공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

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	2017-11-30
기준일	2017-11-29

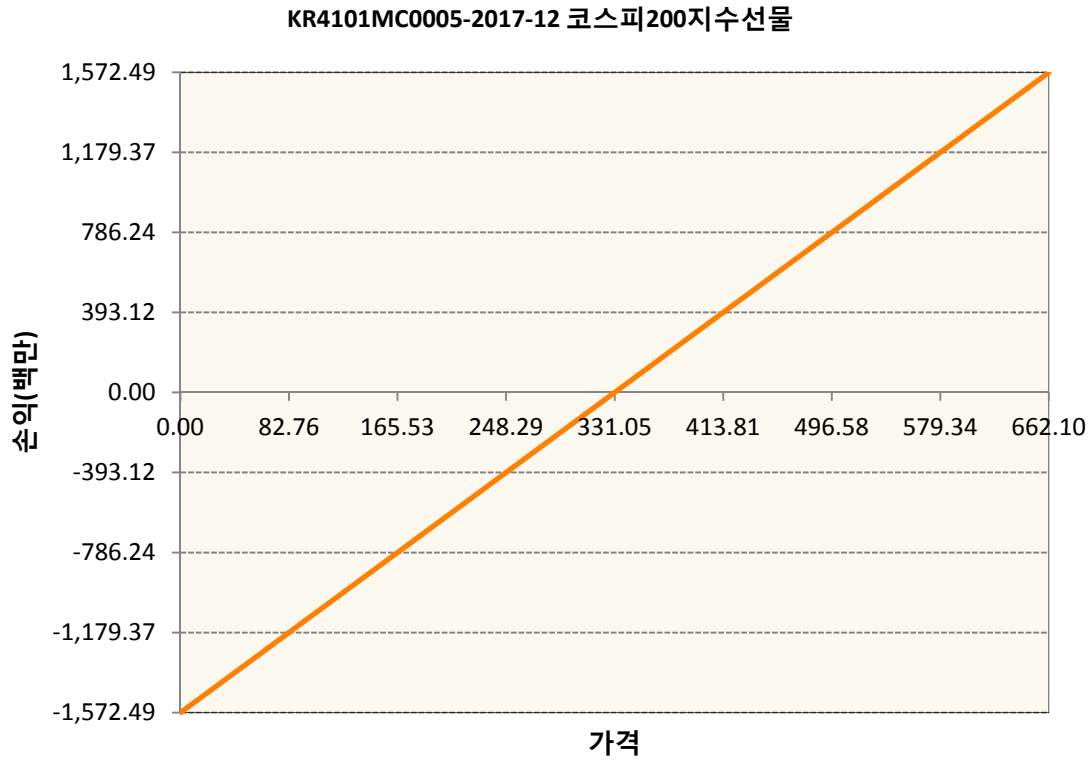
스마트인덱스모

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	2017-11-30
기준일	2017-11-29

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	1,080

* 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	2017-11-30
기준일	2017-11-29

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	405

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

372

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

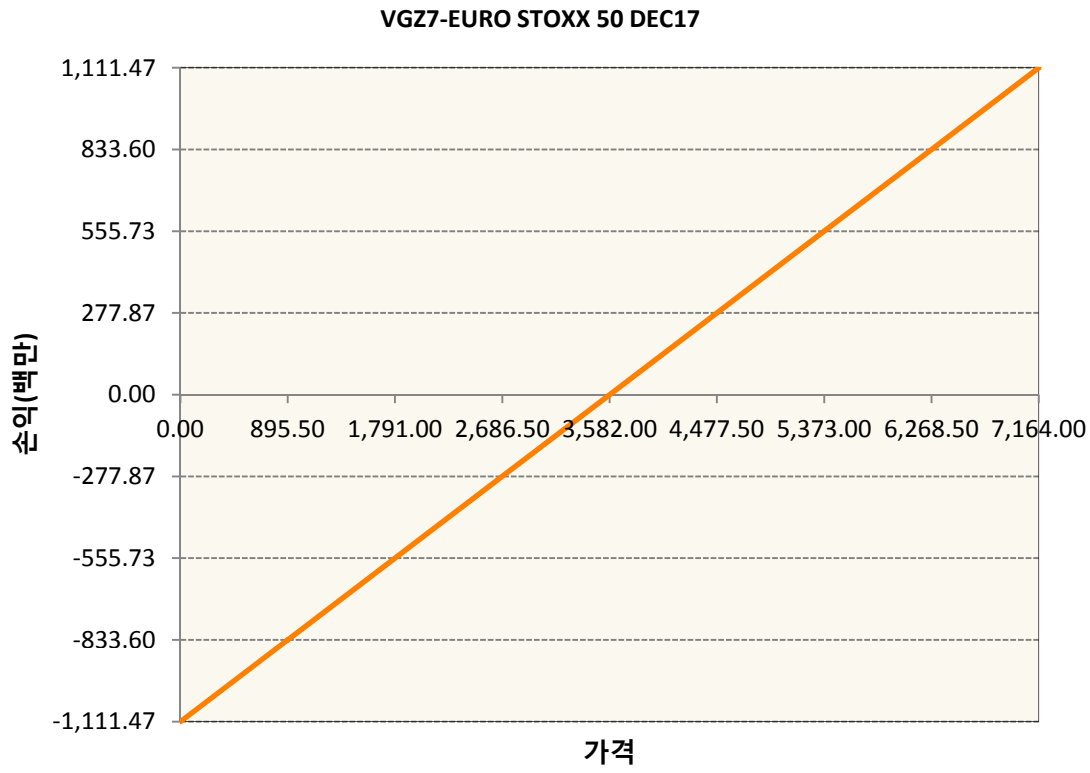
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

51

공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

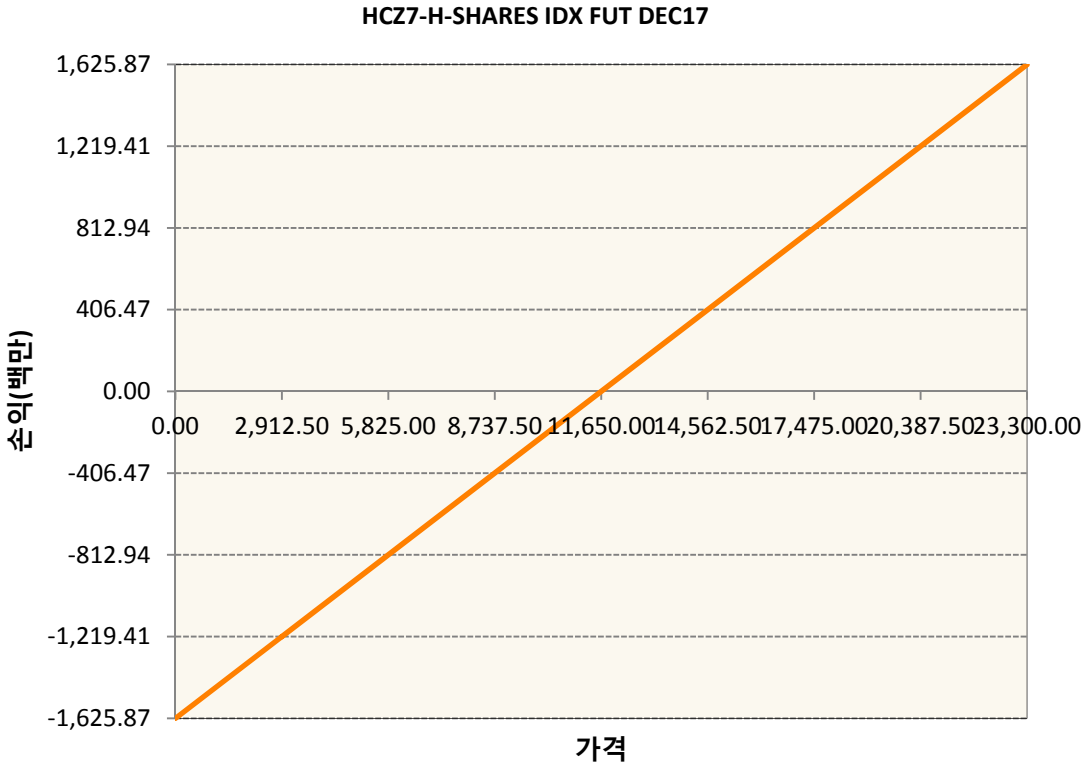
차이나인덱스모(주식-파생형)

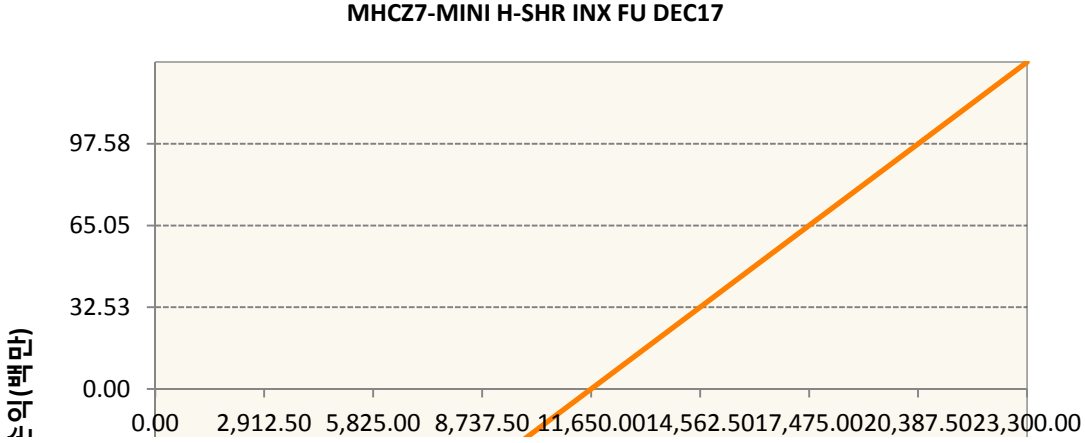
1. 계약금액

(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	1,626	0	1,626	
누계	유가증권	선물	130	0	130	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	130
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	93

공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

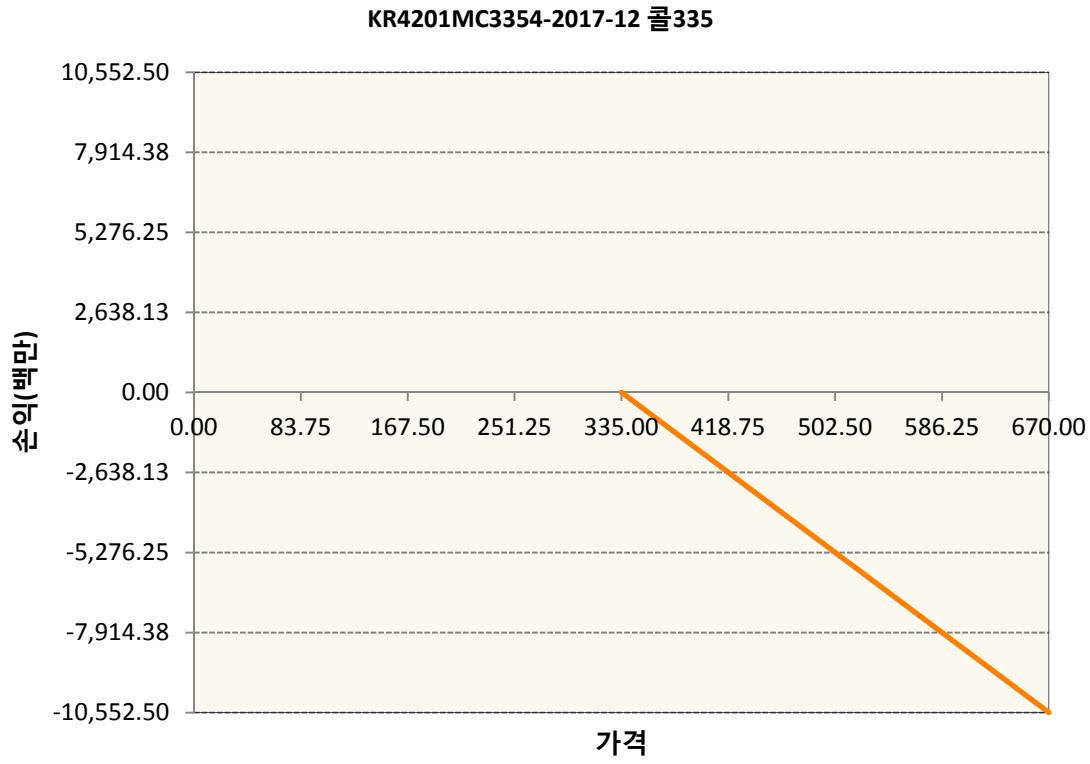
커버드콜모(주식혼합-파생형)

