공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

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	2017-09-14
기준일	2017-09-13

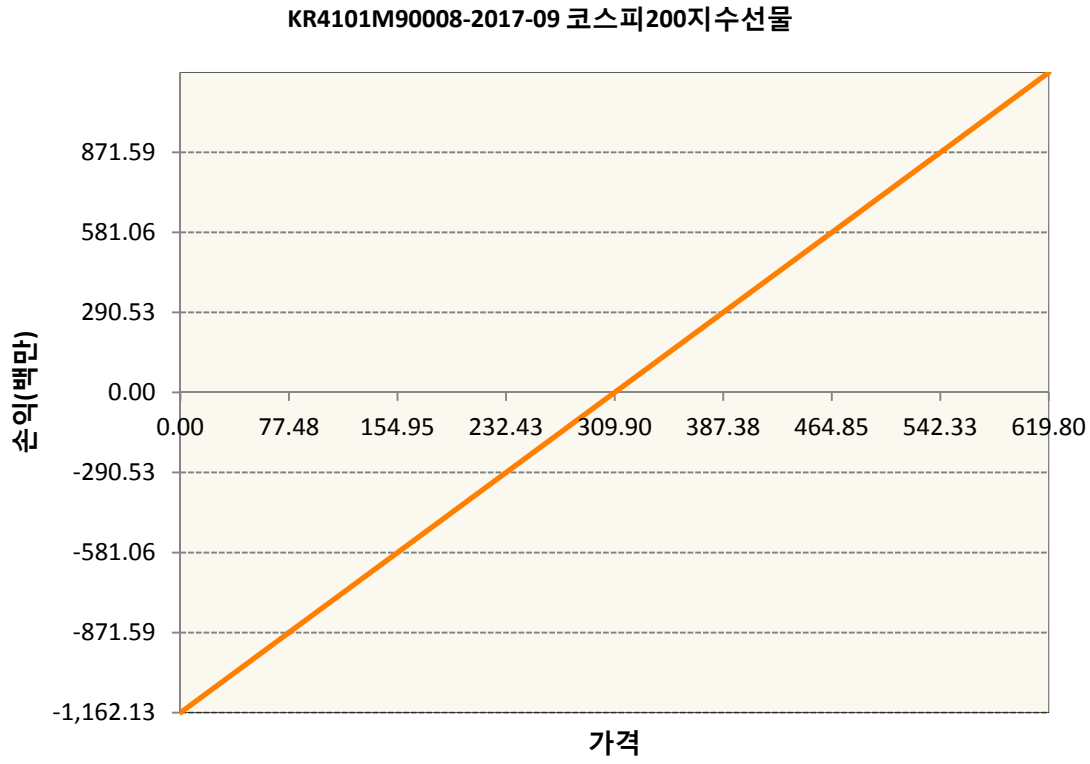
스마트인덱스모

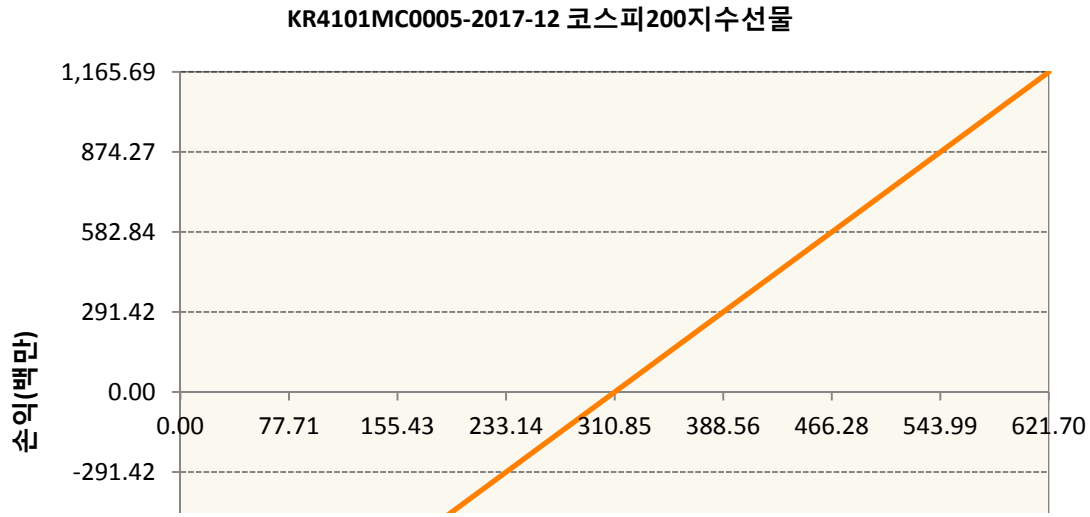
1. 계약금액

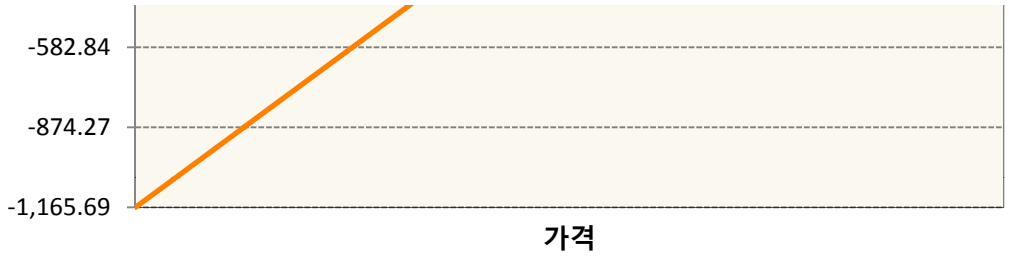
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,172	1,168	3	장내
누계	유가증권	선물	2,328	0	2,328	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	93	93	93	93	93	93	93
KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	93	93	93	93	93	93	93

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

116

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

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	12,592	0	12,592	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170822	1,038

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

469

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

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	5,301	0	5,301	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170908	432

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

372

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

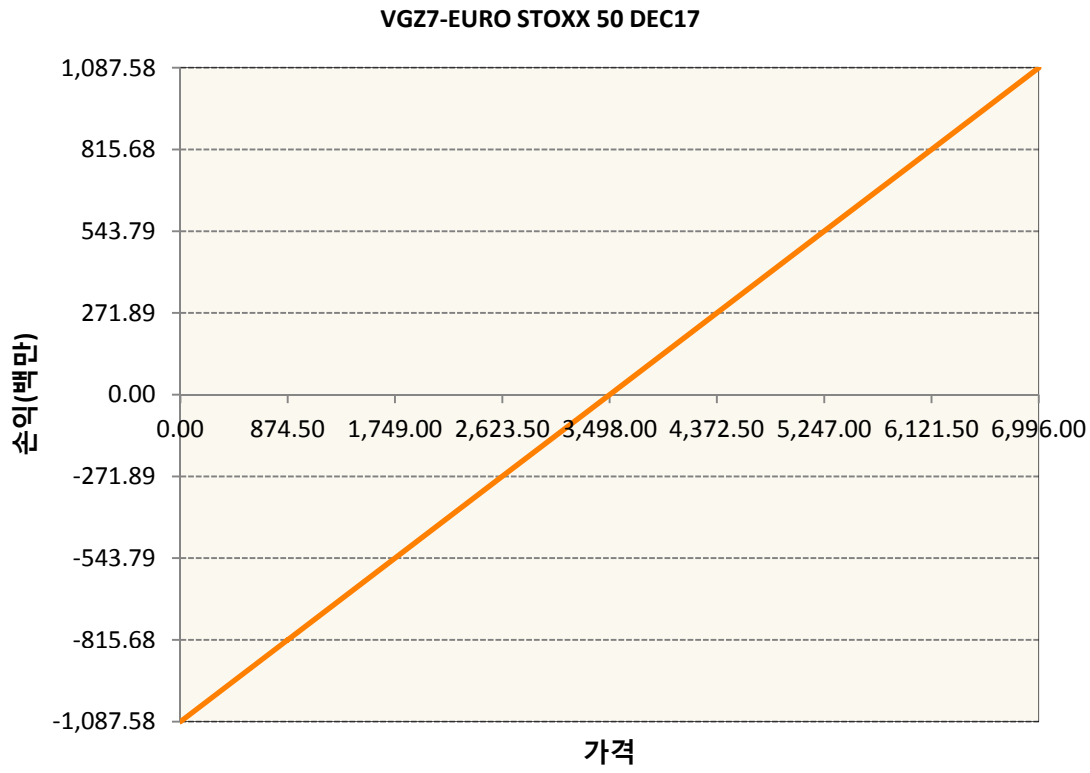
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,088	0	1,088	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	87

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

(단위:백만원)

69

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

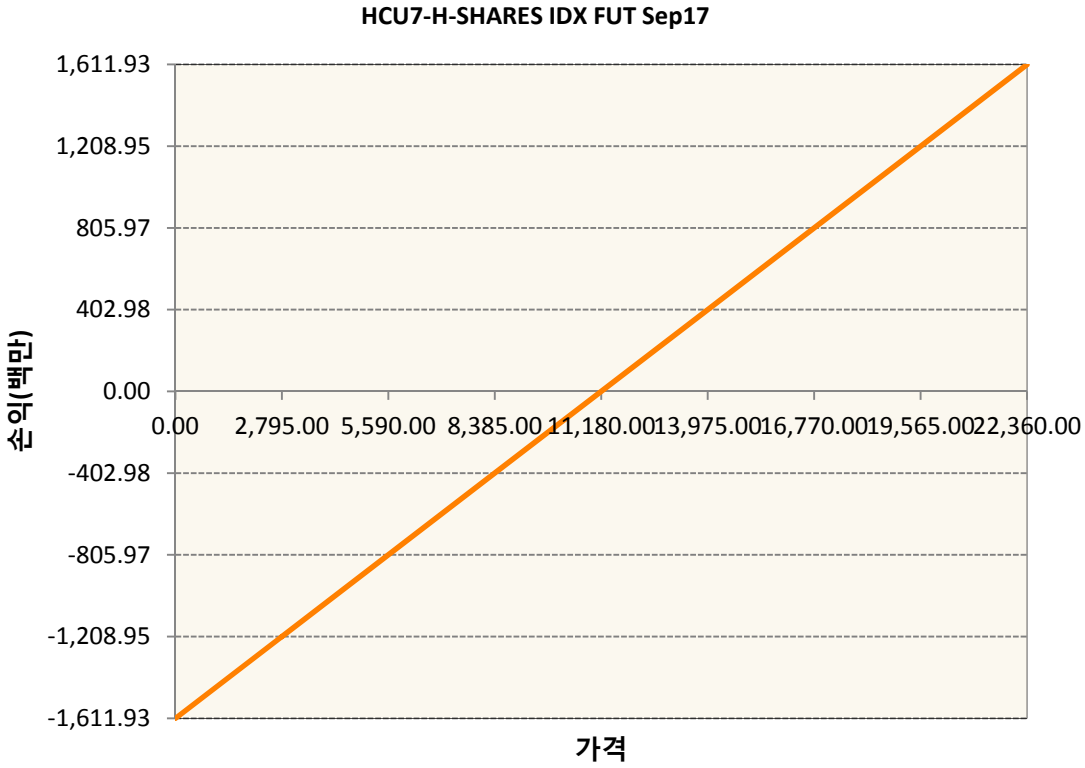
차이나인덱스모(주식-파생형)

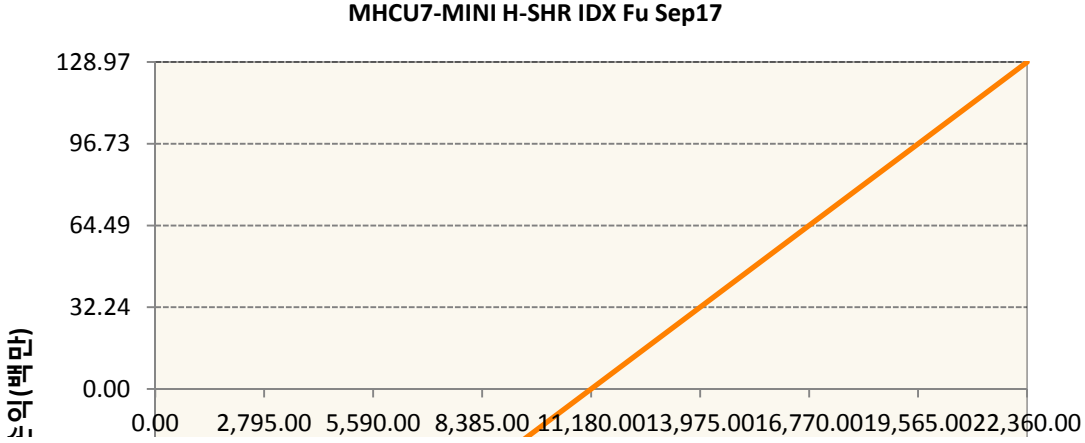
1. 계약금액

(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	129	0	129	
누계	유가증권	선물	1,612	0	1,612	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	129
MHCU7	MINI H-SHR IDX Fu Sep17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	118

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

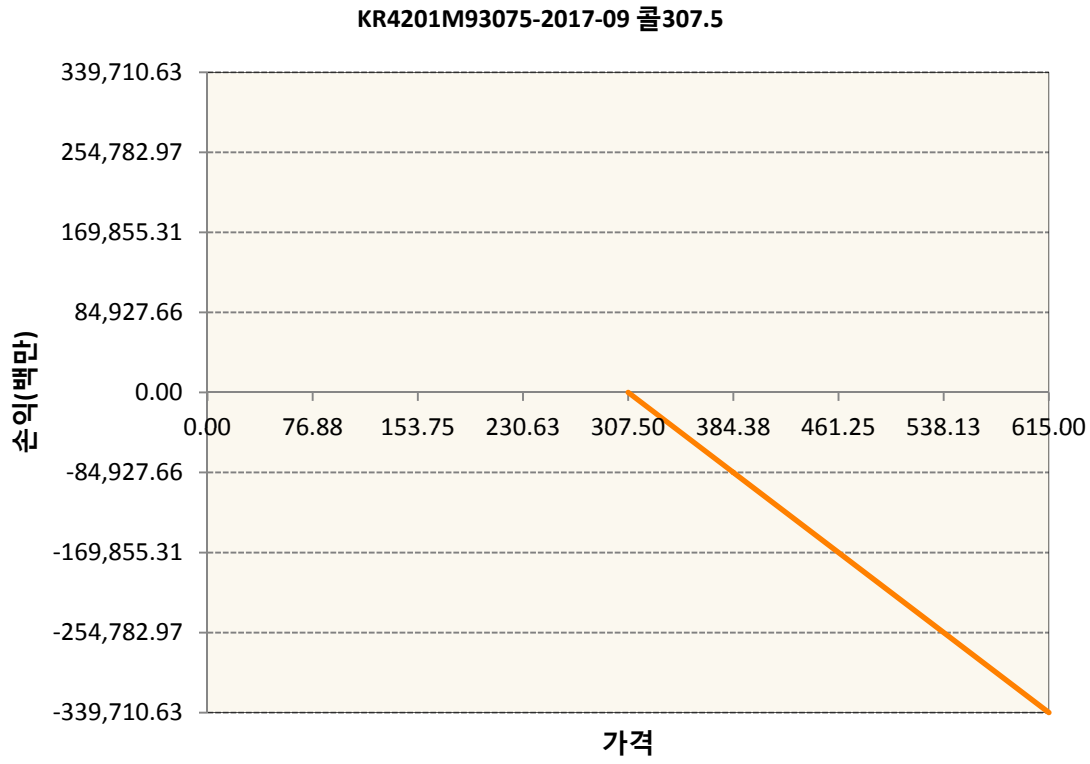
커버드콜모(주식혼합-파생형)

