공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

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	2020-08-18
기준일	2020-08-14

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	1,149

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,388

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

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	710

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,098

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

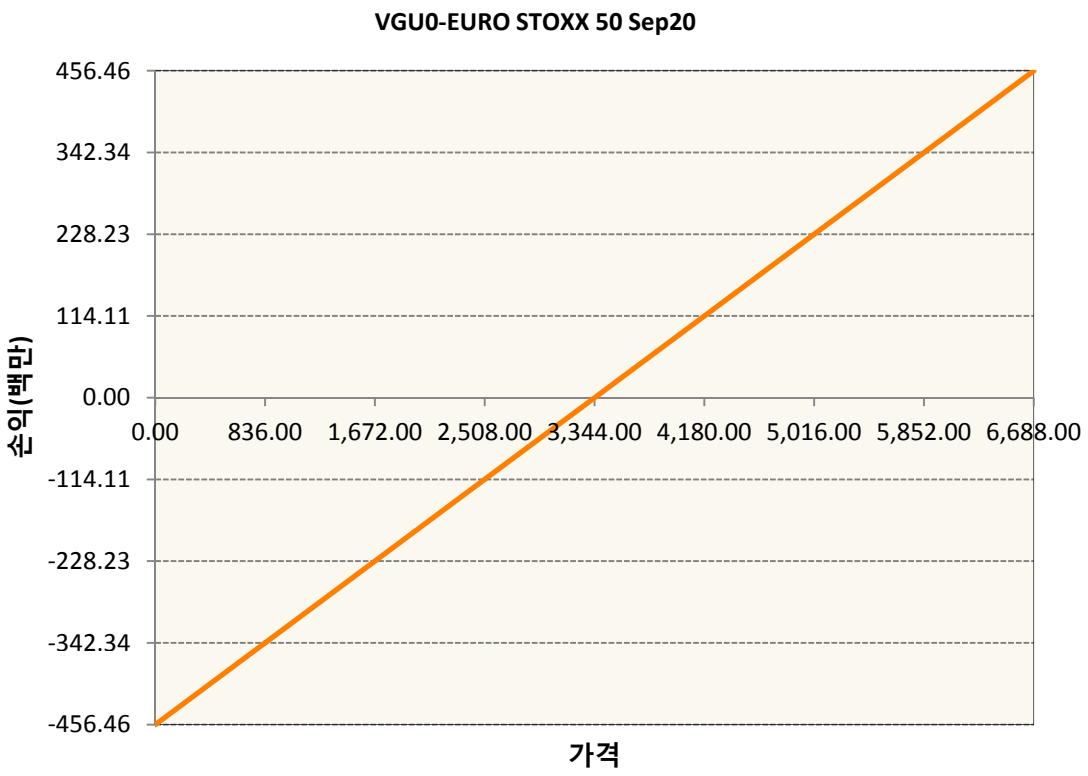
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	456	0	456	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU0	EURO STOXX 50 Sep20	37

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

(단위:백만원)

50

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

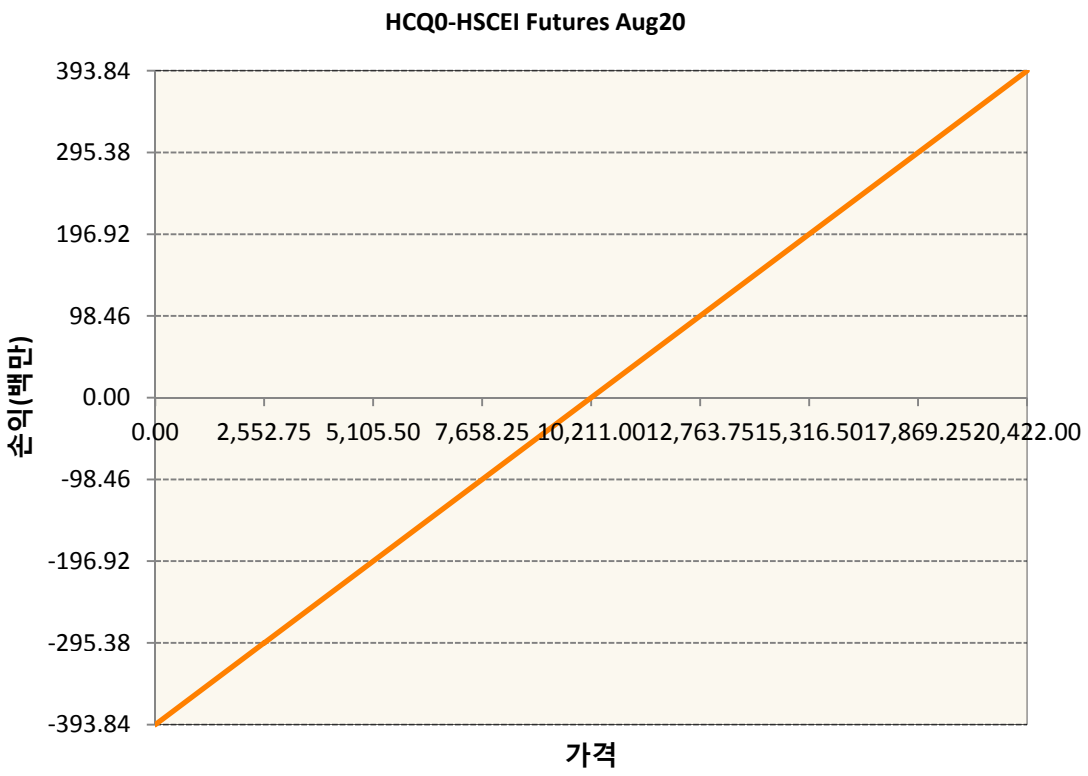
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	394	0	394	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ0	HSCEI Futures Aug20	32

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

(단위:백만원)

35

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

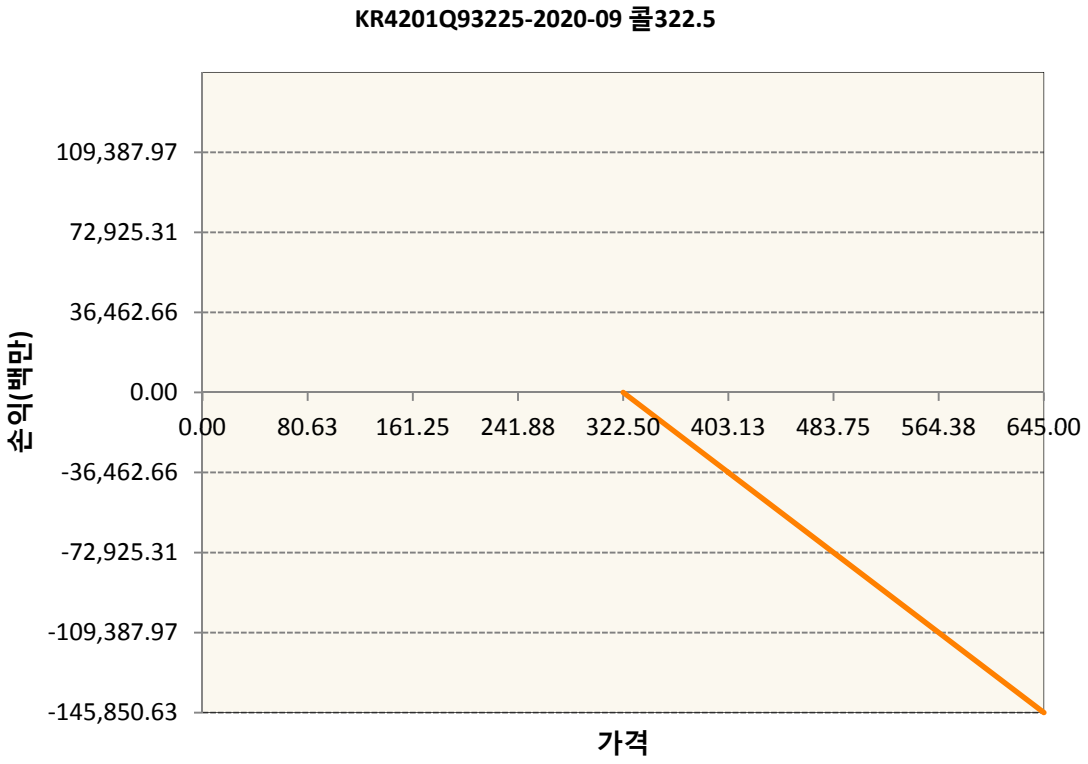
커버드콜모(주식혼합-파생형)

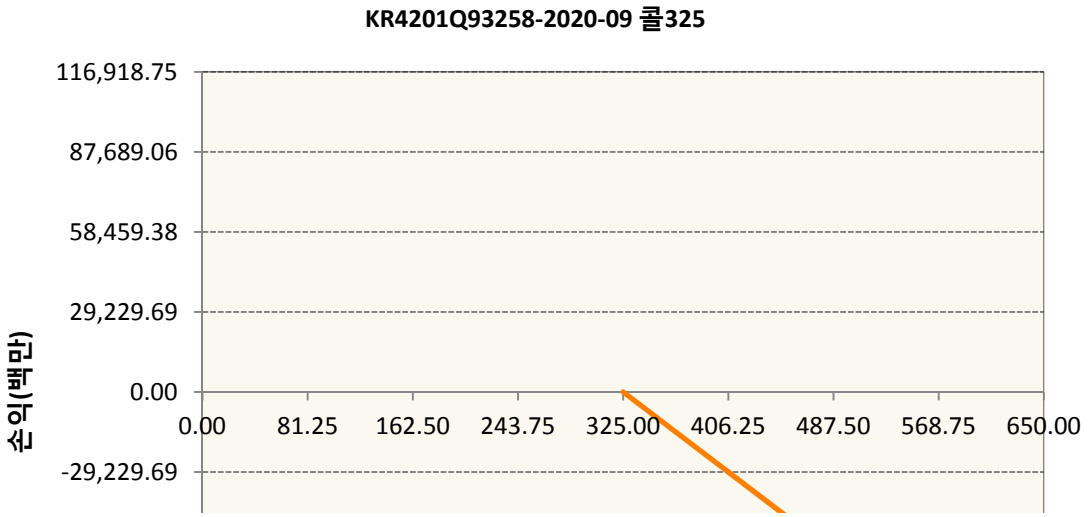
1. 계약금액

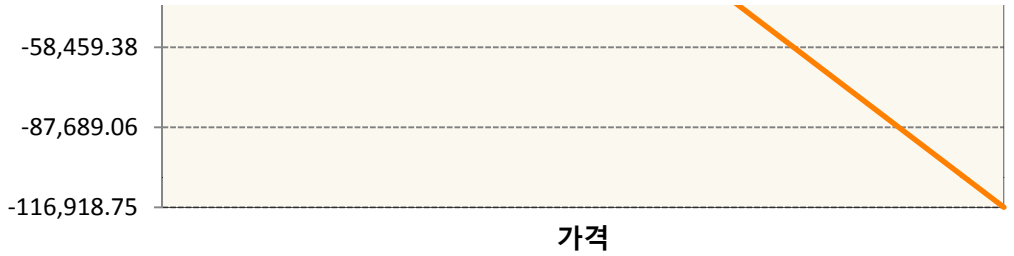
(단위:백만원)

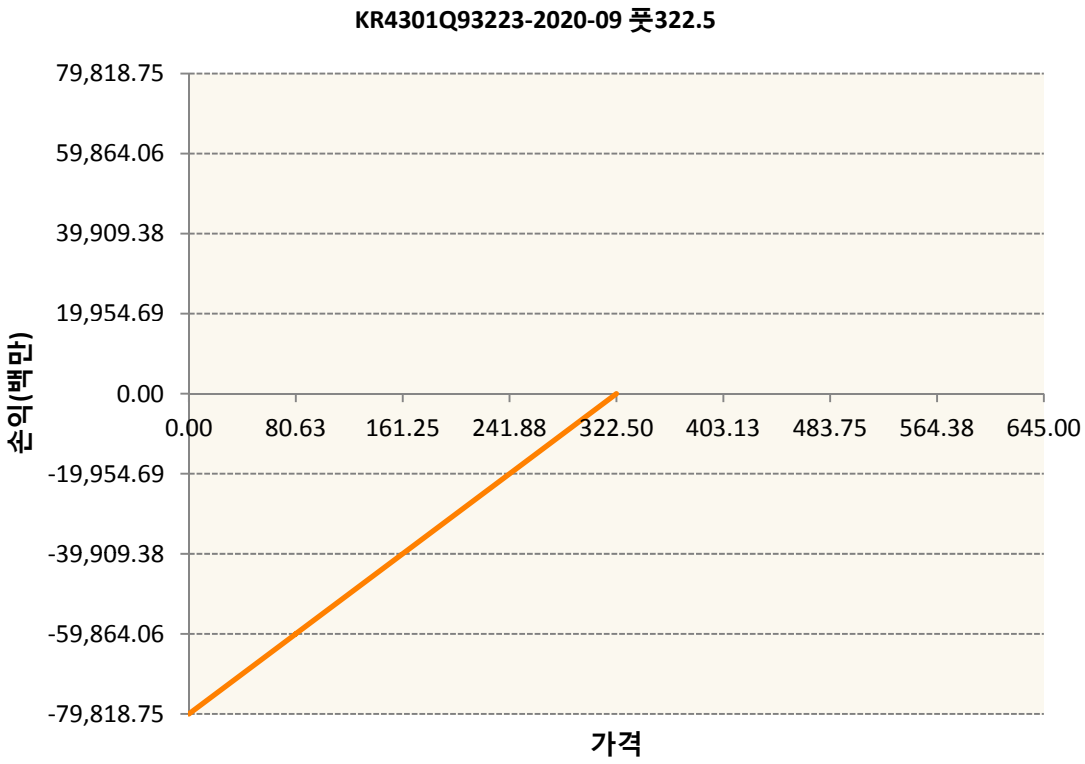
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	8,636	224,791	-216,155	장내
누계	유가증권	옵션	0	342,588	-342,588	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4201Q93225		2020-09 콜322.5				8,671
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,231	4,891	4,518	4,121	3,702	3,266	2,815
-5.33%	4,458	4,014	3,550	3,070	2,579	2,078	1,569
-2.67%	3,310	2,781	2,245	1,703	1,157	607	55
0%	1,731	1,154	577	0	-578	-1,155	-1,733
2.67%	-296	-876	-1,458	-2,041	-2,624	-3,208	-3,792
5.33%	-2,750	-3,294	-3,846	-4,405	-4,970	-5,538	-6,110
8.00%	-5,583	-6,058	-6,554	-7,067	-7,592	-8,127	-8,671
	KR4201Q93258		2020-09 콜325				6,713
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,893	3,643	3,366	3,065	2,747	2,413	2,066

