공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

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	2018-01-03
기준일	2018-01-02

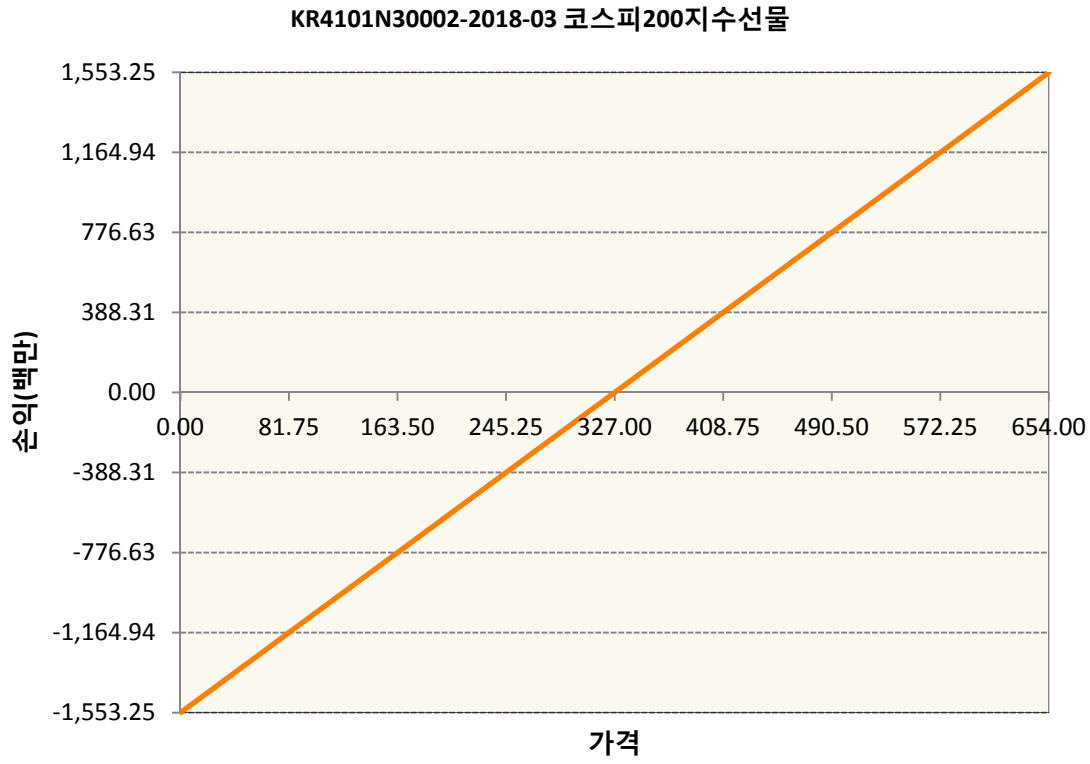
스마트인덱스모

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	1,553	0	1,553	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)

74

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

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	1,100

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

350

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

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	411

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

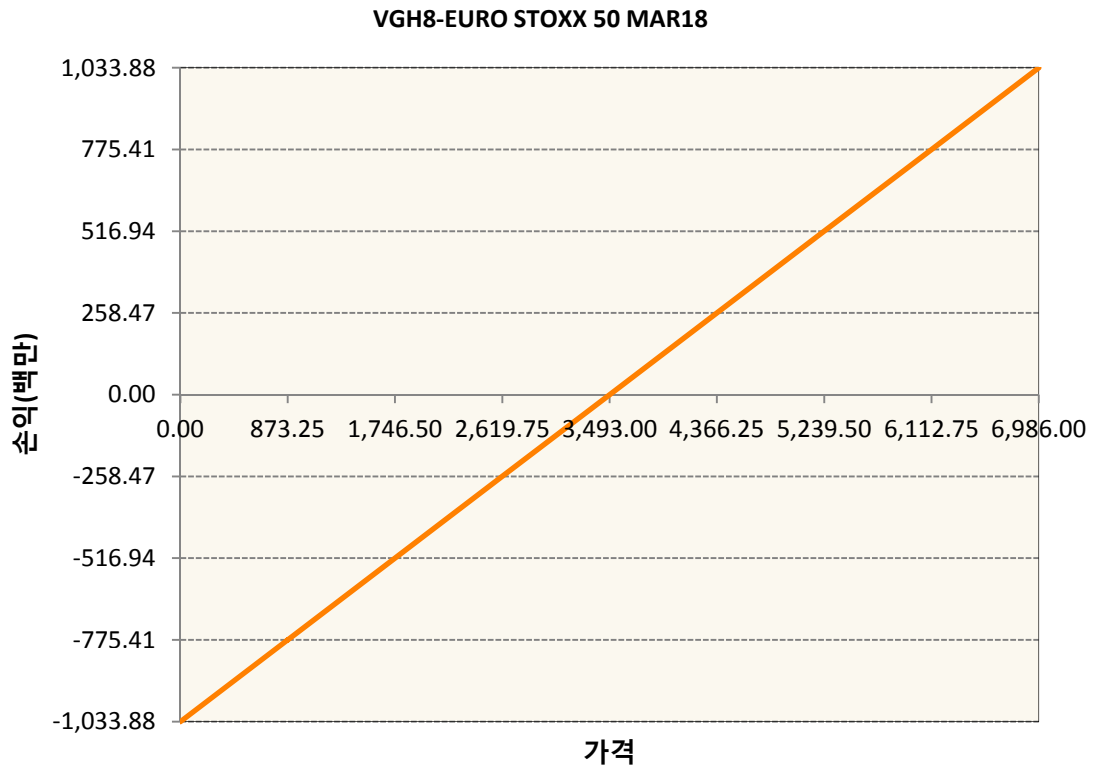
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,034	0	1,034	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	83

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

(단위:백만원)

47

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

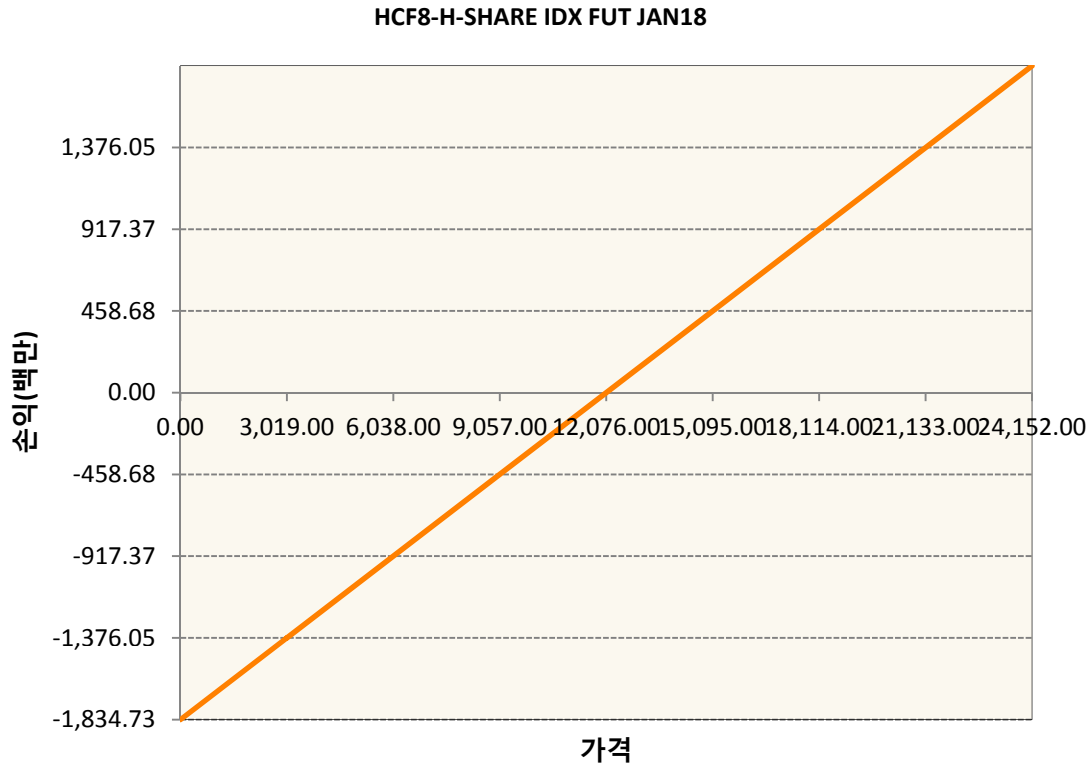
차이나인덱스모(주식-파생형)

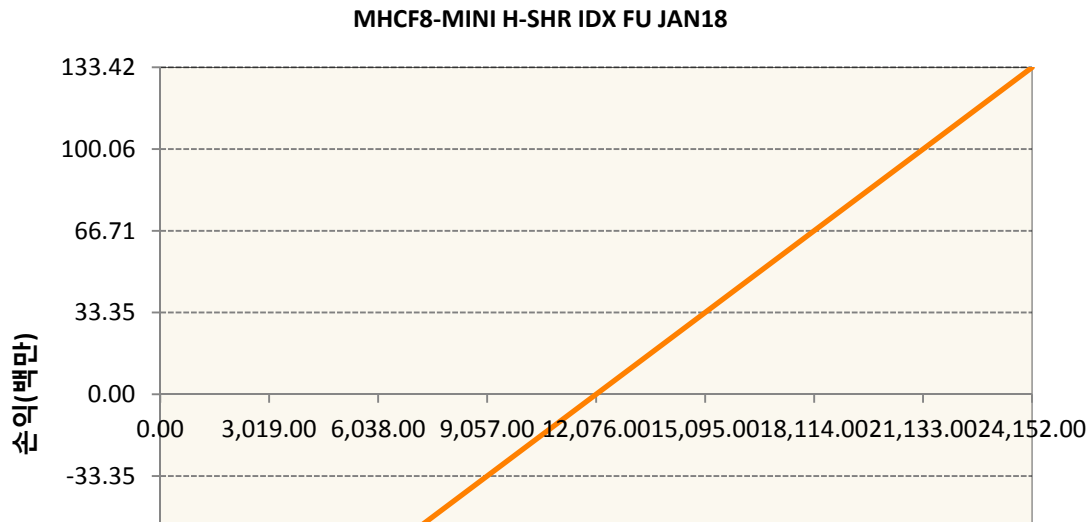
1. 계약금액

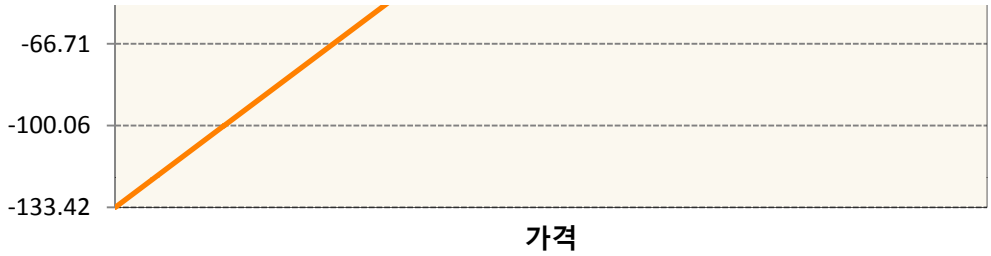
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,968	0	1,968	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	147
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	124

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

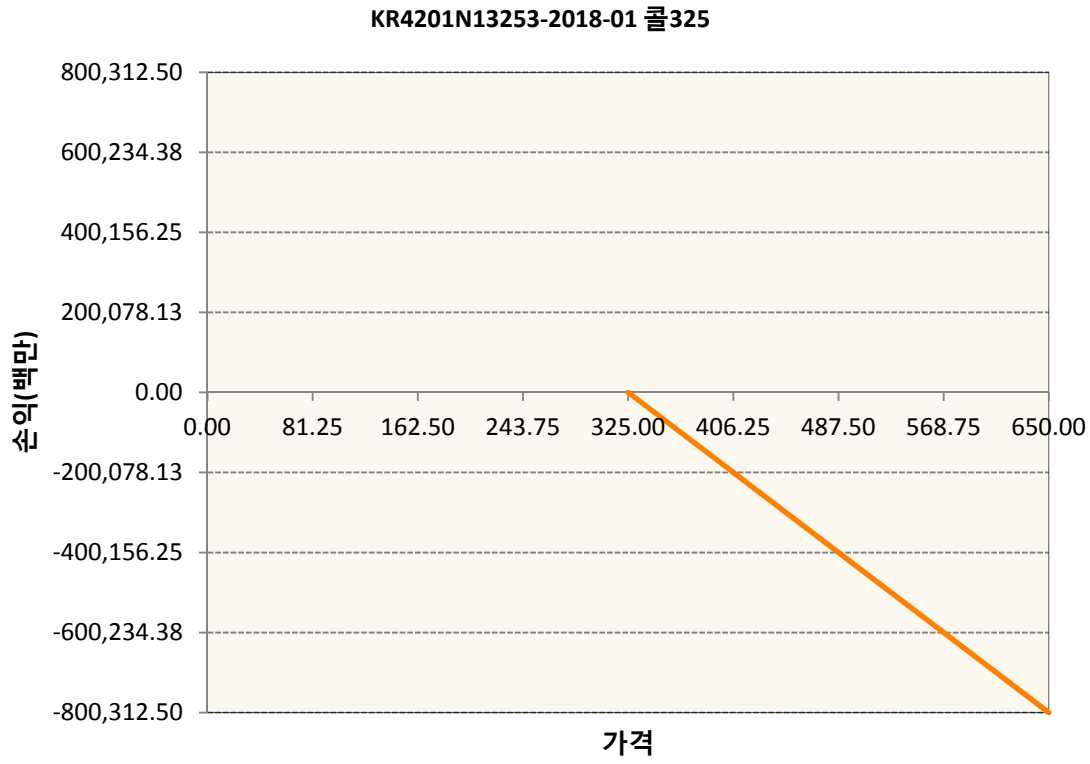
커버드콜모(주식혼합-파생형)

