공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

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	2017-11-20
기준일	2017-11-17

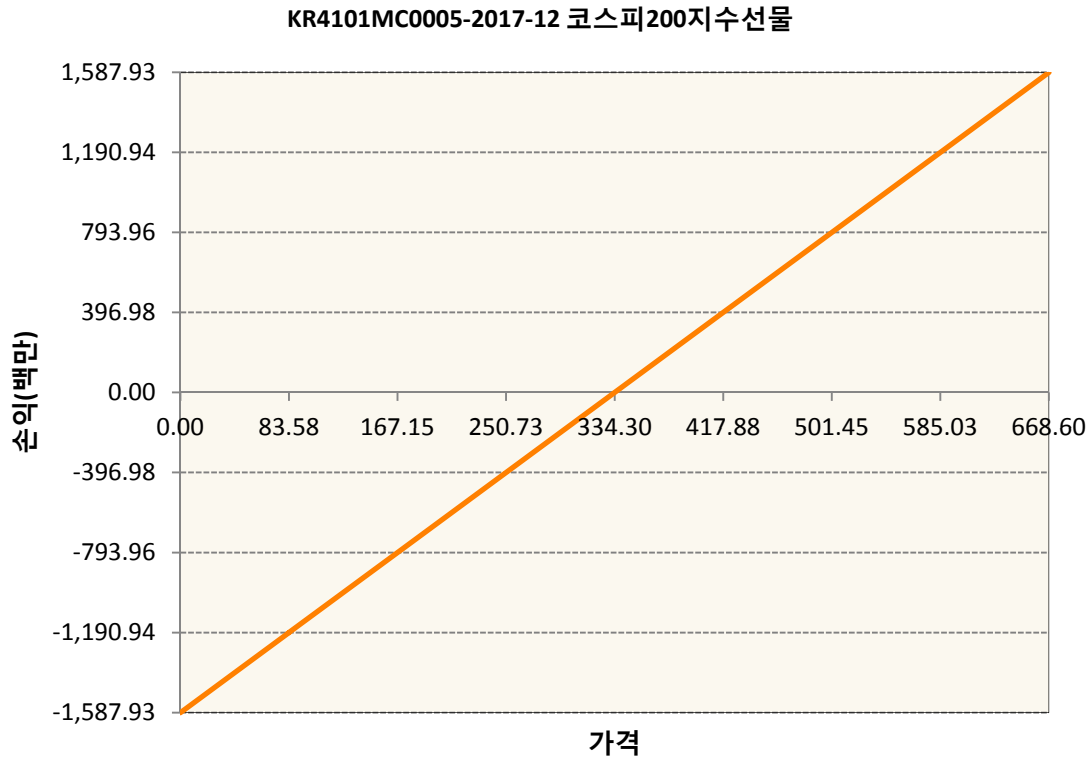
스마트인덱스모

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	1,588	0	1,588	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)

72

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

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	1,064

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

349

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

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	405

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

357

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

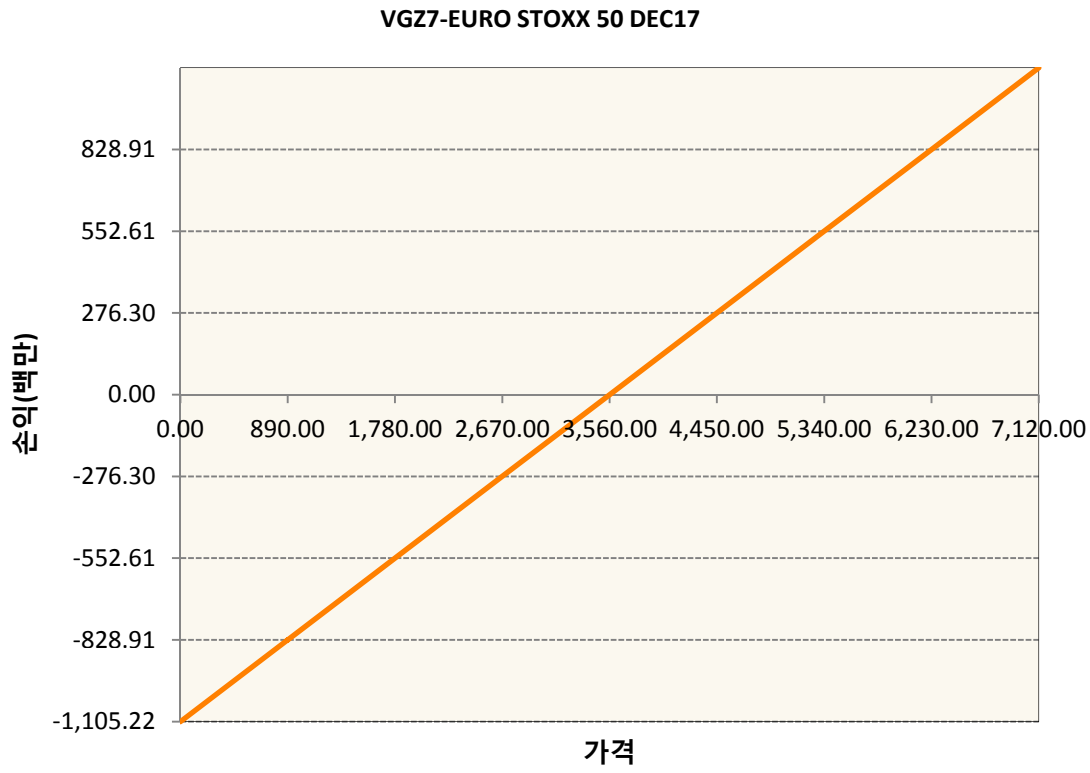
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,105	0	1,105	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	88

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

(단위:백만원)

54

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

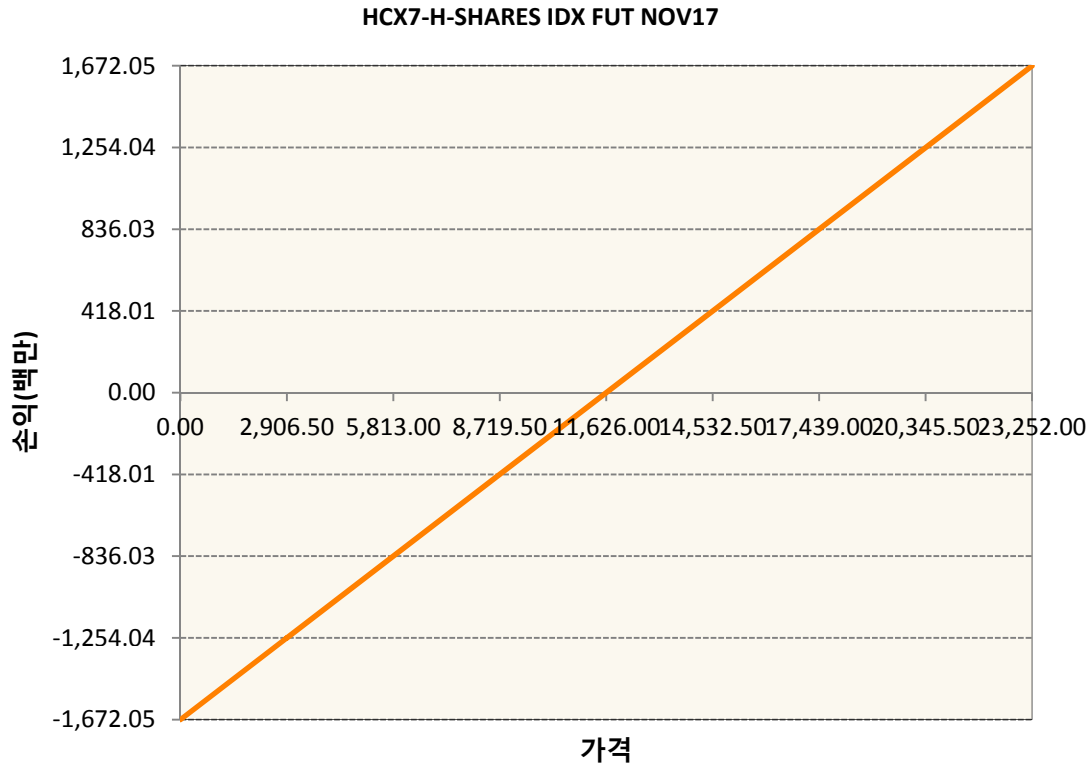
차이나인덱스모(주식-파생형)

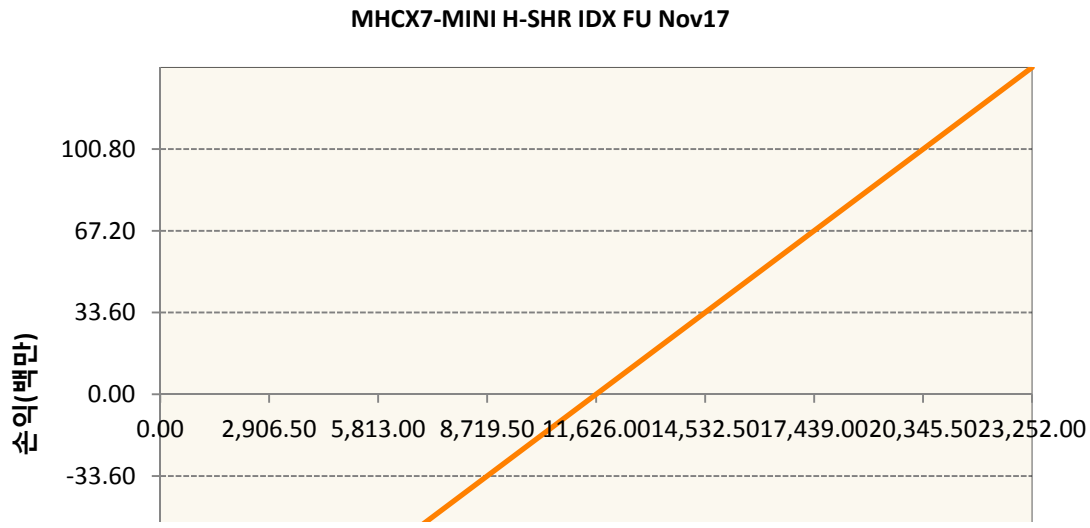
1. 계약금액

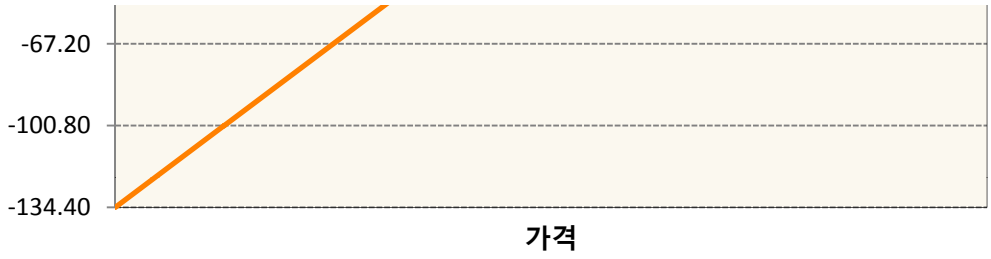
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,806	0	1,806	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	134
MHCX7	MINI H-SHR IDX FU Nov17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	117

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

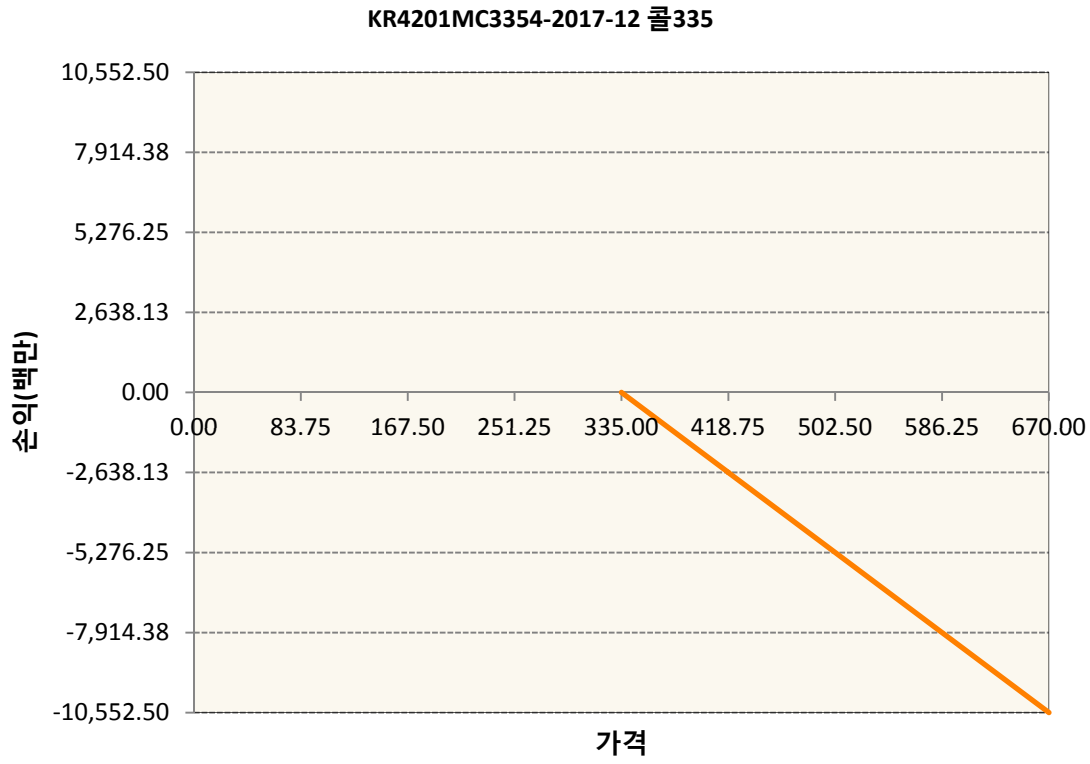
커버드콜모(주식혼합-파생형)

