공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

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	2017-12-19
기준일	2017-12-18

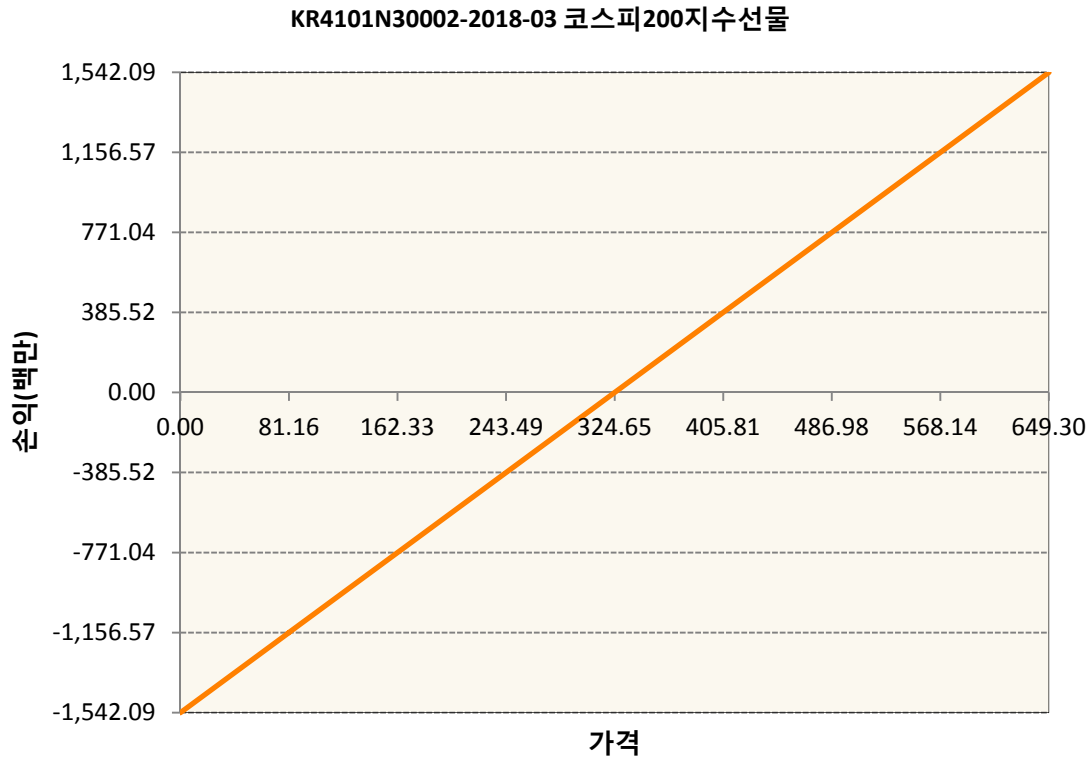
스마트인덱스모

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	1,542	0	1,542	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	2017-12-19
기준일	2017-12-18

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	1,090

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

348

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

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	396

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

355

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

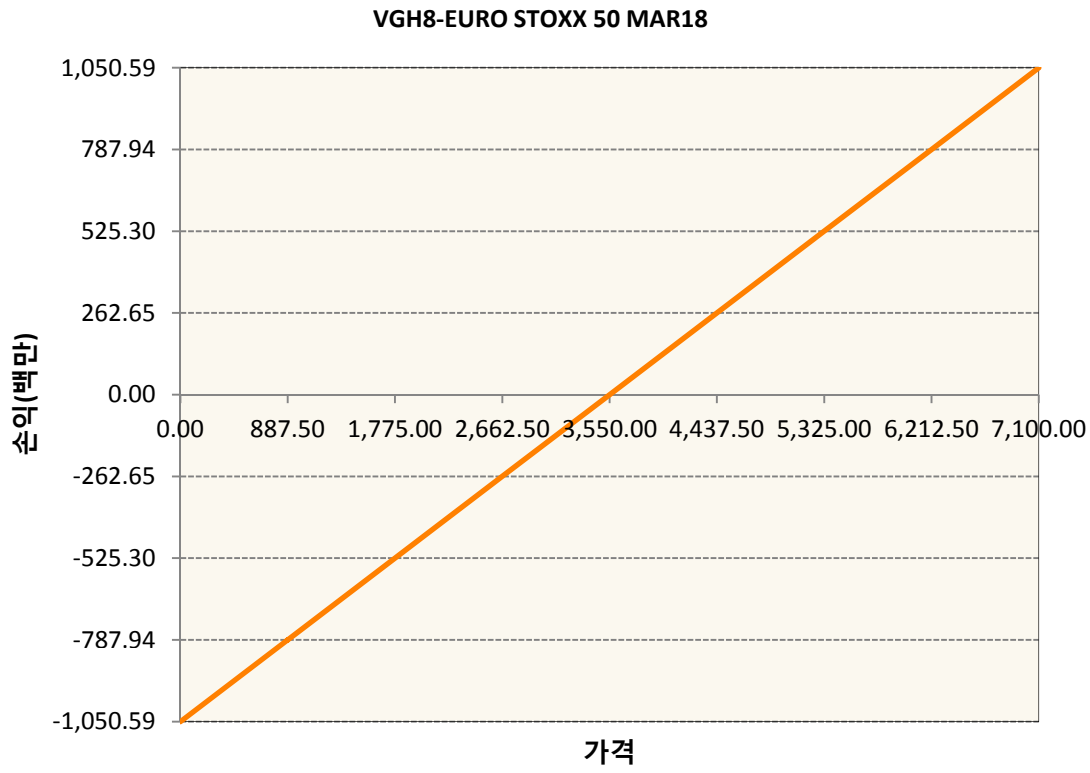
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,051	0	1,051	

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	2017-12-19
기준일	2017-12-18

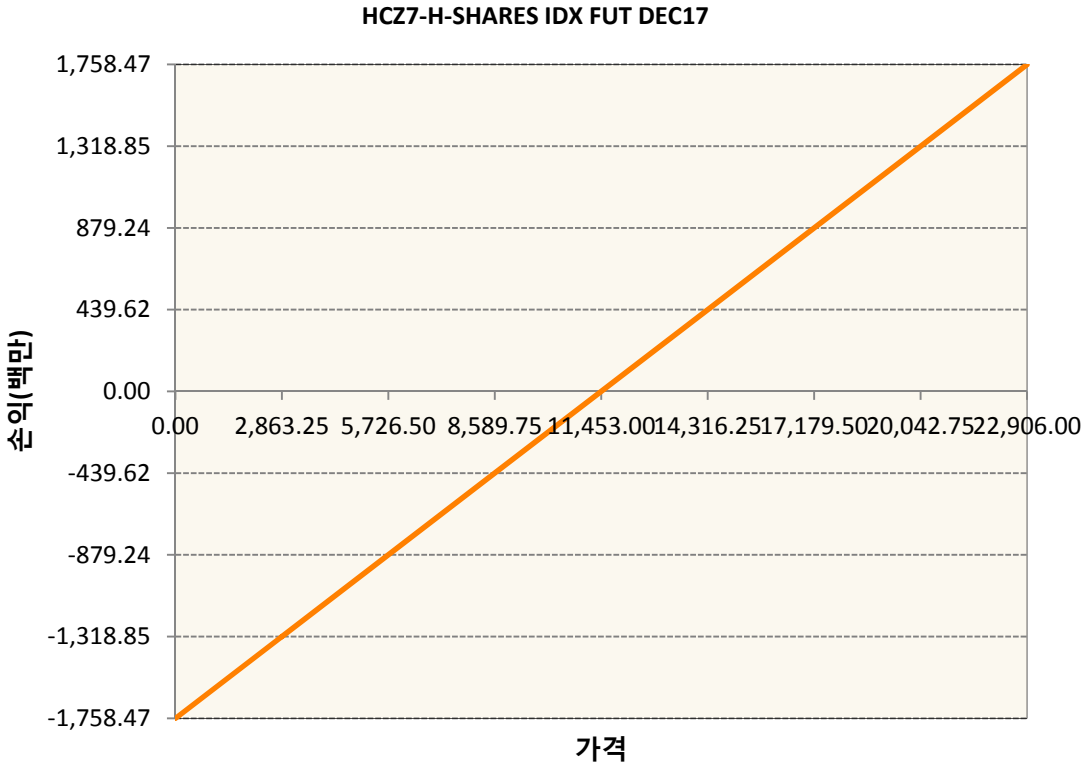
차이나인덱스모(주식-파생형)

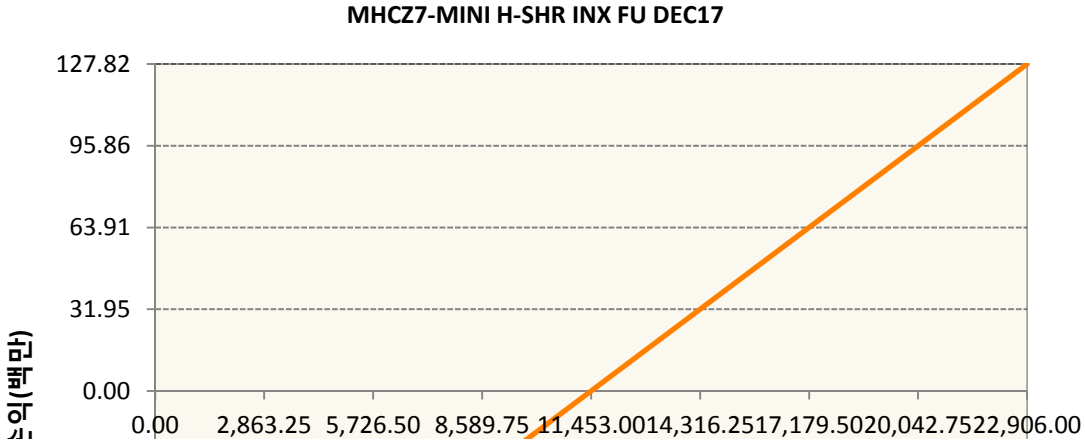
1. 계약금액

(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	1,758	0	1,758	
누계	유가증권	선물	128	0	128	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	141
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	97

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

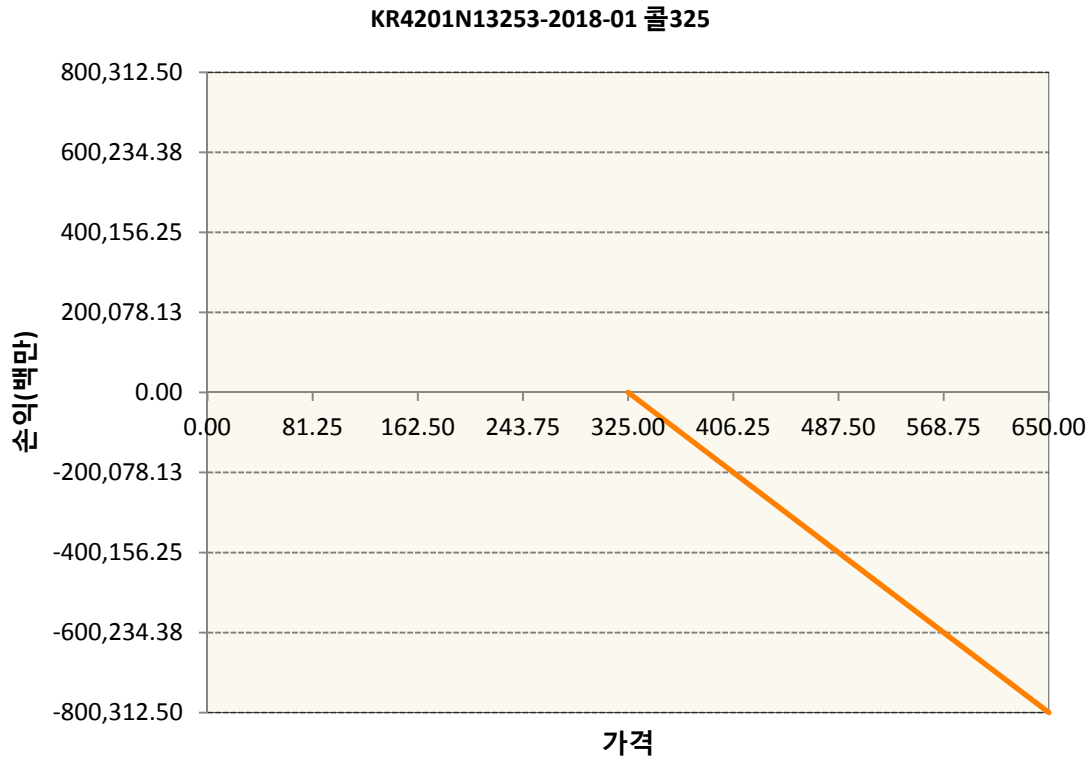
커버드콜모(주식혼합-파생형)

