공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

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	2017-11-14
기준일	2017-11-13

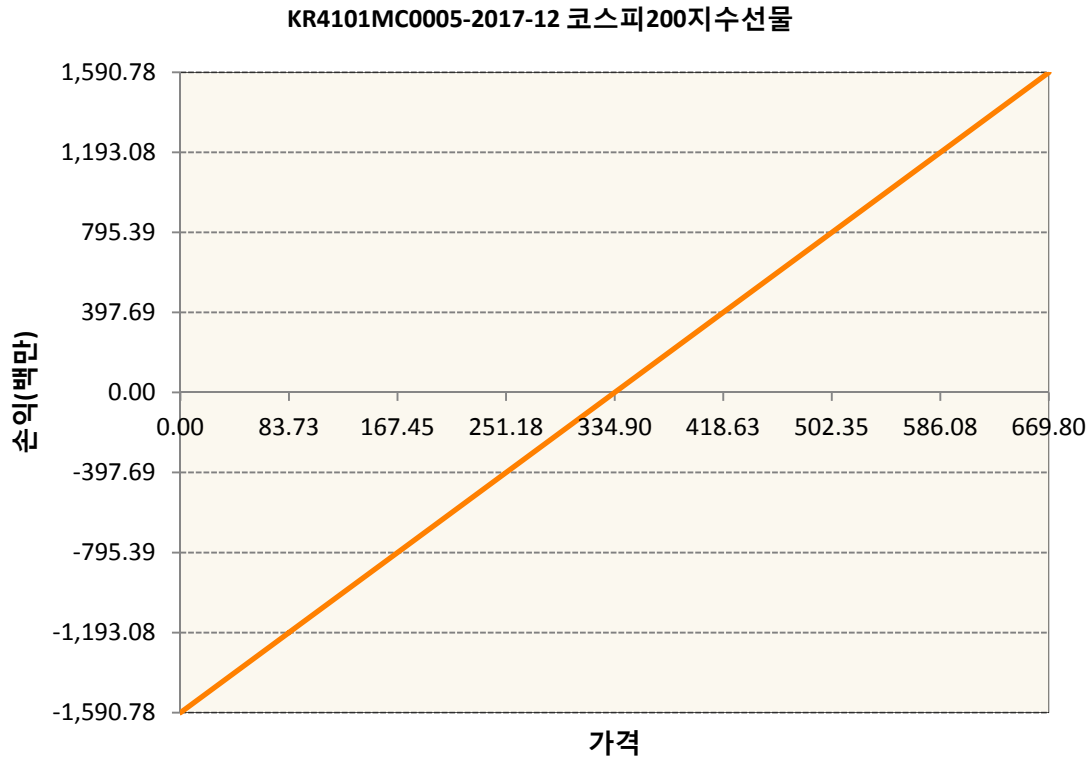
스마트인덱스모

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	1,591	0	1,591	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						127
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	127	127	127	127	127	127	127

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

76

공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

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	1,067

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

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	424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

373

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

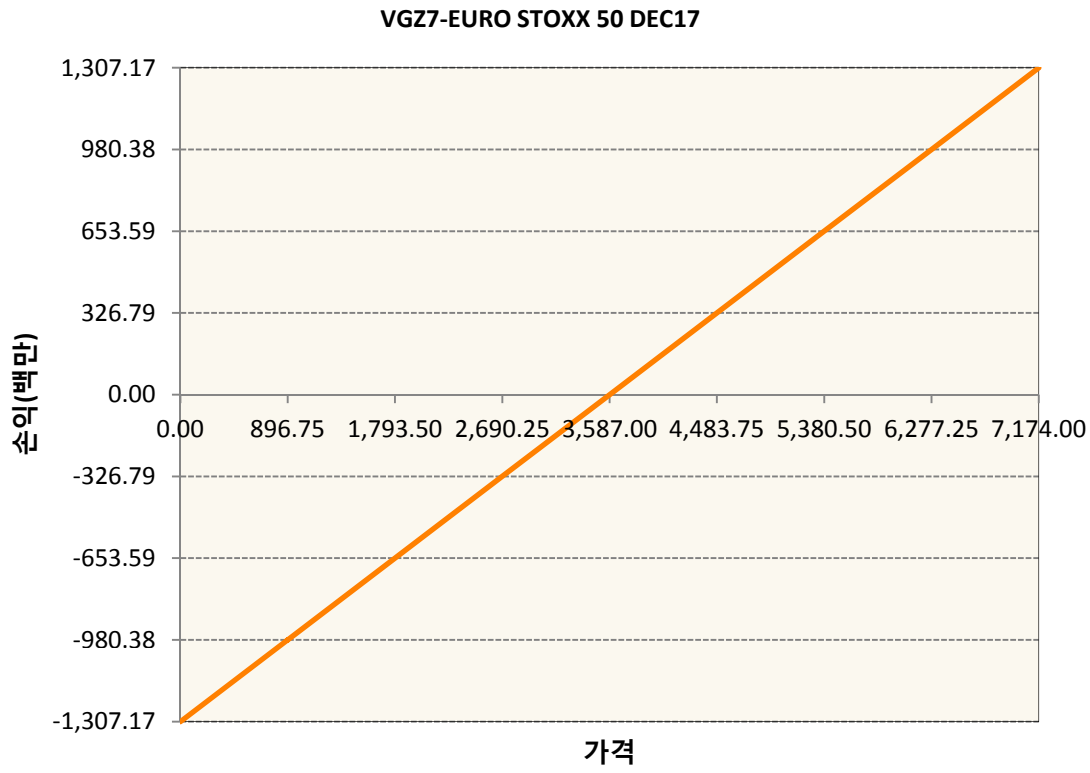
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,307	0	1,307	

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	2017-11-14
기준일	2017-11-13

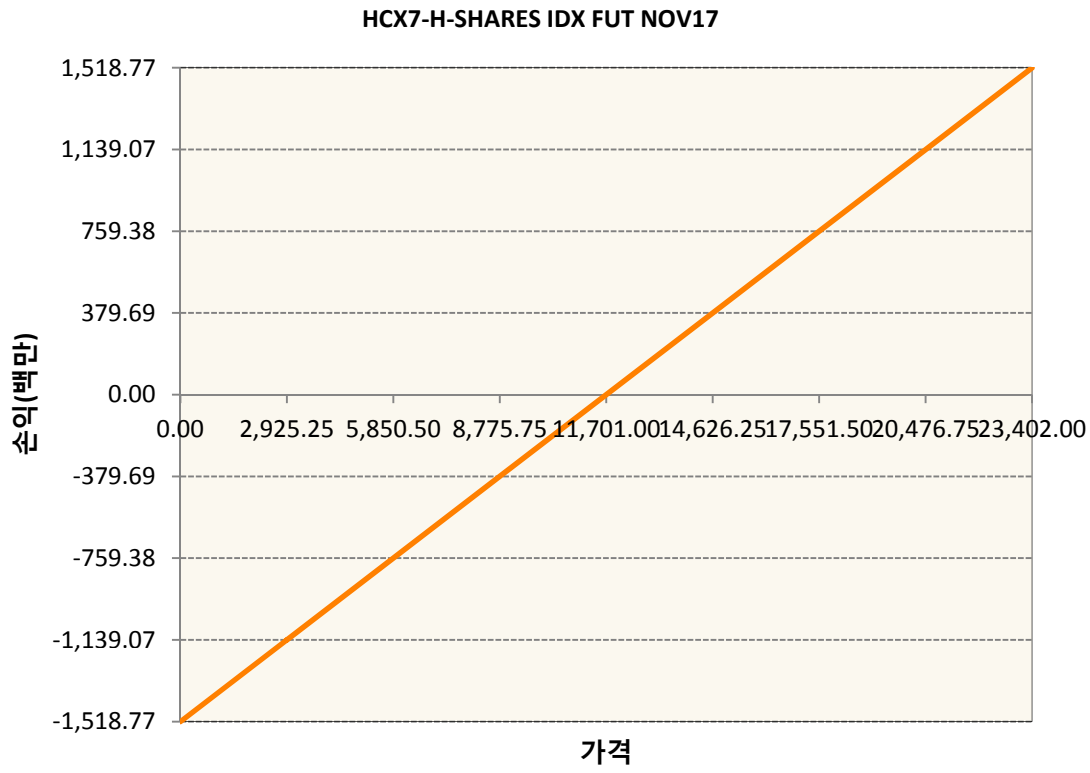
차이나인덱스모(주식-파생형)

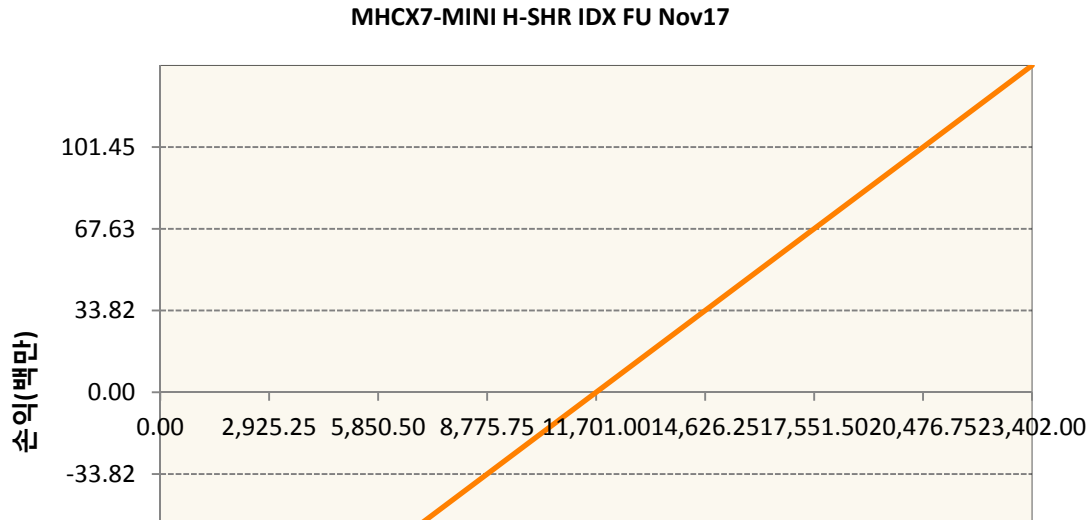
1. 계약금액

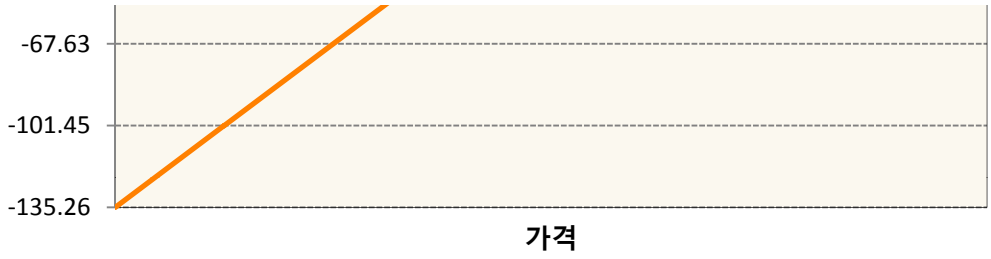
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,654	0	1,654	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	2017-11-14
기준일	2017-11-13

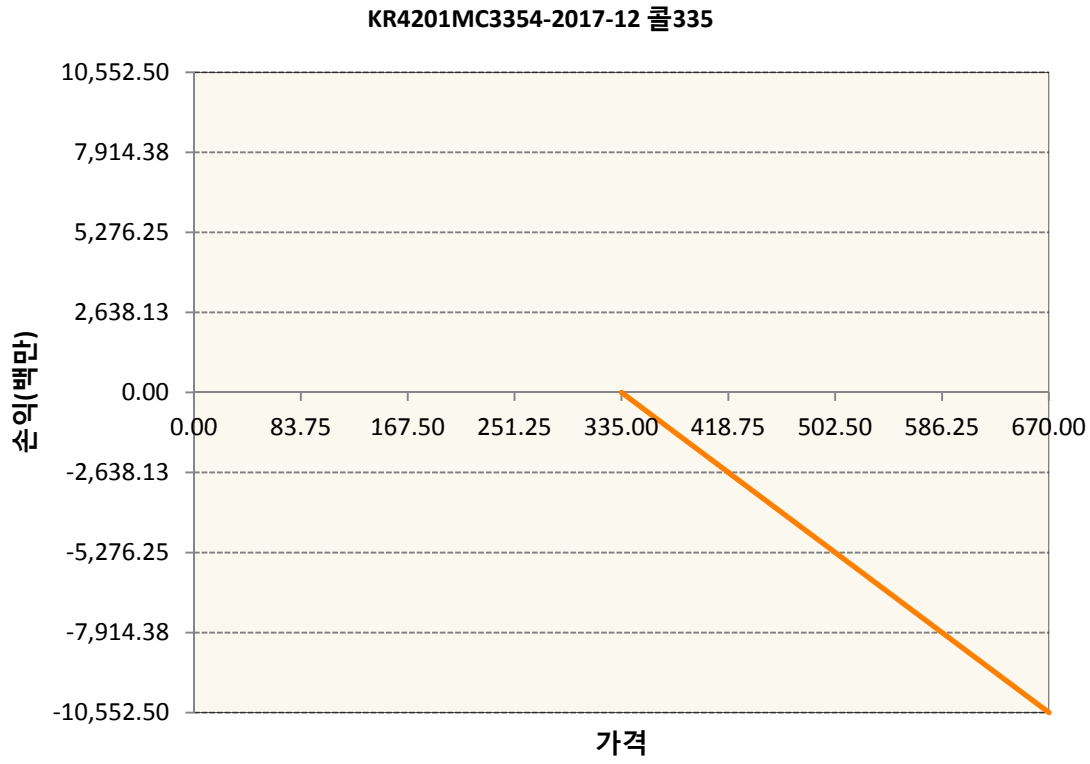
커버드콜모(주식혼합-파생형)

