공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

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	2017-11-17
기준일	2017-11-16

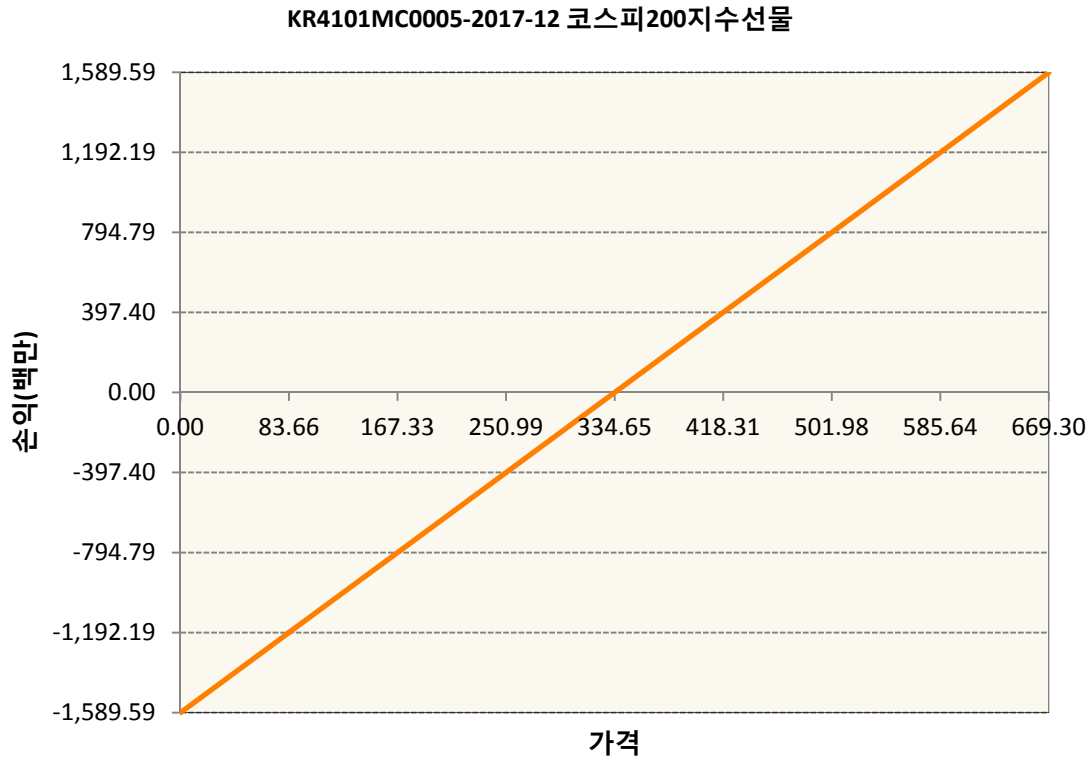
스마트인덱스모

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	1,590	0	1,590	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)

73

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

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	1,057

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

345

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

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	416

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

367

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

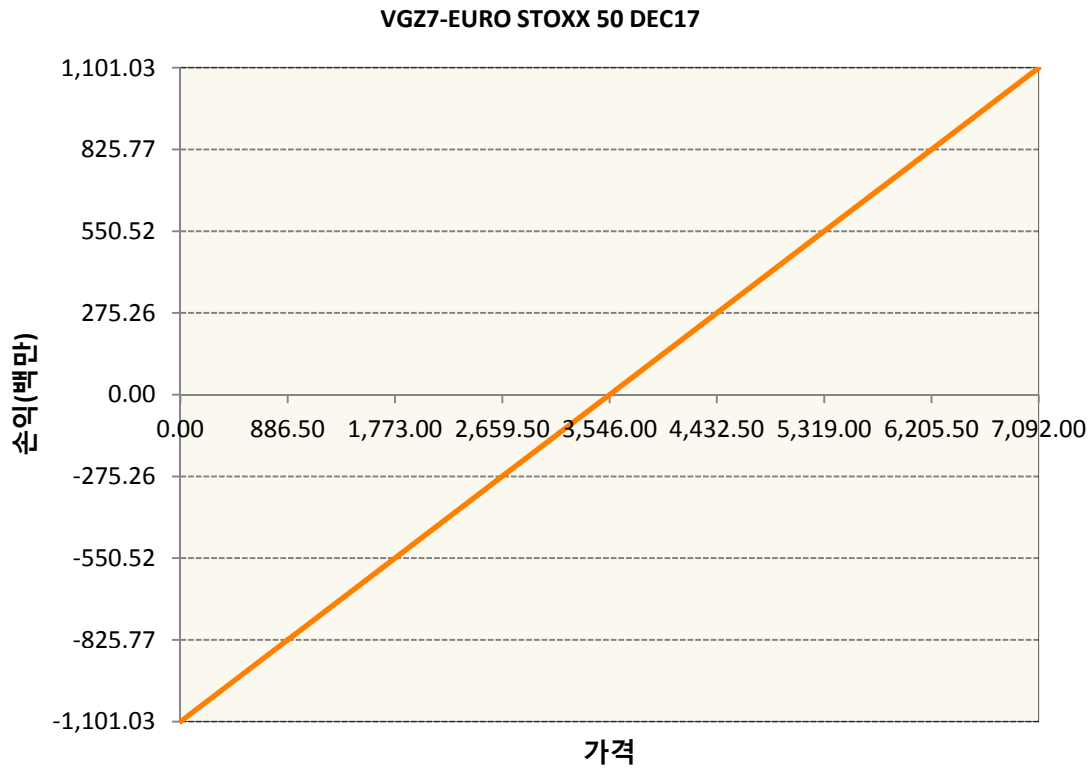
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,101	0	1,101	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	88

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

(단위:백만원)

55

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

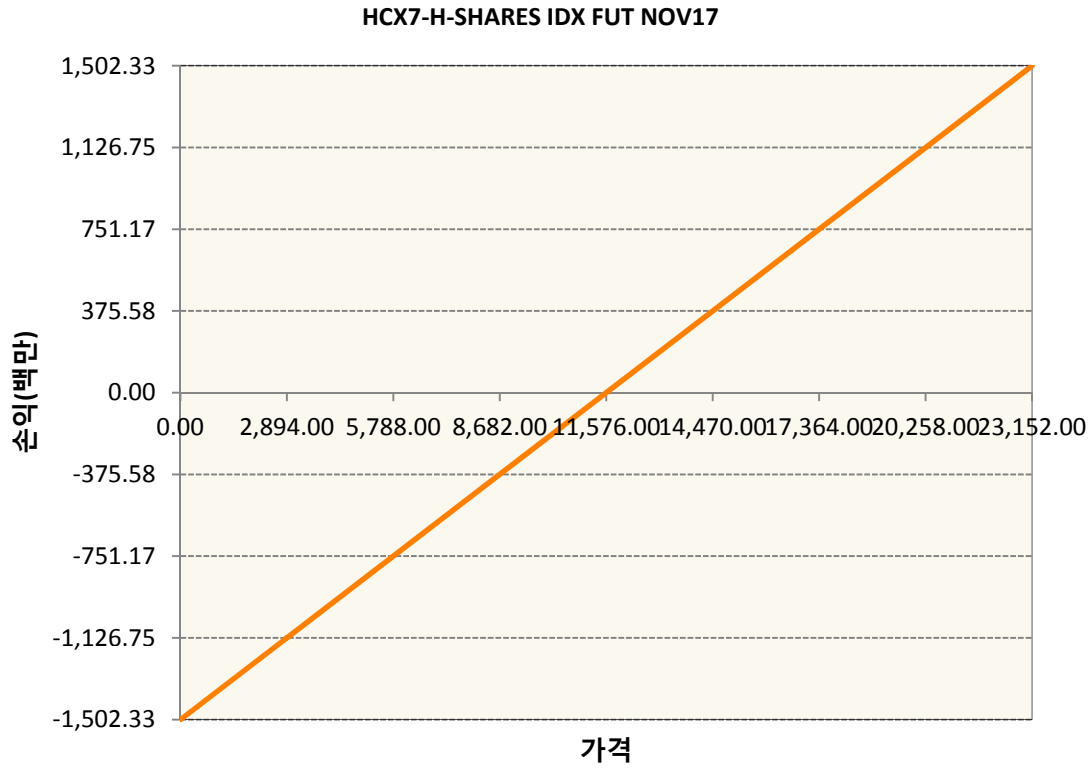
차이나인덱스모(주식-파생형)

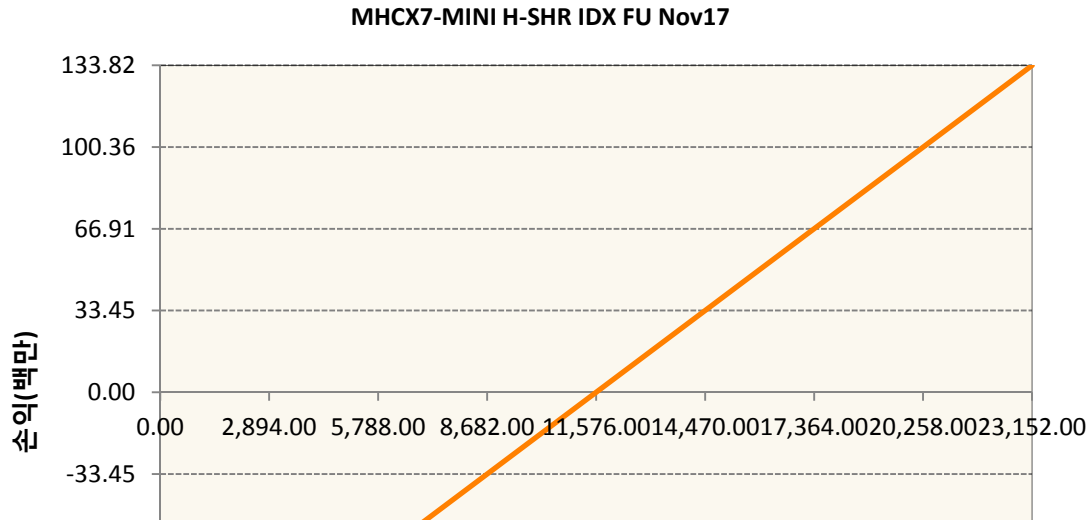
1. 계약금액

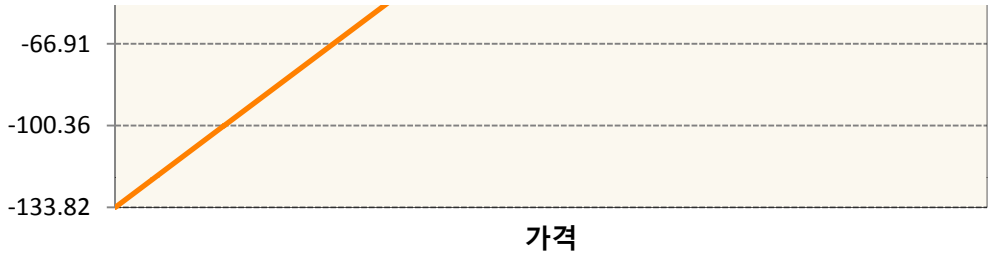
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,636	0	1,636	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	120
MHCX7	MINI H-SHR IDX FU Nov17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	105

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

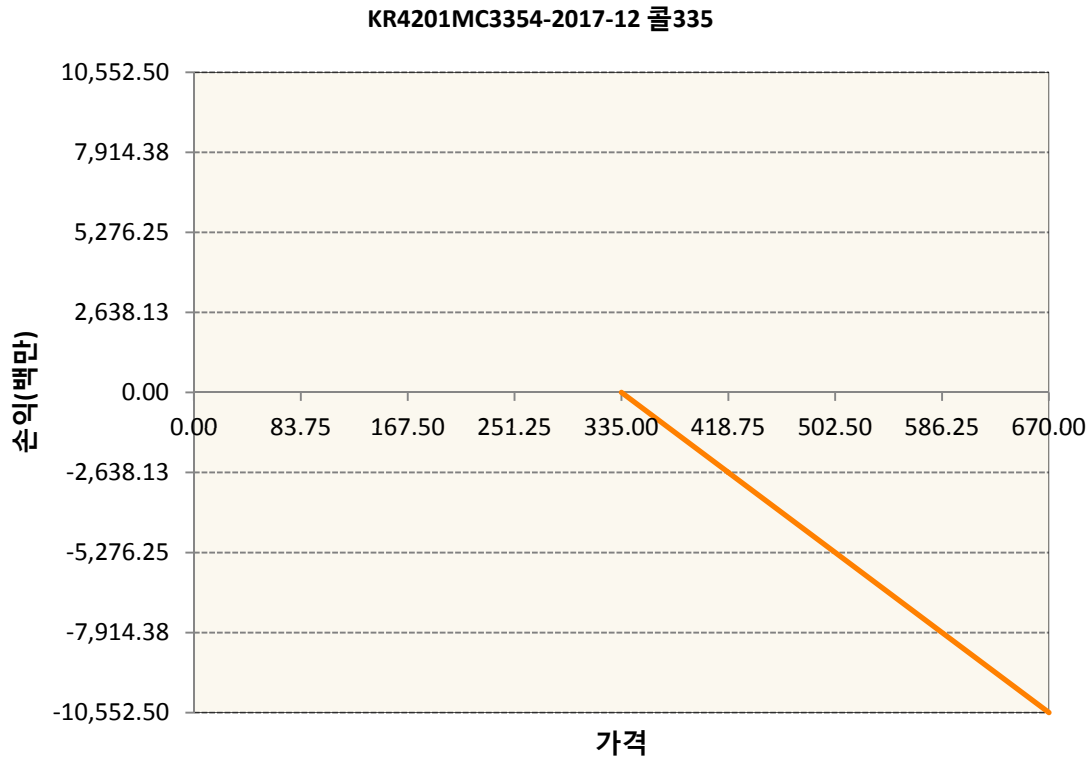
커버드콜모(주식혼합-파생형)

