공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

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	2017-11-24
기준일	2017-11-23

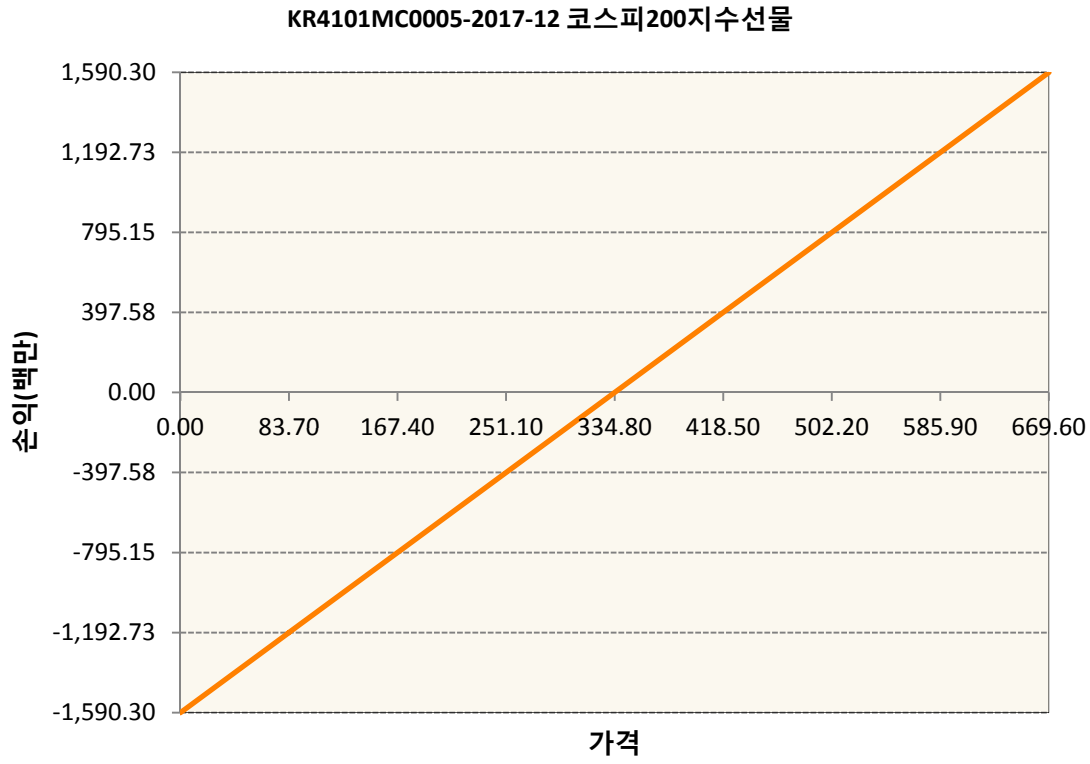
스마트인덱스모

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)

72

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

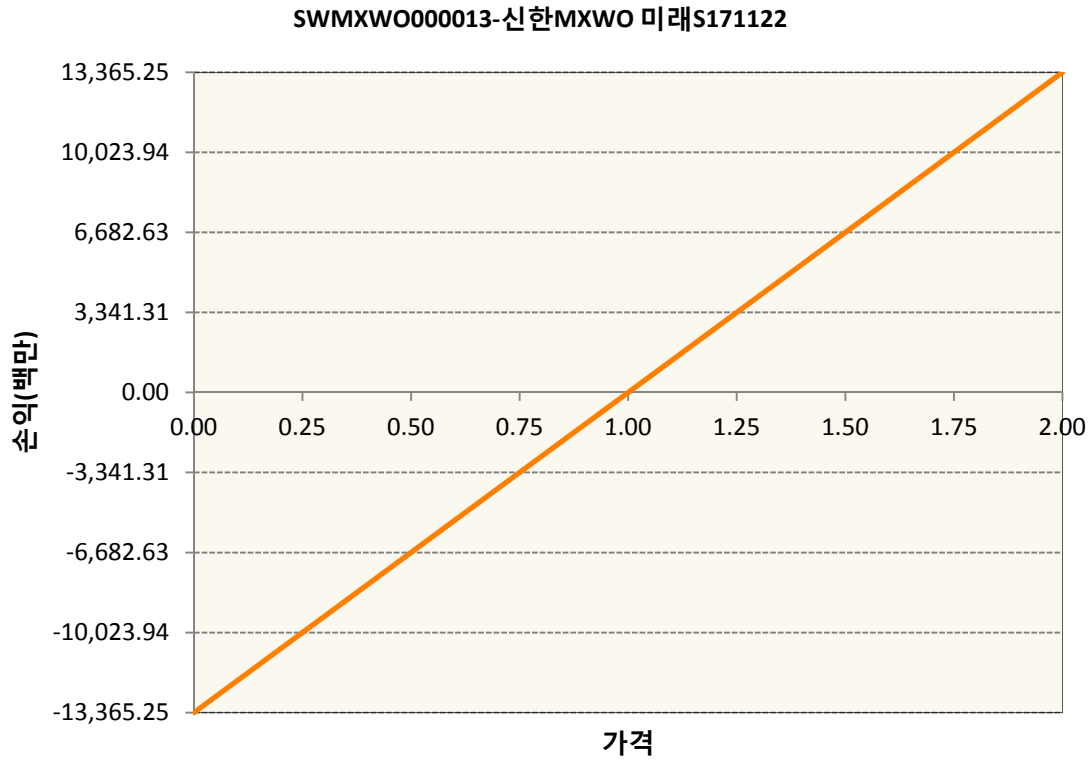
SMART합성-MSCI선진국증권상장지

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	13,365	0	13,365	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S171122	1,071

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

348

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

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	402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

362

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

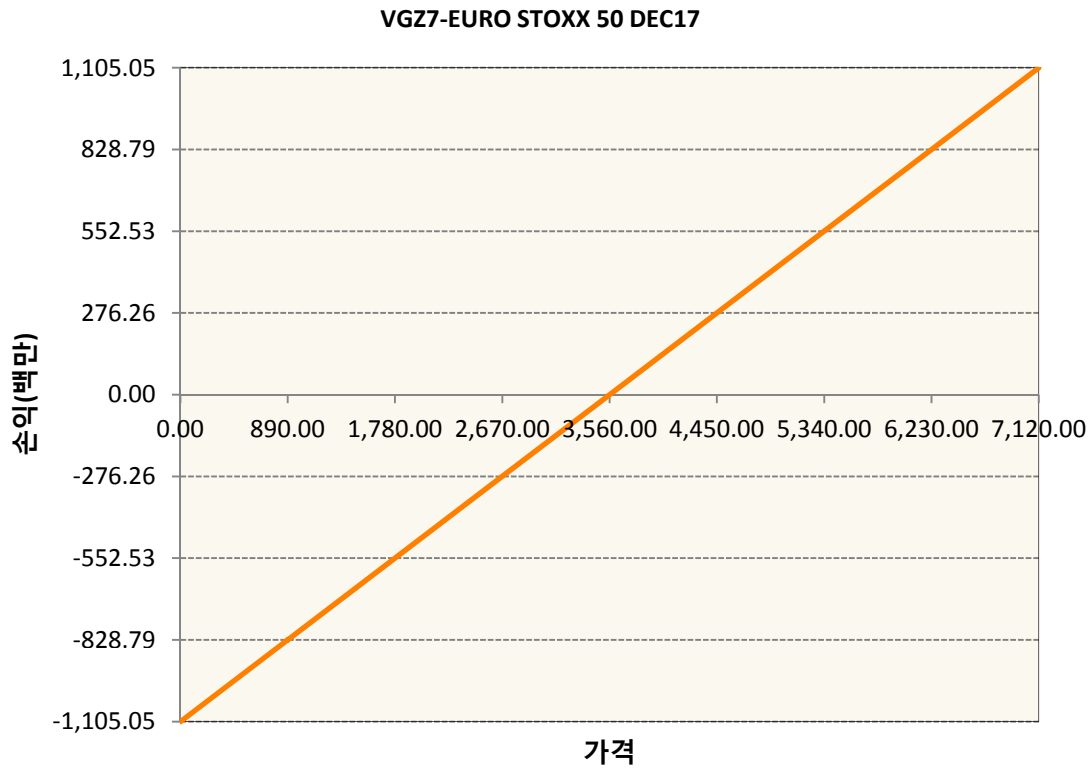
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2017-11-24
기준일	2017-11-23

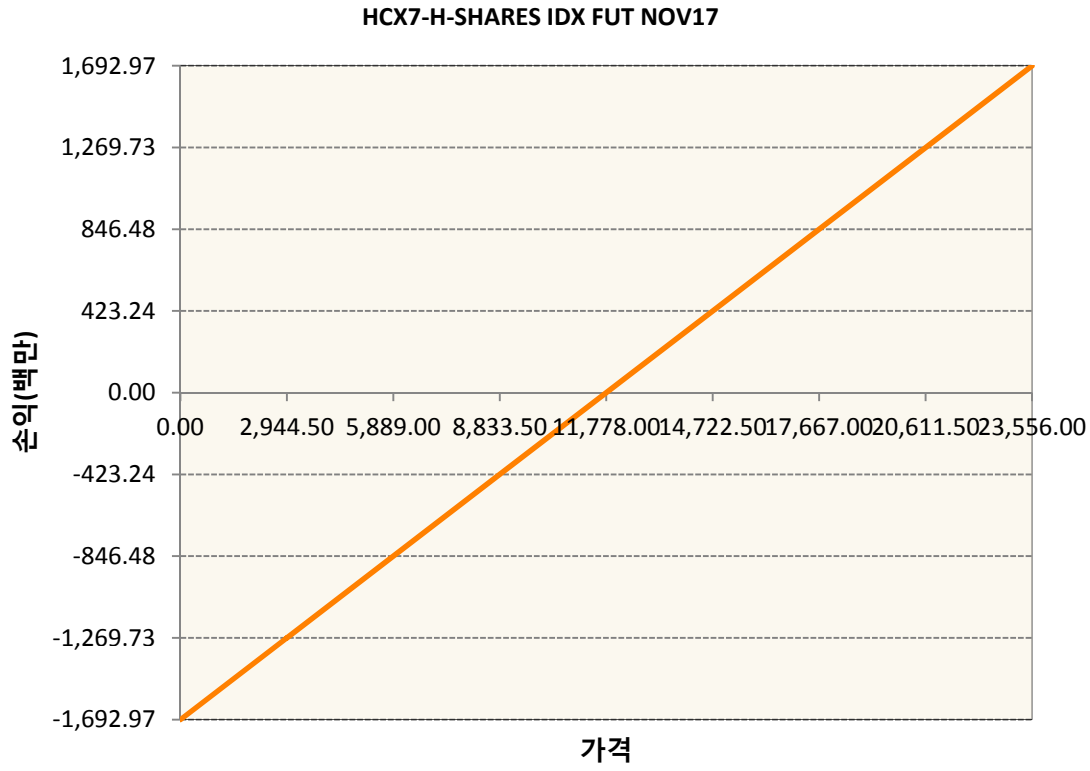
차이나인덱스모(주식-파생형)

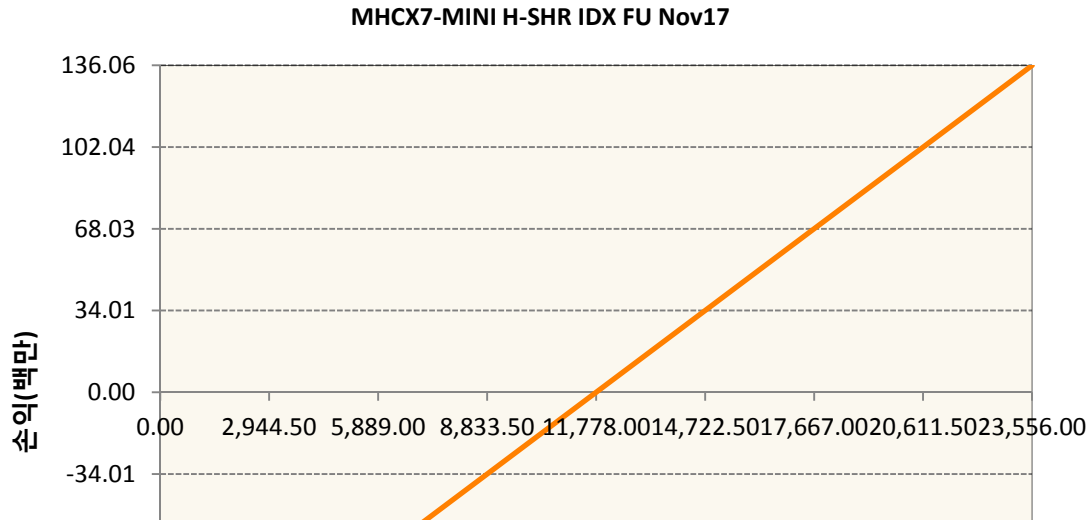
1. 계약금액

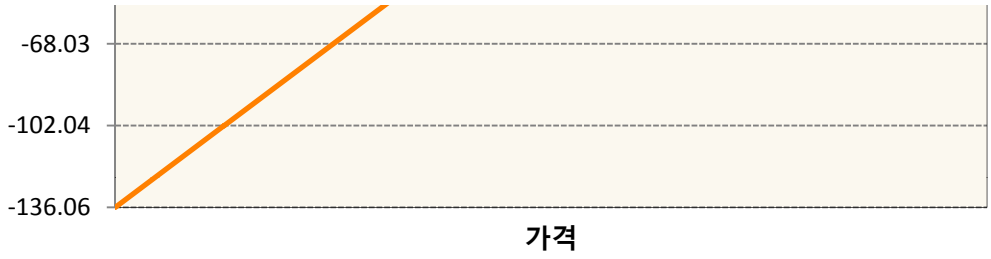
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,829	0	1,829	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCX7	H-SHARES IDX FUT NOV17	135
MHCX7	MINI H-SHR IDX FU Nov17	11