-5.33%	3,349	3,014	2,661	2,294	1,914	1,526	1,130
-2.67%	2,523	2,116	1,700	1,278	851	419	-15
0%	1,368	913	457	0	-458	-916	-1,375
2.67%	-141	-609	-1,077	-1,546	-2,014	-2,482	-2,951
5.33%	-1,994	-2,442	-2,895	-3,351	-3,810	-4,271	-4,734
8.00%	-4,160	-4,560	-4,974	-5,398	-5,831	-6,269	-6,713
KR4301Q93223			2020-09 풋322.5				5,107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,849	-4,869	-4,899	-4,938	-4,986	-5,042	-5,107
-5.33%	-2,832	-2,890	-2,959	-3,039	-3,126	-3,221	-3,323
-2.67%	-1,005	-1,118	-1,237	-1,362	-1,491	-1,623	-1,759
0%	463	309	155	0	-155	-311	-467
2.67%	1,458	1,306	1,153	998	843	687	531
5.33%	2,008	1,896	1,777	1,651	1,520	1,386	1,248
8.00%	2,252	2,189	2,115	2,030	1,936	1,835	1,726

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

17,773

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

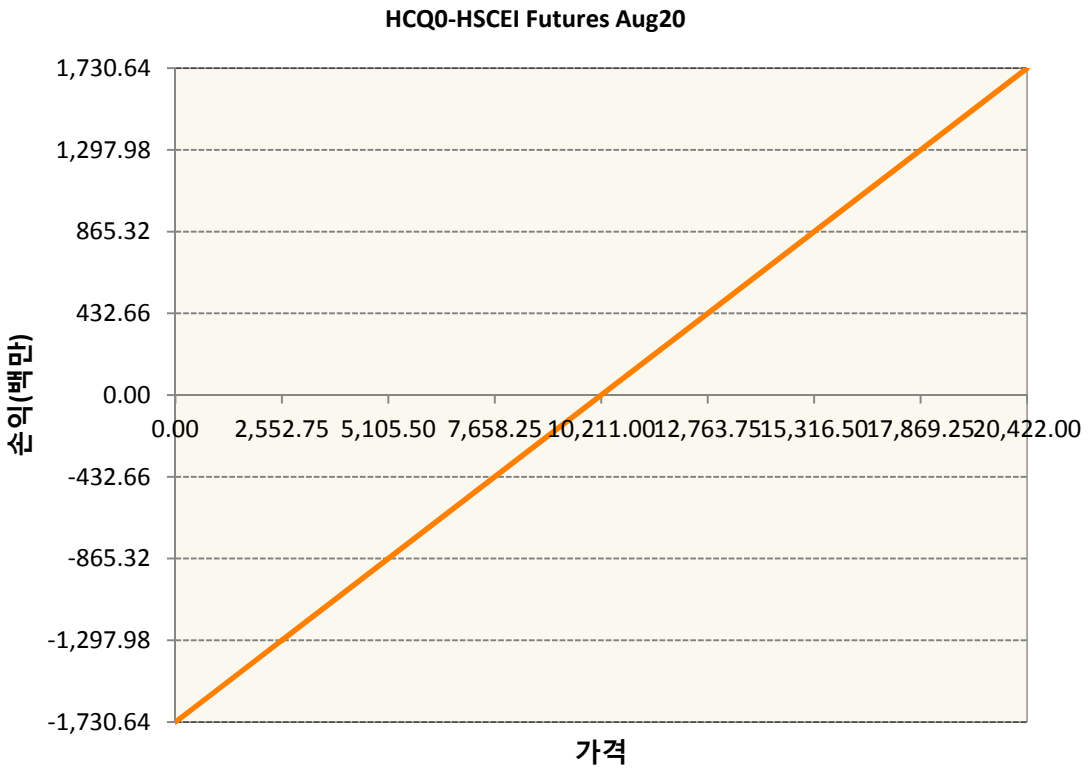
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

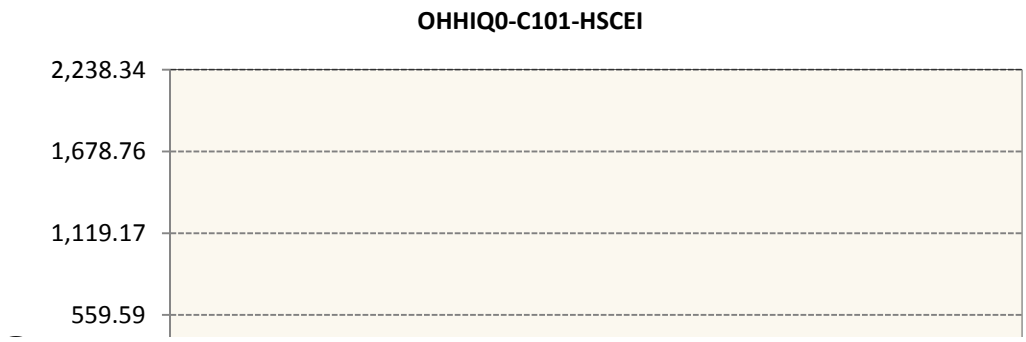
1. 계약금액

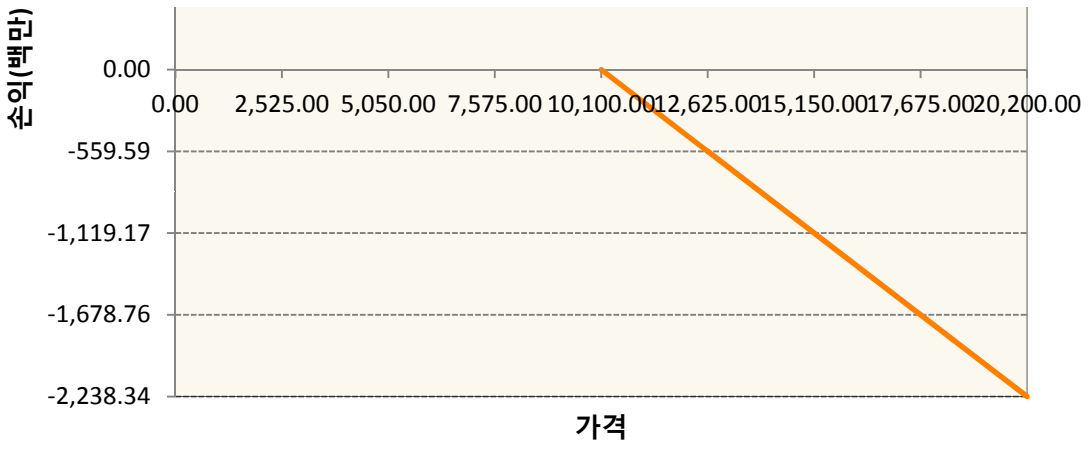
(단위:백만원)

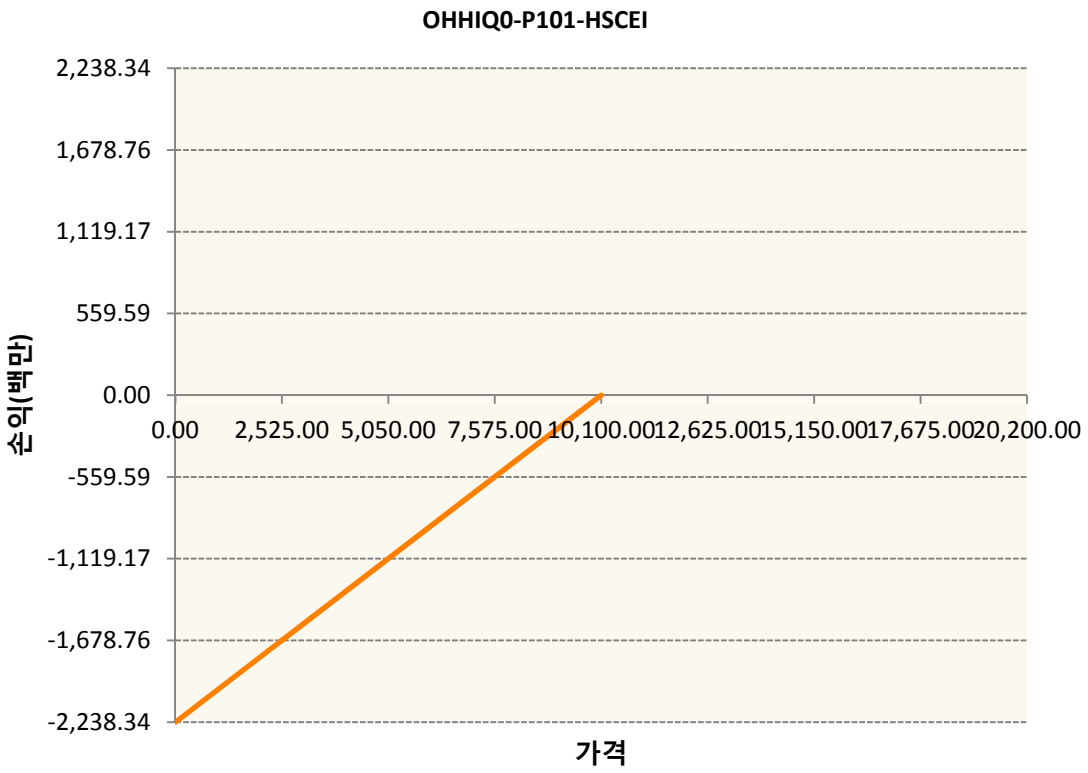
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,731	0	1,731	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,477	-4,477	장내
누계	통화	선도	0	1,479	-1,479	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FX21020K02 KRW/HKD 21-08-20E	118
HCQ0 HSCEI Futures Aug20	138
OHHIQ0-C1(HSCEI	179
OHHIQ0-P1(HSCEI	179

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	615

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

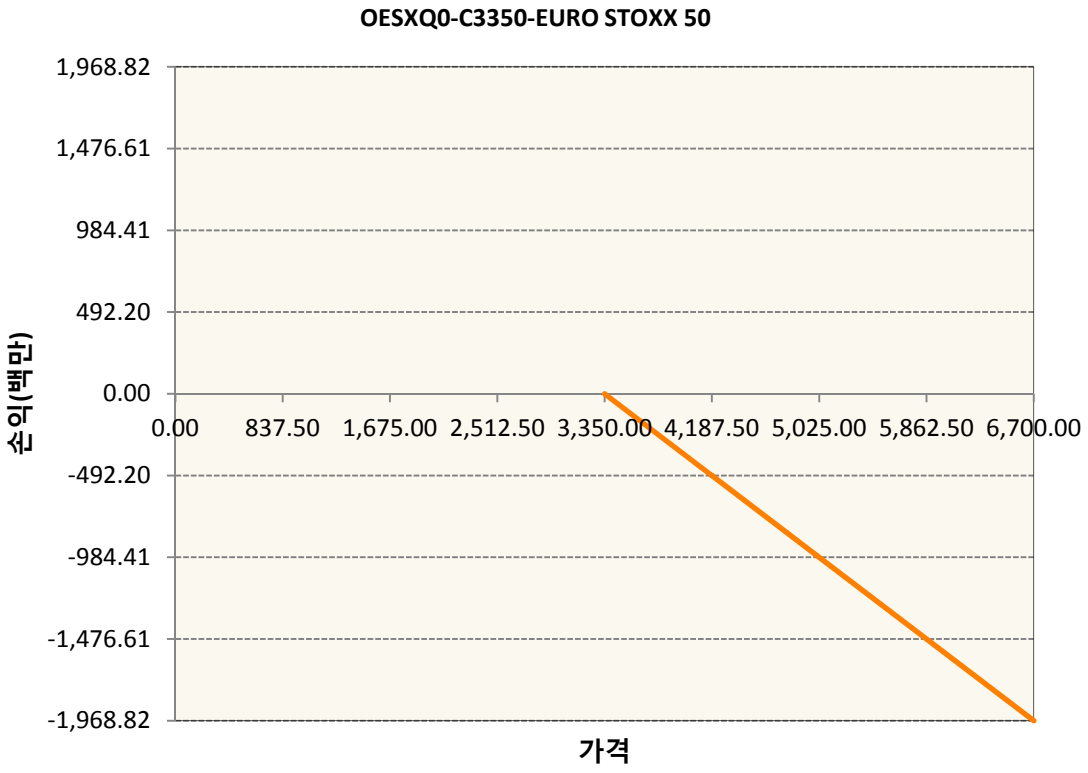
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

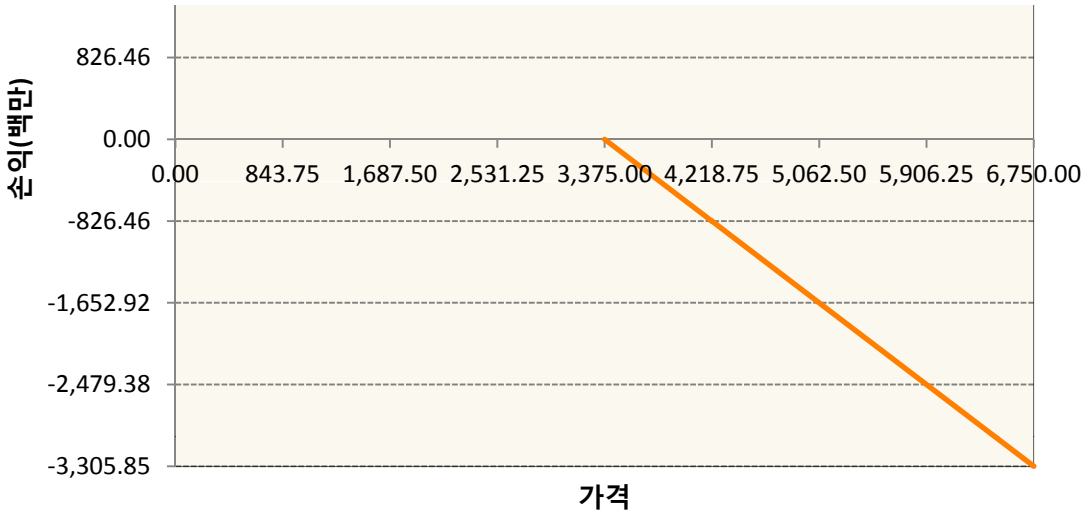
1. 계약금액

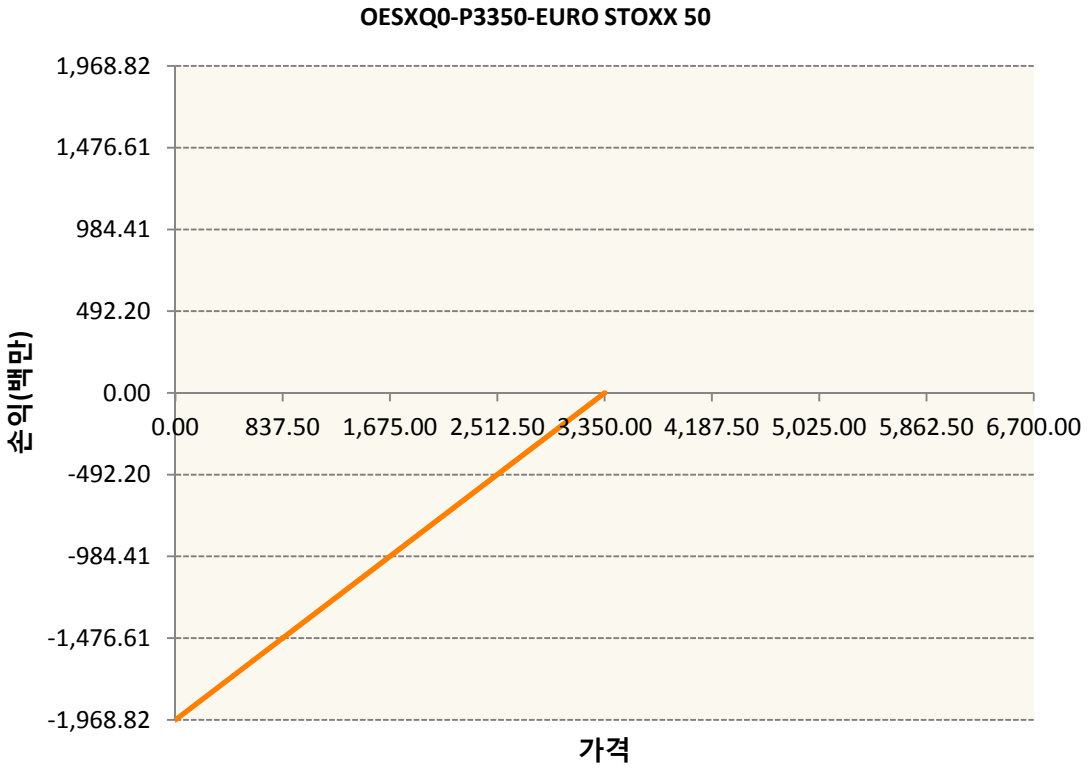
(단위:백만원)

