공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

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	2018-01-08
기준일	2018-01-05

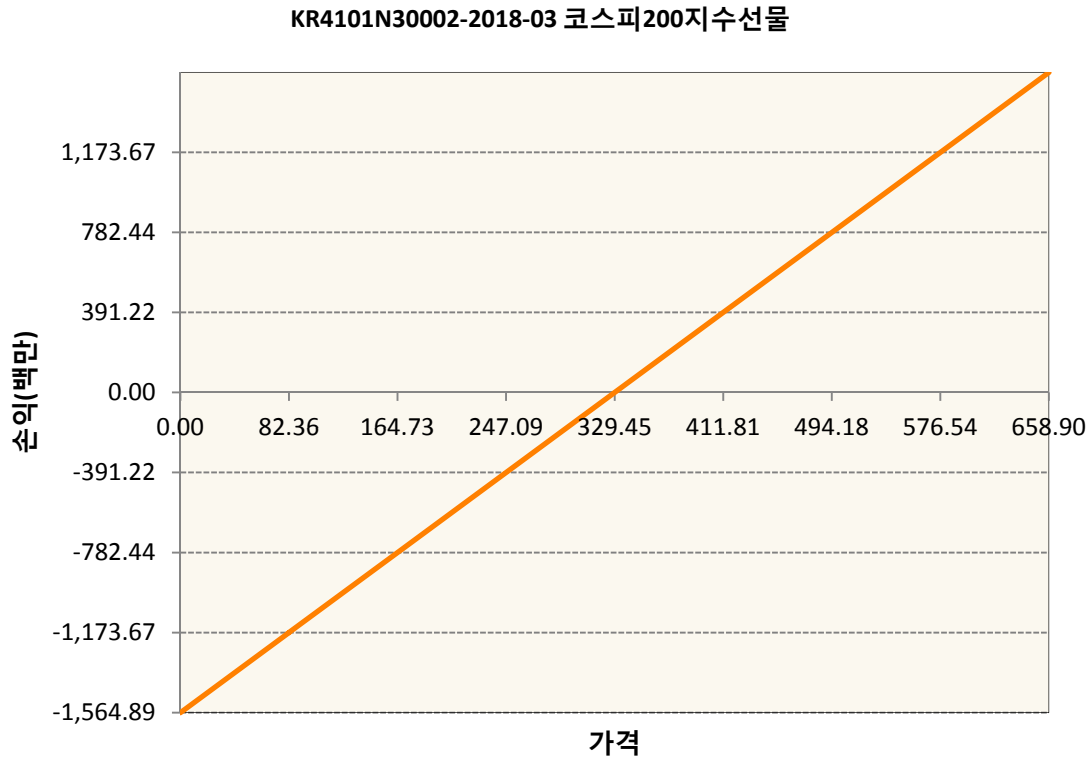
스마트인덱스모

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	1,565	0	1,565	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	125	125	125	125	125	125	125

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

75

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

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	1,120

* 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	2018-01-08
기준일	2018-01-05

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	417

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

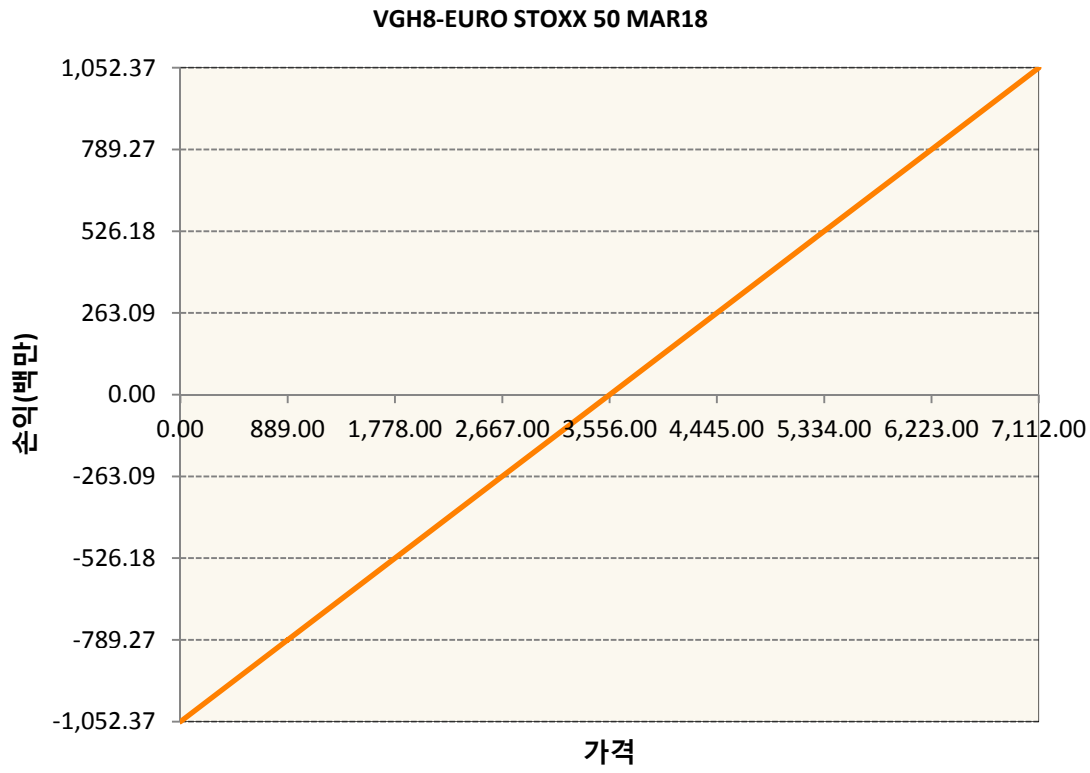
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,052	0	1,052	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	84

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

(단위:백만원)

47

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

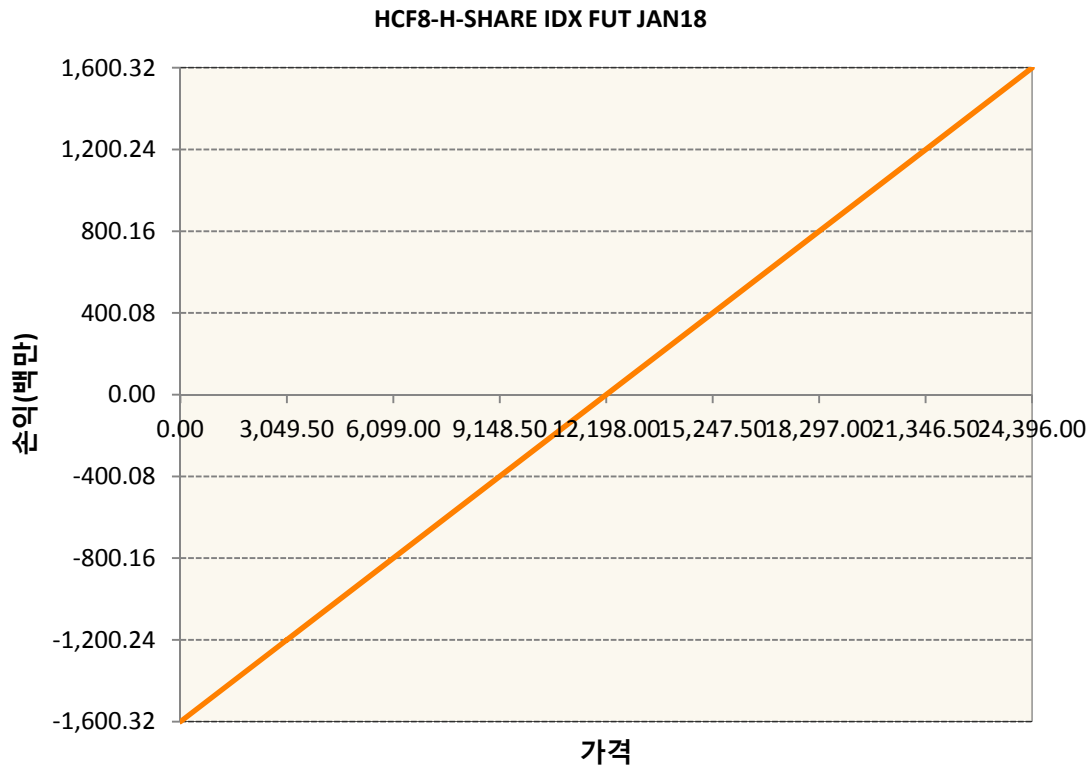
차이나인덱스모(주식-파생형)

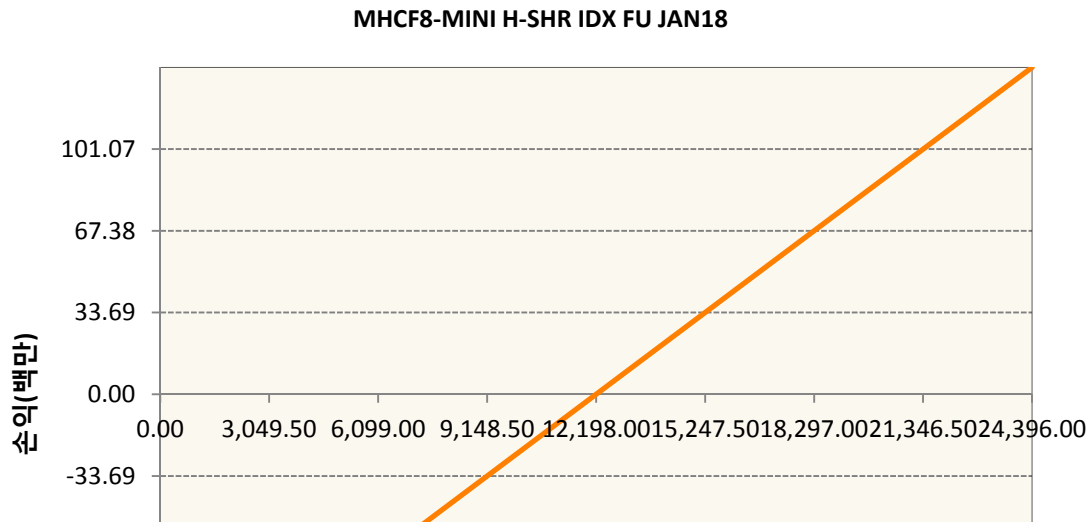
1. 계약금액

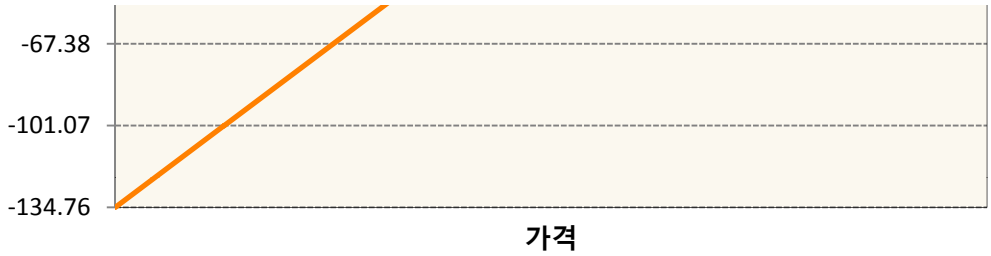
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,735	0	1,735	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	128
MHCF8	MINI H-SHR IDX FU JAN18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	111

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

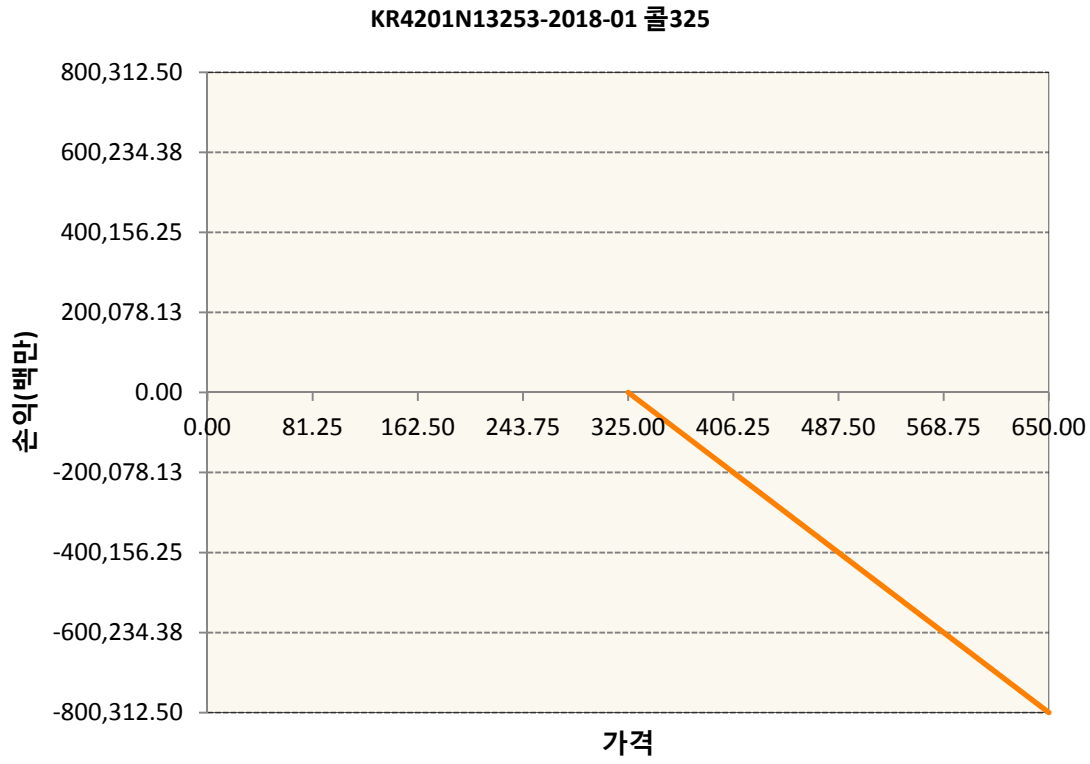
커버드콜모(주식혼합-파생형)

