공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

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	2018-04-19
기준일	2018-04-18

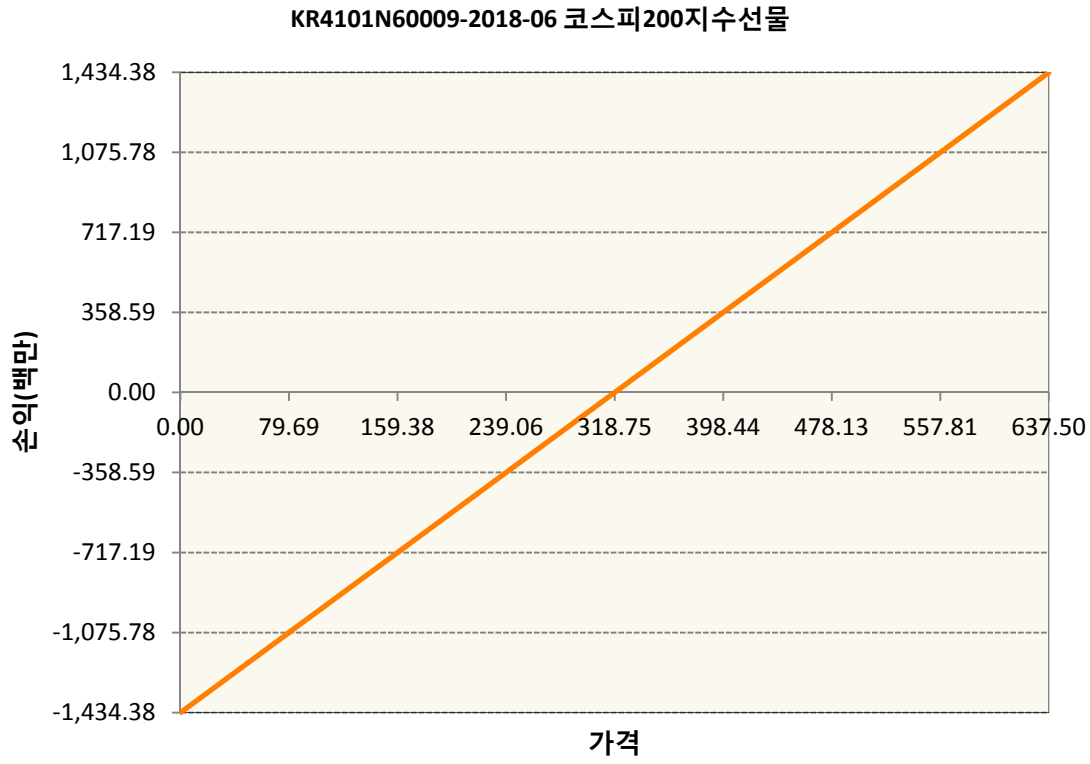
스마트인덱스모

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	1,434	0	1,434	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							115
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
-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%	115	115	115	115	115	115	115

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

84

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

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	1,114

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

454

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

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	402

* 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	2018-04-19
기준일	2018-04-18

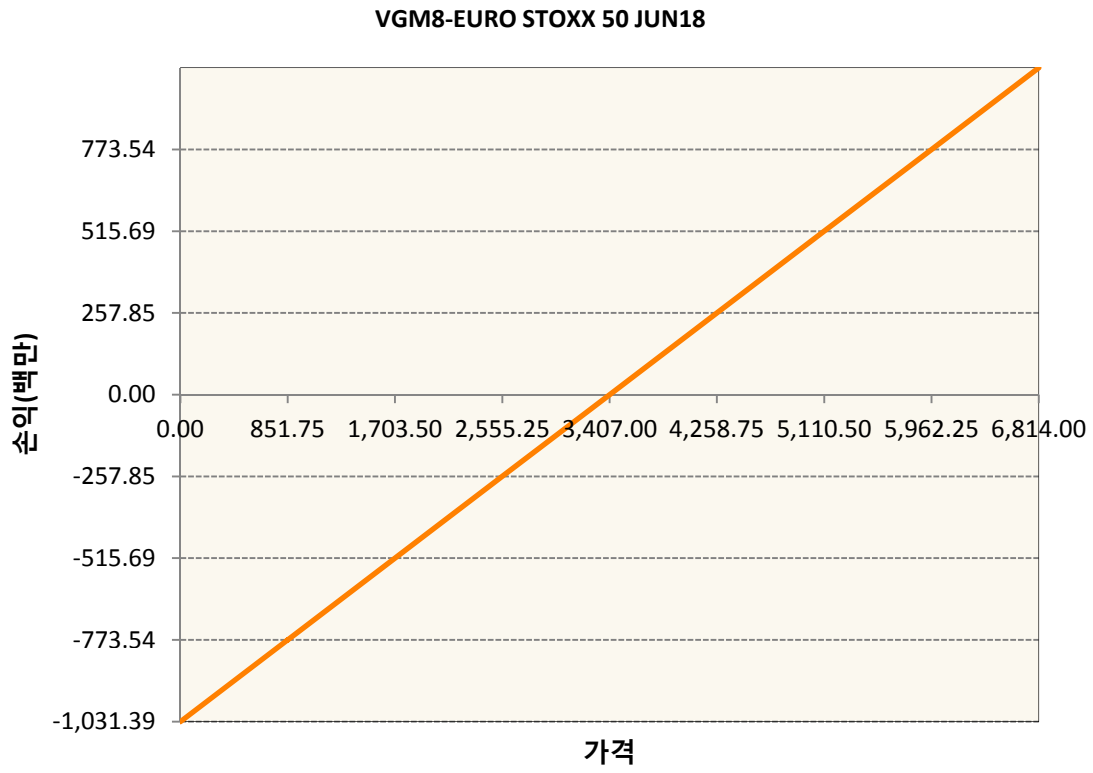
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,031	0	1,031	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	83

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

(단위:백만원)

51

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

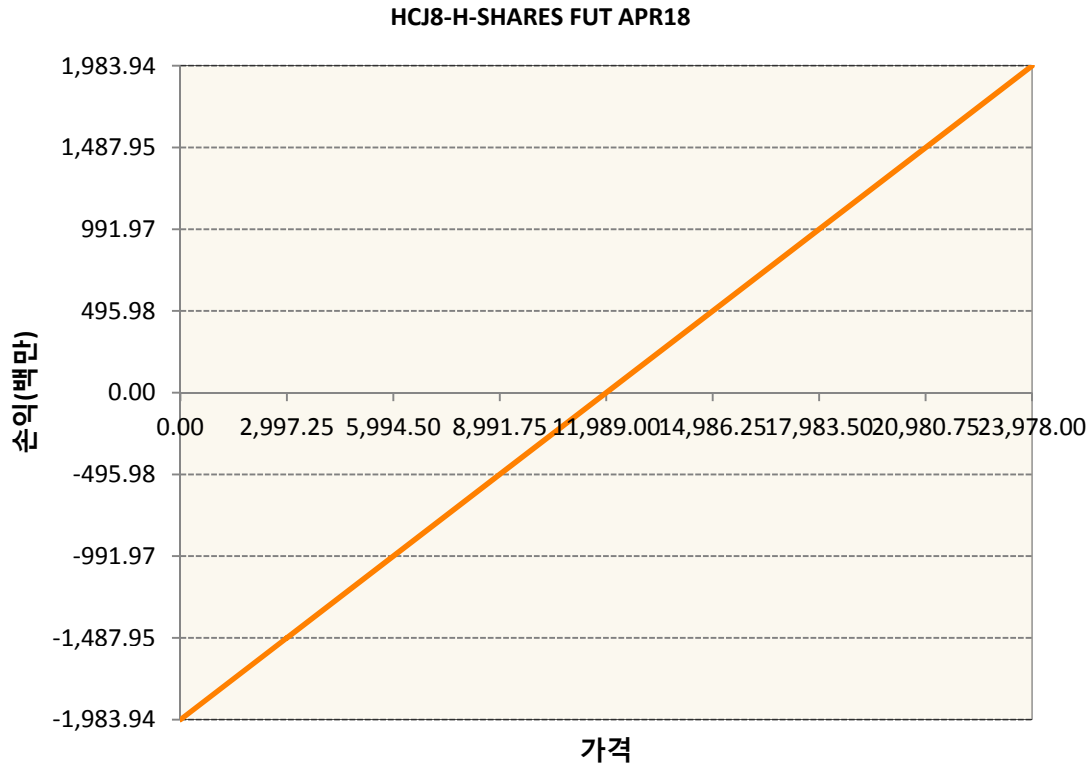
차이나인덱스모(주식-파생형)

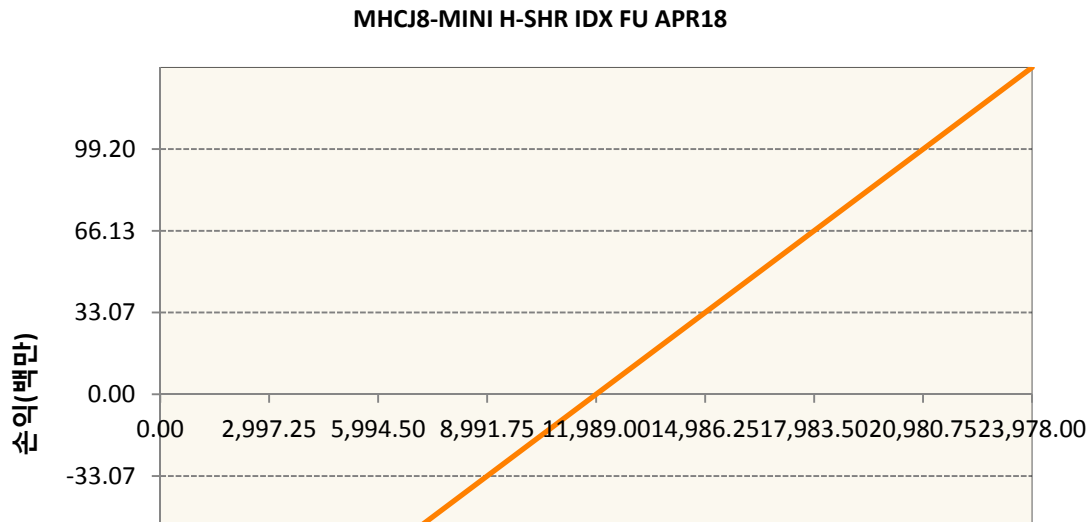
1. 계약금액

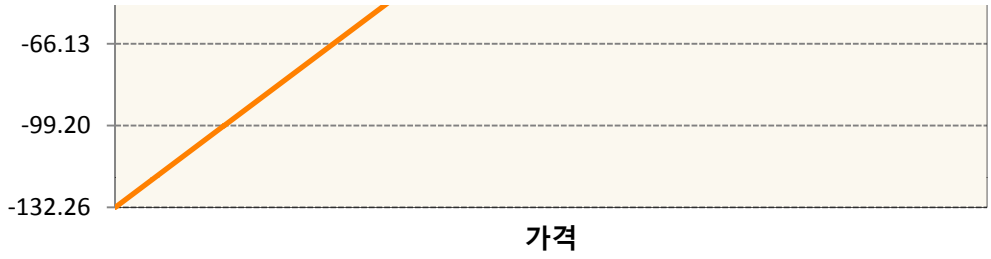
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,116	0	2,116	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	159
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	149

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

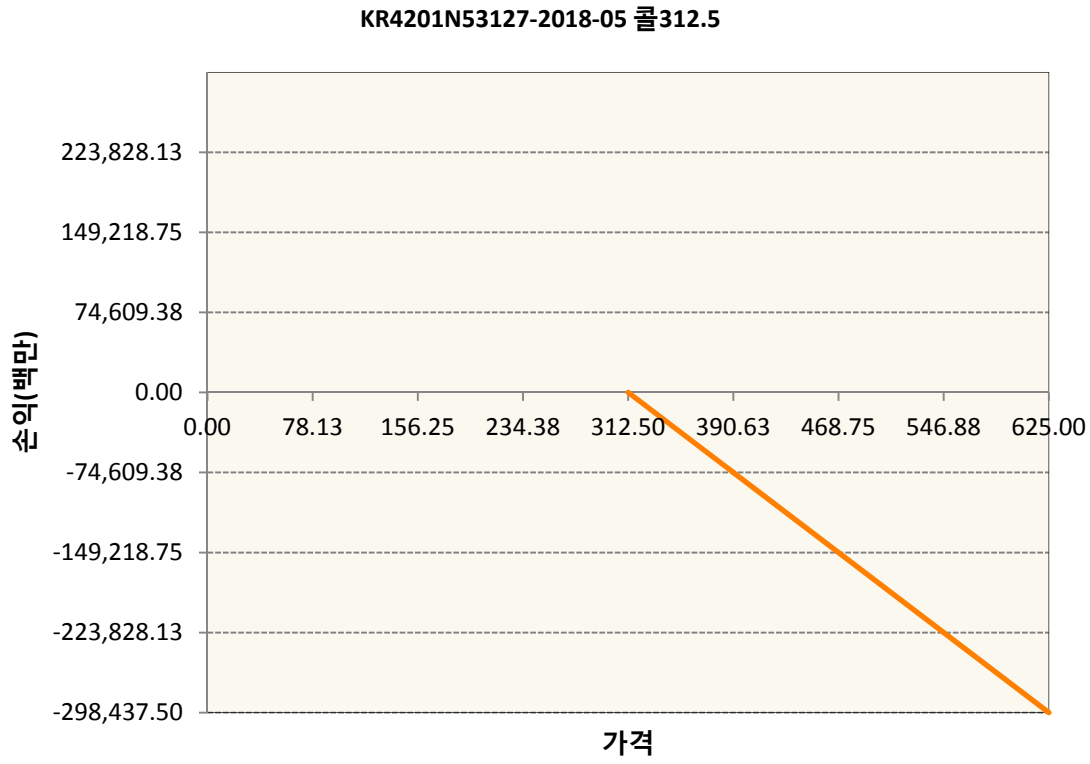
커버드콜모(주식혼합-파생형)