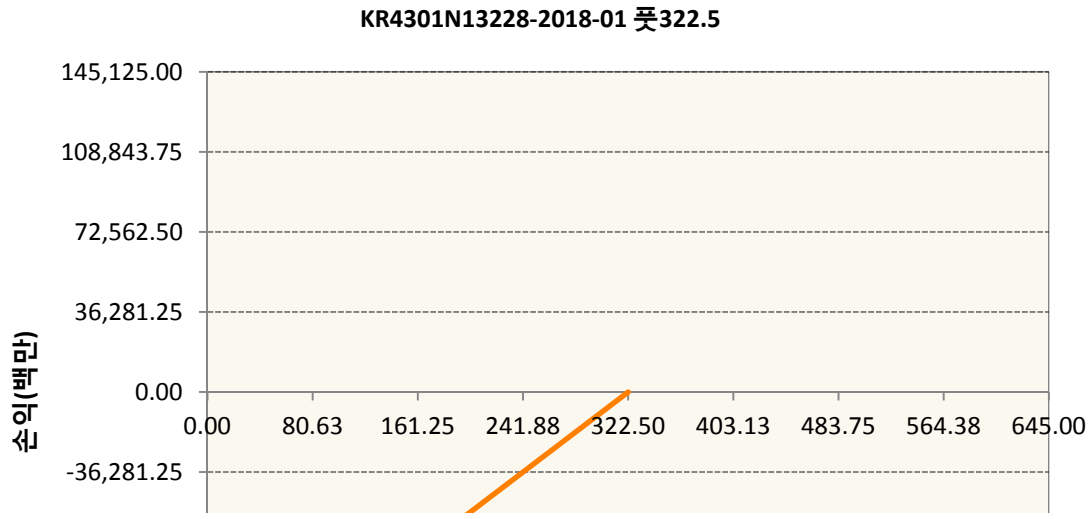
1. 계약금액

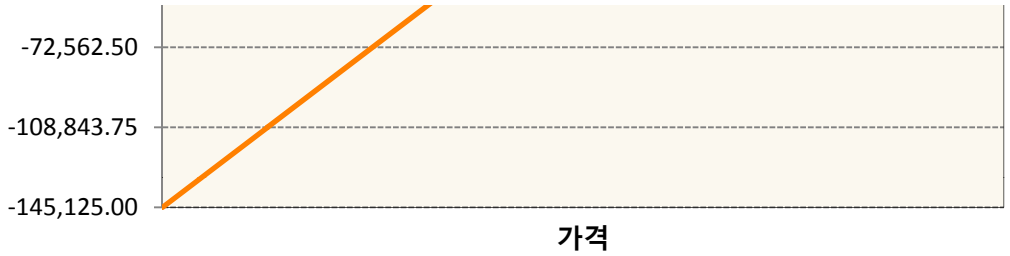
(단위:백만원)

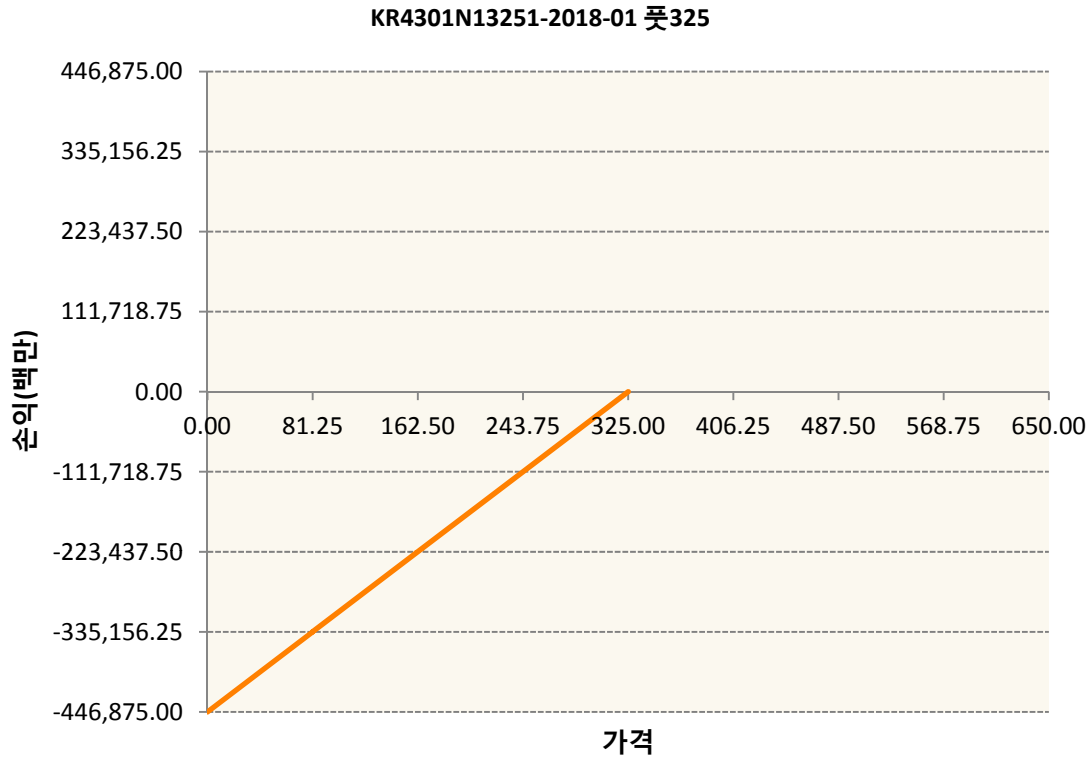
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	4,094	-4,094	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,392,313	-1,392,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							51,186
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21,562	21,091	20,502	19,806	19,014	18,138	17,188
-5.33%	19,512	18,517	17,428	16,263	15,036	13,758	12,437
-2.67%	14,460	12,956	11,425	9,874	8,307	6,728	5,140
0%	5,012	3,343	1,672	0	-1,673	-3,346	-5,020
2.67%	-9,098	-10,490	-11,933	-13,417	-14,932	-16,471	-18,032
5.33%	-26,868	-27,761	-28,766	-29,866	-31,044	-32,287	-33,586
8.00%	-46,813	-47,262	-47,836	-48,526	-49,322	-50,213	-51,186
KR4301N132 2018-01 풋322.5							8,994
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,943	-8,944	-8,947	-8,953	-8,962	-8,976	-8,994

-5.33%	-5,060	-5,086	-5,122	-5,167	-5,220	-5,280	-5,348
-2.67%	-1,604	-1,720	-1,840	-1,962	-2,088	-2,215	-2,343
0%	372	251	127	0	-129	-260	-392
2.67%	870	836	793	739	677	607	531
5.33%	915	912	907	897	882	862	835
8.00%	917	917	916	915	914	910	904
KR4301N132 2018-01 풋325							29,529

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29,440	-29,442	-29,446	-29,454	-29,469	-29,494	-29,529
-5.33%	-17,514	-17,556	-17,620	-17,707	-17,818	-17,952	-18,108
-2.67%	-6,318	-6,592	-6,888	-7,203	-7,534	-7,876	-8,229
0%	1,273	850	426	0	-427	-855	-1,284
2.67%	3,788	3,615	3,411	3,179	2,923	2,646	2,352
5.33%	4,104	4,083	4,047	3,992	3,917	3,819	3,700
8.00%	4,118	4,117	4,114	4,108	4,097	4,077	4,047

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

93,881

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

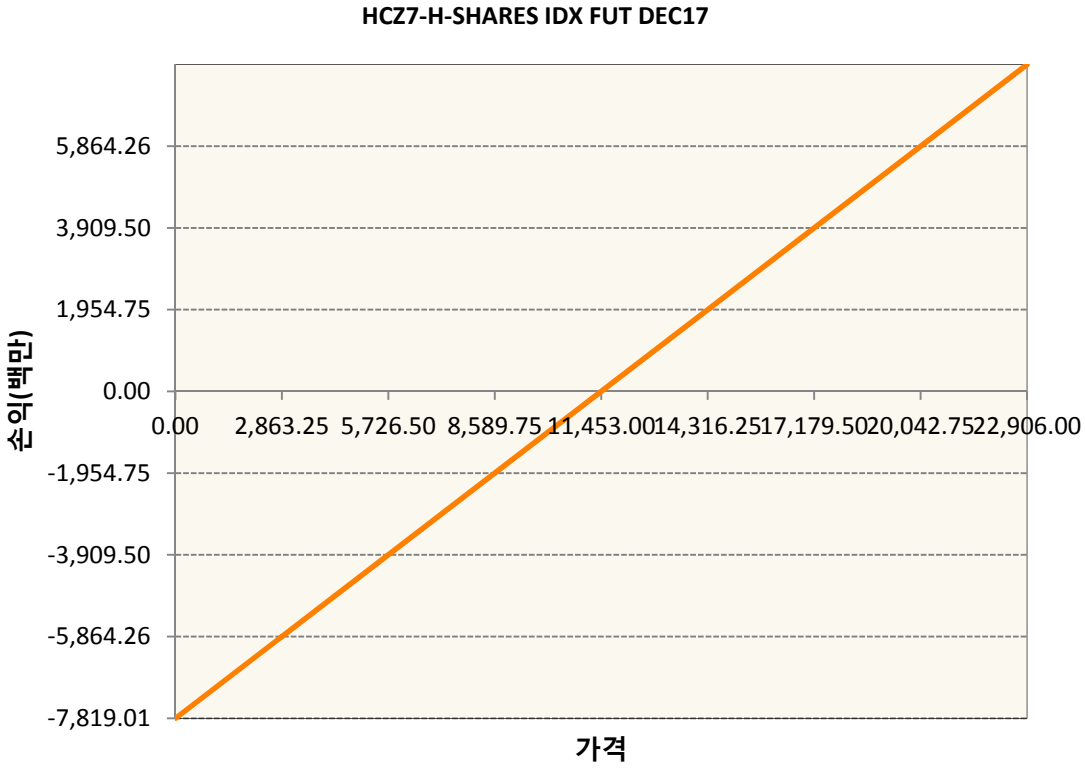
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

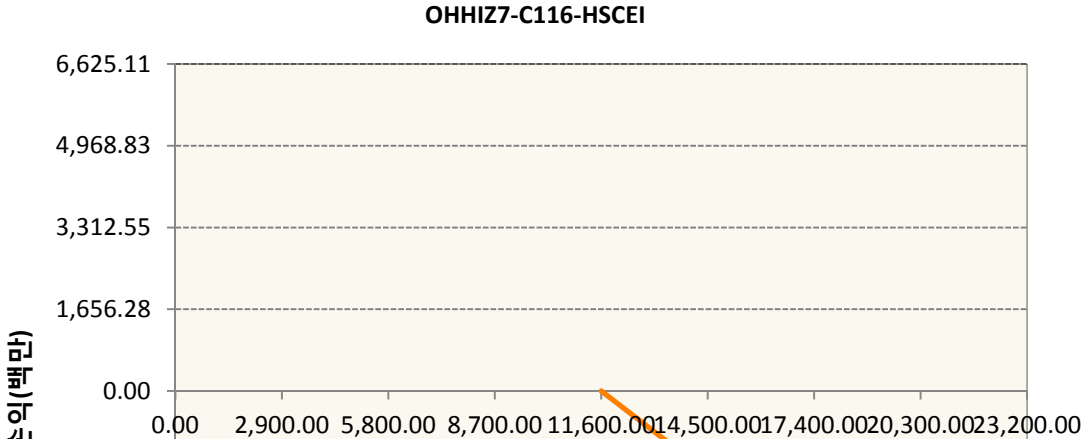
1. 계약금액

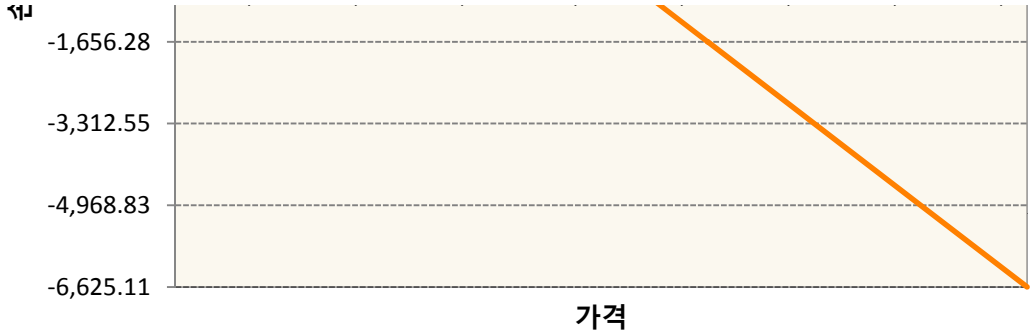
(단위:백만원)

