공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

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	2017-12-27
기준일	2017-12-26

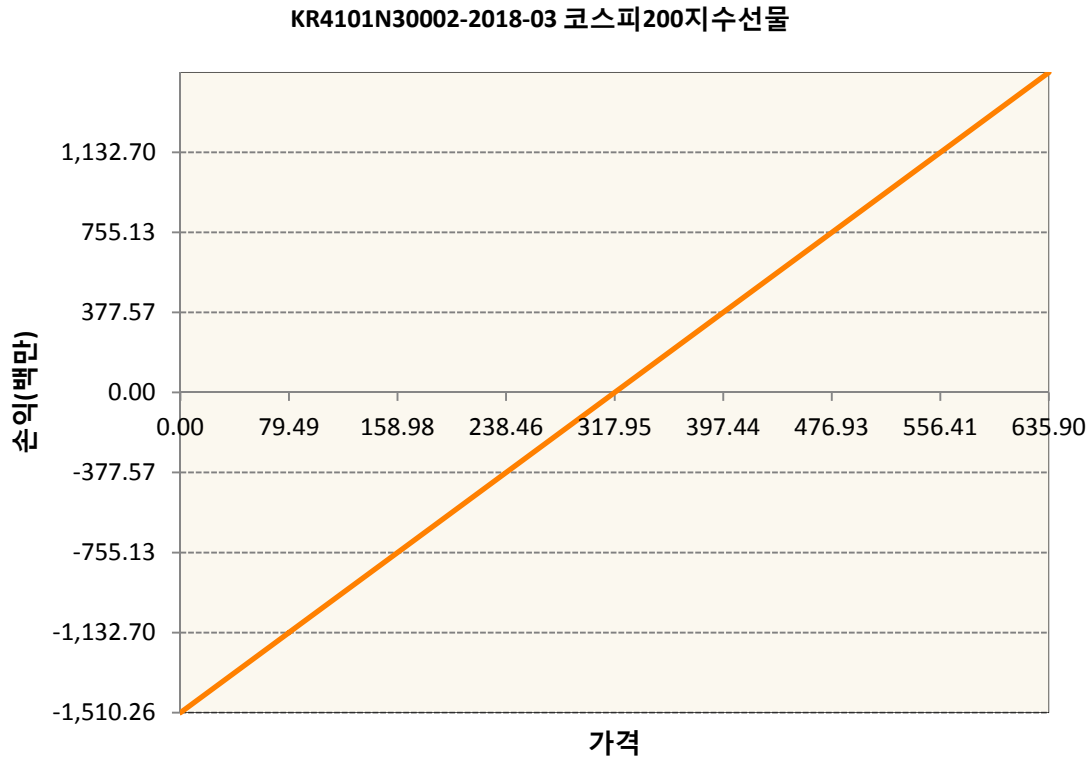
스마트인덱스모

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	1,510	0	1,510	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	2017-12-27
기준일	2017-12-26

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	2017-12-27
기준일	2017-12-26

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	401

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

360

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

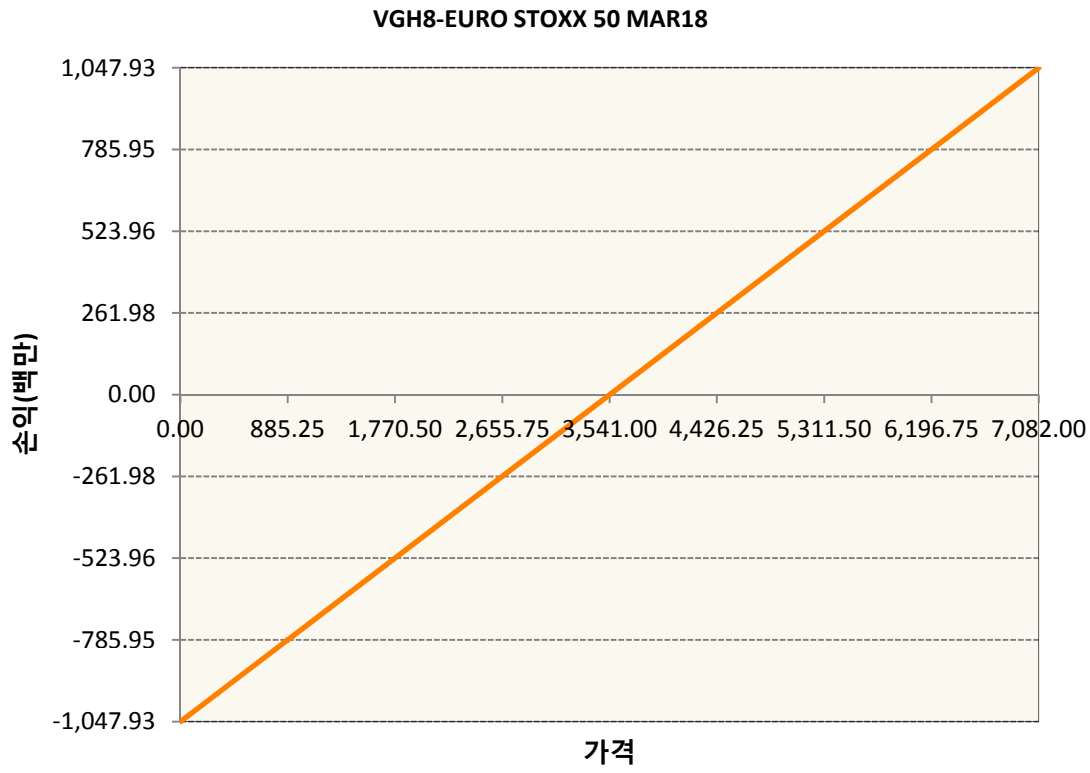
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,048	0	1,048	

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	2017-12-27
기준일	2017-12-26

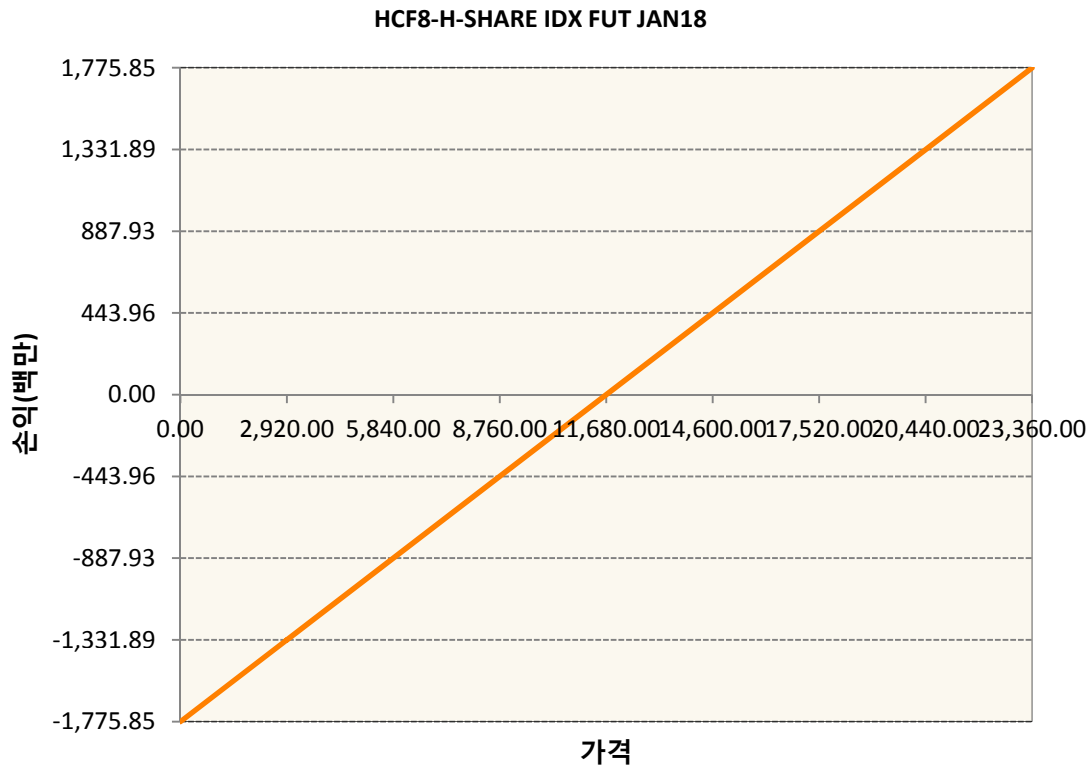
차이나인덱스모(주식-파생형)

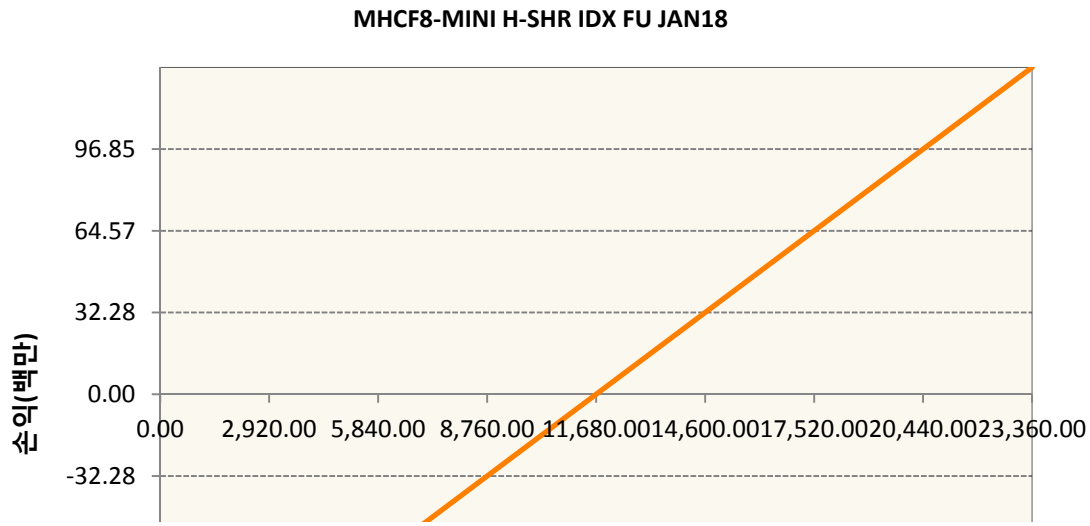
1. 계약금액

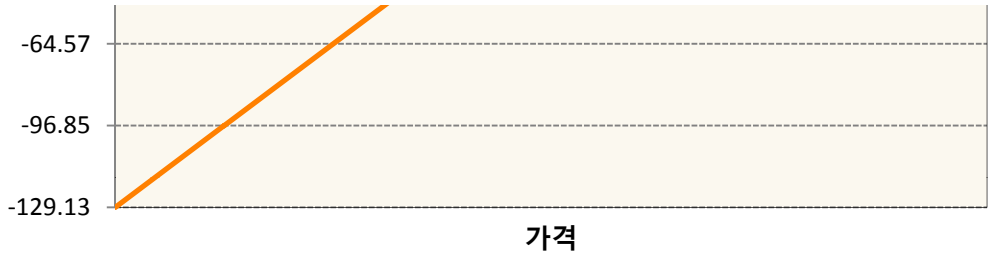
(단위:백만원)

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)
	120

공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

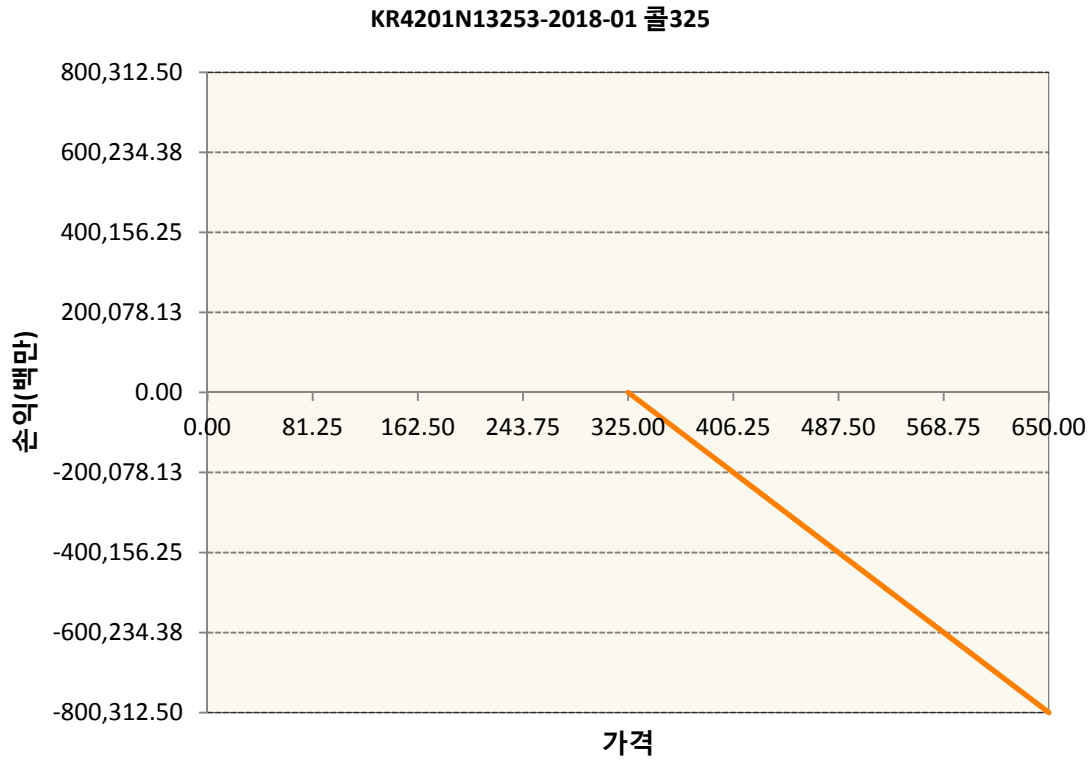
커버드콜모(주식혼합-파생형)

