공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

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	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	2017-11-09
기준일	2017-11-08

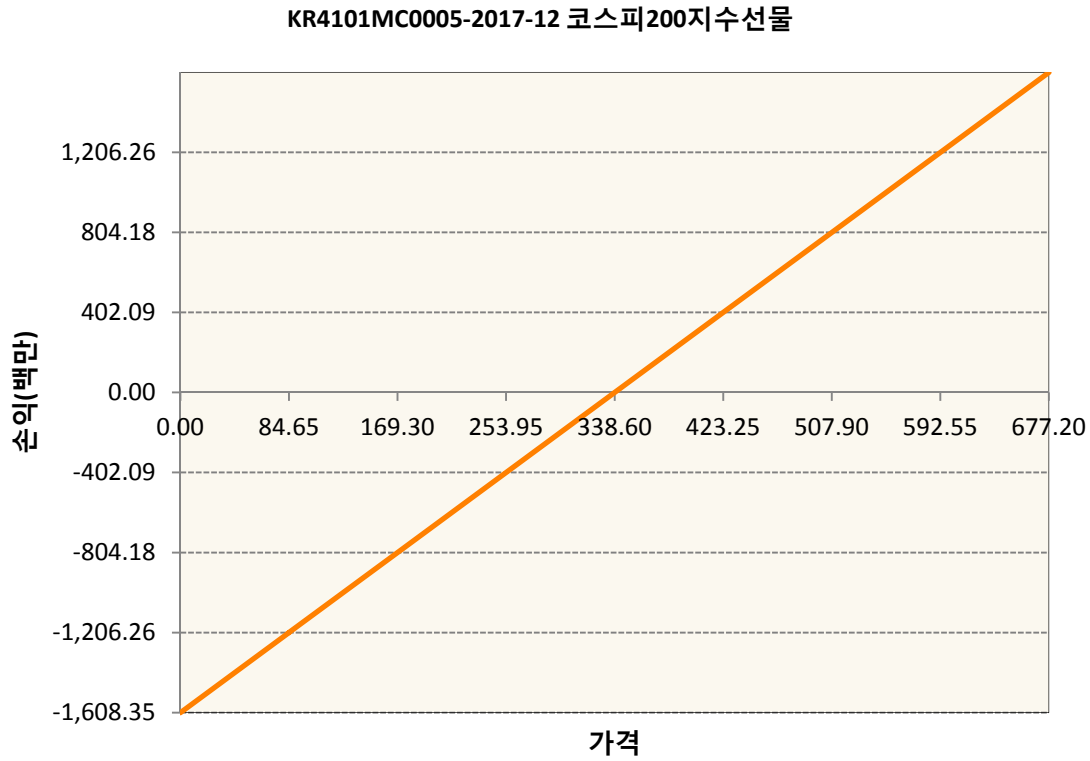
스마트인덱스모

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	1,608	0	1,608	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

77

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

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	12,592	0	12,592	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170822	1,070

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

451

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

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	5,301	0	5,301	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170908	418

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

368

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

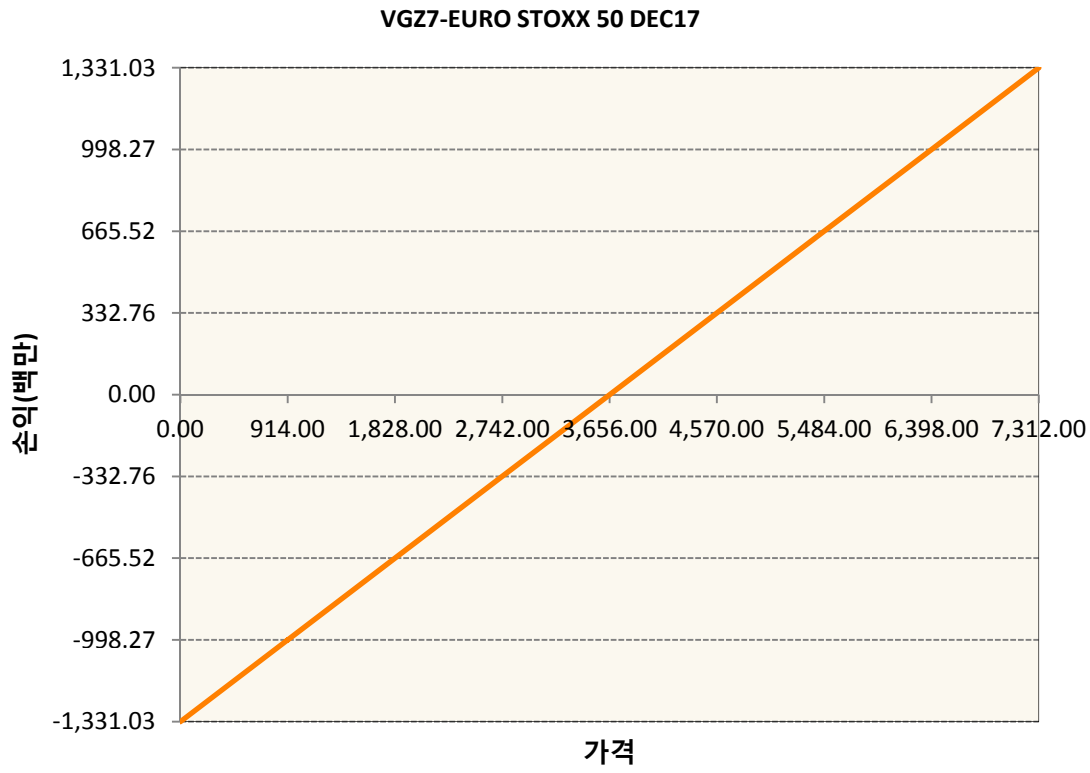
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,331	0	1,331	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	106

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

(단위:백만원)

78

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

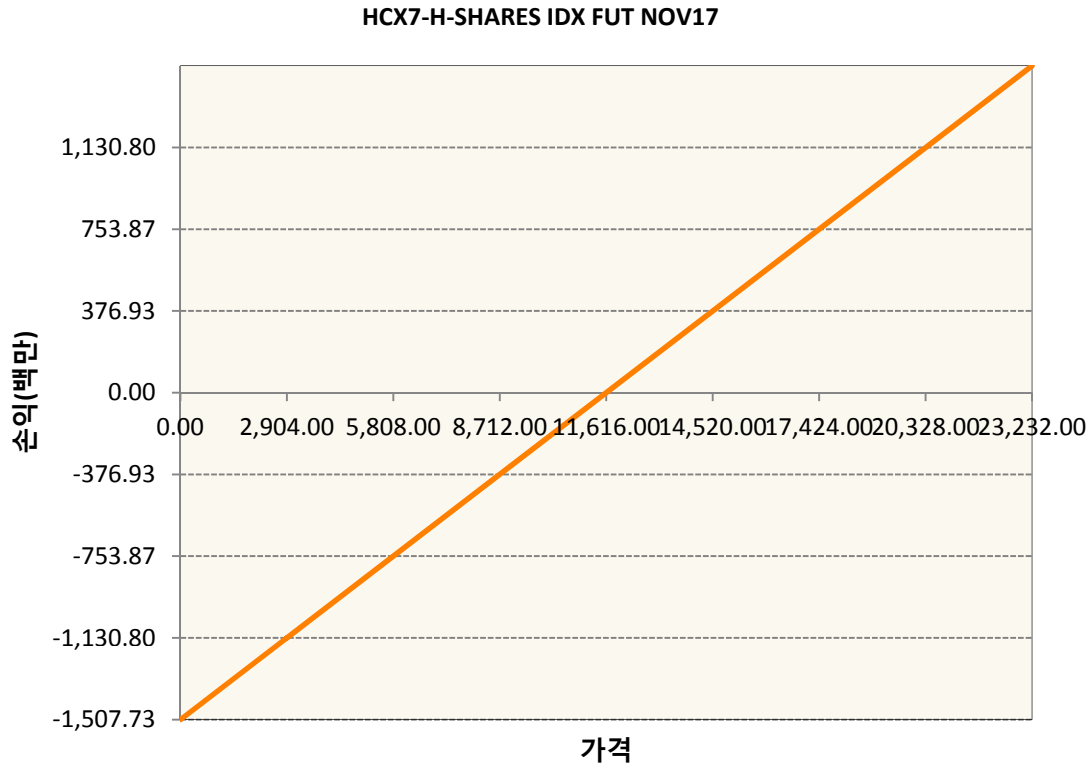
차이나인덱스모(주식-파생형)

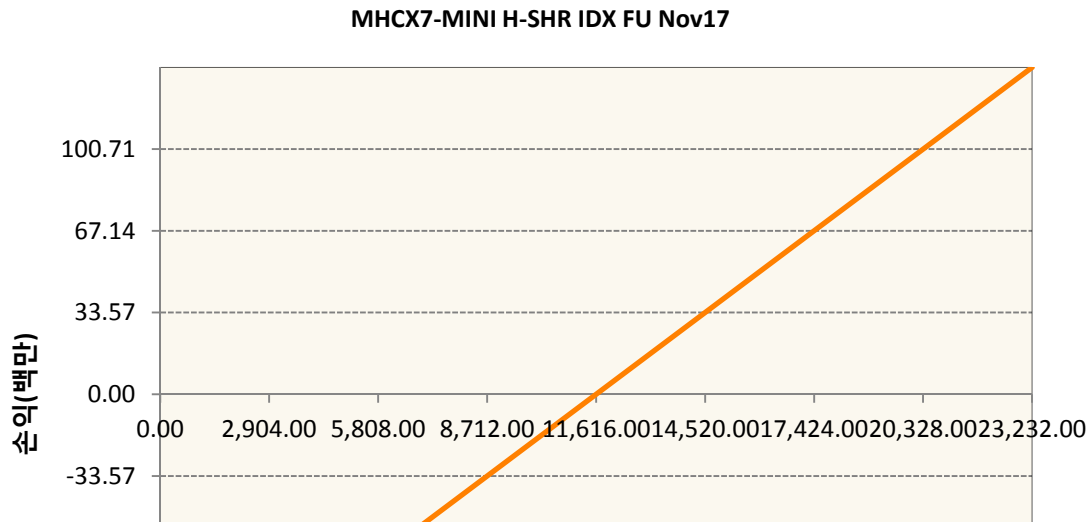
1. 계약금액

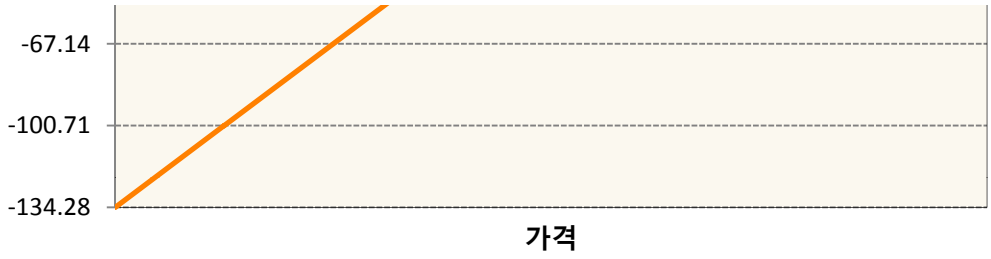
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,642	0	1,642	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	121
MHCX7	MINI H-SHR IDX FU Nov17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	107

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

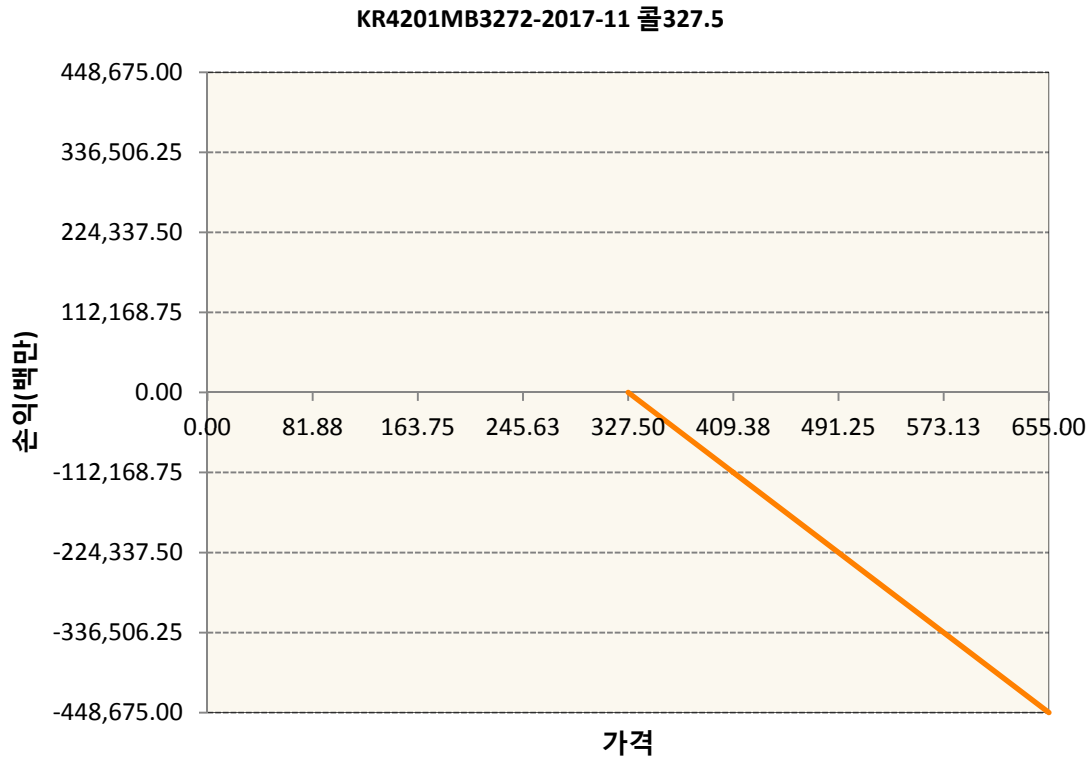
커버드콜모(주식혼합-파생형)

