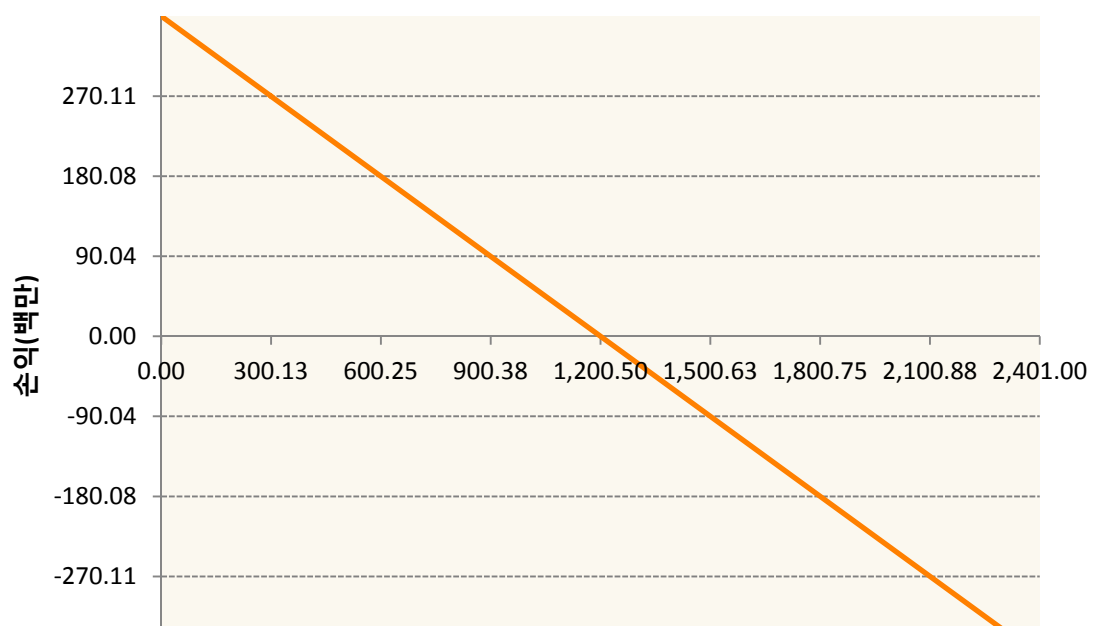


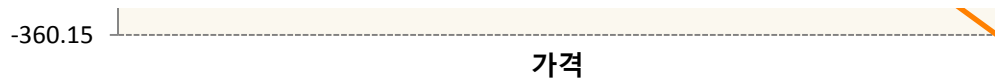
