공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

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	2017-12-07
기준일	2017-12-06

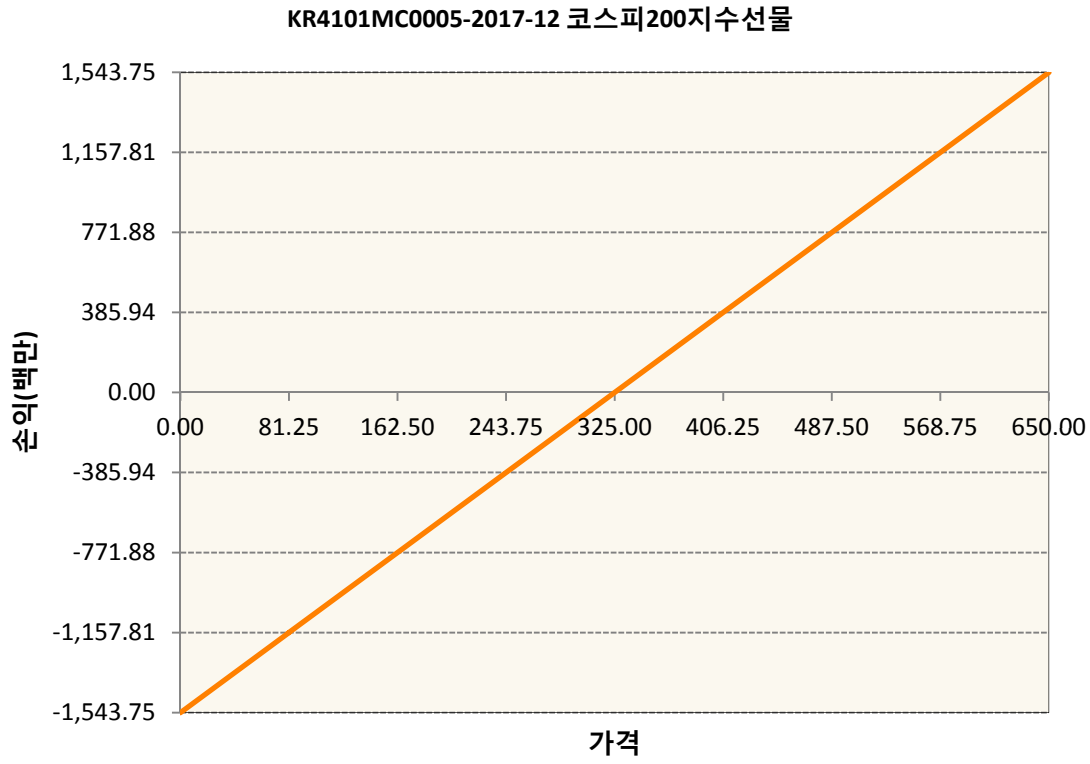
스마트인덱스모

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	1,544	0	1,544	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)

73

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

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	1,079

* 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	2017-12-07
기준일	2017-12-06

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	395

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

367

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

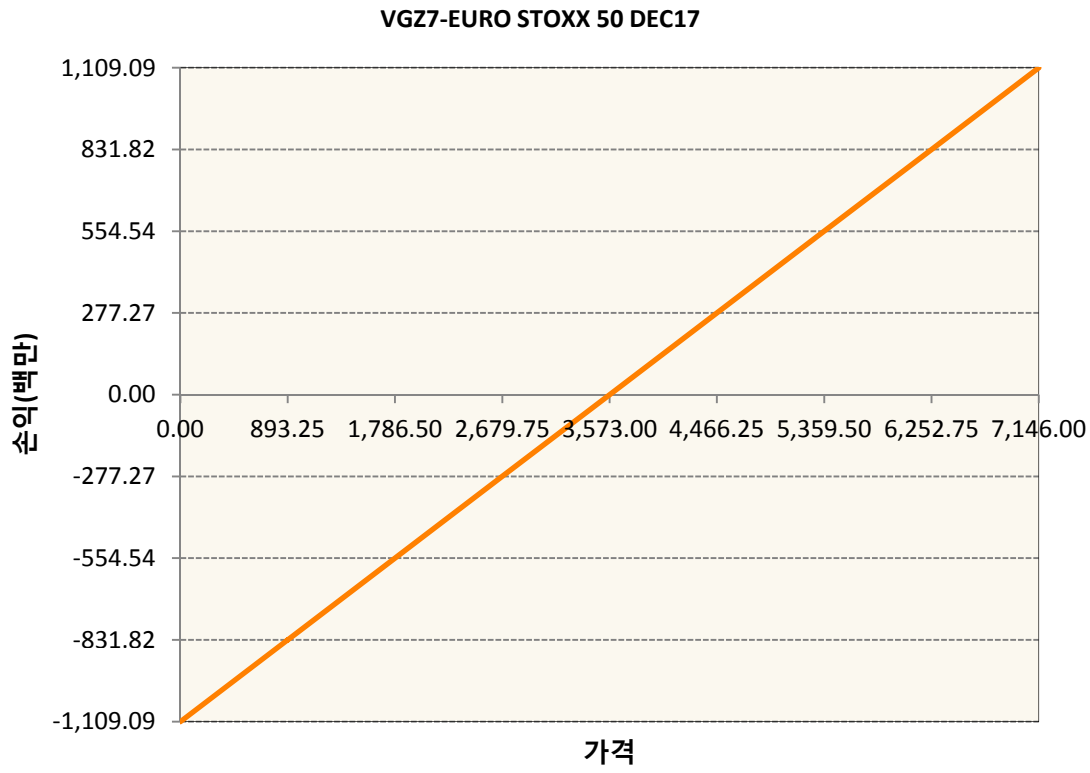
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

50

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

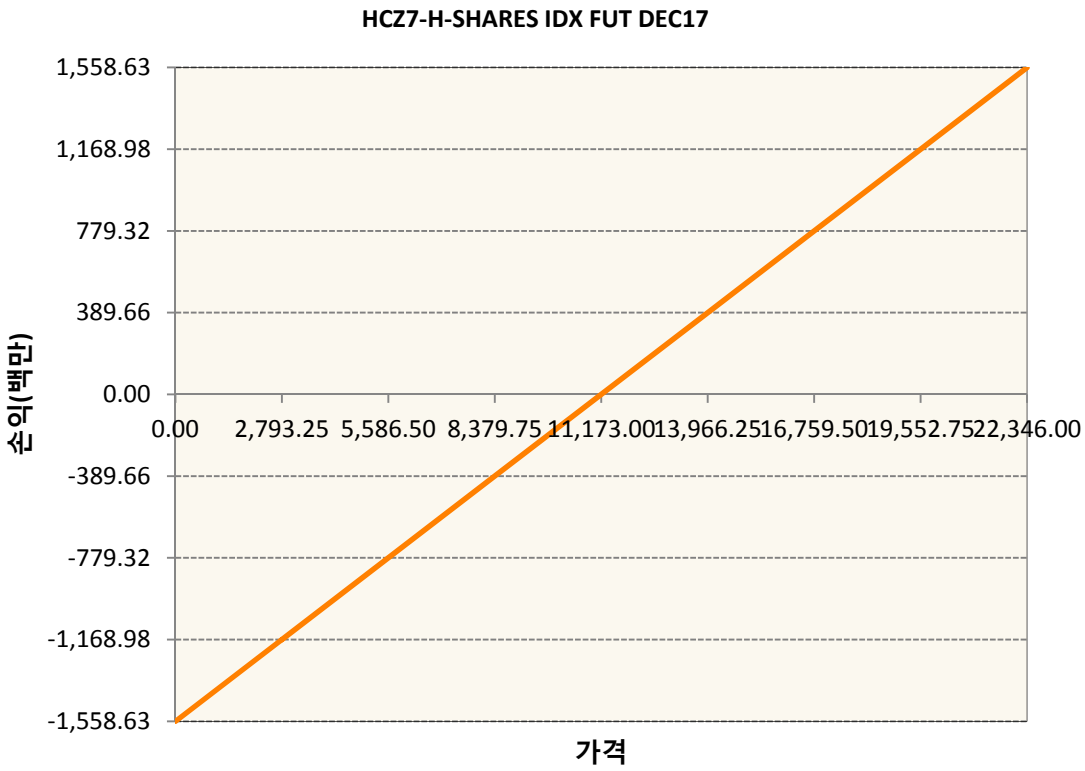
차이나인덱스모(주식-파생형)

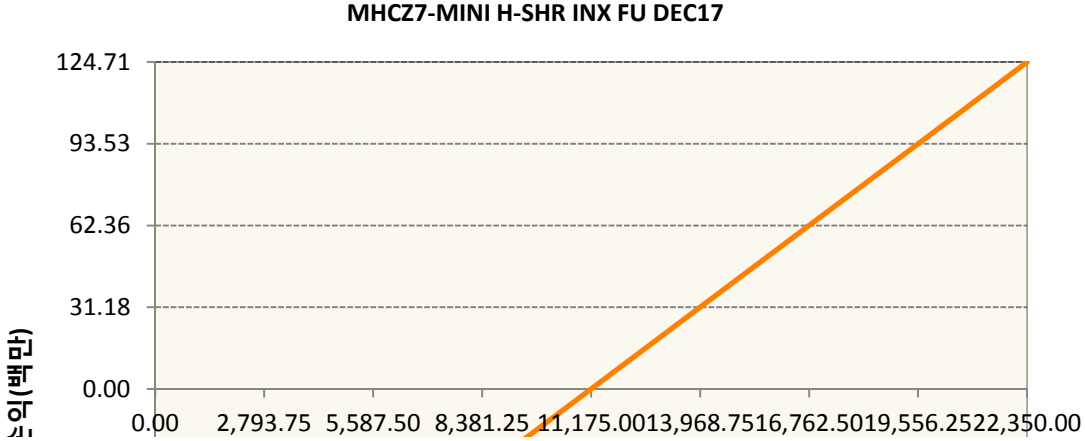
1. 계약금액

(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	1,559	0	1,559	
누계	유가증권	선물	125	0	125	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	125
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	87

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

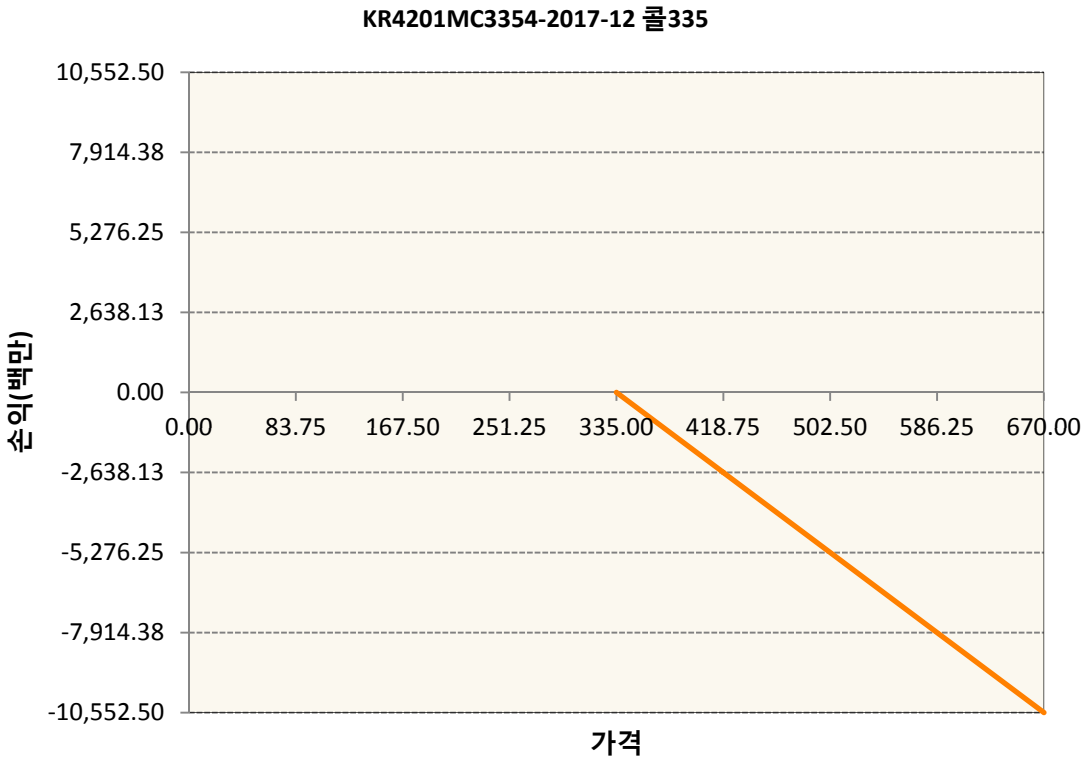
커버드콜모(주식혼합-파생형)

