공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

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	2017-12-01
기준일	2017-11-30

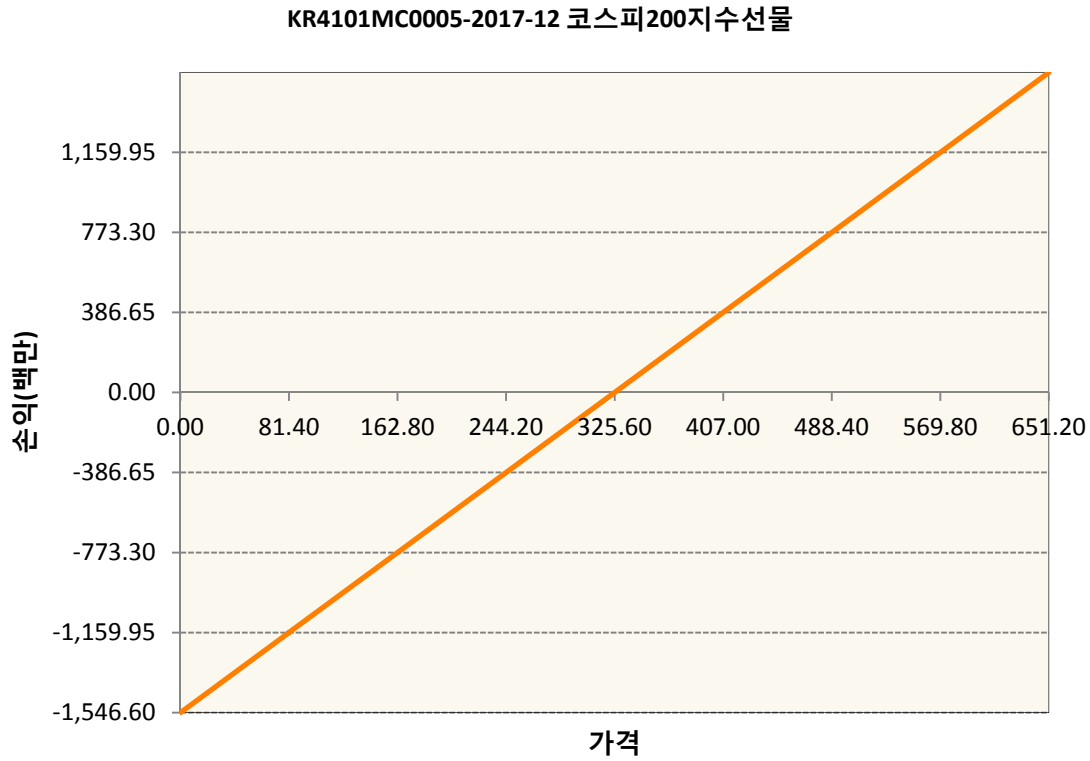
스마트인덱스모

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	1,547	0	1,547	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

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

72

공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

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	2017-12-01
기준일	2017-11-30

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)

368

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

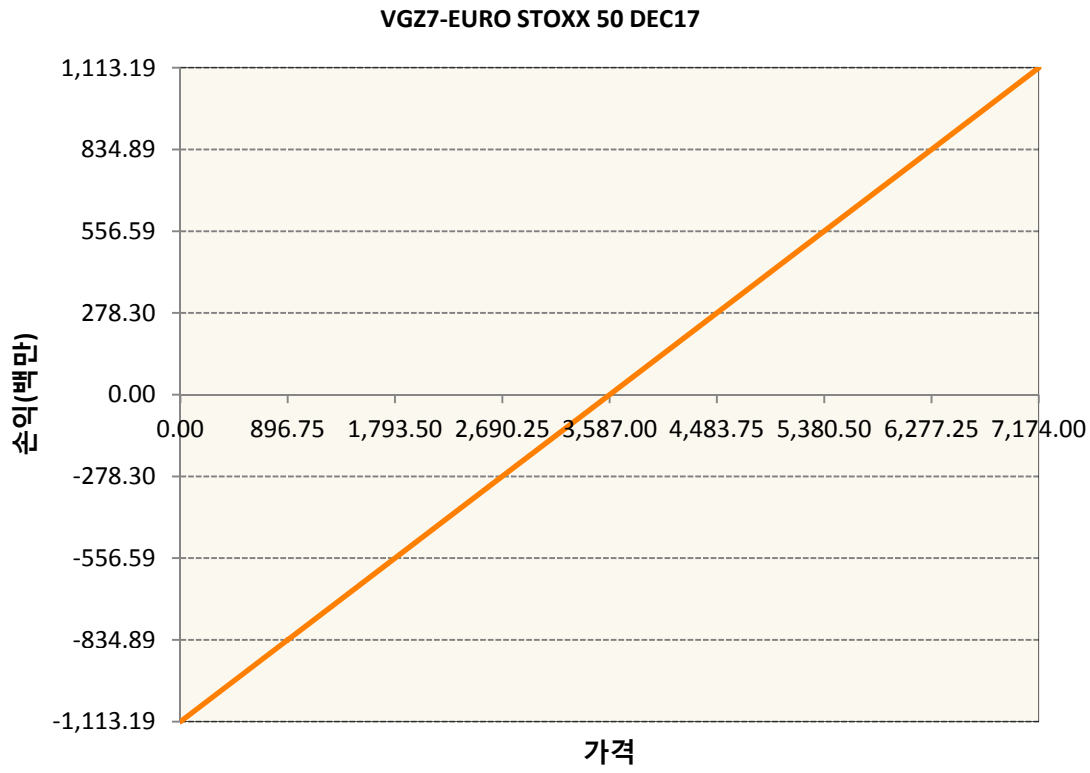
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,113	0	1,113	

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	2017-12-01
기준일	2017-11-30

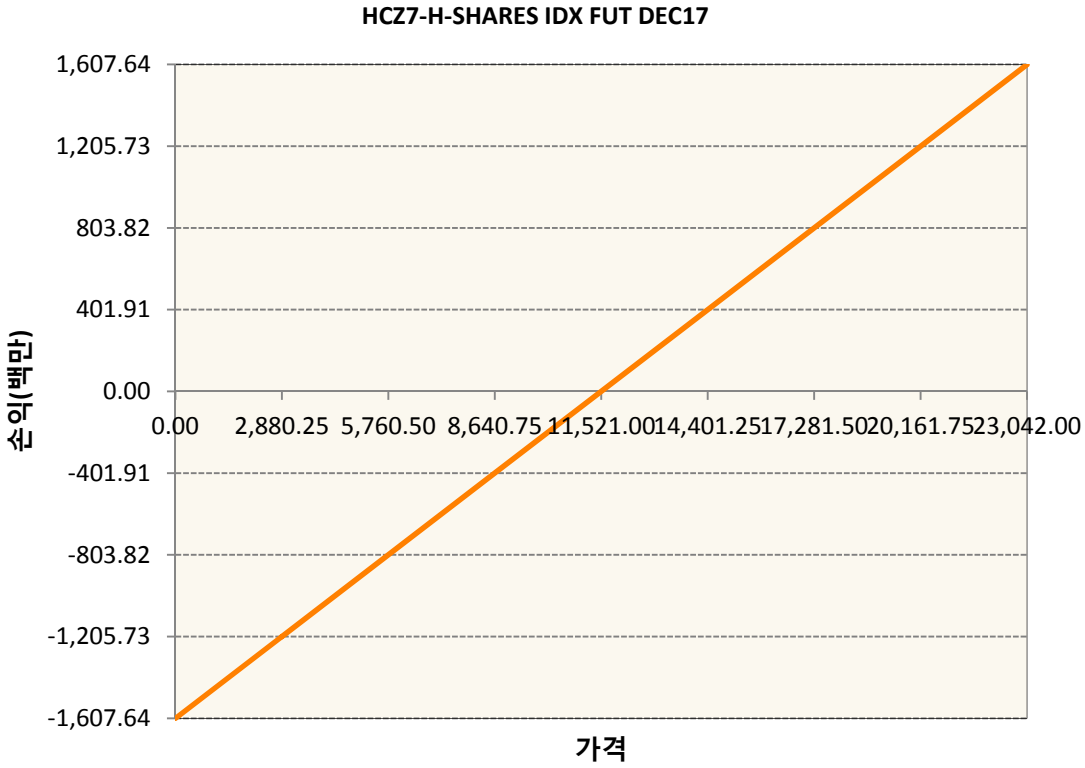
차이나인덱스모(주식-파생형)

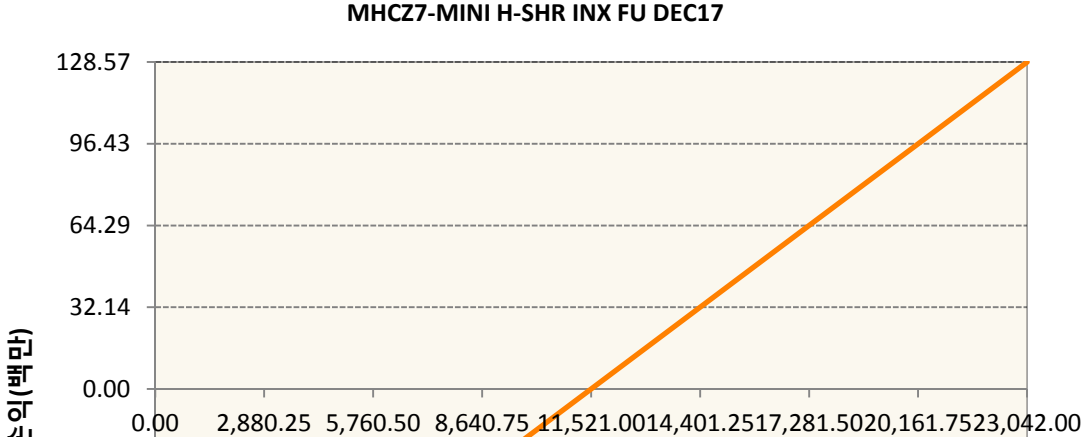
1. 계약금액

(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	1,608	0	1,608	
누계	유가증권	선물	129	0	129	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	129
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	92

공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

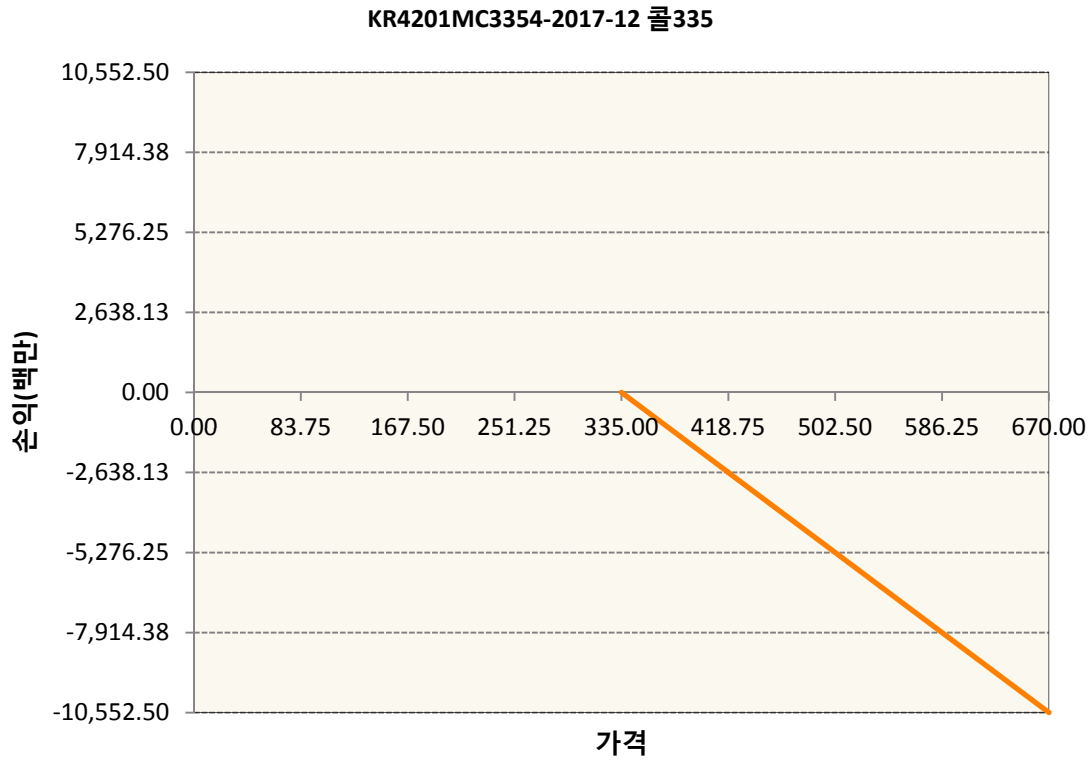
커버드콜모(주식혼합-파생형)