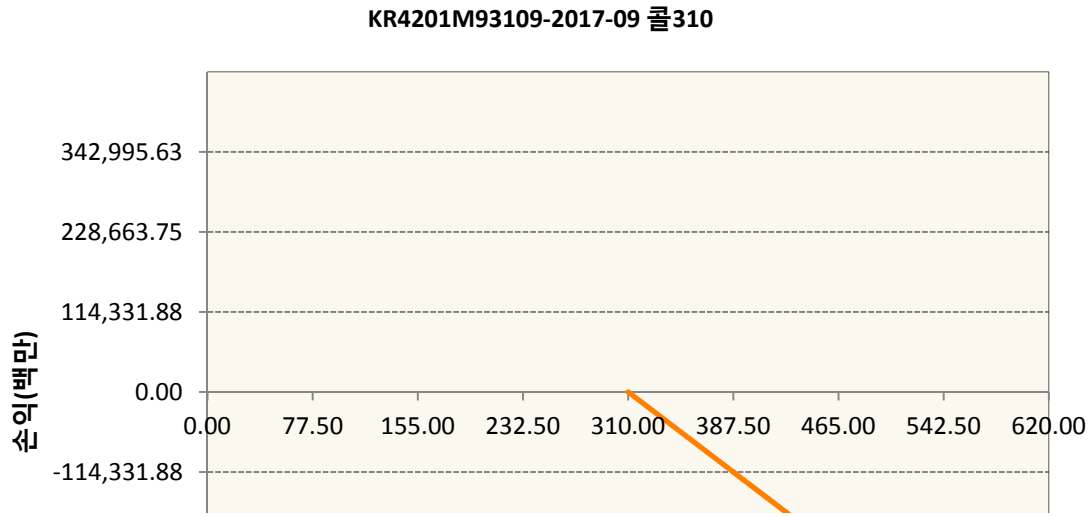
1. 계약금액

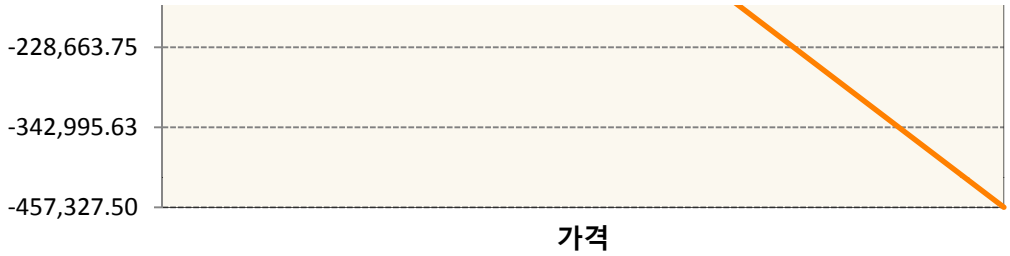
(단위:백만원)

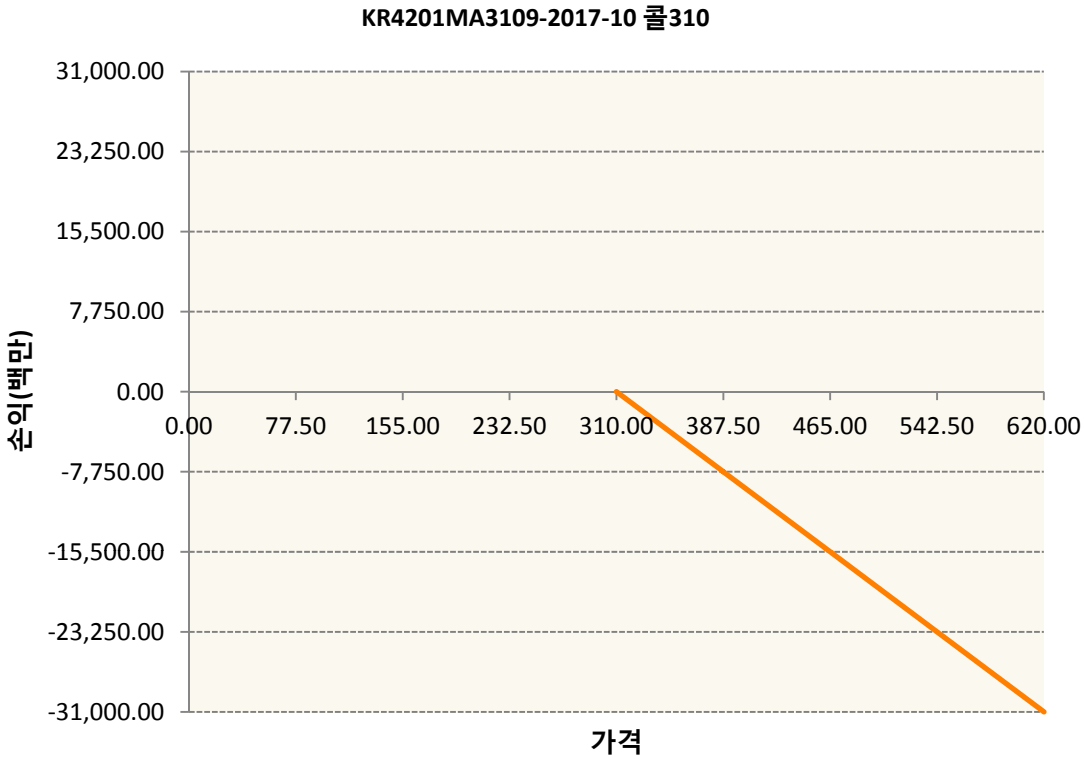
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	30,326	31,470	-1,144	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,497,369	-1,497,369	장내

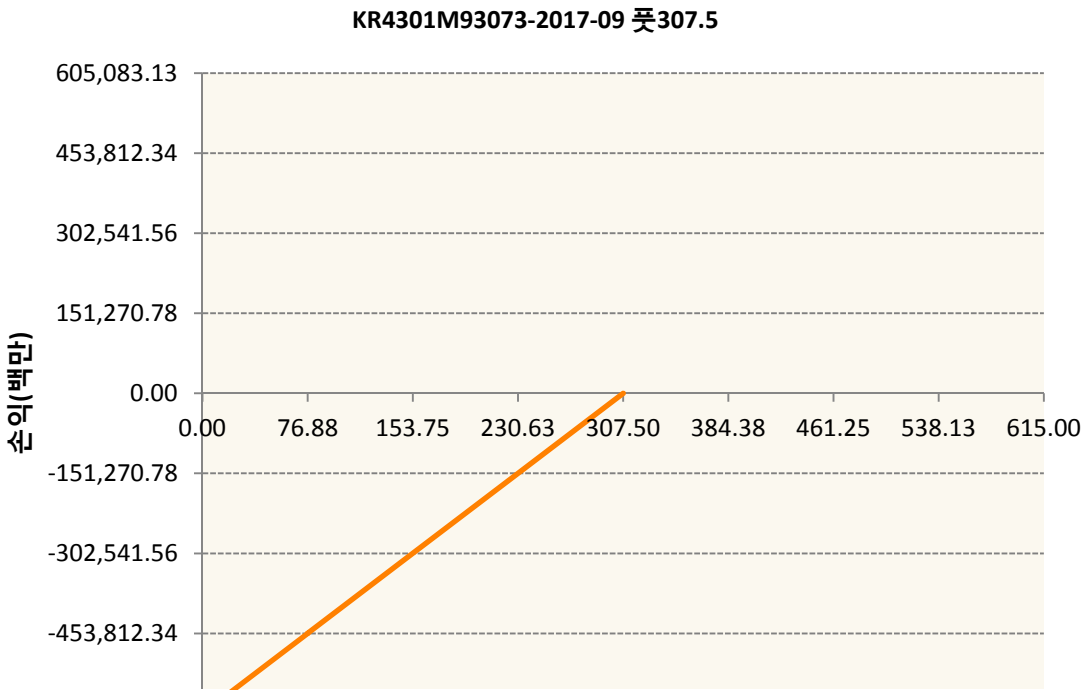
2. 만기시점의 손익구조



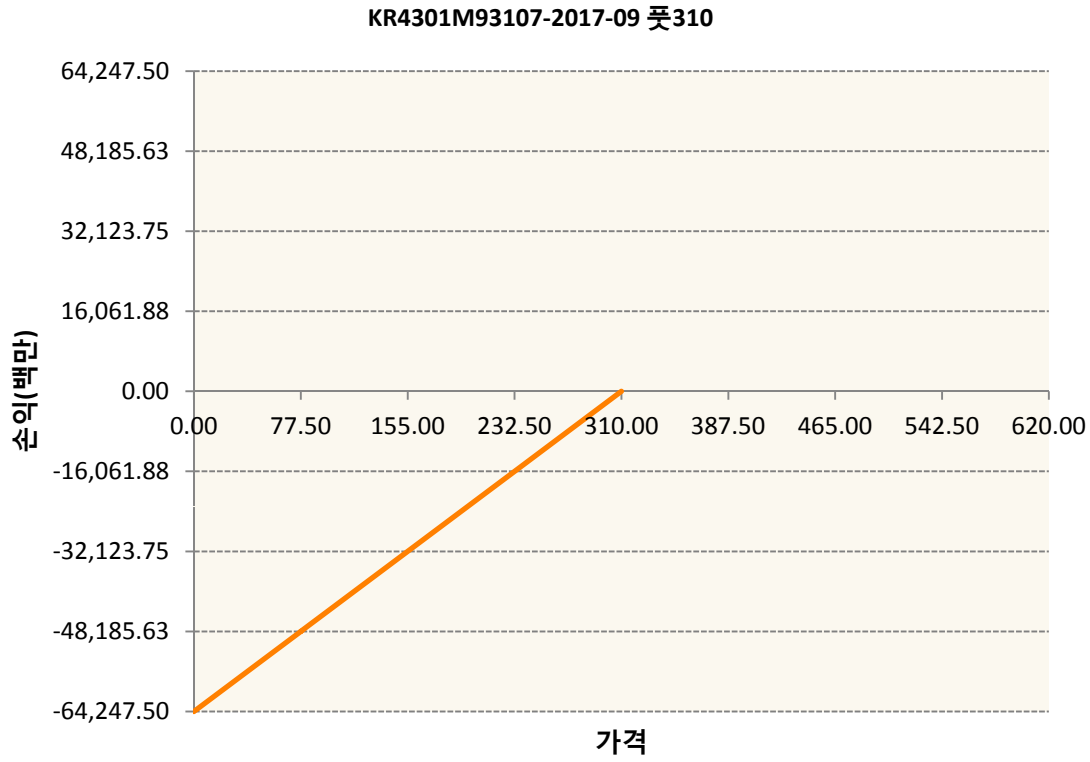



-228,663.75
-342,995.63
-457,327.50
가격


KR4201MA3109-2017-10 콜310
31,000.00
23,250.00
15,500.00
7,750.00
0.00
-7,750.00
-15,500.00
-23,250.00
-31,000.00
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
손익(백만)
가격


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
605,083.13
453,812.34
302,541.56
151,270.78
0.00
-151,270.78
-302,541.56
-453,812.34
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
615.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201M93(2017-09 콜307.5							26,735
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,422	3,422	3,422	3,422	3,422	3,422	3,422
-5.33%	3,422	3,422	3,422	3,422	3,422	3,421	3,420
-2.67%	3,397	3,375	3,344	3,304	3,256	3,200	3,137
0%	320	220	112	0	-116	-236	-358
2.67%	-8,471	-8,471	-8,472	-8,475	-8,479	-8,486	-8,497
5.33%	-17,603	-17,603	-17,603	-17,603	-17,603	-17,603	-17,603
8.00%	-26,735	-26,735	-26,735	-26,735	-26,735	-26,735	-26,735
KR4201M93: 2017-09 콜310							34,310
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,273	2,273	2,273	2,273	2,273	2,273	2,273
-5.33%	2,273	2,273	2,273	2,273	2,273	2,273	2,273
-2.67%	2,271	2,267	2,258	2,243	2,222	2,193	2,155
0%	568	379	189	0	-189	-379	-568
2.67%	-9,923	-9,929	-9,939	-9,956	-9,981	-10,014	-10,056

5.33%	-22,115	-22,115	-22,115	-22,115	-22,115	-22,115	-22,116
8.00%	-34,310	-34,310	-34,310	-34,310	-34,310	-34,310	-34,310
	KR4201MA3 2017-10 콜310						1,910
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	797	778	754	726	693	657	618
-5.33%	722	682	639	592	543	491	438
-2.67%	541	482	420	358	295	231	167
0%	207	138	69	0	-69	-138	-207
2.67%	-298	-360	-423	-487	-552	-618	-685
5.33%	-947	-991	-1,039	-1,090	-1,144	-1,200	-1,257
8.00%	-1,691	-1,717	-1,747	-1,782	-1,821	-1,864	-1,910
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						42,703
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42,703	-42,703	-42,703	-42,703	-42,703	-42,703	-42,703
-5.33%	-26,437	-26,437	-26,437	-26,437	-26,438	-26,439	-26,441
-2.67%	-10,215	-10,255	-10,310	-10,381	-10,466	-10,566	-10,679
0%	571	391	200	0	-207	-420	-638
2.67%	1,177	1,177	1,175	1,171	1,163	1,151	1,132
5.33%	1,178	1,178	1,178	1,178	1,178	1,178	1,178
8.00%	1,178	1,178	1,178	1,178	1,178	1,178	1,178
	KR4301M93: 2017-09 풋310						4,820
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,820	-4,820	-4,820	-4,820	-4,820	-4,820	-4,820
-5.33%	-3,107	-3,107	-3,107	-3,107	-3,107	-3,107	-3,107
-2.67%	-1,394	-1,395	-1,396	-1,398	-1,401	-1,405	-1,410
0%	80	53	27	0	-27	-53	-80
2.67%	319	318	317	314	311	306	300
5.33%	320	320	320	320	320	320	319
8.00%	320	320	320	320	320	320	320

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

157,158

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

ETF스마트레버리지목표전환형6호

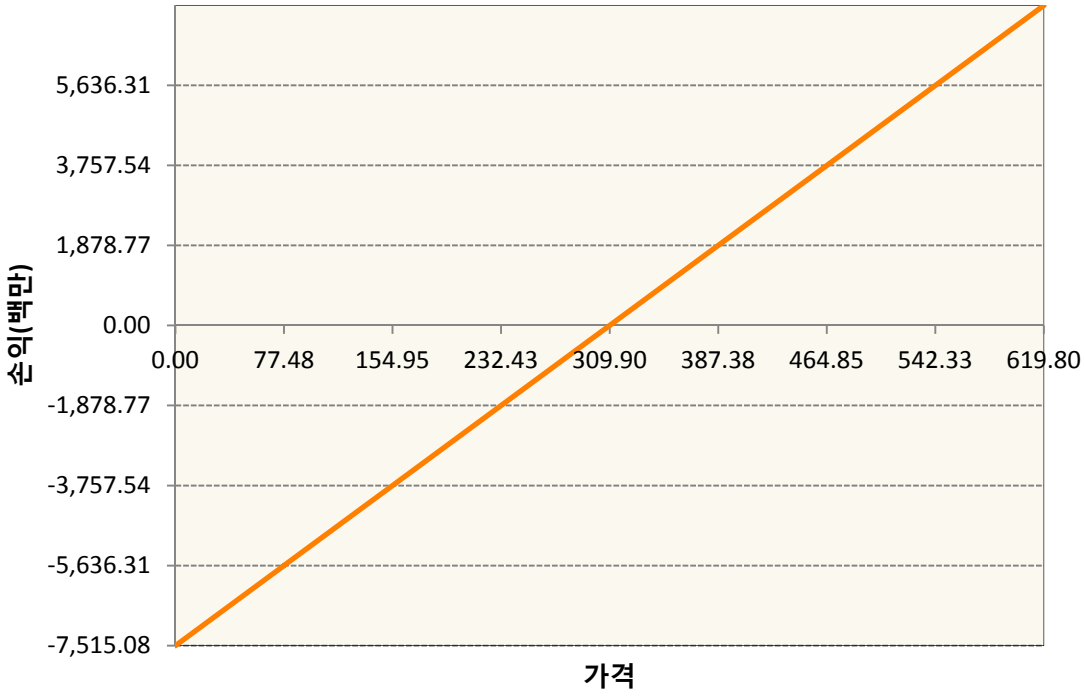
1. 계약금액

(단위:백만원)