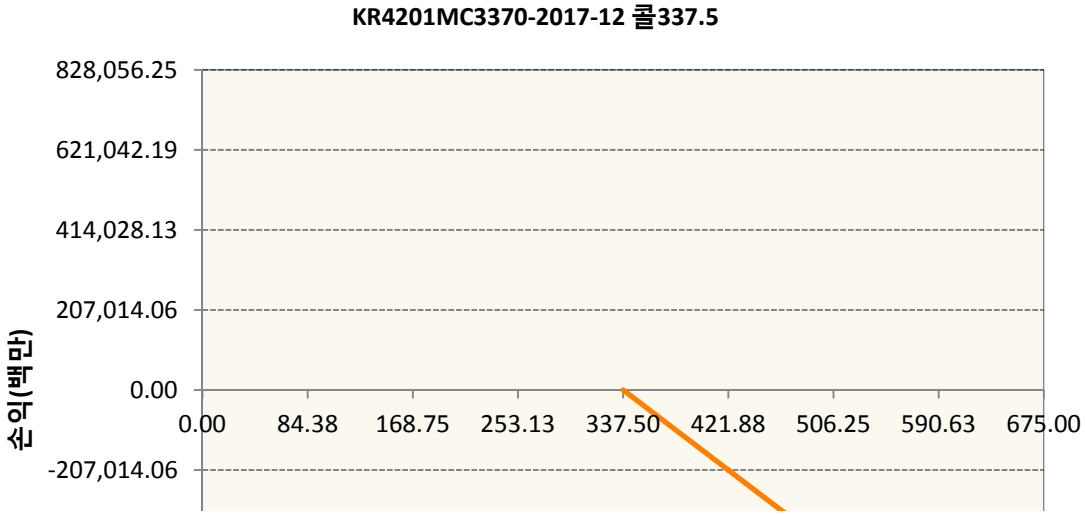
1. 계약금액

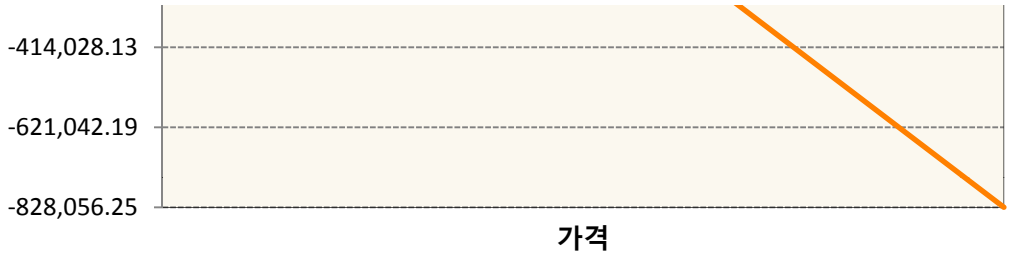
(단위:백만원)

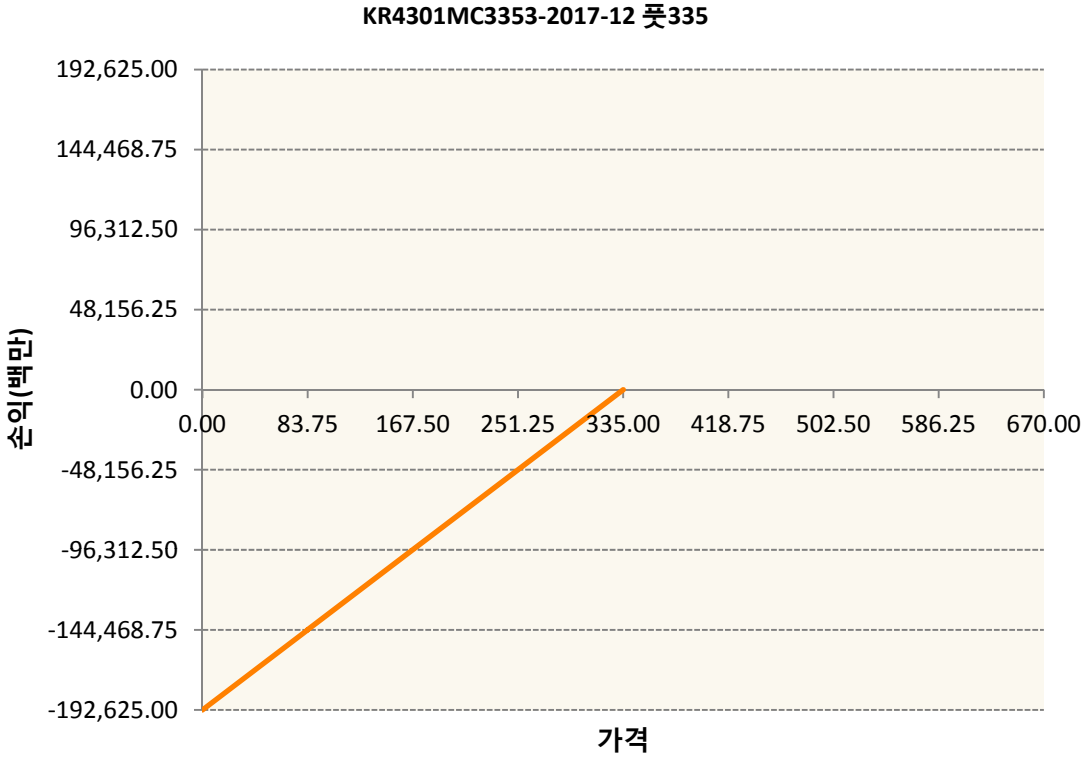
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,453,109	-1,453,109	장내

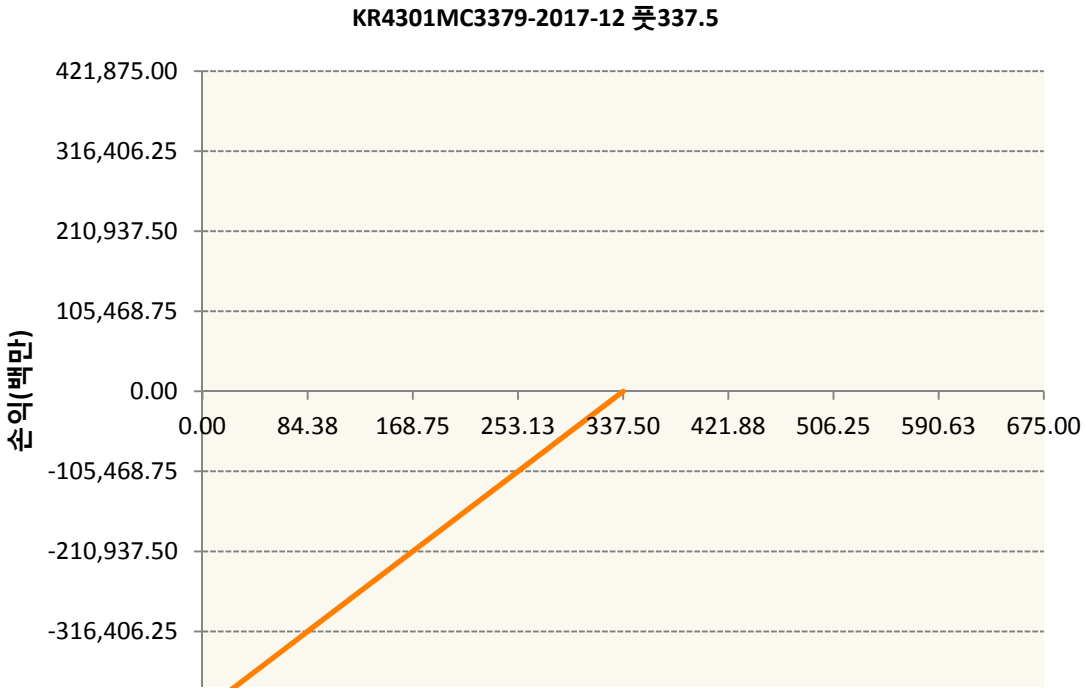
2. 만기시점의 손익구조






-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							490
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	43	43	43	42	42	42
-5.33%	43	42	42	41	40	39	37
-2.67%	41	39	37	33	29	24	19
0%	24	17	9	0	-9	-19	-29
2.67%	-49	-62	-74	-87	-100	-113	-126
5.33%	-214	-225	-236	-247	-258	-270	-282
8.00%	-453	-457	-462	-468	-475	-482	-490
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							34,255
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,299	2,298	2,297	2,295	2,288	2,274	2,250
-5.33%	2,296	2,290	2,274	2,243	2,190	2,109	1,997
-2.67%	2,231	2,149	2,022	1,842	1,609	1,322	983
0%	1,462	1,044	553	0	-606	-1,258	-1,949
2.67%	-2,562	-3,490	-4,435	-5,391	-6,357	-7,331	-8,311
5.33%	-13,309	-14,249	-15,205	-16,174	-17,152	-18,138	-19,130
8.00%	-30,579	-31,040	-31,574	-32,171	-32,822	-33,519	-34,255
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,826
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,826	-14,826	-14,826	-14,826	-14,826	-14,826	-14,826
-5.33%	-9,851	-9,851	-9,851	-9,851	-9,851	-9,851	-9,852
-2.67%	-4,877	-4,877	-4,877	-4,879	-4,882	-4,886	-4,893
0%	78	60	34	0	-42	-90	-146
2.67%	4,350	4,228	4,104	3,980	3,854	3,728	3,602
5.33%	5,978	5,919	5,851	5,775	5,692	5,604	5,510
8.00%	6,103	6,100	6,095	6,086	6,073	6,054	6,030
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							32,356
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,356	-32,356	-32,356	-32,356	-32,356	-32,356	-32,356
-5.33%	-21,542	-21,542	-21,542	-21,542	-21,542	-21,542	-21,542
-2.67%	-10,728	-10,728	-10,728	-10,729	-10,731	-10,735	-10,743
0%	76	62	37	0	-50	-114	-193
2.67%	10,188	9,983	9,765	9,538	9,303	9,061	8,815

5.33%	15,549	15,341	15,120	14,890	14,652	14,408	14,158
8.00%	16,254	16,236	16,206	16,162	16,103	16,030	15,942

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

80,550

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

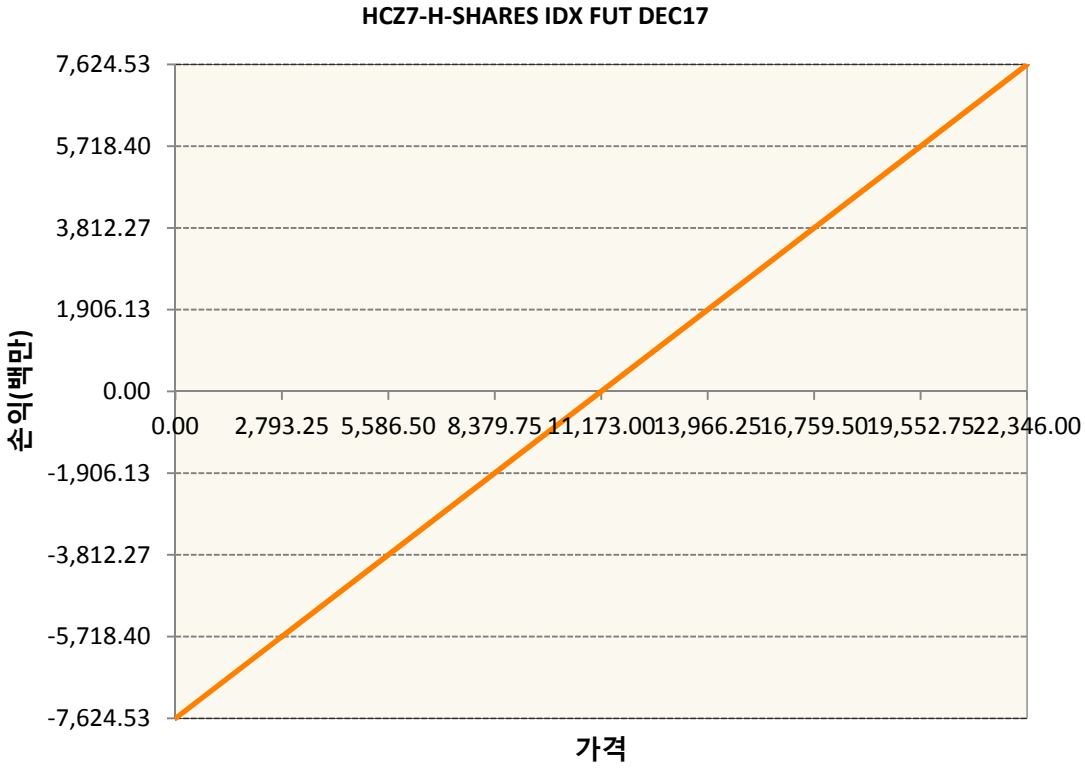
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

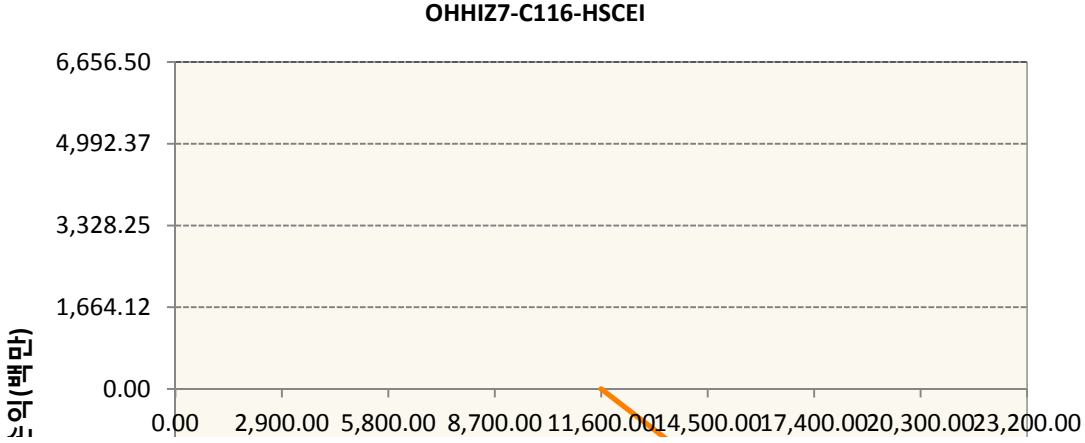
1. 계약금액

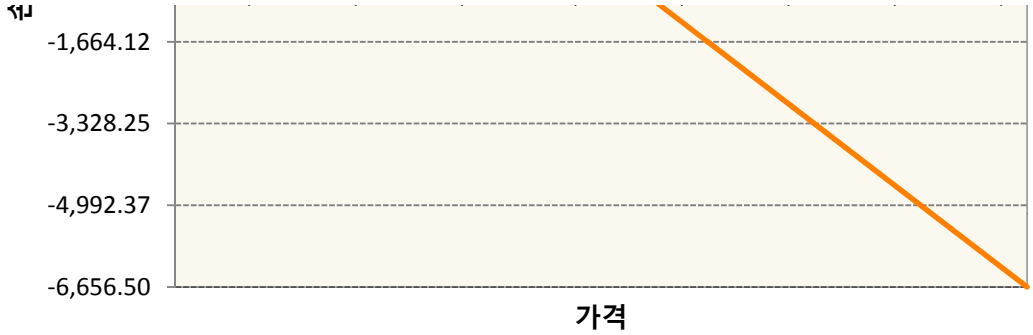
(단위:백만원)