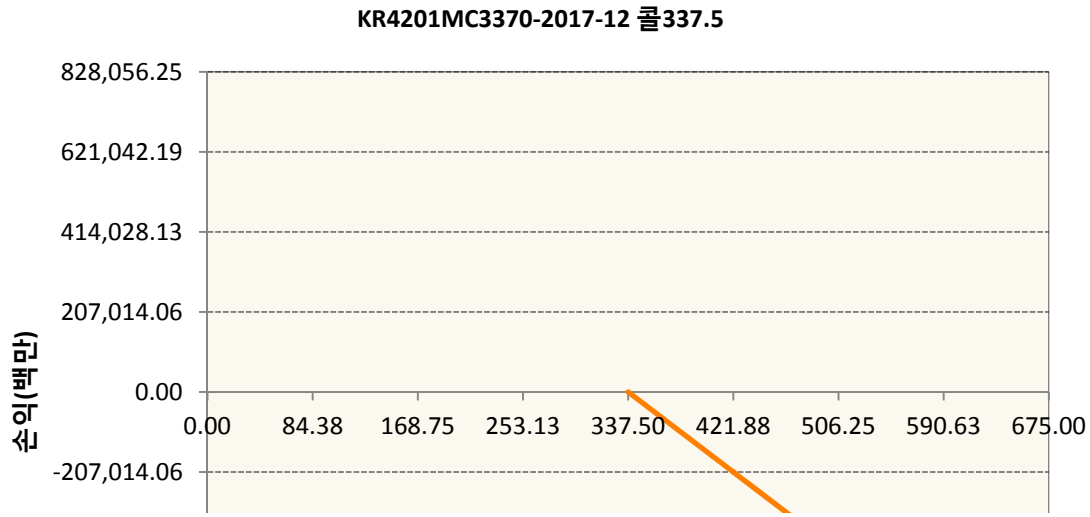
1. 계약금액

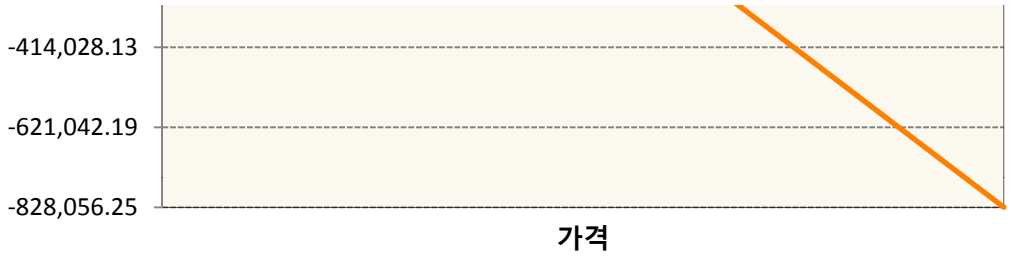
(단위:백만원)

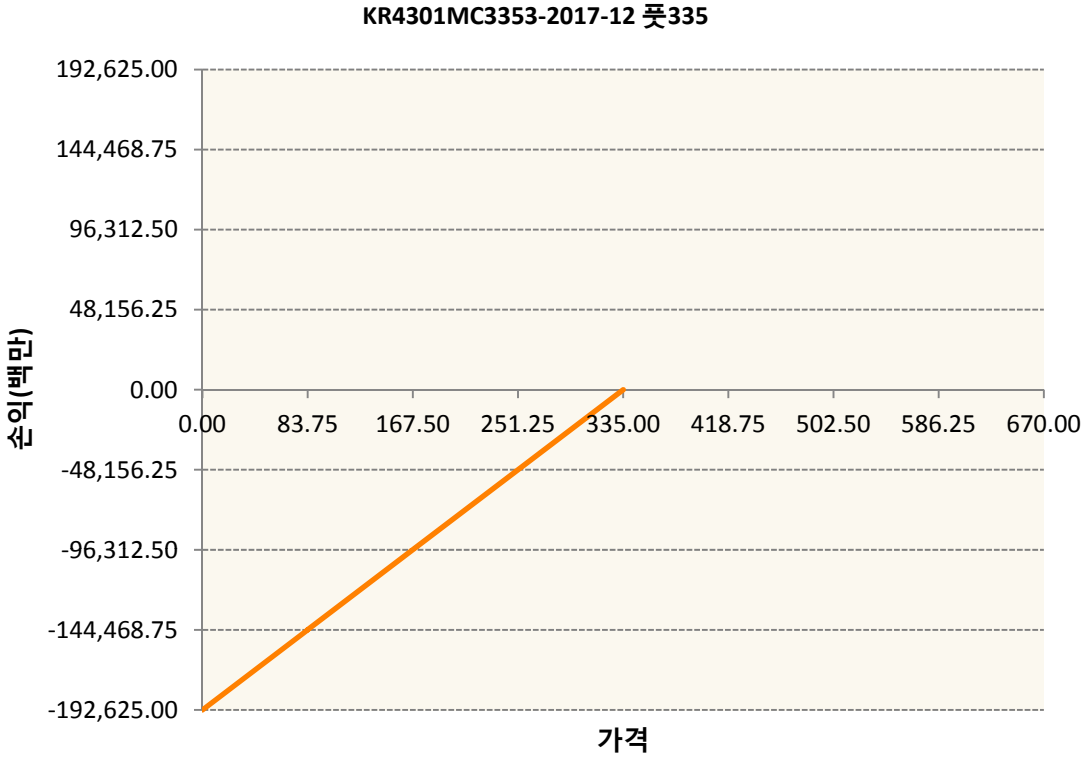
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

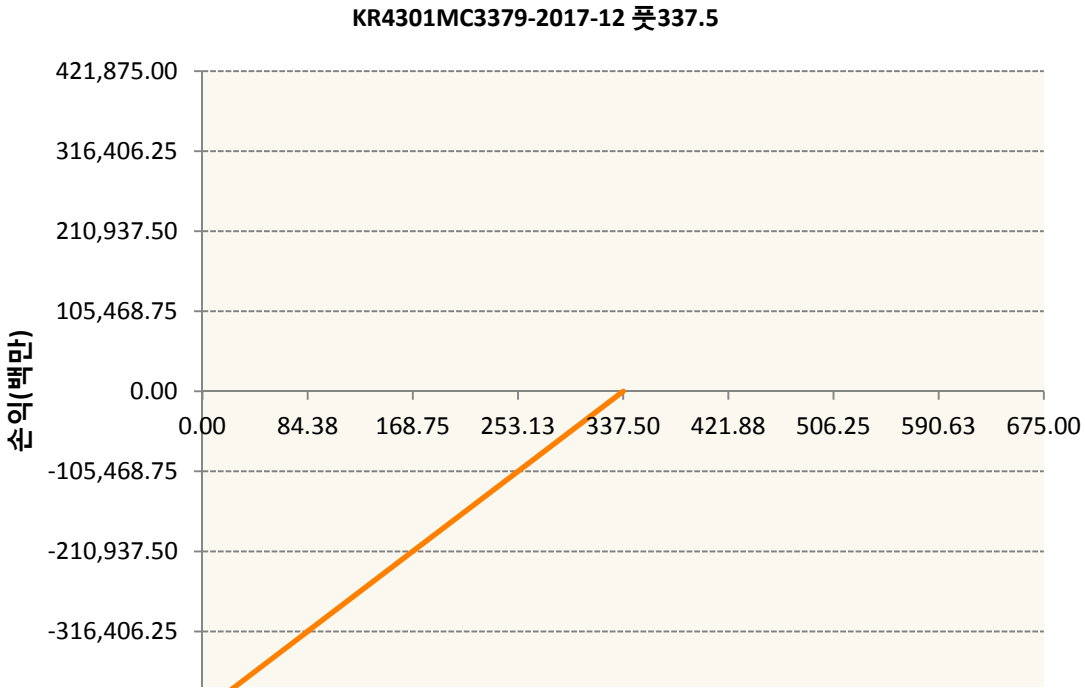
2. 만기시점의 손익구조






-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							643
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	270	263	255	244	233	220	207
-5.33%	244	230	215	199	182	164	145
-2.67%	183	163	142	120	98	76	53
0%	72	48	24	0	-24	-48	-72
2.67%	-96	-118	-140	-163	-186	-209	-232
5.33%	-312	-329	-346	-364	-384	-404	-424
8.00%	-563	-572	-584	-597	-611	-626	-643
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							48,065
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18,480	18,052	17,497	16,821	16,036	15,151	14,179
-5.33%	16,927	16,007	14,964	13,818	12,588	11,285	9,923
-2.67%	13,073	11,582	10,031	8,432	6,797	5,132	3,443
0%	5,581	3,725	1,864	0	-1,866	-3,735	-5,605
2.67%	-6,272	-8,084	-9,913	-11,755	-13,606	-15,465	-17,330
5.33%	-22,167	-23,581	-25,077	-26,638	-28,251	-29,905	-31,594
8.00%	-41,014	-41,910	-42,943	-44,092	-45,338	-46,666	-48,065
KR4301MC3. 2017-12 풋335							13,153
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,115	-13,116	-13,117	-13,121	-13,127	-13,138	-13,153
-5.33%	-8,005	-8,020	-8,043	-8,076	-8,120	-8,173	-8,237
-2.67%	-3,112	-3,213	-3,327	-3,451	-3,585	-3,727	-3,875
0%	598	399	199	0	-199	-399	-598
2.67%	2,208	2,085	1,951	1,808	1,656	1,498	1,335
5.33%	2,523	2,497	2,460	2,410	2,348	2,275	2,191
8.00%	2,548	2,546	2,542	2,533	2,519	2,498	2,470
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							29,891
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29,843	-29,844	-29,845	-29,849	-29,856	-29,870	-29,891
-5.33%	-18,719	-18,735	-18,763	-18,807	-18,869	-18,950	-19,052
-2.67%	-7,837	-7,986	-8,166	-8,375	-8,608	-8,862	-9,134
0%	1,237	829	416	0	-419	-841	-1,264
2.67%	5,999	5,653	5,292	4,919	4,536	4,145	3,748

5.33%	7,198	7,099	6,969	6,809	6,622	6,410	6,176
8.00%	7,325	7,314	7,293	7,259	7,207	7,137	7,048

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

96,252

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

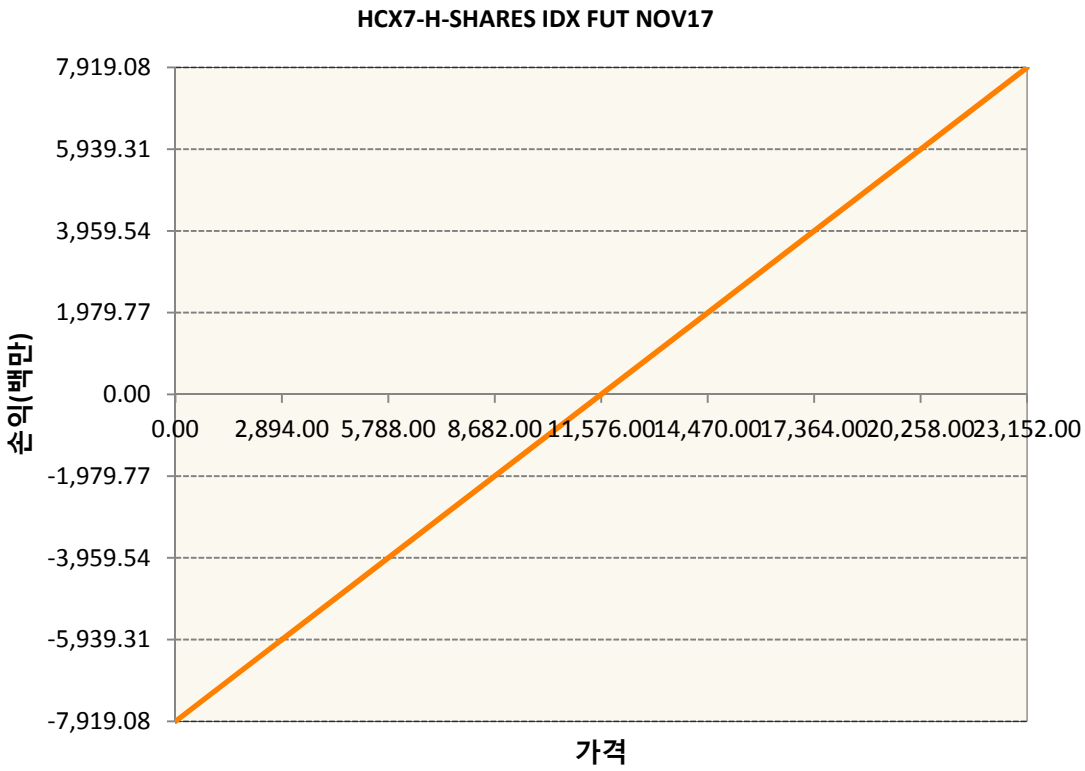
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

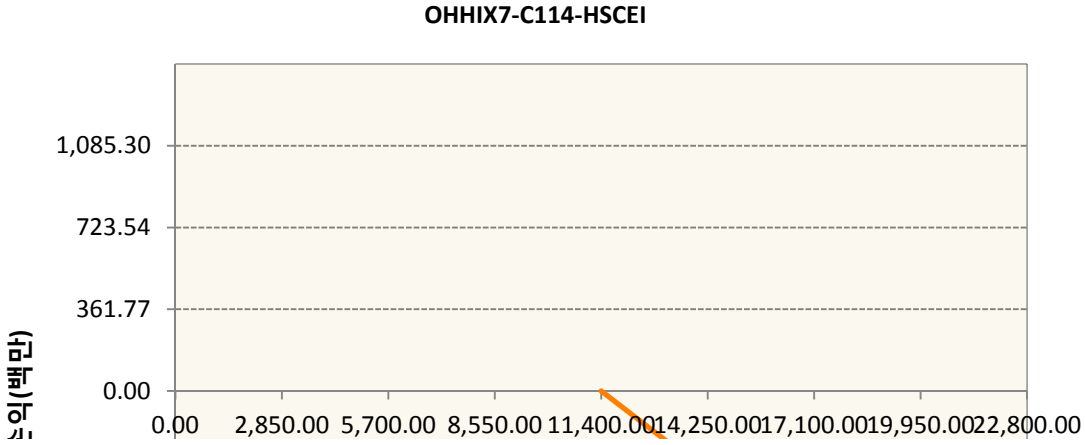
1. 계약금액

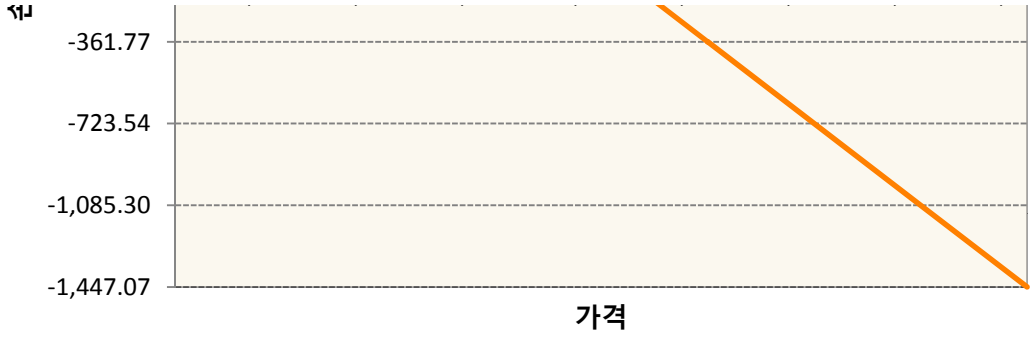
(단위:백만원)