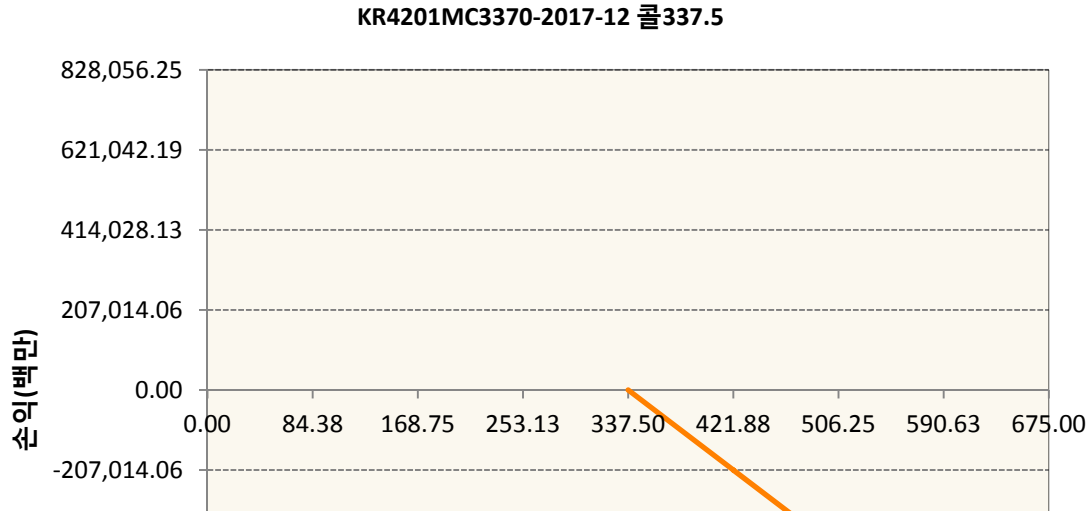
1. 계약금액

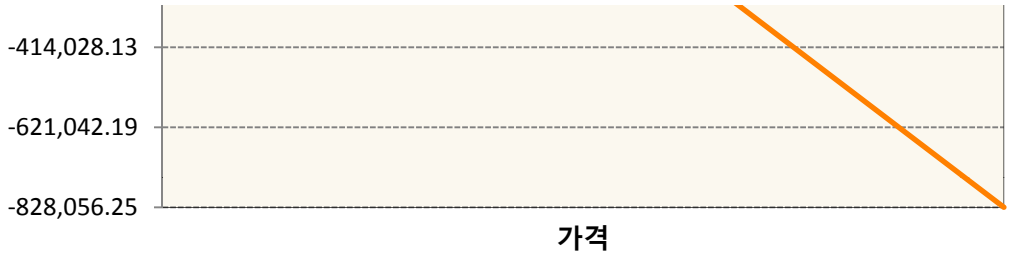
(단위:백만원)

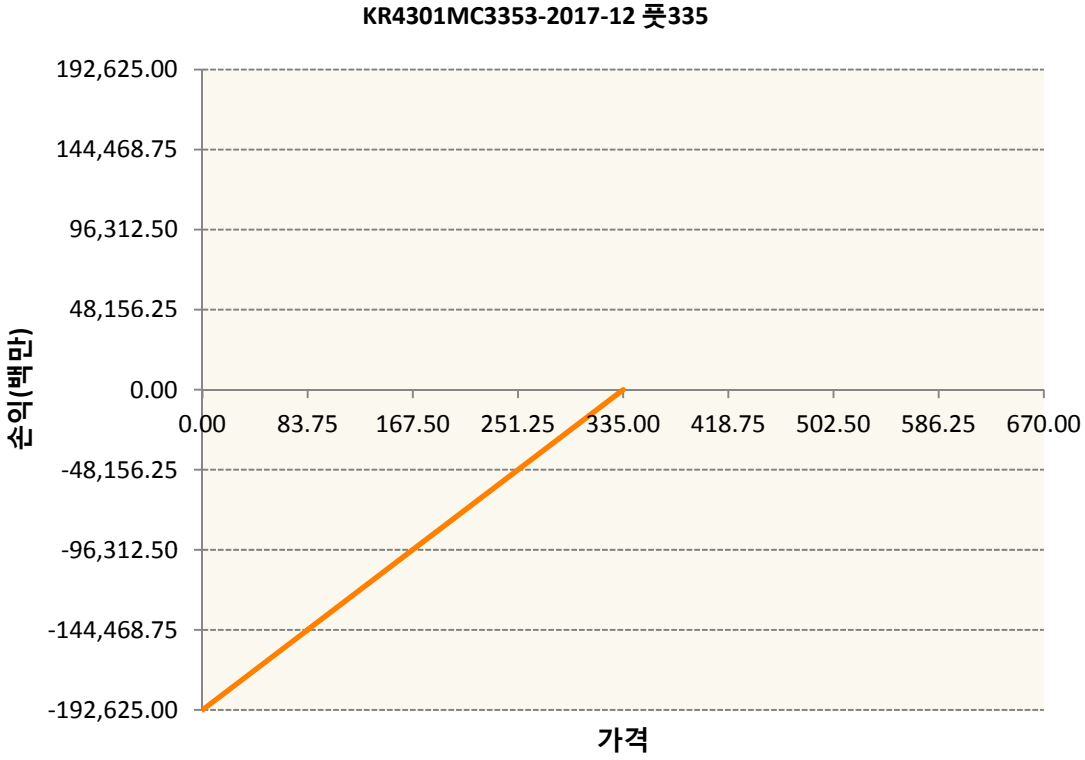
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

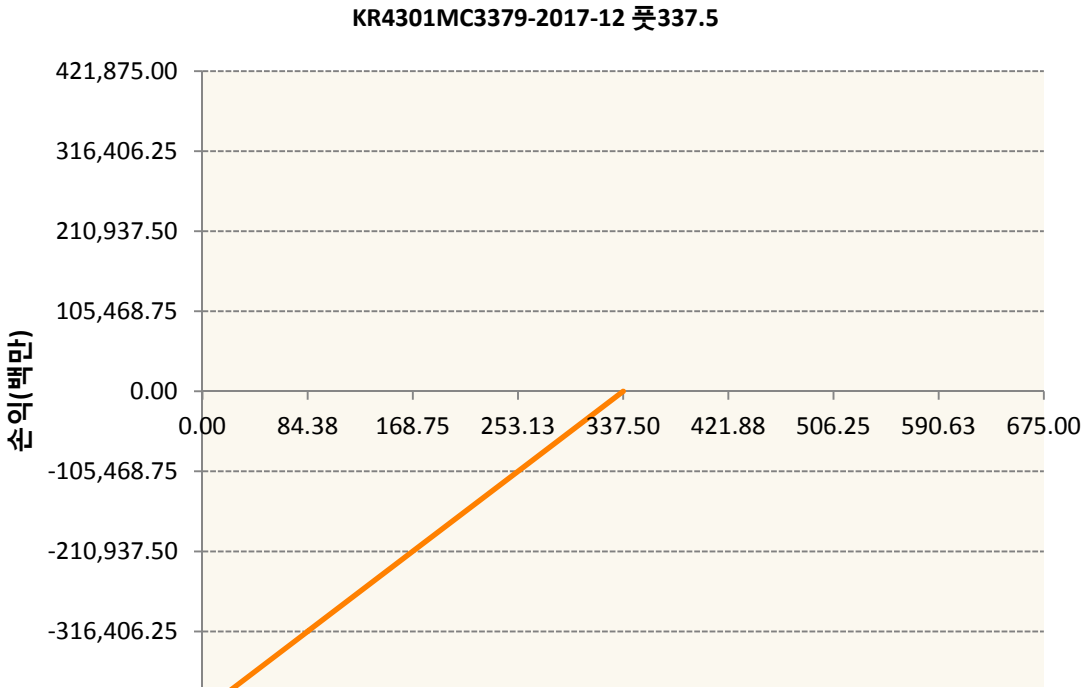
2. 만기시점의 손익구조






-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							641
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	281	273	263	252	239	225	210
-5.33%	252	237	220	203	184	165	145
-2.67%	188	166	144	121	98	75	51
0%	76	50	25	0	-25	-50	-76
2.67%	-91	-114	-138	-162	-186	-211	-235
5.33%	-305	-323	-341	-361	-382	-403	-425
8.00%	-552	-563	-576	-590	-606	-623	-641
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							48,004
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,361	18,852	18,206	17,434	16,548	15,561	14,484
-5.33%	17,600	16,575	15,427	14,176	12,840	11,434	9,969
-2.67%	13,499	11,907	10,256	8,559	6,826	5,065	3,281
0%	5,854	3,907	1,955	0	-1,957	-3,916	-5,877
2.67%	-5,963	-7,872	-9,797	-11,733	-13,679	-15,632	-17,590
5.33%	-21,662	-23,188	-24,794	-26,462	-28,181	-29,940	-31,732
8.00%	-40,266	-41,276	-42,424	-43,688	-45,049	-46,492	-48,004
KR4301MC3. 2017-12 풋335							12,954
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,884	-12,885	-12,889	-12,897	-12,909	-12,928	-12,954
-5.33%	-7,787	-7,811	-7,848	-7,897	-7,959	-8,032	-8,117
-2.67%	-2,969	-3,093	-3,230	-3,378	-3,535	-3,699	-3,870
0%	657	438	219	0	-219	-438	-658
2.67%	2,341	2,194	2,035	1,868	1,693	1,511	1,325
5.33%	2,745	2,704	2,649	2,579	2,495	2,399	2,291
8.00%	2,791	2,786	2,776	2,759	2,734	2,700	2,656
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							29,448
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29,353	-29,354	-29,358	-29,367	-29,384	-29,410	-29,448
-5.33%	-18,243	-18,273	-18,322	-18,393	-18,487	-18,606	-18,748
-2.67%	-7,479	-7,674	-7,904	-8,162	-8,446	-8,751	-9,074
0%	1,371	918	461	0	-464	-929	-1,397
2.67%	6,201	5,804	5,393	4,970	4,539	4,100	3,655

5.33%	7,627	7,485	7,308	7,098	6,858	6,593	6,305
8.00%	7,833	7,810	7,771	7,712	7,630	7,524	7,393

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

93,784

공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

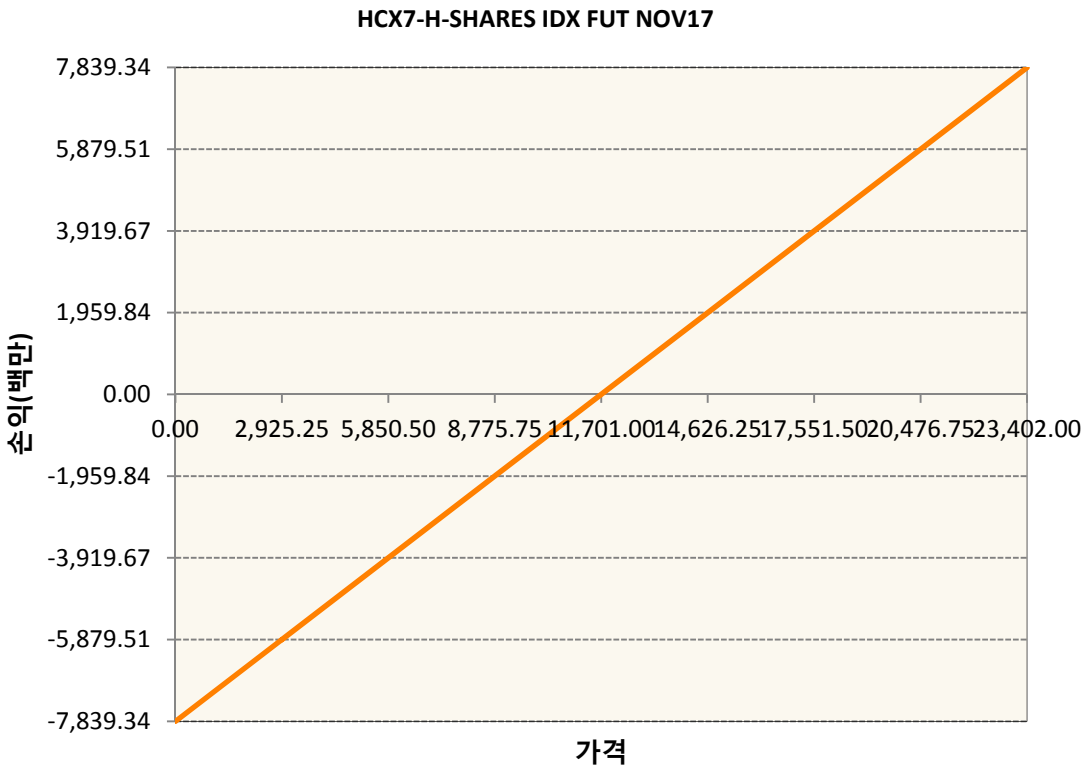
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

