공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

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	2017-11-13
기준일	2017-11-10

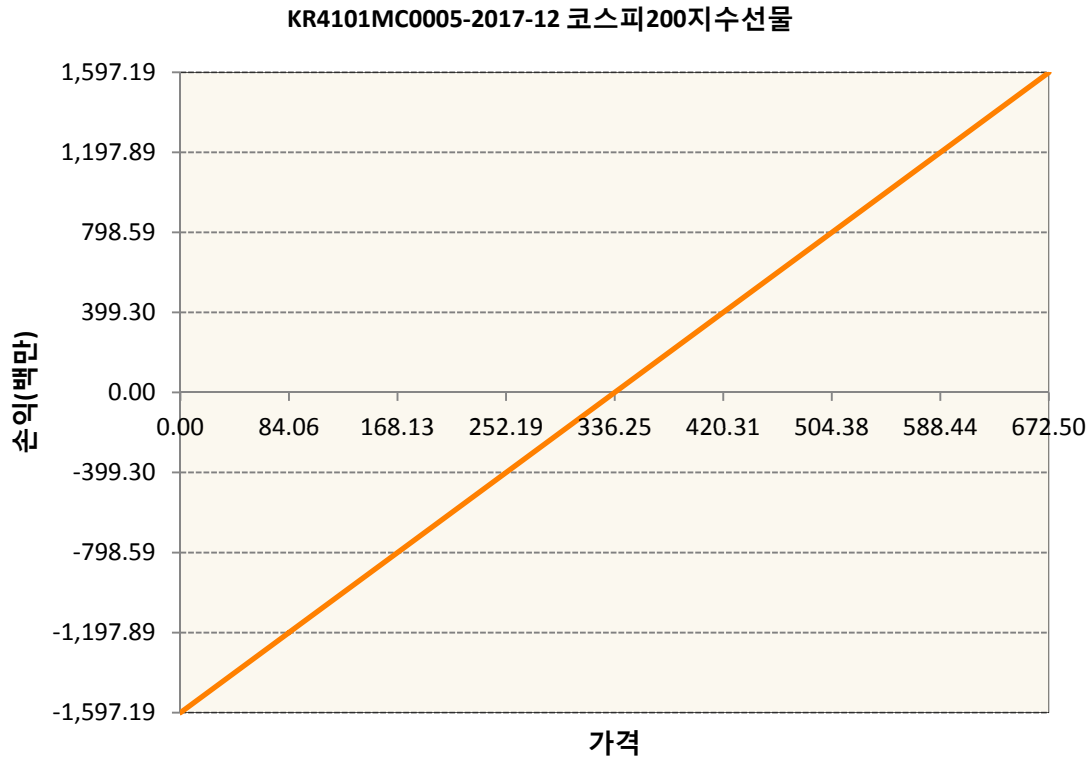
스마트인덱스모

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	1,597	0	1,597	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%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-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%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

77

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

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	1,068

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

385

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

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	422

* 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	2017-11-13
기준일	2017-11-10

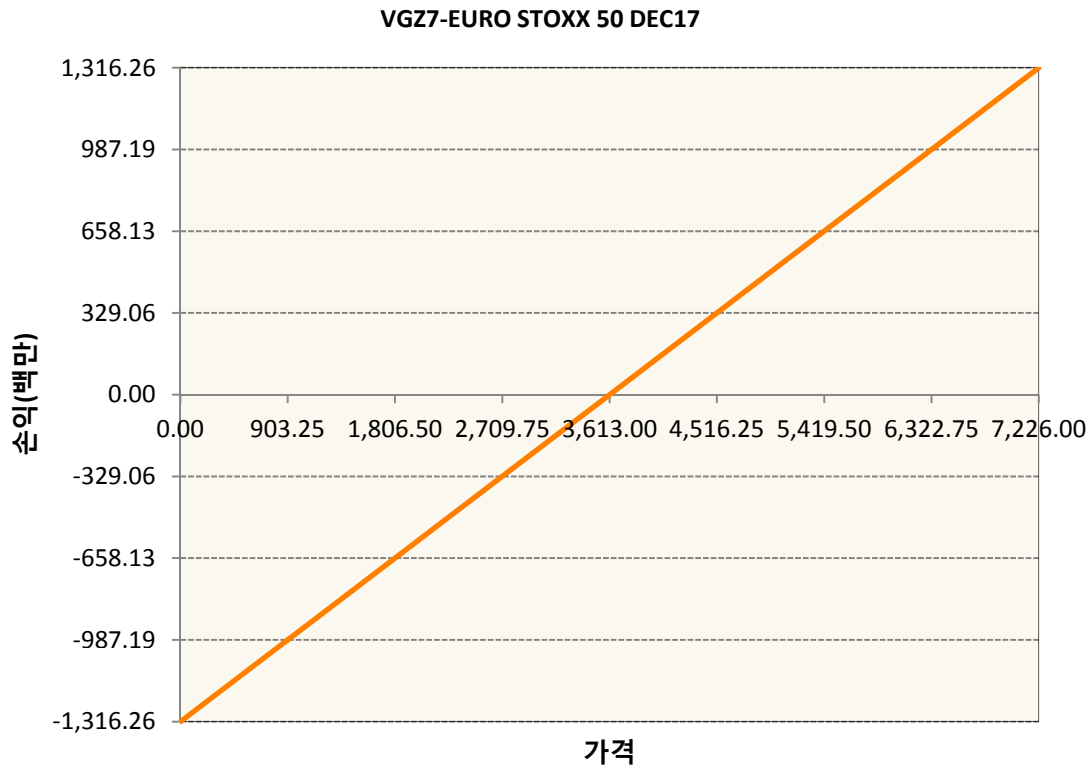
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,316	0	1,316	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	105

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

(단위:백만원)

76

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

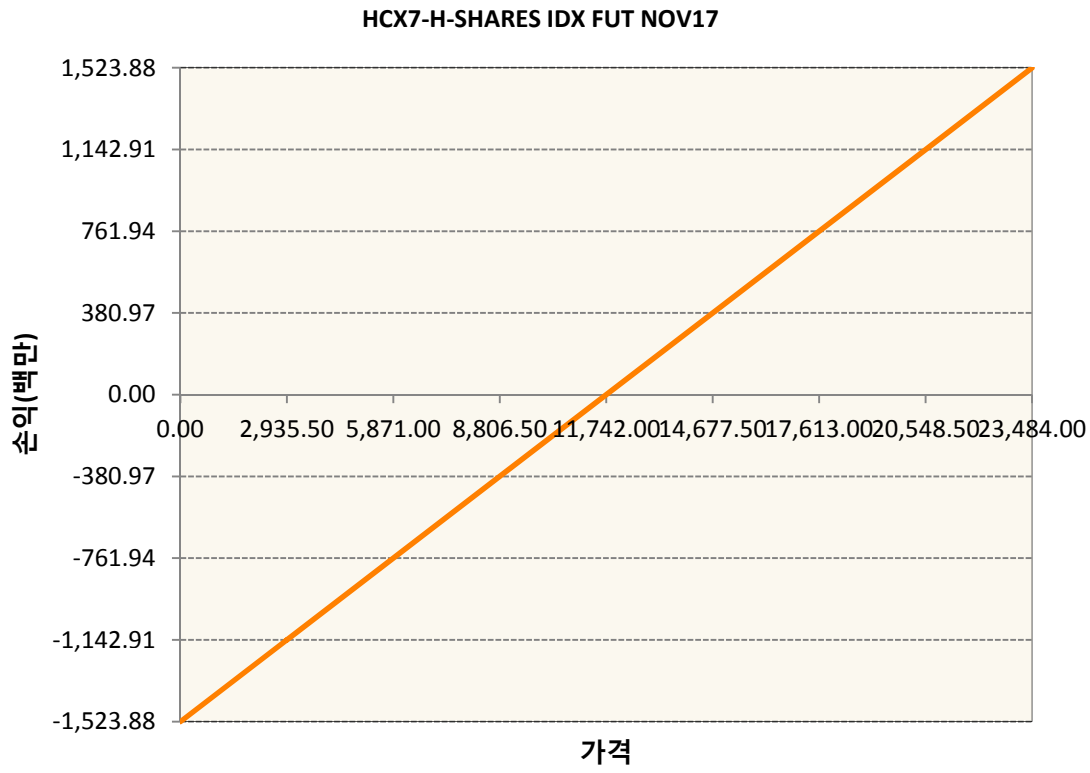
차이나인덱스모(주식-파생형)

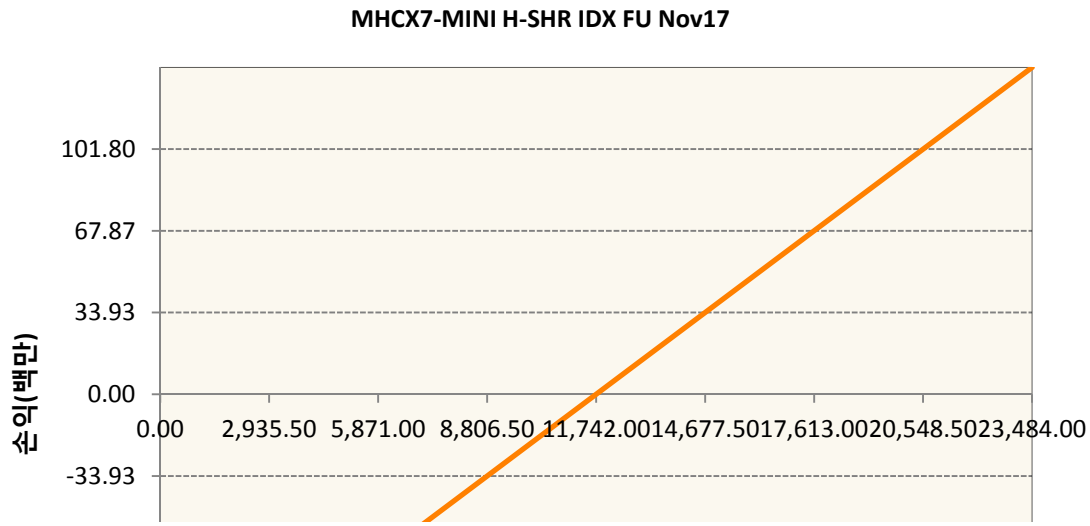
1. 계약금액

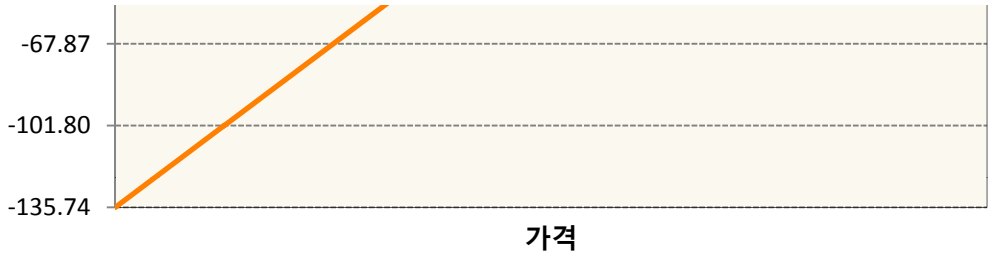
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,660	0	1,660	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	122
MHCX7	MINI H-SHR IDX FU Nov17	11

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

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

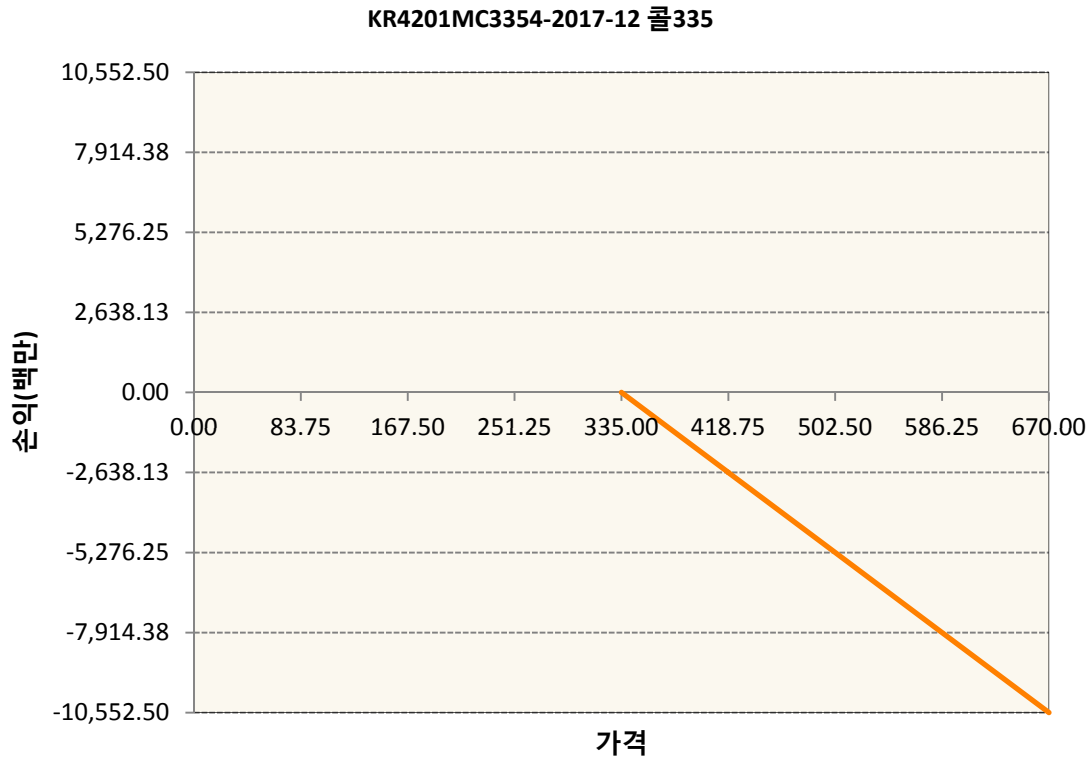
커버드콜모(주식혼합-파생형)

