공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

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	6	0	6	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	2018-10-10
기준일	2018-10-08

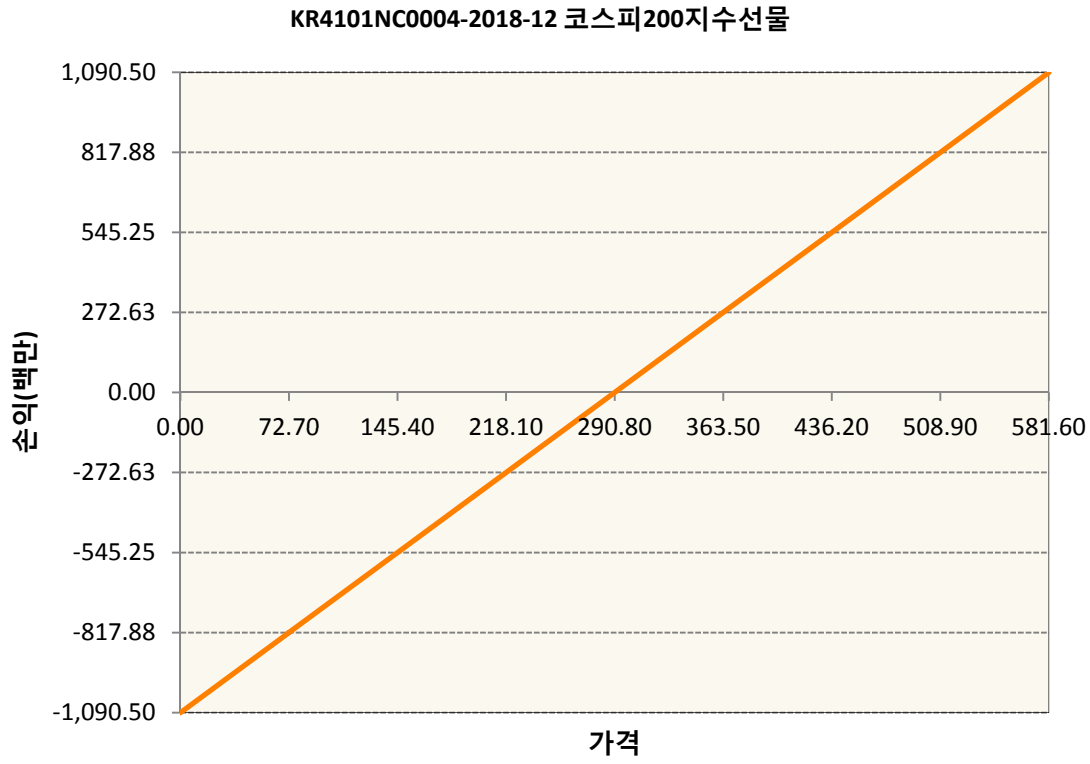
스마트인덱스모

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	1,091	0	1,091	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물							87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

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

66

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

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	14,259	0	14,259	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180822	1,144

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

482

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

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	3,685	0	3,685	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910	282

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

359

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

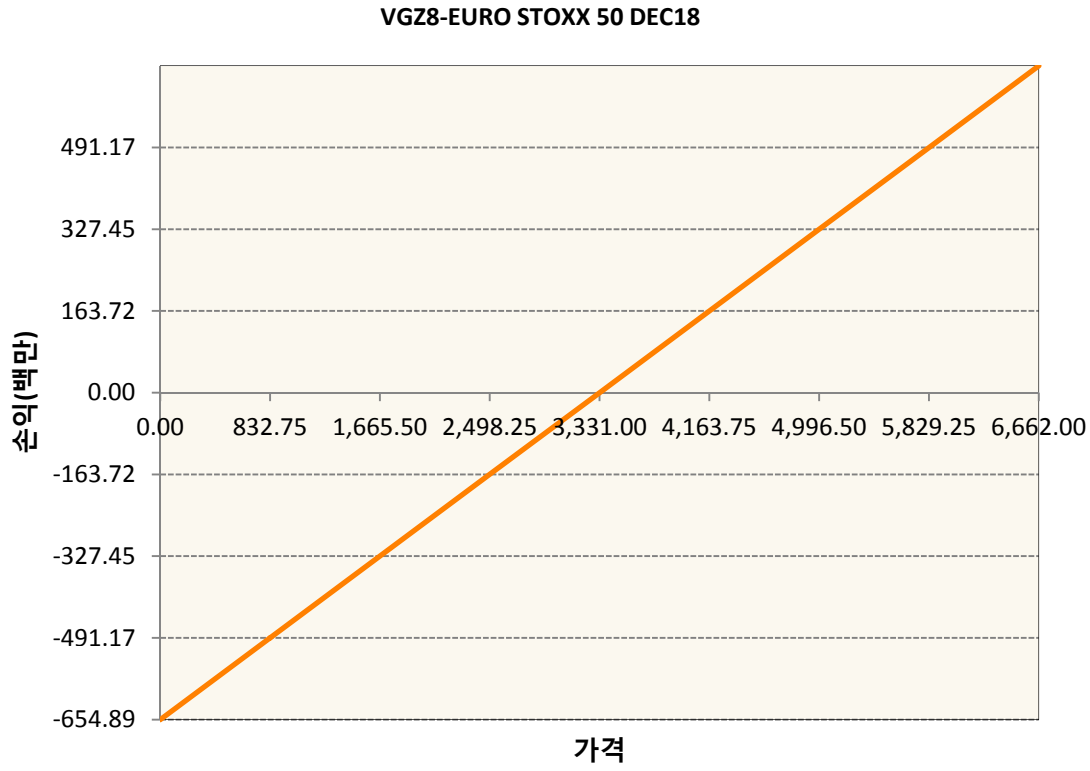
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	655	0	655	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	52

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

(단위:백만원)

32

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

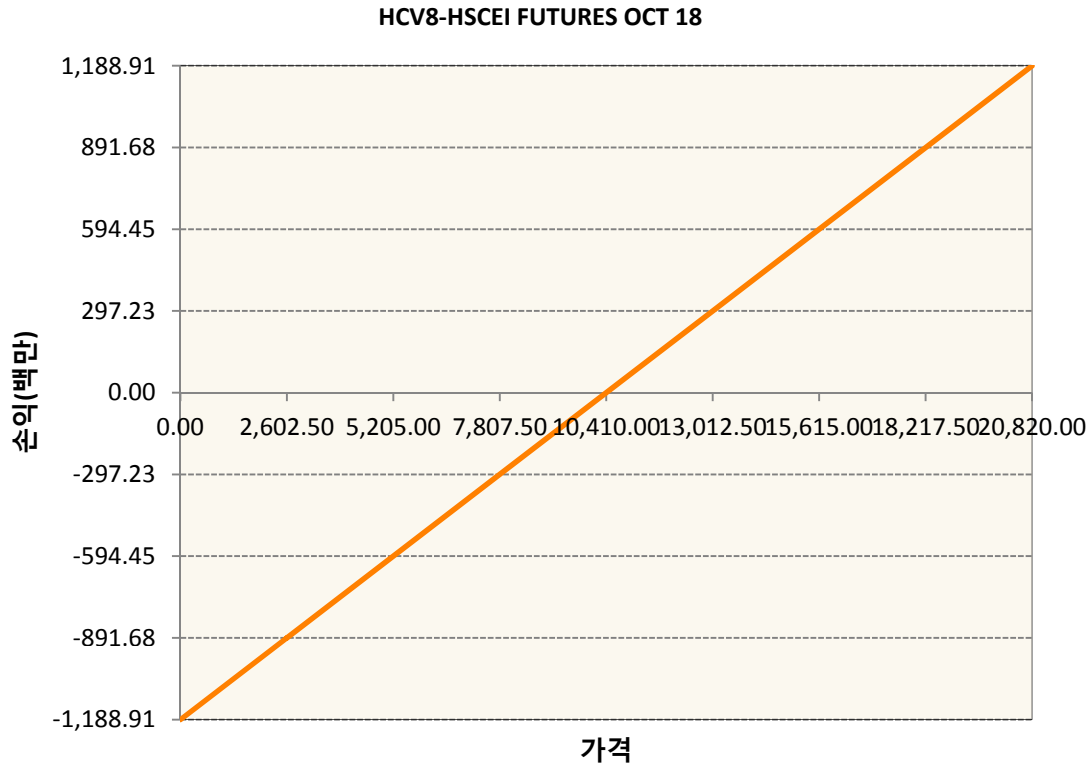
차이나인덱스모(주식-파생형)

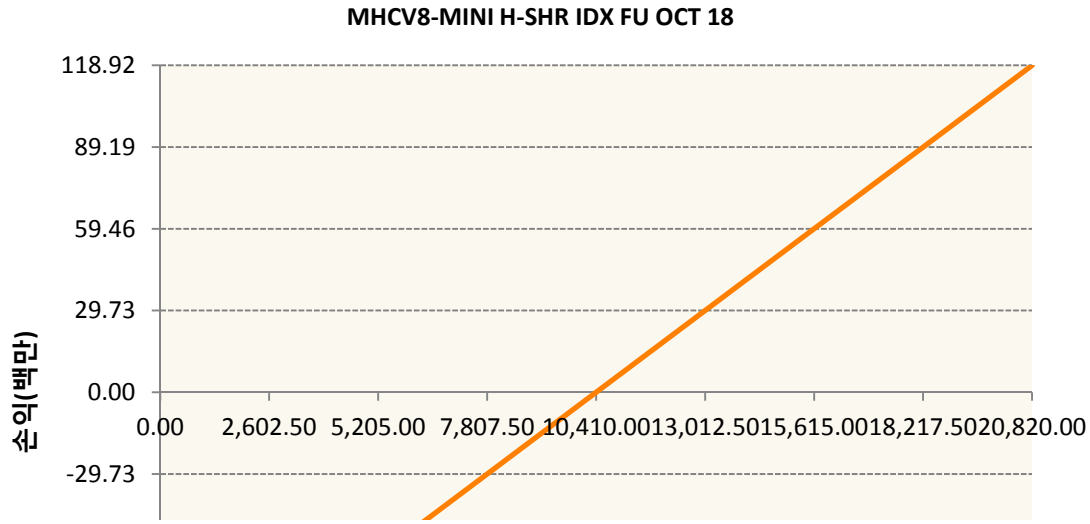
1. 계약금액

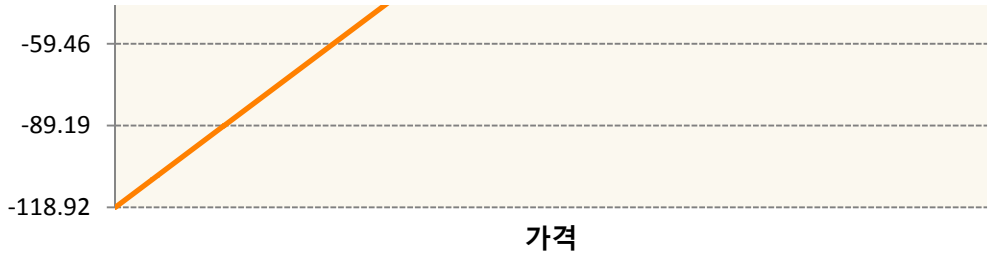
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,308	0	1,308	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCV8	HSCEI FUTURES OCT 18	95
MHCV8	MINI H-SHR IDX FU OCT 18	10

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

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

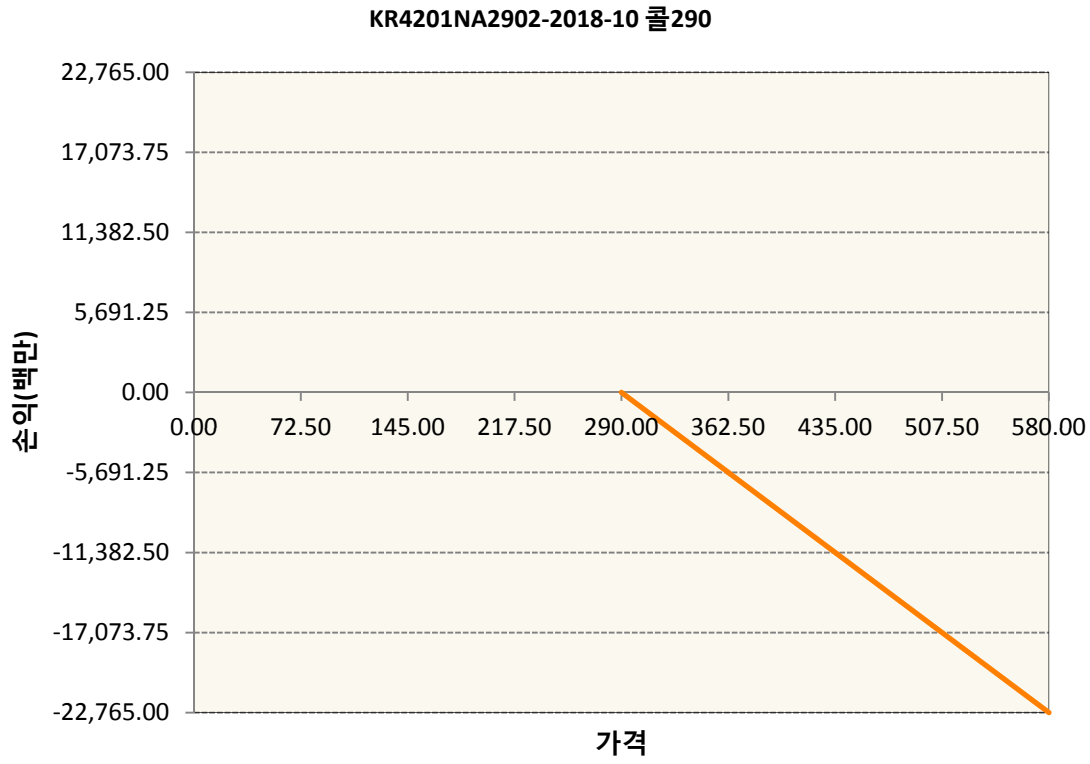
커버드콜모(주식혼합-파생형)

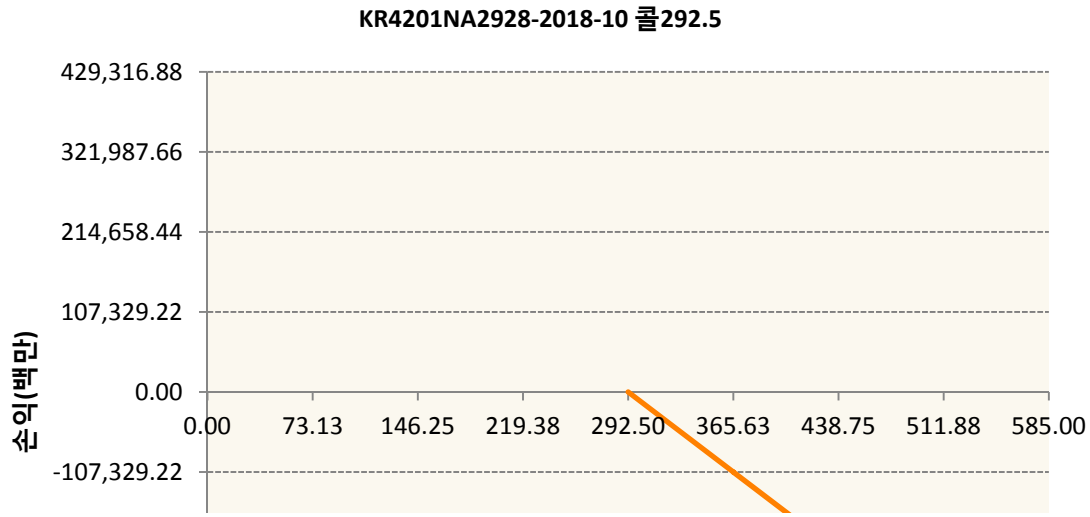
1. 계약금액

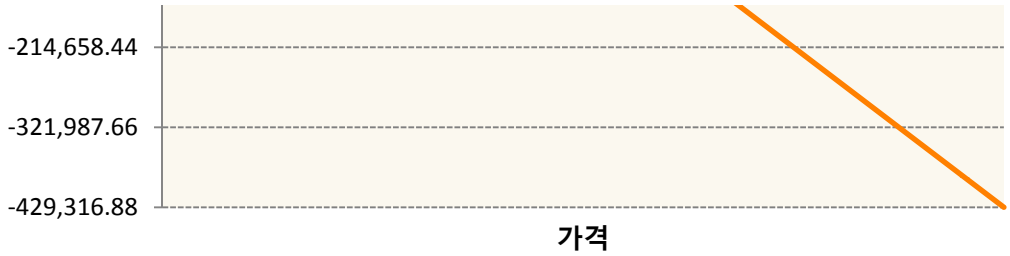
(단위:백만원)