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

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

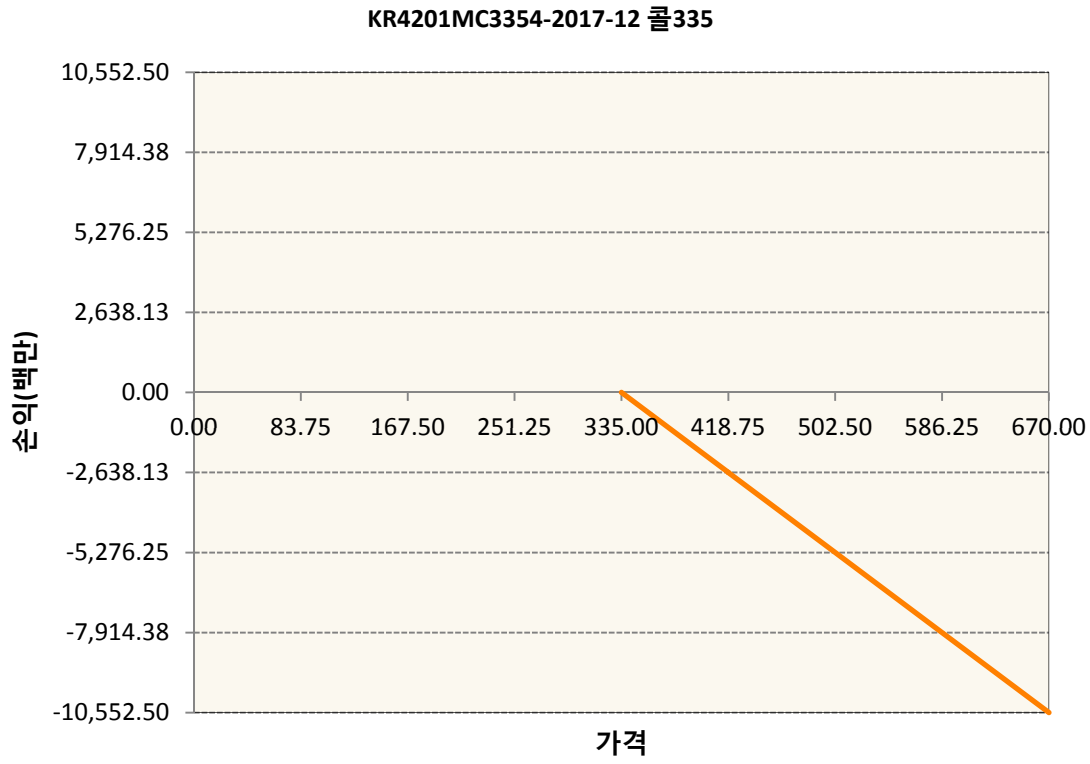
커버드콜모(주식혼합-파생형)

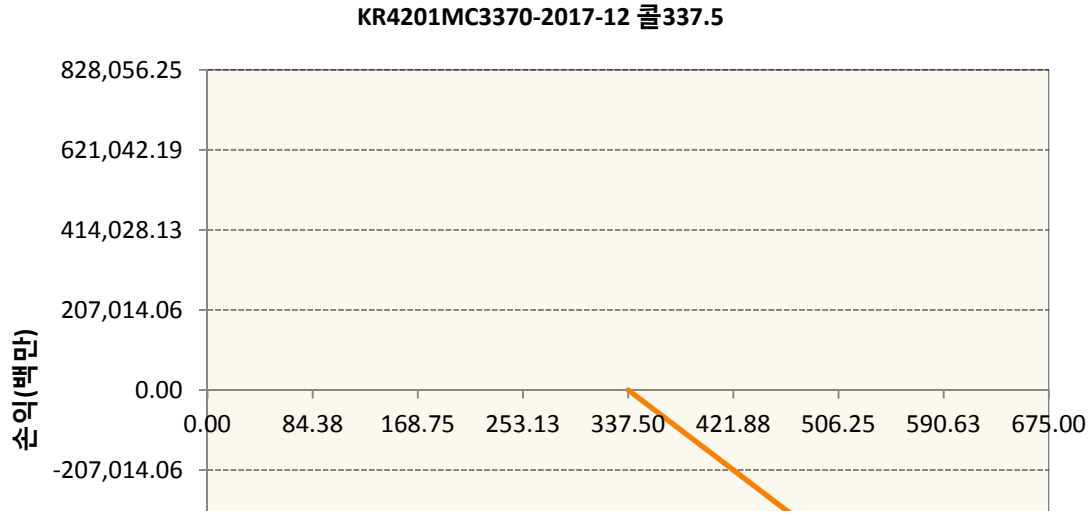
1. 계약금액

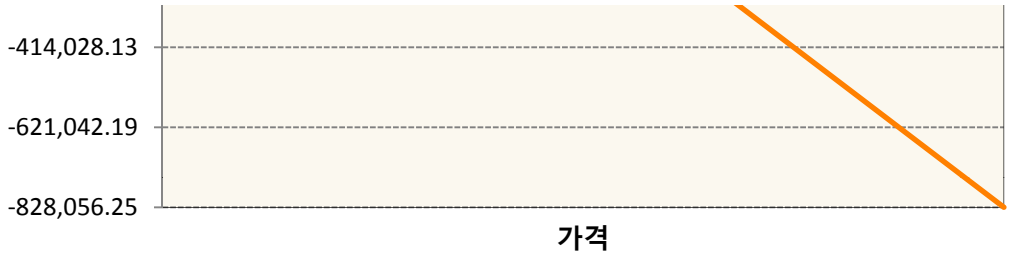
(단위:백만원)

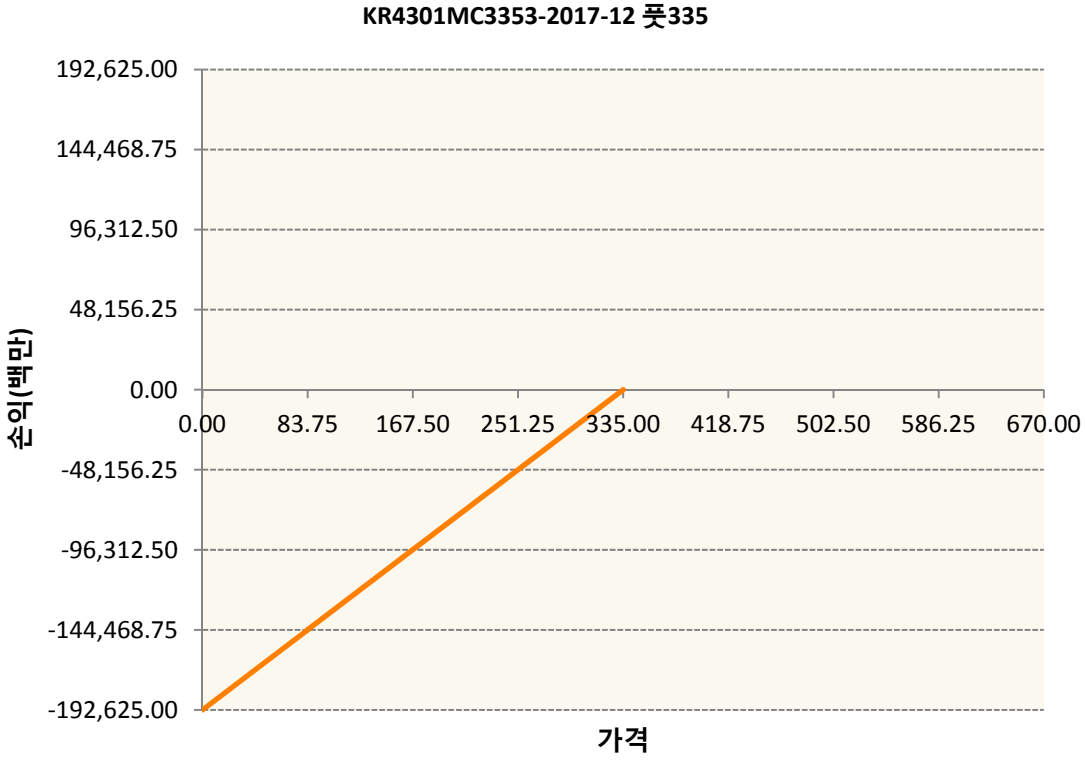
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

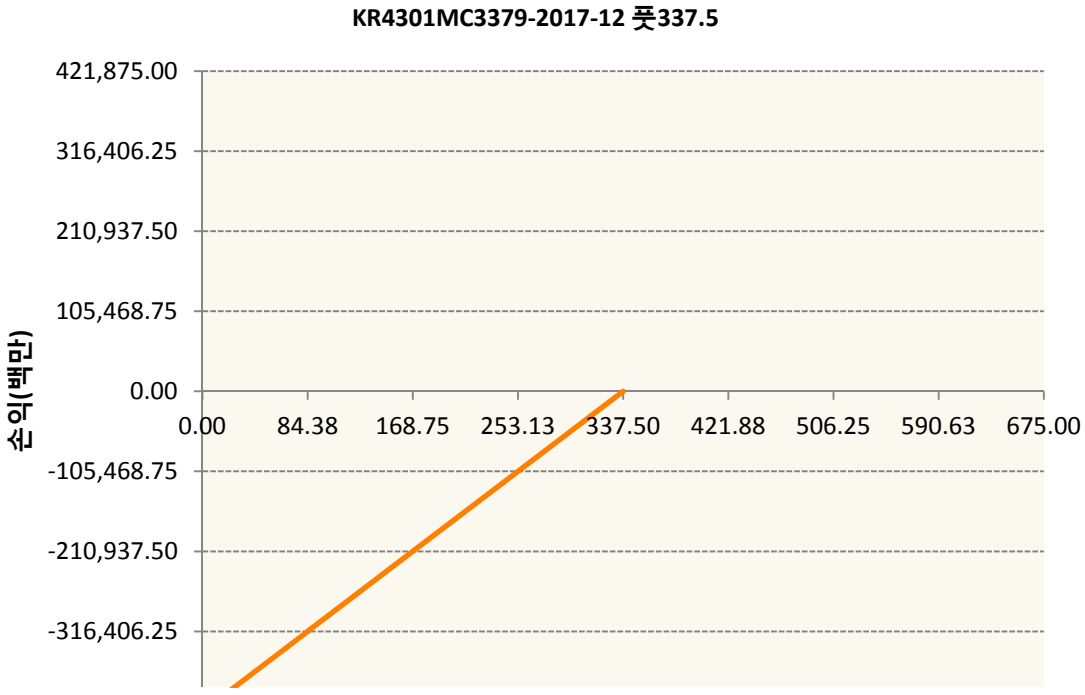
2. 만기시점의 손익구조






-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							651
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	240	236	231	224	216	207	197
-5.33%	222	212	200	188	174	160	144
-2.67%	170	153	135	117	98	79	60
0%	63	42	21	0	-21	-42	-63
2.67%	-109	-127	-146	-166	-185	-205	-225
5.33%	-335	-347	-360	-375	-390	-407	-423
8.00%	-593	-599	-607	-616	-627	-638	-651
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							48,453
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16,078	15,837	15,499	15,063	14,532	13,912	13,210
-5.33%	15,055	14,402	13,634	12,767	11,815	10,790	9,702
-2.67%	11,900	10,680	9,395	8,061	6,686	5,279	3,845
0%	4,855	3,241	1,622	0	-1,625	-3,252	-4,881
2.67%	-7,147	-8,698	-10,268	-11,854	-13,451	-15,057	-16,670
5.33%	-23,675	-24,784	-25,981	-27,247	-28,571	-29,940	-31,348
8.00%	-43,230	-43,834	-44,564	-45,404	-46,340	-47,360	-48,453
KR4301MC3. 2017-12 풋335							13,401
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,387	-13,387	-13,387	-13,388	-13,391	-13,394	-13,401
-5.33%	-8,266	-8,272	-8,283	-8,300	-8,325	-8,358	-8,399
-2.67%	-3,288	-3,362	-3,448	-3,545	-3,651	-3,765	-3,885
0%	525	350	175	0	-175	-350	-525
2.67%	2,004	1,914	1,811	1,699	1,579	1,451	1,319
5.33%	2,210	2,198	2,179	2,151	2,114	2,068	2,012
8.00%	2,218	2,218	2,217	2,214	2,208	2,200	2,186
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							30,440
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30,425	-30,425	-30,425	-30,426	-30,428	-30,432	-30,440
-5.33%	-19,285	-19,291	-19,302	-19,322	-19,354	-19,398	-19,458
-2.67%	-8,284	-8,381	-8,506	-8,656	-8,828	-9,021	-9,232
0%	1,073	720	362	0	-365	-732	-1,102
2.67%	5,680	5,403	5,108	4,800	4,480	4,152	3,816

5.33%	6,566	6,513	6,436	6,336	6,212	6,066	5,900
8.00%	6,621	6,618	6,611	6,598	6,575	6,541	6,494

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

100,734

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

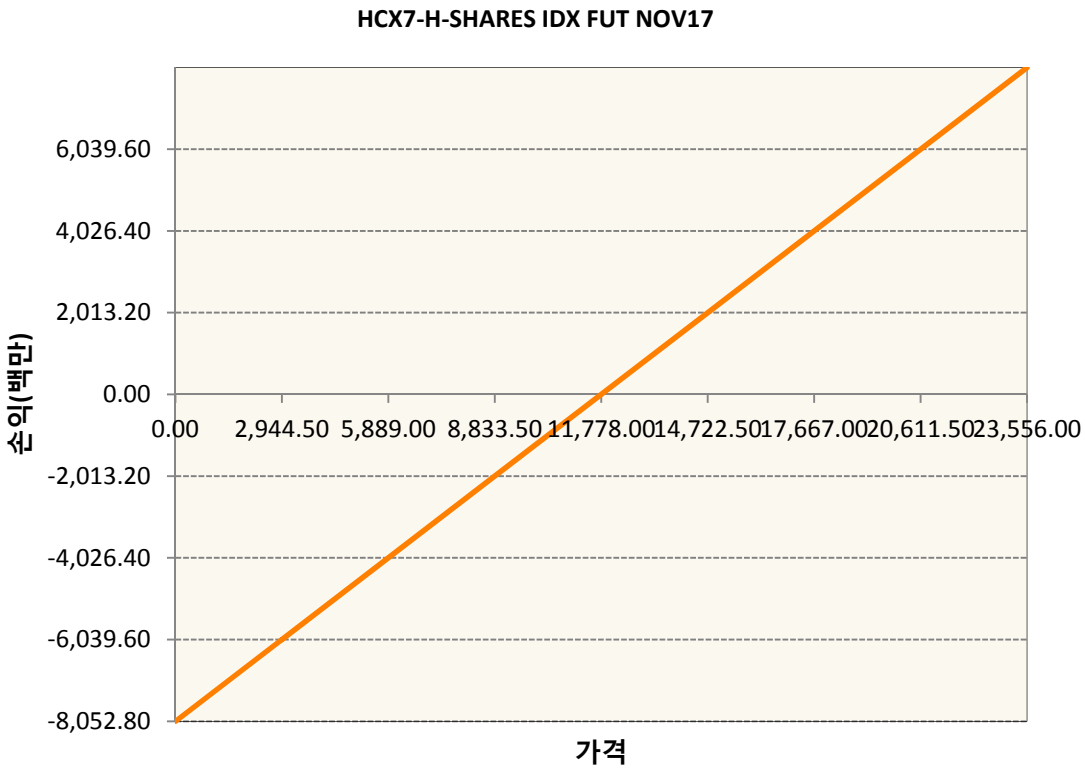
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

