공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

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	2017-12-06
기준일	2017-12-05

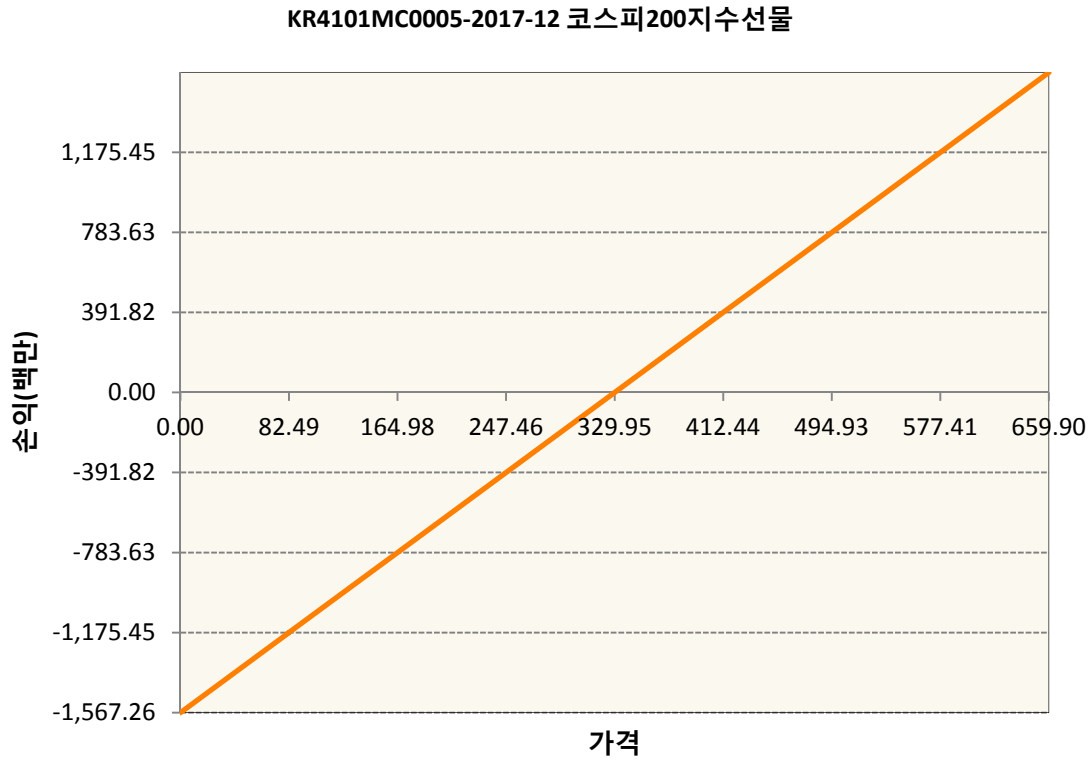
스마트인덱스모

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	1,567	0	1,567	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%	-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%	125	125	125	125	125	125	125

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

73

공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

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	1,082

* 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	2017-12-06
기준일	2017-12-05

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	392

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

361

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

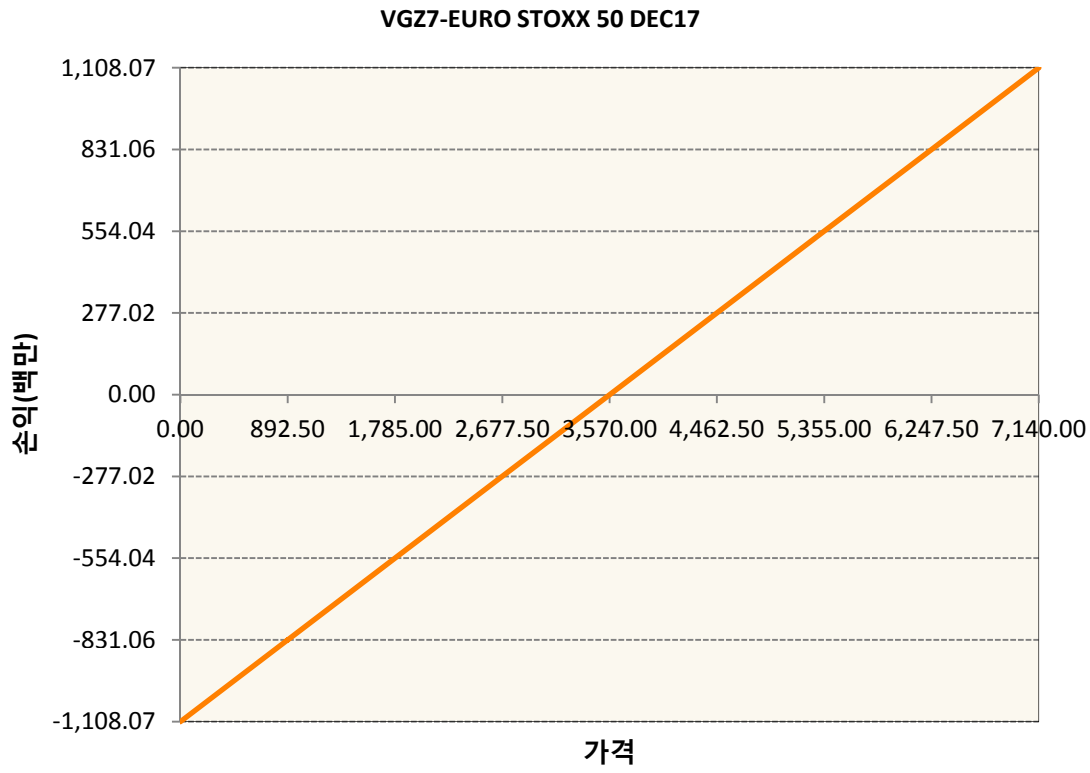
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,108	0	1,108	

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	2017-12-06
기준일	2017-12-05

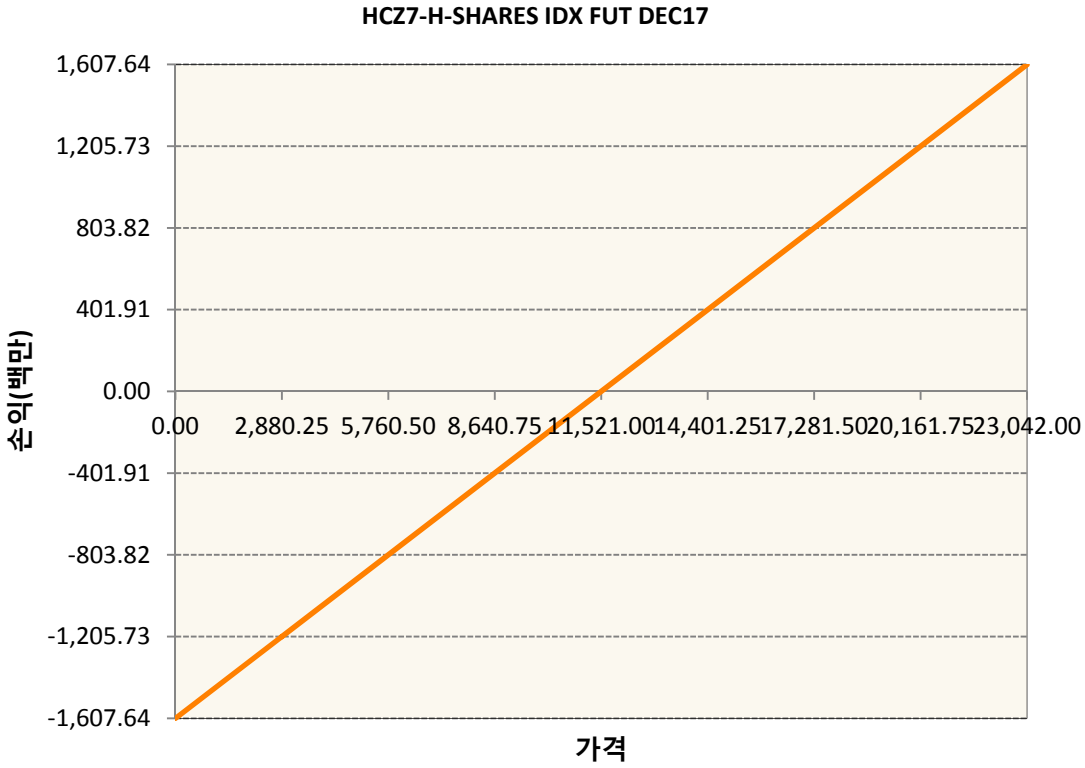
차이나인덱스모(주식-파생형)

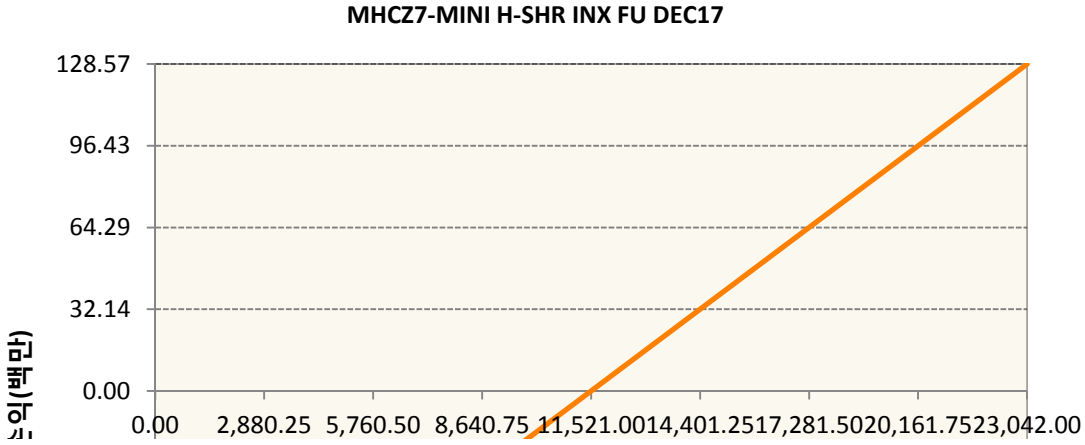
1. 계약금액

(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)
	90

공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

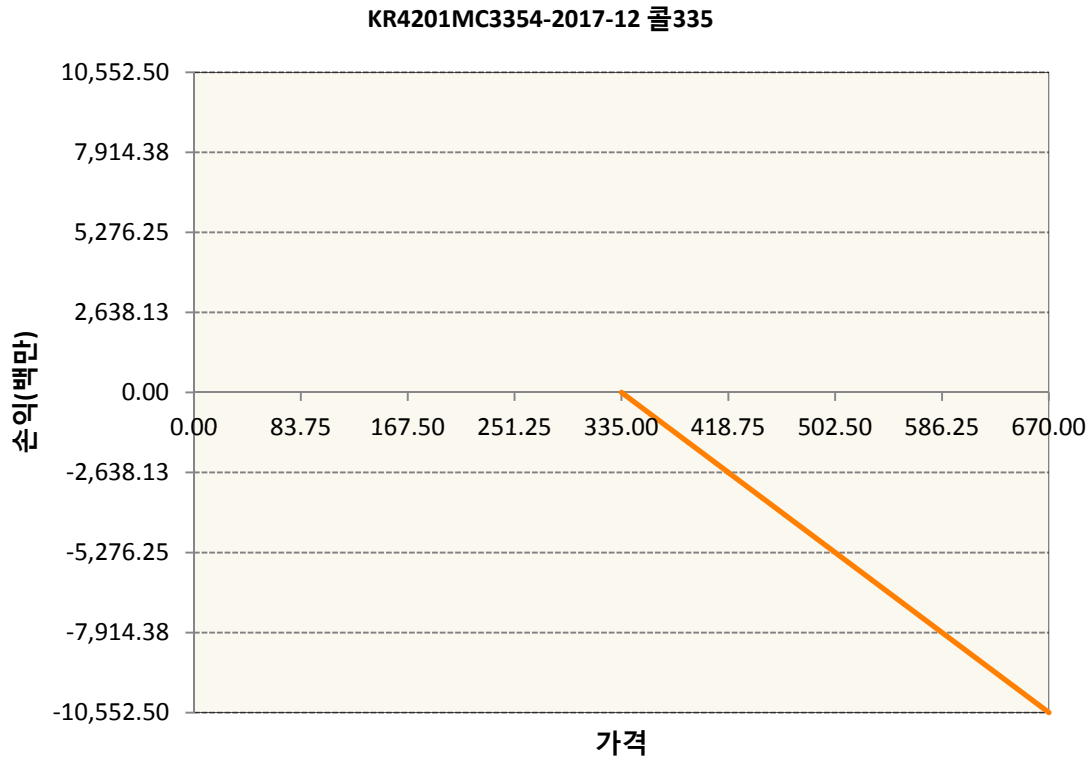
커버드콜모(주식혼합-파생형)

