공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

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	2017-12-26
기준일	2017-12-22

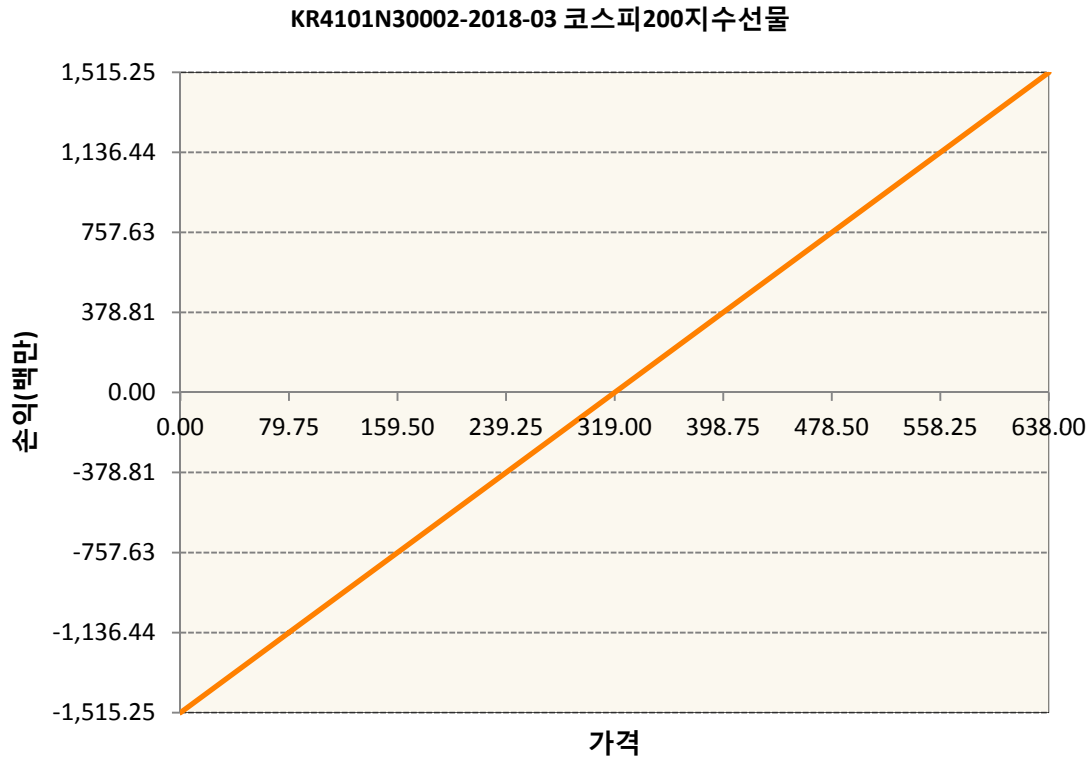
스마트인덱스모

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	1,515	0	1,515	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							122
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-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%	81	81	81	81	81	81	81
8.00%	122	122	122	122	122	122	122

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

72

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

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	1,098

* 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	2017-12-26
기준일	2017-12-22

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	402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

361

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

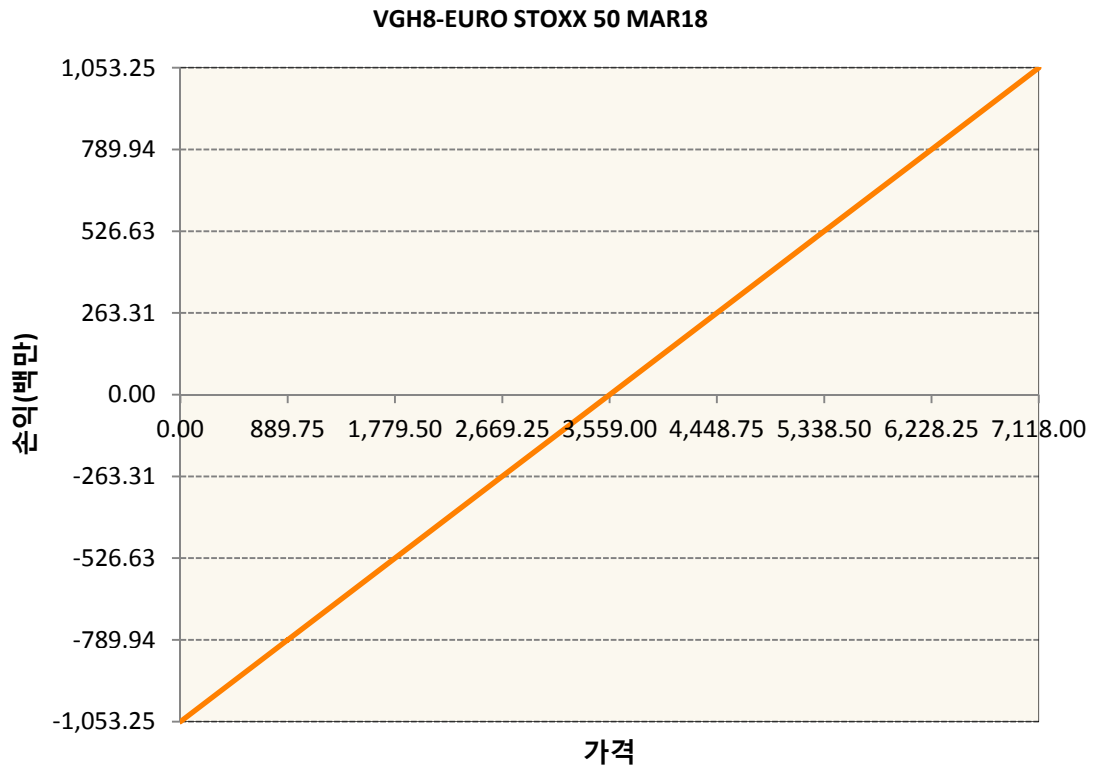
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,053	0	1,053	

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	2017-12-26
기준일	2017-12-22

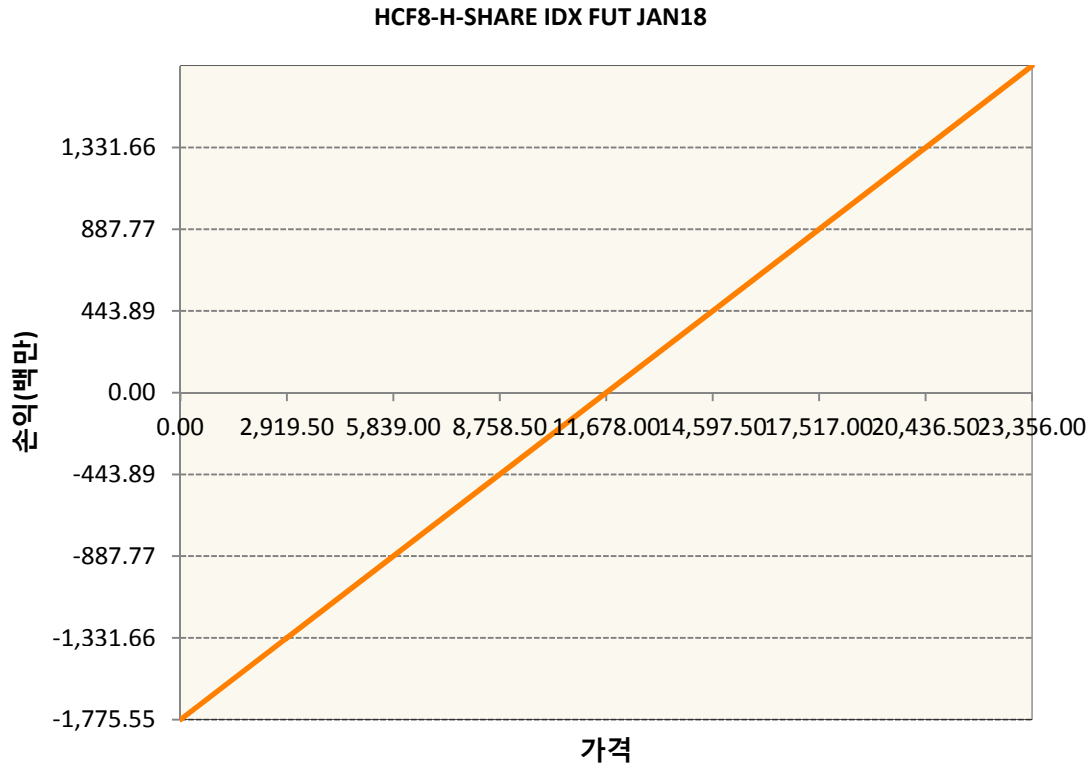
차이나인덱스모(주식-파생형)

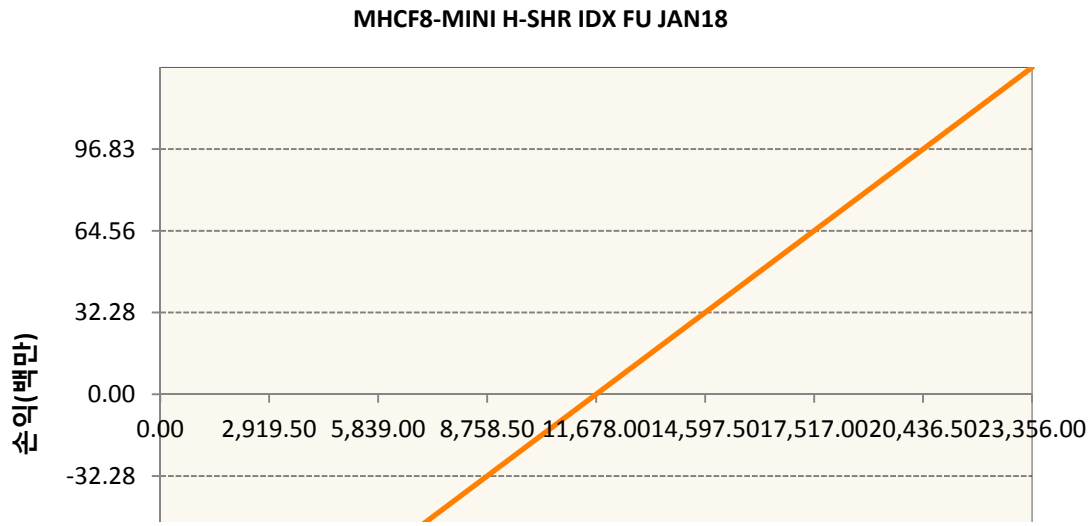
1. 계약금액

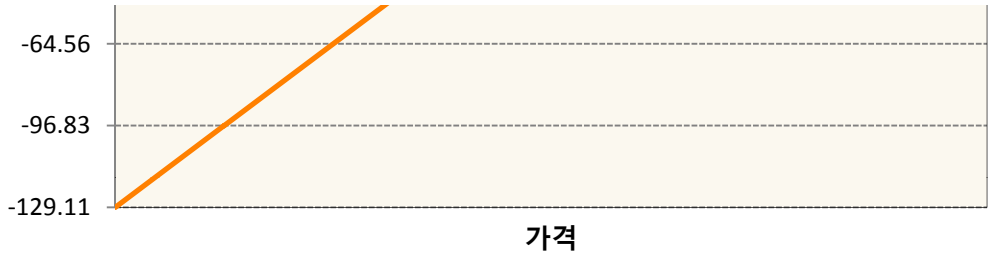
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,905	0	1,905	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	142
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	121

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

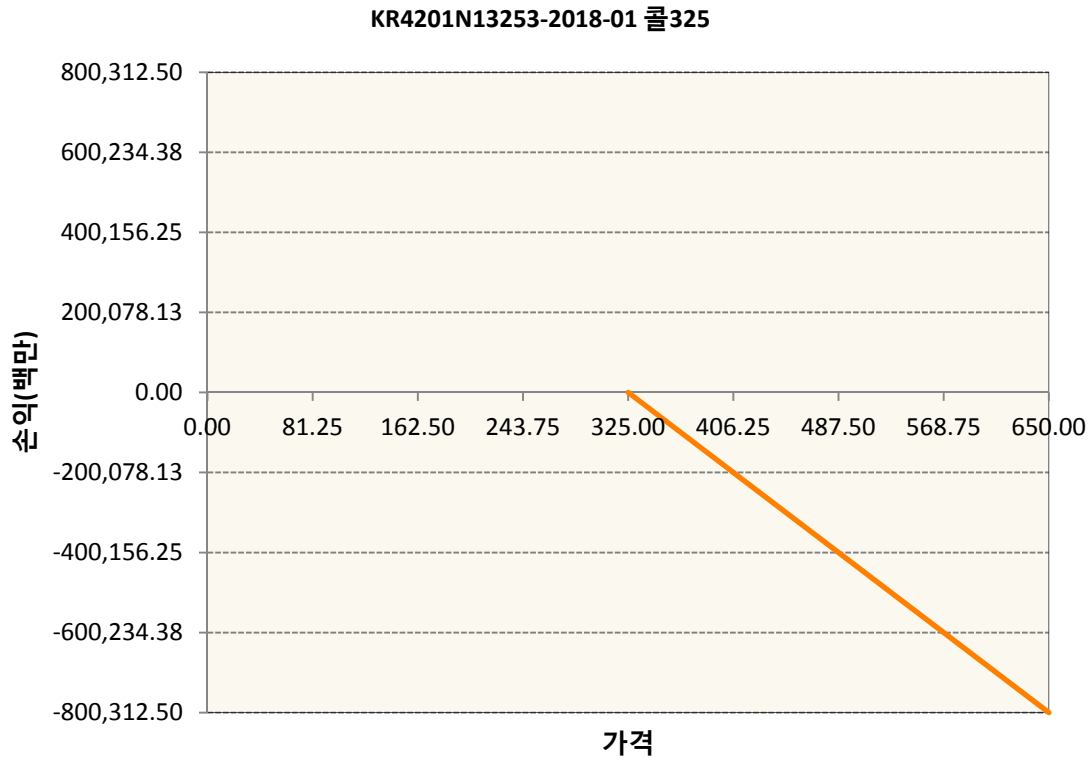
커버드콜모(주식혼합-파생형)

