공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

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	2018-04-17
기준일	2018-04-16

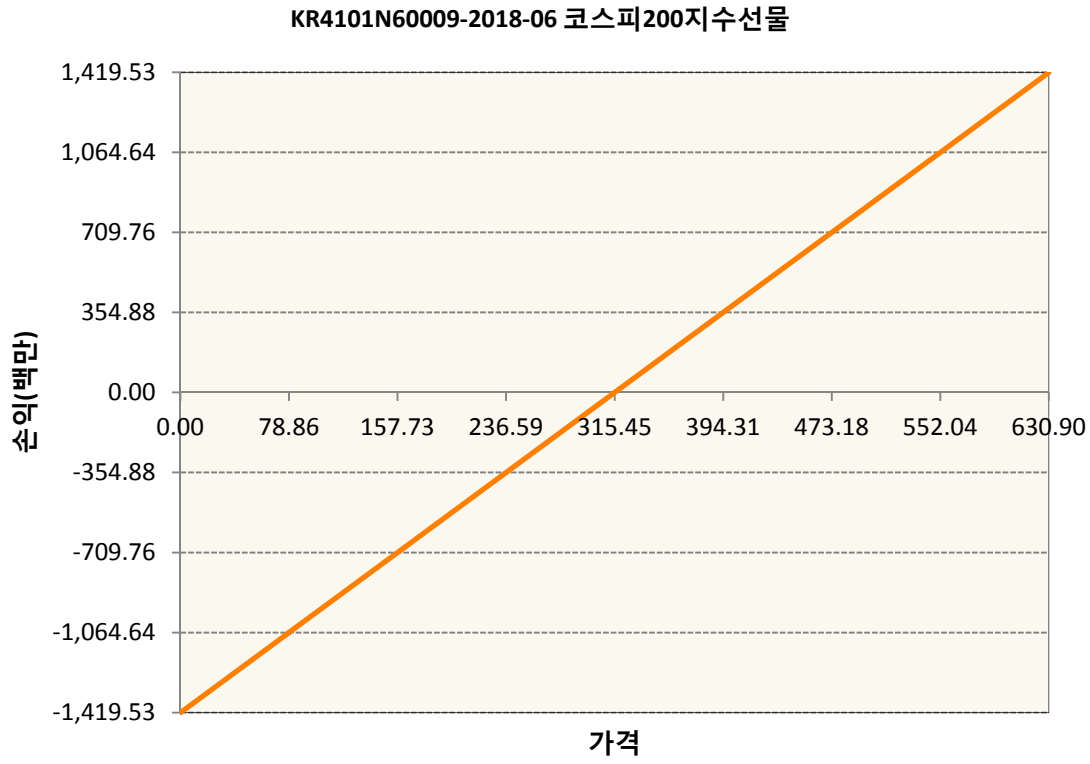
스마트인덱스모

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	1,420	0	1,420	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%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-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%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

83

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

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)

446

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

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	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

432

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

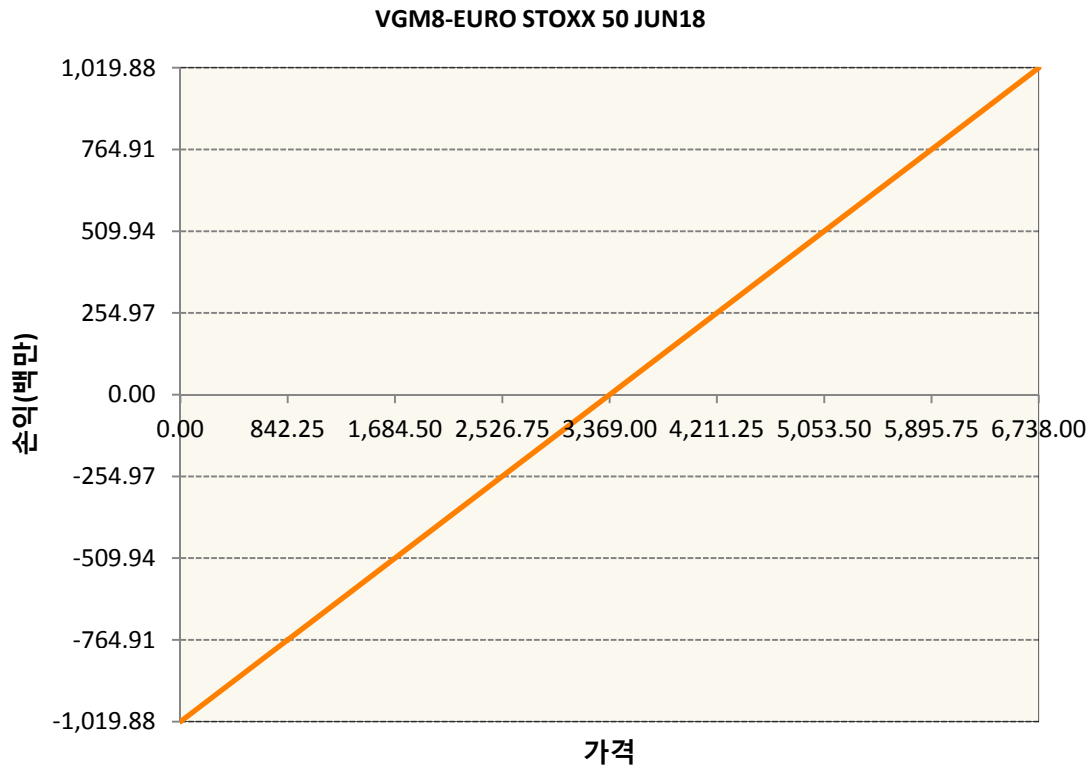
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,020	0	1,020	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	82

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

(단위:백만원)

50

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

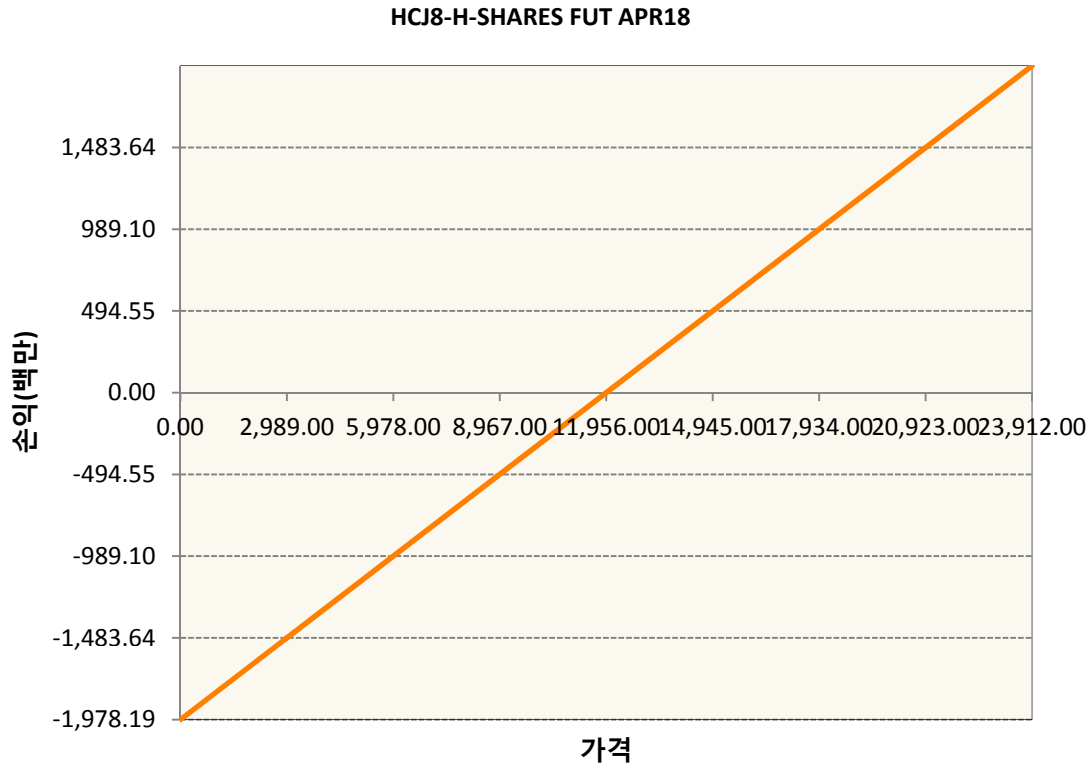
차이나인덱스모(주식-파생형)

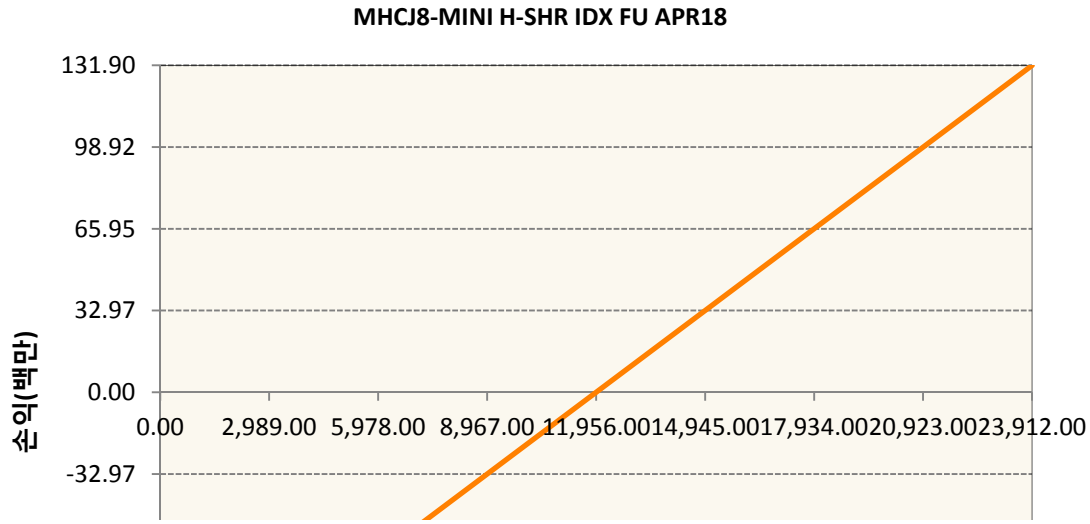
1. 계약금액

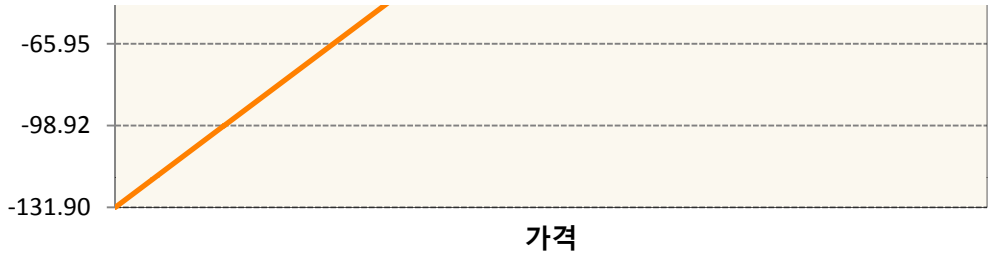
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,110	0	2,110	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	158
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	148

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

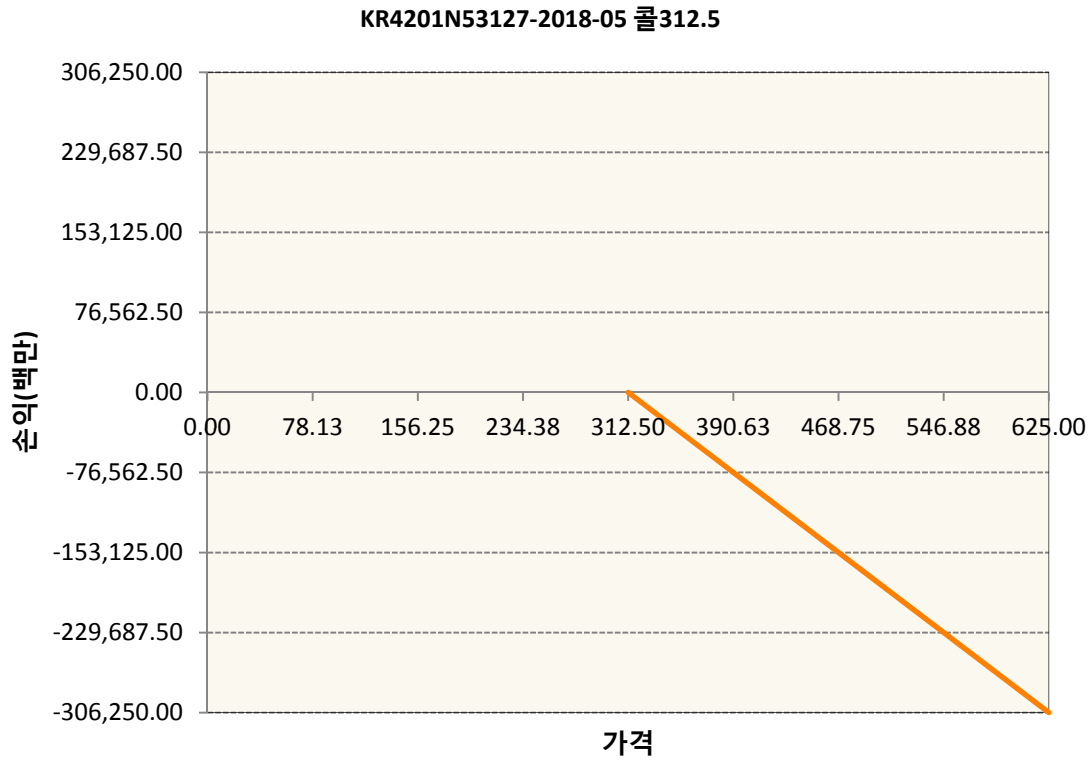
커버드콜모(주식혼합-파생형)