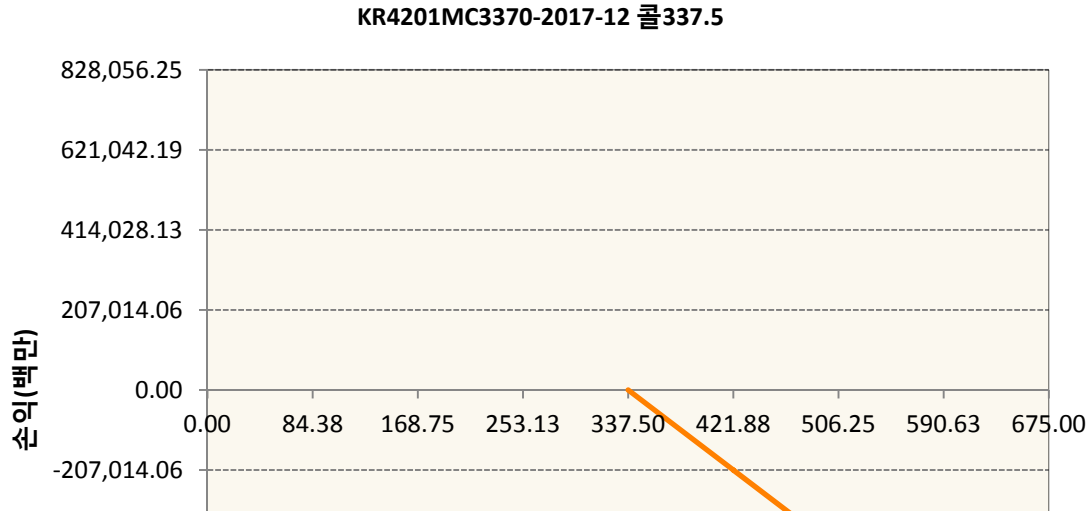
1. 계약금액

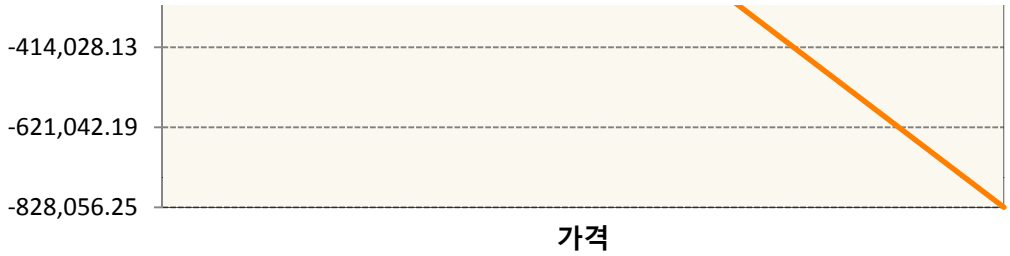
(단위:백만원)

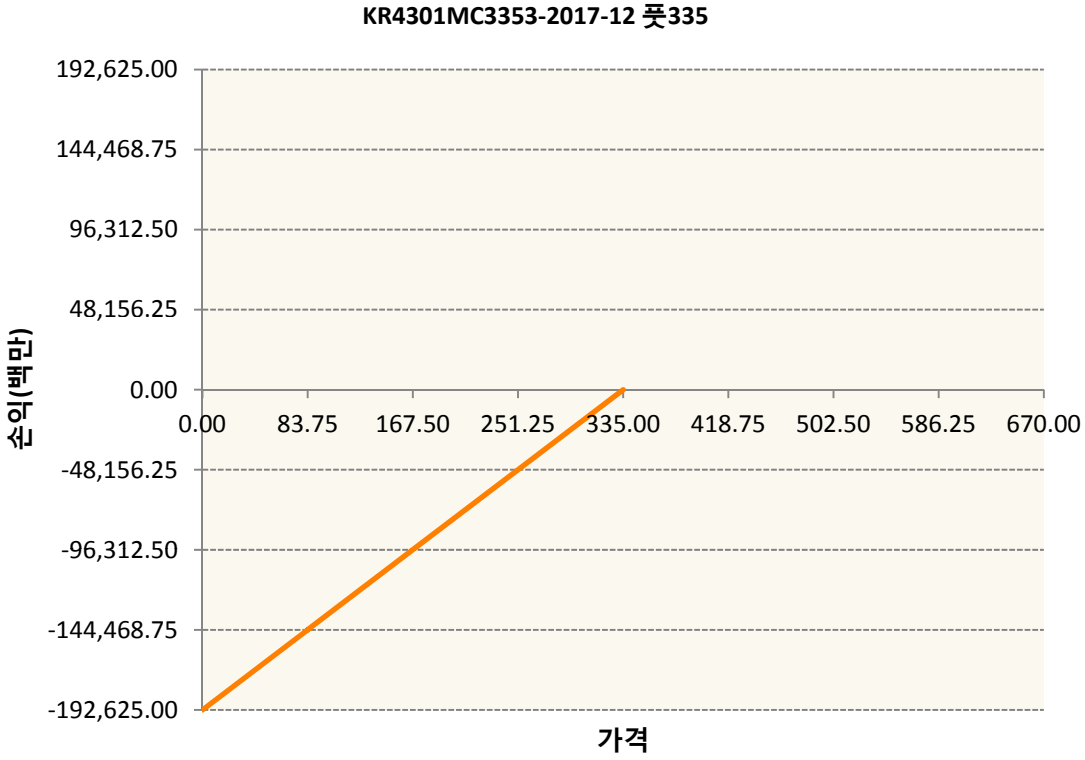
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

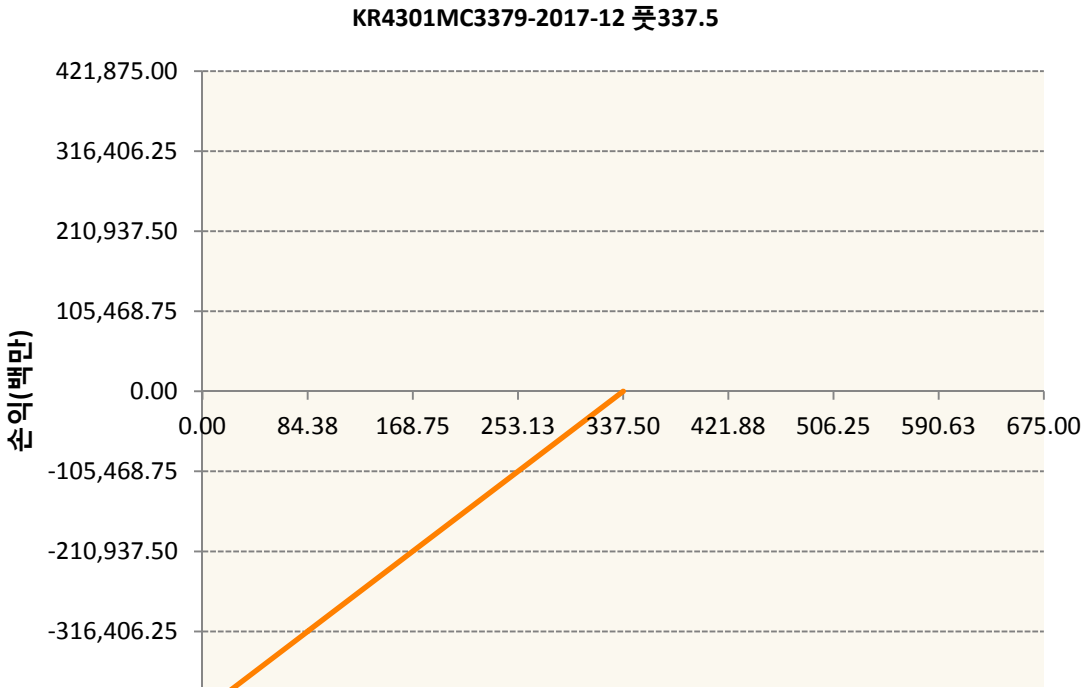
2. 만기시점의 손익구조






-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							596
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	94	94	93	93	91	90
-5.33%	93	92	91	88	85	81	77
-2.67%	84	79	73	66	58	49	40
0%	37	25	13	0	-13	-26	-39
2.67%	-93	-106	-119	-133	-146	-160	-173
5.33%	-308	-316	-324	-333	-343	-353	-363
8.00%	-570	-572	-575	-579	-584	-590	-596
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							42,915
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,477	5,474	5,465	5,446	5,410	5,353	5,270
-5.33%	5,448	5,402	5,322	5,200	5,030	4,810	4,539
-2.67%	5,049	4,764	4,401	3,968	3,472	2,918	2,315
0%	2,542	1,735	884	0	-911	-1,843	-2,793
2.67%	-5,503	-6,587	-7,671	-8,755	-9,840	-10,926	-12,011
5.33%	-20,613	-21,341	-22,126	-22,956	-23,823	-24,721	-25,643
8.00%	-40,292	-40,550	-40,888	-41,299	-41,778	-42,319	-42,915
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,671
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,671	-14,671	-14,671	-14,671	-14,671	-14,671	-14,671
-5.33%	-9,619	-9,619	-9,619	-9,619	-9,619	-9,621	-9,623
-2.67%	-4,568	-4,572	-4,580	-4,591	-4,608	-4,631	-4,660
0%	261	181	93	0	-98	-201	-307
2.67%	3,108	3,000	2,887	2,771	2,653	2,533	2,412
5.33%	3,553	3,541	3,522	3,497	3,464	3,423	3,376
8.00%	3,563	3,563	3,562	3,561	3,559	3,554	3,548
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							32,412
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,412	-32,412	-32,412	-32,412	-32,412	-32,412	-32,412
-5.33%	-21,429	-21,429	-21,429	-21,429	-21,429	-21,430	-21,432
-2.67%	-10,446	-10,449	-10,454	-10,465	-10,482	-10,508	-10,543
0%	360	260	139	0	-156	-325	-507
2.67%	8,296	8,011	7,726	7,440	7,154	6,867	6,580

5.33%	10,266	10,202	10,118	10,014	9,893	9,756	9,604
8.00%	10,350	10,348	10,345	10,337	10,324	10,303	10,274

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

100,301

공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

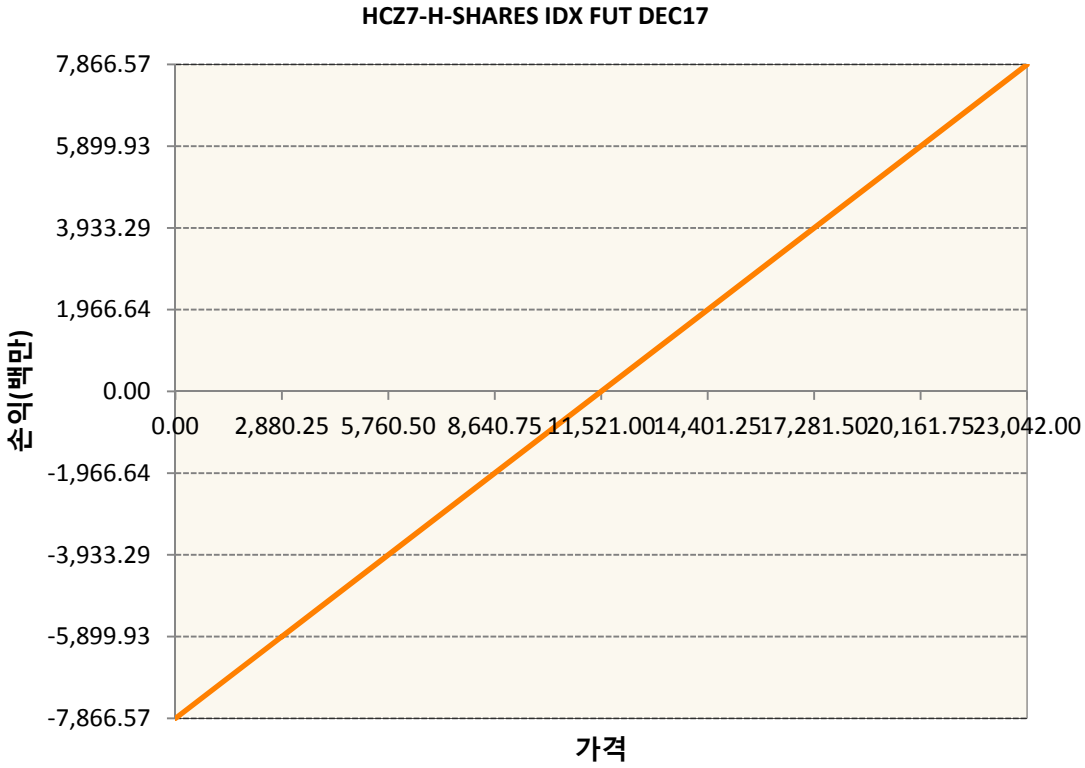
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

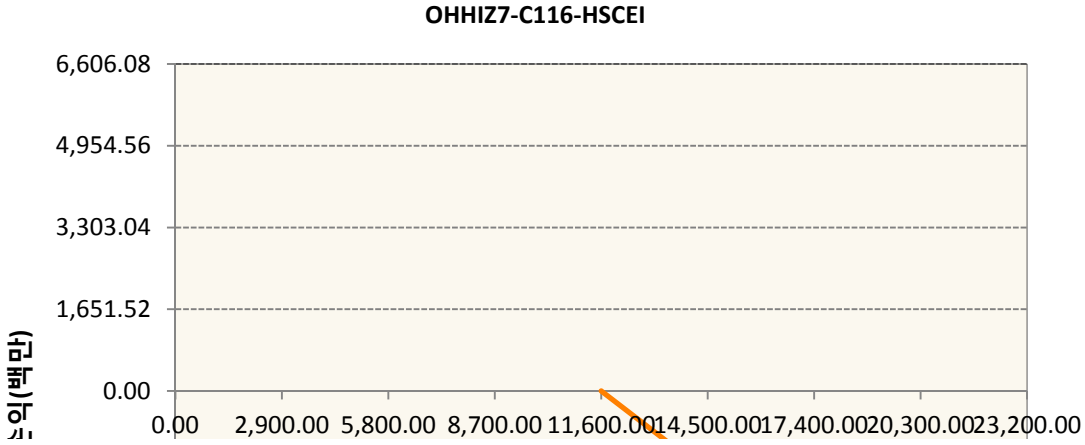
1. 계약금액

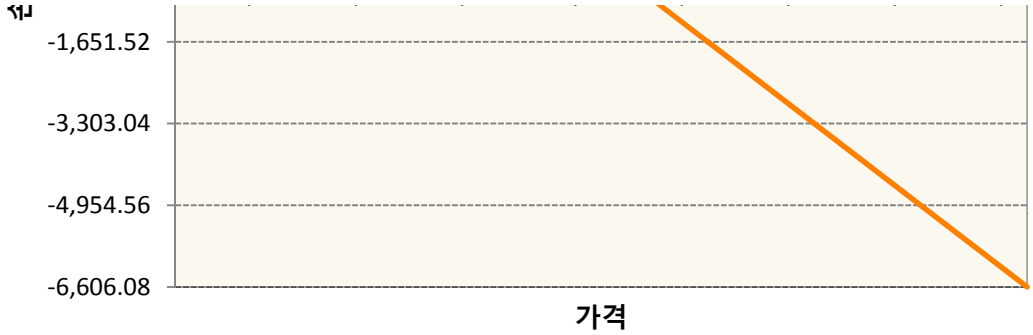
(단위:백만원)