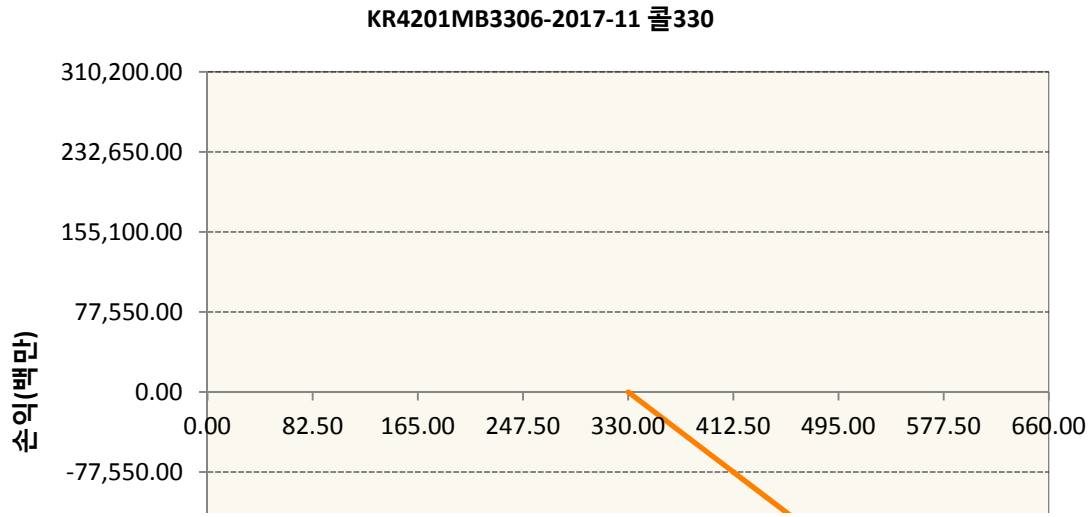
1. 계약금액

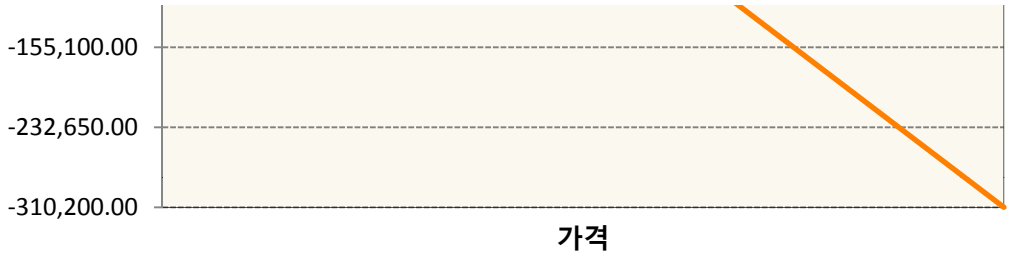
(단위:백만원)

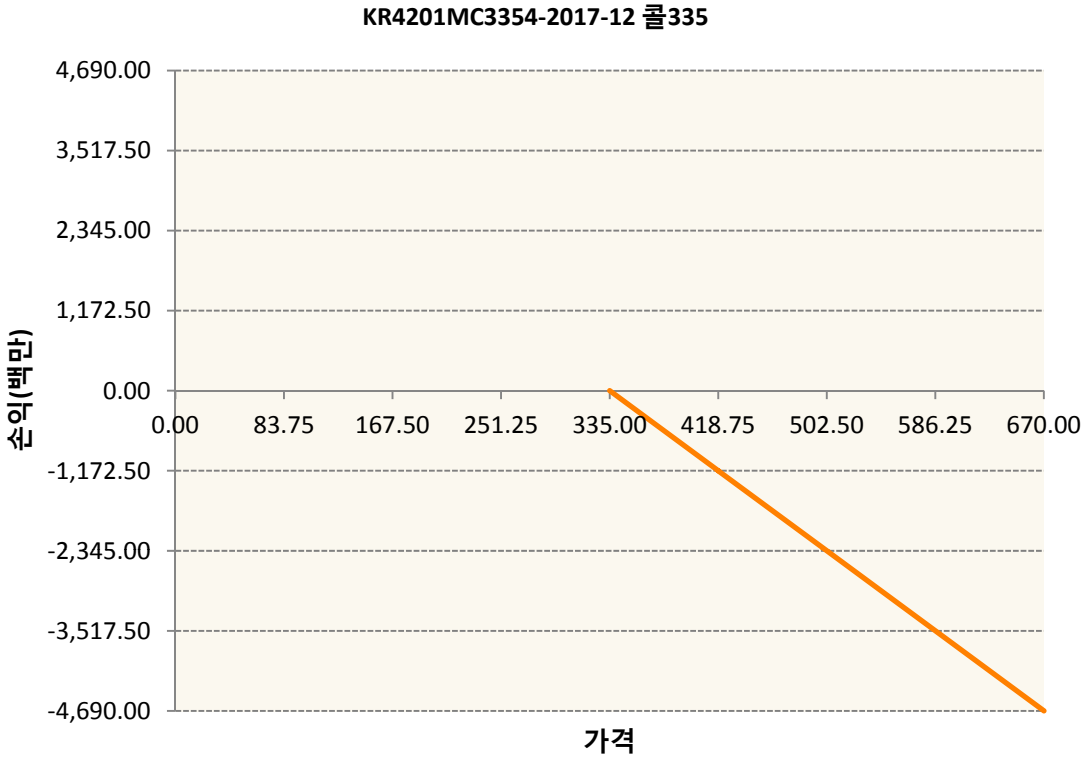
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	64,093	68,556	-4,463	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,440,403	-1,440,403	장내

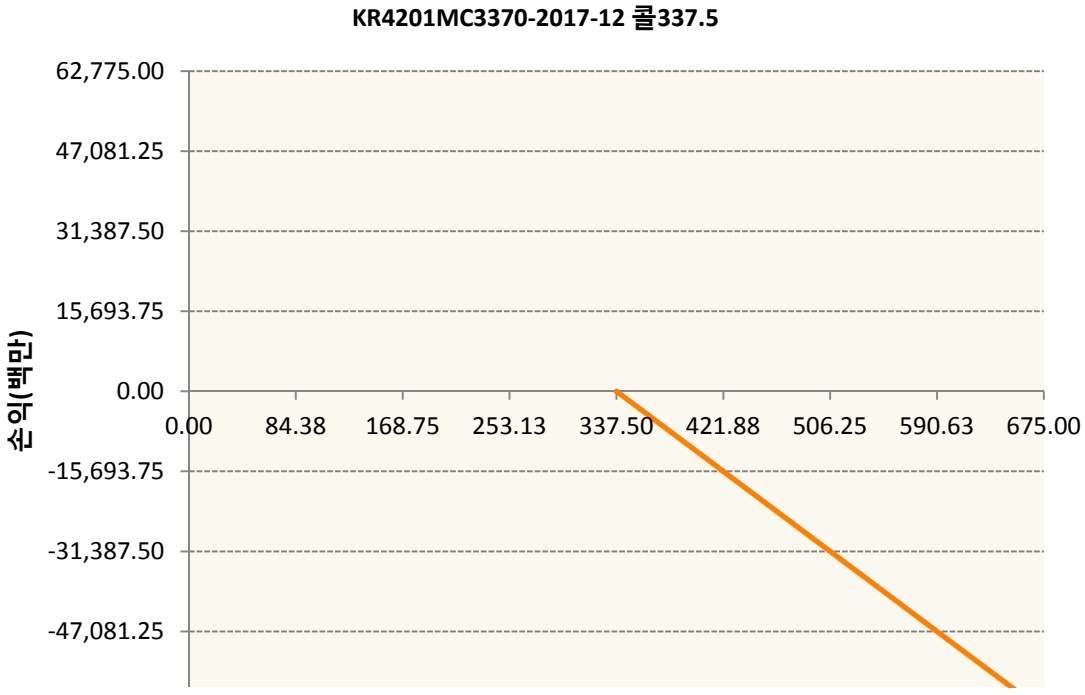
2. 만기시점의 손익구조



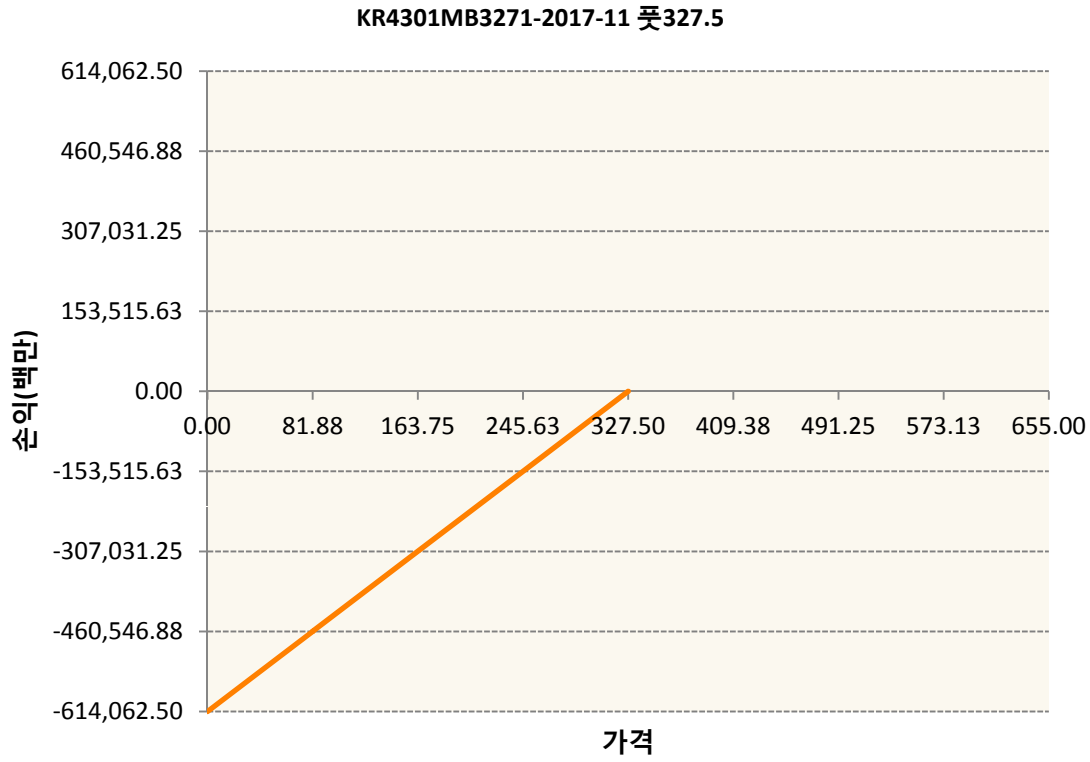



-155,100.00
-232,650.00
-310,200.00
가격


KR4201MC3354-2017-12 콜335
4,690.00
3,517.50
2,345.00
1,172.50
0.00
-1,172.50
-2,345.00
-3,517.50
-4,690.00
0.00
83.75
167.50
251.25
335.00
418.75
502.50
586.25
670.00
손익(백만)
가격


KR4201MC3370-2017-12 콜337.5
62,775.00
47,081.25
31,387.50
15,693.75
0.00
-15,693.75
-31,387.50
-47,081.25
0.00
84.38
168.75
253.13
337.50
421.88
506.25
590.63
675.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201MB3: 2017-11 콜327.5							37,003
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14,134	14,134	14,134	14,134	14,134	14,134	14,133
-5.33%	14,123	14,109	14,086	14,053	14,011	13,958	13,894
-2.67%	11,337	11,154	10,969	10,781	10,593	10,403	10,212
0%	18	15	10	0	-16	-38	-68
2.67%	-12,322	-12,322	-12,322	-12,322	-12,322	-12,322	-12,322
5.33%	-24,662	-24,662	-24,662	-24,662	-24,662	-24,662	-24,662
8.00%	-37,003	-37,003	-37,003	-37,003	-37,003	-37,003	-37,003
KR4201MB3: 2017-11 콜330							25,339
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,398	7,398	7,398	7,398	7,398	7,398	7,398
-5.33%	7,397	7,396	7,393	7,387	7,377	7,363	7,344
-2.67%	6,662	6,535	6,406	6,276	6,145	6,014	5,882
0%	53	42	25	0	-32	-72	-118
2.67%	-8,405	-8,405	-8,405	-8,405	-8,405	-8,405	-8,406

5.33%	-16,872	-16,872	-16,872	-16,872	-16,872	-16,872	-16,872
8.00%	-25,339	-25,339	-25,339	-25,339	-25,339	-25,339	-25,339
	KR4201MC3 2017-12 콜335						301
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	156	151	144	137	129	121	112
-5.33%	136	127	117	107	97	86	76
-2.67%	97	86	74	62	50	38	26
0%	37	25	12	0	-12	-25	-37
2.67%	-46	-56	-67	-79	-90	-102	-113
5.33%	-146	-154	-163	-172	-181	-191	-202
8.00%	-259	-264	-270	-277	-284	-292	-301
	KR4201MC3 2017-12 콜337.5						3,868
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,884	1,817	1,739	1,651	1,555	1,451	1,342
-5.33%	1,657	1,546	1,427	1,302	1,172	1,039	902
-2.67%	1,216	1,066	914	761	606	450	294
0%	494	329	165	0	-165	-329	-494
2.67%	-522	-673	-828	-984	-1,141	-1,300	-1,461
5.33%	-1,794	-1,912	-2,037	-2,169	-2,306	-2,448	-2,592
8.00%	-3,251	-3,330	-3,420	-3,520	-3,629	-3,745	-3,868
	KR4301MB3 2017-11 풋327.5						31,349
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,349	-31,349	-31,349	-31,349	-31,349	-31,349	-31,349
-5.33%	-14,460	-14,460	-14,460	-14,460	-14,461	-14,462	-14,465
-2.67%	-414	-524	-639	-758	-880	-1,005	-1,132
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

