

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

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	2020-07-01
기준일	2020-06-30

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

1,050

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,262

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S200610

615

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

889

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

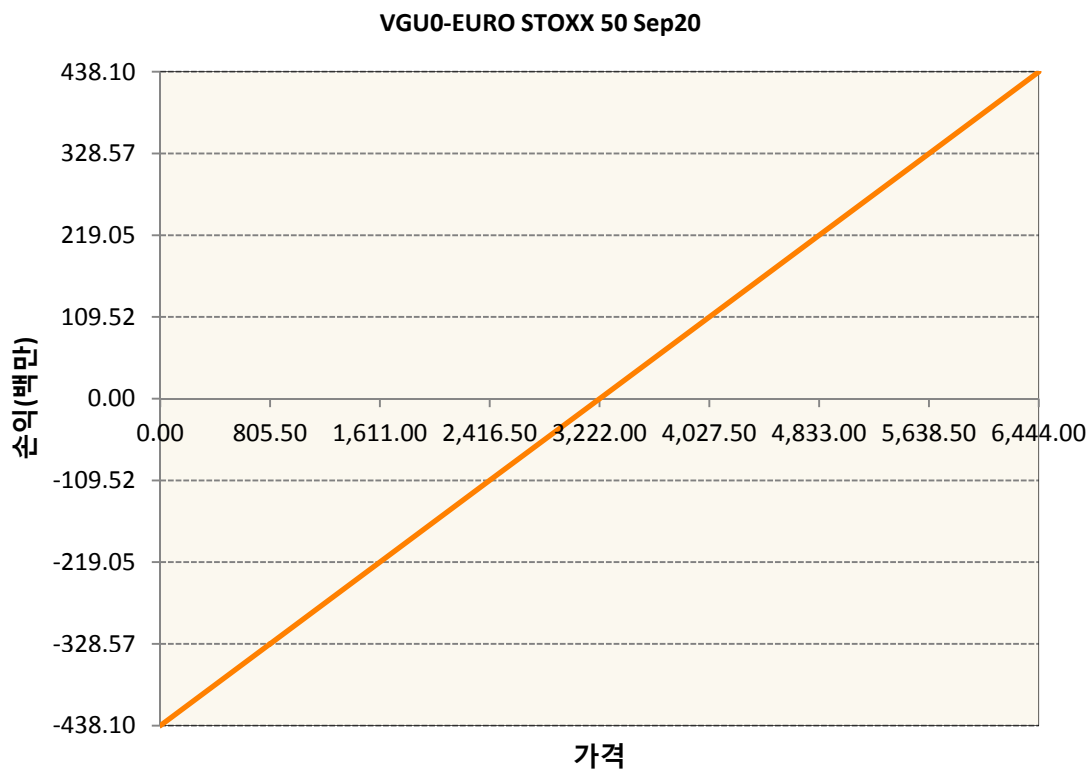
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	438	0	438	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU0	EURO STOXX 50 Sep20	35
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

차이나인덱스모(주식-파생형)

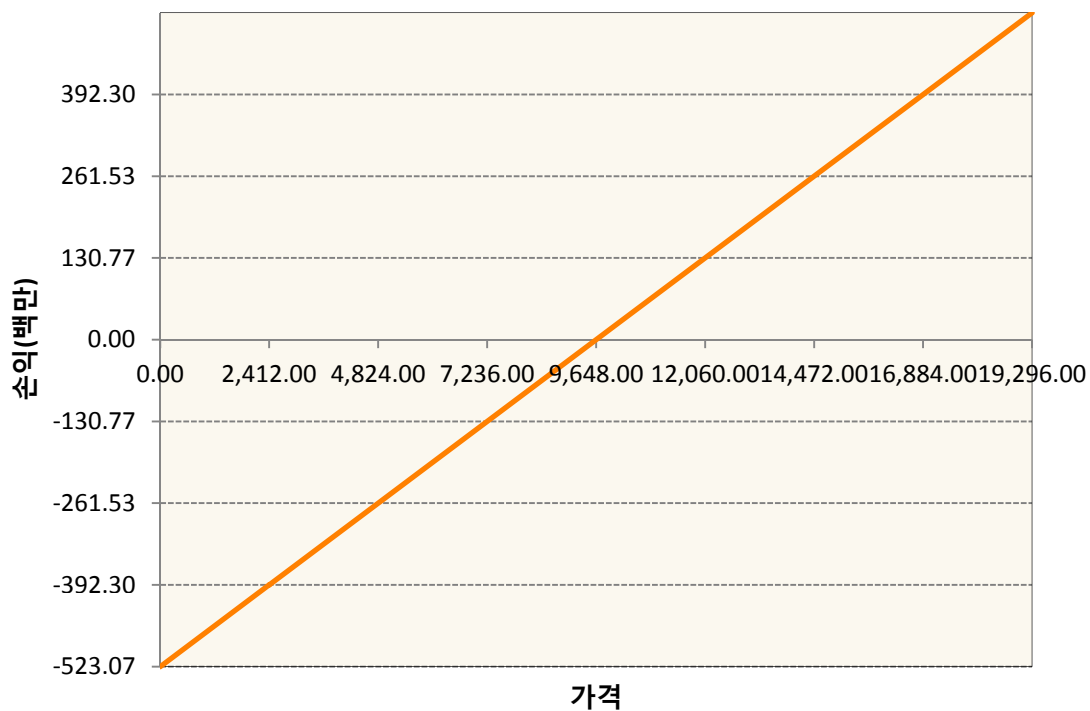
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	523	0	523	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCN0-HSCEI Futures Jul20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

45

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

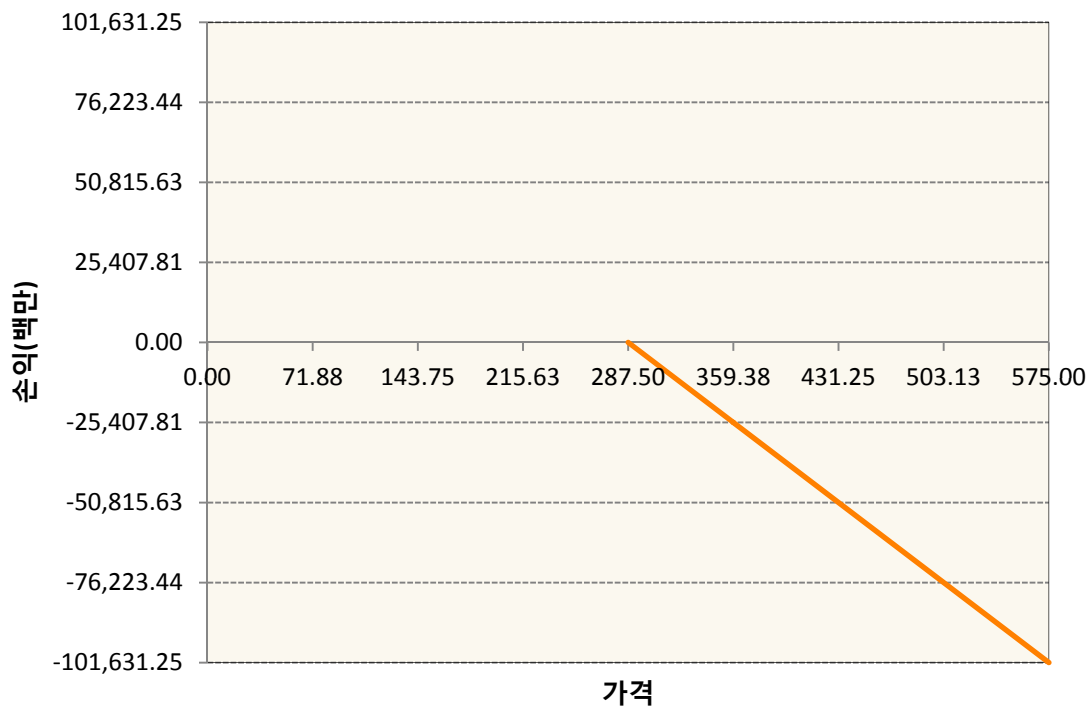
1. 계약금액

(단위:백만원)

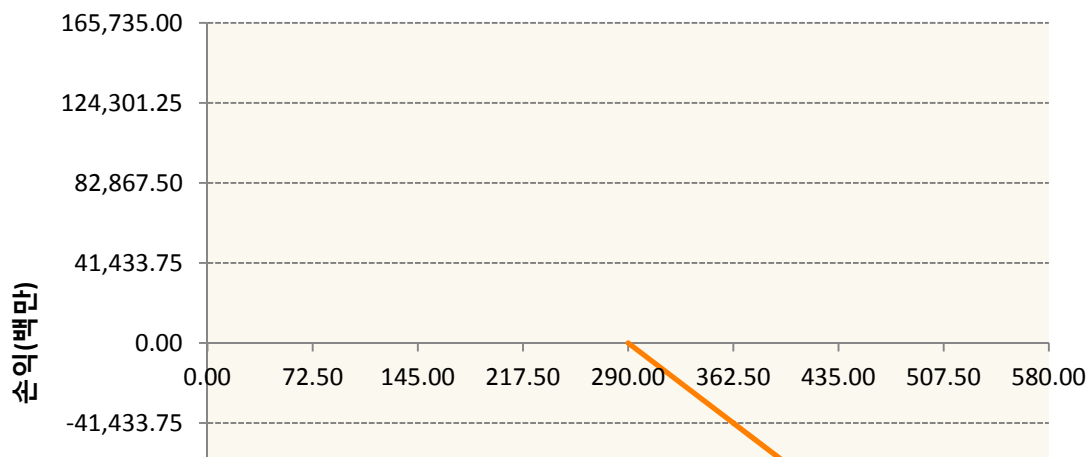
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

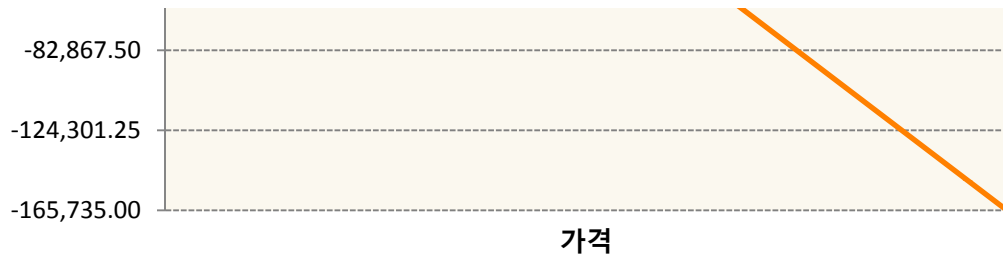
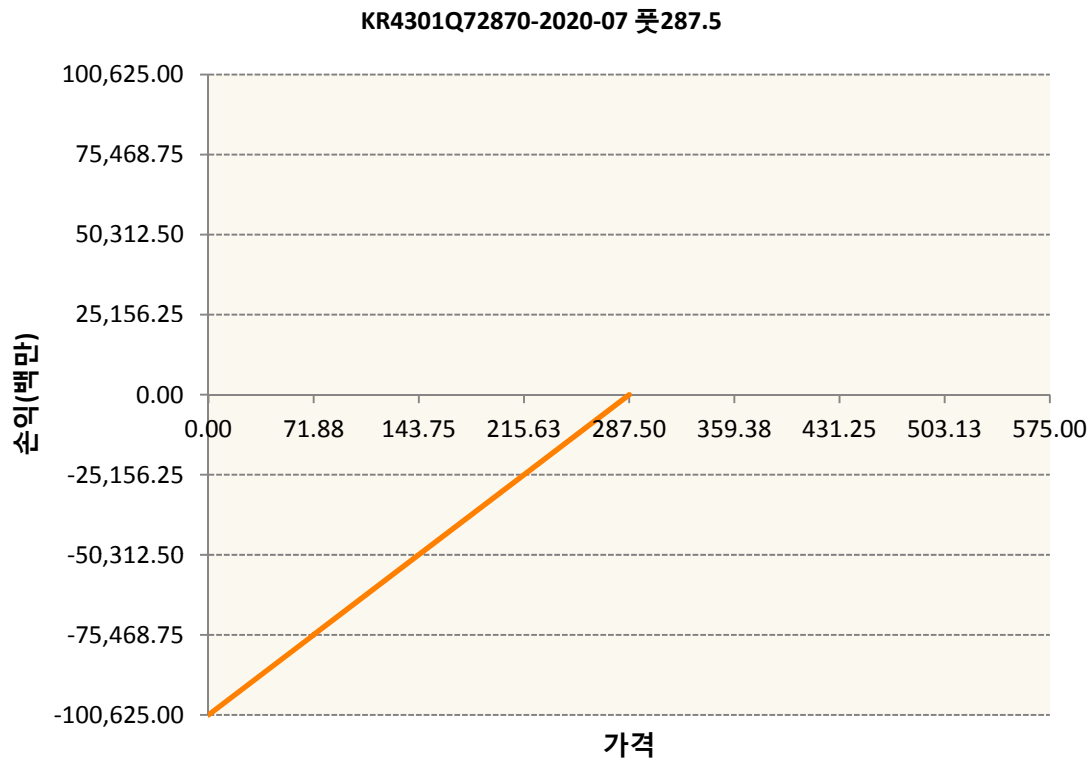
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872			2020-07 콜287.5				5,208
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,734	1,696	1,643	1,576	1,494	1,399	1,293
-5.33%	1,617	1,529	1,424	1,305	1,172	1,027	873
-2.67%	1,309	1,153	985	806	620	426	227
0%	667	448	226	0	-228	-459	-690
2.67%	-430	-676	-922	-1,168	-1,414	-1,660	-1,905
5.33%	-2,018	-2,244	-2,474	-2,707	-2,942	-3,180	-3,418
8.00%	-4,033	-4,205	-4,389	-4,583	-4,785	-4,994	-5,208
KR4201Q72906			2020-07 콜290				7,913
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,366	2,320	2,253	2,163	2,052	1,919	1,767

-5.33%	2,231	2,118	1,976	1,809	1,619	1,409	1,182
-2.67%	1,853	1,635	1,394	1,132	855	563	260
0%	1,013	686	347	0	-354	-713	-1,077
2.67%	-505	-900	-1,295	-1,691	-2,088	-2,485	-2,882
5.33%	-2,810	-3,197	-3,588	-3,981	-4,375	-4,771	-5,168
8.00%	-5,850	-6,164	-6,494	-6,836	-7,188	-7,547	-7,913
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,999
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,907	-6,911	-6,917	-6,929	-6,946	-6,969	-6,999
-5.33%	-4,312	-4,331	-4,359	-4,397	-4,444	-4,500	-4,564
-2.67%	-1,805	-1,870	-1,947	-2,033	-2,129	-2,232	-2,341
0%	409	278	141	0	-144	-292	-441
2.67%	2,052	1,885	1,719	1,552	1,385	1,219	1,052
5.33%	2,999	2,862	2,719	2,573	2,423	2,271	2,117
8.00%	3,402	3,327	3,239	3,142	3,035	2,921	2,801