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	7,867	0	7,867	
누계	유가증권	옵션	0	17,310	-17,310	장내

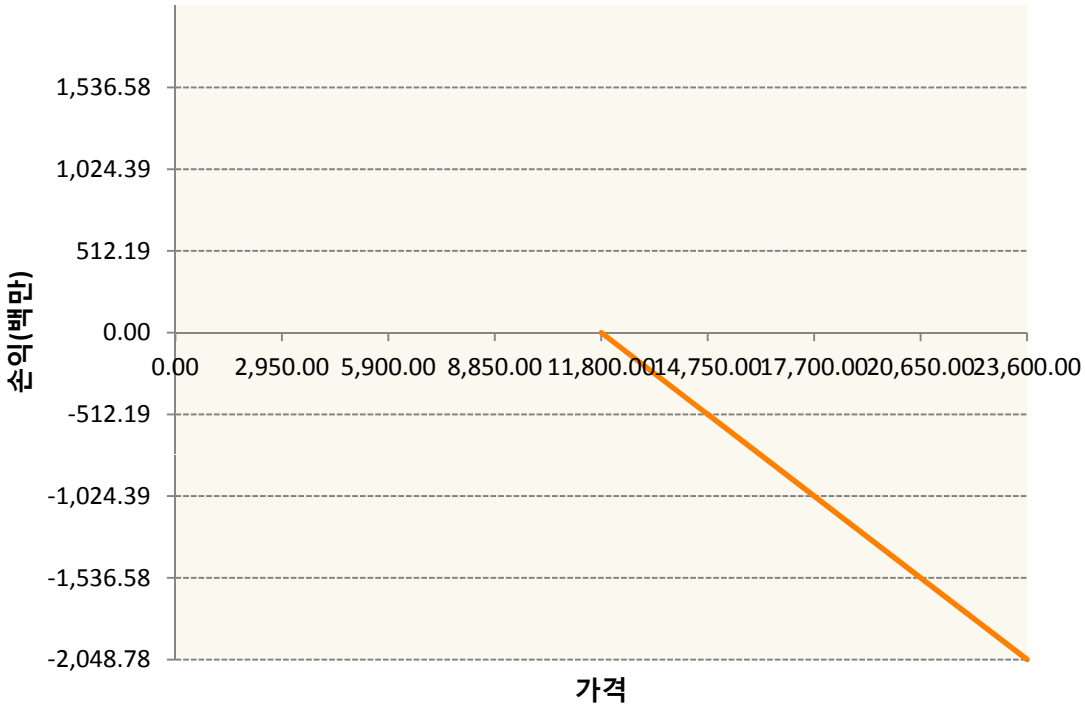
2. 만기시점의 손익구조



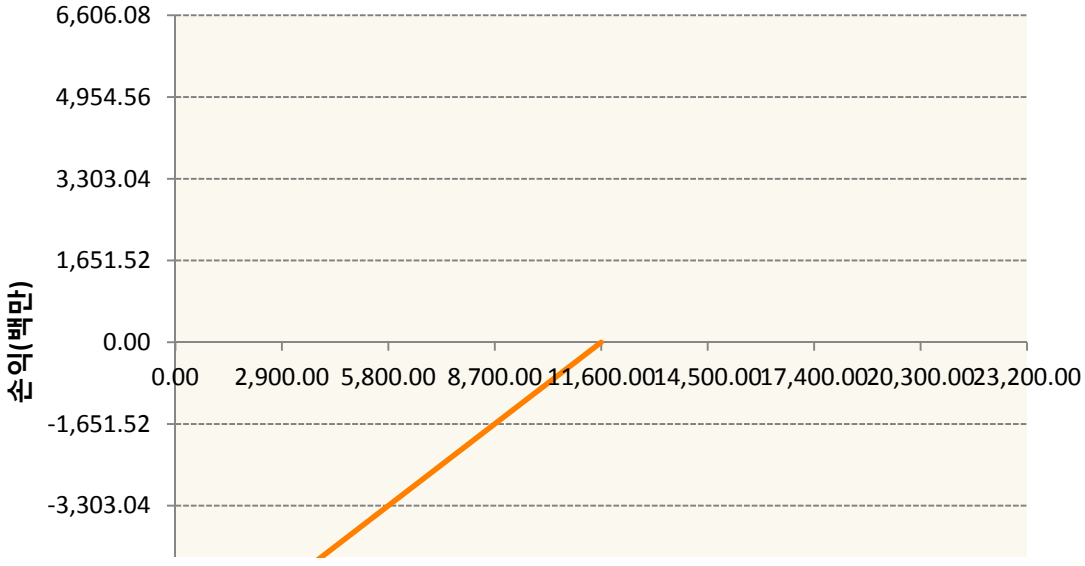


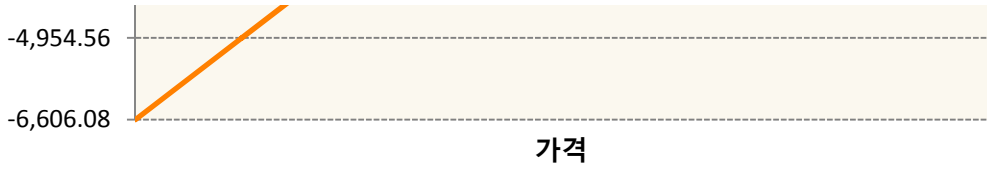


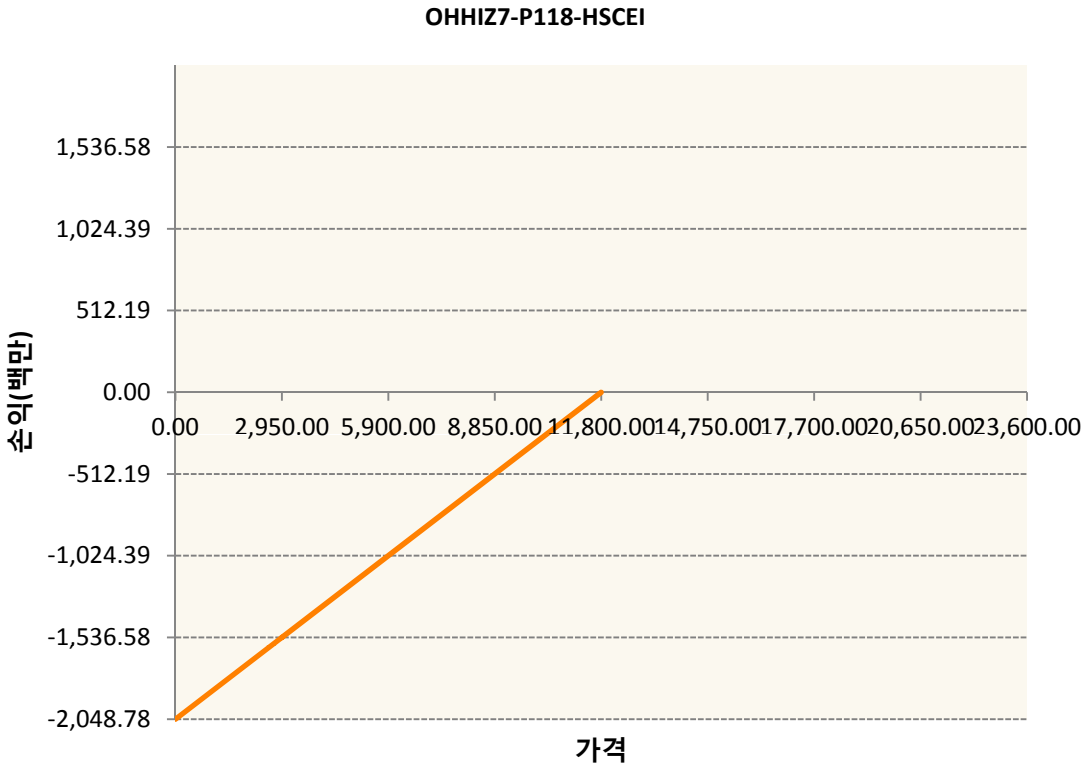
OHHIZ7-C118-HSCEI



OHHIZ7-P116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	629
OHHIZ7-C11	HSCEI	528
OHHIZ7-C11	HSCEI	164
OHHIZ7-P11	HSCEI	528
OHHIZ7-P11	HSCEI	164

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,492

공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

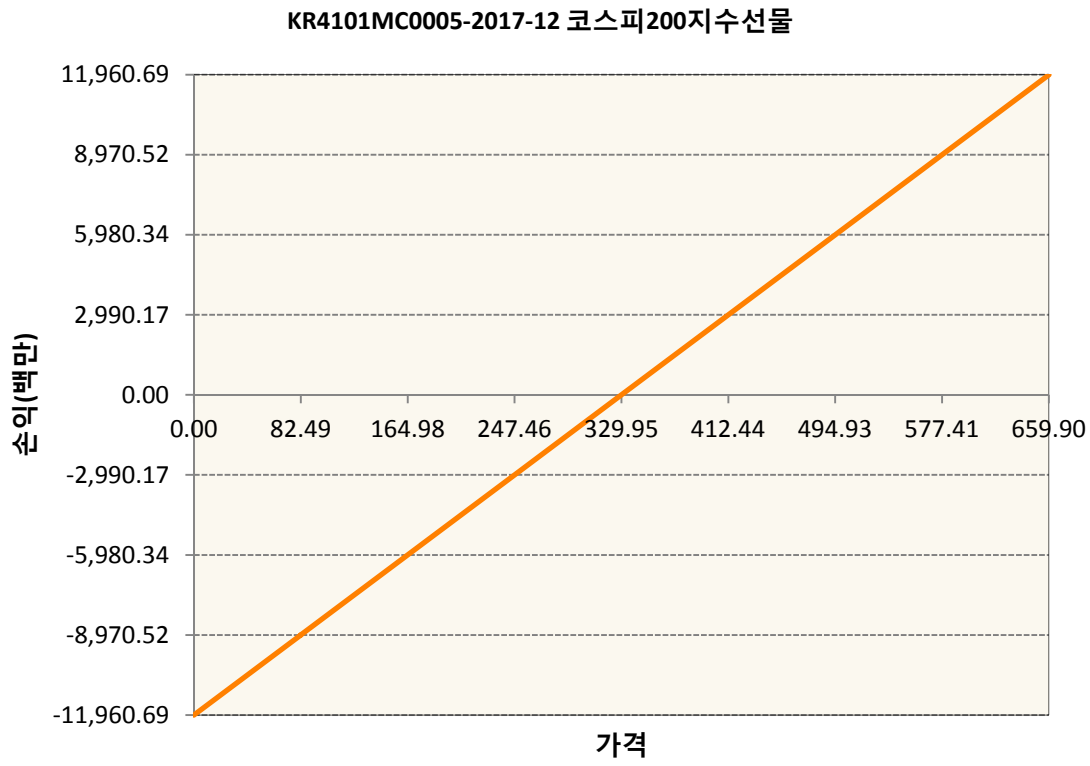
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

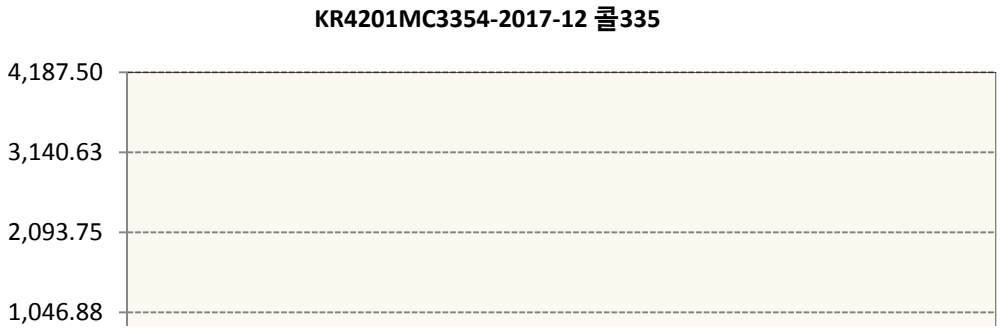
1. 계약금액

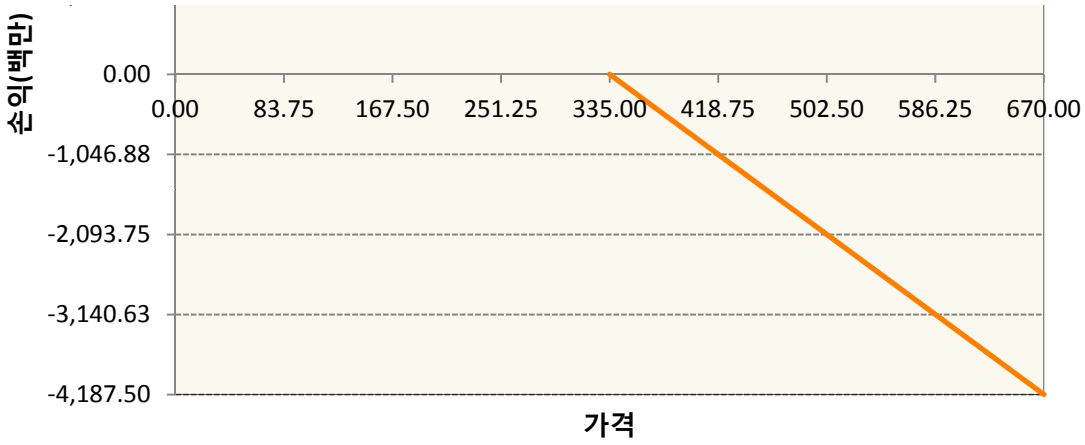
(단위:백만원)

