공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

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	2017-12-18
기준일	2017-12-15

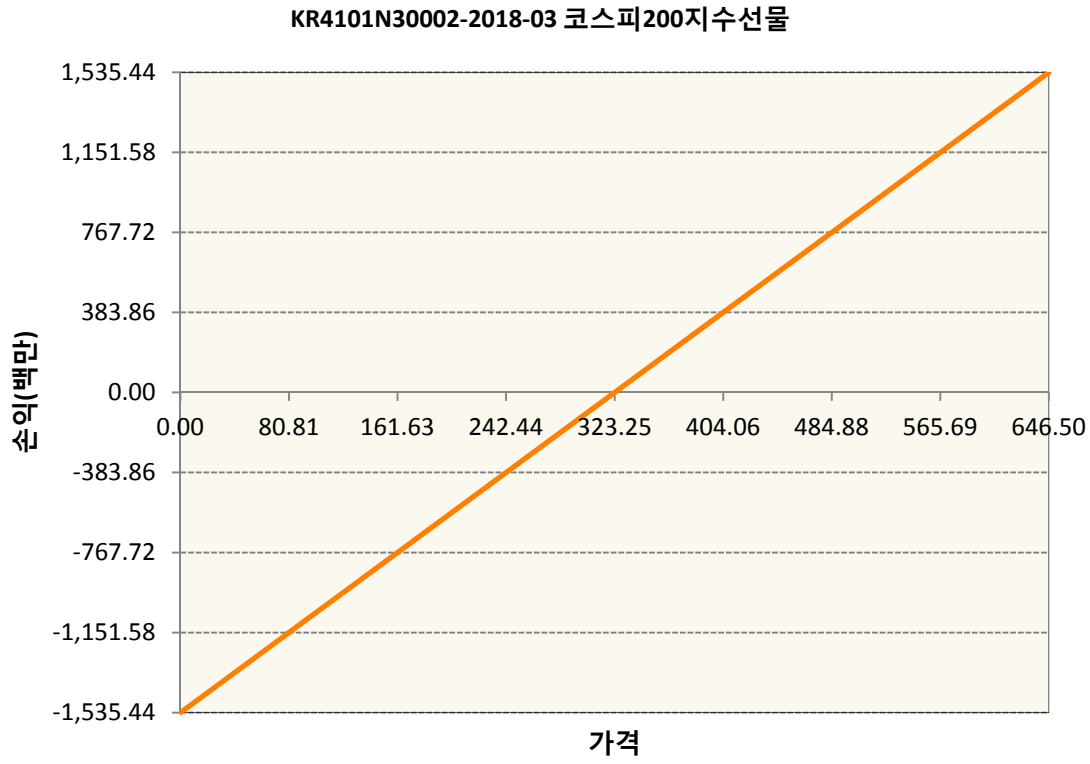
스마트인덱스모

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	1,535	0	1,535	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-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%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

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

71

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,365	0	13,365	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S171122	1,086

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

347

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

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	4,901	0	4,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S171208	399

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

372

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

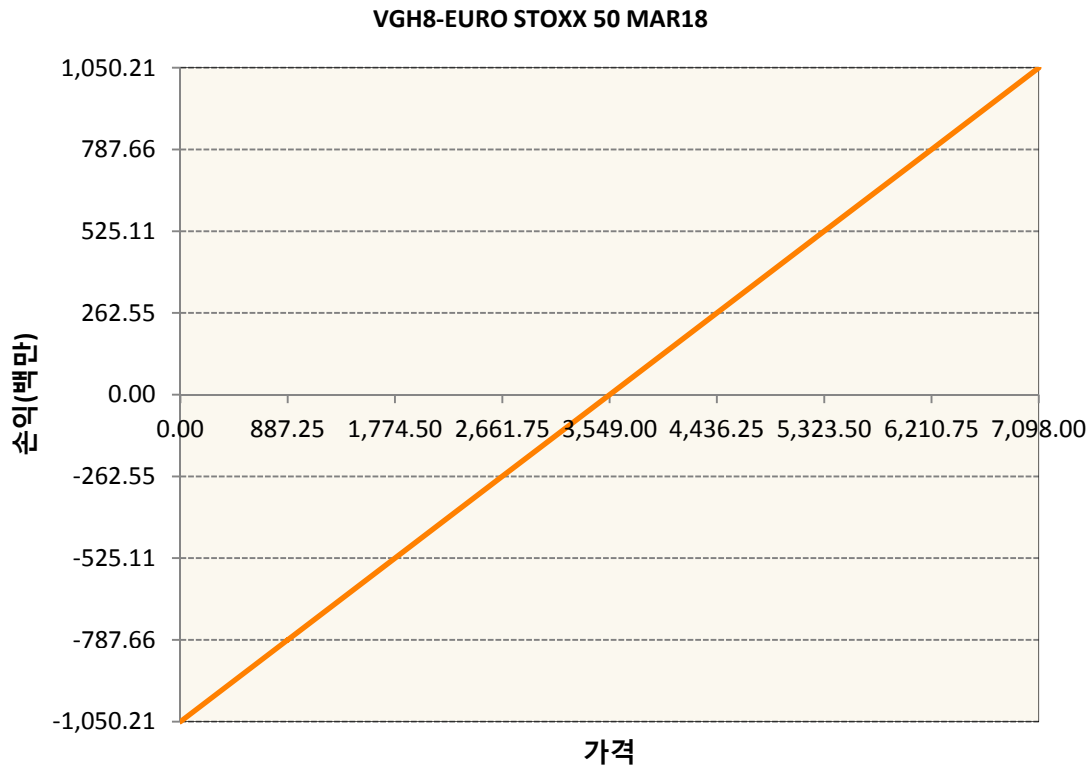
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,050	0	1,050	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	84

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

(단위:백만원)

48

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

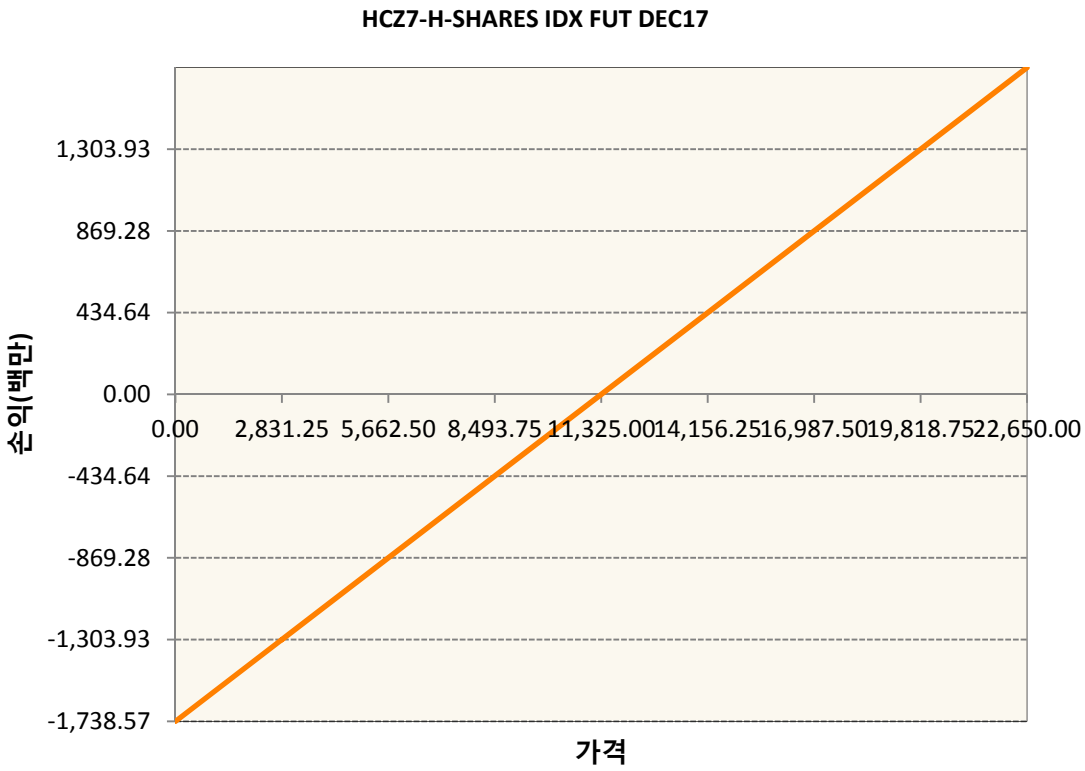
차이나인덱스모(주식-파생형)

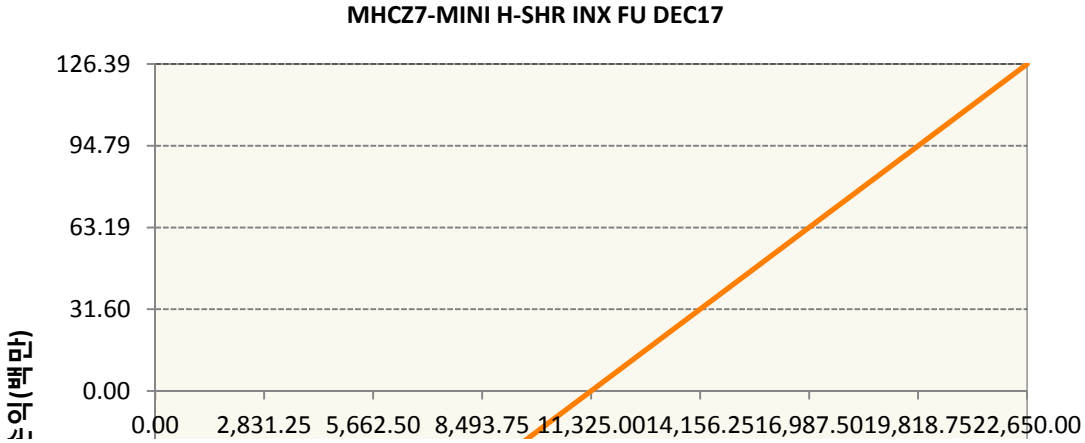
1. 계약금액

(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	1,739	0	1,739	
누계	유가증권	선물	126	0	126	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	139
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	96

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

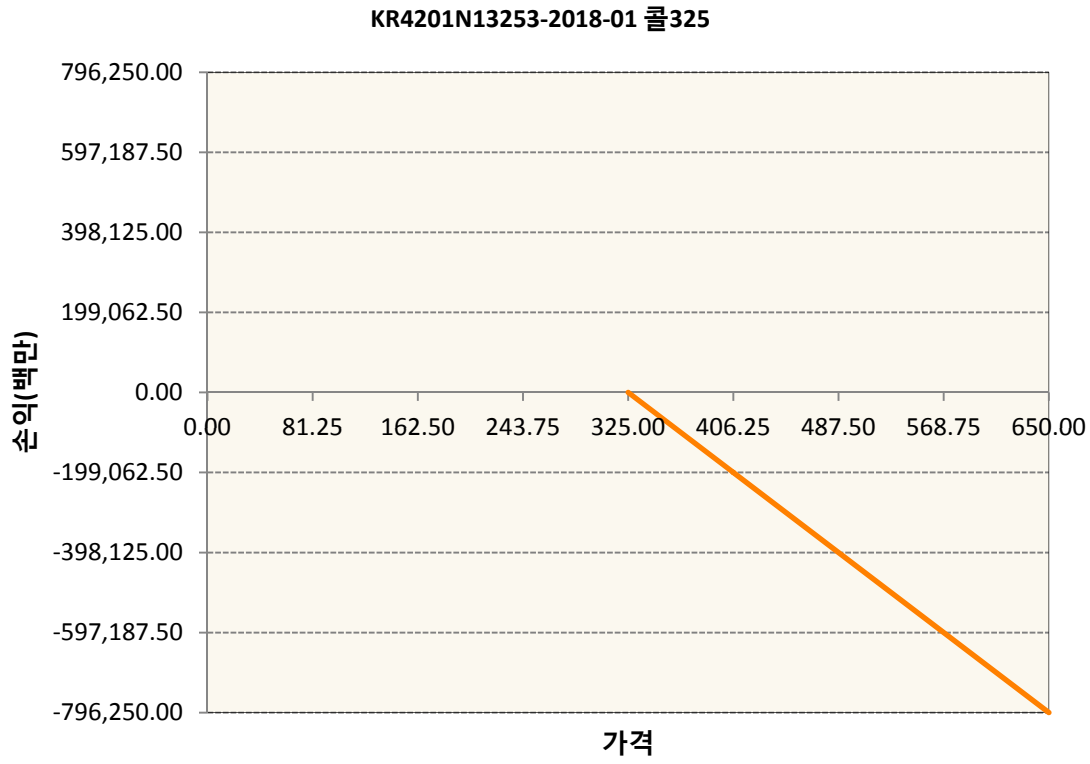
커버드콜모(주식혼합-파생형)