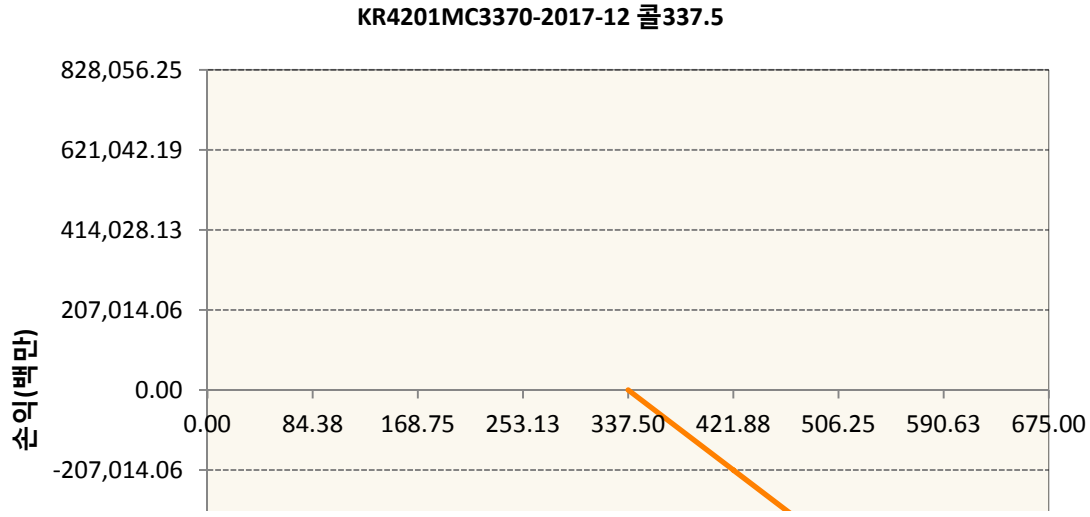
1. 계약금액

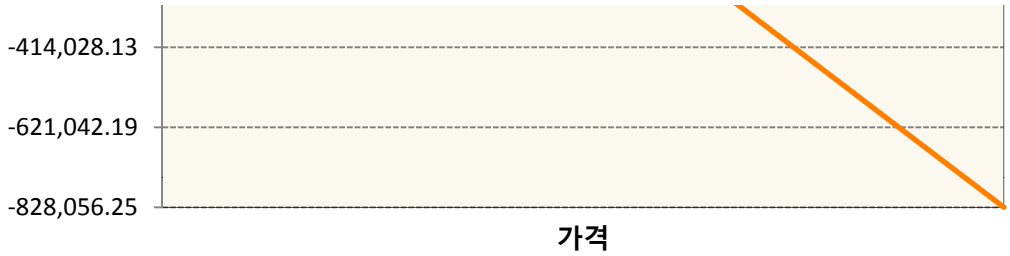
(단위:백만원)

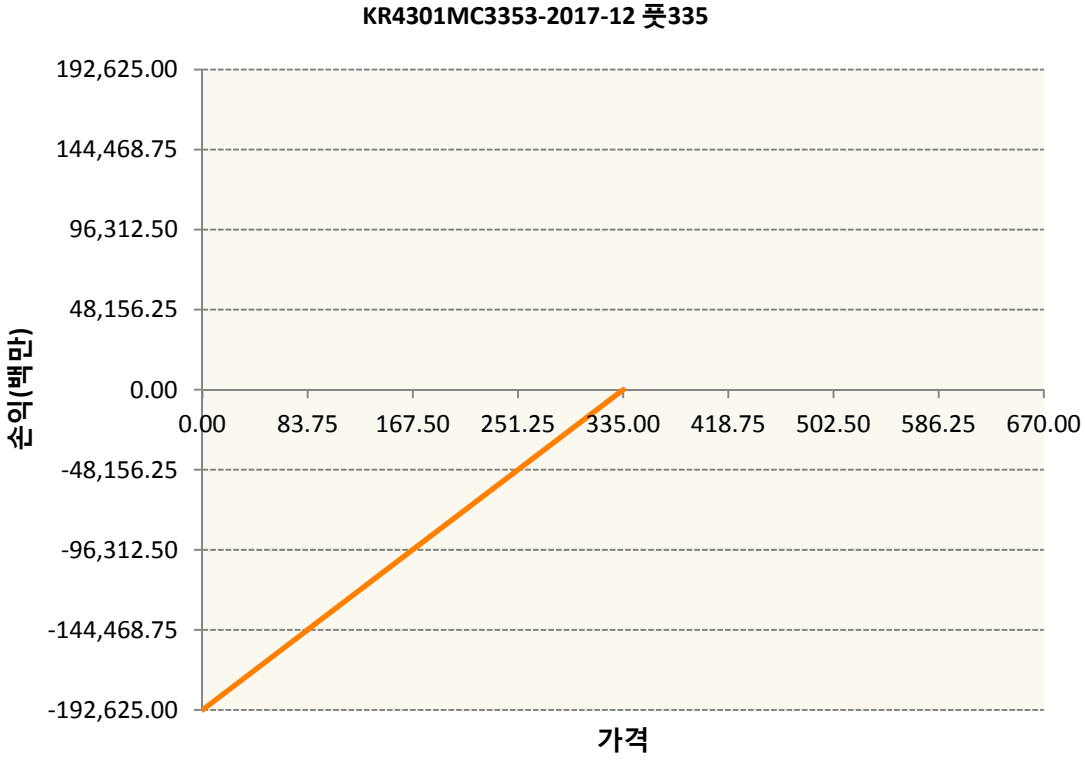
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

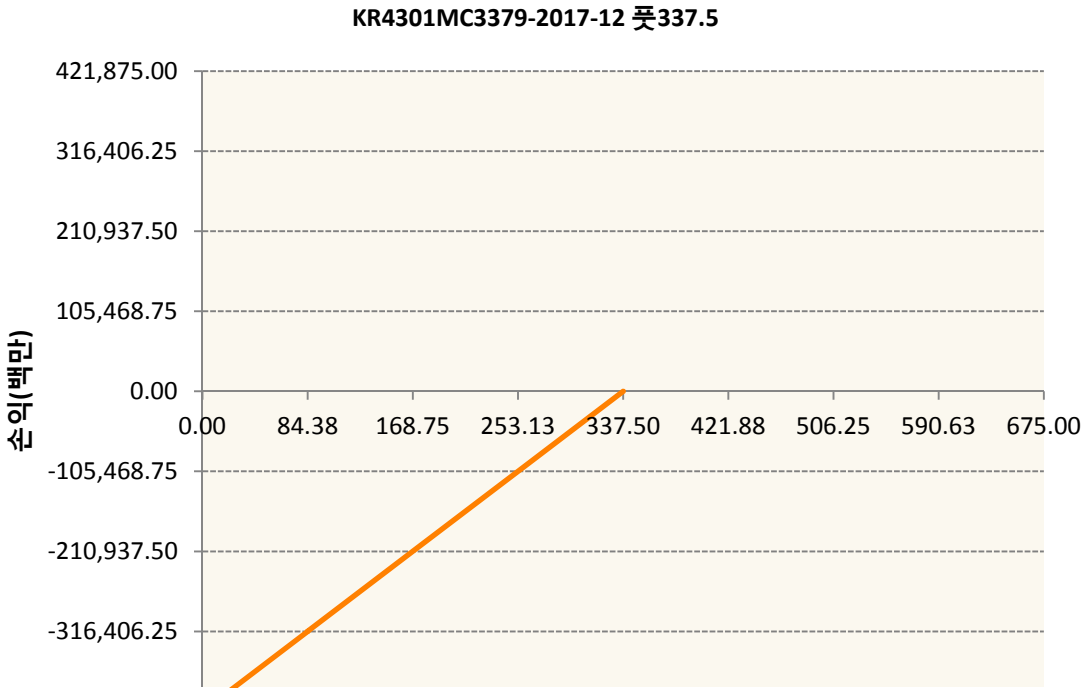
2. 만기시점의 손익구조






-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							511
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	86	86	85	83	81	79
-5.33%	85	83	81	78	73	68	62
-2.67%	76	70	63	55	46	36	25
0%	40	27	14	0	-14	-29	-44
2.67%	-53	-70	-87	-104	-121	-139	-156
5.33%	-219	-234	-249	-265	-281	-297	-313
8.00%	-446	-454	-464	-474	-486	-498	-511
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							36,666
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,246	5,235	5,209	5,160	5,078	4,958	4,793
-5.33%	5,189	5,108	4,974	4,779	4,518	4,190	3,797
-2.67%	4,750	4,409	3,973	3,451	2,849	2,176	1,441
0%	2,746	1,898	978	0	-1,025	-2,088	-3,184
2.67%	-3,027	-4,324	-5,630	-6,942	-8,259	-9,580	-10,904
5.33%	-14,352	-15,615	-16,896	-18,189	-19,493	-20,805	-22,124
8.00%	-30,834	-31,644	-32,536	-33,495	-34,509	-35,569	-36,666
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,632	-14,632	-14,632	-14,632	-14,632	-14,632	-14,632
-5.33%	-9,647	-9,647	-9,648	-9,648	-9,649	-9,652	-9,657
-2.67%	-4,665	-4,669	-4,677	-4,689	-4,708	-4,734	-4,766
0%	214	154	82	0	-92	-191	-297
2.67%	4,082	3,918	3,753	3,587	3,422	3,256	3,091
5.33%	5,660	5,567	5,464	5,352	5,232	5,107	4,977
8.00%	5,884	5,872	5,852	5,825	5,788	5,742	5,688
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							32,123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,122	-32,122	-32,122	-32,122	-32,122	-32,122	-32,123
-5.33%	-21,286	-21,286	-21,287	-21,287	-21,288	-21,291	-21,296
-2.67%	-10,452	-10,455	-10,462	-10,476	-10,498	-10,531	-10,577
0%	292	219	121	0	-143	-306	-487
2.67%	9,690	9,371	9,044	8,711	8,374	8,033	7,689

5.33%	14,578	14,297	14,001	13,695	13,380	13,058	12,731
8.00%	15,559	15,502	15,423	15,321	15,196	15,050	14,885

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

85,689

공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

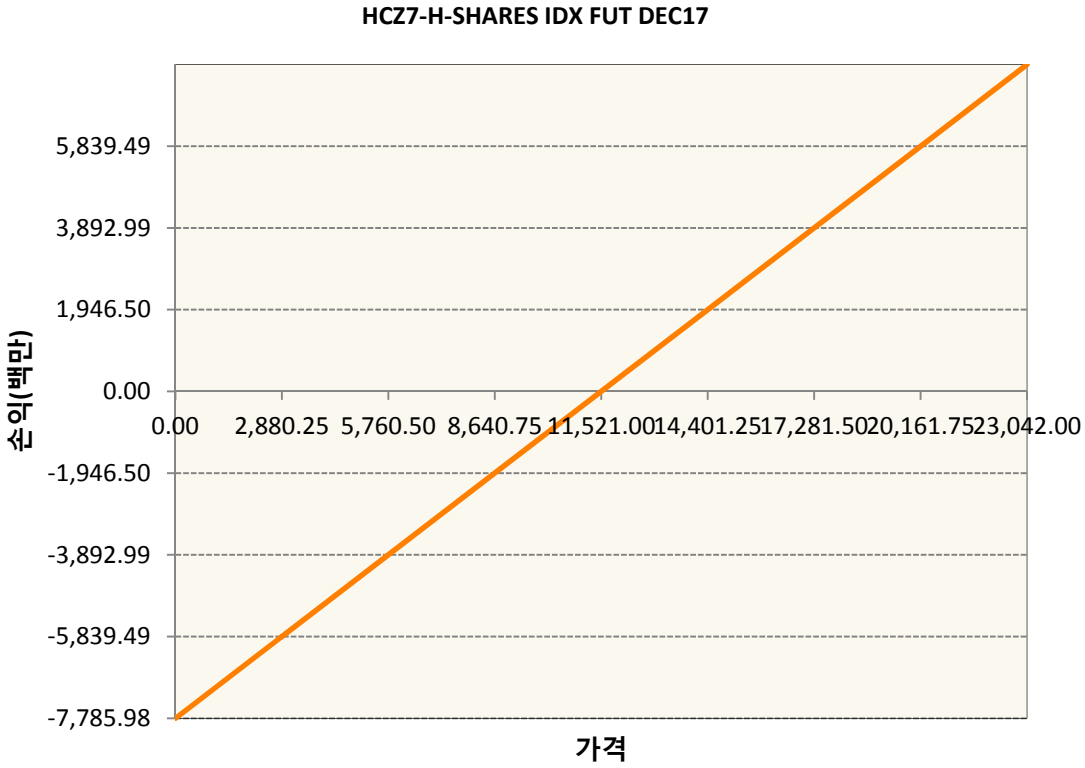
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

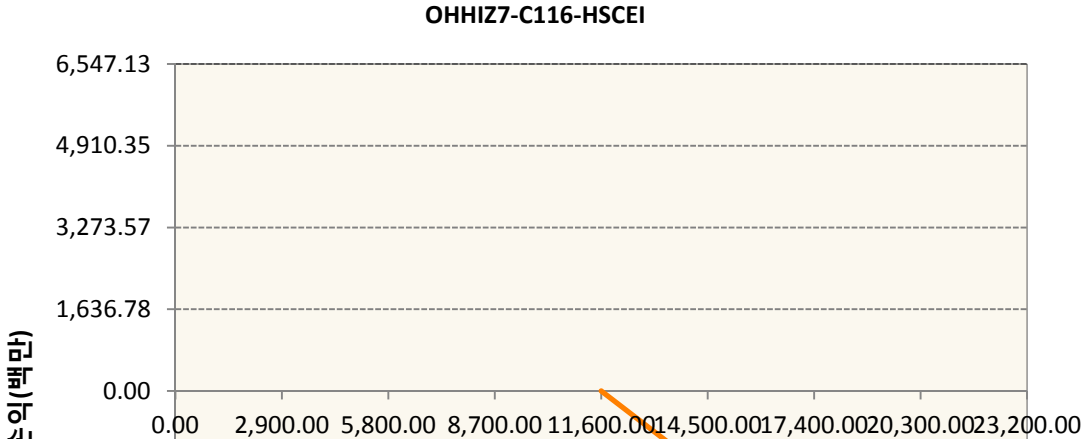
1. 계약금액

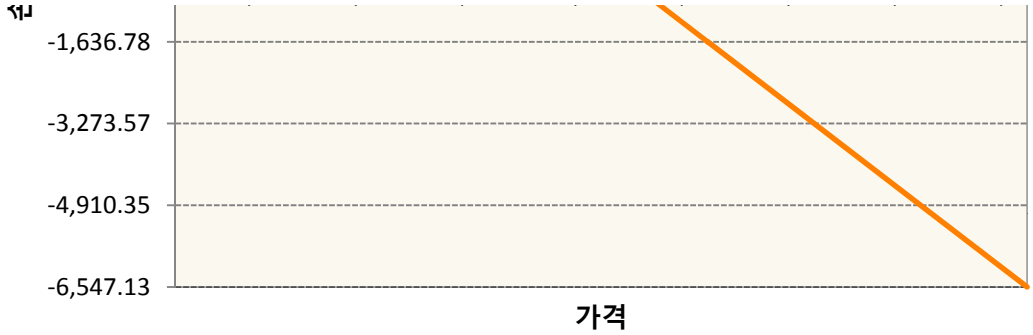
(단위:백만원)

