공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

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	2017-11-28
기준일	2017-11-27

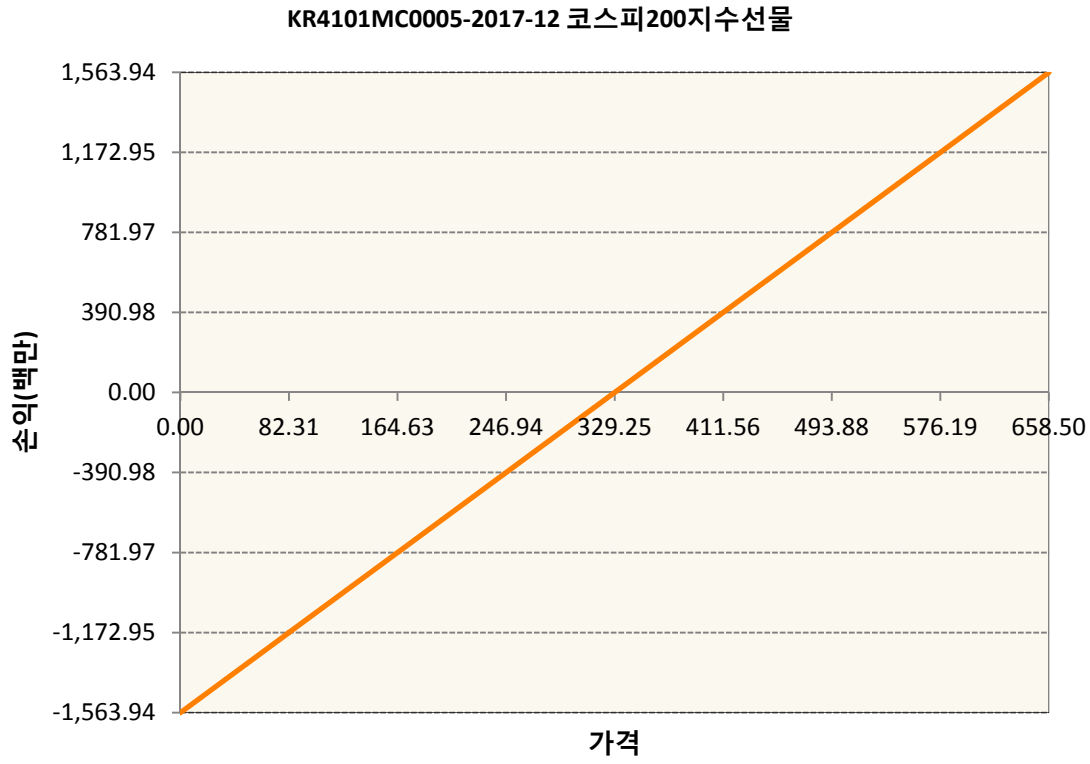
스마트인덱스모

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	1,564	0	1,564	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-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%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	125	125	125	125	125	125	125

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

72

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

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	1,076

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

345

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

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	397

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

361

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

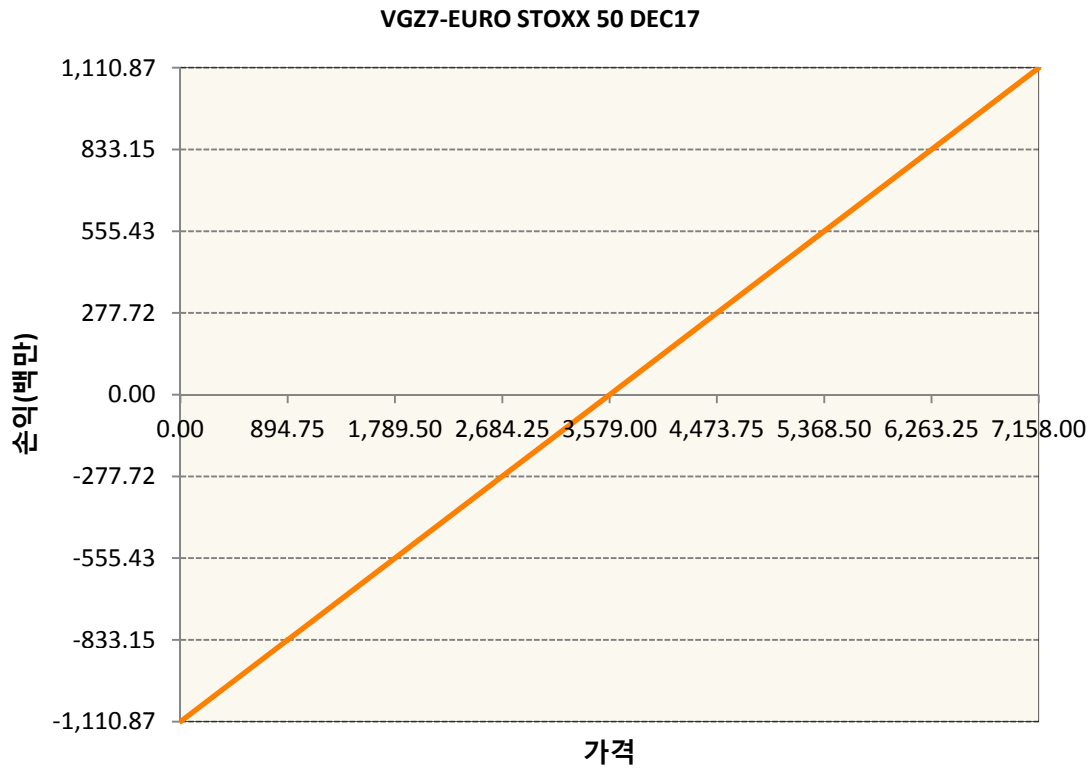
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,111	0	1,111	

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	2017-11-28
기준일	2017-11-27

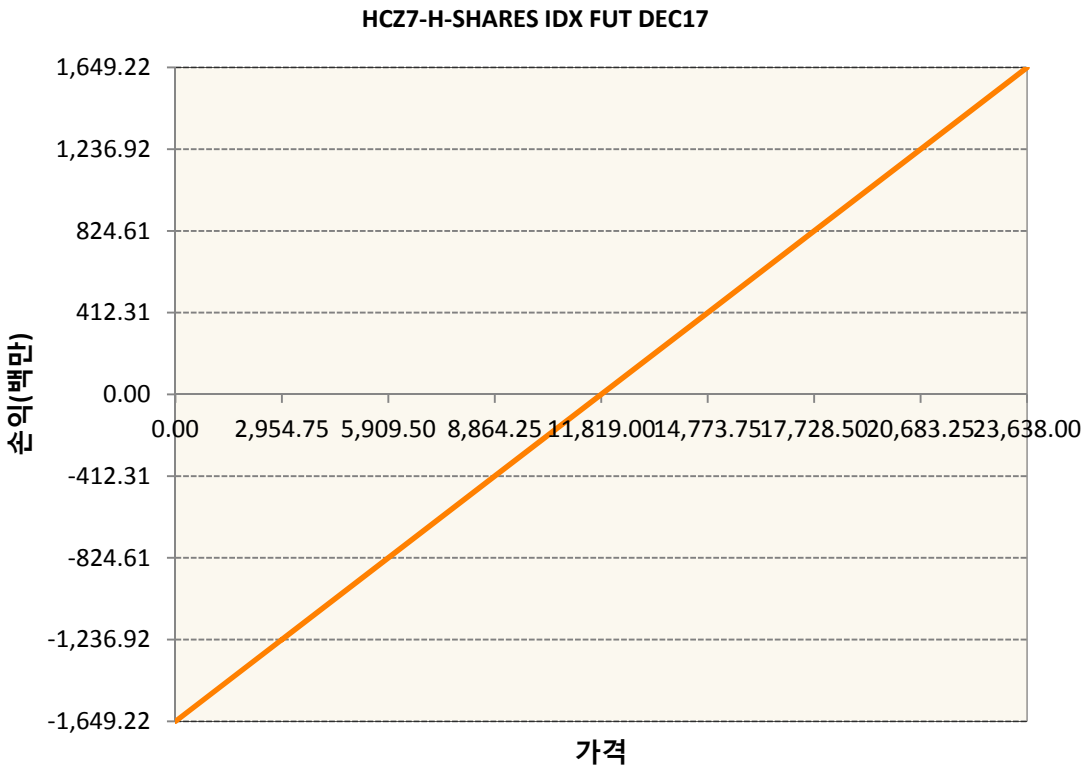
차이나인덱스모(주식-파생형)

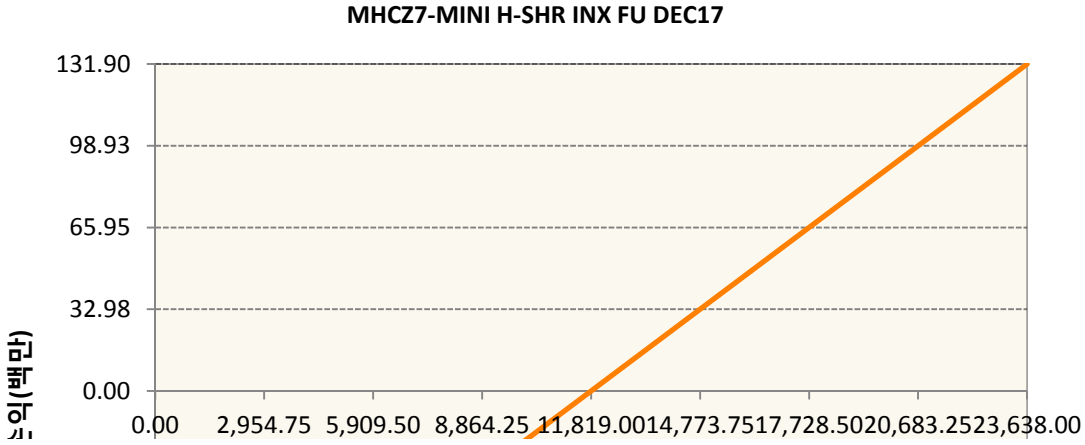
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,649	0	1,649	
누계	유가증권	선물	132	0	132	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	132
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	95

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

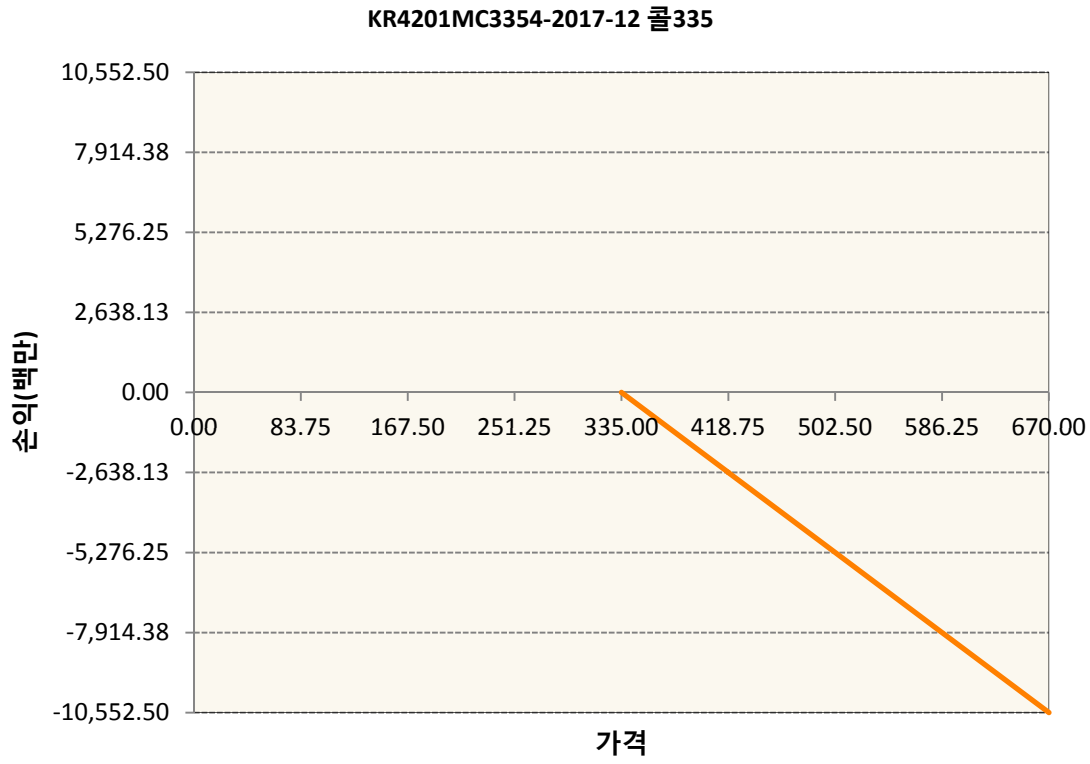
커버드콜모(주식혼합-파생형)