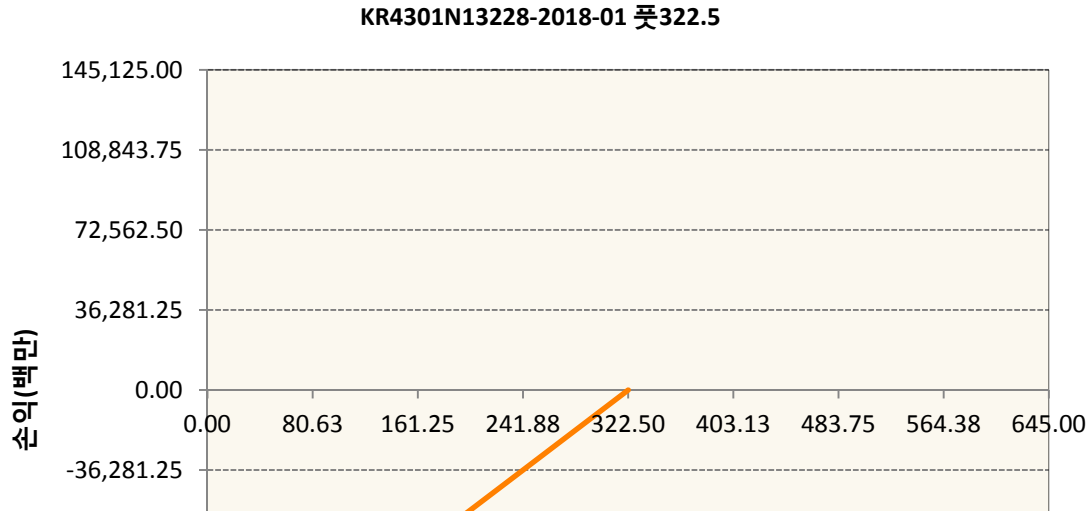
1. 계약금액

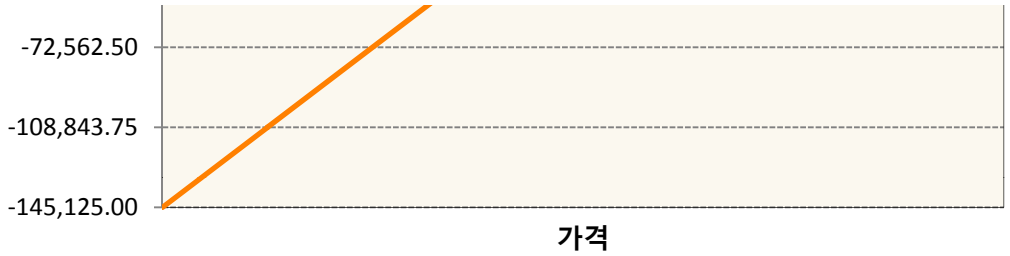
(단위:백만원)

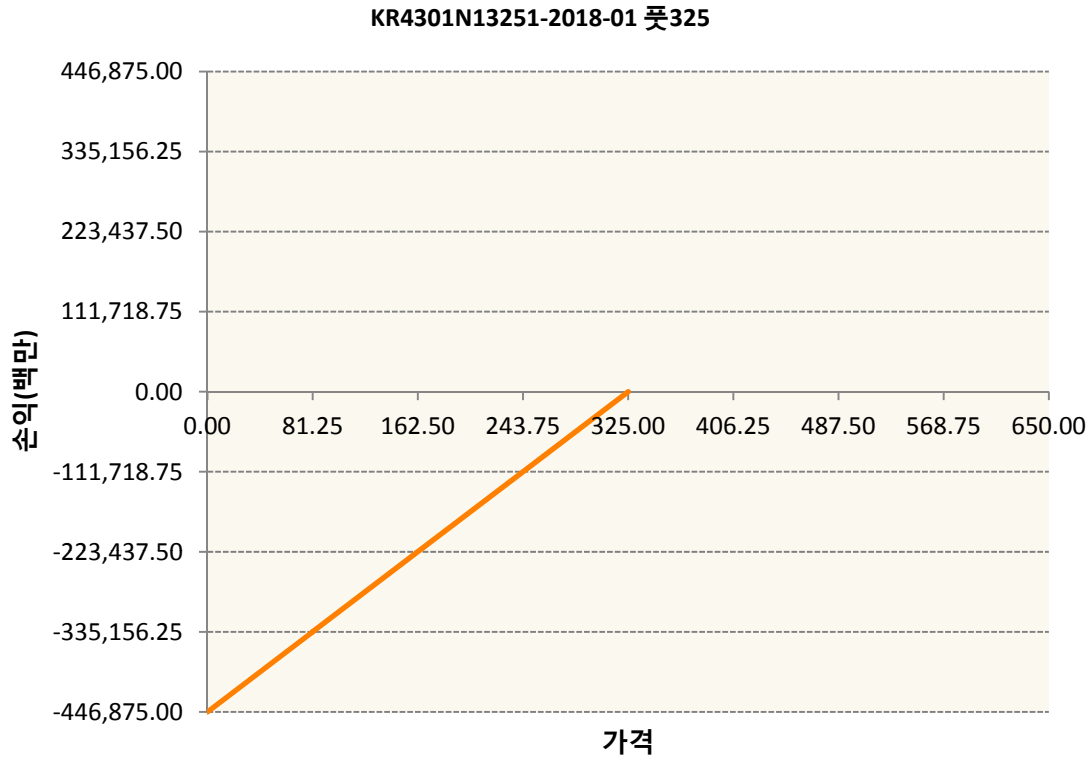
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,344,498	-1,344,498	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,388,250	-1,388,250	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							50,303
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22,054	21,494	20,810	20,013	19,118	18,137	17,080
-5.33%	19,797	18,701	17,511	16,245	14,917	13,537	12,116
-2.67%	14,620	13,023	11,399	9,754	8,093	6,420	4,736
0%	5,318	3,546	1,773	0	-1,774	-3,548	-5,322
2.67%	-8,360	-9,888	-11,462	-13,072	-14,710	-16,369	-18,047
5.33%	-25,594	-26,638	-27,794	-29,041	-30,362	-31,746	-33,181
8.00%	-45,082	-45,658	-46,370	-47,204	-48,146	-49,183	-50,303
KR4301N132 2018-01 풋322.5							8,958
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,874	-8,877	-8,883	-8,893	-8,909	-8,930	-8,958

-5.33%	-5,013	-5,050	-5,097	-5,155	-5,222	-5,297	-5,379
-2.67%	-1,610	-1,738	-1,871	-2,008	-2,147	-2,288	-2,430
0%	428	288	145	0	-147	-295	-444
2.67%	1,049	998	934	861	778	687	589
5.33%	1,132	1,125	1,112	1,093	1,067	1,033	991
8.00%	1,136	1,136	1,135	1,132	1,127	1,119	1,107
KR4301N132 2018-01 풋325							29,299

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29,141	-29,145	-29,154	-29,171	-29,199	-29,241	-29,299
-5.33%	-17,258	-17,323	-17,415	-17,536	-17,685	-17,860	-18,059
-2.67%	-6,218	-6,533	-6,872	-7,230	-7,604	-7,991	-8,388
0%	1,421	948	475	0	-475	-951	-1,427
2.67%	4,333	4,095	3,824	3,526	3,204	2,863	2,506
5.33%	4,838	4,794	4,726	4,632	4,510	4,362	4,187
8.00%	4,875	4,872	4,864	4,848	4,821	4,780	4,723

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

91,254

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

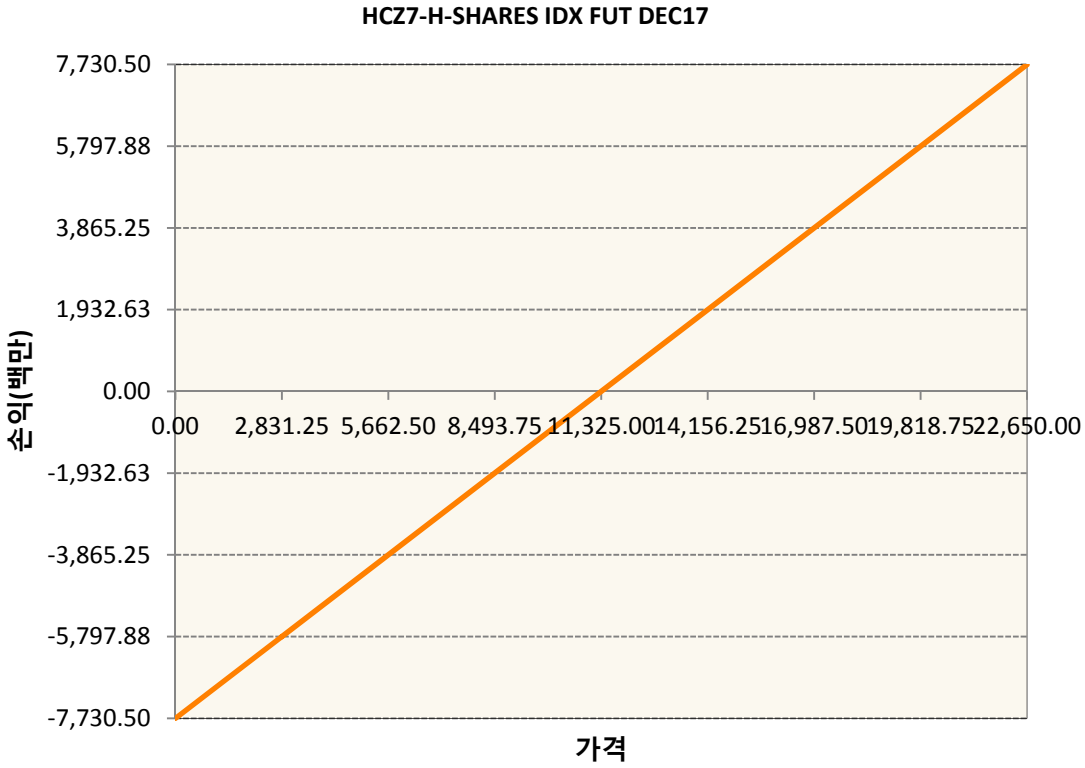
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

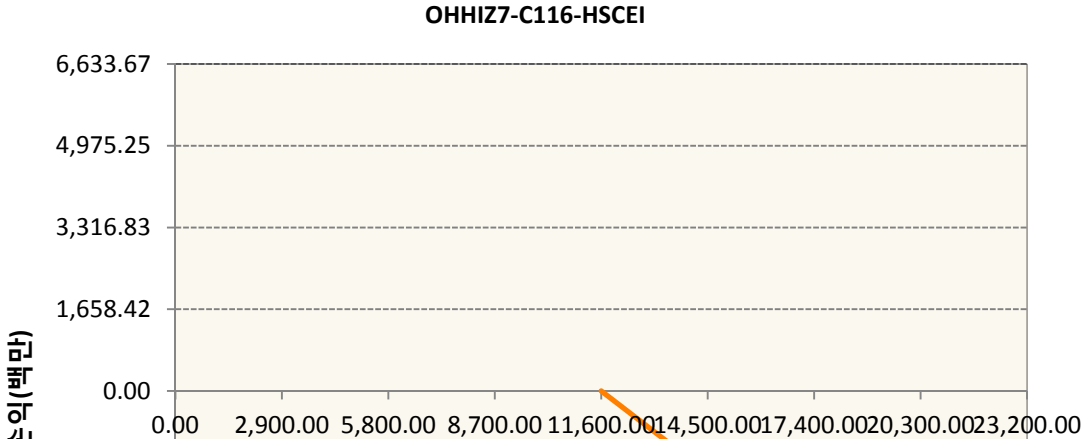
1. 계약금액

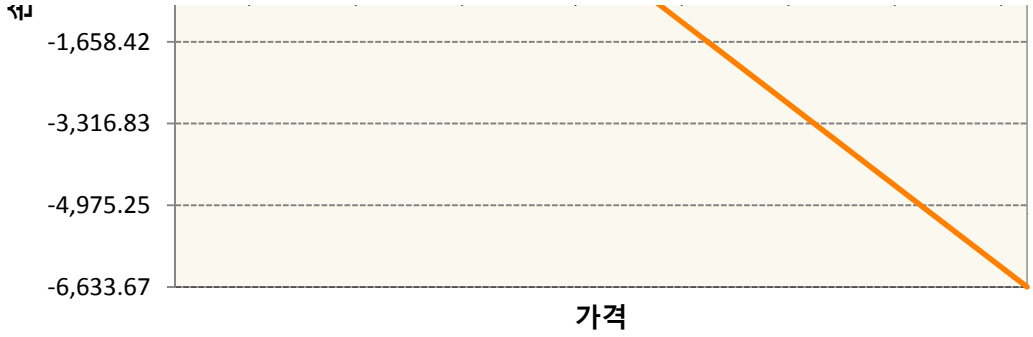
(단위:백만원)