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	11,961	0	11,961	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

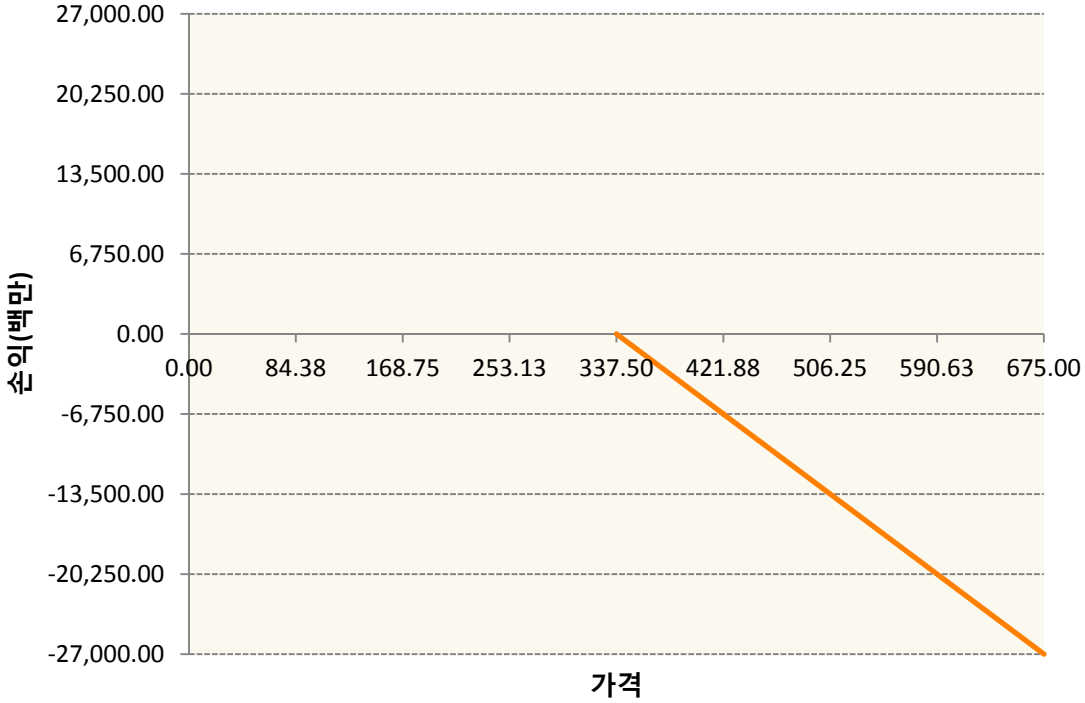
2. 만기시점의 손익구조



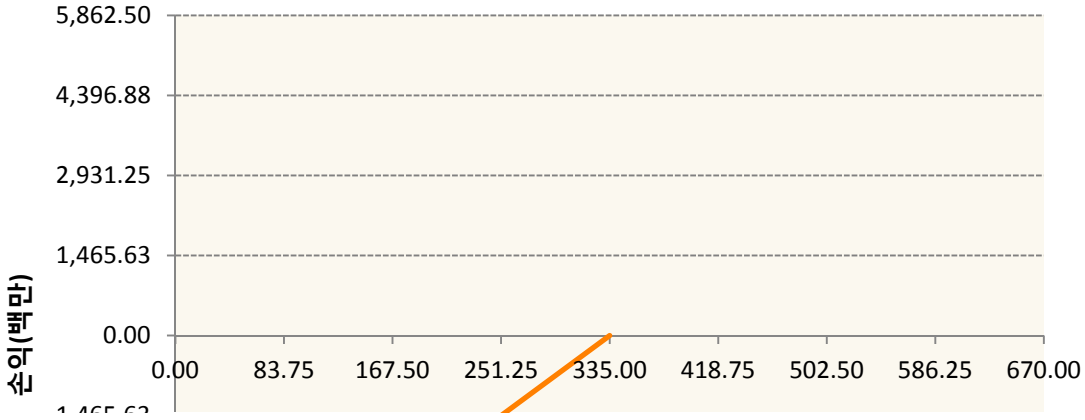




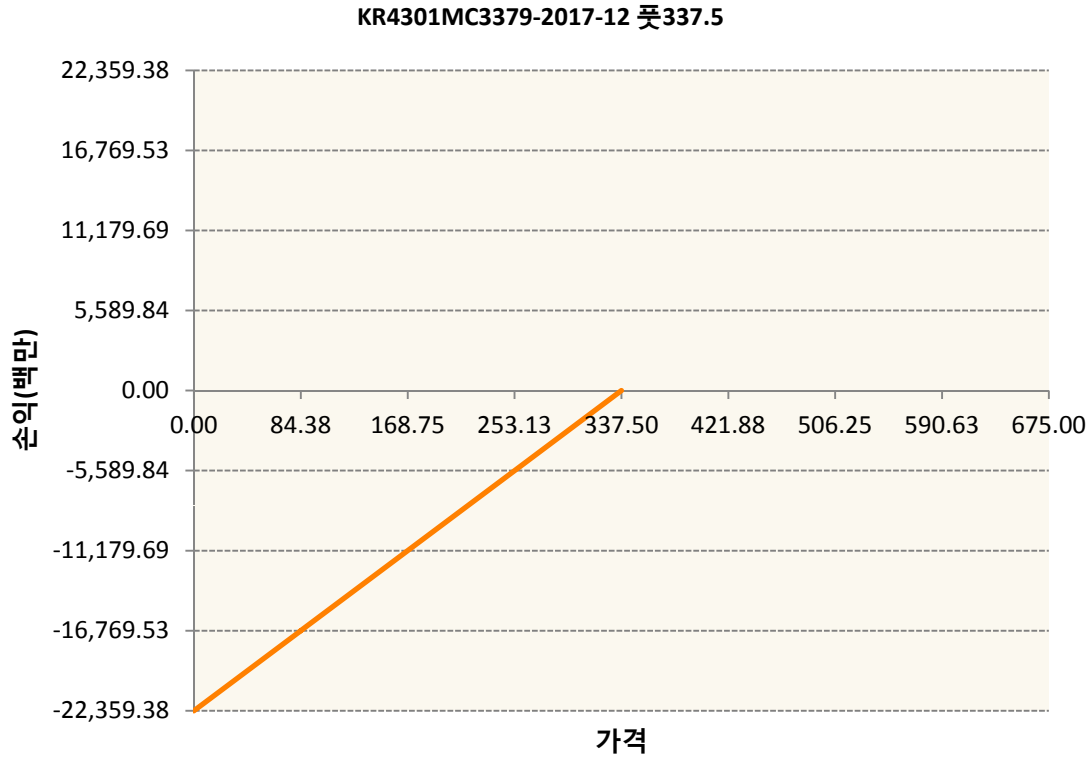
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,461
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461	-1,461
-5.33%	-974	-974	-974	-974	-974	-974	-974
-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%	974	974	974	974	974	974	974
8.00%	1,461	1,461	1,461	1,461	1,461	1,461	1,461
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						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						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%	-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%	197	197	197	197	197	197	197
	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%	-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%	253	253	253	253	253	253	253
	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%	-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%	467	467	467	467	467	467	467
	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						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						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%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-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%	421	421	421	421	421	421	421
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					956

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-956	-956	-956	-956	-956	-956	-956
-5.33%	-637	-637	-637	-637	-637	-637	-637
-2.67%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	319	319	319	319	319	319	319
5.33%	637	637	637	637	637	637	637
8.00%	956	956	956	956	956	956	956
	KR4201MC3	2017-12 콜335					236

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	37	37	37	36	36
-5.33%	37	37	36	35	34	32	31
-2.67%	33	31	29	26	23	20	16
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	-37	-42	-47	-53	-58	-63	-69
5.33%	-122	-125	-129	-132	-136	-140	-144
8.00%	-226	-227	-228	-230	-232	-234	-236
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,399

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	179	178	178	178	176	175	172
-5.33%	178	176	174	170	164	157	148
-2.67%	165	155	144	129	113	95	75
0%	83	57	29	0	-30	-60	-91
2.67%	-179	-215	-250	-285	-321	-356	-392
5.33%	-672	-696	-721	-749	-777	-806	-836
8.00%	-1,314	-1,322	-1,333	-1,347	-1,362	-1,380	-1,399
	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%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293

-2.67%	-139	-139	-139	-140	-140	-141	-142
0%	8	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	95	91	88	84	81	77	73
5.33%	108	108	107	106	105	104	103
8.00%	108	108	108	108	108	108	108
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,718
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,718	-1,718	-1,718	-1,718	-1,718	-1,718	-1,718
-5.33%	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136
-2.67%	-554	-554	-554	-555	-556	-557	-559
0%	19	14	7	0	-8	-17	-27
2.67%	440	425	409	394	379	364	349
5.33%	544	541	536	531	524	517	509
8.00%	549	548	548	548	547	546	545

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

9,568

공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

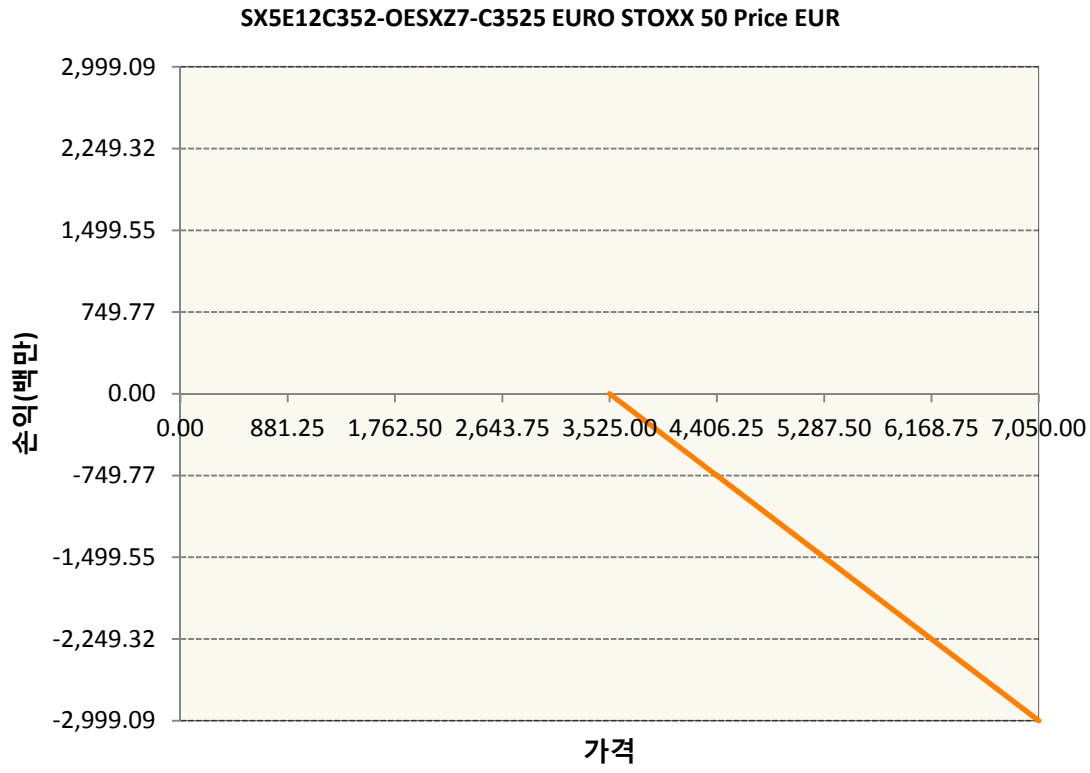
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

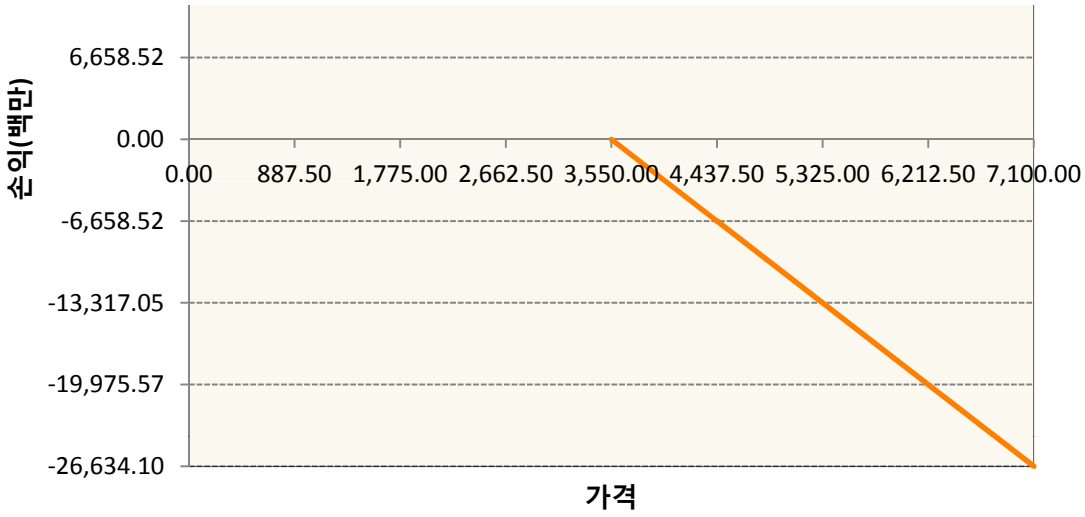
(단위:백만원)

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	21,738	0	21,738	
누계	유가증권	스왑	96,684	0	96,684	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,266	-59,266	장내
누계	지수	스왑	51,565	0	51,565	장외