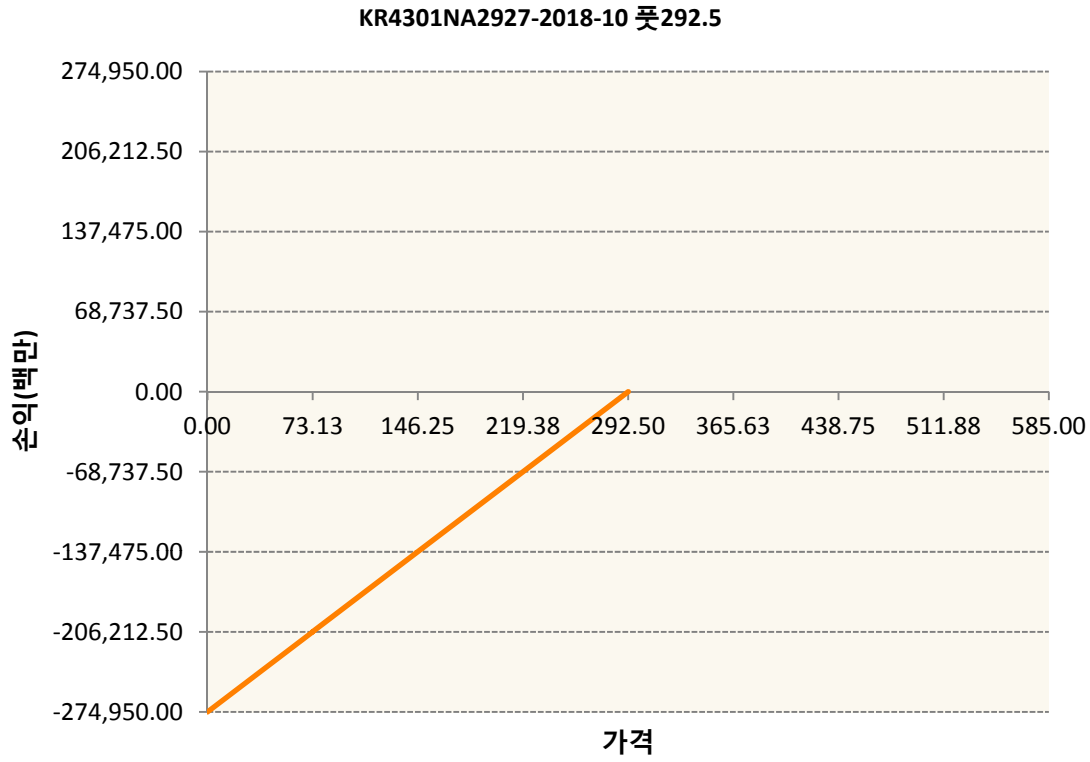
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	727,032	-727,032	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201NA2(2018-10 콜290							1,599
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	216	216	216	216	216	215	215
-5.33%	216	215	215	214	212	210	207
-2.67%	204	198	190	181	171	160	148
0%	55	37	18	0	-18	-37	-55
2.67%	-398	-405	-414	-424	-435	-446	-459
5.33%	-991	-991	-992	-994	-996	-999	-1,003
8.00%	-1,597	-1,597	-1,597	-1,597	-1,598	-1,598	-1,599
KR4201NA2(2018-10 콜292.5							27,792
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,493	2,493	2,493	2,493	2,492	2,491	2,489

-5.33%	2,493	2,491	2,488	2,480	2,466	2,445	2,414
-2.67%	2,425	2,367	2,287	2,186	2,063	1,922	1,763
0%	941	633	319	0	-322	-648	-975
2.67%	-5,750	-5,980	-6,227	-6,489	-6,763	-7,046	-7,337
5.33%	-16,414	-16,442	-16,487	-16,549	-16,631	-16,731	-16,850
8.00%	-27,736	-27,737	-27,739	-27,744	-27,753	-27,769	-27,792
	KR4301NA2	2018-10 풋292.5					21,328

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21,328	-21,328	-21,328	-21,328	-21,328	-21,328	-21,328
-5.33%	-14,062	-14,062	-14,062	-14,062	-14,062	-14,062	-14,062
-2.67%	-6,797	-6,797	-6,797	-6,798	-6,801	-6,805	-6,811
0%	240	165	85	0	-89	-181	-275
2.67%	2,877	2,853	2,821	2,782	2,737	2,684	2,626
5.33%	2,907	2,907	2,907	2,907	2,906	2,905	2,904
8.00%	2,907	2,907	2,907	2,907	2,907	2,907	2,907

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

65,489

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

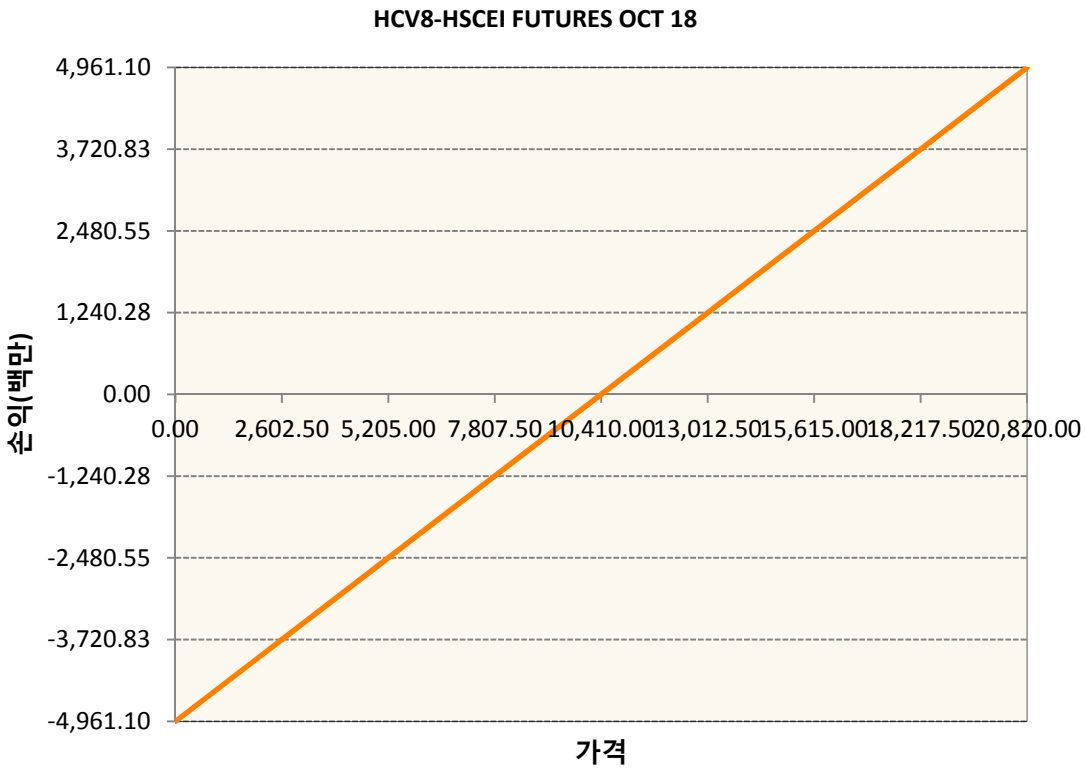
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

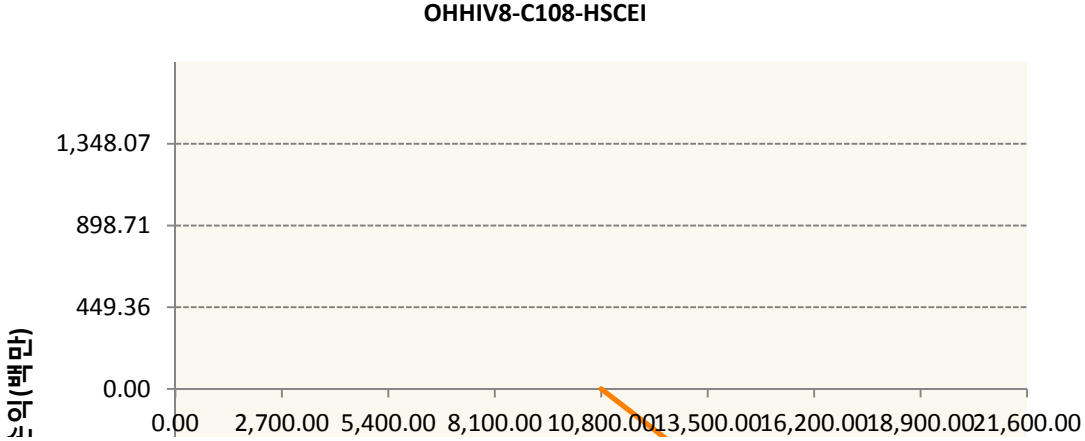
1. 계약금액

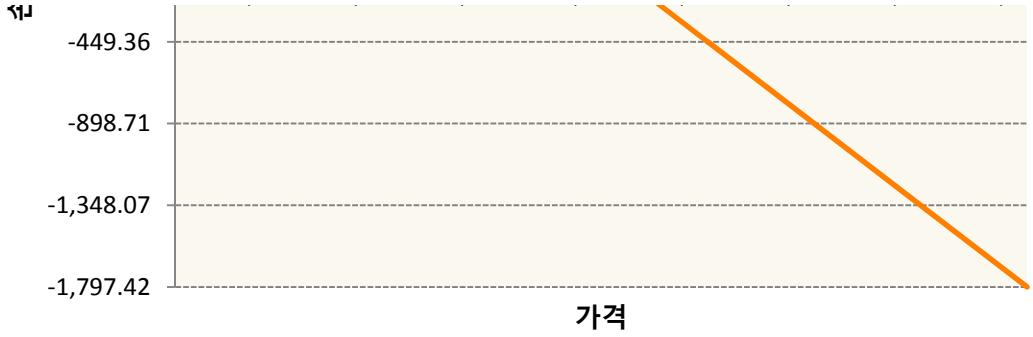
(단위:백만원)

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	4,961	0	4,961	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,873	-11,873	장내

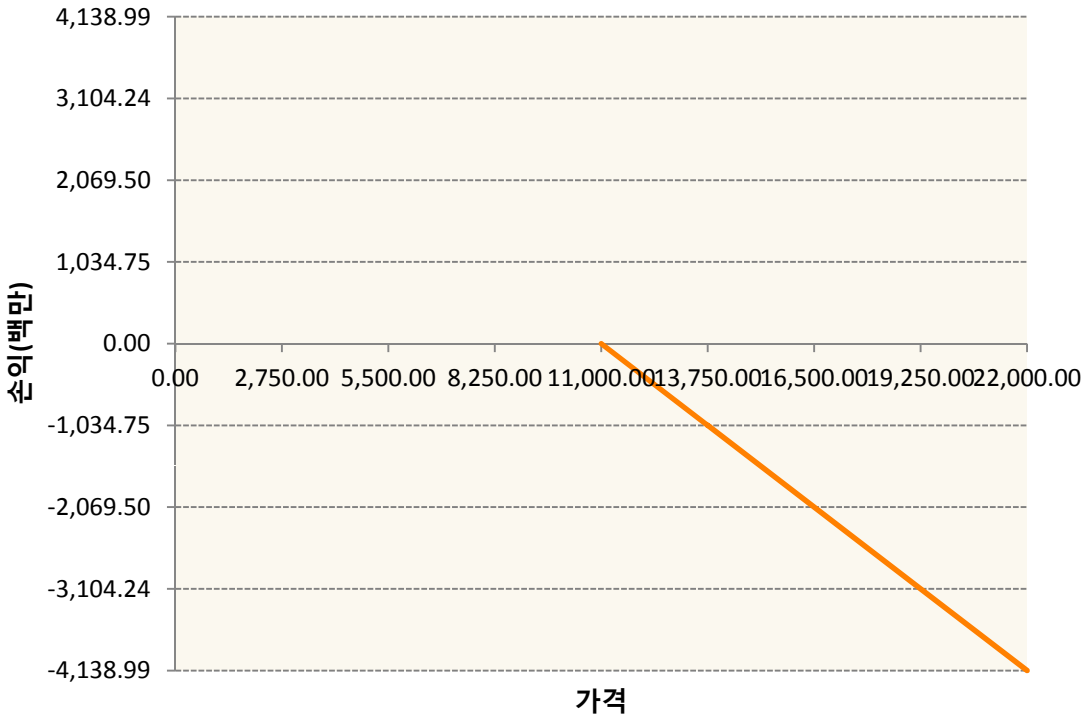
2. 만기시점의 손익구조



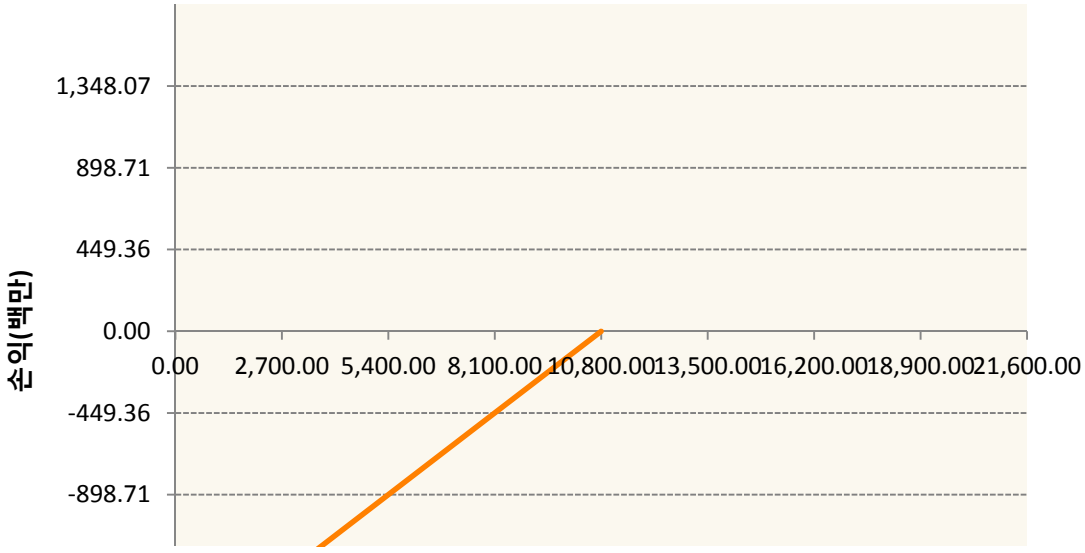


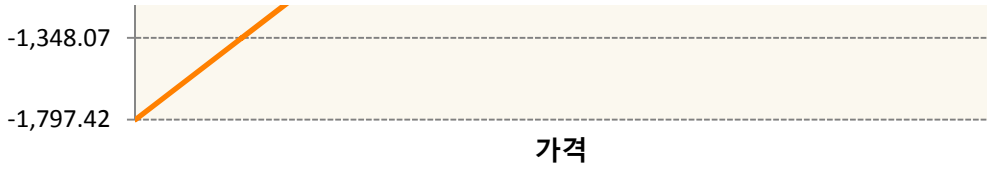


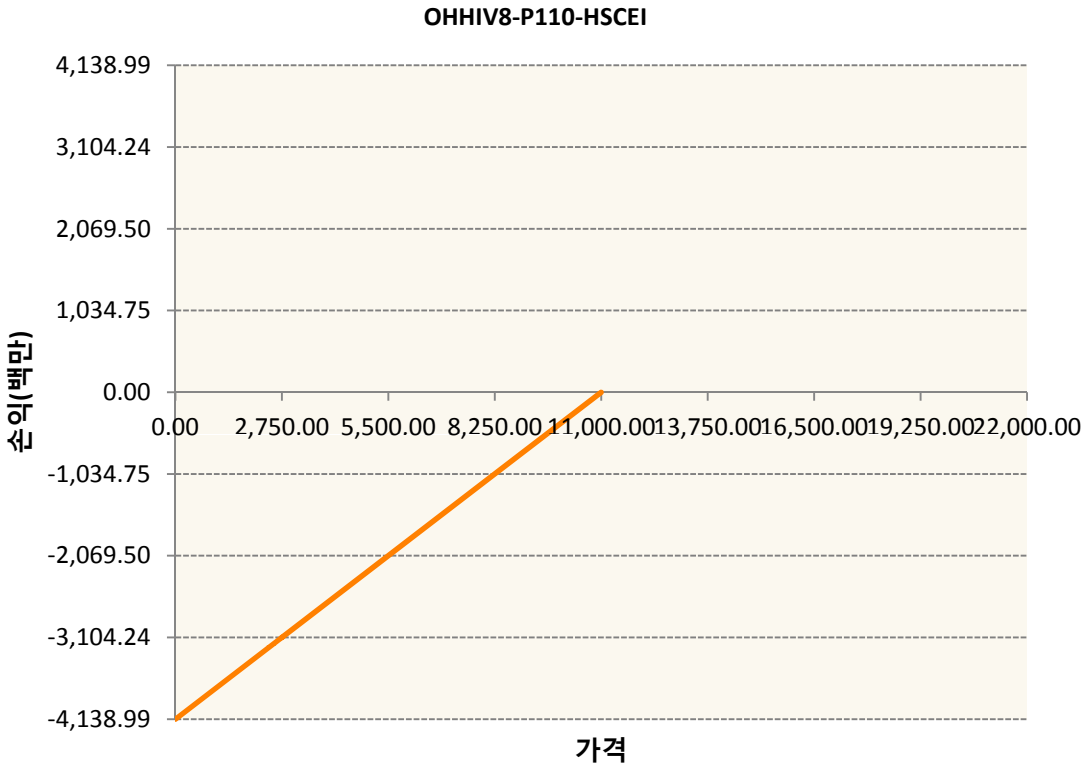
OHHIV8-C110-HSCEI



OHHIV8-P108-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCV8 HSCEI FUTURES OCT 18	397
OHHIV8-C1(HSCEI	144
OHHIV8-C11 HSCEI	331
OHHIV8-P1(HSCEI	144
OHHIV8-P11 HSCEI	331

