공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

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	2018-01-09
기준일	2018-01-08

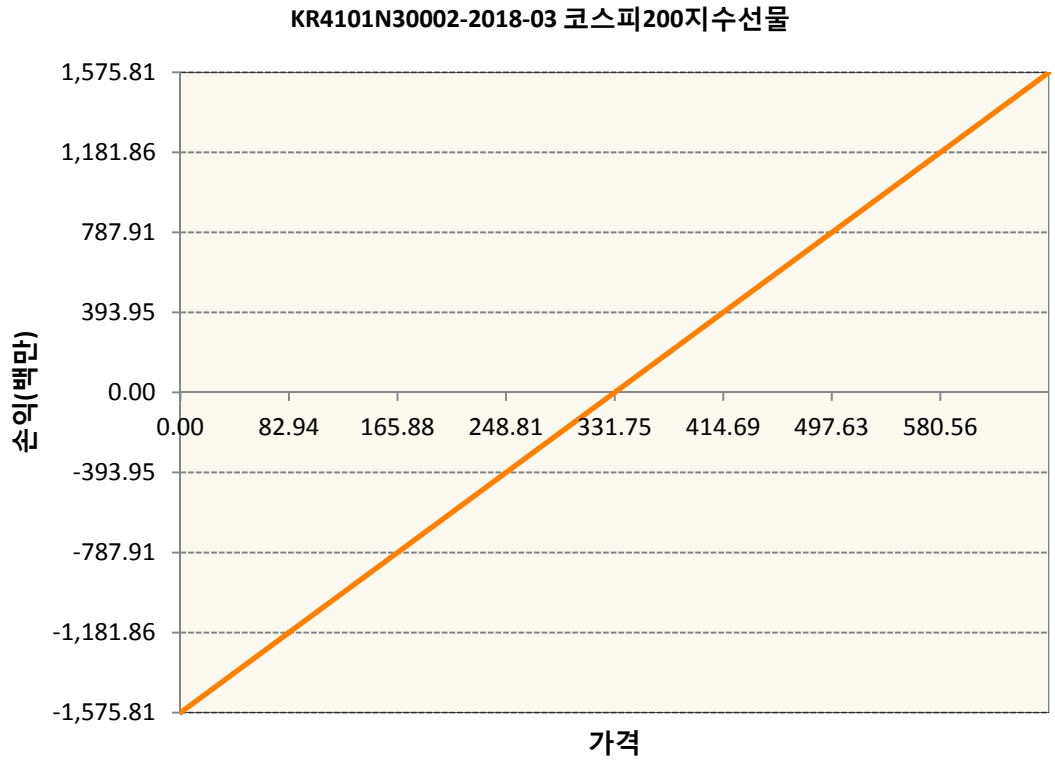
스마트인덱스모

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	1,576	0	1,576	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-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%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	126	126	126	126	126	126	126