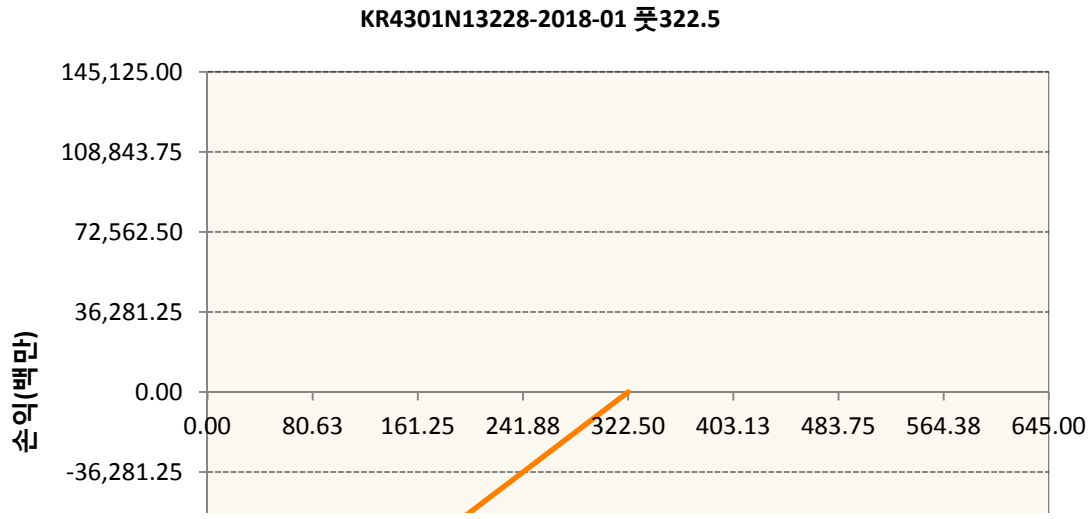
1. 계약금액

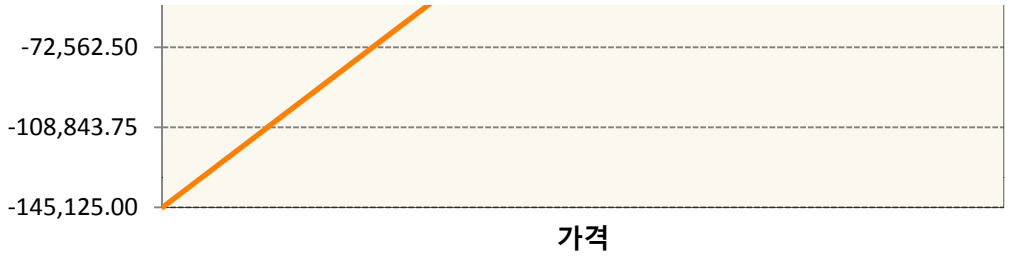
(단위:백만원)

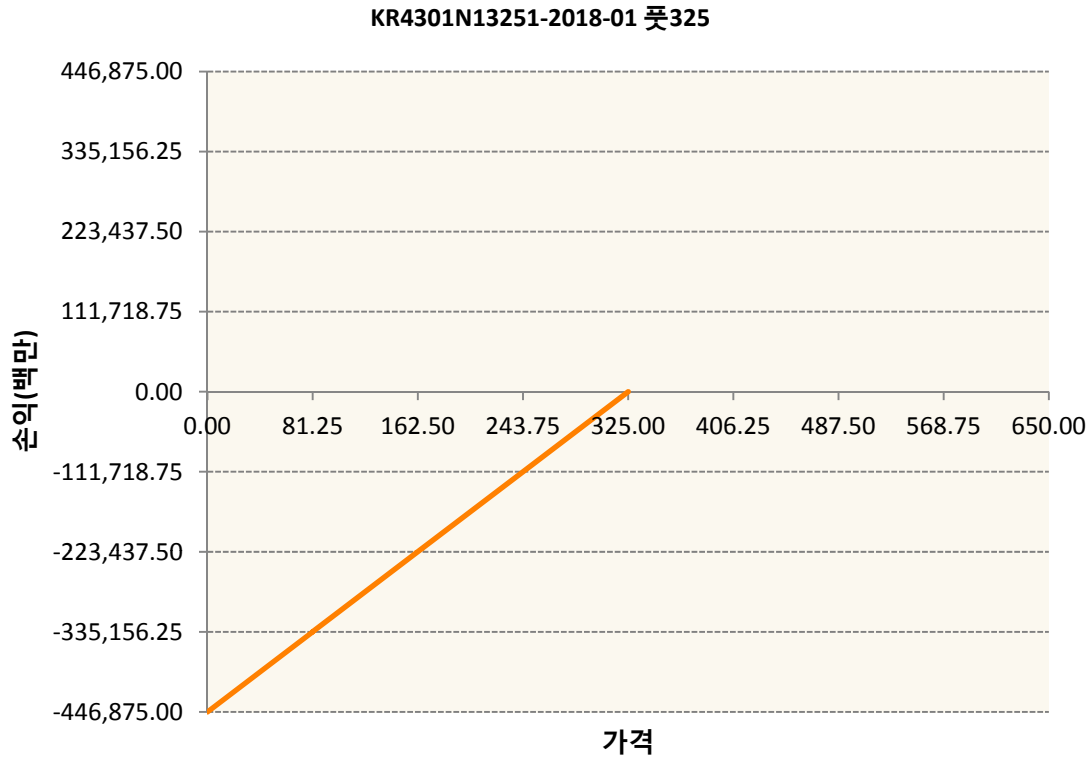
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,392,313	-1,392,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							53,949
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,697	13,665	13,605	13,510	13,374	13,193	12,967
-5.33%	13,376	13,134	12,820	12,440	12,000	11,504	10,960
-2.67%	11,054	10,304	9,511	8,685	7,832	6,958	6,066
0%	3,071	2,048	1,025	0	-1,025	-2,051	-3,077
2.67%	-12,214	-12,865	-13,575	-14,331	-15,125	-15,951	-16,803
5.33%	-31,999	-32,205	-32,482	-32,828	-33,239	-33,709	-34,232
8.00%	-53,164	-53,199	-53,263	-53,365	-53,511	-53,705	-53,949
KR4301N132 2018-01 풋322.5							9,599
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,597	-9,597	-9,597	-9,597	-9,598	-9,598	-9,599

-5.33%	-5,687	-5,689	-5,693	-5,700	-5,710	-5,724	-5,742
-2.67%	-1,931	-1,988	-2,050	-2,117	-2,188	-2,261	-2,338
0%	236	161	82	0	-84	-169	-256
2.67%	522	517	507	492	473	449	420
5.33%	527	527	527	526	525	523	520
8.00%	527	527	527	527	527	527	527
	KR4301N132	2018-01 풋325					31,513

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31,511	-31,511	-31,511	-31,511	-31,511	-31,512	-31,513
-5.33%	-19,561	-19,562	-19,566	-19,573	-19,587	-19,607	-19,636
-2.67%	-7,766	-7,860	-7,976	-8,110	-8,262	-8,429	-8,608
0%	872	582	292	0	-292	-585	-878
2.67%	2,800	2,749	2,679	2,589	2,481	2,356	2,216
5.33%	2,860	2,859	2,857	2,853	2,844	2,830	2,808
8.00%	2,860	2,860	2,860	2,860	2,860	2,859	2,858

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

111,090

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

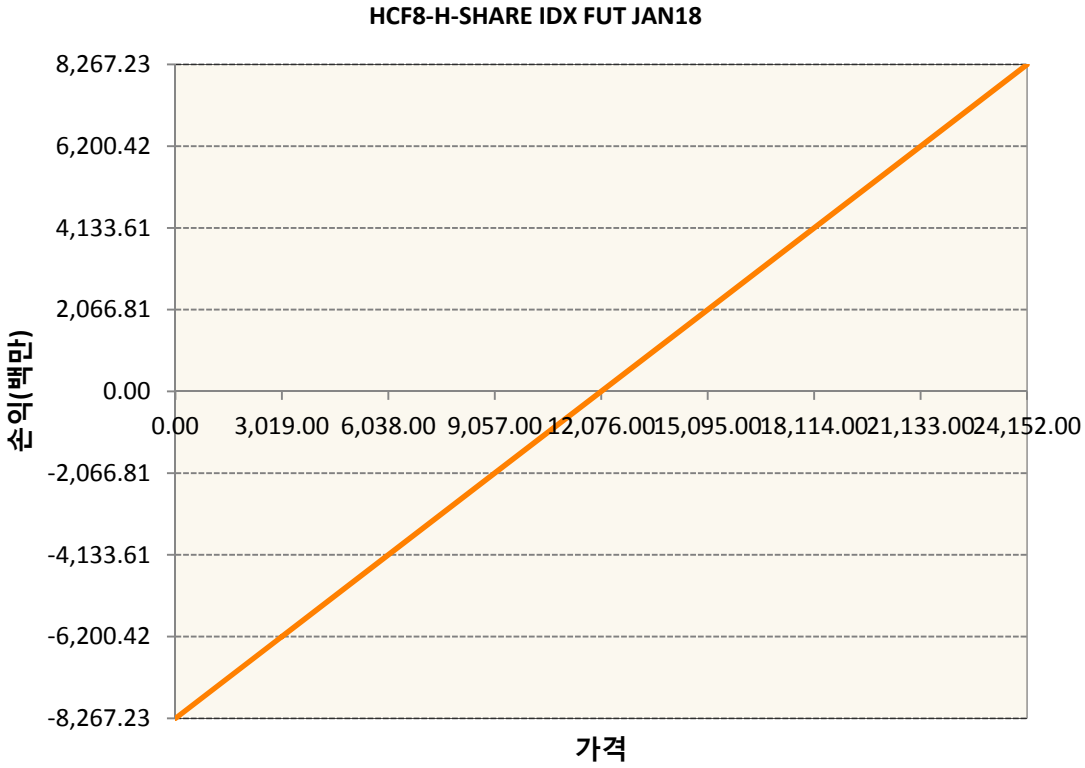
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

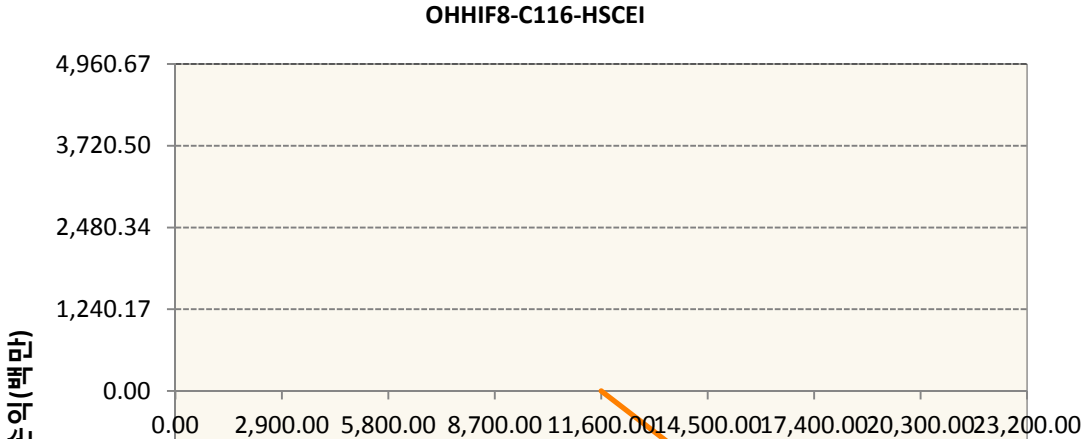
1. 계약금액

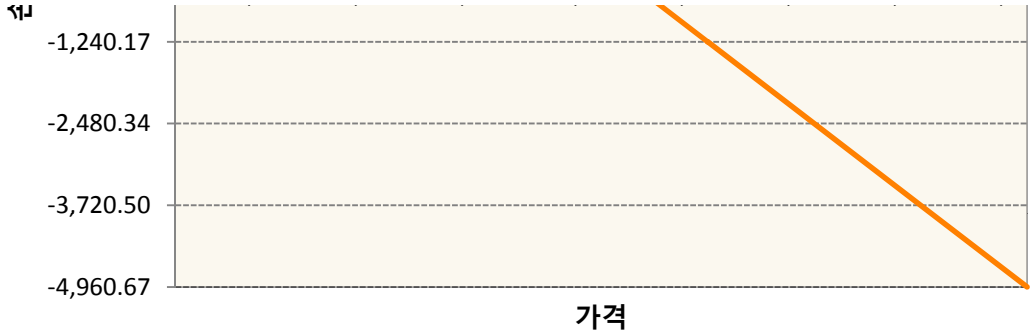
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,267	0	8,267	장내
누계	유가증권	옵션	0	17,130	-17,130	장내

