

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

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	2020-07-03
기준일	2020-07-02

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

1,067

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,283

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

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

627

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

901

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

유로인덱스모(주식-파생형)

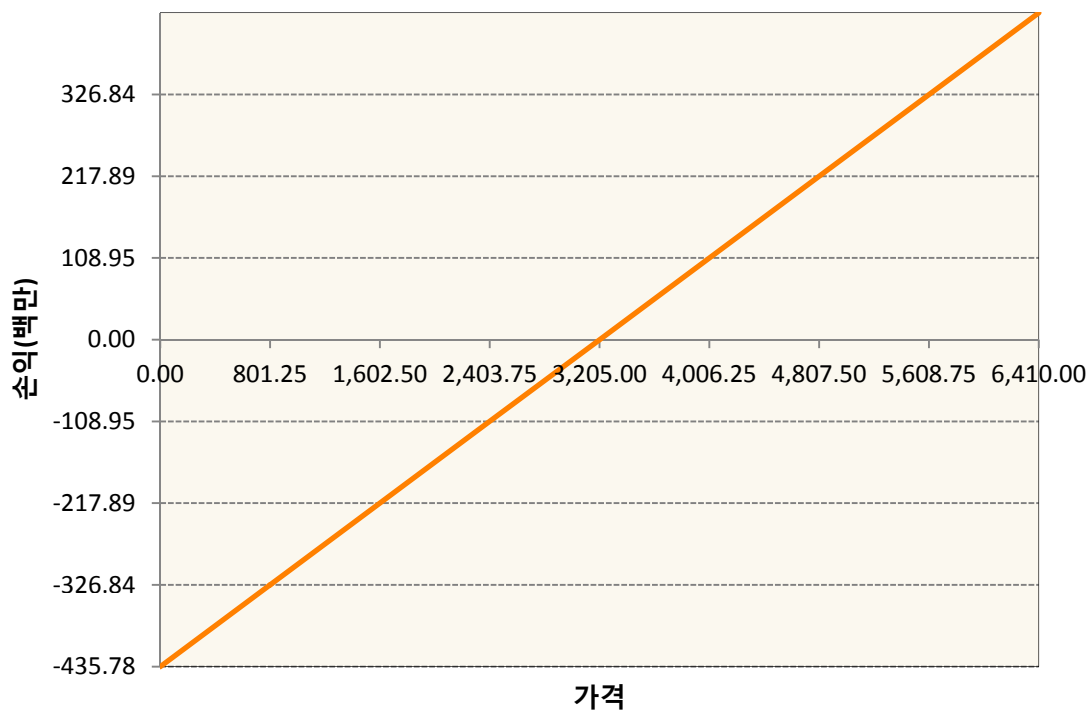
1. 계약금액

(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	2020-07-03
기준일	2020-07-02

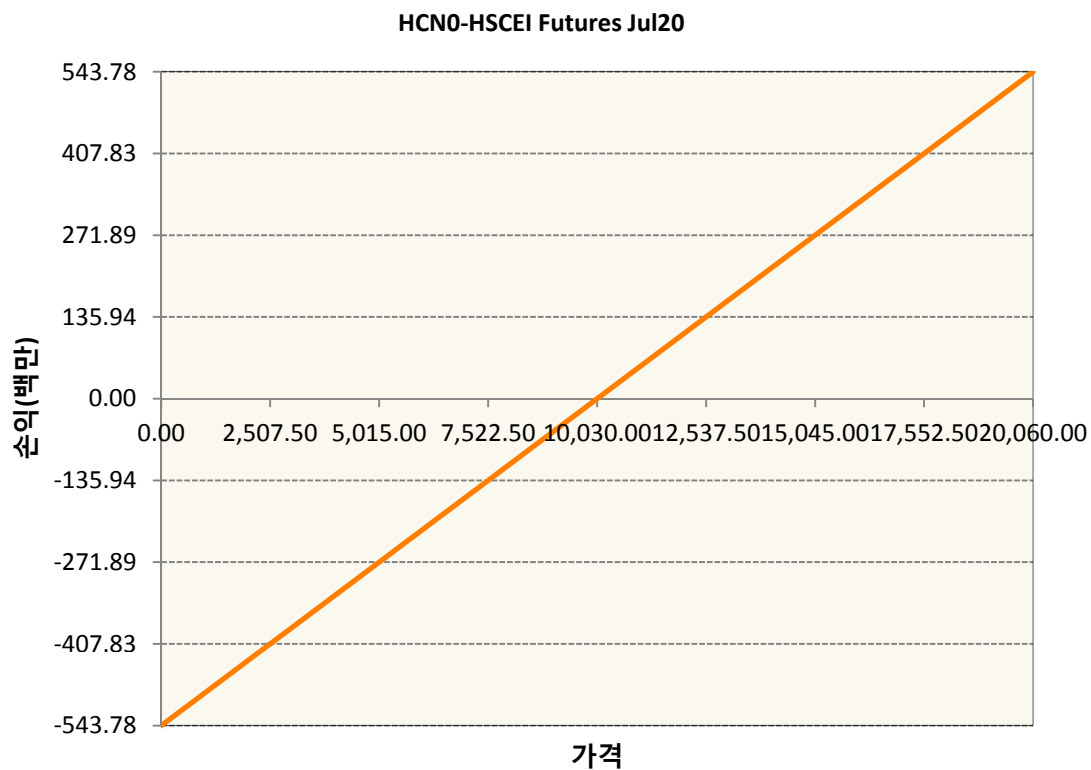
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	544	0	544	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN0	HSCEI Futures Jul20	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

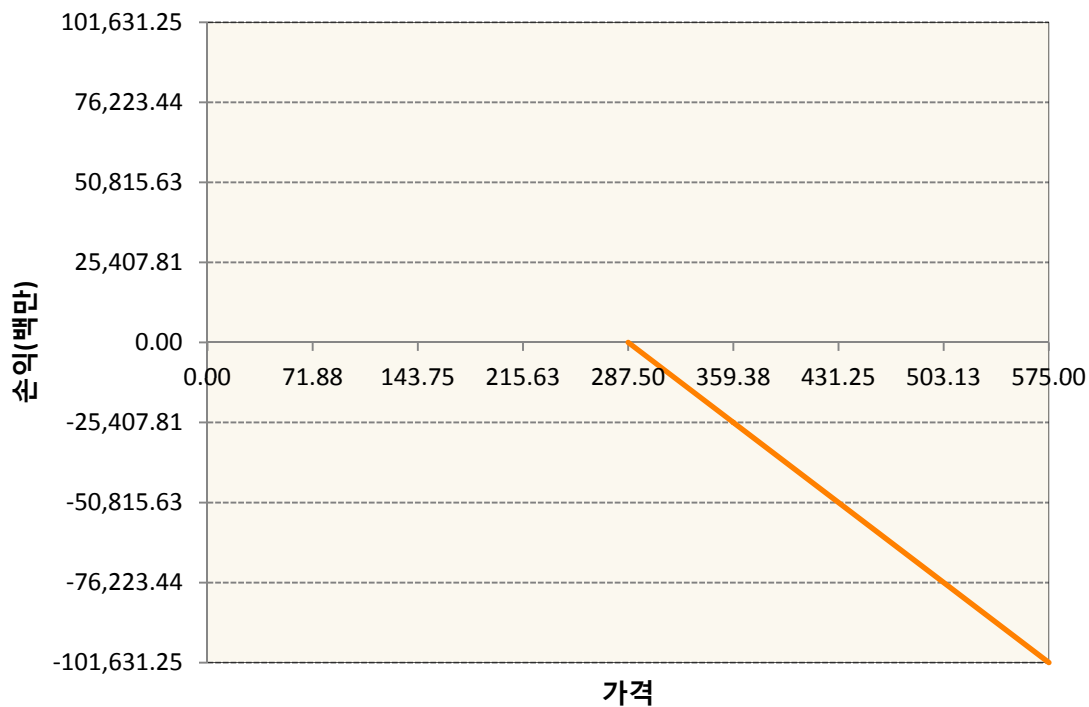
1. 계약금액

(단위:백만원)

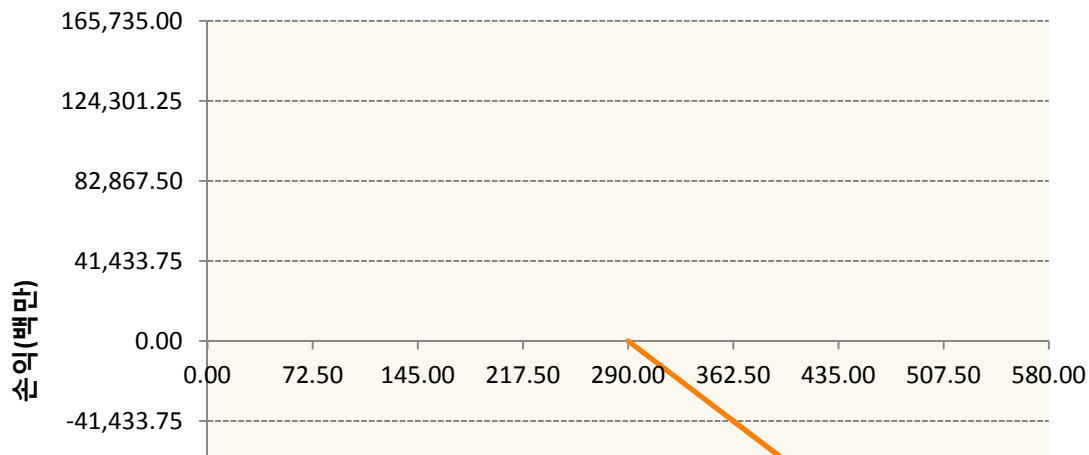
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	367,991	-367,991	장내

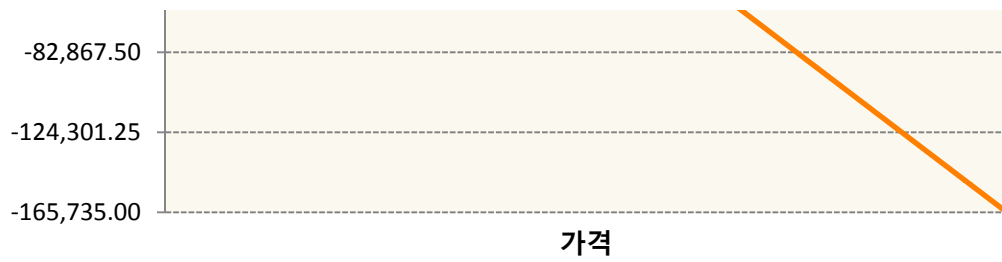
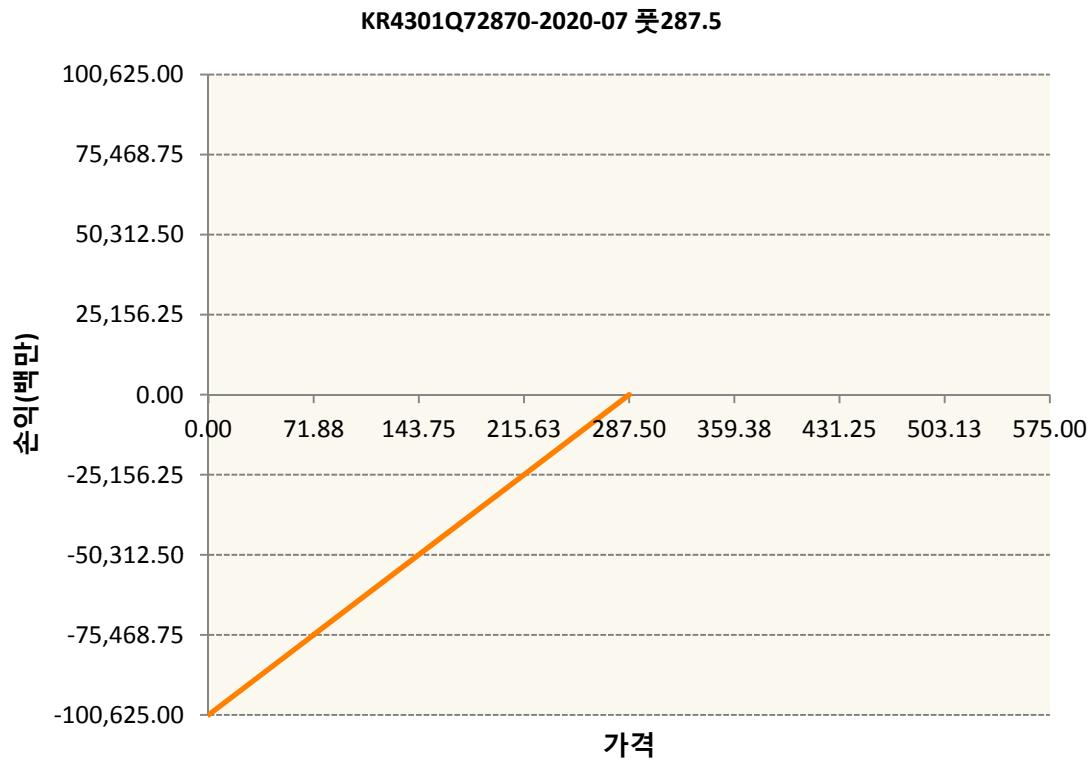
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72872-2020-07 콜287.5



KR4201Q72906-2020-07 콜290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72872			2020-07 콜287.5				5,751
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,865	1,836	1,795	1,741	1,676	1,599	1,511
-5.33%	1,749	1,671	1,579	1,473	1,356	1,230	1,095
-2.67%	1,397	1,249	1,093	929	760	586	408
0%	607	406	203	0	-204	-409	-614
2.67%	-760	-964	-1,168	-1,374	-1,580	-1,787	-1,995
5.33%	-2,682	-2,838	-3,003	-3,176	-3,354	-3,537	-3,723
8.00%	-5,004	-5,097	-5,205	-5,326	-5,458	-5,600	-5,751
KR4201Q72906			2020-07 콜290				8,741
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,496	2,463	2,413	2,345	2,258	2,154	2,033