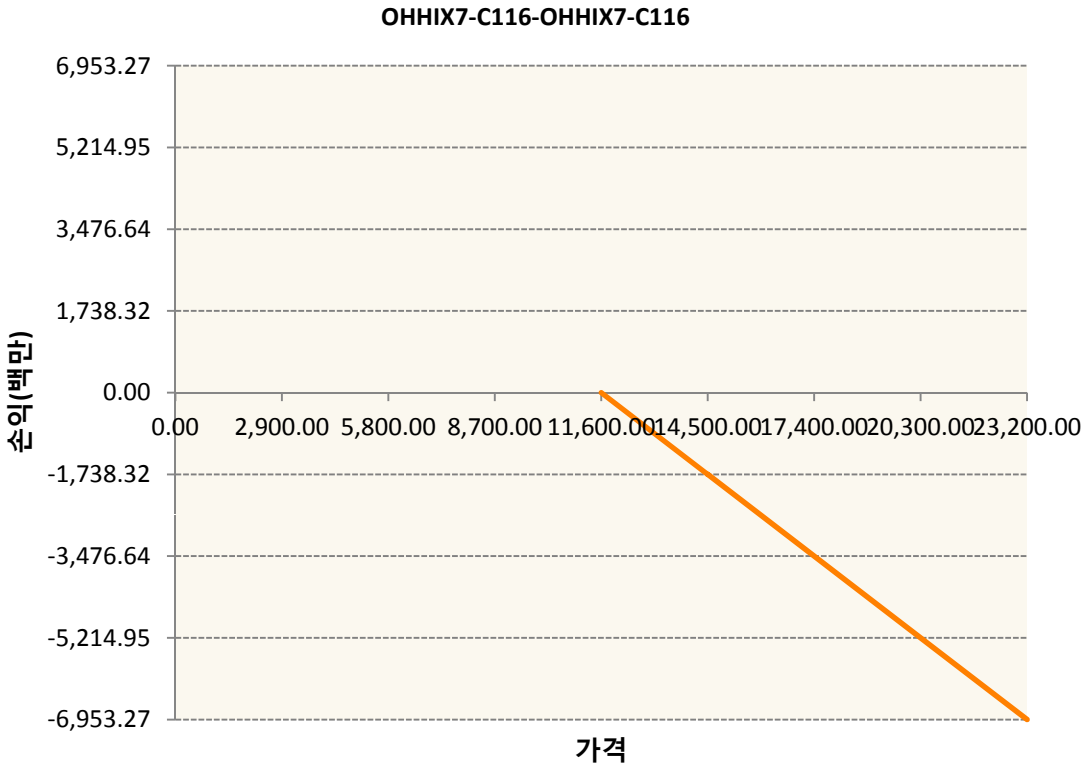
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,919	0	7,919	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,801	-16,801	장내

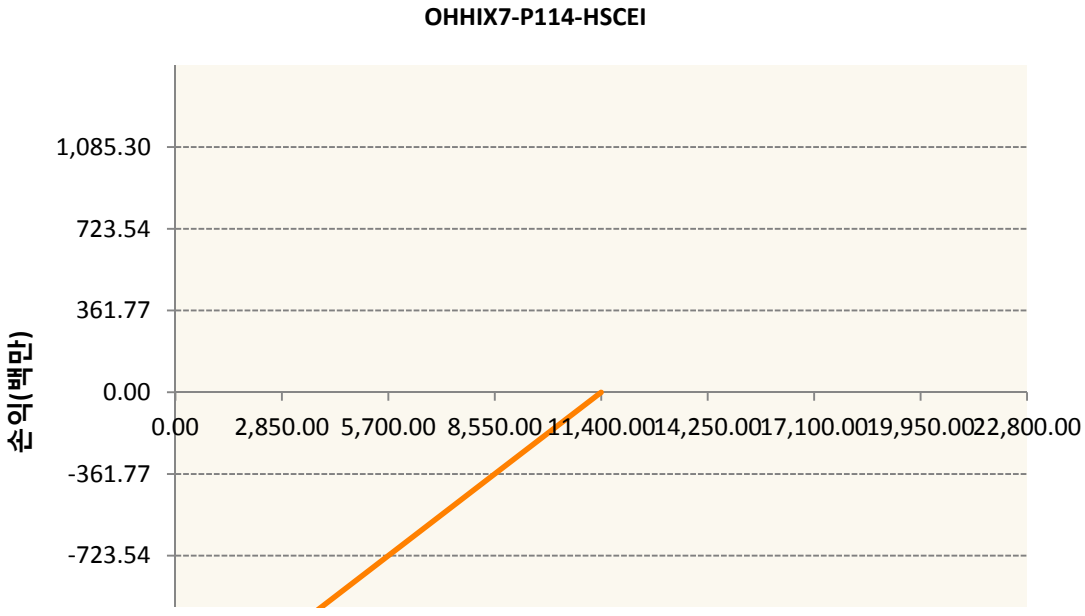
2. 만기시점의 손익구조

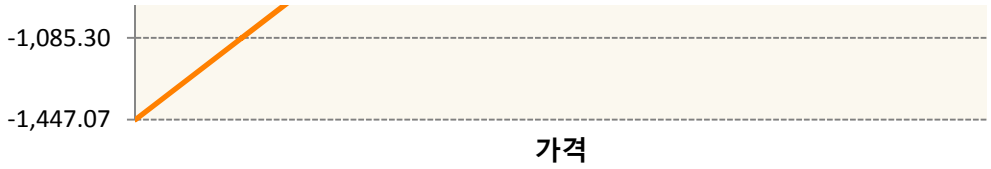


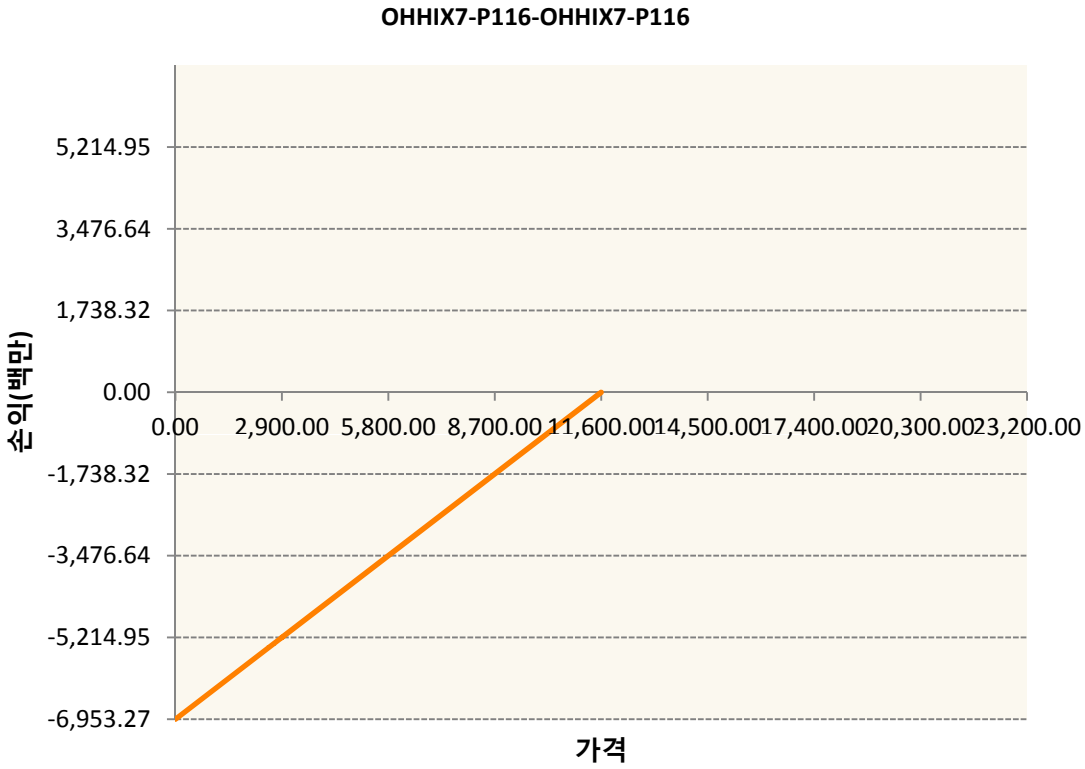



-361.77
-723.54
-1,085.30
-1,447.07
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,953.27
5,214.95
3,476.64
1,738.32
0.00
-1,738.32
-3,476.64
-5,214.95
-6,953.27
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
1,085.30
723.54
361.77
0.00
-361.77
-723.54
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	634
OHHIX7-C11	HSCEI	116
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	556
OHHIX7-P11	HSCEI	116
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	556

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

1,596

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

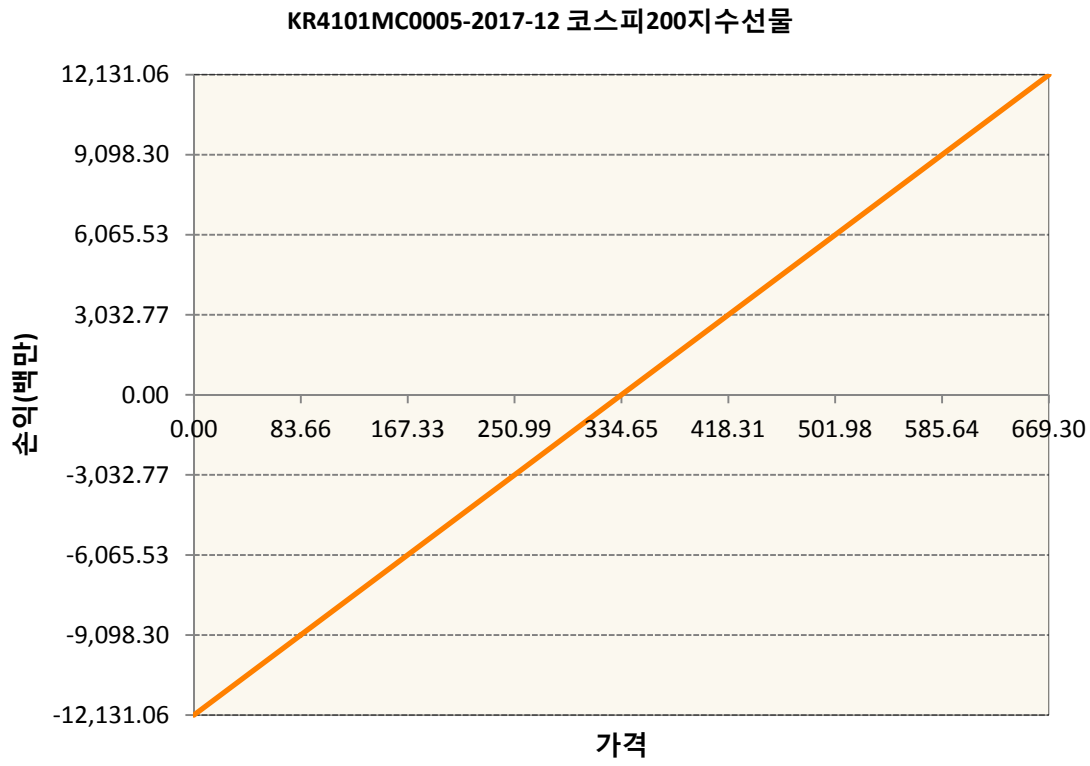
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

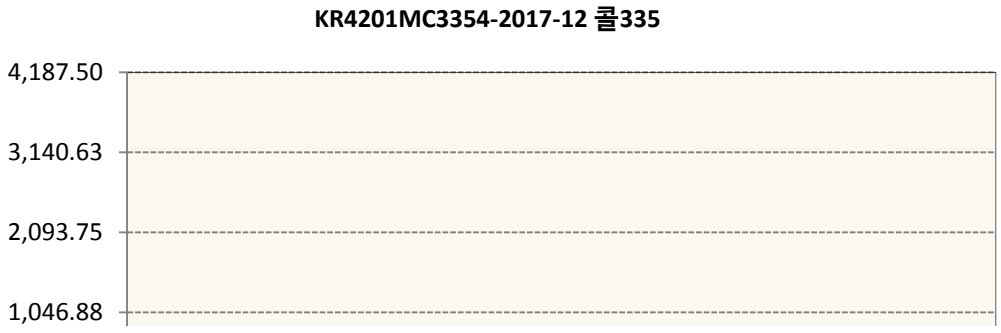
1. 계약금액

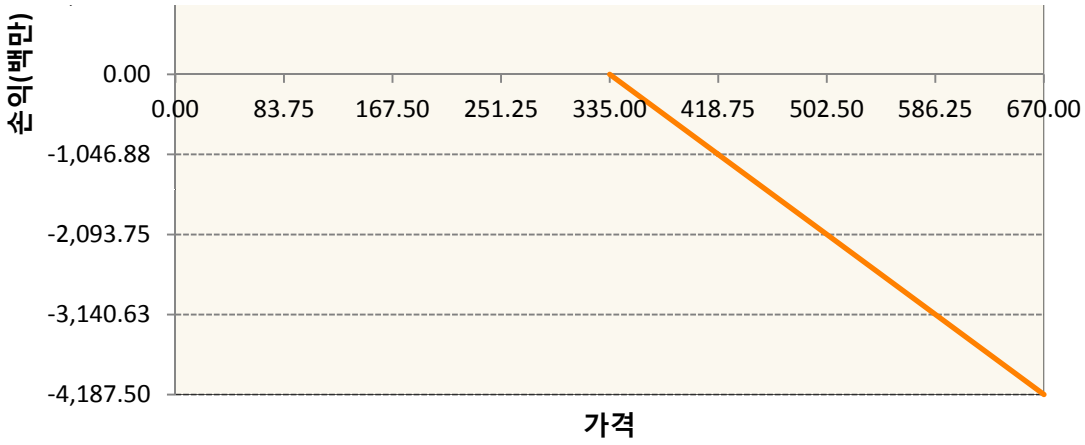
(단위:백만원)

