공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

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	2017-12-04
기준일	2017-12-01

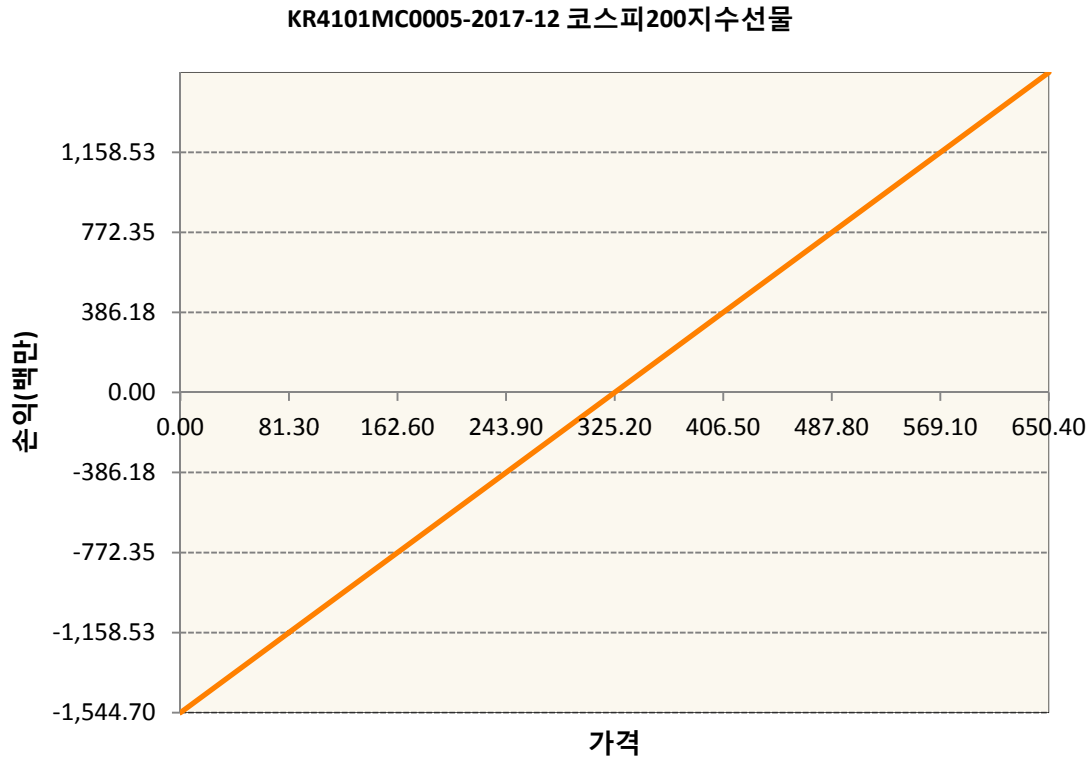
스마트인덱스모

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	1,545	0	1,545	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-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%	123	123	123	123	123	123	123

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

72

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

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	1,086

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

347

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

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	404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

371

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

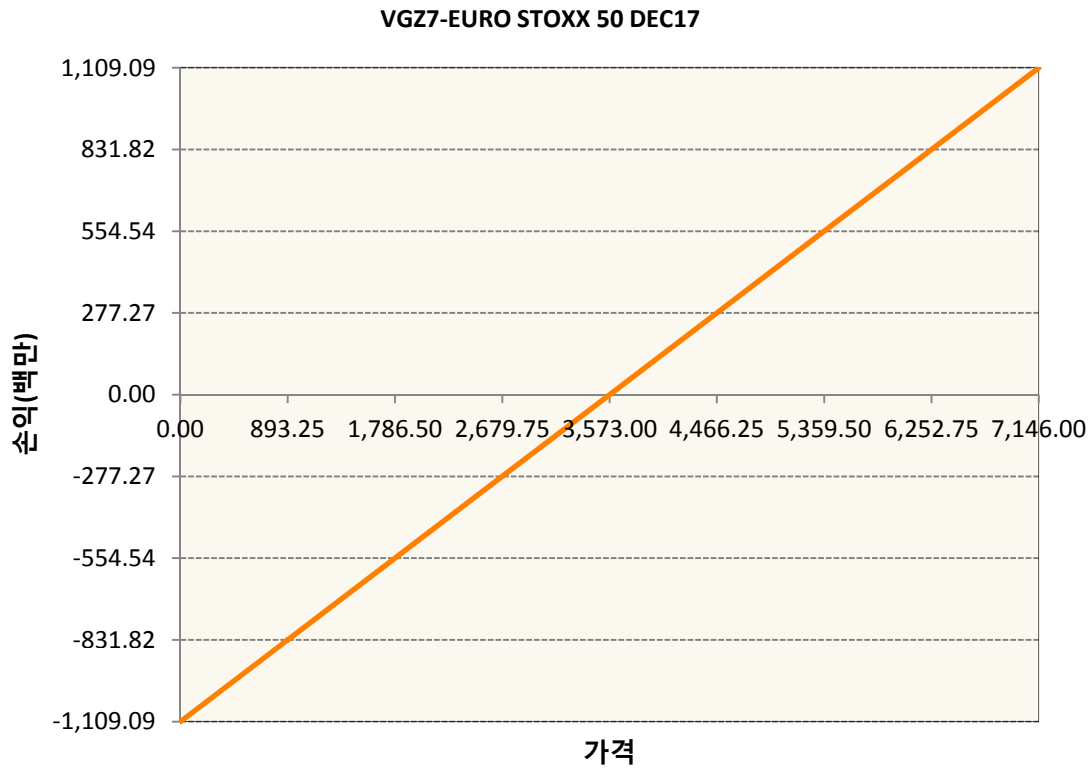
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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	2017-12-04
기준일	2017-12-01

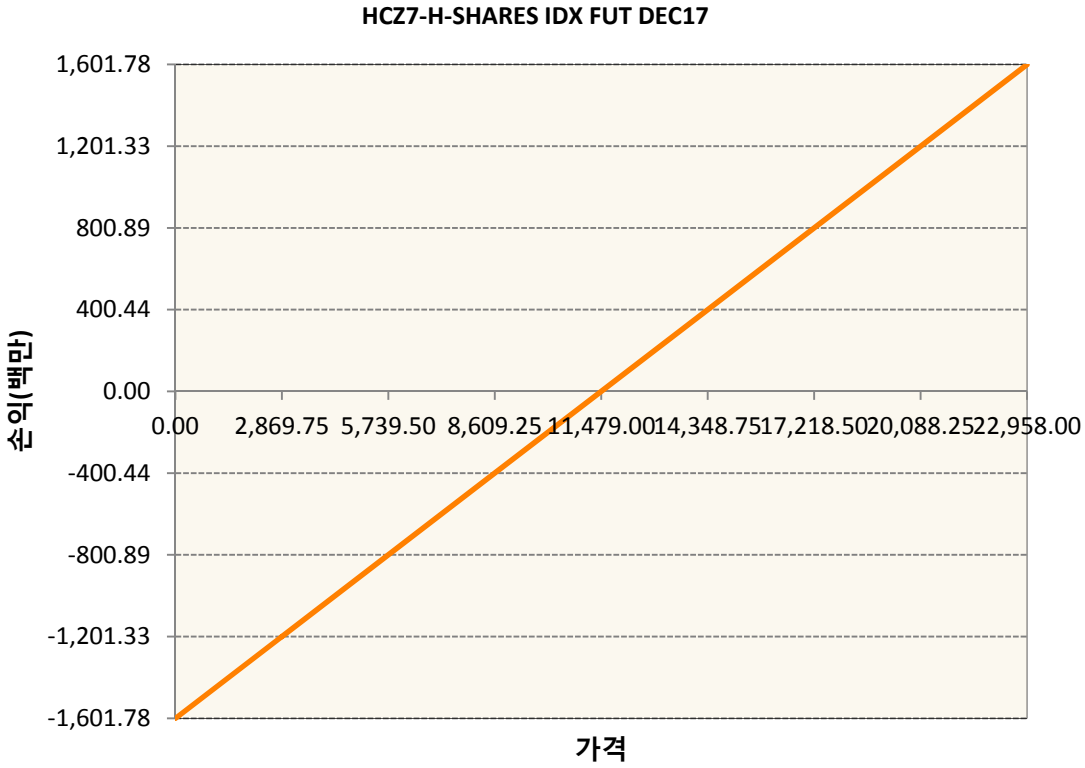
차이나인덱스모(주식-파생형)

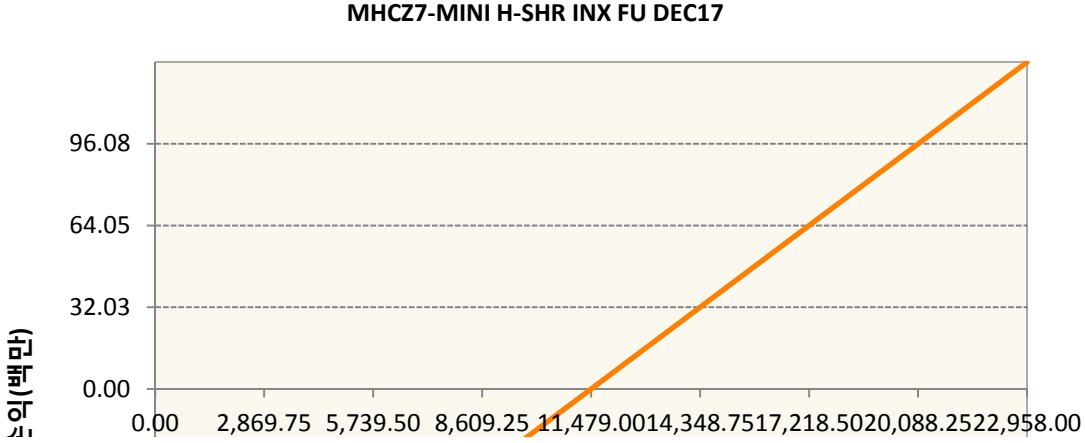
1. 계약금액

(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	1,602	0	1,602	
누계	유가증권	선물	128	0	128	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	128
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

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

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

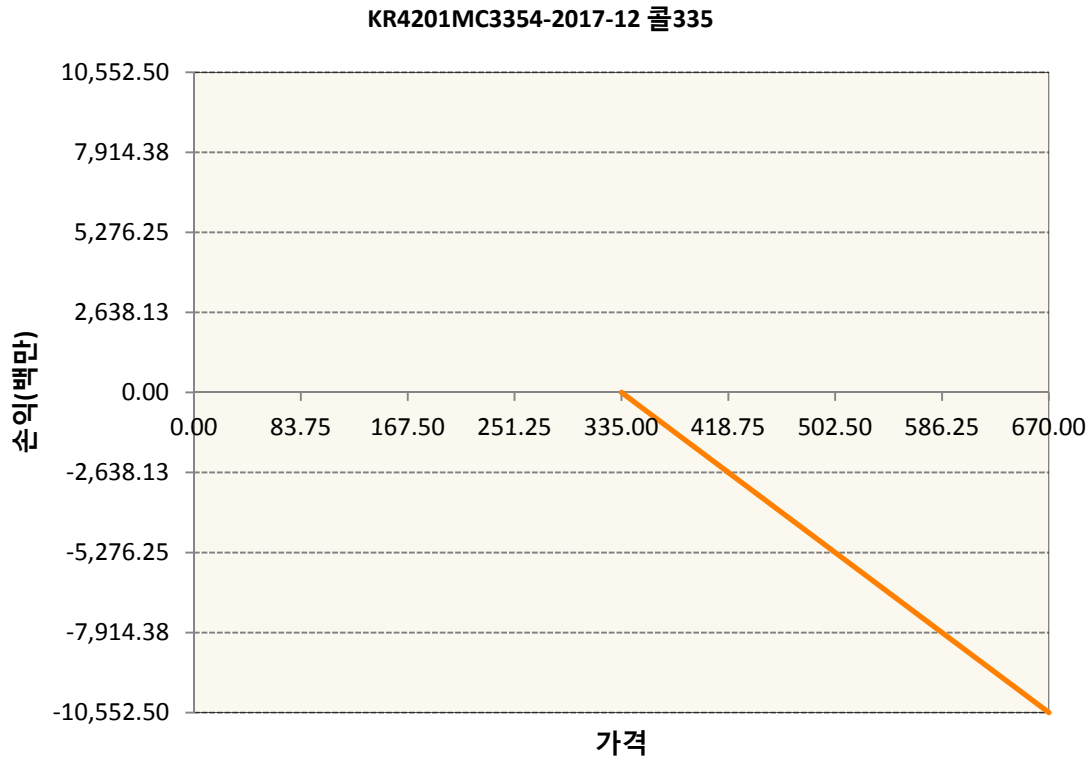
커버드콜모(주식혼합-파생형)