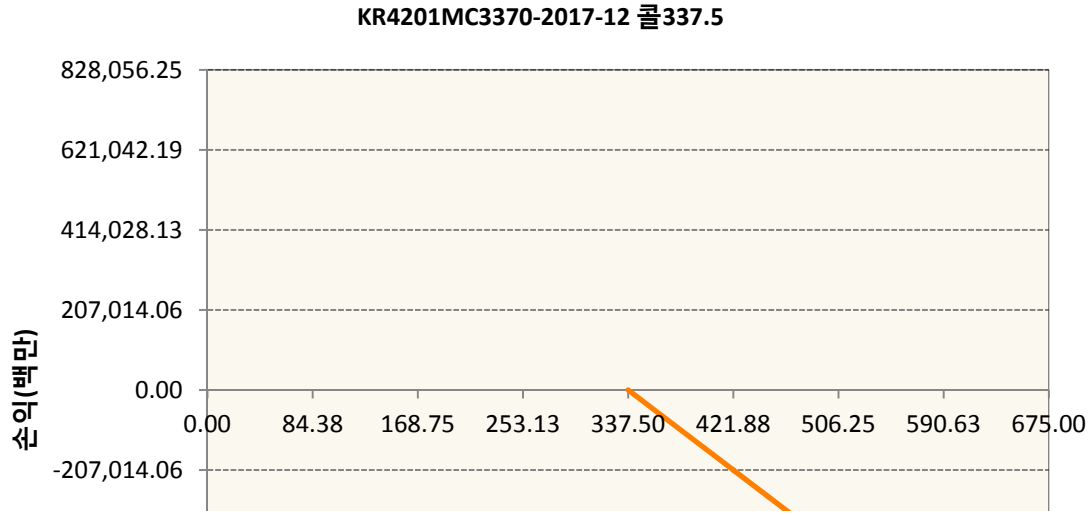
1. 계약금액

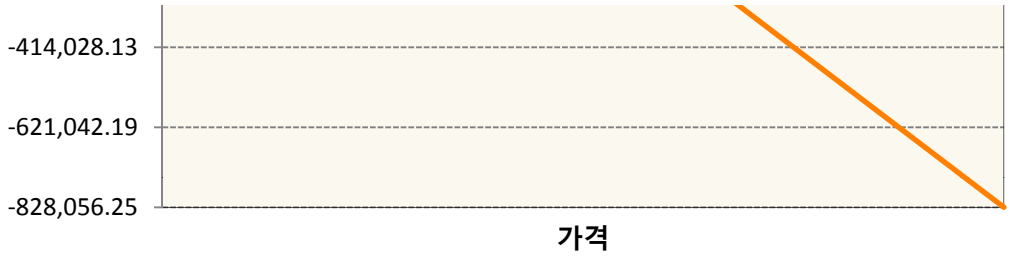
(단위:백만원)

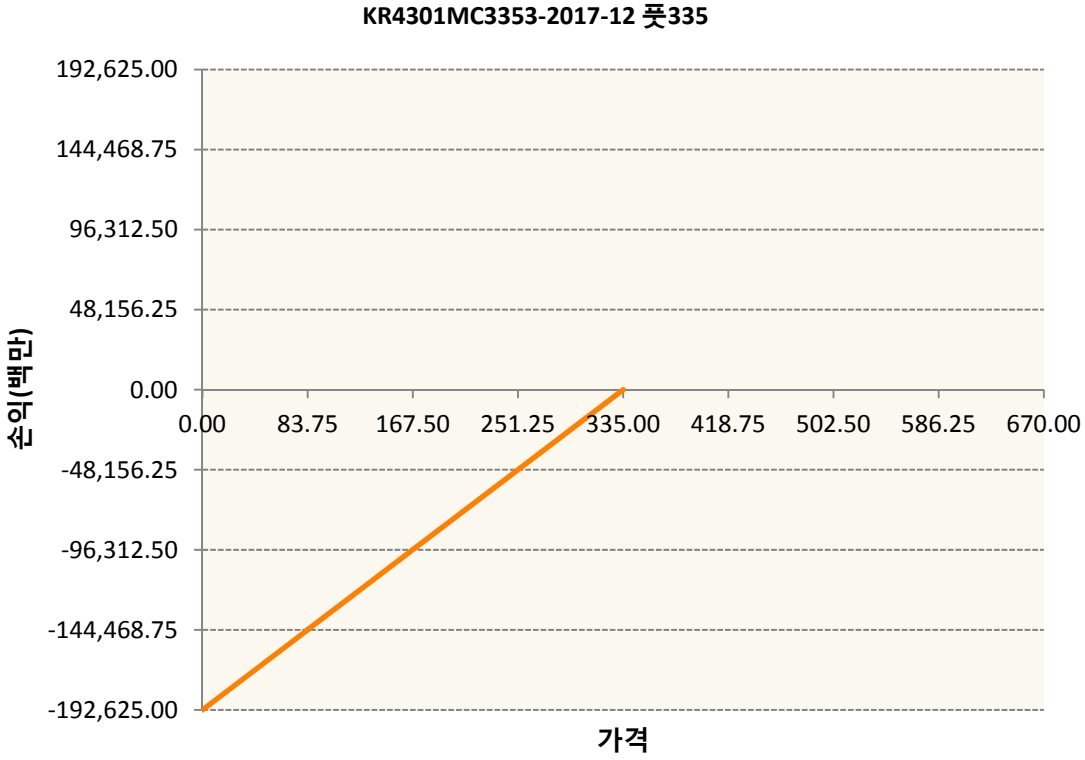
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

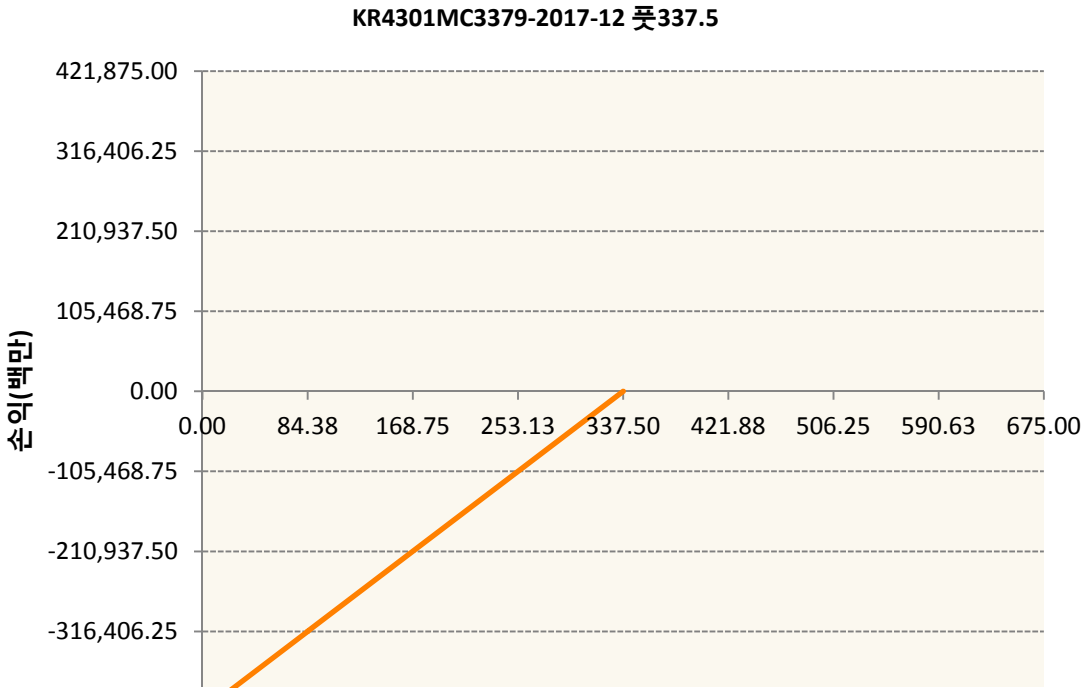
2. 만기시점의 손익구조






-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%	265	258	250	240	229	217	204
-5.33%	240	227	212	196	179	162	144
-2.67%	181	161	140	119	97	75	53
0%	71	48	24	0	-24	-48	-71
2.67%	-95	-117	-139	-162	-185	-208	-231
5.33%	-312	-328	-345	-363	-382	-402	-422
8.00%	-562	-571	-582	-595	-609	-625	-641
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							47,894
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18,087	17,683	17,155	16,508	15,752	14,898	13,956
-5.33%	16,611	15,725	14,715	13,603	12,404	11,132	9,800
-2.67%	12,876	11,418	9,898	8,329	6,722	5,084	3,421
0%	5,512	3,679	1,842	0	-1,844	-3,691	-5,539
2.67%	-6,246	-8,043	-9,856	-11,681	-13,515	-15,356	-17,202
5.33%	-22,096	-23,497	-24,980	-26,526	-28,123	-29,761	-31,433
8.00%	-40,933	-41,817	-42,836	-43,969	-45,200	-46,512	-47,894
KR4301MC3. 2017-12 풋335							13,256
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,227	-13,227	-13,228	-13,231	-13,235	-13,244	-13,256
-5.33%	-8,116	-8,128	-8,147	-8,175	-8,212	-8,259	-8,316
-2.67%	-3,194	-3,286	-3,390	-3,506	-3,631	-3,764	-3,904
0%	580	387	193	0	-194	-387	-581
2.67%	2,210	2,091	1,962	1,823	1,676	1,523	1,365
5.33%	2,515	2,491	2,457	2,411	2,354	2,285	2,206
8.00%	2,537	2,535	2,531	2,524	2,511	2,493	2,468
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							30,094
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30,058	-30,058	-30,059	-30,062	-30,067	-30,077	-30,094
-5.33%	-18,936	-18,948	-18,970	-19,006	-19,058	-19,128	-19,216
-2.67%	-8,018	-8,149	-8,311	-8,500	-8,714	-8,949	-9,203
0%	1,189	798	401	0	-404	-811	-1,221
2.67%	6,032	5,696	5,344	4,981	4,609	4,228	3,842

5.33%	7,213	7,121	6,999	6,849	6,672	6,471	6,249
8.00%	7,328	7,319	7,301	7,271	7,225	7,163	7,081

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

96,928

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

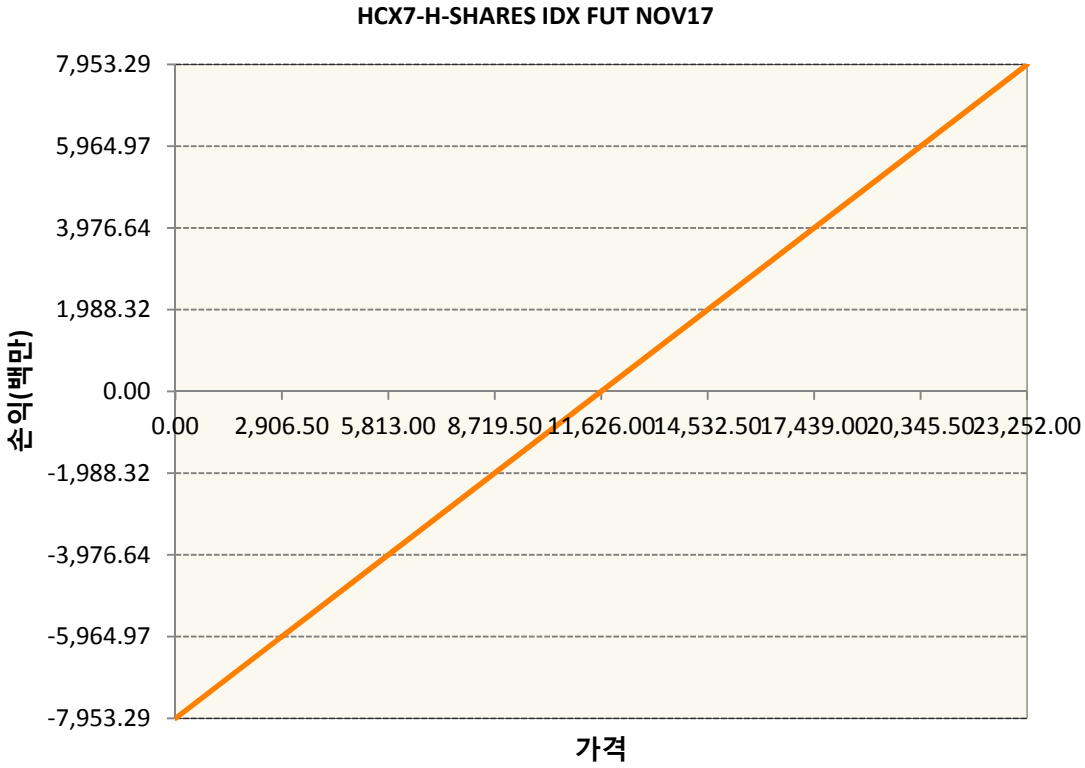
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

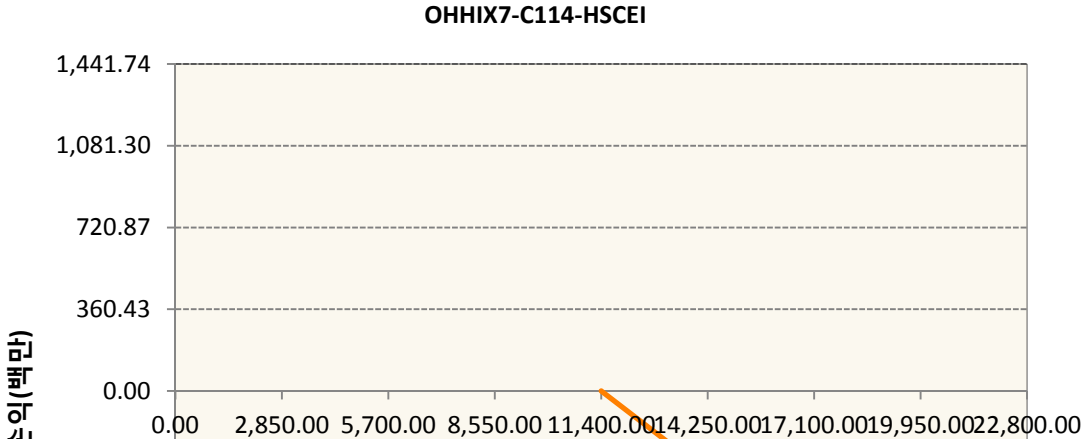
1. 계약금액

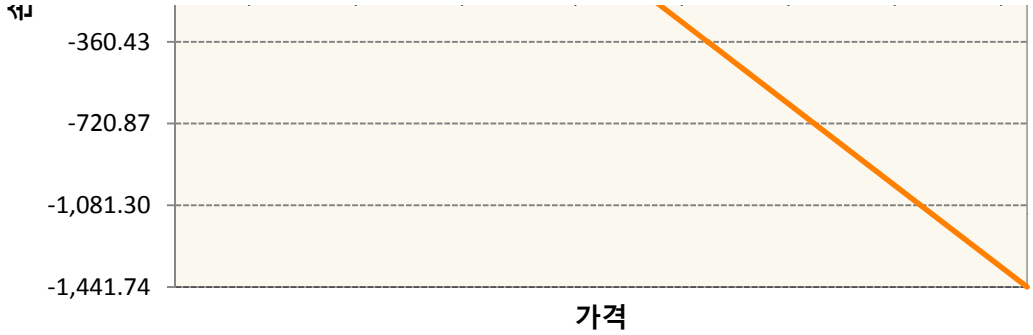
(단위:백만원)

