공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

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	2017-11-22
기준일	2017-11-21

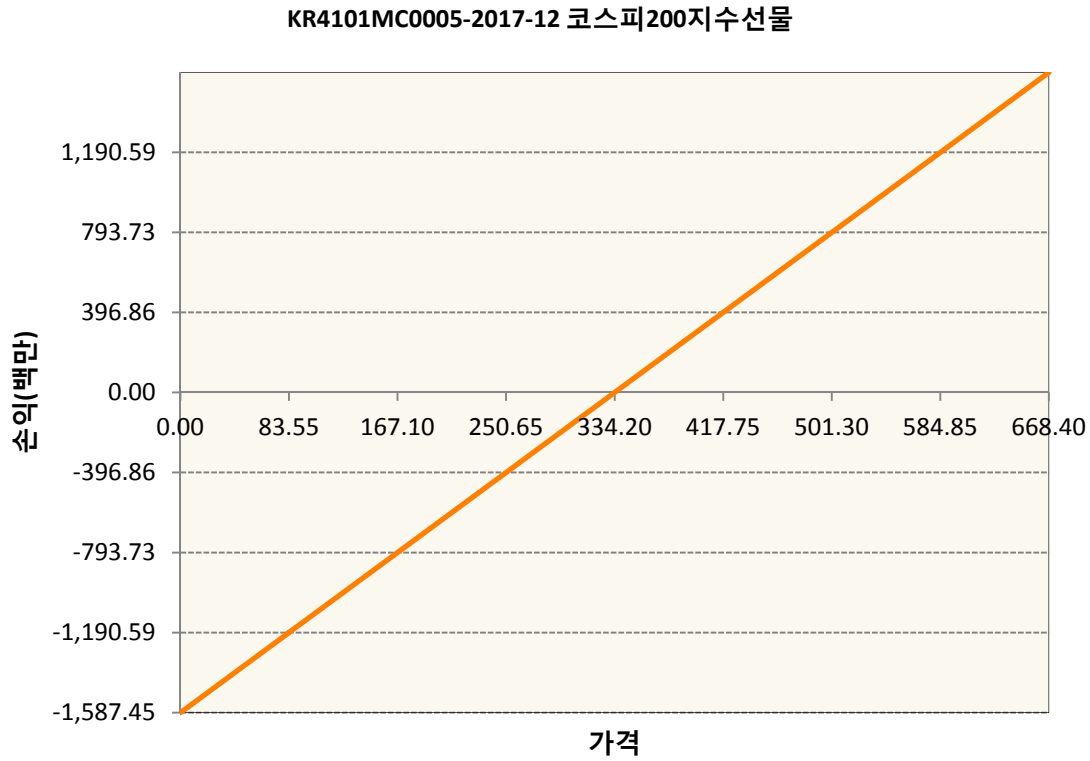
스마트인덱스모

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	1,587	0	1,587	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%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-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%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	127	127	127	127	127	127	127

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

72

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

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	1,065

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

346

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

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	411

* 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	2017-11-22
기준일	2017-11-21

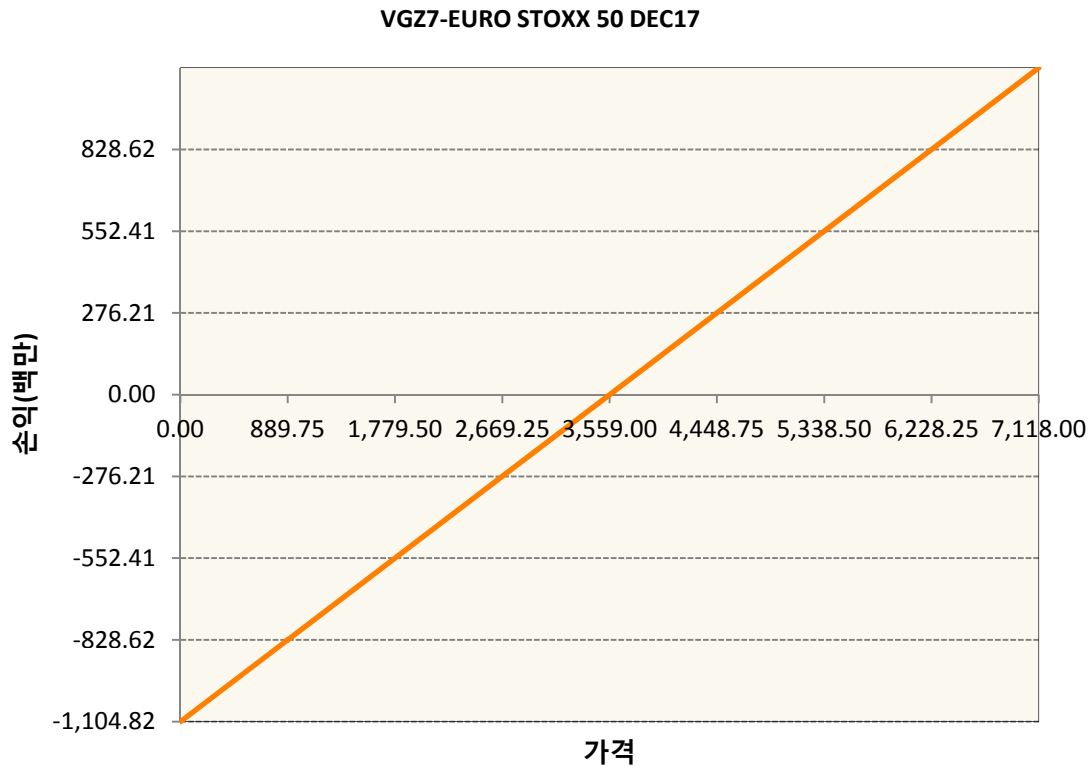
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

52

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

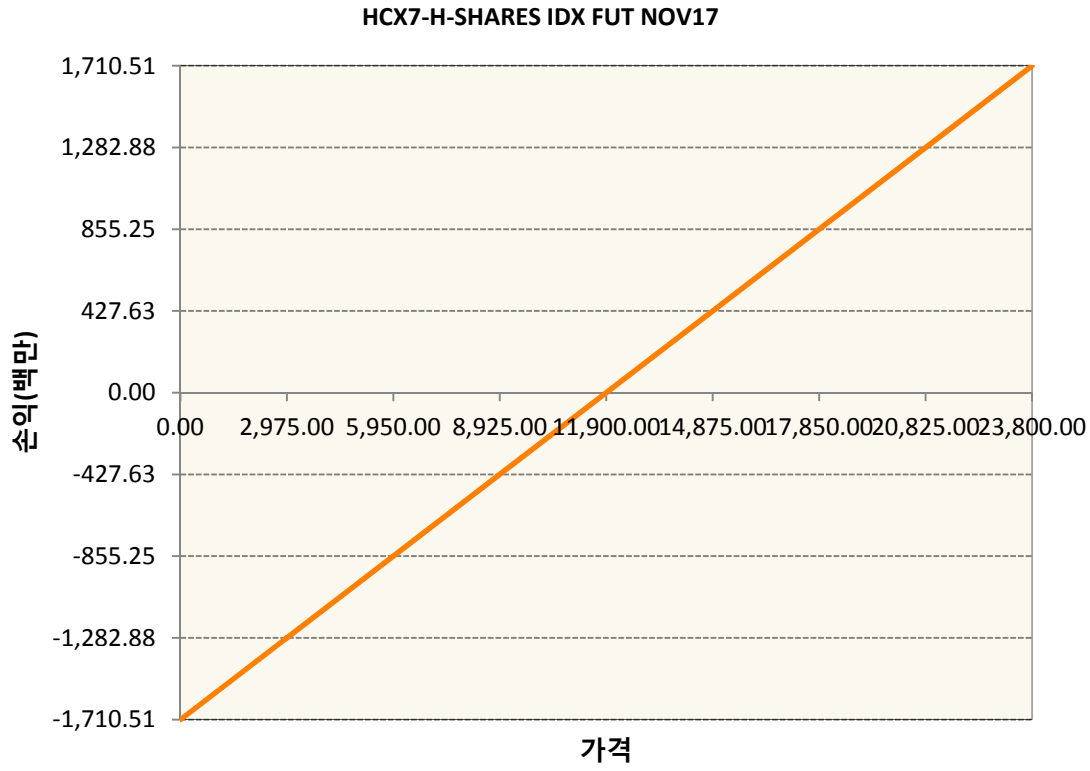
차이나인덱스모(주식-파생형)

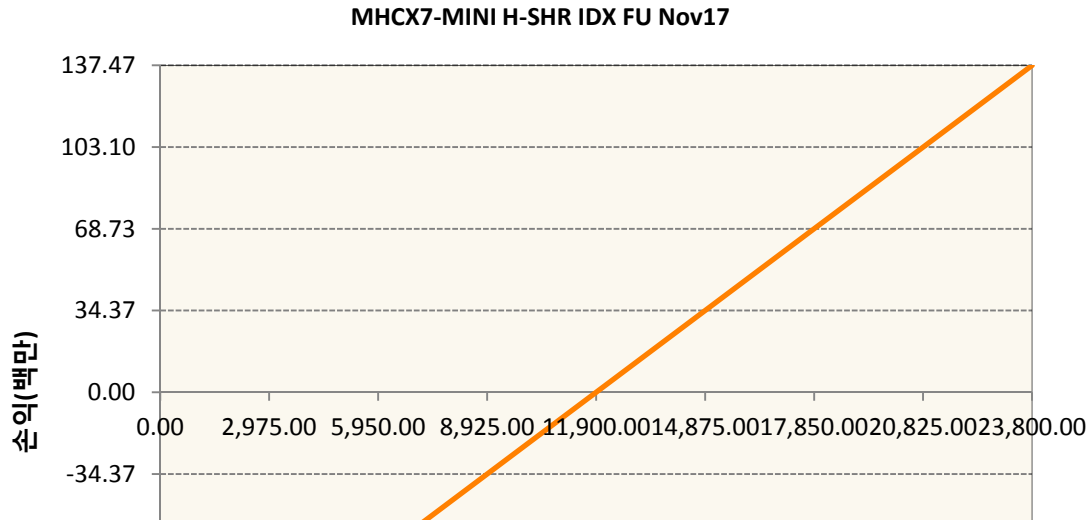
1. 계약금액

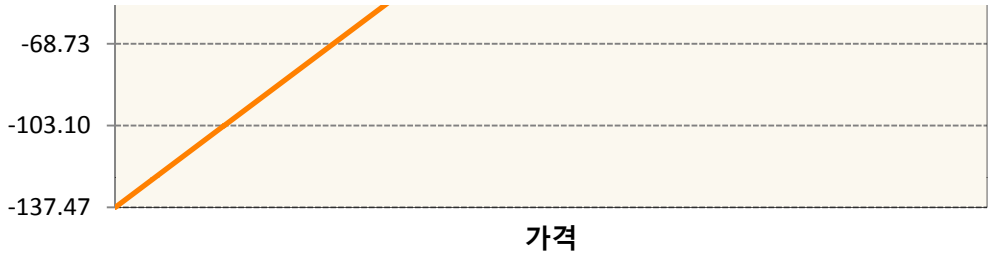
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,848	0	1,848	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	137
MHCX7	MINI H-SHR IDX FU Nov17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	118

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

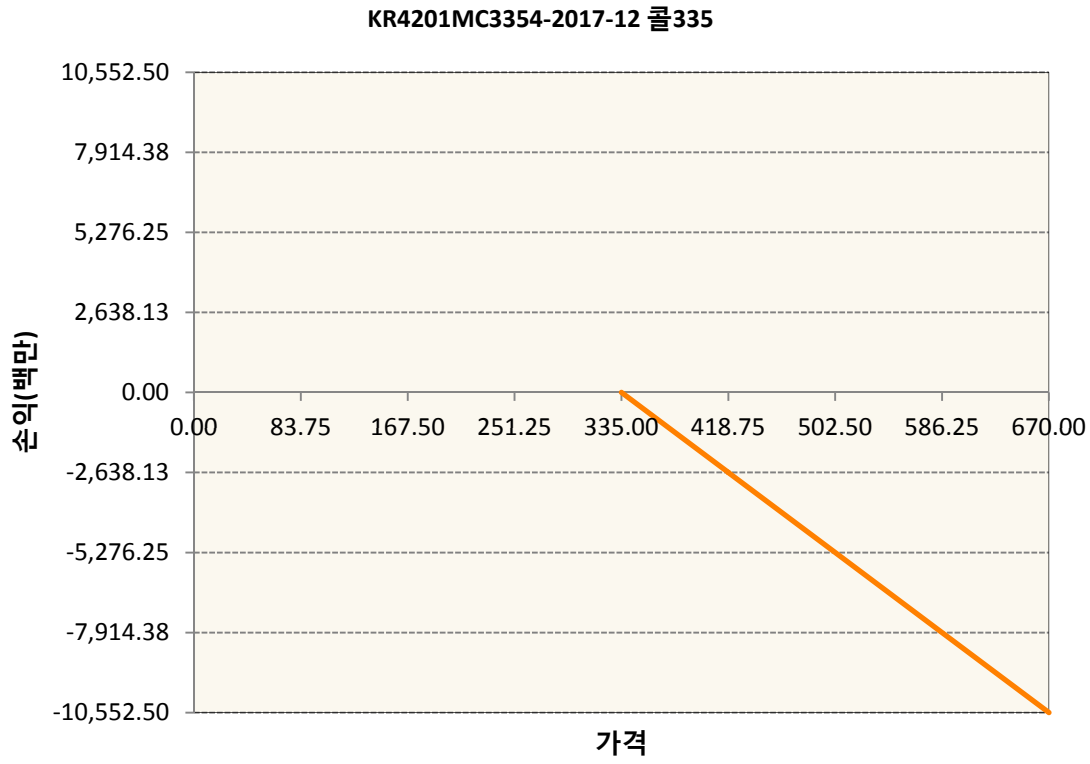
커버드콜모(주식혼합-파생형)