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

(단위:백만원)

18,882

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

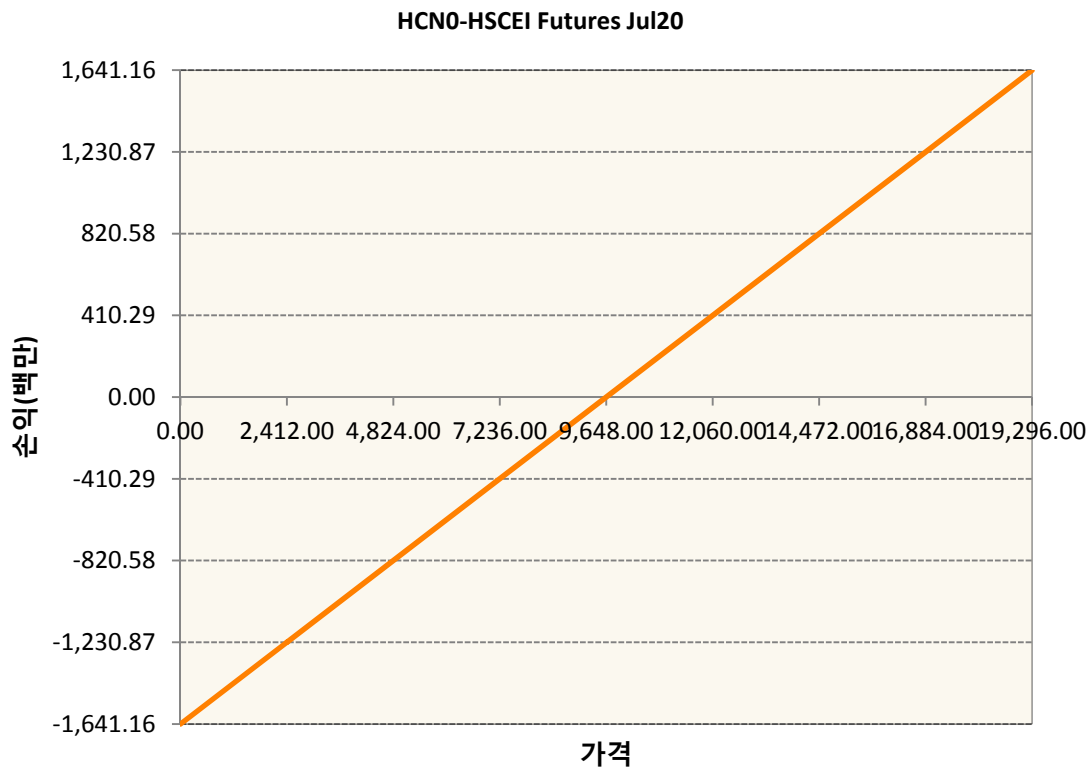
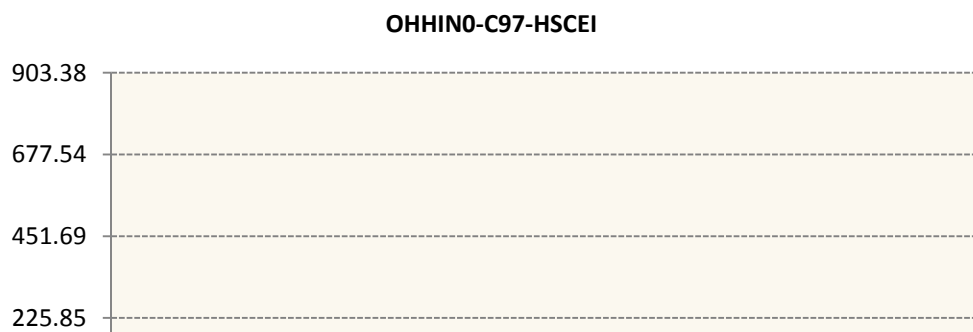
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

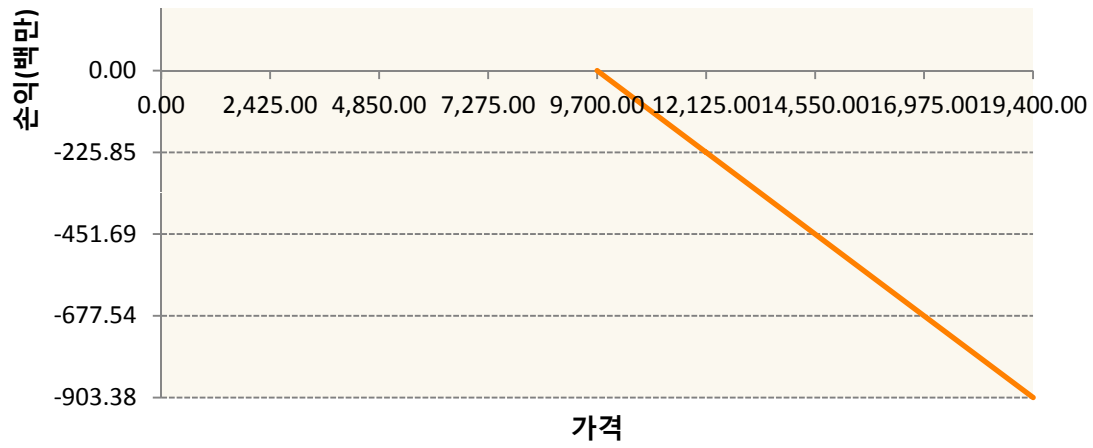
1. 계약금액

(단위:백만원)

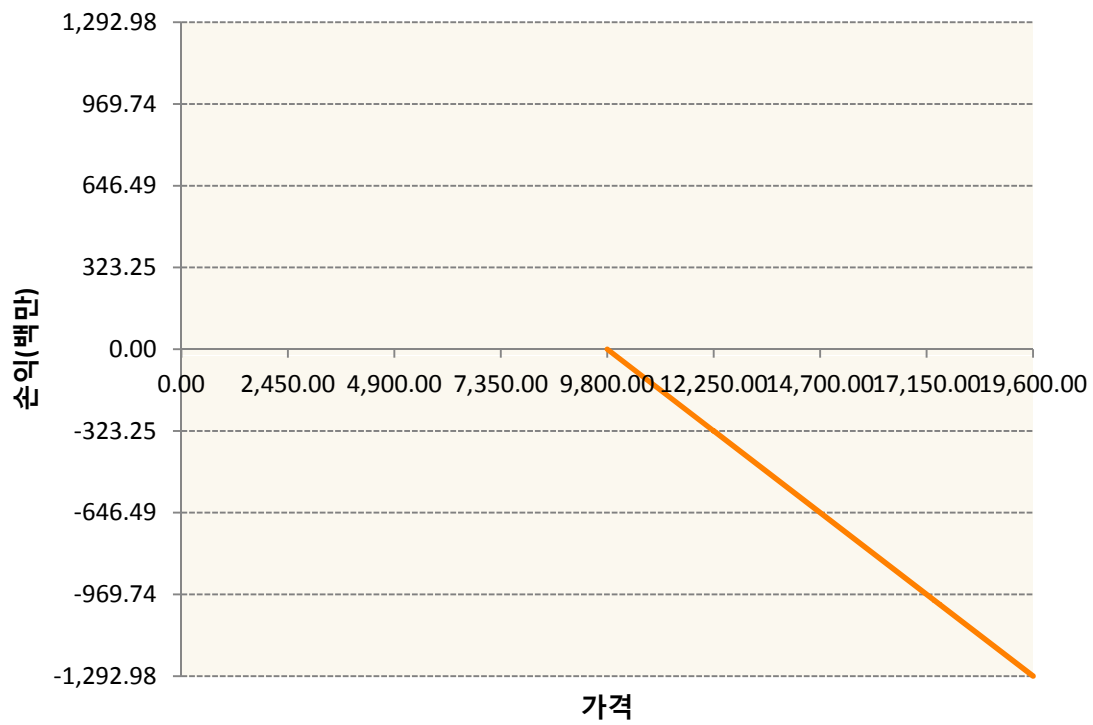
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,641	0	1,641	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,469	-4,469	장내
누계	통화	선도	0	1,503	-1,503	장외

2. 만기시점의 손익구조

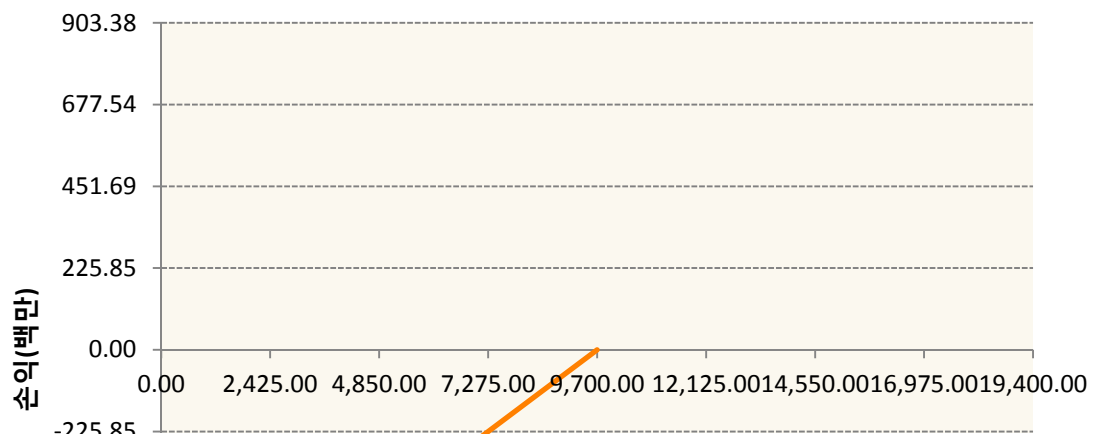


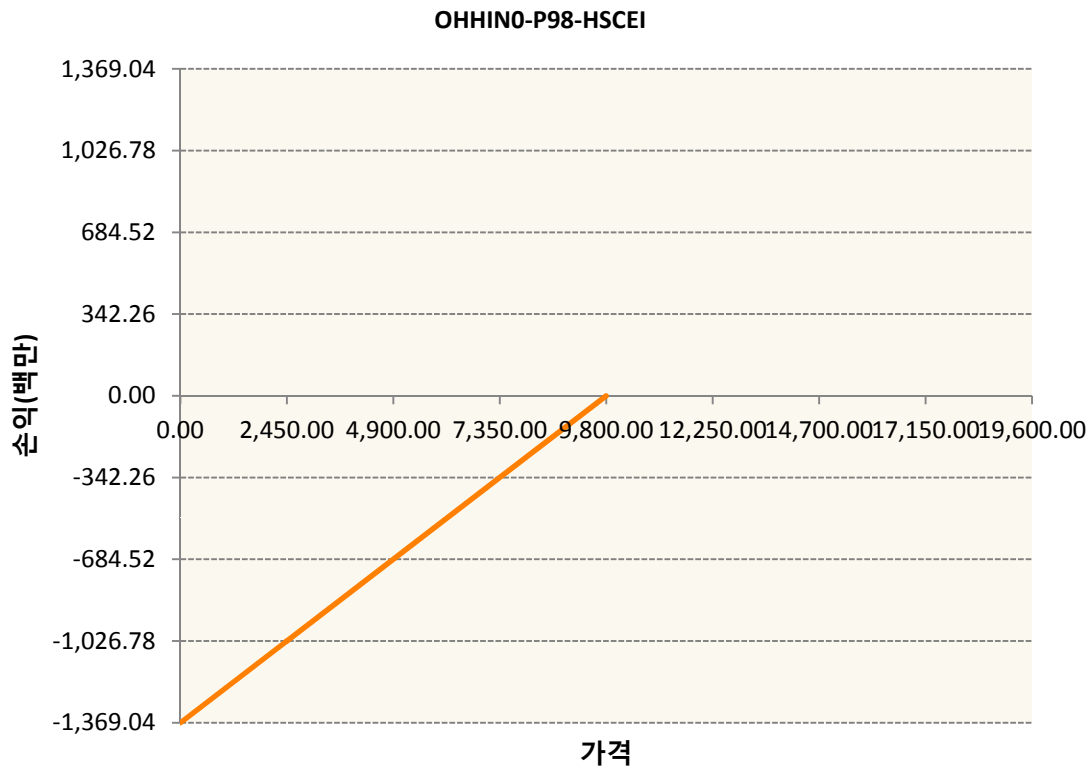


OHHIN0-C98-HSCEI



OHHIN0-P97-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		120
HCN0 HSCEI Futures Jul20		131
OHHIN0-C9 HSCEI		72
OHHIN0-C9 HSCEI		103
OHHIN0-P9 HSCEI		72
OHHIN0-P9 HSCEI		110

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	590

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

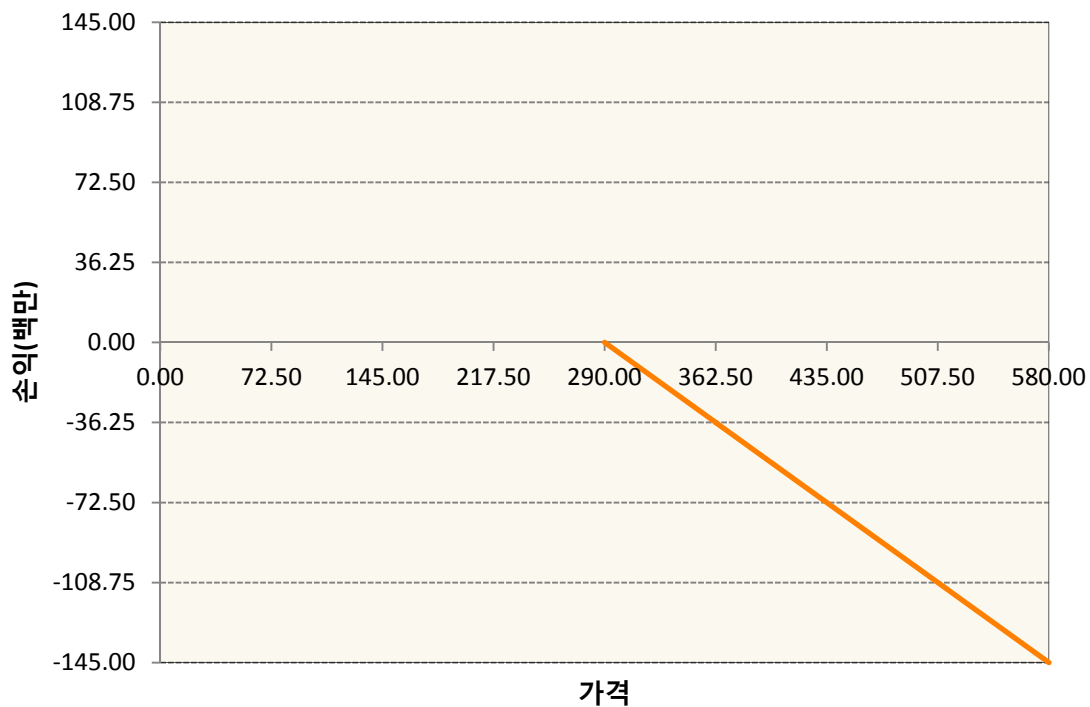
1. 계약금액

(단위:백만원)