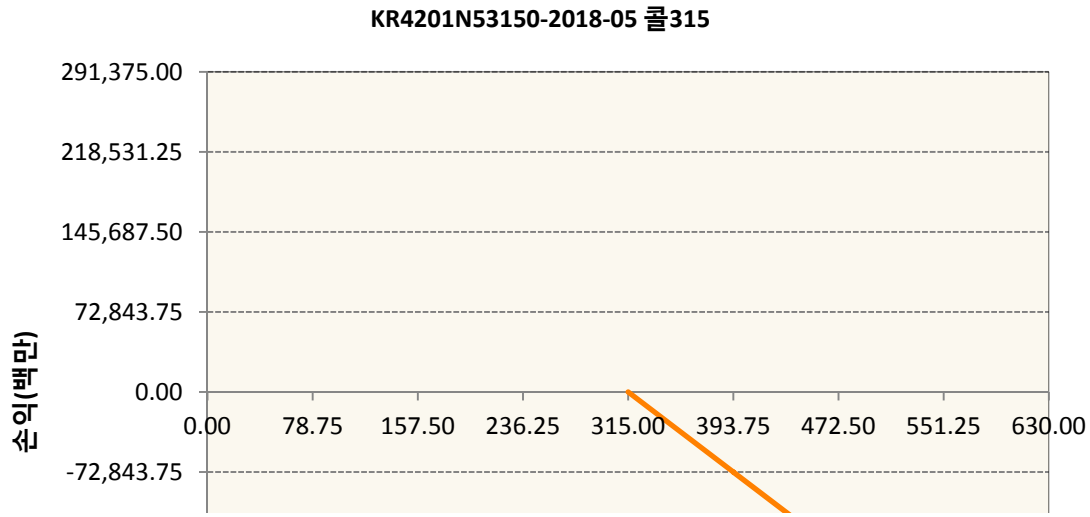
1. 계약금액

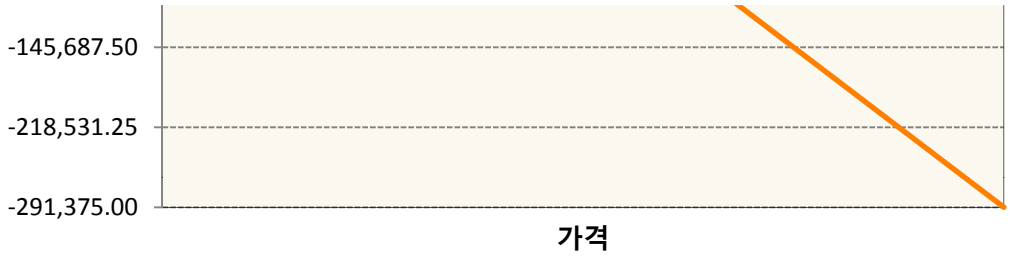
(단위:백만원)

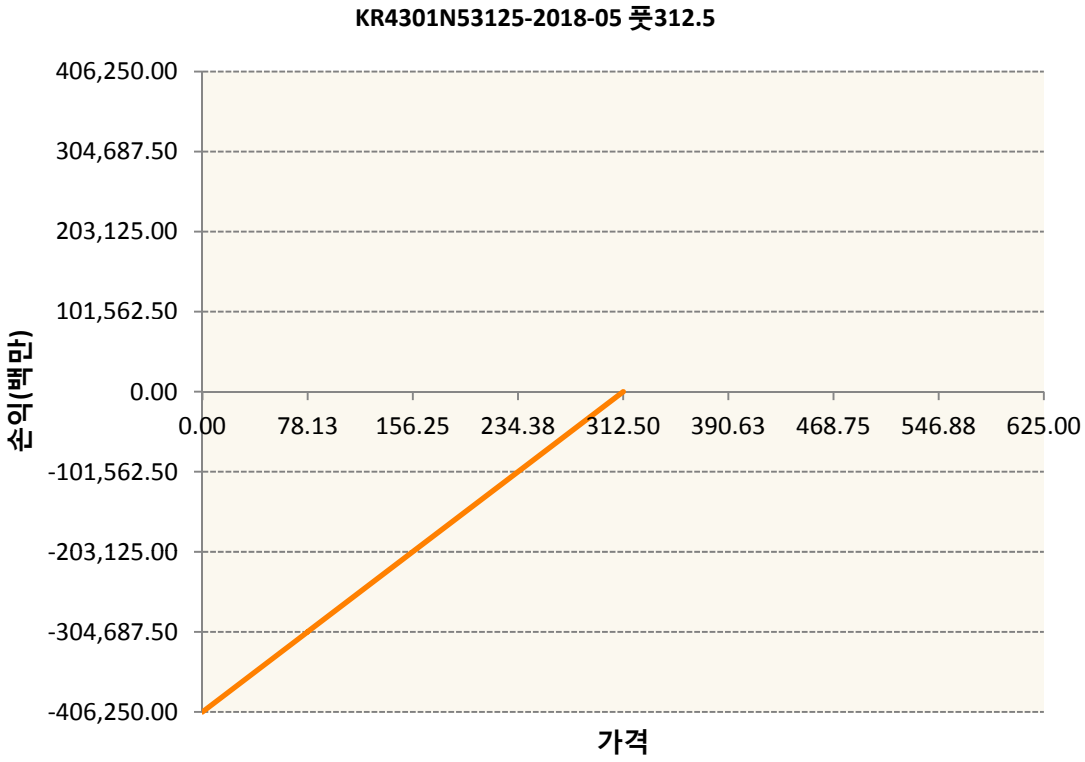
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	15,341	0	15,341	장내
누계	유가증권	옵션	0	996,063	-996,063	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5							20,489
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,656	10,341	9,982	9,586	9,160	8,707	8,232
-5.33%	9,252	8,725	8,177	7,613	7,036	6,448	5,852
-2.67%	6,431	5,773	5,114	4,454	3,793	3,133	2,471
0%	1,909	1,280	643	0	-647	-1,298	-1,952
2.67%	-4,154	-4,624	-5,127	-5,656	-6,207	-6,774	-7,356
5.33%	-11,291	-11,571	-11,902	-12,275	-12,685	-13,127	-13,596
8.00%	-19,017	-19,152	-19,335	-19,563	-19,834	-20,144	-20,489
KR4201N5312018-05 콜315							19,207
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,184	8,930	8,631	8,293	7,922	7,521	7,096

-5.33%	8,113	7,655	7,168	6,659	6,132	5,591	5,038
-2.67%	5,818	5,199	4,574	3,947	3,316	2,684	2,049
0%	1,926	1,286	644	0	-646	-1,293	-1,941
2.67%	-3,536	-4,051	-4,589	-5,147	-5,720	-6,305	-6,900
5.33%	-10,182	-10,511	-10,886	-11,299	-11,744	-12,216	-12,711
8.00%	-17,528	-17,698	-17,918	-18,183	-18,489	-18,832	-19,207
KR4301N5312018-05 풋312.5							23,338

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23,016	-23,031	-23,058	-23,101	-23,161	-23,239	-23,338
-5.33%	-12,245	-12,395	-12,576	-12,783	-13,014	-13,265	-13,533
-2.67%	-3,404	-3,805	-4,210	-4,617	-5,027	-5,437	-5,849
0%	984	673	344	0	-355	-719	-1,091
2.67%	1,974	1,897	1,792	1,659	1,499	1,315	1,109
5.33%	2,063	2,056	2,042	2,017	1,978	1,922	1,850
8.00%	2,066	2,066	2,065	2,063	2,057	2,047	2,030

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

62,403

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

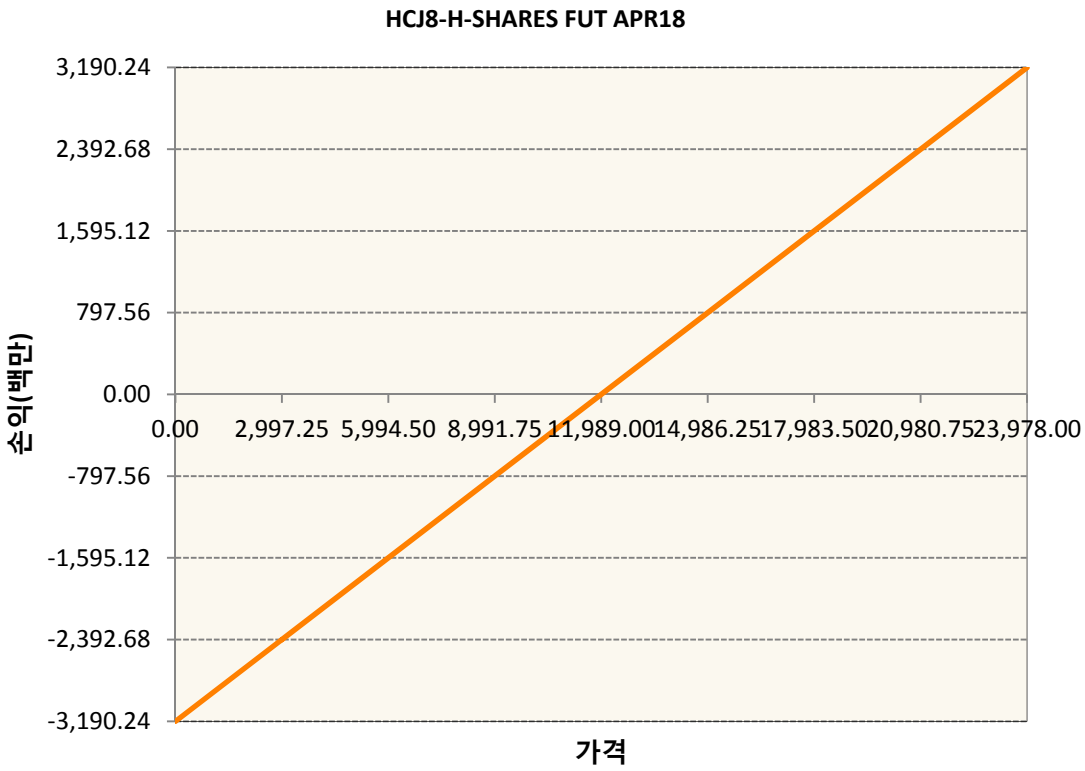
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

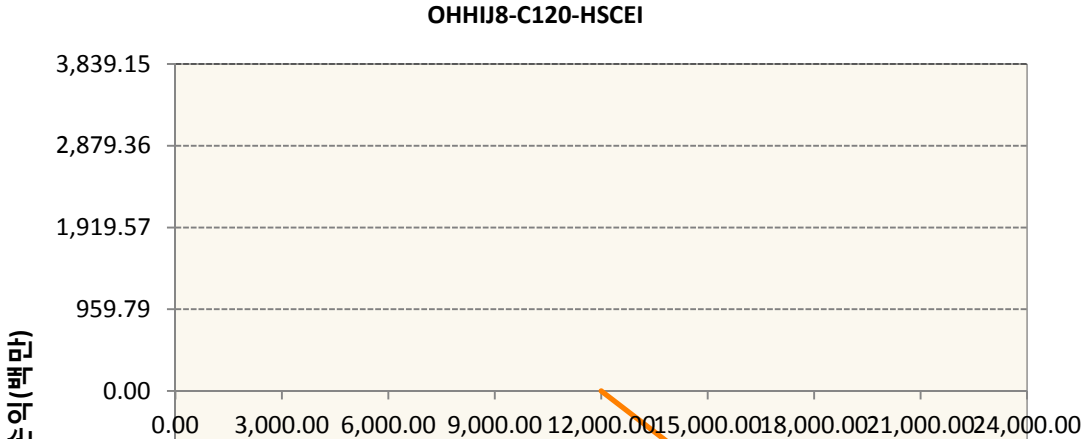
1. 계약금액

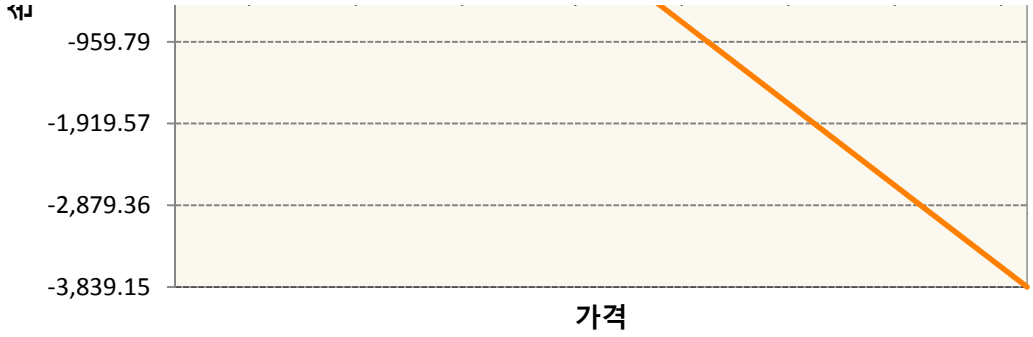
(단위:백만원)