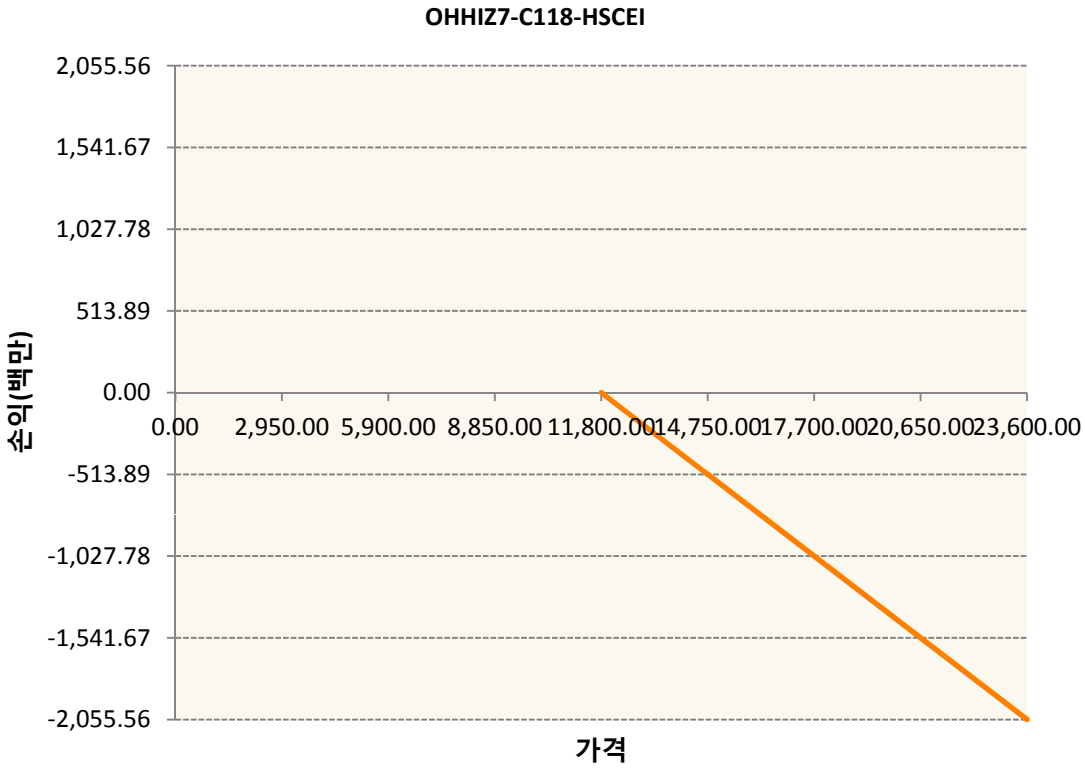
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,786	0	7,786	
누계	유가증권	옵션	0	17,205	-17,205	장내

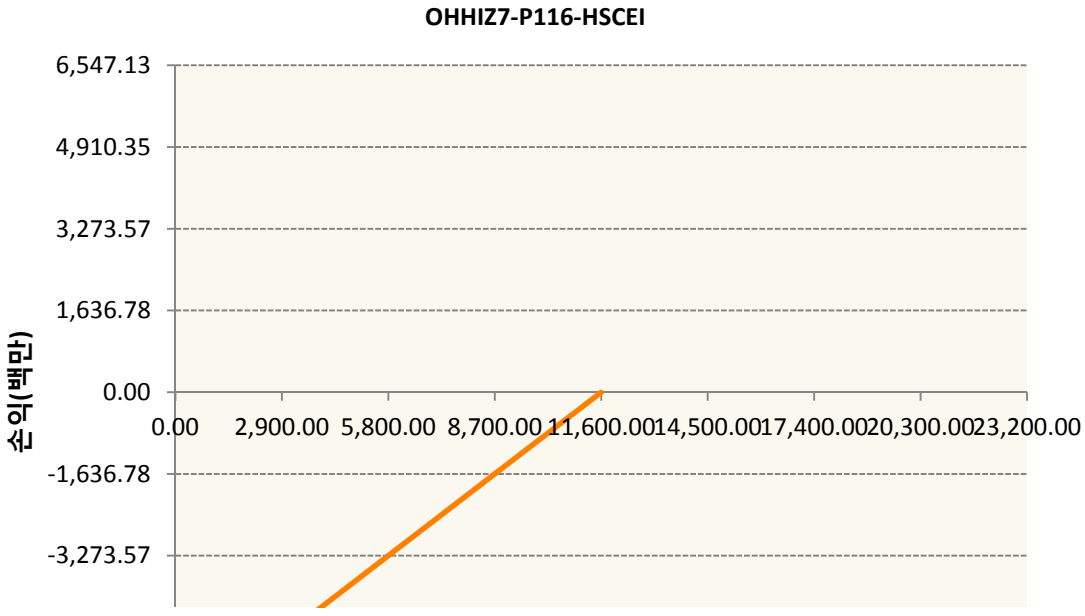
2. 만기시점의 손익구조

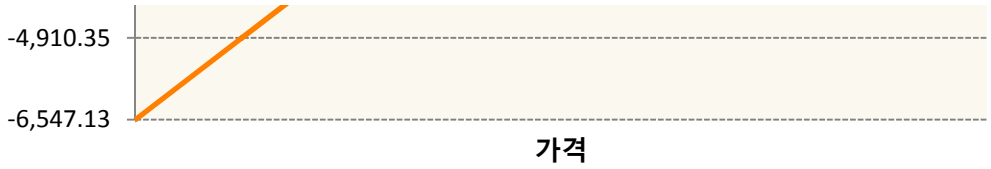


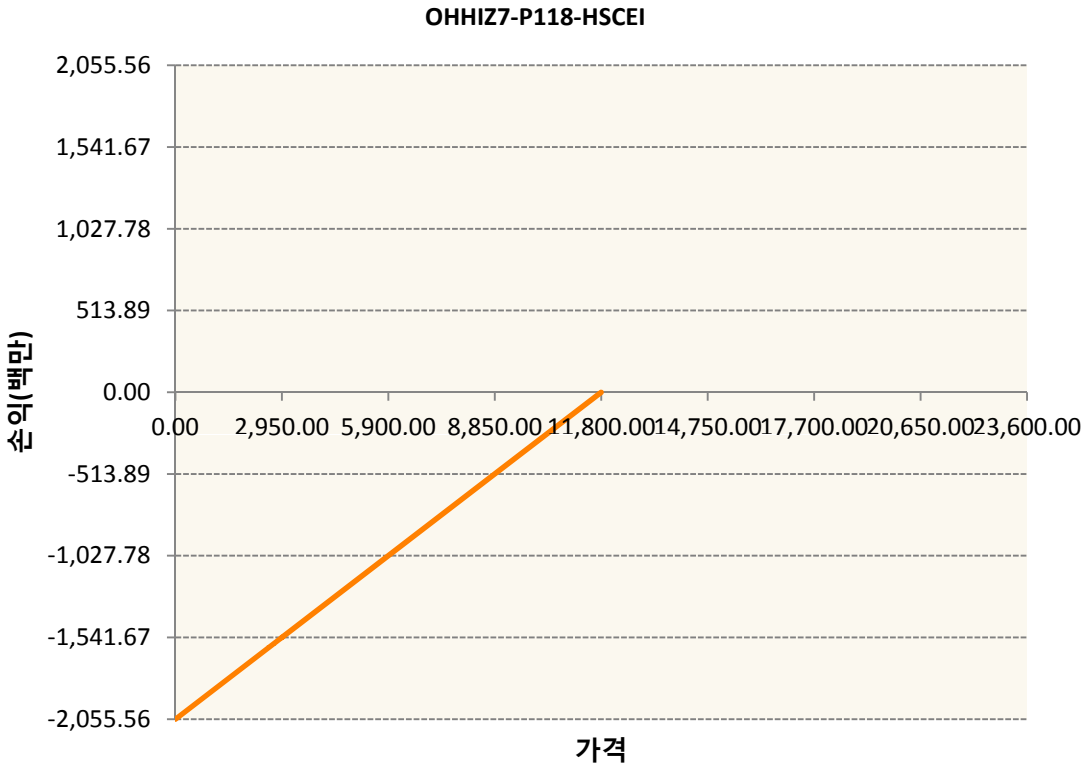



-1,636.78
-3,273.57
-4,910.35
-6,547.13
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,055.56
1,541.67
1,027.78
513.89
0.00
-513.89
-1,027.78
-1,541.67
-2,055.56
손익(백만)
0.00
2,950.00
5,900.00
8,850.00
11,800.00
14,750.00
17,700.00
20,650.00
23,600.00
가격


OHHIZ7-P116-HSCEI
6,547.13
4,910.35
3,273.57
1,636.78
0.00
-1,636.78
-3,273.57
손익(백만)
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





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	623
OHHIZ7-C11	HSCEI	524
OHHIZ7-C11	HSCEI	164
OHHIZ7-P11	HSCEI	524
OHHIZ7-P11	HSCEI	164

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,513

공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

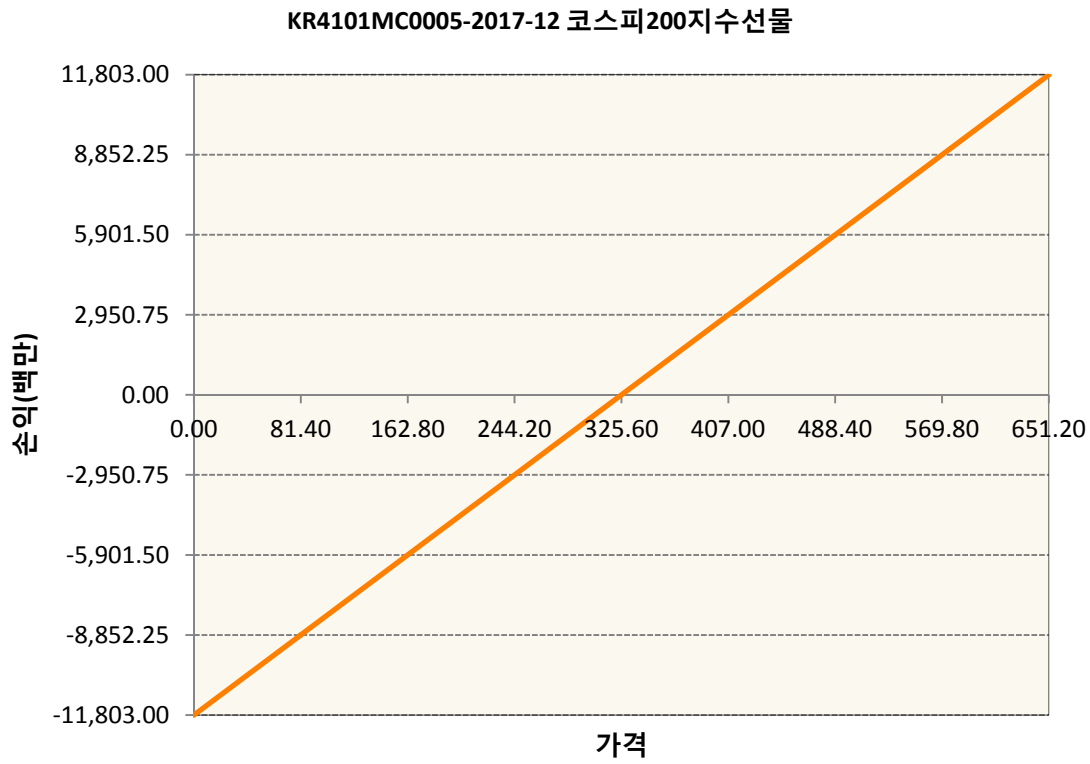
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

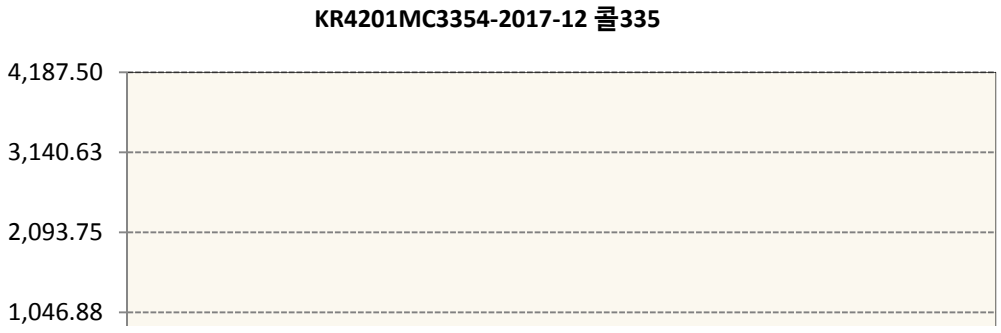
1. 계약금액

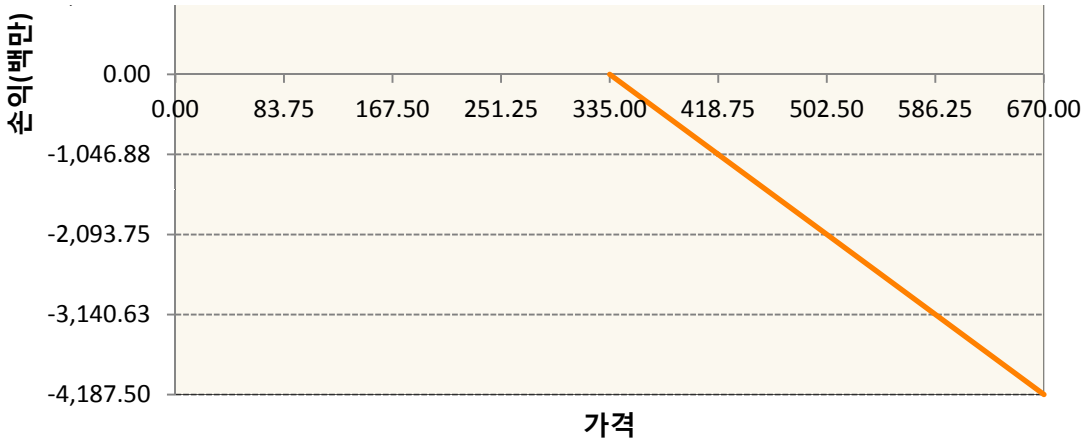
(단위:백만원)