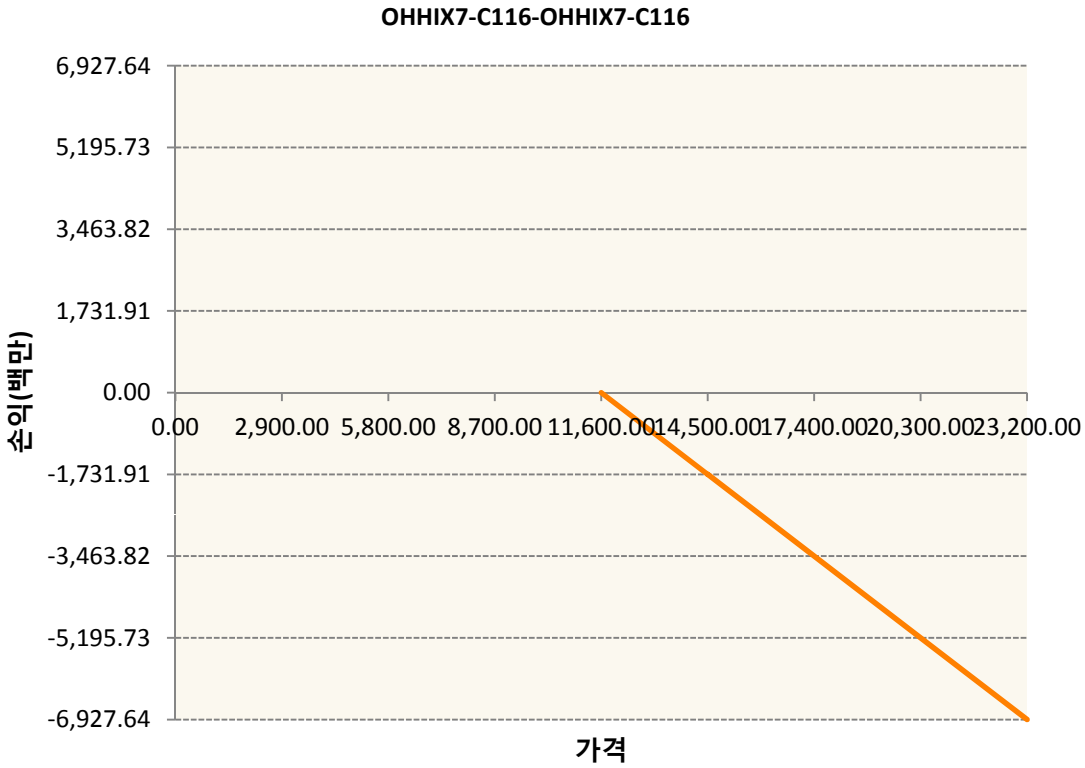
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,953	0	7,953	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,739	-16,739	장내

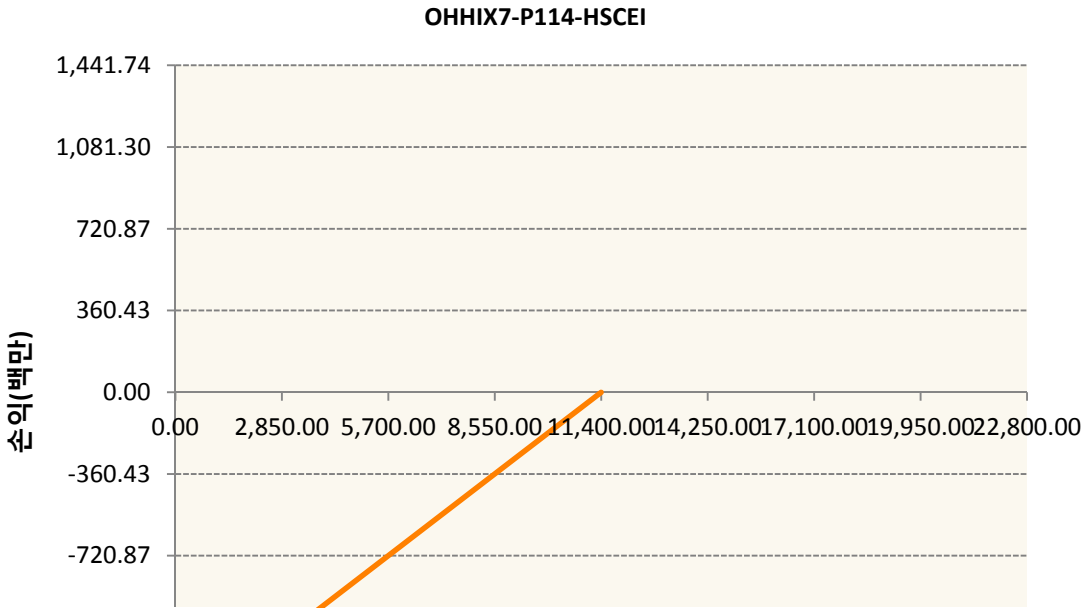
2. 만기시점의 손익구조

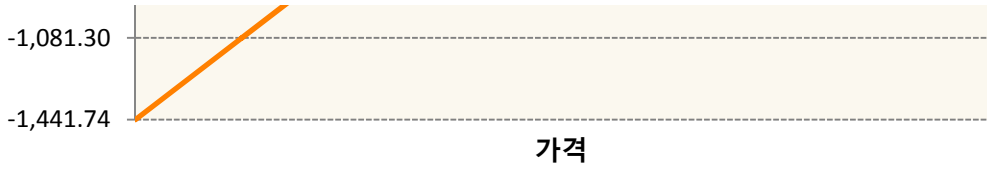


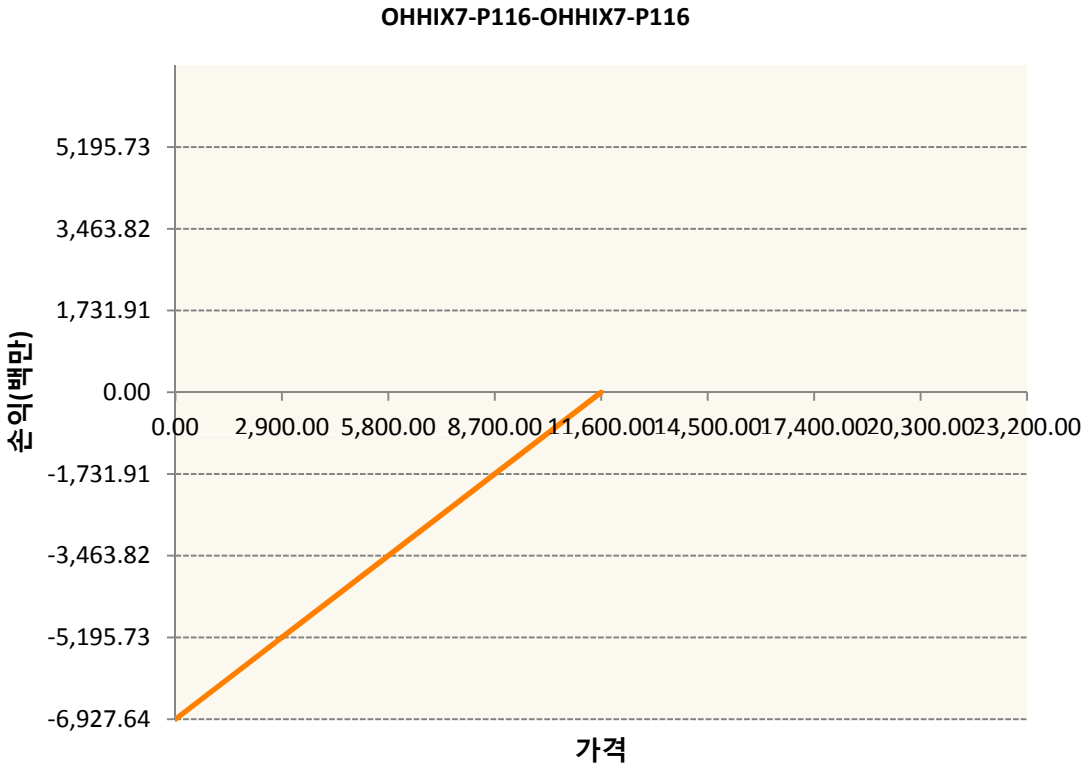



-360.43
-720.87
-1,081.30
-1,441.74
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,927.64
5,195.73
3,463.82
1,731.91
0.00
-1,731.91
-3,463.82
-5,195.73
-6,927.64
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
1,441.74
1,081.30
720.87
360.43
0.00
-360.43
-720.87
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	636
OHHIX7-C11	HSCEI	115
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	554
OHHIX7-P11	HSCEI	115
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	554

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,598

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

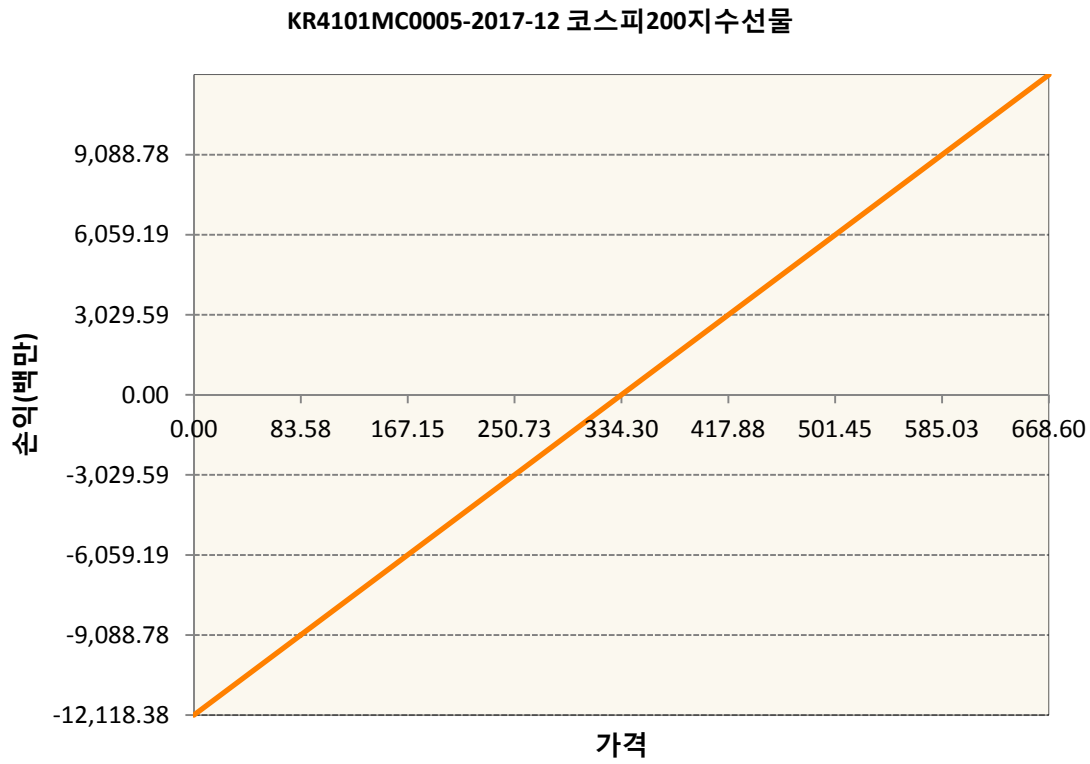
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

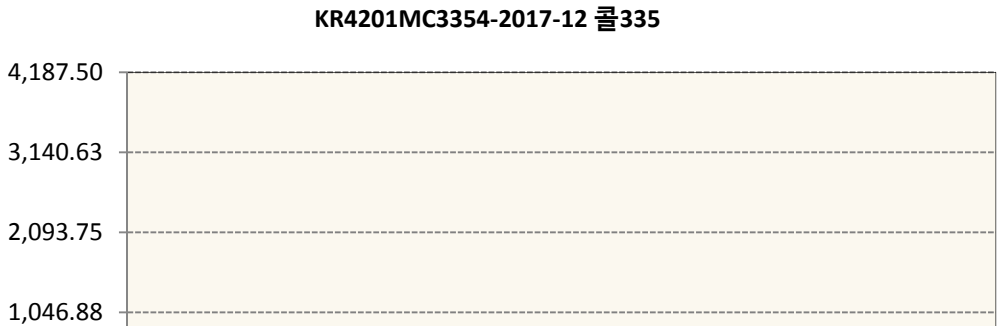
1. 계약금액

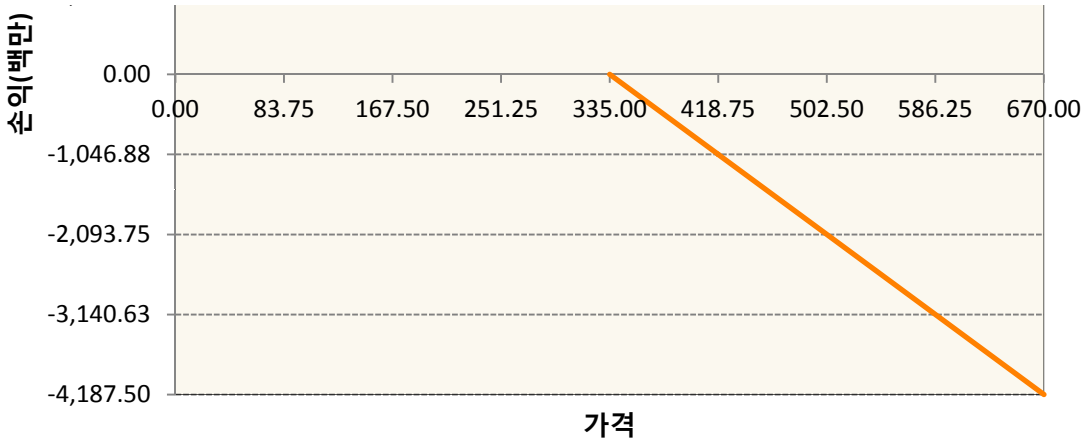
(단위:백만원)