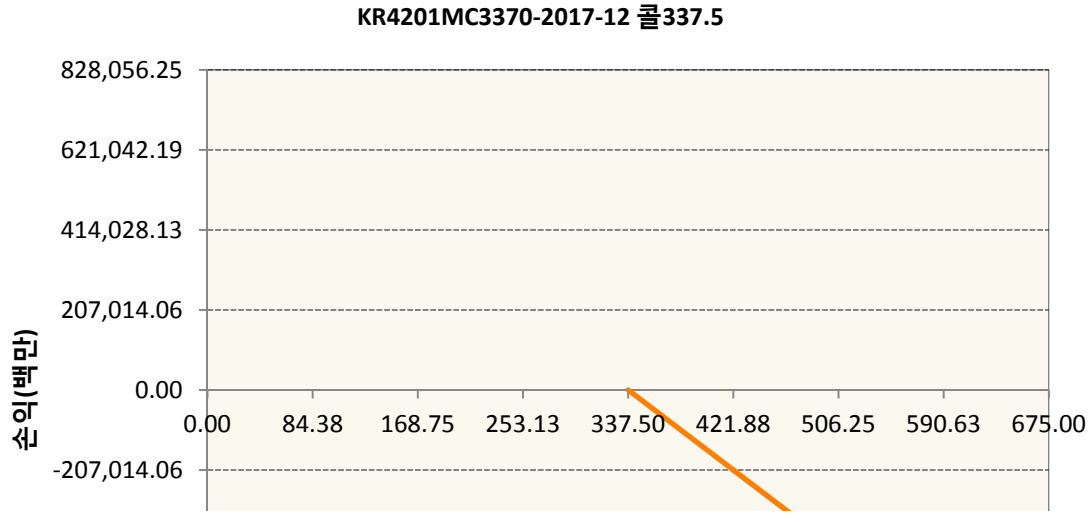
1. 계약금액

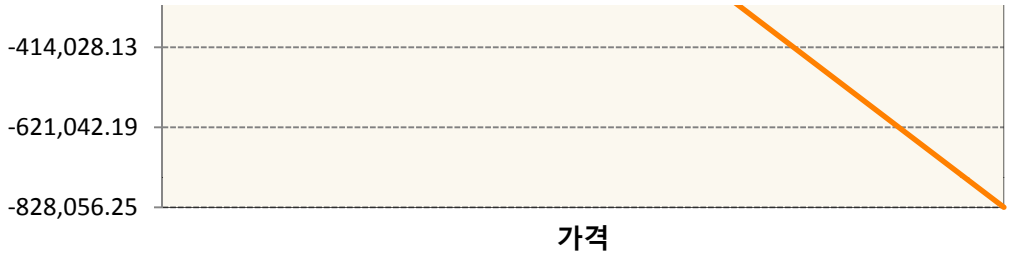
(단위:백만원)

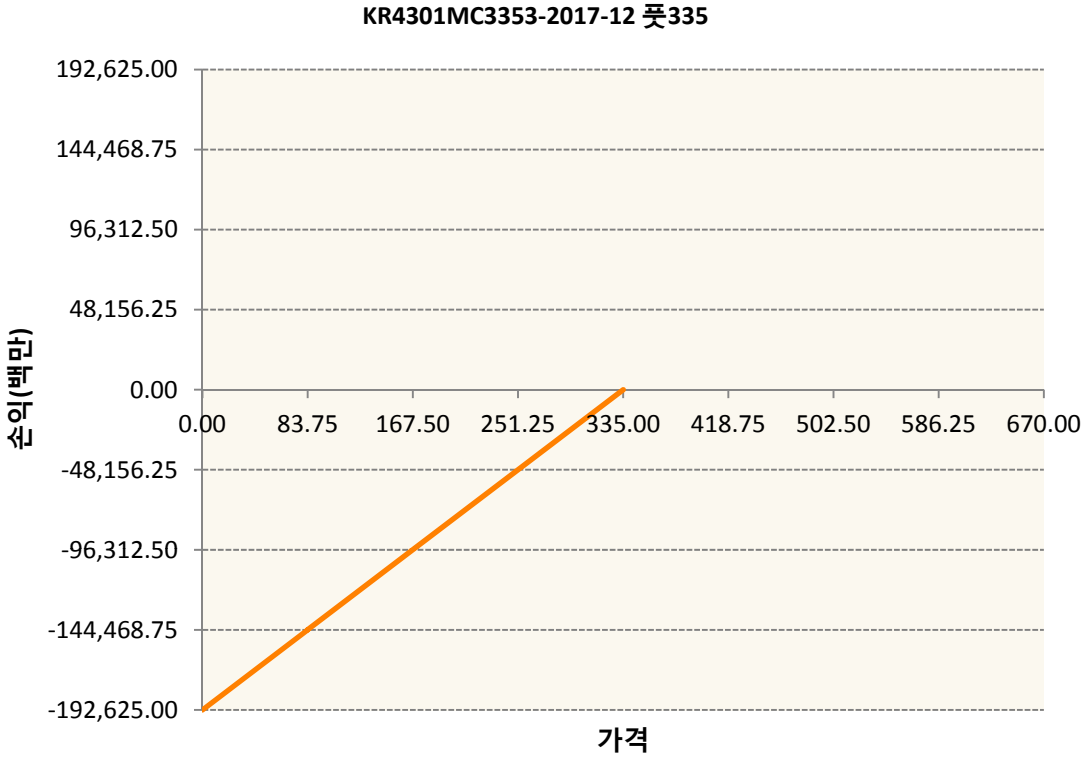
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

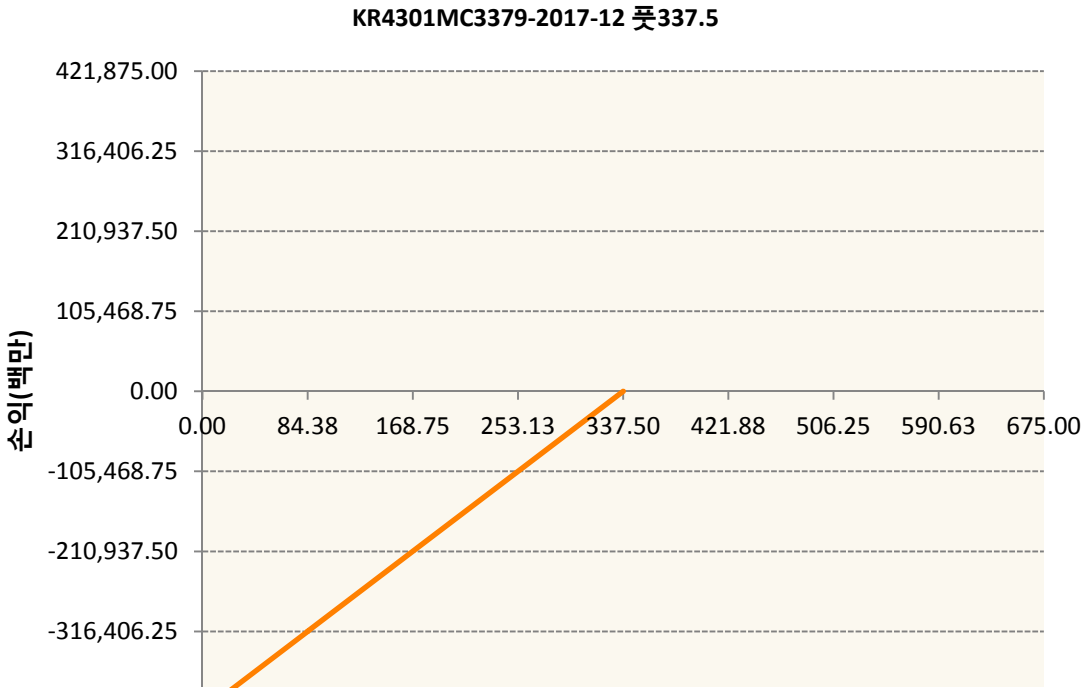
2. 만기시점의 손익구조






-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							501
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	77	76	75	73	71
-5.33%	76	75	73	70	67	62	57
-2.67%	69	64	58	51	43	33	24
0%	37	26	13	0	-14	-28	-42
2.67%	-50	-67	-83	-100	-117	-133	-150
5.33%	-213	-227	-242	-258	-273	-289	-304
8.00%	-438	-446	-456	-466	-477	-489	-501
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							35,840
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,637	4,630	4,612	4,576	4,514	4,419	4,285
-5.33%	4,598	4,538	4,433	4,275	4,058	3,779	3,439
-2.67%	4,255	3,970	3,596	3,138	2,602	1,997	1,328
0%	2,522	1,752	907	0	-957	-1,955	-2,988
2.67%	-2,837	-4,078	-5,330	-6,591	-7,858	-9,131	-10,408
5.33%	-13,819	-15,056	-16,309	-17,572	-18,844	-20,123	-21,408
8.00%	-30,155	-30,947	-31,817	-32,752	-33,740	-34,772	-35,840
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,682
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,682	-14,682	-14,682	-14,682	-14,682	-14,682	-14,682
-5.33%	-9,705	-9,705	-9,705	-9,705	-9,706	-9,707	-9,710
-2.67%	-4,728	-4,731	-4,735	-4,744	-4,757	-4,776	-4,801
0%	175	128	69	0	-79	-165	-259
2.67%	4,180	4,024	3,868	3,711	3,553	3,395	3,237
5.33%	5,856	5,764	5,663	5,553	5,436	5,314	5,187
8.00%	6,087	6,076	6,058	6,032	5,997	5,954	5,903
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							32,177
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,176	-32,176	-32,176	-32,176	-32,176	-32,176	-32,177
-5.33%	-21,356	-21,356	-21,356	-21,356	-21,357	-21,358	-21,361
-2.67%	-10,536	-10,537	-10,542	-10,550	-10,565	-10,588	-10,621
0%	225	172	97	0	-118	-254	-409
2.67%	9,854	9,563	9,262	8,954	8,639	8,320	7,997

5.33%	15,029	14,751	14,460	14,160	13,852	13,537	13,218
8.00%	16,057	16,003	15,928	15,830	15,711	15,571	15,413

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

84,248

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

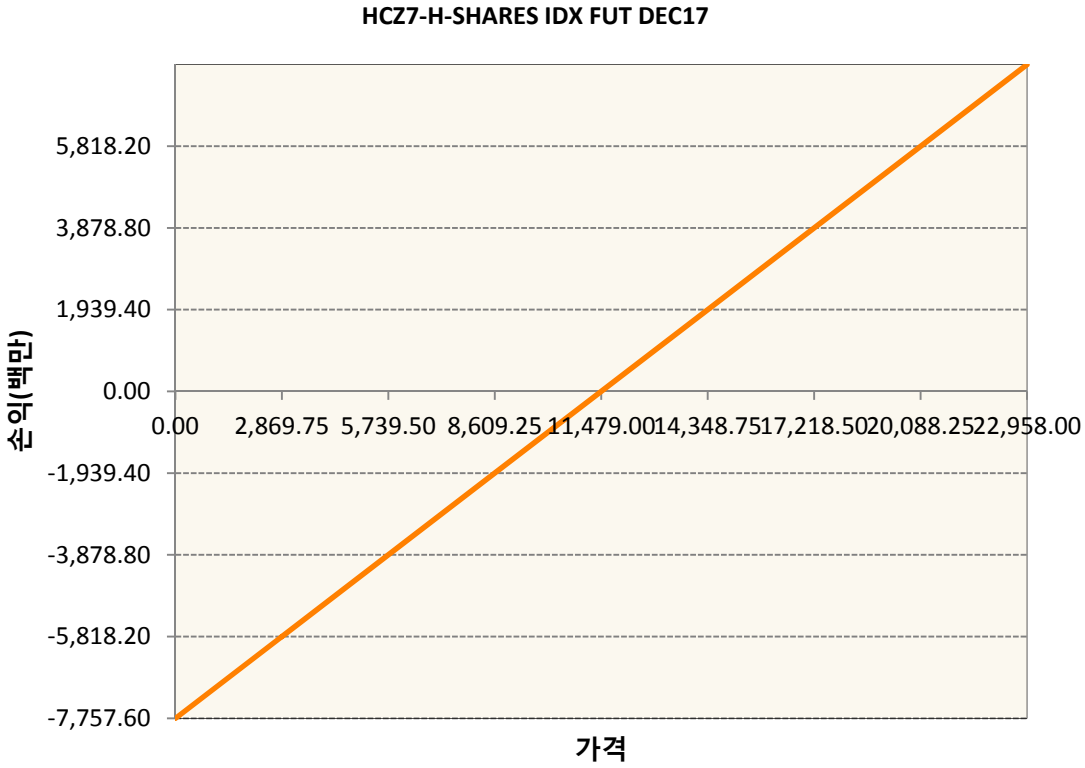
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

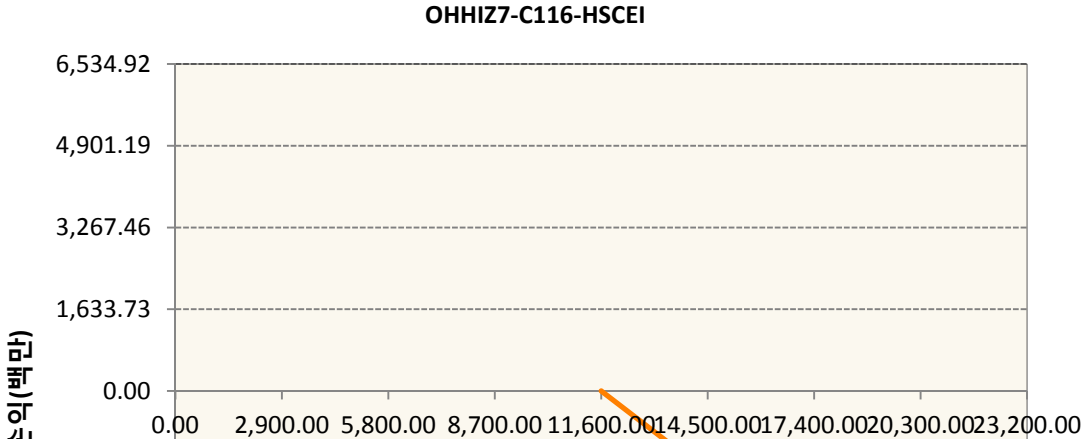
1. 계약금액

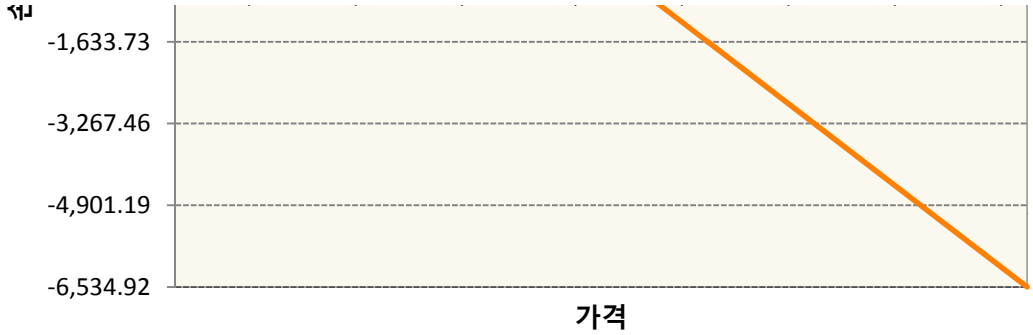
(단위:백만원)