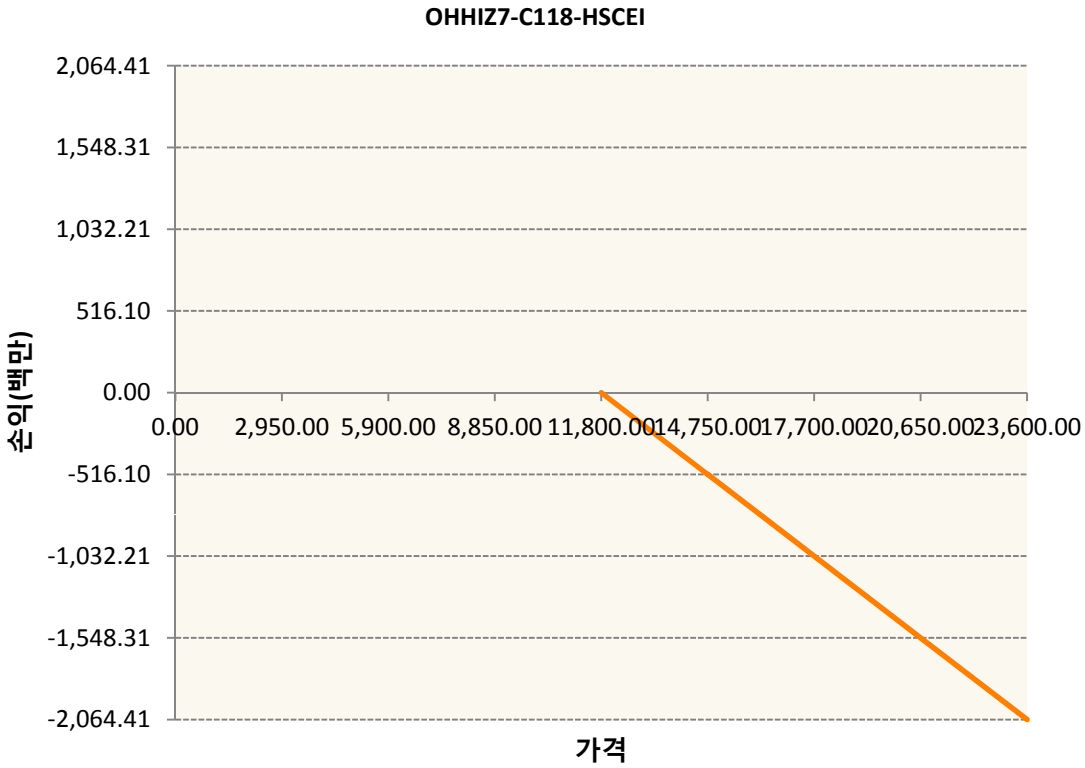
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,625	0	7,625	
누계	유가증권	옵션	0	17,442	-17,442	장내

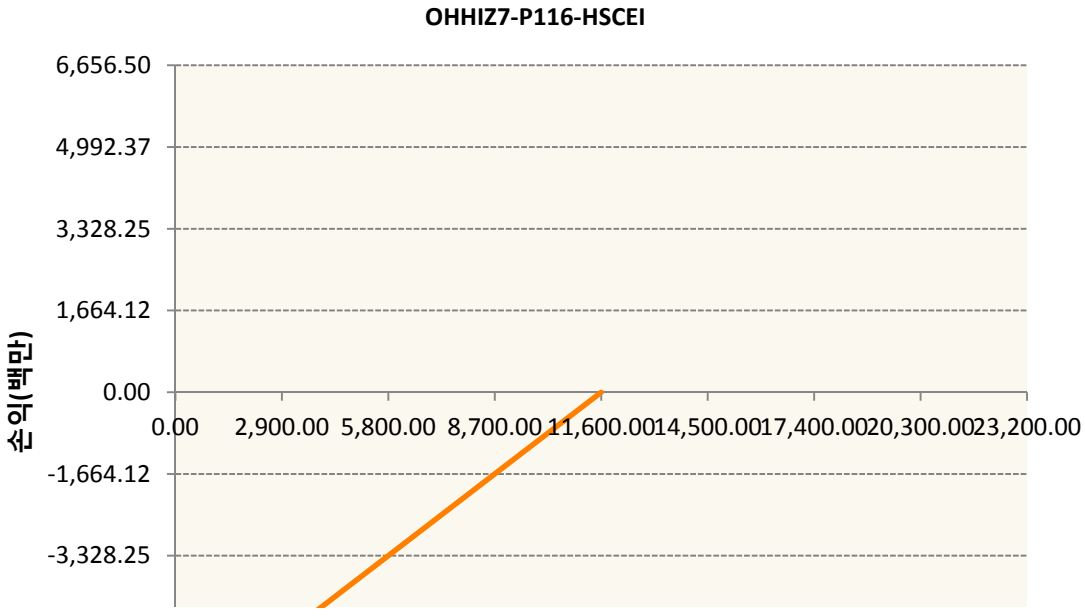
2. 만기시점의 손익구조

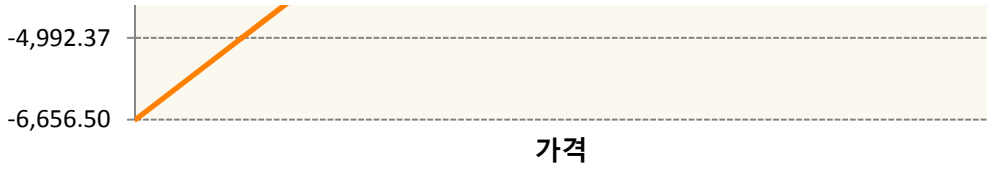


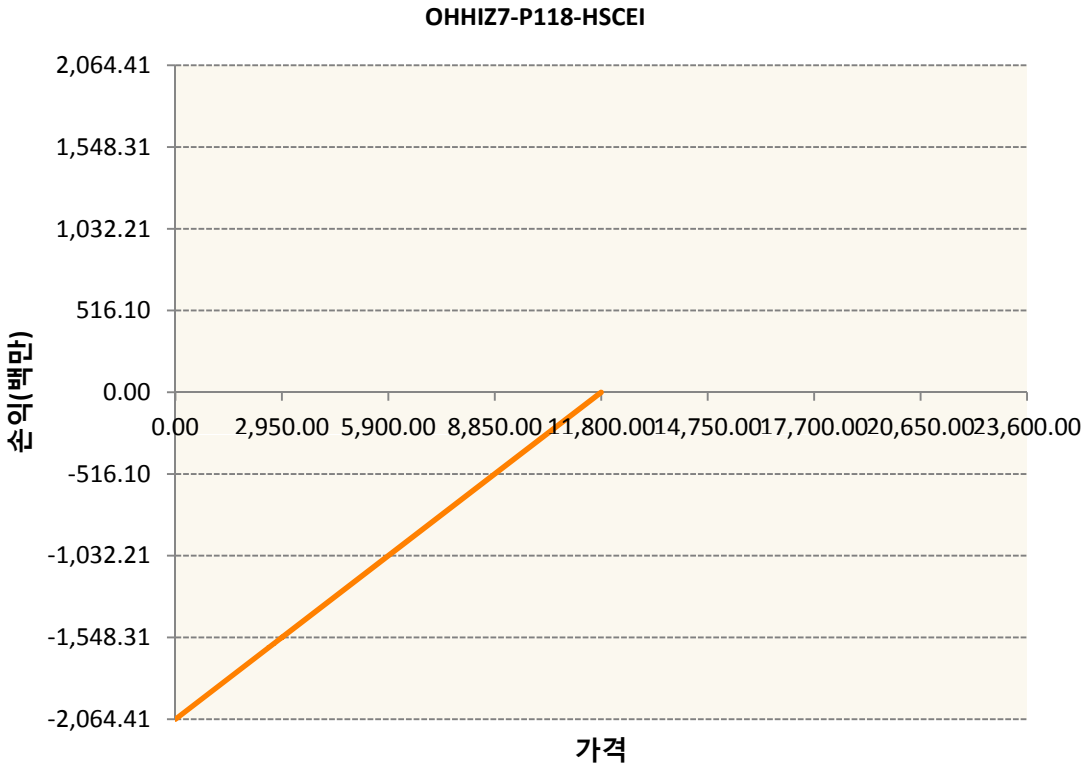



-1,664.12
-3,328.25
-4,992.37
-6,656.50
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,064.41
1,548.31
1,032.21
516.10
0.00
-516.10
-1,032.21
-1,548.31
-2,064.41
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
6,656.50
4,992.37
3,328.25
1,664.12
0.00
-1,664.12
-3,328.25
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	610
OHHIZ7-C11	HSCEI	532
OHHIZ7-C11	HSCEI	165
OHHIZ7-P11	HSCEI	532
OHHIZ7-P11	HSCEI	165

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,489

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

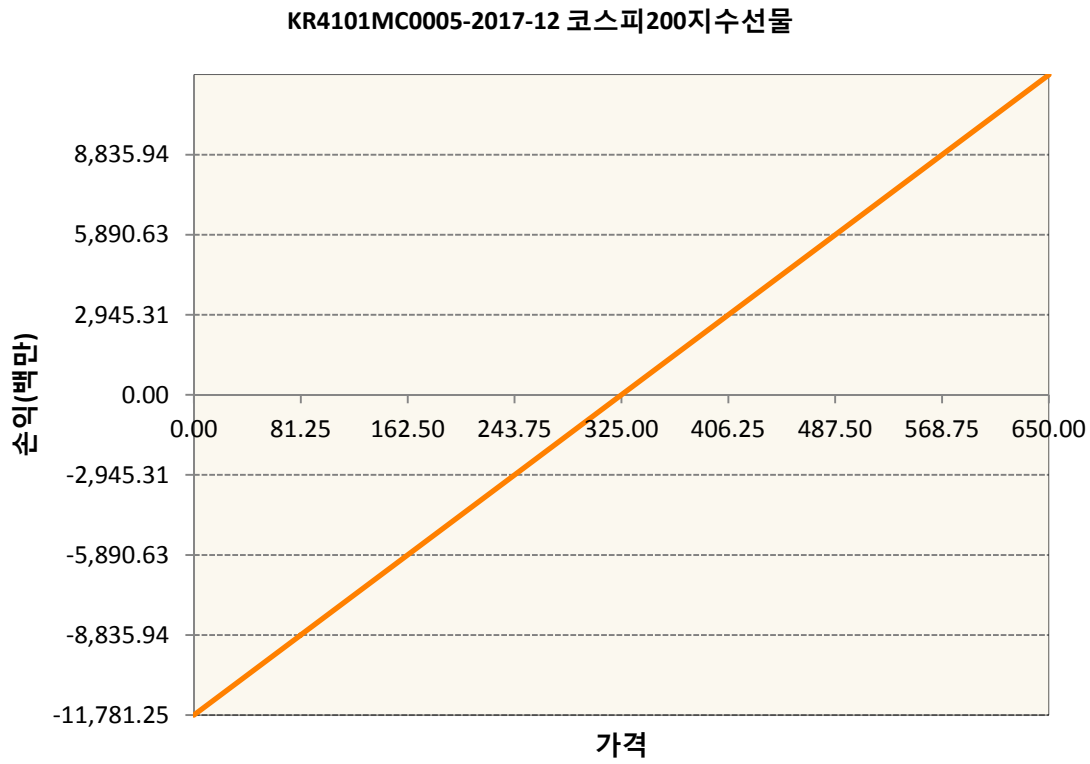
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

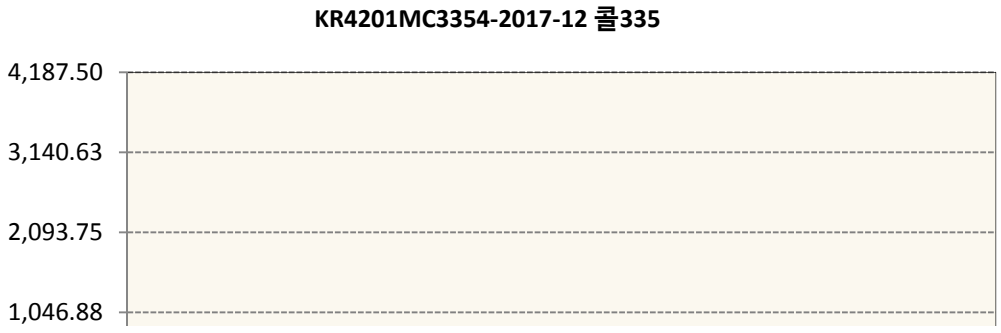
1. 계약금액

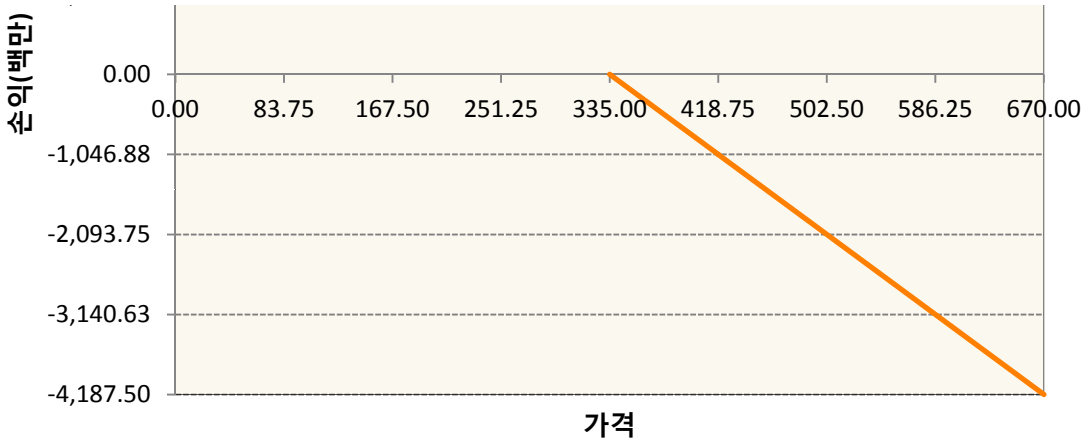
(단위:백만원)