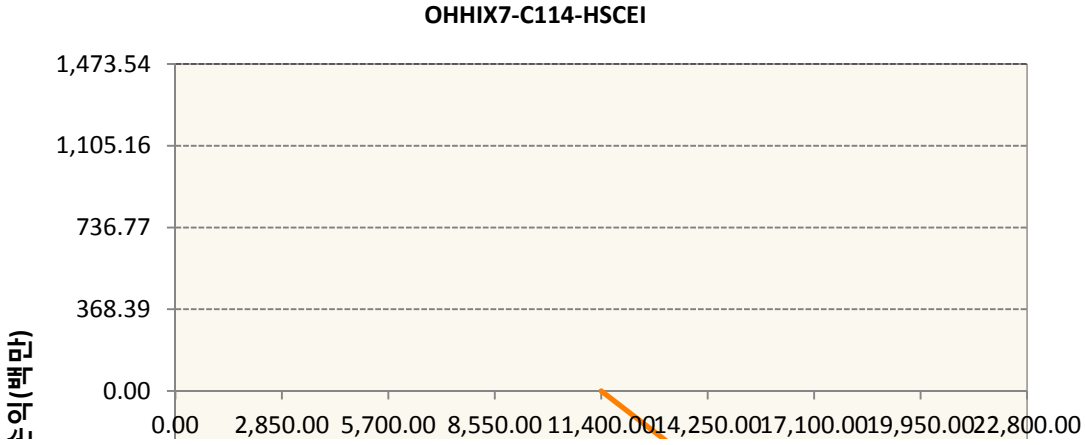
1. 계약금액

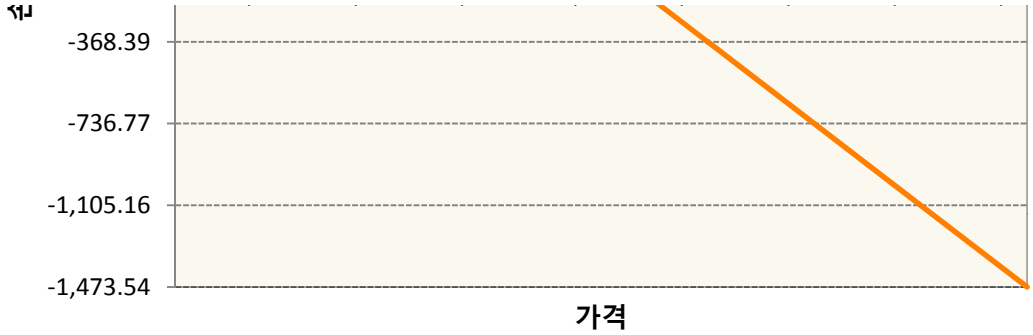
(단위:백만원)

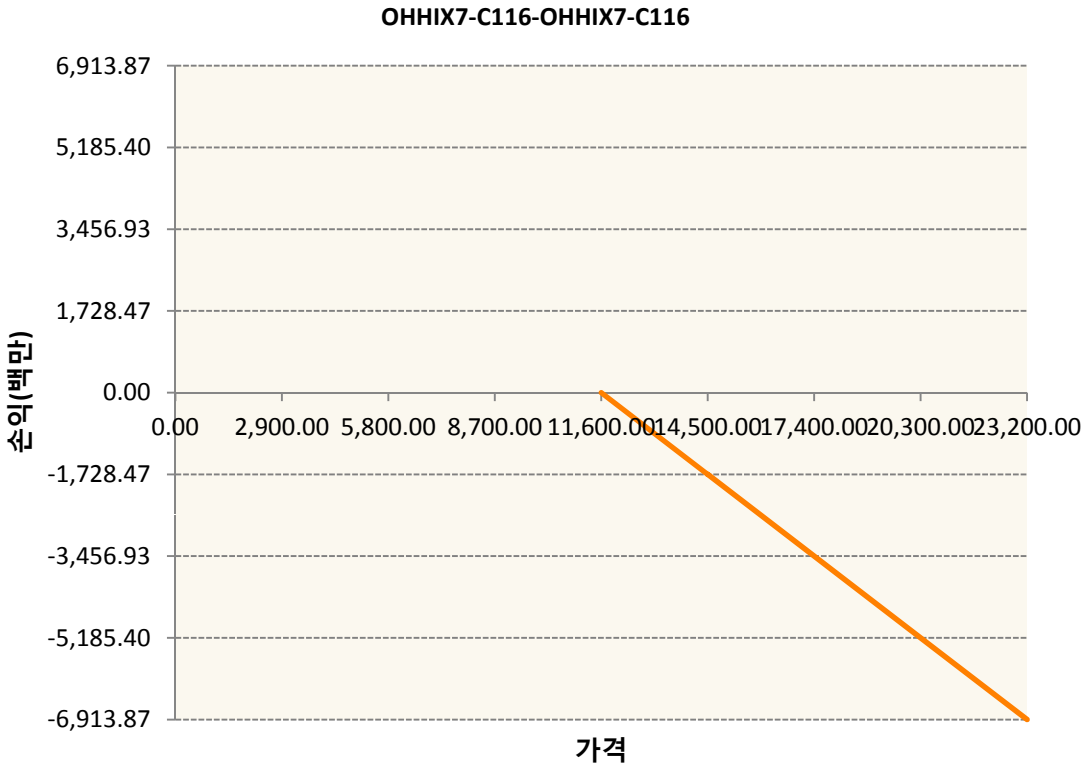
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,839	0	7,839	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,775	-16,775	장내

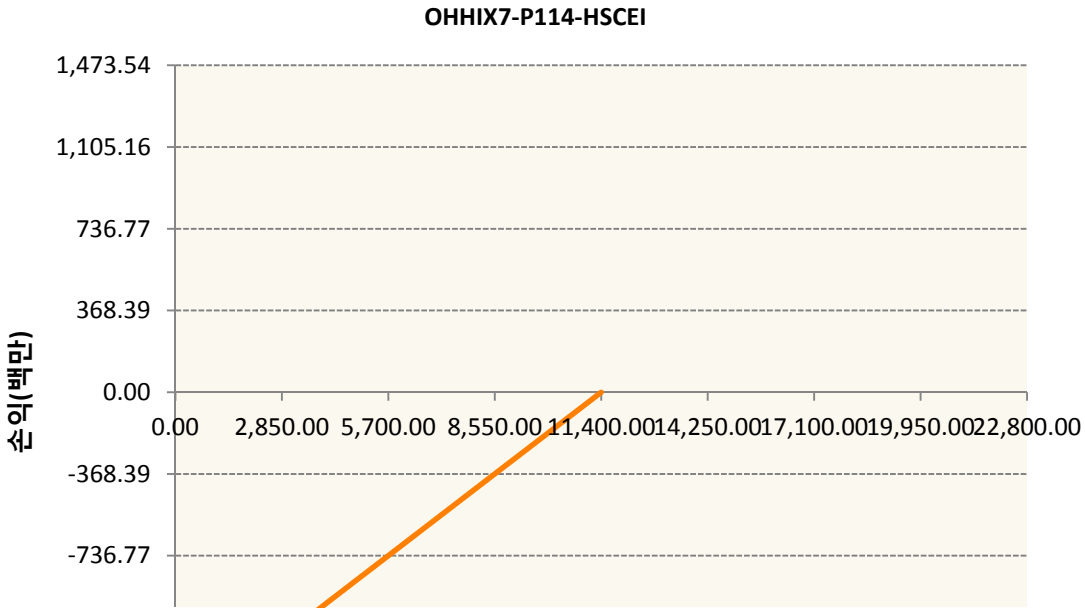
2. 만기시점의 손익구조

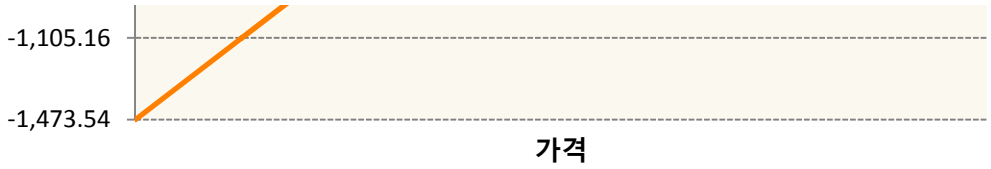


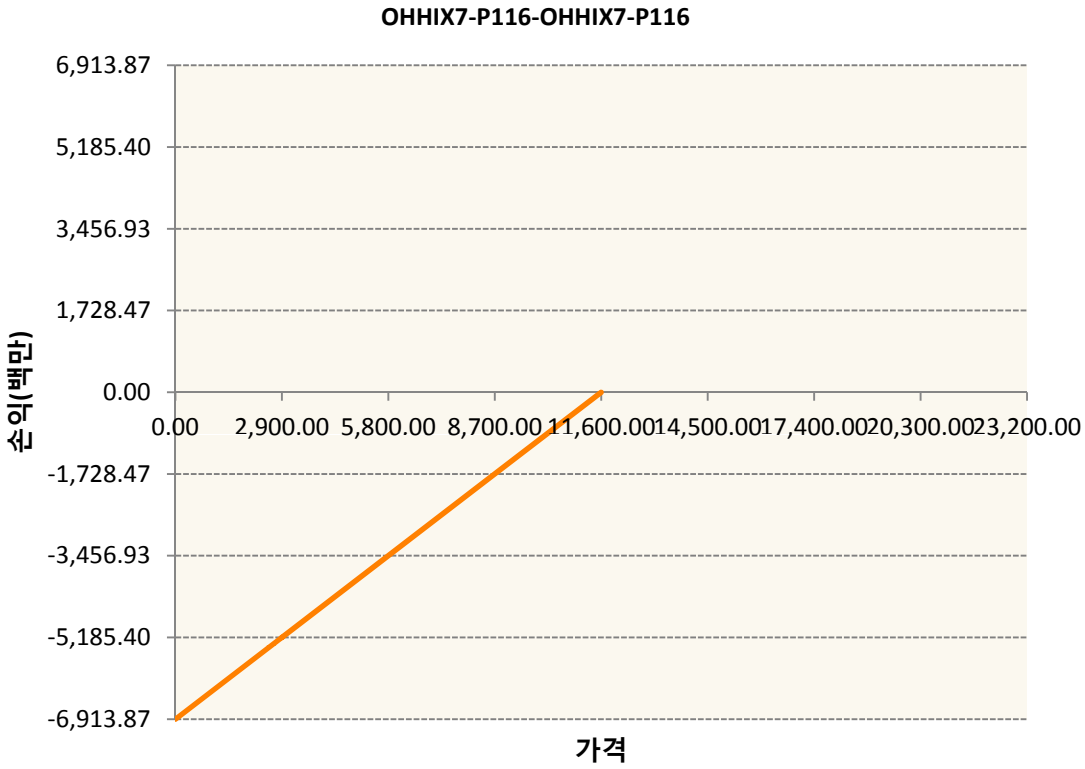



-368.39
-736.77
-1,105.16
-1,473.54
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,913.87
5,185.40
3,456.93
1,728.47
0.00
-1,728.47
-3,456.93
-5,185.40
-6,913.87
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
1,473.54
1,105.16
736.77
368.39
0.00
-368.39
-736.77
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	627
OHHIX7-C11	HSCEI	118
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	553
OHHIX7-P11	HSCEI	118
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	553

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,591

공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

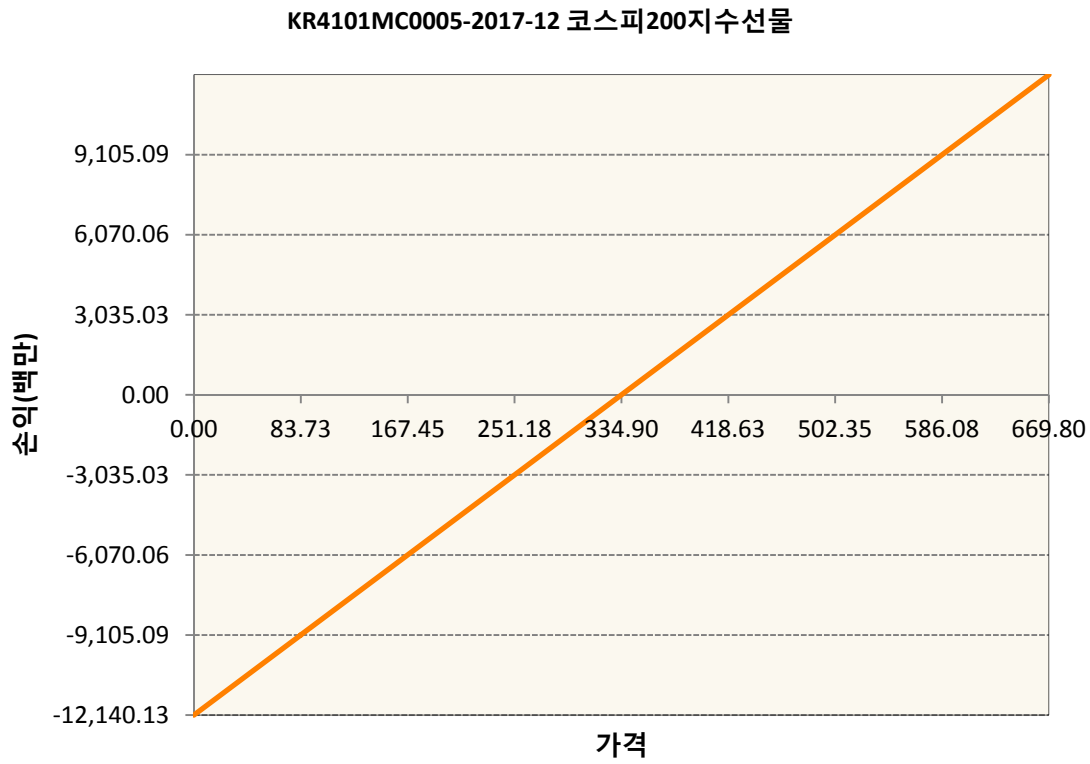
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