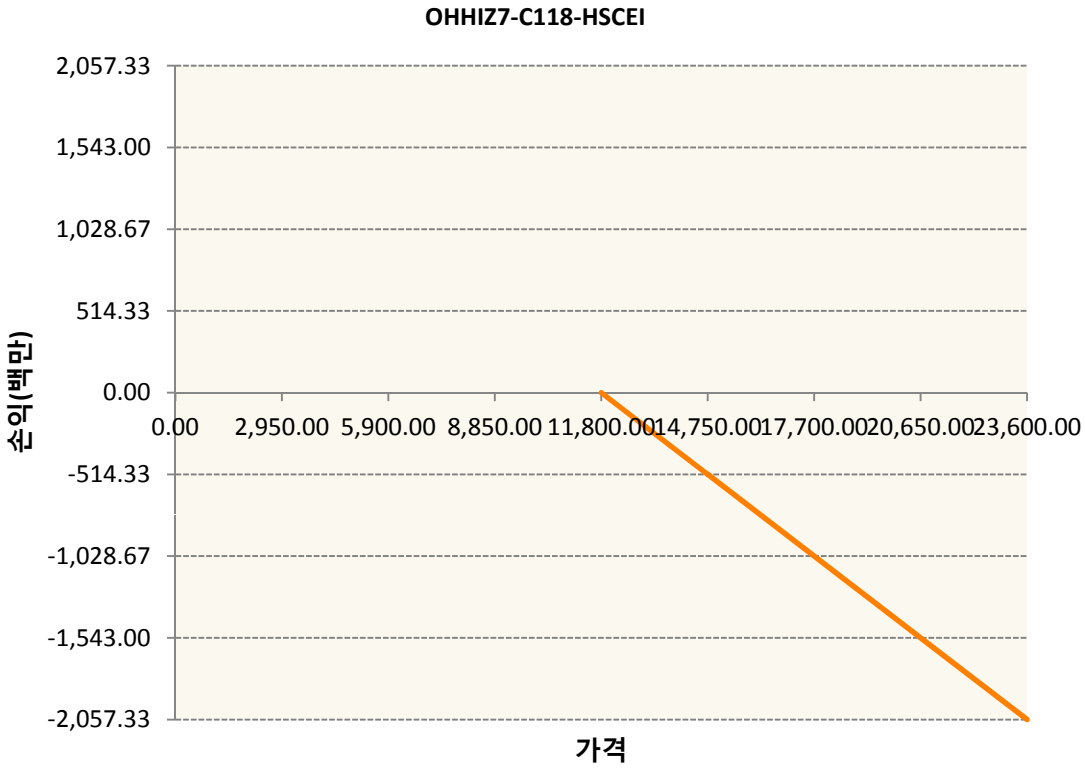
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,731	0	7,731	
누계	유가증권	옵션	0	17,382	-17,382	장내

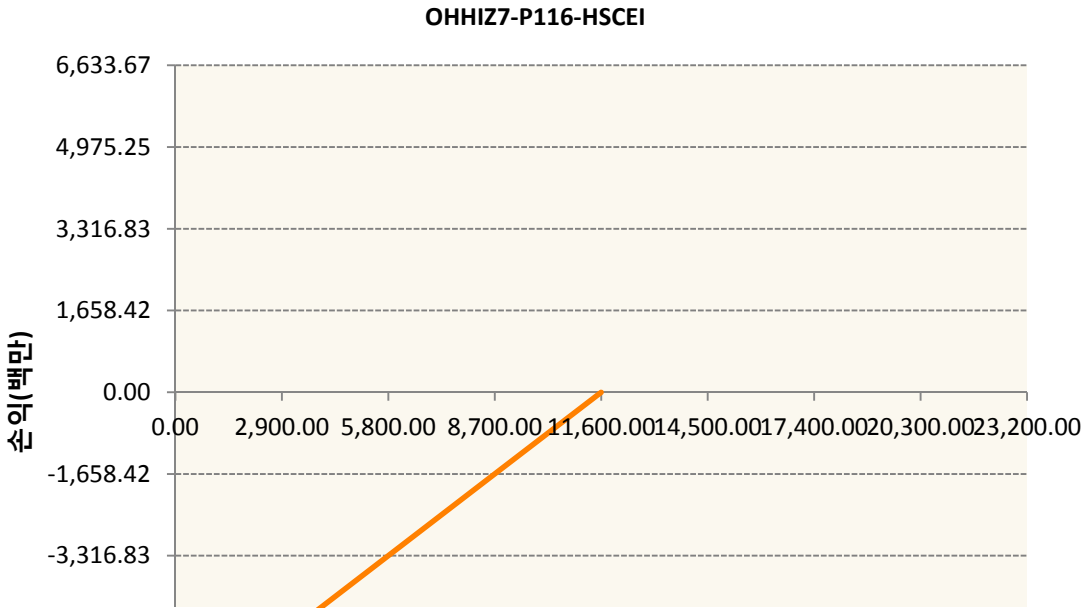
2. 만기시점의 손익구조

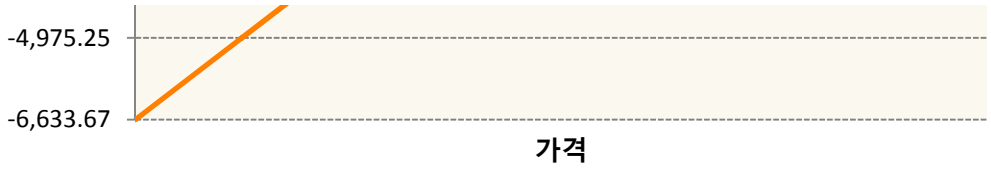


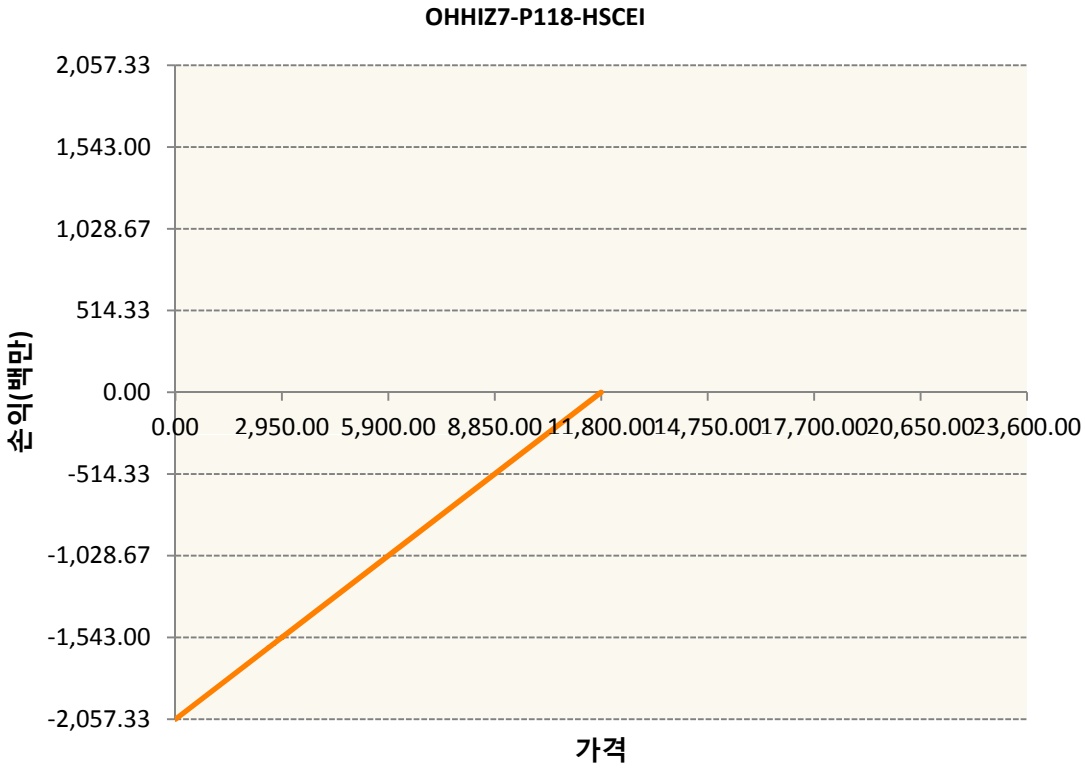



-1,658.42
-3,316.83
-4,975.25
-6,633.67
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,057.33
1,543.00
1,028.67
514.33
0.00
-514.33
-1,028.67
-1,543.00
-2,057.33
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
손익(백만)
가격


OHHIZ7-P116-HSCEI
6,633.67
4,975.25
3,316.83
1,658.42
0.00
-1,658.42
-3,316.83
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
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	618
OHHIZ7-C11	HSCEI	531
OHHIZ7-C11	HSCEI	165
OHHIZ7-P11	HSCEI	531
OHHIZ7-P11	HSCEI	165

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

1,495

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

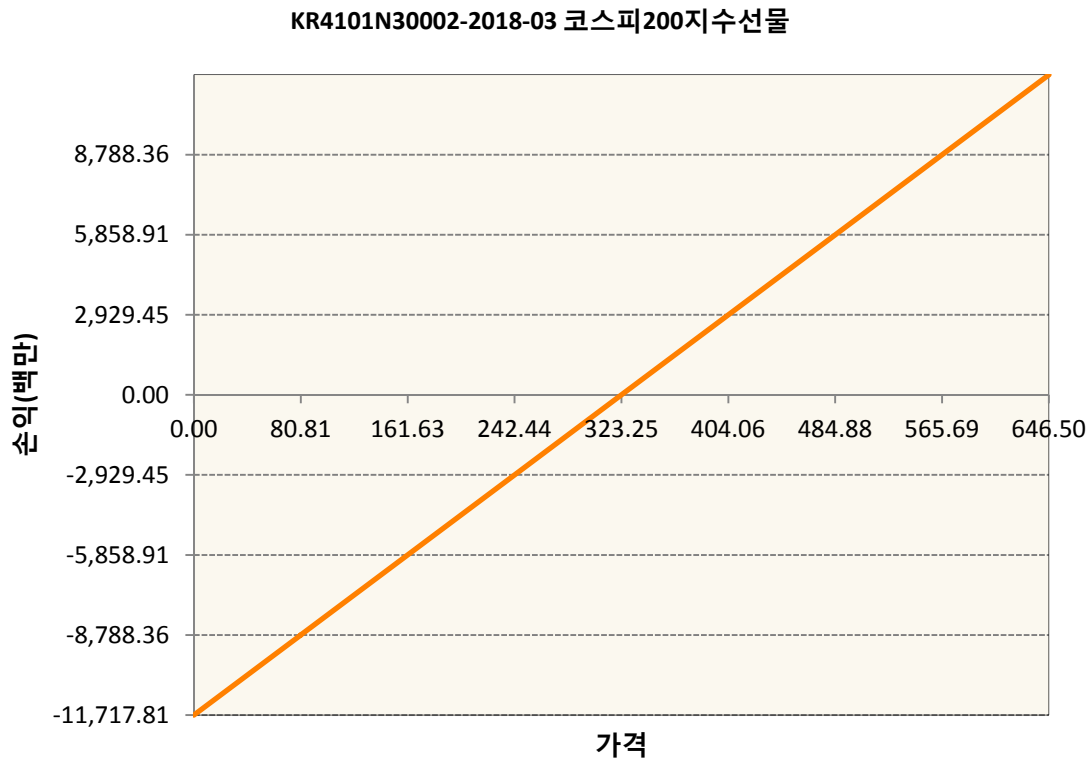
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

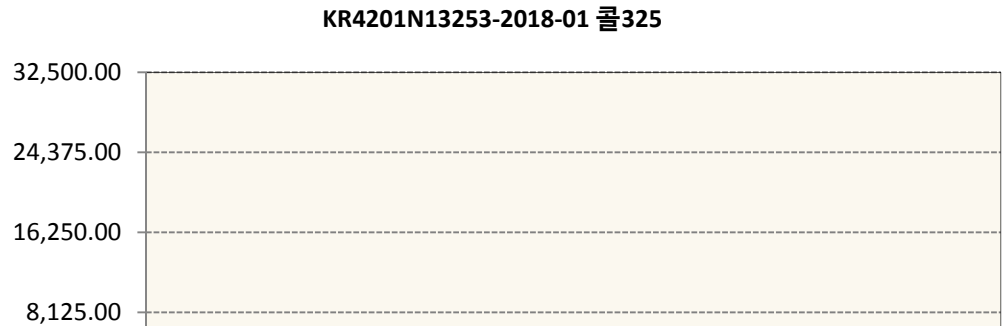
1. 계약금액

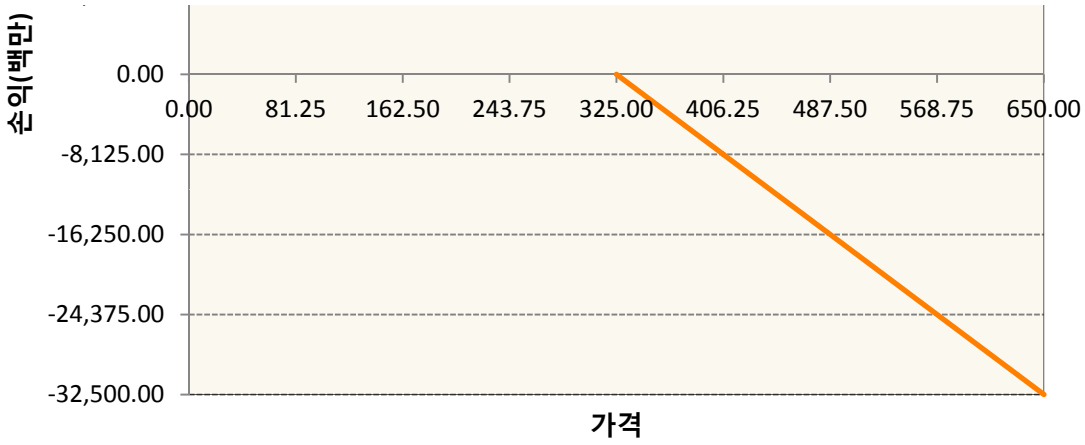
(단위:백만원)

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	61,477	-61,477	장내
누계	유가증권	선물	11,718	0	11,718	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,875	-60,875	장내