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	11,803	0	11,803	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

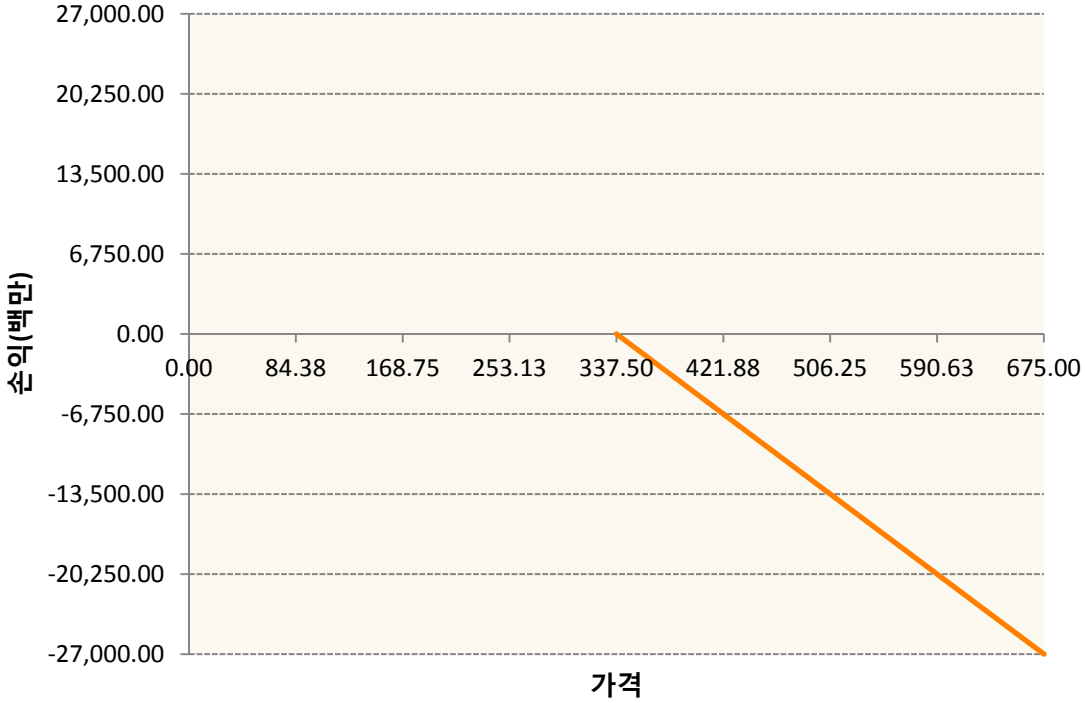
2. 만기시점의 손익구조



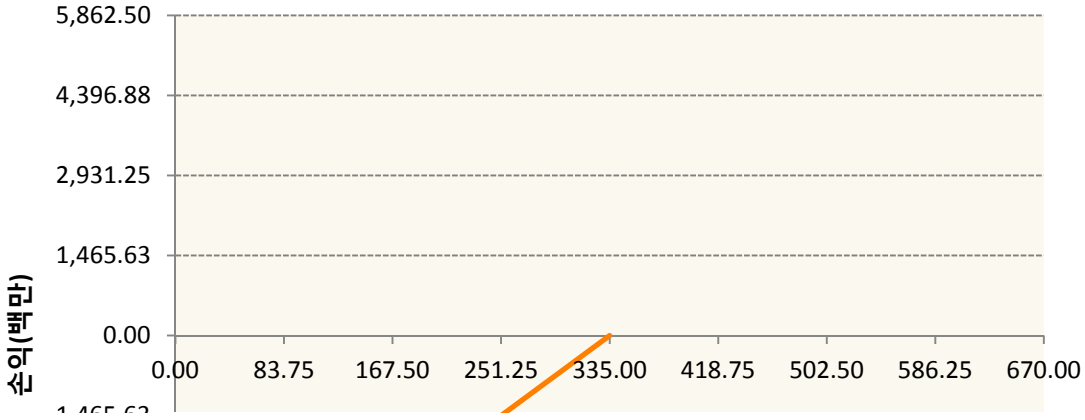




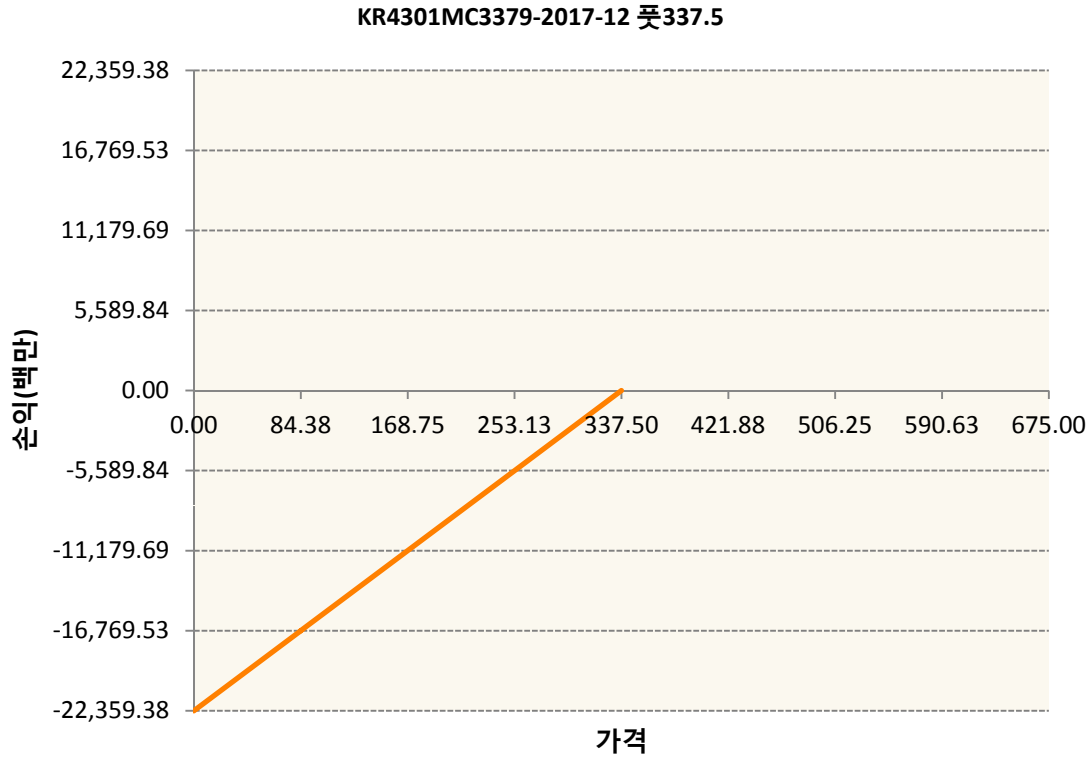
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462
-5.33%	-975	-975	-975	-975	-975	-975	-975
-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%	975	975	975	975	975	975	975
8.00%	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462
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%	-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%	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%	-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						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%	-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%	277	277	277	277	277	277	277
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632
-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%	632	632	632	632	632	632	632
	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					943

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-943	-943	-943	-943	-943	-943	-943
-5.33%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629
-2.67%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	314	314	314	314	314	314	314
5.33%	629	629	629	629	629	629	629
8.00%	943	943	943	943	943	943	943
	KR4201MC3	2017-12 콜335					203

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	33	32	31
-5.33%	34	33	32	31	29	27	25
-2.67%	30	28	25	22	18	14	10
0%	16	11	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-21	-28	-35	-41	-48	-55	-62
5.33%	-87	-93	-99	-105	-111	-118	-124
8.00%	-177	-180	-184	-188	-193	-198	-203
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,196

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	171	171	170	168	166	162	156
-5.33%	169	167	162	156	147	137	124
-2.67%	155	144	130	113	93	71	47
0%	90	62	32	0	-33	-68	-104
2.67%	-99	-141	-184	-226	-269	-312	-356
5.33%	-468	-509	-551	-593	-636	-678	-721
8.00%	-1,005	-1,032	-1,061	-1,092	-1,125	-1,160	-1,196
	KR4301MC3	2017-12 풋335					445

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-445	-445	-445	-445	-445	-445	-445
-5.33%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294

-2.67%	-142	-142	-142	-143	-143	-144	-145
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	124	119	114	109	104	99	94
5.33%	172	169	166	163	159	155	151
8.00%	179	179	178	177	176	175	173
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,702
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,702	-1,702	-1,702	-1,702	-1,702	-1,702	-1,702
-5.33%	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,129
-2.67%	-554	-554	-554	-555	-556	-558	-561
0%	15	12	6	0	-8	-16	-26
2.67%	514	497	479	462	444	426	408
5.33%	773	758	742	726	709	692	675
8.00%	825	822	817	812	805	798	789

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

8,969

공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

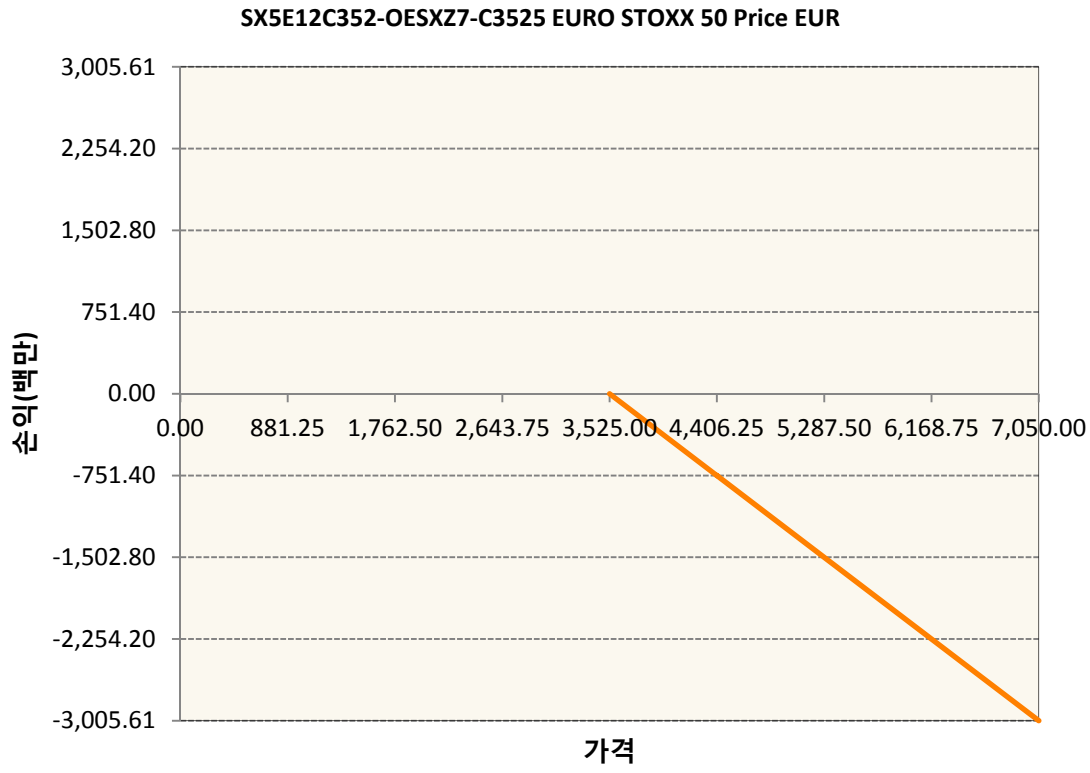
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

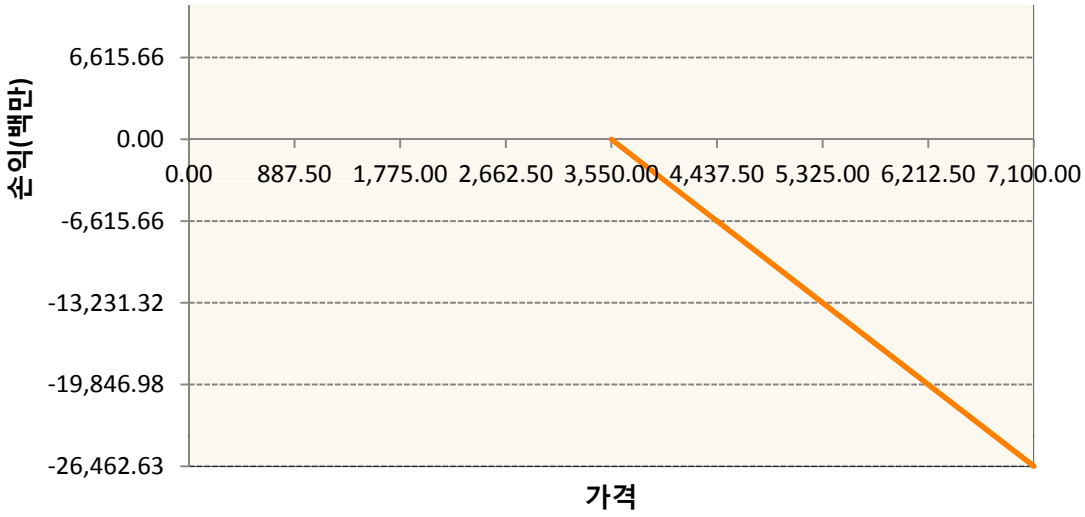
(단위:백만원)