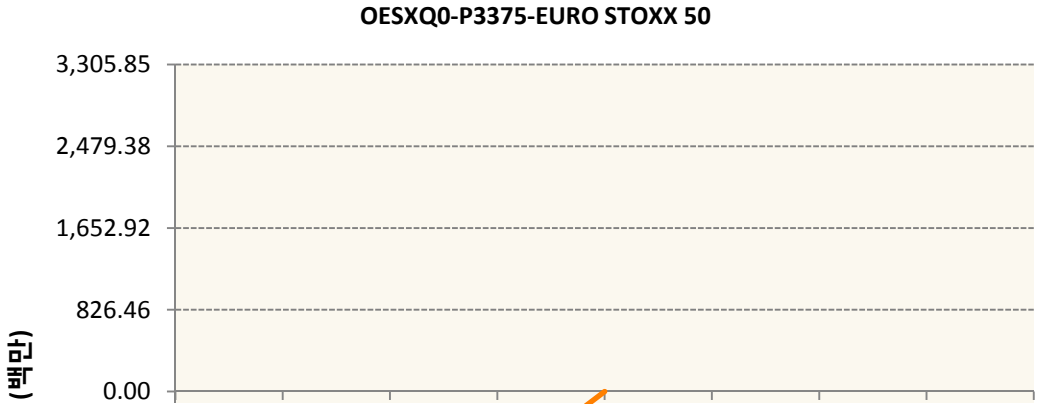
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,139	0	1,139	
누계	유가증권	스왑	8,917	0	8,917	장외
누계	유가증권	옵션	0	10,549	-10,549	장내
누계	통화	선도	0	5,267	-5,267	장외

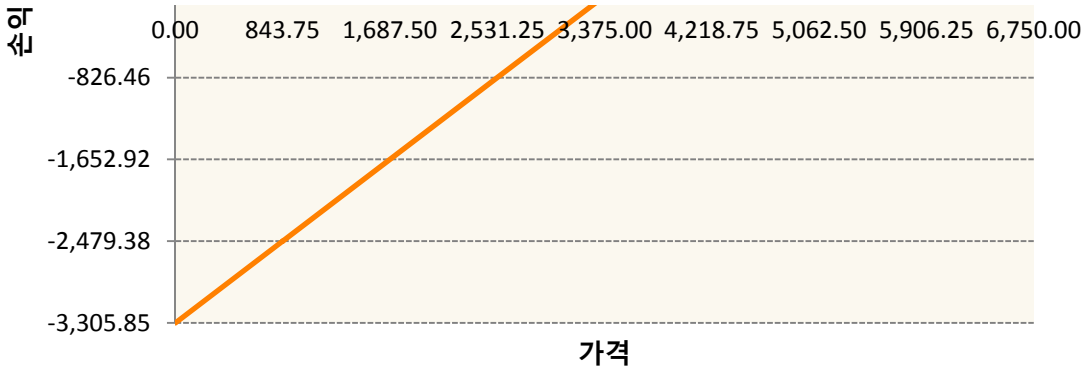
2. 만기시점의 손익구조

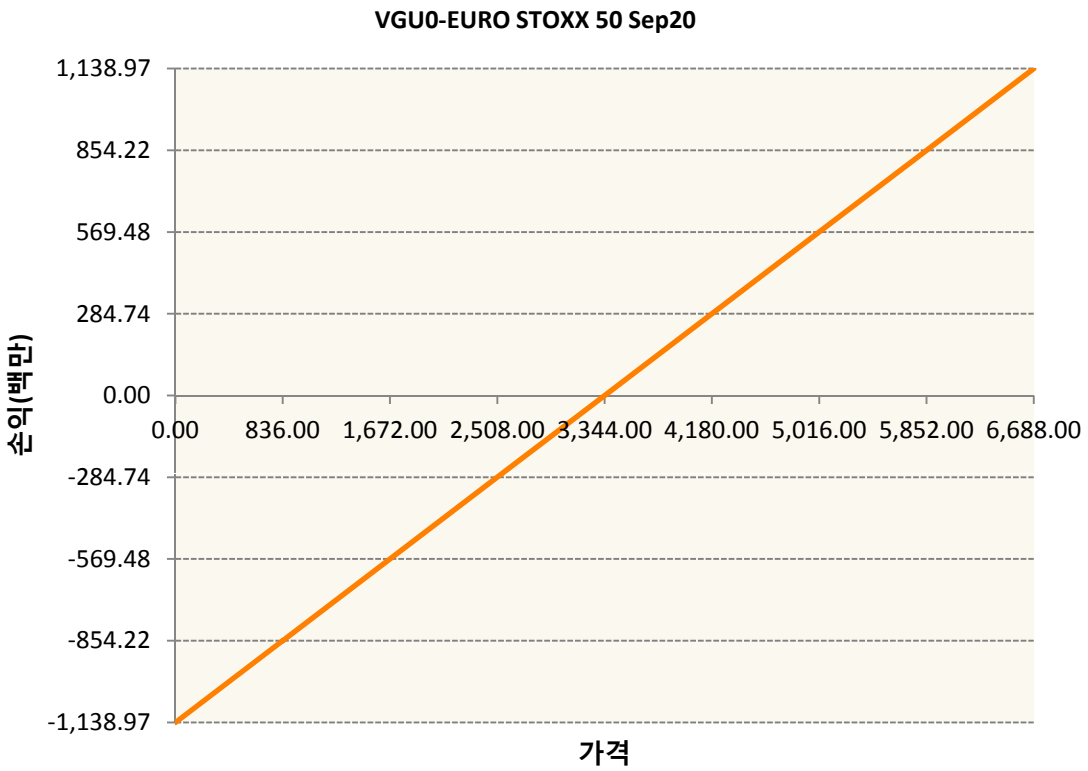



826.46
0.00
-826.46
-1,652.92
-2,479.38
-3,305.85
0.00
843.75
1,687.50
2,531.25
3,375.00
4,218.75
5,062.50
5,906.25
6,750.00
손익(백만)
가격


OESXQ0-P3350-EURO STOXX 50
1,968.82
1,476.61
984.41
492.20
0.00
-492.20
-984.41
-1,476.61
-1,968.82
0.00
837.50
1,675.00
2,512.50
3,350.00
4,187.50
5,025.00
5,862.50
6,700.00
손익(백만)
가격


OESXQ0-P3375-EURO STOXX 50
3,305.85
2,479.38
1,652.92
826.46
0.00
(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	10
FX21020M06 KRW/EUR 25-09-20E	242
FX21020N01 KRW/EUR 25-09-20E	45
FX21020N03 KRW/EUR 25-09-20E	134
OESXQ0-C3: EURO STOXX 50	158
OESXQ0-C3: EURO STOXX 50	264
OESXQ0-P3: EURO STOXX 50	158
OESXQ0-P3: EURO STOXX 50	264
VGU0 EURO STOXX 50 Sep20	91

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,539

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

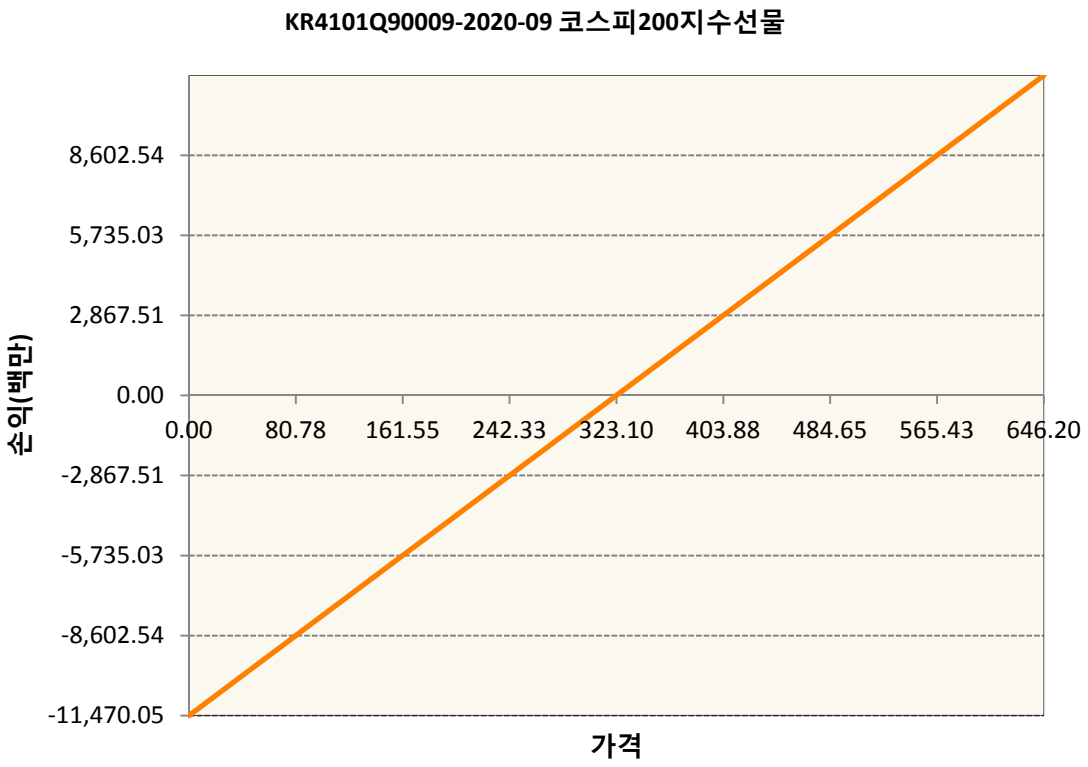
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	11,470	0	11,470	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						907
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-907	-907	-907	-907	-907	-907	-907
-5.33%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604
-2.67%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	302	302	302	302	302	302	302
5.33%	604	604	604	604	604	604	604
8.00%	907	907	907	907	907	907	907

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,441

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

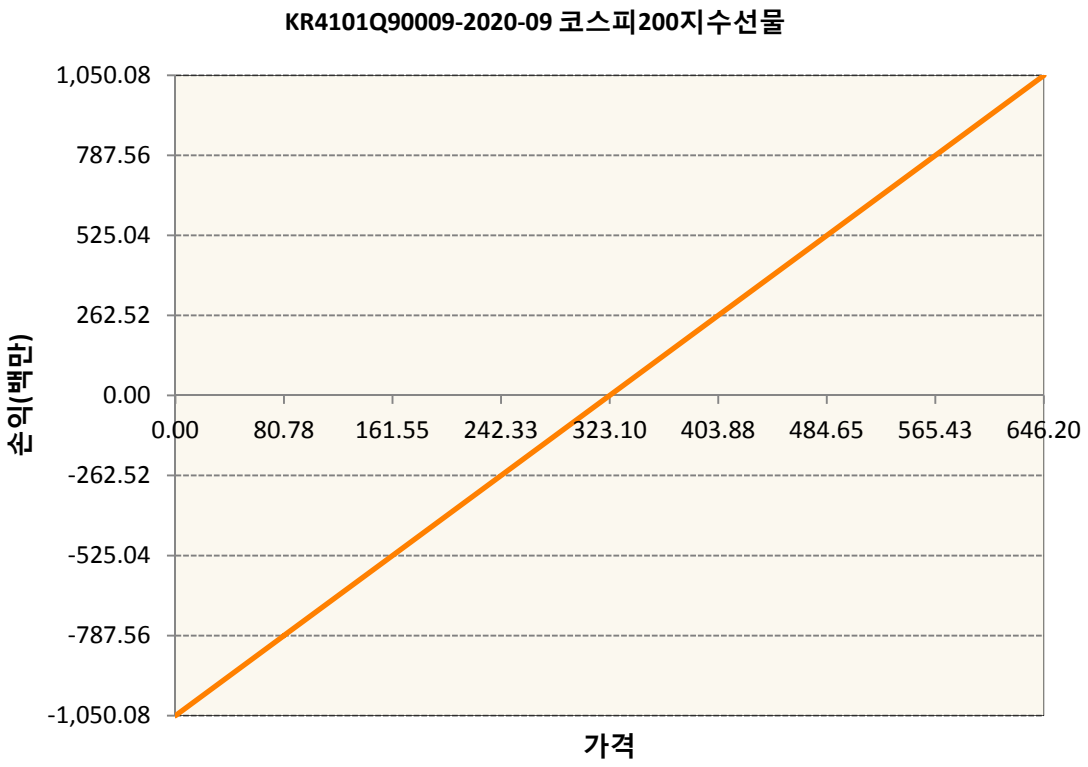
ETF스마트레버리지목표전환형10호

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	1,050	0	1,050	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