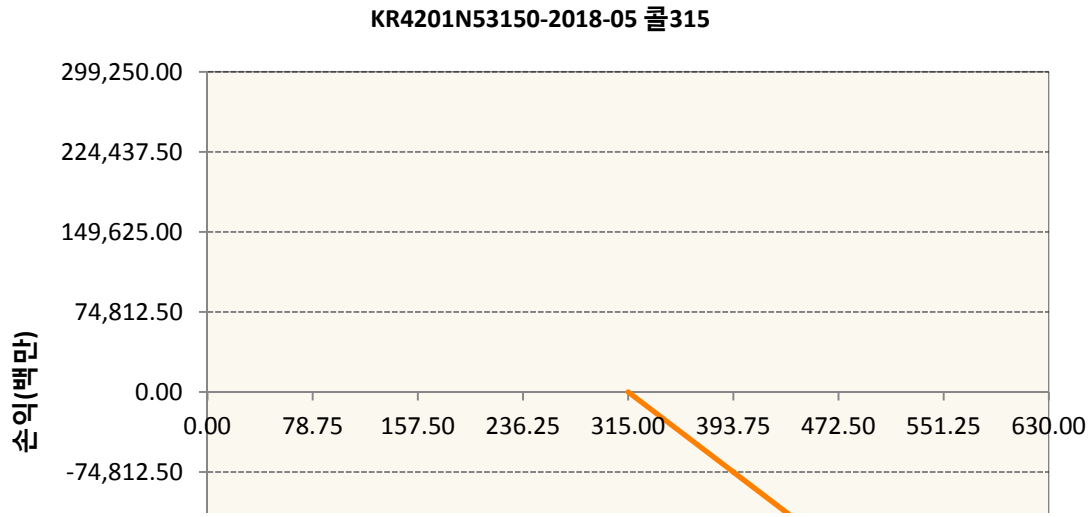
1. 계약금액

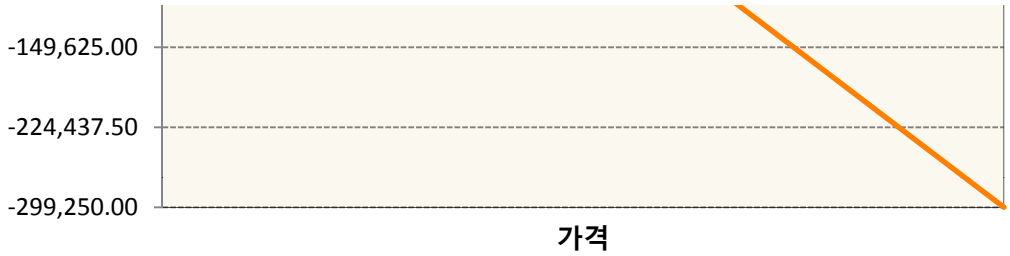
(단위:백만원)

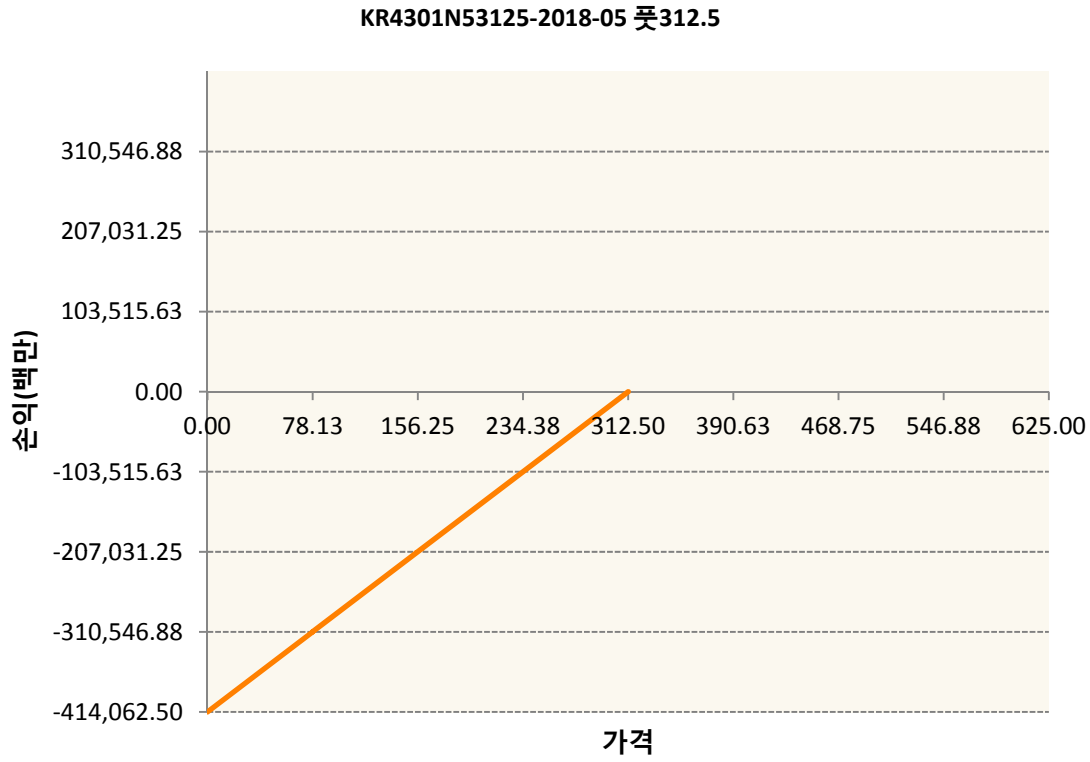
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,019,563	-1,019,563	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5							19,760
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,560	9,268	8,926	8,541	8,119	7,666	7,185
-5.33%	8,421	7,913	7,373	6,808	6,223	5,622	5,007
-2.67%	6,076	5,394	4,705	4,011	3,313	2,613	1,910
0%	2,166	1,446	723	0	-724	-1,449	-2,174
2.67%	-3,318	-3,928	-4,560	-5,208	-5,870	-6,541	-7,222
5.33%	-10,055	-10,476	-10,944	-11,449	-11,986	-12,549	-13,133
8.00%	-17,593	-17,834	-18,130	-18,477	-18,867	-19,297	-19,760
KR4201N5312018-05 콜315							18,453
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,214	7,980	7,697	7,369	7,002	6,602	6,172

-5.33%	7,348	6,912	6,437	5,932	5,403	4,853	4,286
-2.67%	5,455	4,827	4,187	3,537	2,879	2,216	1,548
0%	2,129	1,419	710	0	-710	-1,419	-2,128
2.67%	-2,748	-3,390	-4,045	-4,710	-5,383	-6,062	-6,747
5.33%	-8,949	-9,421	-9,932	-10,473	-11,040	-11,628	-12,232
8.00%	-16,056	-16,343	-16,684	-17,072	-17,499	-17,961	-18,453
KR4301N5312018-05 풋312.5							25,836

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,500	-25,515	-25,542	-25,585	-25,648	-25,731	-25,836
-5.33%	-14,554	-14,680	-14,840	-15,033	-15,254	-15,502	-15,772
-2.67%	-4,845	-5,238	-5,647	-6,067	-6,497	-6,935	-7,378
0%	1,421	951	477	0	-479	-961	-1,443
2.67%	3,783	3,551	3,285	2,989	2,669	2,327	1,968
5.33%	4,242	4,191	4,115	4,010	3,876	3,714	3,526
8.00%	4,286	4,281	4,269	4,247	4,210	4,158	4,086

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

64,242

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

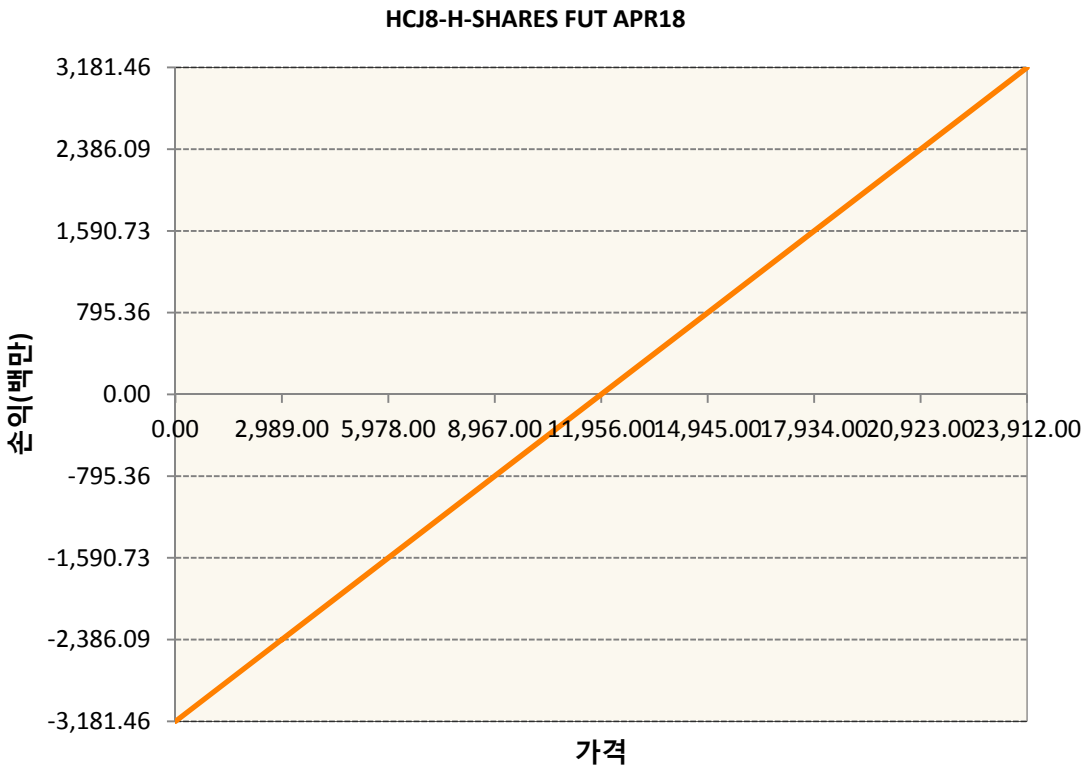
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

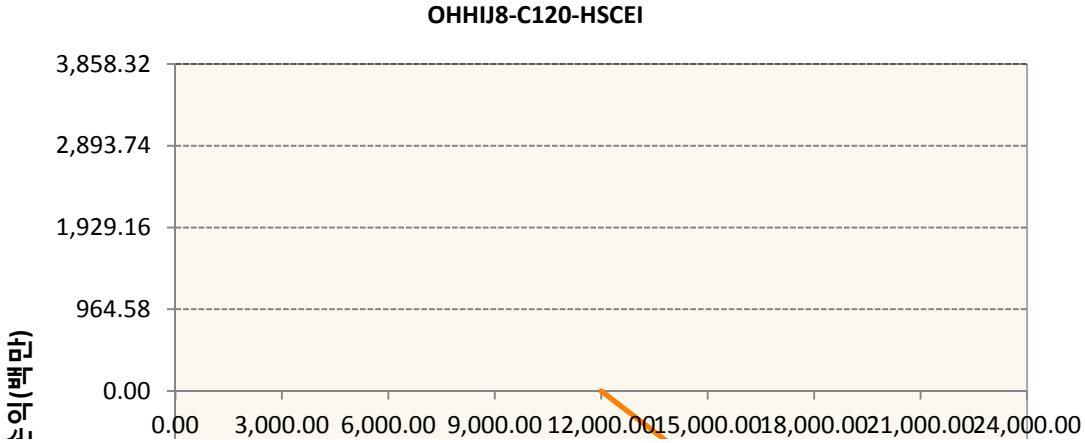
1. 계약금액

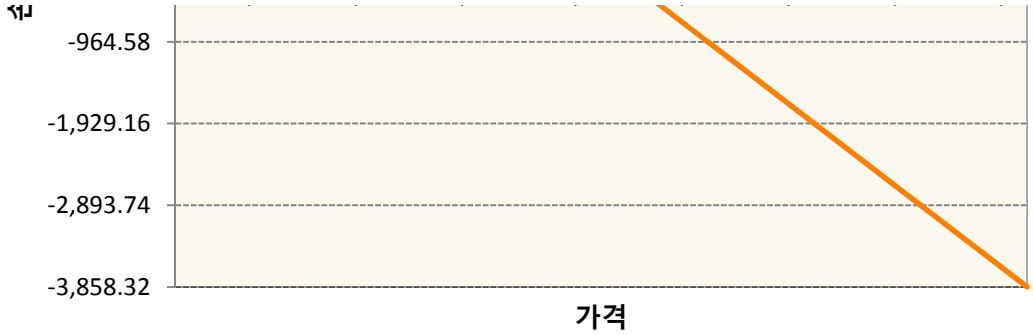
(단위:백만원)