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,272

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

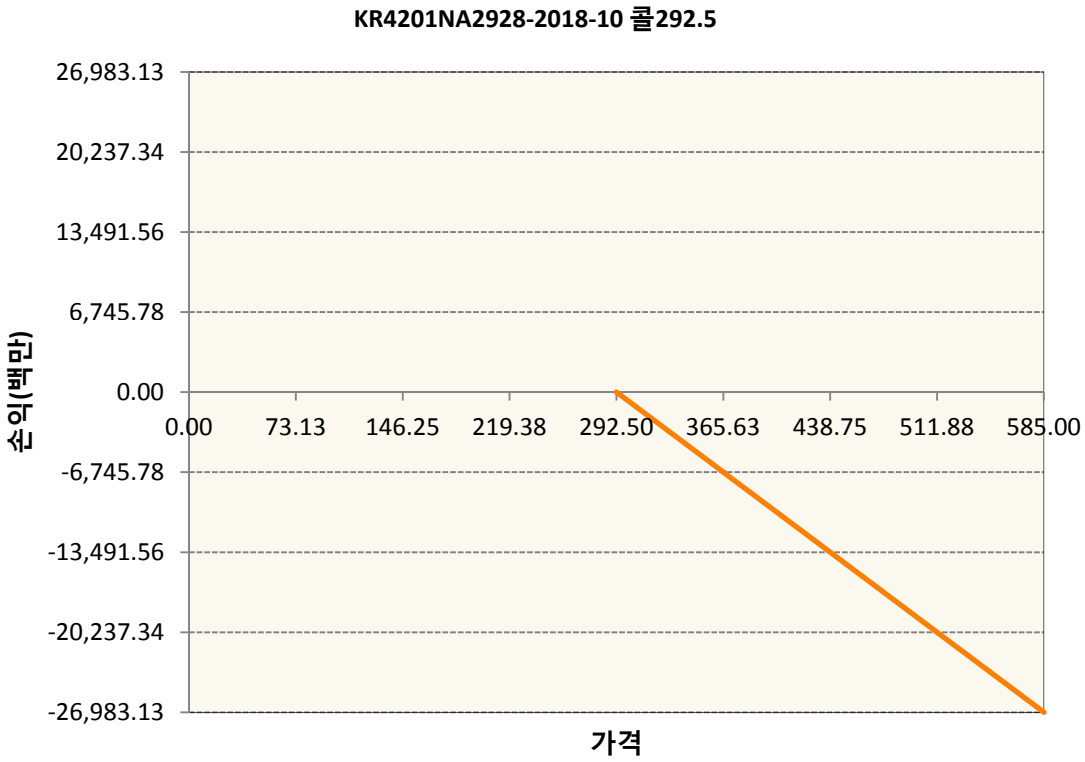
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

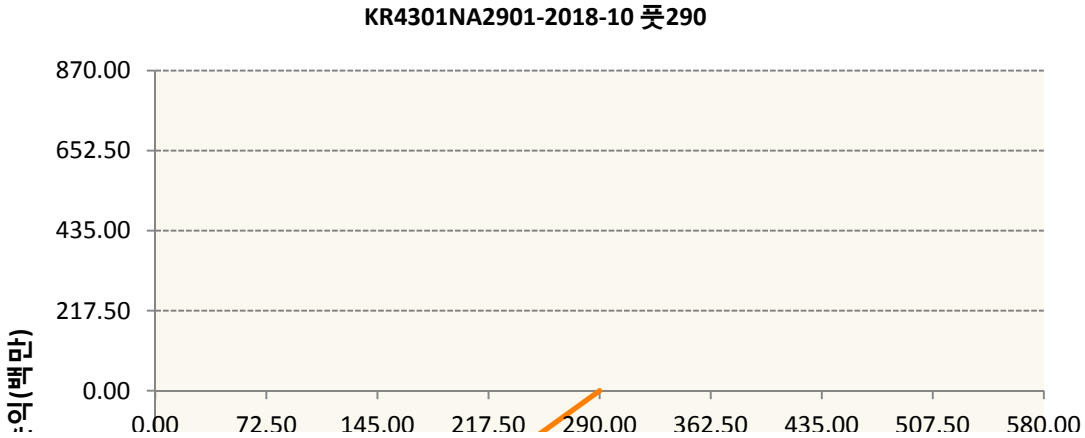
1. 계약금액

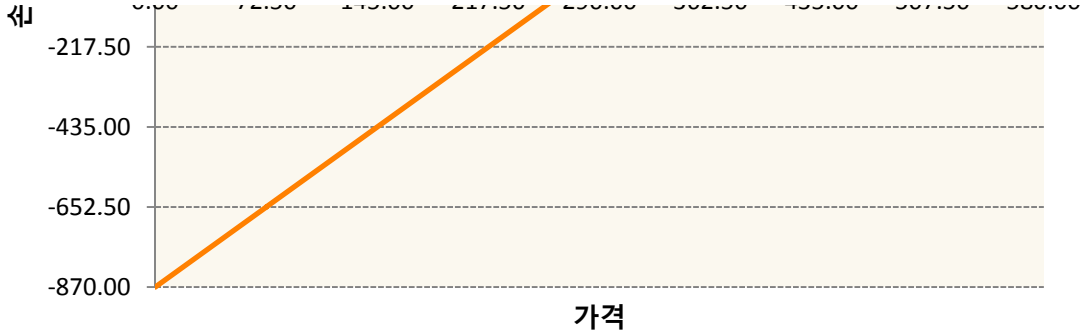
(단위:백만원)

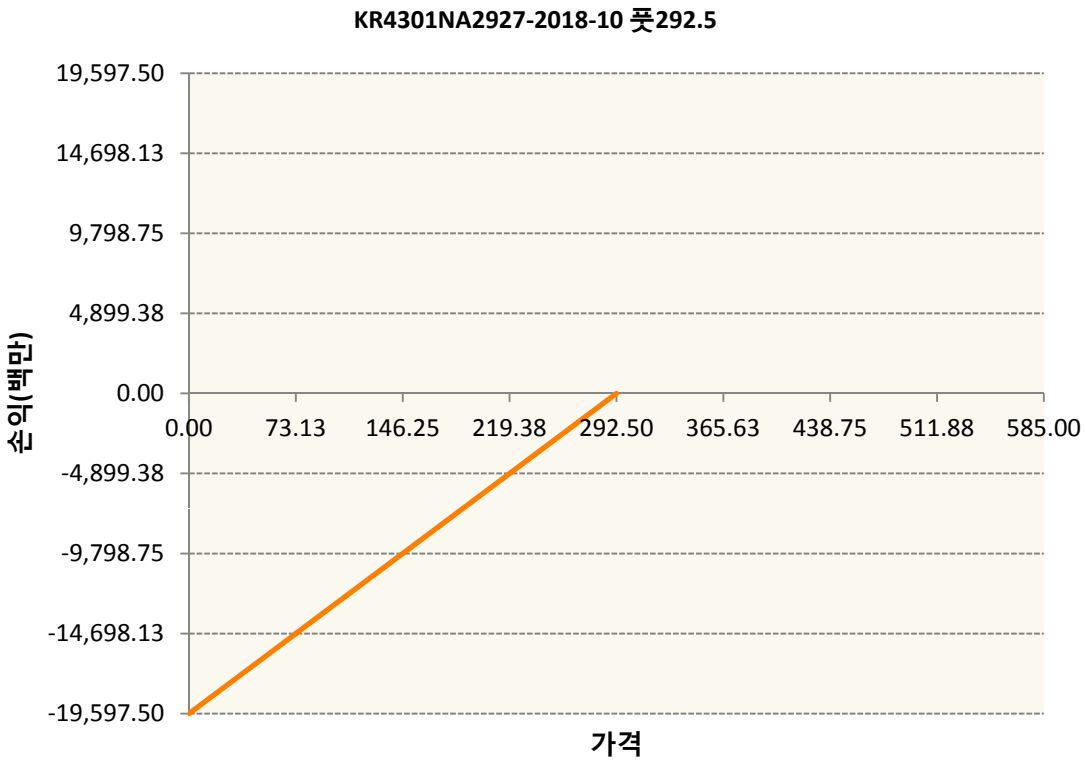
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,836	0	48,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	47,451	-47,451	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14							4,020
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,020	-4,020	-4,020	-4,020	-4,020	-4,020	-4,020
-5.33%	-2,680	-2,680	-2,680	-2,680	-2,680	-2,680	-2,680
-2.67%	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340	-1,340
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340	1,340
5.33%	2,680	2,680	2,680	2,680	2,680	2,680	2,680
8.00%	4,020	4,020	4,020	4,020	4,020	4,020	4,020
KR4201NA2(2018-10 콜292.5							1,747
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	157	157	157	157	157	157	156
-5.33%	157	157	156	156	155	154	152
-2.67%	152	149	144	137	130	121	111
0%	59	40	20	0	-20	-41	-61
2.67%	-361	-376	-391	-408	-425	-443	-461
5.33%	-1,032	-1,033	-1,036	-1,040	-1,045	-1,052	-1,059
8.00%	-1,743	-1,743	-1,743	-1,744	-1,744	-1,745	-1,747
	KR4301NA2	2018-10 풋290					65
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4
	KR4301NA2	2018-10 풋292.5					1,520
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,520	-1,520	-1,520	-1,520	-1,520	-1,520	-1,520
-5.33%	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002
-2.67%	-484	-484	-484	-485	-485	-485	-485
0%	17	12	6	0	-6	-13	-20
2.67%	205	203	201	198	195	191	187
5.33%	207	207	207	207	207	207	207
8.00%	207	207	207	207	207	207	207

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

8,375

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

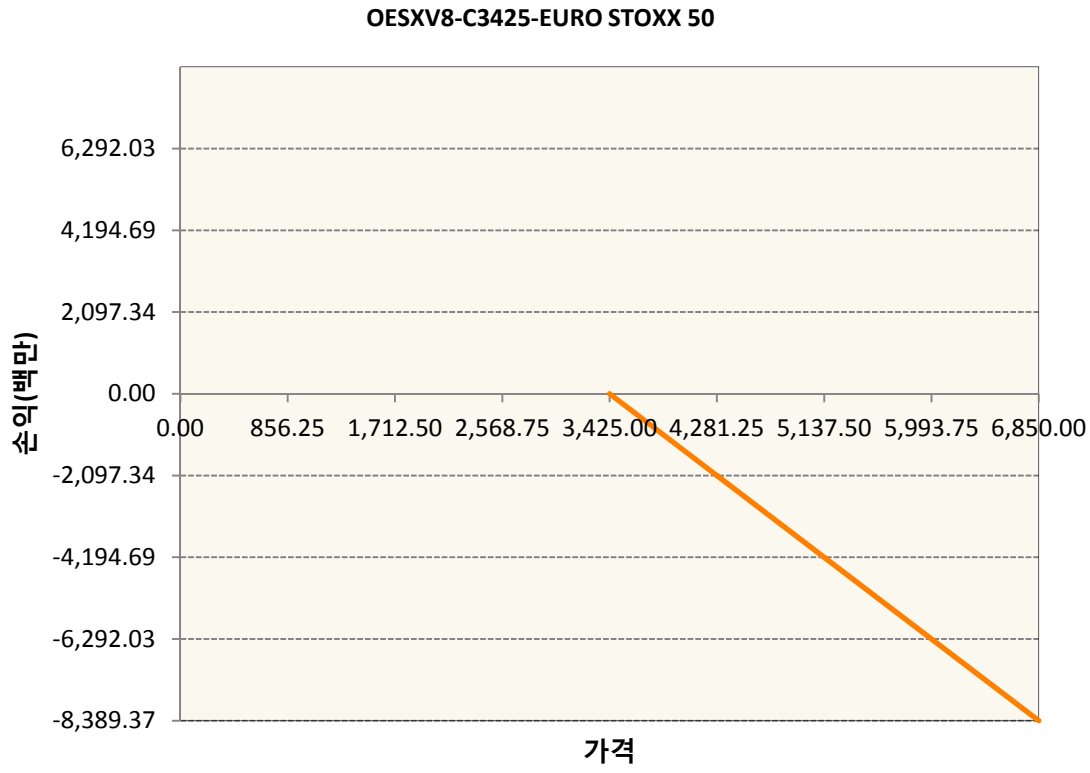
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

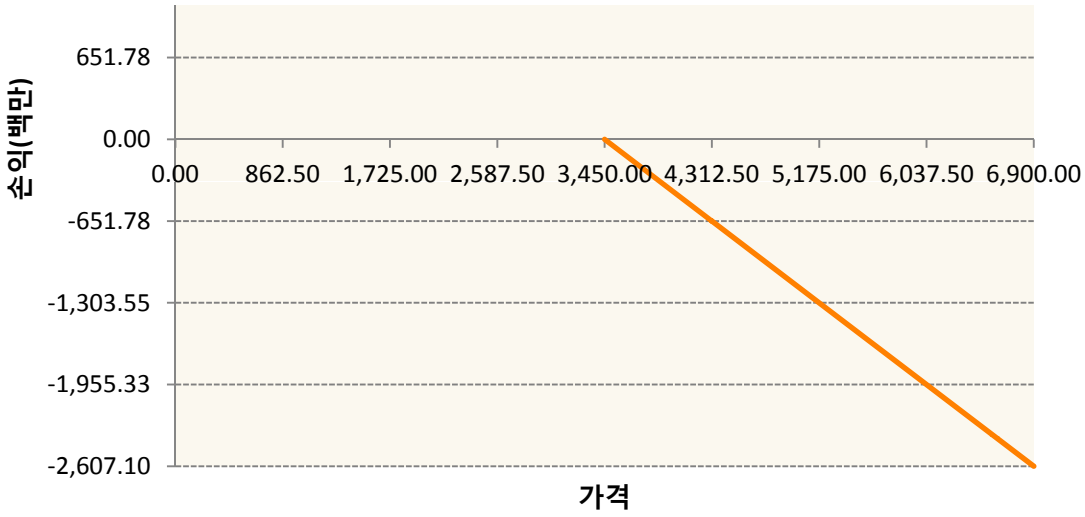
(단위:백만원)

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	3,944	0	3,944	
누계	유가증권	스왑	34,406	0	34,406	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,993	-21,993	장내
누계	지수	스왑	52,894	0	52,894	장외