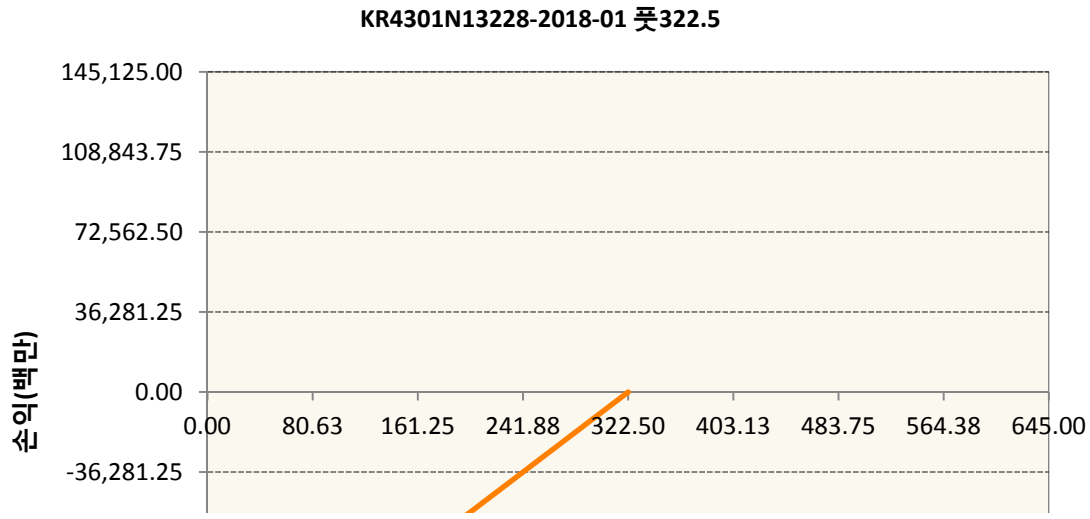
1. 계약금액

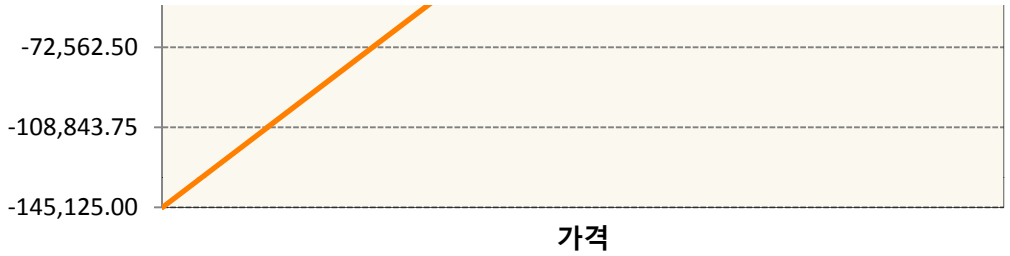
(단위:백만원)

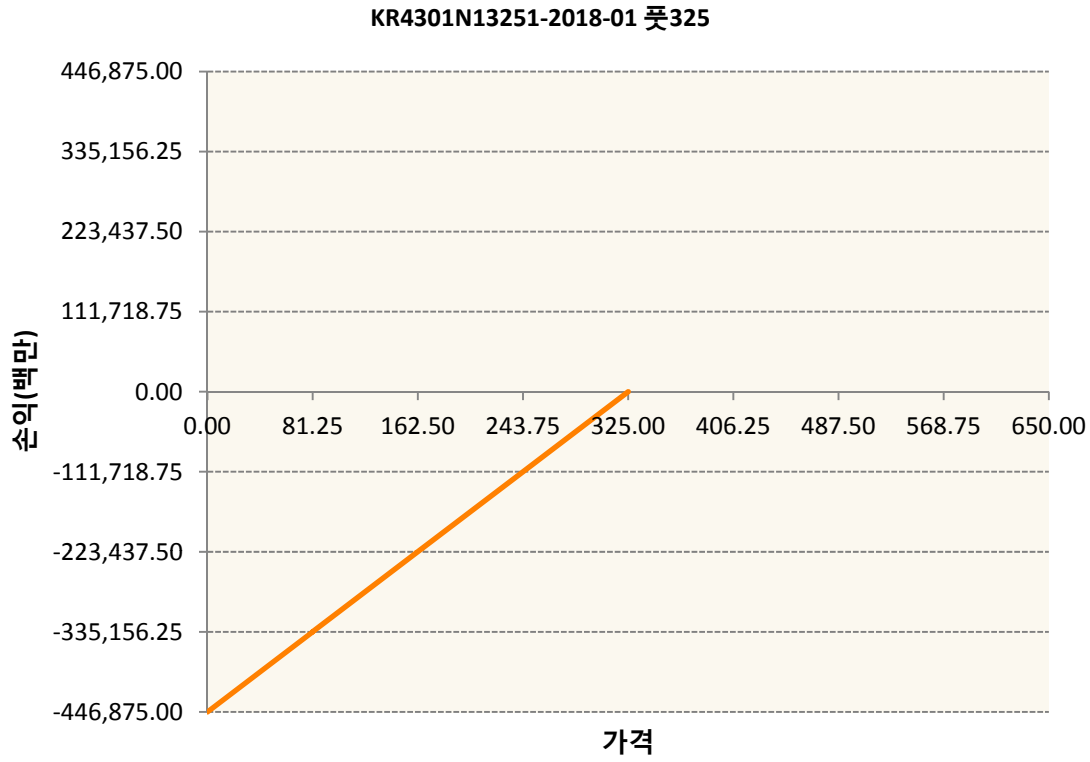
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,392,313	-1,392,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							45,918
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,845	13,680	13,435	13,106	12,693	12,199	11,628
-5.33%	13,113	12,604	11,987	11,273	10,476	9,605	8,671
-2.67%	10,578	9,534	8,419	7,248	6,033	4,781	3,498
0%	4,430	2,961	1,484	0	-1,489	-2,981	-4,477
2.67%	-6,621	-8,078	-9,548	-11,030	-12,520	-14,016	-15,518
5.33%	-22,301	-23,347	-24,471	-25,658	-26,895	-28,173	-29,486
8.00%	-41,096	-41,654	-42,327	-43,103	-43,967	-44,909	-45,918
KR4301N132 2018-01 풋322.5							10,224
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,215	-10,215	-10,215	-10,215	-10,217	-10,219	-10,224

-5.33%	-6,365	-6,369	-6,376	-6,387	-6,403	-6,426	-6,453
-2.67%	-2,602	-2,650	-2,709	-2,776	-2,850	-2,930	-3,016
0%	394	263	132	0	-132	-264	-396
2.67%	1,669	1,590	1,503	1,409	1,310	1,206	1,099
5.33%	1,873	1,860	1,842	1,816	1,782	1,741	1,692
8.00%	1,883	1,882	1,881	1,878	1,872	1,864	1,851
	KR4301N132	2018-01 풋325					32,552
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32,538	-32,538	-32,539	-32,539	-32,541	-32,545	-32,552
-5.33%	-20,771	-20,776	-20,785	-20,803	-20,831	-20,872	-20,928
-2.67%	-9,114	-9,200	-9,313	-9,453	-9,618	-9,806	-10,013
0%	1,092	736	372	0	-377	-758	-1,143
2.67%	6,562	6,233	5,891	5,537	5,175	4,806	4,431
5.33%	7,769	7,693	7,590	7,460	7,303	7,124	6,923
8.00%	7,859	7,854	7,843	7,822	7,790	7,744	7,682

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

96,423

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

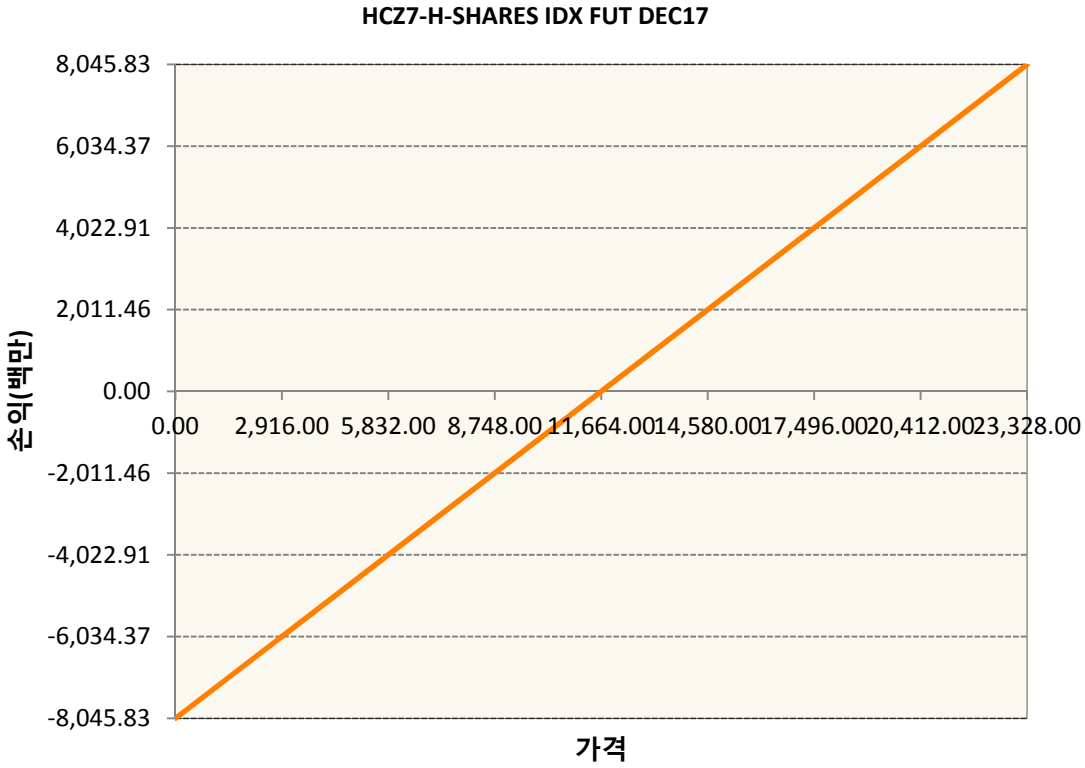
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

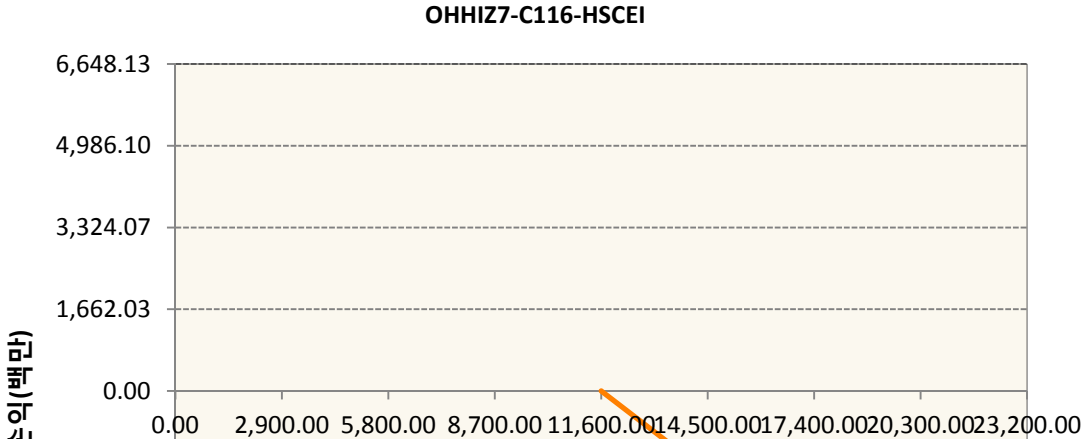
1. 계약금액

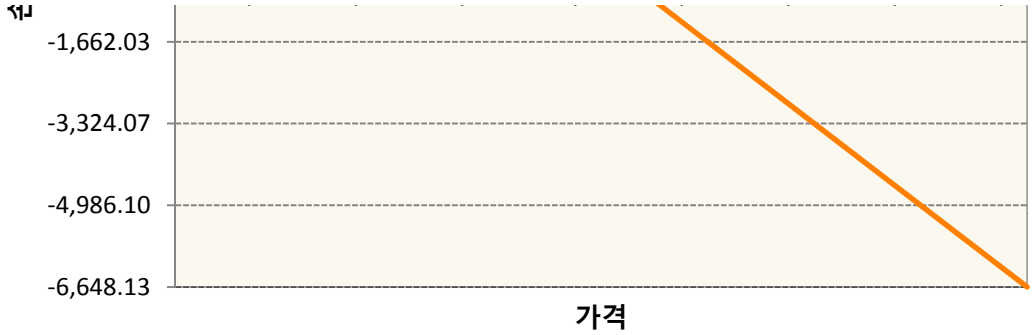
(단위:백만원)

