공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

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	2017-11-27
기준일	2017-11-24

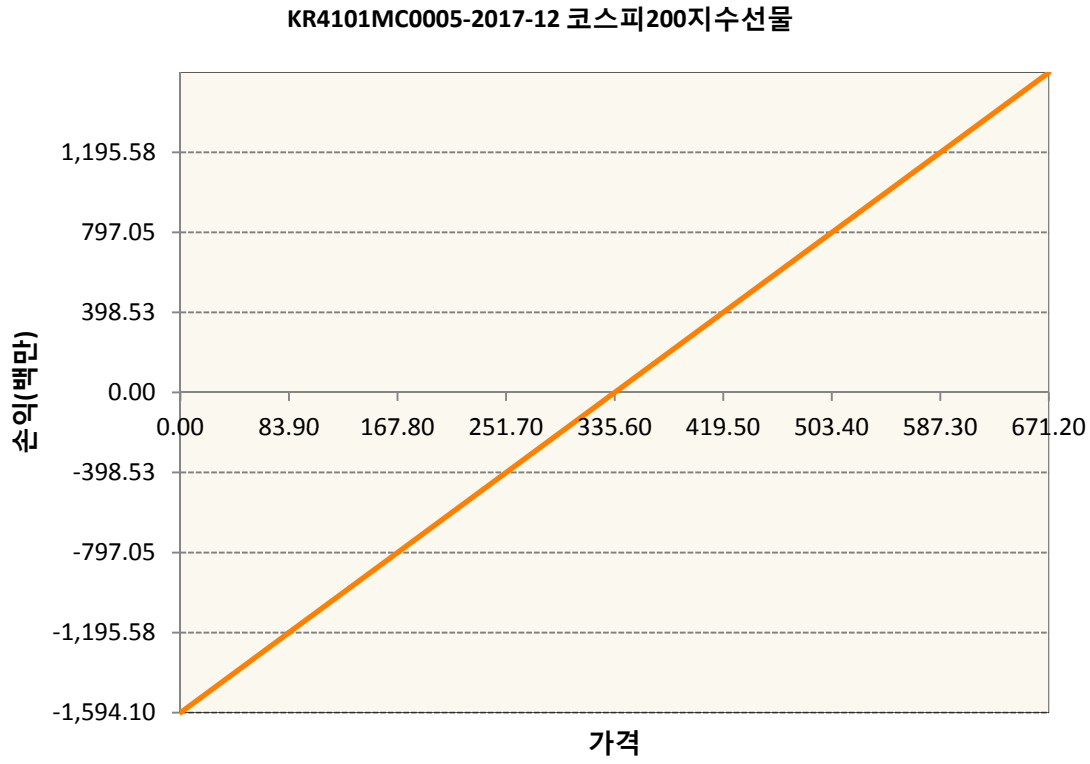
스마트인덱스모

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	1,594	0	1,594	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	2017-11-27
기준일	2017-11-24

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	1,073

* 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	2017-11-27
기준일	2017-11-24

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	401

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

365

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

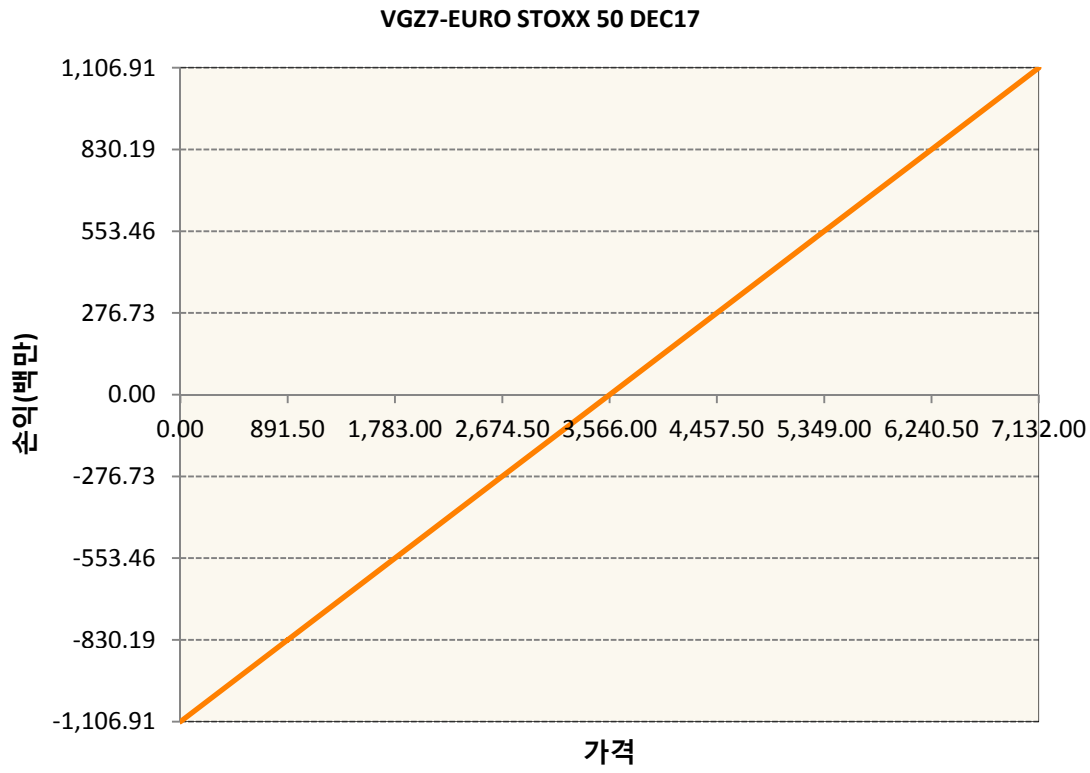
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,107	0	1,107	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	89

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

(단위:백만원)

52

공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

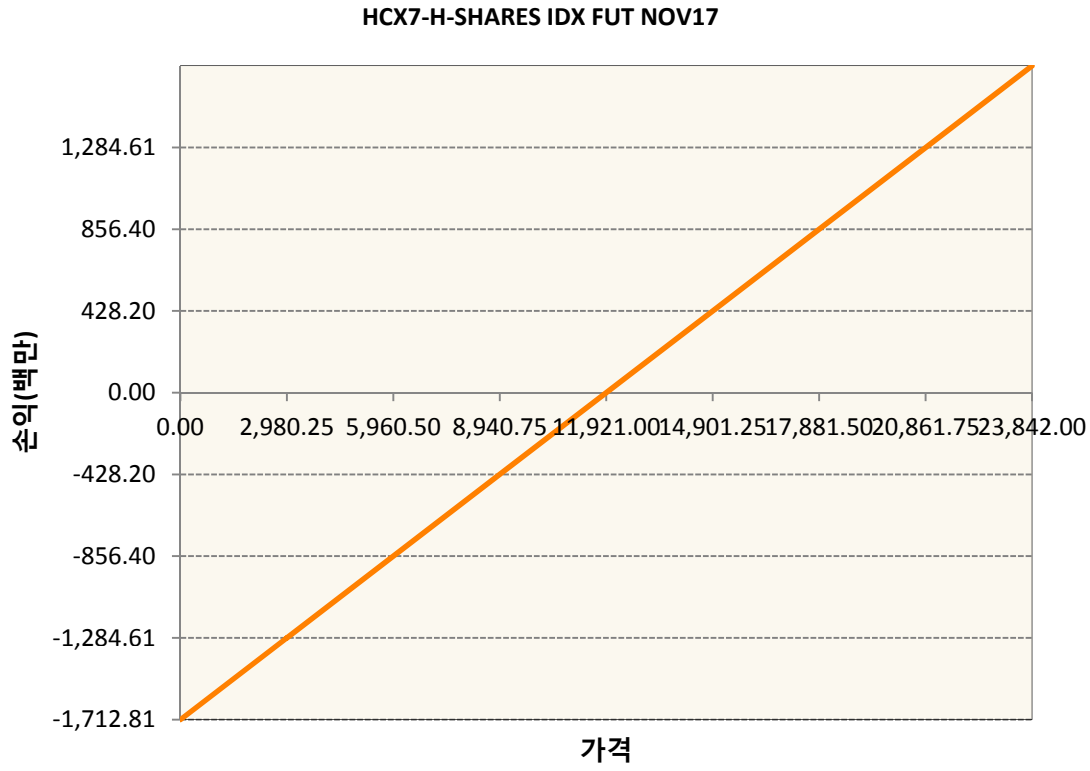
차이나인덱스모(주식-파생형)

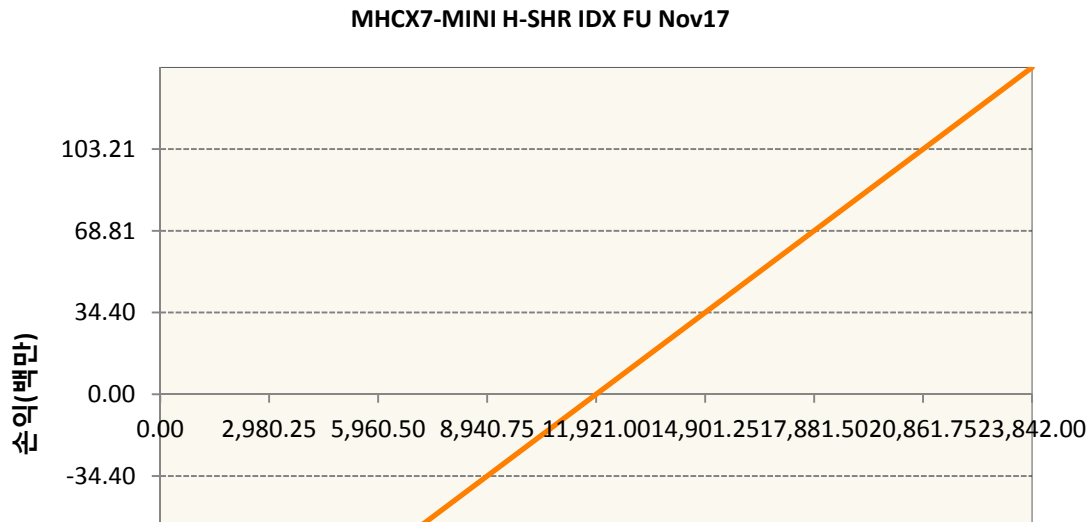
1. 계약금액

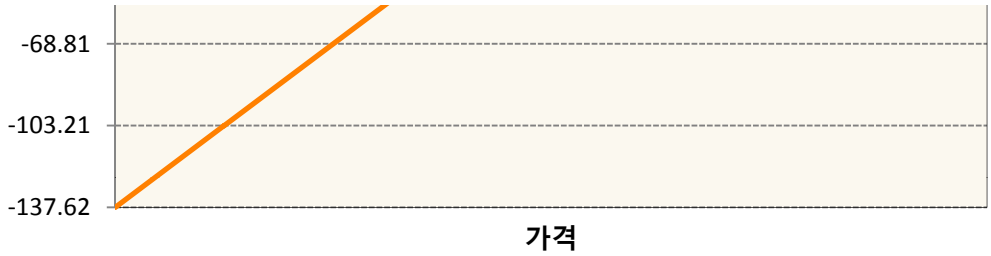
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,850	0	1,850	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)
	119

공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

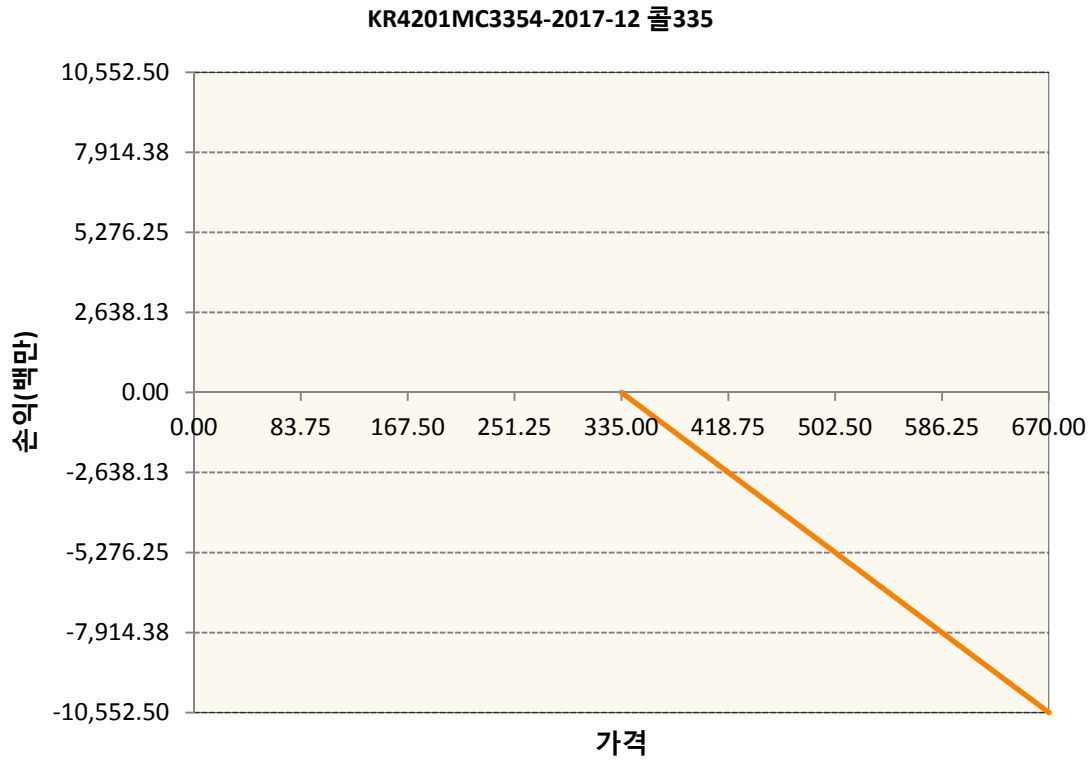
커버드콜모(주식혼합-파생형)