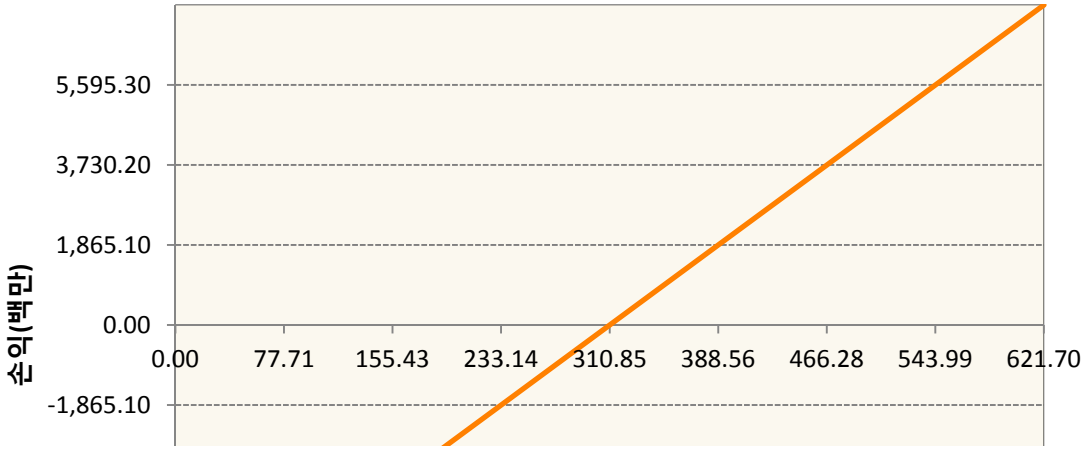
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,500	7,478	22	장내
누계	유가증권	선물	14,975	0	14,975	장내

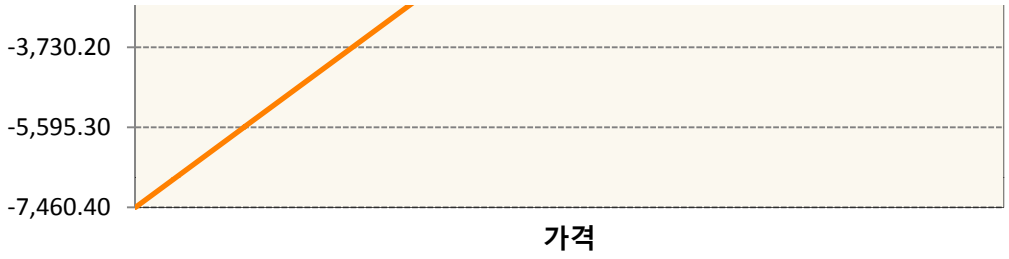
2. 만기시점의 손익구조

KR4101M90008-2017-09 코스피200지수선물



KR4101MC0005-2017-12 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							601
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601
-5.33%	-401	-401	-401	-401	-401	-401	-401
-2.67%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	200	200	200	200	200	200	200
5.33%	401	401	401	401	401	401	401
8.00%	601	601	601	601	601	601	601
KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							595
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-595	-595	-595	-595	-595	-595	-595
-5.33%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397
-2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	198	198	198	198	198	198	198
5.33%	397	397	397	397	397	397	397
8.00%	595	595	595	595	595	595	595

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

744

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

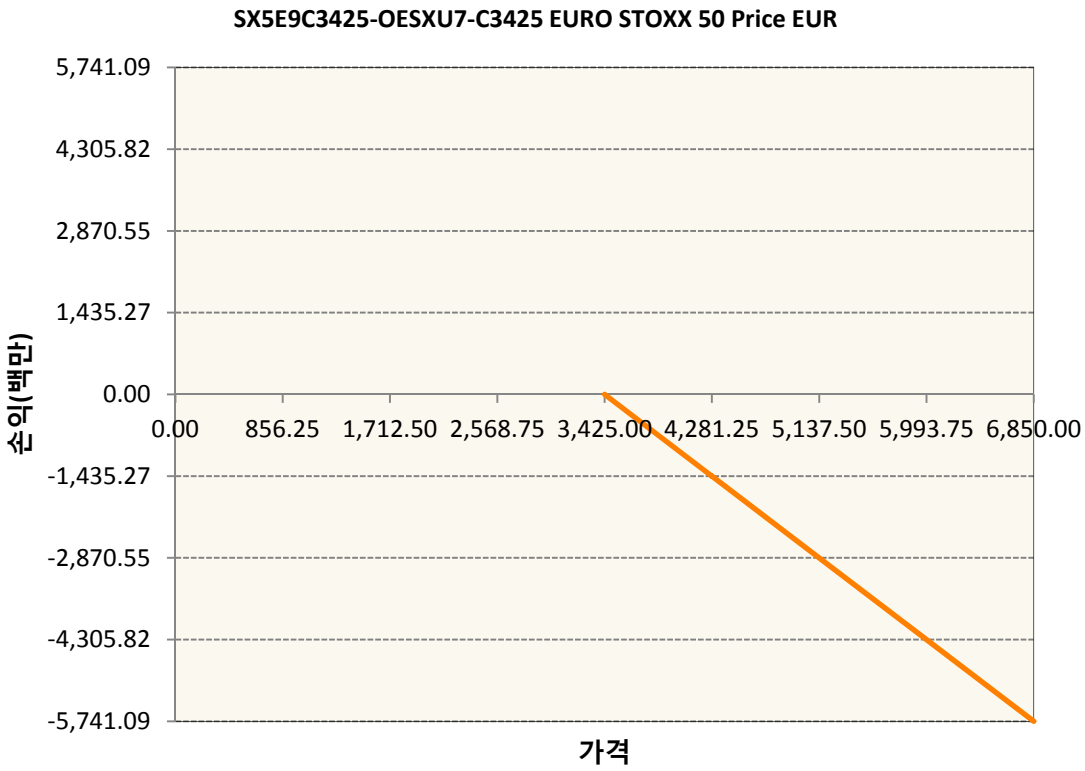
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

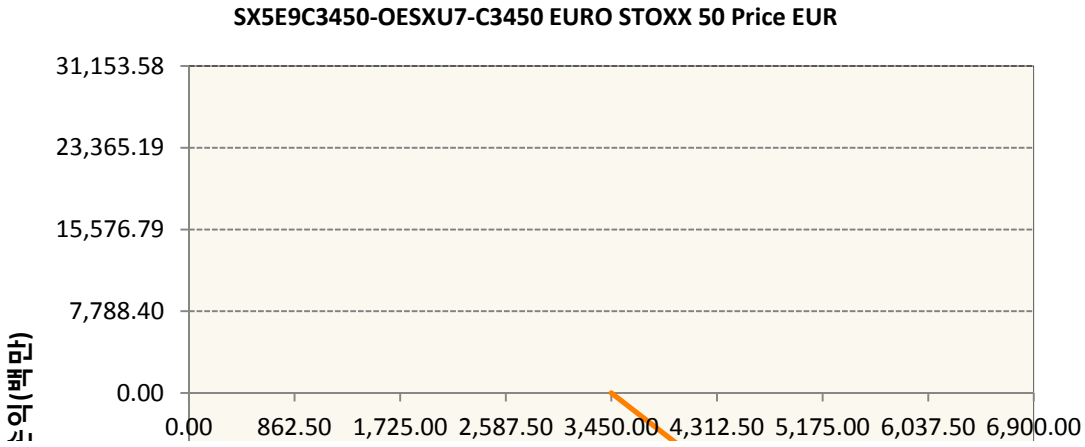
1. 계약금액

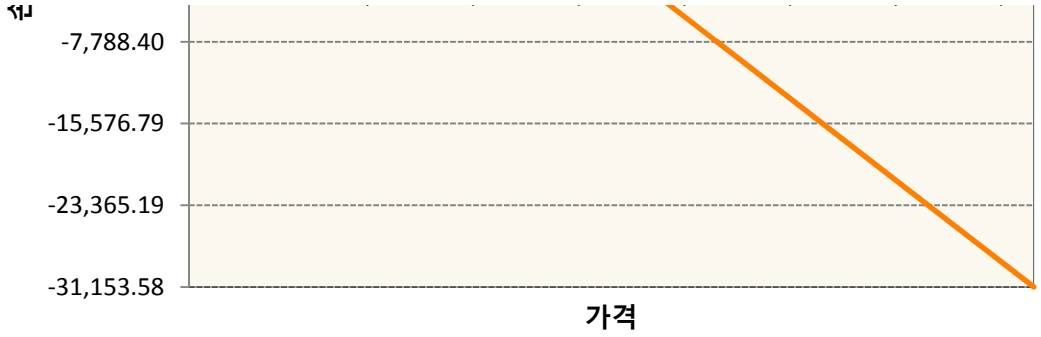
(단위:백만원)

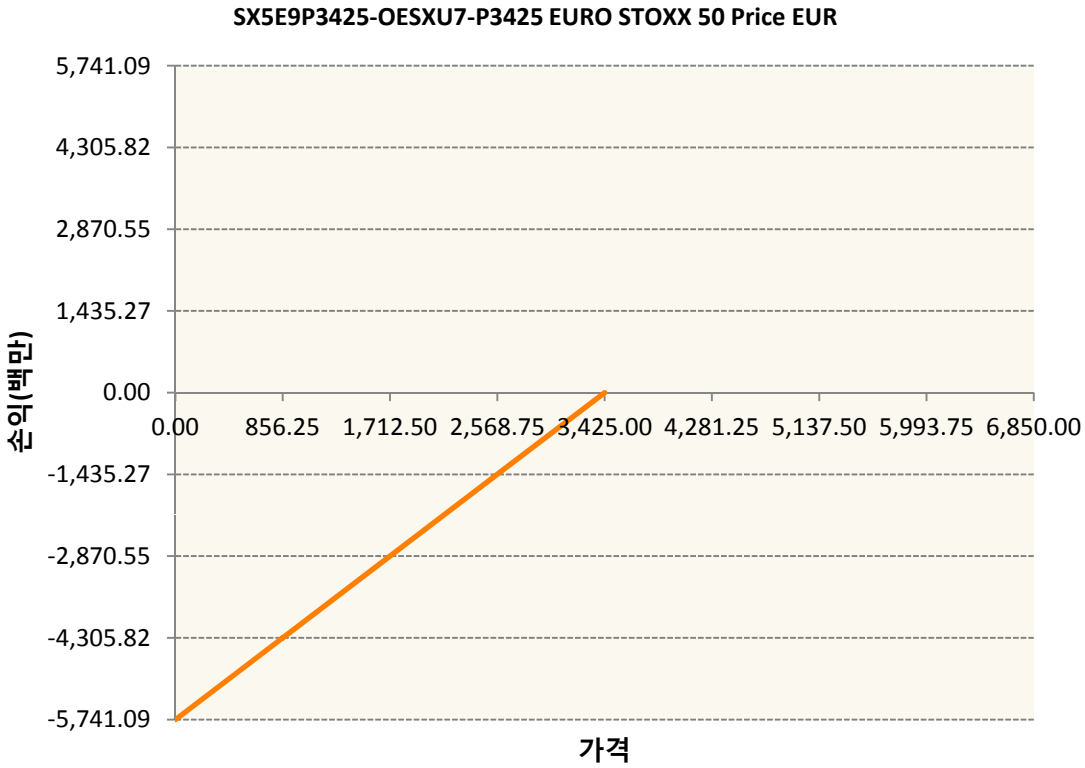
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	32,967	0	32,967	
누계	유가증권	옵션	0	73,789	-73,789	장내

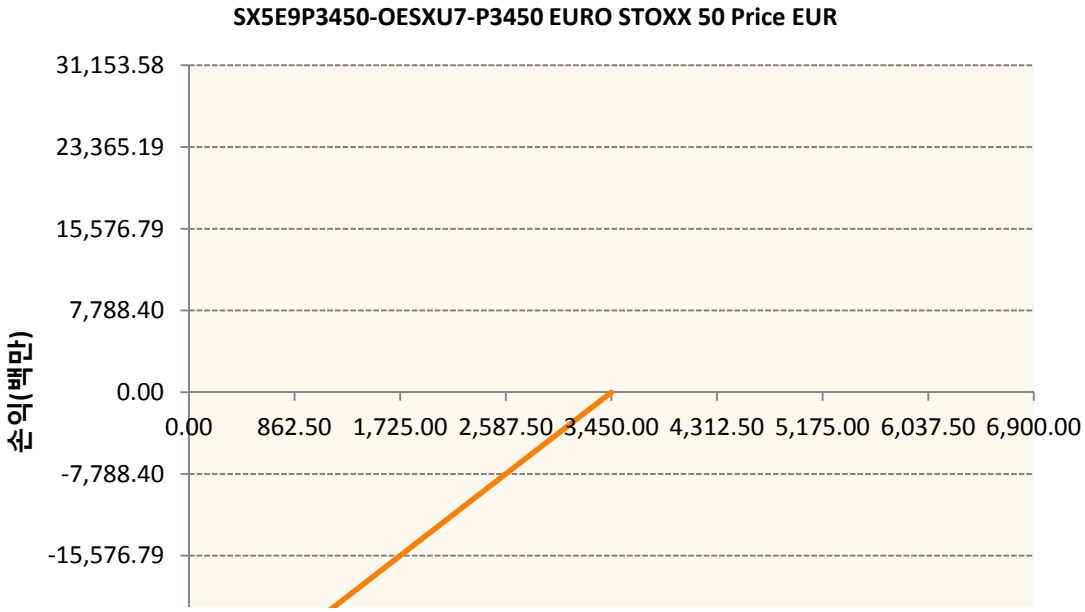
2. 만기시점의 손익구조

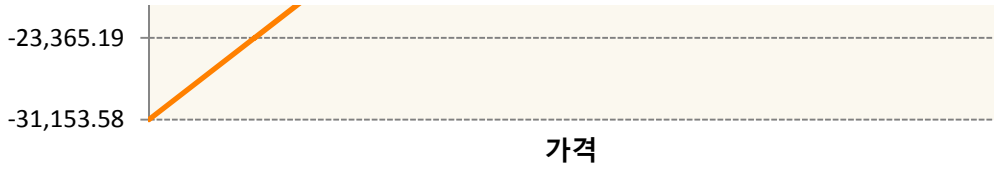


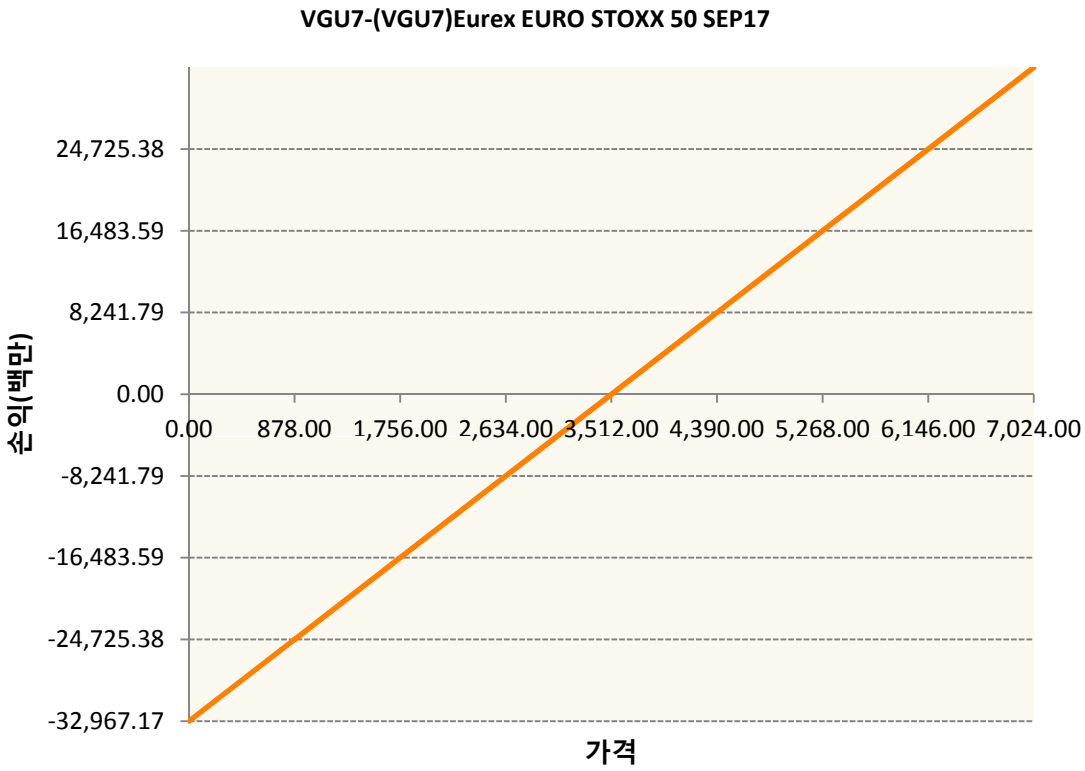



-7,788.40
-15,576.79
-23,365.19
-31,153.58
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
5,741.09
4,305.82
2,870.55
1,435.27
0.00
-1,435.27
-2,870.55
-4,305.82
-5,741.09
0.00
856.25
1,712.50
2,568.75
3,425.00
4,281.25
5,137.50
5,993.75
6,850.00
손익(백만)
가격