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	12,118	0	12,118	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	52,659	-52,659	장내

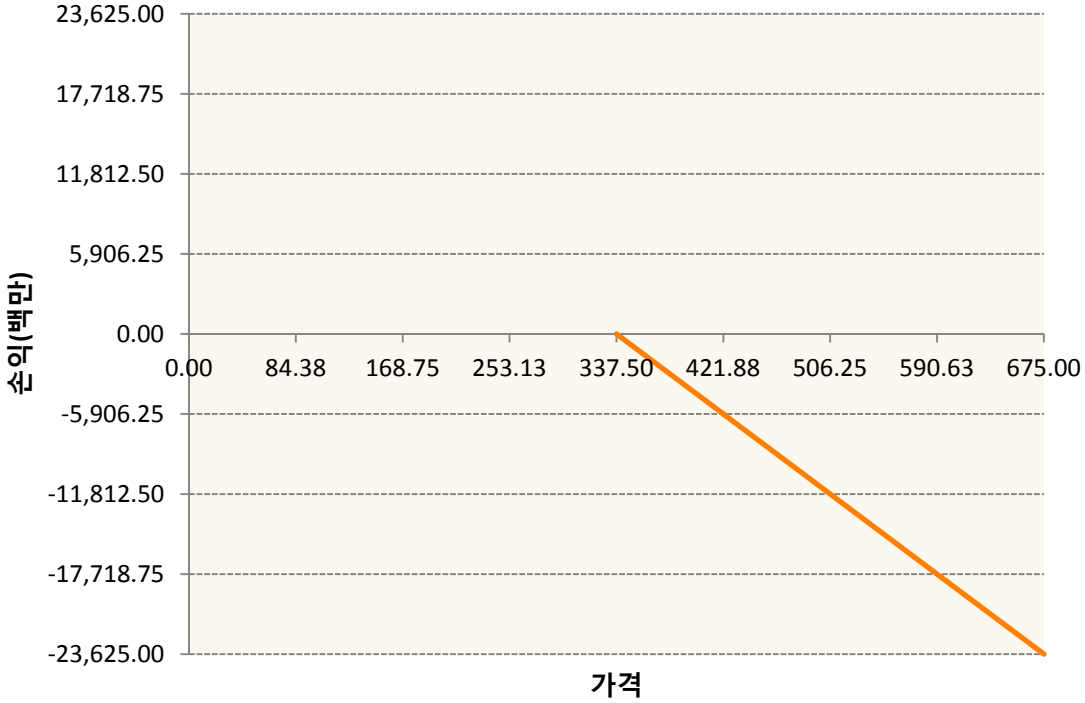
2. 만기시점의 손익구조



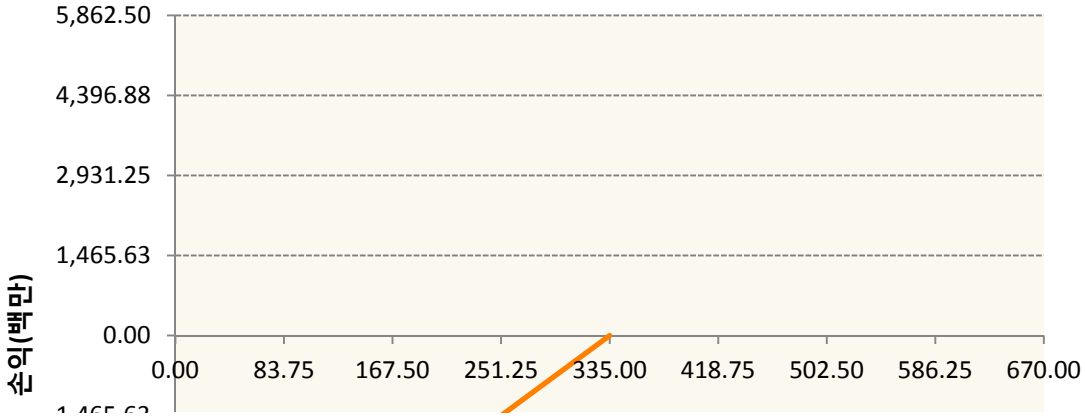




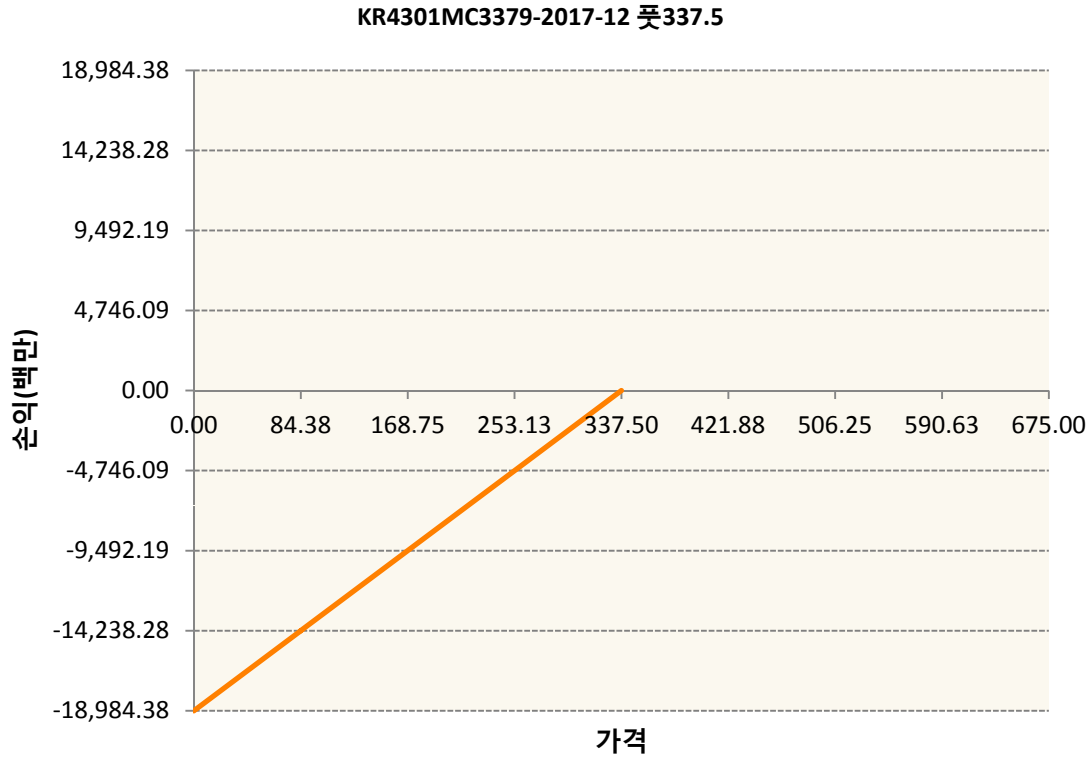
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473	-1,473
-5.33%	-982	-982	-982	-982	-982	-982	-982
-2.67%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	491	491	491	491	491	491	491
5.33%	982	982	982	982	982	982	982
8.00%	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473	1,473
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							279
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	279	279	279	279	279	279	279
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						159
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-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%	106	106	106	106	106	106	106
8.00%	159	159	159	159	159	159	159
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						239
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-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%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	239	239	239	239	239	239	239
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						199
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199
-5.33%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	133	133	133	133	133	133	133
8.00%	199	199	199	199	199	199	199
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						255
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-5.33%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-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%	170	170	170	170	170	170	170
8.00%	255	255	255	255	255	255	255
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-5.33%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	471	471	471	471	471	471	471
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						314
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-5.33%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-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%	209	209	209	209	209	209	209
8.00%	314	314	314	314	314	314	314
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						279
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	279	279	279	279	279	279	279
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						637
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-637	-637	-637	-637	-637	-637	-637
-5.33%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425
-2.67%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	212	212	212	212	212	212	212
5.33%	425	425	425	425	425	425	425
8.00%	637	637	637	637	637	637	637
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					969

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-969	-969	-969	-969	-969	-969	-969
-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%	969	969	969	969	969	969	969
	KR4201MC3. 2017-12 콜335						254

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	105	102	99	95	91	86	81
-5.33%	95	90	84	78	71	64	57
-2.67%	72	64	56	47	39	30	21
0%	28	19	9	0	-9	-19	-28
2.67%	-38	-47	-55	-64	-73	-82	-92
5.33%	-124	-130	-137	-144	-152	-160	-168
8.00%	-223	-227	-231	-236	-242	-248	-254
	KR4201MC3. 2017-12 콜337.5						1,366

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	516	505	489	471	449	425	398
-5.33%	474	449	420	388	354	318	280
-2.67%	367	326	282	238	192	145	98
0%	157	105	53	0	-53	-105	-158
2.67%	-178	-229	-281	-333	-386	-438	-491
5.33%	-630	-670	-713	-757	-802	-849	-897
8.00%	-1,168	-1,193	-1,222	-1,254	-1,290	-1,327	-1,366
	KR4301MC3. 2017-12 풋335						403

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403
-5.33%	-247	-247	-248	-249	-250	-251	-253
-2.67%	-97	-100	-103	-107	-111	-115	-119
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	67	64	60	55	51	46	42
5.33%	77	76	75	73	72	70	67
8.00%	77	77	77	77	76	76	75
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,354

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,353	-1,353	-1,353	-1,353	-1,353	-1,353	-1,354
-5.33%	-852	-853	-854	-855	-858	-861	-865

-2.67%	-361	-367	-374	-382	-392	-403	-414
0%	53	36	18	0	-18	-37	-55
2.67%	271	256	240	224	207	190	173
5.33%	325	320	315	308	300	291	281
8.00%	330	329	329	327	325	322	319

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

8,468

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

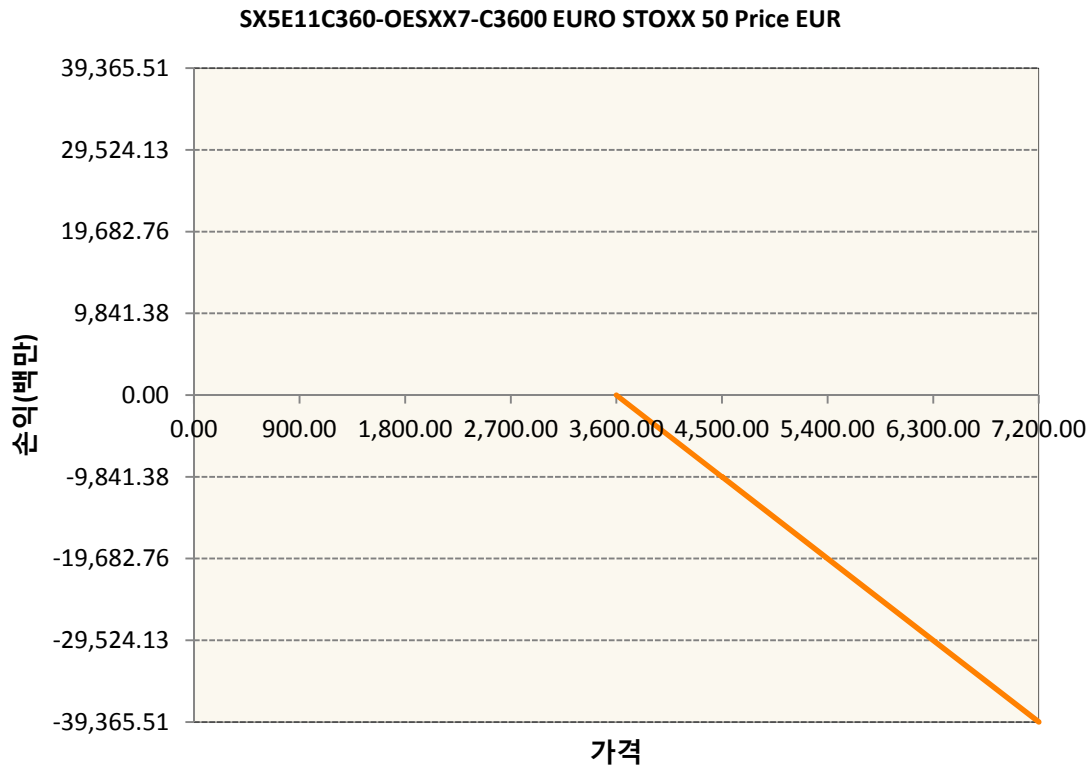
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