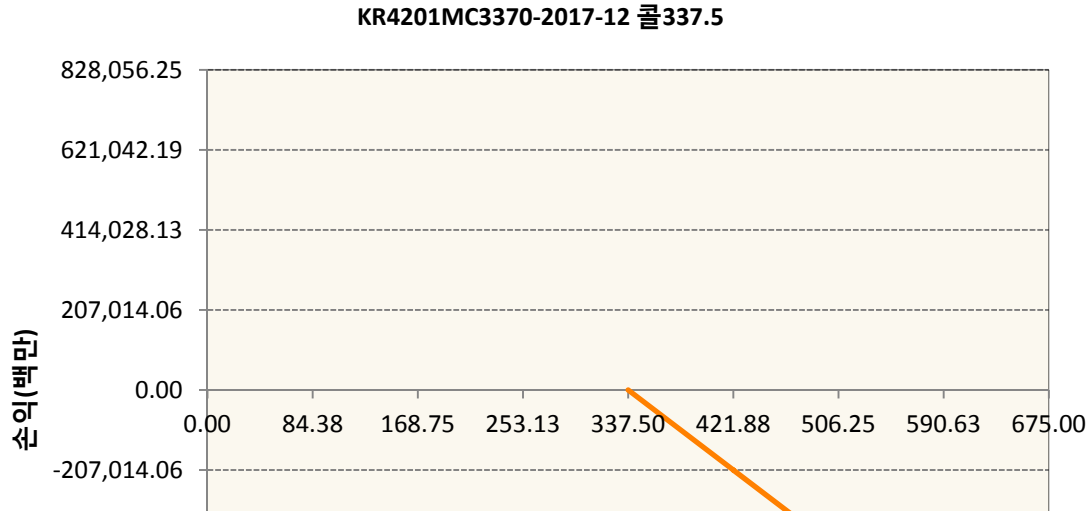
1. 계약금액

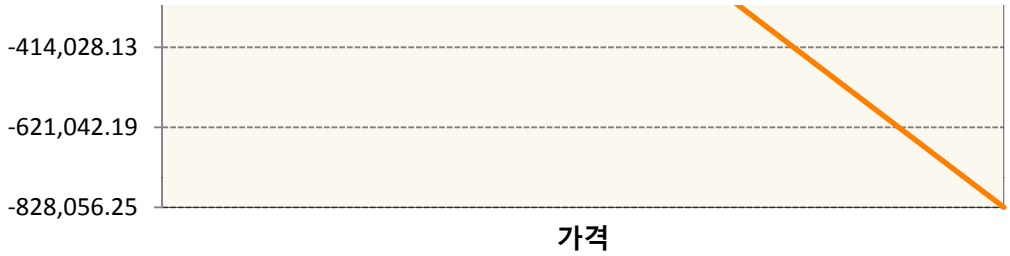
(단위:백만원)

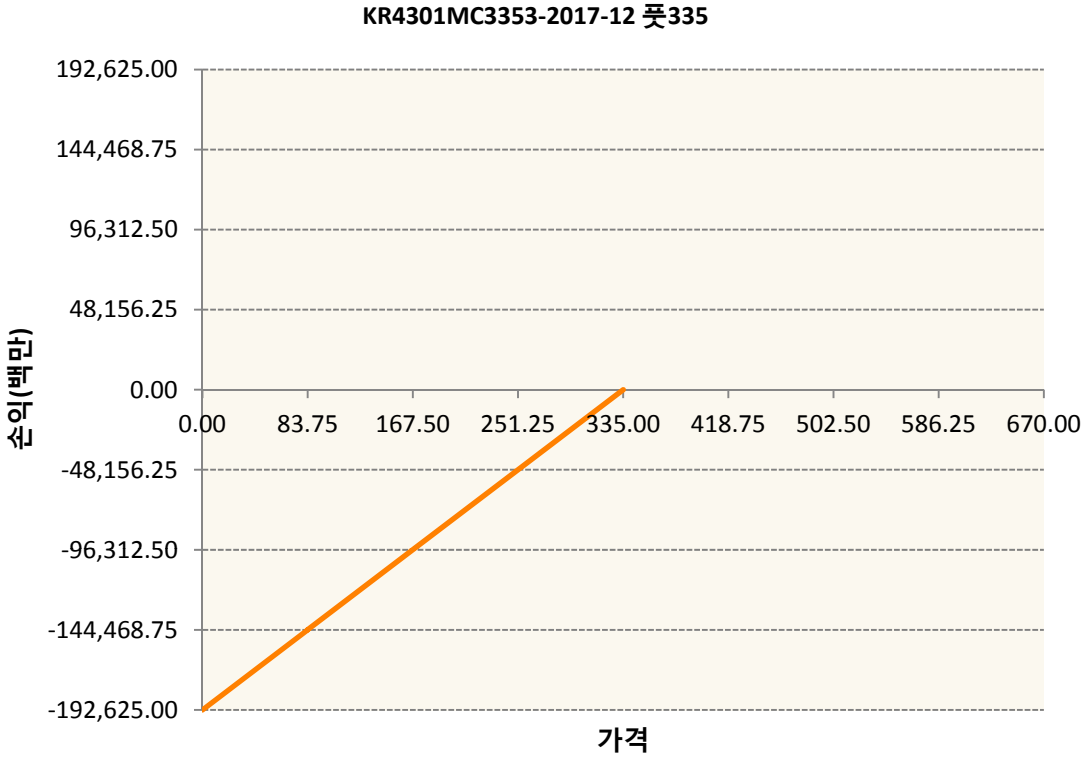
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

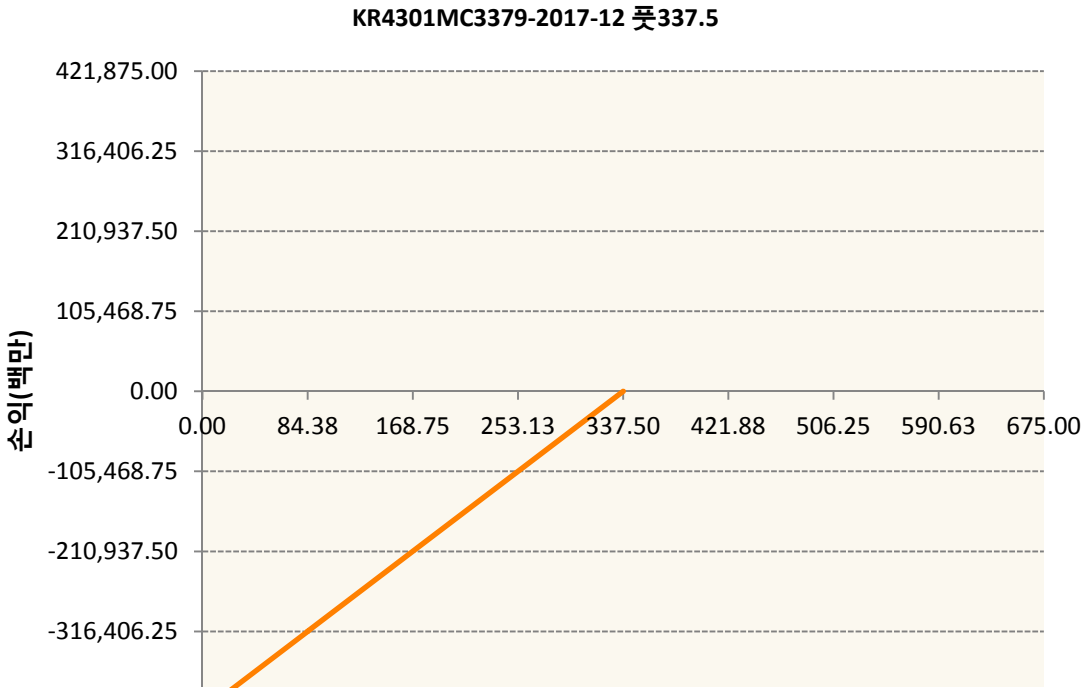
2. 만기시점의 손익구조






-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							664
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	250	246	240	233	225	216	206
-5.33%	231	220	208	196	182	168	152
-2.67%	175	158	140	122	103	84	65
0%	62	41	21	0	-21	-41	-62
2.67%	-118	-135	-153	-172	-191	-210	-229
5.33%	-350	-361	-373	-387	-401	-416	-432
8.00%	-613	-618	-625	-633	-642	-653	-664
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							49,521
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16,718	16,474	16,132	15,694	15,162	14,543	13,845
-5.33%	15,634	14,967	14,188	13,313	12,357	11,331	10,245
-2.67%	12,270	11,035	9,742	8,404	7,031	5,629	4,204
0%	4,795	3,199	1,600	0	-1,601	-3,204	-4,807
2.67%	-7,791	-9,271	-10,777	-12,302	-13,844	-15,397	-16,961
5.33%	-24,872	-25,881	-26,984	-28,163	-29,406	-30,699	-32,036
8.00%	-44,813	-45,331	-45,972	-46,724	-47,574	-48,510	-49,521
KR4301MC3. 2017-12 풋335							13,169
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13,150	-13,151	-13,151	-13,152	-13,155	-13,161	-13,169
-5.33%	-8,017	-8,026	-8,040	-8,063	-8,093	-8,132	-8,180
-2.67%	-3,076	-3,164	-3,263	-3,372	-3,489	-3,613	-3,742
0%	527	351	176	0	-176	-352	-527
2.67%	1,801	1,722	1,631	1,529	1,418	1,300	1,174
5.33%	1,958	1,950	1,934	1,911	1,880	1,839	1,790
8.00%	1,964	1,964	1,963	1,961	1,957	1,949	1,938
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							30,055
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30,035	-30,035	-30,035	-30,037	-30,040	-30,045	-30,055
-5.33%	-18,866	-18,874	-18,889	-18,916	-18,956	-19,011	-19,081
-2.67%	-7,890	-8,011	-8,160	-8,334	-8,530	-8,746	-8,978
0%	1,118	748	375	0	-376	-754	-1,132
2.67%	5,202	4,952	4,681	4,393	4,092	3,779	3,457

5.33%	5,906	5,864	5,801	5,715	5,607	5,478	5,327
8.00%	5,944	5,942	5,937	5,927	5,908	5,880	5,839

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

101,204

공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

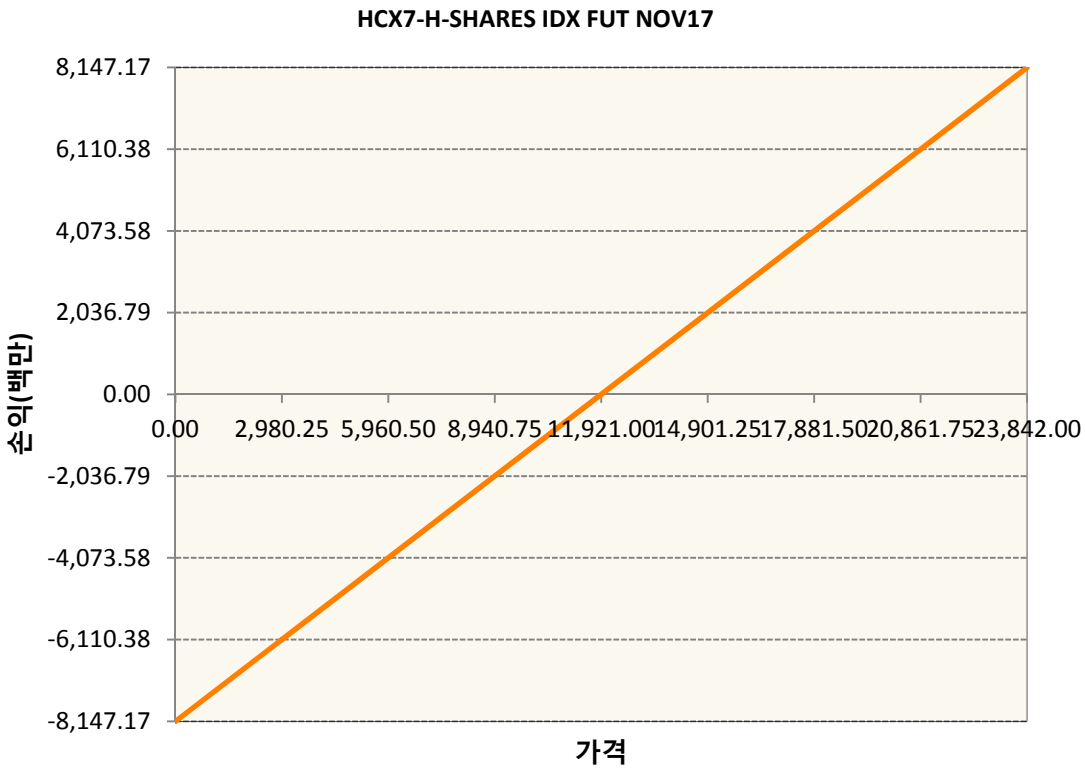
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

