공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

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	2017-12-05
기준일	2017-12-04

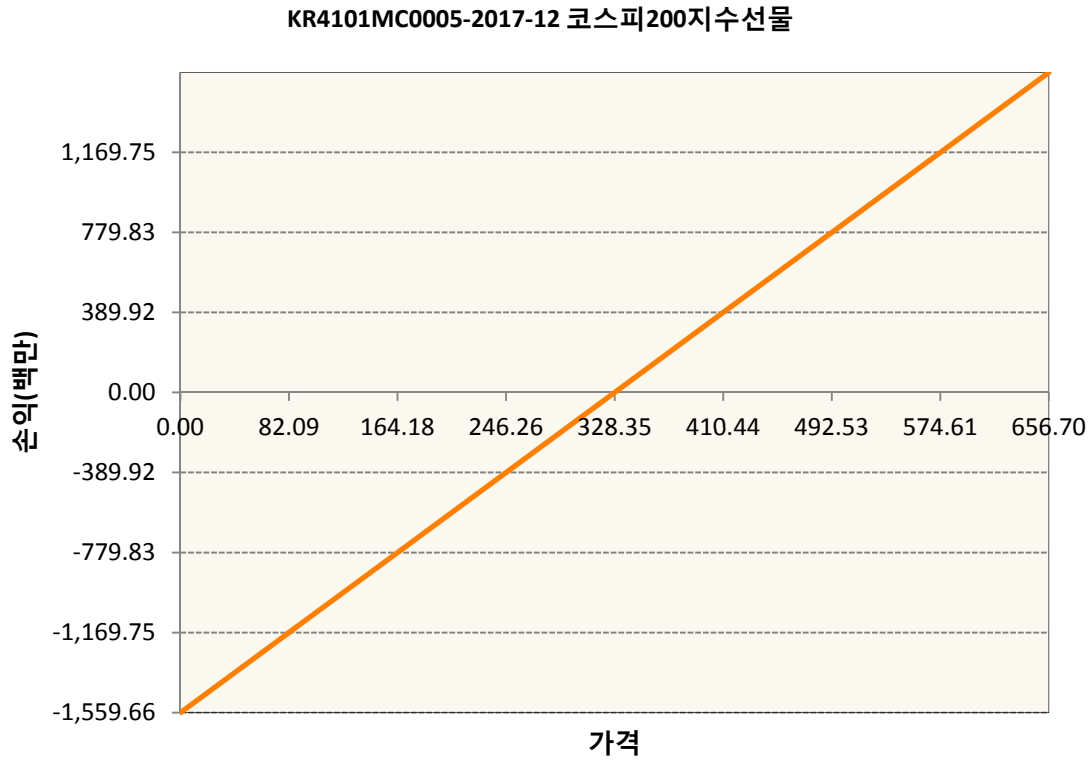
스마트인덱스모

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	1,560	0	1,560	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	125	125	125	125	125	125	125

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

73

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

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	1,081

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

346

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

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)

369

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

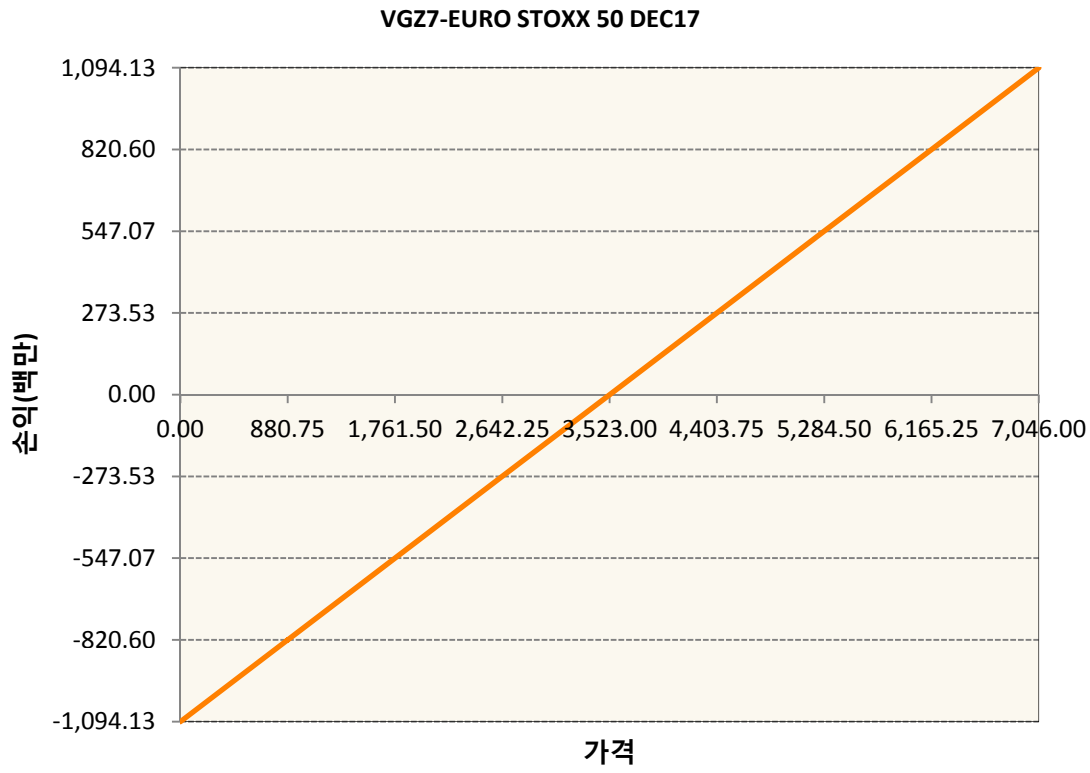
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,094	0	1,094	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ7	EURO STOXX 50 DEC17	88

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

(단위:백만원)

50

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

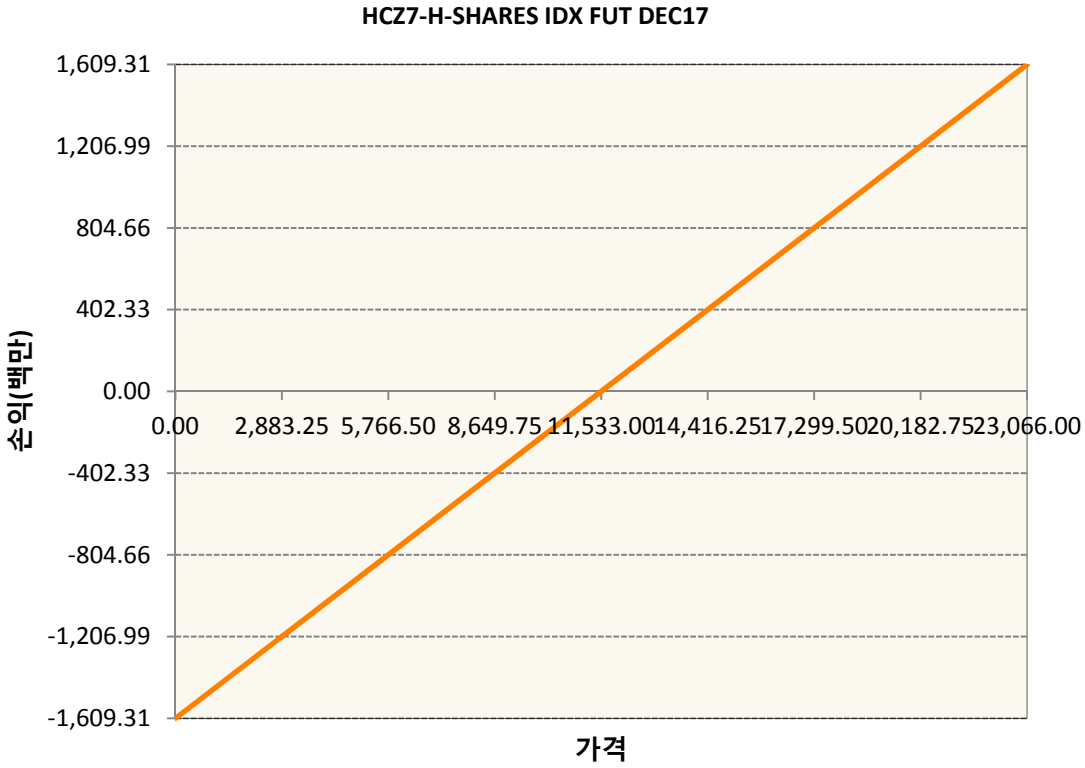
차이나인덱스모(주식-파생형)

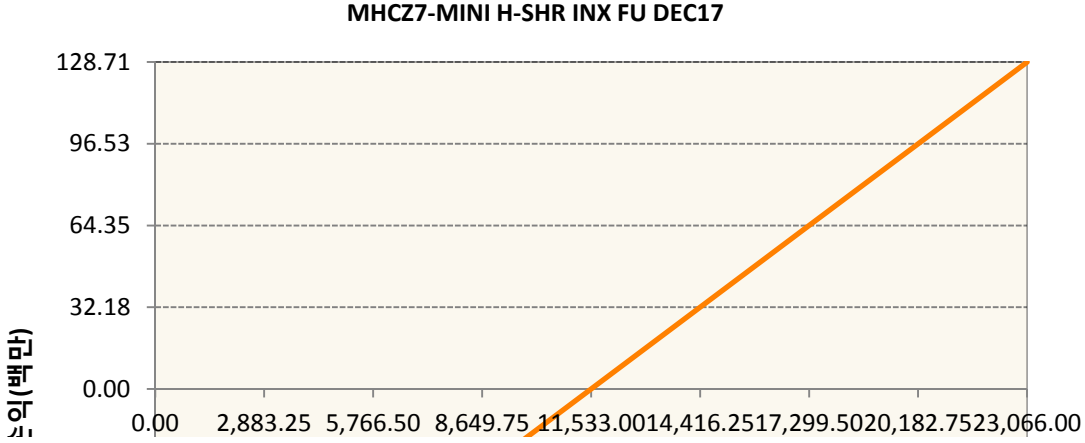
1. 계약금액

(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	1,609	0	1,609	
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)
	90

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

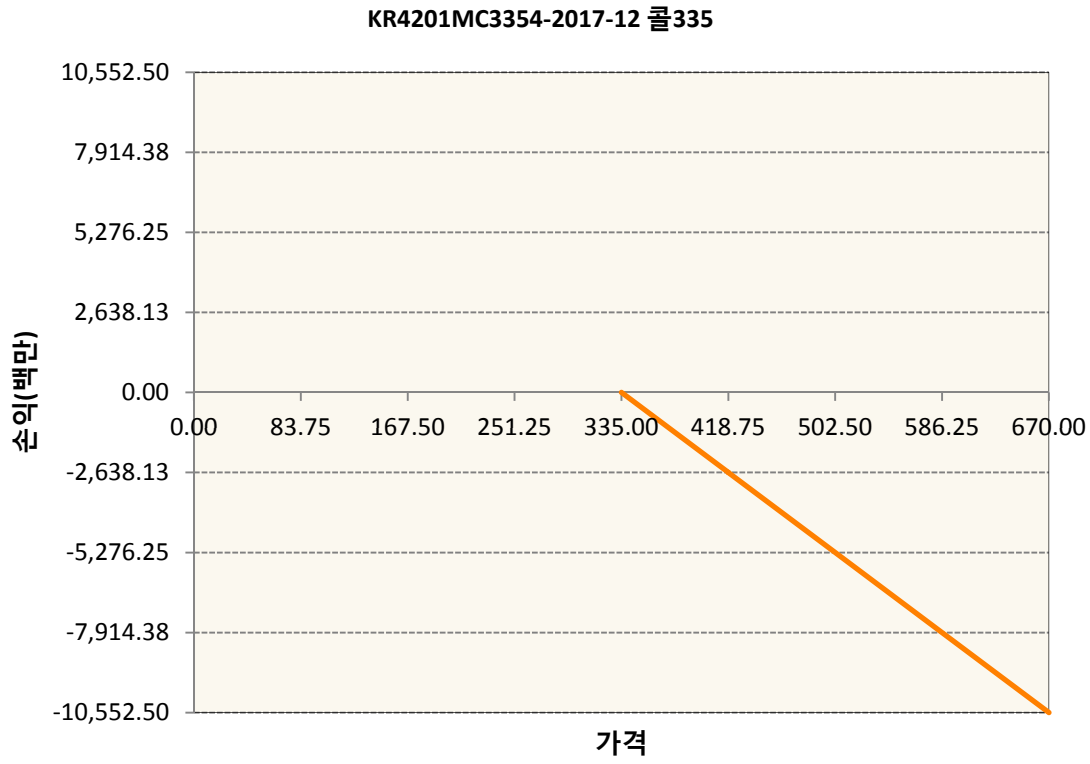
커버드콜모(주식혼합-파생형)