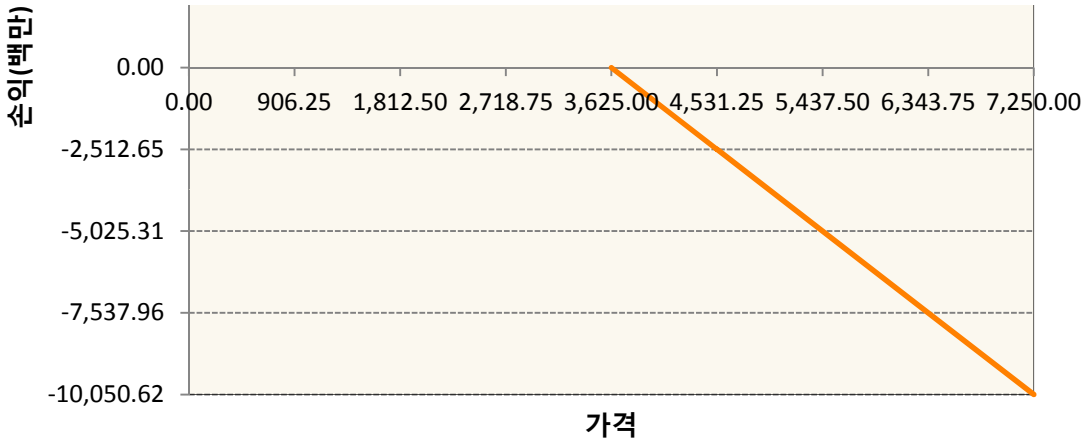
(단위:백만원)

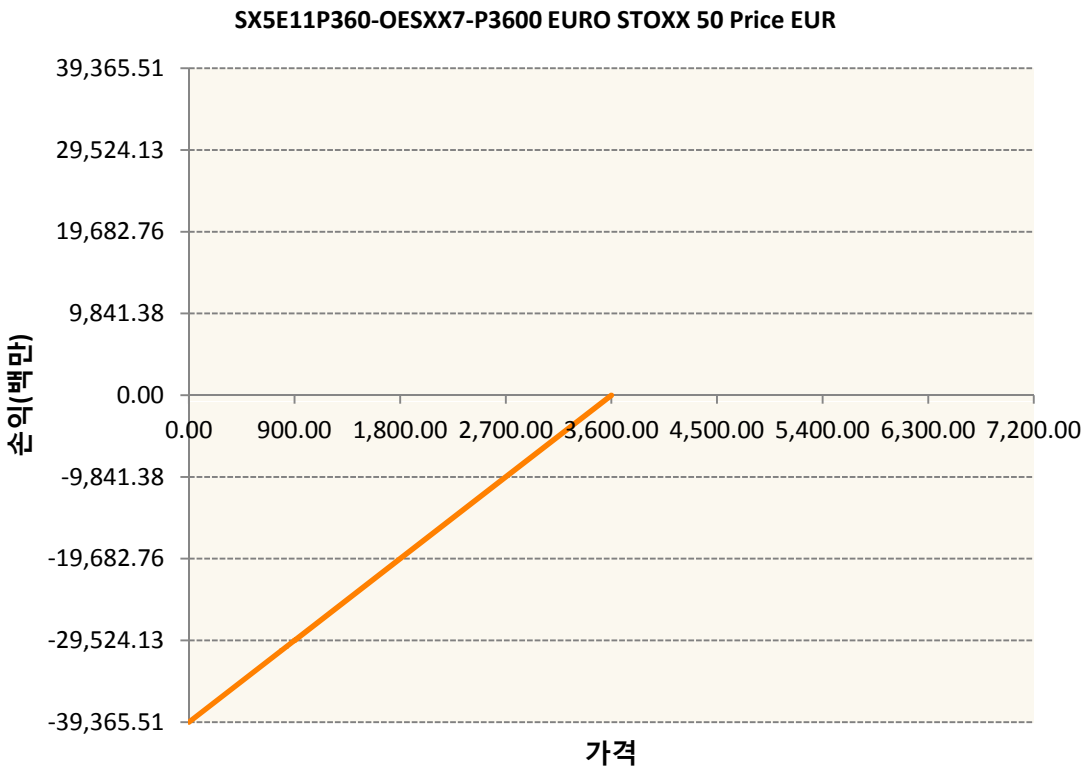
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	42,055	0	42,055	
누계	유가증권	스왑	97,170	0	97,170	장외
누계	유가증권	옵션	0	98,832	-98,832	장내

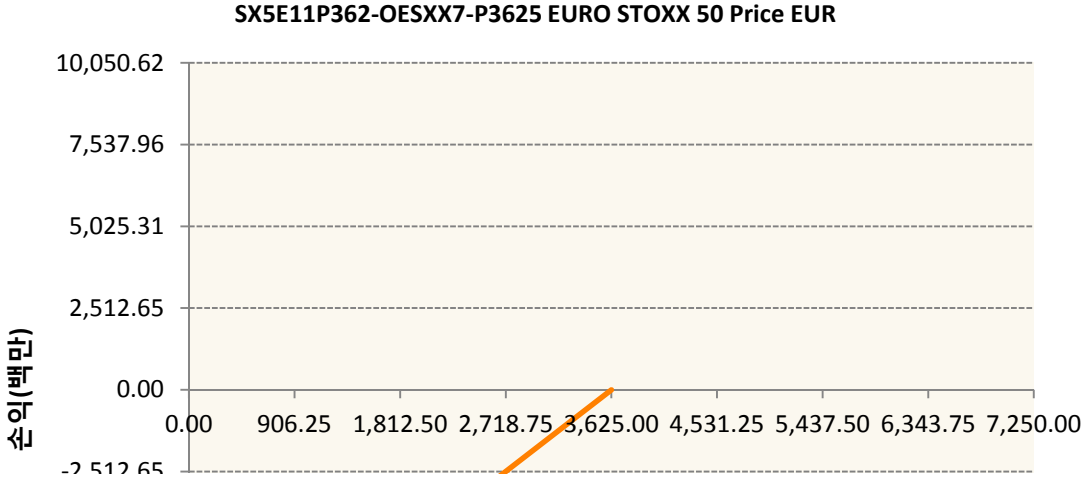
2. 만기시점의 손익구조



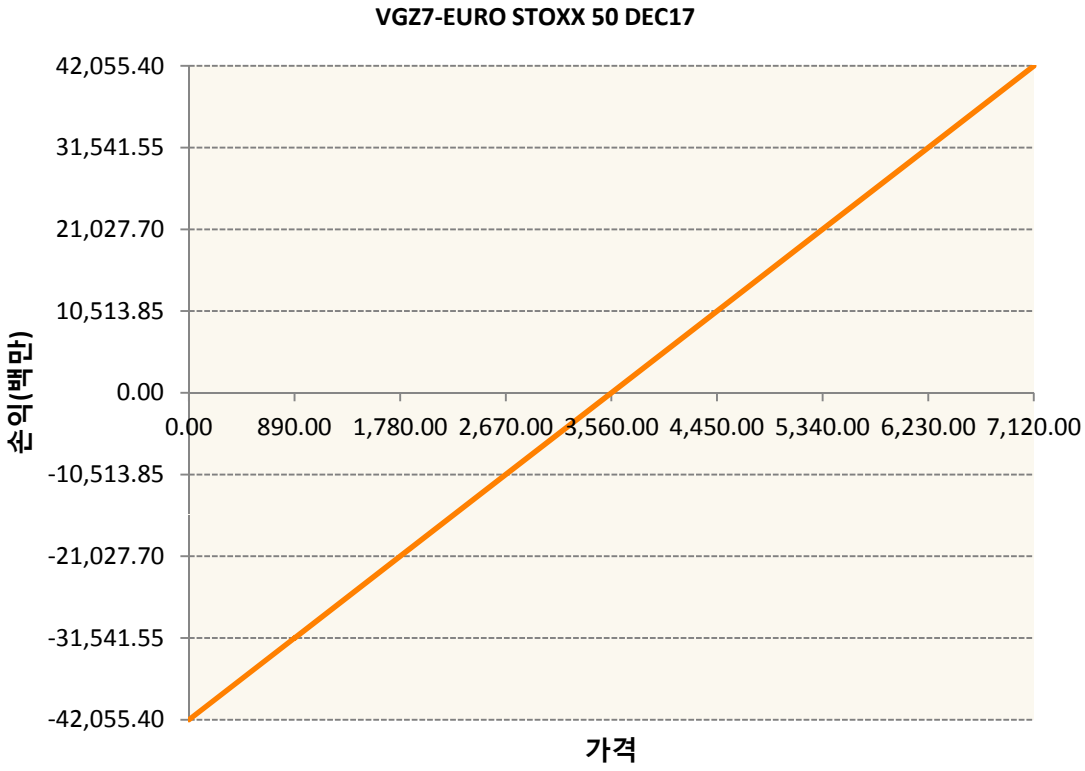



손익(백만)
0.00
-2,512.65
-5,025.31
-7,537.96
-10,050.62
0.00
906.25
1,812.50
2,718.75
3,625.00
4,531.25
5,437.50
6,343.75
7,250.00
가격


SX5E11P360-OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR
손익(백만)
39,365.51
29,524.13
19,682.76
9,841.38
0.00
-9,841.38
-19,682.76
-29,524.13
-39,365.51
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)
10,050.62
7,537.96
5,025.31
2,512.65
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	6
SX5E11C360	OESXX7-C3600 EURO STOXX 50 Price EUR	3,149
SX5E11C362	OESXX7-C3625 EURO STOXX 50 Price EUR	804
SX5E11P360	OESXX7-P3600 EURO STOXX 50 Price EUR	3,149
SX5E11P362	OESXX7-P3625 EURO STOXX 50 Price EUR	804
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	3,365

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

6,843

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

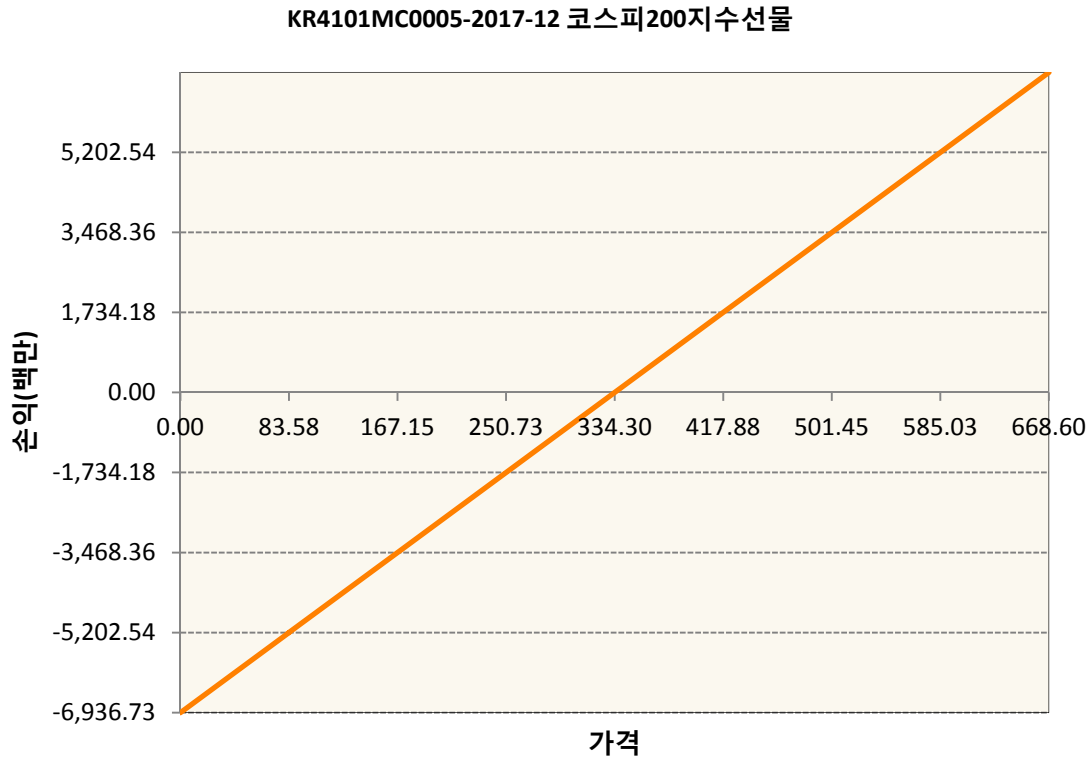
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,937	0	6,937	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)

316

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

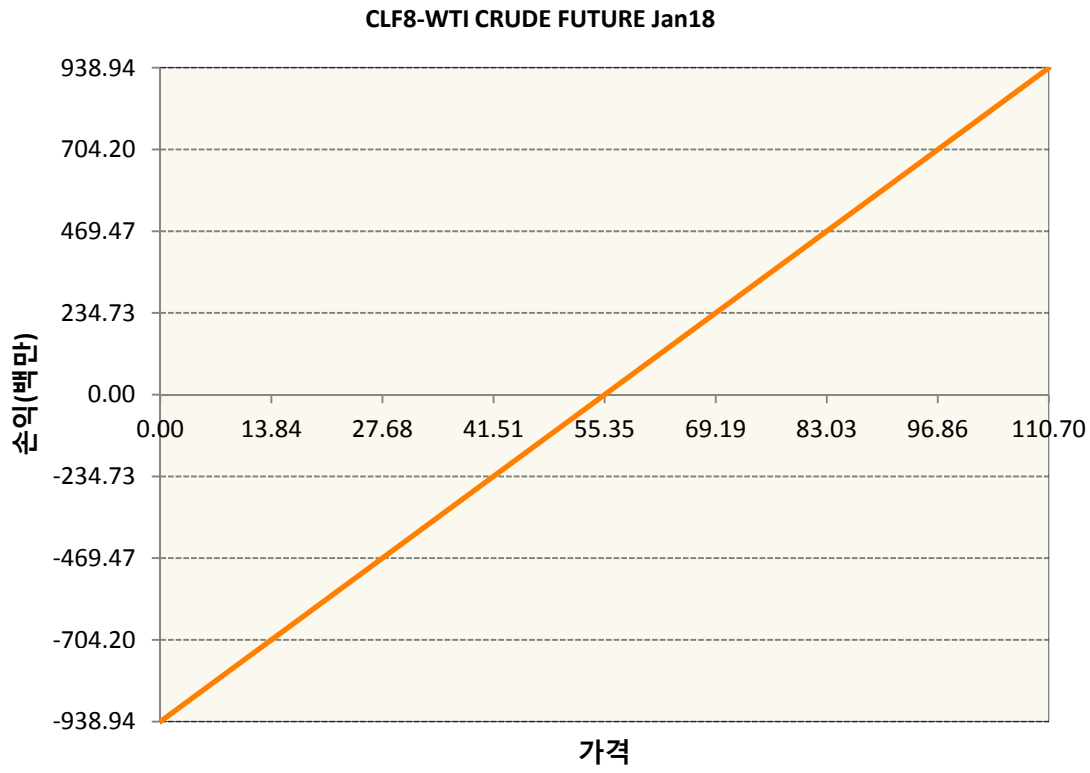
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