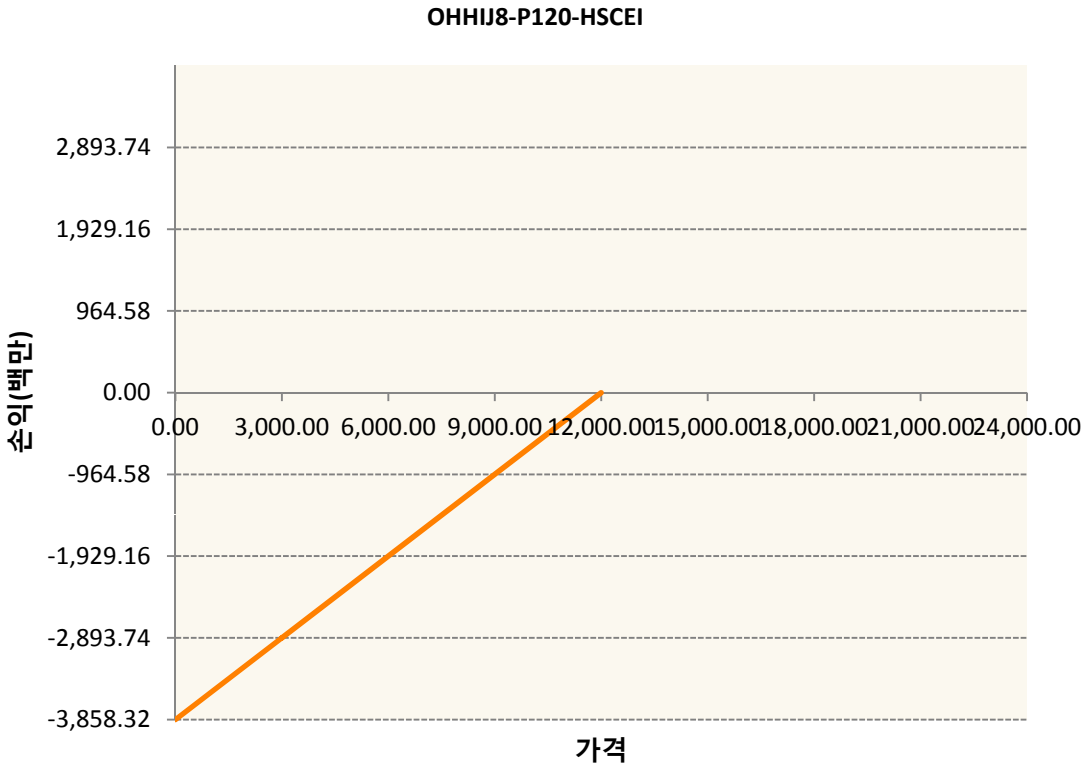
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,181	0	3,181	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,717	-7,717	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	255
OHHIJ8-C12	HSCEI	309
OHHIJ8-P12	HSCEI	309

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	764

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

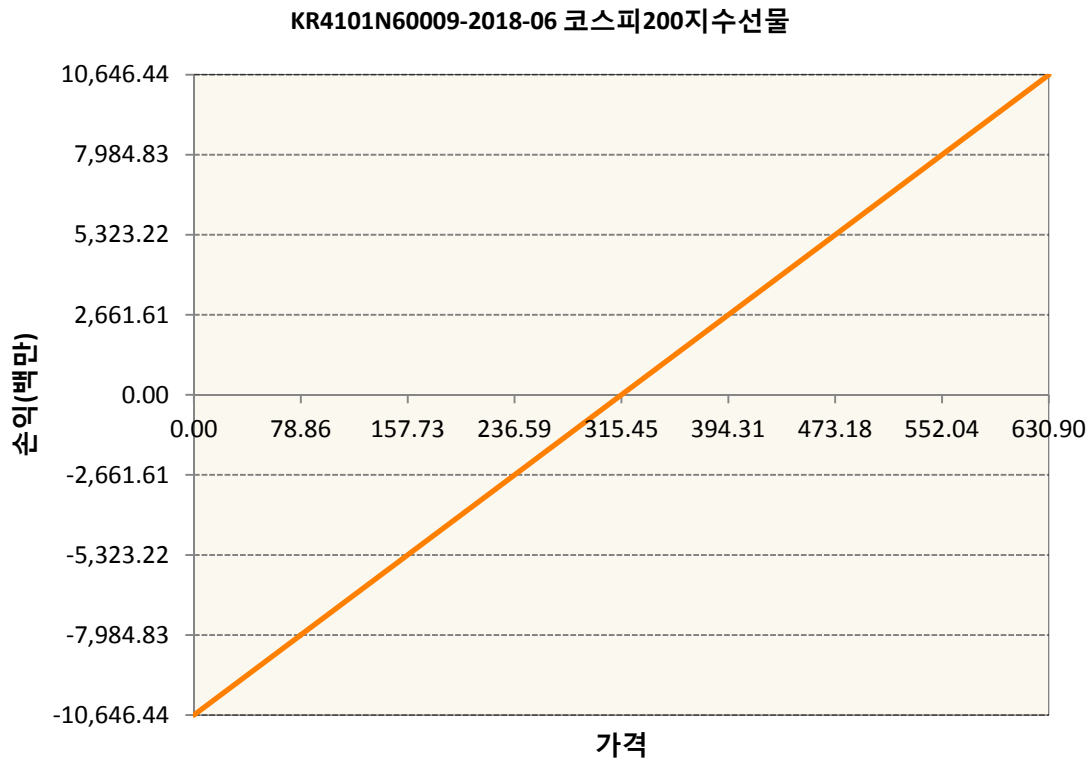
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

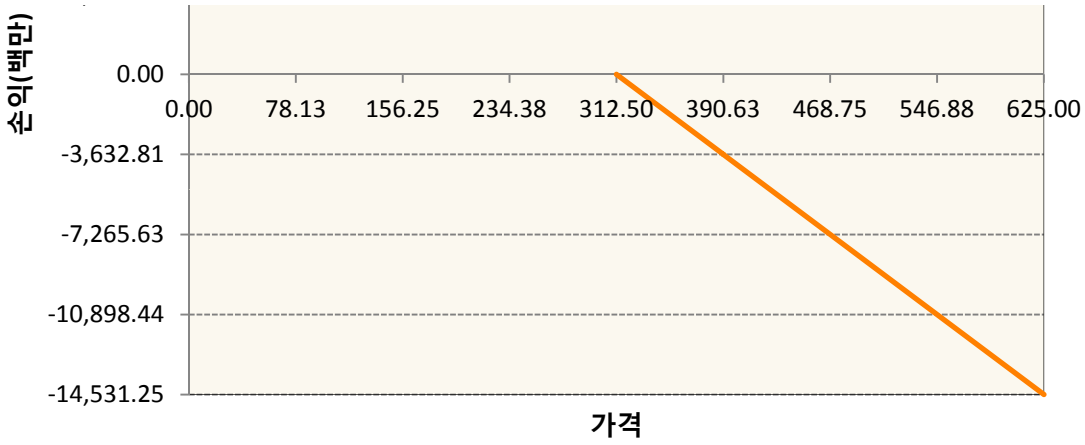
1. 계약금액

(단위:백만원)

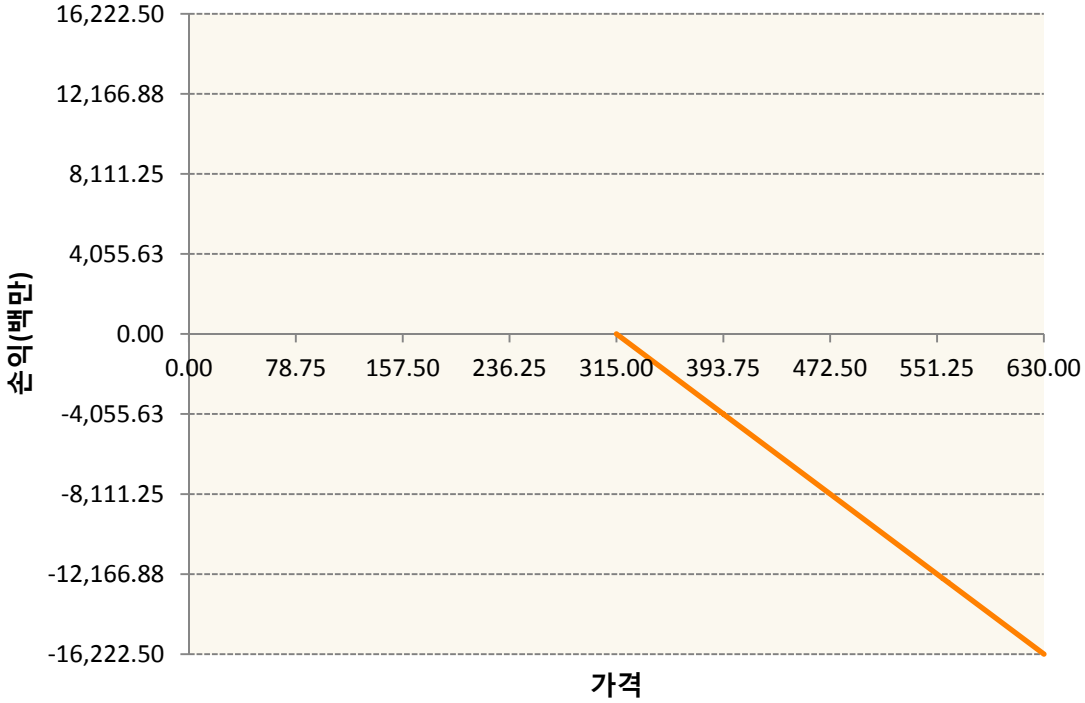
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,646	0	10,646	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

2. 만기시점의 손익구조

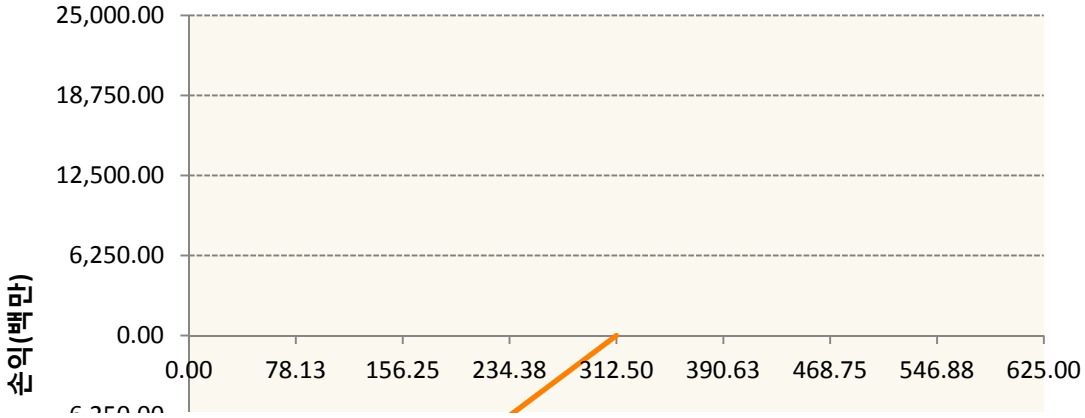




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465
-5.33%	-977	-977	-977	-977	-977	-977	-977
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488
5.33%	977	977	977	977	977	977	977
8.00%	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-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%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							238
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-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%	238	238	238	238	238	238	238
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6							198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-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%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						634
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-634	-634	-634	-634	-634	-634	-634
-5.33%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	422	422	422	422	422	422	422
8.00%	634	634	634	634	634	634	634
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						475
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-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%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	475	475	475	475	475	475	475
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						851
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-851	-851	-851	-851	-851	-851	-851
-5.33%	-567	-567	-567	-567	-567	-567	-567
-2.67%	-284	-284	-284	-284	-284	-284	-284
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	284	284	284	284	284	284	284
5.33%	567	567	567	567	567	567	567
8.00%	851	851	851	851	851	851	851
	KR4201N531 2018-05 콜312.5						938
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	454	440	424	405	385	364	341
-5.33%	400	375	350	323	295	267	238
-2.67%	288	256	223	190	157	124	91
0%	103	69	34	0	-34	-69	-103
2.67%	-157	-186	-216	-247	-279	-310	-343
5.33%	-477	-497	-519	-543	-569	-595	-623
8.00%	-835	-846	-860	-877	-895	-916	-938
	KR4201N531 2018-05 콜315						1,000
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	445	433	417	399	380	358	335
-5.33%	398	375	349	322	293	263	232
-2.67%	296	262	227	192	156	120	84
0%	115	77	38	0	-38	-77	-115
2.67%	-149	-184	-219	-255	-292	-329	-366
5.33%	-485	-511	-538	-568	-599	-630	-663
8.00%	-870	-886	-904	-925	-949	-974	-1,000
	KR4301N531 2018-05 풋312.5						1,560

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,540	-1,541	-1,542	-1,545	-1,549	-1,554	-1,560
-5.33%	-879	-886	-896	-908	-921	-936	-952
-2.67%	-293	-316	-341	-366	-392	-419	-445
0%	86	57	29	0	-29	-58	-87
2.67%	228	214	198	180	161	141	119
5.33%	256	253	248	242	234	224	213
8.00%	259	258	258	256	254	251	247

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

8,274

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

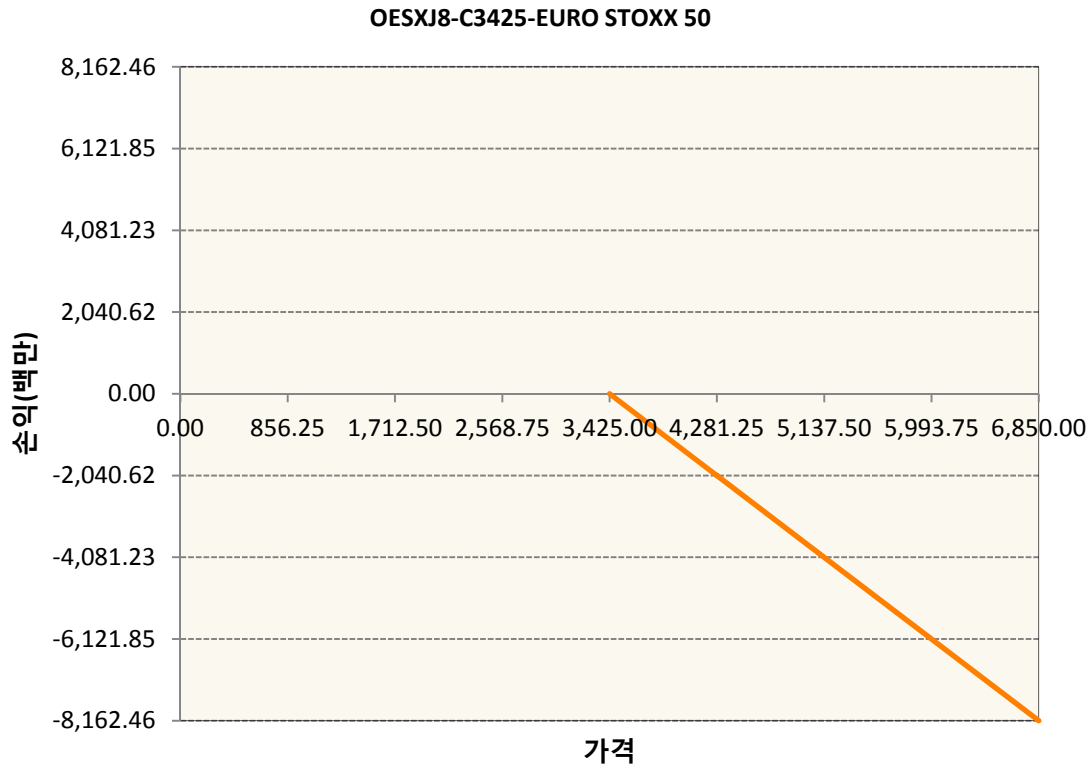
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