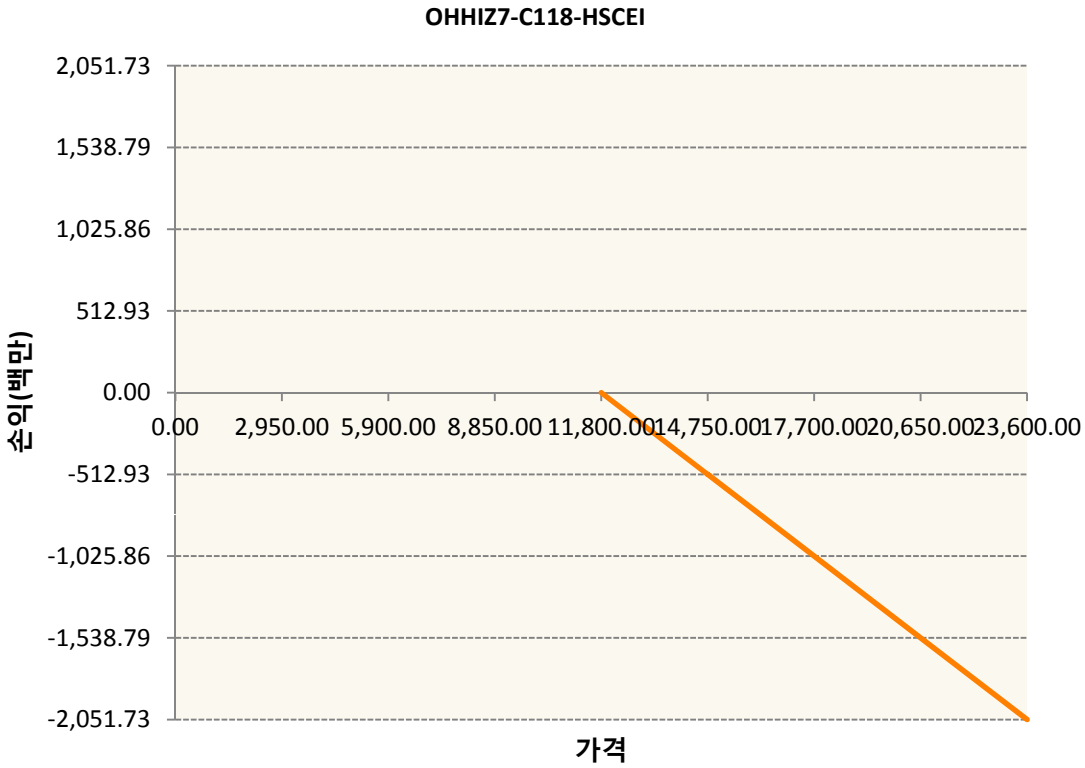
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,758	0	7,758	
누계	유가증권	옵션	0	17,173	-17,173	장내

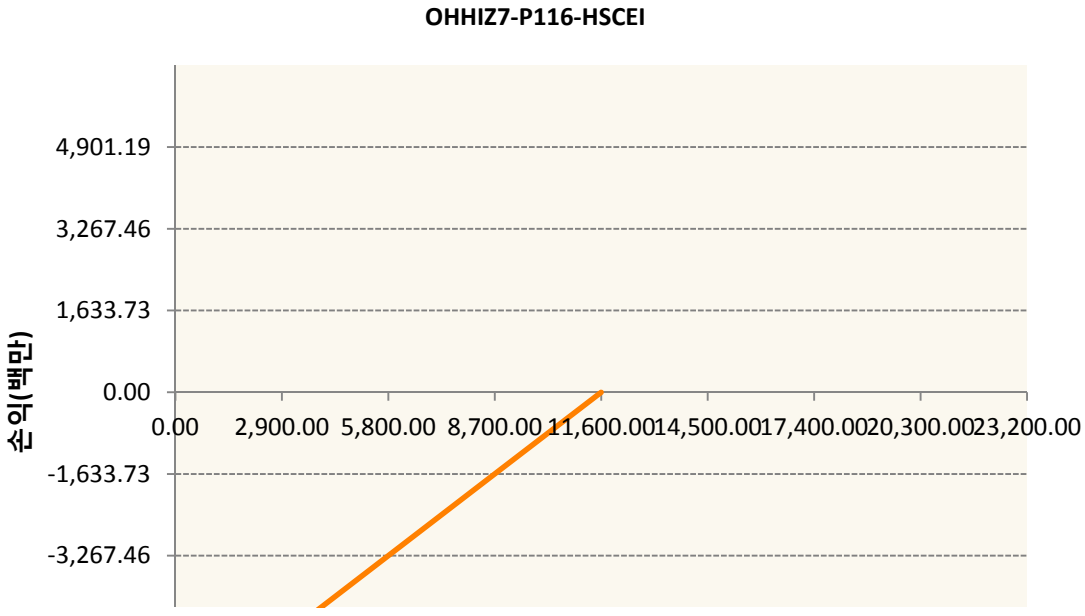
2. 만기시점의 손익구조

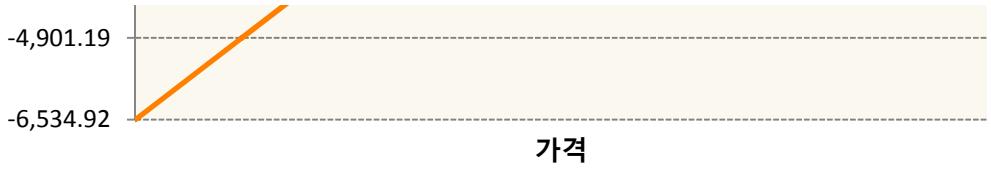


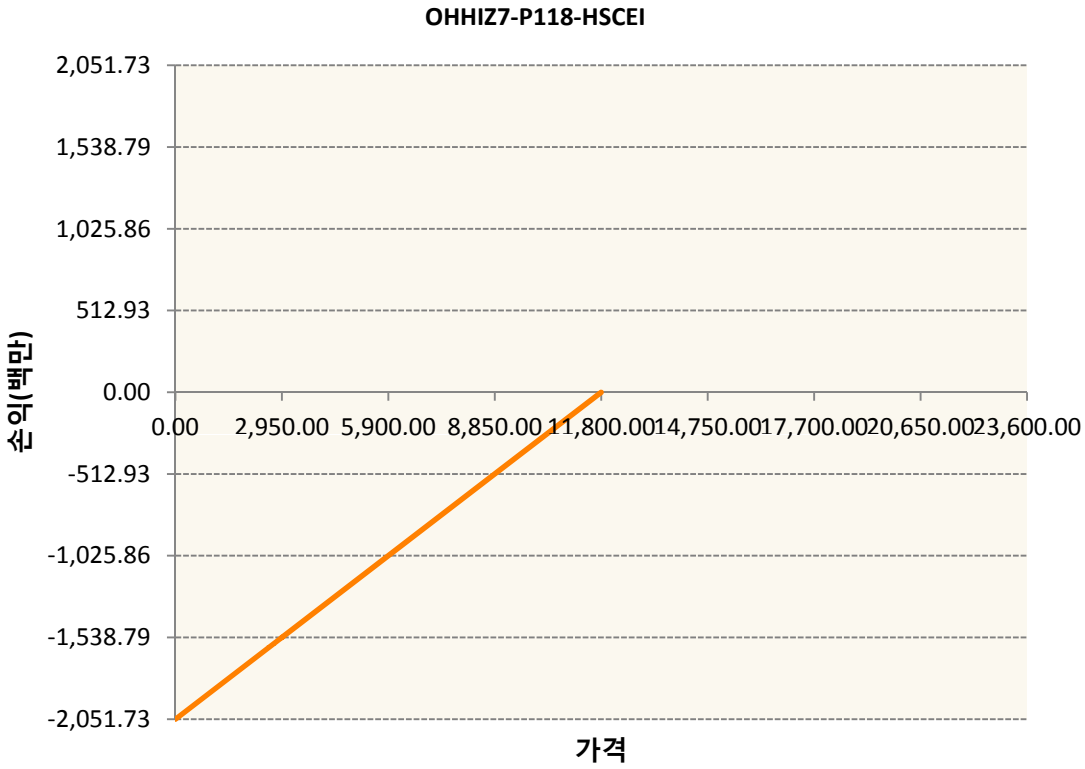



-1,633.73
-3,267.46
-4,901.19
-6,534.92
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,051.73
1,538.79
1,025.86
512.93
0.00
-512.93
-1,025.86
-1,538.79
-2,051.73
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
4,901.19
3,267.46
1,633.73
0.00
-1,633.73
-3,267.46
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	621
OHHIZ7-C11	HSCEI	523
OHHIZ7-C11	HSCEI	164
OHHIZ7-P11	HSCEI	523
OHHIZ7-P11	HSCEI	164

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

1,512

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

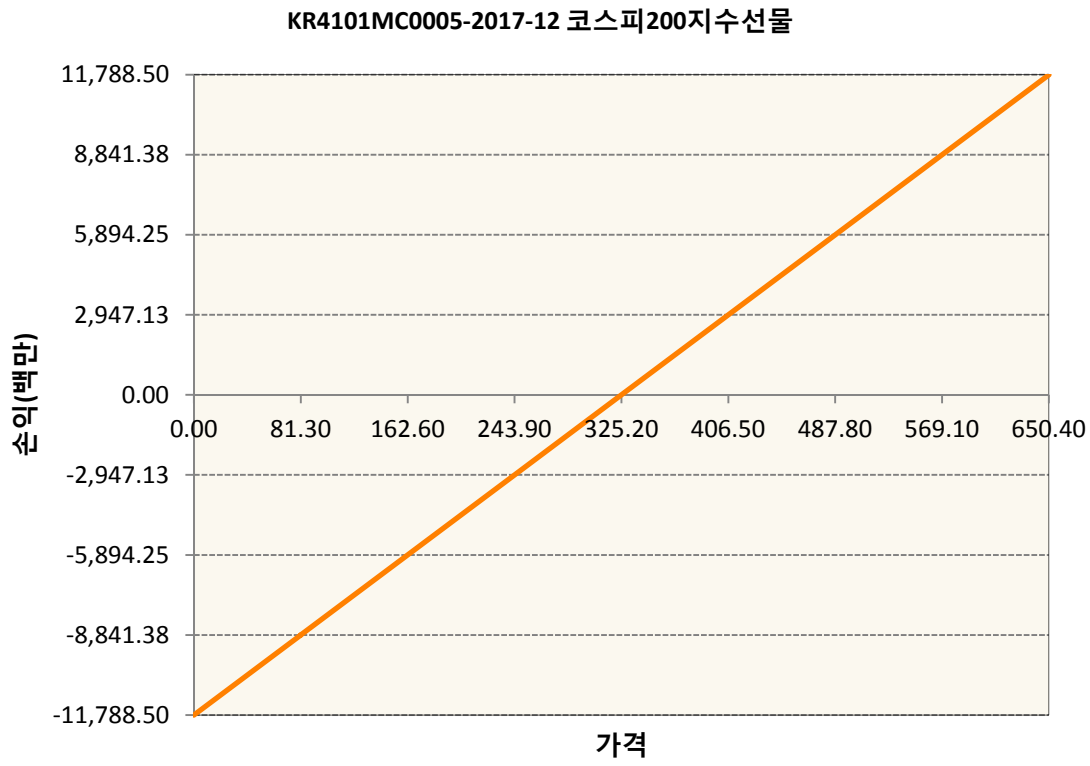
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

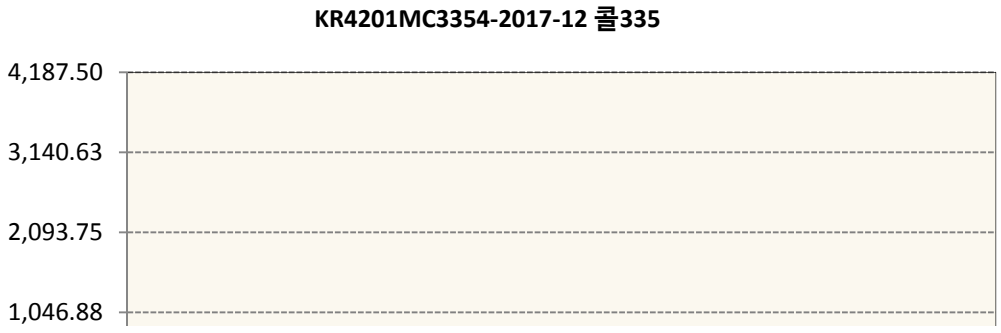
1. 계약금액

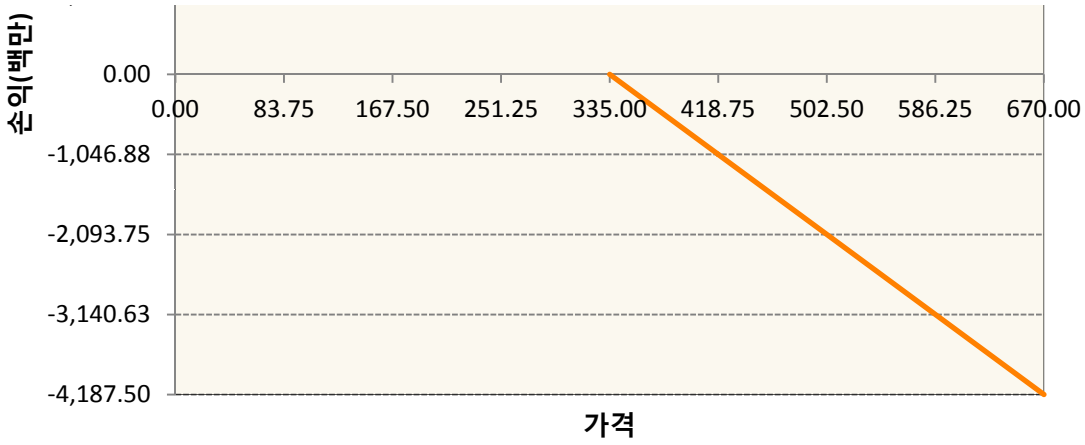
(단위:백만원)