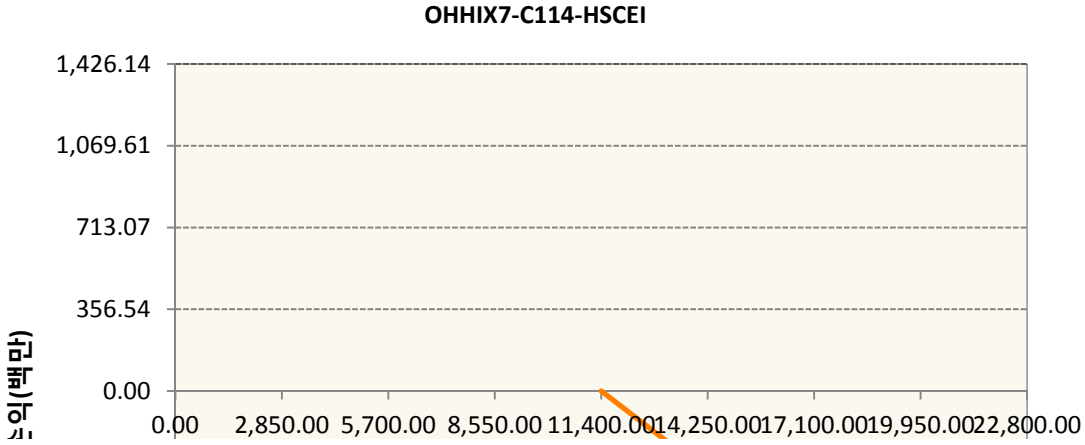
1. 계약금액

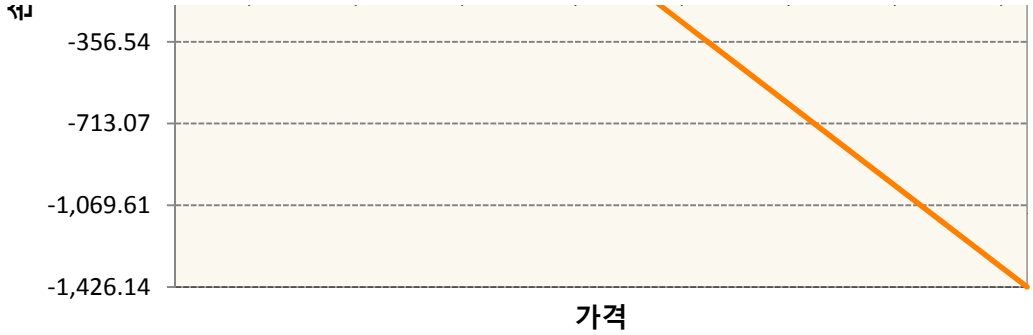
(단위:백만원)

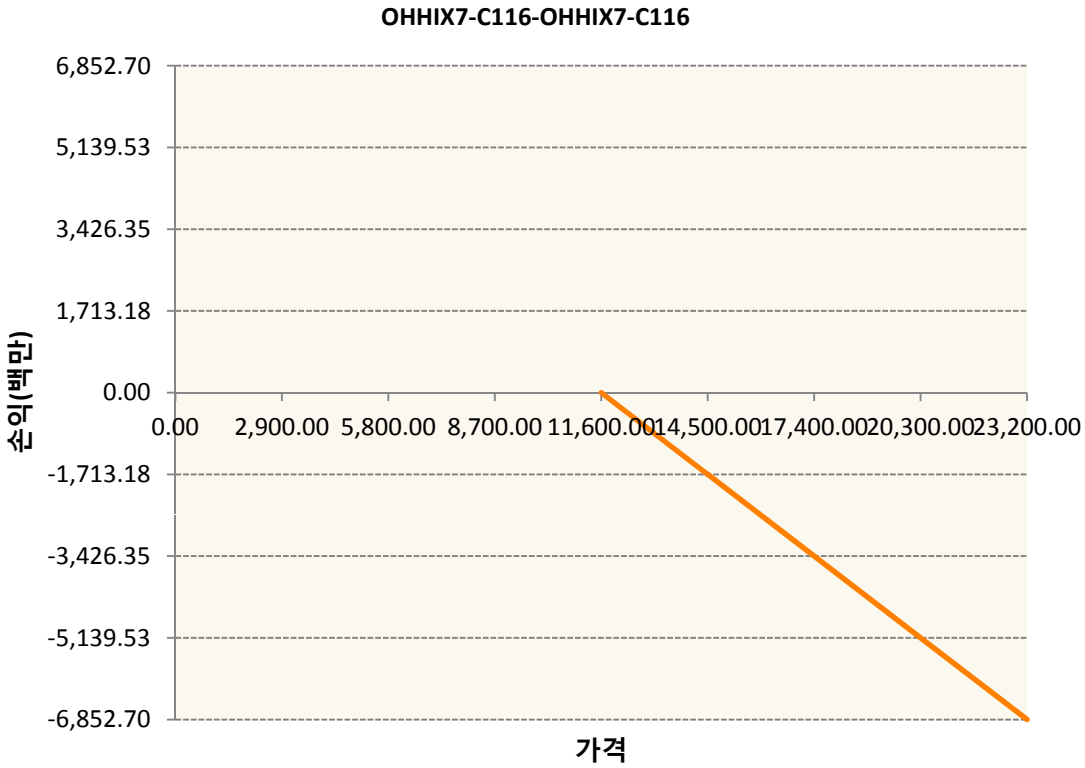
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,053	0	8,053	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,558	-16,558	장내

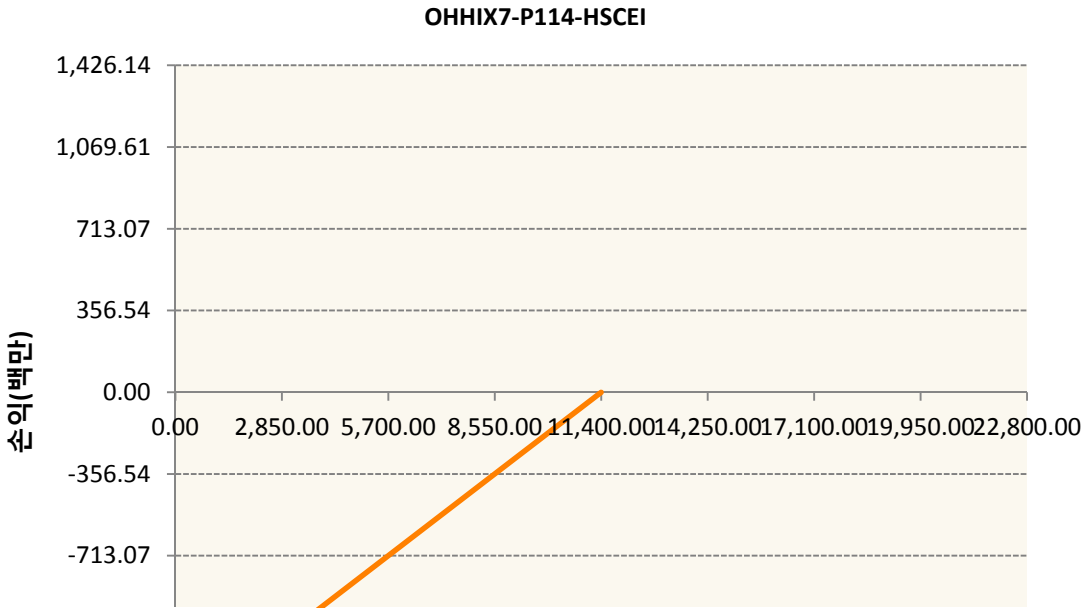
2. 만기시점의 손익구조

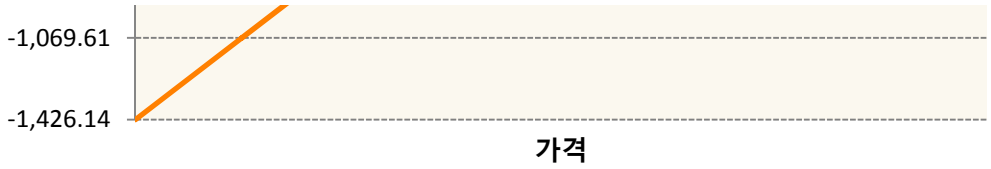


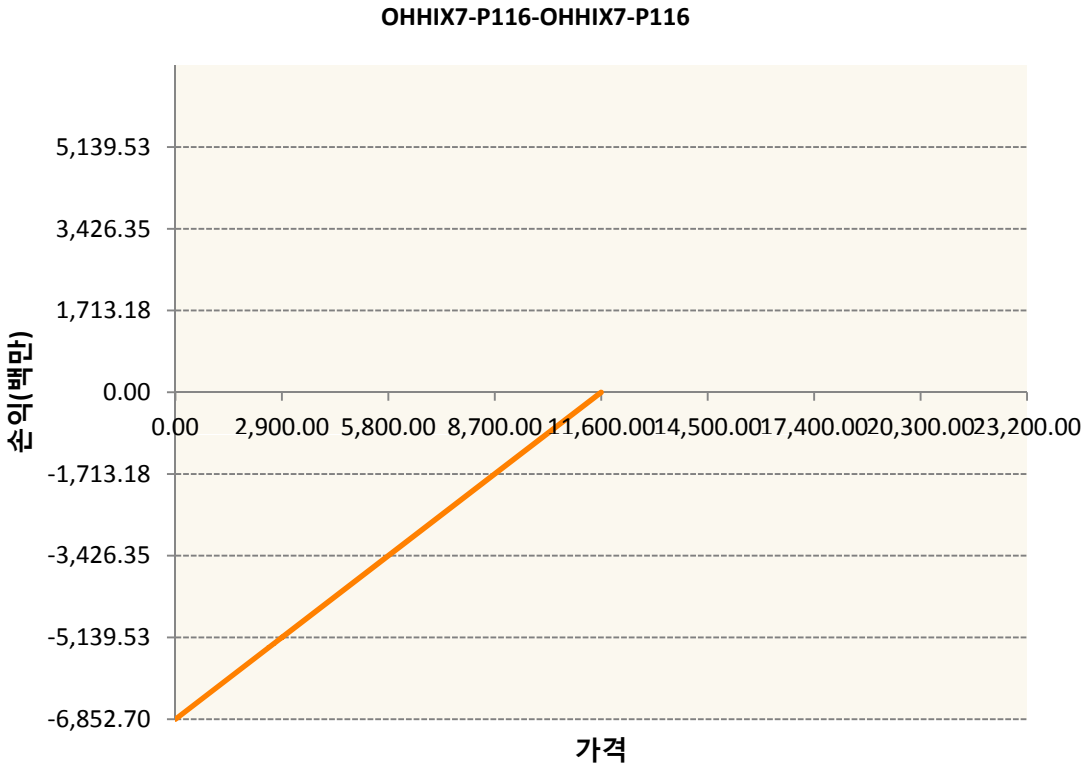



-356.54
-713.07
-1,069.61
-1,426.14
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,852.70
5,139.53
3,426.35
1,713.18
0.00
-1,713.18
-3,426.35
-5,139.53
-6,852.70
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
1,426.14
1,069.61
713.07
356.54
0.00
-356.54
-713.07
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	644
OHHIX7-C11	HSCEI	114
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	548
OHHIX7-P11	HSCEI	114
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	548

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

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

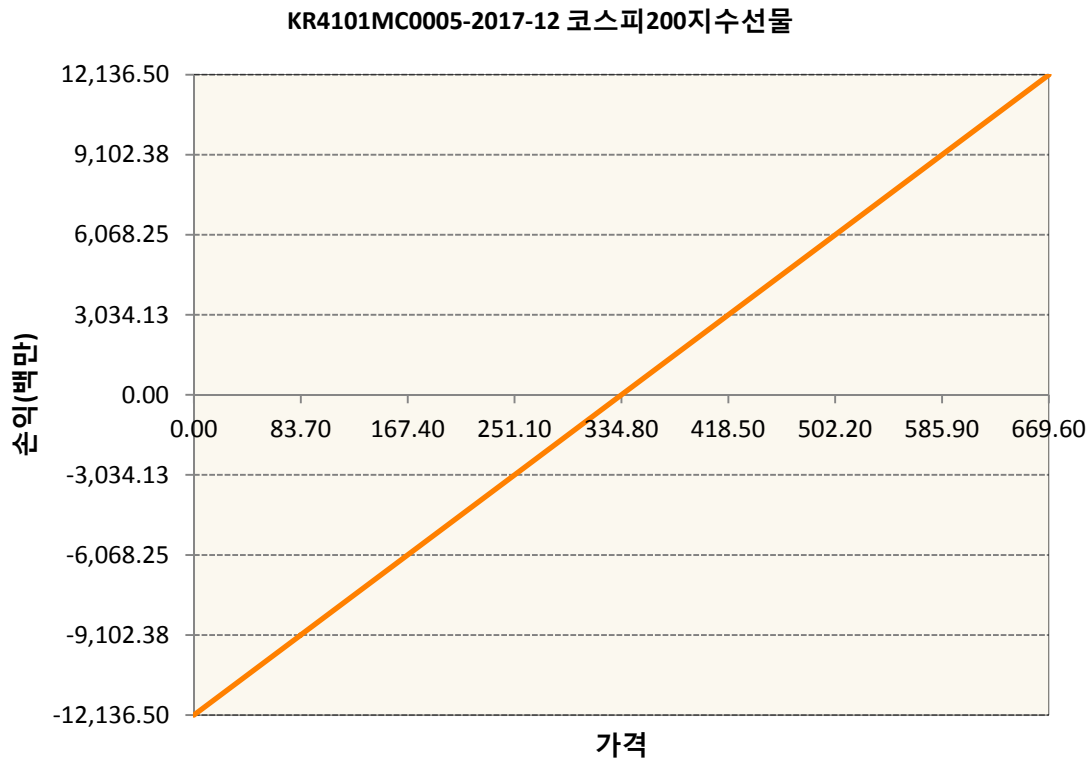
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

