공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

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	2017-12-22
기준일	2017-12-21

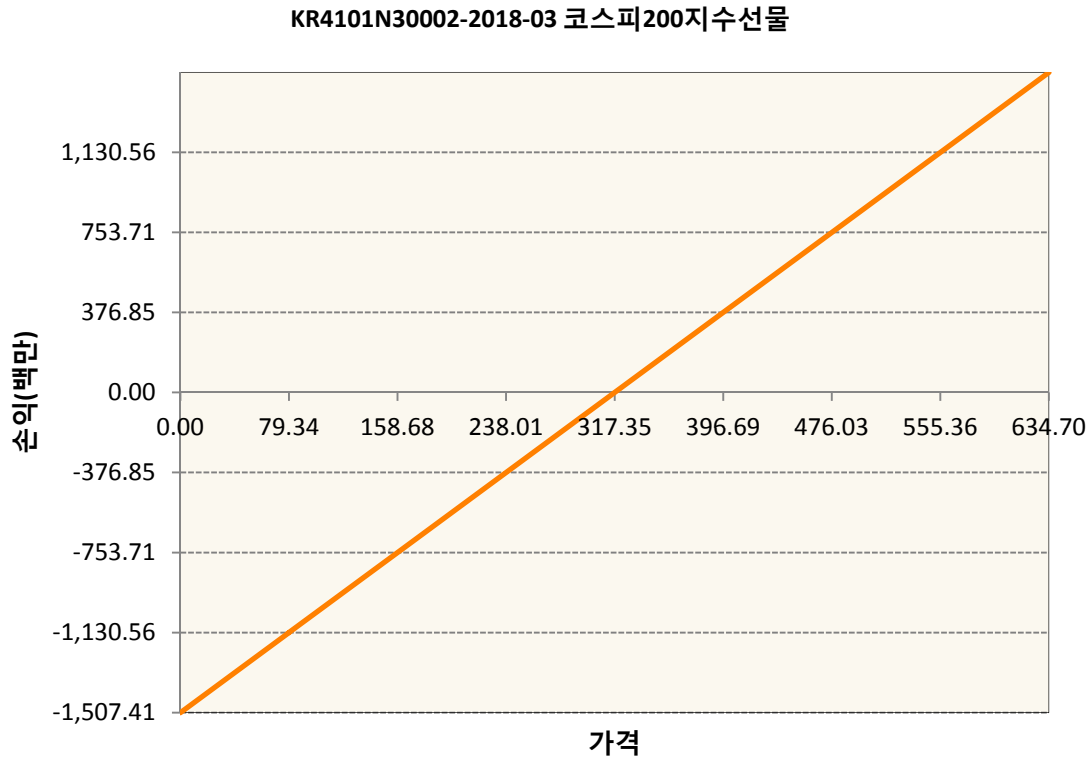
스마트인덱스모

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	1,507	0	1,507	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							121
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	81	81	81	81	81	81	81
8.00%	121	121	121	121	121	121	121

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

71

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

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	1,096

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

351

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

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	400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

359

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

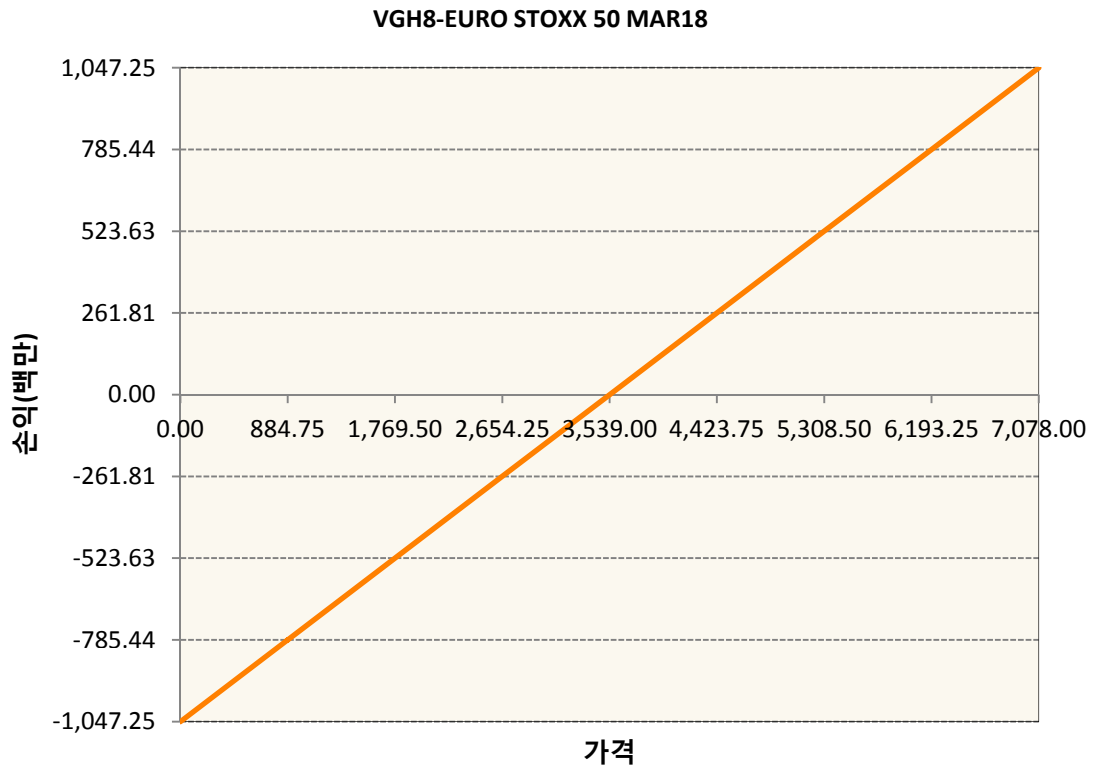
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,047	0	1,047	

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	2017-12-22
기준일	2017-12-21

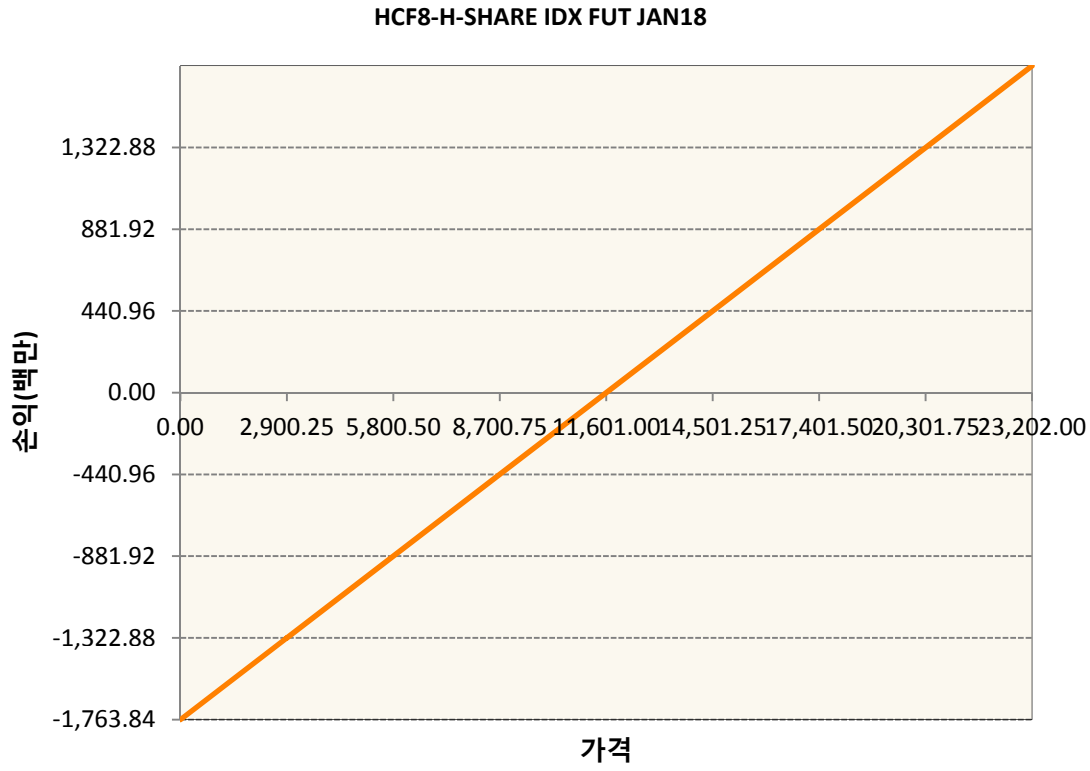
차이나인덱스모(주식-파생형)

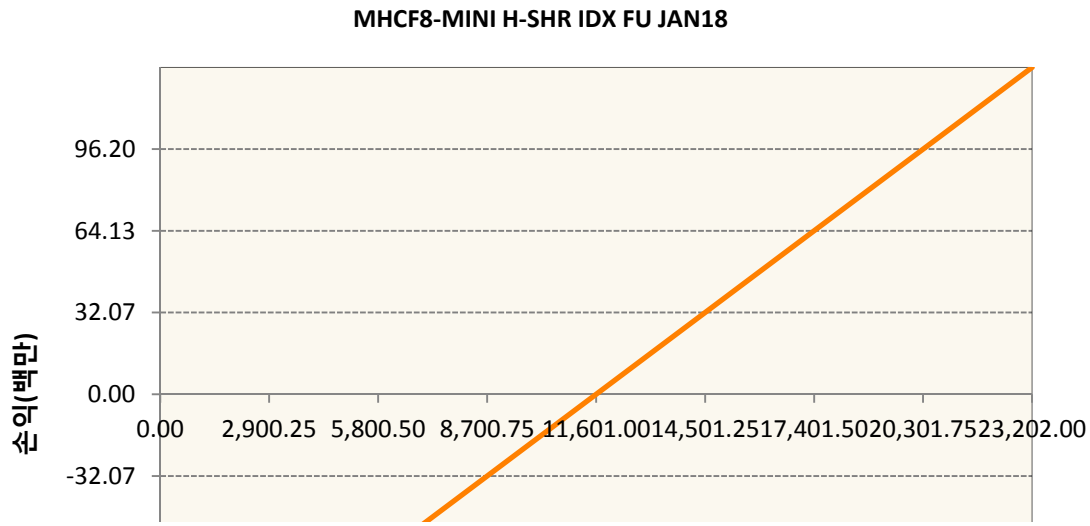
1. 계약금액

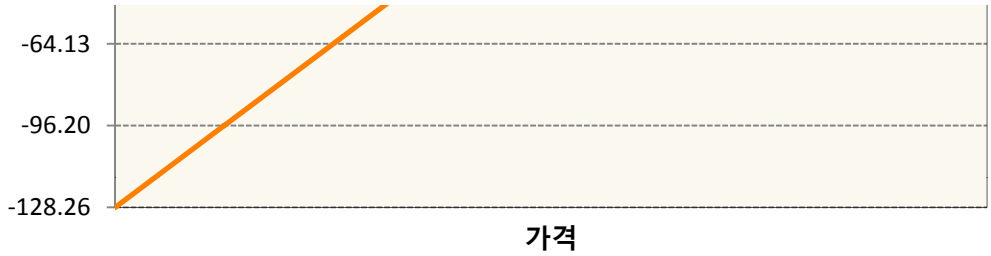
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	141
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	120

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

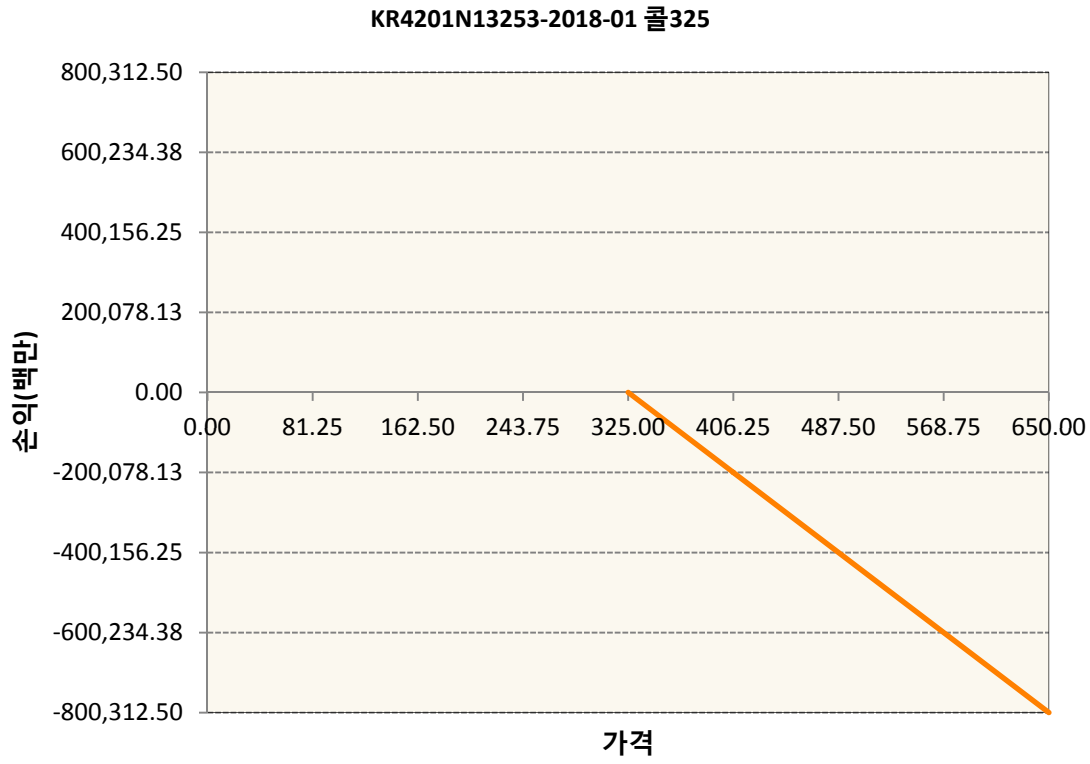
커버드콜모(주식혼합-파생형)