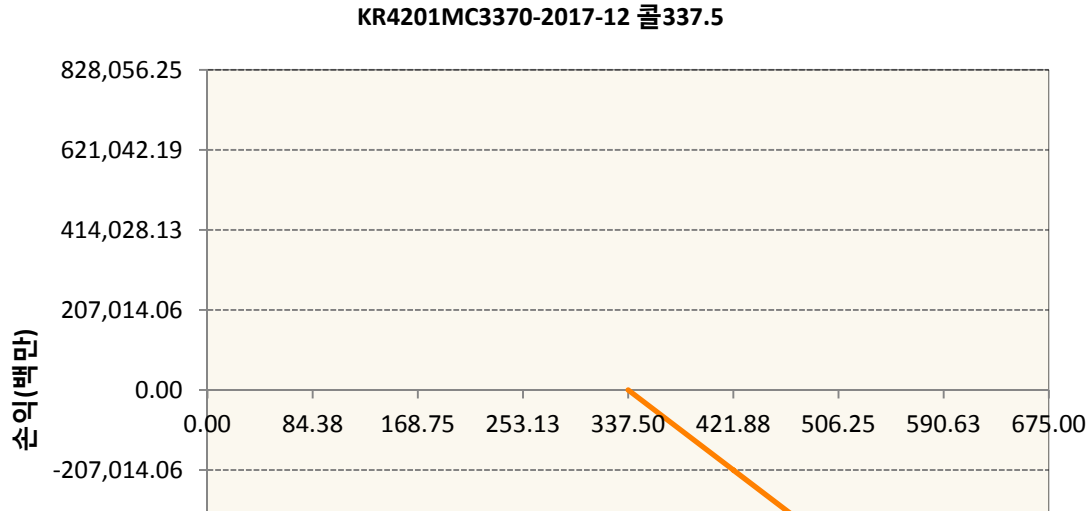
1. 계약금액

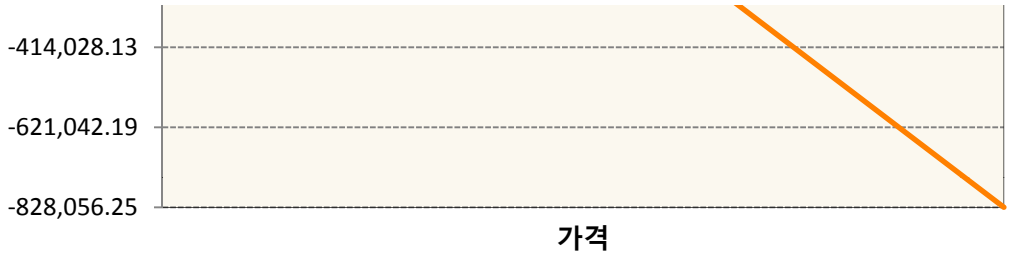
(단위:백만원)

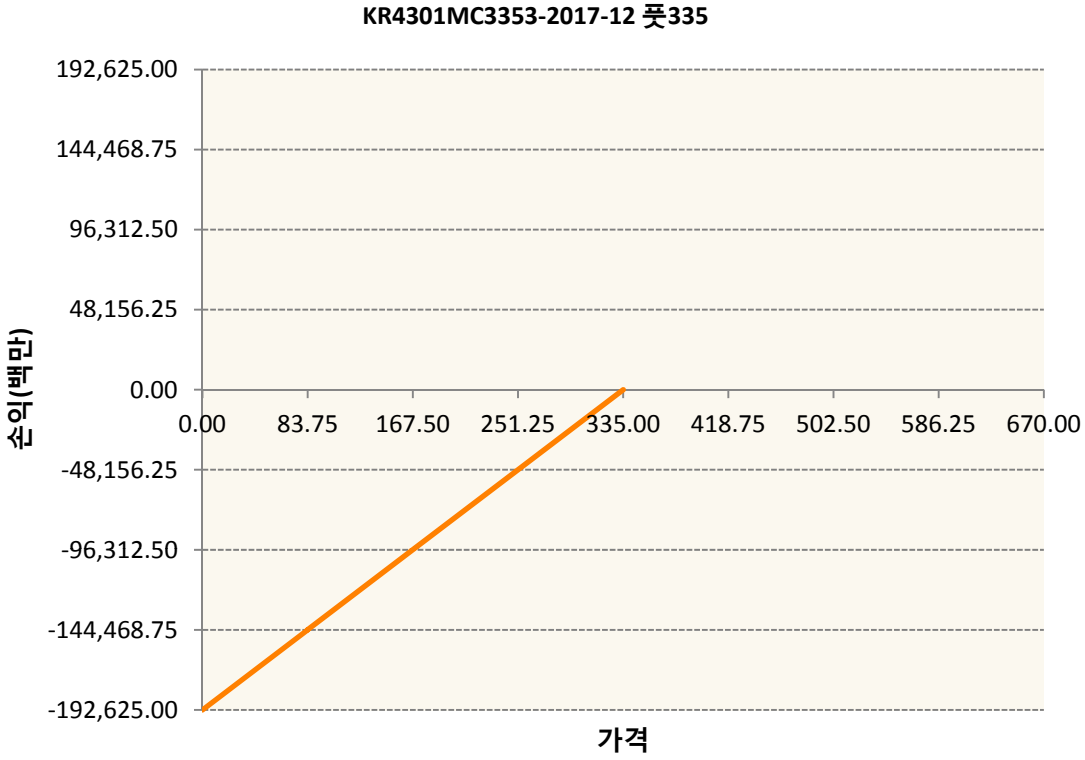
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

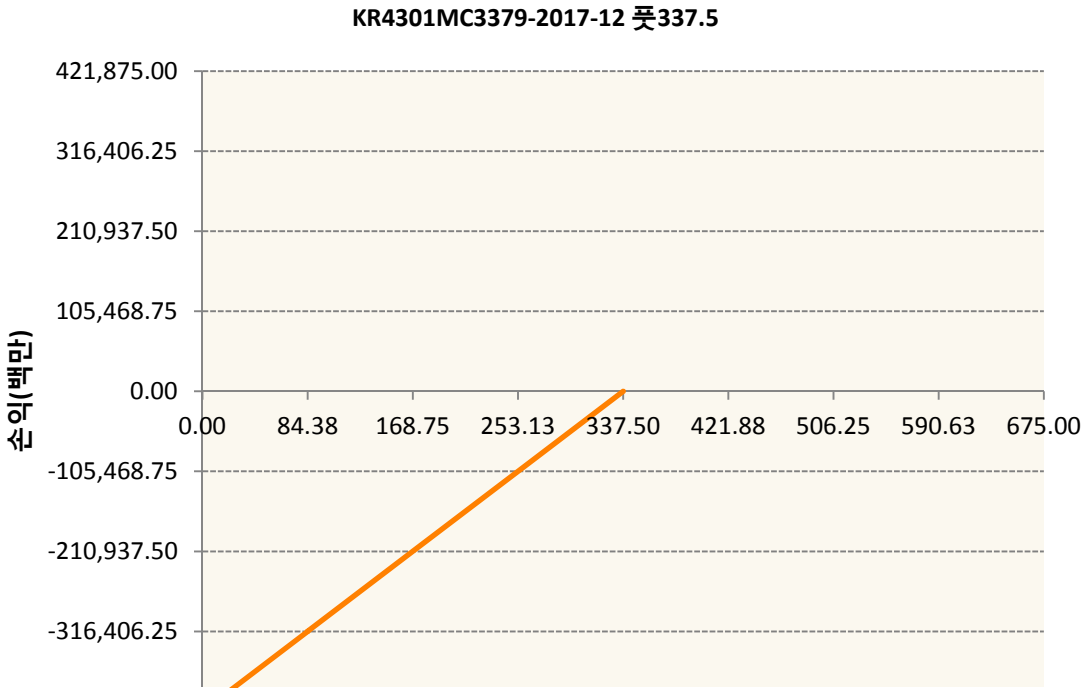
2. 만기시점의 손익구조






-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							583
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	150	148	146	144	140	135	130
-5.33%	144	139	133	126	118	109	99
-2.67%	120	109	97	84	70	56	41
0%	53	36	18	0	-18	-36	-54
2.67%	-79	-98	-116	-135	-154	-173	-191
5.33%	-278	-292	-306	-321	-337	-353	-370
8.00%	-522	-530	-538	-548	-559	-571	-583
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							42,700
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,563	9,501	9,392	9,226	8,996	8,697	8,331
-5.33%	9,280	9,015	8,655	8,203	7,664	7,044	6,351
-2.67%	7,956	7,240	6,426	5,530	4,566	3,544	2,474
0%	3,875	2,616	1,322	0	-1,343	-2,703	-4,077
2.67%	-4,905	-6,390	-7,875	-9,360	-10,846	-12,332	-13,817
5.33%	-18,999	-20,209	-21,469	-22,766	-24,093	-25,445	-26,816
8.00%	-37,189	-37,890	-38,698	-39,596	-40,569	-41,608	-42,700
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,351
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,349	-14,349	-14,349	-14,349	-14,349	-14,350	-14,351
-5.33%	-9,300	-9,300	-9,301	-9,304	-9,309	-9,317	-9,330
-2.67%	-4,267	-4,284	-4,311	-4,346	-4,391	-4,445	-4,508
0%	380	260	133	0	-137	-278	-422
2.67%	3,178	3,030	2,879	2,725	2,570	2,412	2,254
5.33%	3,852	3,814	3,765	3,705	3,635	3,555	3,467
8.00%	3,900	3,898	3,893	3,884	3,871	3,851	3,825
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							31,875
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,873	-31,873	-31,873	-31,873	-31,873	-31,874	-31,875
-5.33%	-20,896	-20,896	-20,897	-20,899	-20,905	-20,914	-20,929
-2.67%	-9,930	-9,947	-9,976	-10,020	-10,081	-10,159	-10,255
0%	620	436	228	0	-244	-503	-772
2.67%	8,175	7,814	7,453	7,091	6,729	6,367	6,004

5.33%	10,653	10,511	10,341	10,149	9,936	9,705	9,460
8.00%	10,916	10,903	10,879	10,842	10,788	10,718	10,630

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

96,362

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

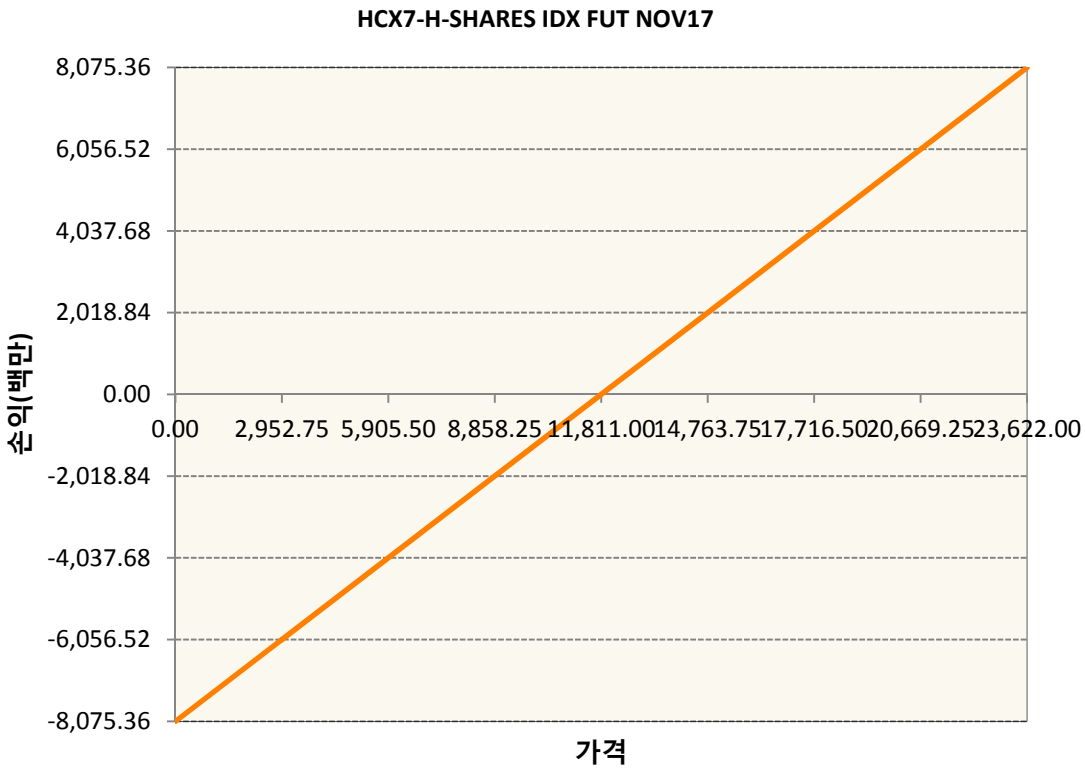
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

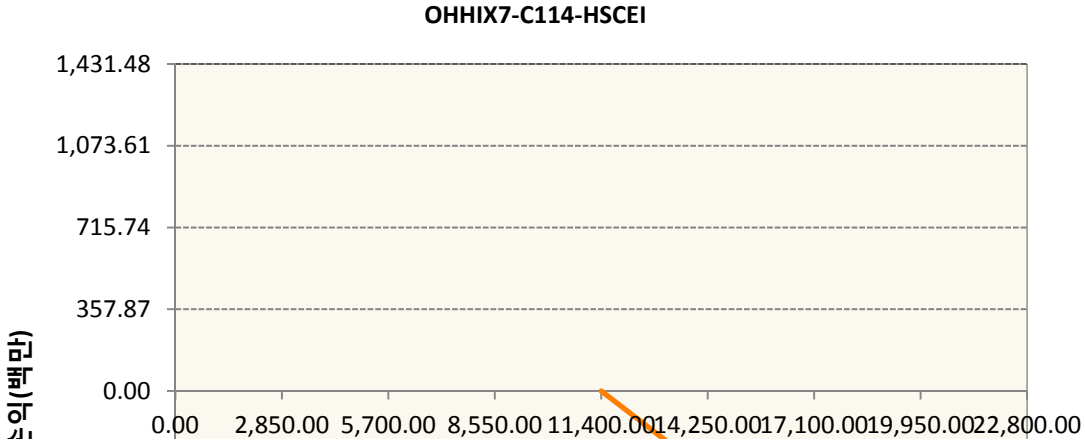
1. 계약금액

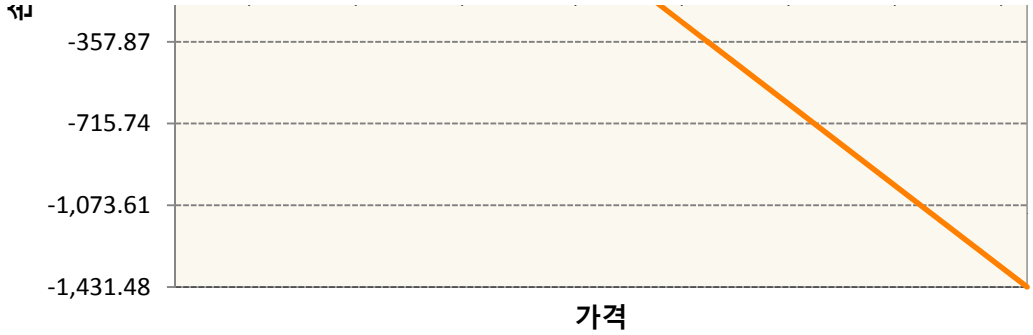
(단위:백만원)

