공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

포커스농산물모(채권-파생평)

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	8	0	8	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	2018-04-12
기준일	2018-04-11

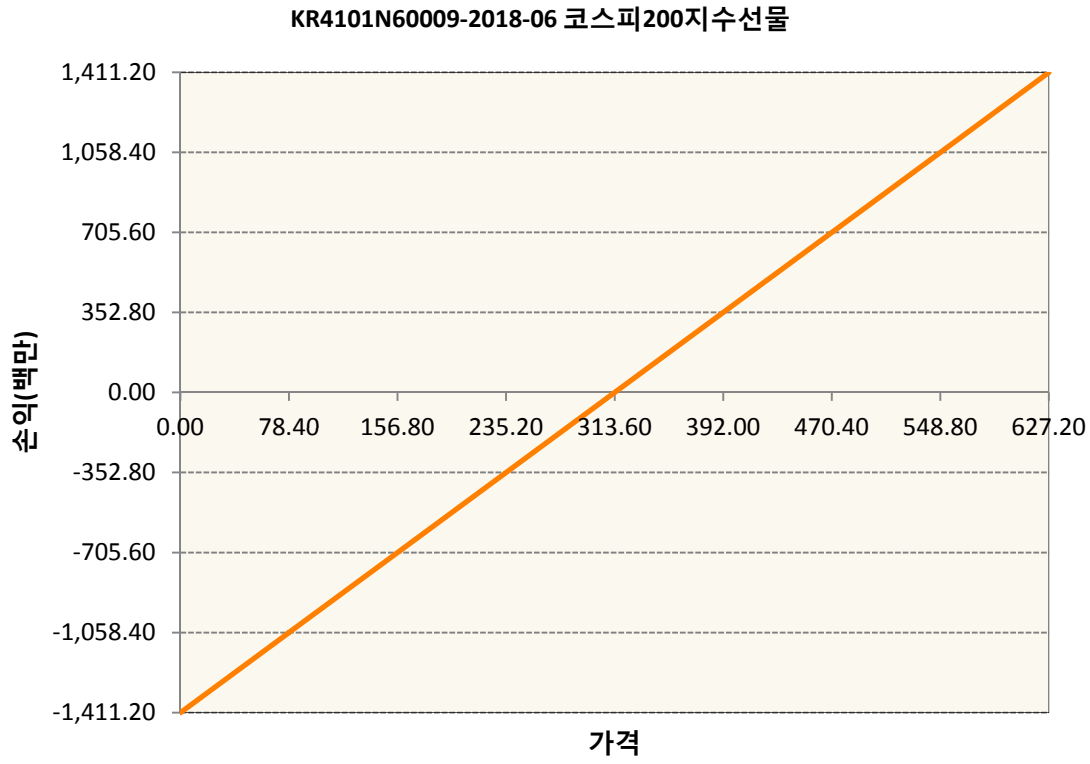
스마트인덱스모

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	1,411	0	1,411	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

82

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

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	13,869	0	13,869	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222	1,099

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

447

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

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	5,081	0	5,081	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180308	408

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

440

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

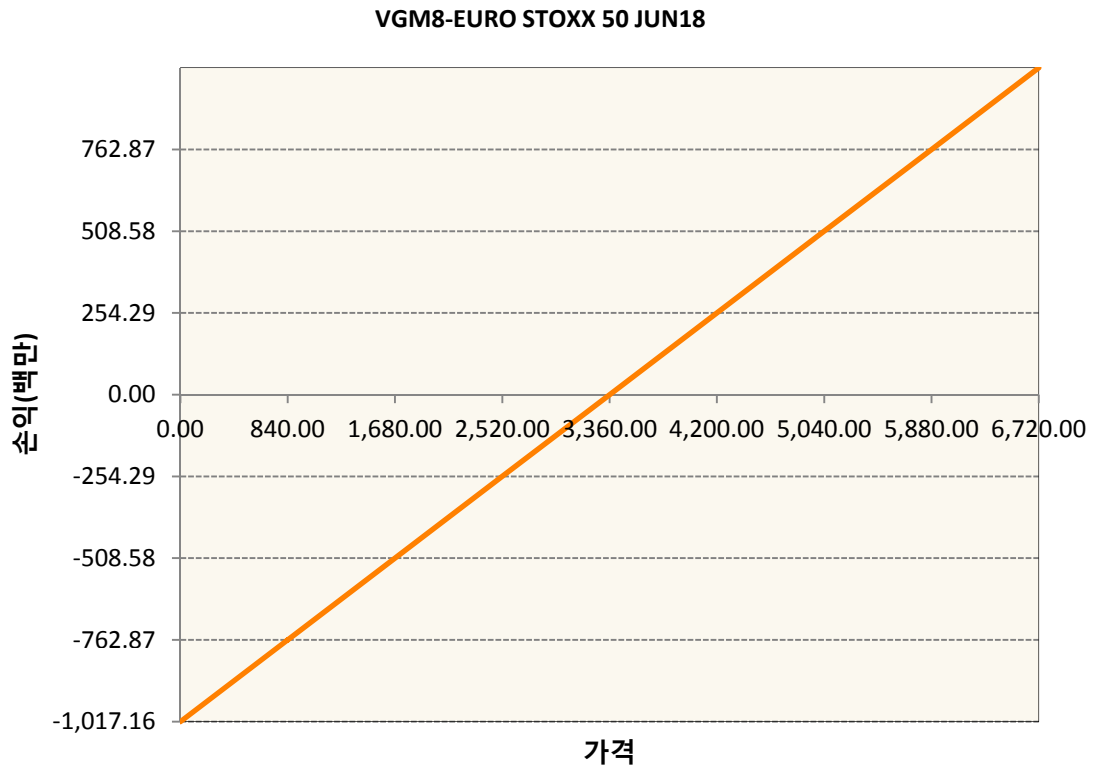
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,017	0	1,017	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	81

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

(단위:백만원)

50

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

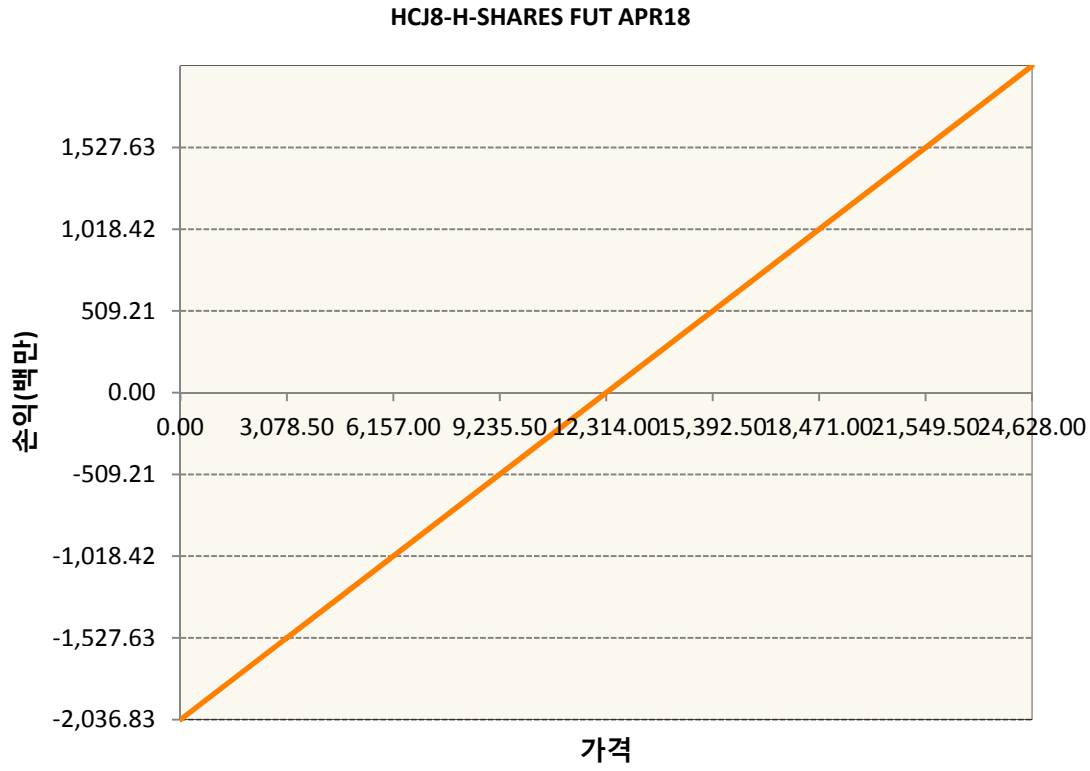
차이나인덱스모(주식-파생형)

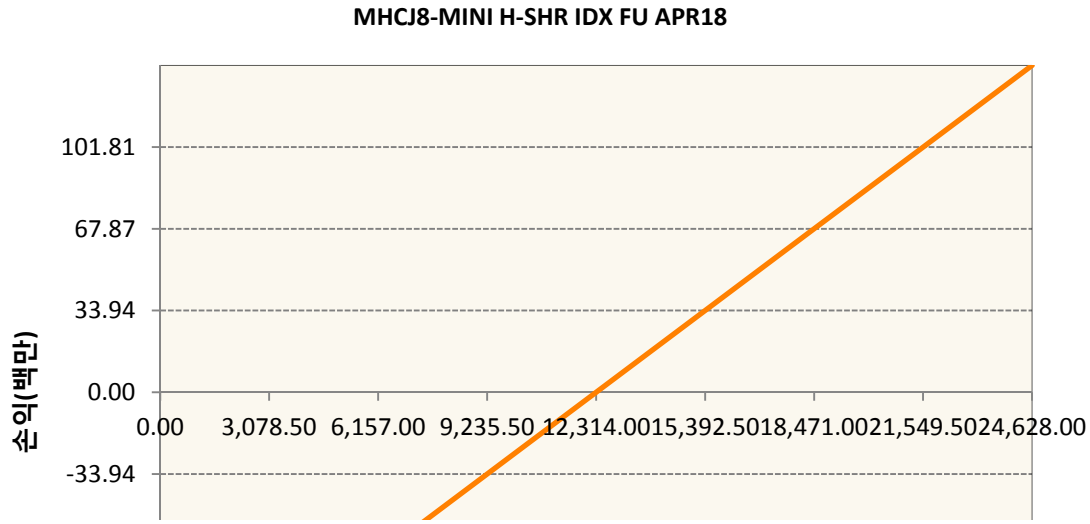
1. 계약금액

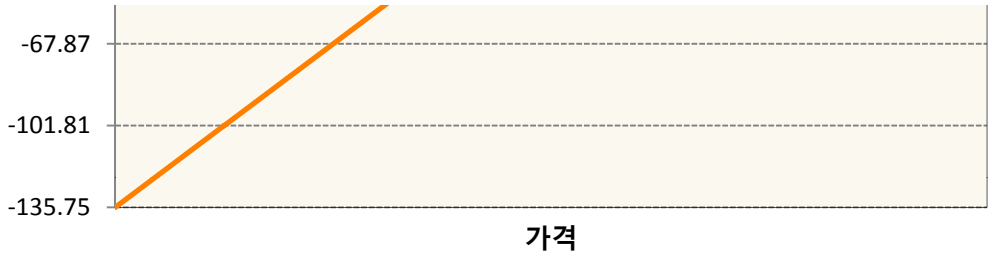
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,173	0	2,173	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	163
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	153

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

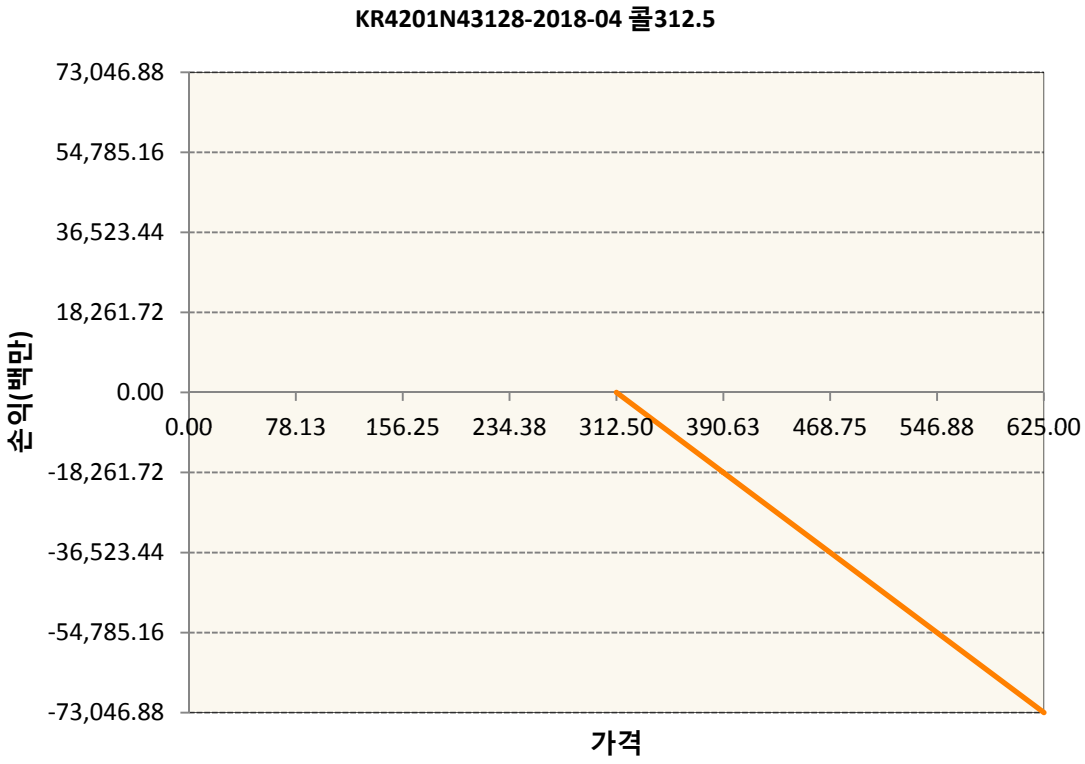
커버드콜모(주식혼합-파생형)