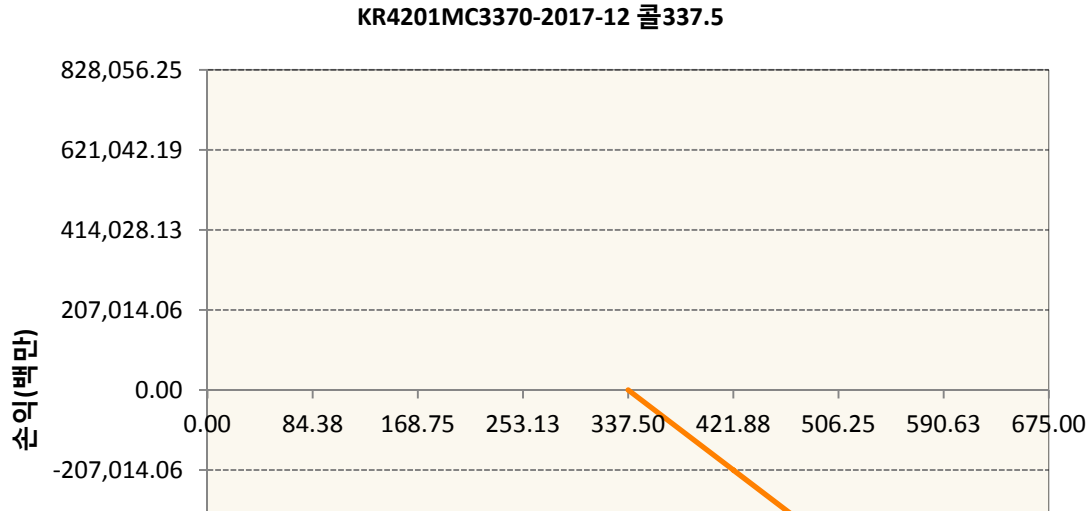
1. 계약금액

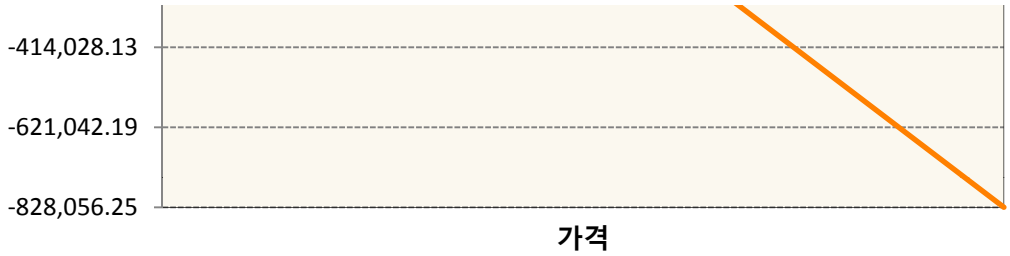
(단위:백만원)

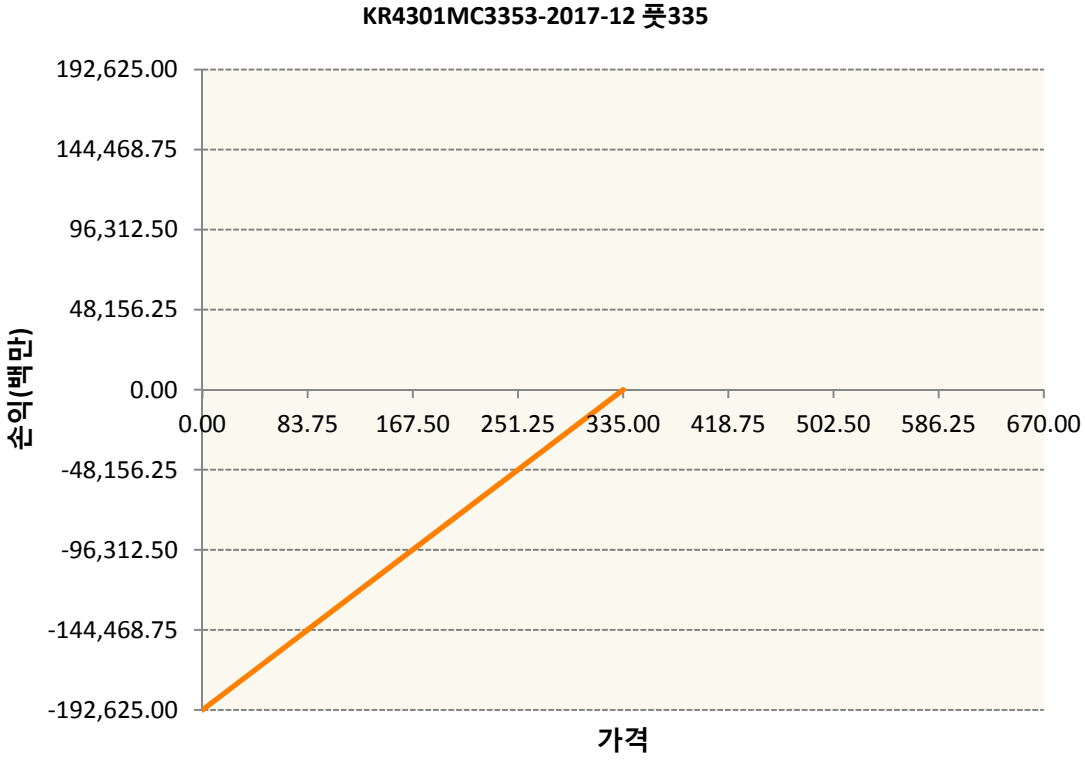
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,302,296	-1,302,296	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

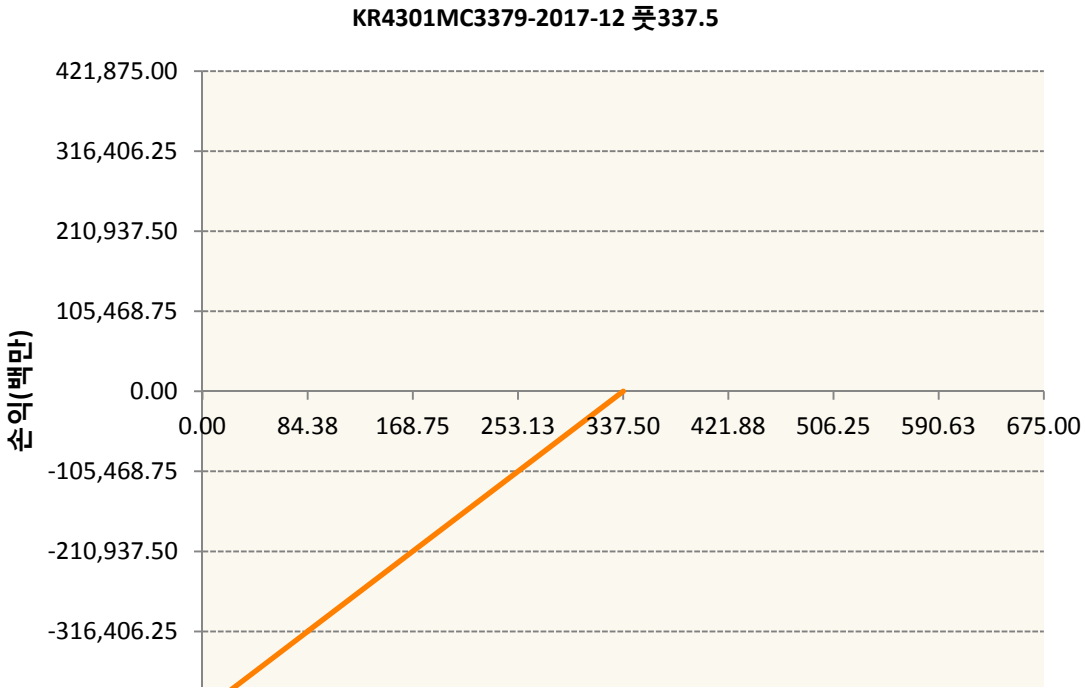
2. 만기시점의 손익구조






-414,028.13
-621,042.19
-828,056.25
가격


KR4301MC3353-2017-12 풋335
192,625.00
144,468.75
96,312.50
48,156.25
0.00
-48,156.25
-96,312.50
-144,468.75
-192,625.00
0.00
83.75
167.50
251.25
335.00
418.75
502.50
586.25
670.00
손익(백만)
가격


KR4301MC3379-2017-12 풋337.5
421,875.00
316,406.25
210,937.50
105,468.75
0.00
-105,468.75
-210,937.50
-316,406.25
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)

KR4201MC3. 2017-12 콜335							659
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	314	304	292	278	263	247	230
-5.33%	277	260	241	221	200	179	157
-2.67%	203	179	155	130	105	80	55
0%	79	53	26	0	-26	-53	-79
2.67%	-97	-121	-145	-169	-194	-219	-245
5.33%	-317	-335	-354	-374	-395	-417	-439
8.00%	-568	-579	-592	-606	-623	-640	-659
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							49,482
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21,879	21,212	20,399	19,457	18,402	17,248	16,008
-5.33%	19,591	18,366	17,028	15,596	14,089	12,520	10,899
-2.67%	14,703	12,933	11,119	9,270	7,394	5,498	3,584
0%	6,165	4,111	2,056	0	-2,056	-4,112	-6,168
2.67%	-6,439	-8,385	-10,356	-12,346	-14,350	-16,366	-18,390
5.33%	-22,689	-24,218	-25,840	-27,535	-29,288	-31,089	-32,927
8.00%	-41,615	-42,627	-43,785	-45,068	-46,455	-47,931	-49,482
KR4301MC3. 2017-12 풋335							12,531
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,427	-12,431	-12,438	-12,450	-12,469	-12,496	-12,531
-5.33%	-7,326	-7,365	-7,417	-7,483	-7,563	-7,655	-7,758
-2.67%	-2,629	-2,781	-2,944	-3,116	-3,294	-3,477	-3,666
0%	667	445	223	0	-223	-446	-668
2.67%	2,050	1,923	1,781	1,628	1,465	1,294	1,117
5.33%	2,349	2,317	2,273	2,214	2,141	2,056	1,958
8.00%	2,380	2,376	2,369	2,356	2,335	2,306	2,268
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							28,681
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28,535	-28,539	-28,546	-28,562	-28,588	-28,627	-28,681
-5.33%	-17,395	-17,444	-17,518	-17,618	-17,745	-17,899	-18,078
-2.67%	-6,785	-7,040	-7,325	-7,637	-7,970	-8,321	-8,687
0%	1,450	967	484	0	-485	-970	-1,455
2.67%	5,538	5,180	4,800	4,403	3,992	3,570	3,139

5.33%	6,624	6,511	6,364	6,183	5,972	5,733	5,469
8.00%	6,766	6,750	6,720	6,672	6,604	6,513	6,398

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

93,101

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

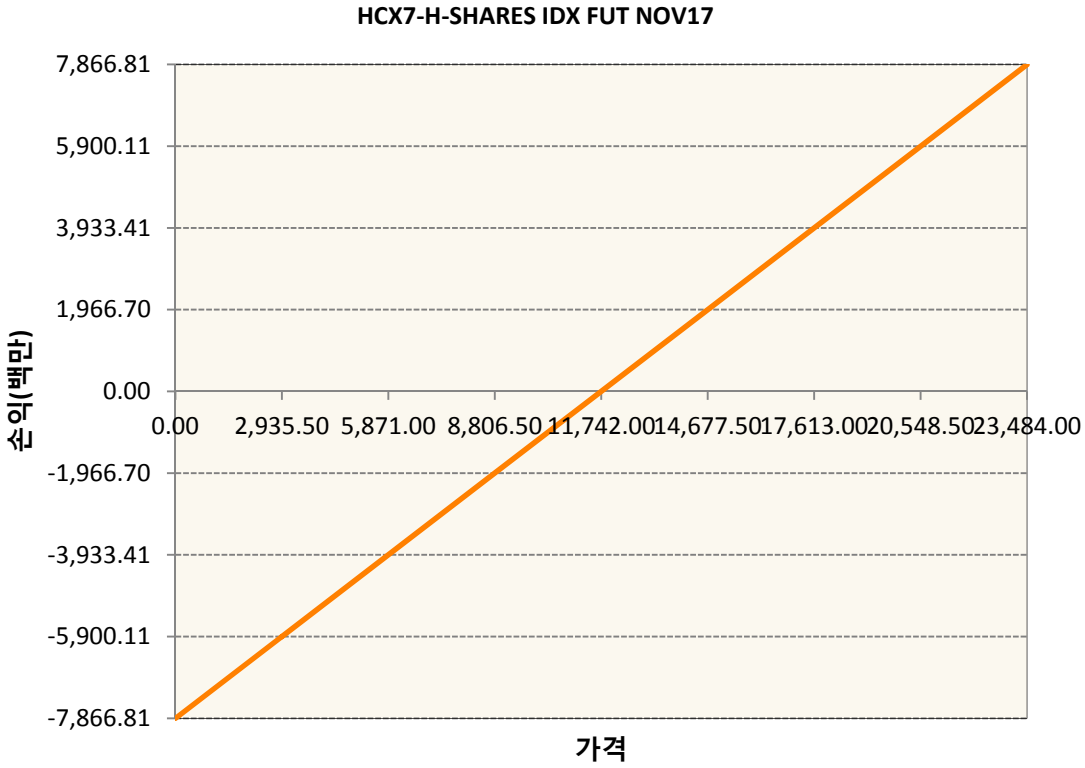
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