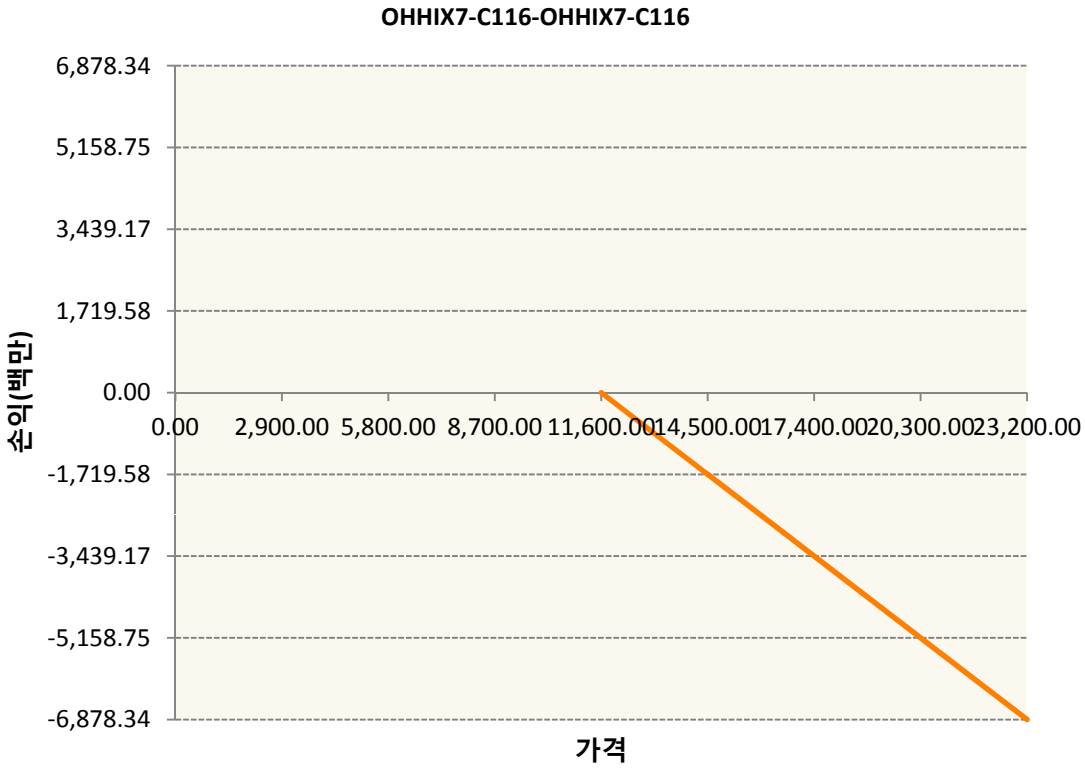
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,075	0	8,075	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,620	-16,620	장내

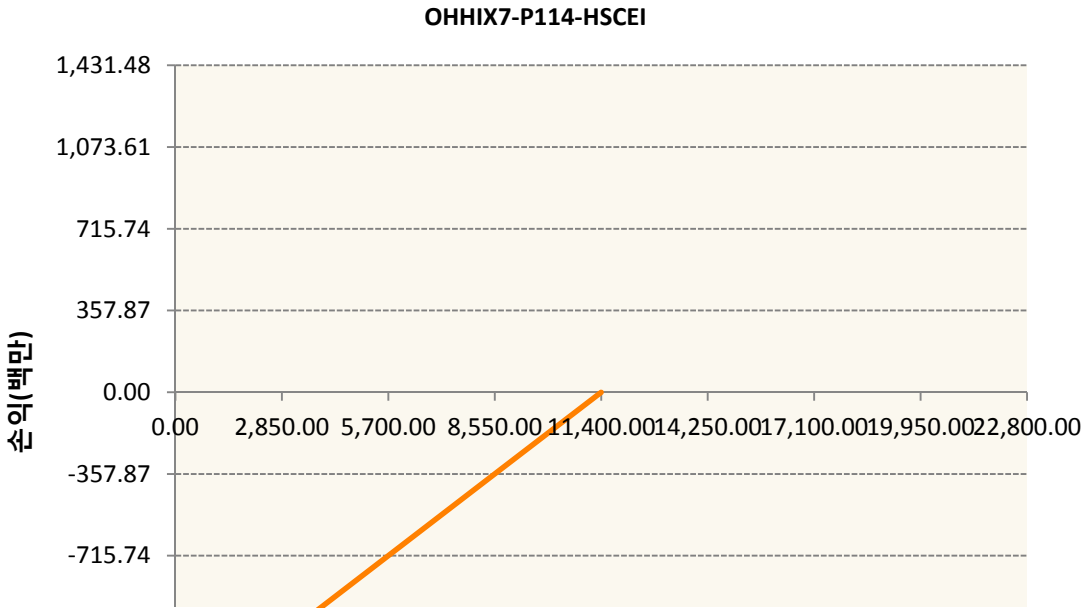
2. 만기시점의 손익구조

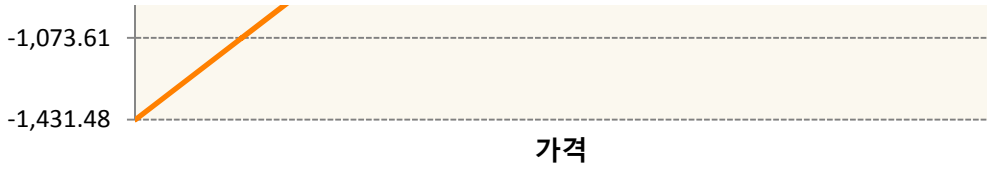


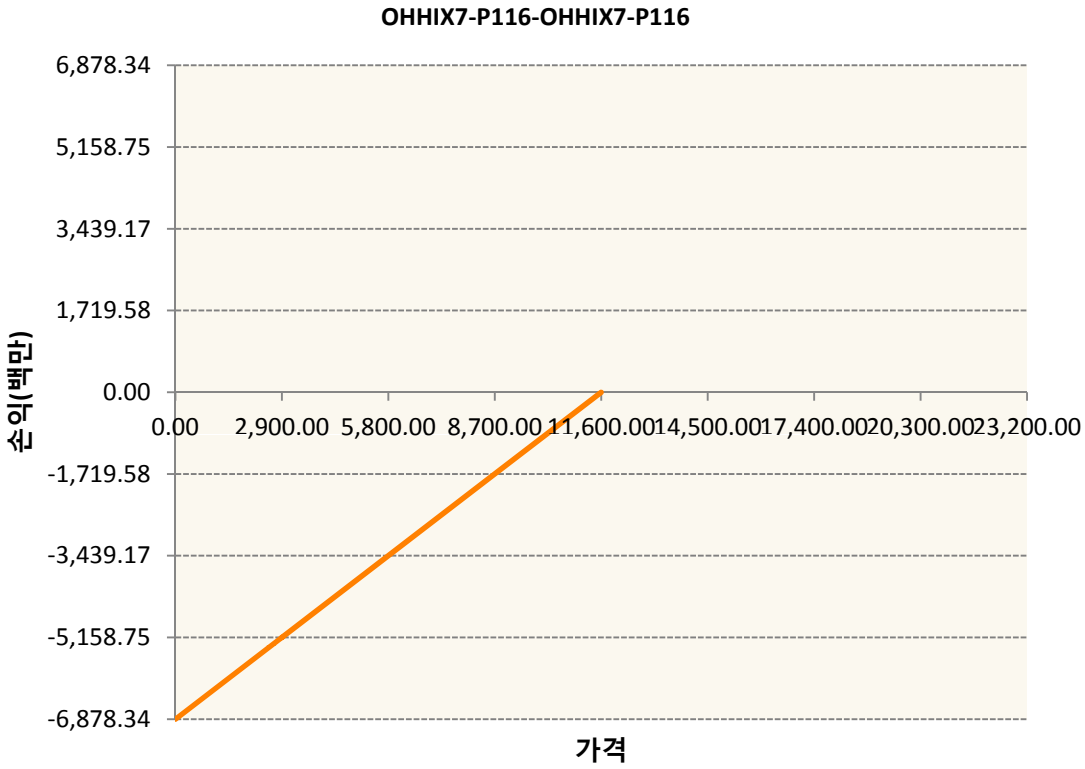



-357.87
-715.74
-1,073.61
-1,431.48
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,878.34
5,158.75
3,439.17
1,719.58
0.00
-1,719.58
-3,439.17
-5,158.75
-6,878.34
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
1,431.48
1,073.61
715.74
357.87
0.00
-357.87
-715.74
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	646
OHHIX7-C11	HSCEI	115
OHHIX7-C11	OHHIX7-C116	550
OHHIX7-P11	HSCEI	115
OHHIX7-P11	OHHIX7-P116	550

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,597

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

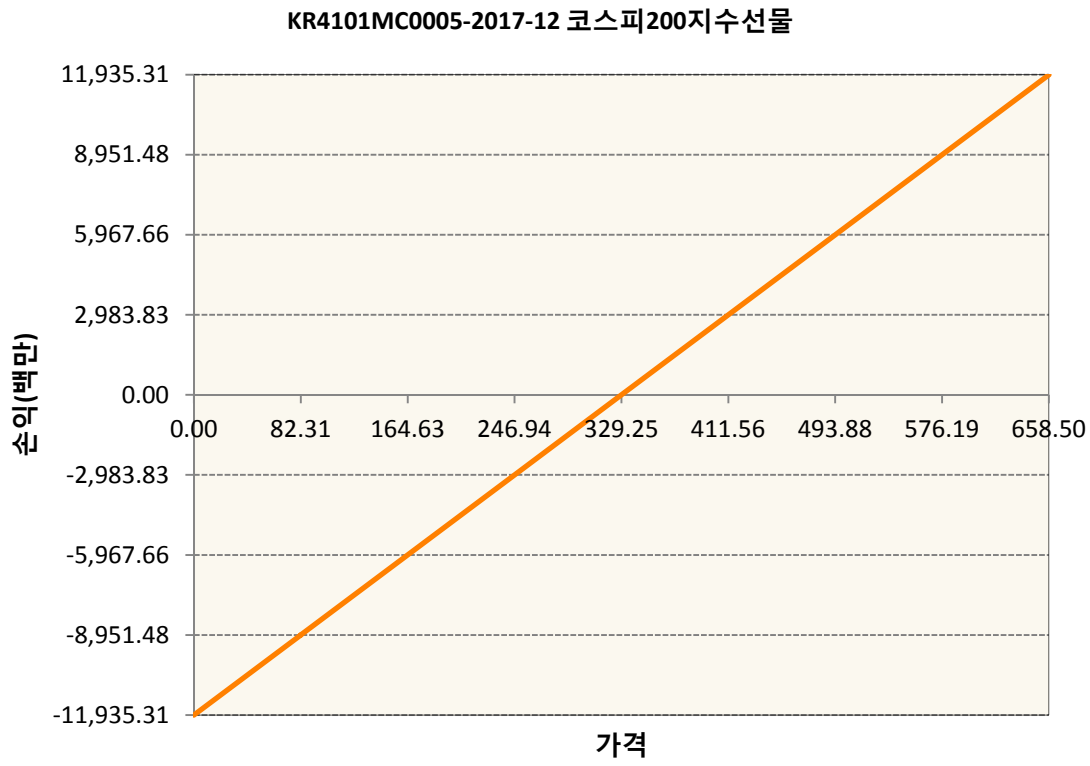
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

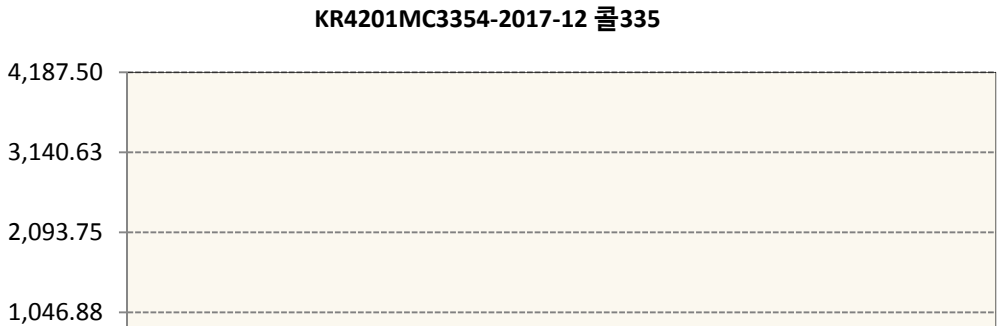
1. 계약금액

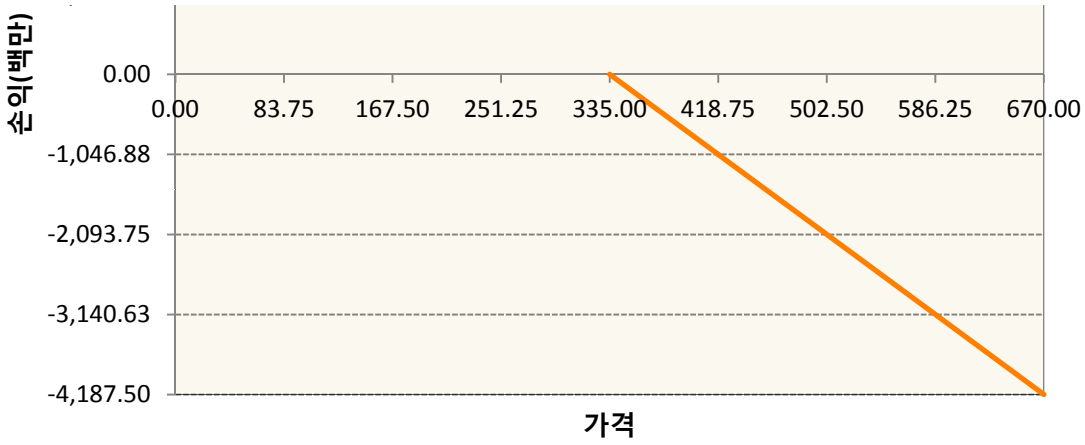
(단위:백만원)