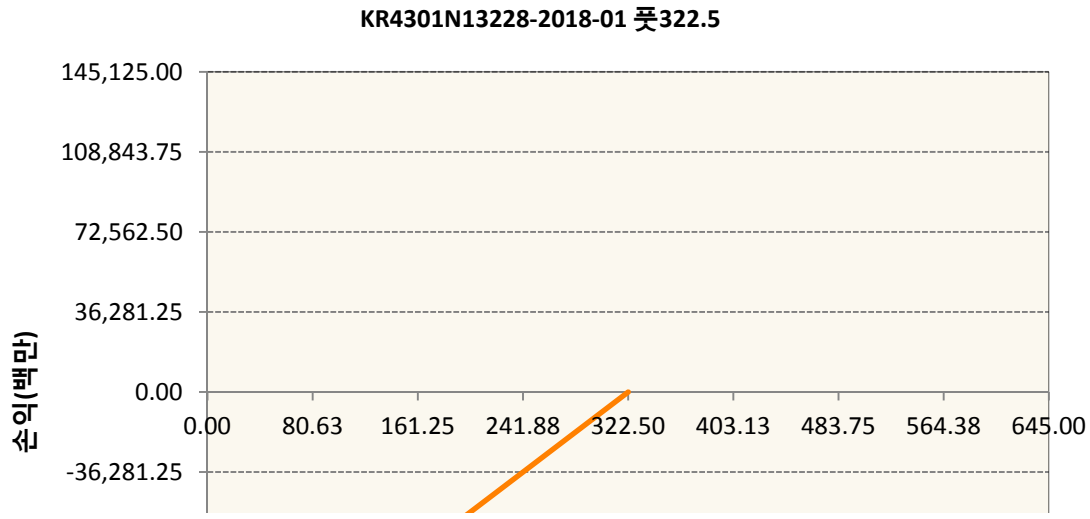
1. 계약금액

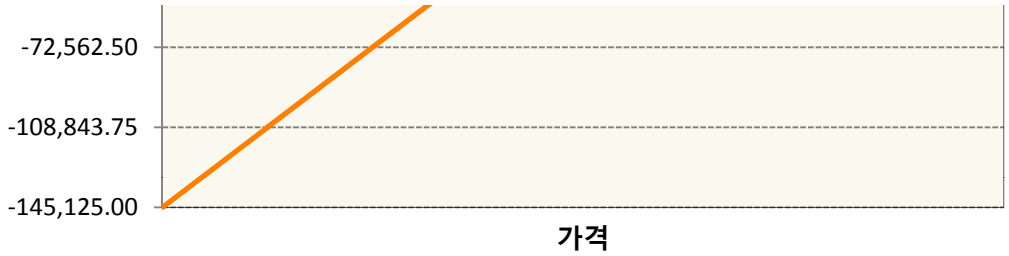
(단위:백만원)

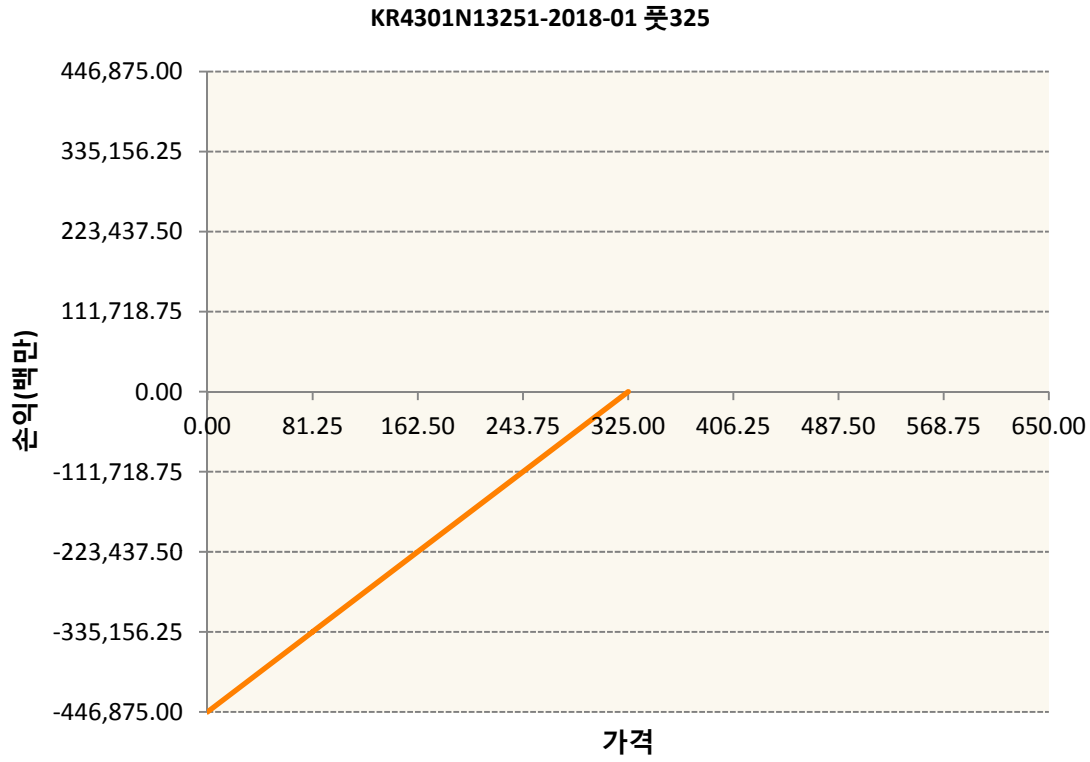
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,392,313	-1,392,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							43,273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,004	9,943	9,838	9,677	9,456	9,171	8,822
-5.33%	9,702	9,433	9,074	8,627	8,099	7,497	6,827
-2.67%	8,247	7,522	6,710	5,826	4,883	3,890	2,856
0%	3,763	2,530	1,274	0	-1,288	-2,587	-3,895
2.67%	-5,694	-7,057	-8,425	-9,795	-11,168	-12,542	-13,918
5.33%	-20,410	-21,424	-22,500	-23,624	-24,787	-25,982	-27,203
8.00%	-38,818	-39,340	-39,967	-40,685	-41,482	-42,348	-43,273
KR4301N132 2018-01 풋322.5							10,584
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10,580	-10,580	-10,580	-10,580	-10,581	-10,582	-10,584

-5.33%	-6,756	-6,757	-6,760	-6,765	-6,774	-6,786	-6,803
-2.67%	-2,966	-2,993	-3,028	-3,072	-3,124	-3,183	-3,249
0%	350	236	119	0	-121	-243	-366
2.67%	2,096	1,994	1,887	1,776	1,662	1,545	1,427
5.33%	2,462	2,440	2,410	2,371	2,324	2,270	2,208
8.00%	2,487	2,486	2,483	2,477	2,468	2,455	2,437
	KR4301N132	2018-01 풋325					33,320
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33,314	-33,314	-33,315	-33,315	-33,315	-33,317	-33,320
-5.33%	-21,629	-21,631	-21,634	-21,641	-21,654	-21,676	-21,707
-2.67%	-9,982	-10,022	-10,084	-10,168	-10,274	-10,402	-10,551
0%	872	600	308	0	-320	-651	-990
2.67%	7,849	7,468	7,083	6,695	6,305	5,912	5,518
5.33%	9,847	9,723	9,568	9,386	9,180	8,953	8,708
8.00%	10,042	10,031	10,010	9,976	9,926	9,858	9,772

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

94,781

공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

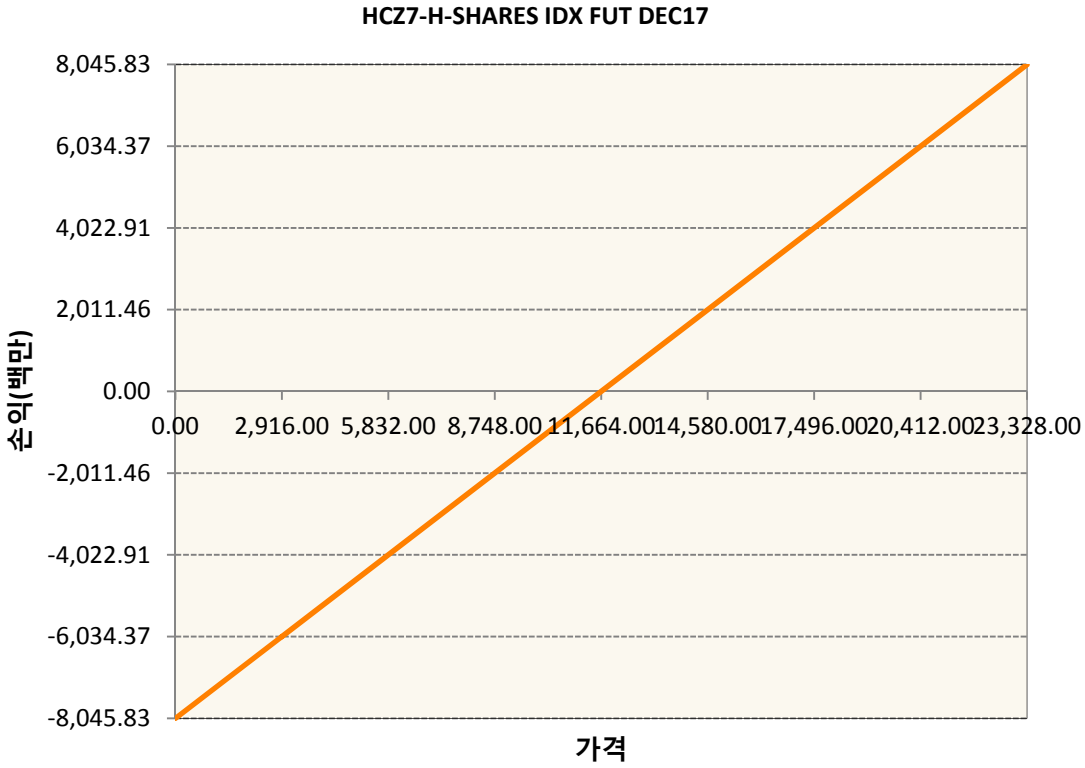
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

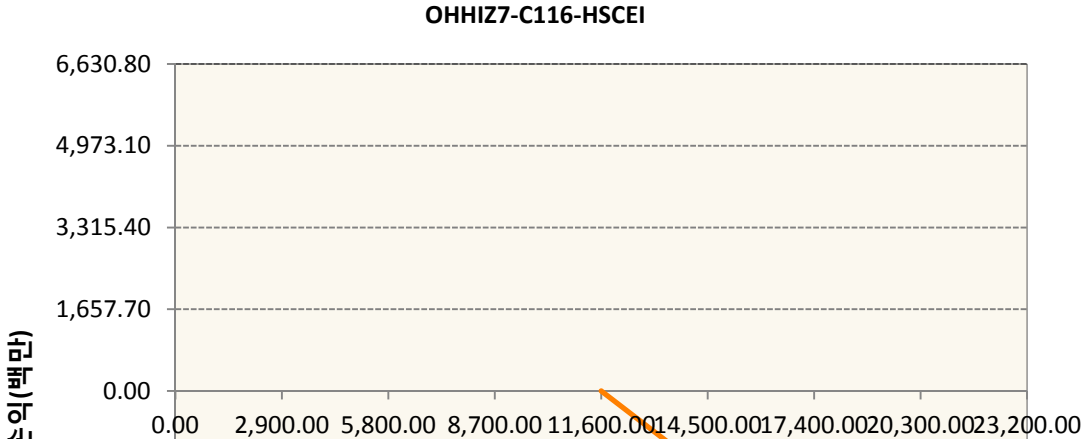
1. 계약금액

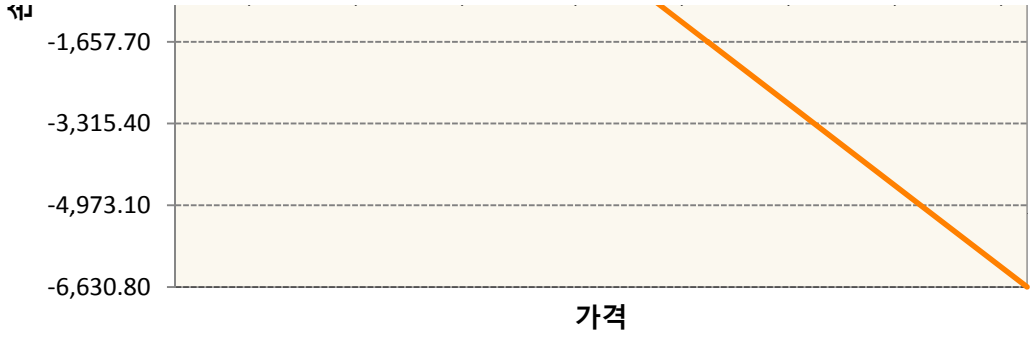
(단위:백만원)