132

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

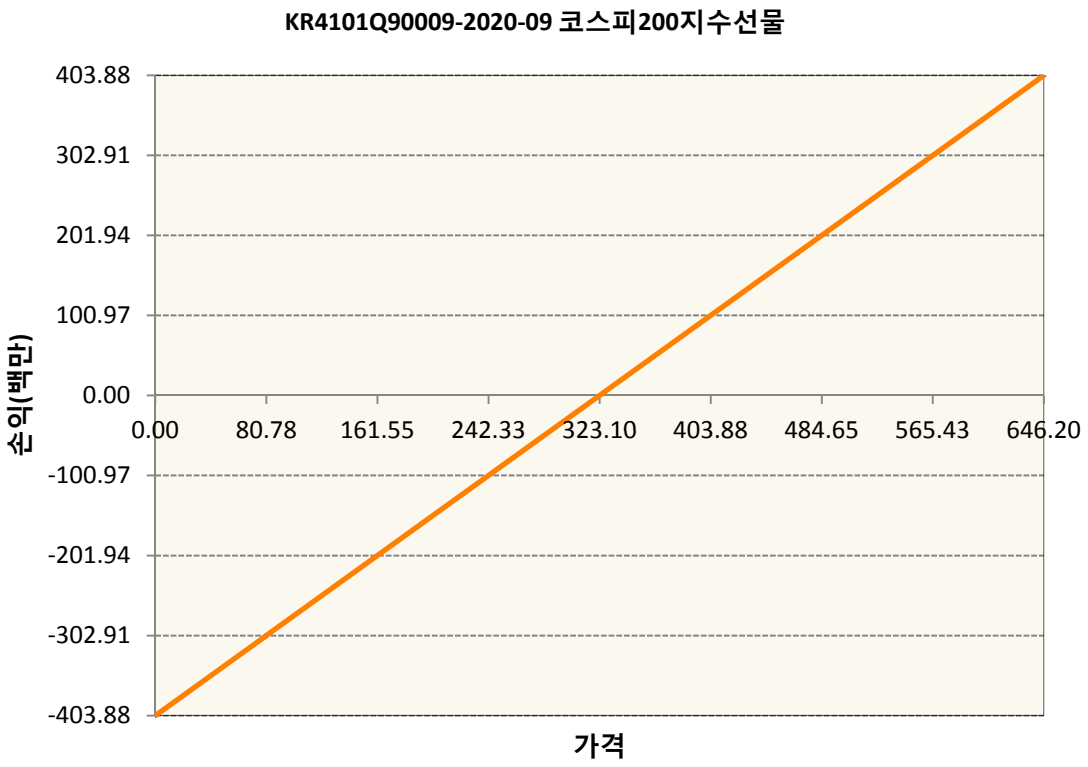
스마트KRX300인덱스목표전환형1호

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	404	0	404	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						32
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	32	32	32	32	32	32	32

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

51

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

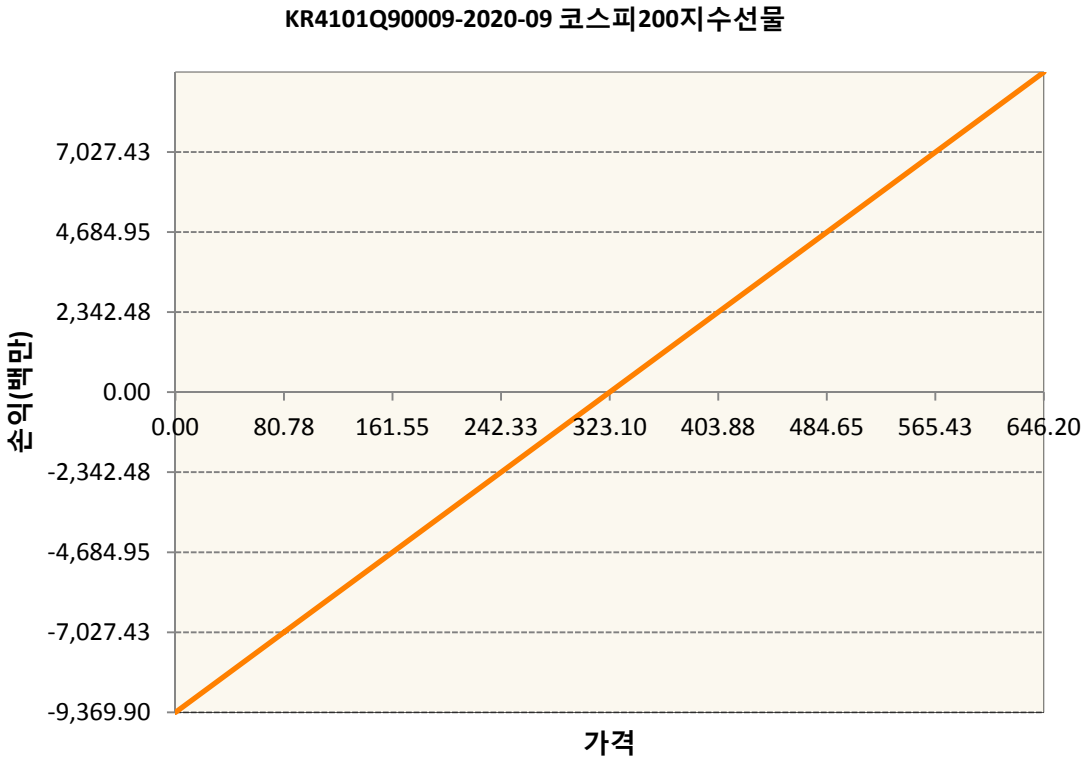
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

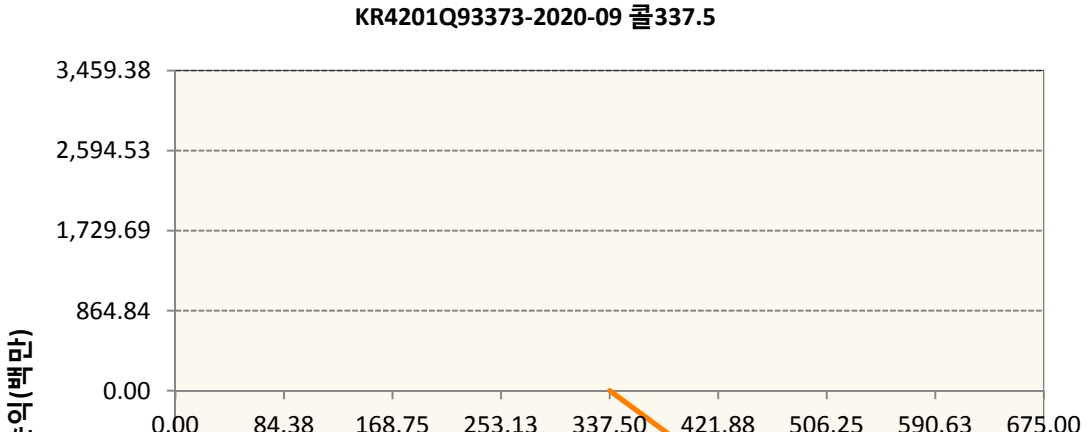
1. 계약금액

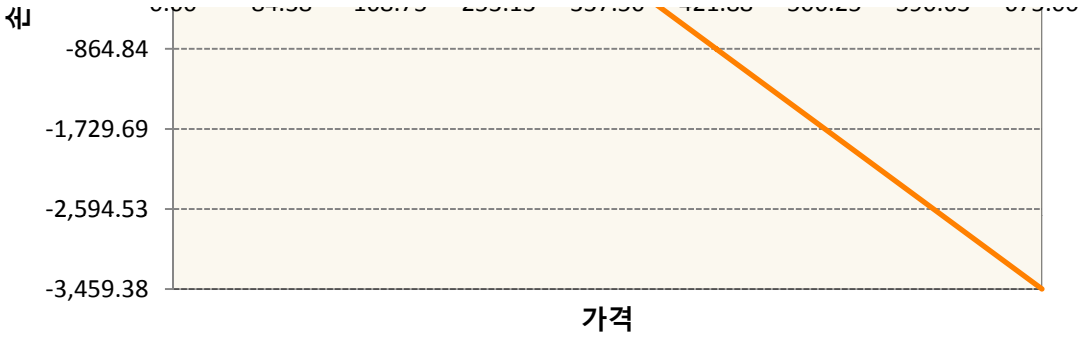
(단위:백만원)

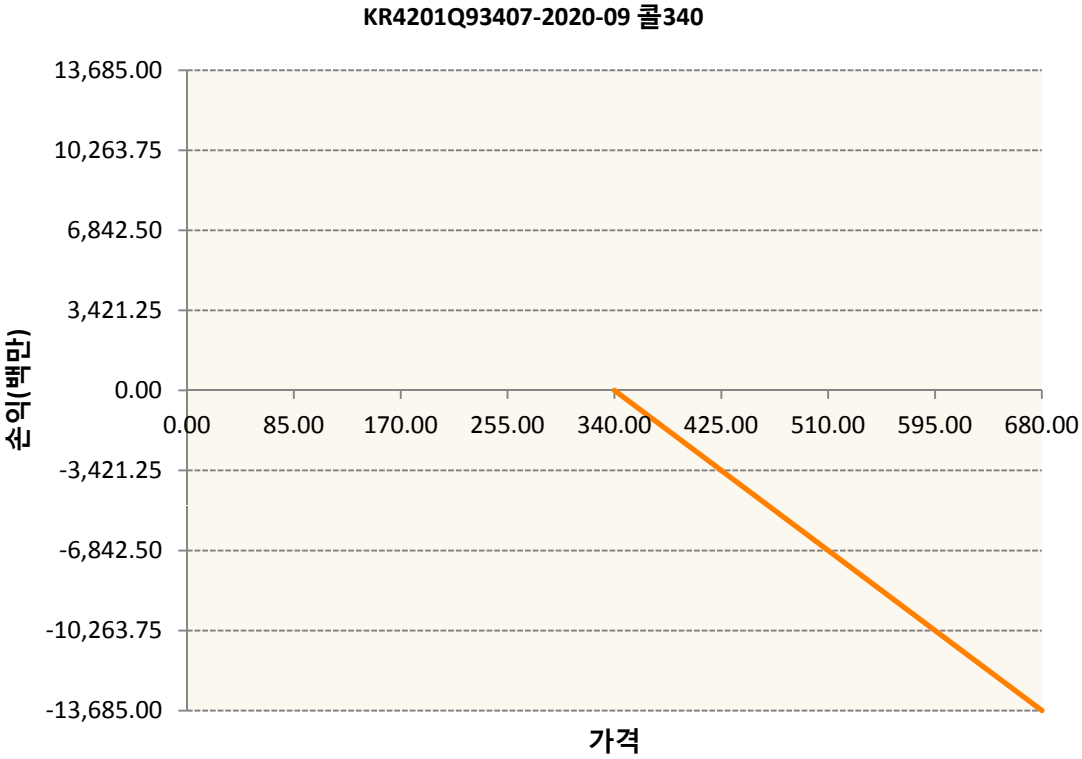
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,334	5,401	-4,067	장내
누계	유가증권	선물	9,370	0	9,370	장내
누계	유가증권	옵션	3,637	17,144	-13,508	장내

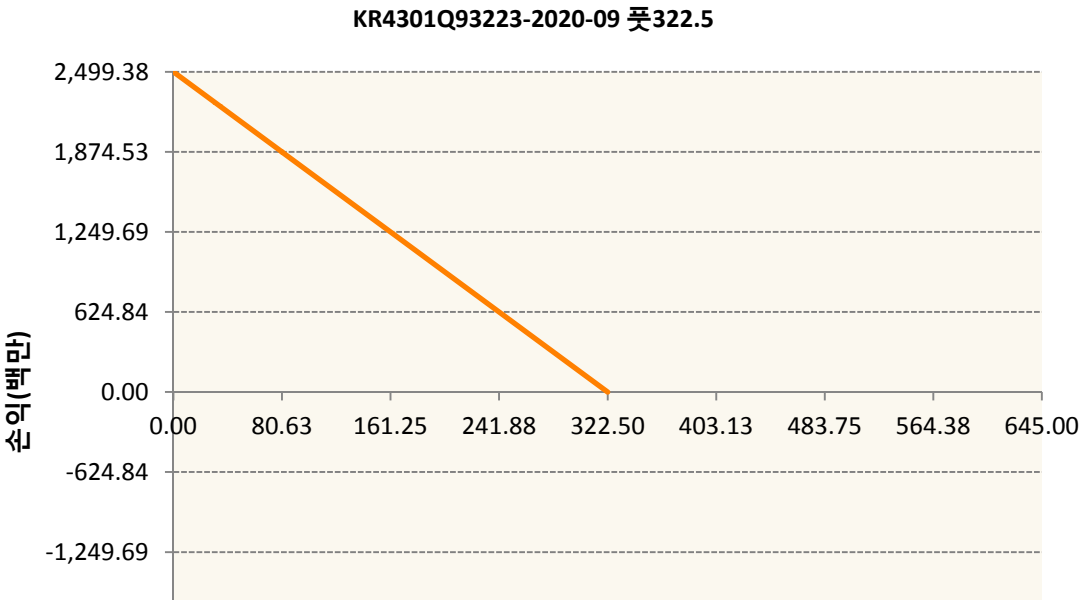
2. 만기시점의 손익구조

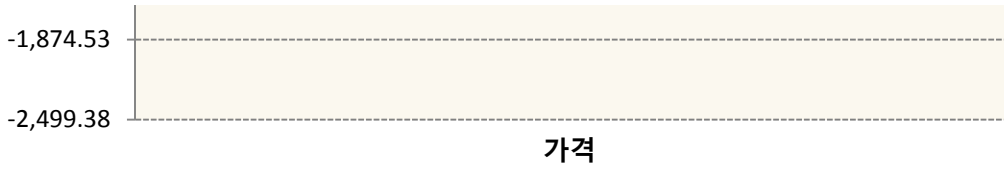


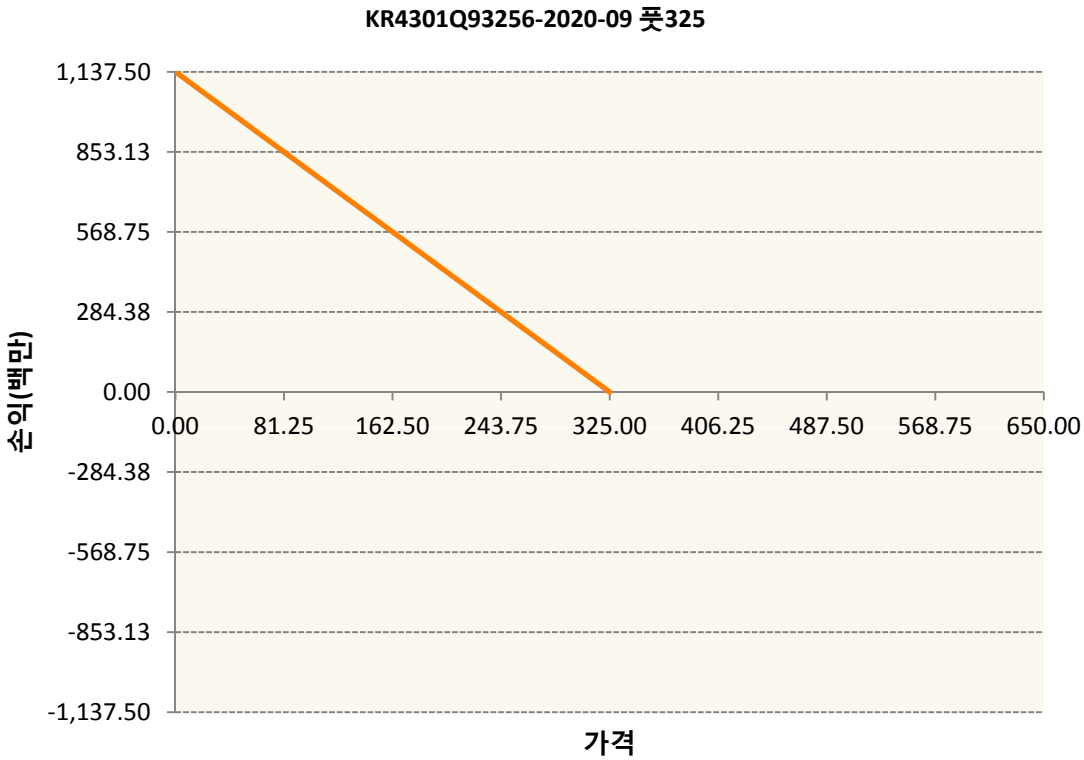



-864.84
-1,729.69
-2,594.53
-3,459.38
가격


KR4201Q93407-2020-09 콜340
13,685.00
10,263.75
6,842.50
3,421.25
0.00
-3,421.25
-6,842.50
-10,263.75
-13,685.00
0.00
85.00
170.00
255.00
340.00
425.00
510.00
595.00
680.00
손익(백만)
가격