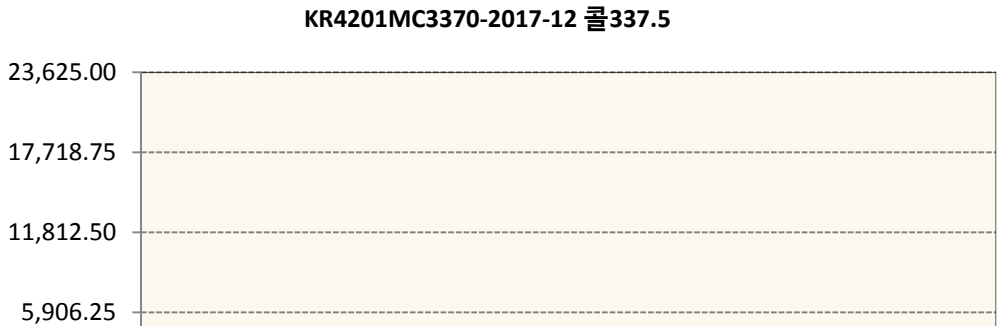
1. 계약금액

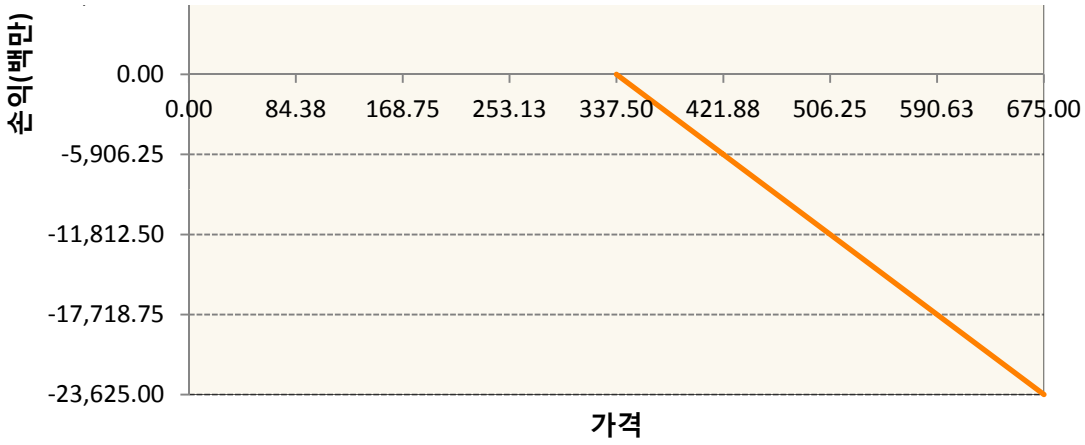
(단위:백만원)

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	12,140	0	12,140	장내
누계	유가증권	스왑	46,200	0	46,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	42,566	-42,566	장내

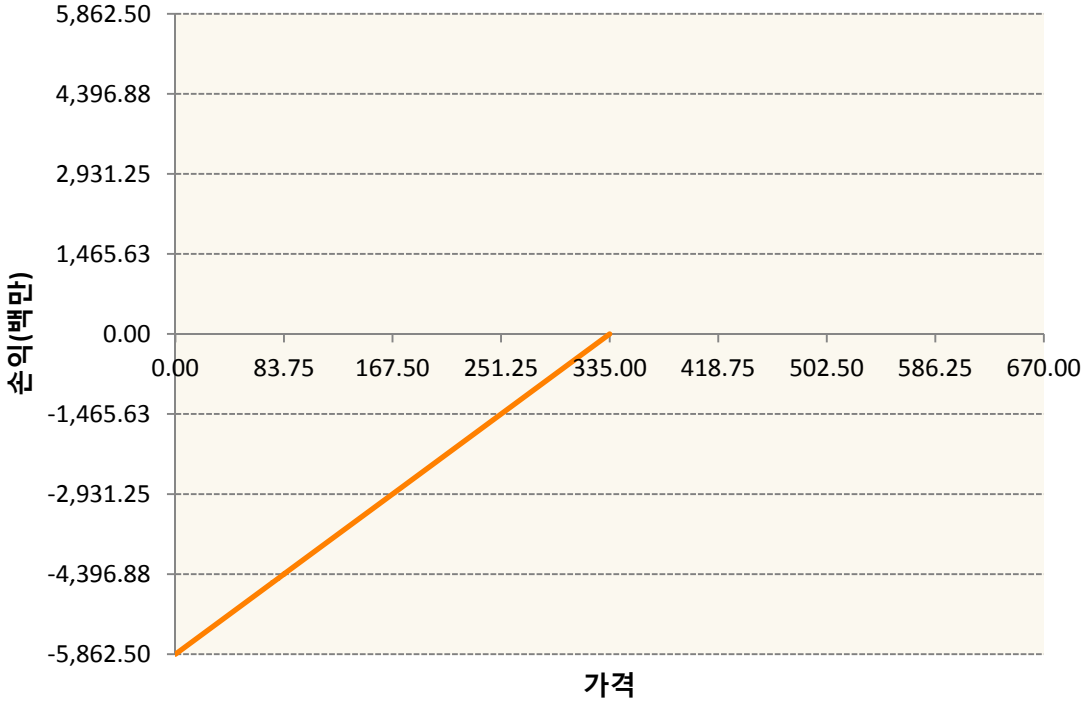
2. 만기시점의 손익구조



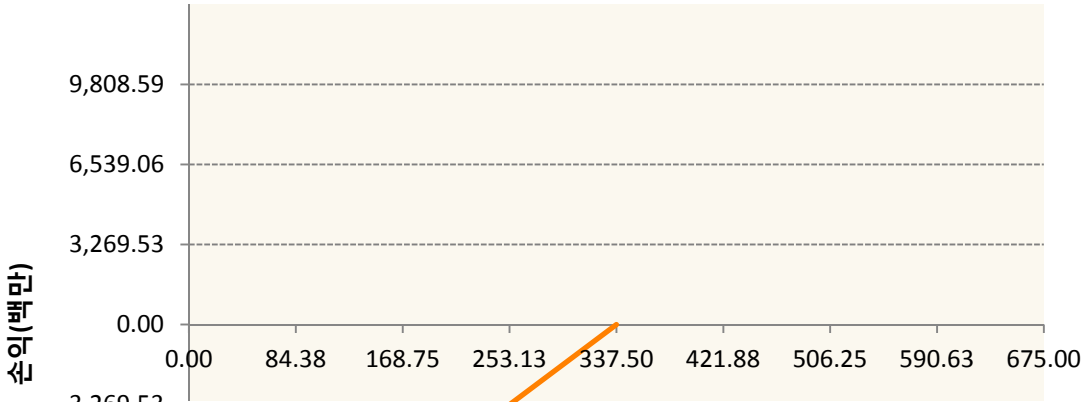




KR4301MC3353-2017-12 풋335



KR4301MC3379-2017-12 풋337.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,493
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493
-5.33%	-995	-995	-995	-995	-995	-995	-995
-2.67%	-498	-498	-498	-498	-498	-498	-498
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	498	498	498	498	498	498	498
5.33%	995	995	995	995	995	995	995
8.00%	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493
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%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-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%	108	108	108	108	108	108	108
8.00%	161	161	161	161	161	161	161
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							242
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	81	81	81	81	81	81	81
5.33%	161	161	161	161	161	161	161
8.00%	242	242	242	242	242	242	242
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						202
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202
-5.33%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-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%	135	135	135	135	135	135	135
8.00%	202	202	202	202	202	202	202
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						258
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-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%	258	258	258	258	258	258	258
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						478
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
-5.33%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
-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%	318	318	318	318	318	318	318
8.00%	478	478	478	478	478	478	478
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						318
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
-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%	318	318	318	318	318	318	318
	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					970
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-970	-970	-970	-970	-970	-970	-970
-5.33%	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646
-2.67%	-323	-323	-323	-323	-323	-323	-323
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	323	323	323	323	323	323	323
5.33%	646	646	646	646	646	646	646
8.00%	970	970	970	970	970	970	970
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,370
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	552	538	519	497	472	444	413
-5.33%	502	473	440	404	366	326	284
-2.67%	385	340	293	244	195	145	94
0%	167	111	56	0	-56	-112	-168
2.67%	-170	-225	-280	-335	-390	-446	-502
5.33%	-618	-662	-707	-755	-804	-854	-905
8.00%	-1,149	-1,178	-1,210	-1,246	-1,285	-1,326	-1,370
	KR4301MC3	2017-12 풋335					394
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-392	-392	-392	-393	-393	-393	-394
-5.33%	-237	-238	-239	-240	-242	-244	-247
-2.67%	-90	-94	-98	-103	-108	-113	-118
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	71	67	62	57	52	46	40
5.33%	84	82	81	78	76	73	70
8.00%	85	85	84	84	83	82	81
	KR4301MC3	2017-12 풋337.5					913

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-910	-910	-910	-910	-911	-912	-913
-5.33%	-566	-566	-568	-570	-573	-577	-581
-2.67%	-232	-238	-245	-253	-262	-271	-281
0%	42	28	14	0	-14	-29	-43
2.67%	192	180	167	154	141	127	113
5.33%	236	232	227	220	213	204	195
8.00%	243	242	241	239	237	233	229

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

7,071

공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

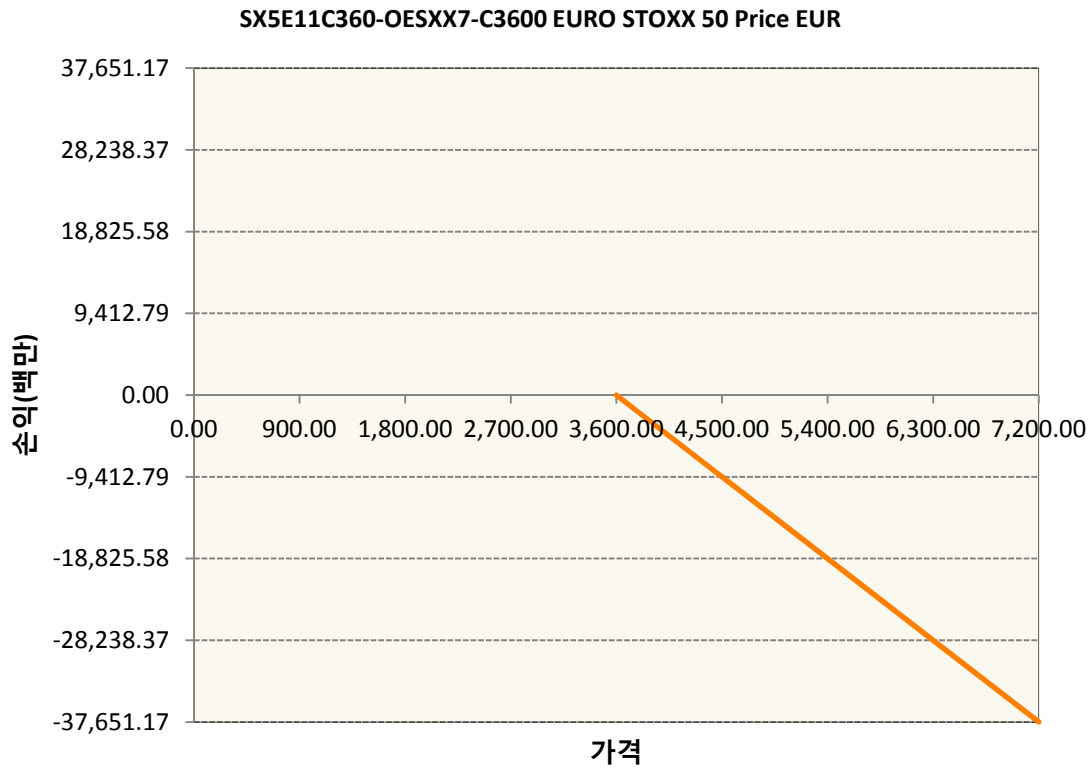
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

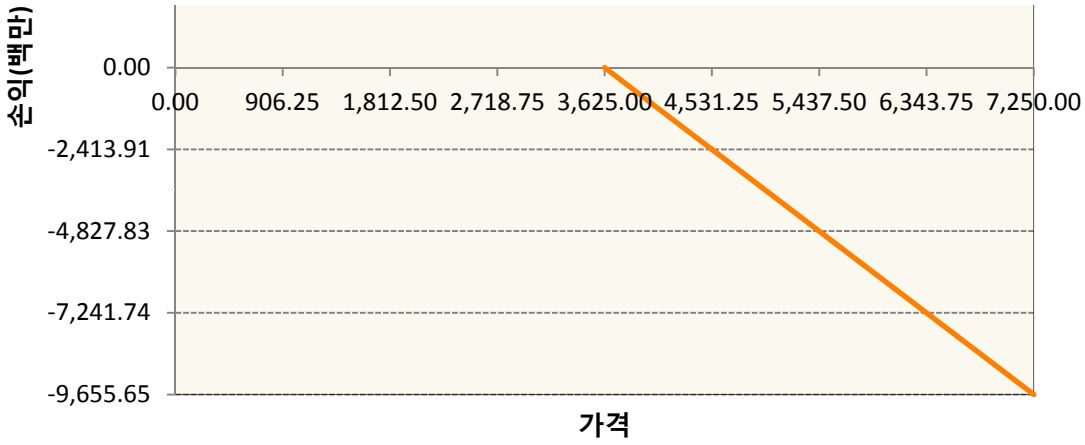
(단위:백만원)

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	39,880	0	39,880	
누계	유가증권	옵션	0	94,614	-94,614	장내
누계	유가증권	ELS	97,929	0	97,929	장외