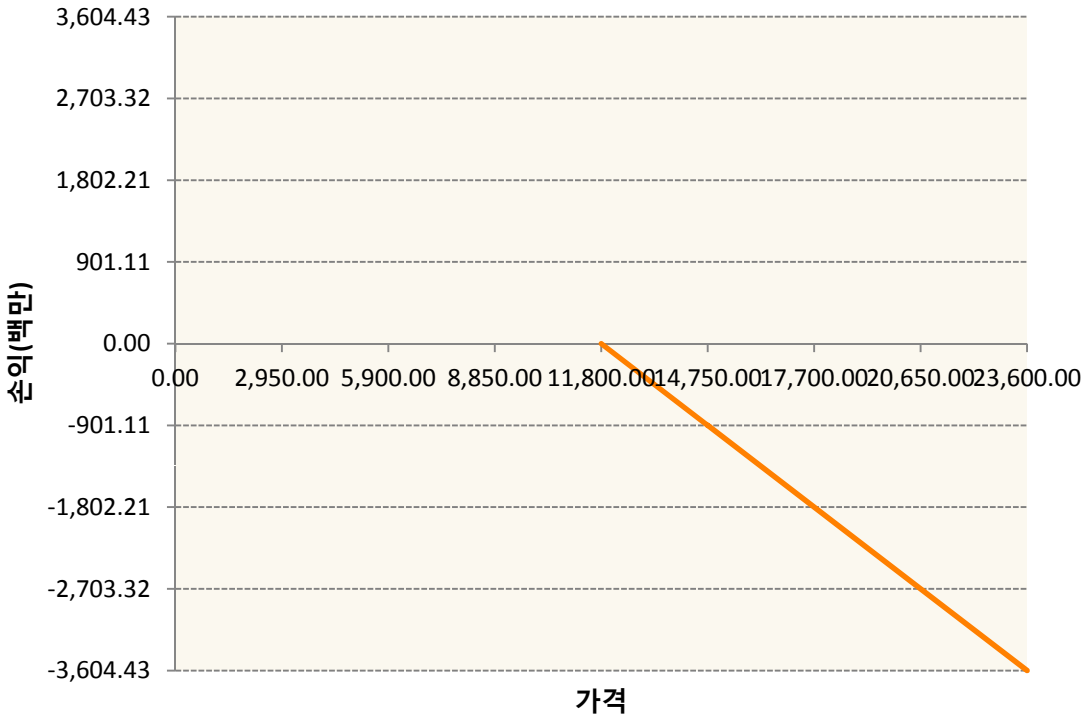
2. 만기시점의 손익구조



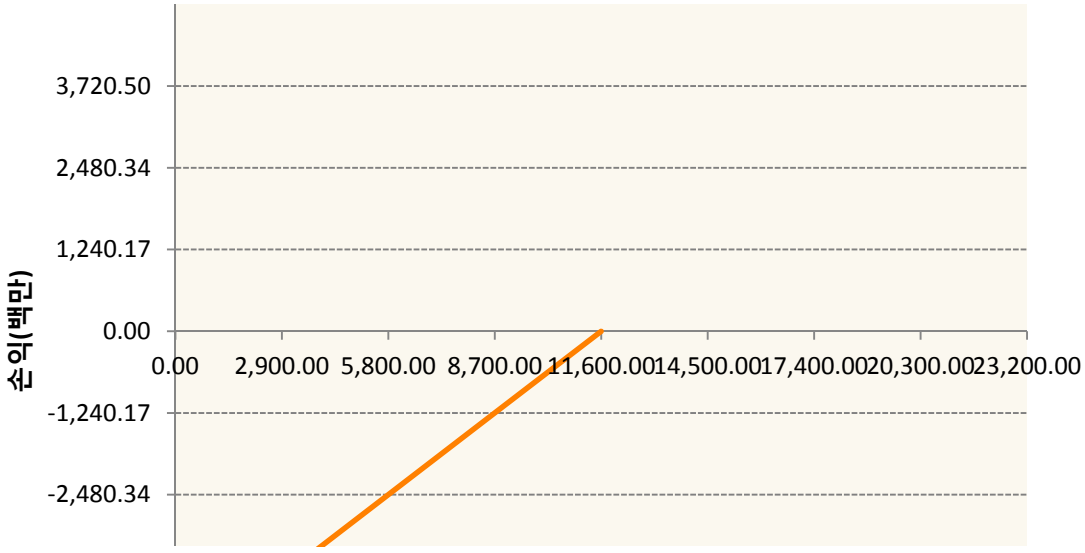


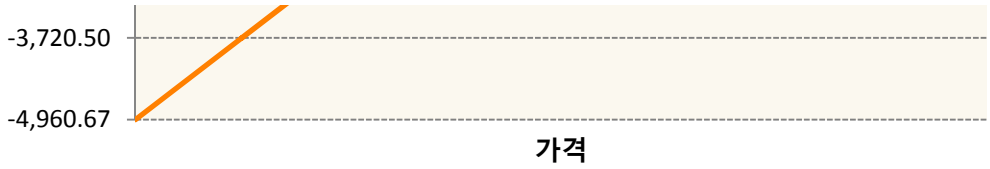


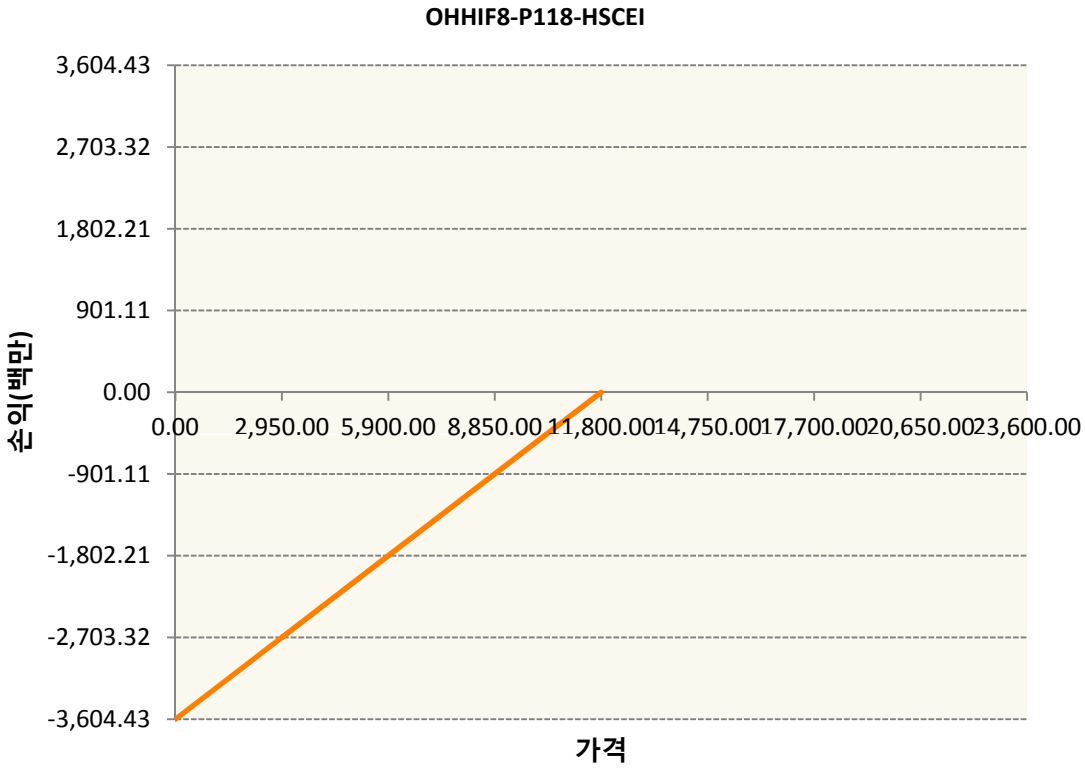
OHHIF8-C118-HSCEI



OHHIF8-P116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	661
OHHIF8-C11	HSCEI	397
OHHIF8-C11	HSCEI	288
OHHIF8-P11	HSCEI	397
OHHIF8-P11	HSCEI	288

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,604

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

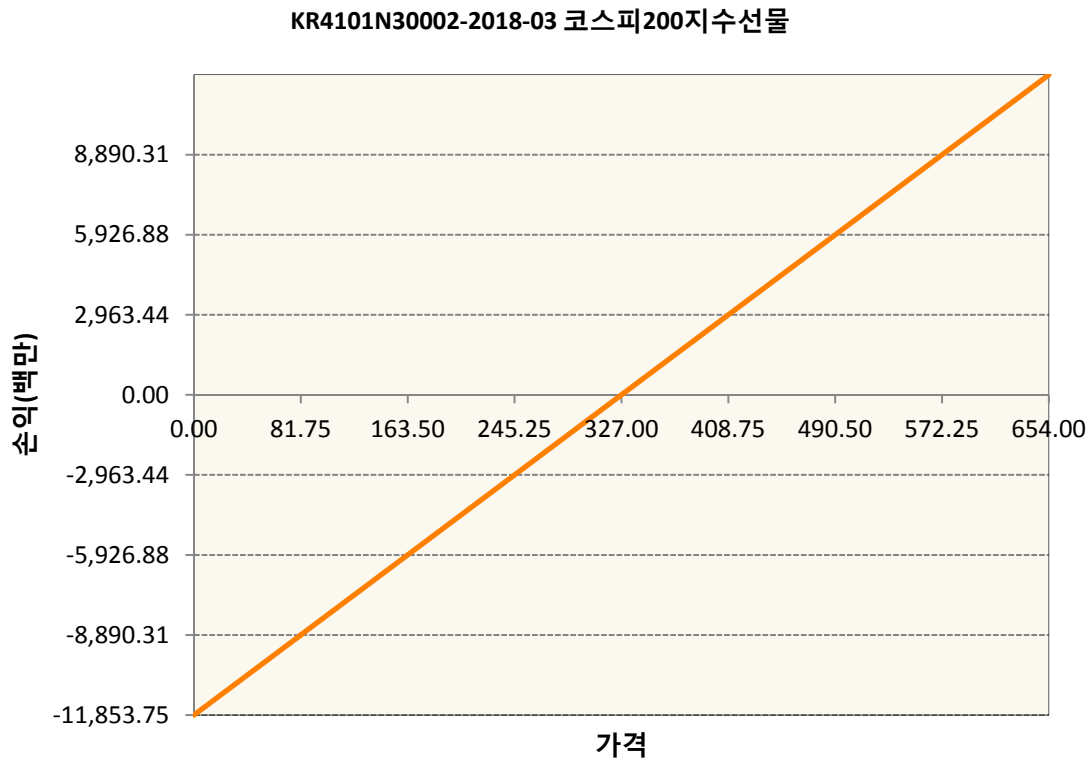
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

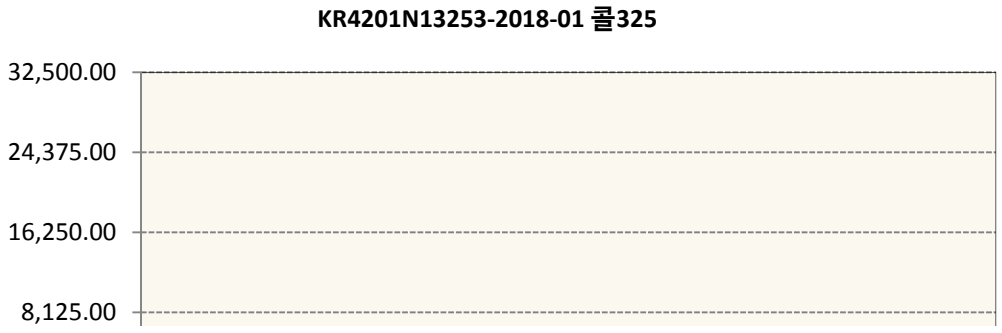
1. 계약금액

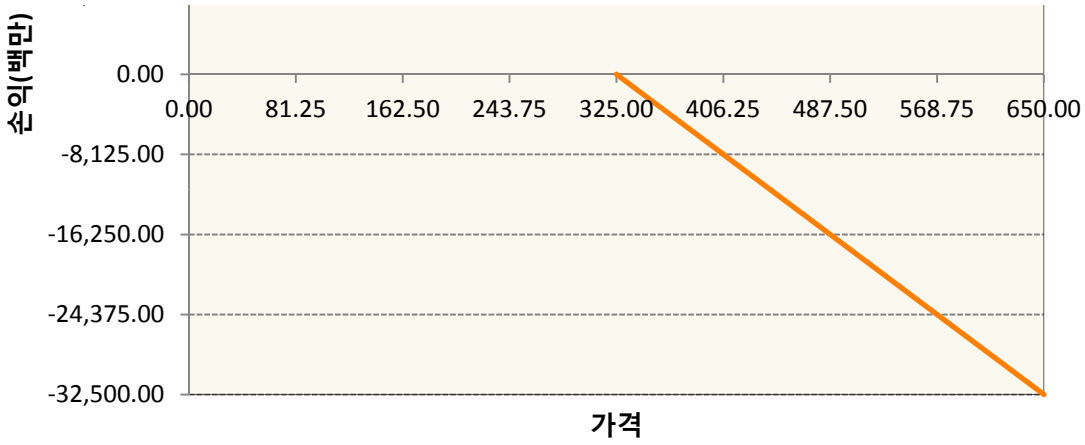
(단위:백만원)

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	11,854	0	11,854	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,875	-60,875	장내