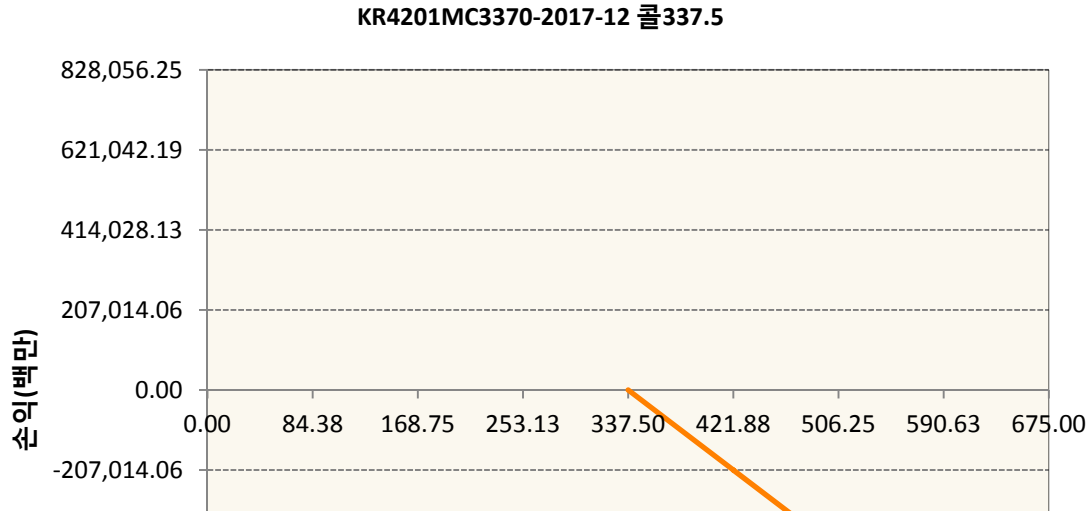
1. 계약금액

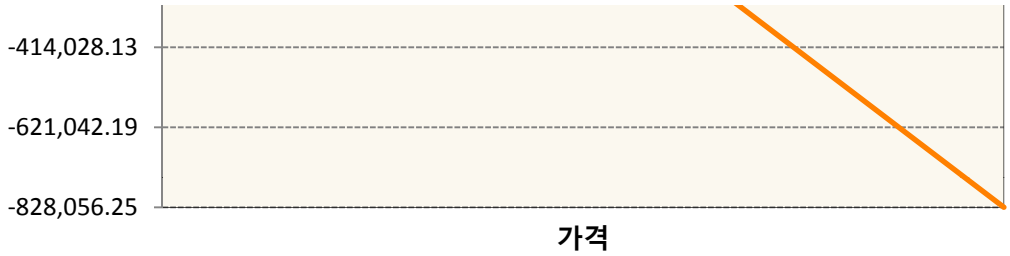
(단위:백만원)

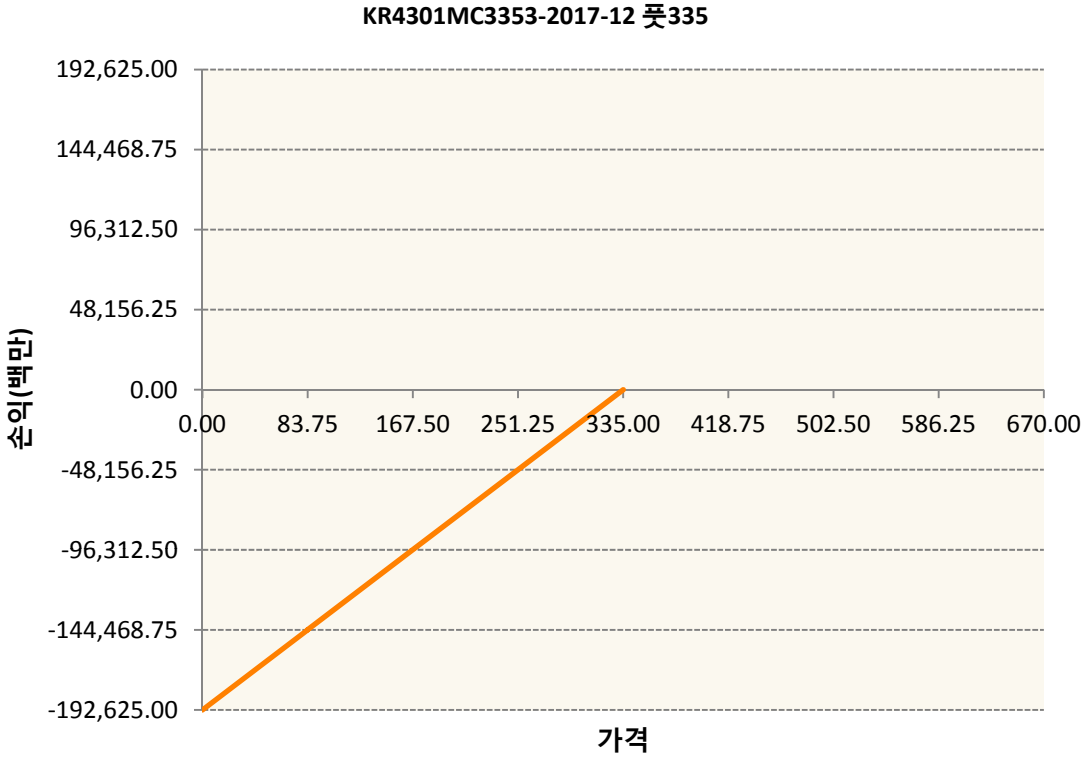
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

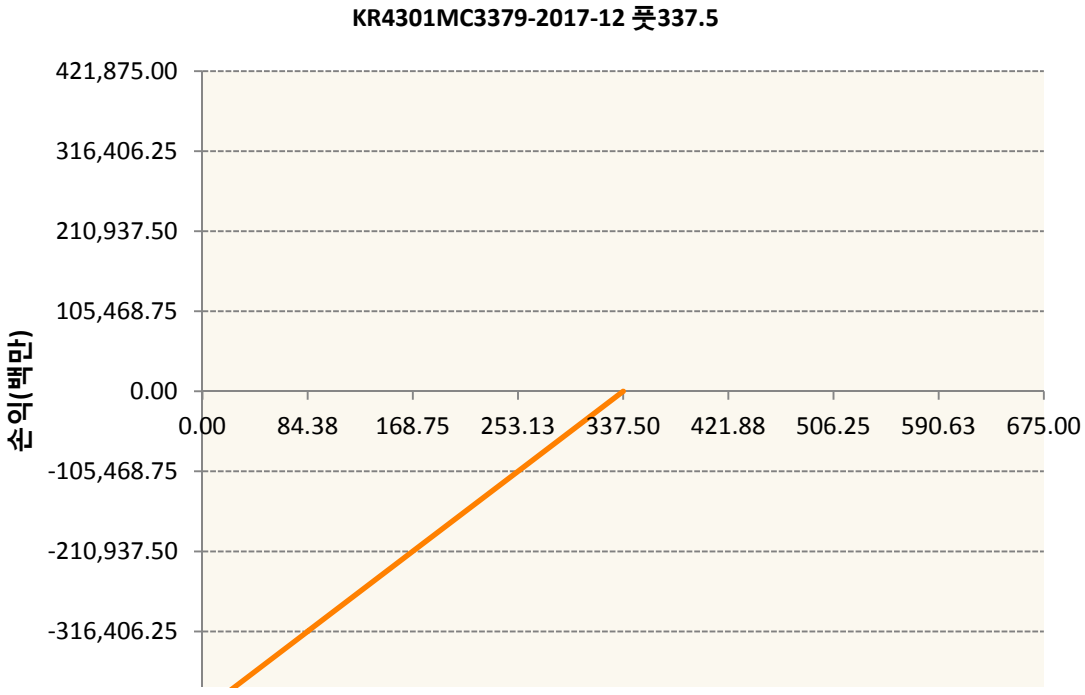
2. 만기시점의 손익구조






-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							636
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	237	232	226	219	210	200	190
-5.33%	218	208	195	182	168	153	137
-2.67%	168	150	132	113	93	74	54
0%	66	44	22	0	-22	-44	-66
2.67%	-98	-118	-138	-159	-180	-202	-223
5.33%	-315	-329	-344	-361	-378	-396	-415
8.00%	-567	-575	-584	-595	-608	-621	-636
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							47,288
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,902	15,635	15,263	14,787	14,211	13,542	12,788
-5.33%	14,847	14,161	13,354	12,444	11,444	10,369	9,228
-2.67%	11,760	10,506	9,181	7,801	6,377	4,917	3,427
0%	5,041	3,368	1,687	0	-1,692	-3,387	-5,085
2.67%	-6,355	-8,022	-9,702	-11,393	-13,090	-14,794	-16,503
5.33%	-22,184	-23,453	-24,801	-26,210	-27,669	-29,168	-30,699
8.00%	-41,176	-41,930	-42,812	-43,804	-44,889	-46,054	-47,288
KR4301MC3. 2017-12 풋335							13,558
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,544	-13,544	-13,545	-13,546	-13,548	-13,552	-13,558
-5.33%	-8,438	-8,444	-8,454	-8,470	-8,493	-8,525	-8,564
-2.67%	-3,450	-3,517	-3,597	-3,688	-3,789	-3,899	-4,015
0%	532	355	178	0	-178	-357	-535
2.67%	2,272	2,160	2,038	1,908	1,771	1,628	1,480
5.33%	2,568	2,549	2,521	2,482	2,433	2,373	2,304
8.00%	2,585	2,584	2,582	2,577	2,568	2,554	2,535
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							30,660
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30,645	-30,645	-30,645	-30,646	-30,648	-30,653	-30,660
-5.33%	-19,540	-19,544	-19,555	-19,574	-19,603	-19,646	-19,704
-2.67%	-8,547	-8,634	-8,748	-8,887	-9,051	-9,235	-9,439
0%	1,053	710	358	0	-363	-731	-1,102
2.67%	6,247	5,927	5,593	5,250	4,899	4,541	4,179

5.33%	7,442	7,364	7,258	7,125	6,968	6,789	6,588
8.00%	7,539	7,533	7,521	7,498	7,464	7,415	7,350

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

99,020

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

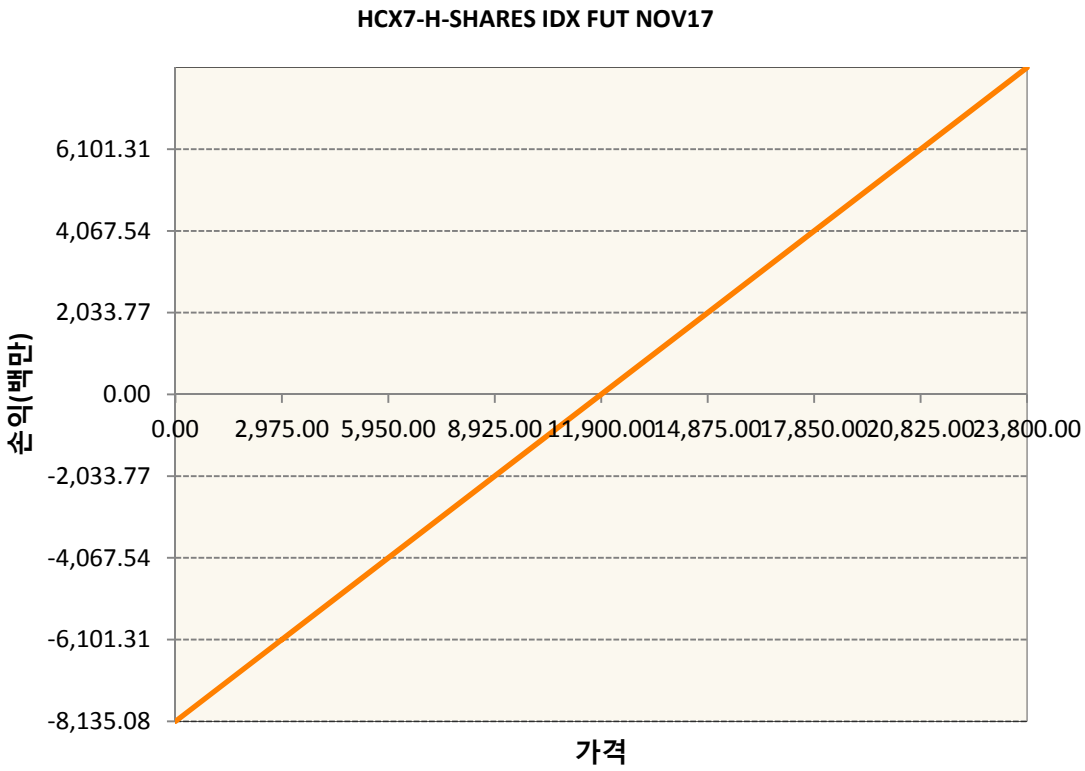
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

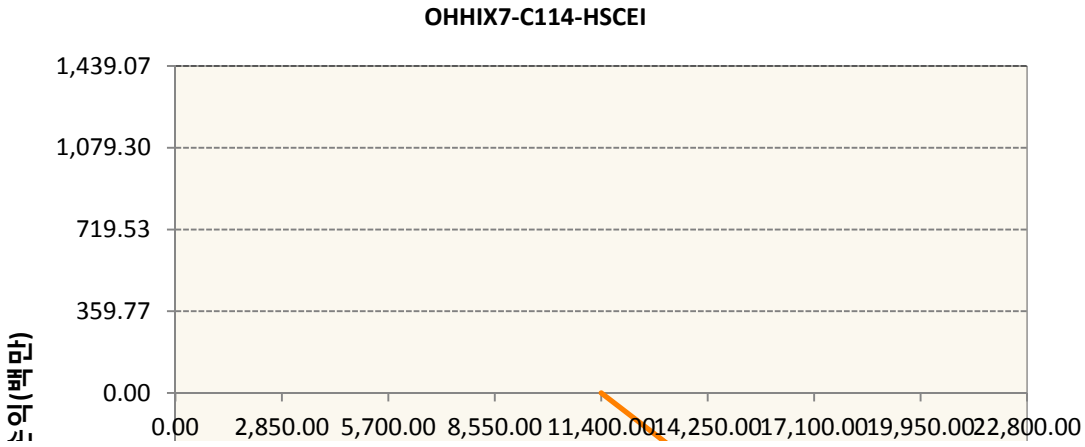
1. 계약금액

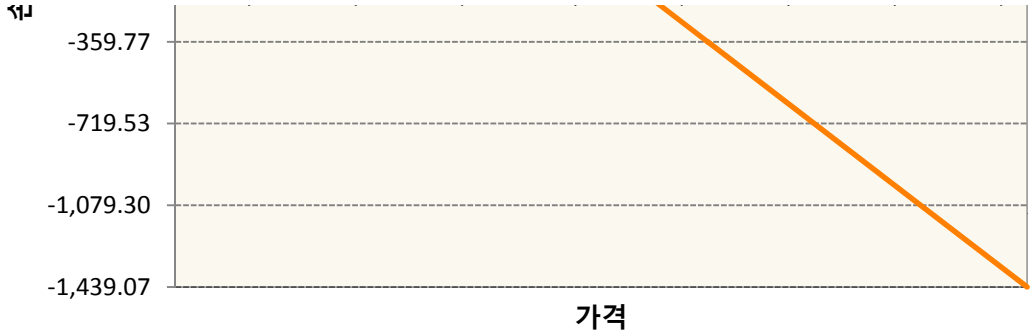
(단위:백만원)