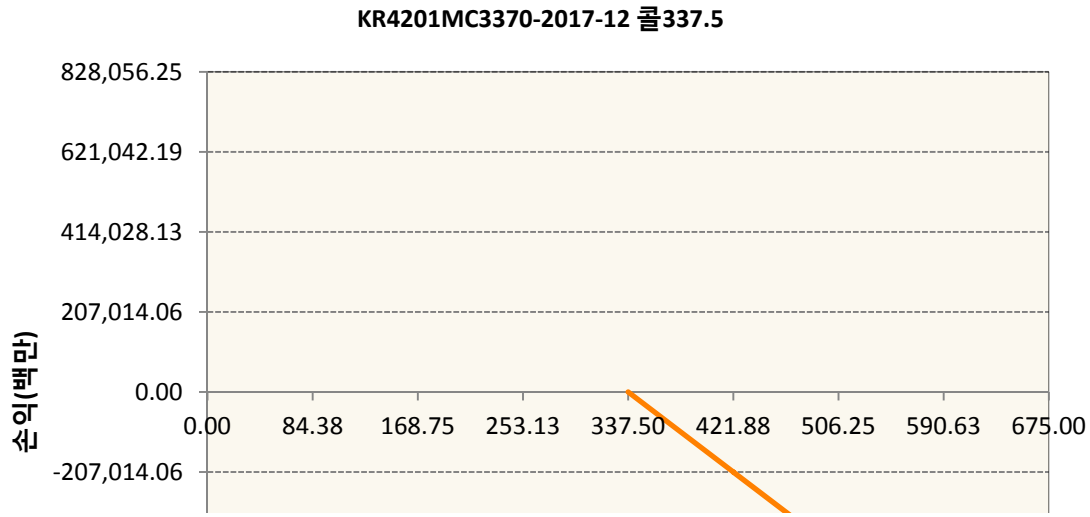
1. 계약금액

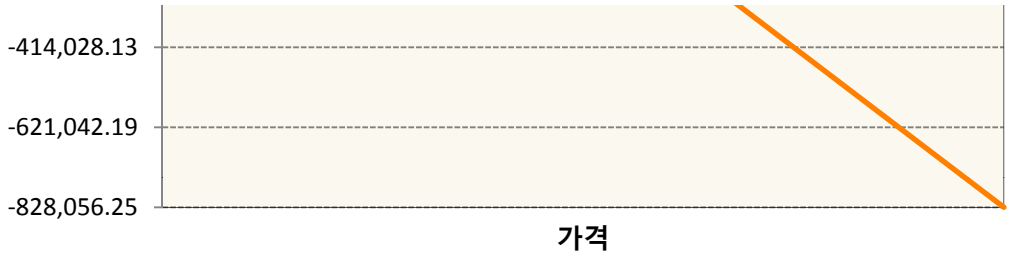
(단위:백만원)

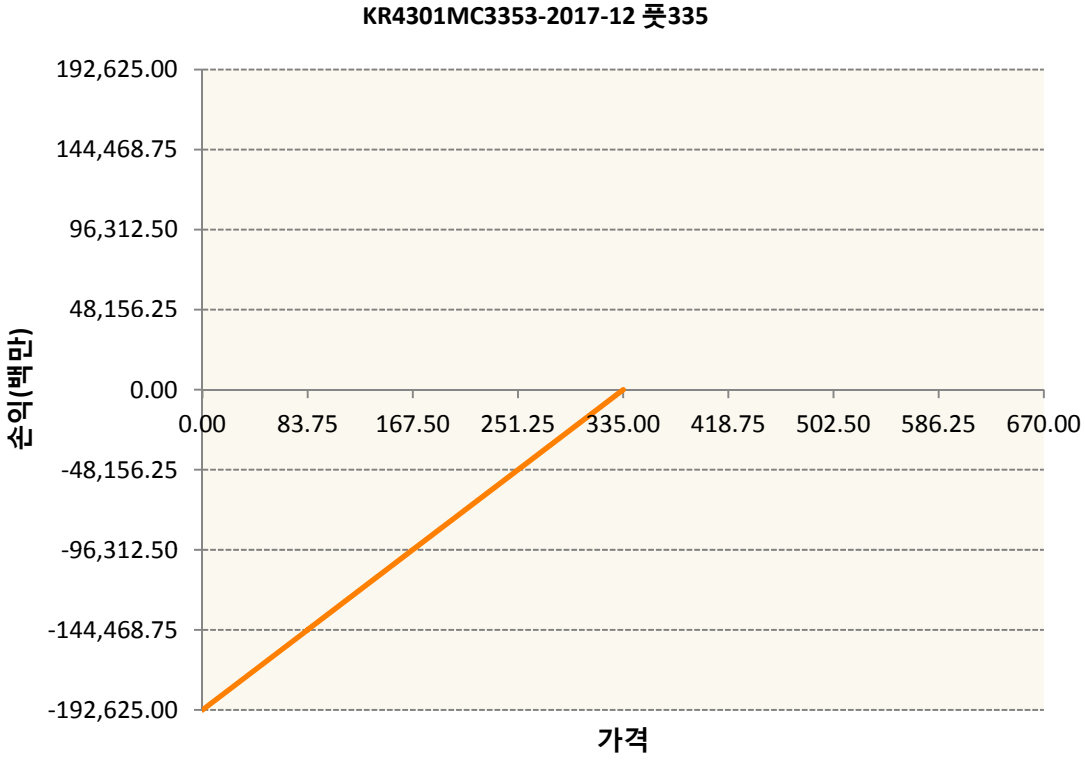
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

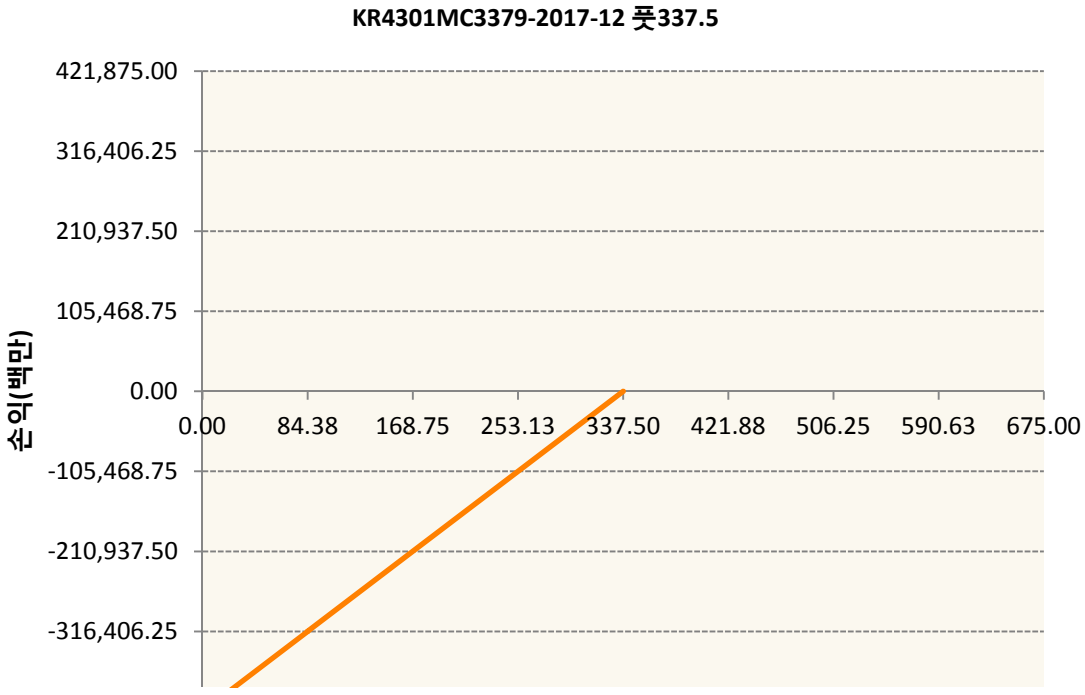
2. 만기시점의 손익구조






-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							603
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	150	149	148	145	142	138	133
-5.33%	145	141	136	129	122	113	104
-2.67%	121	111	99	87	74	60	46
0%	51	34	17	0	-17	-34	-51
2.67%	-91	-108	-125	-143	-160	-177	-195
5.33%	-302	-313	-325	-338	-352	-366	-381
8.00%	-555	-561	-567	-575	-583	-593	-603
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							44,185
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9,516	9,469	9,384	9,249	9,058	8,806	8,493
-5.33%	9,273	9,041	8,723	8,319	7,834	7,273	6,643
-2.67%	7,981	7,305	6,538	5,694	4,786	3,825	2,818
0%	3,713	2,501	1,262	0	-1,279	-2,571	-3,874
2.67%	-5,703	-7,082	-8,464	-9,847	-11,233	-12,619	-14,007
5.33%	-20,726	-21,758	-22,850	-23,989	-25,167	-26,376	-27,610
8.00%	-39,714	-40,238	-40,866	-41,587	-42,387	-43,256	-44,185
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,316
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,314	-14,314	-14,314	-14,314	-14,314	-14,315	-14,316
-5.33%	-9,247	-9,247	-9,248	-9,251	-9,255	-9,262	-9,273
-2.67%	-4,197	-4,216	-4,242	-4,278	-4,323	-4,376	-4,438
0%	388	263	133	0	-137	-276	-417
2.67%	2,860	2,738	2,609	2,476	2,340	2,201	2,059
5.33%	3,313	3,293	3,263	3,224	3,176	3,118	3,052
8.00%	3,334	3,333	3,331	3,327	3,321	3,310	3,295
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							31,888
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,887	-31,887	-31,887	-31,887	-31,887	-31,887	-31,888
-5.33%	-20,871	-20,871	-20,872	-20,873	-20,878	-20,886	-20,899
-2.67%	-9,866	-9,883	-9,912	-9,955	-10,014	-10,090	-10,182
0%	644	448	233	0	-246	-504	-772
2.67%	7,634	7,308	6,979	6,648	6,314	5,980	5,644

5.33%	9,470	9,380	9,265	9,127	8,968	8,790	8,595
8.00%	9,599	9,594	9,584	9,565	9,536	9,495	9,440

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

99,970

공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

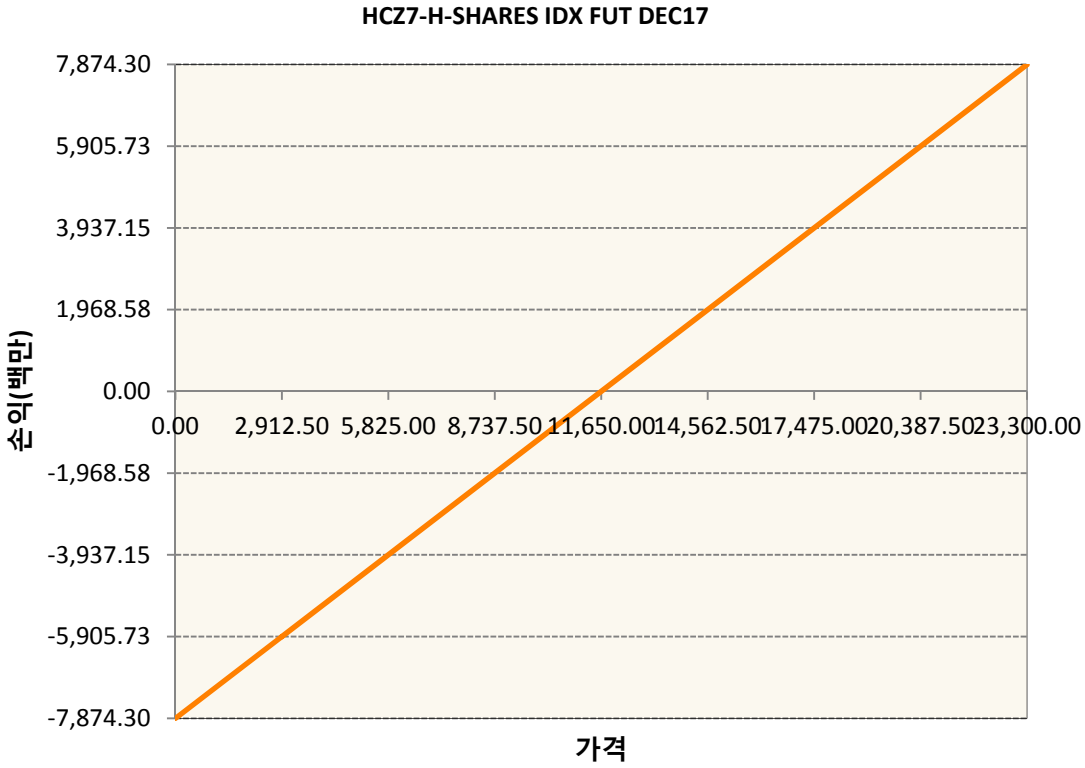
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

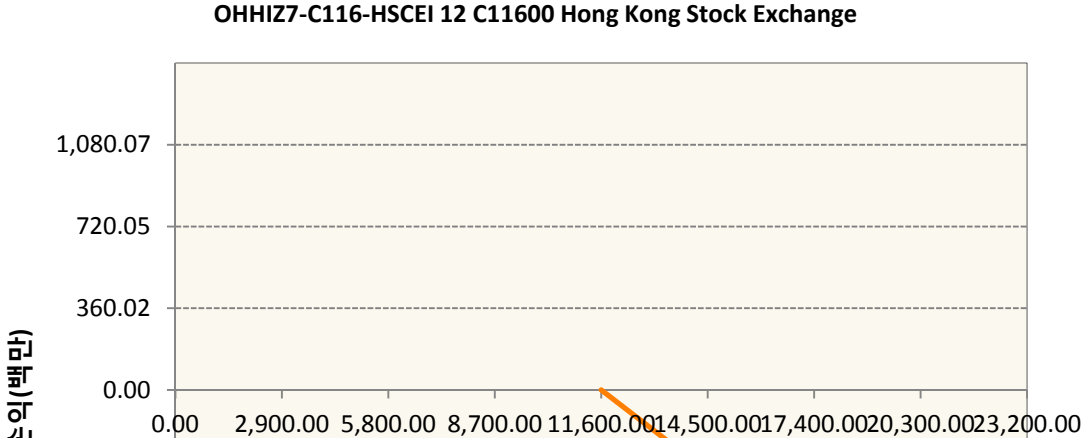
1. 계약금액

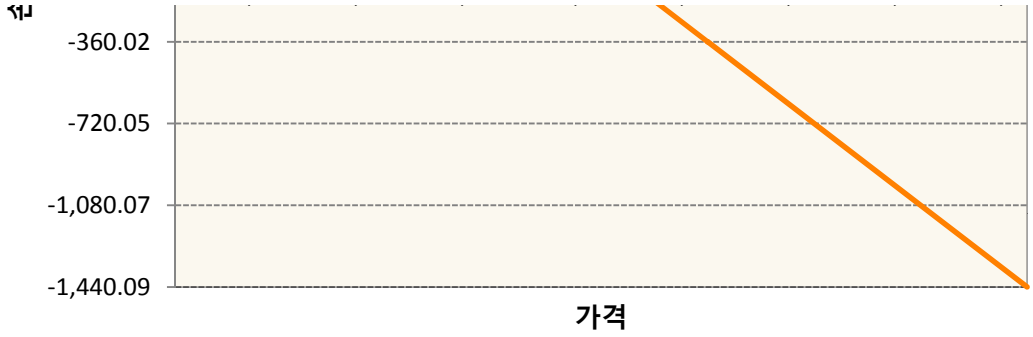
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,874	0	7,874	
누계	유가증권	옵션	0	4,182	-4,182	장내