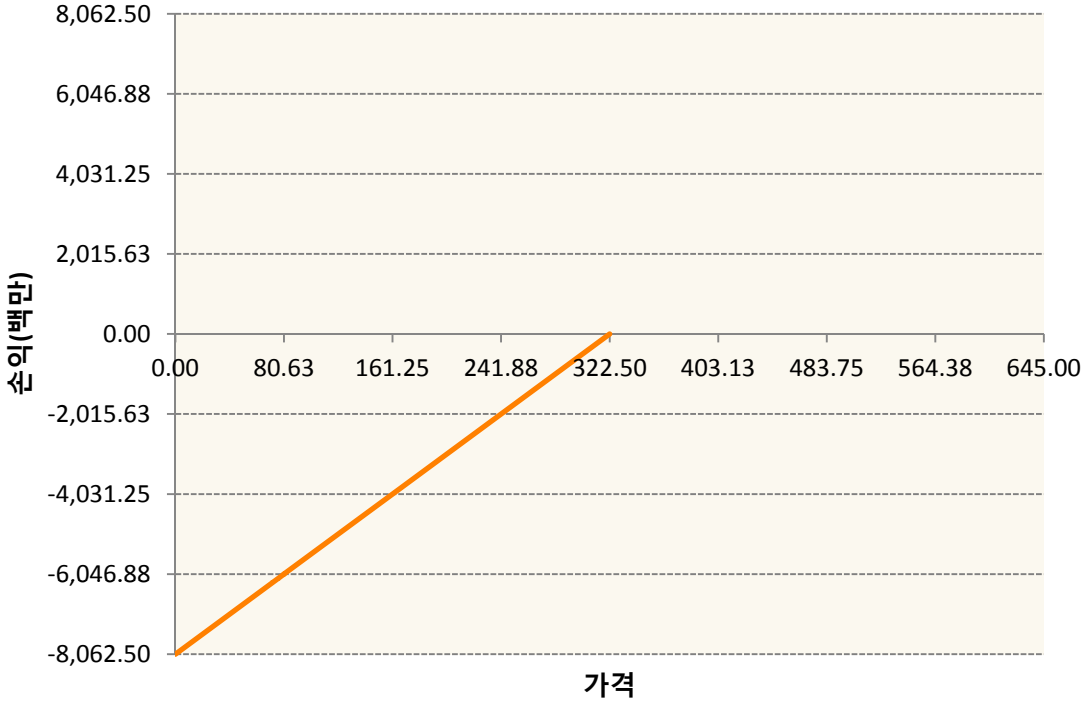
2. 만기시점의 손익구조



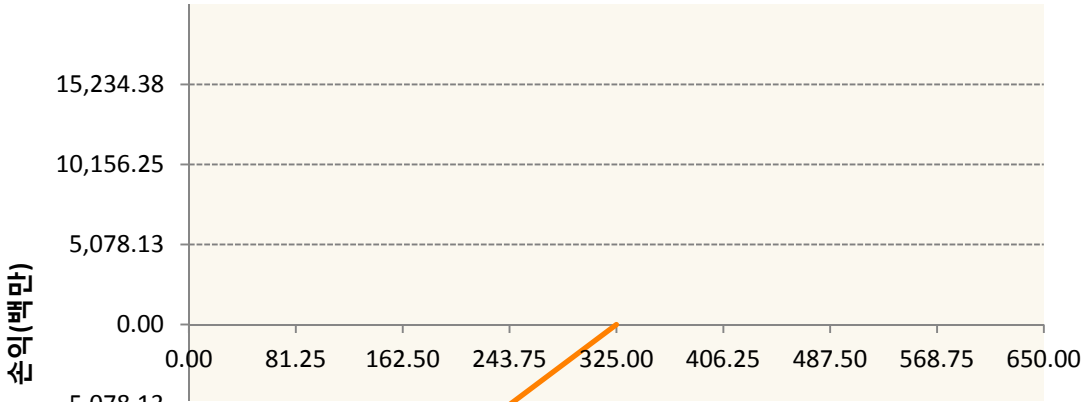




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,444
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444	-1,444
-5.33%	-963	-963	-963	-963	-963	-963	-963
-2.67%	-481	-481	-481	-481	-481	-481	-481
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	481	481	481	481	481	481	481
5.33%	963	963	963	963	963	963	963
8.00%	1,444	1,444	1,444	1,444	1,444	1,444	1,444
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4							156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	156	156	156	156	156	156	156
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							234
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-234	-234	-234	-234	-234	-234	-234
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	234	234	234	234	234	234	234
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	195	195	195	195	195	195	195
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						250
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	250	250	250	250	250	250	250
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-462	-462	-462	-462	-462	-462	-462
-5.33%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	308	308	308	308	308	308	308
8.00%	462	462	462	462	462	462	462
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						308
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-308	-308	-308	-308	-308	-308	-308
-5.33%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	205	205	205	205	205	205	205
8.00%	308	308	308	308	308	308	308
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						273
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
-5.33%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	182	182	182	182	182	182	182
8.00%	273	273	273	273	273	273	273
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						624
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-624	-624	-624	-624	-624	-624	-624
-5.33%	-416	-416	-416	-416	-416	-416	-416
-2.67%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	208	208	208	208	208	208	208
5.33%	416	416	416	416	416	416	416
8.00%	624	624	624	624	624	624	624
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						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
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						945
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-945	-945	-945	-945	-945	-945	-945
-5.33%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630
-2.67%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	315	315	315	315	315	315	315
5.33%	630	630	630	630	630	630	630
8.00%	945	945	945	945	945	945	945
	KR4201N13: 2018-01 콜325						2,191

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	556	555	552	549	543	536	527
-5.33%	543	533	521	505	487	467	445
-2.67%	449	418	386	353	318	283	246
0%	125	83	42	0	-42	-83	-125
2.67%	-496	-522	-551	-582	-614	-648	-682
5.33%	-1,299	-1,308	-1,319	-1,333	-1,350	-1,369	-1,390
8.00%	-2,159	-2,160	-2,163	-2,167	-2,173	-2,181	-2,191
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						533

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-533	-533	-533	-533	-533	-533	-533
-5.33%	-316	-316	-316	-317	-317	-318	-319
-2.67%	-107	-110	-114	-118	-122	-126	-130
0%	13	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	29	29	28	27	26	25	23
5.33%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	29	29	29	29	29	29	29
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,432

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,432	-1,432	-1,432	-1,432	-1,432	-1,432	-1,432
-5.33%	-889	-889	-889	-890	-890	-891	-893
-2.67%	-353	-357	-363	-369	-376	-383	-391
0%	40	26	13	0	-13	-27	-40
2.67%	127	125	122	118	113	107	101
5.33%	130	130	130	130	129	129	128
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

10,125

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

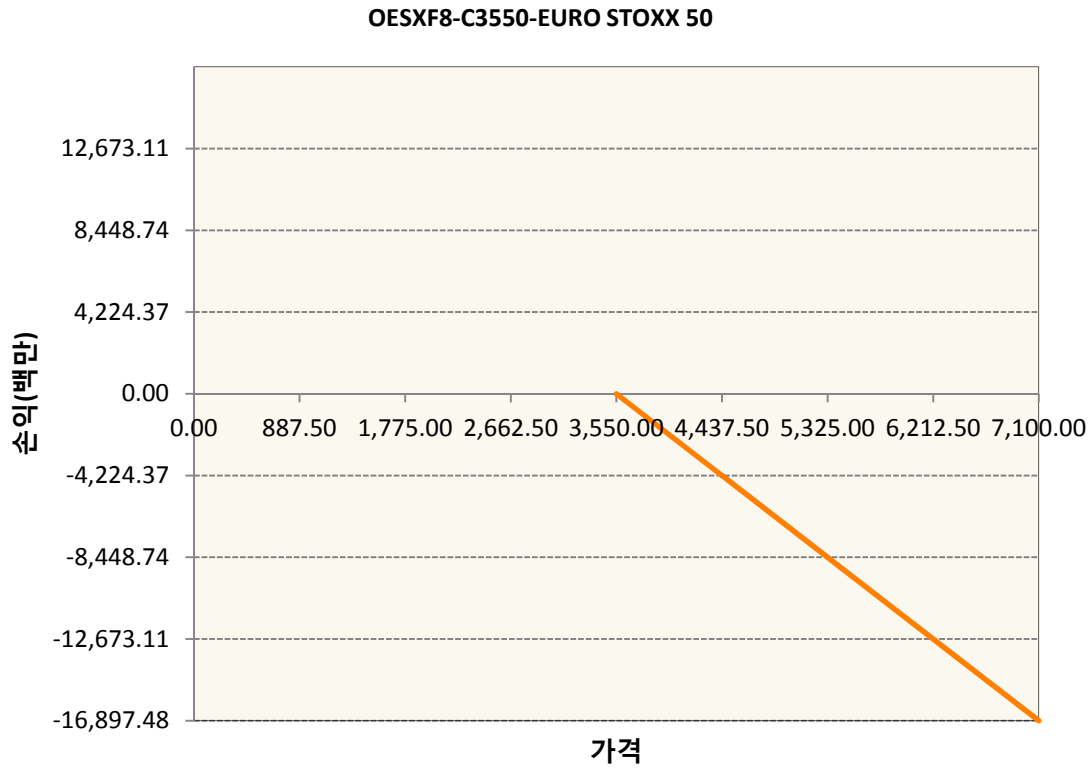
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

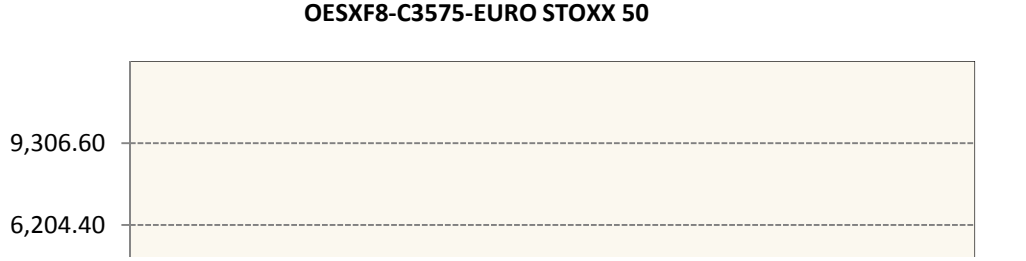
1. 계약금액

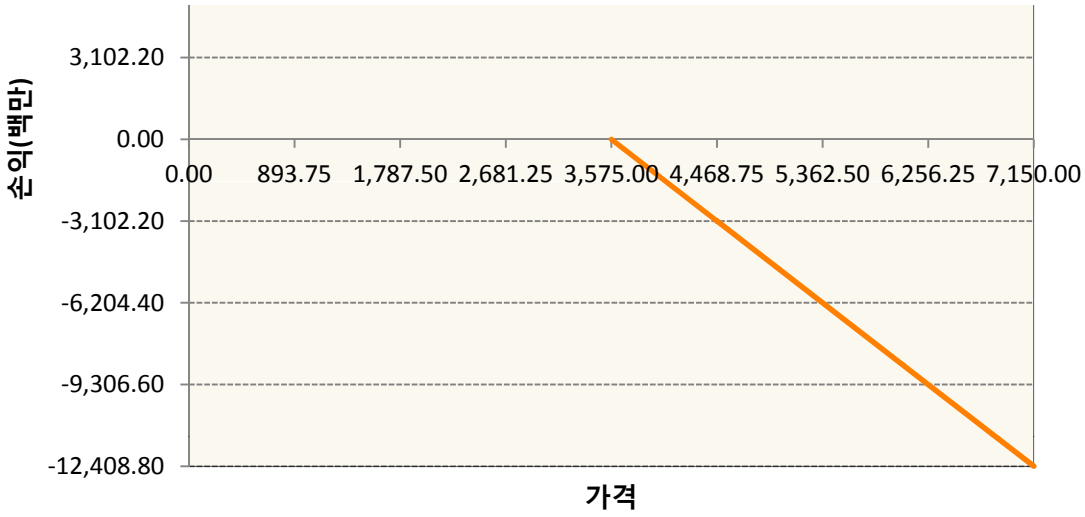
(단위:백만원)

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	20,760	0	20,760	
누계	유가증권	스왑	95,707	0	95,707	장외
누계	유가증권	옵션	0	58,613	-58,613	장내
누계	지수	스왑	51,044	0	51,044	장외