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	12,131	0	12,131	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	52,659	-52,659	장내

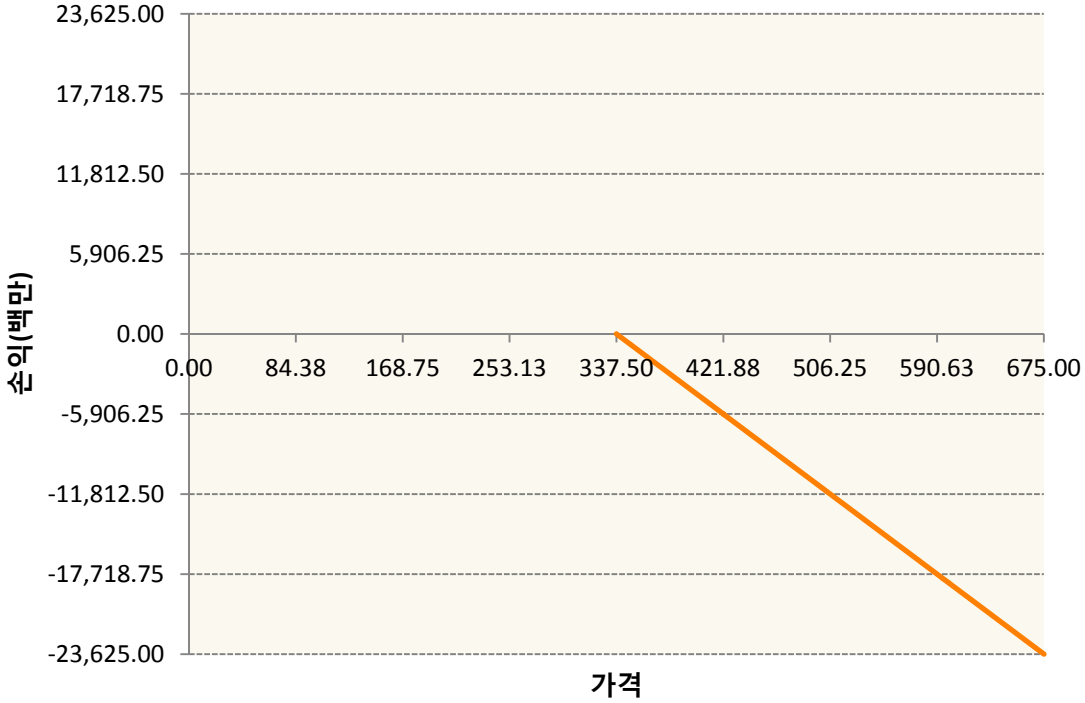
2. 만기시점의 손익구조



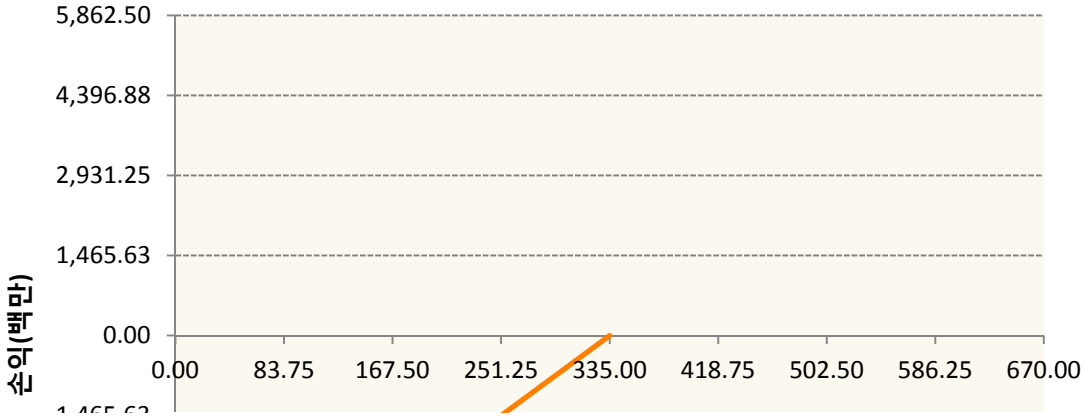




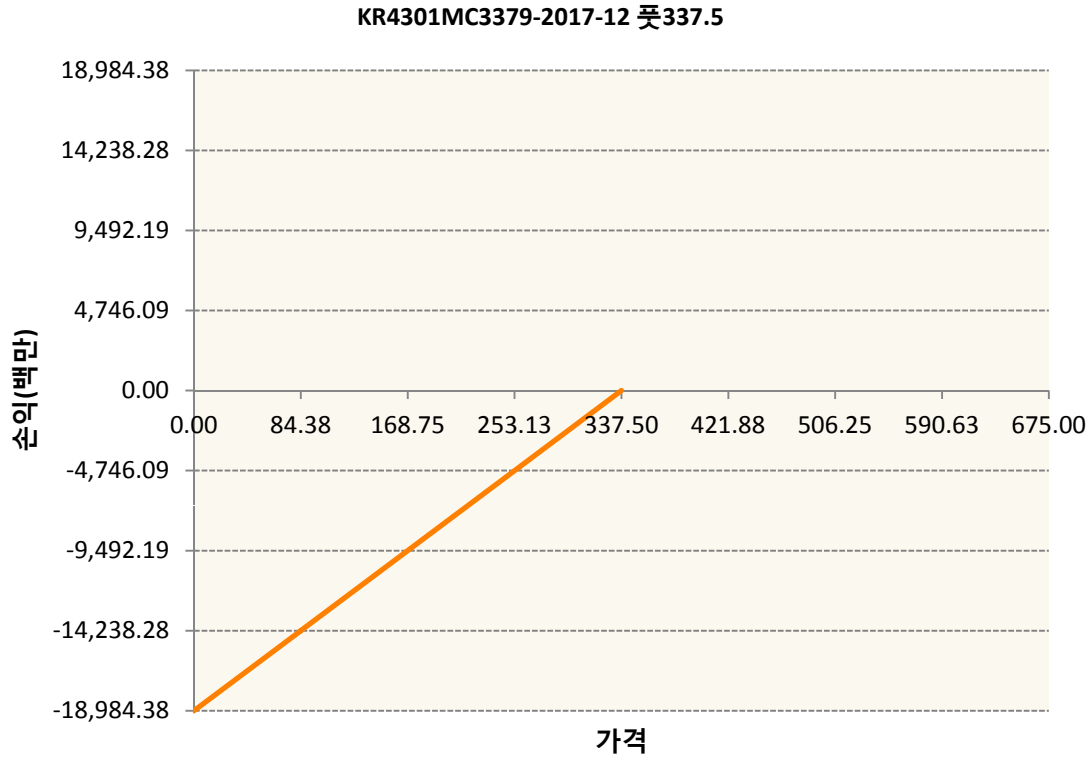
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,481
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,481	-1,481	-1,481	-1,481	-1,481	-1,481	-1,481
-5.33%	-988	-988	-988	-988	-988	-988	-988
-2.67%	-494	-494	-494	-494	-494	-494	-494
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	494	494	494	494	494	494	494
5.33%	988	988	988	988	988	988	988
8.00%	1,481	1,481	1,481	1,481	1,481	1,481	1,481
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%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
-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%	187	187	187	187	187	187	187
8.00%	280	280	280	280	280	280	280
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						160
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	107	107	107	107	107	107	107
8.00%	160	160	160	160	160	160	160
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						240
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-240	-240	-240	-240	-240	-240	-240
-5.33%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
-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%	160	160	160	160	160	160	160
8.00%	240	240	240	240	240	240	240
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						200
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200
-5.33%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-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%	133	133	133	133	133	133	133
8.00%	200	200	200	200	200	200	200
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						256
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256
-5.33%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	171	171	171	171	171	171	171
8.00%	256	256	256	256	256	256	256
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474
-5.33%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	316	316	316	316	316	316	316
8.00%	474	474	474	474	474	474	474
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						316
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-5.33%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
-2.67%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	105	105	105	105	105	105	105
5.33%	211	211	211	211	211	211	211
8.00%	316	316	316	316	316	316	316
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						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%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
-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%	187	187	187	187	187	187	187
8.00%	280	280	280	280	280	280	280
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						641
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-641	-641	-641	-641	-641	-641	-641
-5.33%	-427	-427	-427	-427	-427	-427	-427
-2.67%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	214	214	214	214	214	214	214
5.33%	427	427	427	427	427	427	427
8.00%	641	641	641	641	641	641	641
	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 콜335						255

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	104	101	97	92	87	82
-5.33%	97	91	85	79	72	65	58
-2.67%	73	65	56	48	39	30	21
0%	29	19	10	0	-10	-19	-29
2.67%	-38	-47	-56	-65	-74	-83	-92
5.33%	-124	-130	-137	-145	-152	-160	-168
8.00%	-223	-227	-232	-237	-242	-249	-255
	KR4201MC3. 2017-12 콜337.5						1,371

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	527	515	499	480	458	432	405
-5.33%	483	457	427	394	359	322	283
-2.67%	373	330	286	241	194	146	98
0%	159	106	53	0	-53	-107	-160
2.67%	-179	-231	-283	-335	-388	-441	-494
5.33%	-632	-673	-715	-760	-806	-853	-901
8.00%	-1,170	-1,196	-1,225	-1,258	-1,294	-1,331	-1,371
	KR4301MC3. 2017-12 풋335						400

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-399	-399	-399	-399	-400	-400	-400
-5.33%	-244	-244	-245	-246	-247	-249	-251
-2.67%	-95	-98	-101	-105	-109	-113	-118
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	67	63	59	55	50	46	41
5.33%	77	76	75	73	71	69	67
8.00%	78	77	77	77	77	76	75
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,345

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,343	-1,343	-1,343	-1,343	-1,344	-1,344	-1,345
-5.33%	-842	-843	-844	-846	-849	-853	-857

-2.67%	-353	-359	-367	-377	-387	-399	-411
0%	56	37	19	0	-19	-38	-57
2.67%	270	254	238	221	204	187	169
5.33%	324	319	314	306	298	288	278
8.00%	330	329	328	327	324	321	317

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

8,471

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

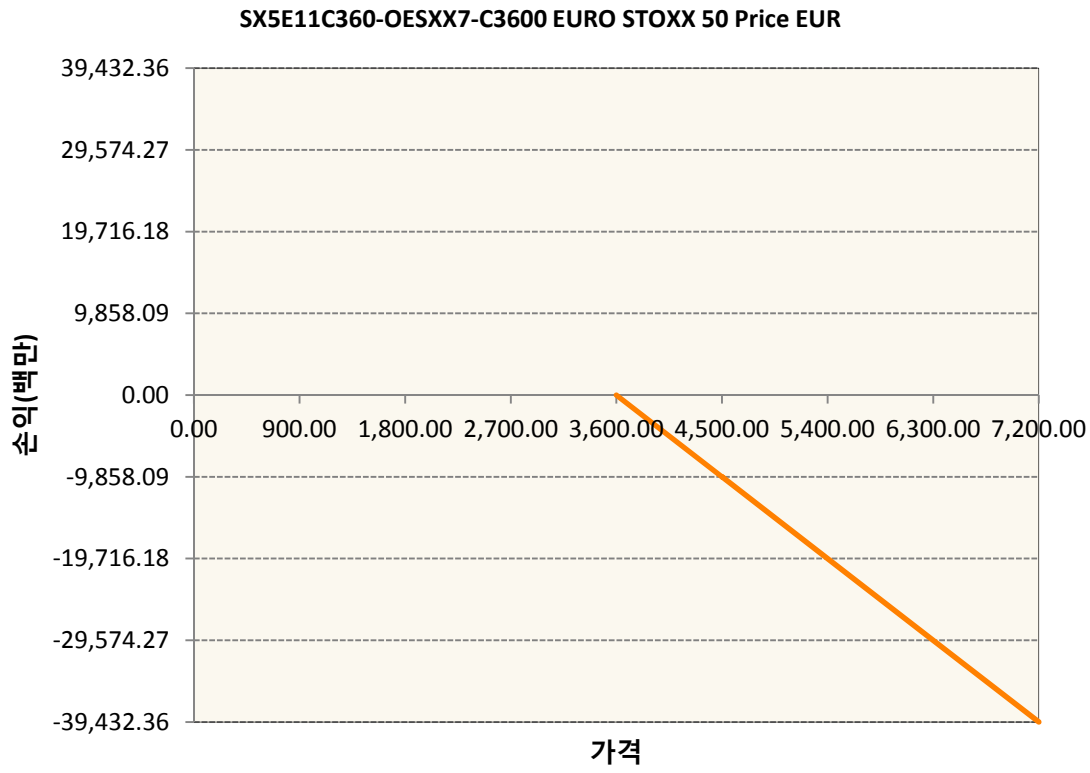
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