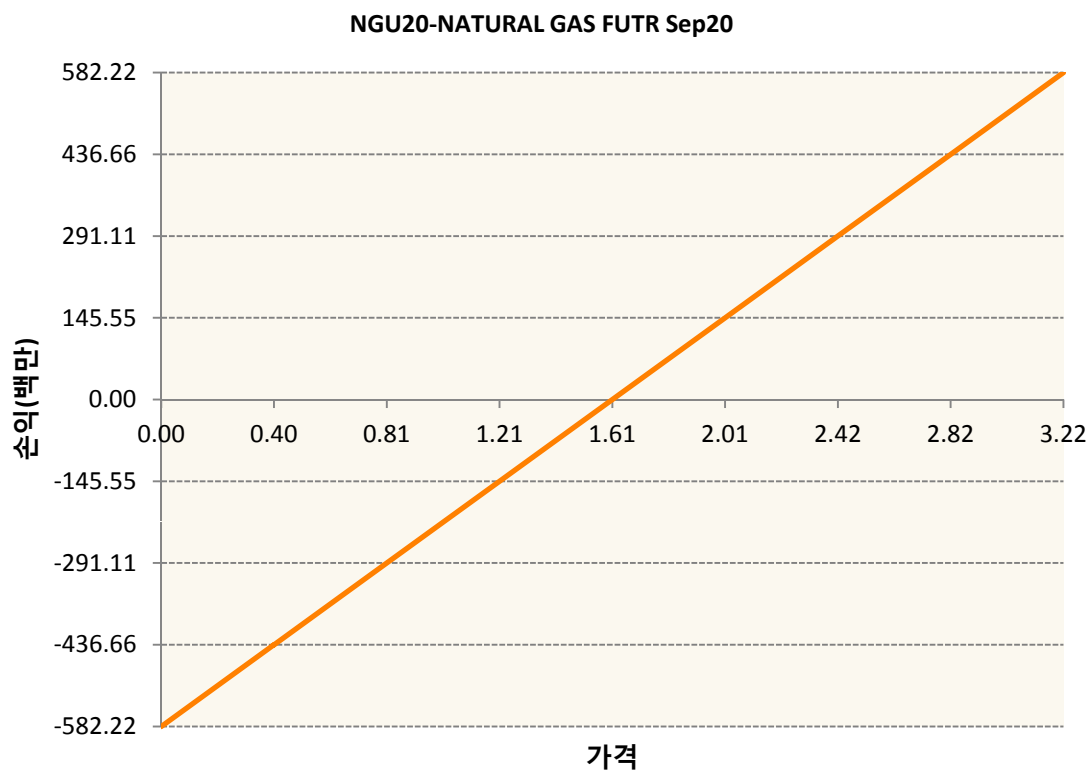
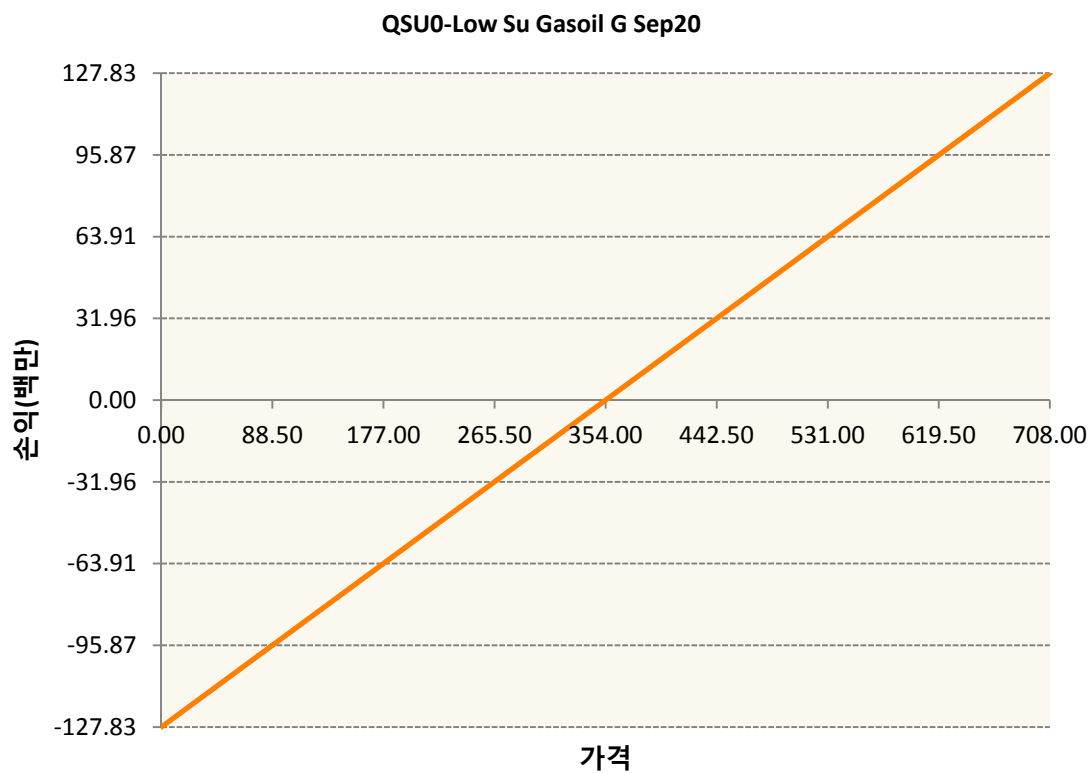