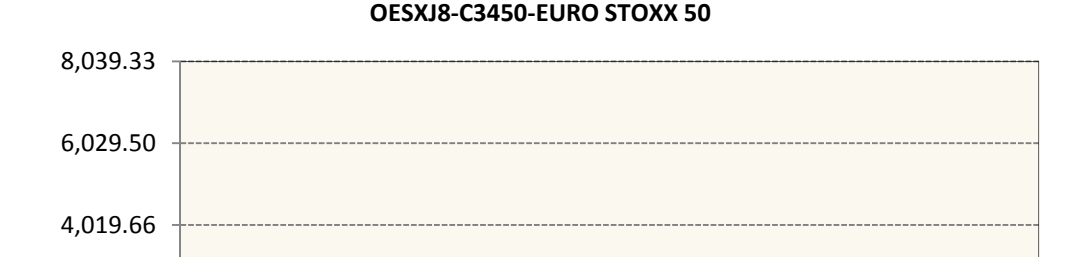
1. 계약금액

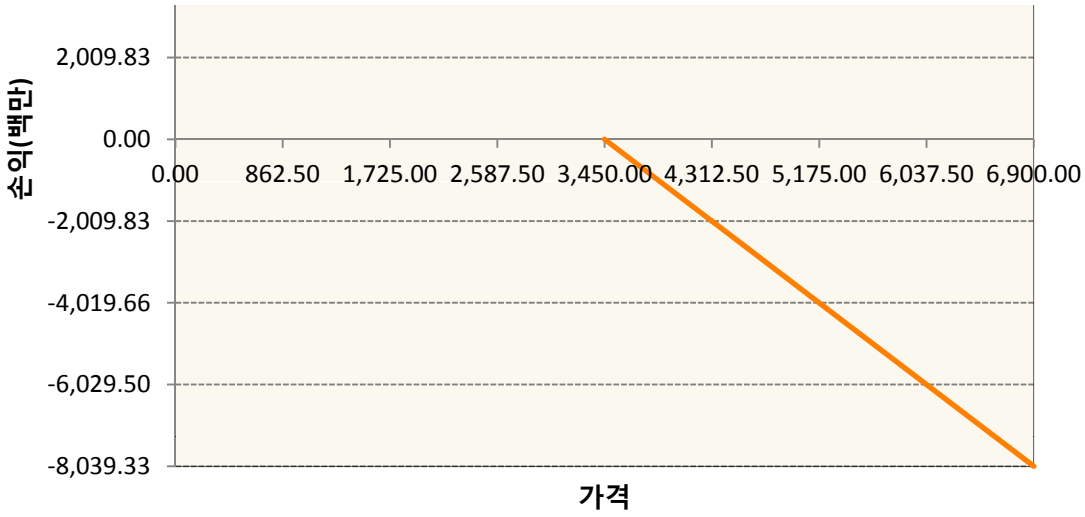
(단위:백만원)

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	7,599	0	7,599	
누계	유가증권	스왑	76,477	0	76,477	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,404	-32,404	장내
누계	지수	스왑	52,962	0	52,962	장외

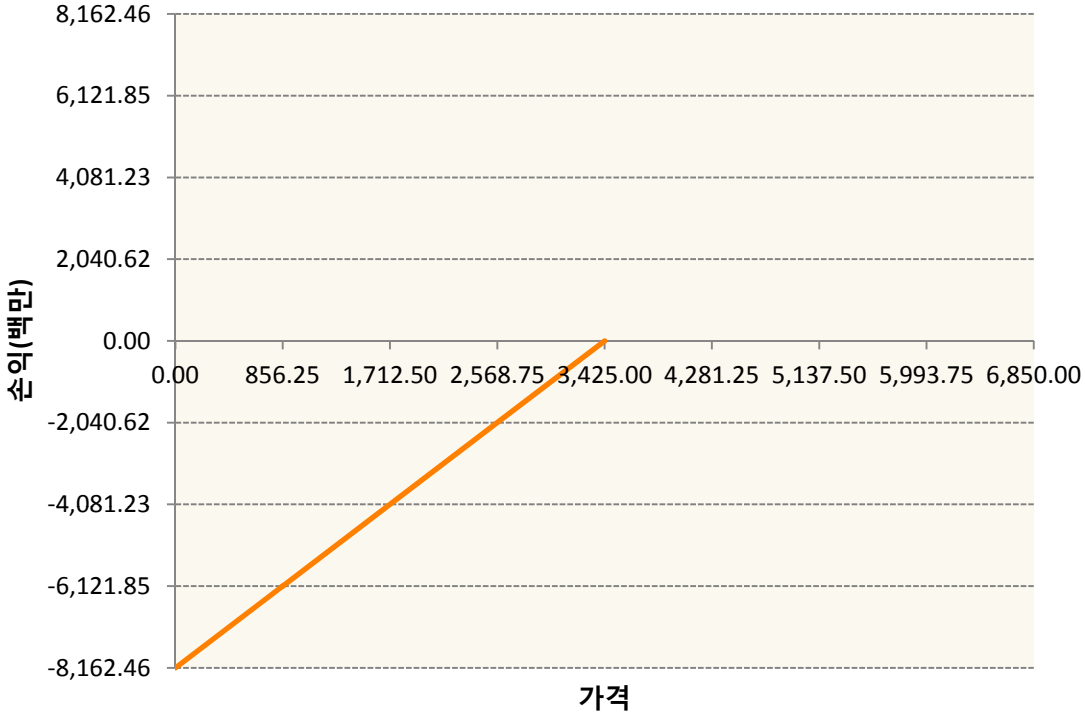
2. 만기시점의 손익구조



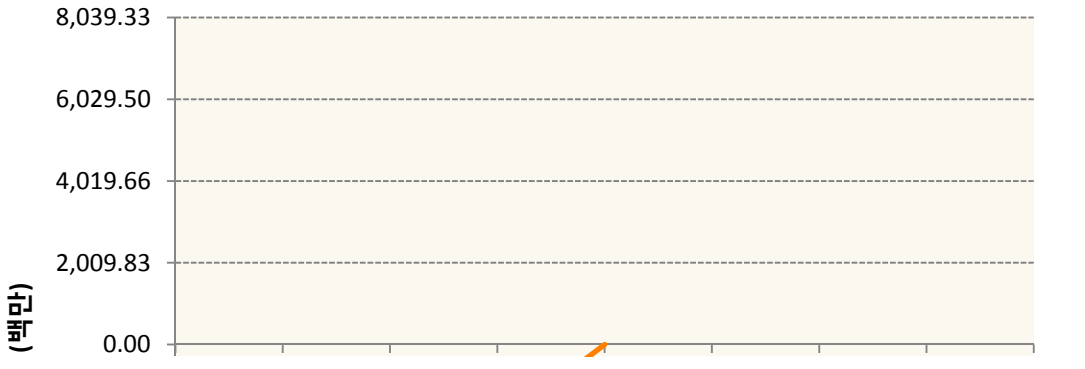


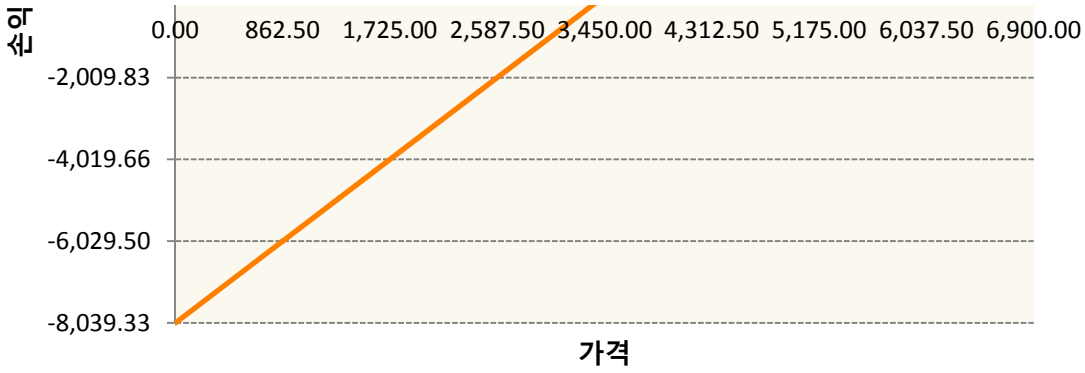


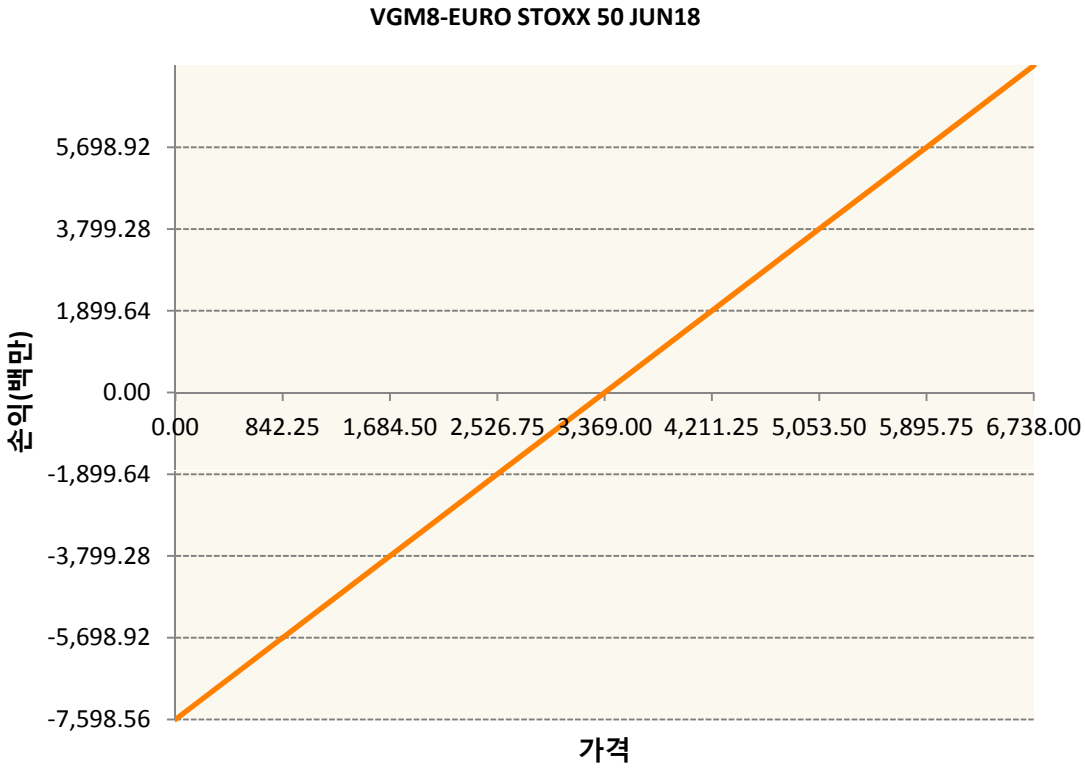
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	114
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	165
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	653
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	643
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	653
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	643
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	608

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

2,170

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

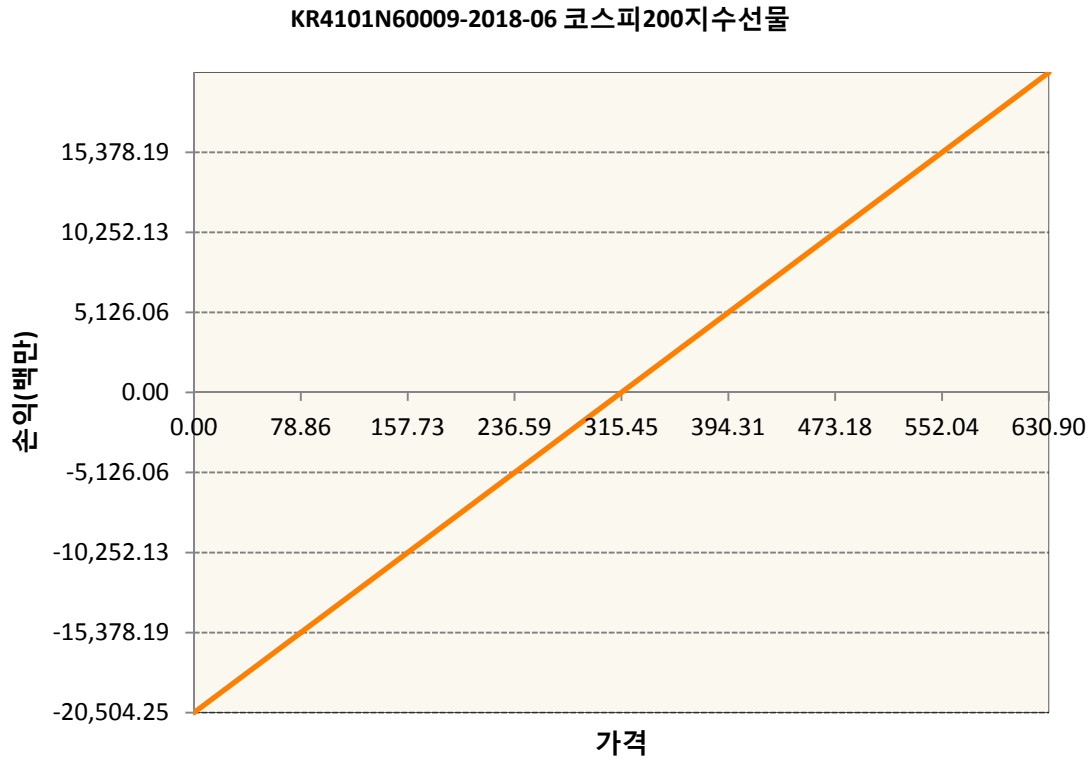
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,504	0	20,504	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,639
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,639	-1,639	-1,639	-1,639	-1,639	-1,639	-1,639
-5.33%	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093	-1,093
-2.67%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	546	546	546	546	546	546	546
5.33%	1,093	1,093	1,093	1,093	1,093	1,093	1,093
8.00%	1,639	1,639	1,639	1,639	1,639	1,639	1,639