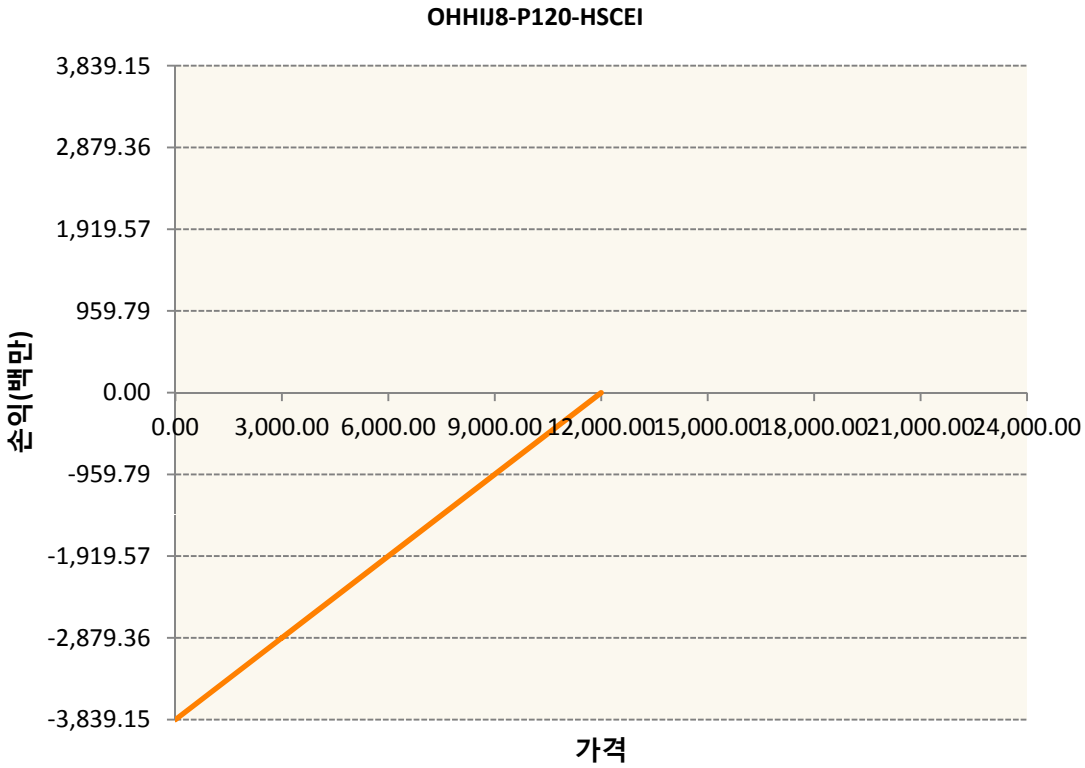
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,190	0	3,190	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,678	-7,678	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	255
OHHIJ8-C12	HSCEI	307
OHHIJ8-P12	HSCEI	307

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	766

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

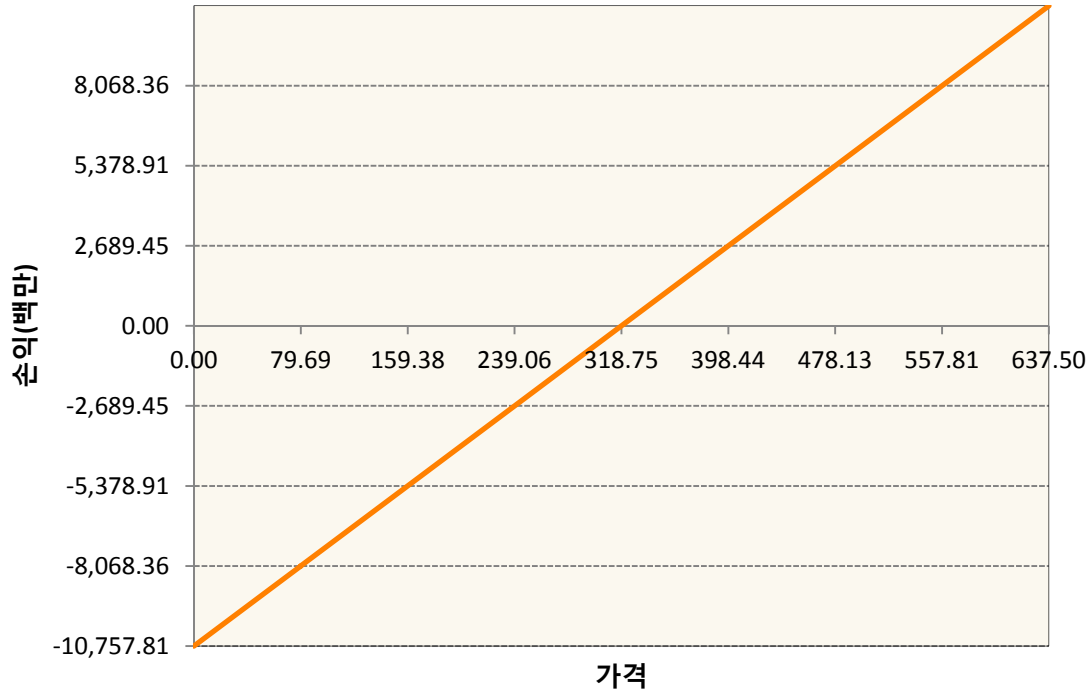
1. 계약금액

(단위:백만원)

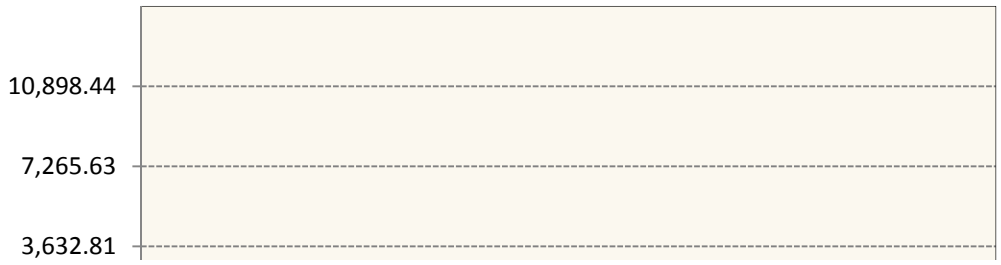
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,758	0	10,758	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

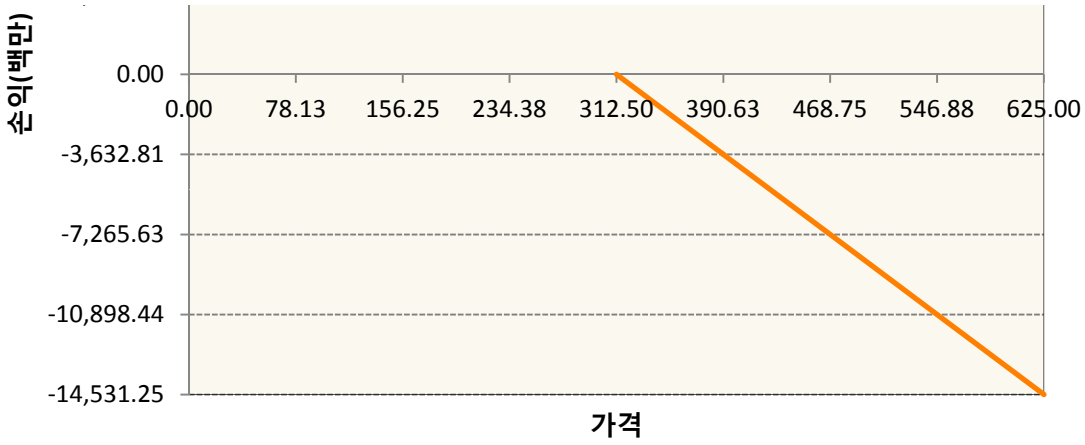
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

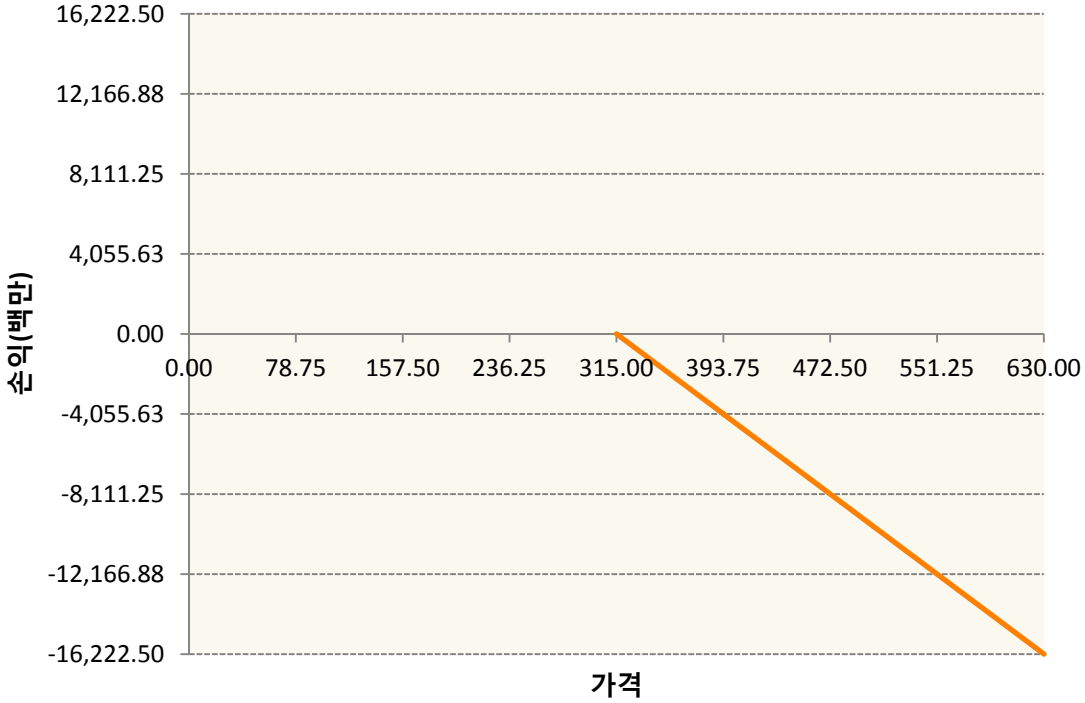


KR4201N53127-2018-05 콜312.5

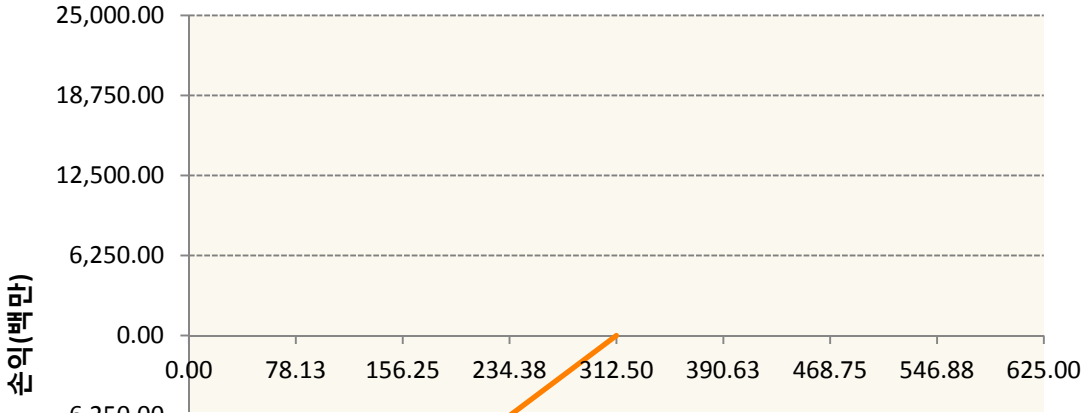




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462
-5.33%	-974	-974	-974	-974	-974	-974	-974
-2.67%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	487	487	487	487	487	487	487
5.33%	974	974	974	974	974	974	974
8.00%	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462
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%	-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%	277	277	277	277	277	277	277
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-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%	237	237	237	237	237	237	237
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						468
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-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%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	468	468	468	468	468	468	468
	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						632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632
-5.33%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-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%	421	421	421	421	421	421	421
8.00%	632	632	632	632	632	632	632
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474
-5.33%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-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%	316	316	316	316	316	316	316
8.00%	474	474	474	474	474	474	474
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						860
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-860	-860	-860	-860	-860	-860	-860
-5.33%	-574	-574	-574	-574	-574	-574	-574
-2.67%	-287	-287	-287	-287	-287	-287	-287
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	287	287	287	287	287	287	287
5.33%	574	574	574	574	574	574	574
8.00%	860	860	860	860	860	860	860
	KR4201N531 2018-05 콜312.5						998
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	519	504	486	467	446	424	401
-5.33%	450	425	398	371	343	314	285
-2.67%	313	281	249	217	185	153	120
0%	93	62	31	0	-32	-63	-95
2.67%	-202	-225	-250	-275	-302	-330	-358
5.33%	-550	-563	-579	-598	-618	-639	-662
8.00%	-926	-933	-941	-953	-966	-981	-998
	KR4201N531 2018-05 콜315						1,069
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	511	497	481	462	441	419	395
-5.33%	452	426	399	371	341	311	280
-2.67%	324	289	255	220	185	149	114
0%	107	72	36	0	-36	-72	-108
2.67%	-197	-226	-256	-287	-318	-351	-384
5.33%	-567	-585	-606	-629	-654	-680	-708
8.00%	-976	-985	-998	-1,012	-1,029	-1,048	-1,069
	KR4301N531 2018-05 풋312.5						1,436

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,416	-1,417	-1,419	-1,422	-1,425	-1,430	-1,436
-5.33%	-754	-763	-774	-787	-801	-816	-833
-2.67%	-209	-234	-259	-284	-309	-335	-360
0%	61	41	21	0	-22	-44	-67
2.67%	121	117	110	102	92	81	68
5.33%	127	127	126	124	122	118	114
8.00%	127	127	127	127	127	126	125