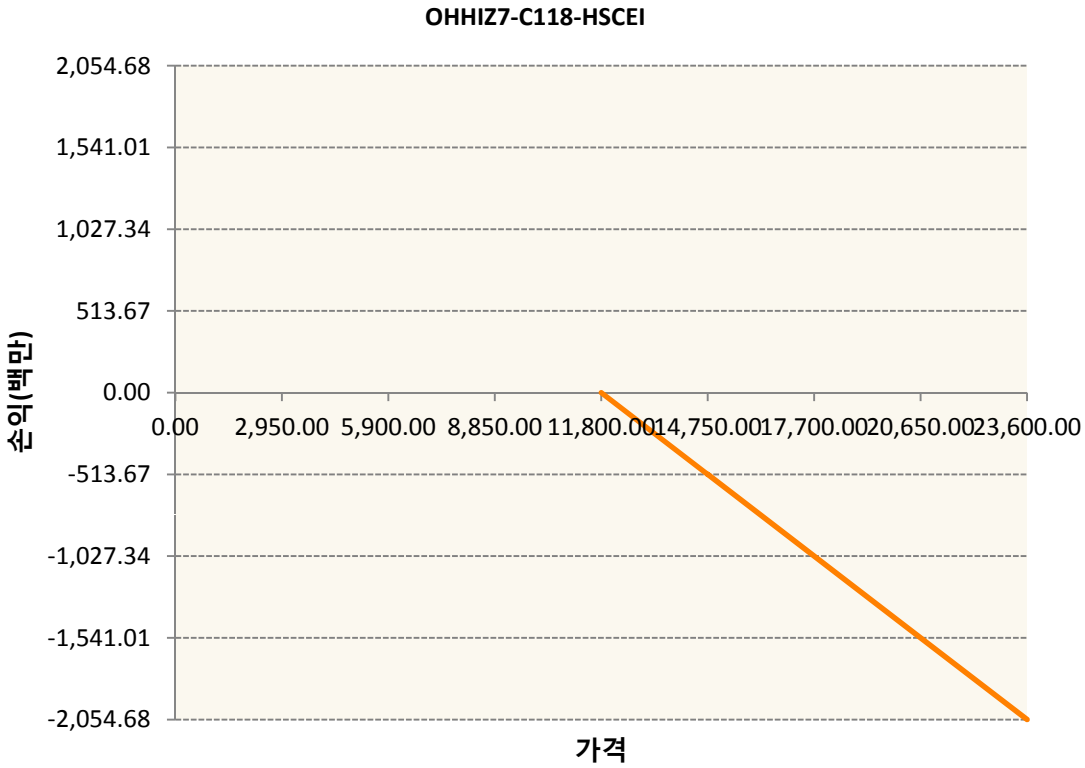
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,819	0	7,819	
누계	유가증권	옵션	0	17,360	-17,360	장내

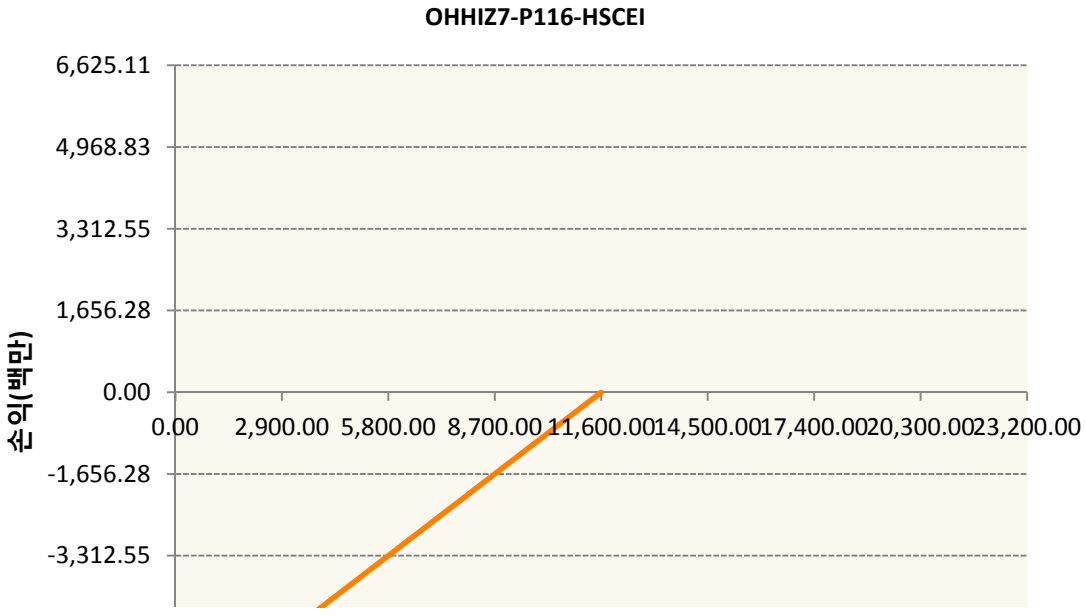
2. 만기시점의 손익구조

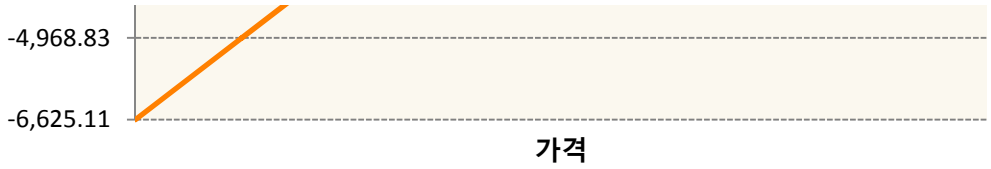


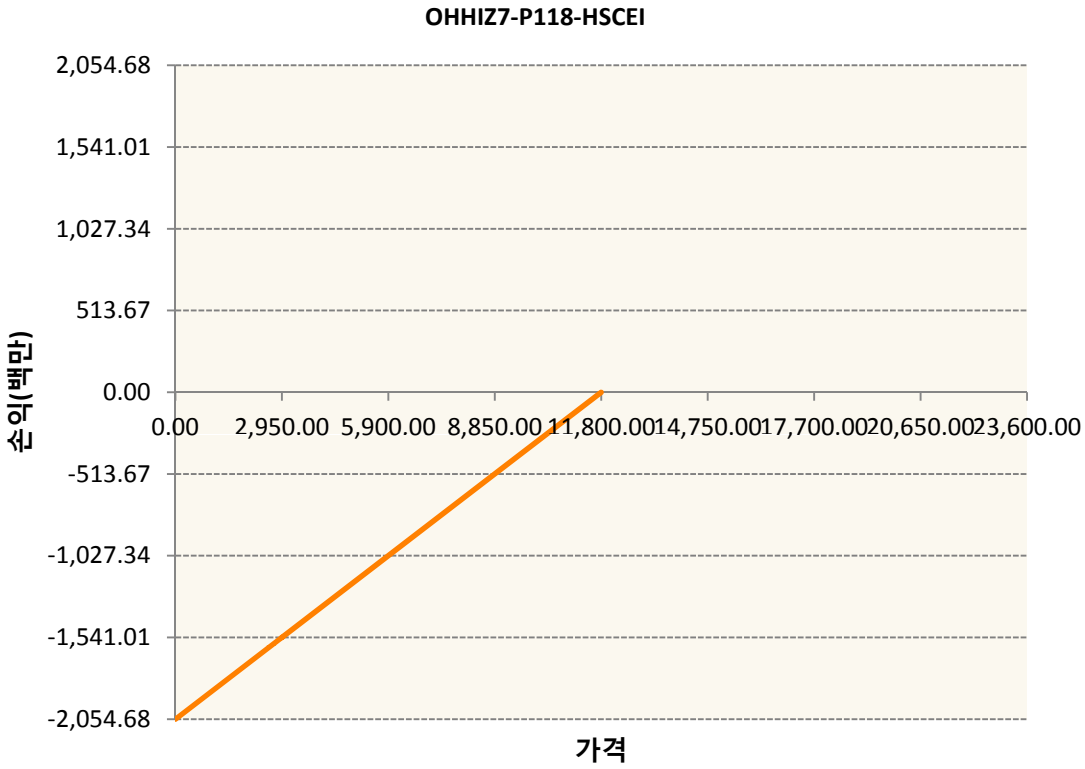



-1,656.28
-3,312.55
-4,968.83
-6,625.11
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,054.68
1,541.01
1,027.34
513.67
0.00
-513.67
-1,027.34
-1,541.01
-2,054.68
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
6,625.11
4,968.83
3,312.55
1,656.28
0.00
-1,656.28
-3,312.55
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	626
OHHIZ7-C11	HSCEI	530
OHHIZ7-C11	HSCEI	164
OHHIZ7-P11	HSCEI	530
OHHIZ7-P11	HSCEI	164

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

1,498

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

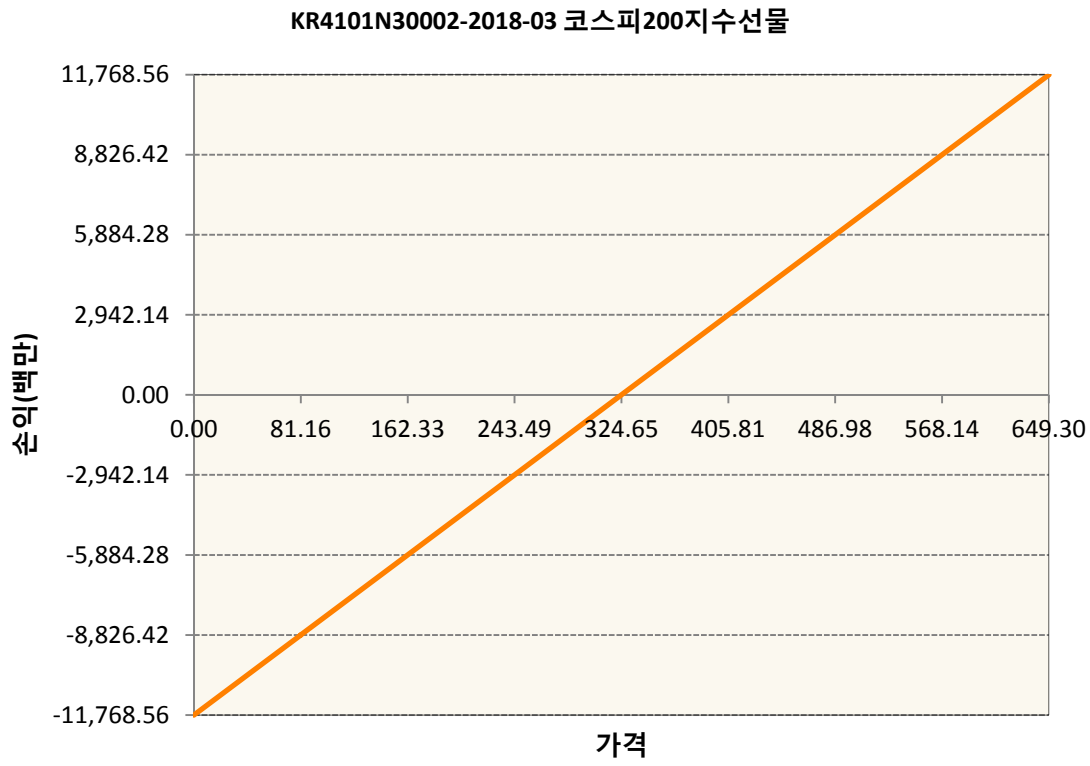
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