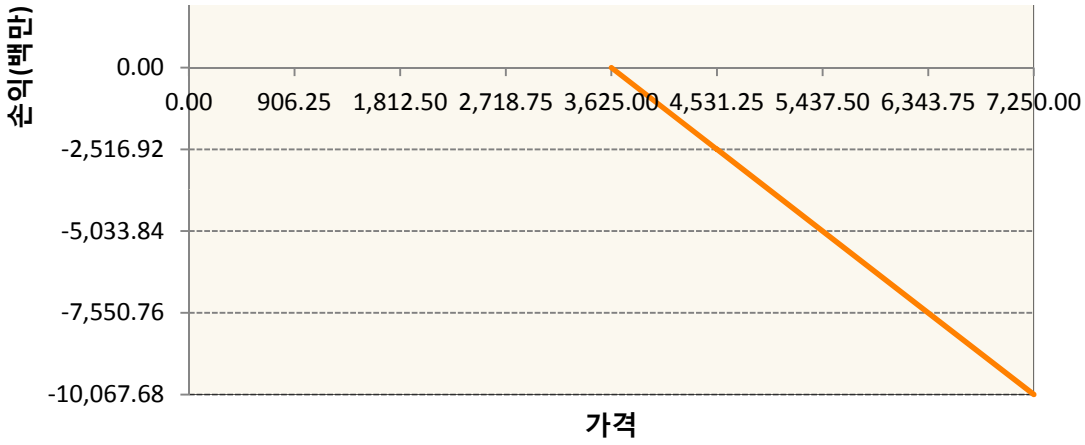
(단위:백만원)

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	41,893	0	41,893	
누계	유가증권	스왑	97,338	0	97,338	장외
누계	유가증권	옵션	0	99,000	-99,000	장내

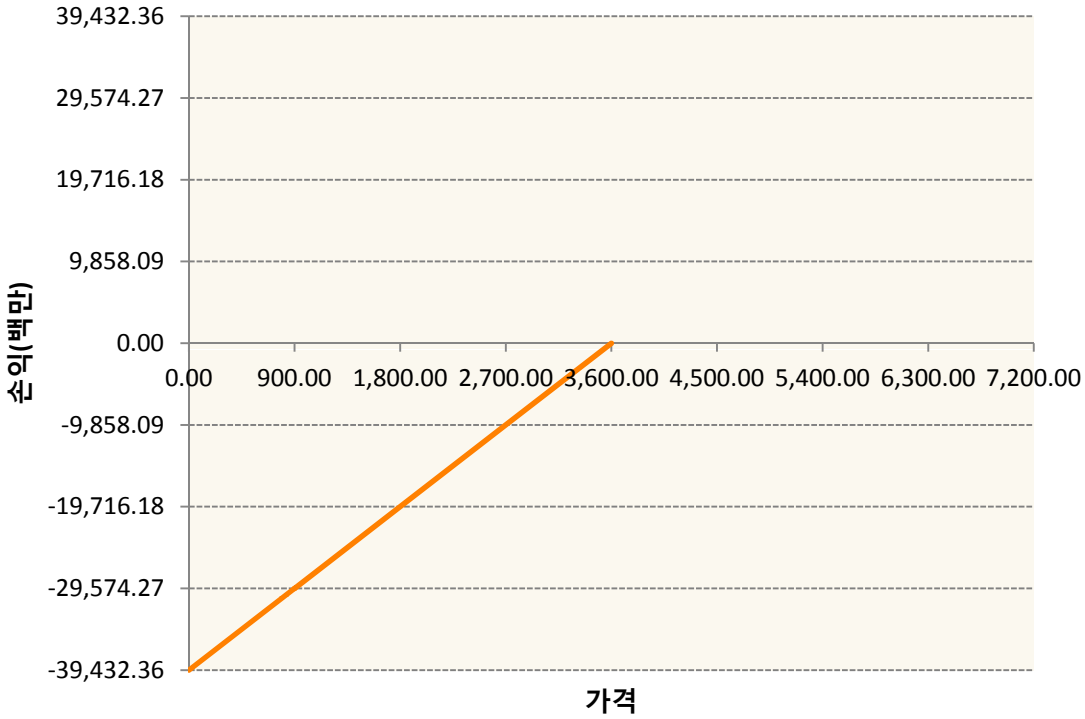
2. 만기시점의 손익구조



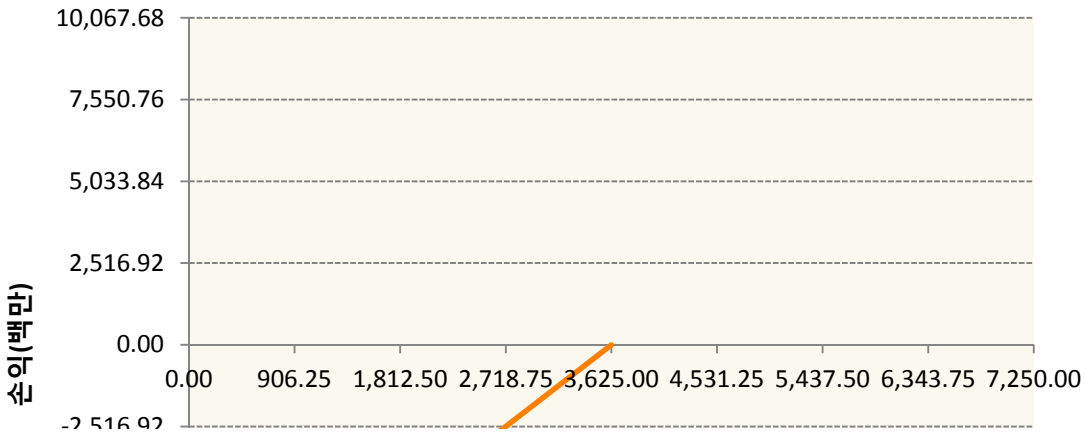




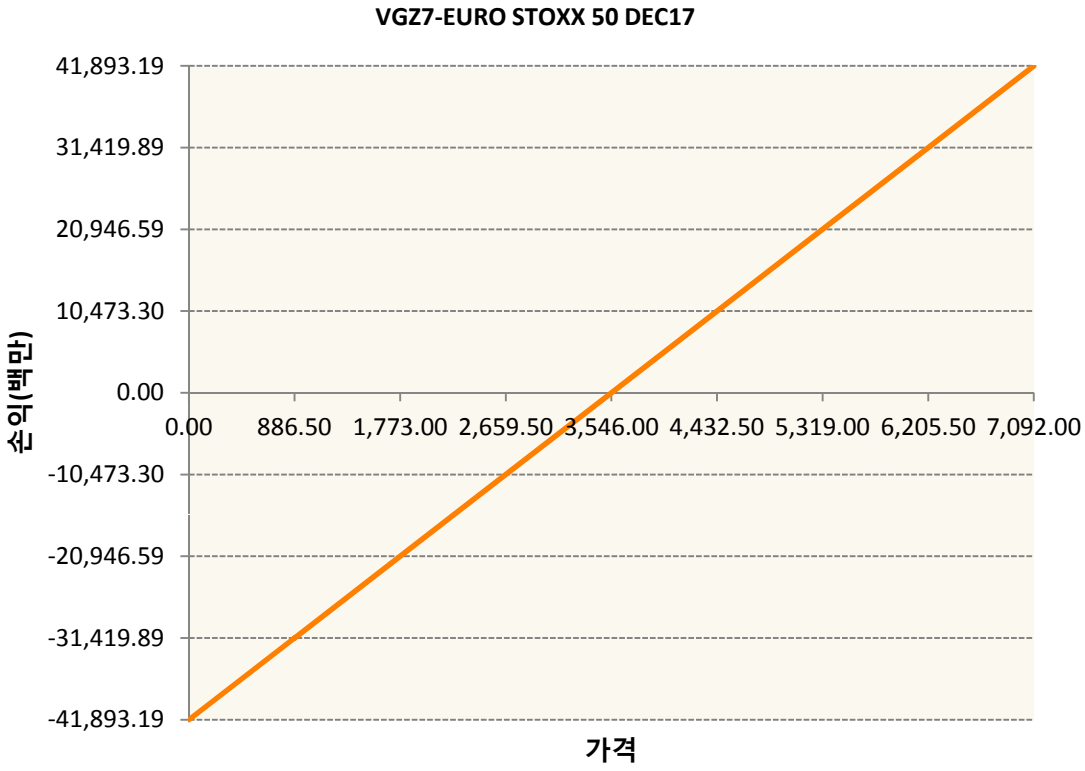
SX5E11P360-OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E11P362-OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	49
SX5E11C360	OESXX7-C3600 EURO STOXX 50 Price EUR	3,155
SX5E11C362	OESXX7-C3625 EURO STOXX 50 Price EUR	805
SX5E11P360	OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR	3,155
SX5E11P362	OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR	805
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,351

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7,021

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

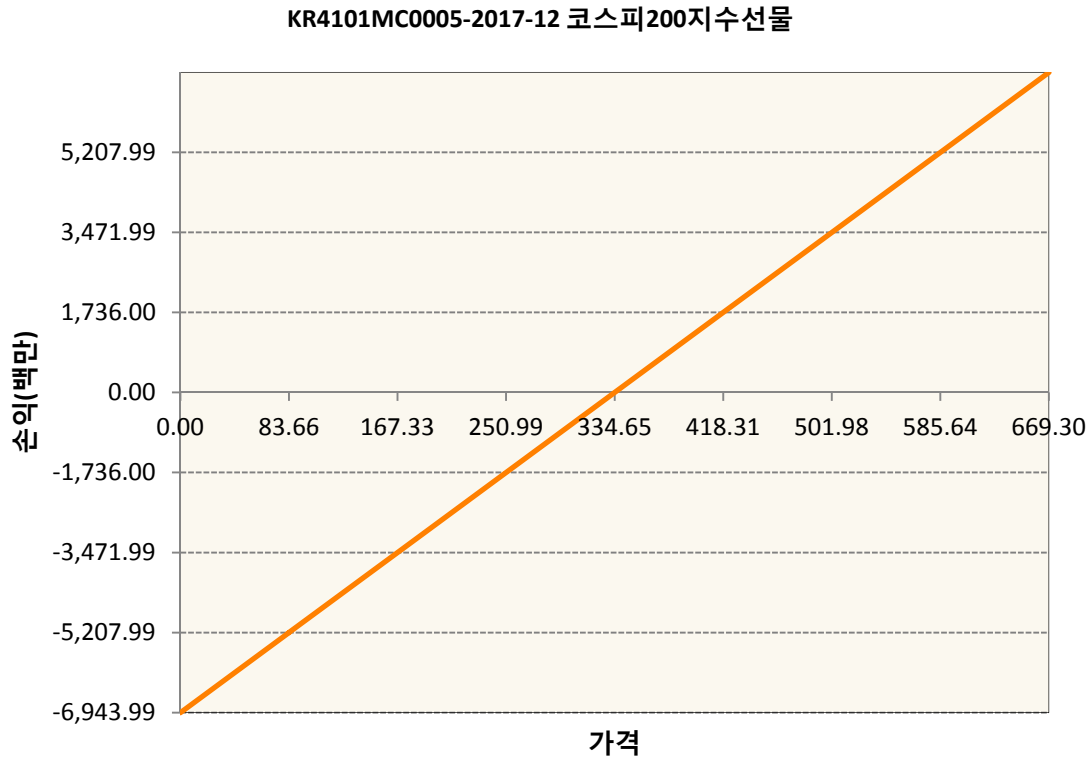
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,944	0	6,944	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)

319

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

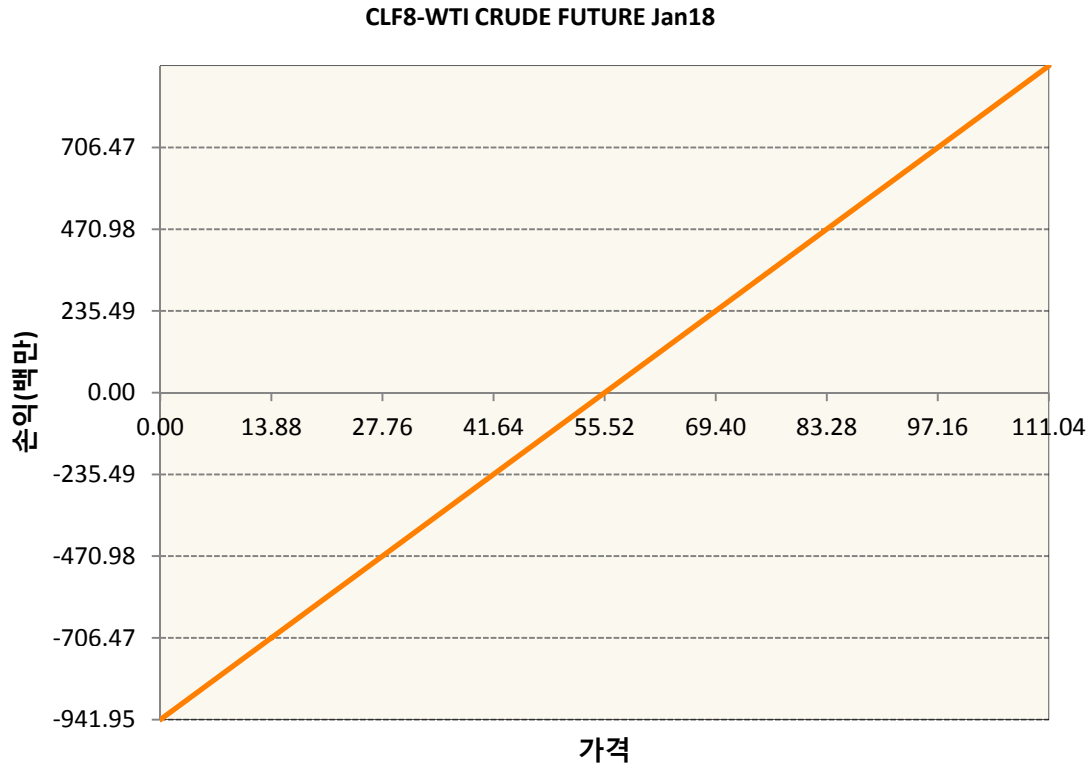
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