KR4301Q93223-2020-09 풋322.5
2,499.38
1,874.53
1,249.69
624.84
0.00
-624.84
-1,249.69
0.00
80.63
161.25
241.88
322.50
403.13
483.75
564.38
645.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q90009	2020-09 코스피200지수선물						741
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-741	-741	-741	-741	-741	-741	-741
-5.33%	-494	-494	-494	-494	-494	-494	-494
-2.67%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	247	247	247	247	247	247	247
5.33%	494	494	494	494	494	494	494
8.00%	741	741	741	741	741	741	741

KR4201Q93373	2020-09 콜337.5						163
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	72	67	60	53	46	38
-5.33%	68	62	54	46	37	28	18
-2.67%	55	46	36	26	16	5	-7

0%	35	24	12	0	-12	-24	-37
2.67%	6	-7	-20	-33	-47	-60	-73
5.33%	-33	-46	-60	-74	-88	-102	-115
8.00%	-81	-94	-108	-122	-136	-150	-163
KR4201Q93407			2020-09 콜340				619
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	276	260	241	219	193	165	135
-5.33%	249	226	198	168	135	100	63
-2.67%	204	170	134	96	56	14	-29
0%	132	90	45	0	-47	-94	-142
2.67%	28	-22	-72	-123	-174	-226	-278
5.33%	-112	-166	-220	-274	-328	-383	-437
8.00%	-290	-345	-399	-454	-509	-564	-619
KR4301Q93223			2020-09 풋322.5				160
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	152	152	153	155	156	158	160
-5.33%	89	90	93	95	98	101	104
-2.67%	31	35	39	43	47	51	55
0%	-14	-10	-5	0	5	10	15
2.67%	-46	-41	-36	-31	-26	-22	-17
5.33%	-63	-59	-56	-52	-48	-43	-39
8.00%	-71	-69	-66	-64	-61	-57	-54
KR4301Q93256			2020-09 풋325				75
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	72	72	73	73	74	75
-5.33%	43	44	44	45	46	48	49
-2.67%	16	18	19	21	22	24	26
0%	-6	-4	-2	0	2	4	6
2.67%	-22	-20	-18	-16	-13	-11	-9
5.33%	-32	-30	-28	-26	-24	-22	-20
8.00%	-36	-35	-34	-33	-31	-30	-28

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

1,915

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

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	123,334	0	123,334	

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	2020-08-18
기준일	2020-08-14

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	84,016	0	84,016	

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	2020-08-18
기준일	2020-08-14

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	4,755	-4,755	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	441,381	0	441,381	
누계	통화	선도	0	477,157	-477,157	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	2,312
FX21020K01 KRW/USD 18-08-20E	948
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	995
FX21020K03 KRW/USD 26-08-20E	1,573
FX21020M0(KRW/USD 26-08-20E	569
FX21020M01 KRW/USD 26-08-20E	4,644
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	1,971
FX21020M02 KRW/USD 14-09-20E	2,388
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	986
FX21020M05 KRW/USD 22-09-20E	2,559
FX21020N04 KRW/USD 24-08-20E	4,028
FX21020N04 KRW/USD 24-08-20E	1,706
FX21020N06 KRW/USD 03-11-20E	3,317
FX21020N06 KRW/USD 03-11-20E	6,918
FX21020Q02 KRW/USD 26-10-20E	948
FX21020Q02 KRW/USD 26-10-20E	2,312
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

19,351

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

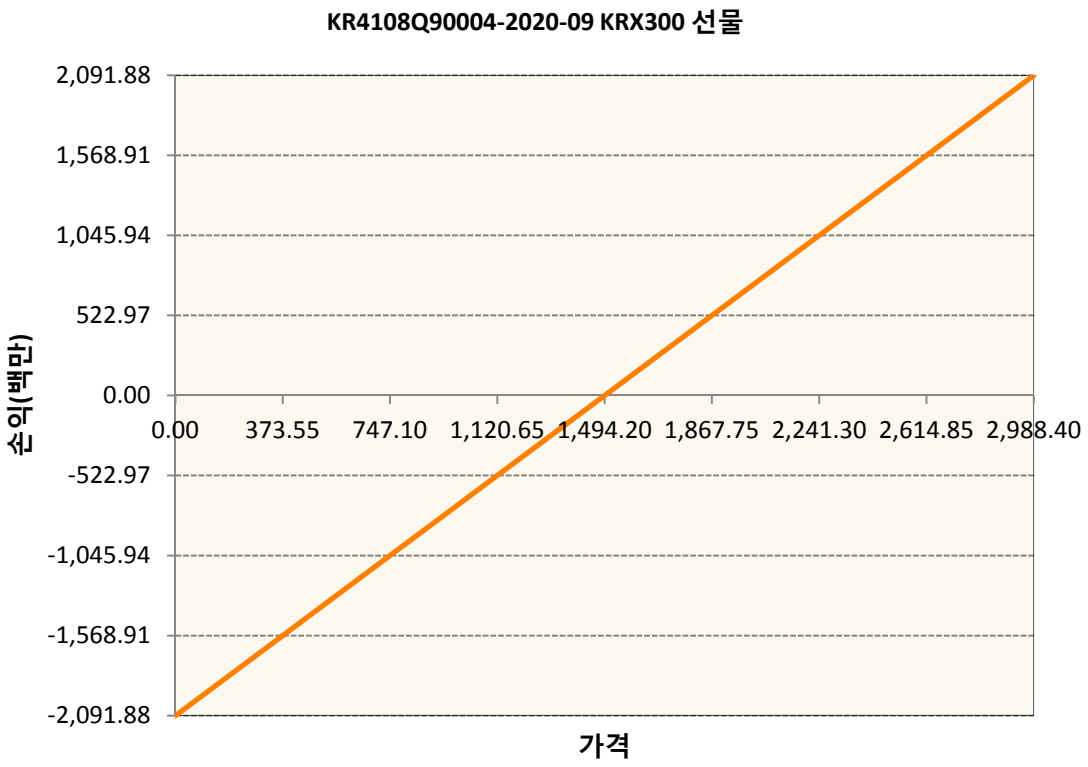
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	2,092	0	2,092	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4108Q90004	2020-09 KRX300 선물						165
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165
-5.33%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	110	110	110	110	110	110	110
8.00%	165	165	165	165	165	165	165

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	262

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

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	7,265	0	7,265	
누계	통화	선도	190	7,250	-7,060	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020N02 KRW/USD 15-09-20E	218
FX21020N03 KRW/USD 20-08-20E	154
FX21020N04 KRW/USD 27-08-20E	160
FX21020Q00 KRW/USD 08-09-20E	47
FX21020Q01 USD/KRW 20-08-20E	8
FX21020Q02 USD/KRW 20-08-20E	8
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

302

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

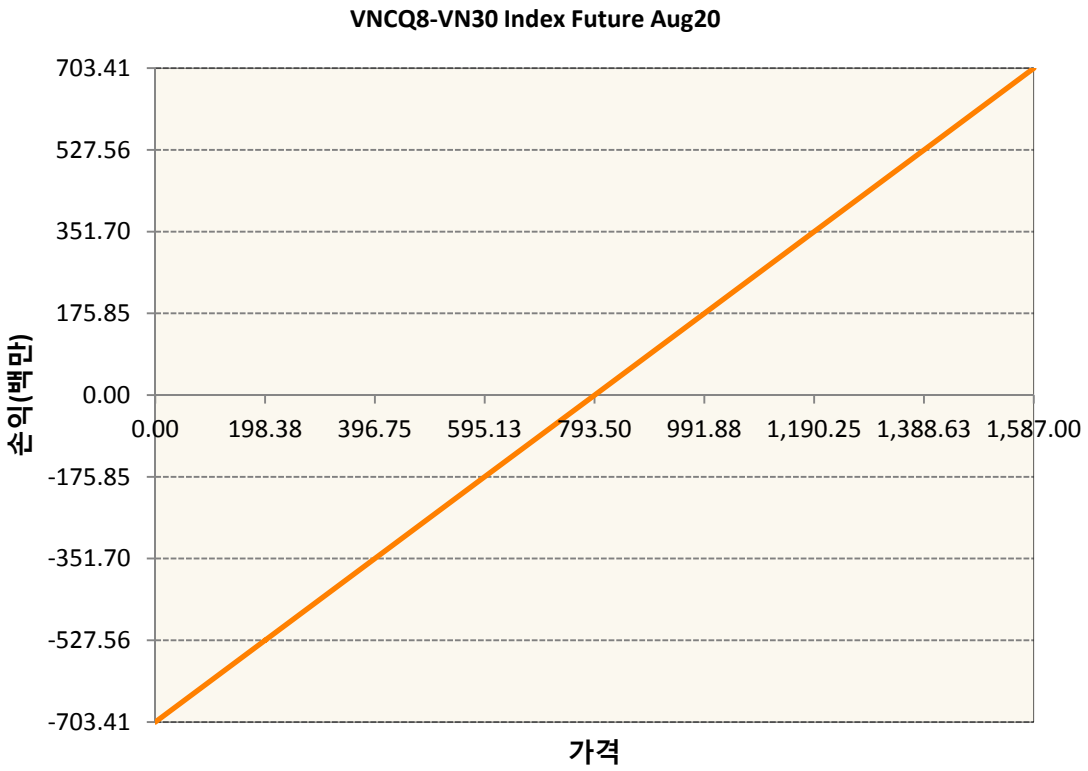
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	703	0	703	
누계	유가증권	스왑	976	0	976	장외
누계	통화	선도	280	840	-560	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	78
FX21020K03 KRW/EUR 28-08-20E	22
FX21020N00 EUR/KRW 28-08-20E	8
FX21020N02 KRW/EUR 28-08-20E	6
FX21020N04 KRW/EUR 23-10-20E	34
FX21020N05 EUR/KRW 28-08-20E	6

FX21020N05	EUR/KRW 28-08-20E	9
FX21020Q00	KRW/EUR 23-10-20E	6
VNCQ8	VN30 Index Future Aug20	56

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

186

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

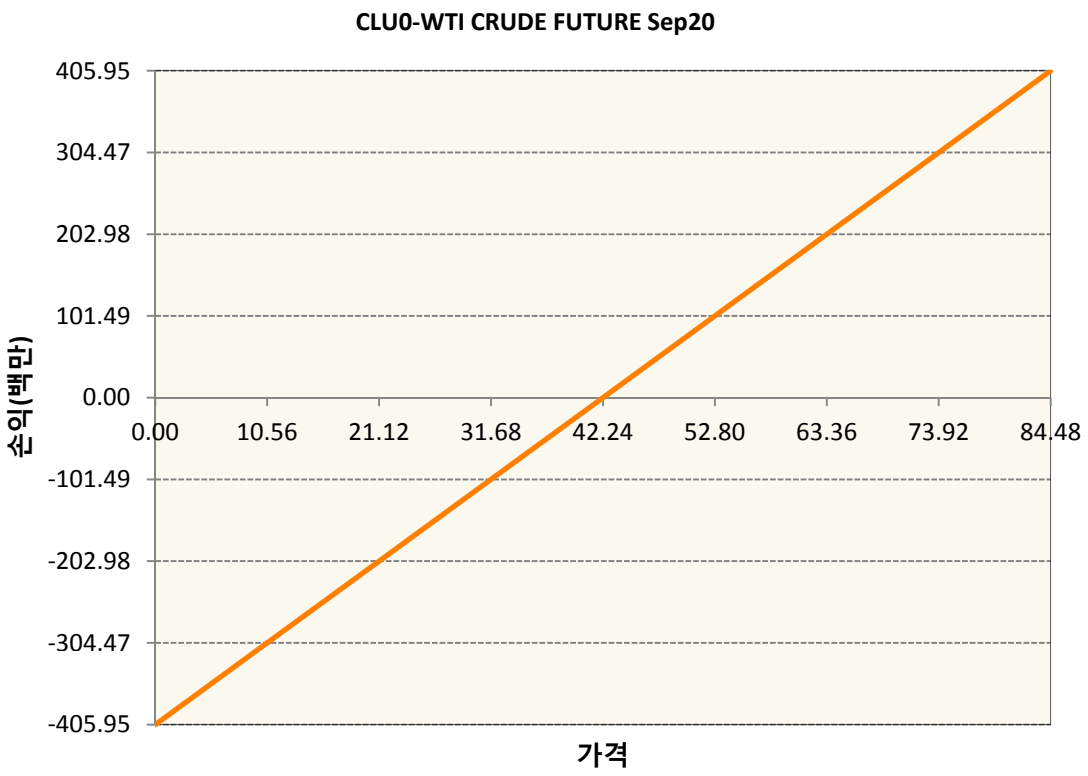
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