-5.33%	2,371	2,273	2,151	2,007	1,844	1,664	1,468
-2.67%	1,953	1,749	1,526	1,288	1,037	775	506
0%	935	628	316	0	-319	-642	-966
2.67%	-959	-1,300	-1,641	-1,983	-2,324	-2,666	-3,007
5.33%	-3,785	-4,072	-4,369	-4,673	-4,984	-5,300	-5,619
8.00%	-7,351	-7,537	-7,746	-7,974	-8,217	-8,474	-8,741
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							6,984
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,939	-6,940	-6,943	-6,948	-6,956	-6,968	-6,984
-5.33%	-4,301	-4,313	-4,332	-4,357	-4,390	-4,429	-4,475
-2.67%	-1,760	-1,817	-1,883	-1,956	-2,036	-2,122	-2,213
0%	365	245	123	0	-125	-250	-376
2.67%	1,667	1,546	1,423	1,298	1,172	1,046	918
5.33%	2,173	2,112	2,041	1,962	1,876	1,785	1,689
8.00%	2,290	2,273	2,249	2,216	2,176	2,128	2,073

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

(단위:백만원)

21,302

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

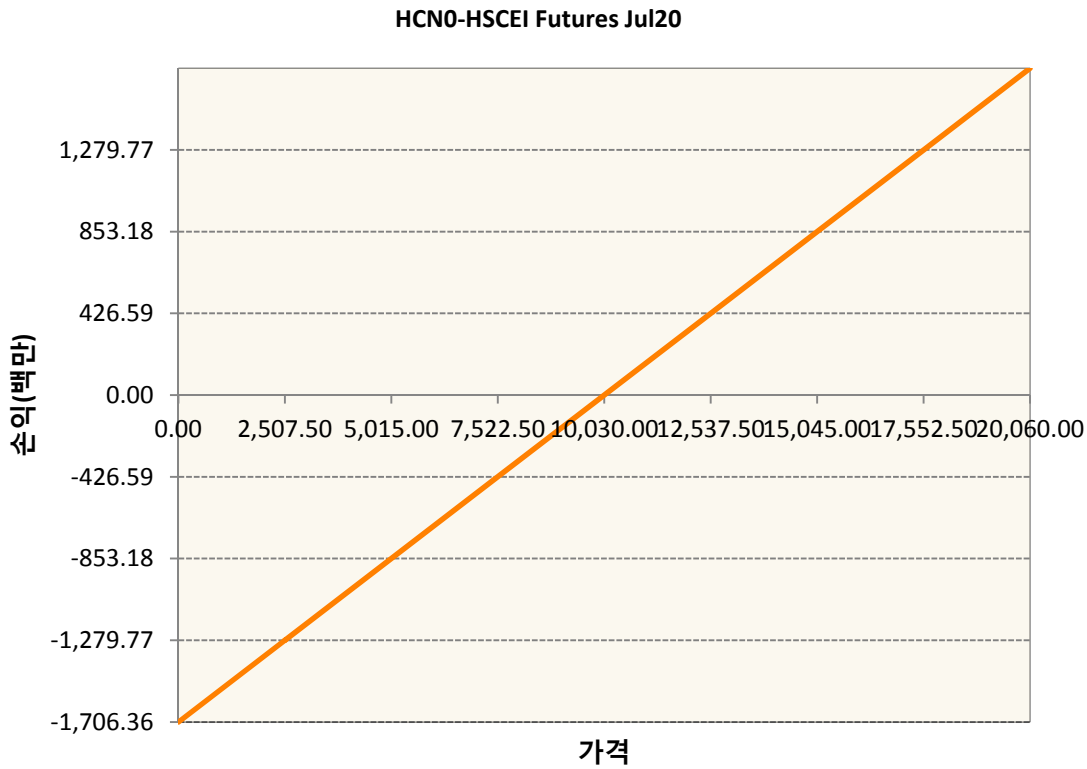
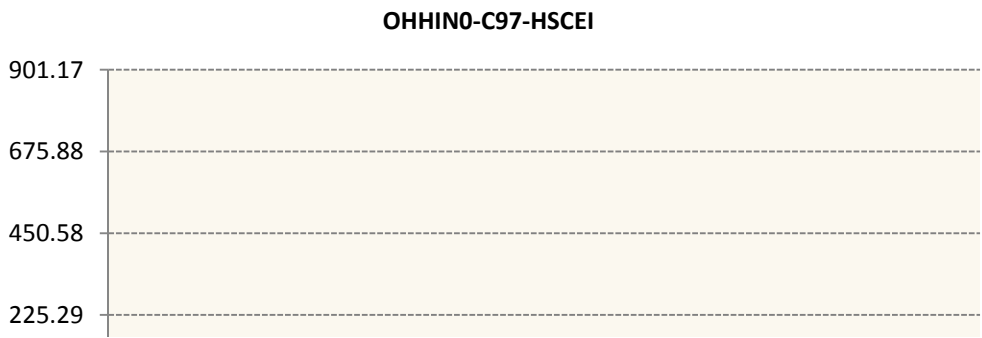
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

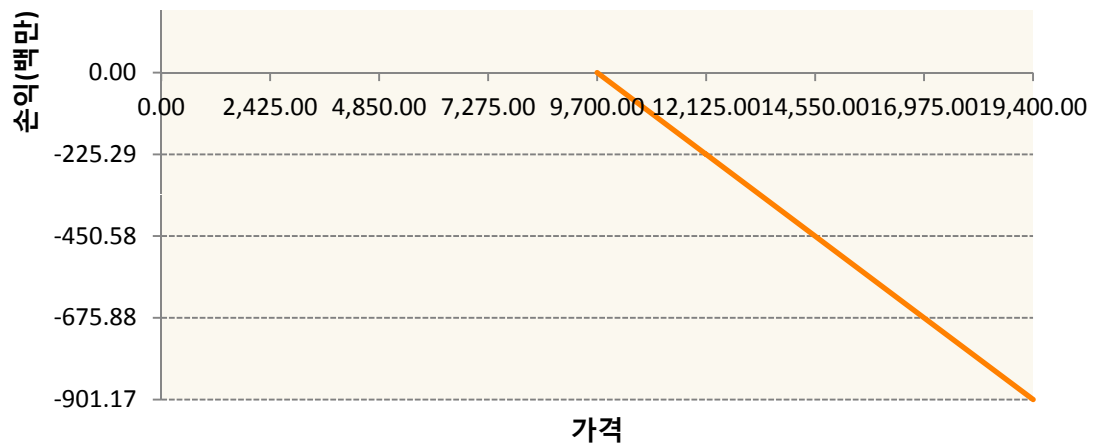
1. 계약금액

(단위:백만원)

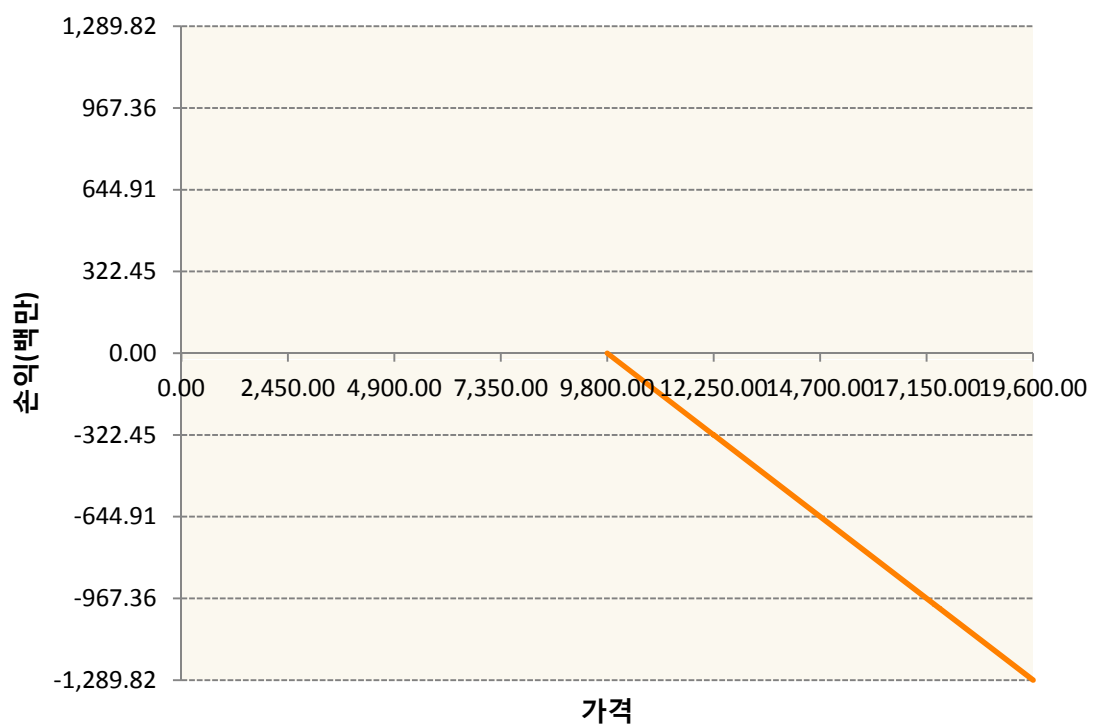
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,706	0	1,706	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,382	-4,382	장내
누계	통화	선도	0	1,499	-1,499	장외

2. 만기시점의 손익구조

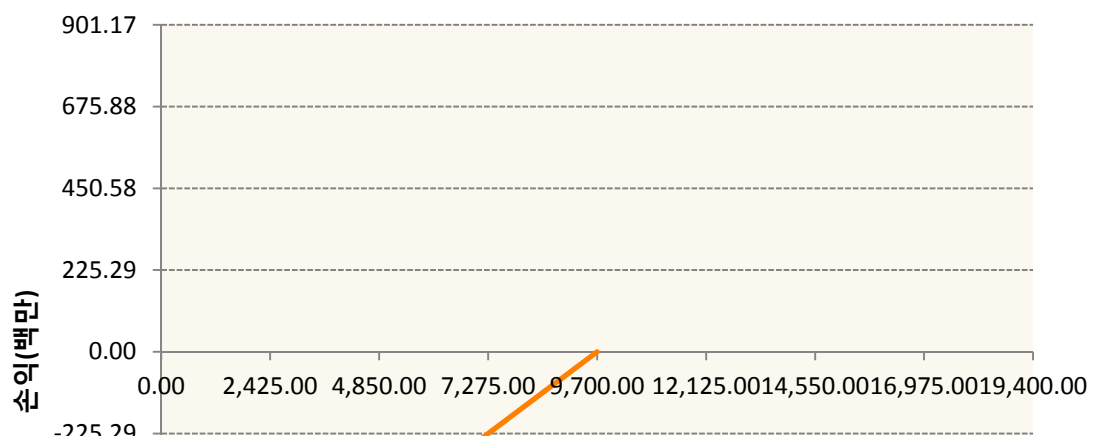


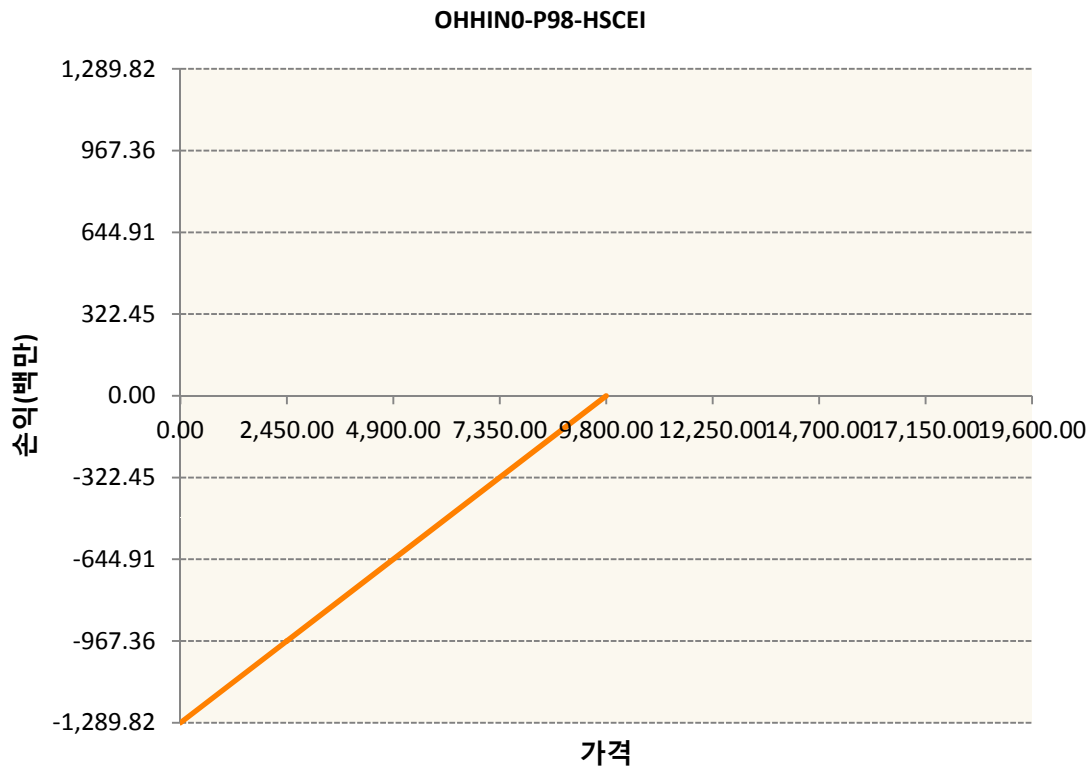


OHHIN0-C98-HSCEI



OHHIN0-P97-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E		120
HCN0 HSCEI Futures Jul20		137
OHHIN0-C9 HSCEI		72
OHHIN0-C9 HSCEI		103
OHHIN0-P9 HSCEI		72
OHHIN0-P9 HSCEI		103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	587