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	11,781	0	11,781	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

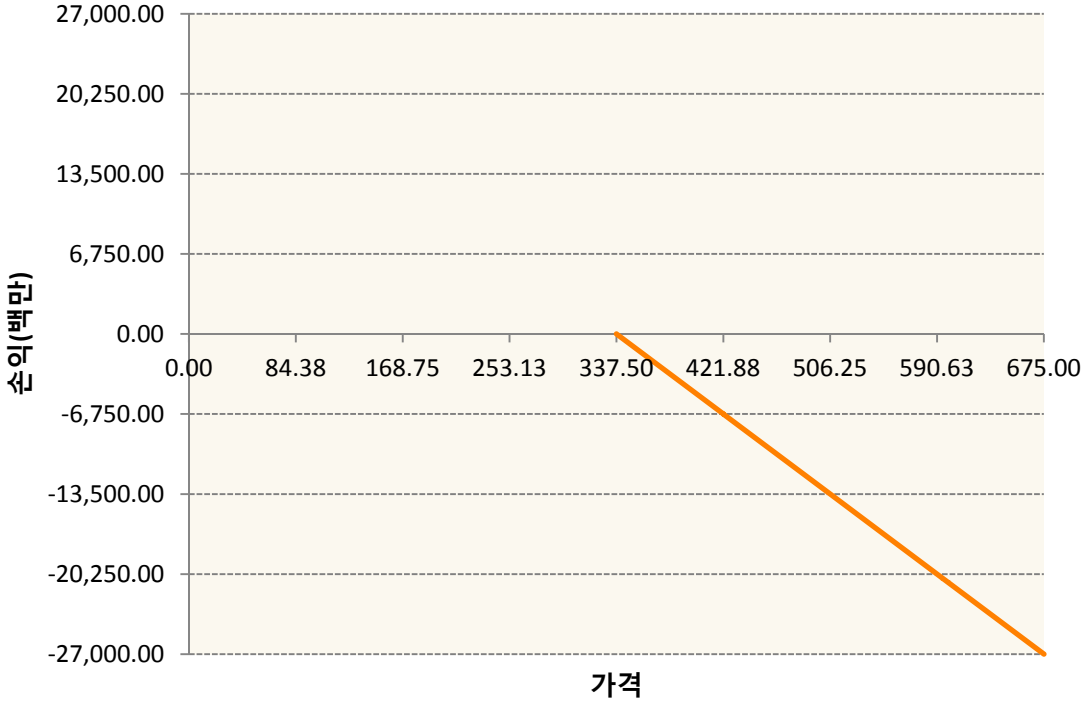
2. 만기시점의 손익구조



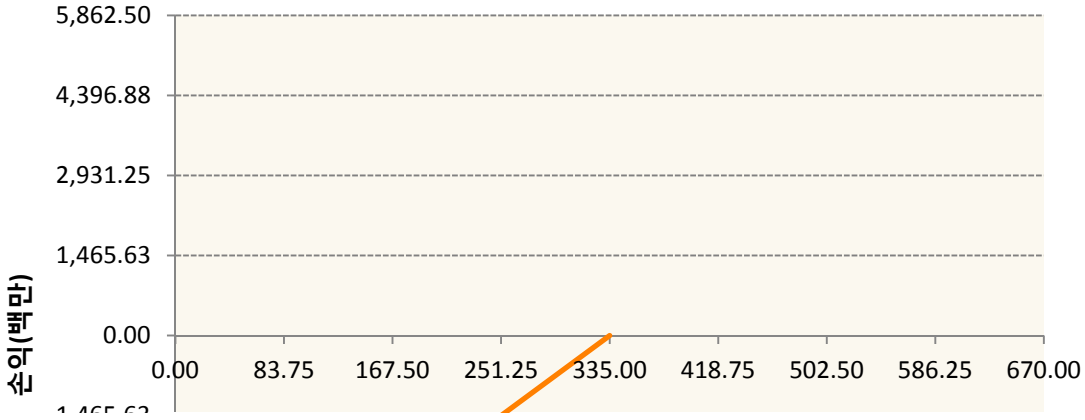




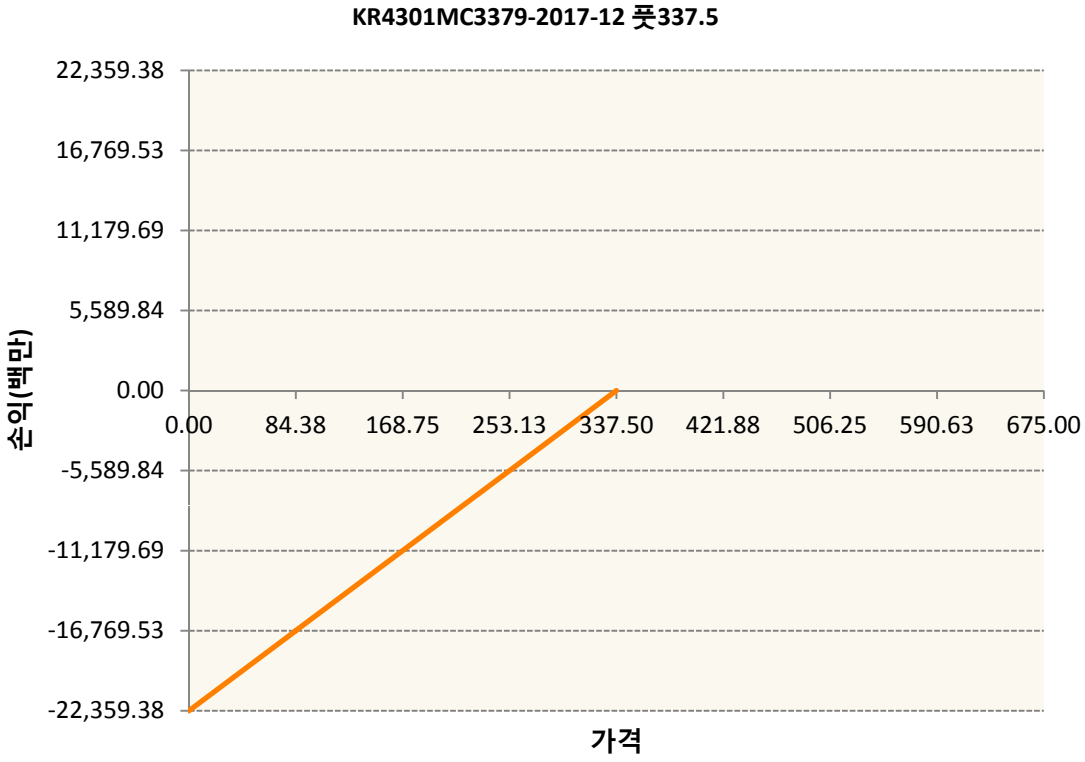
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



KR4301MC3353-2017-12 풋335







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471
-5.33%	-981	-981	-981	-981	-981	-981	-981
-2.67%	-490	-490	-490	-490	-490	-490	-490
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	490	490	490	490	490	490	490
5.33%	981	981	981	981	981	981	981
8.00%	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							278
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	278	278	278	278	278	278	278
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						159
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-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%	159	159	159	159	159	159	159
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						239
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	239	239	239	239	239	239	239
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						199
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199
-5.33%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-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%	133	133	133	133	133	133	133
8.00%	199	199	199	199	199	199	199
	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%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-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%	170	170	170	170	170	170	170
8.00%	254	254	254	254	254	254	254
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						471
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-5.33%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	471	471	471	471	471	471	471
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						314
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-5.33%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-2.67%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	105	105	105	105	105	105	105
5.33%	209	209	209	209	209	209	209
8.00%	314	314	314	314	314	314	314
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						278
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	278	278	278	278	278	278	278
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						636
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636
-5.33%	-424	-424	-424	-424	-424	-424	-424
-2.67%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	212	212	212	212	212	212	212
5.33%	424	424	424	424	424	424	424
8.00%	636	636	636	636	636	636	636
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						477

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-477	-477	-477	-477	-477	-477	-477
-5.33%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	159	159	159	159	159	159	159
5.33%	318	318	318	318	318	318	318
8.00%	477	477	477	477	477	477	477
	KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물					941

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-941	-941	-941	-941	-941	-941	-941
-5.33%	-627	-627	-627	-627	-627	-627	-627
-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%	627	627	627	627	627	627	627
8.00%	941	941	941	941	941	941	941
	KR4201MC3	2017-12 콜335					195

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	17	17	17	16	16	15	15
-2.67%	16	15	14	13	12	10	8
0%	10	7	3	0	-4	-8	-11
2.67%	-19	-24	-30	-35	-40	-45	-50
5.33%	-85	-89	-93	-98	-103	-107	-112
8.00%	-180	-181	-183	-186	-188	-191	-195
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,117

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	75	75	75	75	74	73
-5.33%	75	75	74	73	71	69	65
-2.67%	73	70	66	60	52	43	32
0%	48	34	18	0	-20	-41	-64
2.67%	-84	-114	-145	-176	-207	-239	-271
5.33%	-434	-465	-496	-527	-559	-591	-624
8.00%	-997	-1,012	-1,030	-1,049	-1,070	-1,093	-1,117
	KR4301MC3	2017-12 풋335					451

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-451	-451	-451	-451	-451	-451	-451
-5.33%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300

-2.67%	-148	-148	-148	-148	-149	-149	-149
0%	2	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	132	129	125	121	117	113	110
5.33%	182	180	178	176	173	171	168
8.00%	186	186	186	185	185	184	184
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,715
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,715	-1,715	-1,715	-1,715	-1,715	-1,715	-1,715
-5.33%	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142
-2.67%	-569	-569	-569	-569	-569	-569	-569
0%	4	3	2	0	-3	-6	-10
2.67%	540	529	518	506	493	480	467
5.33%	824	813	801	789	777	764	750
8.00%	861	860	859	857	853	850	845

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

8,809

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

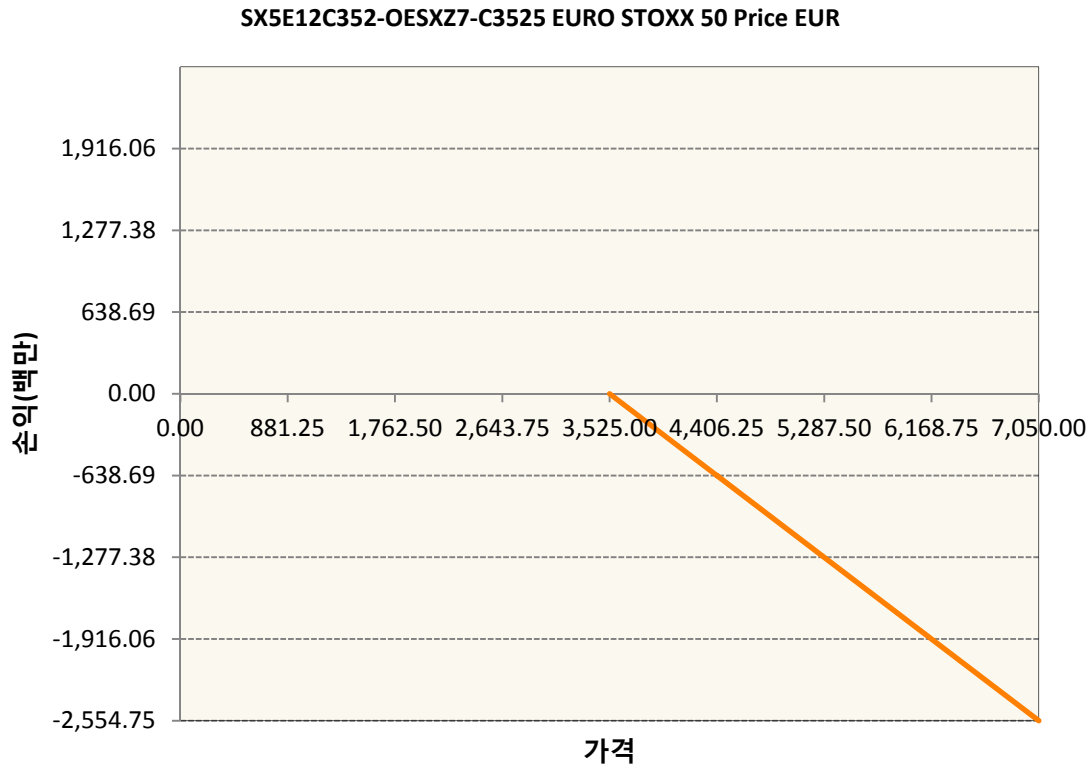
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

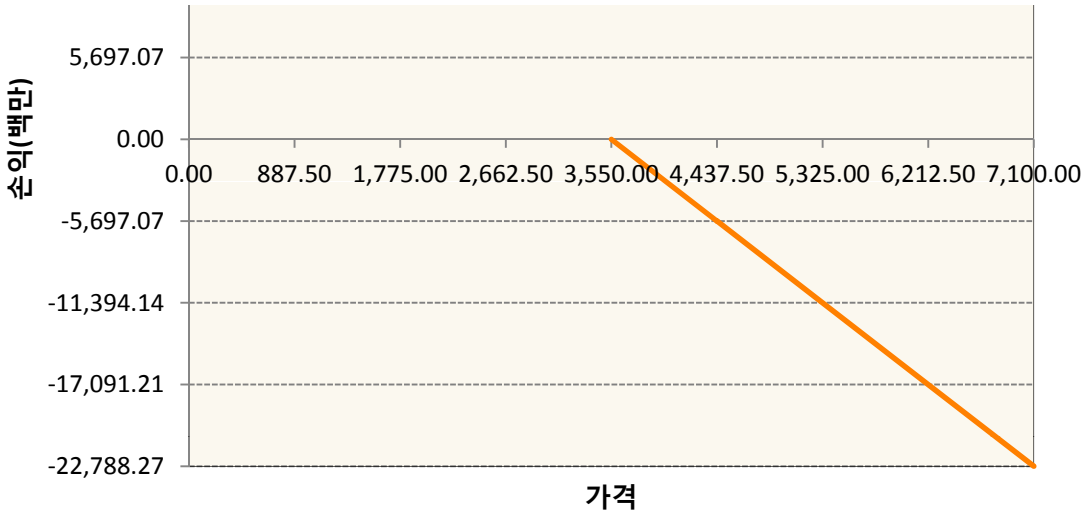
(단위:백만원)