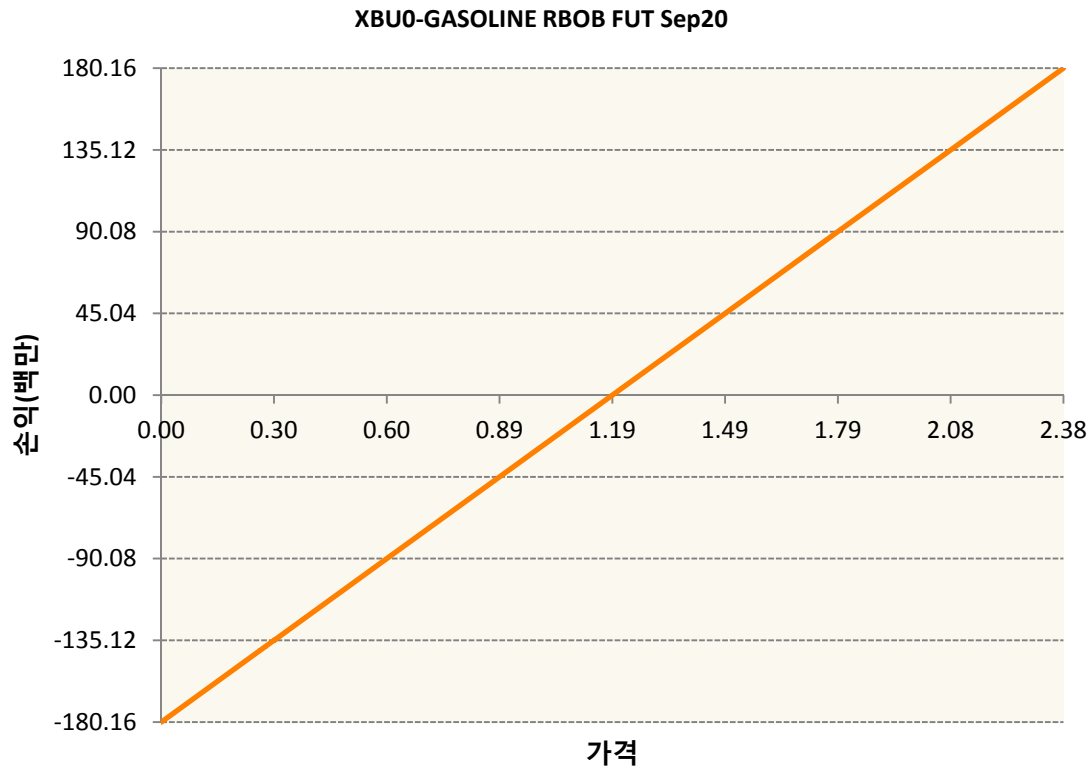
HOU0-NY Harb ULSD Fut Sep20



KR4175Q70005-2020-07 달러선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20	30
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20	32
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20	10
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20	47
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20	10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20	14

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

885

공시일	2020-06-29
기준일	2020-06-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

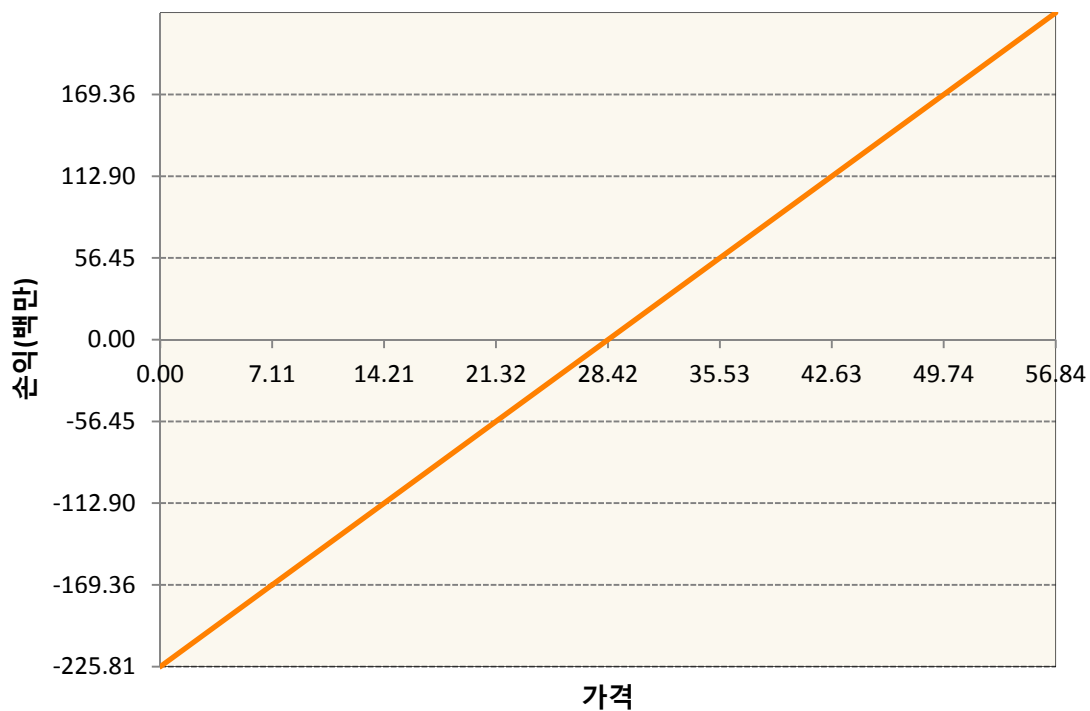
1. 계약금액

(단위:백만원)