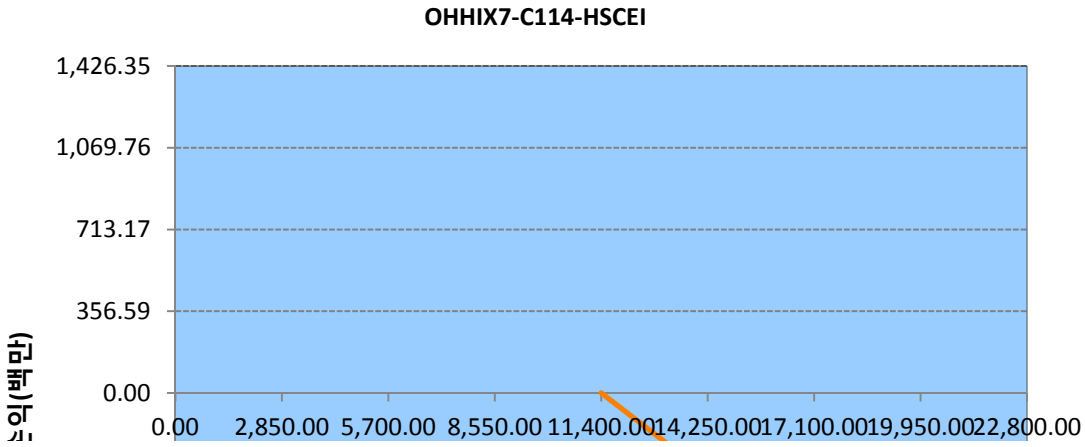
1. 계약금액

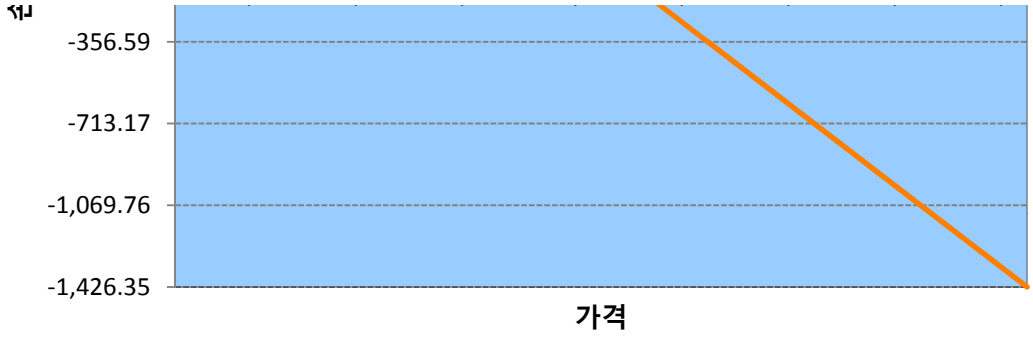
(단위:백만원)

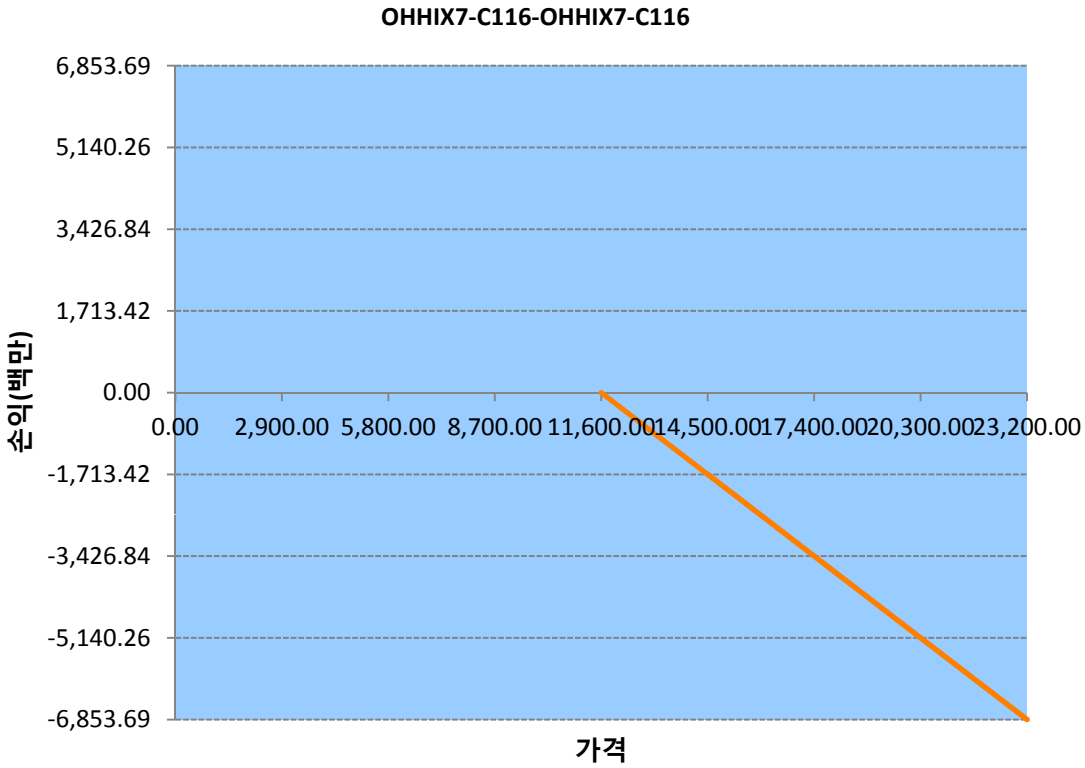
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,147	0	8,147	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,560	-16,560	장내

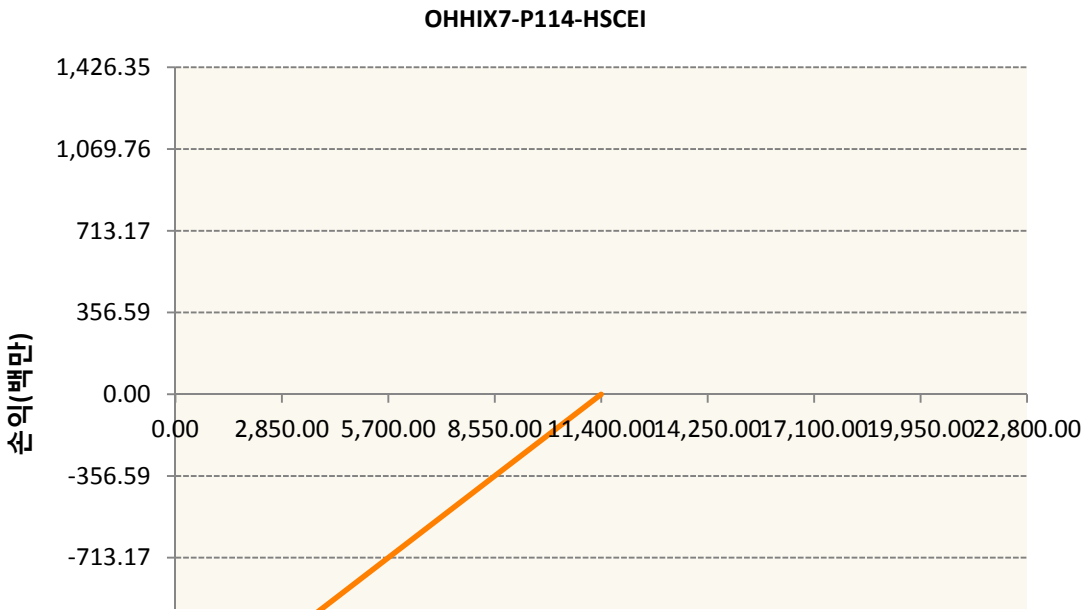
2. 만기시점의 손익구조

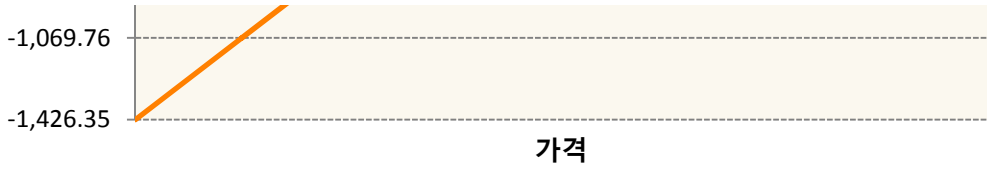


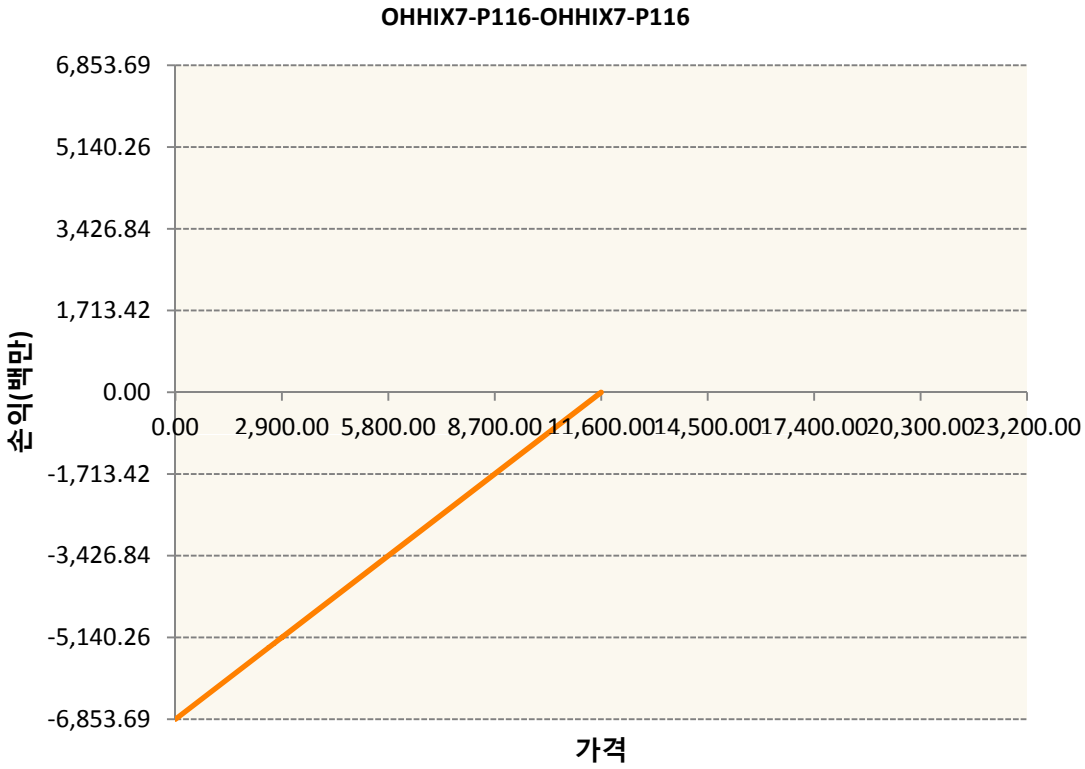



-356.59
-713.17
-1,069.76
-1,426.35
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,853.69
5,140.26
3,426.84
1,713.42
0.00
-1,713.42
-3,426.84
-5,140.26
-6,853.69
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
1,426.35
1,069.76
713.17
356.59
0.00
-356.59
-713.17
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	652
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)
	1,596

공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

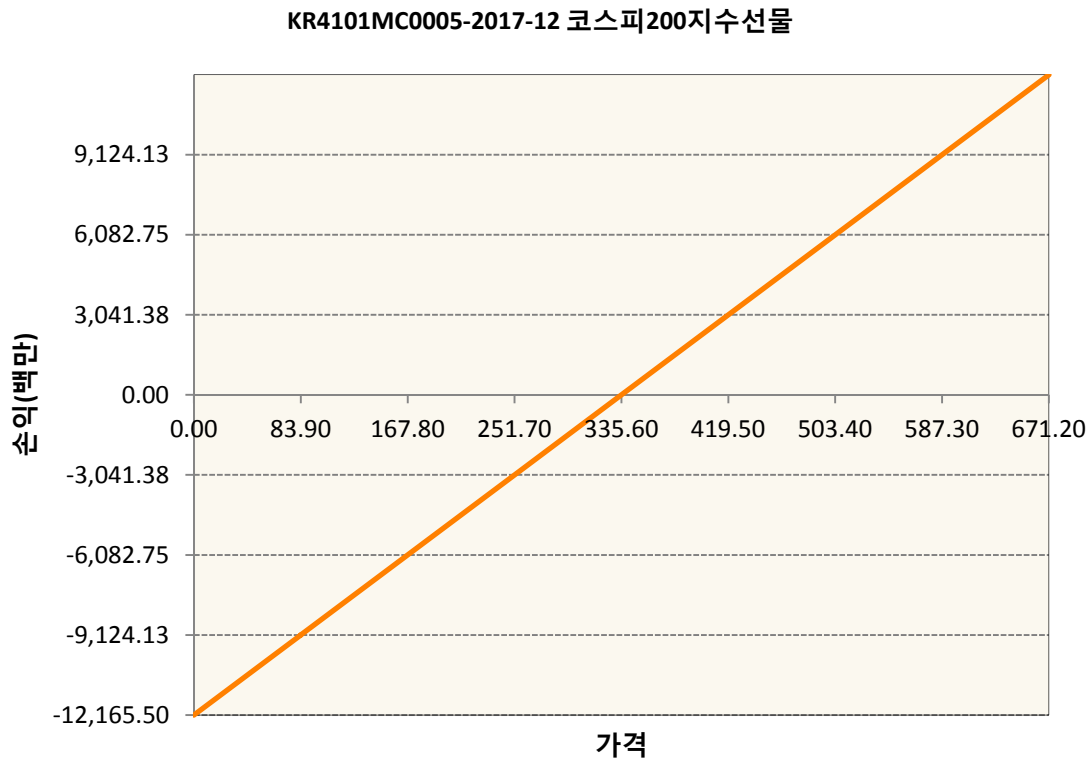
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