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	21,608	0	21,608	
누계	유가증권	스왑	96,893	0	96,893	장외
누계	유가증권	옵션	0	58,936	-58,936	장내
누계	지수	스왑	51,677	0	51,677	장외

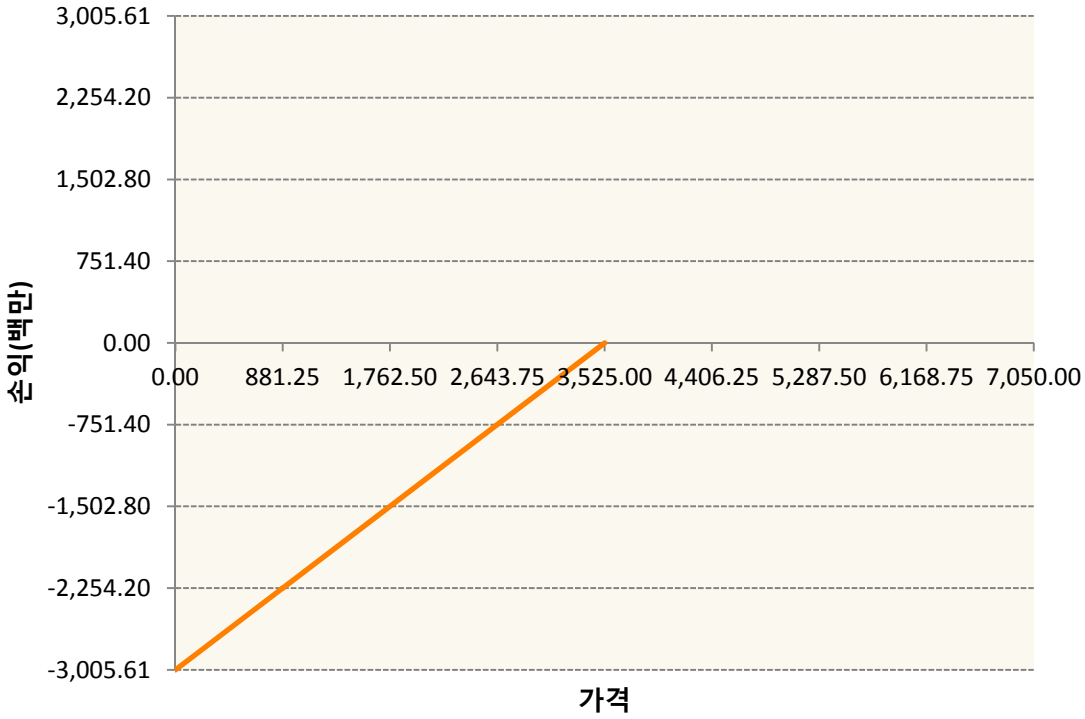
2. 만기시점의 손익구조



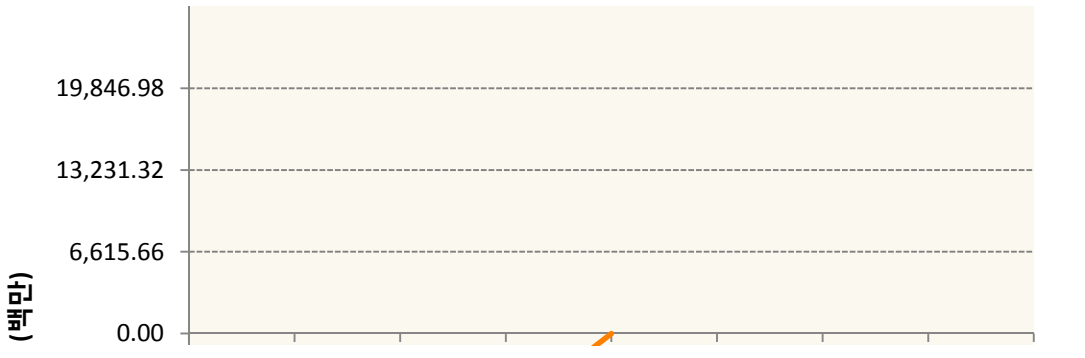


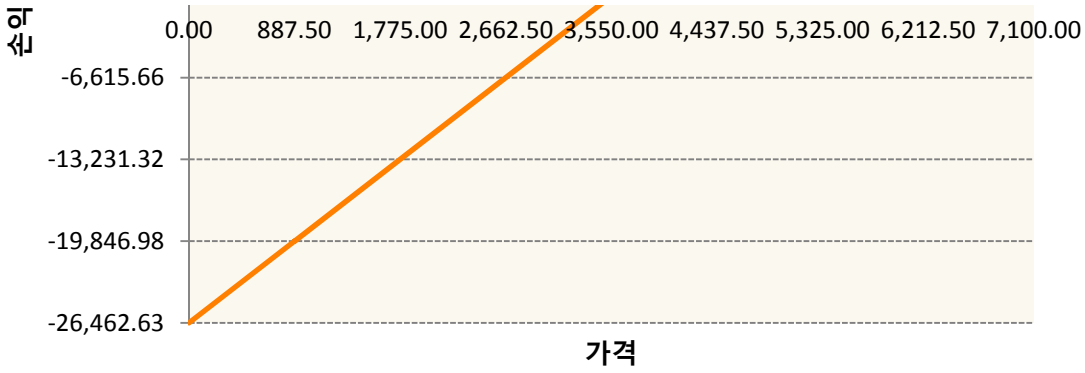


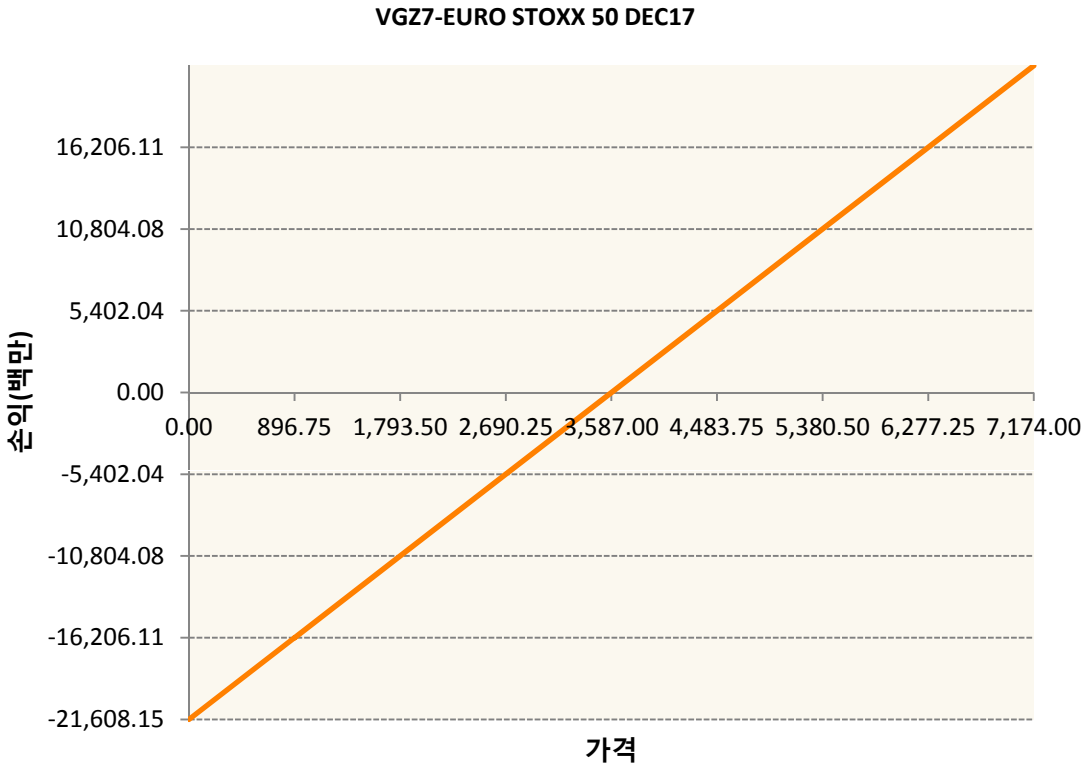
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	34
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	22
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	240
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,117
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	240
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,117
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,729

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

3,717

공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

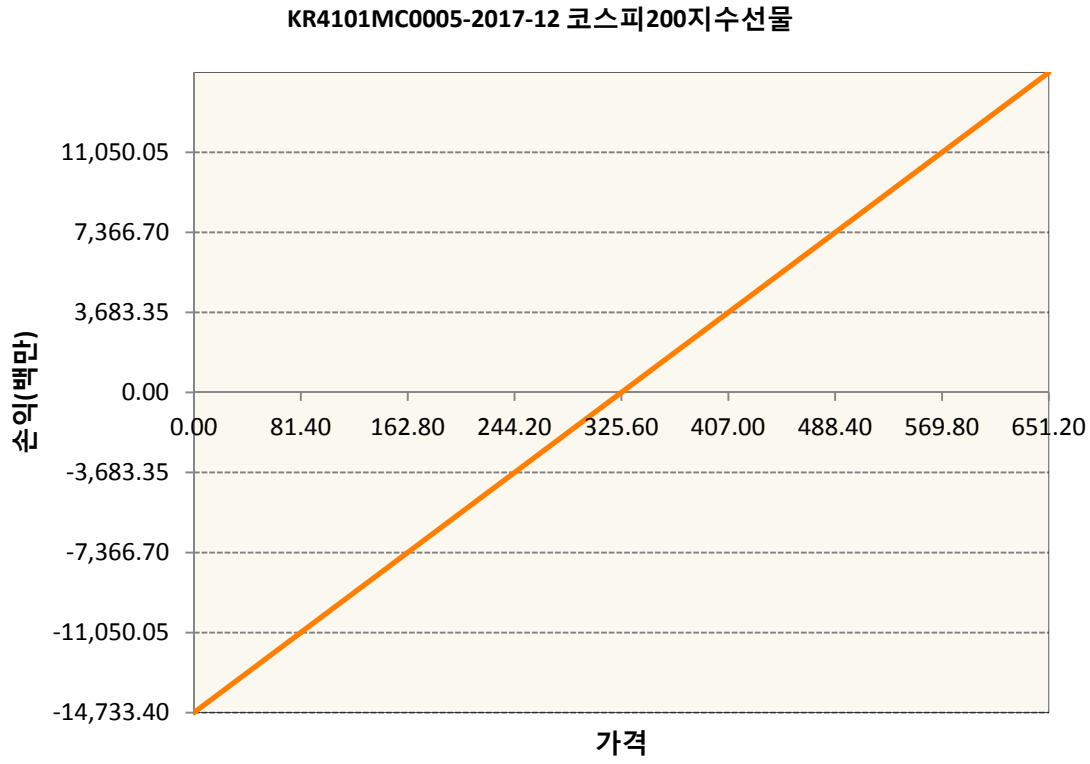
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,974	0	7,974	장내
누계	유가증권	선물	14,733	0	14,733	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,177
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177
-5.33%	-785	-785	-785	-785	-785	-785	-785
-2.67%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	392	392	392	392	392	392	392
5.33%	785	785	785	785	785	785	785
8.00%	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177

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

685

공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

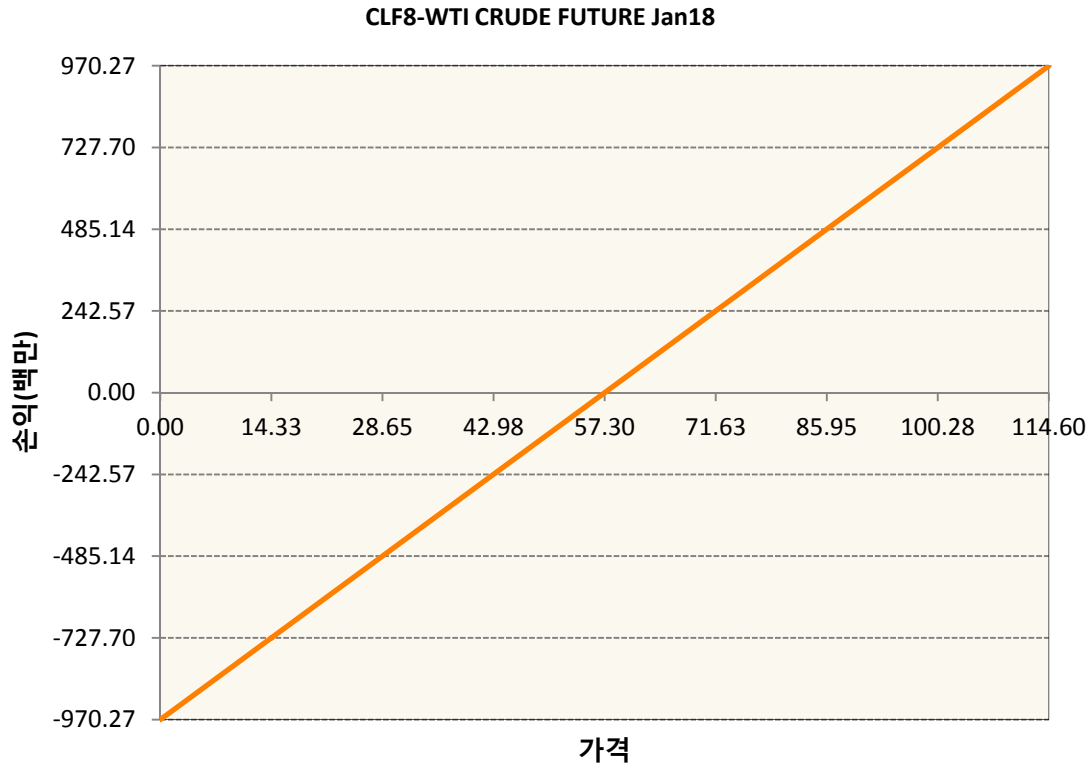
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

