공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

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	2017-11-29
기준일	2017-11-28

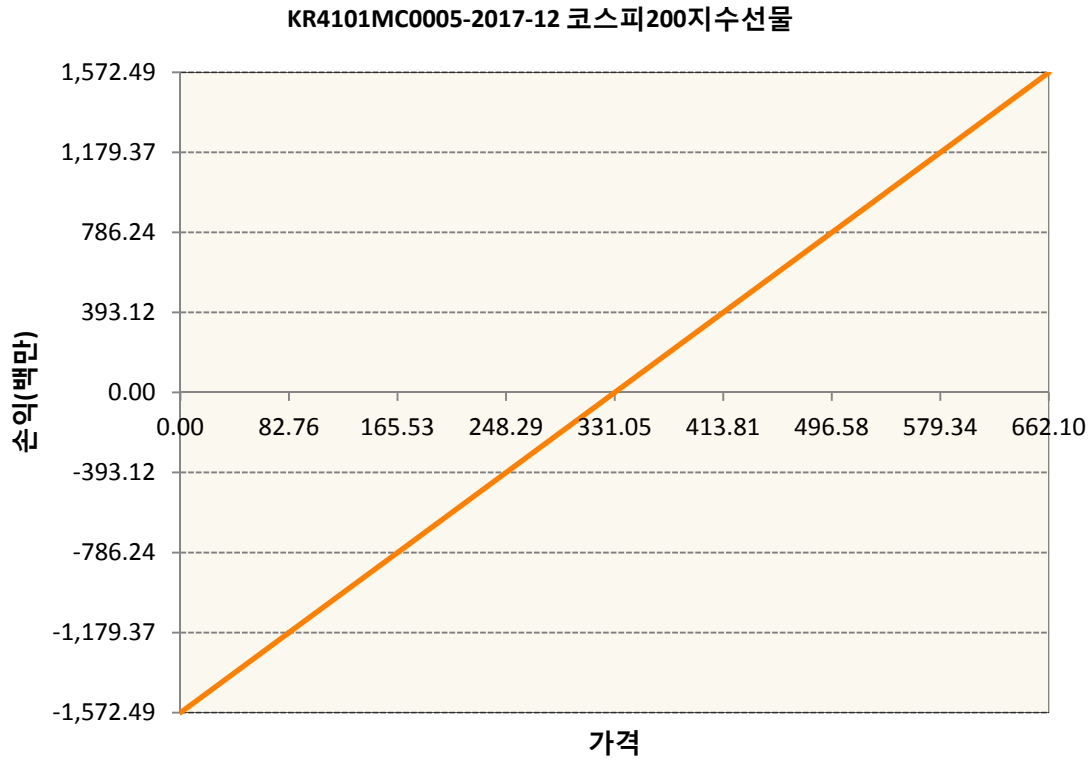
스마트인덱스모

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	1,572	0	1,572	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-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%	126	126	126	126	126	126	126

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

72

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

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	1,074

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

343

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

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	403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

368

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

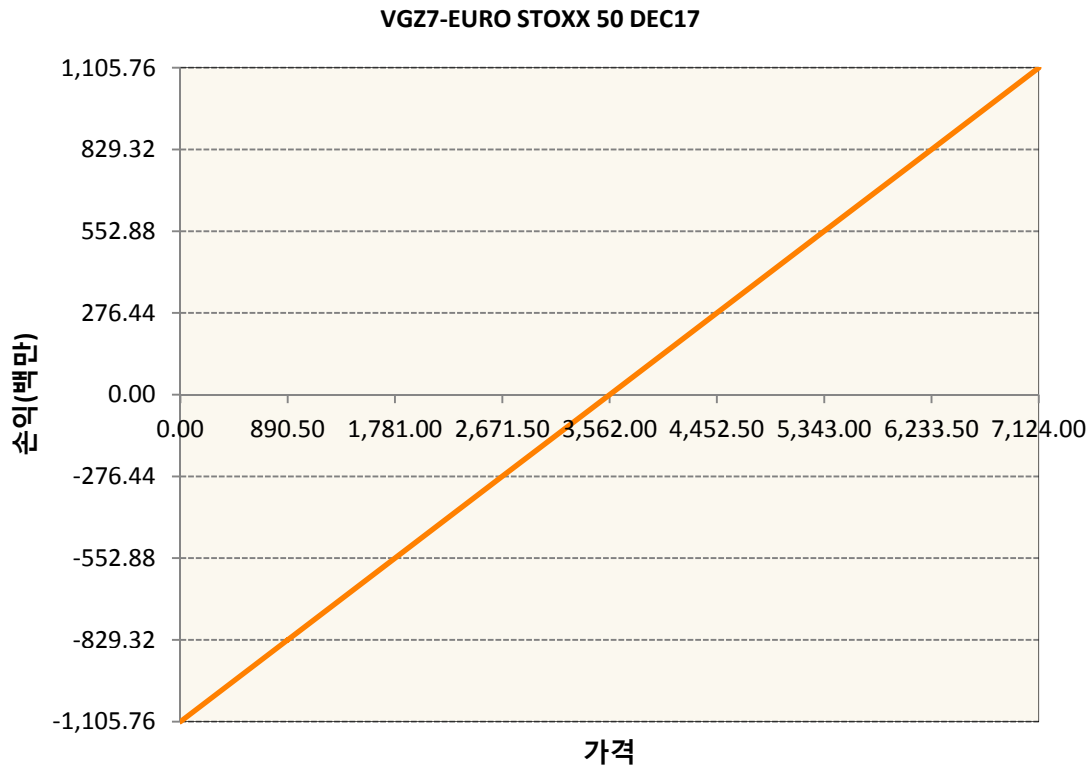
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,106	0	1,106	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	88

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

(단위:백만원)

51

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

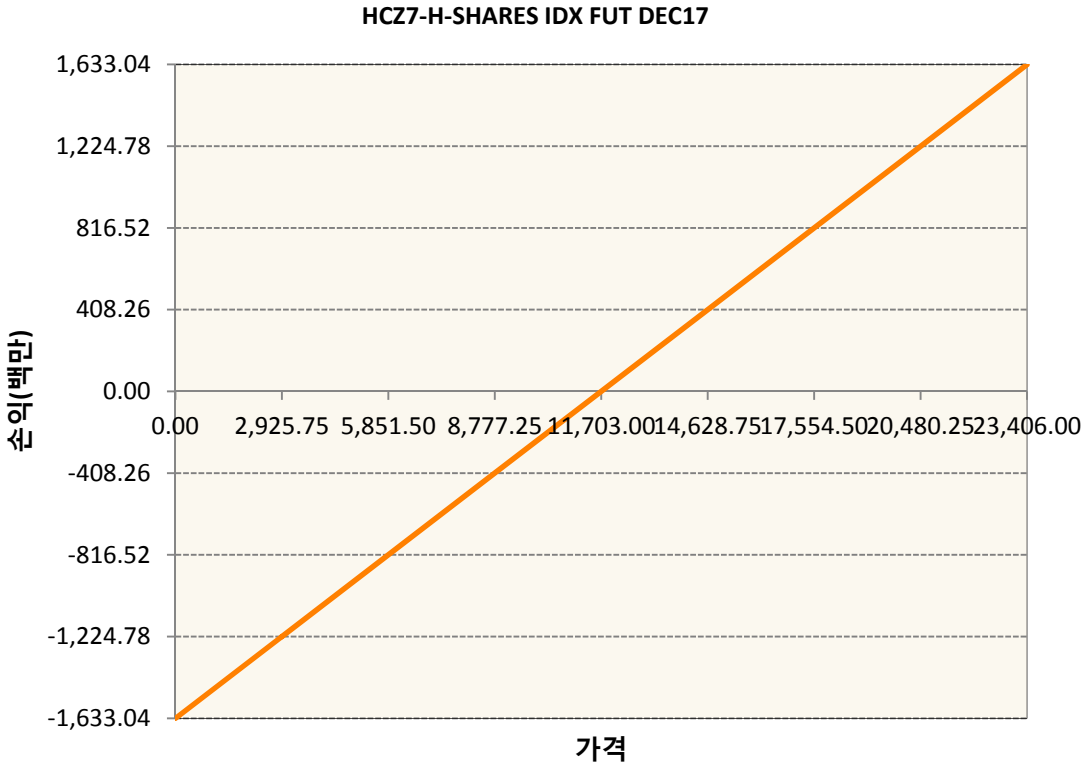
차이나인덱스모(주식-파생형)

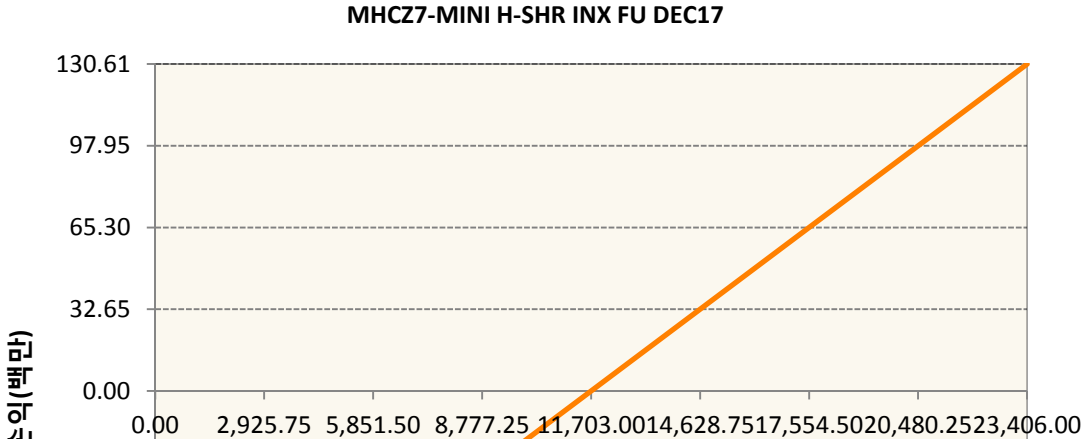
1. 계약금액

(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	1,633	0	1,633	
누계	유가증권	선물	131	0	131	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	131
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	94

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

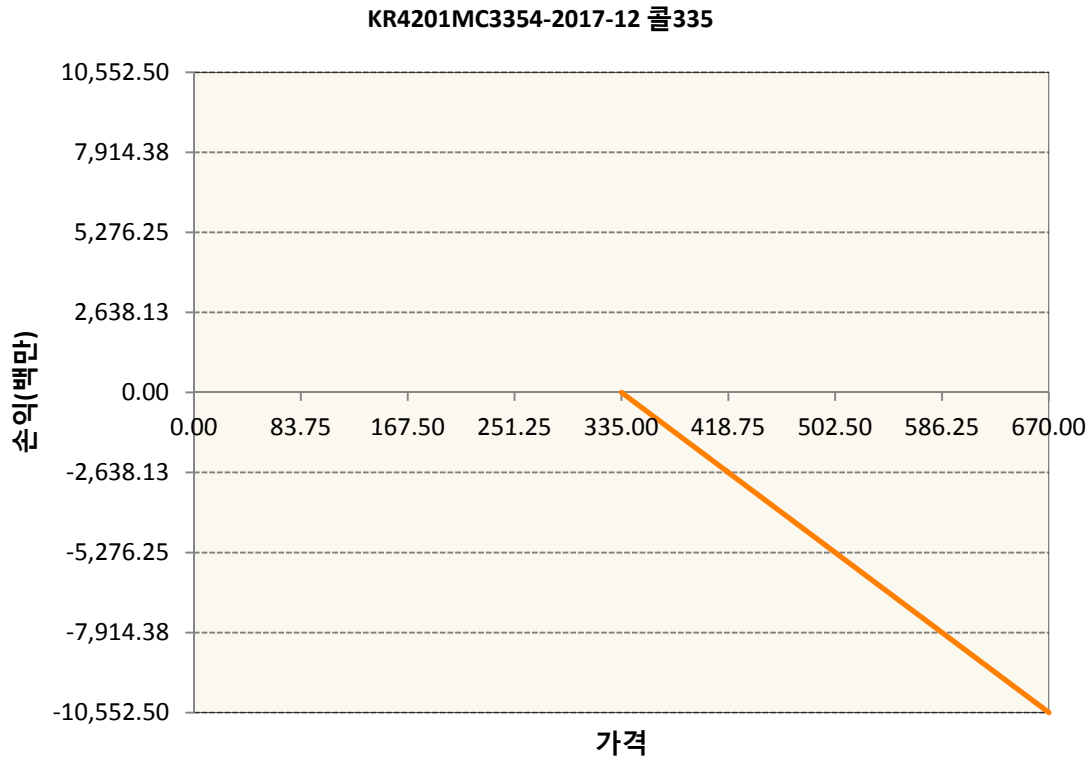
커버드콜모(주식혼합-파생형)