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	17,243	0	17,243	
누계	유가증권	스왑	97,067	0	97,067	장외
누계	유가증권	옵션	0	50,686	-50,686	장내
누계	지수	스왑	51,770	0	51,770	장외

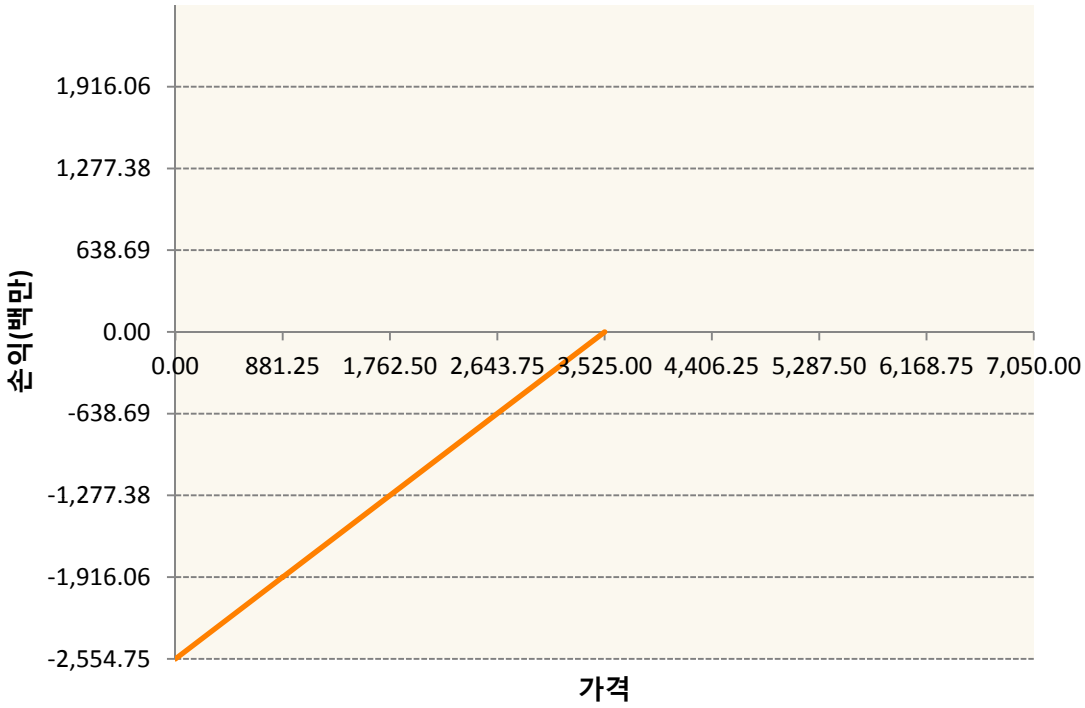
2. 만기시점의 손익구조



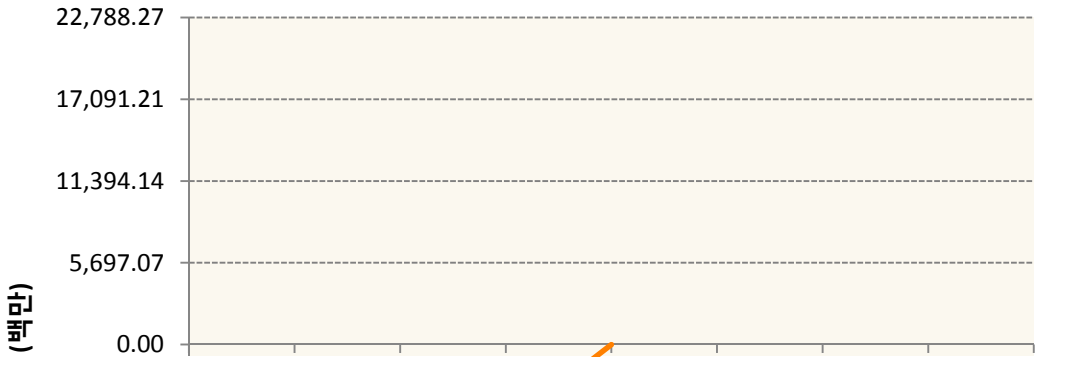


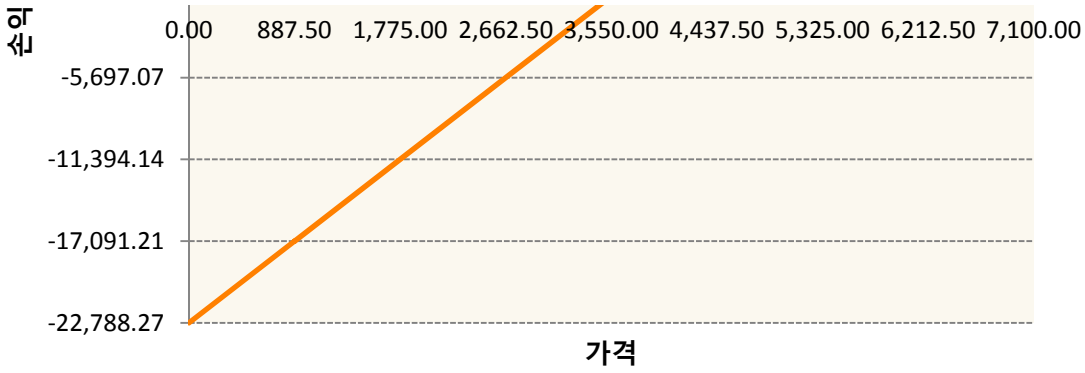


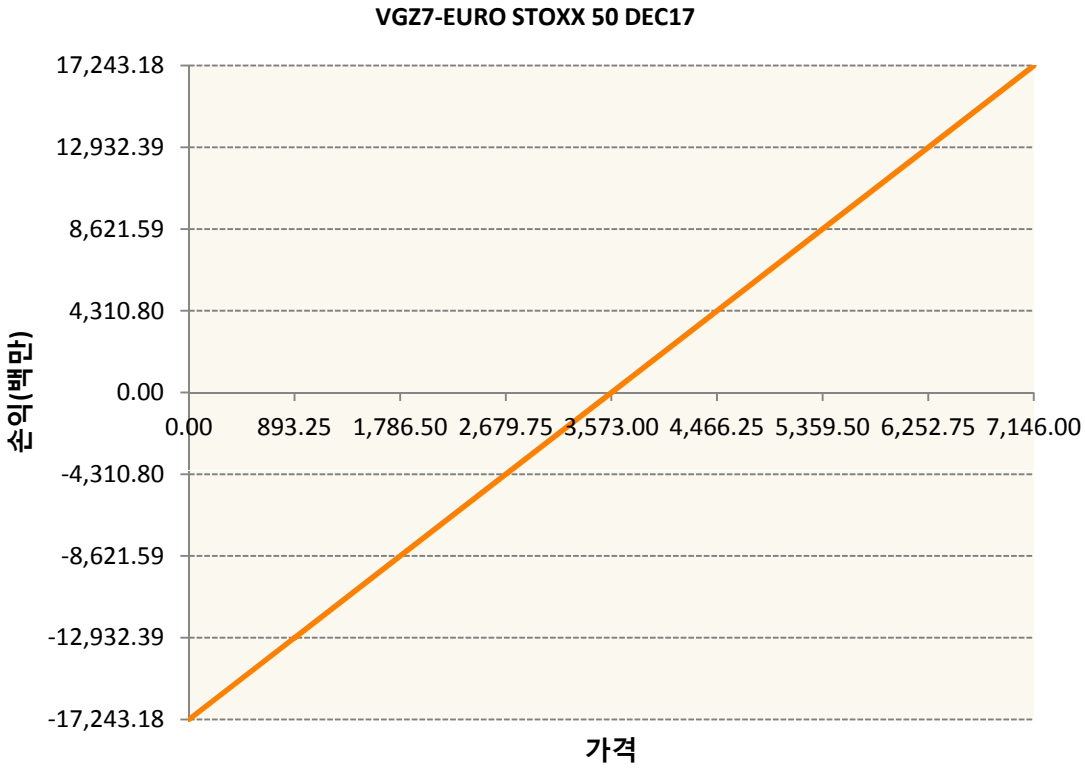
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	35
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	22
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	204
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,823
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	204
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,823
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,379

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

3,119

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

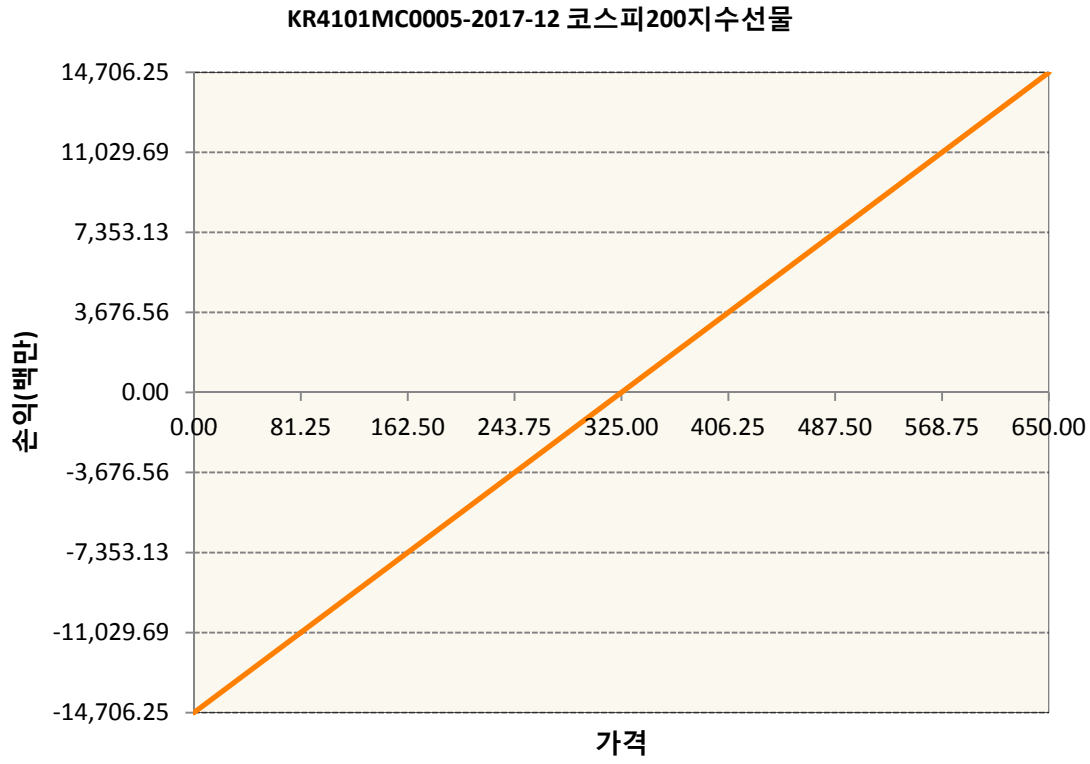
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,706	0	14,706	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,175
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175	-1,175
-5.33%	-783	-783	-783	-783	-783	-783	-783
-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%	783	783	783	783	783	783	783
8.00%	1,175	1,175	1,175	1,175	1,175	1,175	1,175

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

697

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

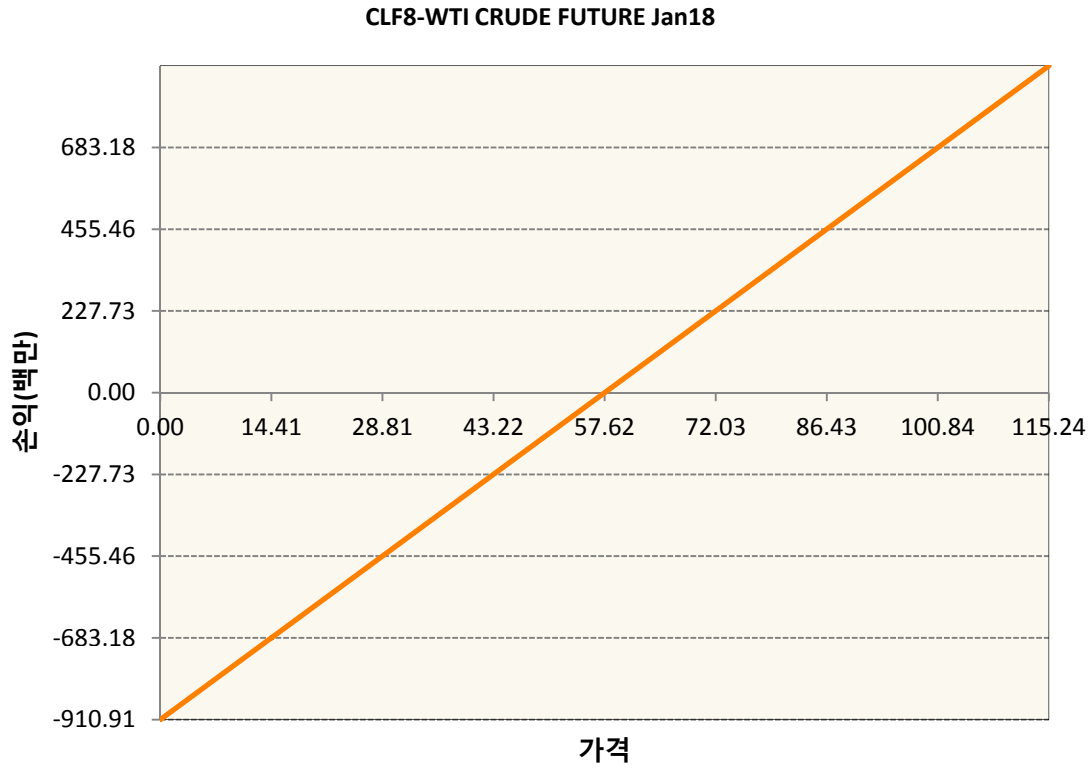
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