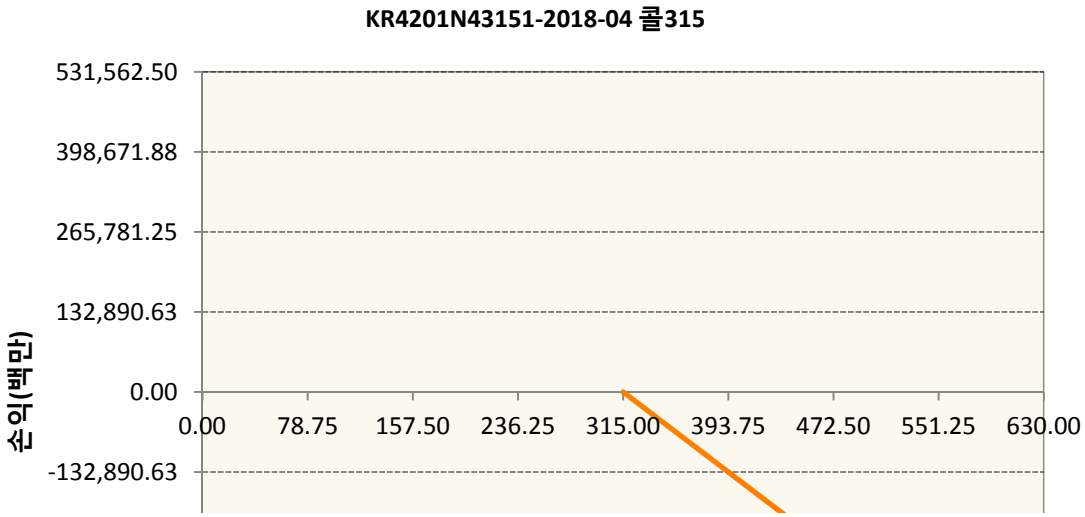
1. 계약금액

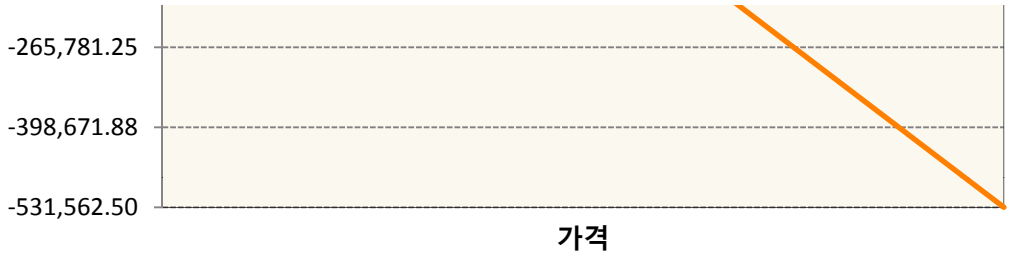
(단위:백만원)

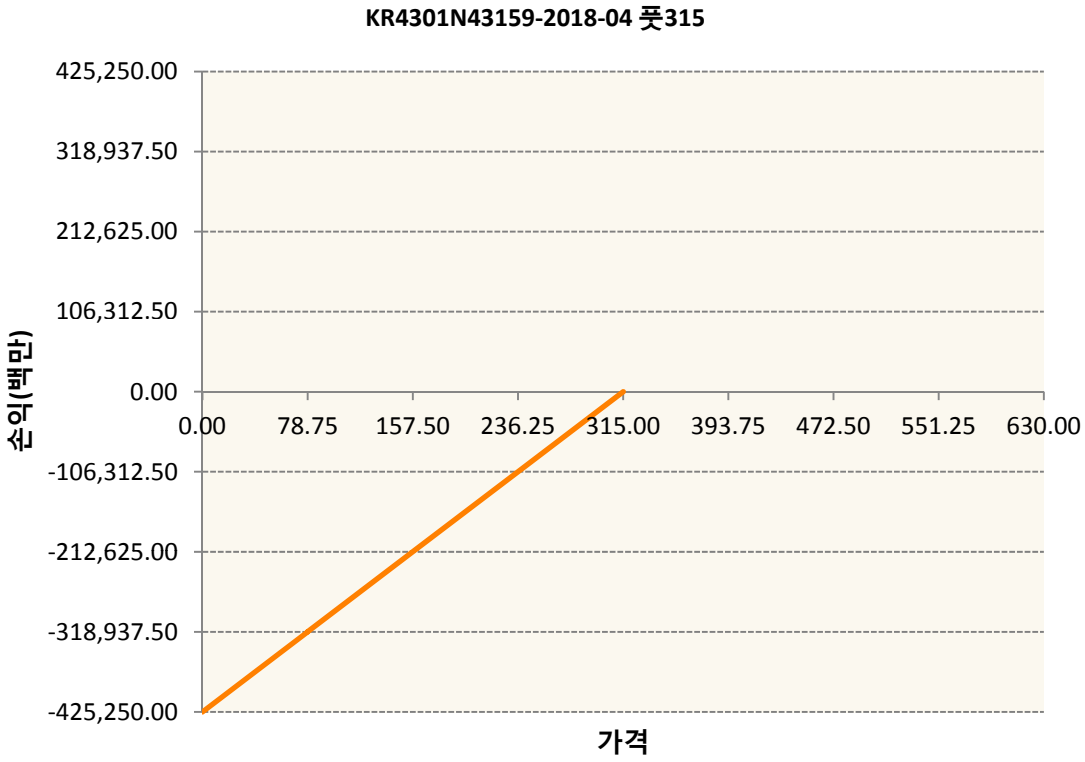
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	3,925	0	3,925	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,029,859	-1,029,859	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N4312018-04 콜312.5							5,474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	481	481	481	481	481	481	481
-5.33%	481	481	481	481	481	481	481
-2.67%	479	475	471	464	455	445	432
0%	106	71	35	0	-35	-71	-107
2.67%	-1,574	-1,576	-1,580	-1,585	-1,592	-1,601	-1,611
5.33%	-3,523	-3,523	-3,523	-3,523	-3,523	-3,524	-3,524
8.00%	-5,474	-5,474	-5,474	-5,474	-5,474	-5,474	-5,474
KR4201N4312018-04 콜315							37,105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,667	1,667	1,667	1,667	1,667	1,667	1,667

-5.33%	1,667	1,667	1,667	1,667	1,667	1,667	1,666
-2.67%	1,666	1,662	1,653	1,639	1,616	1,584	1,541
0%	678	458	232	0	-236	-474	-715
2.67%	-9,026	-9,088	-9,167	-9,265	-9,378	-9,506	-9,646
5.33%	-23,023	-23,023	-23,024	-23,025	-23,028	-23,034	-23,044
8.00%	-37,105	-37,105	-37,105	-37,105	-37,105	-37,105	-37,105
KR4301N4312018-04 풋315							33,360

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33,360	-33,360	-33,360	-33,360	-33,360	-33,360	-33,360
-5.33%	-22,095	-22,095	-22,095	-22,095	-22,095	-22,095	-22,095
-2.67%	-10,829	-10,829	-10,829	-10,829	-10,829	-10,830	-10,830
0%	234	162	84	0	-88	-181	-276
2.67%	3,214	3,212	3,209	3,204	3,195	3,182	3,164
5.33%	3,214	3,214	3,214	3,214	3,214	3,214	3,214
8.00%	3,214	3,214	3,214	3,214	3,214	3,214	3,214

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

110,176

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

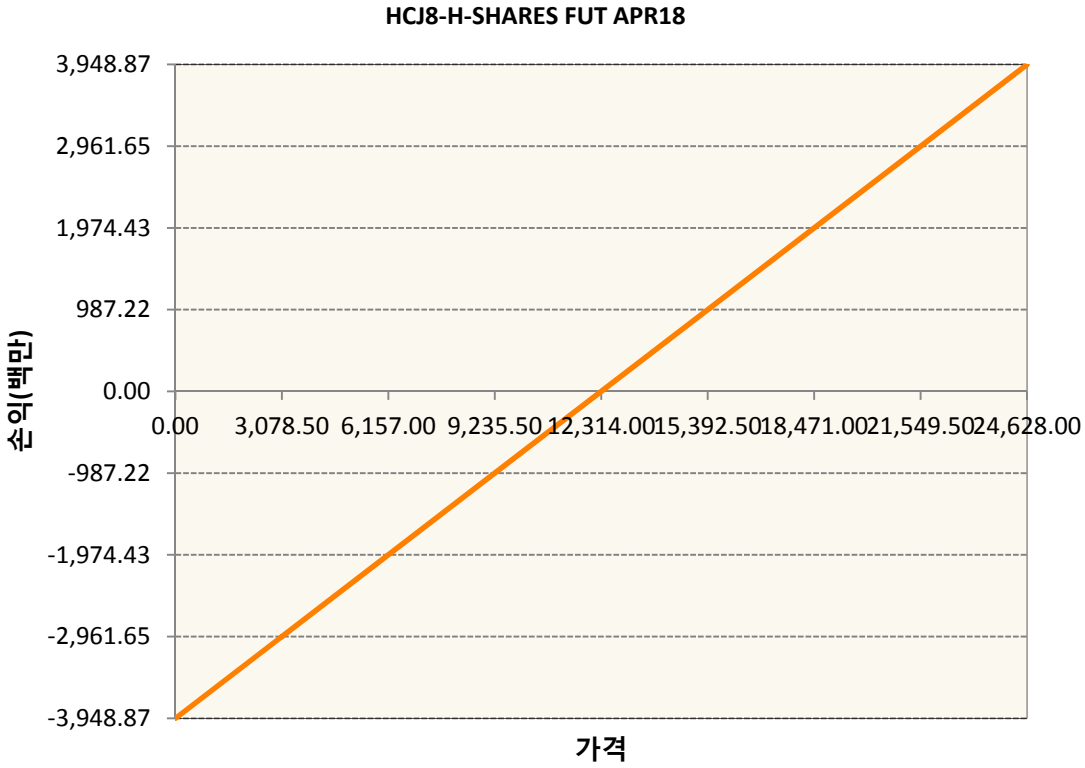
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

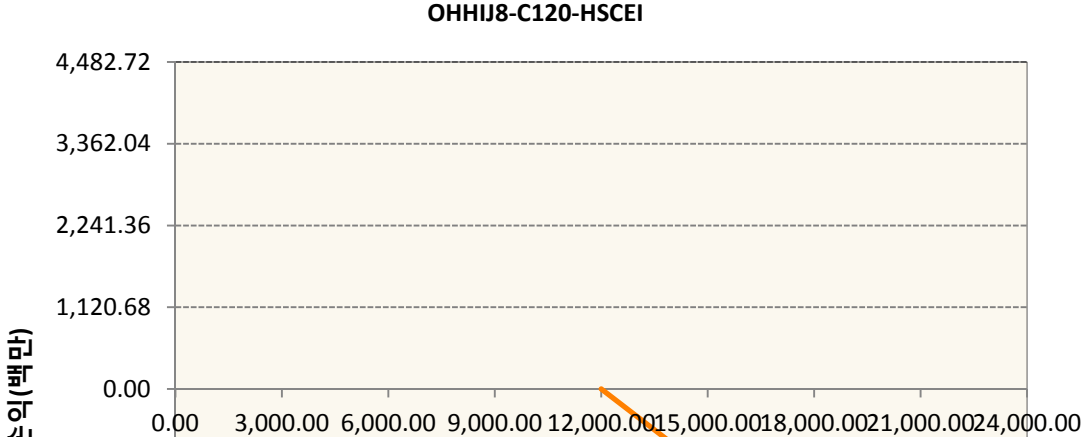
1. 계약금액

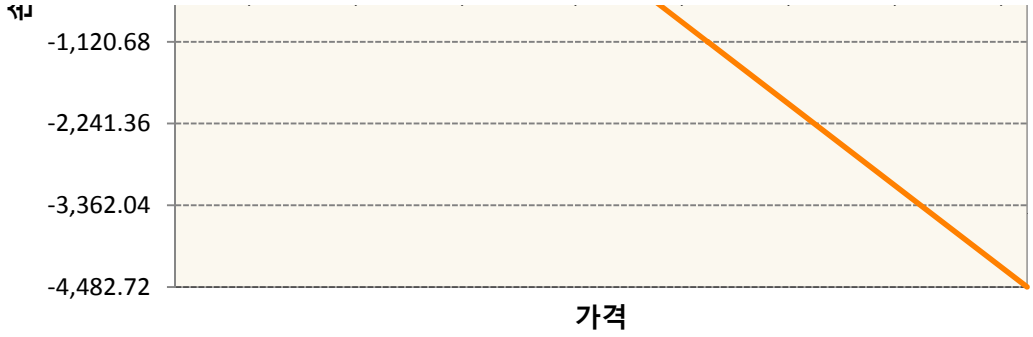
(단위:백만원)