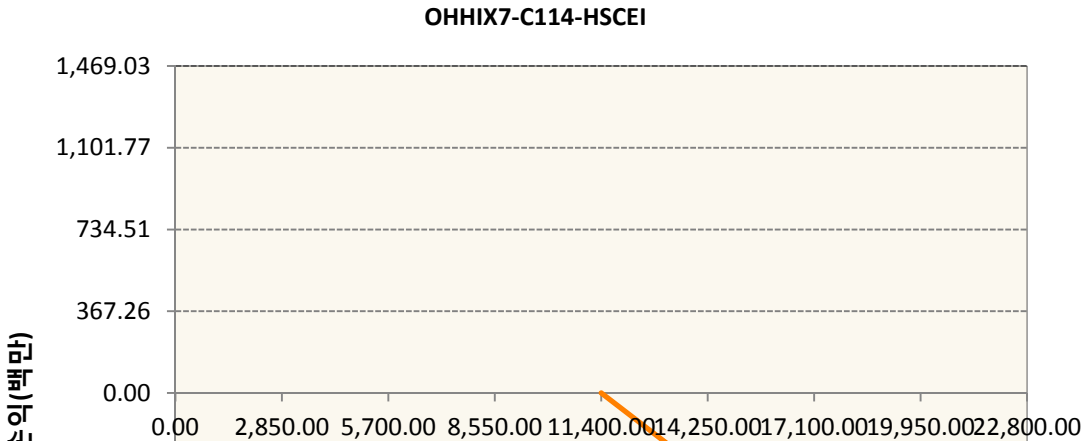
1. 계약금액

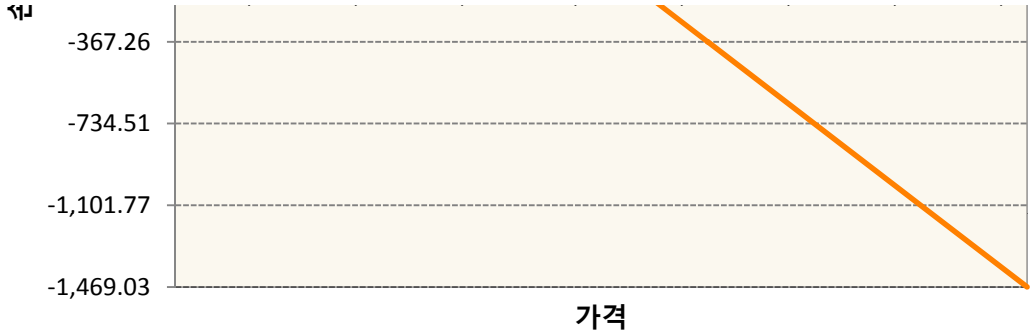
(단위:백만원)

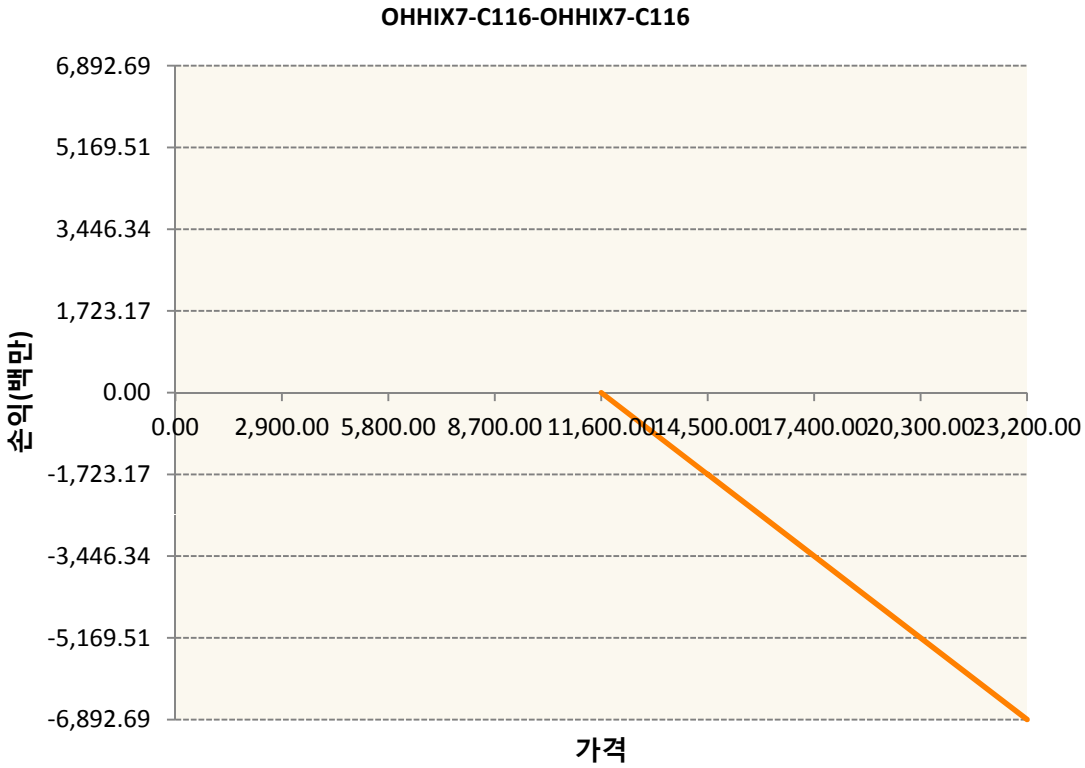
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,867	0	7,867	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,723	-16,723	장내

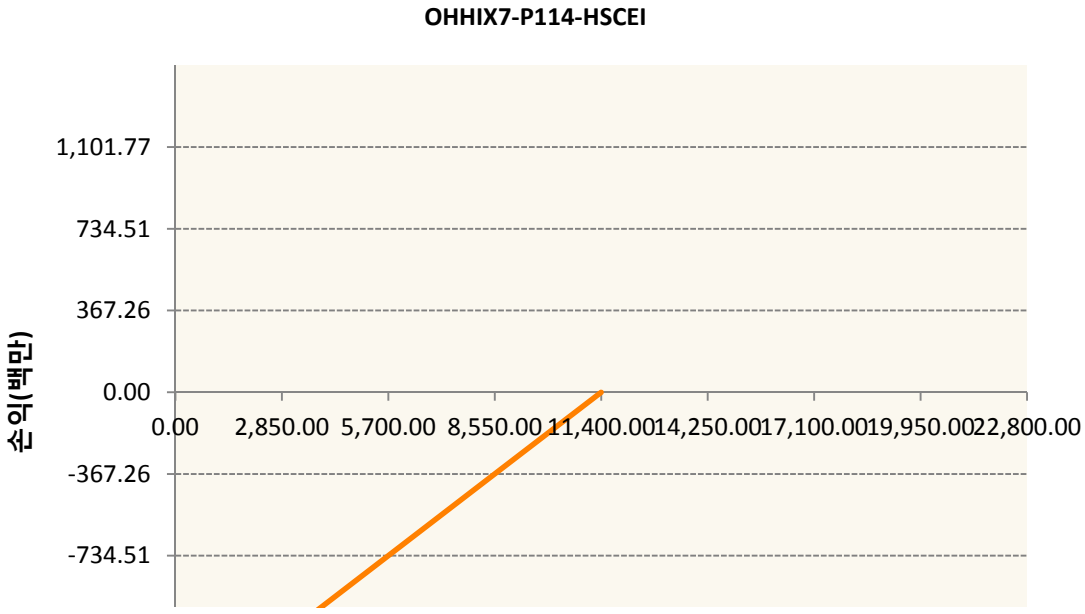
2. 만기시점의 손익구조

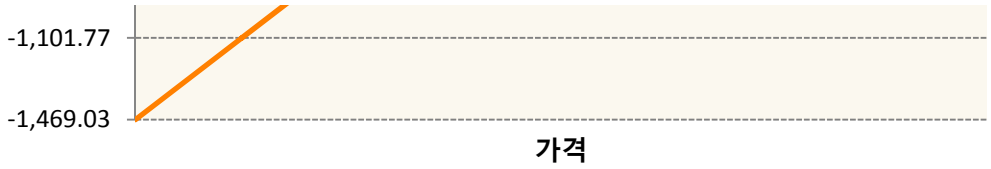


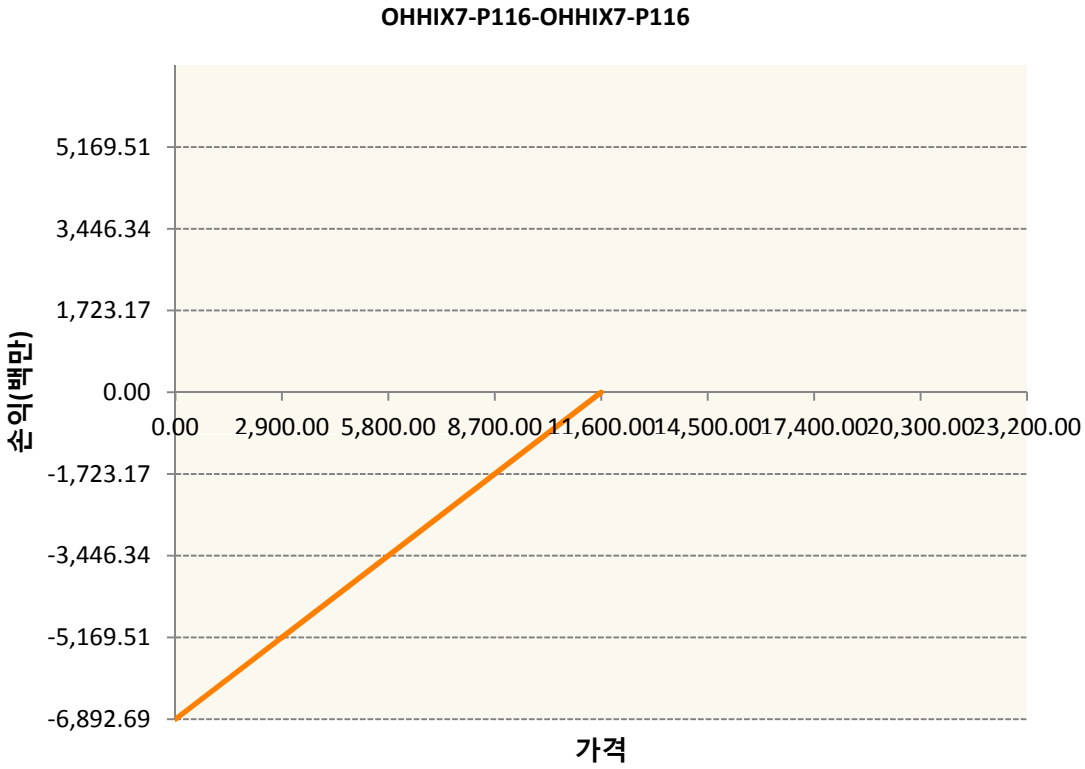



-367.26
-734.51
-1,101.77
-1,469.03
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,892.69
5,169.51
3,446.34
1,723.17
0.00
-1,723.17
-3,446.34
-5,169.51
-6,892.69
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
1,101.77
734.51
367.26
0.00
-367.26
-734.51
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	629
OHHIX7-C11	HSCEI	118
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	551
OHHIX7-P11	HSCEI	118
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	551

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,589

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

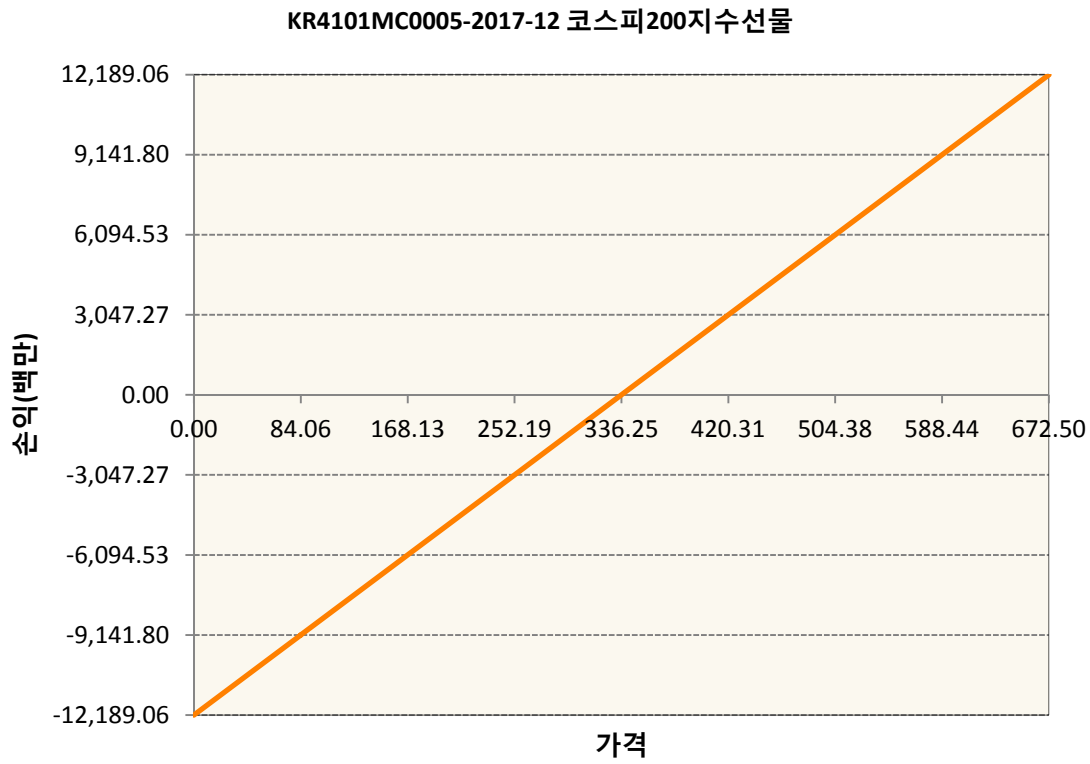
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