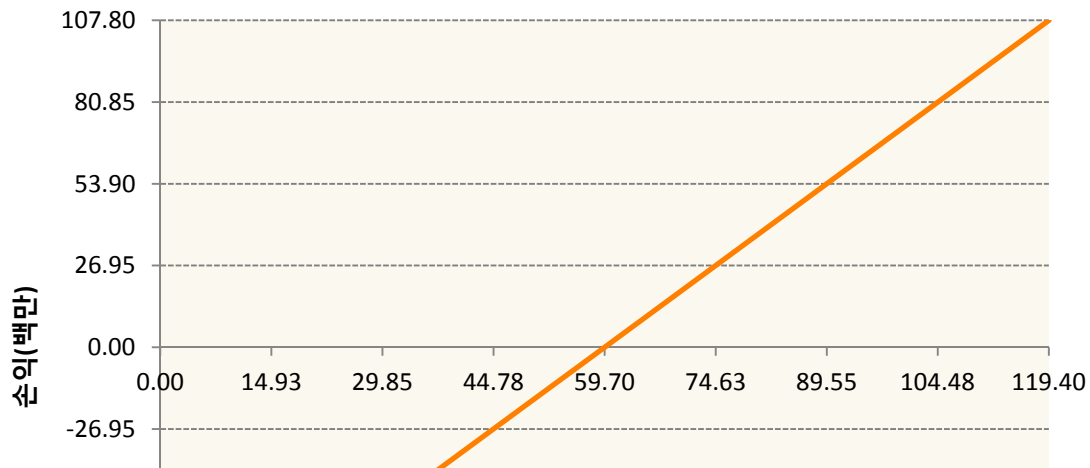
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,525	72	2,453	