84,845

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

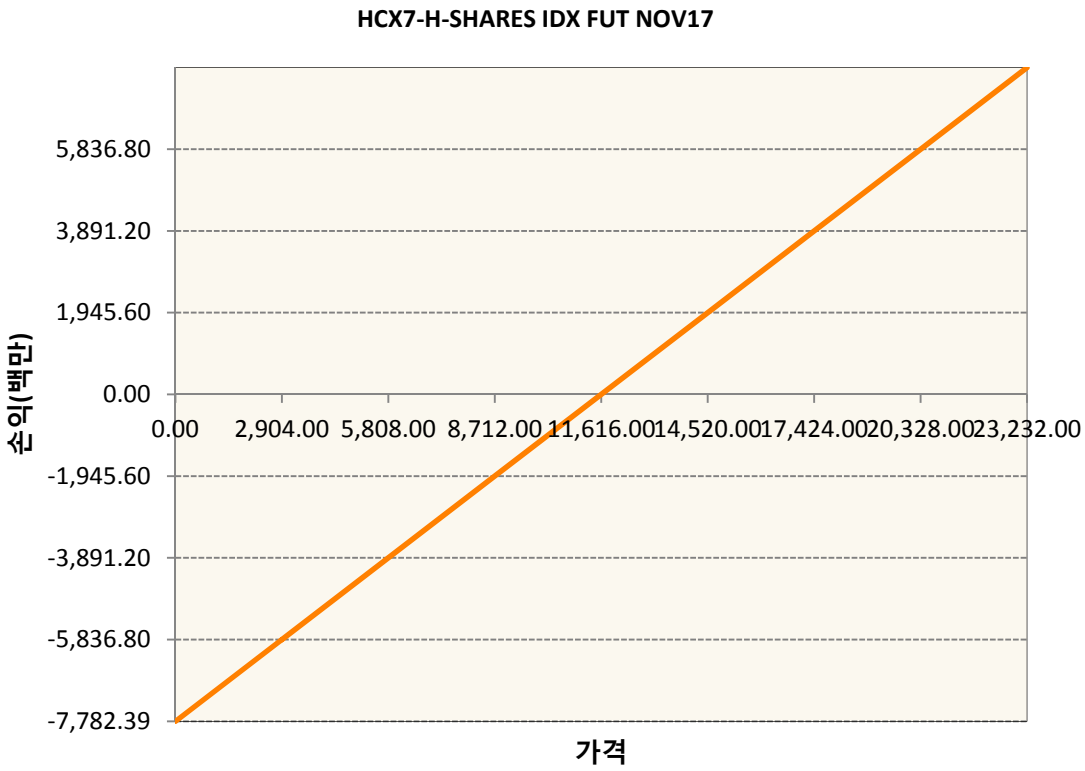
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

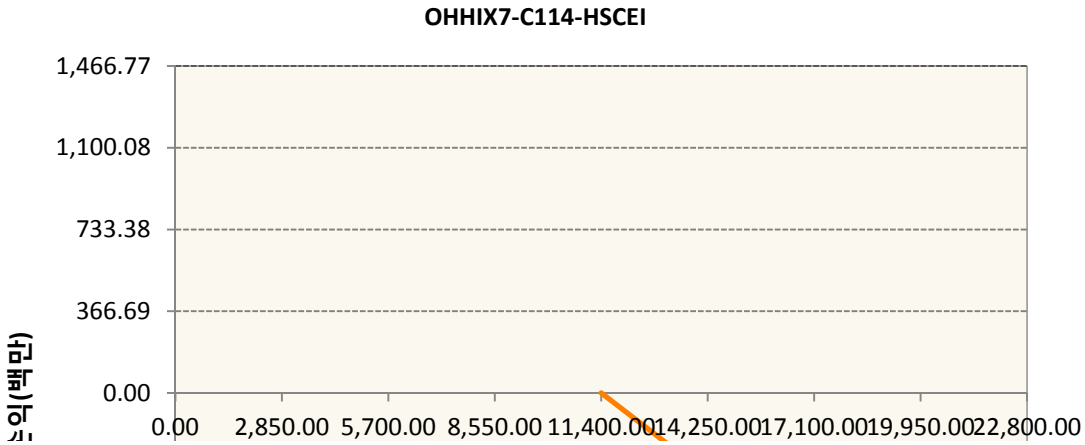
1. 계약금액

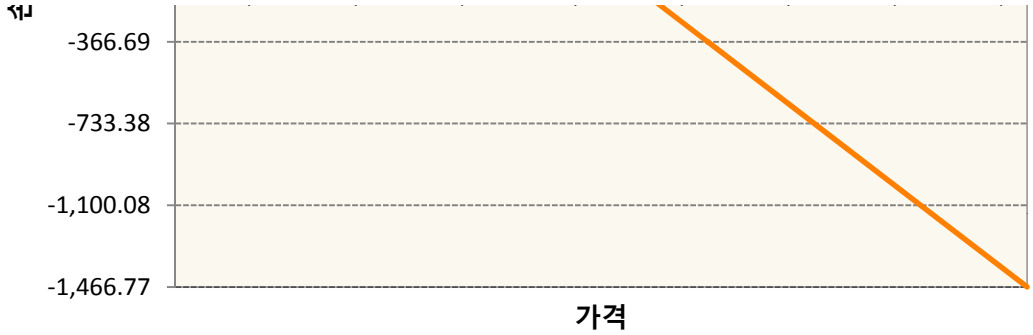
(단위:백만원)

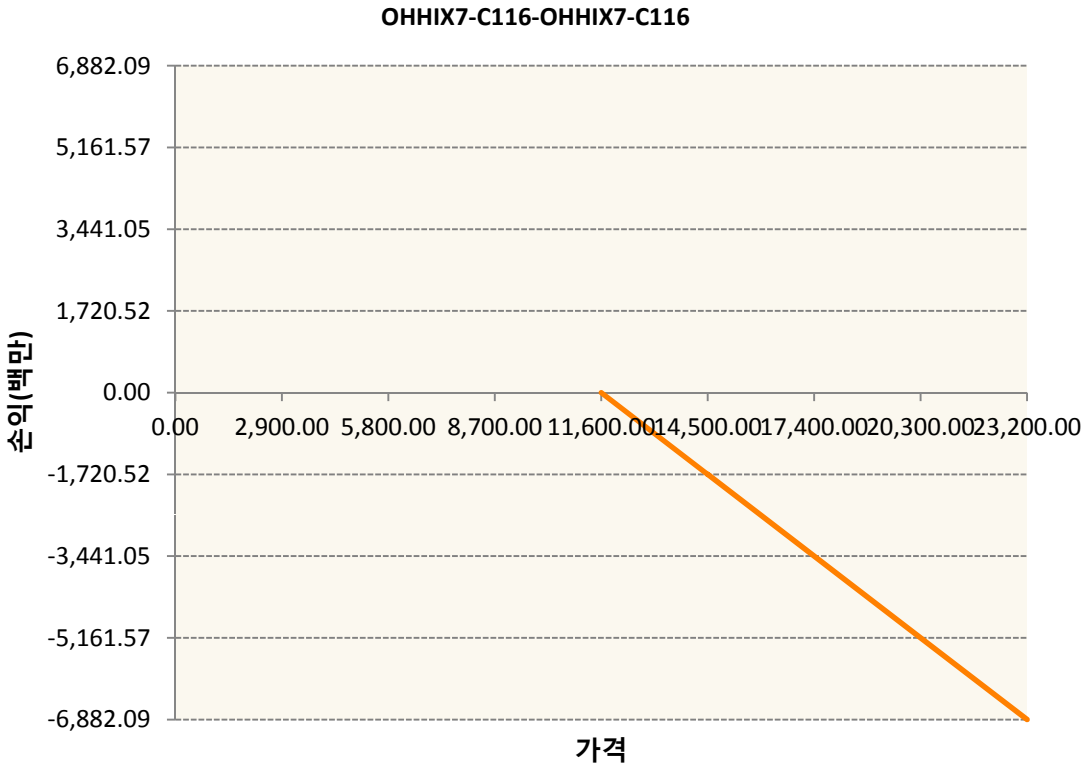
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,782	0	7,782	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,698	-16,698	장내

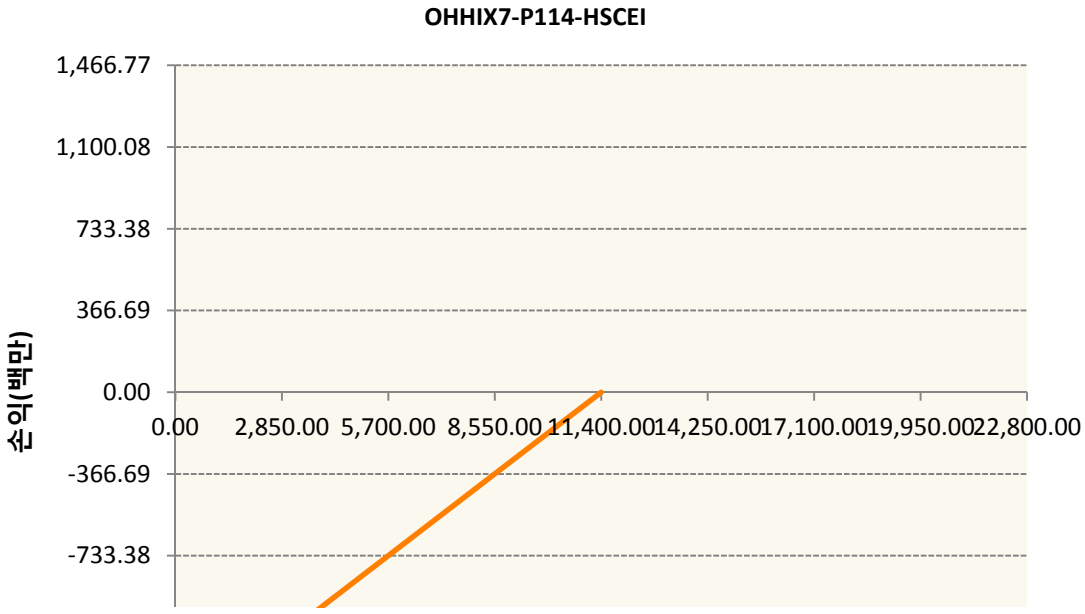
2. 만기시점의 손익구조

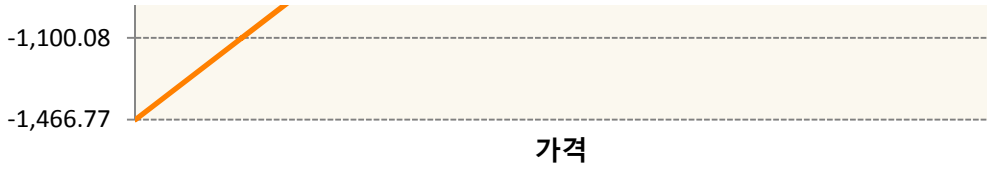


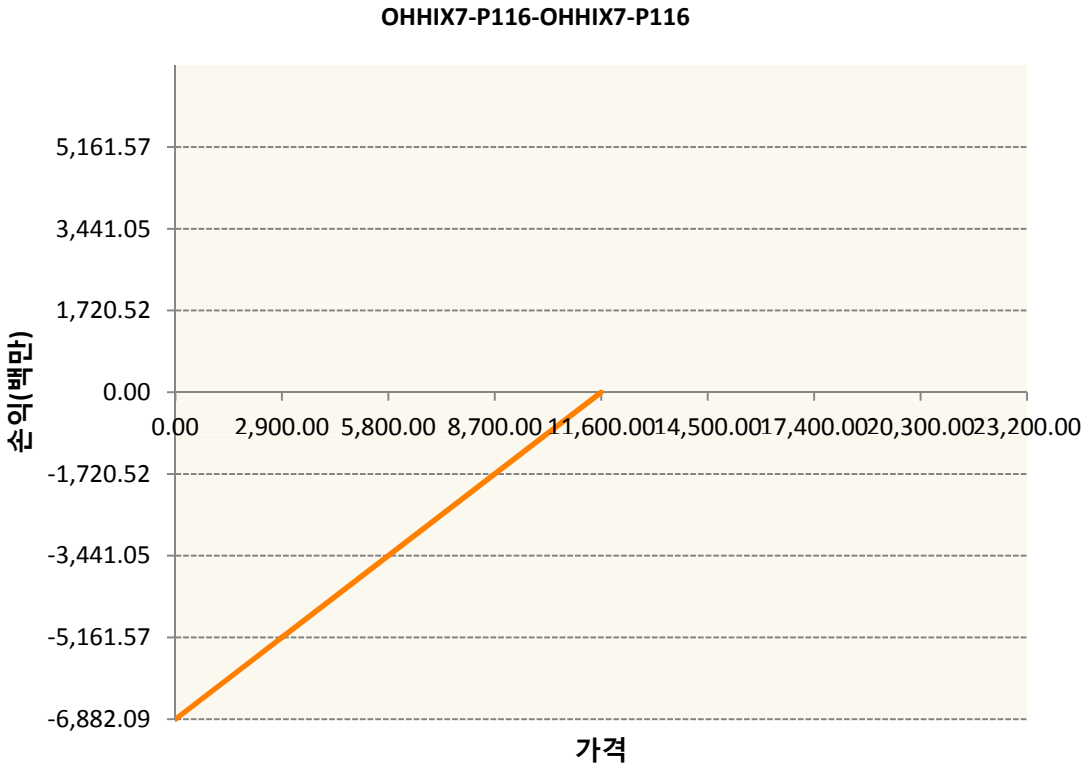



-366.69
-733.38
-1,100.08
-1,466.77
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,882.09
5,161.57
3,441.05
1,720.52
0.00
-1,720.52
-3,441.05
-5,161.57
-6,882.09
0.00
2,900.00
5,800.00
8,700.00
11,600.00
14,500.00
17,400.00
20,300.00
23,200.00
손익(백만)
가격


OHHIX7-P114-HSCEI
1,466.77
1,100.08
733.38
366.69
0.00
-366.69
-733.38
0.00
2,850.00
5,700.00
8,550.00
11,400.00
14,250.00
17,100.00
19,950.00
22,800.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	623
OHHIX7-C11	HSCEI	117
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	551
OHHIX7-P11	HSCEI	117
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	551