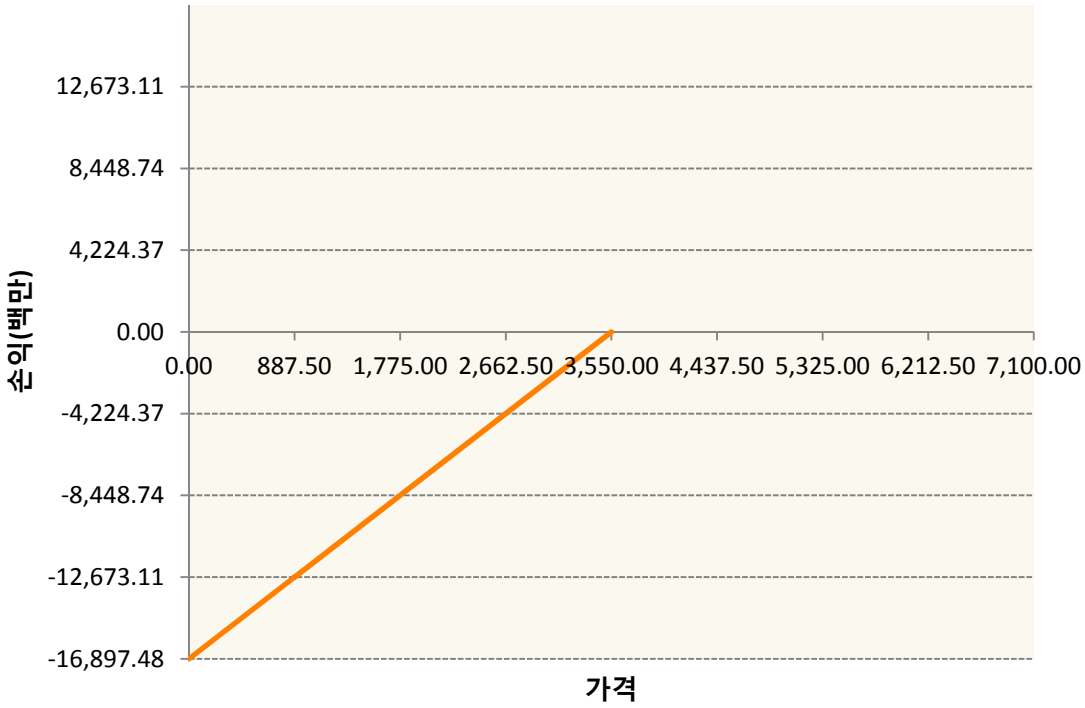
2. 만기시점의 손익구조



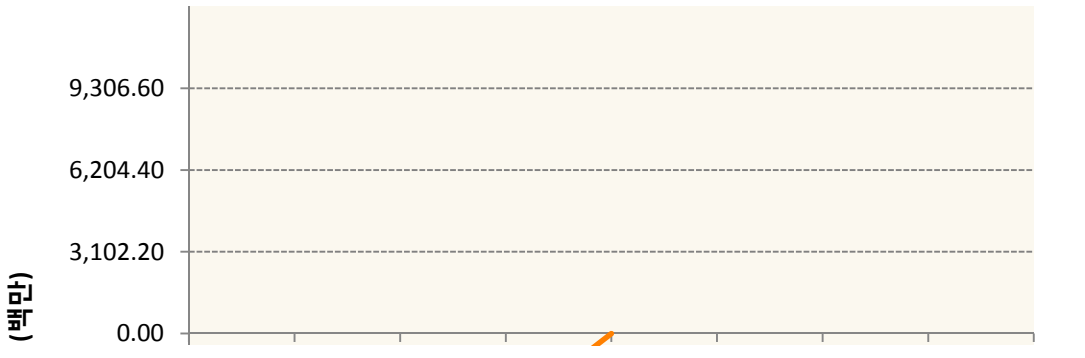


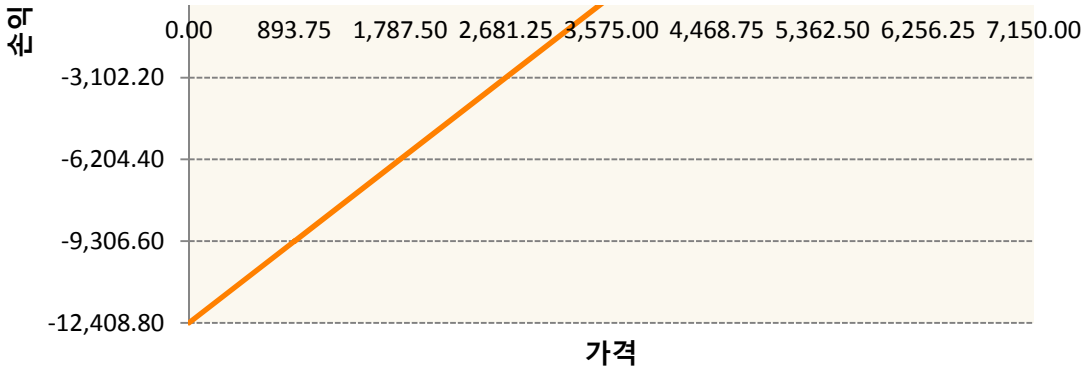


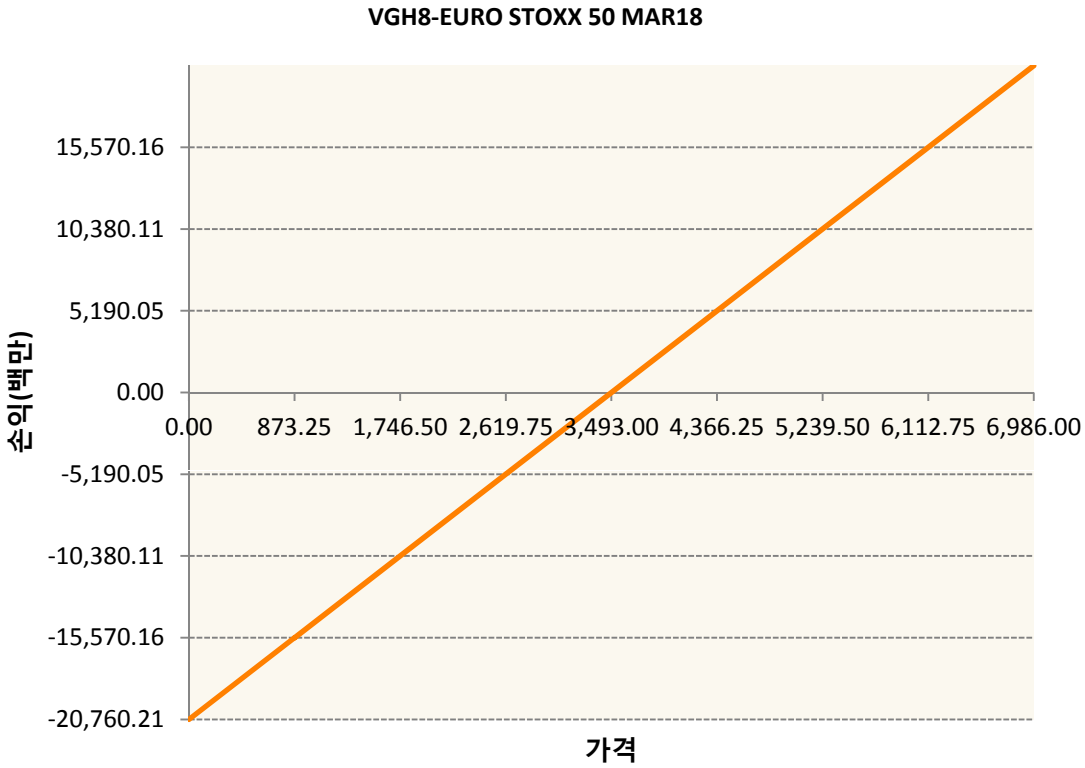
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	25
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	5
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,352
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	993
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,352
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	993
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,661

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

3,603

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

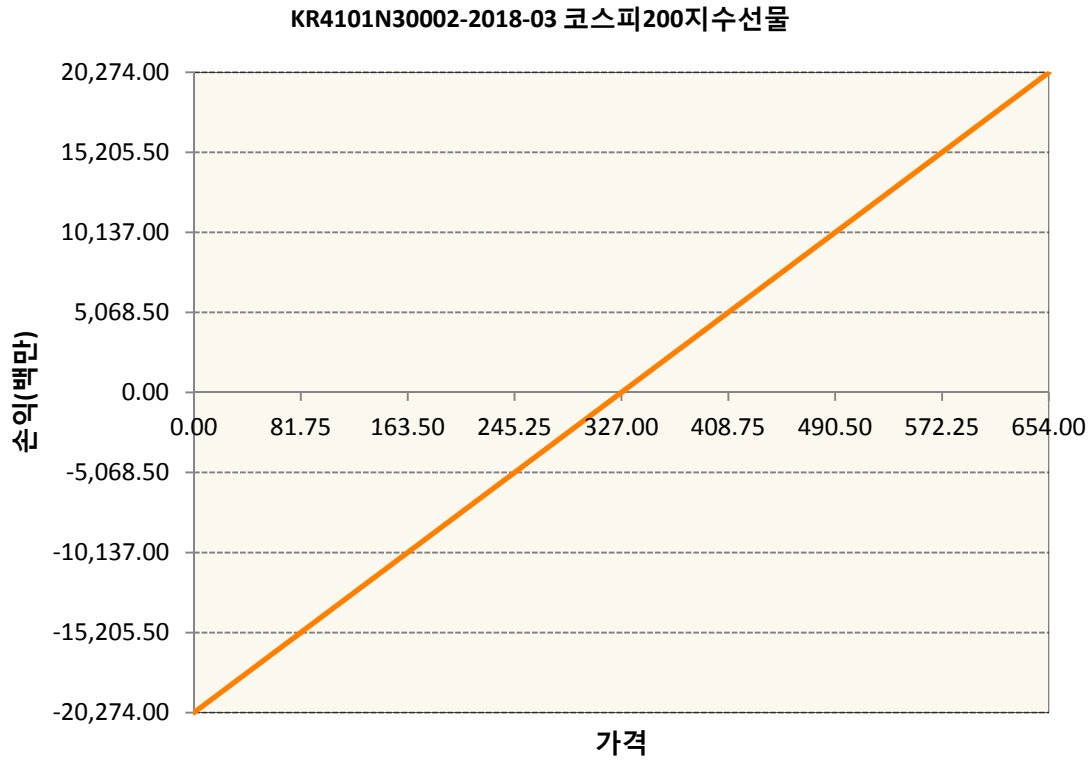
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,274	0	20,274	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,617
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,617	-1,617	-1,617	-1,617	-1,617	-1,617	-1,617
-5.33%	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078
-2.67%	-539	-539	-539	-539	-539	-539	-539
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	539	539	539	539	539	539	539
5.33%	1,078	1,078	1,078	1,078	1,078	1,078	1,078
8.00%	1,617	1,617	1,617	1,617	1,617	1,617	1,617

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

960

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

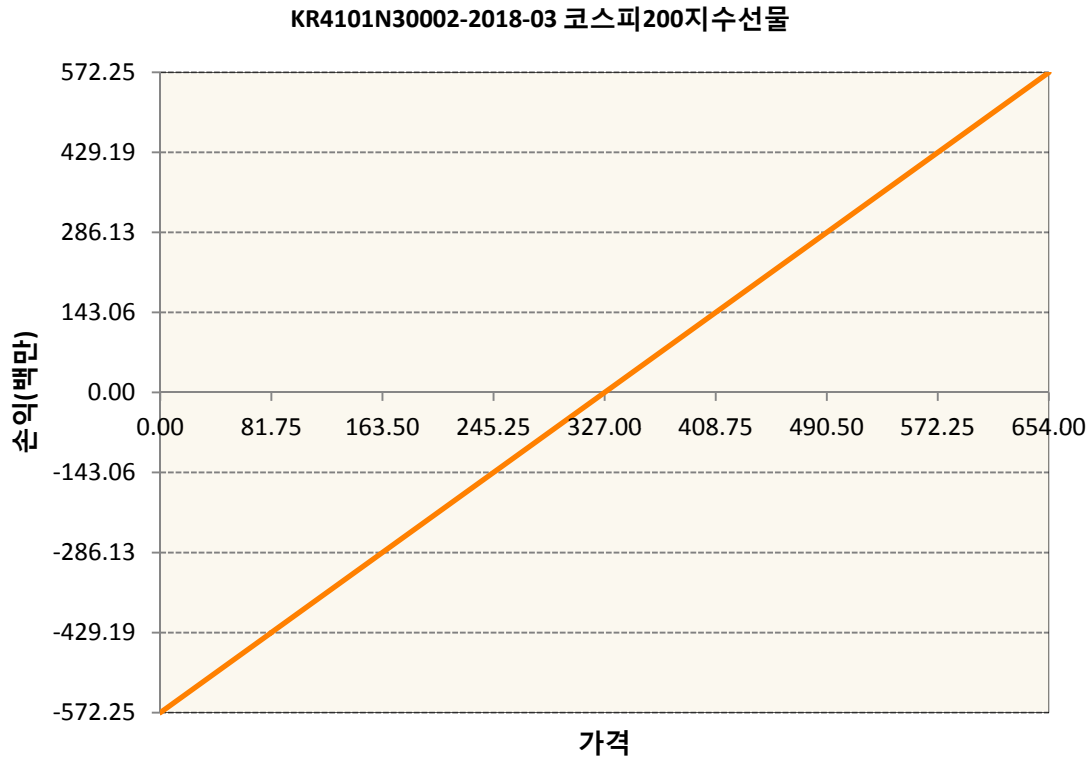
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	572	0	572	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)

27

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

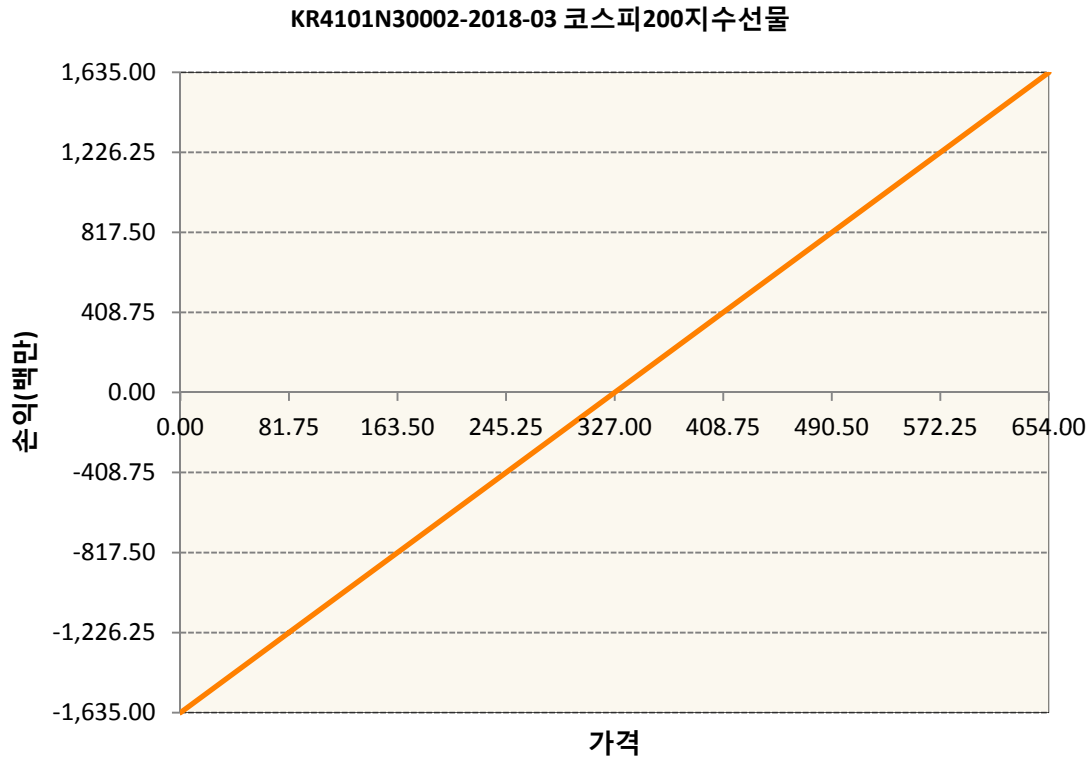
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,635	0	1,635	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-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%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

77

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

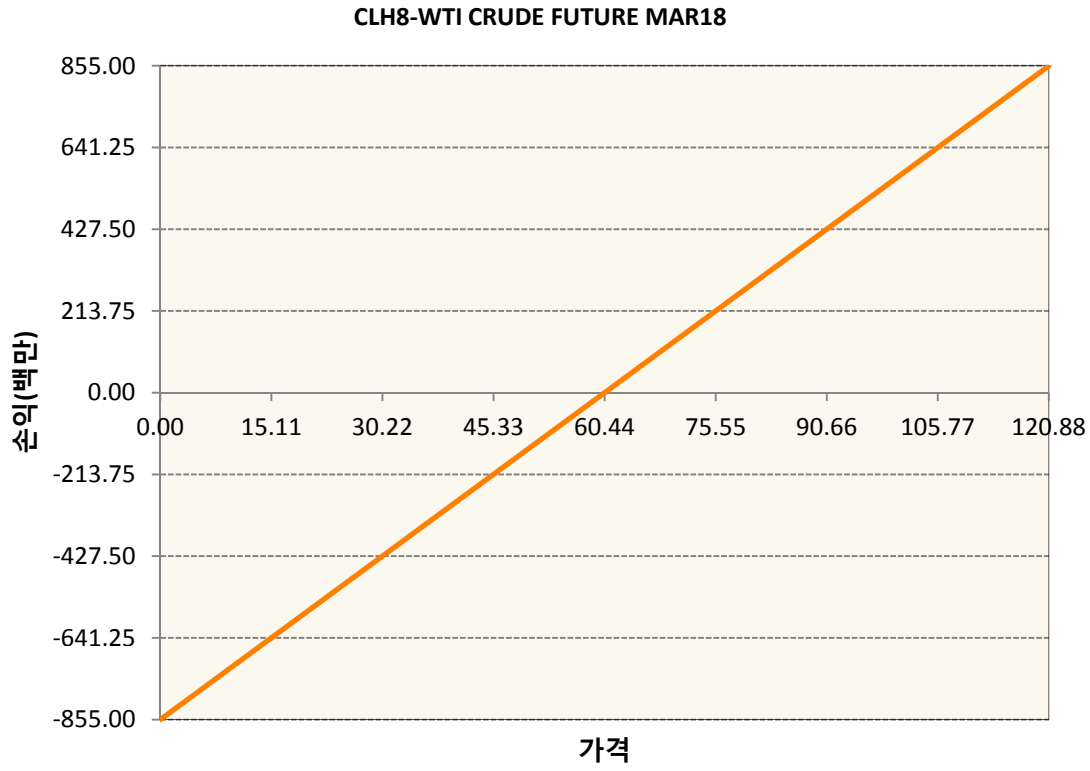
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