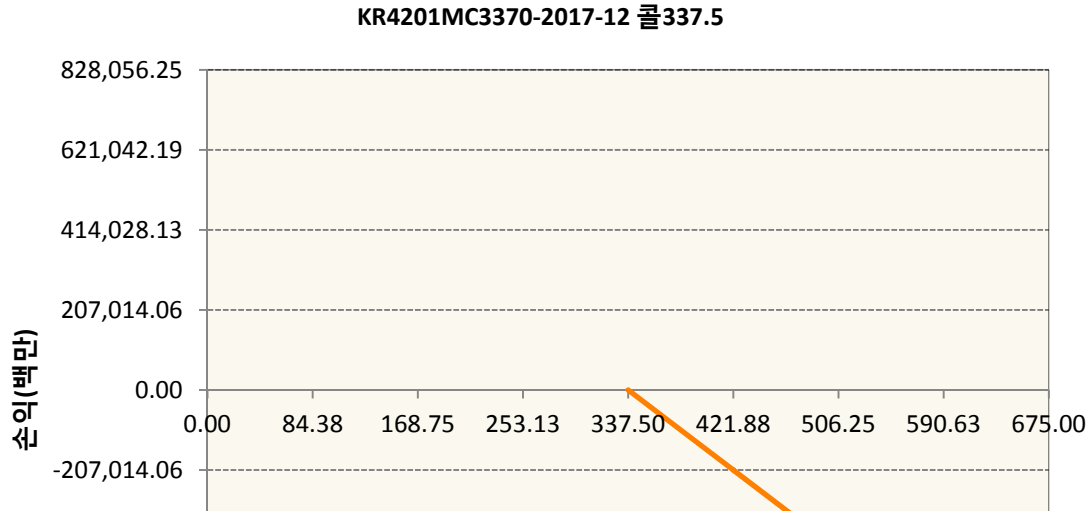
1. 계약금액

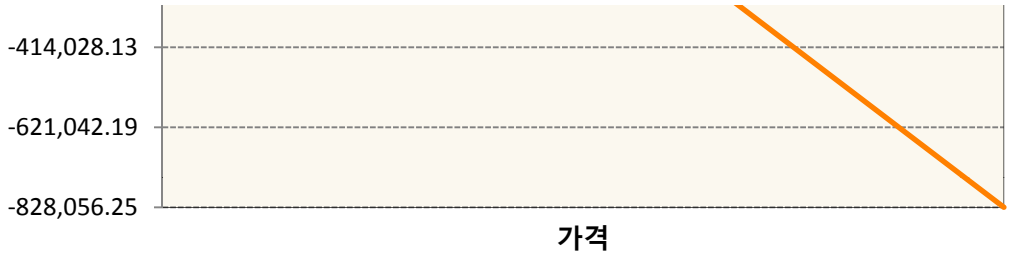
(단위:백만원)

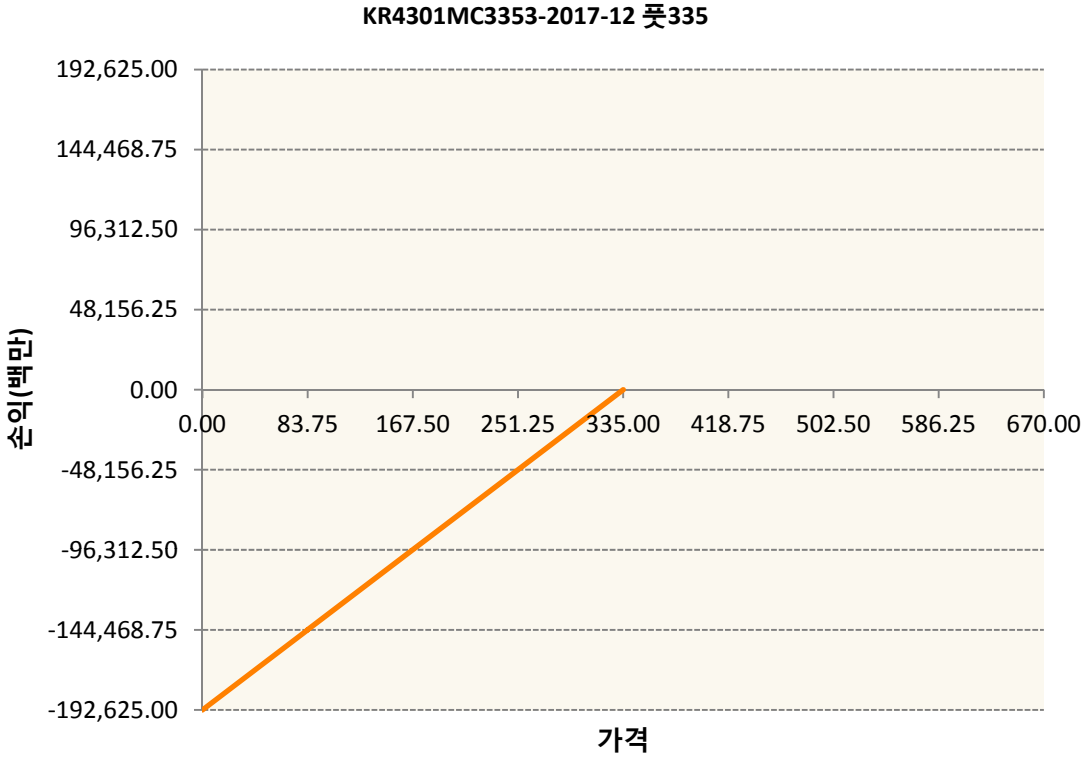
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

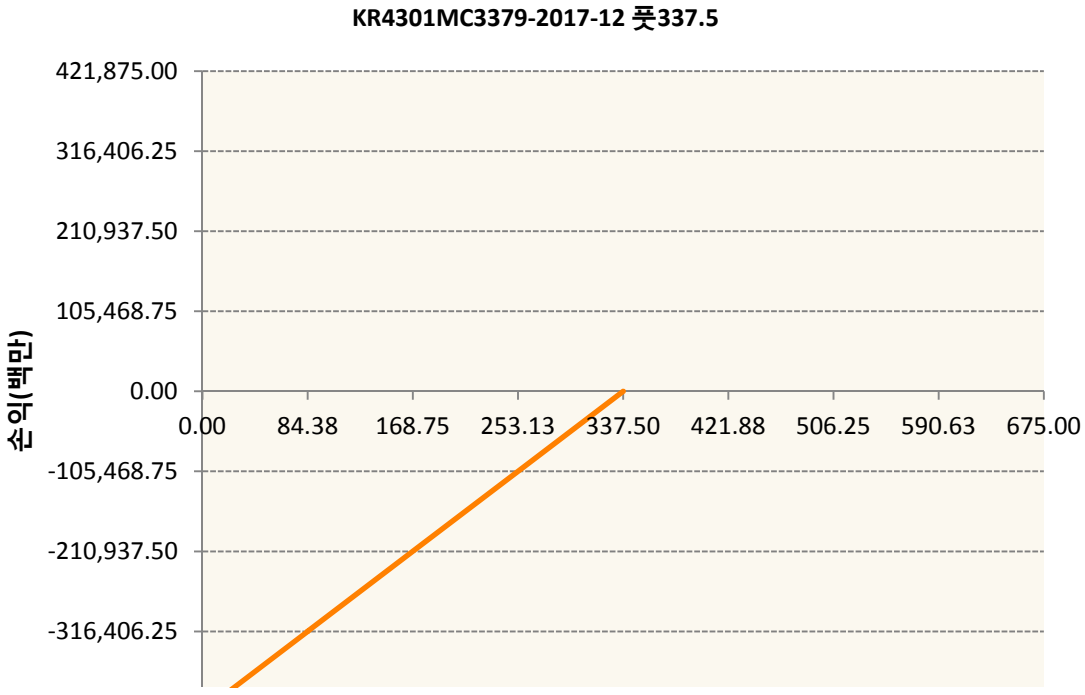
2. 만기시점의 손익구조






-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							607
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	161	159	157	155	151	146	141
-5.33%	154	150	144	136	128	119	109
-2.67%	128	116	104	90	76	62	47
0%	53	35	18	0	-18	-36	-53
2.67%	-92	-110	-127	-145	-162	-180	-198
5.33%	-303	-315	-328	-341	-355	-370	-385
8.00%	-556	-562	-569	-577	-586	-596	-607
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							44,561
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,262	10,200	10,091	9,925	9,696	9,401	9,040
-5.33%	9,953	9,677	9,307	8,846	8,301	7,679	6,986
-2.67%	8,469	7,723	6,886	5,974	5,000	3,973	2,904
0%	3,891	2,618	1,319	0	-1,334	-2,679	-4,035
2.67%	-5,787	-7,206	-8,628	-10,053	-11,480	-12,909	-14,339
5.33%	-20,900	-21,965	-23,092	-24,269	-25,485	-26,733	-28,007
8.00%	-39,863	-40,419	-41,083	-41,841	-42,680	-43,590	-44,561
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,268
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,266	-14,266	-14,266	-14,267	-14,267	-14,267	-14,268
-5.33%	-9,195	-9,195	-9,196	-9,199	-9,204	-9,212	-9,224
-2.67%	-4,144	-4,164	-4,194	-4,233	-4,281	-4,337	-4,402
0%	400	271	137	0	-140	-282	-425
2.67%	2,779	2,659	2,534	2,404	2,270	2,132	1,992
5.33%	3,197	3,178	3,150	3,113	3,067	3,012	2,948
8.00%	3,215	3,214	3,212	3,209	3,203	3,193	3,179
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							31,825
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,824	-31,824	-31,824	-31,824	-31,824	-31,824	-31,825
-5.33%	-20,797	-20,798	-20,799	-20,801	-20,806	-20,815	-20,829
-2.67%	-9,785	-9,805	-9,837	-9,885	-9,949	-10,031	-10,129
0%	675	469	242	0	-255	-521	-795
2.67%	7,469	7,147	6,821	6,492	6,161	5,828	5,493

5.33%	9,184	9,100	8,991	8,859	8,706	8,534	8,345
8.00%	9,300	9,296	9,286	9,269	9,242	9,202	9,150

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

100,338

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

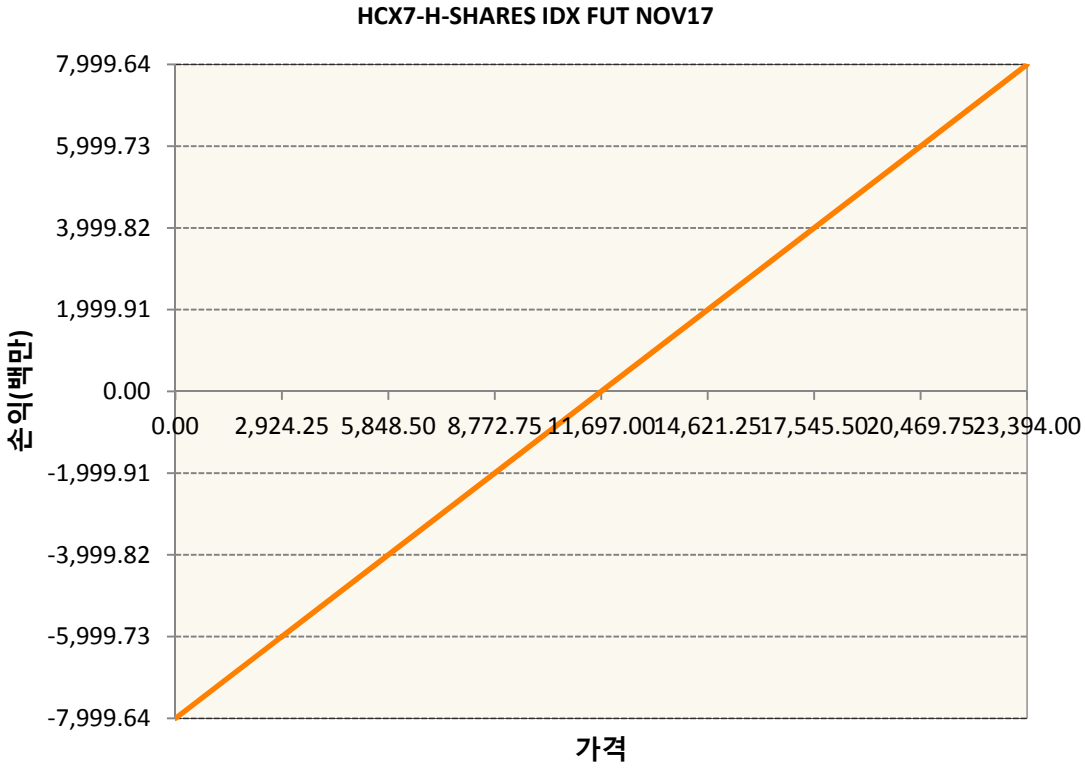
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

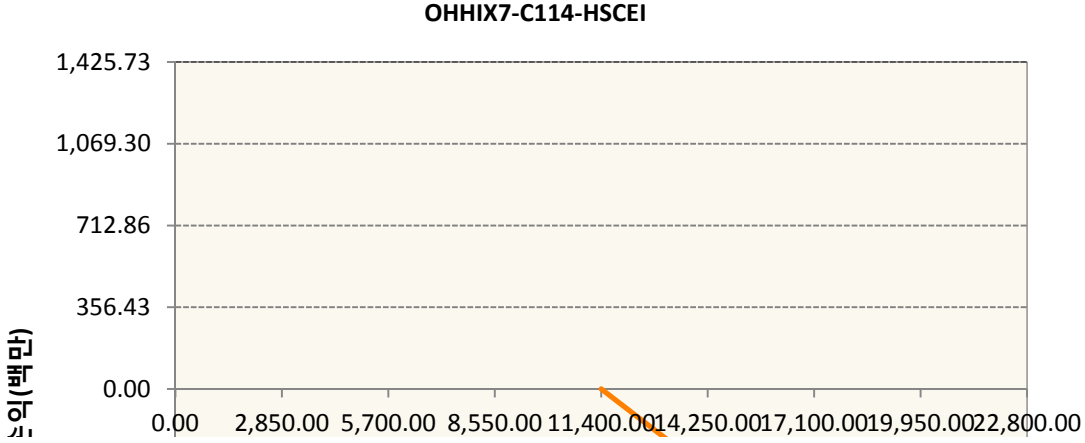
1. 계약금액

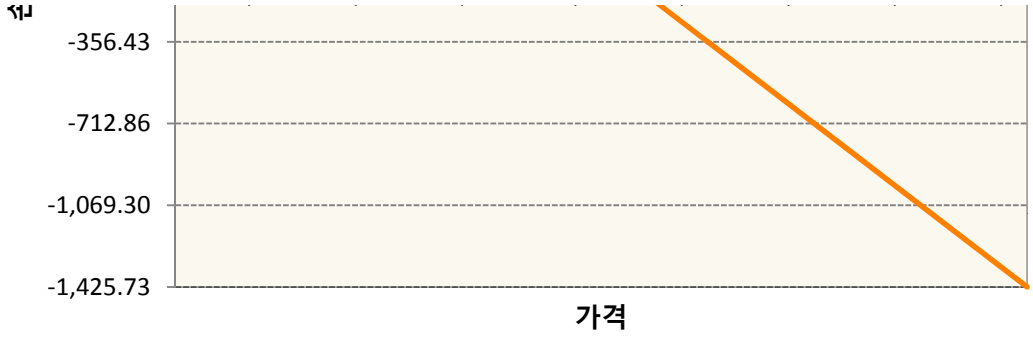
(단위:백만원)