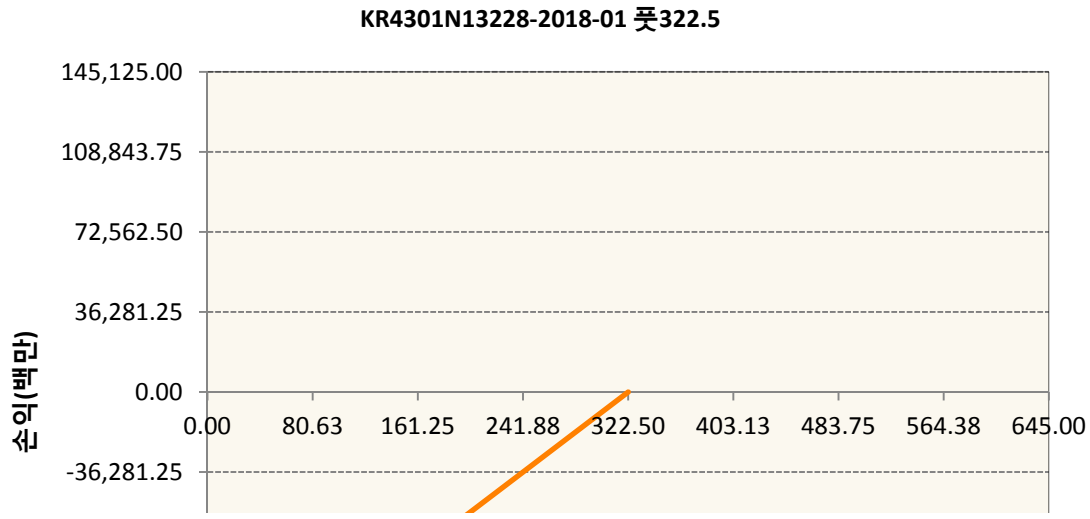
1. 계약금액

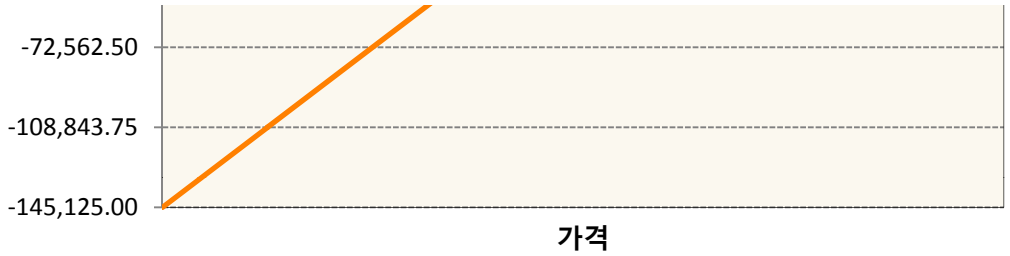
(단위:백만원)

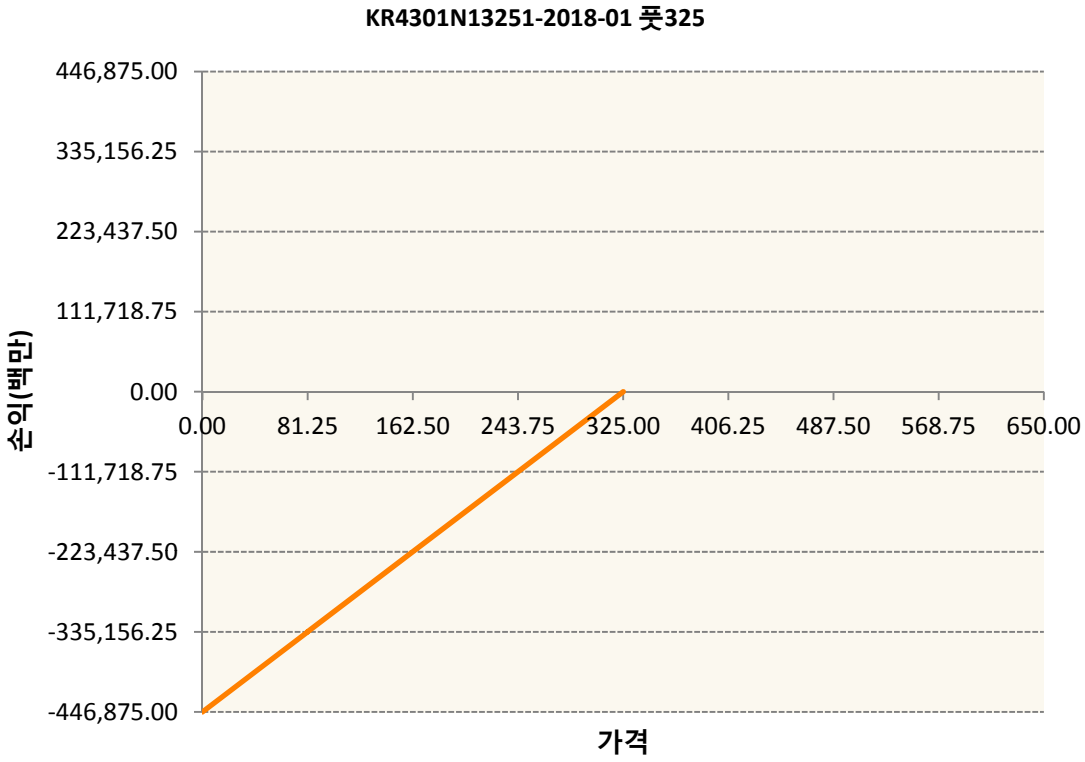
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,392,313	-1,392,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							44,166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12,893	12,734	12,496	12,174	11,765	11,274	10,704
-5.33%	12,236	11,752	11,156	10,460	9,676	8,814	7,884
-2.67%	9,981	8,972	7,883	6,729	5,523	4,274	2,990
0%	4,460	2,988	1,500	0	-1,509	-3,026	-4,548
2.67%	-5,672	-7,217	-8,770	-10,327	-11,888	-13,451	-15,018
5.33%	-20,424	-21,621	-22,883	-24,196	-25,550	-26,937	-28,351
8.00%	-38,539	-39,239	-40,054	-40,968	-41,966	-43,036	-44,166
KR4301N132 2018-01 풋322.5							10,333
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,322	-10,322	-10,322	-10,323	-10,325	-10,328	-10,333

-5.33%	-6,490	-6,494	-6,502	-6,514	-6,532	-6,555	-6,585
-2.67%	-2,732	-2,777	-2,834	-2,899	-2,973	-3,053	-3,141
0%	407	273	137	0	-138	-277	-416
2.67%	2,000	1,891	1,776	1,657	1,534	1,409	1,280
5.33%	2,360	2,333	2,297	2,251	2,196	2,133	2,062
8.00%	2,391	2,389	2,384	2,376	2,363	2,344	2,320
KR4301N132	2018-01 풋325						32,709
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,690	-32,690	-32,691	-32,692	-32,694	-32,699	-32,709
-5.33%	-20,979	-20,984	-20,994	-21,014	-21,046	-21,092	-21,153
-2.67%	-9,363	-9,445	-9,555	-9,694	-9,859	-10,048	-10,260
0%	1,084	737	374	0	-384	-775	-1,172
2.67%	7,466	7,060	6,648	6,231	5,809	5,384	4,957
5.33%	9,357	9,215	9,039	8,834	8,603	8,348	8,073
8.00%	9,583	9,566	9,535	9,488	9,421	9,333	9,223

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

93,219

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

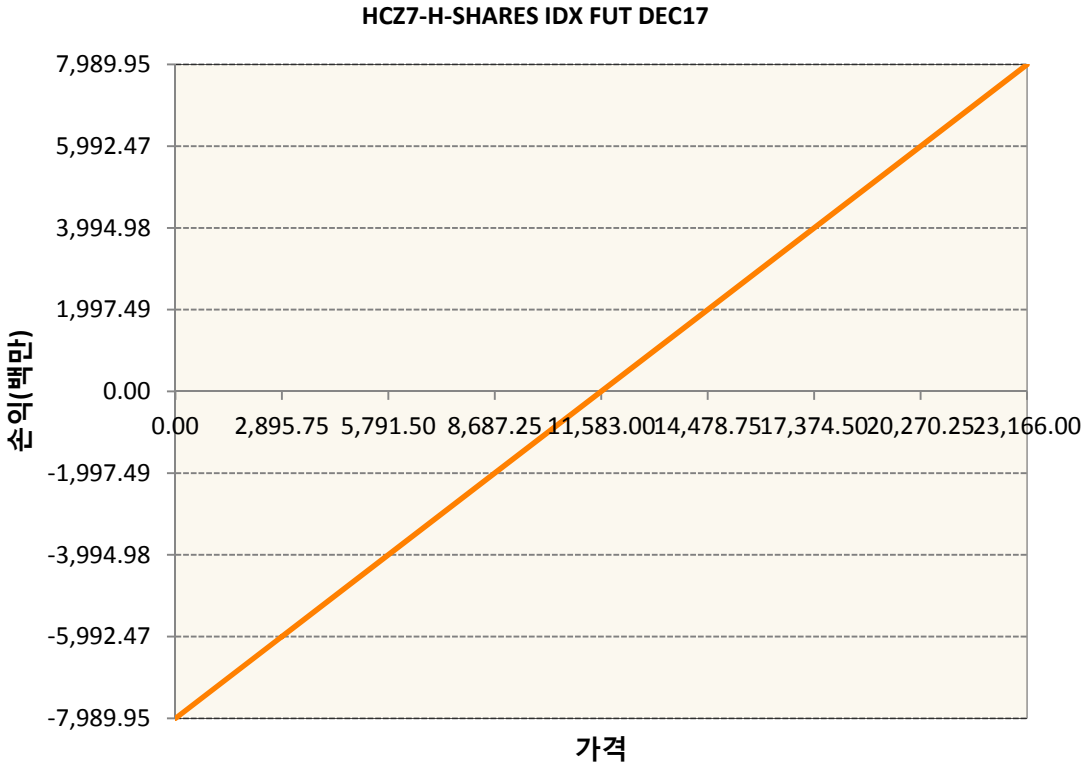
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

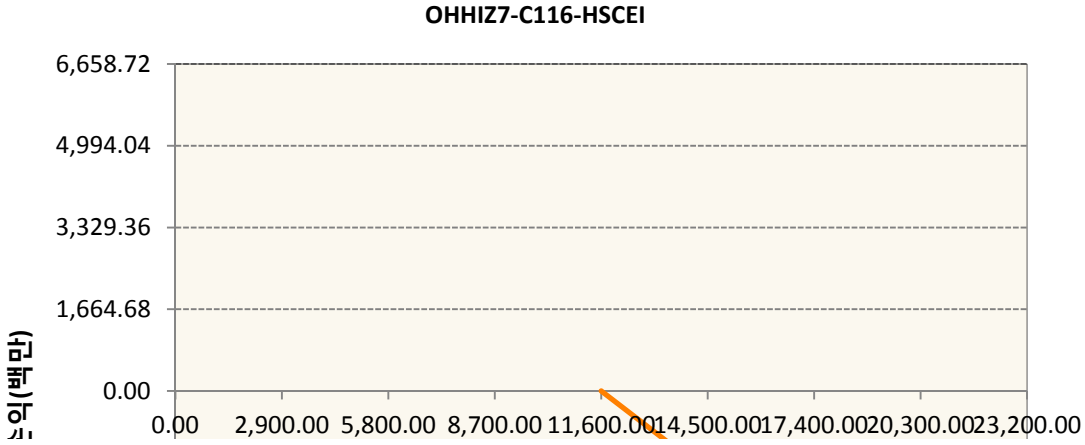
1. 계약금액

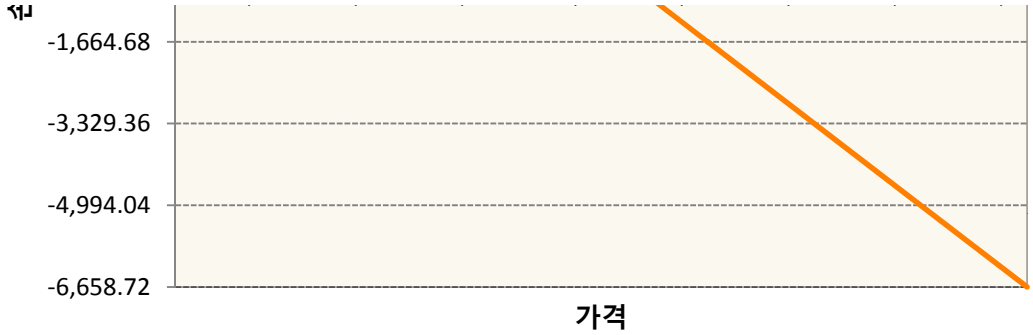
(단위:백만원)

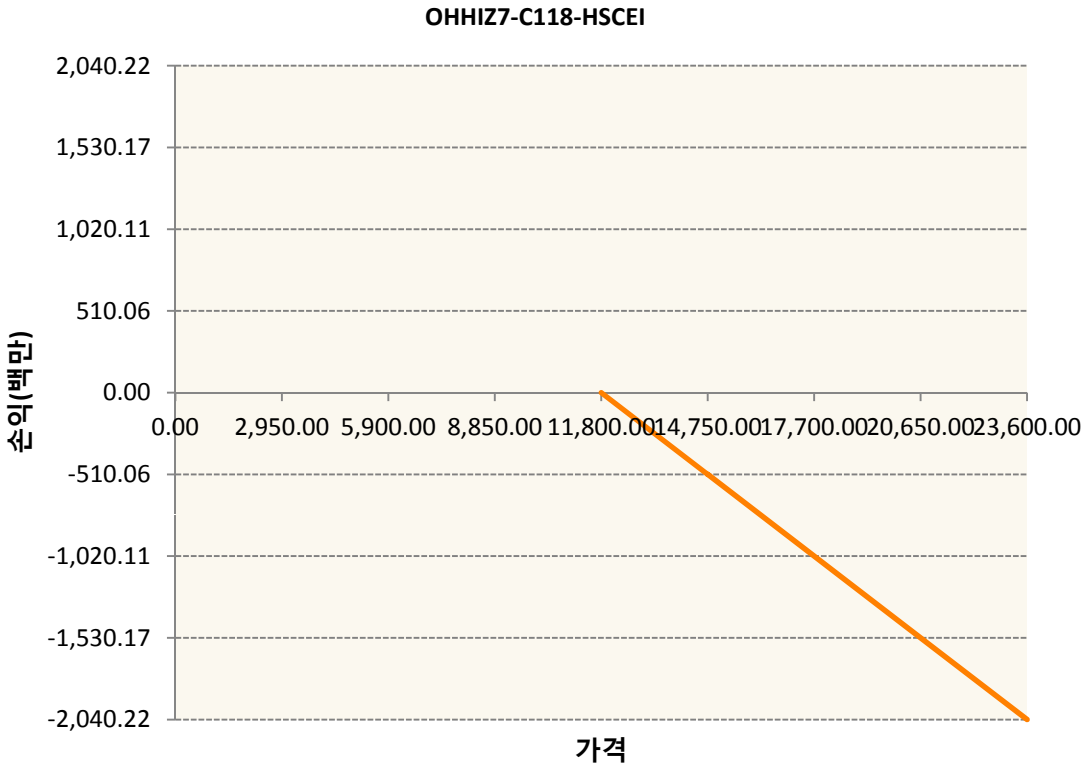
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,990	0	7,990	
누계	유가증권	옵션	0	17,398	-17,398	장내

