공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

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	2017-12-08
기준일	2017-12-07

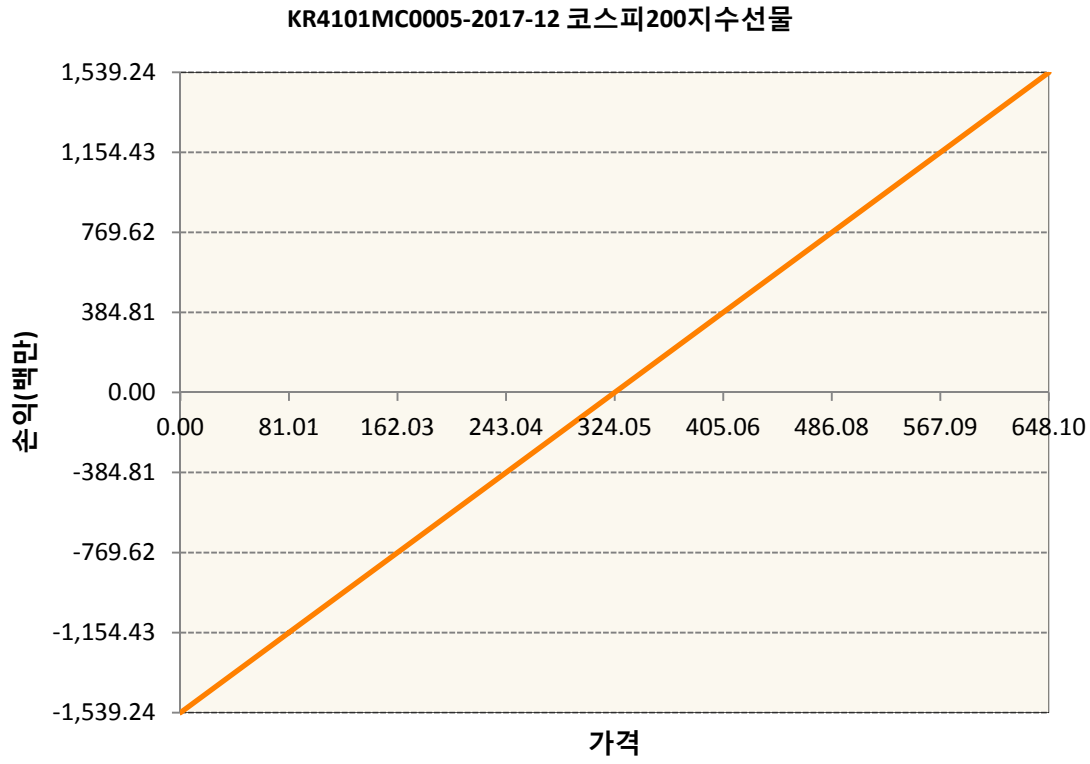
스마트인덱스모

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	1,539	0	1,539	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	2017-12-08
기준일	2017-12-07

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	1,076

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

344

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

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)

364

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

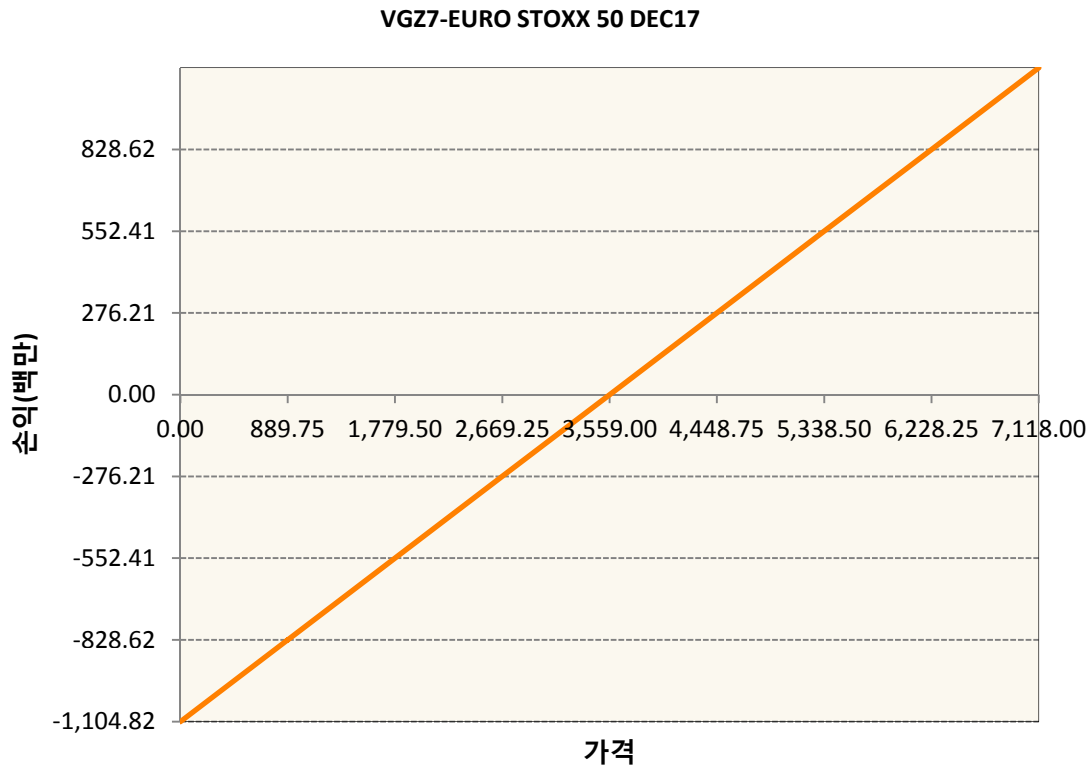
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,105	0	1,105	

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	2017-12-08
기준일	2017-12-07

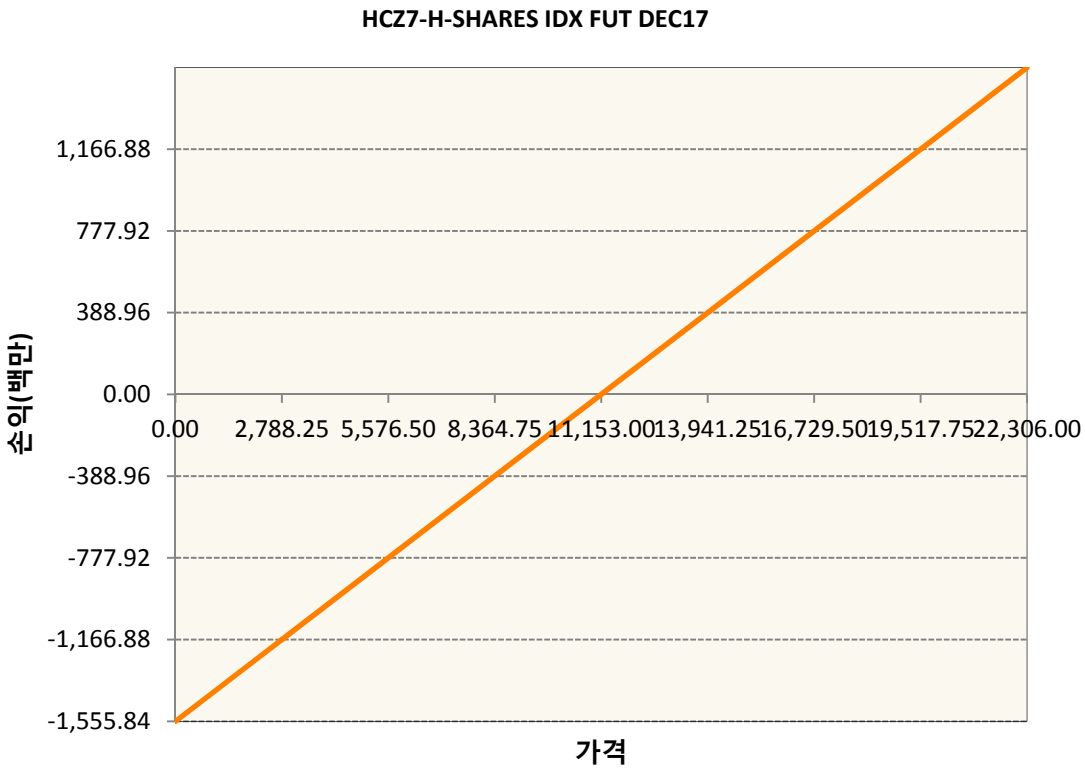
차이나인덱스모(주식-파생형)

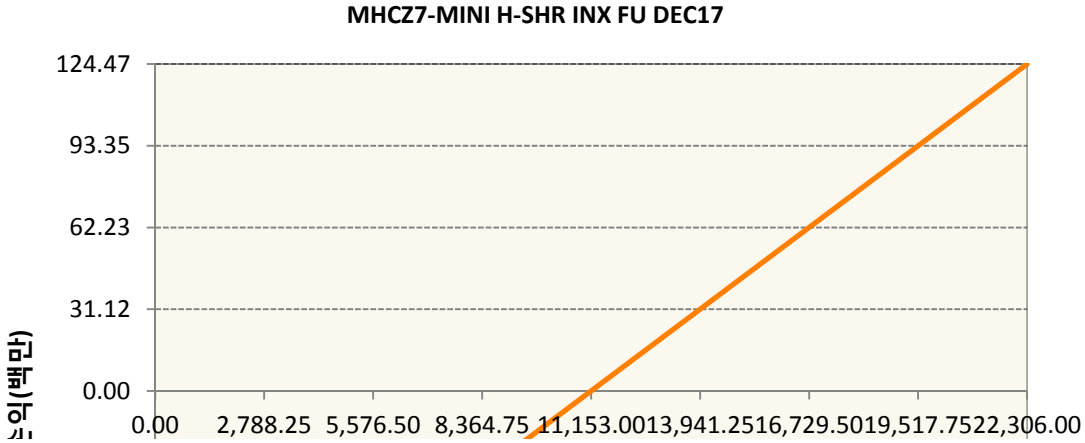
1. 계약금액

(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	1,556	0	1,556	
누계	유가증권	선물	124	0	124	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	124
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	88

공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

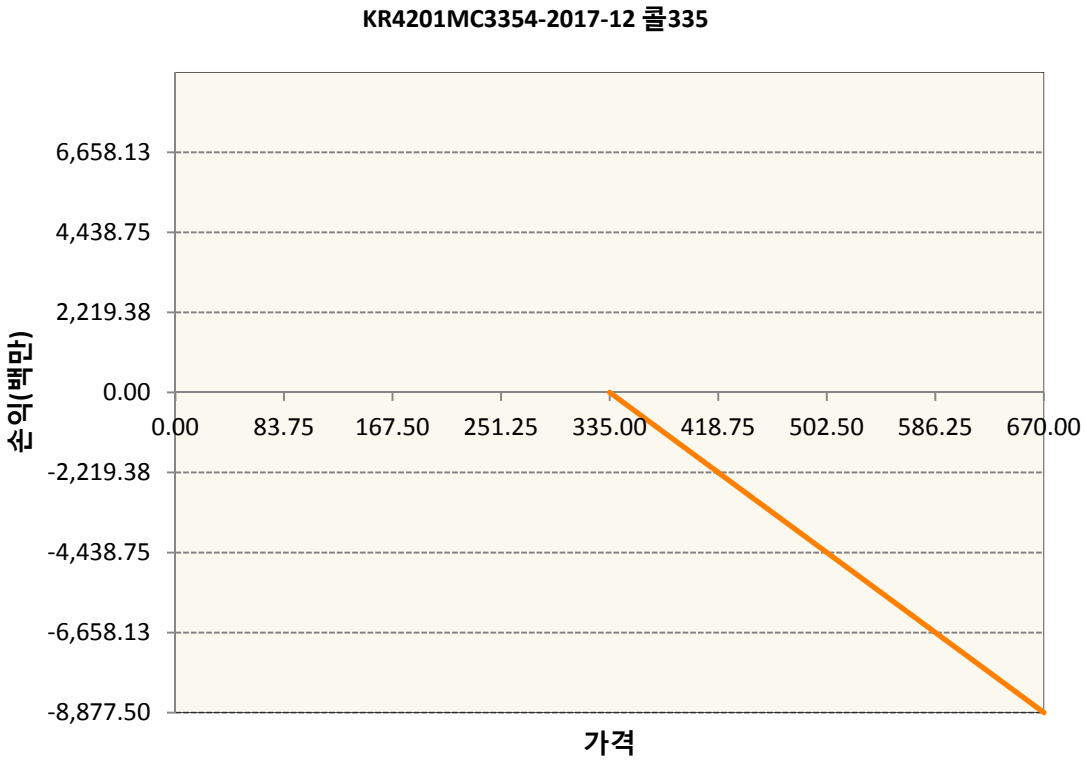
커버드콜모(주식혼합-파생형)