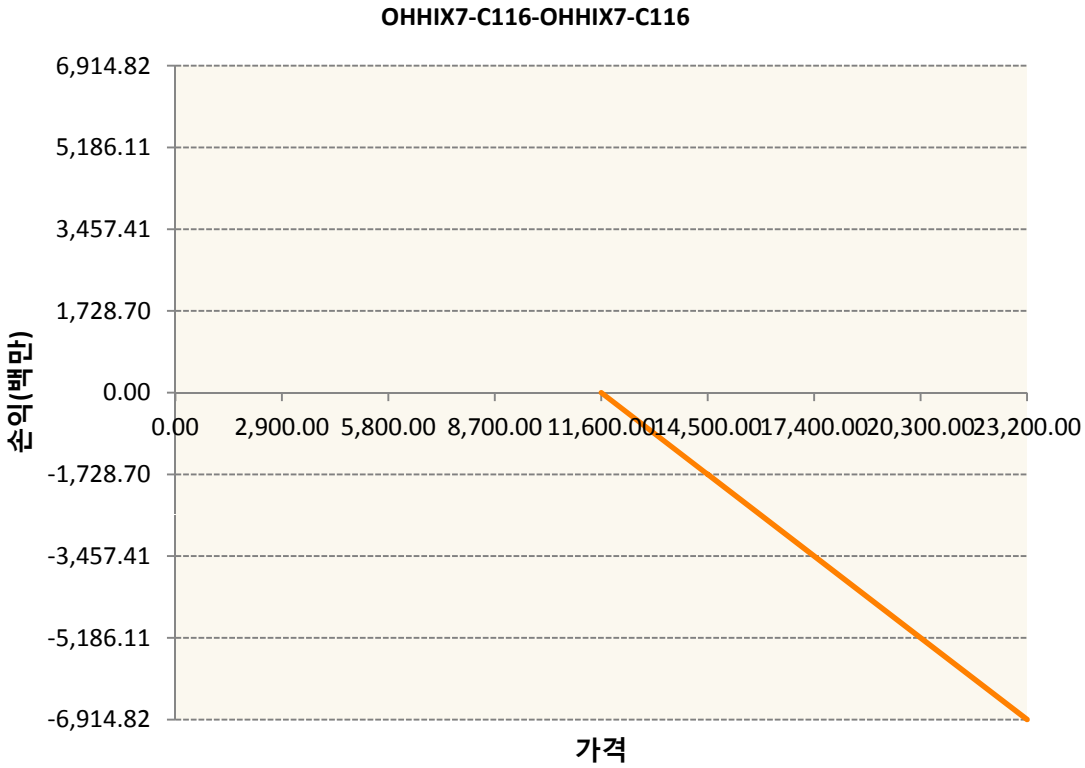
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,135	0	8,135	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,708	-16,708	장내

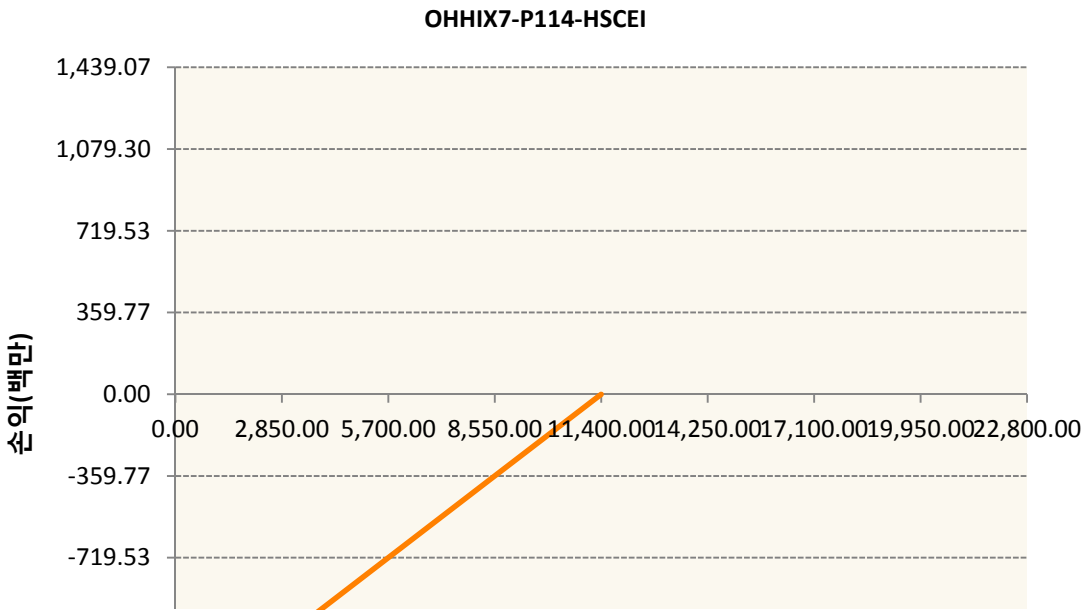
2. 만기시점의 손익구조

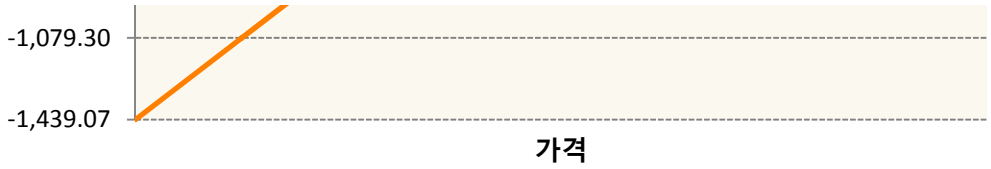


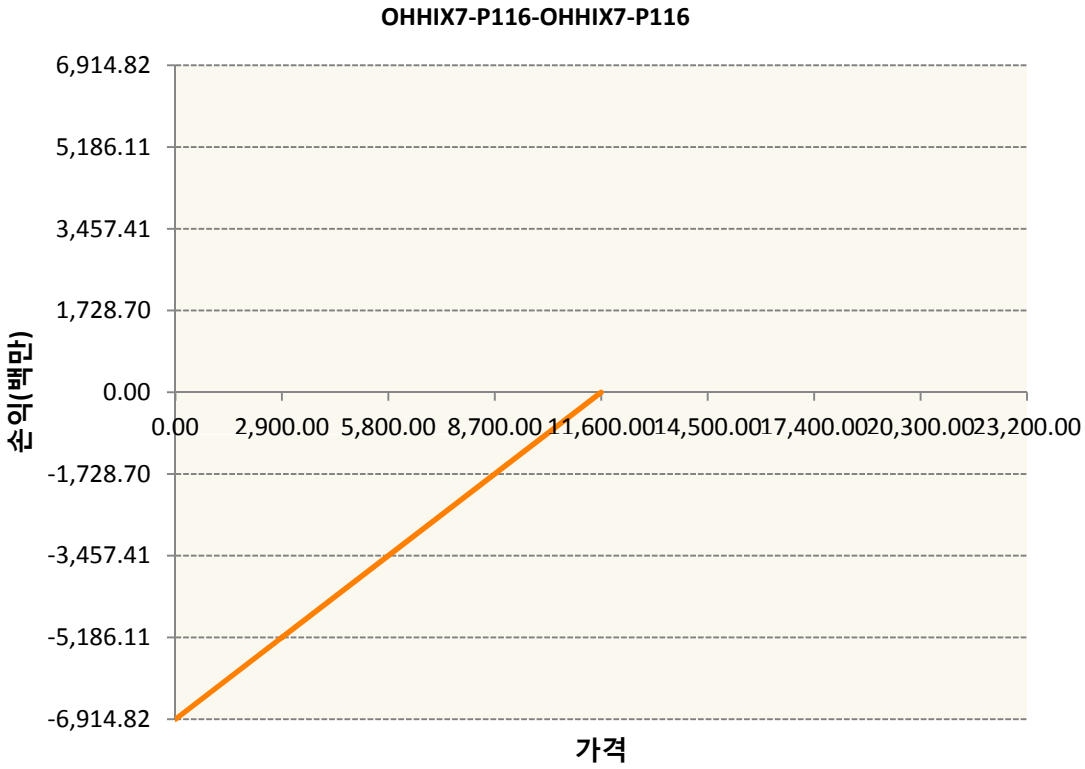



-359.77
-719.53
-1,079.30
-1,439.07
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,914.82
5,186.11
3,457.41
1,728.70
0.00
-1,728.70
-3,457.41
-5,186.11
-6,914.82
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
1,439.07
1,079.30
719.53
359.77
0.00
-359.77
-719.53
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	651
OHHIX7-C11	HSCEI	115
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	553
OHHIX7-P11	HSCEI	115
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	553

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,594

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

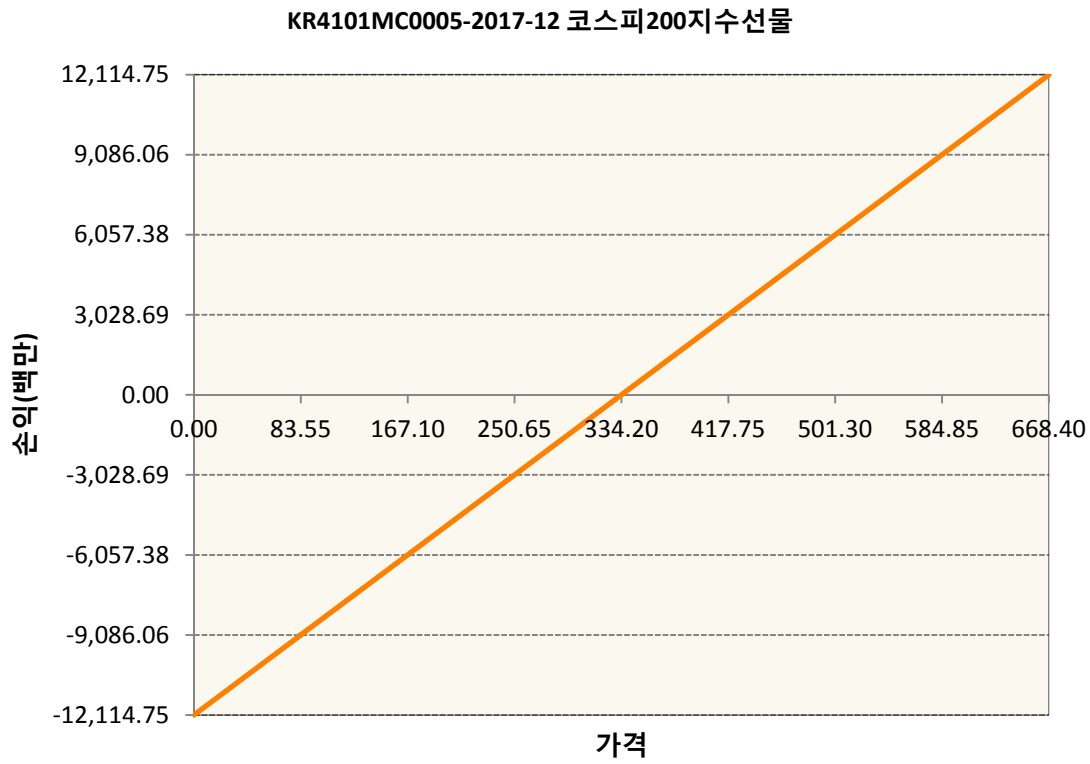
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

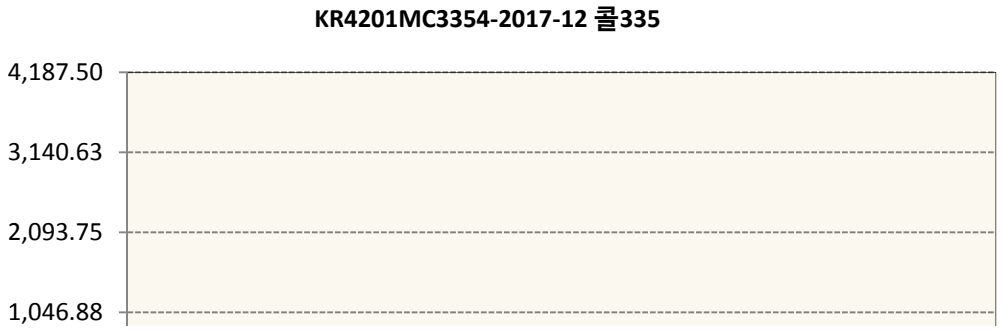
1. 계약금액

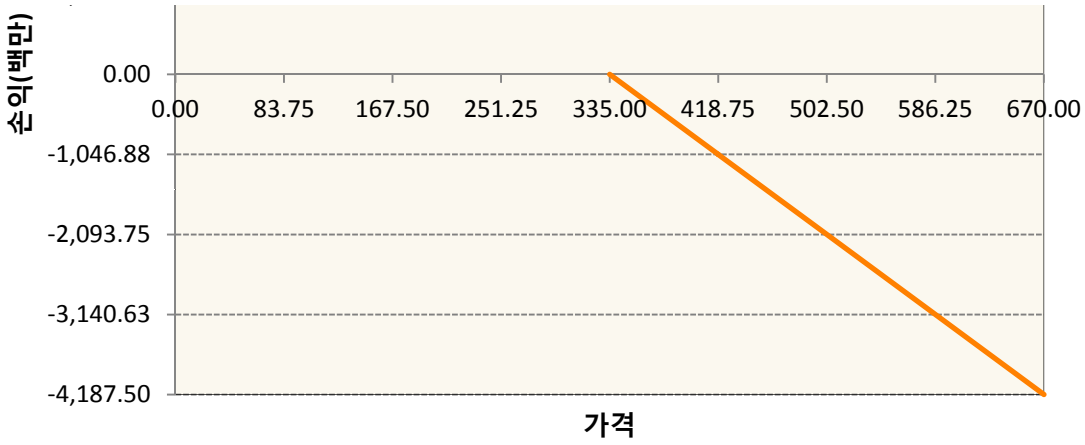
(단위:백만원)