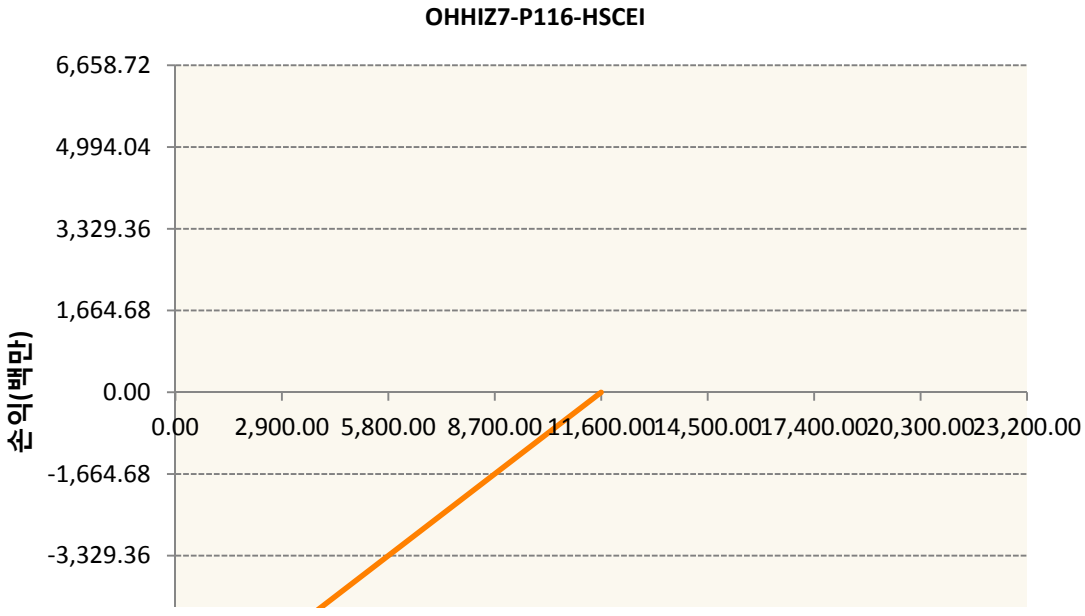
2. 만기시점의 손익구조

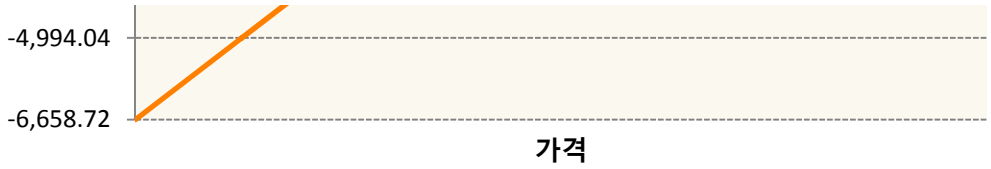


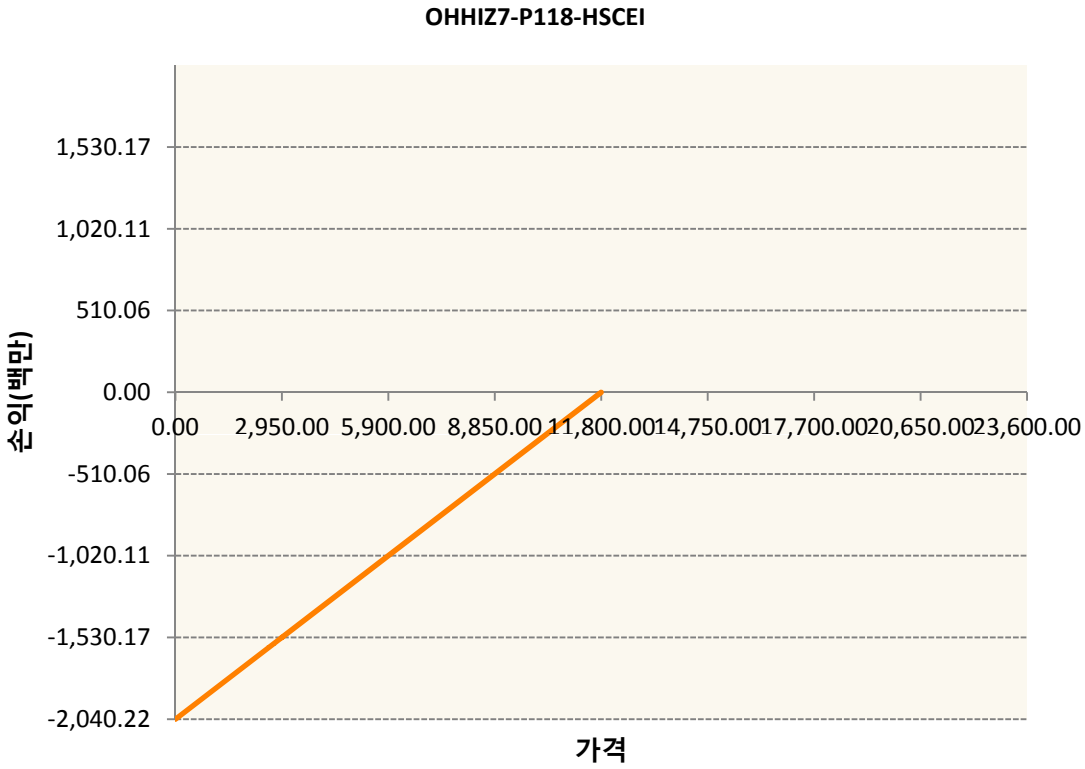



-1,664.68
-3,329.36
-4,994.04
-6,658.72
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,040.22
1,530.17
1,020.11
510.06
0.00
-510.06
-1,020.11
-1,530.17
-2,040.22
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
6,658.72
4,994.04
3,329.36
1,664.68
0.00
-1,664.68
-3,329.36
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	639
OHHIZ7-C11	HSCEI	533
OHHIZ7-C11	HSCEI	163
OHHIZ7-P11	HSCEI	533
OHHIZ7-P11	HSCEI	163

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,502

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

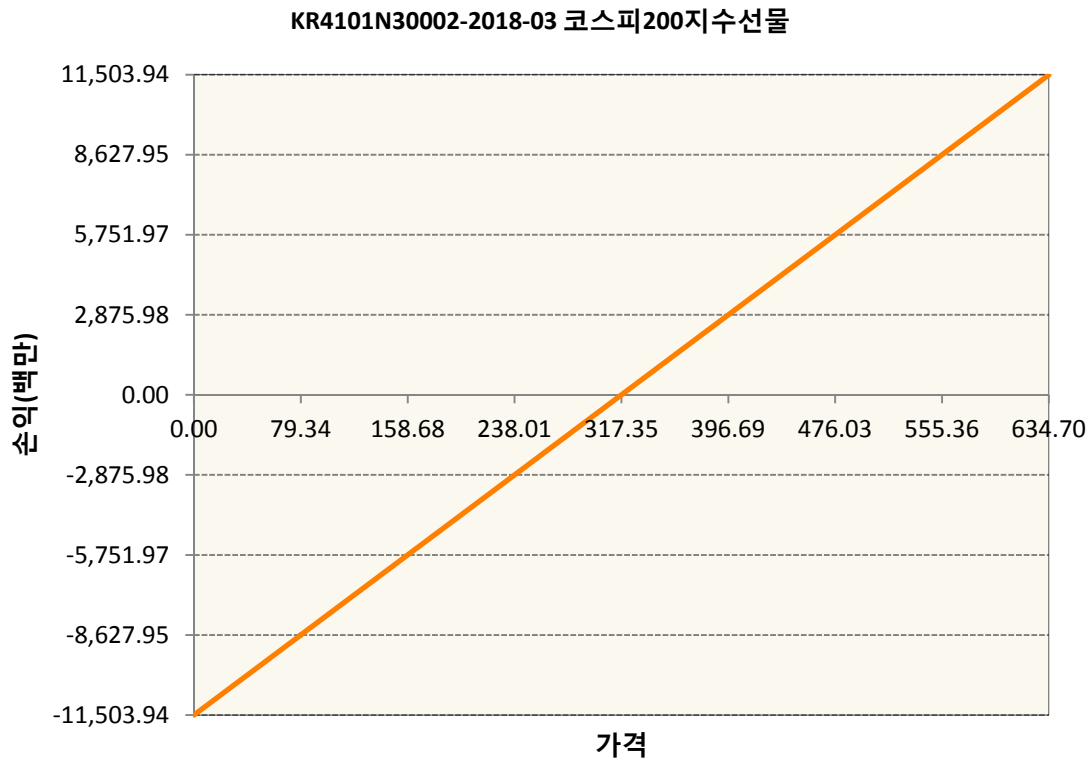
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

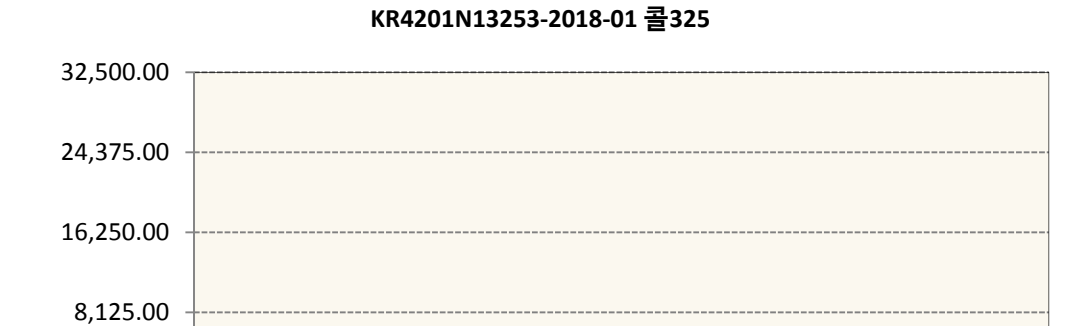
1. 계약금액

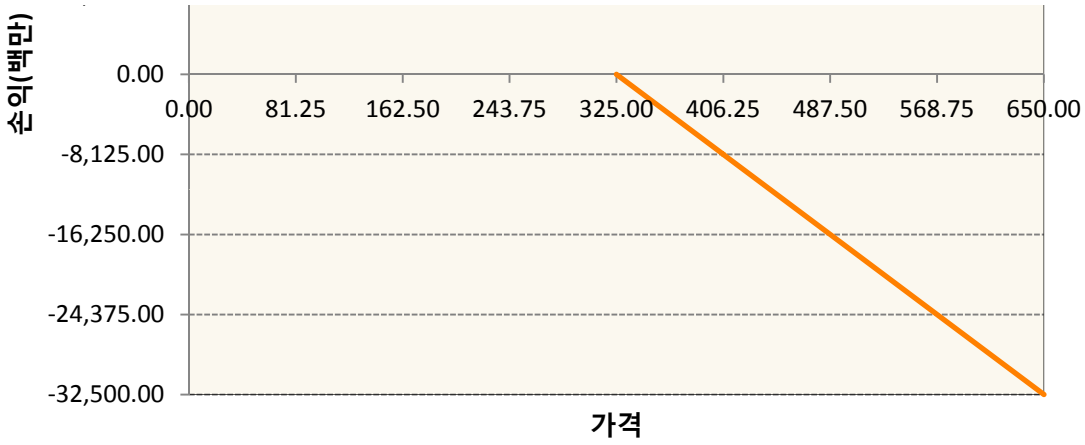
(단위:백만원)

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	11,504	0	11,504	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,875	-60,875	장내