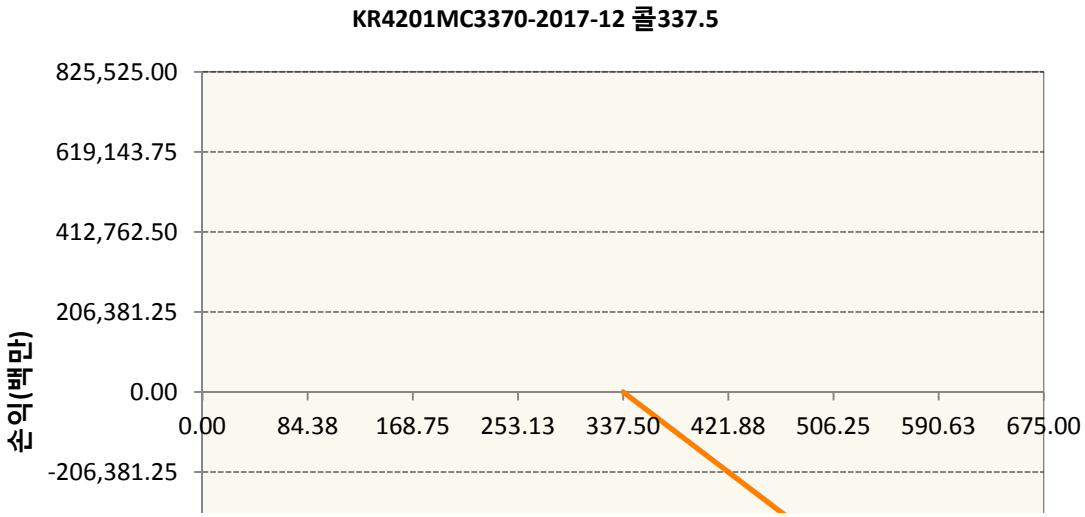
1. 계약금액

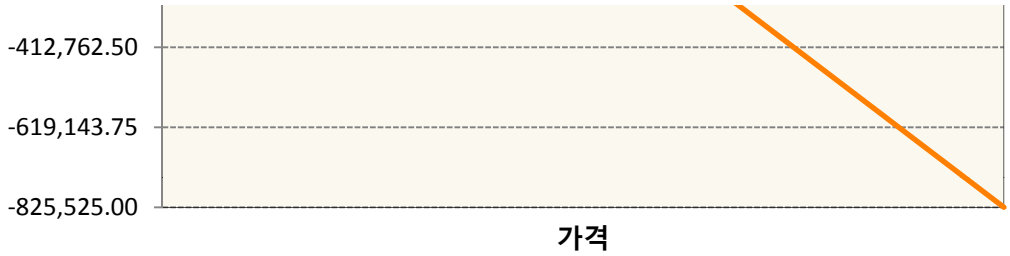
(단위:백만원)

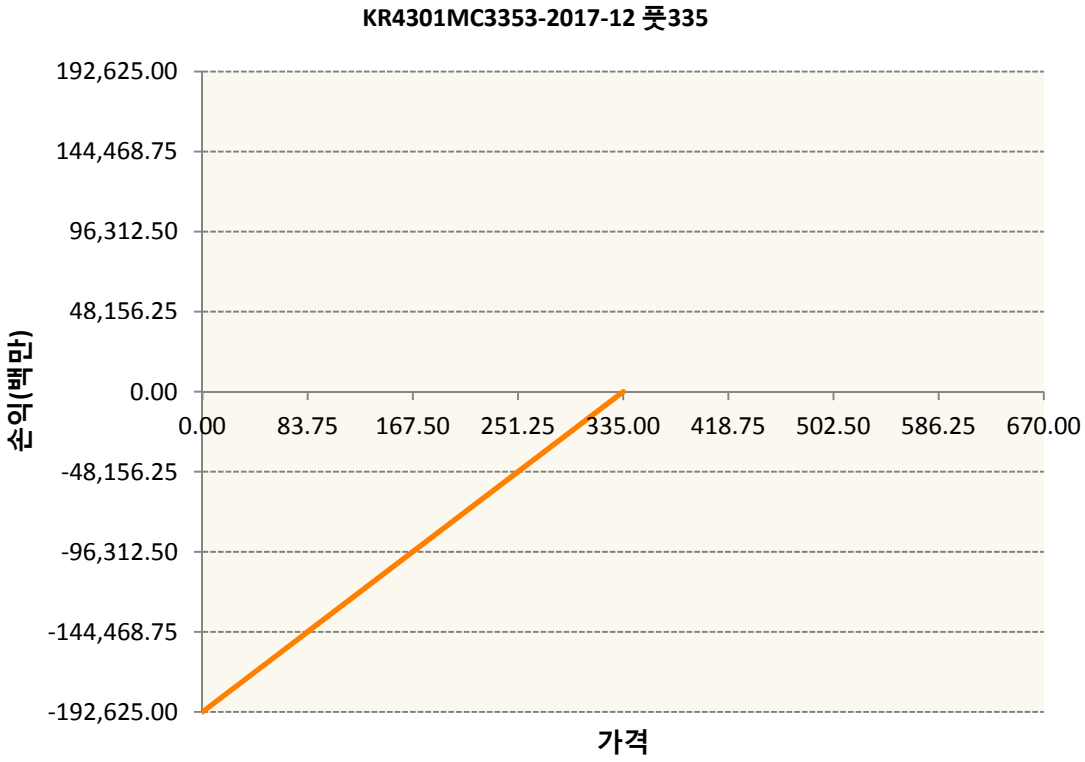
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	4,205	0	4,205	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,448,903	-1,448,903	장내

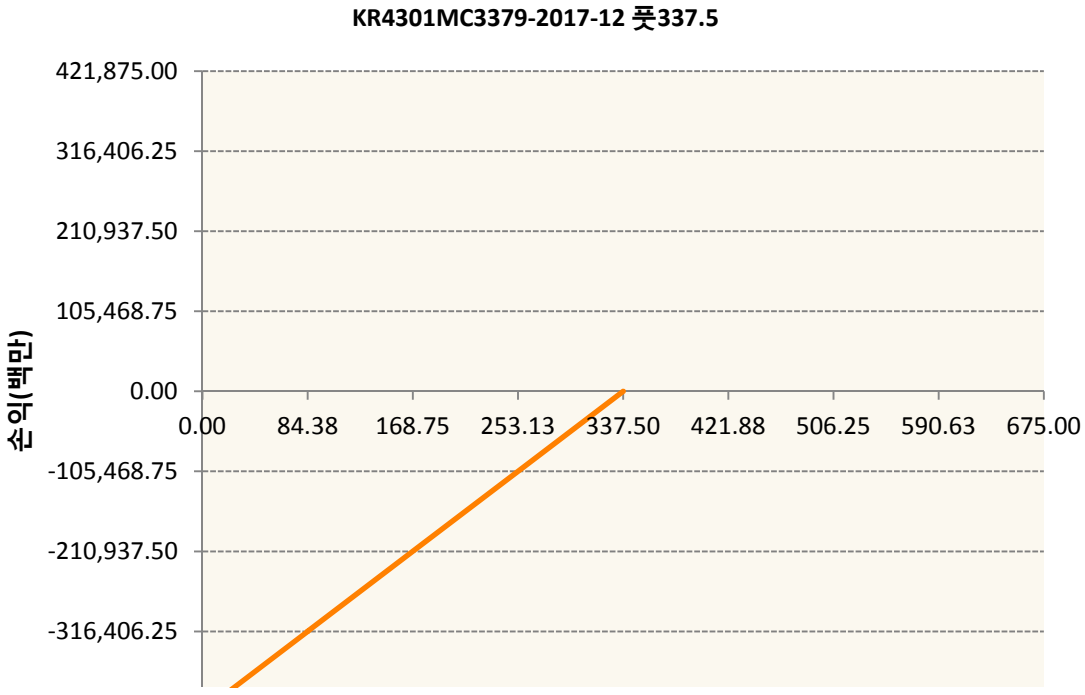
2. 만기시점의 손익구조






-412,762.50
-619,143.75
-825,525.00
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							393
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	26	26	26	26	26	26
-5.33%	26	26	26	25	25	24	23
-2.67%	25	24	23	21	19	16	12
0%	16	11	6	0	-6	-13	-21
2.67%	-35	-44	-54	-64	-74	-84	-94
5.33%	-165	-174	-183	-192	-201	-211	-220
8.00%	-364	-367	-371	-376	-381	-387	-393
KR4201MC3. 2017-12 콜337.5							32,188
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,581	1,581	1,581	1,580	1,577	1,572	1,561
-5.33%	1,580	1,578	1,572	1,558	1,531	1,486	1,420
-2.67%	1,553	1,512	1,439	1,327	1,174	975	731
0%	1,090	794	428	0	-483	-1,014	-1,586
2.67%	-2,051	-2,861	-3,696	-4,548	-5,416	-6,295	-7,183
5.33%	-11,840	-12,744	-13,658	-14,580	-15,509	-16,443	-17,380
8.00%	-28,708	-29,147	-29,655	-30,222	-30,837	-31,495	-32,188
KR4301MC3. 2017-12 풋335							14,831
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14,831	-14,831	-14,831	-14,831	-14,831	-14,831	-14,831
-5.33%	-9,871	-9,871	-9,871	-9,871	-9,871	-9,871	-9,871
-2.67%	-4,910	-4,911	-4,911	-4,911	-4,912	-4,914	-4,917
0%	43	34	20	0	-26	-59	-98
2.67%	4,530	4,426	4,318	4,208	4,097	3,984	3,870
5.33%	6,443	6,379	6,308	6,229	6,145	6,057	5,964
8.00%	6,592	6,590	6,585	6,576	6,564	6,546	6,523
KR4301MC3. 2017-12 풋337.5							32,312
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,312	-32,312	-32,312	-32,312	-32,312	-32,312	-32,312
-5.33%	-21,529	-21,529	-21,529	-21,529	-21,529	-21,529	-21,529
-2.67%	-10,745	-10,745	-10,745	-10,745	-10,746	-10,748	-10,751
0%	35	30	19	0	-28	-67	-116
2.67%	10,408	10,254	10,084	9,900	9,706	9,503	9,293

5.33%	16,515	16,299	16,074	15,842	15,605	15,364	15,119
8.00%	17,373	17,354	17,324	17,280	17,222	17,150	17,064

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

75,654

공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

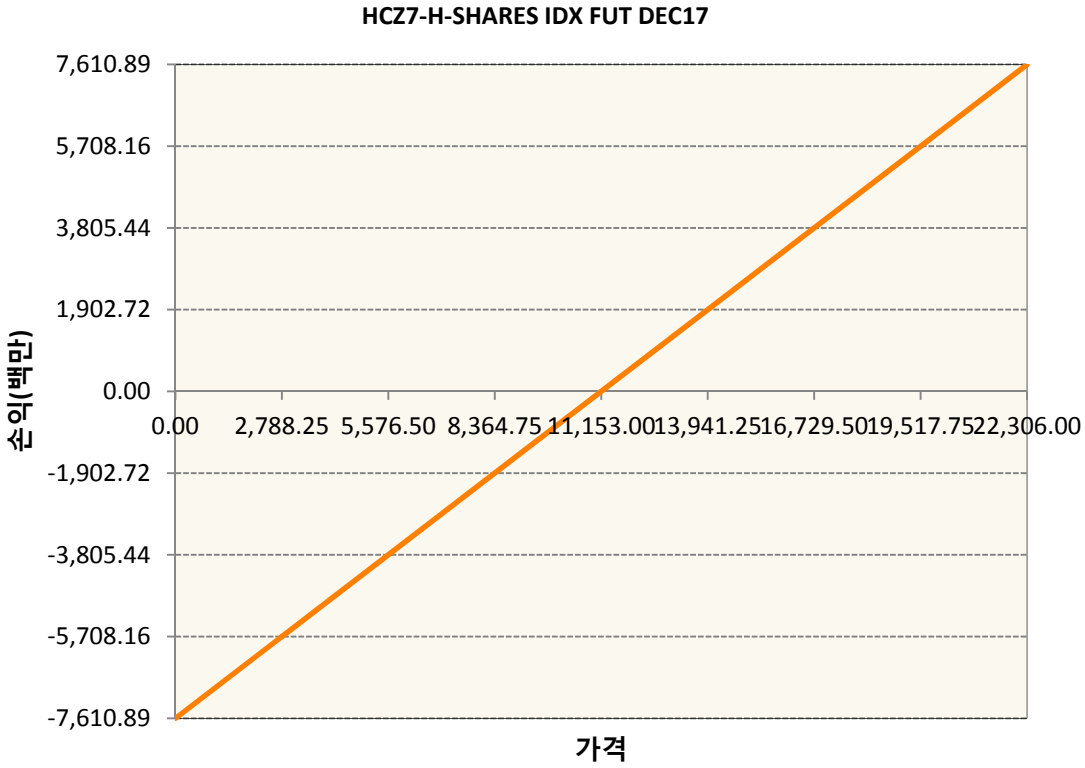
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

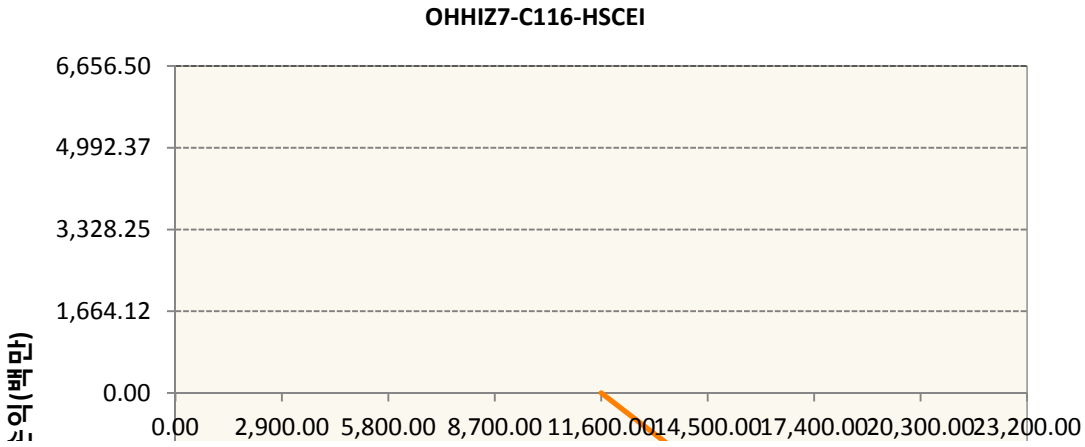
1. 계약금액

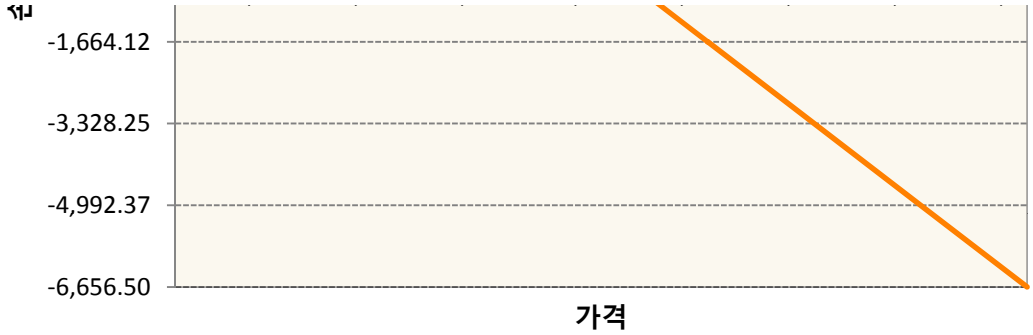
(단위:백만원)