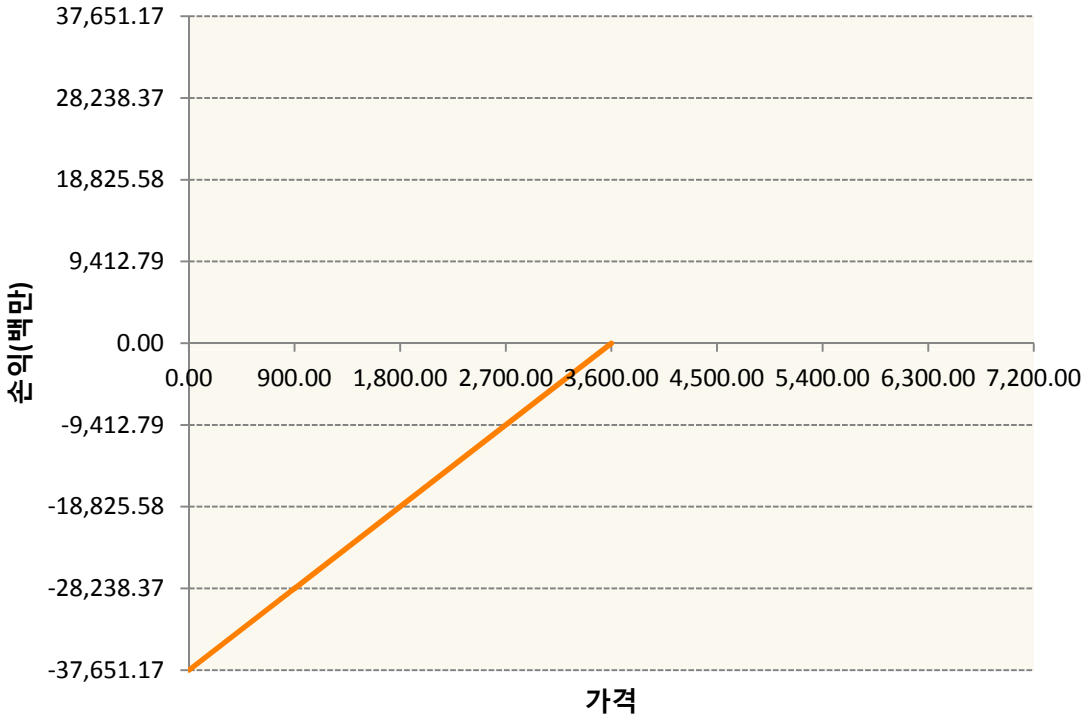
2. 만기시점의 손익구조



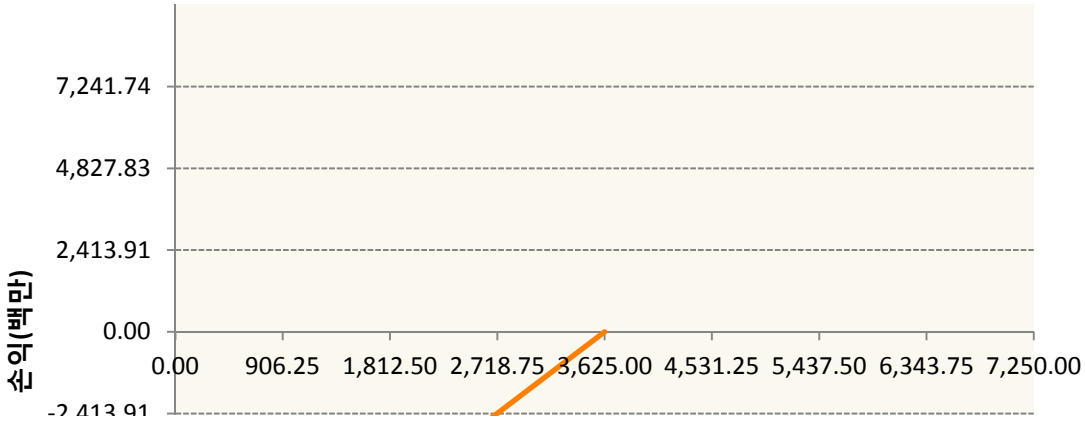


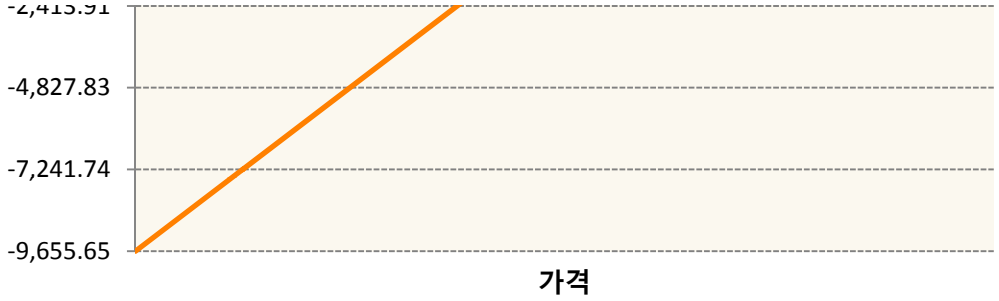


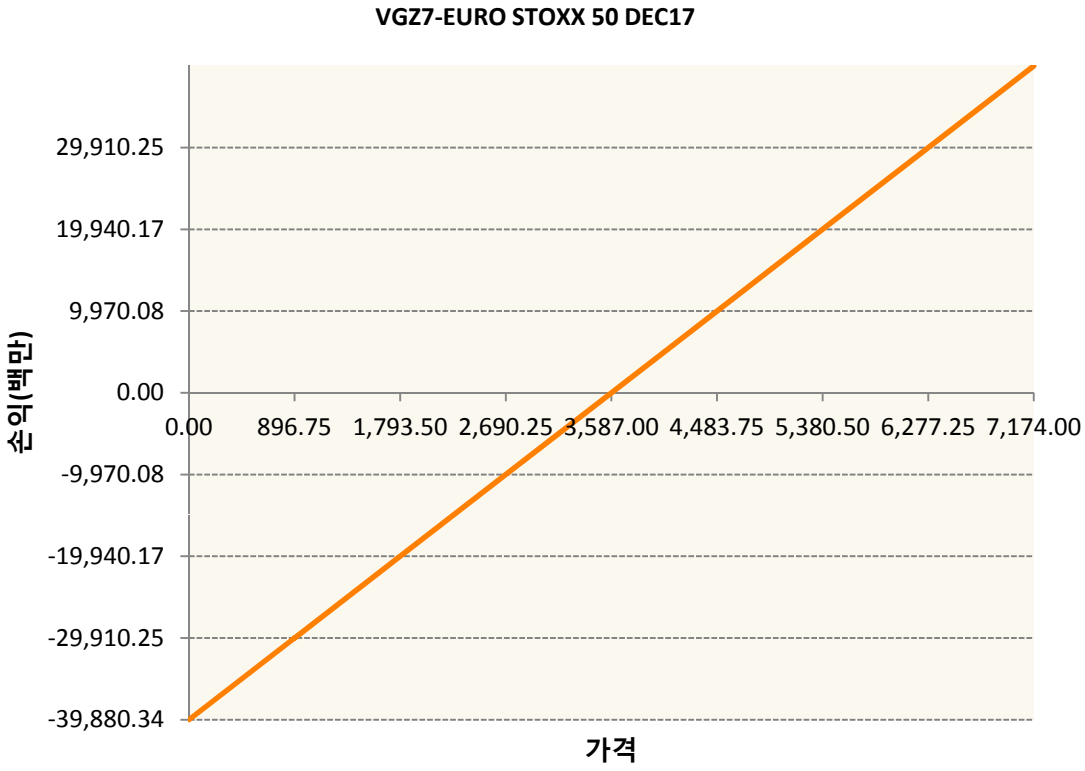
SX5E11P360-OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E11P362-OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	17
SX5E11C360	OESXX7-C3600 EURO STOXX 50 Price EUR	3,012
SX5E11C362	OESXX7-C3625 EURO STOXX 50 Price EUR	772
SX5E11P360	OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR	3,012
SX5E11P362	OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR	772
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,190

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7,810

공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

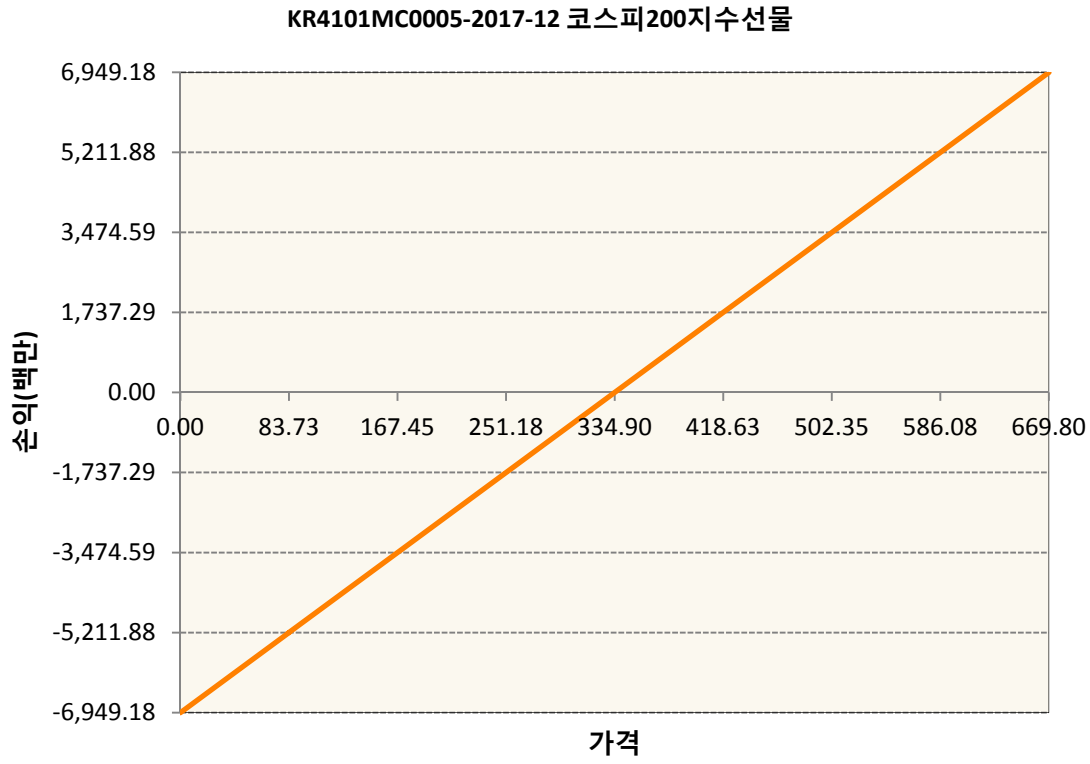
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,949	0	6,949	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						555
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-555	-555	-555	-555	-555	-555	-555
-5.33%	-370	-370	-370	-370	-370	-370	-370
-2.67%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	185	185	185	185	185	185	185
5.33%	370	370	370	370	370	370	370
8.00%	555	555	555	555	555	555	555

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

334

공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

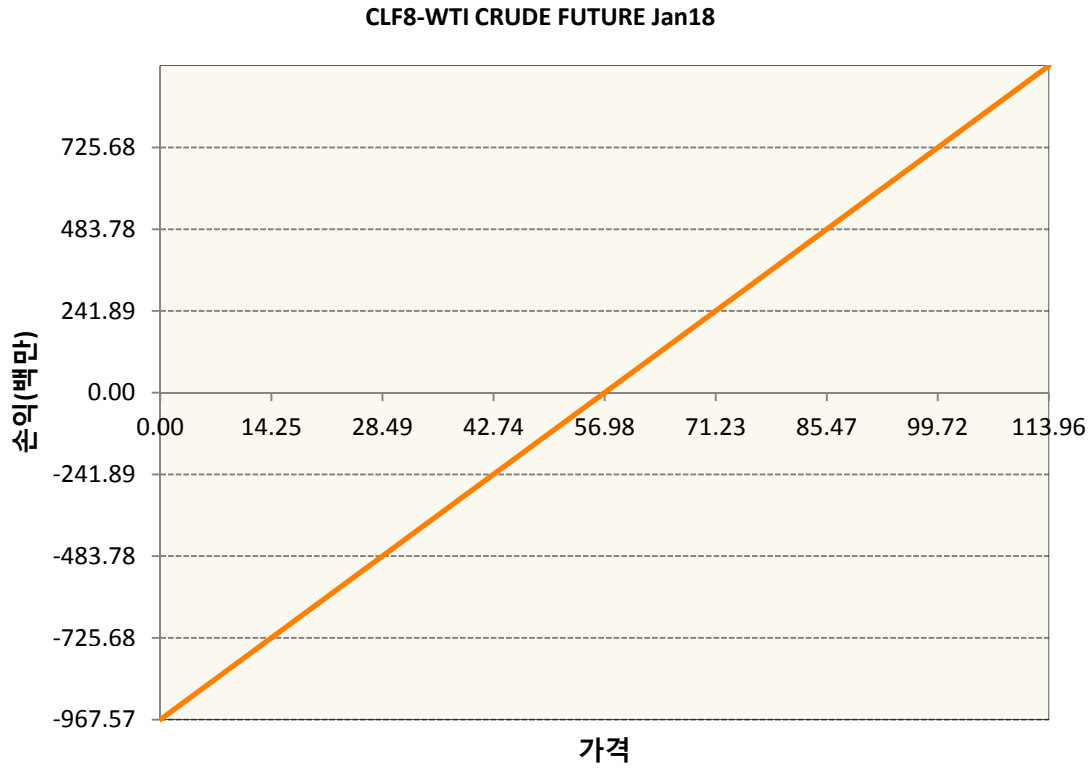
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