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

1,592

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

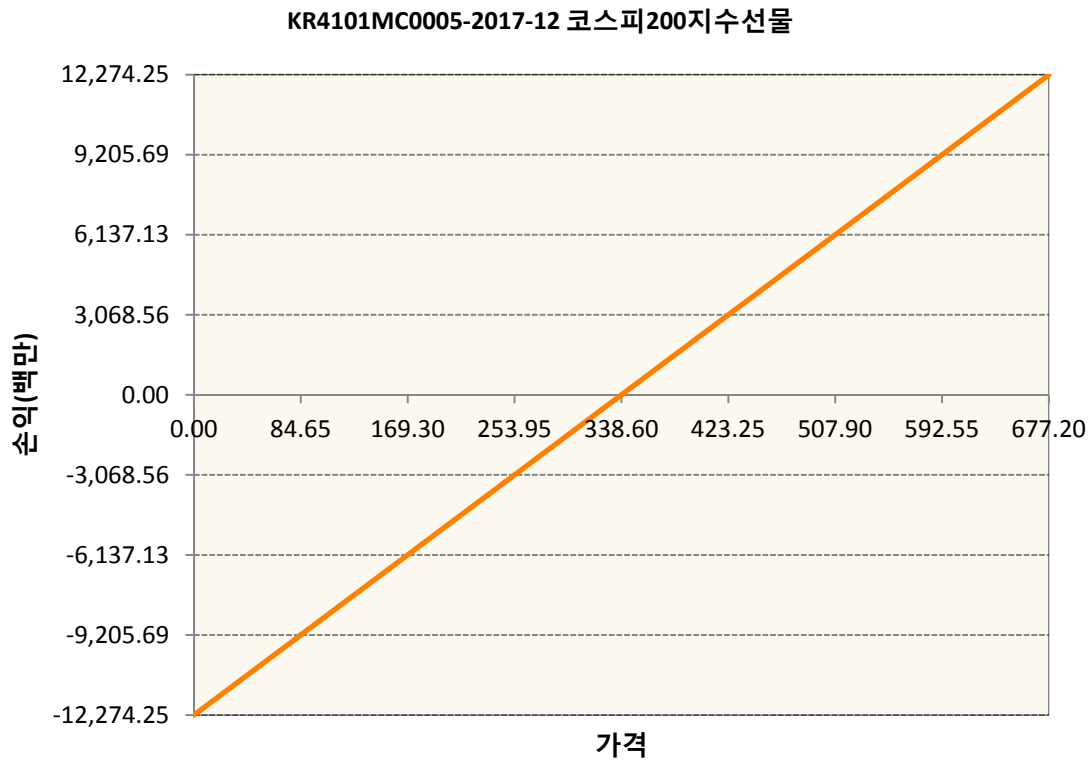
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

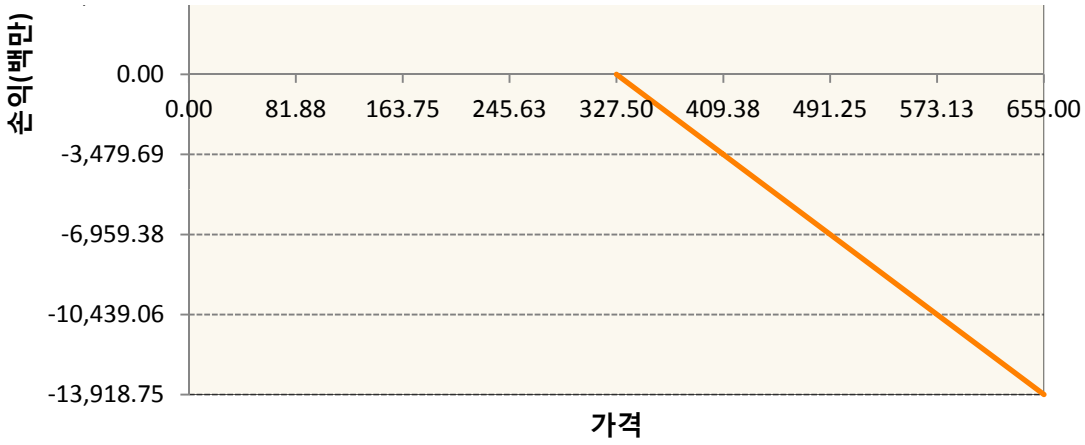
(단위:백만원)

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	12,274	0	12,274	장내
누계	유가증권	스왑	42,700	0	42,700	장외
누계	유가증권	옵션	0	41,416	-41,416	장내

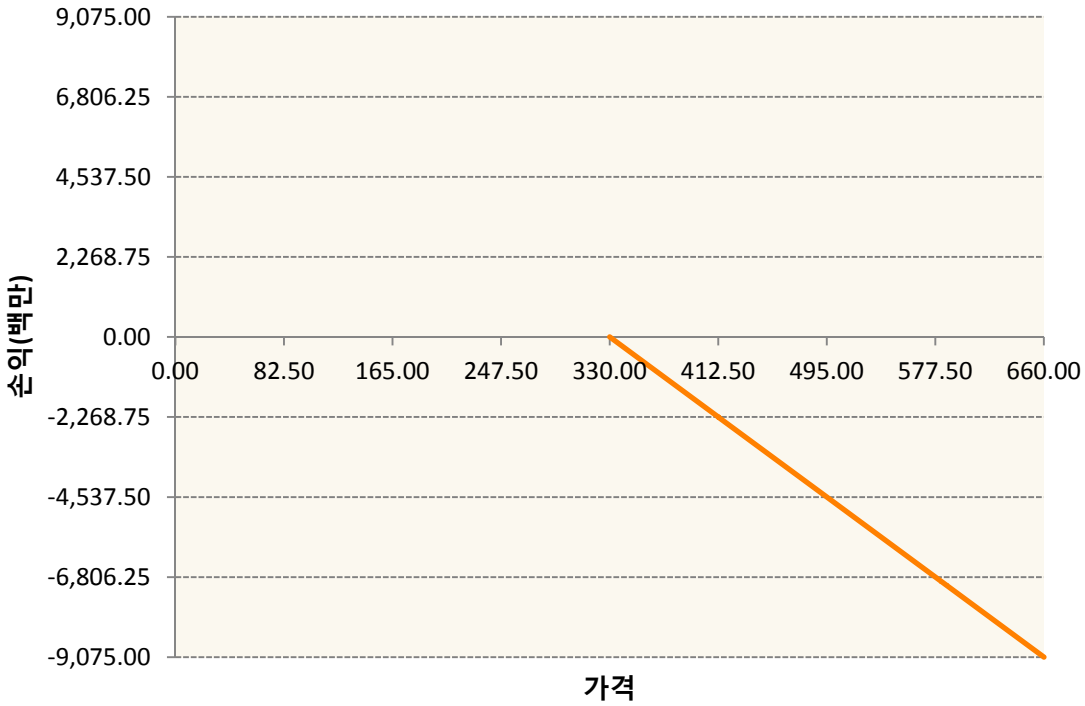
2. 만기시점의 손익구조



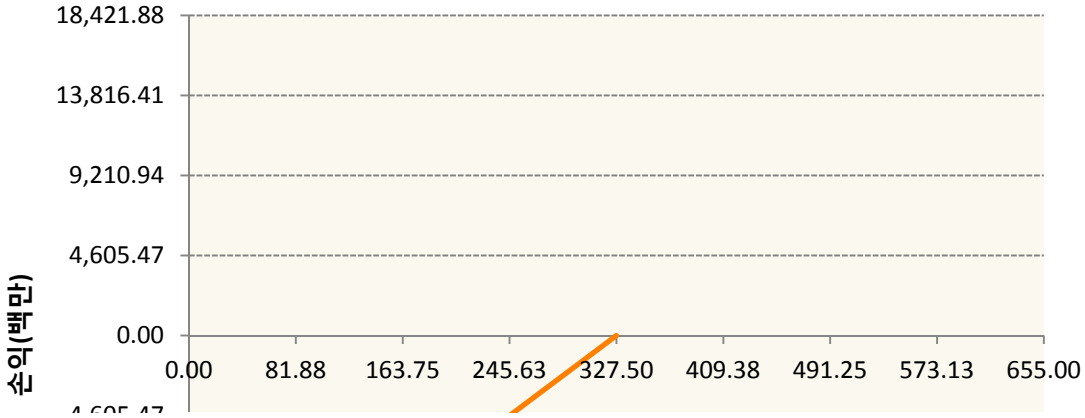




KR4201MB3306-2017-11 콜330



KR4301MB3271-2017-11 풋327.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,488
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,488	-1,488	-1,488	-1,488	-1,488	-1,488	-1,488
-5.33%	-992	-992	-992	-992	-992	-992	-992
-2.67%	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	496	496	496	496	496	496	496
5.33%	992	992	992	992	992	992	992
8.00%	1,488	1,488	1,488	1,488	1,488	1,488	1,488
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							282
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282
-5.33%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	94	94	94	94	94	94	94
5.33%	188	188	188	188	188	188	188
8.00%	282	282	282	282	282	282	282
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							161
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-2.67%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	54	54	54	54	54	54	54
5.33%	107	107	107	107	107	107	107
8.00%	161	161	161	161	161	161	161
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							241
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-241	-241	-241	-241	-241	-241	-241
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	161	161	161	161	161	161	161
8.00%	241	241	241	241	241	241	241
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						201
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
-5.33%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-2.67%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	67	67	67	67	67	67	67
5.33%	134	134	134	134	134	134	134
8.00%	201	201	201	201	201	201	201
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						257
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-5.33%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	172	172	172	172	172	172	172
8.00%	257	257	257	257	257	257	257
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						476
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-476	-476	-476	-476	-476	-476	-476
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	159	159	159	159	159	159	159
5.33%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	476	476	476	476	476	476	476
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						317
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-5.33%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
-2.67%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	106	106	106	106	106	106	106
5.33%	212	212	212	212	212	212	212
8.00%	317	317	317	317	317	317	317
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					980
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-980	-980	-980	-980	-980	-980	-980
-5.33%	-653	-653	-653	-653	-653	-653	-653
-2.67%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	327	327	327	327	327	327	327
5.33%	653	653	653	653	653	653	653
8.00%	980	980	980	980	980	980	980
	KR4201MB3	2017-11 콜327.5					1,148
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	438	438	438	438	438	438	438
-5.33%	438	438	437	436	435	433	431
-2.67%	352	346	340	334	329	323	317
0%	1	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	-382	-382	-382	-382	-382	-382	-382
5.33%	-765	-765	-765	-765	-765	-765	-765
8.00%	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148
	KR4201MB3	2017-11 콜330					741
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	216	216	216	216	216	216	216
-5.33%	216	216	216	216	216	215	215
-2.67%	195	191	187	184	180	176	172
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-246
5.33%	-494	-494	-494	-494	-494	-494	-494
8.00%	-741	-741	-741	-741	-741	-741	-741
	KR4301MB3	2017-11 풋327.5					940
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-940	-940	-940	-940	-940	-940	-940
-5.33%	-434	-434	-434	-434	-434	-434	-434
-2.67%	-12	-16	-19	-23	-26	-30	-34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

6,462

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

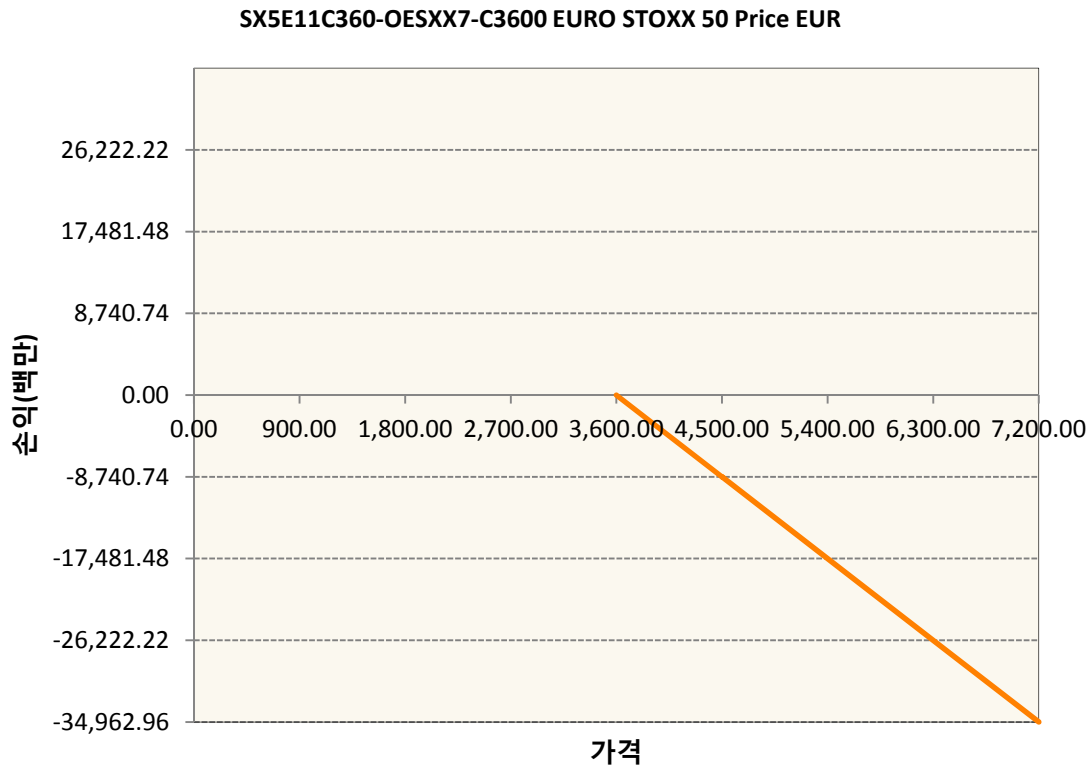
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

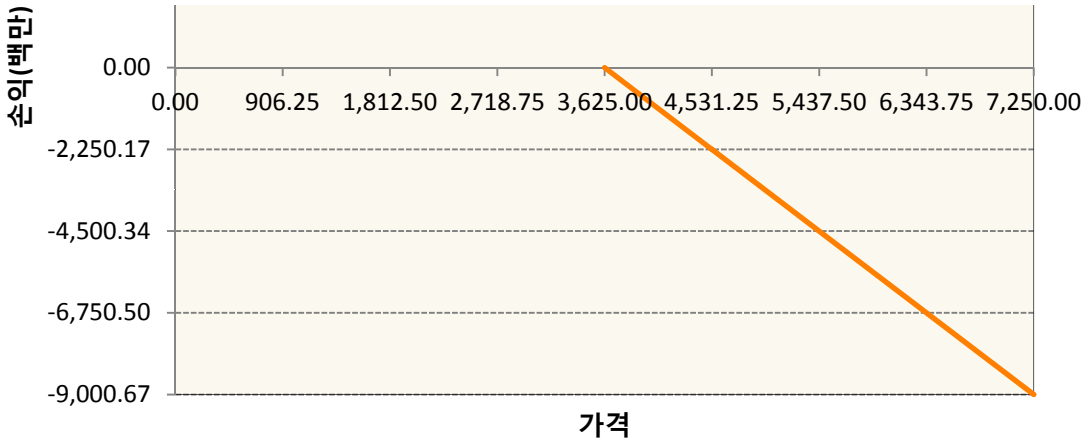
(단위:백만원)