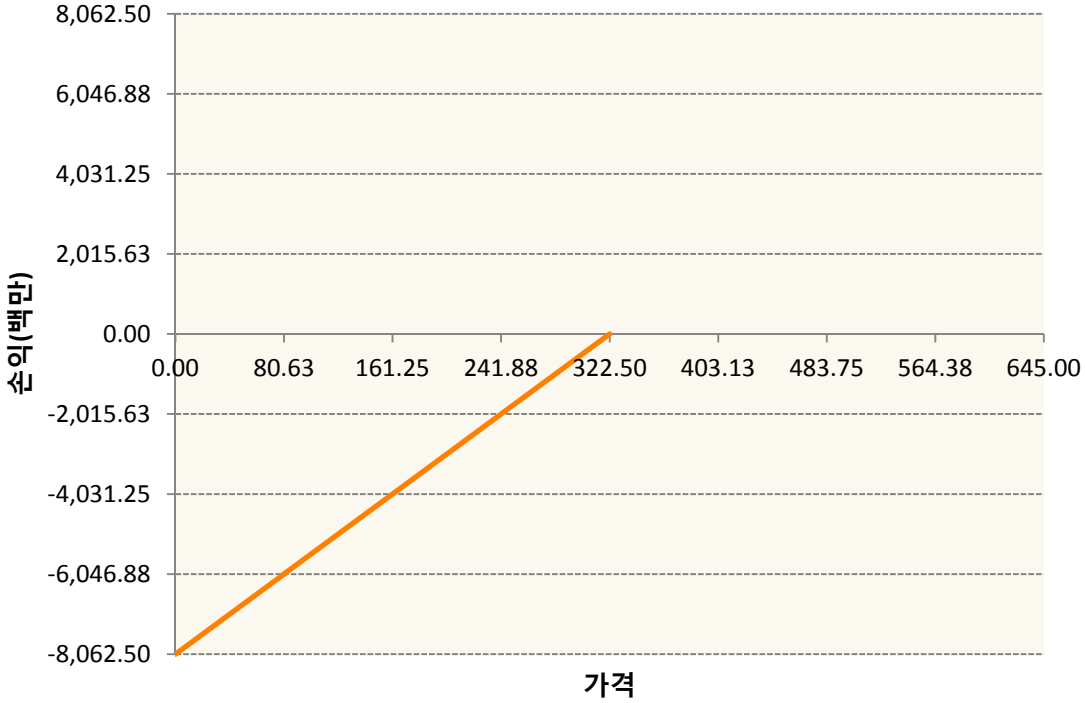
2. 만기시점의 손익구조



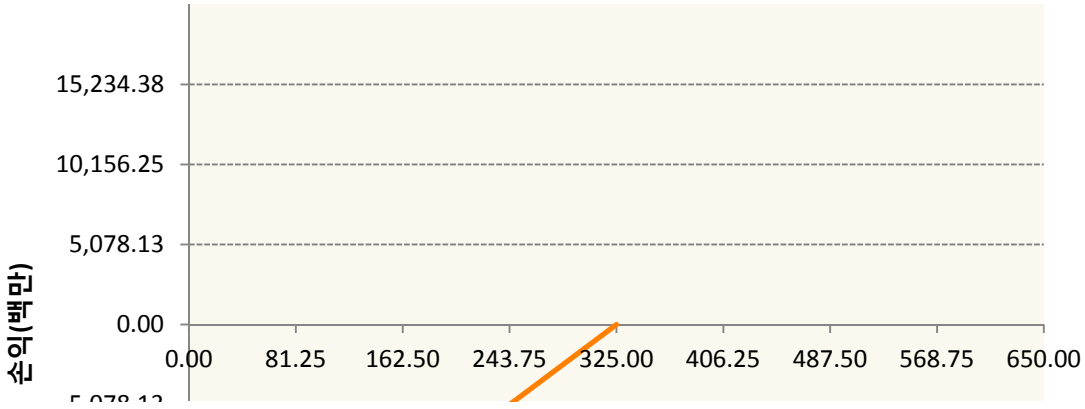




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462
-5.33%	-975	-975	-975	-975	-975	-975	-975
-2.67%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	487	487	487	487	487	487	487
5.33%	975	975	975	975	975	975	975
8.00%	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462
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%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	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%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	158	158	158	158	158	158	158
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	237	237	237	237	237	237	237
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						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						468
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-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%	468	468	468	468	468	468	468
	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%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-632	-632	-632	-632	-632	-632	-632
-5.33%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	421	421	421	421	421	421	421
8.00%	632	632	632	632	632	632	632
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474
-5.33%	-316	-316	-316	-316	-316	-316	-316
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	316	316	316	316	316	316	316
8.00%	474	474	474	474	474	474	474
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						927
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-927	-927	-927	-927	-927	-927	-927
-5.33%	-618	-618	-618	-618	-618	-618	-618
-2.67%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	309	309	309	309	309	309	309
5.33%	618	618	618	618	618	618	618
8.00%	927	927	927	927	927	927	927
	KR4201N13: 2018-01 콜325						1,794

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	524	517	507	494	478	458	435
-5.33%	497	477	453	425	393	358	320
-2.67%	405	364	320	273	224	174	121
0%	181	121	61	0	-61	-123	-185
2.67%	-230	-293	-356	-419	-483	-546	-610
5.33%	-829	-878	-929	-983	-1,038	-1,094	-1,151
8.00%	-1,565	-1,593	-1,627	-1,664	-1,704	-1,748	-1,794
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						574

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-573	-573	-573	-573	-574	-574	-574
-5.33%	-361	-361	-361	-362	-363	-364	-366
-2.67%	-152	-154	-157	-161	-165	-170	-174
0%	23	15	8	0	-8	-15	-23
2.67%	111	105	99	92	85	78	71
5.33%	131	130	128	125	122	118	115
8.00%	133	133	132	132	131	130	129
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,487

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,487
-5.33%	-954	-954	-954	-955	-957	-959	-962
-2.67%	-426	-429	-434	-441	-448	-457	-466
0%	49	33	17	0	-17	-35	-53
2.67%	339	321	302	283	264	245	225
5.33%	425	419	411	402	391	379	367
8.00%	436	435	433	431	428	424	419

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

9,452

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

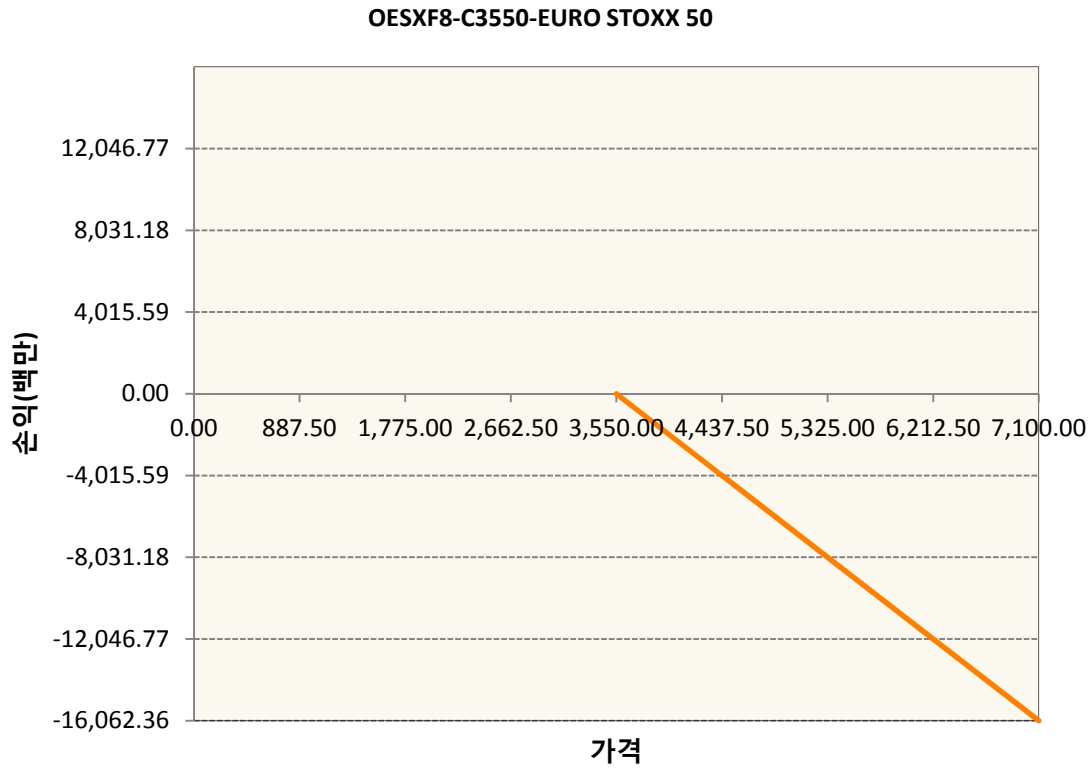
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

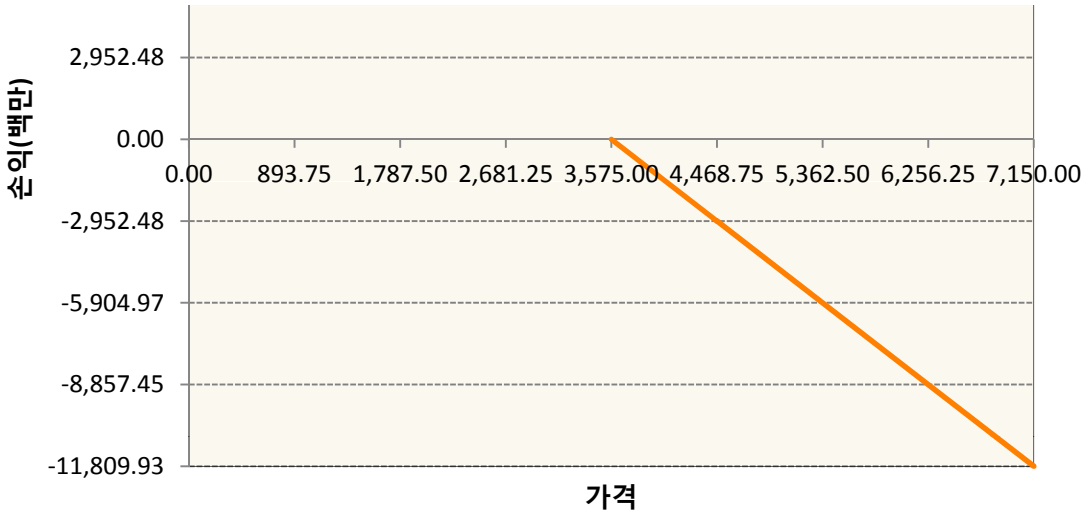
(단위:백만원)

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	19,402	0	19,402	
누계	유가증권	스왑	96,408	0	96,408	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,745	-55,745	장내
누계	지수	스왑	51,418	0	51,418	장외