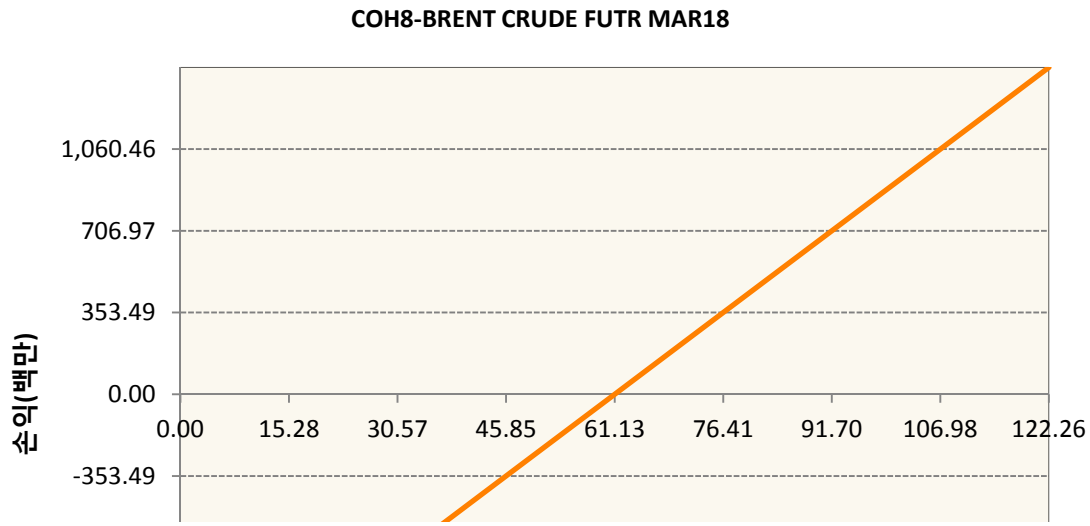
1. 계약금액

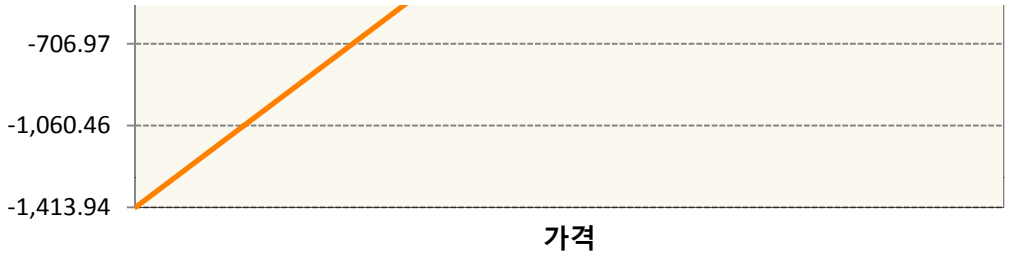
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,131	878	4,253	

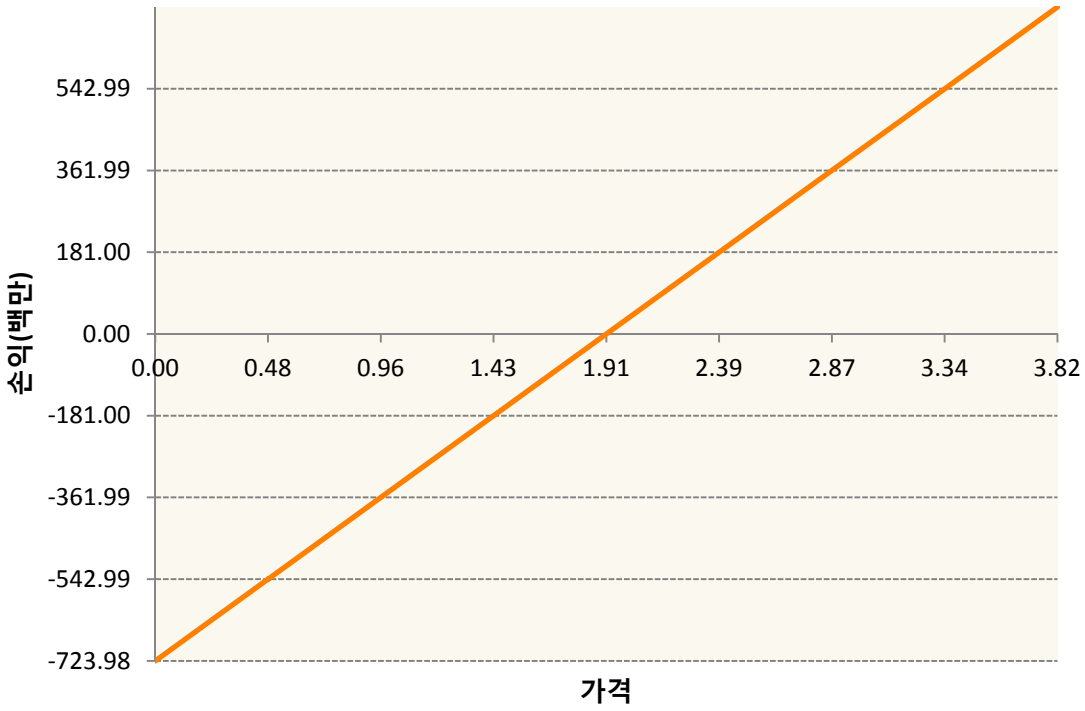
2. 만기시점의 손익구조



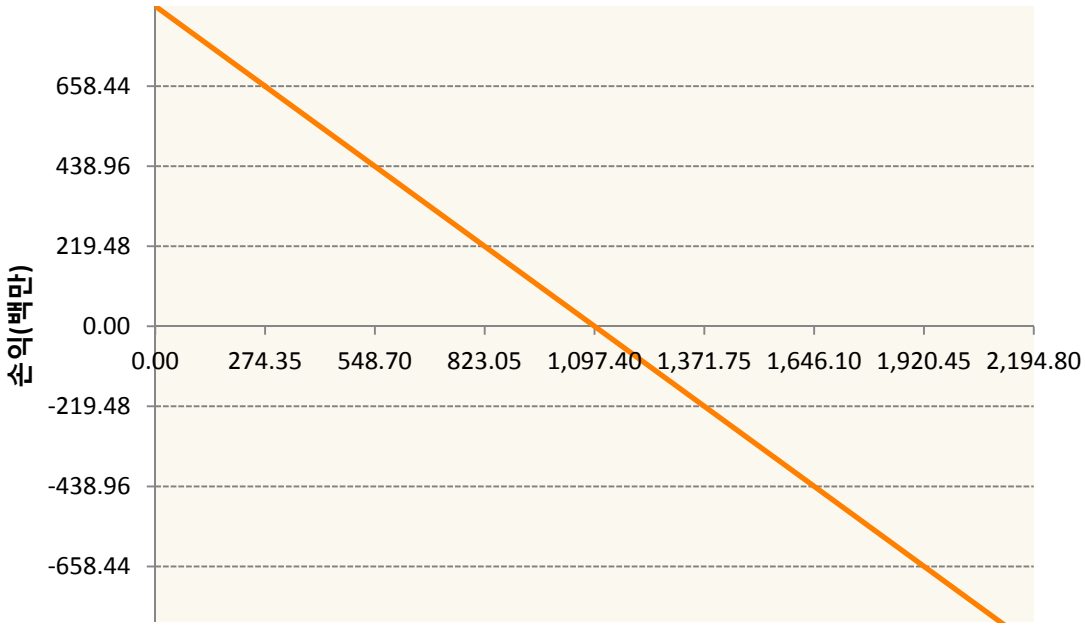


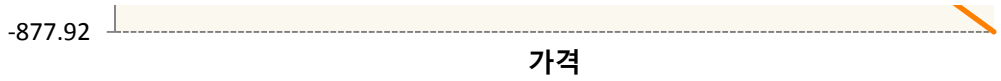


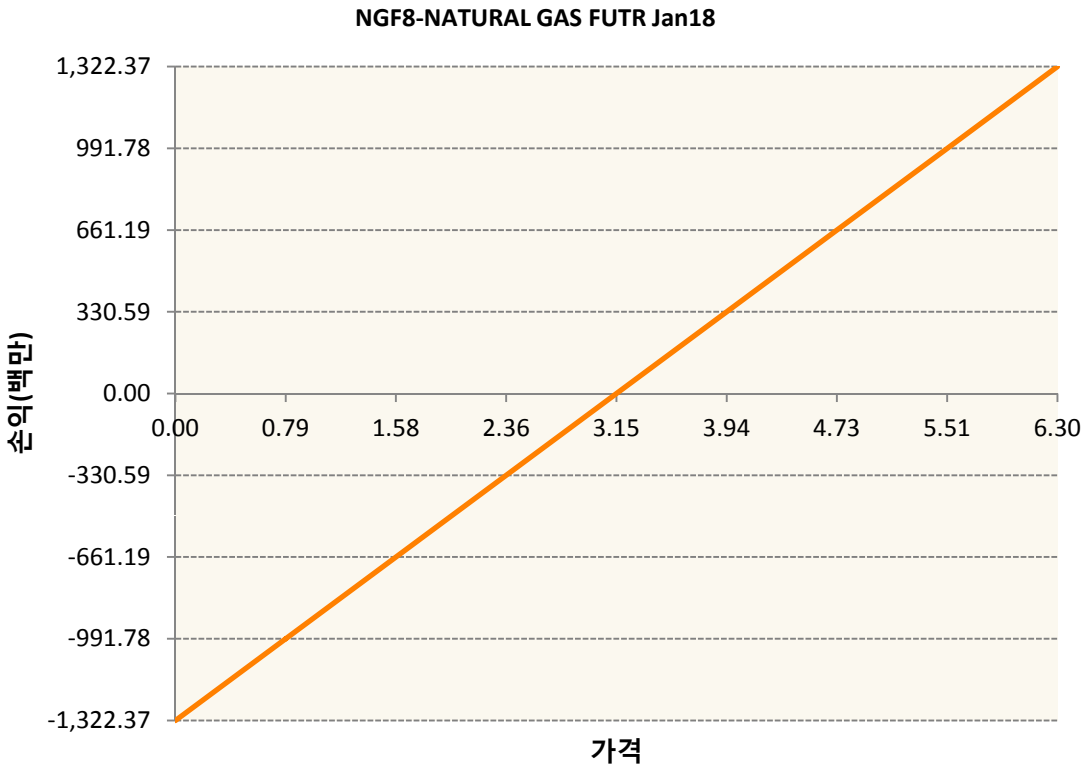
HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18

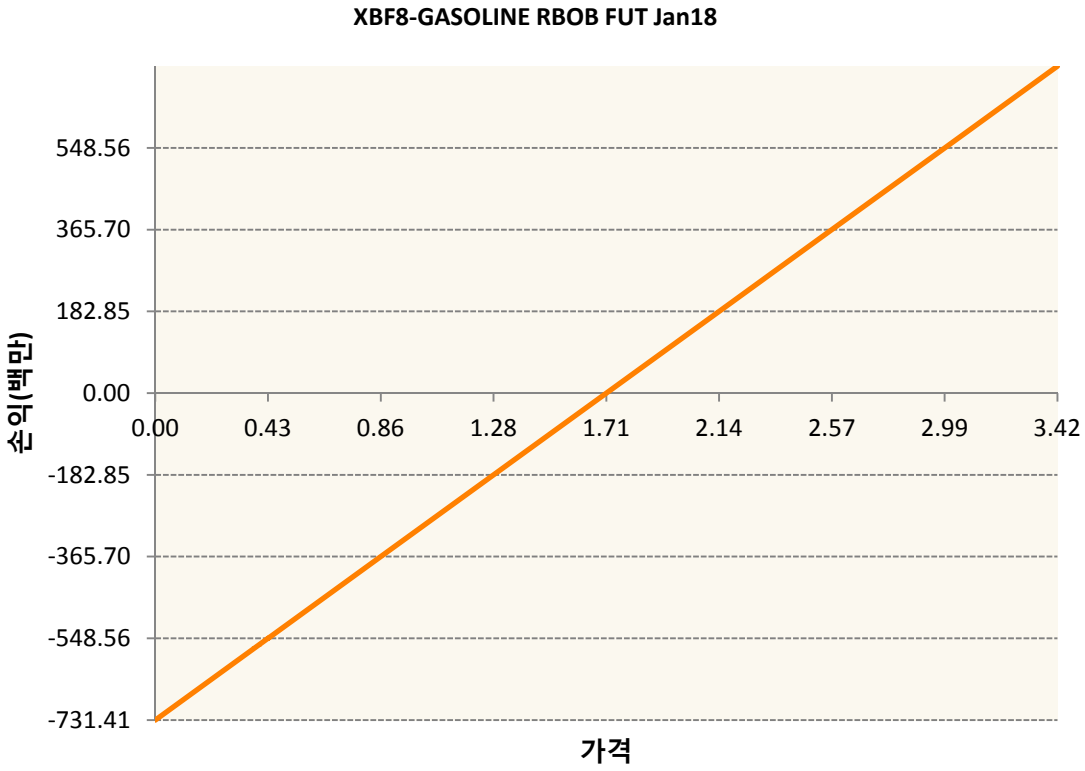


KR4175MC0006-2017-12 달러선물




-877.92
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,322.37
991.78
661.19
330.59
0.00
-330.59
-661.19
-991.78
-1,322.37
0.00
0.79
1.58
2.36
3.15
3.94
4.73
5.51
6.30
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
548.56
365.70
182.85
0.00
-182.85
-365.70
-548.56
-731.41
0.00
0.43
0.86
1.28
1.71
2.14
2.57
2.99
3.42
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	75
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	113
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	58
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	106
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	59