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	11,935	0	11,935	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

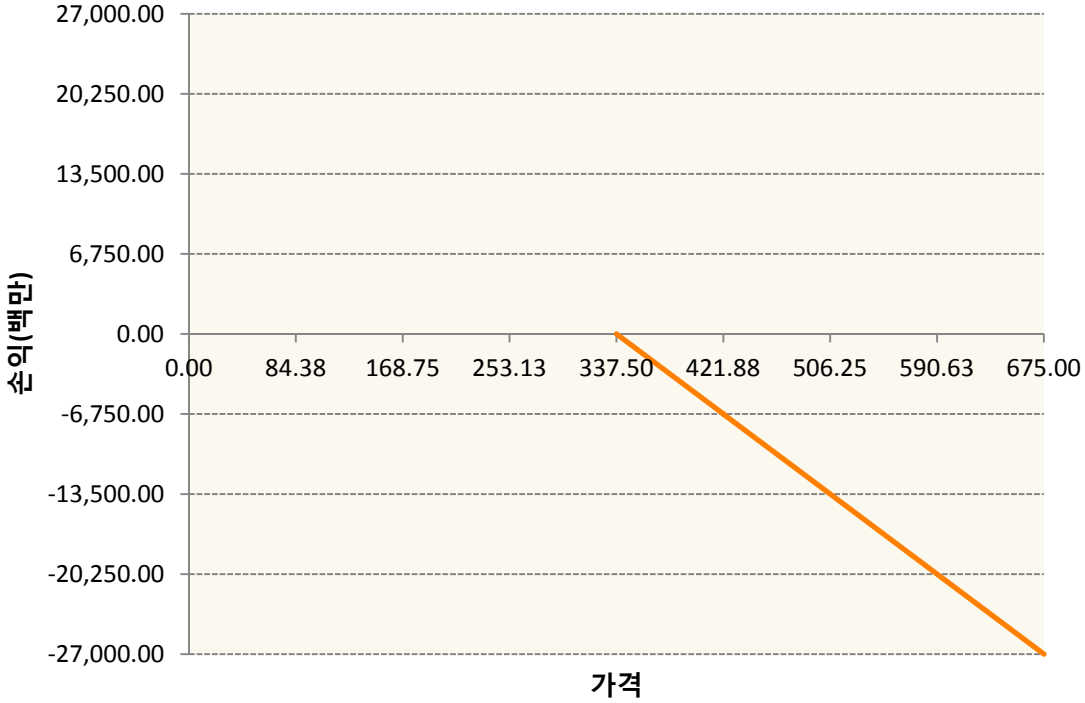
2. 만기시점의 손익구조



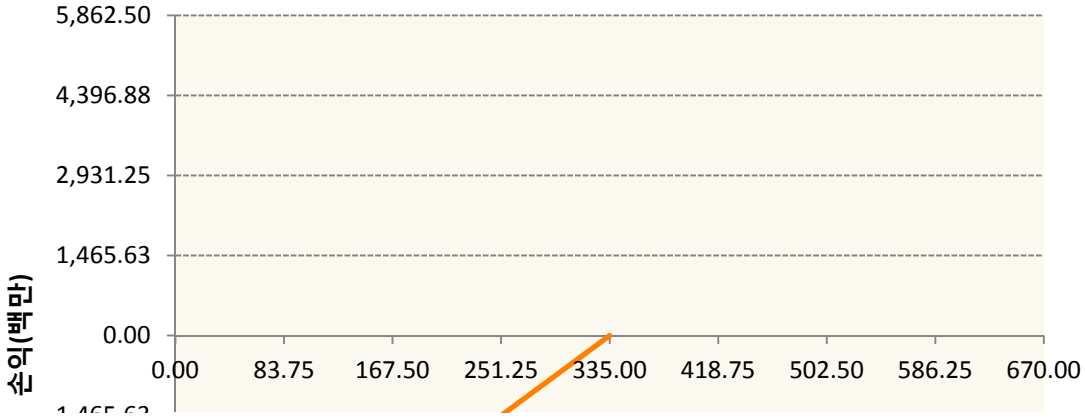




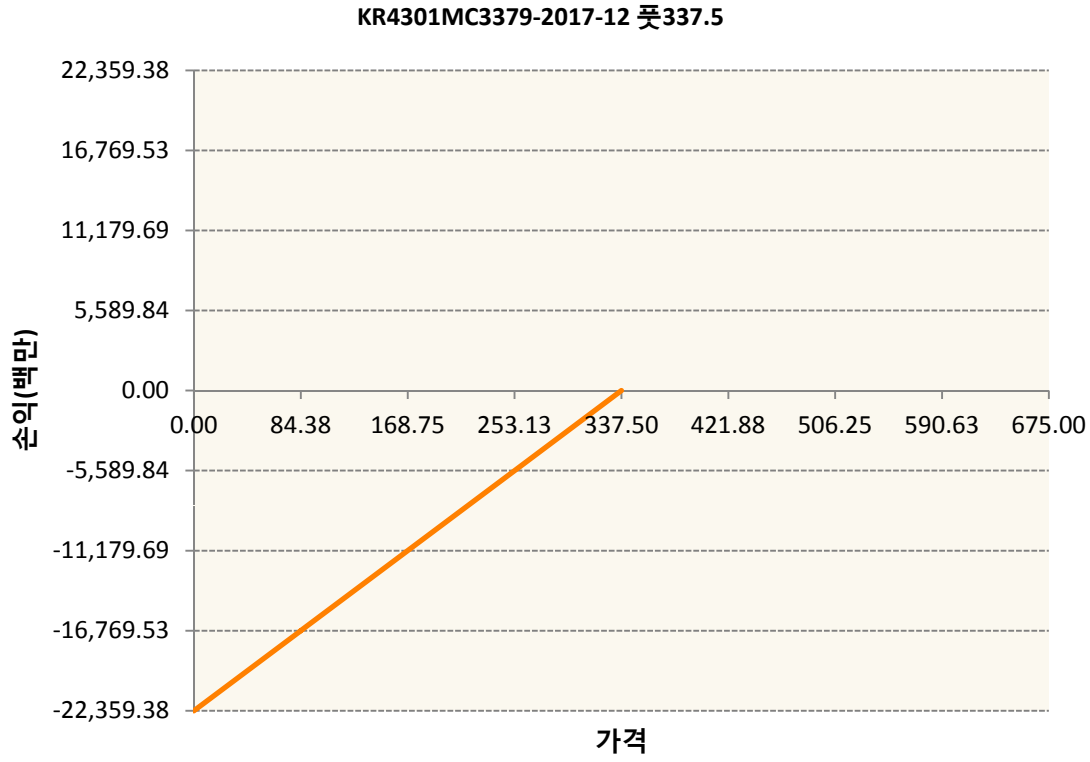
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



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					956

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-956	-956	-956	-956	-956	-956	-956
-5.33%	-637	-637	-637	-637	-637	-637	-637
-2.67%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	319	319	319	319	319	319	319
5.33%	637	637	637	637	637	637	637
8.00%	956	956	956	956	956	956	956
	KR4201MC3	2017-12 콜335					231

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	58	57	55	54	51
-5.33%	57	55	53	50	47	43	39
-2.67%	48	43	38	33	28	22	16
0%	21	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	-31	-39	-46	-54	-61	-68	-76
5.33%	-110	-116	-121	-127	-134	-140	-147
8.00%	-207	-210	-214	-217	-222	-226	-231
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,392

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	312	310	306	301	293	284	272
-5.33%	303	294	282	267	250	230	207
-2.67%	259	236	210	180	149	116	81
0%	126	85	43	0	-44	-88	-133
2.67%	-160	-208	-257	-305	-354	-402	-451
5.33%	-619	-659	-700	-742	-786	-830	-874
8.00%	-1,213	-1,235	-1,262	-1,291	-1,323	-1,357	-1,392
	KR4301MC3	2017-12 풋335					437

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-437	-437	-437	-437	-437	-437	-437
-5.33%	-283	-283	-283	-283	-283	-284	-284

-2.67%	-130	-130	-131	-132	-134	-135	-137
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	97	92	88	83	78	73	69
5.33%	117	116	115	113	111	108	106
8.00%	119	119	118	118	118	117	116
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,689
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689
-5.33%	-1,107	-1,107	-1,108	-1,108	-1,108	-1,108	-1,109
-2.67%	-526	-527	-529	-531	-534	-538	-544
0%	33	23	12	0	-13	-27	-41
2.67%	433	414	395	376	357	337	318
5.33%	565	557	548	538	527	514	501
8.00%	579	578	577	575	572	568	563

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

9,400

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

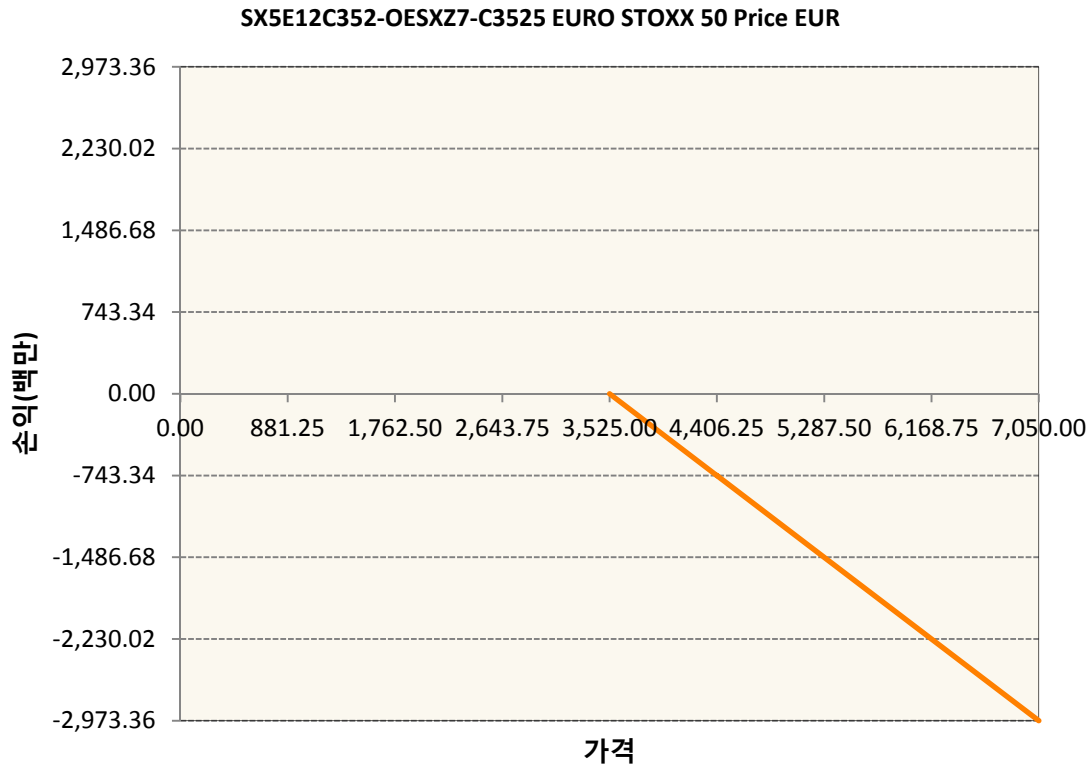
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

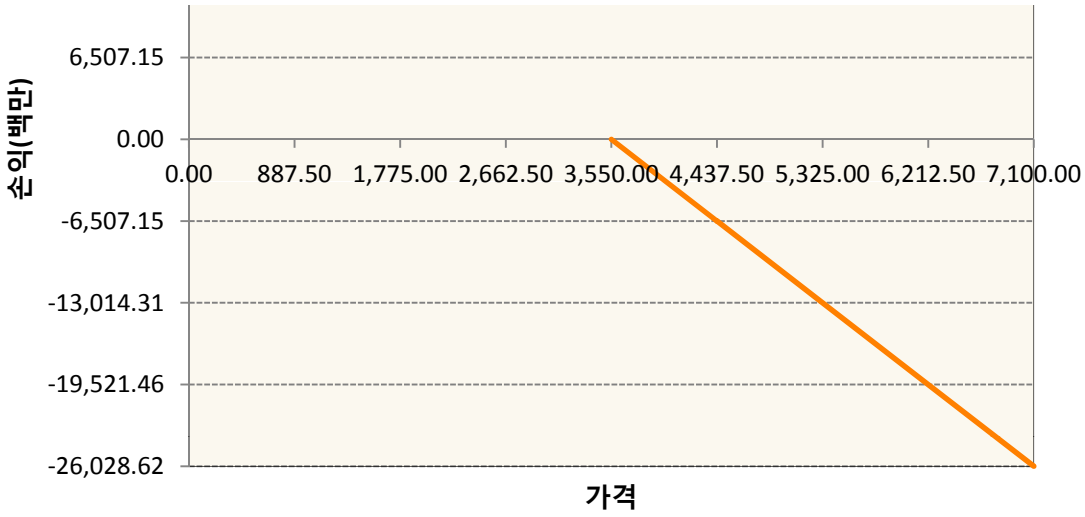
(단위:백만원)