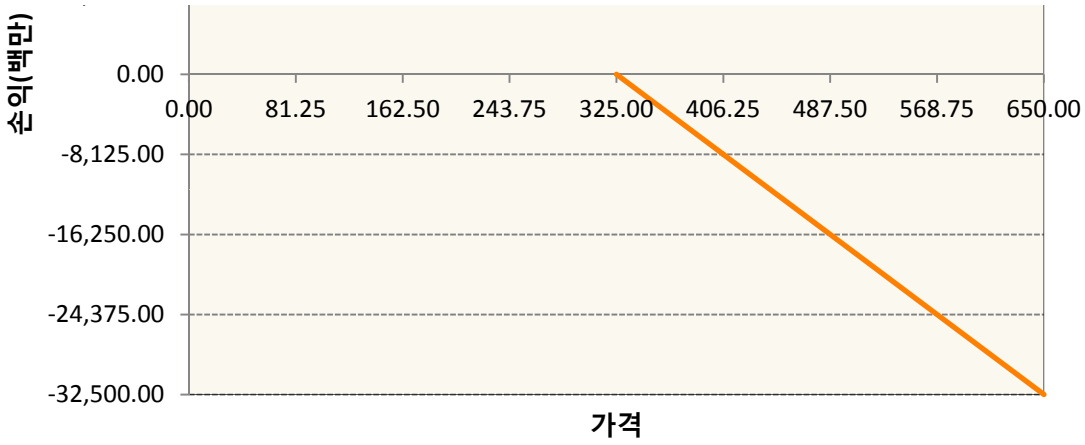
(단위:백만원)

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	11,769	0	11,769	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,875	-60,875	장내

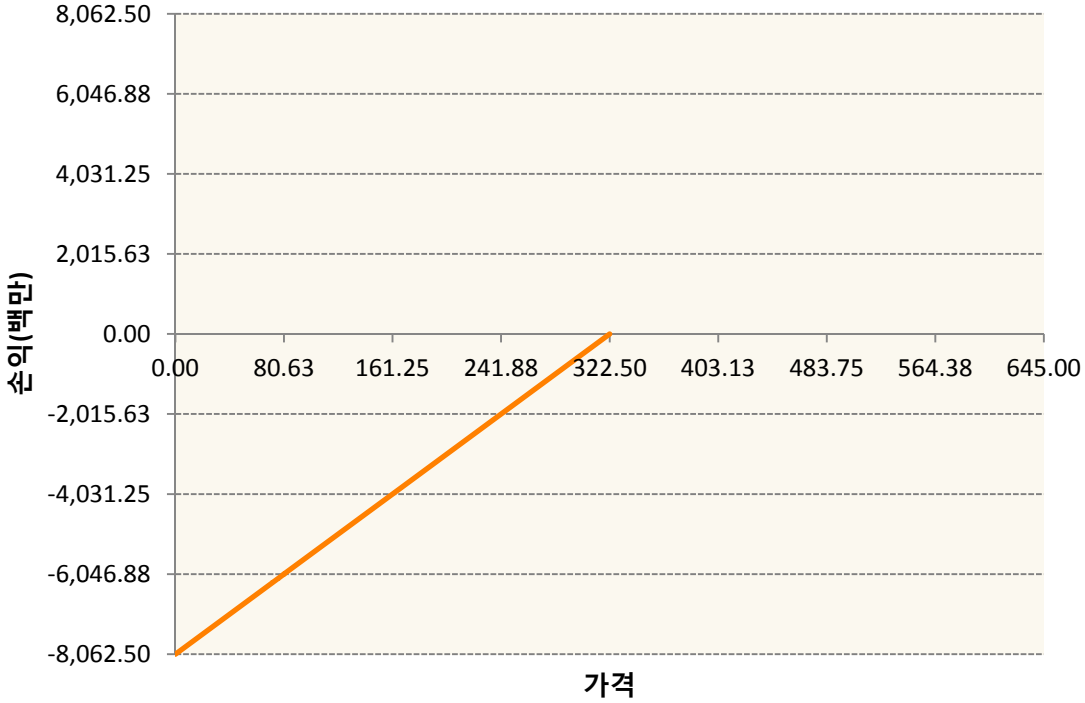
2. 만기시점의 손익구조



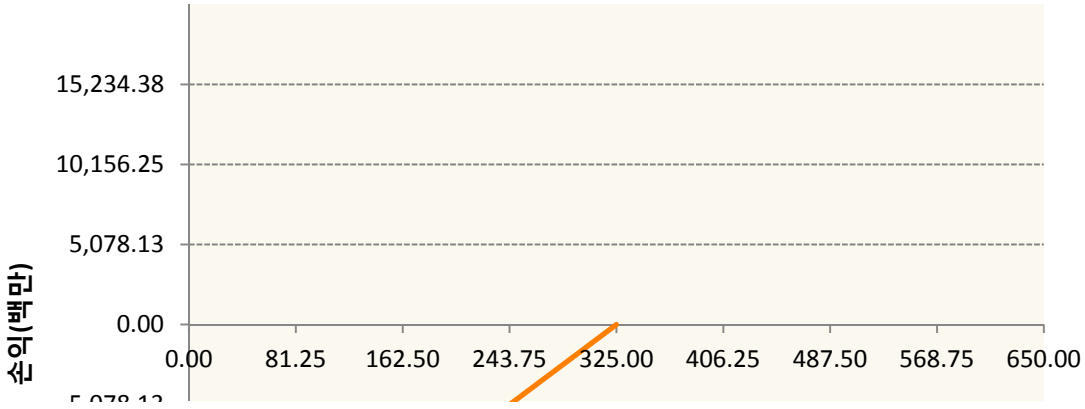




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,466
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466	-1,466
-5.33%	-978	-978	-978	-978	-978	-978	-978
-2.67%	-489	-489	-489	-489	-489	-489	-489
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	489	489	489	489	489	489	489
5.33%	978	978	978	978	978	978	978
8.00%	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466	1,466
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							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							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%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-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%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	238	238	238	238	238	238	238
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						254
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	254	254	254	254	254	254	254
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						313
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-5.33%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	104	104	104	104	104	104	104
5.33%	208	208	208	208	208	208	208
8.00%	313	313	313	313	313	313	313
	2.529E+11	UBCSFXC1 INDEX_10					277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
	2.529E+11	UBCSFXC1 INDEX_11					634
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-634	-634	-634	-634	-634	-634	-634
-5.33%	-423	-423	-423	-423	-423	-423	-423
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	423	423	423	423	423	423	423
8.00%	634	634	634	634	634	634	634
	2.529E+11	UBCSFXC1 INDEX_12					476
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-476	-476	-476	-476	-476	-476	-476
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-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%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	476	476	476	476	476	476	476
	KR4101N30(	2018-03	코스피200지수선물				947
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-947	-947	-947	-947	-947	-947	-947
-5.33%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-2.67%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	316	316	316	316	316	316	316
5.33%	631	631	631	631	631	631	631
8.00%	947	947	947	947	947	947	947
	KR4201N13:	2018-01	콜325				2,079

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	876	856	833	804	772	737	698
-5.33%	792	752	708	660	611	559	505
-2.67%	587	526	464	401	337	273	209
0%	204	136	68	0	-68	-136	-204
2.67%	-369	-426	-485	-545	-606	-669	-732
5.33%	-1,091	-1,127	-1,168	-1,213	-1,261	-1,311	-1,364
8.00%	-1,901	-1,919	-1,943	-1,971	-2,003	-2,039	-2,079
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						500

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-497	-497	-497	-497	-498	-499	-500
-5.33%	-281	-283	-285	-287	-290	-293	-297
-2.67%	-89	-96	-102	-109	-116	-123	-130
0%	21	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	48	46	44	41	38	34	29
5.33%	51	51	50	50	49	48	46
8.00%	51	51	51	51	51	51	50
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,342

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,338	-1,338	-1,338	-1,339	-1,340	-1,341	-1,342
-5.33%	-796	-798	-801	-805	-810	-816	-823
-2.67%	-287	-300	-313	-327	-342	-358	-374
0%	58	39	19	0	-19	-39	-58
2.67%	172	164	155	144	133	120	107
5.33%	187	186	184	181	178	174	168
8.00%	187	187	187	187	186	185	184

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

9,426

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

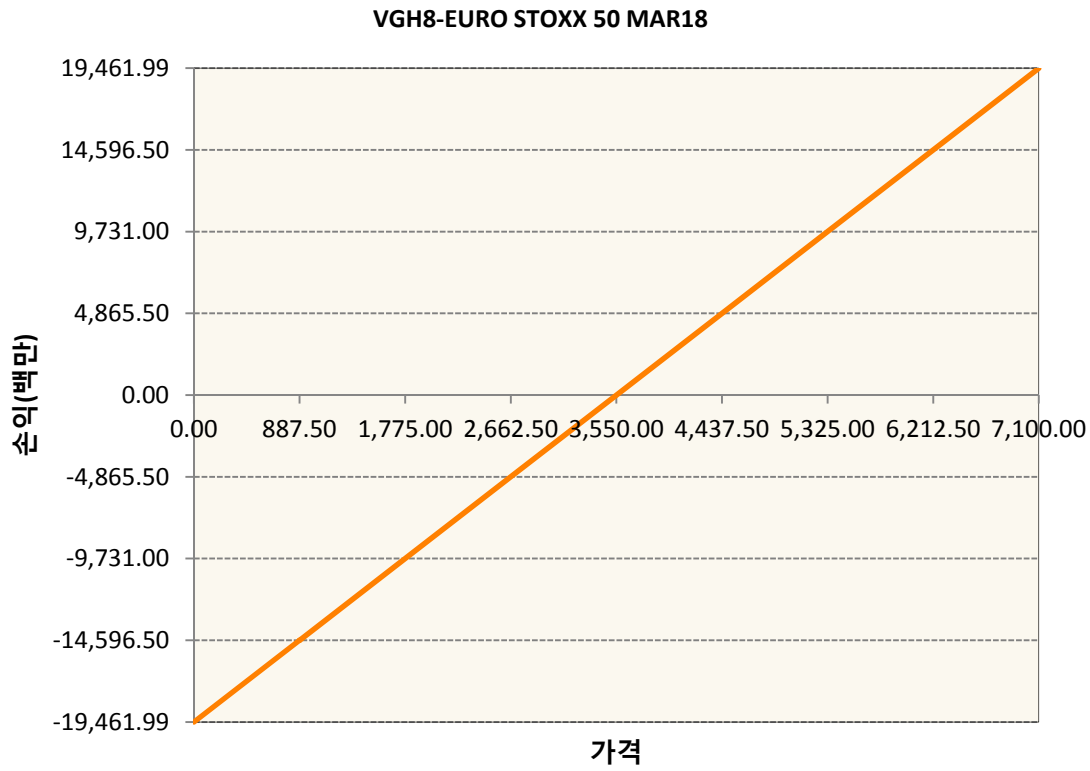
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2	0	2	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	19,462	0	19,462	
누계	유가증권	스왑	96,067	0	96,067	장외
누계	지수	스왑	51,236	0	51,236	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SGPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	57
260105SQPX	SG EURO Covered CALL STRATEGY	63
VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	1,557

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

946

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

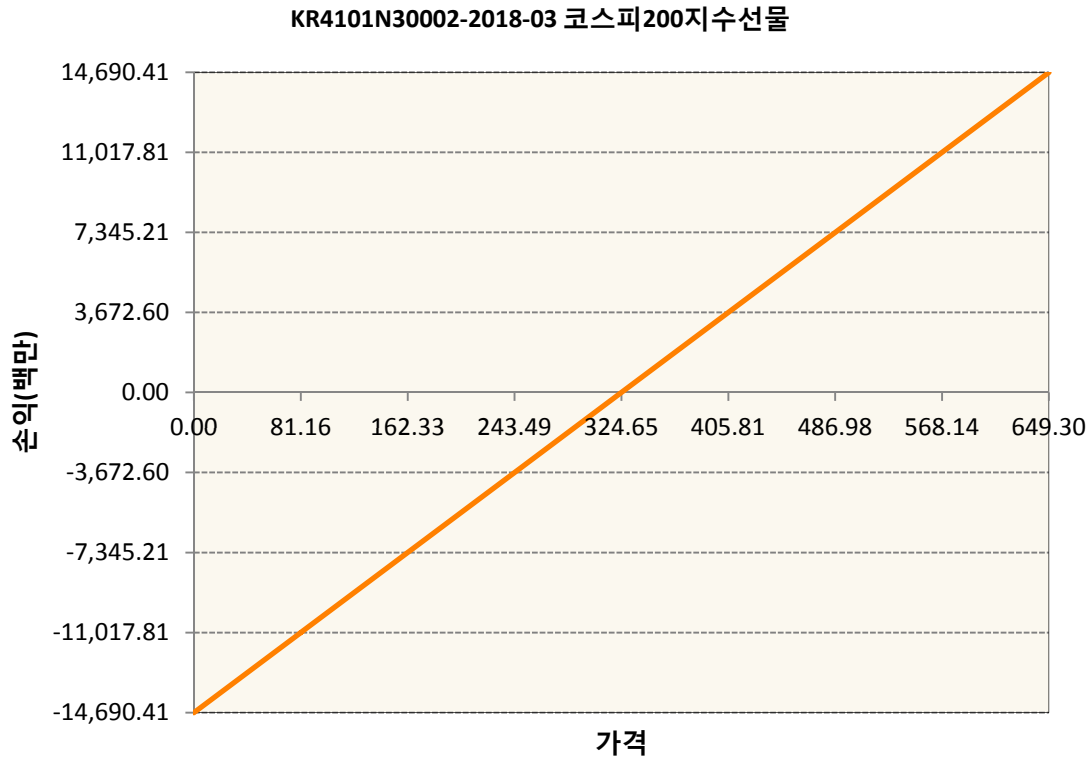
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,690	0	14,690	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,182
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,182	-1,182	-1,182	-1,182	-1,182	-1,182	-1,182
-5.33%	-788	-788	-788	-788	-788	-788	-788
-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%	788	788	788	788	788	788	788
8.00%	1,182	1,182	1,182	1,182	1,182	1,182	1,182