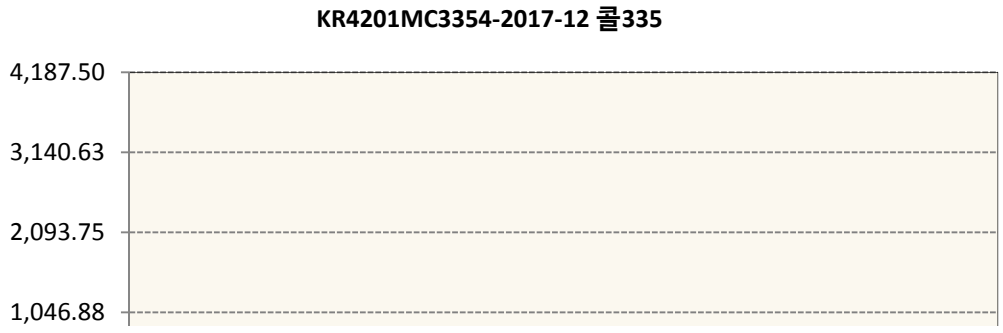
1. 계약금액

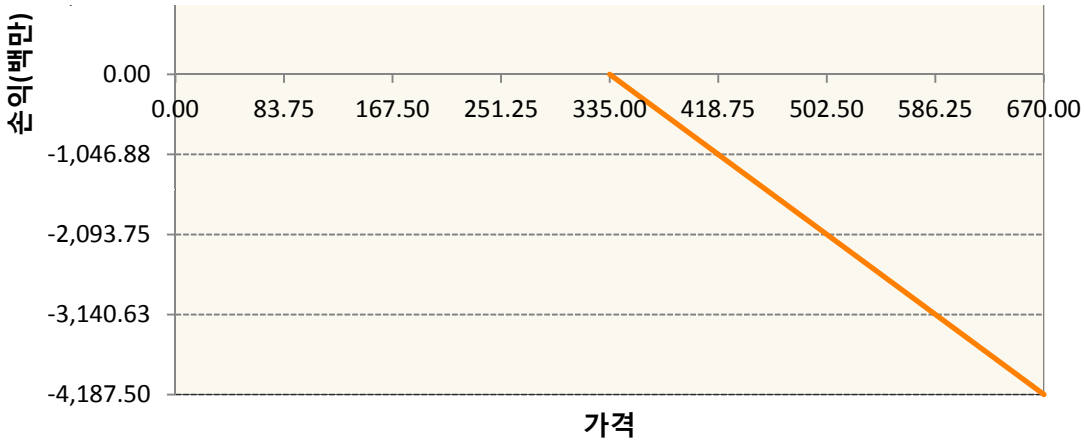
(단위:백만원)

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	12,137	0	12,137	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

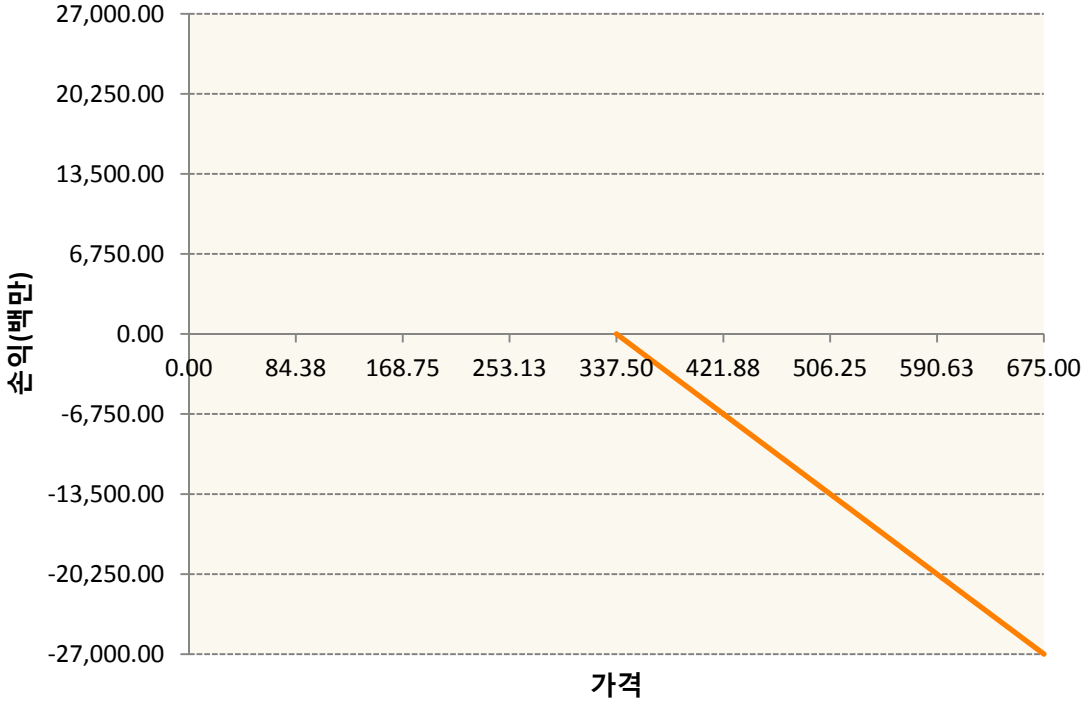
2. 만기시점의 손익구조



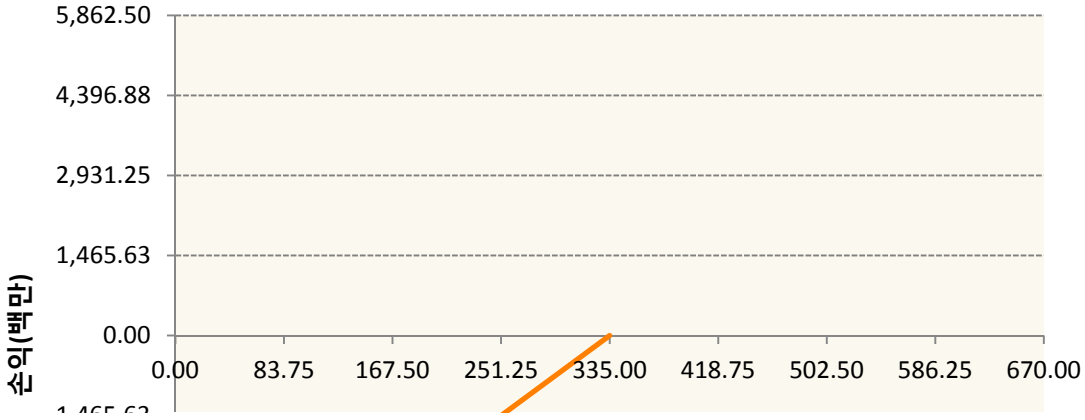




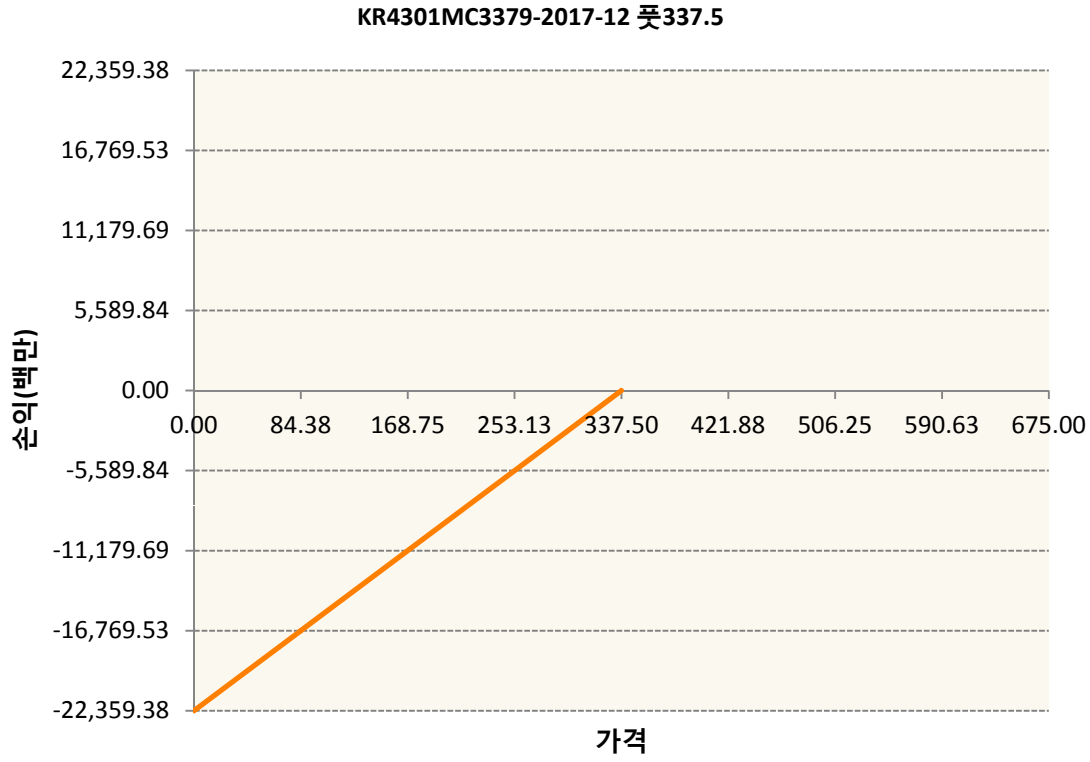
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464
-5.33%	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488
5.33%	976	976	976	976	976	976	976
8.00%	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						158
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-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%	158	158	158	158	158	158	158
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	237	237	237	237	237	237	237
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						468
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	468	468	468	468	468	468	468
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						312
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-5.33%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	104	104	104	104	104	104	104
5.33%	208	208	208	208	208	208	208
8.00%	312	312	312	312	312	312	312
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						633
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633
-5.33%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	422	422	422	422	422	422	422
8.00%	633	633	633	633	633	633	633
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						475

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-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%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	475	475	475	475	475	475	475
	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%	-647	-647	-647	-647	-647	-647	-647
-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%	647	647	647	647	647	647	647
8.00%	970	970	970	970	970	970	970
	KR4201MC3	2017-12 콜335					258

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	94	92	89	86	82	78
-5.33%	88	84	80	75	69	63	57
-2.67%	68	61	54	46	39	31	24
0%	25	17	8	0	-8	-17	-25
2.67%	-43	-51	-58	-66	-74	-81	-89
5.33%	-133	-138	-143	-149	-155	-161	-168
8.00%	-235	-238	-241	-245	-249	-253	-258
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,580

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	524	516	505	491	474	454	431
-5.33%	491	470	445	416	385	352	316
-2.67%	388	348	306	263	218	172	125
0%	158	106	53	0	-53	-106	-159
2.67%	-233	-284	-335	-387	-439	-491	-544
5.33%	-772	-808	-847	-888	-932	-976	-1,022
8.00%	-1,410	-1,429	-1,453	-1,480	-1,511	-1,544	-1,580
	KR4301MC3	2017-12 풋335					408

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-407	-407	-407	-407	-408	-408	-408
-5.33%	-252	-252	-252	-253	-253	-254	-256

-2.67%	-100	-102	-105	-108	-111	-115	-118
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	61	58	55	52	48	44	40
5.33%	67	67	66	65	64	63	61
8.00%	68	68	67	67	67	67	67
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,613
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,613	-1,613	-1,613	-1,613	-1,613	-1,613	-1,613
-5.33%	-1,022	-1,022	-1,023	-1,024	-1,026	-1,028	-1,031
-2.67%	-439	-444	-451	-459	-468	-478	-489
0%	57	38	19	0	-19	-39	-58
2.67%	301	286	271	254	237	220	202
5.33%	348	345	341	336	329	322	313
8.00%	351	351	350	350	348	347	344

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

9,549

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

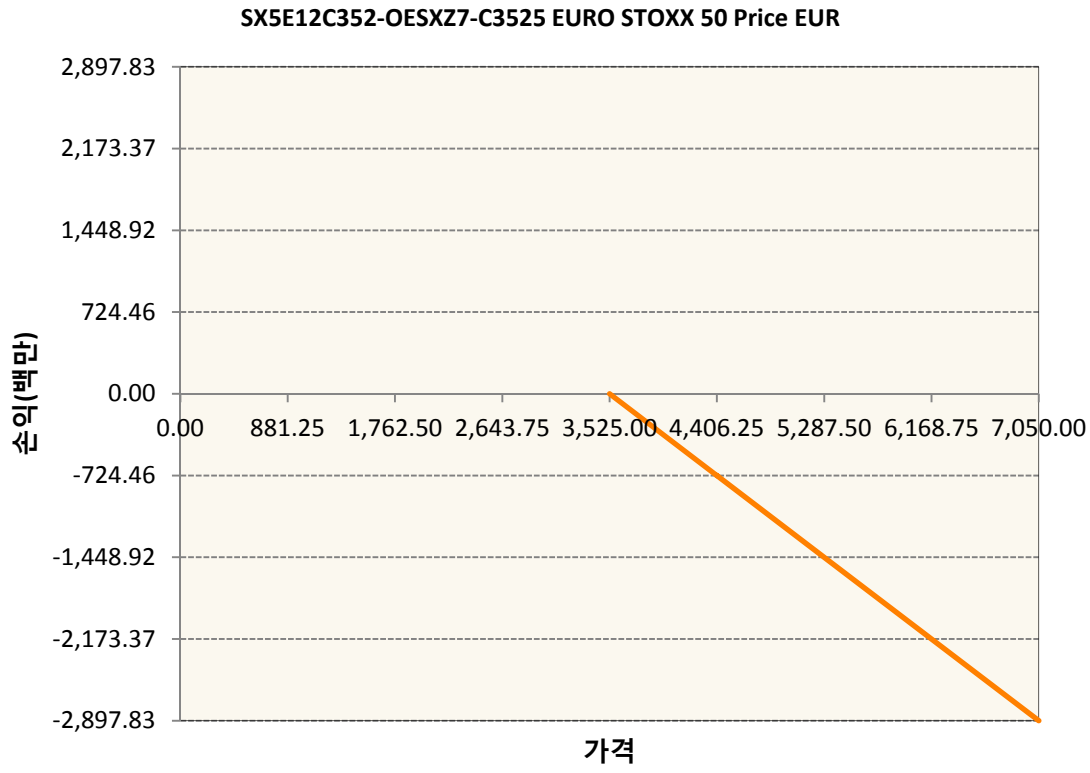
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