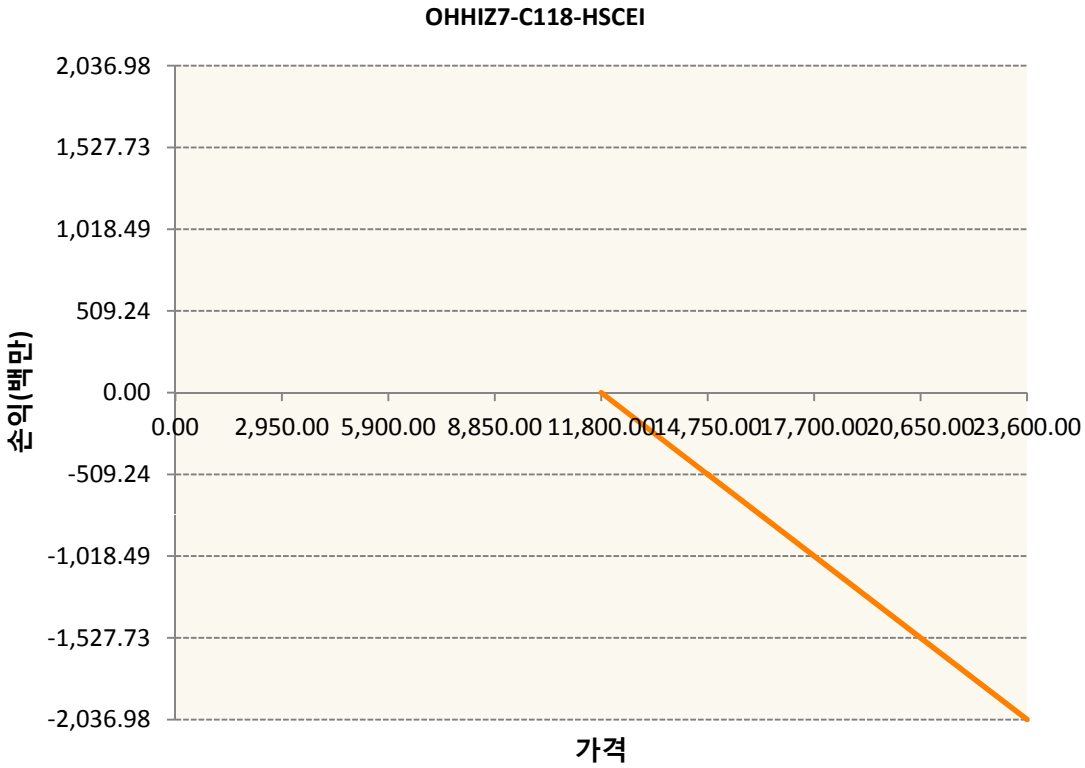
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,046	0	8,046	
누계	유가증권	옵션	0	17,370	-17,370	장내

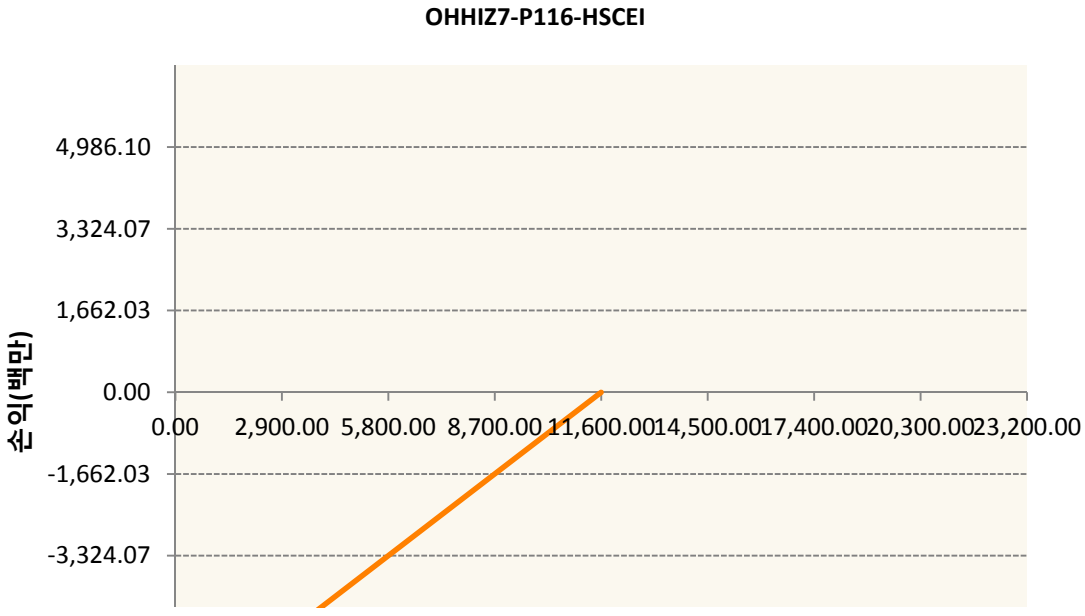
2. 만기시점의 손익구조

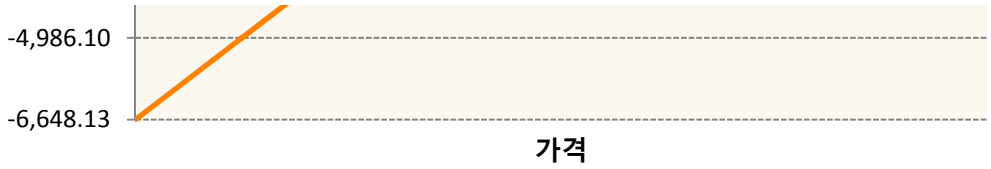


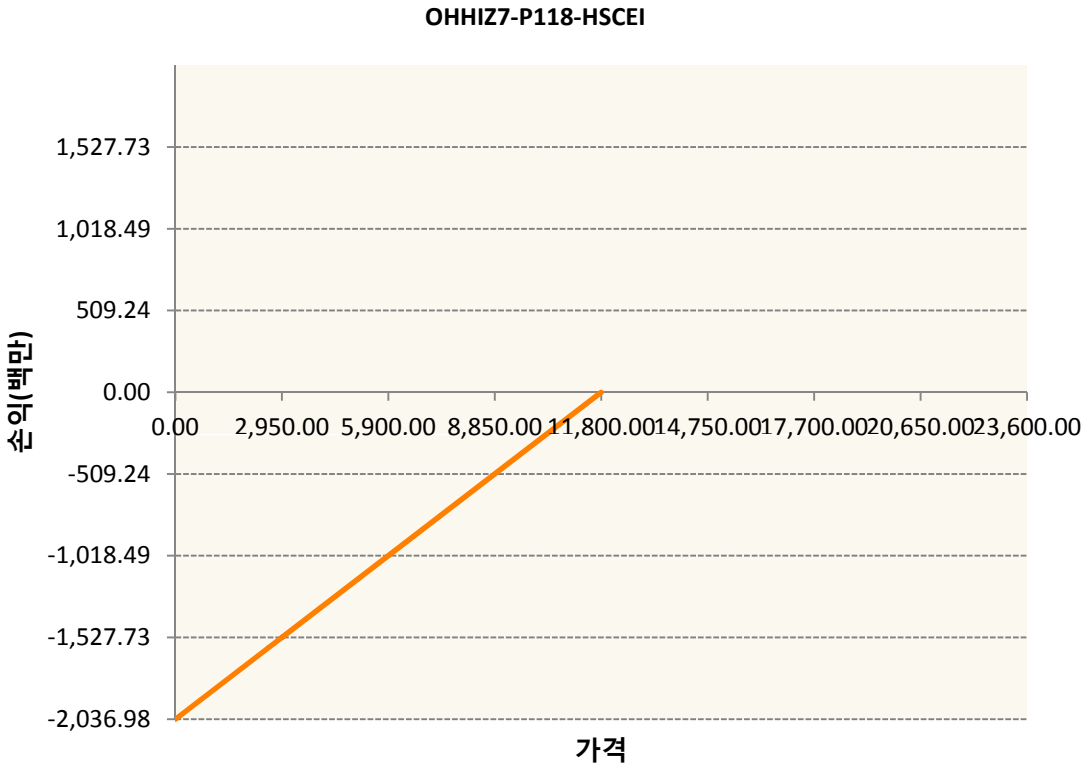



-1,662.03
-3,324.07
-4,986.10
-6,648.13
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,036.98
1,527.73
1,018.49
509.24
0.00
-509.24
-1,018.49
-1,527.73
-2,036.98
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
4,986.10
3,324.07
1,662.03
0.00
-1,662.03
-3,324.07
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	644
OHHIZ7-C11	HSCEI	532
OHHIZ7-C11	HSCEI	163
OHHIZ7-P11	HSCEI	532
OHHIZ7-P11	HSCEI	163

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,503

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

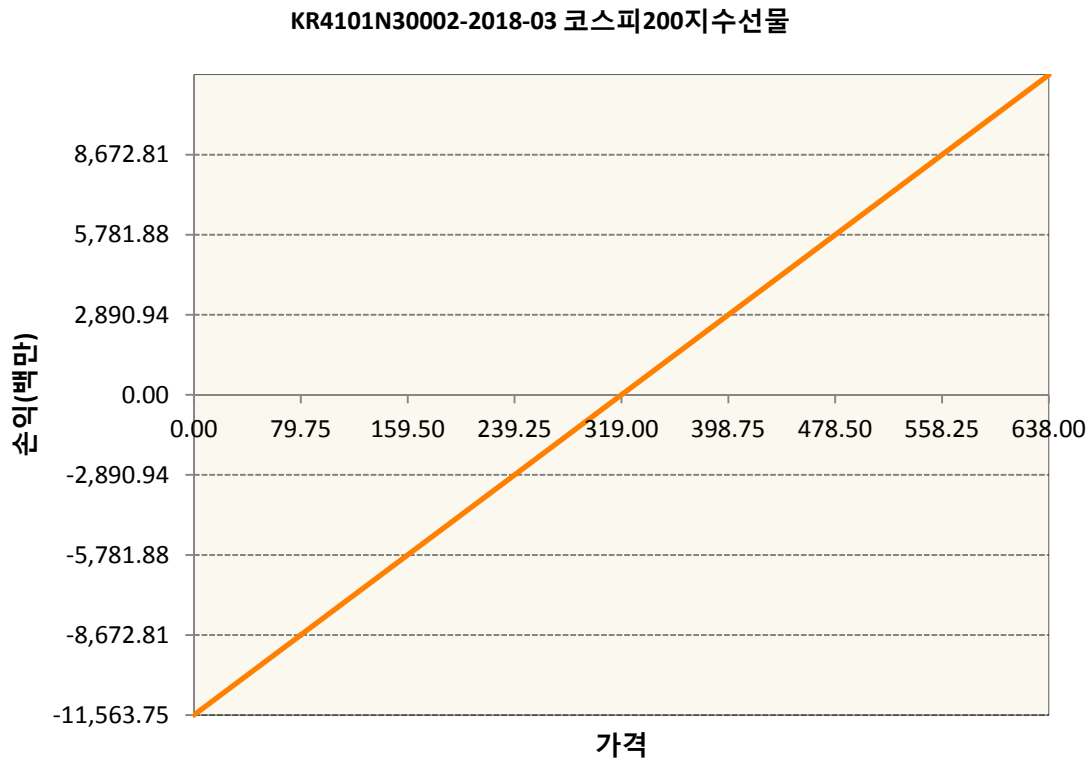
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

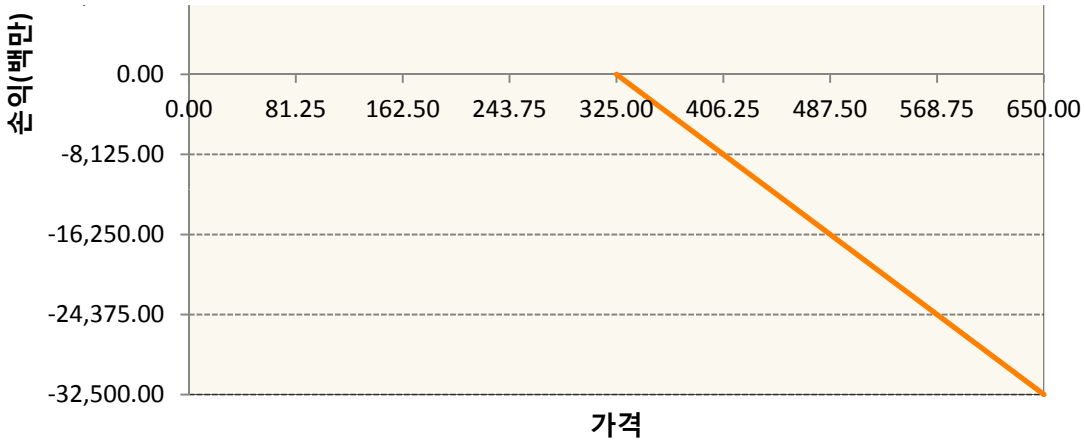
(단위:백만원)

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	11,564	0	11,564	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,875	-60,875	장내