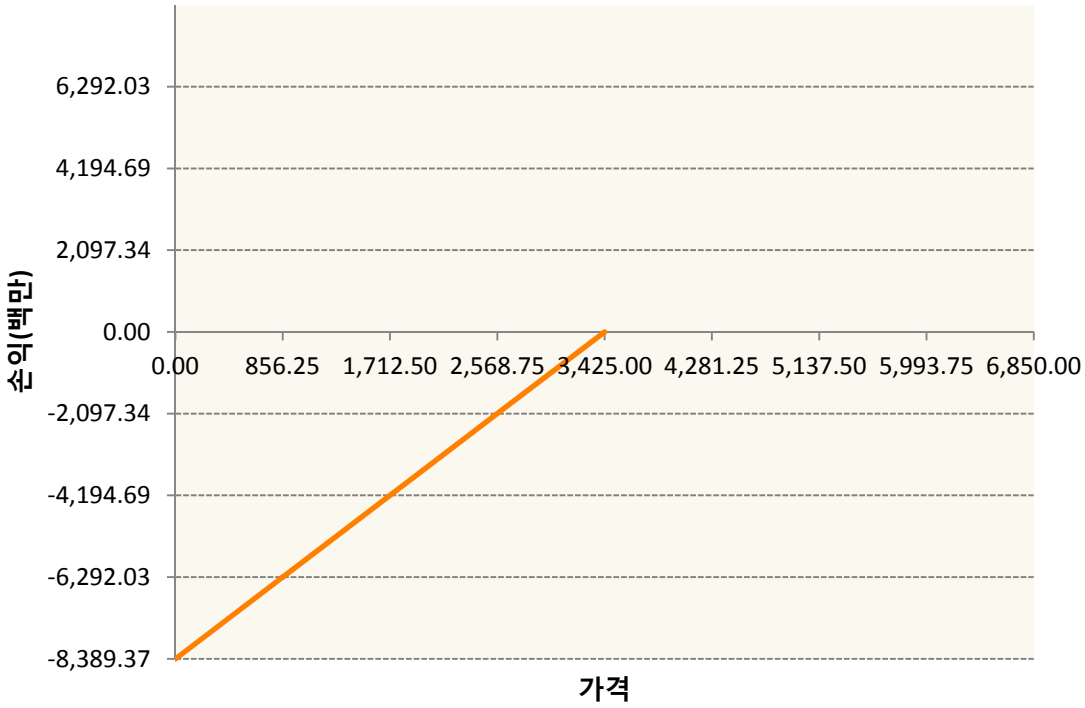
2. 만기시점의 손익구조



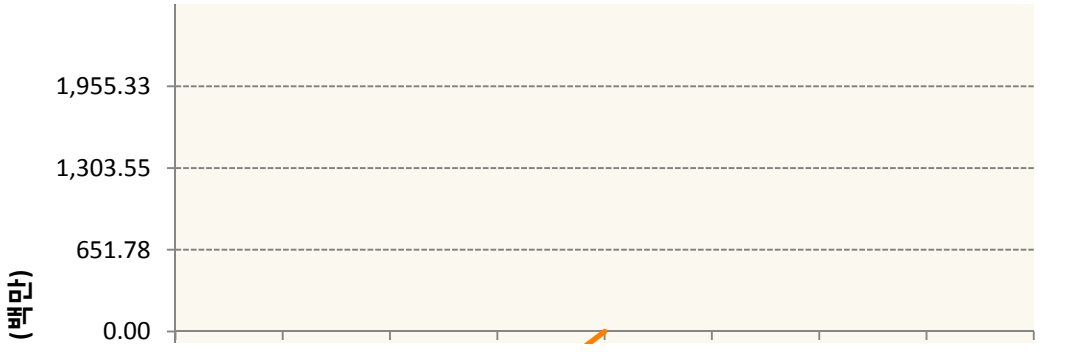


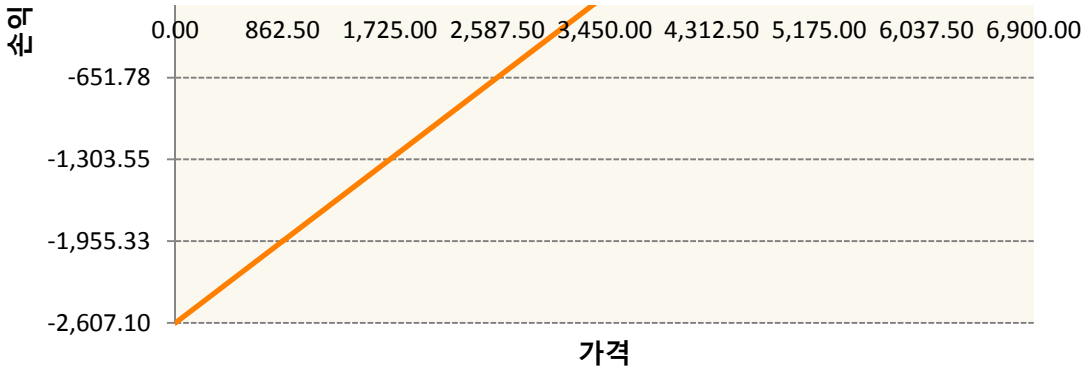


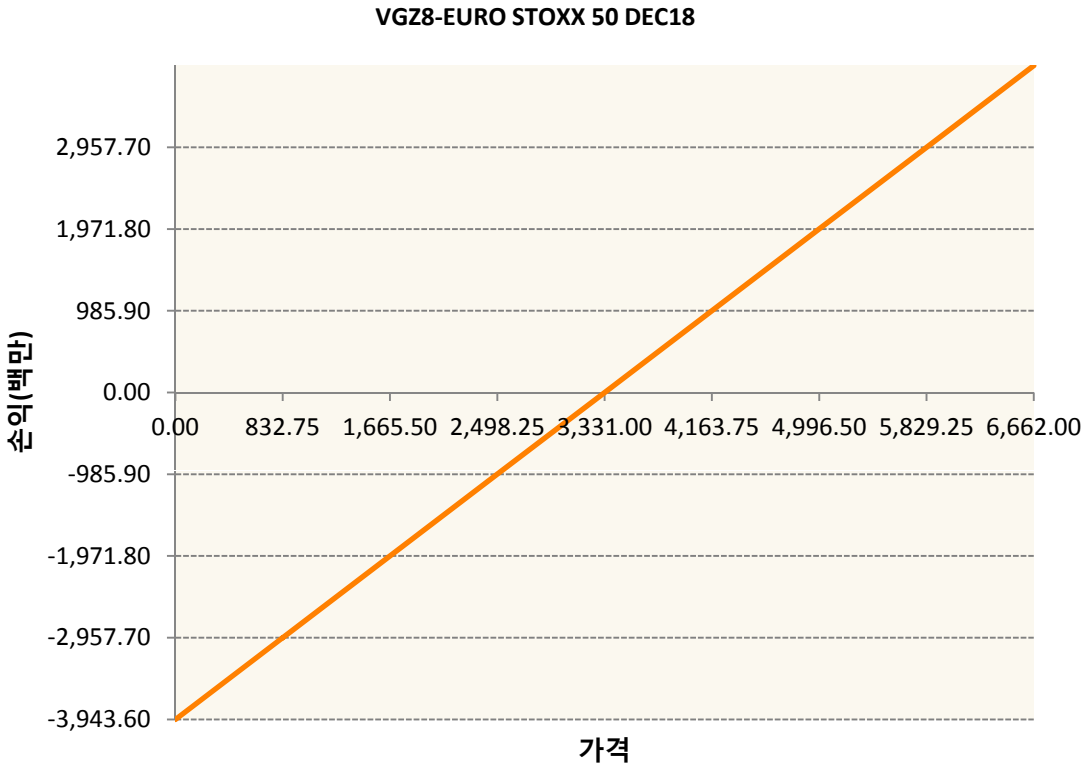
OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	53
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	34
OESXV8-C34 EURO STOXX 50	671
OESXV8-C34 EURO STOXX 50	209
OESXV8-P34 EURO STOXX 50	671
OESXV8-P34 EURO STOXX 50	209
VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18	315

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

1,334

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

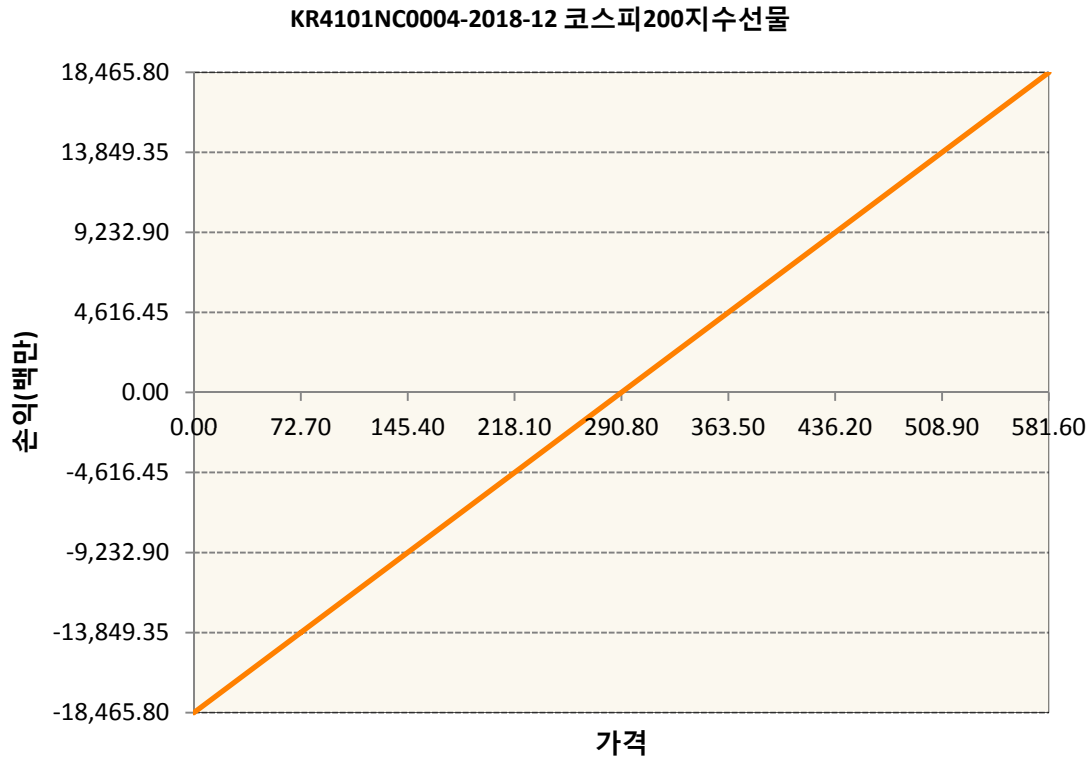
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	18,466	0	18,466	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물							1,473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473
-5.33%	-982	-982	-982	-982	-982	-982	-982
-2.67%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	491	491	491	491	491	491	491
5.33%	982	982	982	982	982	982	982
8.00%	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473

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

1,119

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

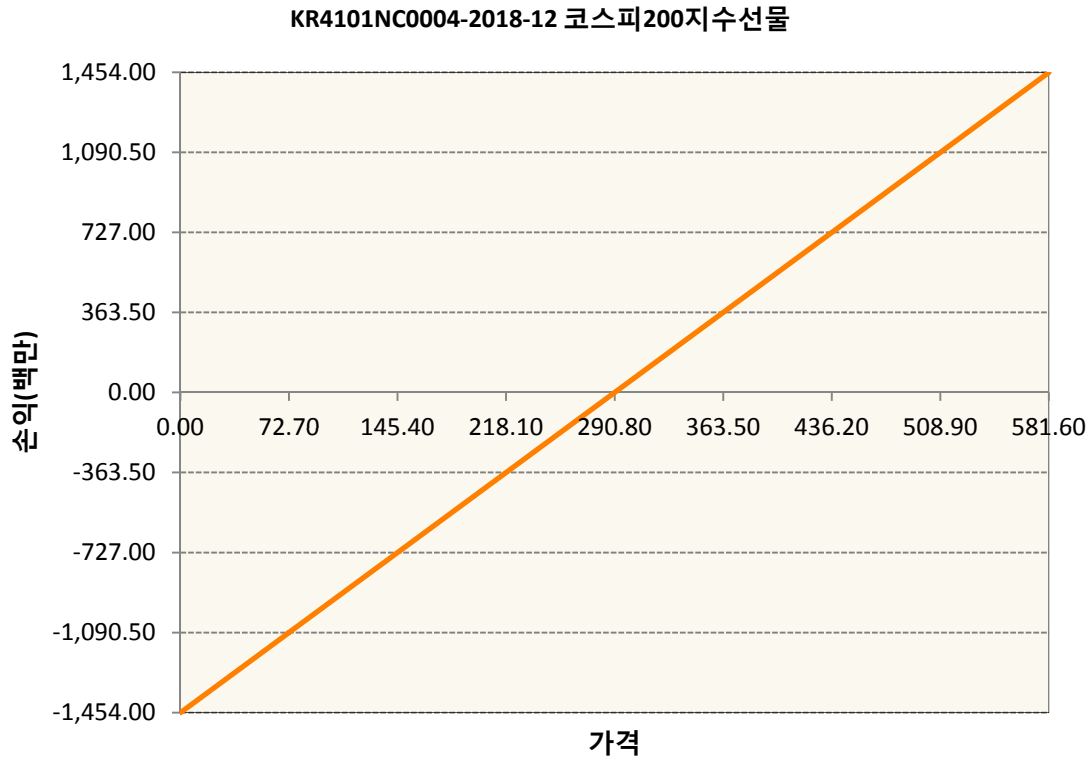
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,454	0	1,454	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물							116
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	116	116	116	116	116	116	116

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

88

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

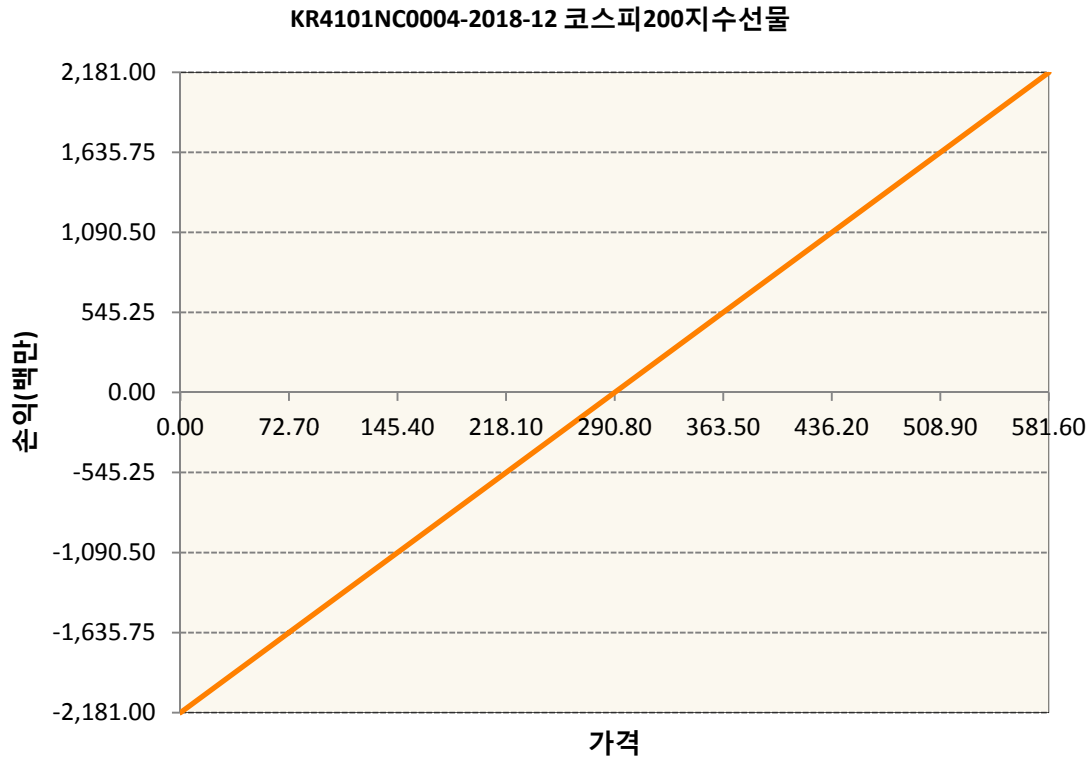
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	2,181	0	2,181	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물							174
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
-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%	174	174	174	174	174	174	174