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

1,197

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

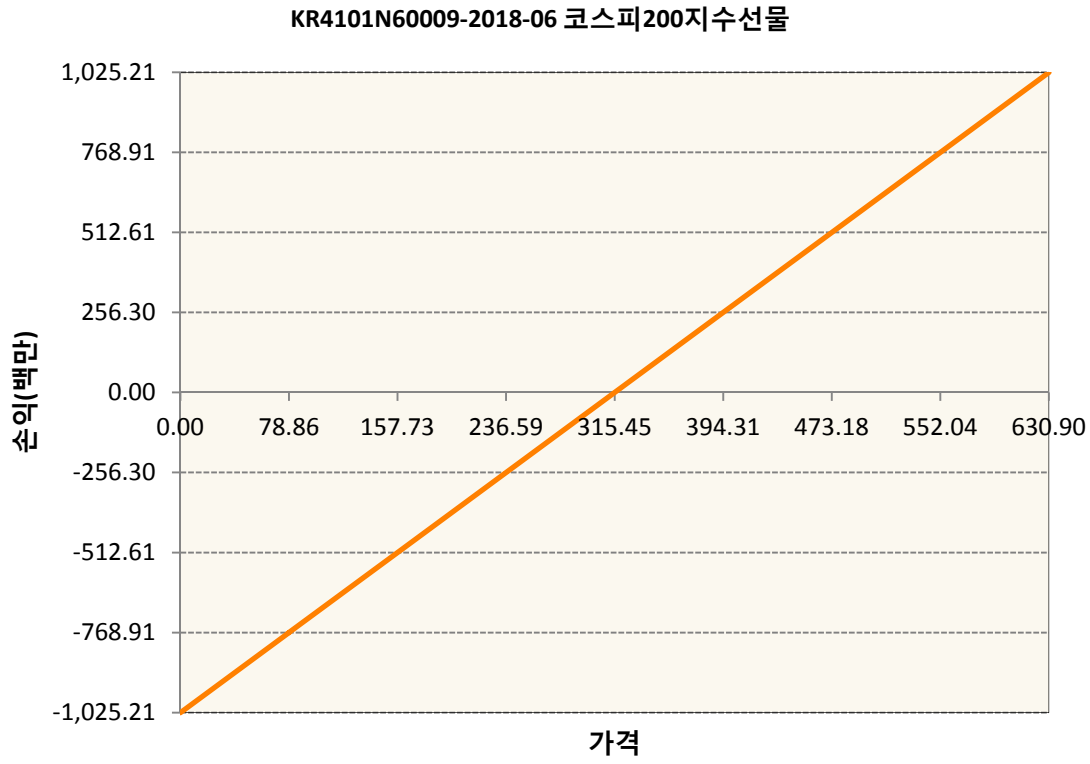
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,025	0	1,025	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

60

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

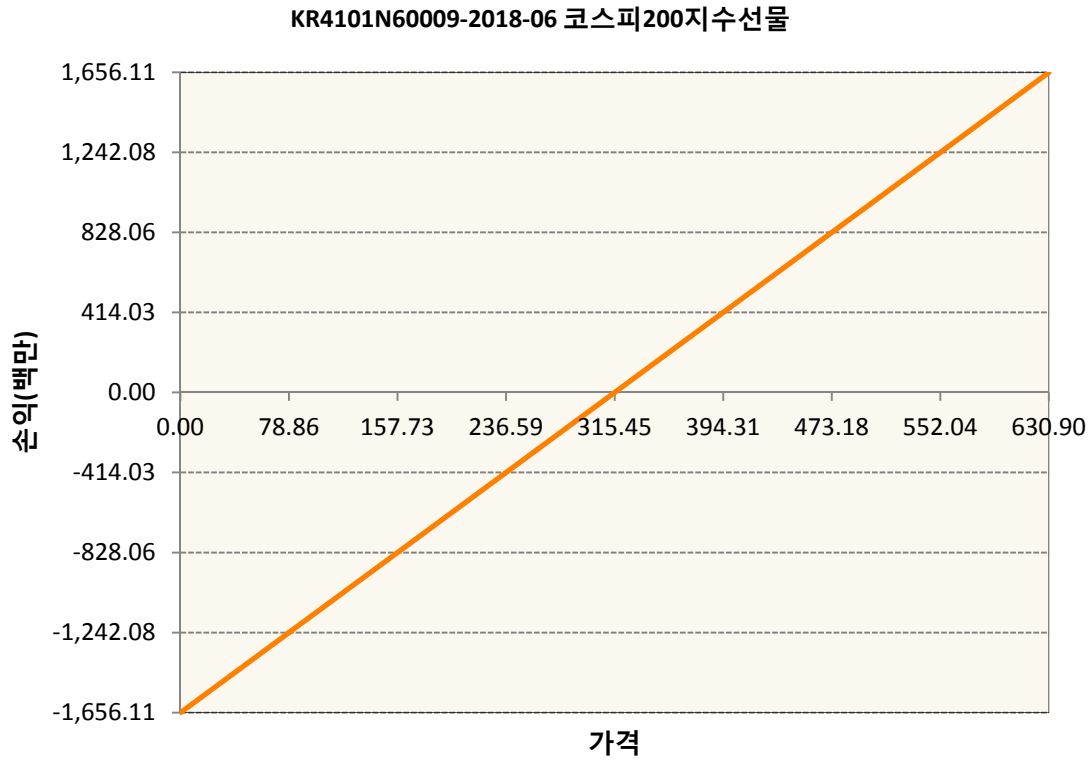
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,656	0	1,656	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132

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

97

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

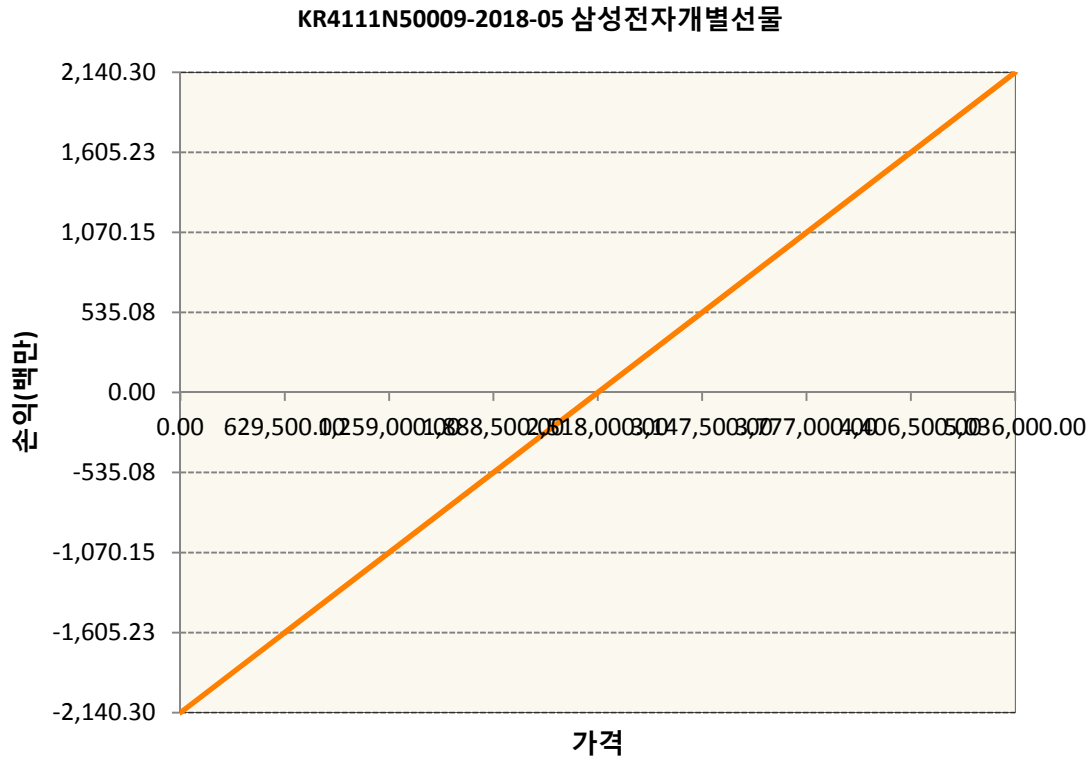
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,140	0	2,140	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N50(2018-05 삼성전자개별선물							171
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	57	57	57	57	57	57	57
5.33%	114	114	114	114	114	114	114
8.00%	171	171	171	171	171	171	171

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

213

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

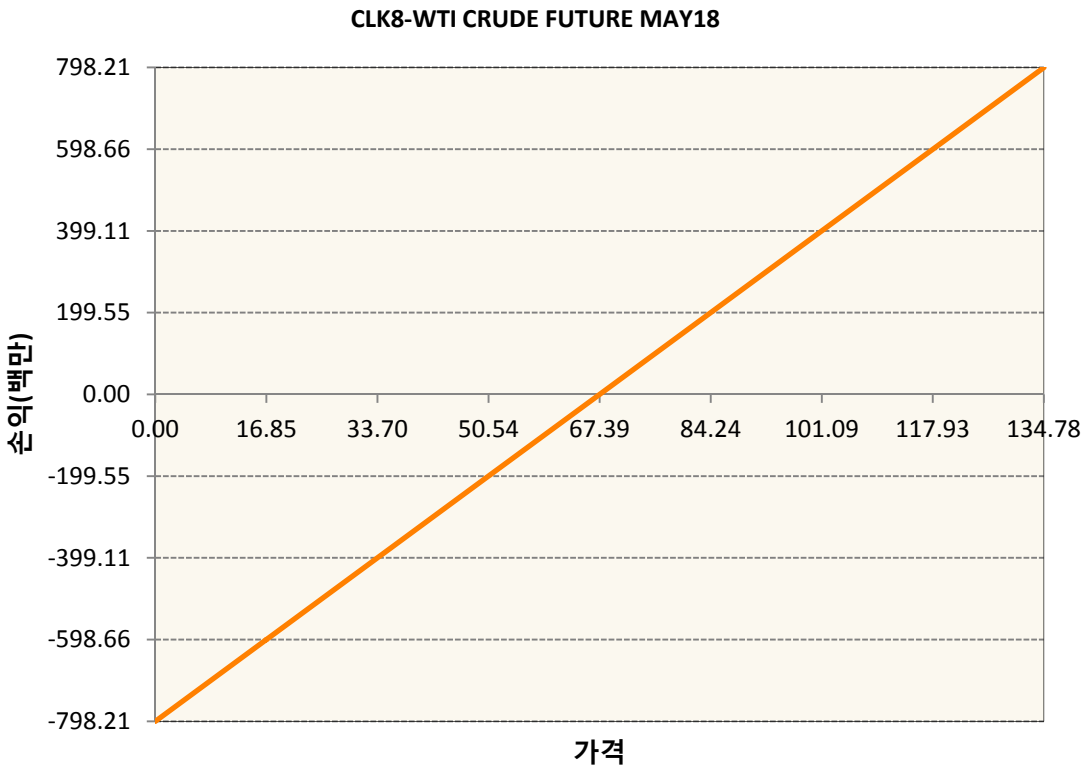
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