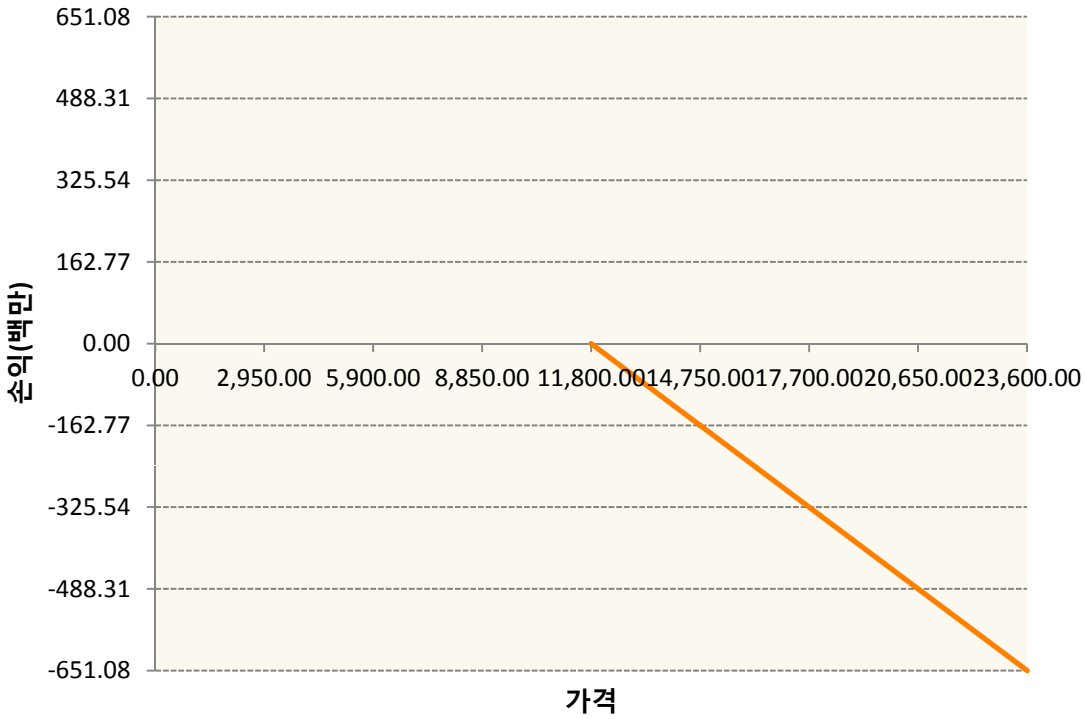
2. 만기시점의 손익구조



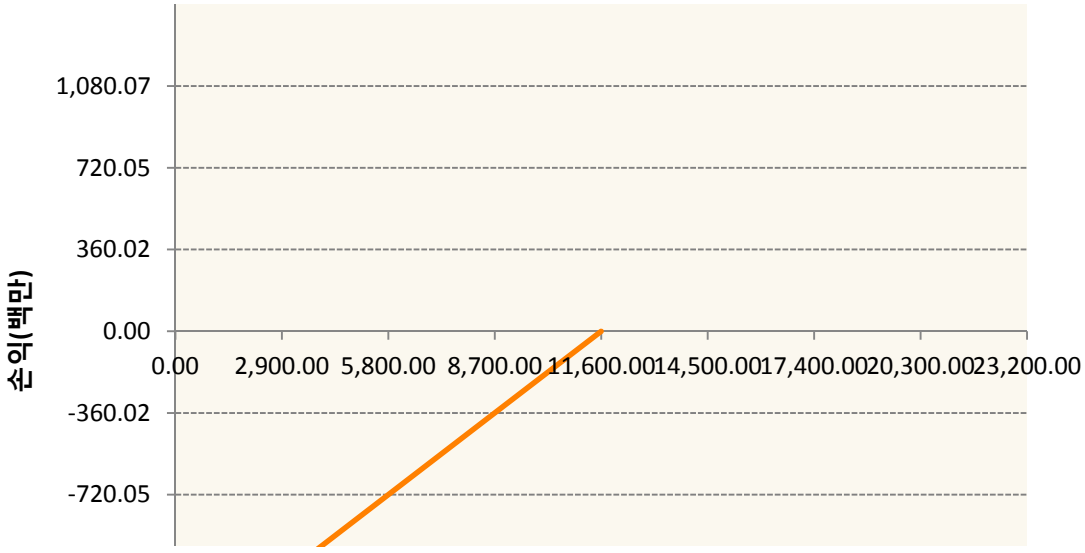


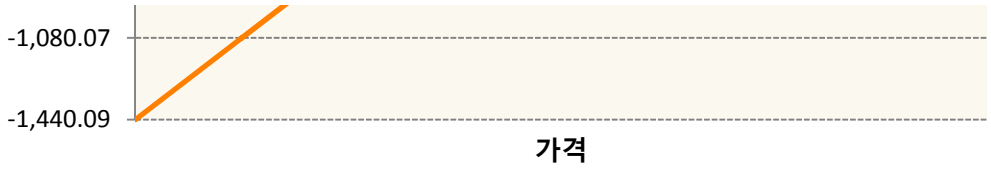


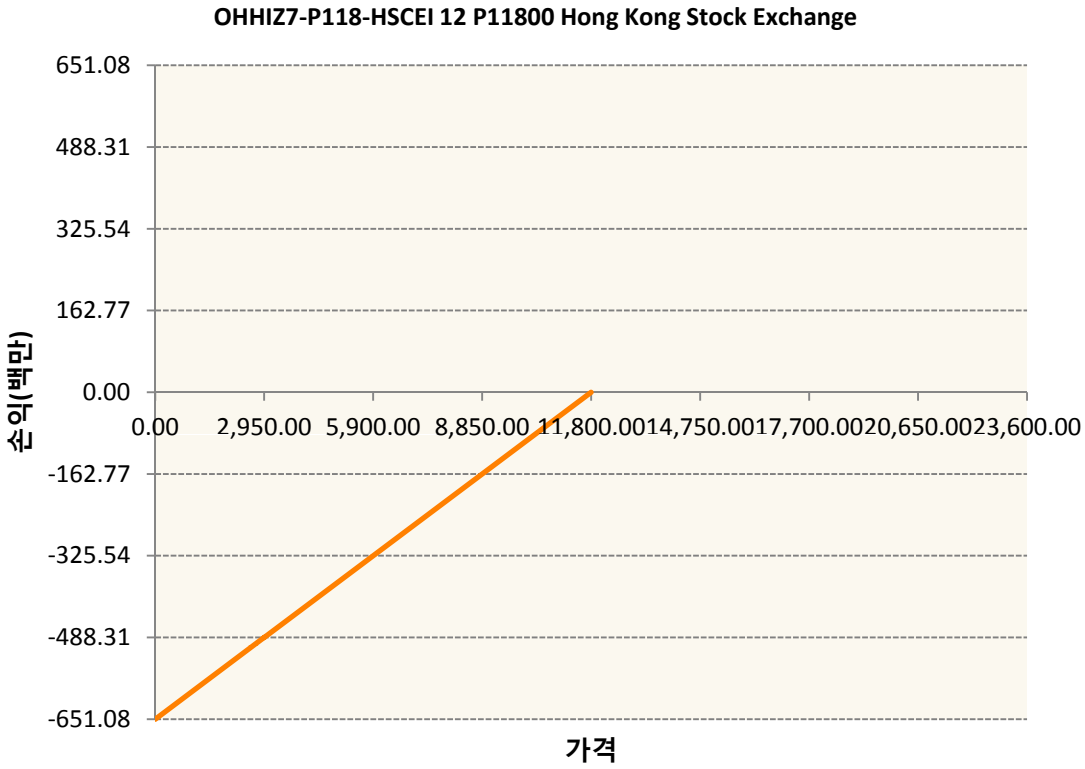
OHHIZ7-C118-HSCEI 12 C11800 Hong Kong Stock Exchange



OHHIZ7-P116-HSCEI 12 P11600 Hong Kong Stock Exchange







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	630
OHHIZ7-C11	HSCEI 12 C11600 Hong Kong Stock Exchange	115
OHHIZ7-C11	HSCEI 12 C11800 Hong Kong Stock Exchange	52
OHHIZ7-P11	HSCEI 12 P11600 Hong Kong Stock Exchange	115
OHHIZ7-P11	HSCEI 12 P11800 Hong Kong Stock Exchange	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	682

공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

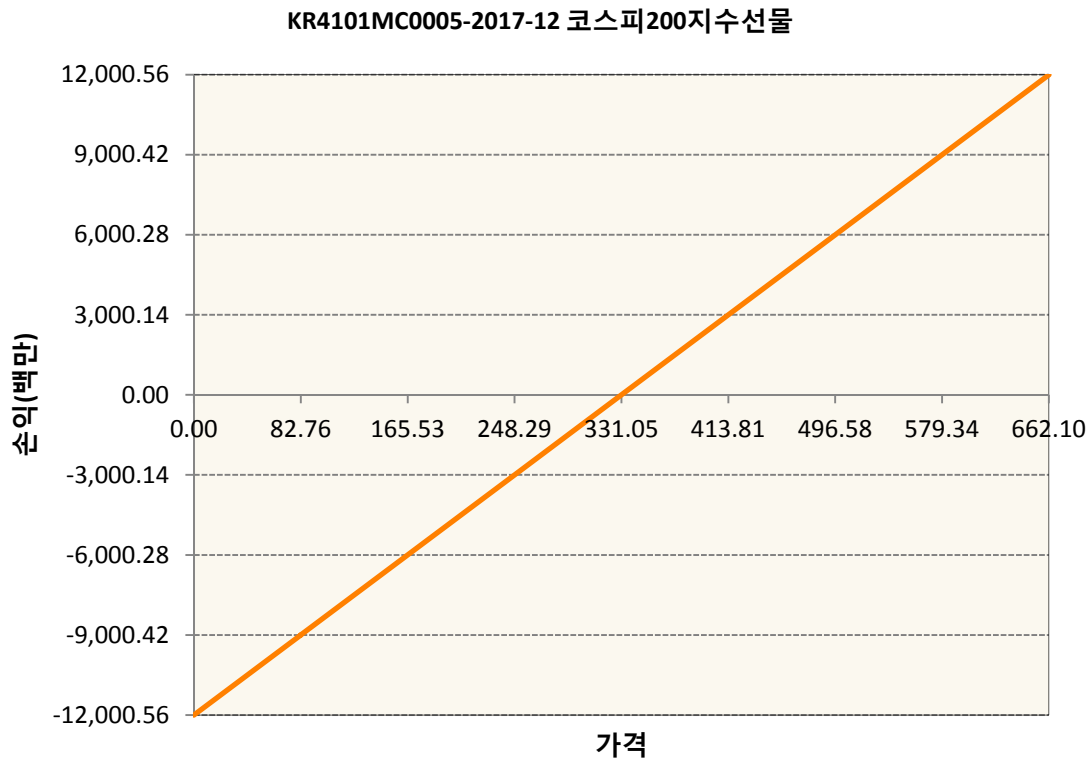
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

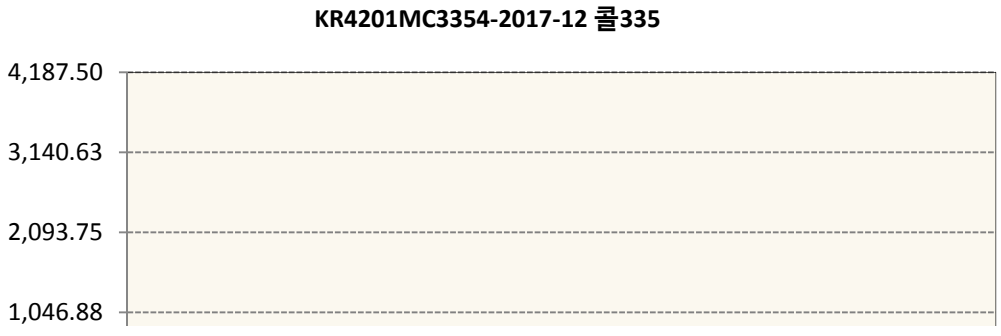
1. 계약금액

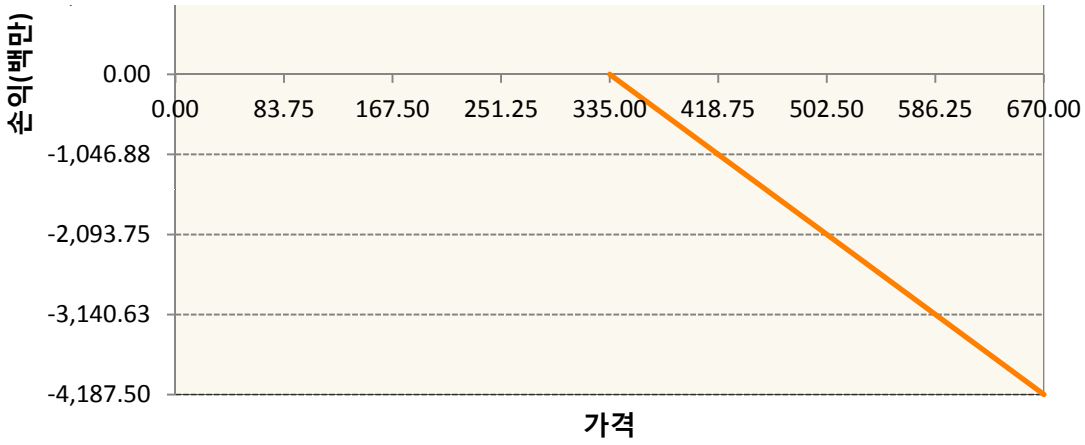
(단위:백만원)