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	11,789	0	11,789	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

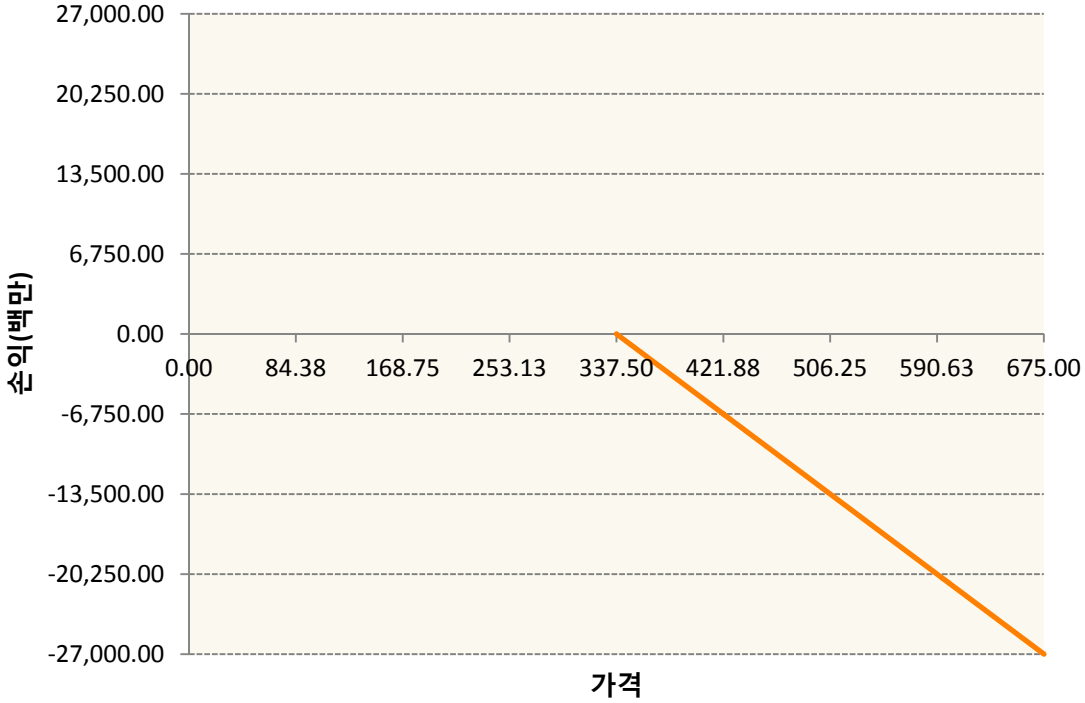
2. 만기시점의 손익구조



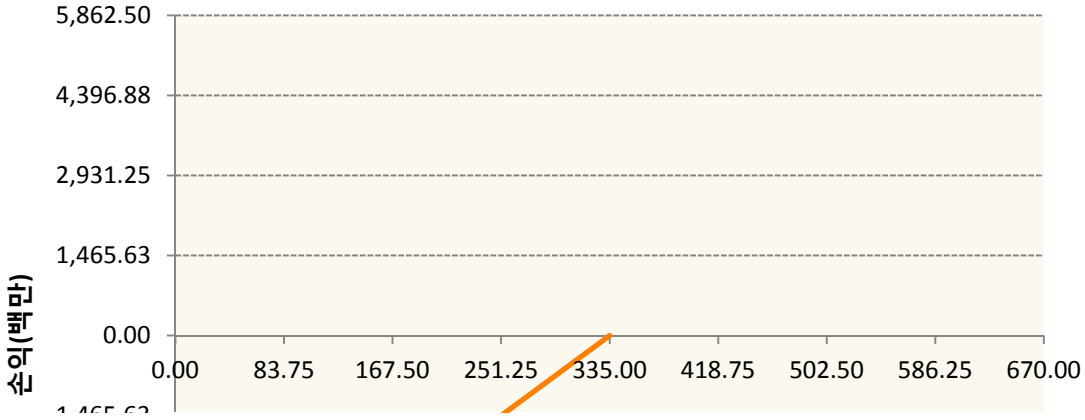




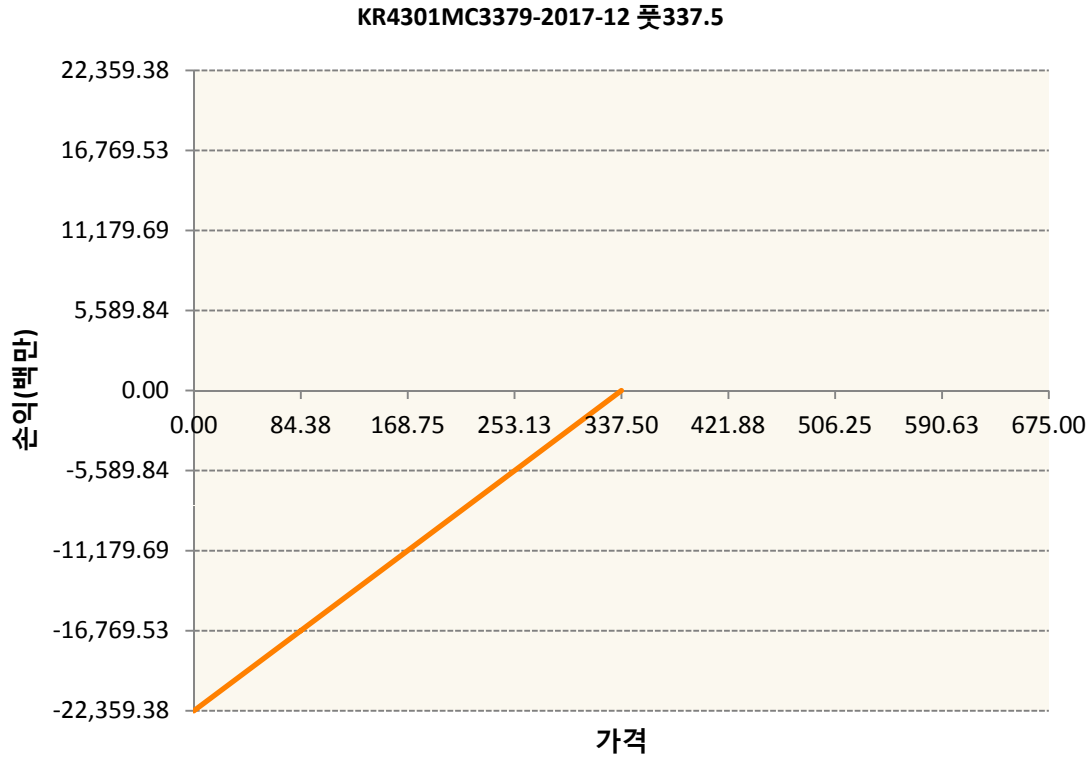
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



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					942

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-942	-942	-942	-942	-942	-942	-942
-5.33%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-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%	628	628	628	628	628	628	628
8.00%	942	942	942	942	942	942	942
	KR4201MC3	2017-12 콜335					199

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	30	30	30	29	28
-5.33%	30	30	29	28	27	25	23
-2.67%	27	25	23	20	17	13	9
0%	15	10	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-20	-26	-33	-40	-46	-53	-59
5.33%	-85	-90	-96	-102	-108	-115	-121
8.00%	-174	-177	-181	-185	-189	-194	-199
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,169

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	151	151	150	149	147	144	140
-5.33%	150	148	145	139	132	123	112
-2.67%	139	129	117	102	85	65	43
0%	82	57	30	0	-31	-64	-97
2.67%	-93	-133	-174	-215	-256	-298	-339
5.33%	-451	-491	-532	-573	-614	-656	-698
8.00%	-983	-1,009	-1,037	-1,068	-1,100	-1,134	-1,169
	KR4301MC3	2017-12 풋335					447

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-447	-447	-447	-447	-447	-447	-447
-5.33%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-296

-2.67%	-144	-144	-144	-144	-145	-145	-146
0%	5	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	127	122	118	113	108	103	99
5.33%	178	175	172	169	165	162	158
8.00%	185	185	184	184	183	181	180
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,705
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,705	-1,705	-1,705	-1,705	-1,705	-1,705	-1,705
-5.33%	-1,132	-1,132	-1,132	-1,132	-1,132	-1,132	-1,132
-2.67%	-558	-558	-559	-559	-560	-561	-563
0%	12	9	5	0	-6	-13	-22
2.67%	522	507	491	475	458	441	424
5.33%	797	782	766	750	734	717	701
8.00%	851	848	844	839	833	825	817

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

8,917

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

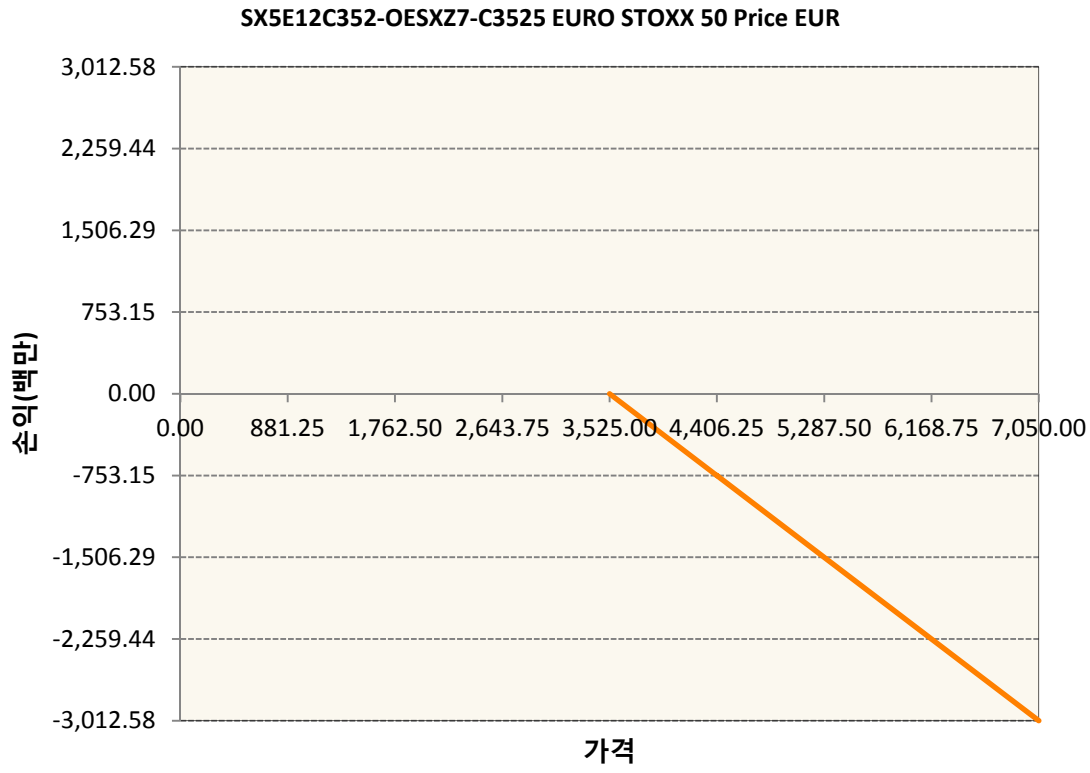
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

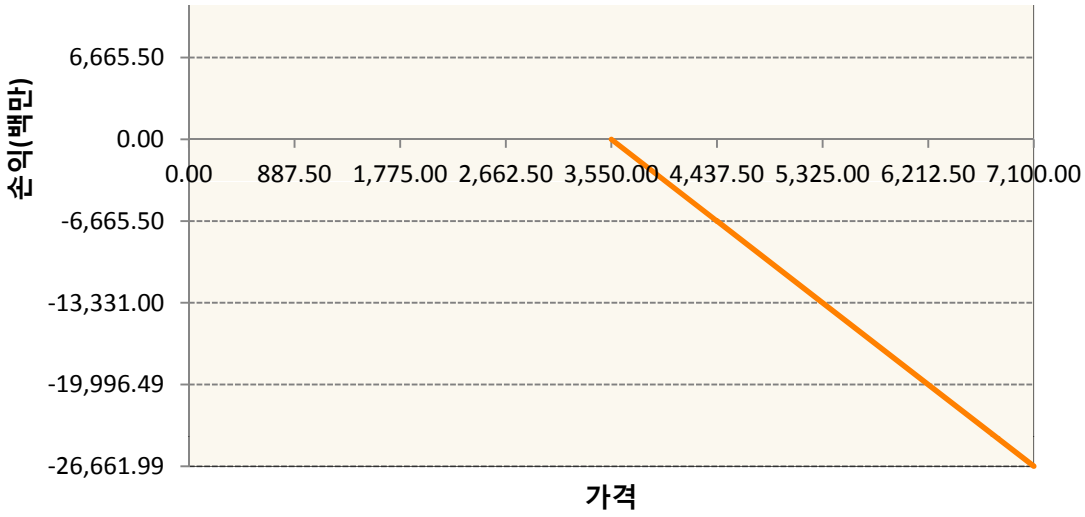
(단위:백만원)

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	21,662	0	21,662	
누계	유가증권	스왑	97,120	0	97,120	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,349	-59,349	장내
누계	지수	스왑	51,798	0	51,798	장외