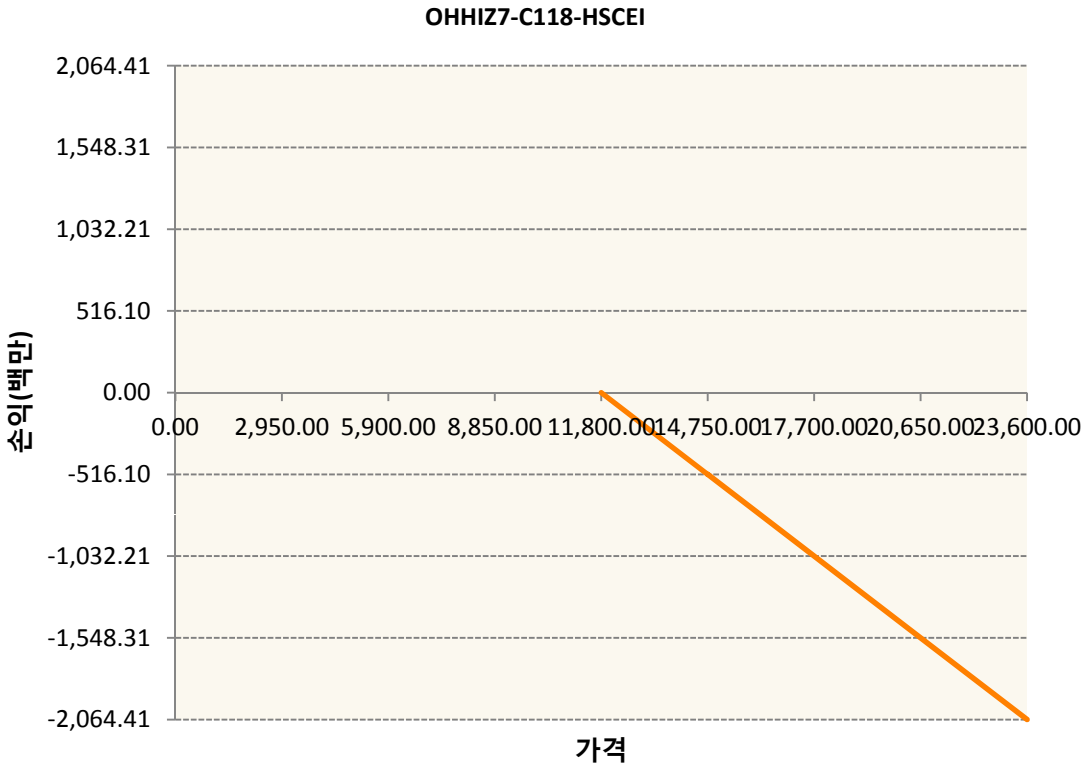
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,611	0	7,611	
누계	유가증권	옵션	0	17,442	-17,442	장내

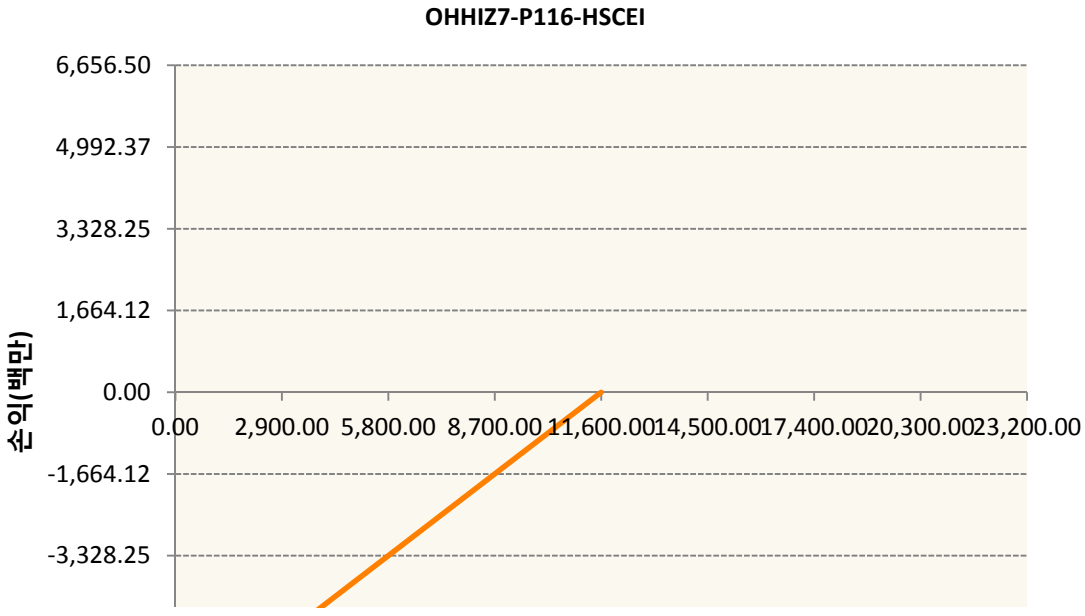
2. 만기시점의 손익구조

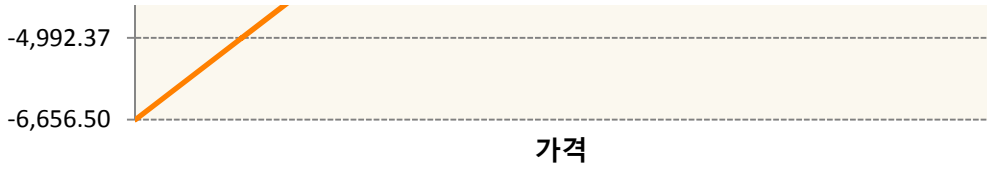


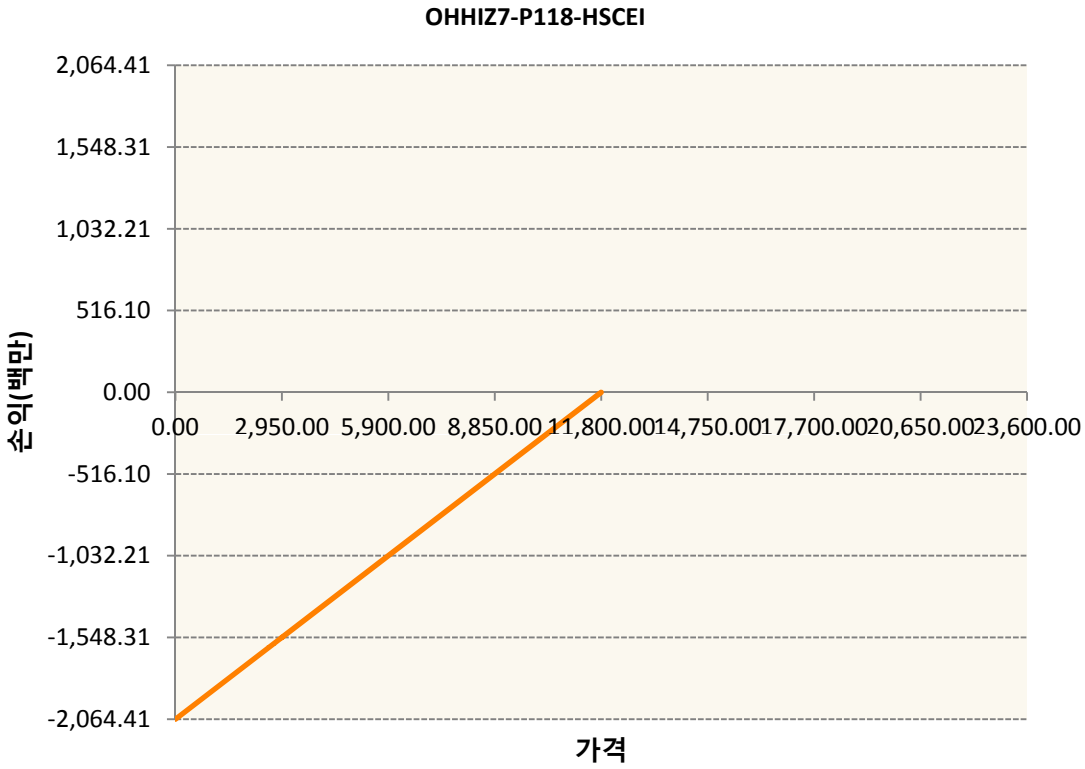



-1,664.12
-3,328.25
-4,992.37
-6,656.50
가격


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	609
OHHIZ7-C11	HSCEI	533
OHHIZ7-C11	HSCEI	165
OHHIZ7-P11	HSCEI	533
OHHIZ7-P11	HSCEI	165

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,507

공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

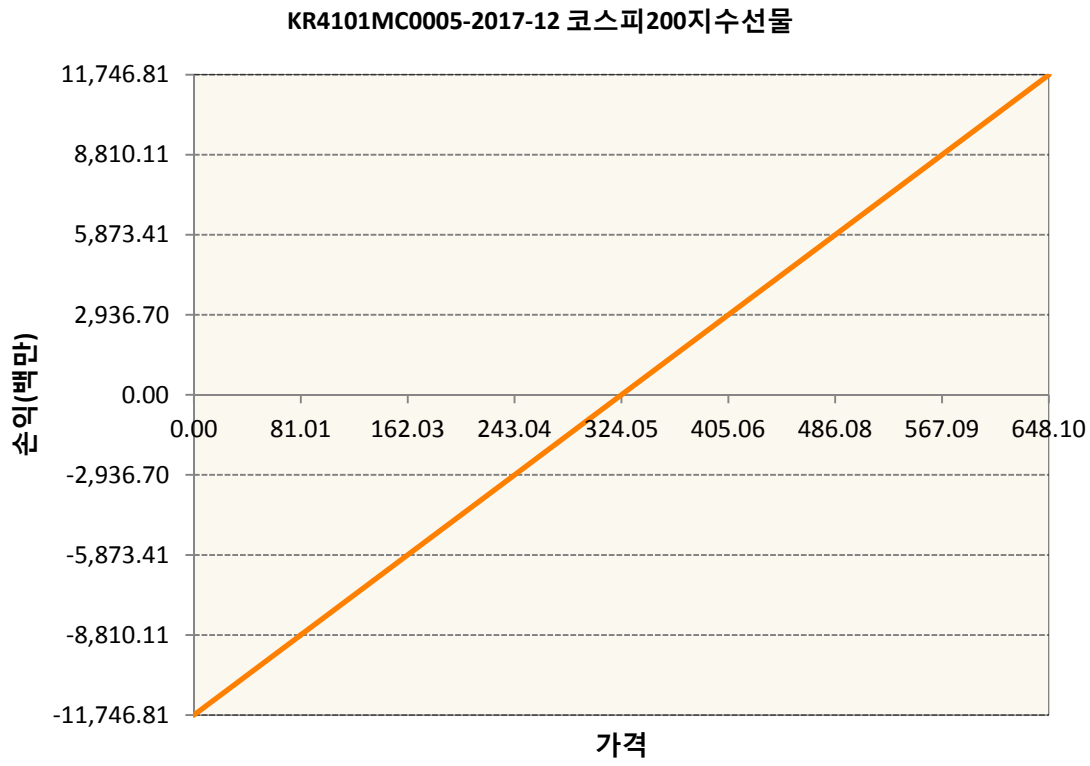
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

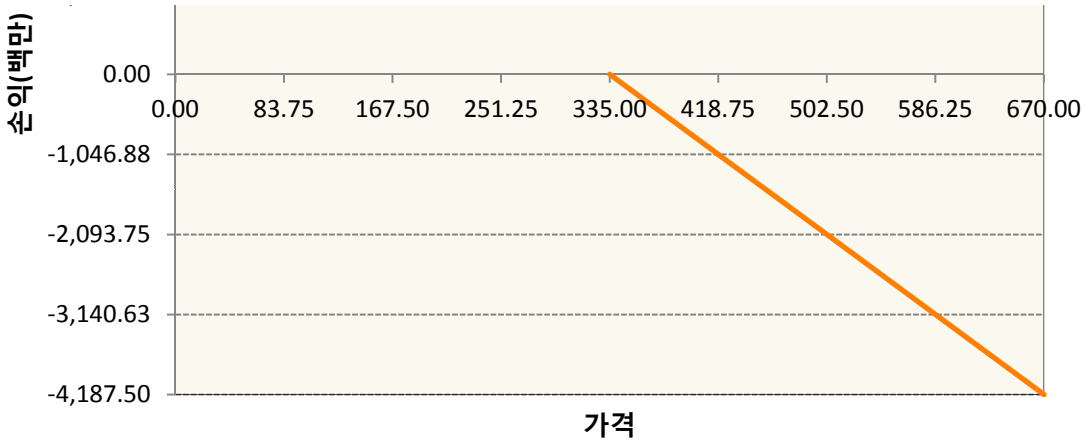
(단위:백만원)

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	11,747	0	11,747	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,409	-59,409	장내