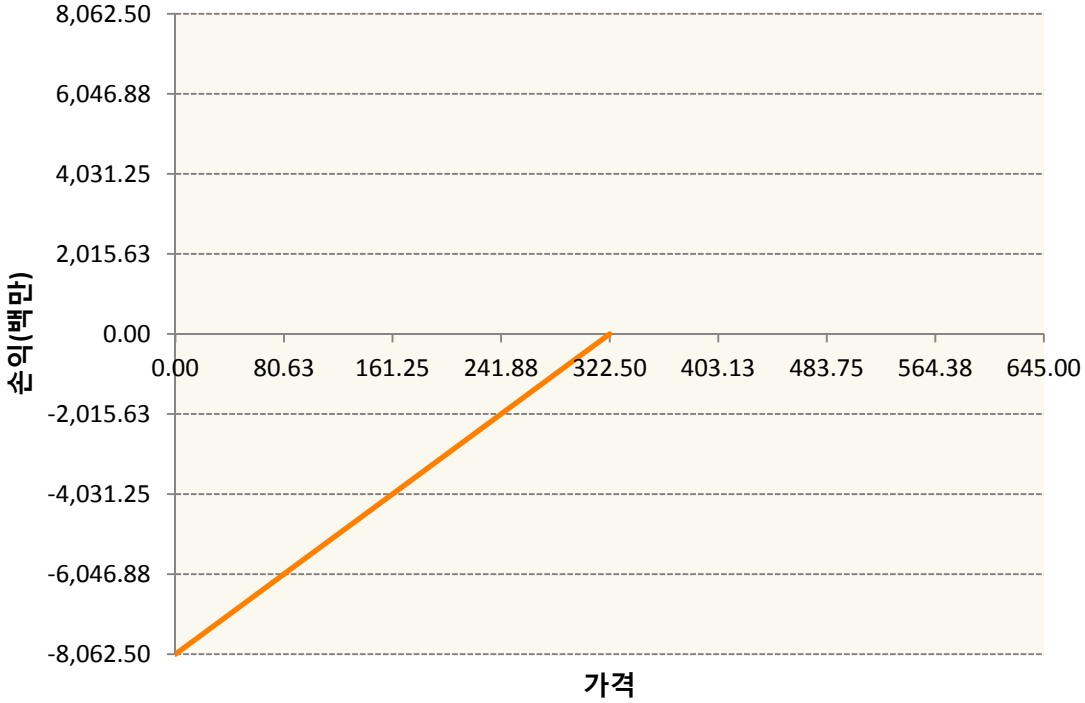
2. 만기시점의 손익구조



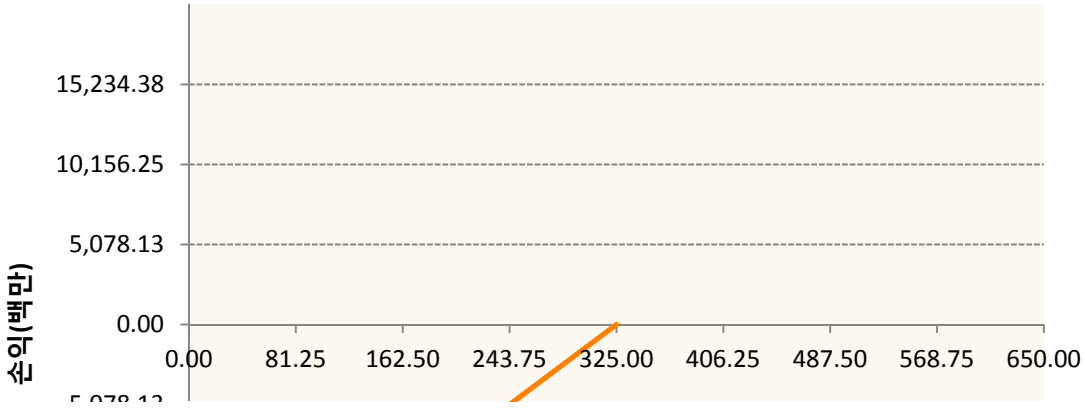




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465
-5.33%	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488
5.33%	976	976	976	976	976	976	976
8.00%	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465
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						253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						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%	-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%	469	469	469	469	469	469	469
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						312
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-5.33%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	104	104	104	104	104	104	104
5.33%	208	208	208	208	208	208	208
8.00%	312	312	312	312	312	312	312
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						633
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633
-5.33%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	422	422	422	422	422	422	422
8.00%	633	633	633	633	633	633	633
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						475
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	475	475	475	475	475	475	475
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						946
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-946	-946	-946	-946	-946	-946	-946
-5.33%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-2.67%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	315	315	315	315	315	315	315
5.33%	631	631	631	631	631	631	631
8.00%	946	946	946	946	946	946	946
	KR4201N13: 2018-01 콜325						2,053

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	900	877	849	817	780	740	697
-5.33%	808	763	715	663	609	553	495
-2.67%	597	532	465	398	330	262	193
0%	217	145	72	0	-72	-145	-217
2.67%	-341	-404	-468	-534	-600	-668	-737
5.33%	-1,045	-1,087	-1,134	-1,185	-1,239	-1,296	-1,354
8.00%	-1,840	-1,864	-1,893	-1,927	-1,965	-2,007	-2,053
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						498

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-493	-493	-493	-494	-495	-496	-498
-5.33%	-279	-281	-283	-286	-290	-294	-299
-2.67%	-89	-97	-104	-112	-119	-127	-135
0%	24	16	8	0	-8	-16	-25
2.67%	58	55	52	48	43	38	33
5.33%	63	62	62	61	59	57	55
8.00%	63	63	63	63	63	62	62
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,332

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,325	-1,325	-1,325	-1,326	-1,327	-1,329	-1,332
-5.33%	-784	-787	-792	-797	-804	-812	-821
-2.67%	-283	-297	-312	-329	-346	-363	-381
0%	65	43	22	0	-22	-43	-65
2.67%	197	186	174	160	146	130	114
5.33%	220	218	215	211	205	198	190
8.00%	222	221	221	220	219	217	215

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

9,318

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

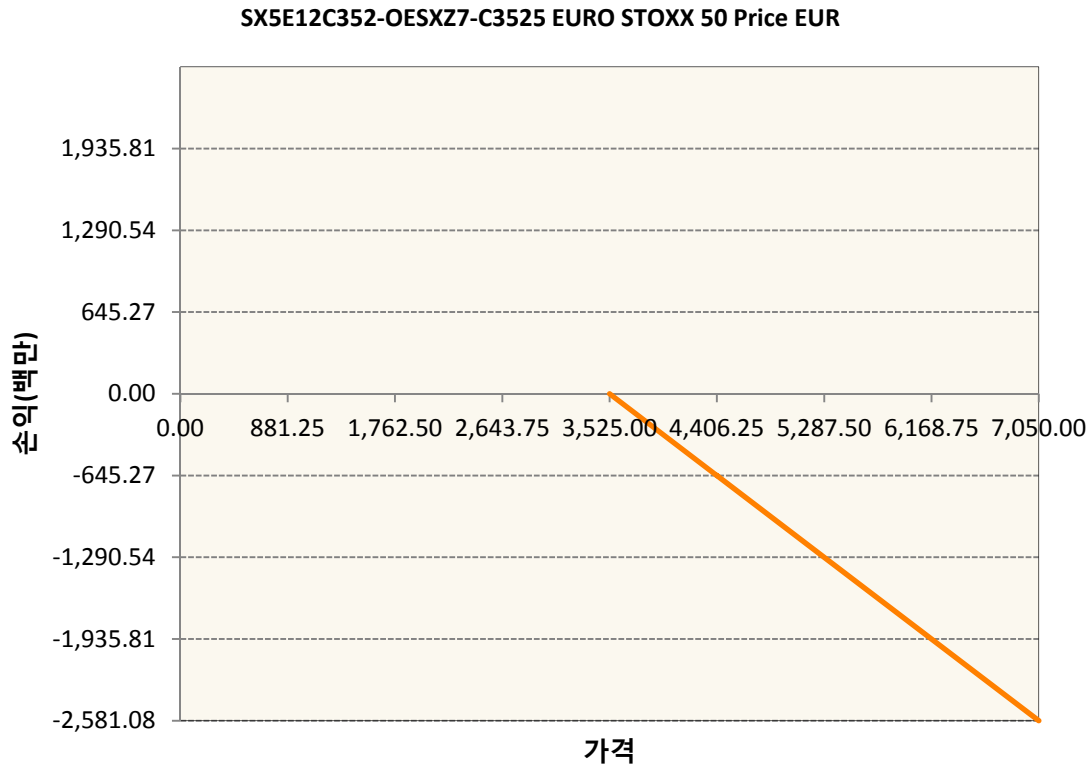
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

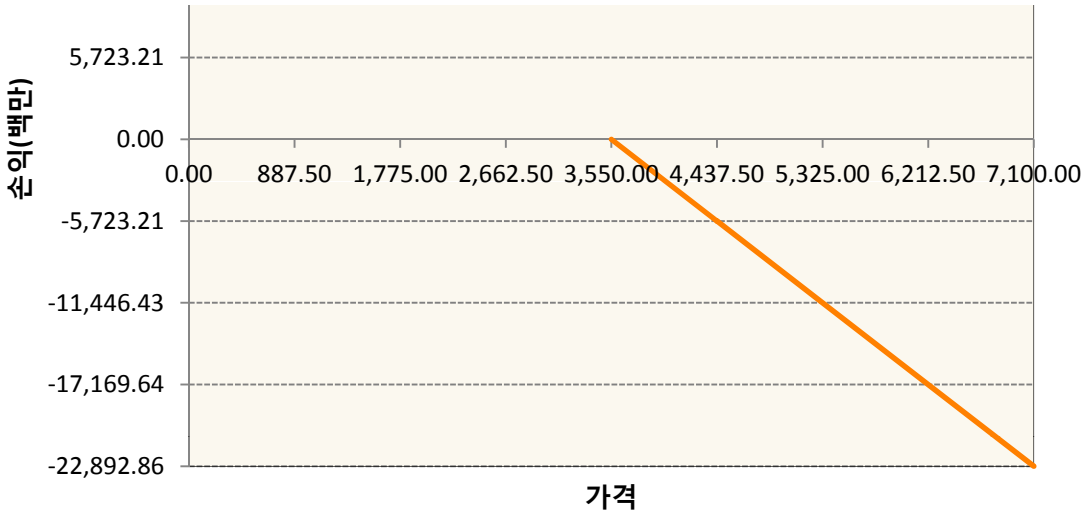
(단위:백만원)

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	17,509	0	17,509	
누계	유가증권	스왑	96,345	0	96,345	장외
누계	유가증권	옵션	0	50,948	-50,948	장내
누계	지수	스왑	51,385	0	51,385	장외