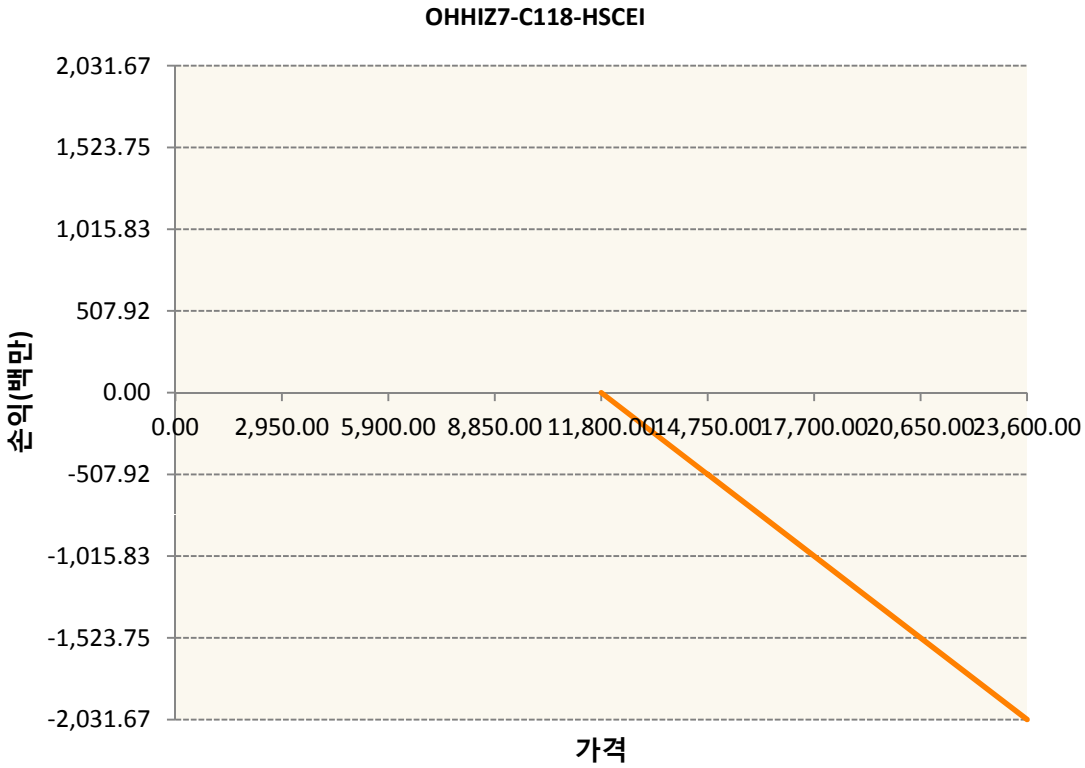
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,046	0	8,046	
누계	유가증권	옵션	0	17,325	-17,325	장내

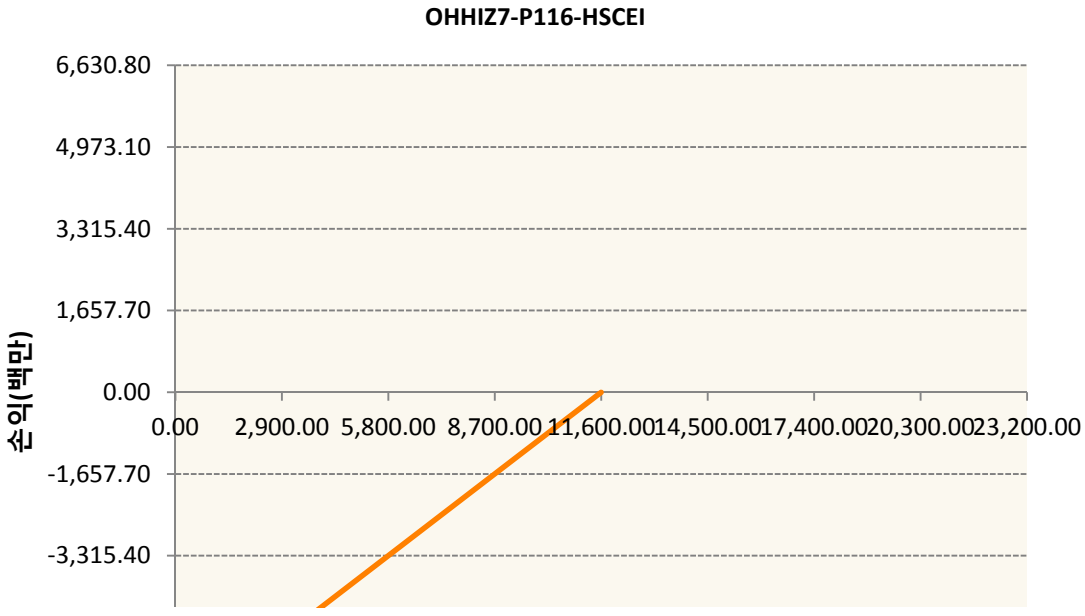
2. 만기시점의 손익구조

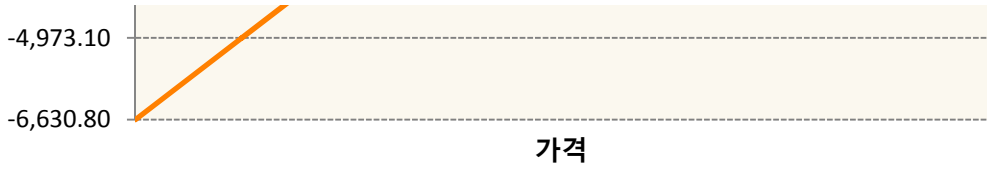


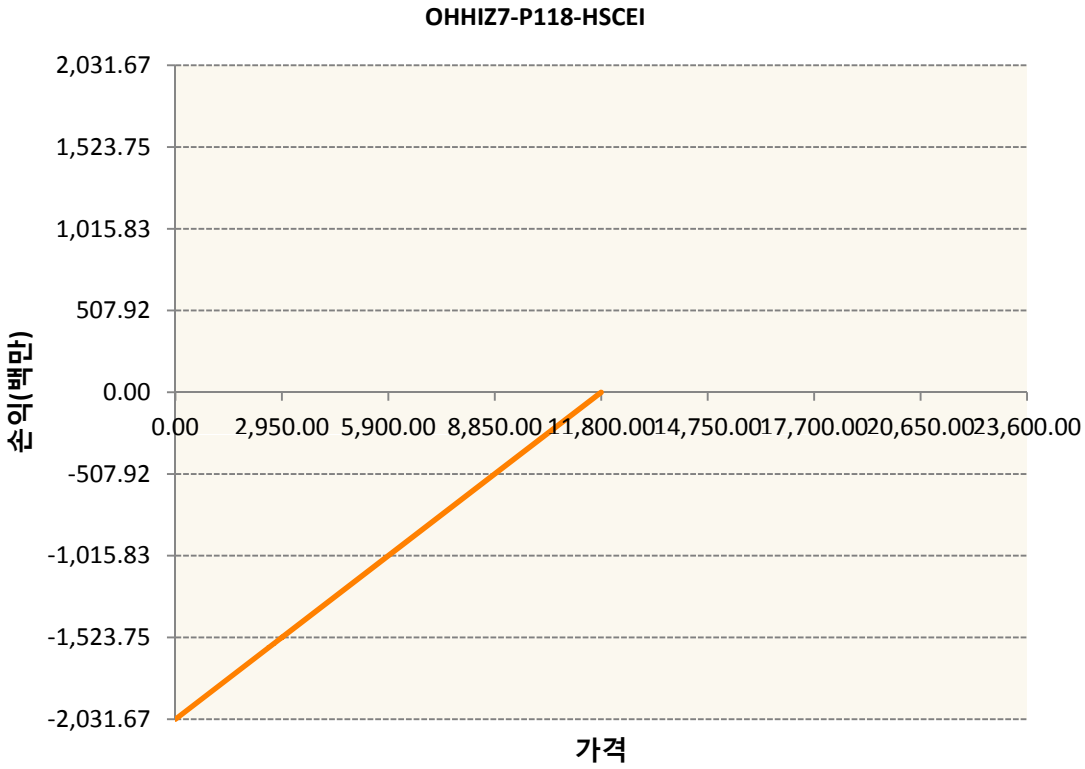



-1,657.70
-3,315.40
-4,973.10
-6,630.80
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,031.67
1,523.75
1,015.83
507.92
0.00
-507.92
-1,015.83
-1,523.75
-2,031.67
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
6,630.80
4,973.10
3,315.40
1,657.70
0.00
-1,657.70
-3,315.40
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	644
OHHIZ7-C11	HSCEI	530
OHHIZ7-C11	HSCEI	163
OHHIZ7-P11	HSCEI	530
OHHIZ7-P11	HSCEI	163

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

1,499

공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

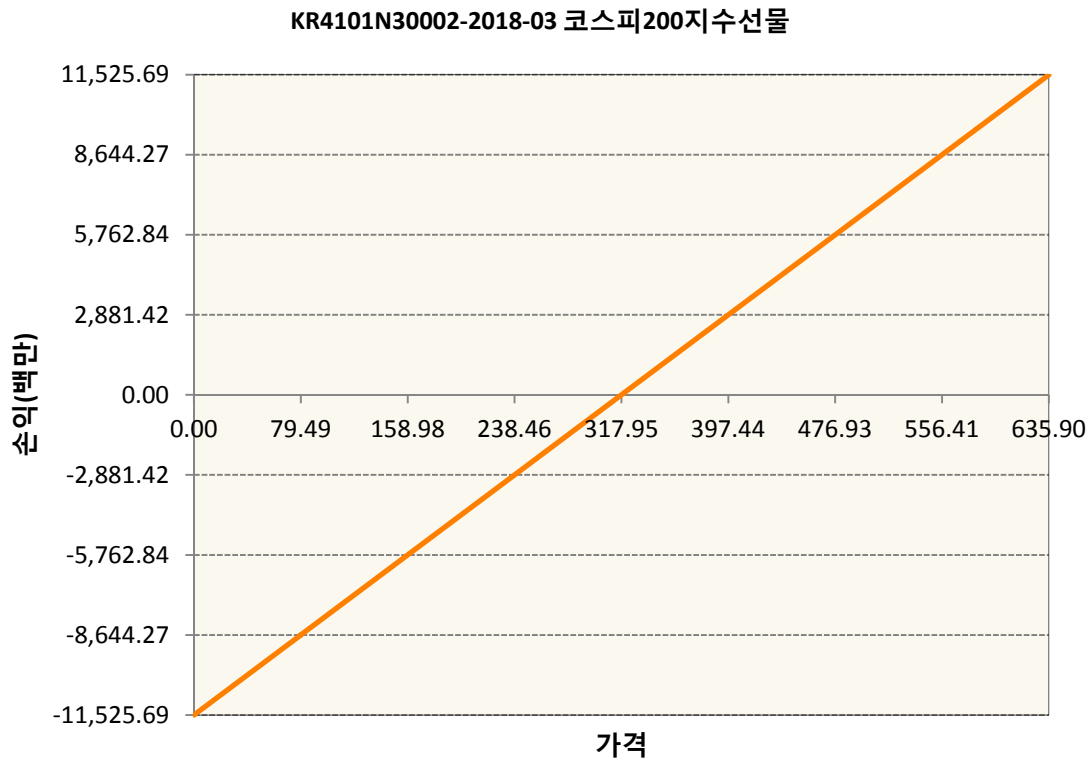
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

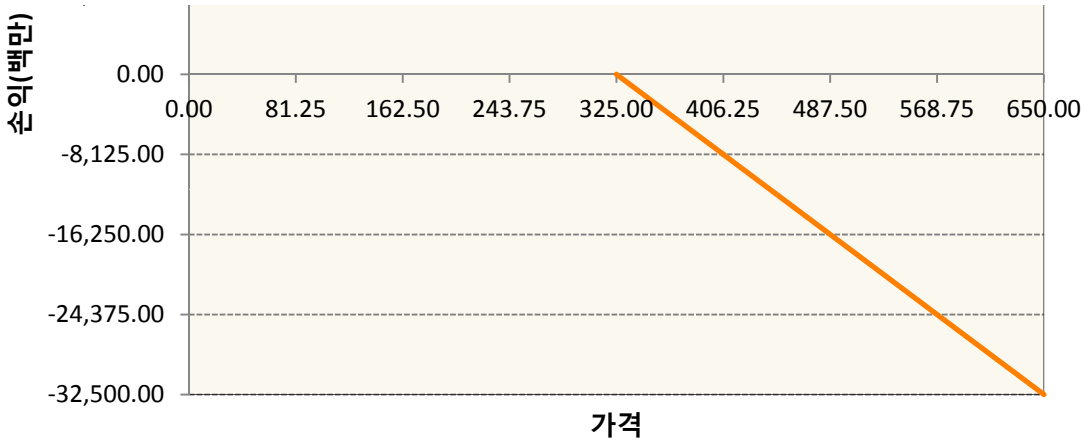
(단위:백만원)

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	11,526	0	11,526	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,875	-60,875	장내

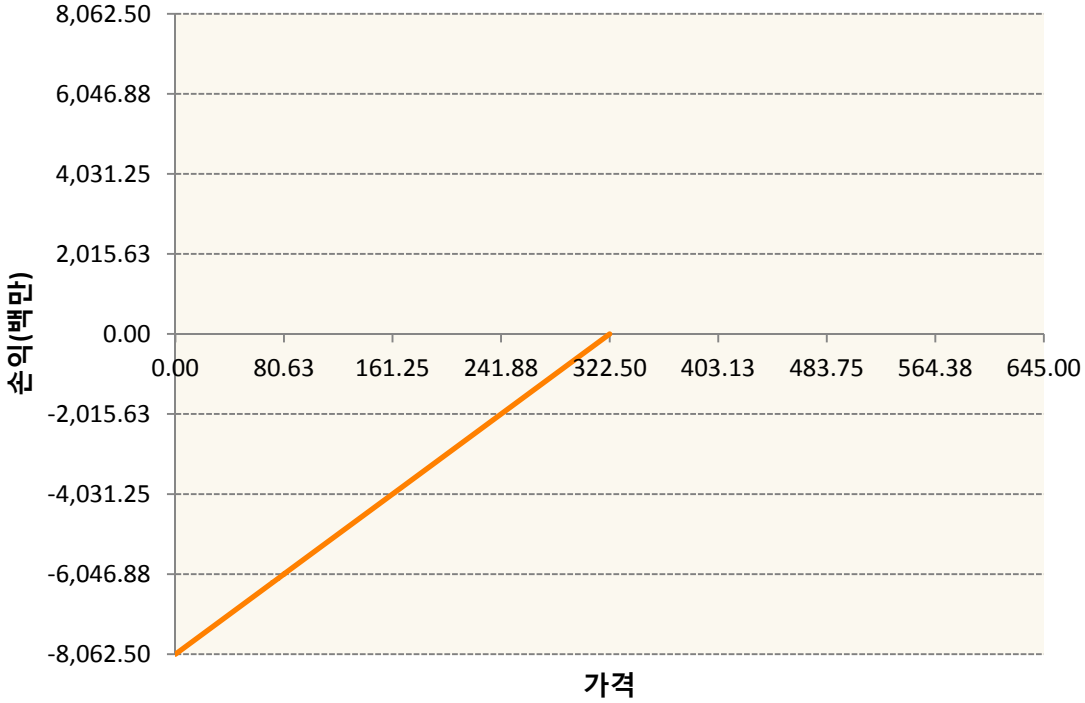
2. 만기시점의 손익구조



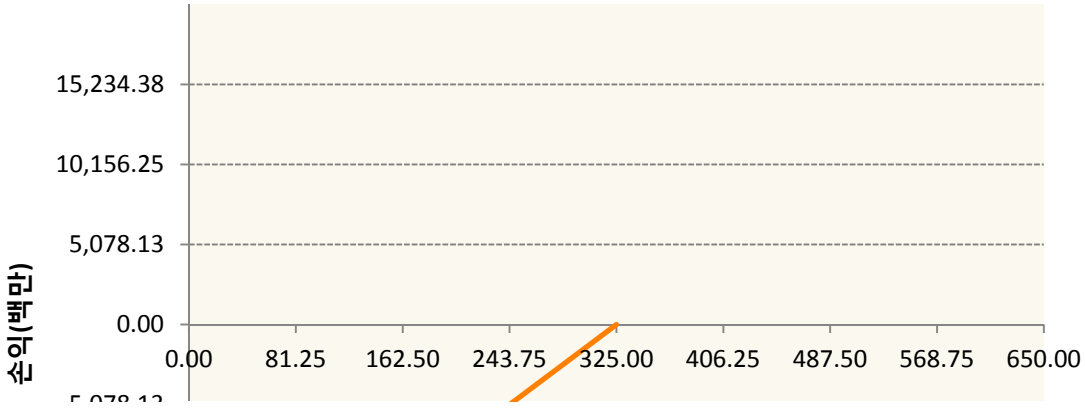




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



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						925
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-925	-925	-925	-925	-925	-925	-925
-5.33%	-617	-617	-617	-617	-617	-617	-617
-2.67%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	308	308	308	308	308	308	308
5.33%	617	617	617	617	617	617	617
8.00%	925	925	925	925	925	925	925
	KR4201N13: 2018-01 콜325						1,757