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

132

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

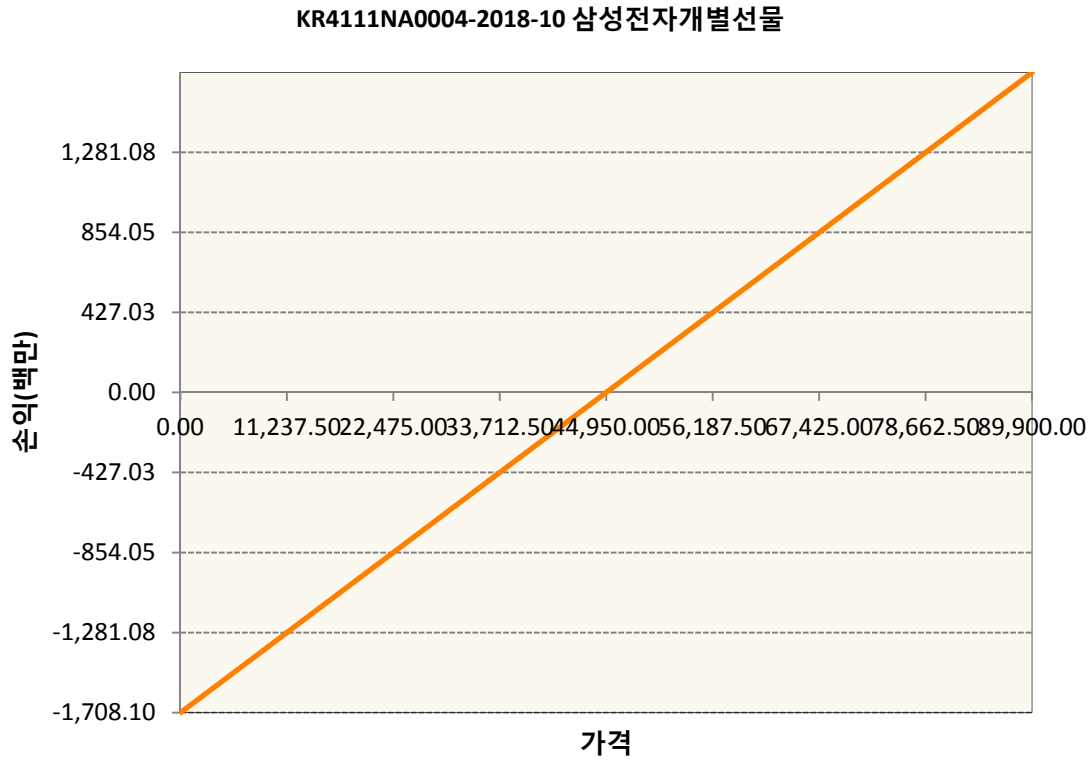
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	1,708	0	1,708	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111NA0(2018-10 삼성전자개별선물							137
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	91	91	91	91	91	91	91
8.00%	137	137	137	137	137	137	137

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

160

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

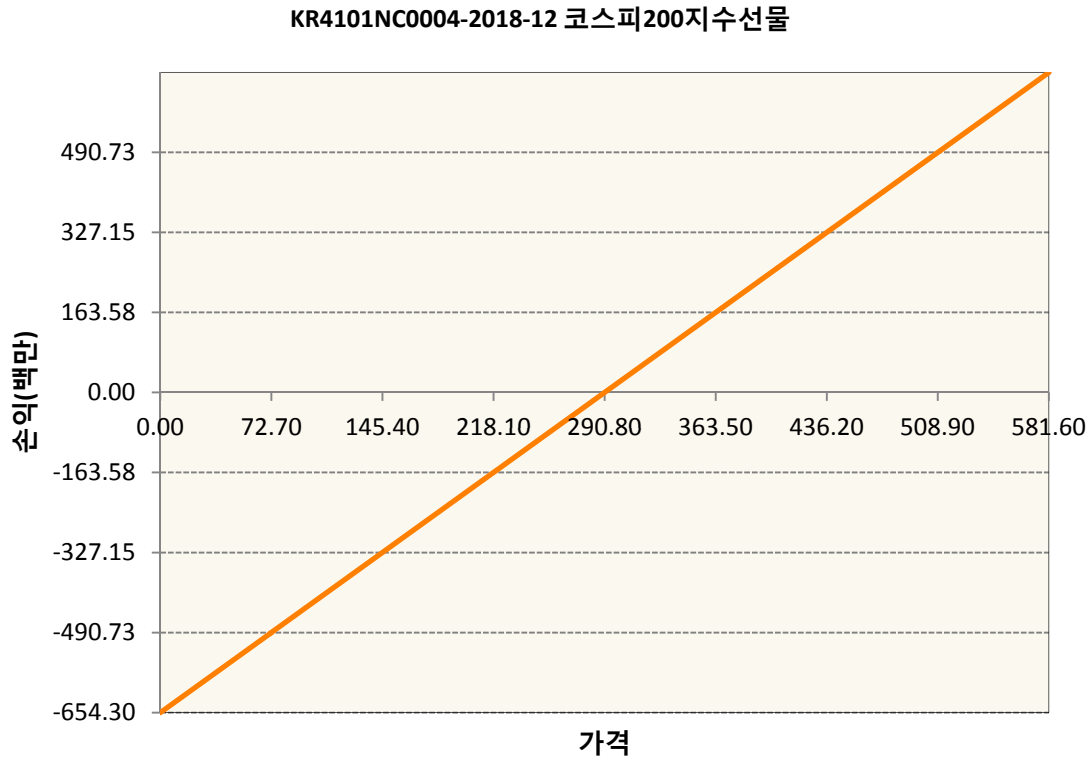
스마트KRX300인덱스목표전환형1

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	654	0	654	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물							52
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	52	52	52	52	52	52	52

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

40

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

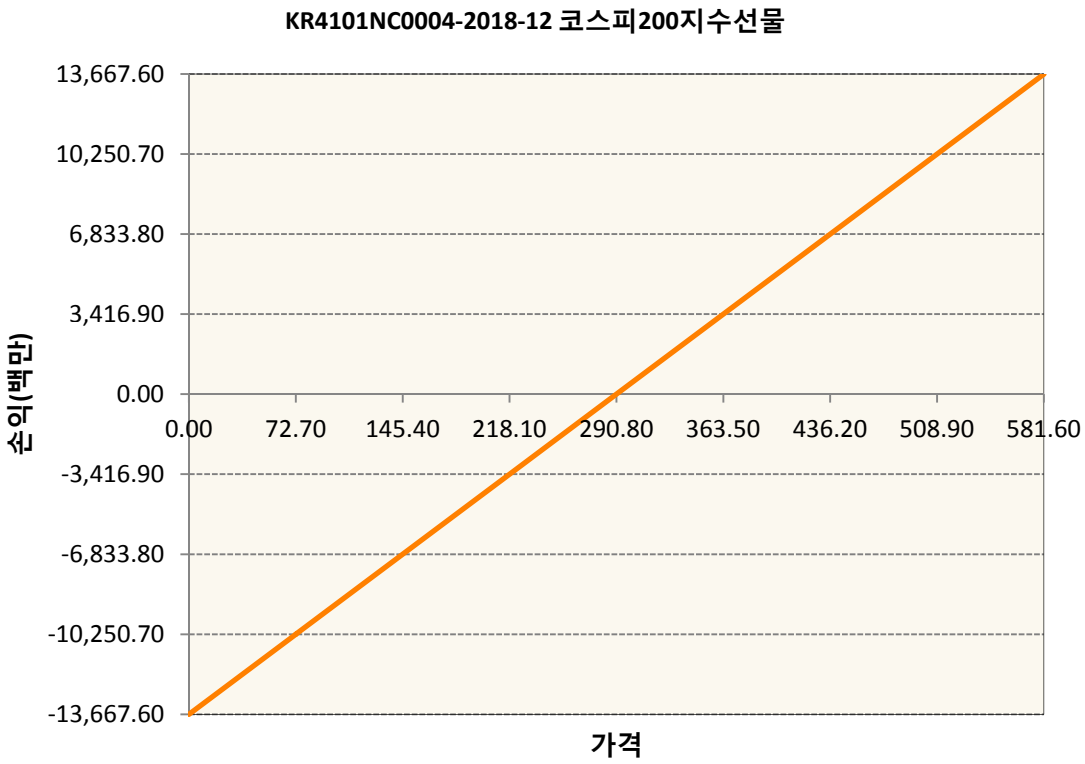
리디파인K200(주식혼합-파생재간

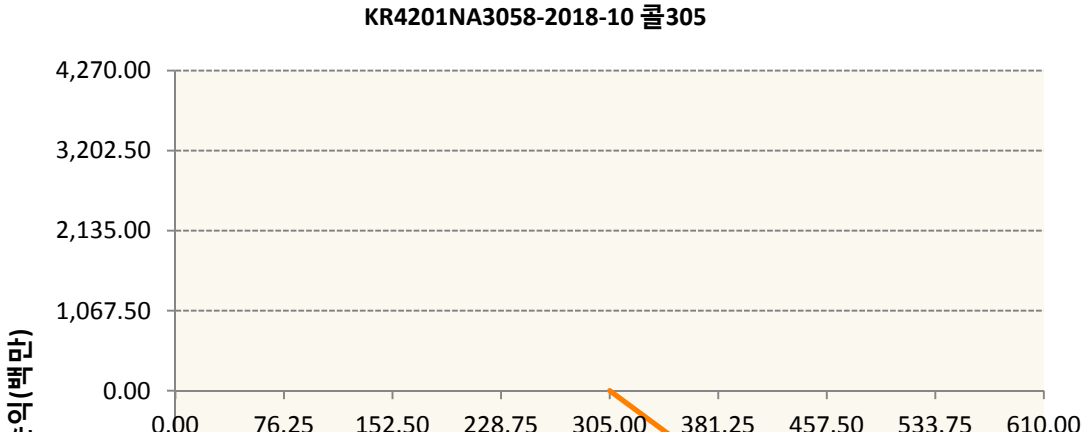
1. 계약금액

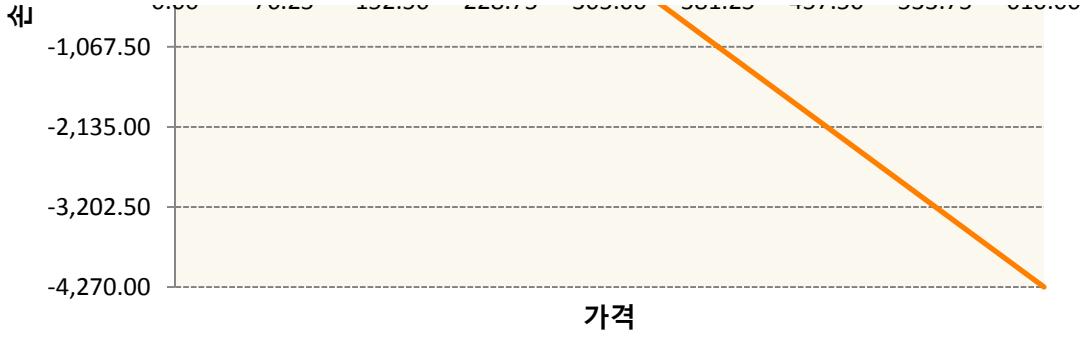
(단위:백만원)

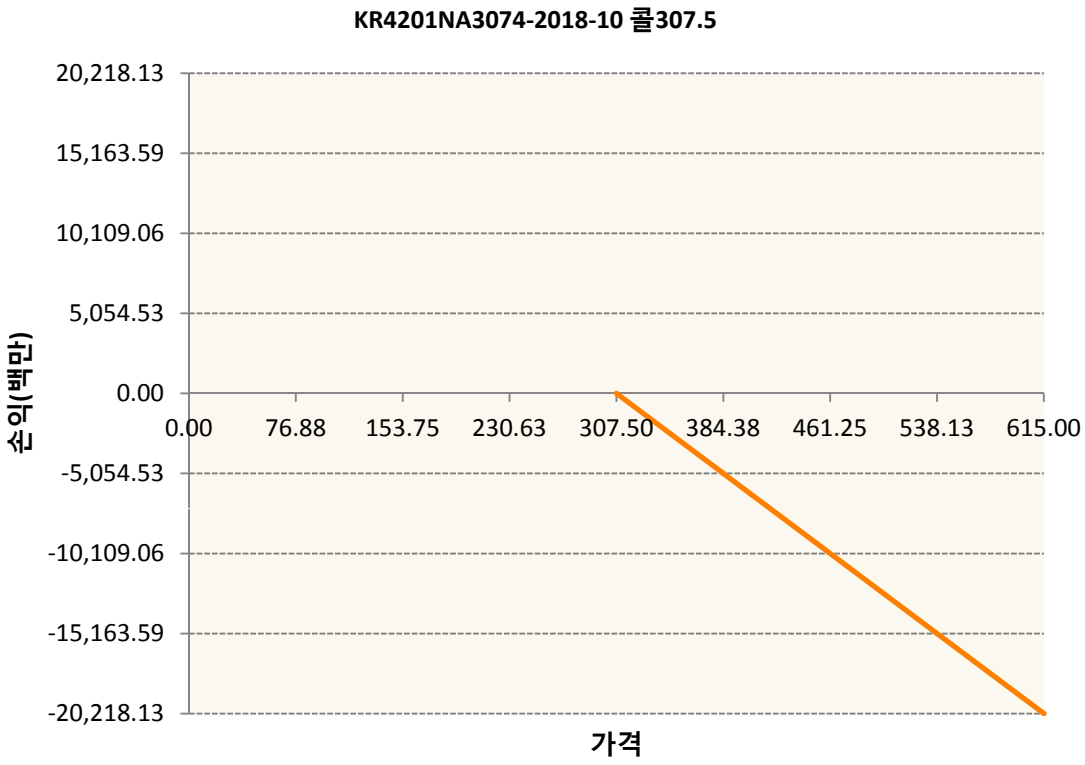
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,668	0	13,668	장내
누계	유가증권	옵션	2,119	24,488	-22,369	장내