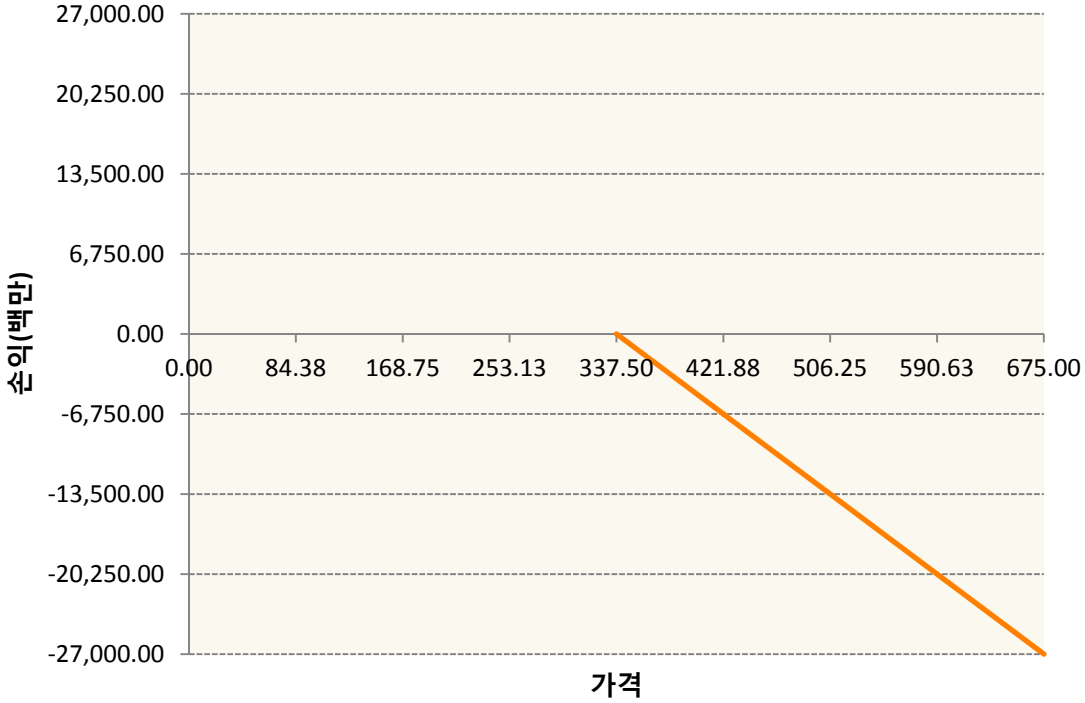
2. 만기시점의 손익구조



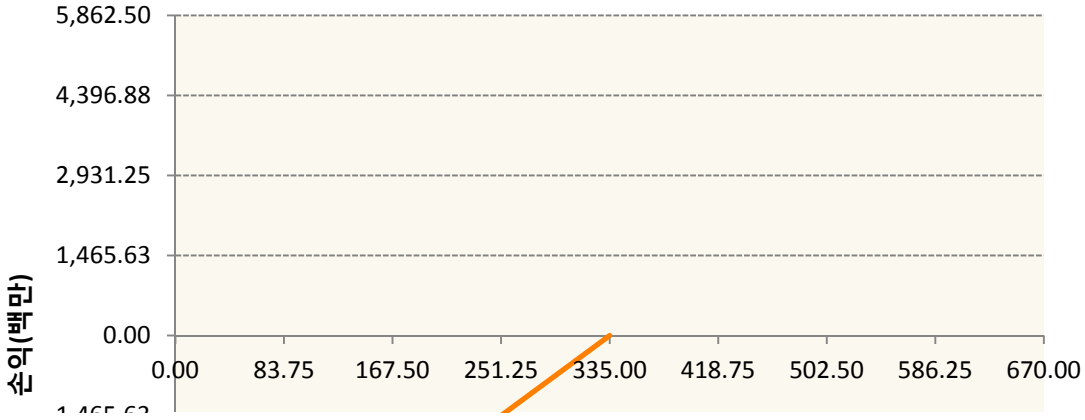




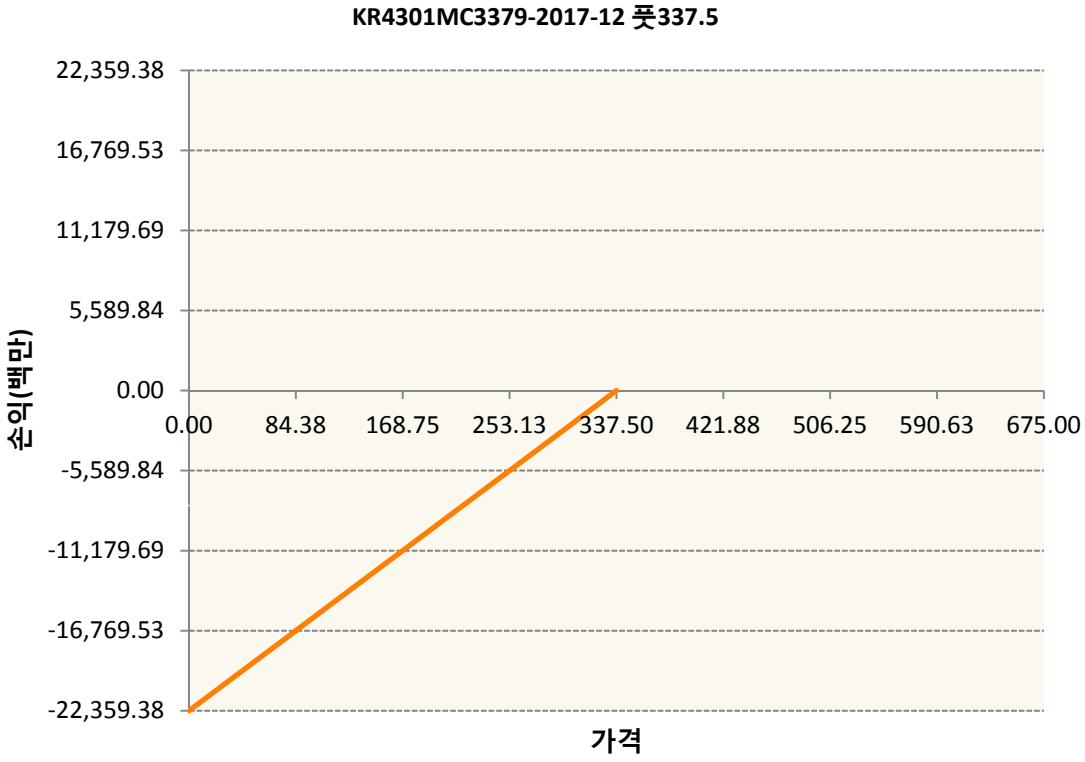
KR4201MC3370-2017-12 콜337.5



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					938

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-938	-938	-938	-938	-938	-938	-938
-5.33%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-2.67%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	313	313	313	313	313	313	313
5.33%	626	626	626	626	626	626	626
8.00%	938	938	938	938	938	938	938
	KR4201MC3	2017-12 콜335					185

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	12	12	12	12	12	11	11
-2.67%	12	12	11	10	9	8	6
0%	8	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	-16	-21	-26	-30	-35	-40	-45
5.33%	-78	-82	-86	-91	-95	-99	-104
8.00%	-172	-173	-175	-177	-180	-182	-185
	KR4201MC3	2017-12 콜337.5					1,053

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	52	52	52	52	52	51	51
-5.33%	52	52	51	51	50	49	46
-2.67%	51	49	47	43	38	32	24
0%	36	26	14	0	-16	-33	-52
2.67%	-67	-94	-121	-149	-177	-206	-235
5.33%	-387	-417	-447	-477	-507	-538	-568
8.00%	-939	-953	-970	-988	-1,009	-1,030	-1,053
	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%	-149	-149	-149	-149	-149	-150	-150
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	138	135	131	128	125	121	118
5.33%	196	194	192	190	187	184	182
8.00%	201	201	200	200	200	199	199
	KR4301MC3. 2017-12 풋337.5						1,713
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713
-5.33%	-1,141	-1,141	-1,141	-1,141	-1,141	-1,141	-1,141
-2.67%	-569	-569	-569	-570	-570	-570	-570
0%	2	2	1	0	-1	-4	-6
2.67%	552	543	534	525	514	504	493
5.33%	875	864	852	840	827	814	801
8.00%	921	920	918	916	913	909	904

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

8,620

공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

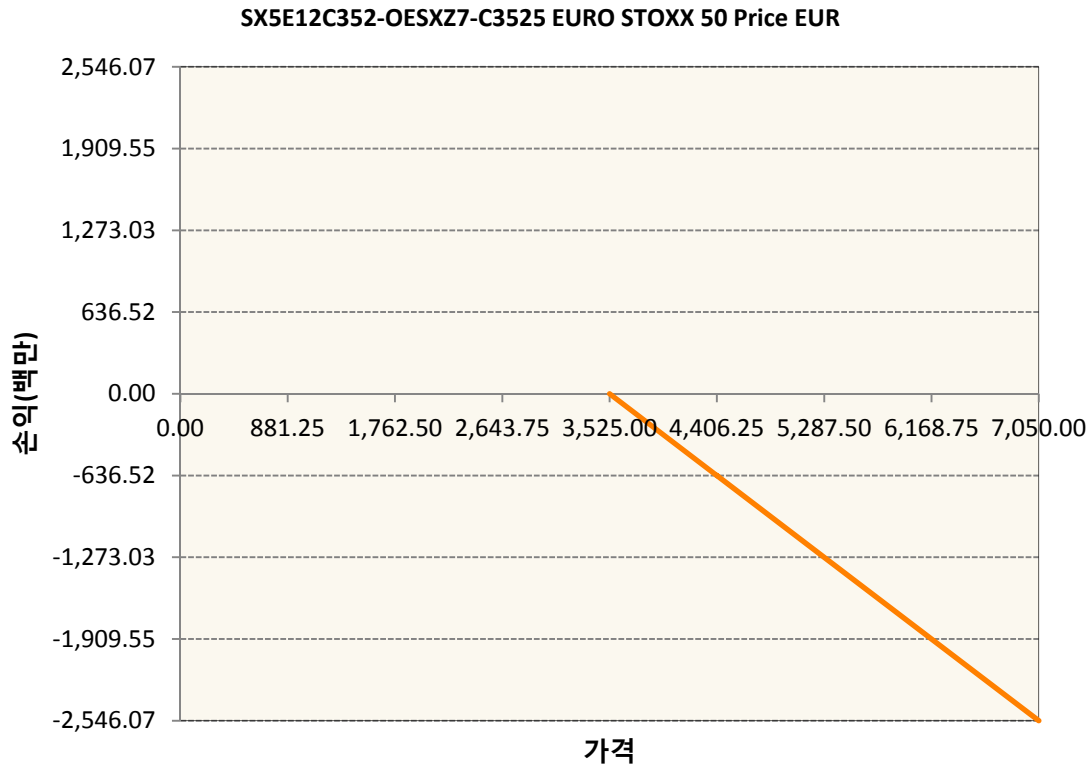
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

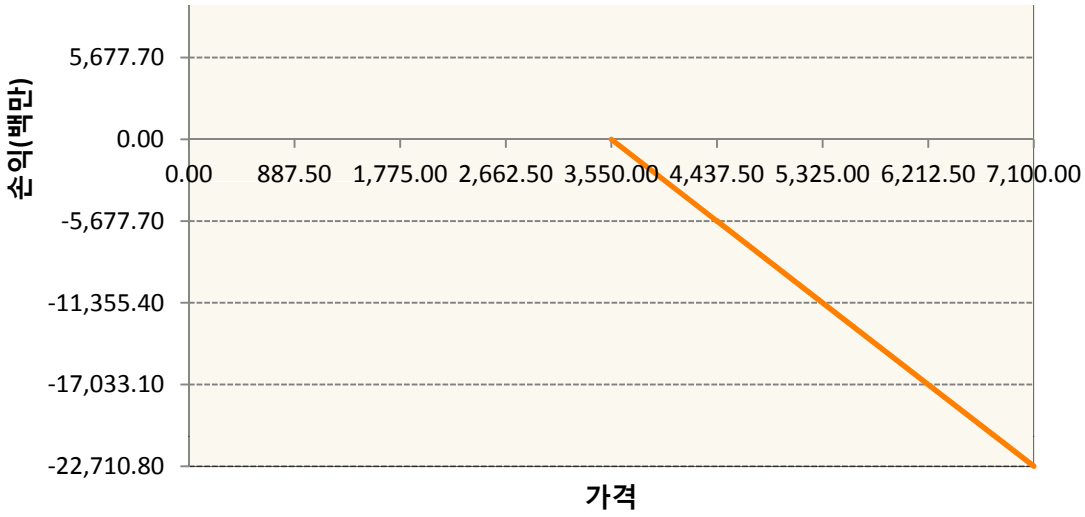
(단위:백만원)

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	17,177	0	17,177	
누계	유가증권	스왑	96,738	0	96,738	장외
누계	유가증권	옵션	0	50,514	-50,514	장내
누계	지수	스왑	51,594	0	51,594	장외