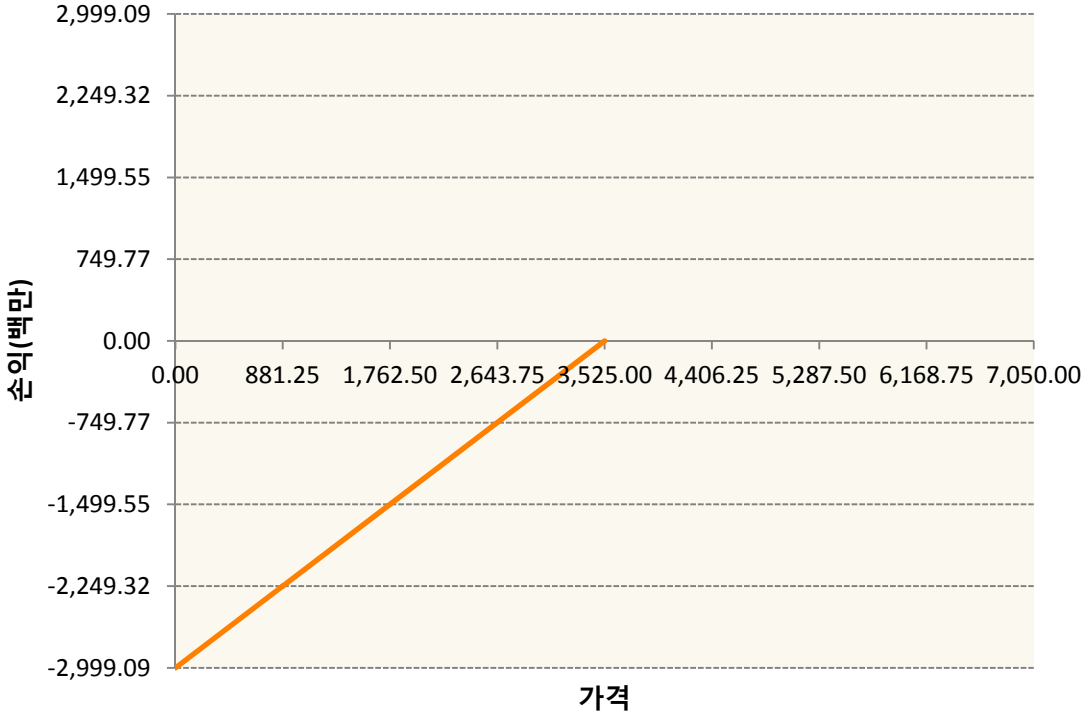
2. 만기시점의 손익구조



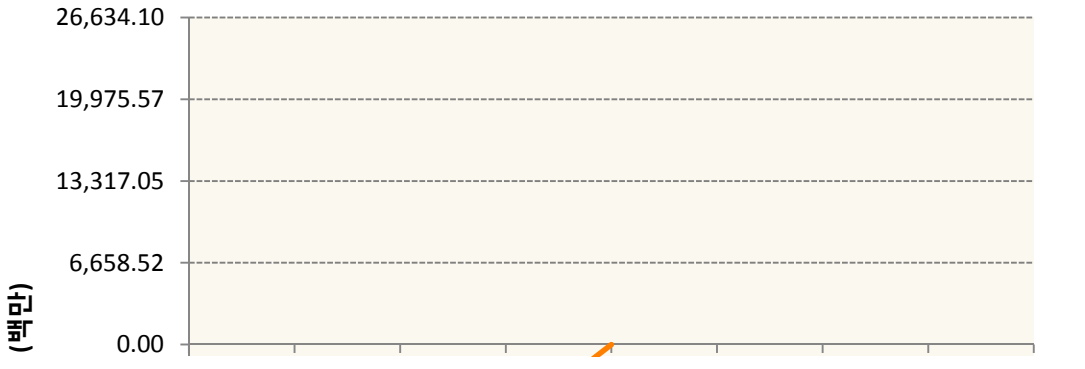


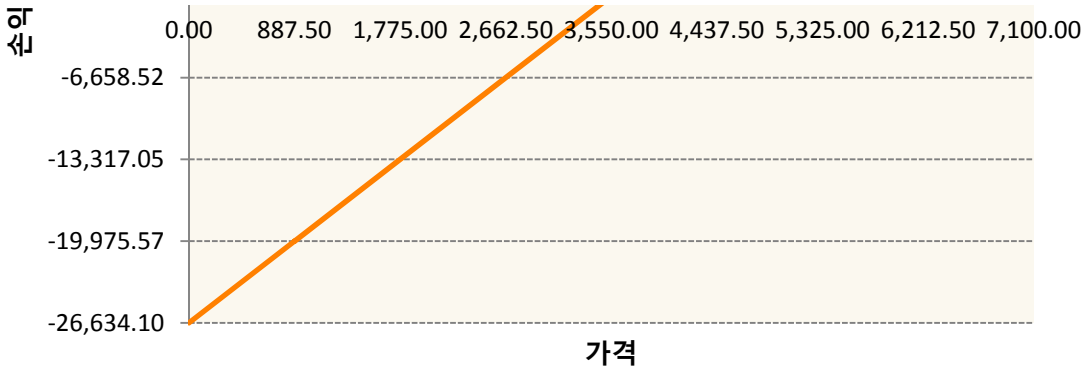


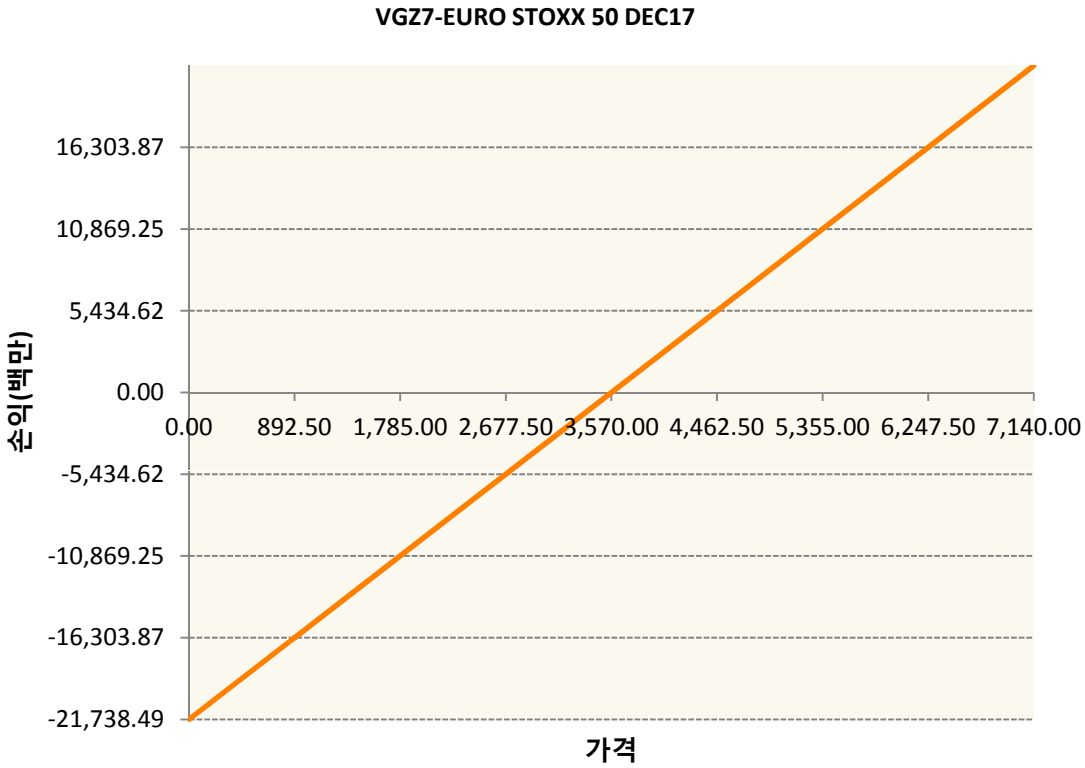
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



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	20
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	240
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,131
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	240
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	2,131
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,739

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

3,725

공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

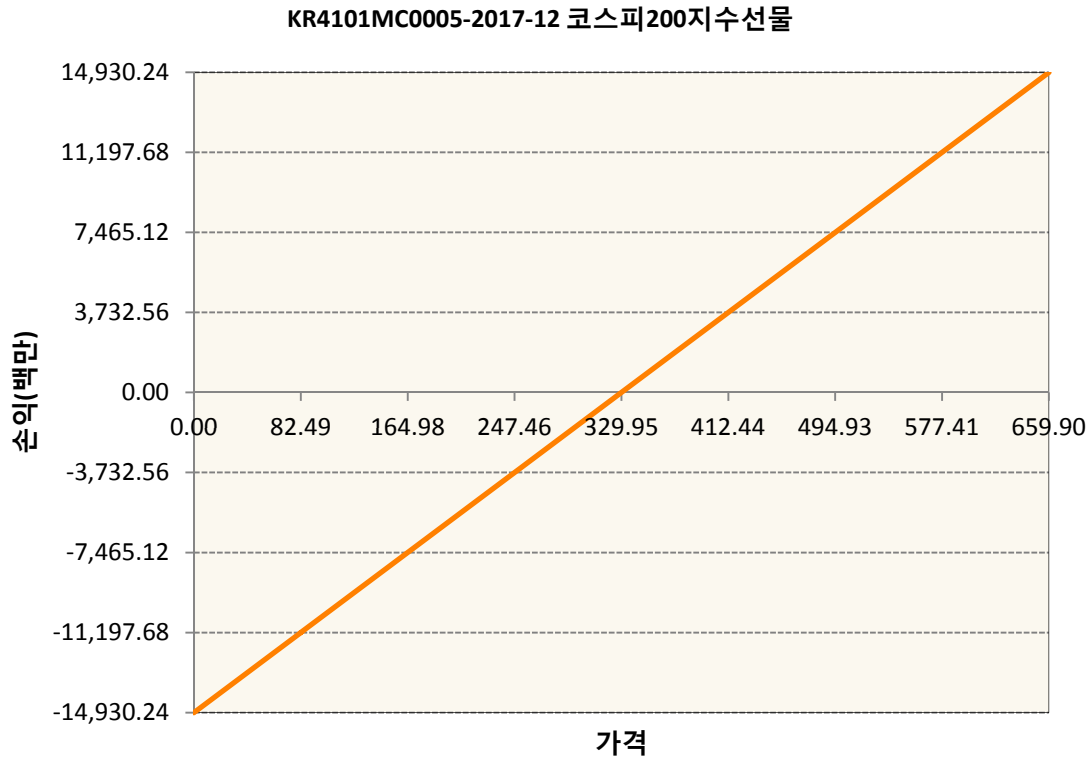
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,930	0	14,930	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,193
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193	-1,193
-5.33%	-795	-795	-795	-795	-795	-795	-795
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	398	398	398	398	398	398	398
5.33%	795	795	795	795	795	795	795
8.00%	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193	1,193

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

699

공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

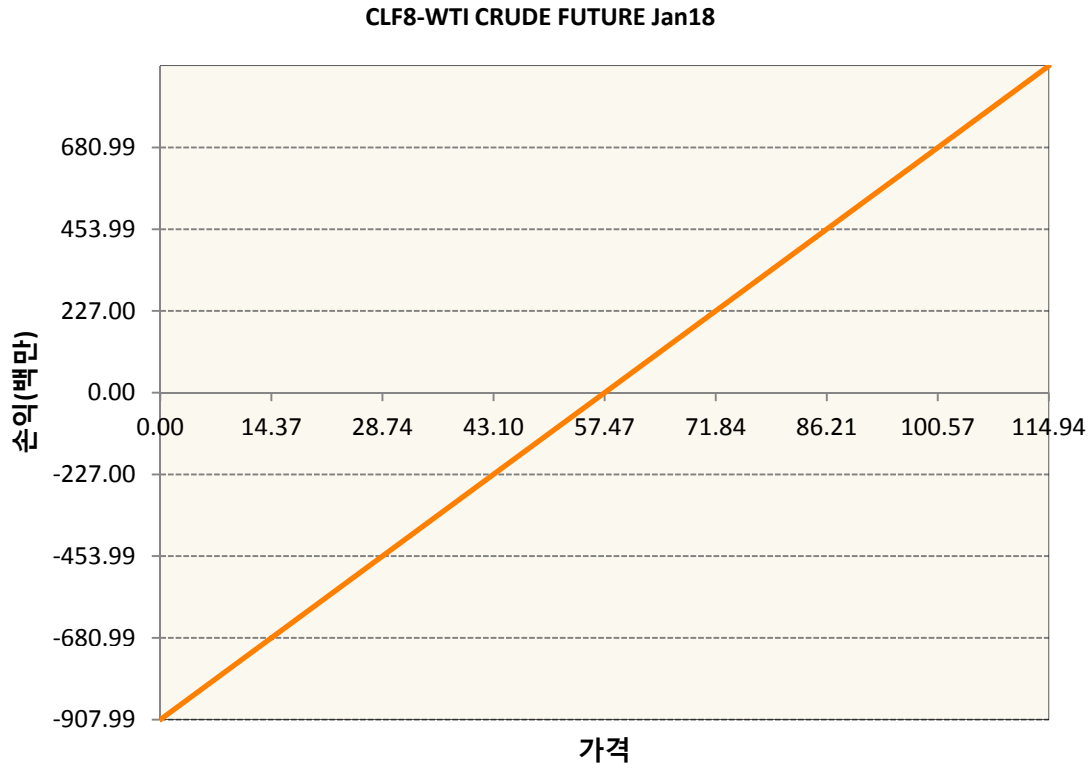
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