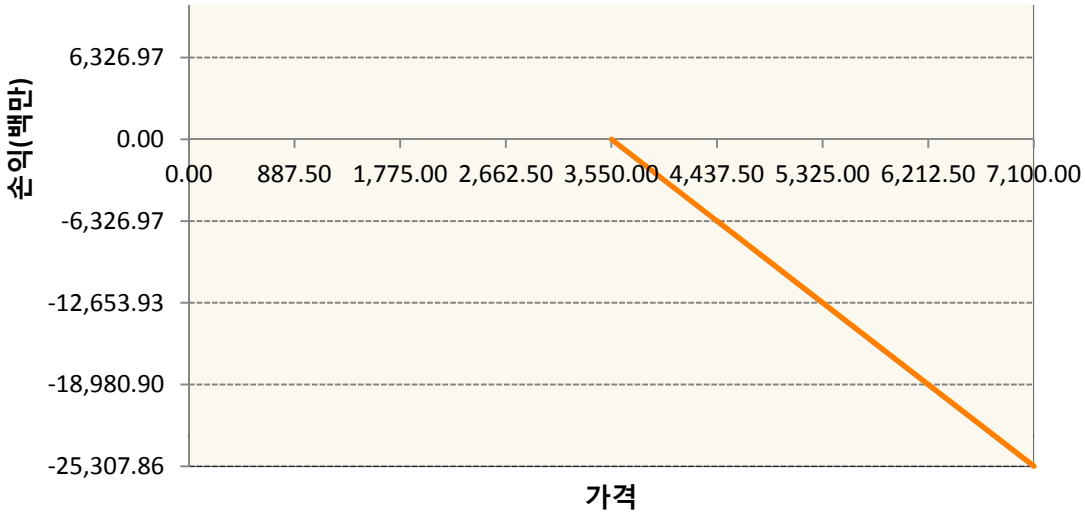
(단위:백만원)

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	20,350	0	20,350	
누계	유가증권	스왑	96,335	0	96,335	장외
누계	유가증권	옵션	0	56,411	-56,411	장내
누계	지수	스왑	51,379	0	51,379	장외

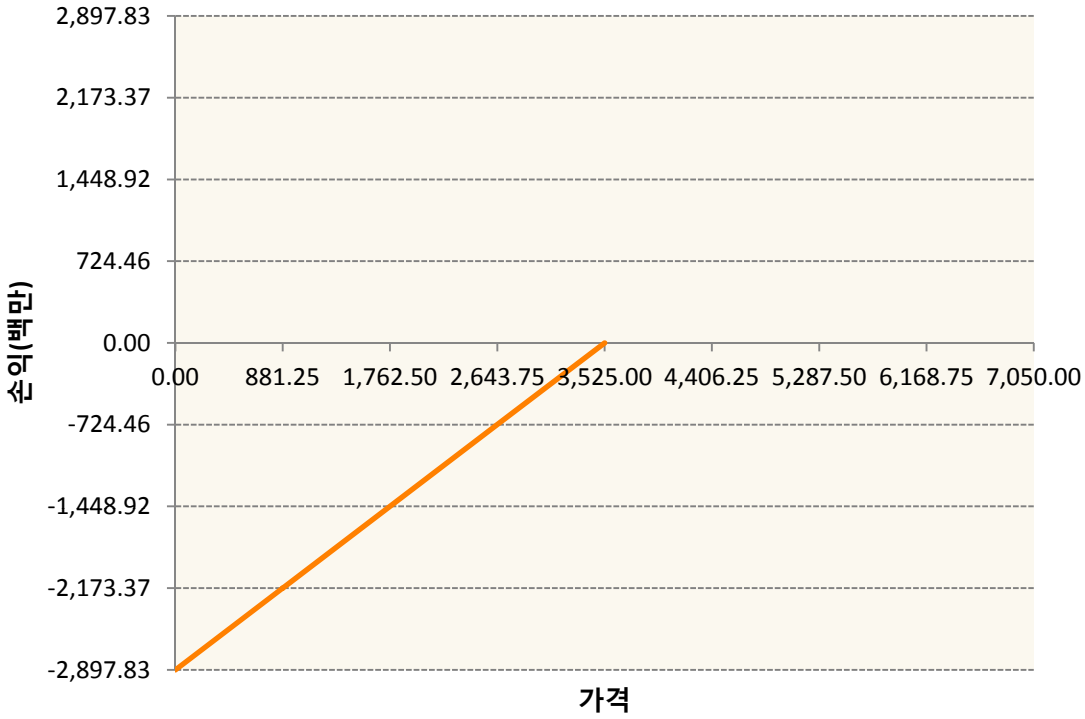
2. 만기시점의 손익구조



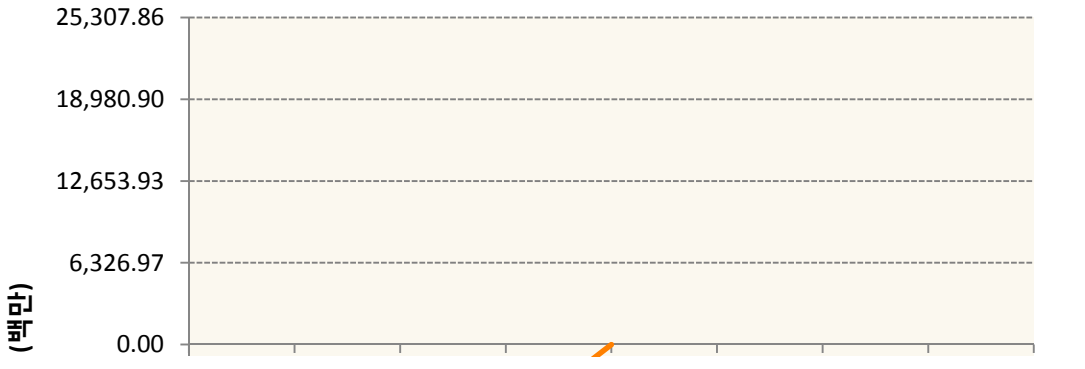


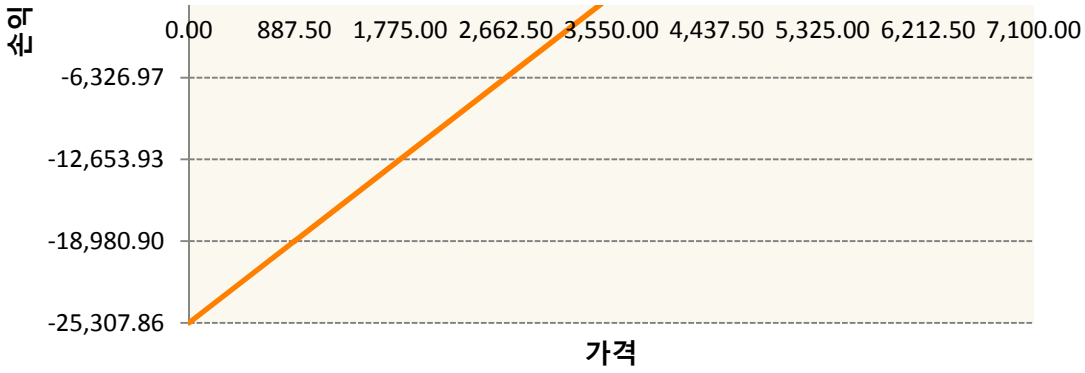


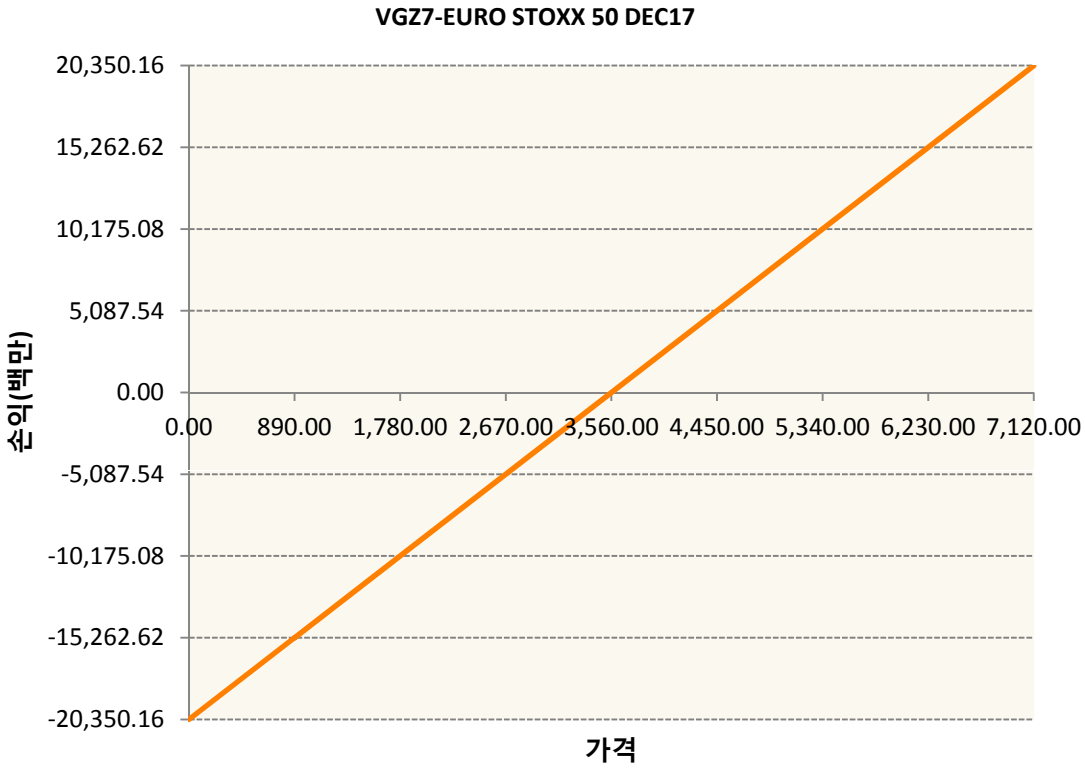
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	20
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	5
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	232
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,025
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	232
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,025
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,628

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

3,629

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

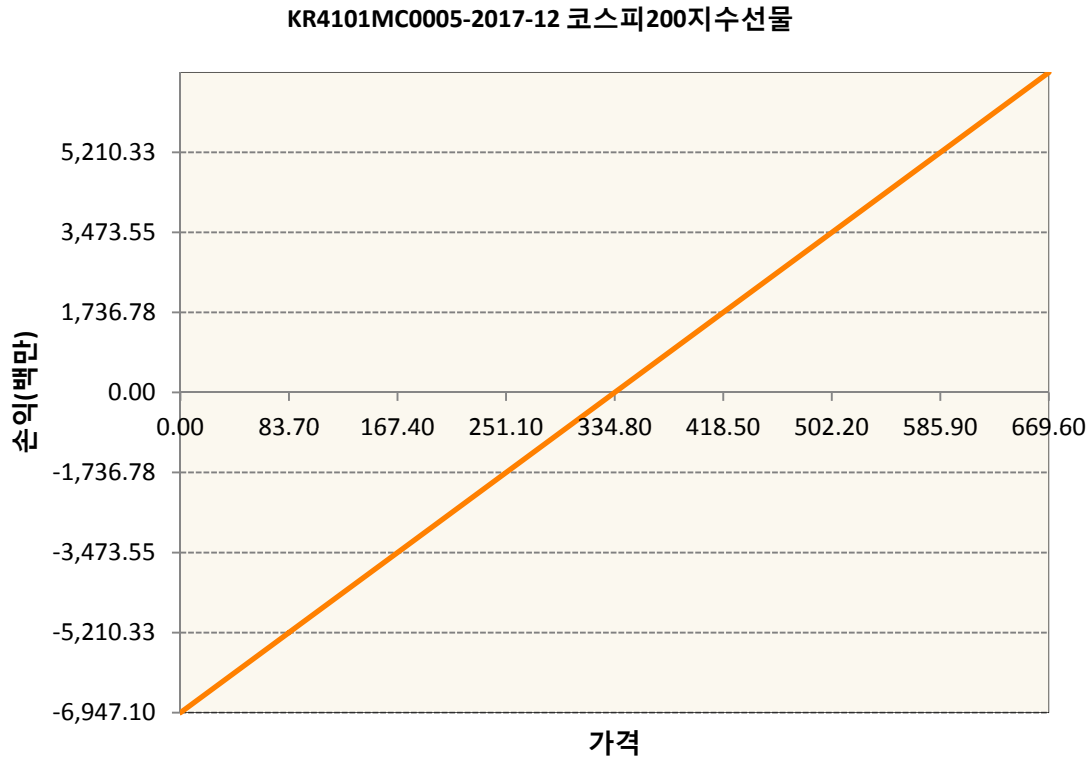
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,947	0	6,947	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)