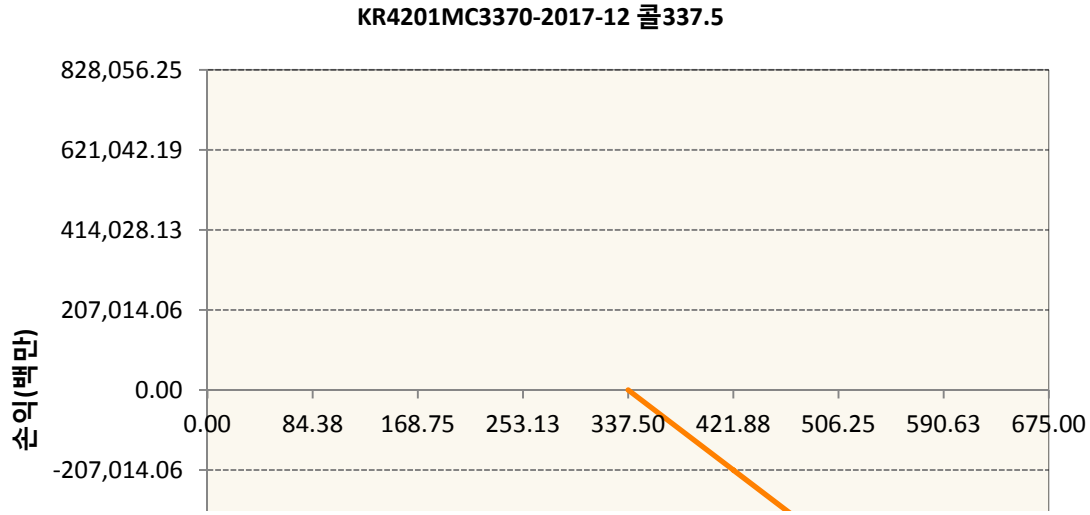
1. 계약금액

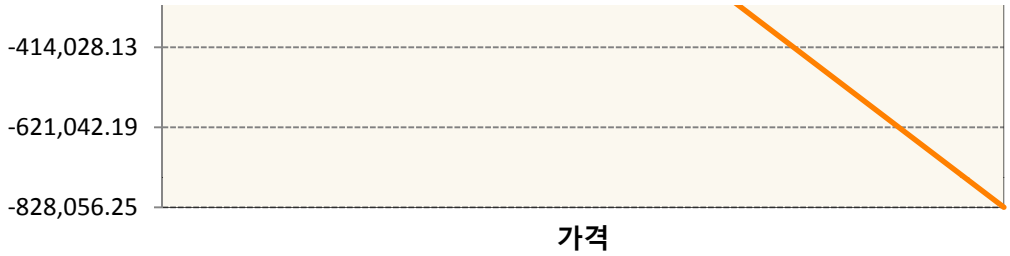
(단위:백만원)

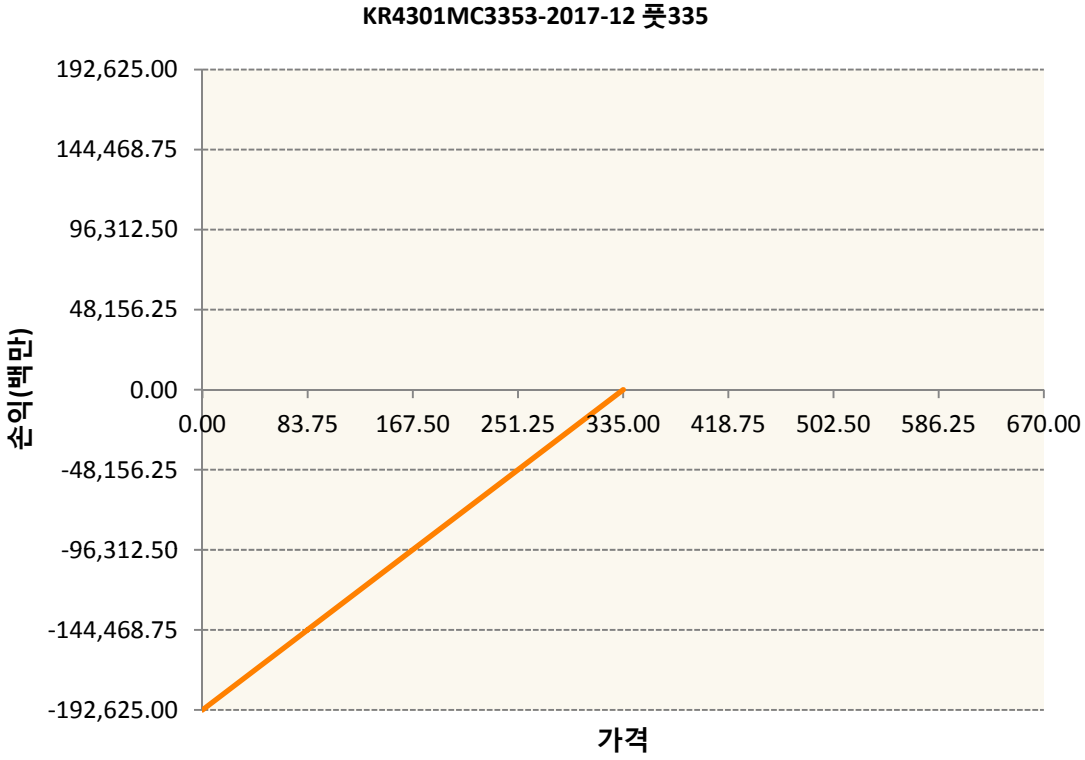
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

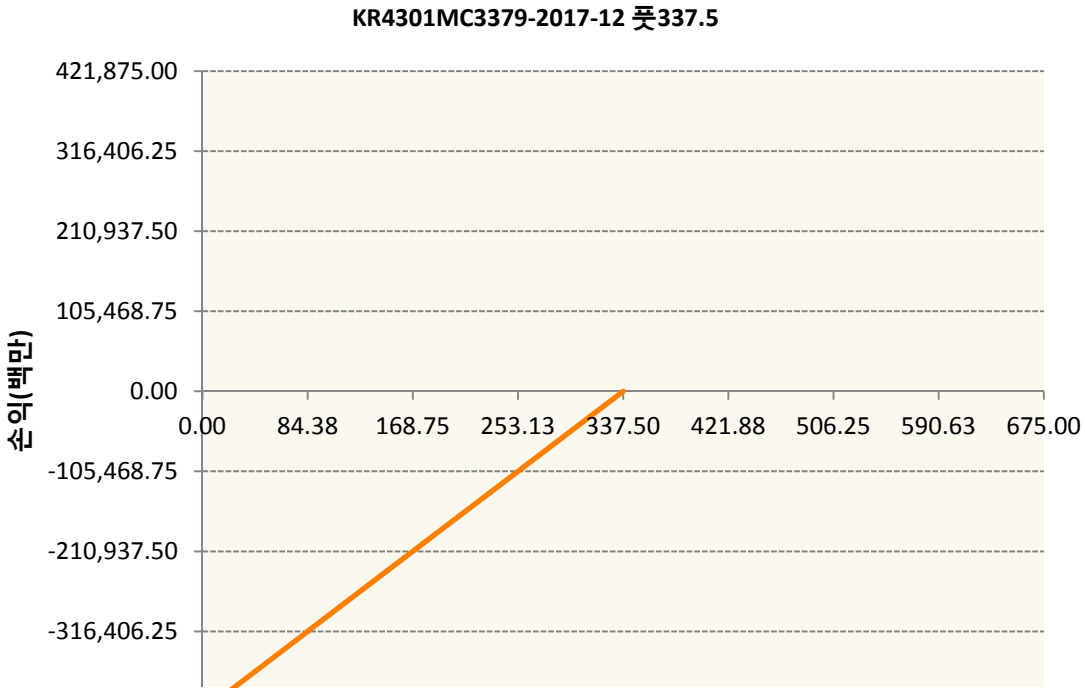
2. 만기시점의 손익구조






-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							577
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	94	93	93	92	91	89
-5.33%	93	91	90	87	84	79	75
-2.67%	83	78	71	64	56	47	37
0%	38	26	13	0	-13	-27	-40
2.67%	-83	-97	-112	-126	-141	-155	-170
5.33%	-288	-297	-307	-318	-329	-340	-352
8.00%	-544	-547	-551	-556	-562	-569	-577
KR4201MC3 2017-12 콜337.5							41,541
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,526	5,521	5,508	5,482	5,436	5,364	5,260
-5.33%	5,489	5,433	5,337	5,194	4,998	4,747	4,442
-2.67%	5,061	4,753	4,364	3,901	3,370	2,780	2,137
0%	2,625	1,795	917	0	-947	-1,919	-2,911
2.67%	-4,911	-6,060	-7,209	-8,359	-9,508	-10,657	-11,805
5.33%	-19,179	-20,036	-20,941	-21,885	-22,860	-23,860	-24,881
8.00%	-38,250	-38,611	-39,058	-39,583	-40,177	-40,833	-41,541
KR4301MC3 2017-12 풋335							14,661
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,661	-14,661	-14,661	-14,661	-14,661	-14,661	-14,661
-5.33%	-9,621	-9,621	-9,622	-9,622	-9,623	-9,624	-9,627
-2.67%	-4,585	-4,589	-4,597	-4,610	-4,628	-4,653	-4,683
0%	257	180	93	0	-99	-203	-311
2.67%	3,355	3,227	3,098	2,966	2,833	2,699	2,564
5.33%	3,990	3,967	3,936	3,896	3,847	3,790	3,725
8.00%	4,015	4,014	4,013	4,010	4,004	3,996	3,983
KR4301MC3 2017-12 풋337.5							32,345
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,345	-32,345	-32,345	-32,345	-32,345	-32,345	-32,345
-5.33%	-21,390	-21,390	-21,390	-21,391	-21,391	-21,393	-21,395
-2.67%	-10,437	-10,439	-10,446	-10,458	-10,478	-10,507	-10,547
0%	356	259	140	0	-157	-330	-516
2.67%	8,664	8,358	8,051	7,744	7,437	7,131	6,824

5.33%	11,205	11,104	10,979	10,834	10,671	10,492	10,299
8.00%	11,376	11,371	11,362	11,345	11,319	11,282	11,233

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

96,799

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

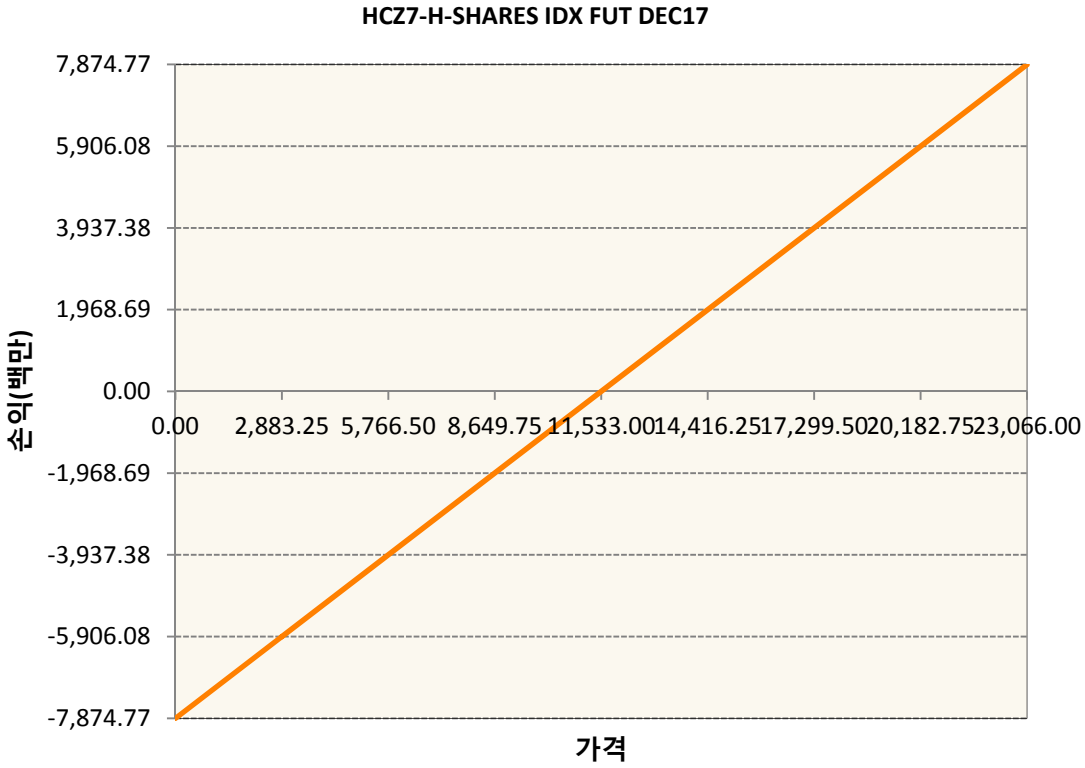
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

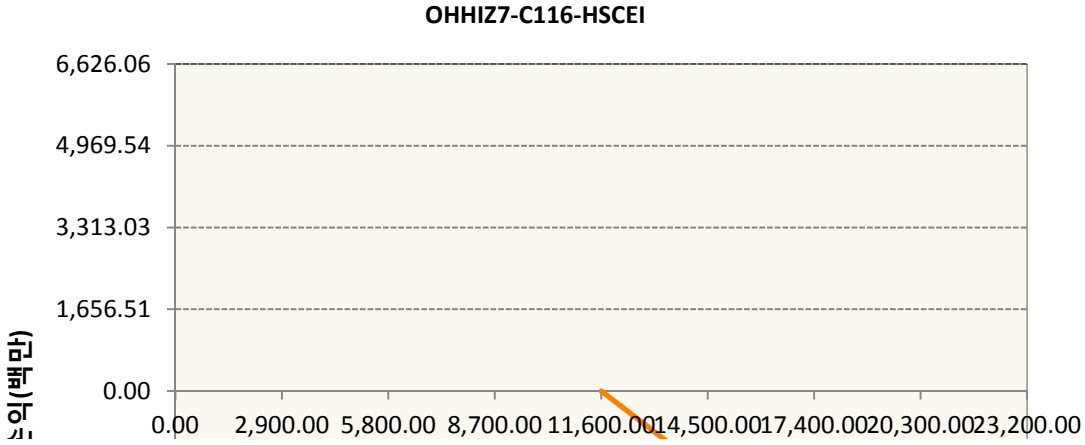
1. 계약금액

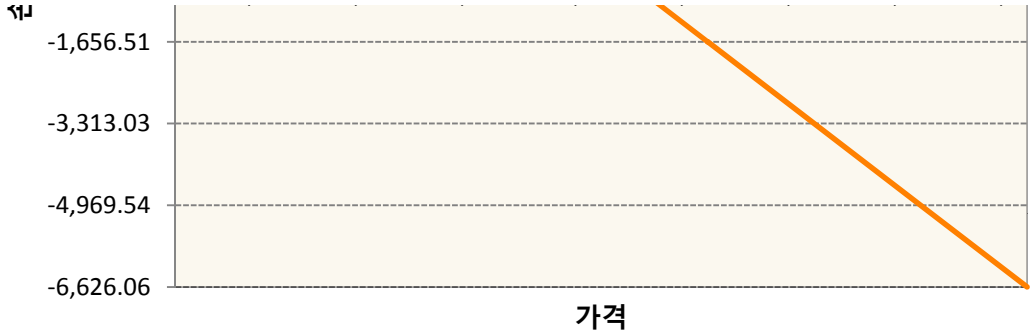
(단위:백만원)