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

720

공시일	2017-11-20
기준일	2017-11-17

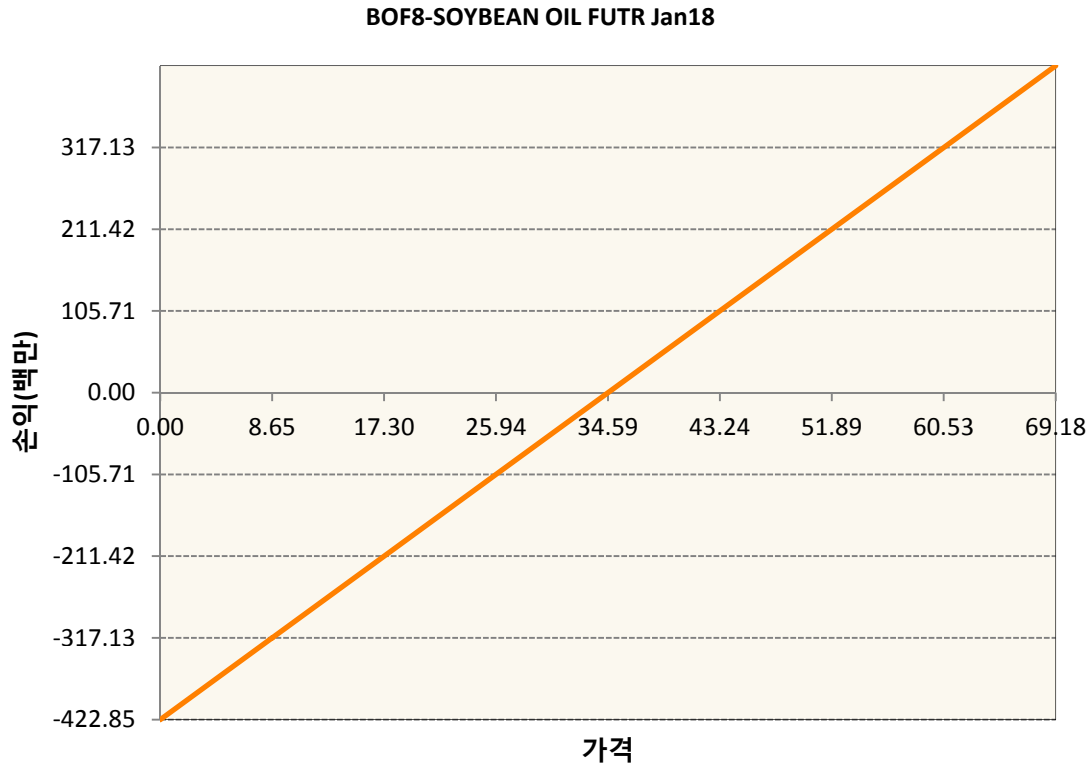
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

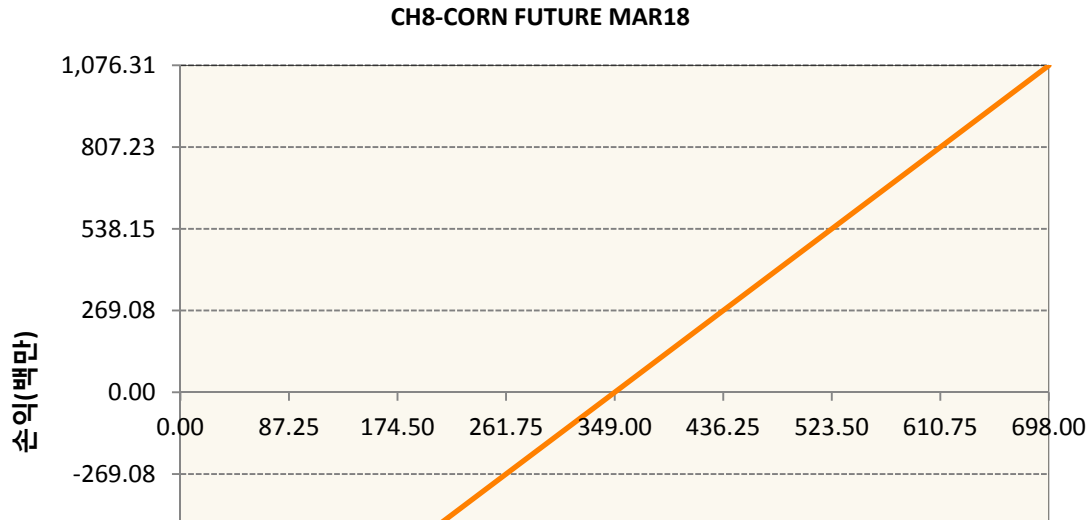
1. 계약금액

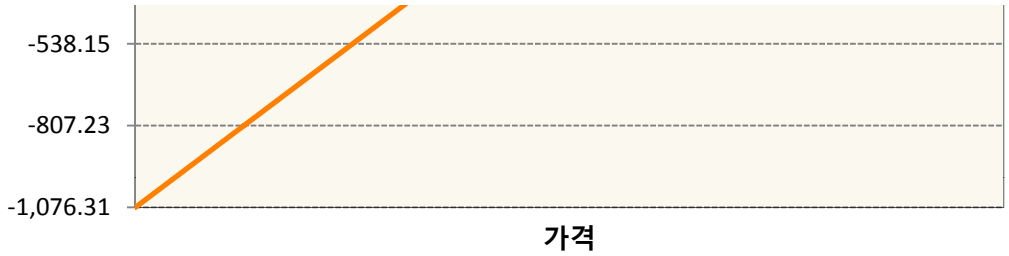
(단위:백만원)

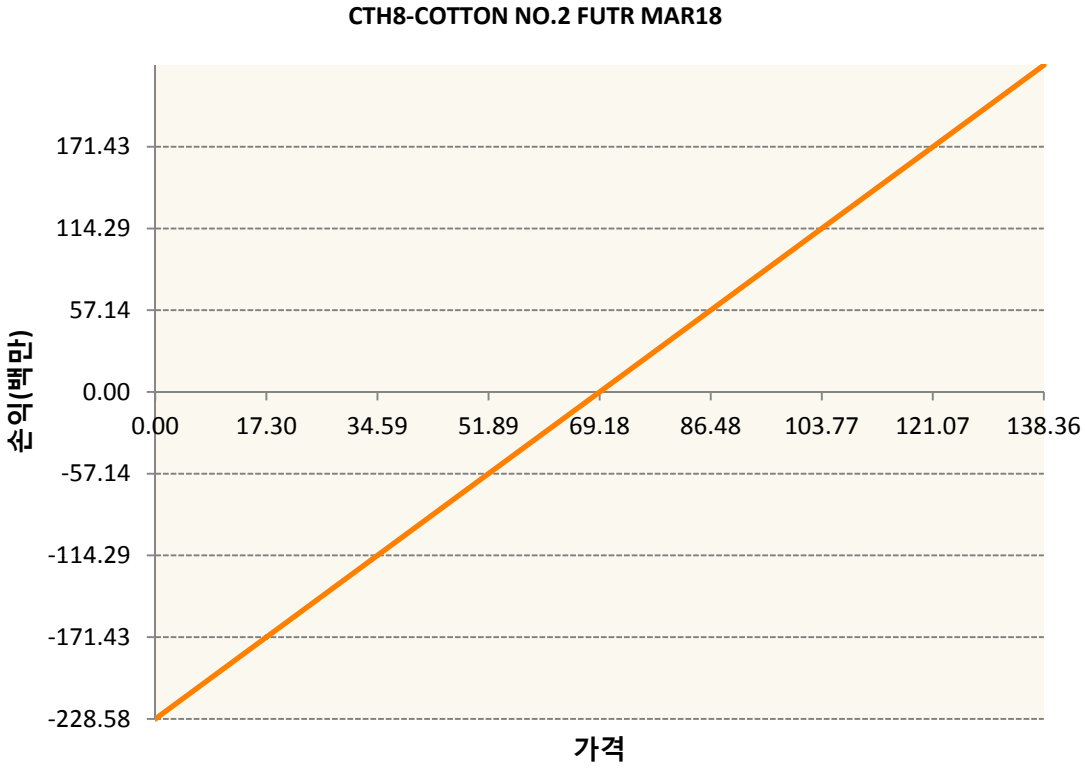
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,500	329	4,170	