315

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

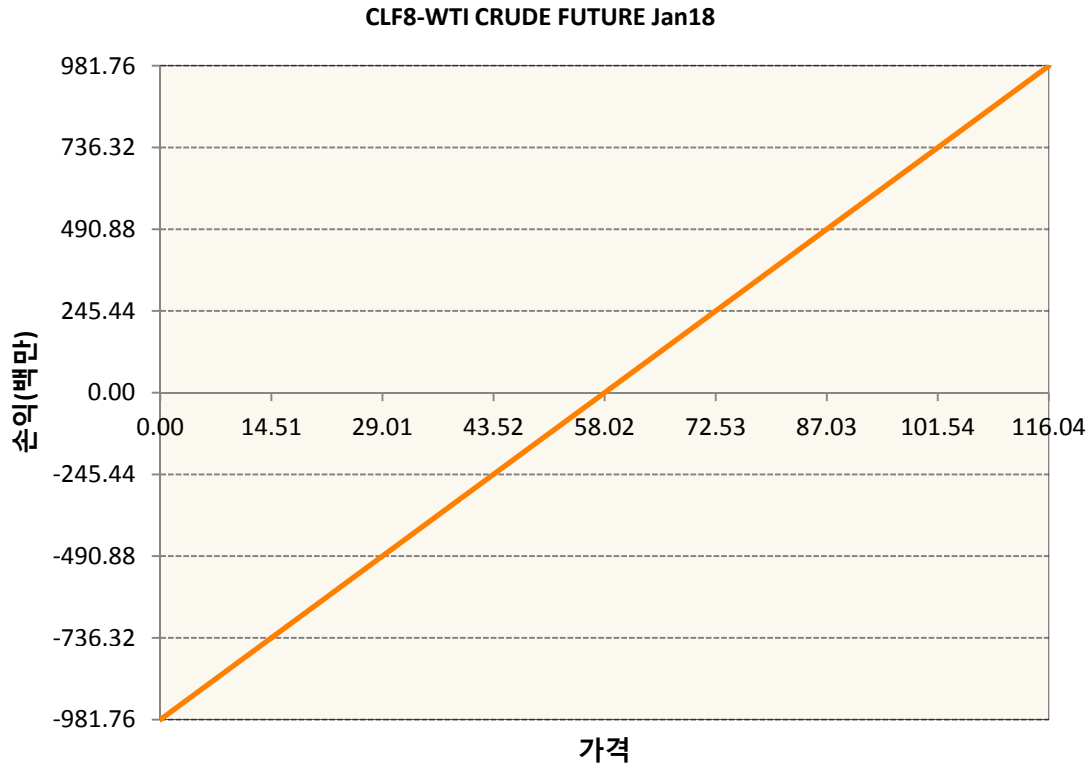
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

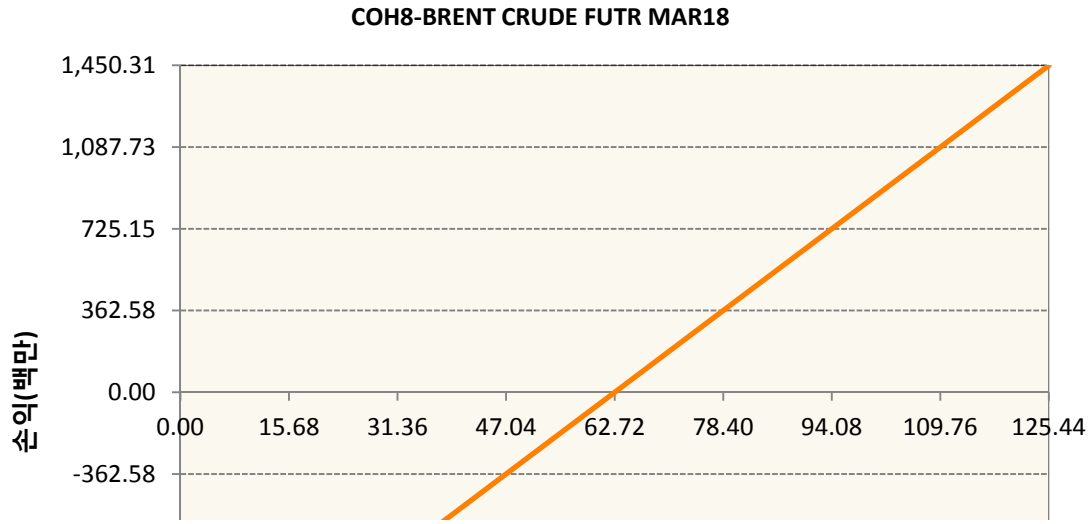
1. 계약금액

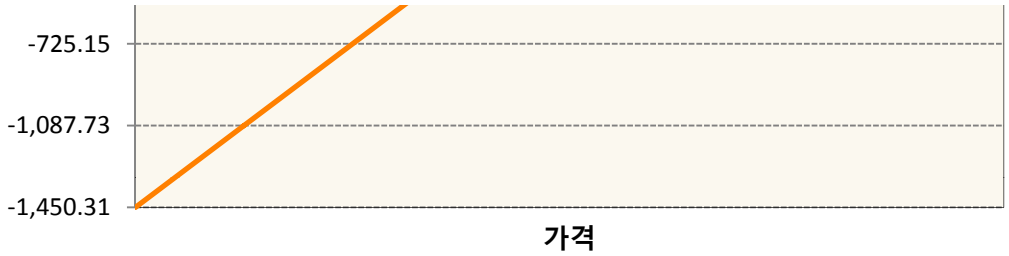
(단위:백만원)

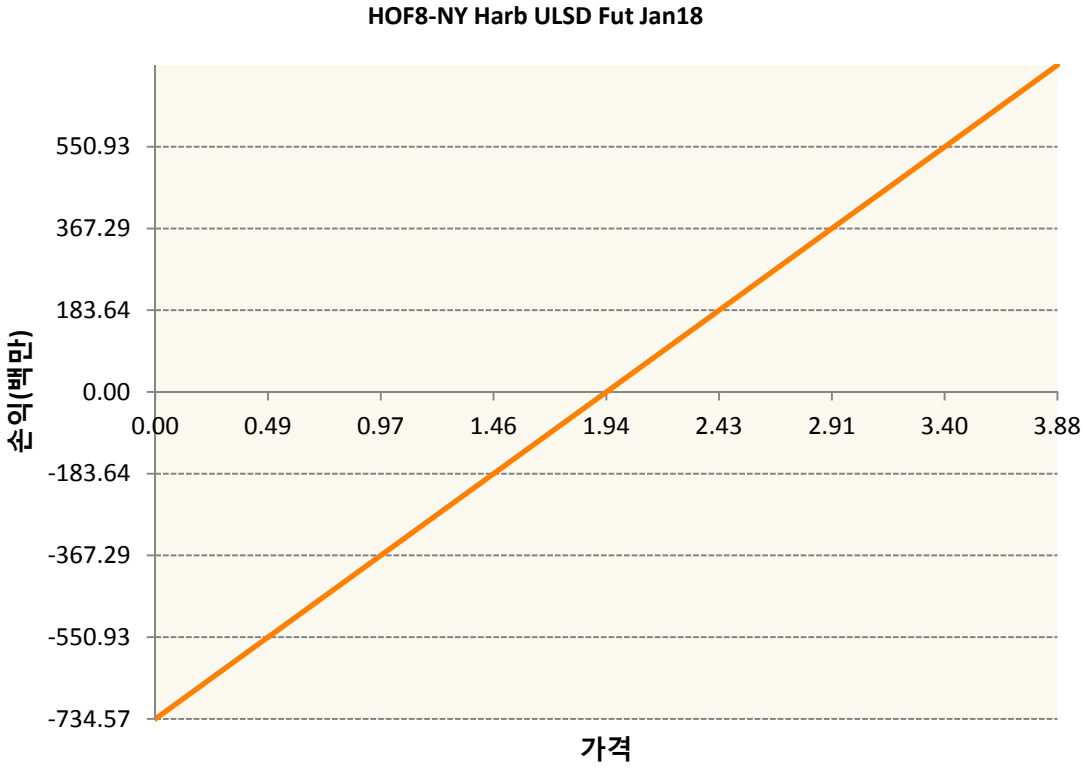
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,203	868	4,334	

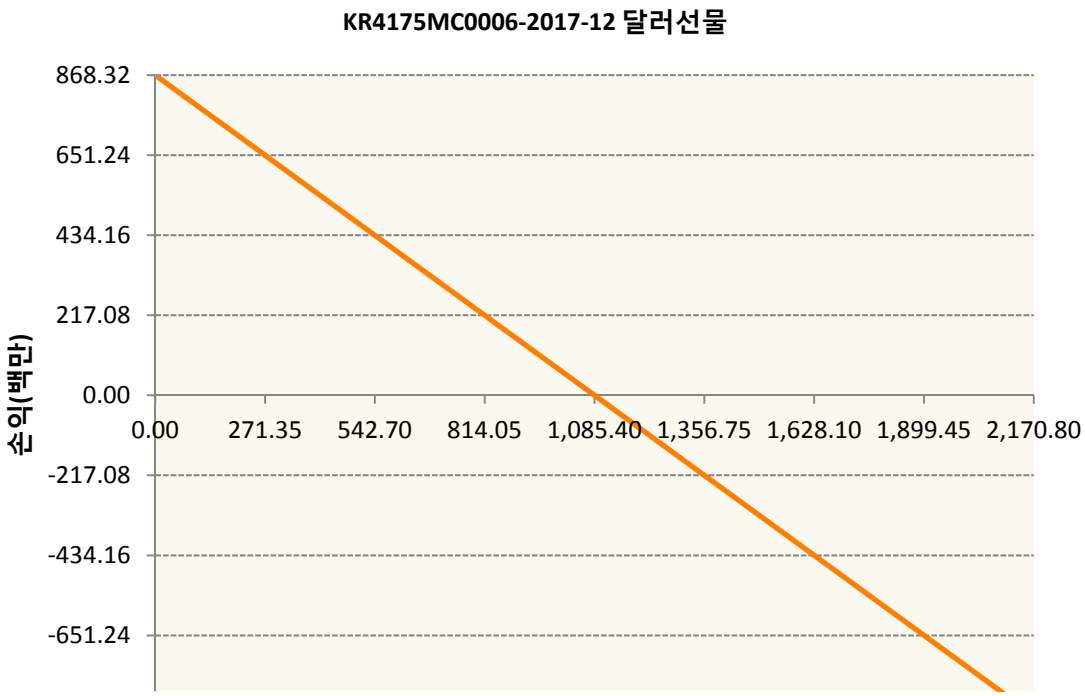
2. 만기시점의 손익구조

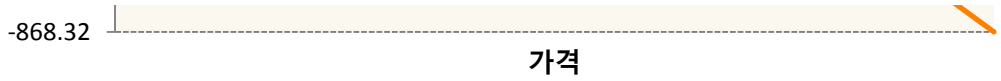


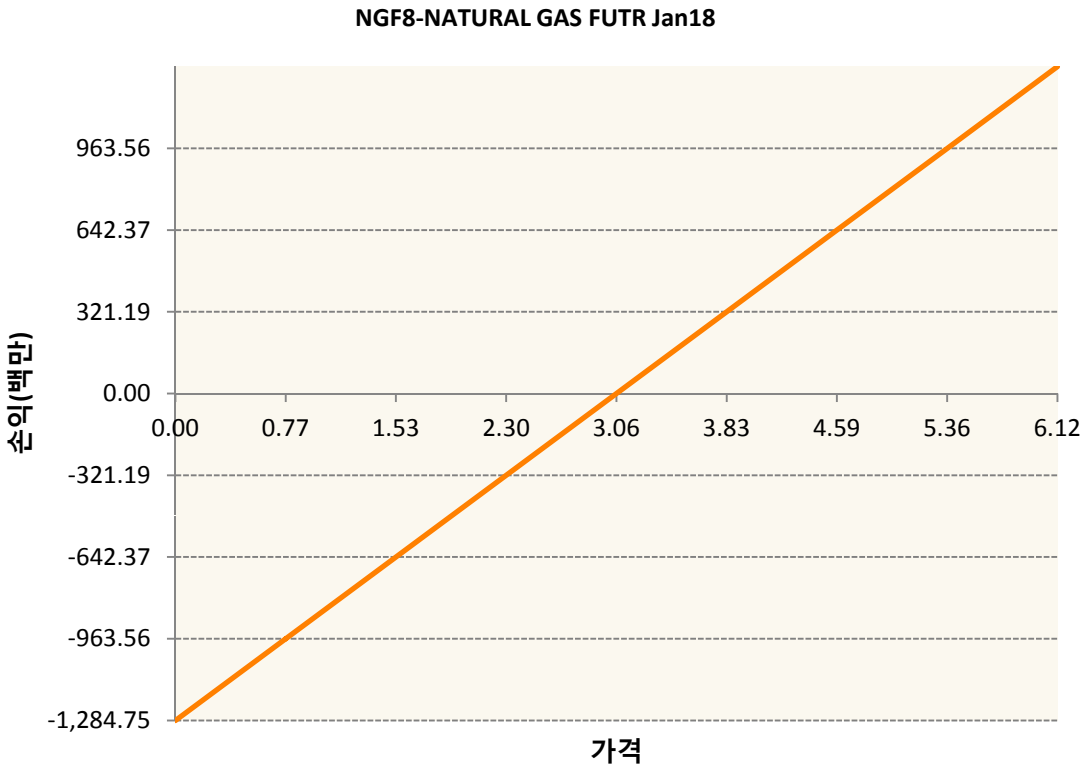


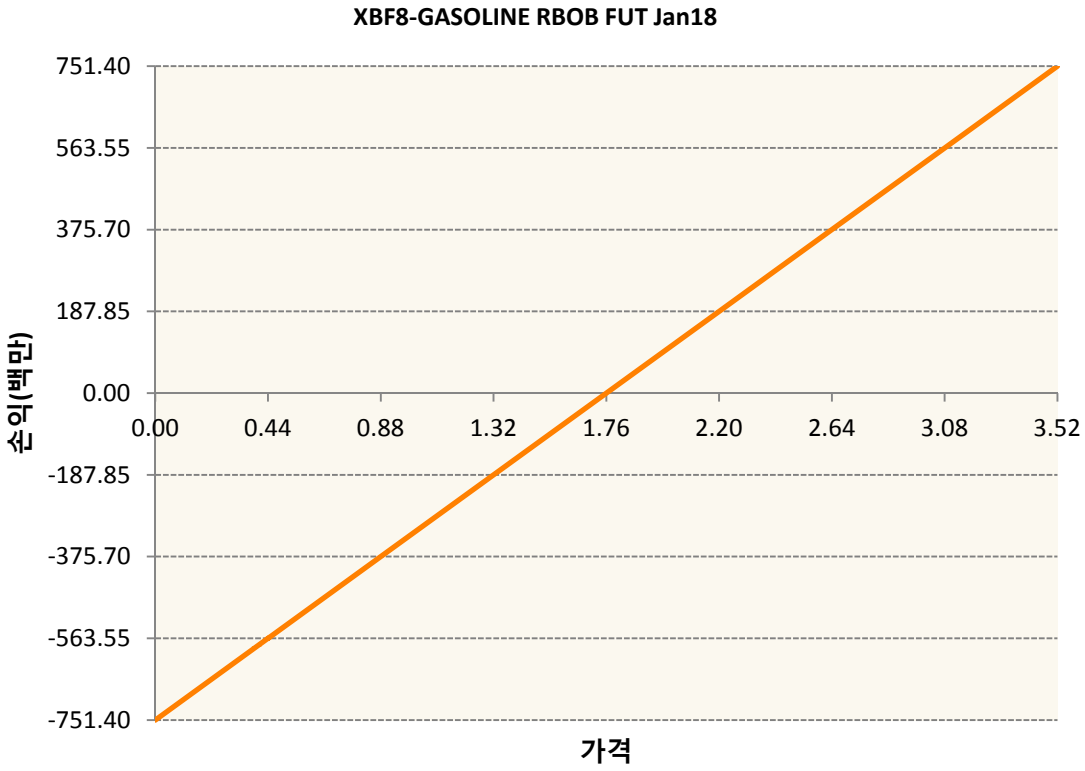

-725.15
-1,087.73
-1,450.31
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
550.93
367.29
183.64
0.00
-183.64
-367.29
-550.93
-734.57
0.00
0.49
0.97
1.46
1.94
2.43
2.91
3.40
3.88
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
868.32
651.24
434.16
217.08
0.00
-217.08
-434.16
-651.24
0.00
271.35
542.70
814.05
1,085.40
1,356.75
1,628.10
1,899.45
2,170.80
손익(백만)