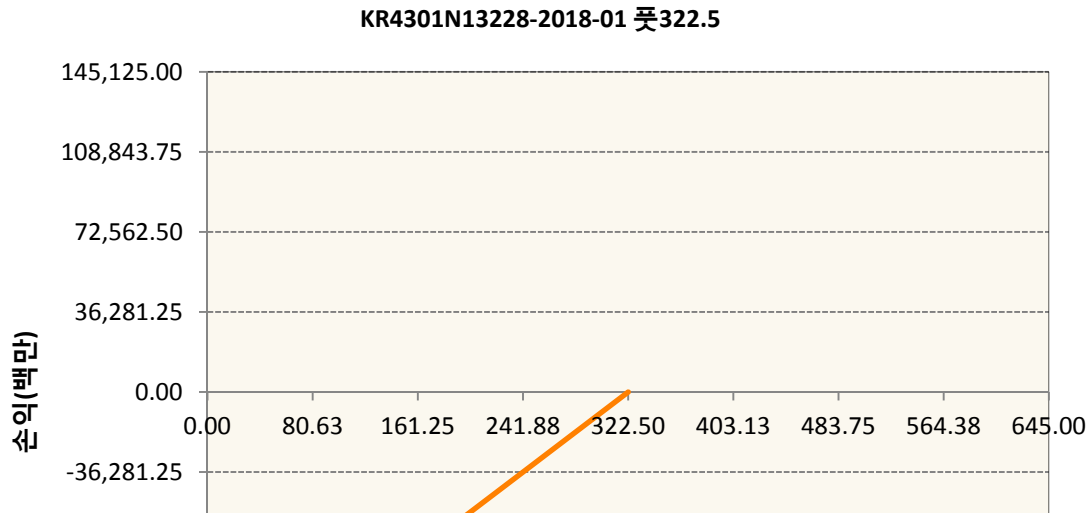
1. 계약금액

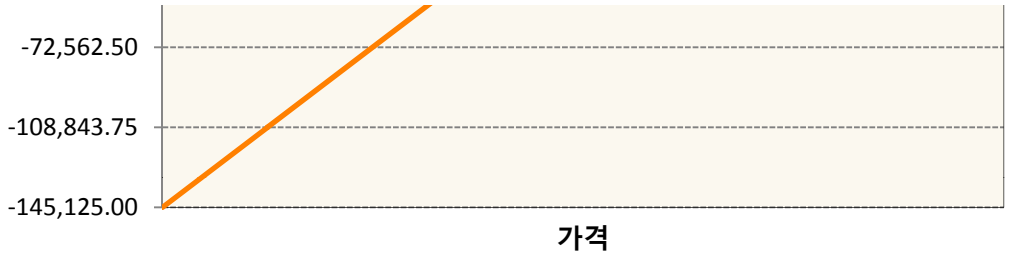
(단위:백만원)

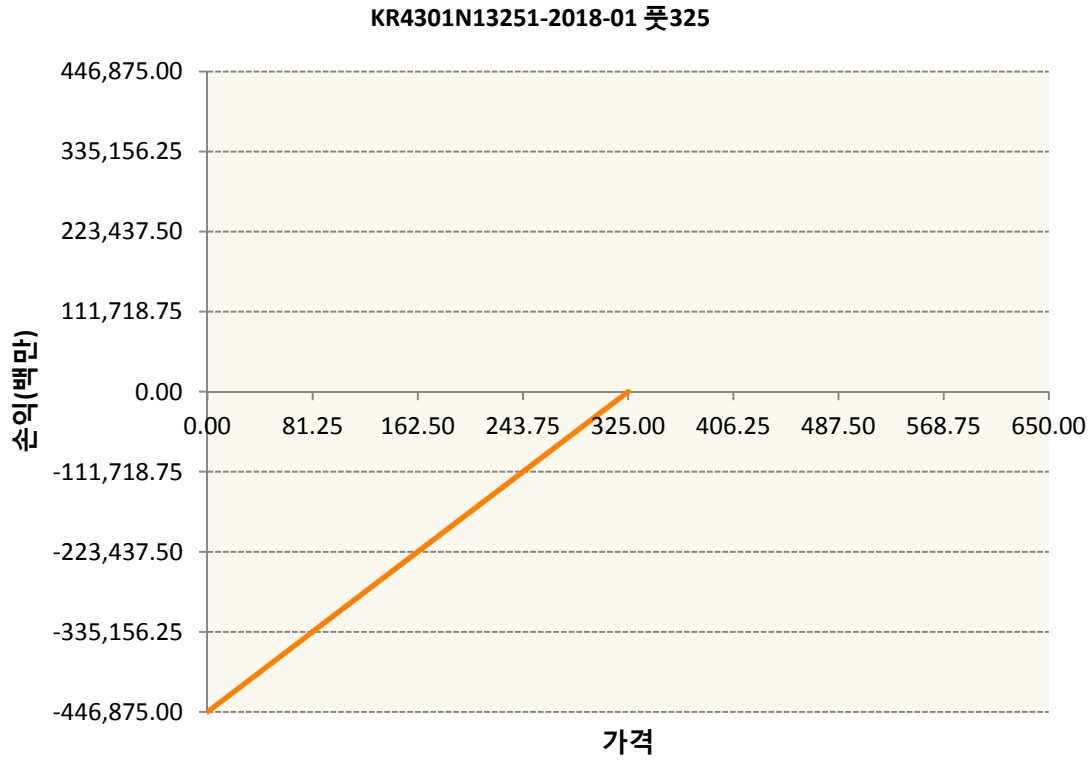
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,392,313	-1,392,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							59,127
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15,683	15,671	15,645	15,599	15,528	15,427	15,295
-5.33%	15,445	15,265	15,027	14,737	14,396	14,012	13,587
-2.67%	12,734	12,050	11,343	10,618	9,880	9,130	8,372
0%	2,244	1,512	762	0	-772	-1,553	-2,340
2.67%	-16,193	-16,438	-16,744	-17,106	-17,518	-17,974	-18,469
5.33%	-37,425	-37,454	-37,506	-37,589	-37,707	-37,864	-38,060
8.00%	-59,008	-59,010	-59,014	-59,023	-59,043	-59,076	-59,127
KR4301N132 2018-01 풋322.5							8,808
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,807	-8,807	-8,807	-8,807	-8,807	-8,807	-8,808

-5.33%	-4,861	-4,862	-4,864	-4,869	-4,876	-4,885	-4,897
-2.67%	-1,188	-1,250	-1,314	-1,380	-1,447	-1,514	-1,583
0%	73	54	29	0	-34	-72	-113
2.67%	100	100	100	100	98	96	93
5.33%	100	100	100	100	100	100	100
8.00%	100	100	100	100	100	100	100
KR4301N132 2018-01 풋325							29,833

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29,832	-29,832	-29,832	-29,832	-29,832	-29,832	-29,833
-5.33%	-17,772	-17,772	-17,774	-17,777	-17,784	-17,794	-17,810
-2.67%	-5,951	-6,059	-6,182	-6,318	-6,465	-6,622	-6,786
0%	447	311	161	0	-170	-347	-530
2.67%	821	820	816	809	796	778	751
5.33%	822	822	822	822	822	821	821
8.00%	822	822	822	822	822	822	822

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

113,820

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

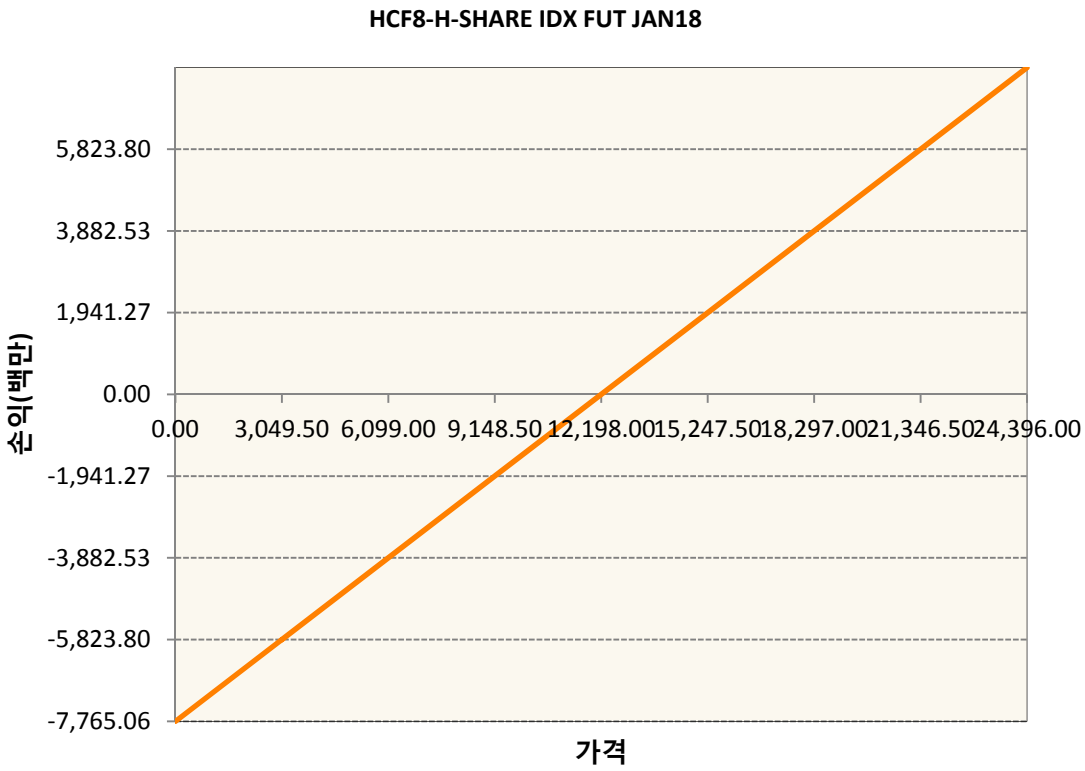
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

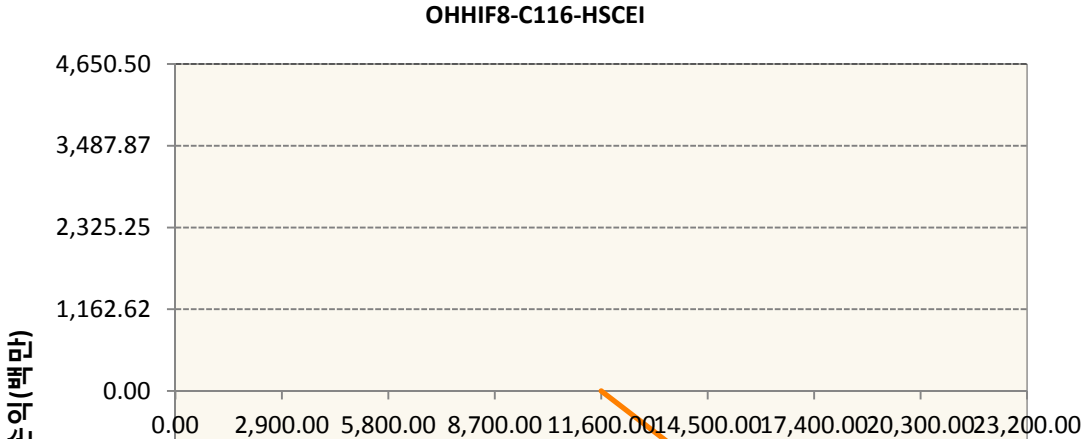
1. 계약금액

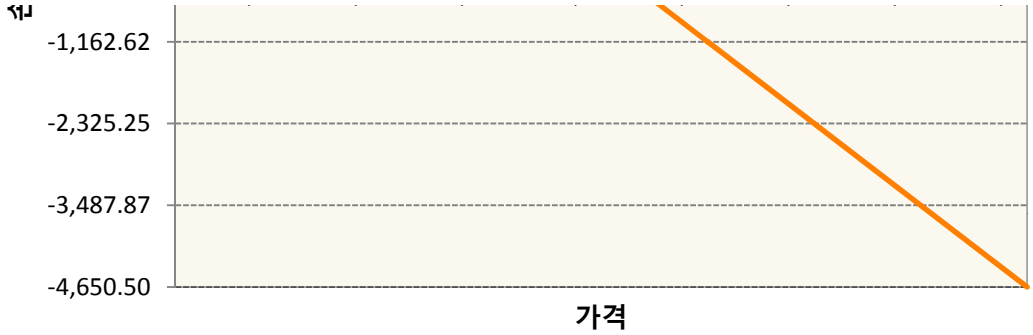
(단위:백만원)

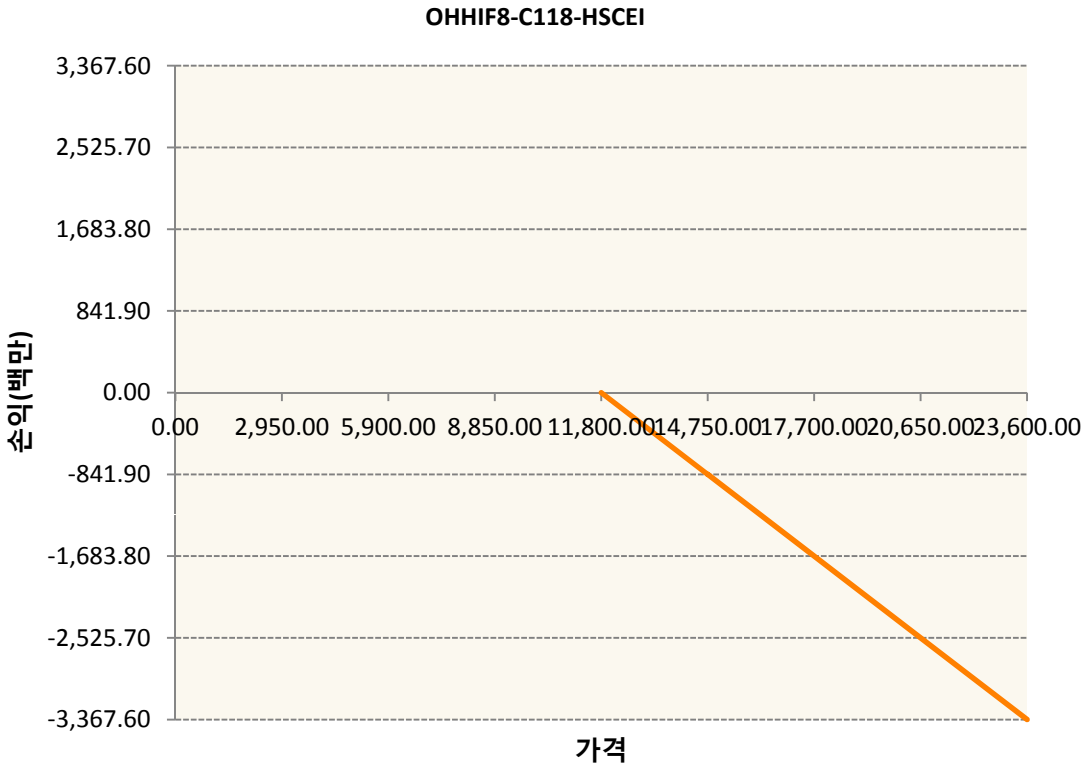
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,765	0	7,765	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,036	-16,036	장내