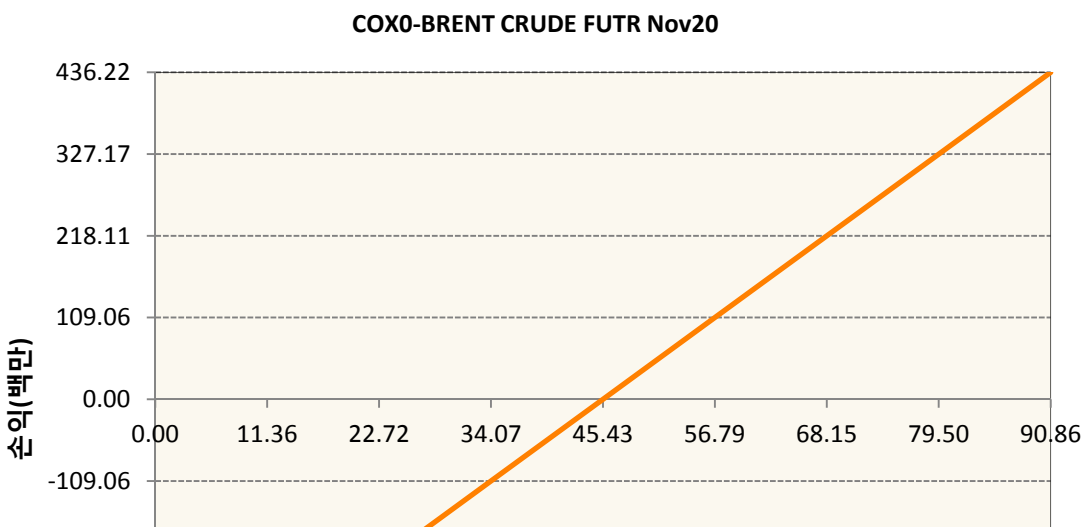
1. 계약금액

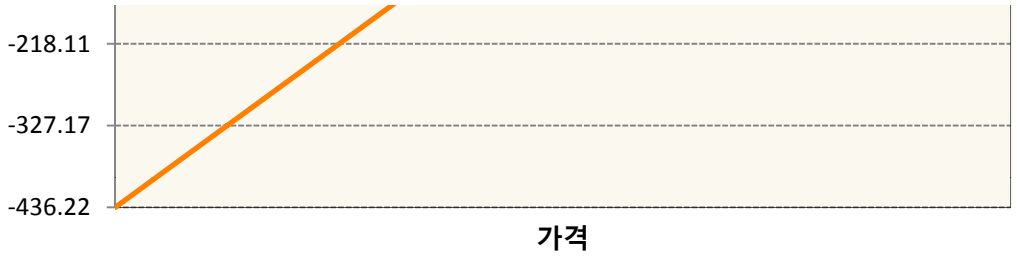
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,076	355	1,721	

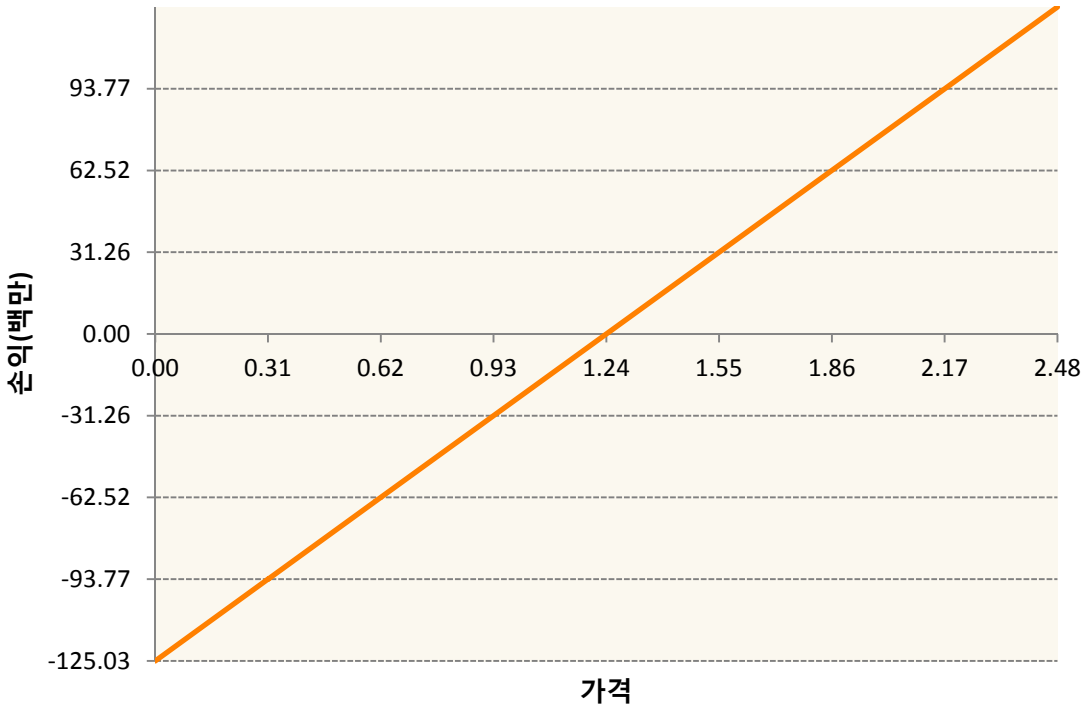
2. 만기시점의 손익구조



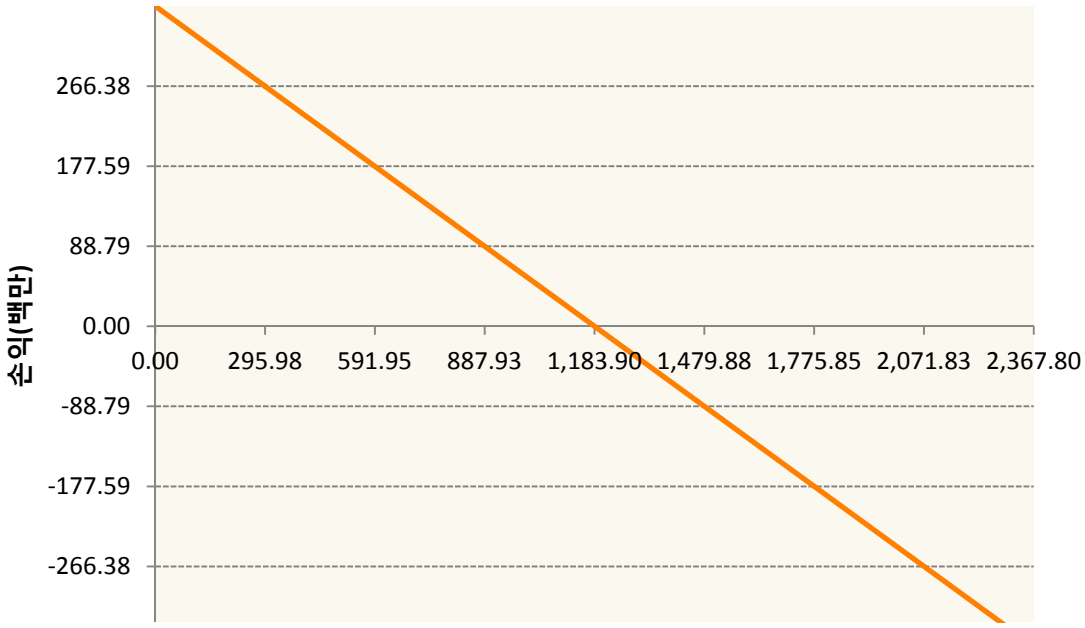


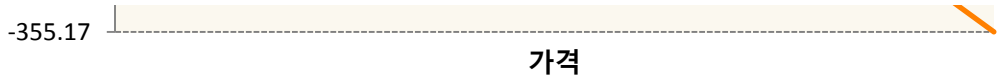


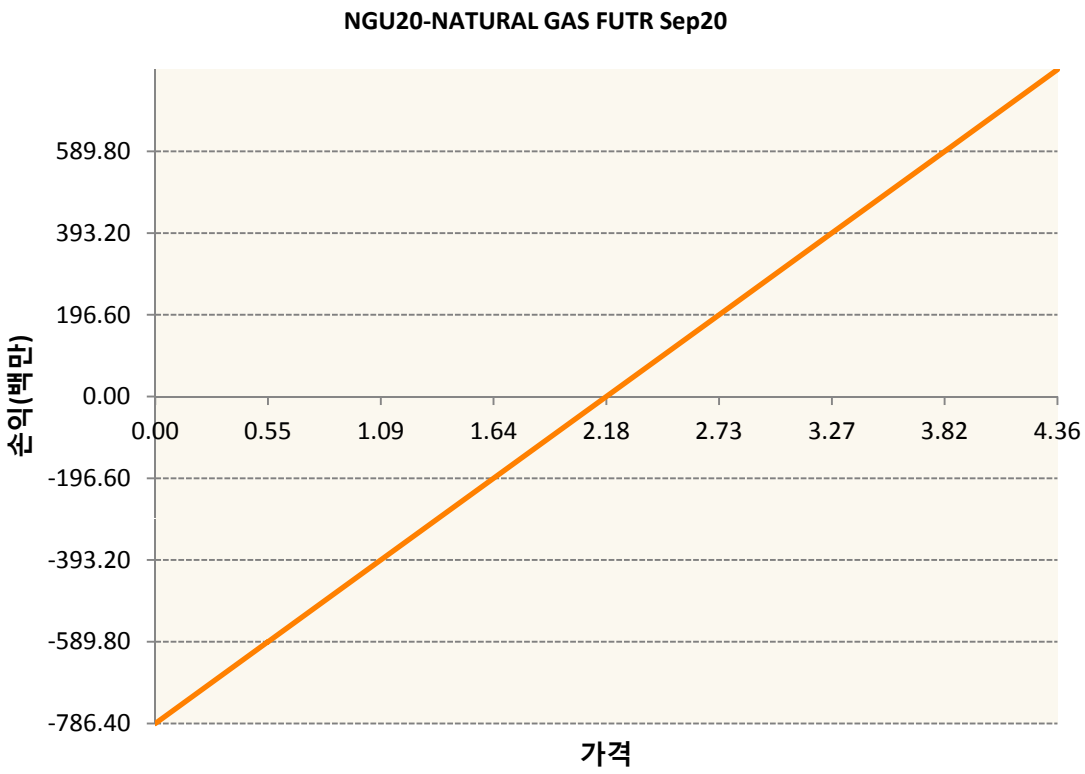
HOU0-NY Harb ULSD Fut Sep20

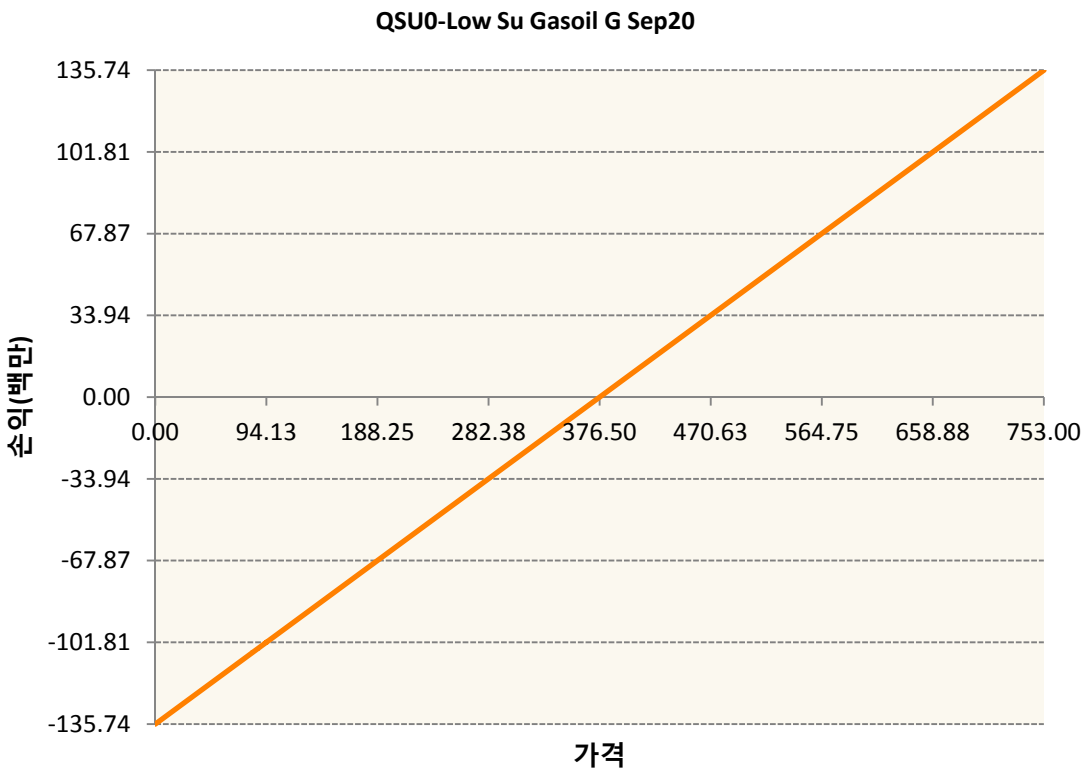


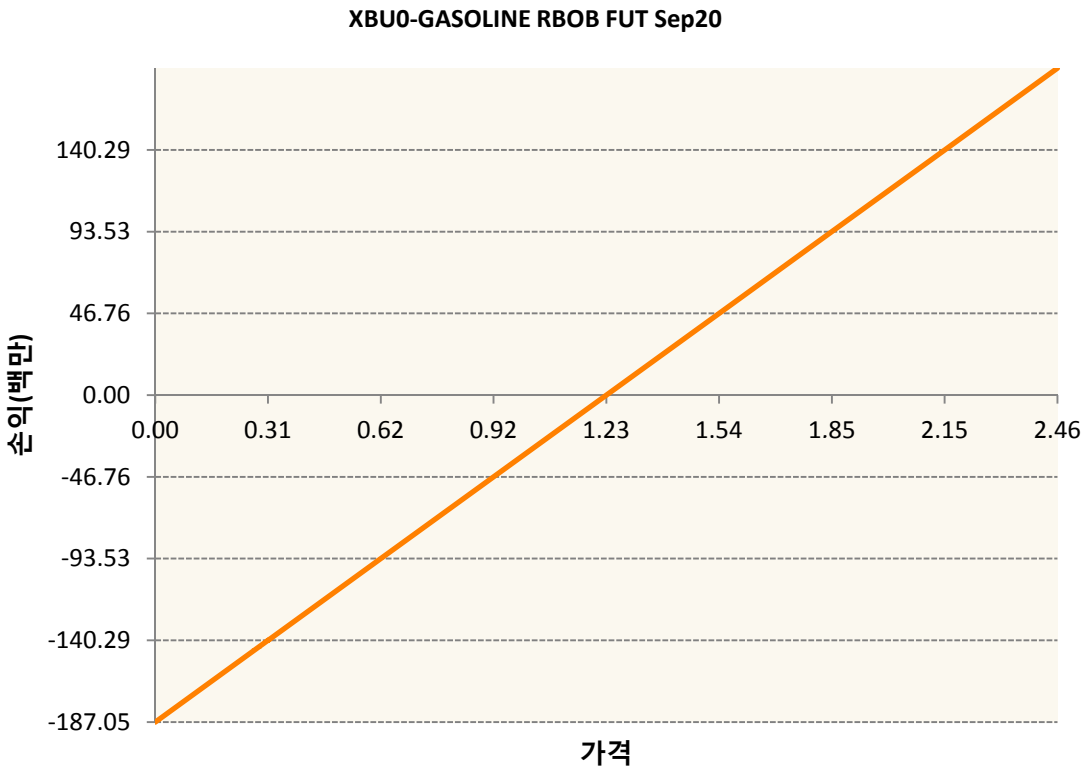
KR4175Q90003-2020-09 달러선물




-355.17
가격


NGU20-NATURAL GAS FUTR Sep20
589.80
393.20
196.60
0.00
-196.60
-393.20
-589.80
-786.40
0.00
0.55
1.09
1.64
2.18
2.73
3.27
3.82
4.36
손익(백만)
가격