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	20,960	0	20,960	
누계	유가증권	스왑	97,325	0	97,325	장외
누계	유가증권	옵션	0	58,004	-58,004	장내
누계	지수	스왑	51,907	0	51,907	장외

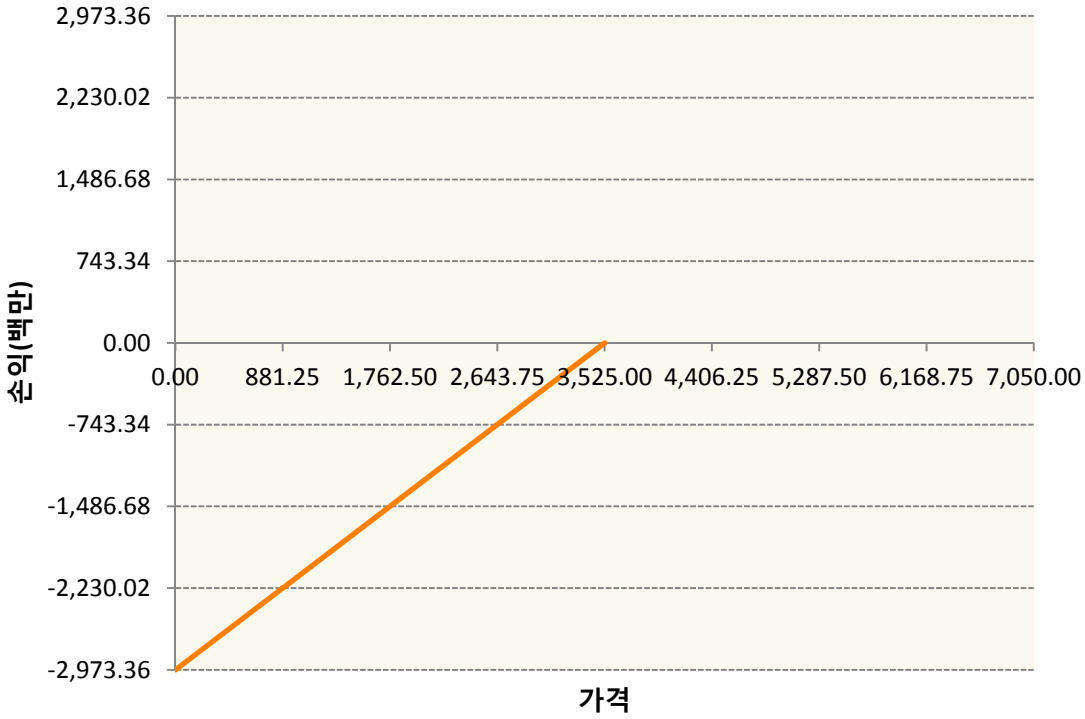
2. 만기시점의 손익구조



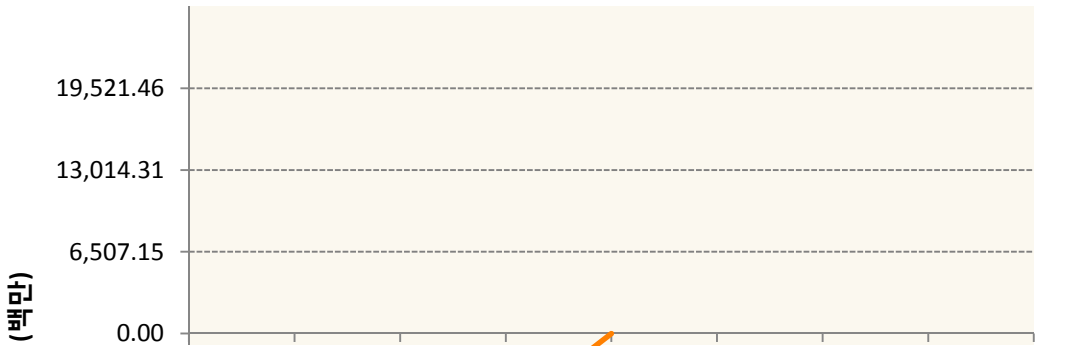


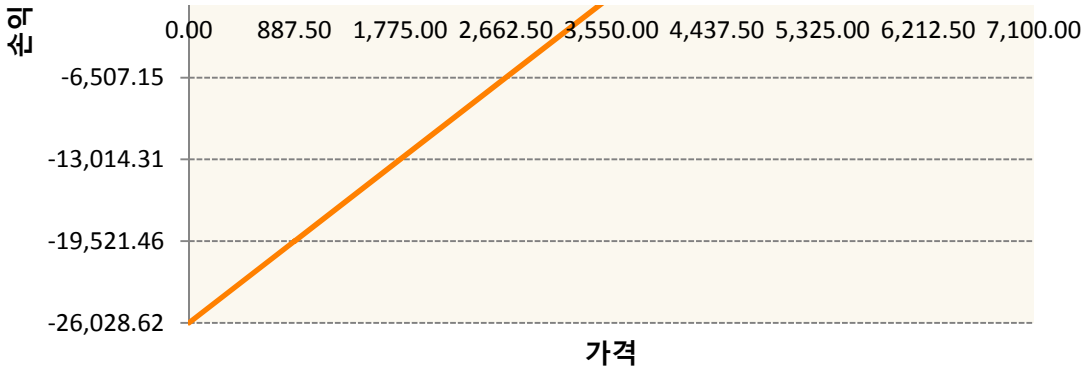


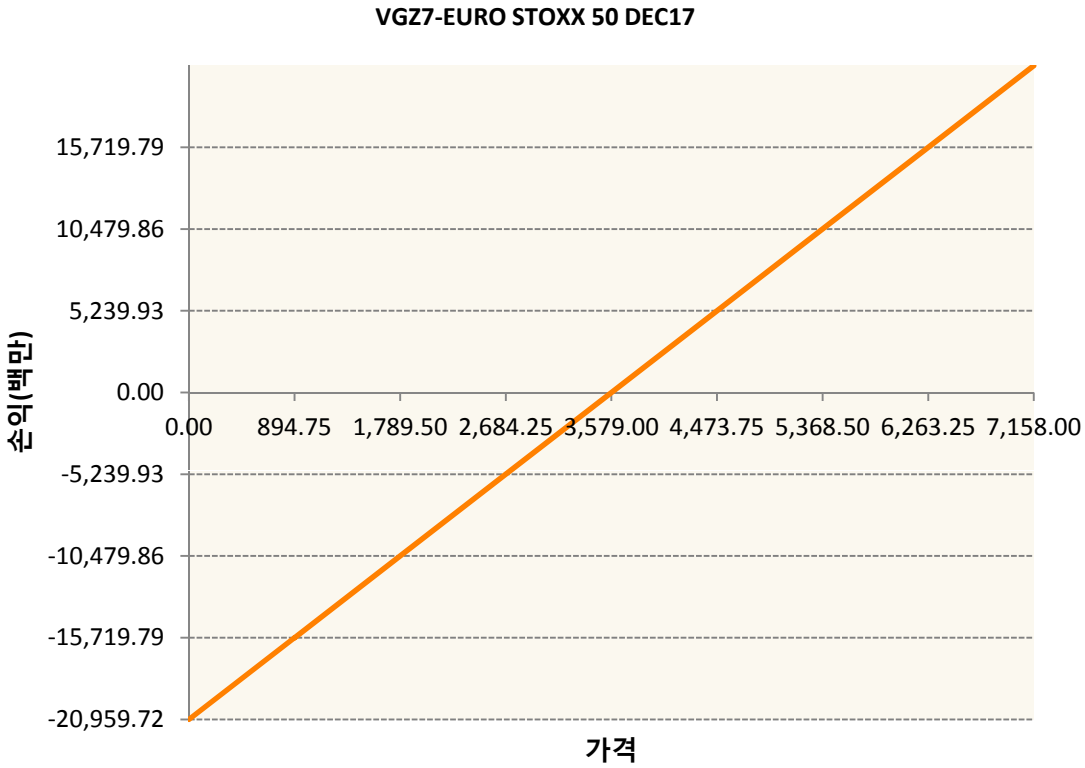
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	29
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	12
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	238
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,082
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	238
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,082
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,677

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

3,710

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

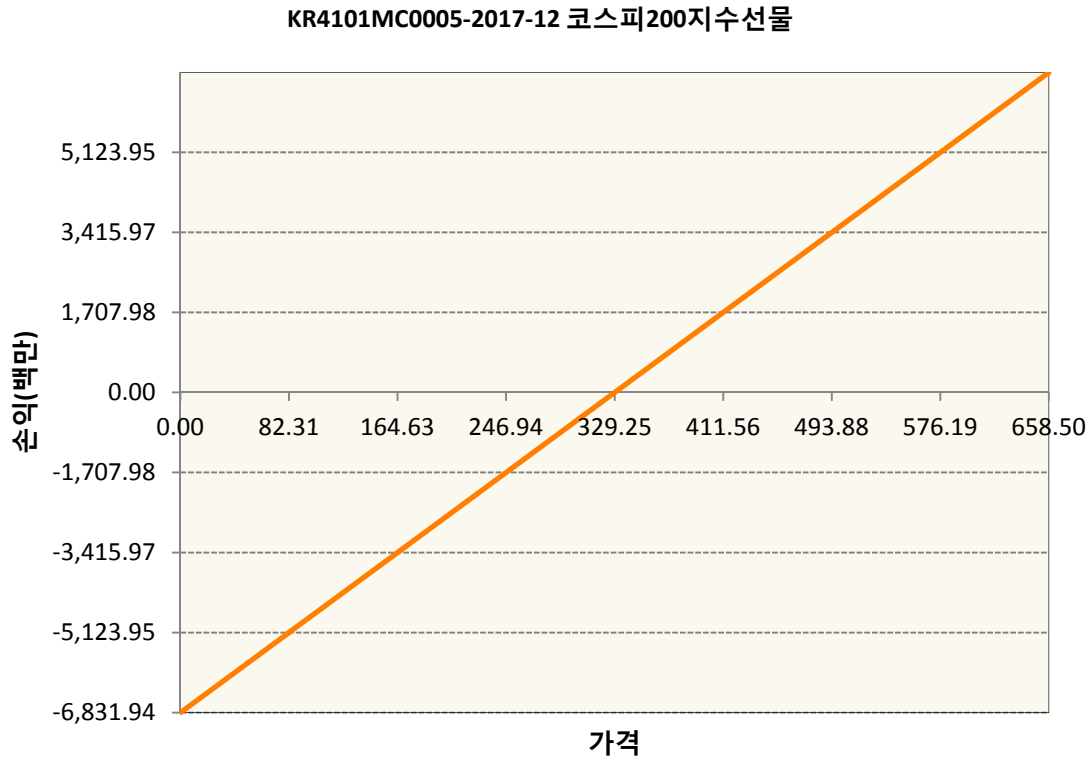
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,832	0	6,832	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						547
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-547	-547	-547	-547	-547	-547	-547
-5.33%	-365	-365	-365	-365	-365	-365	-365
-2.67%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	182	182	182	182	182	182	182
5.33%	365	365	365	365	365	365	365
8.00%	547	547	547	547	547	547	547

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

316

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

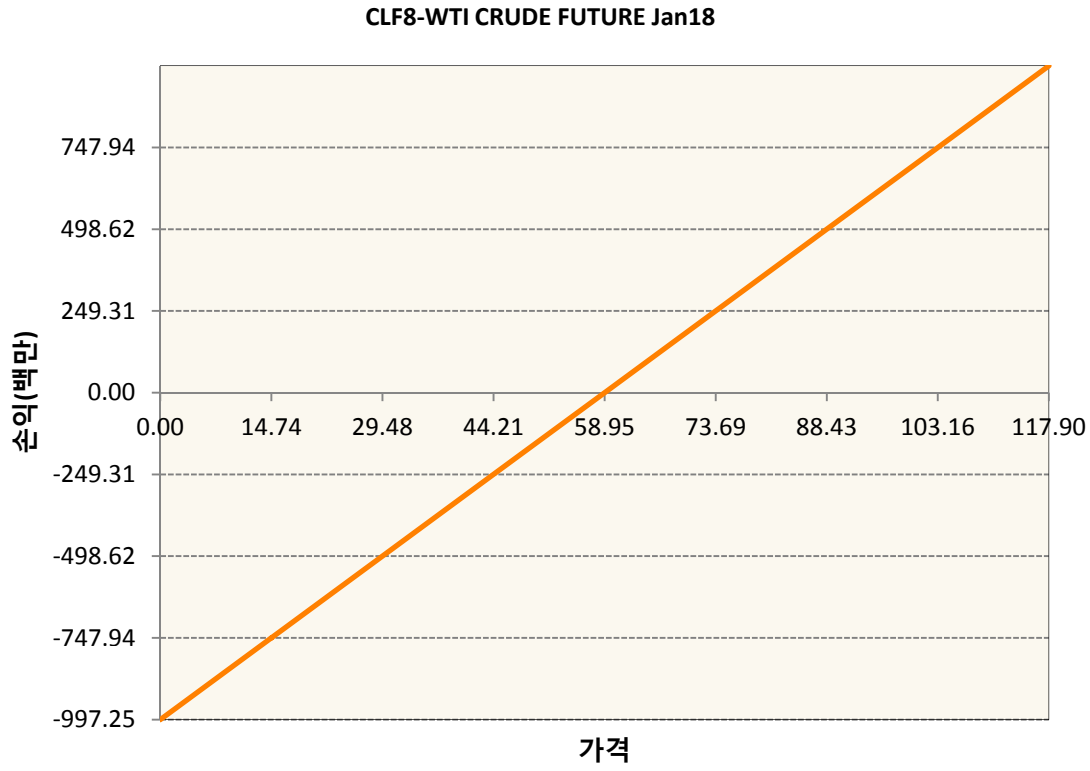
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