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

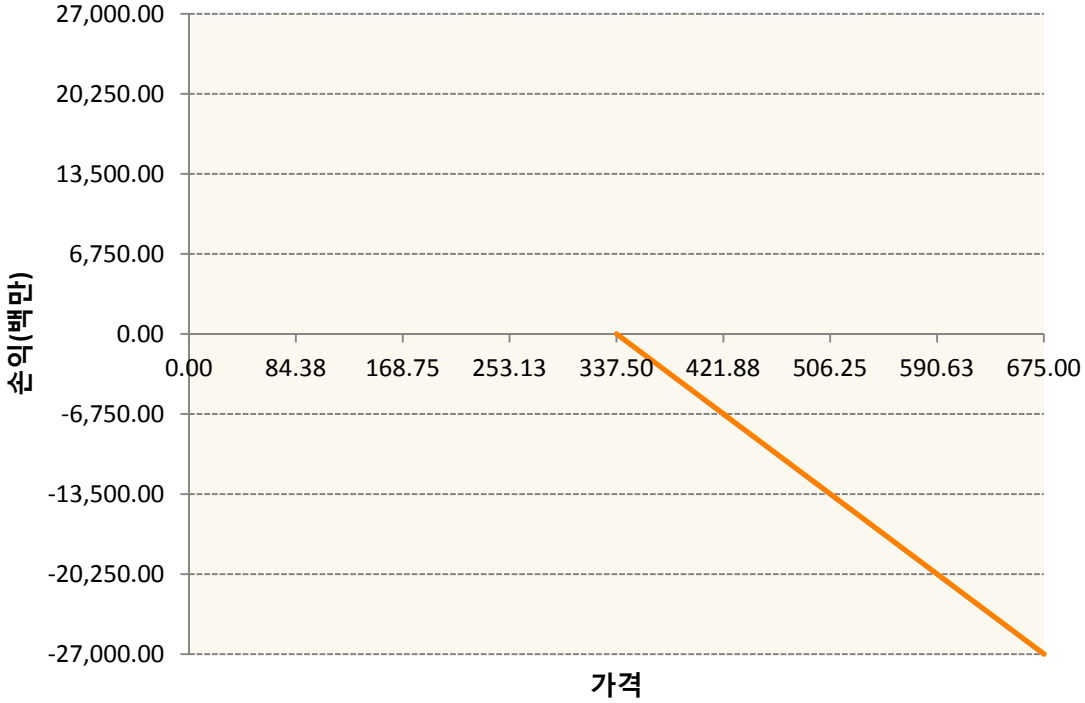
2. 만기시점의 손익구조



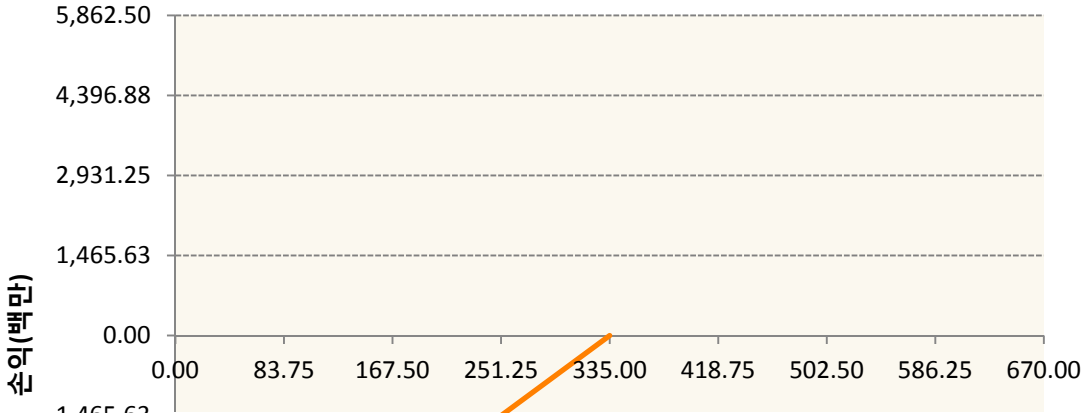




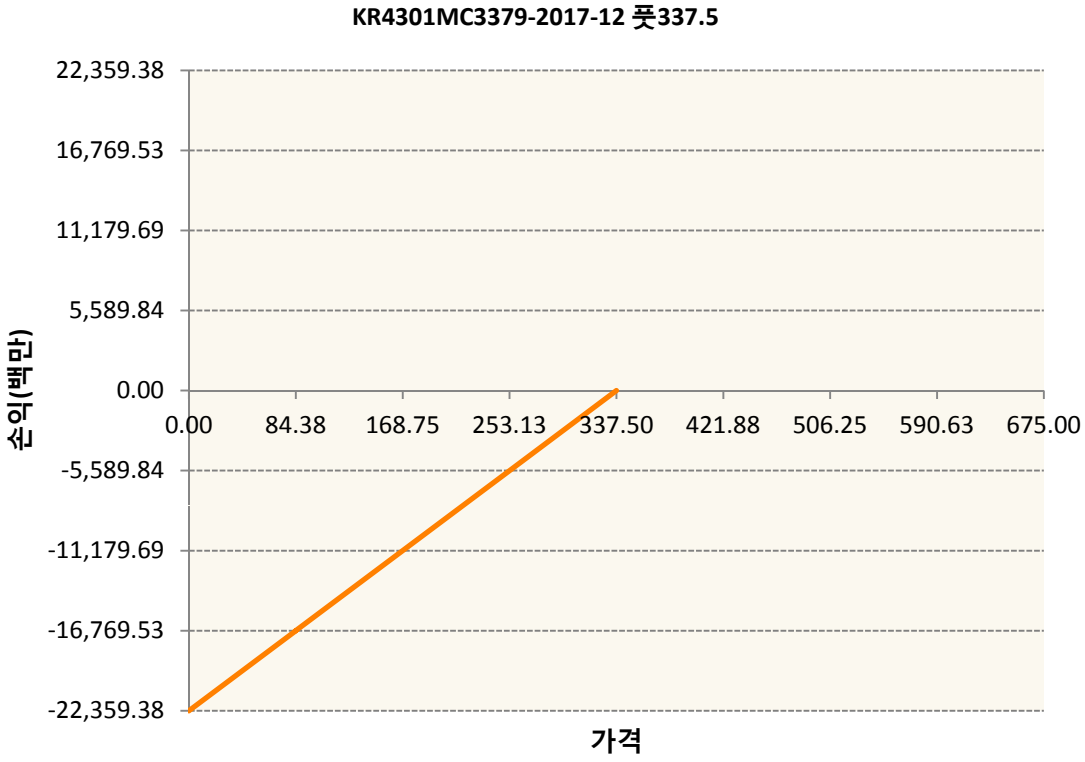
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,458
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458	-1,458
-5.33%	-972	-972	-972	-972	-972	-972	-972
-2.67%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	486	486	486	486	486	486	486
5.33%	972	972	972	972	972	972	972
8.00%	1,458	1,458	1,458	1,458	1,458	1,458	1,458
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						236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-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%	236	236	236	236	236	236	236
	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%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-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%	252	252	252	252	252	252	252
	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%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-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%	207	207	207	207	207	207	207
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%	-420	-420	-420	-420	-420	-420	-420
-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%	420	420	420	420	420	420	420
8.00%	631	631	631	631	631	631	631
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						473

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-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%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	473	473	473	473	473	473	473
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					959

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-959	-959	-959	-959	-959	-959	-959
-5.33%	-639	-639	-639	-639	-639	-639	-639
-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%	639	639	639	639	639	639	639
8.00%	959	959	959	959	959	959	959
	KR4201MC3	2017-12 콜335					239

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	59	59	58	56	55	53
-5.33%	58	56	54	51	48	45	41
-2.67%	48	44	39	34	29	24	18
0%	20	13	7	0	-7	-14	-20
2.67%	-36	-43	-50	-57	-63	-70	-77
5.33%	-120	-124	-129	-134	-140	-145	-151
8.00%	-220	-222	-225	-228	-231	-235	-239
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,441

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	310	309	306	302	295	287	277
-5.33%	302	295	284	271	255	237	217
-2.67%	260	238	213	186	156	125	92
0%	121	82	41	0	-42	-84	-126
2.67%	-186	-231	-276	-321	-366	-411	-457
5.33%	-676	-709	-745	-782	-821	-860	-900
8.00%	-1,295	-1,312	-1,333	-1,356	-1,382	-1,410	-1,441
	KR4301MC3	2017-12 풋335					436

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-436	-436	-436	-436	-436	-436	-436
-5.33%	-281	-281	-281	-282	-282	-282	-282

-2.67%	-128	-128	-129	-130	-132	-133	-135
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	87	83	79	75	71	67	63
5.33%	101	100	99	98	97	95	93
8.00%	101	101	101	101	101	101	100
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,690

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,690	-1,690	-1,690	-1,690	-1,690	-1,690	-1,690
-5.33%	-1,106	-1,106	-1,106	-1,106	-1,107	-1,107	-1,108
-2.67%	-523	-524	-525	-528	-531	-535	-540
0%	34	24	12	0	-13	-27	-41
2.67%	405	387	370	352	335	317	299
5.33%	502	497	491	484	475	466	456
8.00%	509	509	508	507	505	503	500

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

9,527

공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

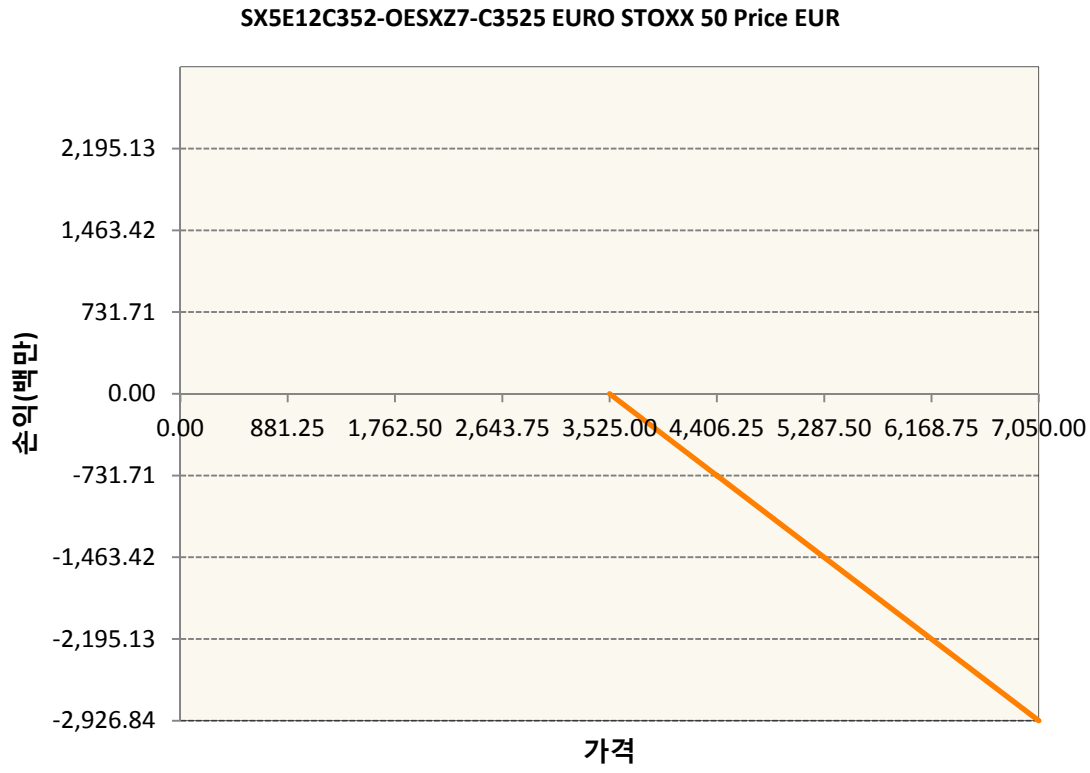
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

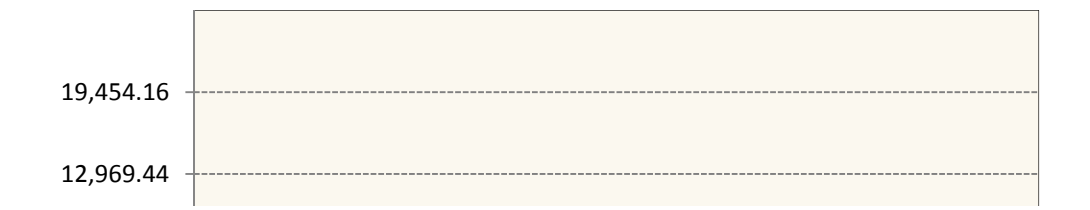
1. 계약금액

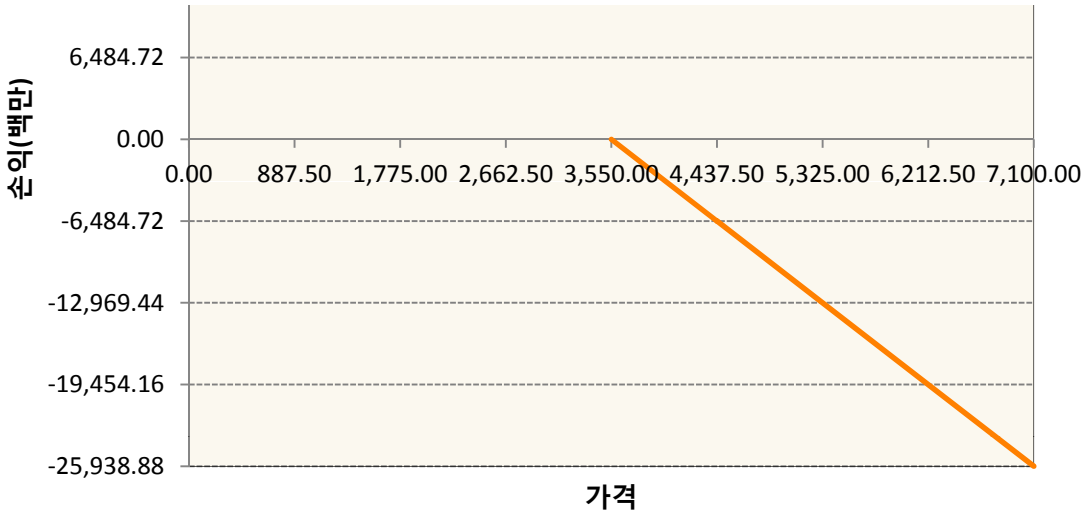
(단위:백만원)