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

8,214

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

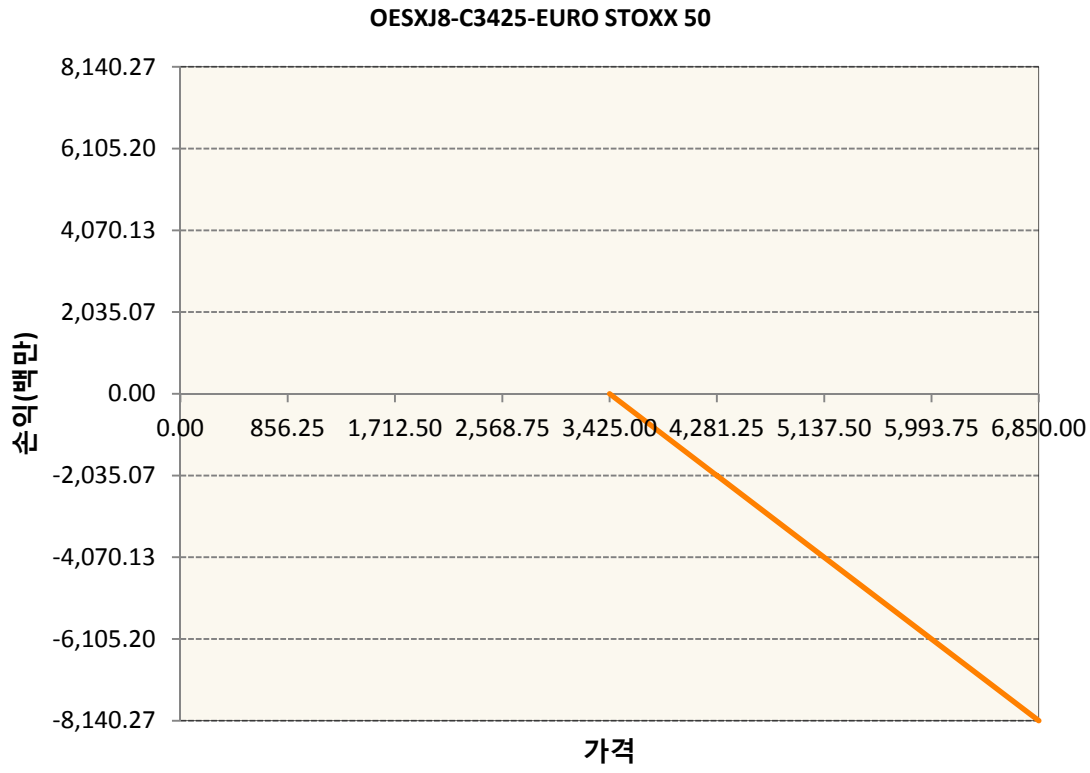
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

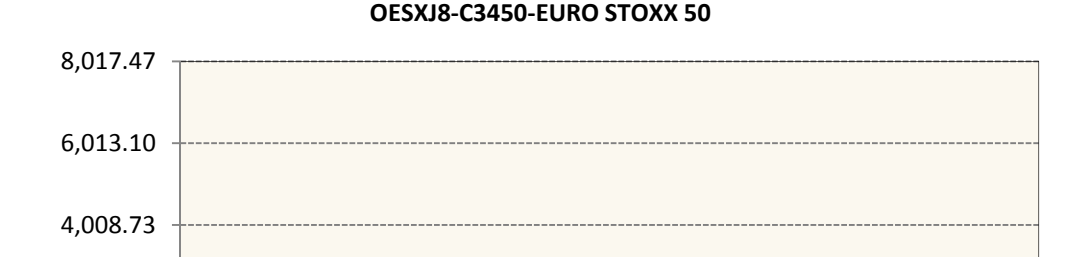
1. 계약금액

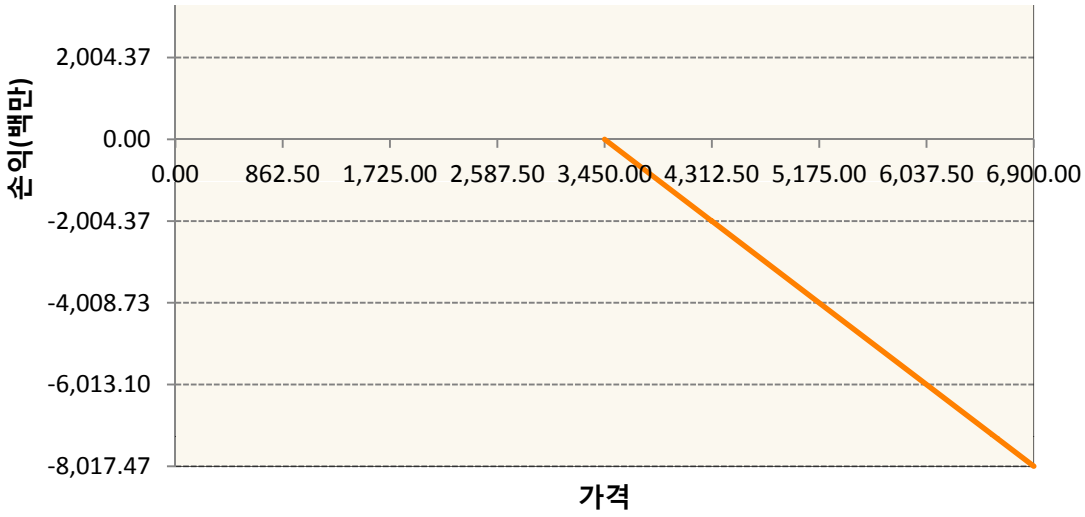
(단위:백만원)

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	7,685	0	7,685	
누계	유가증권	스왑	76,269	0	76,269	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,315	-32,315	장내
누계	지수	스왑	52,818	0	52,818	장외

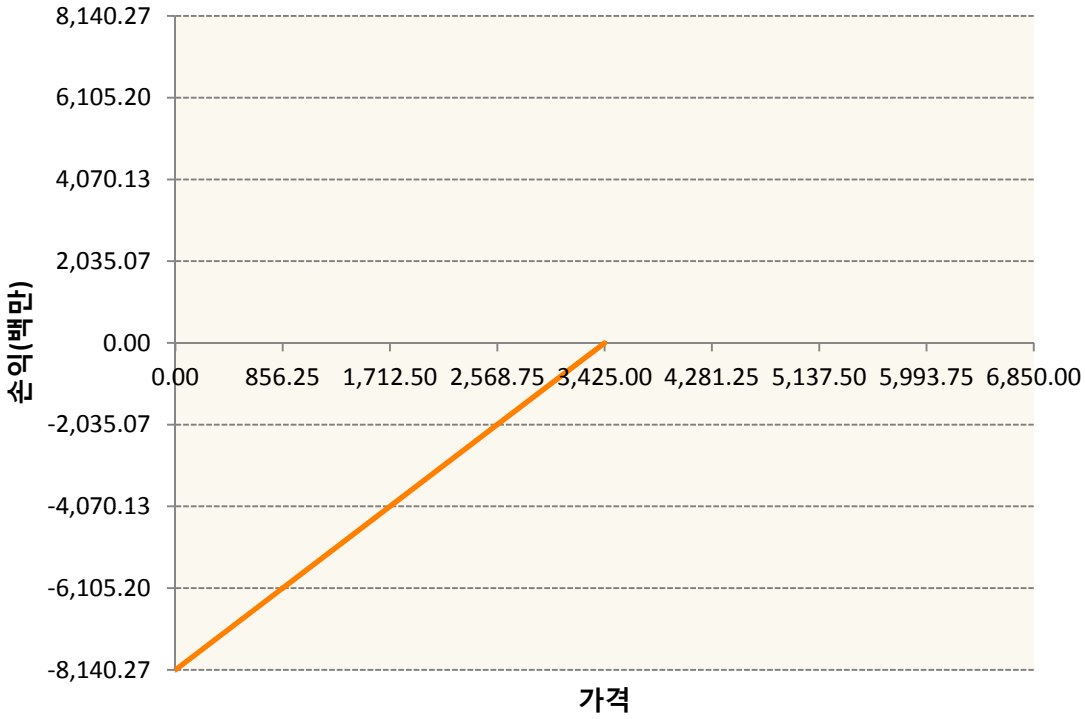
2. 만기시점의 손익구조



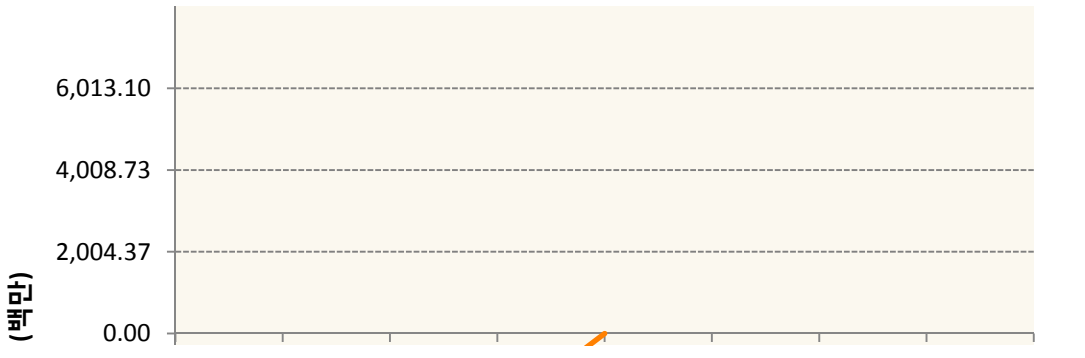


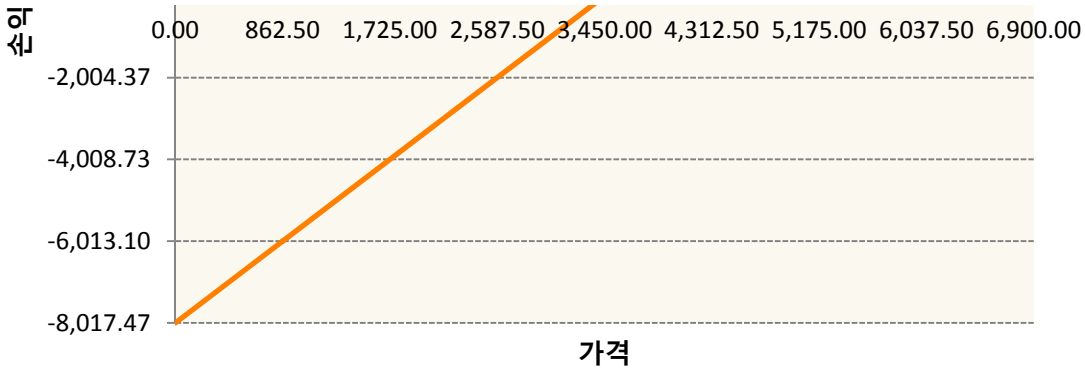


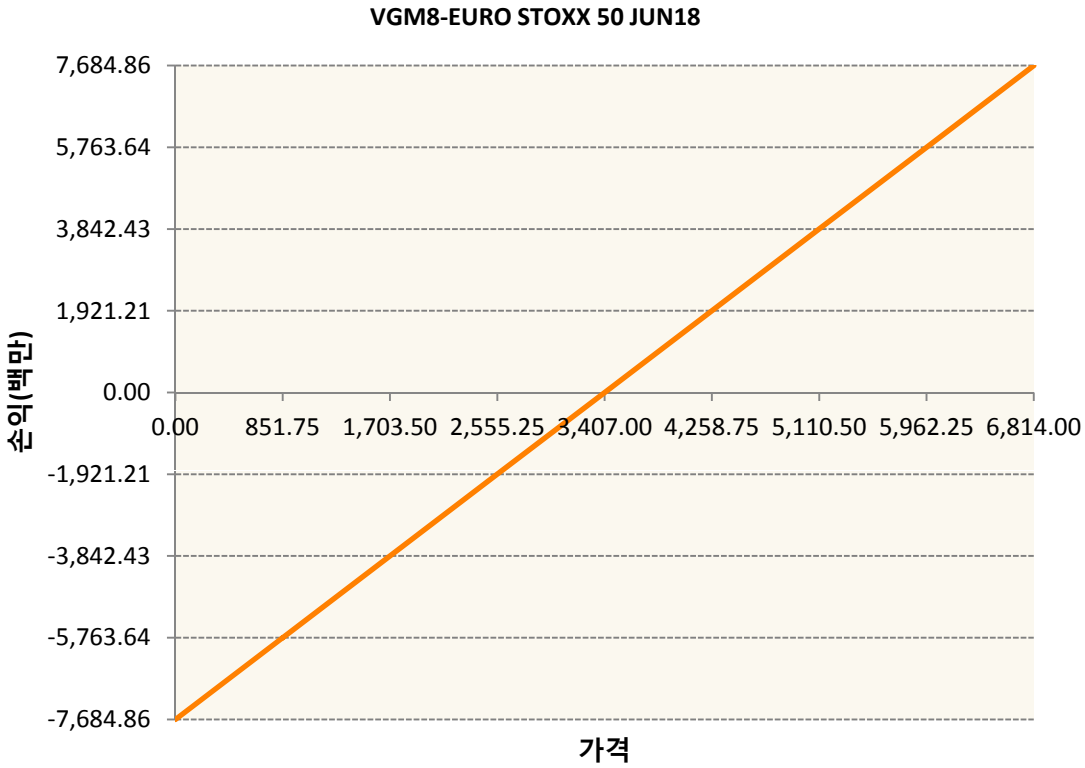
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	95
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	138
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	615

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

2,139

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

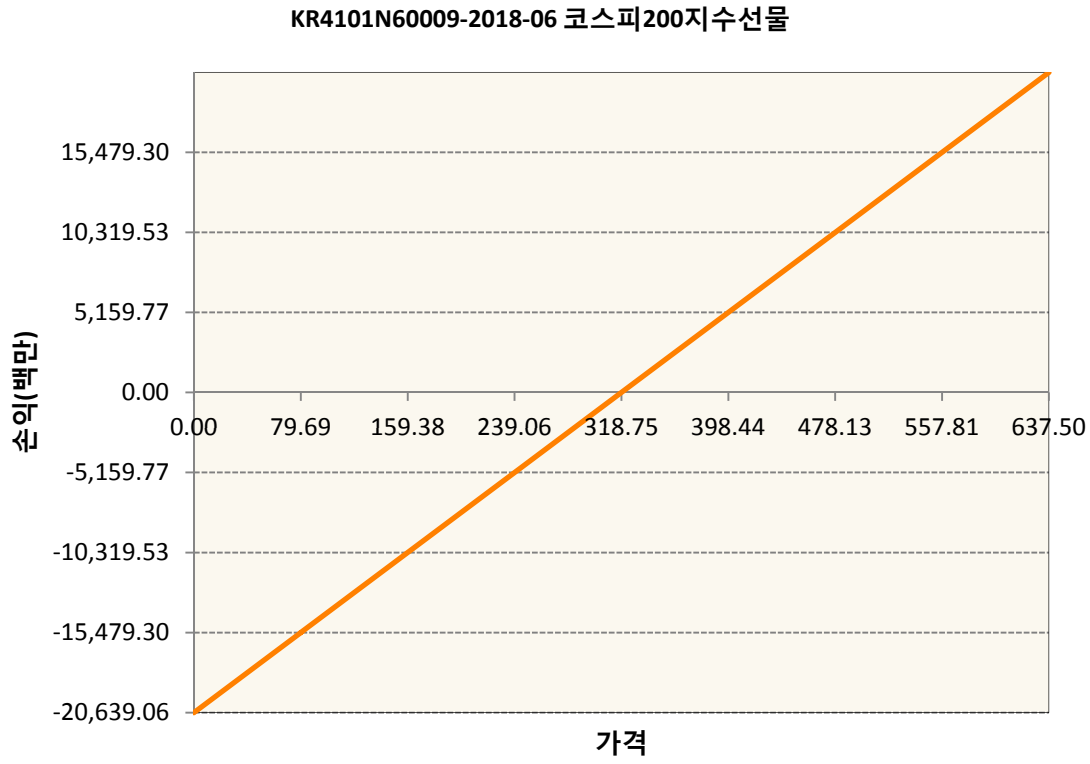
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,639	0	20,639	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,651
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,651	-1,651	-1,651	-1,651	-1,651	-1,651	-1,651
-5.33%	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100	-1,100
-2.67%	-550	-550	-550	-550	-550	-550	-550
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	550	550	550	550	550	550	550
5.33%	1,100	1,100	1,100	1,100	1,100	1,100	1,100
8.00%	1,651	1,651	1,651	1,651	1,651	1,651	1,651