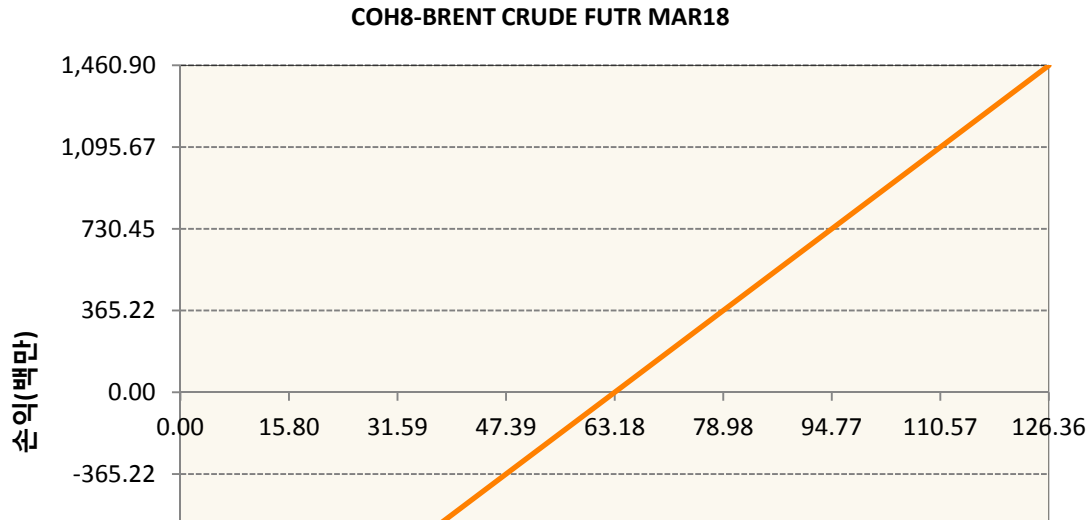
1. 계약금액

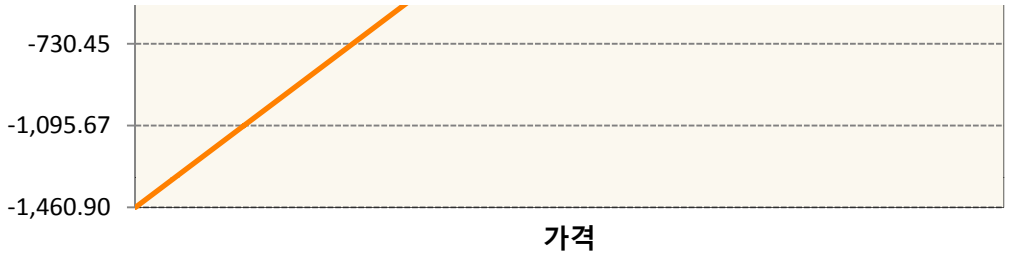
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,187	871	4,315	

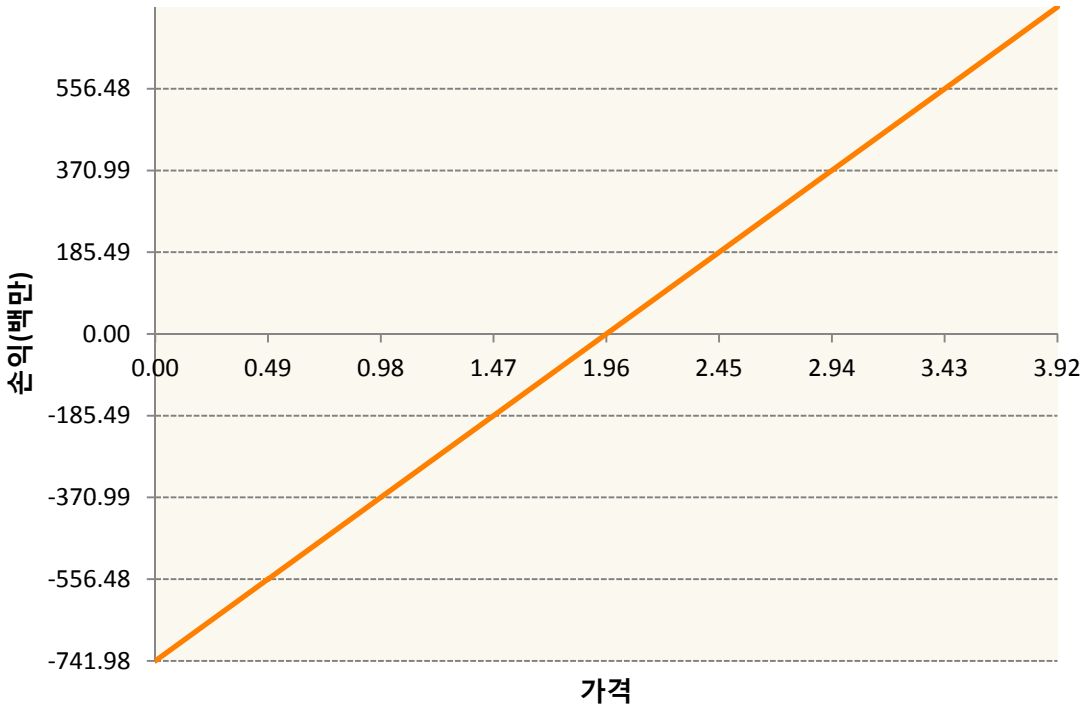
2. 만기시점의 손익구조



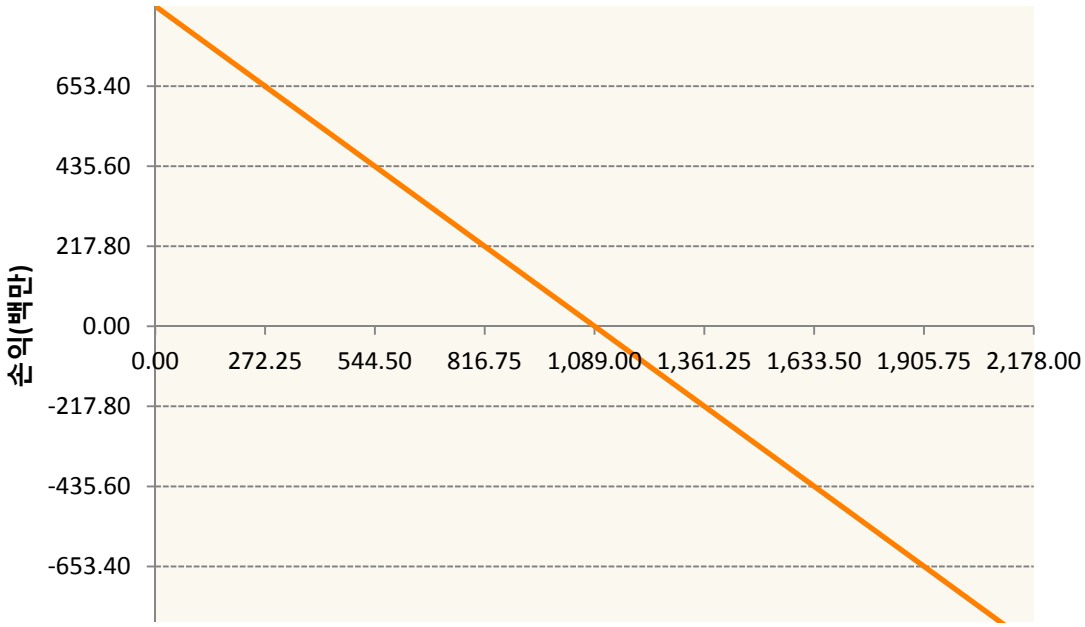


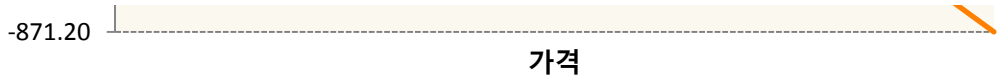


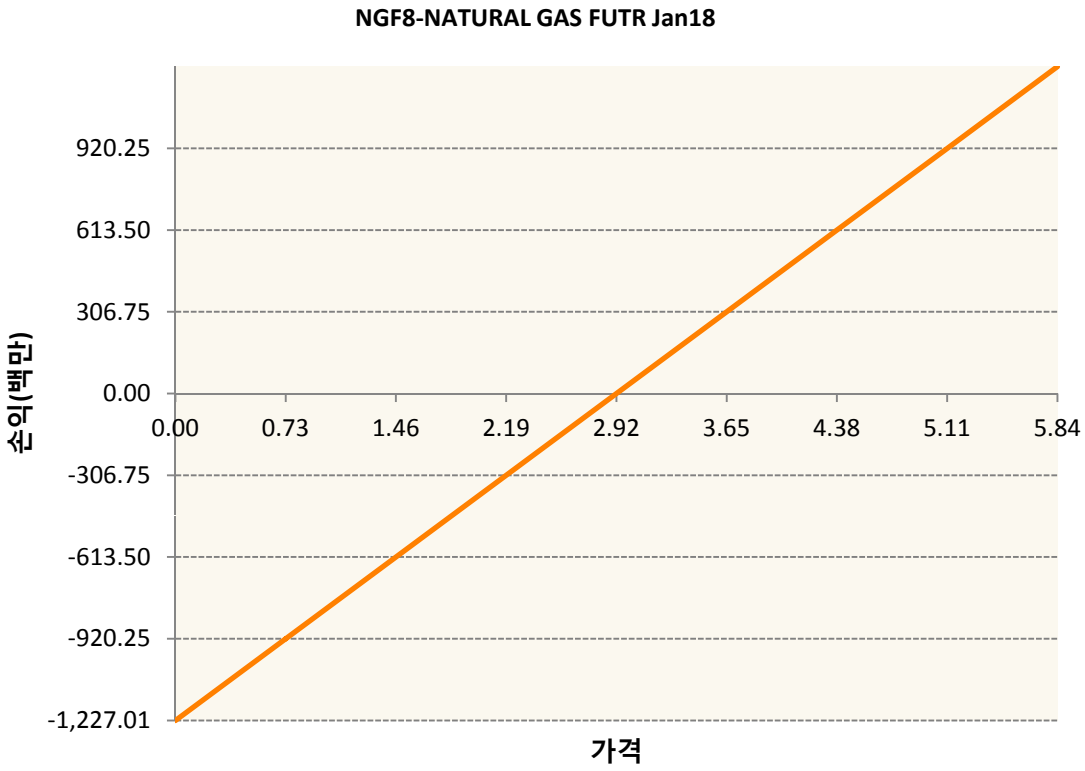
HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18

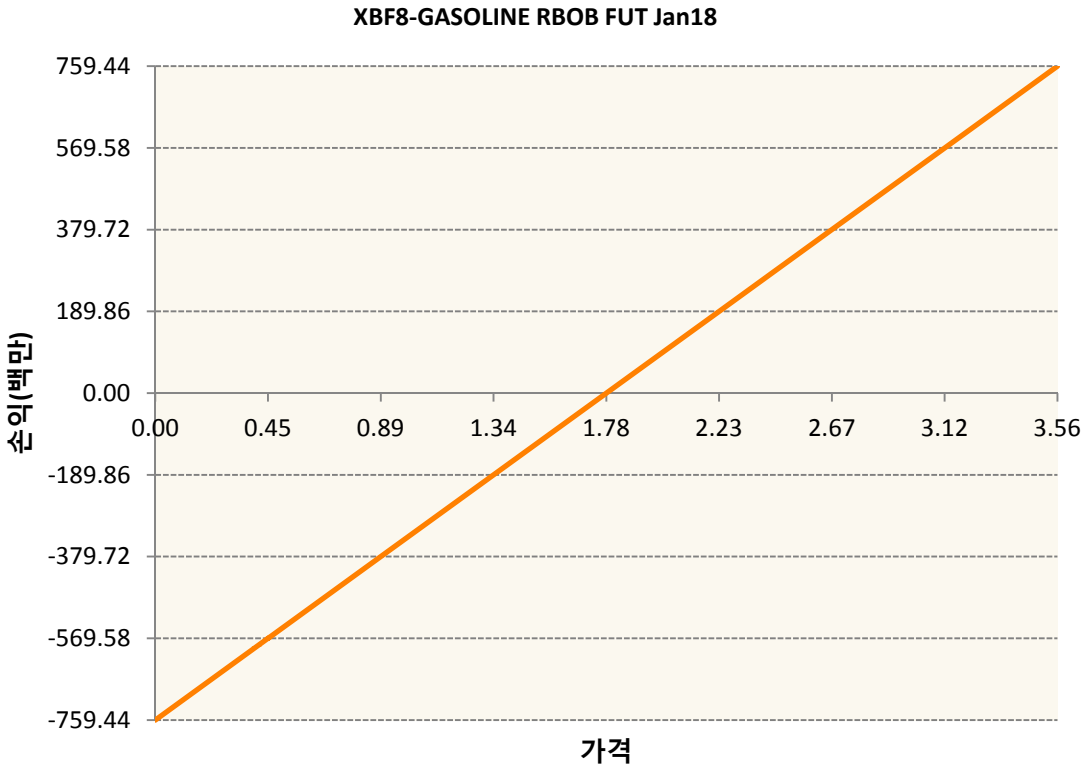


KR4175MC0006-2017-12 달러선물




-871.20
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
920.25
613.50
306.75
0.00
-306.75
-613.50
-920.25
-1,227.01
0.00
0.73
1.46
2.19
2.92
3.65
4.38
5.11
5.84
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
759.44
569.58
379.72
189.86
0.00
-189.86
-379.72
-569.58
-759.44
0.00
0.45
0.89
1.34
1.78
2.23
2.67
3.12
3.56
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	80
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	117
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	98
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	61