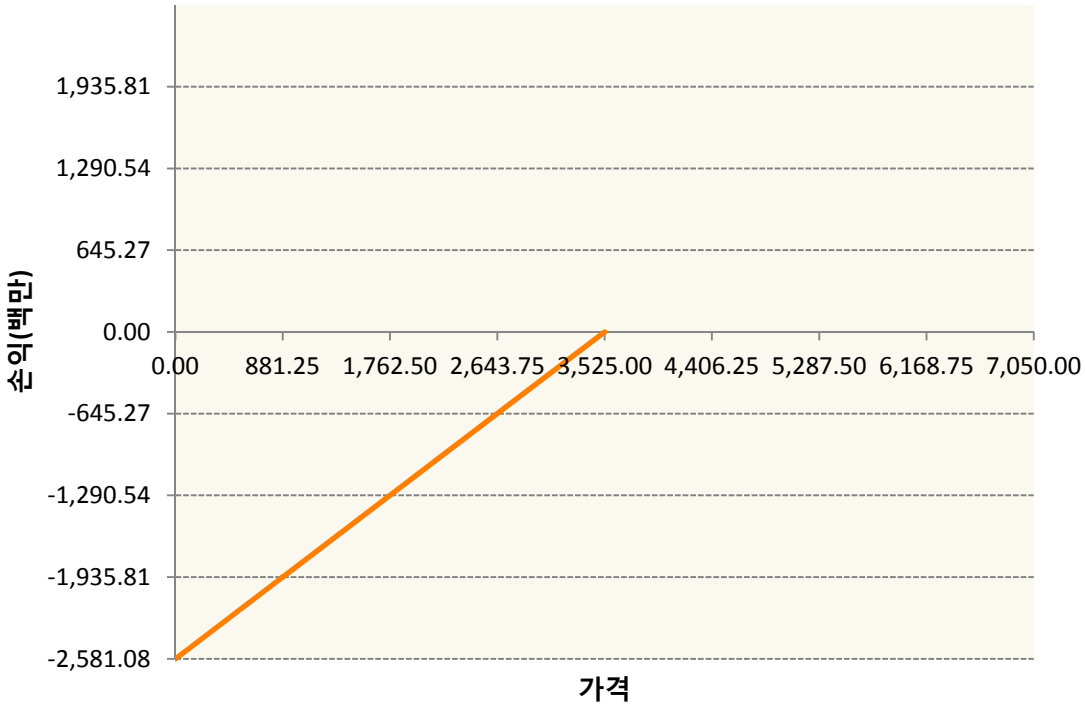
2. 만기시점의 손익구조



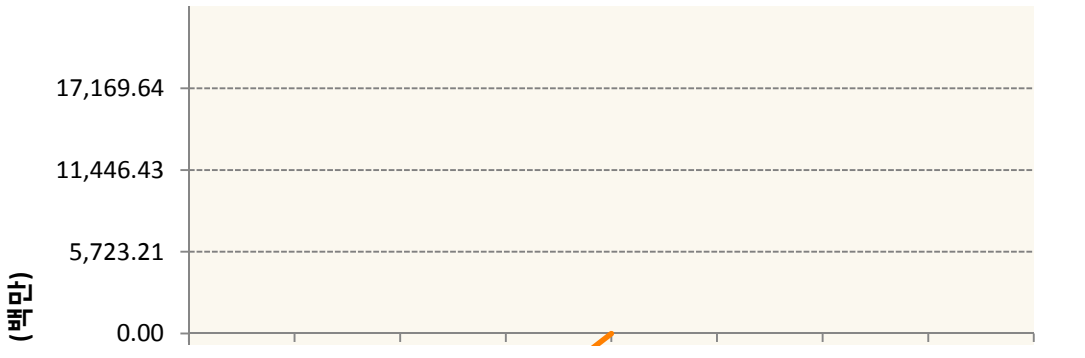


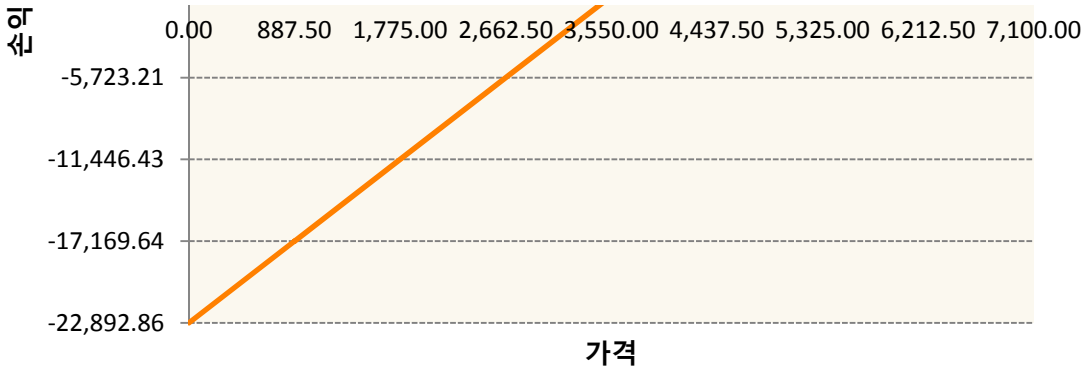


SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR

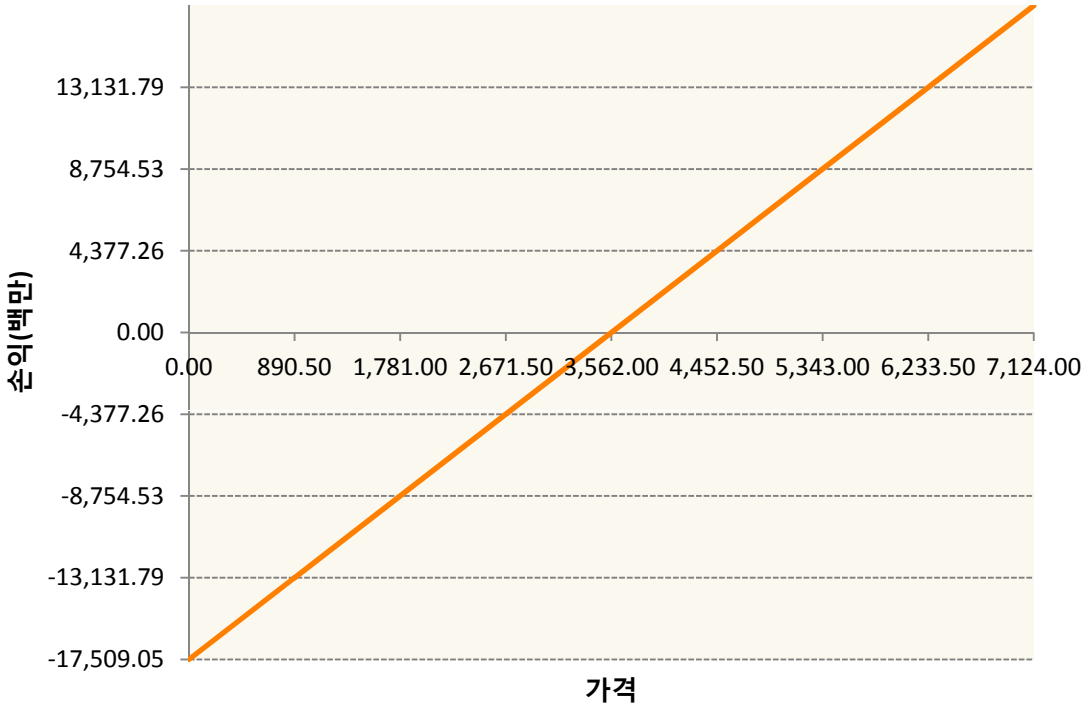


SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR





VGZ7-EURO STOXX 50 DEC17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	52
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	54
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	206
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,831
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	206
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,831
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,401

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

3,162

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

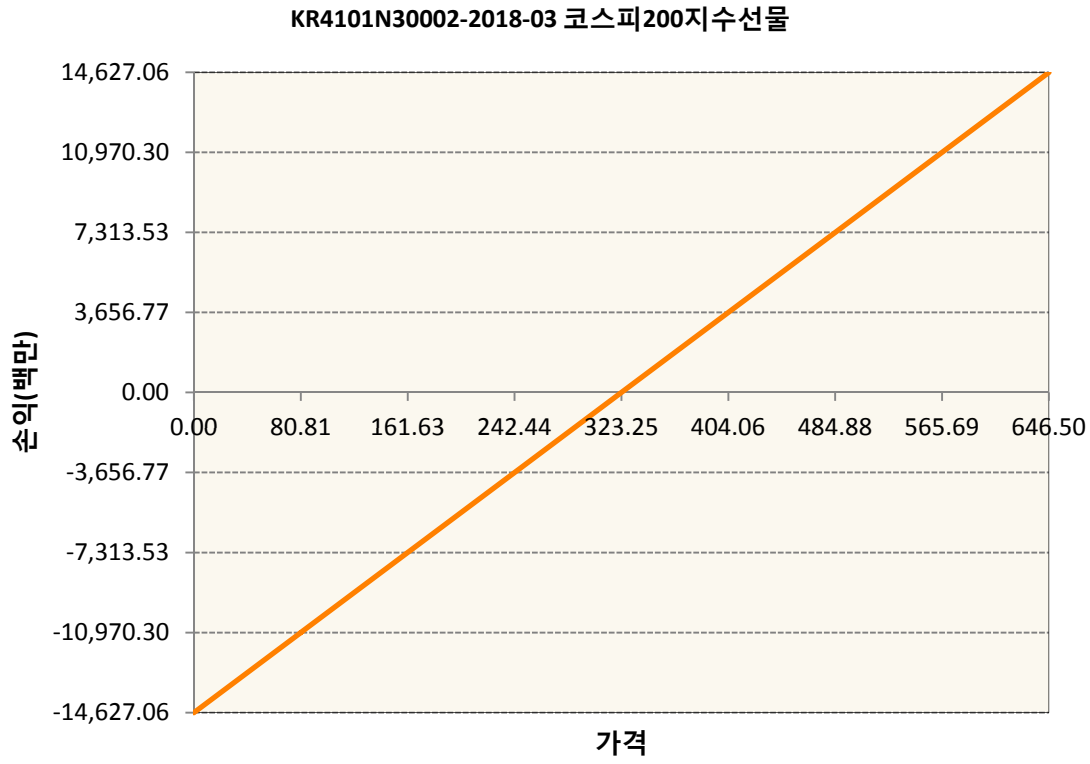
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,627	0	14,627	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,181
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,181	-1,181	-1,181	-1,181	-1,181	-1,181	-1,181
-5.33%	-787	-787	-787	-787	-787	-787	-787
-2.67%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-394
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	394	394	394	394	394	394	394
5.33%	787	787	787	787	787	787	787
8.00%	1,181	1,181	1,181	1,181	1,181	1,181	1,181

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

680

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

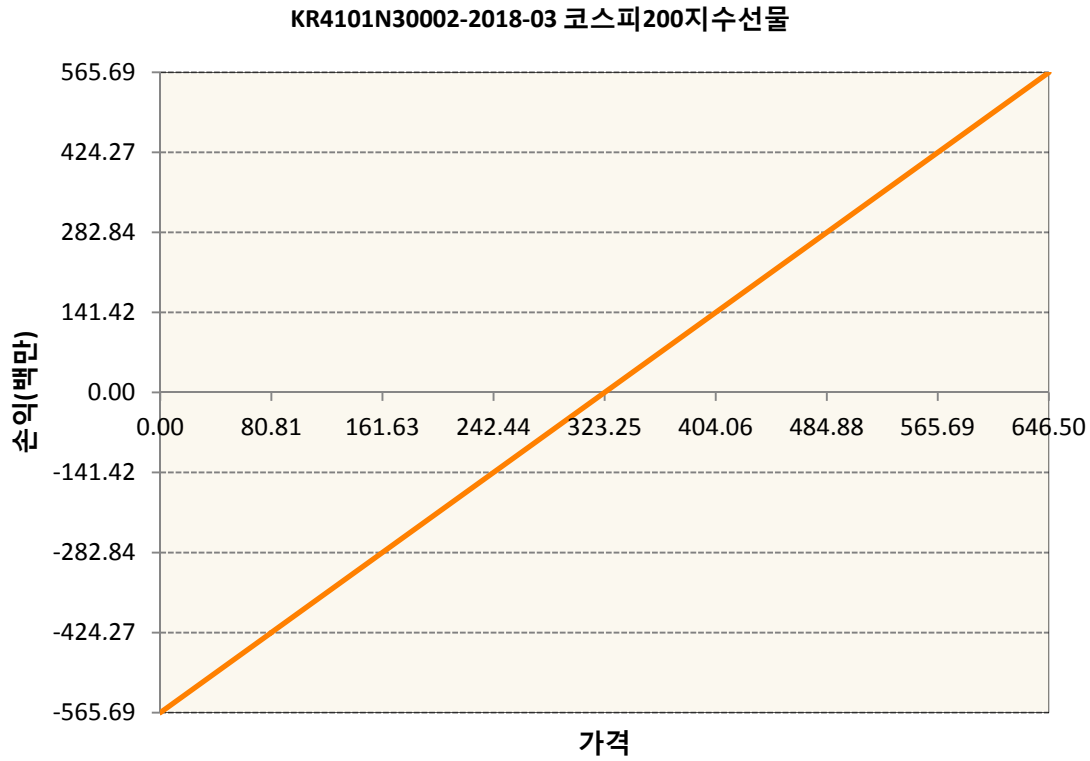
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	566	0	566	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							46
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	46	46	46	46	46	46	46

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

26

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

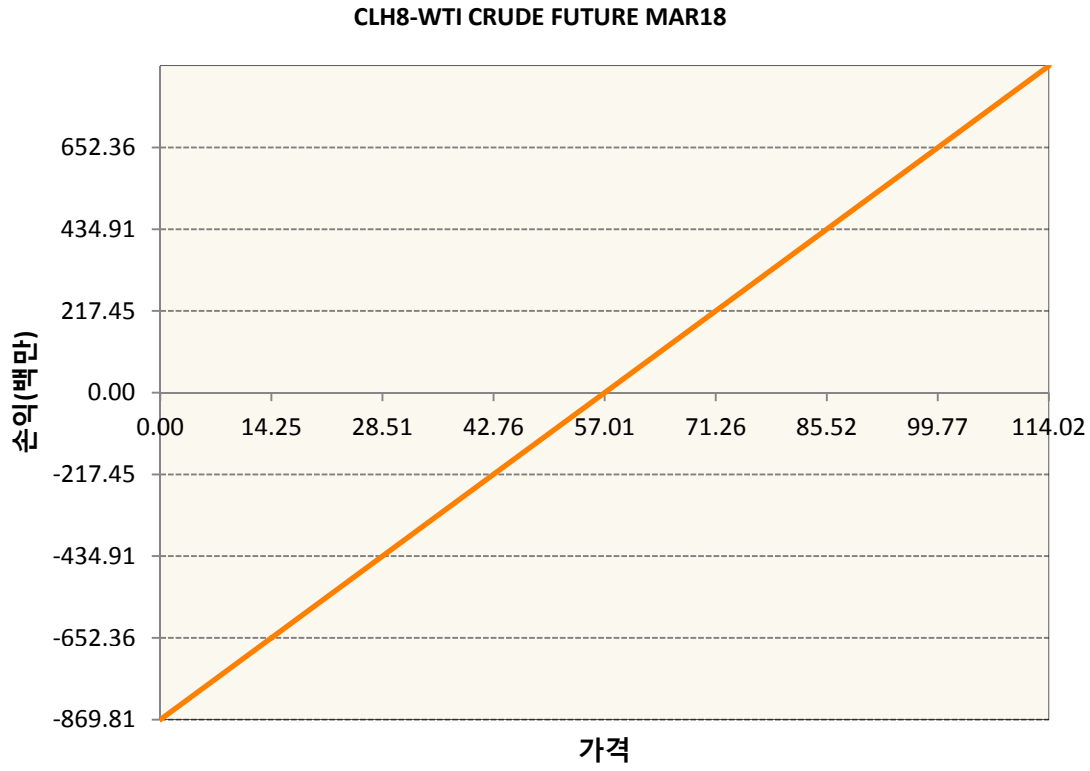
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