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	406	404	399	393	384	372	358
-5.33%	394	383	368	350	329	304	277
-2.67%	335	305	272	237	198	158	116
0%	153	103	52	0	-52	-105	-158
2.67%	-231	-287	-342	-398	-454	-509	-565
5.33%	-829	-870	-914	-959	-1,007	-1,055	-1,105
8.00%	-1,576	-1,598	-1,623	-1,652	-1,685	-1,720	-1,757
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						588

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-588	-588	-588	-588	-588	-588	-588
-5.33%	-375	-375	-376	-376	-376	-377	-378
-2.67%	-165	-166	-168	-171	-174	-177	-180
0%	19	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	116	111	105	99	92	86	79
5.33%	137	136	134	132	129	126	123
8.00%	138	138	138	138	137	136	135
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,515

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,514	-1,514	-1,514	-1,514	-1,514	-1,514	-1,515
-5.33%	-983	-983	-983	-984	-984	-985	-987
-2.67%	-454	-456	-458	-462	-467	-473	-480
0%	40	27	14	0	-15	-30	-45
2.67%	357	339	322	304	287	269	251
5.33%	448	442	435	427	417	407	396
8.00%	456	456	455	453	451	448	444

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

9,523

공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

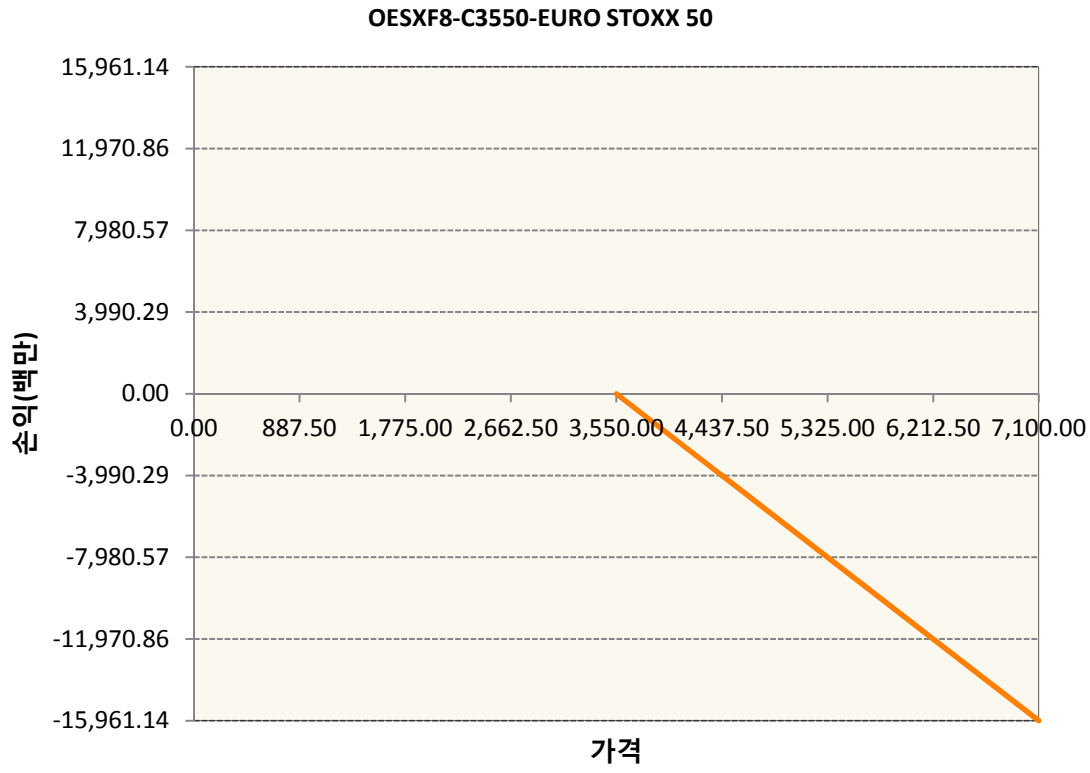
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

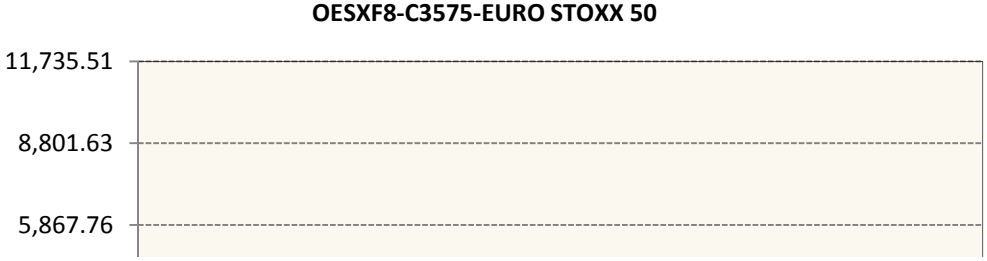
1. 계약금액

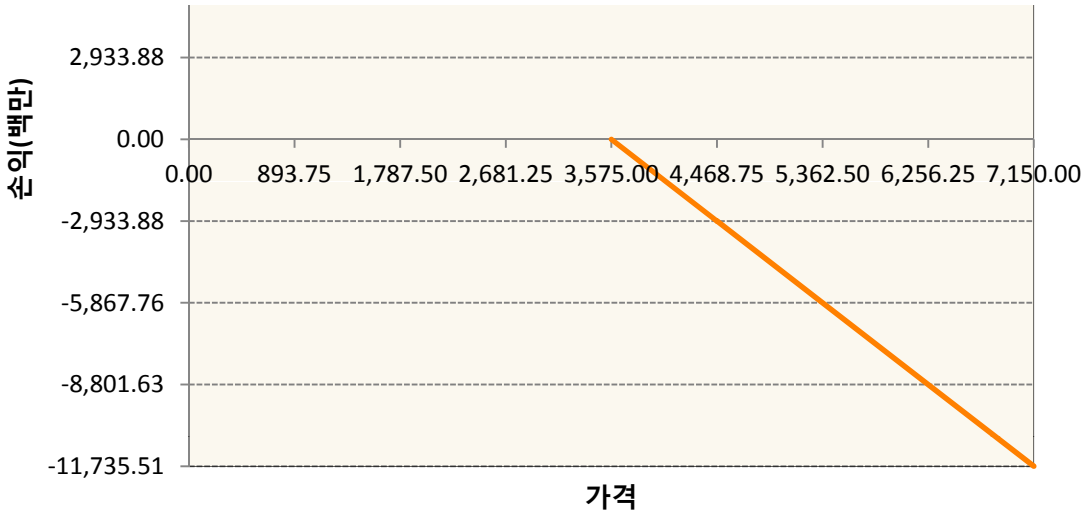
(단위:백만원)

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	19,413	0	19,413	
누계	유가증권	스왑	95,796	0	95,796	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,393	-55,393	장내
누계	지수	스왑	51,092	0	51,092	장외