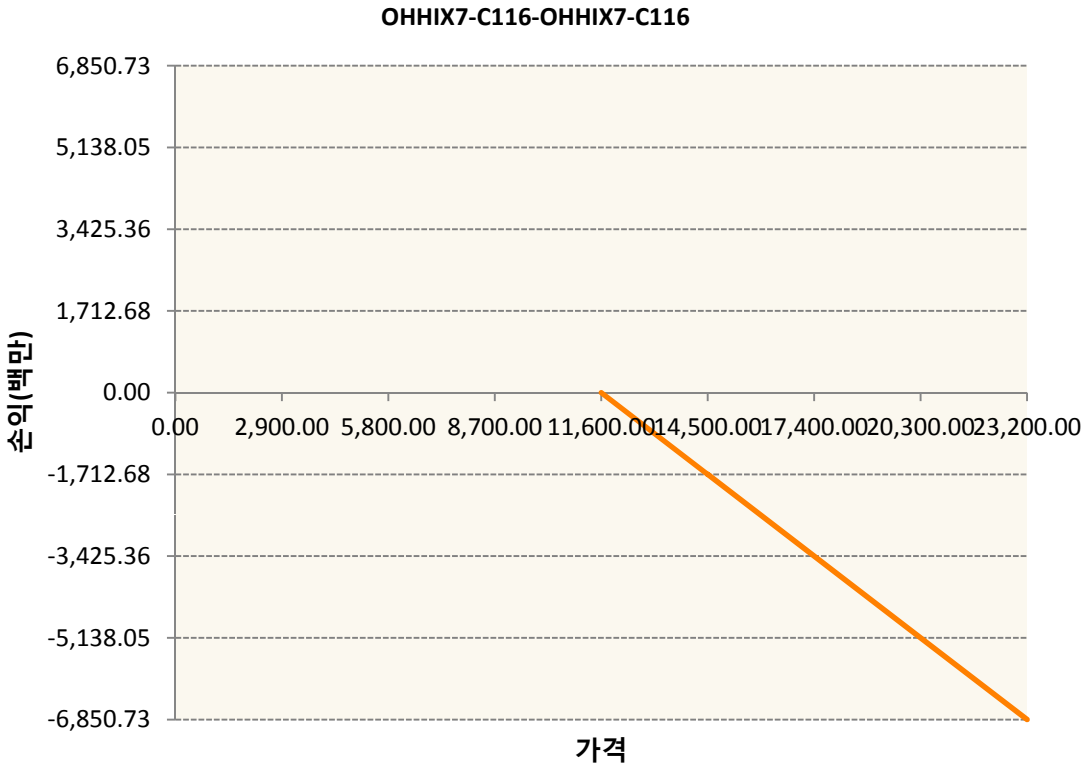
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,000	0	8,000	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,553	-16,553	장내

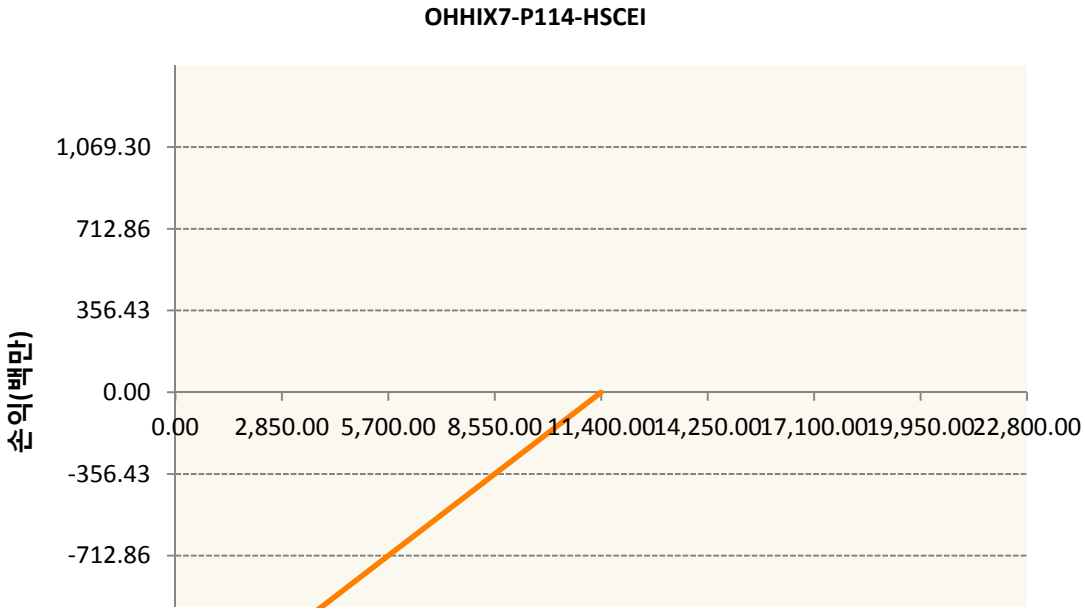
2. 만기시점의 손익구조

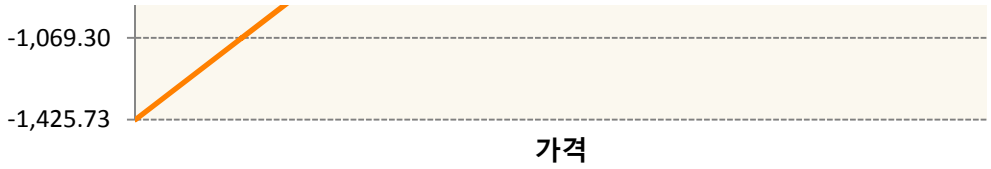


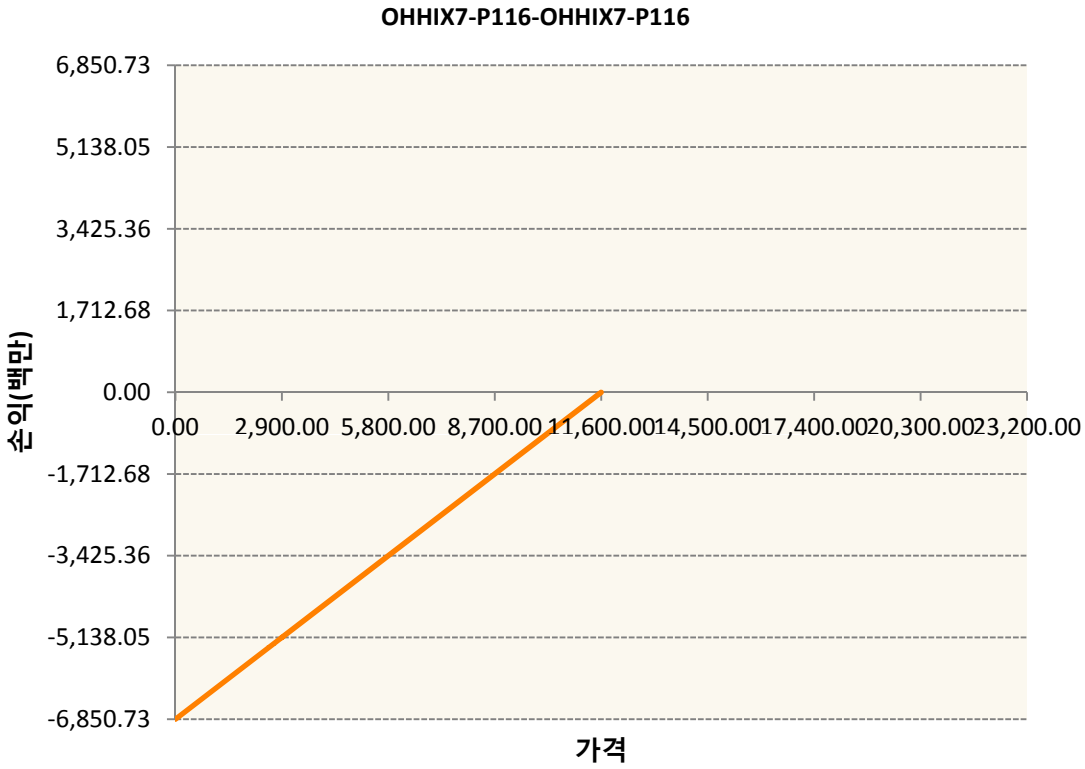



-356.43
-712.86
-1,069.30
-1,425.73
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,850.73
5,138.05
3,425.36
1,712.68
0.00
-1,712.68
-3,425.36
-5,138.05
-6,850.73
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
1,069.30
712.86
356.43
0.00
-356.43
-712.86
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	640
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)

1,581

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

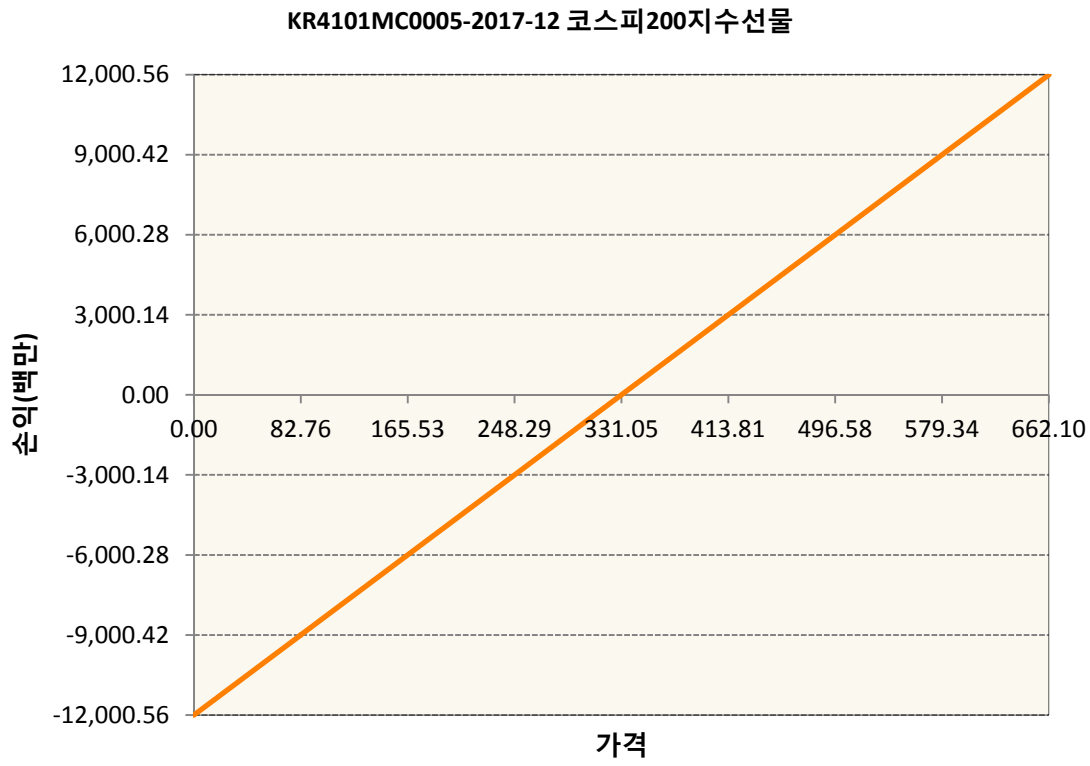
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

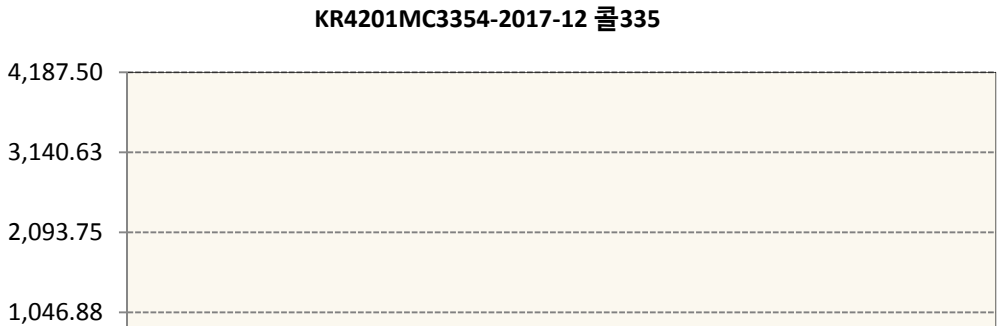
1. 계약금액

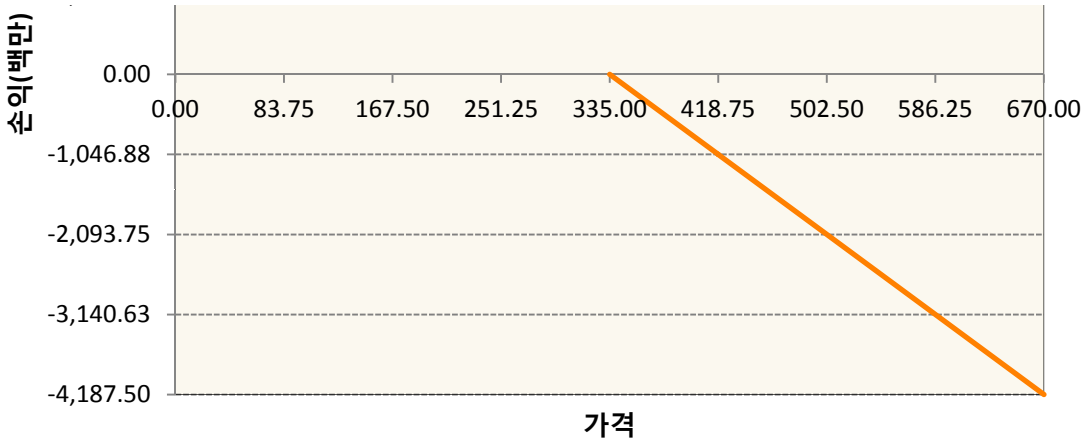
(단위:백만원)