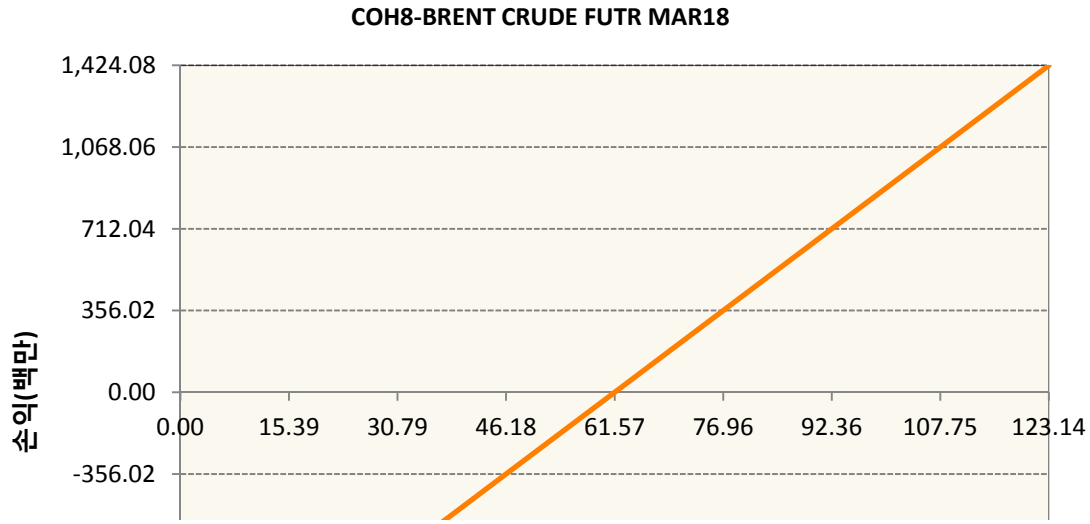
1. 계약금액

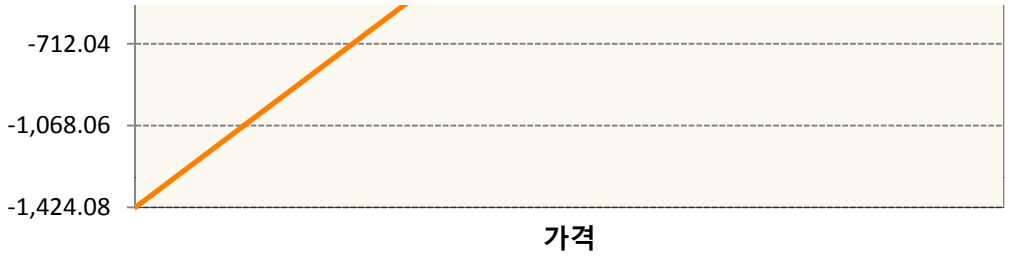
(단위:백만원)

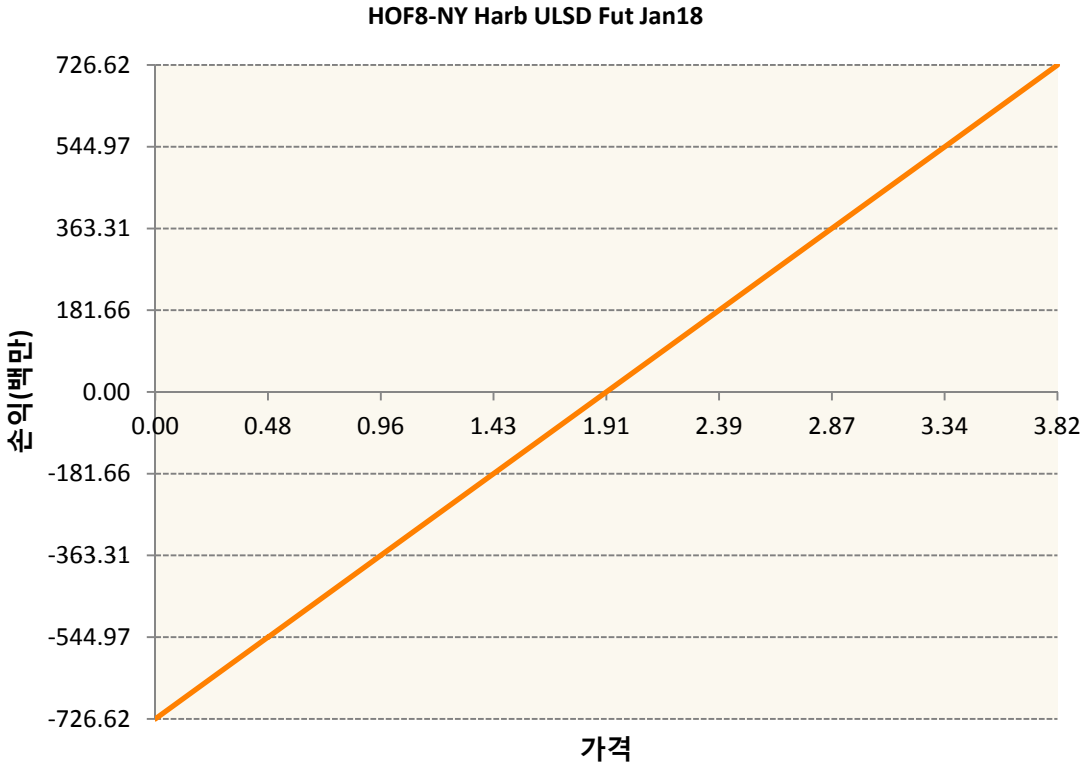
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,166	881	4,285	

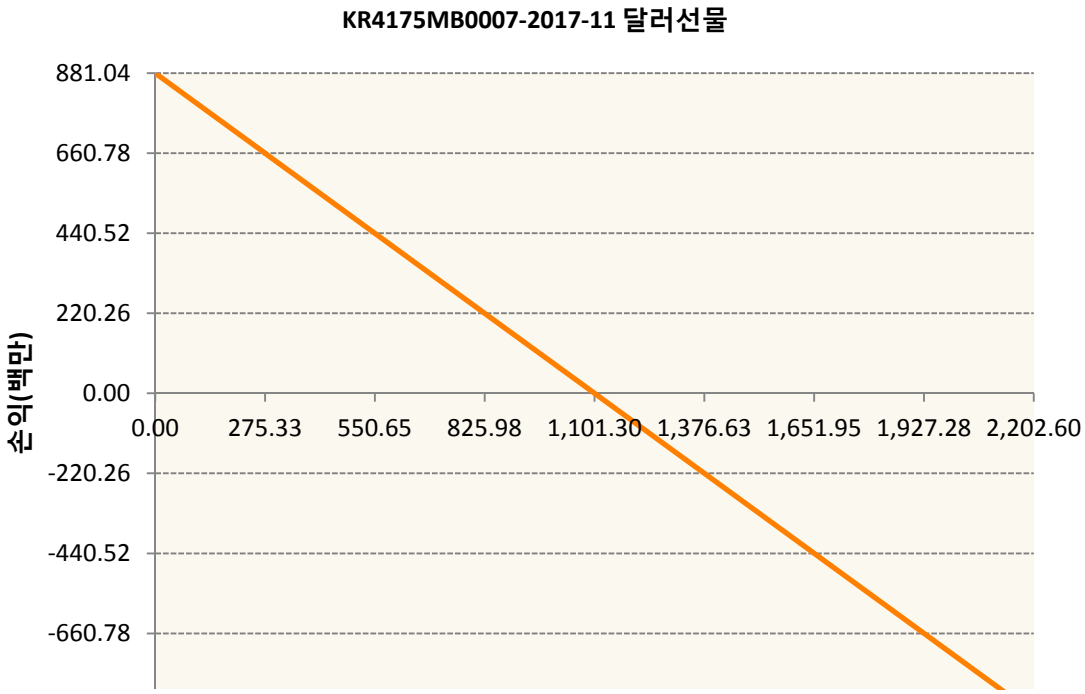
2. 만기시점의 손익구조

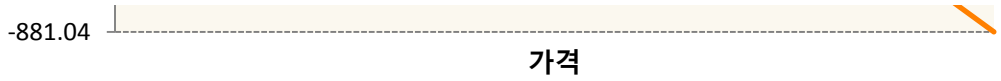


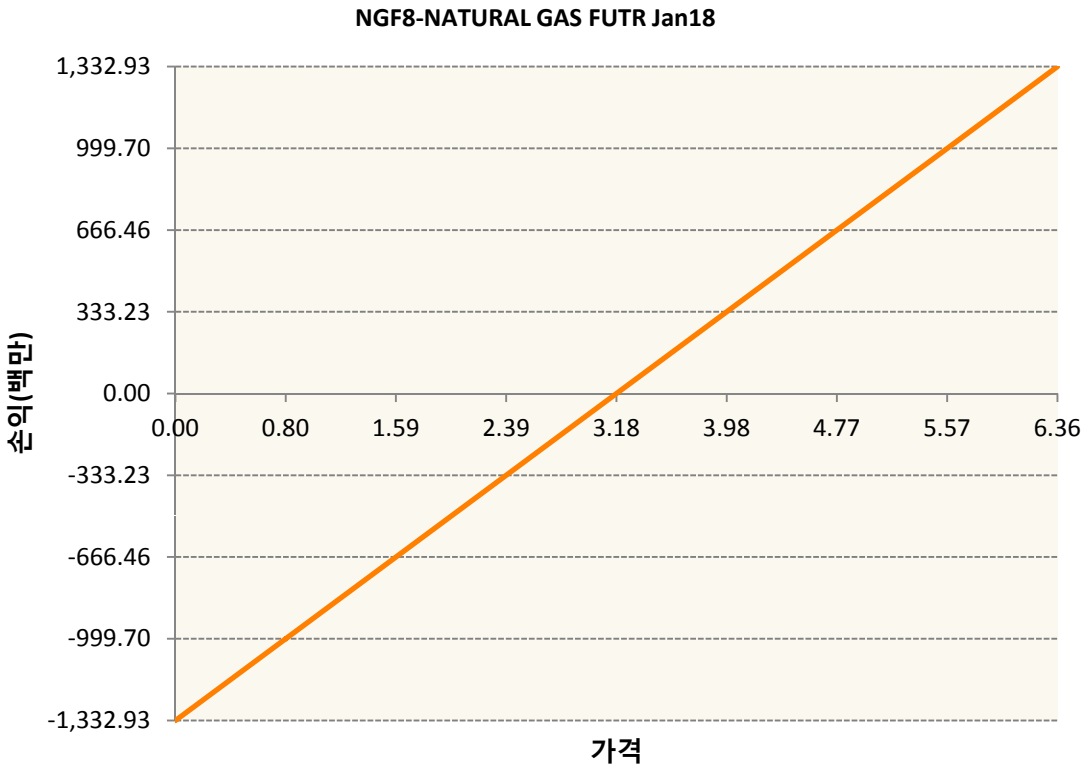


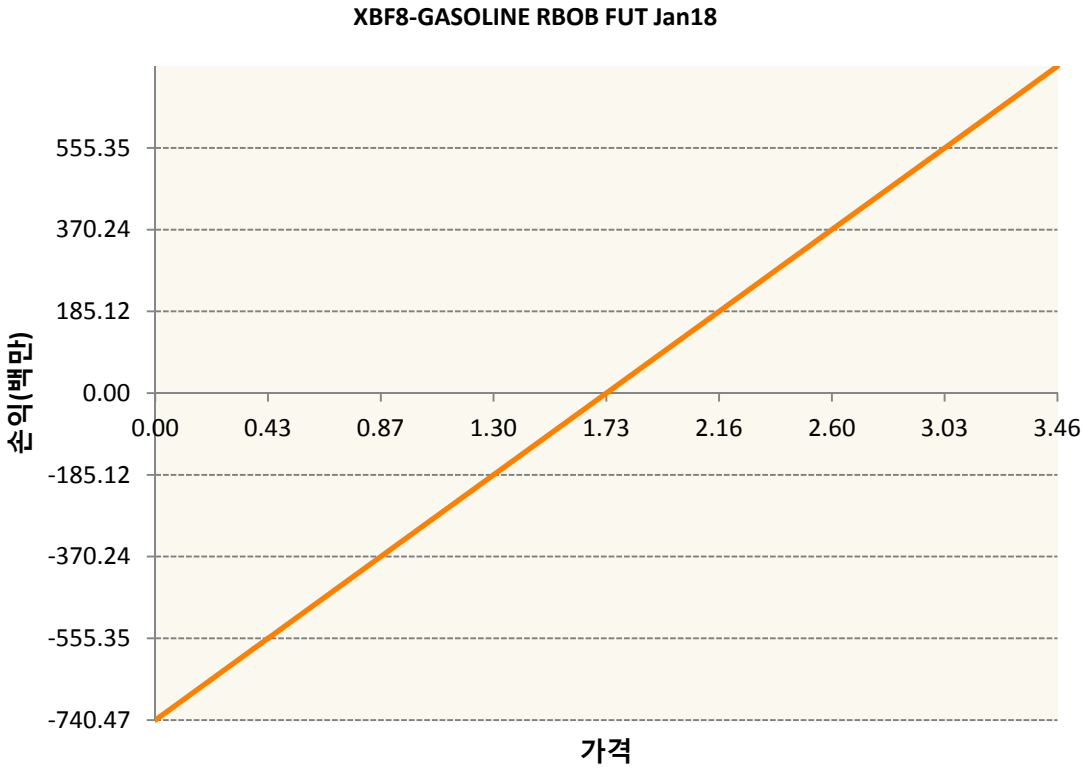

-712.04
-1,068.06
-1,424.08
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
726.62
544.97
363.31
181.66
0.00
-181.66
-363.31
-544.97
-726.62
0.00
0.48
0.96
1.43
1.91
2.39
2.87
3.34
3.82
손익(백만)
가격


KR4175MB0007-2017-11 달러선물
881.04
660.78
440.52
220.26
0.00
-220.26
-440.52
-660.78
0.00
275.33
550.65
825.98
1,101.30
1,376.63
1,651.95
1,927.28
2,202.60
손익(백만)