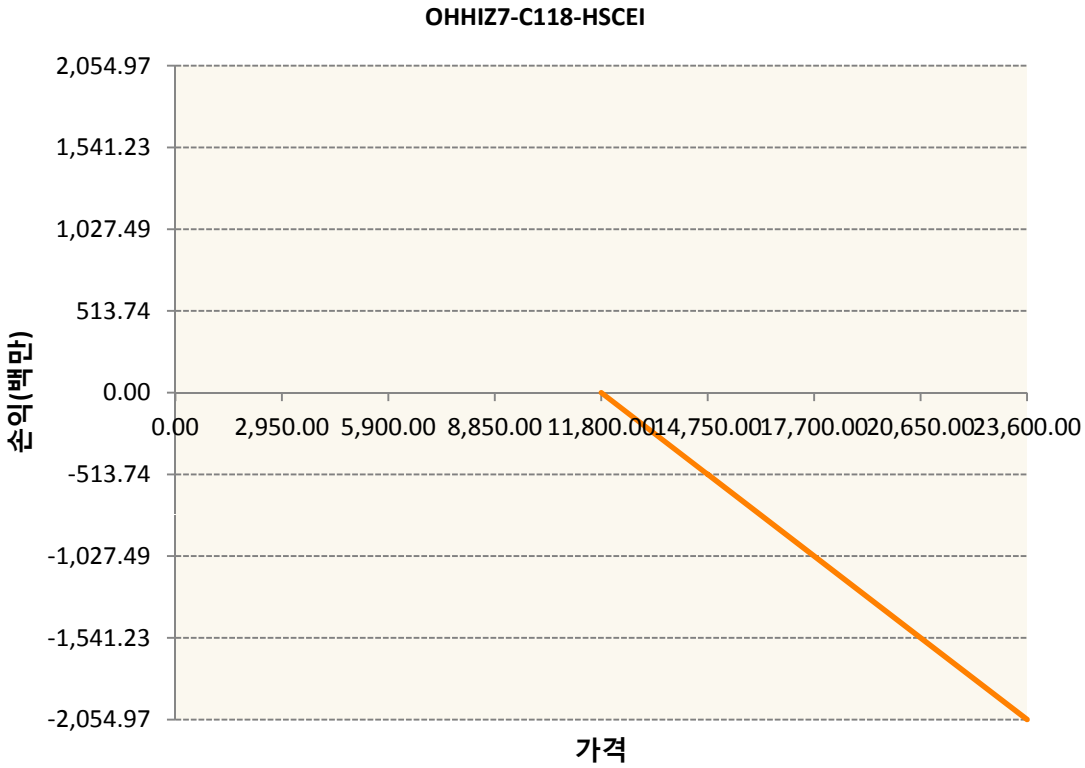
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,875	0	7,875	
누계	유가증권	옵션	0	17,362	-17,362	장내

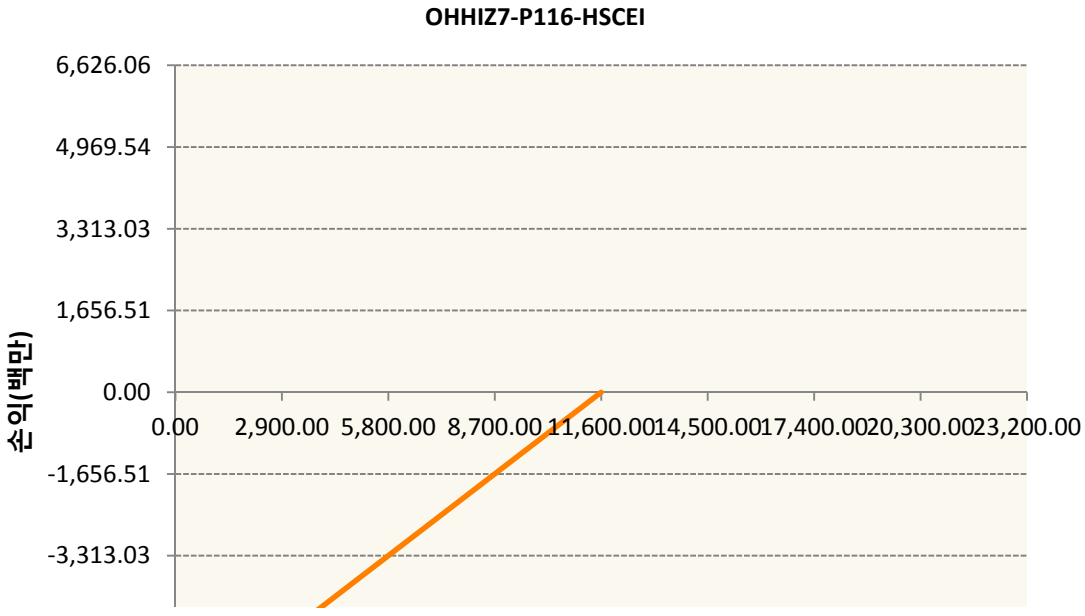
2. 만기시점의 손익구조

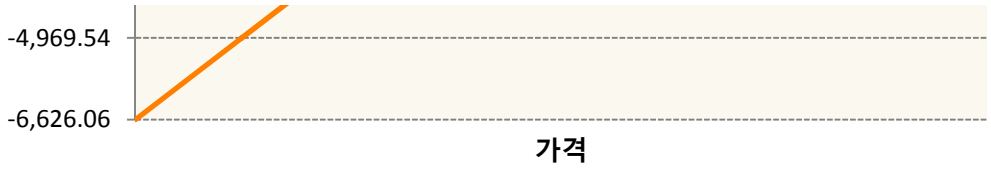


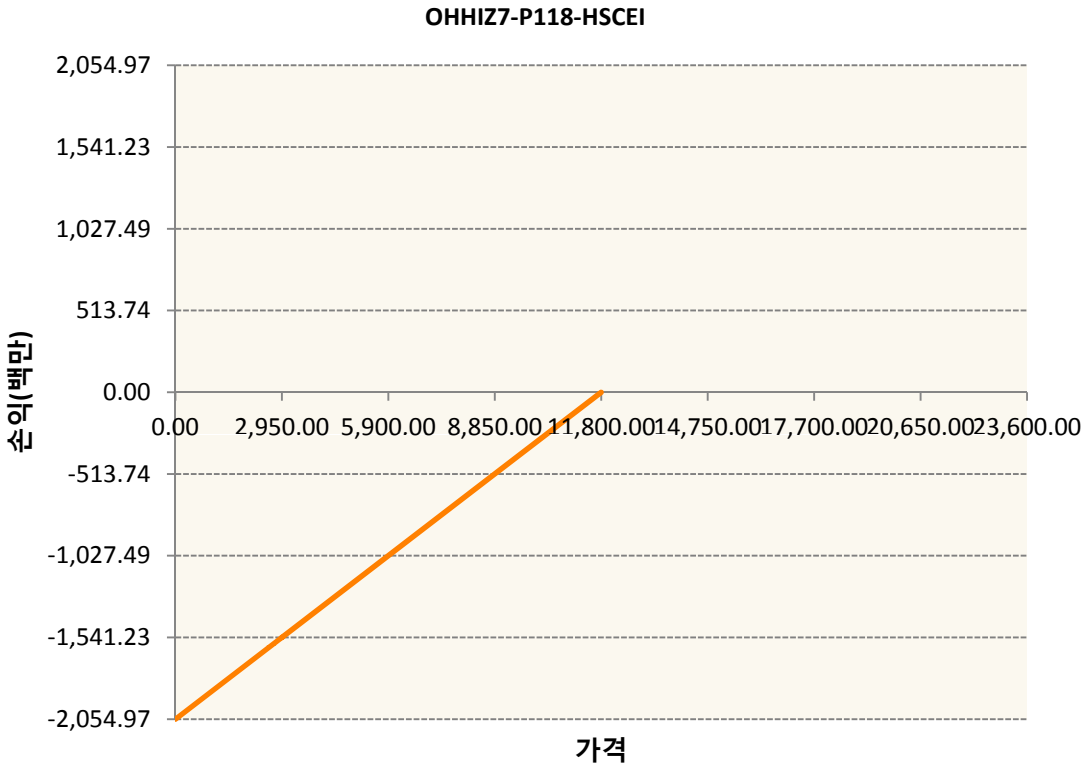



-1,656.51
-3,313.03
-4,969.54
-6,626.06
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,054.97
1,541.23
1,027.49
513.74
0.00
-513.74
-1,027.49
-1,541.23
-2,054.97
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
6,626.06
4,969.54
3,313.03
1,656.51
0.00
-1,656.51
-3,313.03
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	630
OHHIZ7-C11	HSCEI	530
OHHIZ7-C11	HSCEI	164
OHHIZ7-P11	HSCEI	530
OHHIZ7-P11	HSCEI	164

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,496

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

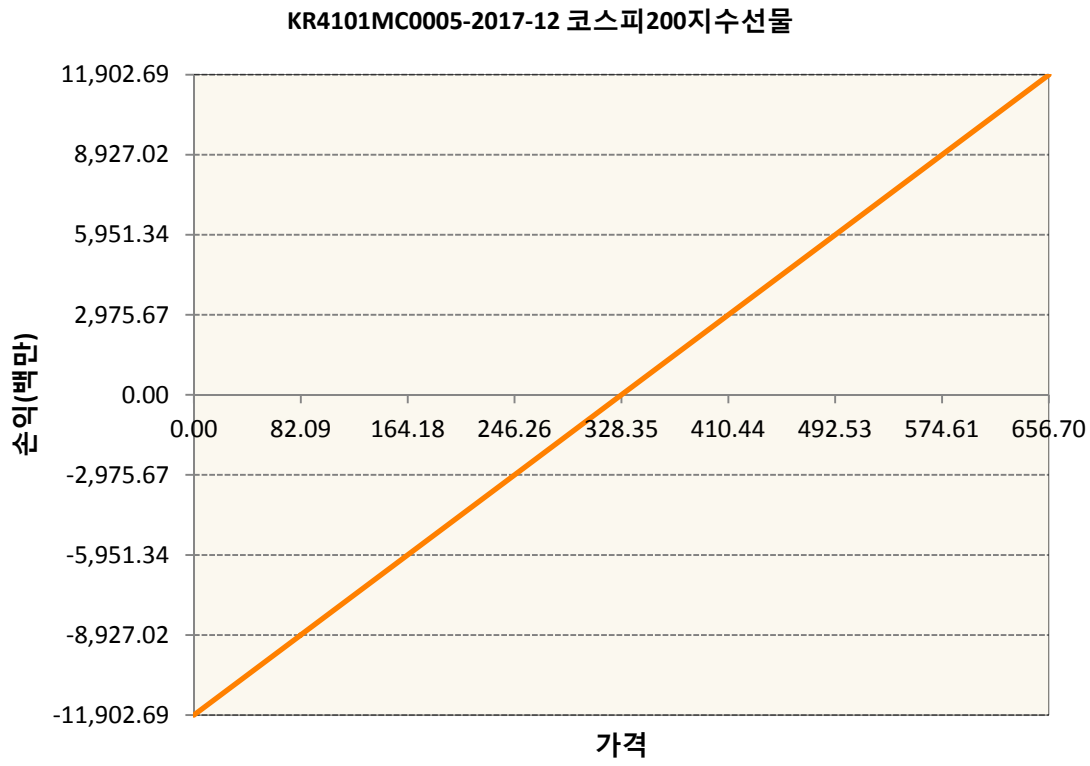
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

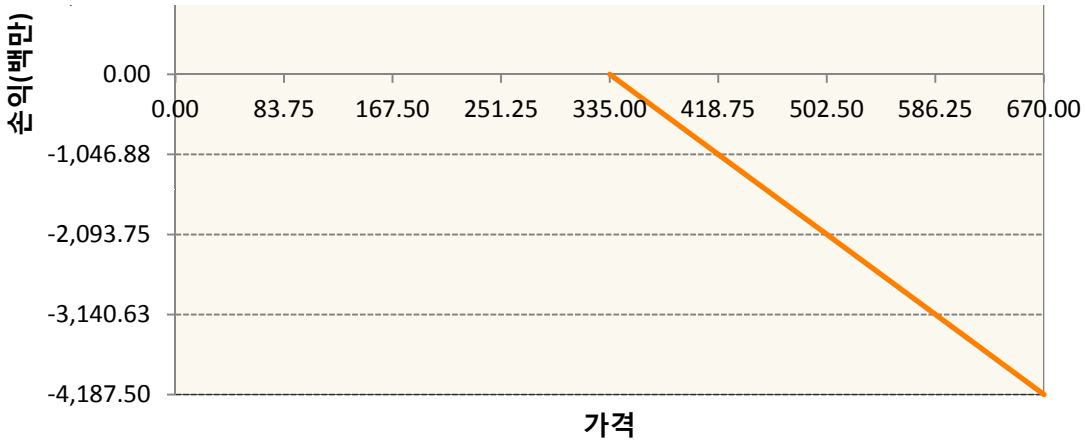
(단위:백만원)

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	11,903	0	11,903	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