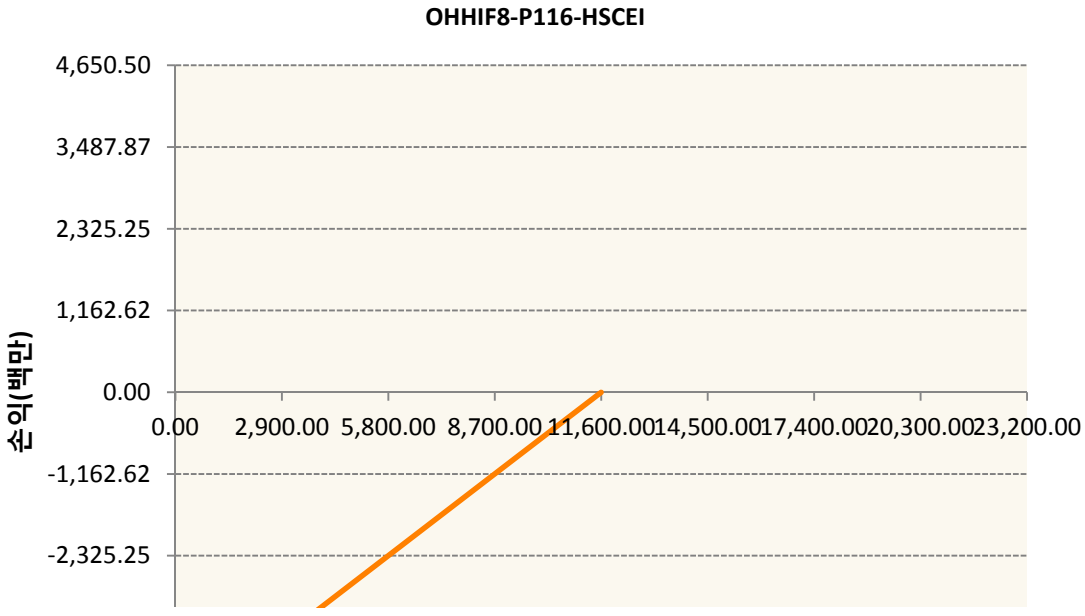
2. 만기시점의 손익구조

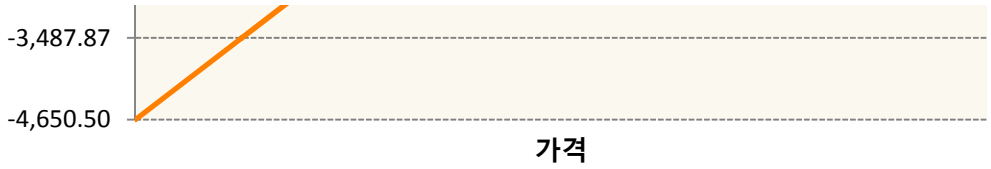


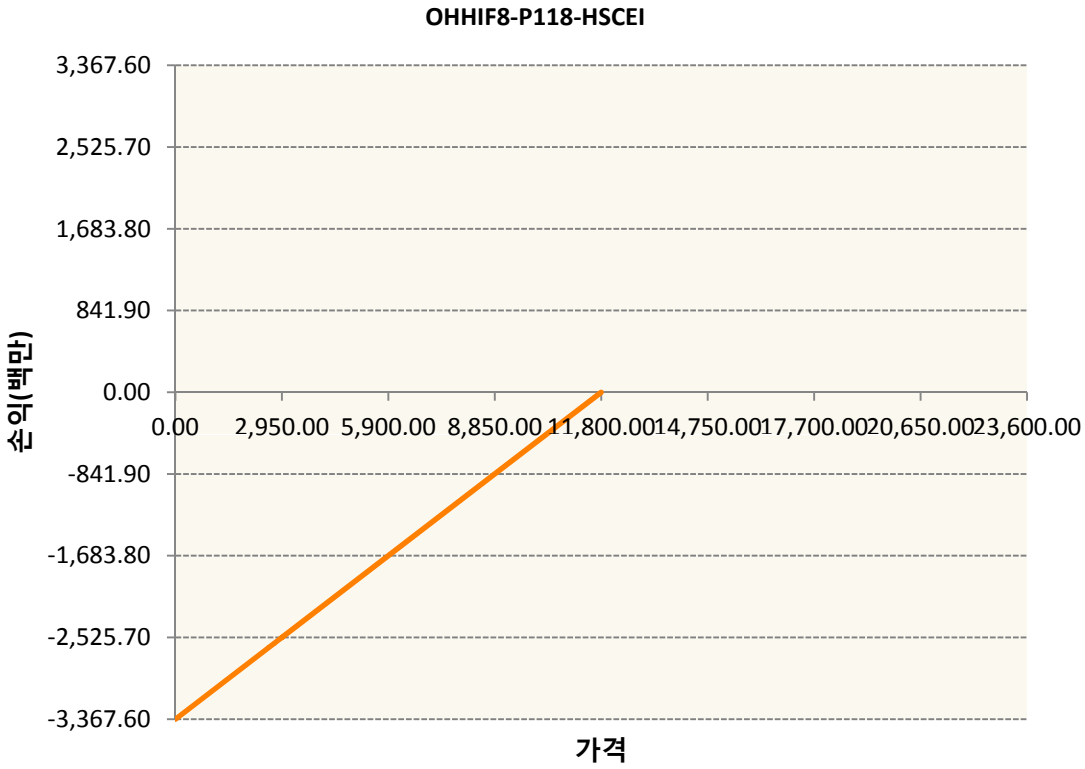



-1,162.62
-2,325.25
-3,487.87
-4,650.50
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
3,367.60
2,525.70
1,683.80
841.90
0.00
-841.90
-1,683.80
-2,525.70
-3,367.60
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


OHHIF8-P116-HSCEI
4,650.50
3,487.87
2,325.25
1,162.62
0.00
-1,162.62
-2,325.25
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)

HCF8	H-SHARE IDX FUT JAN18	621
OHHIF8-C11	HSCEI	372
OHHIF8-C11	HSCEI	269
OHHIF8-P11	HSCEI	372
OHHIF8-P11	HSCEI	269

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

1,521

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

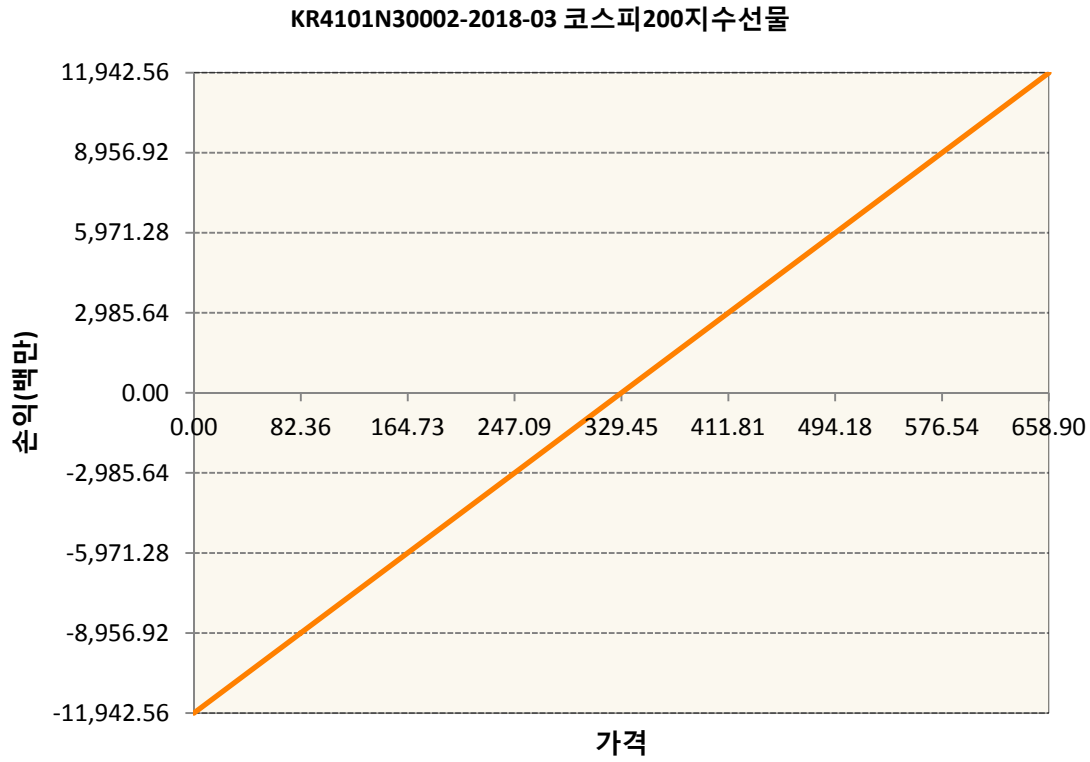
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

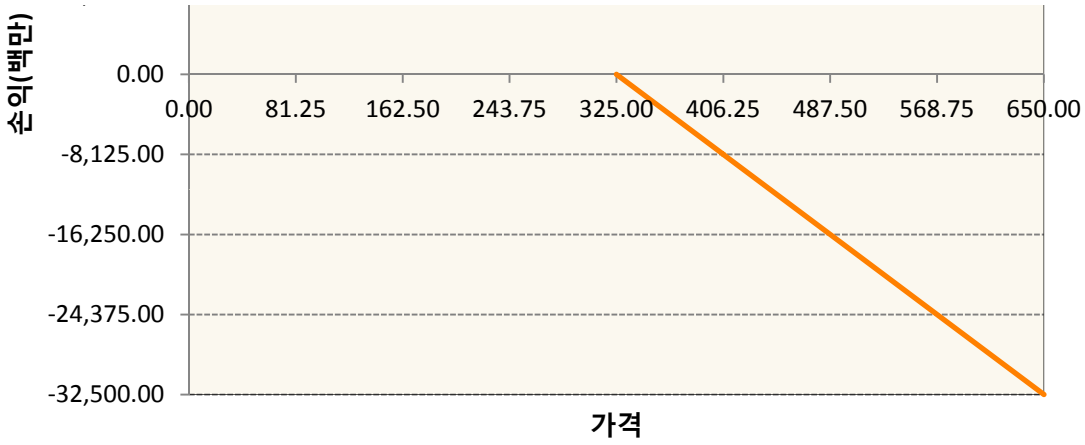
(단위:백만원)

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	11,943	0	11,943	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,263	-59,263	장내