-868.32
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
963.56
642.37
321.19
0.00
-321.19
-642.37
-963.56
-1,284.75
0.00
0.77
1.53
2.30
3.06
3.83
4.59
5.36
6.12
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
751.40
563.55
375.70
187.85
0.00
-187.85
-375.70
-563.55
-751.40
0.00
0.44
0.88
1.32
1.76
2.20
2.64
3.08
3.52
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	79
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	116
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	69
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	103
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	60

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

723

공시일	2017-11-24
기준일	2017-11-23

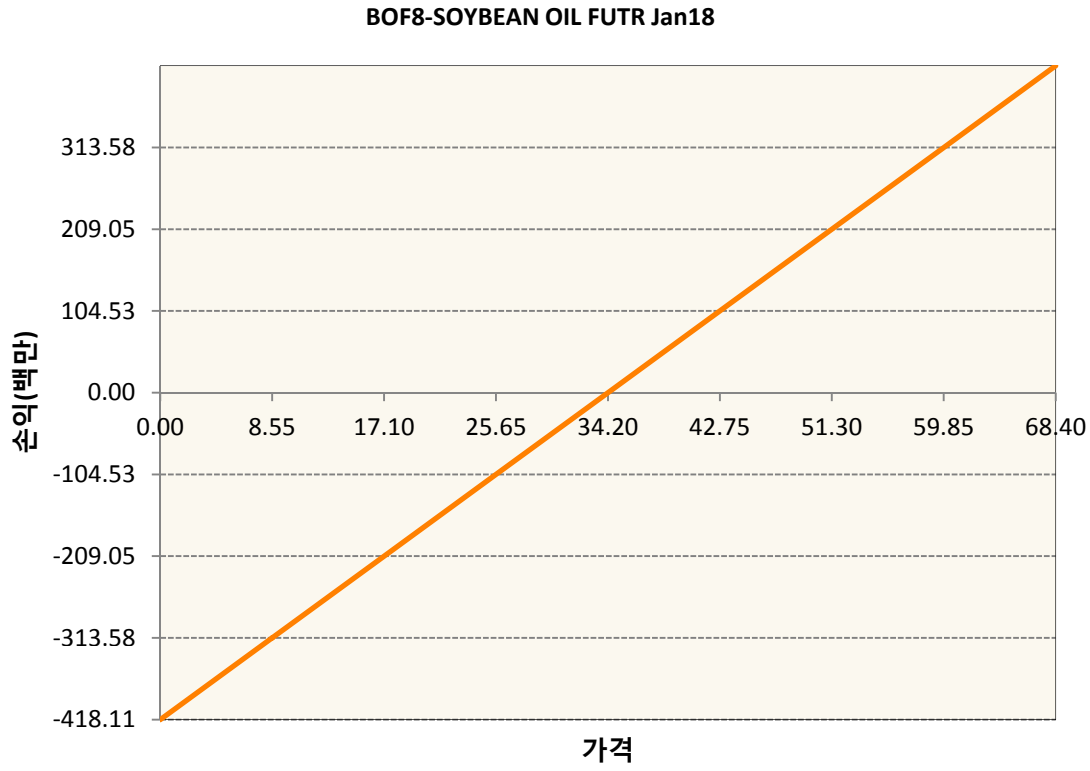
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

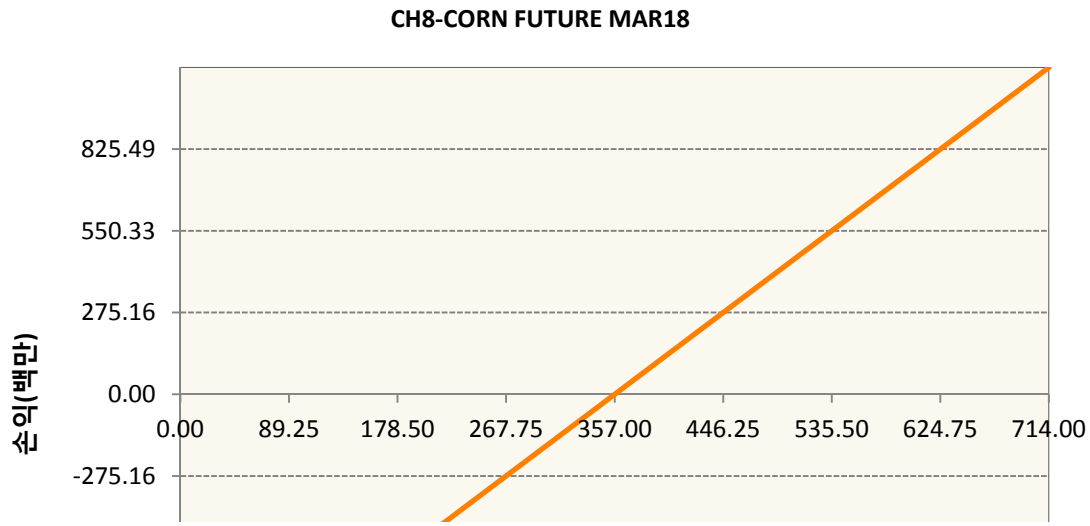
1. 계약금액

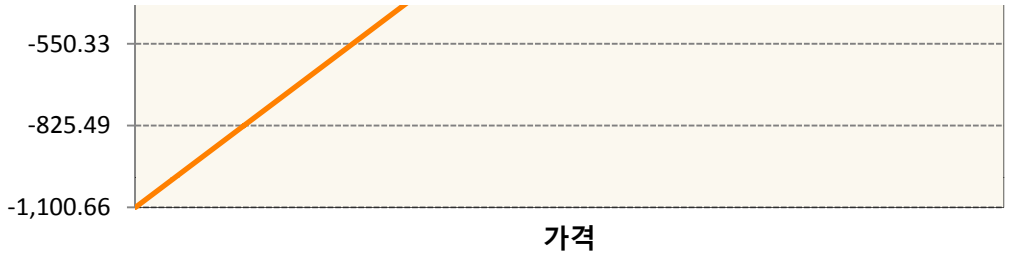
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,565	326	4,240	

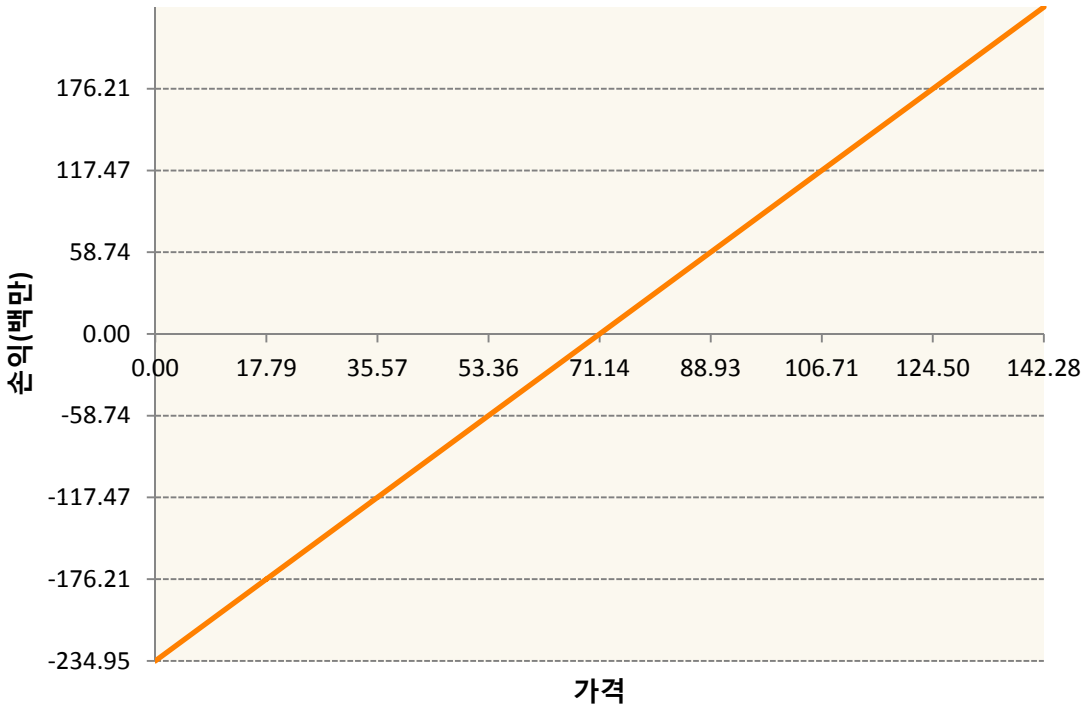
2. 만기시점의 손익구조



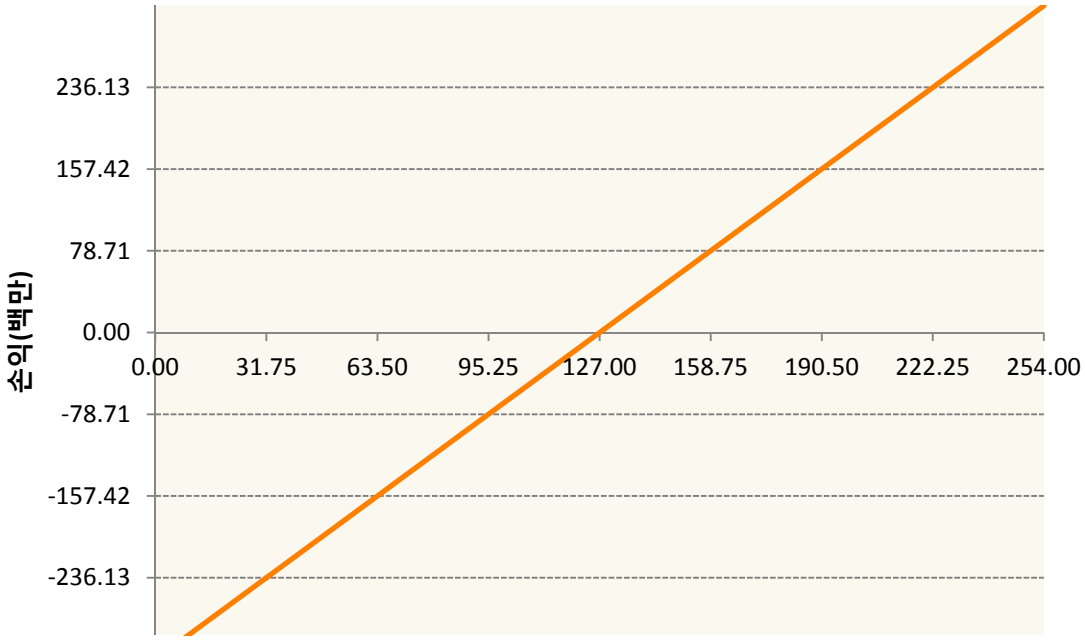


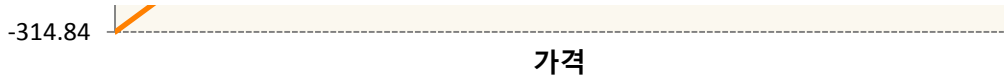


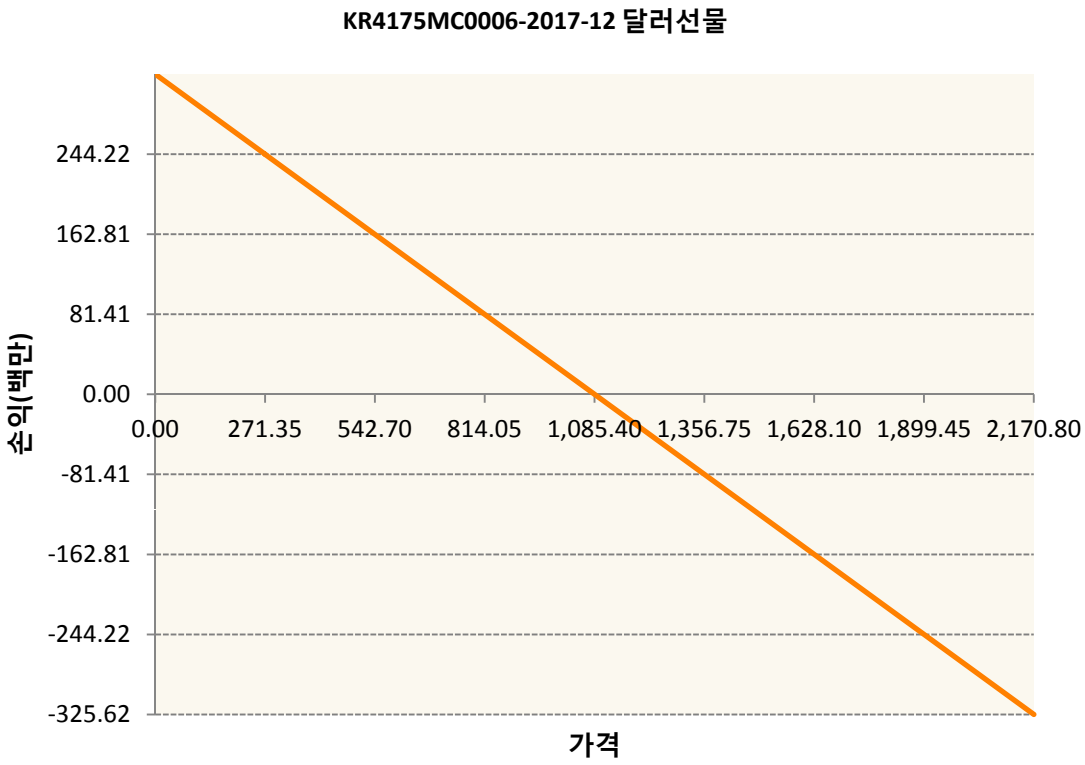
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