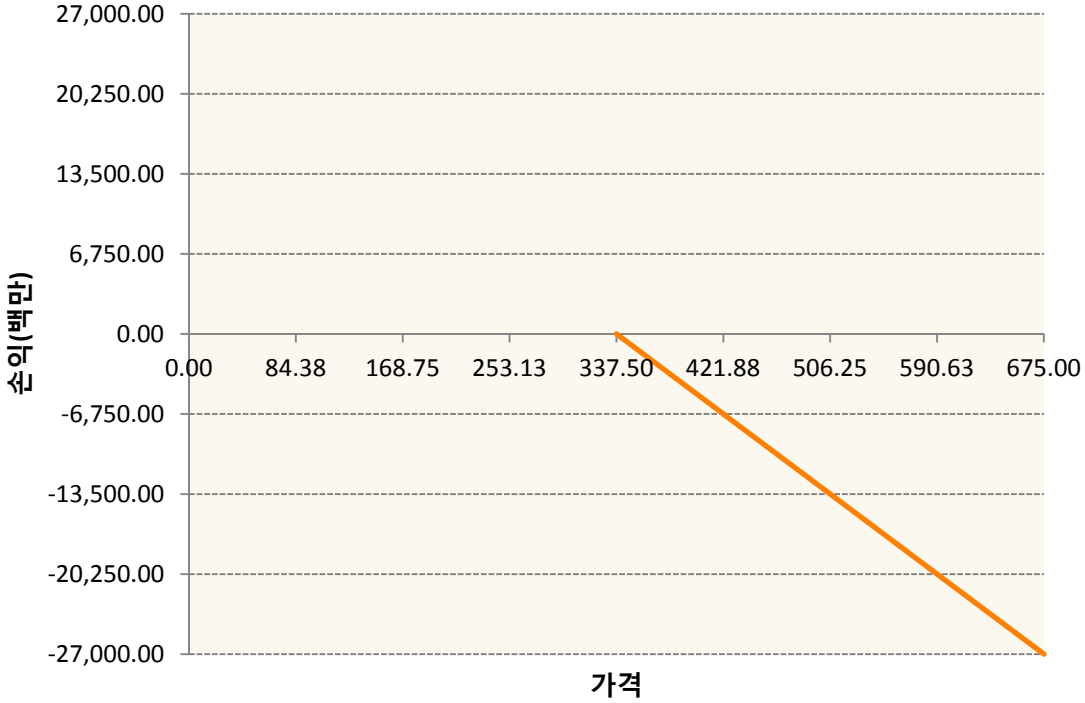
2. 만기시점의 손익구조



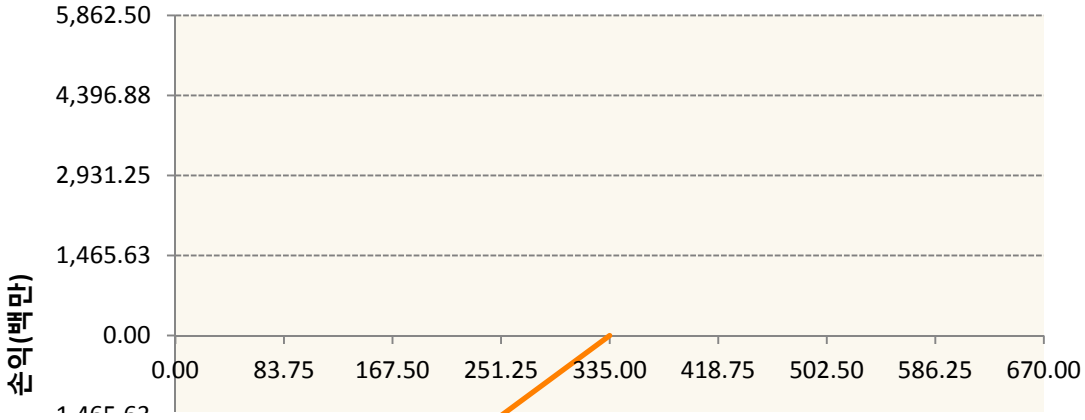




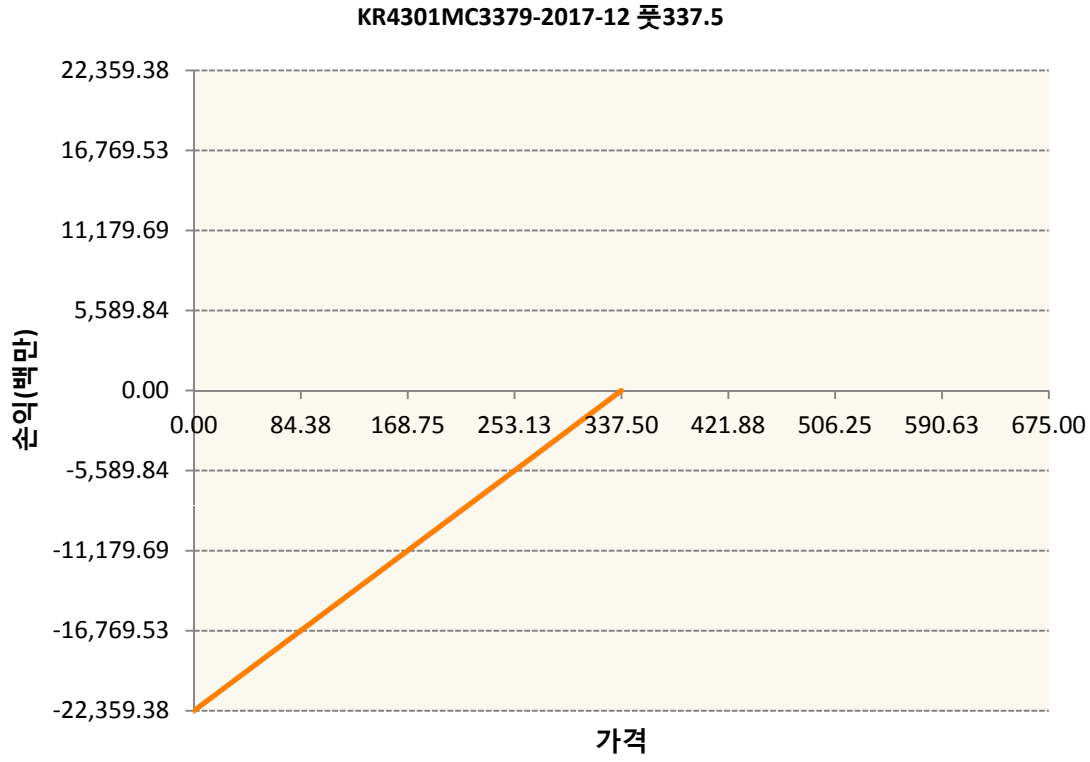
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,466
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466
-5.33%	-977	-977	-977	-977	-977	-977	-977
-2.67%	-489	-489	-489	-489	-489	-489	-489
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	489	489	489	489	489	489	489
5.33%	977	977	977	977	977	977	977
8.00%	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466
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						254
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	254	254	254	254	254	254	254
	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%	-423	-423	-423	-423	-423	-423	-423
-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%	423	423	423	423	423	423	423
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					953

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-953	-953	-953	-953	-953	-953	-953
-5.33%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636
-2.67%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	318	318	318	318	318	318	318
5.33%	636	636	636	636	636	636	636
8.00%	953	953	953	953	953	953	953
	KR4201MC3	2017-12 콜335					229

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	37	36	36	35
-5.33%	37	36	36	35	33	32	30
-2.67%	33	31	28	25	22	19	15
0%	15	10	5	0	-5	-11	-16
2.67%	-33	-39	-44	-50	-56	-62	-67
5.33%	-114	-118	-122	-126	-130	-135	-140
8.00%	-216	-217	-219	-221	-223	-226	-229
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,355

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	180	180	180	179	177	175	172
-5.33%	179	177	174	169	163	155	145
-2.67%	165	155	142	127	110	91	70
0%	86	59	30	0	-31	-63	-95
2.67%	-160	-198	-235	-273	-310	-347	-385
5.33%	-625	-653	-683	-714	-745	-778	-811
8.00%	-1,247	-1,259	-1,274	-1,291	-1,310	-1,331	-1,355
	KR4301MC3	2017-12 풋335					446

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-446	-446	-446	-446	-446	-446	-446
-5.33%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293

-2.67%	-140	-140	-140	-140	-141	-142	-143
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	102	98	94	90	86	82	78
5.33%	121	121	120	119	117	115	113
8.00%	122	122	122	122	122	122	121
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,714
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,714	-1,714	-1,714	-1,714	-1,714	-1,714	-1,714
-5.33%	-1,134	-1,134	-1,134	-1,134	-1,134	-1,134	-1,134
-2.67%	-553	-553	-554	-554	-555	-557	-559
0%	19	14	7	0	-8	-17	-27
2.67%	459	443	427	410	394	378	362
5.33%	594	588	582	574	566	556	546
8.00%	603	603	602	601	600	598	595

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

9,441

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

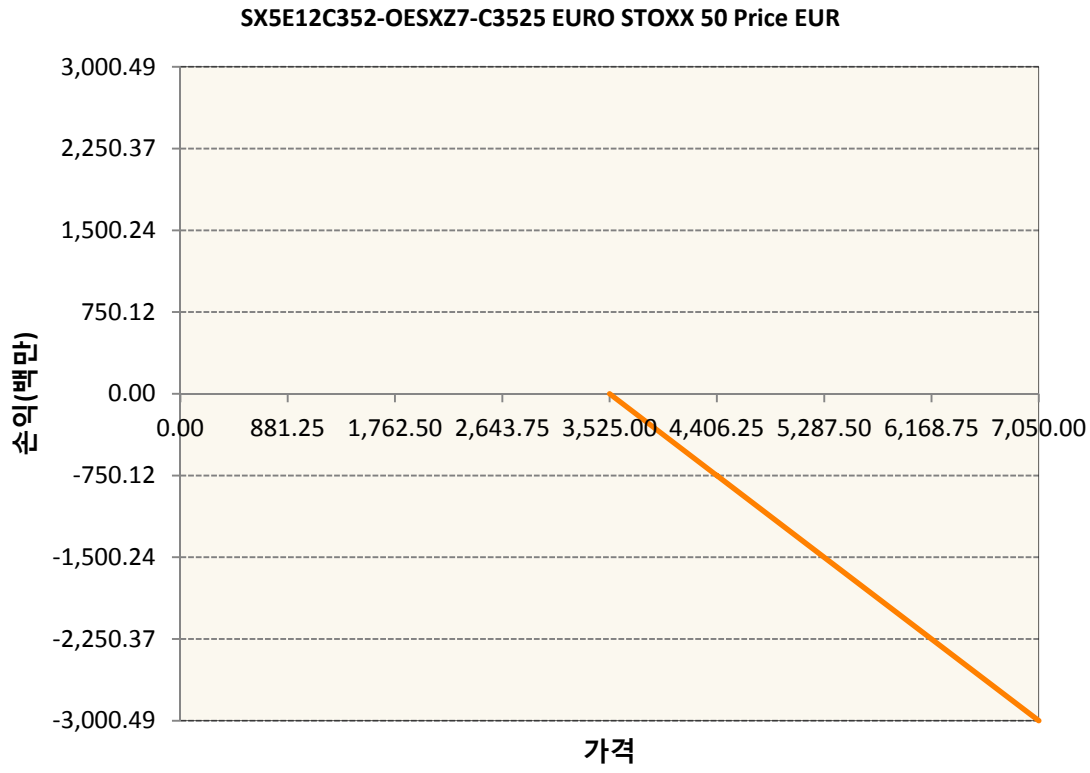
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

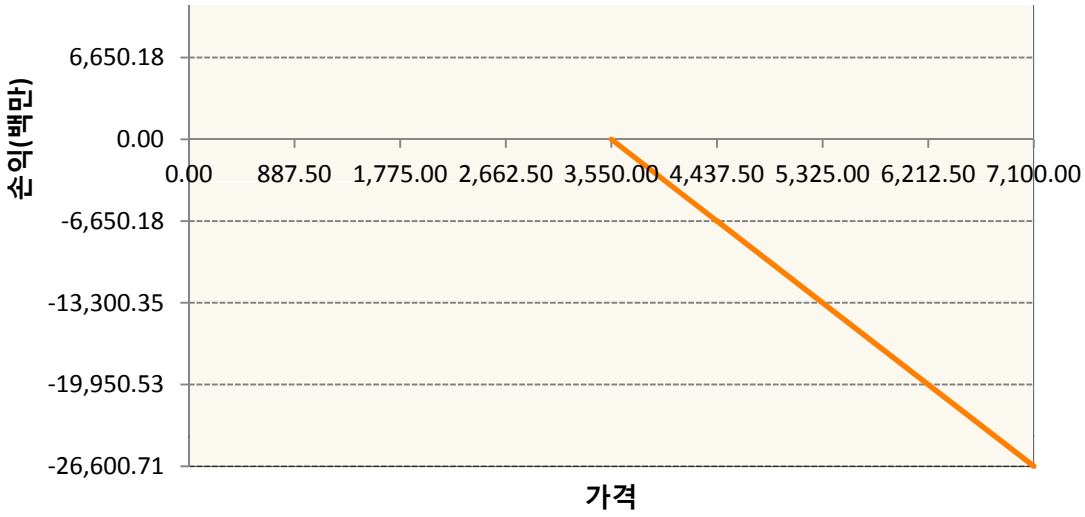
(단위:백만원)

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	21,410	0	21,410	
누계	유가증권	스왑	96,726	0	96,726	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,202	-59,202	장내
누계	지수	스왑	51,588	0	51,588	장외