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	12,001	0	12,001	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

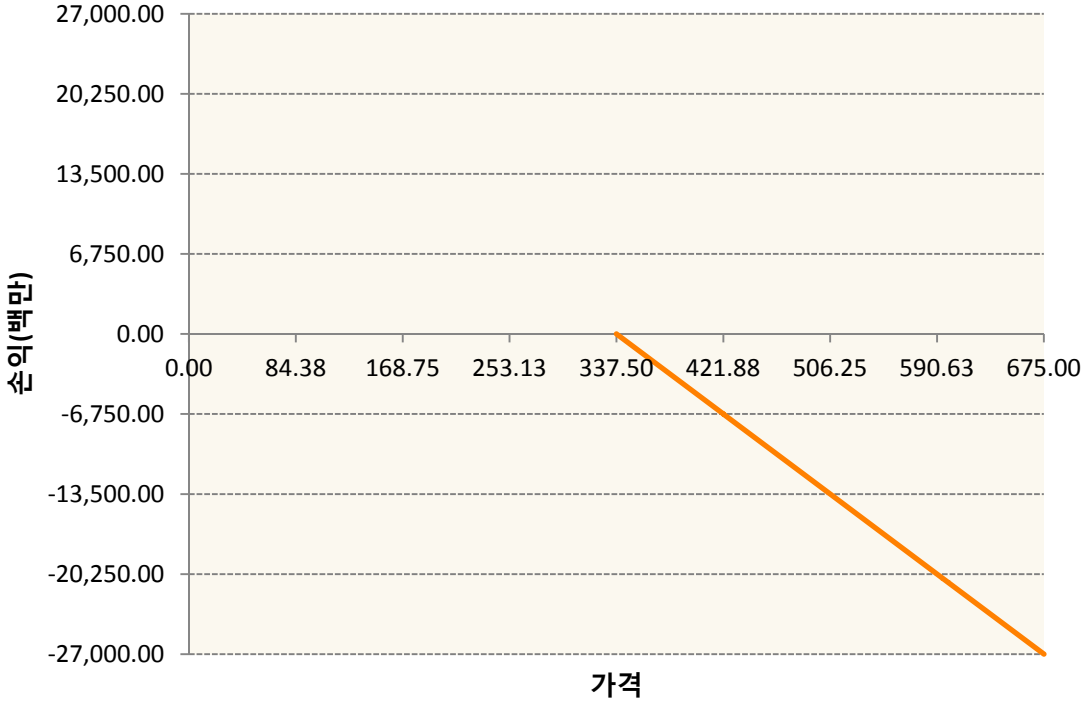
2. 만기시점의 손익구조



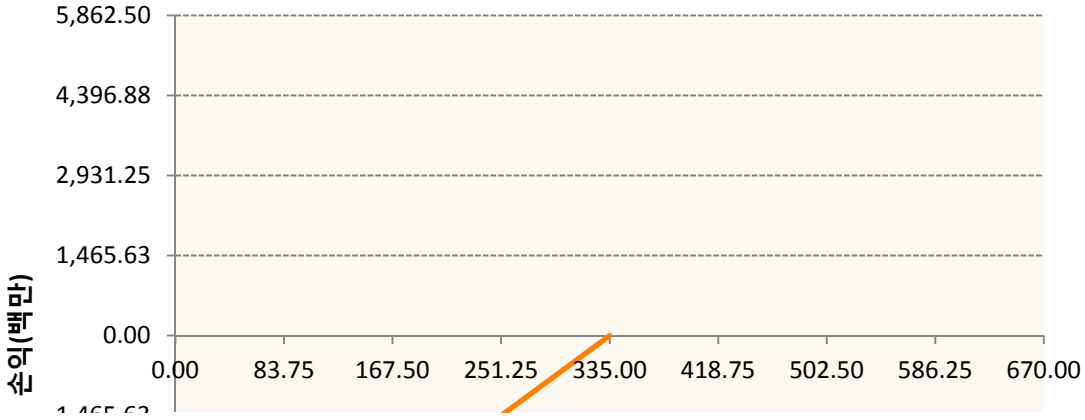




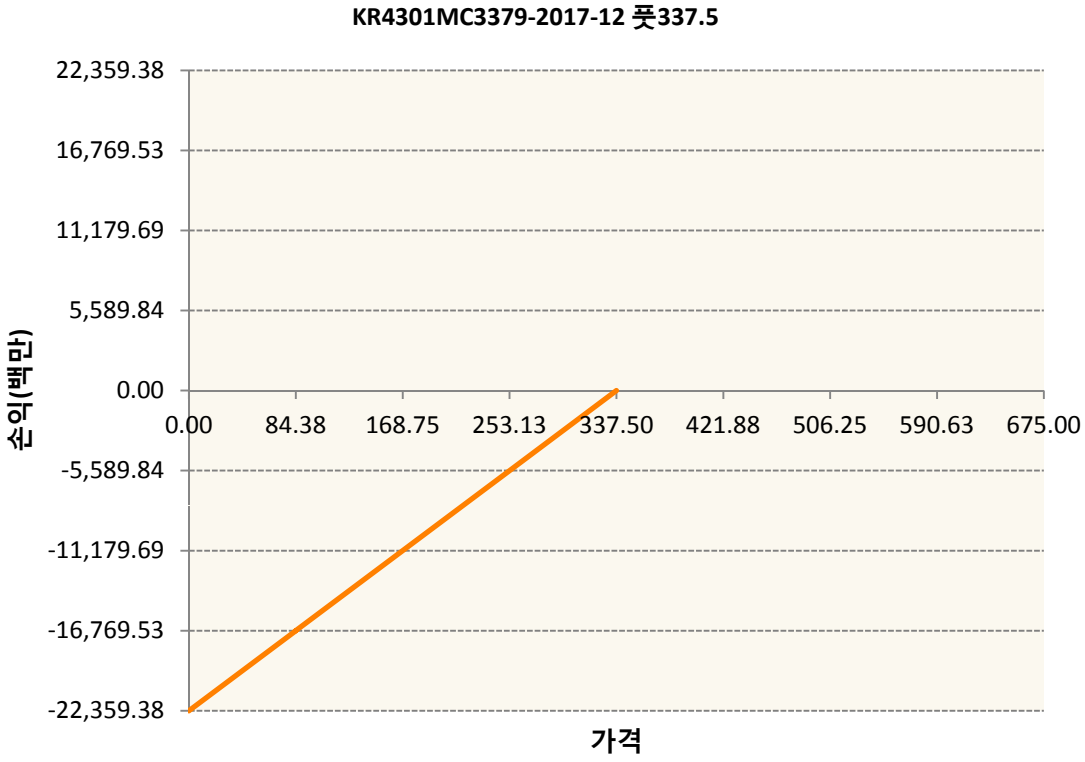
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465
-5.33%	-977	-977	-977	-977	-977	-977	-977
-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%	977	977	977	977	977	977	977
8.00%	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465
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						238
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-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%	238	238	238	238	238	238	238
	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						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						313
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
	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						634
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-634	-634	-634	-634	-634	-634	-634
-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%	634	634	634	634	634	634	634
	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					960

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-960	-960	-960	-960	-960	-960	-960
-5.33%	-640	-640	-640	-640	-640	-640	-640
-2.67%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	320	320	320	320	320	320	320
5.33%	640	640	640	640	640	640	640
8.00%	960	960	960	960	960	960	960
	KR4201MC3	2017-12 콜335					241

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	64	63	62	61	60	58	56
-5.33%	61	59	57	54	51	47	43
-2.67%	51	46	41	36	30	25	19
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-37	-43	-50	-57	-64	-72	-79
5.33%	-120	-125	-130	-135	-141	-147	-153
8.00%	-221	-223	-226	-229	-232	-237	-241
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,453

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	335	333	329	324	316	307	295
-5.33%	325	316	303	288	271	250	228
-2.67%	276	252	225	195	163	130	95
0%	127	85	43	0	-43	-87	-132
2.67%	-189	-235	-281	-328	-374	-421	-468
5.33%	-681	-716	-753	-791	-831	-872	-913
8.00%	-1,300	-1,318	-1,340	-1,364	-1,392	-1,421	-1,453
	KR4301MC3	2017-12 풋335					434

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-434	-434	-434	-434	-434	-434	-434
-5.33%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-281

-2.67%	-126	-127	-128	-129	-130	-132	-134
0%	12	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	85	81	77	73	69	65	61
5.33%	97	97	96	95	93	92	90
8.00%	98	98	98	98	97	97	97
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,687
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,687	-1,687	-1,687	-1,687	-1,687	-1,687	-1,687
-5.33%	-1,102	-1,102	-1,102	-1,102	-1,103	-1,103	-1,104
-2.67%	-519	-520	-521	-524	-527	-532	-537
0%	36	25	13	0	-14	-28	-42
2.67%	396	379	362	344	327	309	291
5.33%	487	482	477	470	461	452	442
8.00%	493	493	492	491	490	488	485

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

9,565

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

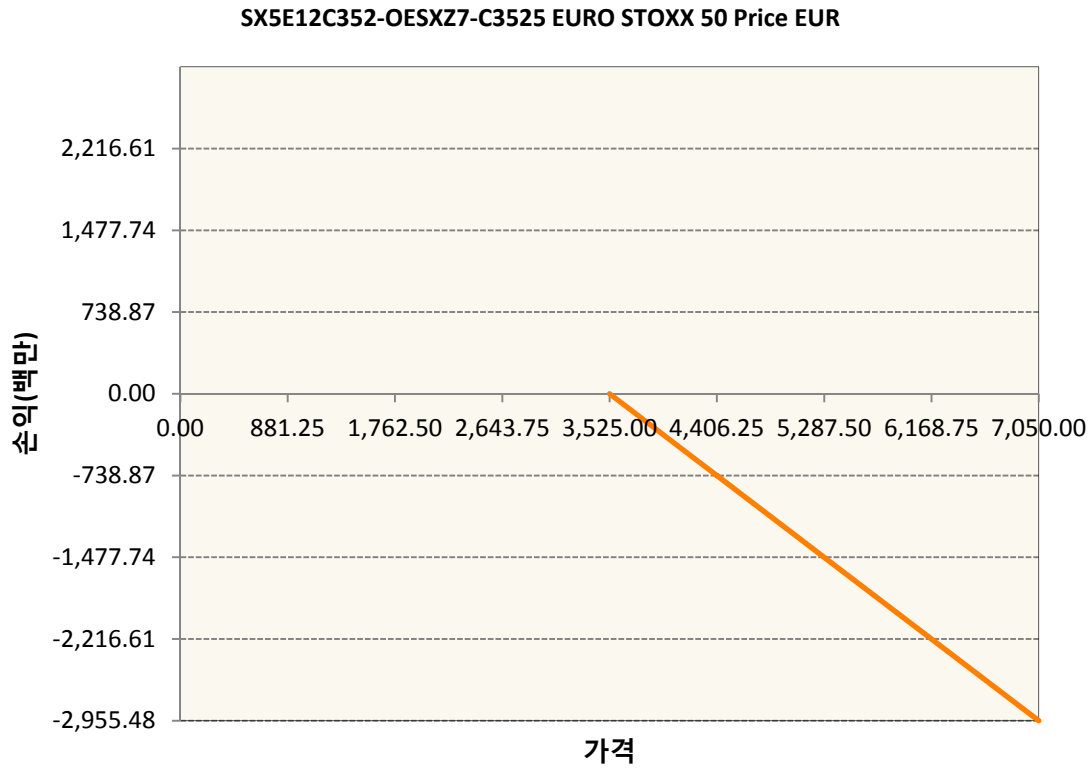
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

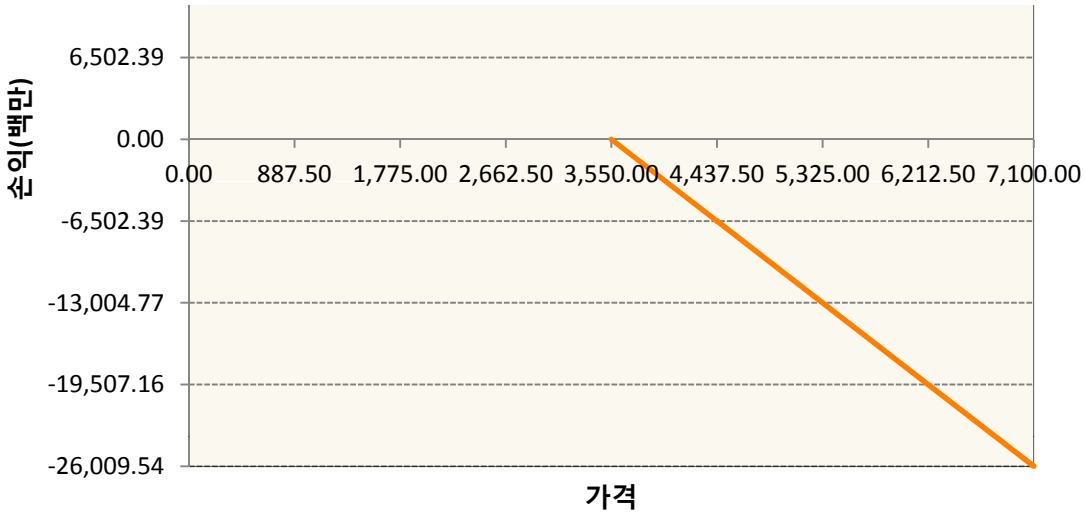
(단위:백만원)

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	21,001	0	21,001	
누계	유가증권	스왑	96,746	0	96,746	장외
누계	유가증권	옵션	0	57,930	-57,930	장내
누계	지수	스왑	51,599	0	51,599	장외