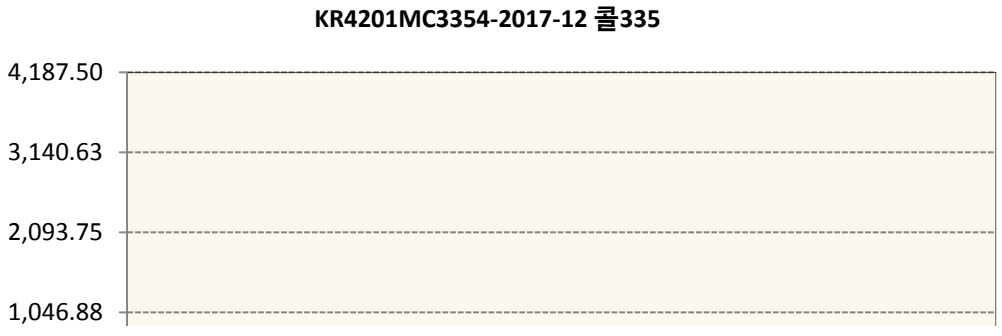
1. 계약금액

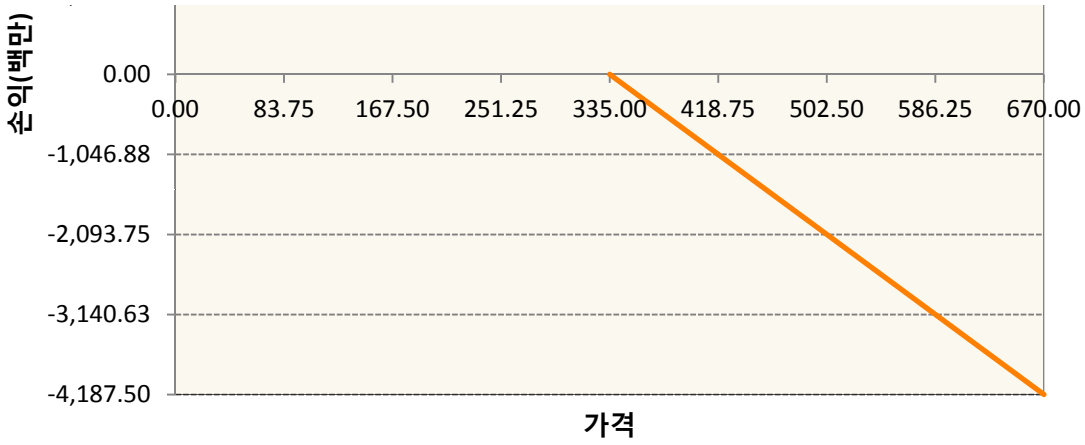
(단위:백만원)

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	12,166	0	12,166	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

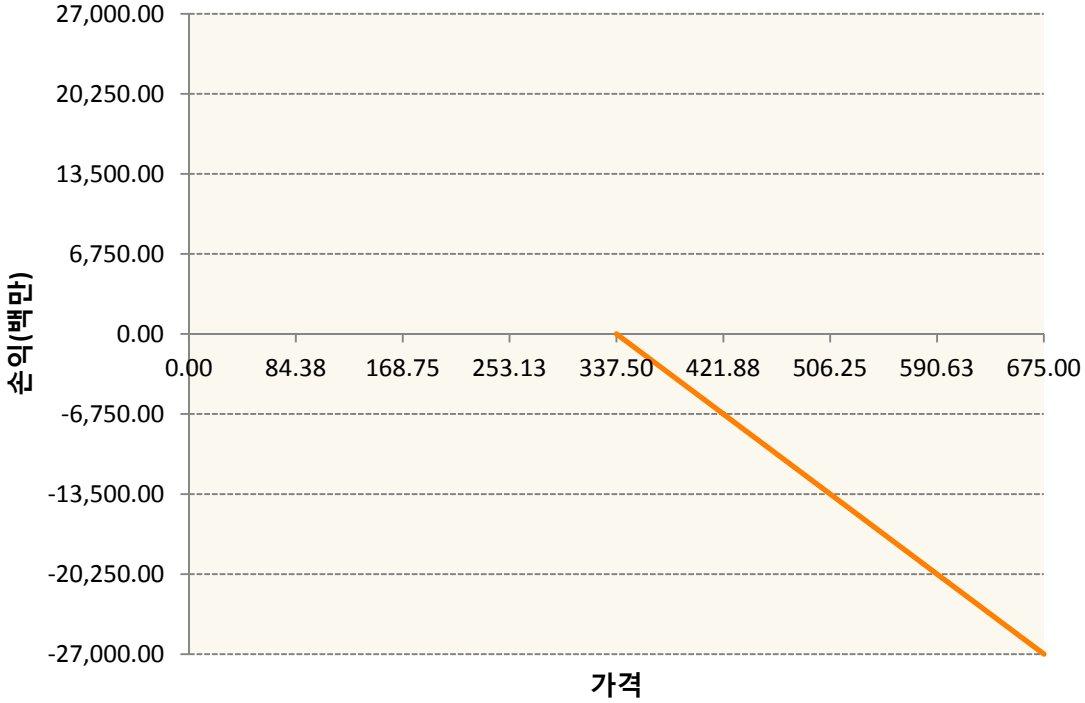
2. 만기시점의 손익구조



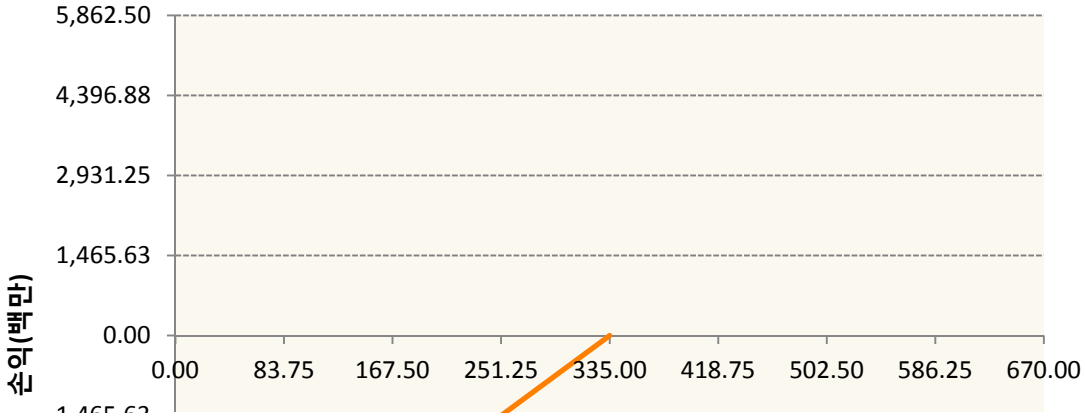




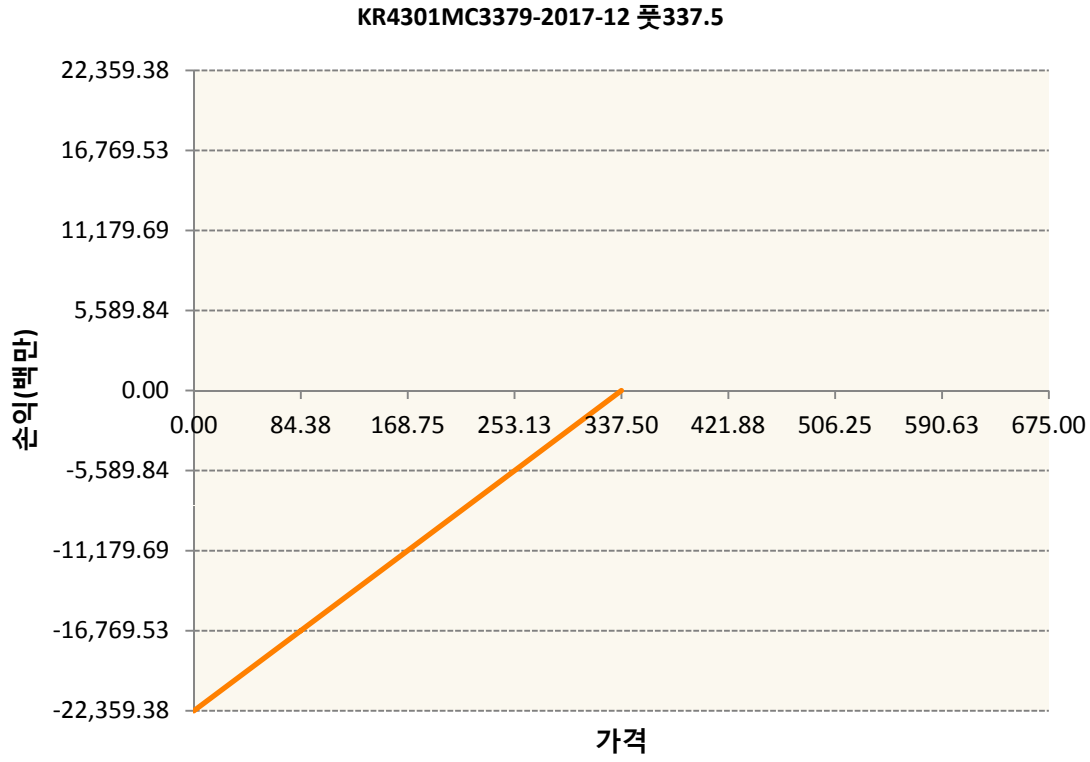
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,460
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460	-1,460
-5.33%	-974	-974	-974	-974	-974	-974	-974
-2.67%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	487	487	487	487	487	487	487
5.33%	974	974	974	974	974	974	974
8.00%	1,460	1,460	1,460	1,460	1,460	1,460	1,460
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
	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%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-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%	105	105	105	105	105	105	105
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						197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-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%	197	197	197	197	197	197	197
	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%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-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%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						467
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-467	-467	-467	-467	-467	-467	-467
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-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%	311	311	311	311	311	311	311
8.00%	467	467	467	467	467	467	467
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						311
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-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%	311	311	311	311	311	311	311
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						631
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-5.33%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	421	421	421	421	421	421	421
8.00%	631	631	631	631	631	631	631
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						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
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					973

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-973	-973	-973	-973	-973	-973	-973
-5.33%	-649	-649	-649	-649	-649	-649	-649
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	324	324	324	324	324	324	324
5.33%	649	649	649	649	649	649	649
8.00%	973	973	973	973	973	973	973
	KR4201MC3	2017-12 콜335					264

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	99	98	95	93	89	86	82
-5.33%	91	87	83	78	72	66	60
-2.67%	70	63	56	48	41	33	26
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-47	-54	-61	-68	-76	-83	-91
5.33%	-139	-143	-148	-153	-159	-165	-172
8.00%	-243	-245	-248	-251	-255	-259	-264
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,615

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	545	537	526	512	494	474	451
-5.33%	510	488	463	434	403	369	334
-2.67%	400	360	318	274	229	184	137
0%	156	104	52	0	-52	-104	-157
2.67%	-254	-302	-351	-401	-451	-502	-553
5.33%	-811	-844	-880	-918	-959	-1,001	-1,045
8.00%	-1,461	-1,478	-1,499	-1,524	-1,551	-1,582	-1,615
	KR4301MC3	2017-12 풋335					401

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-400	-400	-400	-400	-400	-401	-401
-5.33%	-244	-244	-245	-245	-246	-248	-249

-2.67%	-94	-96	-99	-103	-106	-110	-114
0%	16	11	5	0	-5	-11	-16
2.67%	55	52	50	47	43	40	36
5.33%	60	59	59	58	57	56	54
8.00%	60	60	60	60	60	59	59
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,593
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,592	-1,592	-1,592	-1,592	-1,592	-1,592	-1,593
-5.33%	-1,000	-1,000	-1,001	-1,003	-1,005	-1,008	-1,011
-2.67%	-418	-425	-432	-442	-452	-464	-476
0%	59	40	20	0	-20	-40	-60
2.67%	276	262	248	233	217	200	183
5.33%	313	311	307	303	297	290	282
8.00%	315	315	315	314	313	312	309

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

9,547

공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

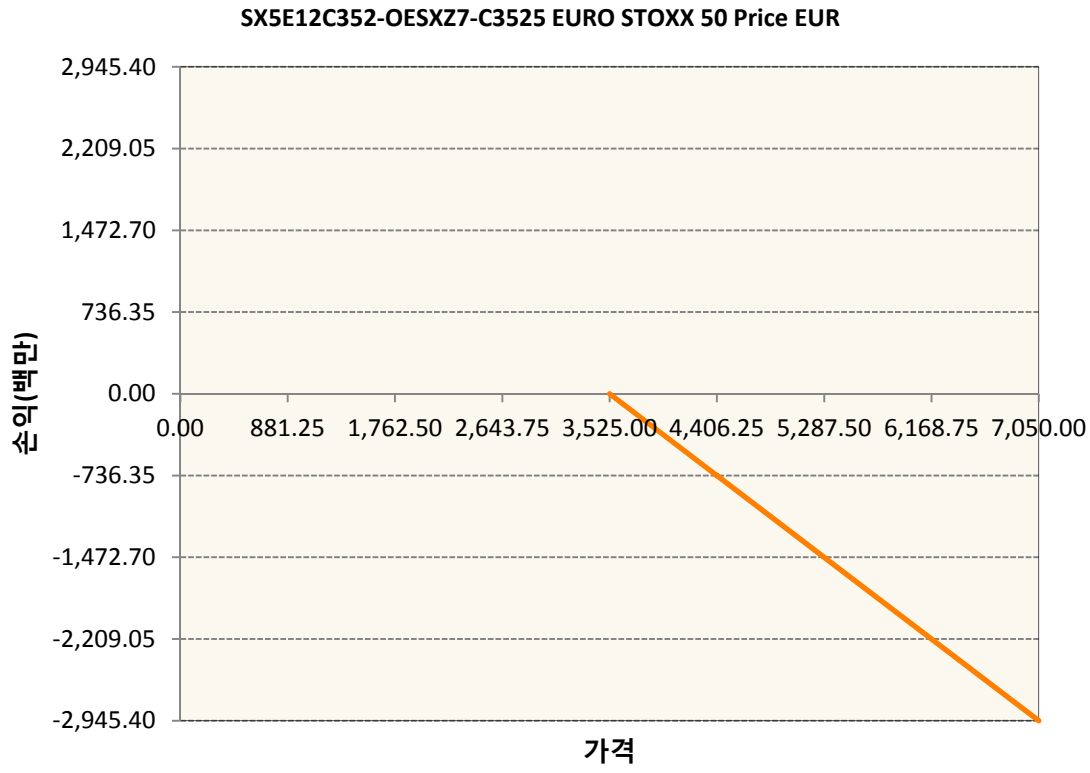
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