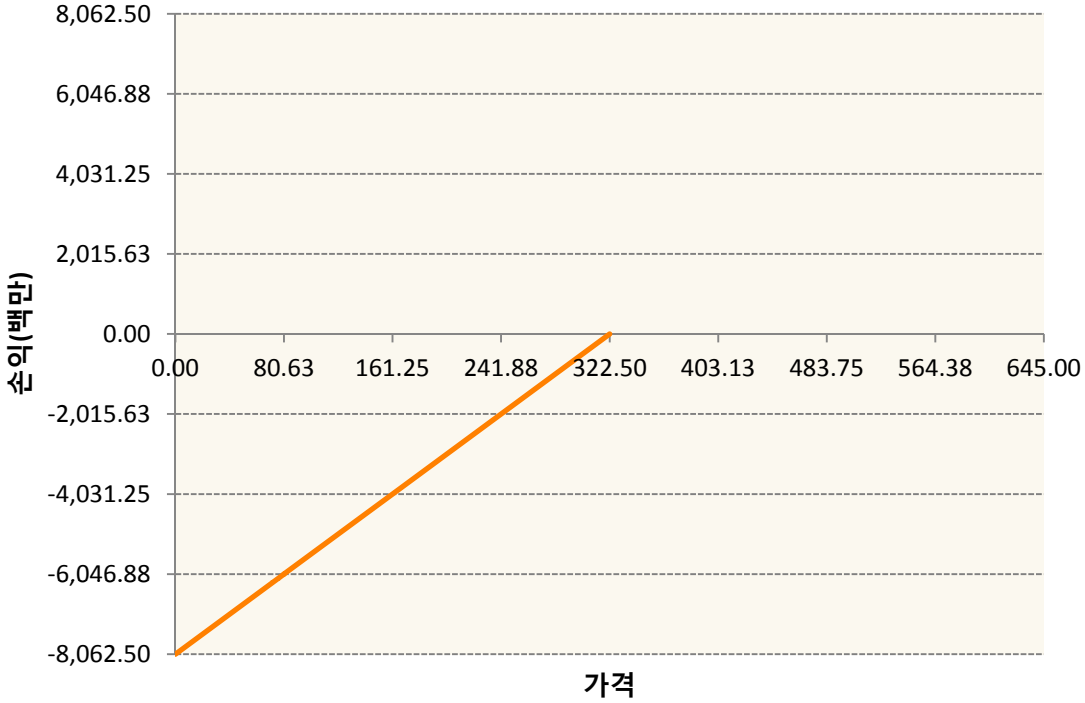
2. 만기시점의 손익구조



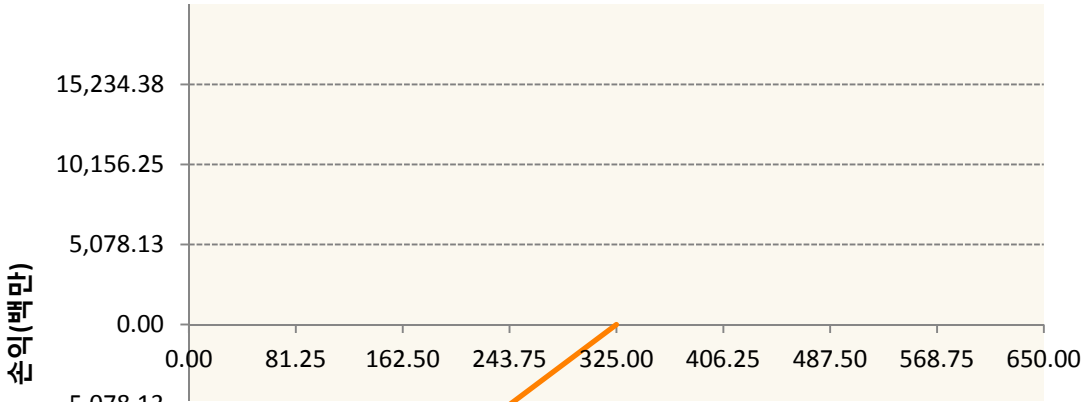




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,459
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459	-1,459
-5.33%	-973	-973	-973	-973	-973	-973	-973
-2.67%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	486	486	486	486	486	486	486
5.33%	973	973	973	973	973	973	973
8.00%	1,459	1,459	1,459	1,459	1,459	1,459	1,459
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-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%	276	276	276	276	276	276	276
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						197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-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%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	252	252	252	252	252	252	252
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						467
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-467	-467	-467	-467	-467	-467	-467
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-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%	311	311	311	311	311	311	311
8.00%	467	467	467	467	467	467	467
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						311
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-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%	207	207	207	207	207	207	207
8.00%	311	311	311	311	311	311	311
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-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%	276	276	276	276	276	276	276
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						631
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-631	-631	-631	-631	-631	-631	-631
-5.33%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	421	421	421	421	421	421	421
8.00%	631	631	631	631	631	631	631
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						473
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-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%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	473	473	473	473	473	473	473
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					932
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-932	-932	-932	-932	-932	-932	-932
-5.33%	-621	-621	-621	-621	-621	-621	-621
-2.67%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	311	311	311	311	311	311	311
5.33%	621	621	621	621	621	621	621
8.00%	932	932	932	932	932	932	932
	KR4201N13:	2018-01 콜325					1,865

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	562	556	546	532	515	495	472
-5.33%	533	512	487	458	425	390	352
-2.67%	430	387	342	294	245	194	142
0%	180	120	60	0	-60	-121	-182
2.67%	-269	-328	-388	-448	-508	-569	-630
5.33%	-906	-948	-994	-1,042	-1,092	-1,144	-1,197
8.00%	-1,669	-1,692	-1,719	-1,750	-1,785	-1,824	-1,865
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						568

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-567	-567	-567	-568	-568	-568	-568
-5.33%	-354	-354	-354	-355	-356	-357	-359
-2.67%	-145	-147	-150	-154	-158	-163	-168
0%	22	15	7	0	-7	-15	-22
2.67%	93	88	83	78	73	67	61
5.33%	104	103	102	101	99	97	94
8.00%	105	105	105	104	104	104	103
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,480

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,479	-1,479	-1,479	-1,479	-1,479	-1,479	-1,480
-5.33%	-944	-944	-945	-946	-947	-949	-951
-2.67%	-414	-418	-423	-430	-437	-446	-455
0%	50	33	17	0	-17	-34	-52
2.67%	298	283	268	252	235	218	201
5.33%	353	350	345	339	332	324	315
8.00%	357	357	356	356	354	352	349

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

9,578

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

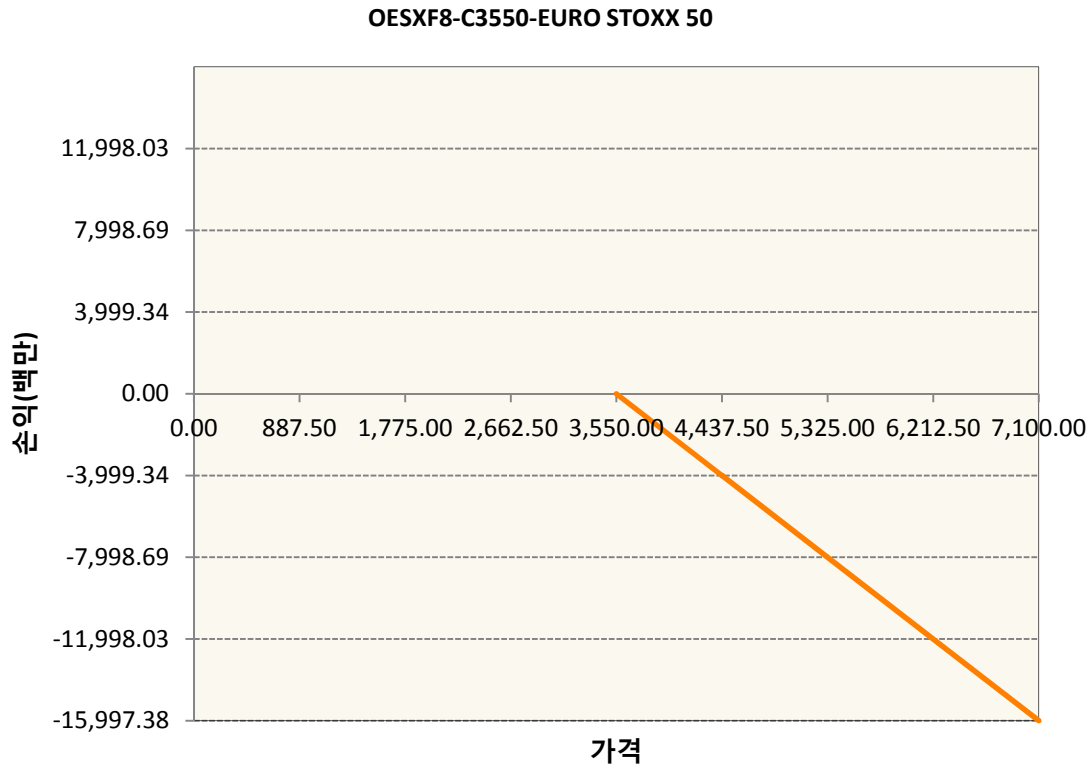
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

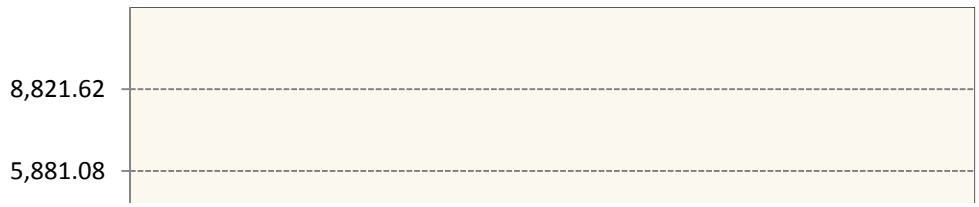
1. 계약금액

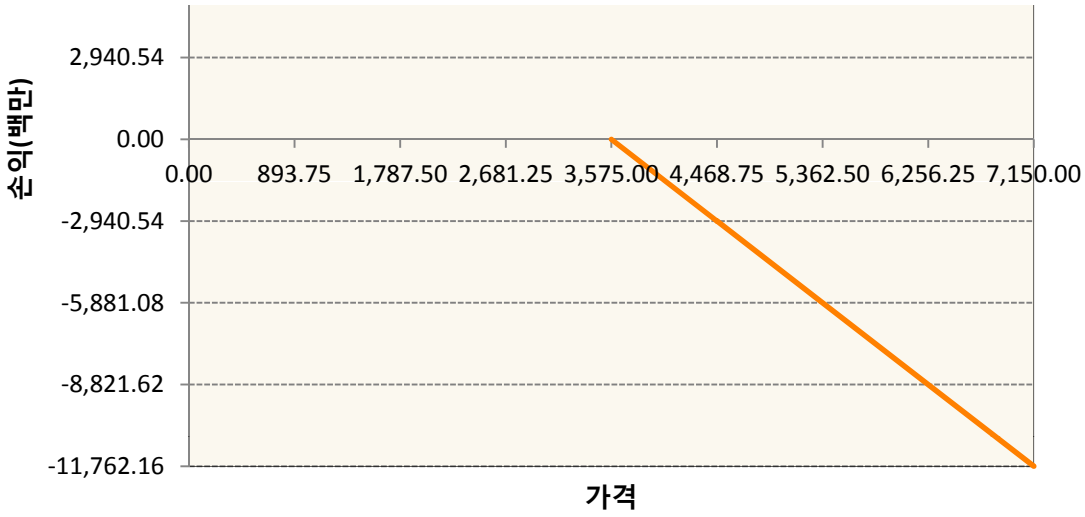
(단위:백만원)

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	19,511	0	19,511	
누계	유가증권	스왑	96,015	0	96,015	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,519	-55,519	장내
누계	지수	스왑	51,209	0	51,209	장외