QSU0-Low Su Gasoil G Sep20
135.74
101.81
67.87
33.94
0.00
-33.94
-67.87
-101.81
-135.74
0.00
94.13
188.25
282.38
376.50
470.63
564.75
658.88
753.00
손익(백만)
가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLU0	WTI CRUDE FUTURE Sep20	32
COX0	BRENT CRUDE FUTR Nov20	35
HOU0	NY Harb ULSD Fut Sep20	10
KR4175Q90(	2020-09 달러선물	28
NGU20	NATURAL GAS FUTR Sep20	63
QSU0	Low Su Gasoil G Sep20	11
XBU0	GASOLINE RBOB FUT Sep20	15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	991

공시일	2020-08-18
기준일	2020-08-14

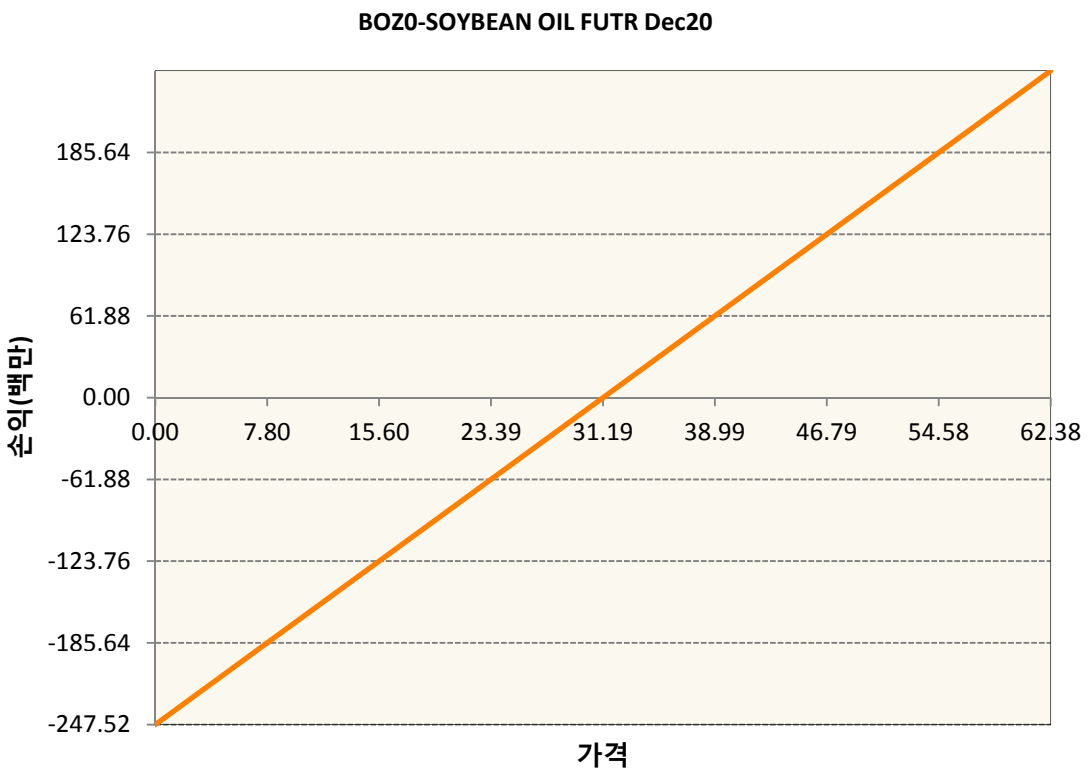
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

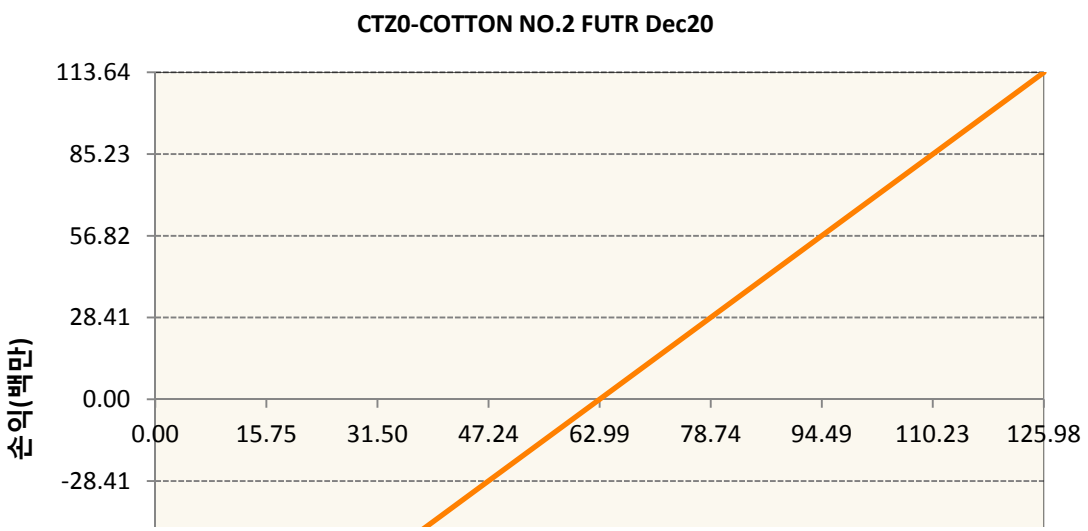
1. 계약금액

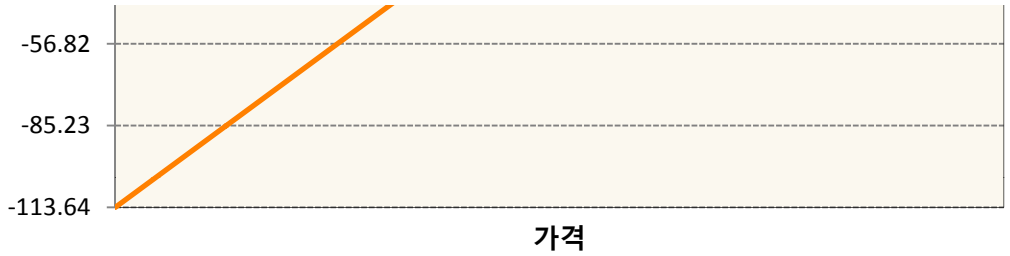
(단위:백만원)

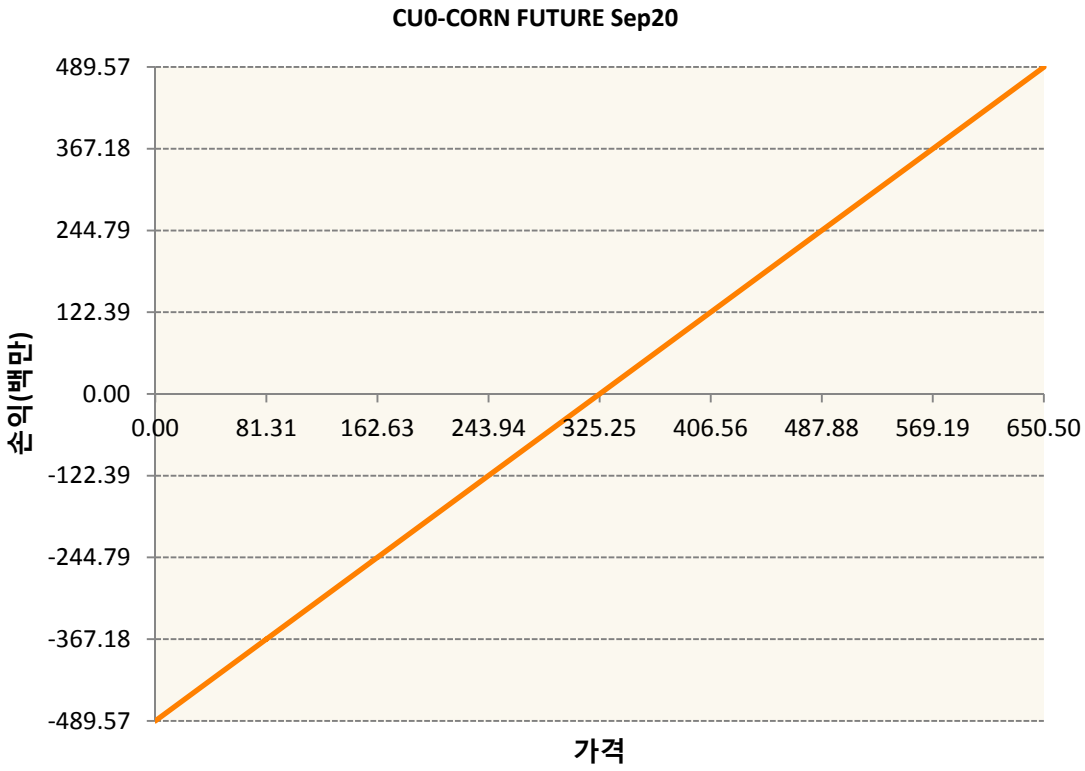
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,602	71	2,531	