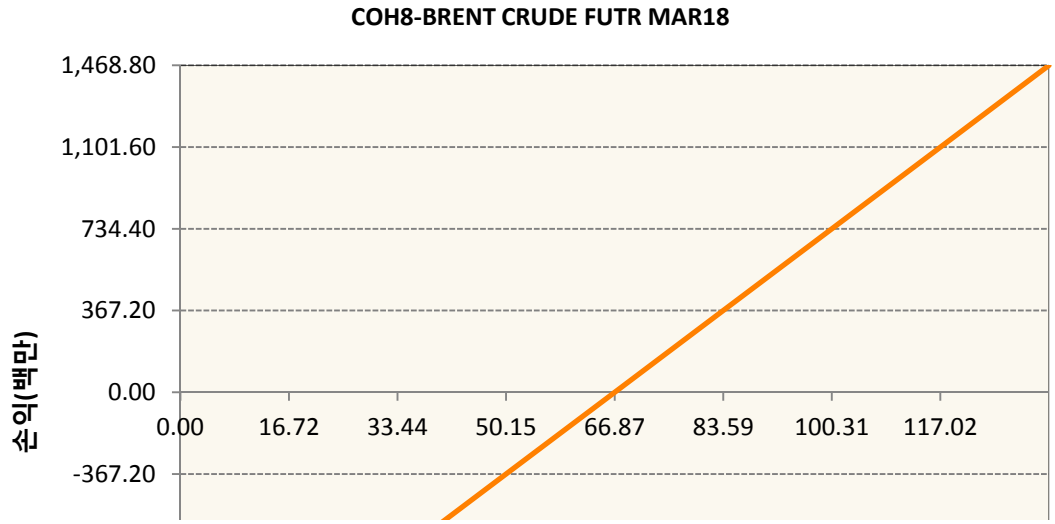
1. 계약금액

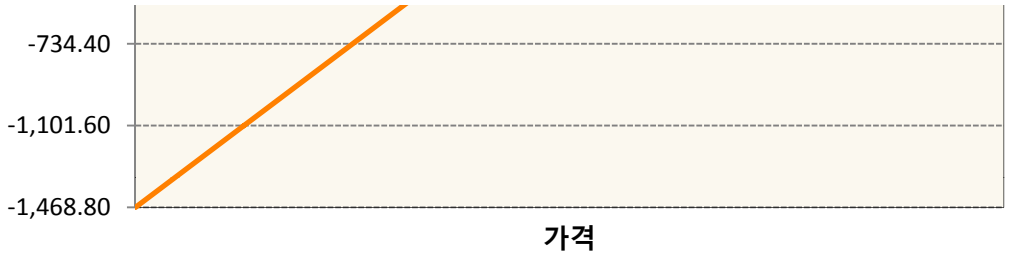
(단위:백만원)

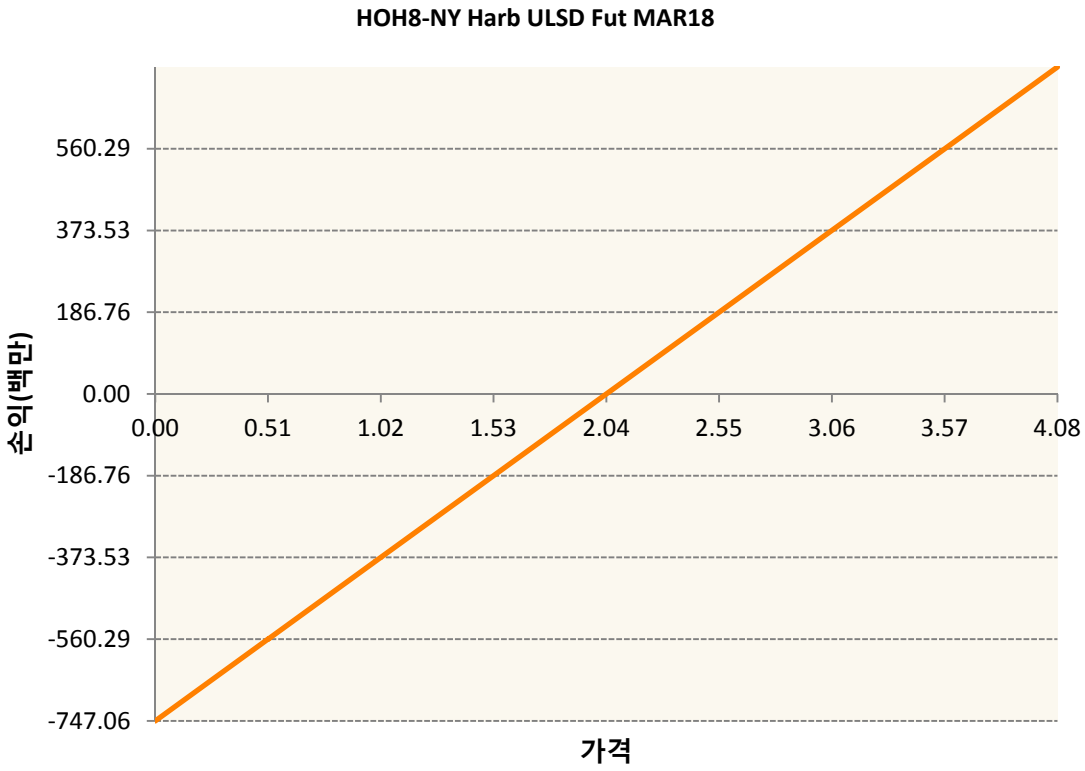
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,714	849	3,865	

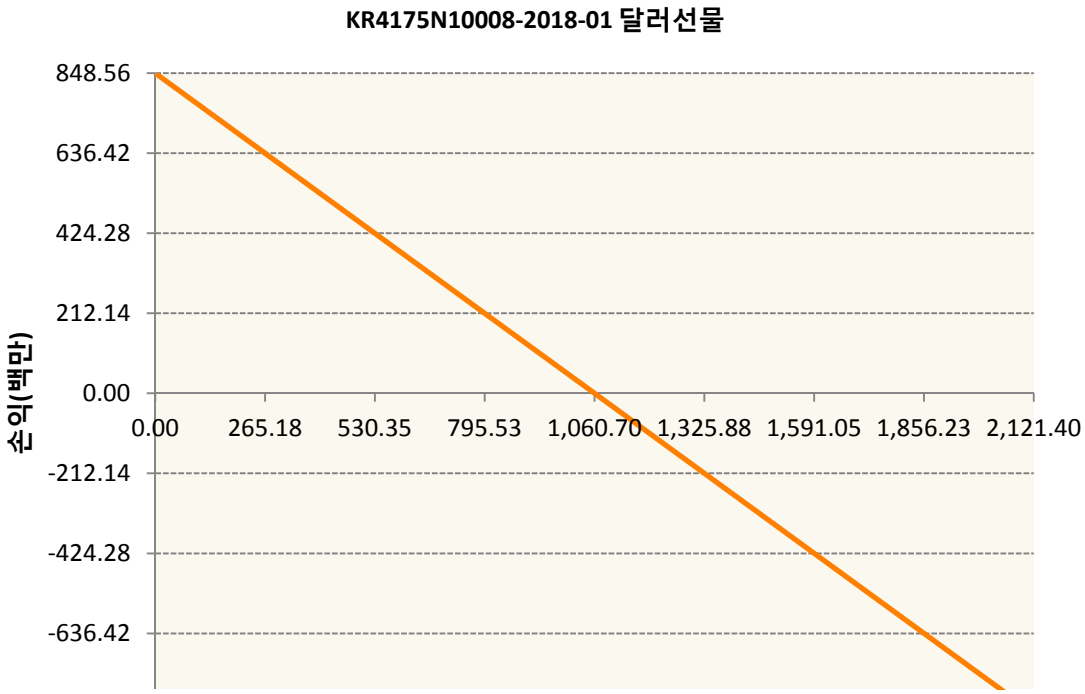
2. 만기시점의 손익구조

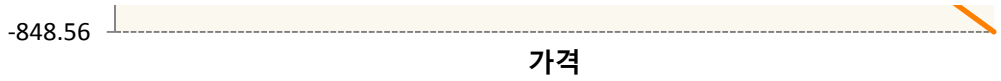


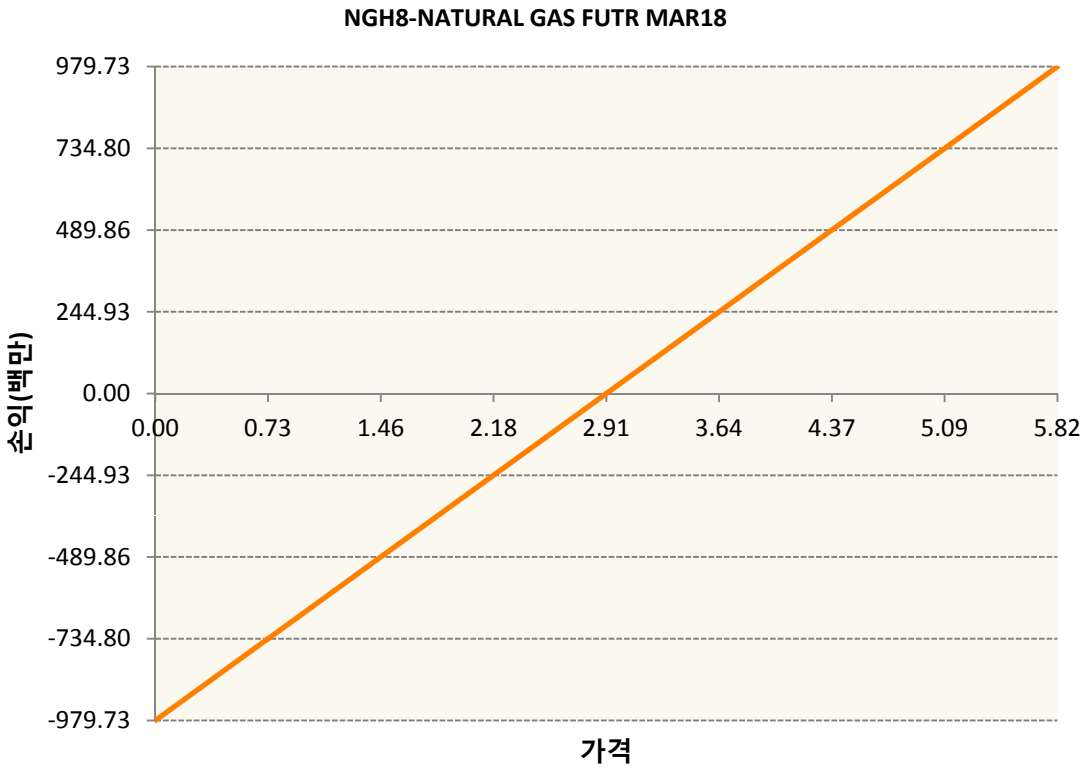


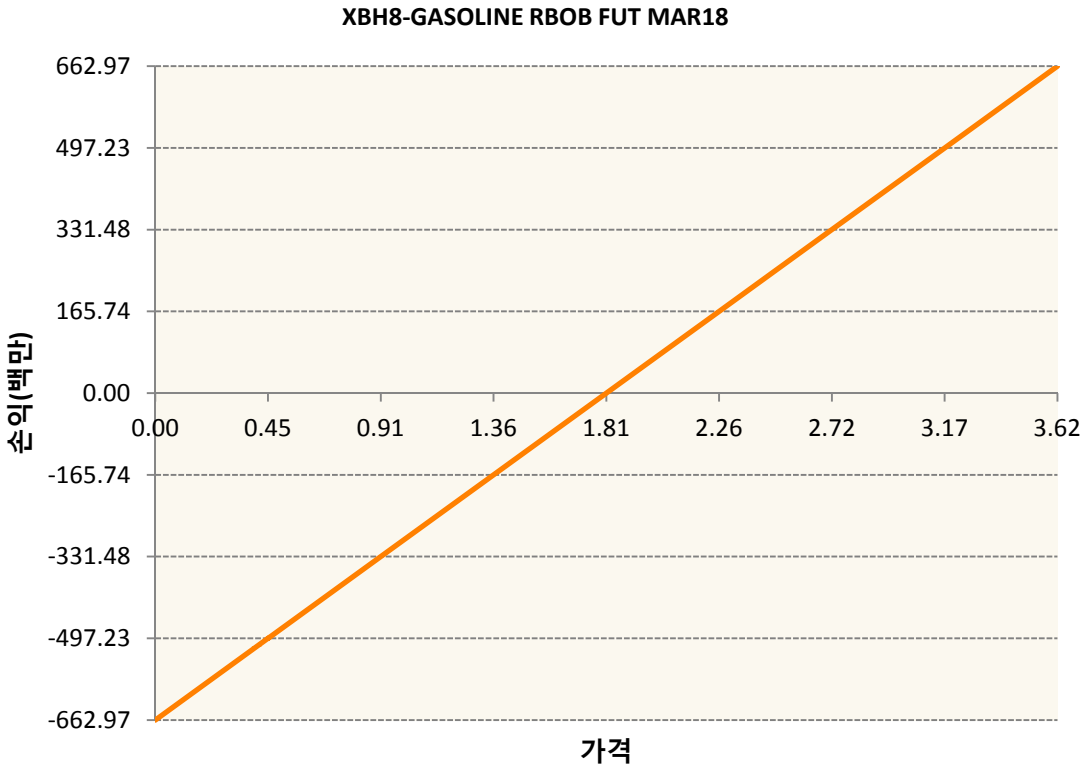

-734.40
-1,101.60
-1,468.80
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
560.29
373.53
186.76
0.00
-186.76
-373.53
-560.29
-747.06
0.00
0.51
1.02
1.53
2.04
2.55
3.06
3.57
4.08
손익(백만)
가격


KR4175N10008-2018-01 달러선물
848.56
636.42
424.28
212.14
0.00
-212.14
-424.28
-636.42
0.00
265.18
530.35
795.53
1,060.70
1,325.88
1,591.05
1,856.23
2,121.40
손익(백만)