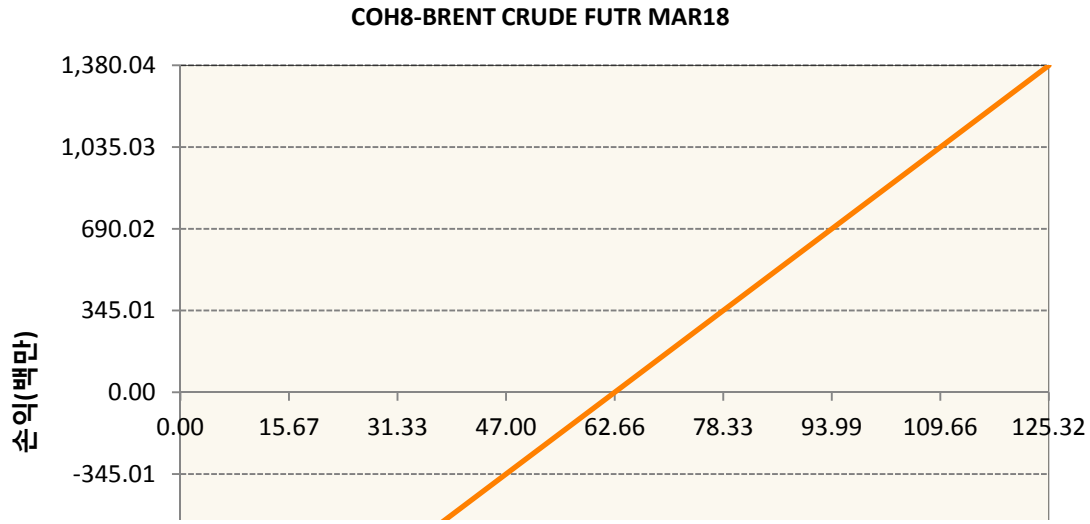
1. 계약금액

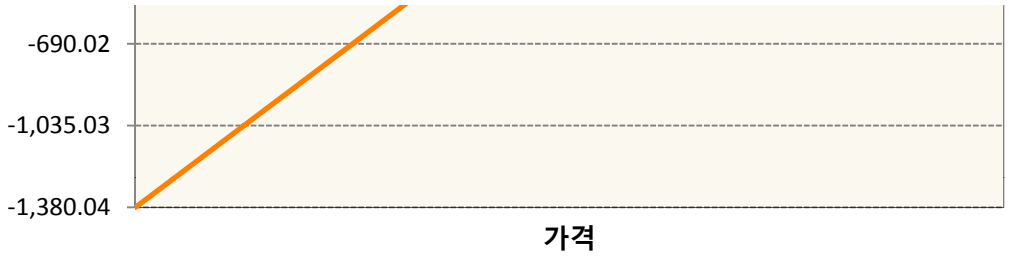
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,595	871	3,723	

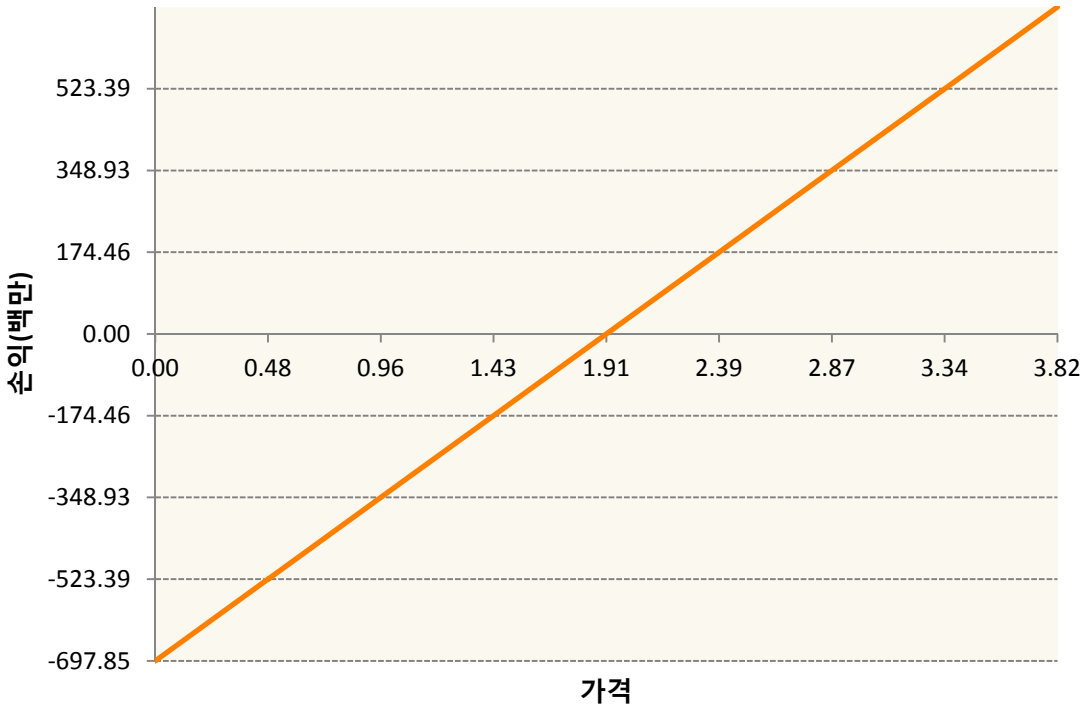
2. 만기시점의 손익구조



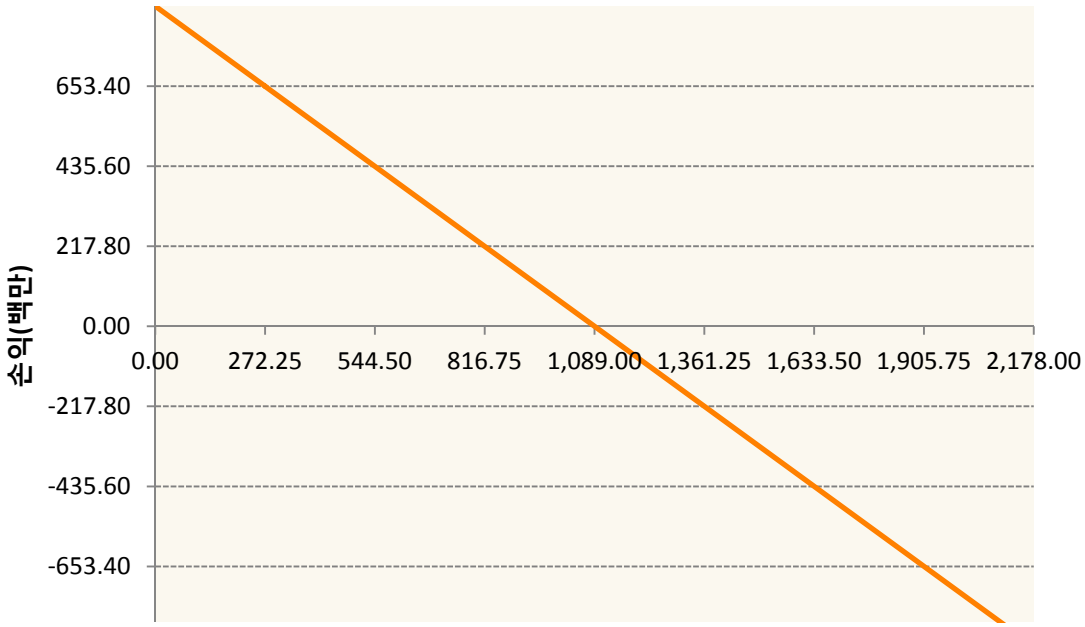


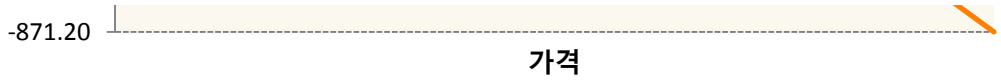


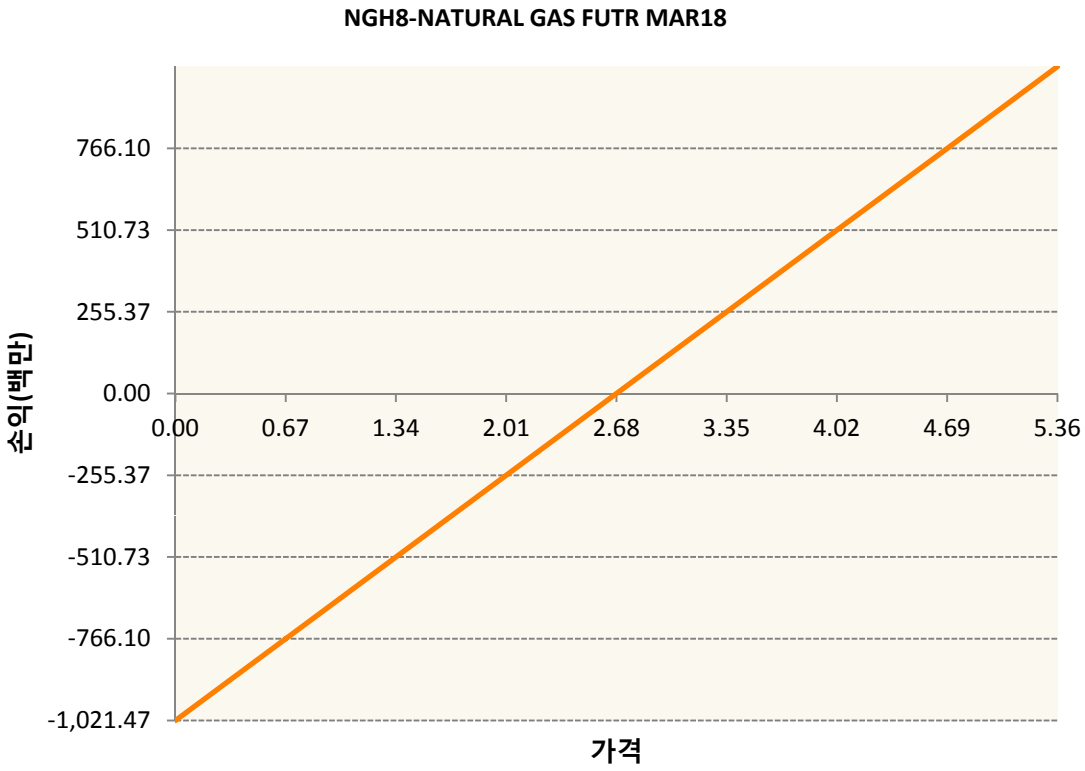
HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18

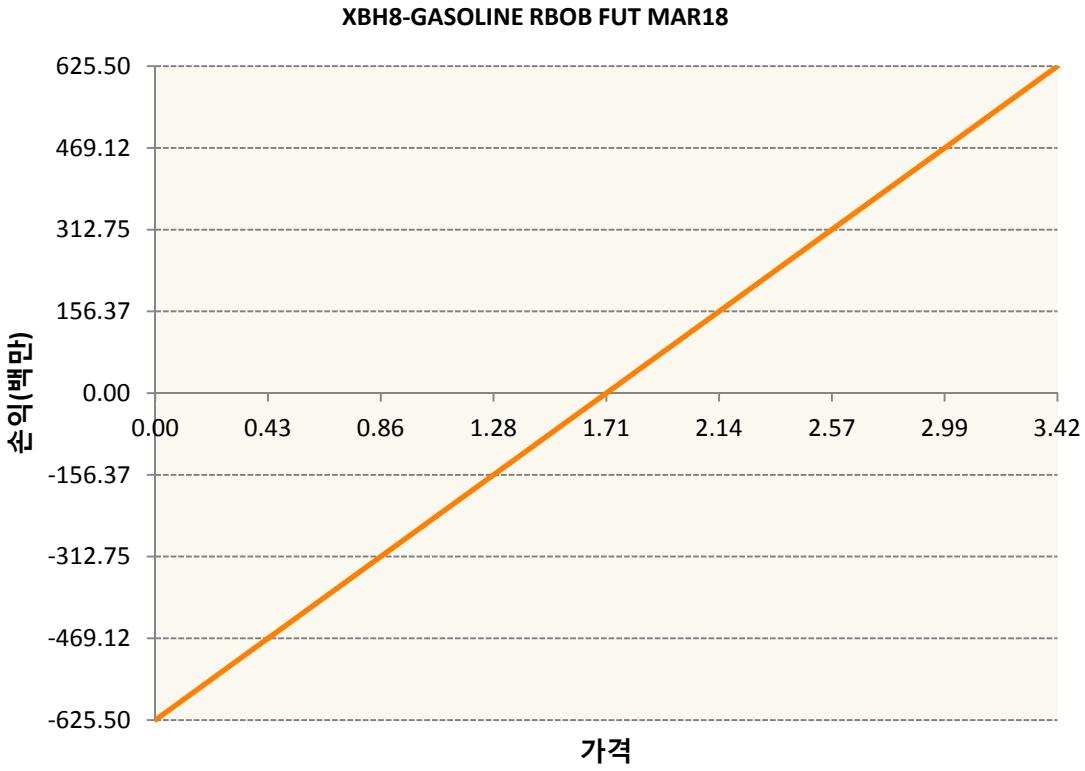


KR4175N10008-2018-01 달러선물




-871.20
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
766.10
510.73
255.37
0.00
-255.37
-510.73
-766.10
-1,021.47
0.00
0.67
1.34
2.01
2.68
3.35
4.02
4.69
5.36
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
625.50
469.12
312.75
156.37
0.00
-156.37
-312.75
-469.12
-625.50
0.00
0.43
0.86
1.28
1.71
2.14
2.57
2.99
3.42
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	70
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	110
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	56
KR4175N10(	2018-01 달러선물	70
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	82
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	50