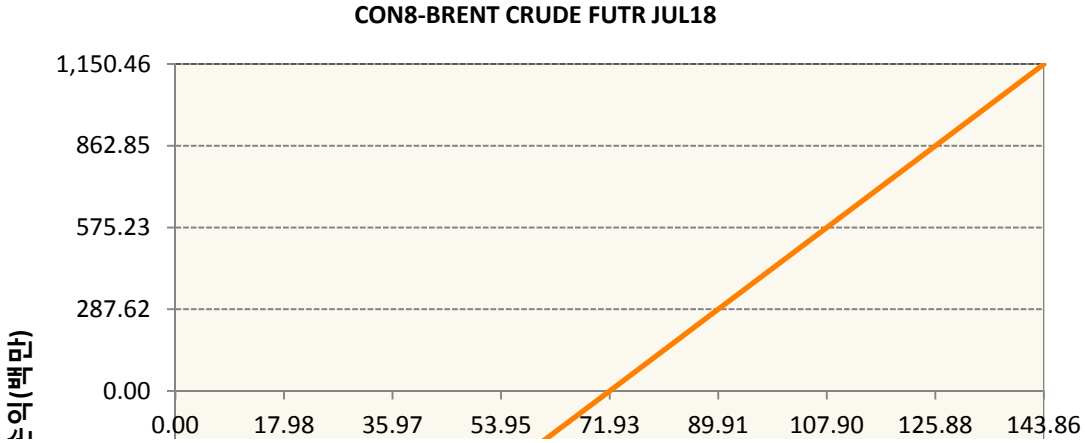
1. 계약금액

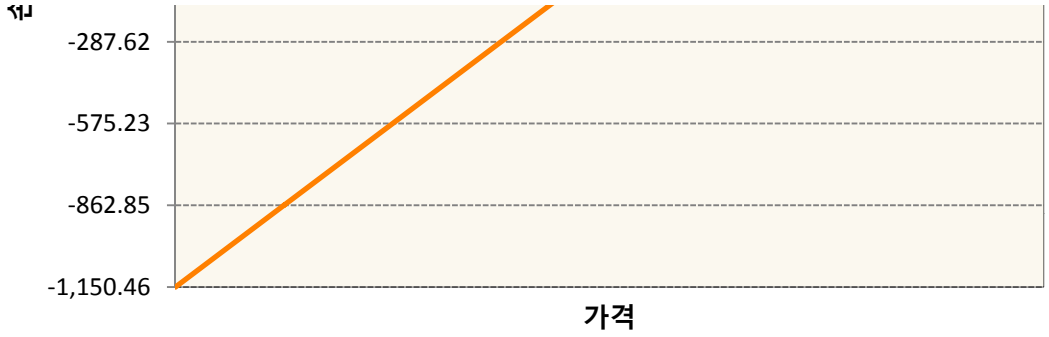
(단위:백만원)

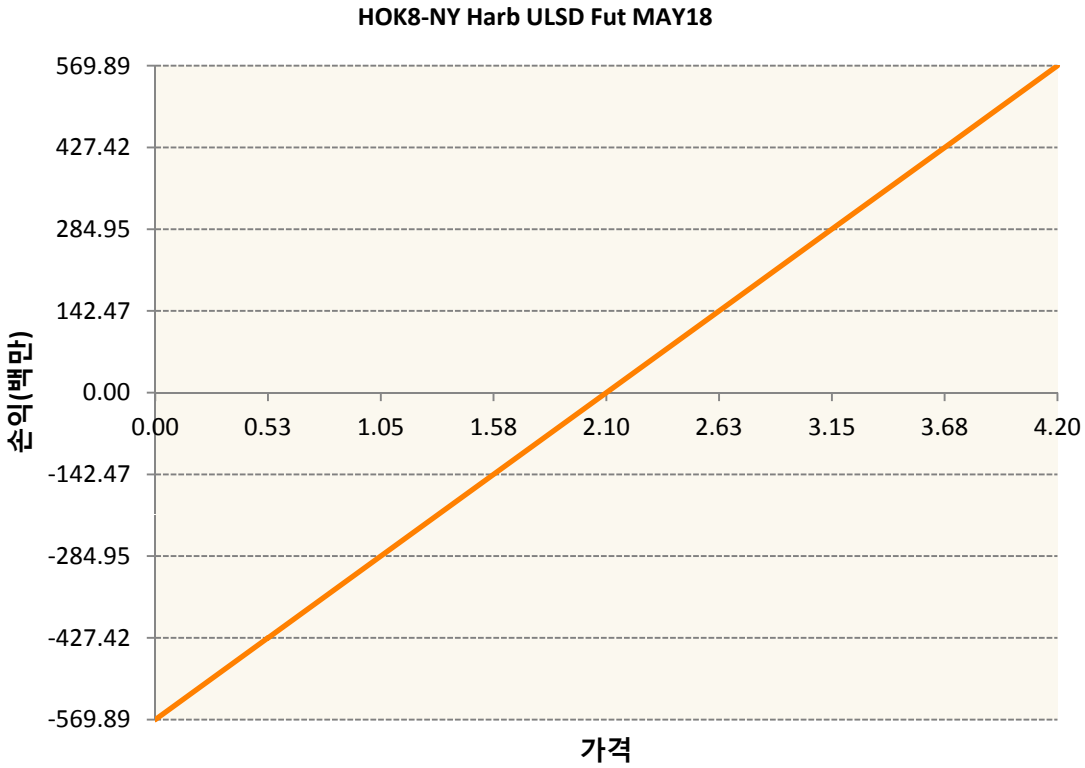
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	798	0	798	
누계	유가증권	선물	3,341	590	2,752	

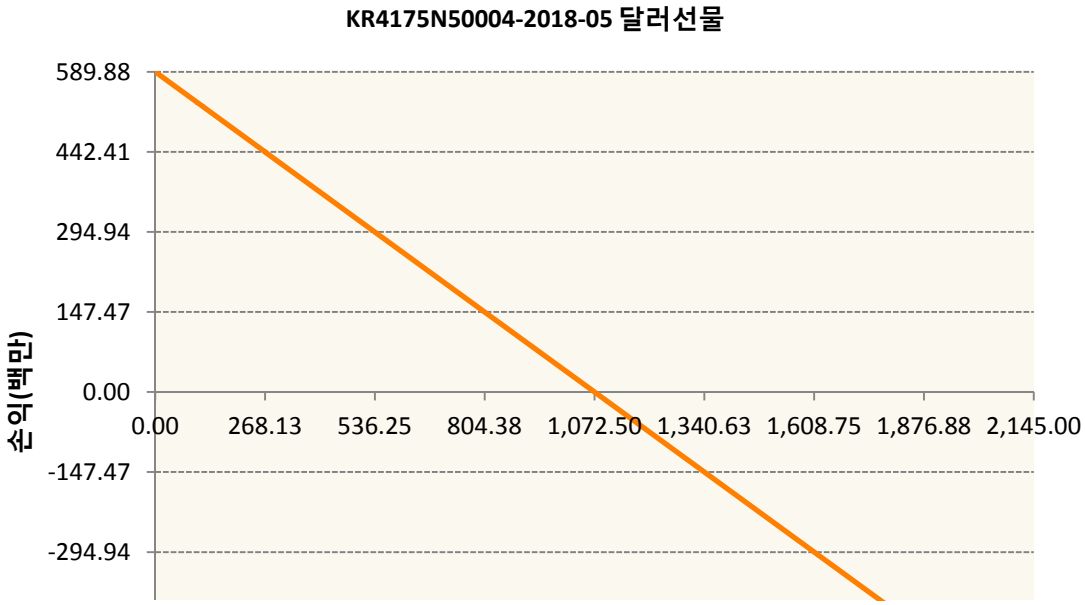
2. 만기시점의 손익구조

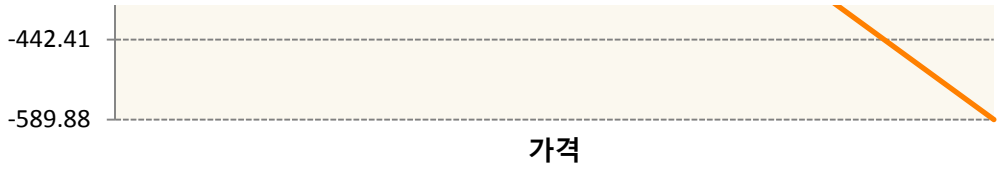


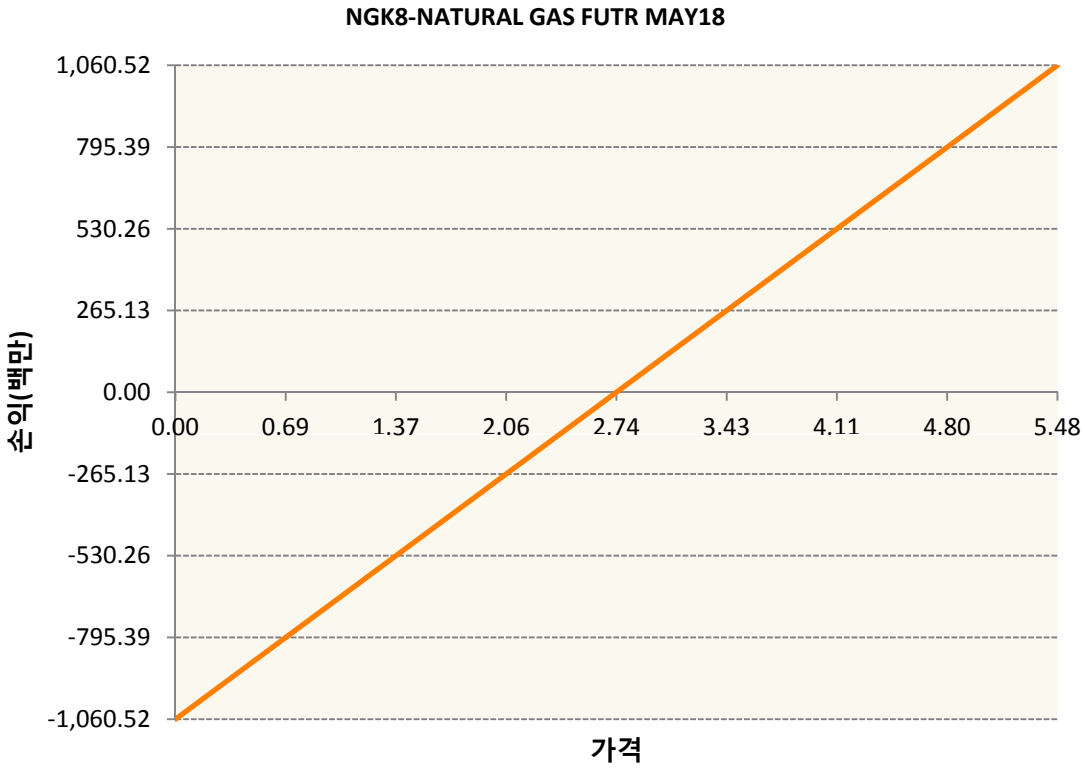


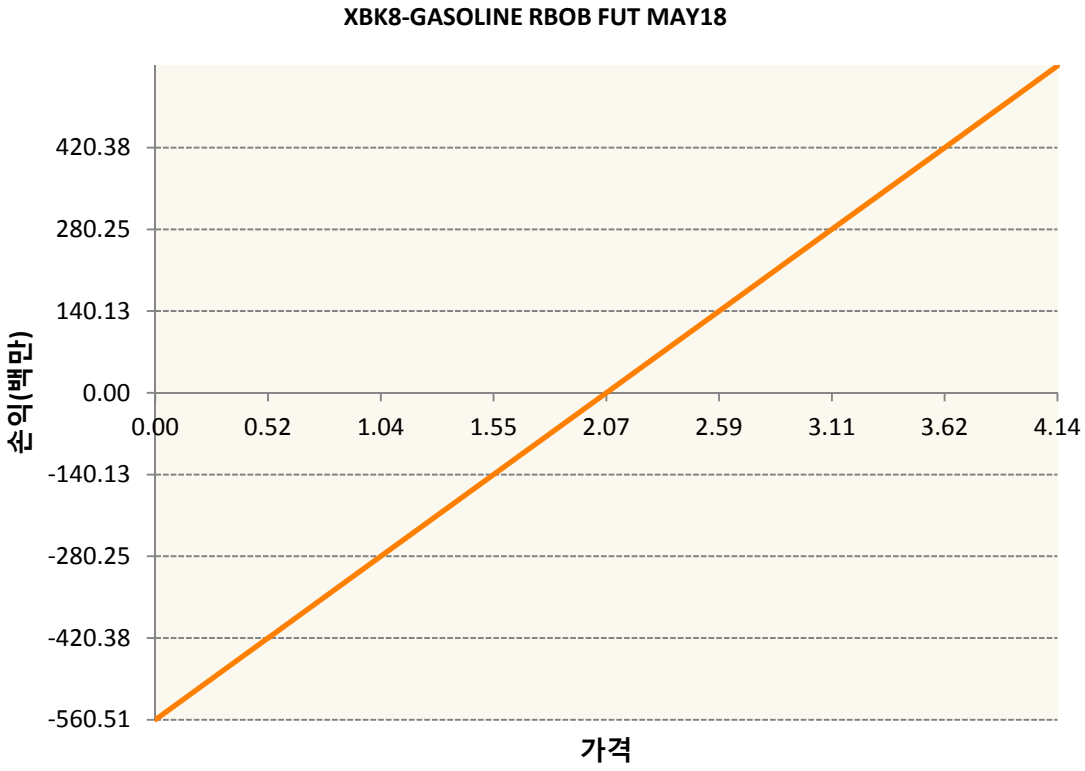

-287.62
-575.23
-862.85
-1,150.46
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
569.89
427.42
284.95
142.47
0.00
-142.47
-284.95
-427.42
-569.89
손익(백만)
0.00
0.53
1.05
1.58
2.10
2.63
3.15
3.68
4.20
가격


KR4175N50004-2018-05 달러선물
589.88
442.41
294.94
147.47
0.00
-147.47
-294.94
손익(백만)
0.00
268.13
536.25
804.38
1,072.50
1,340.63
1,608.75
1,876.88
2,145.00


-442.41
-589.88
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,060.52
795.39
530.26
265.13
0.00
-265.13
-530.26
-795.39
-1,060.52
0.00
0.69
1.37
2.06
2.74
3.43
4.11
4.80
5.48
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
420.38
280.25
140.13
0.00
-140.13
-280.25
-420.38
-560.51
0.00
0.52
1.04
1.55
2.07
2.59
3.11
3.62
4.14
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	64
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	92
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	46
KR4175N50(	2018-05 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	85
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	45