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	6,824	-6,824	장내
누계	유가증권	선물	12,115	0	12,115	장내
누계	유가증권	스왑	54,200	0	54,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

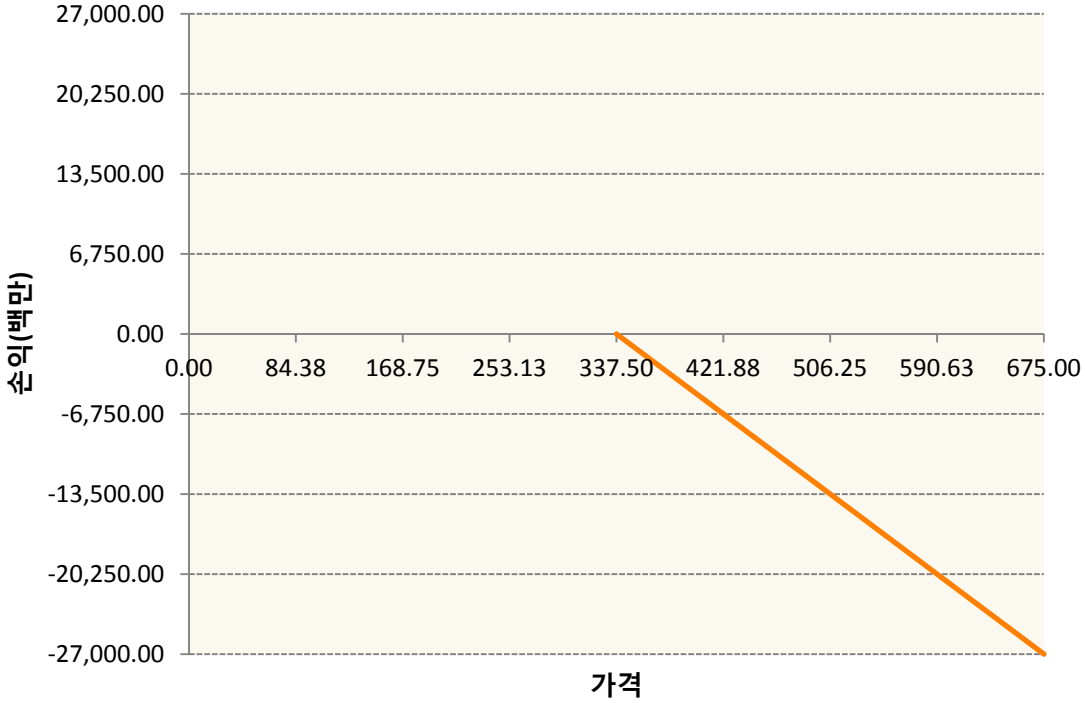
2. 만기시점의 손익구조



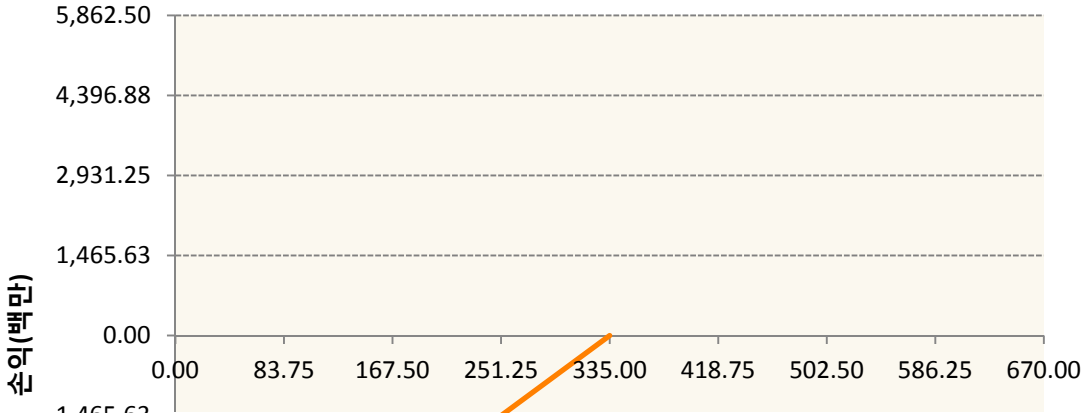




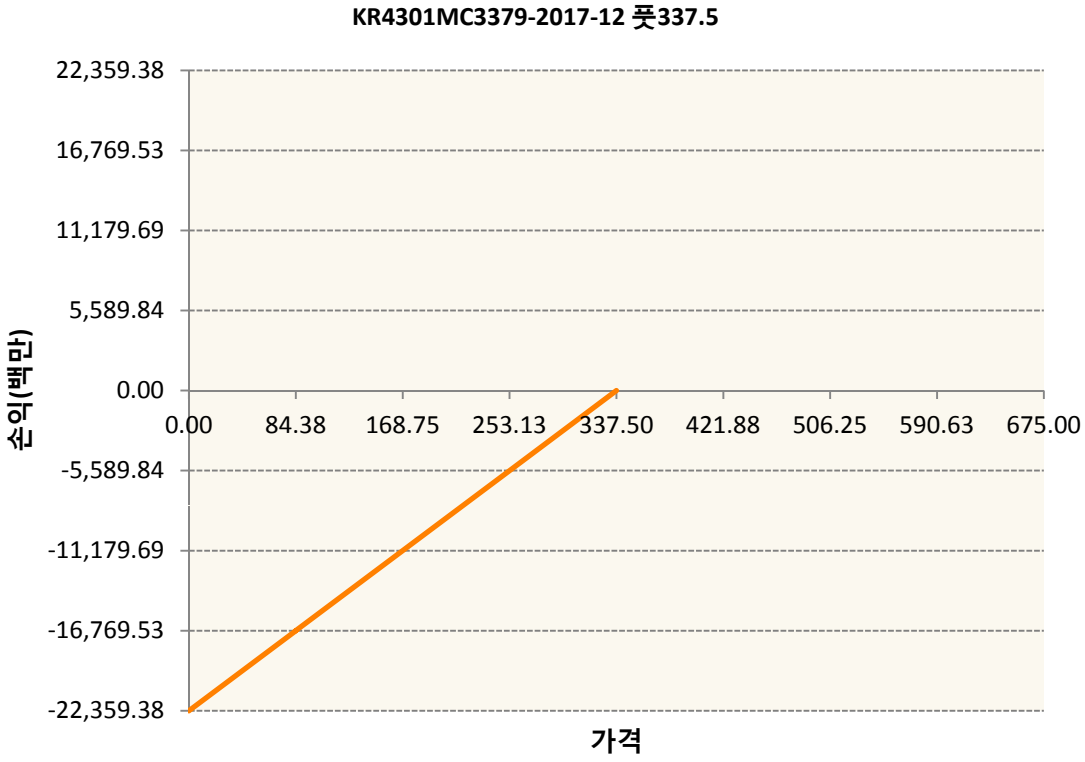
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,474	-1,474	-1,474	-1,474	-1,474	-1,474	-1,474
-5.33%	-983	-983	-983	-983	-983	-983	-983
-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%	983	983	983	983	983	983	983
8.00%	1,474	1,474	1,474	1,474	1,474	1,474	1,474
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						472
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-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%	472	472	472	472	472	472	472
	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%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
-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%	210	210	210	210	210	210	210
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						638
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-638	-638	-638	-638	-638	-638	-638
-5.33%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425
-2.67%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	213	213	213	213	213	213	213
5.33%	425	425	425	425	425	425	425
8.00%	638	638	638	638	638	638	638
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					967

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-967	-967	-967	-967	-967	-967	-967
-5.33%	-645	-645	-645	-645	-645	-645	-645
-2.67%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	322	322	322	322	322	322	322
5.33%	645	645	645	645	645	645	645
8.00%	967	967	967	967	967	967	967
	KR4201MC3. 2017-12 콜335						252

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	92	90	87	83	80	75
-5.33%	87	82	78	72	67	61	54
-2.67%	67	60	52	45	37	29	21
0%	26	17	9	0	-9	-17	-26
2.67%	-39	-47	-55	-63	-72	-80	-88
5.33%	-125	-131	-137	-143	-150	-157	-165
8.00%	-225	-228	-232	-236	-241	-246	-252
	KR4201MC3. 2017-12 콜337.5						1,542

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	519	510	498	482	463	442	417
-5.33%	484	462	435	406	373	338	301
-2.67%	383	343	299	254	208	160	112
0%	164	110	55	0	-55	-110	-166
2.67%	-207	-262	-316	-371	-427	-482	-538
5.33%	-723	-765	-809	-855	-902	-951	-1,001
8.00%	-1,343	-1,367	-1,396	-1,428	-1,464	-1,502	-1,542
	KR4301MC3. 2017-12 풋335						413

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-412	-412	-412	-412	-412	-412	-413
-5.33%	-257	-257	-257	-258	-258	-259	-261
-2.67%	-105	-107	-109	-112	-115	-119	-122
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	69	66	62	58	54	50	45
5.33%	78	78	77	76	74	72	70
8.00%	79	79	79	78	78	78	77
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,625

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624	-1,624	-1,625	-1,625
-5.33%	-1,036	-1,036	-1,036	-1,037	-1,039	-1,041	-1,044

-2.67%	-453	-458	-464	-471	-480	-489	-500
0%	56	38	19	0	-19	-39	-58
2.67%	331	314	296	278	260	241	221
5.33%	394	390	385	378	369	360	349
8.00%	400	399	399	397	396	393	390

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

9,036

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

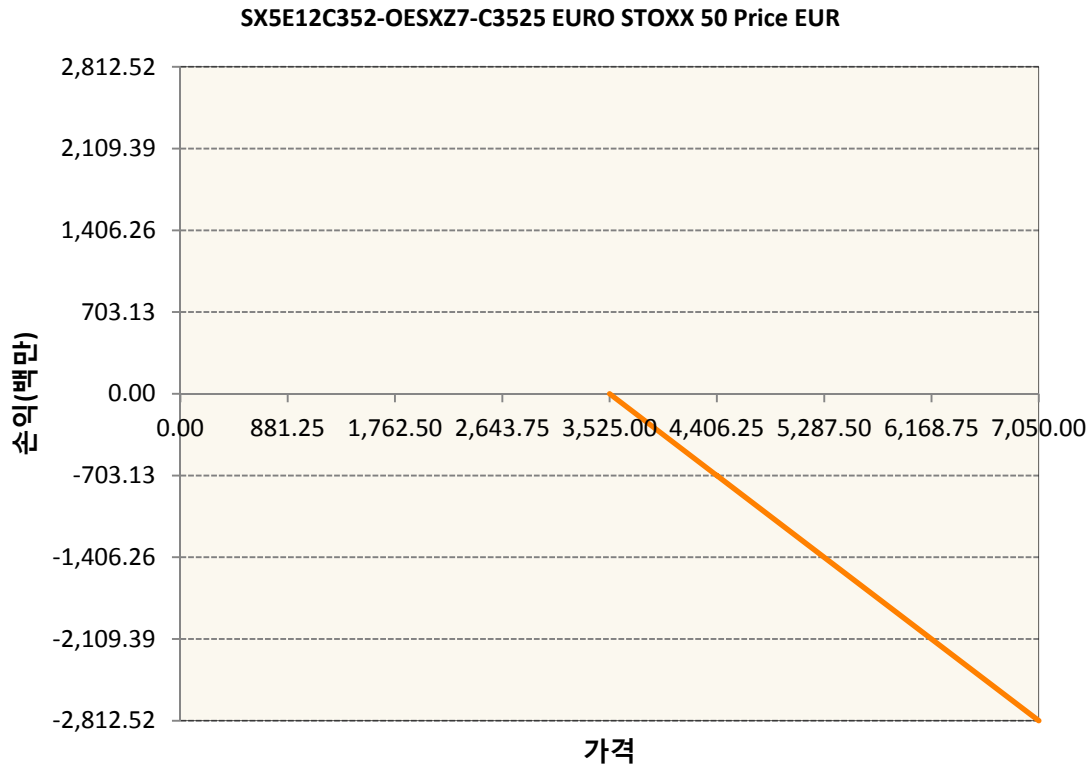
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

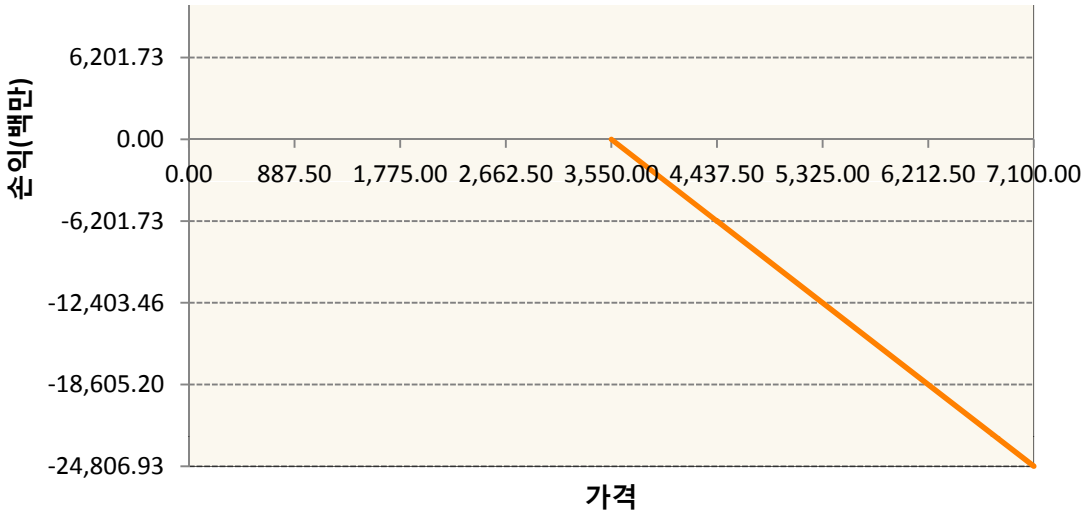
(단위:백만원)