-848.56
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
979.73
734.80
489.86
244.93
0.00
-244.93
-489.86
-734.80
-979.73
0.00
0.73
1.46
2.18
2.91
3.64
4.37
5.09
5.82
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
662.97
497.23
331.48
165.74
0.00
-165.74
-331.48
-497.23
-662.97
0.00
0.45
0.91
1.36
1.81
2.26
2.72
3.17
3.62
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	68
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	118
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	60
KR4175N10(	2018-01 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	78
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	53

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

625

공시일	2018-01-03
기준일	2018-01-02

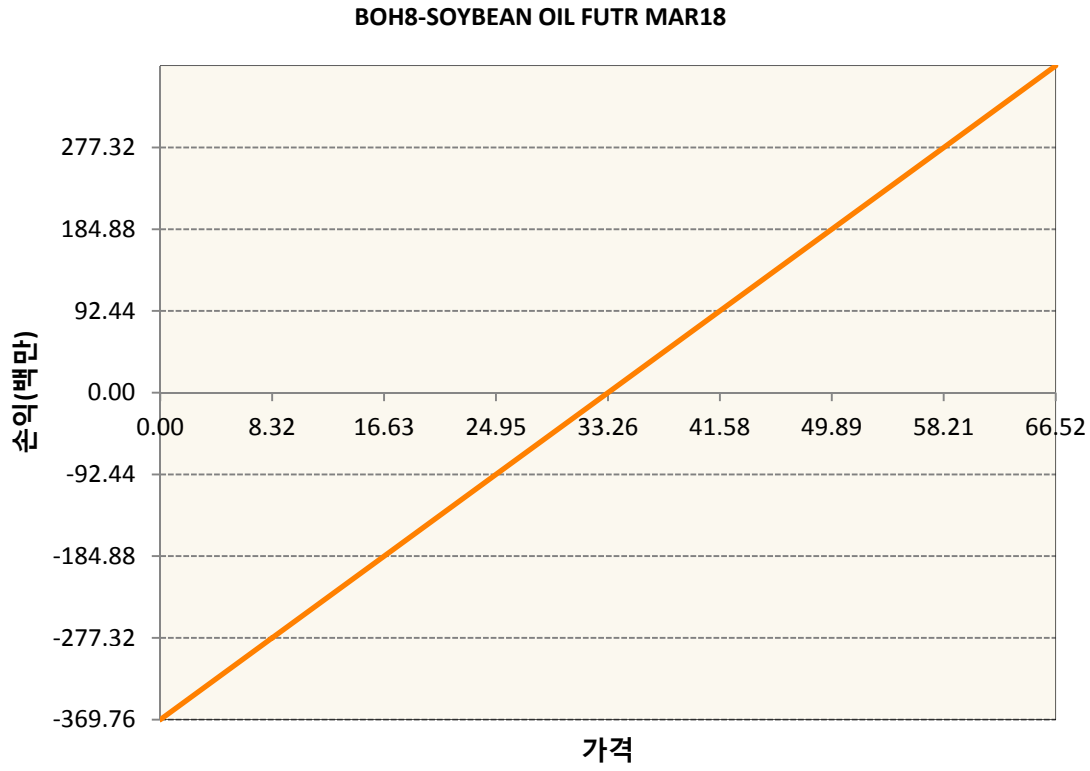
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

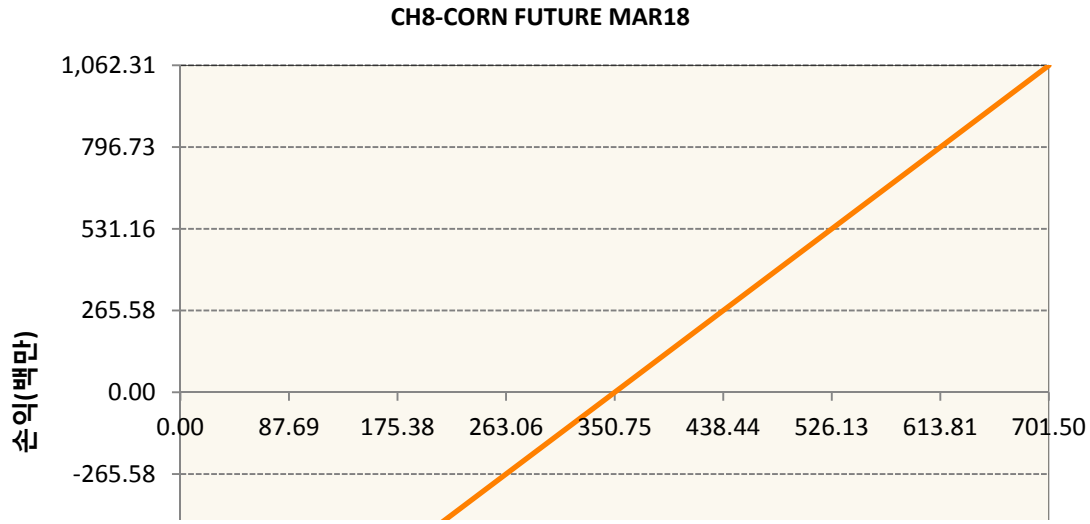
1. 계약금액

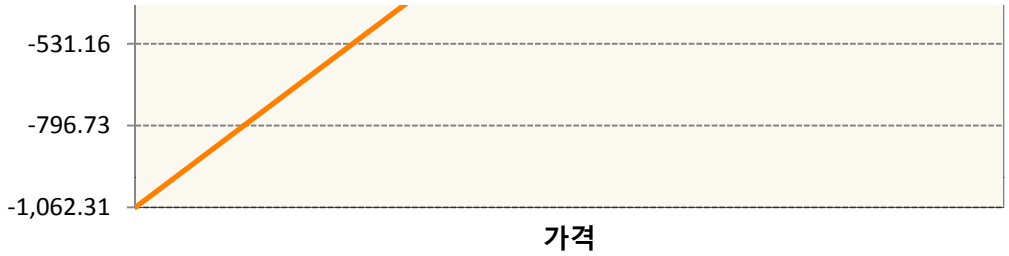
(단위:백만원)

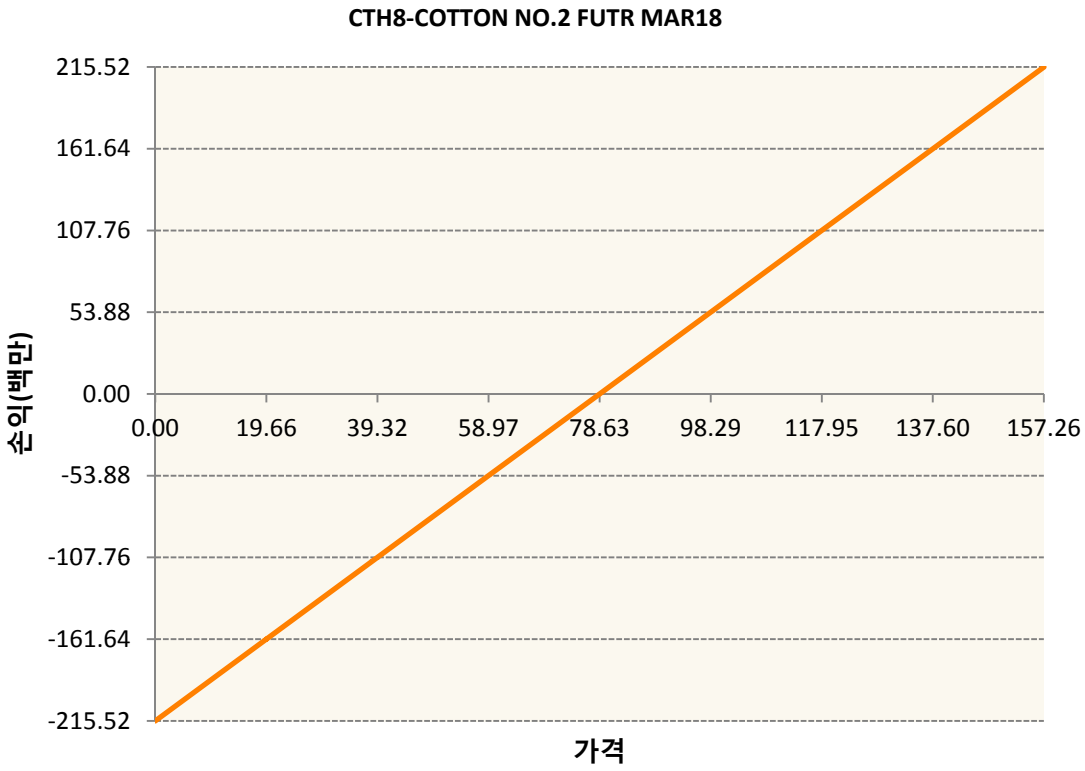
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,257	318	3,938	