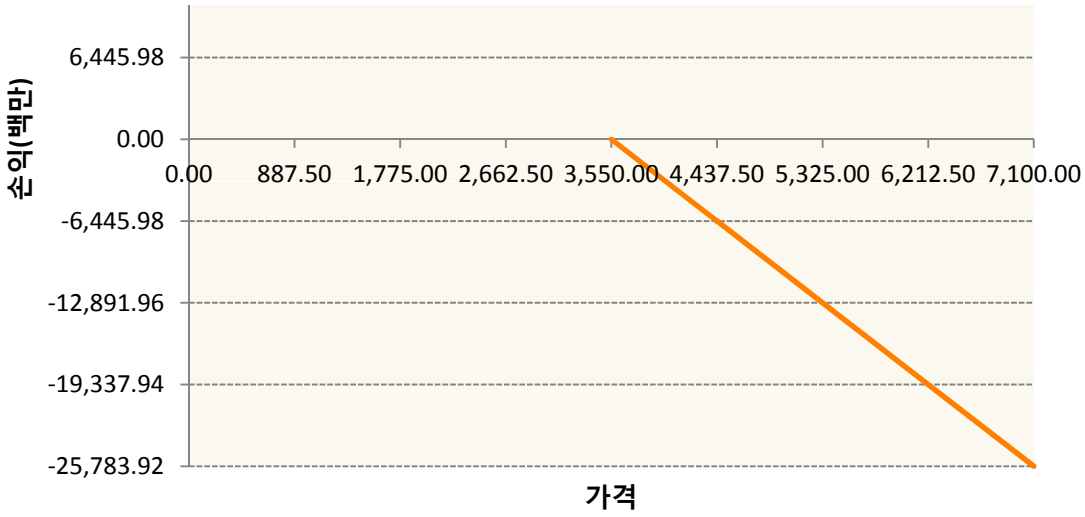
(단위:백만원)

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	20,888	0	20,888	
누계	유가증권	스왑	96,412	0	96,412	장외
누계	유가증권	옵션	0	57,459	-57,459	장내
누계	지수	스왑	51,420	0	51,420	장외

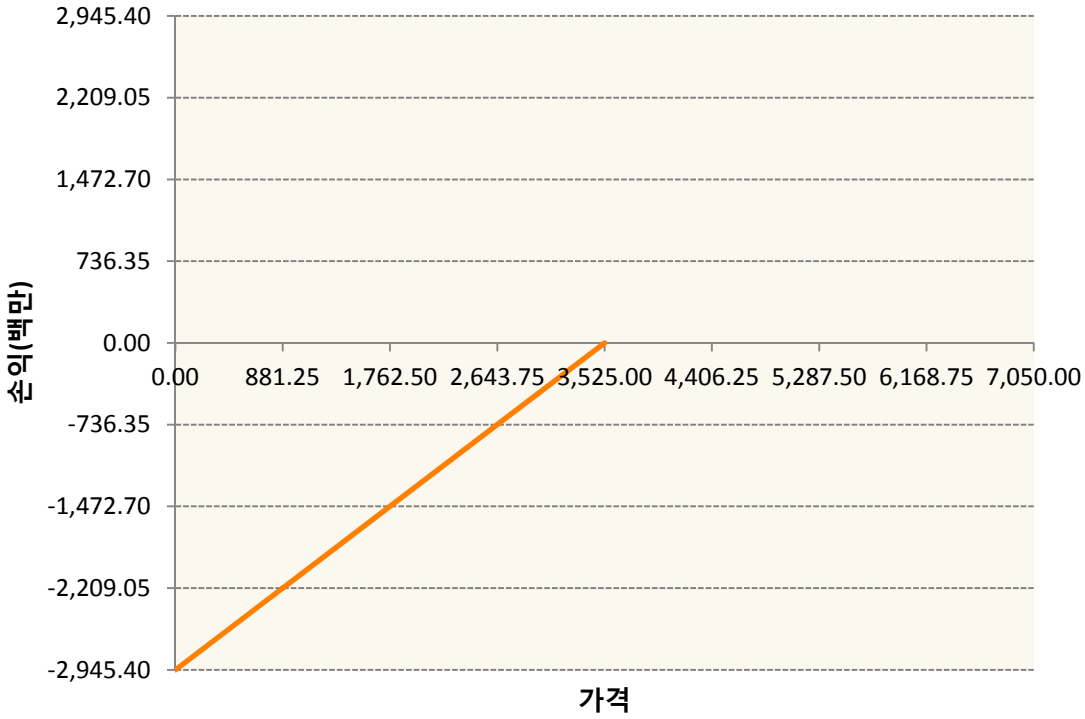
2. 만기시점의 손익구조



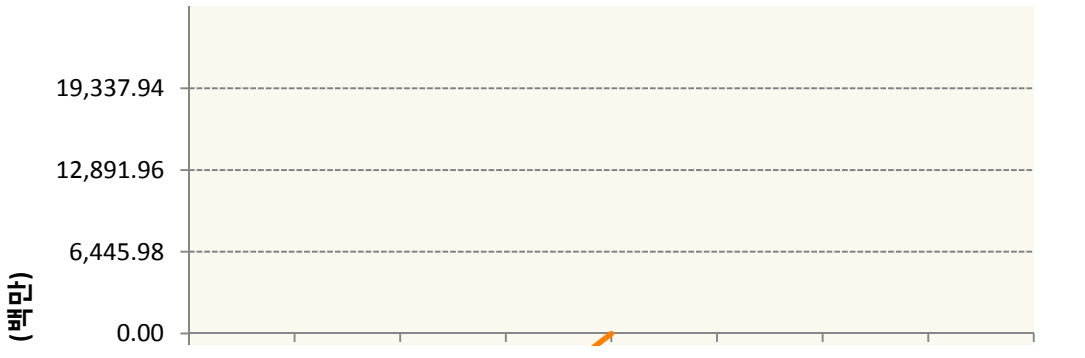


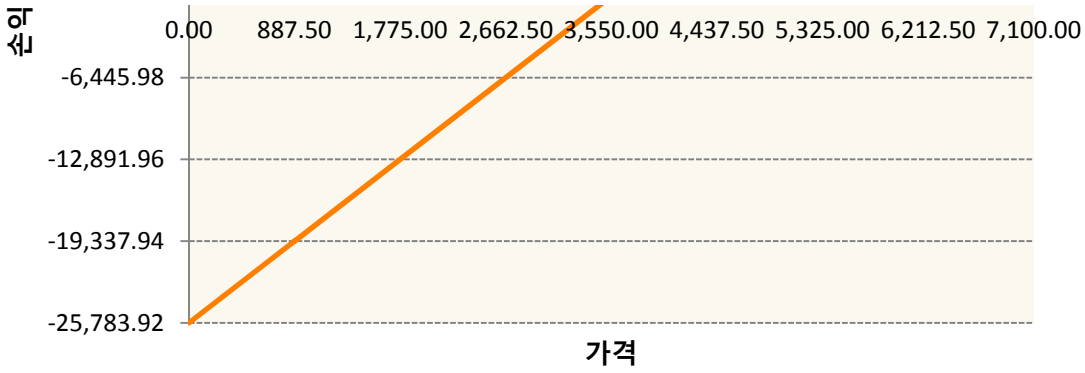


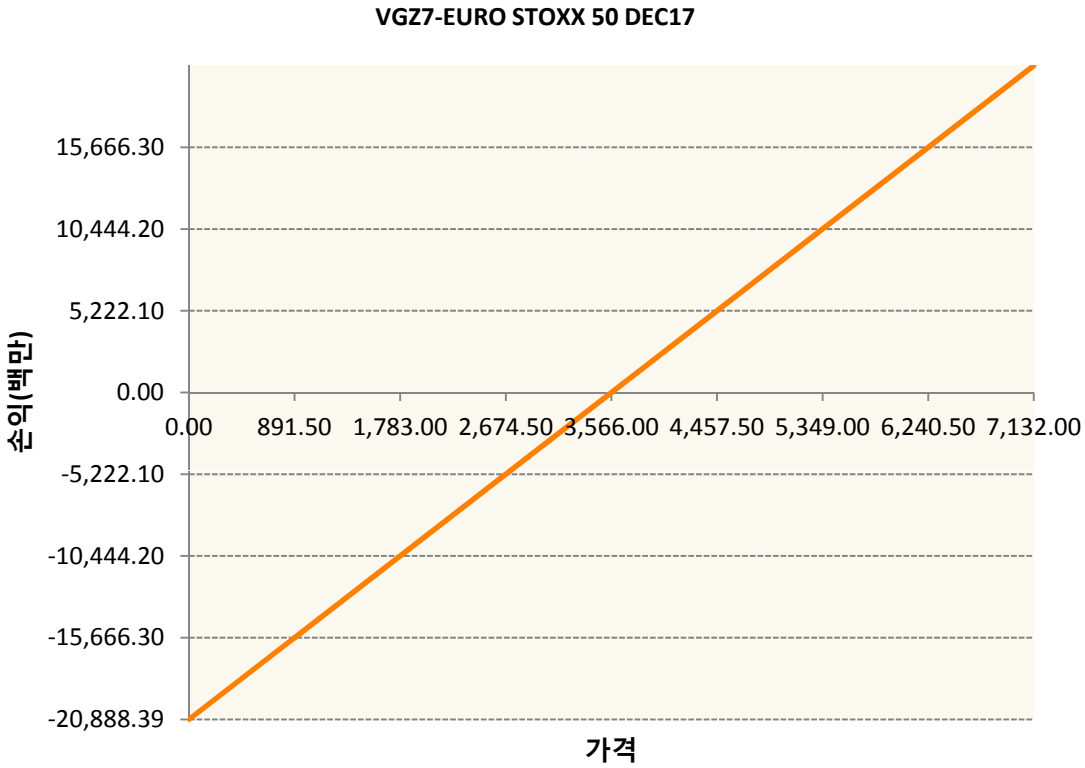
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	25
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	5
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	236
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,063
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	236
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,063
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,671

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

3,702

공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

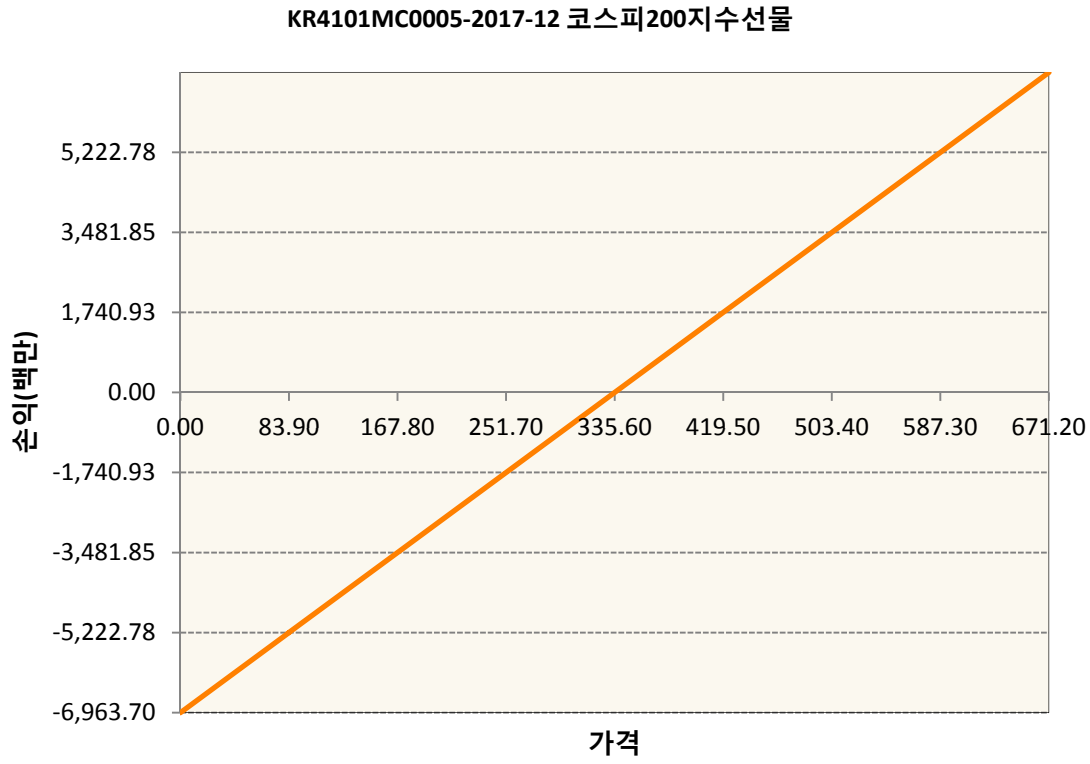
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,964	0	6,964	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						557
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-557	-557	-557	-557	-557	-557	-557
-5.33%	-371	-371	-371	-371	-371	-371	-371
-2.67%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	186	186	186	186	186	186	186
5.33%	371	371	371	371	371	371	371
8.00%	557	557	557	557	557	557	557