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

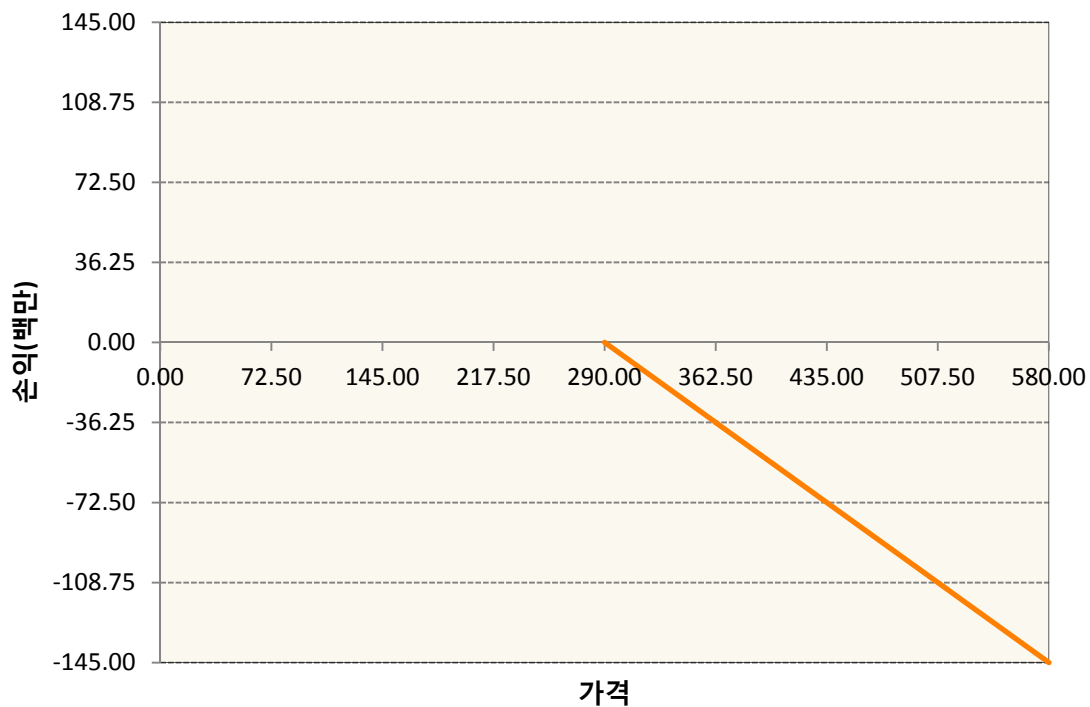
1. 계약금액

(단위:백만원)

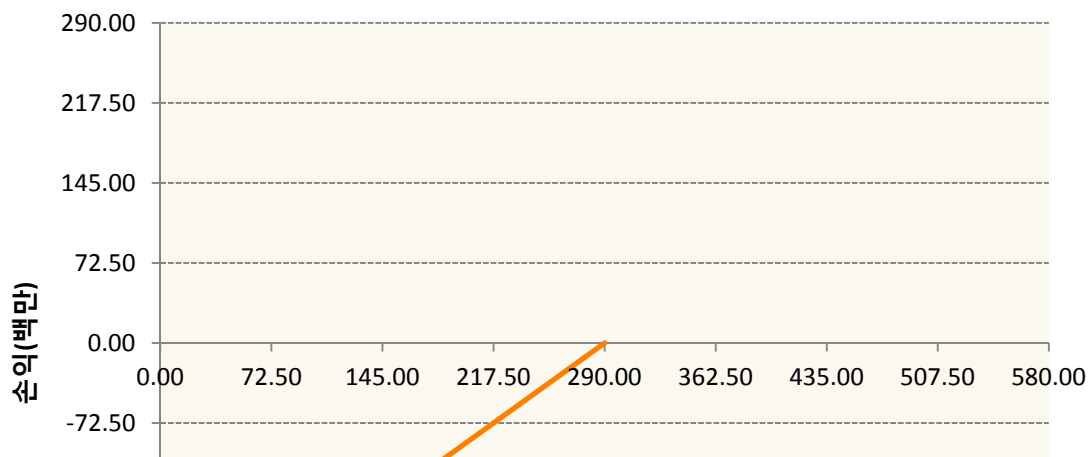
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	435	-435	장내

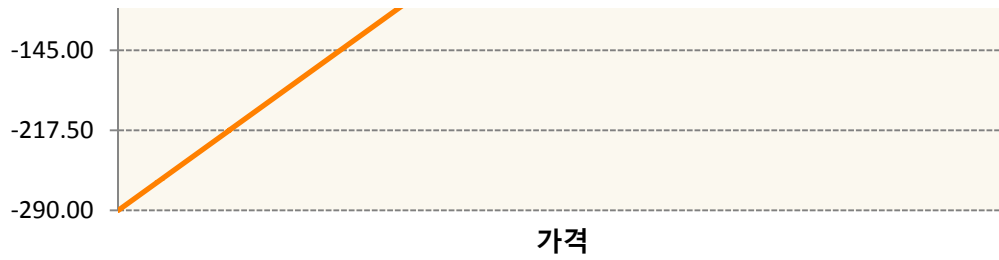
2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q72906-2020-07 콜290



KR4301Q72904-2020-07 풋290





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201Q72906			2020-07 콜290				8
	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	2	1	1
-2.67%	2	2	1	1	1	1	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-3
5.33%	-3	-4	-4	-4	-4	-5	-5
8.00%	-6	-7	-7	-7	-7	-7	-8

KR4301Q72904			2020-07 풋290				21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-7
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	5	5	5	4	4	4	3
5.33%	8	7	7	7	7	6	6
8.00%	8	8	8	8	8	8	7

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

30

공시일 2020-07-03
기준일 2020-07-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

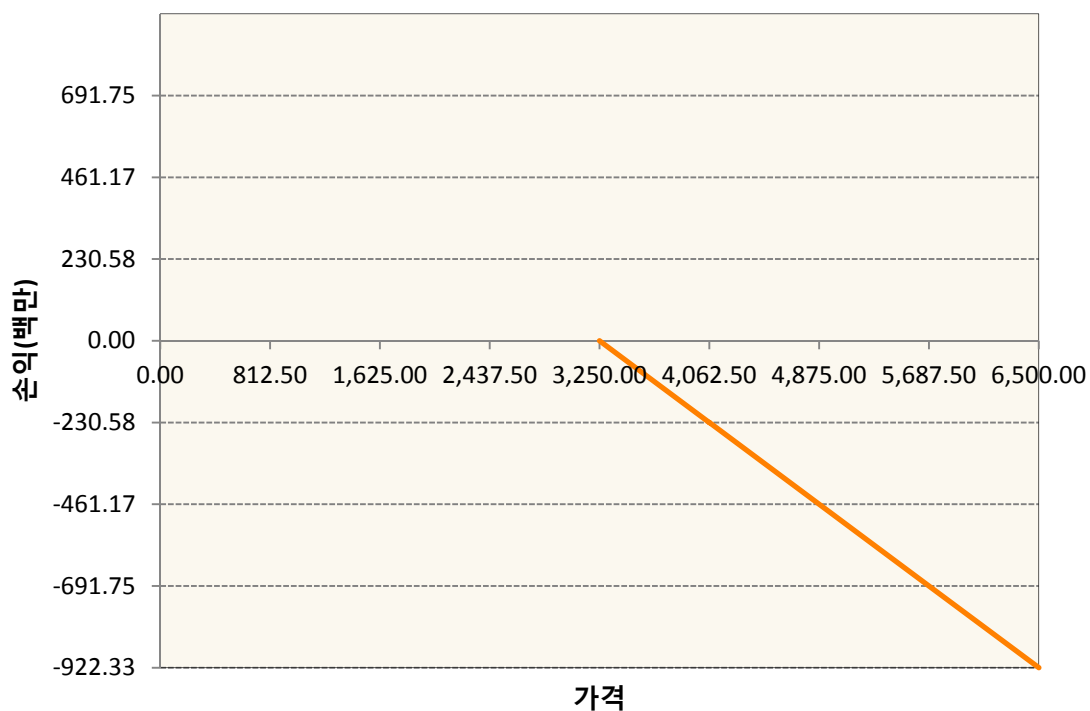
1. 계약금액

(단위:백만원)

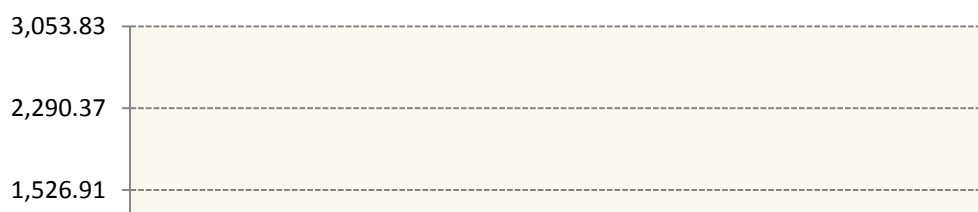
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,309	0	1,309	
누계	유가증권	스왑	8,060	0	8,060	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,908	-7,908	장내
누계	통화	선도	0	2,925	-2,925	장외

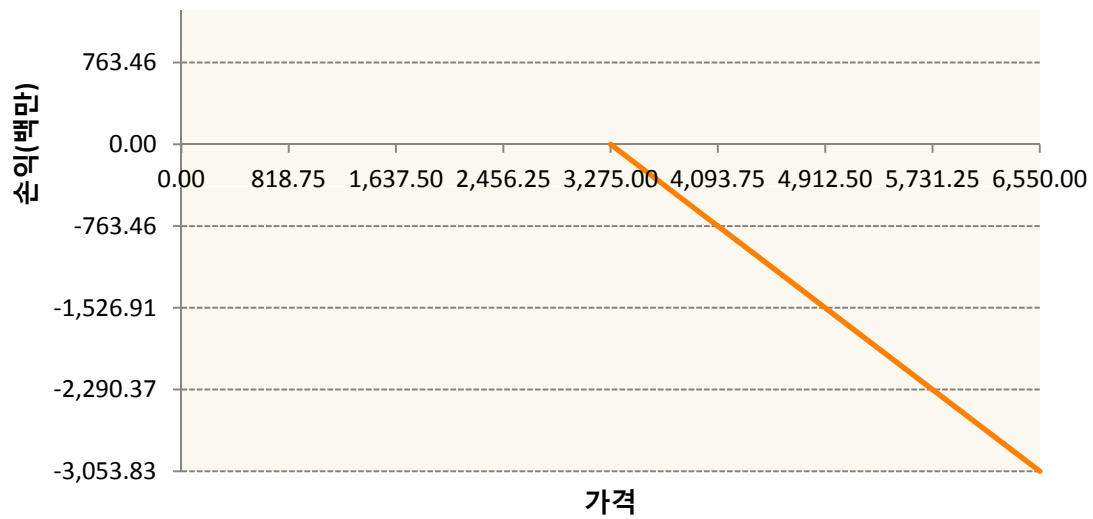
2. 만기시점의 손익구조

OESXN0-C3250-EURO STOXX 50

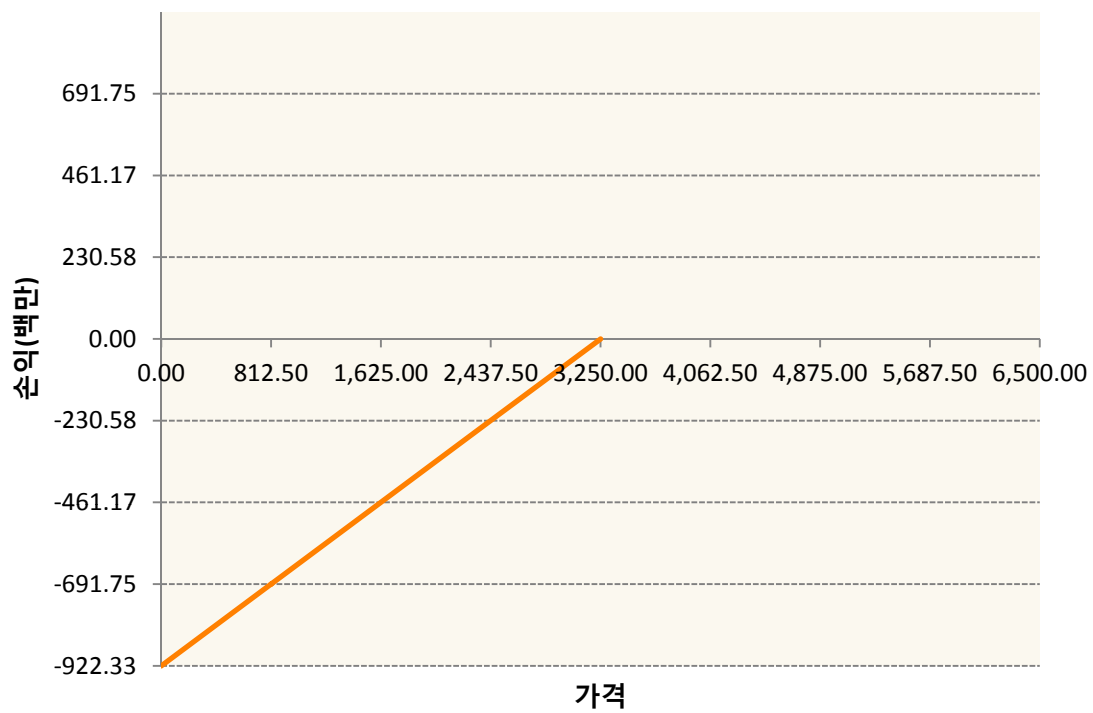


OESXN0-C3275-EURO STOXX 50



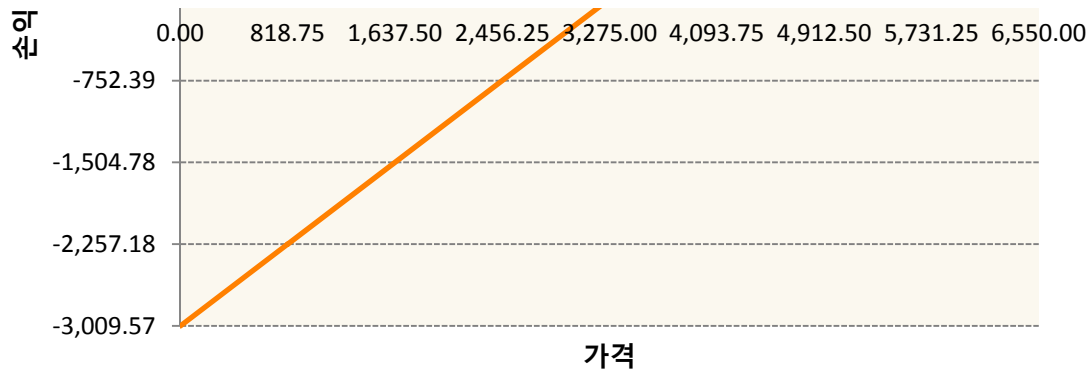
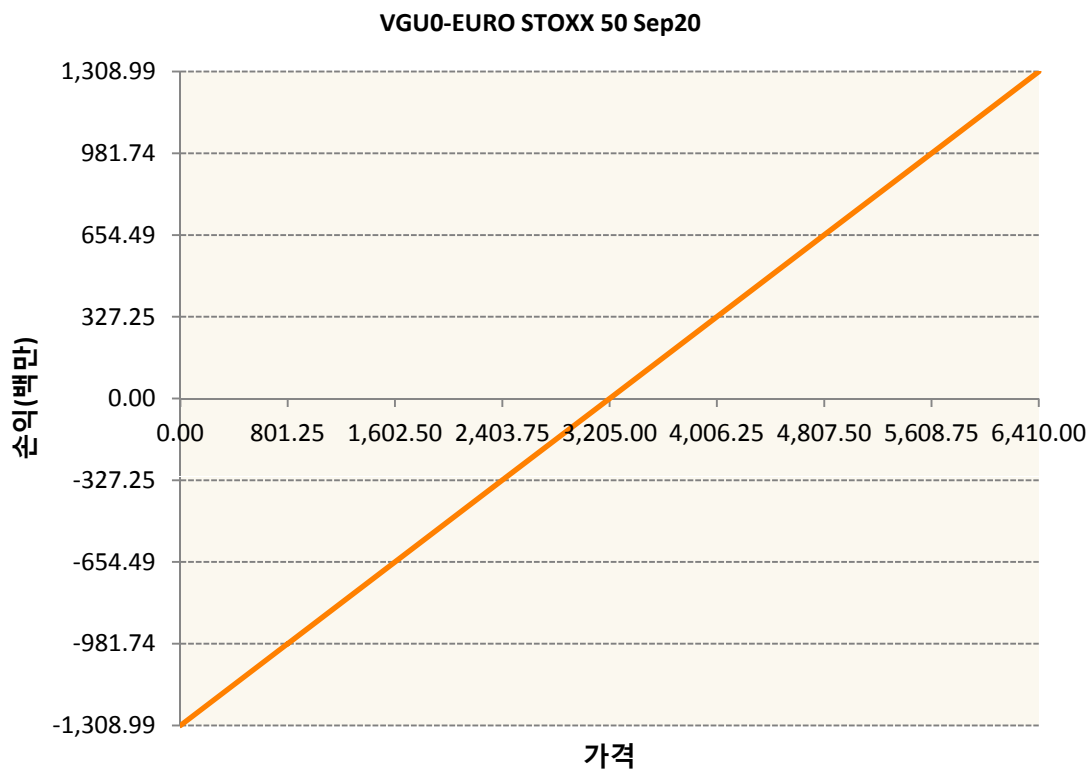