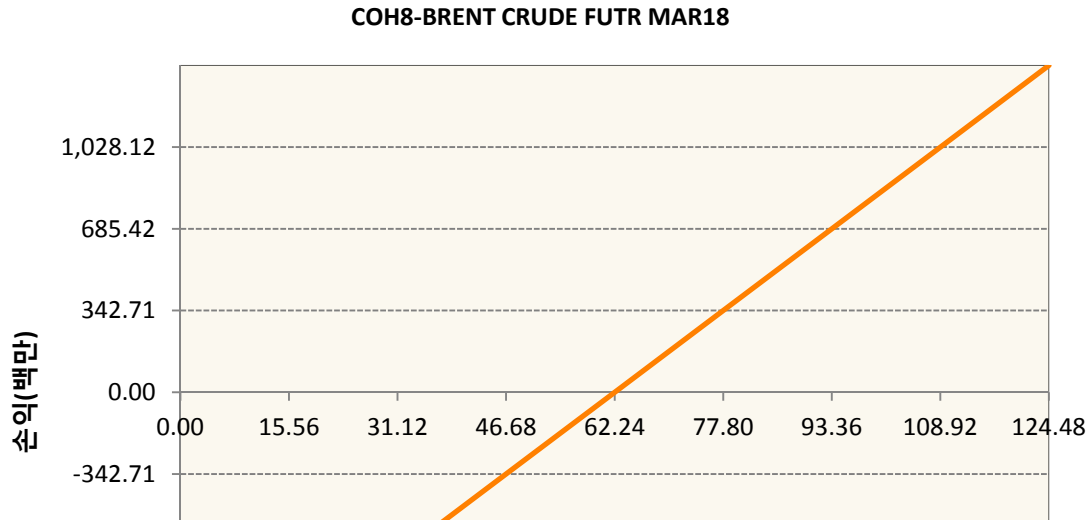
1. 계약금액

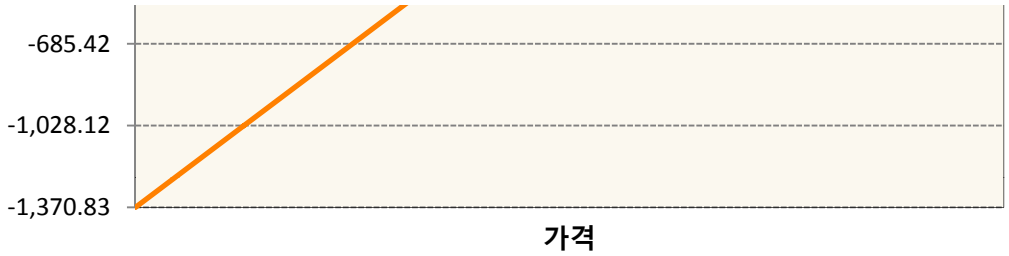
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,942	868	4,074	

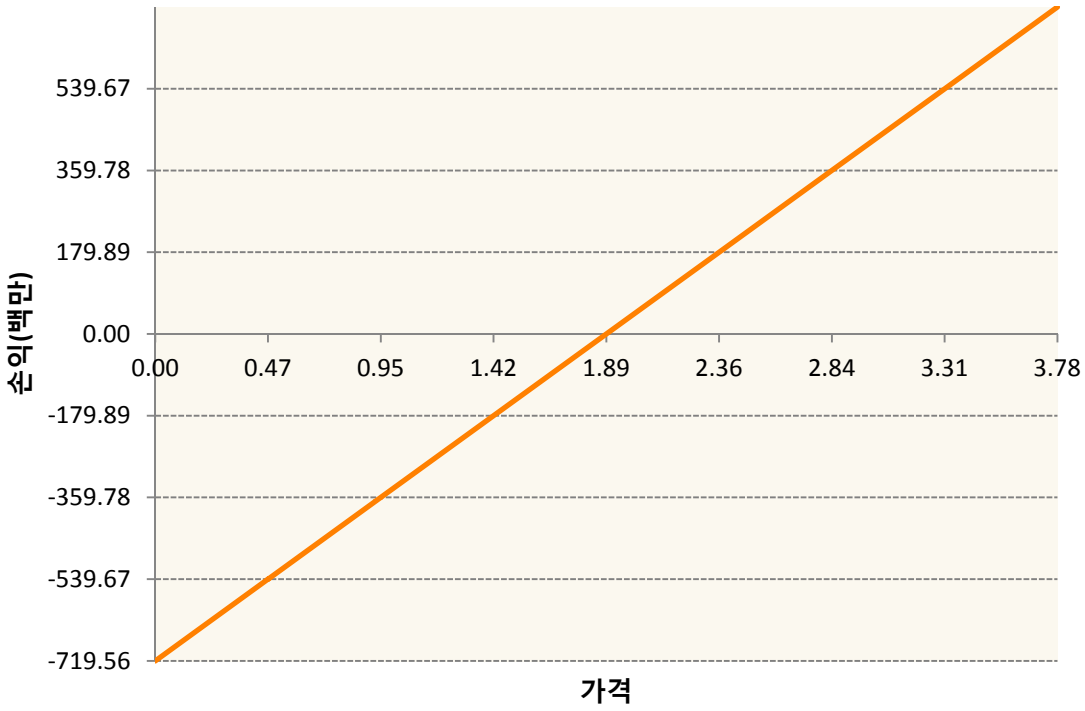
2. 만기시점의 손익구조



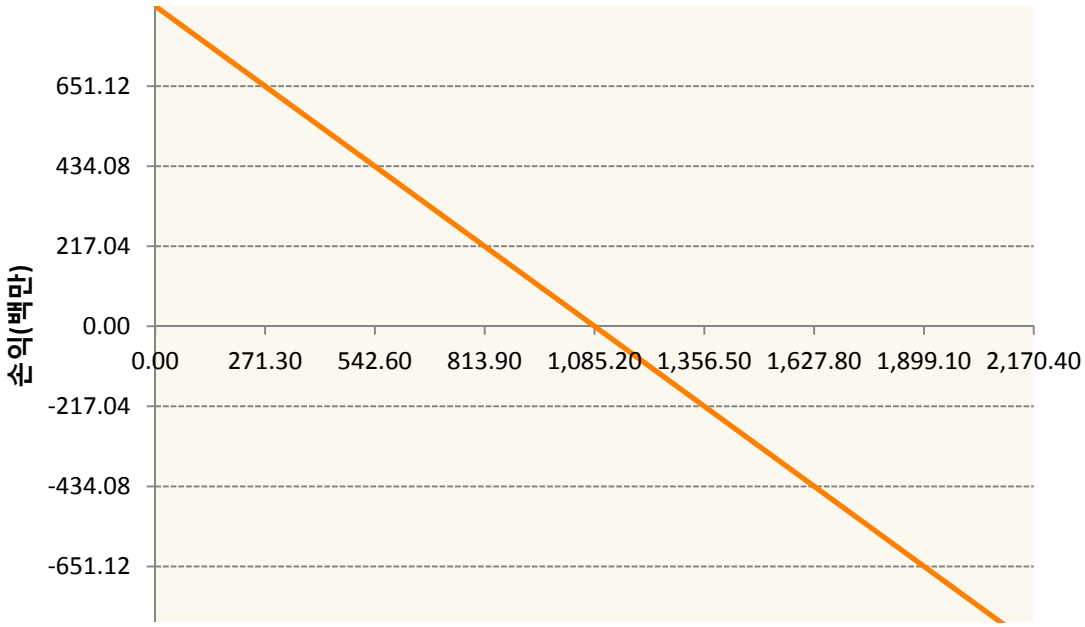


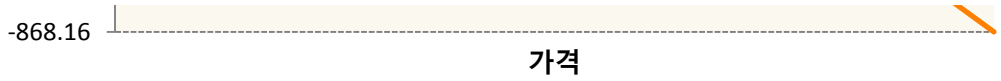


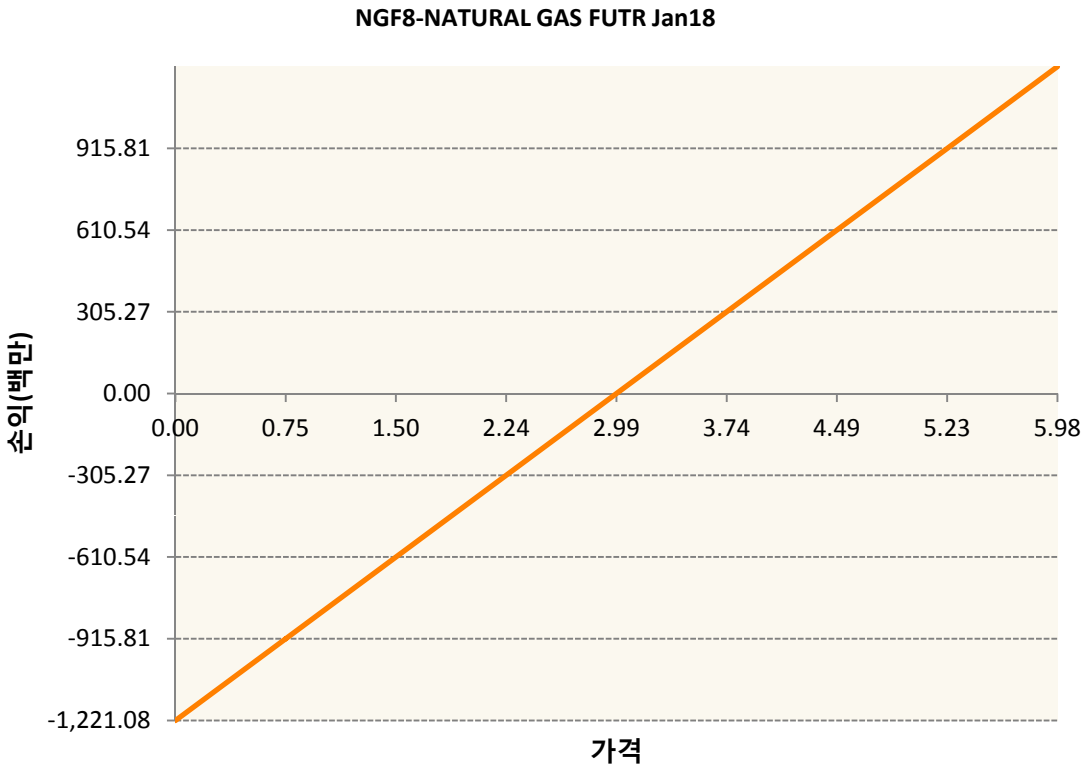
HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18

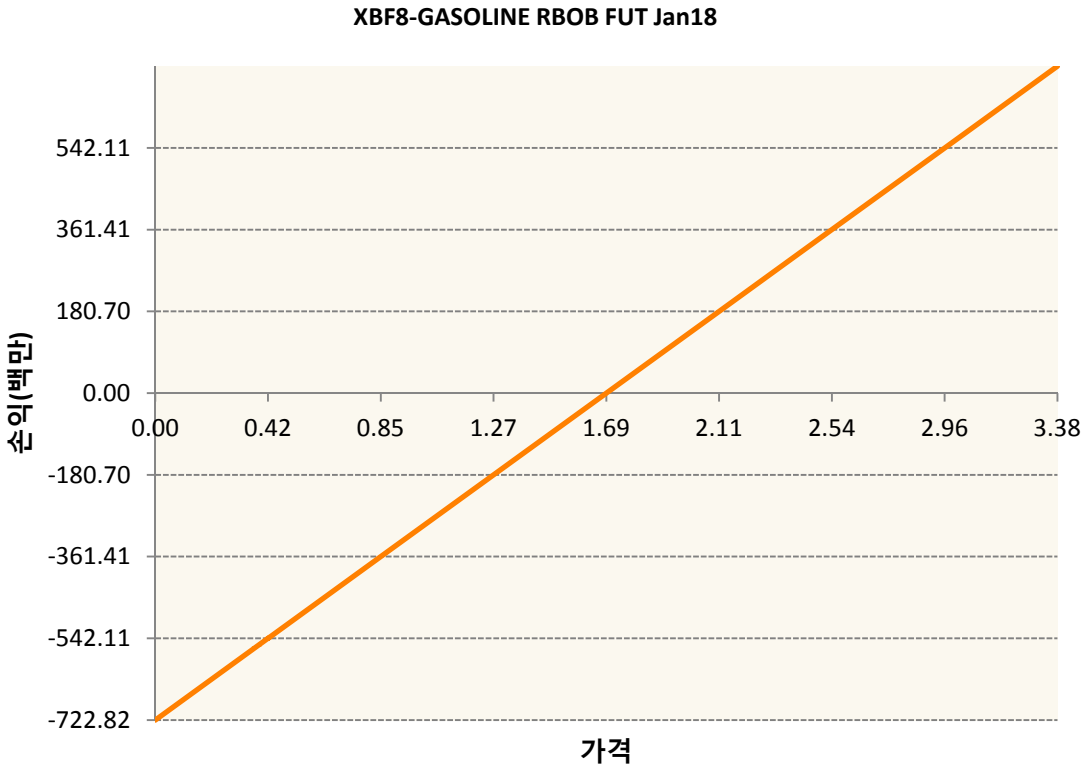


KR4175MC0006-2017-12 달러선물




-868.16
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
915.81
610.54
305.27
0.00
-305.27
-610.54
-915.81
-1,221.08
손익(백만)
0.00
0.75
1.50
2.24
2.99
3.74
4.49
5.23
5.98
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
542.11
361.41
180.70
0.00
-180.70
-361.41
-542.11
-722.82
손익(백만)
0.00
0.42
0.85
1.27
1.69
2.11
2.54
2.96
3.38
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	73
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	110
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	58
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	69
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	98
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	58