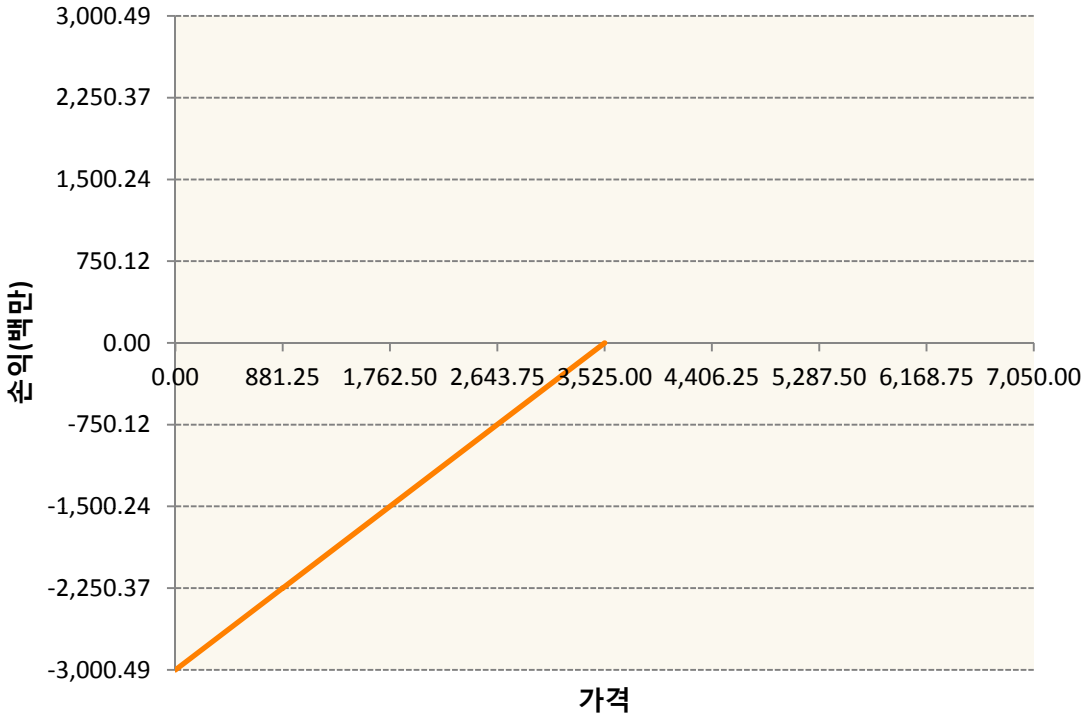
2. 만기시점의 손익구조



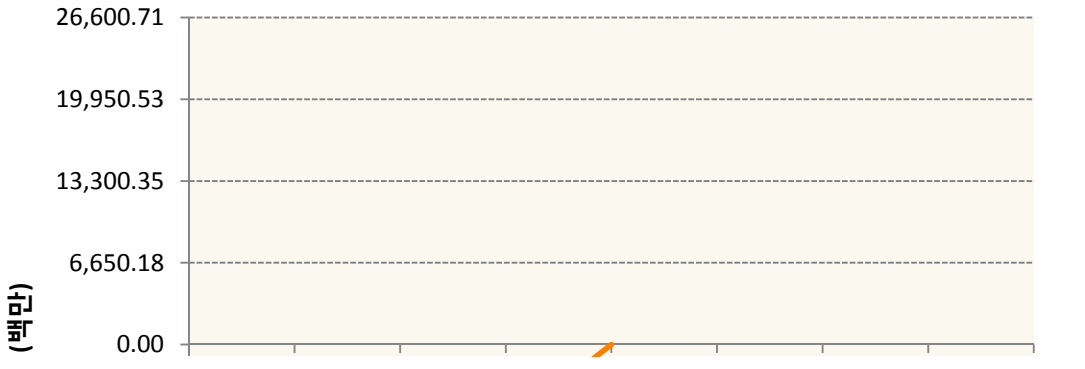


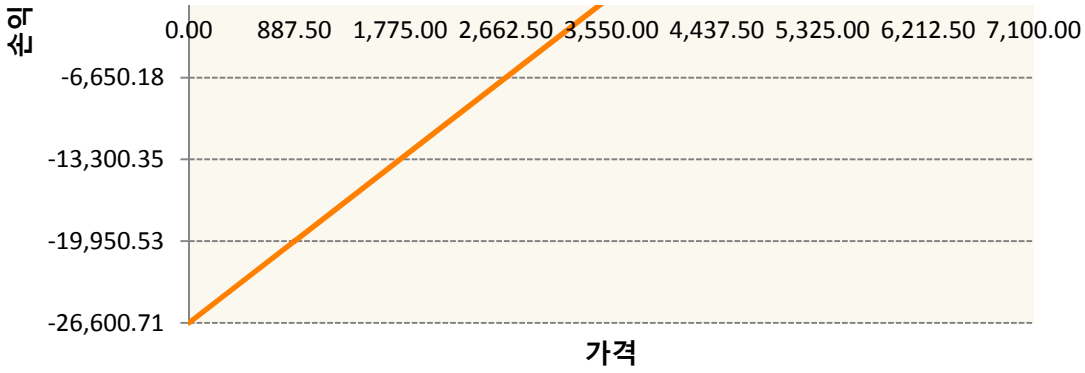


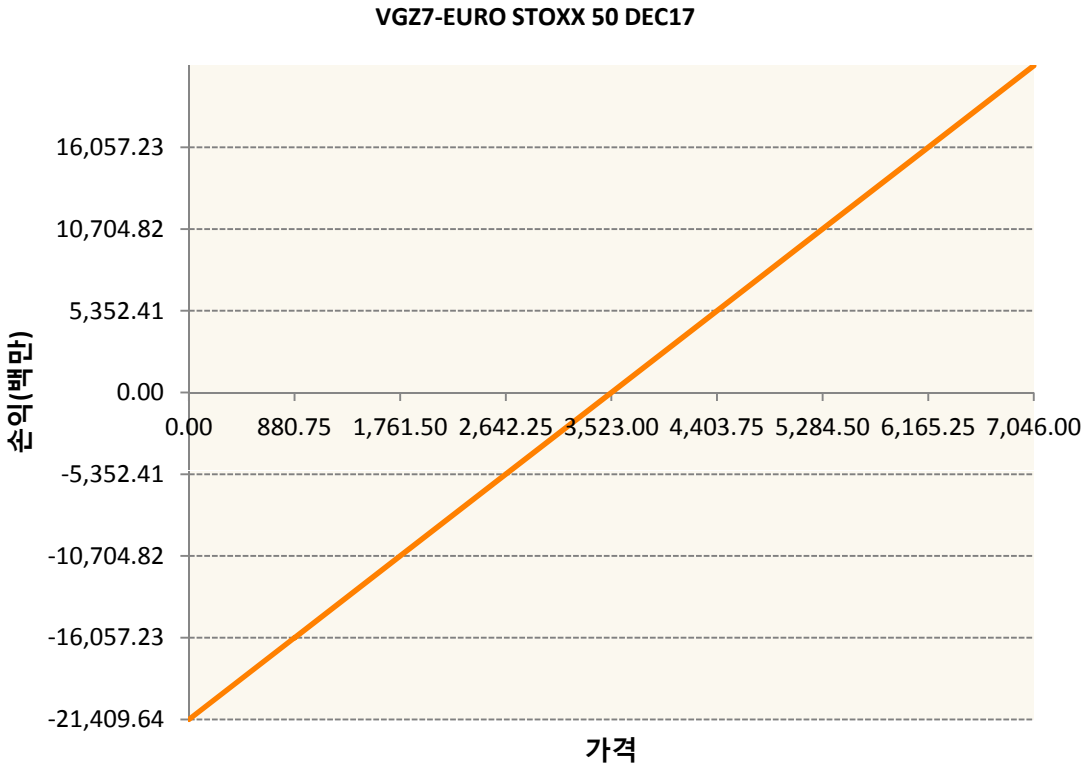
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	3
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	48
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	240
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,128
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	240
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,128
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,713

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

3,699

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

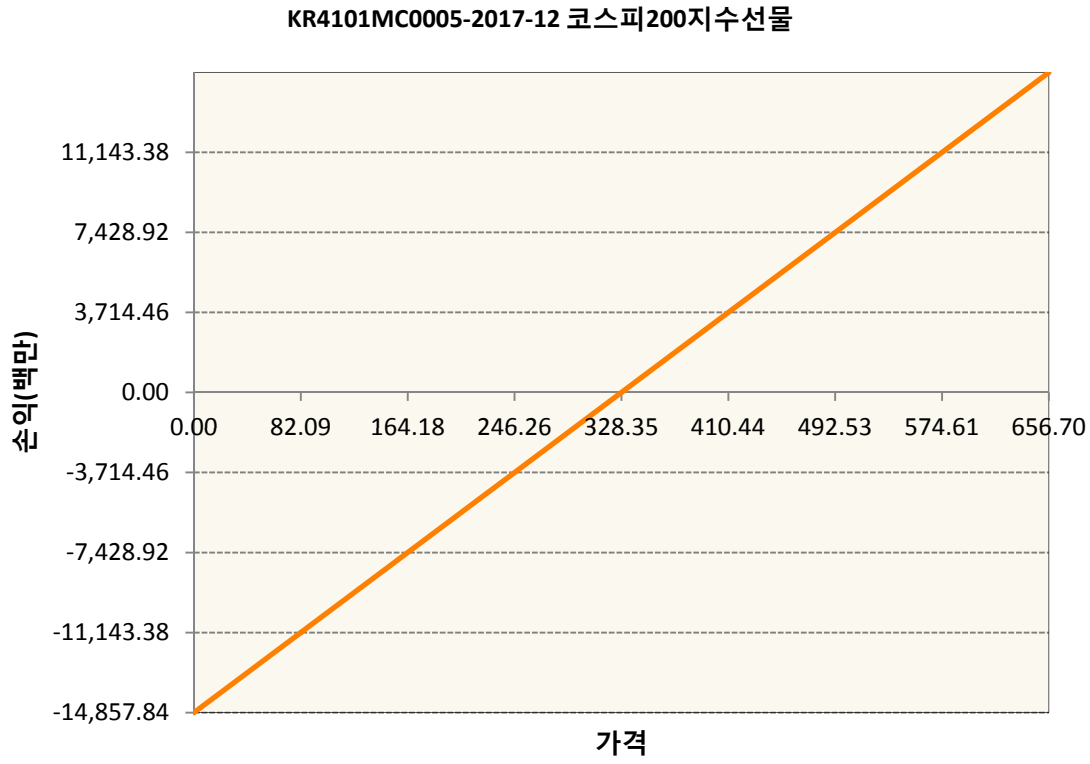
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,858	0	14,858	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190
-5.33%	-793	-793	-793	-793	-793	-793	-793
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	397	397	397	397	397	397	397
5.33%	793	793	793	793	793	793	793
8.00%	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190

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

697

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

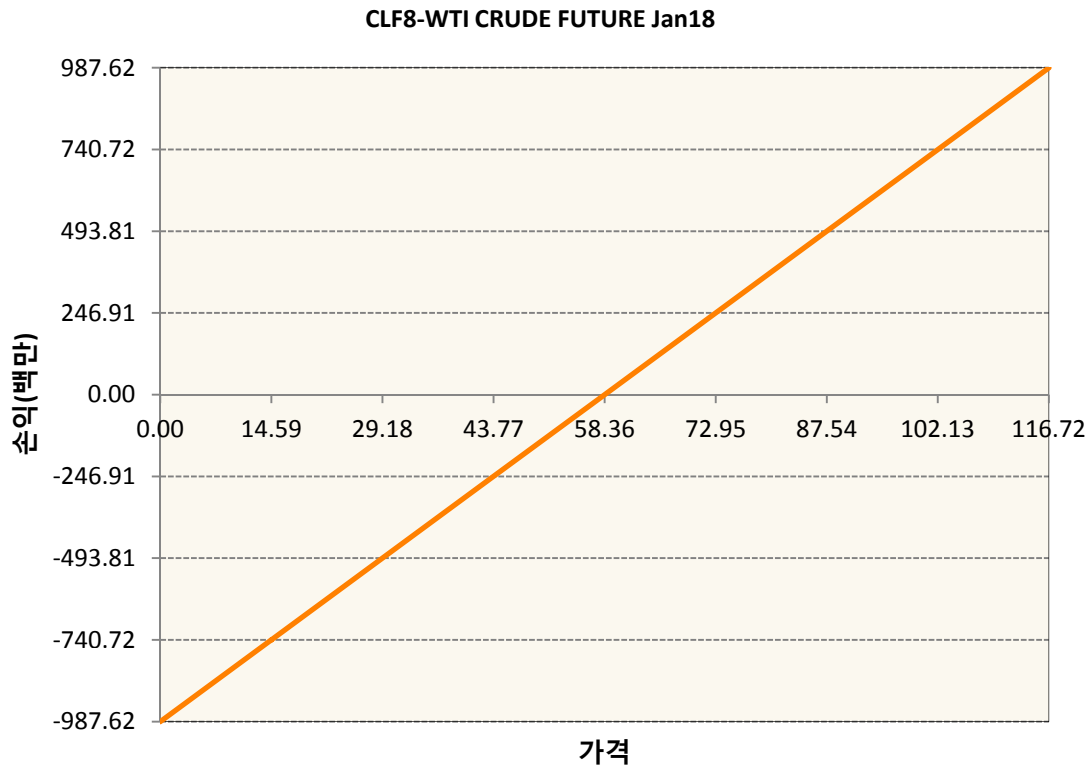
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