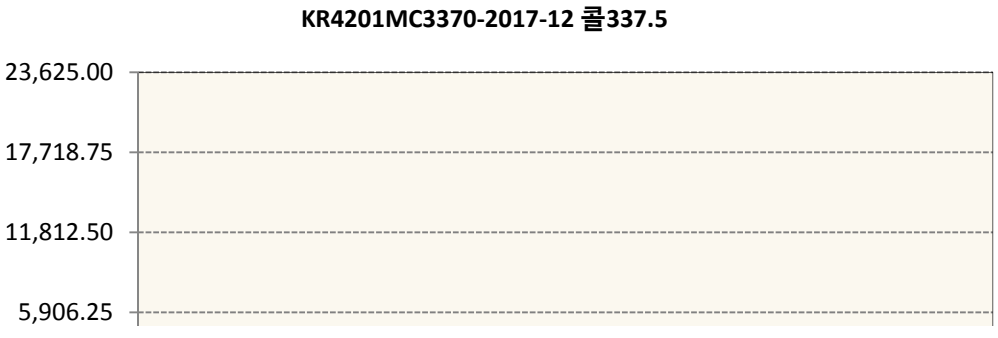
1. 계약금액

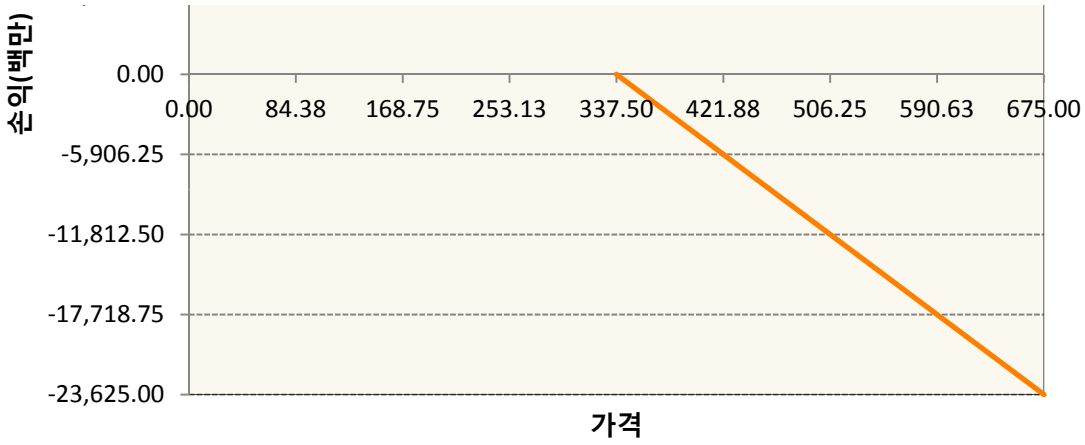
(단위:백만원)

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	43,059	-43,059	장내
누계	유가증권	선물	12,189	0	12,189	장내
누계	유가증권	스왑	46,200	0	46,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	42,566	-42,566	장내

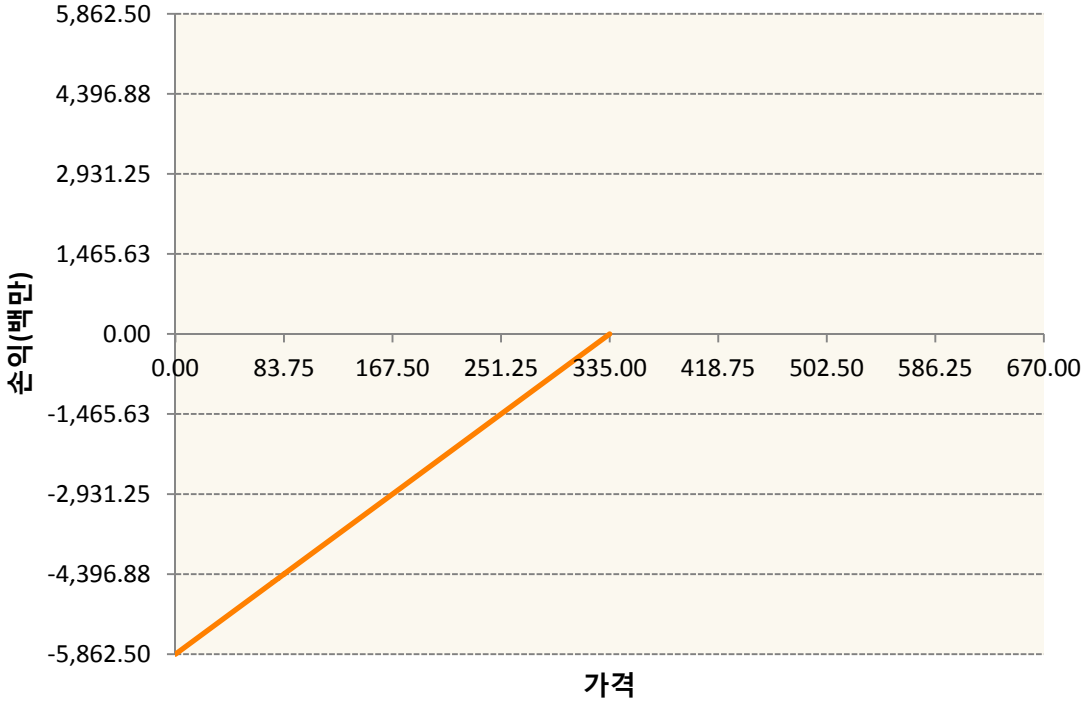
2. 만기시점의 손익구조



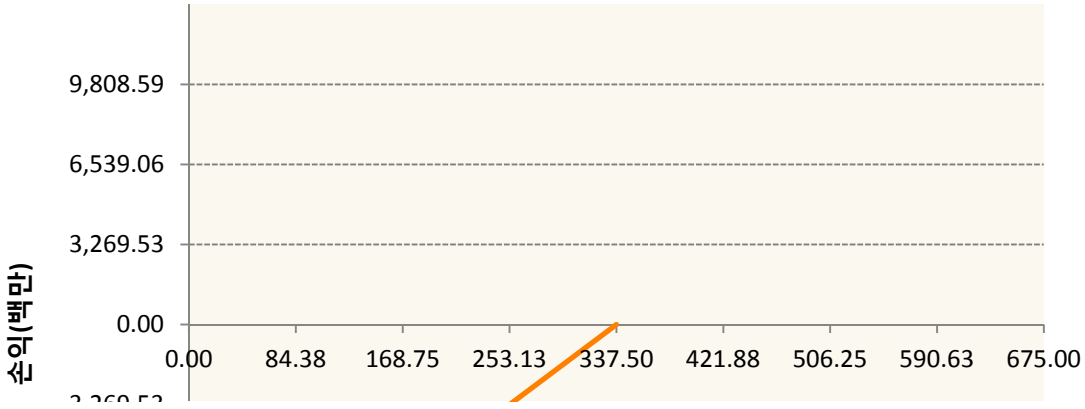




KR4301MC3353-2017-12 풋335



KR4301MC3379-2017-12 풋337.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,489
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489	-1,489
-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%	1,489	1,489	1,489	1,489	1,489	1,489	1,489
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
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						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
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					974
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-974	-974	-974	-974	-974	-974	-974
-5.33%	-650	-650	-650	-650	-650	-650	-650
-2.67%	-325	-325	-325	-325	-325	-325	-325
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	325	325	325	325	325	325	325
5.33%	650	650	650	650	650	650	650
8.00%	974	974	974	974	974	974	974
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,412
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	624	605	582	555	525	492	457
-5.33%	559	524	486	445	402	357	311
-2.67%	419	369	317	264	211	157	102
0%	176	117	59	0	-59	-117	-176
2.67%	-184	-239	-295	-352	-409	-467	-525
5.33%	-647	-691	-737	-786	-836	-887	-939
8.00%	-1,187	-1,216	-1,249	-1,286	-1,325	-1,368	-1,412
	KR4301MC3	2017-12 풋335					381
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-378	-378	-379	-379	-379	-380	-381
-5.33%	-223	-224	-226	-228	-230	-233	-236
-2.67%	-80	-85	-90	-95	-100	-106	-112
0%	20	14	7	0	-7	-14	-20
2.67%	62	59	54	50	45	39	34
5.33%	71	71	69	67	65	63	60
8.00%	72	72	72	72	71	70	69
	KR4301MC3	2017-12 풋337.5					889

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-885	-885	-885	-885	-886	-887	-889
-5.33%	-539	-541	-543	-546	-550	-555	-560
-2.67%	-210	-218	-227	-237	-247	-258	-269
0%	45	30	15	0	-15	-30	-45
2.67%	172	161	149	136	124	111	97
5.33%	205	202	197	192	185	178	170
8.00%	210	209	208	207	205	202	198

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

7,039

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

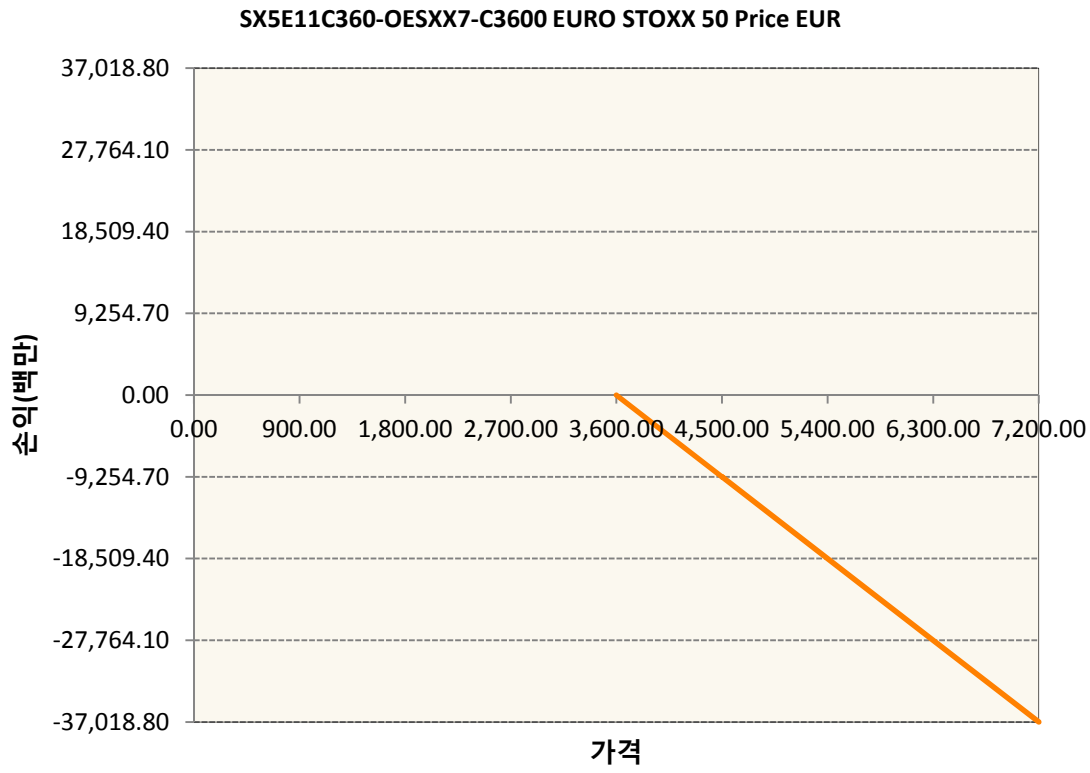
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

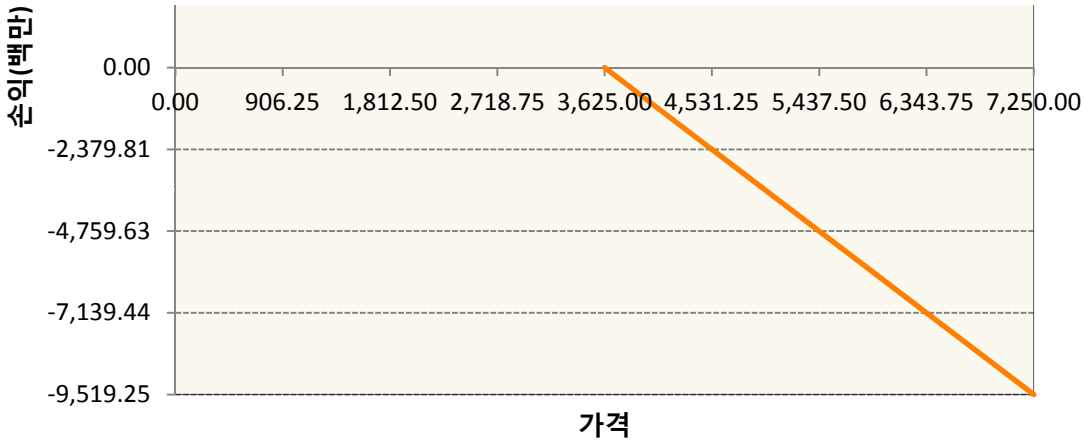
(단위:백만원)

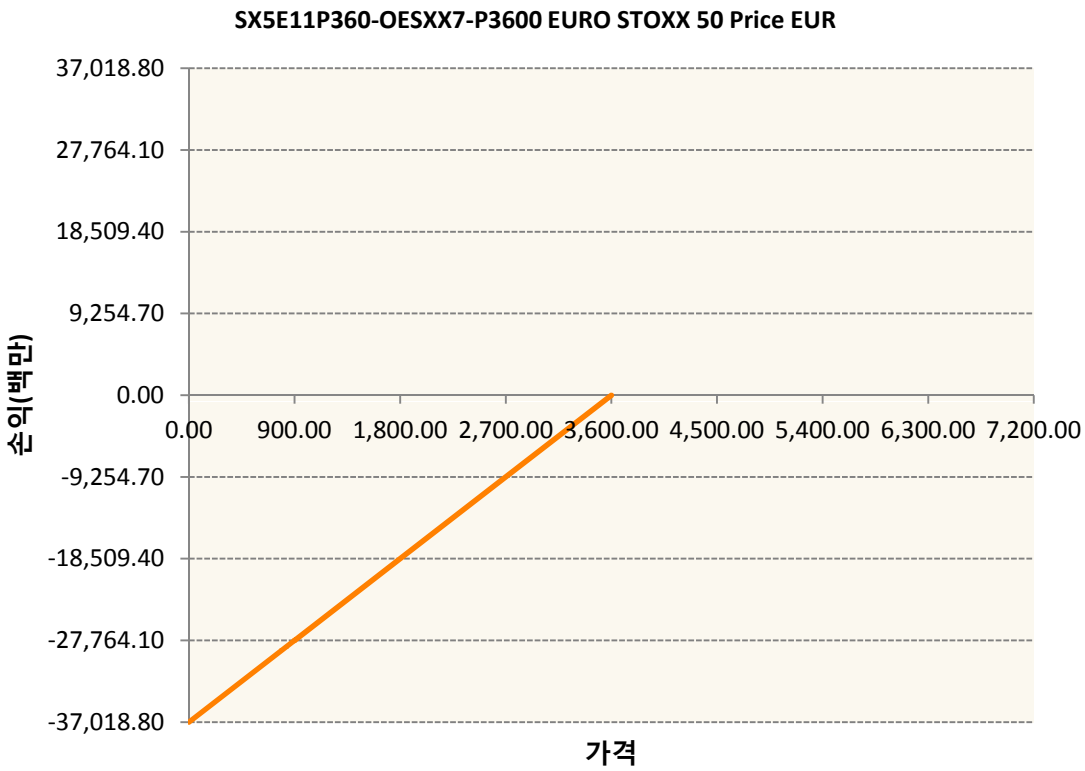
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	39,599	0	39,599	
누계	유가증권	옵션	0	93,076	-93,076	장내
누계	유가증권	ELS	97,502	0	97,502	장외