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
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	19,705	0	19,705	
누계	유가증권	스왑	96,514	0	96,514	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,239	-55,239	장내
누계	지수	스왑	51,475	0	51,475	장외

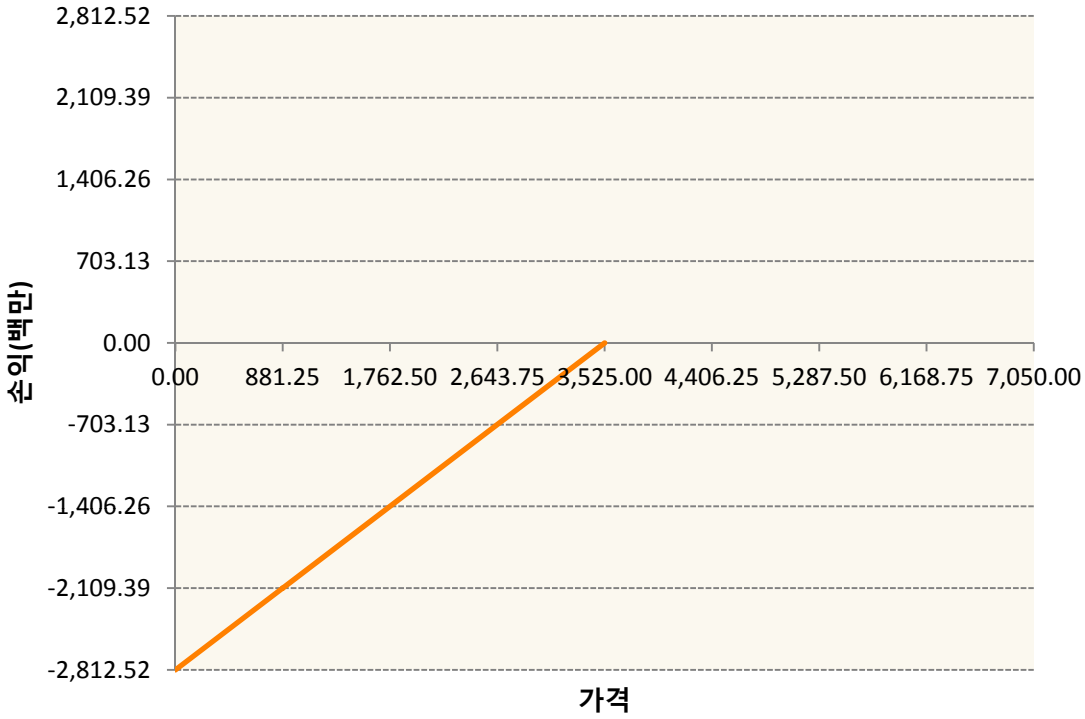
2. 만기시점의 손익구조



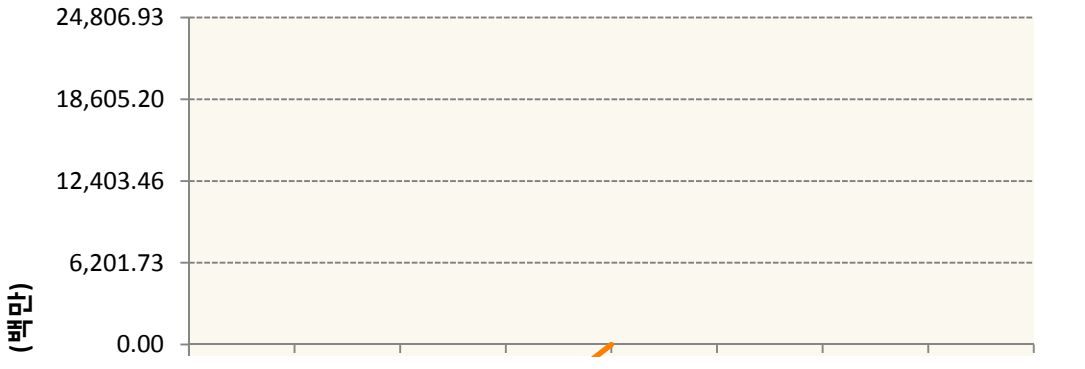


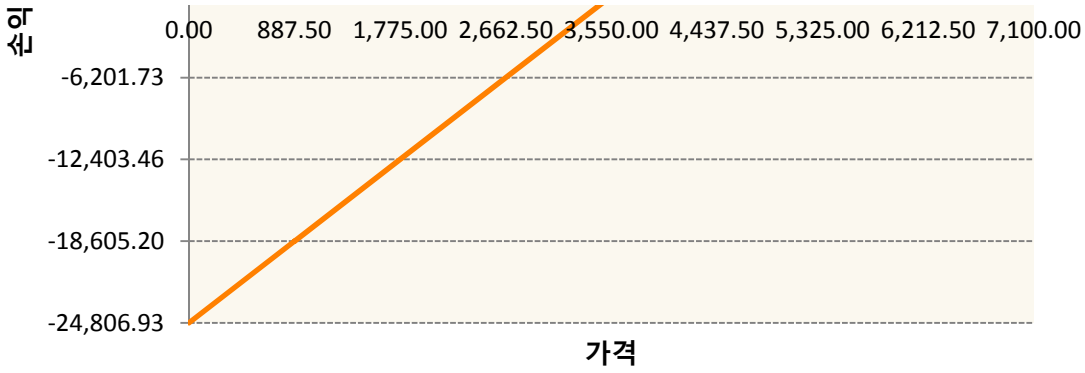


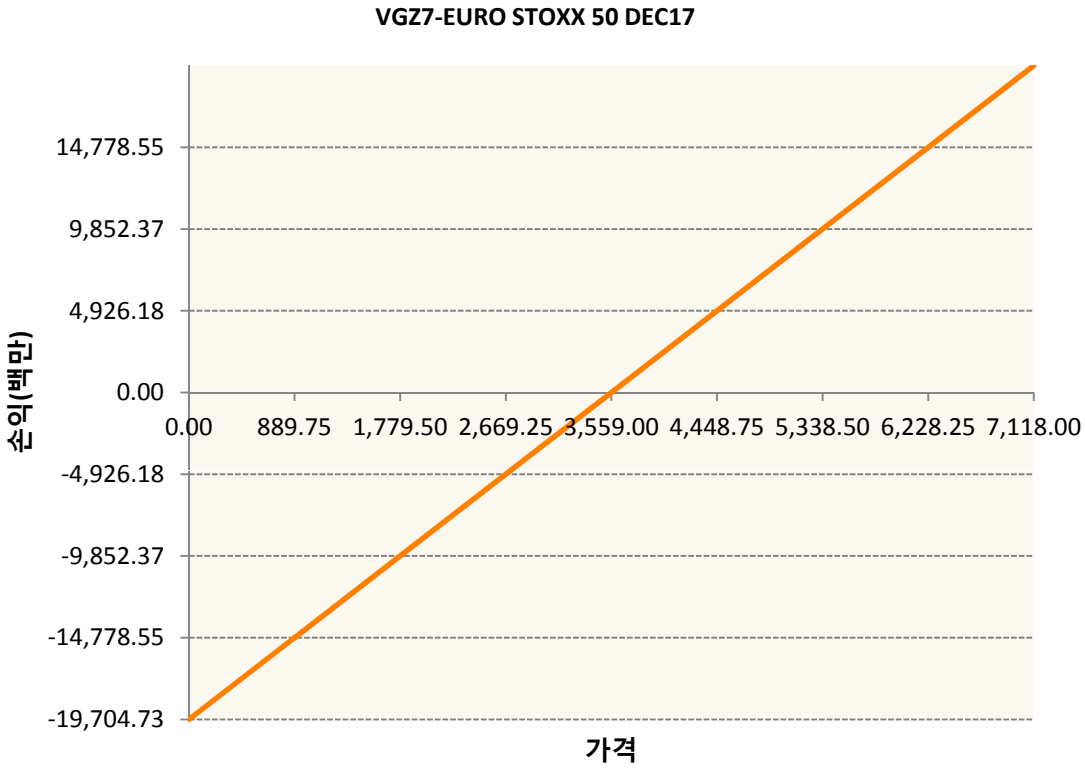
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	13
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	17
SX5E12C352	OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	225
SX5E12C355	OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,984
SX5E12P352	OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	225
SX5E12P355	OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,984
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	1,576

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

3,561

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

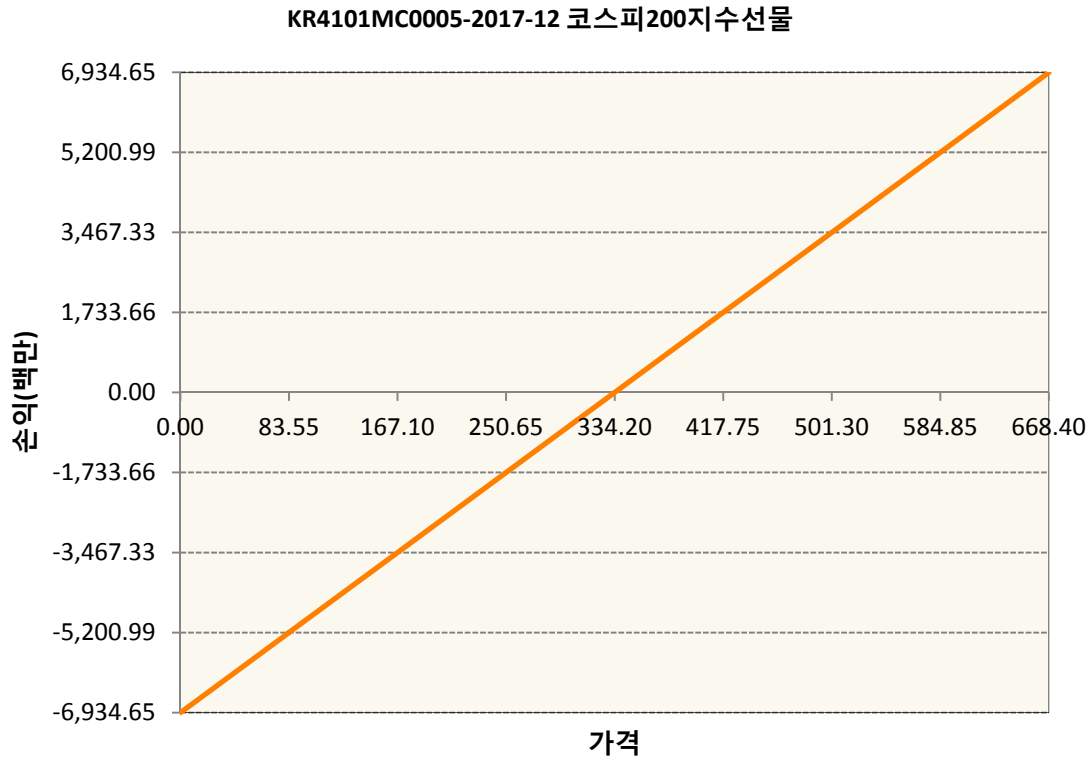
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,935	0	6,935	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						554
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-554	-554	-554	-554	-554	-554	-554
-5.33%	-369	-369	-369	-369	-369	-369	-369
-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%	369	369	369	369	369	369	369
8.00%	554	554	554	554	554	554	554

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

314

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

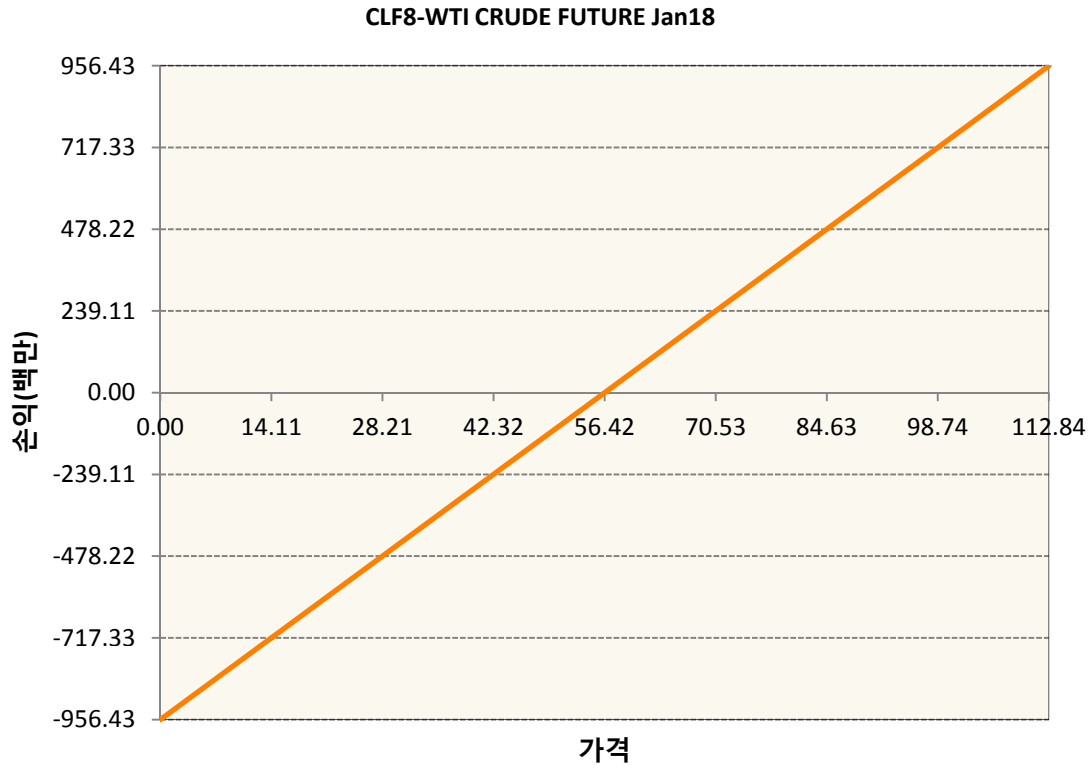
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