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

618

공시일	2017-12-18
기준일	2017-12-15

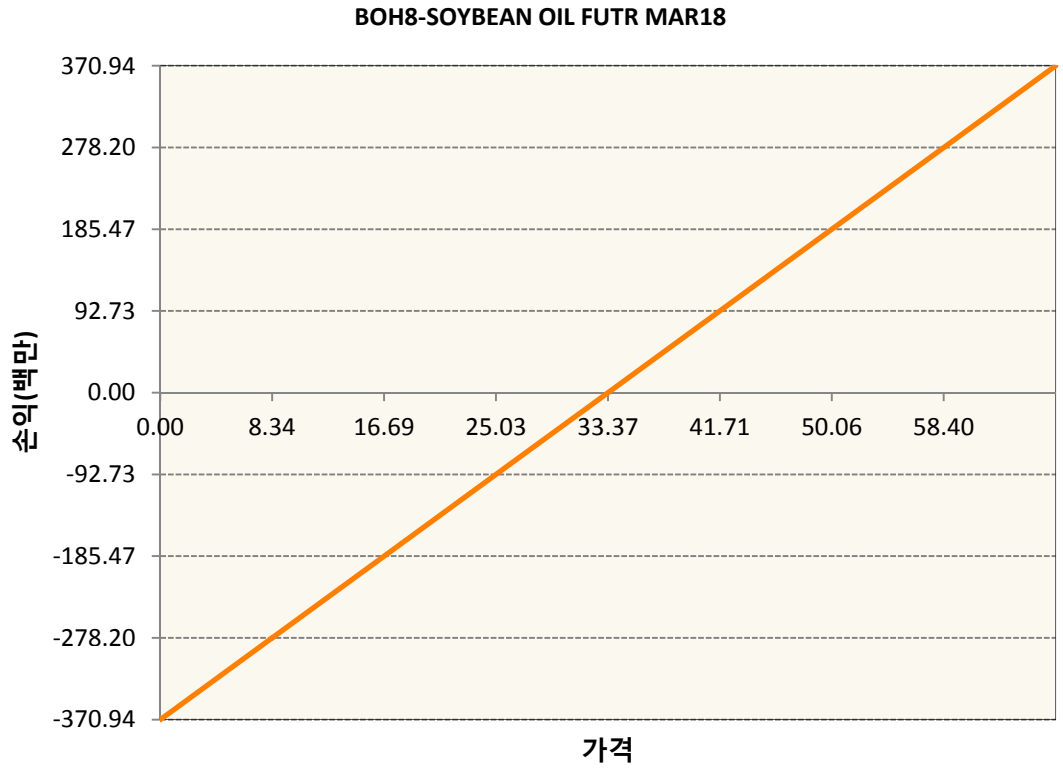
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

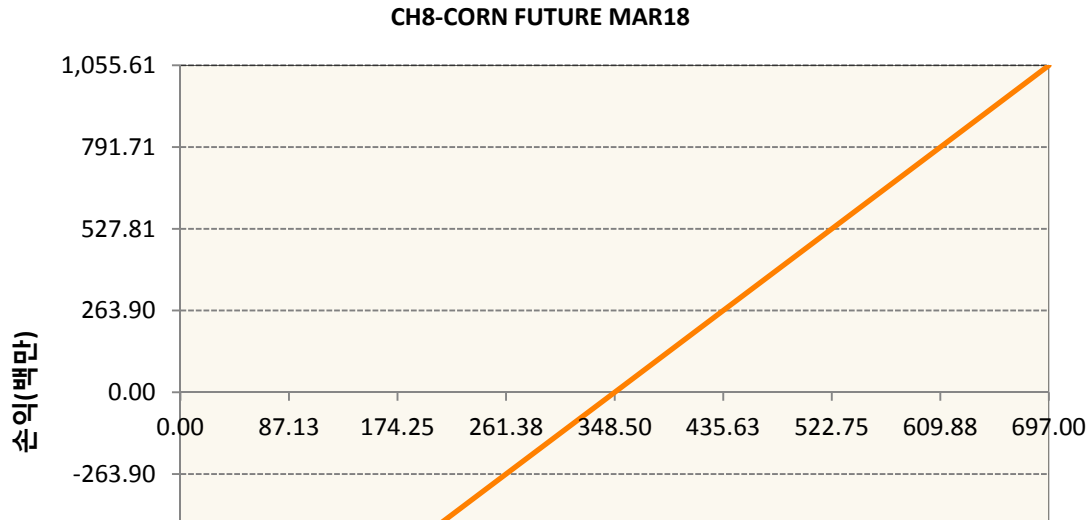
1. 계약금액

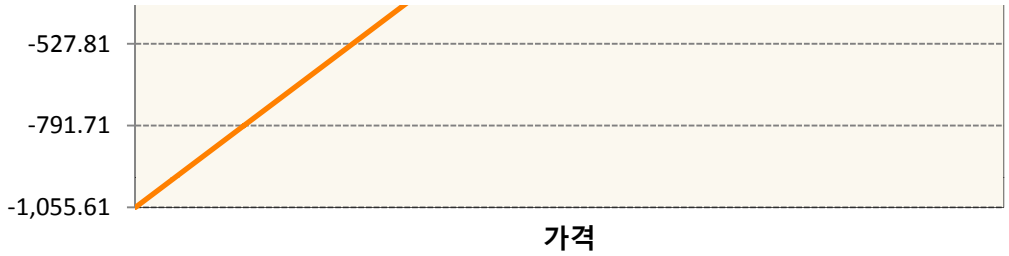
(단위:백만원)

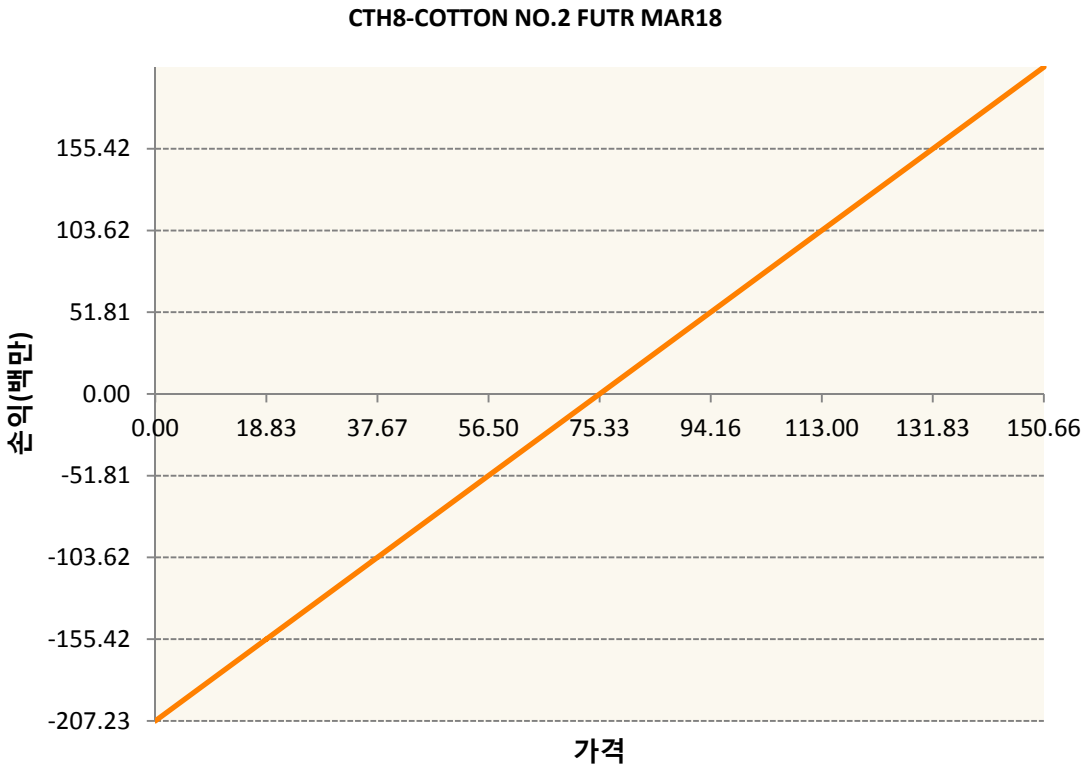
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,205	327	3,879	