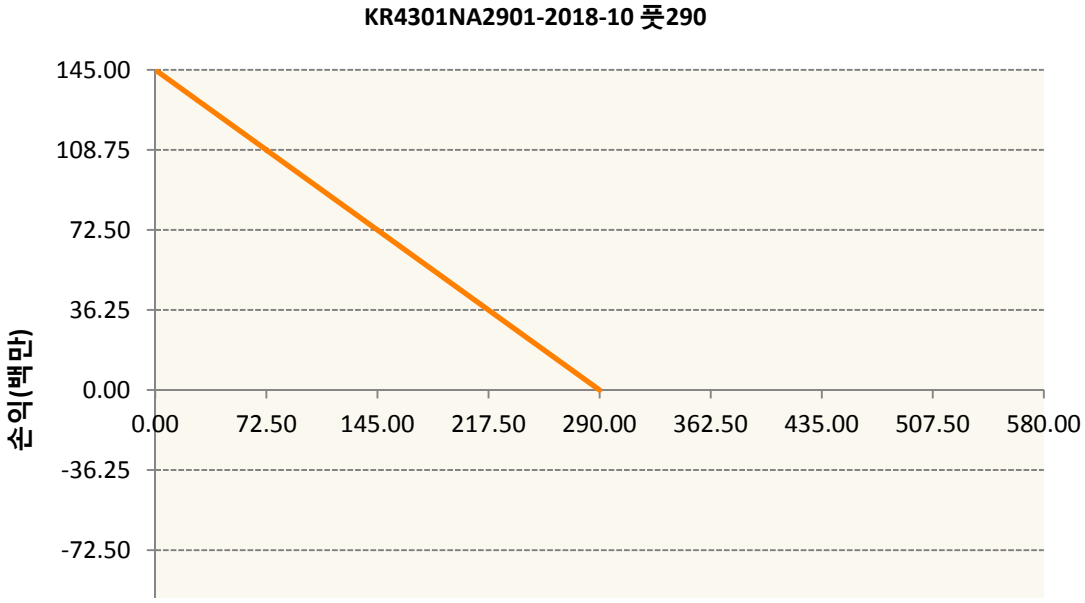
2. 만기시점의 손익구조

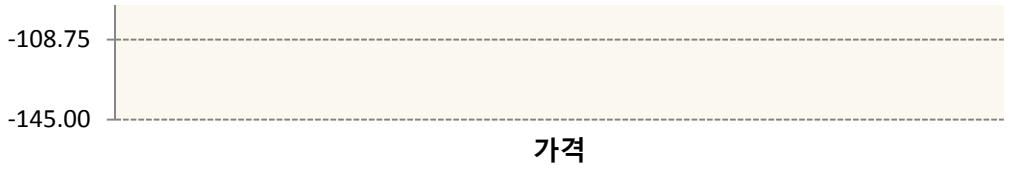


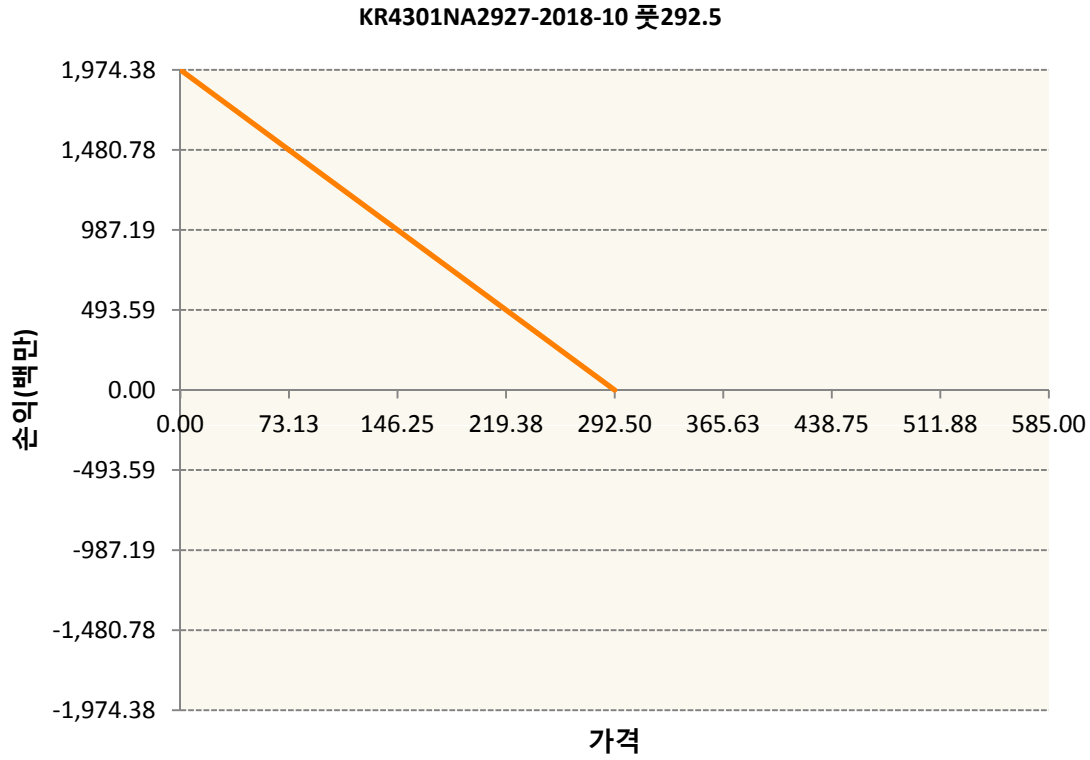



-1,067.50
-2,135.00
-3,202.50
-4,270.00
가격


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5
20,218.13
15,163.59
10,109.06
5,054.53
0.00
-5,054.53
-10,109.06
-15,163.59
-20,218.13
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
615.00
손익(백만)
가격


KR4301NA2901-2018-10 풋290
145.00
108.75
72.50
36.25
0.00
-36.25
-72.50
0.00
72.50
145.00
217.50
290.00
362.50
435.00
507.50
580.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물							1,090
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090
-5.33%	-727	-727	-727	-727	-727	-727	-727
-2.67%	-363	-363	-363	-363	-363	-363	-363
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	363	363	363	363	363	363	363
5.33%	727	727	727	727	727	727	727
8.00%	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090
KR4201NA3(2018-10 콜305							127
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0

0%	1	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	-2	-4	-6	-8	-10	-12	-14
5.33%	-33	-36	-40	-43	-47	-50	-53
8.00%	-115	-117	-118	-120	-122	-124	-127
KR4201NA3(2018-10 콜307.5							471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	1	1	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-4	-8	-13	-19	-25	-33	-42
5.33%	-85	-100	-115	-131	-147	-162	-178
8.00%	-398	-408	-420	-432	-445	-458	-471
KR4301NA2(2018-10 풋290							11
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7
-2.67%	3	3	3	3	3	3	3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301NA2(2018-10 풋292.5							153
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	153	153	153	153	153	153	153
-5.33%	101	101	101	101	101	101	101
-2.67%	49	49	49	49	49	49	49
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-21	-20	-20	-20	-20	-19	-19
5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21

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

1,103

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

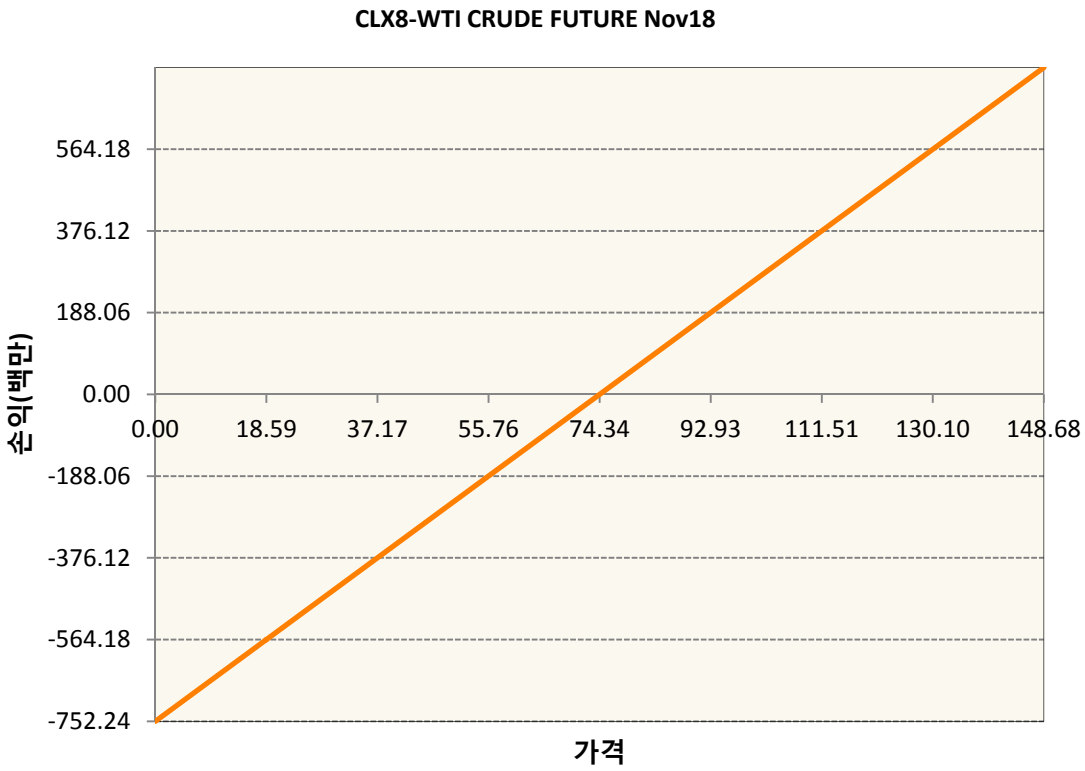
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

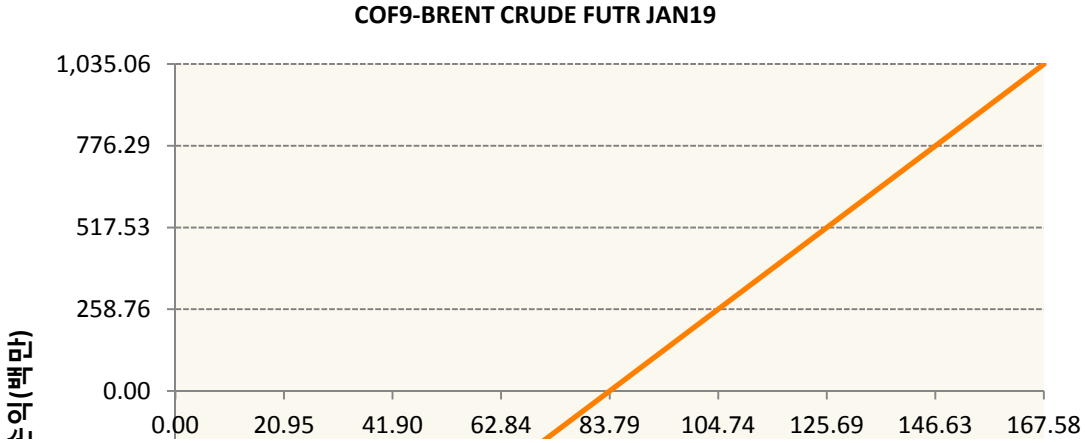
1. 계약금액

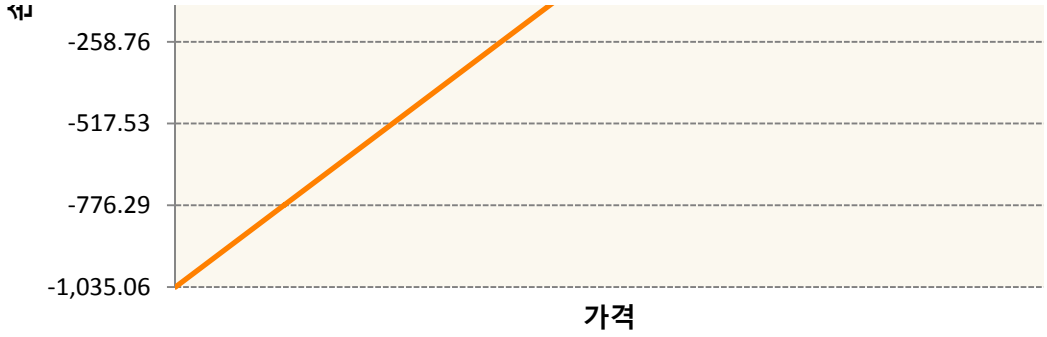
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,304	623	2,681	
누계	유가증권	선물	452	0	452	장내