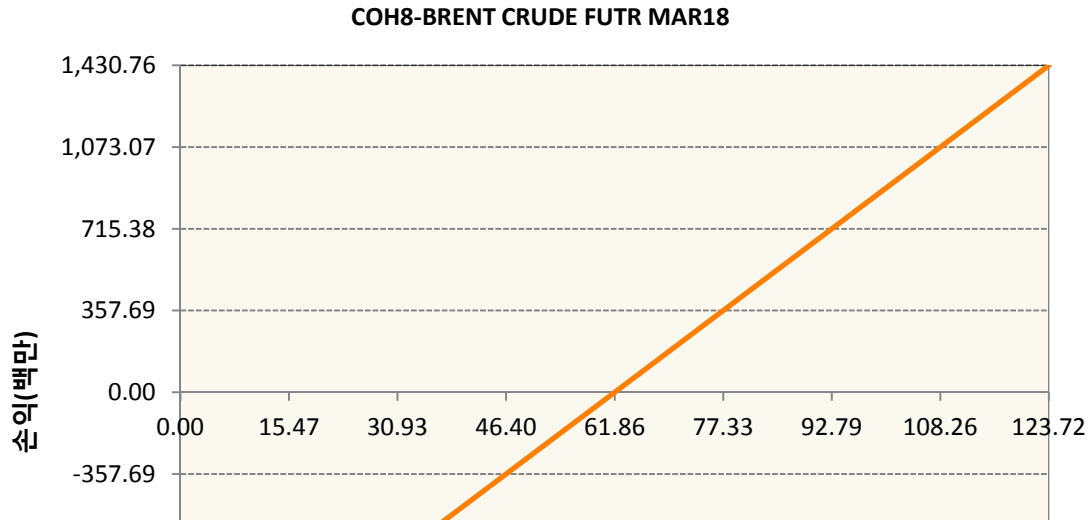
1. 계약금액

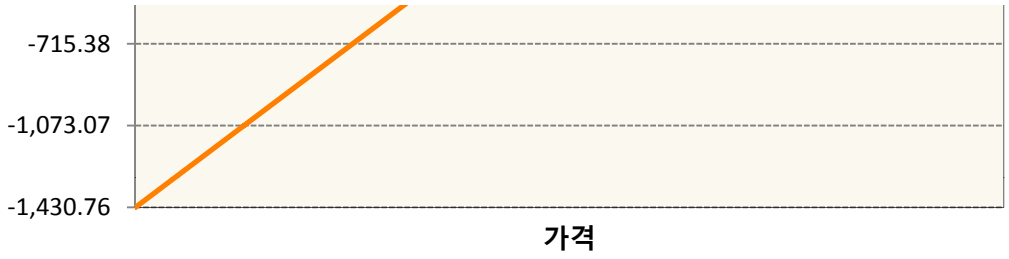
(단위:백만원)

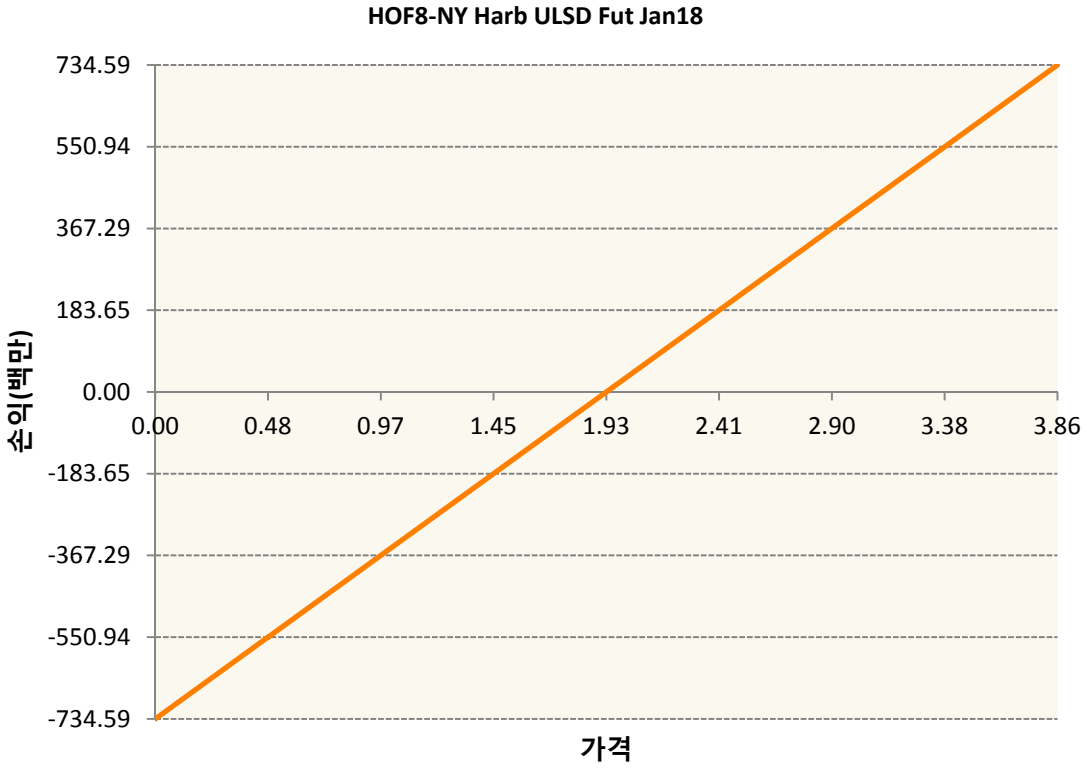
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,181	877	4,304	

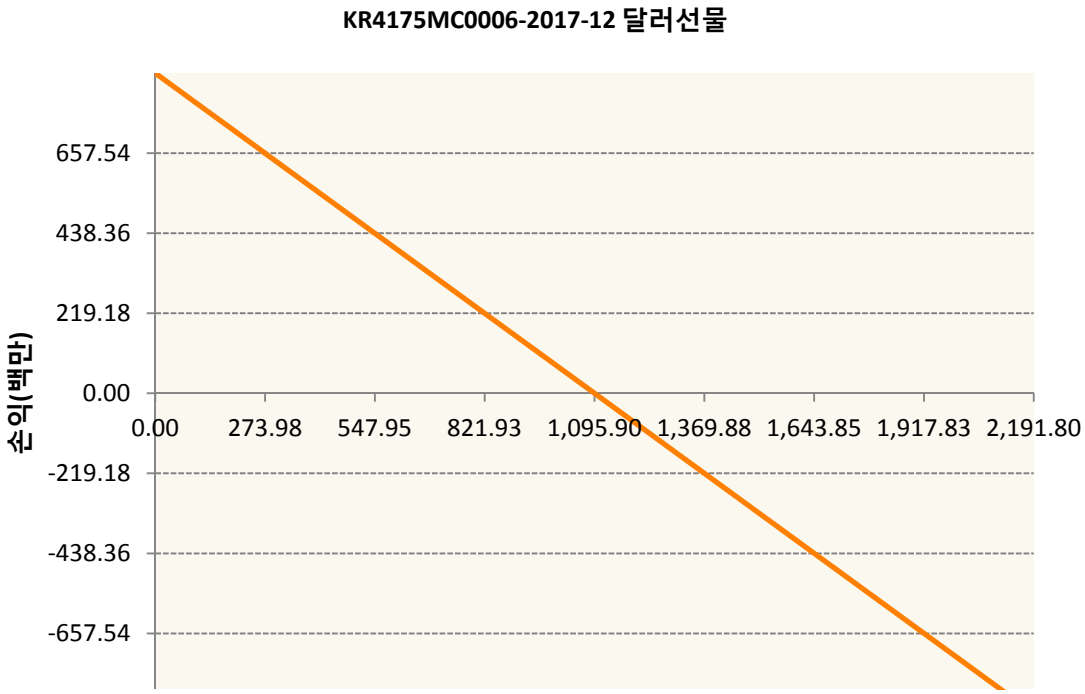
2. 만기시점의 손익구조

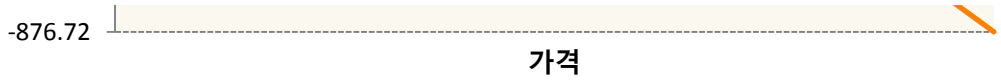


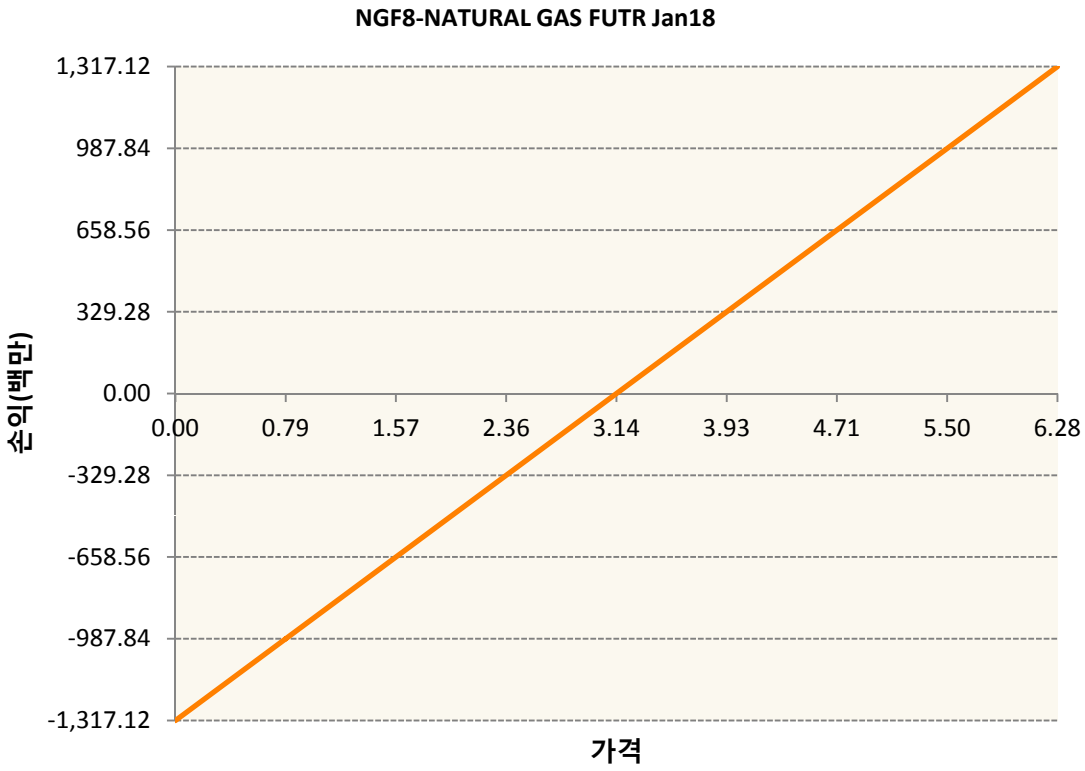


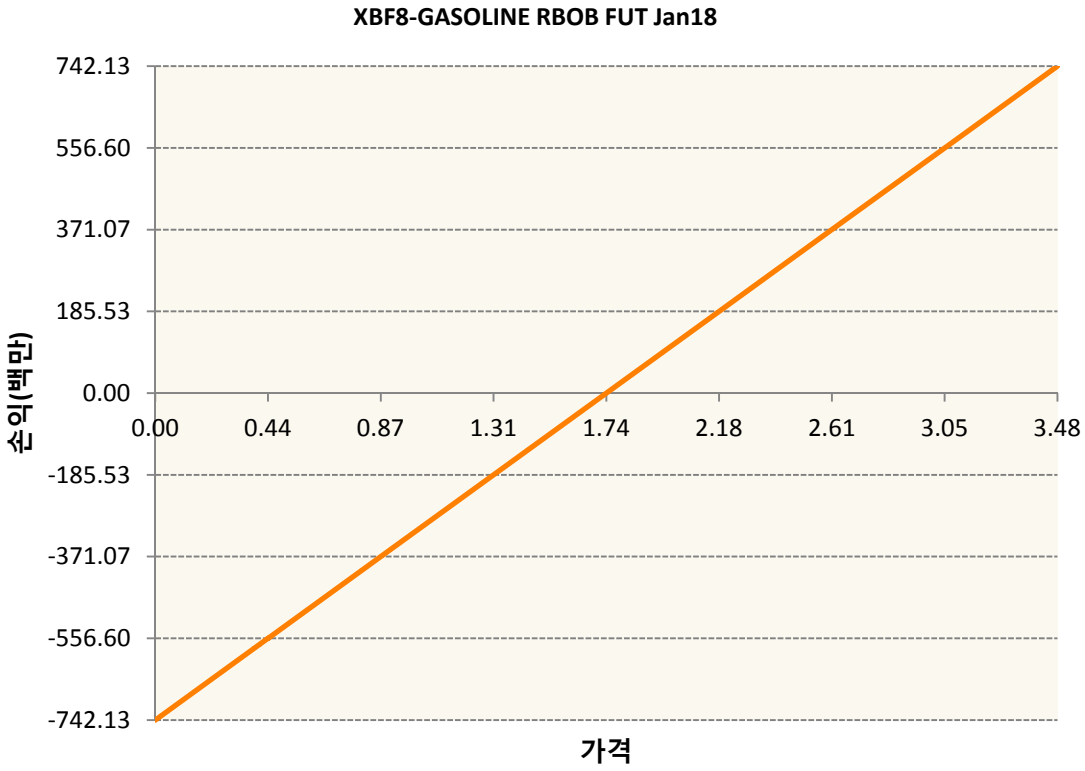

-715.38
-1,073.07
-1,430.76
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
734.59
550.94
367.29
183.65
0.00
-183.65
-367.29
-550.94
-734.59
0.00
0.48
0.97
1.45
1.93
2.41
2.90
3.38
3.86
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
657.54
438.36
219.18
0.00
-219.18
-438.36
-657.54
0.00
273.98
547.95
821.93
1,095.90
1,369.88
1,643.85
1,917.83
2,191.80
손익(백만)