OESXN0-P3250-EURO STOXX 50



OESXN0-P3275-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY		25
FX21020M0₩/EUR 25-09-20E		234
OESXN0-C3₩ EURO STOXX 50		74
OESXN0-C3₩ EURO STOXX 50		244
OESXN0-P3₩ EURO STOXX 50		74
OESXN0-P3₩ EURO STOXX 50		241
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20		105

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

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

(단위:백만원)

1,334

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

ETF스마트레버리지목표전환형9호

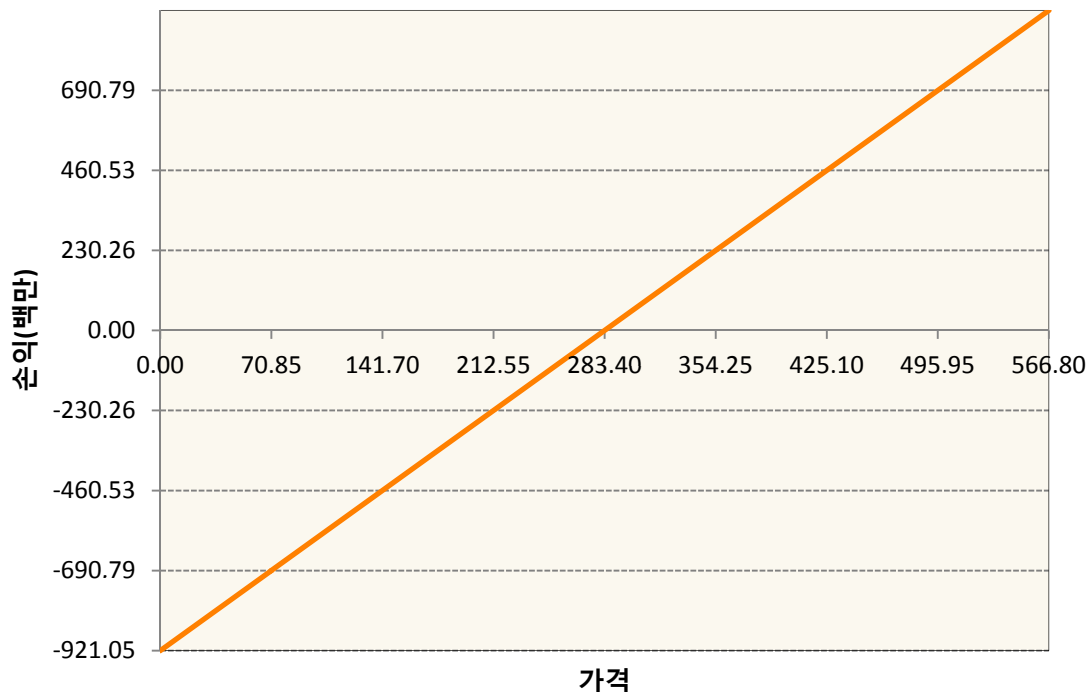
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	921	0	921	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	
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	25	25	25	25	25	25	25	25	
5.33%	49	49	49	49	49	49	49	49	
8.00%	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)

171

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

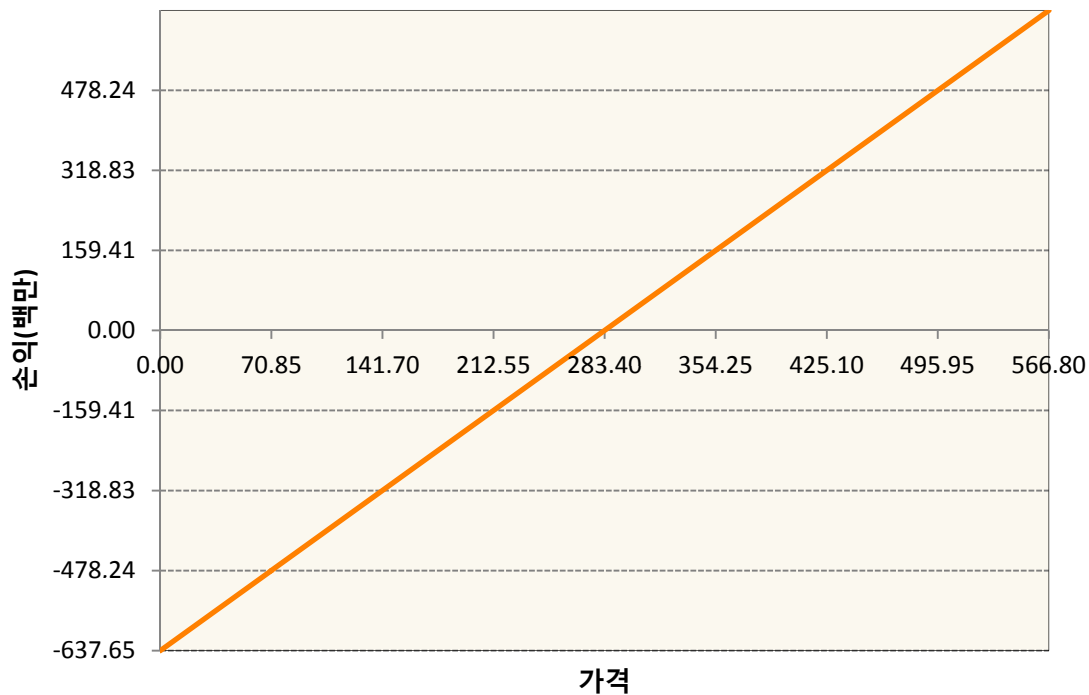
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	638	0	638	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	2020-07-03
기준일	2020-07-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

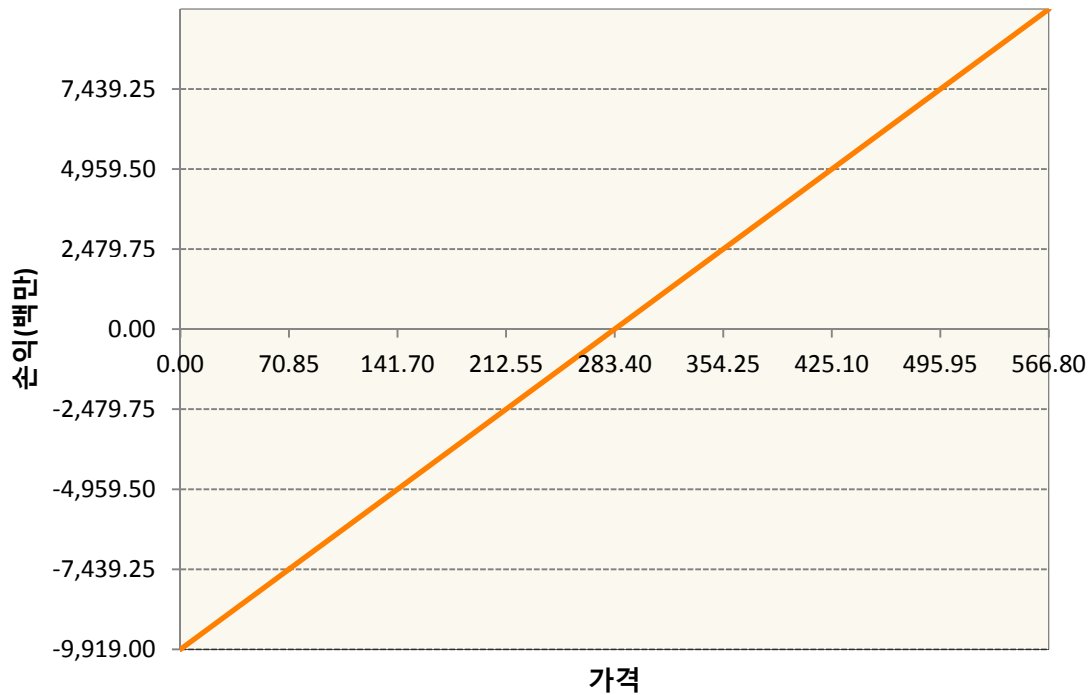
1. 계약금액

(단위:백만원)

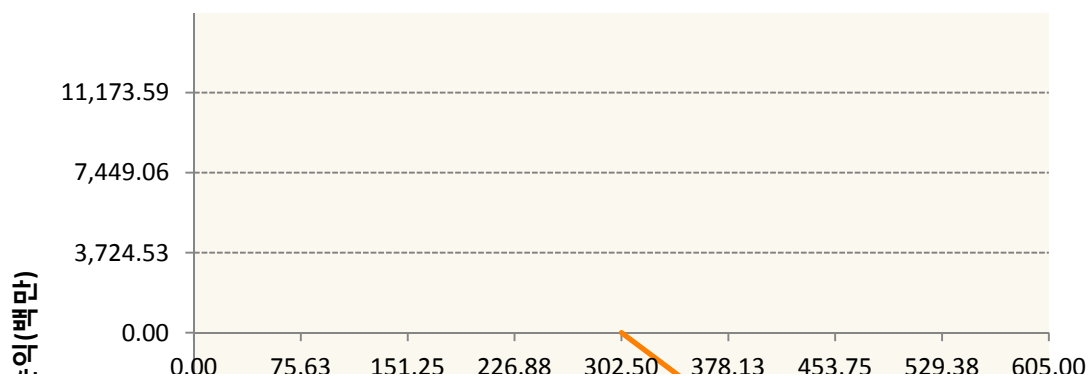
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,919	0	9,919	장내
누계	유가증권	옵션	3,247	19,092	-15,845	장내

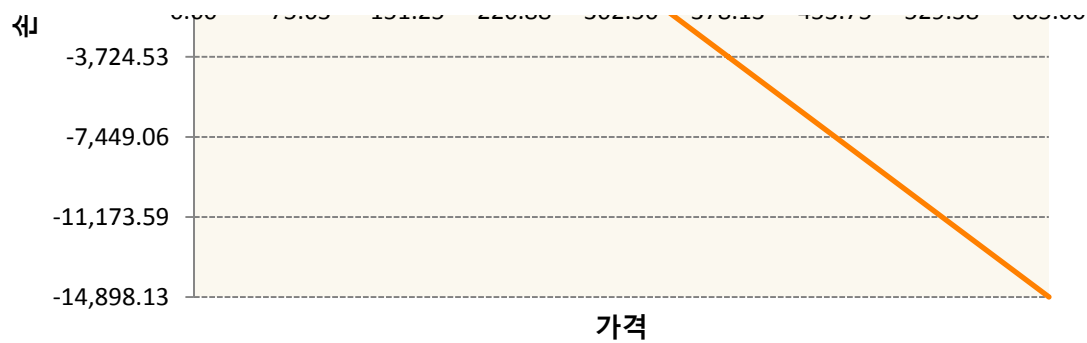
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q90009-2020-09 코스피200지수선물