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

680

공시일	2017-12-06
기준일	2017-12-05

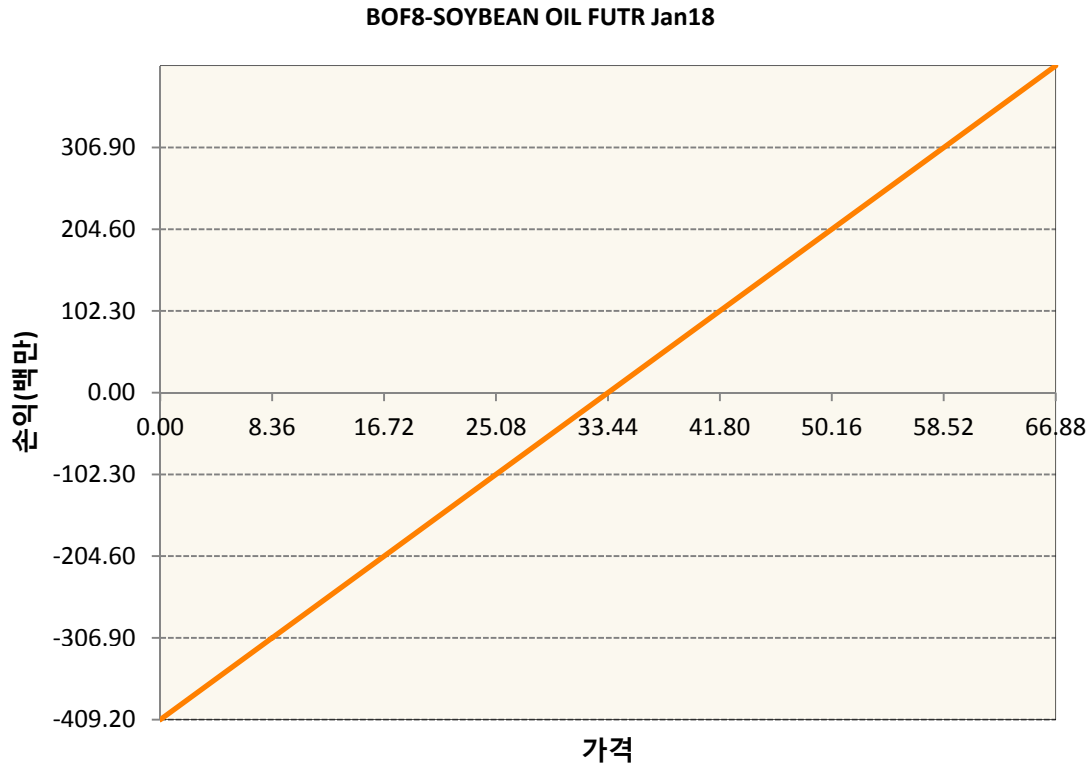
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

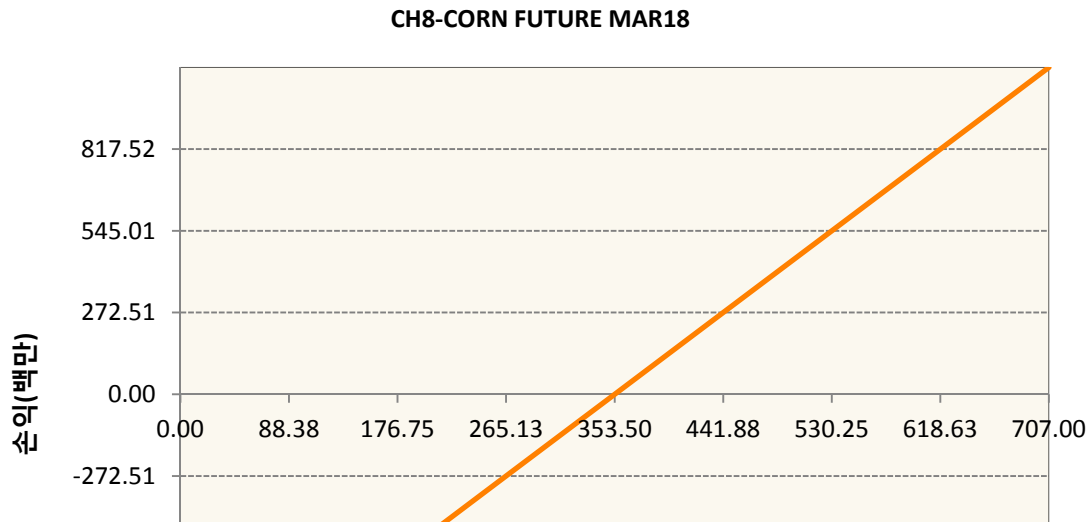
1. 계약금액

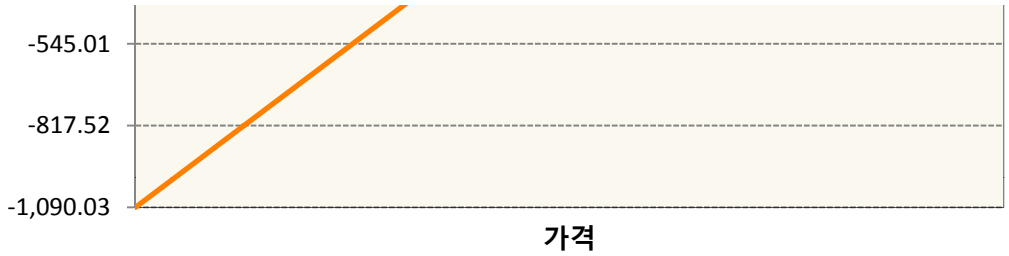
(단위:백만원)

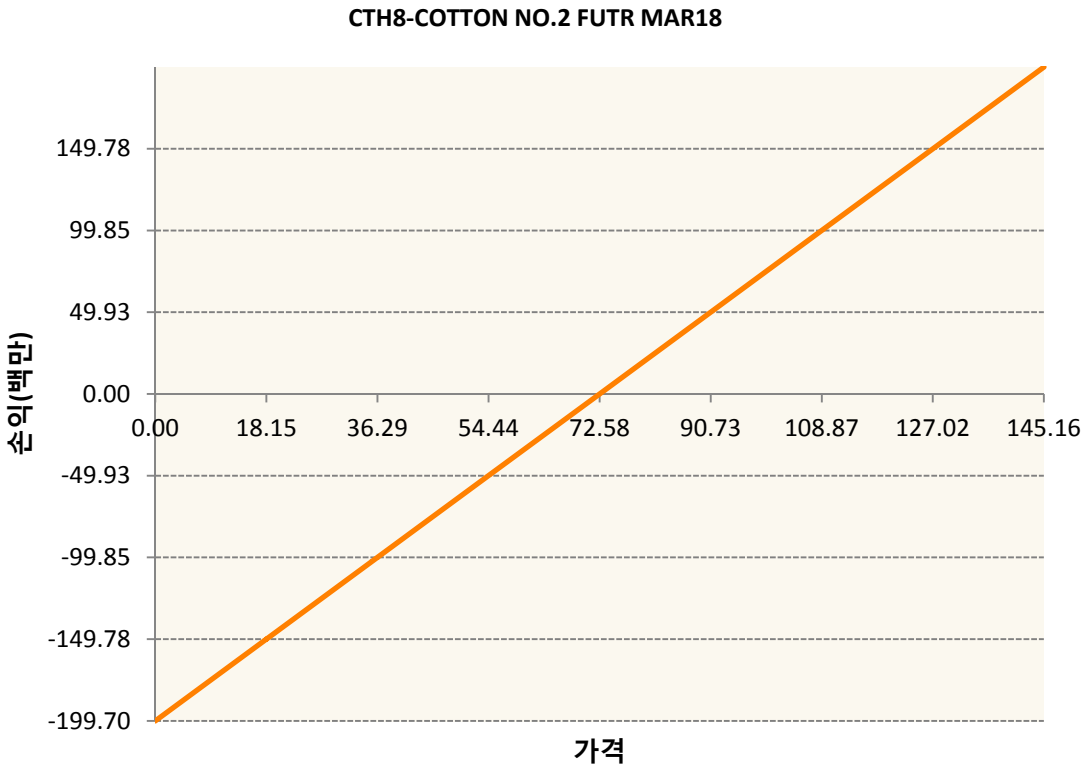
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,469	326	4,143	