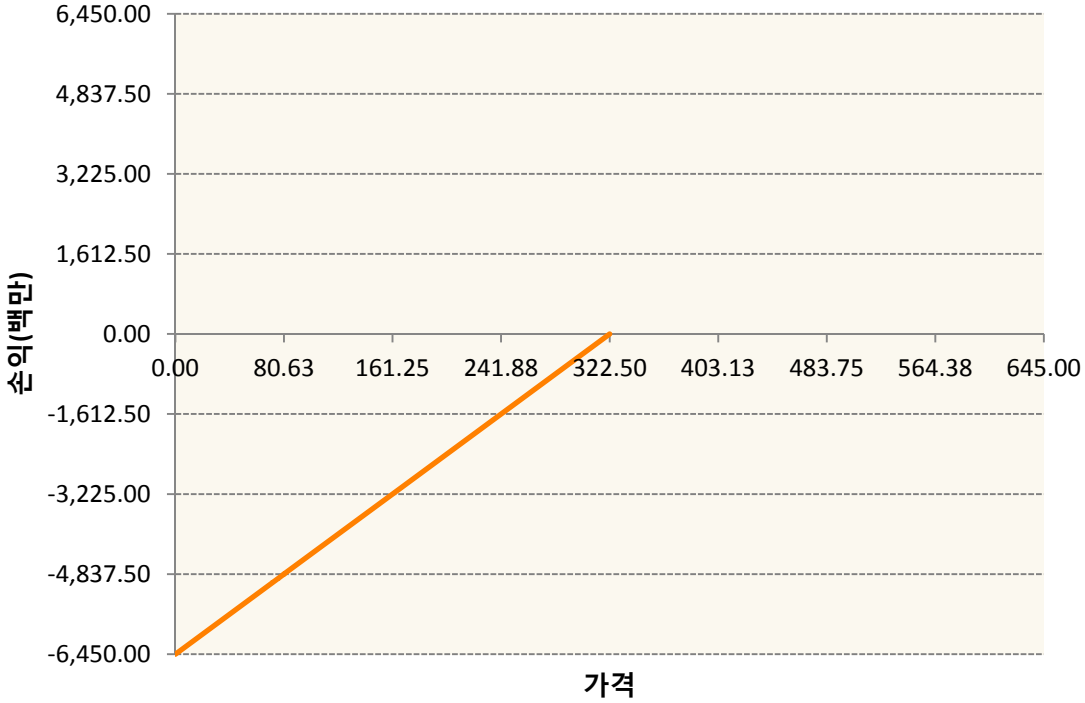
2. 만기시점의 손익구조



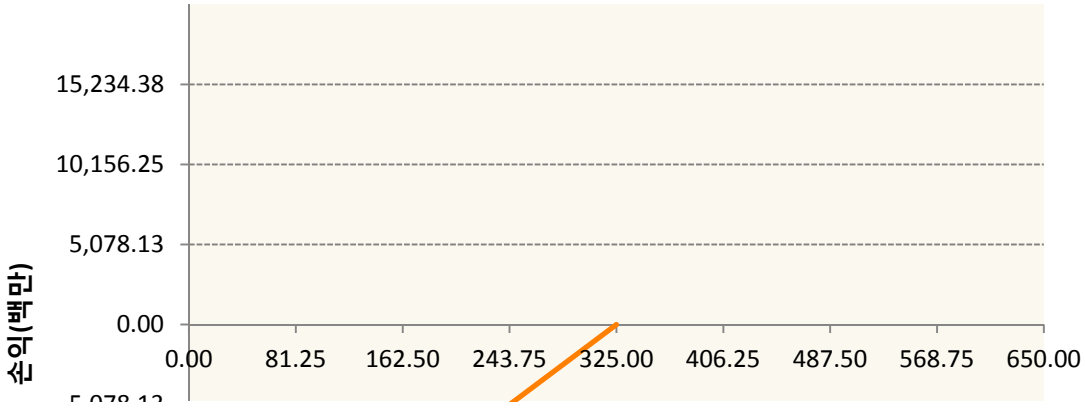




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,442
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442
-5.33%	-961	-961	-961	-961	-961	-961	-961
-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%	961	961	961	961	961	961	961
8.00%	1,442	1,442	1,442	1,442	1,442	1,442	1,442
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						249
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-249	-249	-249	-249	-249	-249	-249
-5.33%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-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%	166	166	166	166	166	166	166
8.00%	249	249	249	249	249	249	249
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						461
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-461	-461	-461	-461	-461	-461	-461
-5.33%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307
-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%	307	307	307	307	307	307	307
8.00%	461	461	461	461	461	461	461
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						307
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307
-5.33%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	102	102	102	102	102	102	102
5.33%	205	205	205	205	205	205	205
8.00%	307	307	307	307	307	307	307
	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					623
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-623	-623	-623	-623	-623	-623	-623
-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%	623	623	623	623	623	623	623
	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				954
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-954	-954	-954	-954	-954	-954	-954
-5.33%	-636	-636	-636	-636	-636	-636	-636
-2.67%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	318	318	318	318	318	318	318
5.33%	636	636	636	636	636	636	636
8.00%	954	954	954	954	954	954	954
	KR4201N13:	2018-01	콜325				2,401

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	637	636	635	633	631	626	621
-5.33%	627	620	610	598	585	569	552
-2.67%	517	489	461	431	401	371	340
0%	91	61	31	0	-31	-63	-95
2.67%	-658	-668	-680	-695	-711	-730	-750
5.33%	-1,520	-1,521	-1,523	-1,526	-1,531	-1,538	-1,546
8.00%	-2,396	-2,396	-2,396	-2,397	-2,398	-2,399	-2,401
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						391

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-391	-391	-391	-391	-391	-391	-391
-5.33%	-216	-216	-216	-216	-217	-217	-218
-2.67%	-53	-56	-58	-61	-64	-67	-70
0%	3	2	1	0	-2	-3	-5
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	4	4	4	4	4	4	4
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,356

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,356	-1,356	-1,356	-1,356	-1,356	-1,356	-1,356
-5.33%	-808	-808	-808	-808	-808	-809	-810
-2.67%	-271	-275	-281	-287	-294	-301	-308
0%	20	14	7	0	-8	-16	-24
2.67%	37	37	37	37	36	35	34
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

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

10,077

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

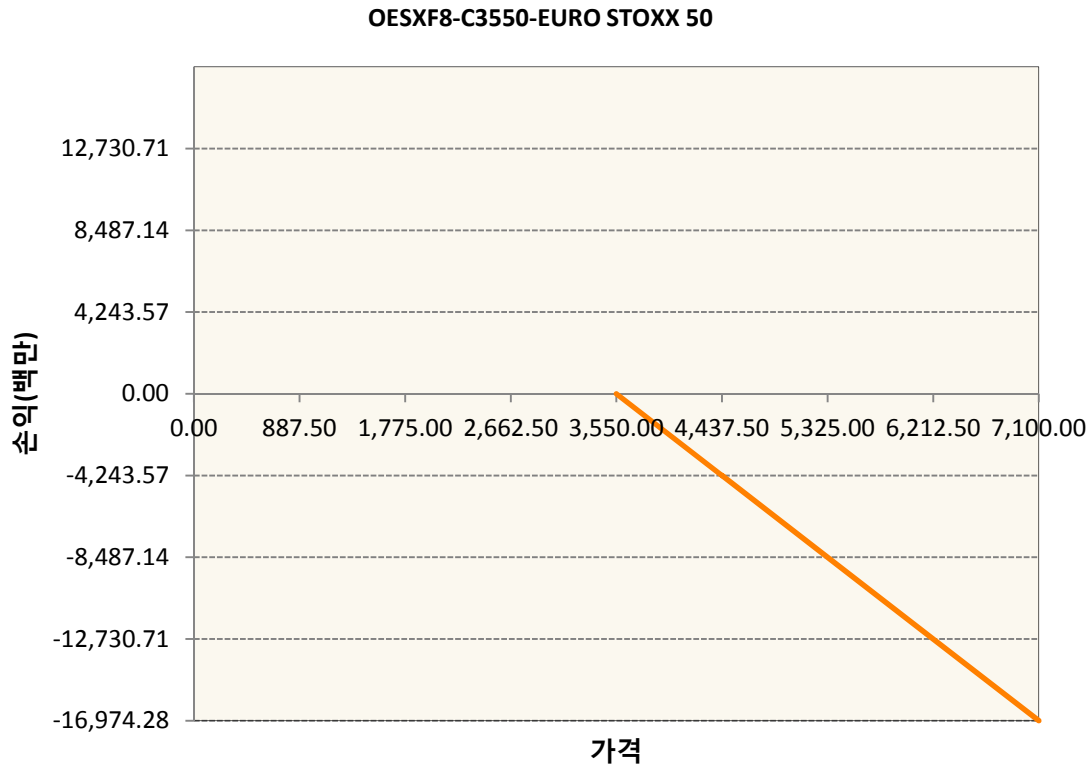
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

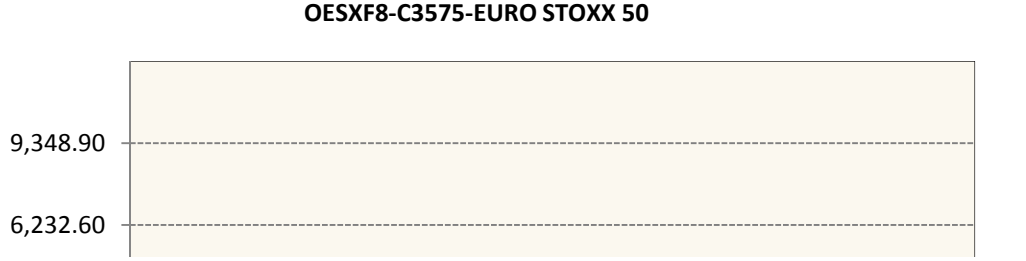
1. 계약금액

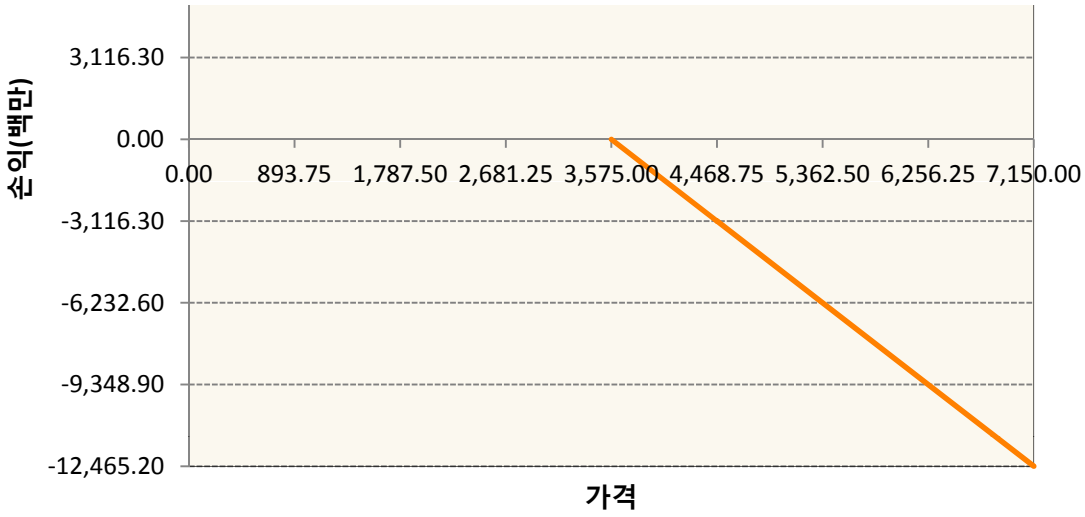
(단위:백만원)

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	21,133	0	21,133	
누계	유가증권	스왑	96,141	0	96,141	장외
누계	유가증권	옵션	0	58,879	-58,879	장내
누계	지수	스왑	51,276	0	51,276	장외