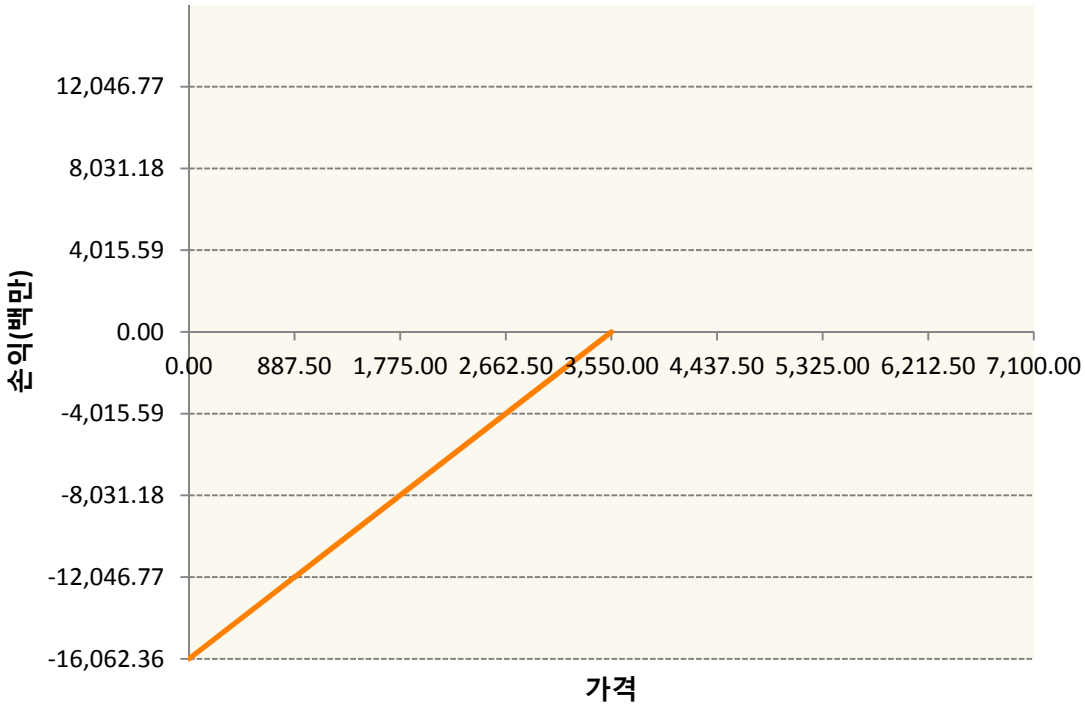
2. 만기시점의 손익구조



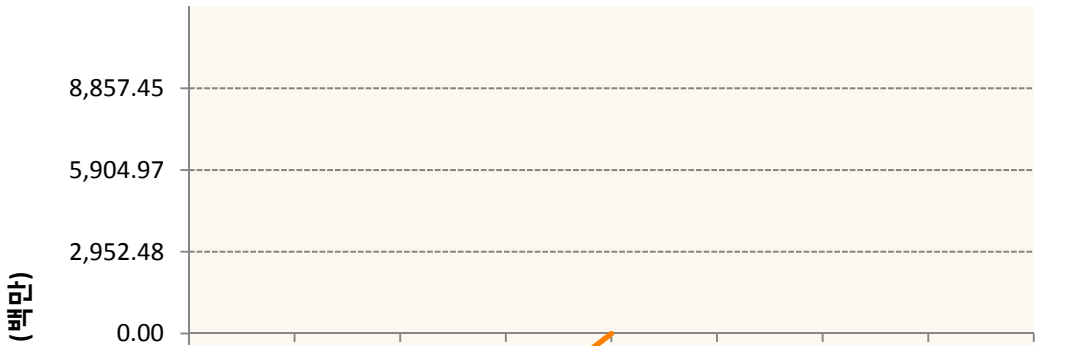


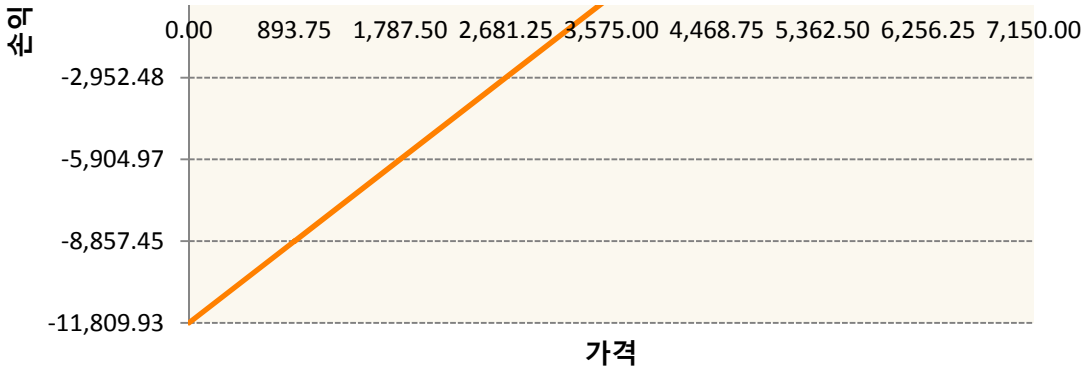


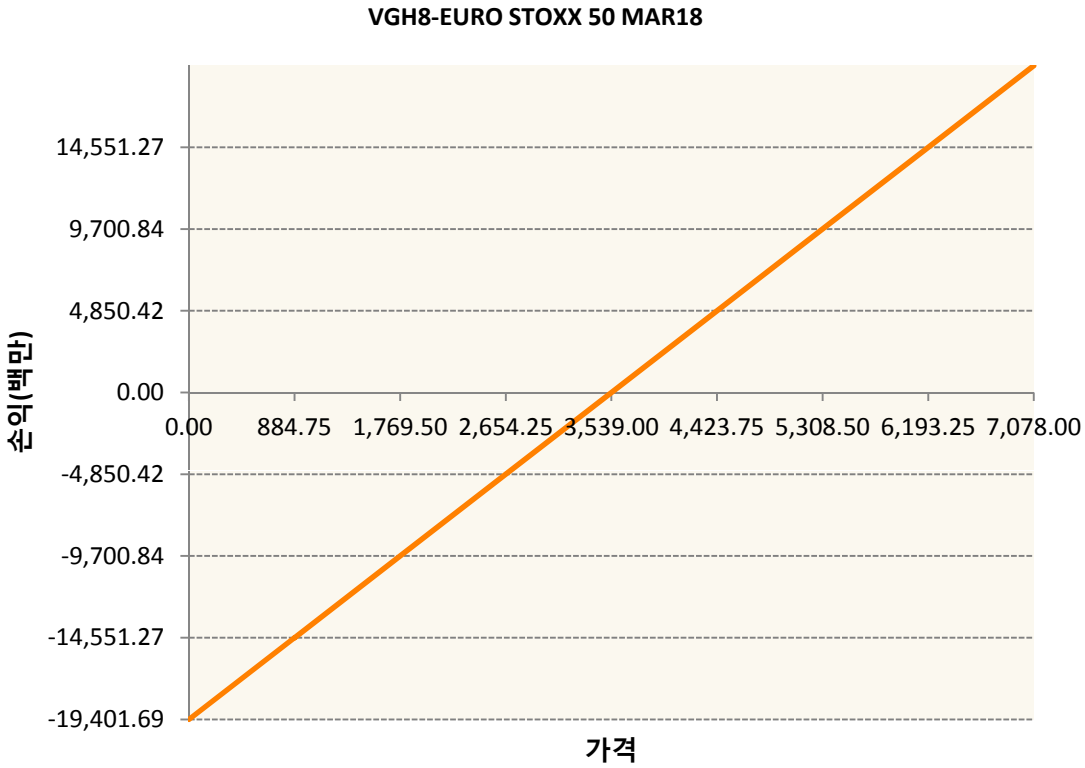
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	73
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	93
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,285
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	945
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,285
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	945
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,552

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

3,520

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

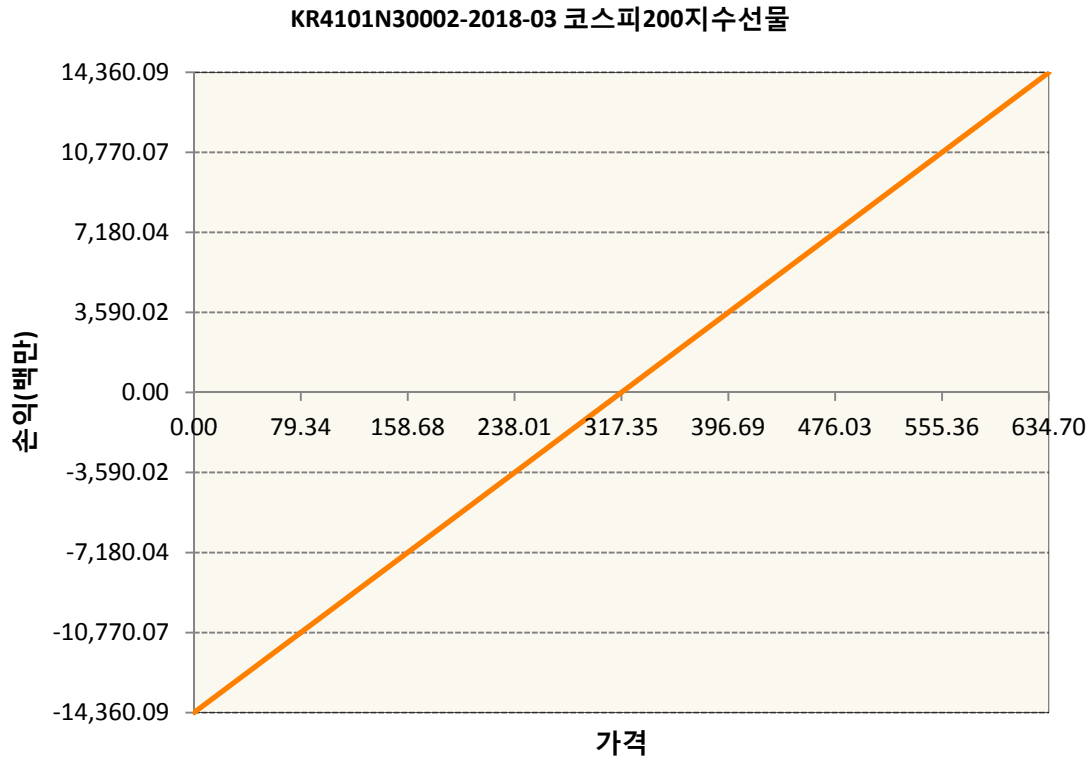
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	14,360	0	14,360	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,157	-1,157	-1,157	-1,157	-1,157	-1,157	-1,157
-5.33%	-772	-772	-772	-772	-772	-772	-772
-2.67%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	386	386	386	386	386	386	386
5.33%	772	772	772	772	772	772	772
8.00%	1,157	1,157	1,157	1,157	1,157	1,157	1,157

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

680

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

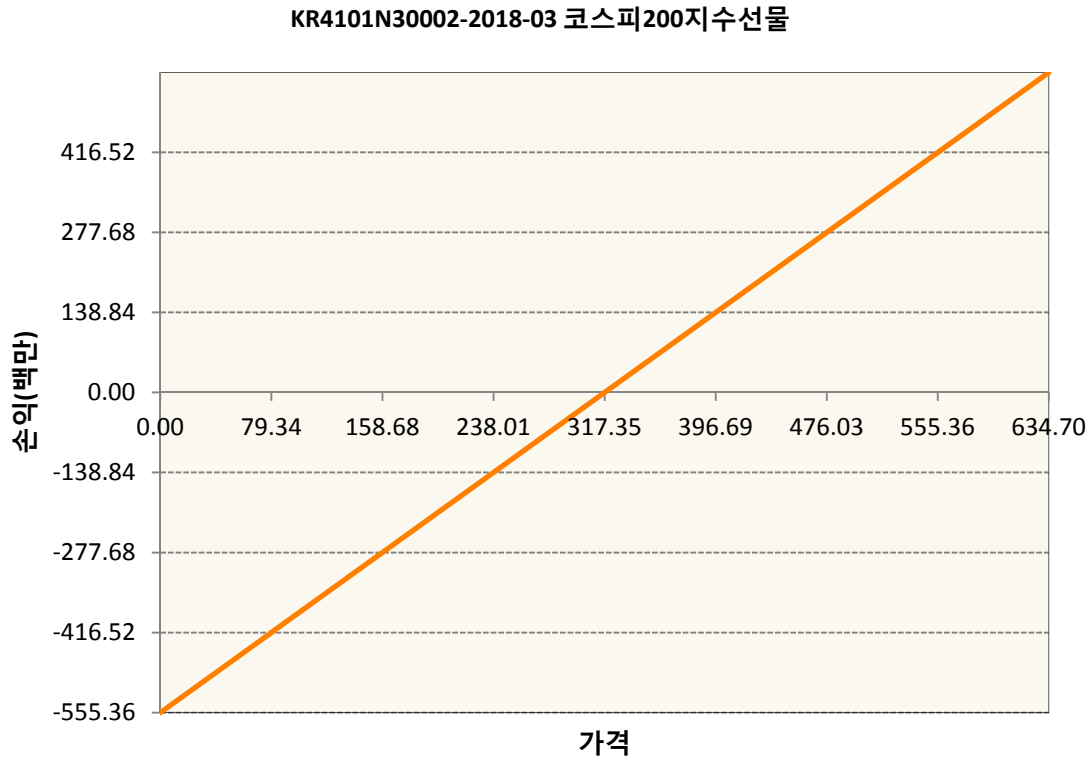
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	555	0	555	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-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%	45	45	45	45	45	45	45

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

26

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

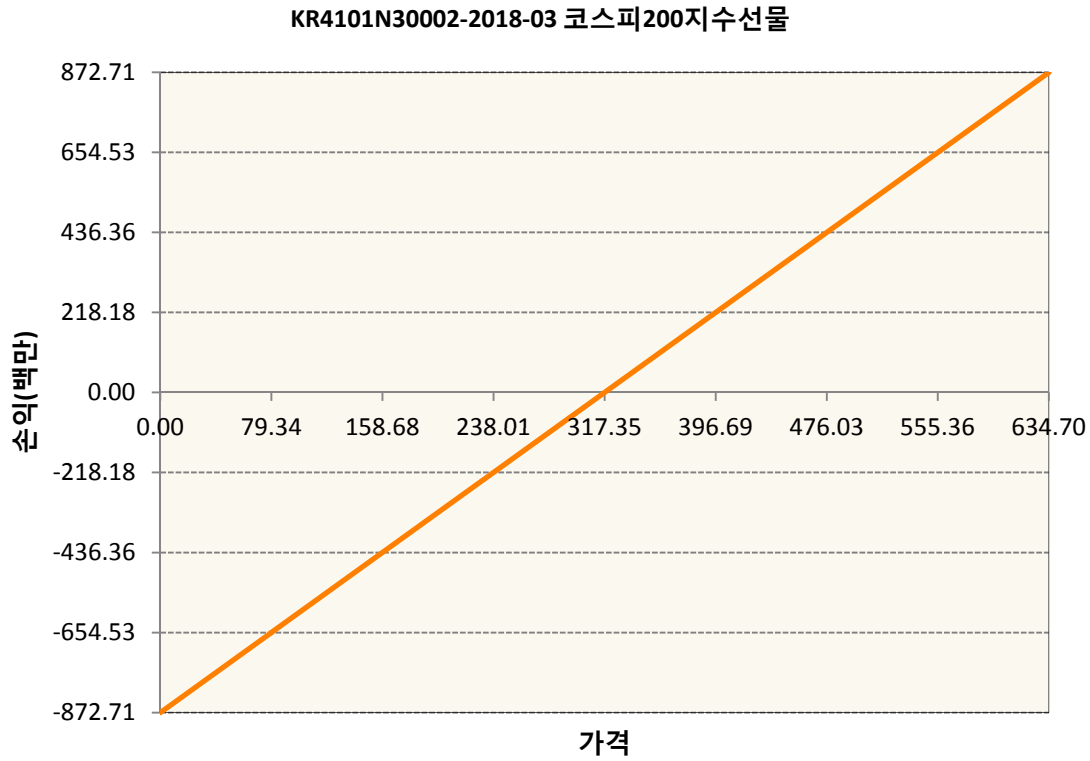
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	873	0	873	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							70
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	70	70	70	70	70	70	70

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

41

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

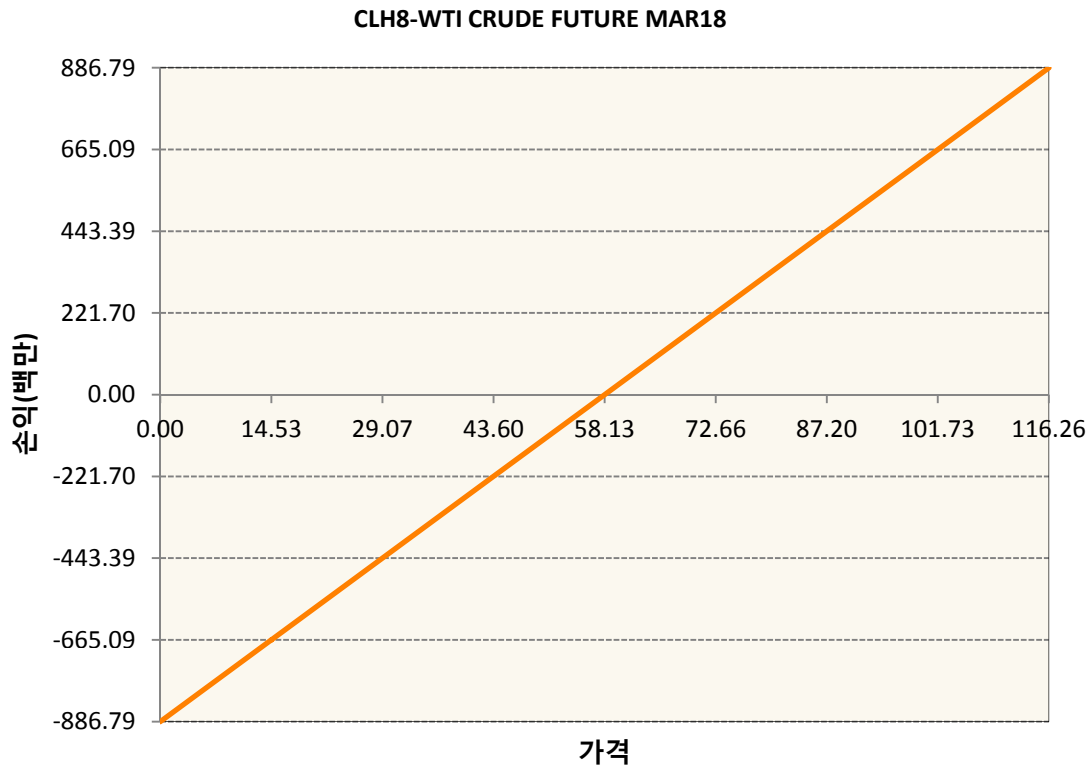
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