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

717

공시일	2017-11-28
기준일	2017-11-27

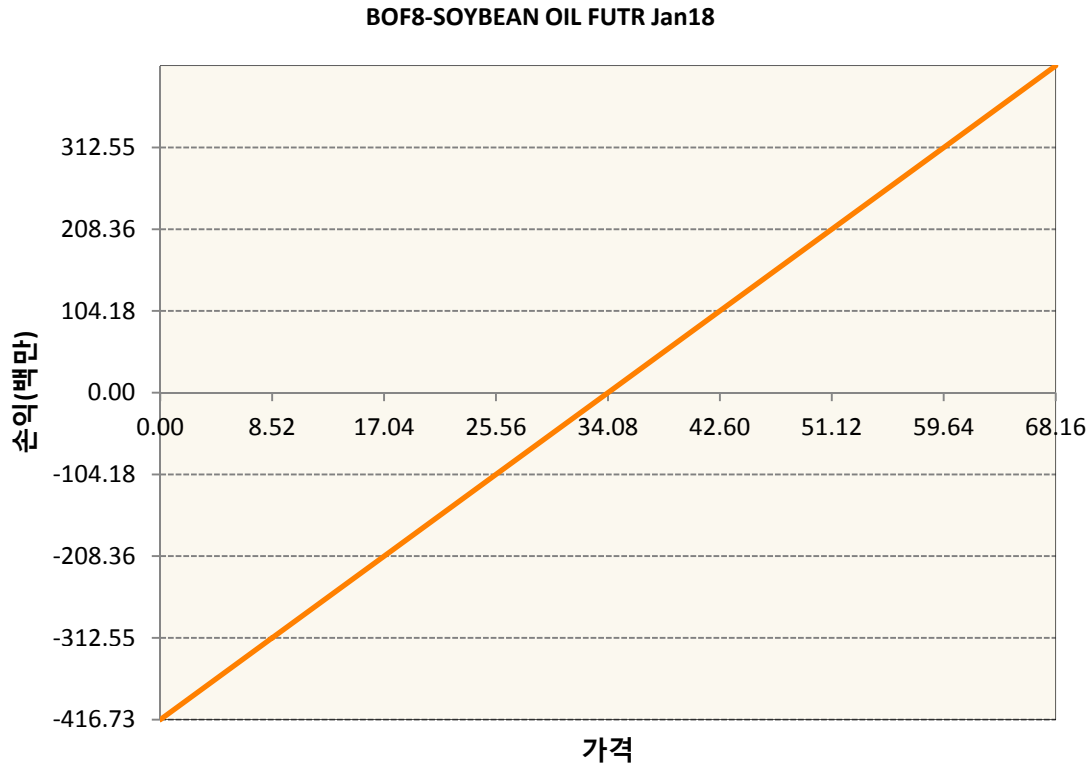
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

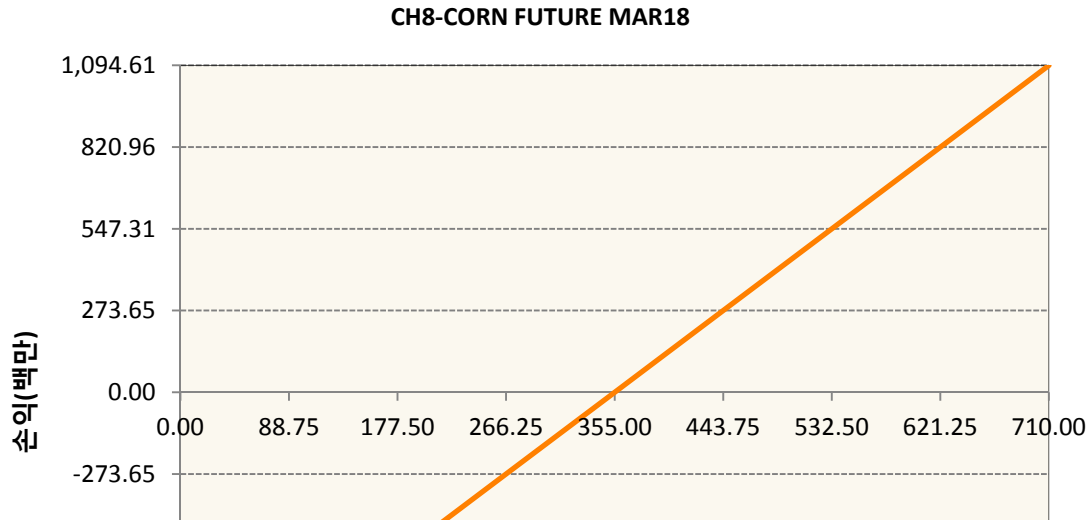
1. 계약금액

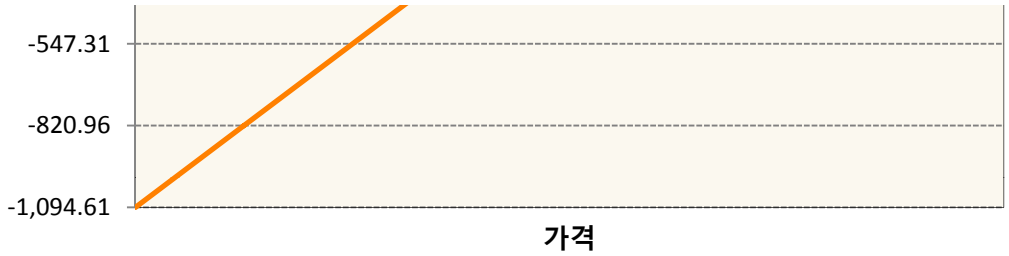
(단위:백만원)

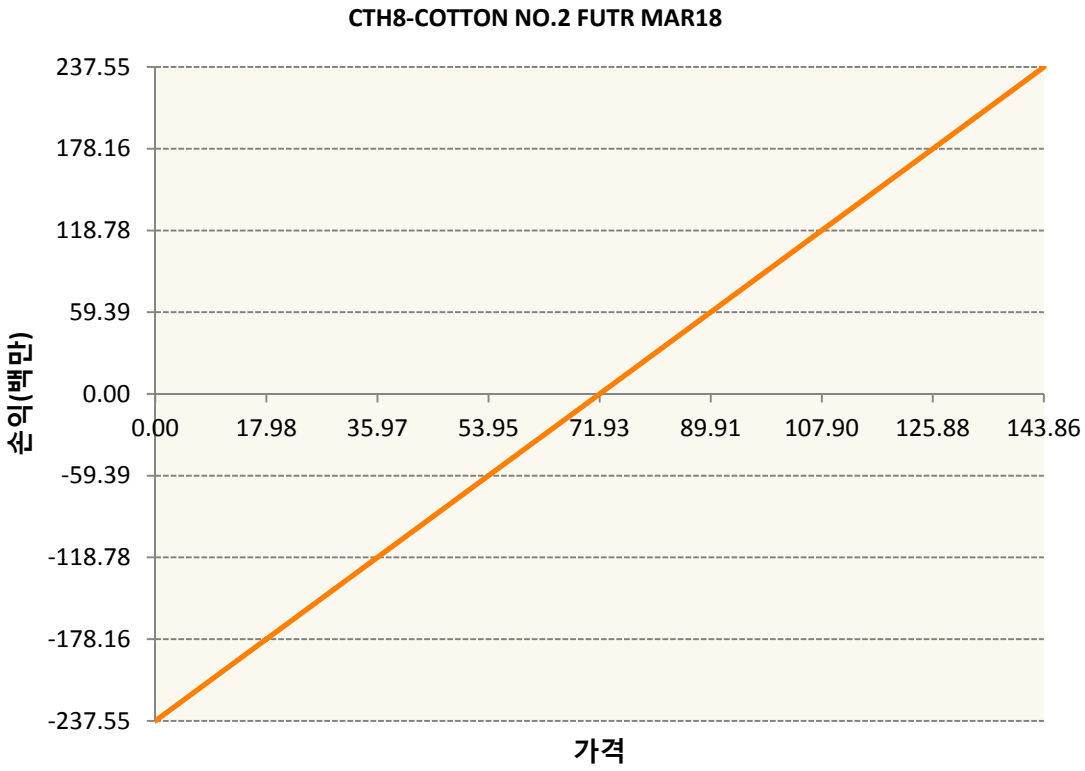
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,551	327	4,225	