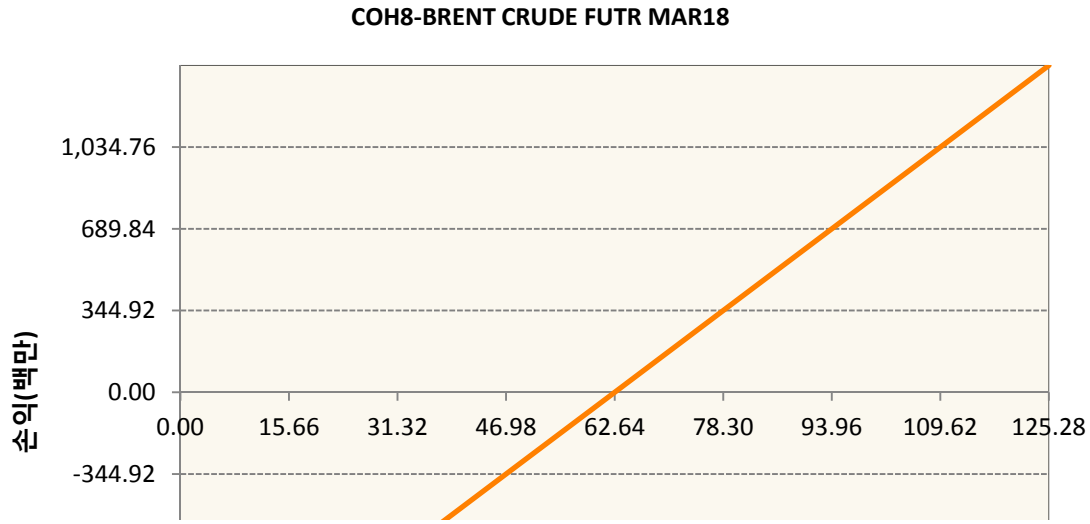
1. 계약금액

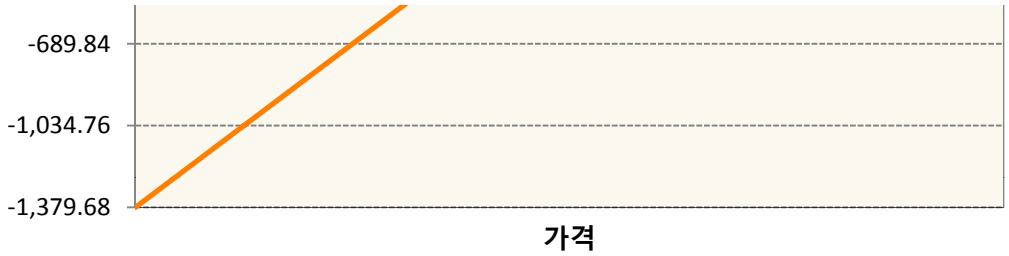
(단위:백만원)

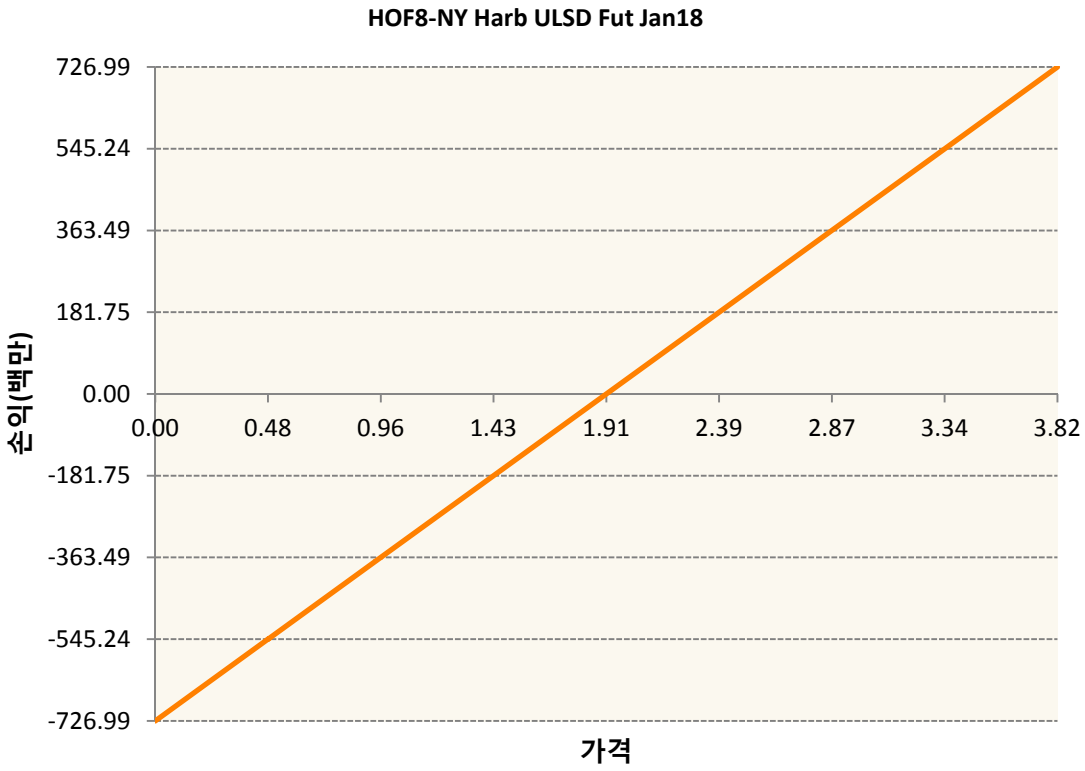
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,944	874	4,070	

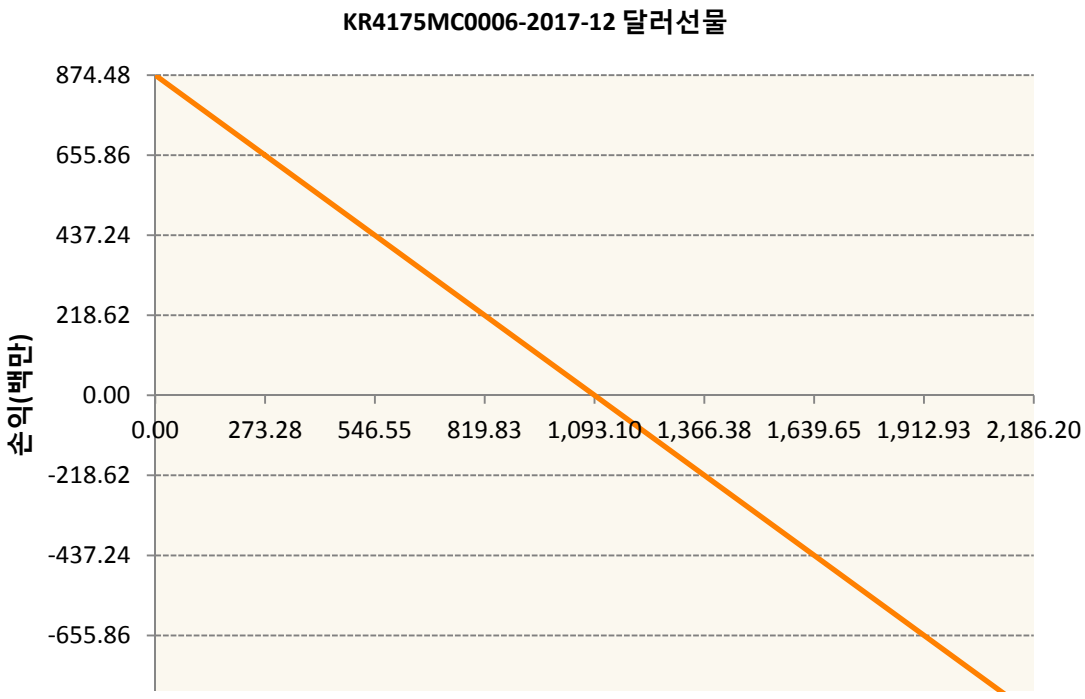
2. 만기시점의 손익구조

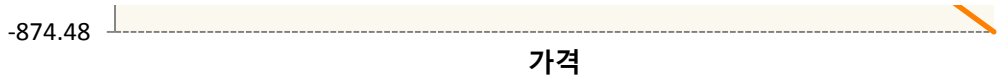


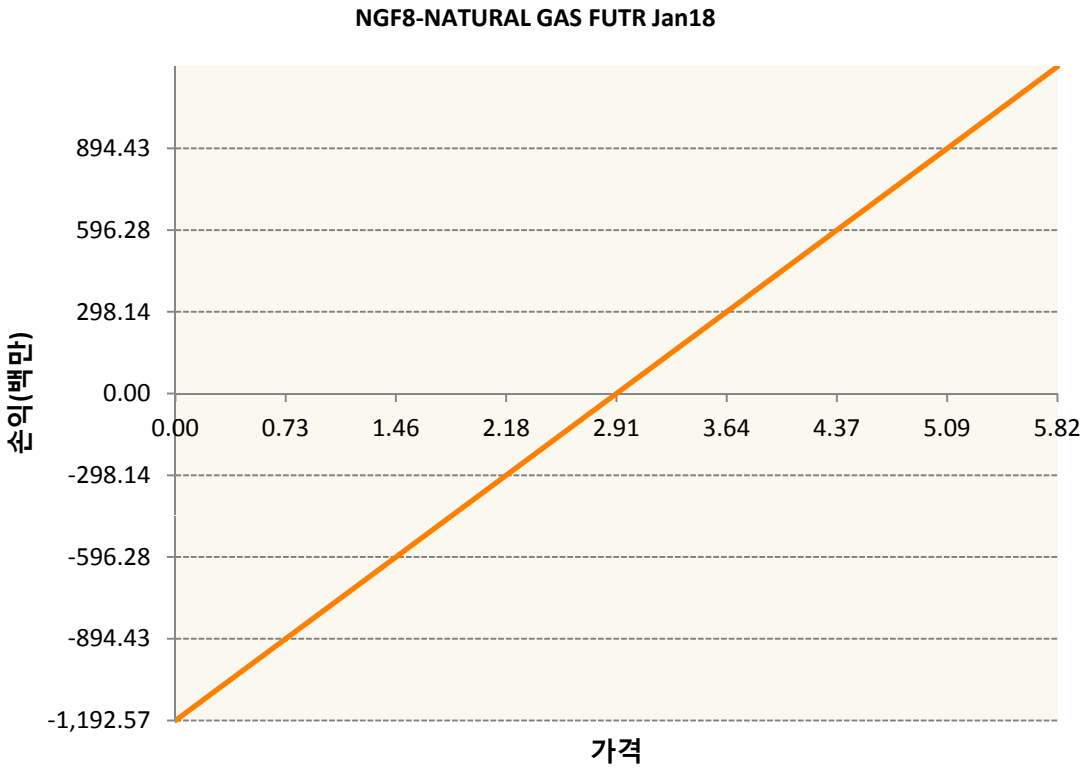


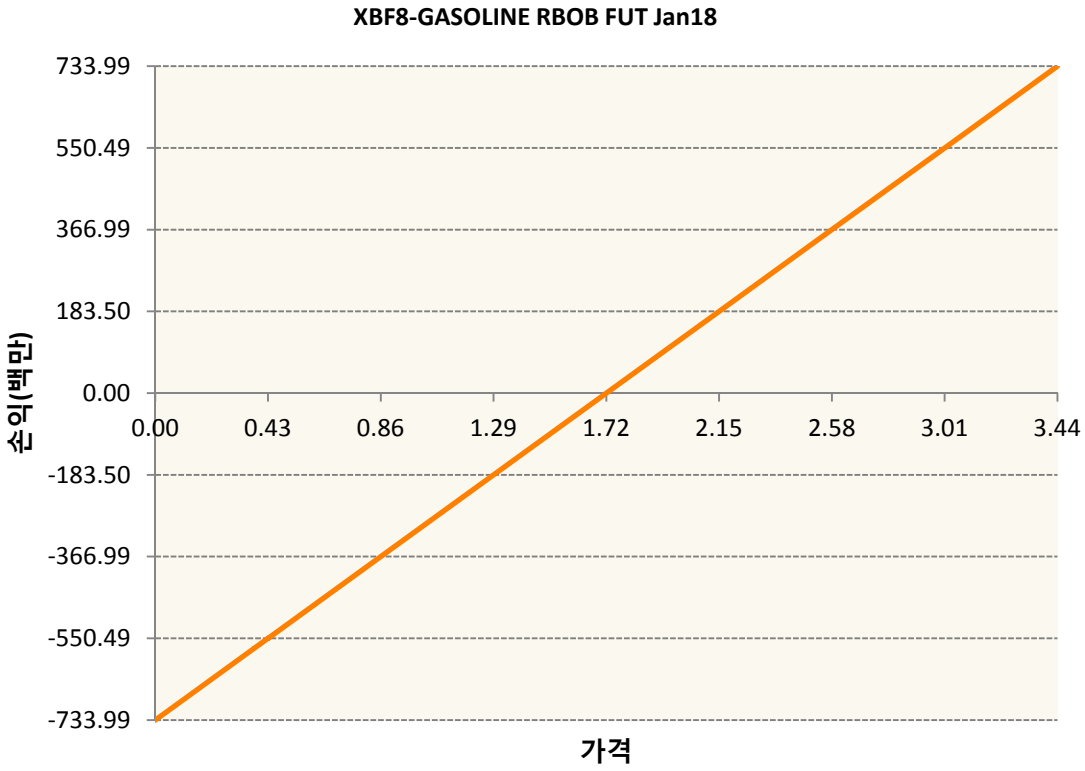

-689.84
-1,034.76
-1,379.68
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
726.99
545.24
363.49
181.75
0.00
-181.75
-363.49
-545.24
-726.99
0.00
0.48
0.96
1.43
1.91
2.39
2.87
3.34
3.82
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
874.48
655.86
437.24
218.62
0.00
-218.62
-437.24
-655.86
0.00
273.28
546.55
819.83
1,093.10
1,366.38
1,639.65
1,912.93
2,186.20
손익(백만)