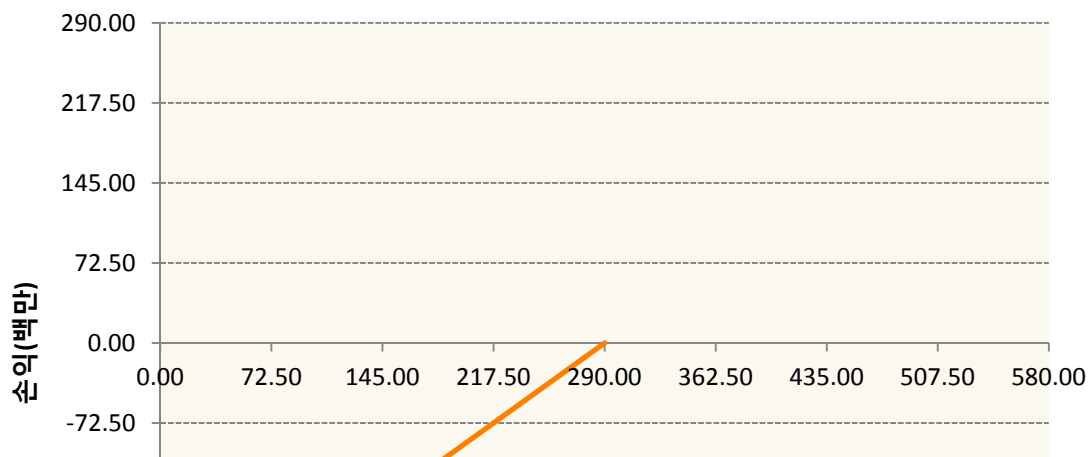
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	72	0	72	장내
누계	유가증권	옵션	0	435	-435	장내

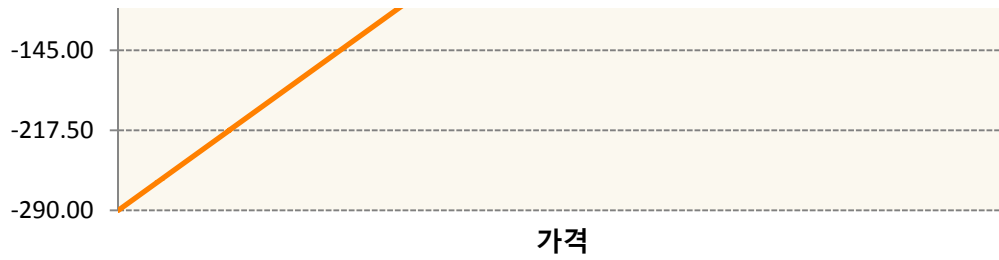
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72906			2020-07 콜290				7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	1	1	1
-2.67%	2	1	1	1	1	0	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	-1	-1	-1	-2	-2	-3
5.33%	-2	-3	-3	-3	-4	-4	-5
8.00%	-5	-5	-6	-6	-6	-7	-7
KR4301Q72904			2020-07 풋290				21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-21	-21
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-7	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	6	6	5	5	4	4	4
5.33%	10	9	9	8	8	7	7
8.00%	11	11	11	10	10	10	9

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

28

공시일 2020-07-01
기준일 2020-06-30

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

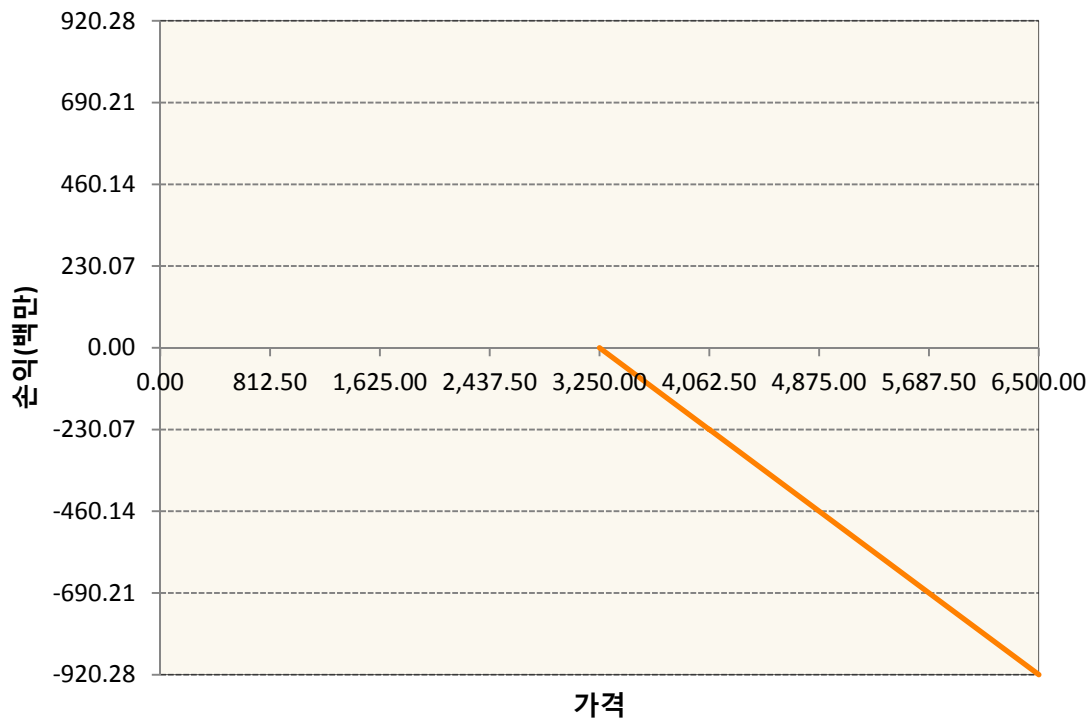
1. 계약금액

(단위:백만원)

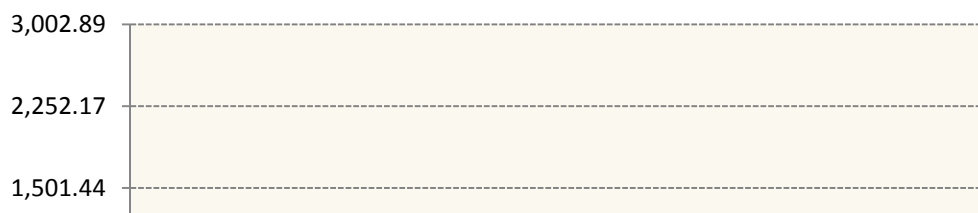
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,316	0	1,316	
누계	유가증권	스왑	8,042	0	8,042	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,846	-7,846	장내
누계	통화	선도	0	2,918	-2,918	장외

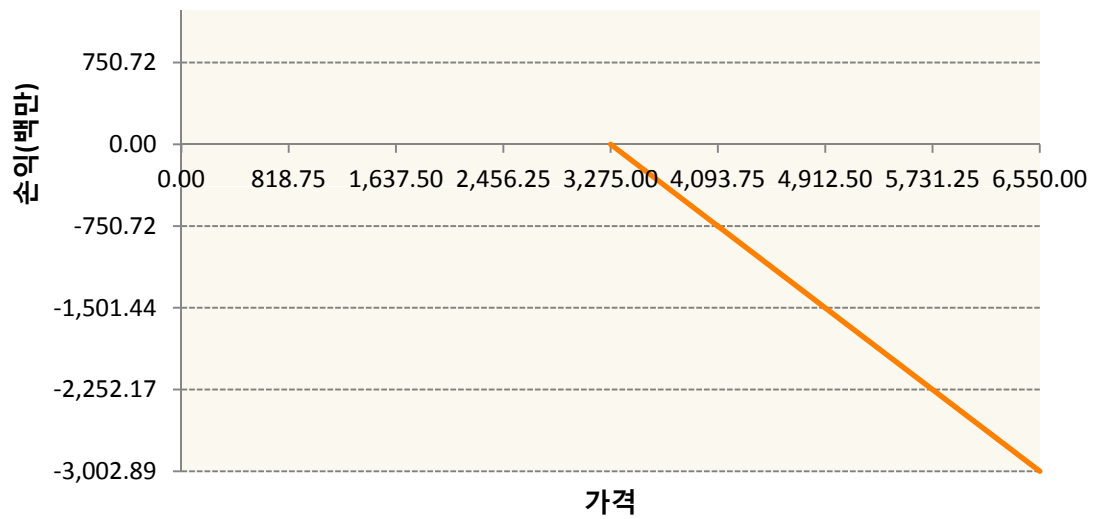
2. 만기시점의 손익구조

OESXN0-C3250-EURO STOXX 50

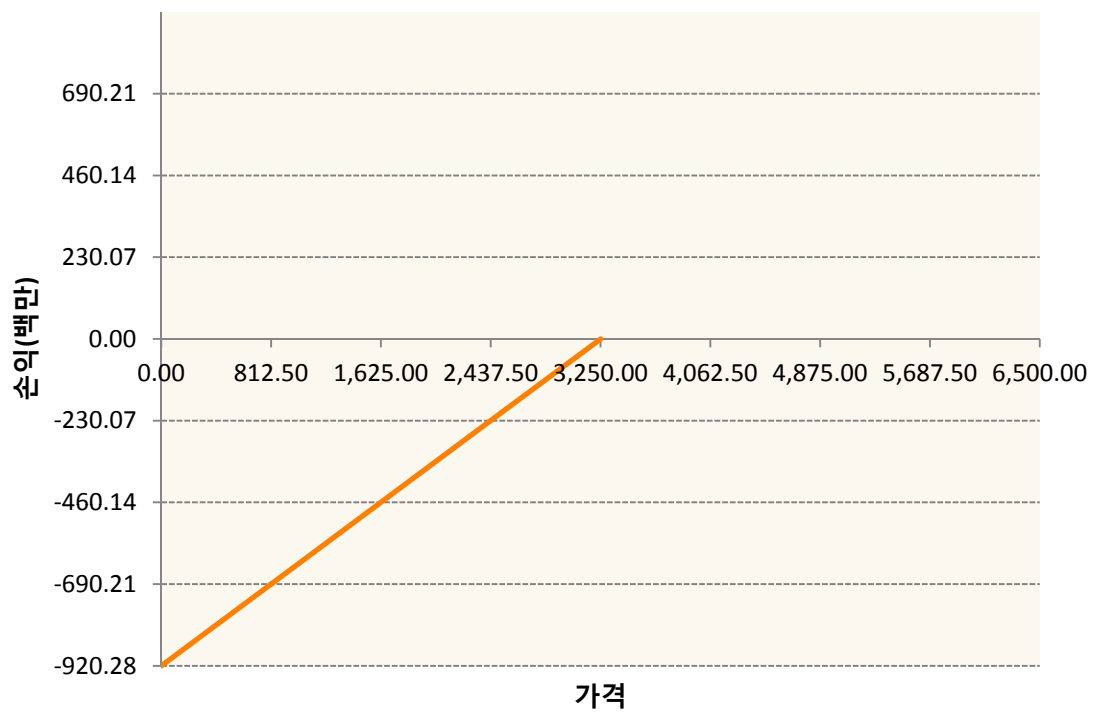


OESXN0-C3275-EURO STOXX 50

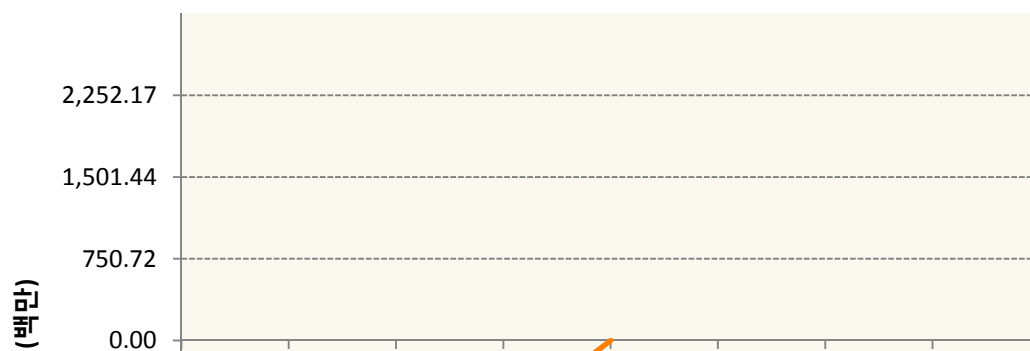


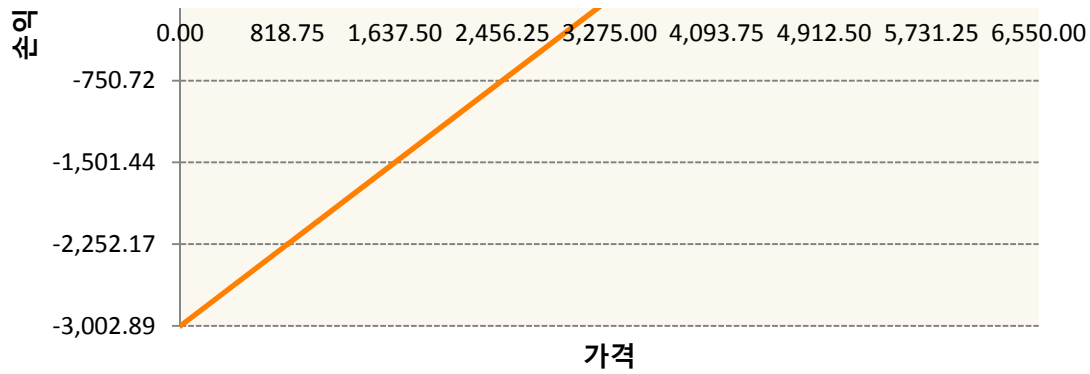
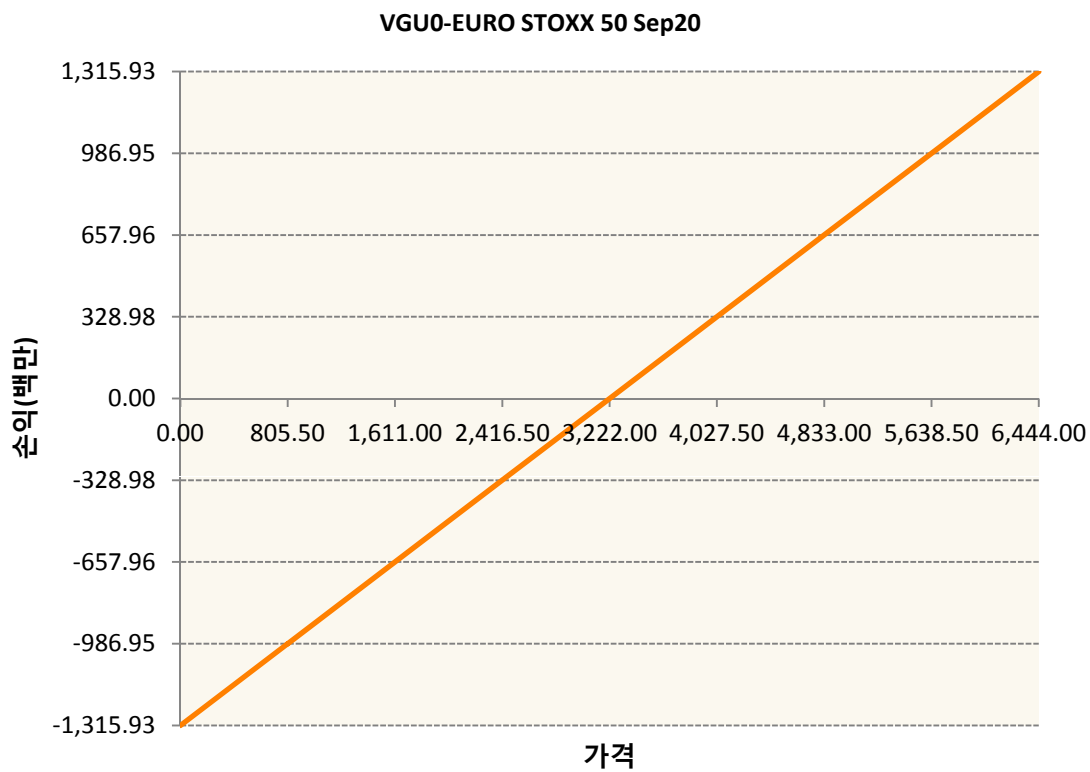