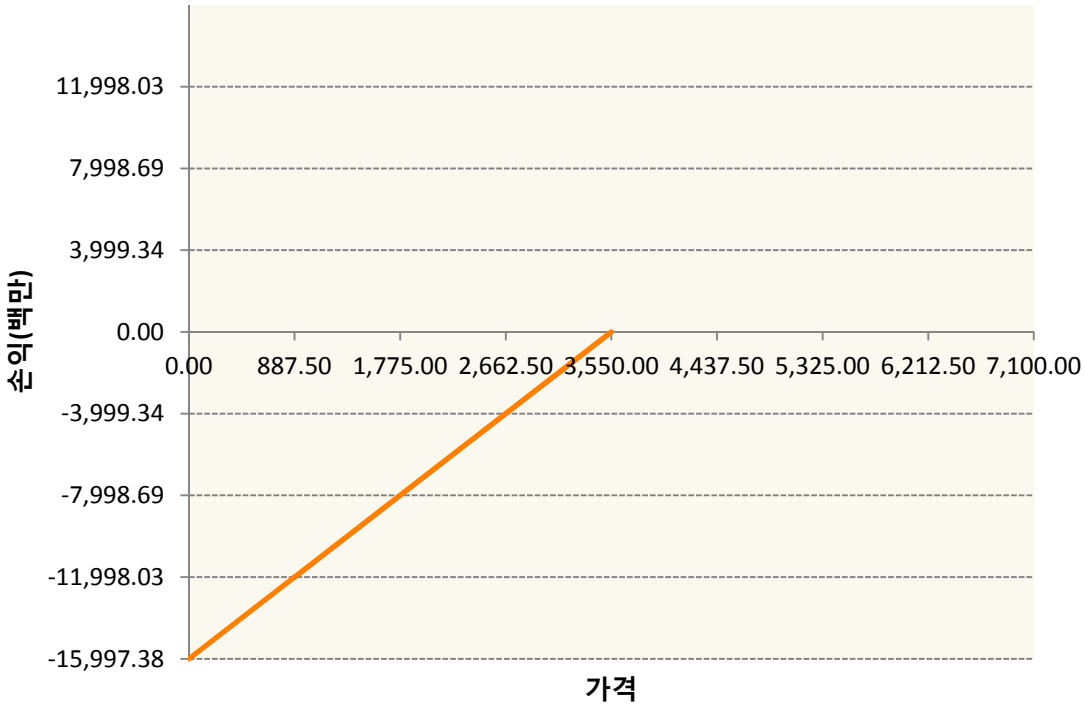
2. 만기시점의 손익구조



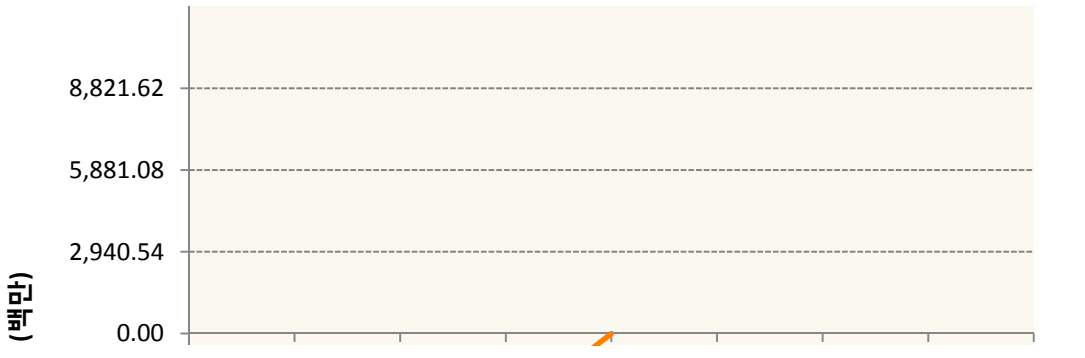


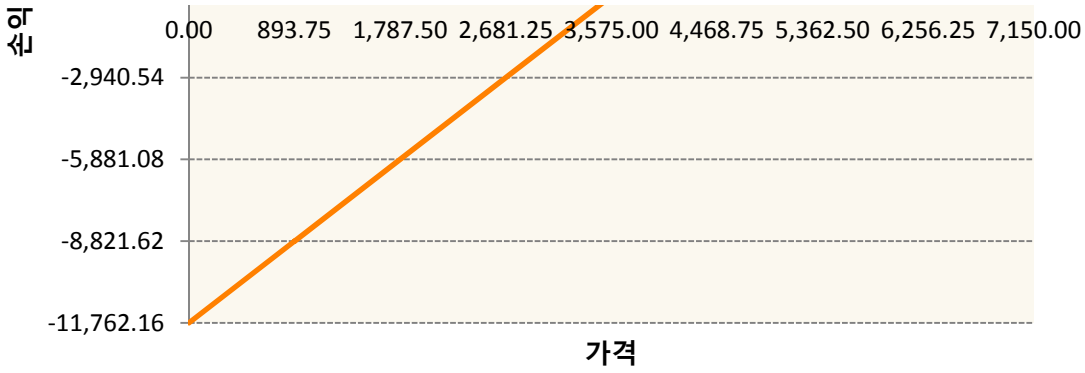


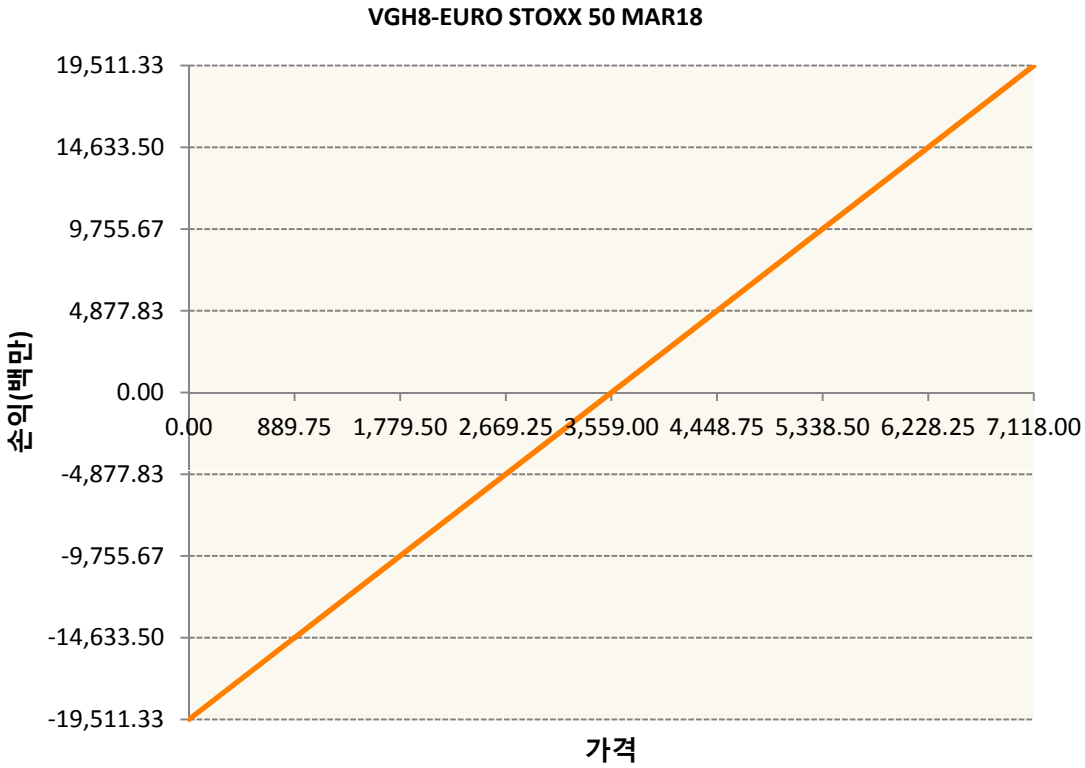
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	68
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	85
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,280
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	941
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,280
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	941
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,561

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

3,507

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

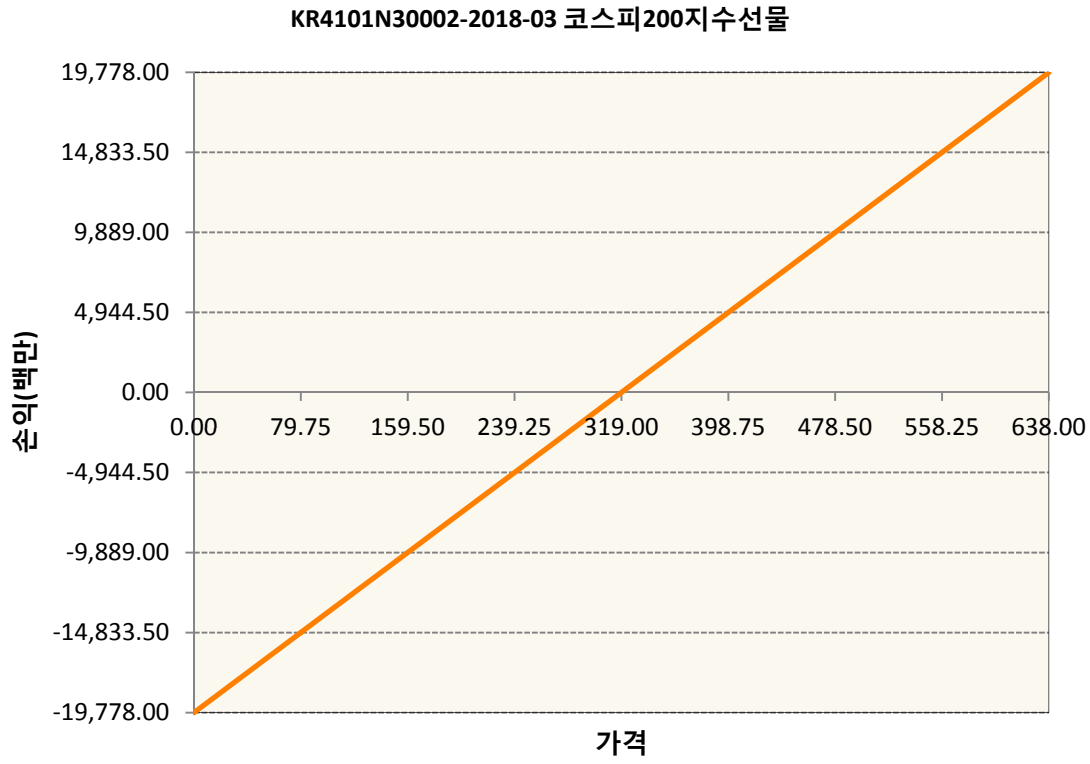
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,328	0	5,328	장내
누계	유가증권	선물	19,778	0	19,778	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,593
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593	-1,593
-5.33%	-1,062	-1,062	-1,062	-1,062	-1,062	-1,062	-1,062
-2.67%	-531	-531	-531	-531	-531	-531	-531
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	531	531	531	531	531	531	531
5.33%	1,062	1,062	1,062	1,062	1,062	1,062	1,062
8.00%	1,593	1,593	1,593	1,593	1,593	1,593	1,593

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

936

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

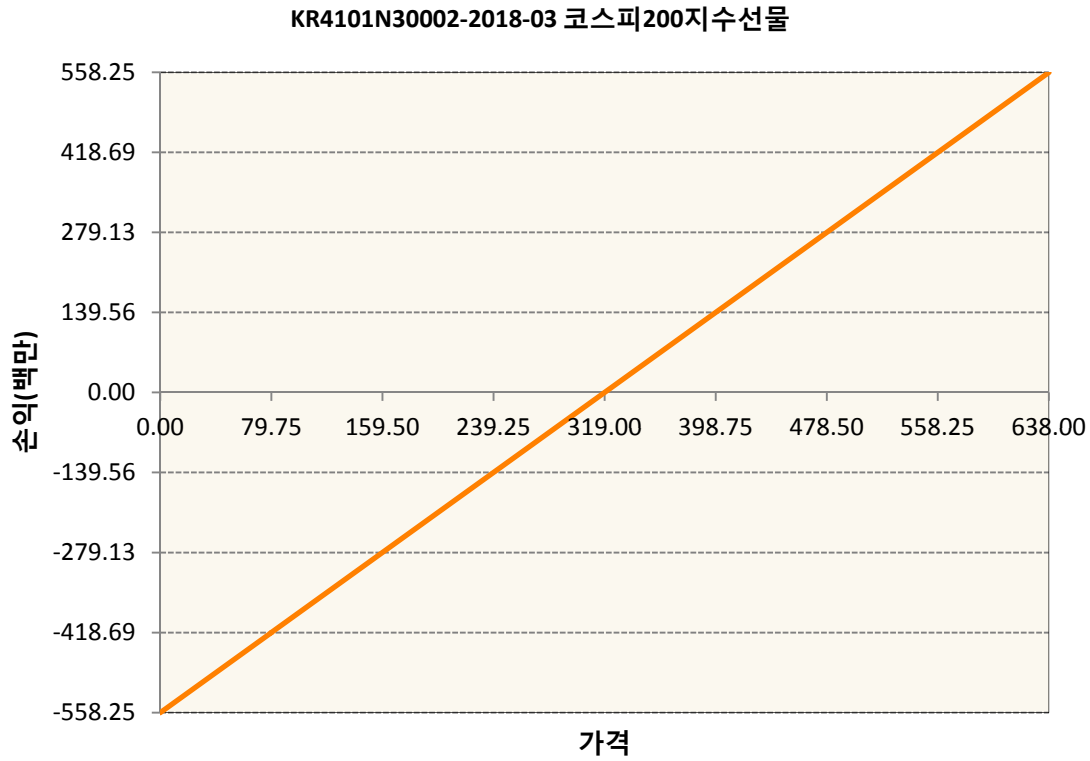
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	558	0	558	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	2017-12-26
기준일	2017-12-22

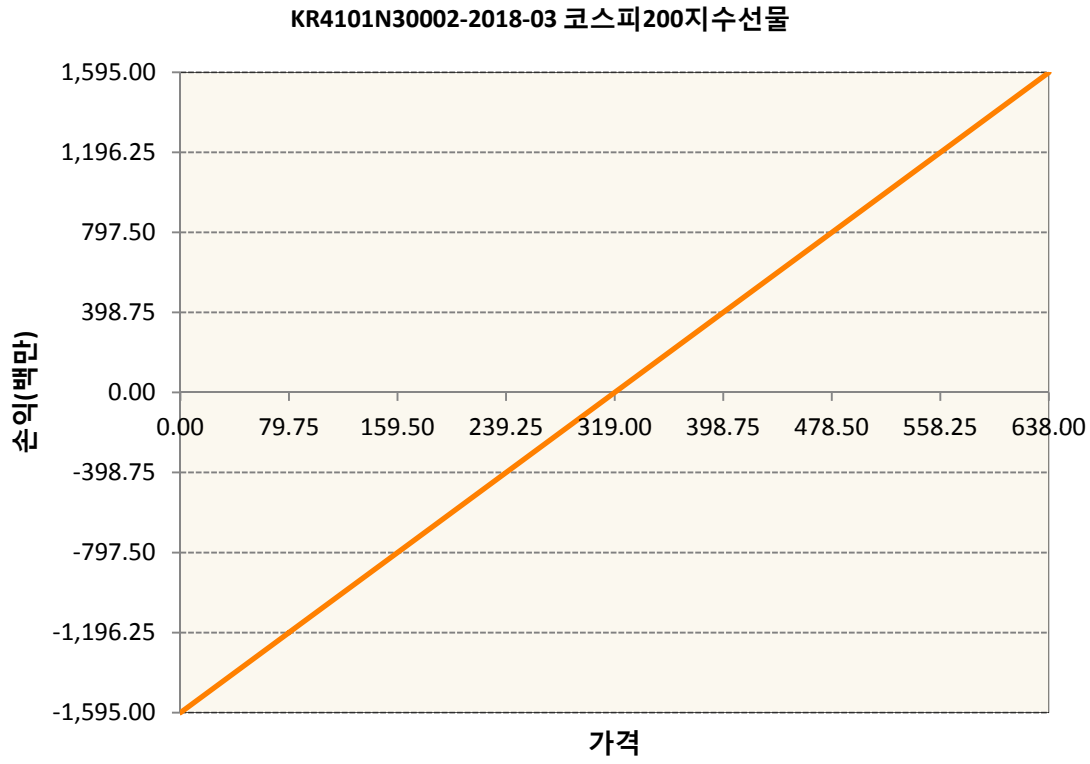
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	716	0	716	장내
누계	유가증권	선물	1,595	0	1,595	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

75

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

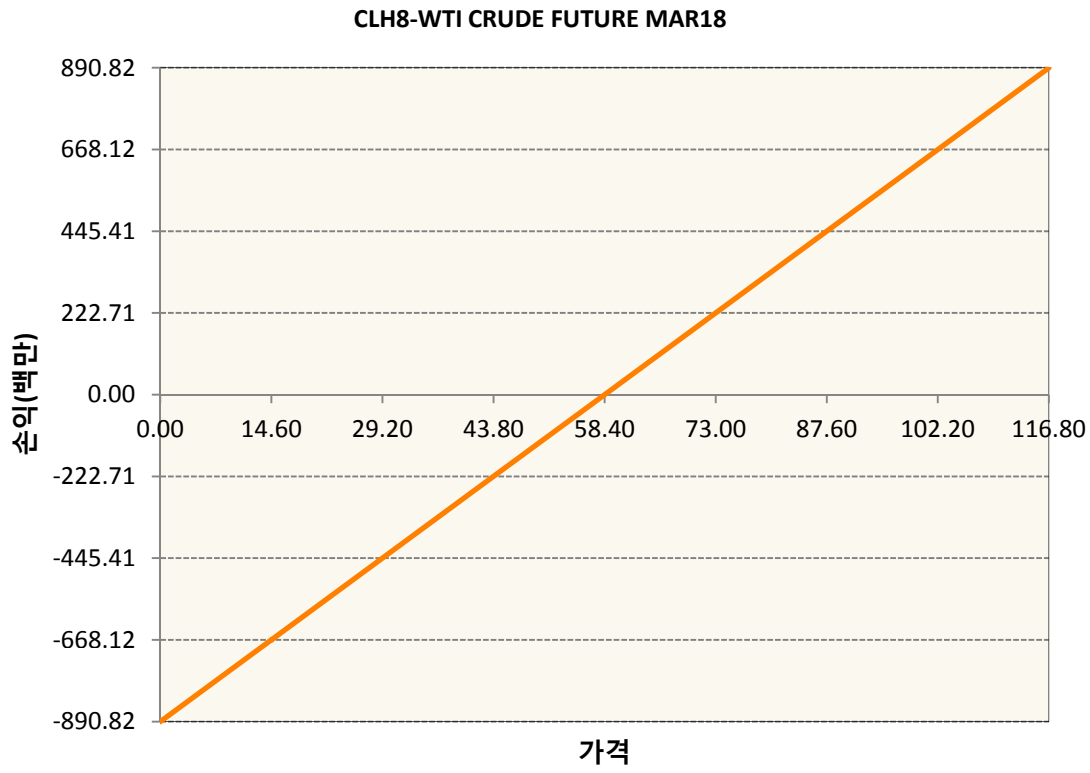
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