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

681

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

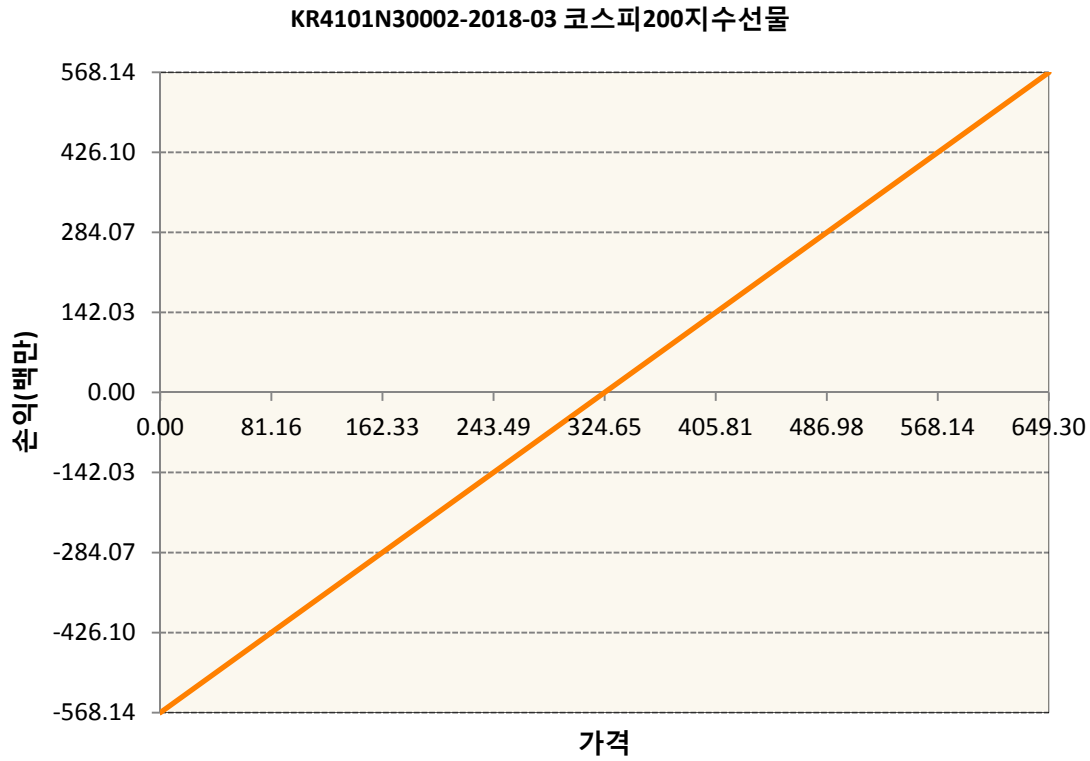
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	568	0	568	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	2017-12-19
기준일	2017-12-18

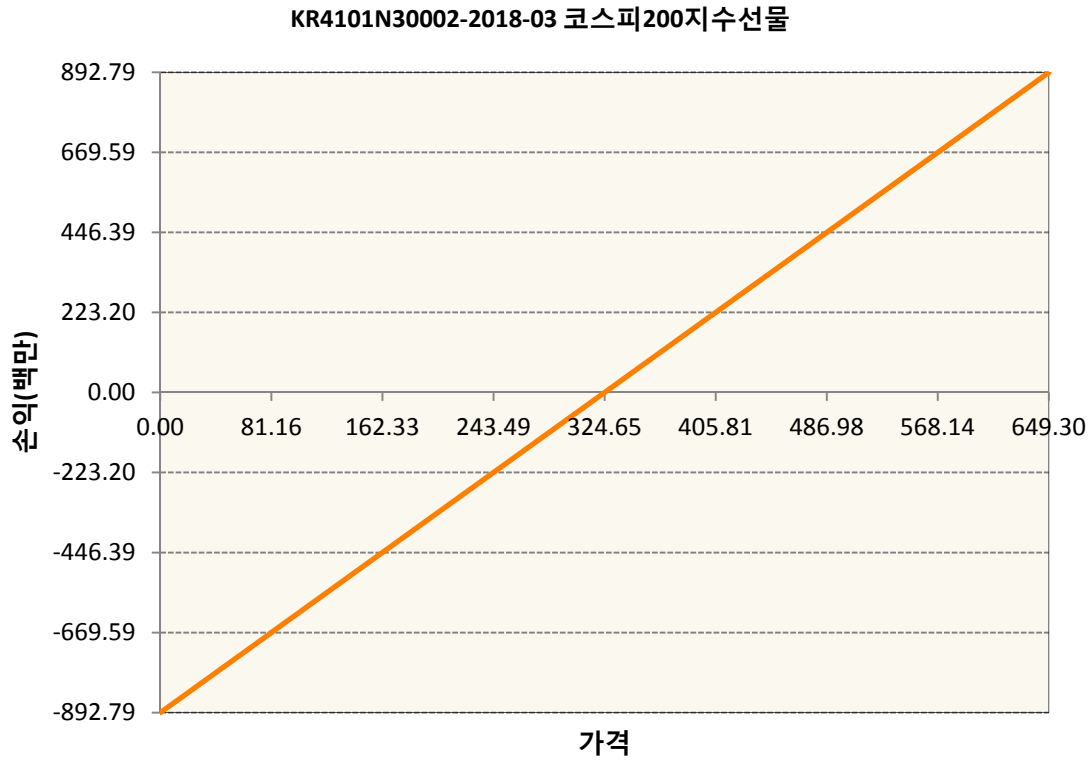
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	892	0	892	장내
누계	유가증권	선물	893	0	893	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							72
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	72	72	72	72	72	72	72

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

41

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

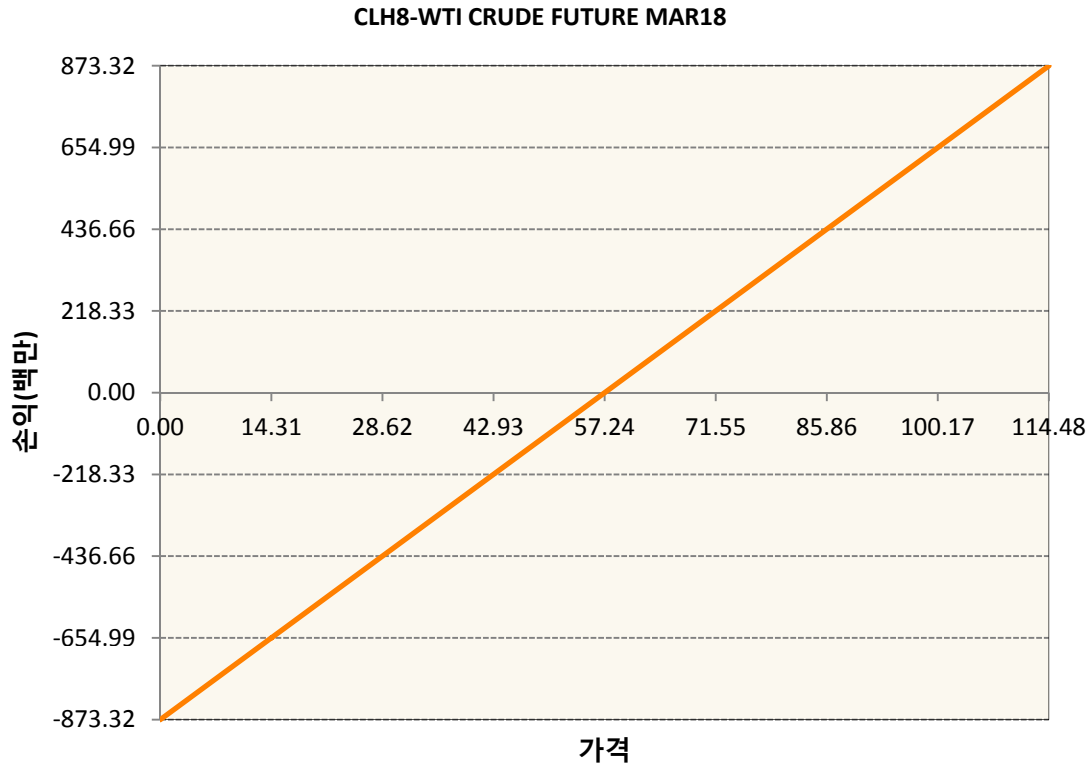
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

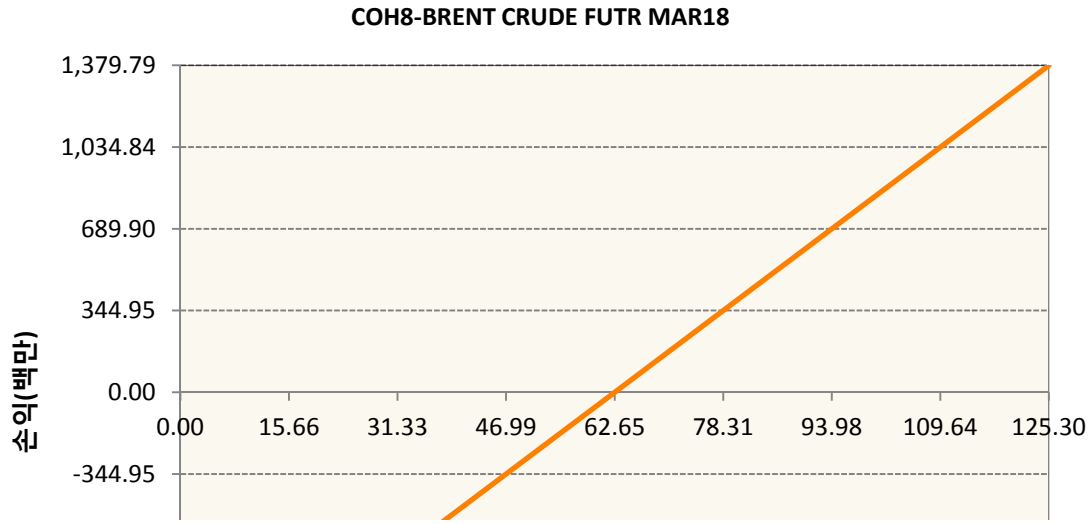
1. 계약금액

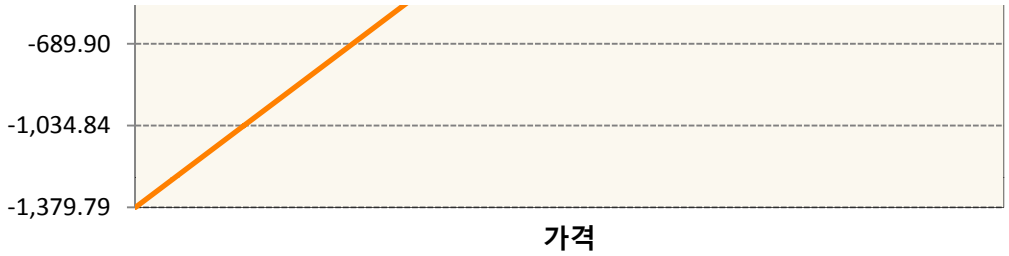
(단위:백만원)