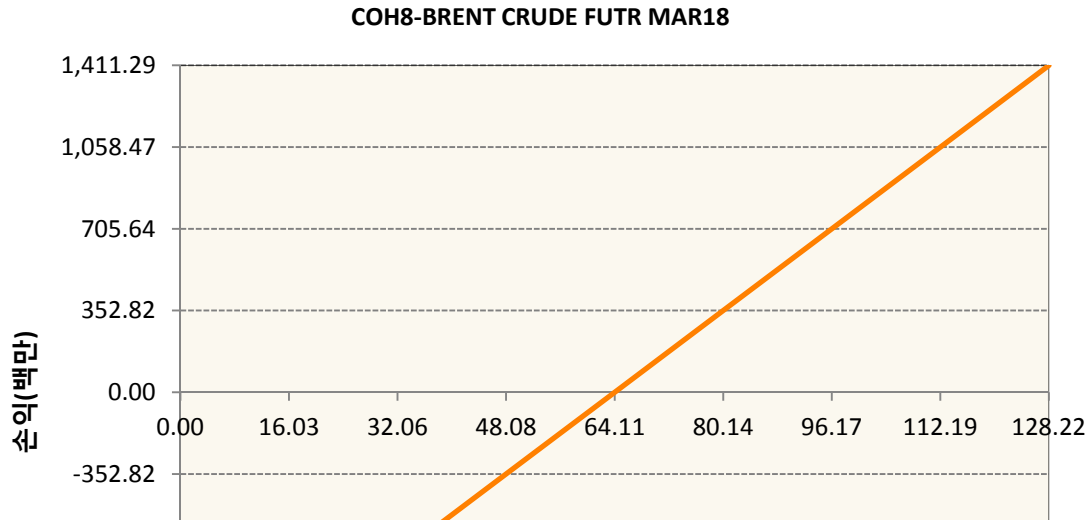
1. 계약금액

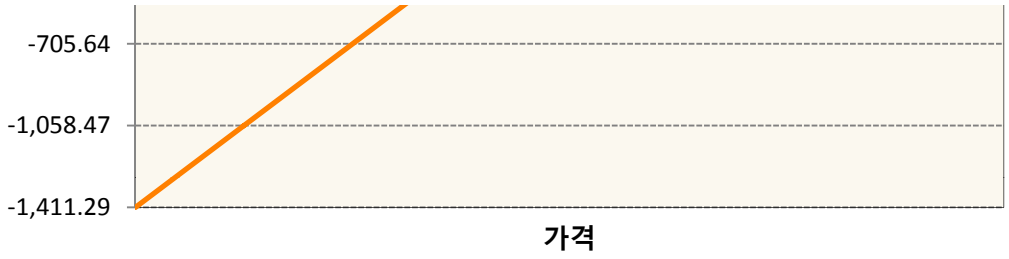
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,646	865	3,781	

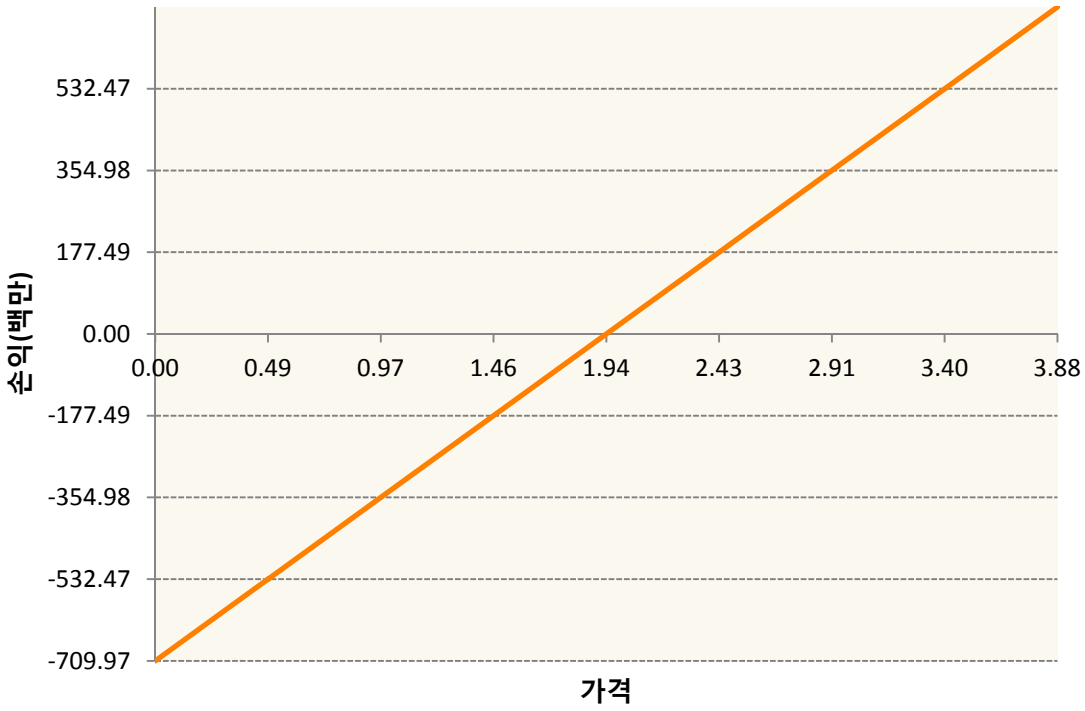
2. 만기시점의 손익구조



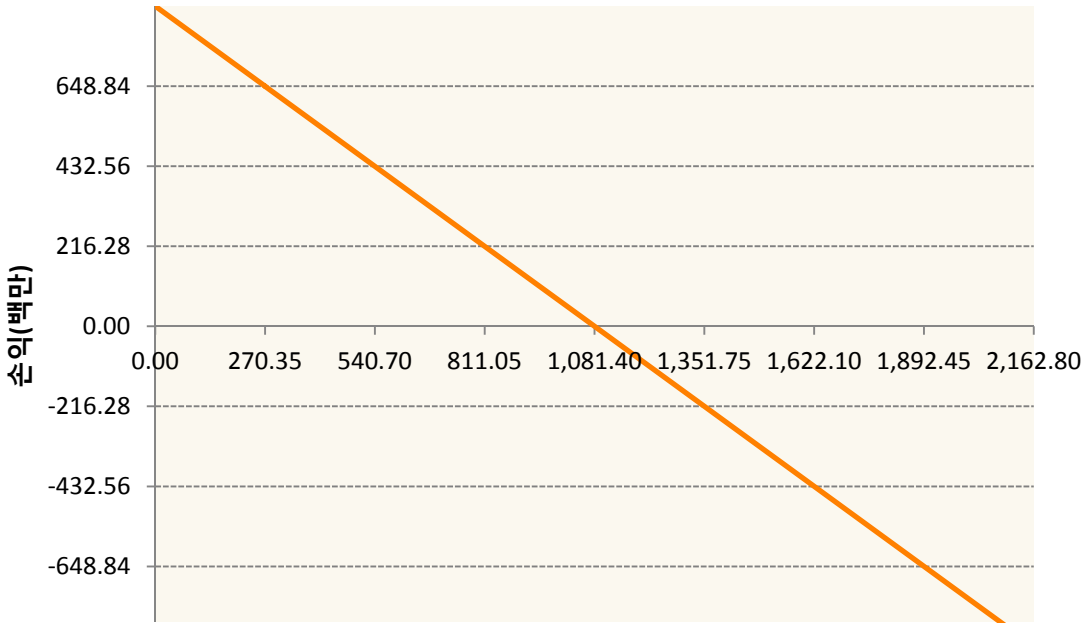


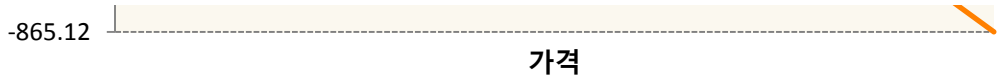


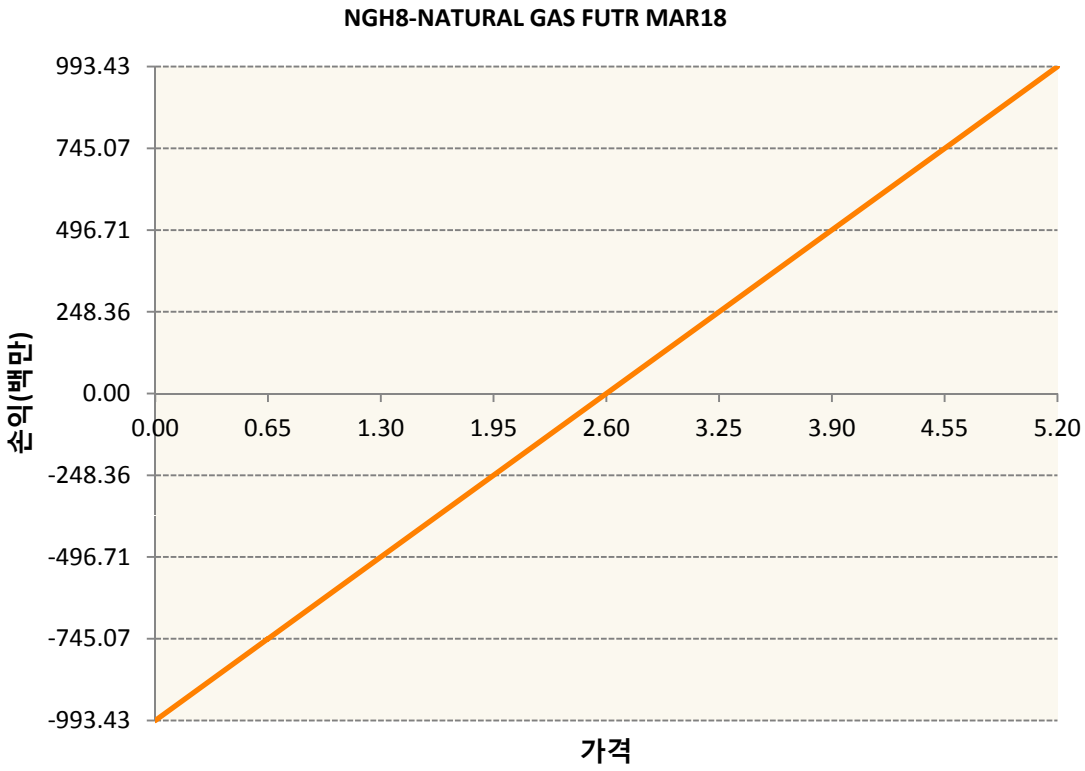
HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18

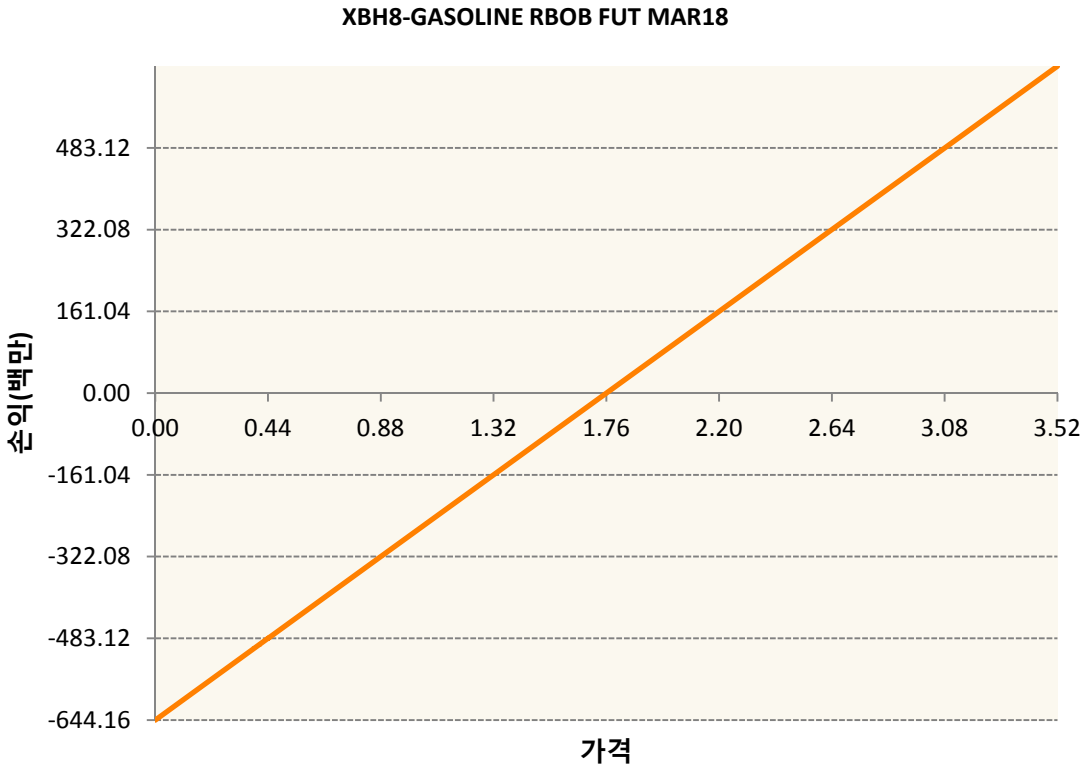


KR4175N10008-2018-01 달러선물




-865.12
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
993.43
745.07
496.71
248.36
0.00
-248.36
-496.71
-745.07
-993.43
0.00
0.65
1.30
1.95
2.60
3.25
3.90
4.55
5.20
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
483.12
322.08
161.04
0.00
-161.04
-322.08
-483.12
-644.16
0.00
0.44
0.88
1.32
1.76
2.20
2.64
3.08
3.52
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	71
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	113
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	57
KR4175N10(	2018-01 달러선물	69
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	79
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	52