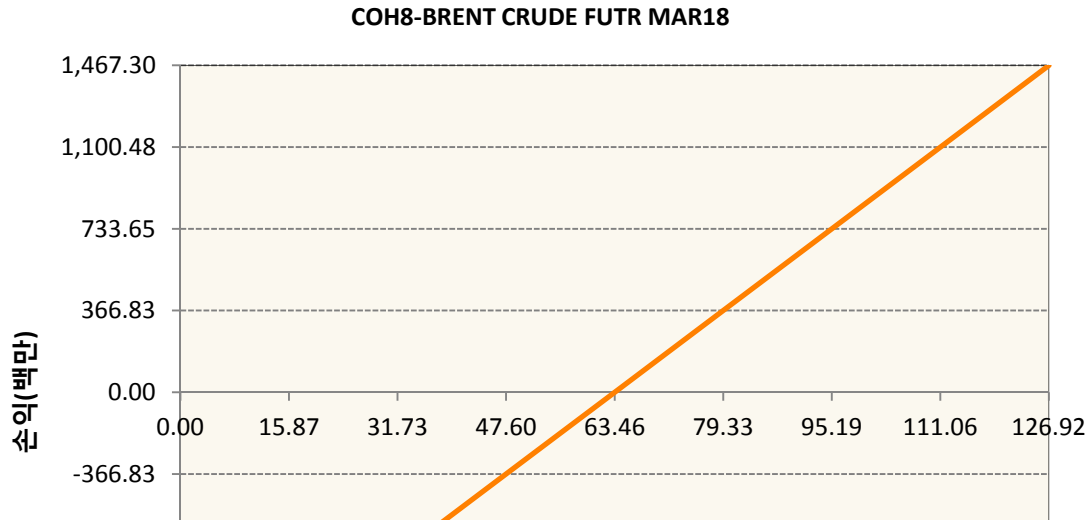
1. 계약금액

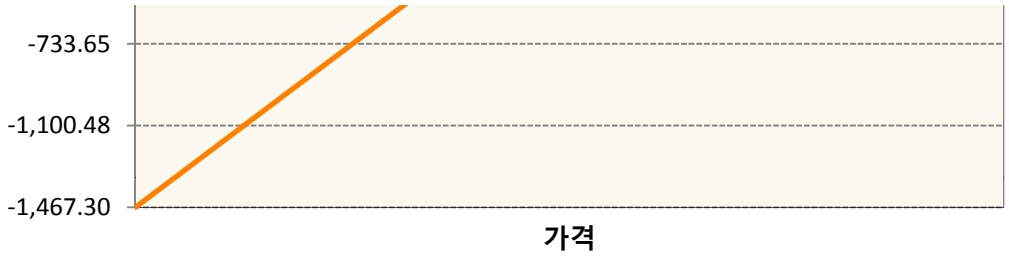
(단위:백만원)

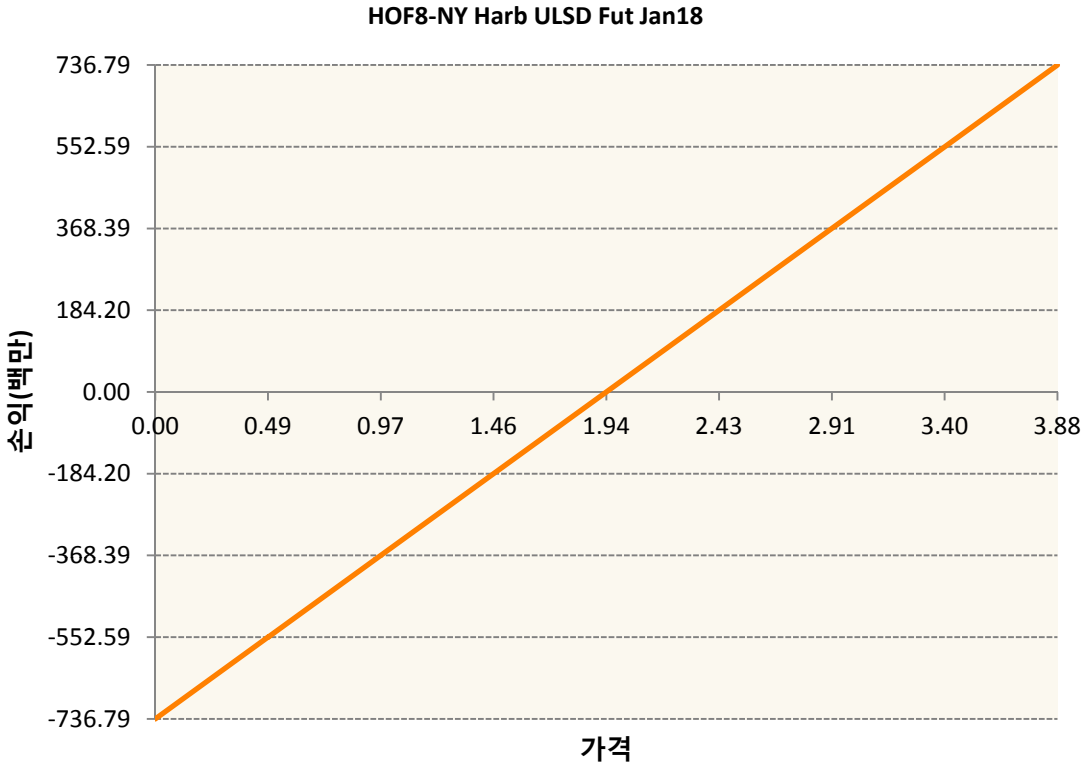
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,220	871	4,350	

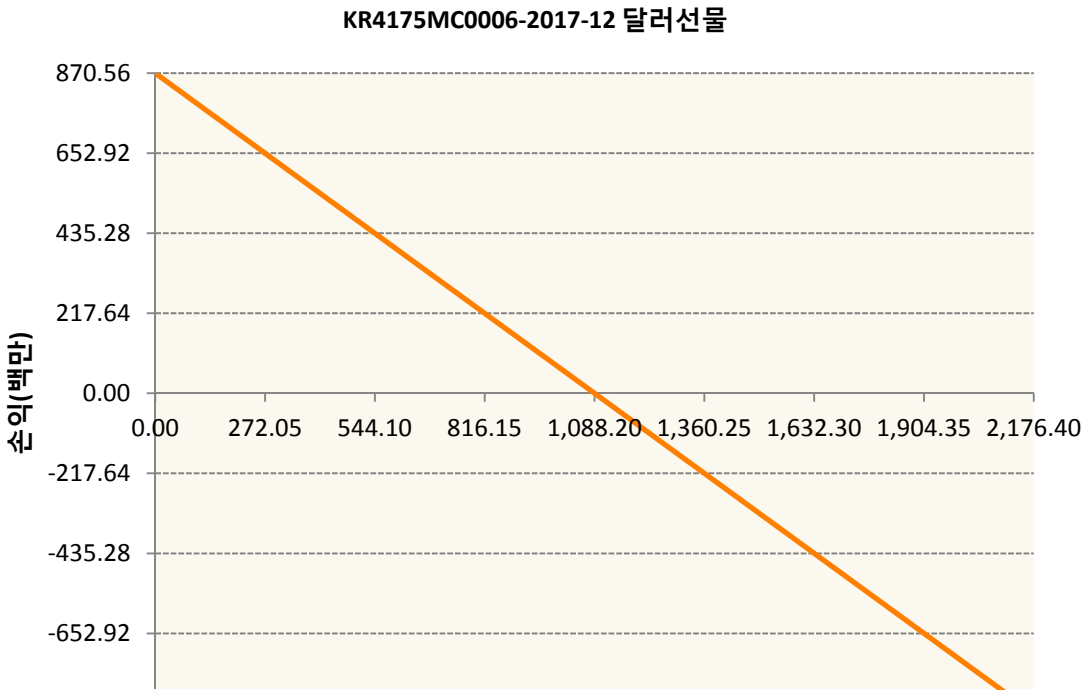
2. 만기시점의 손익구조

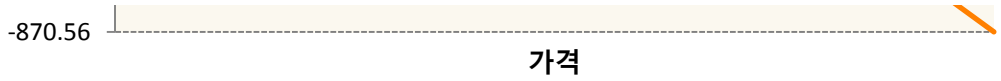


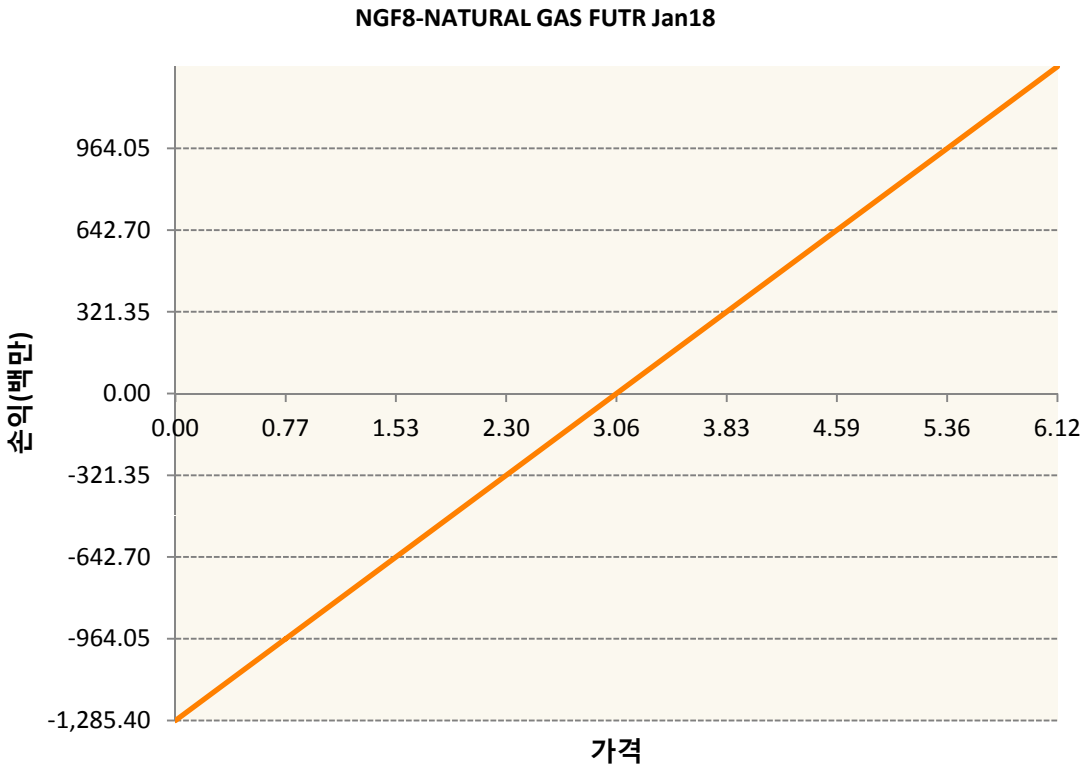


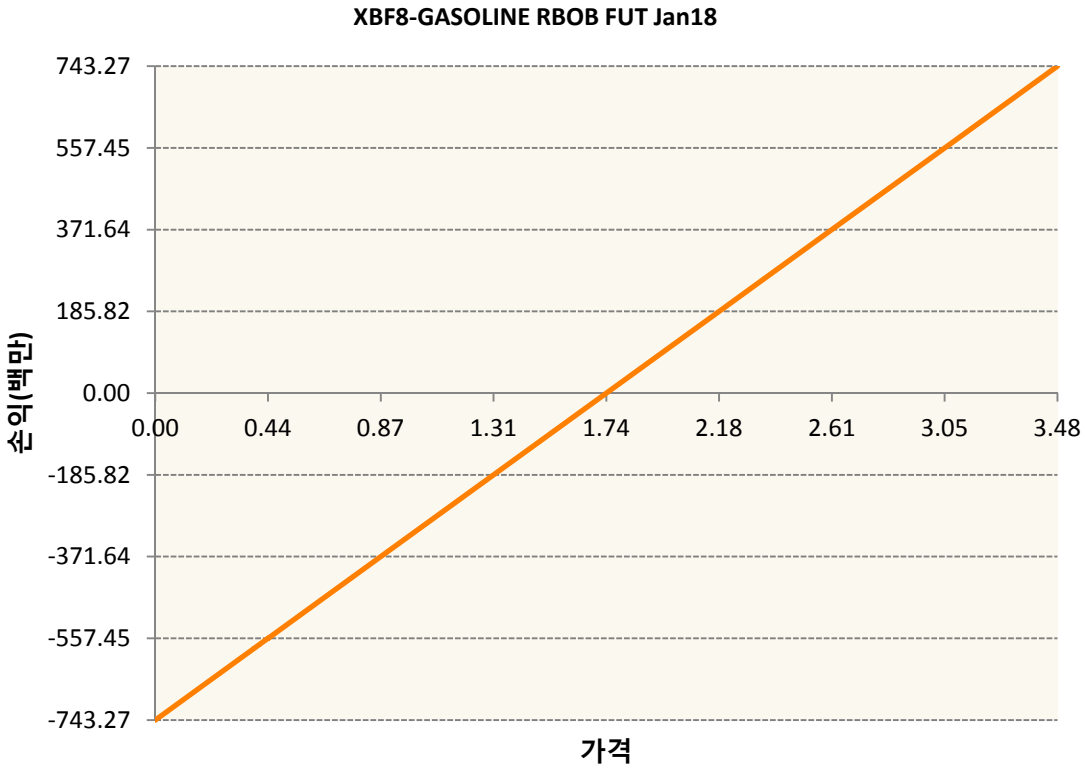

-733.65
-1,100.48
-1,467.30
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
736.79
552.59
368.39
184.20
0.00
-184.20
-368.39
-552.59
-736.79
0.00
0.49
0.97
1.46
1.94
2.43
2.91
3.40
3.88
손익(만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
870.56
652.92
435.28
217.64
0.00
-217.64
-435.28
-652.92
0.00
272.05
544.10
816.15
1,088.20
1,360.25
1,632.30
1,904.35
2,176.40
손익(만)


-870.56
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
964.05
642.70
321.35
0.00
-321.35
-642.70
-964.05
-1,285.40
0.00
0.77
1.53
2.30
3.06
3.83
4.59
5.36
6.12
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
743.27
557.45
371.64
185.82
0.00
-185.82
-371.64
-557.45
-743.27
0.00
0.44
0.87
1.31
1.74
2.18
2.61
3.05
3.48
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	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	103
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	59