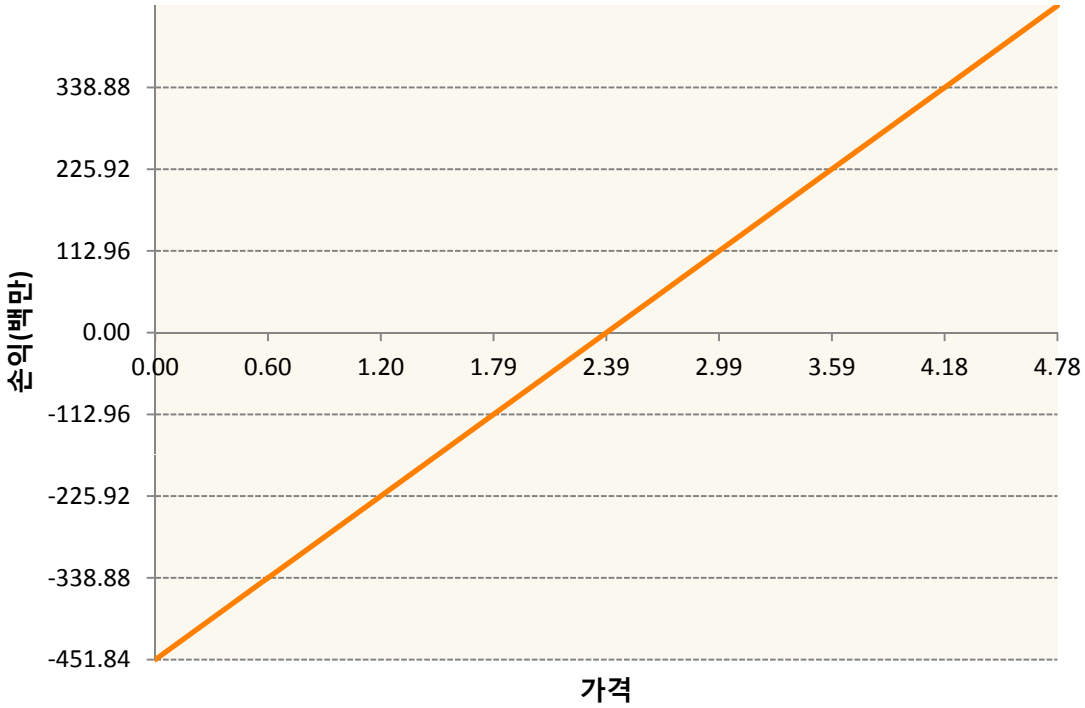
2. 만기시점의 손익구조



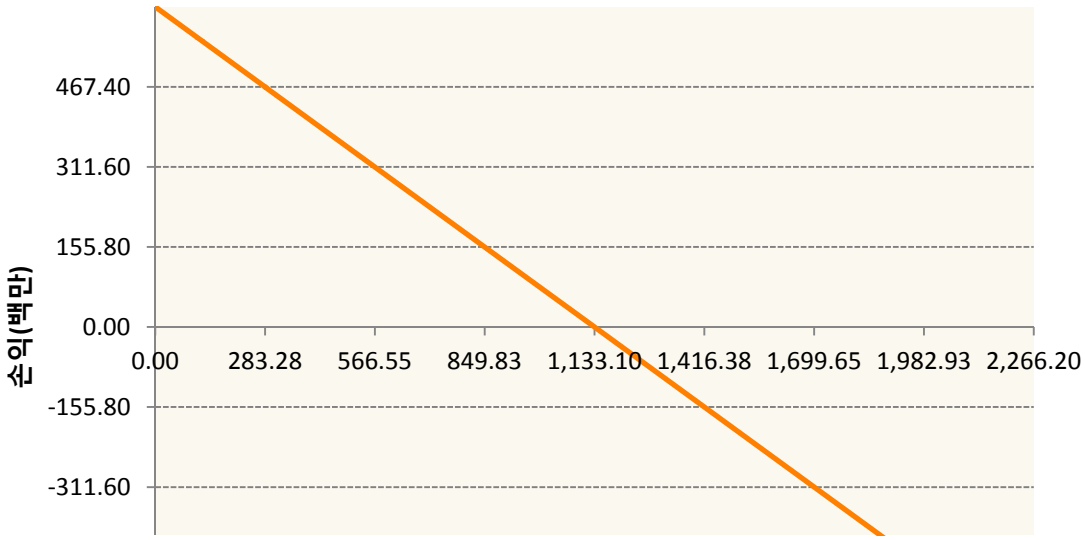


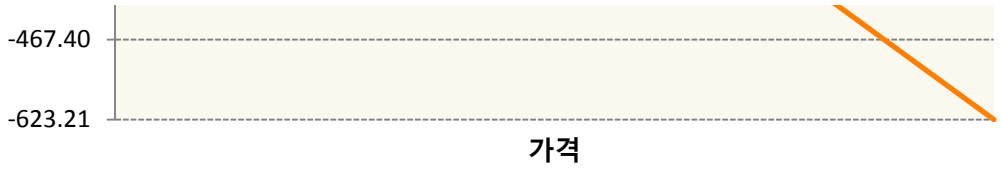


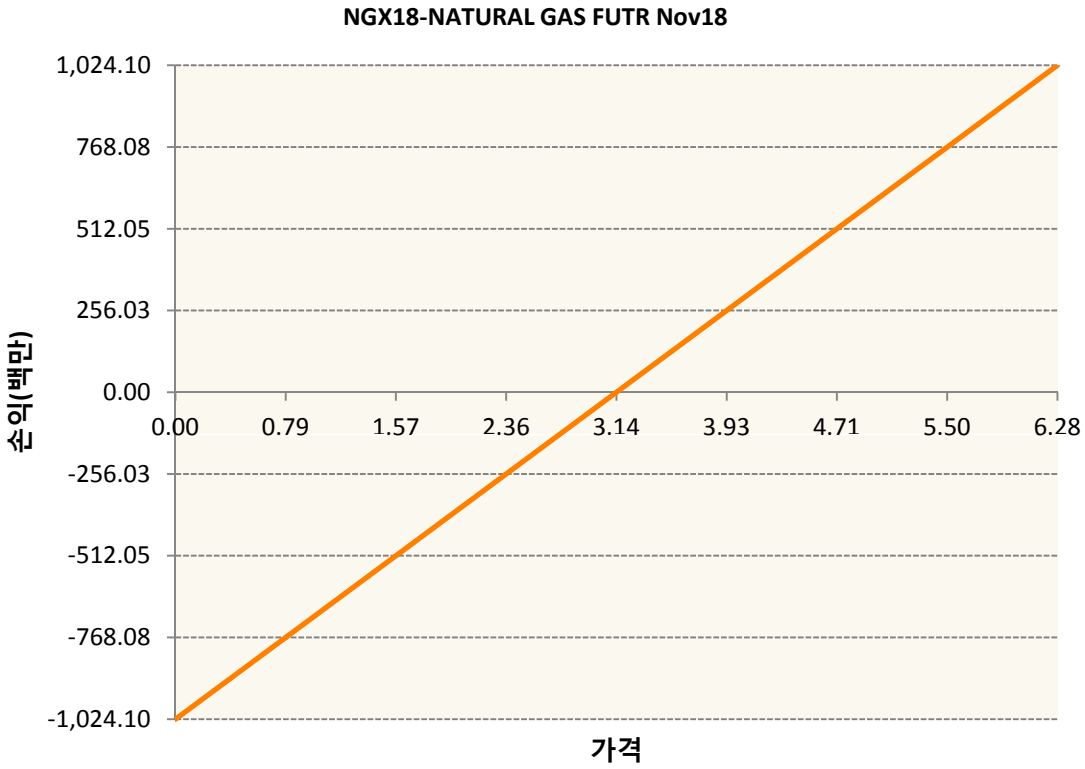
HOX8-Heating Oil

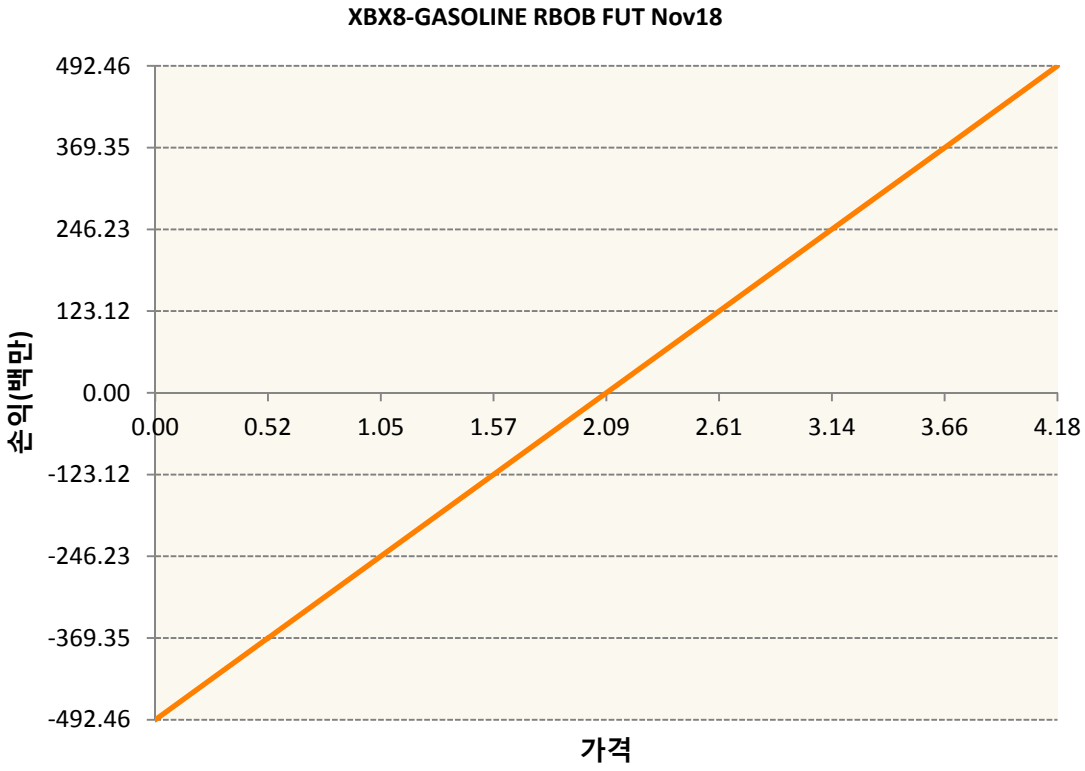


KR4175NA0007-2018-10 달러선물




-467.40
-623.21
가격


NGX18-NATURAL GAS FUTR Nov18
1,024.10
768.08
512.05
256.03
0.00
-256.03
-512.05
-768.08
-1,024.10
0.00
0.79
1.57
2.36
3.14
3.93
4.71
5.50
6.28
손익(백만)
가격


XBX8-GASOLINE RBOB FUT Nov18
492.46
369.35
246.23
123.12
0.00
-123.12
-246.23
-369.35
-492.46
0.00
0.52
1.05
1.57
2.09
2.61
3.14
3.66
4.18
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX8	WTI CRUDE FUTURE Nov18	60
COF9	BRENT CRUDE FUTR JAN19	83
HOX8	Heating Oil	36
KR4175NA0(	2018-10 달러선물	50
NGX18	NATURAL GAS FUTR Nov18	82
XBX8	GASOLINE RBOB FUT Nov18	39

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

452

공시일	2018-10-10
기준일	2018-10-08

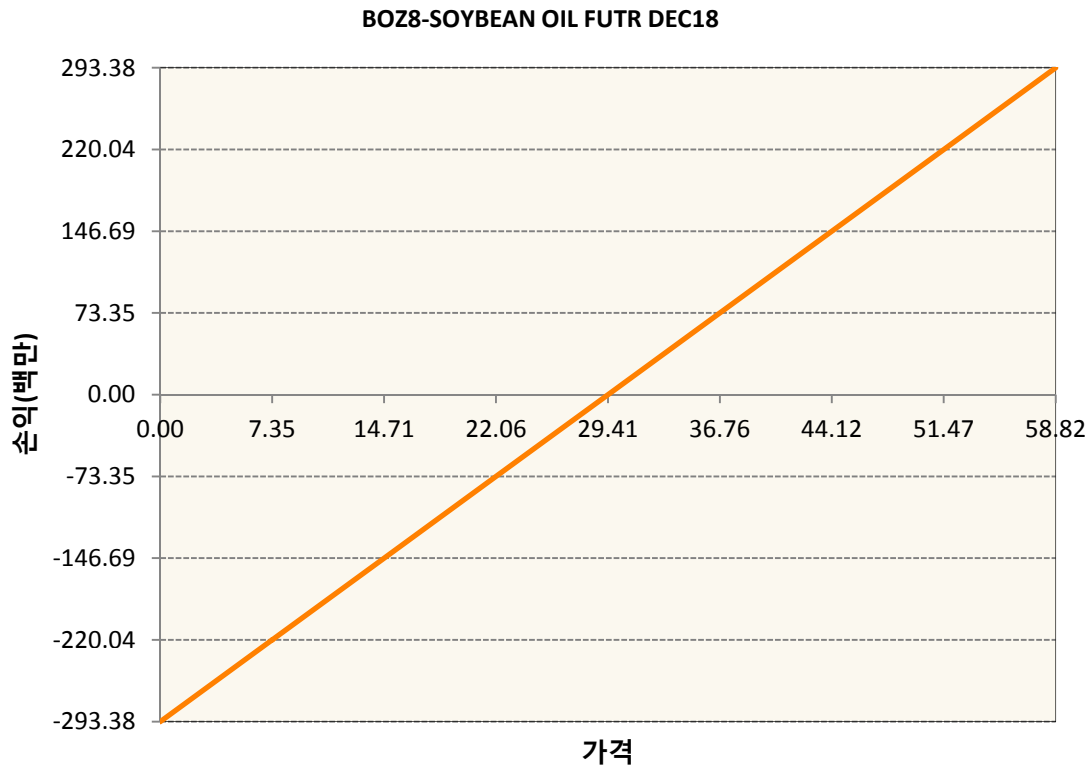
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

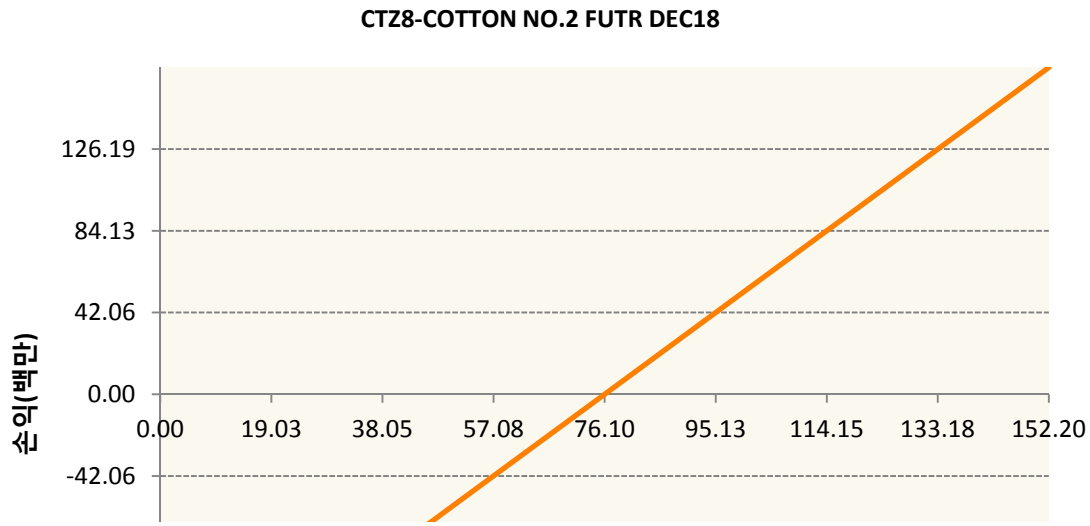
1. 계약금액

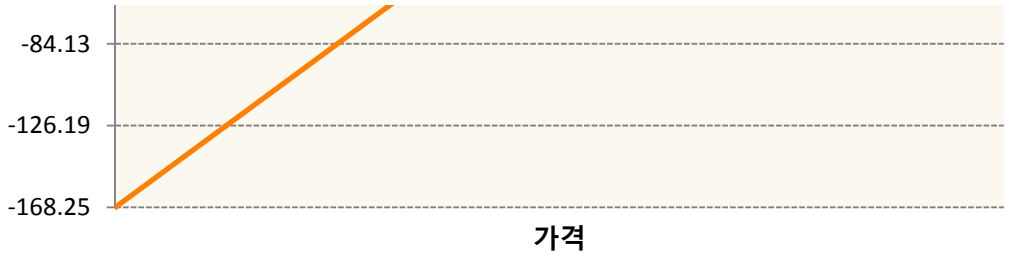
(단위:백만원)

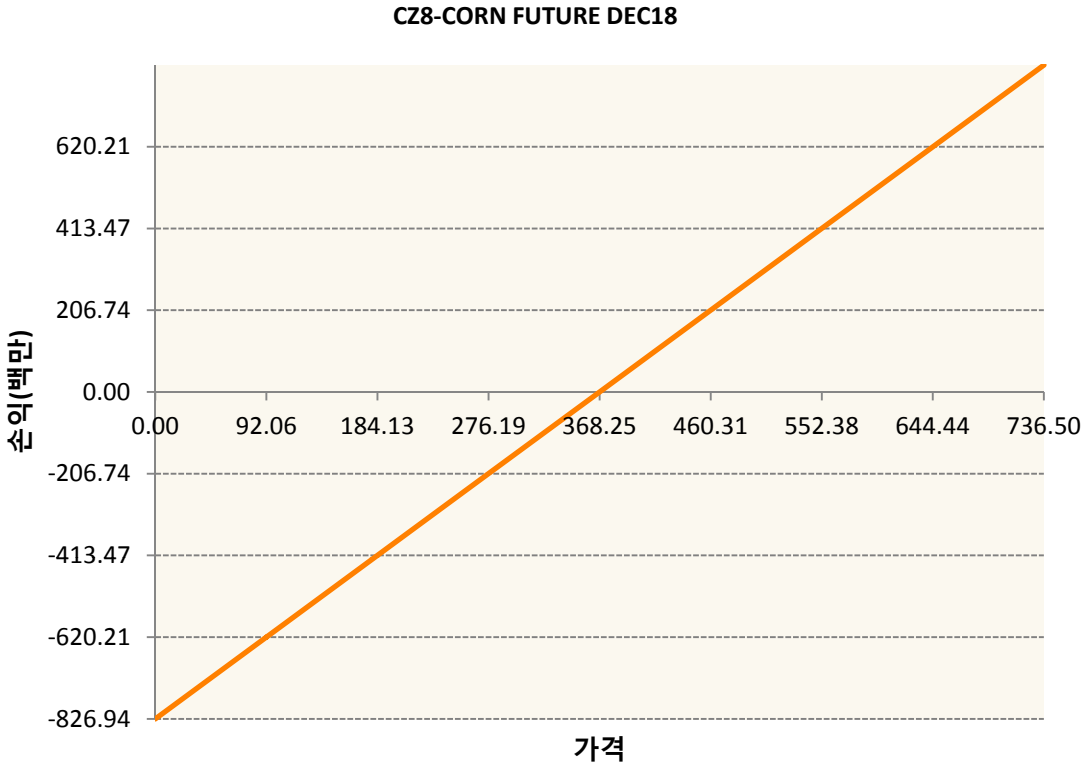
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,607	79	3,527	