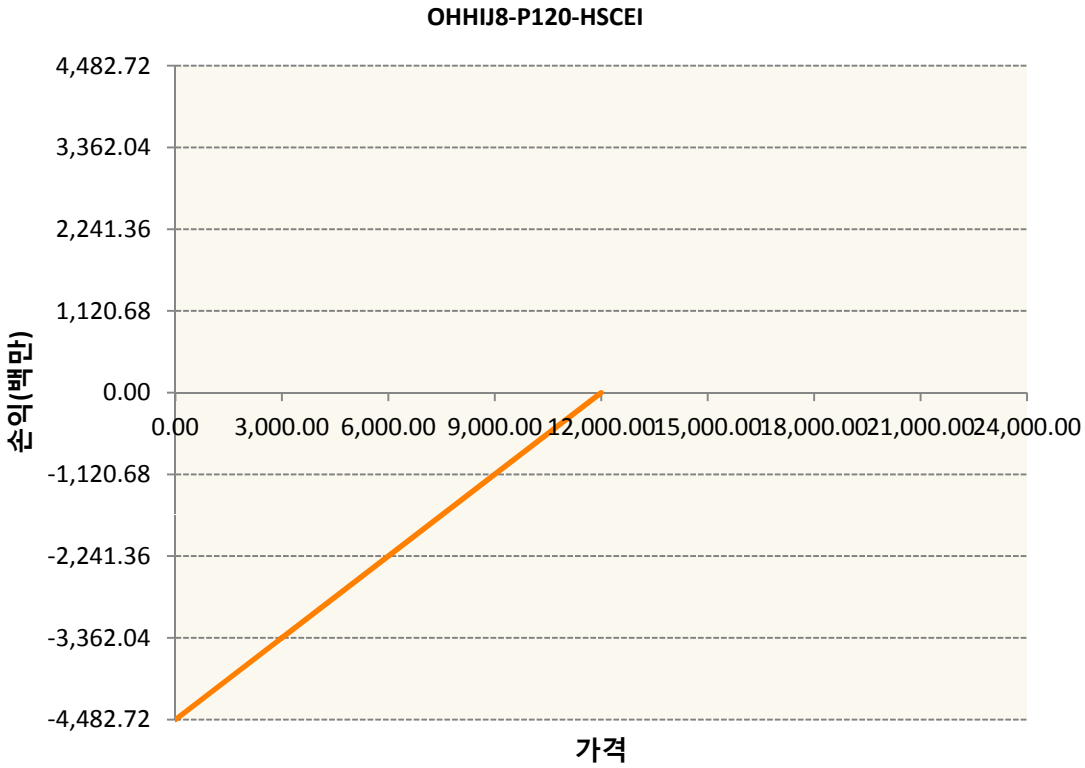
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,949	0	3,949	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,965	-8,965	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	316
OHHIJ8-C12	HSCEI	359
OHHIJ8-P12	HSCEI	359

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	909

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

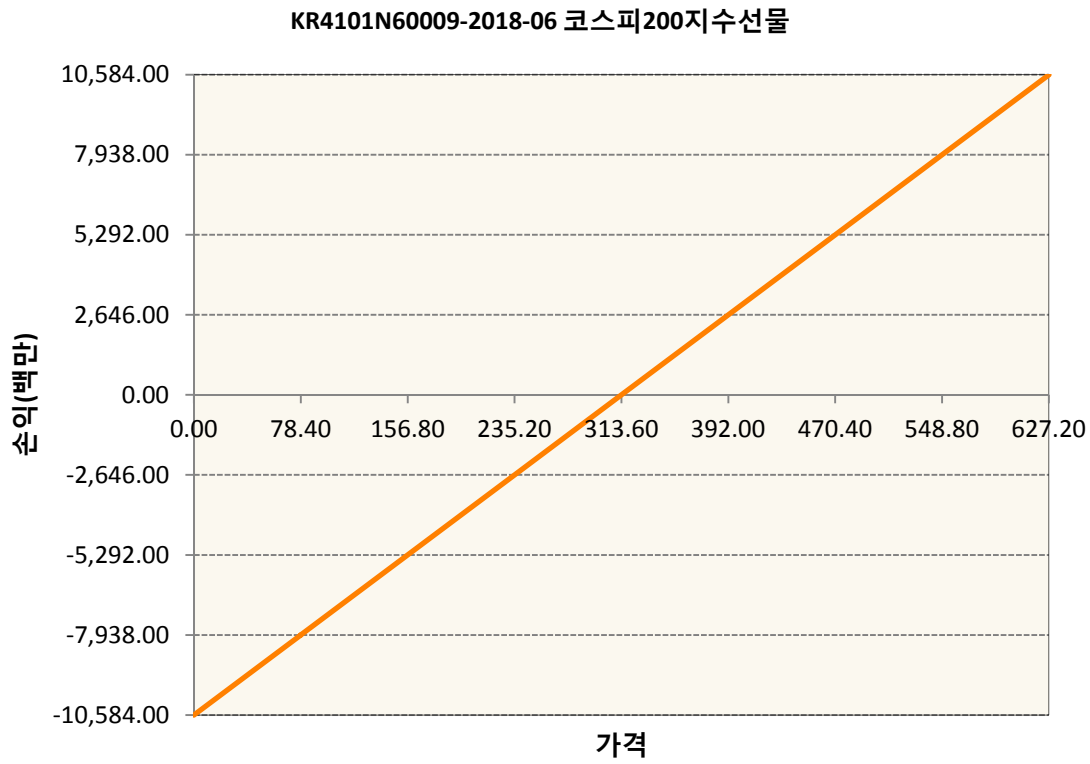
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

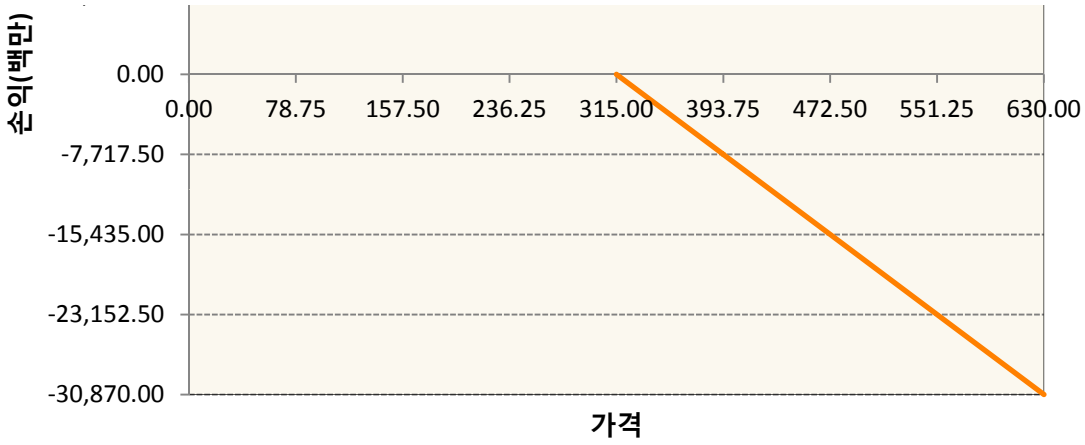
1. 계약금액

(단위:백만원)

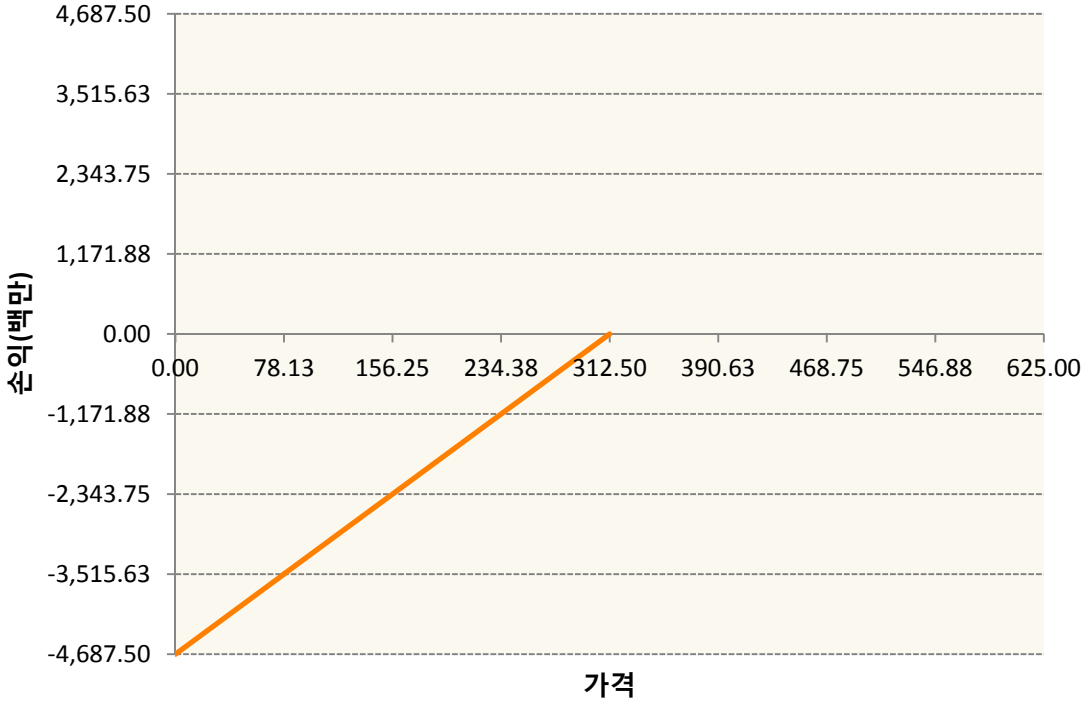
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,584	0	10,584	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,718	-55,718	장내

2. 만기시점의 손익구조

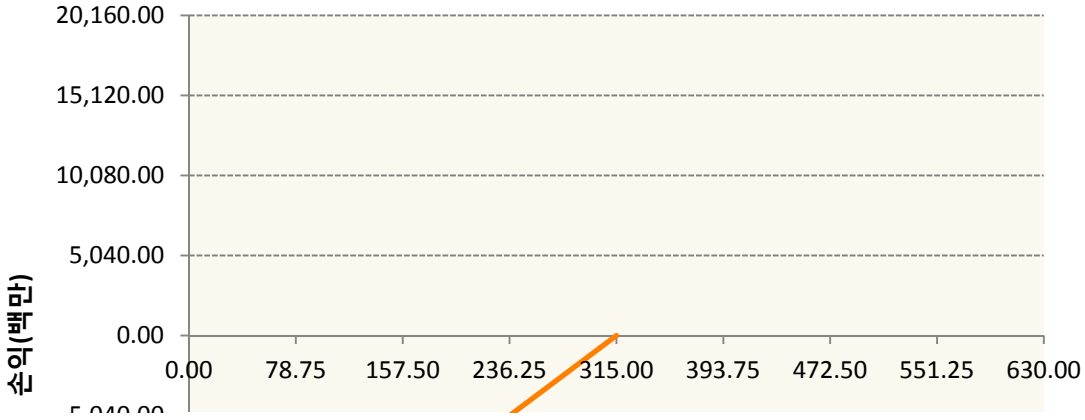




KR4301N43126-2018-04 풋312.5



KR4301N43159-2018-04 풋315



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,457
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457	-1,457
-5.33%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971
-2.67%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	486	486	486	486	486	486	486
5.33%	971	971	971	971	971	971	971
8.00%	1,457	1,457	1,457	1,457	1,457	1,457	1,457
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6							197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	252	252	252	252	252	252	252
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						466
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	311	311	311	311	311	311	311
8.00%	466	466	466	466	466	466	466
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						630
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630
-5.33%	-420	-420	-420	-420	-420	-420	-420
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	420	420	420	420	420	420	420
8.00%	630	630	630	630	630	630	630
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	473	473	473	473	473	473	473
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						845
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-845	-845	-845	-845	-845	-845	-845
-5.33%	-563	-563	-563	-563	-563	-563	-563
-2.67%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	282	282	282	282	282	282	282
5.33%	563	563	563	563	563	563	563
8.00%	845	845	845	845	845	845	845
	KR4201N431 2018-04 콜315						2,155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	97	97	97	97	97	97	97
-5.33%	97	97	97	97	97	97	97
-2.67%	97	96	96	95	94	92	90
0%	39	27	13	0	-14	-28	-42
2.67%	-524	-528	-532	-538	-545	-552	-560
5.33%	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,338	-1,338
8.00%	-2,155	-2,155	-2,155	-2,155	-2,155	-2,155	-2,155
	KR4301N431 2018-04 풋312.5						356
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-356	-356	-356	-356	-356	-356	-356
-5.33%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231
-2.67%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	13	13	13	13	13	12	12
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	13	13	13	13	13	13	13
	KR4301N431 2018-04 풋315						1,582

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582
-5.33%	-1,047	-1,047	-1,047	-1,047	-1,047	-1,047	-1,047
-2.67%	-513	-513	-513	-513	-513	-513	-513
0%	11	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	152	152	152	152	151	151	150
5.33%	152	152	152	152	152	152	152
8.00%	152	152	152	152	152	152	152

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

10,828

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

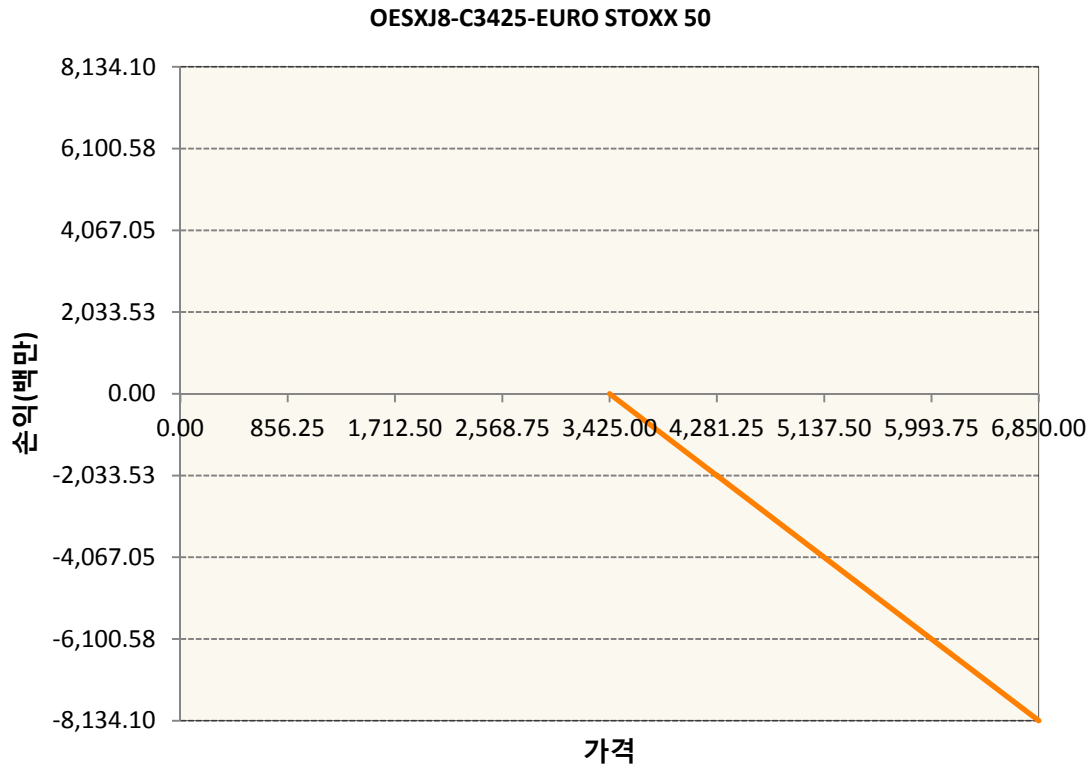
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