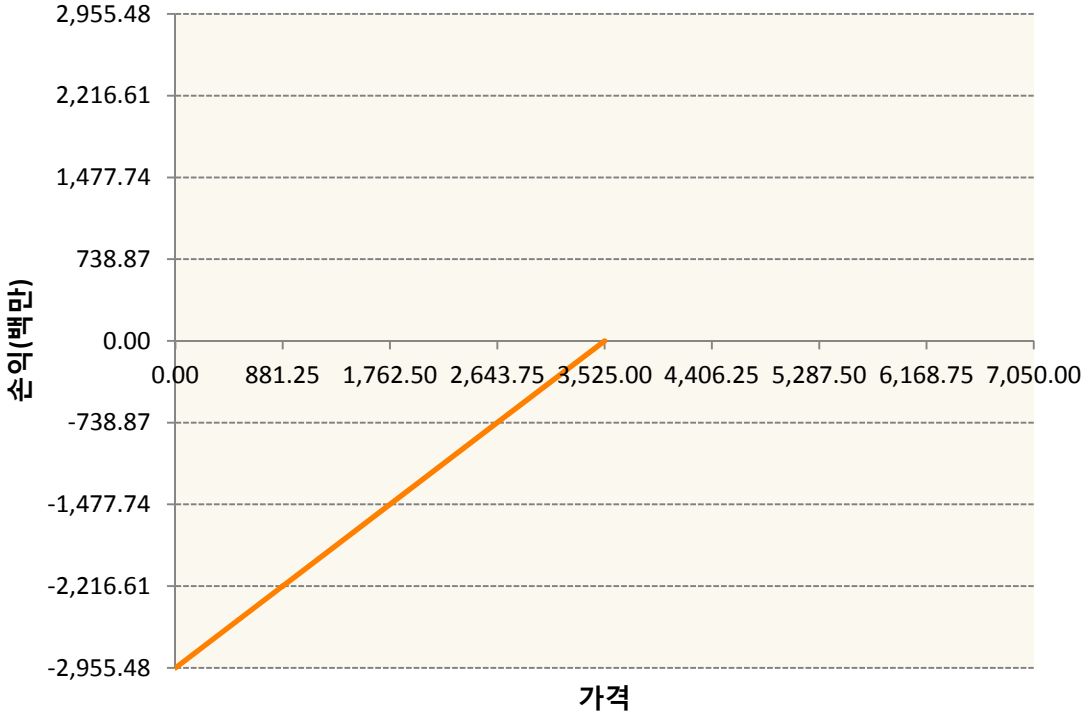
2. 만기시점의 손익구조



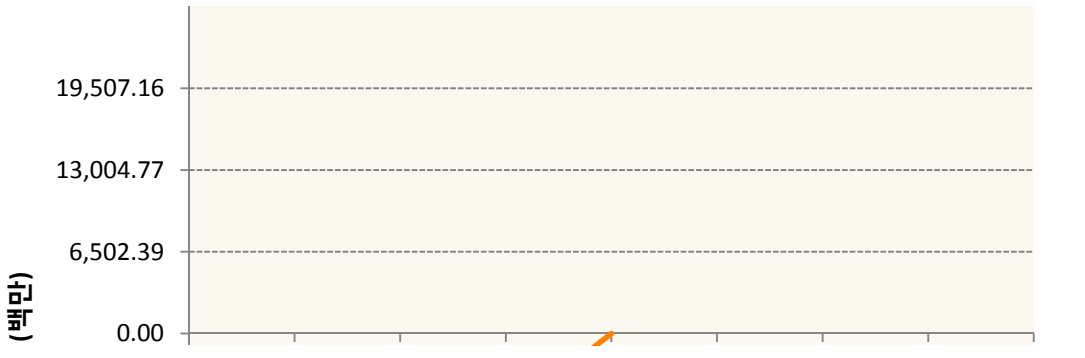


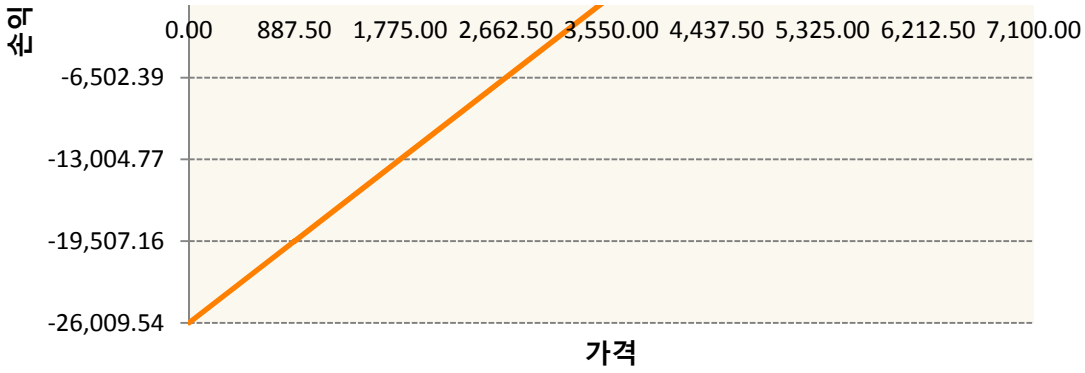


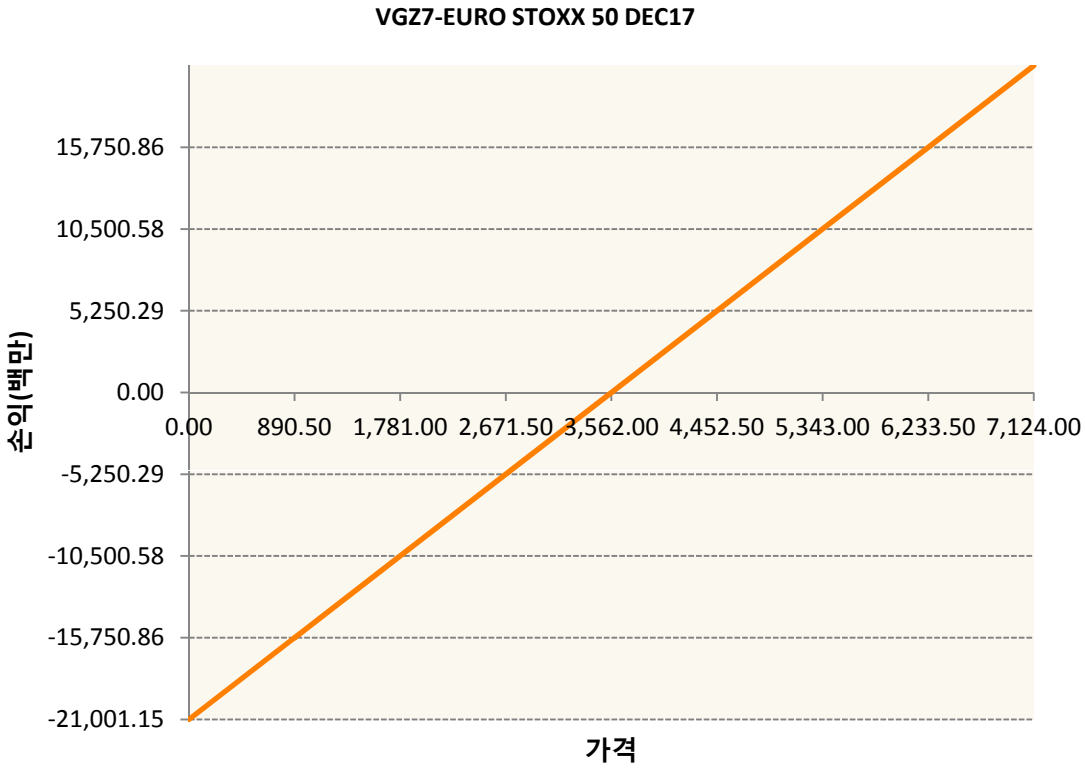
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	23
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	0.3
SX5E12C352	OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	236
SX5E12C355	OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,081
SX5E12P352	OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	236
SX5E12P355	OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,081
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	1,680

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

3,665

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

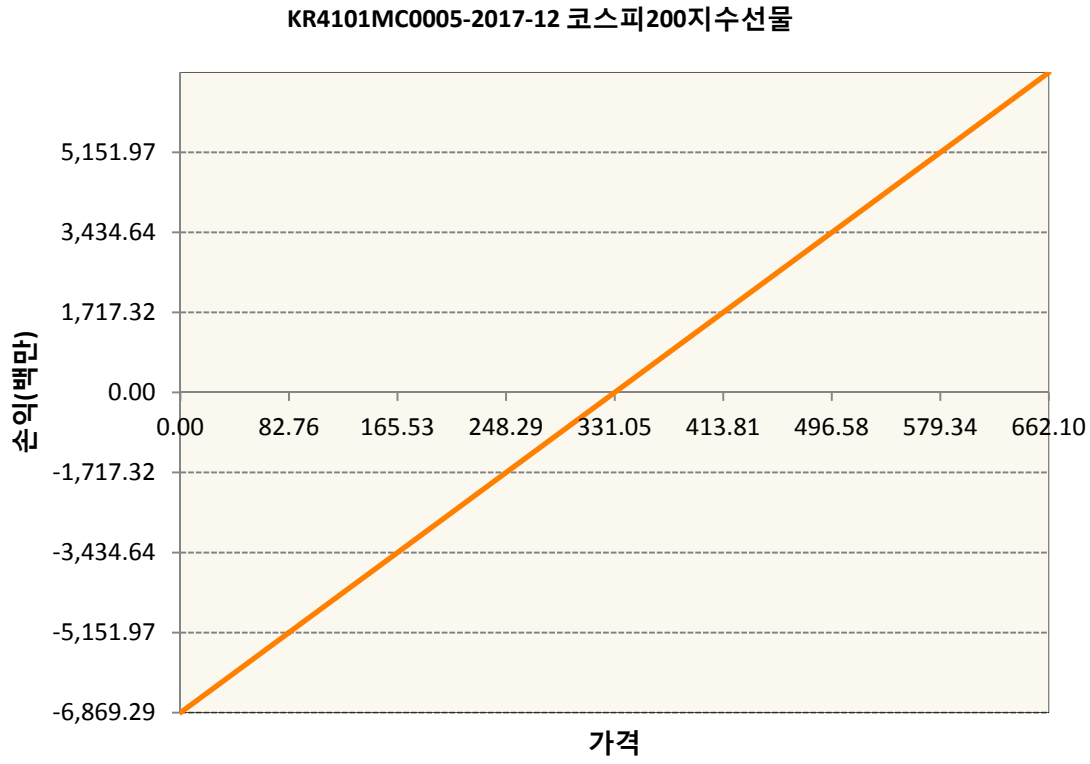
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	6,869	0	6,869	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물	549

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-549	-549	-549	-549	-549	-549	-549
-5.33%	-366	-366	-366	-366	-366	-366	-366
-2.67%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	183	183	183	183	183	183	183
5.33%	366	366	366	366	366	366	366
8.00%	549	549	549	549	549	549	549

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

316

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

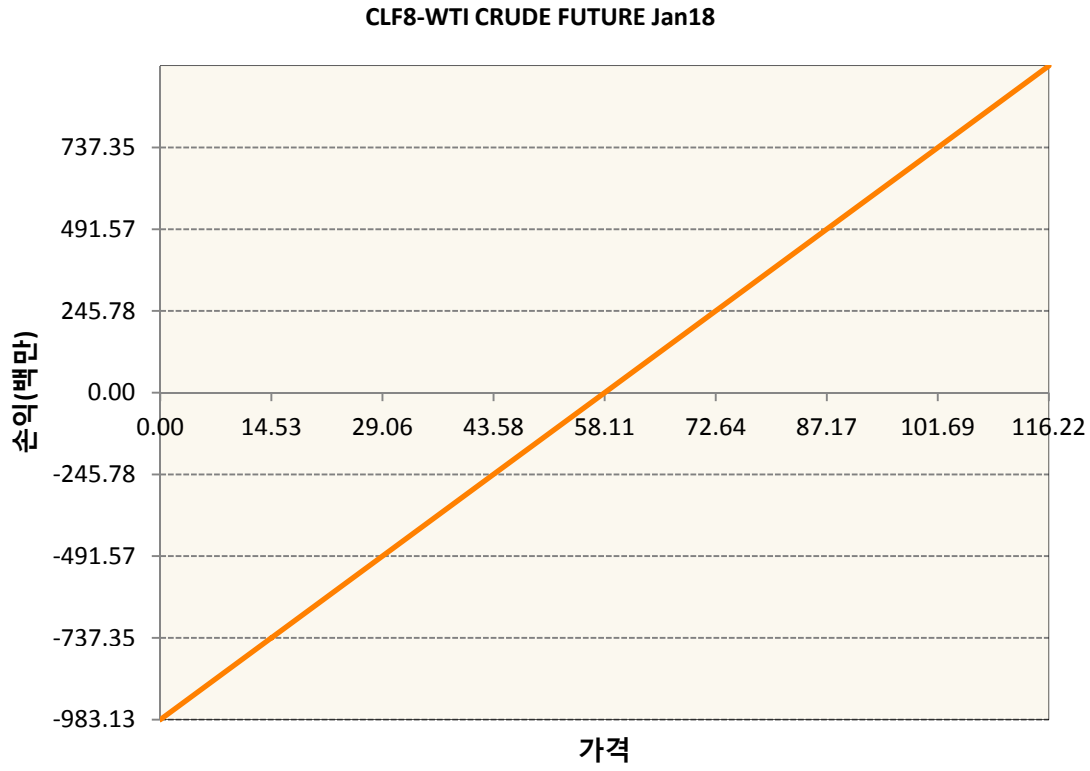
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