SX5E9P3450-OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR
31,153.58
23,365.19
15,576.79
7,788.40
0.00
-7,788.40
-15,576.79
0.00
862.50
1,725.00
2,587.50
3,450.00
4,312.50
5,175.00
6,037.50
6,900.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E9C3425	OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR	459
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,492
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	459
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,492
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,637

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6,737

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

ETF스마트레버리지목표전환형7호

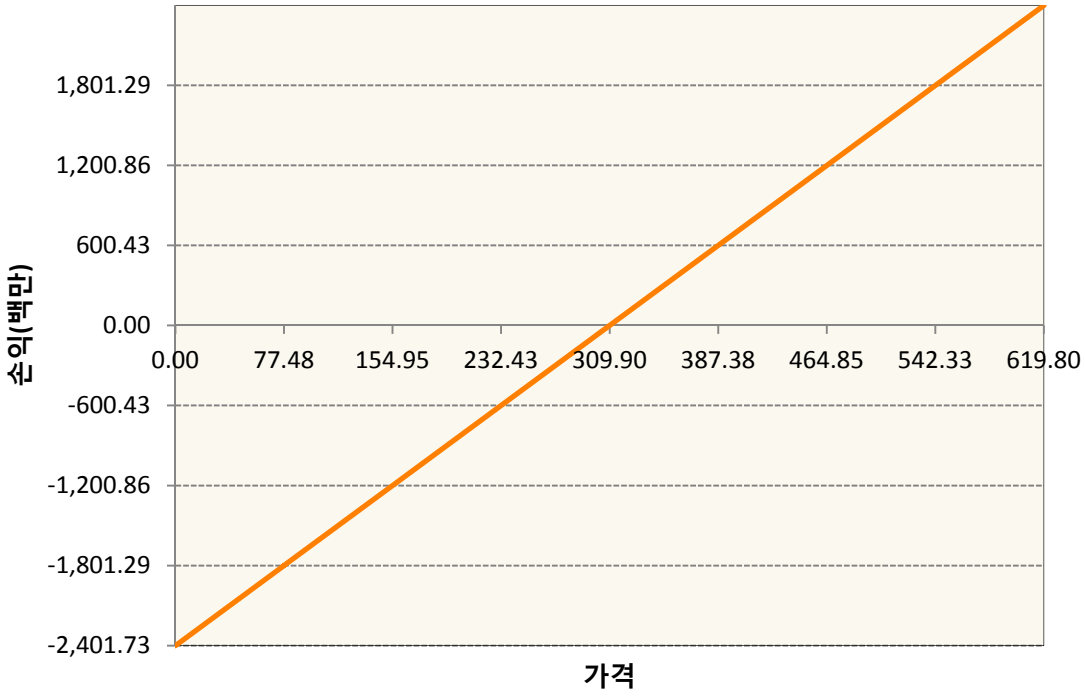
1. 계약금액

(단위:백만원)

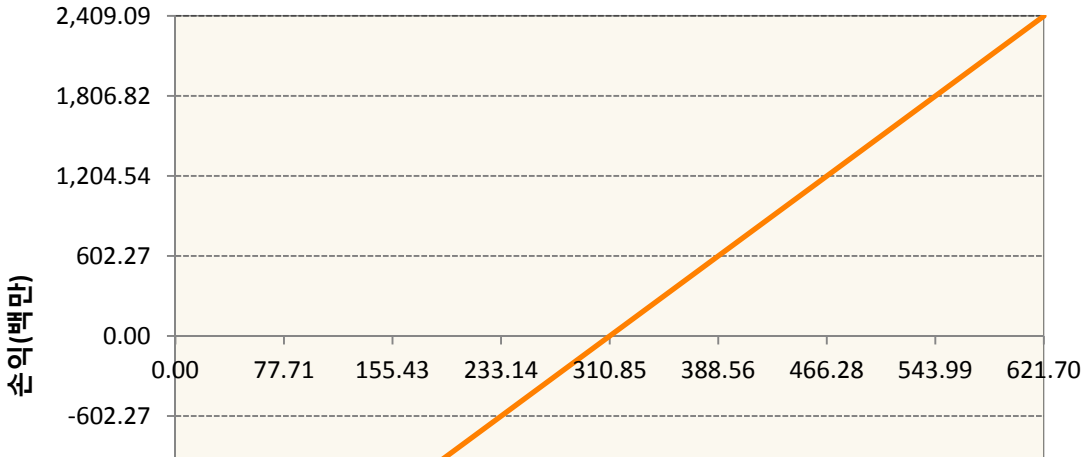
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,422	2,415	7	장내
누계	유가증권	선물	4,811	0	4,811	장내

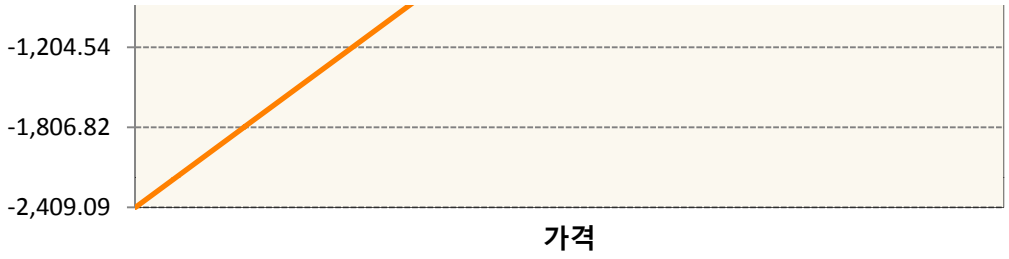
2. 만기시점의 손익구조

KR4101M90008-2017-09 코스피200지수선물



KR4101MC0005-2017-12 코스피200지수선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							192
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
-5.33%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	64	64	64	64	64	64	64
5.33%	128	128	128	128	128	128	128
8.00%	192	192	192	192	192	192	192

KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							192
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
-5.33%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	64	64	64	64	64	64	64
5.33%	128	128	128	128	128	128	128
8.00%	192	192	192	192	192	192	192

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

239

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

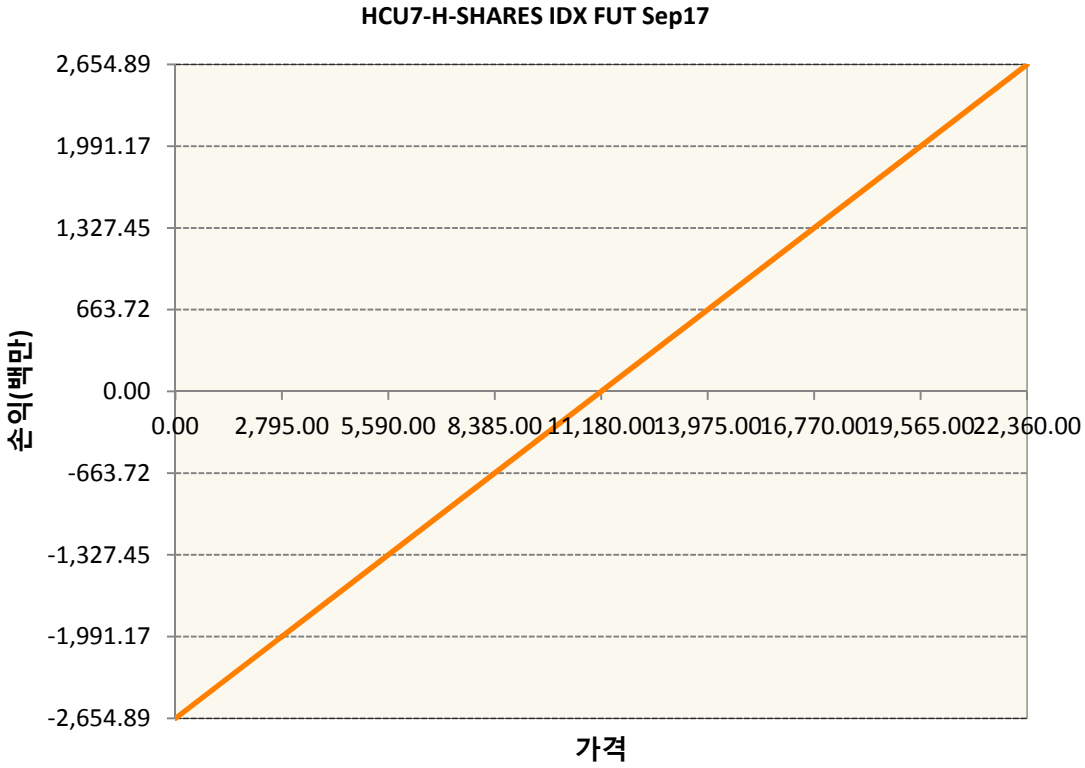
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

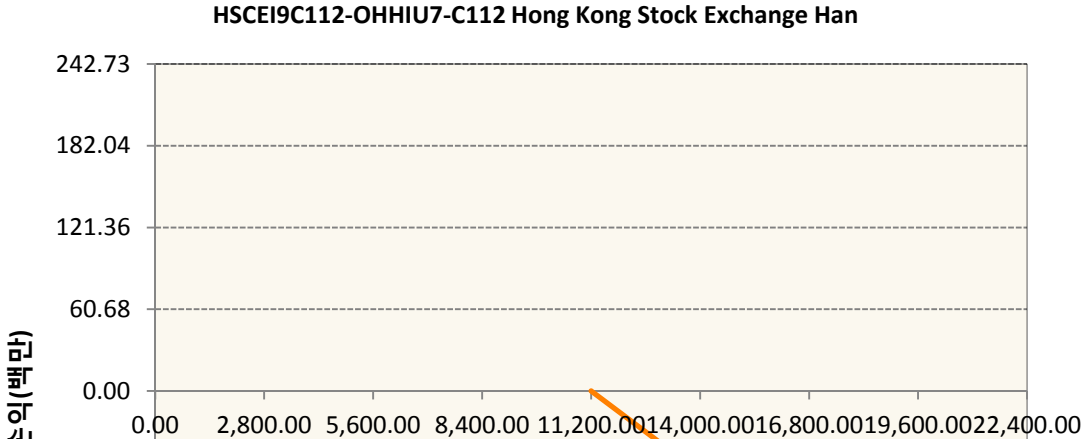
1. 계약금액

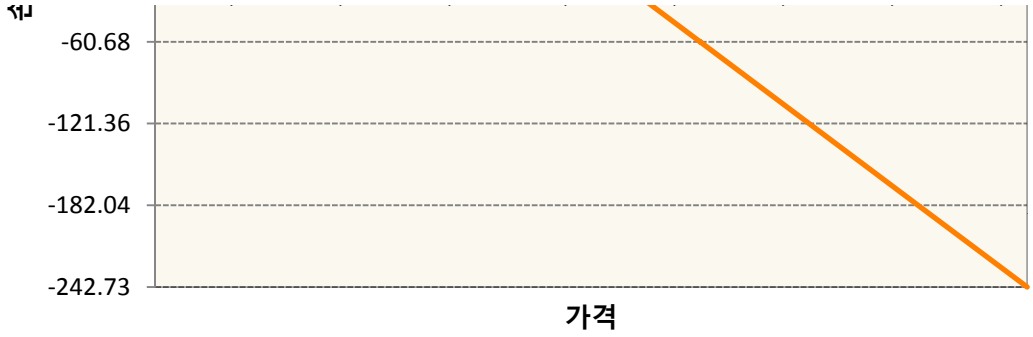
(단위:백만원)

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	2,655	0	2,655	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,085	-6,085	장내