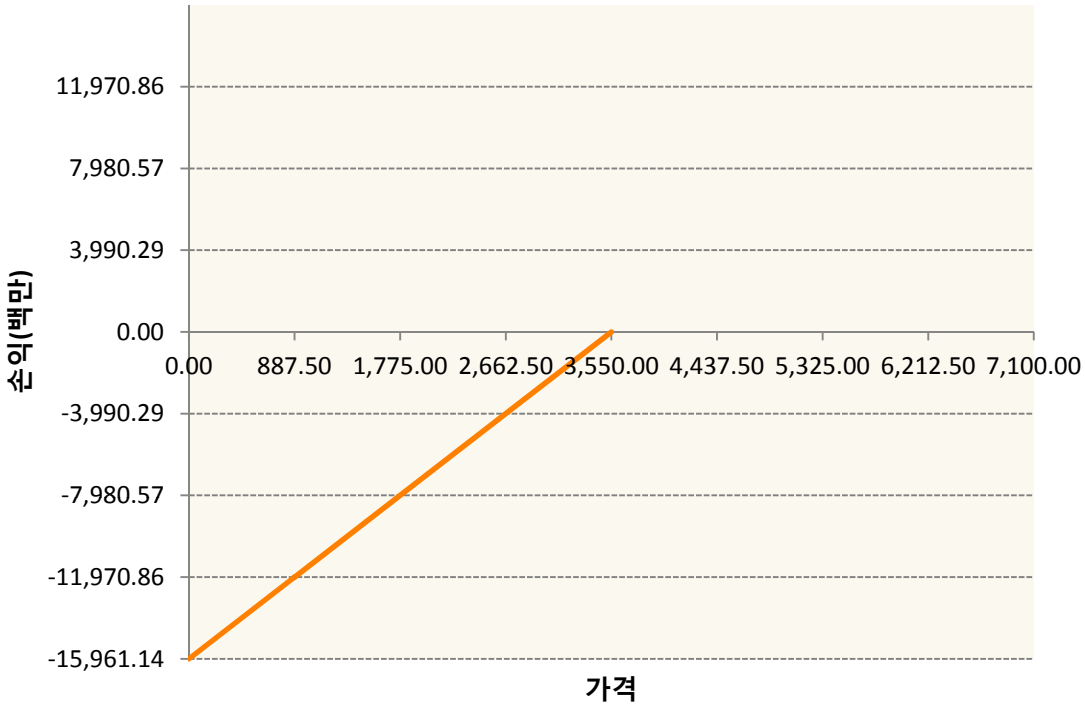
2. 만기시점의 손익구조



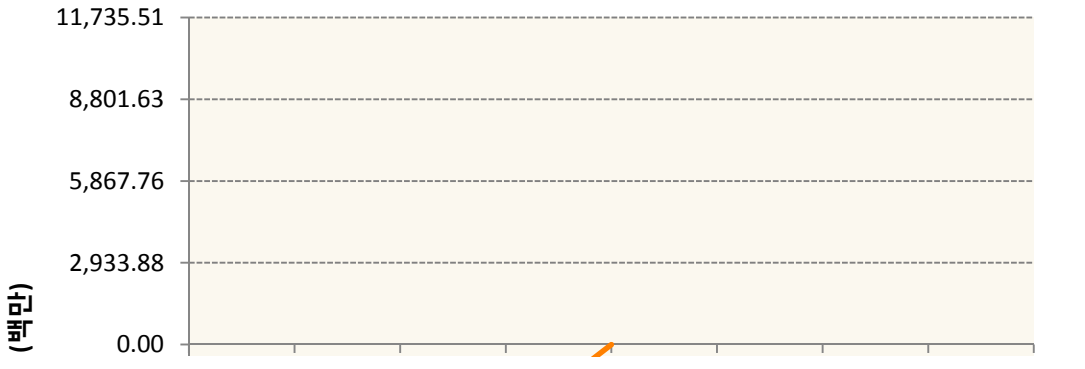


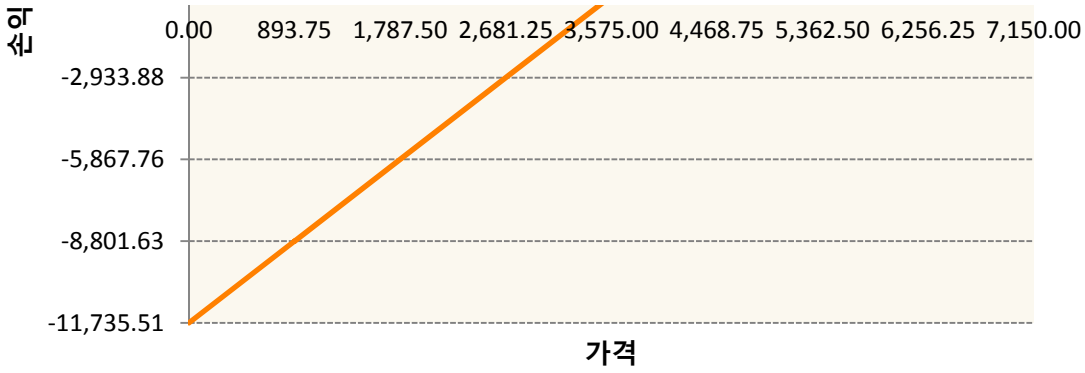


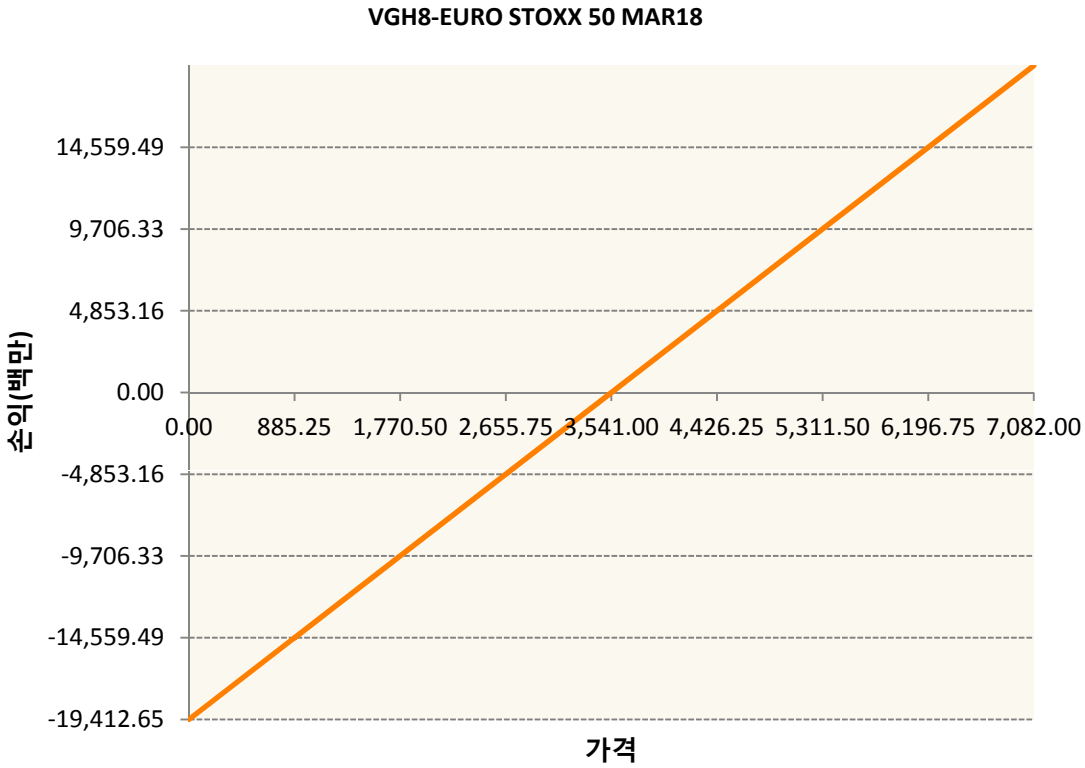
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	61
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	71
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,277
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	939
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,277
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	939
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,553

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

3,485

공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

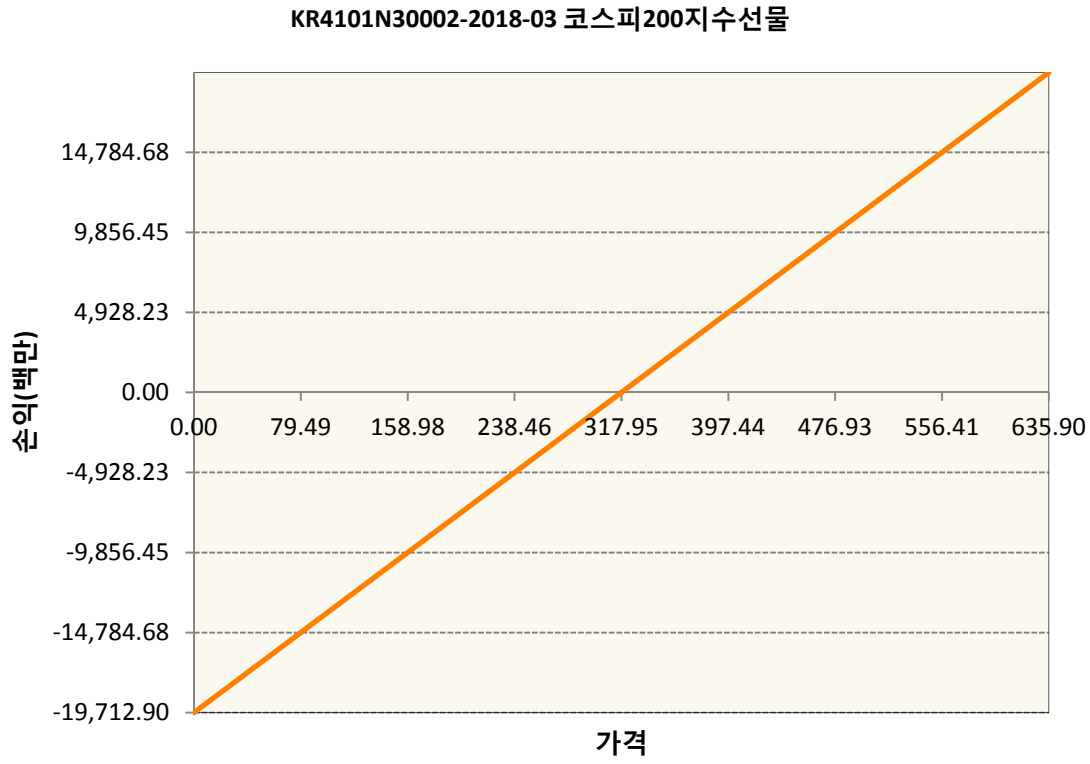
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	19,713	0	19,713	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,582
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582	-1,582
-5.33%	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054
-2.67%	-527	-527	-527	-527	-527	-527	-527
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	527	527	527	527	527	527	527
5.33%	1,054	1,054	1,054	1,054	1,054	1,054	1,054
8.00%	1,582	1,582	1,582	1,582	1,582	1,582	1,582

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

931

공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

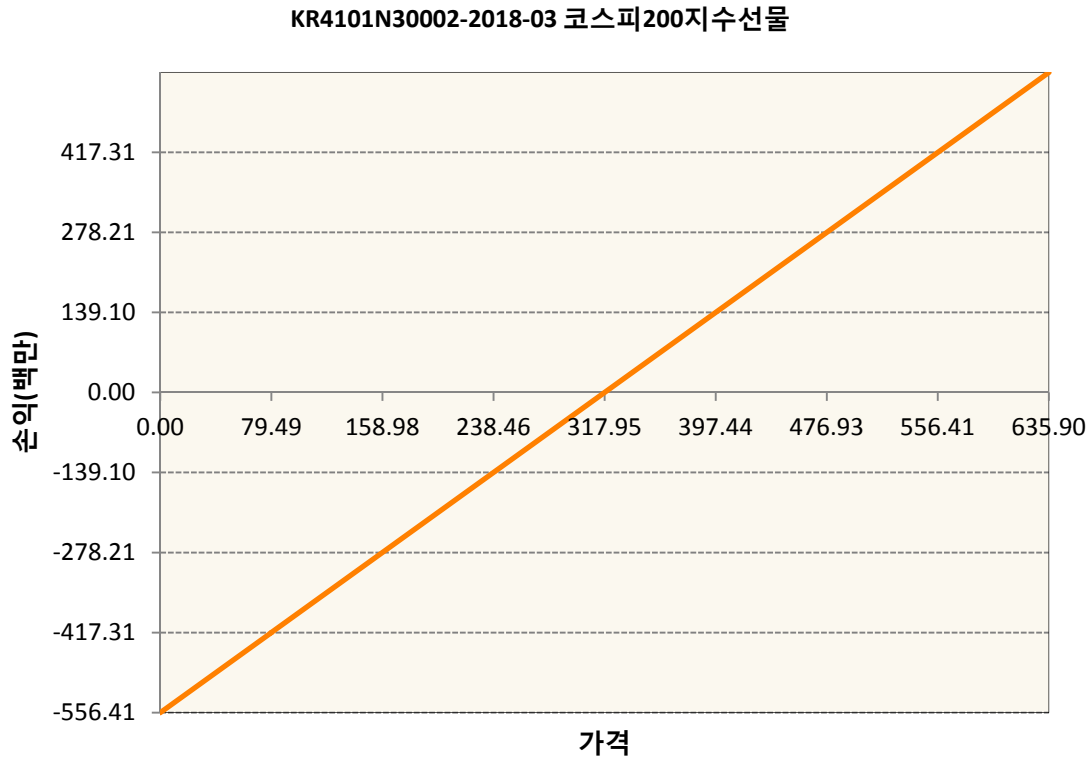
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	556	0	556	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	2017-12-27
기준일	2017-12-26

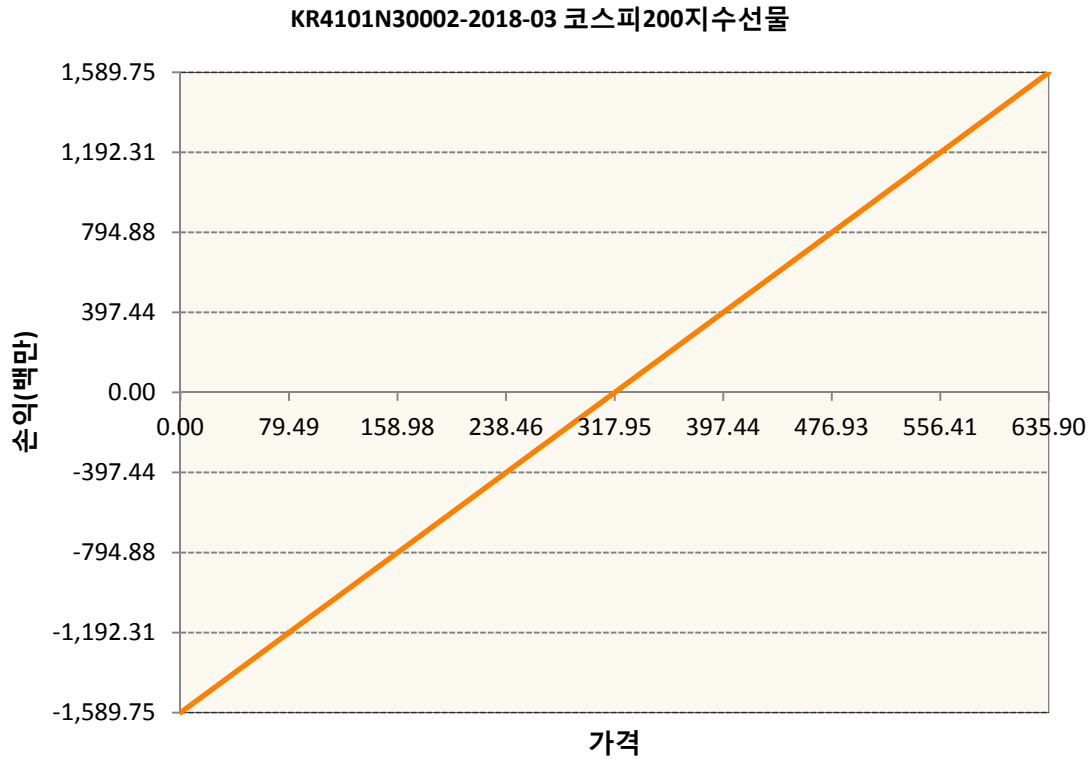
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,590	0	1,590	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%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-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%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

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

75

공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

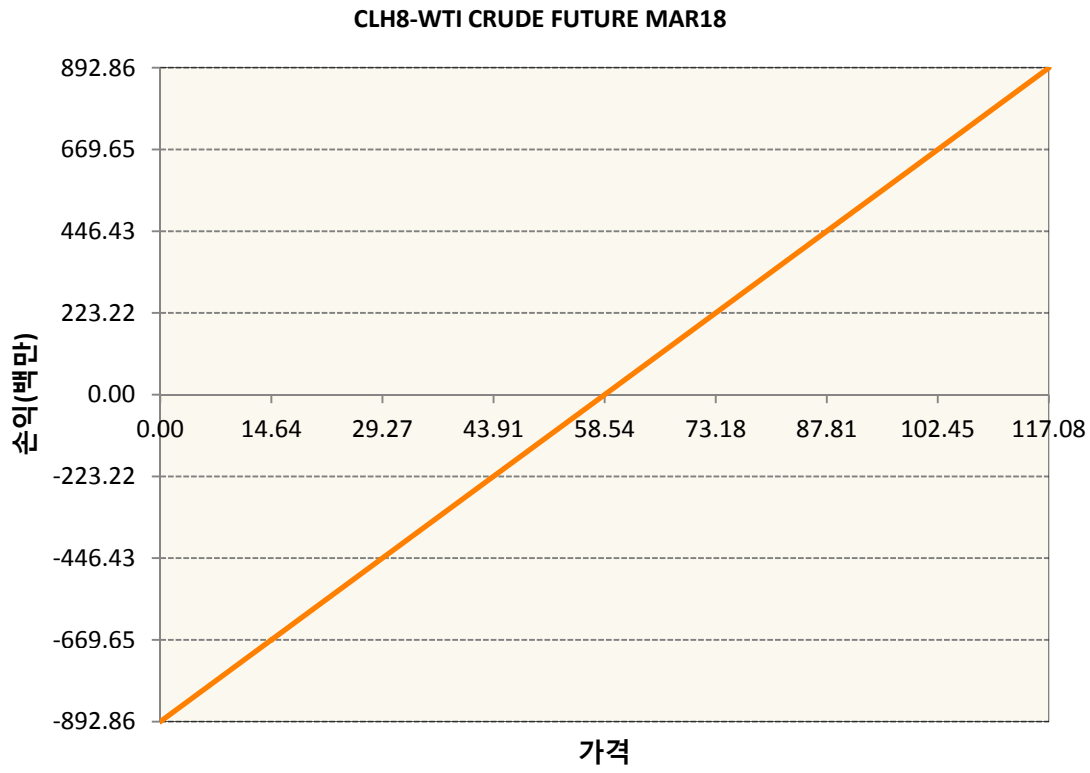
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