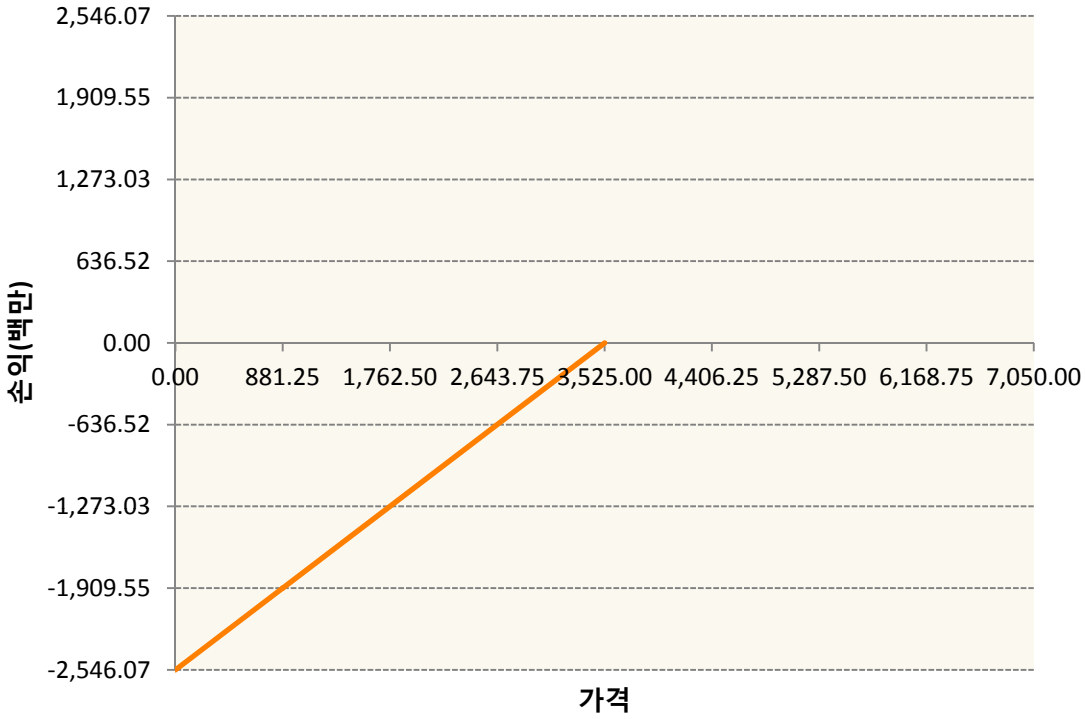
2. 만기시점의 손익구조



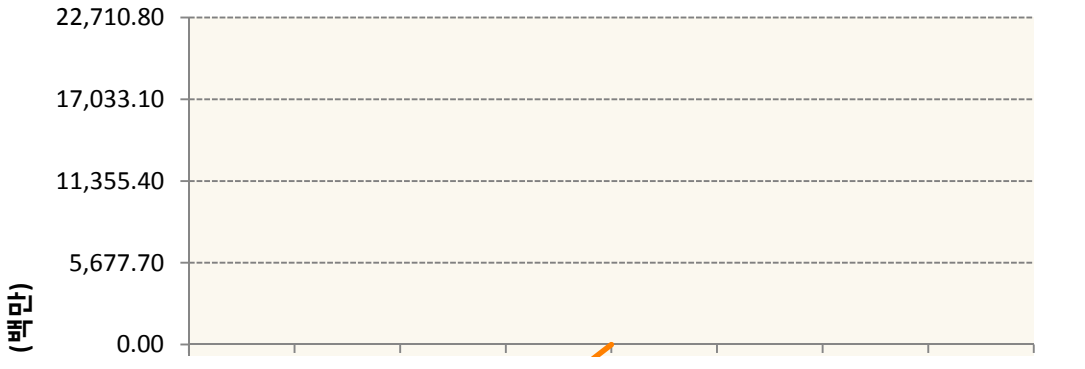


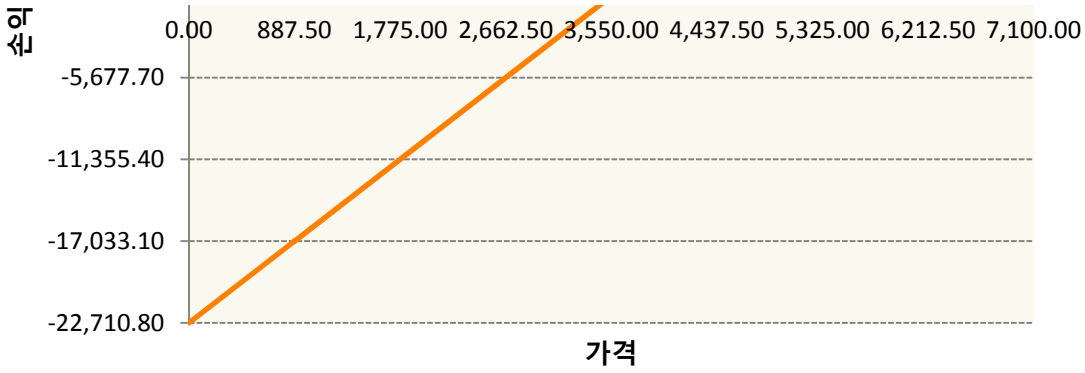


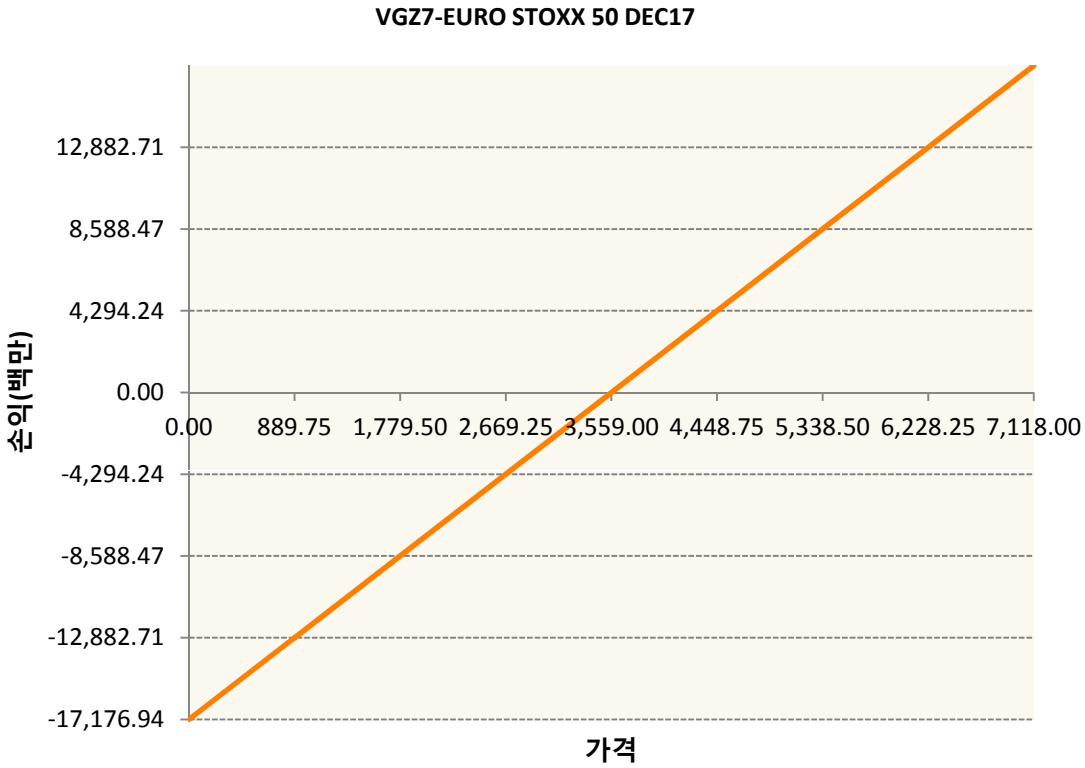
SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR



SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	31
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	16
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	204
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,817
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	204
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,817
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,374

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

3,100

공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

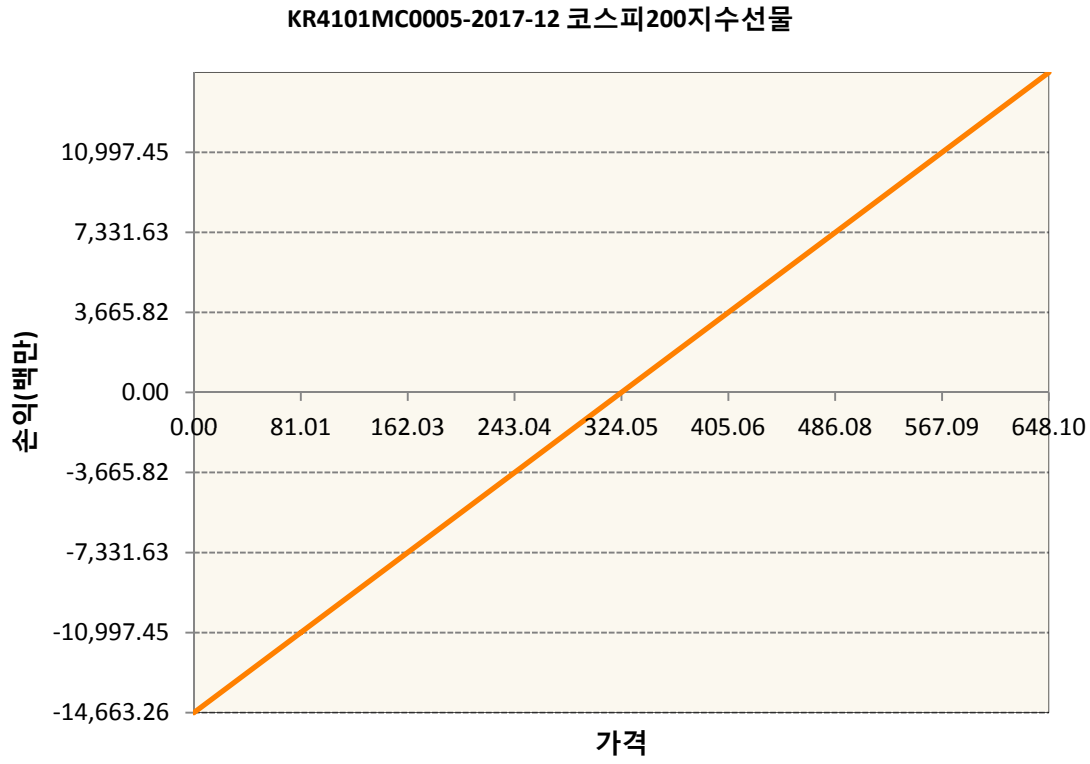
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,663	0	14,663	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101MC0	2017-12 코스피200지수선물						1,171
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,171	-1,171	-1,171	-1,171	-1,171	-1,171	-1,171
-5.33%	-781	-781	-781	-781	-781	-781	-781
-2.67%	-390	-390	-390	-390	-390	-390	-390
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	390	390	390	390	390	390	390
5.33%	781	781	781	781	781	781	781
8.00%	1,171	1,171	1,171	1,171	1,171	1,171	1,171

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

695

공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

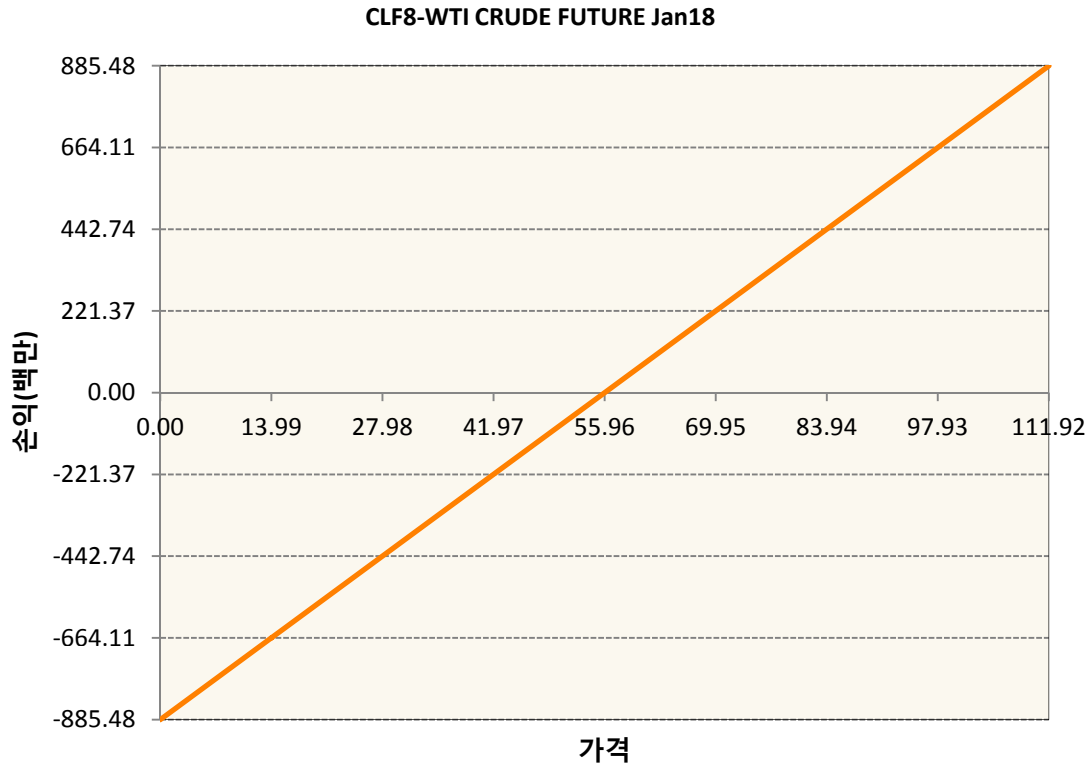
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