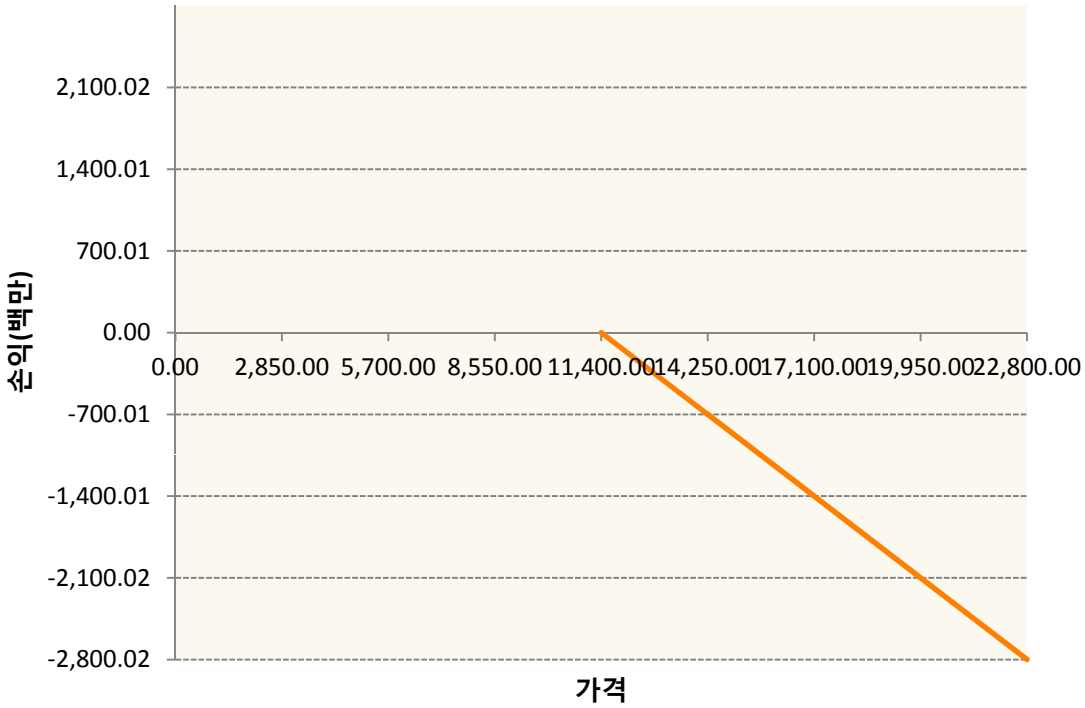
2. 만기시점의 손익구조



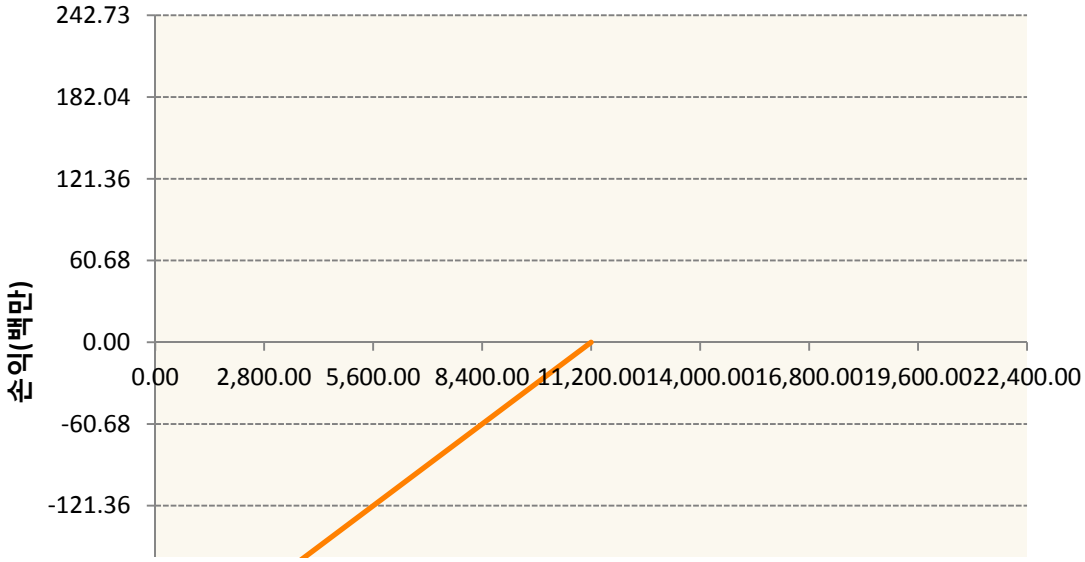


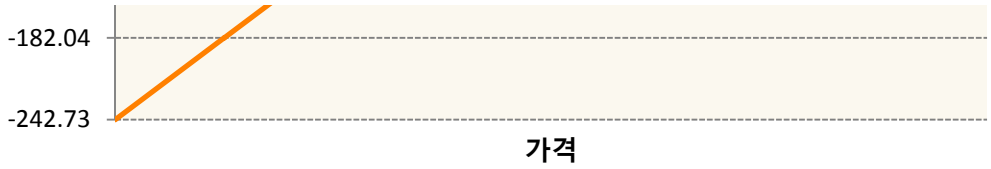


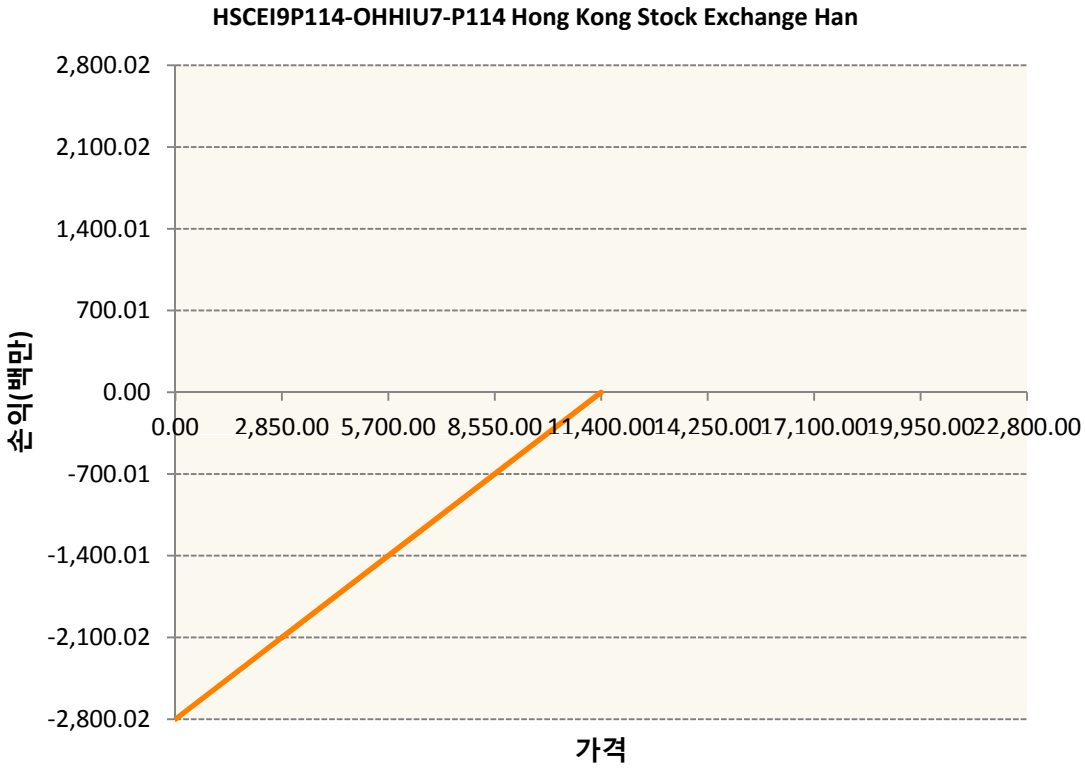
HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han



HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	212
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	19
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	224
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	19
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	224

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

591

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

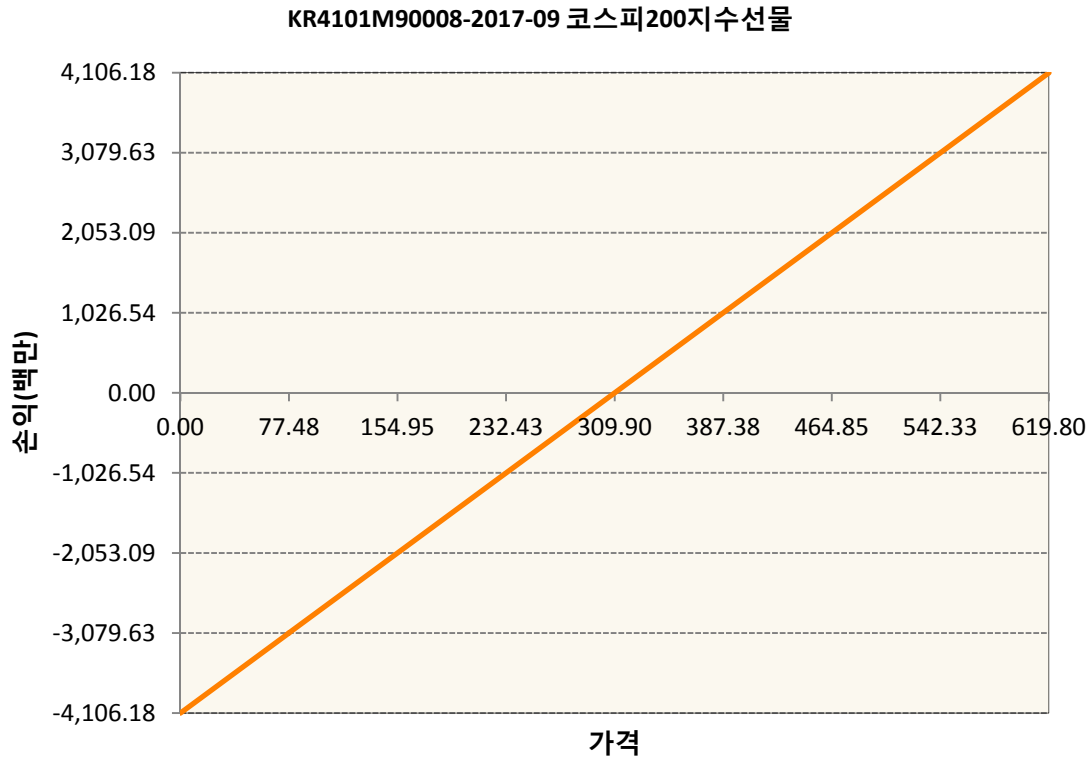
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

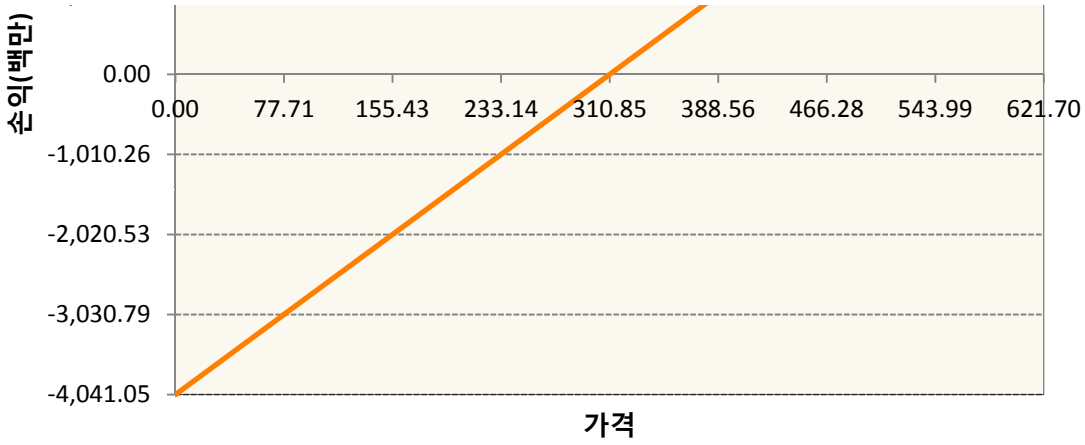
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,062	4,050	12	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,147	0	8,147	장내
누계	유가증권	스왑	22,000	0	22,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,972	-21,972	장내