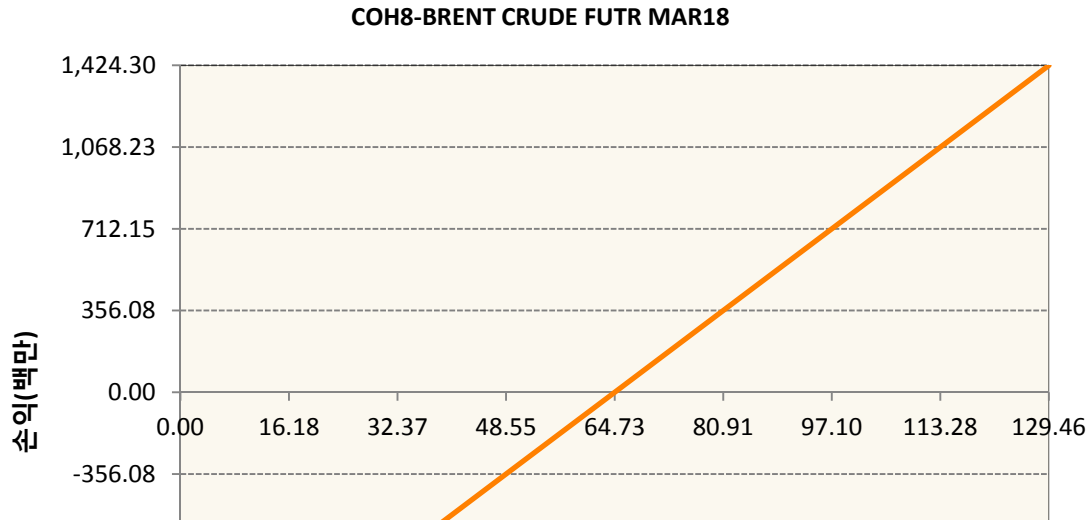
1. 계약금액

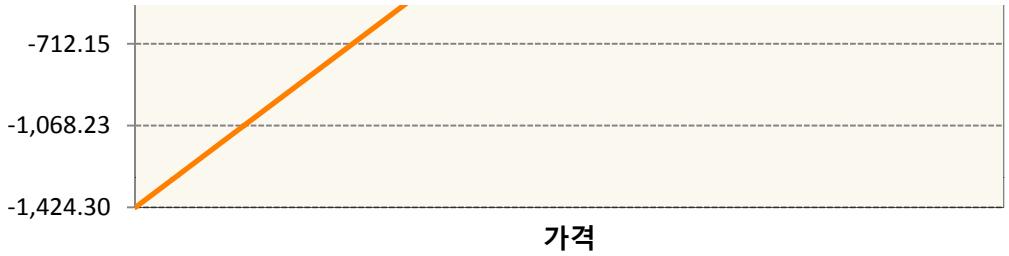
(단위:백만원)

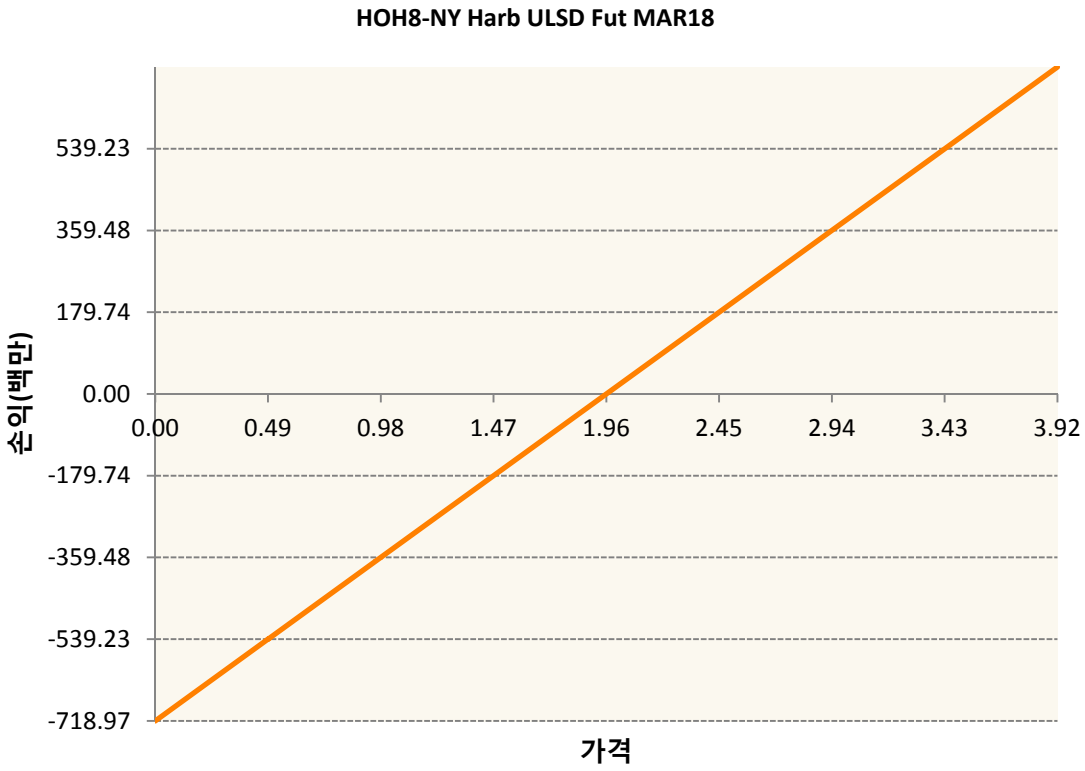
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,688	861	3,828	

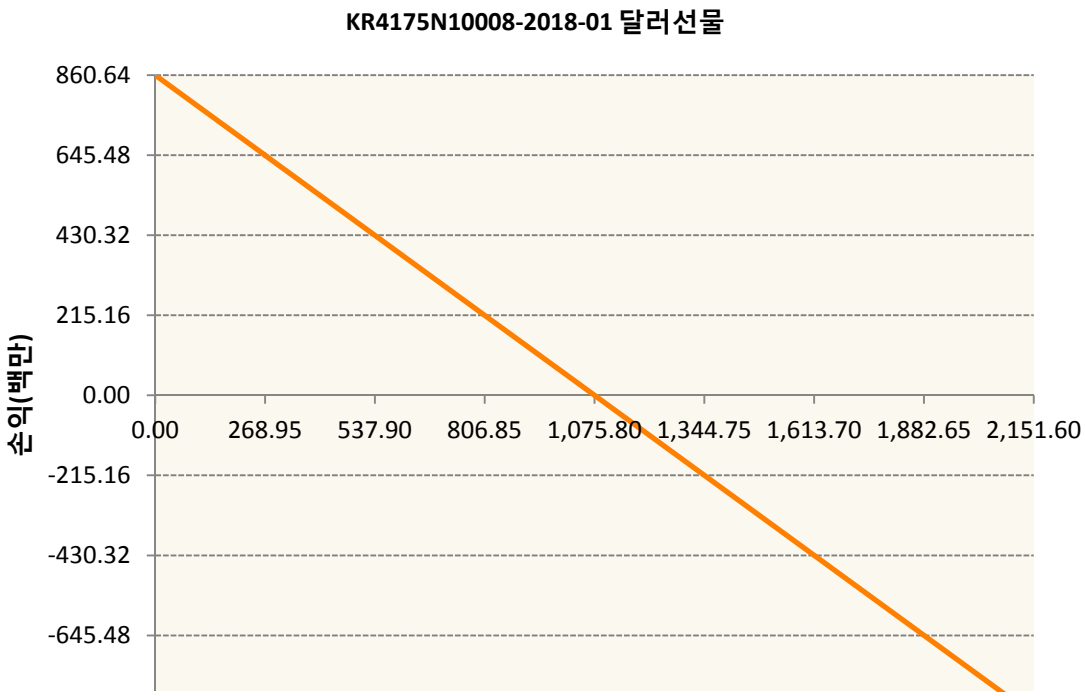
2. 만기시점의 손익구조

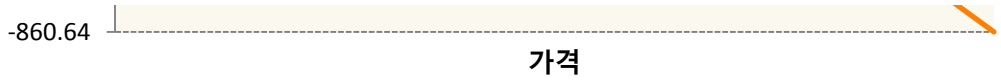


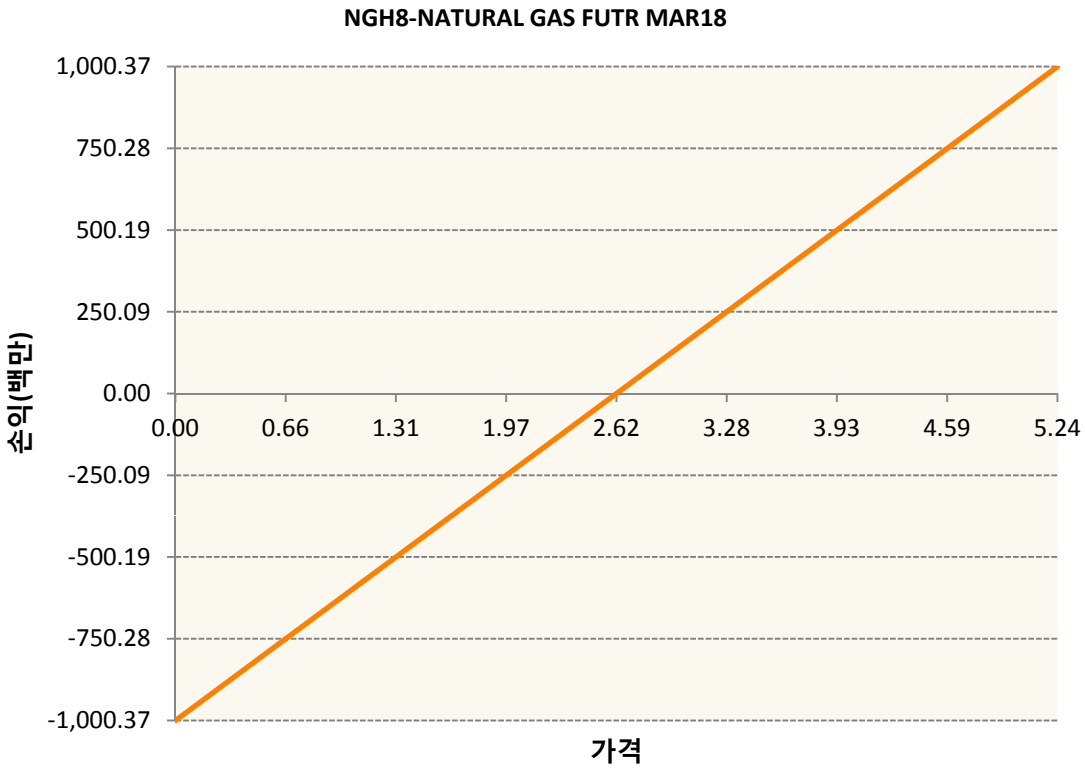


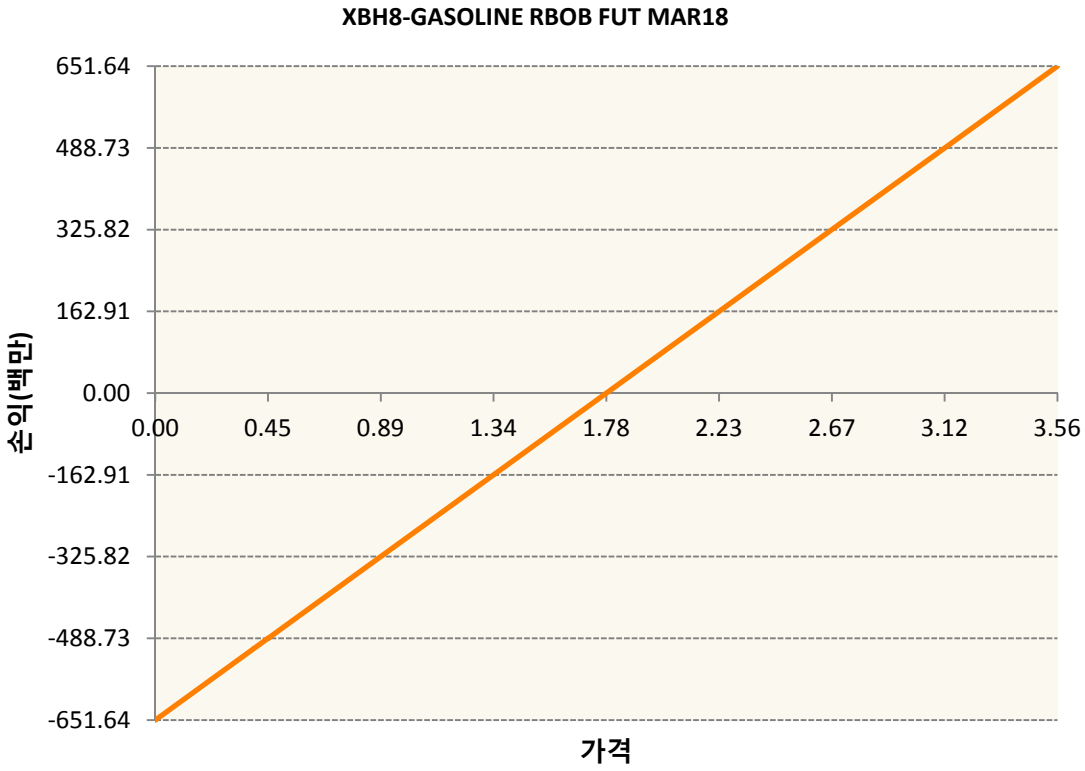

-712.15
-1,068.23
-1,424.30
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
539.23
359.48
179.74
0.00
-179.74
-359.48
-539.23
-718.97
0.00
0.49
0.98
1.47
1.96
2.45
2.94
3.43
3.92
손익(백만)
가격