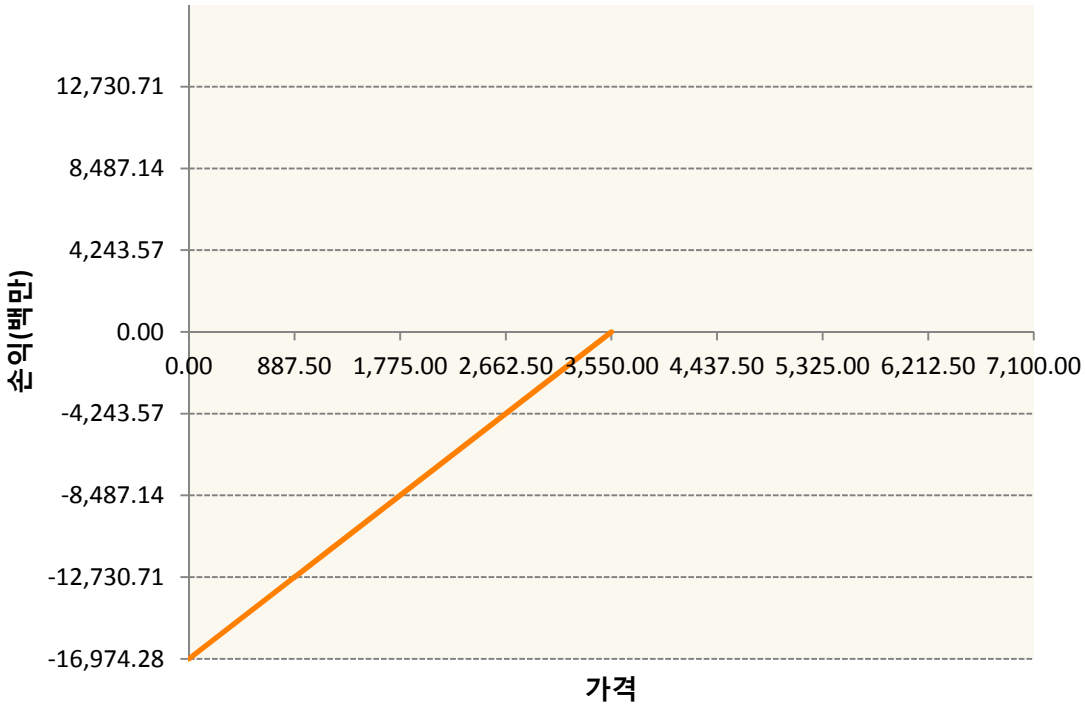
2. 만기시점의 손익구조



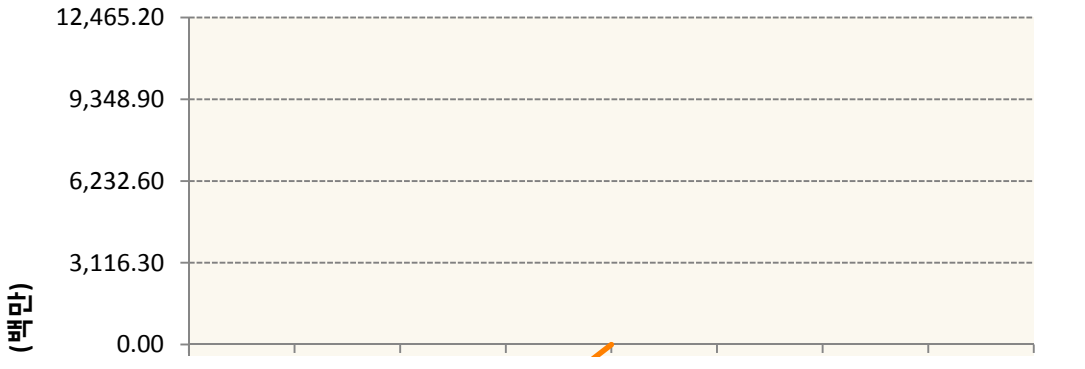


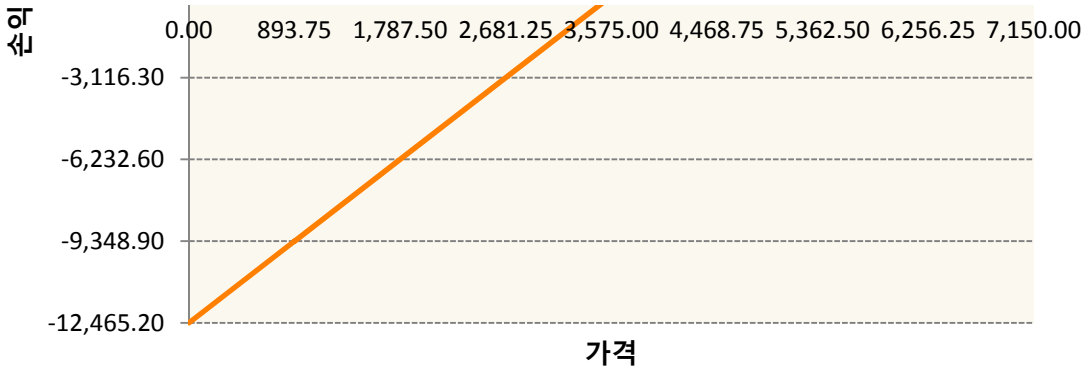


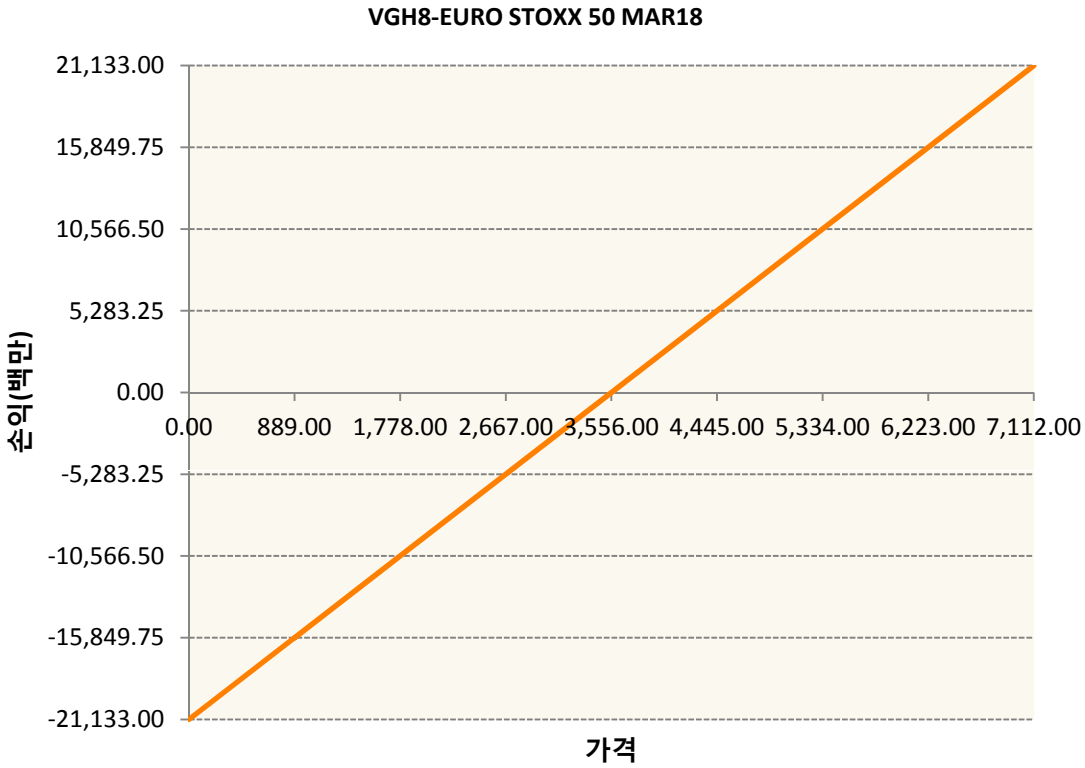
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	82
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	110
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,358
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	997
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,358
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	997
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,691

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

3,716

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

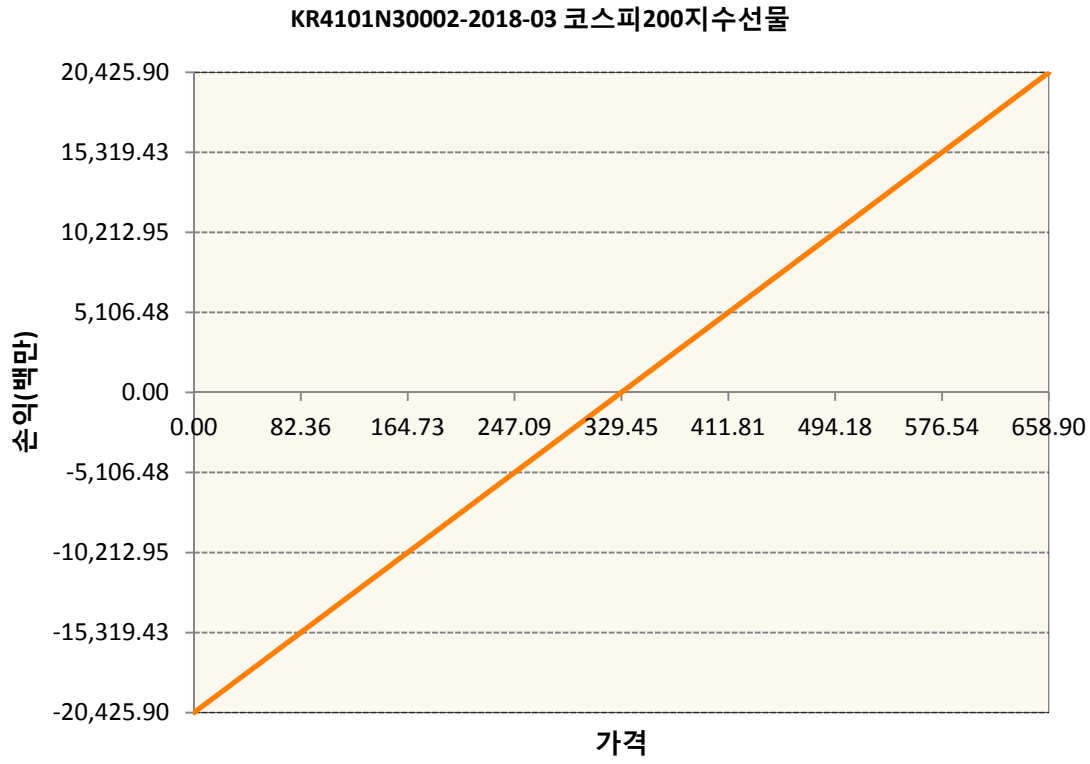
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,426	0	20,426	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,632
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632	-1,632
-5.33%	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088	-1,088
-2.67%	-544	-544	-544	-544	-544	-544	-544
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	544	544	544	544	544	544	544
5.33%	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088	1,088
8.00%	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632	1,632

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

974

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

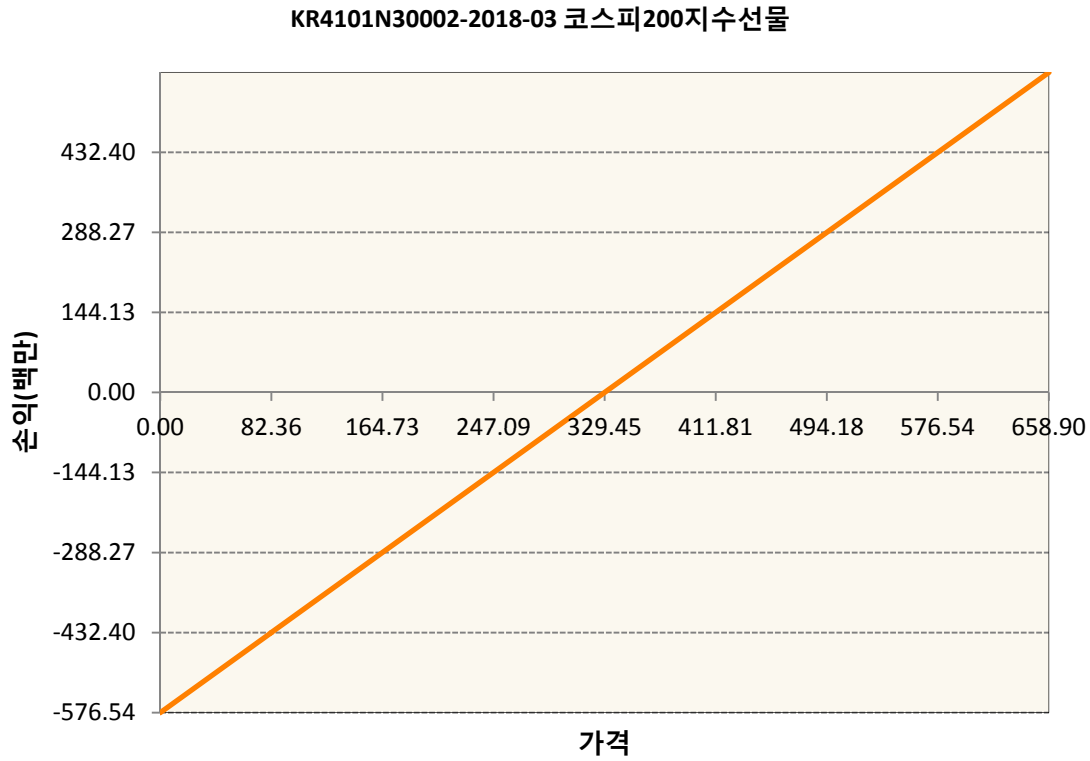
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	577	0	577	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%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-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%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	46	46	46	46	46	46	46

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

27

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

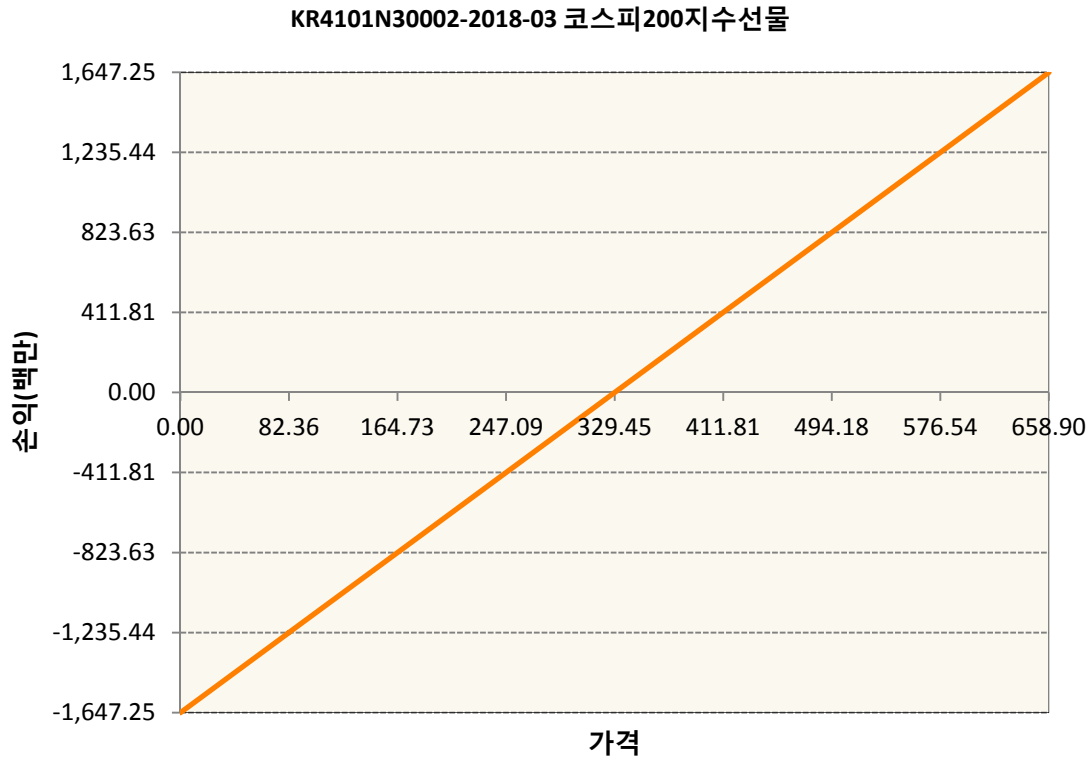
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,647	0	1,647	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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

79

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

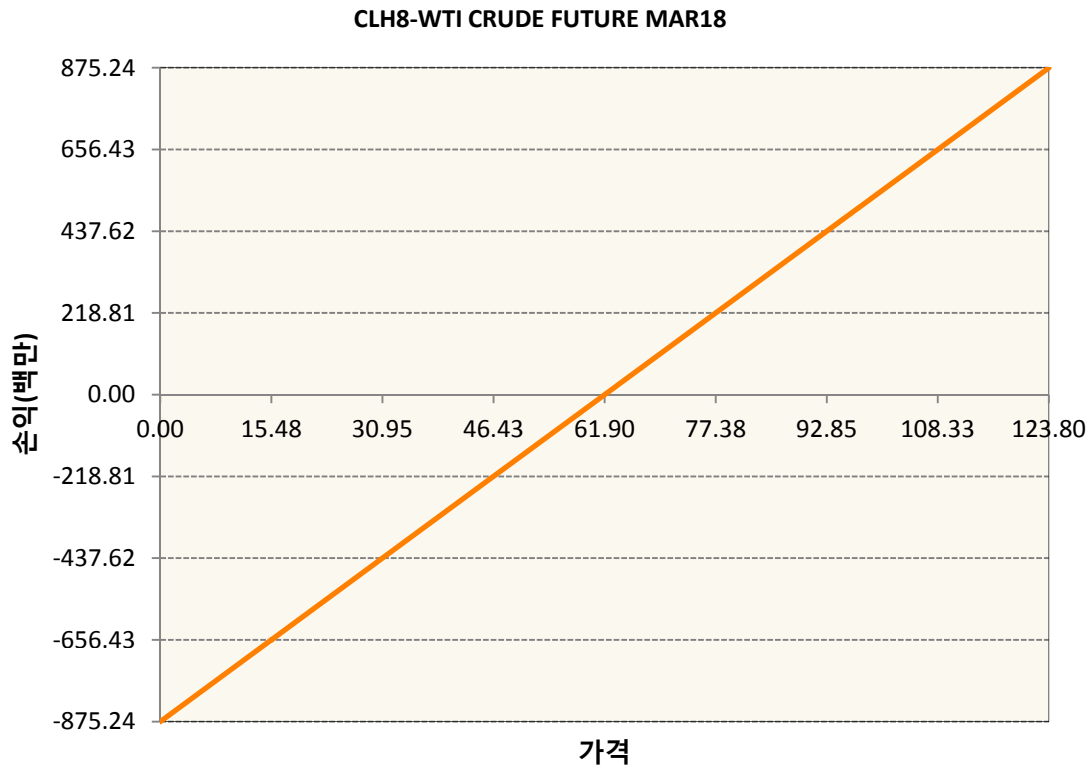
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