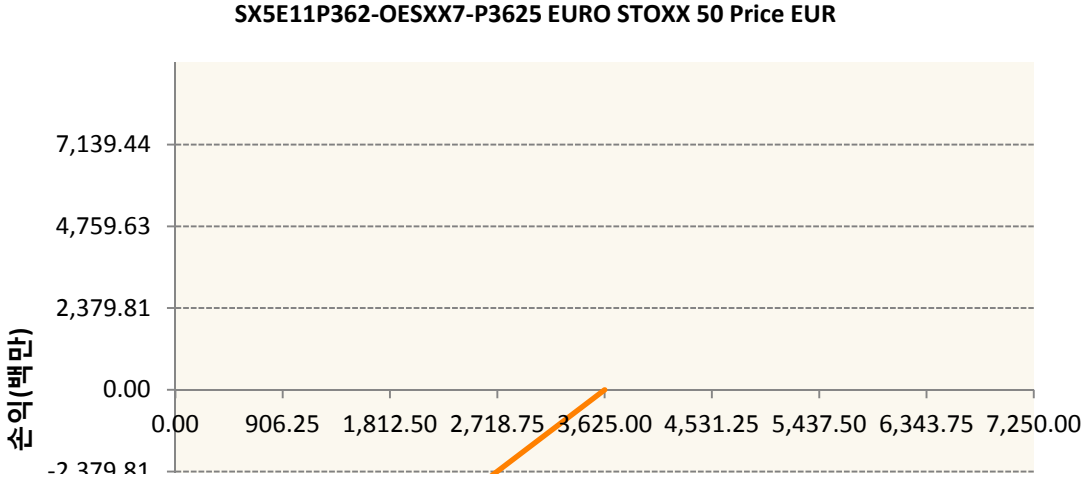
2. 만기시점의 손익구조

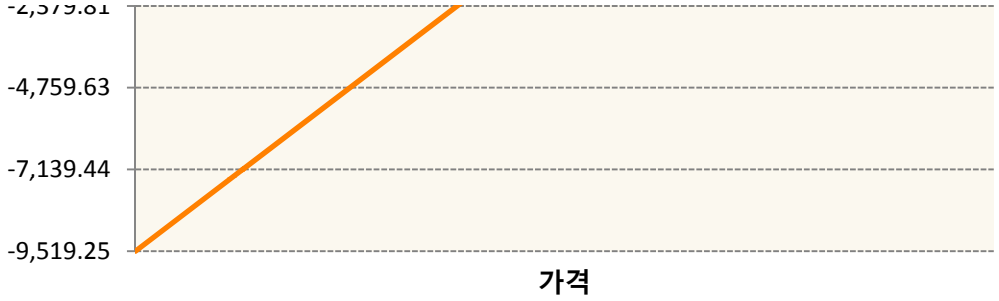


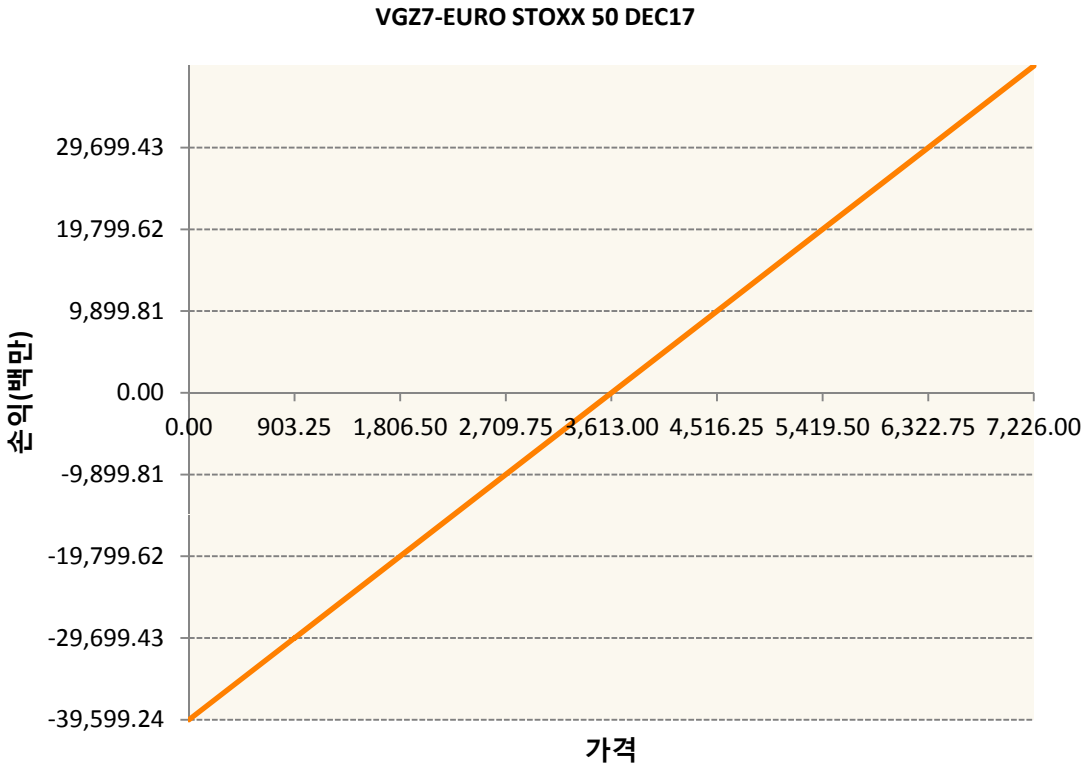



손익(백만)
0.00
-2,379.81
-4,759.63
-7,139.44
-9,519.25
0.00
906.25
1,812.50
2,718.75
3,625.00
4,531.25
5,437.50
6,343.75
7,250.00
가격


SX5E11P360-OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR
손익(백만)
37,018.80
27,764.10
18,509.40
9,254.70
0.00
-9,254.70
-18,509.40
-27,764.10
-37,018.80
0.00
900.00
1,800.00
2,700.00
3,600.00
4,500.00
5,400.00
6,300.00
7,200.00
가격


SX5E11P362-OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR
손익(백만)
7,139.44
4,759.63
2,379.81
0.00
0.00
906.25
1,812.50
2,718.75
3,625.00
4,531.25
5,437.50
6,343.75
7,250.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	30
SX5E11C360	OESXX7-C3600 EURO STOXX 50 Price EUR	2,962
SX5E11C362	OESXX7-C3625 EURO STOXX 50 Price EUR	762
SX5E11P360	OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR	2,962
SX5E11P362	OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR	762
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,168

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7,720

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

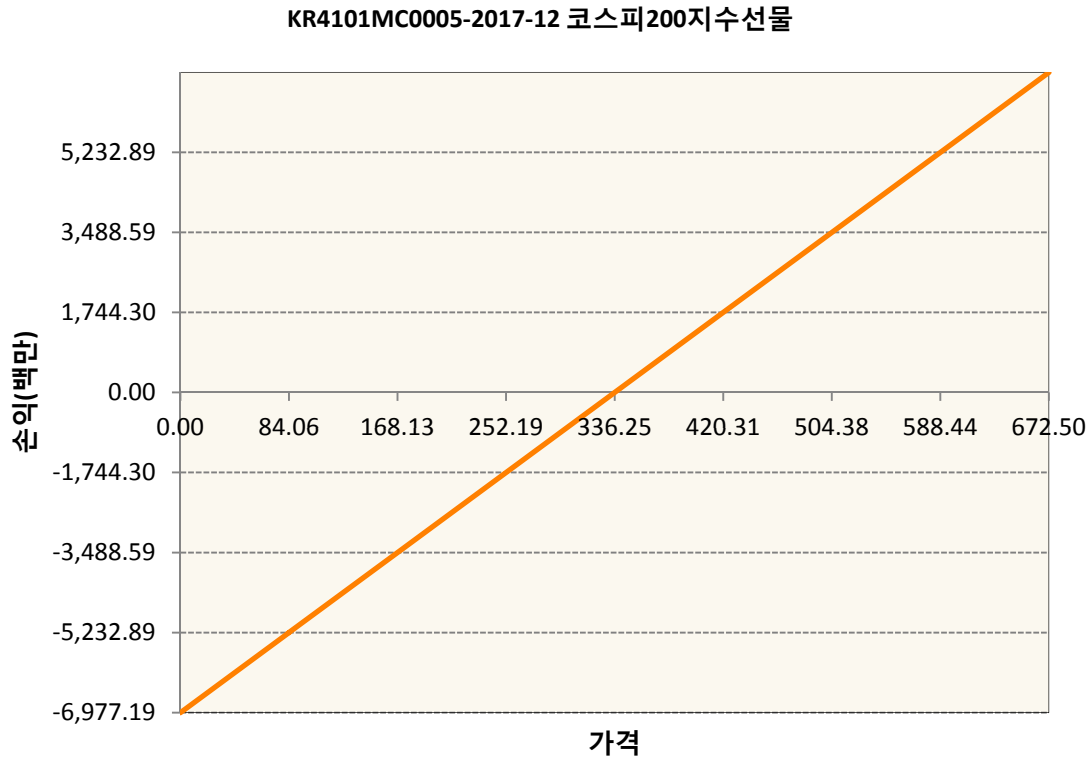
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,977	0	6,977	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물	558

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-558	-558	-558	-558	-558	-558	-558
-5.33%	-372	-372	-372	-372	-372	-372	-372
-2.67%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	186	186	186	186	186	186	186
5.33%	372	372	372	372	372	372	372
8.00%	558	558	558	558	558	558	558

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

336

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

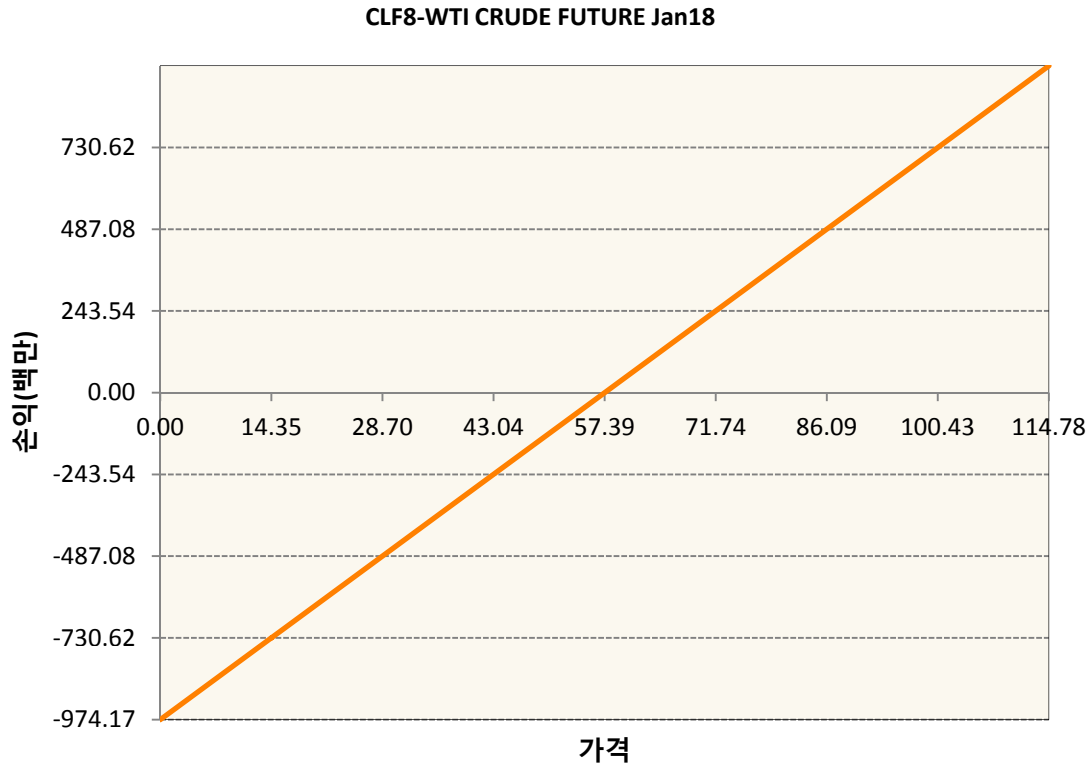
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