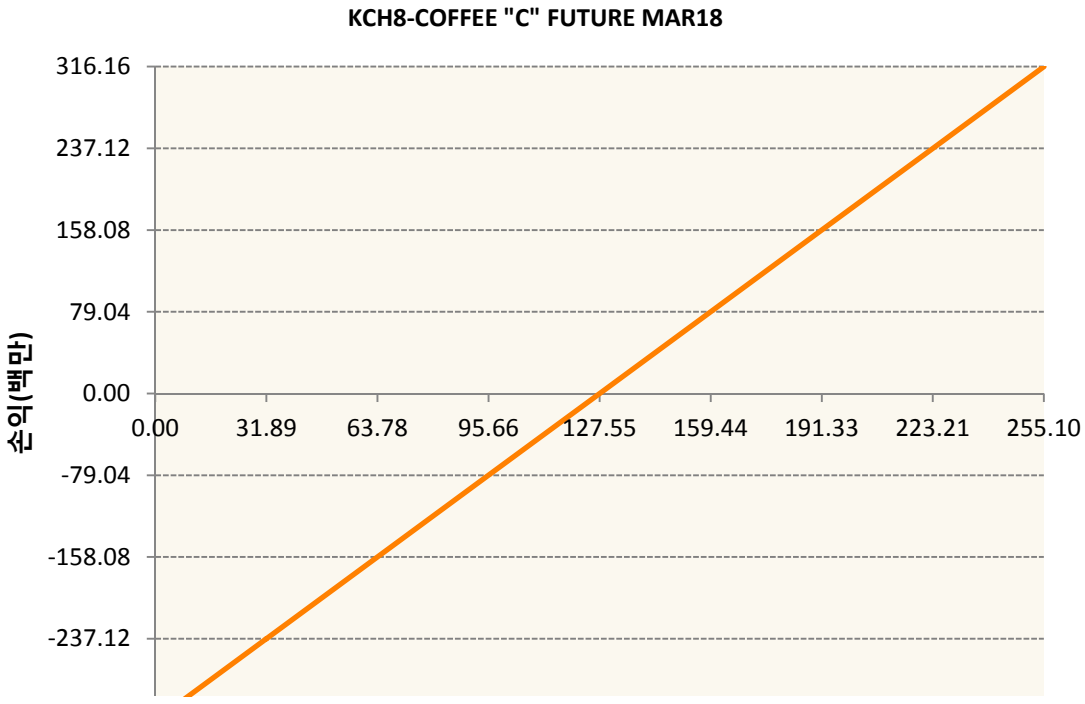
2. 만기시점의 손익구조

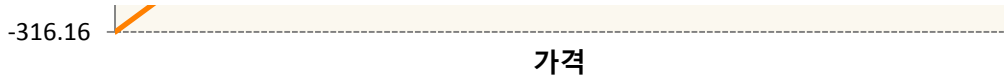


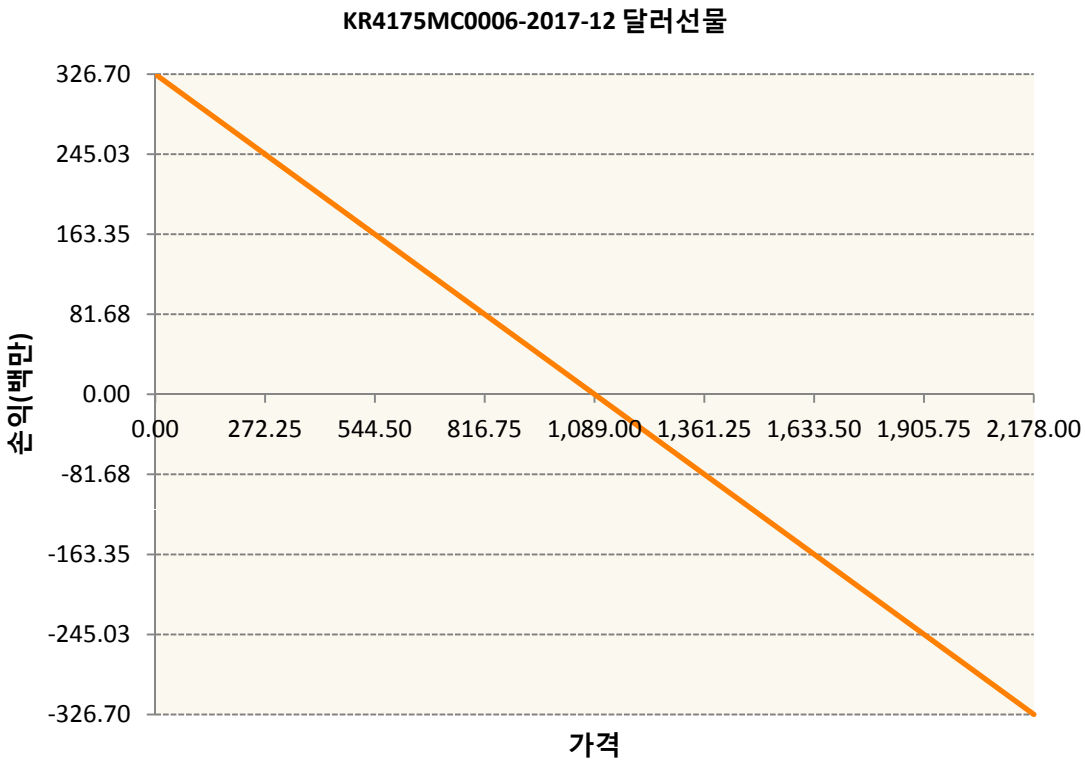


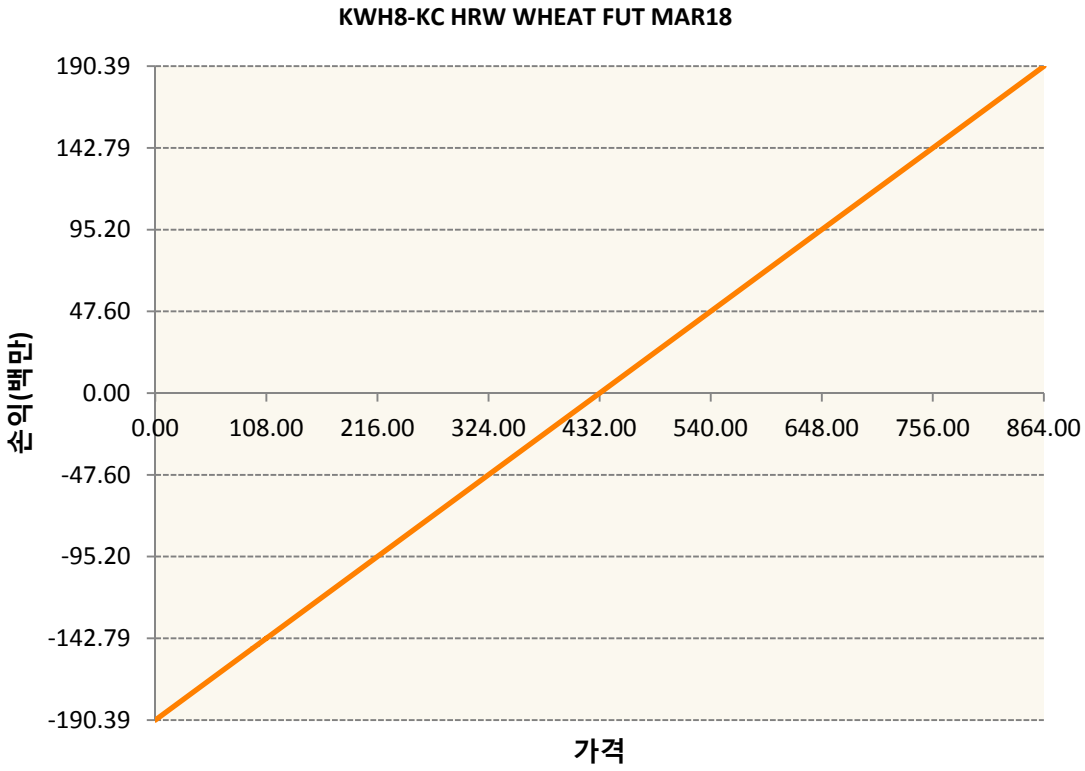

-547.31
-820.96
-1,094.61
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
237.55
178.16
118.78
59.39
0.00
-59.39
-118.78
-178.16
-237.55
0.00
17.98
35.97
53.95
71.93
89.91
107.90
125.88
143.86
손익(백만)
가격

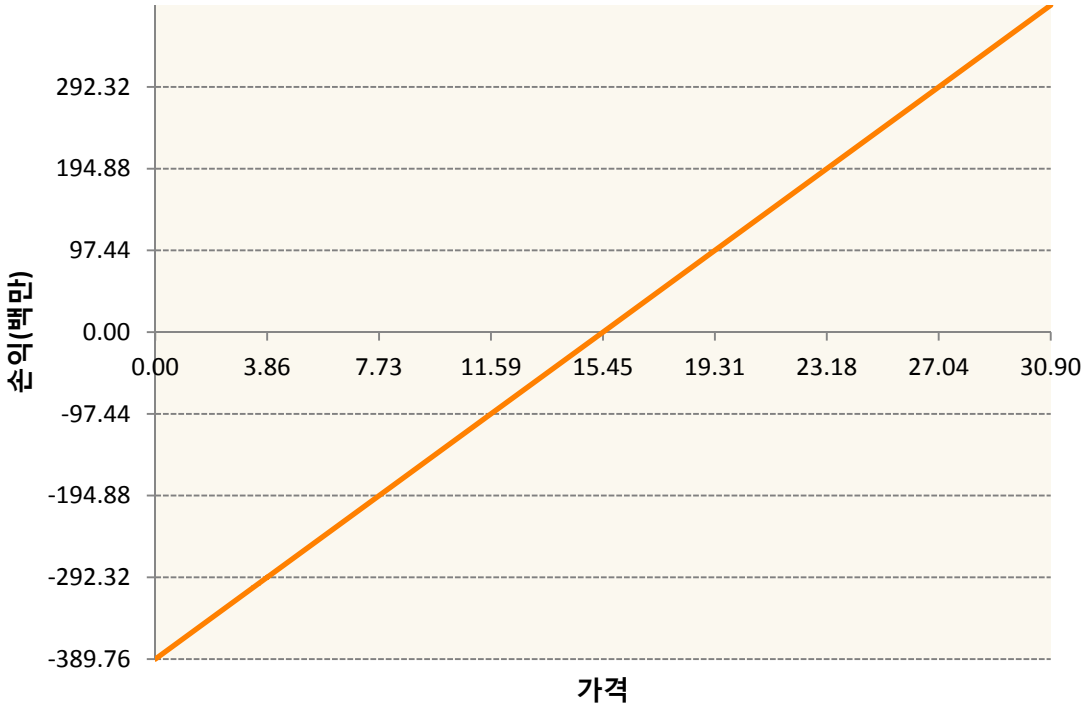

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
316.16
237.12
158.08
79.04
0.00
-79.04
-158.08
-237.12
0.00
31.89
63.78
95.66
127.55
159.44
191.33
223.21
255.10
손익(백만)


-316.16
가격

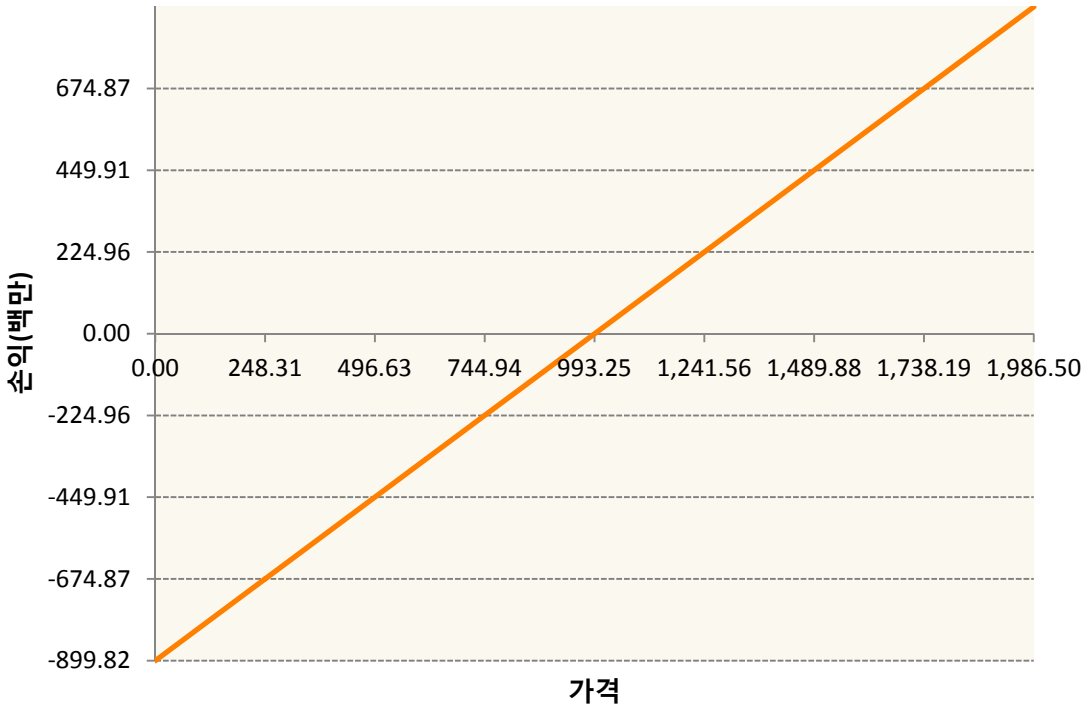

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
326.70
245.03
163.35
81.68
0.00
-81.68
-163.35
-245.03
-326.70
0.00
272.25
544.50
816.75
1,089.00
1,361.25
1,633.50
1,905.75
2,178.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
190.39
142.79
95.20
47.60
0.00
-47.60
-95.20
-142.79
-190.39
0.00
108.00
216.00
324.00
432.00
540.00
648.00
756.00
864.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

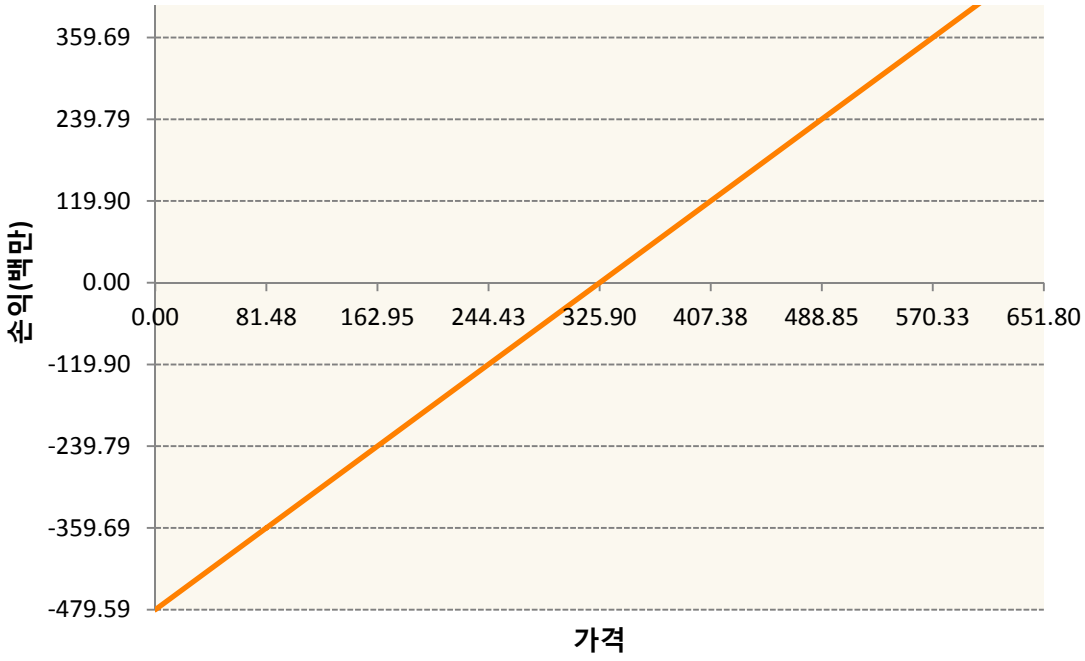


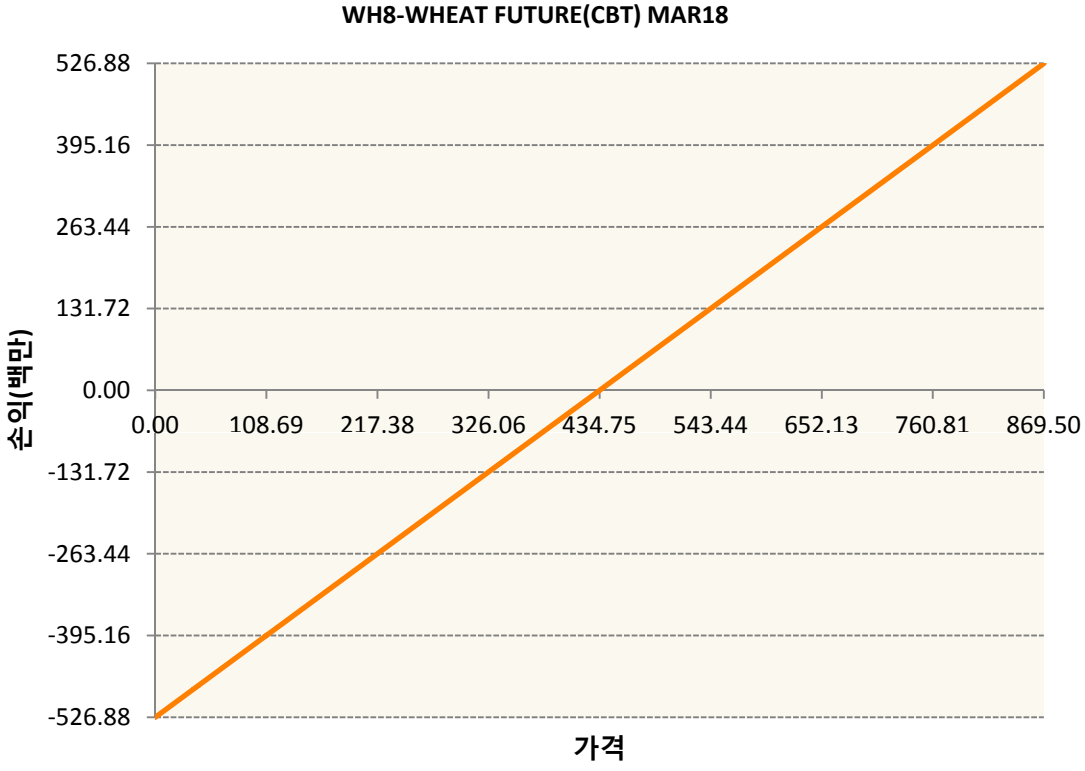
SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18



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	42

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

401