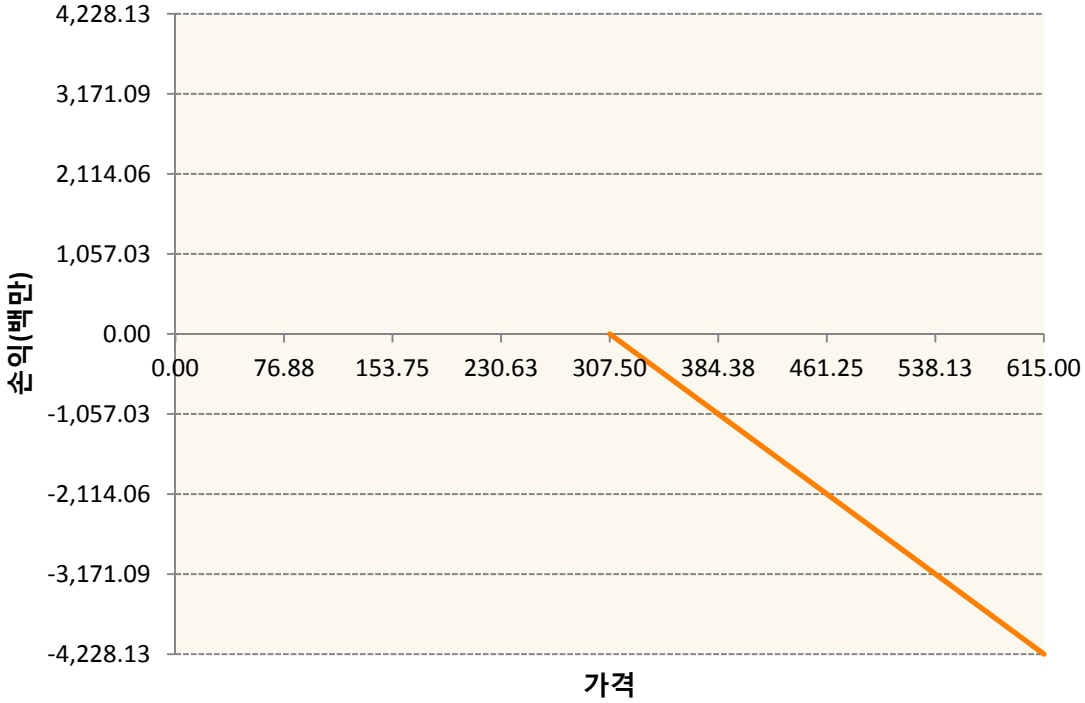
2. 만기시점의 손익구조



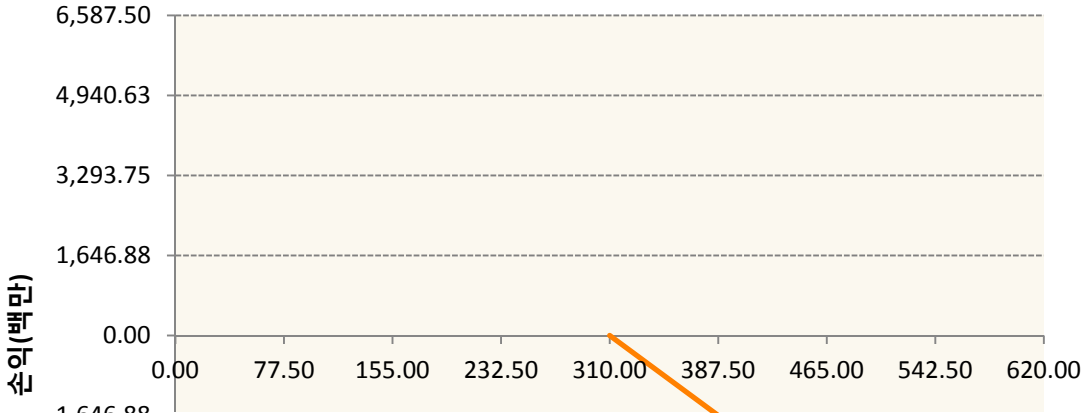


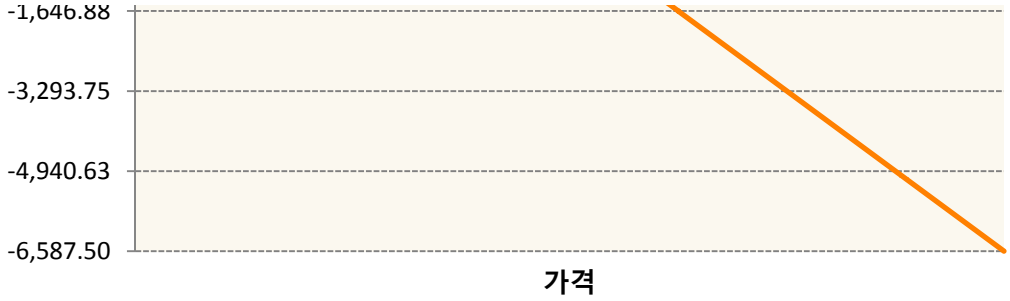


KR4201M93075-2017-09 콜307.5

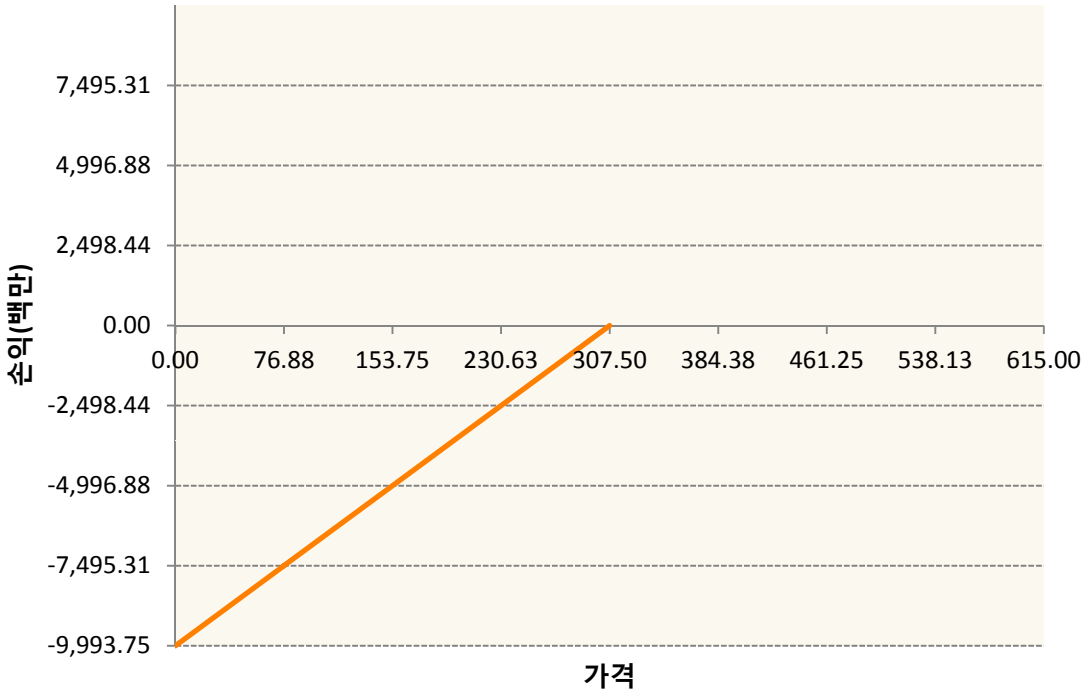


KR4201M93109-2017-09 콜310

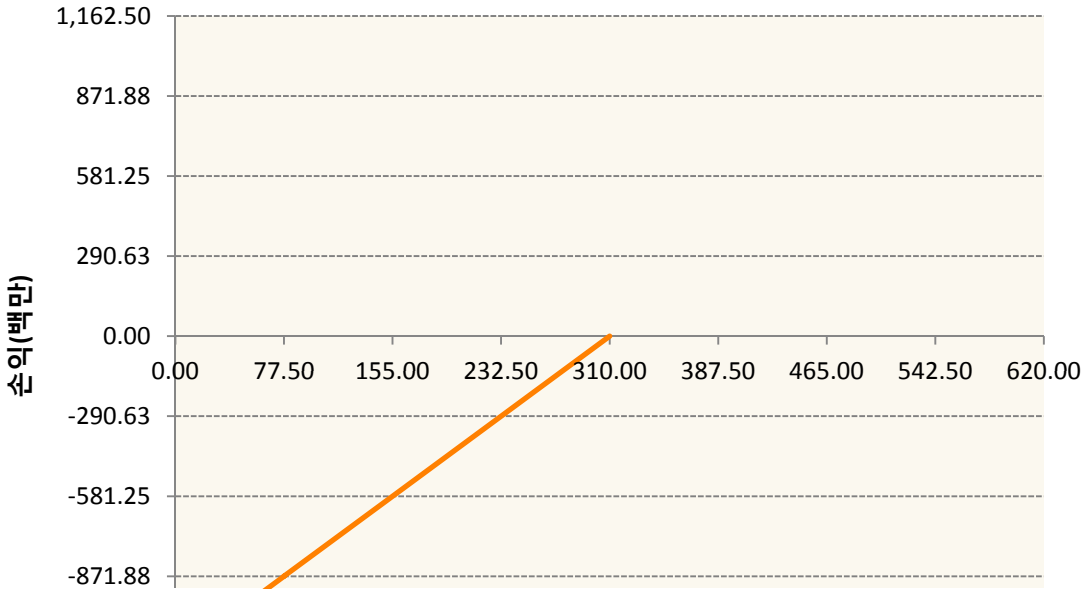




KR4301M93073-2017-09 풋307.5



KR4301M93107-2017-09 풋310





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,478
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478
-5.33%	-986	-986	-986	-986	-986	-986	-986
-2.67%	-493	-493	-493	-493	-493	-493	-493
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	493	493	493	493	493	493	493
5.33%	986	986	986	986	986	986	986
8.00%	1,478	1,478	1,478	1,478	1,478	1,478	1,478
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							280
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	280	280	280	280	280	280	280
KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							329
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-329	-329	-329	-329	-329	-329	-329
-5.33%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
-2.67%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	110	110	110	110	110	110	110
5.33%	219	219	219	219	219	219	219
8.00%	329	329	329	329	329	329	329
KR4101MC0(2017-12 코스피200지수선물							322
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322
-5.33%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215
-2.67%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	107	107	107	107	107	107	107
5.33%	215	215	215	215	215	215	215
8.00%	322	322	322	322	322	322	322
	KR4201M93(2017-09 콜307.5						333
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	43	43	43	43	43	43
-5.33%	43	43	43	43	43	43	43
-2.67%	42	42	42	41	41	40	39
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-105	-105	-105	-105	-106	-106	-106
5.33%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
8.00%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333
	KR4201M93: 2017-09 콜310						494
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33
-5.33%	33	33	33	33	33	33	33
-2.67%	33	33	33	32	32	32	31
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	-143	-143	-143	-143	-144	-144	-145
5.33%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
8.00%	-494	-494	-494	-494	-494	-494	-494
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						705
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-705	-705	-705	-705	-705	-705	-705
-5.33%	-437	-437	-437	-437	-437	-437	-437
-2.67%	-169	-169	-170	-171	-173	-175	-176
0%	9	6	3	0	-3	-7	-11
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	19	19	19	19	19	19	19
8.00%	19	19	19	19	19	19	19
	KR4301M93: 2017-09 풋310						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%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-26
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	6	6	6	6	6	6	5
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

4,471

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

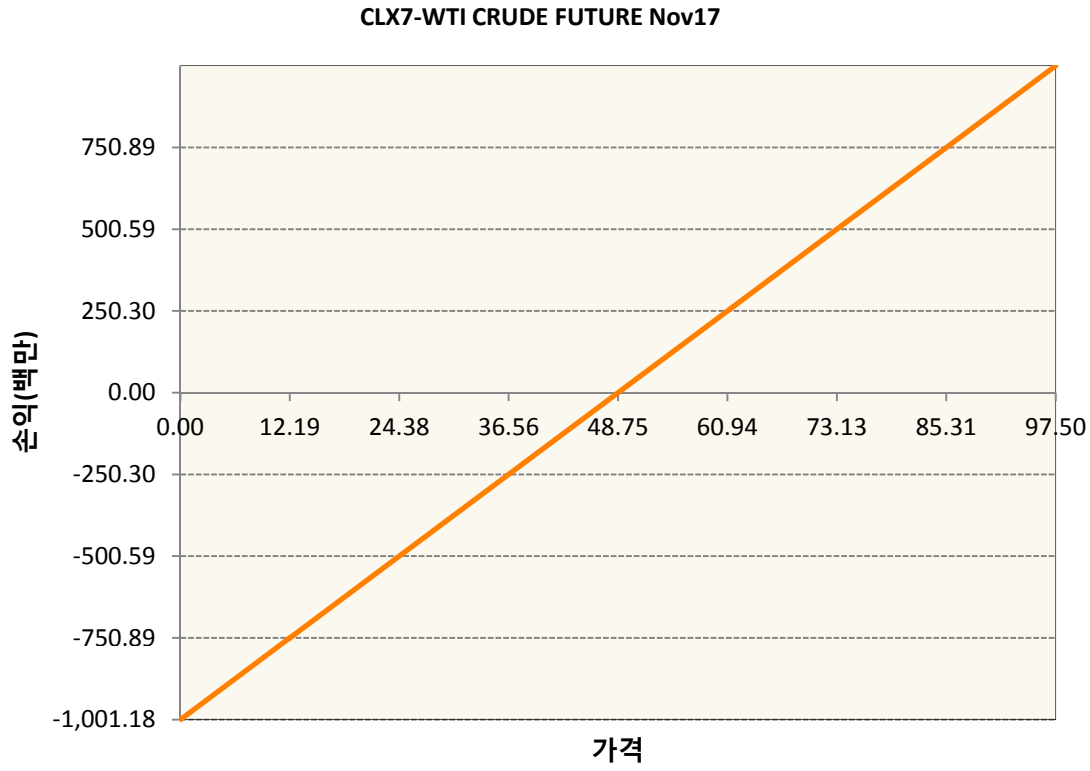
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

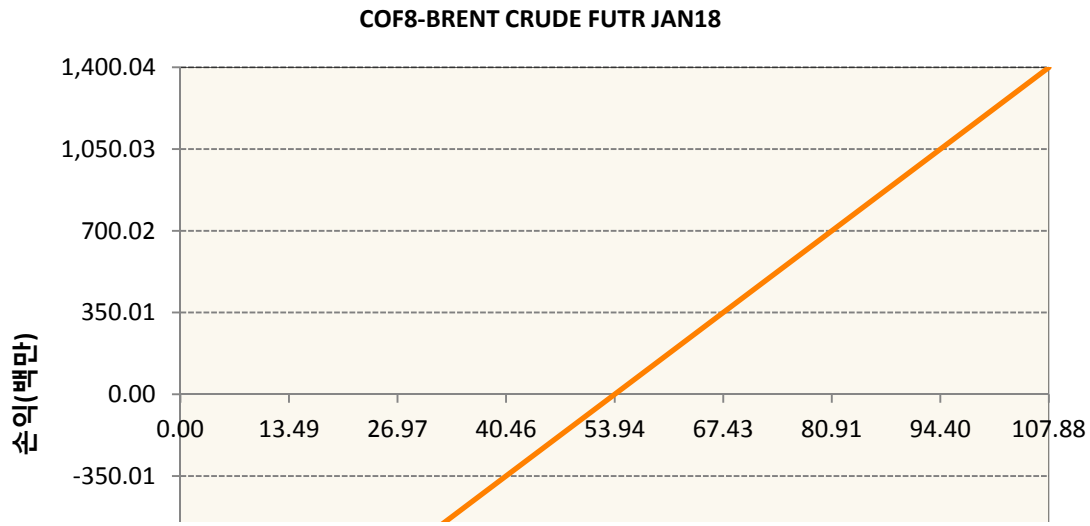
1. 계약금액

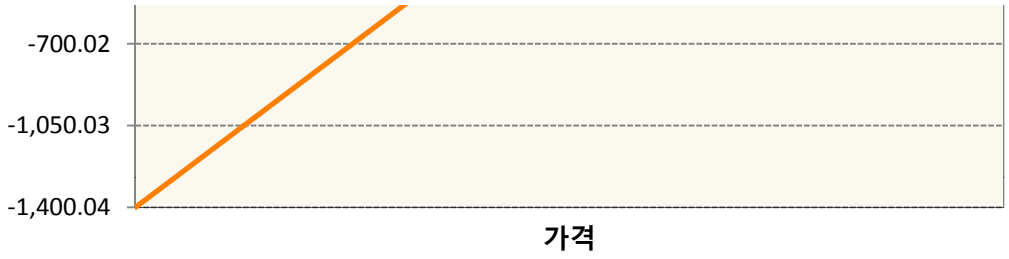
(단위:백만원)

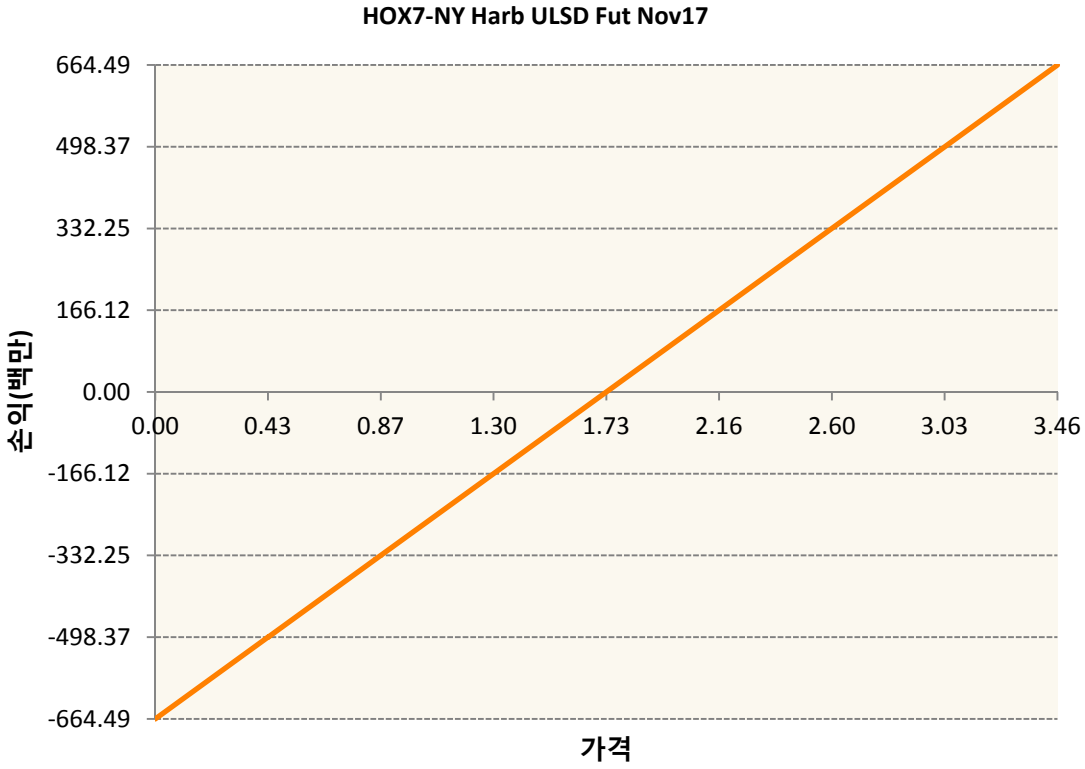
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,225	621	4,605	