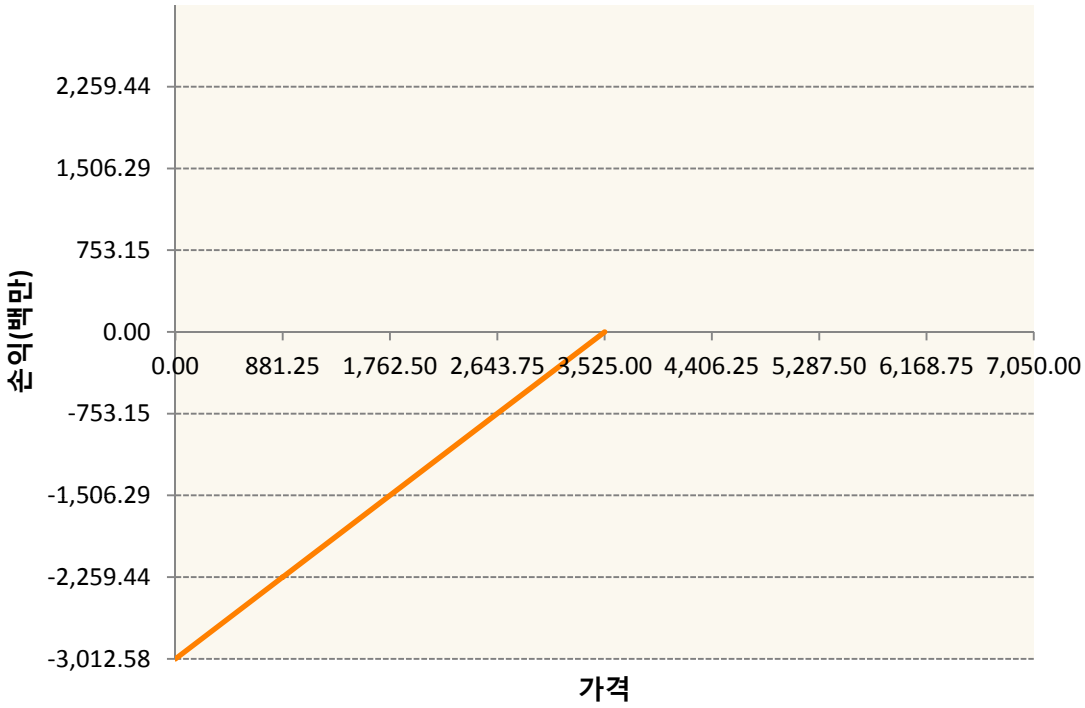
2. 만기시점의 손익구조



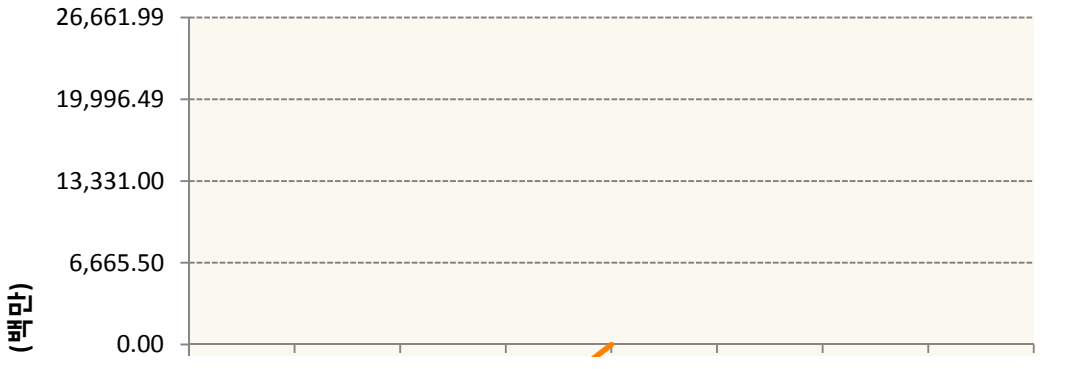


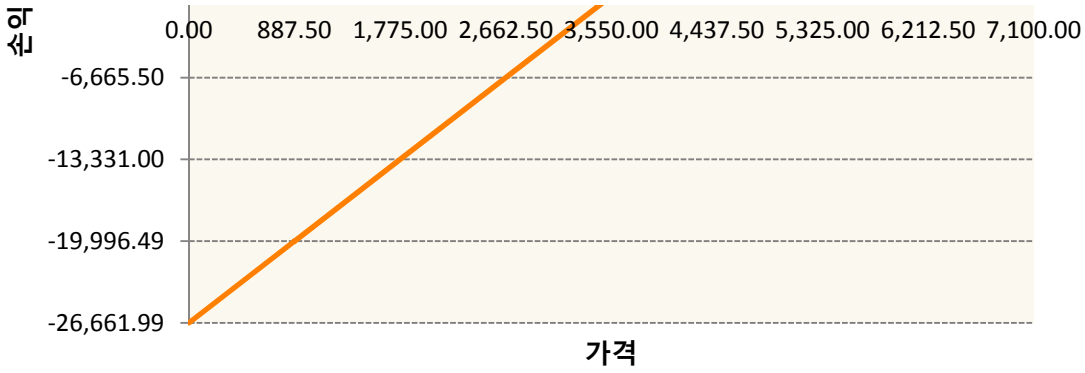


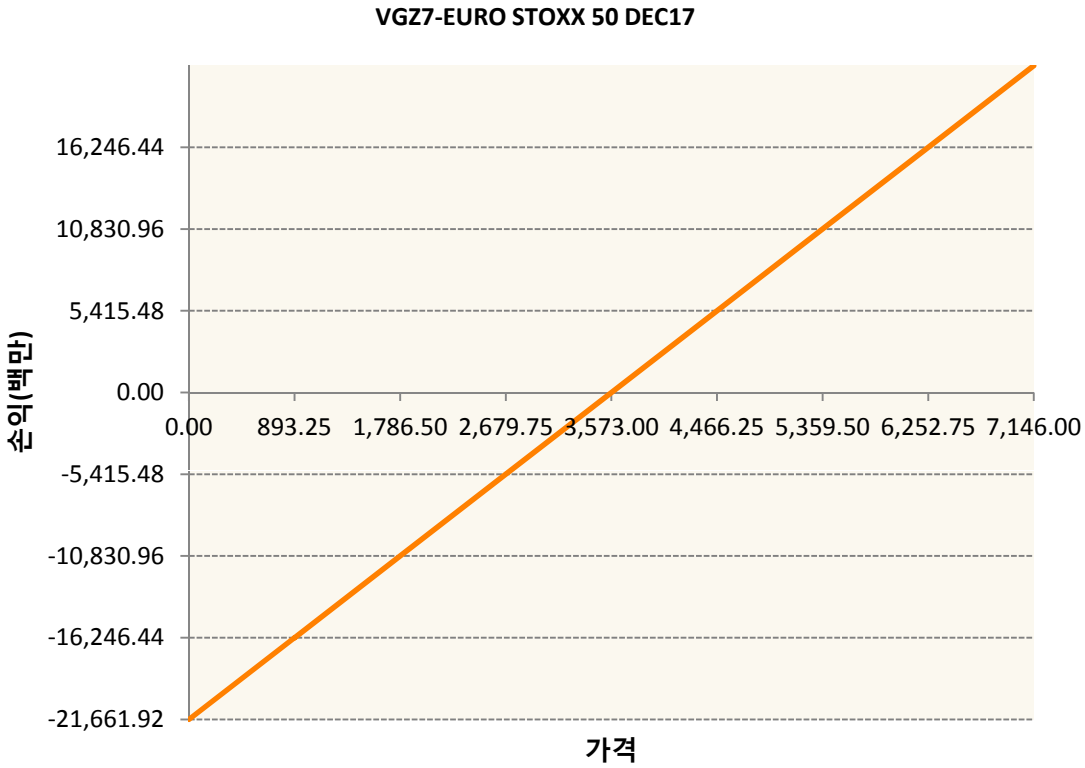
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	28
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	10
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	241
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,133
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	241
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,133
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,733

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

3,707

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

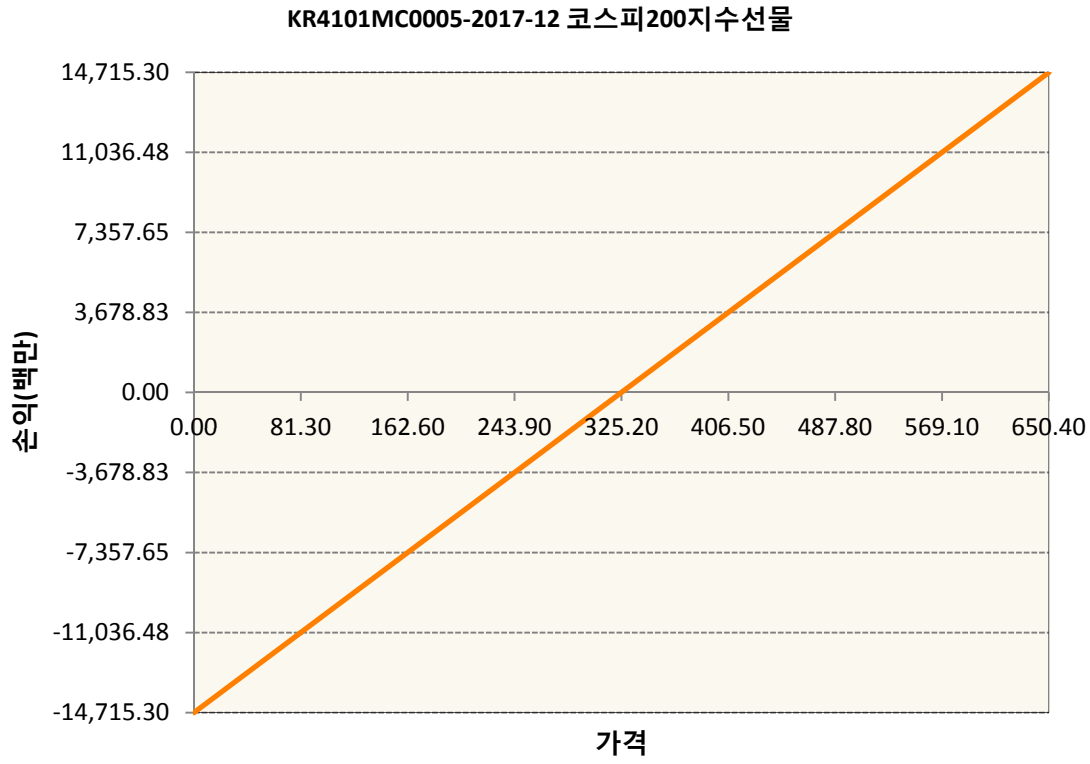
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,715	0	14,715	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176
-5.33%	-784	-784	-784	-784	-784	-784	-784
-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%	784	784	784	784	784	784	784
8.00%	1,176	1,176	1,176	1,176	1,176	1,176	1,176

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

684

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

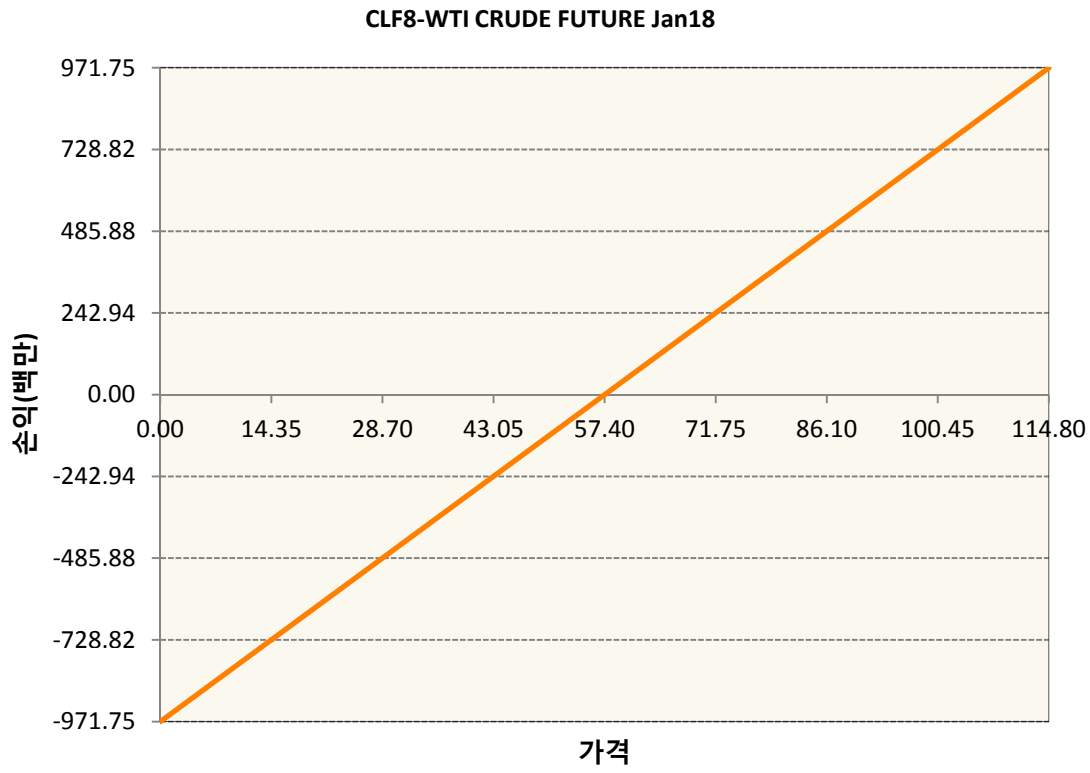
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