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

316

공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

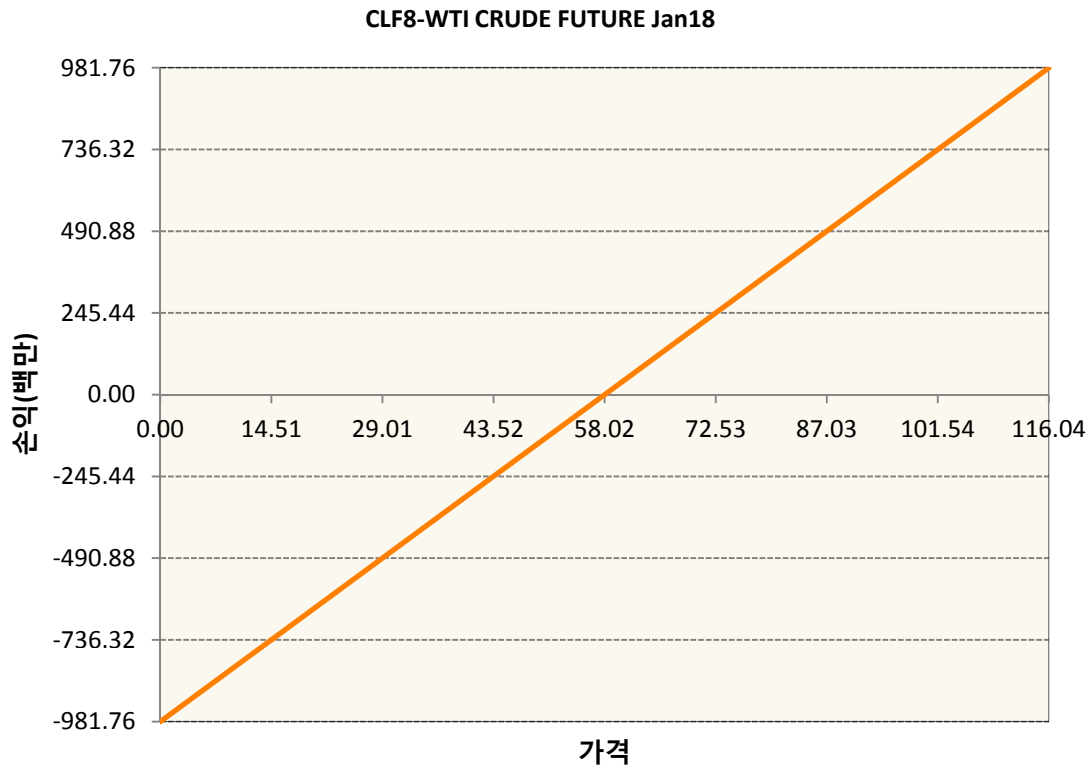
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

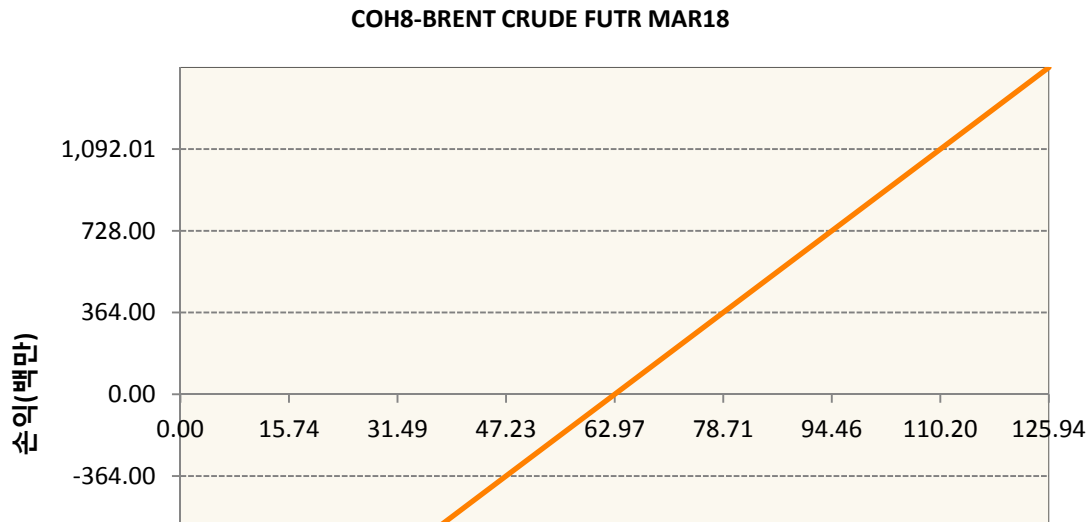
1. 계약금액

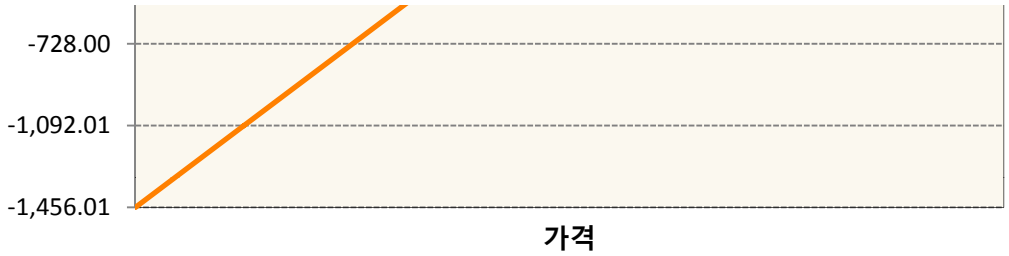
(단위:백만원)

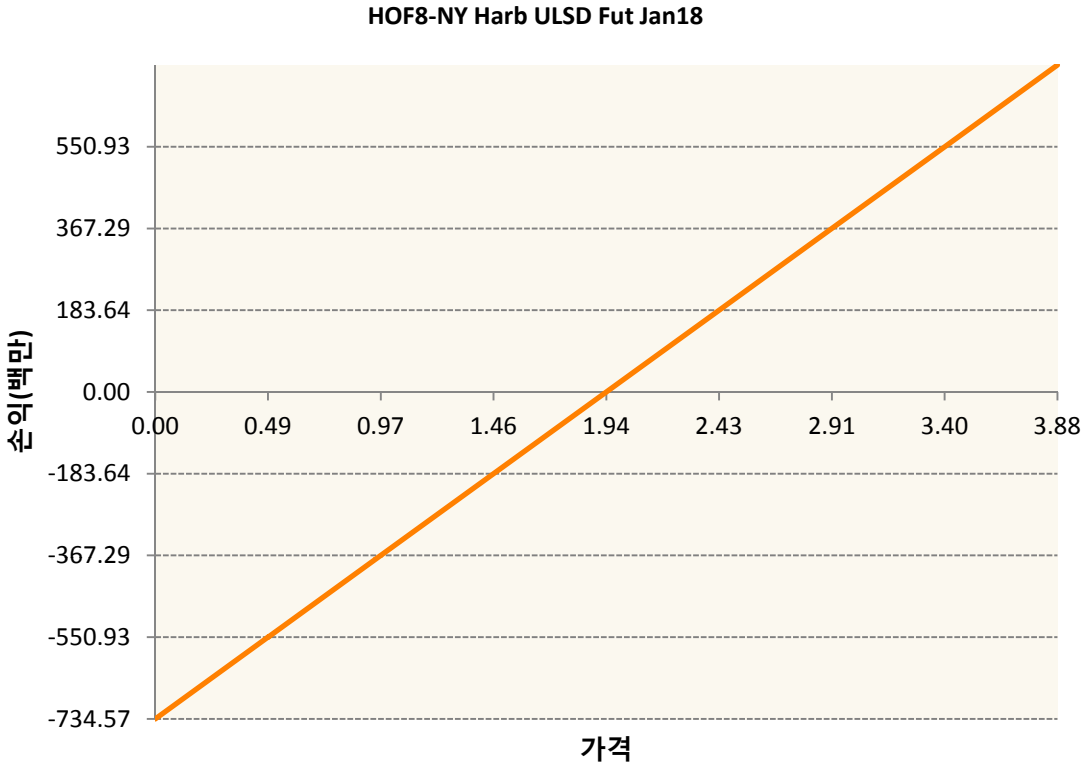
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,208	869	4,339	

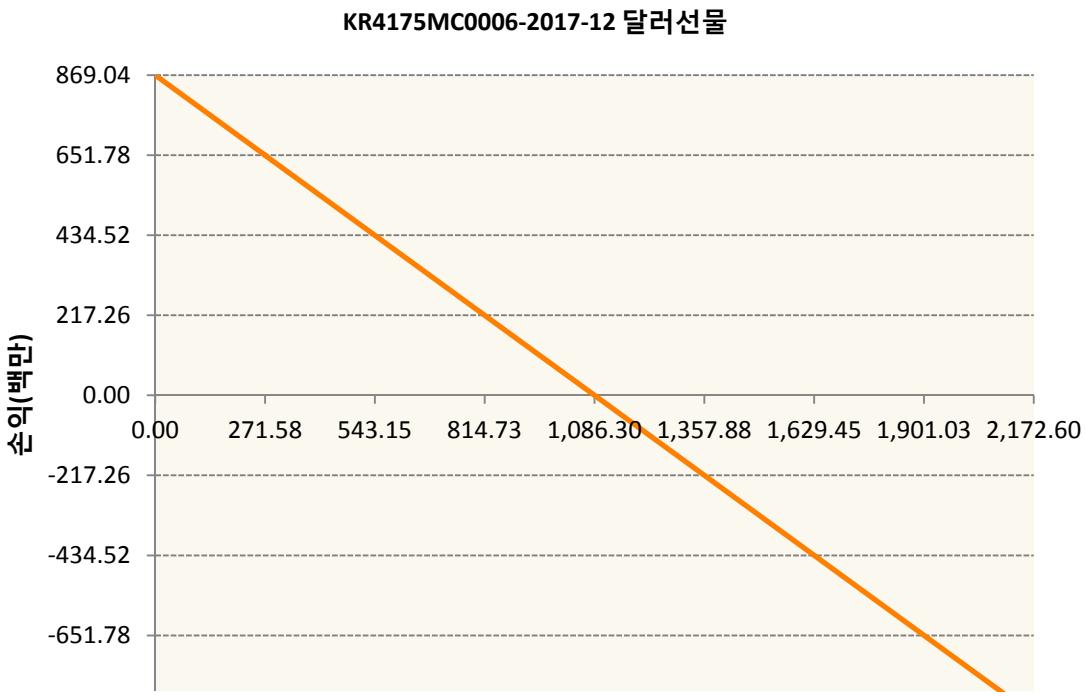
2. 만기시점의 손익구조

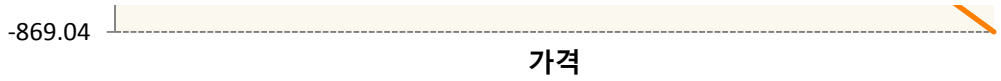


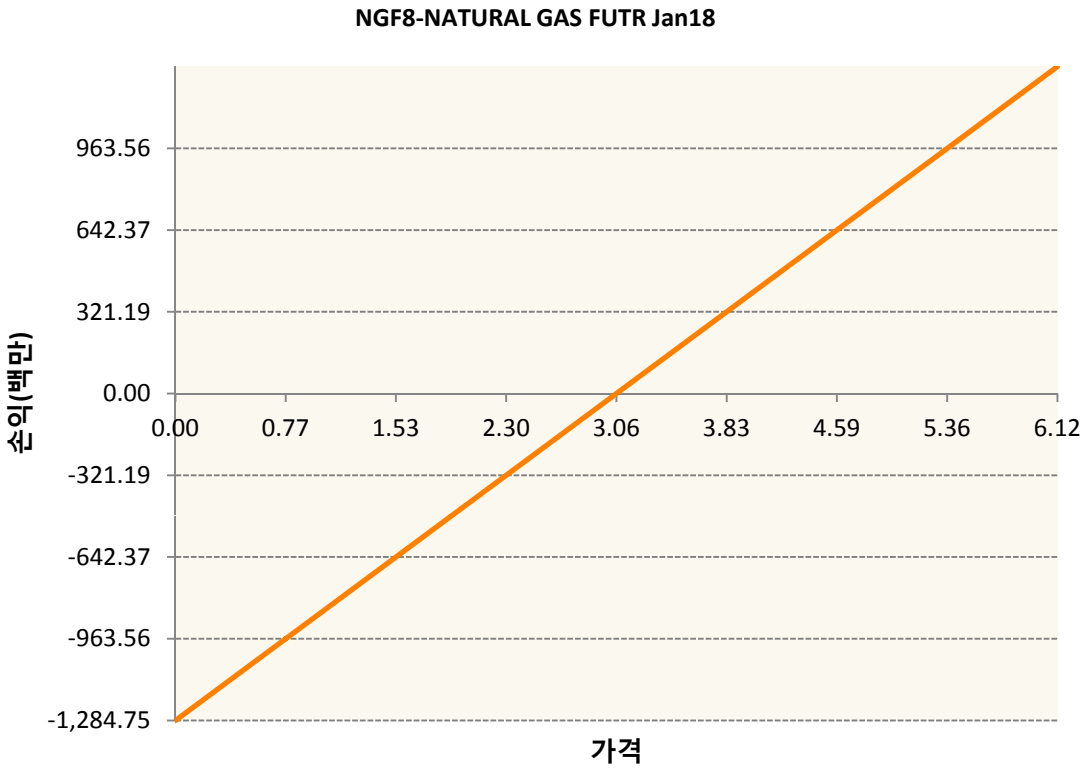


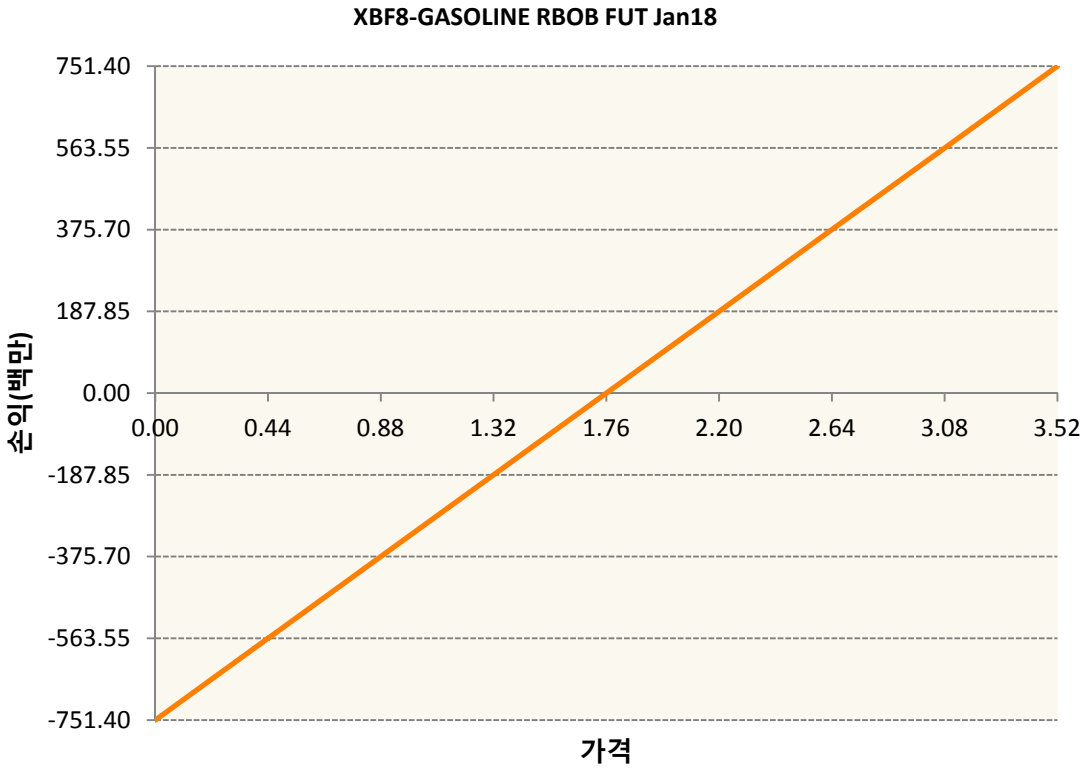

-728.00
-1,092.01
-1,456.01
가격


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
869.04
651.78
434.52
217.26
0.00
-217.26
-434.52
-651.78
0.00
271.58
543.15
814.73
1,086.30
1,357.88
1,629.45
1,901.03
2,172.60
손익(백만)