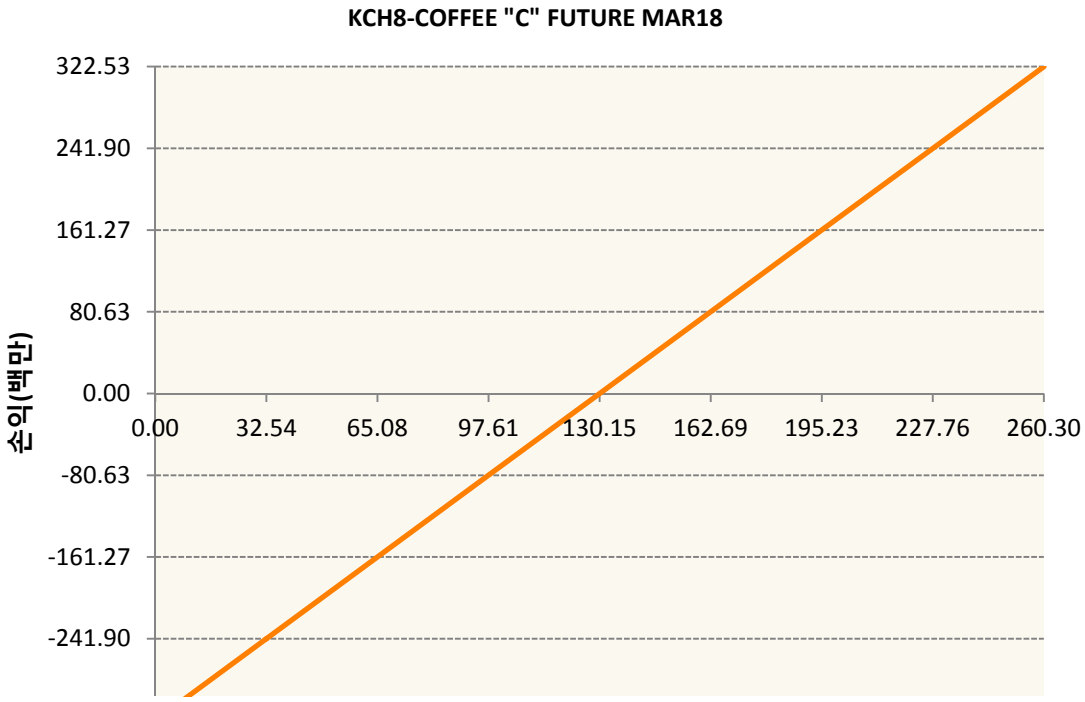
2. 만기시점의 손익구조

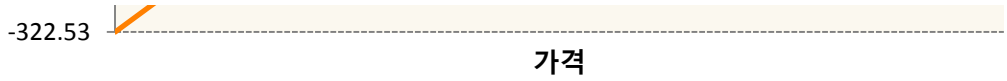


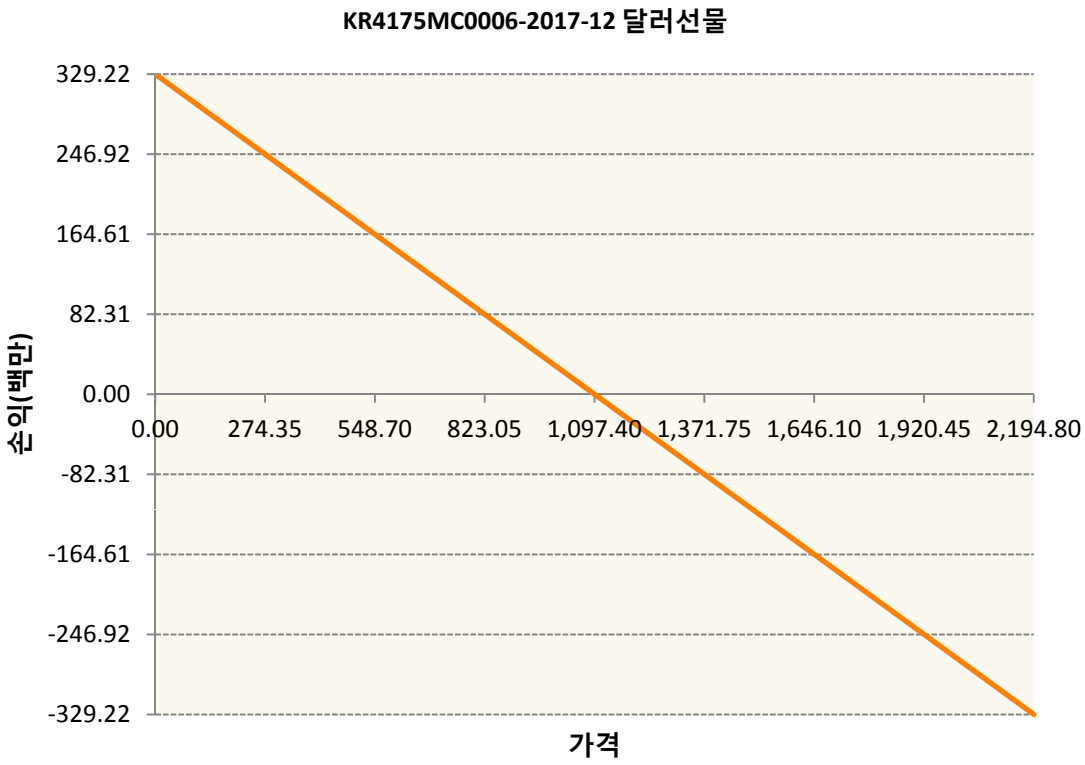


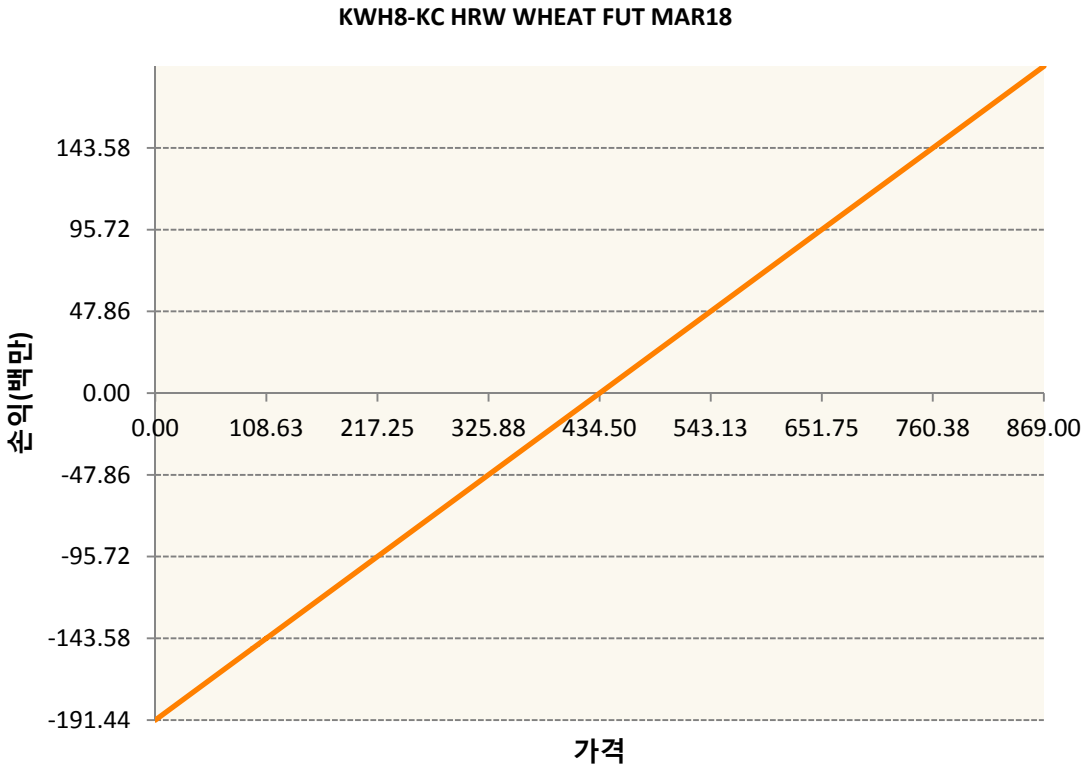

-538.15
-807.23
-1,076.31
가격

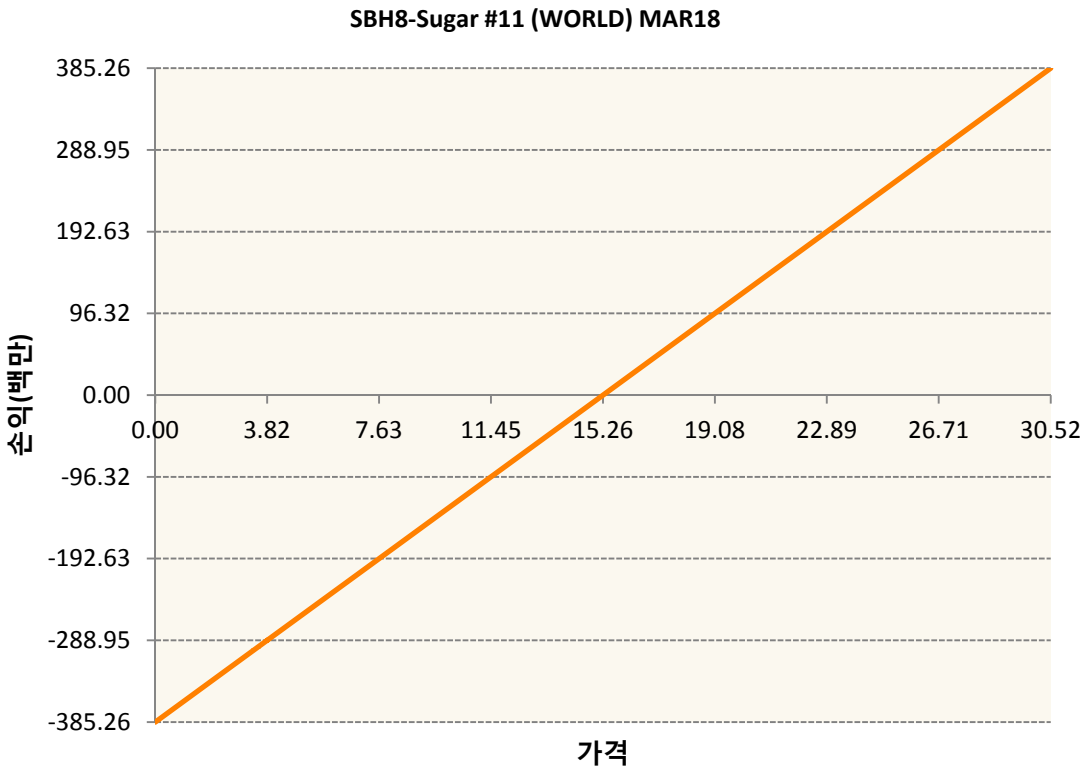

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
손익(백만)
171.43
114.29
57.14
0.00
-57.14
-114.29
-171.43
-228.58
0.00
17.30
34.59
51.89
69.18
86.48
103.77
121.07
138.36
가격

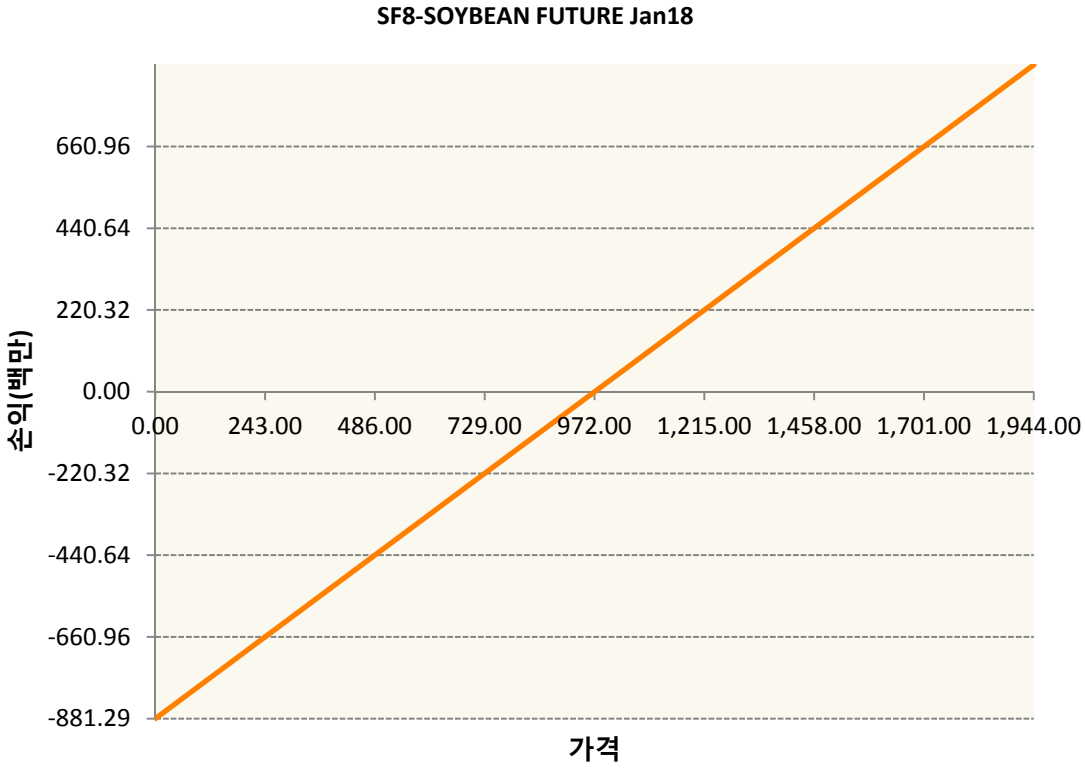

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
손익(백만)
322.53
241.90
161.27
80.63
0.00
-80.63
-161.27
-241.90
0.00
32.54
65.08
97.61
130.15
162.69
195.23
227.76
260.30


-322.53
가격

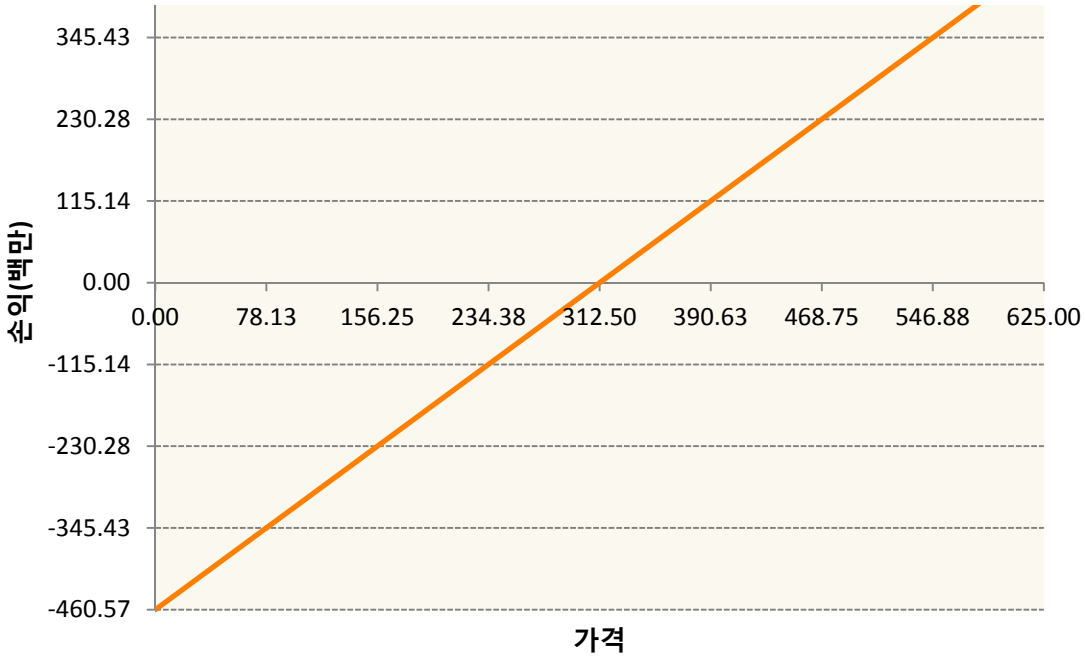

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
329.22
246.92
164.61
82.31
0.00
-82.31
-164.61
-246.92
-329.22
0.00
274.35
548.70
823.05
1,097.40
1,371.75
1,646.10
1,920.45
2,194.80
손익(백만)
가격

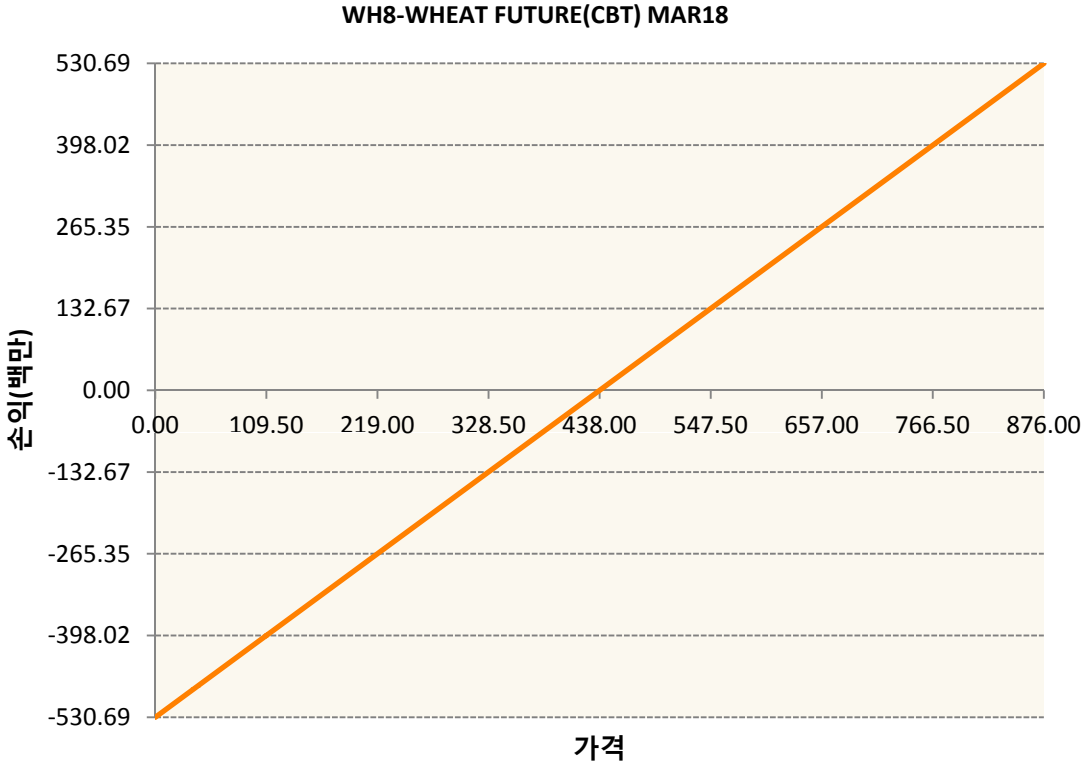

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
143.58
95.72
47.86
0.00
-47.86
-95.72
-143.58
-191.44
0.00
108.63
217.25
325.88
434.50
543.13
651.75
760.38
869.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
385.26
288.95
192.63
96.32
0.00
-96.32
-192.63
-288.95
-385.26
0.00
3.82
7.63
11.45
15.26
19.08
22.89
26.71
30.52
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
660.96
440.64
220.32
0.00
-220.32
-440.64
-660.96
-881.29
0.00
243.00
486.00
729.00
972.00
1,215.00
1,458.00
1,701.00
1,944.00
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
460.57





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	34
CH8	CORN FUTURE MAR18	86
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	18
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	26
KR4175MC0	2017-12 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	15
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	31
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)

404