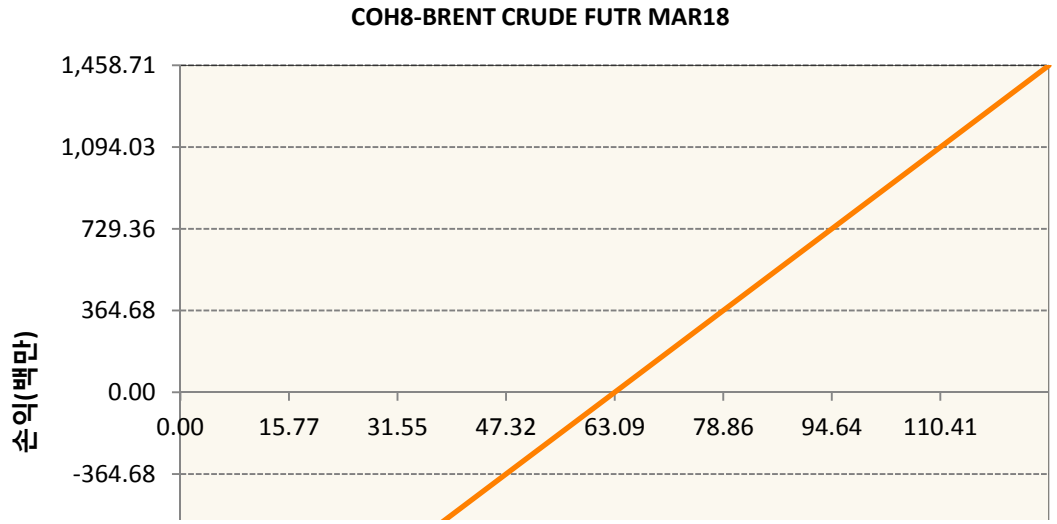
1. 계약금액

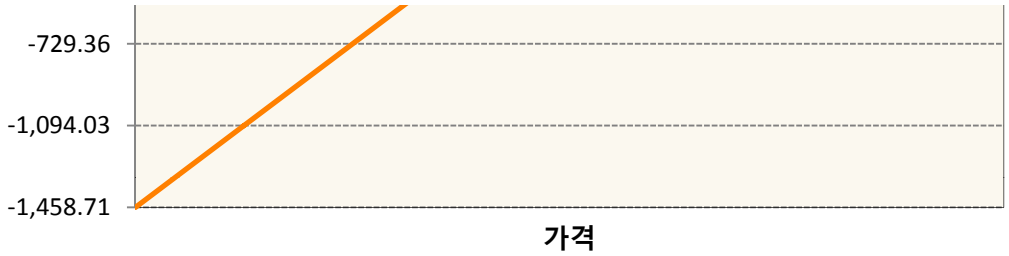
(단위:백만원)

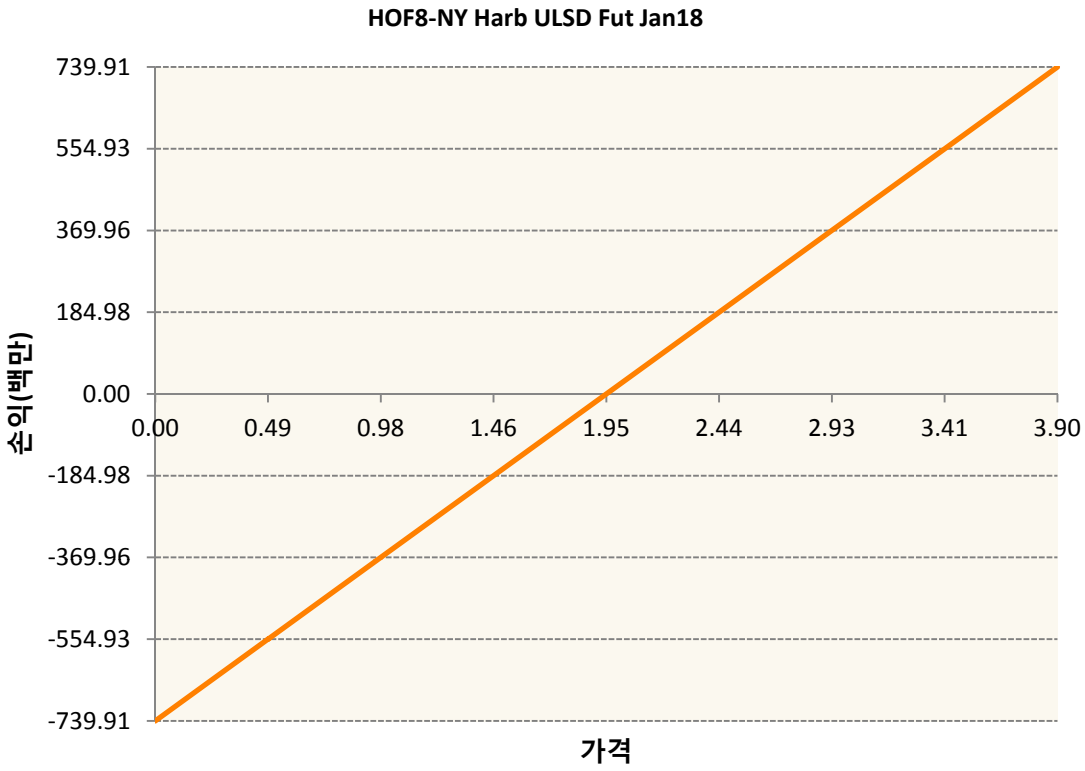
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,211	868	4,343	

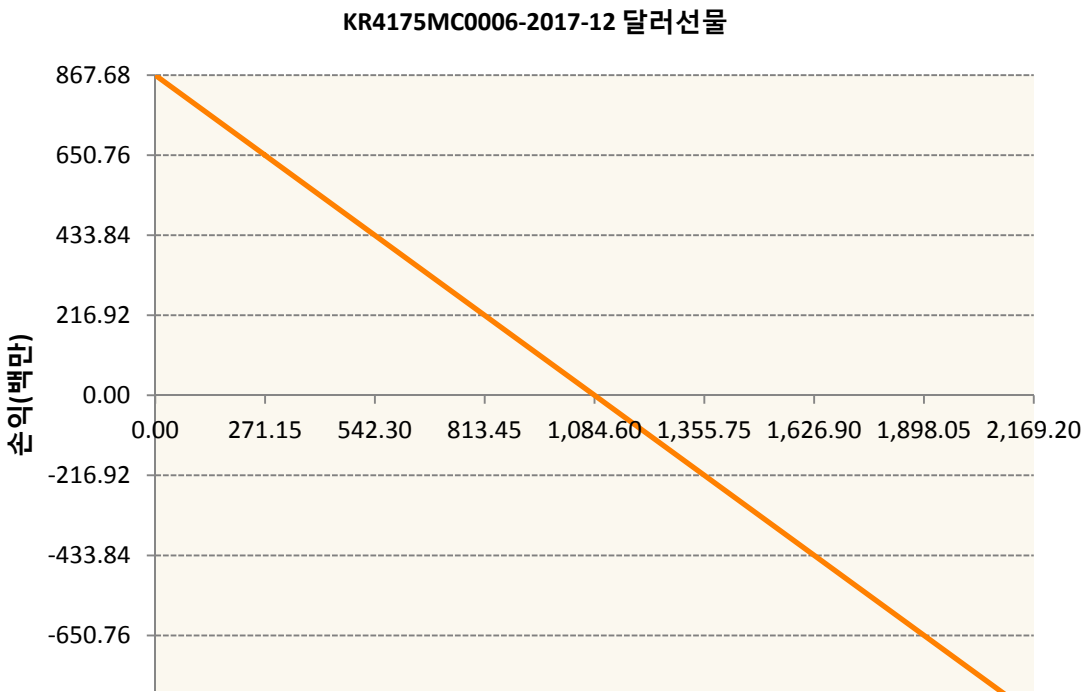
2. 만기시점의 손익구조

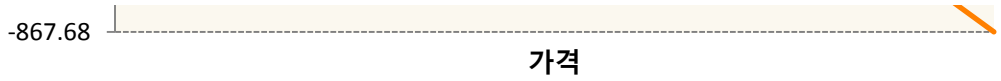


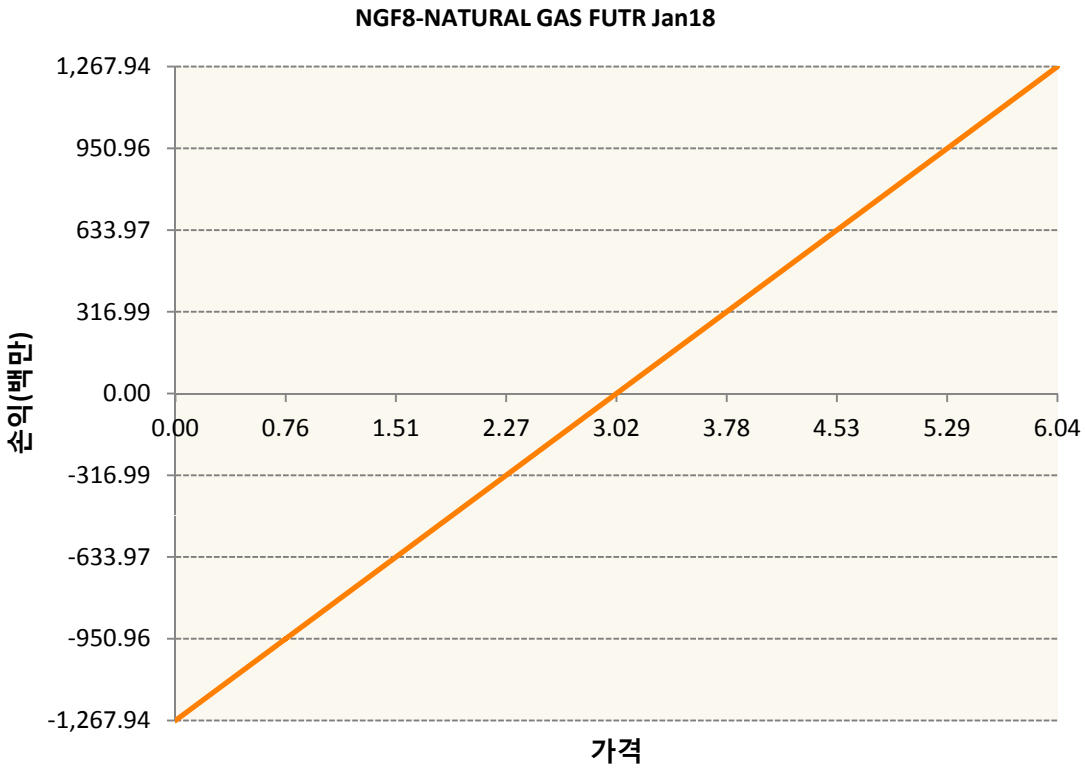


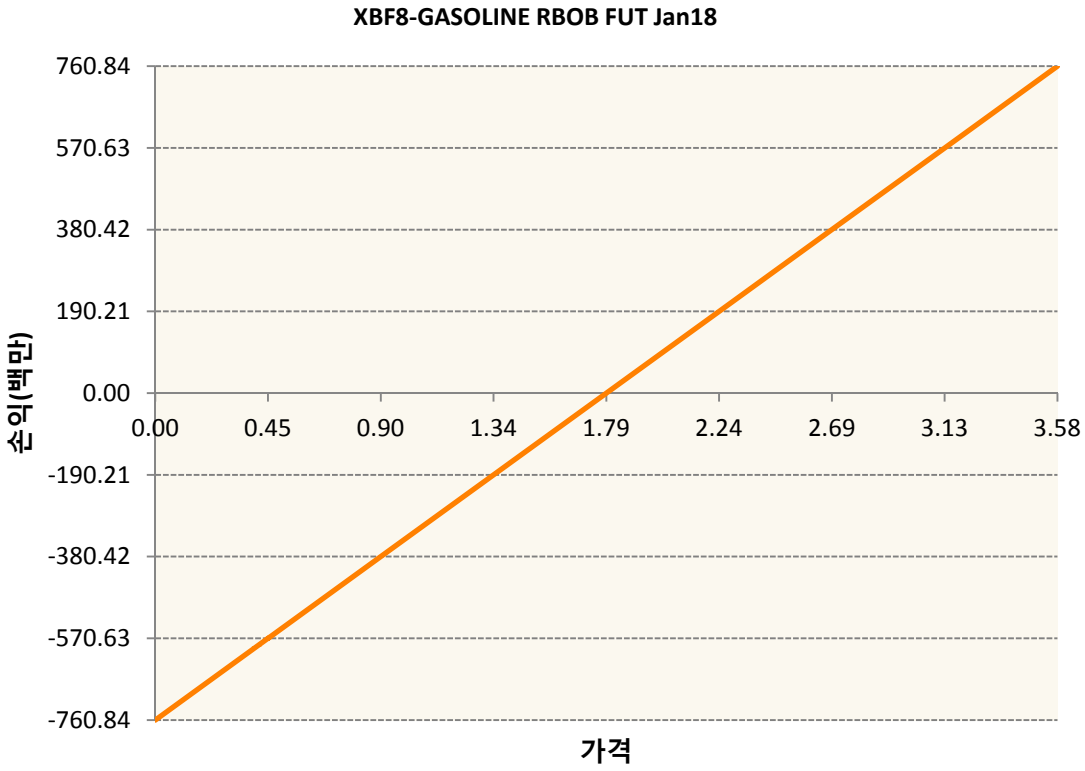

-729.36
-1,094.03
-1,458.71
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
739.91
554.93
369.96
184.98
0.00
-184.98
-369.96
-554.93
-739.91
0.00
0.49
0.98
1.46
1.95
2.44
2.93
3.41
3.90
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
867.68
650.76
433.84
216.92
0.00
-216.92
-433.84
-650.76
0.00
271.15
542.30
813.45
1,084.60
1,355.75
1,626.90
1,898.05
2,169.20
손익(백만)


-867.68
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,267.94
950.96
633.97
316.99
0.00
-316.99
-633.97
-950.96
-1,267.94
0.00
0.76
1.51
2.27
3.02
3.78
4.53
5.29
6.04
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
760.84
570.63
380.42
190.21
0.00
-190.21
-380.42
-570.63
-760.84
0.00
0.45
0.90
1.34
1.79
2.24
2.69
3.13
3.58
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	79
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	117
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	69
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	101
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	61