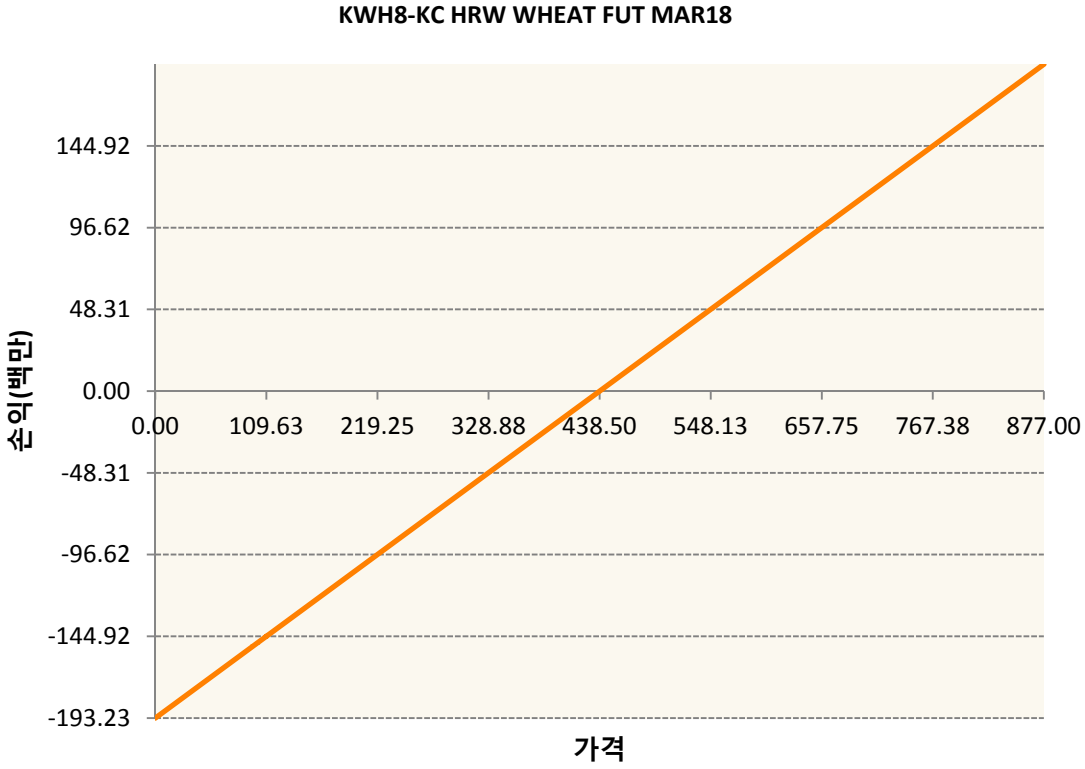


KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

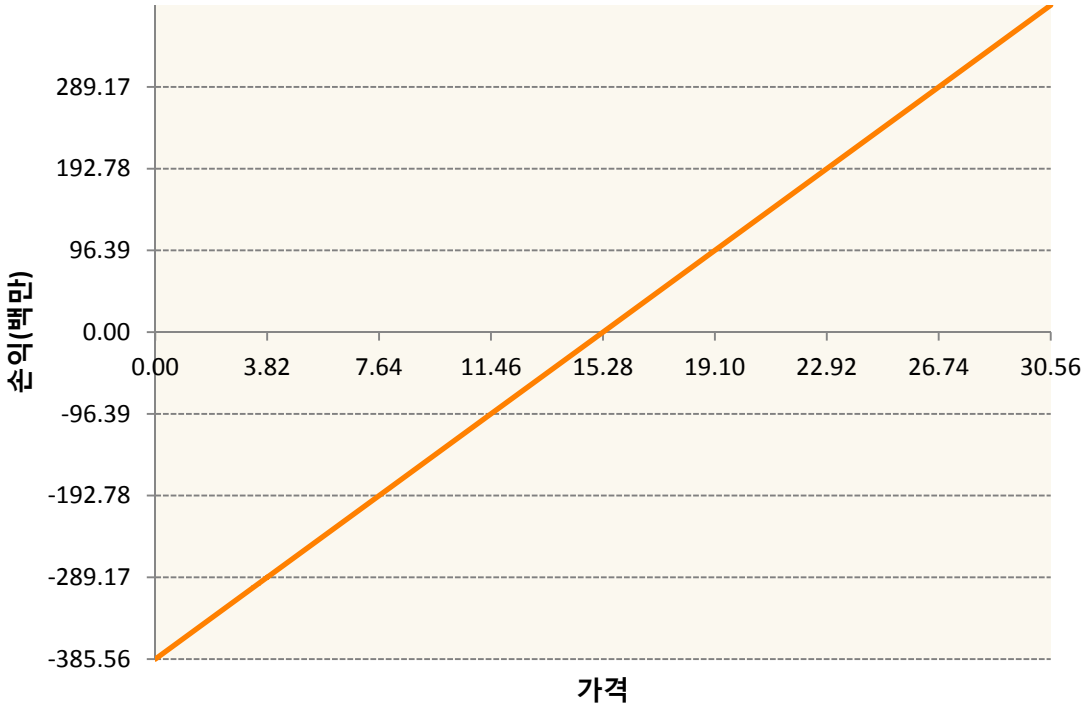



-314.84
가격

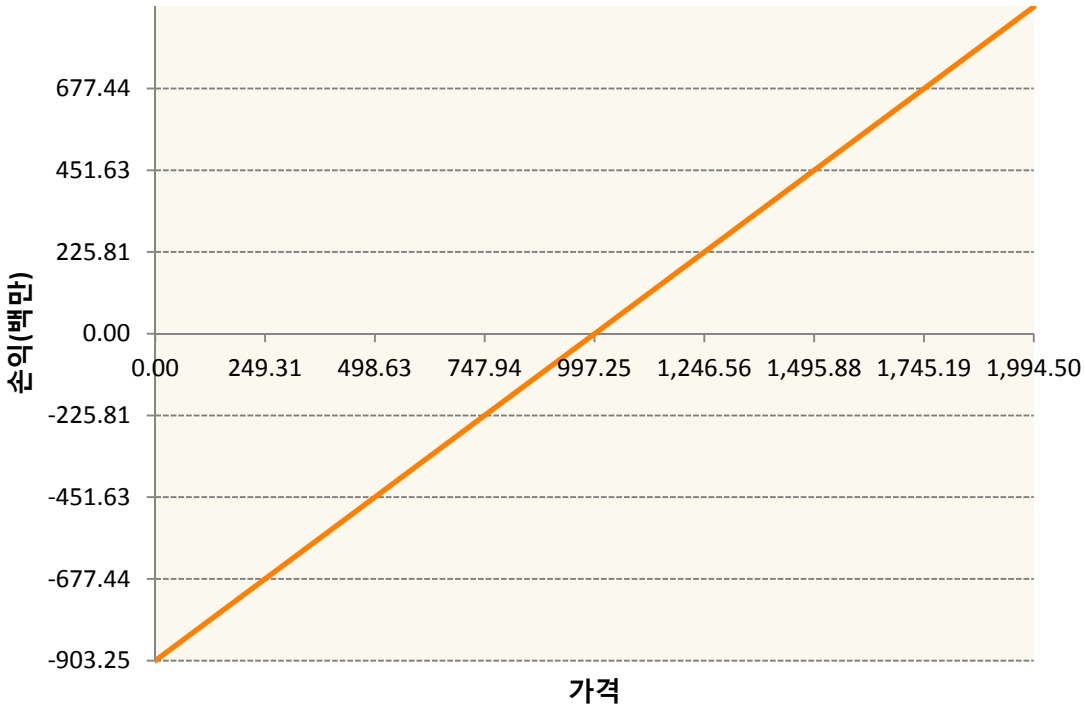

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
244.22
162.81
81.41
0.00
-81.41
-162.81
-244.22
-325.62
0.00
271.35
542.70
814.05
1,085.40
1,356.75
1,628.10
1,899.45
2,170.80
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
144.92
96.62
48.31
0.00
-48.31
-96.62
-144.92
-193.23
0.00
109.63
219.25
328.88
438.50
548.13
657.75
767.38
877.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

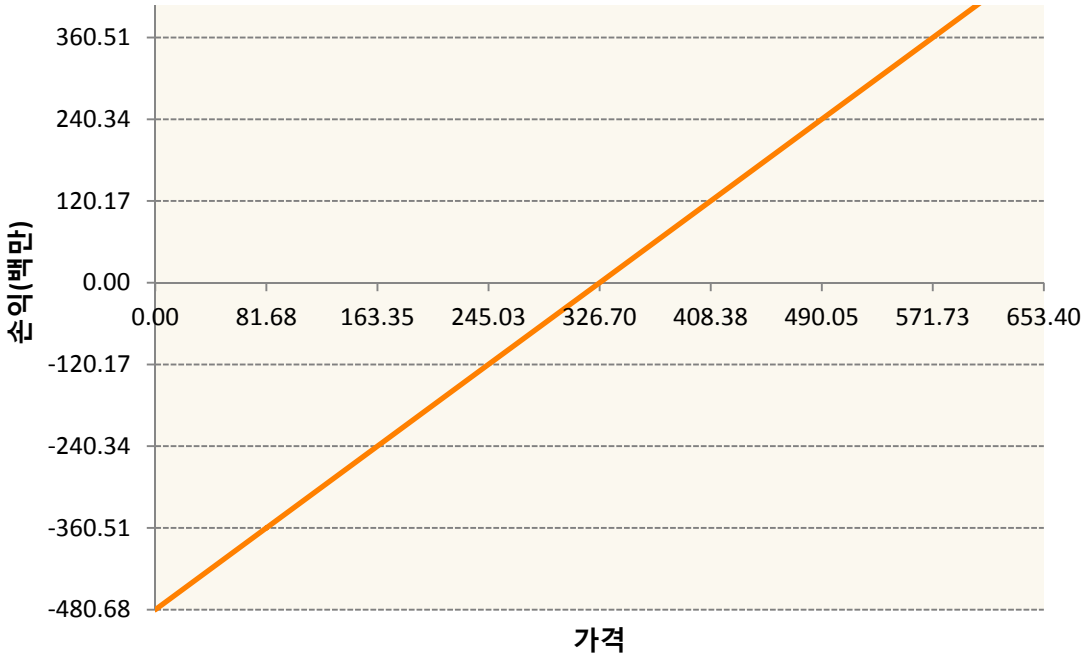


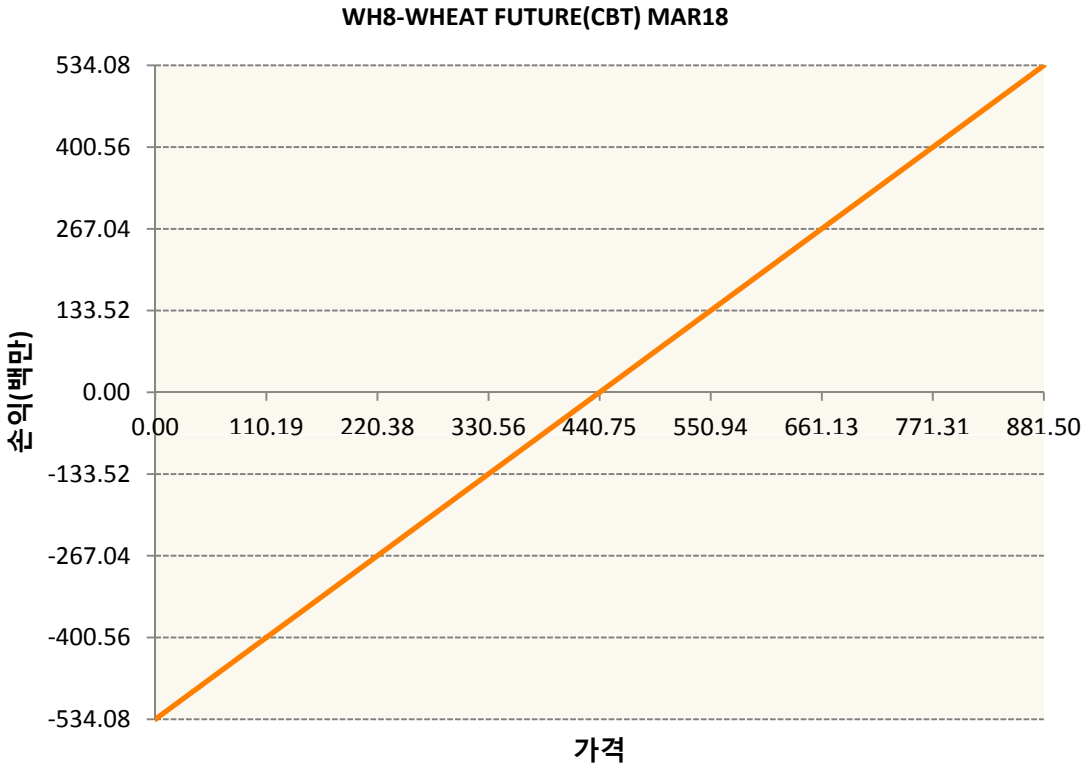
SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18



SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18







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	31
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)

403