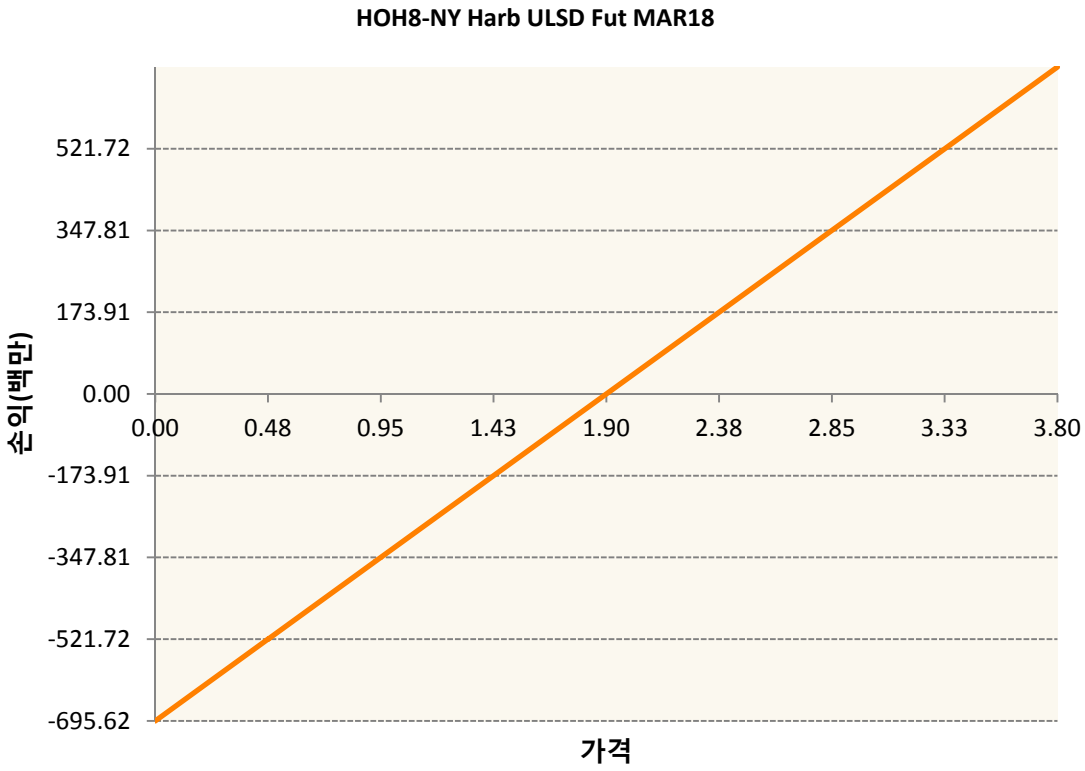
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,565	870	3,694	

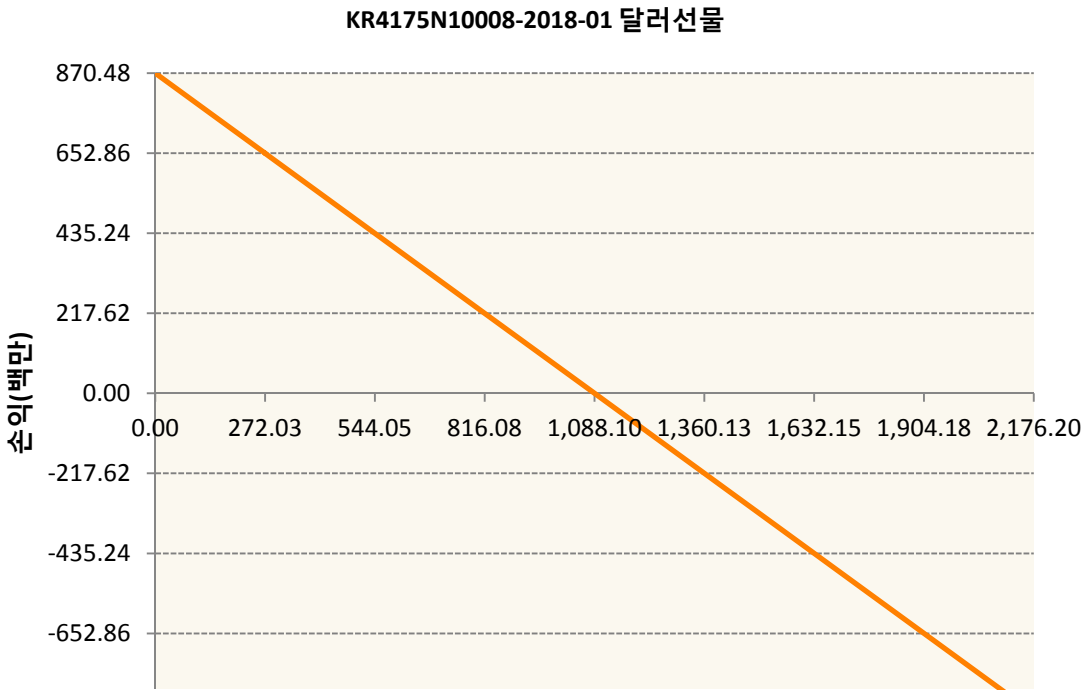
2. 만기시점의 손익구조

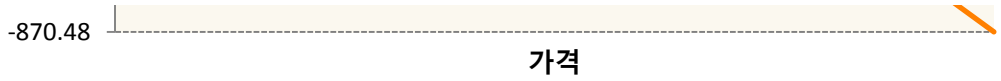


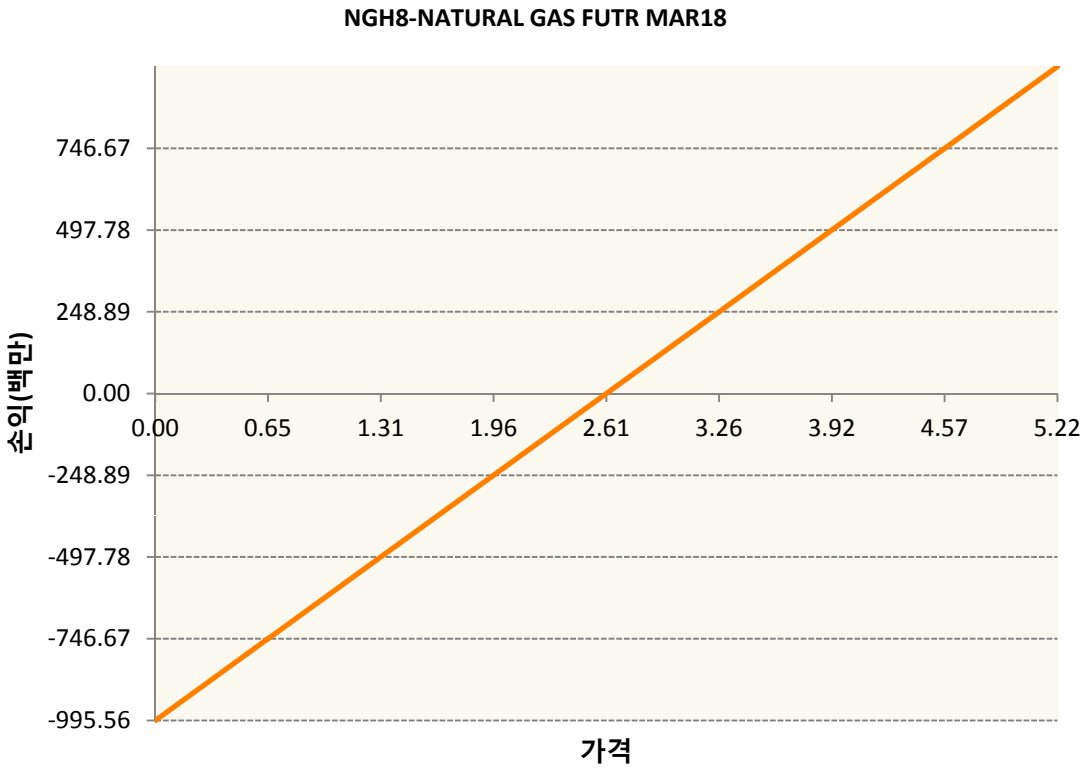


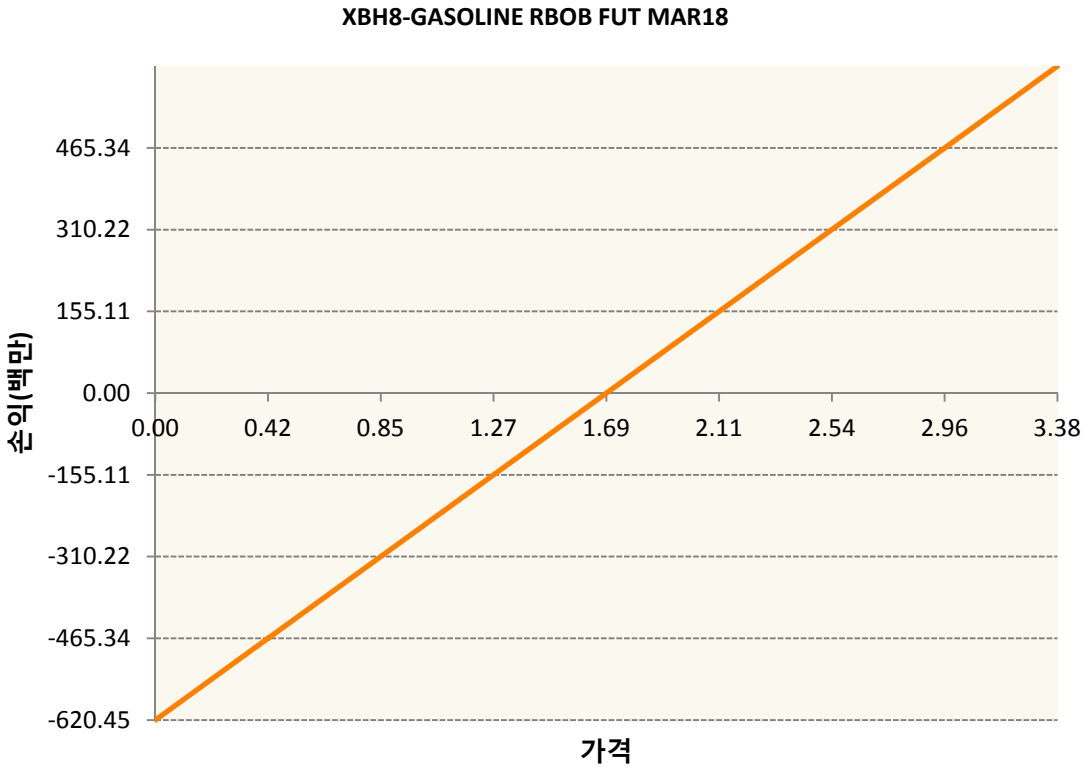

-689.90
-1,034.84
-1,379.79
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
521.72
347.81
173.91
0.00
-173.91
-347.81
-521.72
-695.62
0.00
0.48
0.95
1.43
1.90
2.38
2.85
3.33
3.80
손익(백만)
가격


KR4175N10008-2018-01 달러선물
870.48
652.86
435.24
217.62
0.00
-217.62
-435.24
-652.86
0.00
272.03
544.05
816.08
1,088.10
1,360.13
1,632.15
1,904.18
2,176.20
손익(백만)


-870.48
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
746.67
497.78
248.89
0.00
-248.89
-497.78
-746.67
-995.56
0.00
0.65
1.31
1.96
2.61
3.26
3.92
4.57
5.22
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
465.34
310.22
155.11
0.00
-155.11
-310.22
-465.34
-620.45
0.00
0.42
0.85
1.27
1.69
2.11
2.54
2.96
3.38
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	80
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	50