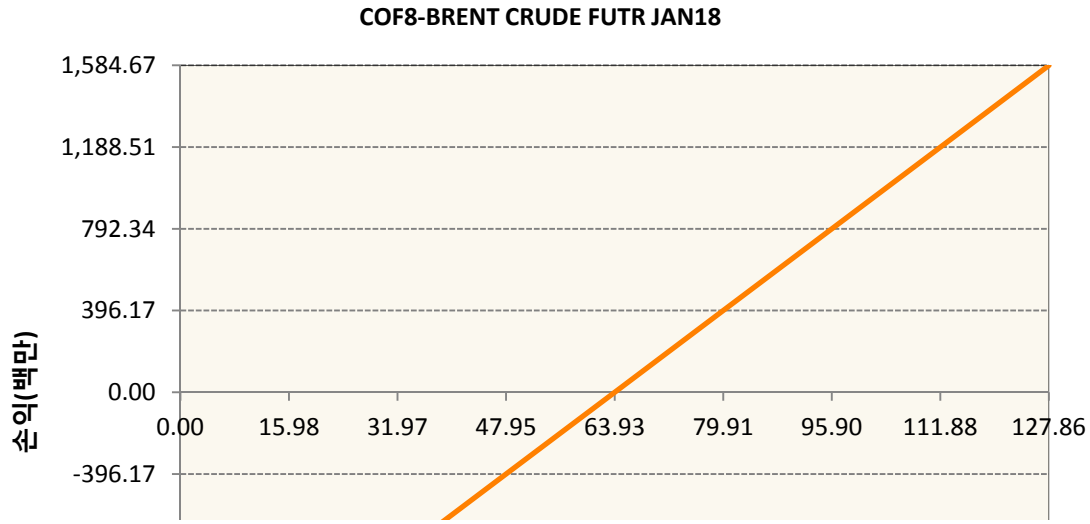
1. 계약금액

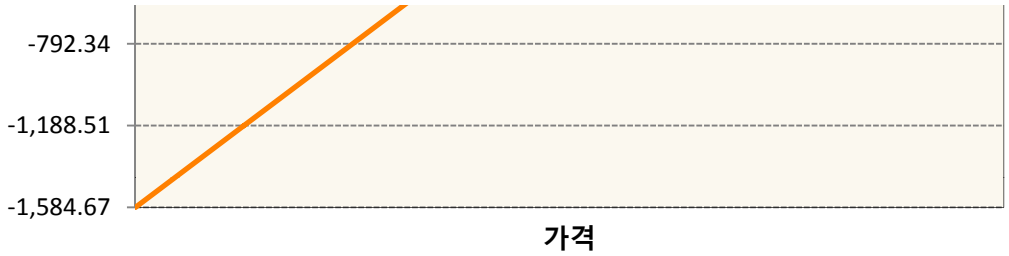
(단위:백만원)

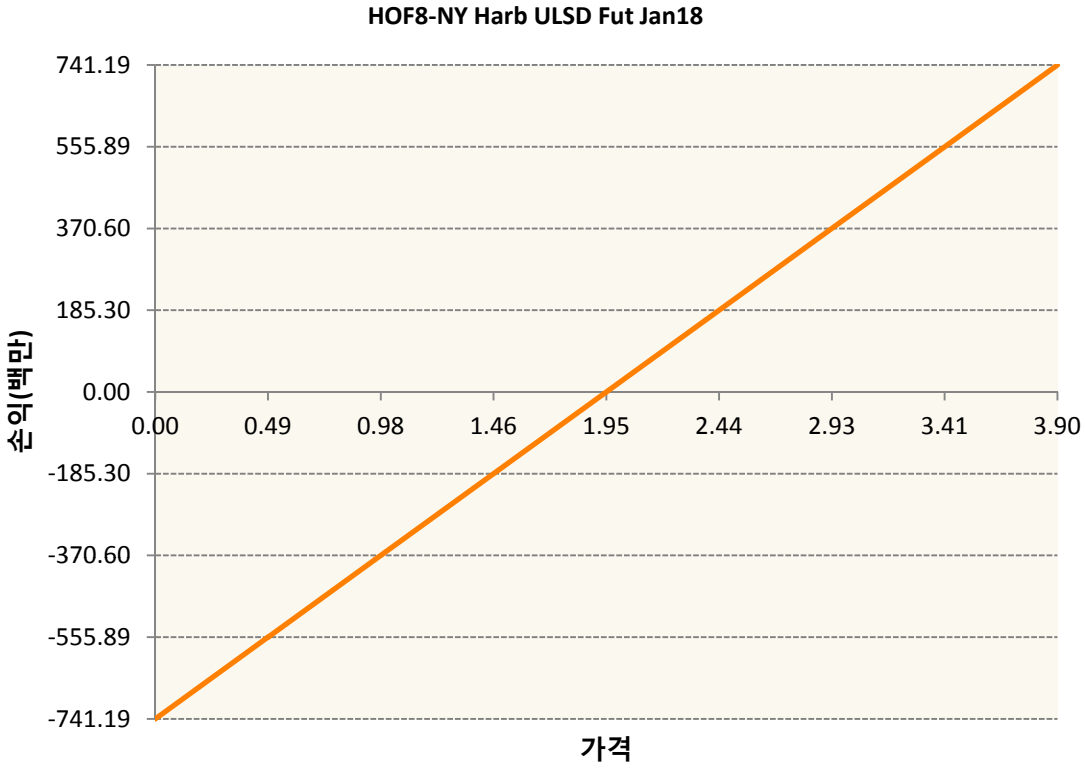
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,489	894	4,595	

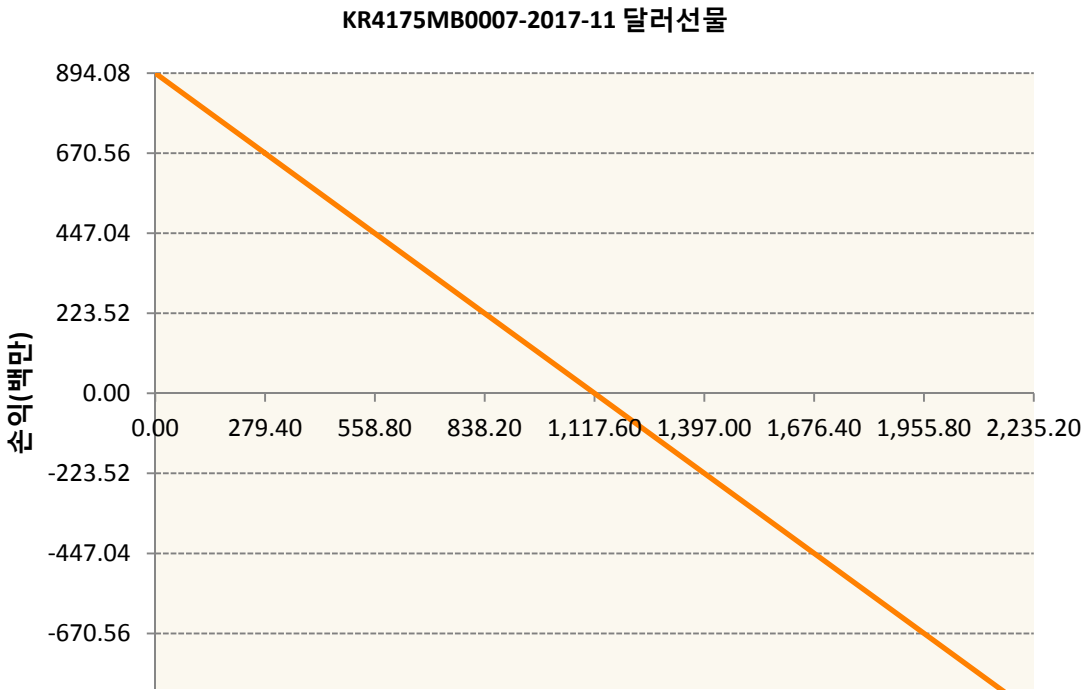
2. 만기시점의 손익구조

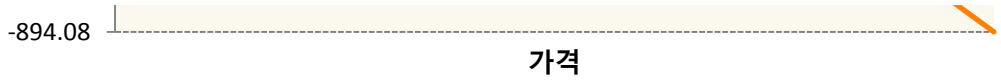


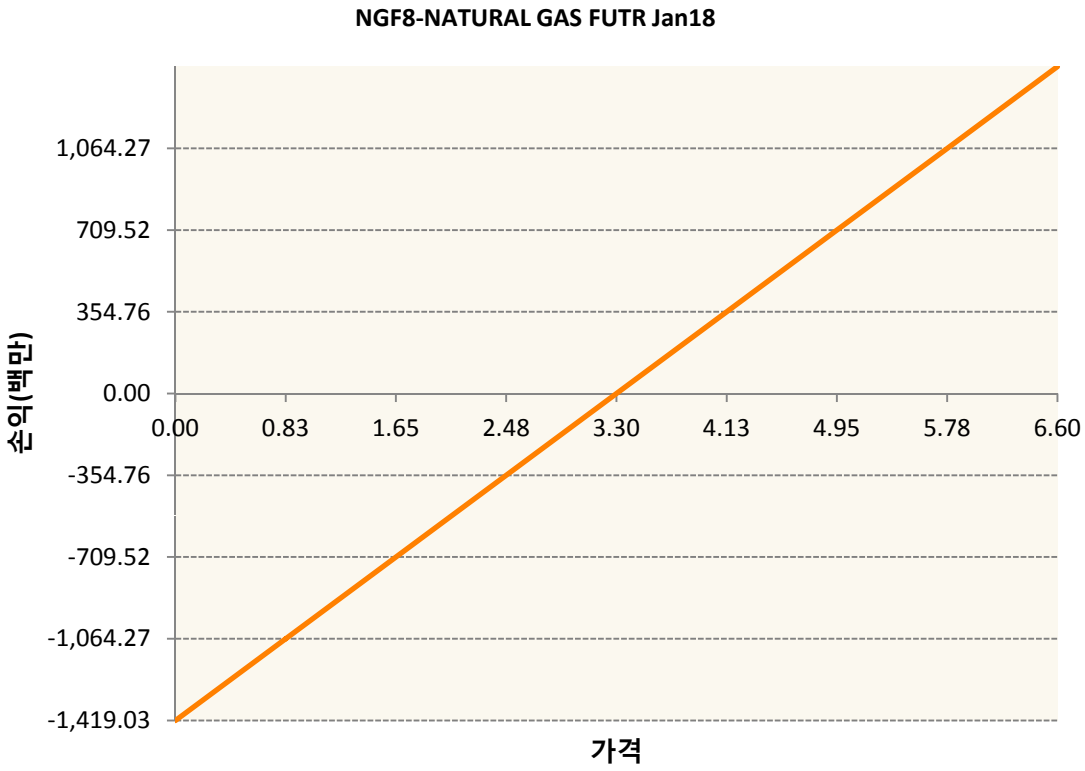


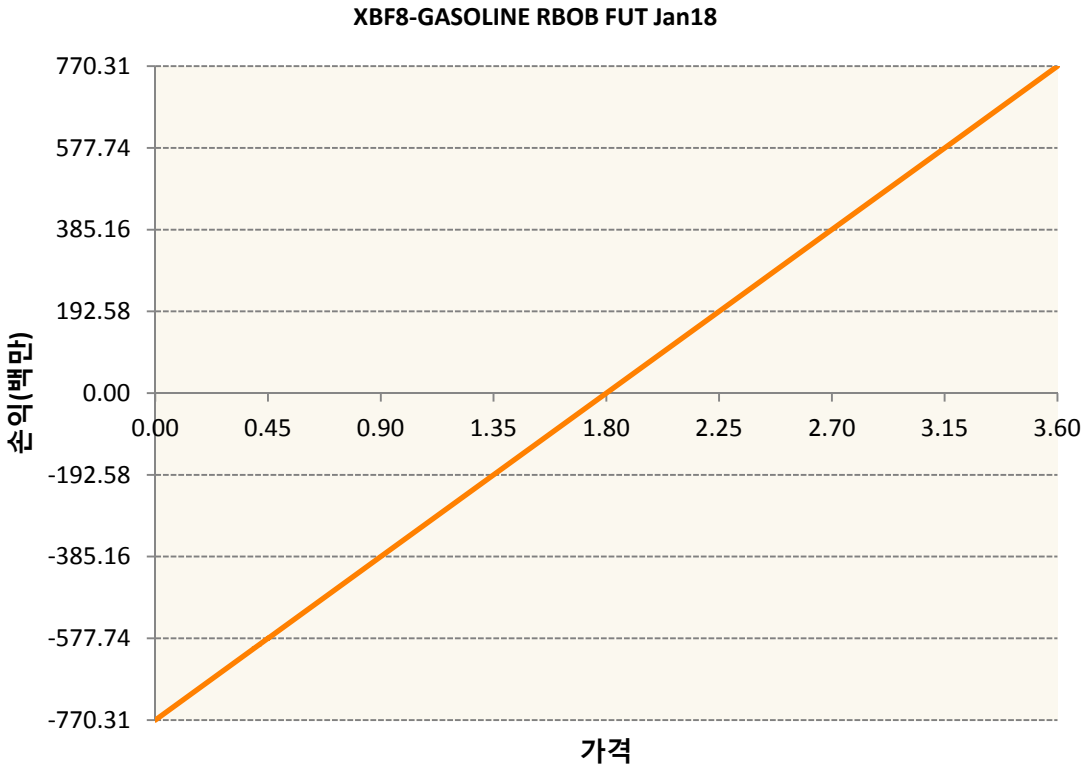

-792.34
-1,188.51
-1,584.67
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
741.19
555.89
370.60
185.30
0.00
-185.30
-370.60
-555.89
-741.19
0.00
0.49
0.98
1.46
1.95
2.44
2.93
3.41
3.90
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
894.08
670.56
447.04
223.52
0.00
-223.52
-447.04
-670.56
0.00
279.40
558.80
838.20
1,117.60
1,397.00
1,676.40
1,955.80
2,235.20
손익(백만)


-894.08
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
손익(백만)
1,064.27
709.52
354.76
0.00
-354.76
-709.52
-1,064.27
-1,419.03
0.00
0.83
1.65
2.48
3.30
4.13
4.95
5.78
6.60
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
손익(백만)
770.31
577.74
385.16
192.58
0.00
-192.58
-385.16
-577.74
-770.31
0.00
0.45
0.90
1.35
1.80
2.25
2.70
3.15
3.60
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	78
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	127
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	114
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	62