-876.72
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,317.12
987.84
658.56
329.28
0.00
-329.28
-658.56
-987.84
-1,317.12
0.00
0.79
1.57
2.36
3.14
3.93
4.71
5.50
6.28
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
742.13
556.60
371.07
185.53
0.00
-185.53
-371.07
-556.60
-742.13
0.00
0.44
0.87
1.31
1.74
2.18
2.61
3.05
3.48
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	77
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	114
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	105
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	59

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

723

공시일	2017-11-22
기준일	2017-11-21

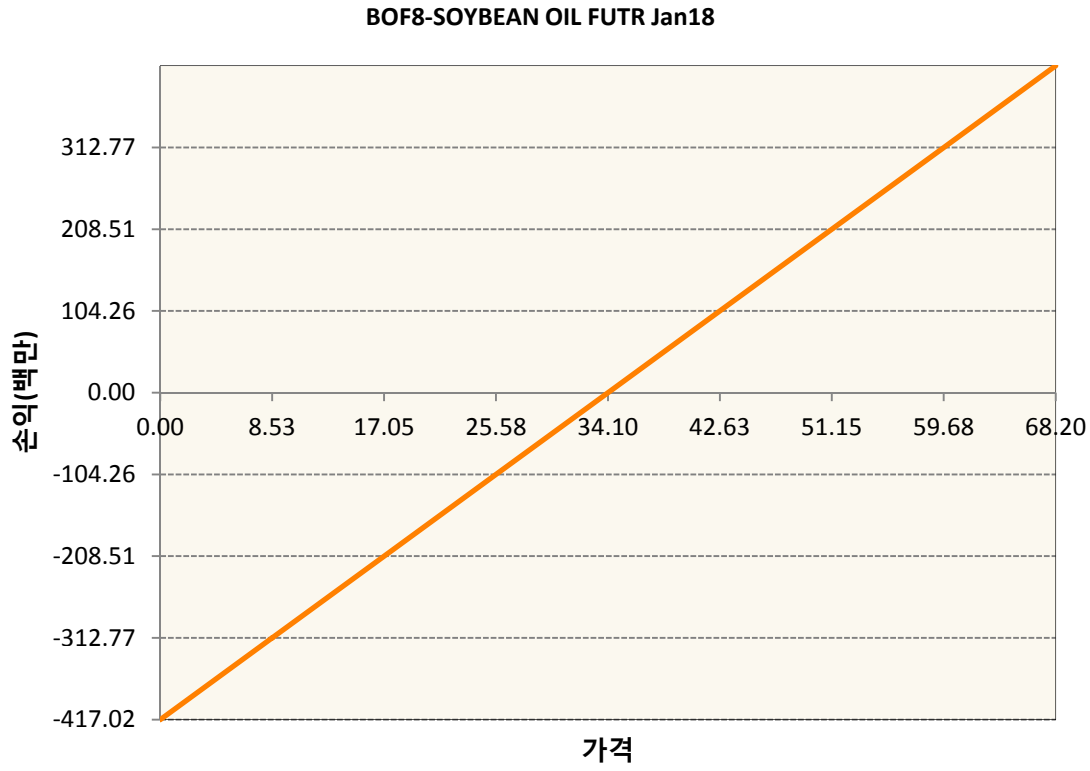
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

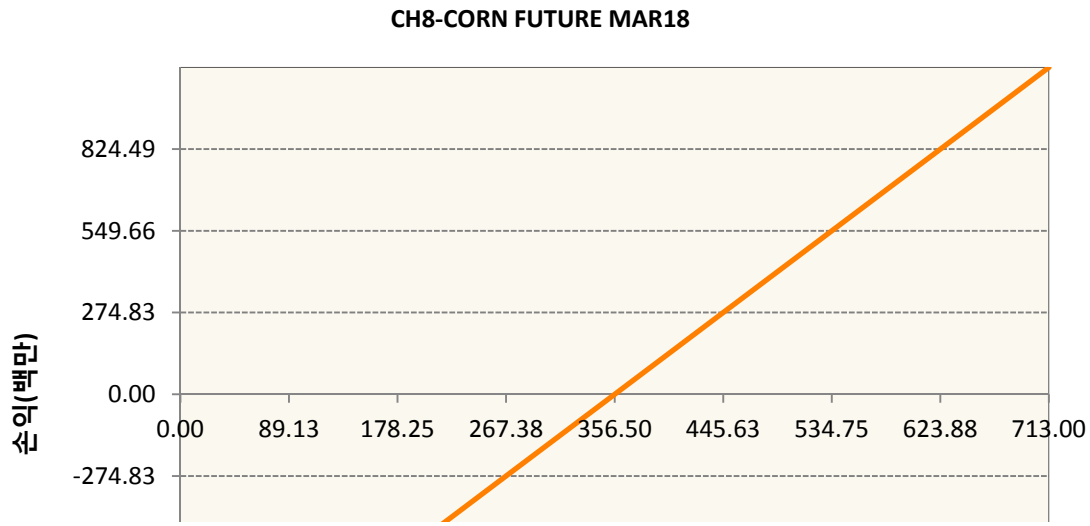
1. 계약금액

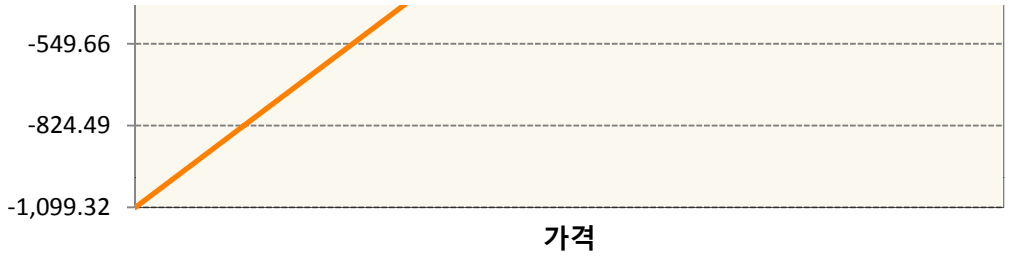
(단위:백만원)

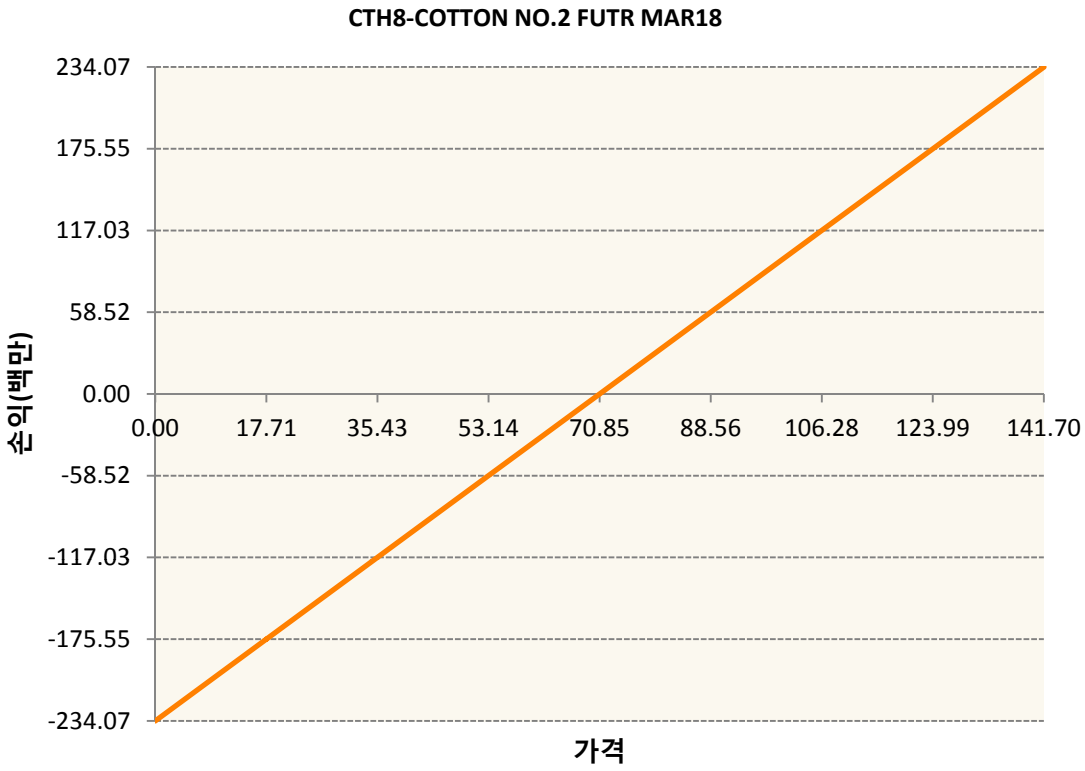
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,534	329	4,205	