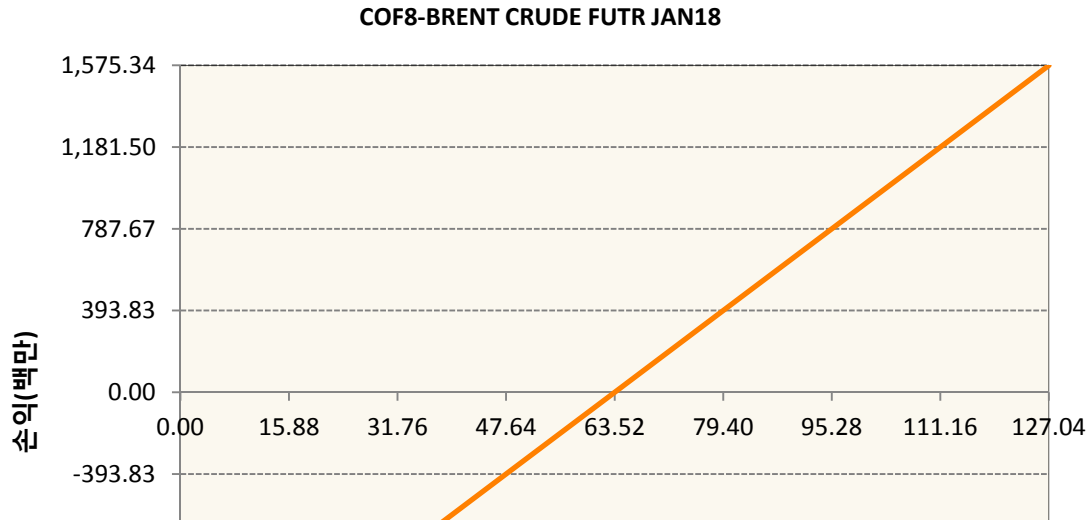
1. 계약금액

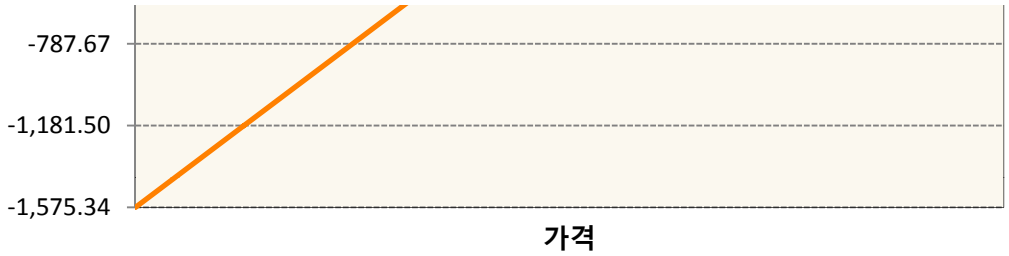
(단위:백만원)

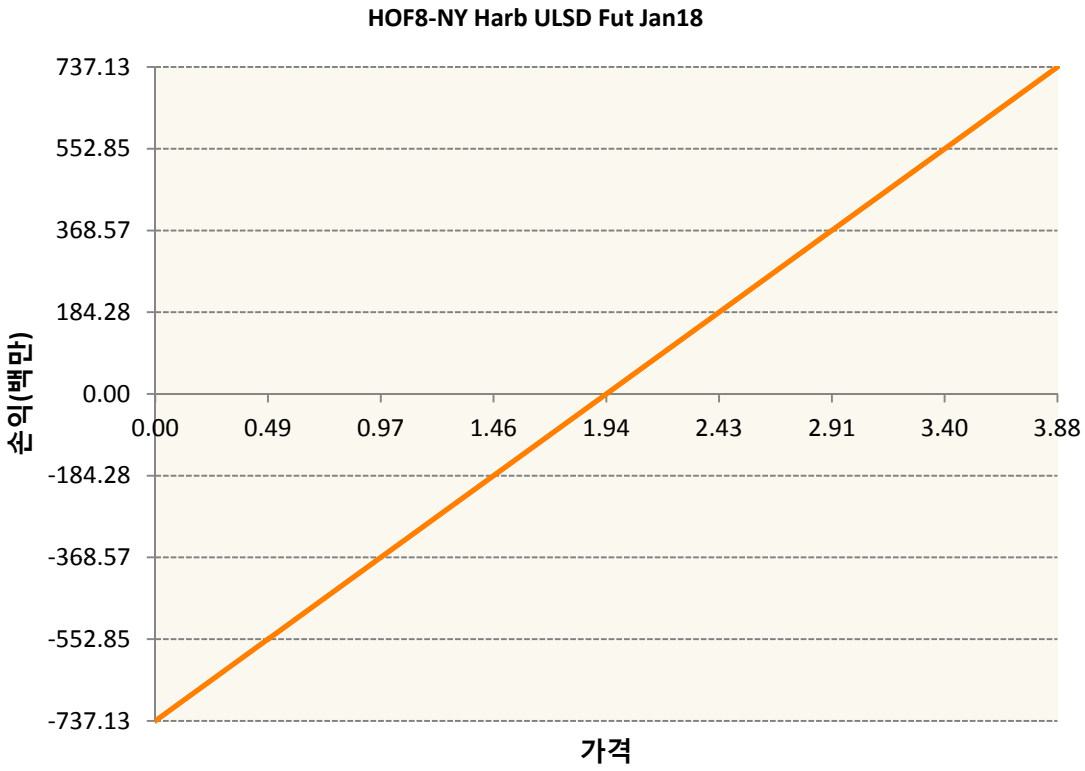
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,471	898	4,574	

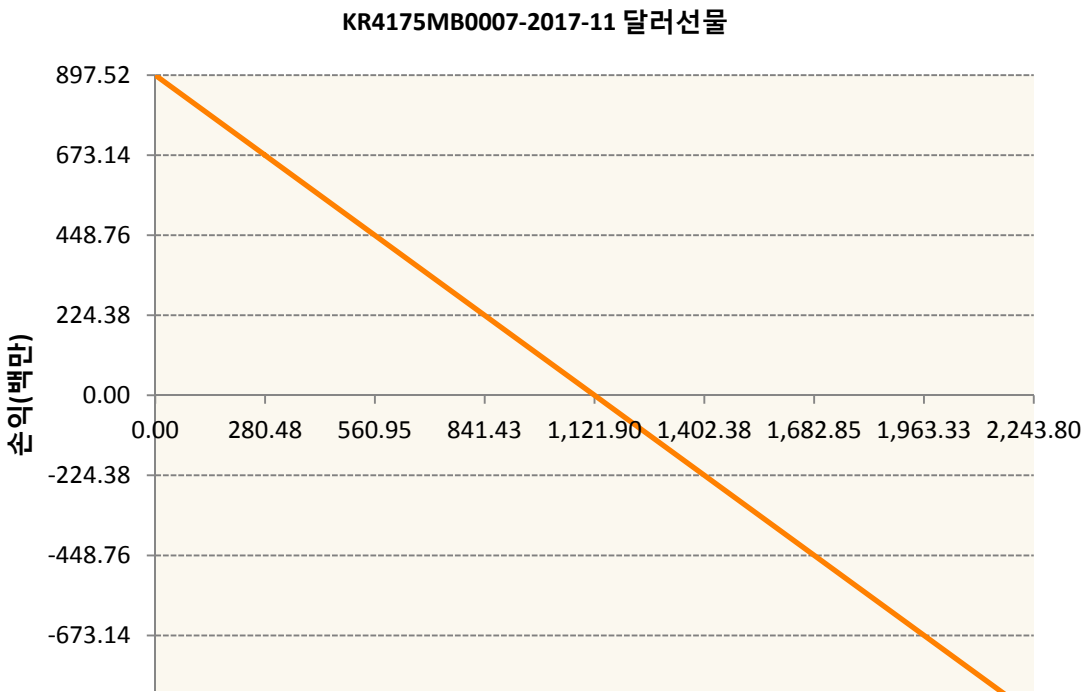
2. 만기시점의 손익구조

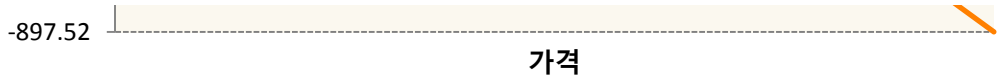


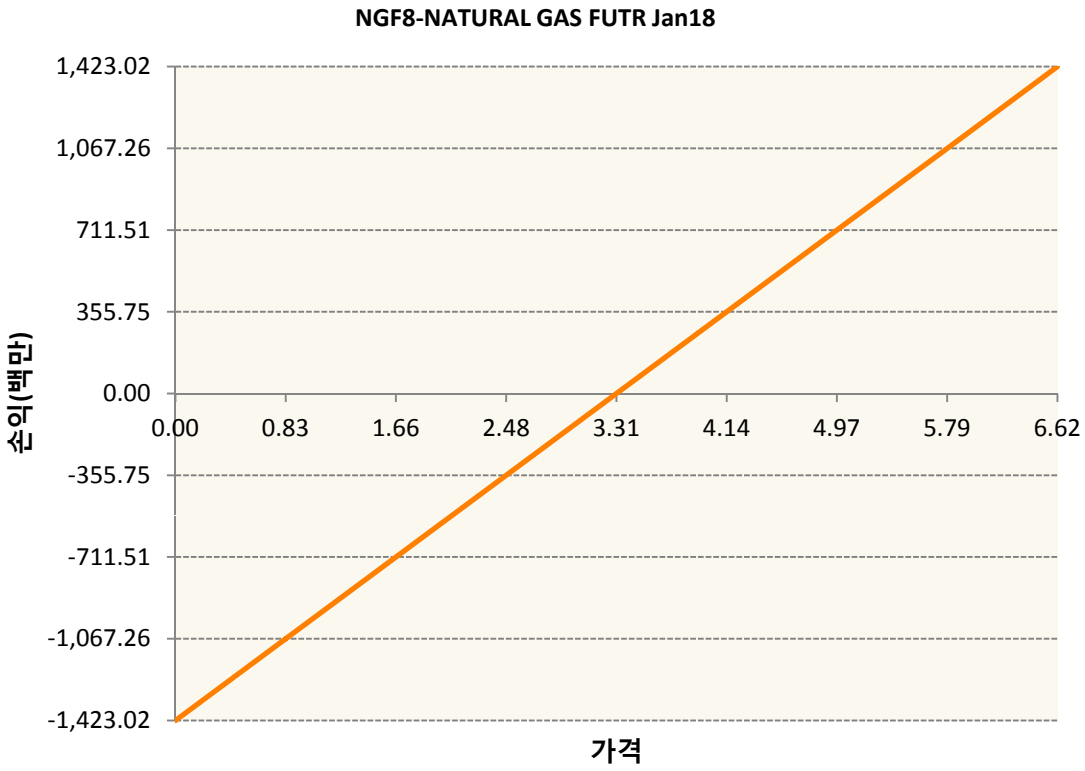


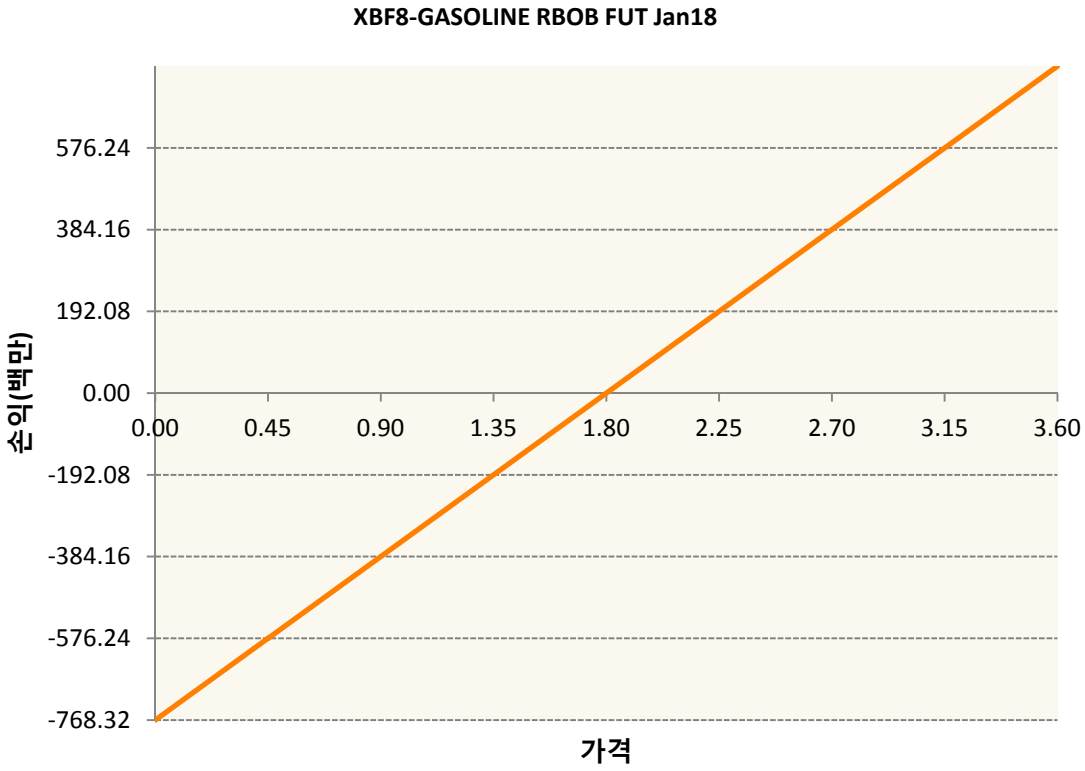

-787.67
-1,181.50
-1,575.34
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
737.13
552.85
368.57
184.28
0.00
-184.28
-368.57
-552.85
-737.13
0.00
0.49
0.97
1.46
1.94
2.43
2.91
3.40
3.88
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
897.52
673.14
448.76
224.38
0.00
-224.38
-448.76
-673.14
0.00
280.48
560.95
841.43
1,121.90
1,402.38
1,682.85
1,963.33
2,243.80
손익(백만)


-897.52
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,423.02
1,067.26
711.51
355.75
0.00
-355.75
-711.51
-1,067.26
-1,423.02
0.00
0.83
1.66
2.48
3.31
4.14
4.97
5.79
6.62
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
576.24
384.16
192.08
0.00
-192.08
-384.16
-576.24
-768.32
0.00
0.45
0.90
1.35
1.80
2.25
2.70
3.15
3.60
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	77
COF8	BRENT CRUDE FUTR JAN18	126
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	72
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	114
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	61