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

1,209

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

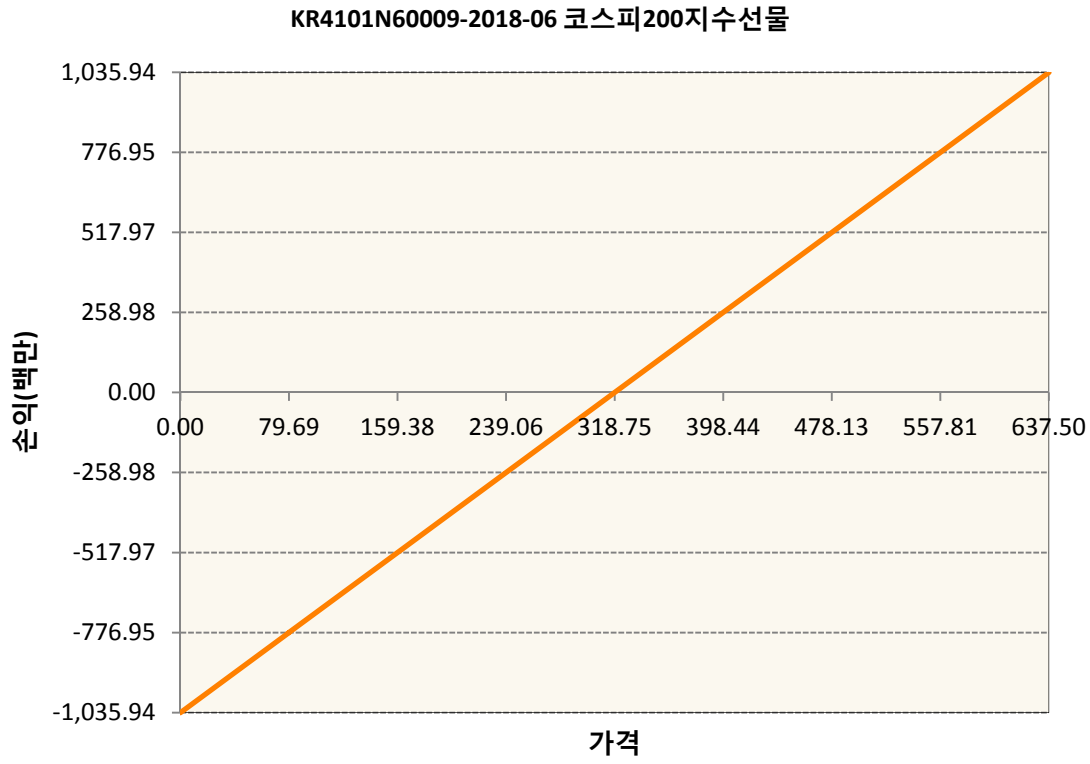
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,036	0	1,036	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 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)

61

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

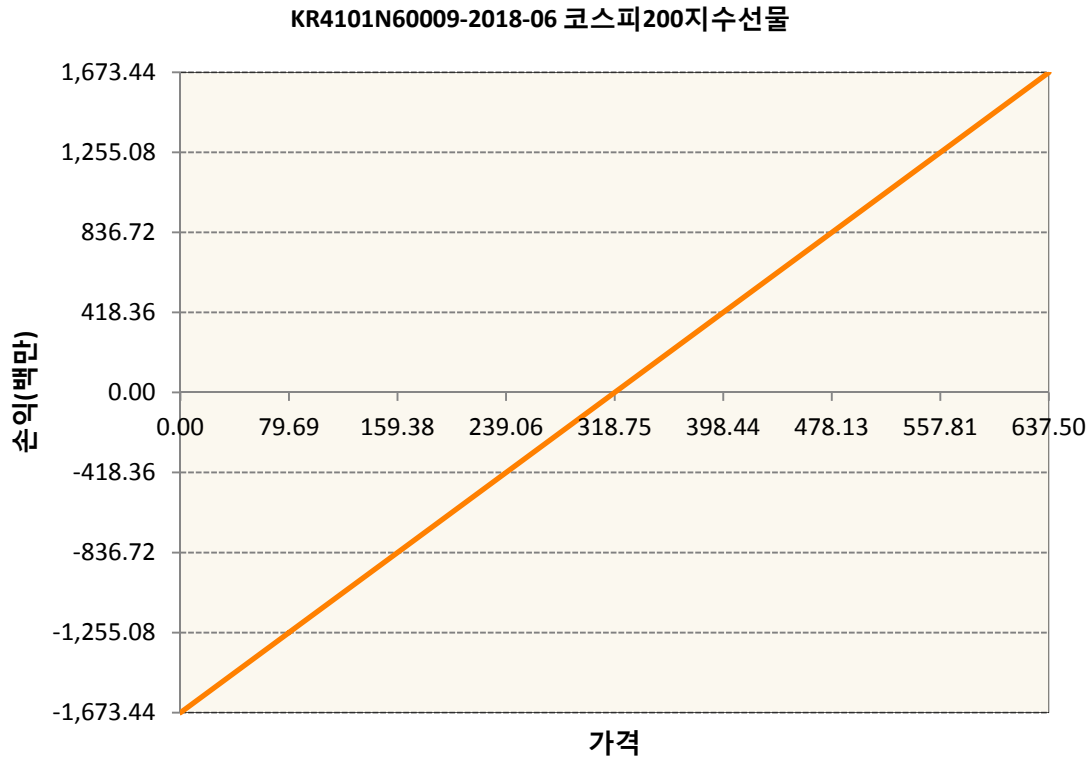
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,673	0	1,673	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							134
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	134	134	134	134	134	134	134

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

98

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

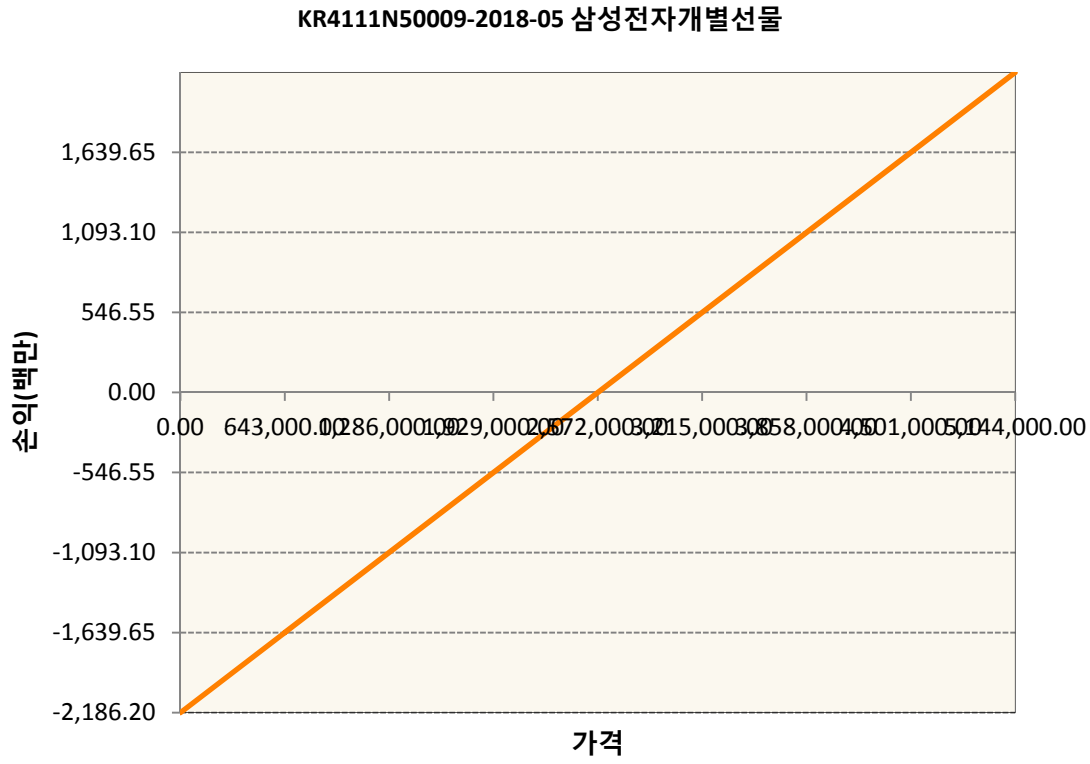
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,186	0	2,186	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N50(2018-05 삼성전자개별선물							175
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175
-5.33%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-2.67%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	58	58	58	58	58	58	58
5.33%	116	116	116	116	116	116	116
8.00%	175	175	175	175	175	175	175

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

219

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

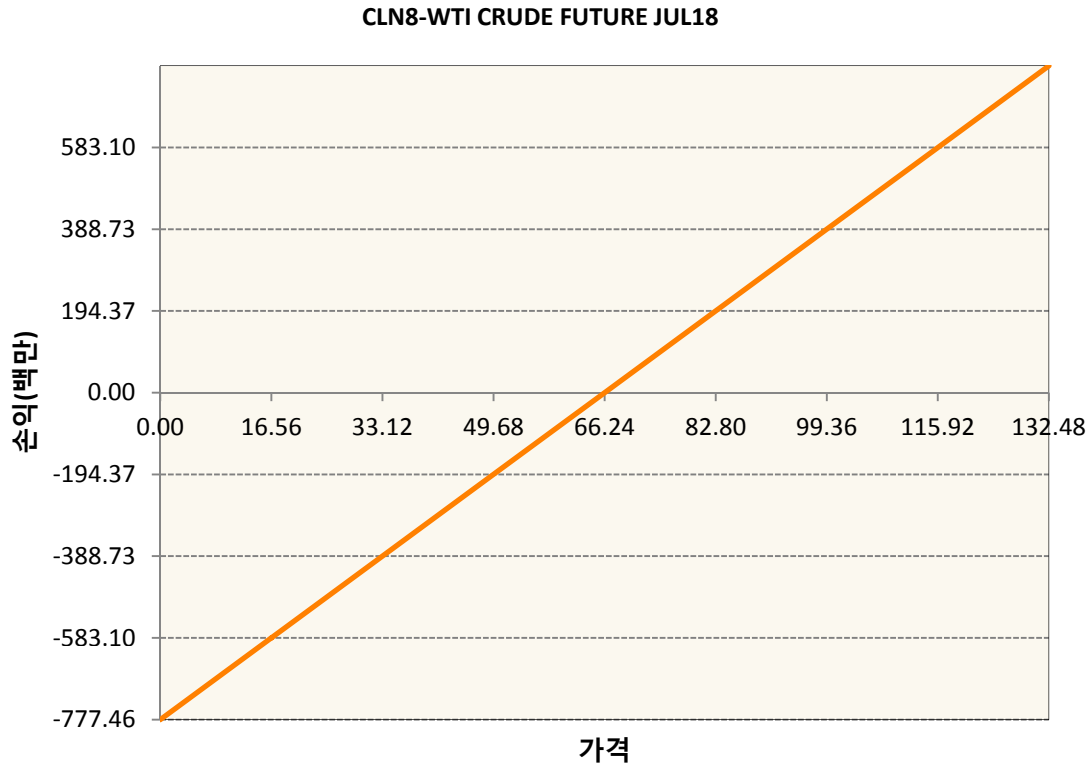
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