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	21,304	0	21,304	
누계	유가증권	스왑	95,806	0	95,806	장외
누계	유가증권	옵션	0	57,731	-57,731	장내
누계	지수	스왑	51,097	0	51,097	장외

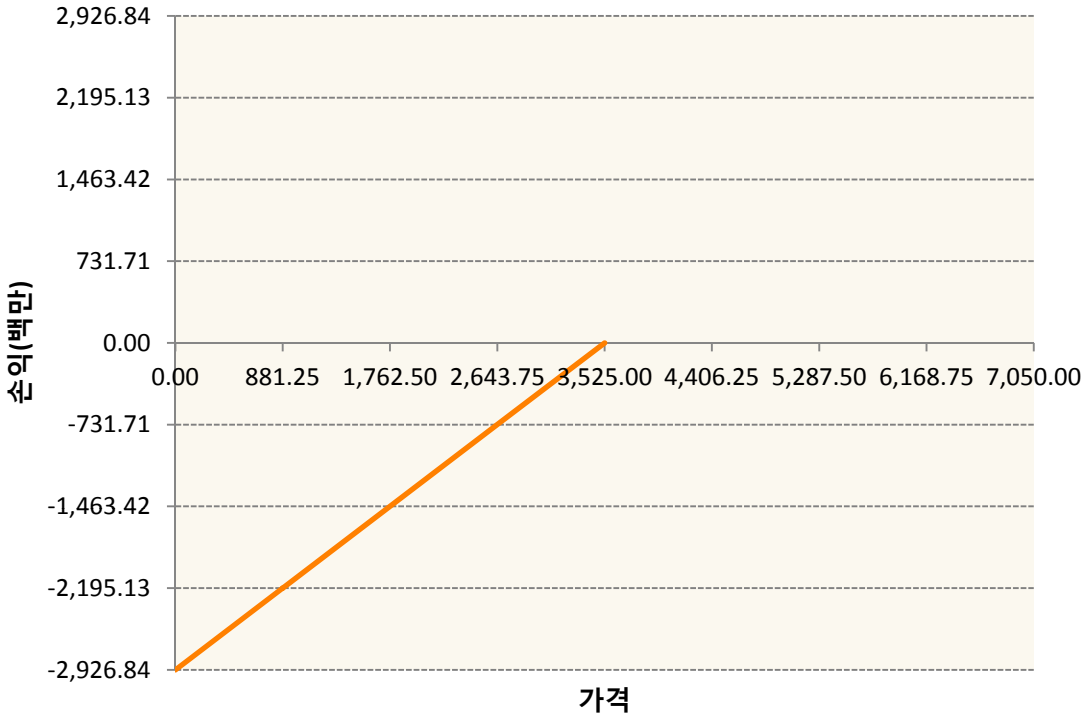
2. 만기시점의 손익구조



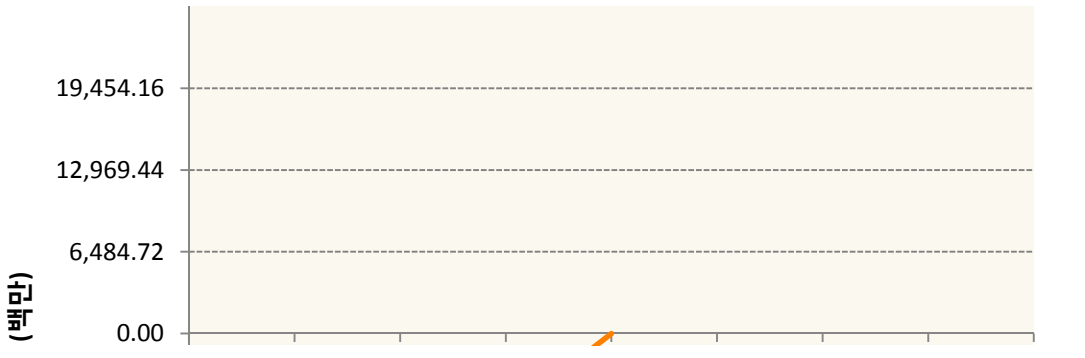


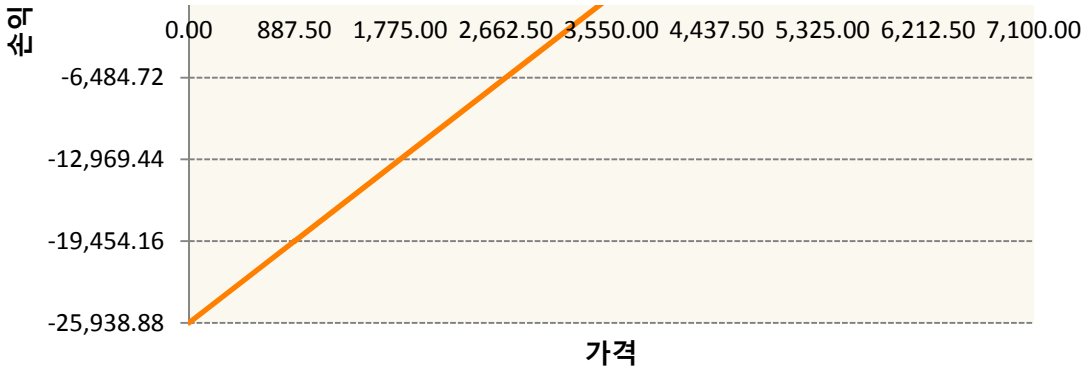


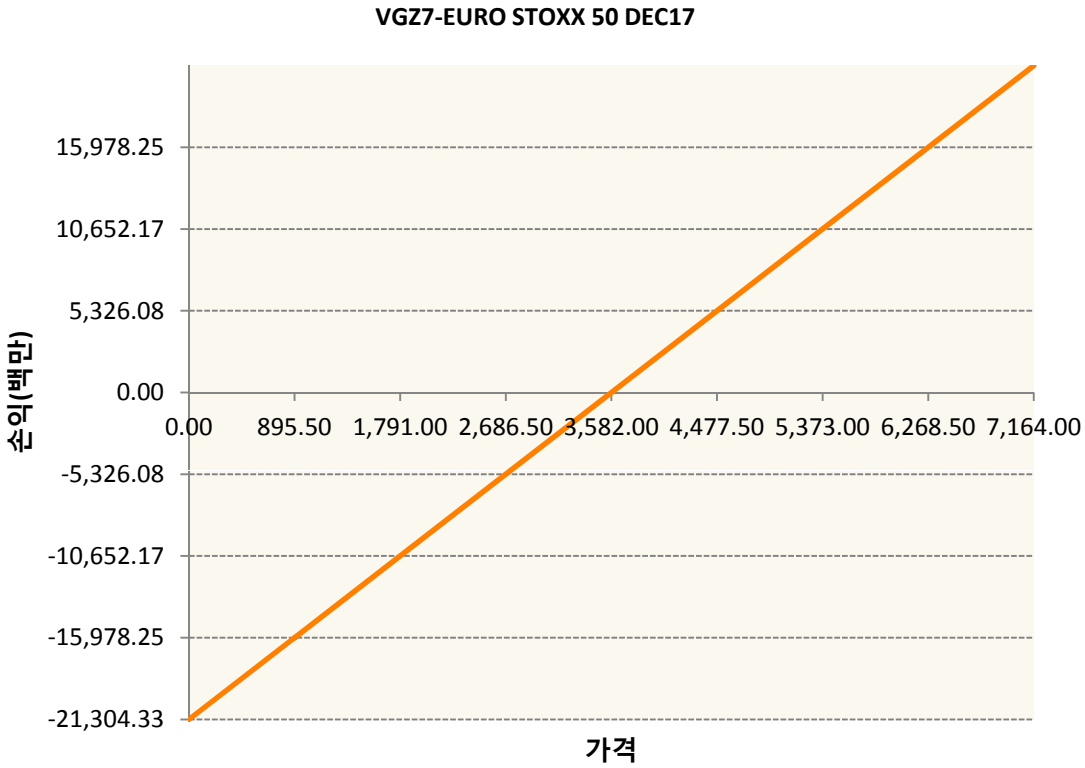
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	33
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	19
SX5E12C352	OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	234
SX5E12C355	OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,075
SX5E12P352	OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	234
SX5E12P355	OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,075
VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	1,704

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

3,683

공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

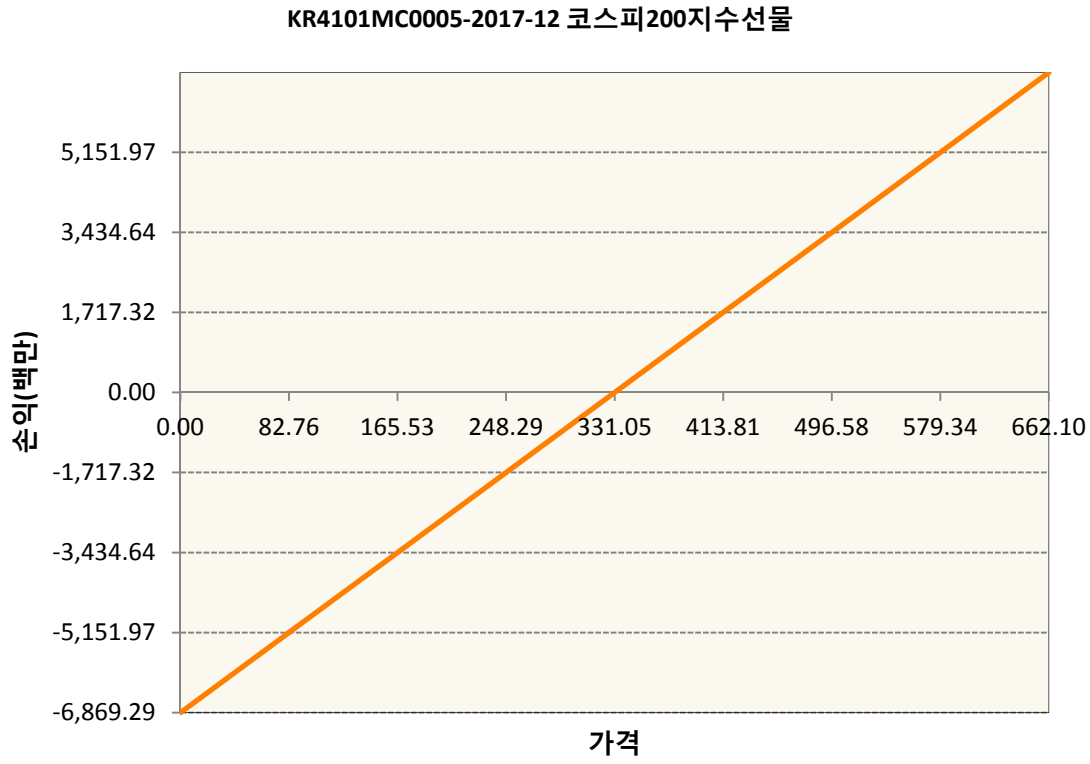
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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)

315

공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

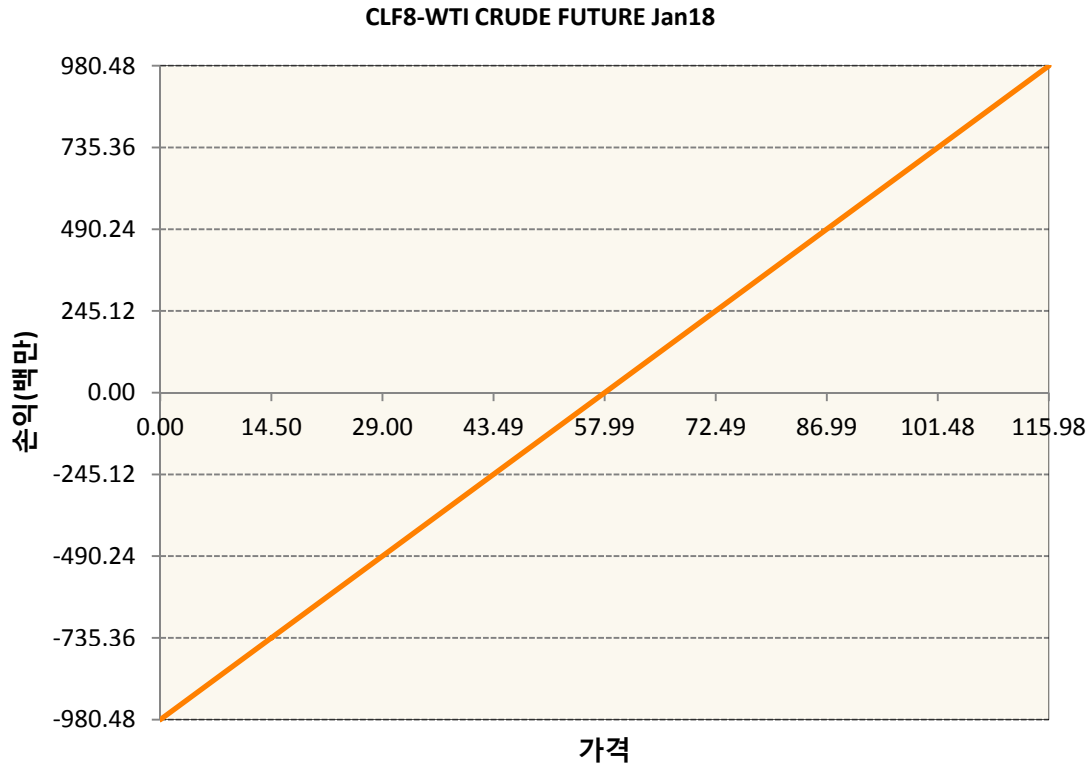
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