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

772

공시일	2017-11-14
기준일	2017-11-13

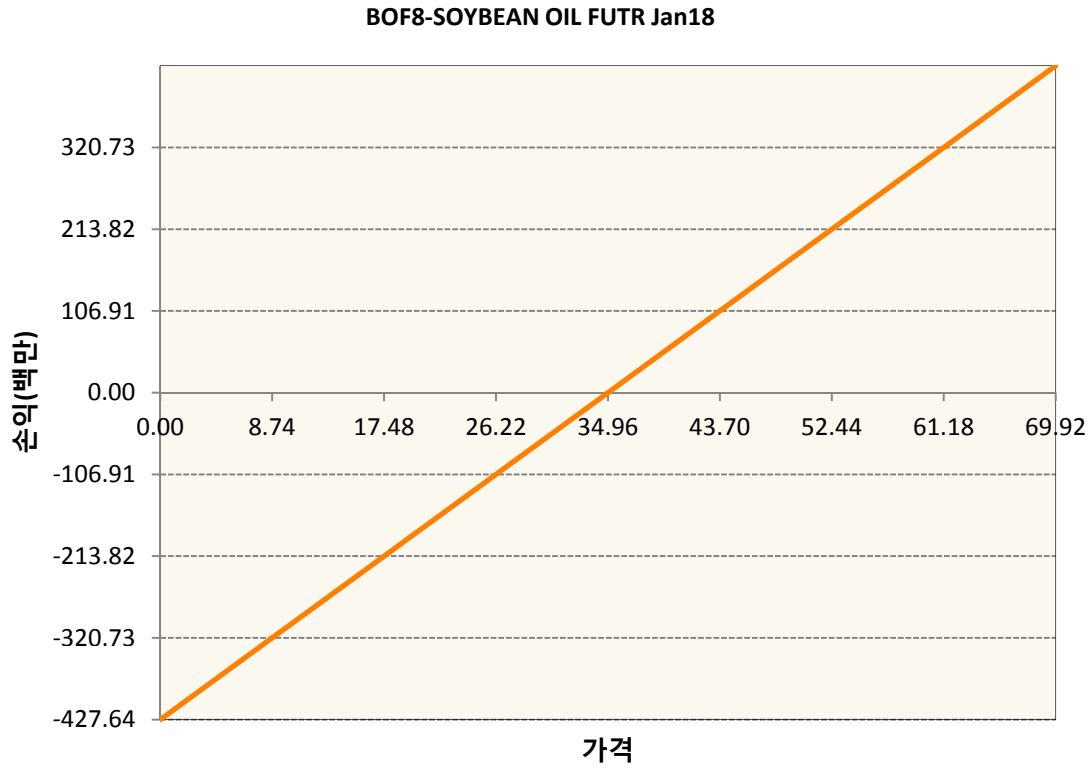
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

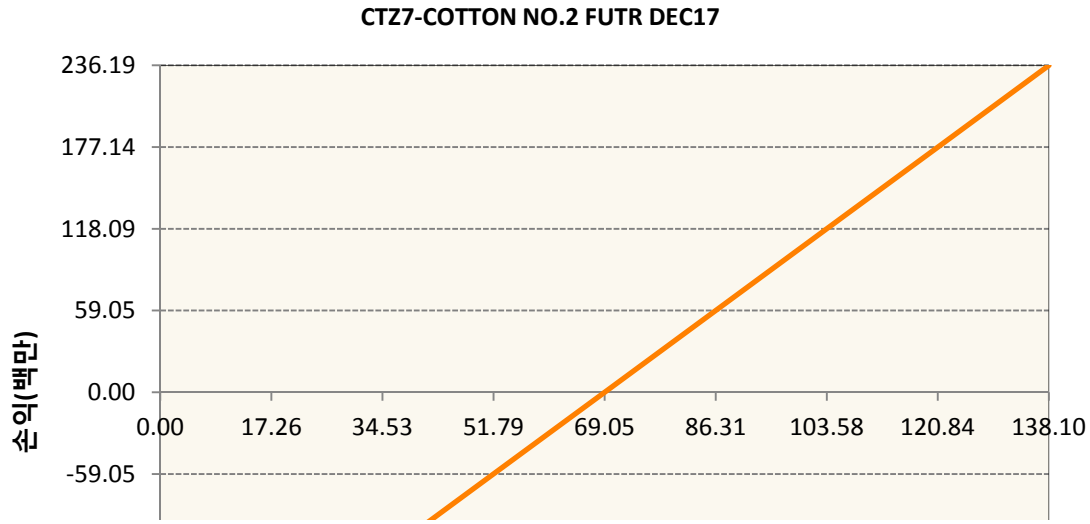
1. 계약금액

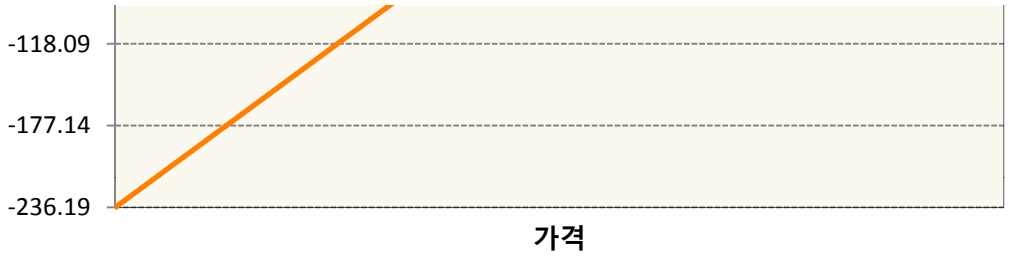
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,570	337	4,233	