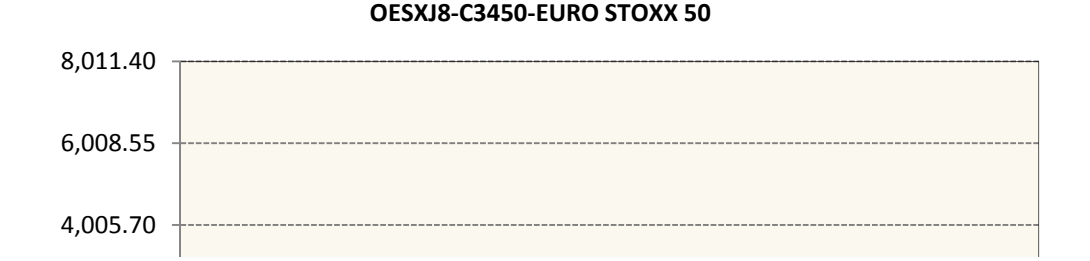
1. 계약금액

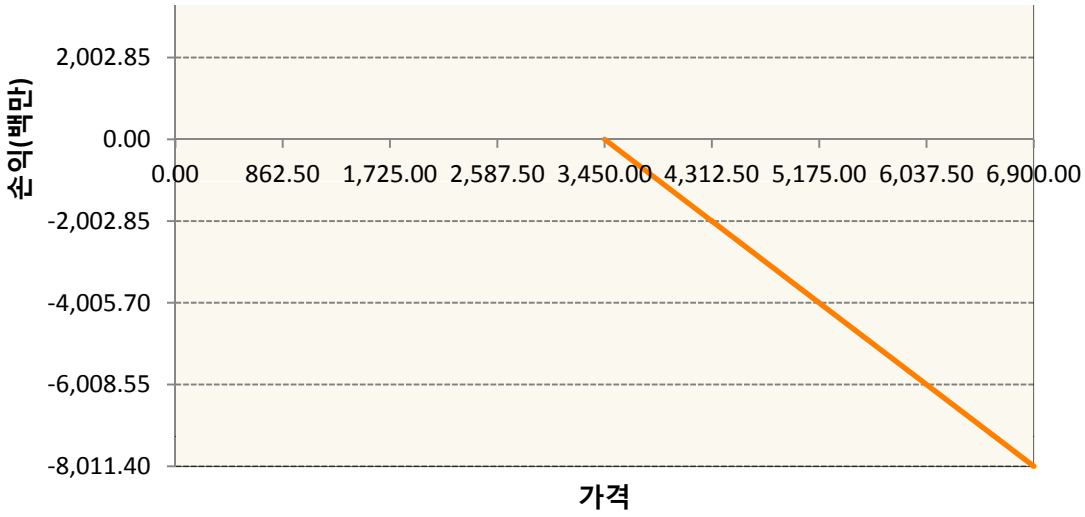
(단위:백만원)

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	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,578	0	7,578	
누계	유가증권	스왑	76,209	0	76,209	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,291	-32,291	장내
누계	지수	스왑	52,776	0	52,776	장외

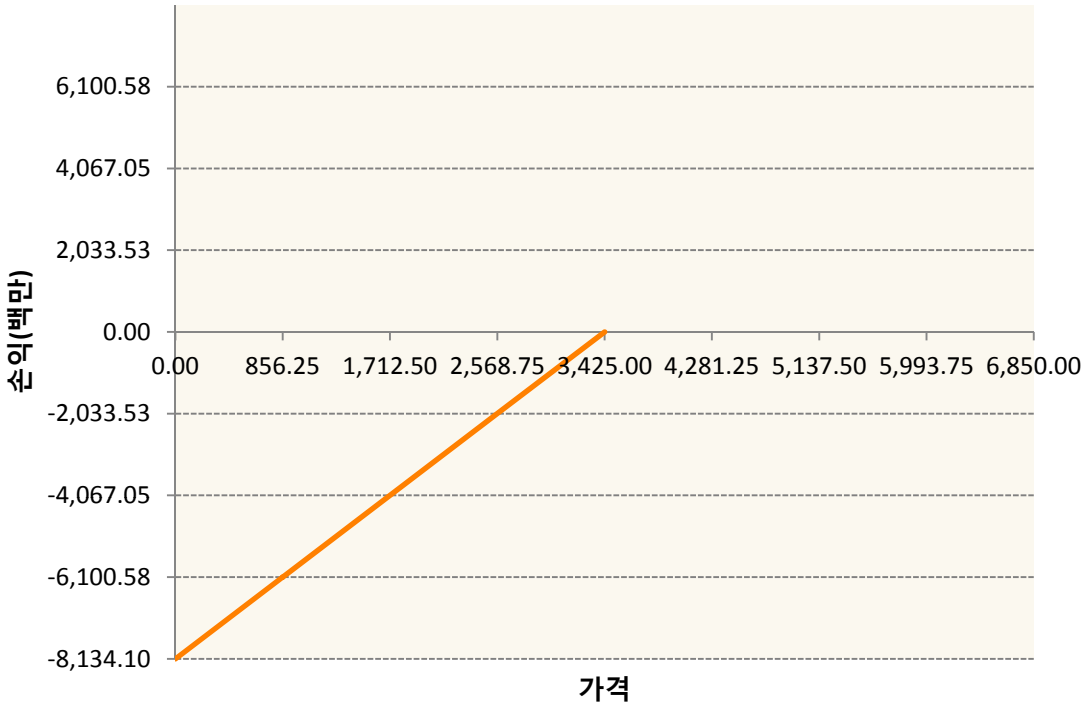
2. 만기시점의 손익구조



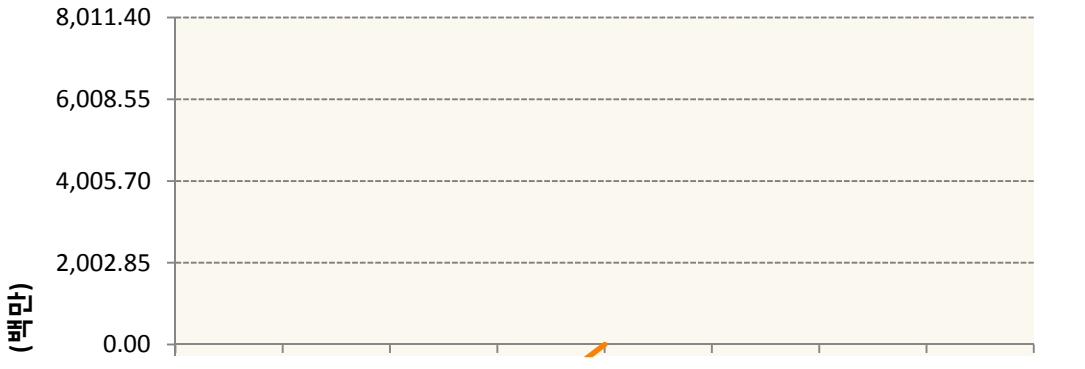


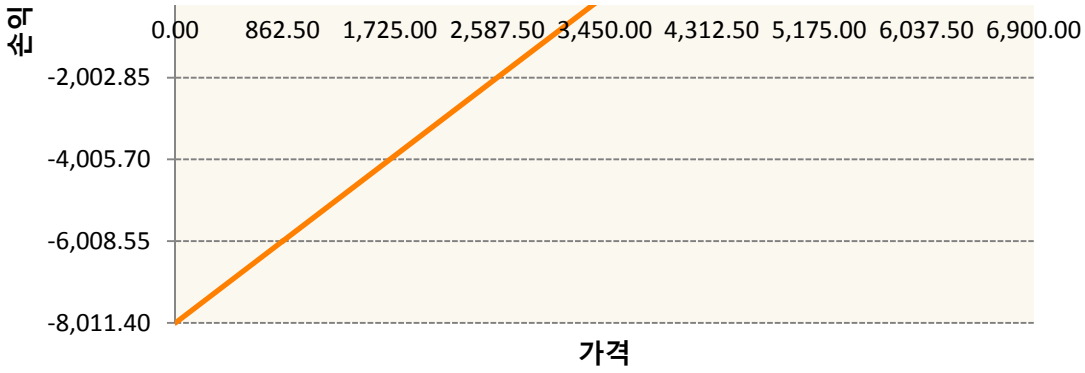


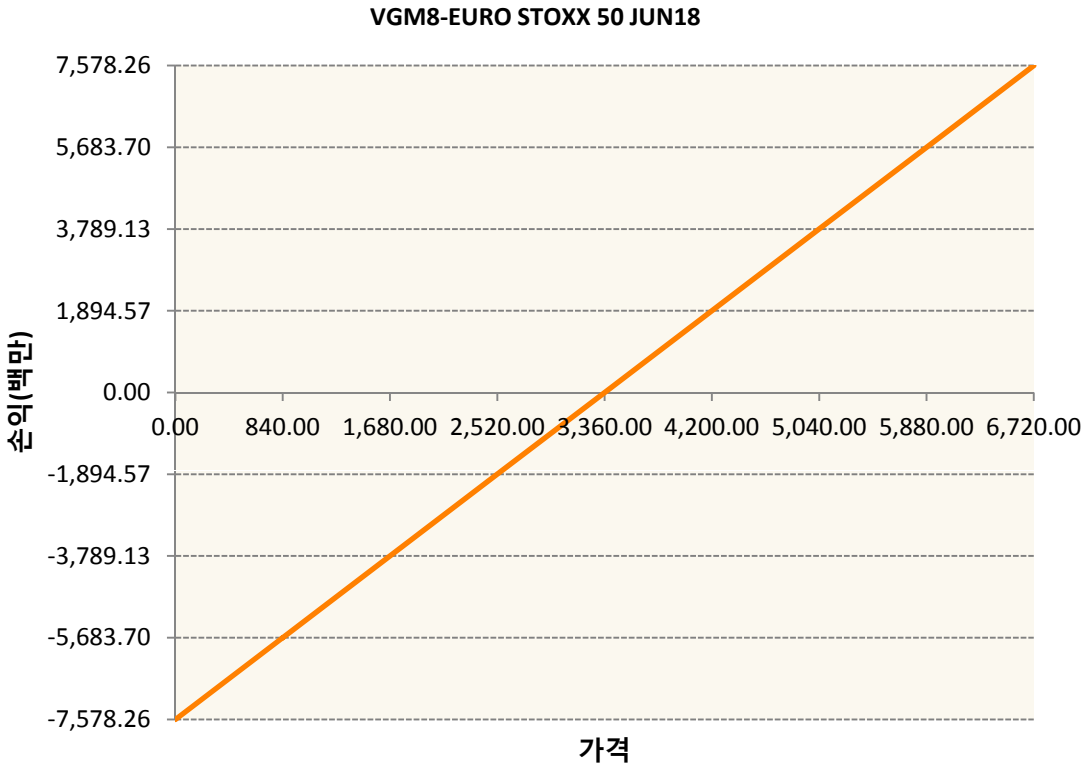
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	141
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	204
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	651
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	641
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	651
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	641
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	606

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

2,212

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

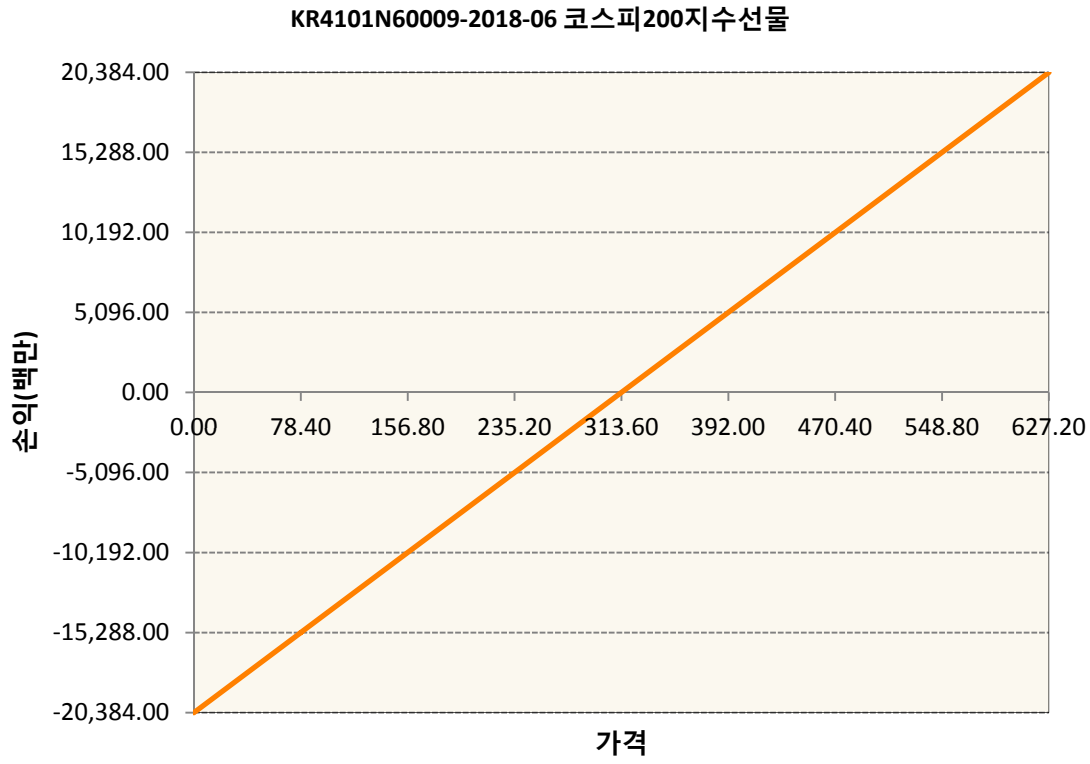
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,384	0	20,384	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627
-5.33%	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085
-2.67%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	542	542	542	542	542	542	542
5.33%	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085
8.00%	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627