-869.04
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	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	103
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	60

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

718

공시일	2017-11-27
기준일	2017-11-24

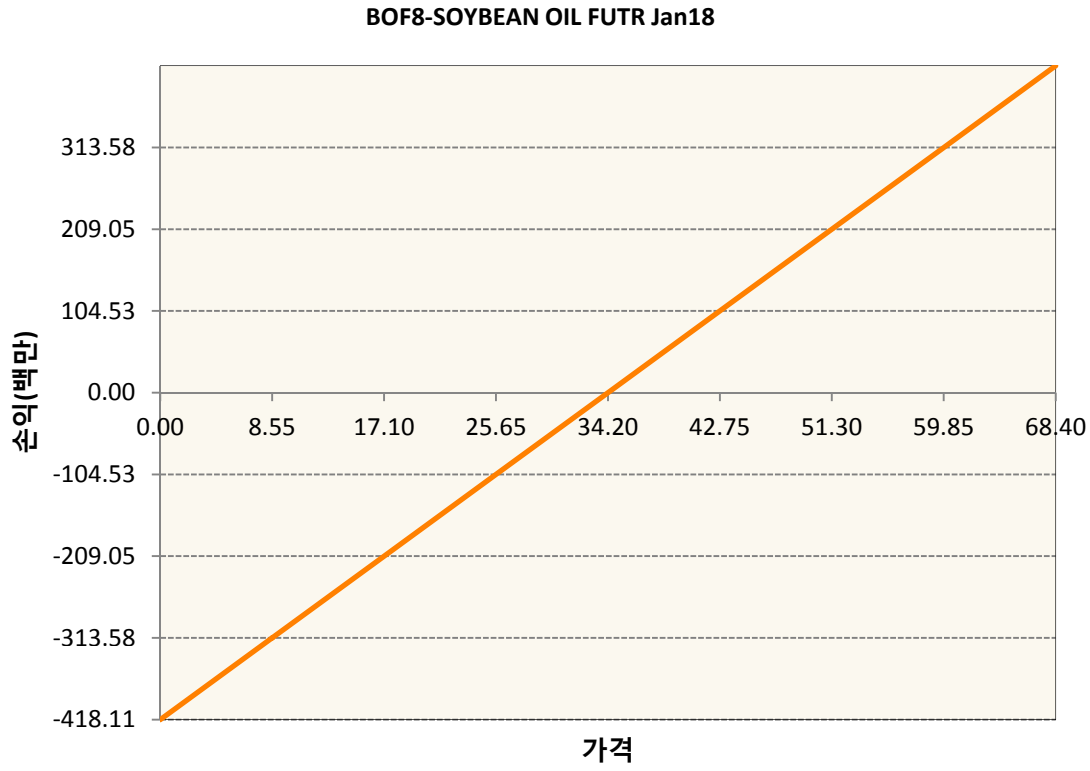
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

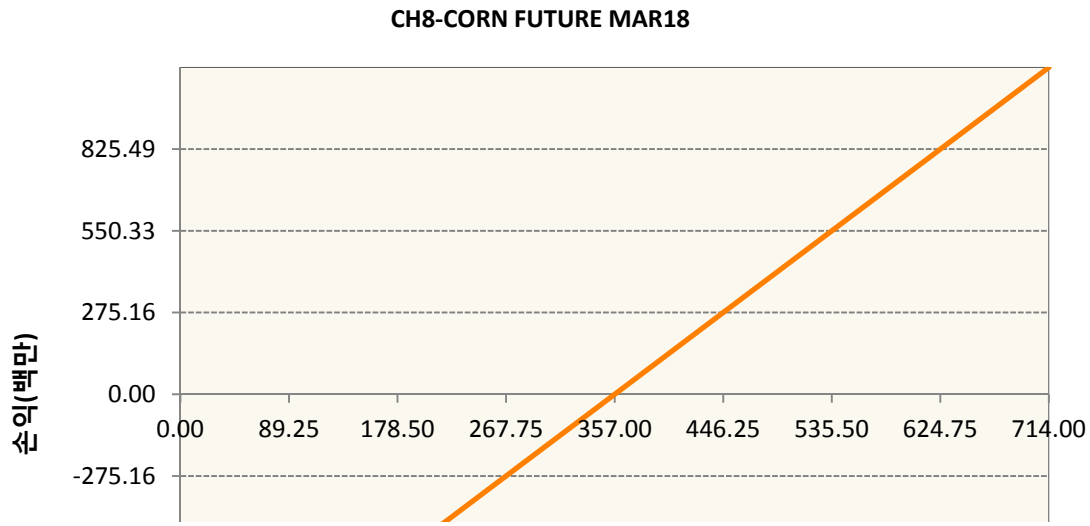
1. 계약금액

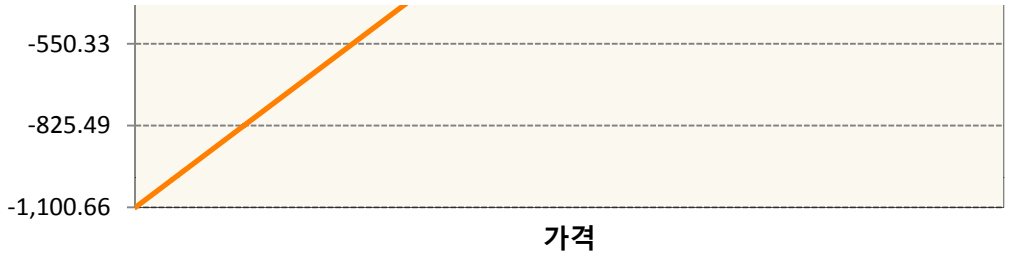
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,565	326	4,239	

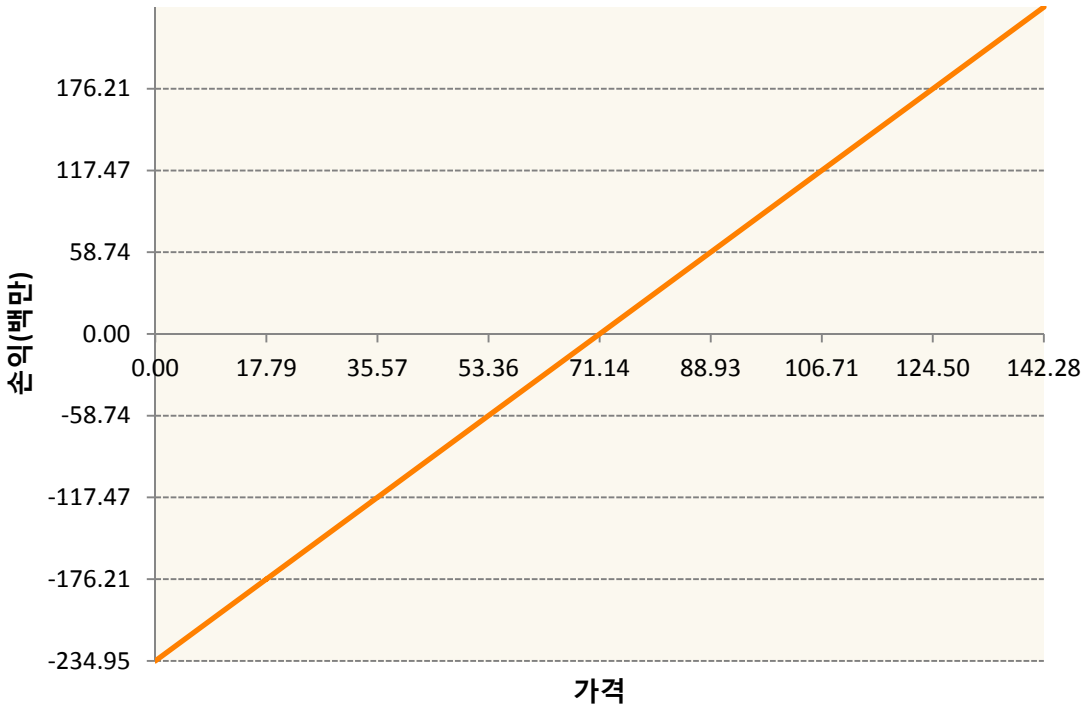
2. 만기시점의 손익구조



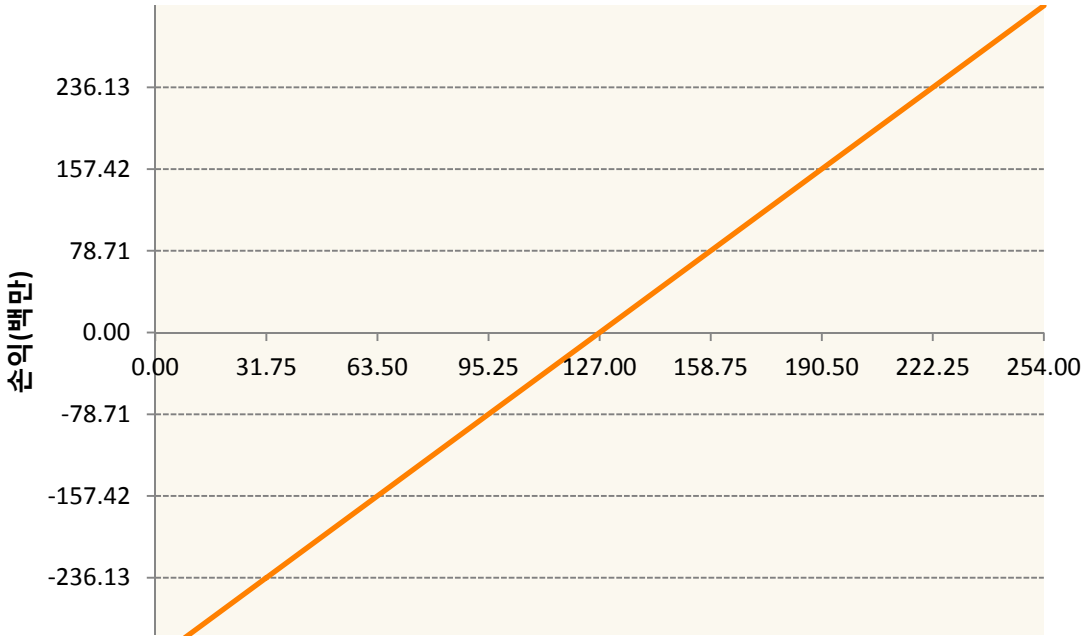


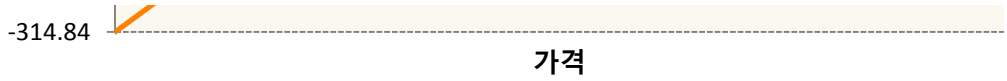


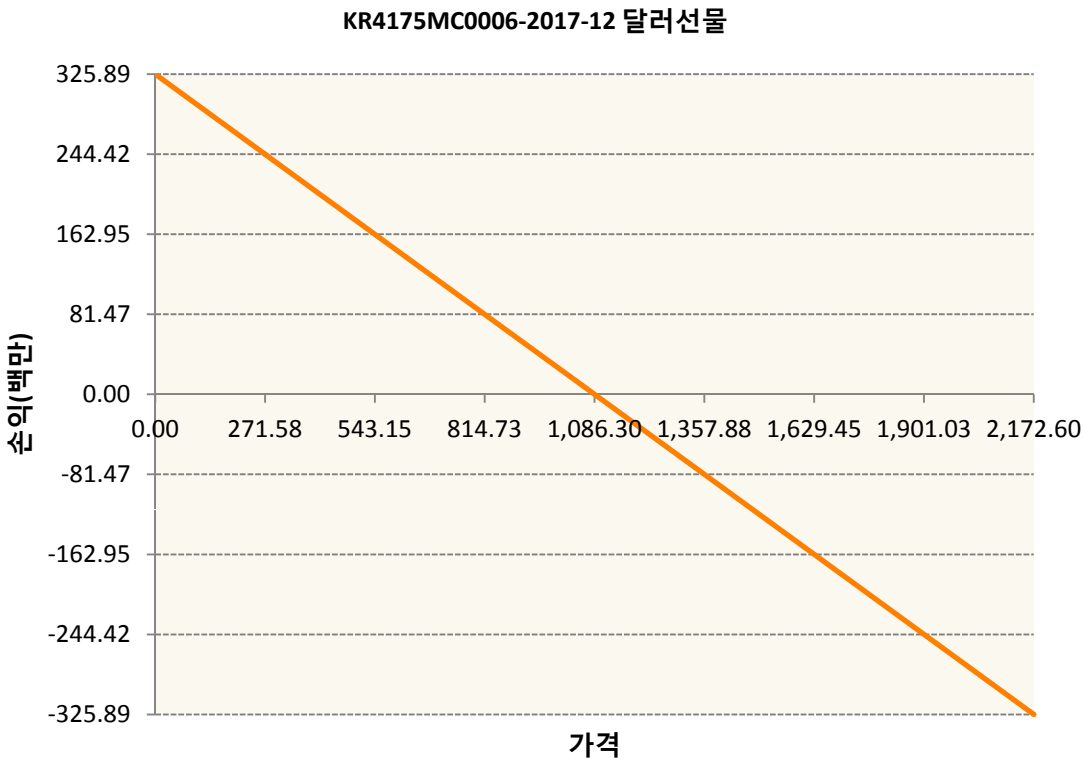
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