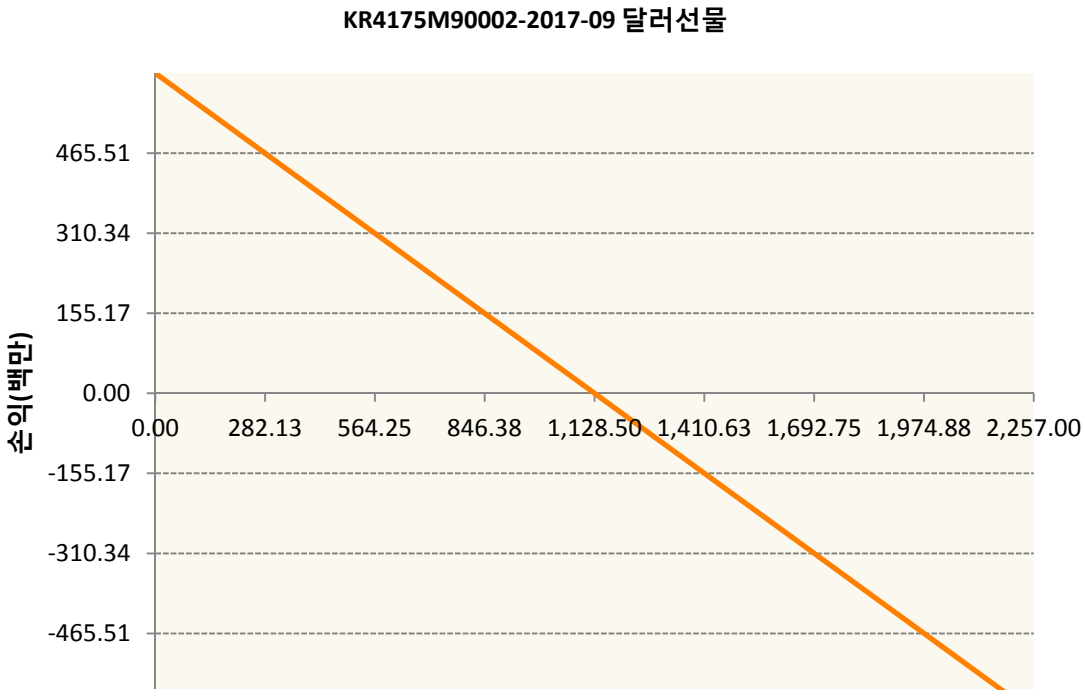
2. 만기시점의 손익구조

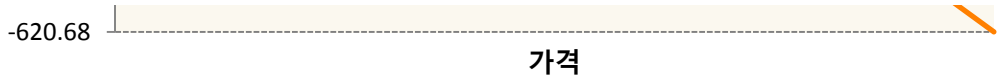


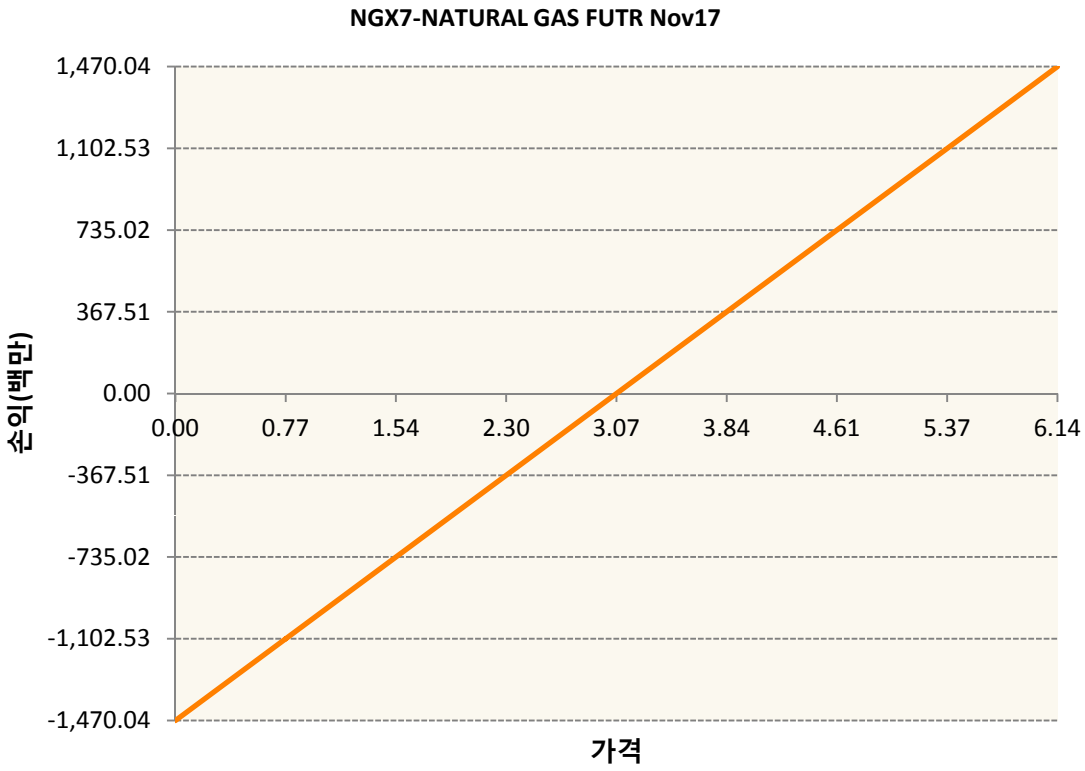


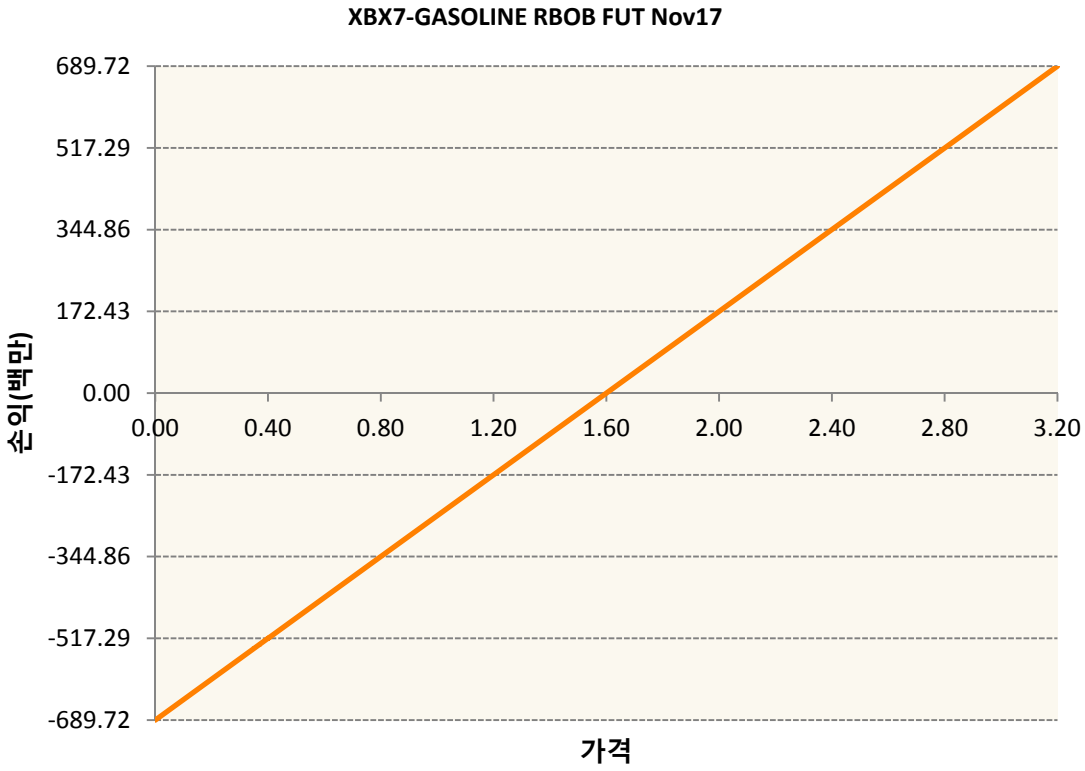

-700.02
-1,050.03
-1,400.04
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
664.49
498.37
332.25
166.12
0.00
-166.12
-332.25
-498.37
-664.49
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
3.46
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
465.51
310.34
155.17
0.00
-155.17
-310.34
-465.51
0.00
282.13
564.25
846.38
1,128.50
1,410.63
1,692.75
1,974.88
2,257.00
손익(백만)


-620.68
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,470.04
1,102.53
735.02
367.51
0.00
-367.51
-735.02
-1,102.53
-1,470.04
0.00
0.77
1.54
2.30
3.07
3.84
4.61
5.37
6.14
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
689.72
517.29
344.86
172.43
0.00
-172.43
-344.86
-517.29
-689.72
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
3.20
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	80
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	112
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	53
KR4175M90(	2017-09 달러선물	50
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	118
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	55

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

761

공시일	2017-09-14
기준일	2017-09-13

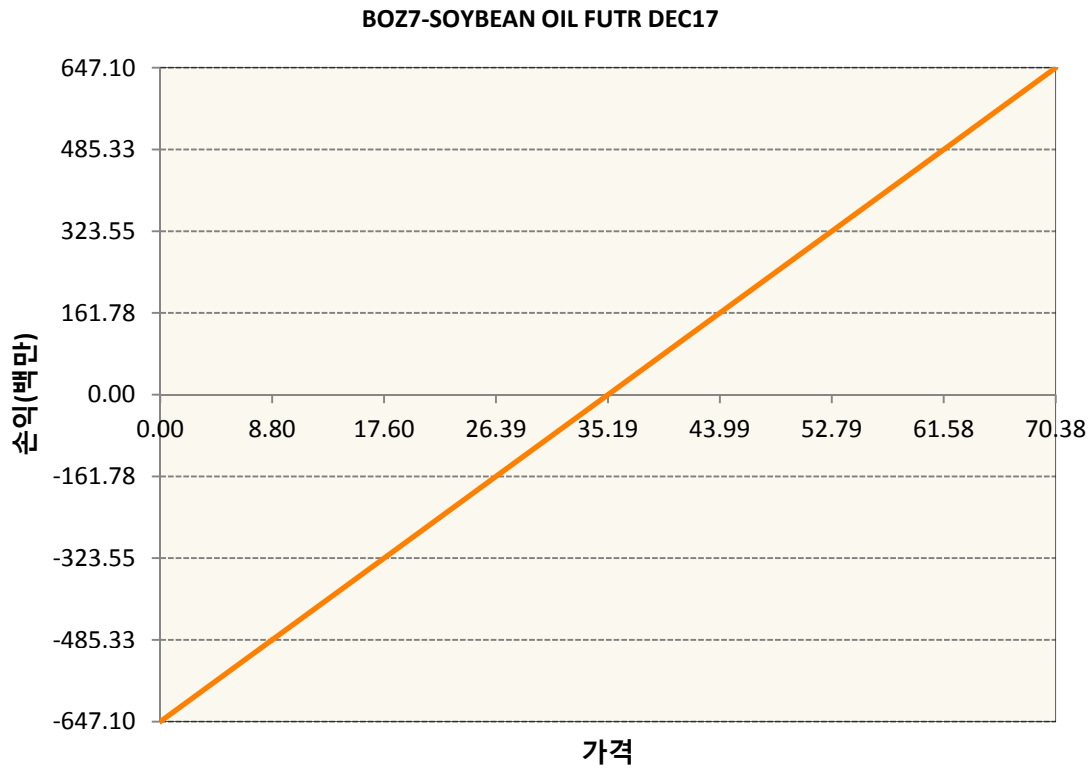
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

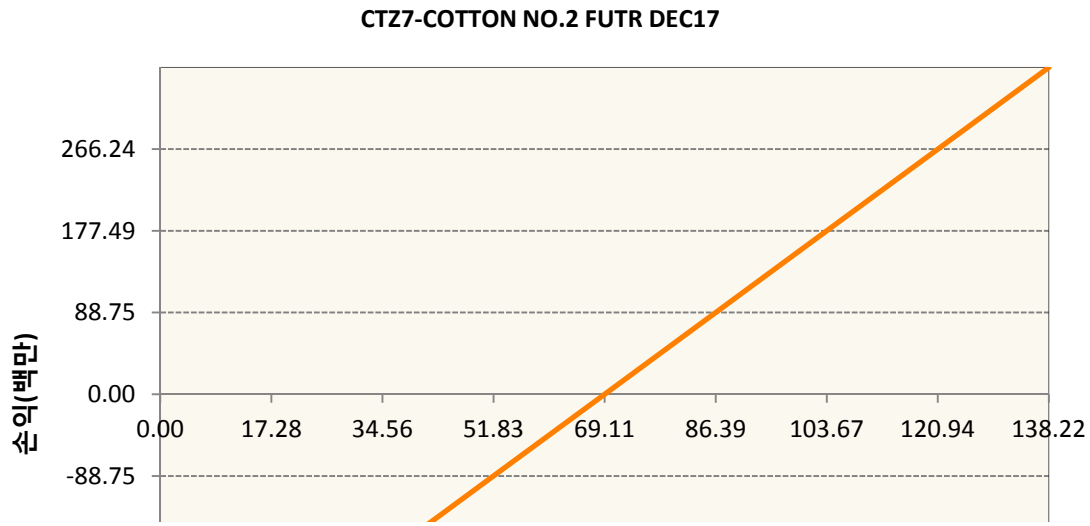
1. 계약금액

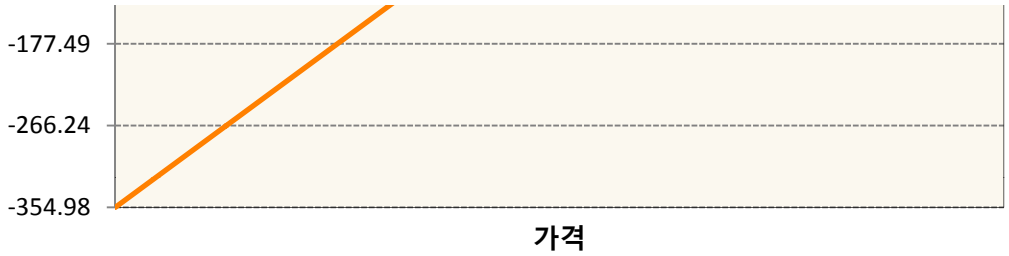
(단위:백만원)

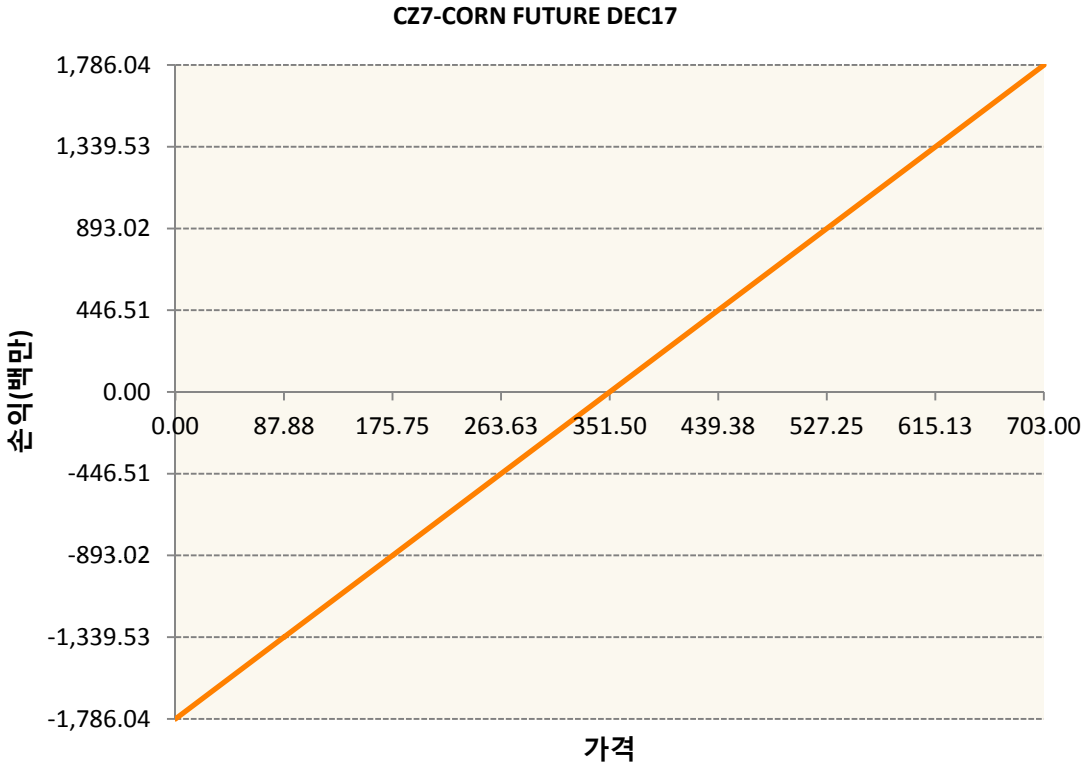
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,887	339	6,549	