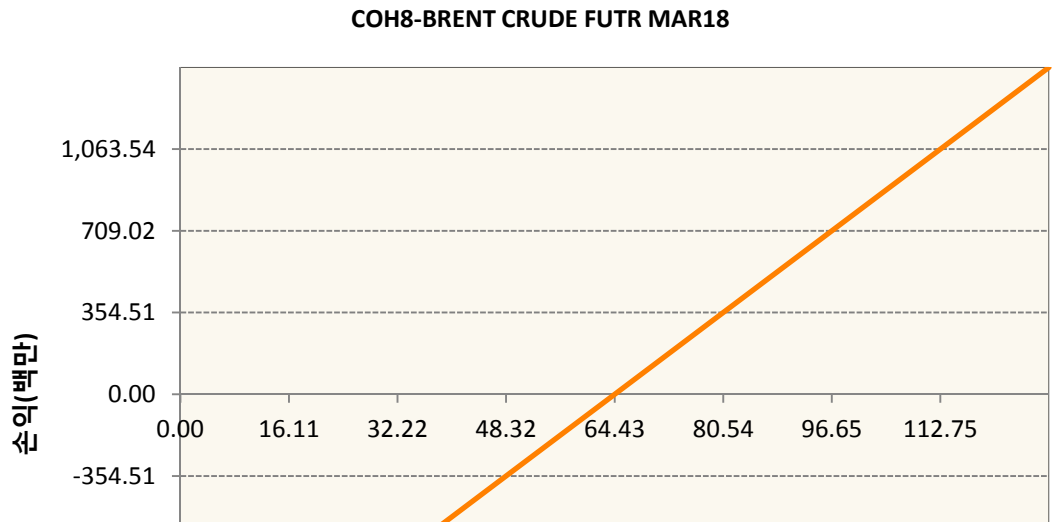
1. 계약금액

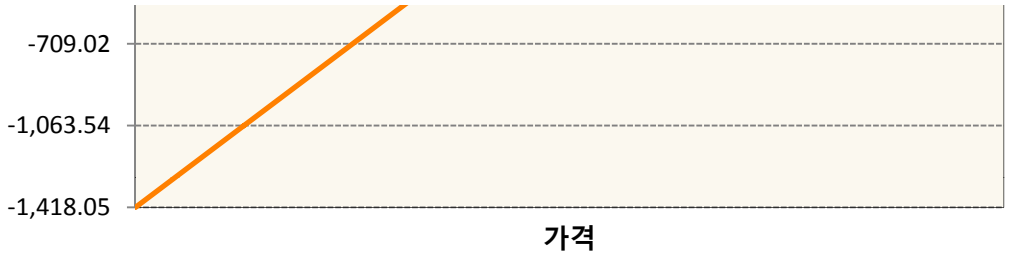
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,646	863	3,782	

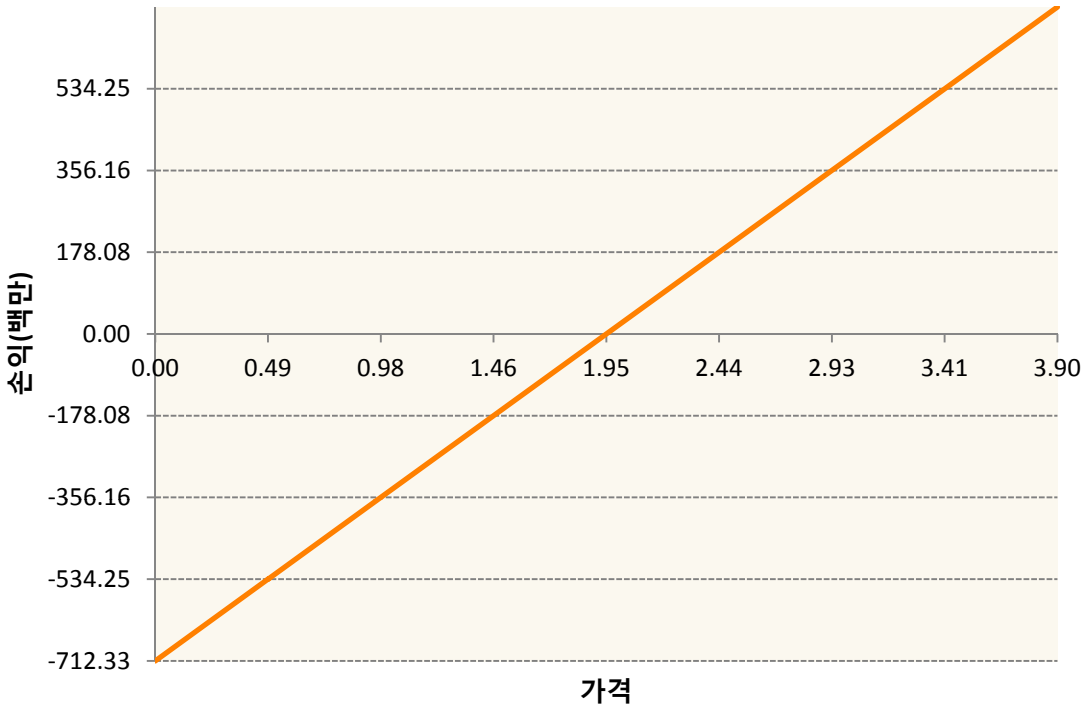
2. 만기시점의 손익구조



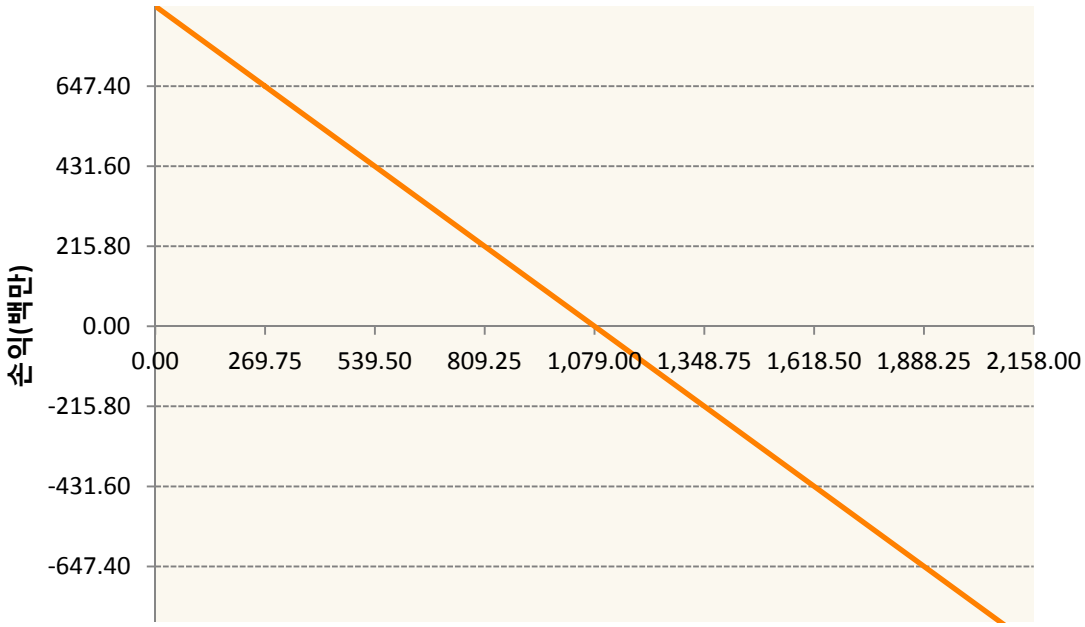


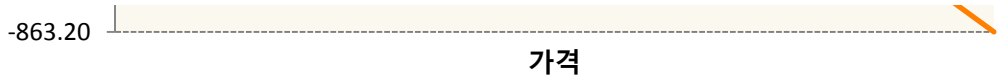


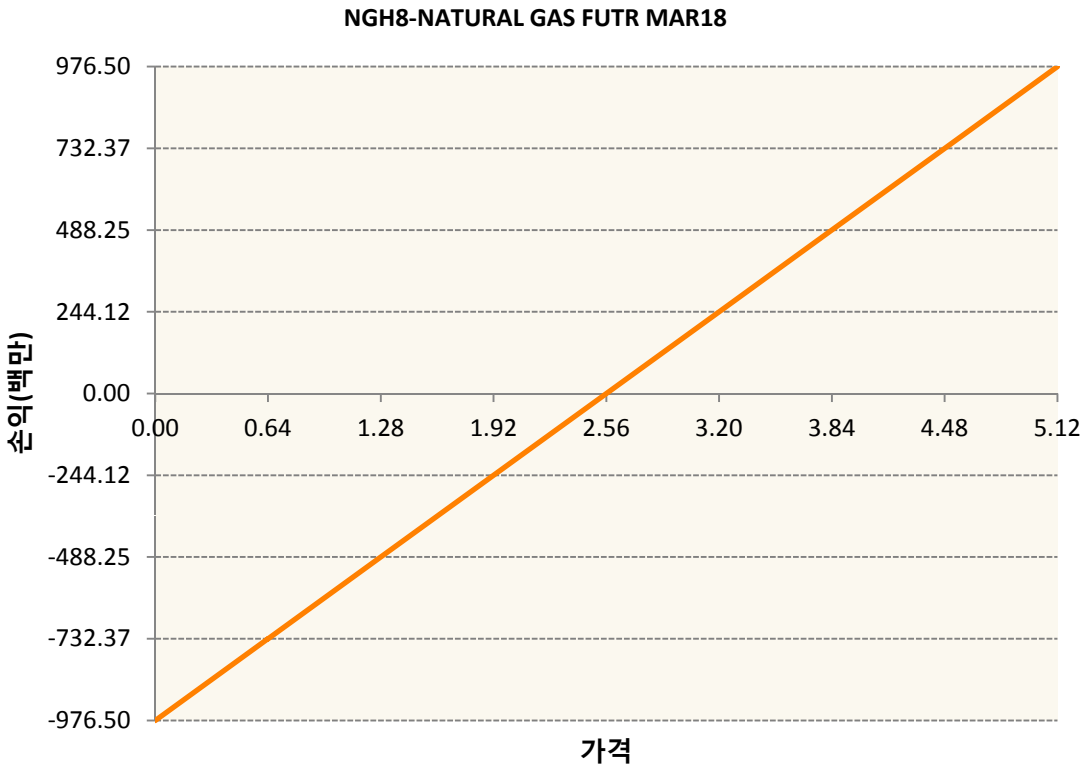
HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18

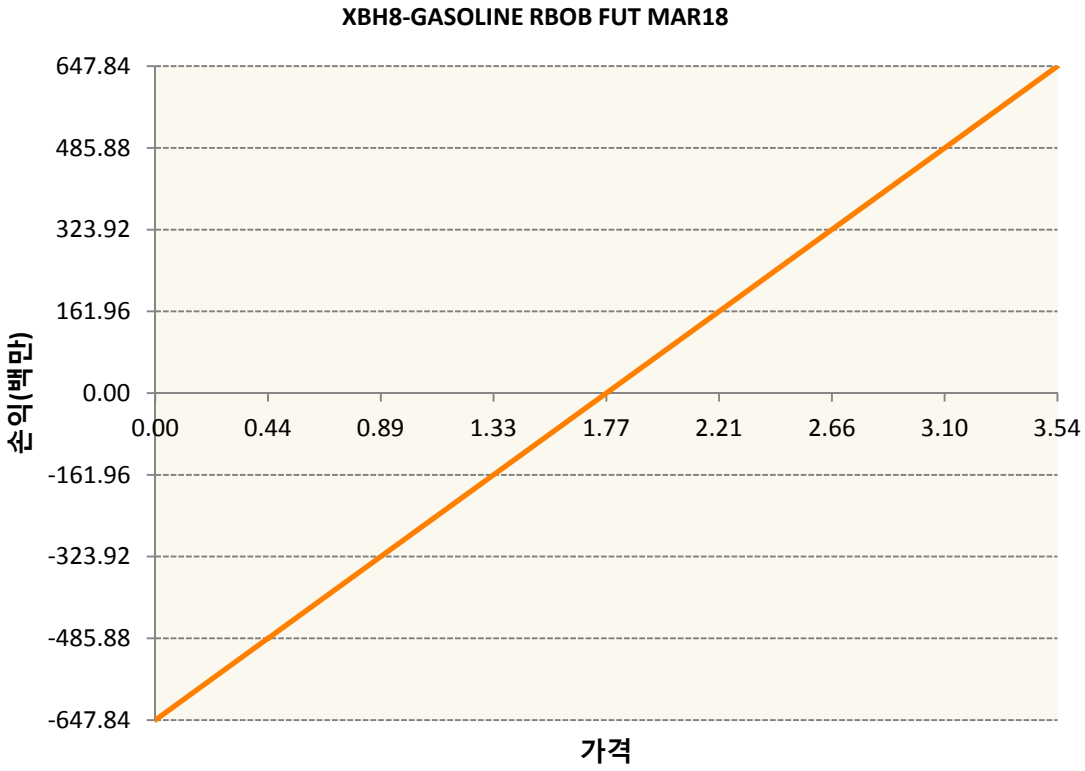


KR4175N10008-2018-01 달러선물




-863.20
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
976.50
732.37
488.25
244.12
0.00
-244.12
-488.25
-732.37
-976.50
손익(백만)
0.00
0.64
1.28
1.92
2.56
3.20
3.84
4.48
5.12
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
647.84
485.88
323.92
161.96
0.00
-161.96
-323.92
-485.88
-647.84
손익(백만)
0.00
0.44
0.89
1.33
1.77
2.21
2.66
3.10
3.54
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	78
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	52