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

1,189

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

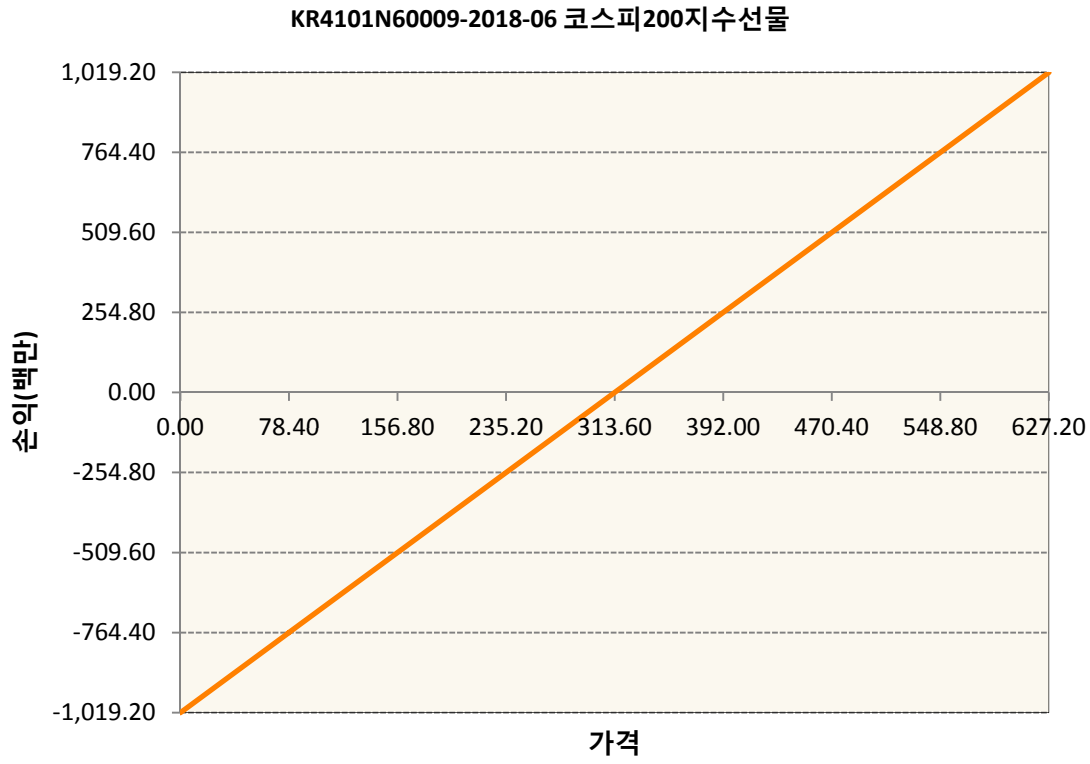
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,019	0	1,019	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							81
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	81	81	81	81	81	81	81

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

59

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

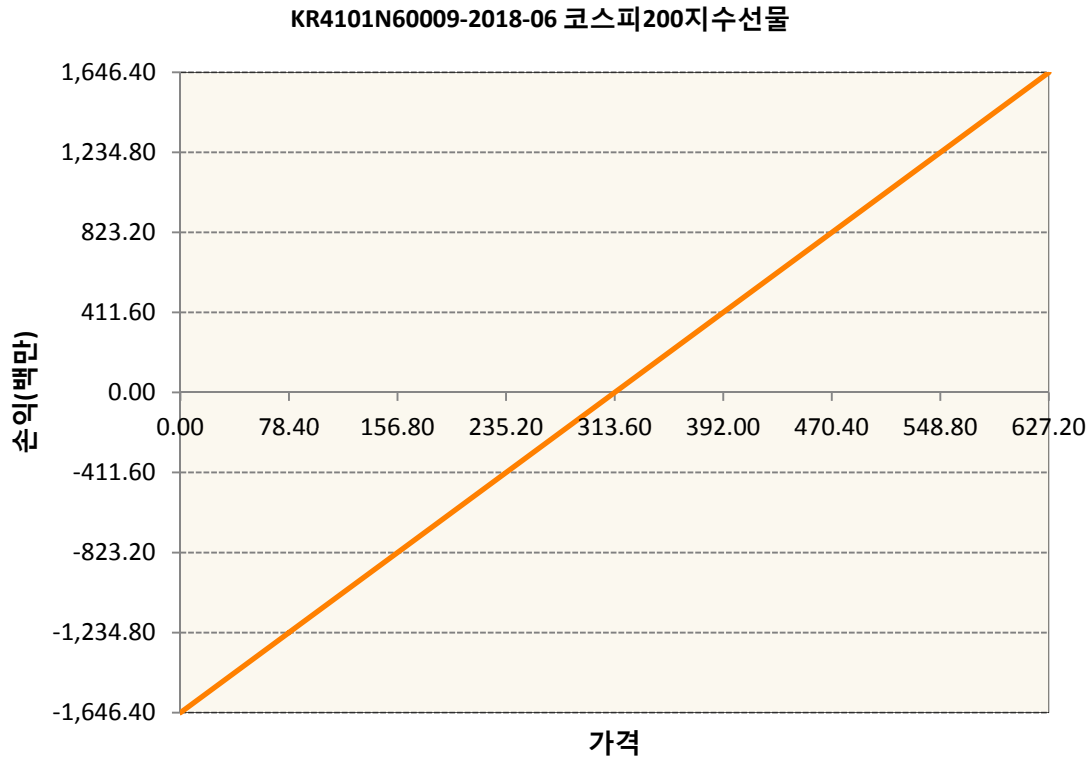
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,646	0	1,646	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							131
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	131	131	131	131	131	131	131

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

96

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

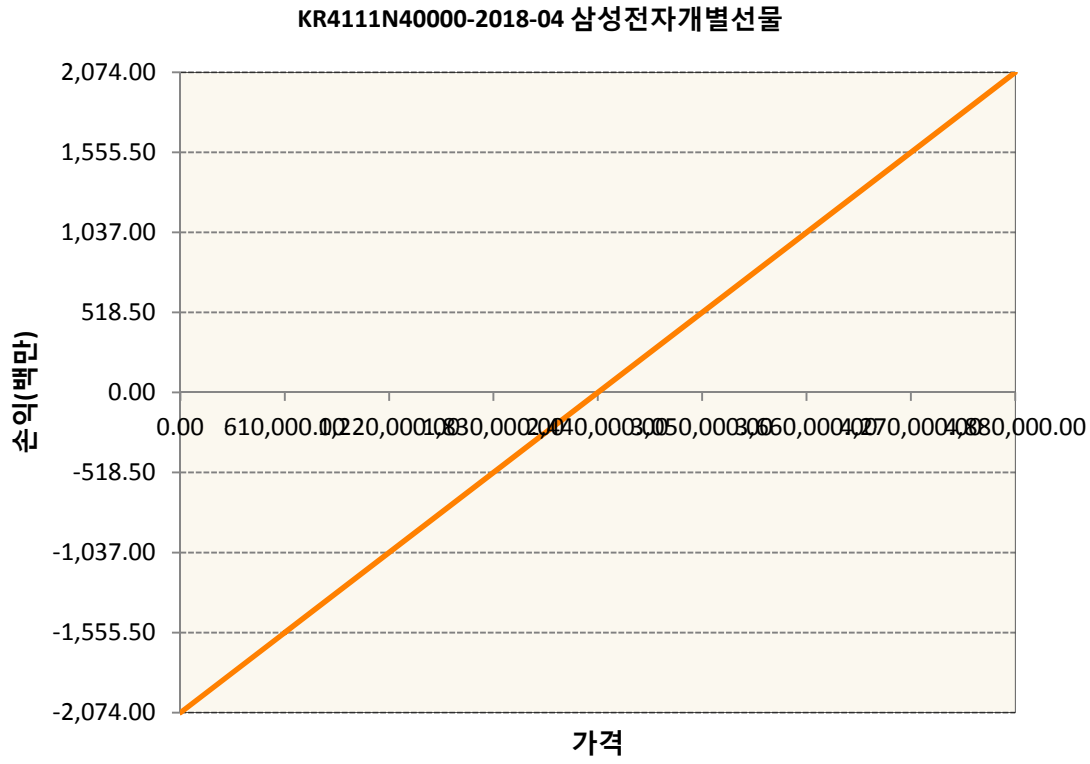
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,074	0	2,074	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N40(2018-04 삼성전자개별선물							166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-5.33%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-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%	111	111	111	111	111	111	111
8.00%	166	166	166	166	166	166	166

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

206

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

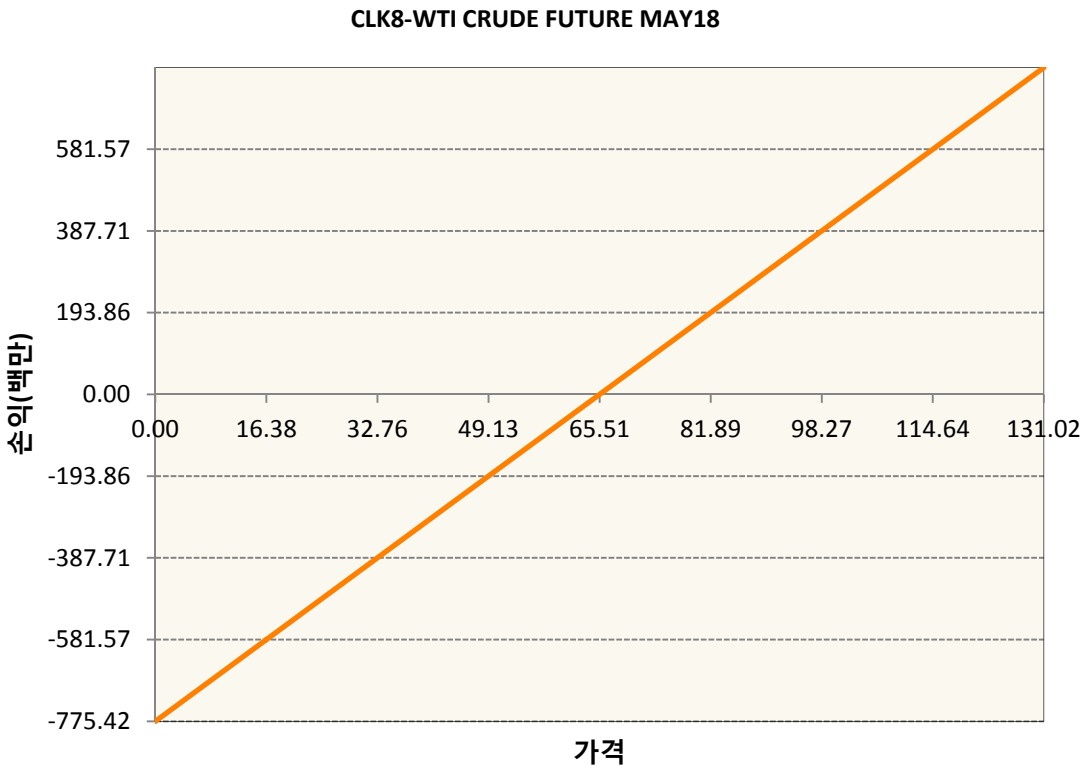
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