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

623

공시일	2017-12-22
기준일	2017-12-21

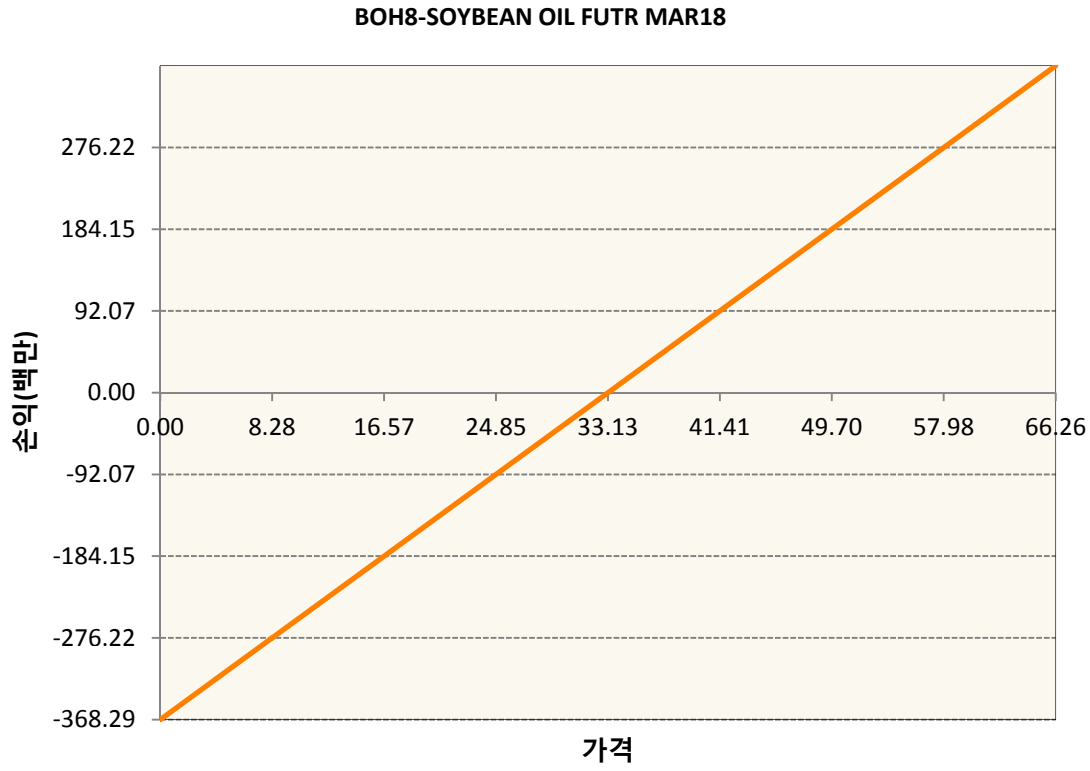
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

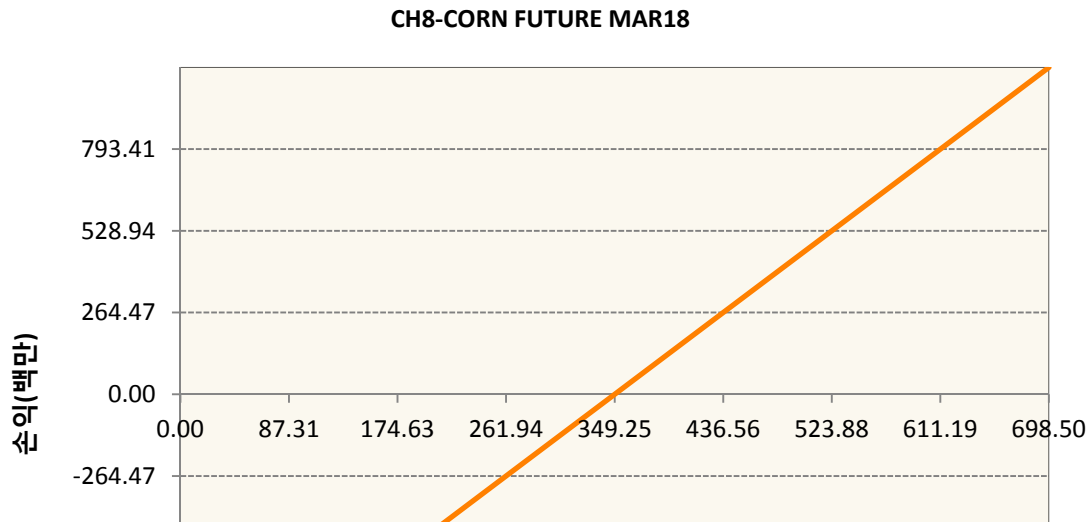
1. 계약금액

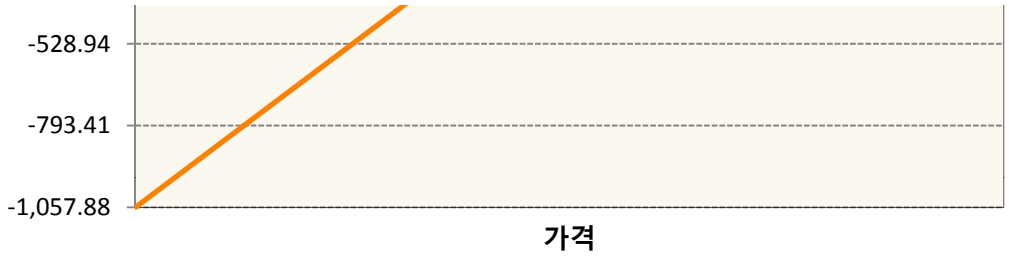
(단위:백만원)

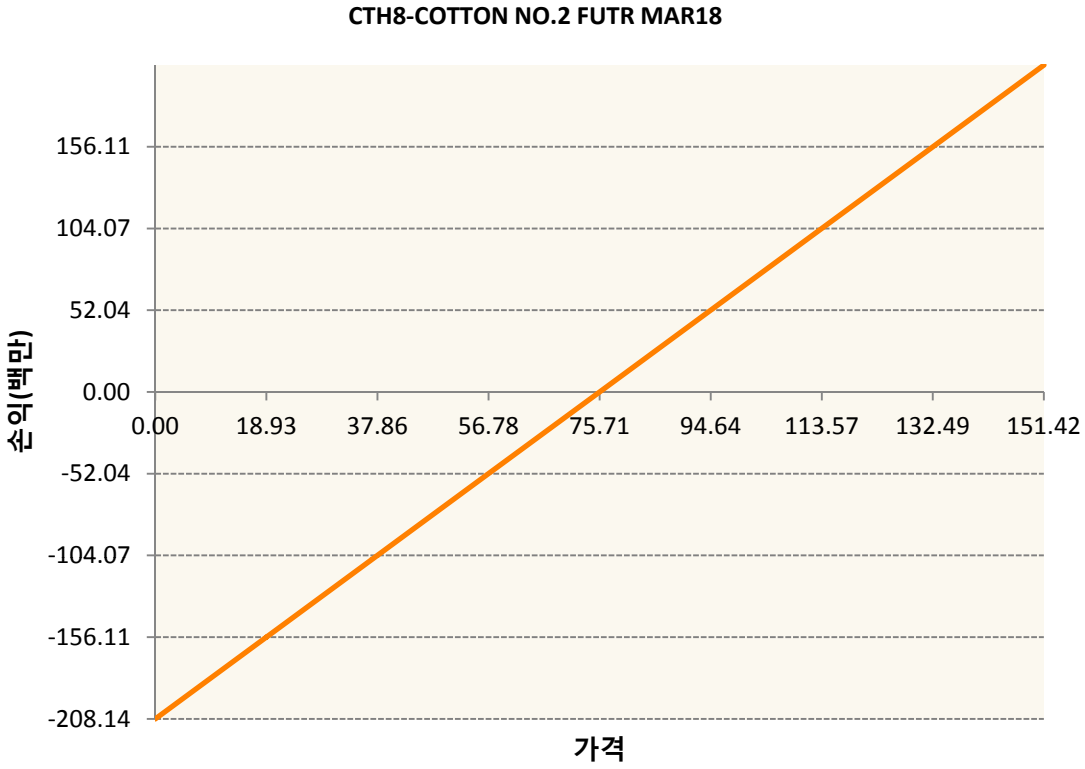
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,221	324	3,896	