KR4175N10008-2018-01 달러선물
860.64
645.48
430.32
215.16
0.00
-215.16
-430.32
-645.48
0.00
268.95
537.90
806.85
1,075.80
1,344.75
1,613.70
1,882.65
2,151.60
손익(백만)


-860.64
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,000.37
750.28
500.19
250.09
0.00
-250.09
-500.19
-750.28
-1,000.37
0.00
0.66
1.31
1.97
2.62
3.28
3.93
4.59
5.24
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
651.64
488.73
325.82
162.91
0.00
-162.91
-325.82
-488.73
-651.64
0.00
0.45
0.89
1.34
1.78
2.23
2.67
3.12
3.56
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	71
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	114
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	58
KR4175N10(	2018-01 달러선물	69
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	80
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	52

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

622

공시일	2017-12-27
기준일	2017-12-26

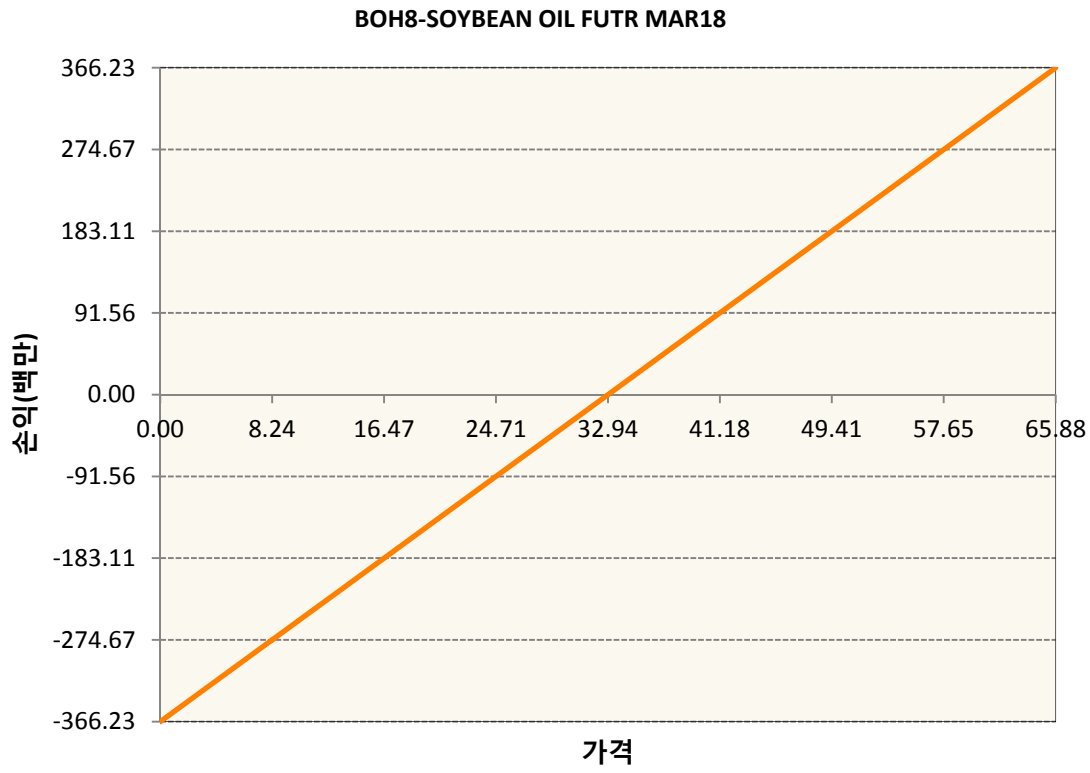
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

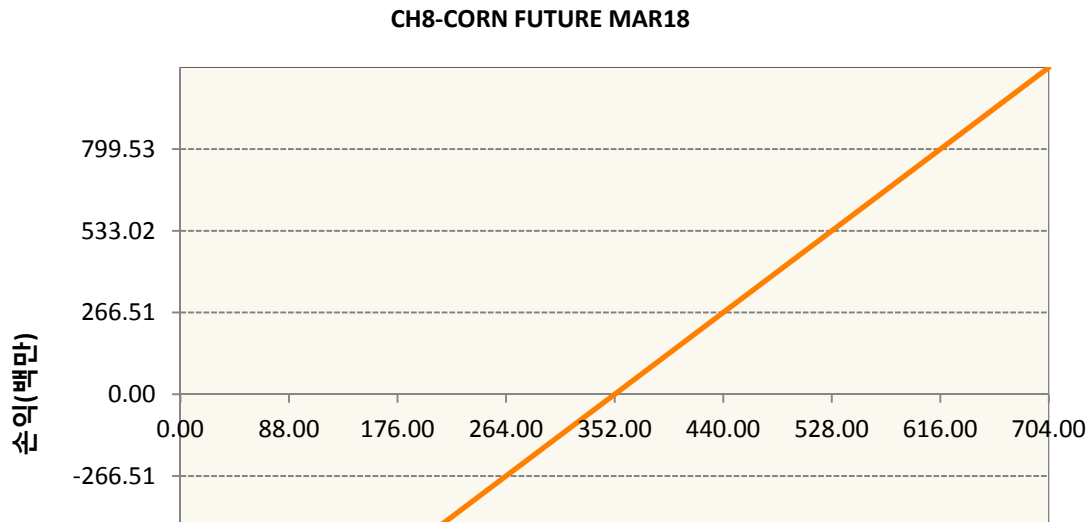
1. 계약금액

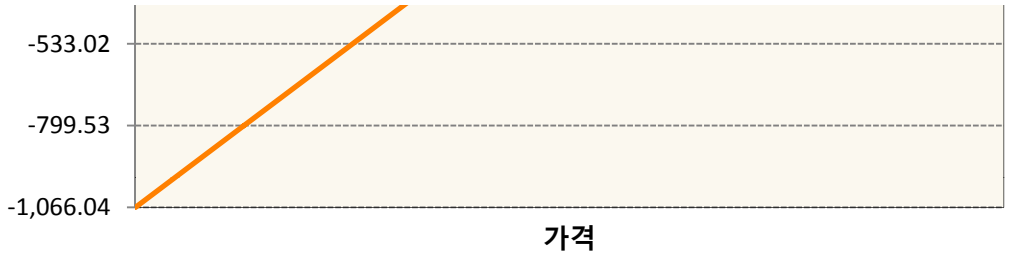
(단위:백만원)

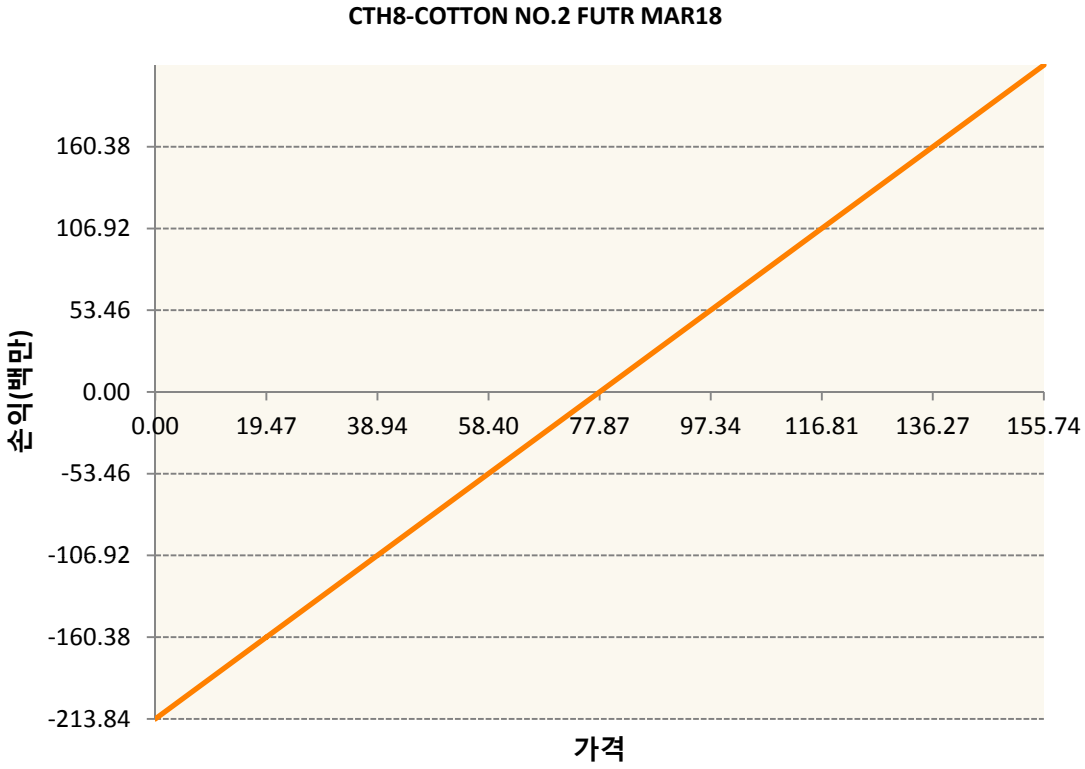
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,221	323	3,898	