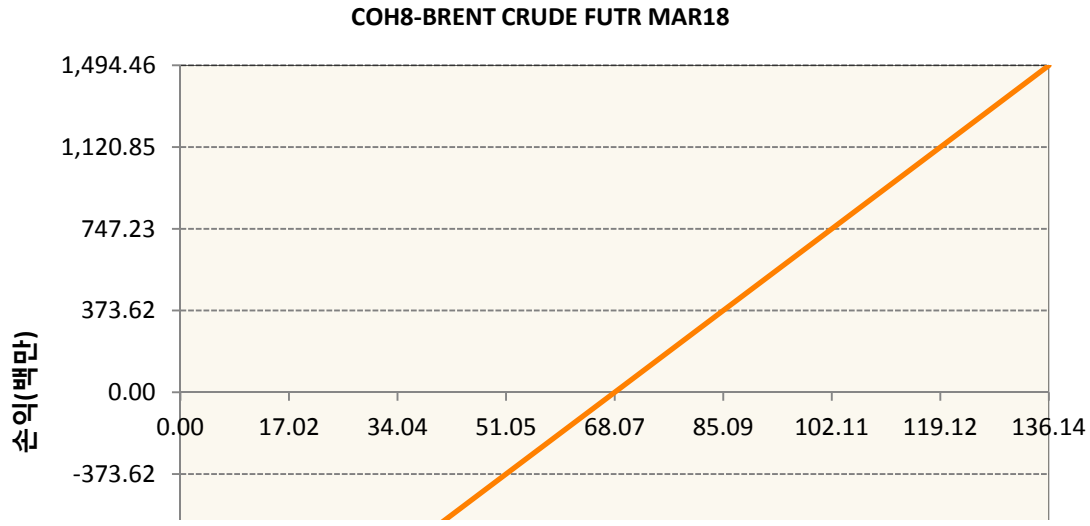
1. 계약금액

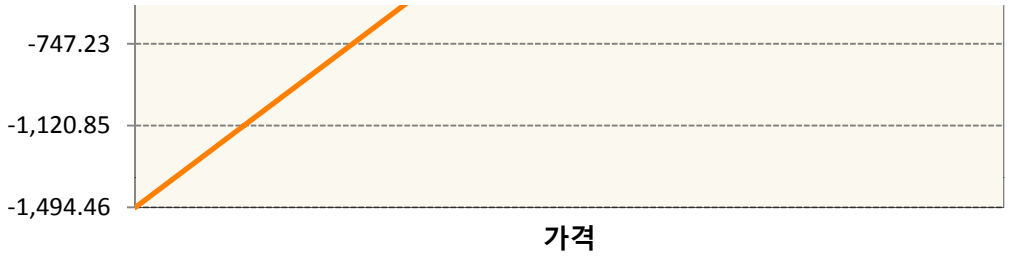
(단위:백만원)

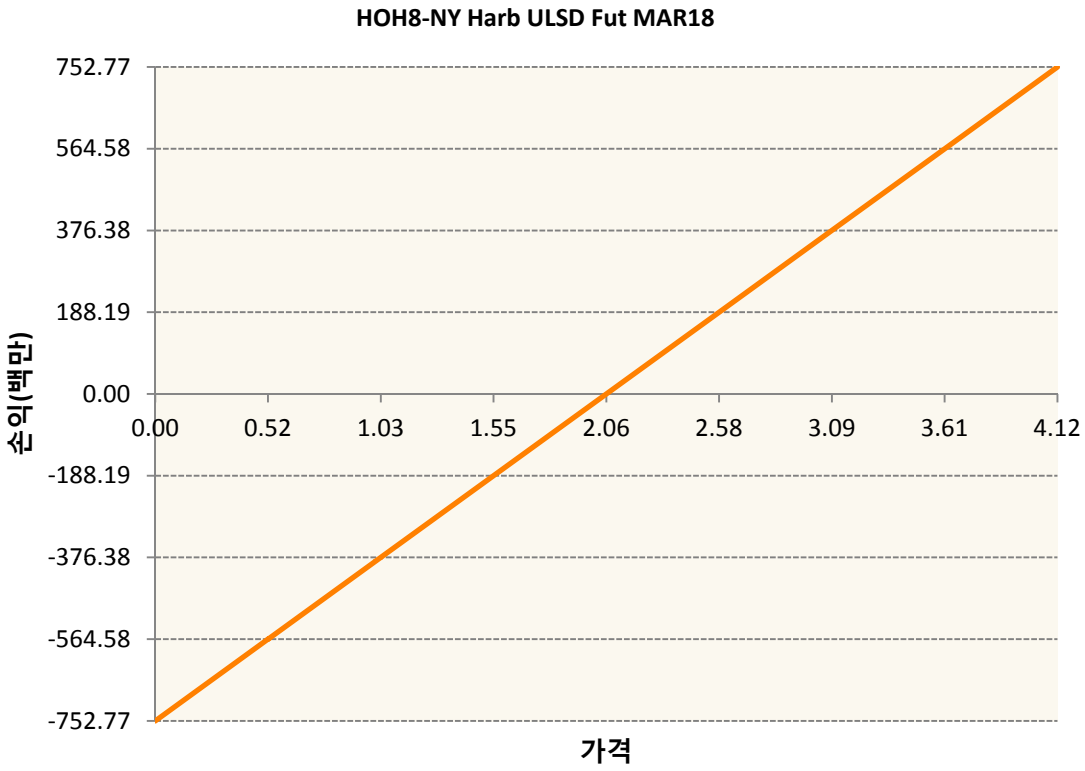
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,740	850	3,889	

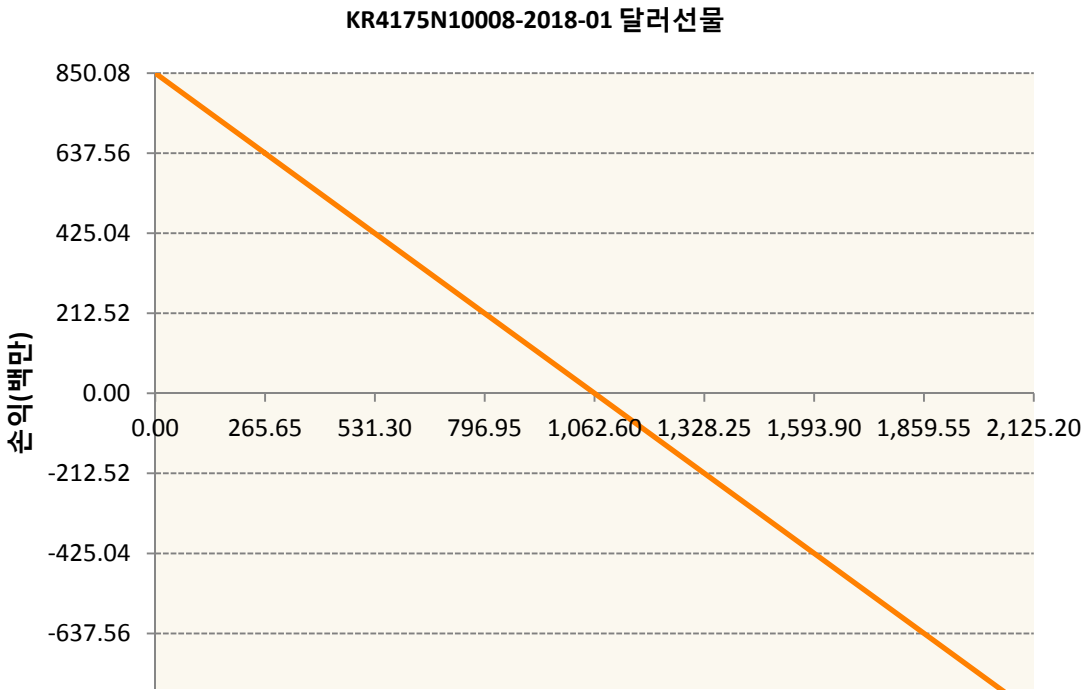
2. 만기시점의 손익구조

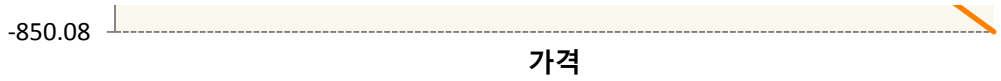


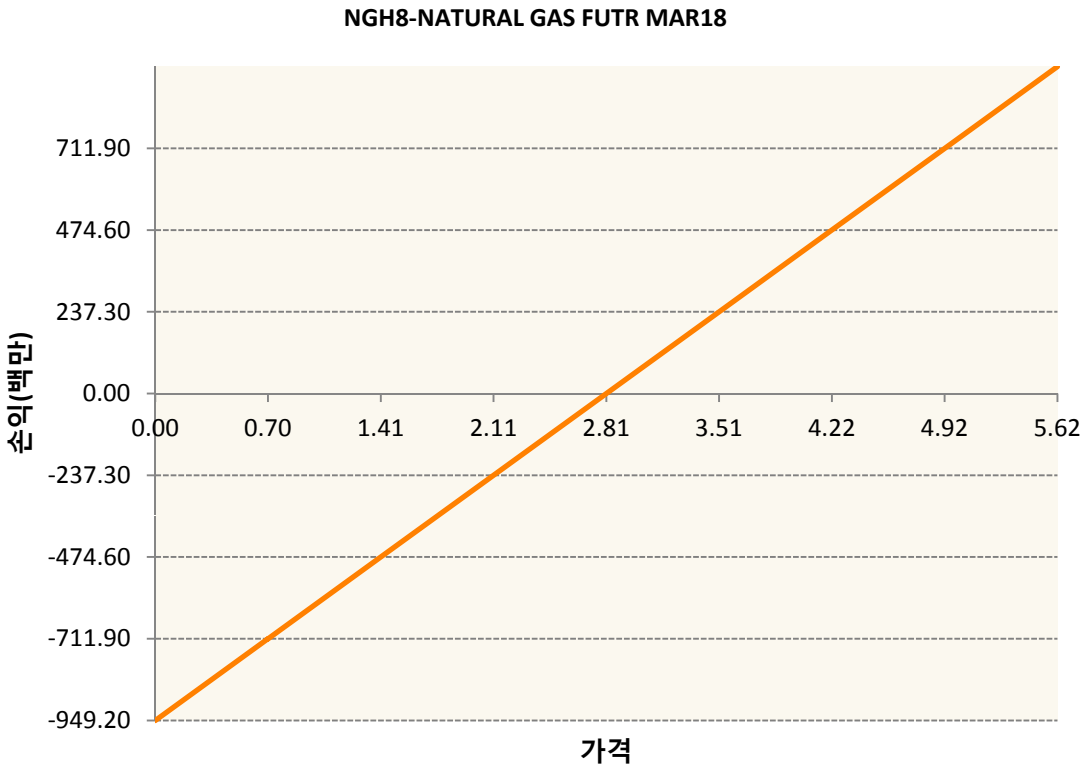


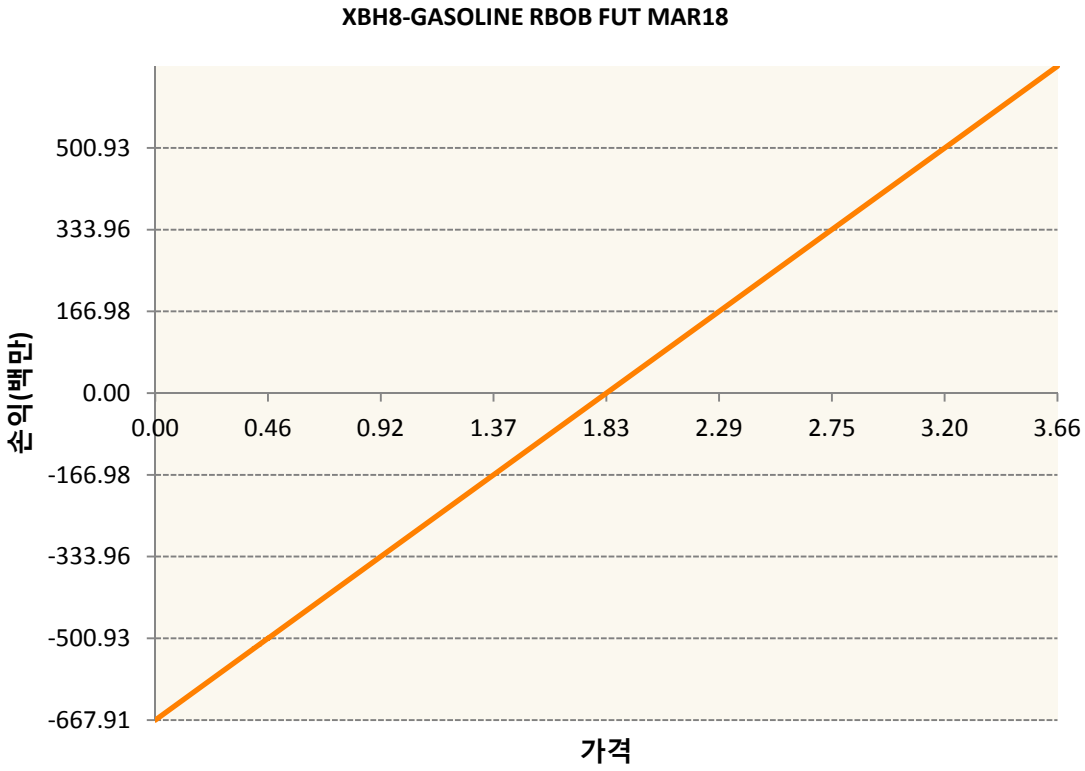

-747.23
-1,120.85
-1,494.46
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
752.77
564.58
376.38
188.19
0.00
-188.19
-376.38
-564.58
-752.77
0.00
0.52
1.03
1.55
2.06
2.58
3.09
3.61
4.12
손익(백만)
가격