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

775

공시일	2017-11-13
기준일	2017-11-10

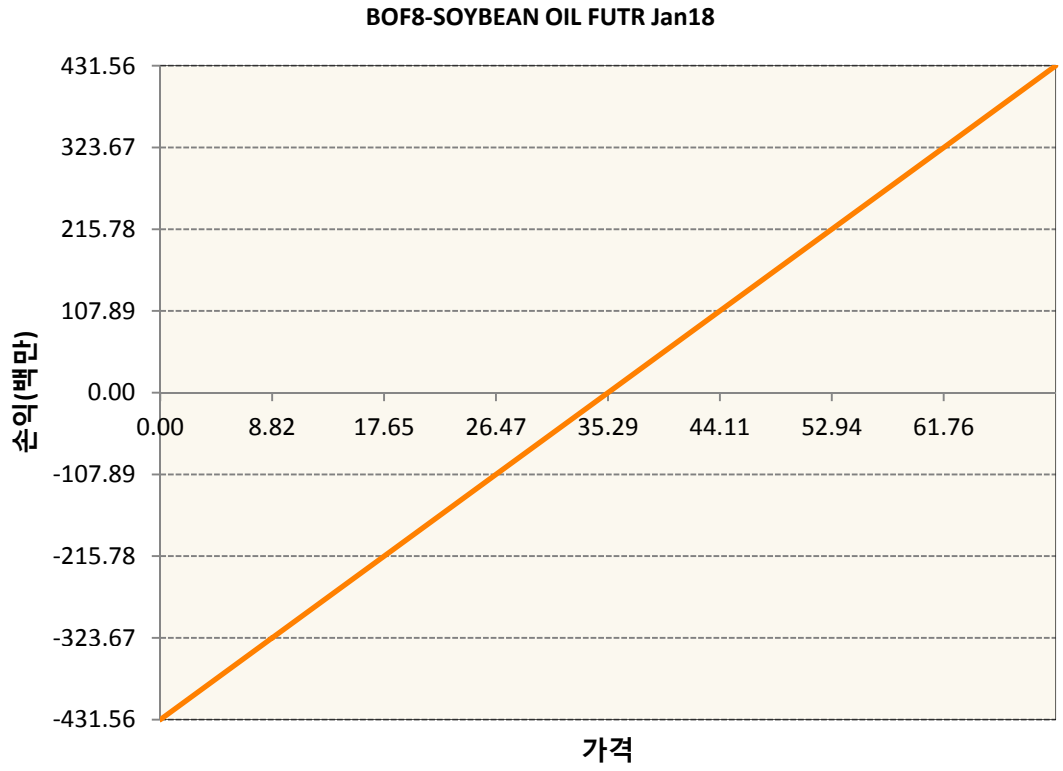
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

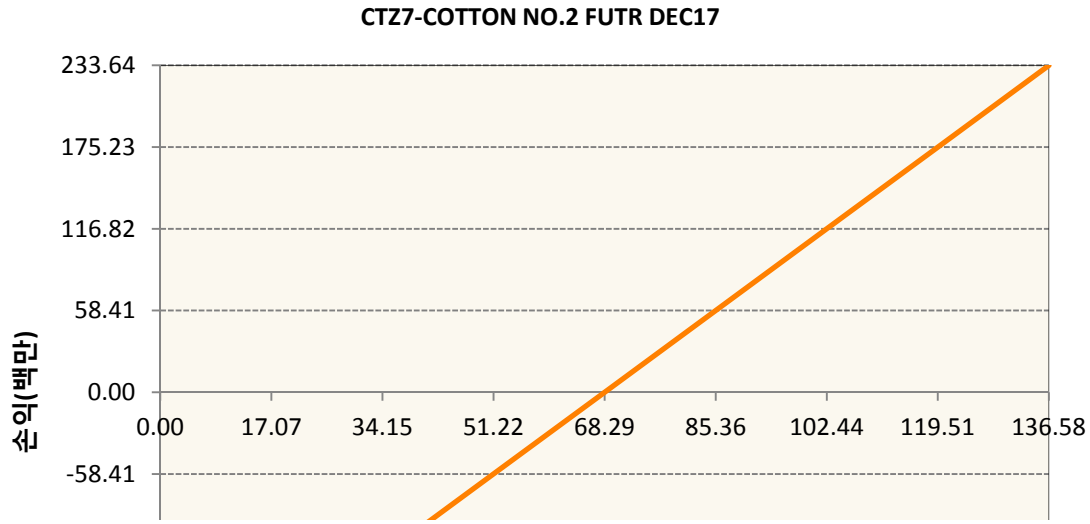
1. 계약금액

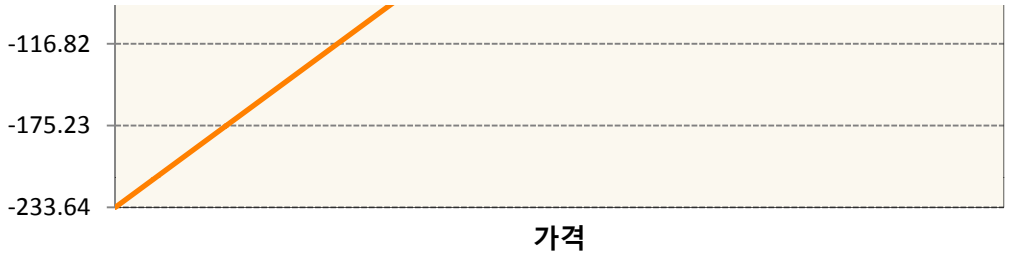
(단위:백만원)

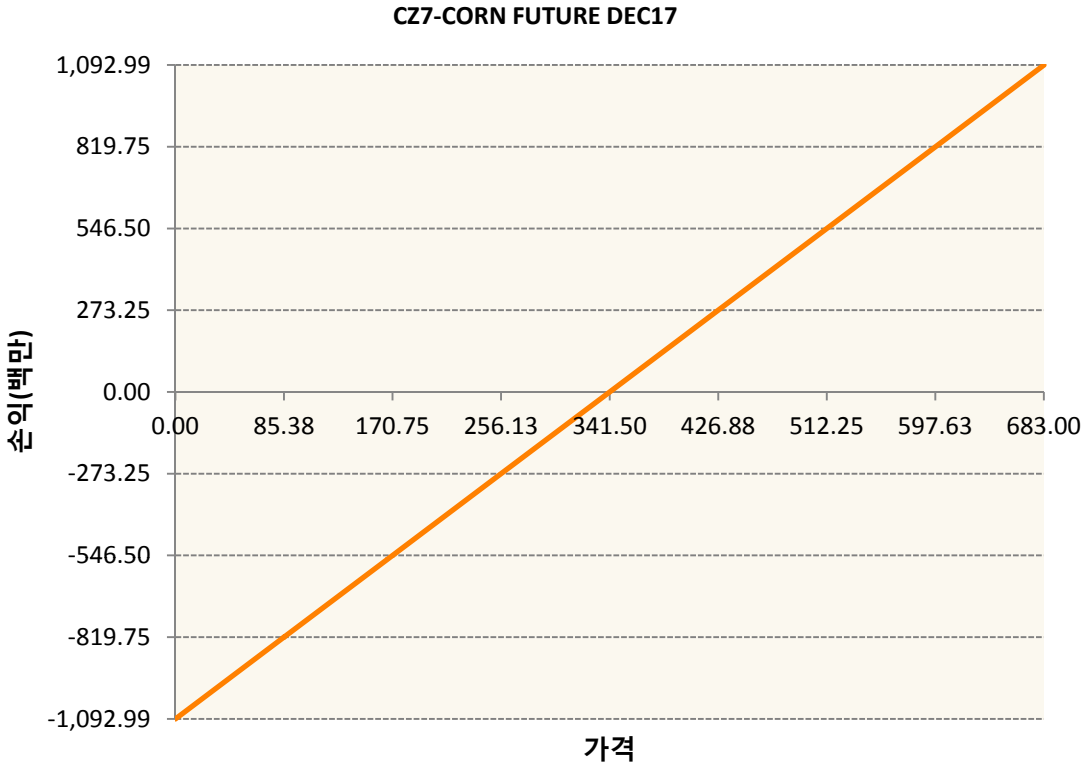
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,550	335	4,214	