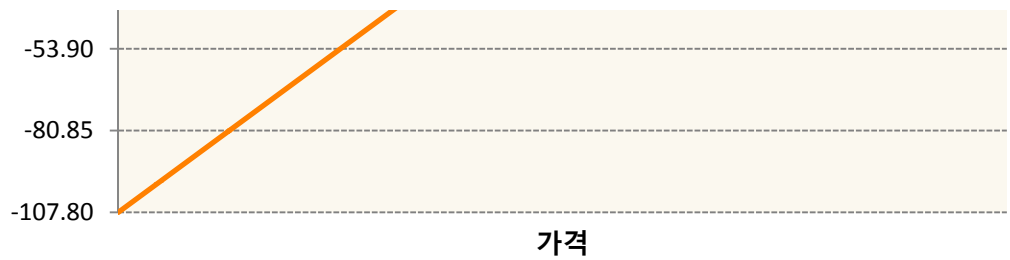
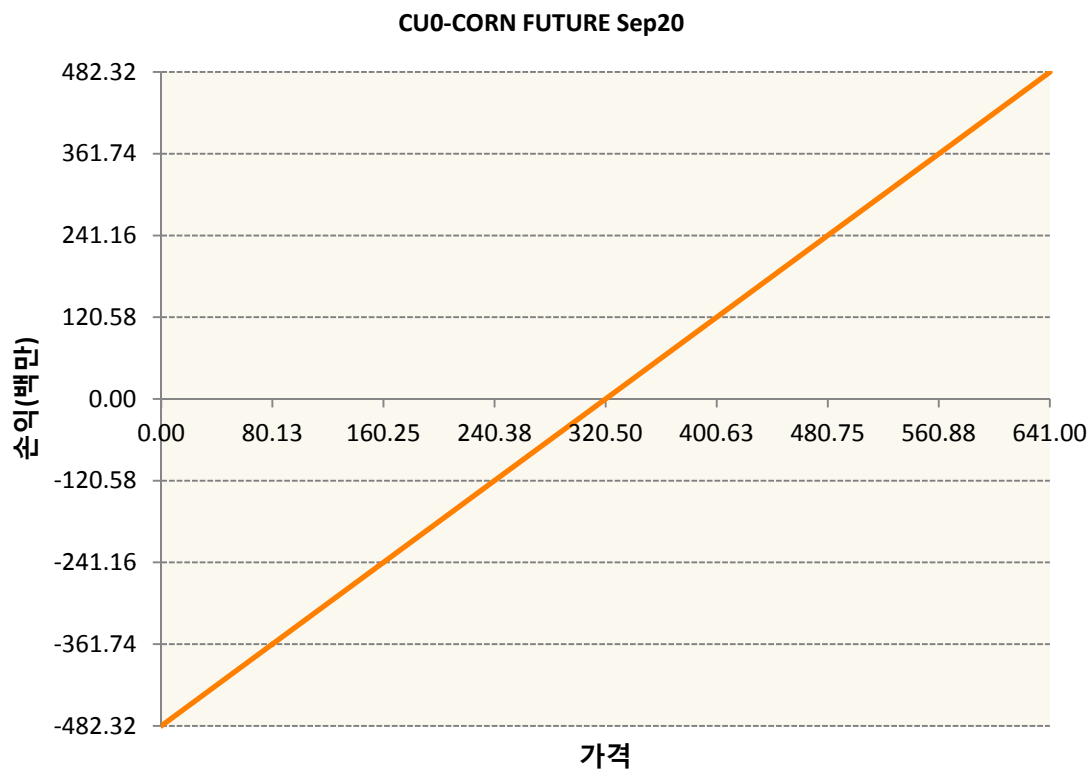
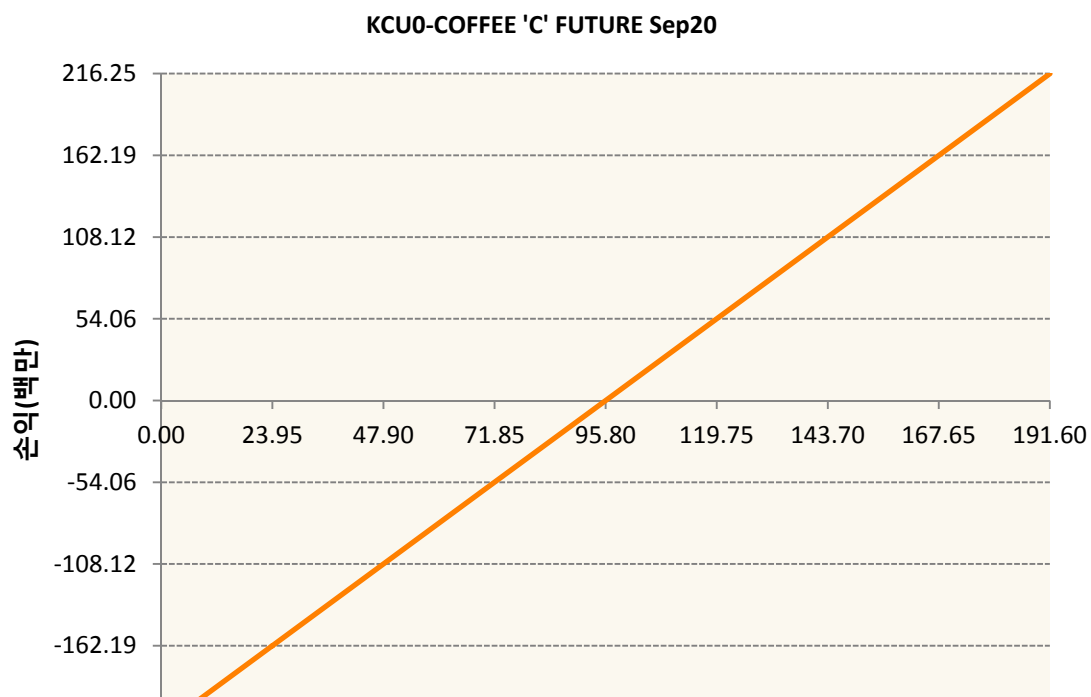
2. 만기시점의 손익구조