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

524

공시일	2018-04-17
기준일	2018-04-16

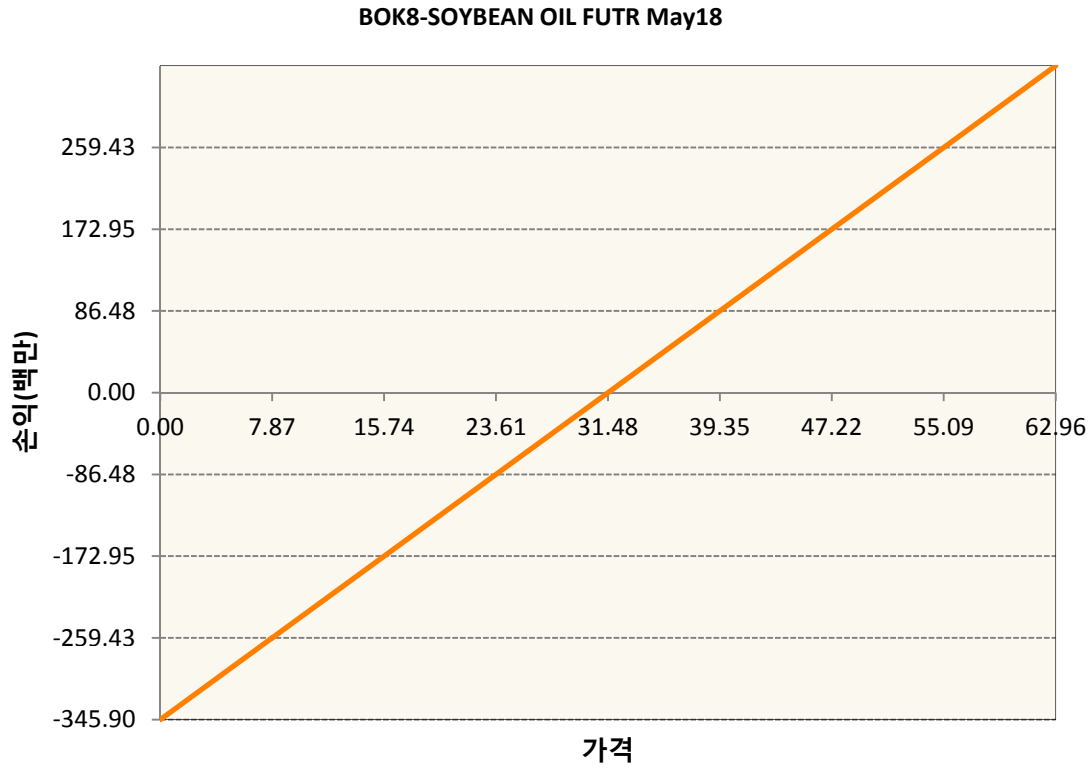
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

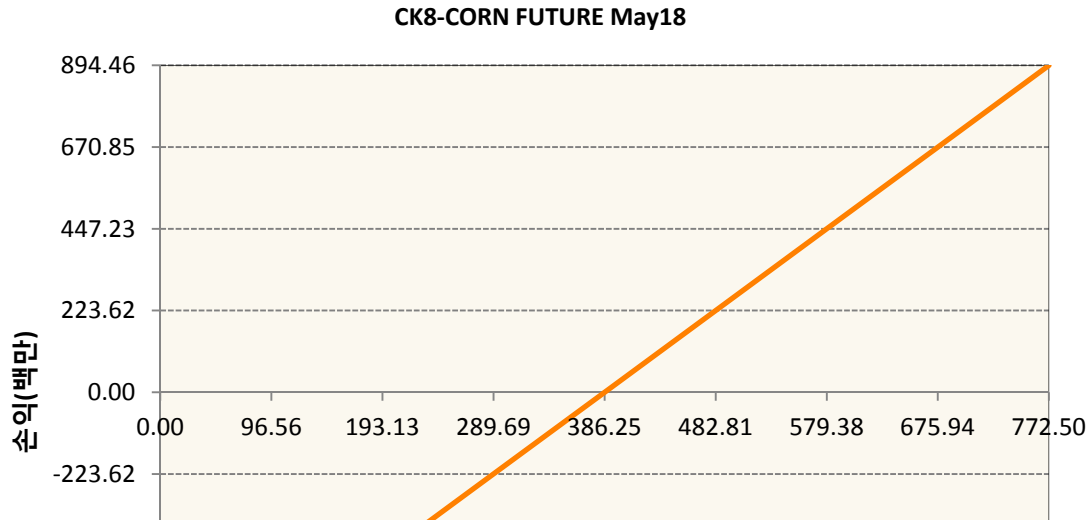
1. 계약금액

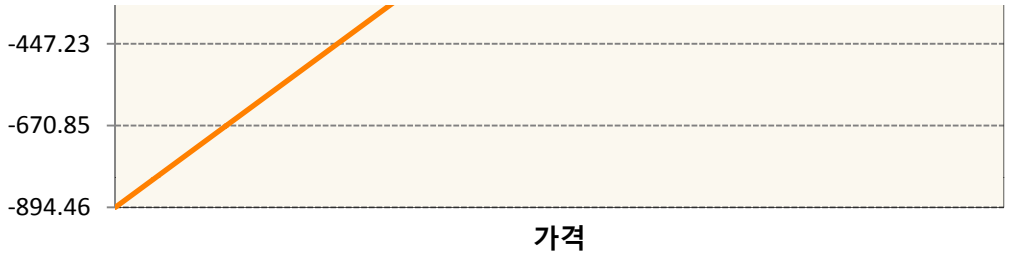
(단위:백만원)

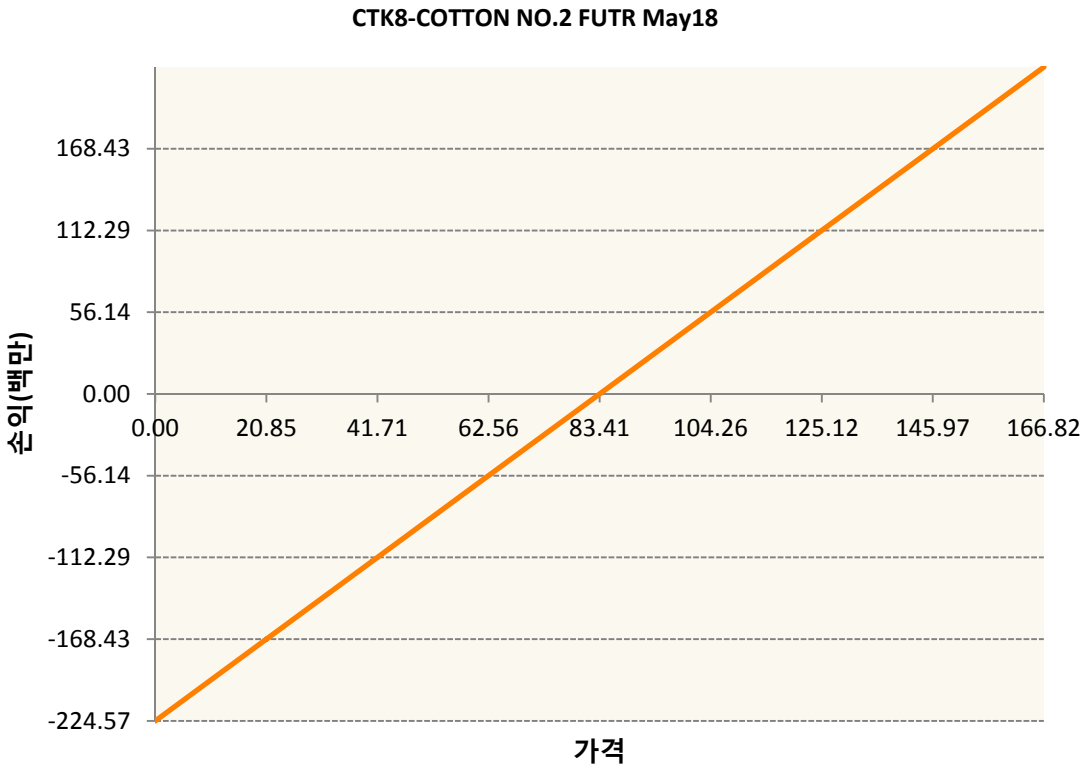
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,138	322	3,816	