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

715

공시일	2017-12-05
기준일	2017-12-04

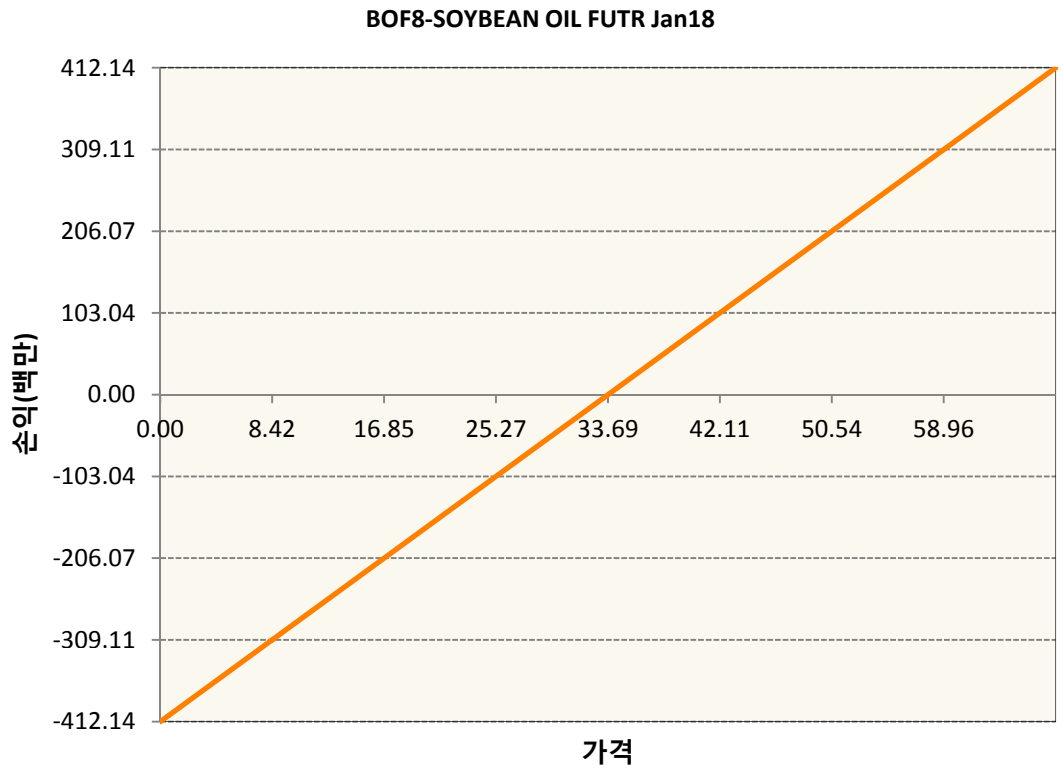
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

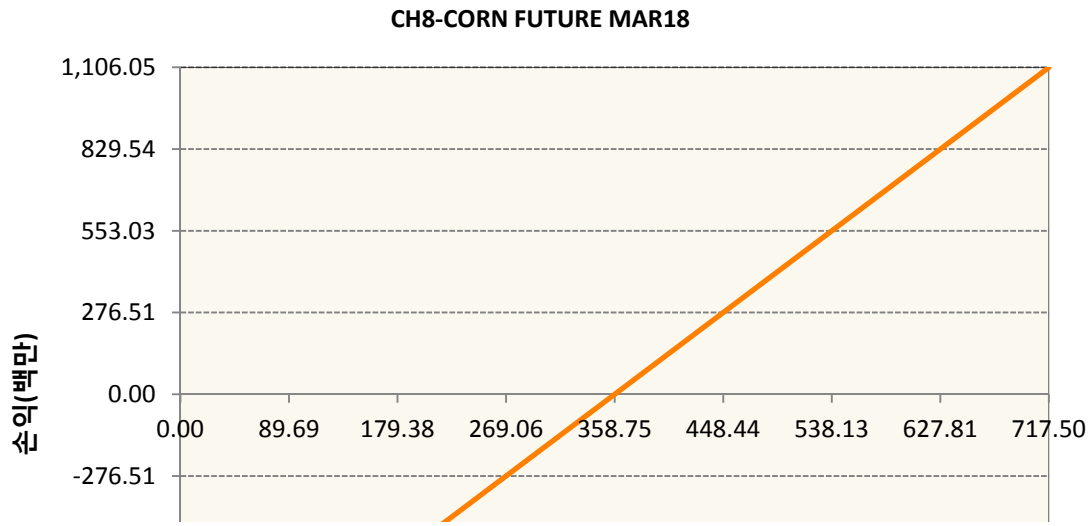
1. 계약금액

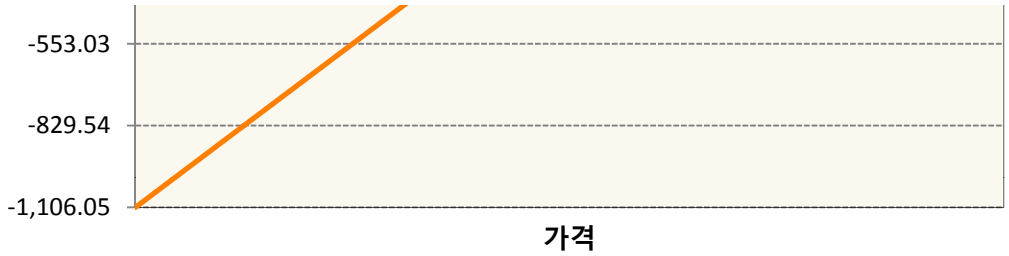
(단위:백만원)

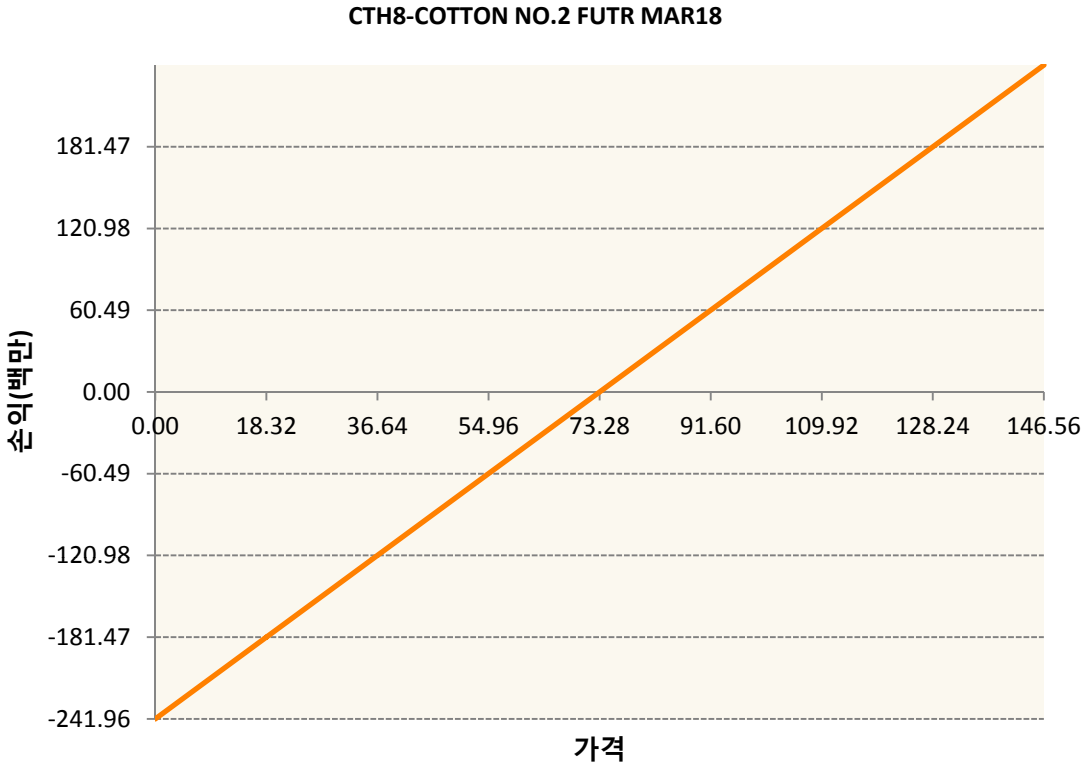
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,570	326	4,244	