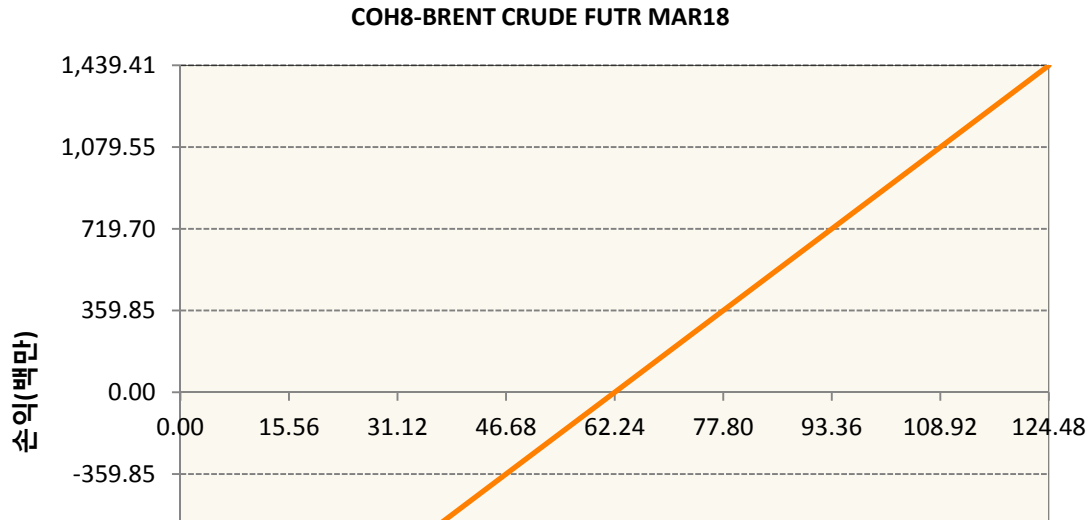
1. 계약금액

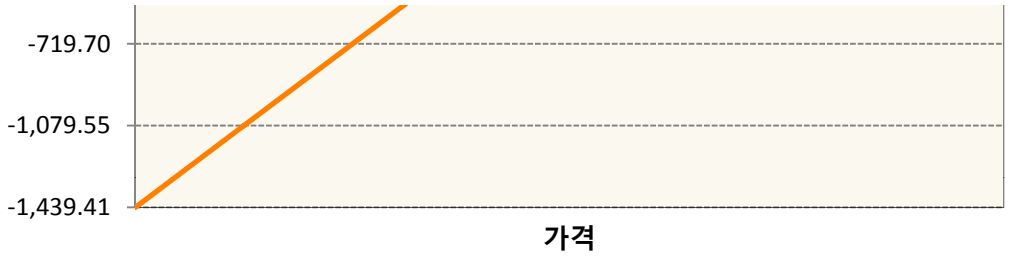
(단위:백만원)

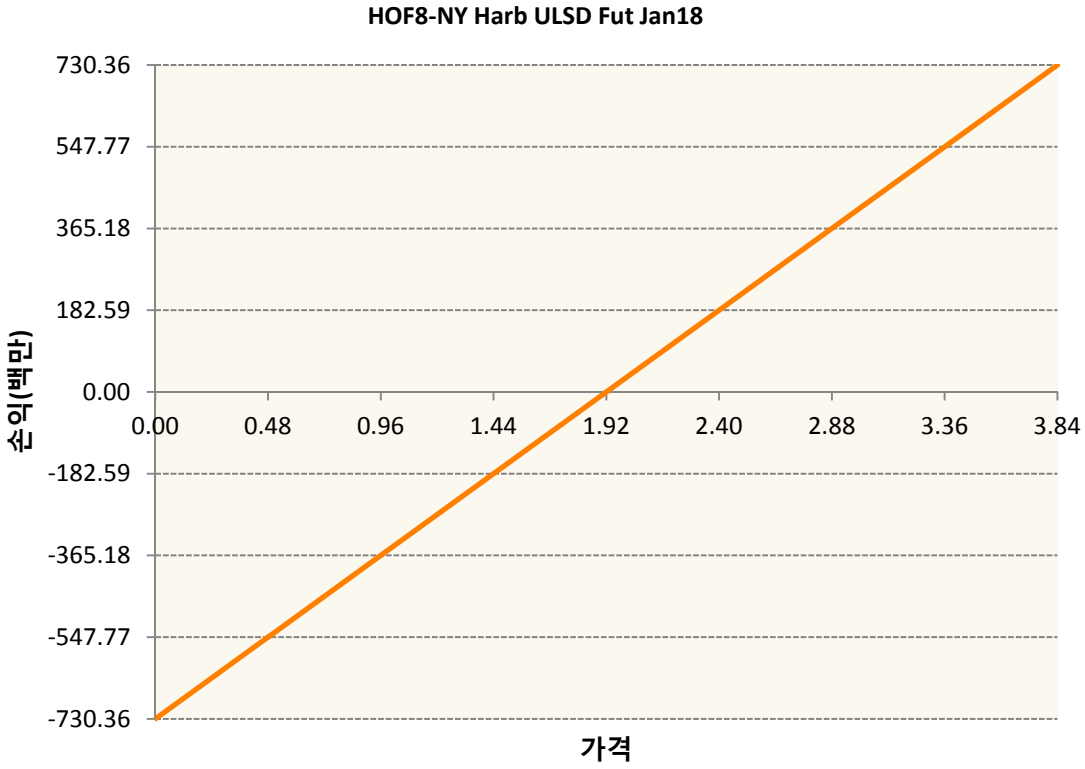
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,213	870	4,343	

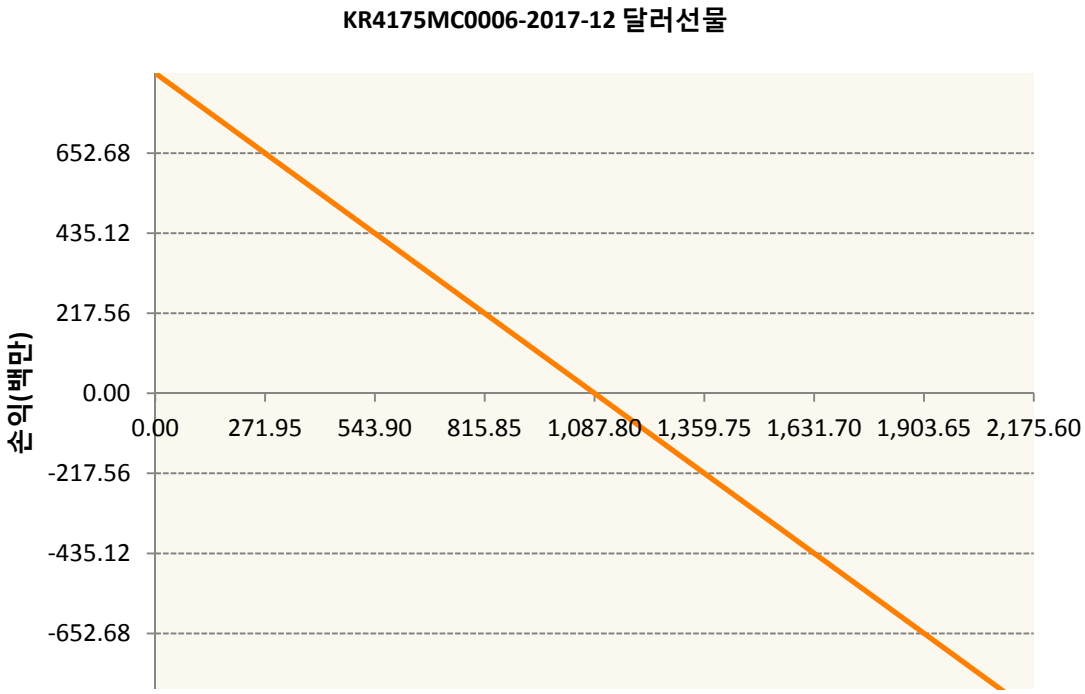
2. 만기시점의 손익구조

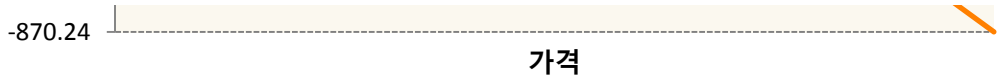


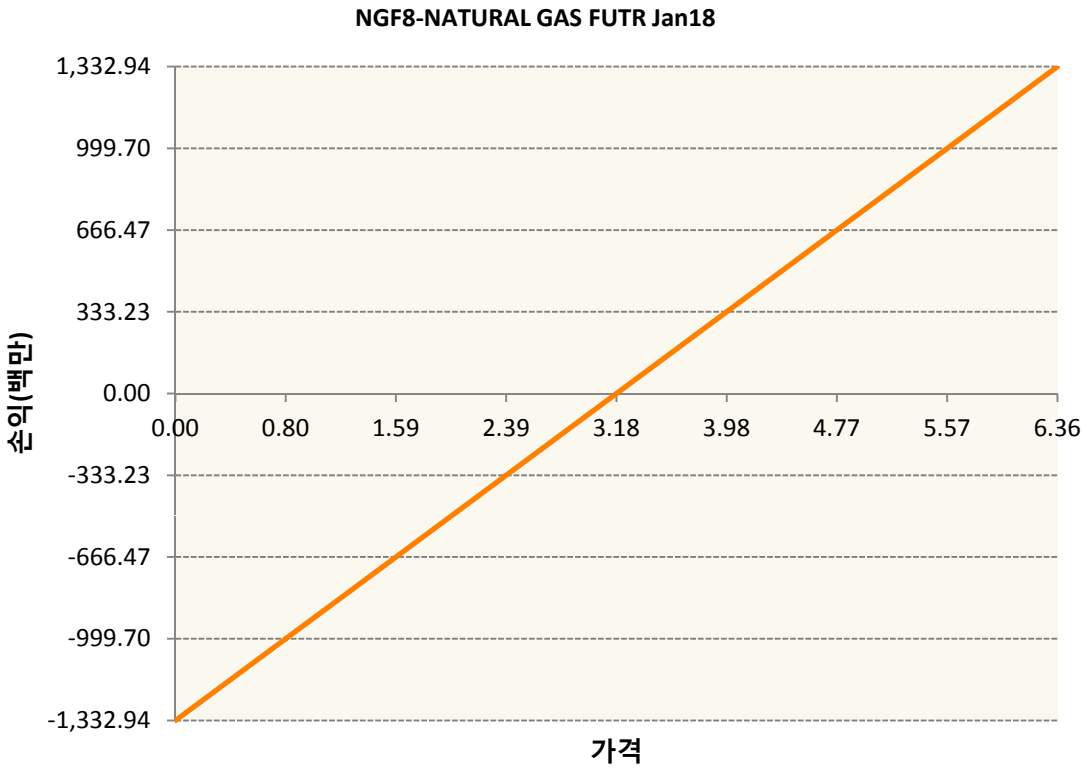


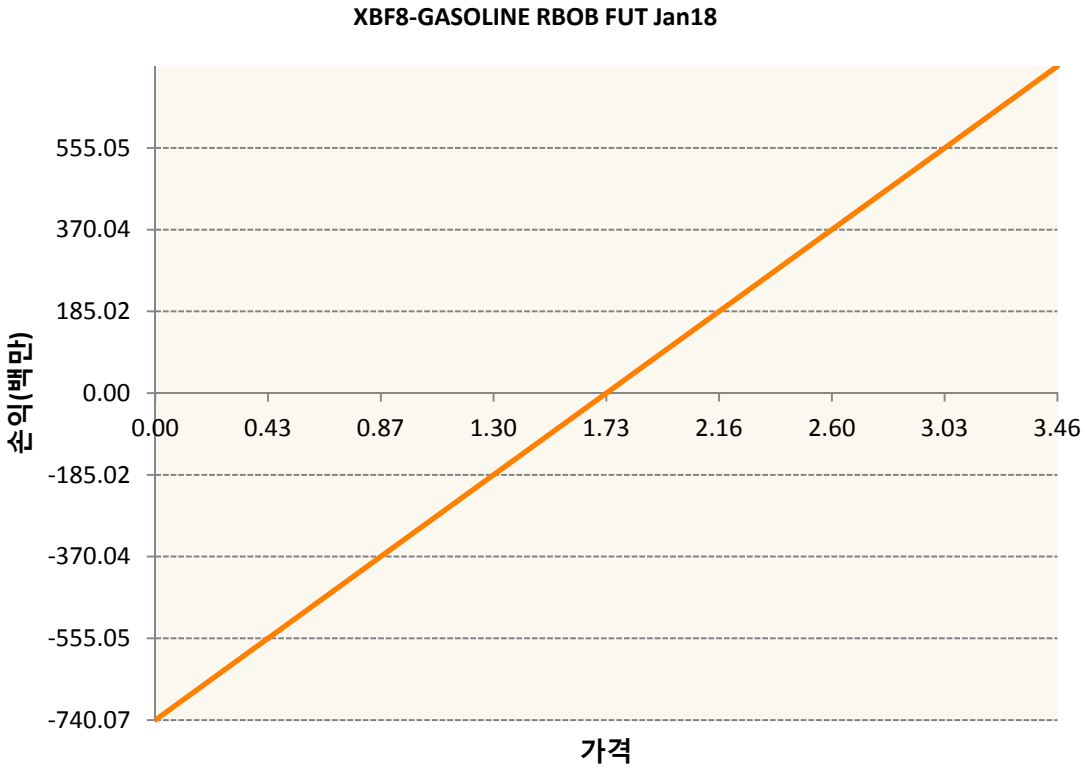

-719.70
-1,079.55
-1,439.41
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
730.36
547.77
365.18
182.59
0.00
-182.59
-365.18
-547.77
-730.36
0.00
0.48
0.96
1.44
1.92
2.40
2.88
3.36
3.84
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
652.68
435.12
217.56
0.00
-217.56
-435.12
-652.68
0.00
271.95
543.90
815.85
1,087.80
1,359.75
1,631.70
1,903.65
2,175.60
손익(백만)