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
누계	유가증권	선물	37,688	0	37,688	
누계	유가증권	스왑	96,990	0	96,990	장외
누계	유가증권	옵션	0	87,927	-87,927	장내

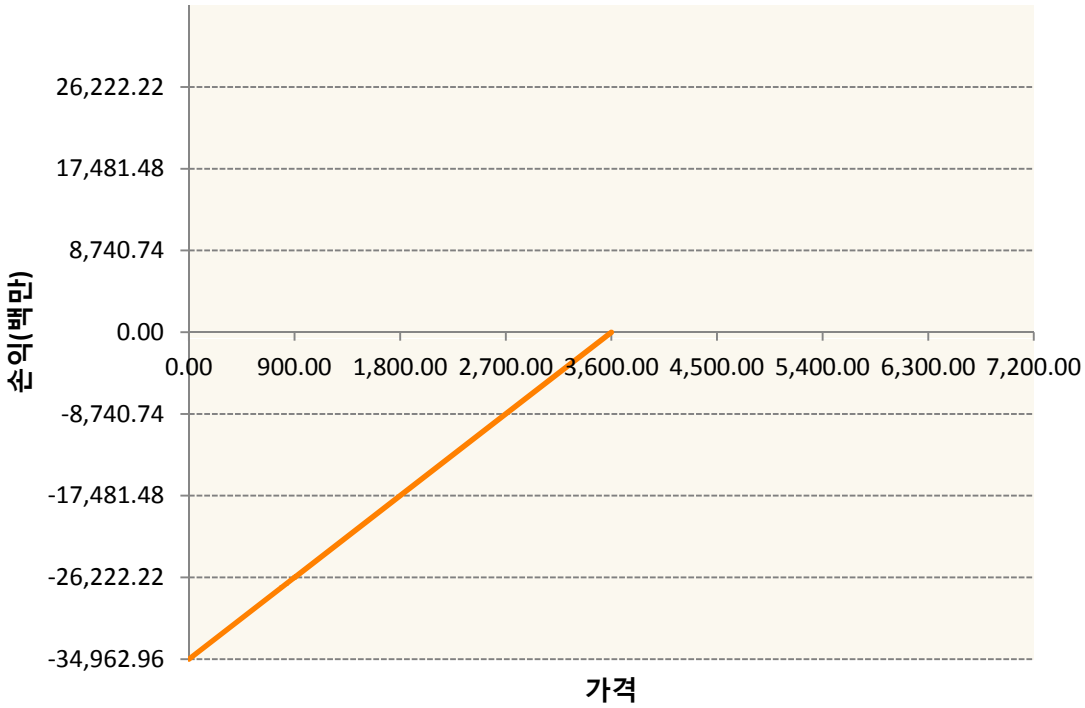
2. 만기시점의 손익구조



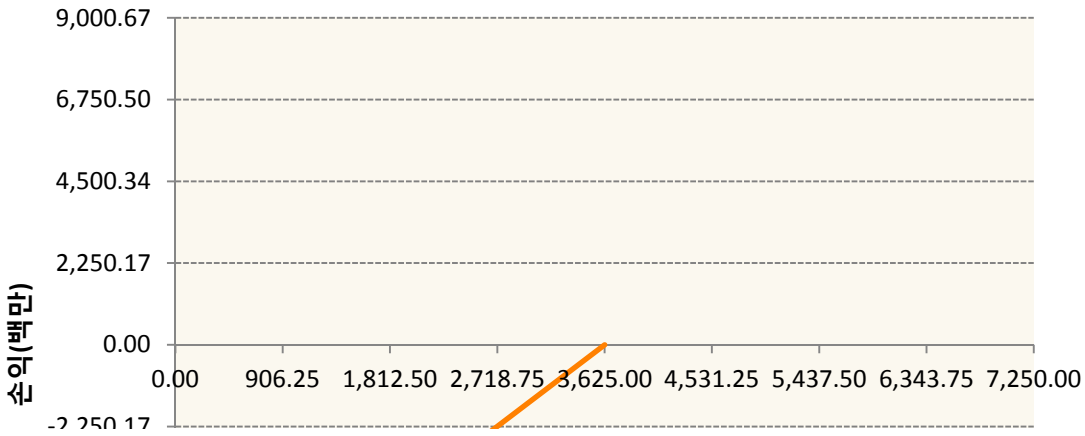


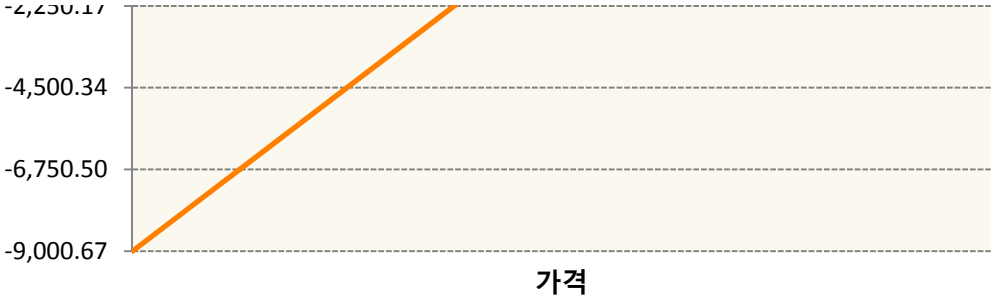


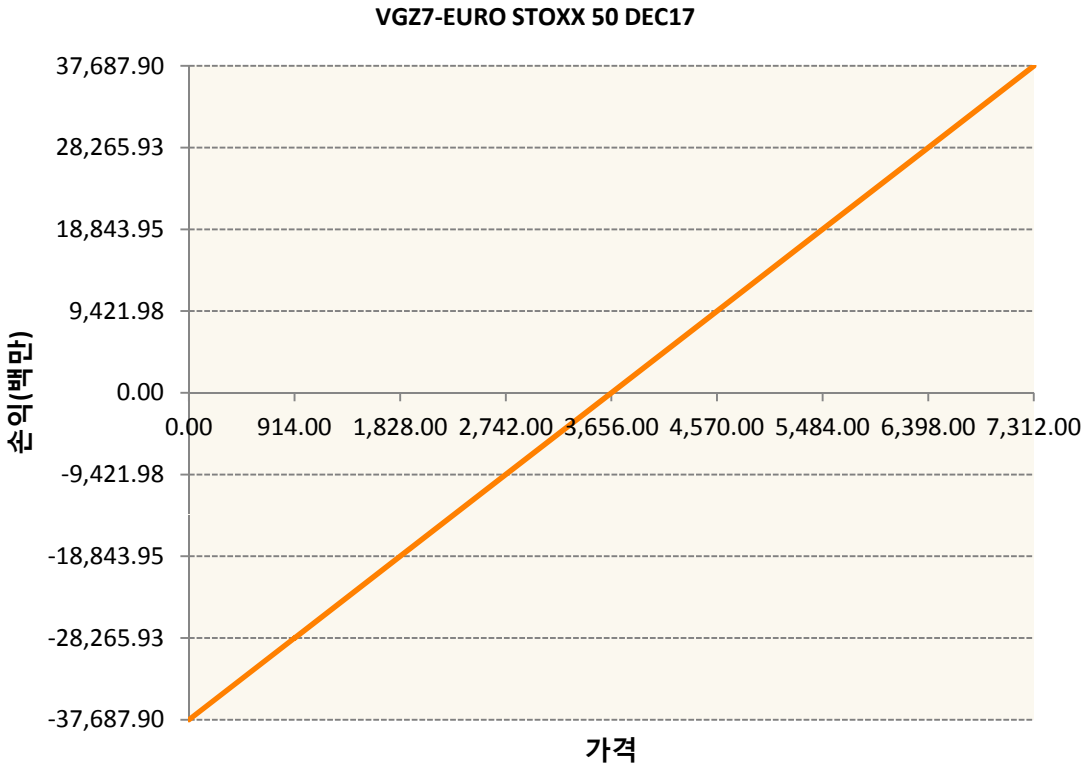
SX5E11P360-OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E11P362-OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	64
SX5E11C360	OESXX7-C3600 EURO STOXX 50 Price EUR	2,797
SX5E11C362	OESXX7-C3625 EURO STOXX 50 Price EUR	720
SX5E11P360	OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR	2,797
SX5E11P362	OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR	720
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,015

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7,417

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

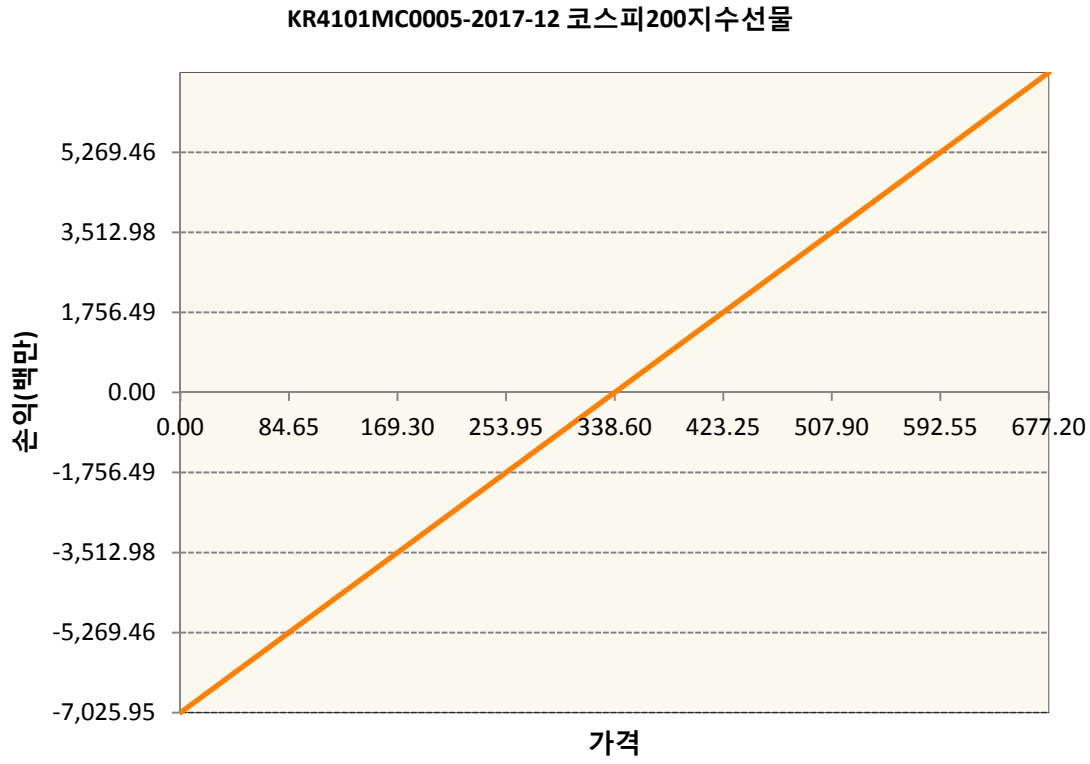
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	7,026	0	7,026	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						561
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-561	-561	-561	-561	-561	-561	-561
-5.33%	-374	-374	-374	-374	-374	-374	-374
-2.67%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	187	187	187	187	187	187	187
5.33%	374	374	374	374	374	374	374
8.00%	561	561	561	561	561	561	561

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

337

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

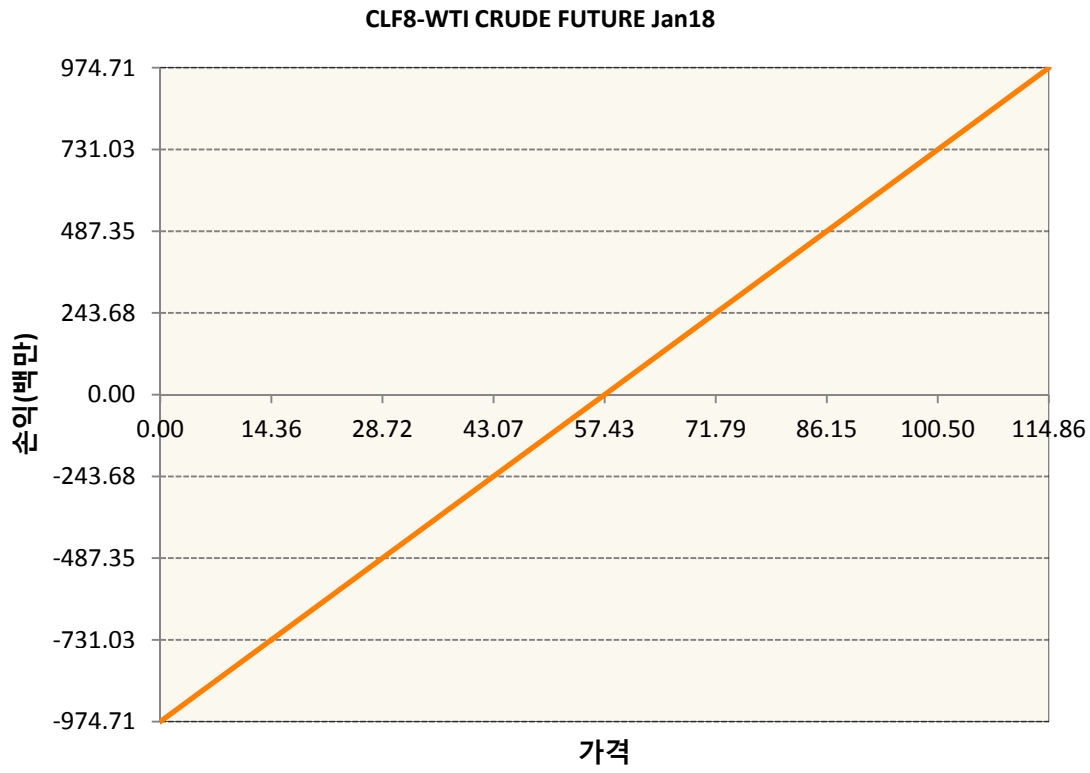
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