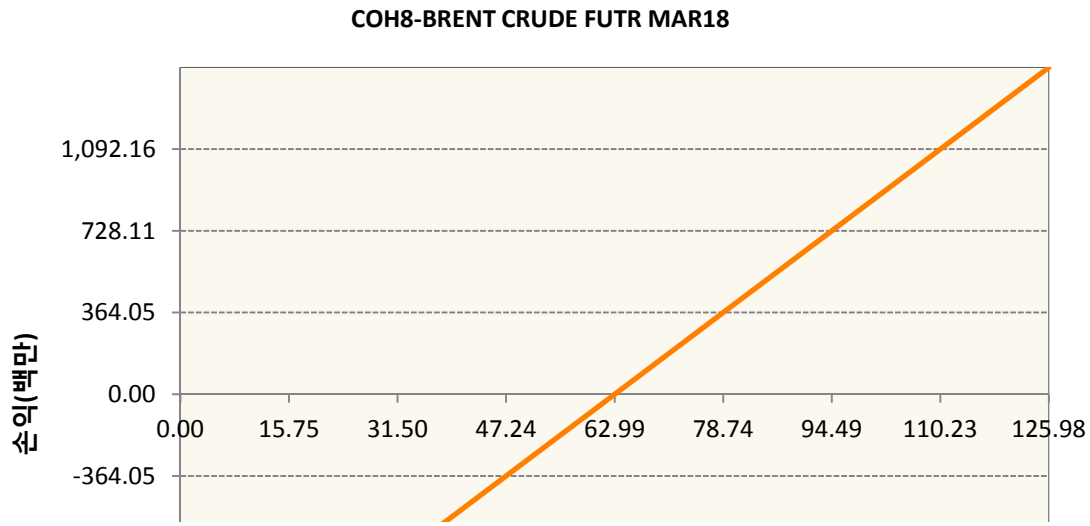
1. 계약금액

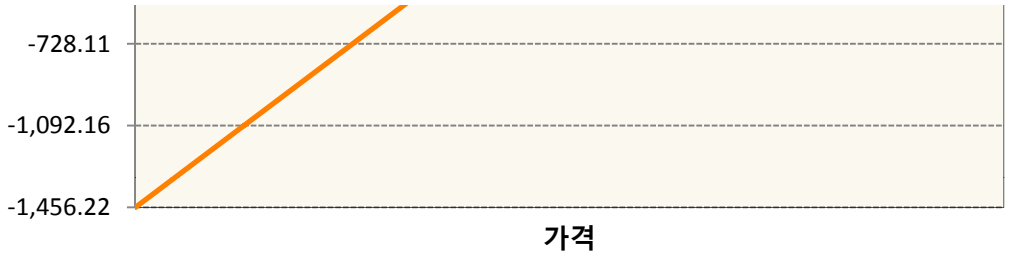
(단위:백만원)

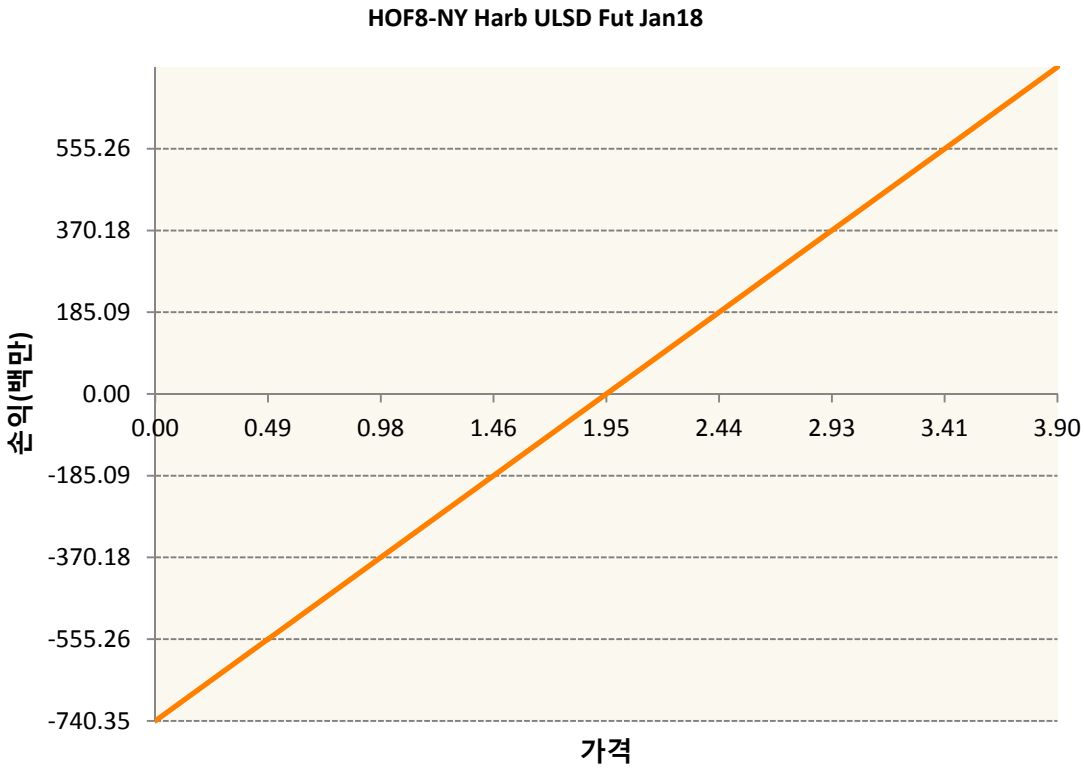
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,243	860	4,383	

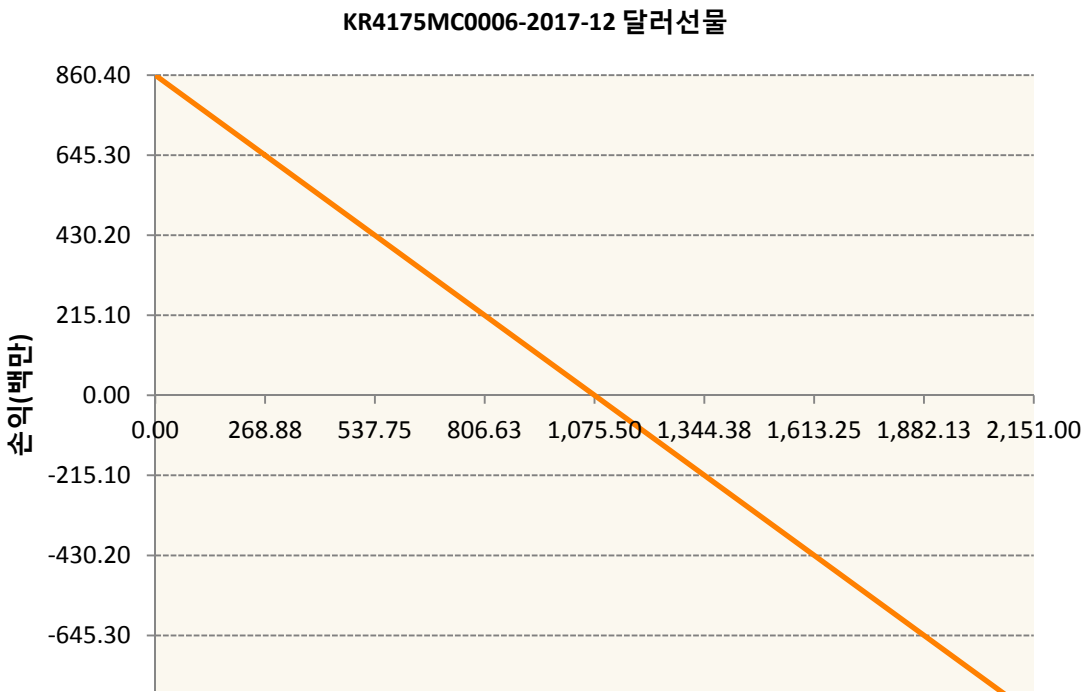
2. 만기시점의 손익구조

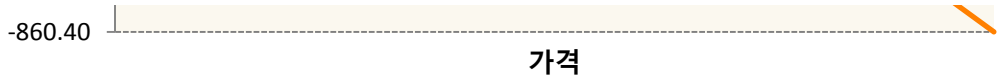


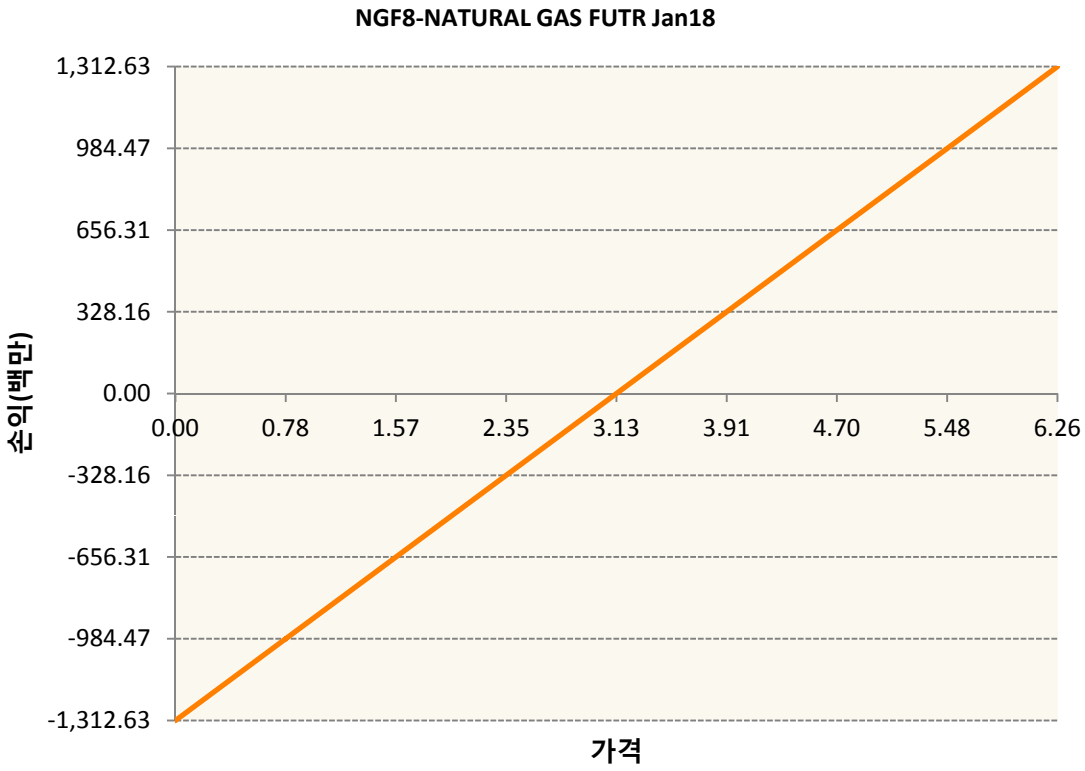


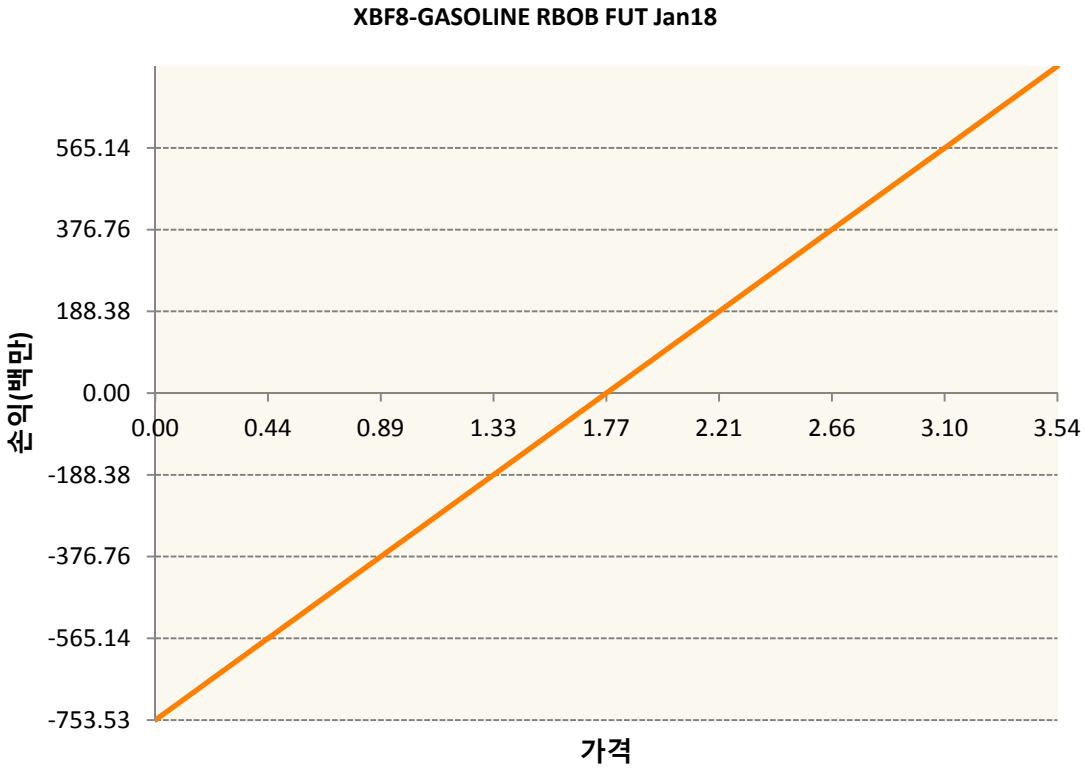

-728.11
-1,092.16
-1,456.22
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
555.26
370.18
185.09
0.00
-185.09
-370.18
-555.26
-740.35
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
860.40
645.30
430.20
215.10
0.00
-215.10
-430.20
-645.30
0.00
268.88
537.75
806.63
1,075.50
1,344.38
1,613.25
1,882.13
2,151.00
손익(백만)