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

613

공시일	2017-12-19
기준일	2017-12-18

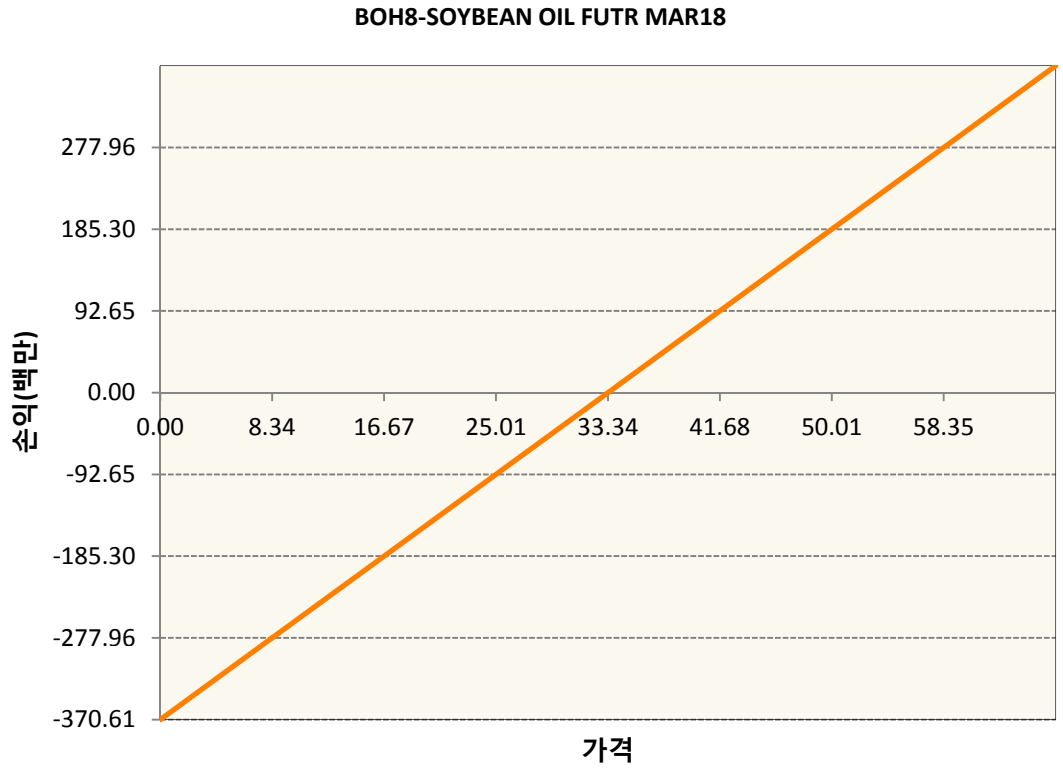
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

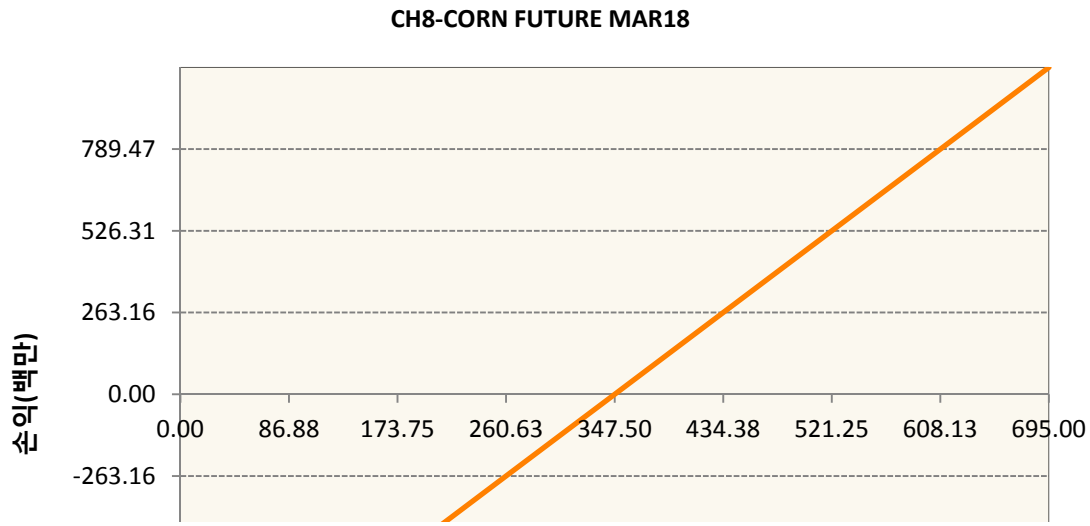
1. 계약금액

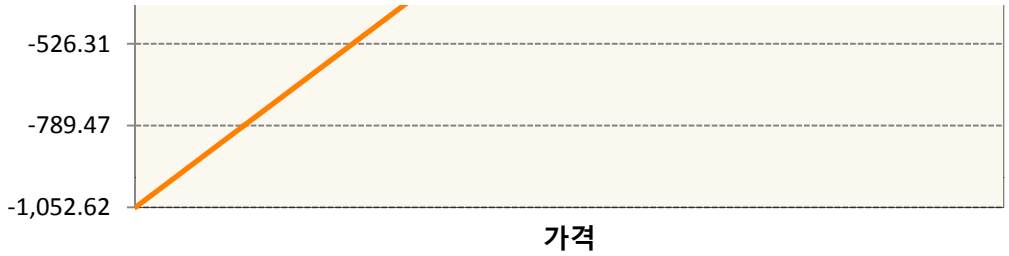
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,200	326	3,873	

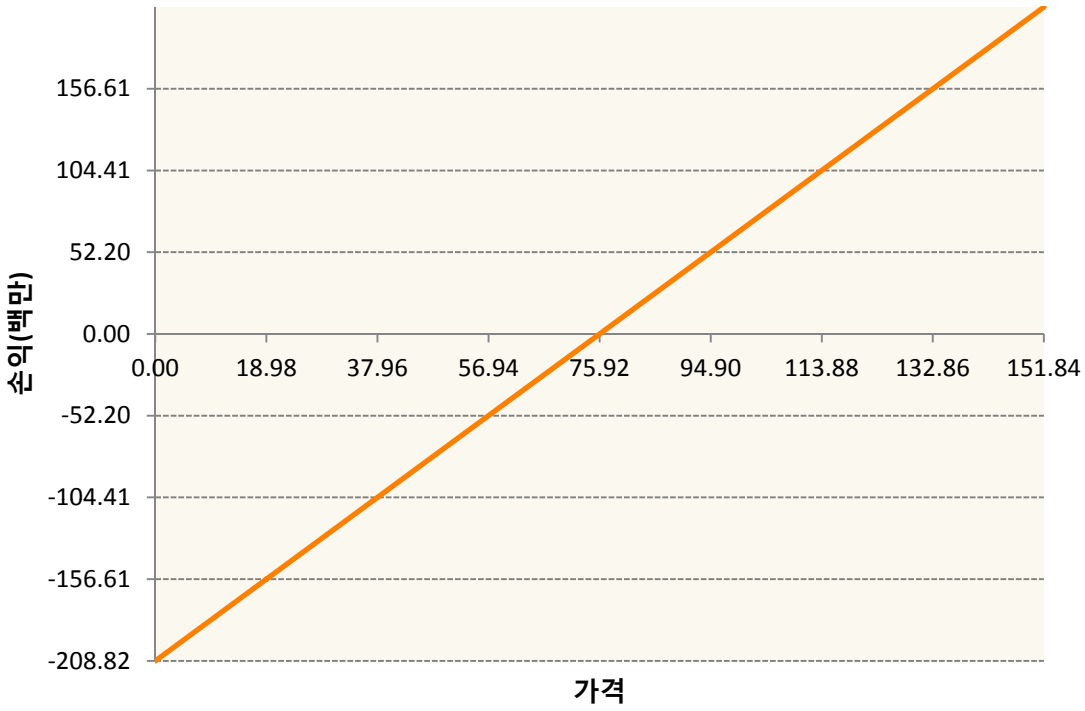
2. 만기시점의 손익구조



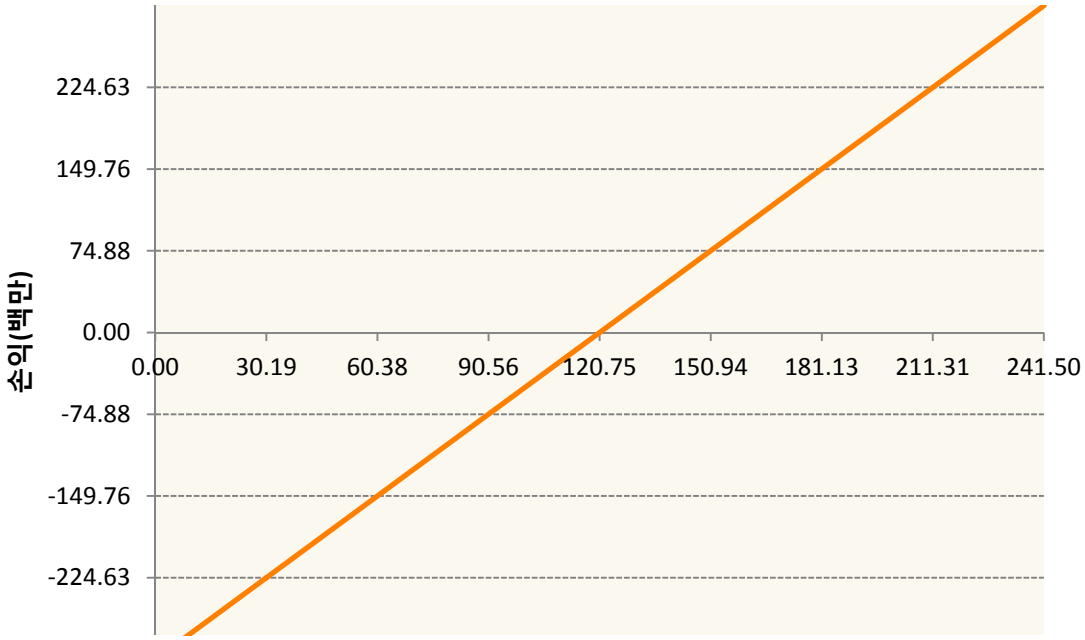


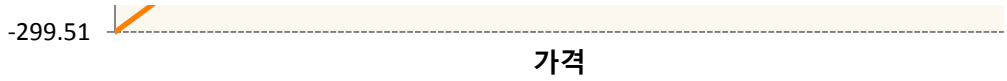


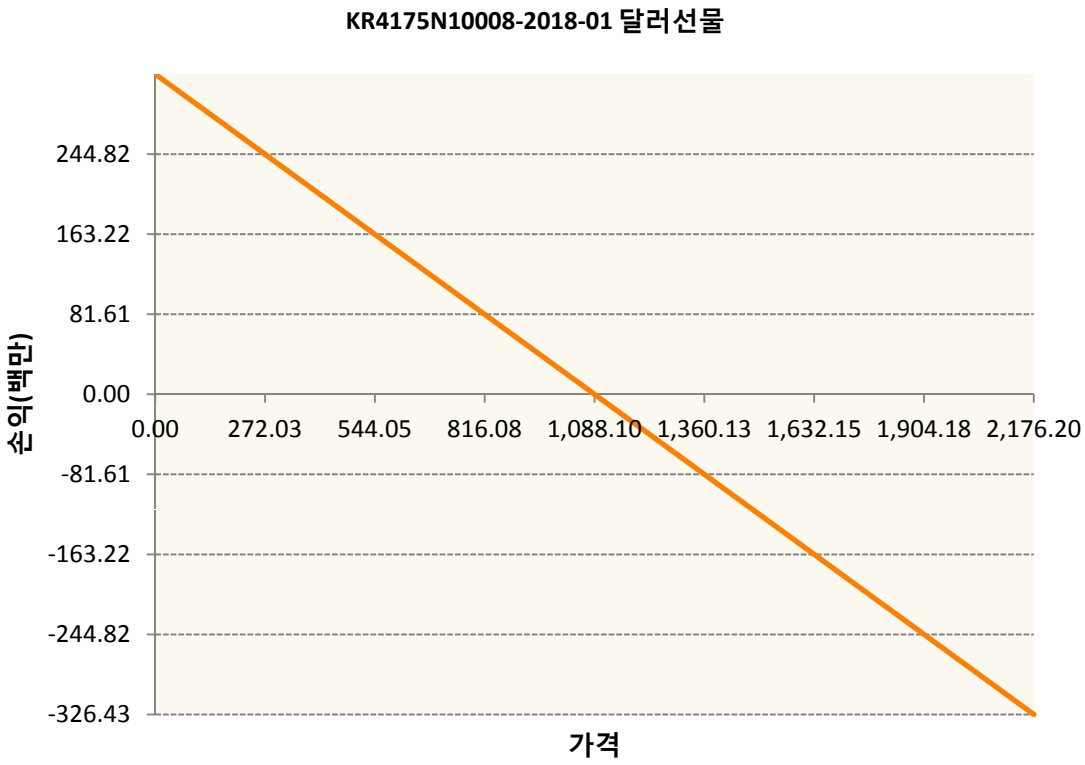
CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18