KR4175N10008-2018-01 달러선물
850.08
637.56
425.04
212.52
0.00
-212.52
-425.04
-637.56
0.00
265.65
531.30
796.95
1,062.60
1,328.25
1,593.90
1,859.55
2,125.20
손익(백만)


-850.08
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
711.90
474.60
237.30
0.00
-237.30
-474.60
-711.90
-949.20
0.00
0.70
1.41
2.11
2.81
3.51
4.22
4.92
5.62
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
500.93
333.96
166.98
0.00
-166.98
-333.96
-500.93
-667.91
0.00
0.46
0.92
1.37
1.83
2.29
2.75
3.20
3.66
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	70
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	120
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	60
KR4175N10(	2018-01 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	76
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	53

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

626

공시일	2018-01-08
기준일	2018-01-05

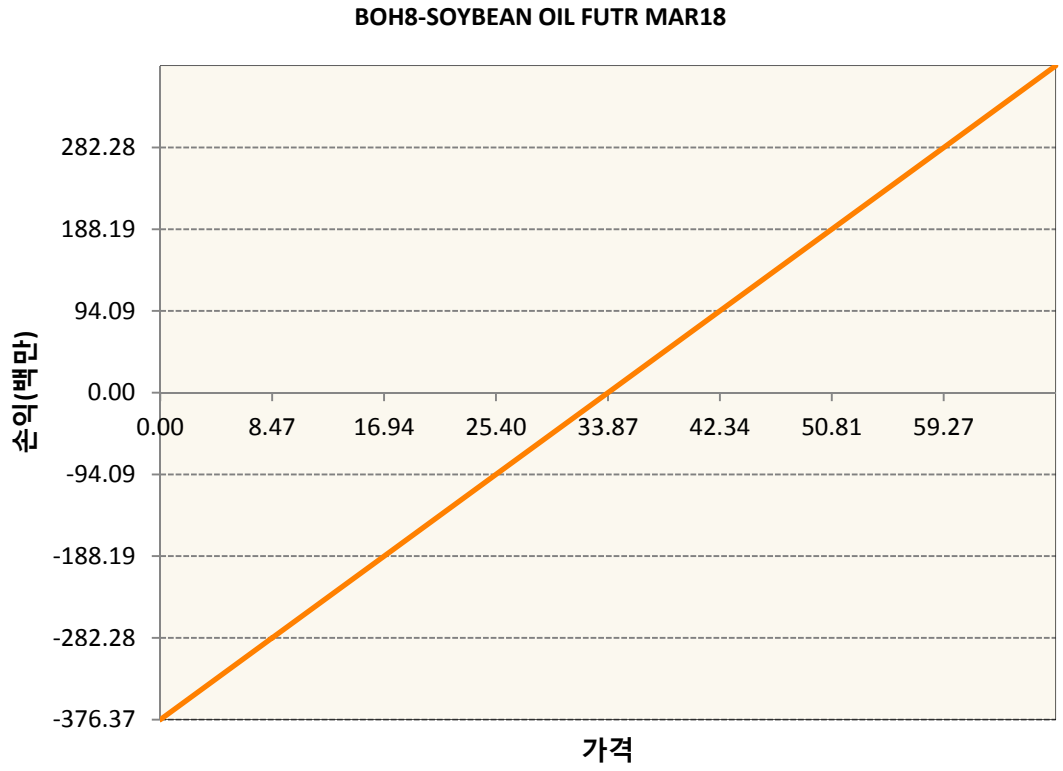
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

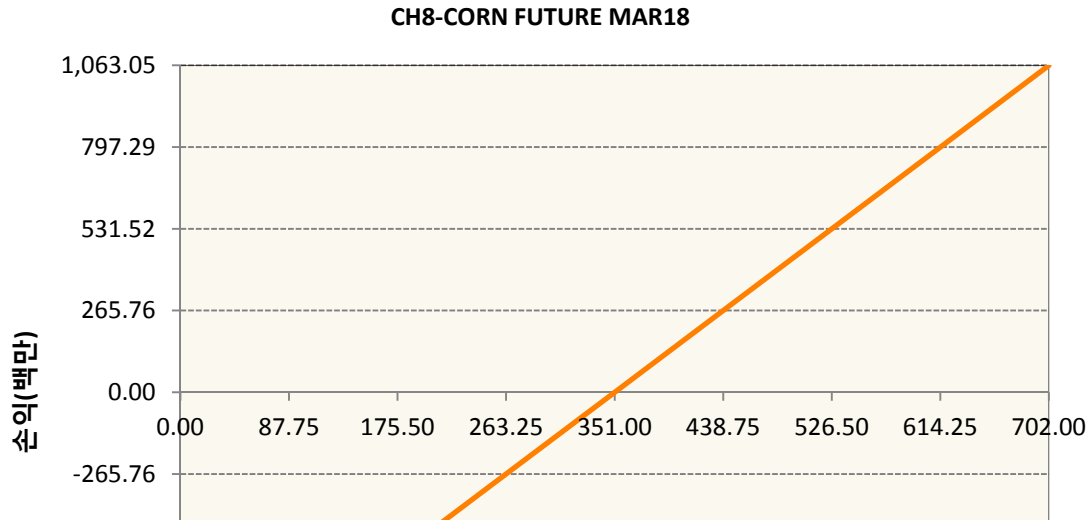
1. 계약금액

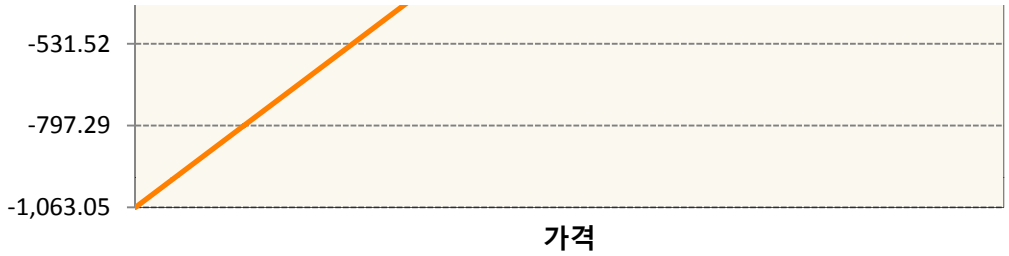
(단위:백만원)

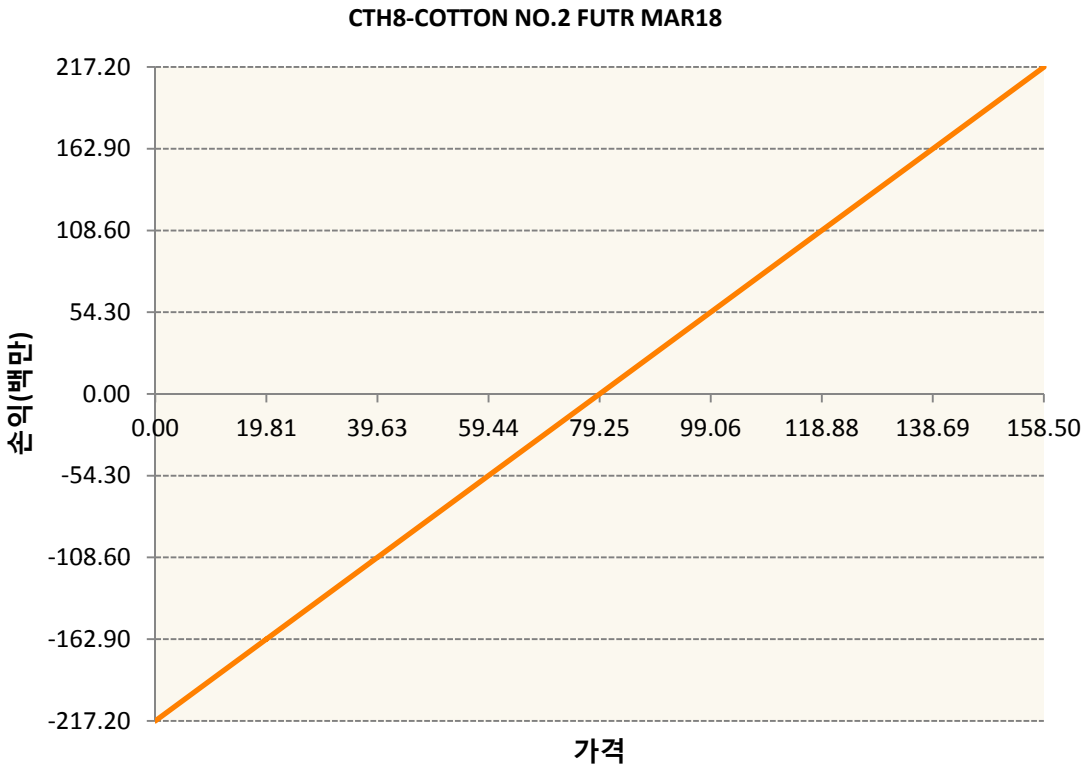
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,297	319	3,978	