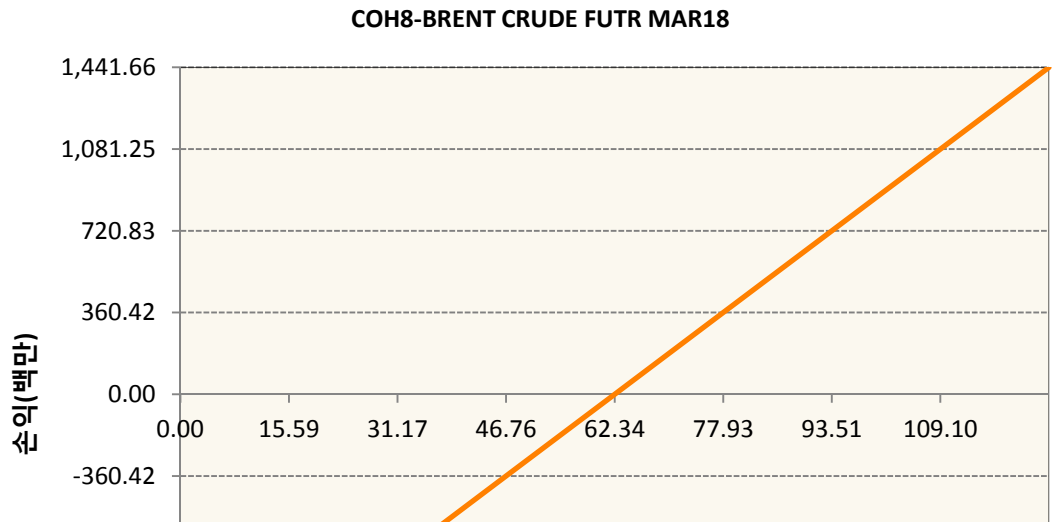
1. 계약금액

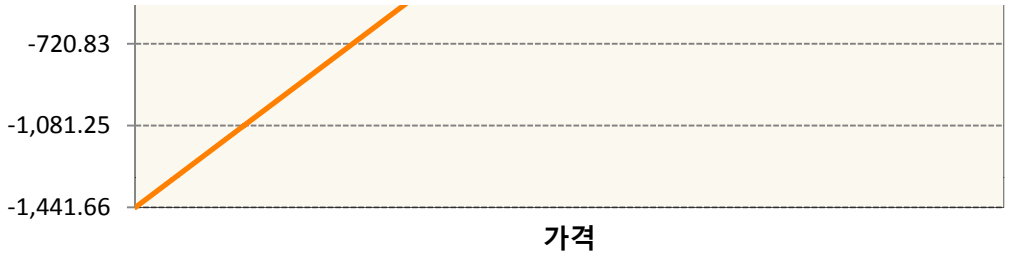
(단위:백만원)

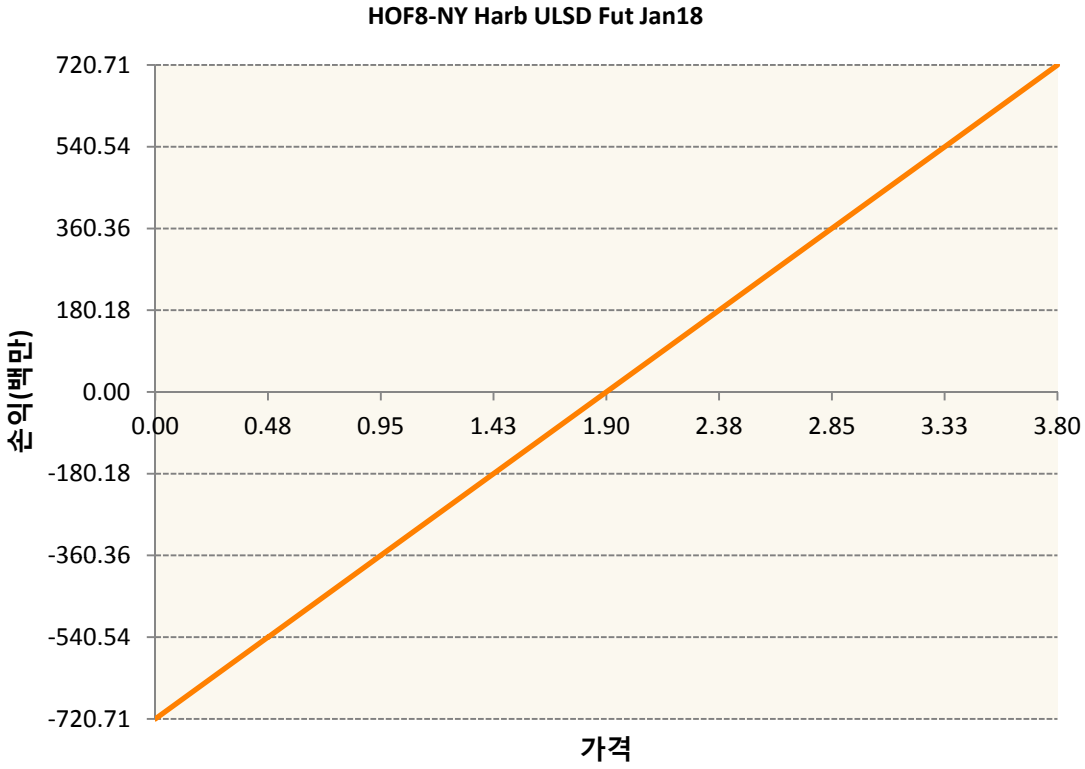
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,144	869	4,274	

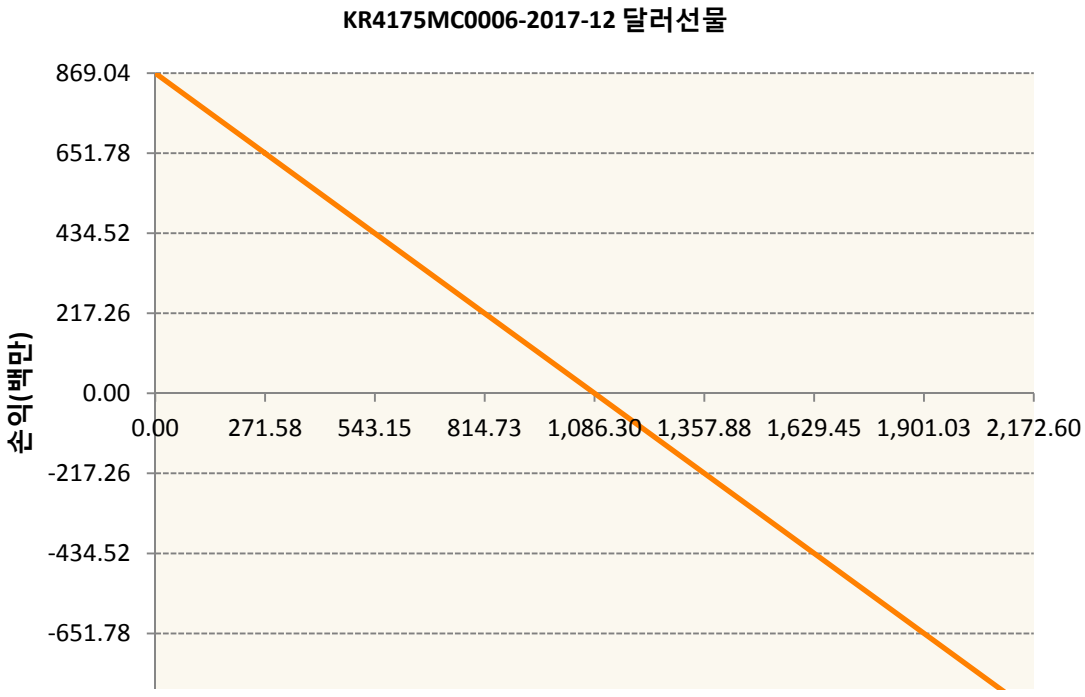
2. 만기시점의 손익구조

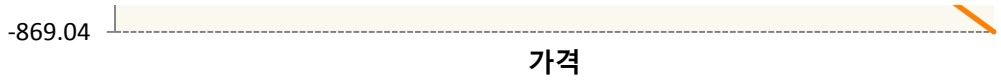


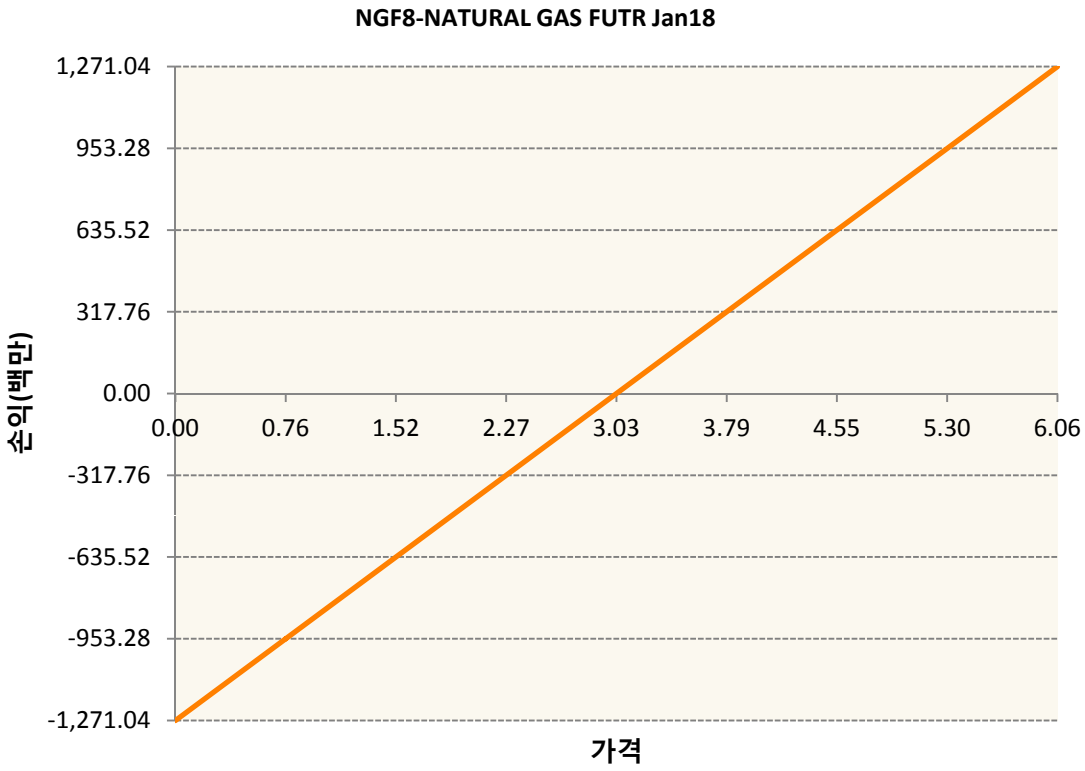


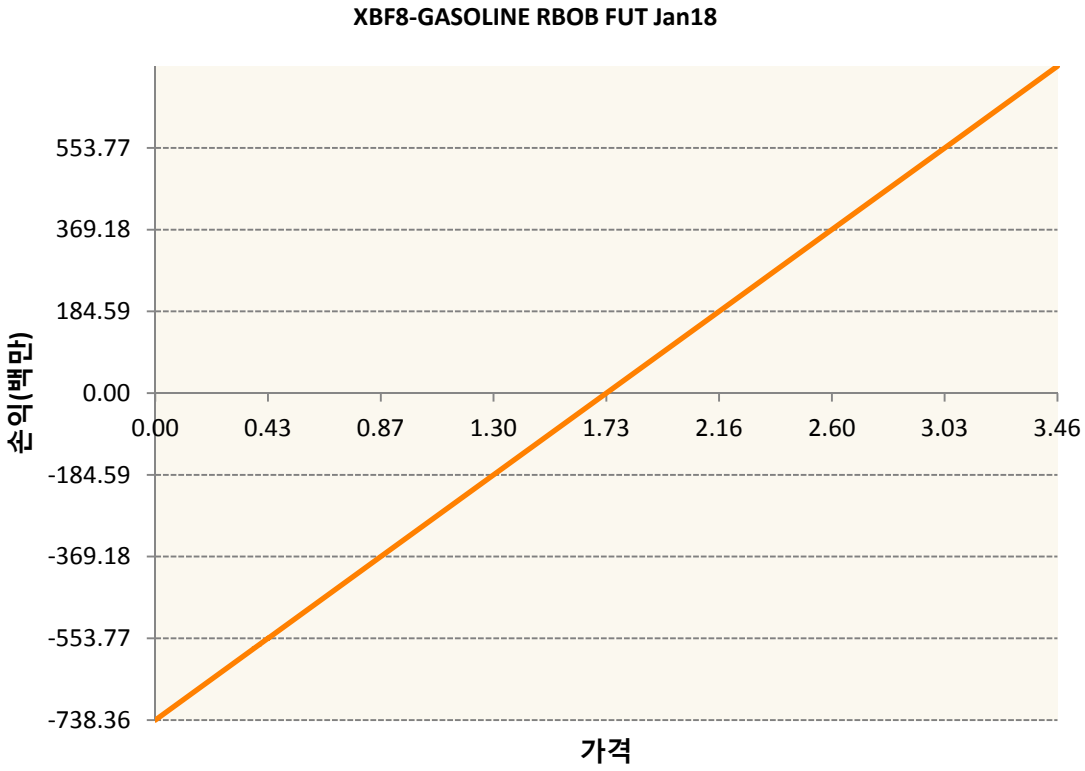

-720.83
-1,081.25
-1,441.66
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
720.71
540.54
360.36
180.18
0.00
-180.18
-360.36
-540.54
-720.71
0.00
0.48
0.95
1.43
1.90
2.38
2.85
3.33
3.80
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
869.04
651.78
434.52
217.26
0.00
-217.26
-434.52
-651.78
0.00
271.58
543.15
814.73
1,086.30
1,357.88
1,629.45
1,901.03
2,172.60
손익(백만)


-869.04
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,271.04
953.28
635.52
317.76
0.00
-317.76
-635.52
-953.28
-1,271.04
0.00
0.76
1.52
2.27
3.03
3.79
4.55
5.30
6.06
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
553.77
369.18
184.59
0.00
-184.59
-369.18
-553.77
-738.36
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	102
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	59