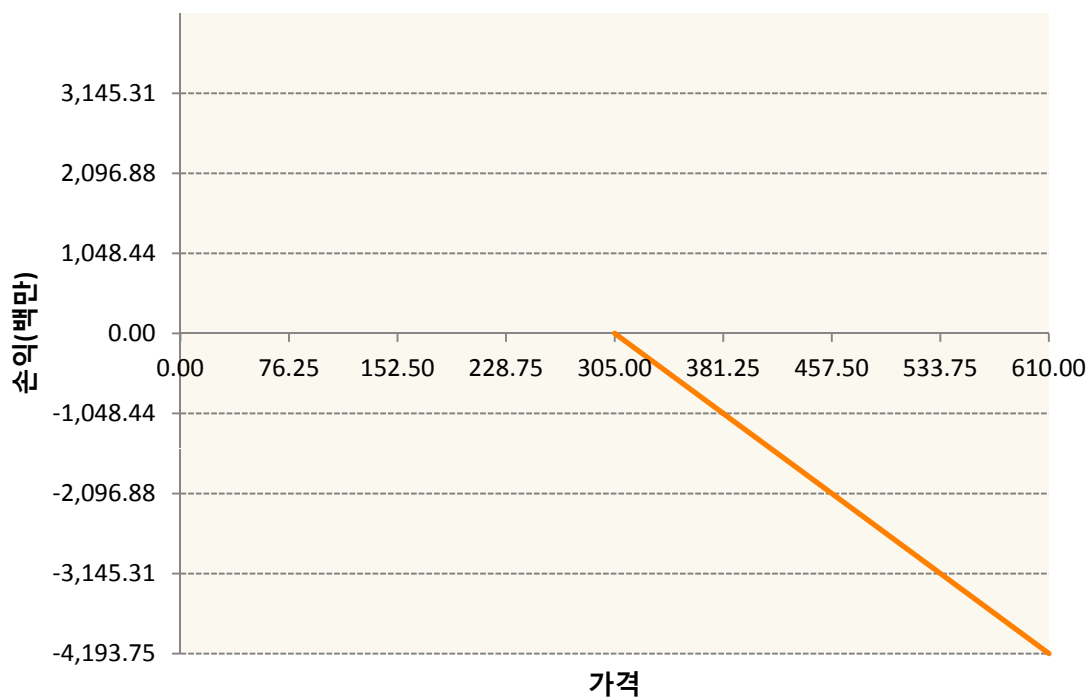


KR4201Q73029-2020-07 콜302.5

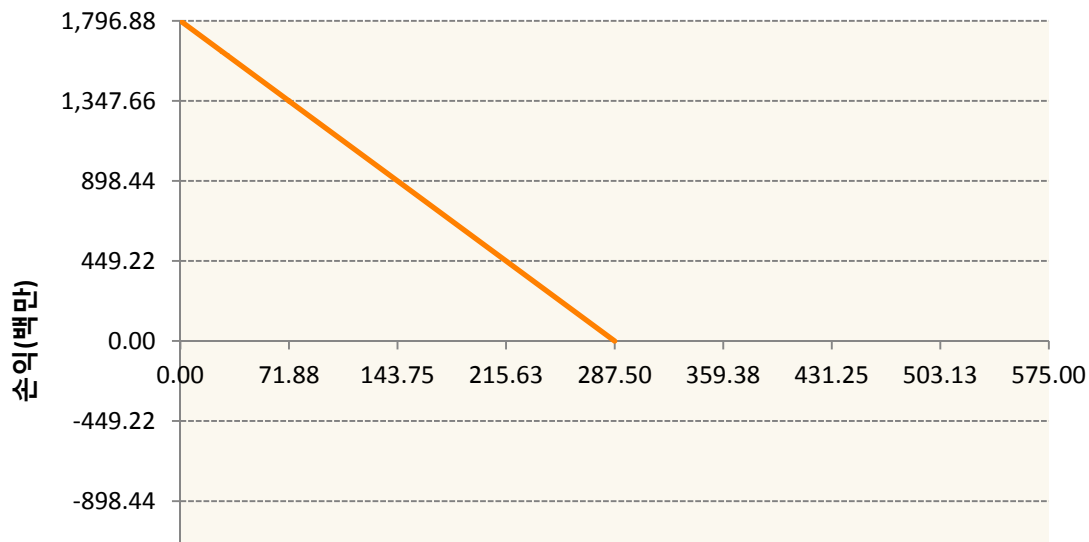


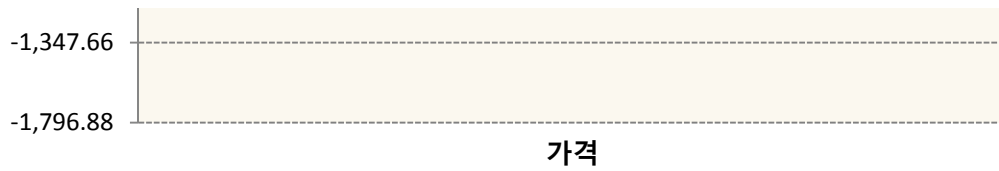
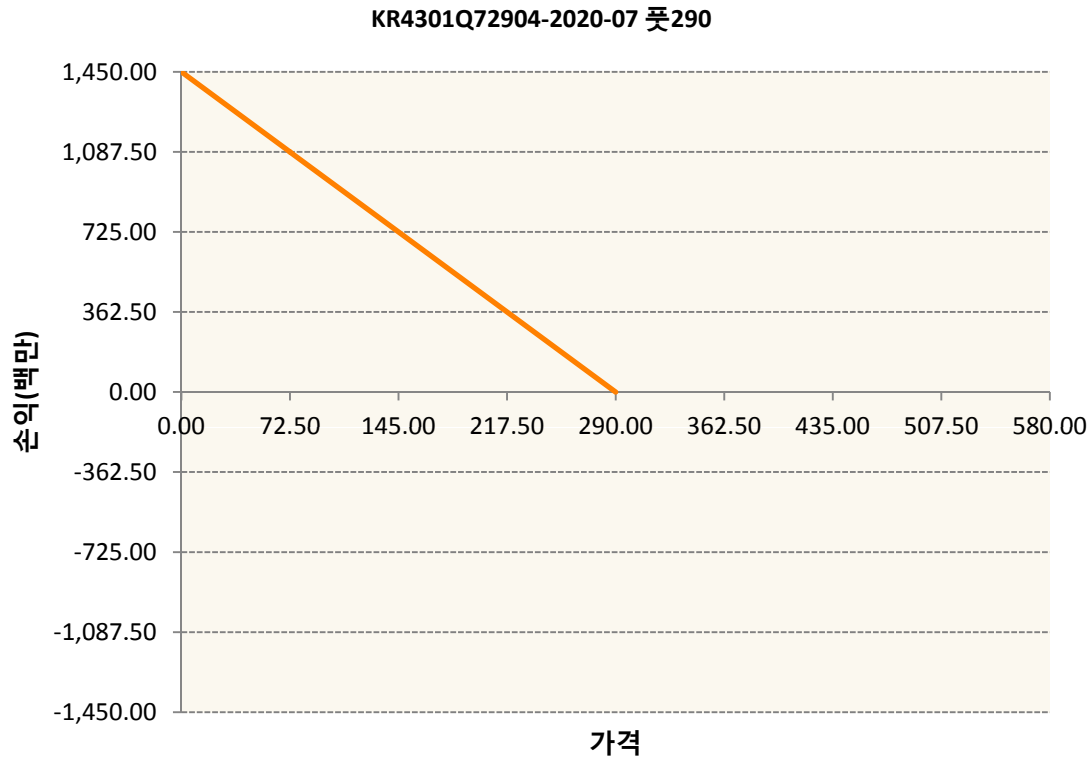


KR4201Q73052-2020-07 콜305



KR4301Q72870-2020-07 풋287.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009		2020-09 코스피200지수선물						795
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-795	-795	-795	-795	-795	-795	-795
-5.33%		-530	-530	-530	-530	-530	-530	-530
-2.67%		-265	-265	-265	-265	-265	-265	-265
0%		0	0	0	0	0	0	0
2.67%		265	265	265	265	265	265	265
5.33%		530	530	530	530	530	530	530
8.00%		795	795	795	795	795	795	795
KR4201Q73029		2020-07 콜302.5						498
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		70	70	69	68	66	63	59
-5.33%		69	68	65	61	56	49	41
-2.67%		64	59	52	42	32	19	5

0%	44	32	17	0	-18	-38	-58
2.67%	-10	-33	-57	-81	-107	-133	-159
5.33%	-125	-155	-185	-215	-245	-275	-305
8.00%	-317	-347	-377	-407	-437	-468	-498
KR4201Q73052 2020-07 콜305							125
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	14	14	13
-5.33%	15	15	14	13	12	11	9
-2.67%	14	13	11	9	7	4	0
0%	10	7	4	0	-4	-9	-15
2.67%	-1	-7	-13	-19	-25	-32	-39
5.33%	-27	-35	-43	-51	-59	-67	-76
8.00%	-73	-82	-91	-99	-108	-117	-125
KR4301Q72870 2020-07 풋287.5							125
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	124	124	124	124	124	124	125
-5.33%	77	77	77	78	78	79	80
-2.67%	31	32	34	35	36	38	40
0%	-7	-4	-2	0	2	4	7
2.67%	-30	-28	-25	-23	-21	-19	-16
5.33%	-39	-38	-36	-35	-34	-32	-30
8.00%	-41	-41	-40	-40	-39	-38	-37
KR4301Q72904 2020-07 풋290							104
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	103	103	103	103	103	104
-5.33%	65	65	66	66	66	67	67
-2.67%	28	29	30	30	31	32	33
0%	-5	-3	-2	0	2	3	5
2.67%	-27	-26	-24	-22	-20	-18	-16
5.33%	-38	-37	-35	-34	-33	-31	-29
8.00%	-41	-40	-40	-39	-38	-38	-37

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

(단위:백만원)

1,874

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,198	-1,198	
누계	유가증권	수익증권	131,804	0	131,804	

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	2020-07-03
기준일	2020-07-02

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	94,734	0	94,734	

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	2020-07-03
기준일	2020-07-02

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	456,866	0	456,866	
누계	통화	선도	0	439,680	-439,680	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020J03: KRW/USD 24-07-20E	2,160
FX21020J04: KRW/USD 24-07-20E	1,728
FX21020J04: KRW/USD 24-07-20E	1,920
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,342
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	960
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,008
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,594
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	3,360
FX21020K05 KRW/USD 03-08-20E	6,816
FX21020M0: KRW/USD 26-08-20E	576
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,704
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	1,997
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,419
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	998
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	2,592

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

IE00BHNZKL13

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

18,146

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

2. 만기시점의 손익구조

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (Dividend) (순이익(배당)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 2,614.00. The y-axis represents Net Income (Dividend), ranging from -1,829.80 to 1,372.35. A solid orange line shows the trend, starting at a price of 0.00 with a net income of -1,829.80 and increasing linearly to a price of 2,614.00 with a net income of 1,372.35.

(단위:백만원)

KR4108Q90004							2020-09 KRX300 선물		147
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147	
-5.33%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	49	49	49	49	49	49	49	49	
5.33%	98	98	98	98	98	98	98	98	
8.00%	147	147	147	147	147	147	147	147	

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

(단위:백만원)

234

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

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	7,531	0	7,531	
누계	통화	선도	0	8,052	-8,052	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	36
FX21020N00 KRW/USD 06-08-20E	48

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

332

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

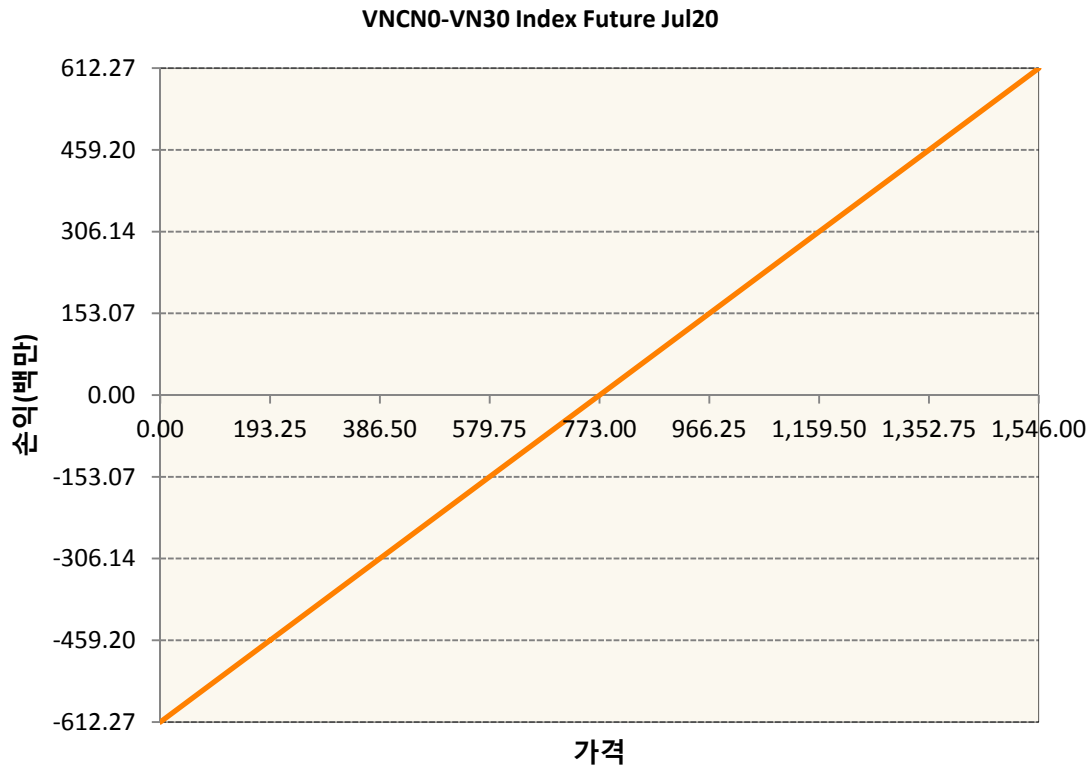
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	612	0	612	
누계	유가증권	스왑	980	0	980	장외
누계	통화	선도	95	676	-581	장외

2. 만기시점의 손익구조



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
FX21020N00 EUR/KRW 28-08-20E
VNCN0 VN30 Index Future Jul20

5
9
22
8
49

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

(단위:백만원)

157

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

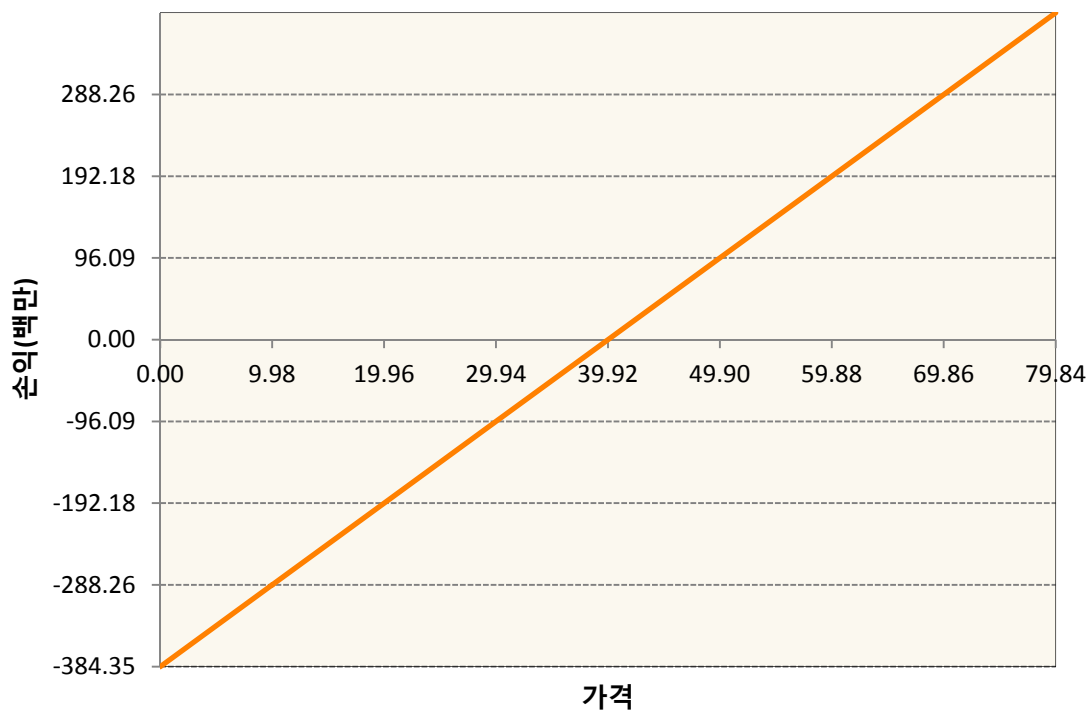
1. 계약금액

(단위:백만원)