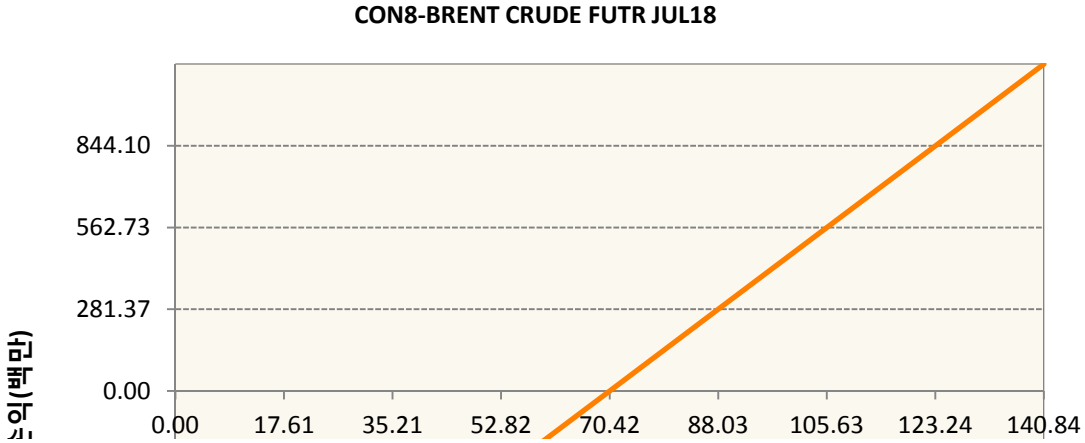
1. 계약금액

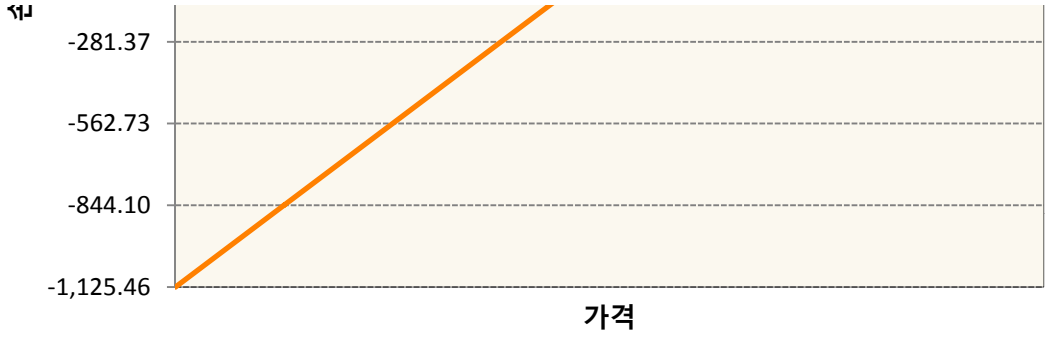
(단위:백만원)

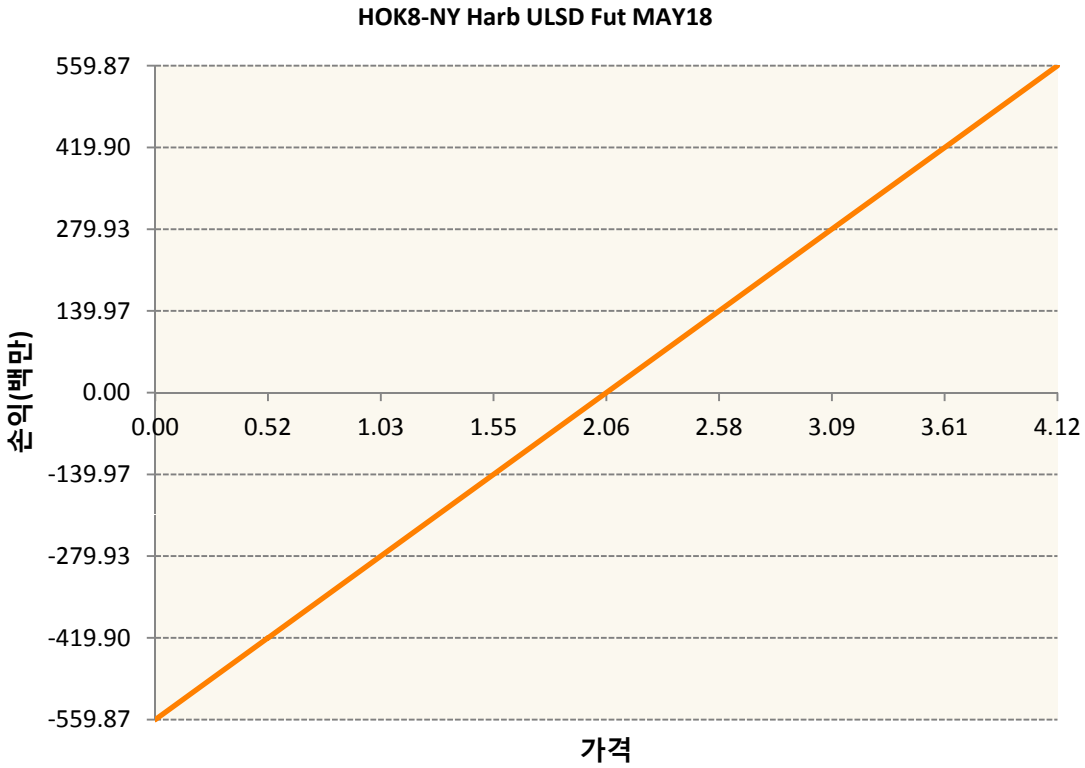
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	775	0	775	
누계	유가증권	선물	3,269	586	2,683	

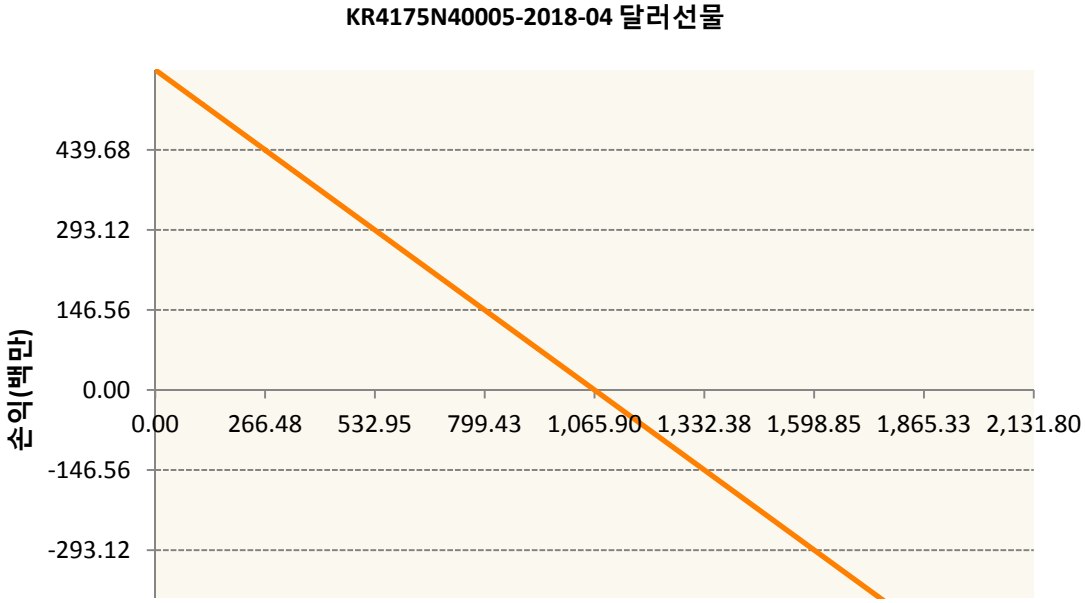
2. 만기시점의 손익구조

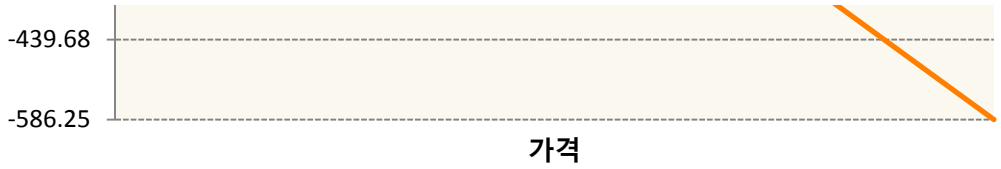


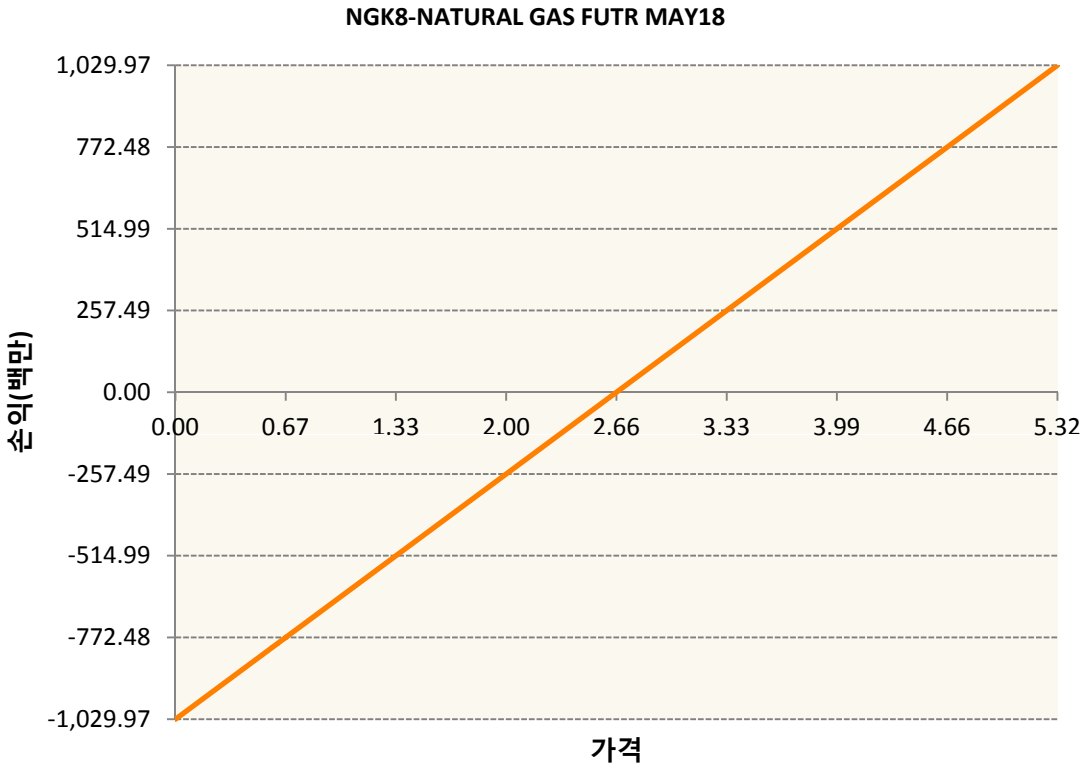


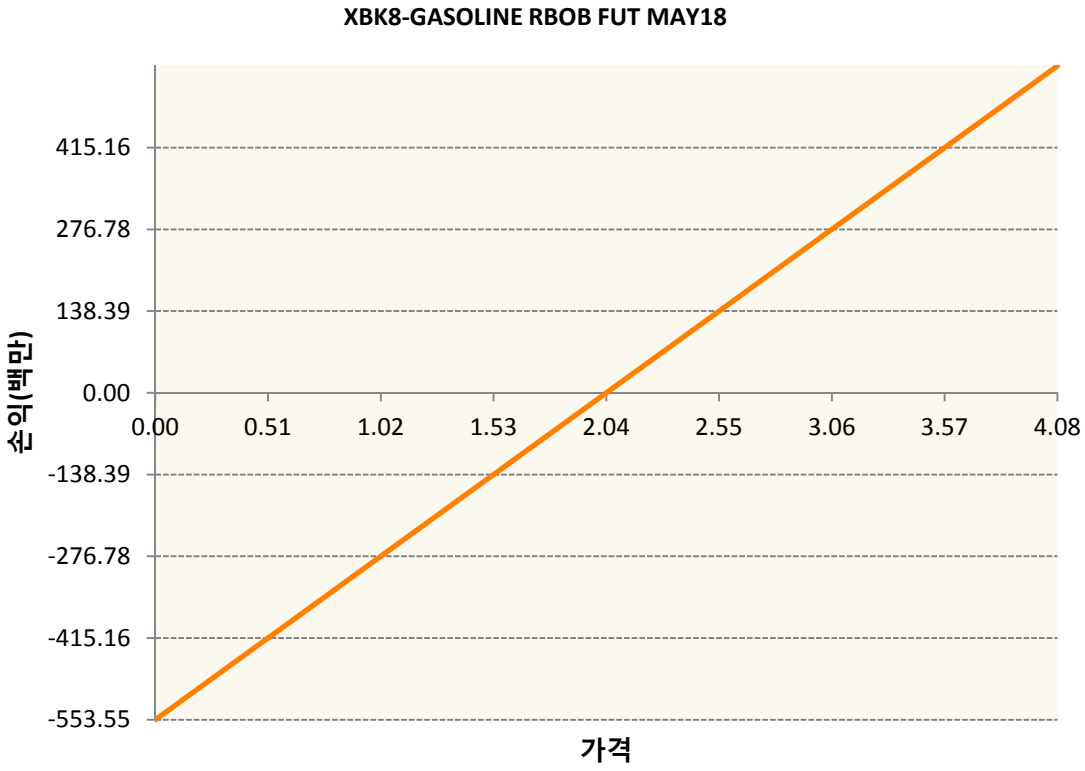

-281.37
-562.73
-844.10
-1,125.46
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
559.87
419.90
279.93
139.97
0.00
-139.97
-279.93
-419.90
-559.87
손익(백만)
0.00
0.52
1.03
1.55
2.06
2.58
3.09
3.61
4.12
가격


KR4175N40005-2018-04 달러선물
439.68
293.12
146.56
0.00
-146.56
-293.12
손익(백만)
0.00
266.48
532.95
799.43
1,065.90
1,332.38
1,598.85
1,865.33
2,131.80


-439.68
-586.25
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,029.97
772.48
514.99
257.49
0.00
-257.49
-514.99
-772.48
-1,029.97
0.00
0.67
1.33
2.00
2.66
3.33
3.99
4.66
5.32
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
415.16
276.78
138.39
0.00
-138.39
-276.78
-415.16
-553.55
0.00
0.51
1.02
1.53
2.04
2.55
3.06
3.57
4.08
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	62
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	90
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	45
KR4175N40(	2018-04 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	82
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	44