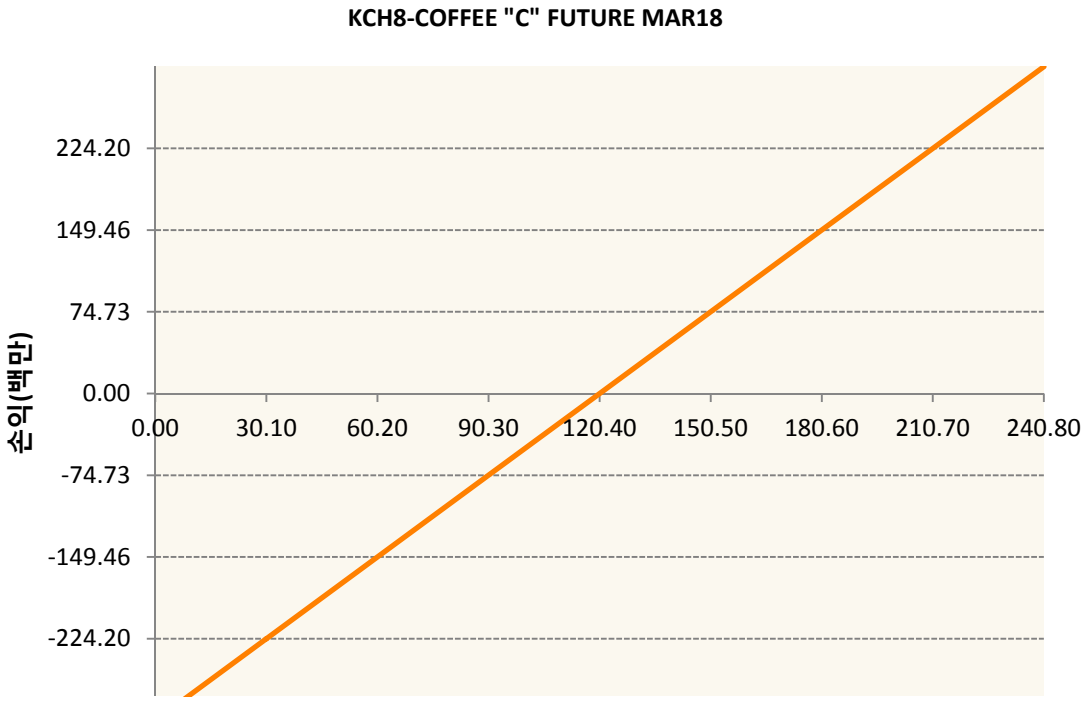
2. 만기시점의 손익구조

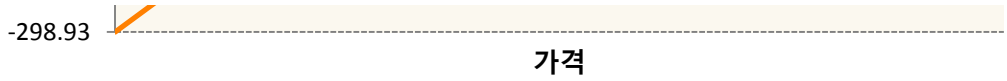


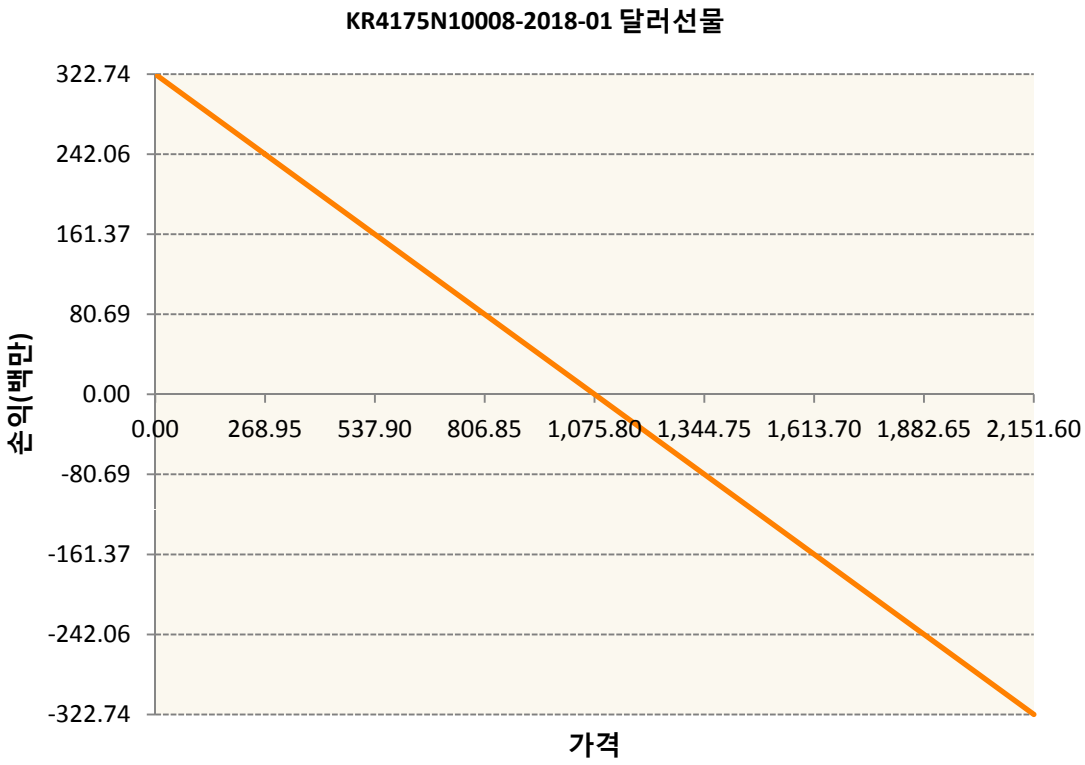


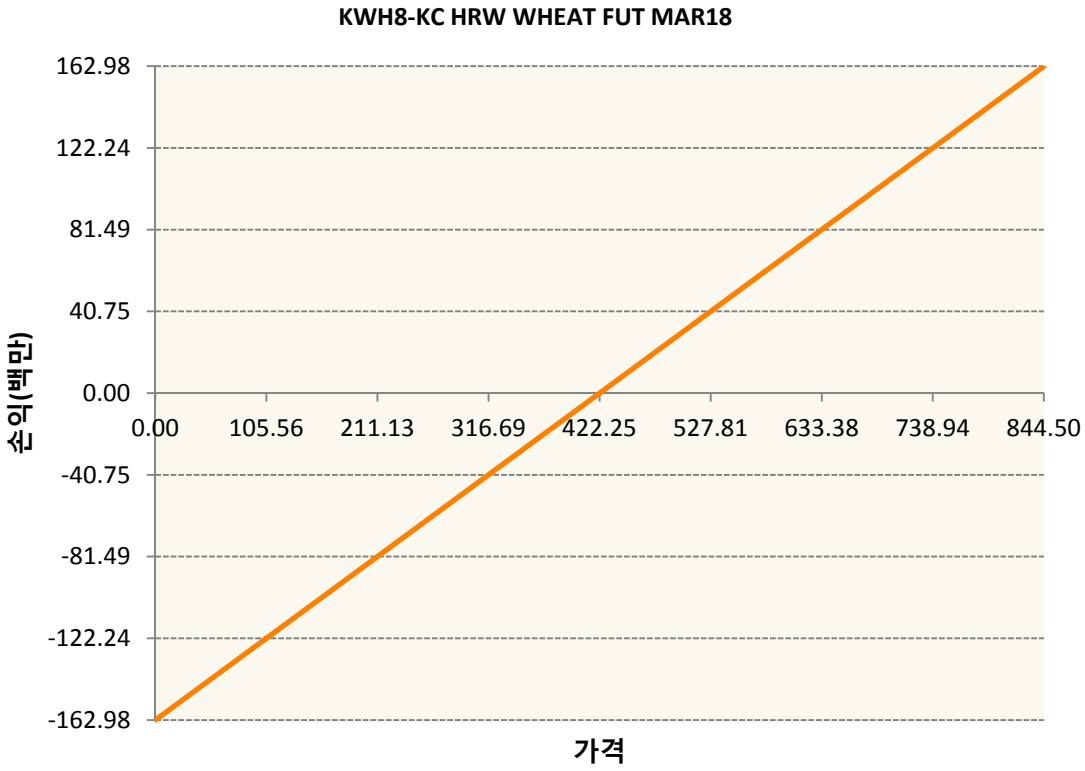

-533.02
-799.53
-1,066.04
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
160.38
106.92
53.46
0.00
-53.46
-106.92
-160.38
-213.84
0.00
19.47
38.94
58.40
77.87
97.34
116.81
136.27
155.74
손익(백만)
가격

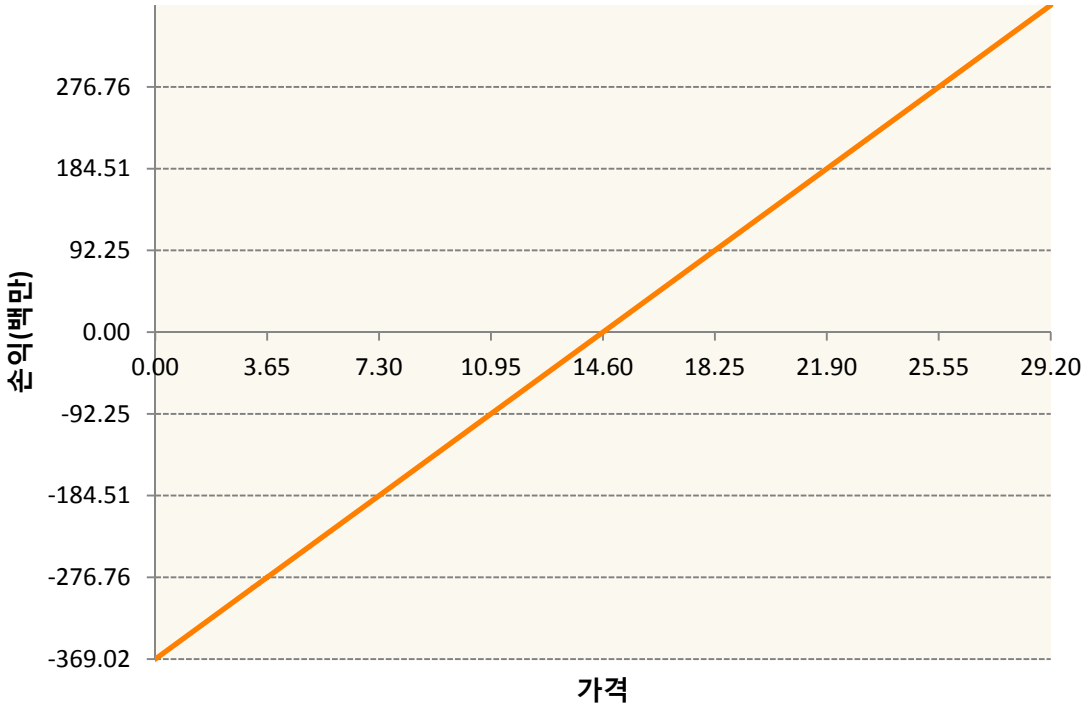

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
224.20
149.46
74.73
0.00
-74.73
-149.46
-224.20
0.00
30.10
60.20
90.30
120.40
150.50
180.60
210.70
240.80
손익(백만)


-298.93
가격

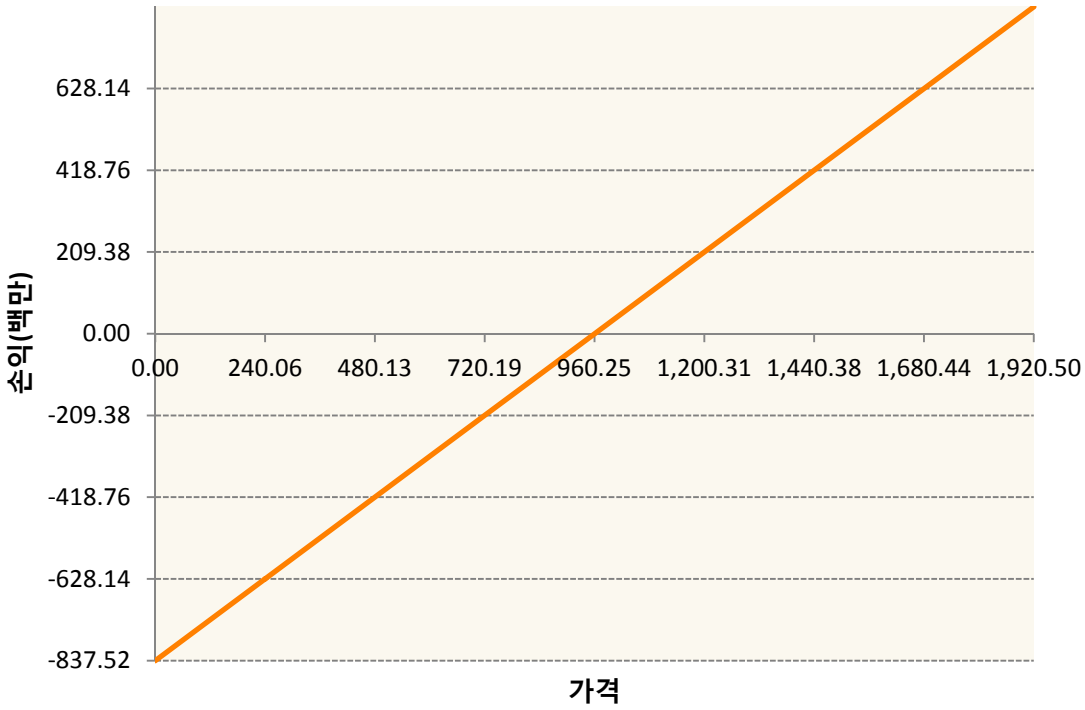

KR4175N10008-2018-01 달러선물
322.74
242.06
161.37
80.69
0.00
-80.69
-161.37
-242.06
-322.74
0.00
268.95
537.90
806.85
1,075.80
1,344.75
1,613.70
1,882.65
2,151.60
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
162.98
122.24
81.49
40.75
0.00
-40.75
-81.49
-122.24
-162.98
0.00
105.56
211.13
316.69
422.25
527.81
633.38
738.94
844.50
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

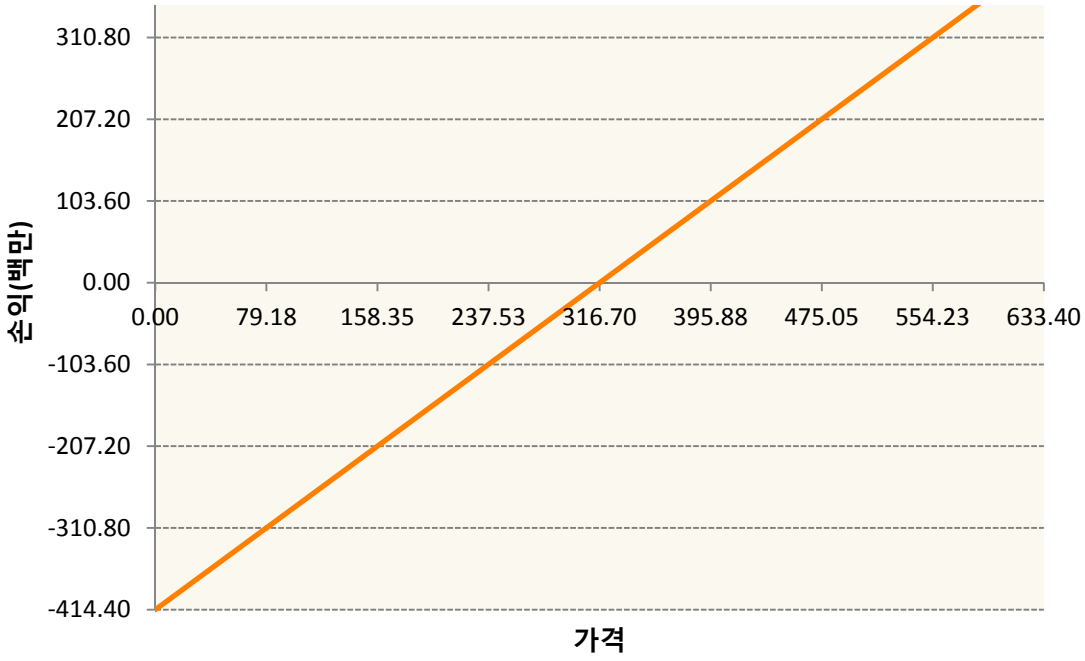


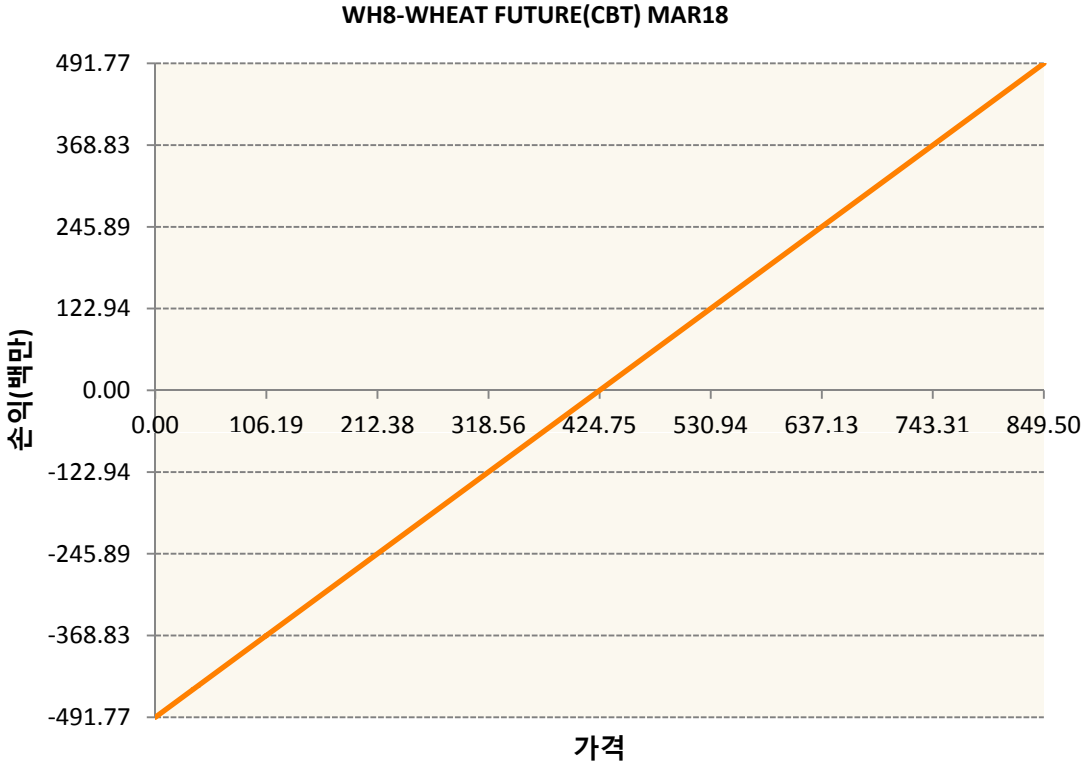
SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18



SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	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	39

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

358