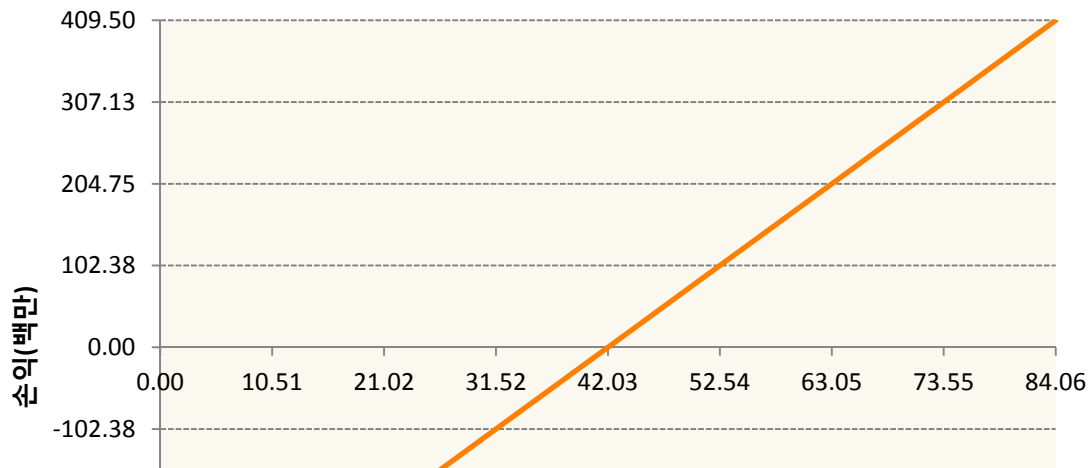
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,851	360	1,491	

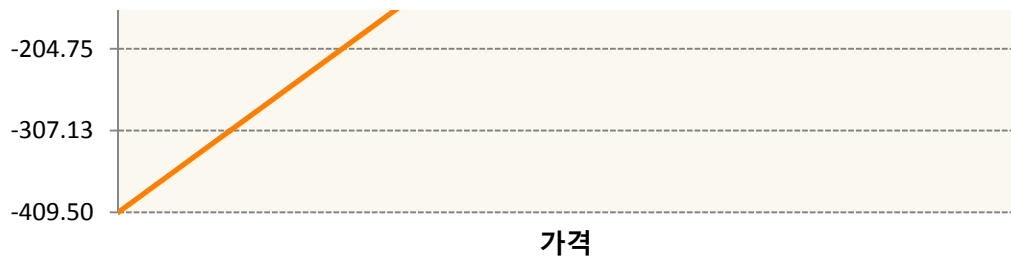
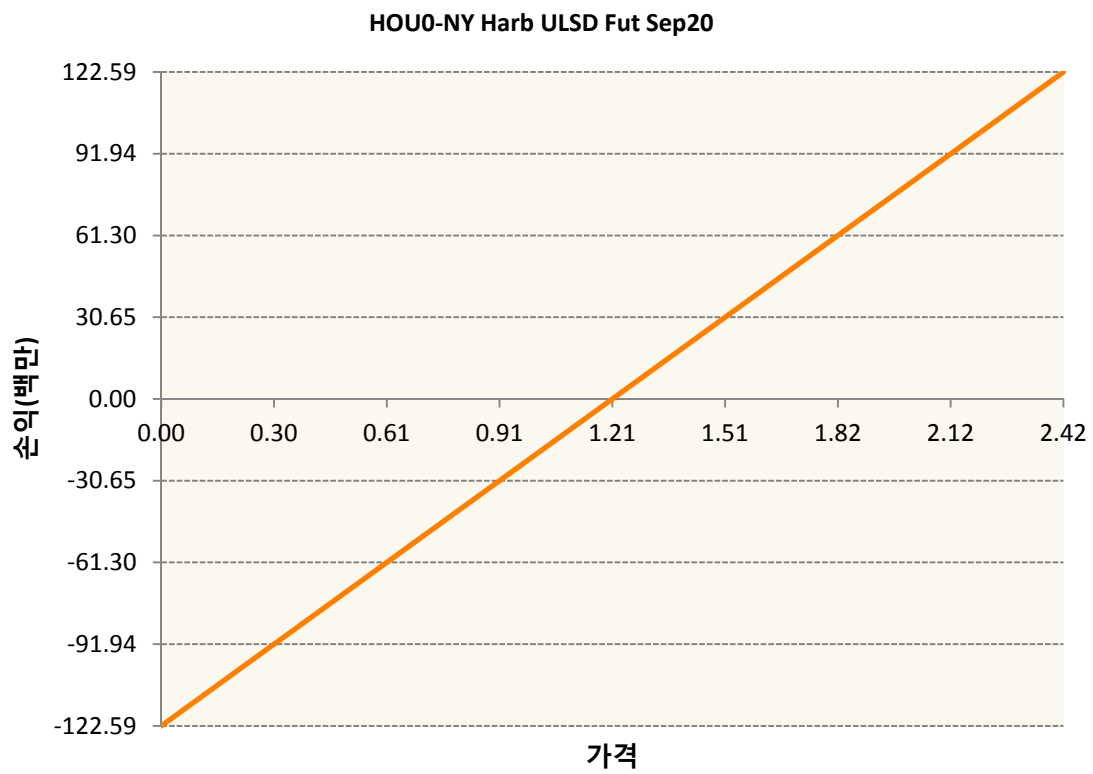
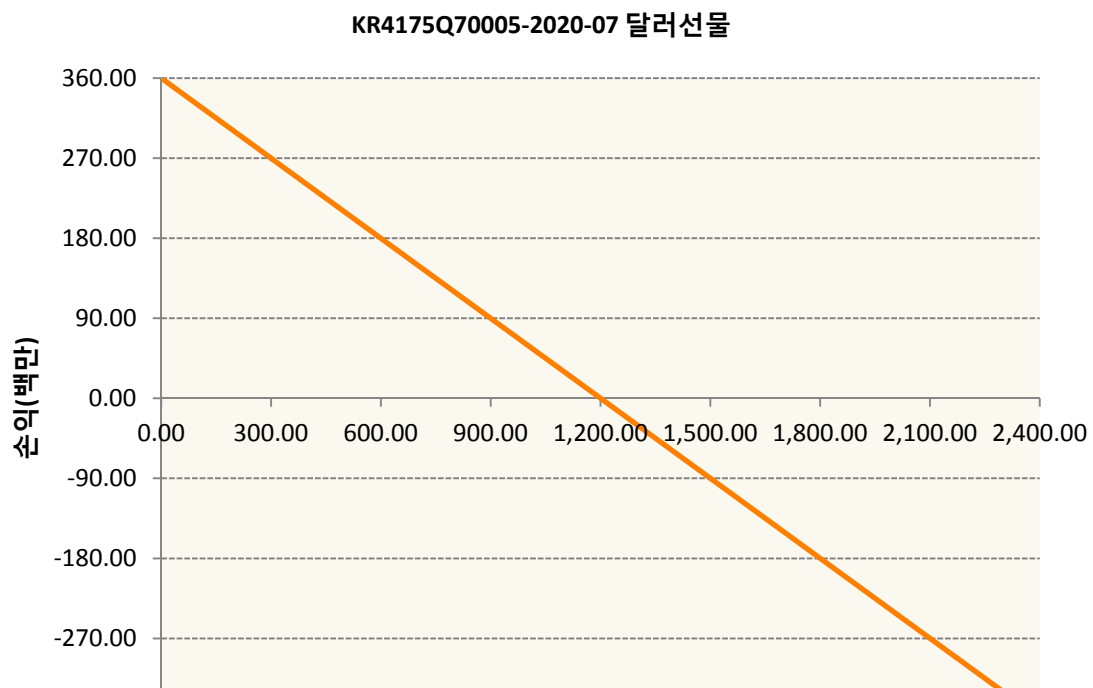
2. 만기시점의 손익구조

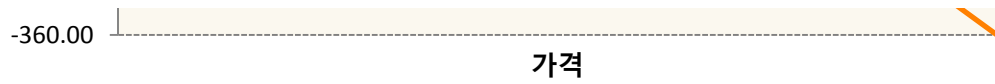
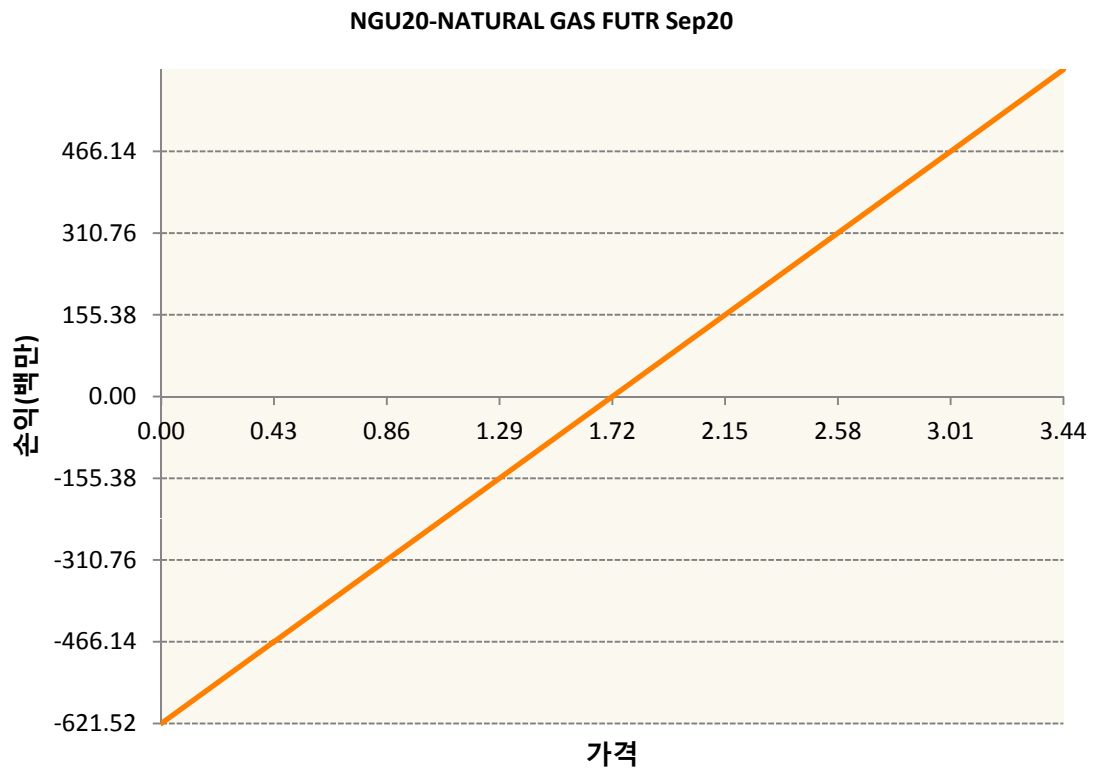
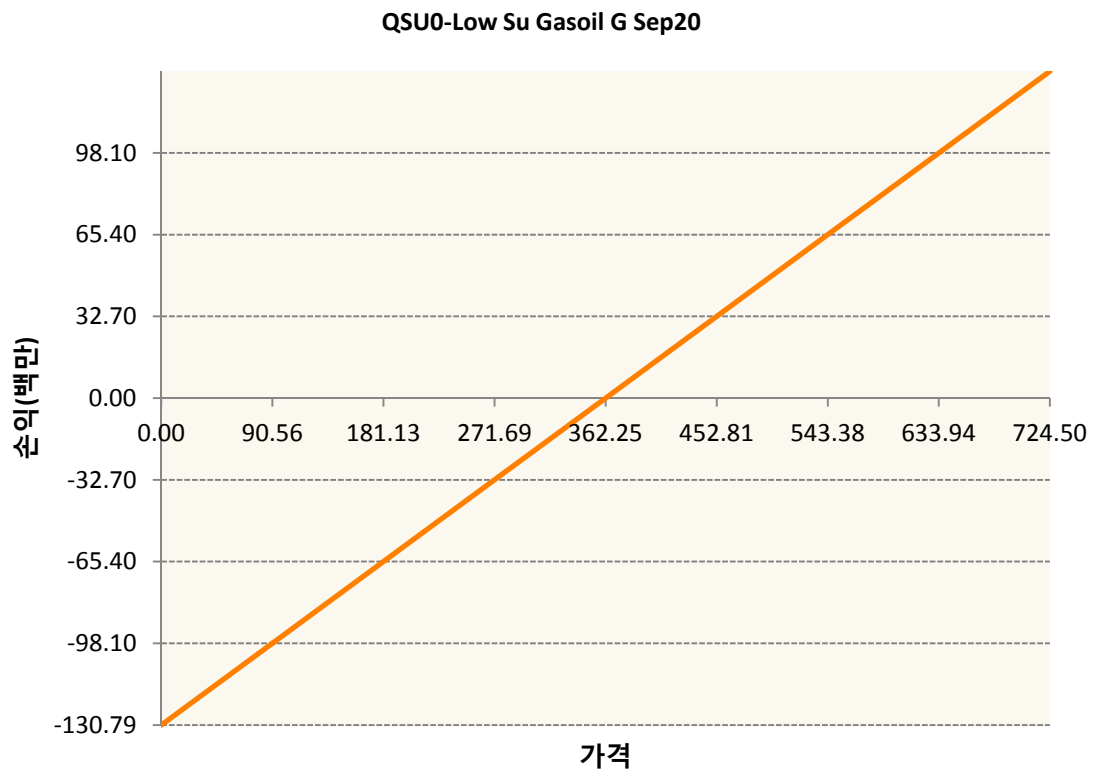
CLU0-WTI CRUDE FUTURE Sep20