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

513

공시일	2018-04-12
기준일	2018-04-11

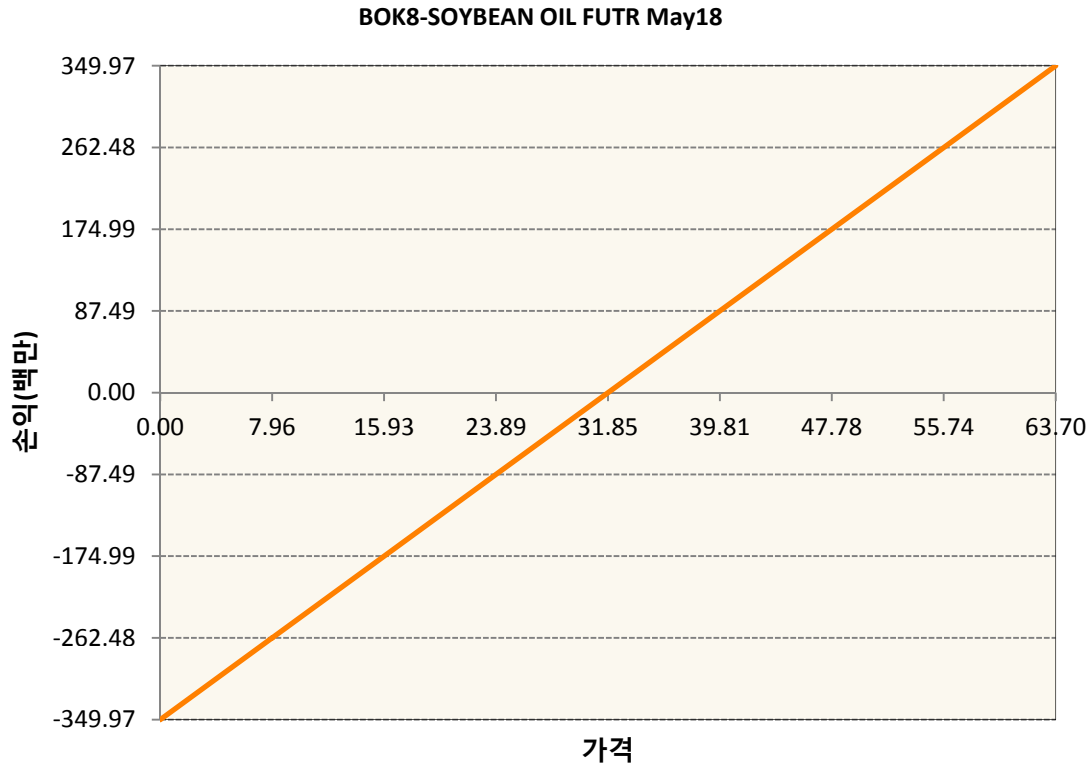
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

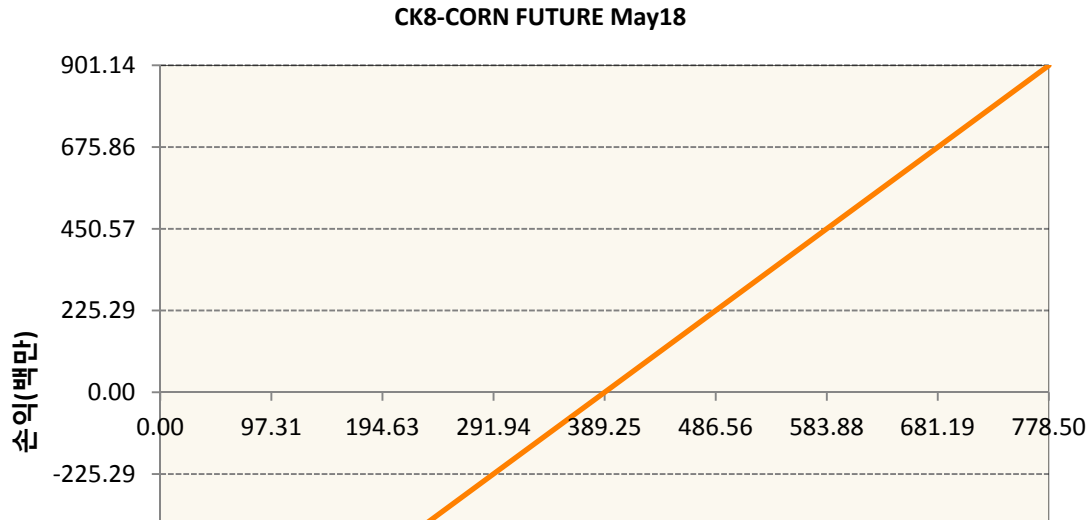
1. 계약금액

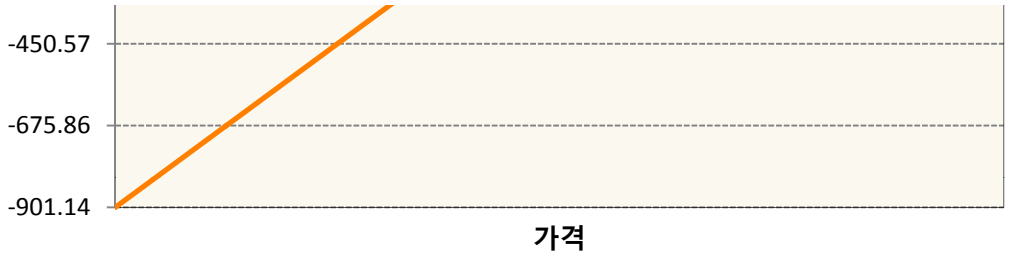
(단위:백만원)

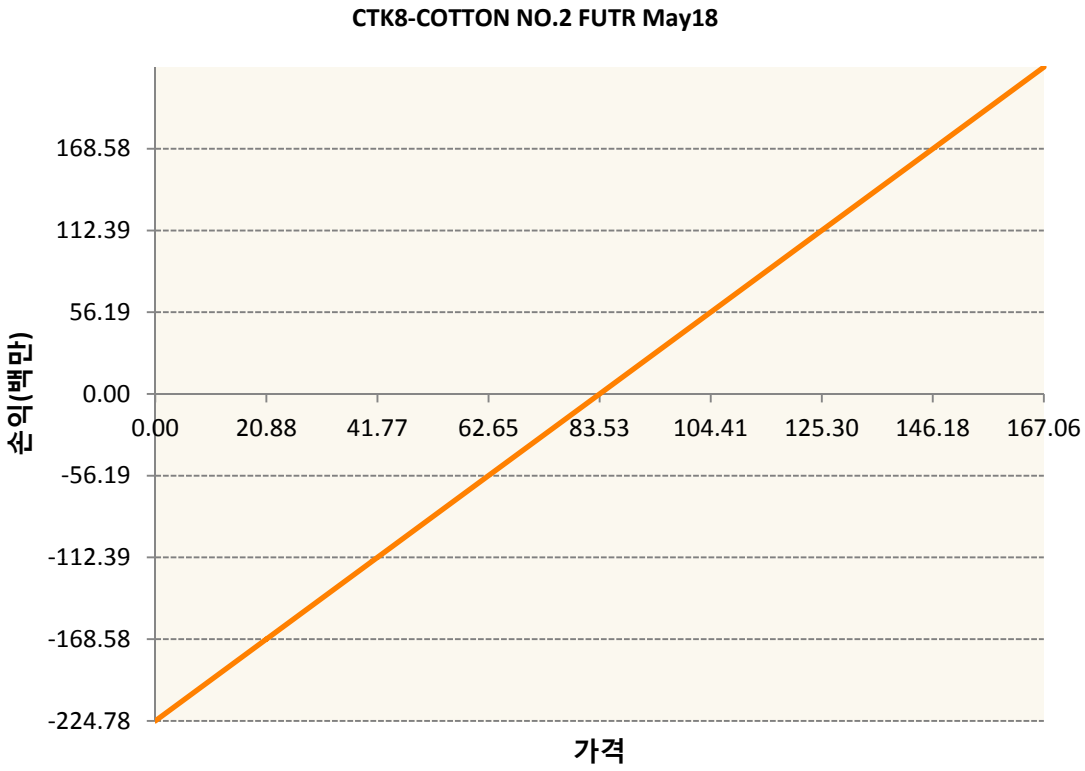
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,178	320	3,858	