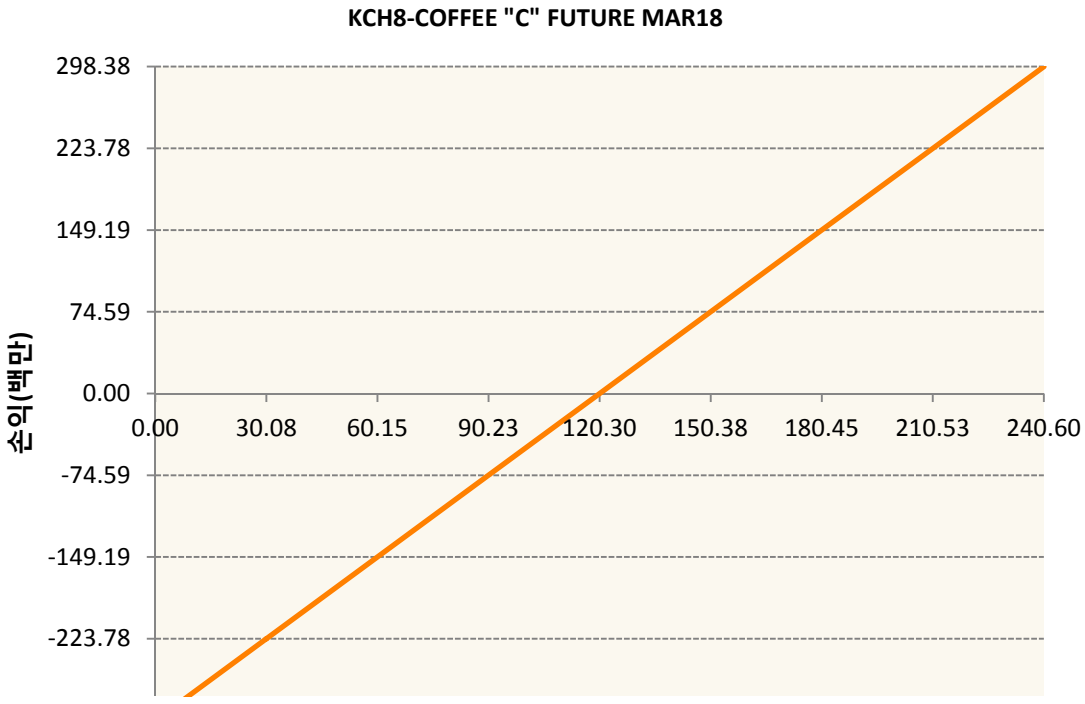
2. 만기시점의 손익구조

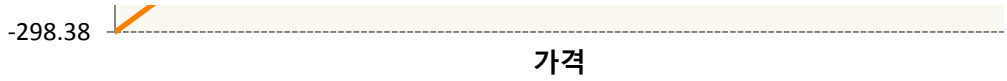


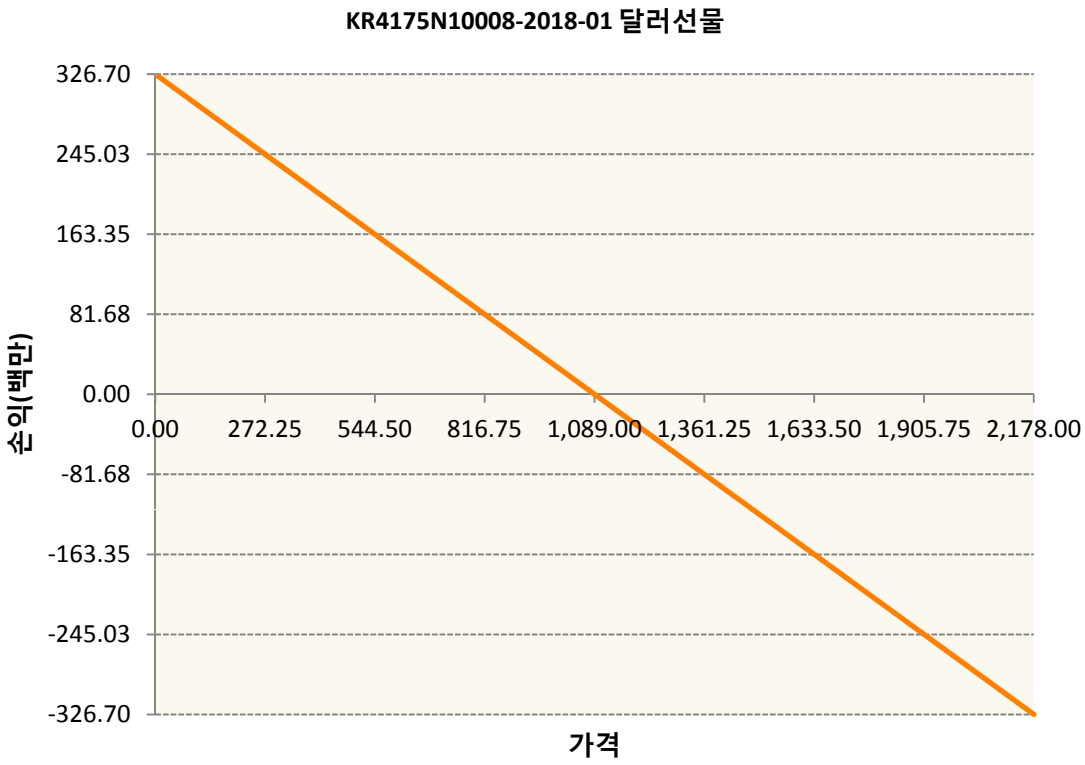


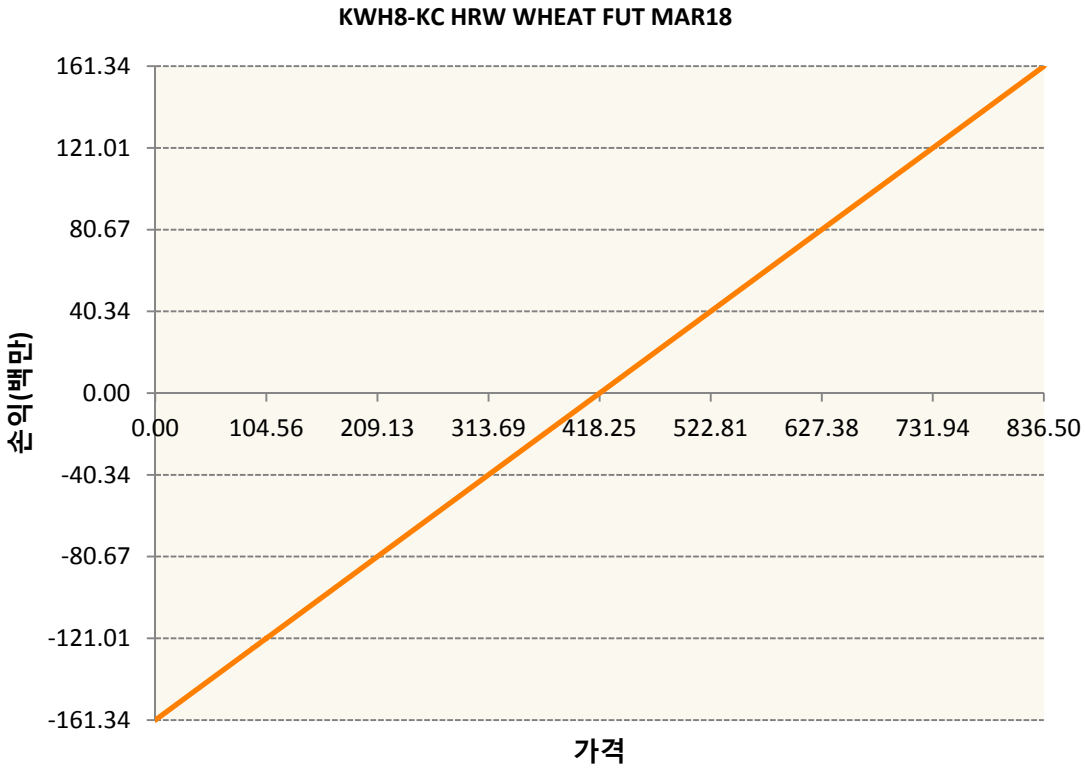

-527.81
-791.71
-1,055.61
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
155.42
103.62
51.81
0.00
-51.81
-103.62
-155.42
-207.23
0.00
18.83
37.67
56.50
75.33
94.16
113.00
131.83
150.66
손익(백만)
가격

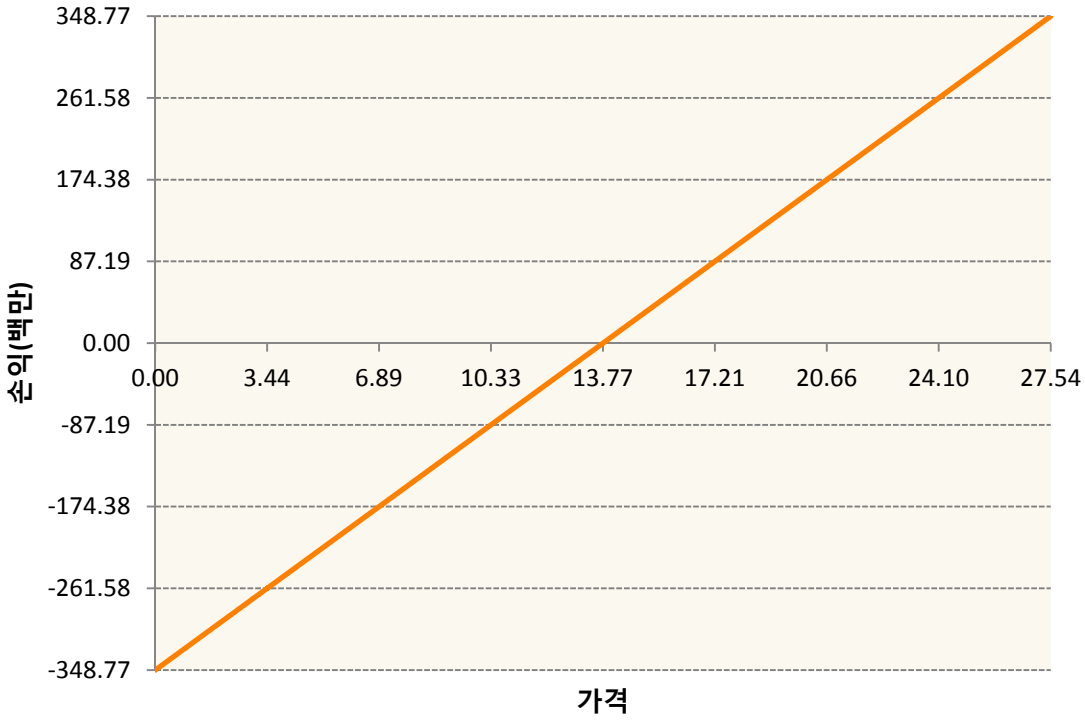

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
298.38
223.78
149.19
74.59
0.00
-74.59
-149.19
-223.78
0.00
30.08
60.15
90.23
120.30
150.38
180.45
210.53
240.60
손익(백만)


-298.38
가격

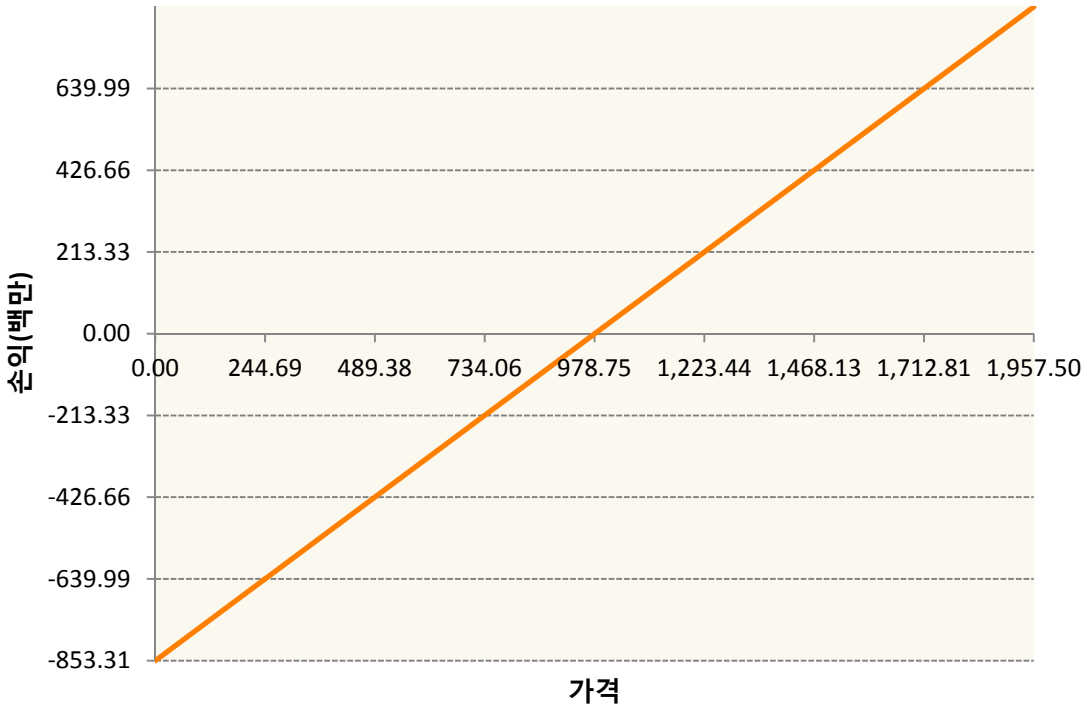

KR4175N10008-2018-01 달러선물
326.70
245.03
163.35
81.68
0.00
-81.68
-163.35
-245.03
-326.70
0.00
272.25
544.50
816.75
1,089.00
1,361.25
1,633.50
1,905.75
2,178.00
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
161.34
121.01
80.67
40.34
0.00
-40.34
-80.67
-121.01
-161.34
0.00
104.56
209.13
313.69
418.25
522.81
627.38
731.94
836.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

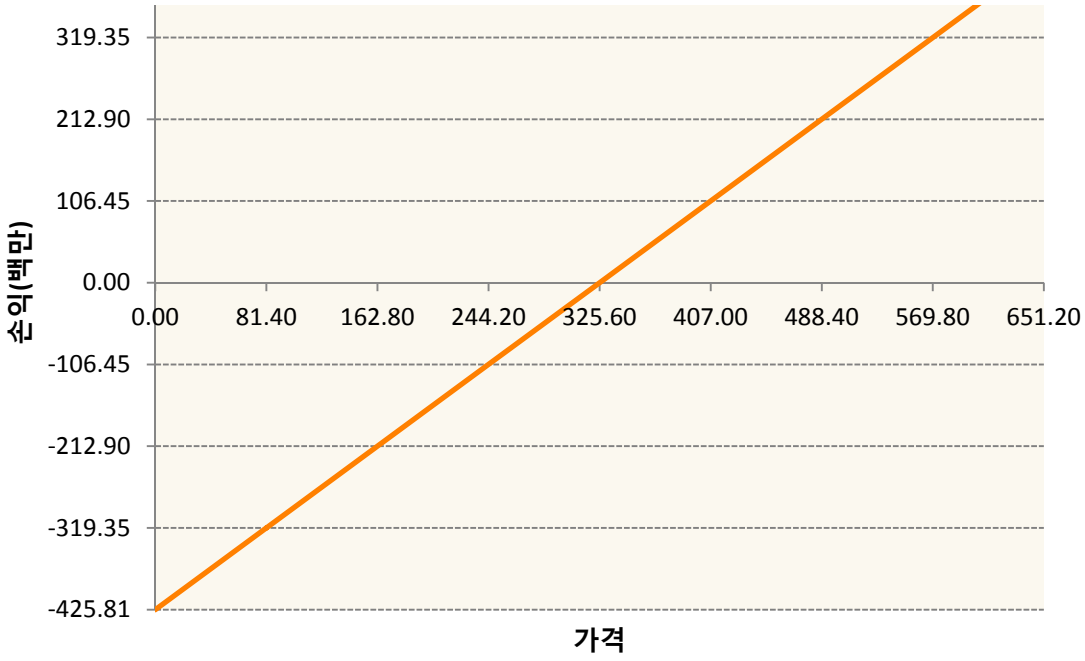


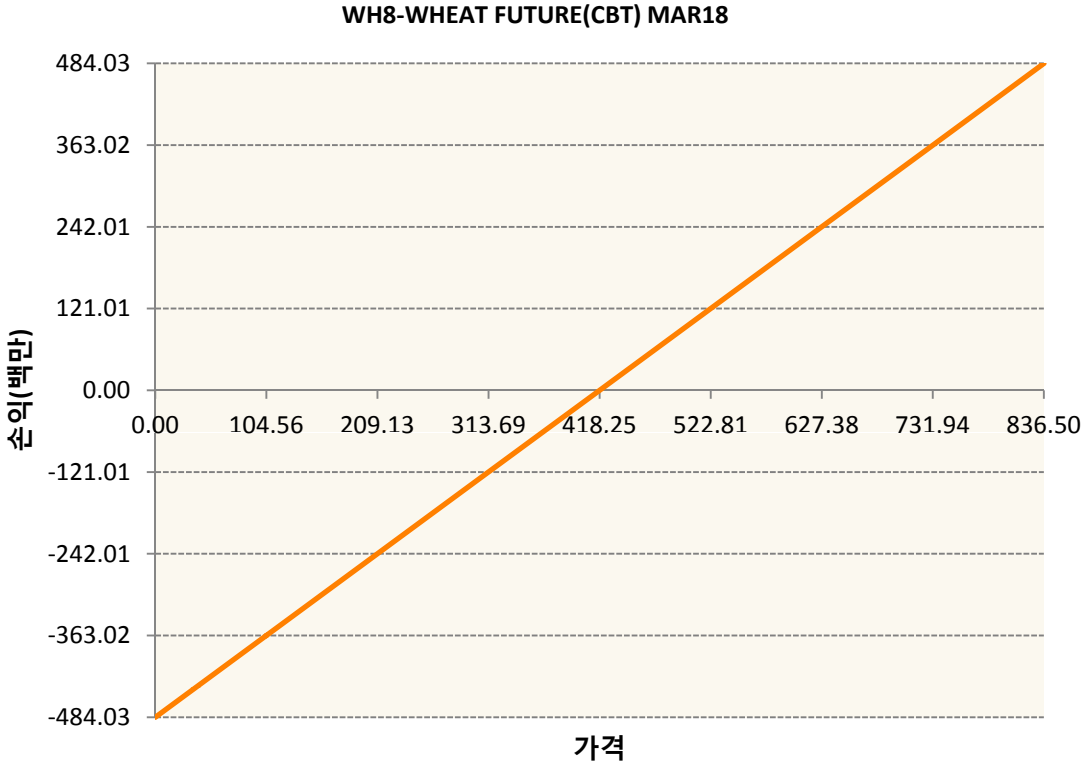
SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18



SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	30
CH8	CORN FUTURE MAR18	84
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	17
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	24
KR4175N10(	2018-01 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	28
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	68
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	34
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	39

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

357