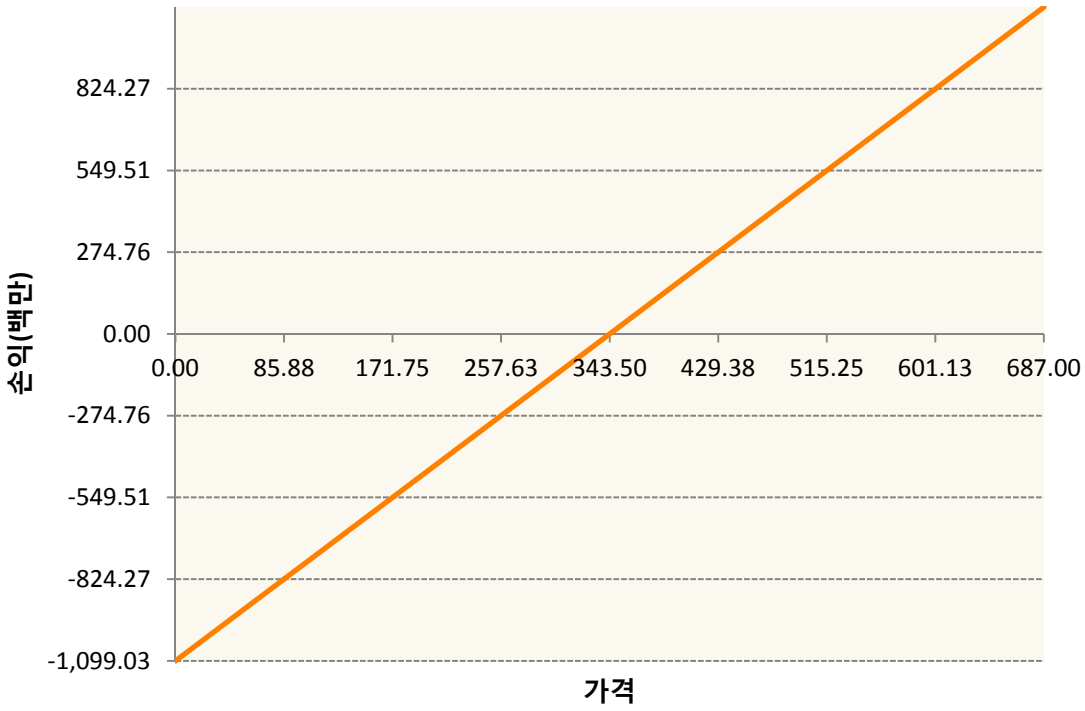
2. 만기시점의 손익구조



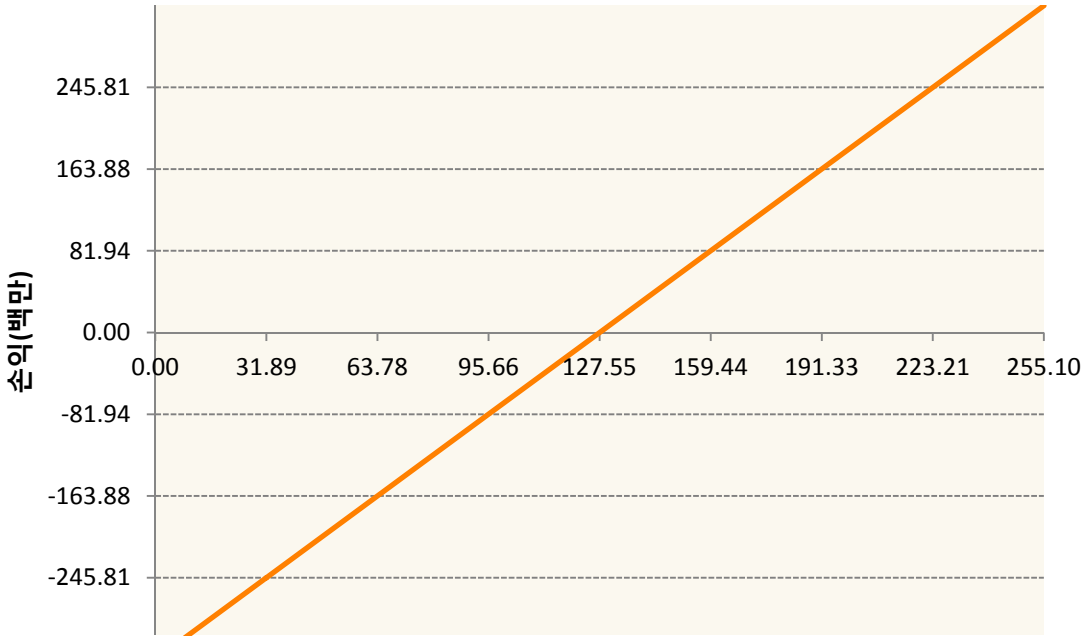


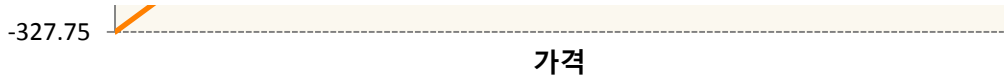


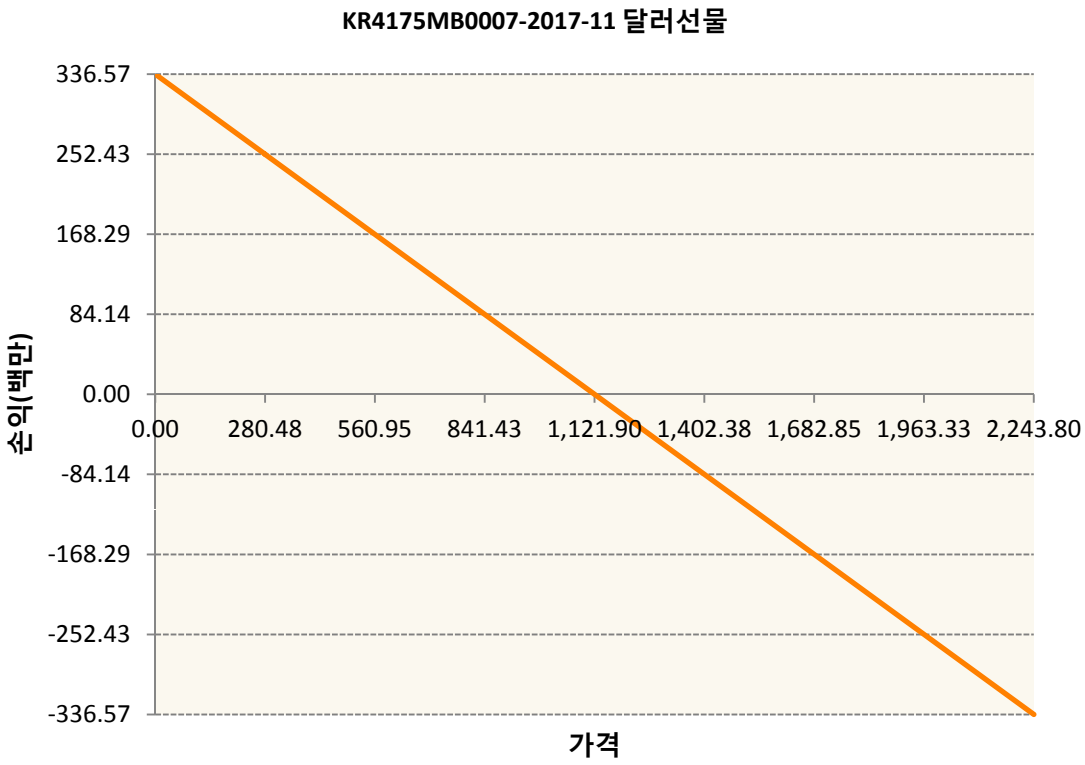
CZ7-CORN FUTURE DEC17

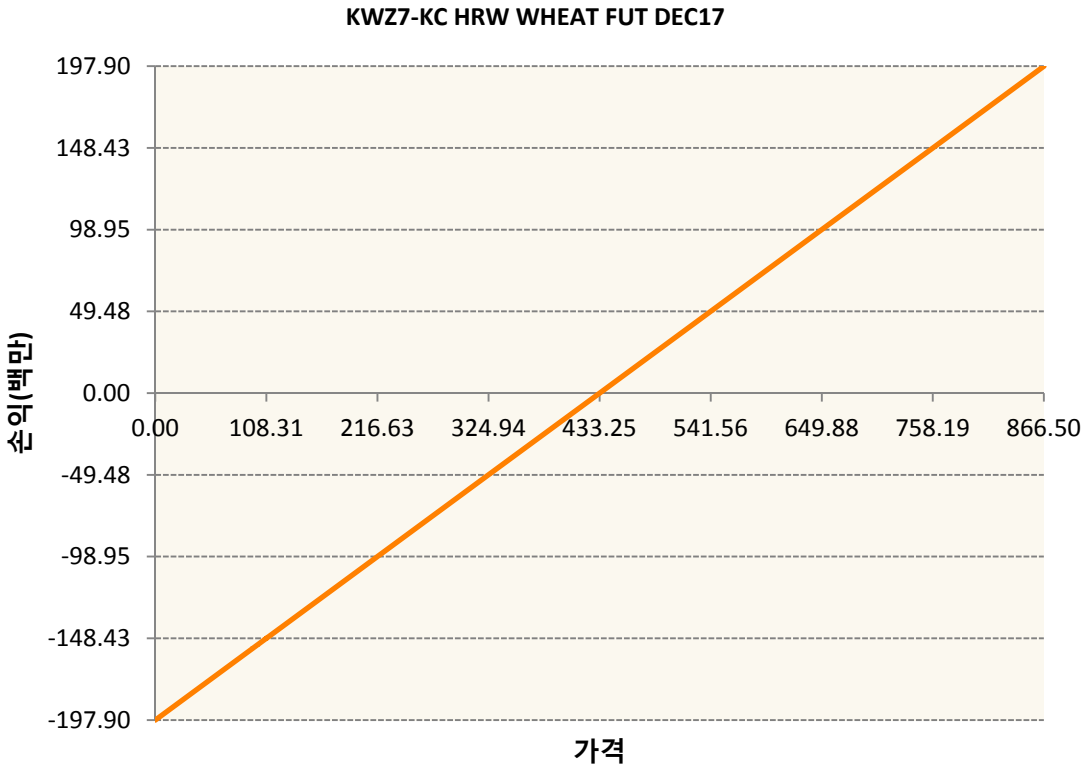


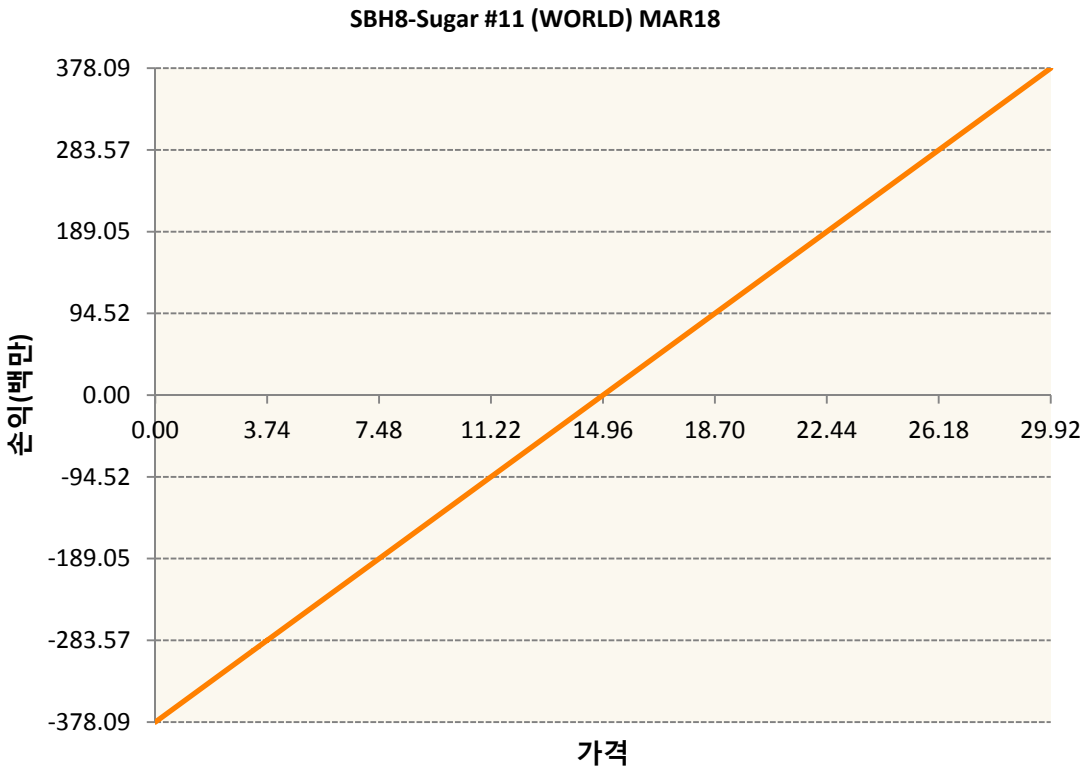
KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17

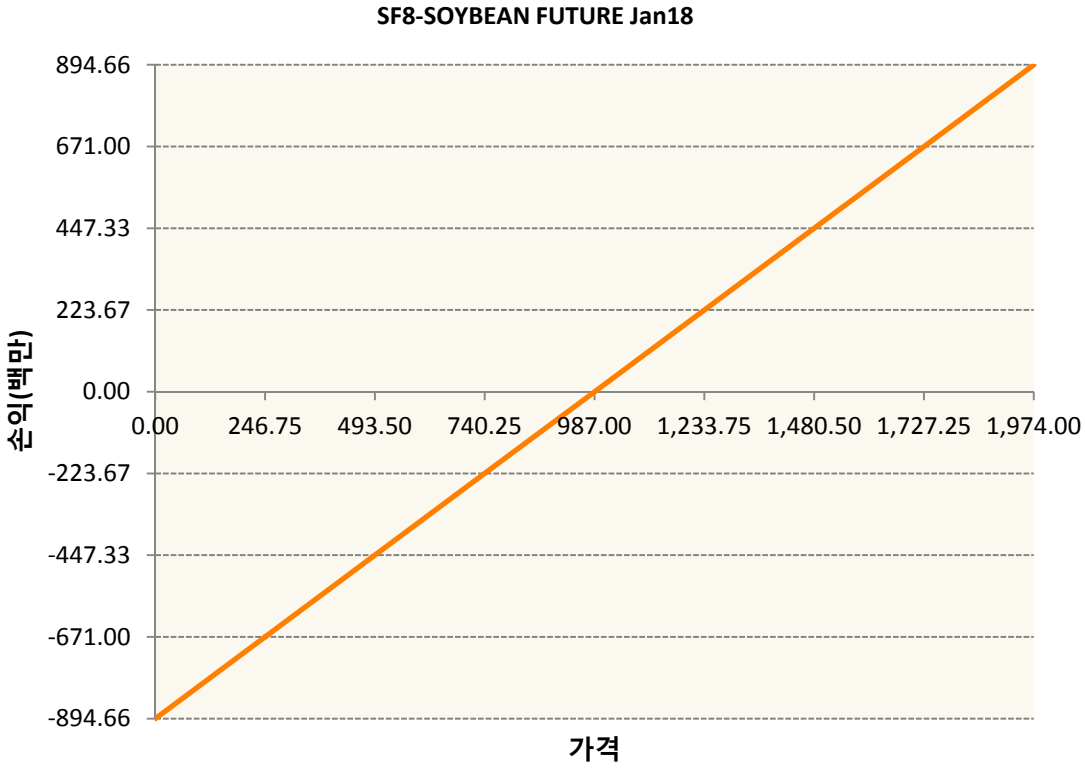



-327.75
가격

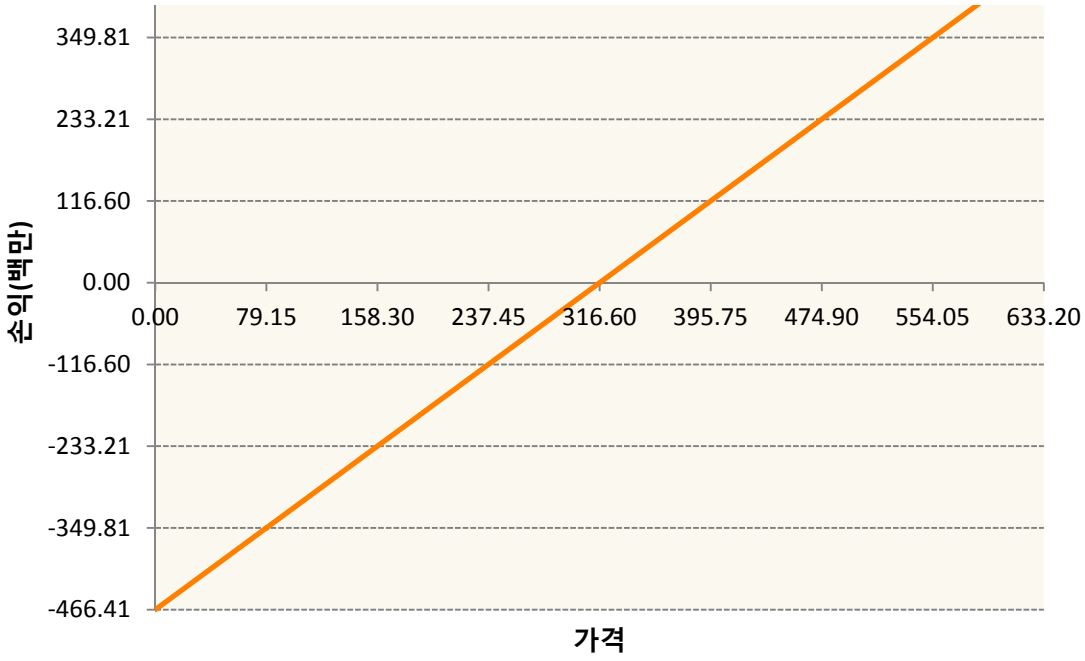

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
336.57
252.43
168.29
84.14
0.00
-84.14
-168.29
-252.43
-336.57
0.00
280.48
560.95
841.43
1,121.90
1,402.38
1,682.85
1,963.33
2,243.80
손익(백만)
가격

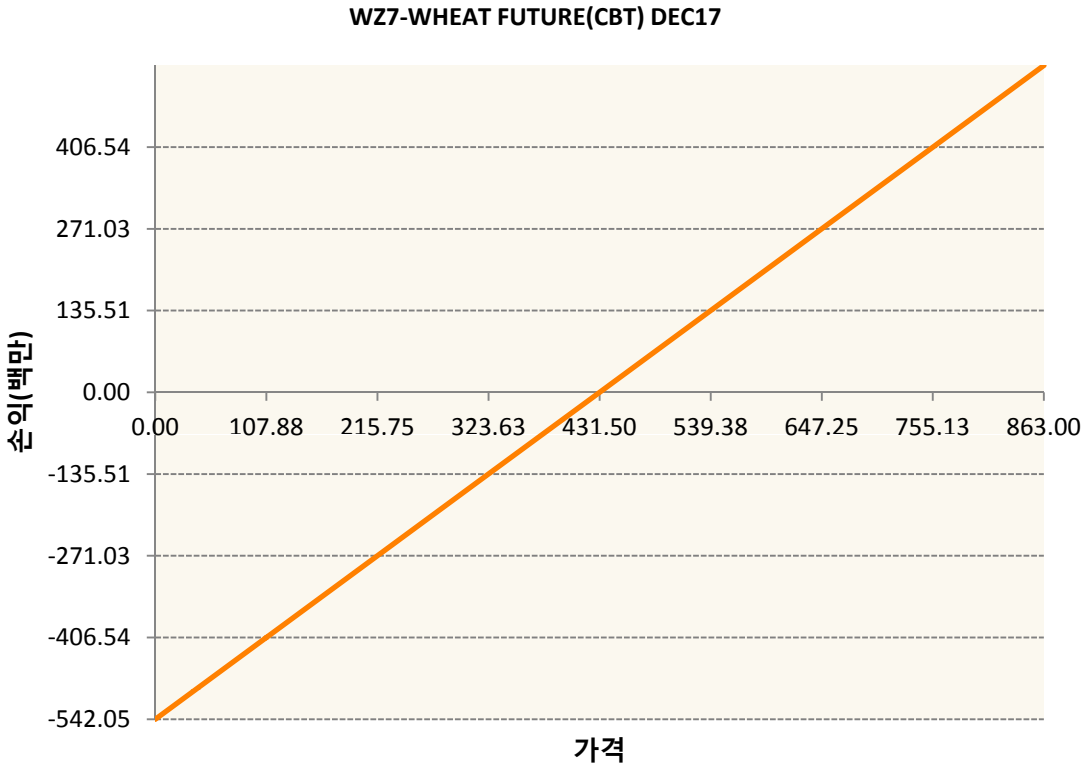

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
197.90
148.43
98.95
49.48
0.00
-49.48
-98.95
-148.43
-197.90
0.00
108.31
216.63
324.94
433.25
541.56
649.88
758.19
866.50
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
378.09
283.57
189.05
94.52
0.00
-94.52
-189.05
-283.57
-378.09
손익(백만)
0.00
3.74
7.48
11.22
14.96
18.70
22.44
26.18
29.92
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
894.66
671.00
447.33
223.67
0.00
-223.67
-447.33
-671.00
-894.66
손익(백만)
0.00
246.75
493.50
740.25
987.00
1,233.75
1,480.50
1,727.25
1,974.00
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
466.41





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	34
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	19
CZ7	CORN FUTURE DEC17	88
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)

411