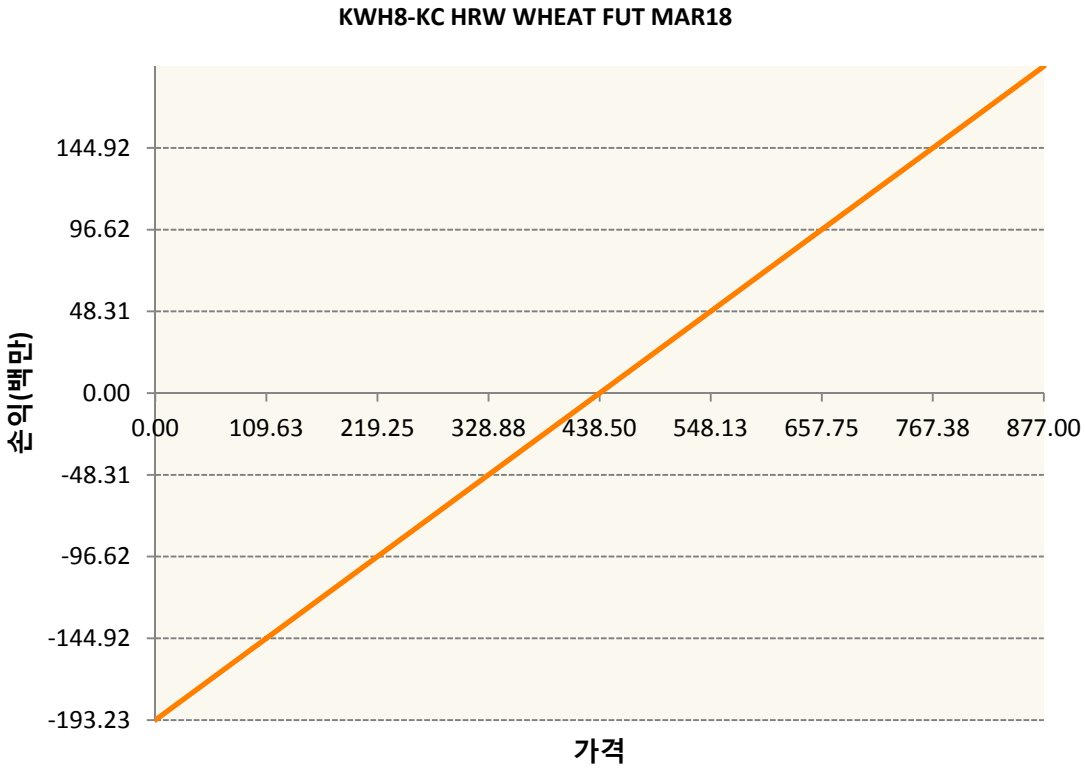


KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

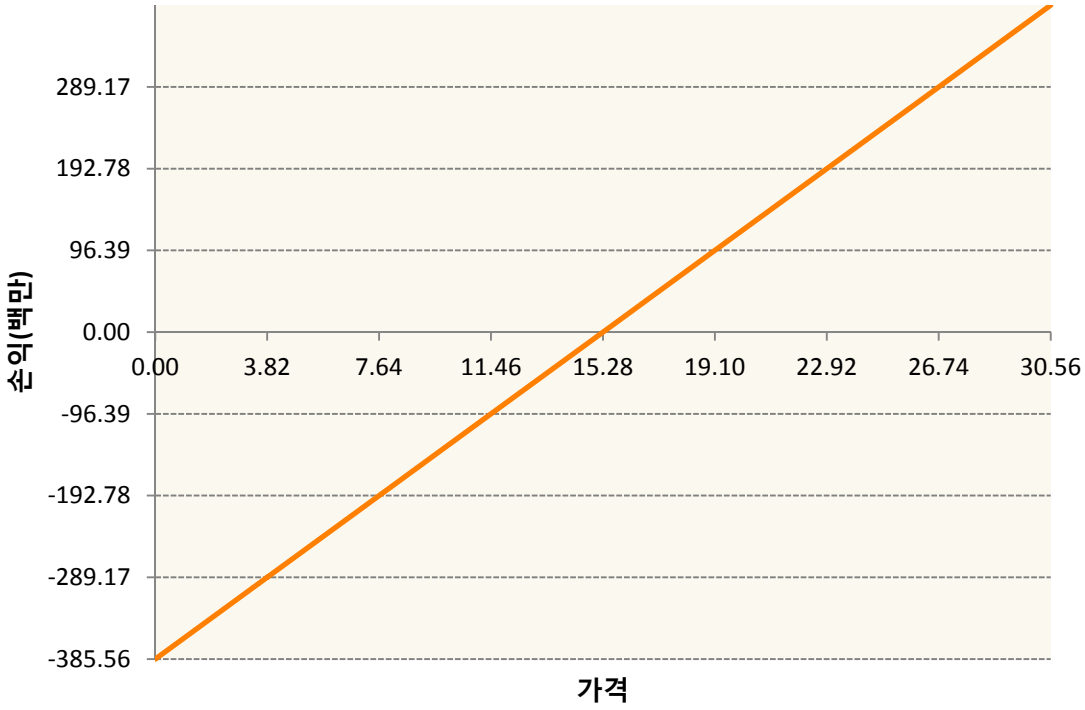



-314.84
가격

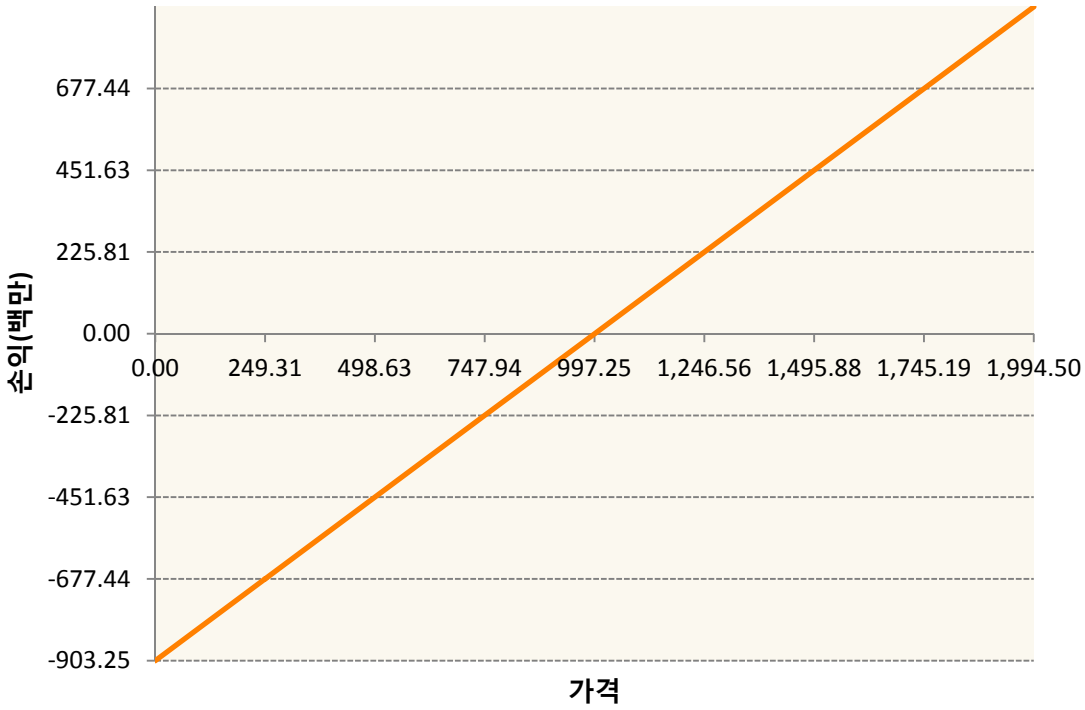

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
325.89
244.42
162.95
81.47
0.00
-81.47
-162.95
-244.42
-325.89
0.00
271.58
543.15
814.73
1,086.30
1,357.88
1,629.45
1,901.03
2,172.60
손익(백만)
가격


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

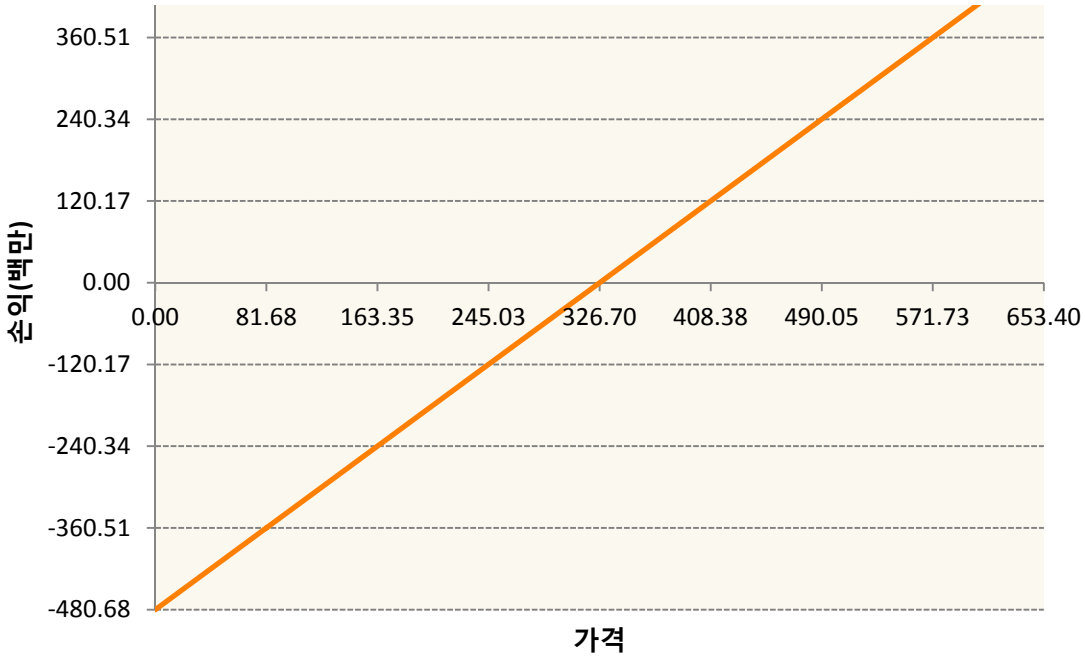


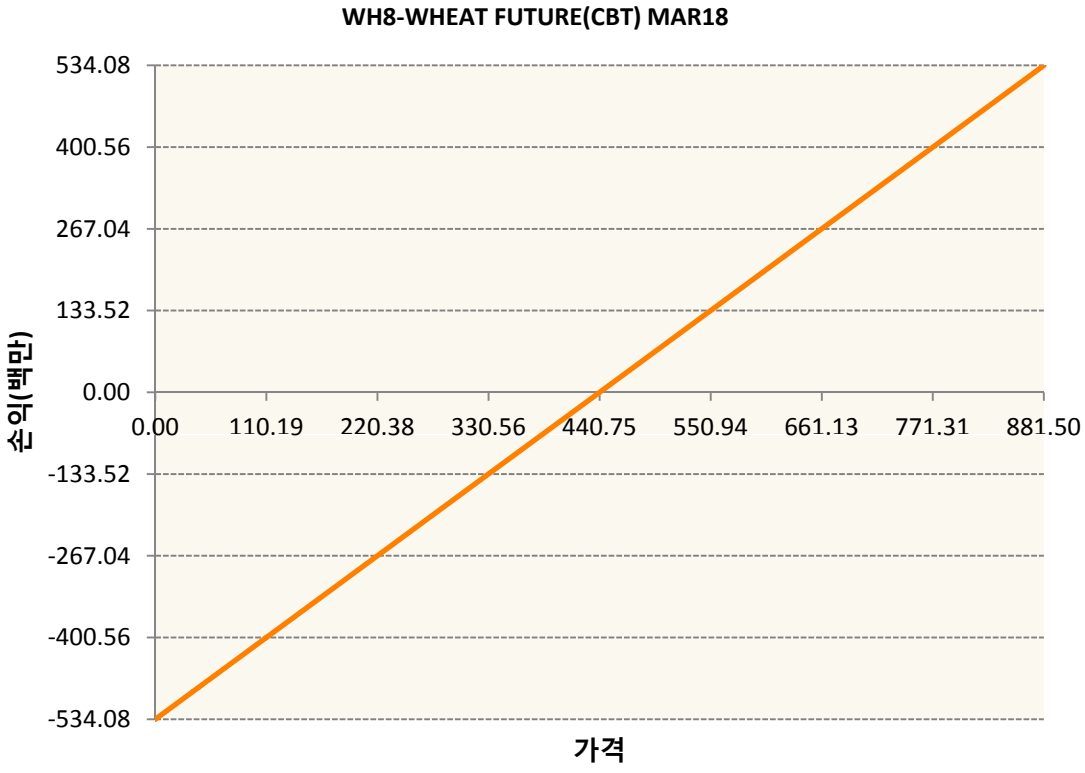
SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18



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