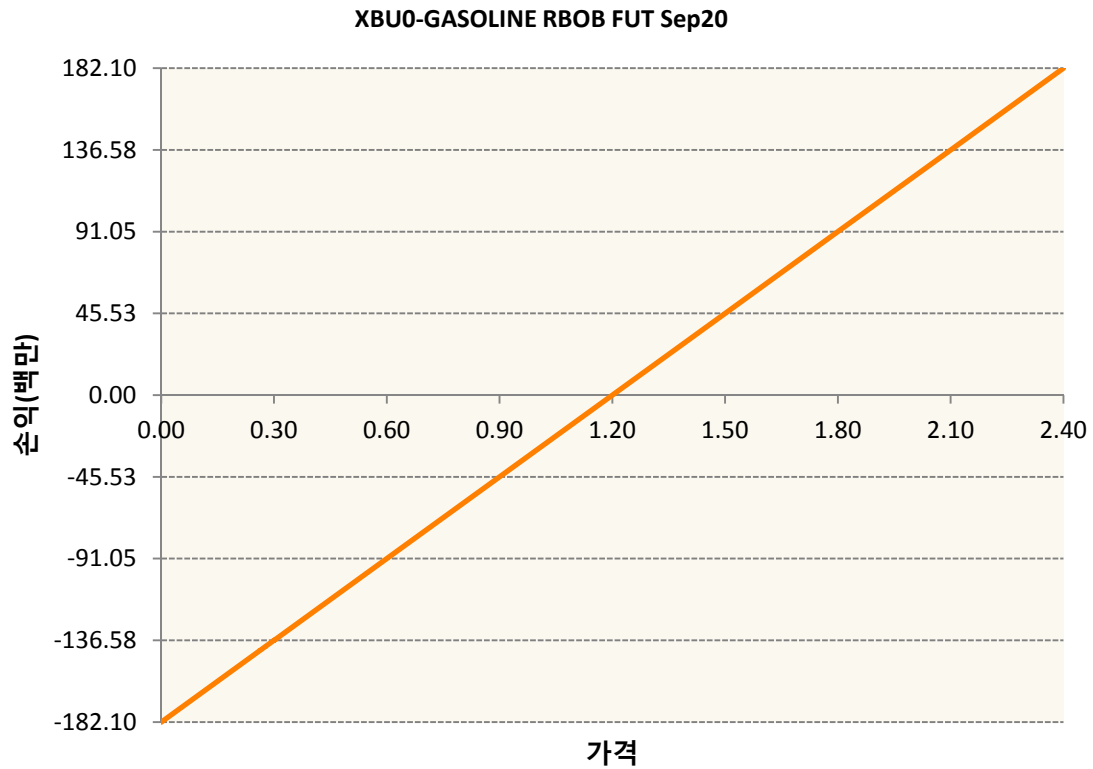


COU0-BRENT CRUDE FUTR Sep20









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	50
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20	10
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20	15

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

912

공시일	2020-07-03
기준일	2020-07-02

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

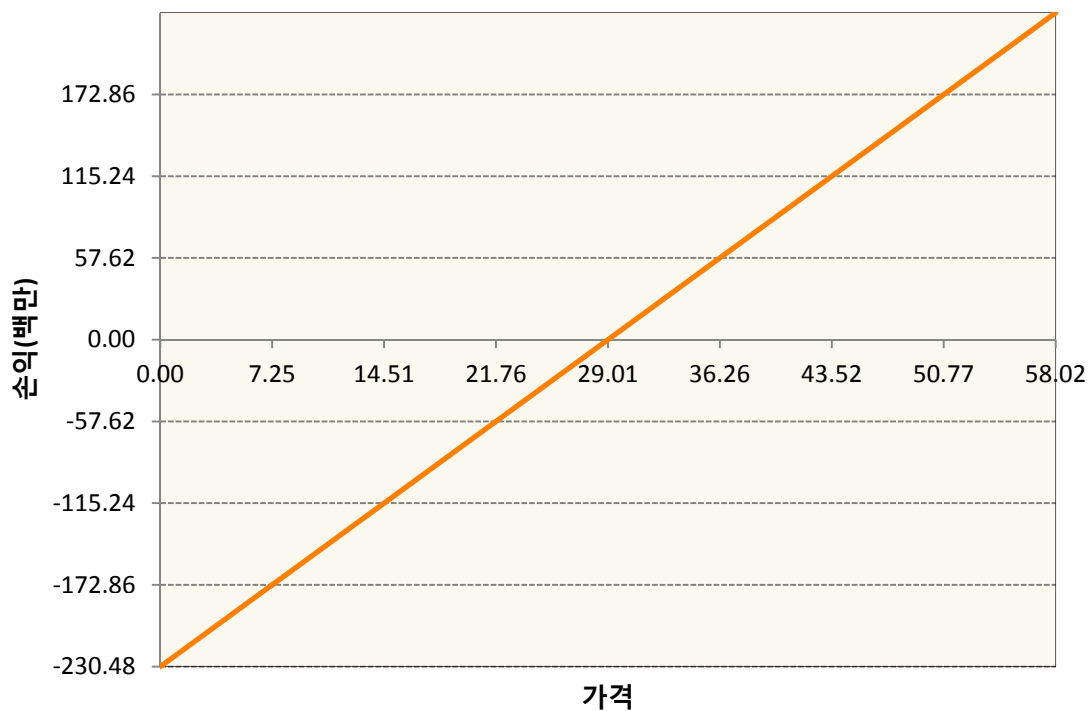
1. 계약금액

(단위:백만원)

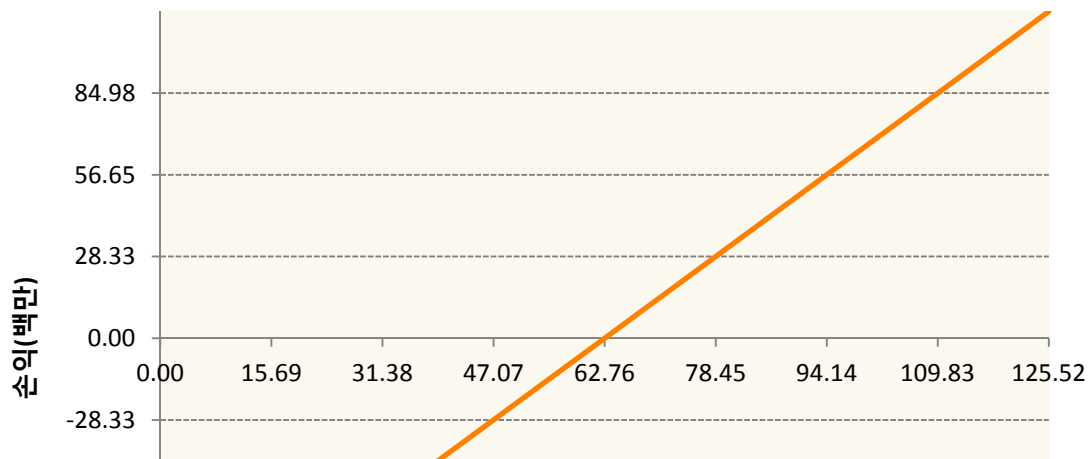
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,642	72	2,570	