OESXN0-P3250-EURO STOXX 50



OESXN0-P3275-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		22
FX21020M0₩KRW/EUR 25-09-20E		233
OESXN0-C3₩EURO STOXX 50		74
OESXN0-C3₩EURO STOXX 50		240
OESXN0-P3₩EURO STOXX 50		74
OESXN0-P3₩EURO STOXX 50		240
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20		105

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

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

(단위:백만원)

1,315

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

ETF스마트레버리지목표전환형9호

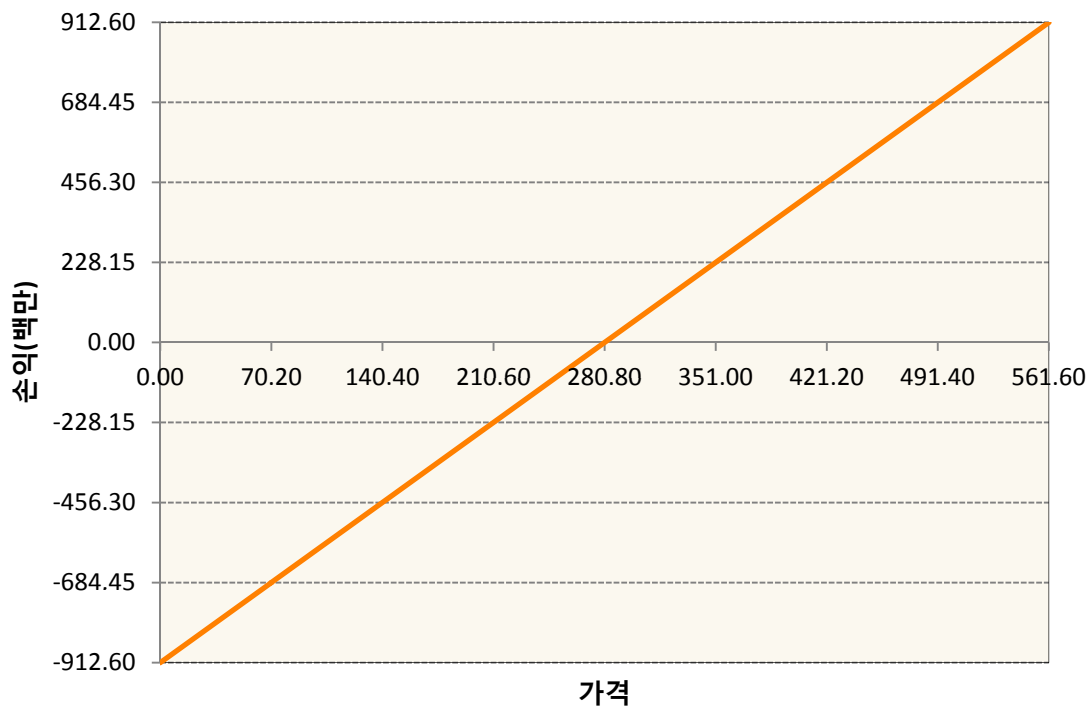
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	913	0	913	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		73
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	24	24	24	24	24	24	24	24	
5.33%	49	49	49	49	49	49	49	49	
8.00%	73	73	73	73	73	73	73	73	

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

(단위:백만원)

115

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

(단위:백만원)

169

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

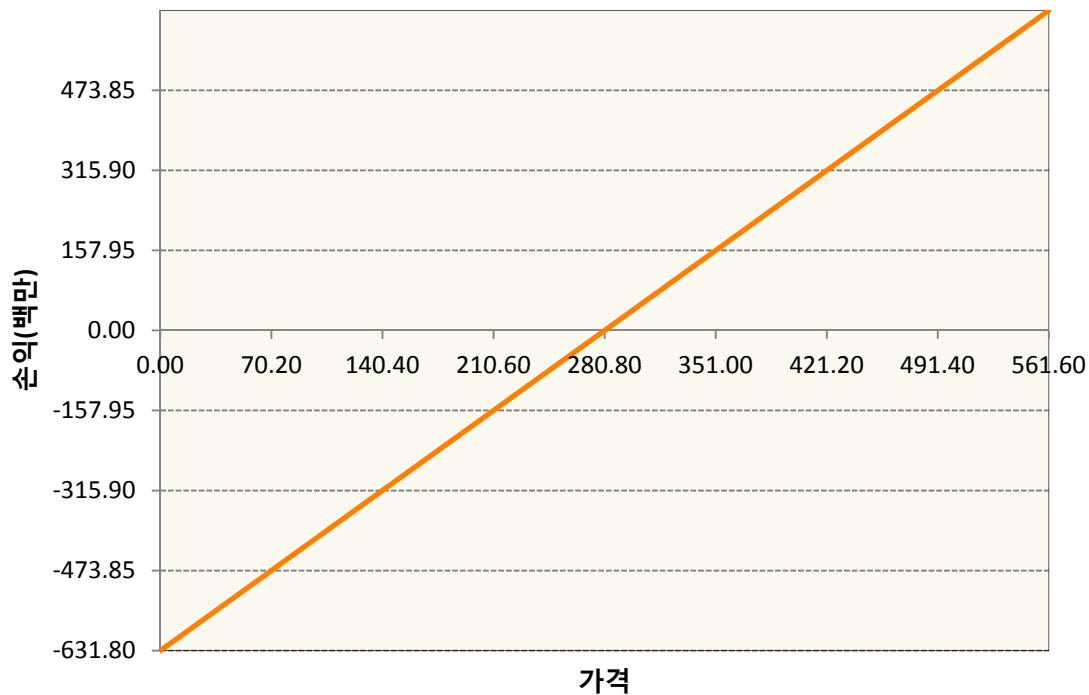
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	632	0	632	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009							2020-09 코스피200지수선물		50
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-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%	50	50	50	50	50	50	50	50	

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

(단위:백만원)

80

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

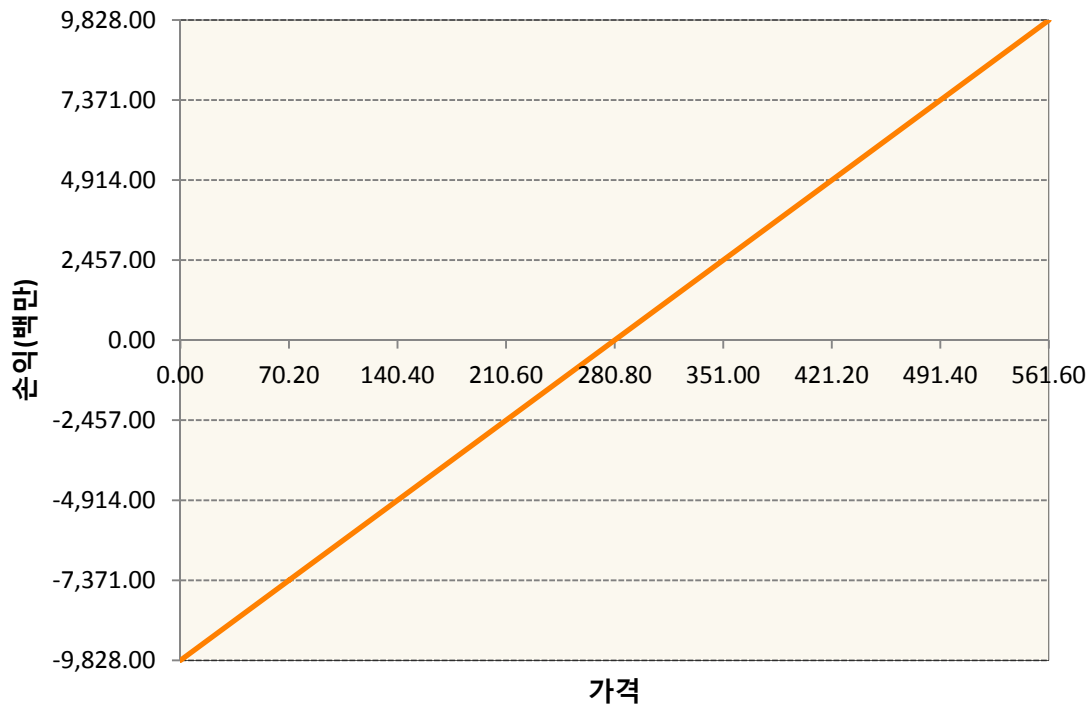
1. 계약금액

(단위:백만원)

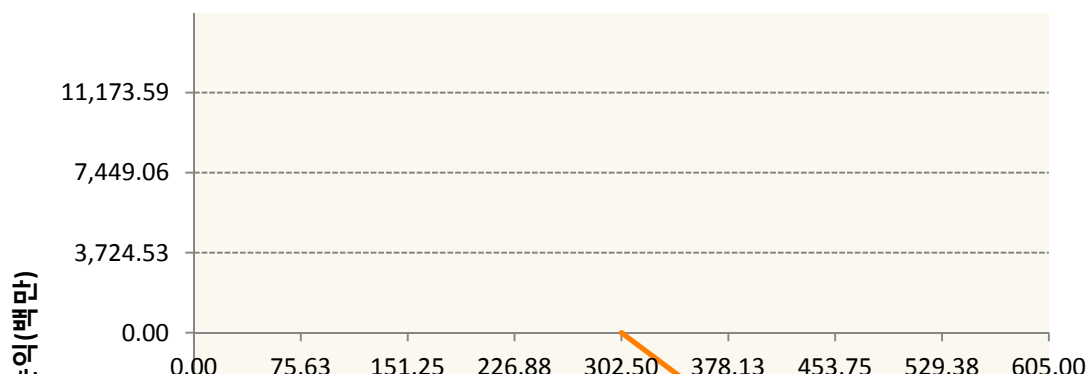
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,828	0	9,828	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

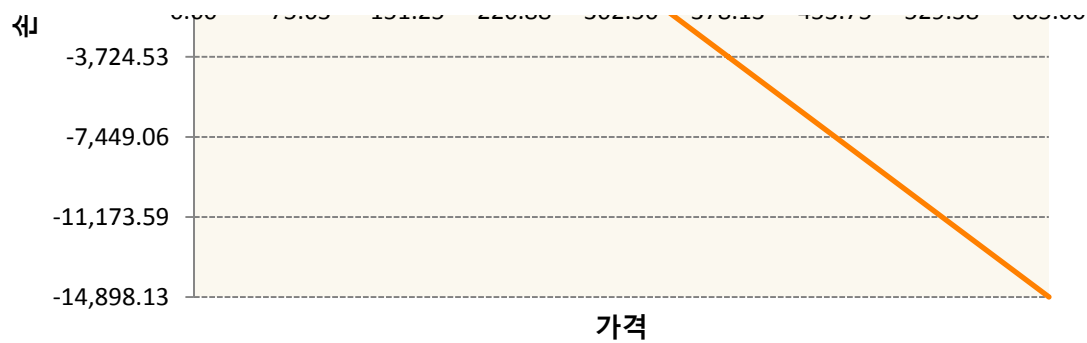
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