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

720

공시일	2017-11-29
기준일	2017-11-28

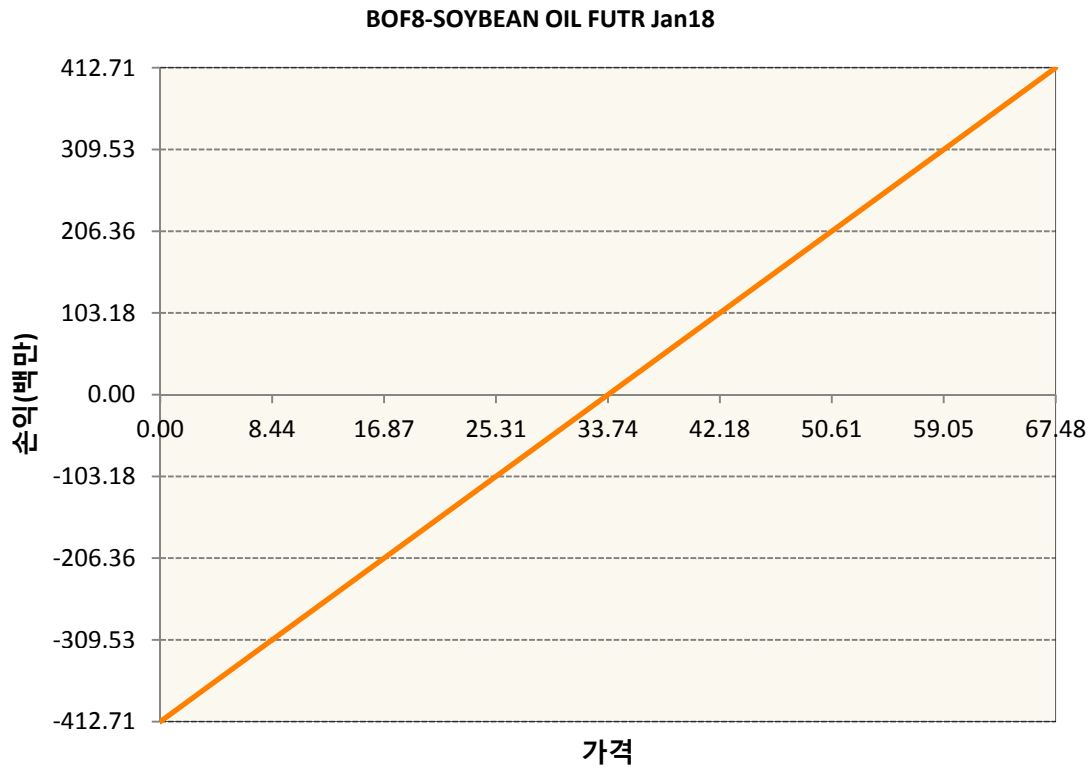
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

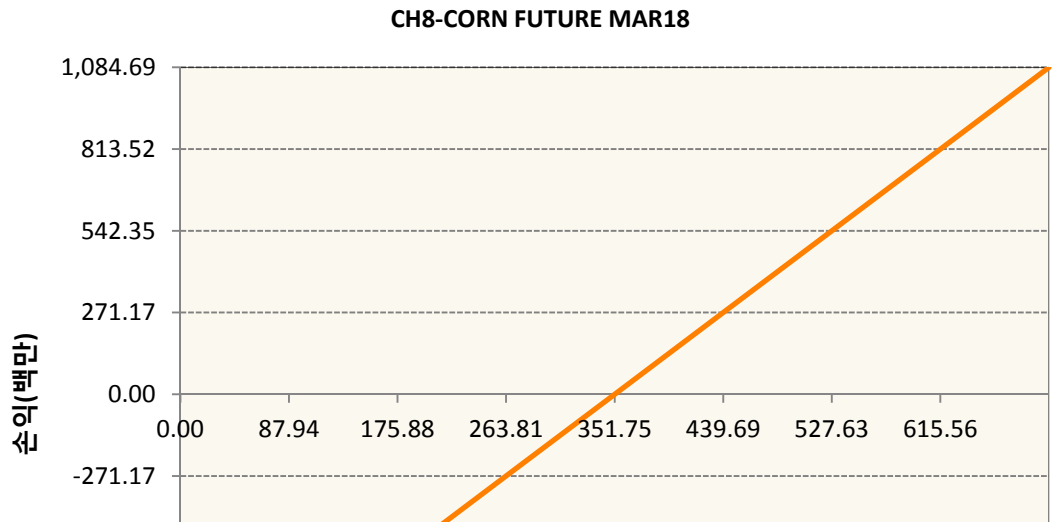
1. 계약금액

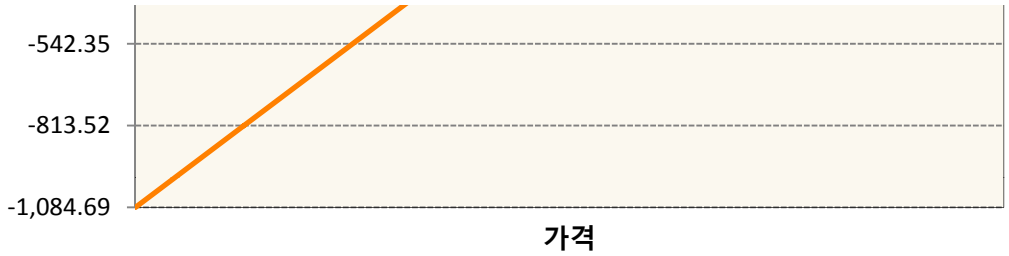
(단위:백만원)

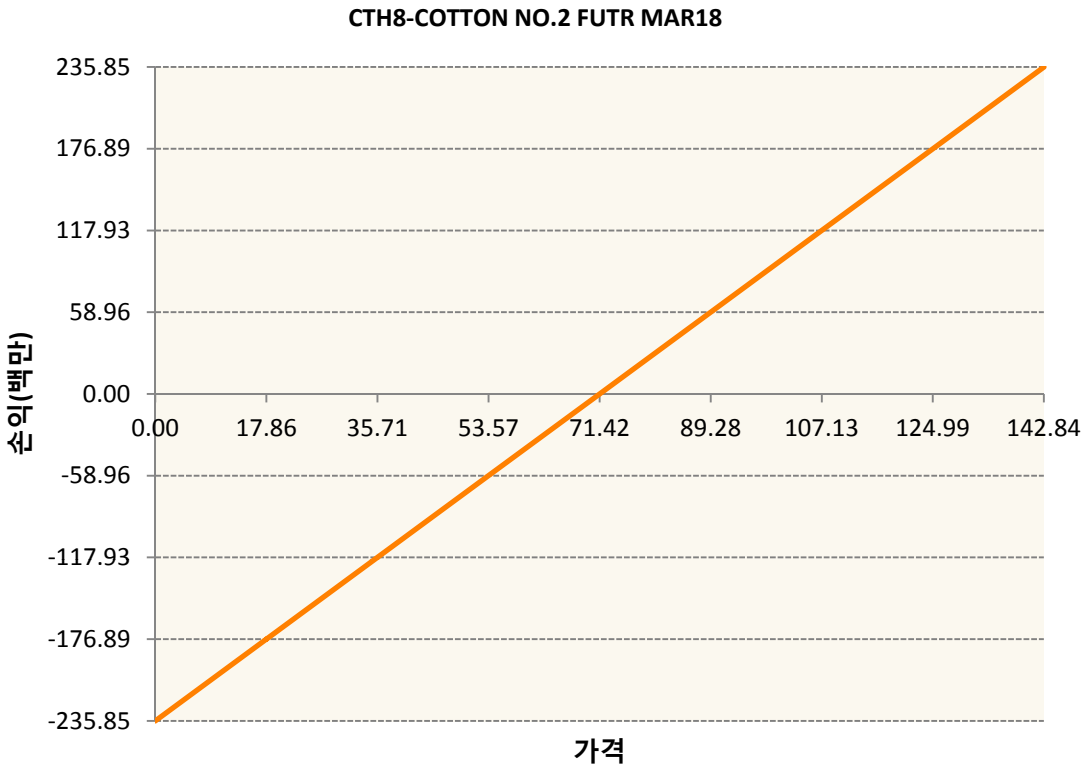
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,532	325	4,207	