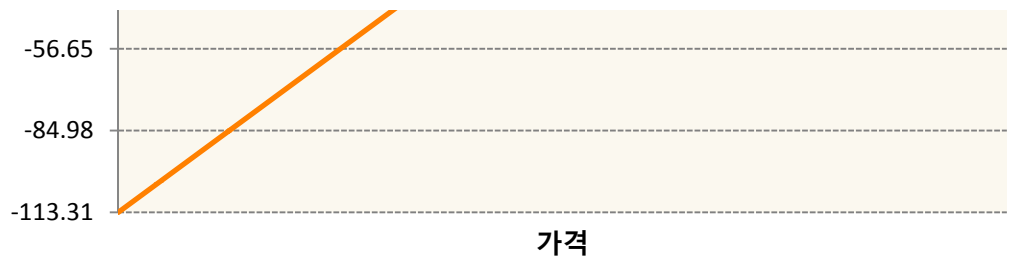
2. 만기시점의 손익구조

BOZ0-SOYBEAN OIL FUTR Dec20

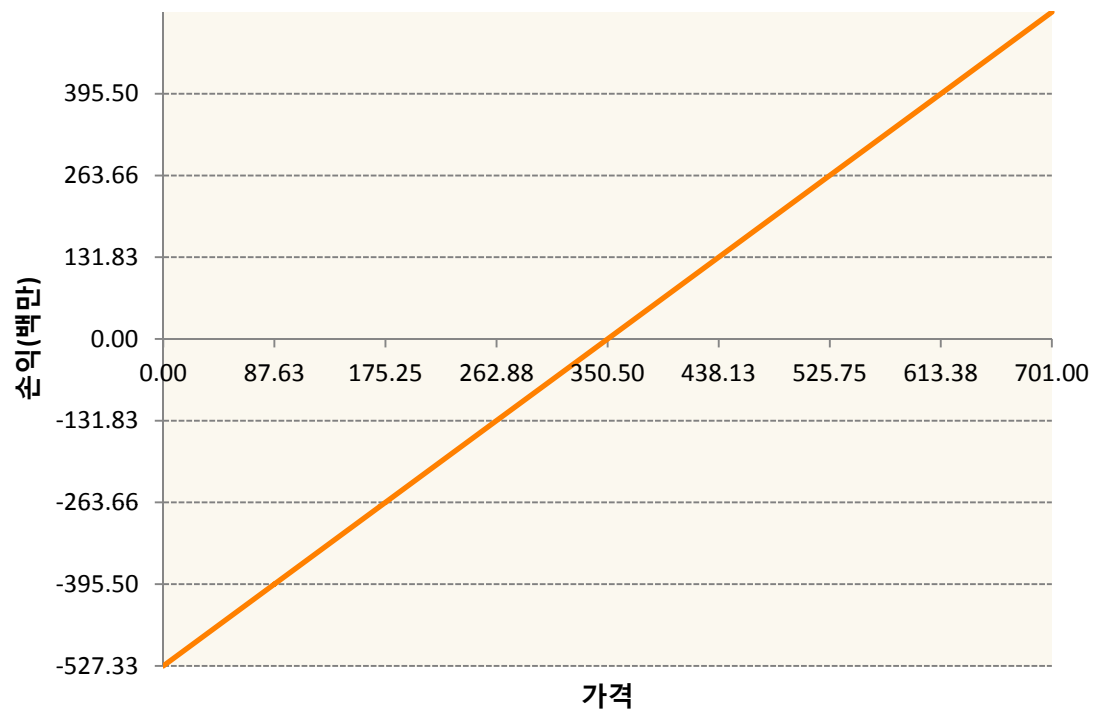


CTZ0-COTTON NO.2 FUTR Dec20

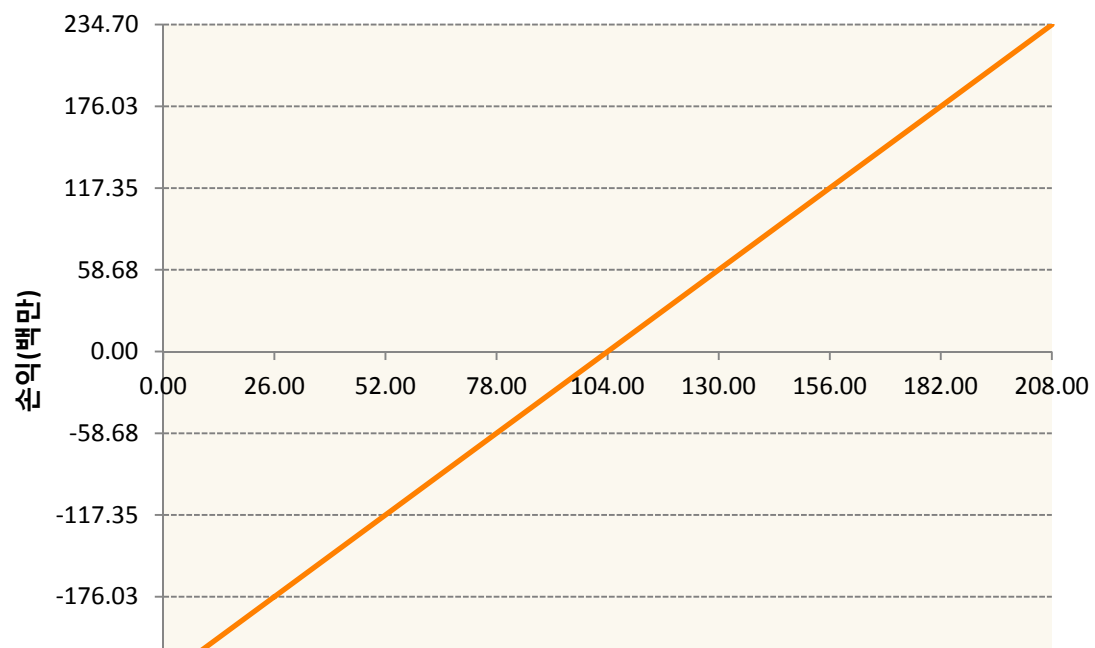


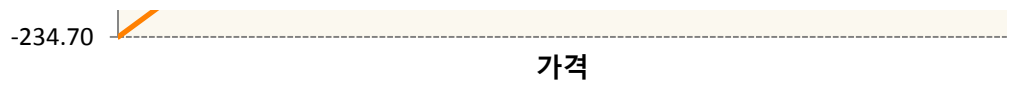


CU0-CORN FUTURE Sep20

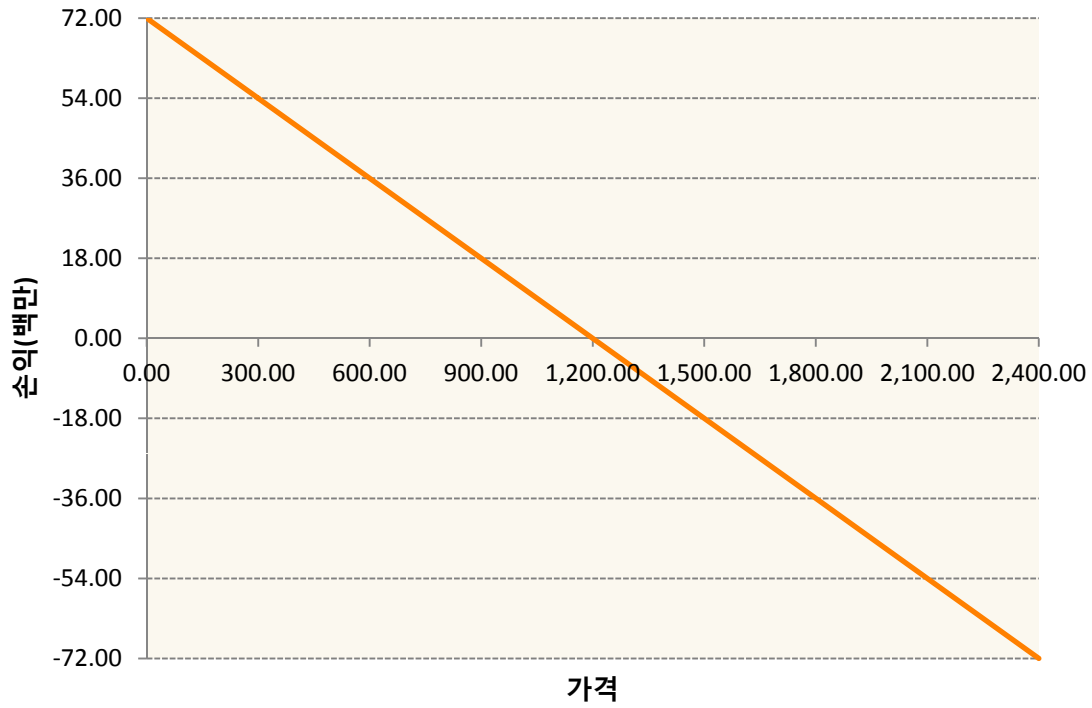


KCU0-COFFEE 'C' FUTURE Sep20

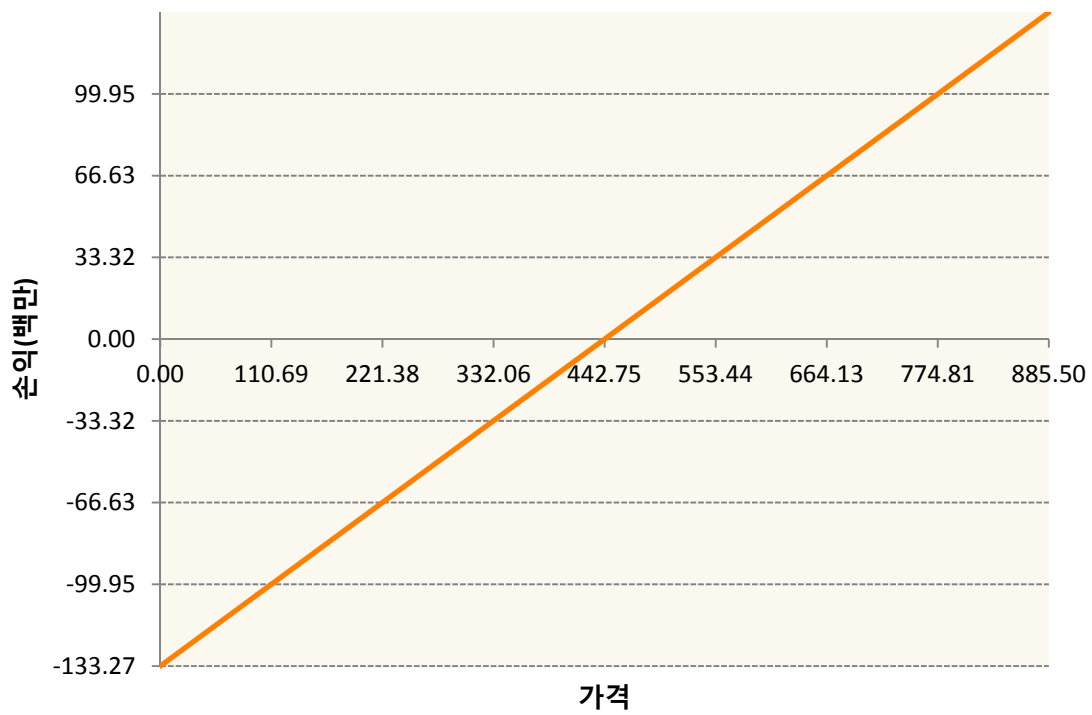




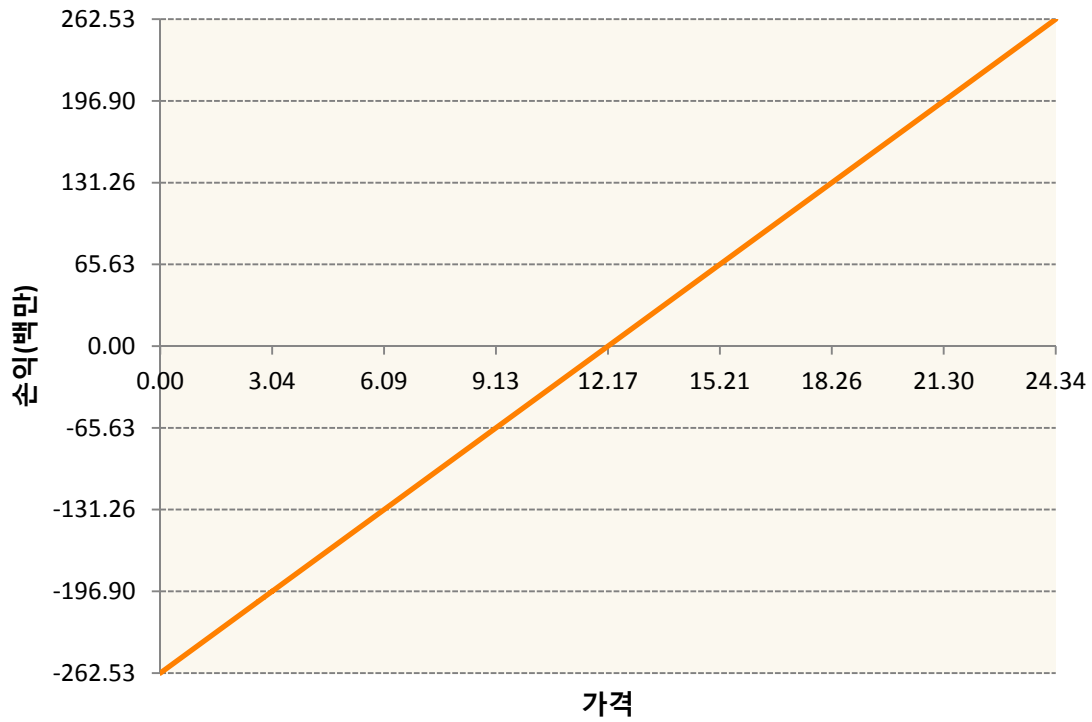
KR4175Q70005-2020-07 달러선물



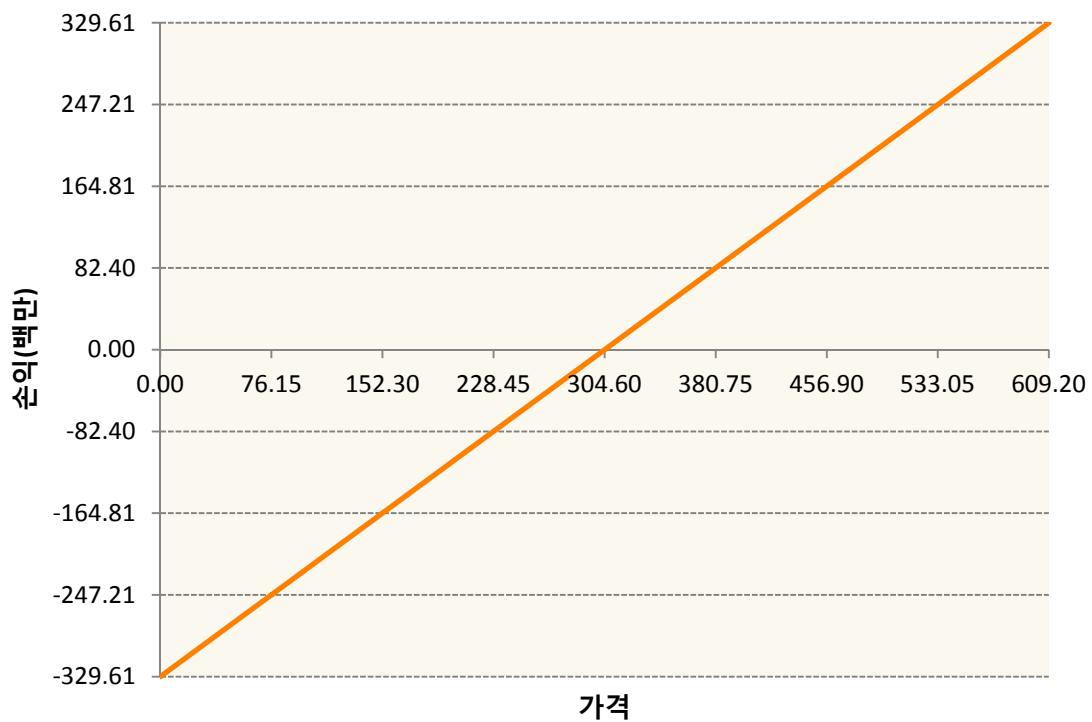
KWU0-KC HRW WHEAT FUT Sep20



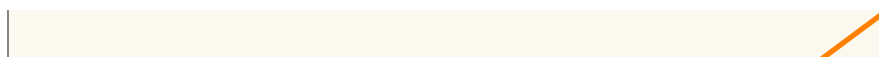
SBV0-Sugar Oct20

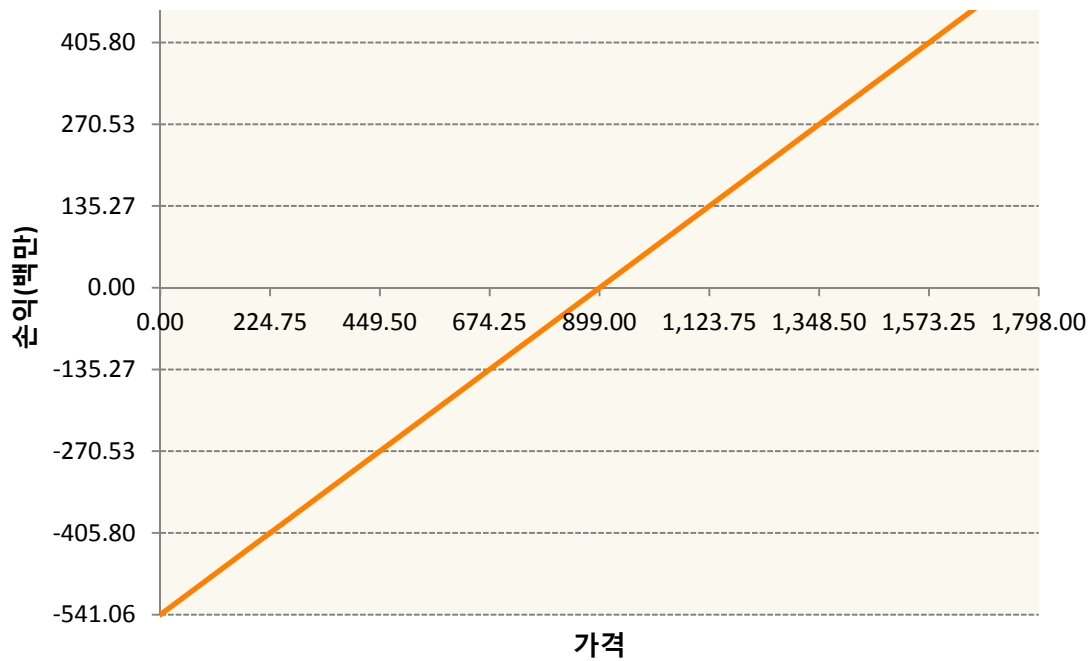
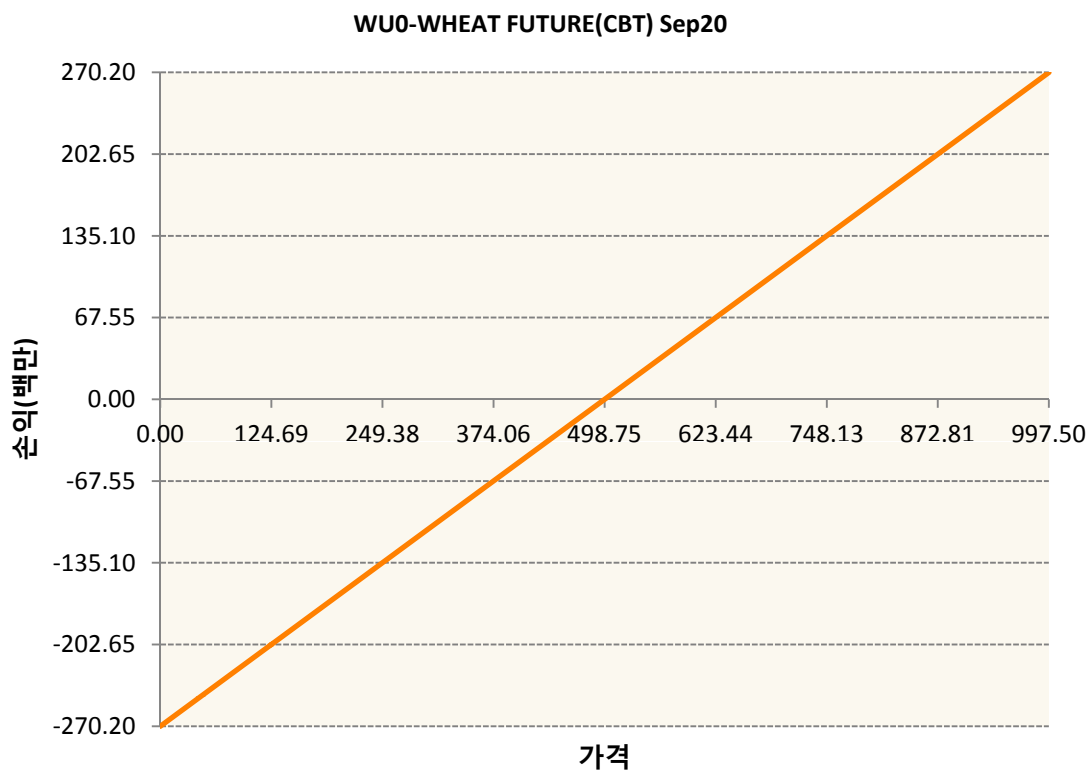


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20



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	42
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	19
KR4175Q70C 2020-07 달러선물		6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	11
SBV0	Sugar Oct20	21
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	26
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	43
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	22

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

(단위:백만원)

249