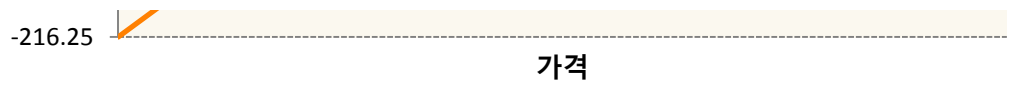
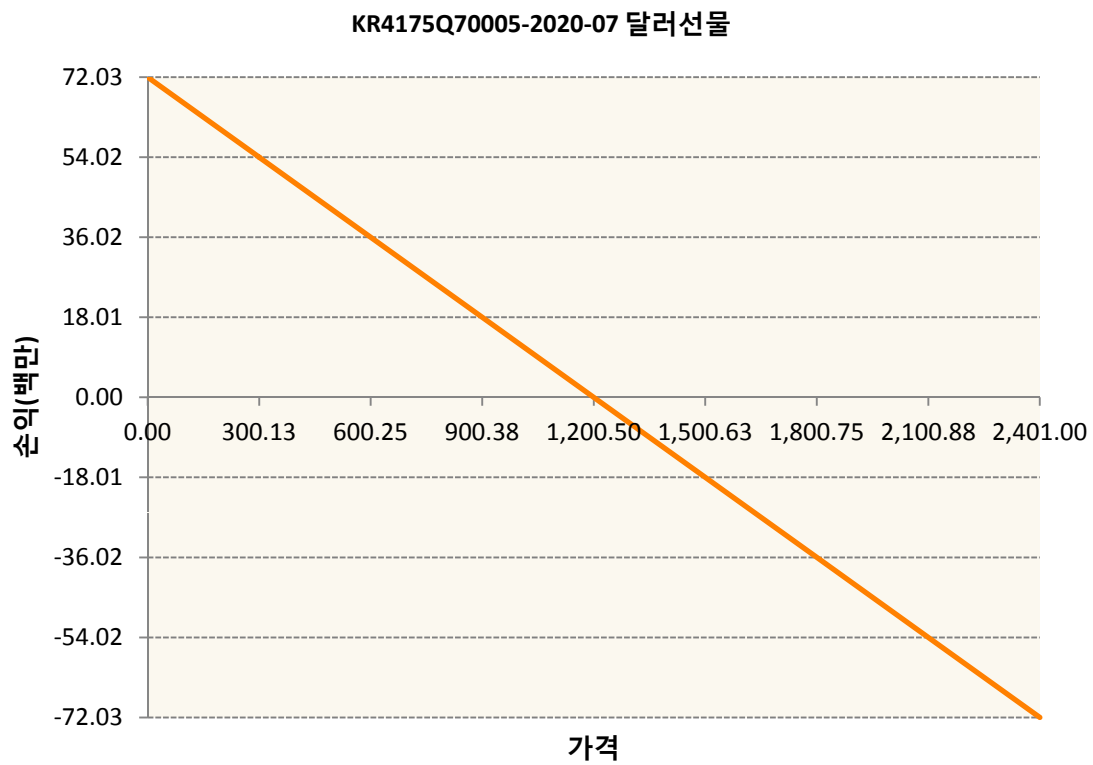
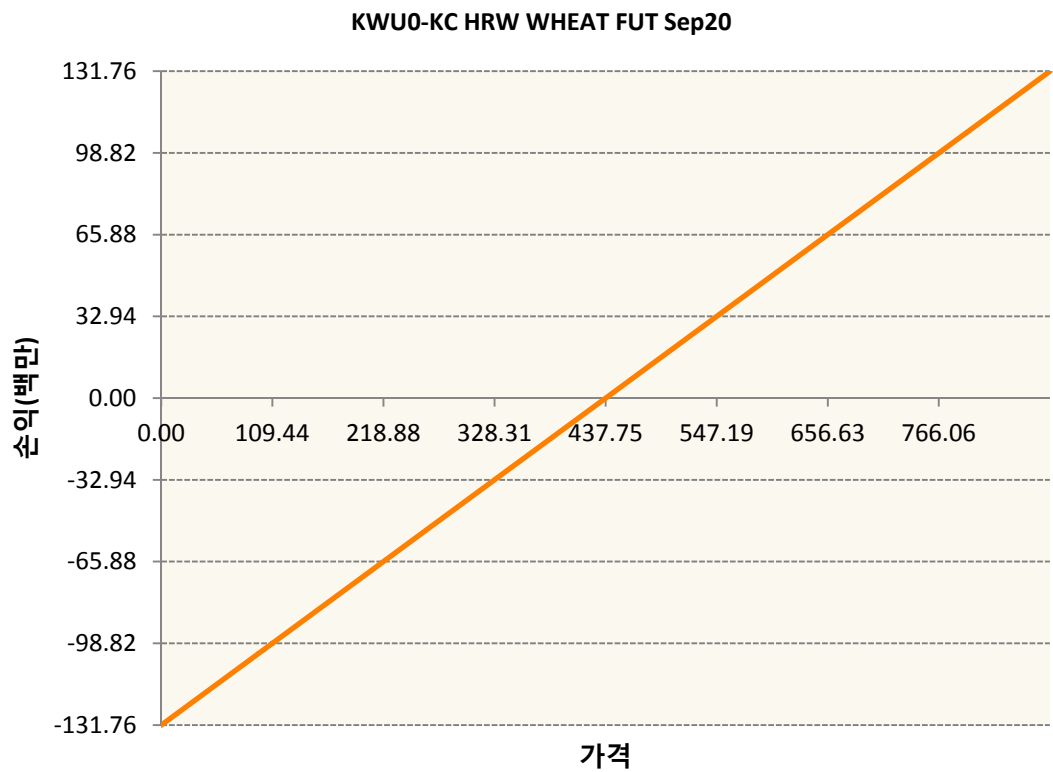
BOZ0-SOYBEAN OIL FUTR Dec20