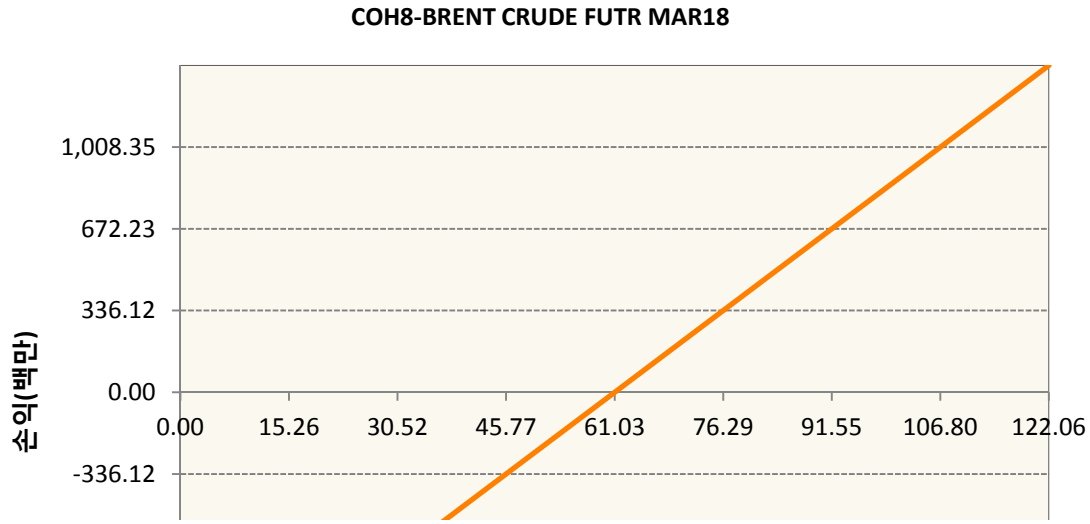
1. 계약금액

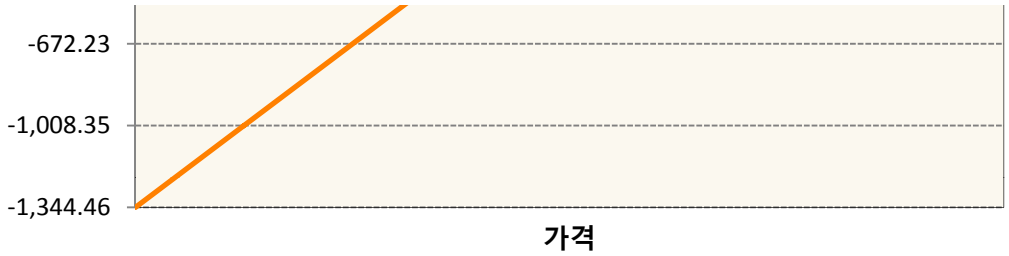
(단위:백만원)

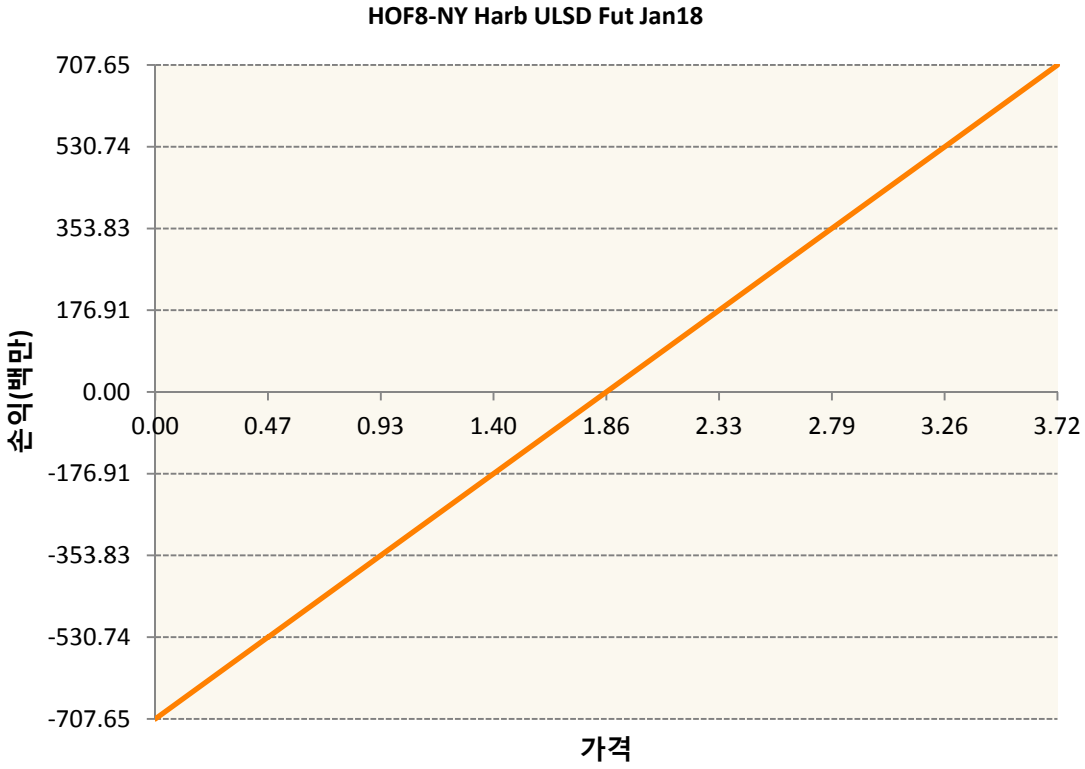
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,844	876	3,968	

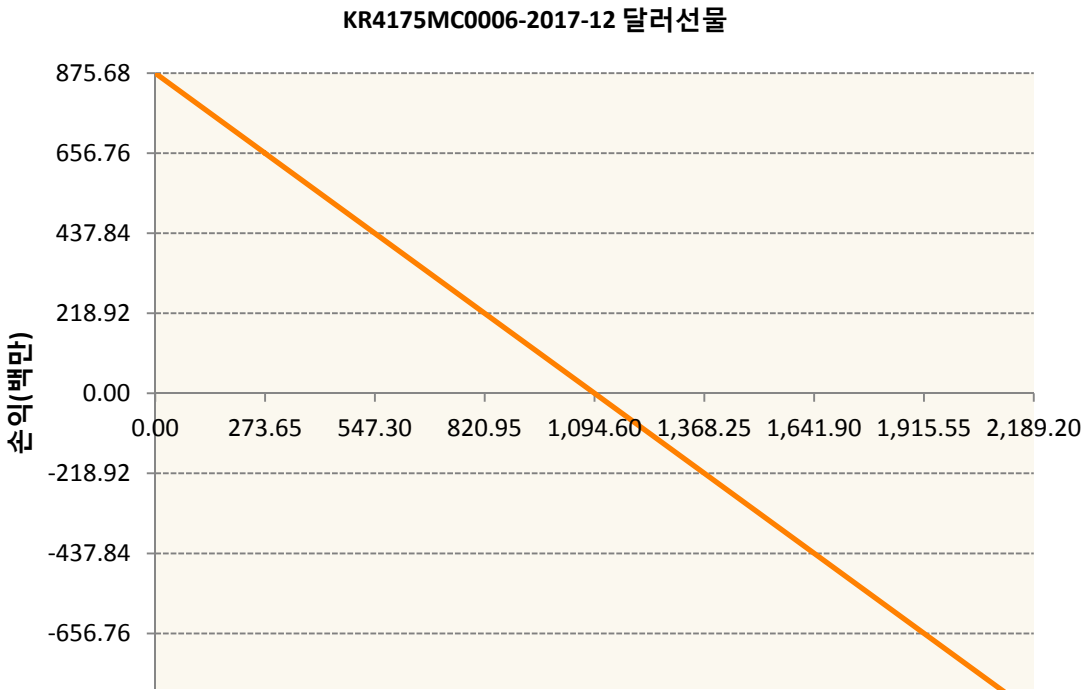
2. 만기시점의 손익구조

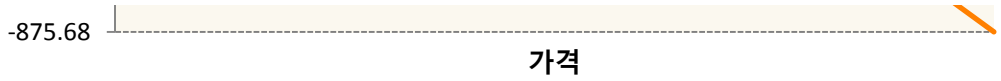


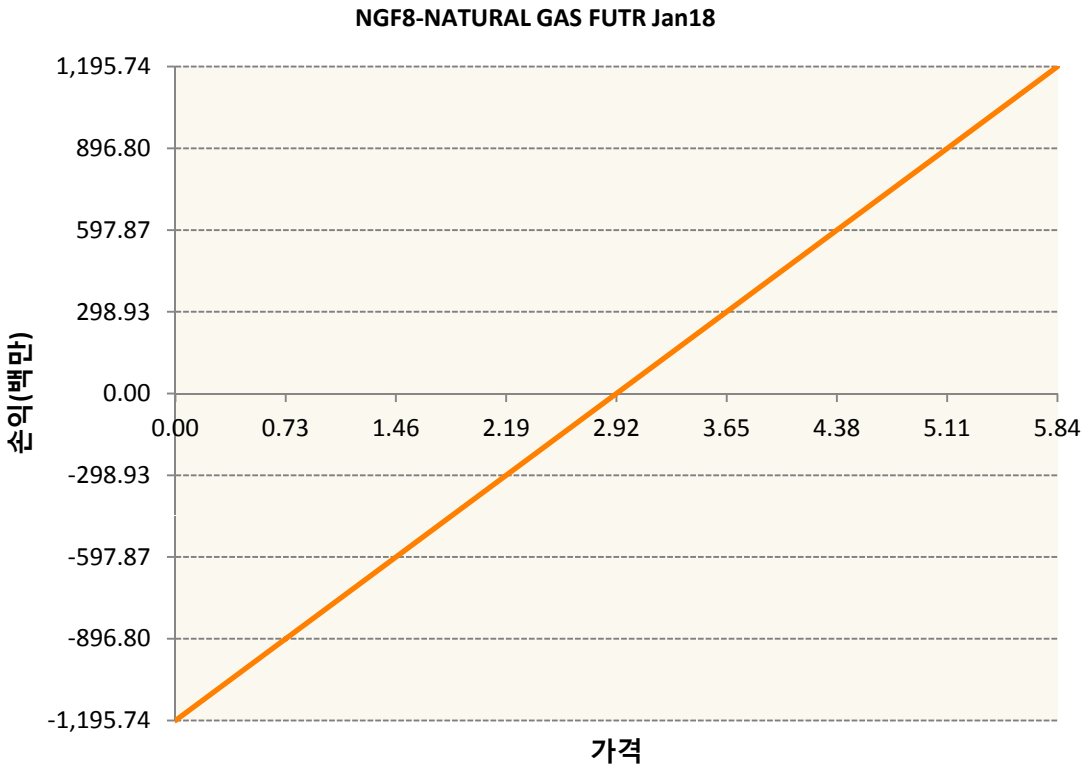


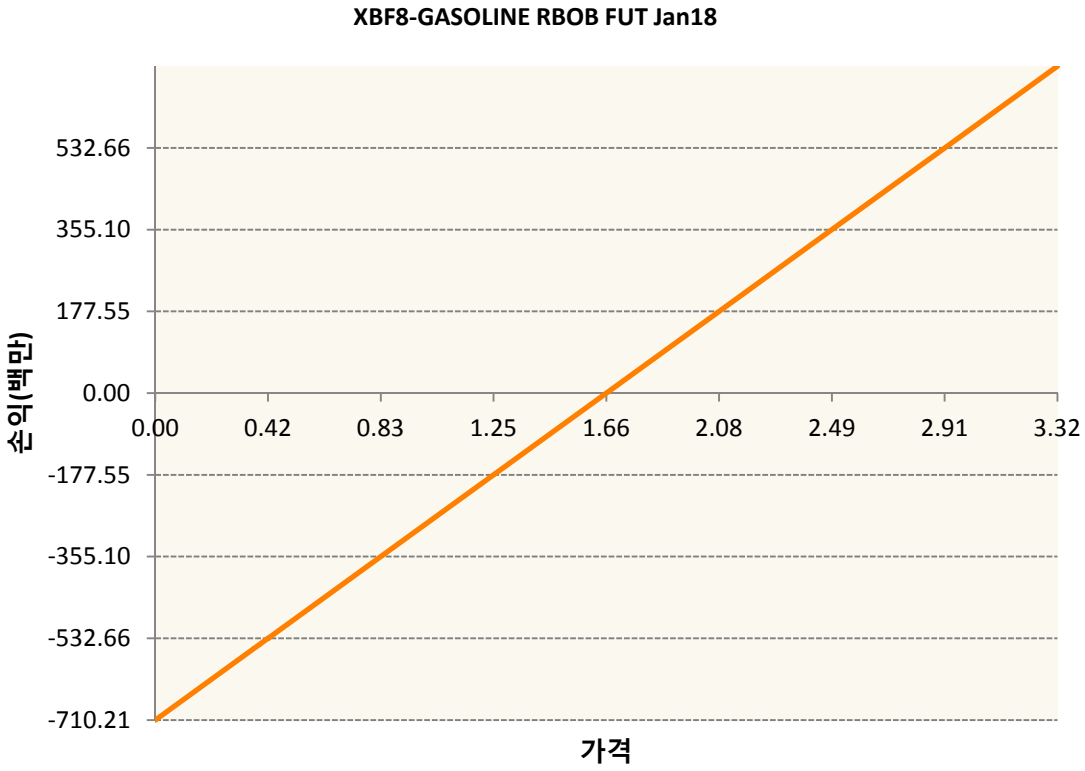

-672.23
-1,008.35
-1,344.46
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
707.65
530.74
353.83
176.91
0.00
-176.91
-353.83
-530.74
-707.65
0.00
0.47
0.93
1.40
1.86
2.33
2.79
3.26
3.72
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
875.68
656.76
437.84
218.92
0.00
-218.92
-437.84
-656.76
0.00
273.65
547.30
820.95
1,094.60
1,368.25
1,641.90
1,915.55
2,189.20
손익(백만)


-875.68
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,195.74
896.80
597.87
298.93
0.00
-298.93
-597.87
-896.80
-1,195.74
0.00
0.73
1.46
2.19
2.92
3.65
4.38
5.11
5.84
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
532.66
355.10
177.55
0.00
-177.55
-355.10
-532.66
-710.21
0.00
0.42
0.83
1.25
1.66
2.08
2.49
2.91
3.32
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	71
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	108
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	57
KR4175MC0(	2017-12 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	96
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	57