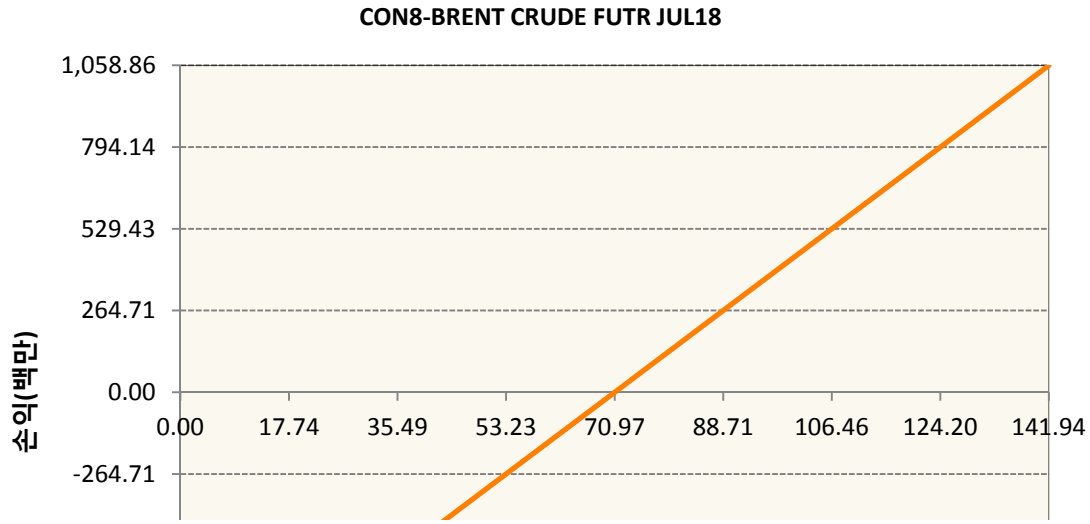
1. 계약금액

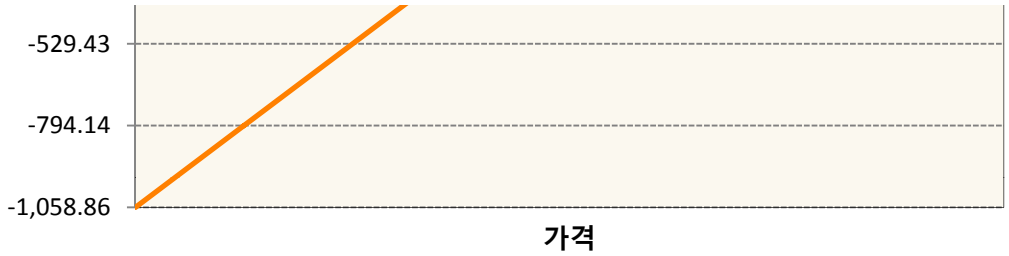
(단위:백만원)

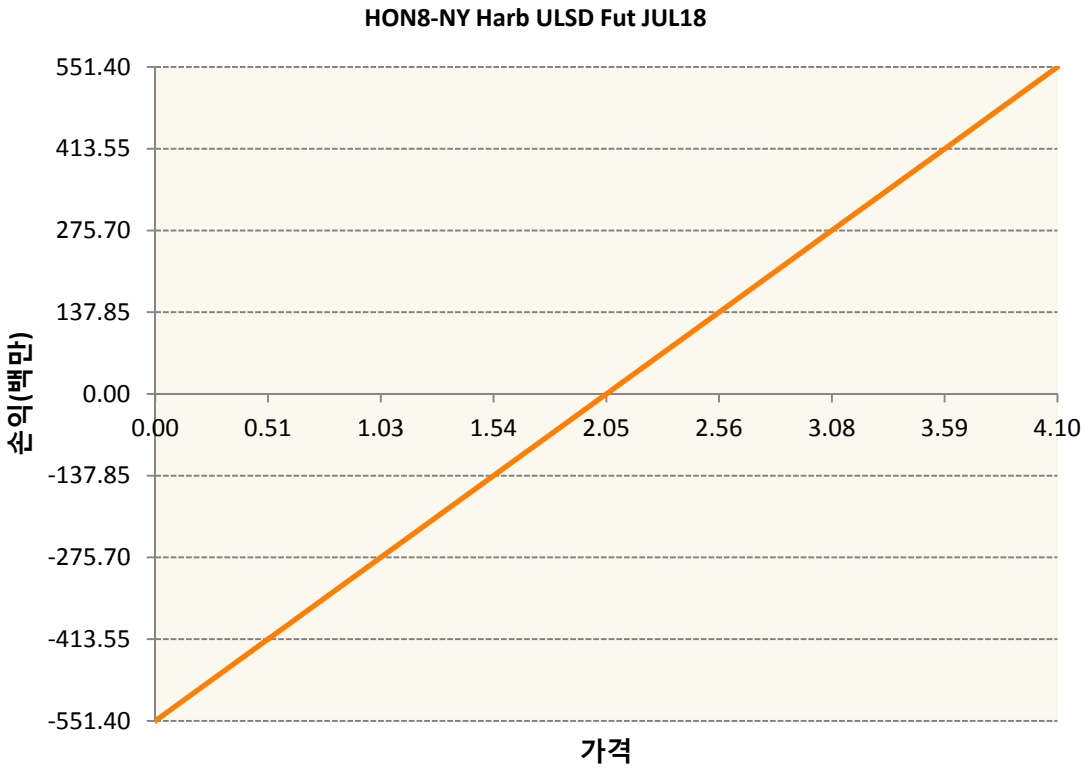
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,018	587	3,432	

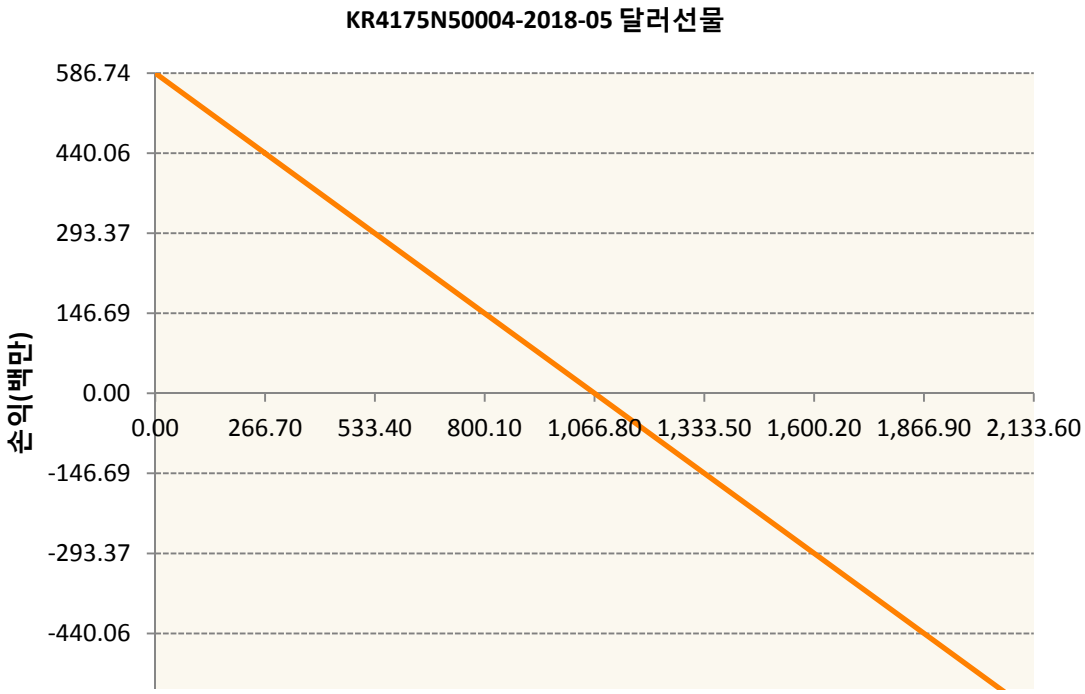
2. 만기시점의 손익구조

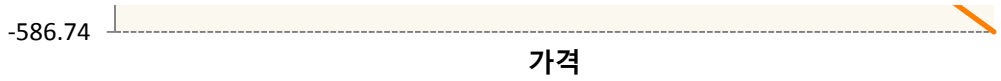


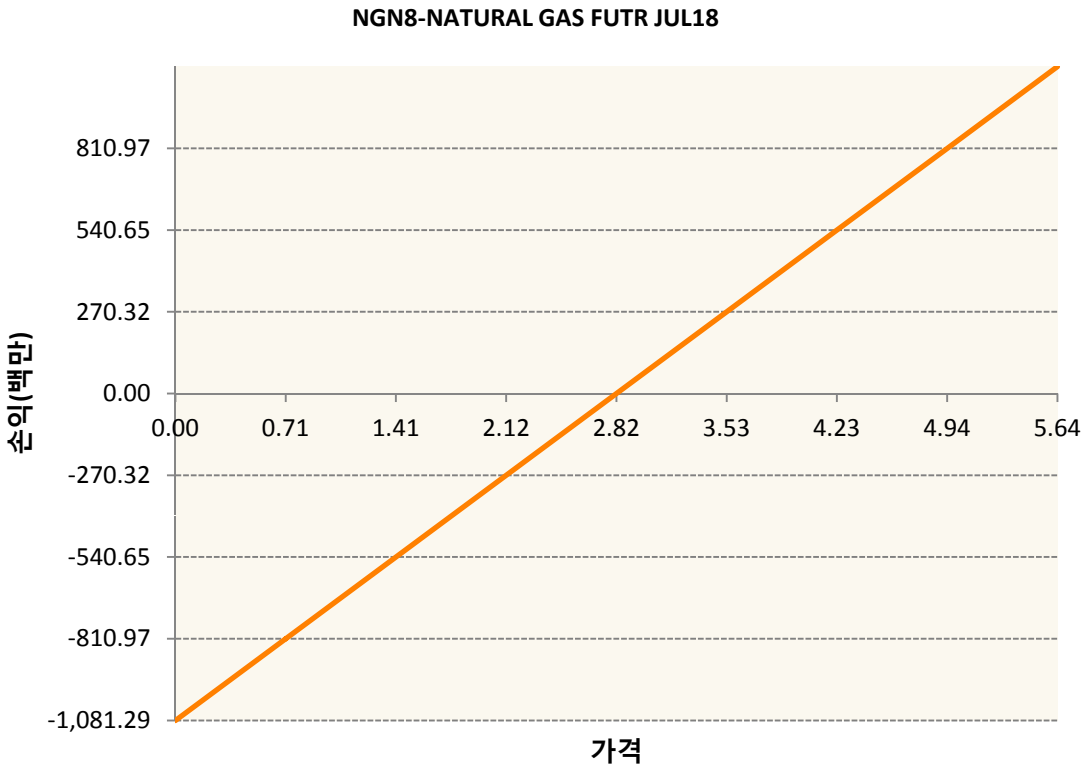


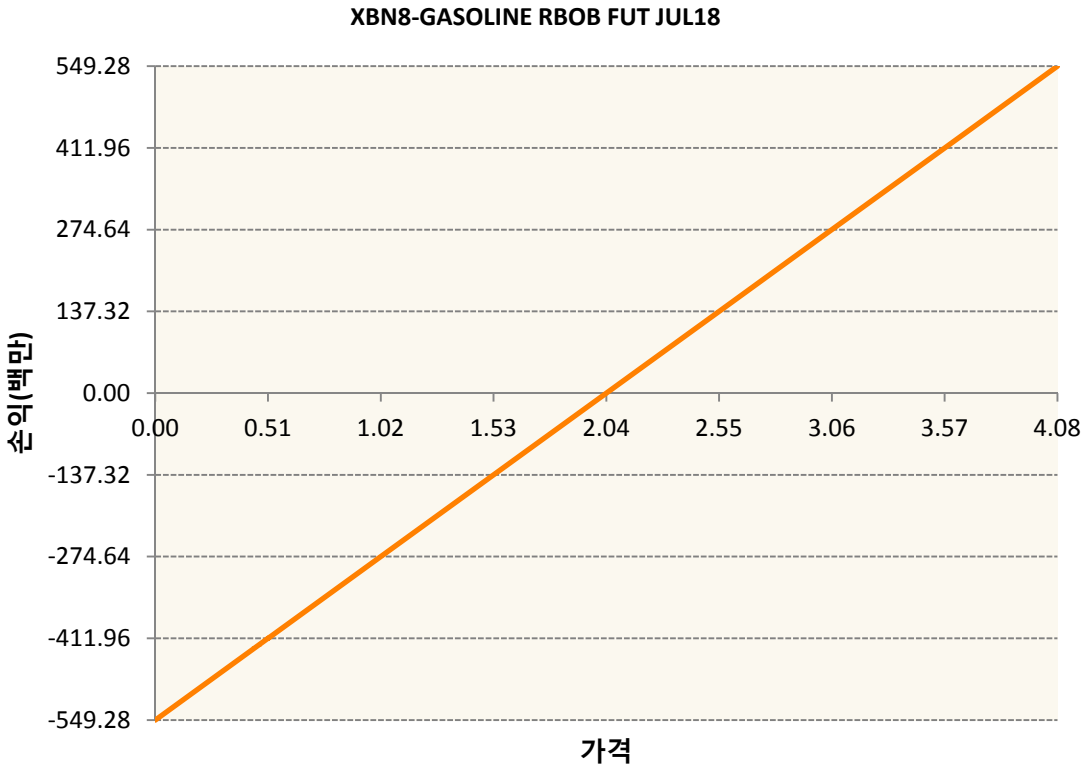

-529.43
-794.14
-1,058.86
가격


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18
551.40
413.55
275.70
137.85
0.00
-137.85
-275.70
-413.55
-551.40
0.00
0.51
1.03
1.54
2.05
2.56
3.08
3.59
4.10
손익(백만)
가격


KR4175N50004-2018-05 달러선물
586.74
440.06
293.37
146.69
0.00
-146.69
-293.37
-440.06
0.00
266.70
533.40
800.10
1,066.80
1,333.50
1,600.20
1,866.90
2,133.60
손익(백만)


-586.74
가격


NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18
손익(백만)
810.97
540.65
270.32
0.00
-270.32
-540.65
-810.97
-1,081.29
0.00
0.71
1.41
2.12
2.82
3.53
4.23
4.94
5.64
가격


XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18
손익(백만)
549.28
411.96
274.64
137.32
0.00
-137.32
-274.64
-411.96
-549.28
0.00
0.51
1.02
1.53
2.04
2.55
3.06
3.57
4.08
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	62
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	85
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	44
KR4175N50(	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	87
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	44