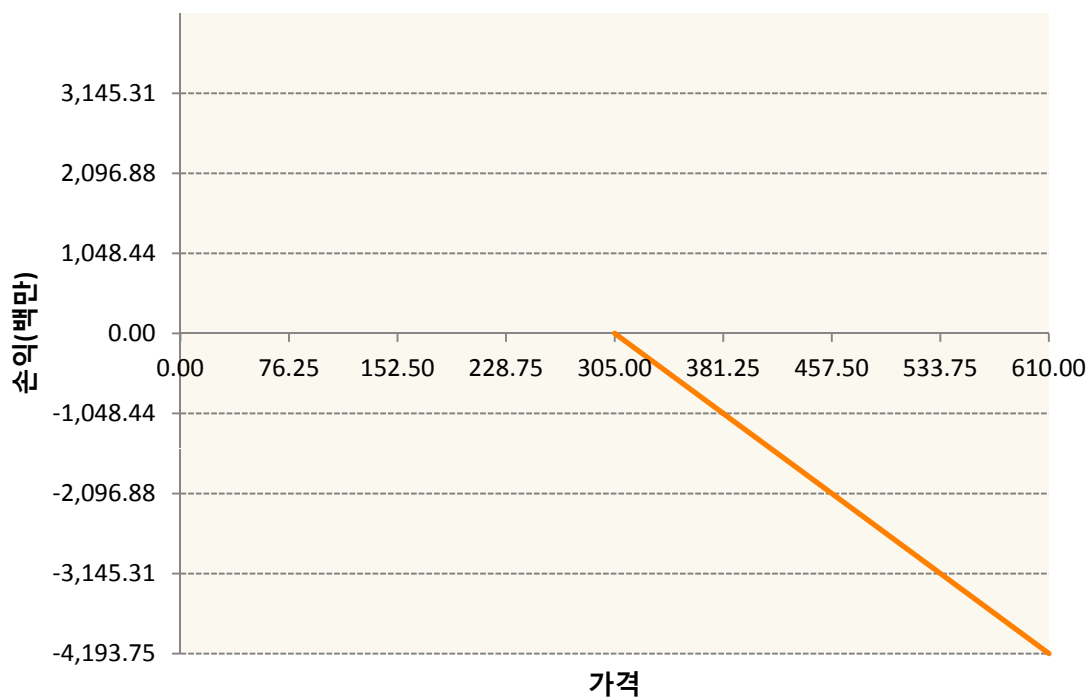


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

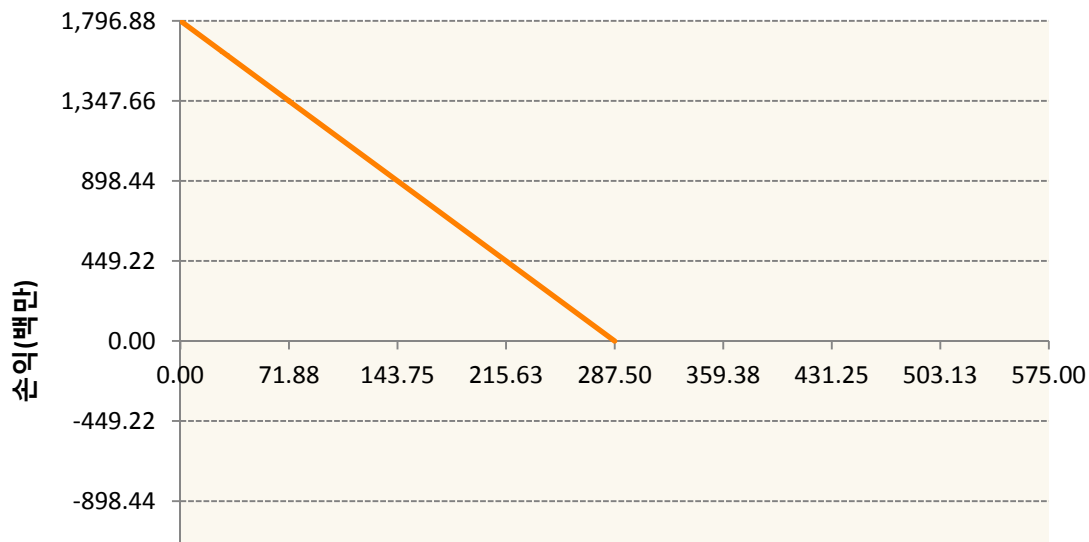


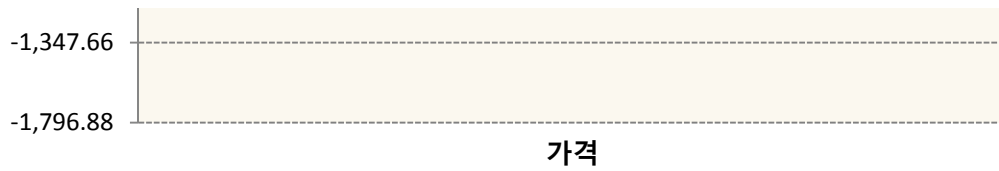
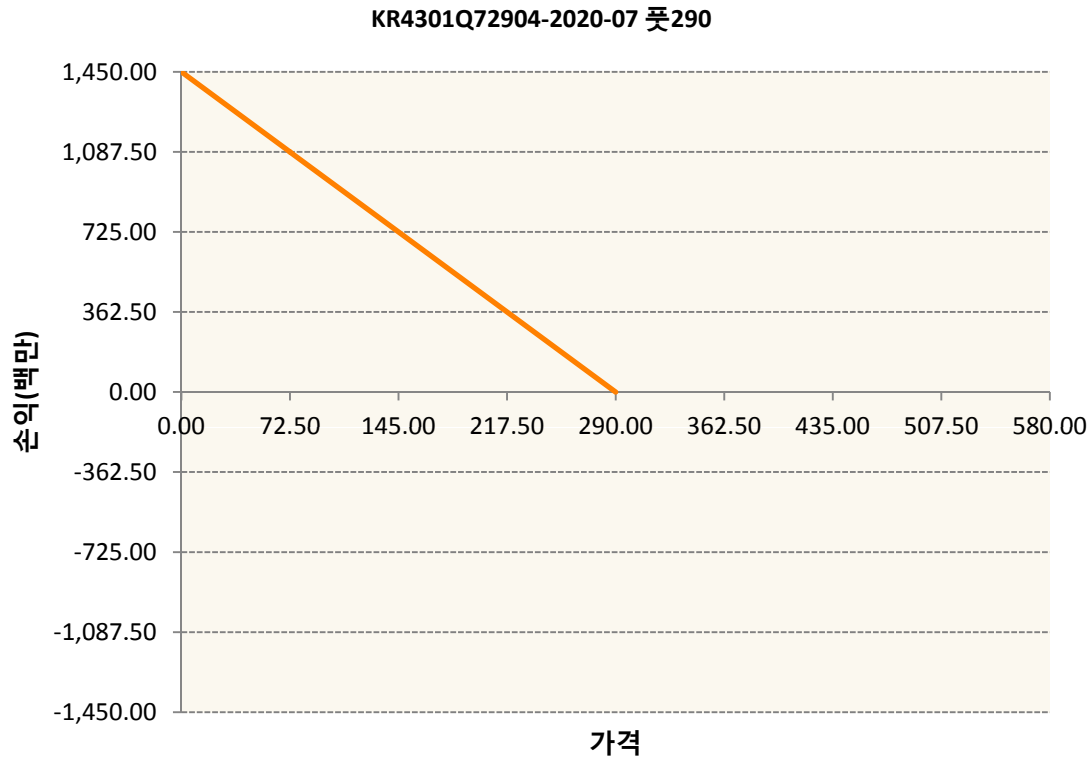


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009			2020-09 코스피200지수선물					784
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-784	-784	-784	-784	-784	-784	-784	
-5.33%	-523	-523	-523	-523	-523	-523	-523	
-2.67%	-261	-261	-261	-261	-261	-261	-261	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	261	261	261	261	261	261	261	
5.33%	523	523	523	523	523	523	523	
8.00%	784	784	784	784	784	784	784	
KR4201Q73029			2020-07 콜302.5					461
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	77	76	75	72	69	64	58	
-5.33%	75	73	69	63	56	47	36	
-2.67%	69	62	53	42	29	14	-3	

0%	49	35	19	0	-21	-43	-66
2.67%	2	-21	-47	-74	-102	-131	-160
5.33%	-91	-123	-156	-189	-223	-257	-291
8.00%	-245	-281	-317	-353	-389	-425	-461
KR4201Q73052 2020-07 콜305							117
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	16	16	14	13
-5.33%	17	16	16	14	13	10	8
-2.67%	16	14	12	10	6	3	-1
0%	12	9	5	0	-5	-11	-17
2.67%	2	-4	-11	-18	-25	-32	-40
5.33%	-20	-28	-37	-46	-55	-64	-73
8.00%	-57	-67	-77	-87	-97	-107	-117
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							125
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	123	123	124	124	124	124	125
-5.33%	77	77	78	79	79	80	82
-2.67%	32	33	35	36	38	40	42
0%	-7	-5	-3	0	3	5	8
2.67%	-37	-34	-31	-28	-25	-22	-19
5.33%	-54	-51	-49	-46	-43	-41	-38
8.00%	-61	-59	-58	-56	-54	-52	-50
KR4301Q72904 2020-07 풋290							103
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	102	102	102	102	102	103	103
-5.33%	65	65	65	66	66	67	67
-2.67%	28	29	30	31	32	33	35
0%	-5	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-32	-29	-27	-25	-22	-20	-18
5.33%	-48	-46	-44	-42	-39	-37	-35
8.00%	-56	-55	-53	-52	-50	-48	-46

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

(단위:백만원)

1,817

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

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	134,712	0	134,712	

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	2020-07-01
기준일	2020-06-30

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,783	-1,783	
누계	유가증권	수익증권	96,482	0	96,482	

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	2020-07-01
기준일	2020-06-30

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	457,821	0	457,821	
누계	통화	선도	0	440,779	-440,779	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J03: KRW/USD 24-07-20E	2,165
FX21020J04: KRW/USD 24-07-20E	1,732
FX21020J04: KRW/USD 24-07-20E	1,925
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,348
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	962
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,011
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,598
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,368
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,833
FX21020M0: KRW/USD 26-08-20E	577
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,716
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,002
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,425
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	1,001
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	2,598

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,182

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

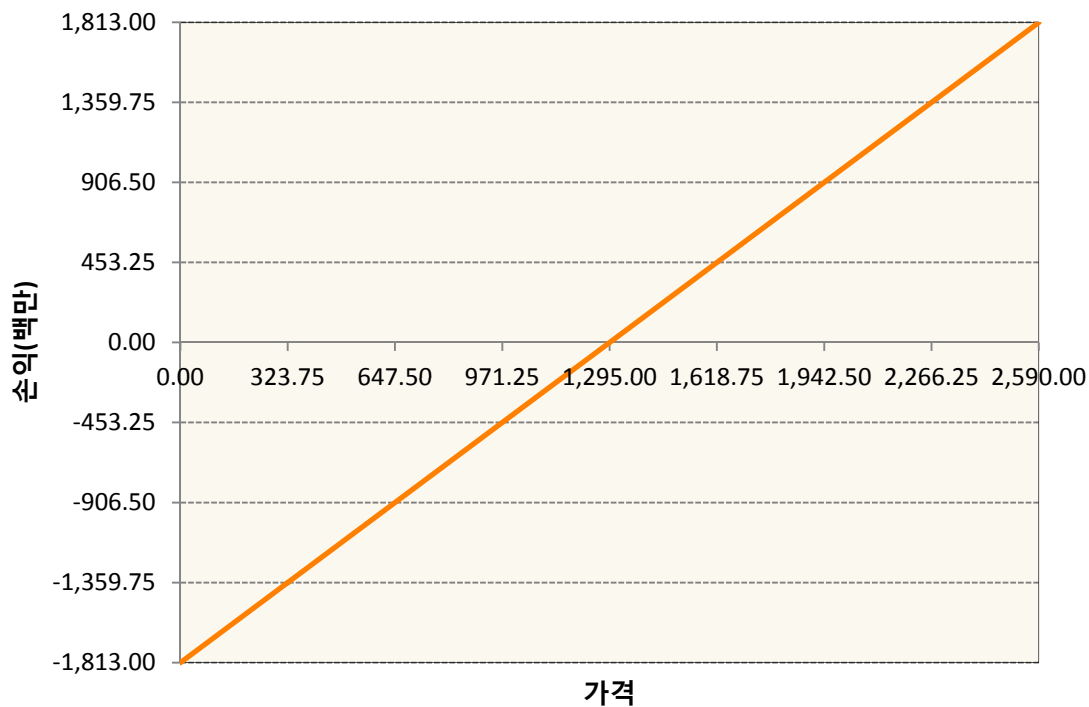
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,813	0	1,813	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4108Q90004-2020-09 KRX300 선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108Q90004 2020-09 KRX300 선물							145
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	48	48	48	48	48	48	48
5.33%	97	97	97	97	97	97	97
8.00%	145	145	145	145	145	145	145

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

(단위:백만원)

231

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

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	7,546	0	7,546	
누계	통화	선도	0	7,471	-7,471	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 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	37

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

308

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

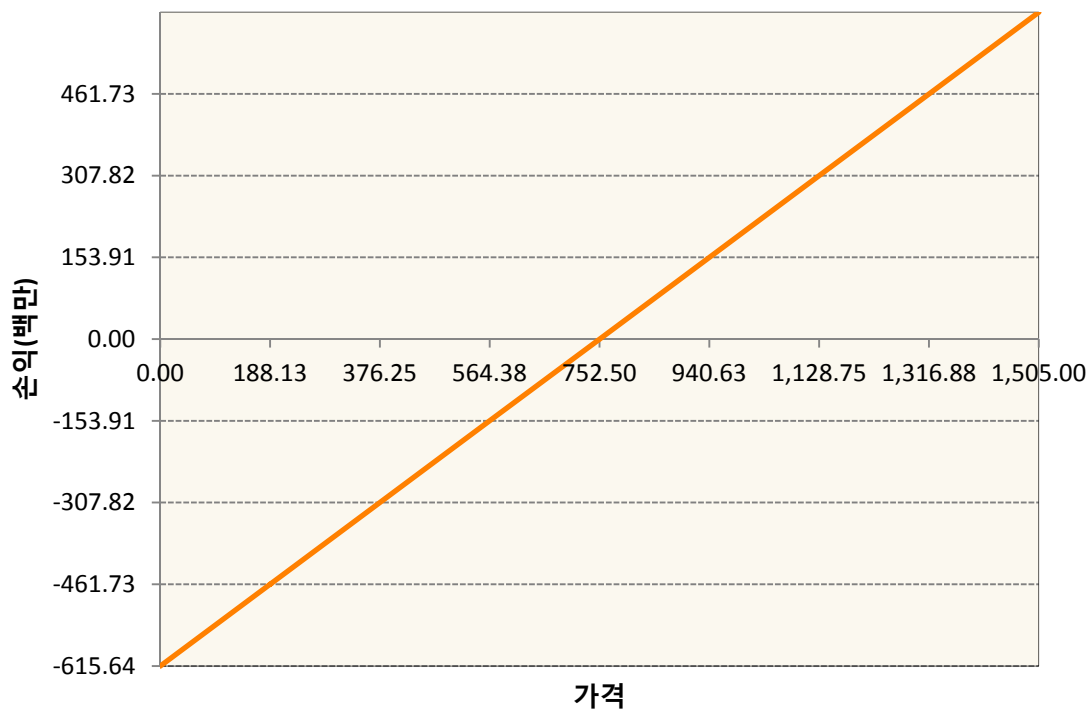
1. 계약금액

(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	616	0	616	
누계	유가증권	스왑	978	0	978	장외
누계	통화	선도	0	674	-674	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
49

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

(단위:백만원)

152

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

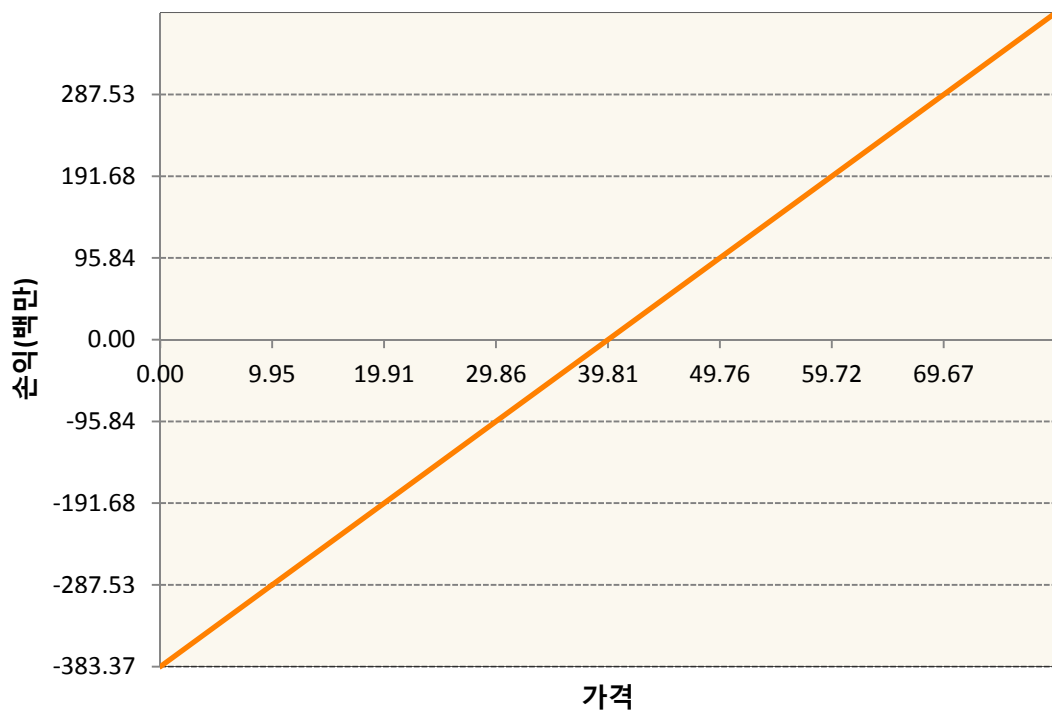
1. 계약금액

(단위:백만원)