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

663

공시일	2017-12-08
기준일	2017-12-07

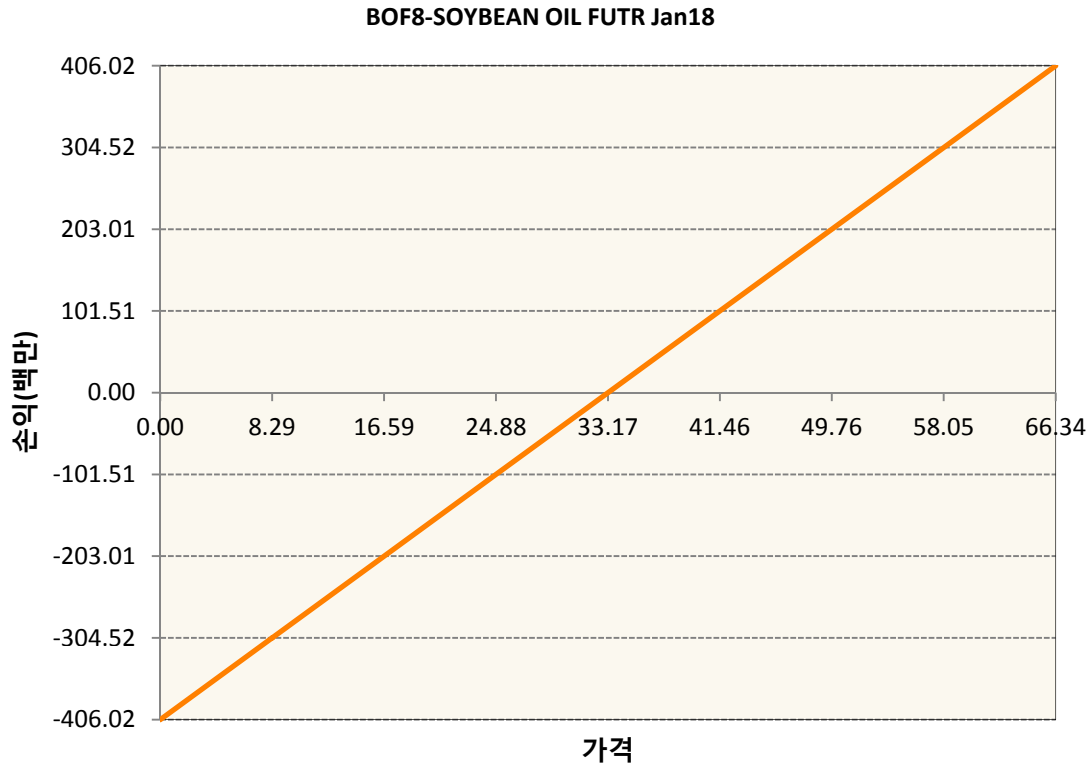
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

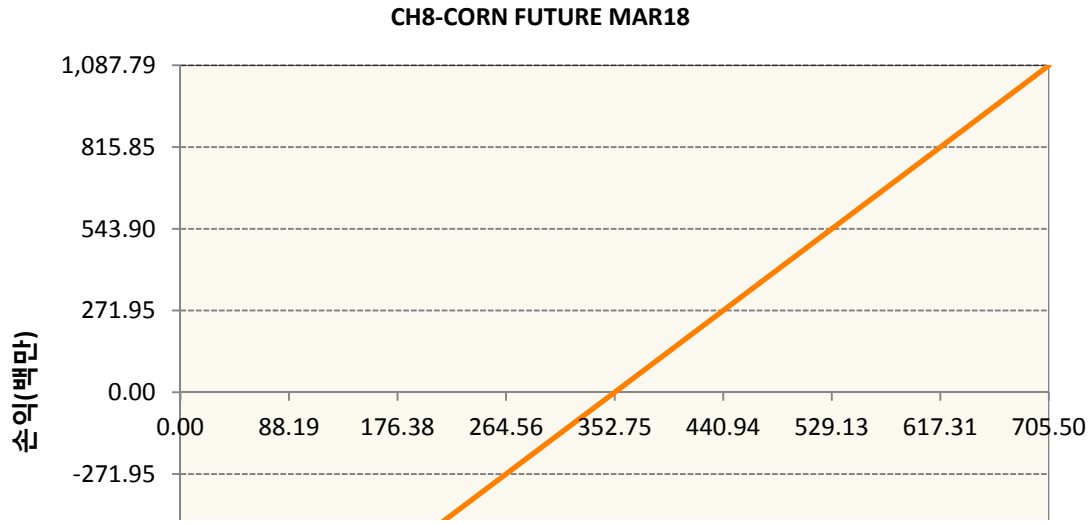
1. 계약금액

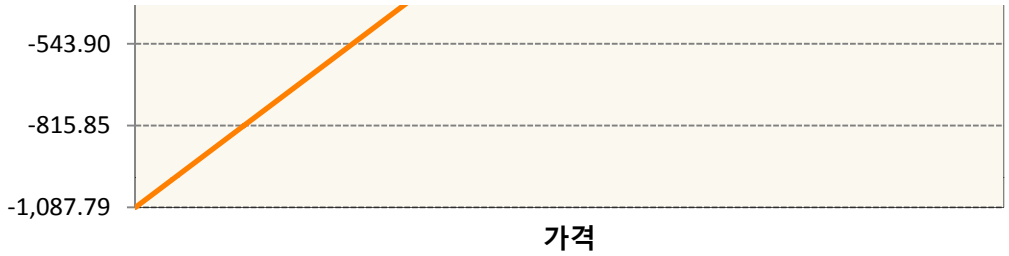
(단위:백만원)

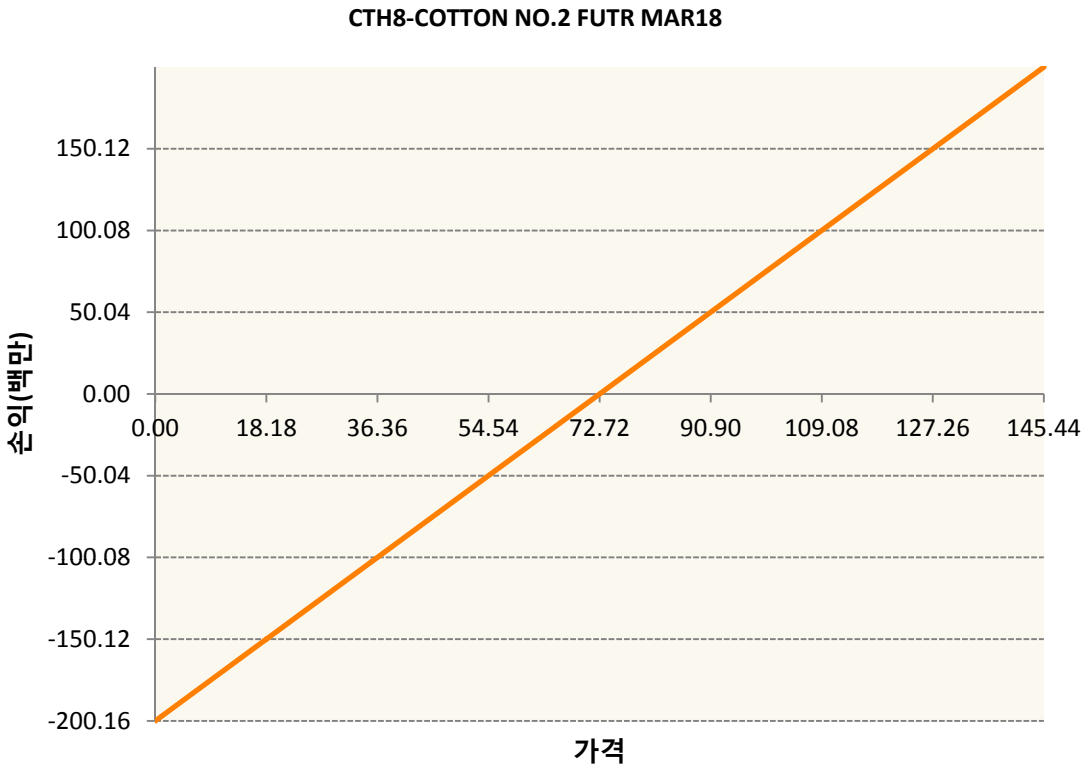
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,438	328	4,110	