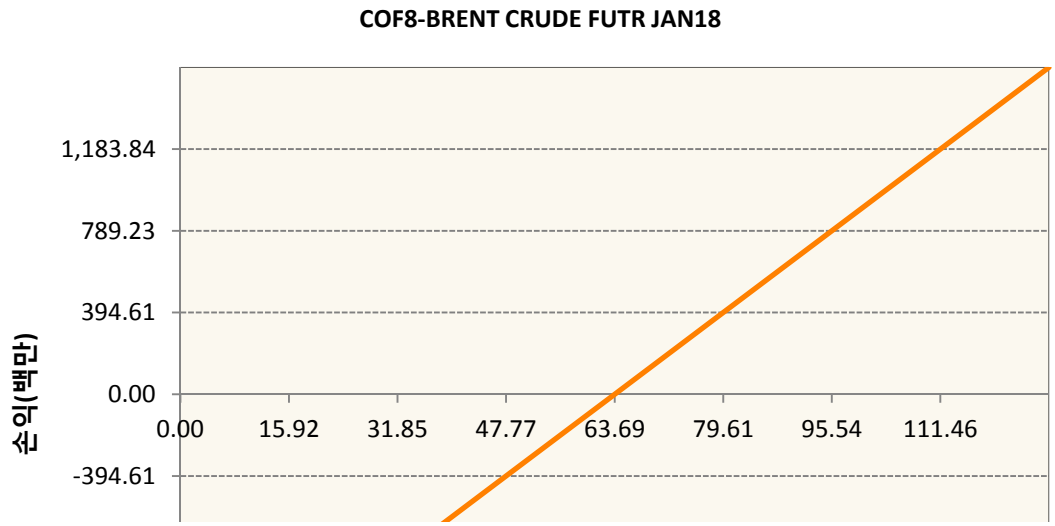
1. 계약금액

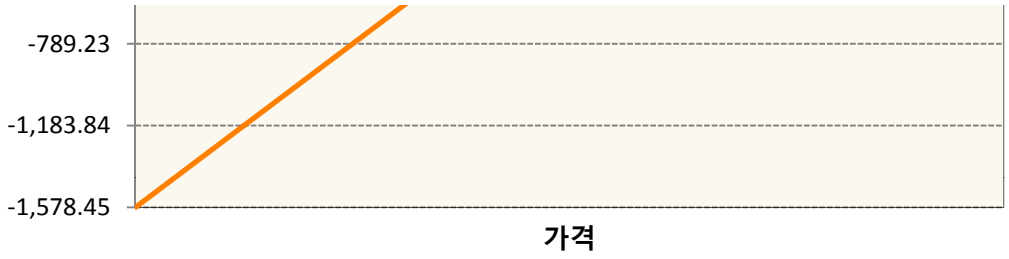
(단위:백만원)

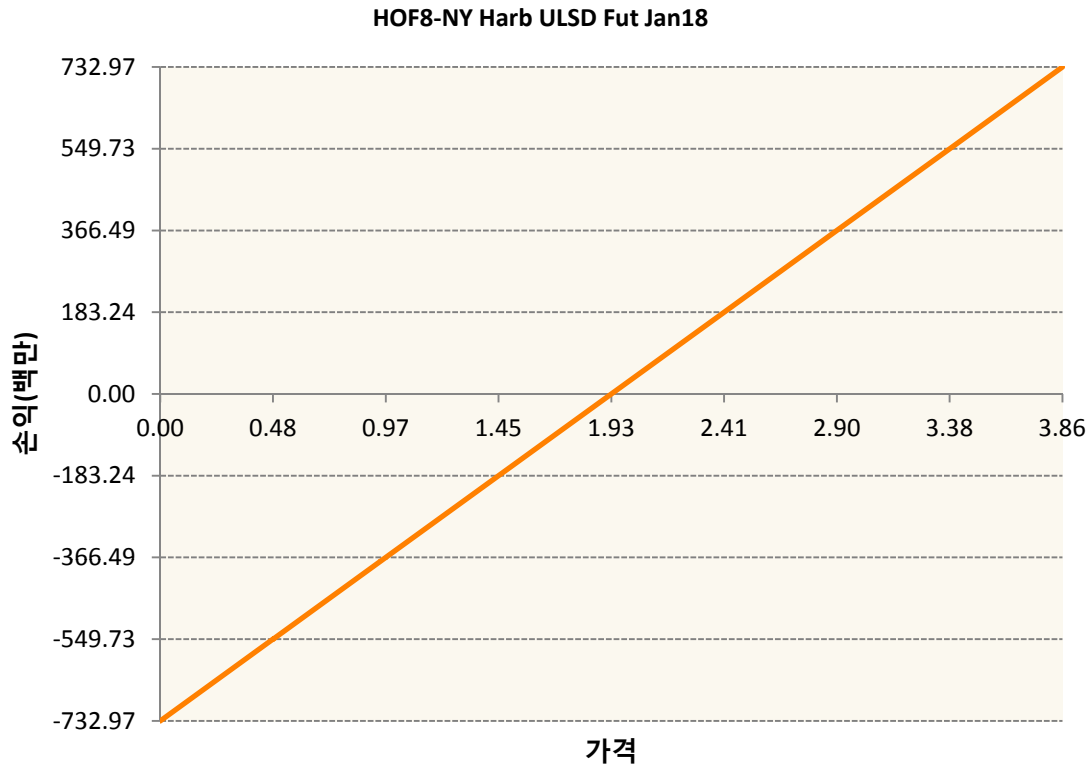
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,452	892	4,560	

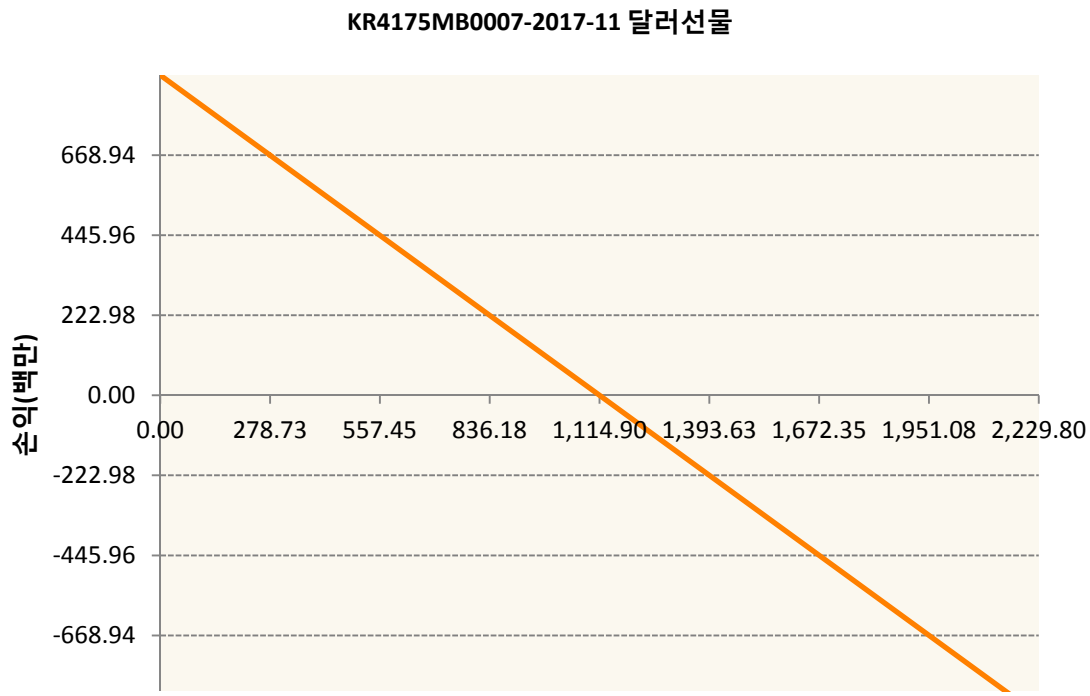
2. 만기시점의 손익구조

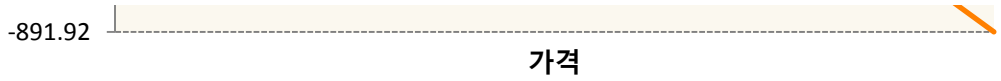


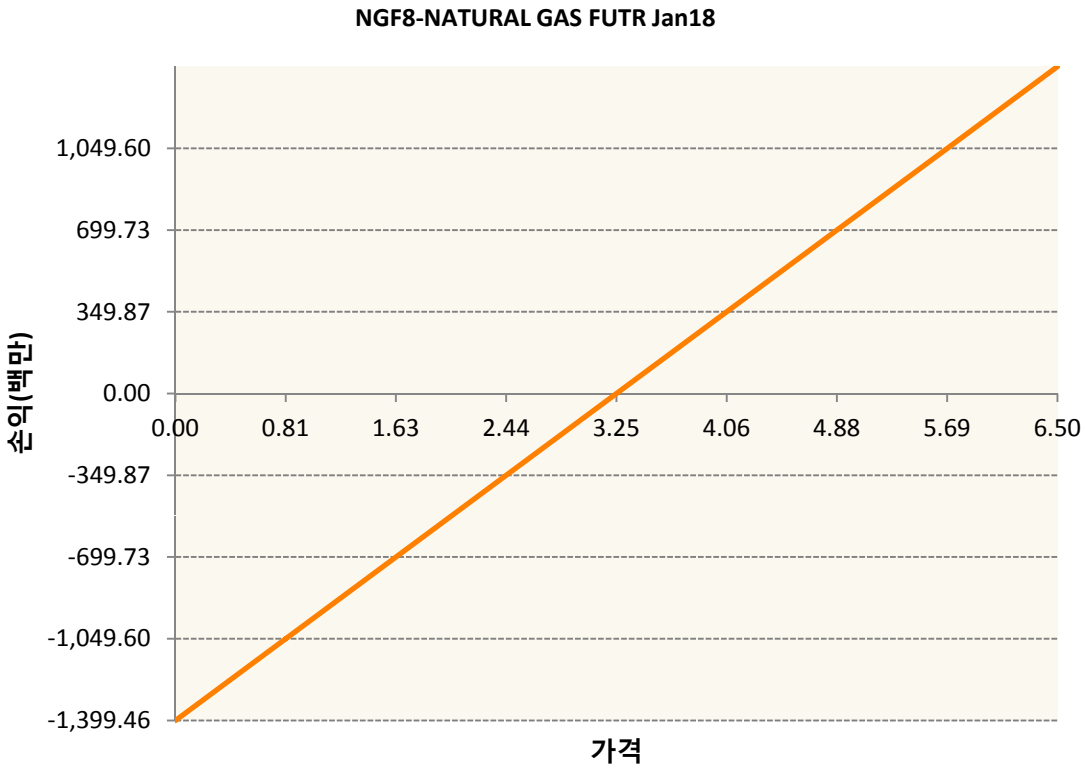


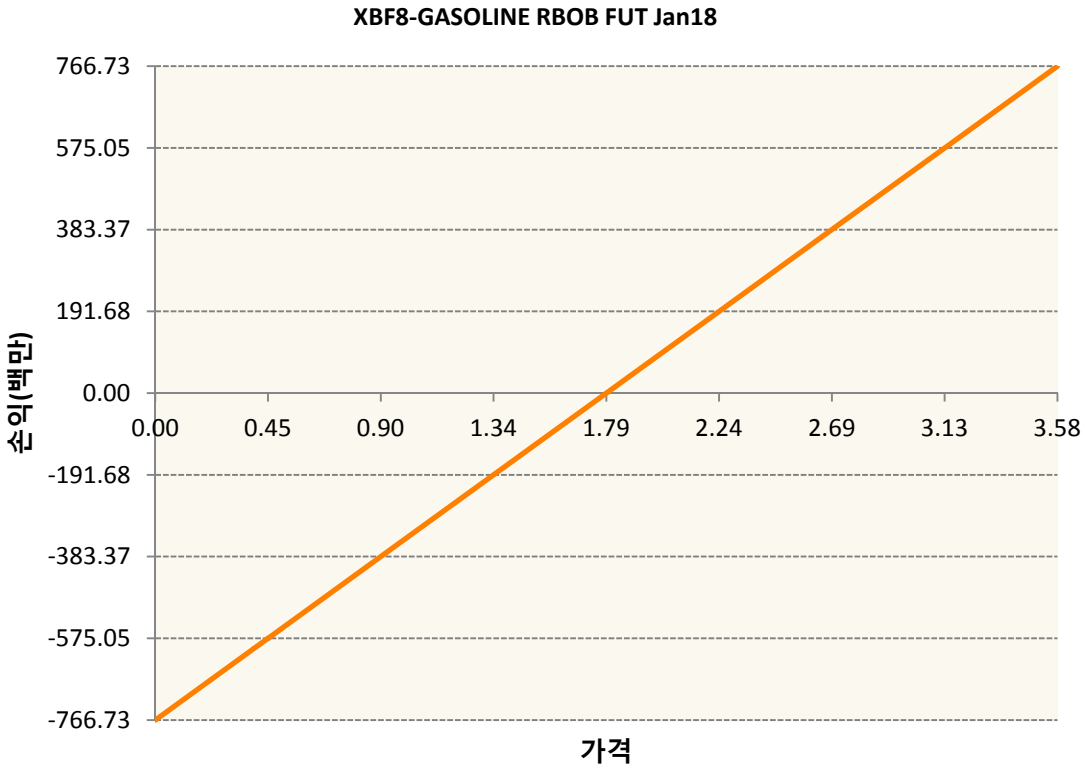

-789.23
-1,183.84
-1,578.45
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
732.97
549.73
366.49
183.24
0.00
-183.24
-366.49
-549.73
-732.97
0.00
0.48
0.97
1.45
1.93
2.41
2.90
3.38
3.86
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
668.94
445.96
222.98
0.00
-222.98
-445.96
-668.94
0.00
278.73
557.45
836.18
1,114.90
1,393.63
1,672.35
1,951.08
2,229.80
손익(백만)