-870.24
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,332.94
999.70
666.47
333.23
0.00
-333.23
-666.47
-999.70
-1,332.94
0.00
0.80
1.59
2.39
3.18
3.98
4.77
5.57
6.36
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
555.05
370.04
185.02
0.00
-185.02
-370.04
-555.05
-740.07
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
3.46
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	78
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	115
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	58
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	107
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	59

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

719

공시일	2017-12-01
기준일	2017-11-30

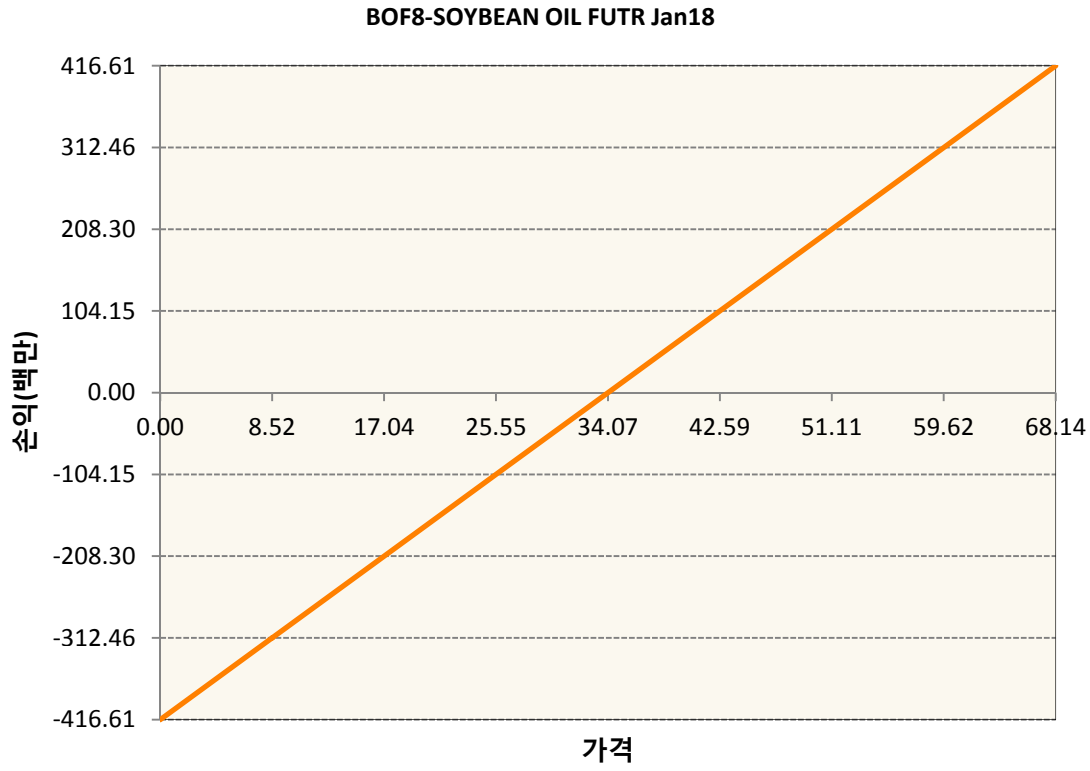
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

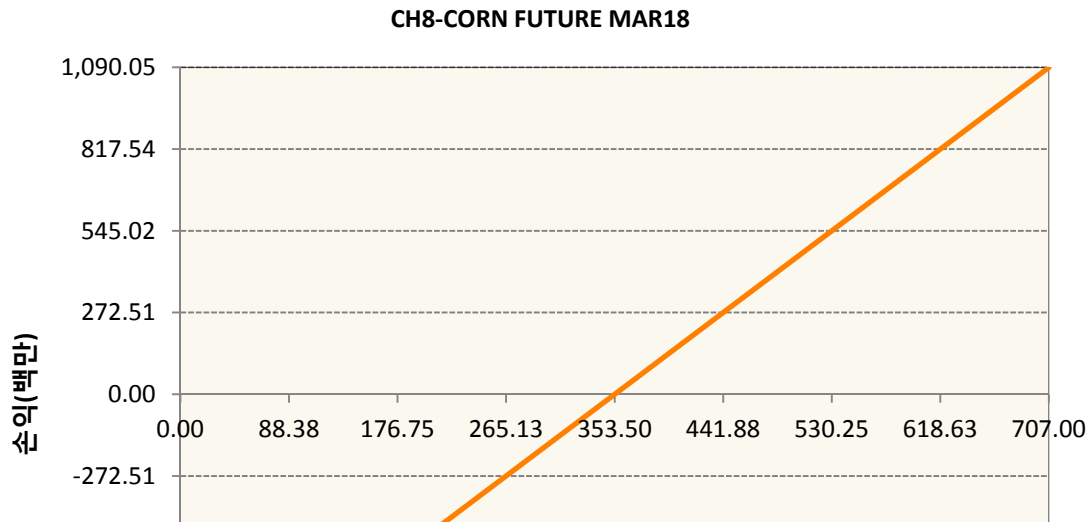
1. 계약금액

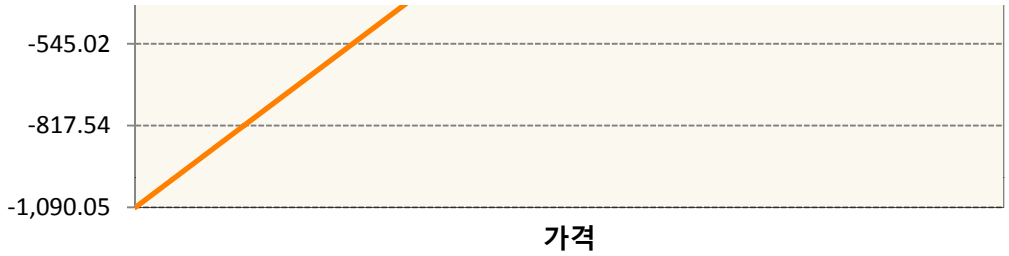
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,555	326	4,229	

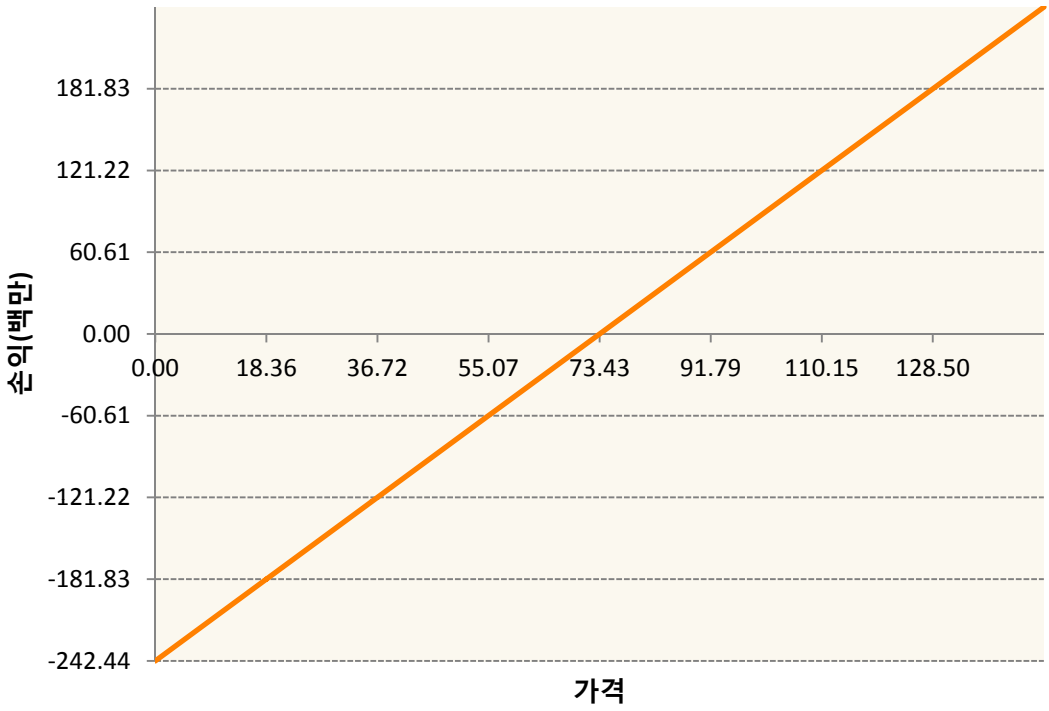
2. 만기시점의 손익구조



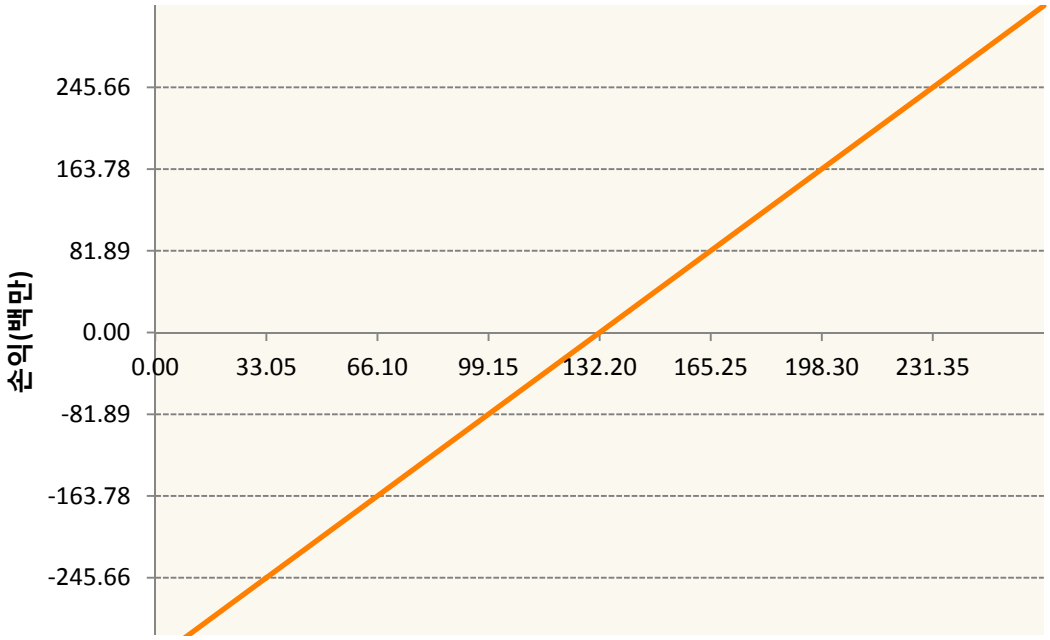


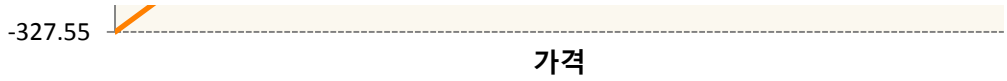


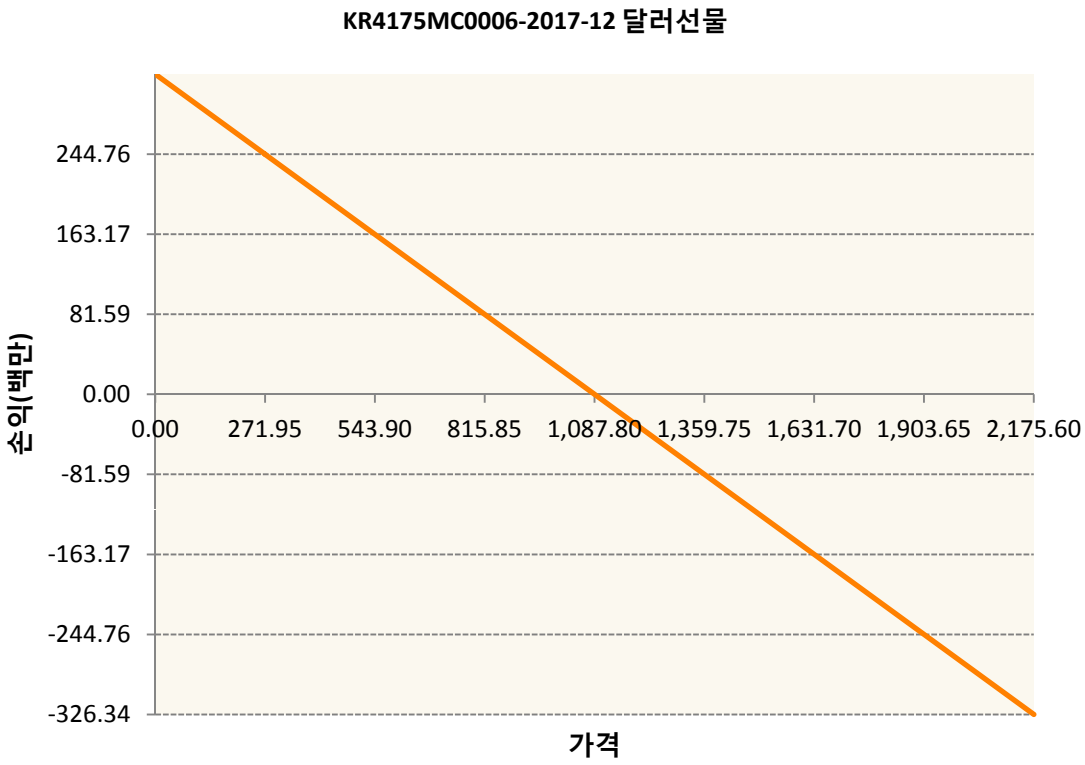
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