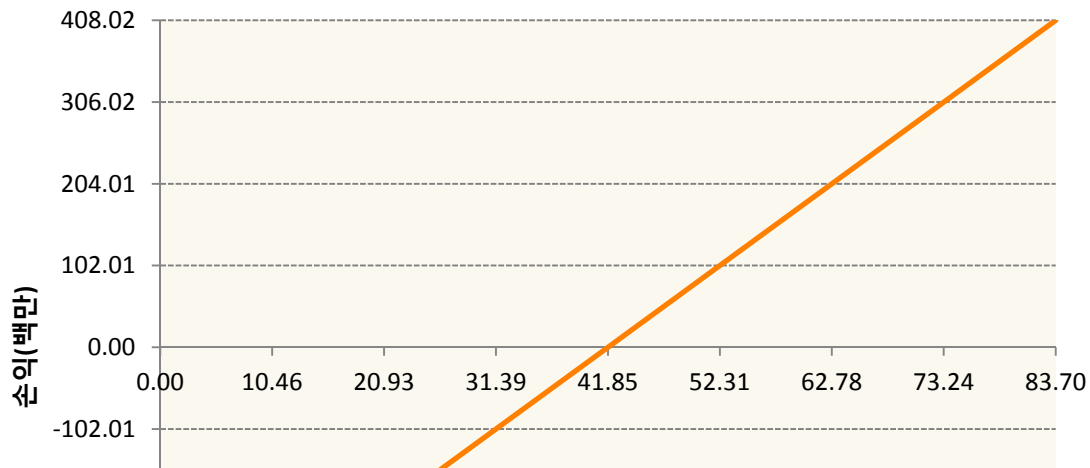
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,854	361	1,493	

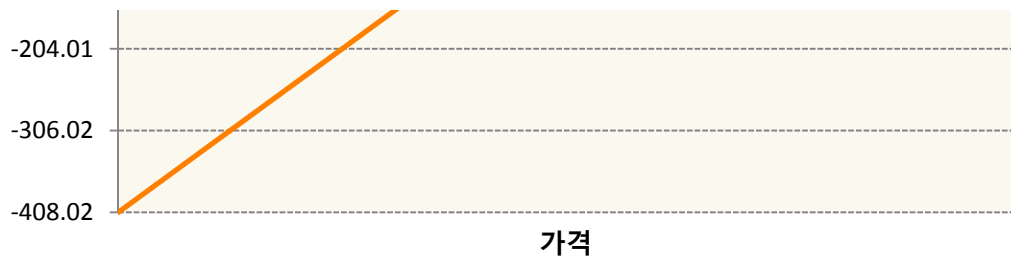
2. 만기시점의 손익구조

CLU0-WTI CRUDE FUTURE Sep20

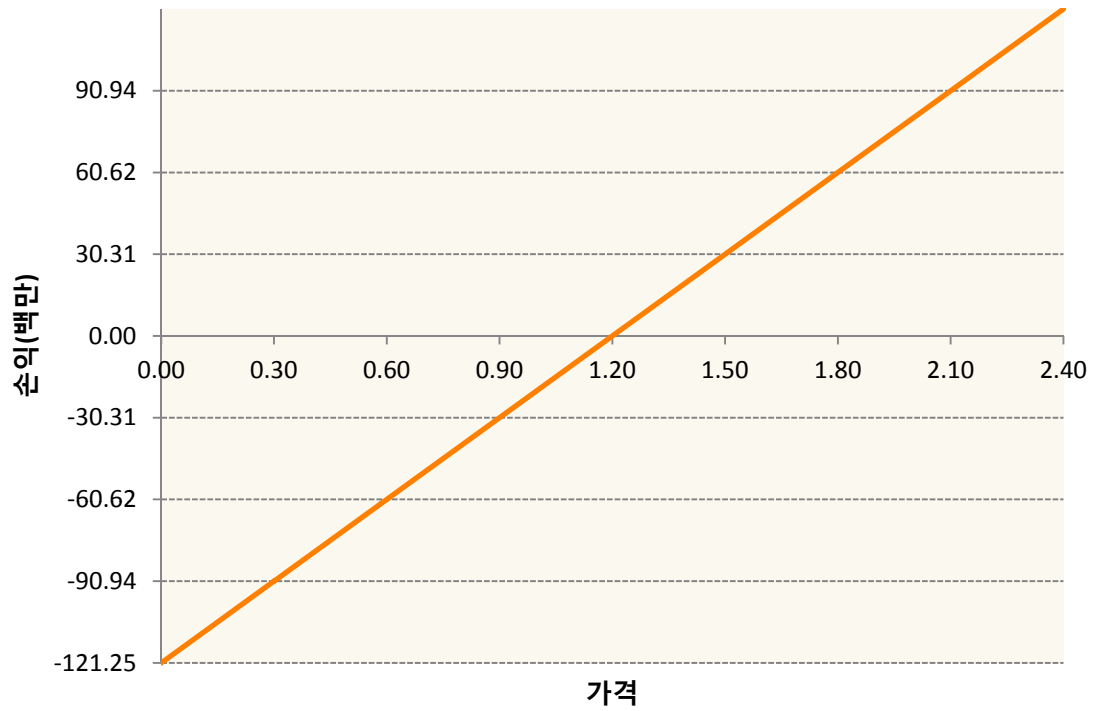


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20

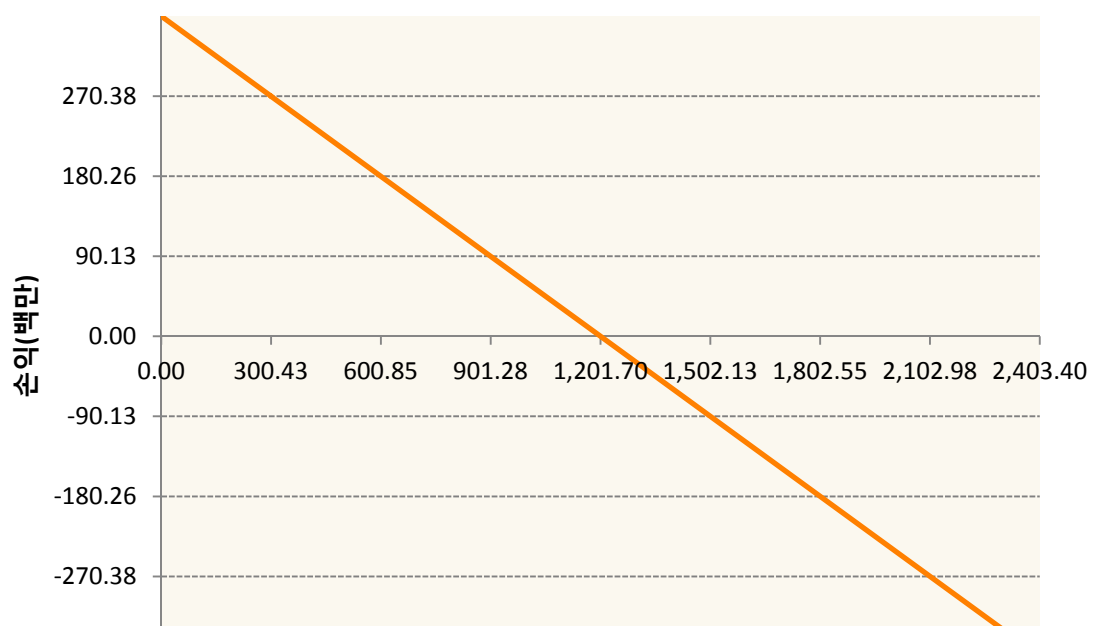


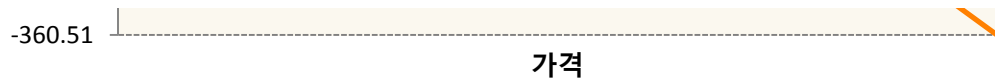
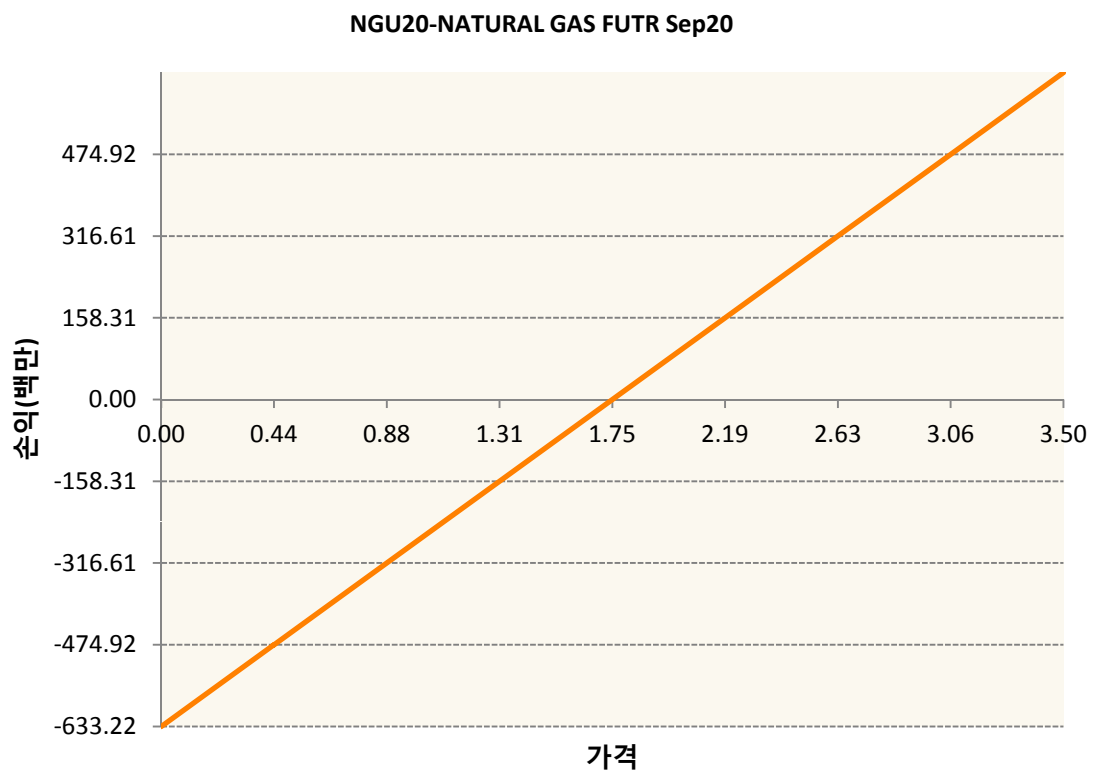
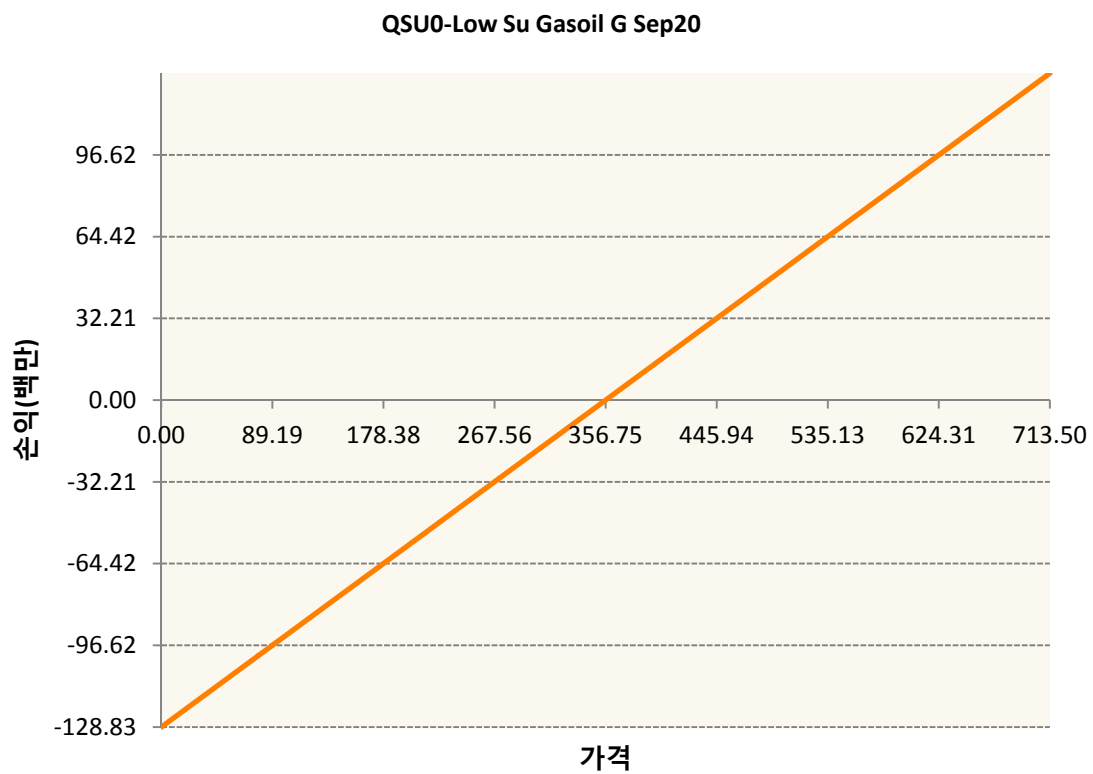