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

707

공시일	2017-12-04
기준일	2017-12-01

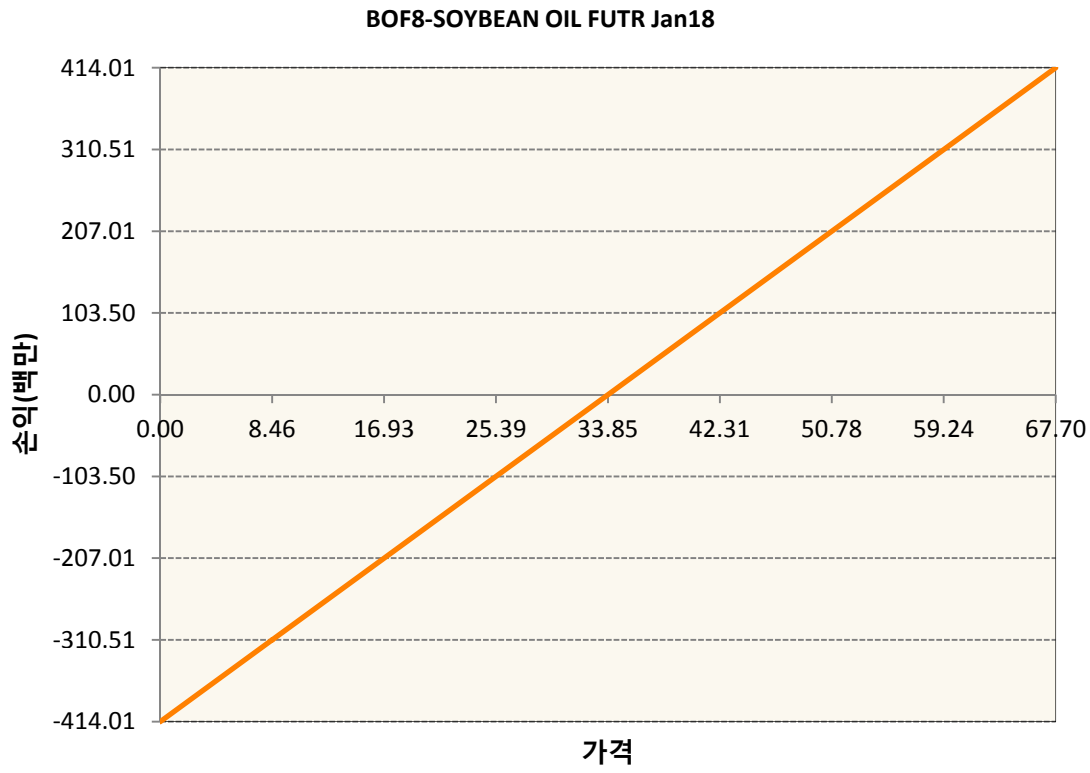
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

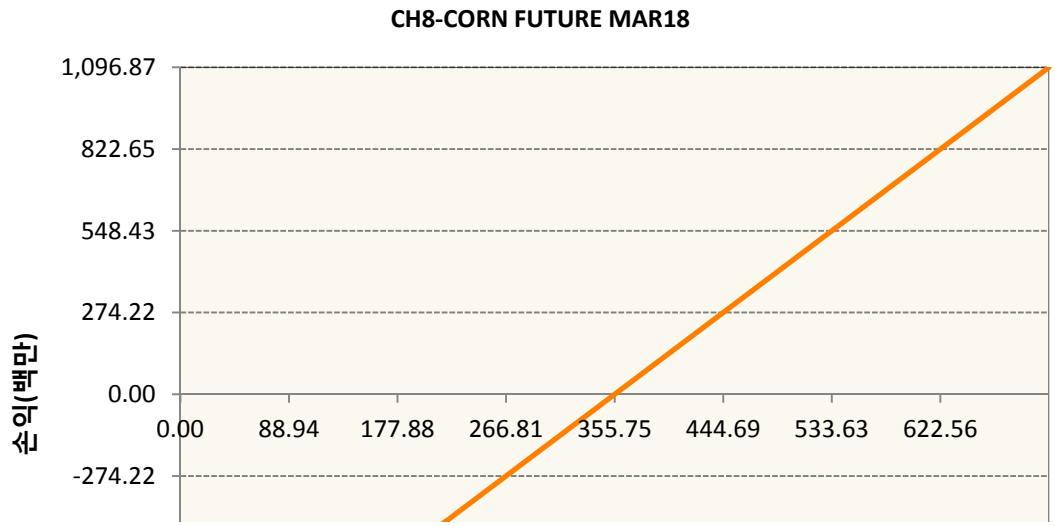
1. 계약금액

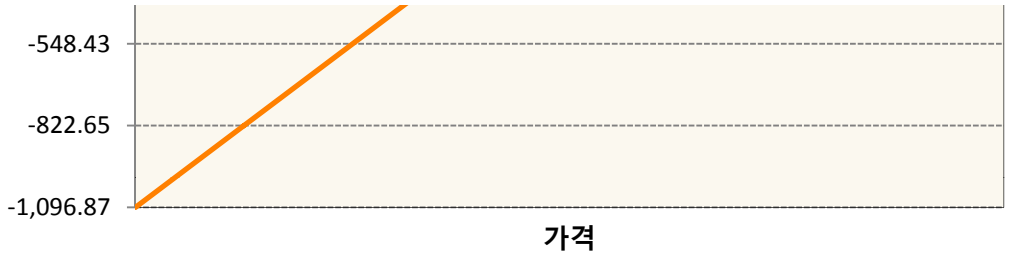
(단위:백만원)

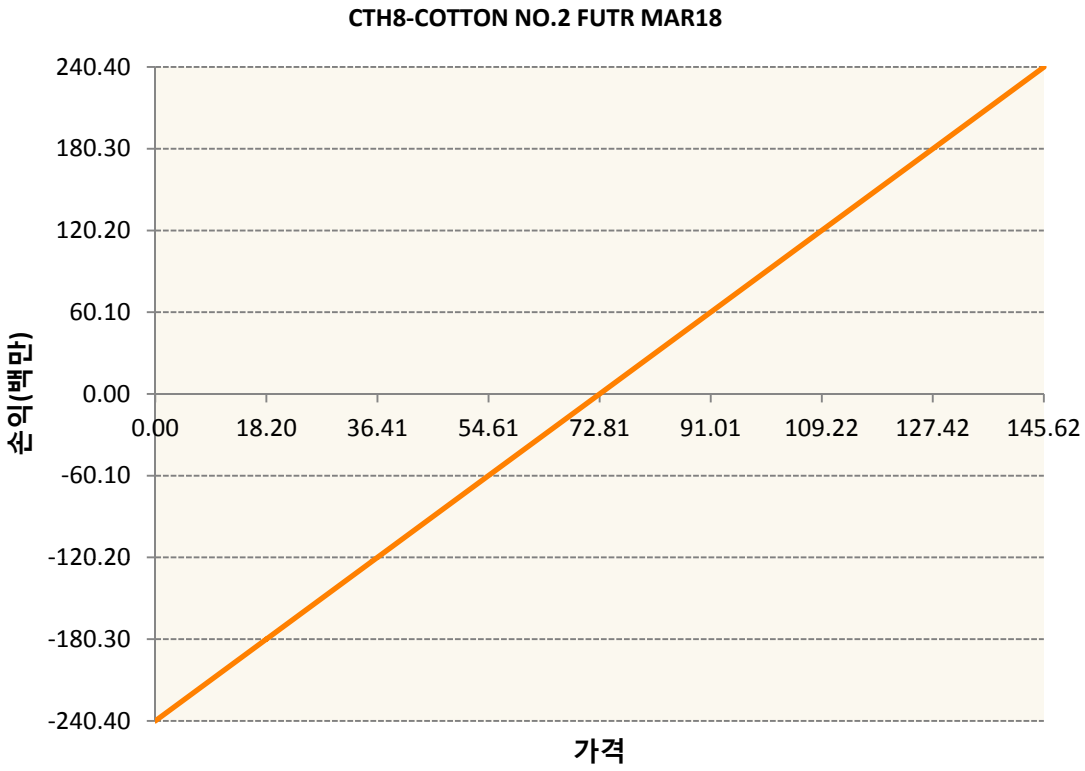
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,539	326	4,213	