-881.04
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,332.93
999.70
666.46
333.23
0.00
-333.23
-666.46
-999.70
-1,332.93
0.00
0.80
1.59
2.39
3.18
3.98
4.77
5.57
6.36
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
555.35
370.24
185.12
0.00
-185.12
-370.24
-555.35
-740.47
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
3.46
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	75
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	114
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	58
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	107
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	59

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

727

공시일	2017-11-17
기준일	2017-11-16

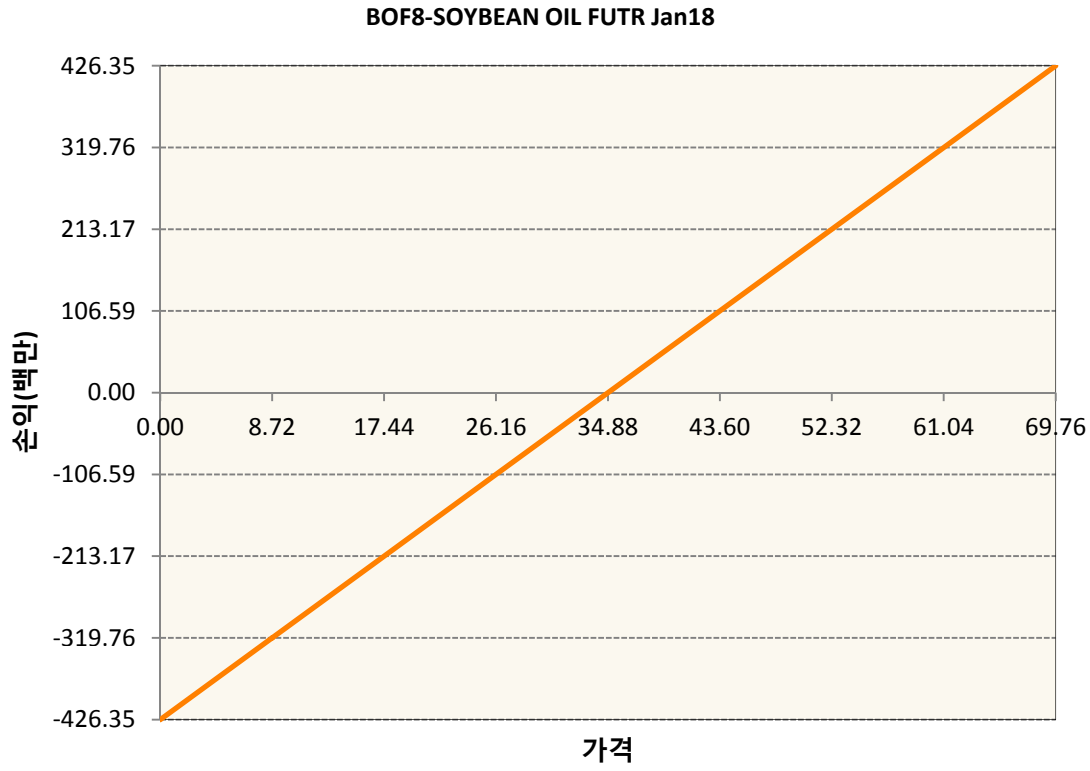
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

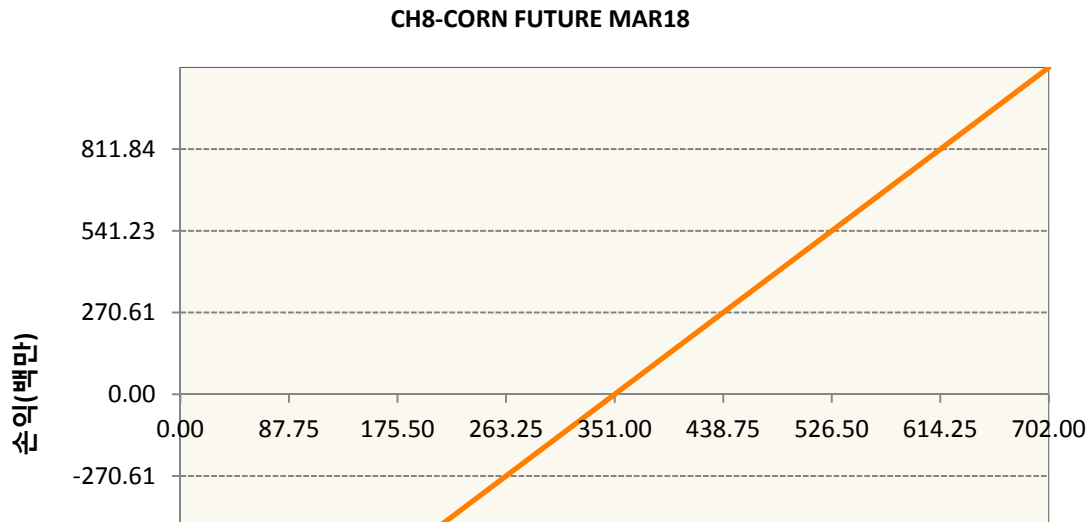
1. 계약금액

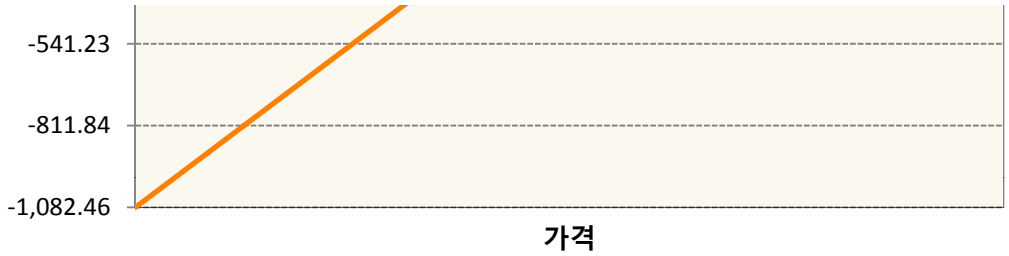
(단위:백만원)

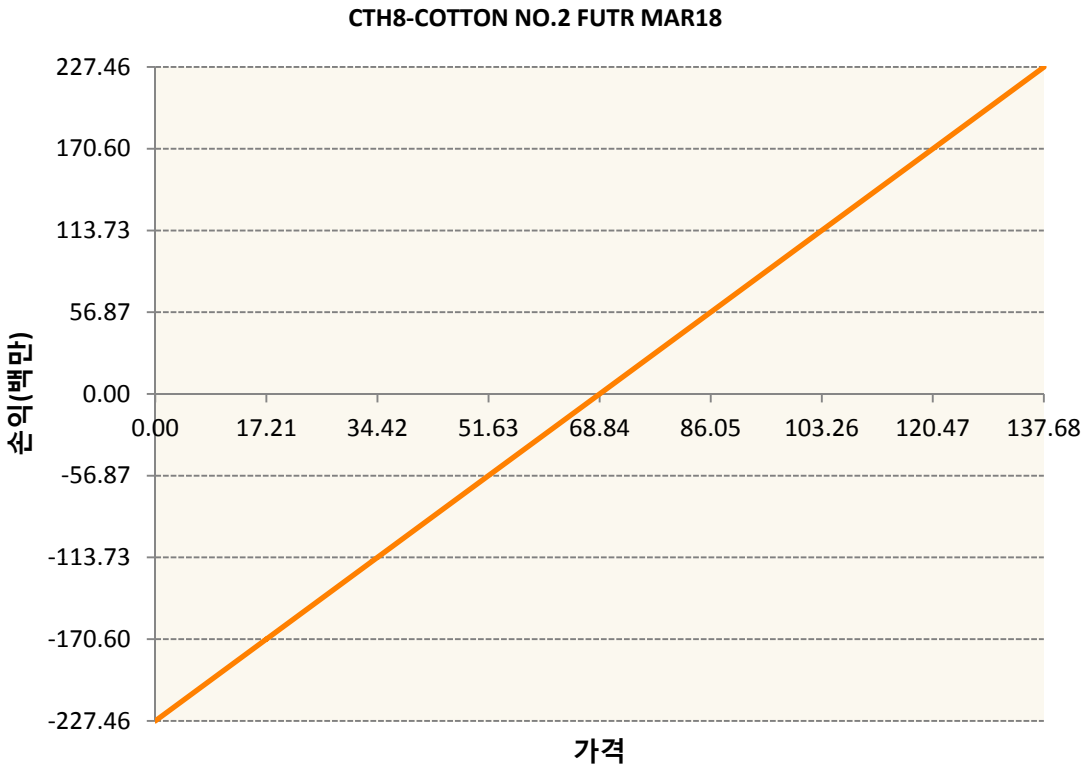
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,509	330	4,178	