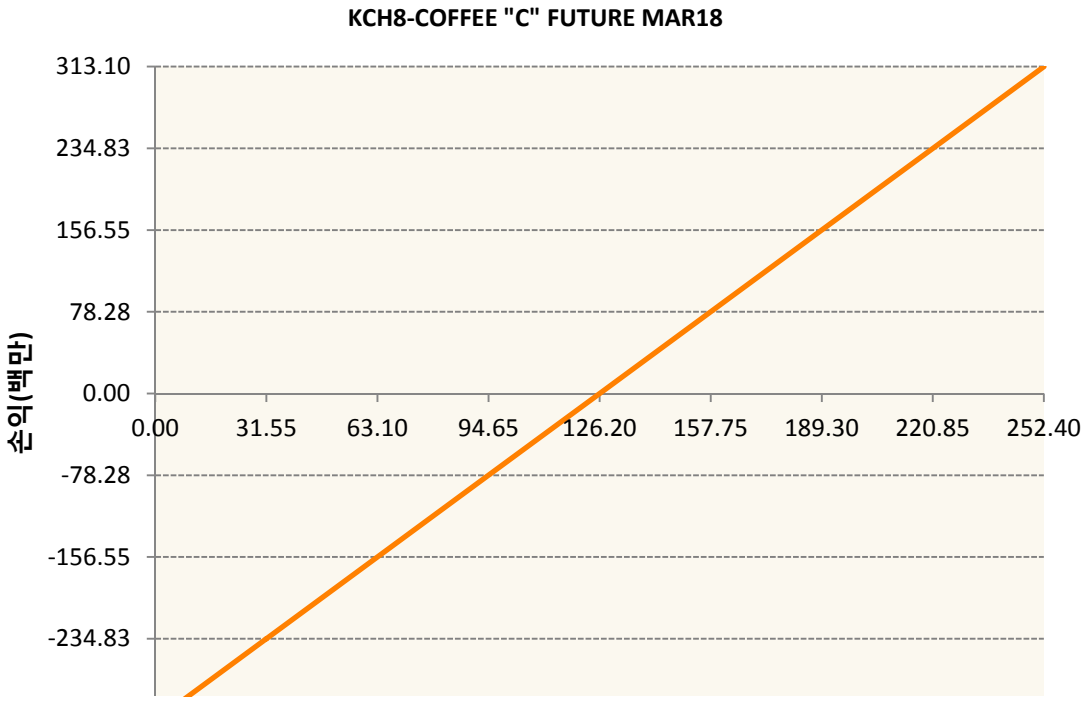
2. 만기시점의 손익구조

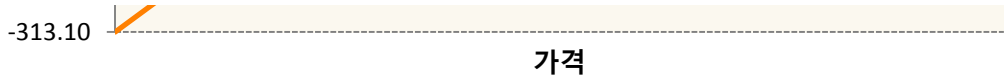


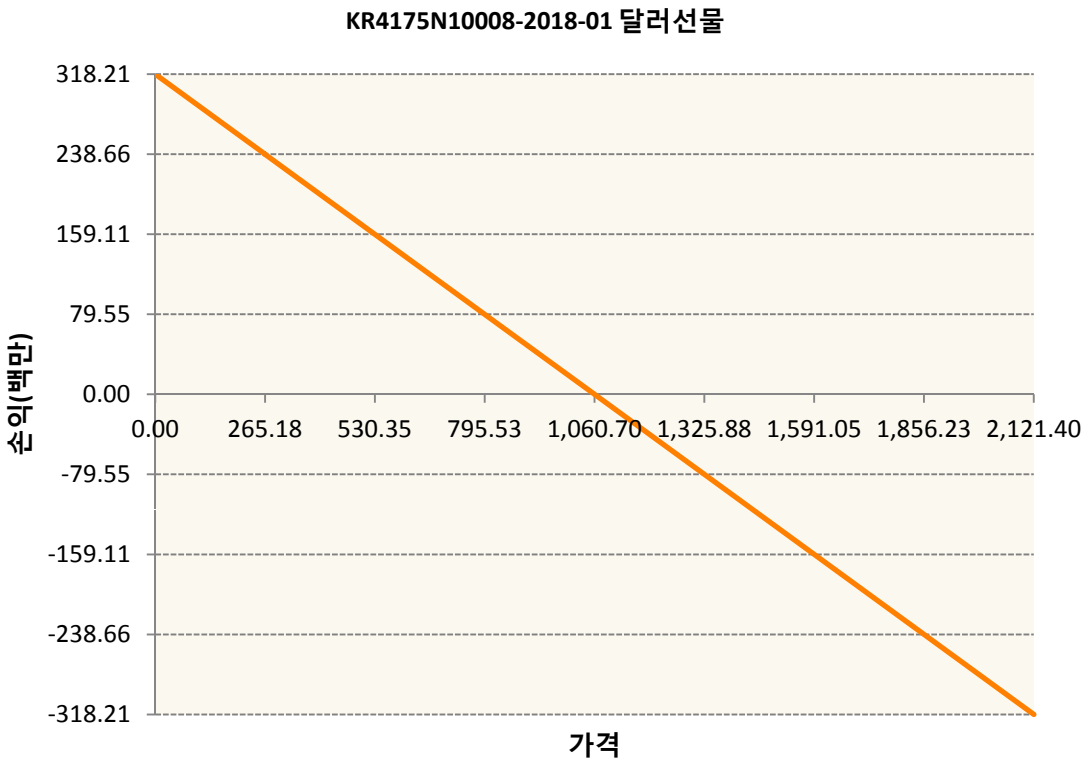


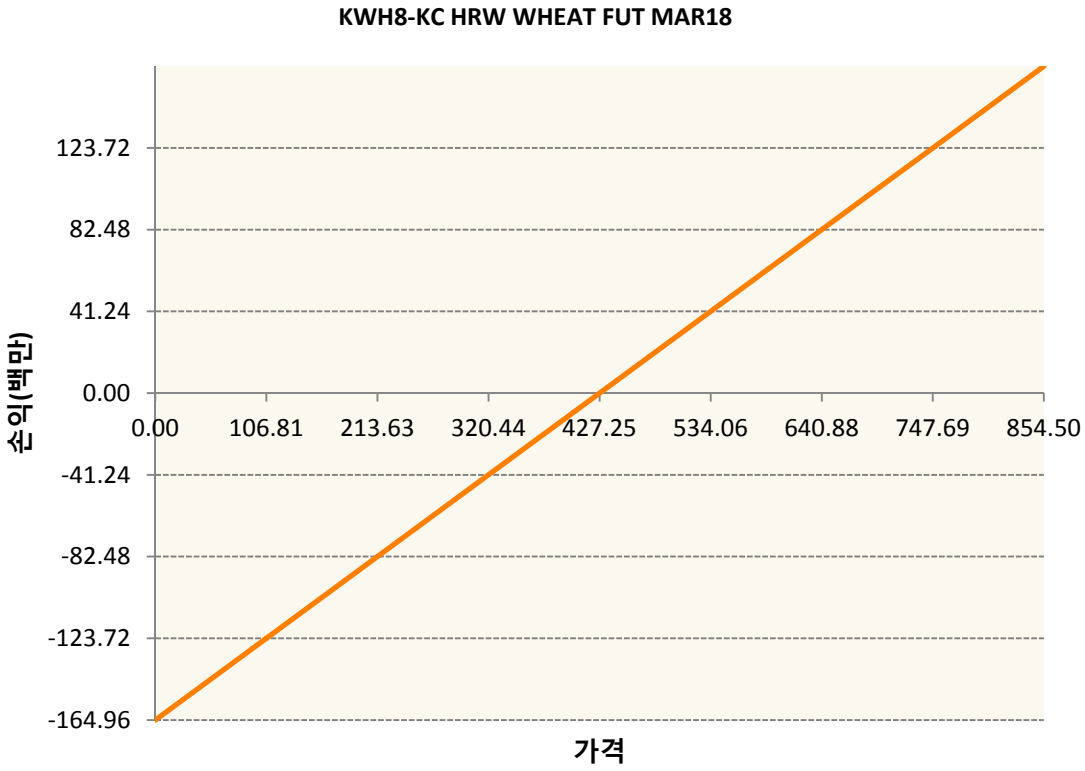

-531.16
-796.73
-1,062.31
가격

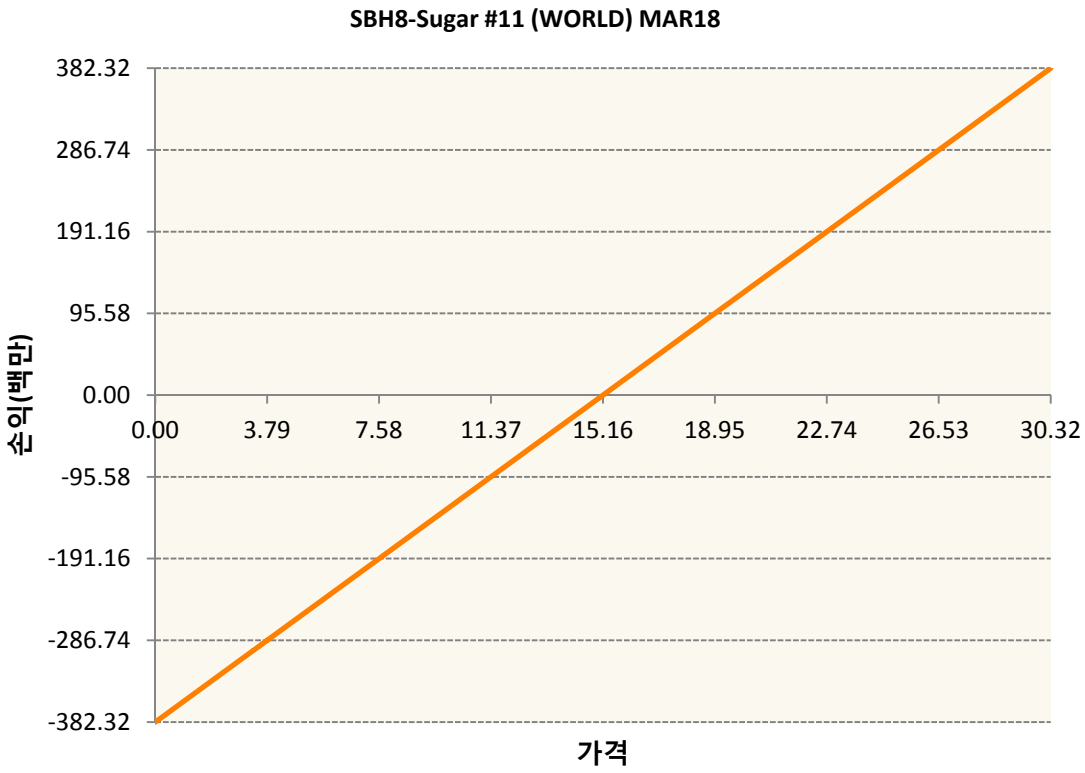

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
215.52
161.64
107.76
53.88
0.00
-53.88
-107.76
-161.64
-215.52
0.00
19.66
39.32
58.97
78.63
98.29
117.95
137.60
157.26
손익(백만)
가격

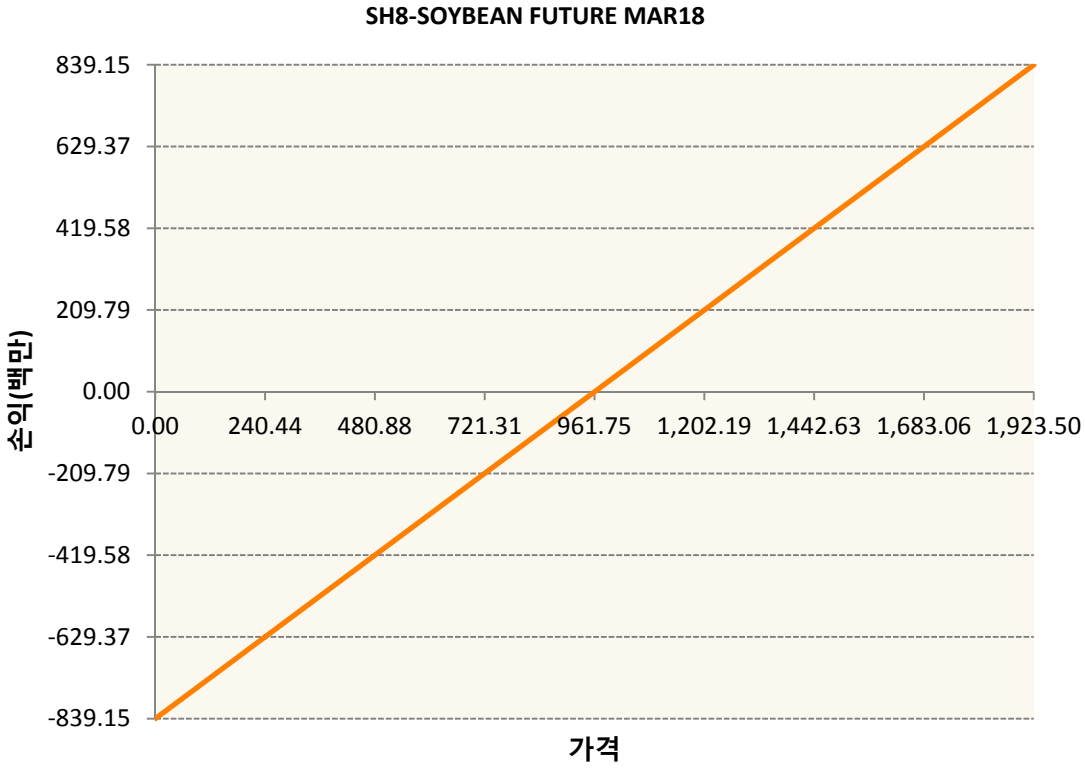

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
313.10
234.83
156.55
78.28
0.00
-78.28
-156.55
-234.83
0.00
31.55
63.10
94.65
126.20
157.75
189.30
220.85
252.40
손익(백만)


-313.10
가격

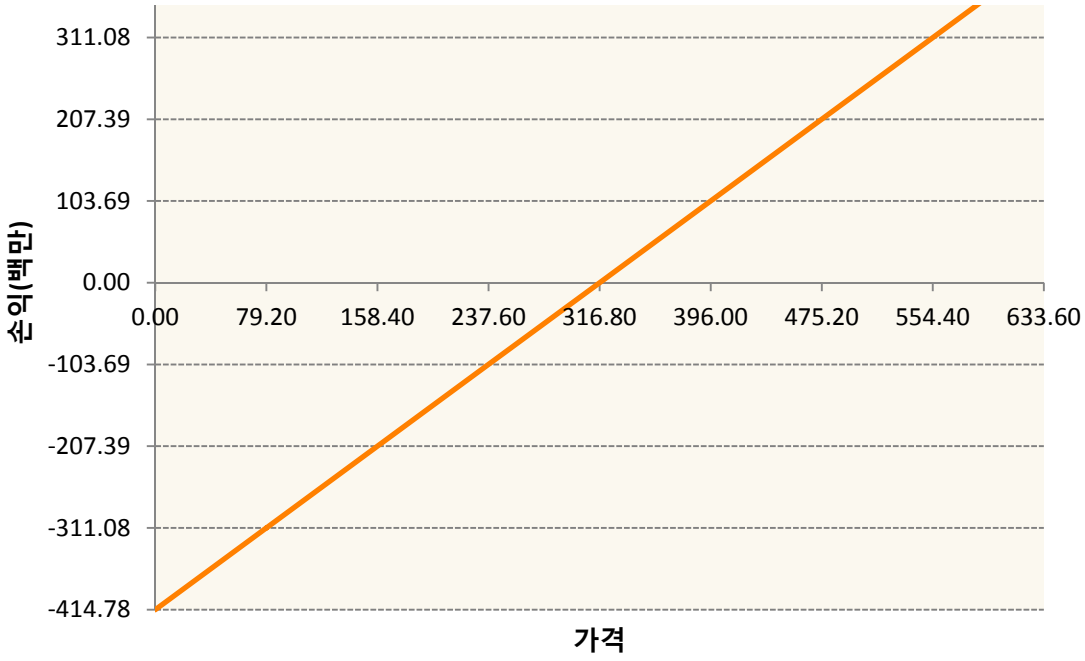

KR4175N10008-2018-01 달러선물
318.21
238.66
159.11
79.55
0.00
-79.55
-159.11
-238.66
-318.21
0.00
265.18
530.35
795.53
1,060.70
1,325.88
1,591.05
1,856.23
2,121.40
손익(백만)
가격

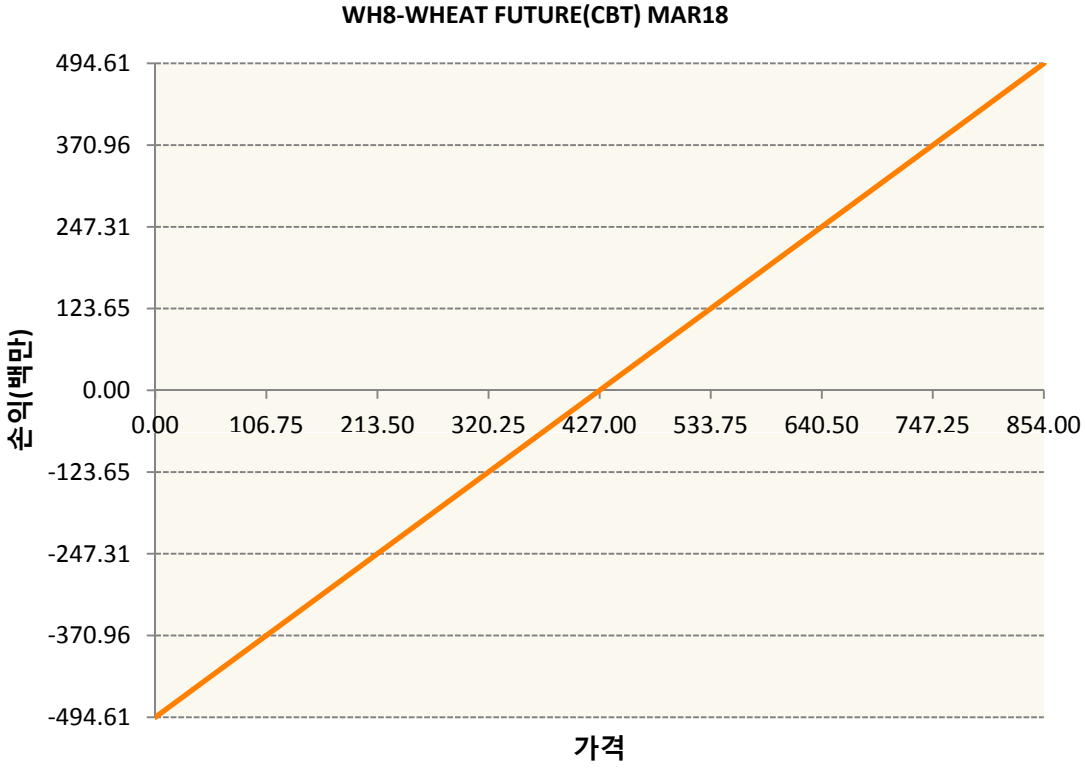

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
123.72
82.48
41.24
0.00
-41.24
-82.48
-123.72
-164.96
0.00
106.81
213.63
320.44
427.25
534.06
640.88
747.69
854.50
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
382.32
286.74
191.16
95.58
0.00
-95.58
-191.16
-286.74
-382.32
0.00
3.79
7.58
11.37
15.16
18.95
22.74
26.53
30.32
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
839.15
629.37
419.58
209.79
0.00
-209.79
-419.58
-629.37
-839.15
0.00
240.44
480.88
721.31
961.75
1,202.19
1,442.63
1,683.06
1,923.50
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18
414.78





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	30
CH8	CORN FUTURE MAR18	85
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	17
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	25
KR4175N10(	2018-01 달러선물	25

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	31
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