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

621

공시일	2017-12-26
기준일	2017-12-22

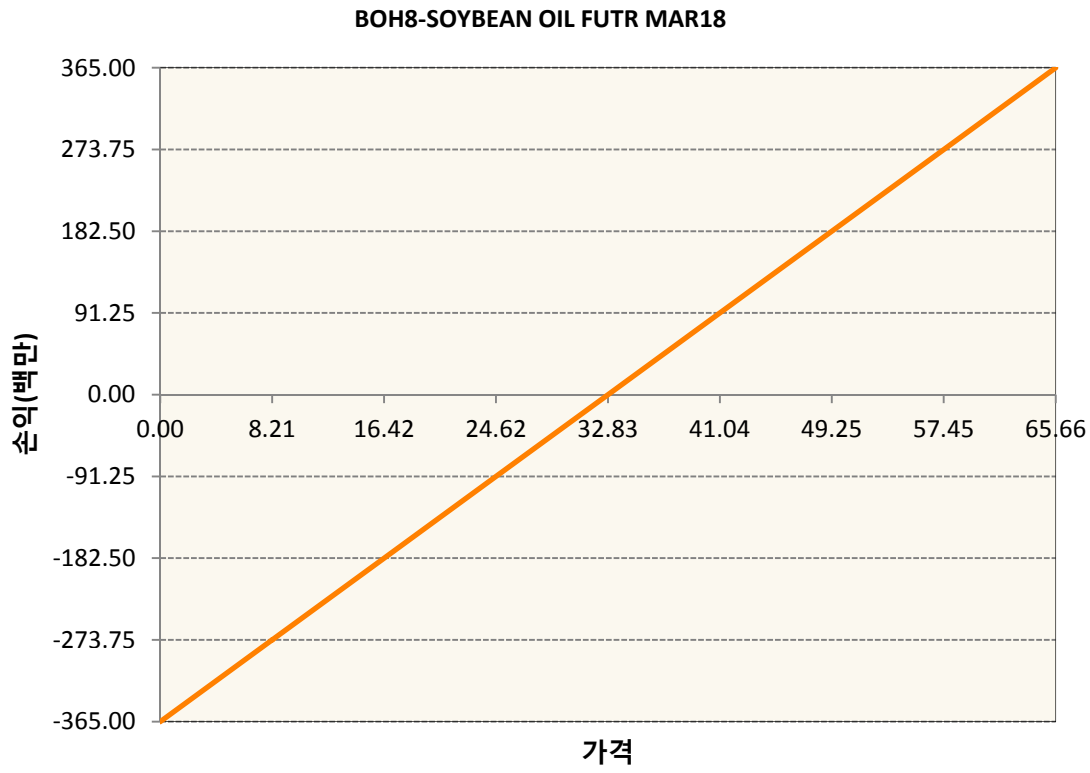
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

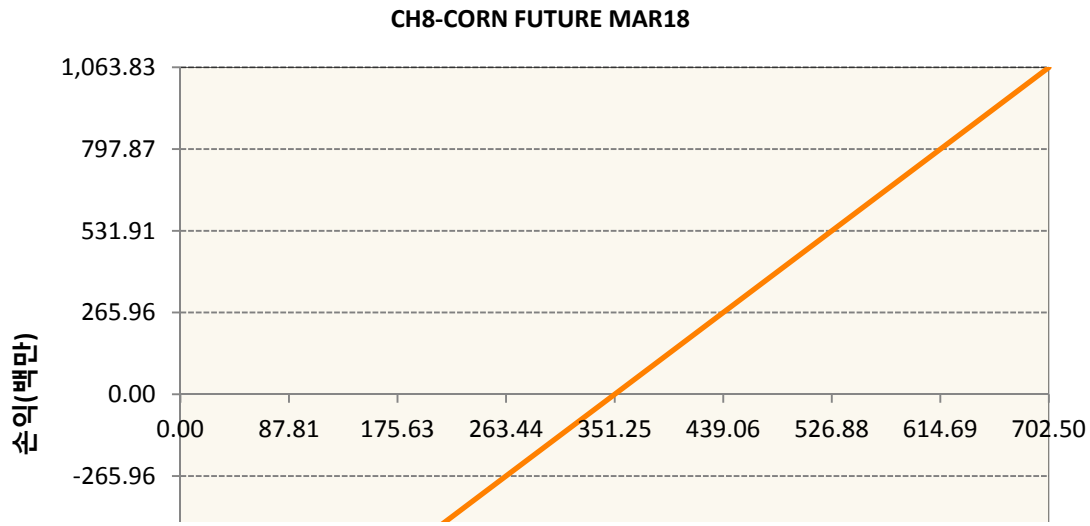
1. 계약금액

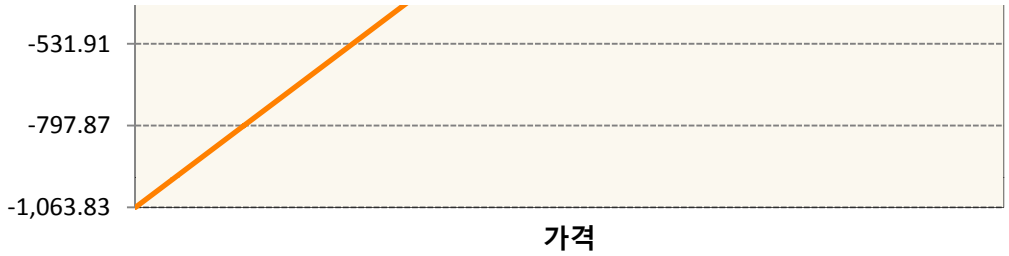
(단위:백만원)

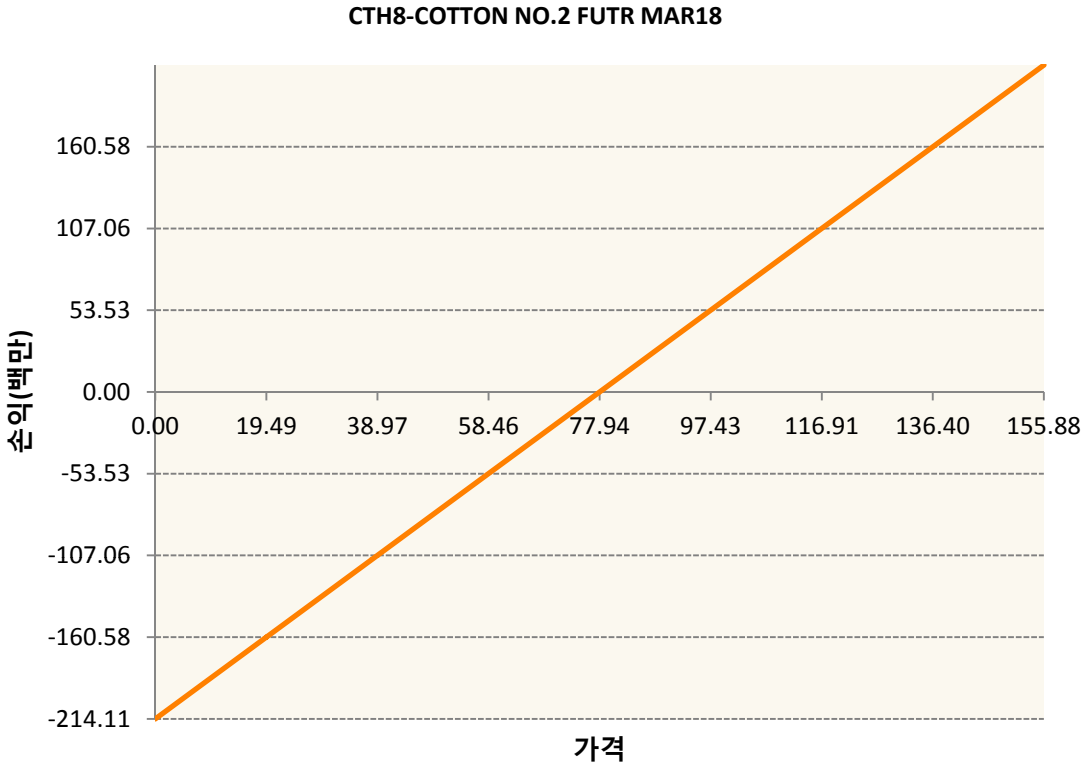
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,230	324	3,906	