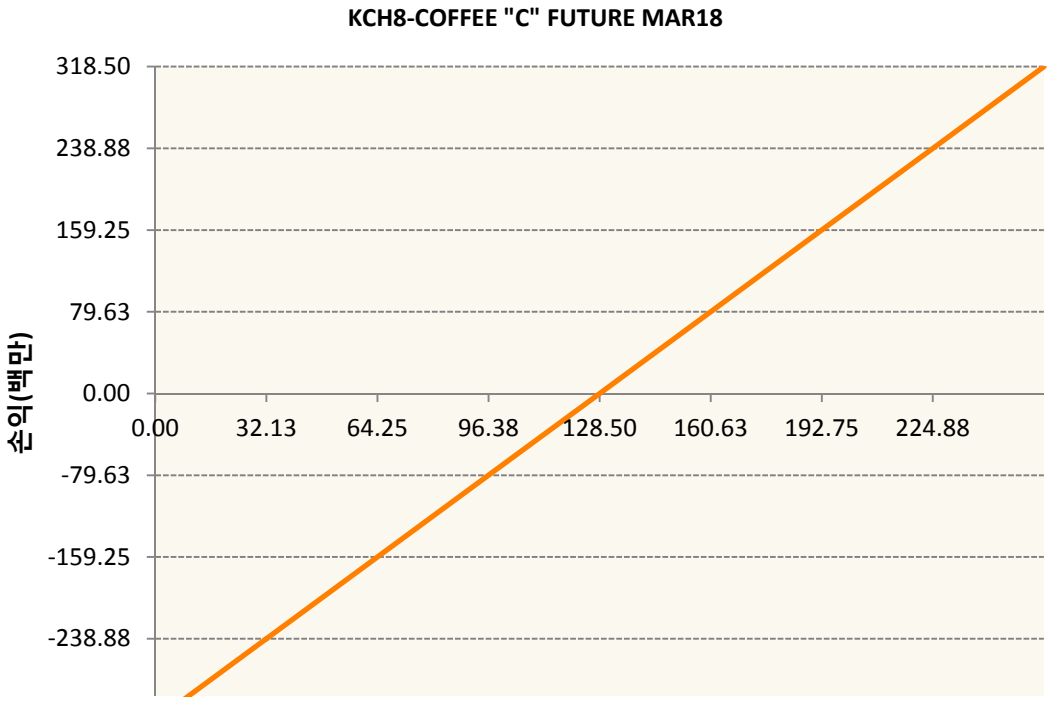
2. 만기시점의 손익구조

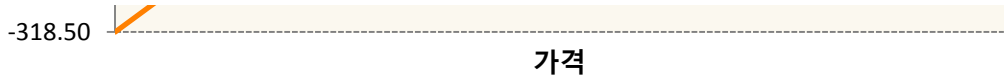


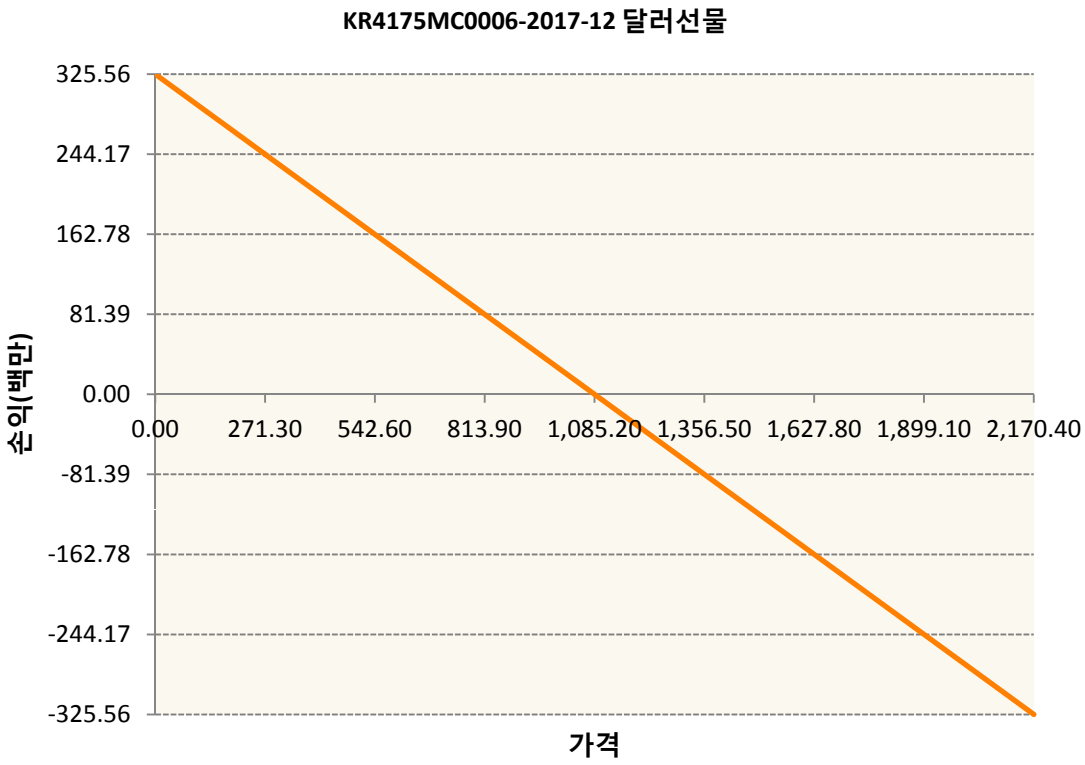


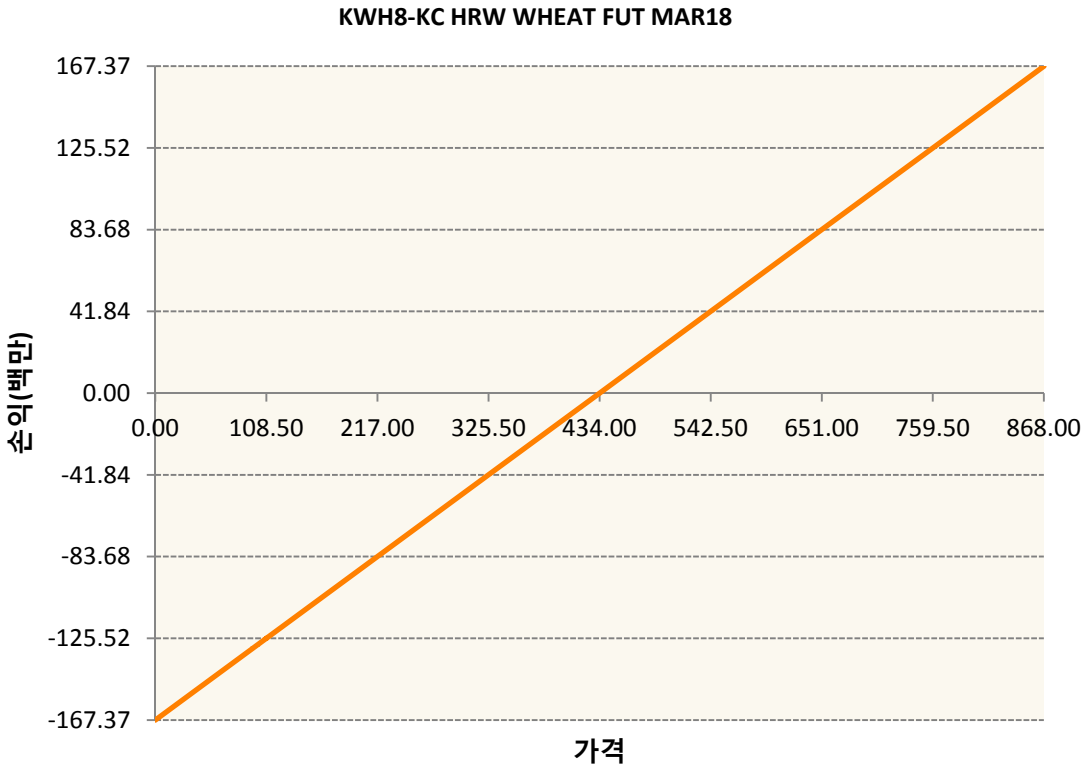

-545.01
-817.52
-1,090.03
가격

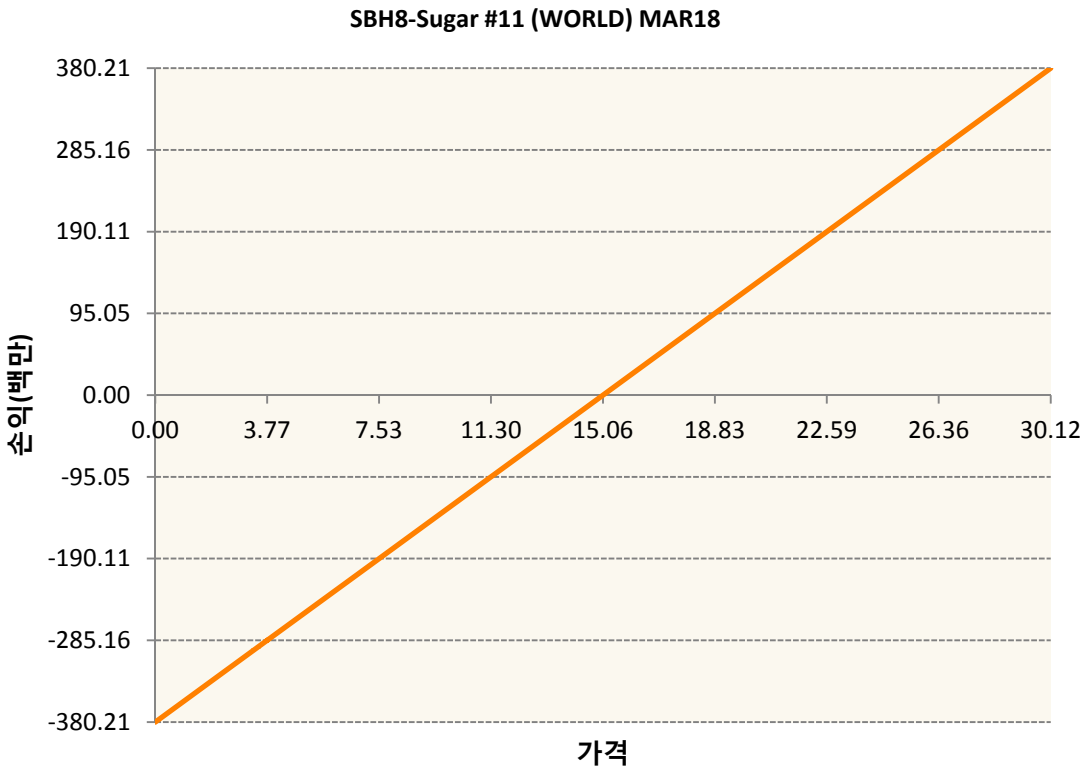

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
149.78
99.85
49.93
0.00
-49.93
-99.85
-149.78
-199.70
0.00
18.15
36.29
54.44
72.58
90.73
108.87
127.02
145.16
손익(백만)
가격

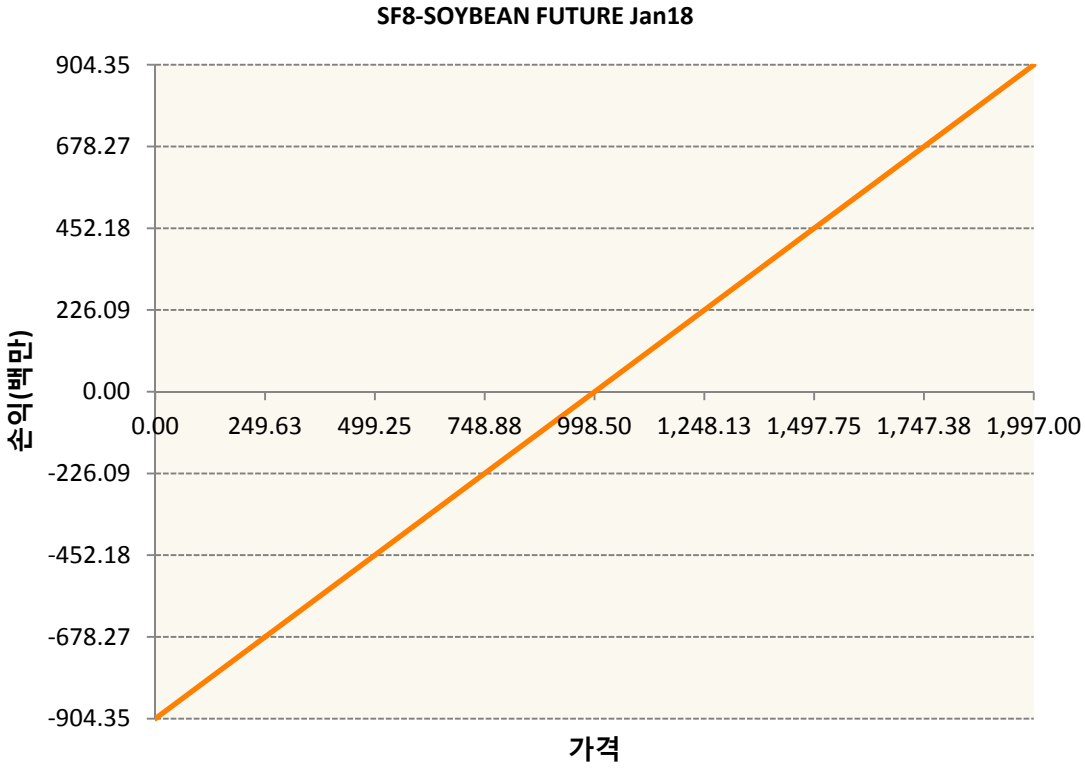

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
318.50
238.88
159.25
79.63
0.00
-79.63
-159.25
-238.88
0.00
32.13
64.25
96.38
128.50
160.63
192.75
224.88
손익(백만)


-318.50
가격

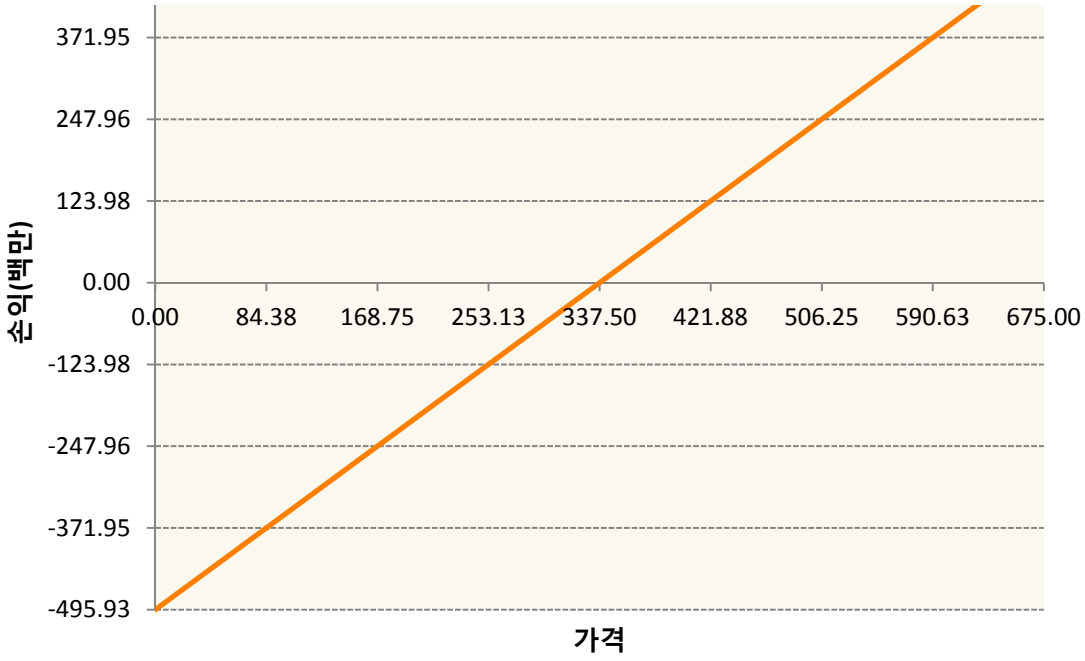

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
325.56
244.17
162.78
81.39
0.00
-81.39
-162.78
-244.17
-325.56
0.00
271.30
542.60
813.90
1,085.20
1,356.50
1,627.80
1,899.10
2,170.40
손익(백만)
가격

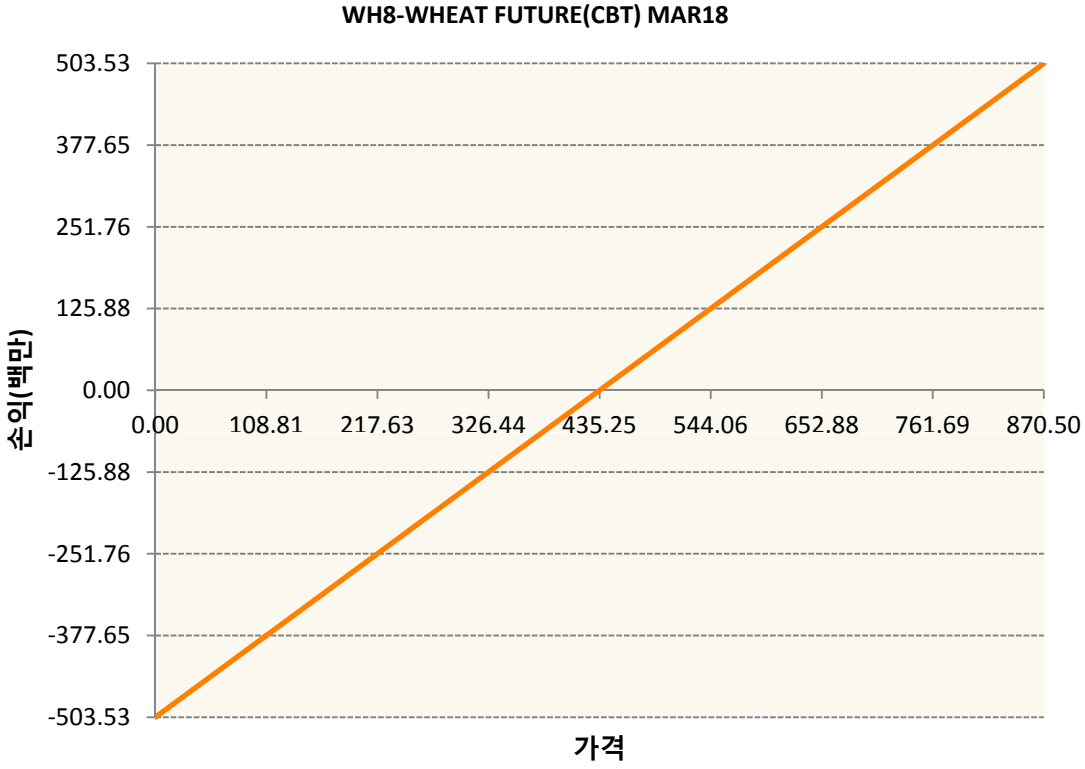

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
167.37
125.52
83.68
41.84
0.00
-41.84
-83.68
-125.52
-167.37
0.00
108.50
217.00
325.50
434.00
542.50
651.00
759.50
868.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
380.21
285.16
190.11
95.05
0.00
-95.05
-190.11
-285.16
-380.21
0.00
3.77
7.53
11.30
15.06
18.83
22.59
26.36
30.12
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
904.35
678.27
452.18
226.09
0.00
-226.09
-452.18
-678.27
-904.35
0.00
249.63
499.25
748.88
998.50
1,248.13
1,497.75
1,747.38
1,997.00
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
495.93





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	33
CH8	CORN FUTURE MAR18	87
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	16
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	25
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	30
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	72
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	40
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	40

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

387