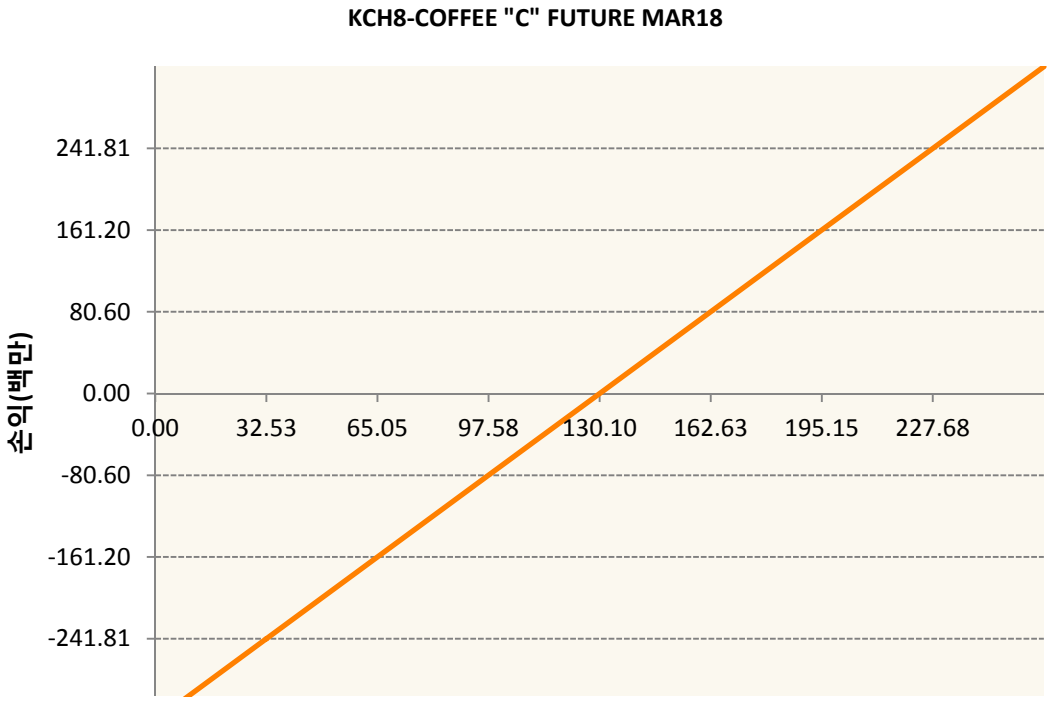
2. 만기시점의 손익구조

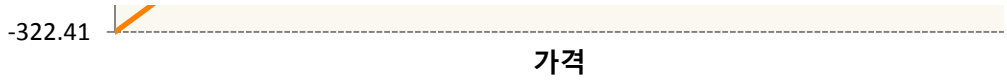


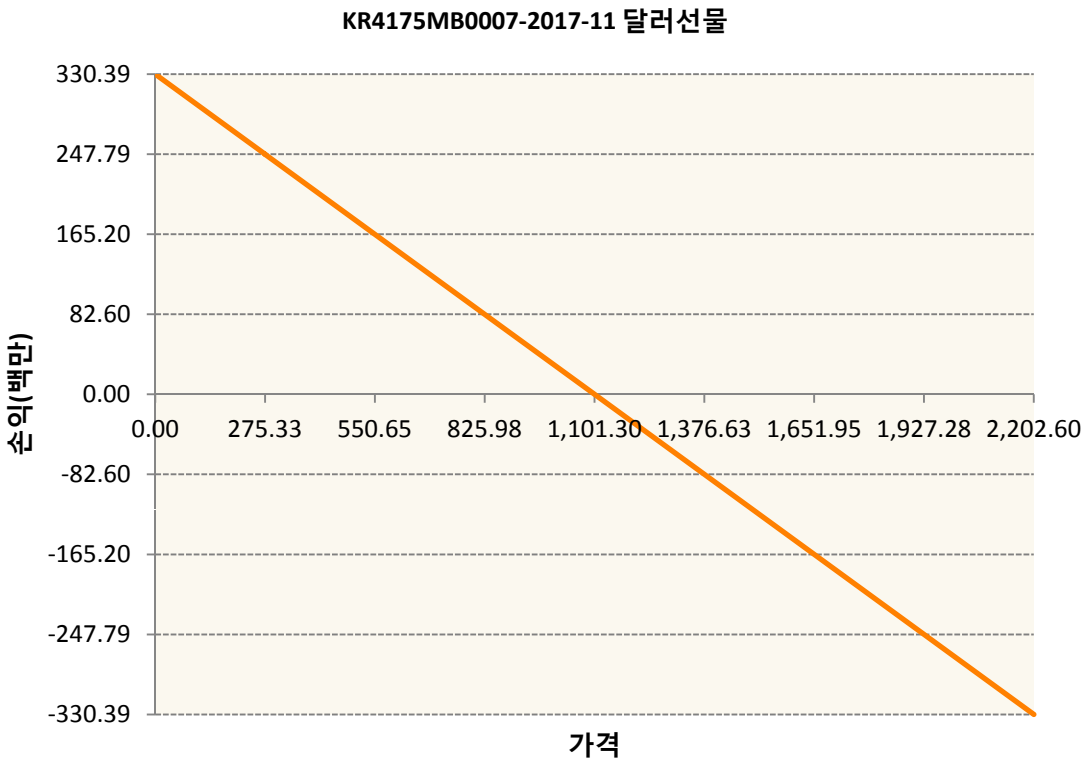


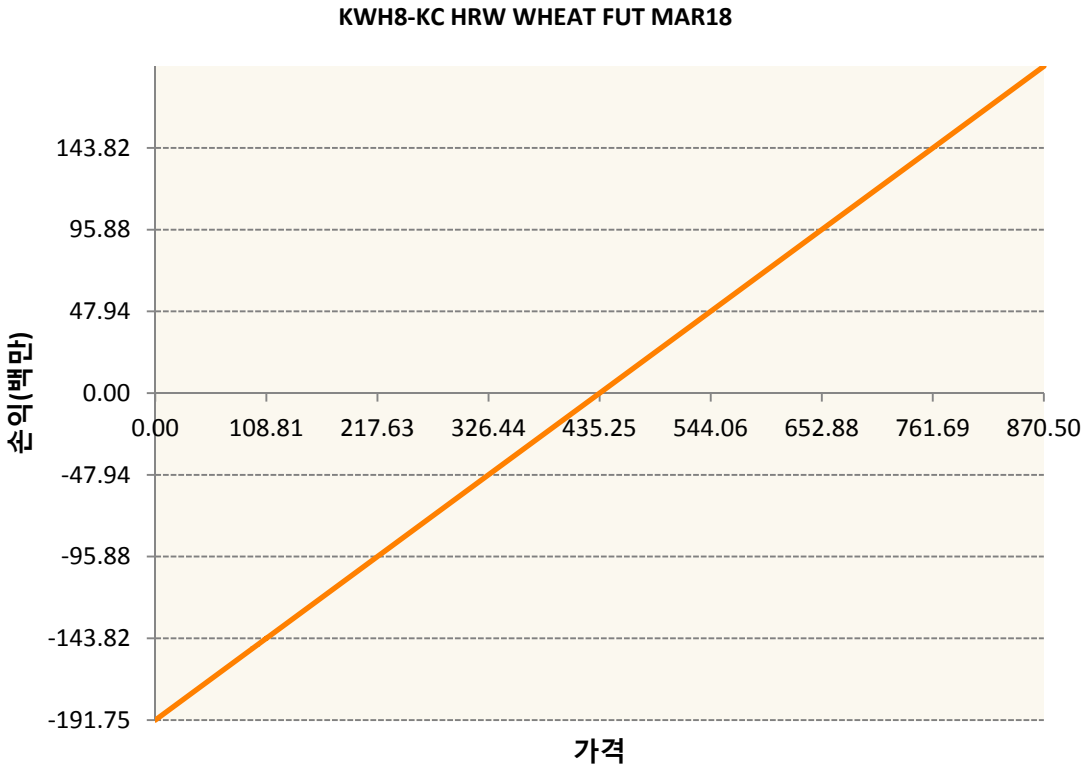

-541.23
-811.84
-1,082.46
가격

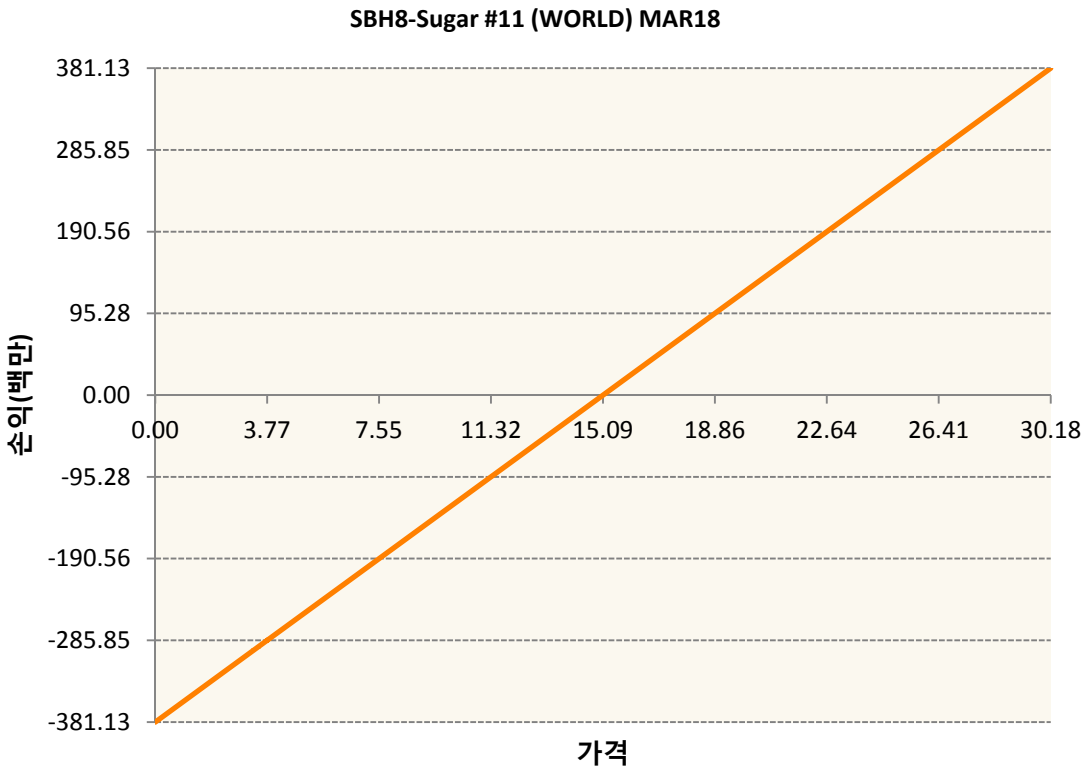

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
227.46
170.60
113.73
56.87
0.00
-56.87
-113.73
-170.60
-227.46
0.00
17.21
34.42
51.63
68.84
86.05
103.26
120.47
137.68
손익(백만)
가격

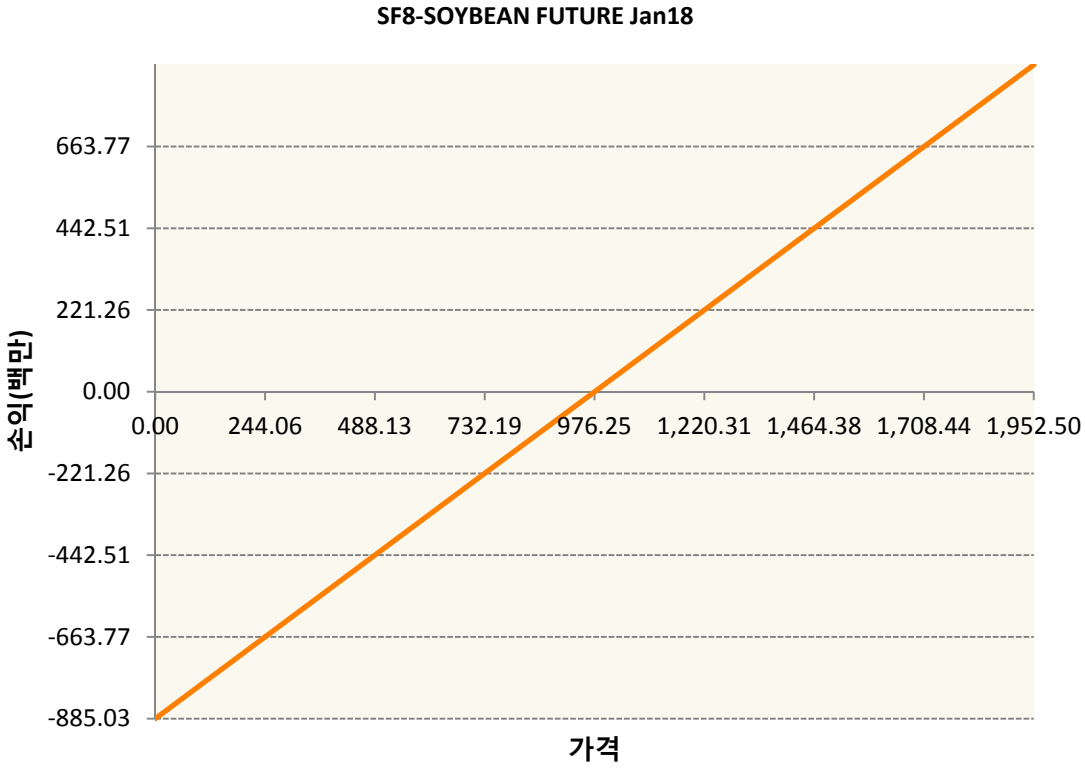

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
241.81
161.20
80.60
0.00
-80.60
-161.20
-241.81
0.00
32.53
65.05
97.58
130.10
162.63
195.15
227.68
손익(백만)


-322.41
가격

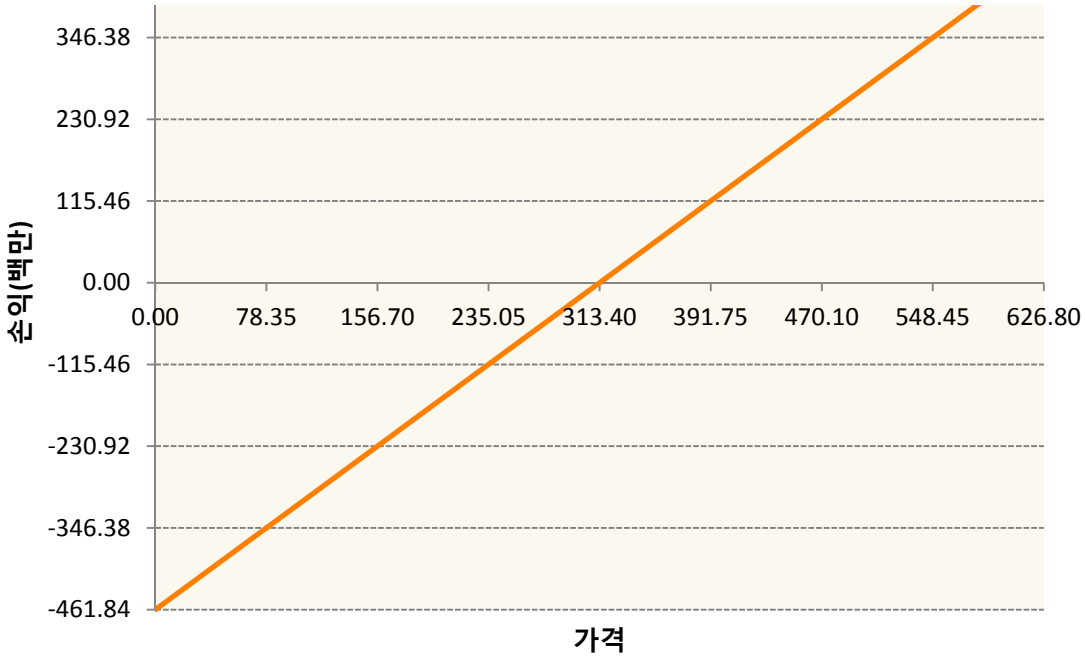

KR4175MB0007-2017-11 달러선물
330.39
247.79
165.20
82.60
0.00
-82.60
-165.20
-247.79
-330.39
0.00
275.33
550.65
825.98
1,101.30
1,376.63
1,651.95
1,927.28
2,202.60
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
143.82
95.88
47.94
0.00
-47.94
-95.88
-143.82
-191.75
0.00
108.81
217.63
326.44
435.25
544.06
652.88
761.69
870.50
손익(백만)
가격

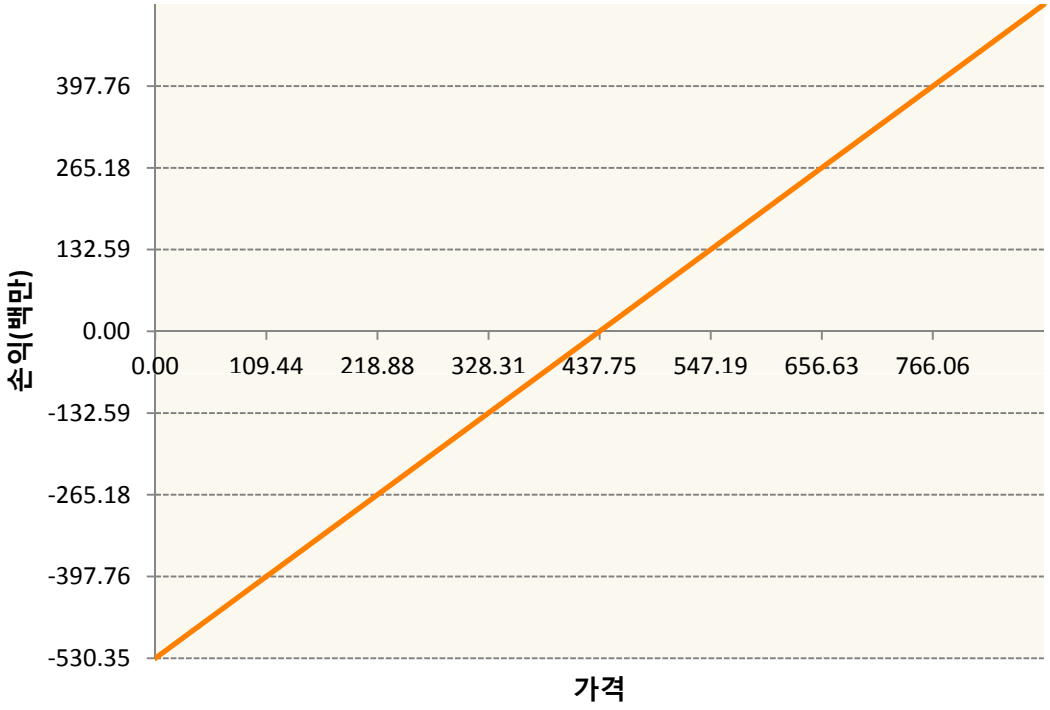

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
381.13
285.85
190.56
95.28
0.00
-95.28
-190.56
-285.85
-381.13
0.00
3.77
7.55
11.32
15.09
18.86
22.64
26.41
30.18
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
663.77
442.51
221.26
0.00
-221.26
-442.51
-663.77
-885.03
0.00
244.06
488.13
732.19
976.25
1,220.31
1,464.38
1,708.44
1,952.50
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
461.84



WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	34
CH8	CORN FUTURE MAR18	87
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	18
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	26
KR4175MB0(	2017-11 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	15
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	30
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	71
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	37
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	42

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

405