-874.48
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
894.43
596.28
298.14
0.00
-298.14
-596.28
-894.43
-1,192.57
0.00
0.73
1.46
2.18
2.91
3.64
4.37
5.09
5.82
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
733.99
550.49
366.99
183.50
0.00
-183.50
-366.99
-550.49
-733.99
0.00
0.43
0.86
1.29
1.72
2.15
2.58
3.01
3.44
손익(백만)
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	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	95
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	59

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

674

공시일	2017-12-07
기준일	2017-12-06

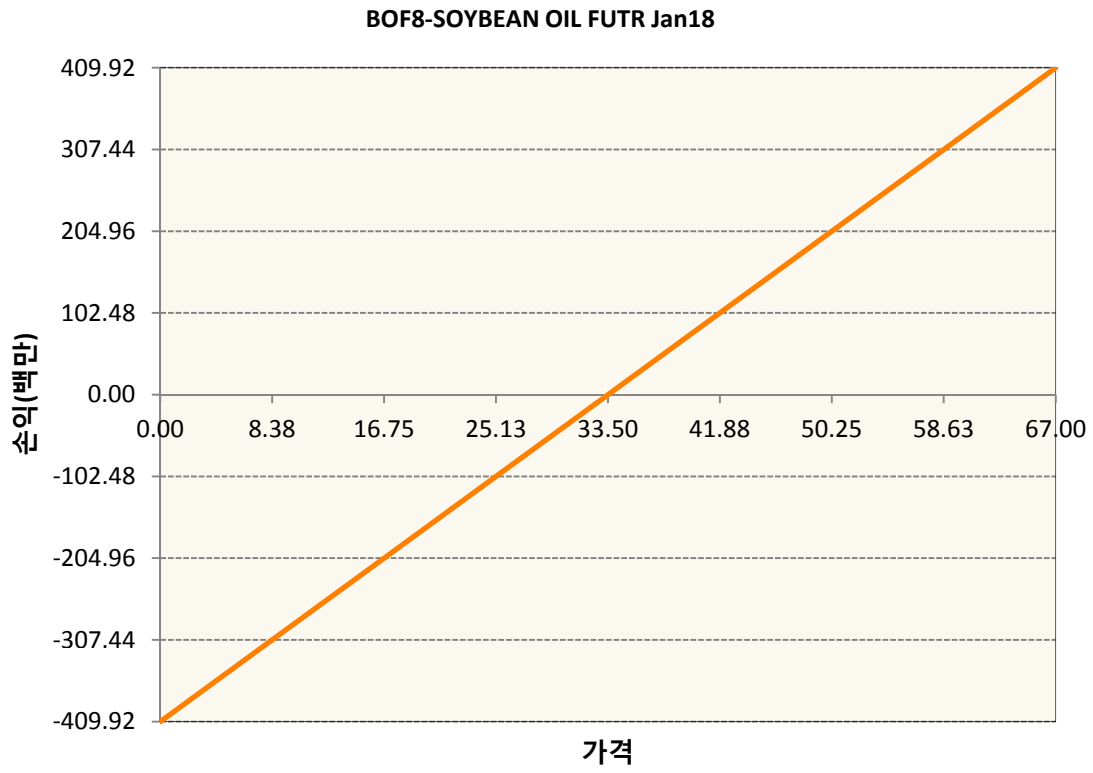
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

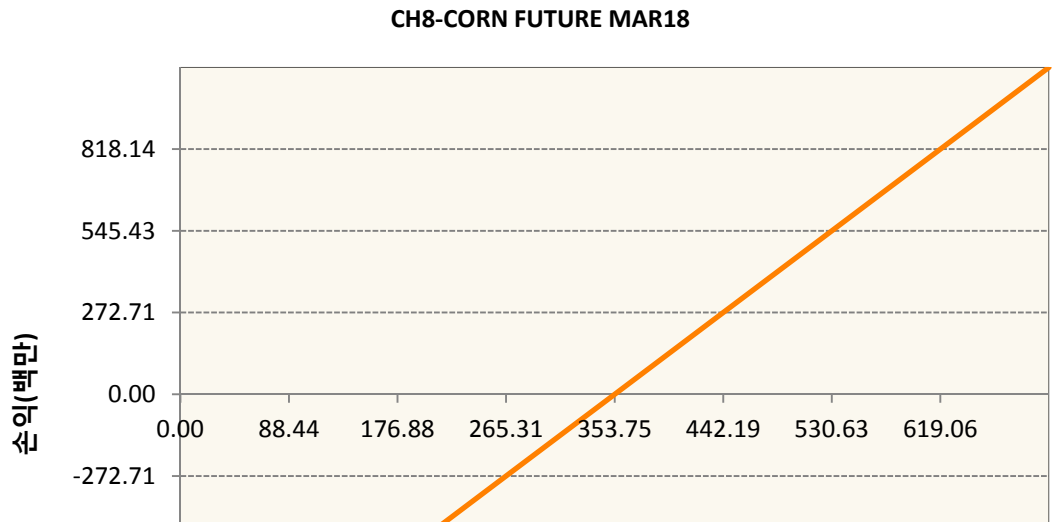
1. 계약금액

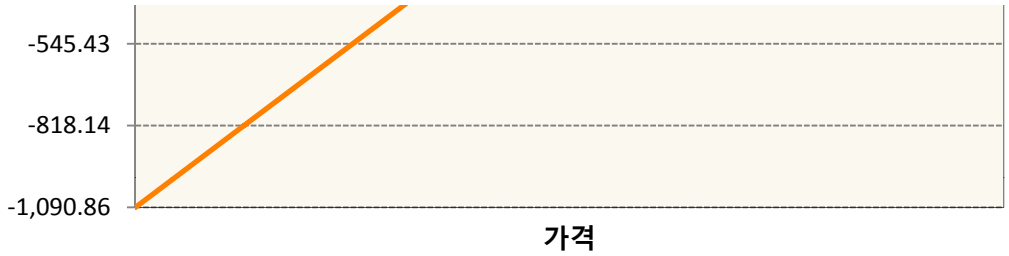
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,477	328	4,149	

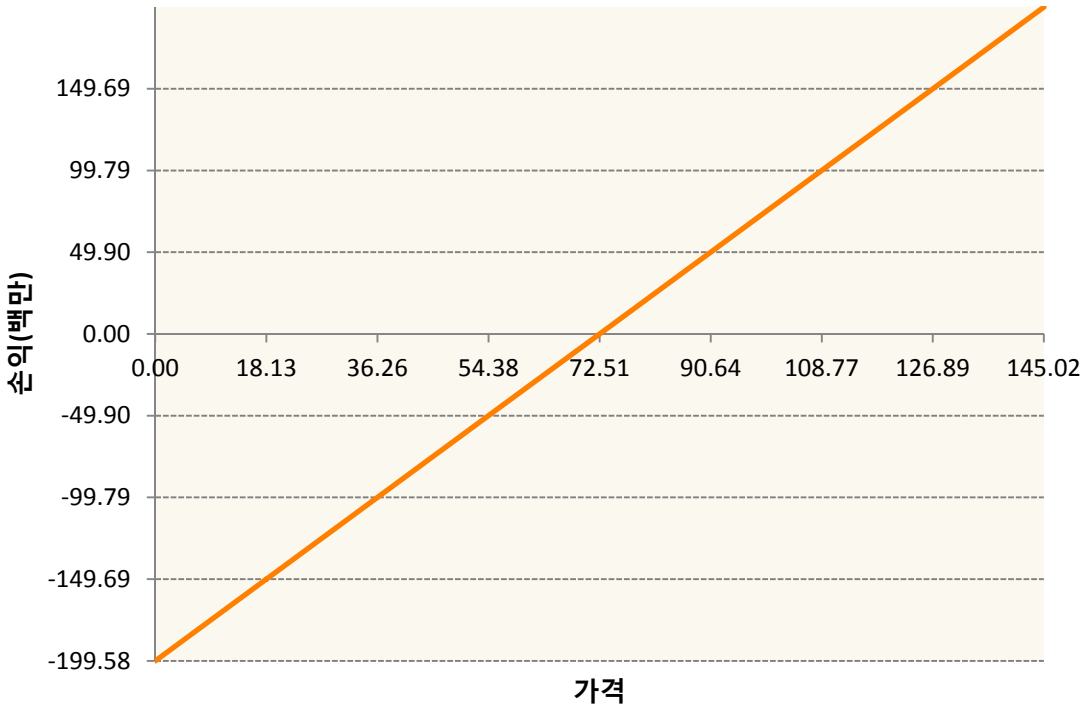
2. 만기시점의 손익구조



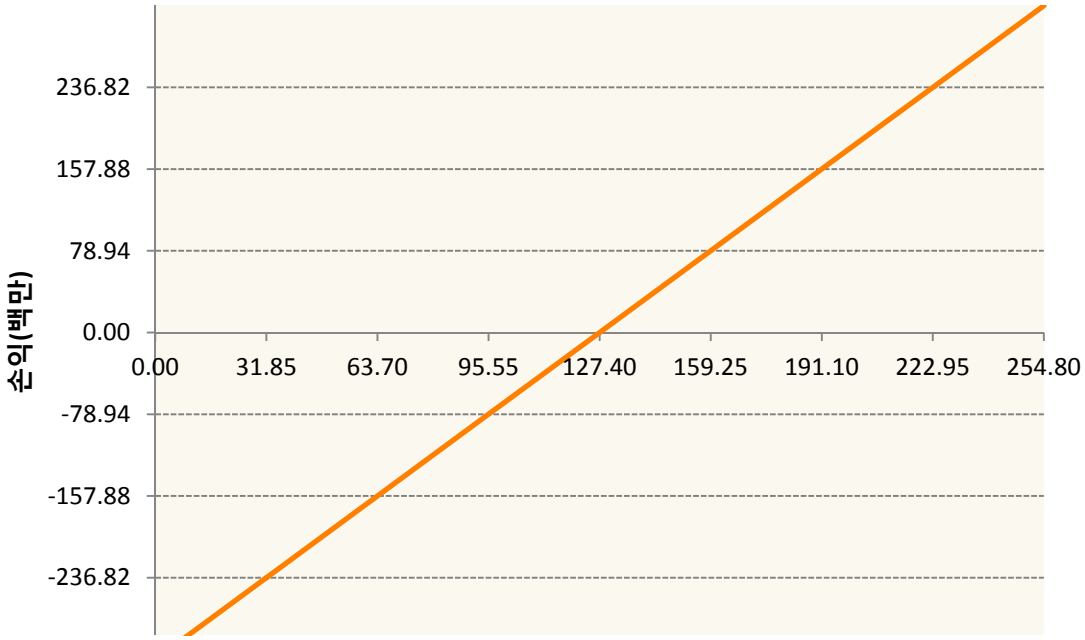


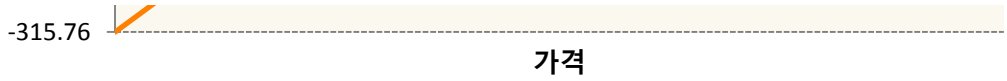


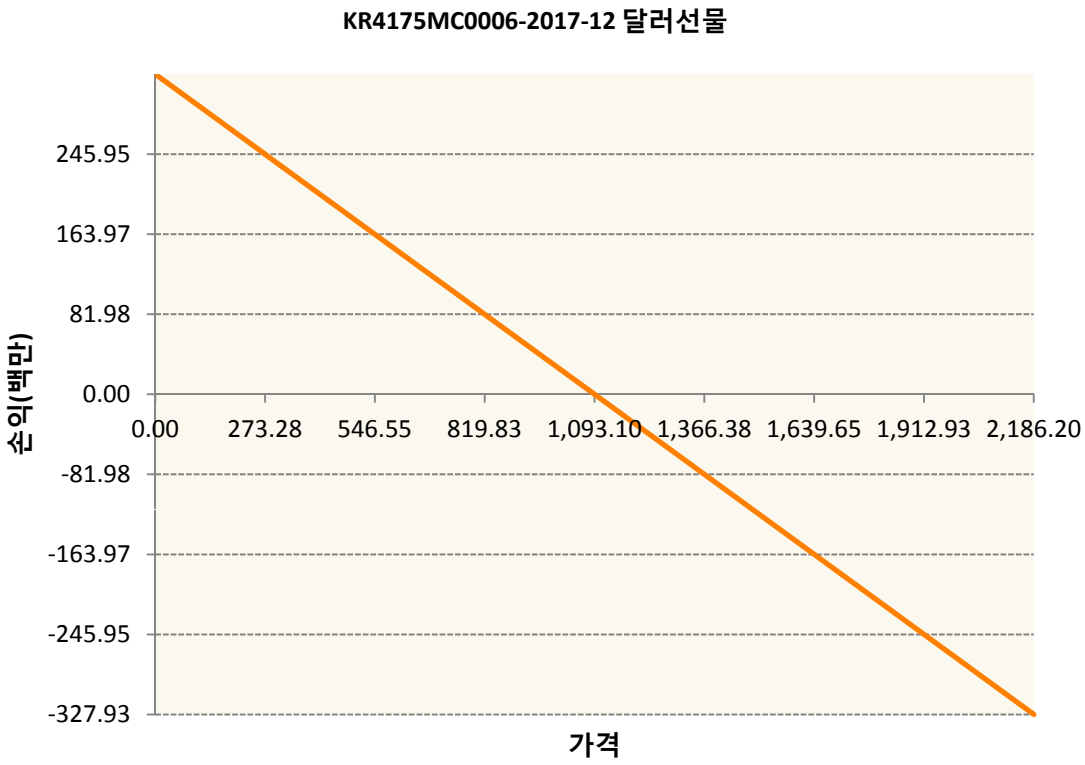
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