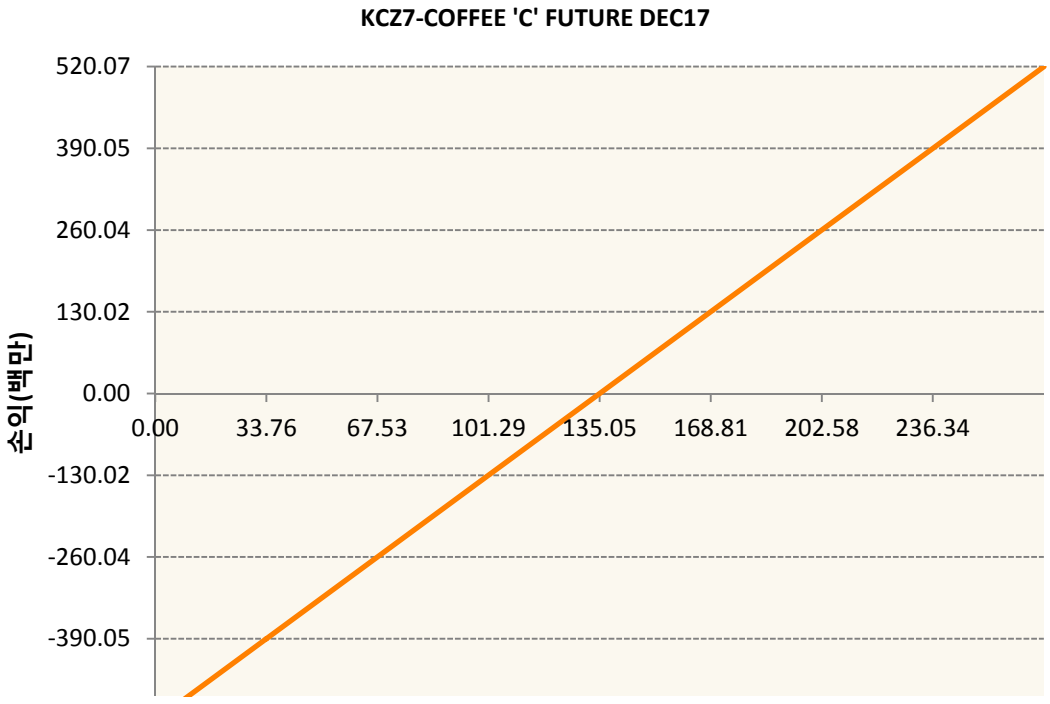
2. 만기시점의 손익구조

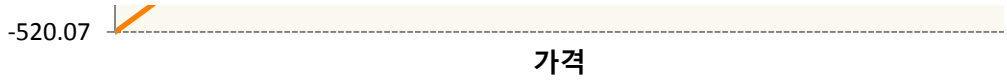


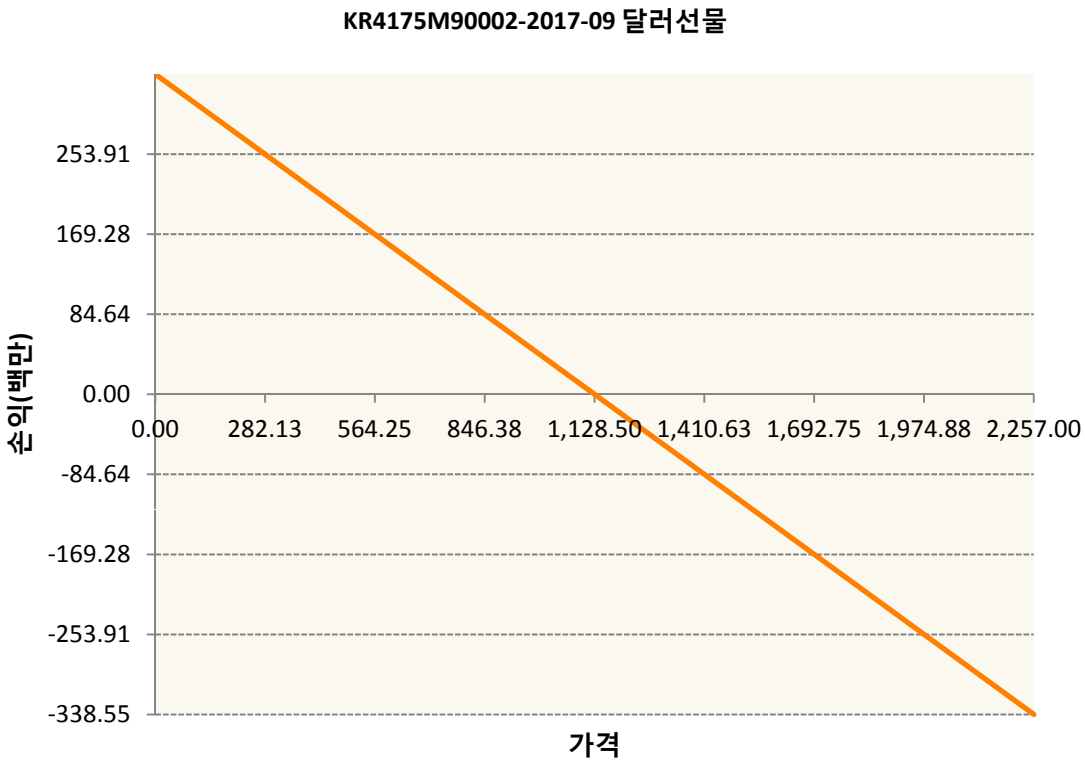


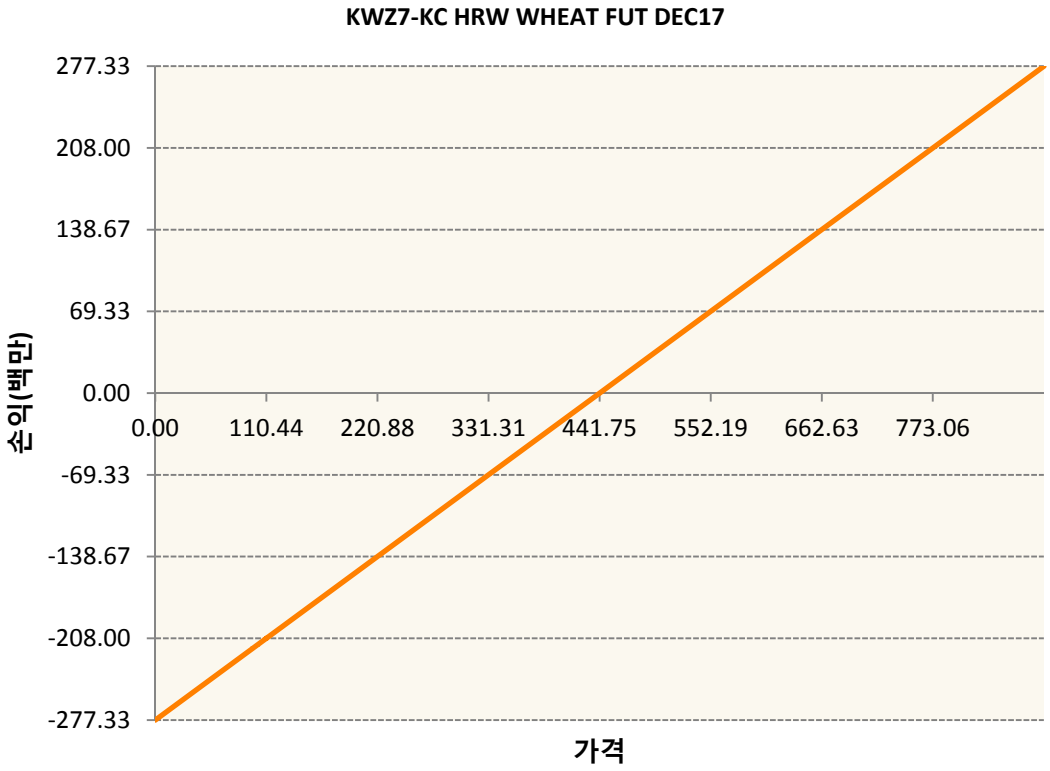

-177.49
-266.24
-354.98
가격

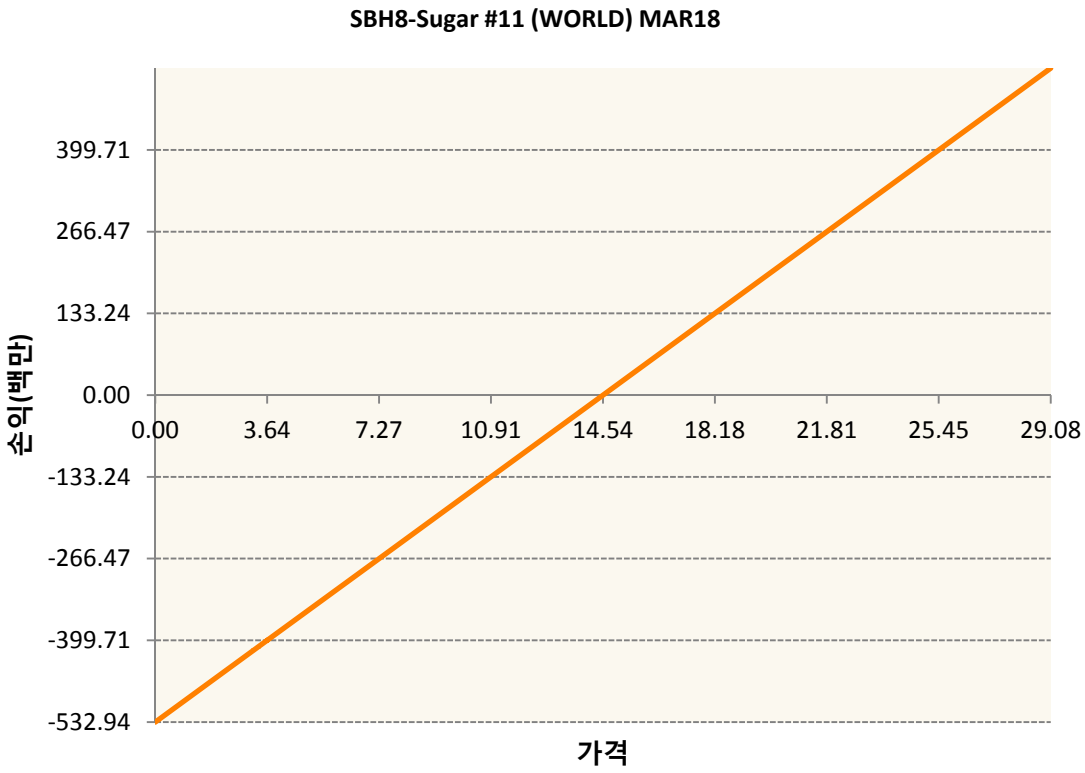

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,786.04
1,339.53
893.02
446.51
0.00
손익(백만)
0.00
87.88
175.75
263.63
351.50
439.38
527.25
615.13
703.00
-446.51
-893.02
-1,339.53
-1,786.04
가격

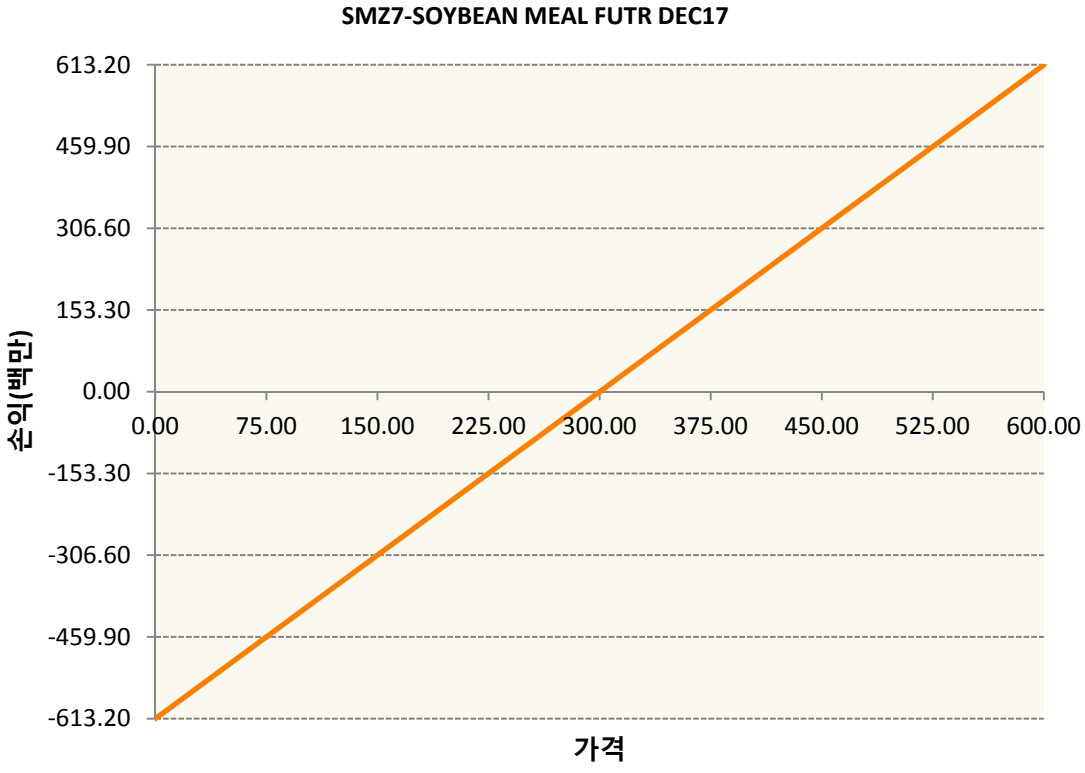

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
520.07
390.05
260.04
130.02
0.00
손익(백만)
0.00
33.76
67.53
101.29
135.05
168.81
202.58
236.34
-130.02
-260.04
-390.05

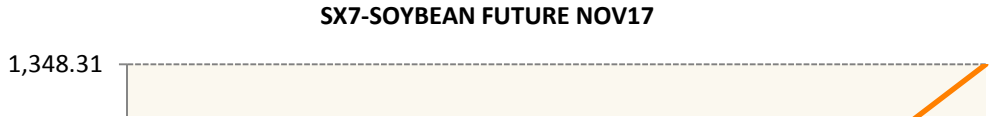

-520.07
가격

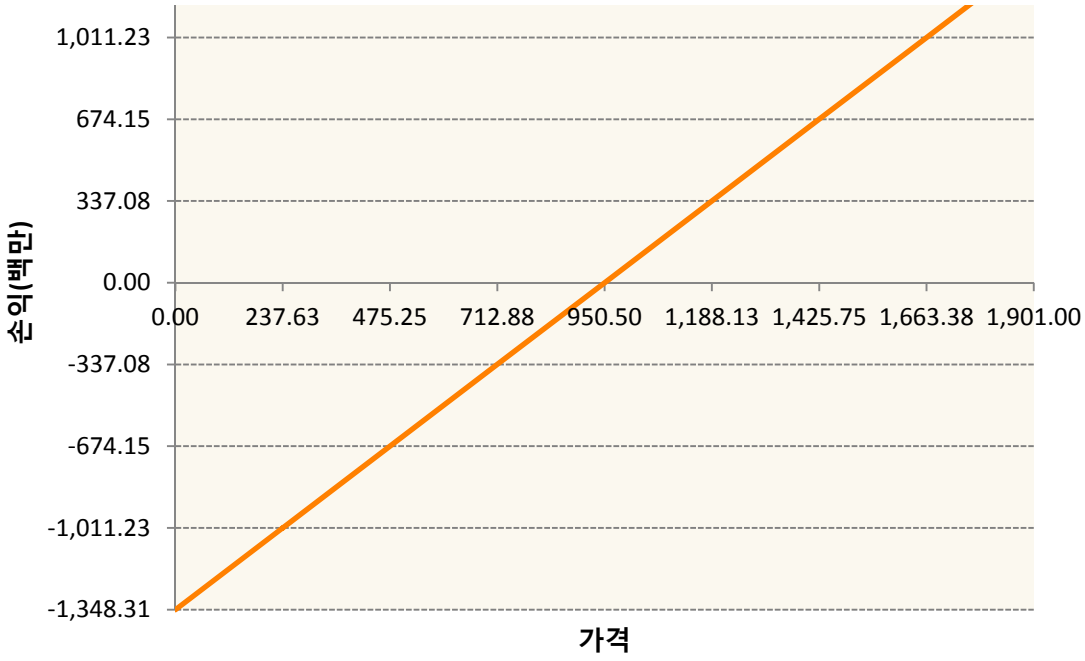

KR4175M90002-2017-09 달러선물
253.91
169.28
84.64
0.00
-84.64
-169.28
-253.91
-338.55
0.00
282.13
564.25
846.38
1,128.50
1,410.63
1,692.75
1,974.88
2,257.00
손익(백만)
가격

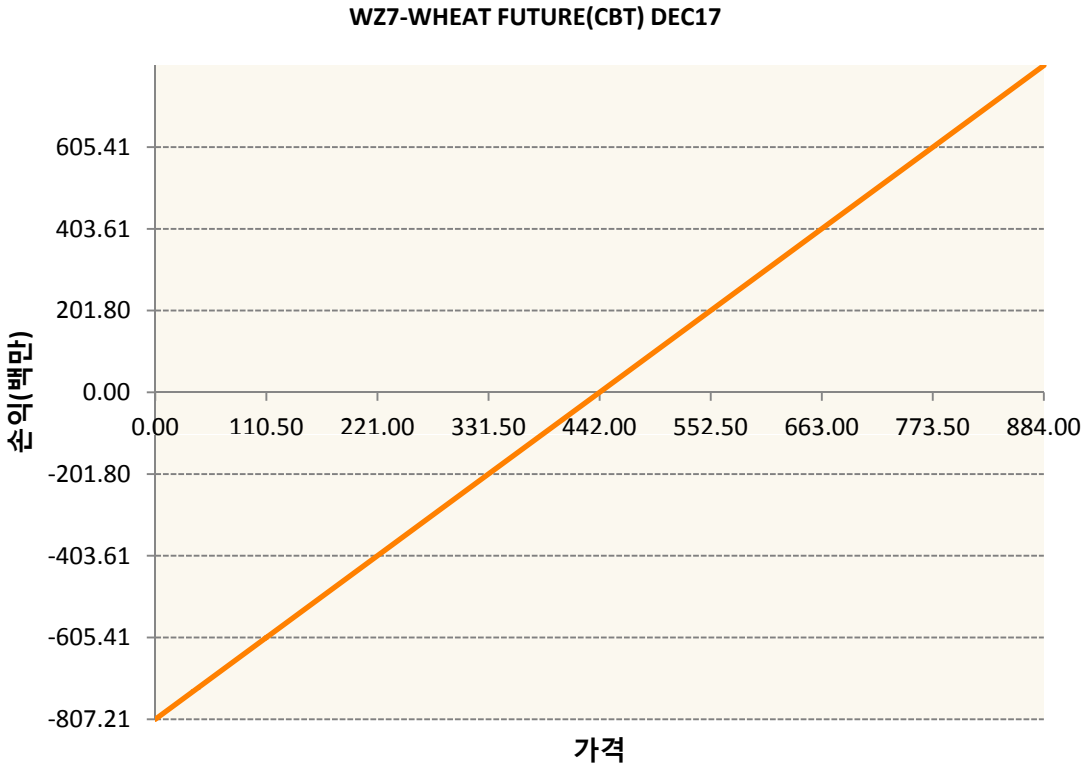

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
277.33
208.00
138.67
69.33
0.00
-69.33
-138.67
-208.00
-277.33
0.00
110.44
220.88
331.31
441.75
552.19
662.63
773.06
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
399.71
266.47
133.24
0.00
-133.24
-266.47
-399.71
-532.94
0.00
3.64
7.27
10.91
14.54
18.18
21.81
25.45
29.08
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
613.20
459.90
306.60
153.30
0.00
-153.30
-306.60
-459.90
-613.20
0.00
75.00
150.00
225.00
300.00
375.00
450.00
525.00
600.00
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,348.31





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	52
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	28
CZ7	CORN FUTURE DEC17	143
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	42
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	22
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	43
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	49
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	108
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	65

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

649