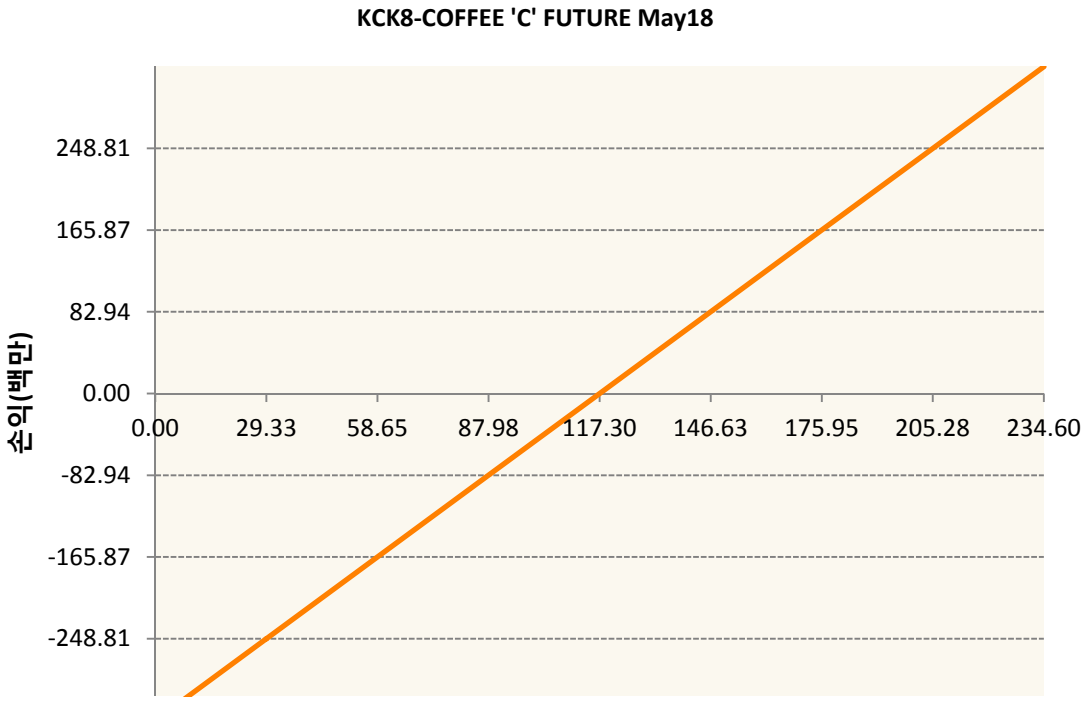
2. 만기시점의 손익구조

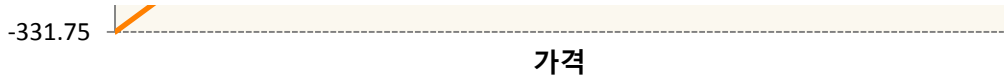


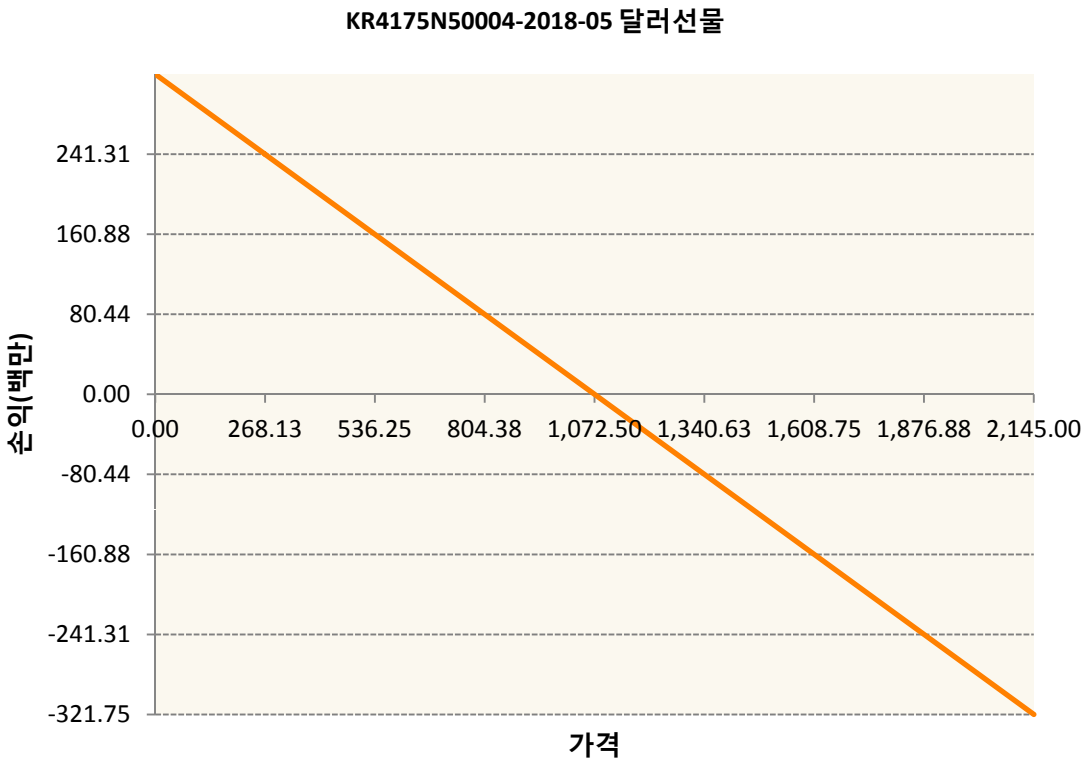


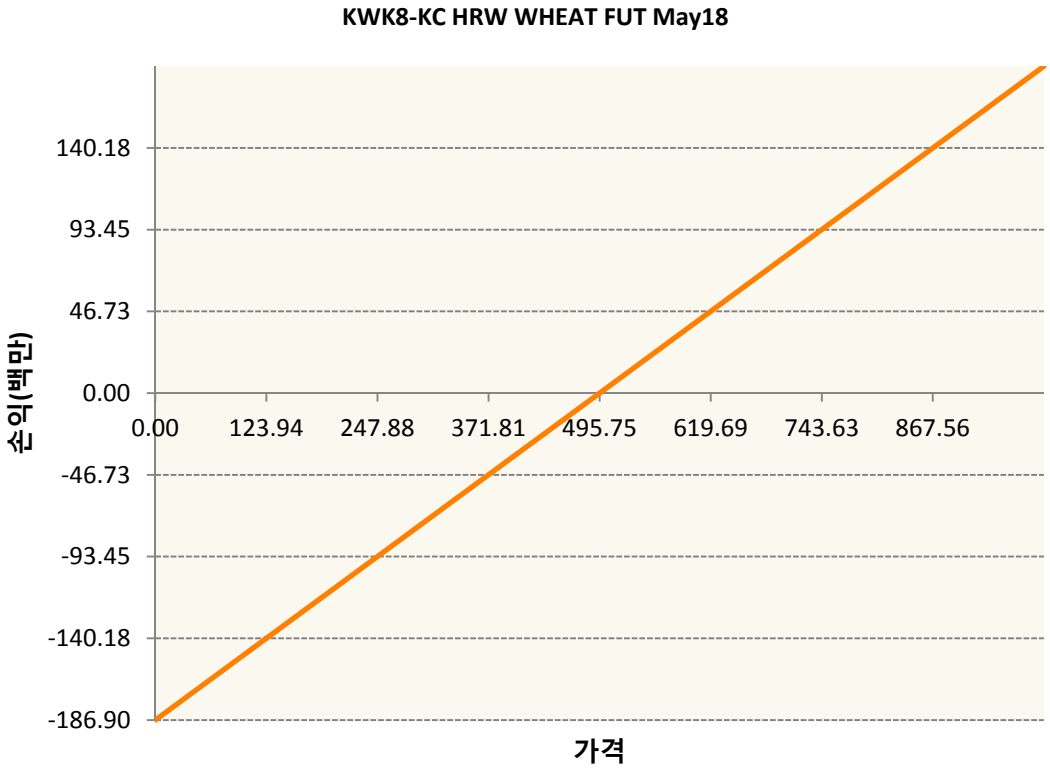

-447.23
-670.85
-894.46
가격

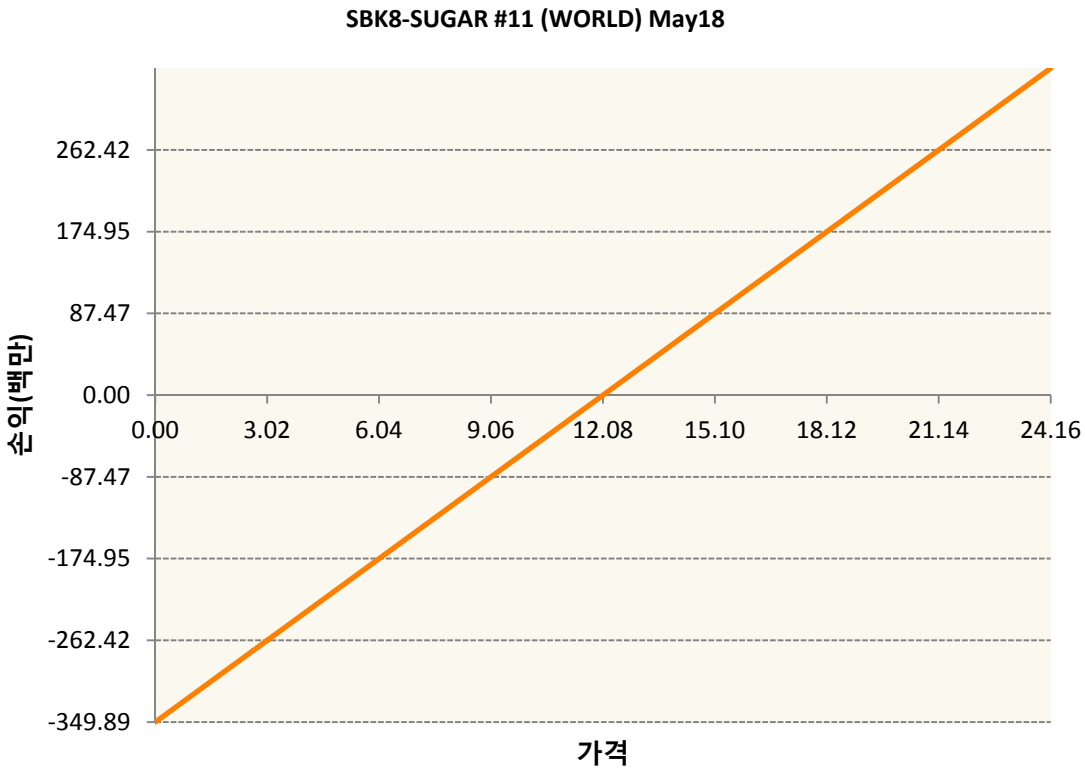

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
168.43
112.29
56.14
0.00
-56.14
-112.29
-168.43
-224.57
0.00
20.85
41.71
62.56
83.41
104.26
125.12
145.97
166.82
손익(백만)
가격

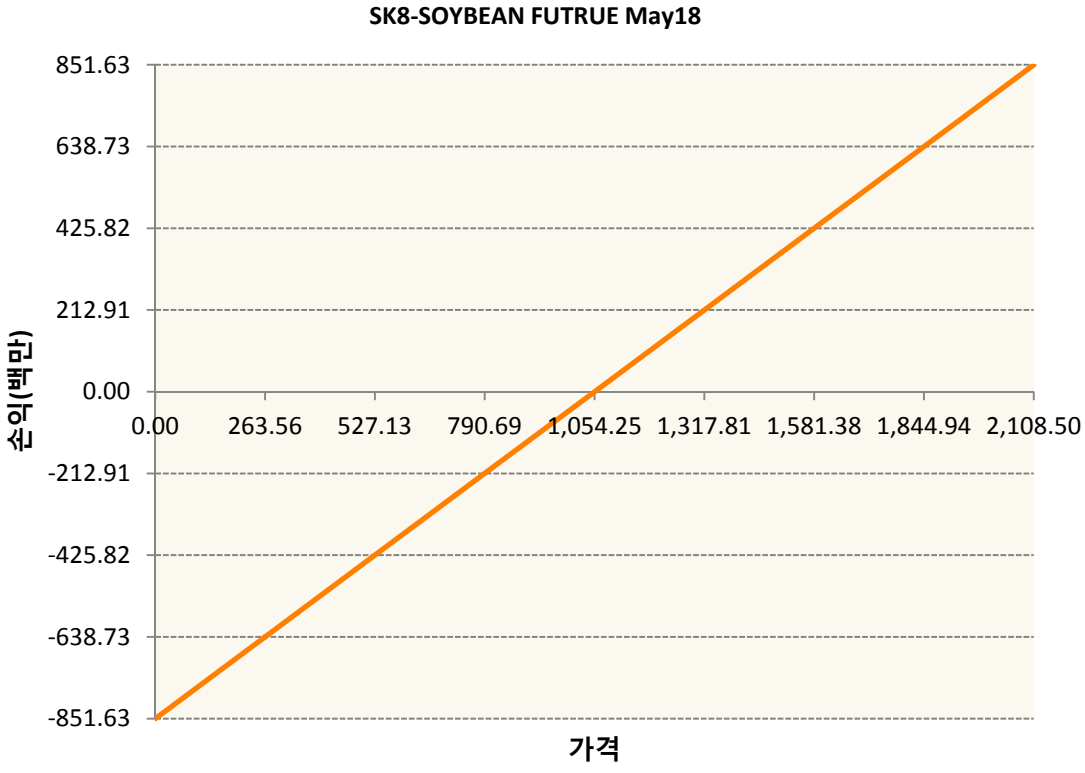

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
248.81
165.87
82.94
0.00
-82.94
-165.87
-248.81
0.00
29.33
58.65
87.98
117.30
146.63
175.95
205.28
234.60
손익(백만)


-331.75
가격

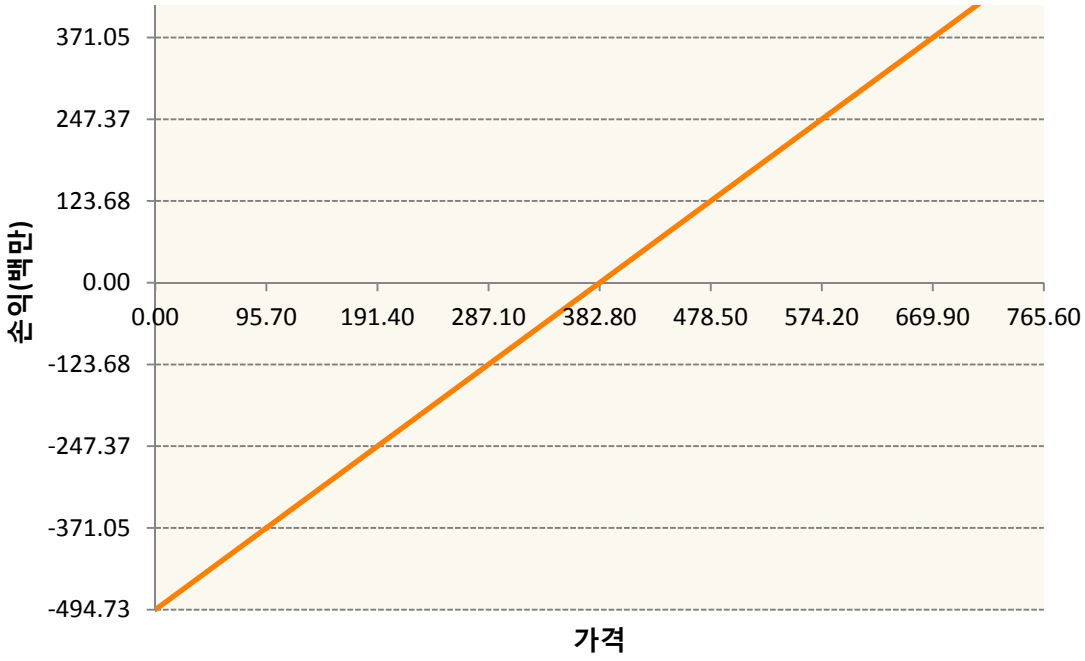

KR4175N50004-2018-05 달러선물
241.31
160.88
80.44
0.00
-80.44
-160.88
-241.31
-321.75
0.00
268.13
536.25
804.38
1,072.50
1,340.63
1,608.75
1,876.88
2,145.00
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
140.18
93.45
46.73
0.00
-46.73
-93.45
-140.18
-186.90
0.00
123.94
247.88
371.81
495.75
619.69
743.63
867.56
손익(백만)
가격

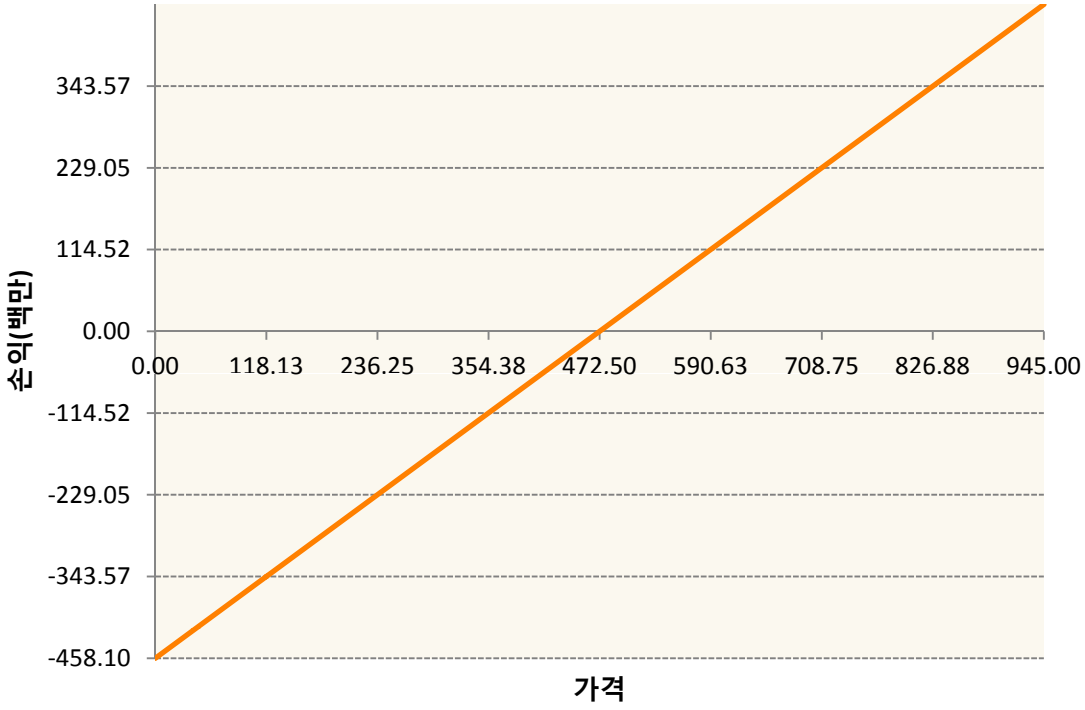

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
262.42
174.95
87.47
0.00
-87.47
-174.95
-262.42
-349.89
0.00
3.02
6.04
9.06
12.08
15.10
18.12
21.14
24.16
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
851.63
638.73
425.82
212.91
0.00
-212.91
-425.82
-638.73
-851.63
0.00
263.56
527.13
790.69
1,054.25
1,317.81
1,581.38
1,844.94
2,108.50
손익(백만)
가격

SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18
494.73



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
KR4175N50(	2018-05 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	15
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	28
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	68
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	40
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	37

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

334