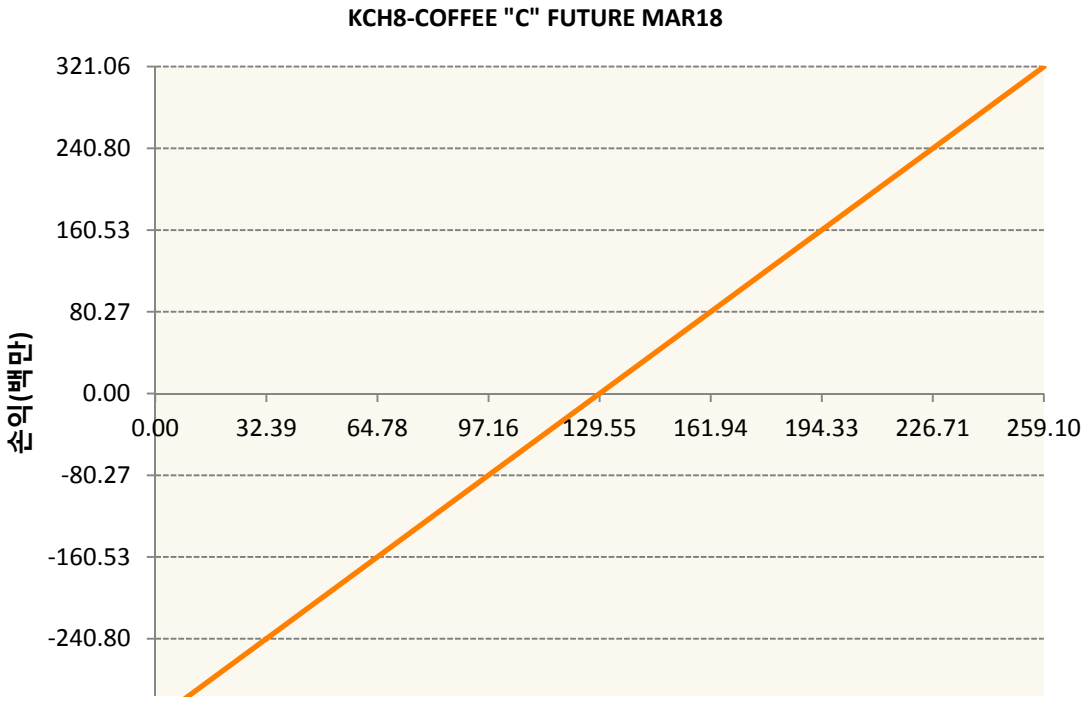
2. 만기시점의 손익구조

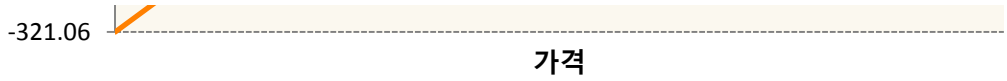


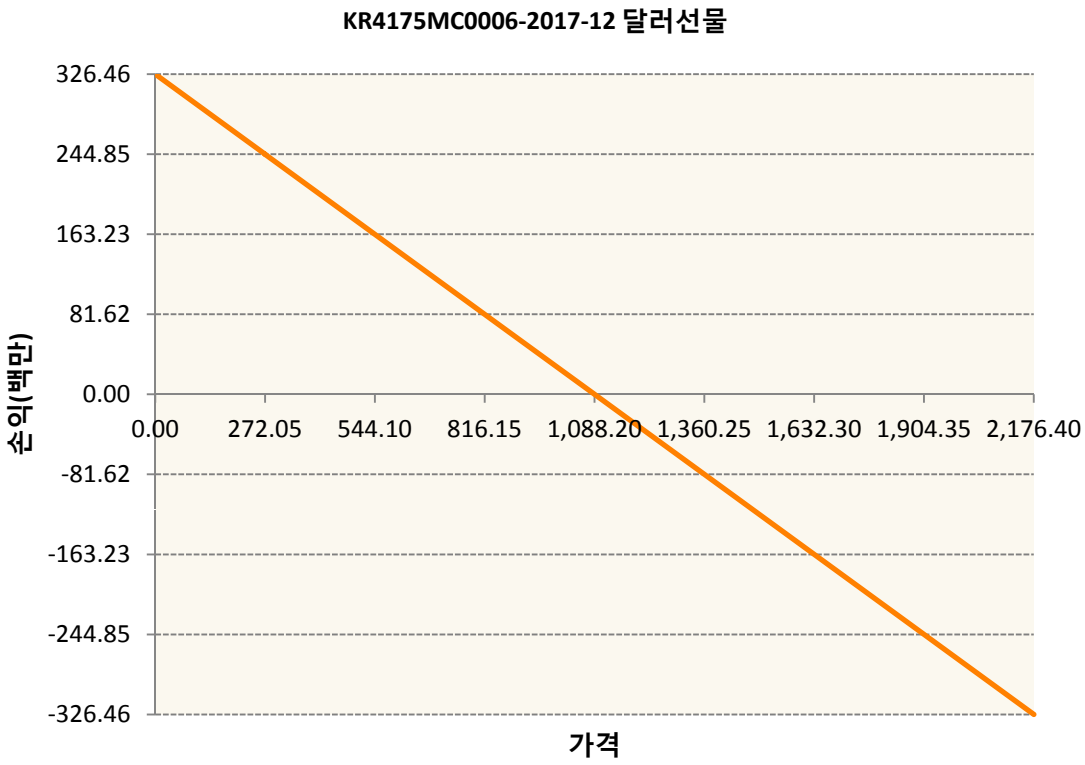


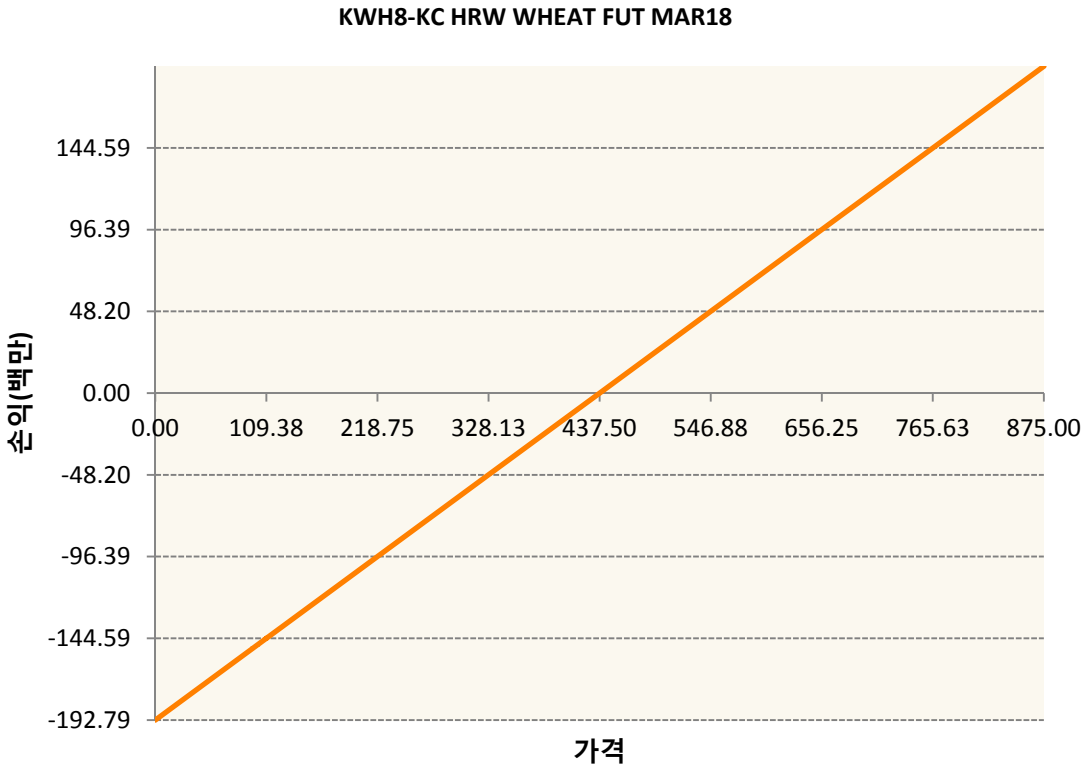

-553.03
-829.54
-1,106.05
가격

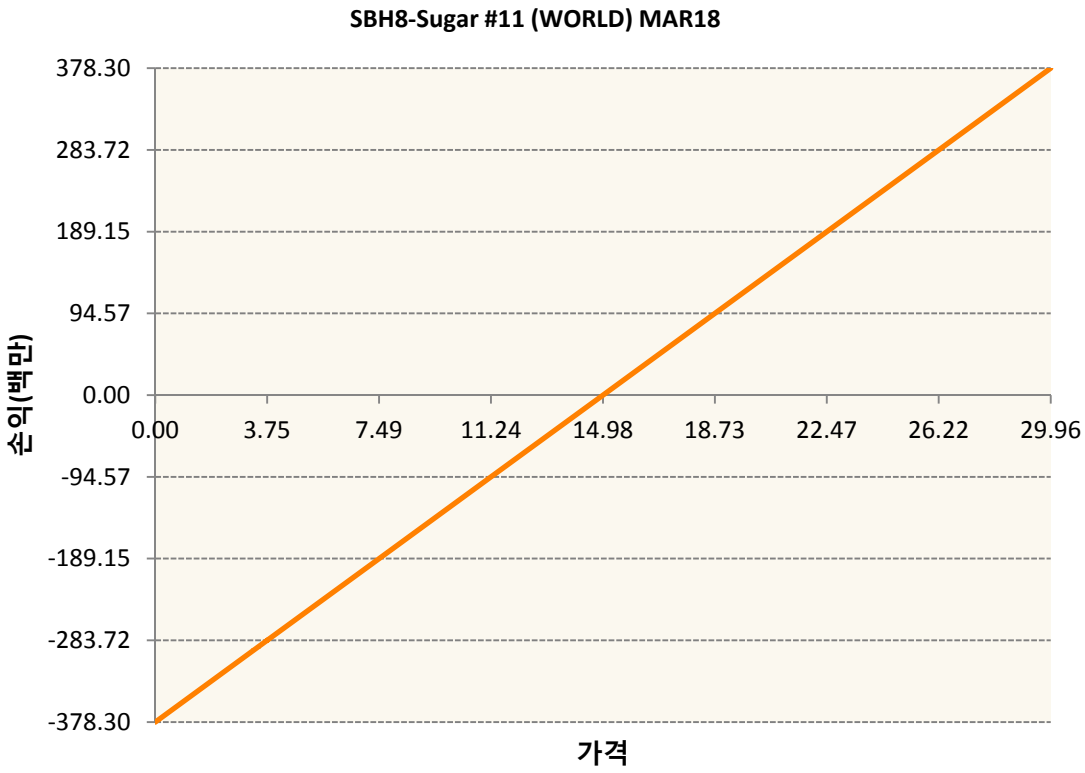

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
손익(백만)
181.47
120.98
60.49
0.00
-60.49
-120.98
-181.47
-241.96
0.00
18.32
36.64
54.96
73.28
91.60
109.92
128.24
146.56
가격

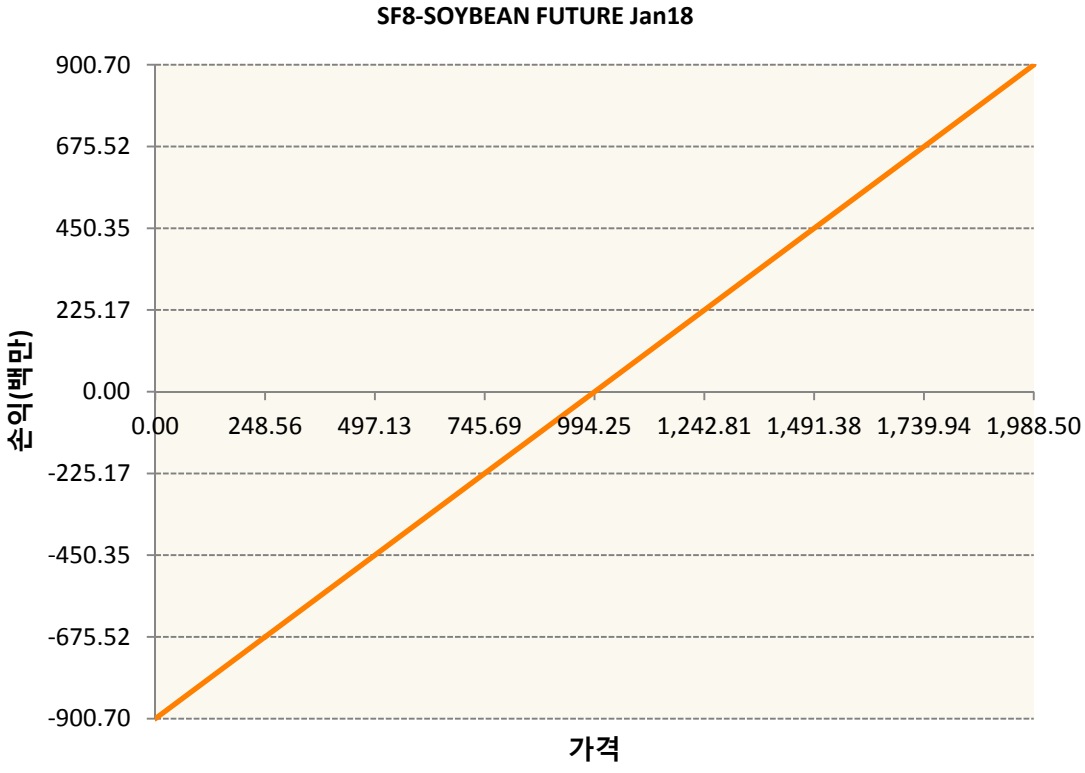

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
손익(백만)
321.06
240.80
160.53
80.27
0.00
-80.27
-160.53
-240.80
0.00
32.39
64.78
97.16
129.55
161.94
194.33
226.71
259.10


-321.06
가격

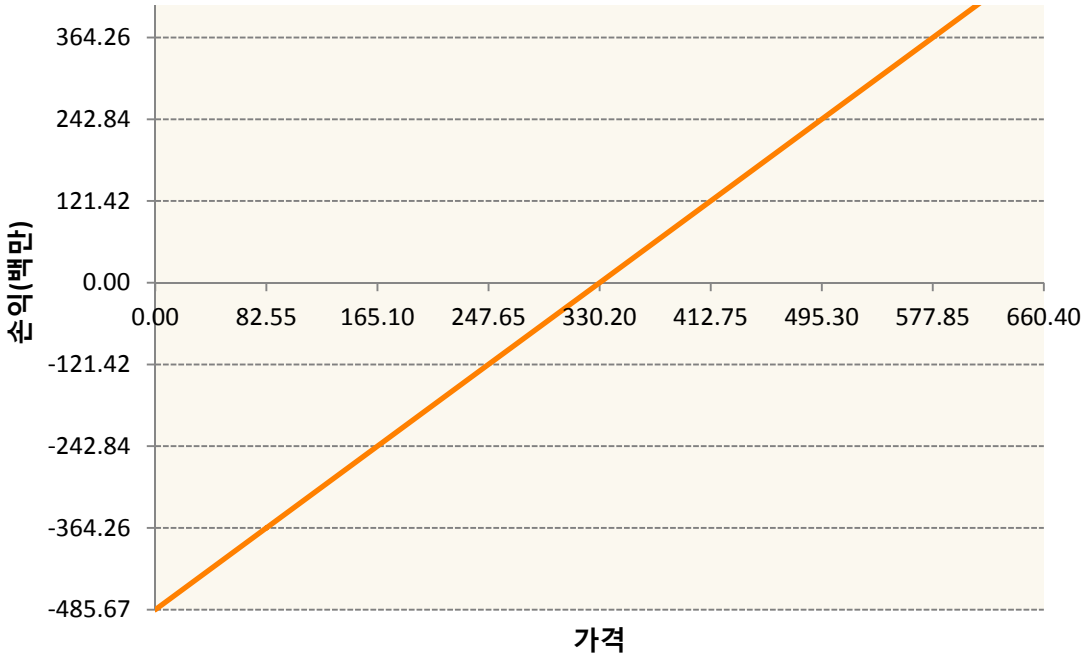

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
326.46
244.85
163.23
81.62
0.00
-81.62
-163.23
-244.85
-326.46
0.00
272.05
544.10
816.15
1,088.20
1,360.25
1,632.30
1,904.35
2,176.40
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
144.59
96.39
48.20
0.00
-48.20
-96.39
-144.59
-192.79
0.00
109.38
218.75
328.13
437.50
546.88
656.25
765.63
875.00
손익(백만)
가격

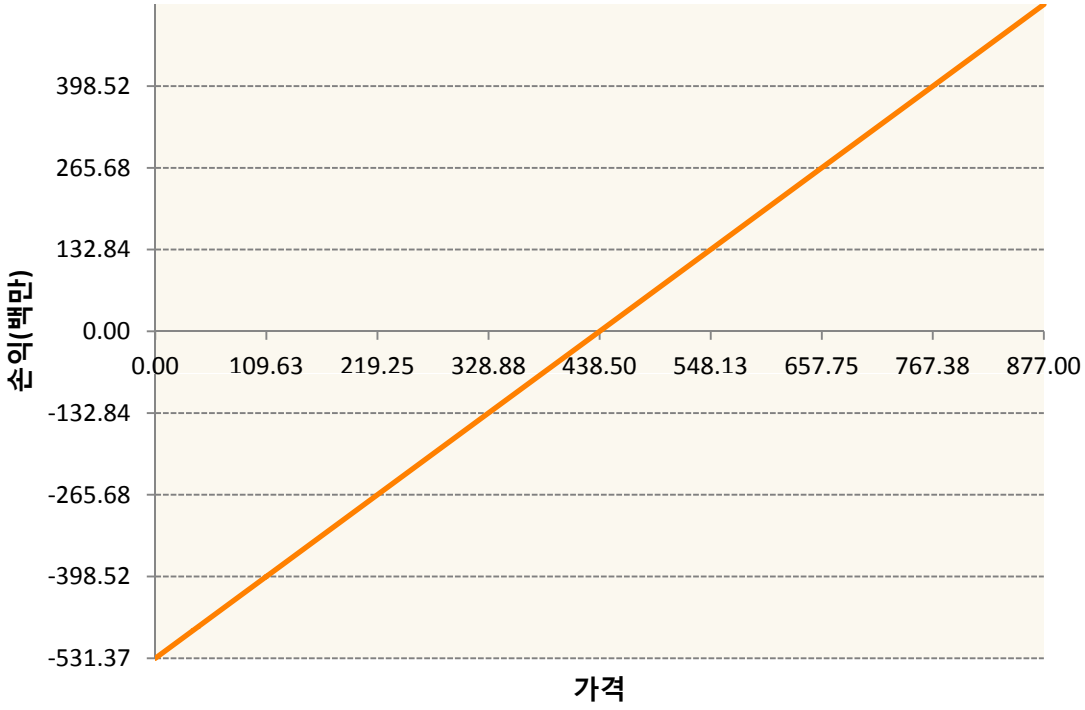

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
378.30
283.72
189.15
94.57
0.00
-94.57
-189.15
-283.72
-378.30
0.00
3.75
7.49
11.24
14.98
18.73
22.47
26.22
29.96
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
900.70
675.52
450.35
225.17
0.00
-225.17
-450.35
-675.52
-900.70
0.00
248.56
497.13
745.69
994.25
1,242.81
1,491.38
1,739.94
1,988.50
손익(백만)
가격


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	88
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	43

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

398