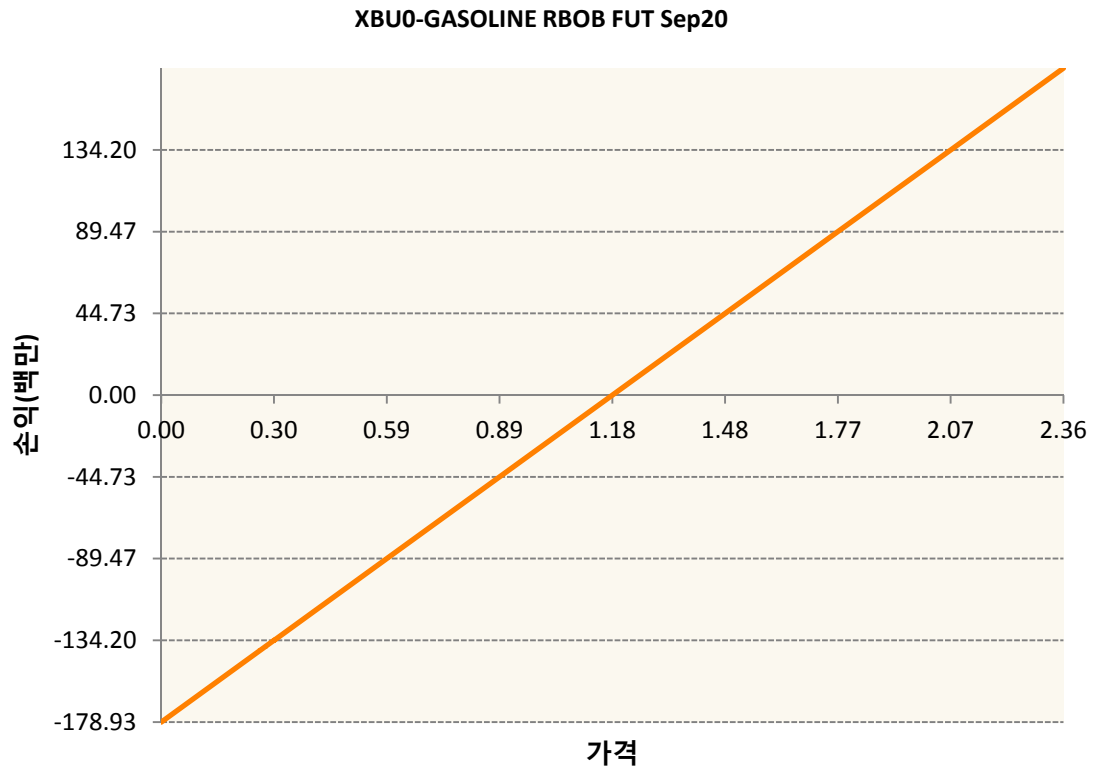
HOU0-NY Harb ULSD Fut Sep20



KR4175Q70005-2020-07 달러선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20		31
COU0	BRENT CRUDE FUTR Sep20		33
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20		10
KR4175Q70C 2020-07 달러선물			29
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20		51
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20		10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20		14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	912

공시일	2020-07-01
기준일	2020-06-30

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

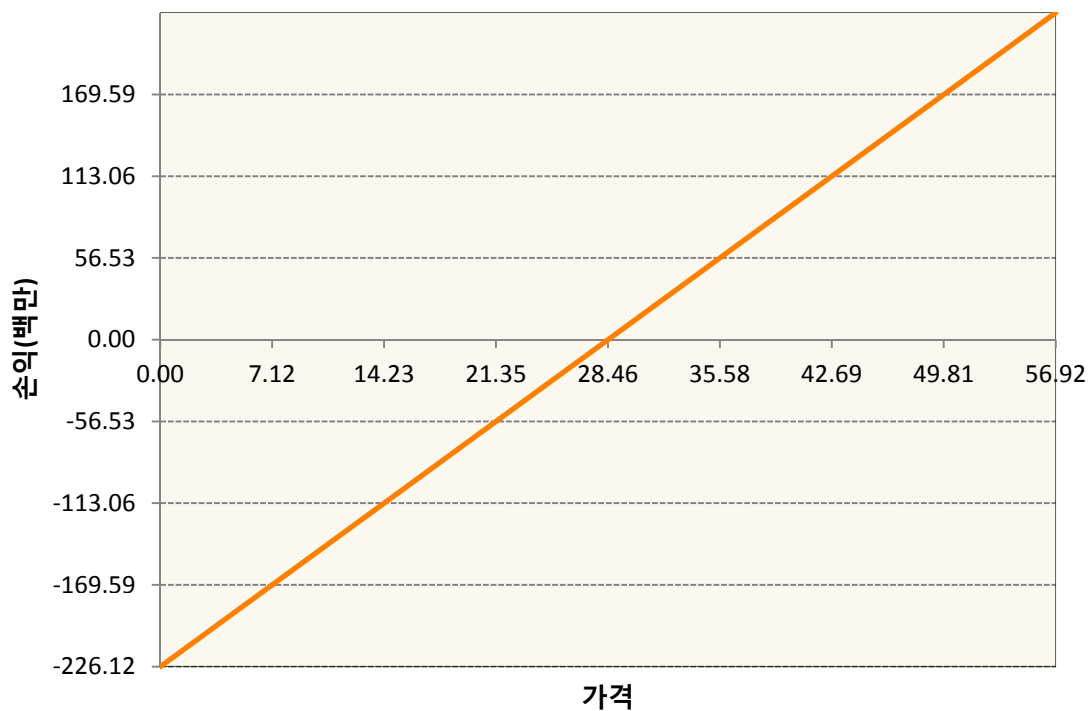
1. 계약금액

(단위:백만원)

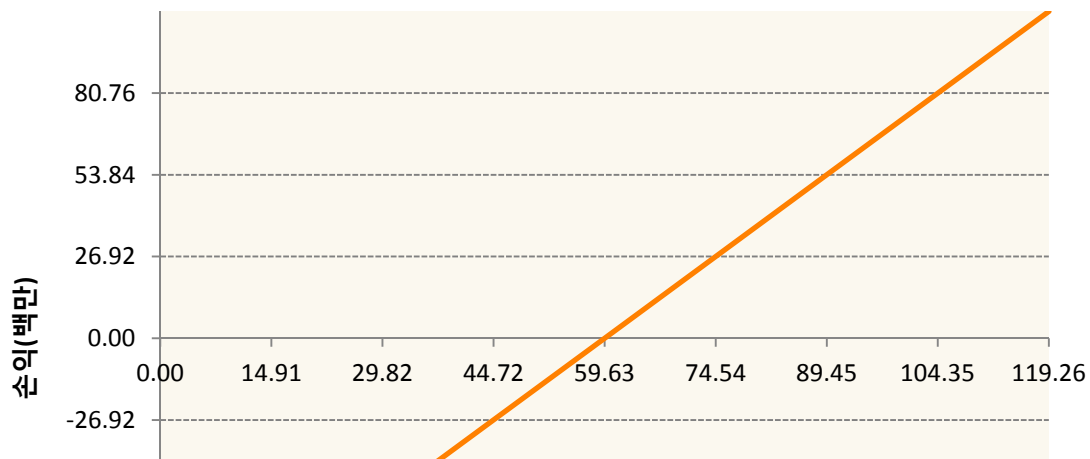
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,534	72	2,462	

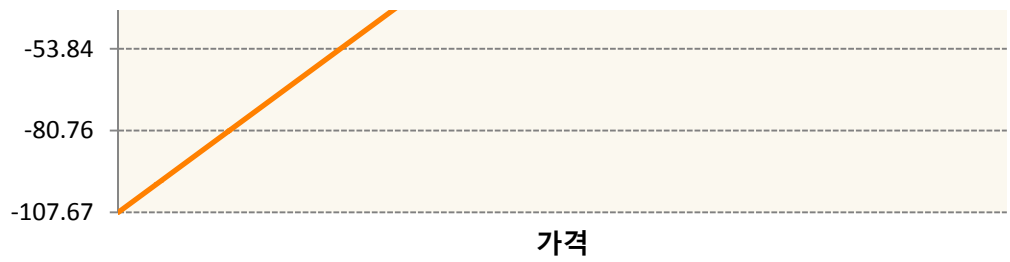
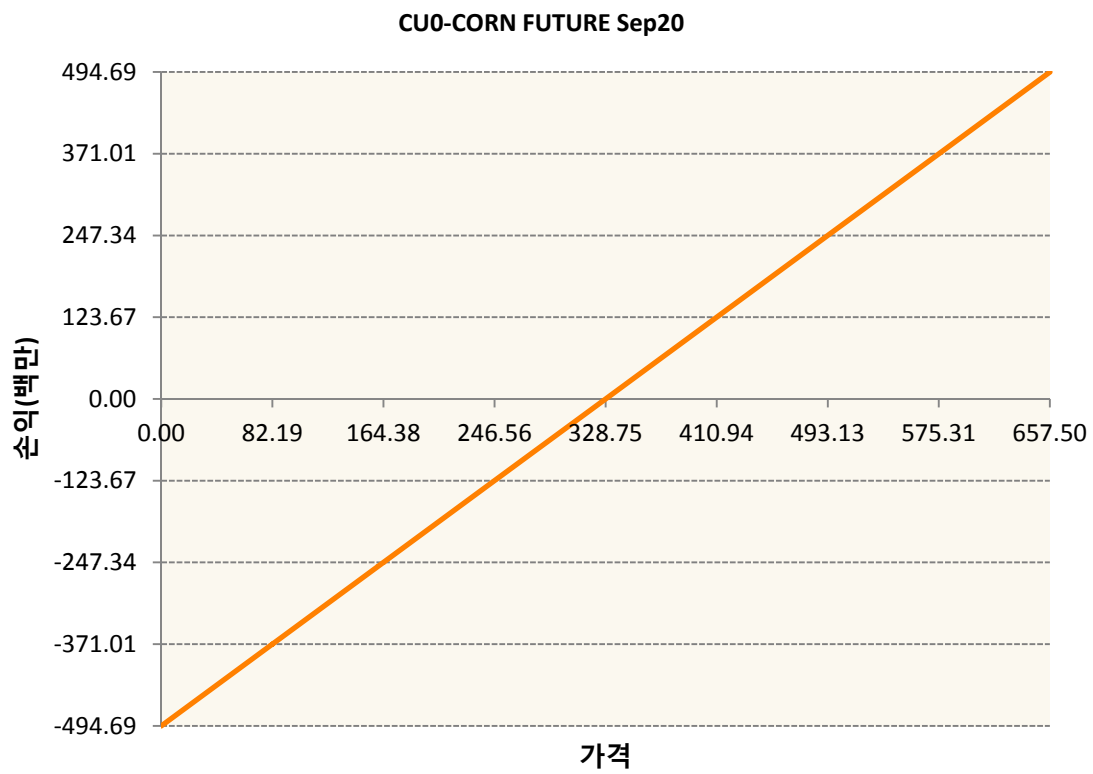
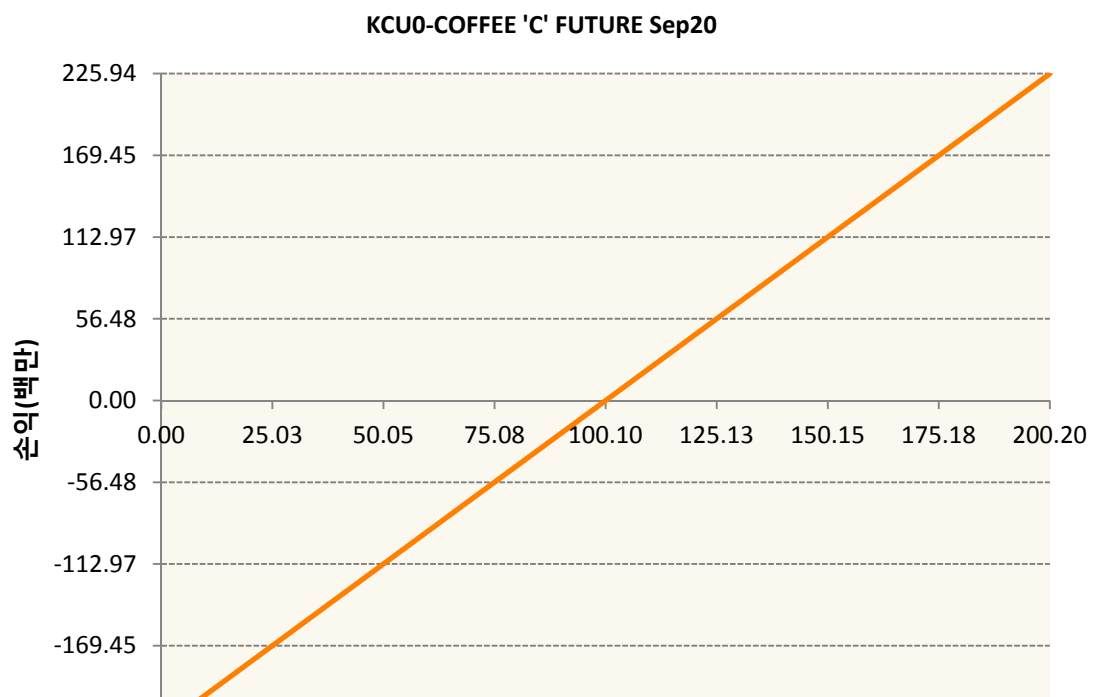
2. 만기시점의 손익구조