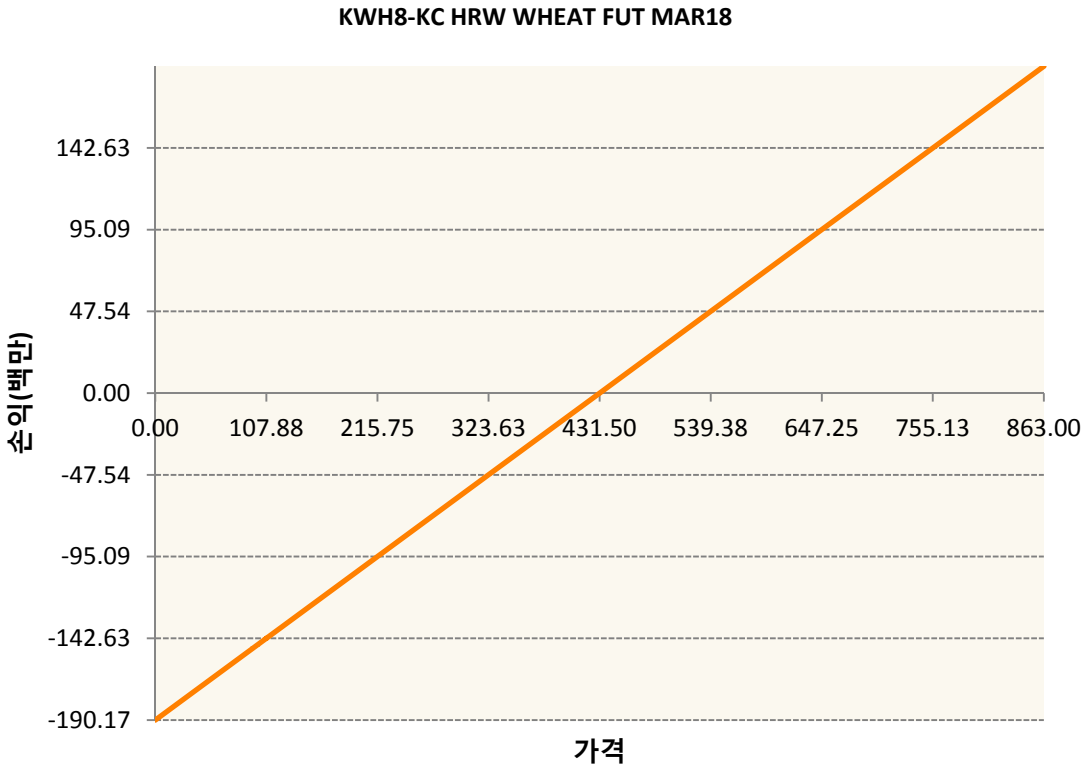


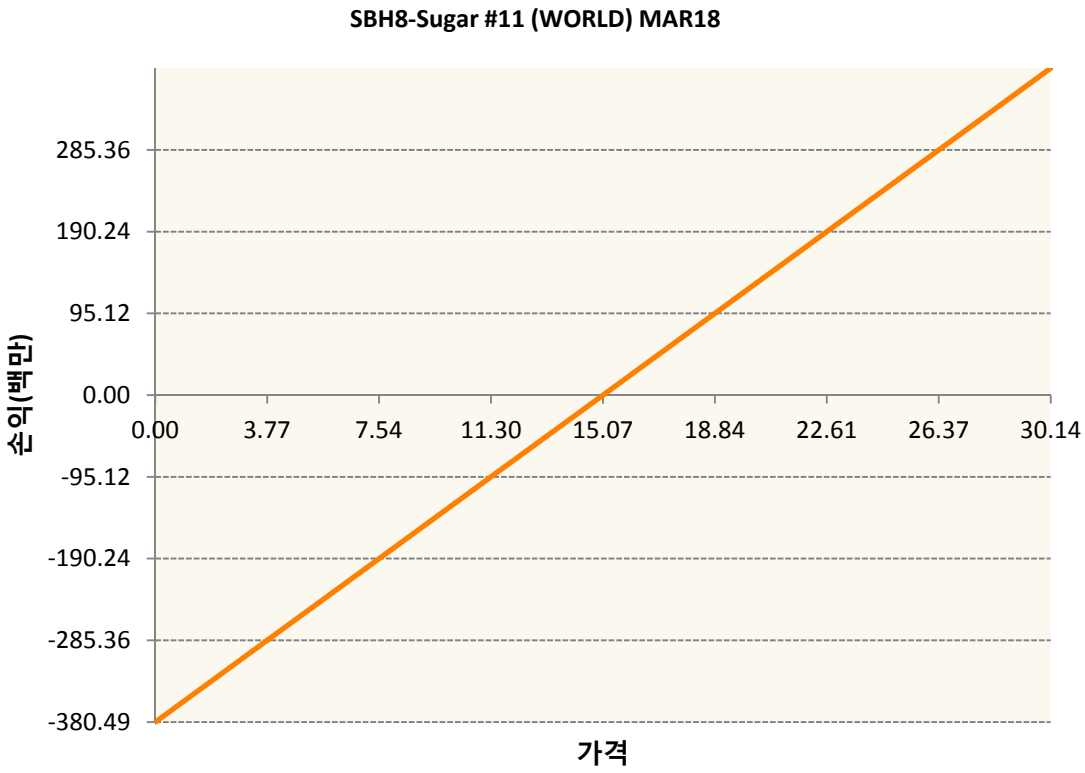
KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

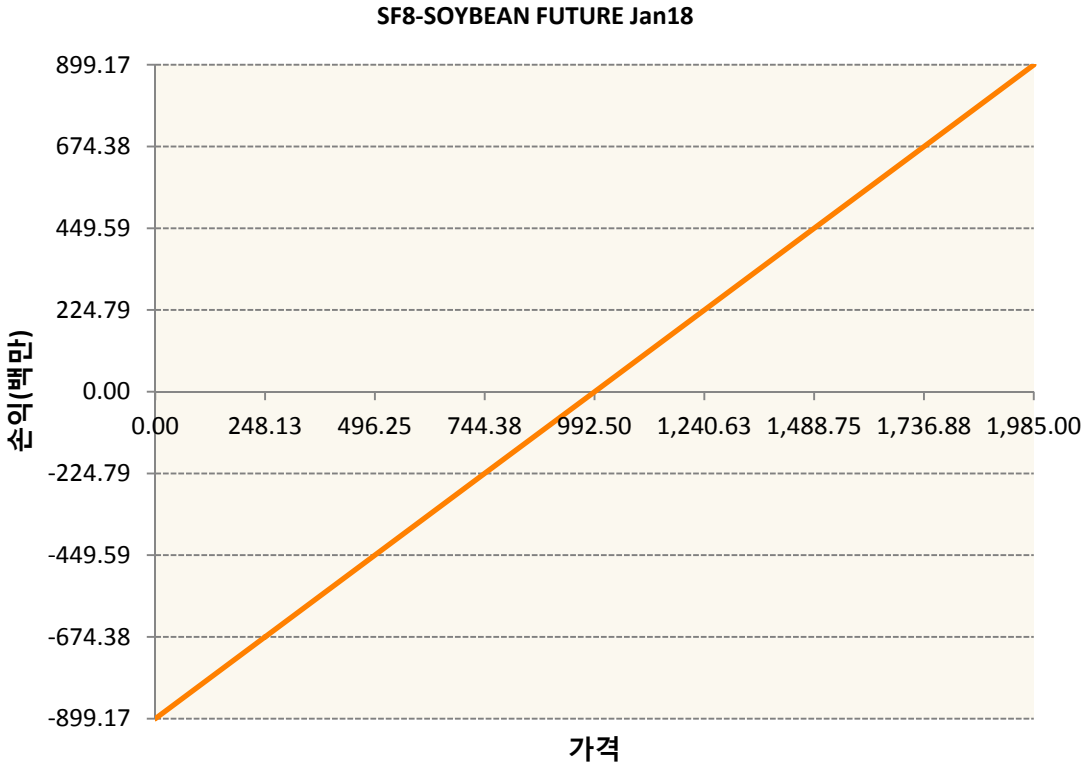



-327.55
가격

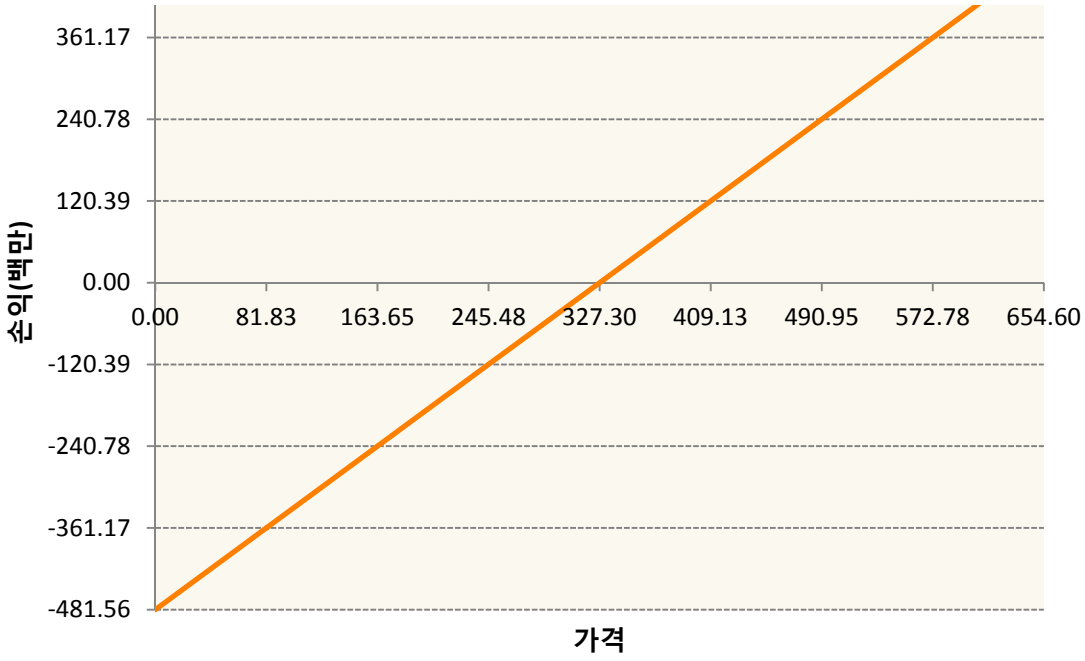

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
244.76
163.17
81.59
0.00
-81.59
-163.17
-244.76
-326.34
0.00
271.95
543.90
815.85
1,087.80
1,359.75
1,631.70
1,903.65
2,175.60
손익(백만)
가격

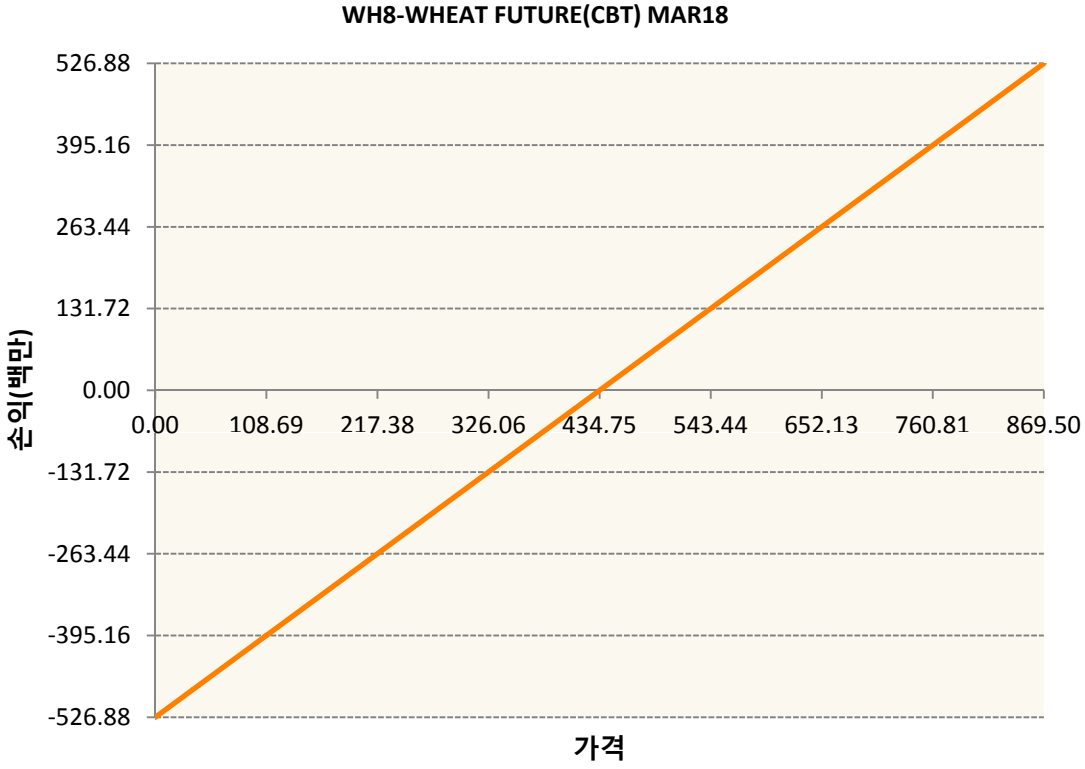

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
142.63
95.09
47.54
0.00
-47.54
-95.09
-142.63
-190.17
0.00
107.88
215.75
323.63
431.50
539.38
647.25
755.13
863.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
285.36
190.24
95.12
0.00
-95.12
-190.24
-285.36
-380.49
0.00
3.77
7.54
11.30
15.07
18.84
22.61
26.37
30.14
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
899.17
674.38
449.59
224.79
0.00
-224.79
-449.59
-674.38
-899.17
0.00
248.13
496.25
744.38
992.50
1,240.63
1,488.75
1,736.88
1,985.00
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
481.56





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	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	39
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	42

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

400