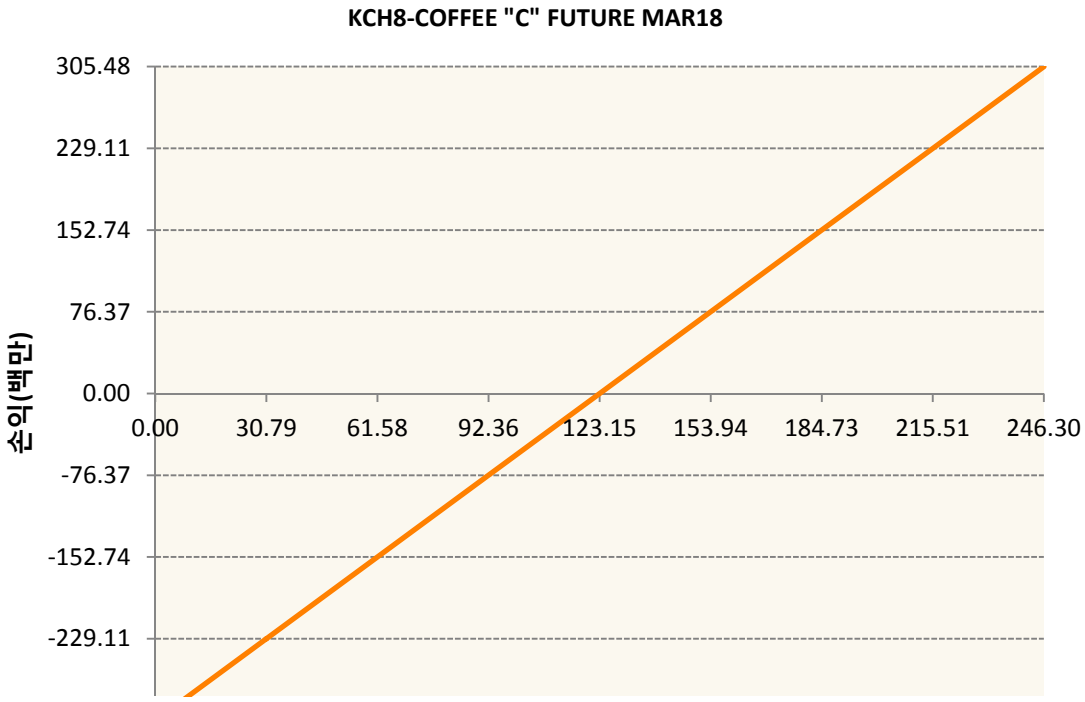
2. 만기시점의 손익구조

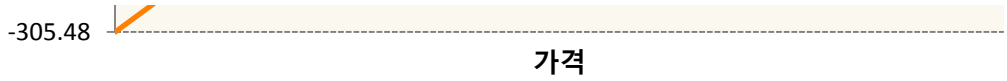


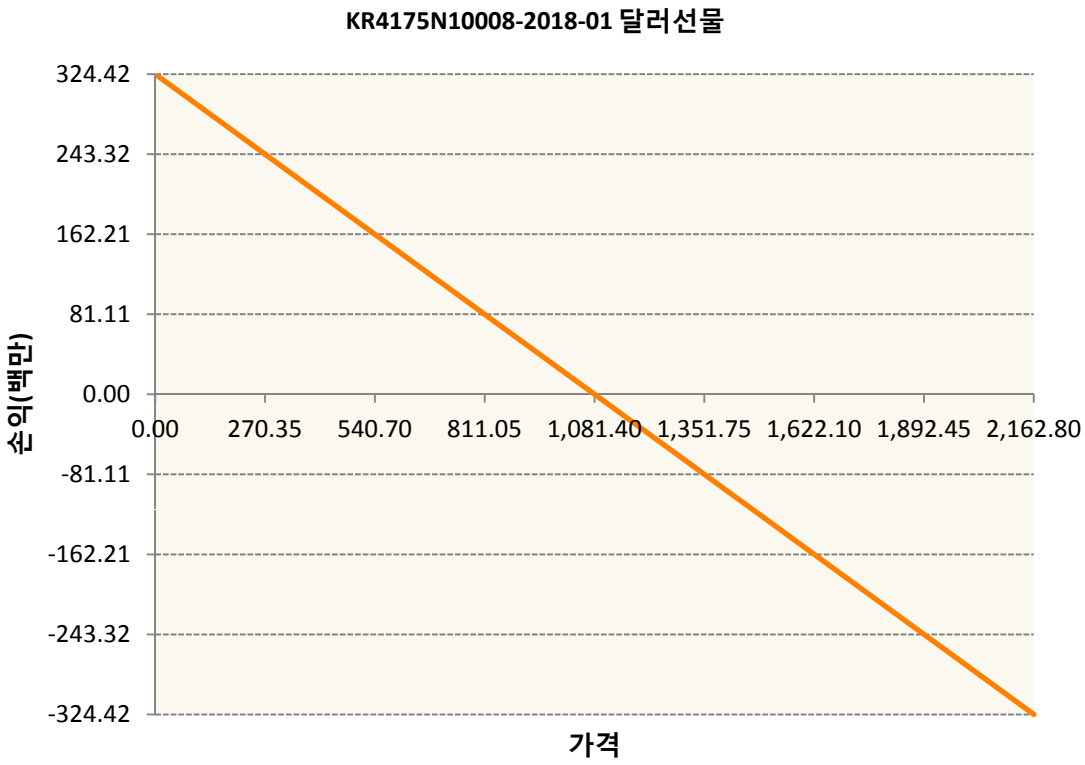


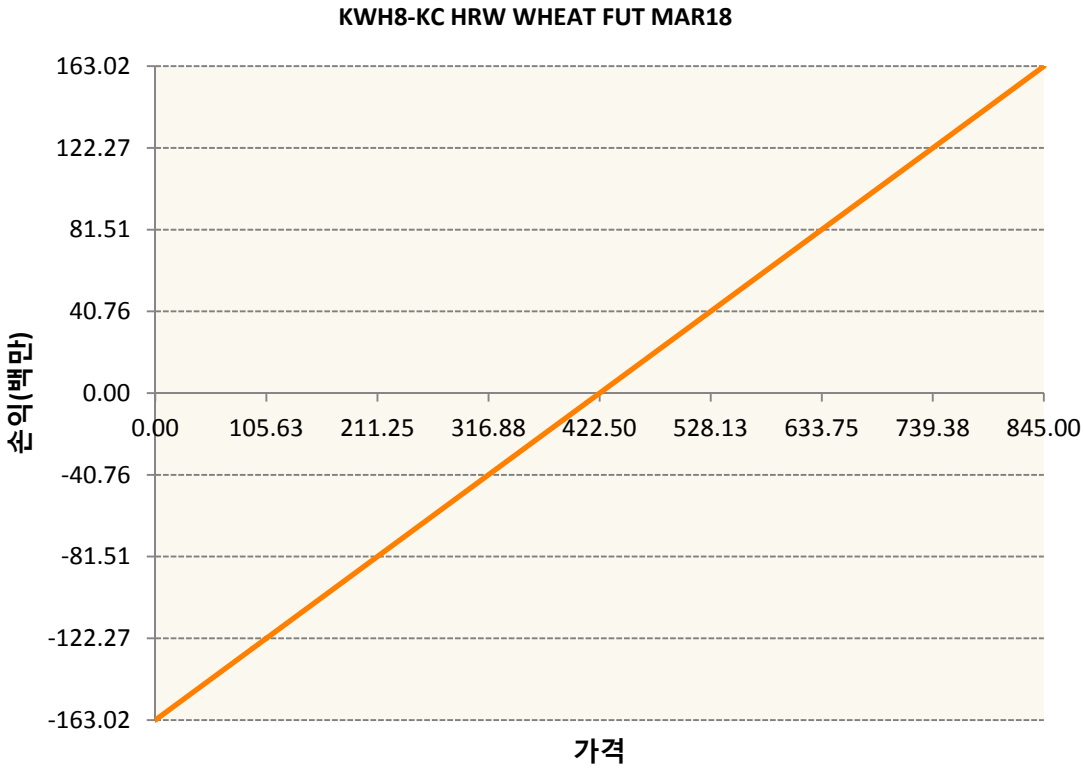

-528.94
-793.41
-1,057.88
가격

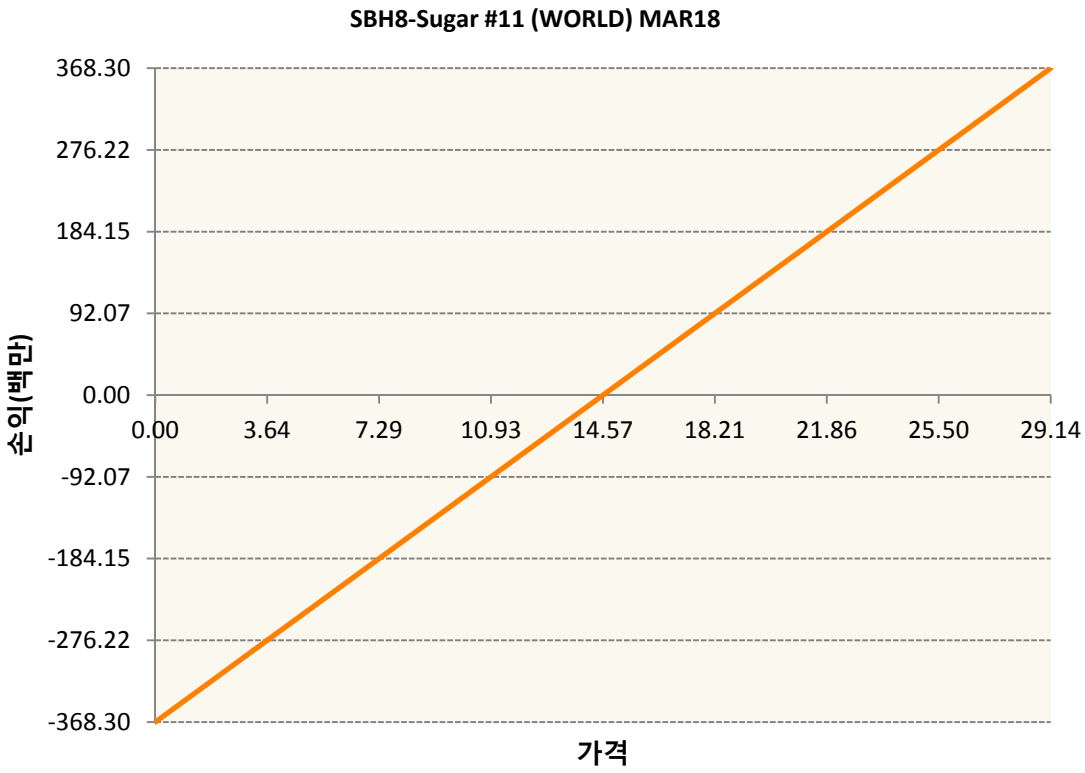

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
156.11
104.07
52.04
0.00
-52.04
-104.07
-156.11
-208.14
0.00
18.93
37.86
56.78
75.71
94.64
113.57
132.49
151.42
손익(백만)
가격

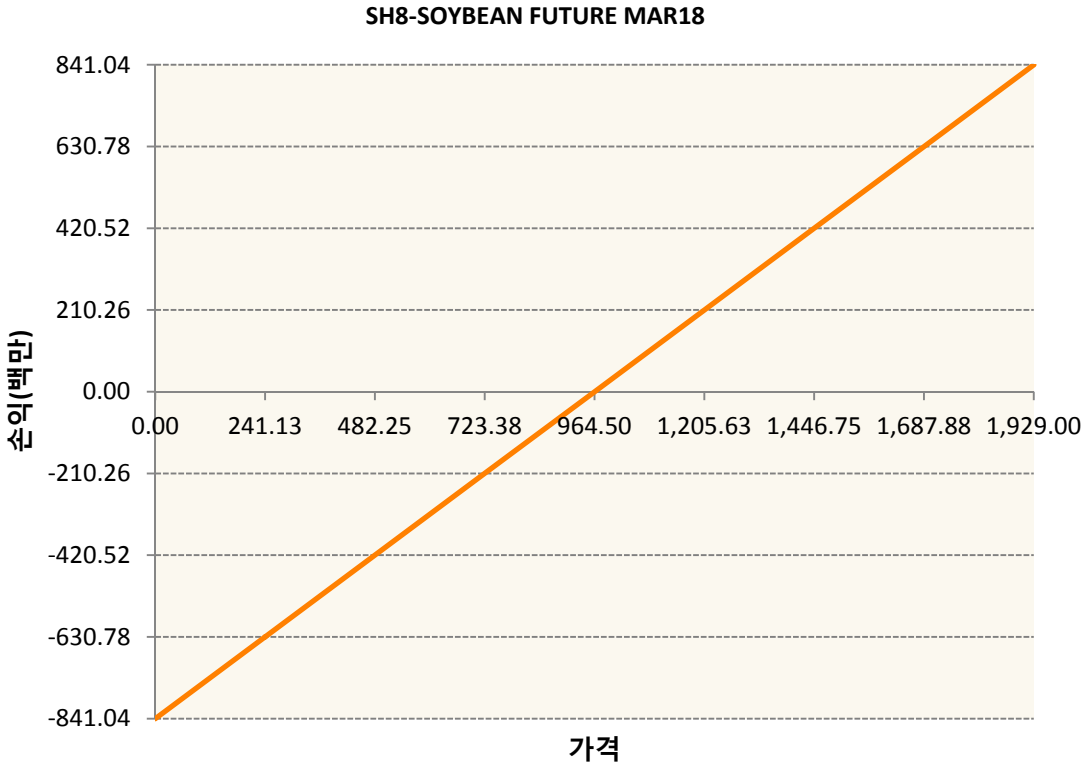

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
305.48
229.11
152.74
76.37
0.00
-76.37
-152.74
-229.11
0.00
30.79
61.58
92.36
123.15
153.94
184.73
215.51
246.30
손익(백만)


-305.48
가격

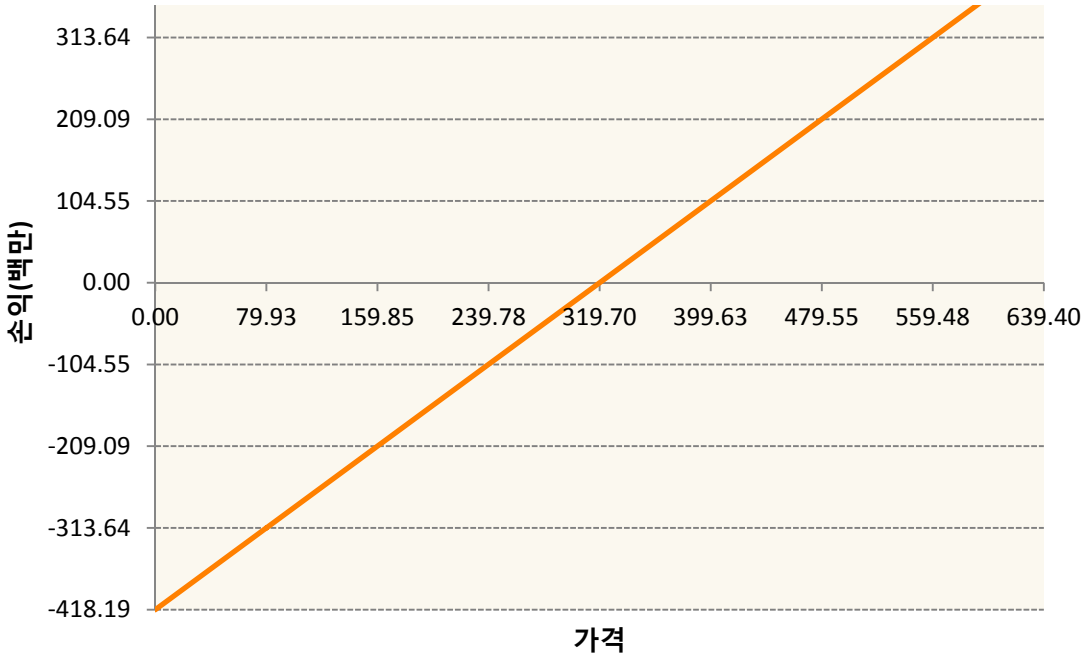

KR4175N10008-2018-01 달러선물
324.42
243.32
162.21
81.11
0.00
-81.11
-162.21
-243.32
-324.42
0.00
270.35
540.70
811.05
1,081.40
1,351.75
1,622.10
1,892.45
2,162.80
손익(백만)
가격

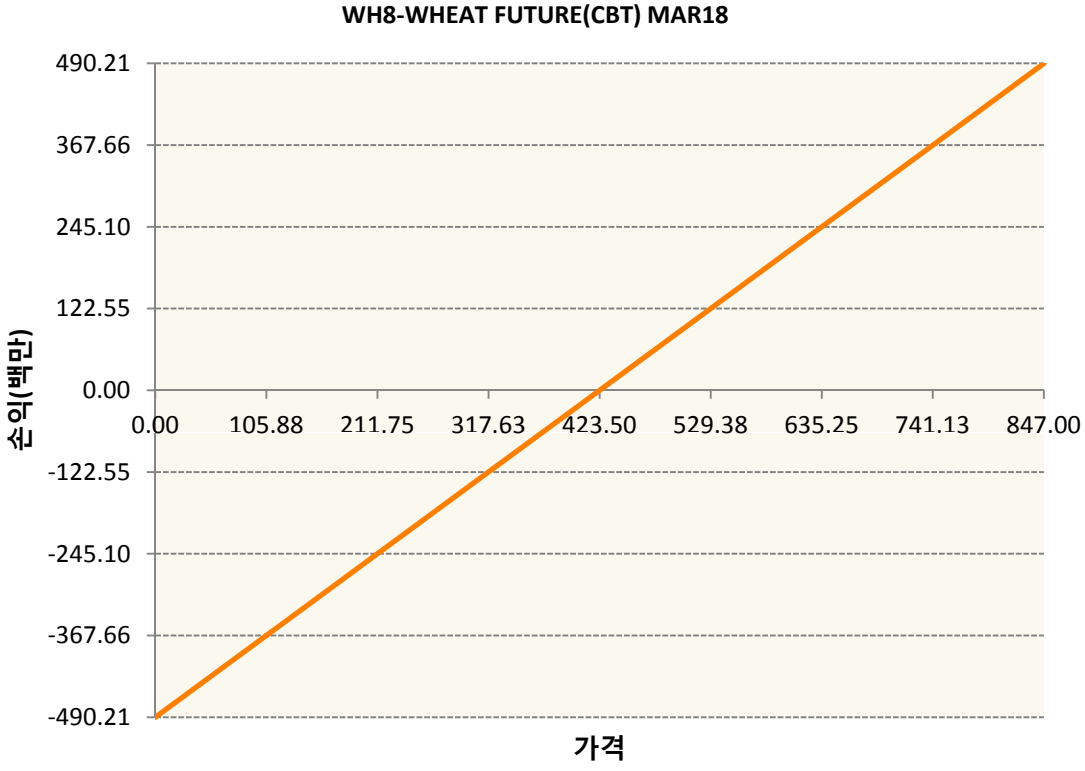

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
163.02
122.27
81.51
40.76
0.00
-40.76
-81.51
-122.27
-163.02
0.00
105.63
211.25
316.88
422.50
528.13
633.75
739.38
845.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
368.30
276.22
184.15
92.07
0.00
-92.07
-184.15
-276.22
-368.30
0.00
3.64
7.29
10.93
14.57
18.21
21.86
25.50
29.14
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
841.04
630.78
420.52
210.26
0.00
-210.26
-420.52
-630.78
-841.04
0.00
241.13
482.25
723.38
964.50
1,205.63
1,446.75
1,687.88
1,929.00
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	85
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	29
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	67
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	33
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	39

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

357