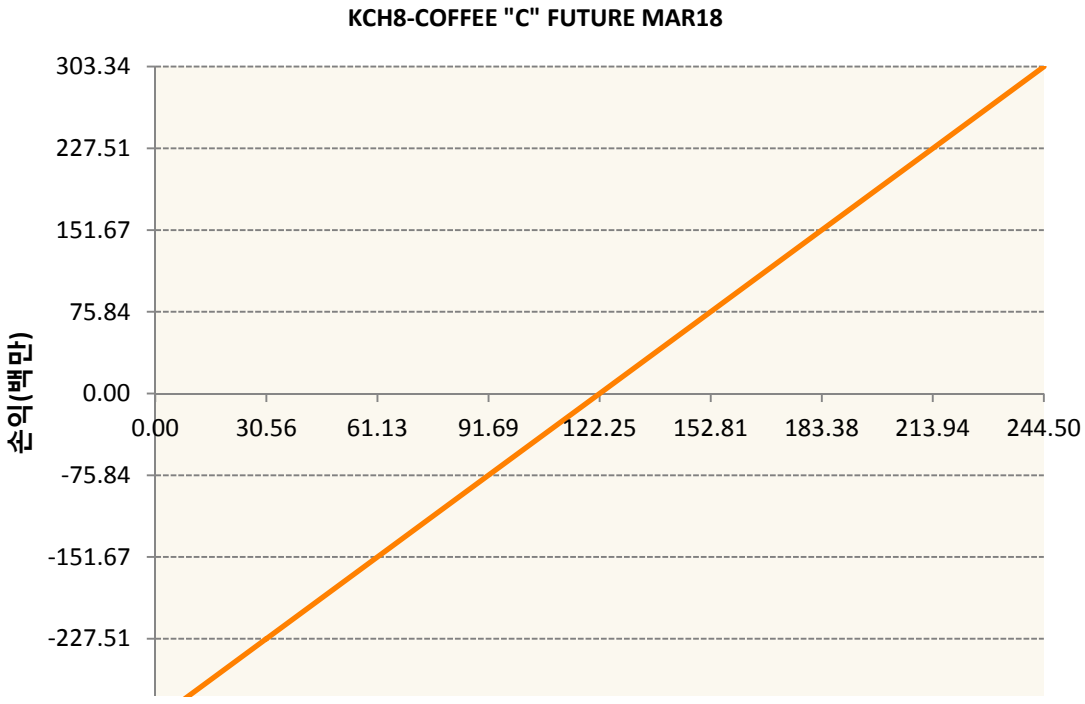
2. 만기시점의 손익구조

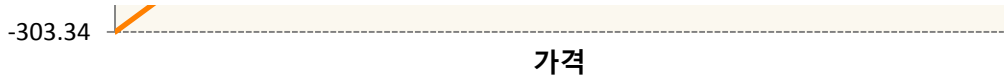


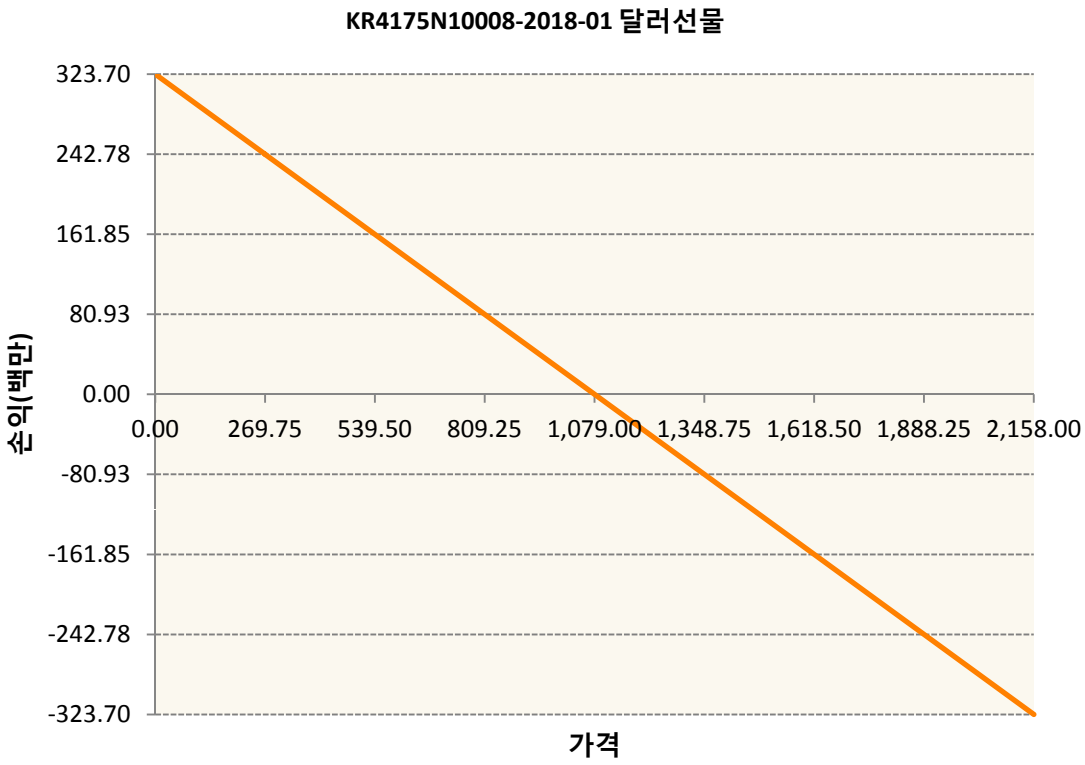


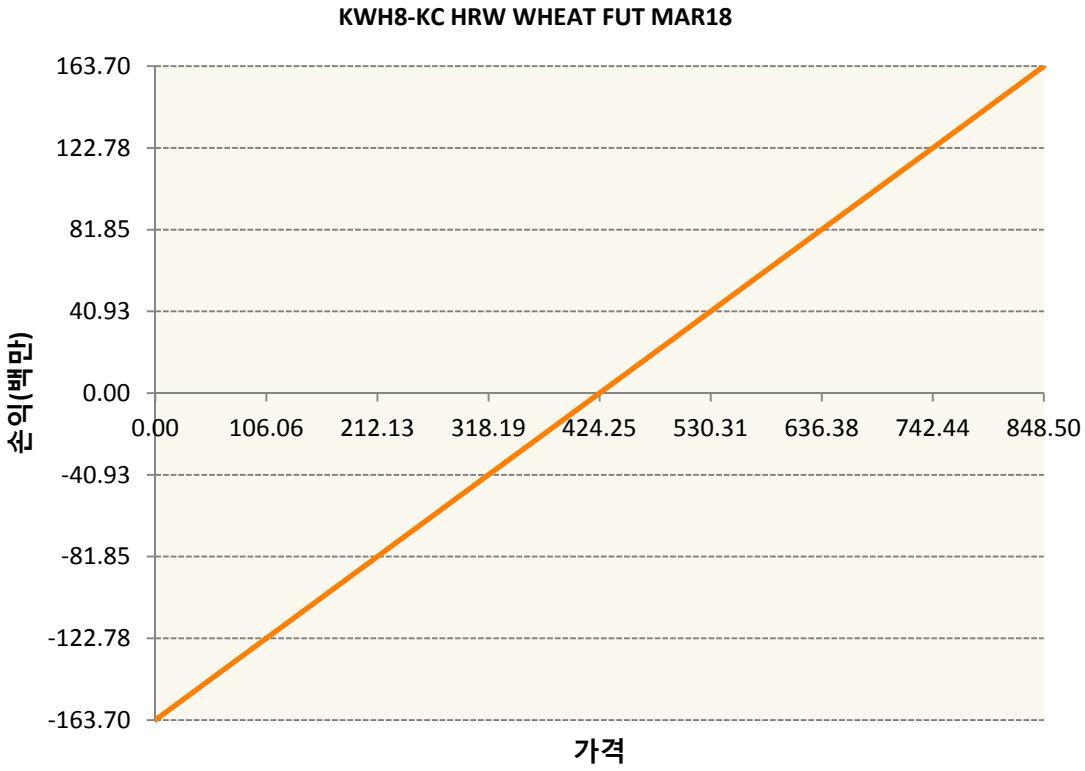

-531.91
-797.87
-1,063.83
가격

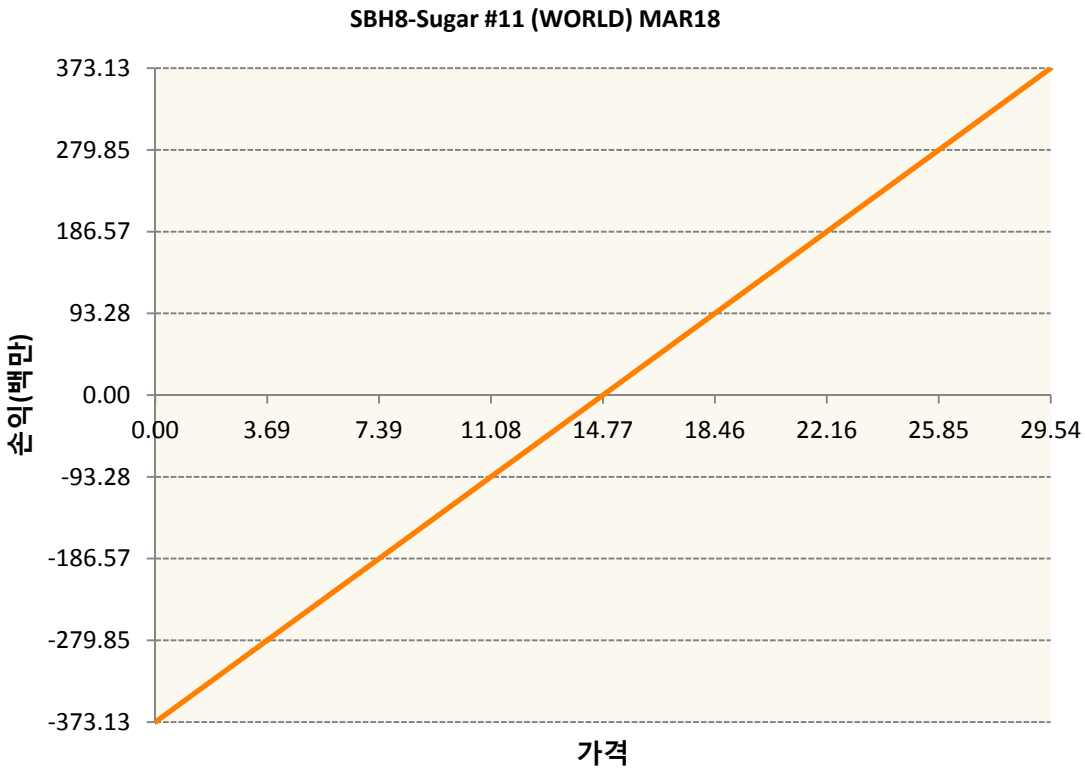

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
160.58
107.06
53.53
0.00
-53.53
-107.06
-160.58
-214.11
0.00
19.49
38.97
58.46
77.94
97.43
116.91
136.40
155.88
손익(백만)
가격

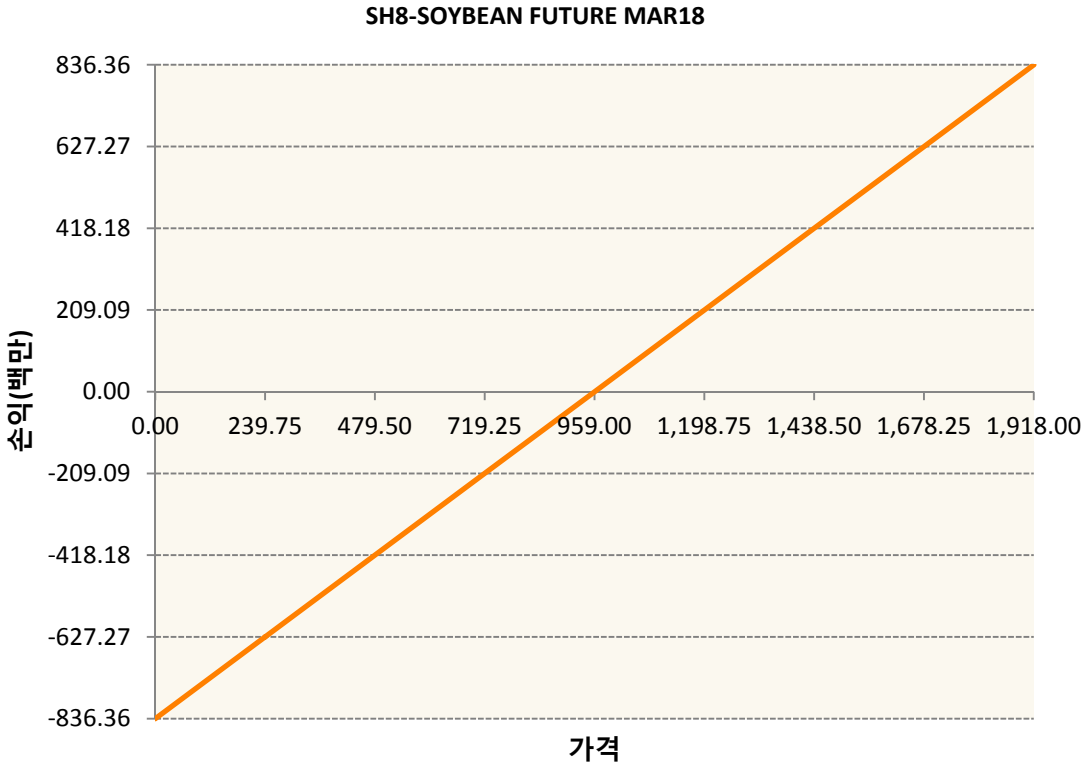

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
303.34
227.51
151.67
75.84
0.00
-75.84
-151.67
-227.51
0.00
30.56
61.13
91.69
122.25
152.81
183.38
213.94
244.50
손익(백만)


-303.34
가격

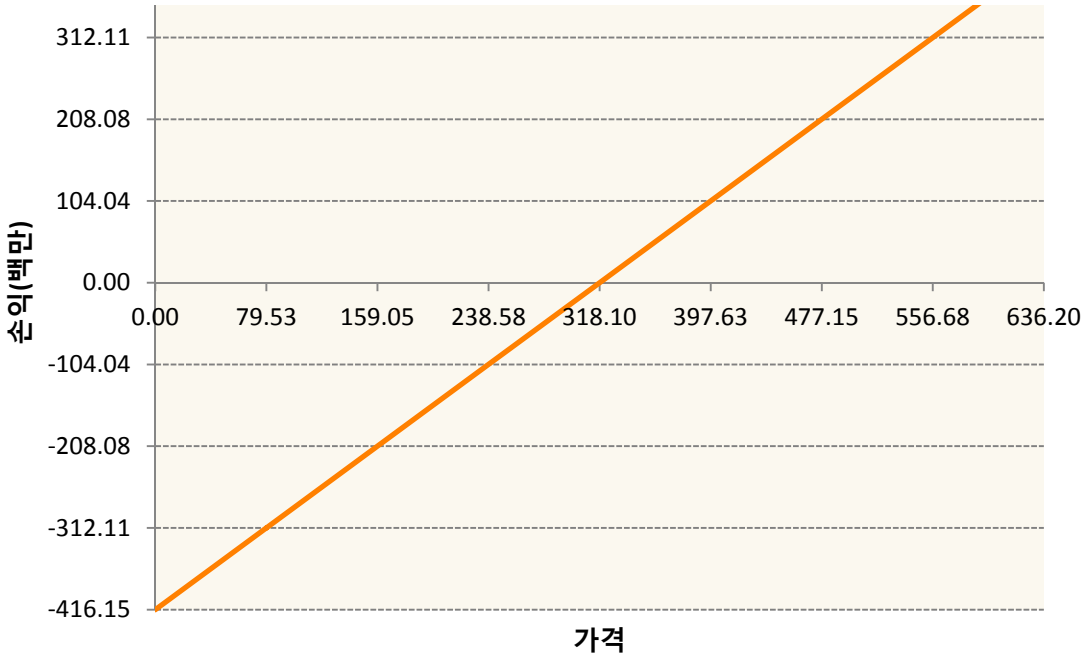

KR4175N10008-2018-01 달러선물
323.70
242.78
161.85
80.93
0.00
-80.93
-161.85
-242.78
-323.70
0.00
269.75
539.50
809.25
1,079.00
1,348.75
1,618.50
1,888.25
2,158.00
손익(백만)
가격

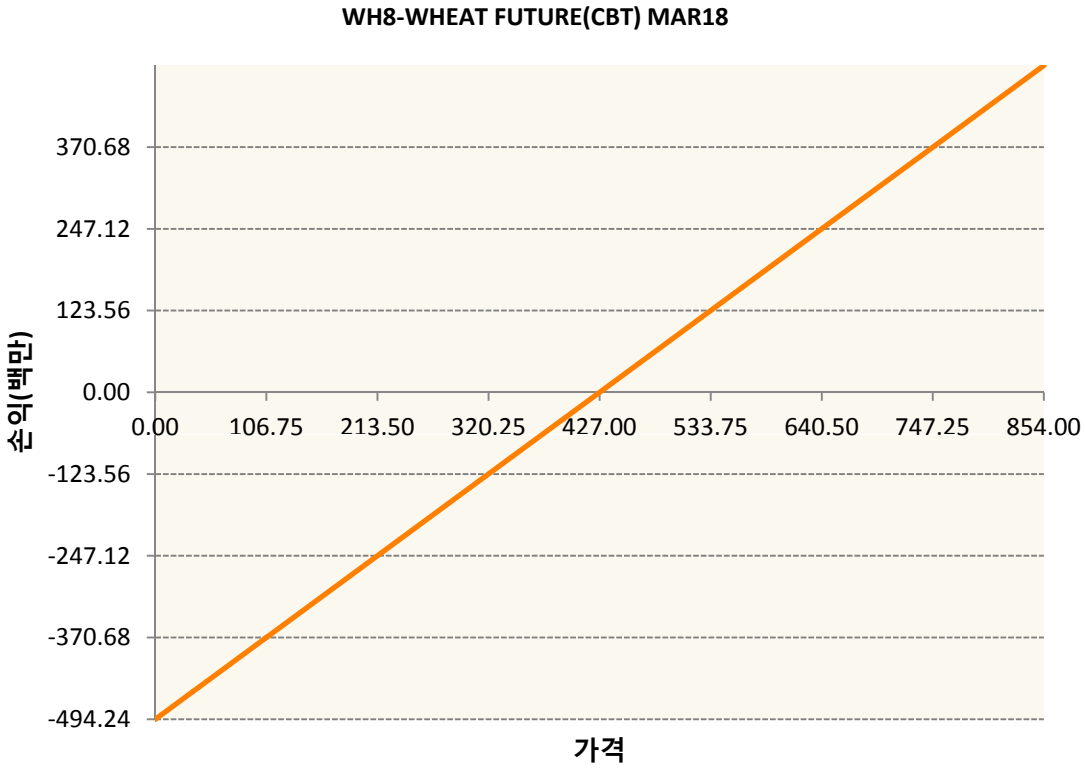

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
163.70
122.78
81.85
40.93
0.00
-40.93
-81.85
-122.78
-163.70
0.00
106.06
212.13
318.19
424.25
530.31
636.38
742.44
848.50
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
373.13
279.85
186.57
93.28
0.00
-93.28
-186.57
-279.85
-373.13
0.00
3.69
7.39
11.08
14.77
18.46
22.16
25.85
29.54
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
836.36
627.27
418.18
209.09
0.00
-209.09
-418.18
-627.27
-836.36
0.00
239.75
479.50
719.25
959.00
1,198.75
1,438.50
1,678.25
1,918.00
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18
416.15





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	30
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	67
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	33
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	40

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

359