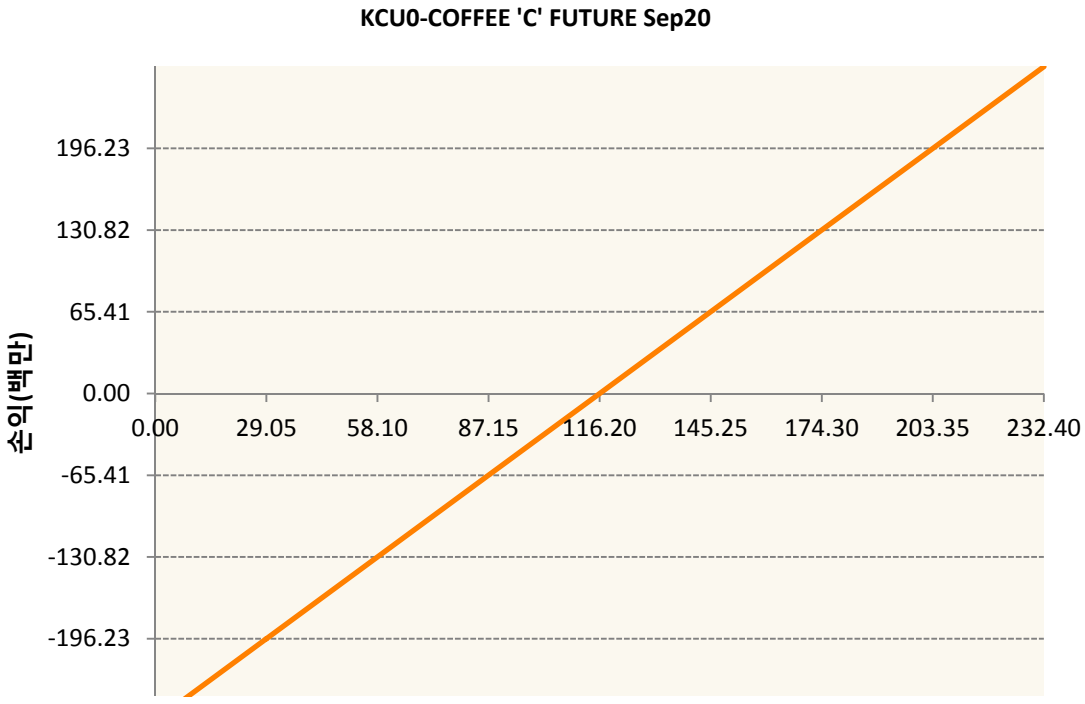
2. 만기시점의 손익구조

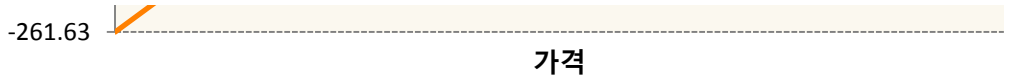


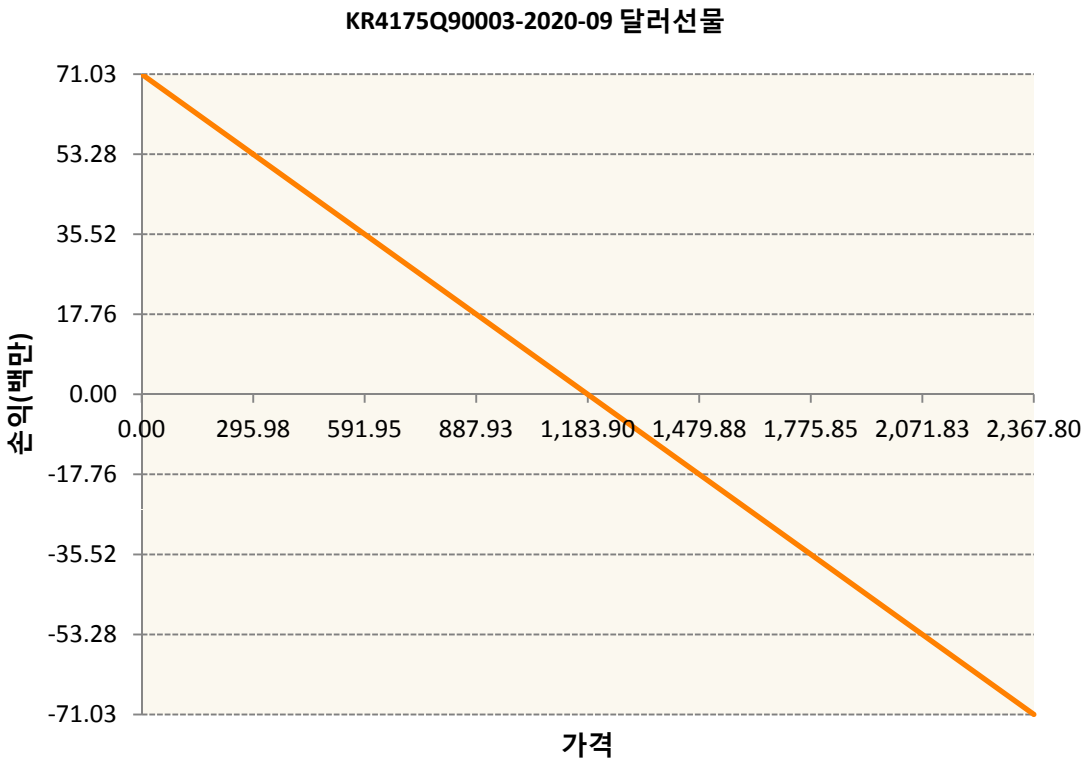


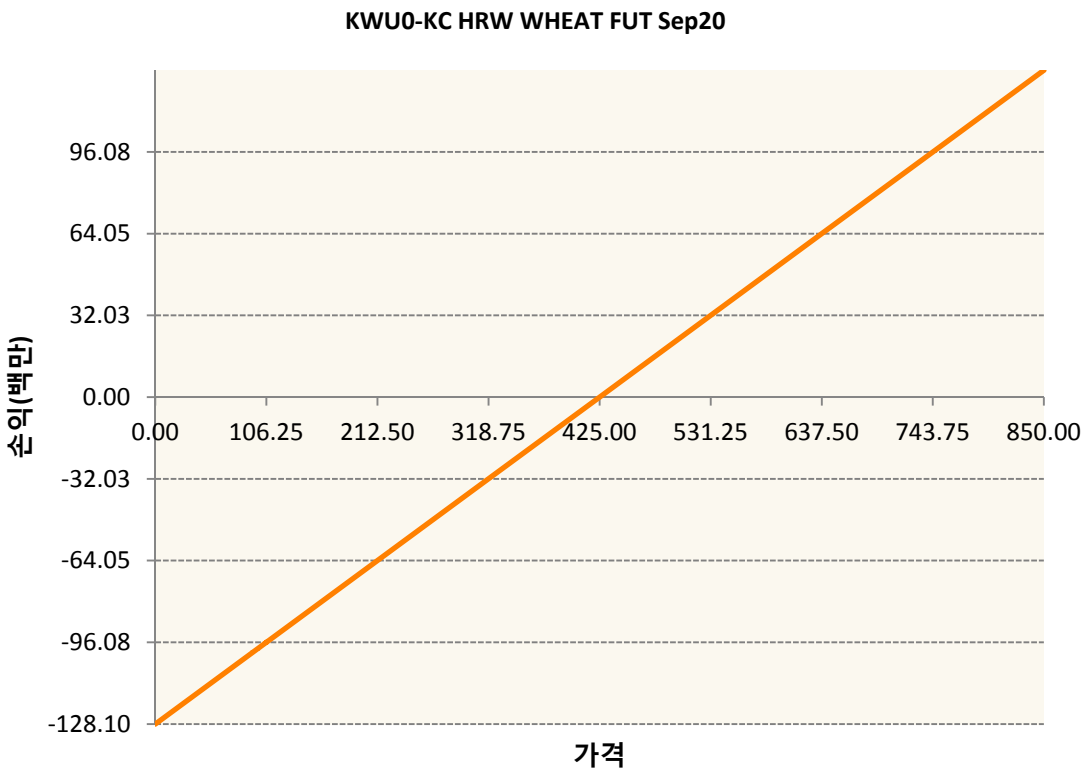

-56.82
-85.23
-113.64
가격

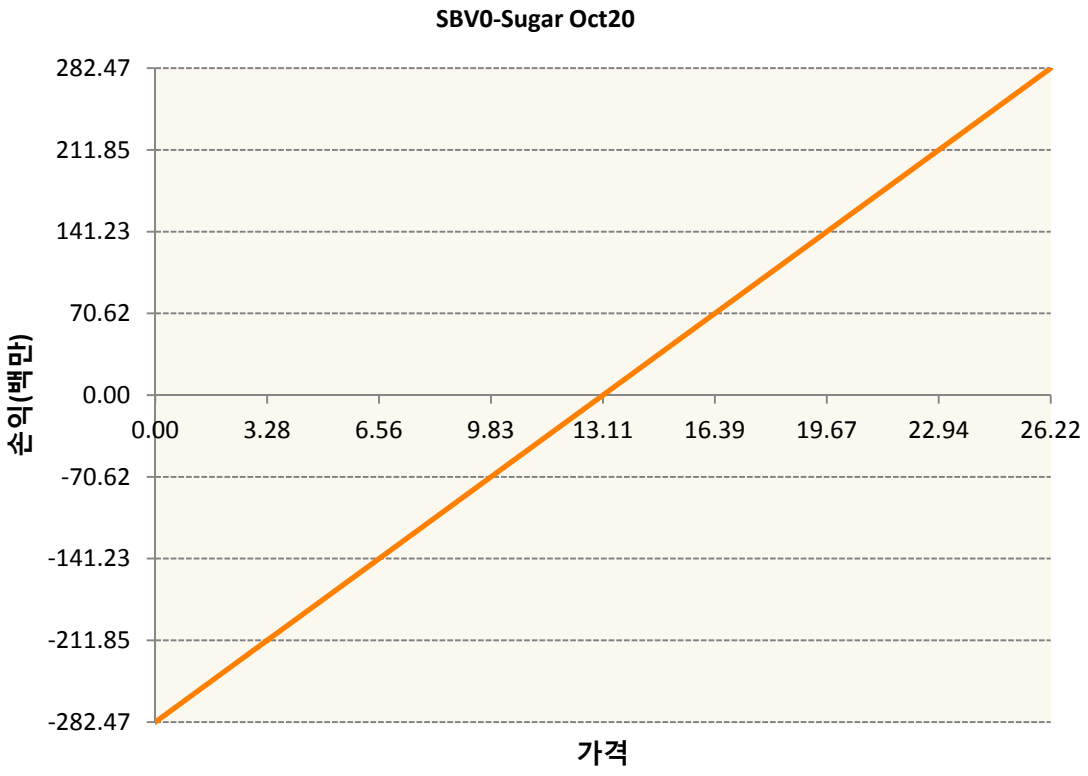

CU0-CORN FUTURE Sep20
489.57
367.18
244.79
122.39
0.00
-122.39
-244.79
-367.18
-489.57
0.00
81.31
162.63
243.94
325.25
406.56
487.88
569.19
650.50
손익(백만)
가격

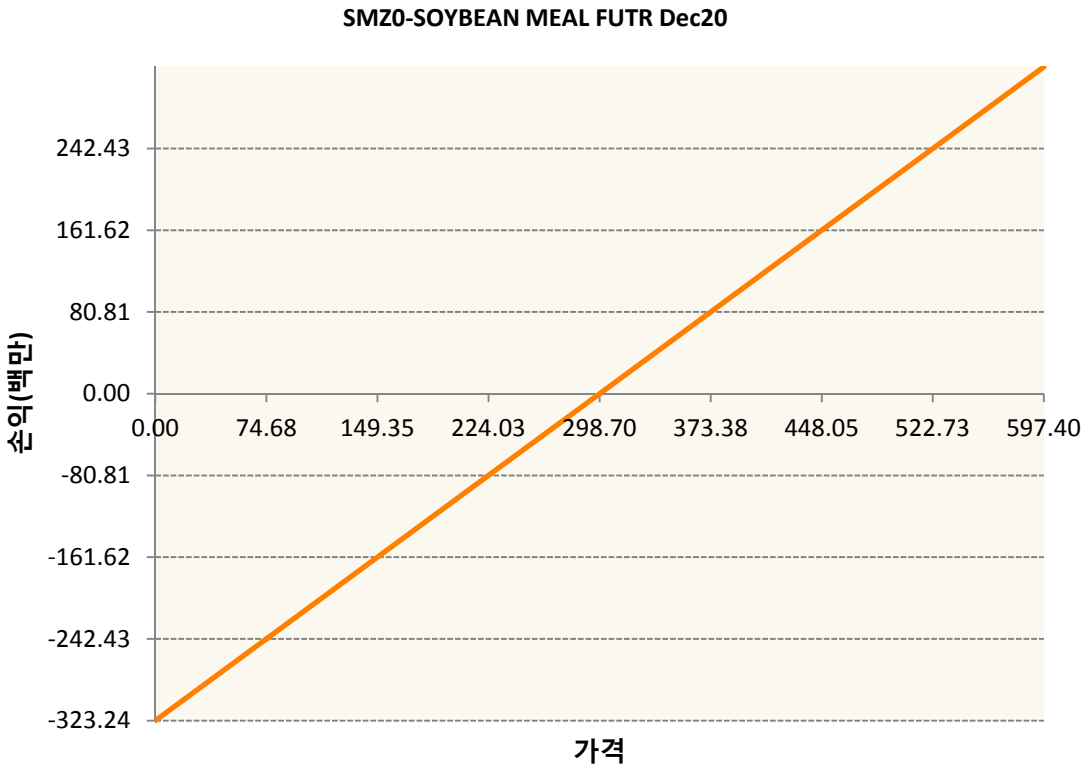

KCU0-COFFEE 'C' FUTURE Sep20
196.23
130.82
65.41
0.00
-65.41
-130.82
-196.23
0.00
29.05
58.10
87.15
116.20
145.25
174.30
203.35
232.40
손익(백만)

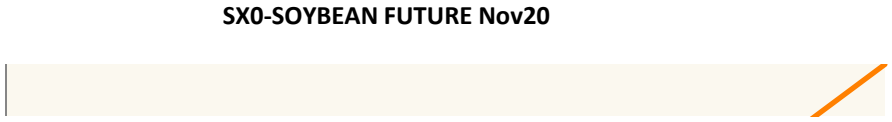

-261.63
가격

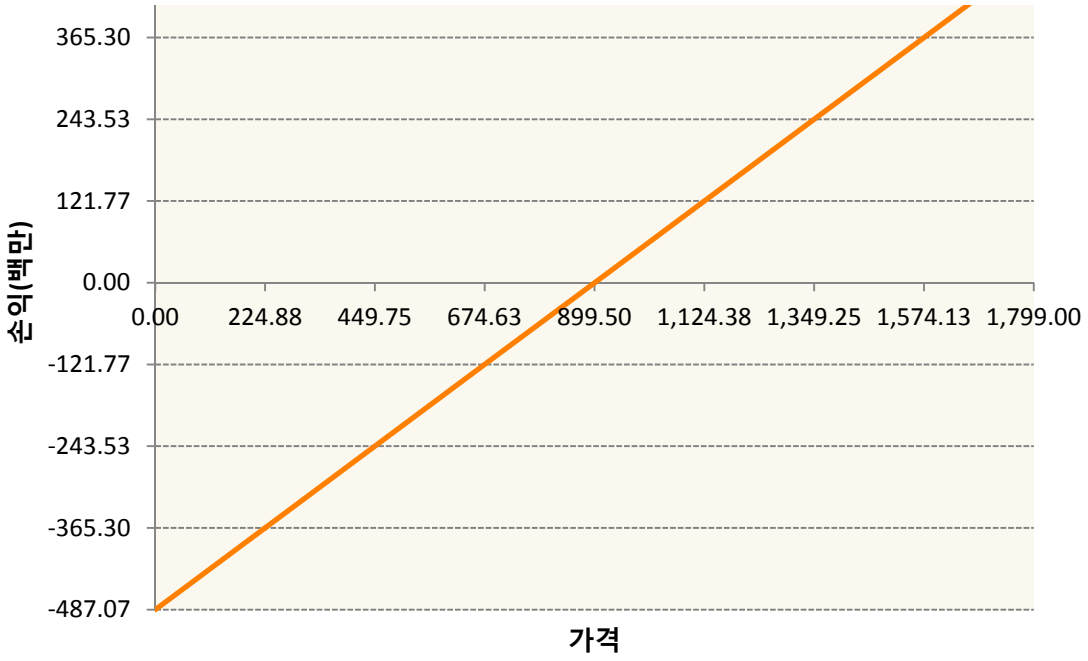

KR4175Q90003-2020-09 달러선물
71.03
53.28
35.52
17.76
0.00
-17.76
-35.52
-53.28
-71.03
손익(백만)
0.00
295.98
591.95
887.93
1,183.90
1,479.88
1,775.85
2,071.83
2,367.80
가격

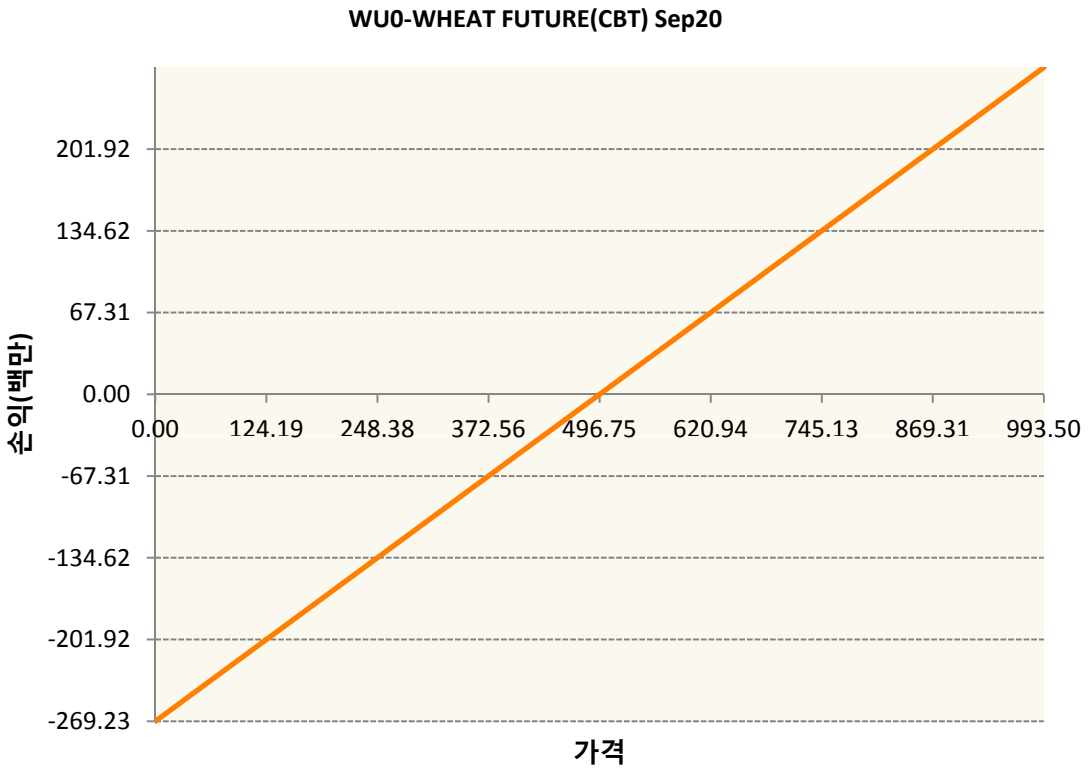

KWU0-KC HRW WHEAT FUT Sep20
96.08
64.05
32.03
0.00
-32.03
-64.05
-96.08
-128.10
손익(백만)
0.00
106.25
212.50
318.75
425.00
531.25
637.50
743.75
850.00
가격


SBV0-Sugar Oct20
282.47
211.85
141.23
70.62
0.00
-70.62
-141.23
-211.85
-282.47
0.00
3.28
6.56
9.83
13.11
16.39
19.67
22.94
26.22
손익(백만)
가격


SMZ0-SOYBEAN MEAL FUTR Dec20
242.43
161.62
80.81
0.00
-80.81
-161.62
-242.43
-323.24
0.00
74.68
149.35
224.03
298.70
373.38
448.05
522.73
597.40
손익(백만)
가격


SX0-SOYBEAN FUTURE Nov20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ0	SOYBEAN OIL FUTR Dec20	20
CTZ0	COTTON NO.2 FUTR Dec20	9
CU0	CORN FUTURE Sep20	39
KCU0	COFFEE 'C' FUTURE Sep20	21
KR4175Q90(	2020-09 달러선물	6

KWU0	KC HRW WHEAT FUT Sep20	10
SBV0	Sugar Oct20	23
SMZ0	SOYBEAN MEAL FUTR Dec20	26
SX0	SOYBEAN FUTURE Nov20	39
WU0	WHEAT FUTURE(CBT) Sep20	22

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

252