-891.92
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
손익(백만)
1,049.60
699.73
349.87
0.00
-349.87
-699.73
-1,049.60
-1,399.46
0.00
0.81
1.63
2.44
3.25
4.06
4.88
5.69
6.50
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
손익(백만)
766.73
575.05
383.37
191.68
0.00
-191.68
-383.37
-575.05
-766.73
0.00
0.45
0.90
1.34
1.79
2.24
2.69
3.13
3.58
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	78
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	126
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	71
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	112
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	61

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

772

공시일	2017-11-09
기준일	2017-11-08

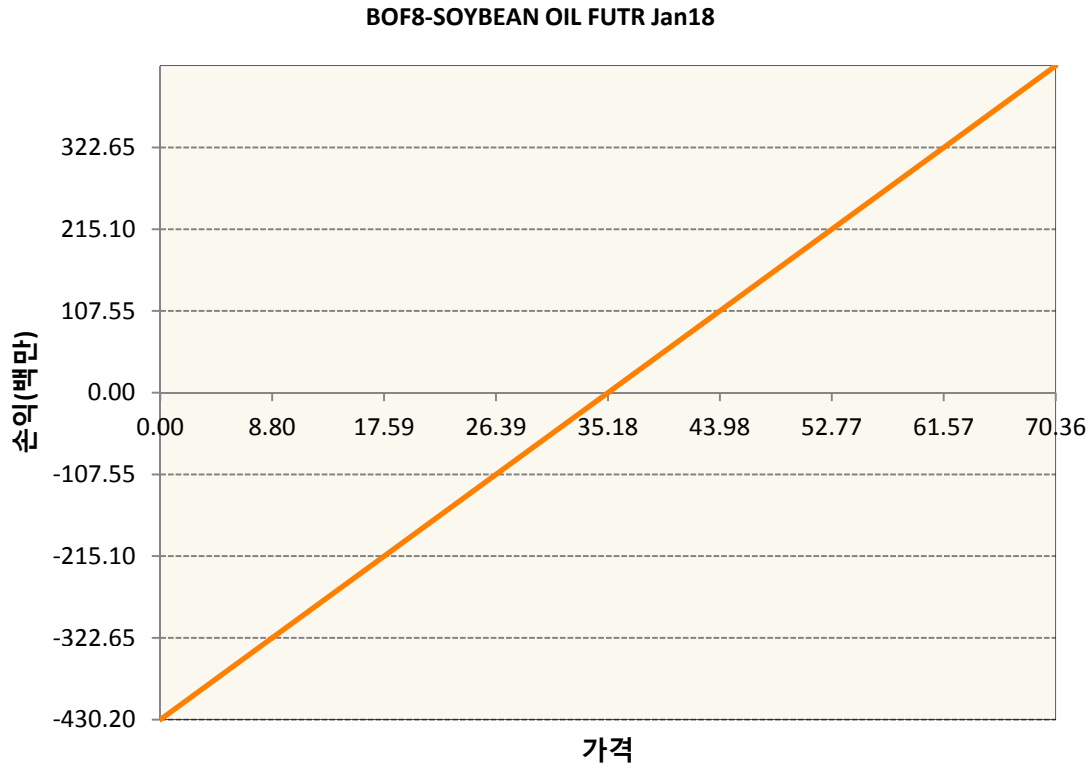
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

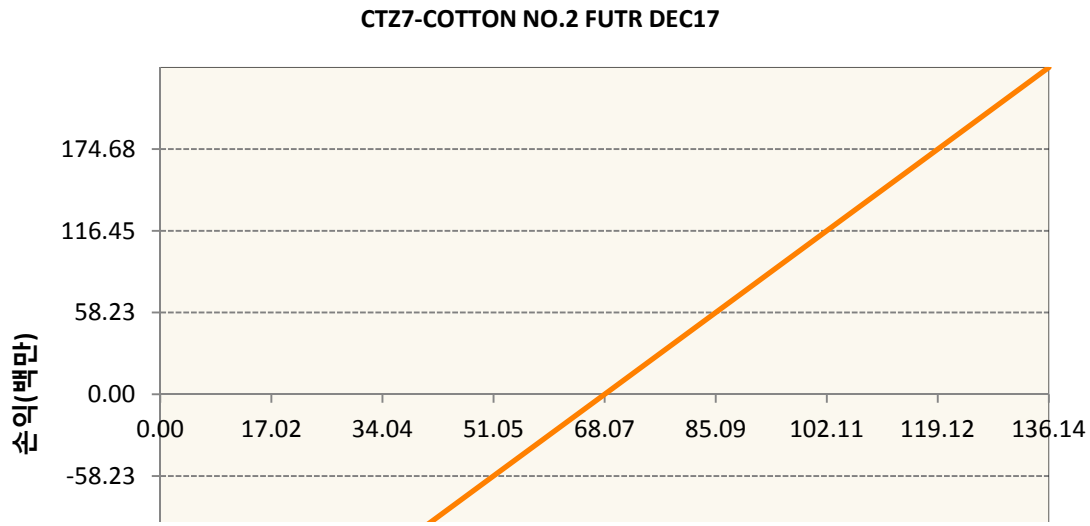
1. 계약금액

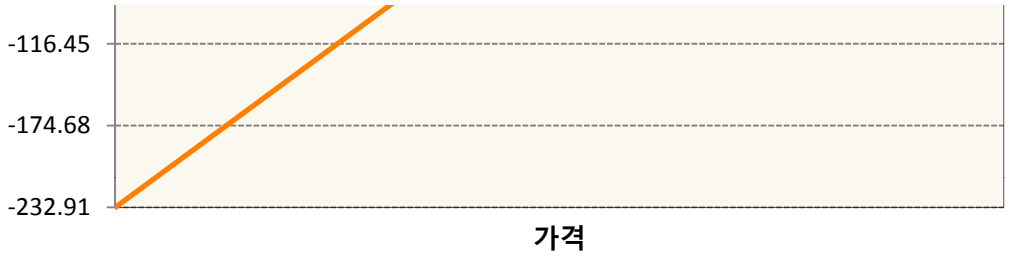
(단위:백만원)

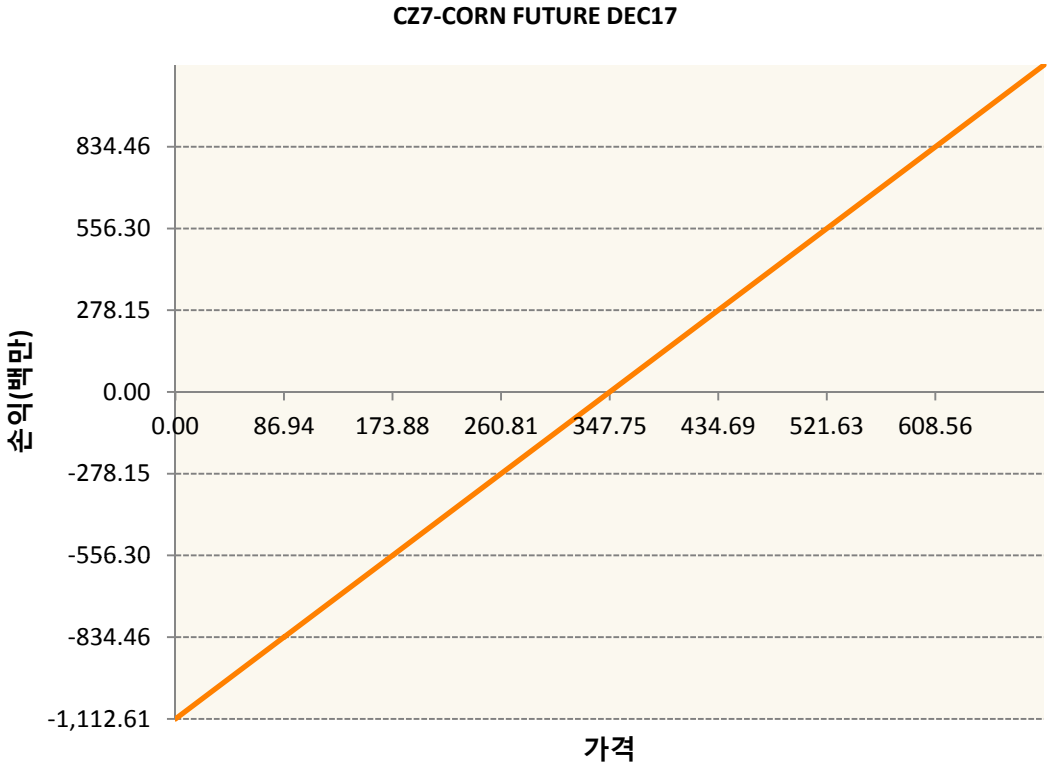
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,571	334	4,236	