-860.40
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,312.63
984.47
656.31
328.16
0.00
-328.16
-656.31
-984.47
-1,312.63
손익(백만)
0.00
0.78
1.57
2.35
3.13
3.91
4.70
5.48
6.26
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
565.14
376.76
188.38
0.00
-188.38
-376.76
-565.14
-753.53
손익(백만)
0.00
0.44
0.89
1.33
1.77
2.21
2.66
3.10
3.54
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	78
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	116
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	59
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	69
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	105
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	60

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

726

공시일	2017-11-30
기준일	2017-11-29

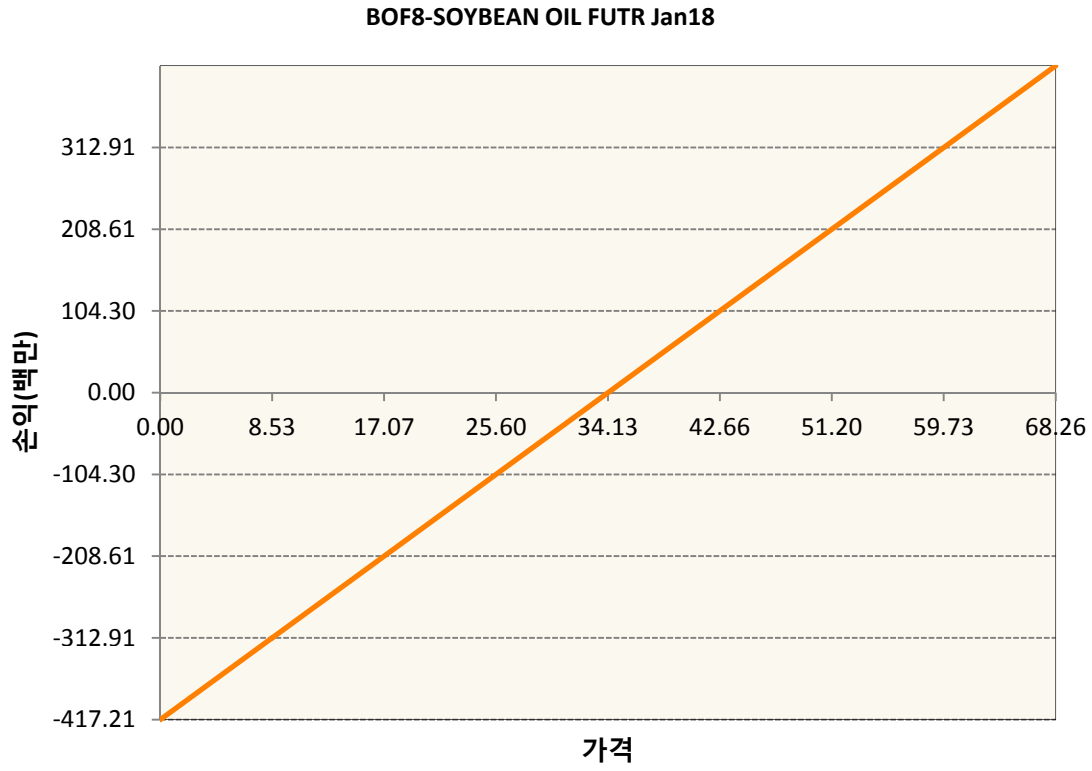
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

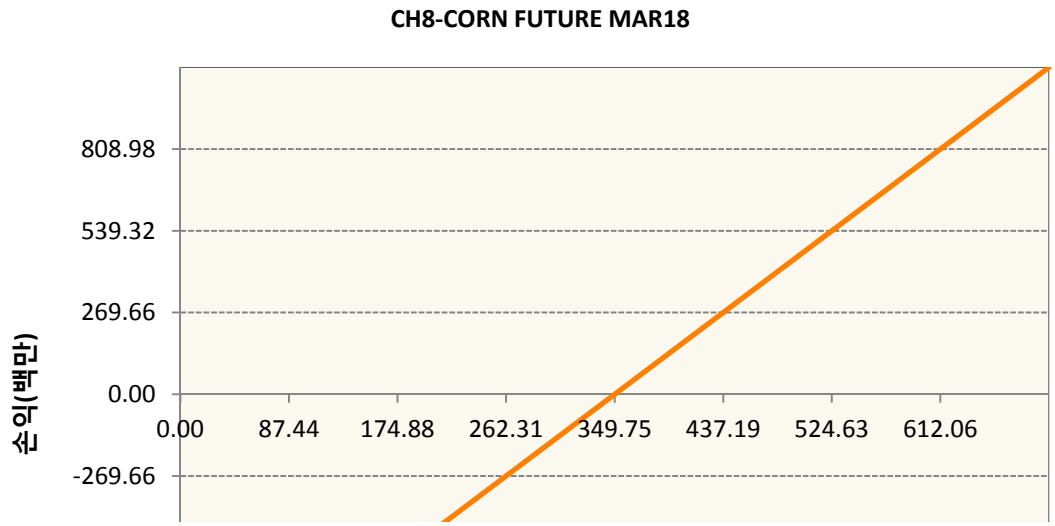
1. 계약금액

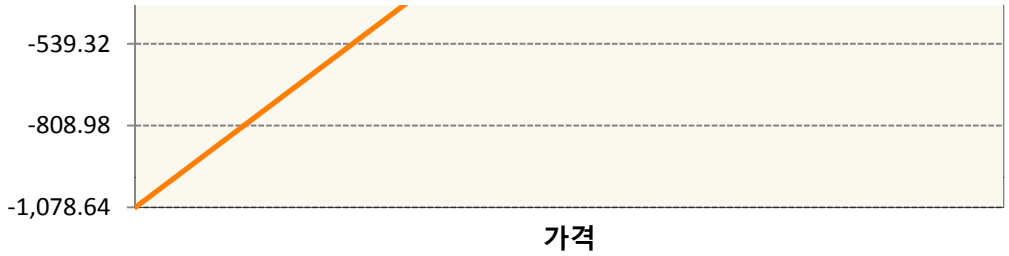
(단위:백만원)

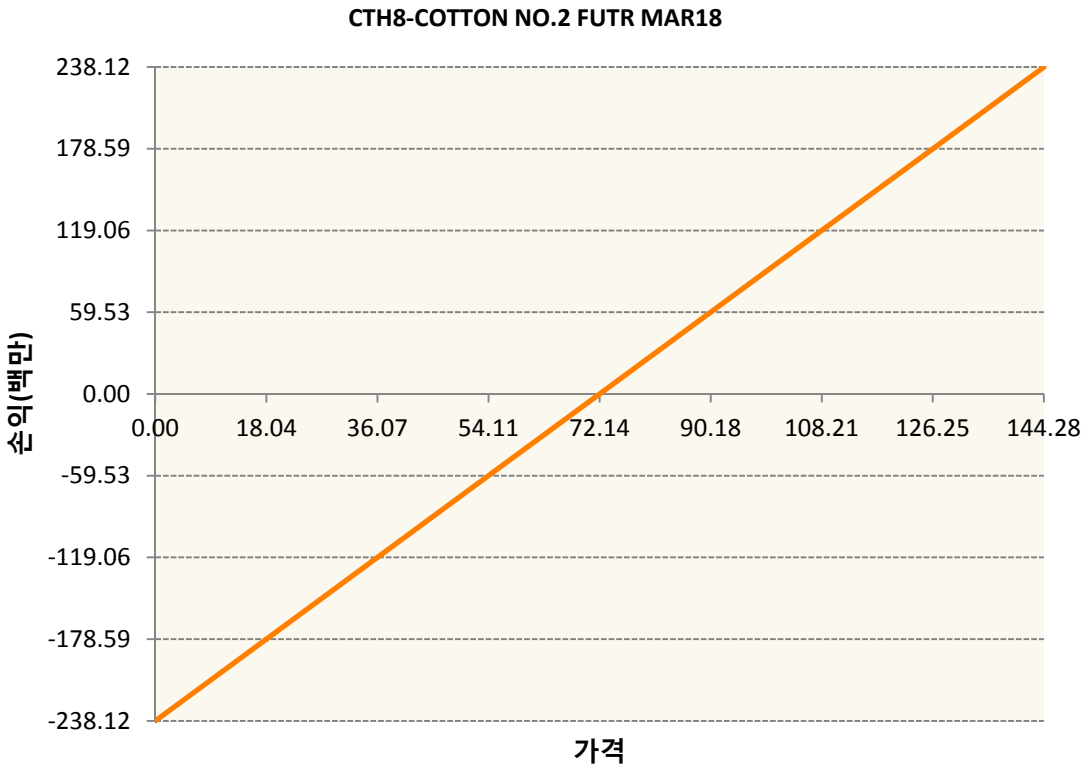
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,523	323	4,201	