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

511

공시일	2018-04-19
기준일	2018-04-18

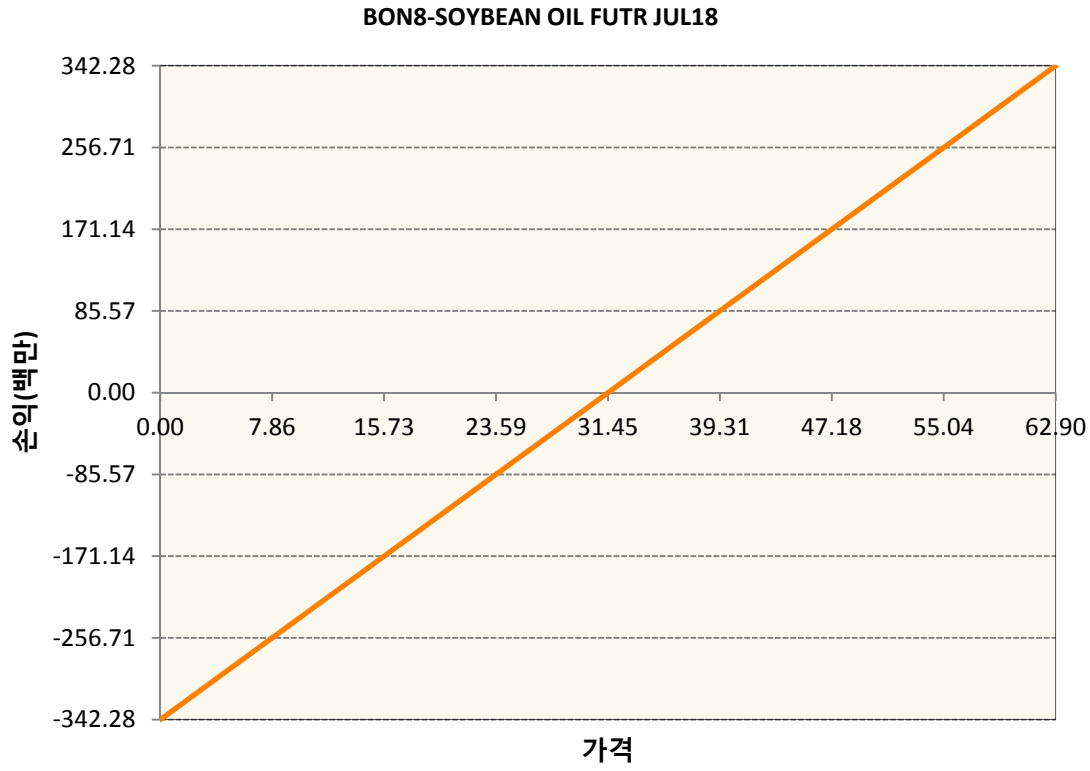
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

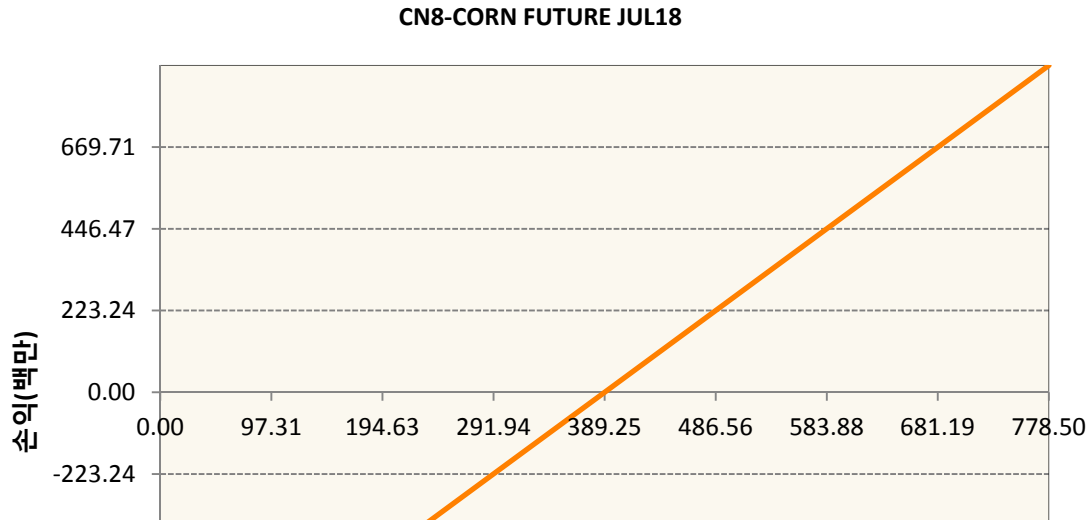
1. 계약금액

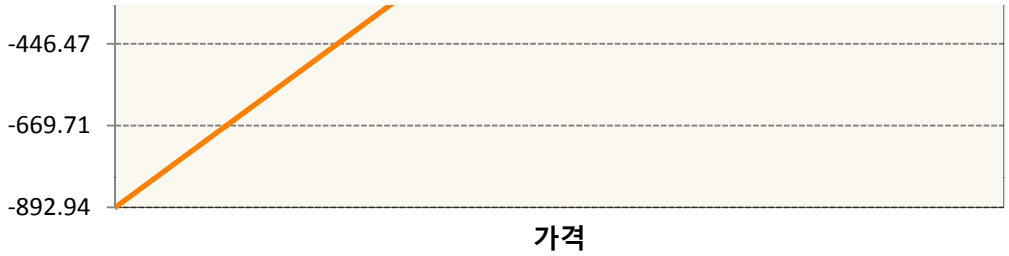
(단위:백만원)

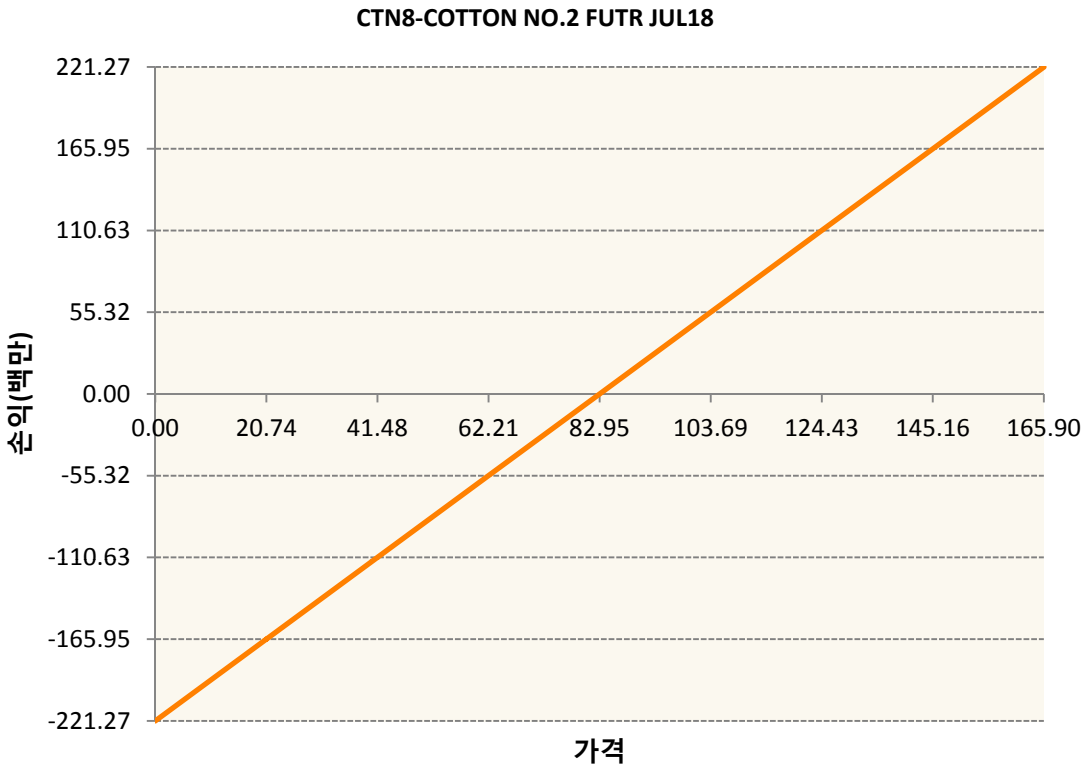
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,108	320	3,788	