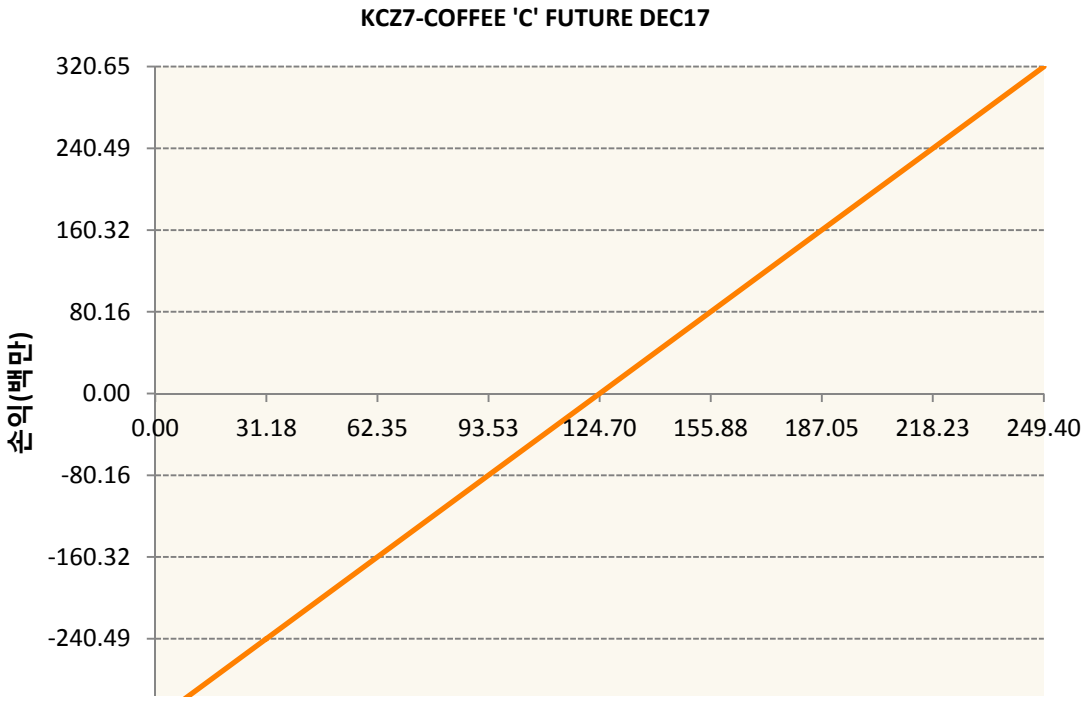
2. 만기시점의 손익구조

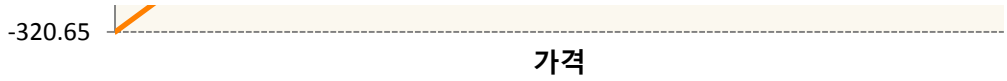


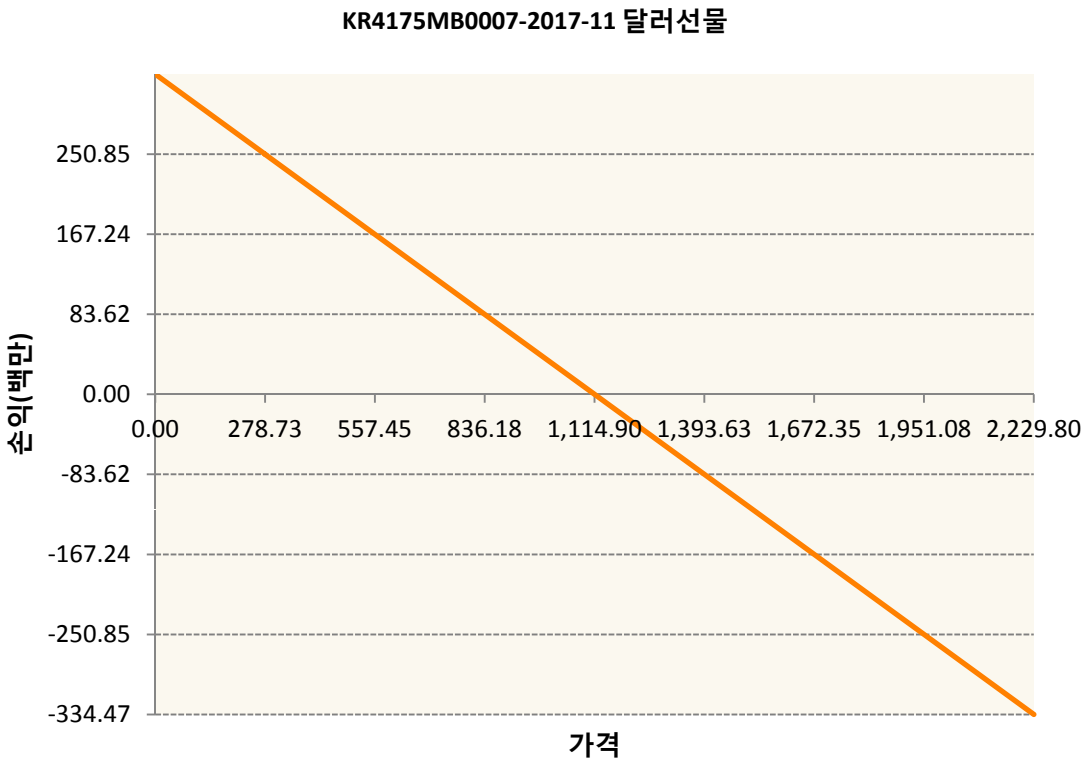


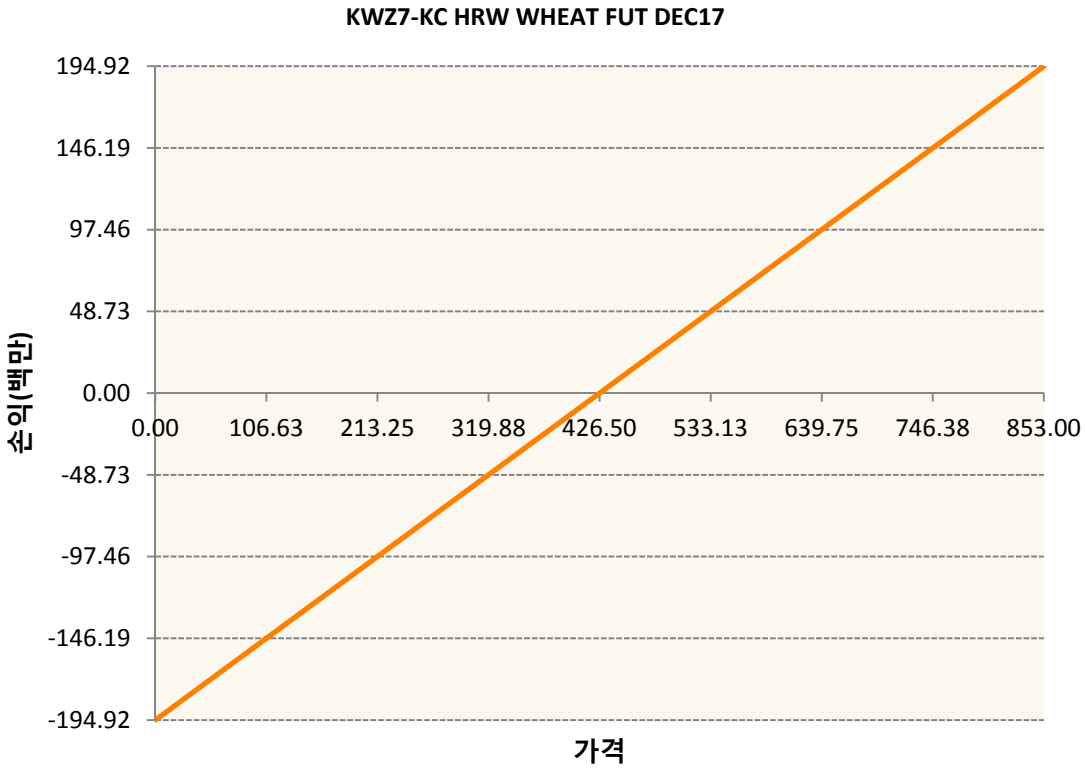

-116.45
-174.68
-232.91
가격

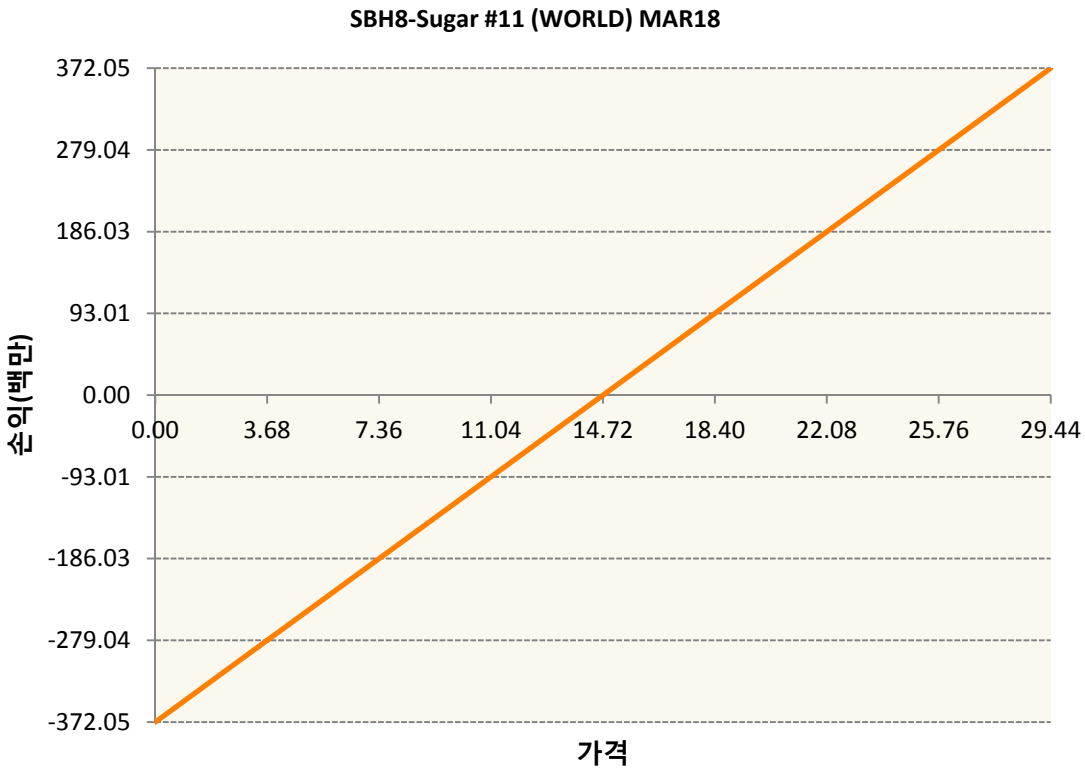

CZ7-CORN FUTURE DEC17
834.46
556.30
278.15
0.00
-278.15
-556.30
-834.46
-1,112.61
0.00
86.94
173.88
260.81
347.75
434.69
521.63
608.56
손익(백만)
가격

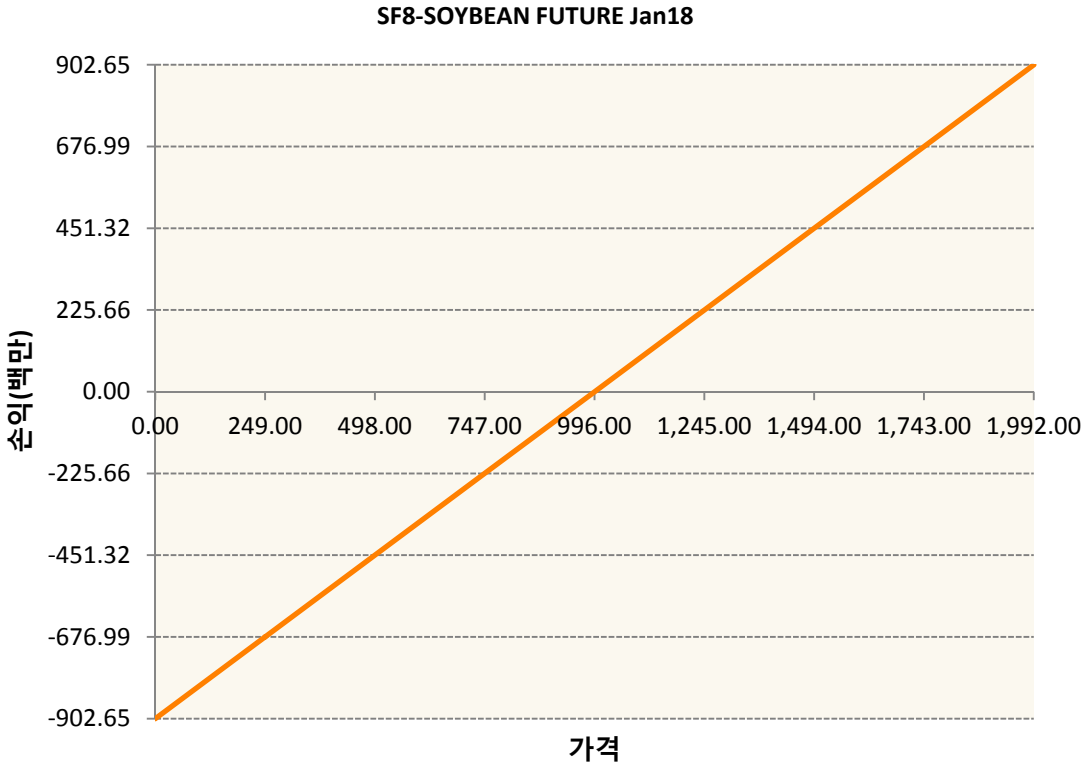

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
320.65
240.49
160.32
80.16
0.00
-80.16
-160.32
-240.49
0.00
31.18
62.35
93.53
124.70
155.88
187.05
218.23
249.40
손익(백만)


-320.65
가격

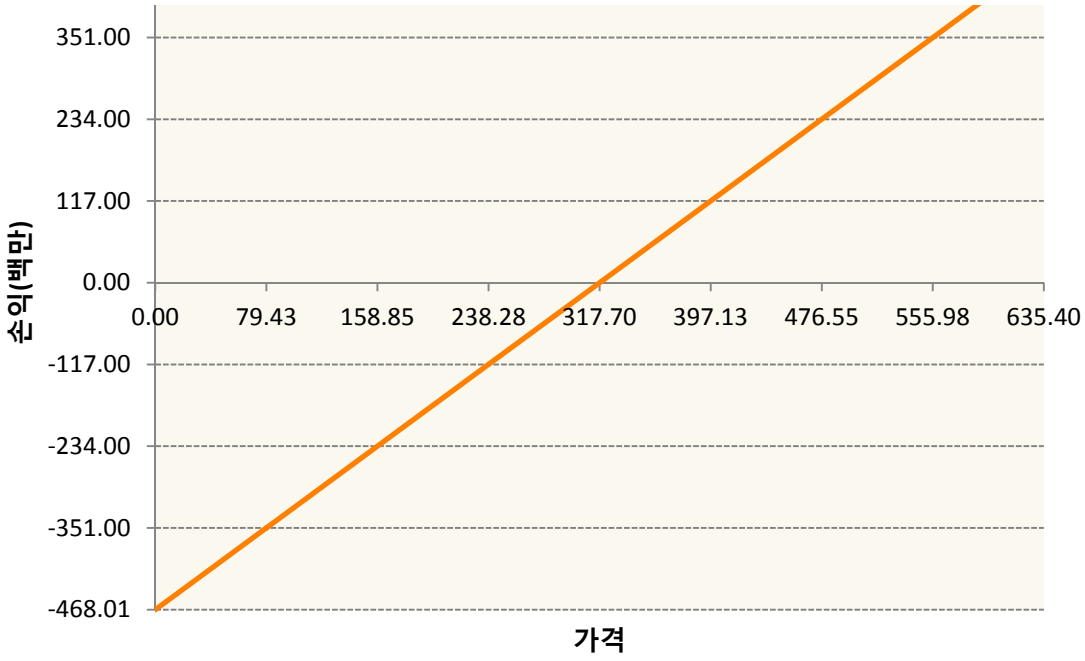

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
250.85
167.24
83.62
0.00
-83.62
-167.24
-250.85
-334.47
0.00
278.73
557.45
836.18
1,114.90
1,393.63
1,672.35
1,951.08
2,229.80
손익(백만)
가격

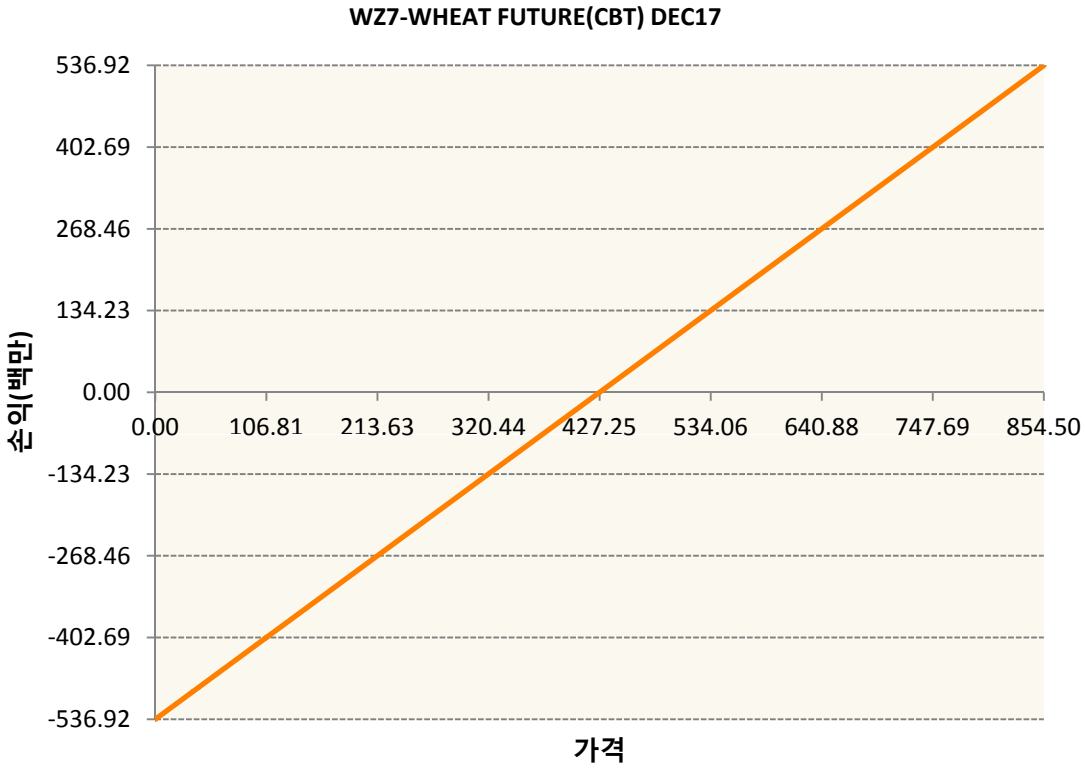

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
194.92
146.19
97.46
48.73
0.00
-48.73
-97.46
-146.19
-194.92
0.00
106.63
213.25
319.88
426.50
533.13
639.75
746.38
853.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
372.05
279.04
186.03
93.01
0.00
-93.01
-186.03
-279.04
-372.05
0.00
3.68
7.36
11.04
14.72
18.40
22.08
25.76
29.44
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
902.65
676.99
451.32
225.66
0.00
-225.66
-451.32
-676.99
-902.65
0.00
249.00
498.00
747.00
996.00
1,245.00
1,494.00
1,743.00
1,992.00
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
468.01





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	34
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	19
CZ7	CORN FUTURE DEC17	89
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	26
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	16
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	30
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	72
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	37
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	43

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

413