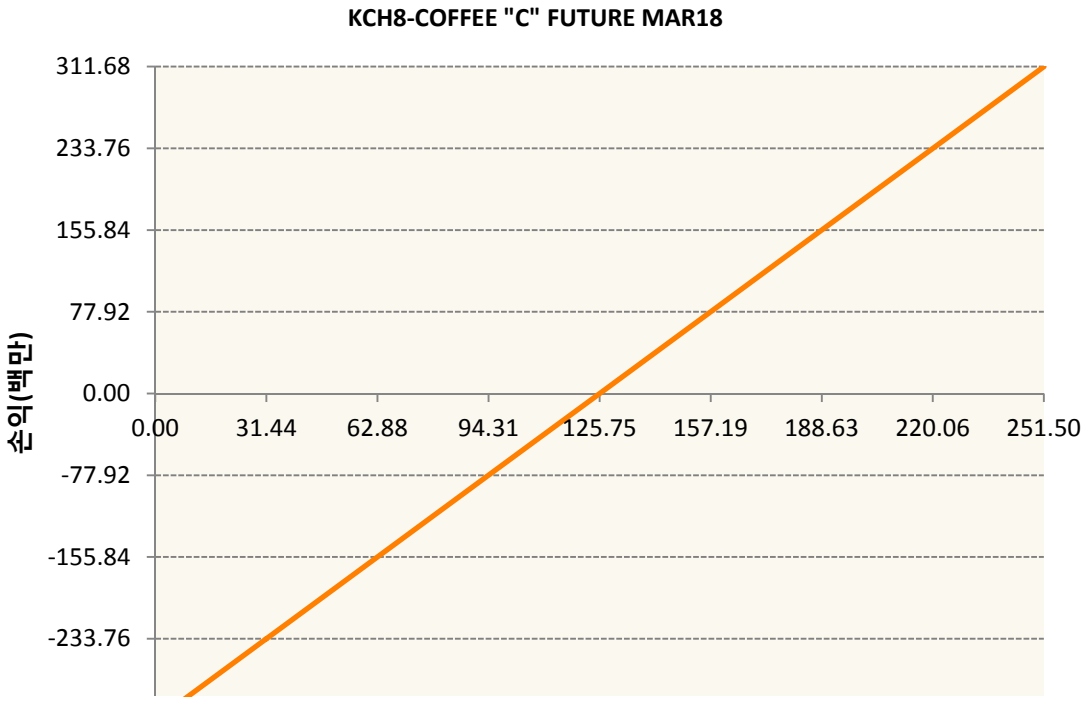
2. 만기시점의 손익구조

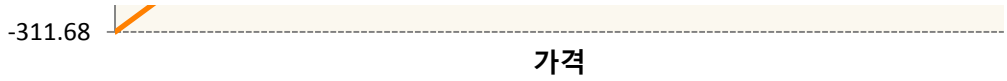


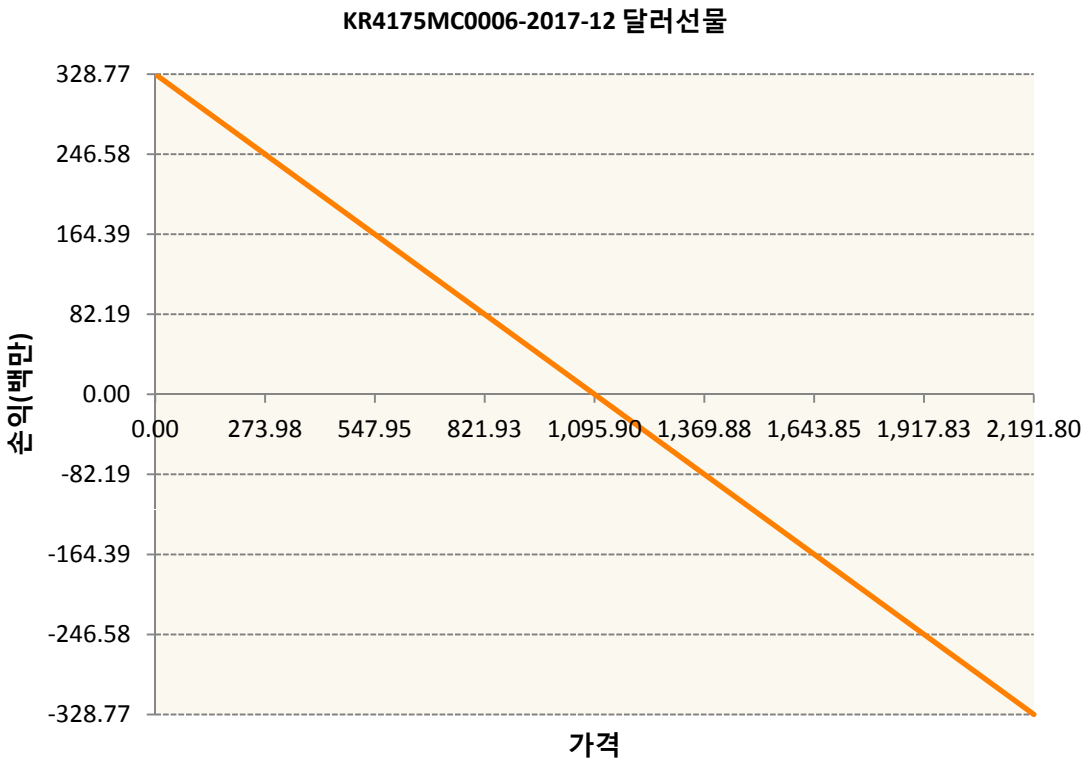


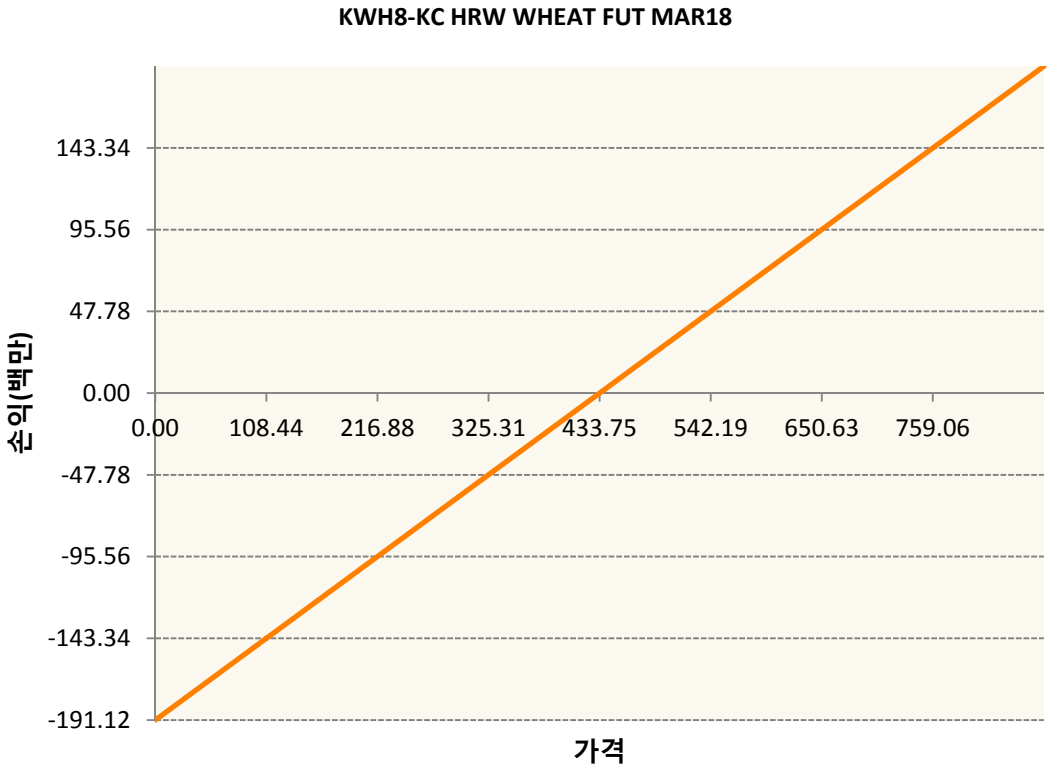

-549.66
-824.49
-1,099.32
가격

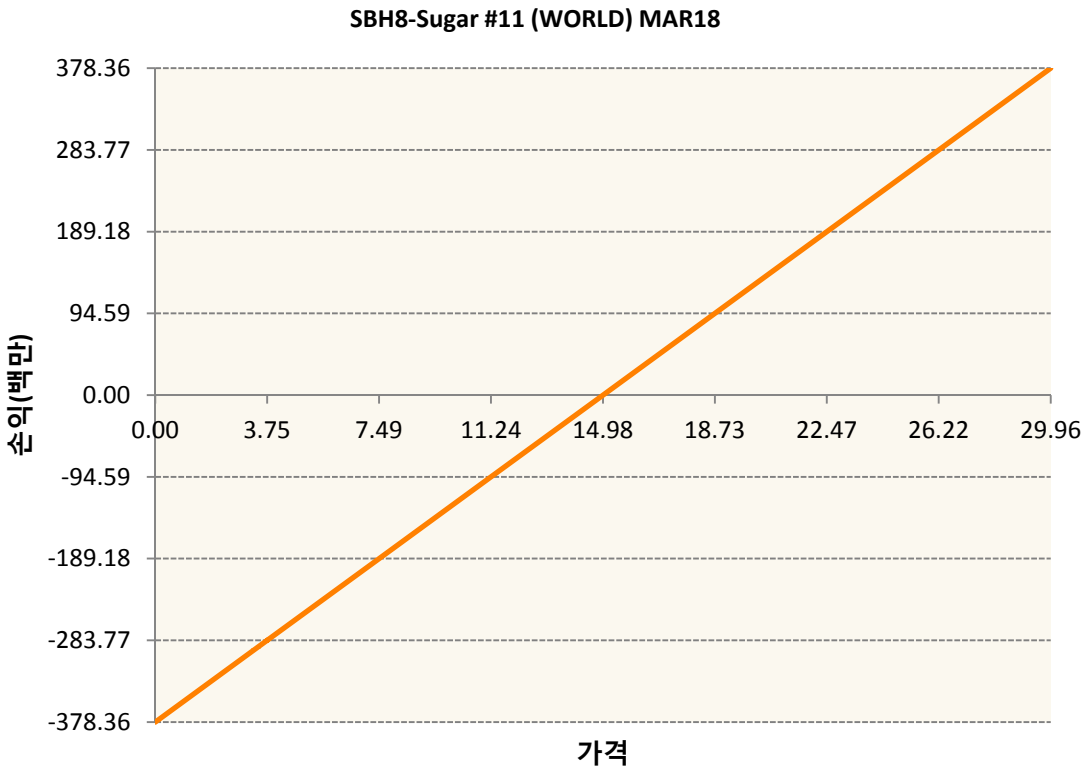

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
234.07
175.55
117.03
58.52
0.00
-58.52
-117.03
-175.55
-234.07
0.00
17.71
35.43
53.14
70.85
88.56
106.28
123.99
141.70
손익(백만)
가격

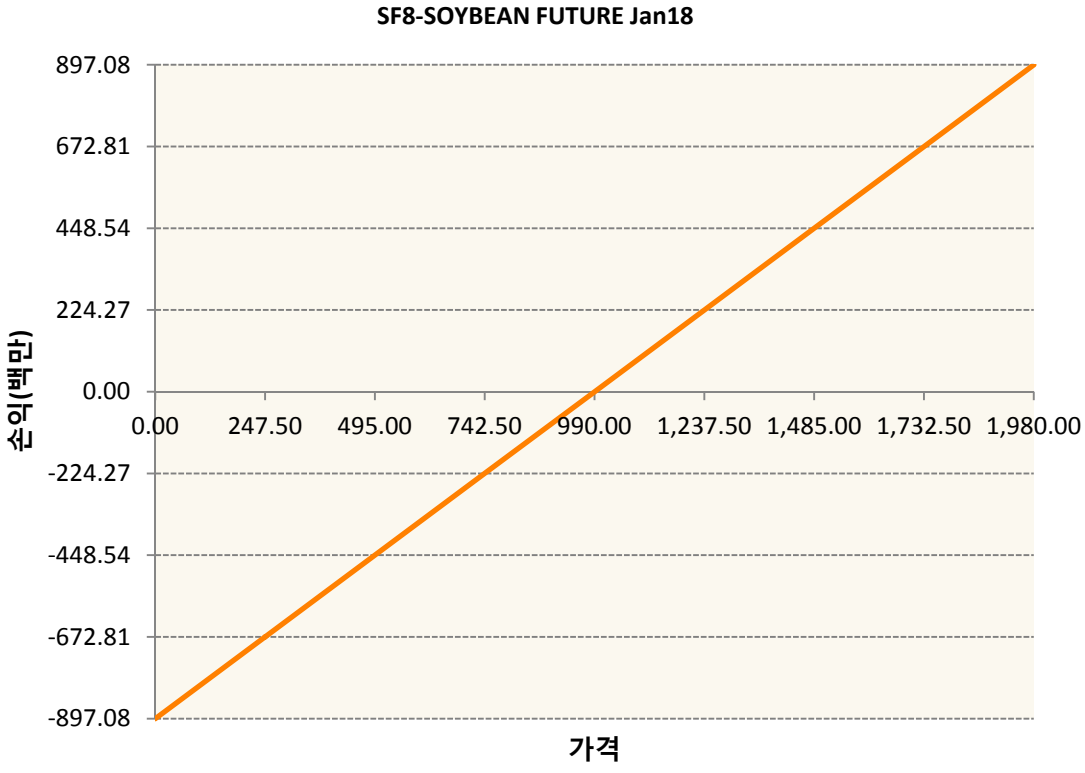

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
311.68
233.76
155.84
77.92
0.00
-77.92
-155.84
-233.76
0.00
31.44
62.88
94.31
125.75
157.19
188.63
220.06
251.50
손익(백만)


-311.68
가격

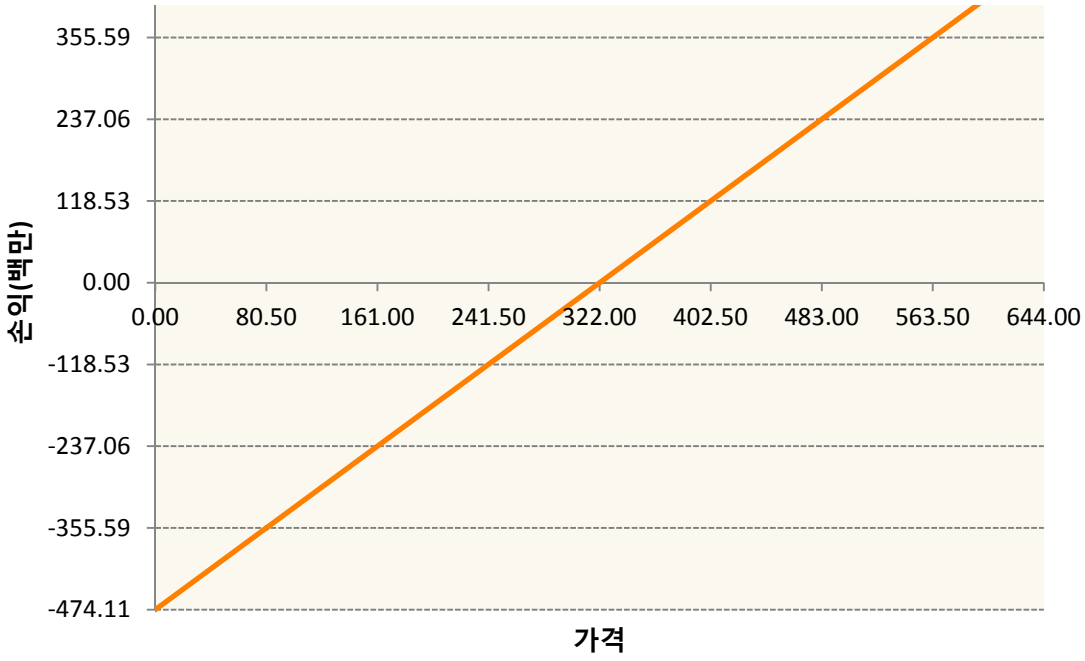

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
328.77
246.58
164.39
82.19
0.00
-82.19
-164.39
-246.58
-328.77
0.00
273.98
547.95
821.93
1,095.90
1,369.88
1,643.85
1,917.83
2,191.80
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
143.34
95.56
47.78
0.00
-47.78
-95.56
-143.34
-191.12
0.00
108.44
216.88
325.31
433.75
542.19
650.63
759.06
손익(백만)
가격

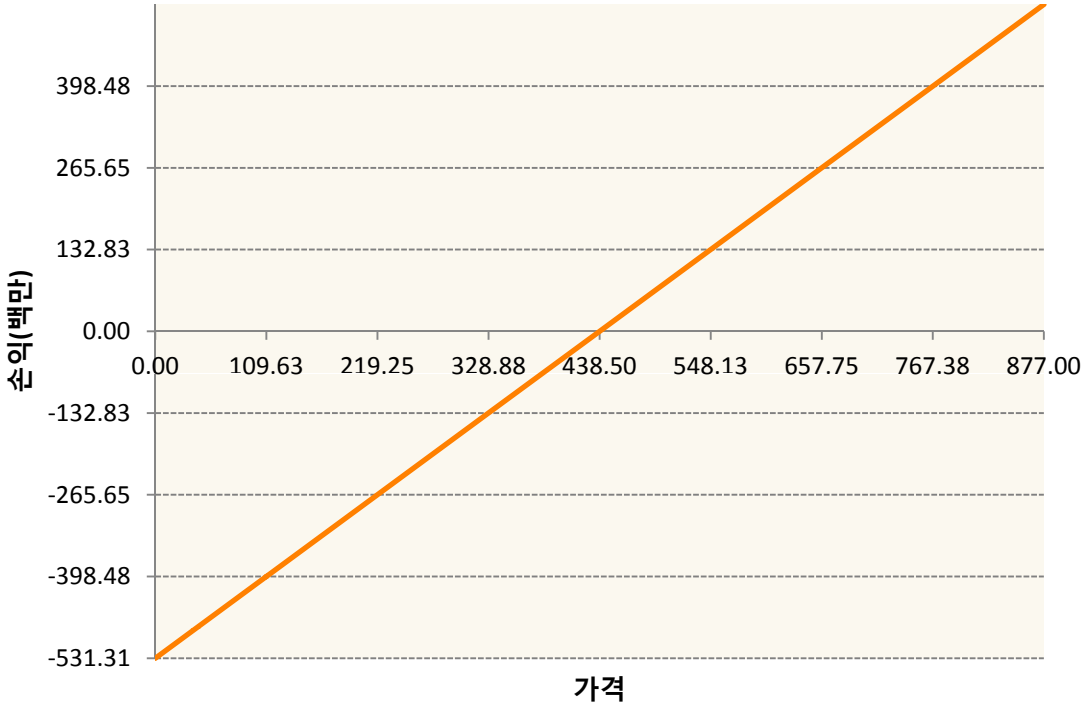

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
378.36
283.77
189.18
94.59
0.00
-94.59
-189.18
-283.77
-378.36
0.00
3.75
7.49
11.24
14.98
18.73
22.47
26.22
29.96
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
897.08
672.81
448.54
224.27
0.00
-224.27
-448.54
-672.81
-897.08
0.00
247.50
495.00
742.50
990.00
1,237.50
1,485.00
1,732.50
1,980.00
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
474.11



WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	33
CH8	CORN FUTURE MAR18	88
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	19
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	25
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	15
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	30
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	72
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	38
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	43

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

404