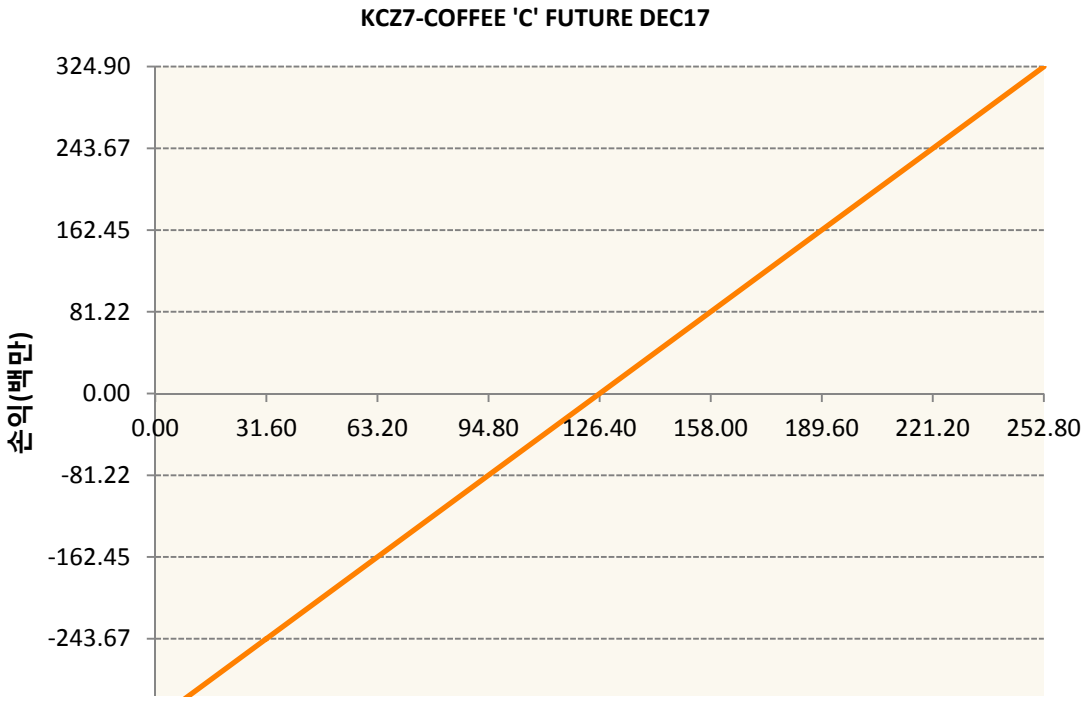
2. 만기시점의 손익구조

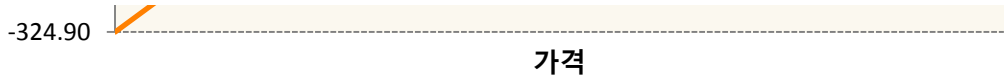


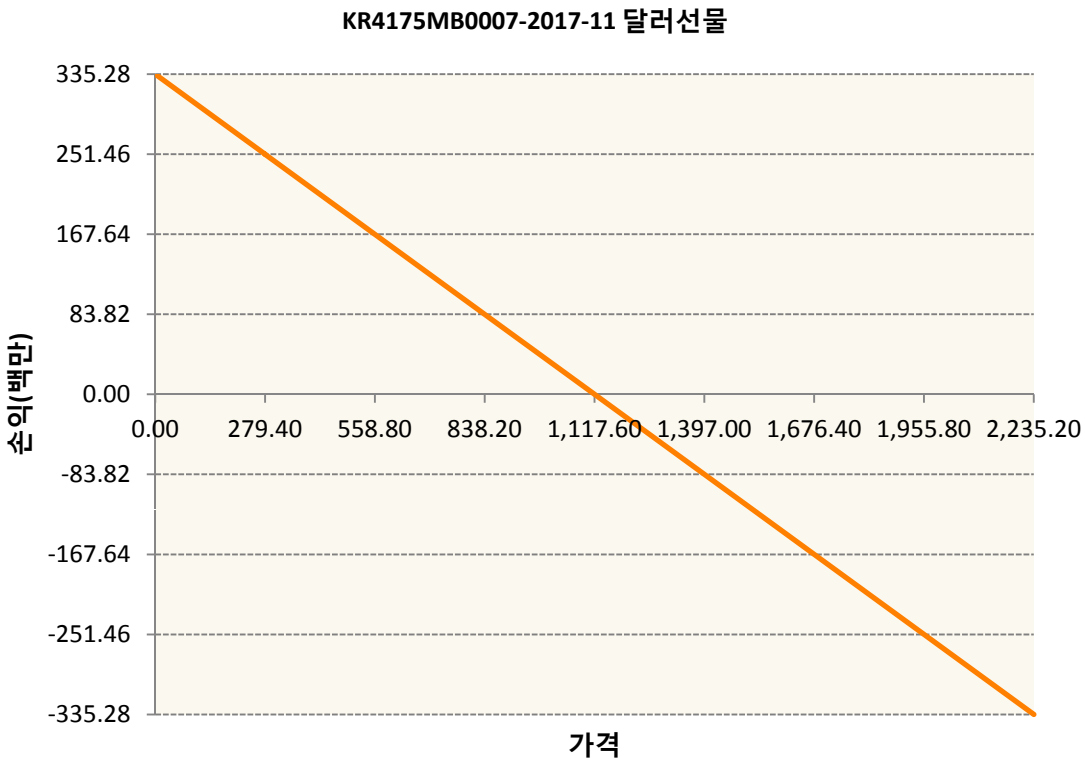


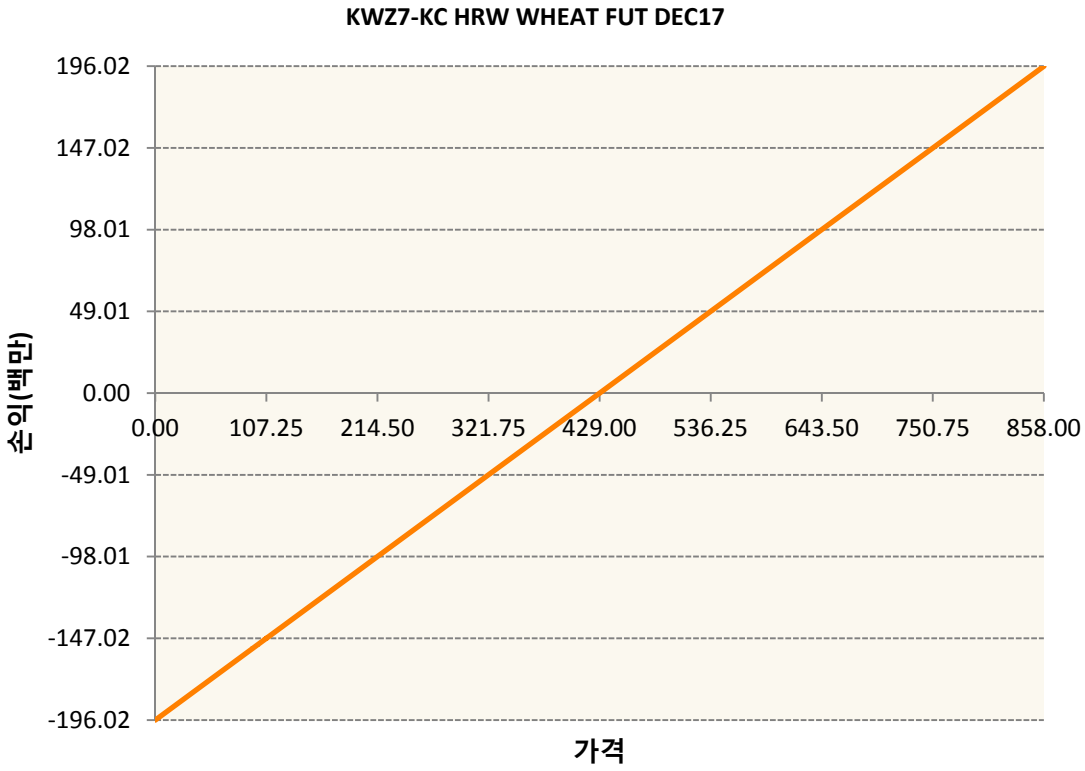

-116.82
-175.23
-233.64
가격

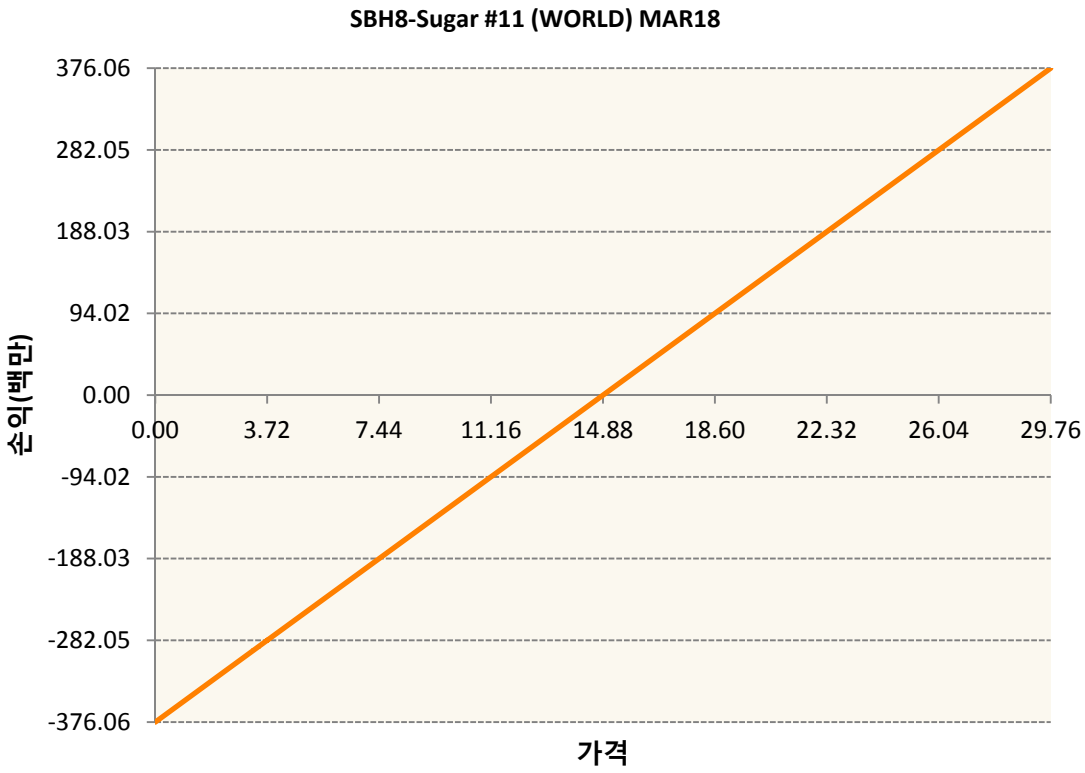

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,092.99
819.75
546.50
273.25
0.00
-273.25
-546.50
-819.75
-1,092.99
0.00
85.38
170.75
256.13
341.50
426.88
512.25
597.63
683.00
손익(백만)
가격

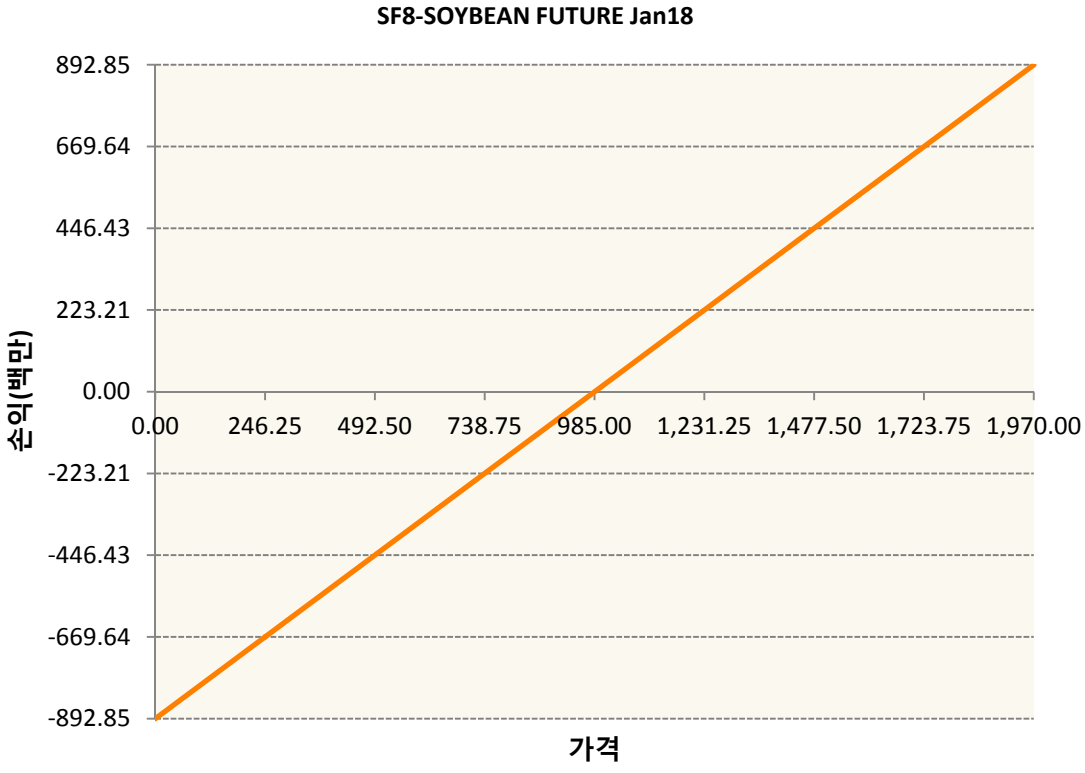

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
324.90
243.67
162.45
81.22
0.00
-81.22
-162.45
-243.67
0.00
31.60
63.20
94.80
126.40
158.00
189.60
221.20
252.80
손익(백만)


-324.90
가격

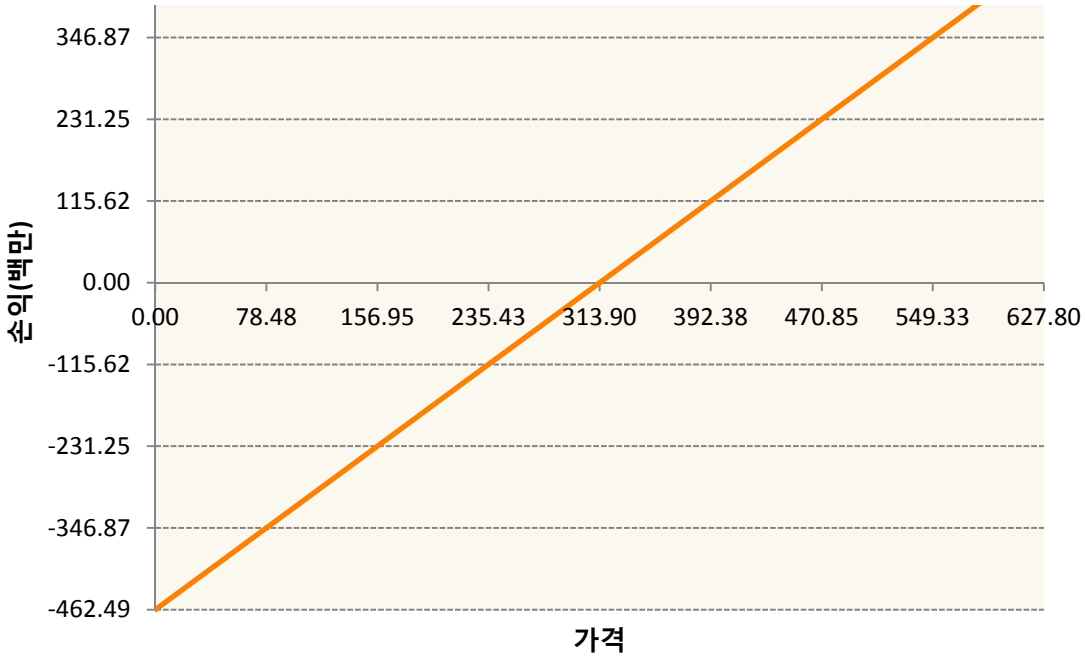

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
335.28
251.46
167.64
83.82
0.00
-83.82
-167.64
-251.46
-335.28
0.00
279.40
558.80
838.20
1,117.60
1,397.00
1,676.40
1,955.80
2,235.20
손익(백만)
가격

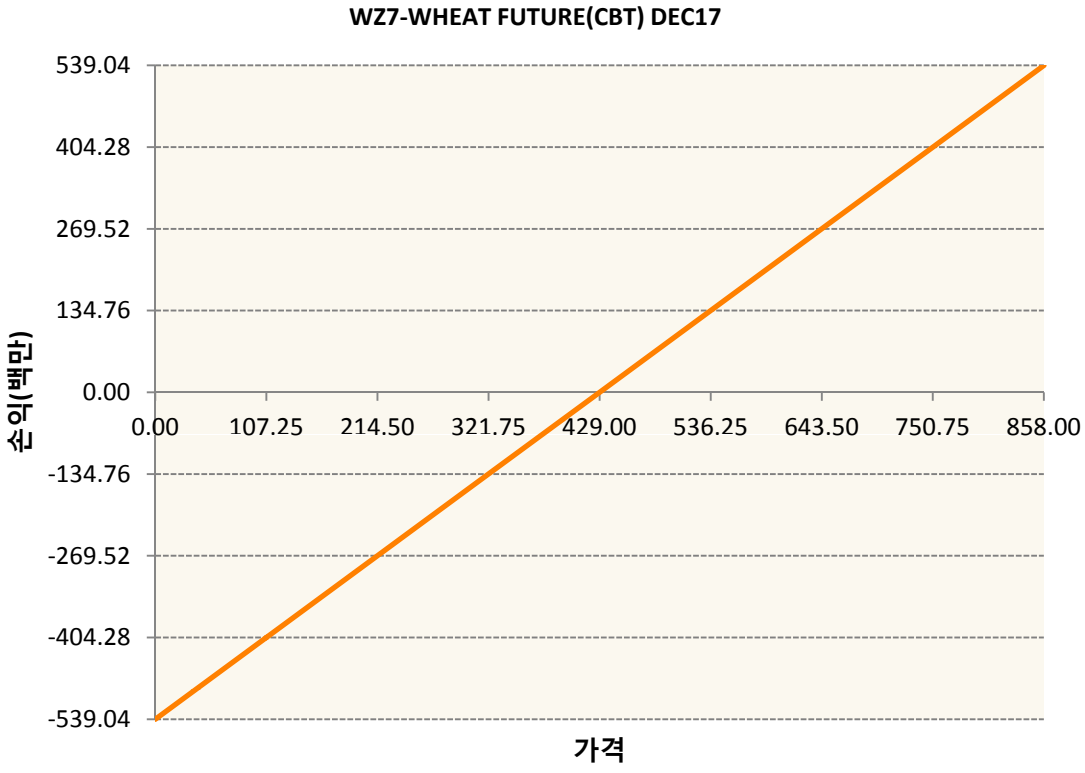

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
196.02
147.02
98.01
49.01
0.00
-49.01
-98.01
-147.02
-196.02
0.00
107.25
214.50
321.75
429.00
536.25
643.50
750.75
858.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
376.06
282.05
188.03
94.02
0.00
-94.02
-188.03
-282.05
-376.06
0.00
3.72
7.44
11.16
14.88
18.60
22.32
26.04
29.76
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
892.85
669.64
446.43
223.21
0.00
-223.21
-446.43
-669.64
-892.85
0.00
246.25
492.50
738.75
985.00
1,231.25
1,477.50
1,723.75
1,970.00
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
462.49





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	35
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	19
CZ7	CORN FUTURE DEC17	87
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	71
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	37
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	43

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

410