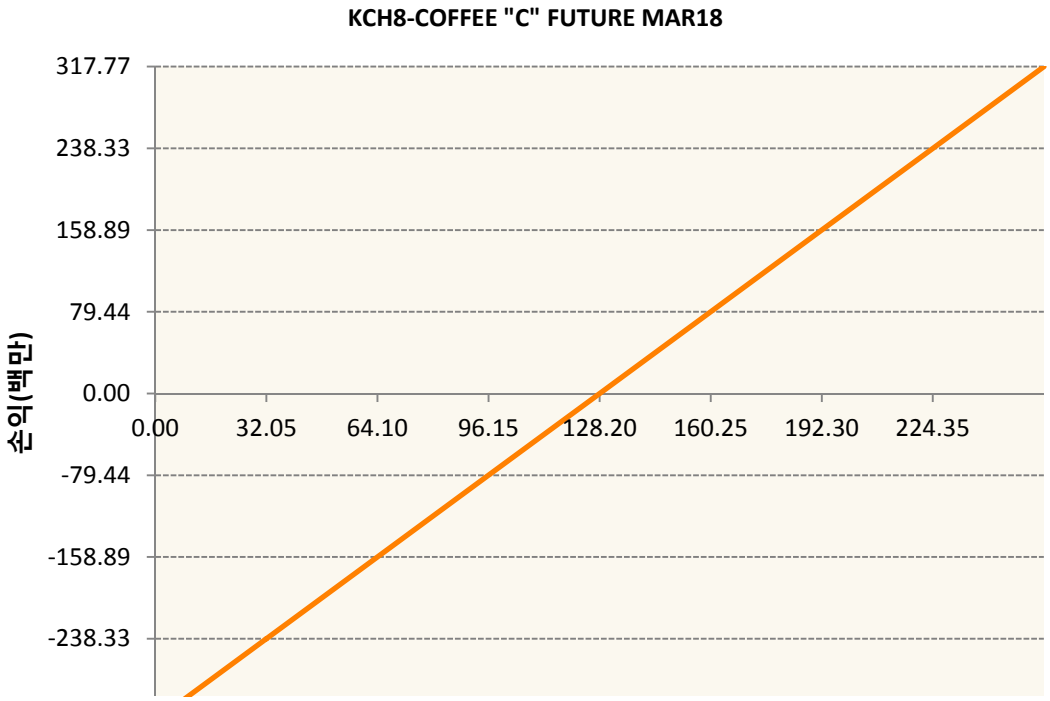
2. 만기시점의 손익구조

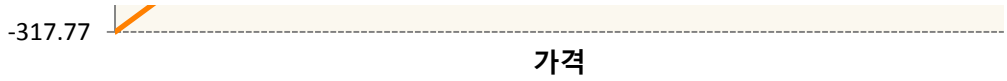


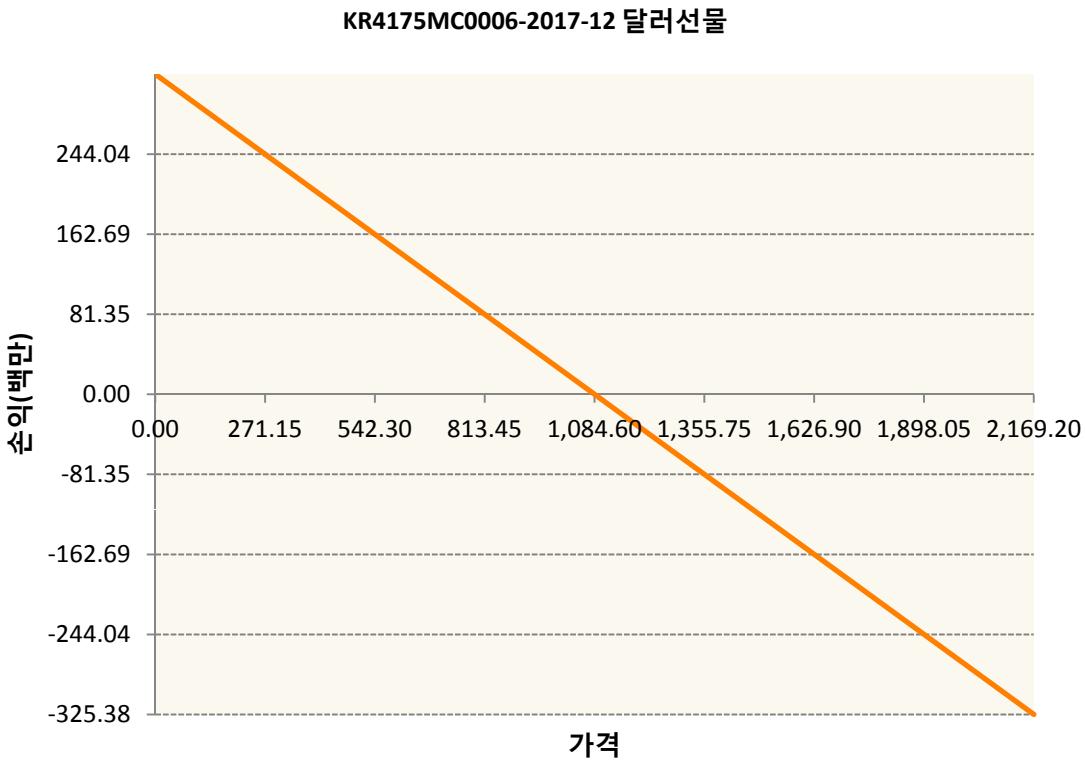


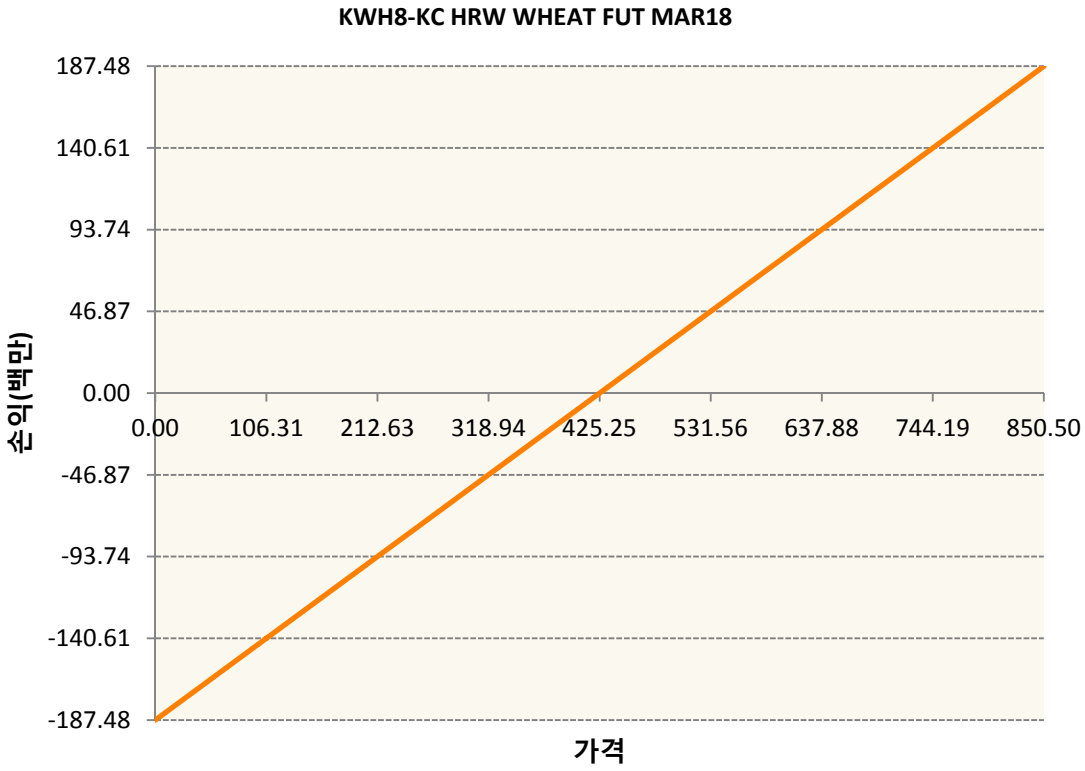

-542.35
-813.52
-1,084.69
가격

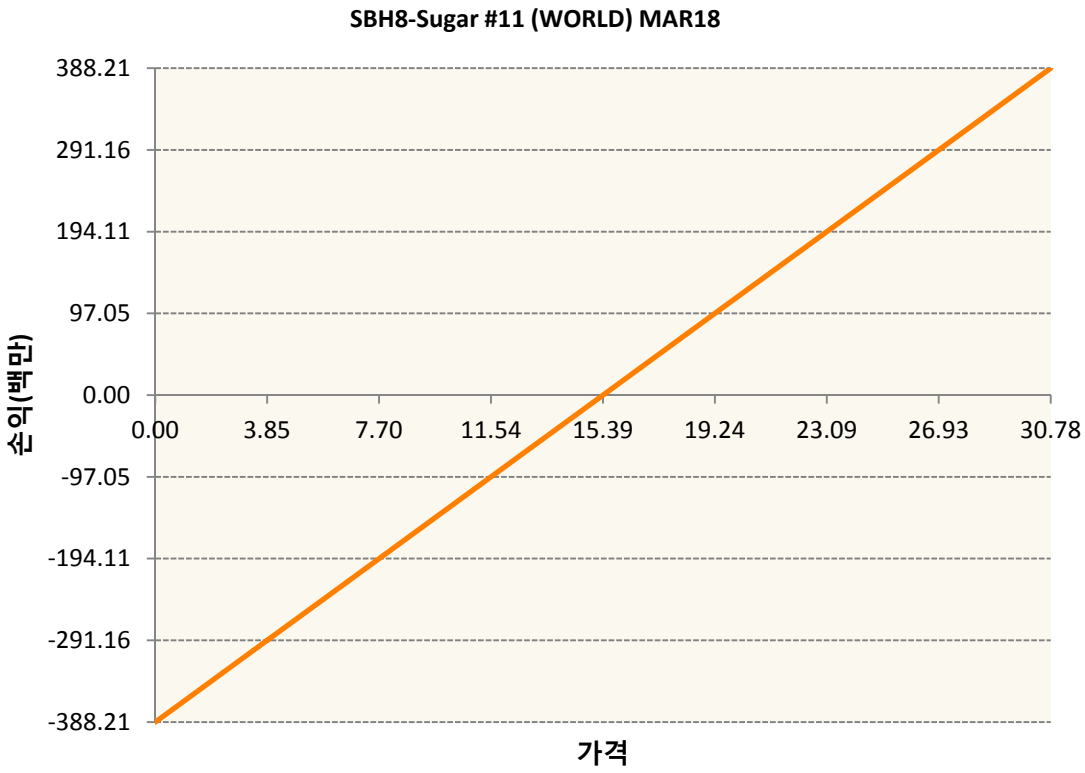

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
235.85
176.89
117.93
58.96
0.00
-58.96
-117.93
-176.89
-235.85
0.00
17.86
35.71
53.57
71.42
89.28
107.13
124.99
142.84
손익(백만)
가격

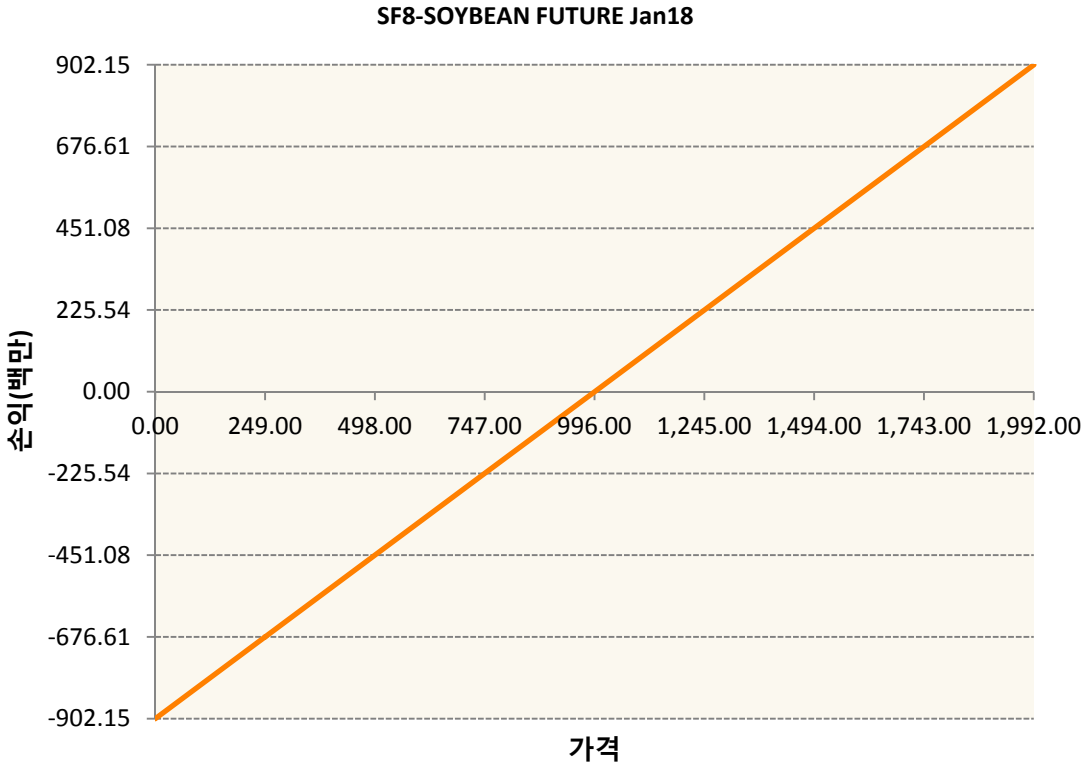

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
317.77
238.33
158.89
79.44
0.00
-79.44
-158.89
-238.33
0.00
32.05
64.10
96.15
128.20
160.25
192.30
224.35
손익(백만)


-317.77
가격

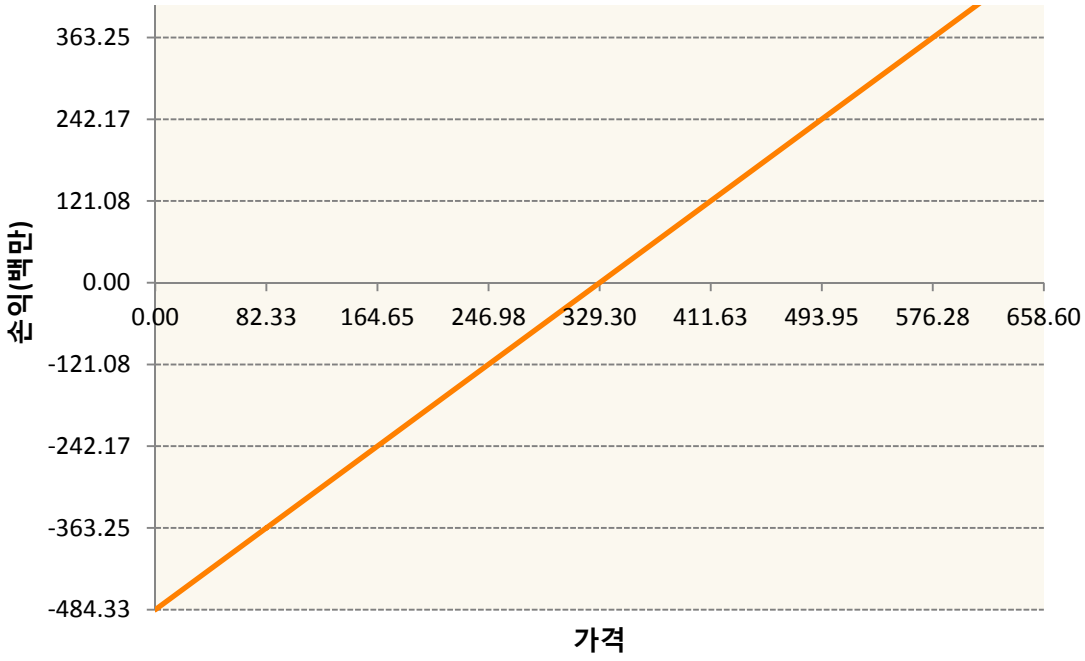

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
244.04
162.69
81.35
0.00
-81.35
-162.69
-244.04
-325.38
0.00
271.15
542.30
813.45
1,084.60
1,355.75
1,626.90
1,898.05
2,169.20
손익(백만)
가격

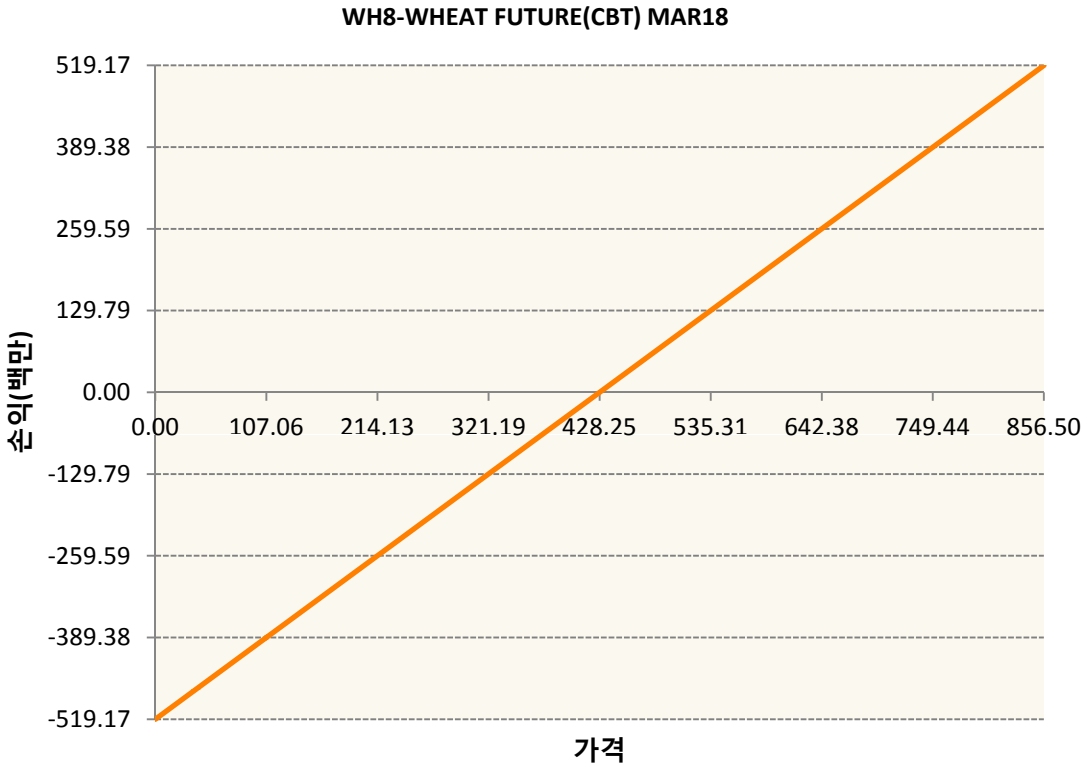

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
187.48
140.61
93.74
46.87
0.00
-46.87
-93.74
-140.61
-187.48
0.00
106.31
212.63
318.94
425.25
531.56
637.88
744.19
850.50
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
388.21
291.16
194.11
97.05
0.00
-97.05
-194.11
-291.16
-388.21
0.00
3.85
7.70
11.54
15.39
19.24
23.09
26.93
30.78
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
902.15
676.61
451.08
225.54
0.00
-225.54
-451.08
-676.61
-902.15
0.00
249.00
498.00
747.00
996.00
1,245.00
1,494.00
1,743.00
1,992.00
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
484.33





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	33
CH8	CORN FUTURE MAR18	87
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	39
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	42

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

399