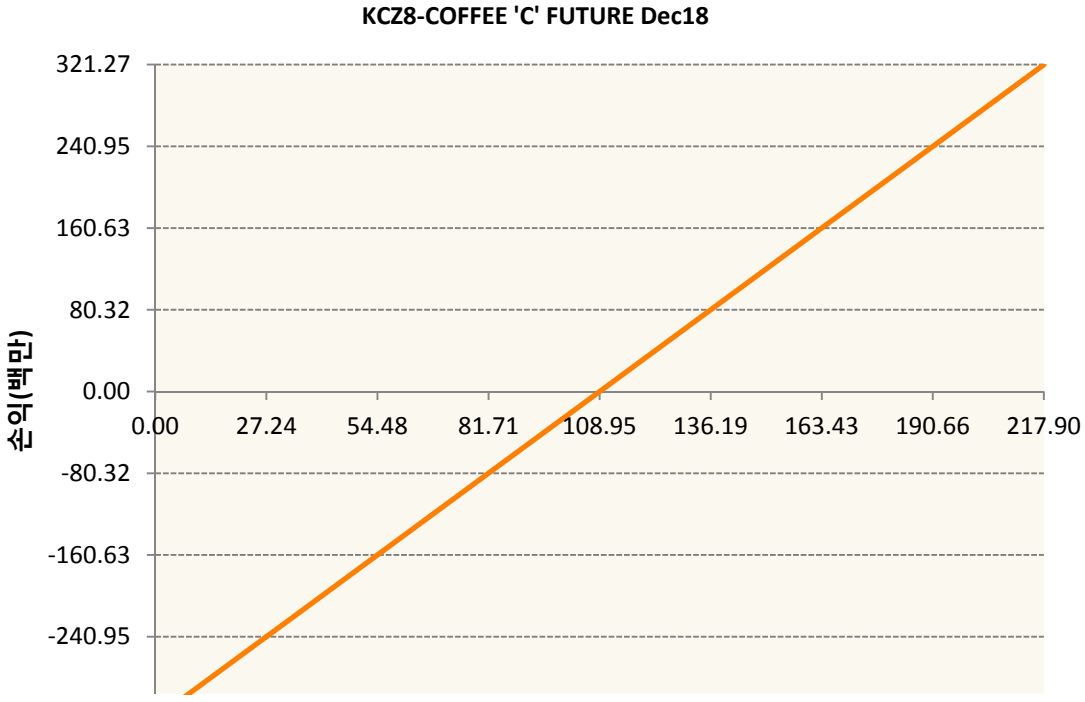
2. 만기시점의 손익구조

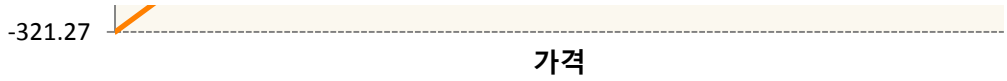


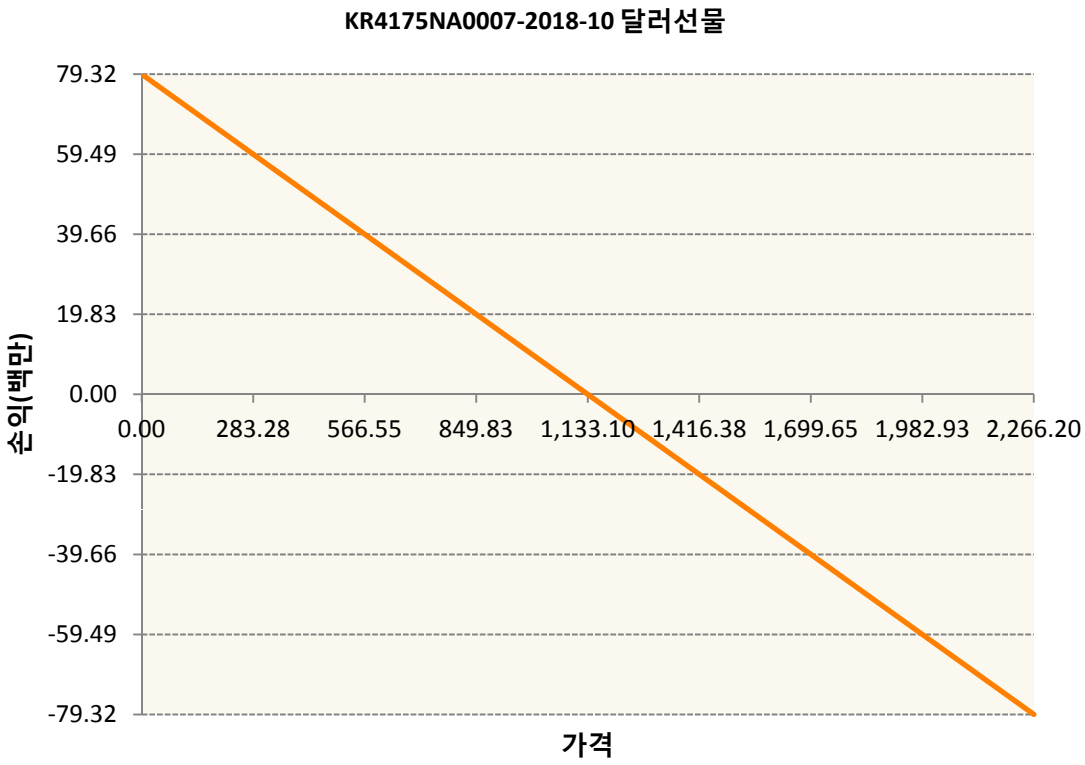


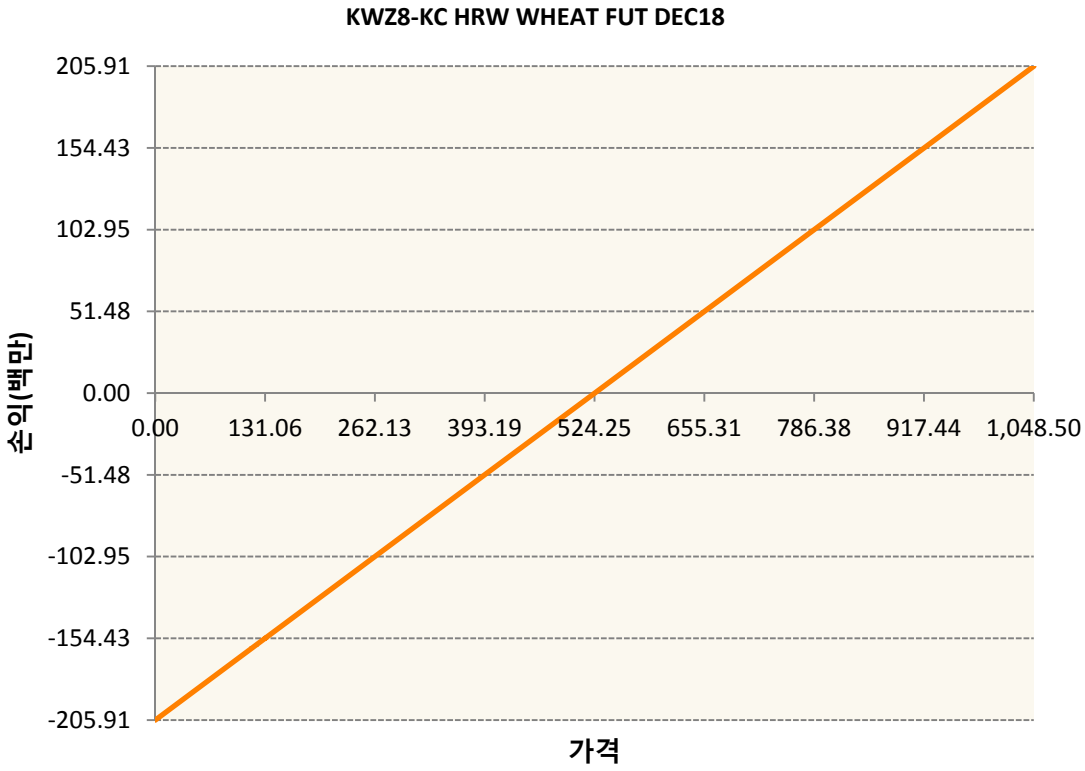

-84.13
-126.19
-168.25
가격

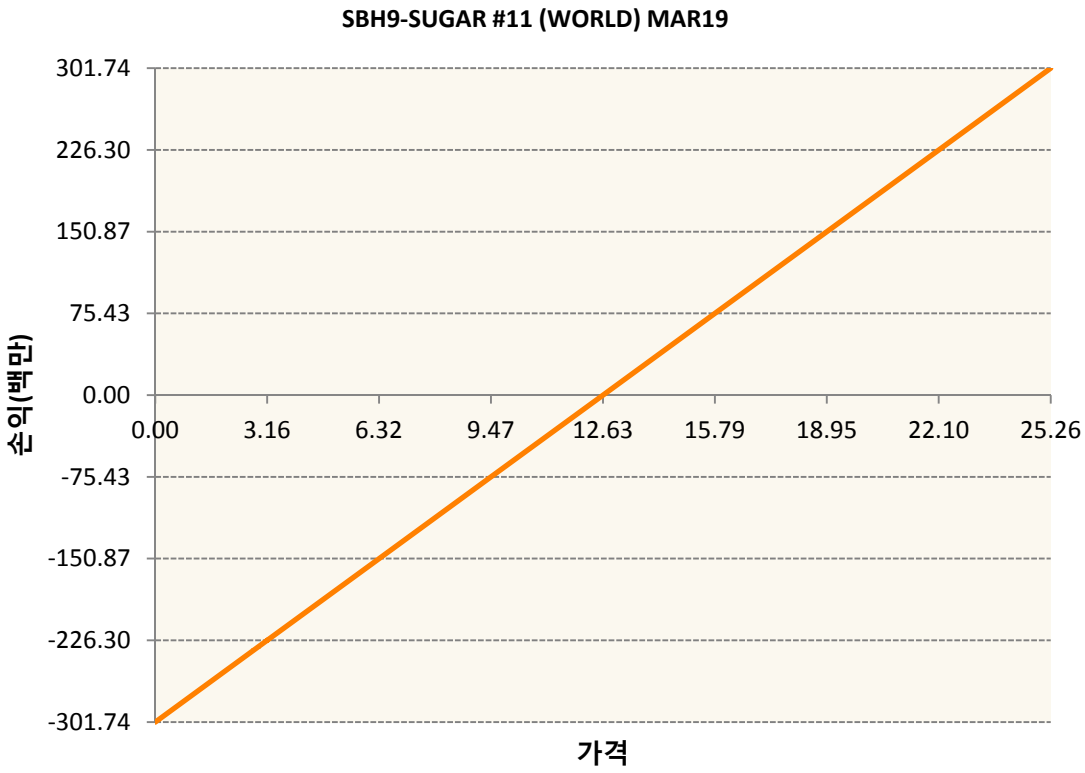

CZ8-CORN FUTURE DEC18
620.21
413.47
206.74
0.00
-206.74
-413.47
-620.21
-826.94
0.00
92.06
184.13
276.19
368.25
460.31
552.38
644.44
736.50
손익(백만)
가격

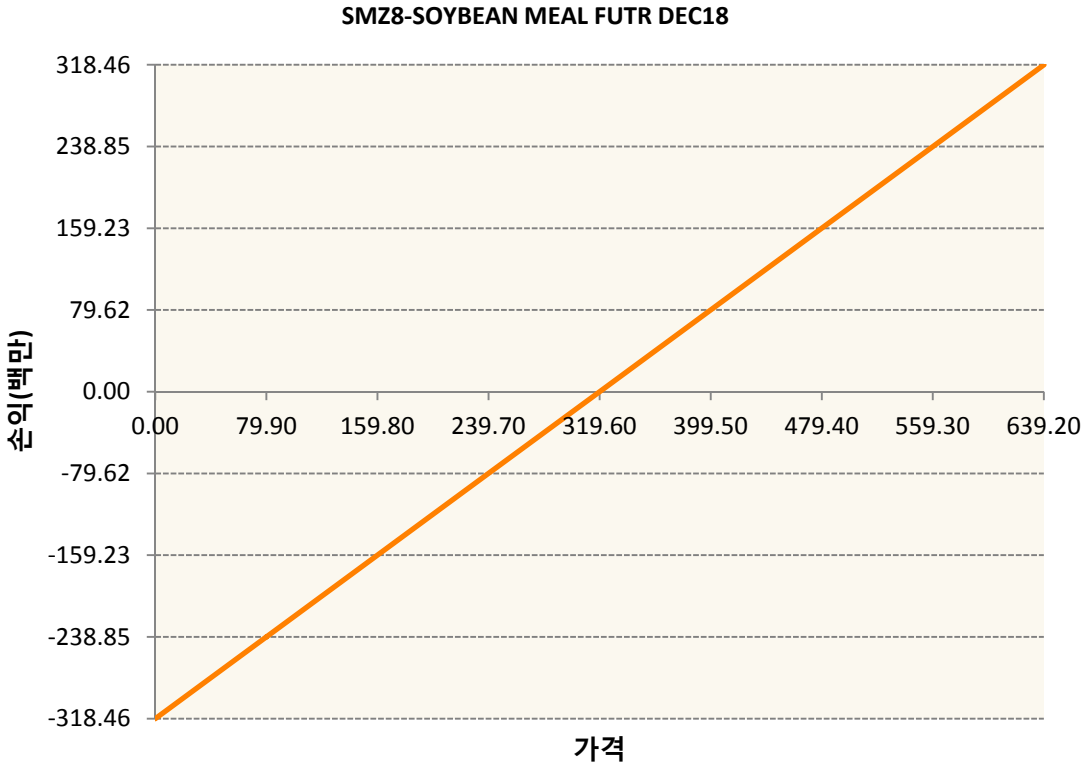

KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18
321.27
240.95
160.63
80.32
0.00
-80.32
-160.63
-240.95
0.00
27.24
54.48
81.71
108.95
136.19
163.43
190.66
217.90
손익(백만)


-321.27
가격

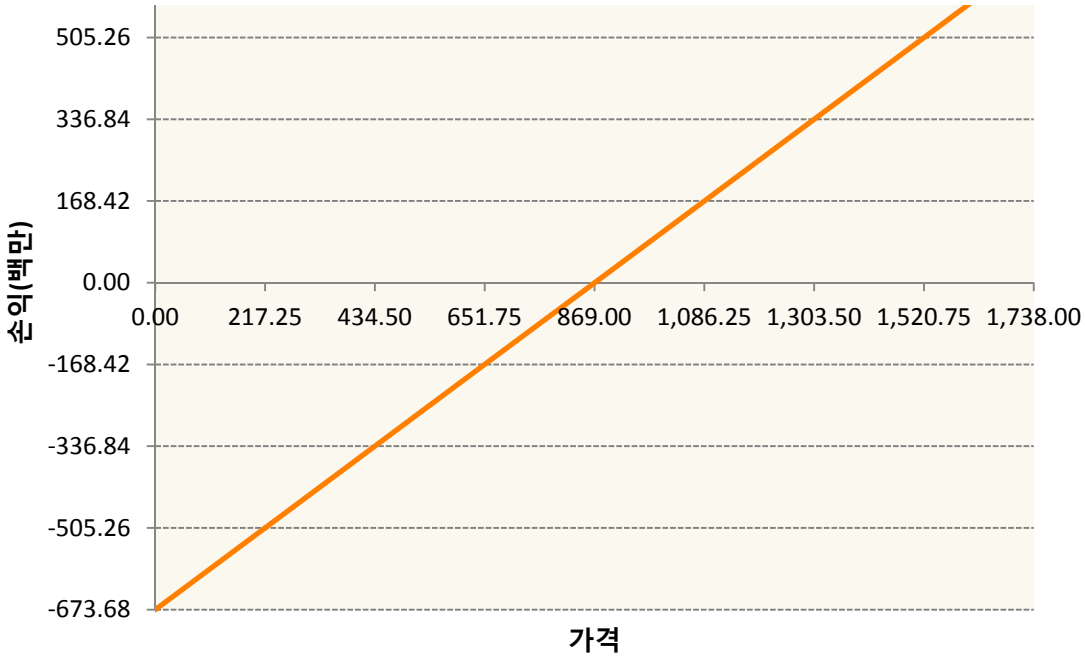

KR4175NA0007-2018-10 달러선물
79.32
59.49
39.66
19.83
0.00
-19.83
-39.66
-59.49
-79.32
0.00
283.28
566.55
849.83
1,133.10
1,416.38
1,699.65
1,982.93
2,266.20
손익(백만)
가격

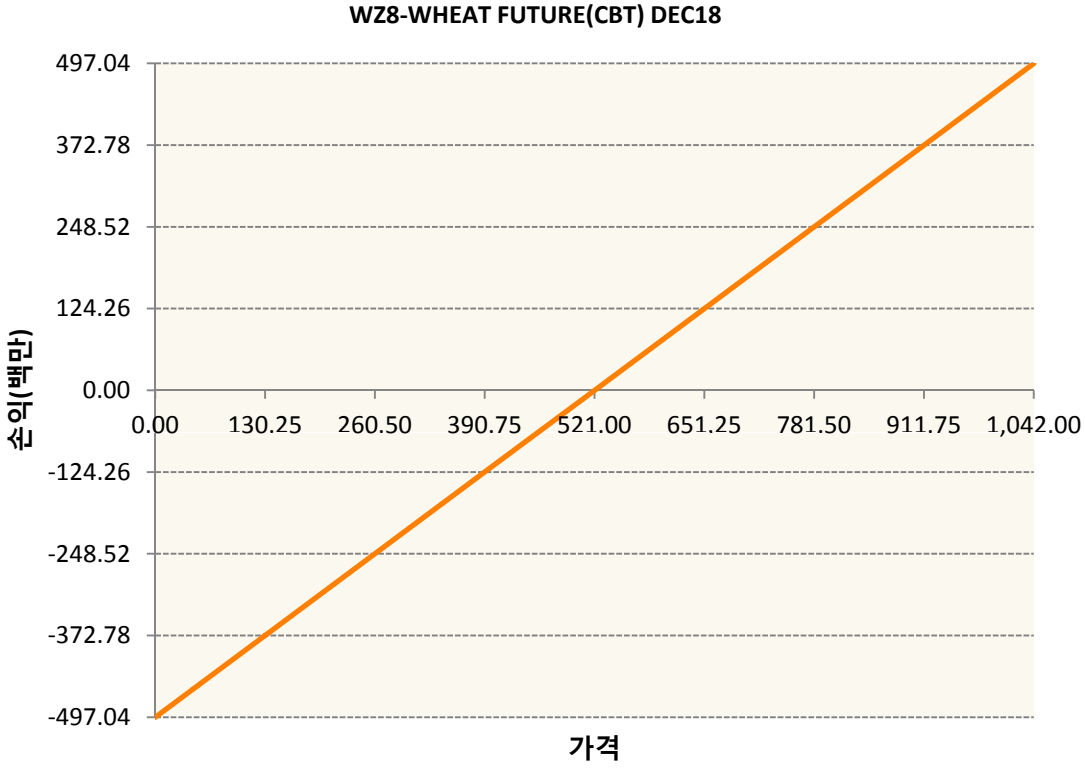

KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18
205.91
154.43
102.95
51.48
0.00
-51.48
-102.95
-154.43
-205.91
0.00
131.06
262.13
393.19
524.25
655.31
786.38
917.44
1,048.50
손익(백만)
가격


SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19
301.74
226.30
150.87
75.43
0.00
-75.43
-150.87
-226.30
-301.74
0.00
3.16
6.32
9.47
12.63
15.79
18.95
22.10
25.26
손익(백만)
가격


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18
318.46
238.85
159.23
79.62
0.00
-79.62
-159.23
-238.85
-318.46
0.00
79.90
159.80
239.70
319.60
399.50
479.40
559.30
639.20
손익(백만)
가격


SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18
673.68





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	23
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	13
CZ8	CORN FUTURE DEC18	66
KCZ8	COFFEE 'C' FUTURE Dec18	26
KR4175NA0(	2018-10 달러선물	6

KWZ8	KC HRW WHEAT FUT DEC18	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	24
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	25
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	54
WZ8	WHEAT FUTURE(CBT) DEC18	40

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

314