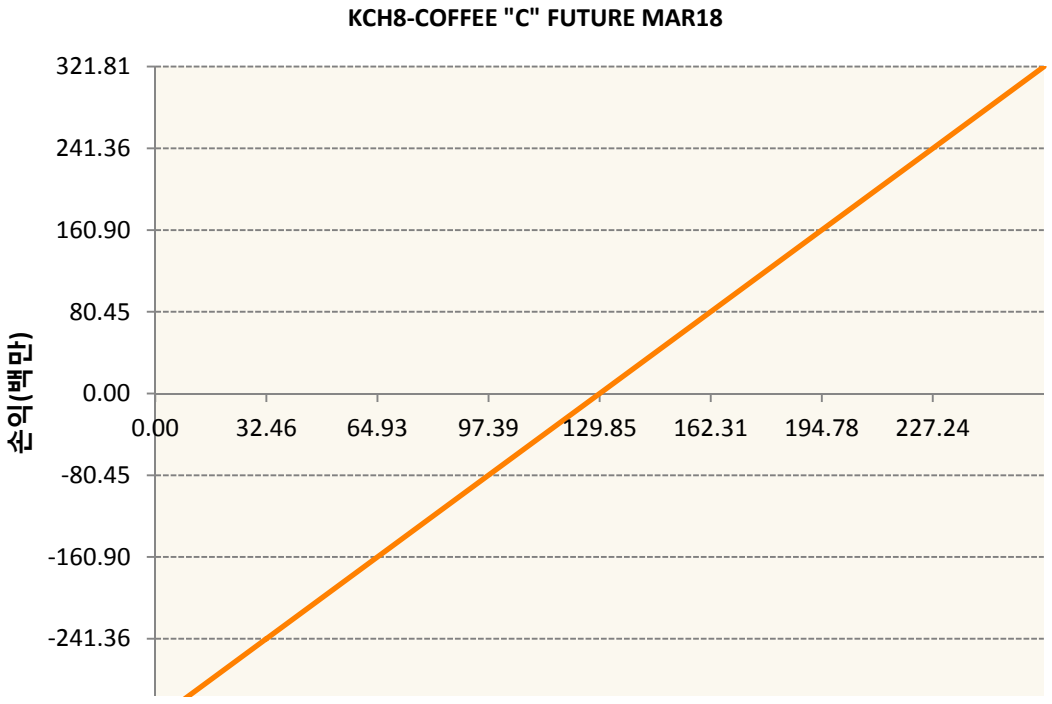
2. 만기시점의 손익구조

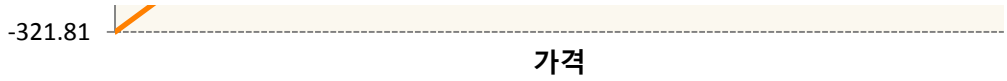


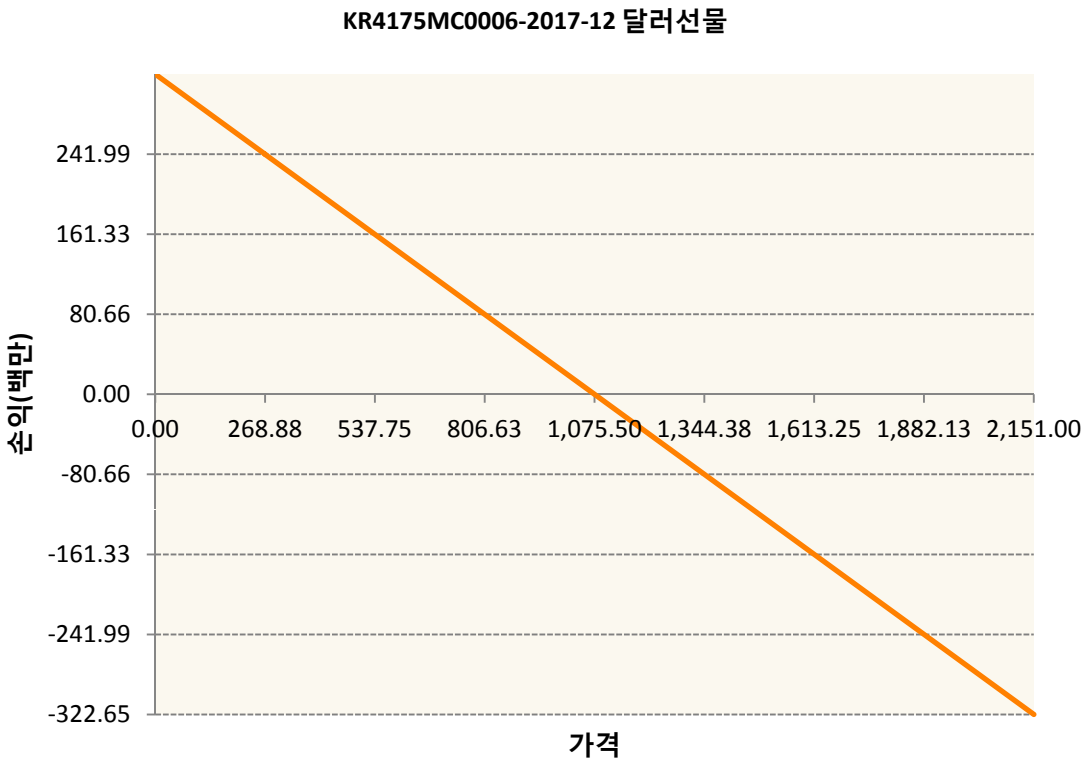


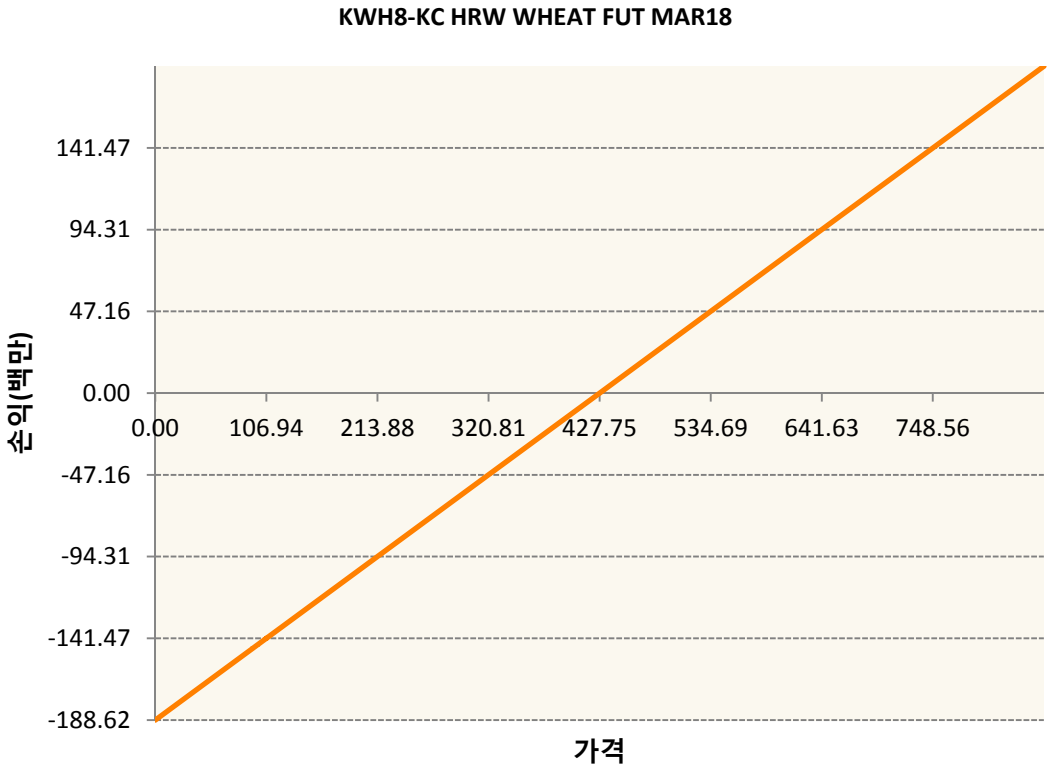

-539.32
-808.98
-1,078.64
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
238.12
178.59
119.06
59.53
0.00
-59.53
-119.06
-178.59
-238.12
0.00
18.04
36.07
54.11
72.14
90.18
108.21
126.25
144.28
손익(백만)
가격

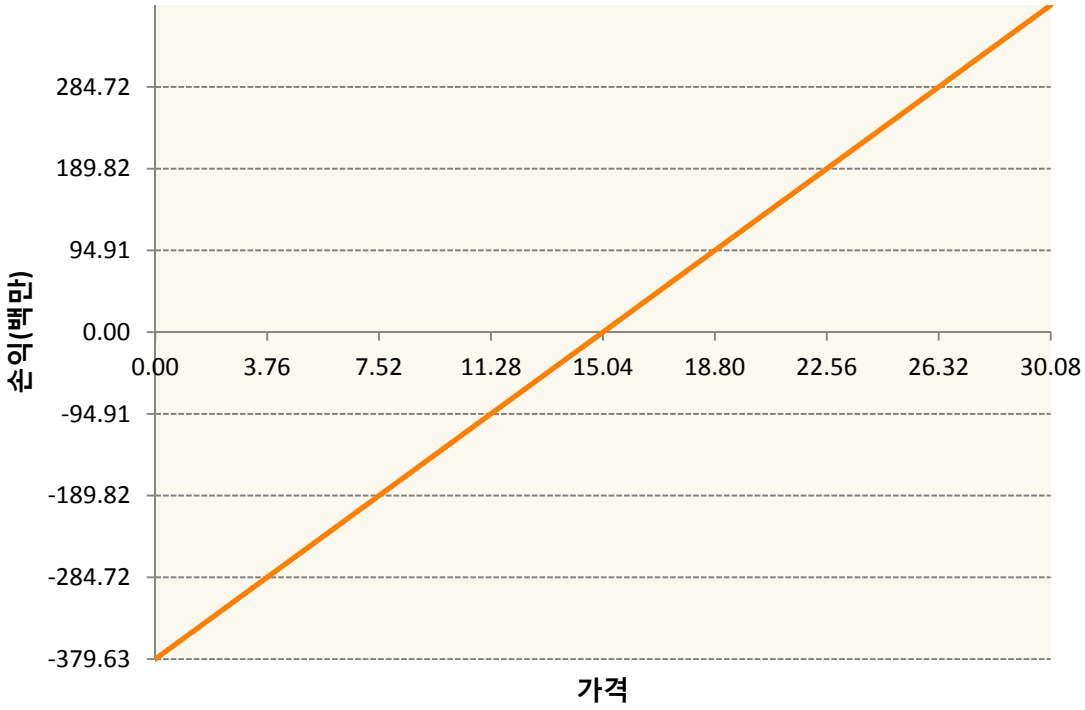

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
321.81
241.36
160.90
80.45
0.00
-80.45
-160.90
-241.36
0.00
32.46
64.93
97.39
129.85
162.31
194.78
227.24
손익(백만)


-321.81
가격

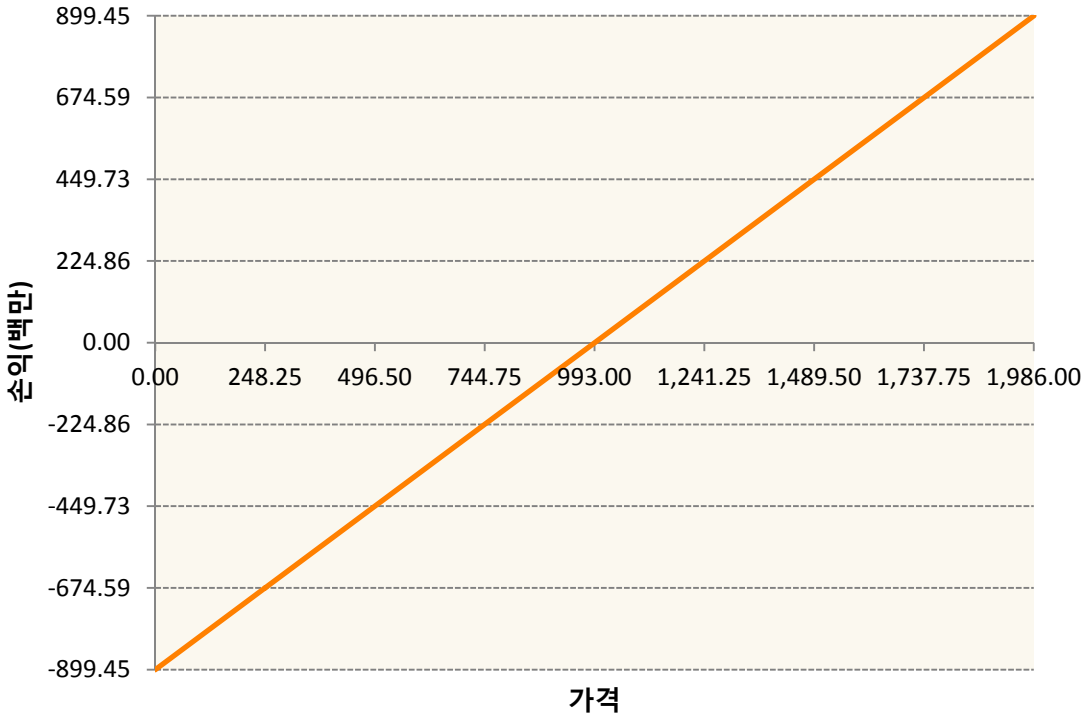

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
241.99
161.33
80.66
0.00
-80.66
-161.33
-241.99
-322.65
0.00
268.88
537.75
806.63
1,075.50
1,344.38
1,613.25
1,882.13
2,151.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
141.47
94.31
47.16
0.00
-47.16
-94.31
-141.47
-188.62
0.00
106.94
213.88
320.81
427.75
534.69
641.63
748.56
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

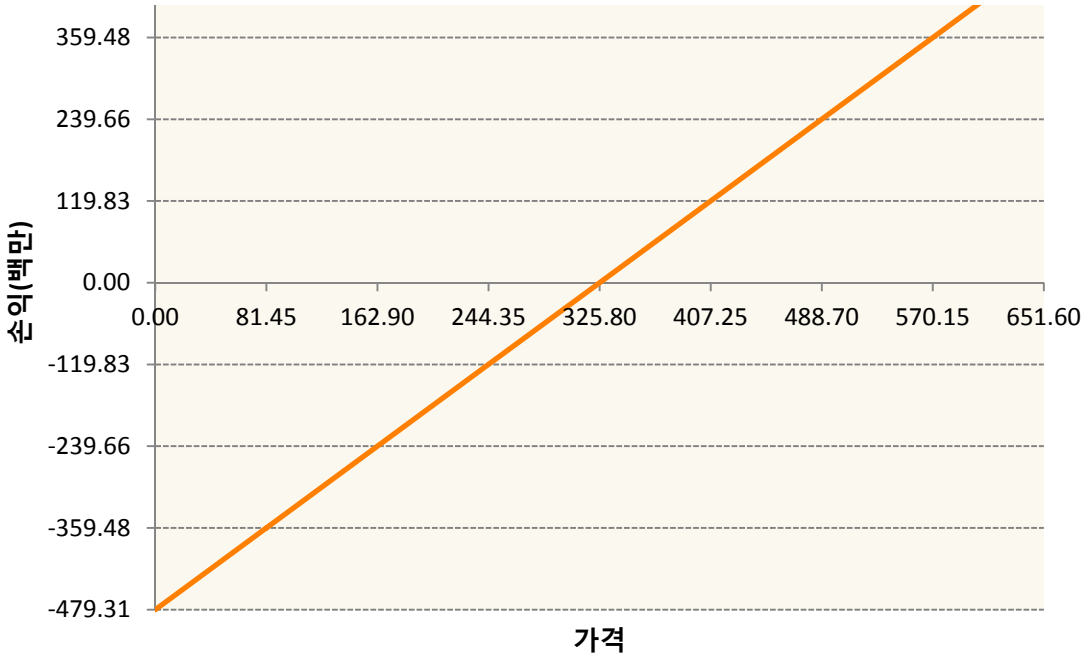


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18

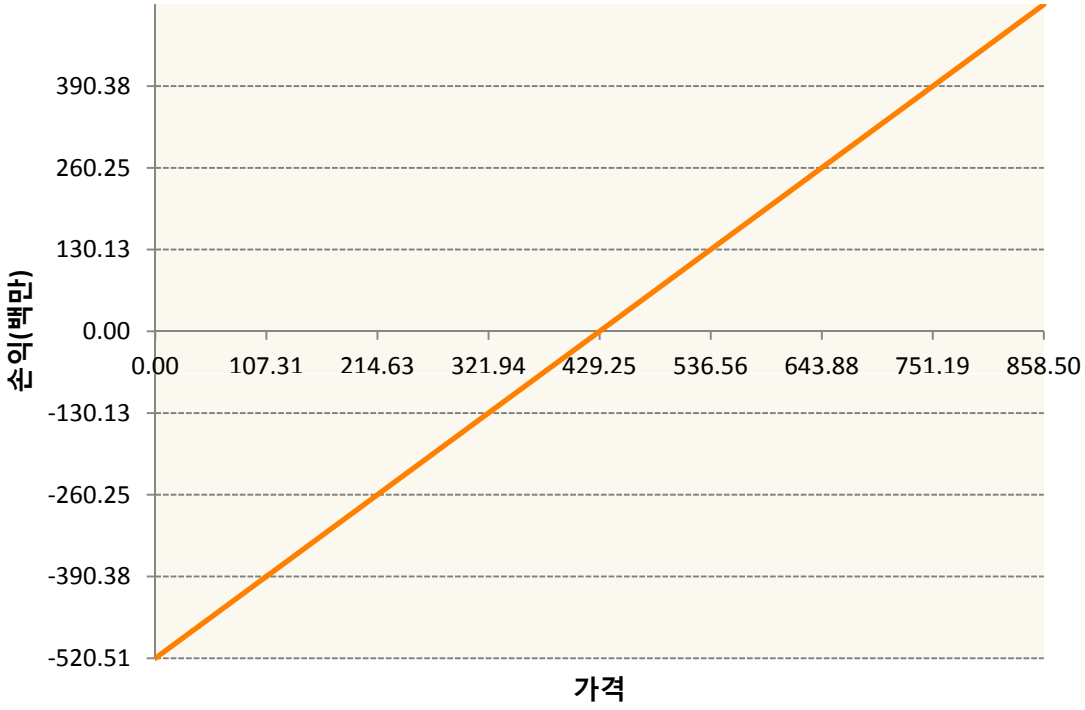


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	33
CH8	CORN FUTURE MAR18	86
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	19
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	26
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	15
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	30
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	72
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	38
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	42

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

397