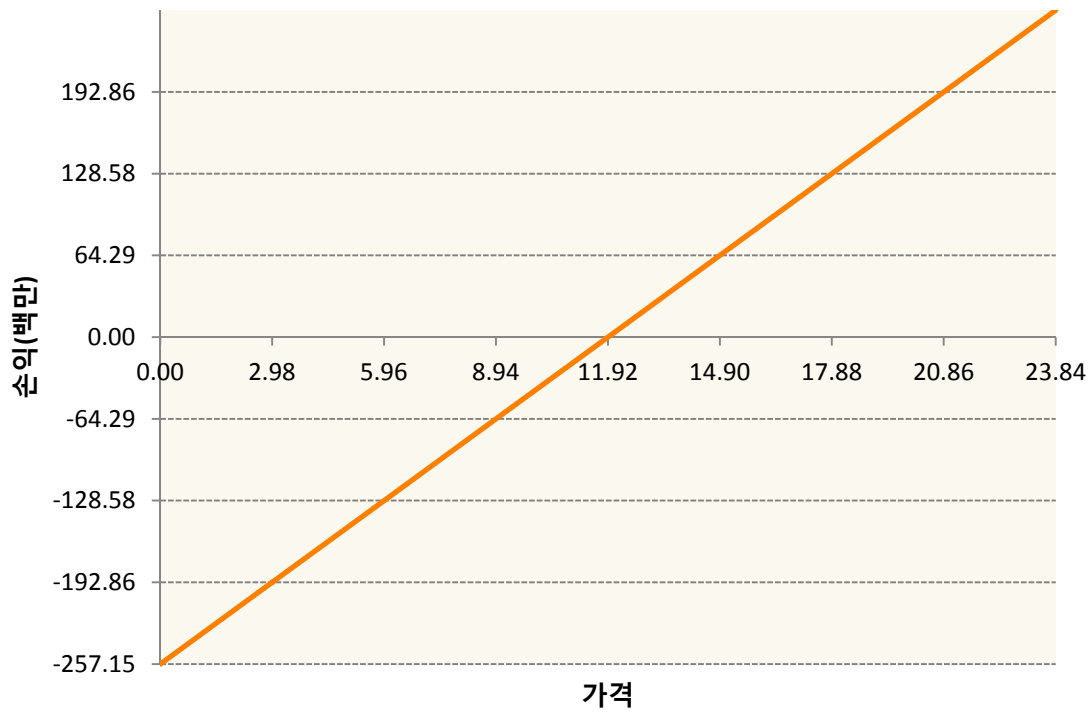
CTZ0-COTTON NO.2 FUTR Dec20



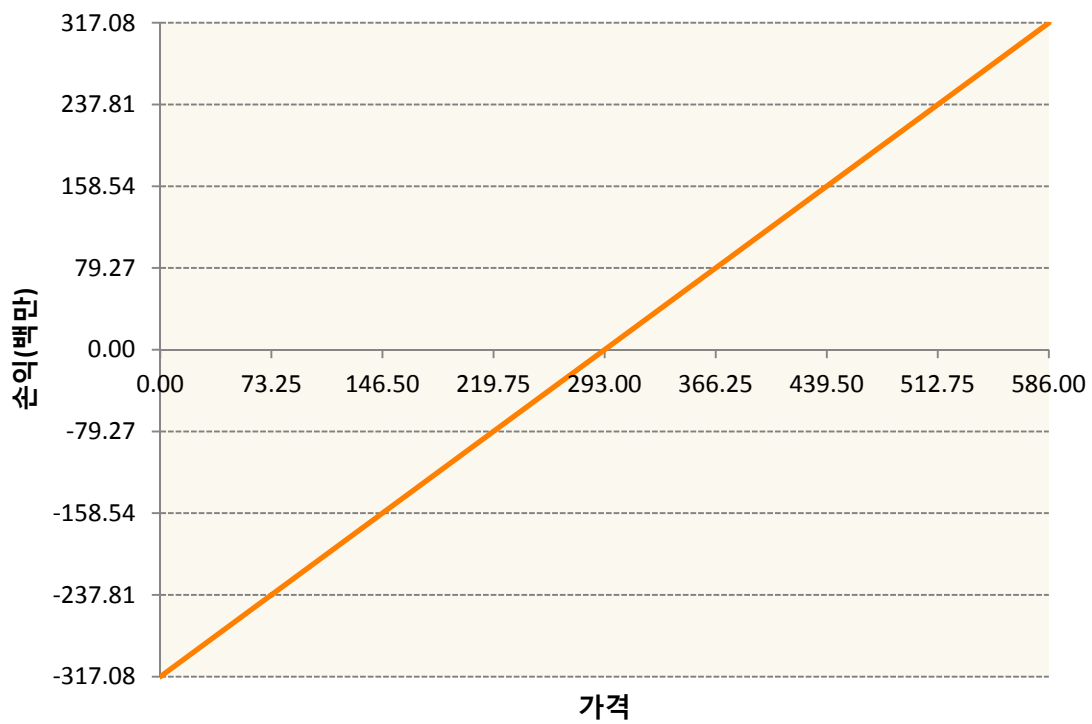




SBV0-Sugar Oct20

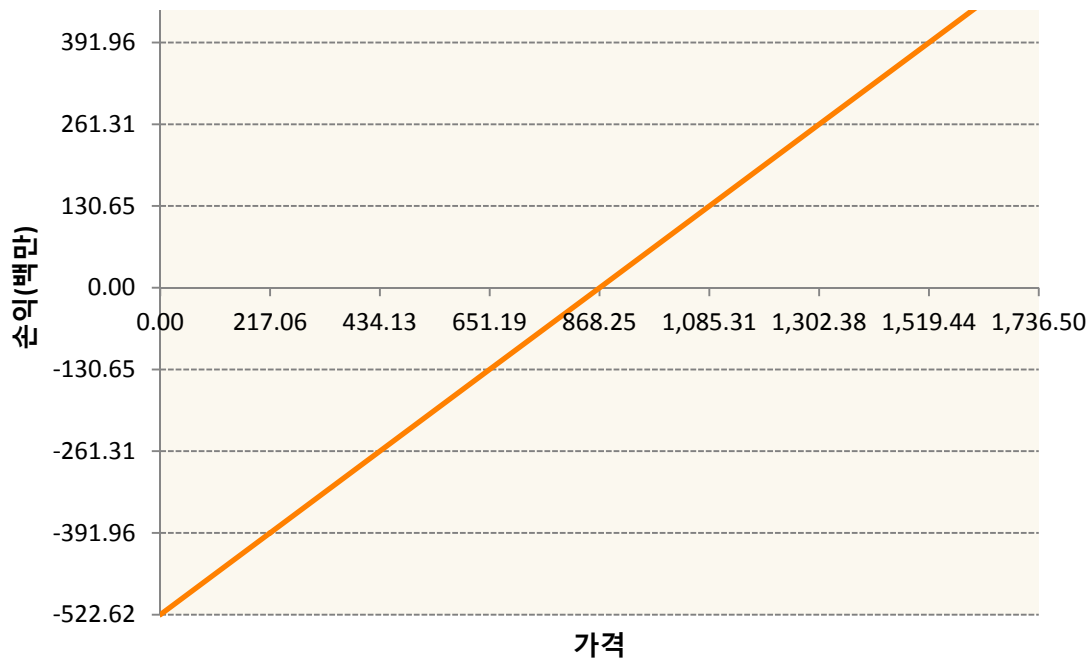
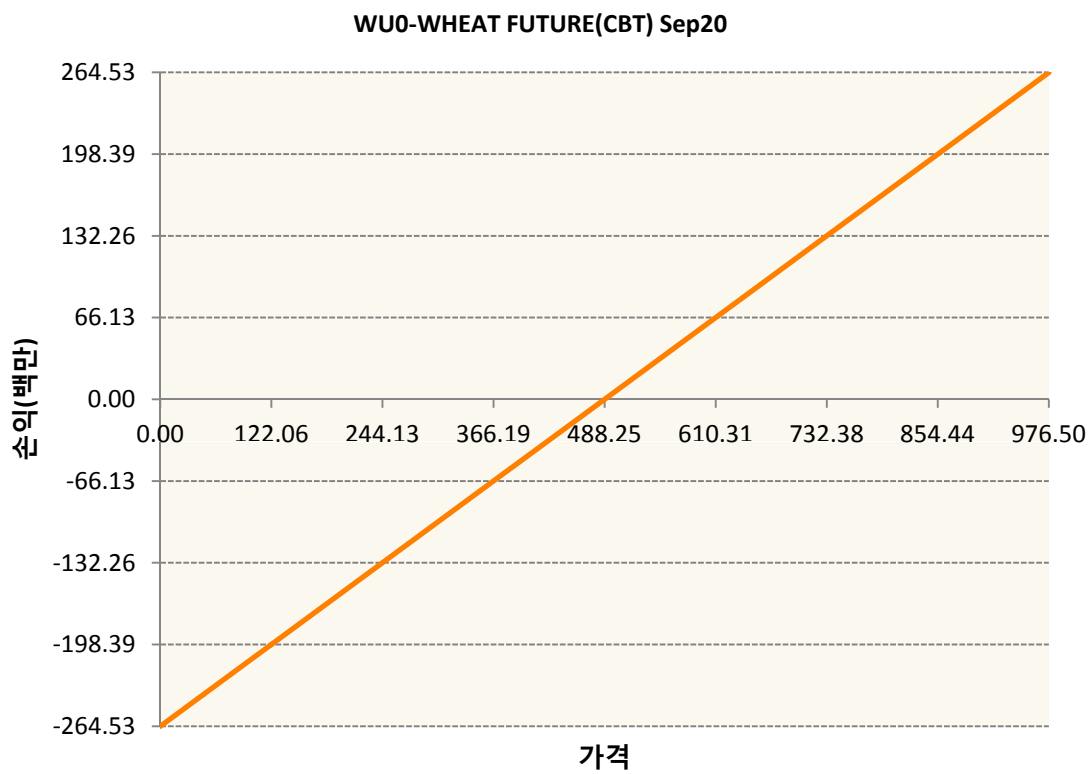


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20



SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOZ0	SOYBEAN OIL FUTR Dec20	18
CTZ0	COTTON NO.2 FUTR Dec20	9
CU0	CORN FUTURE Sep20	39
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	17
KR4175Q70C 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)

236