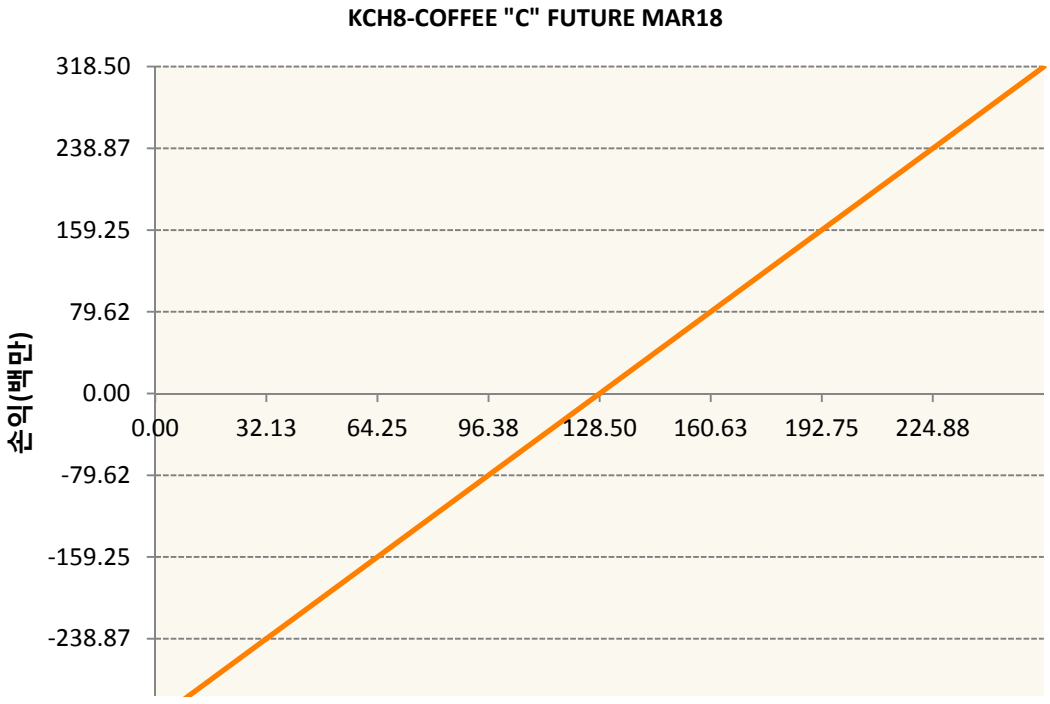
2. 만기시점의 손익구조

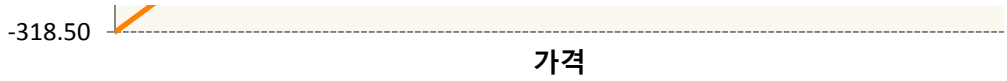


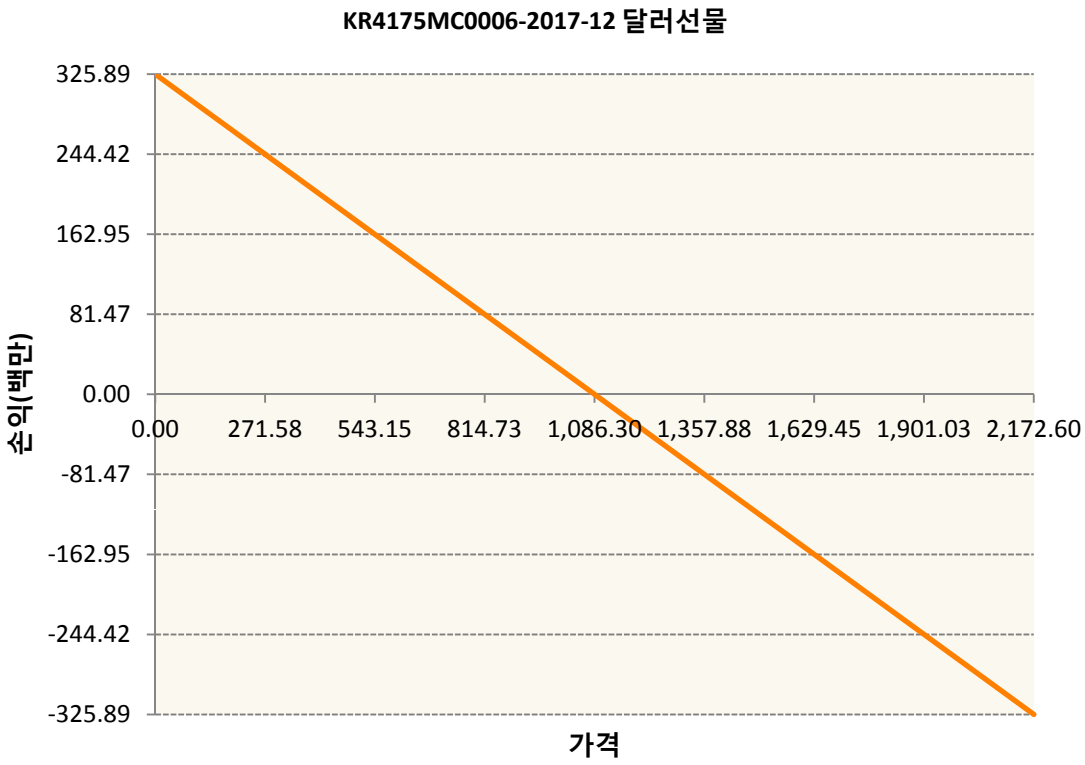


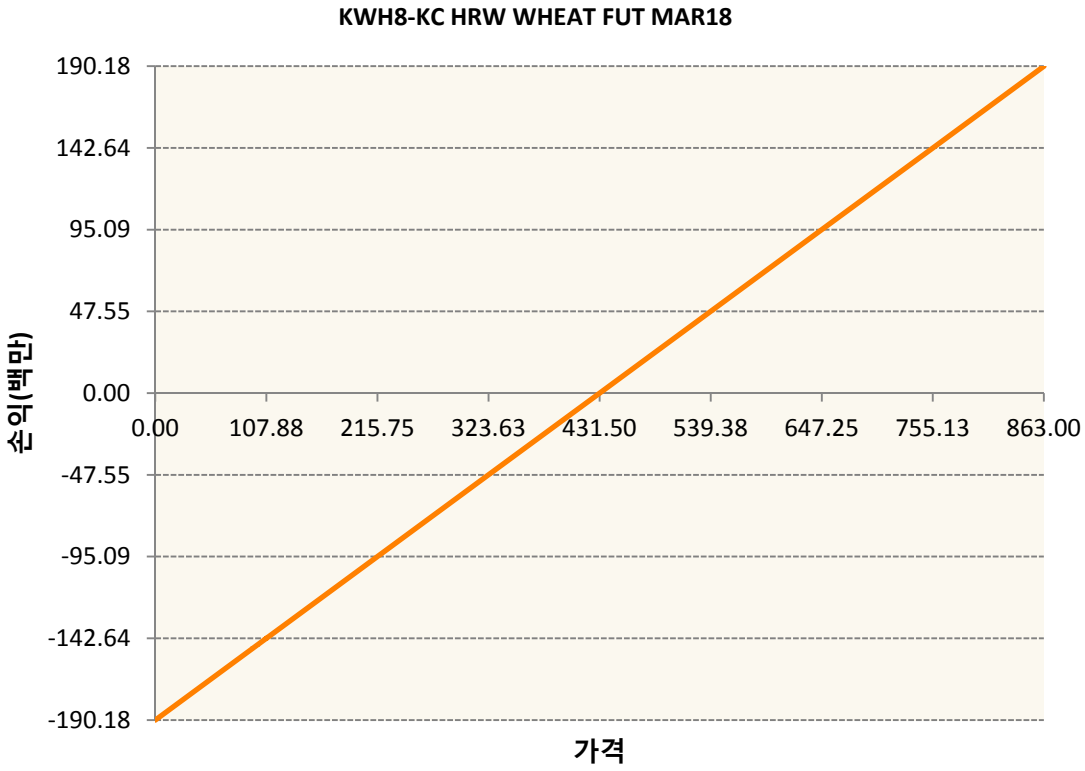

-548.43
-822.65
-1,096.87
가격

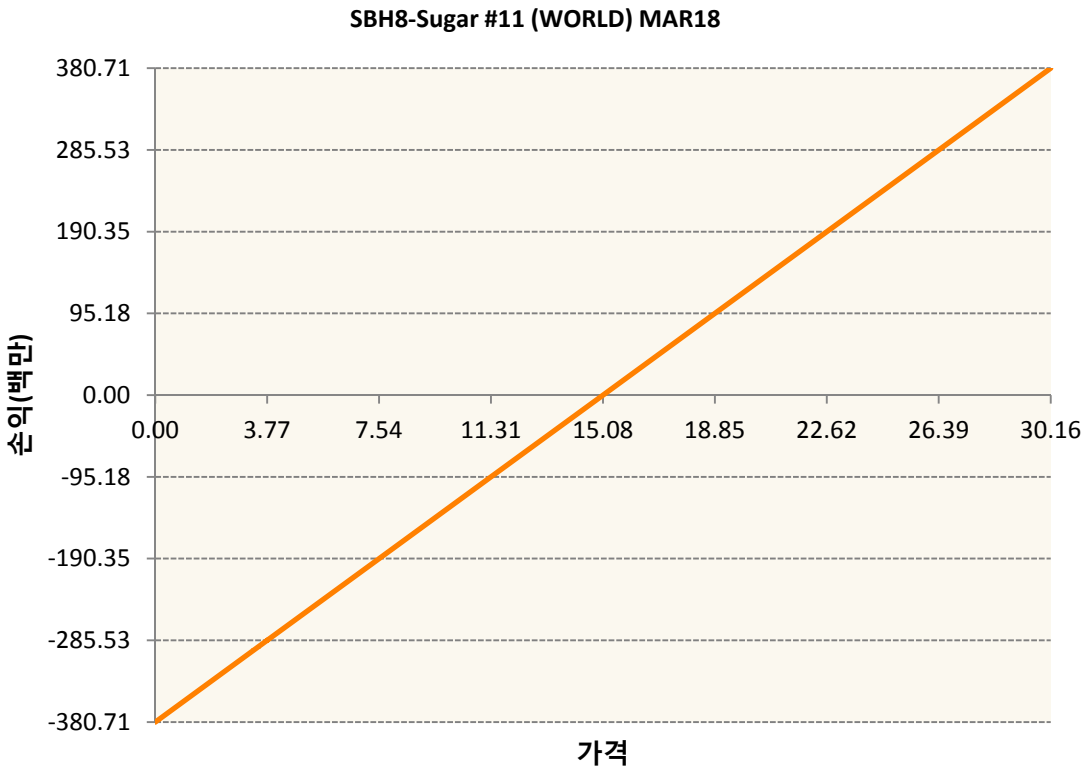

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
240.40
180.30
120.20
60.10
0.00
-60.10
-120.20
-180.30
-240.40
0.00
18.20
36.41
54.61
72.81
91.01
109.22
127.42
145.62
손익(백만)
가격

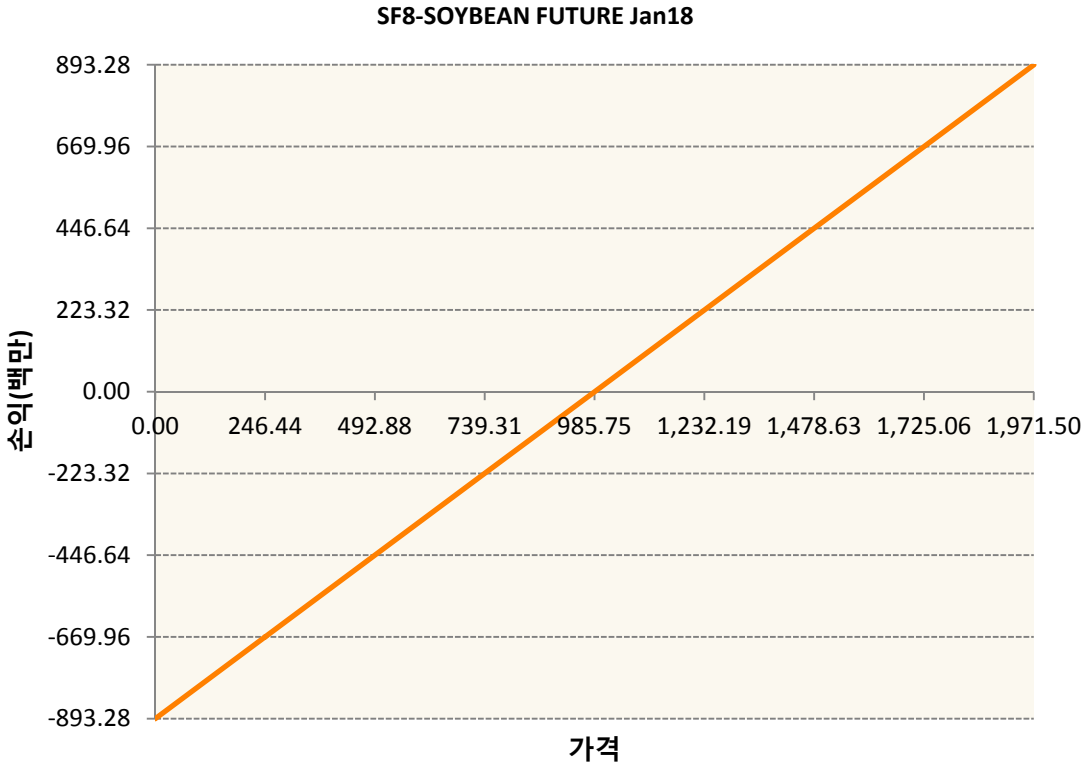

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
318.50
238.87
159.25
79.62
0.00
-79.62
-159.25
-238.87
0.00
32.13
64.25
96.38
128.50
160.63
192.75
224.88
손익(백만)


-318.50
가격

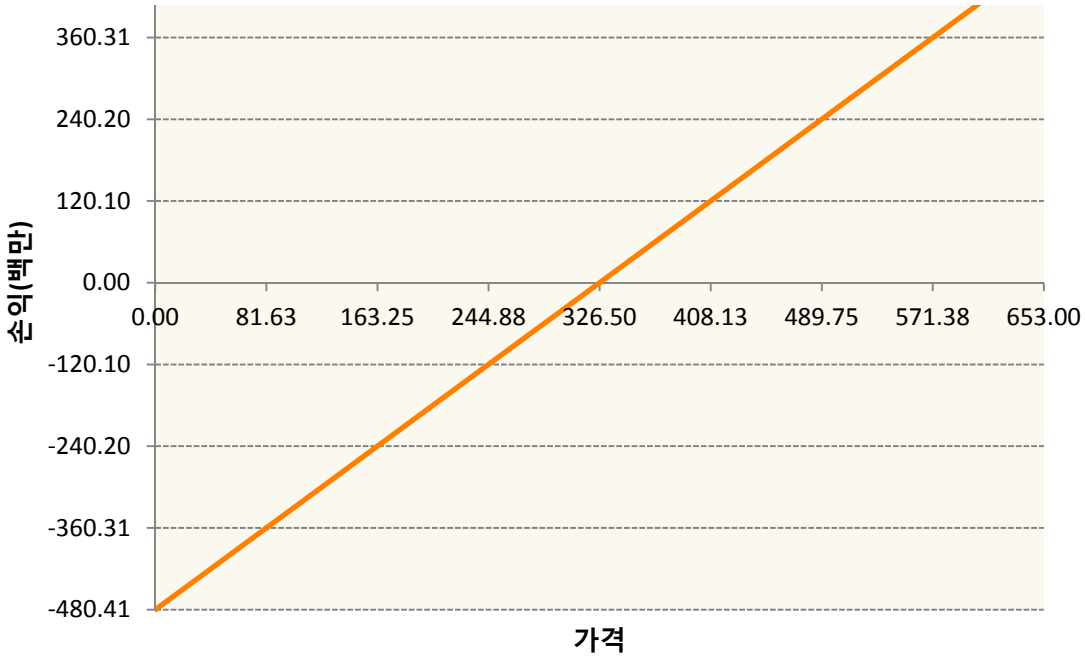

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
325.89
244.42
162.95
81.47
0.00
-81.47
-162.95
-244.42
-325.89
0.00
271.58
543.15
814.73
1,086.30
1,357.88
1,629.45
1,901.03
2,172.60
손익(백만)
가격

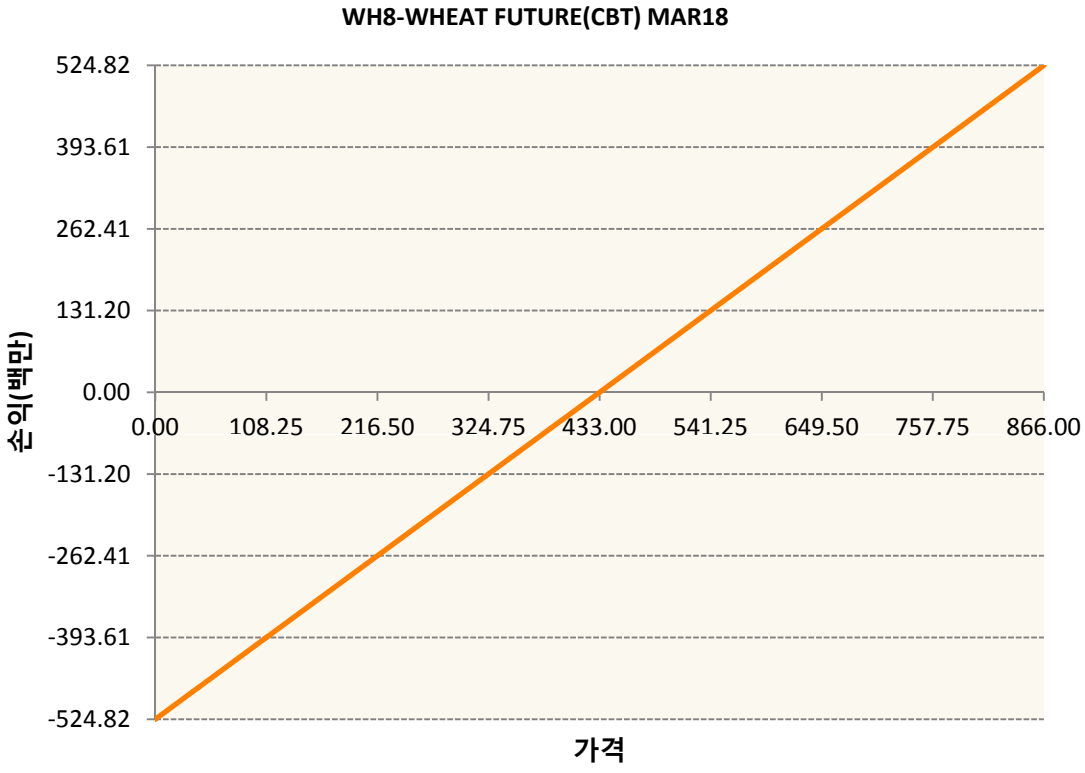

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
190.18
142.64
95.09
47.55
0.00
-47.55
-95.09
-142.64
-190.18
0.00
107.88
215.75
323.63
431.50
539.38
647.25
755.13
863.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
380.71
285.53
190.35
95.18
0.00
-95.18
-190.35
-285.53
-380.71
0.00
3.77
7.54
11.31
15.08
18.85
22.62
26.39
30.16
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
893.28
669.96
446.64
223.32
0.00
-223.32
-446.64
-669.96
-893.28
0.00
246.44
492.88
739.31
985.75
1,232.19
1,478.63
1,725.06
1,971.50
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
480.41





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	30
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	71
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	38
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	42

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

397