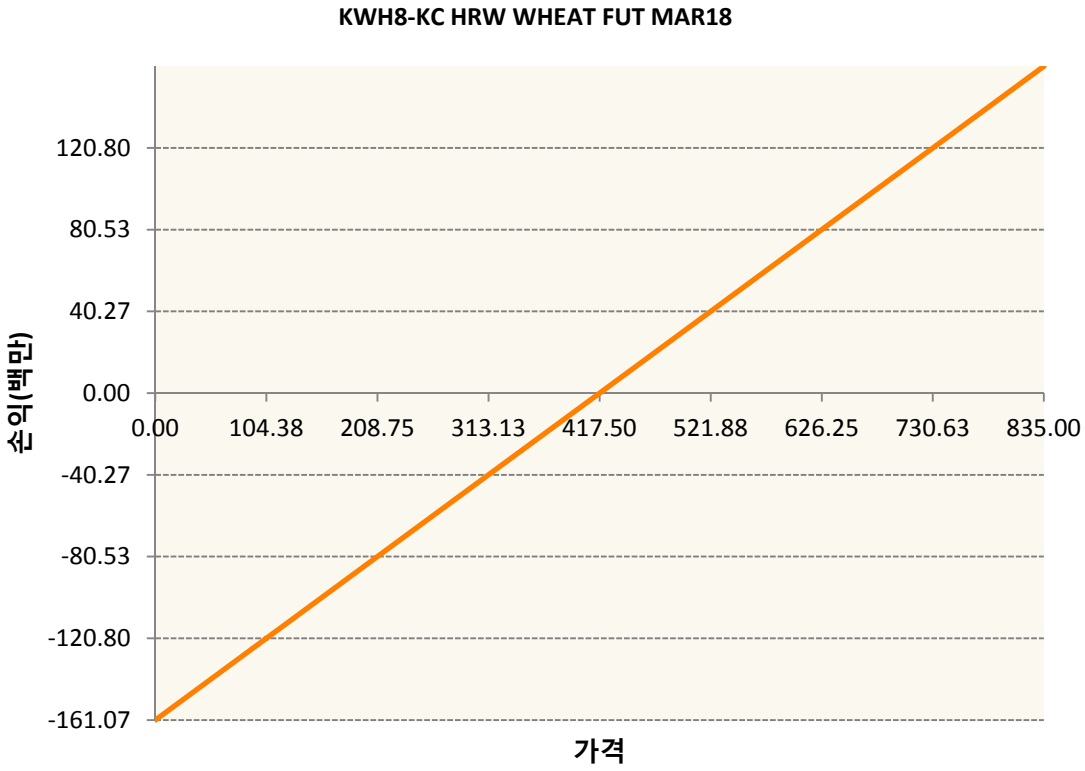


KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18

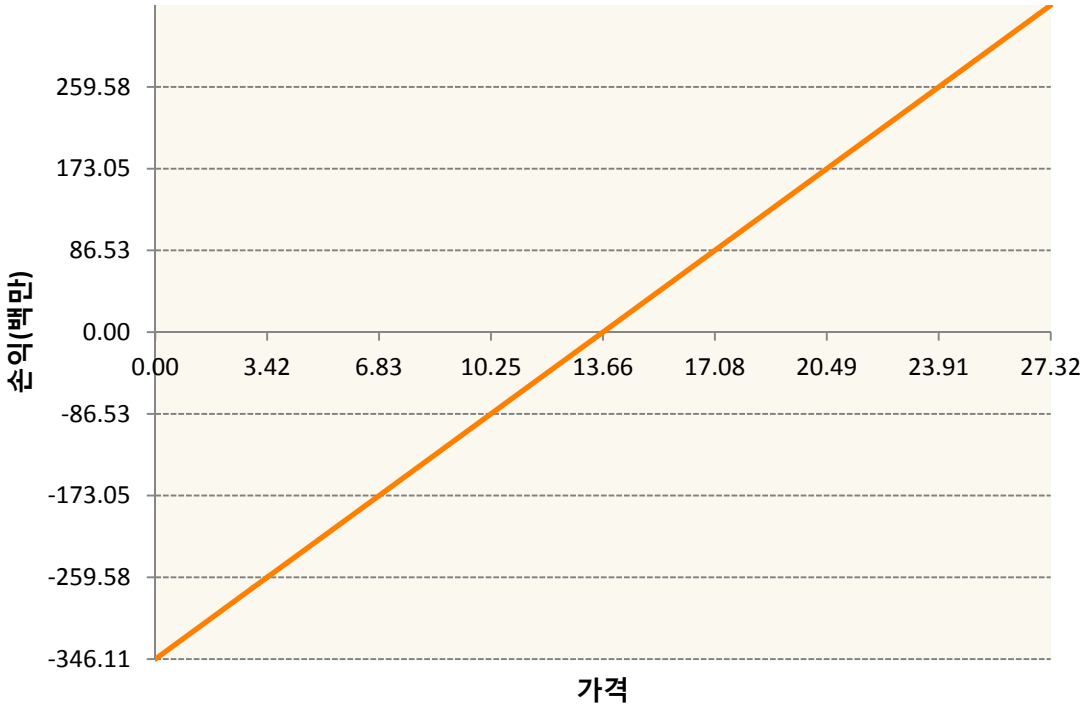



-299.51
가격

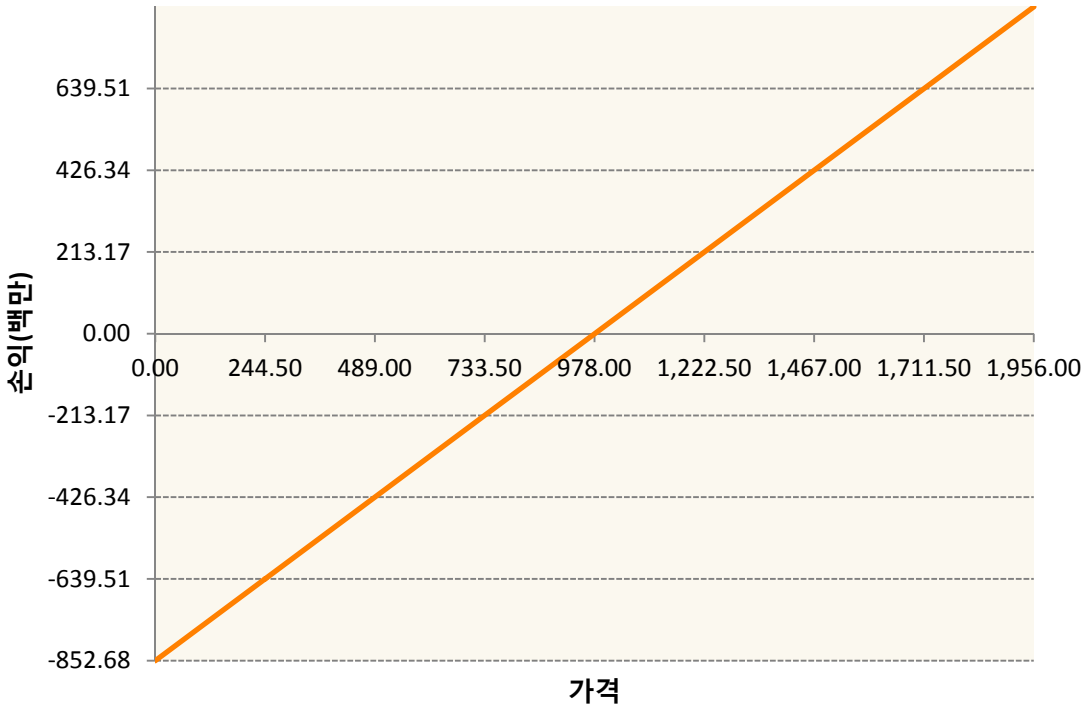

KR4175N10008-2018-01 달러선물
244.82
163.22
81.61
0.00
-81.61
-163.22
-244.82
-326.43
0.00
272.03
544.05
816.08
1,088.10
1,360.13
1,632.15
1,904.18
2,176.20
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
120.80
80.53
40.27
0.00
-40.27
-80.53
-120.80
-161.07
0.00
104.38
208.75
313.13
417.50
521.88
626.25
730.63
835.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

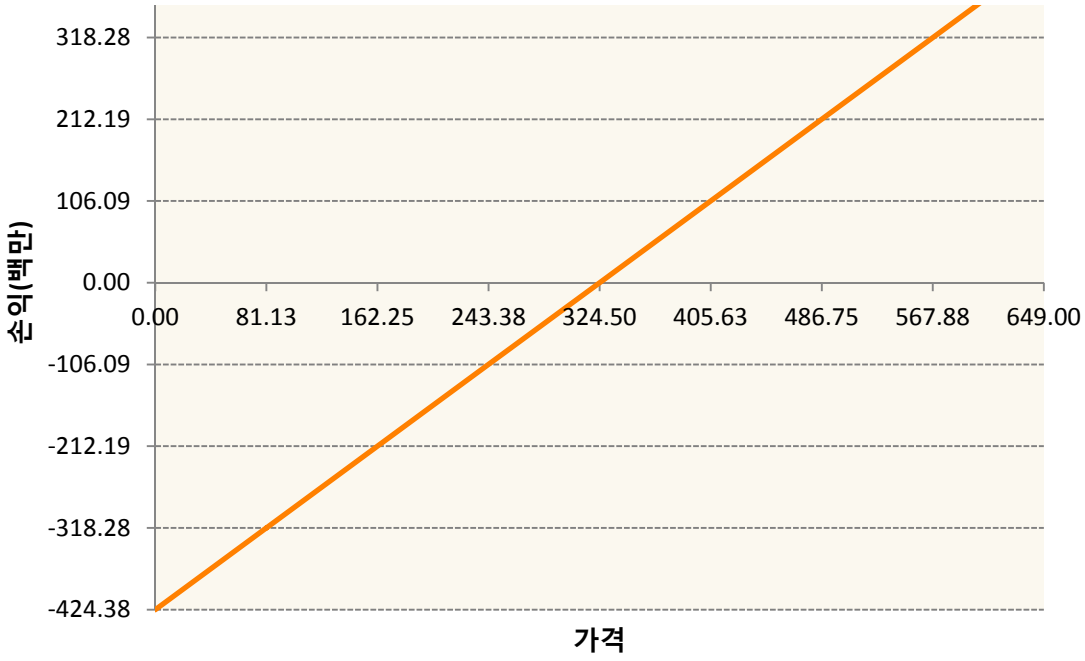


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

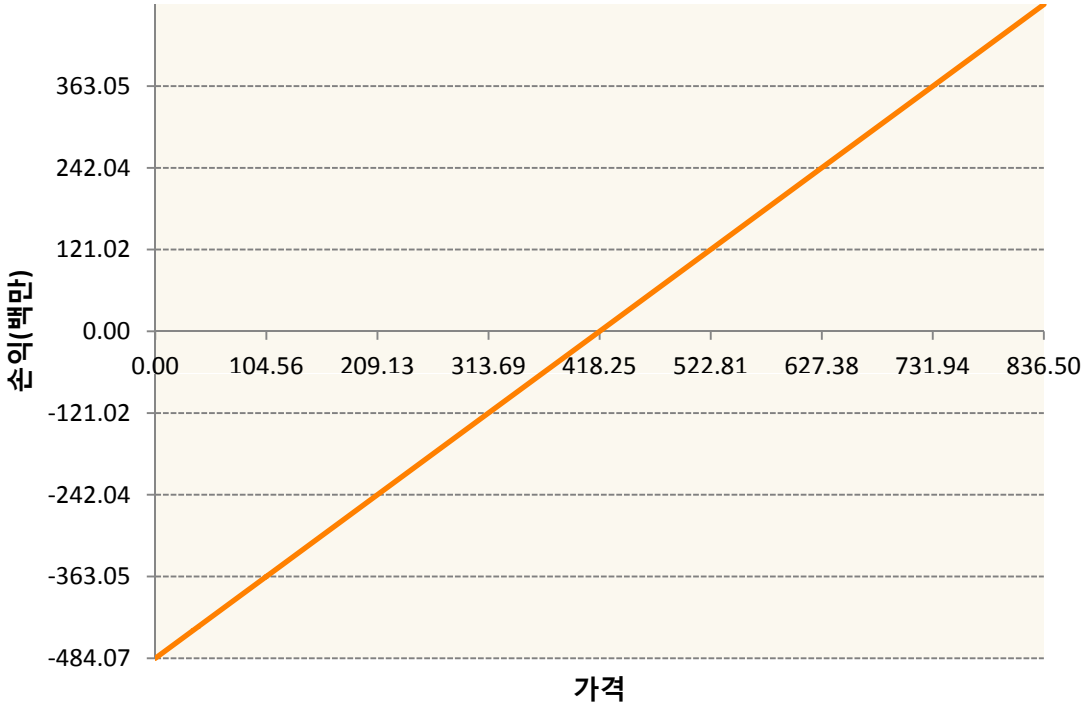


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) 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