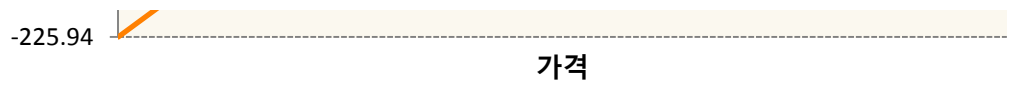
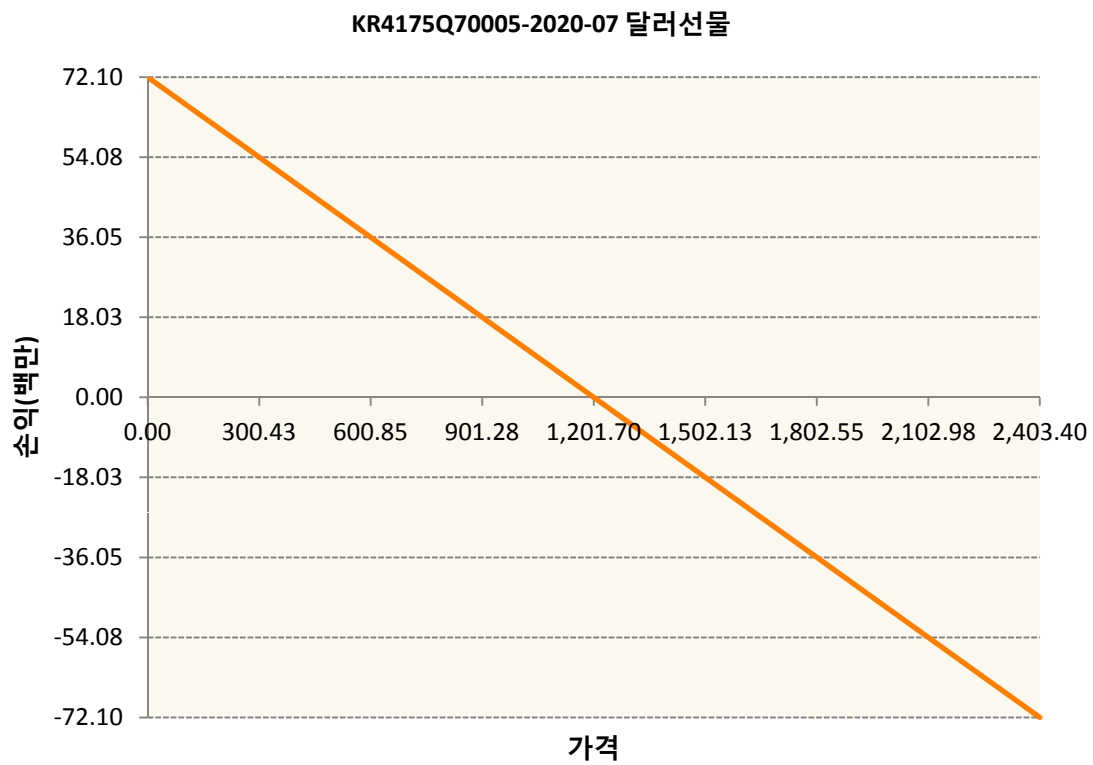
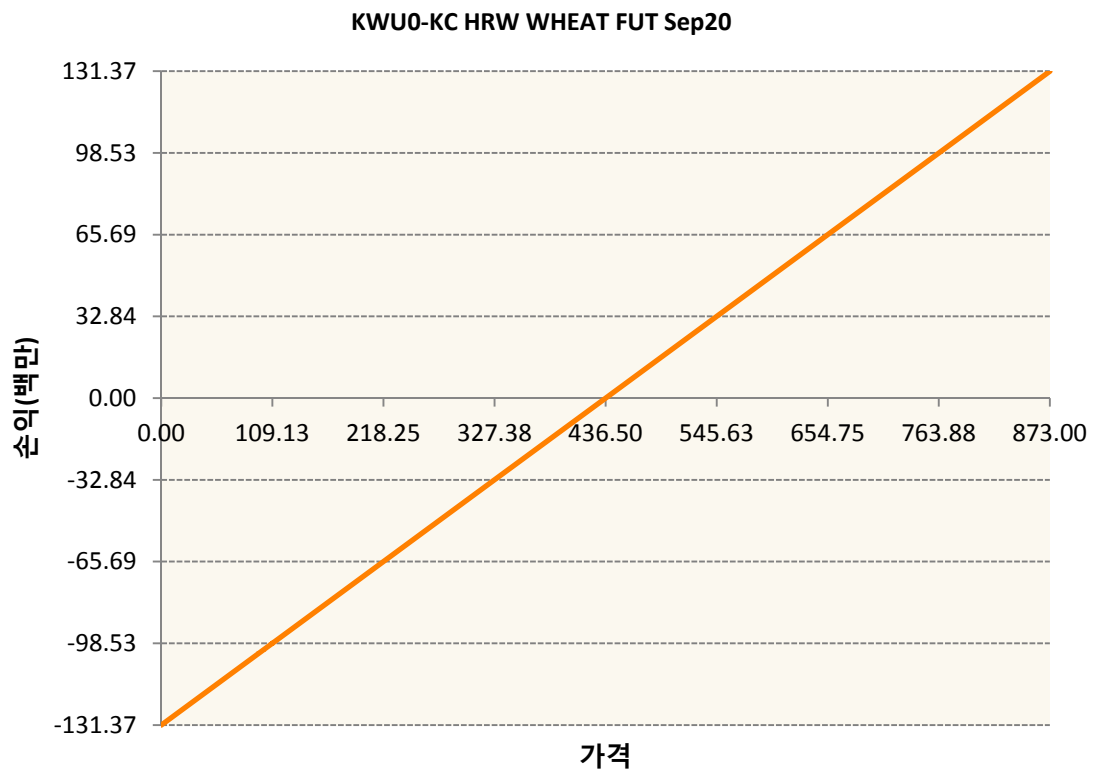
BOZ0-SOYBEAN OIL FUTR Dec20

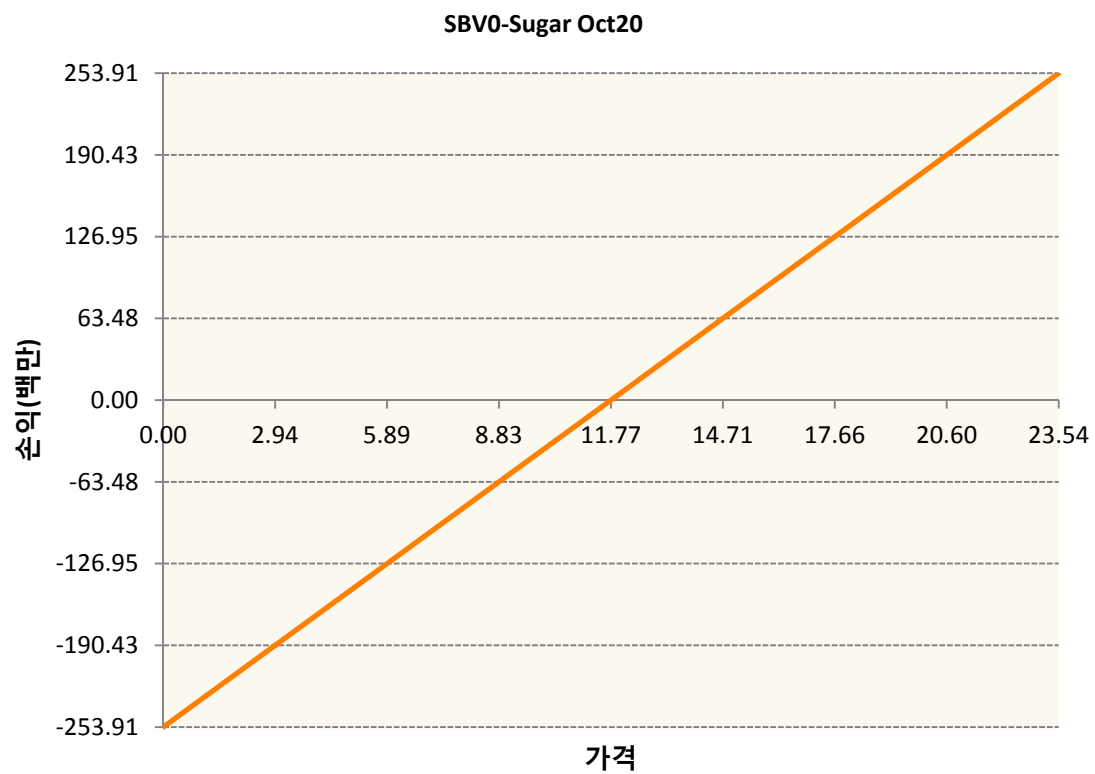
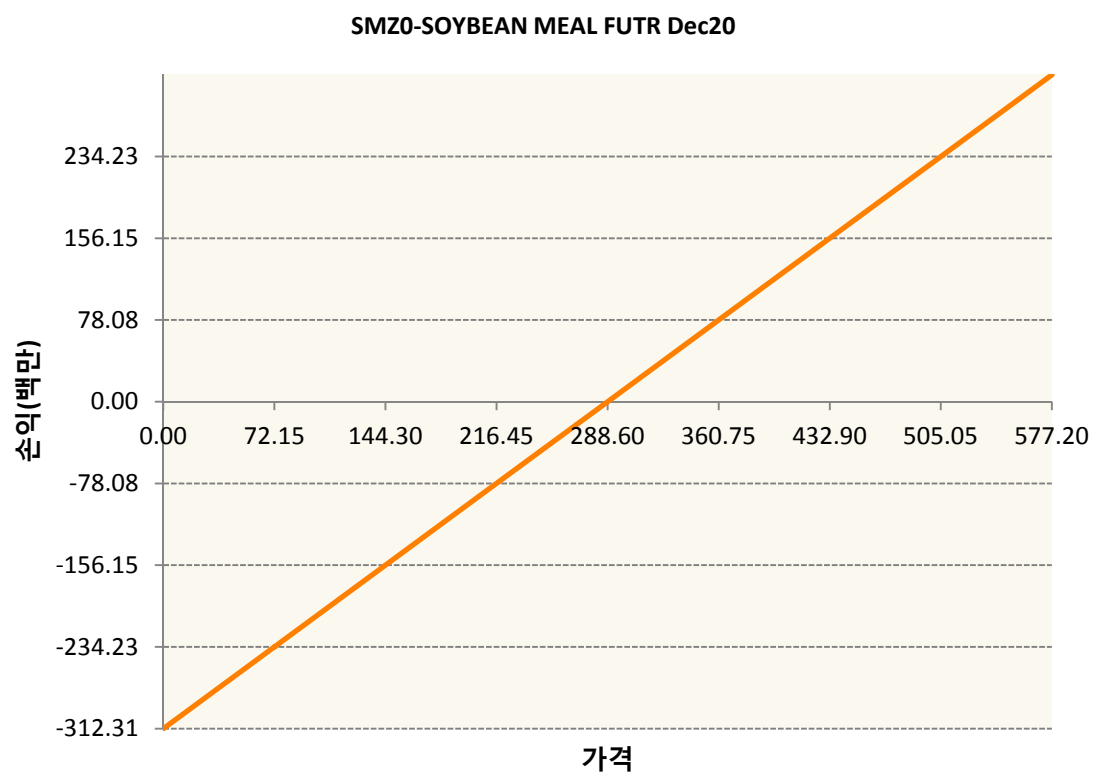
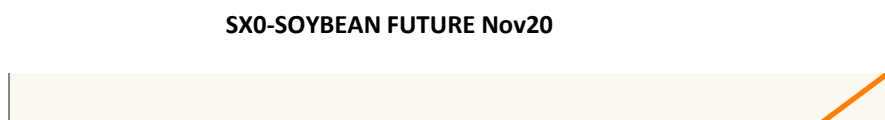


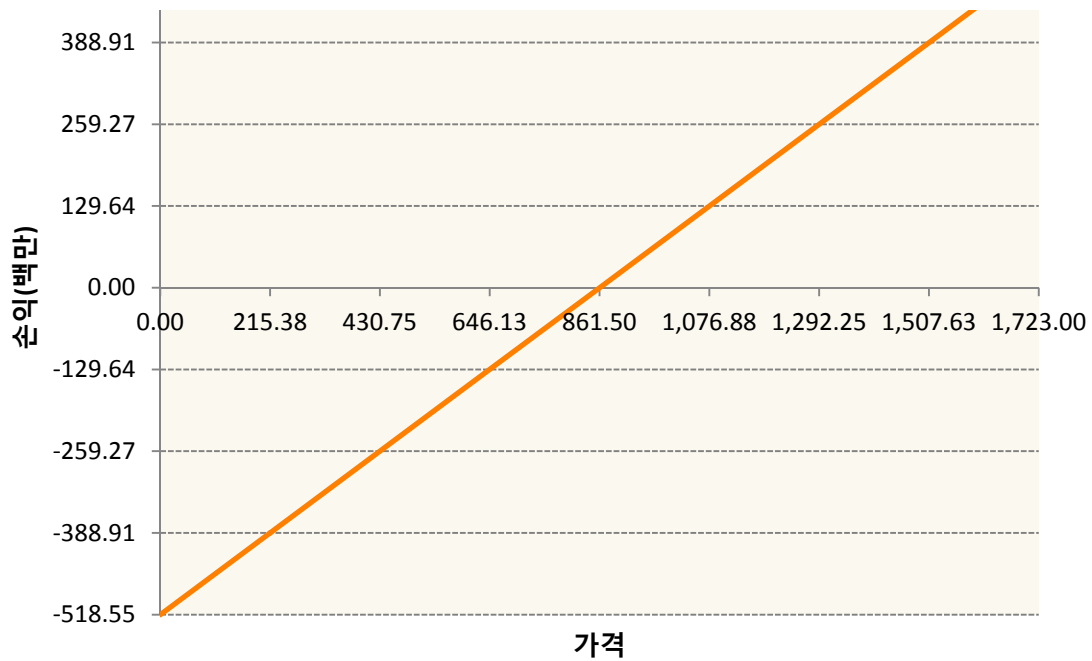
CTZ0-COTTON NO.2 FUTR Dec20



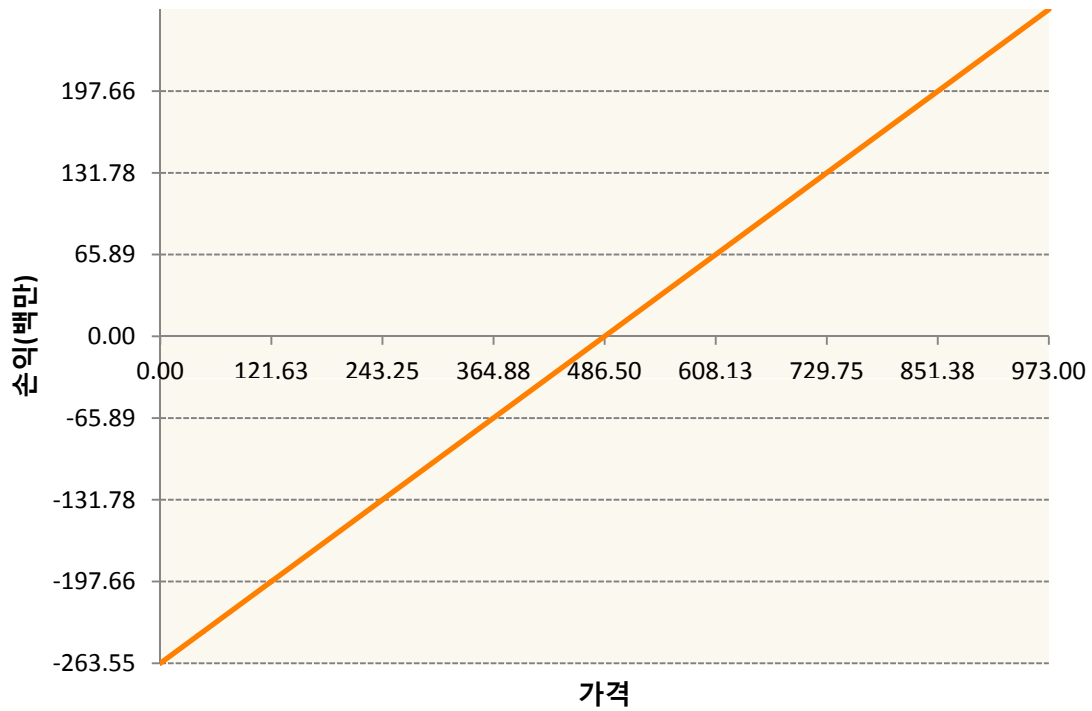








WU0-WHEAT FUTURE(CBT) Sep20



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
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	11
SBV0	Sugar Oct20	20
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	25
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	41
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	21

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

(단위:백만원)

238