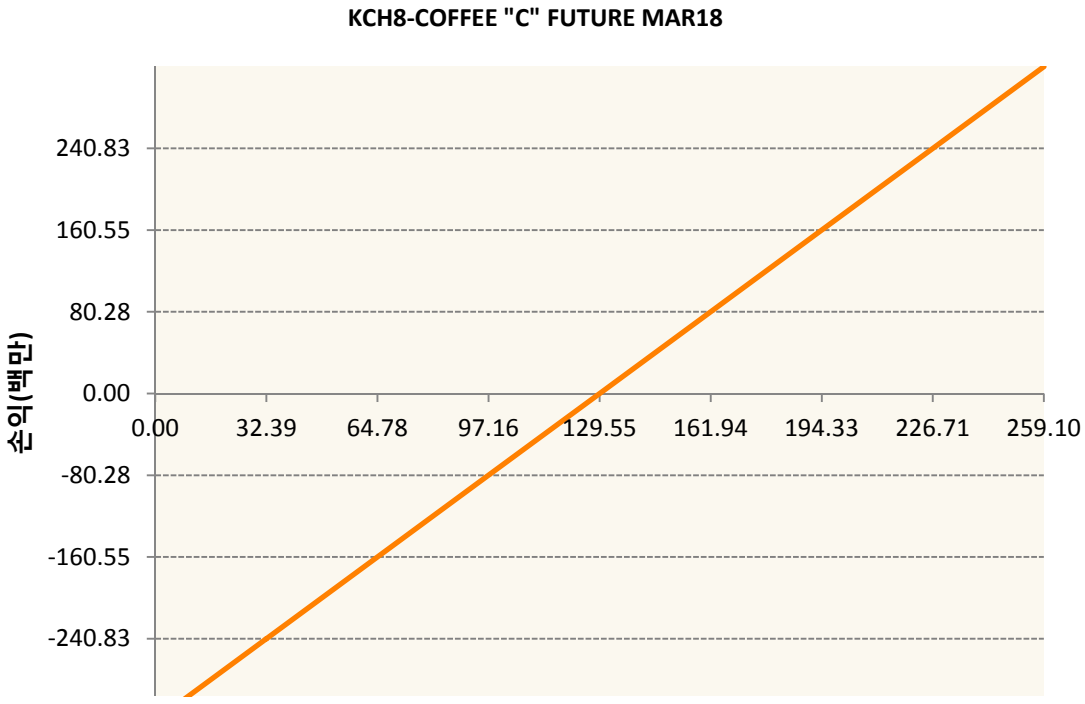
2. 만기시점의 손익구조

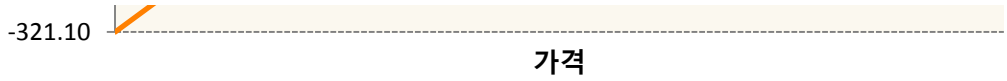


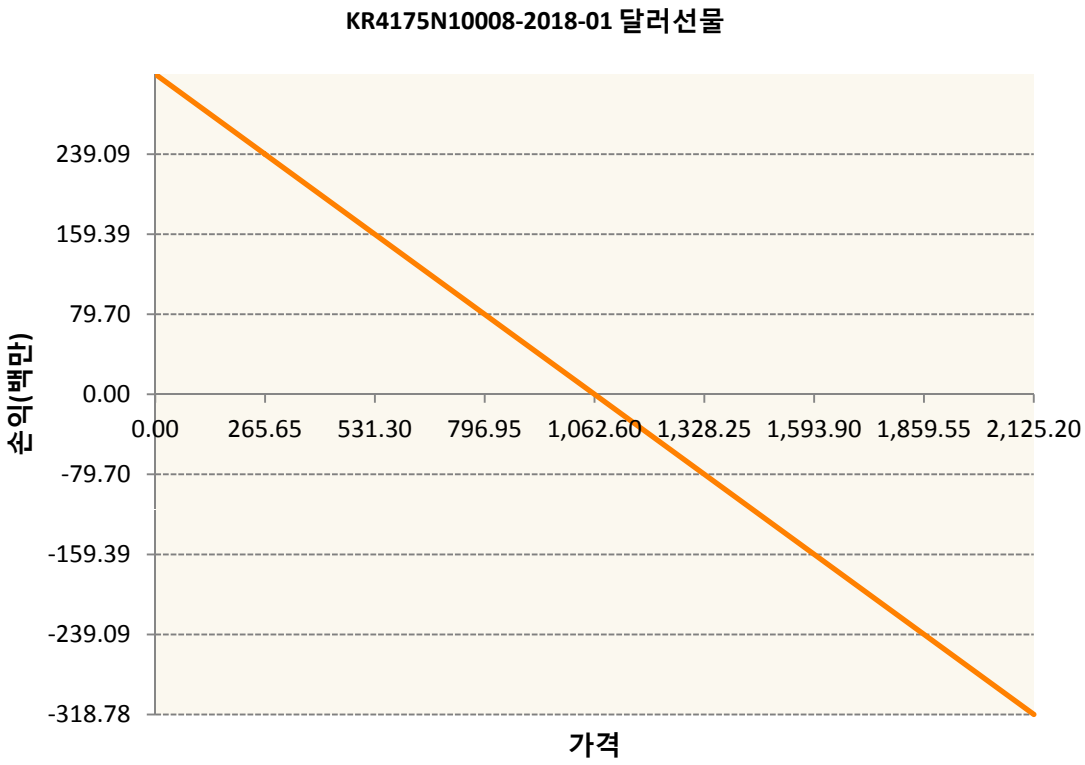


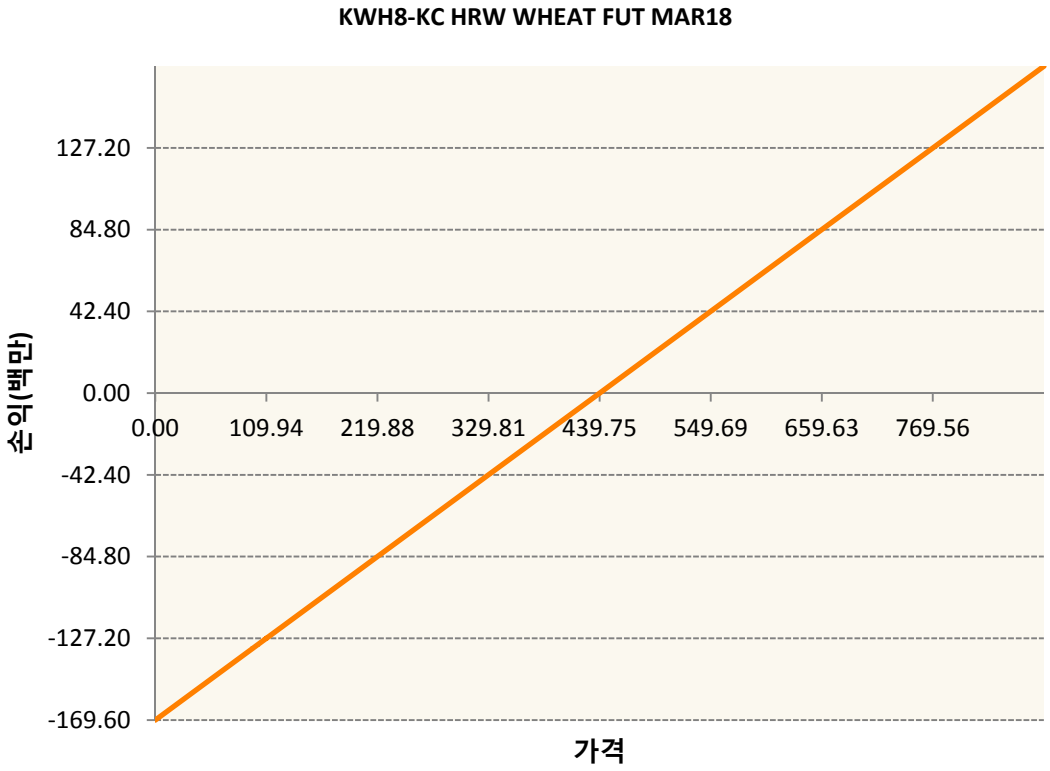

-531.52
-797.29
-1,063.05
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
217.20
162.90
108.60
54.30
0.00
-54.30
-108.60
-162.90
-217.20
손익(백만)
0.00
19.81
39.63
59.44
79.25
99.06
118.88
138.69
158.50
가격

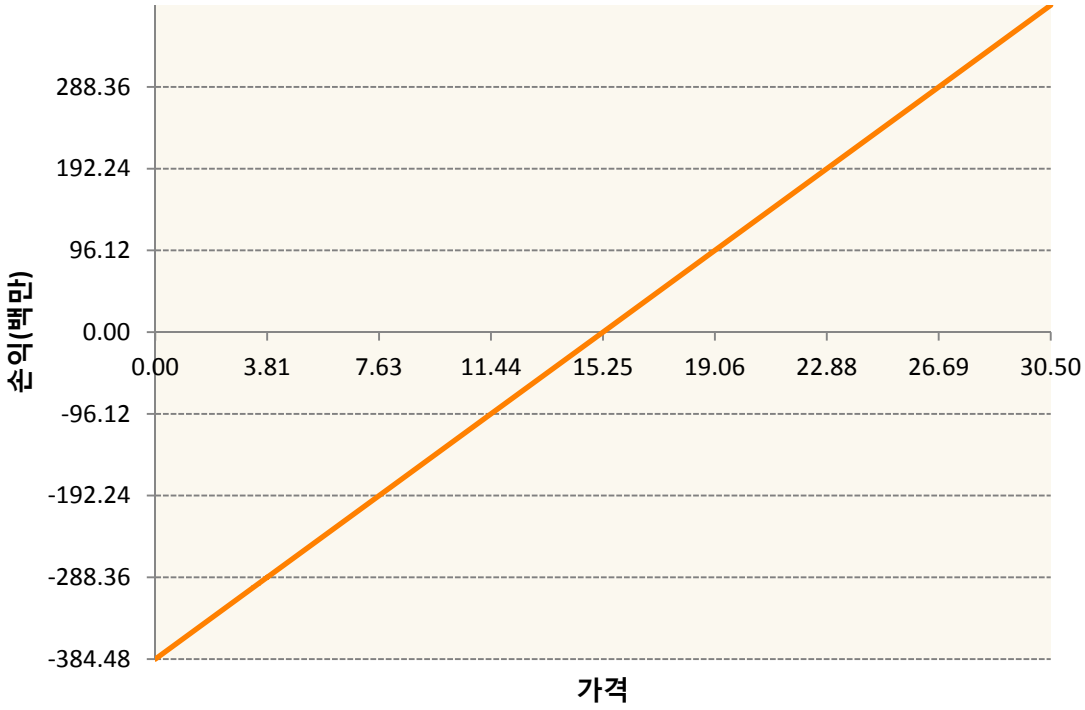

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
240.83
160.55
80.28
0.00
-80.28
-160.55
-240.83
손익(백만)
0.00
32.39
64.78
97.16
129.55
161.94
194.33
226.71
259.10


-321.10
가격

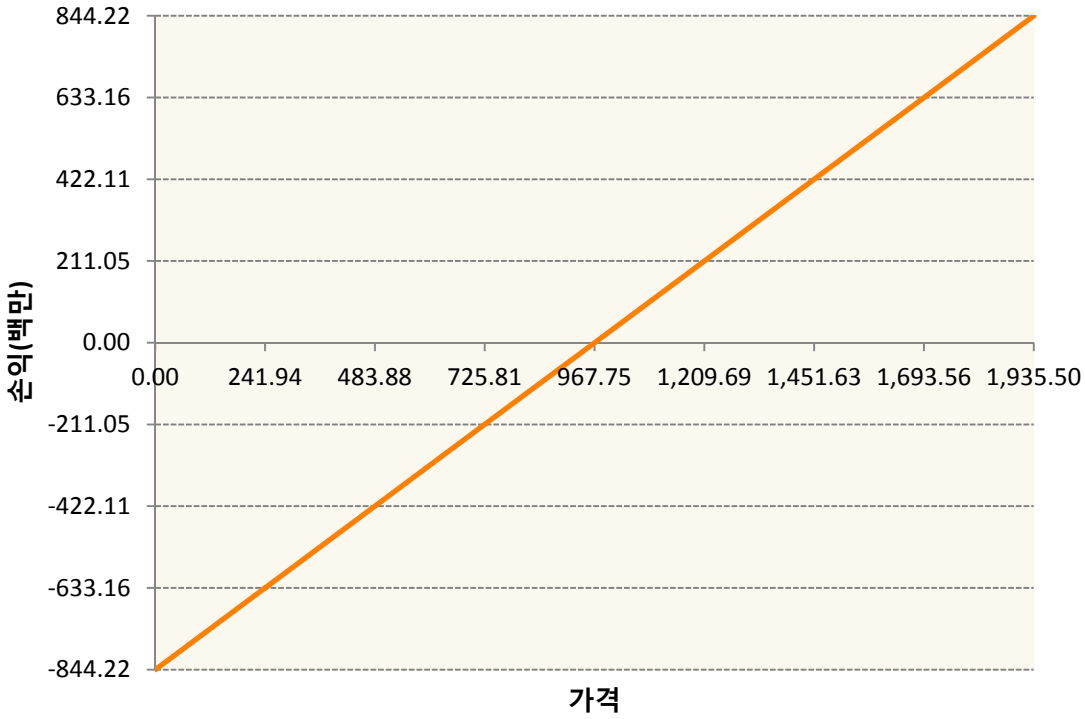

KR4175N10008-2018-01 달러선물
239.09
159.39
79.70
0.00
-79.70
-159.39
-239.09
-318.78
0.00
265.65
531.30
796.95
1,062.60
1,328.25
1,593.90
1,859.55
2,125.20
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
127.20
84.80
42.40
0.00
-42.40
-84.80
-127.20
-169.60
0.00
109.94
219.88
329.81
439.75
549.69
659.63
769.56
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

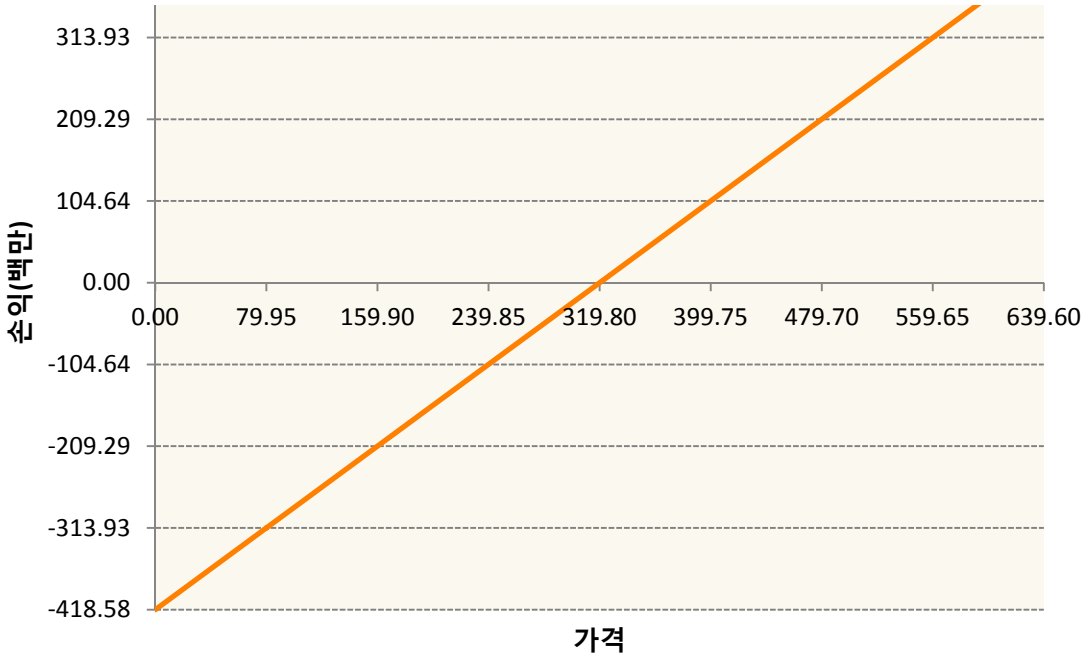


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18

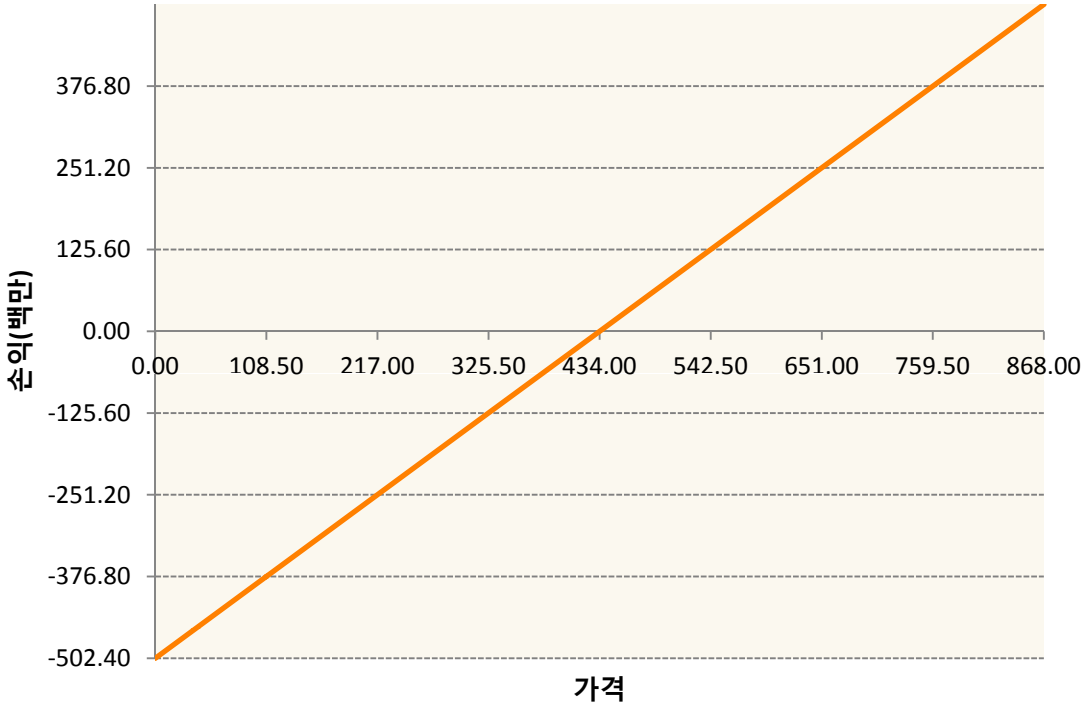


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	30
CH8	CORN FUTURE MAR18	85
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	17
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	26
KR4175N10(	2018-01 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	14
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	31
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	68
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	33
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	40

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

360