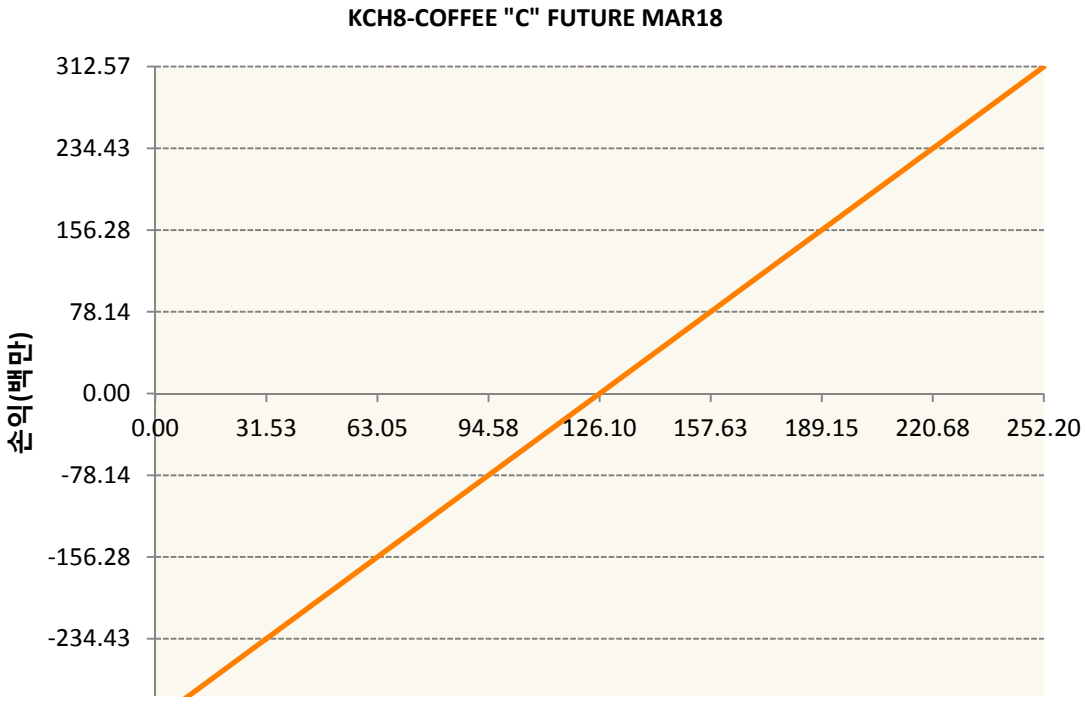
2. 만기시점의 손익구조

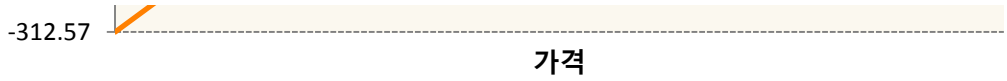


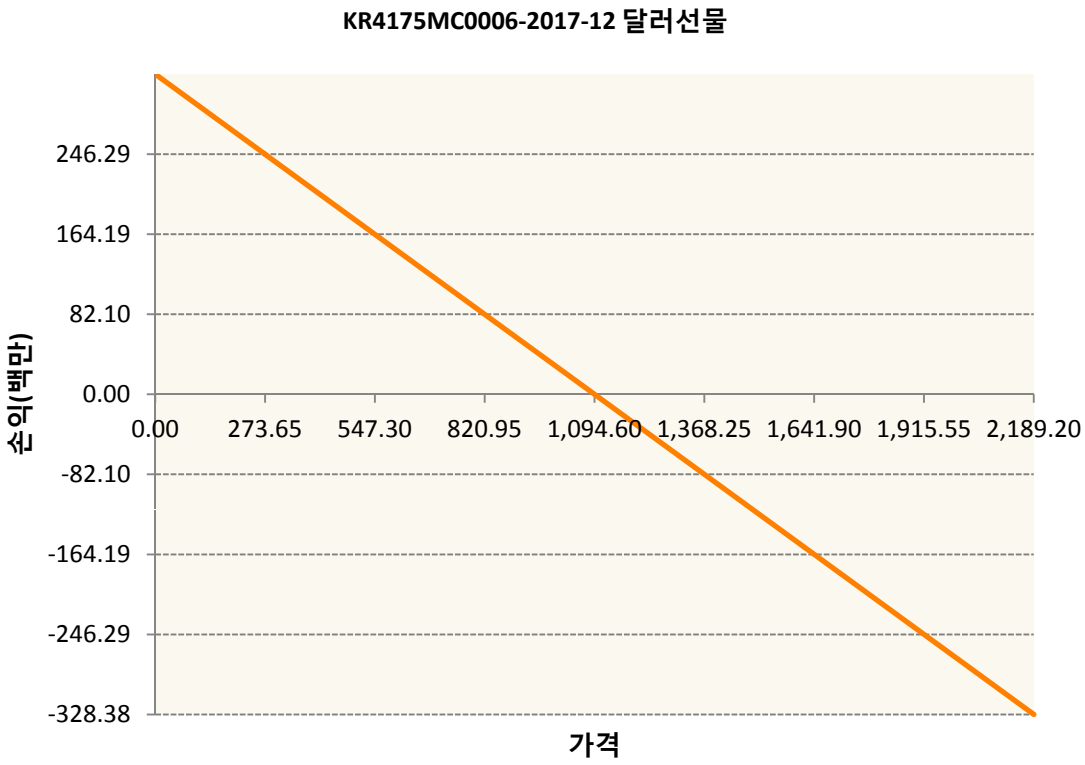


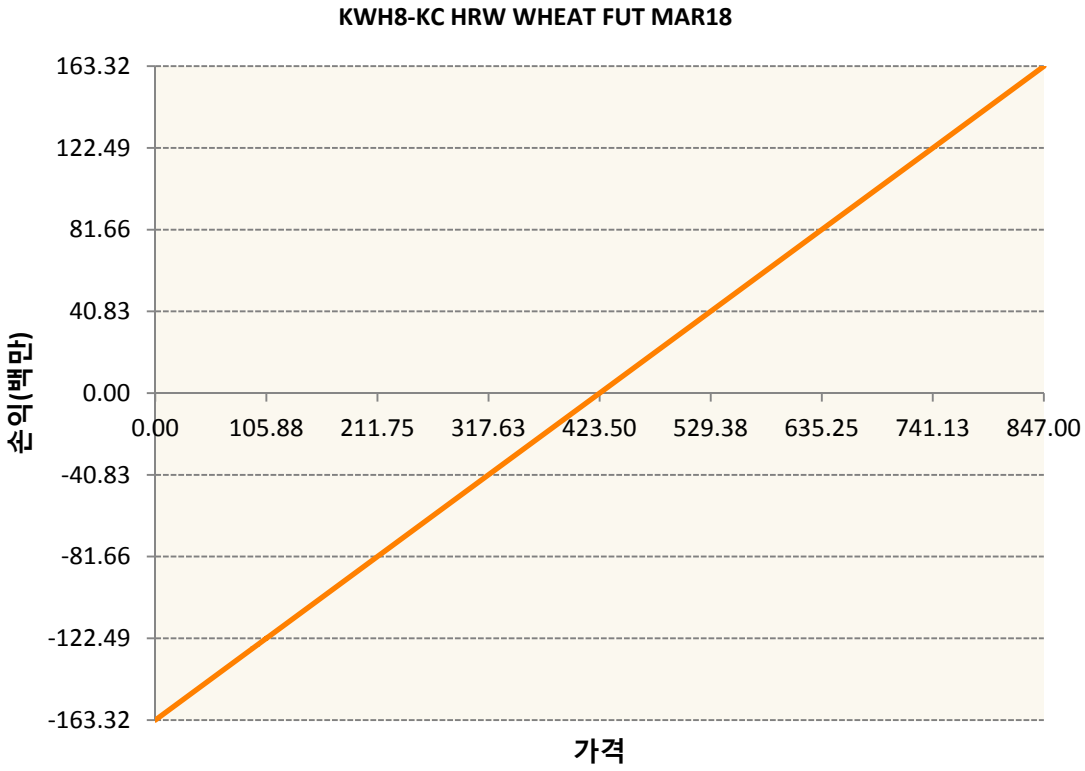

-543.90
-815.85
-1,087.79
가격

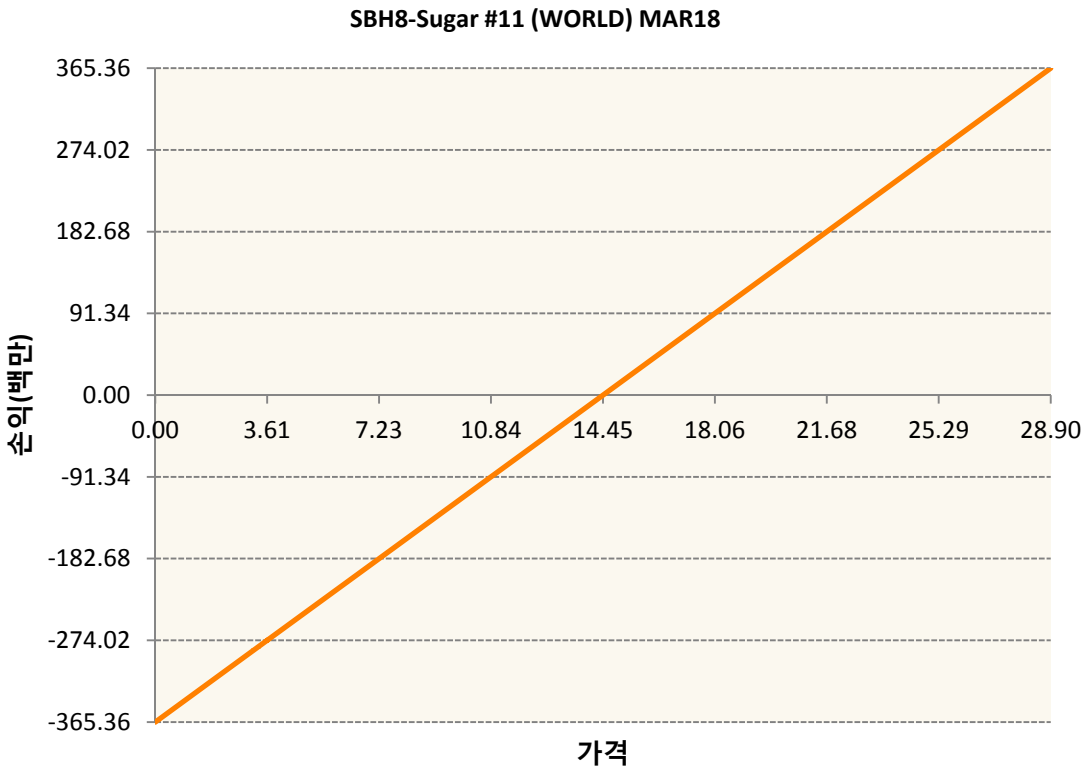

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
150.12
100.08
50.04
0.00
-50.04
-100.08
-150.12
-200.16
0.00
18.18
36.36
54.54
72.72
90.90
109.08
127.26
145.44
손익(백만)
가격

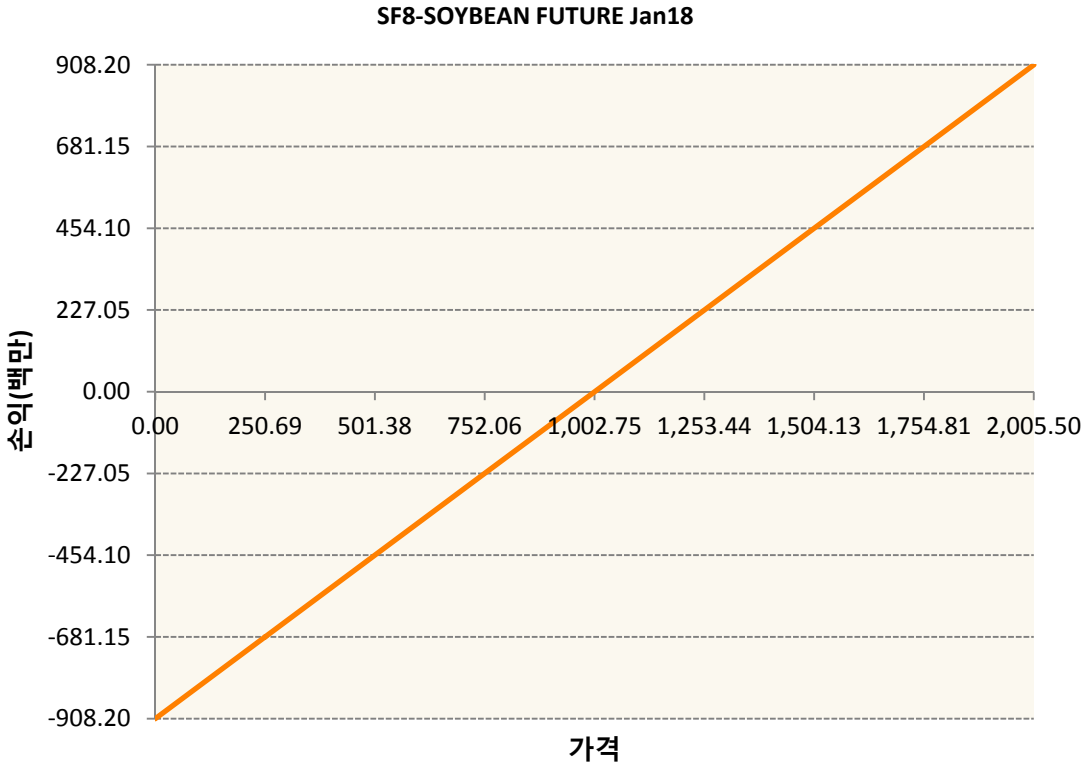

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
312.57
234.43
156.28
78.14
0.00
-78.14
-156.28
-234.43
0.00
31.53
63.05
94.58
126.10
157.63
189.15
220.68
252.20
손익(백만)


-312.57
가격

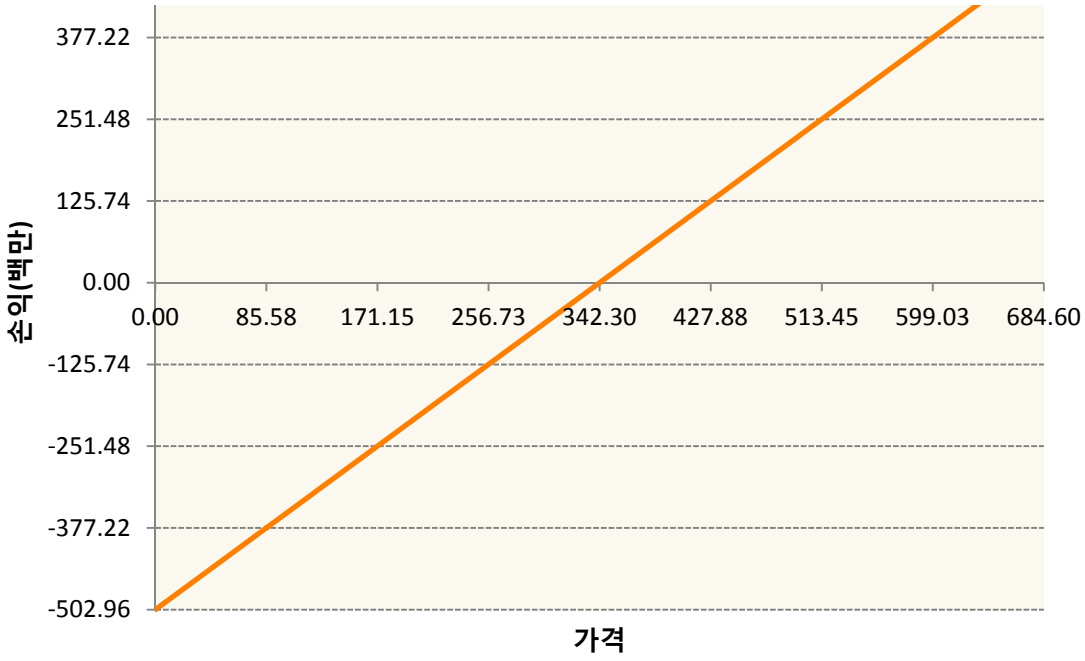

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
246.29
164.19
82.10
0.00
-82.10
-164.19
-246.29
-328.38
0.00
273.65
547.30
820.95
1,094.60
1,368.25
1,641.90
1,915.55
2,189.20
손익(백만)
가격

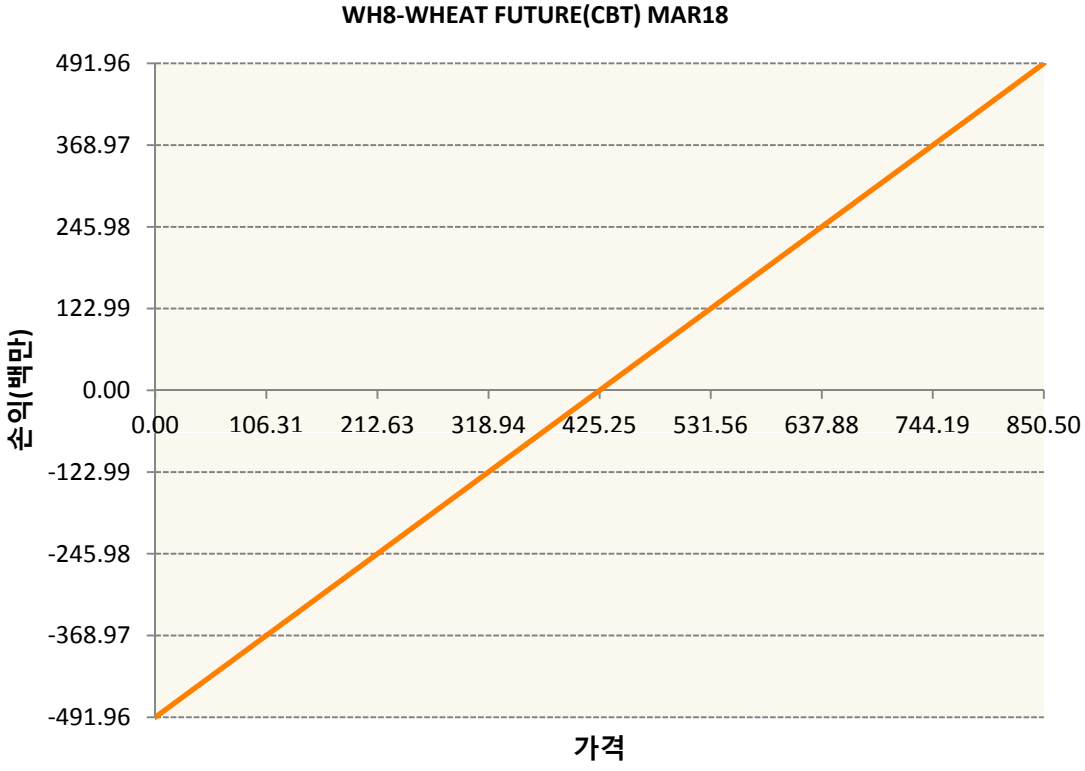

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
163.32
122.49
81.66
40.83
0.00
-40.83
-81.66
-122.49
-163.32
0.00
105.88
211.75
317.63
423.50
529.38
635.25
741.13
847.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
365.36
274.02
182.68
91.34
0.00
-91.34
-182.68
-274.02
-365.36
0.00
3.61
7.23
10.84
14.45
18.06
21.68
25.29
28.90
손익(백만)
가격


SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18
908.20
681.15
454.10
227.05
0.00
-227.05
-454.10
-681.15
-908.20
0.00
250.69
501.38
752.06
1,002.75
1,253.44
1,504.13
1,754.81
2,005.50
손익(백만)
가격


SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18
502.96





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	32
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	29
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	73
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	40
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	39

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

382