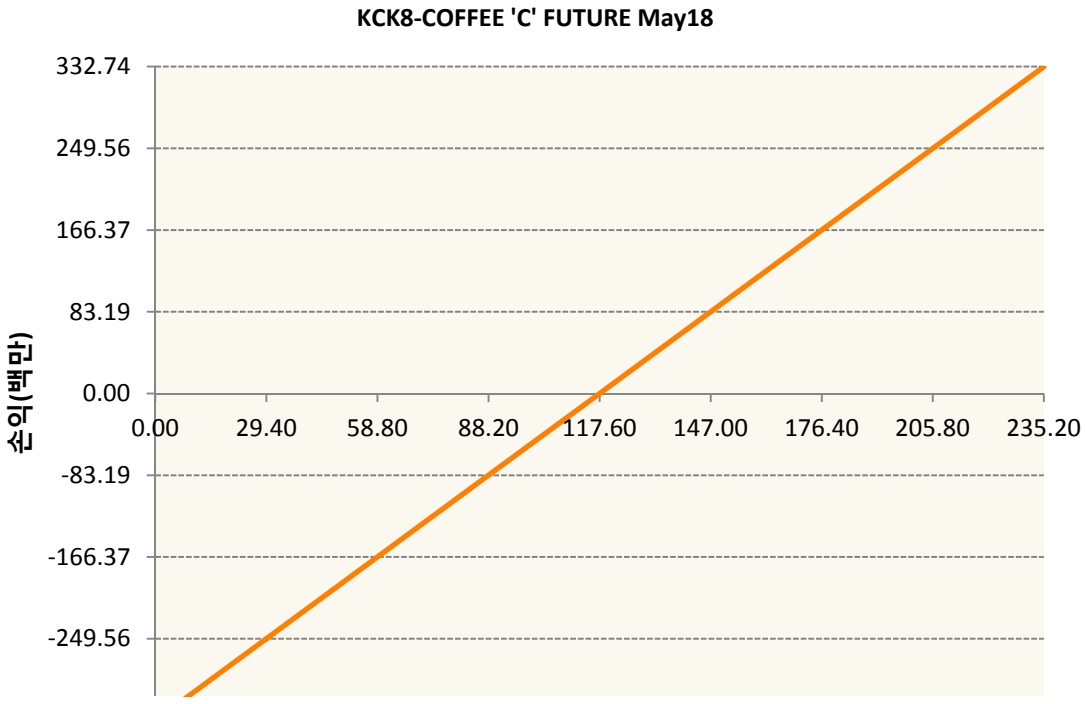
2. 만기시점의 손익구조

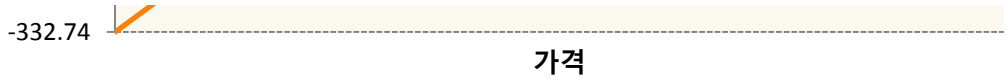


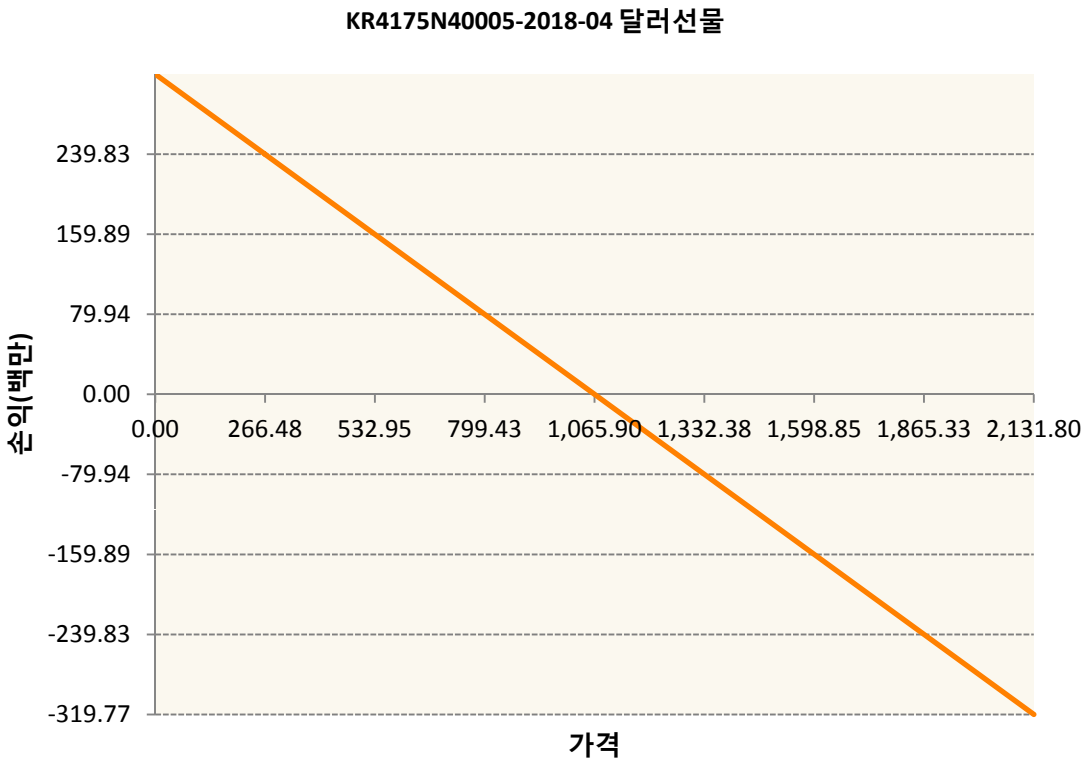


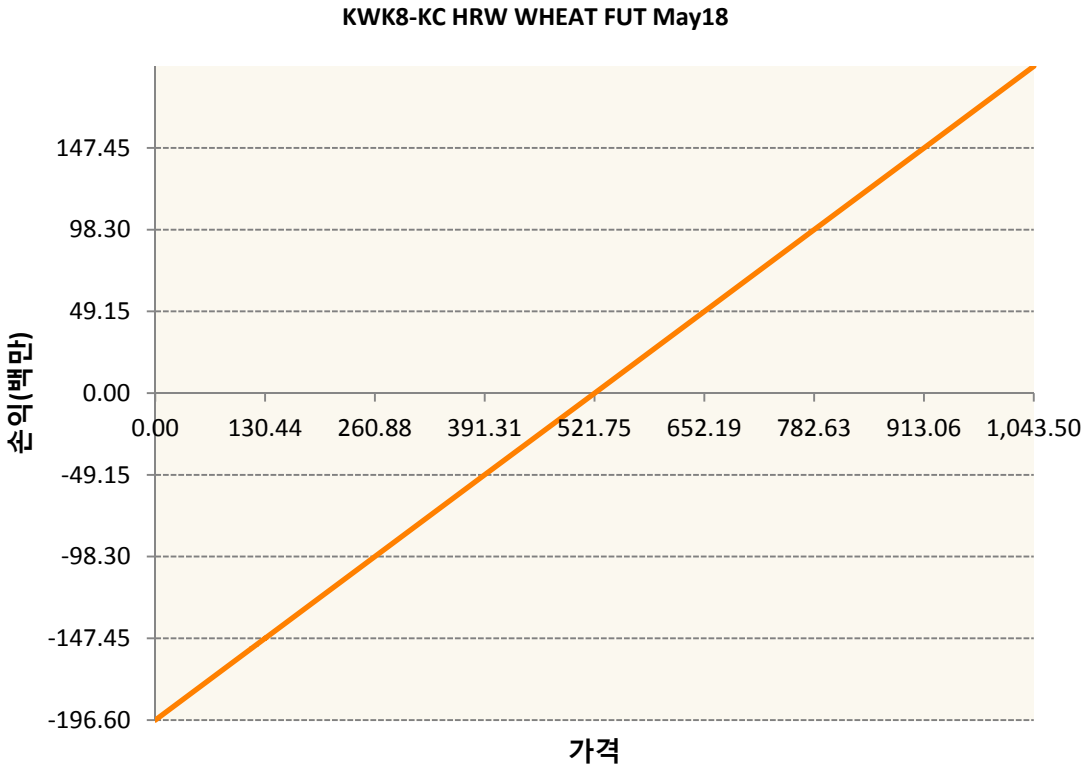

-450.57
-675.86
-901.14
가격

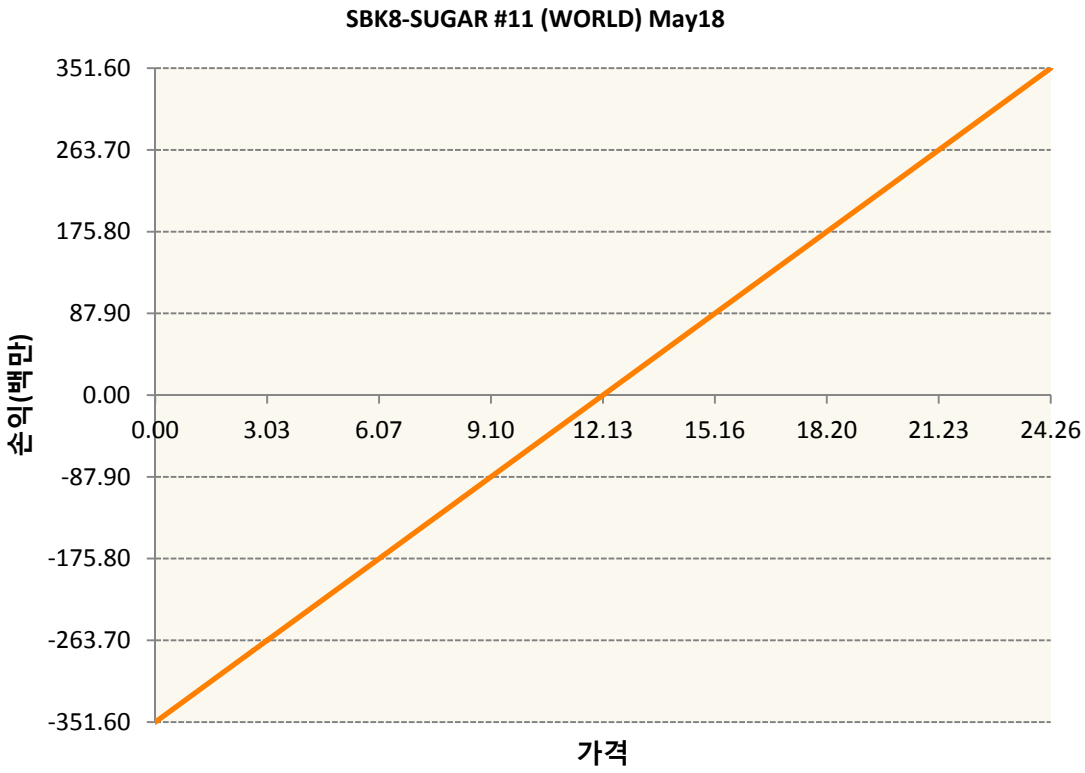

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
168.58
112.39
56.19
0.00
-56.19
-112.39
-168.58
-224.78
0.00
20.88
41.77
62.65
83.53
104.41
125.30
146.18
167.06
손익(백만)
가격

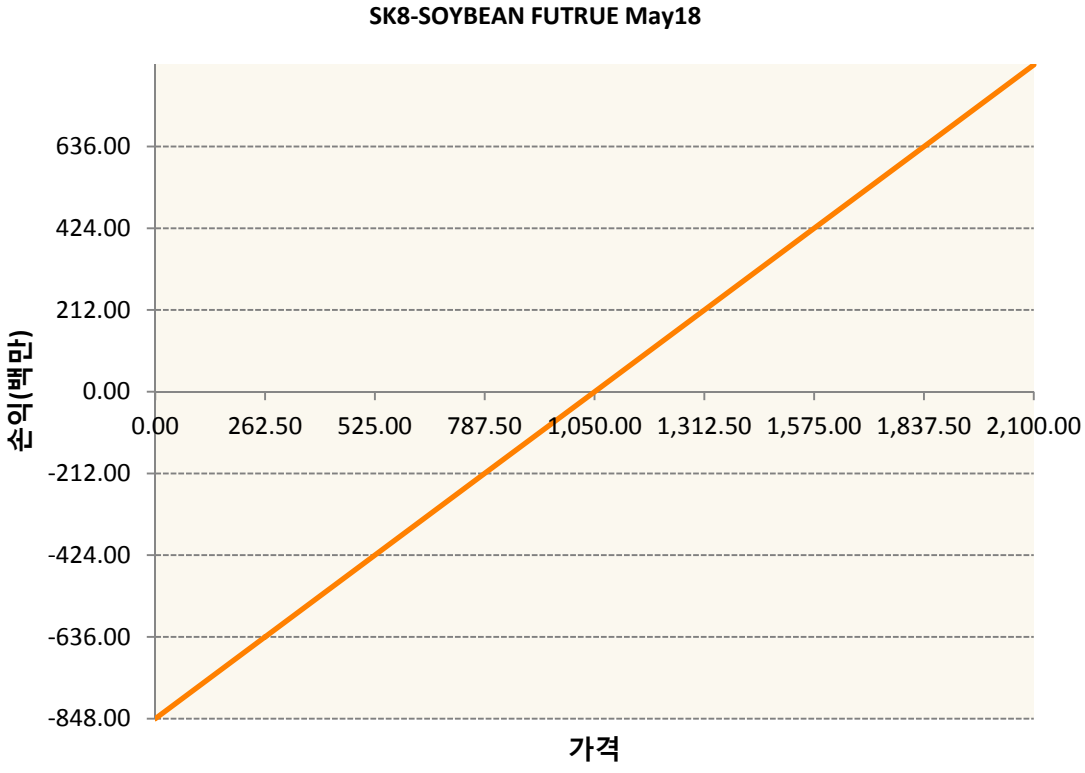

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
332.74
249.56
166.37
83.19
0.00
-83.19
-166.37
-249.56
0.00
29.40
58.80
88.20
117.60
147.00
176.40
205.80
235.20
손익(백만)


-332.74
가격

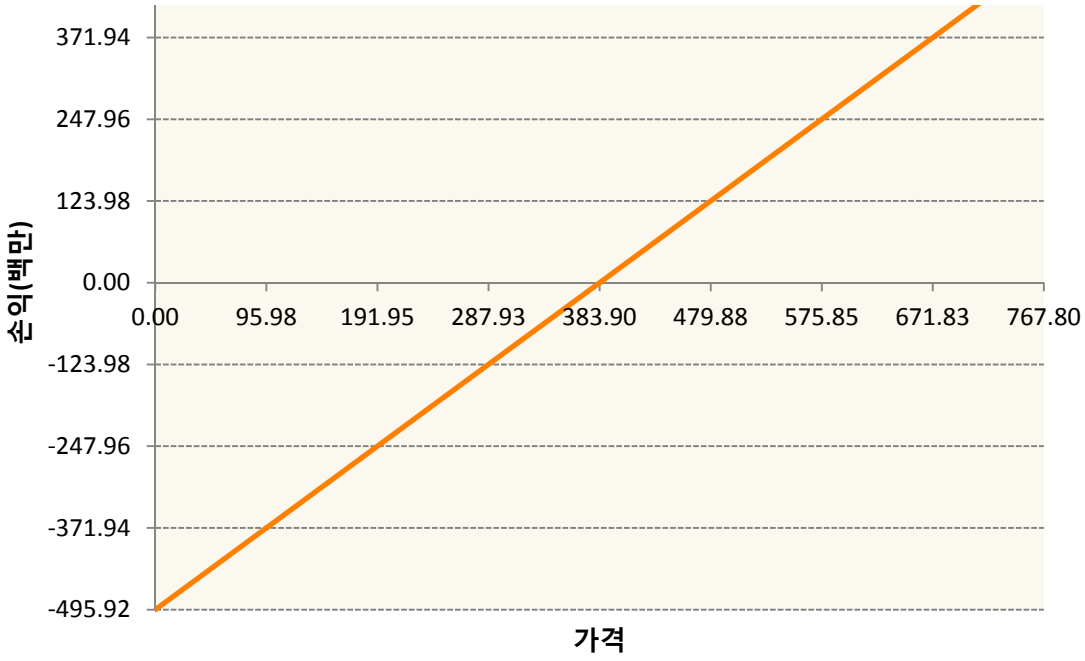

KR4175N40005-2018-04 달러선물
239.83
159.89
79.94
0.00
-79.94
-159.89
-239.83
-319.77
0.00
266.48
532.95
799.43
1,065.90
1,332.38
1,598.85
1,865.33
2,131.80
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
147.45
98.30
49.15
0.00
-49.15
-98.30
-147.45
-196.60
0.00
130.44
260.88
391.31
521.75
652.19
782.63
913.06
1,043.50
손익(백만)
가격

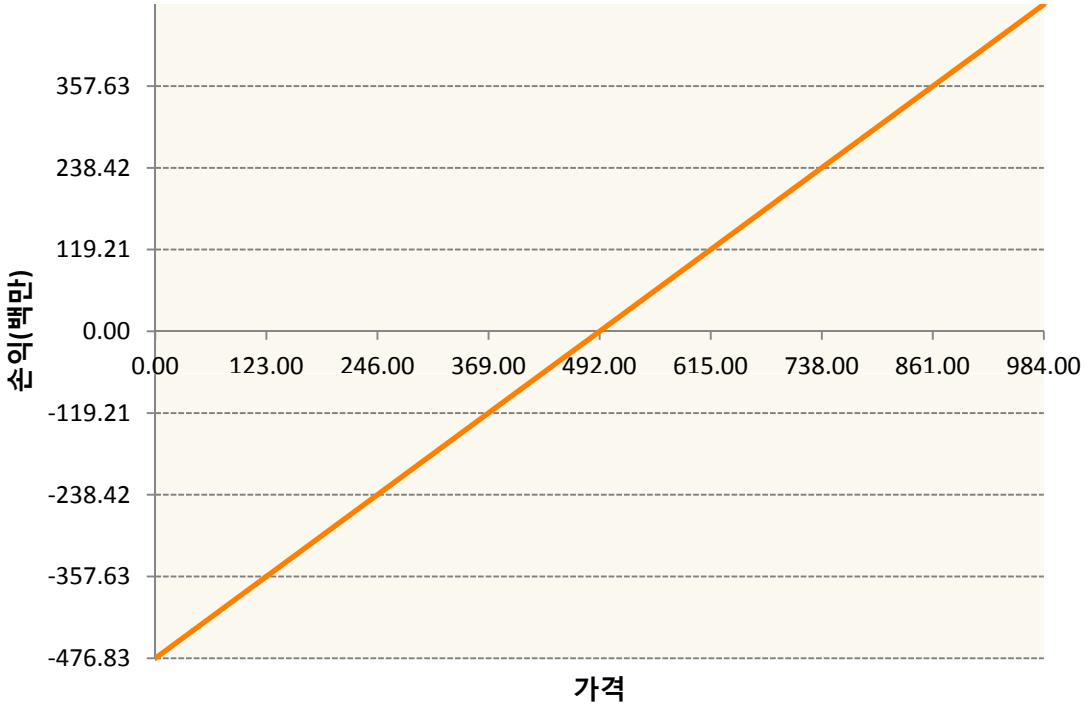

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
351.60
263.70
175.80
87.90
0.00
-87.90
-175.80
-263.70
-351.60
0.00
3.03
6.07
9.10
12.13
15.16
18.20
21.23
24.26
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
636.00
424.00
212.00
0.00
-212.00
-424.00
-636.00
-848.00
0.00
262.50
525.00
787.50
1,050.00
1,312.50
1,575.00
1,837.50
2,100.00
손익(백만)
가격

SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18



WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	72
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	27
KR4175N40(	2018-04 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	16
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	28
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	68
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	40
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	38

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

338