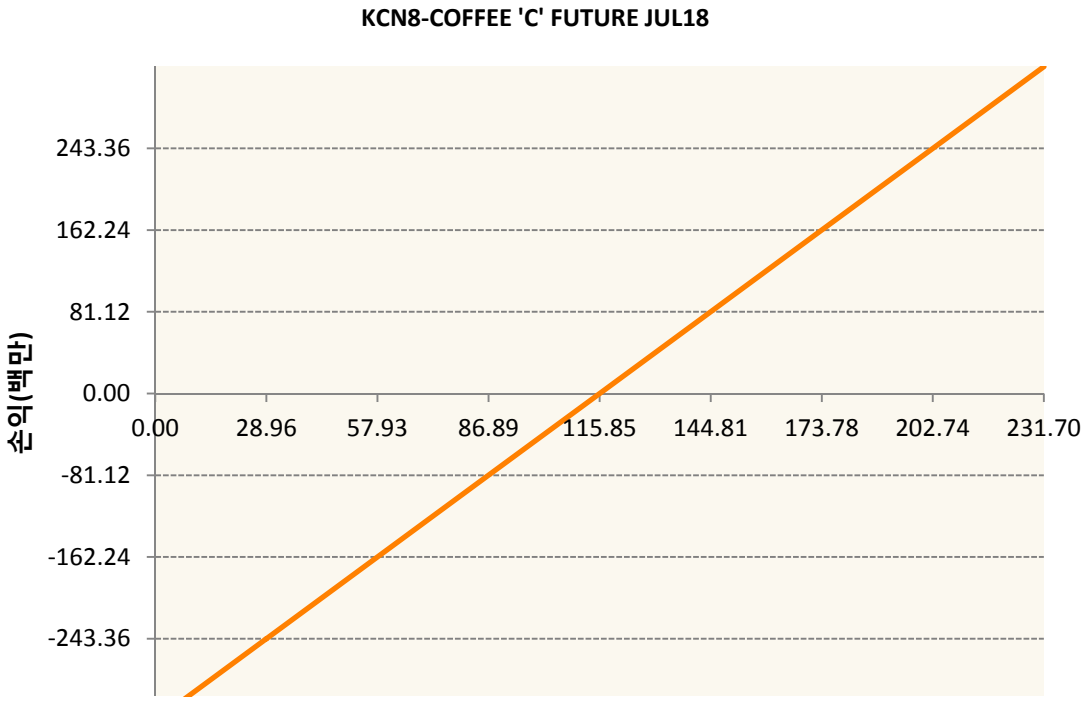
2. 만기시점의 손익구조

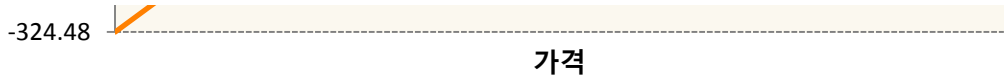


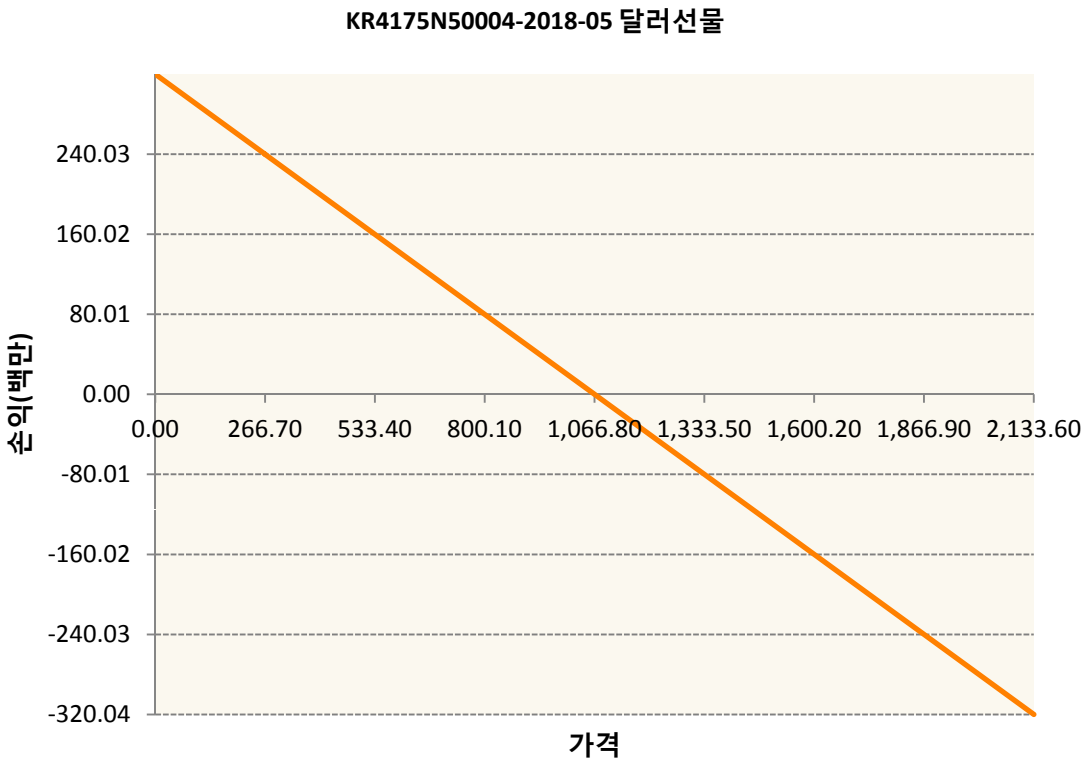


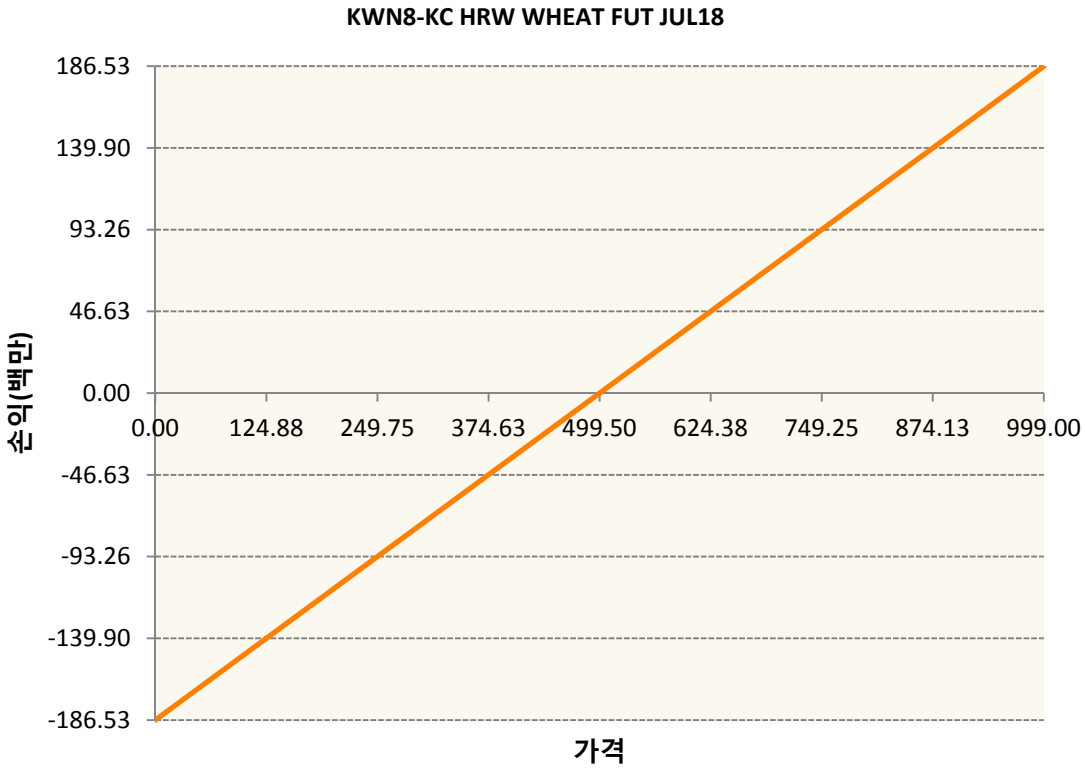

-446.47
-669.71
-892.94
가격

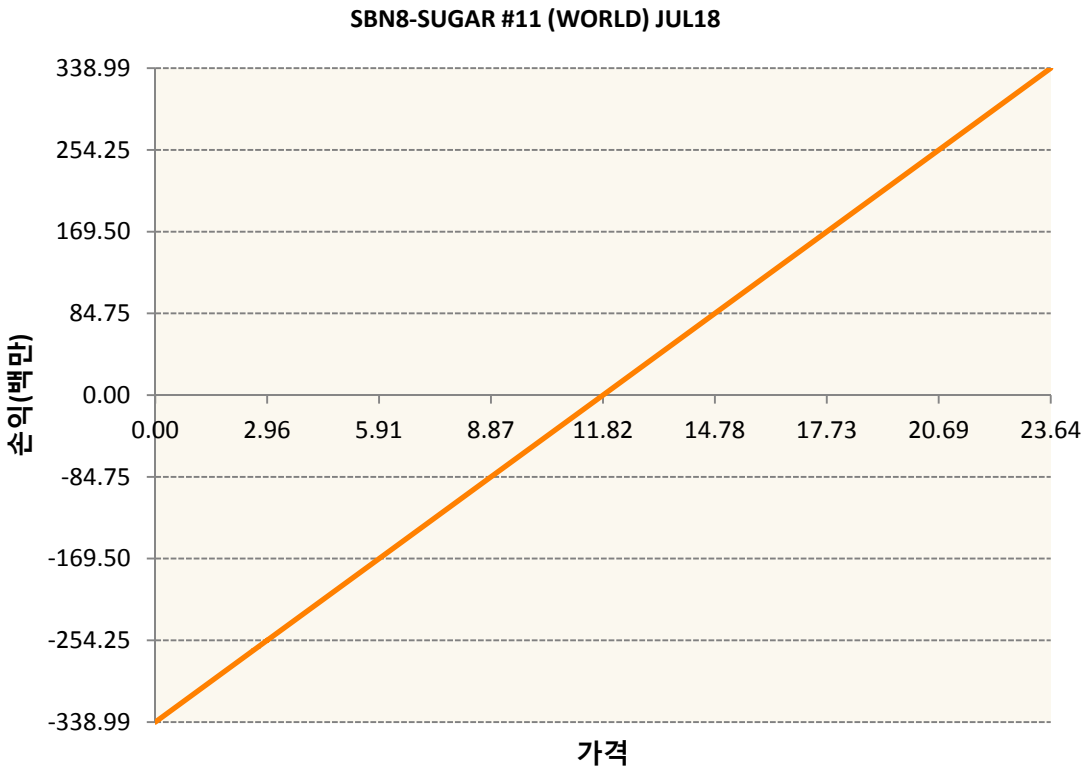

CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18
221.27
165.95
110.63
55.32
0.00
-55.32
-110.63
-165.95
-221.27
0.00
20.74
41.48
62.21
82.95
103.69
124.43
145.16
165.90
손익(백만)
가격

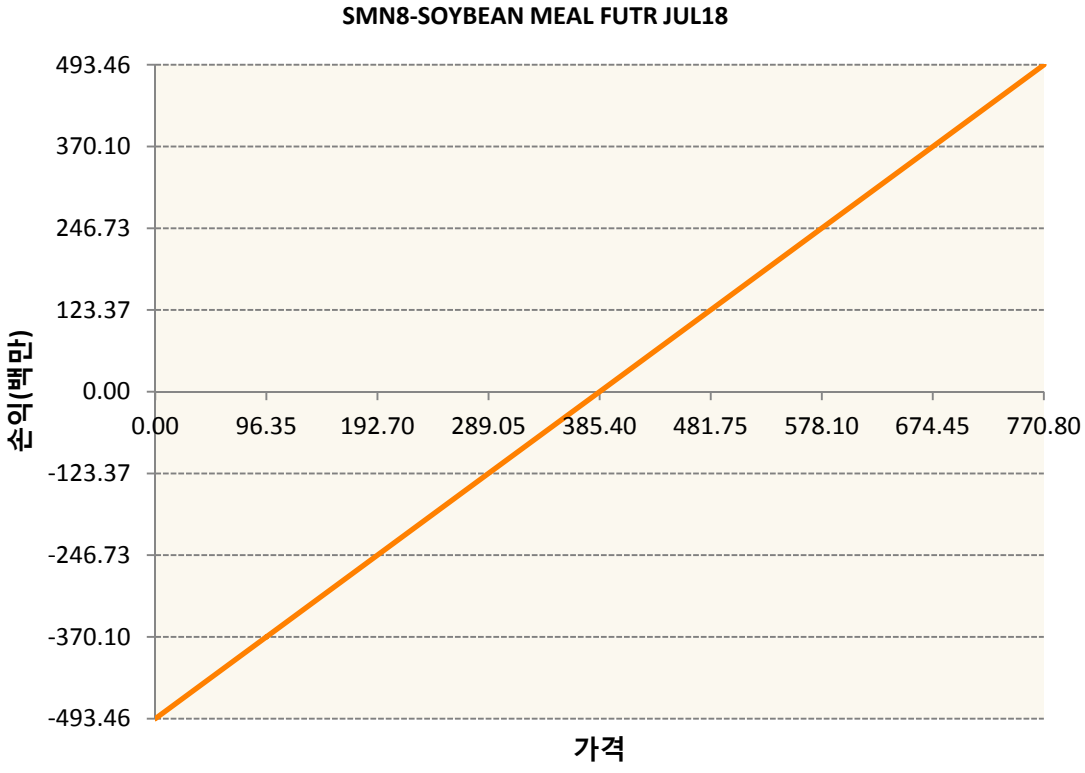

KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18
243.36
162.24
81.12
0.00
-81.12
-162.24
-243.36
0.00
28.96
57.93
86.89
115.85
144.81
173.78
202.74
231.70
손익(백만)

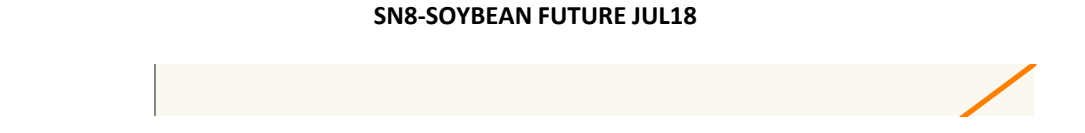

-324.48
가격

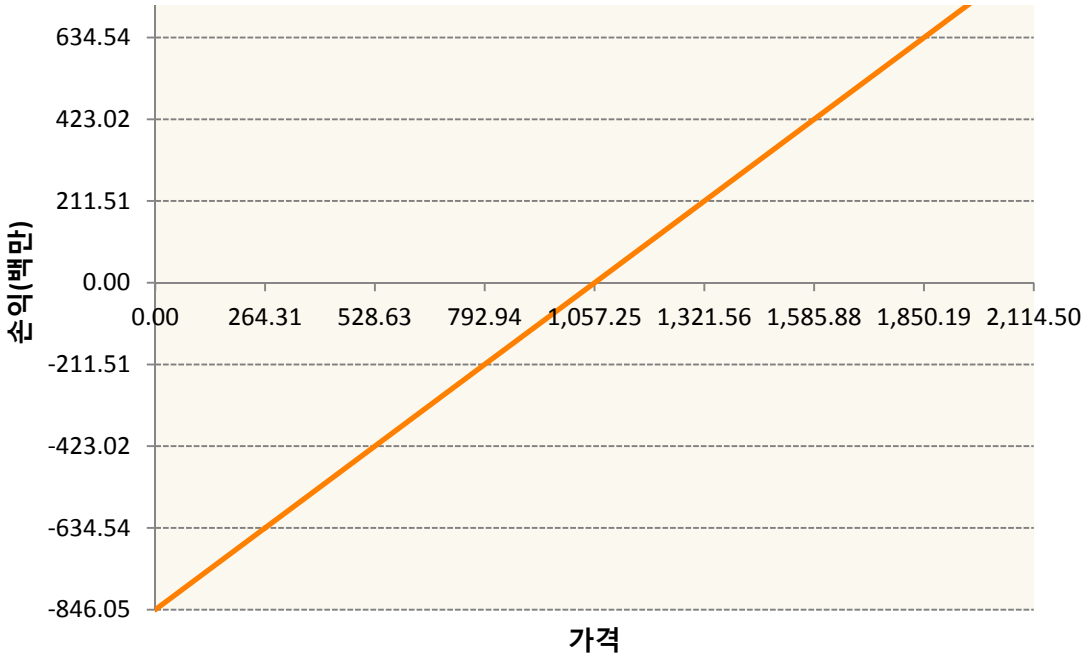

KR4175N50004-2018-05 달러선물
240.03
160.02
80.01
0.00
-80.01
-160.02
-240.03
-320.04
0.00
266.70
533.40
800.10
1,066.80
1,333.50
1,600.20
1,866.90
2,133.60
손익(백만)
가격

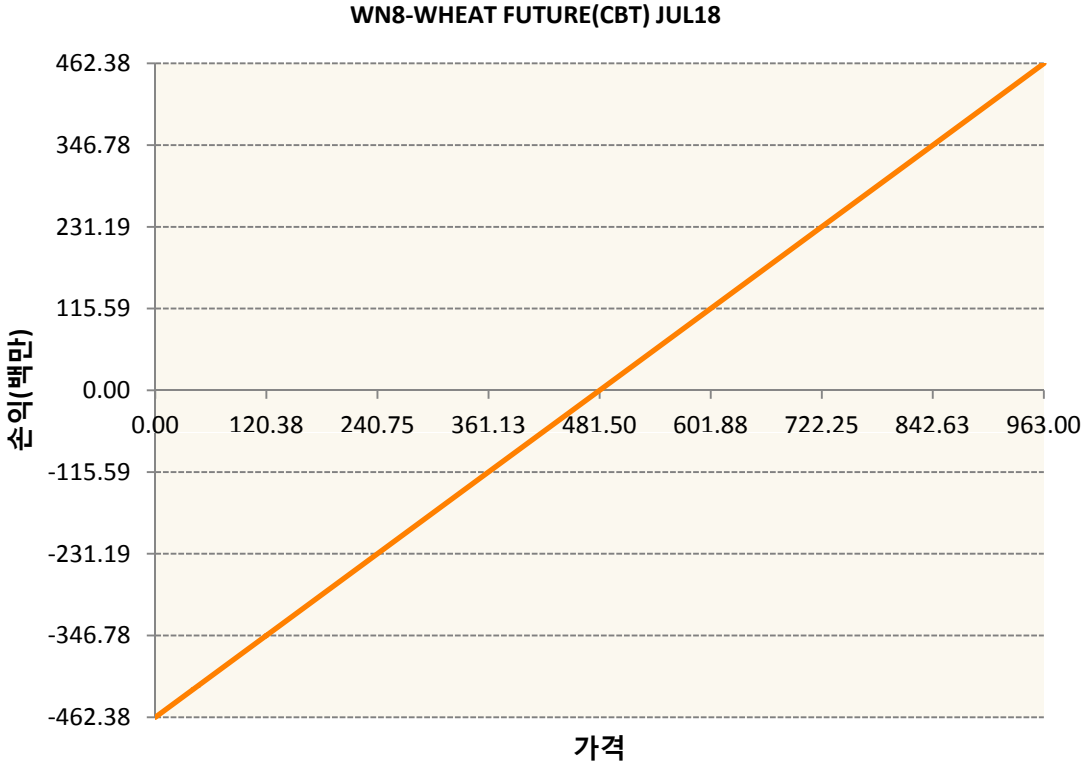

KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18
186.53
139.90
93.26
46.63
0.00
-46.63
-93.26
-139.90
-186.53
0.00
124.88
249.75
374.63
499.50
624.38
749.25
874.13
999.00
손익(백만)
가격


SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18
338.99
254.25
169.50
84.75
0.00
-84.75
-169.50
-254.25
-338.99
0.00
2.96
5.91
8.87
11.82
14.78
17.73
20.69
23.64
손익(백만)
가격


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18
493.46
370.10
246.73
123.37
0.00
-123.37
-246.73
-370.10
-493.46
0.00
96.35
192.70
289.05
385.40
481.75
578.10
674.45
770.80
손익(백만)
가격


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	27
CN8	CORN FUTURE JUL18	71
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	18
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	26
KR4175N50(	2018-05 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	15
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	27
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	39
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	68
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	37

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

330