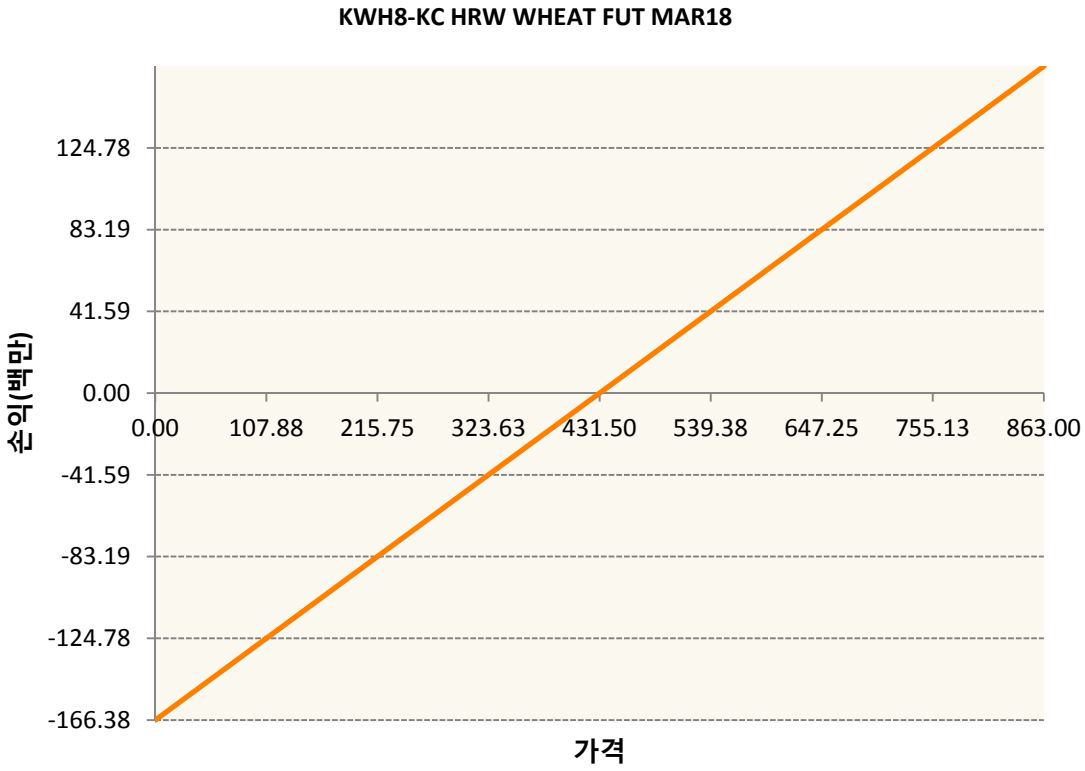


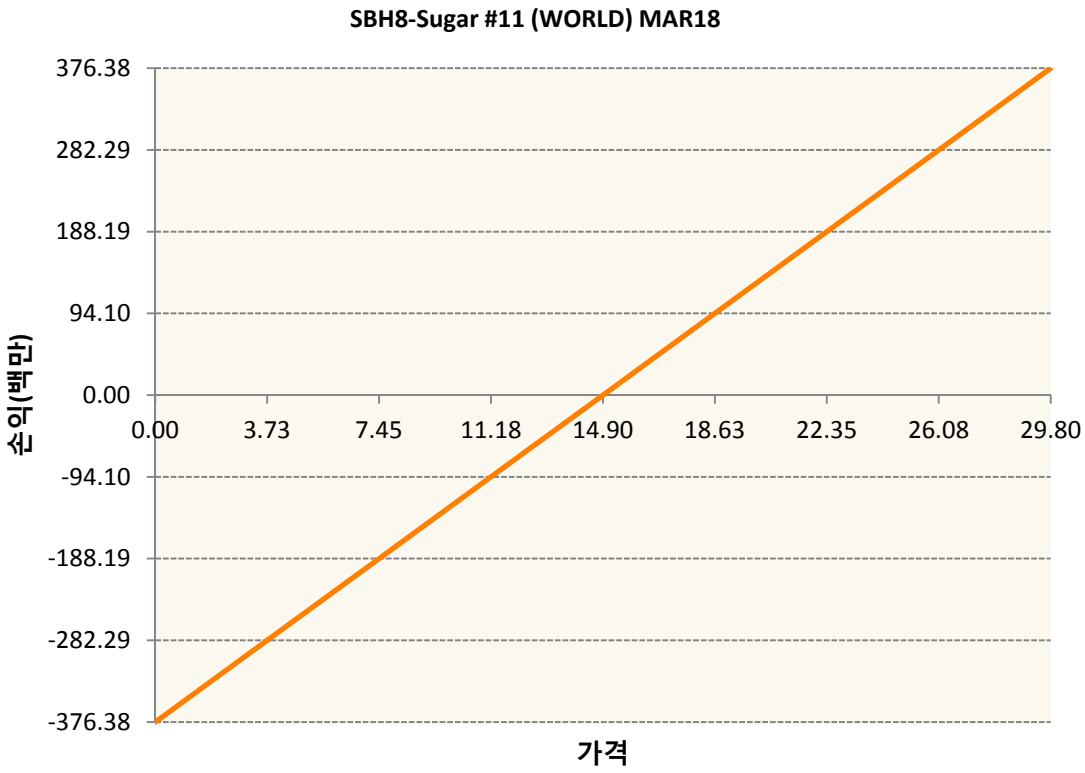
KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

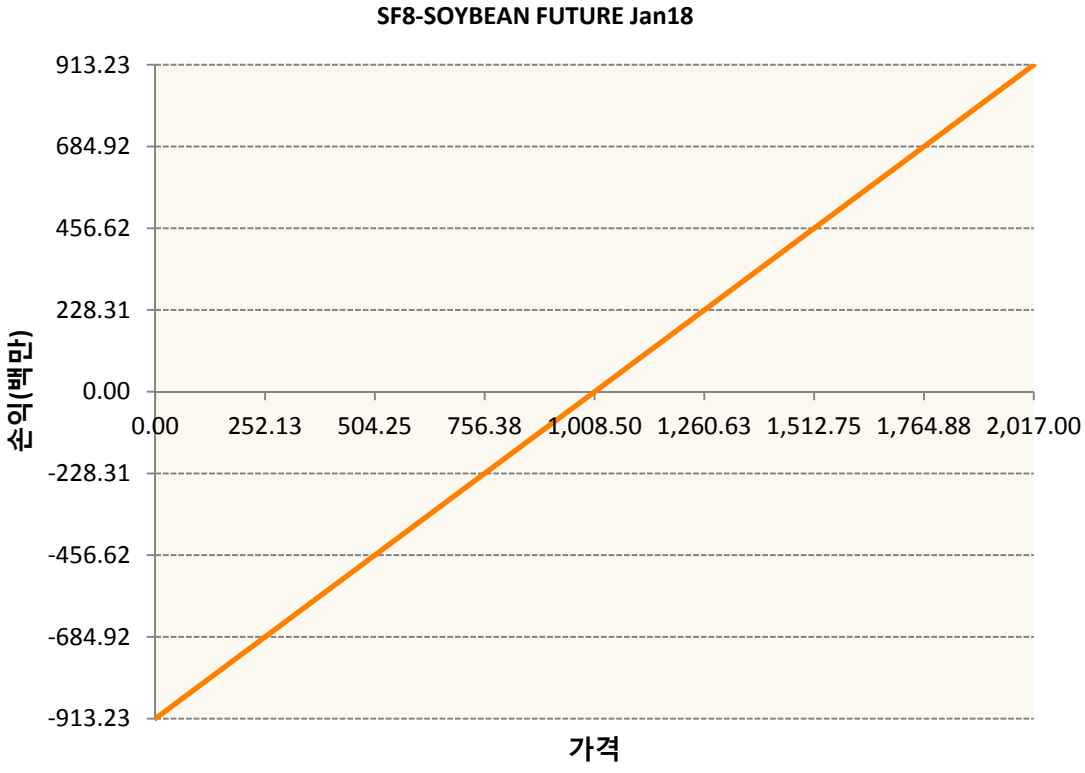



-315.76
가격

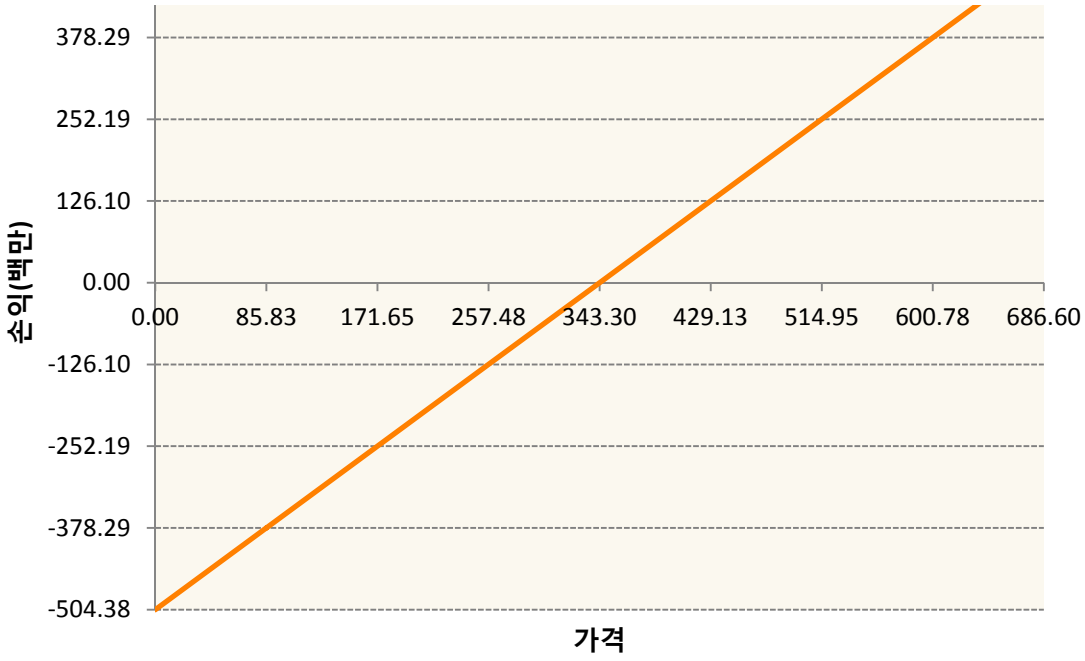

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
245.95
163.97
81.98
0.00
-81.98
-163.97
-245.95
-327.93
0.00
273.28
546.55
819.83
1,093.10
1,366.38
1,639.65
1,912.93
2,186.20
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
124.78
83.19
41.59
0.00
-41.59
-83.19
-124.78
-166.38
0.00
107.88
215.75
323.63
431.50
539.38
647.25
755.13
863.00
손익(백만)
가격

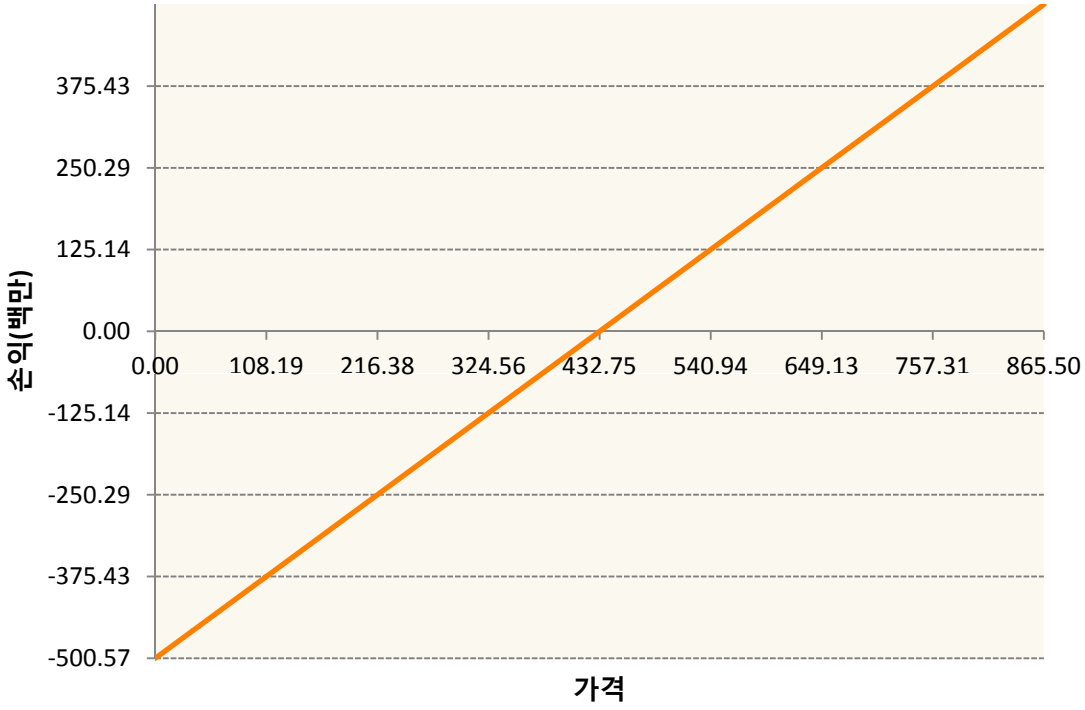

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
376.38
282.29
188.19
94.10
0.00
-94.10
-188.19
-282.29
-376.38
0.00
3.73
7.45
11.18
14.90
18.63
22.35
26.08
29.80
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
913.23
684.92
456.62
228.31
0.00
-228.31
-456.62
-684.92
-913.23
0.00
252.13
504.25
756.38
1,008.50
1,260.63
1,512.75
1,764.88
2,017.00
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
504.38



WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



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	73
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	40
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	40

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

386