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

75

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

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	1,127

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

362

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

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	419

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

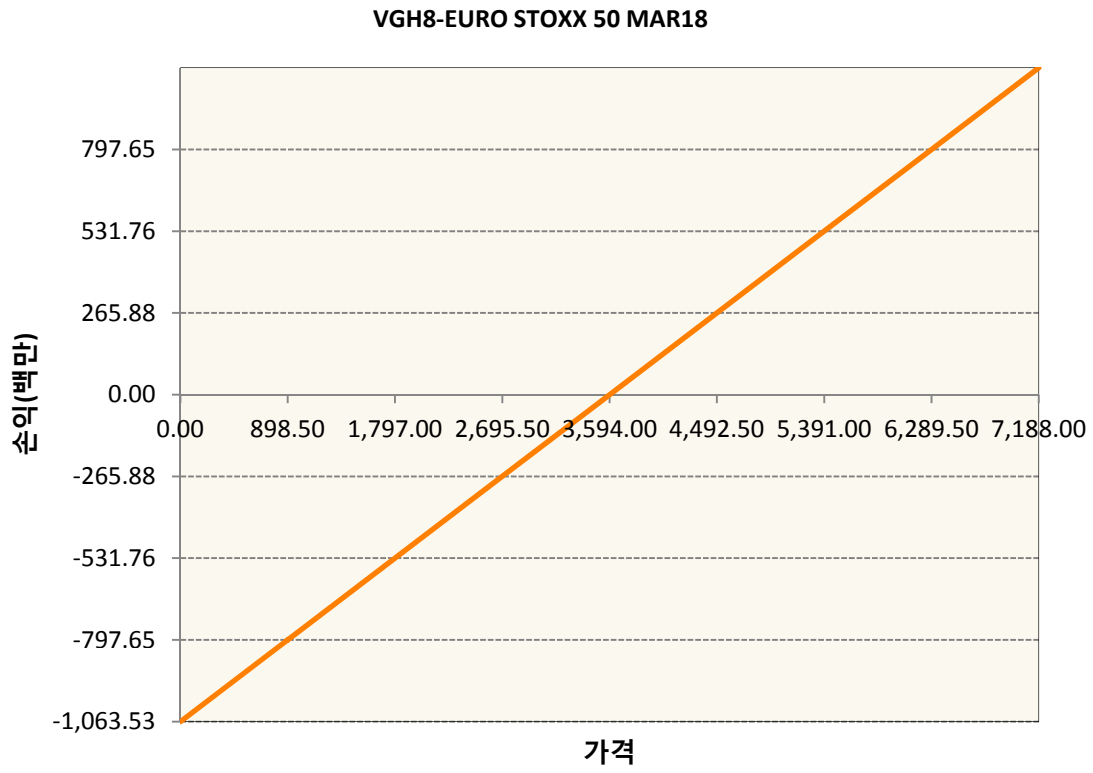
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,064	0	1,064	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	85

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

(단위:백만원)

48

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

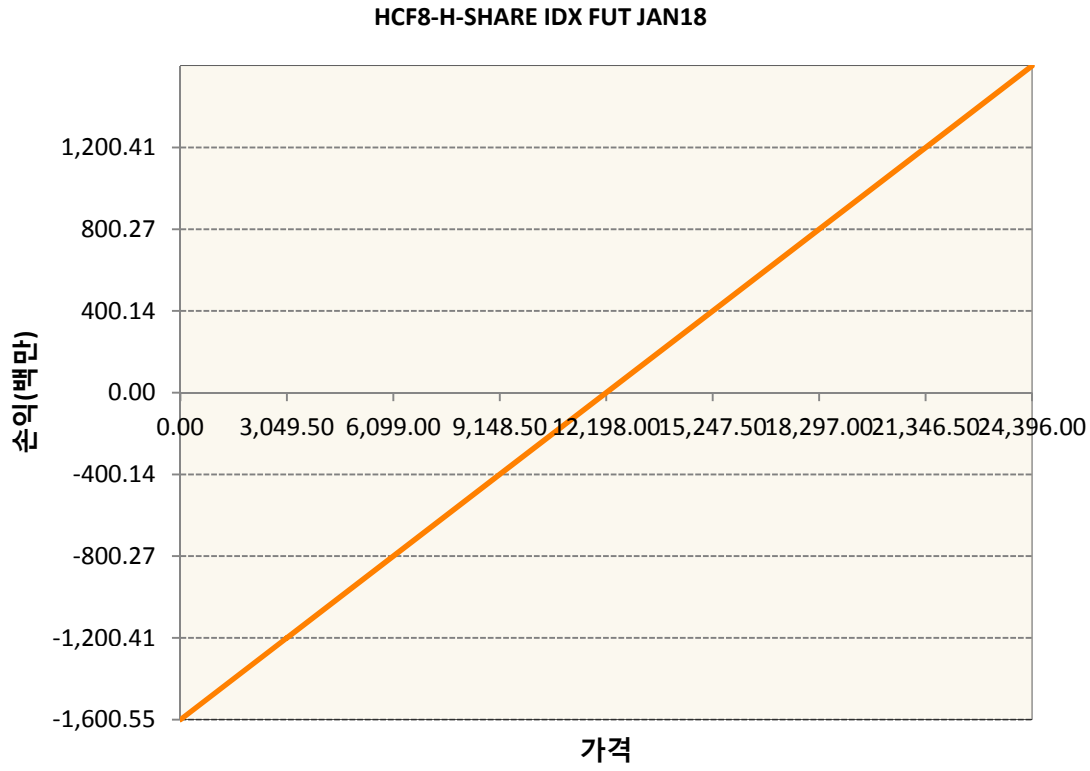
차이나인덱스모(주식-파생형)

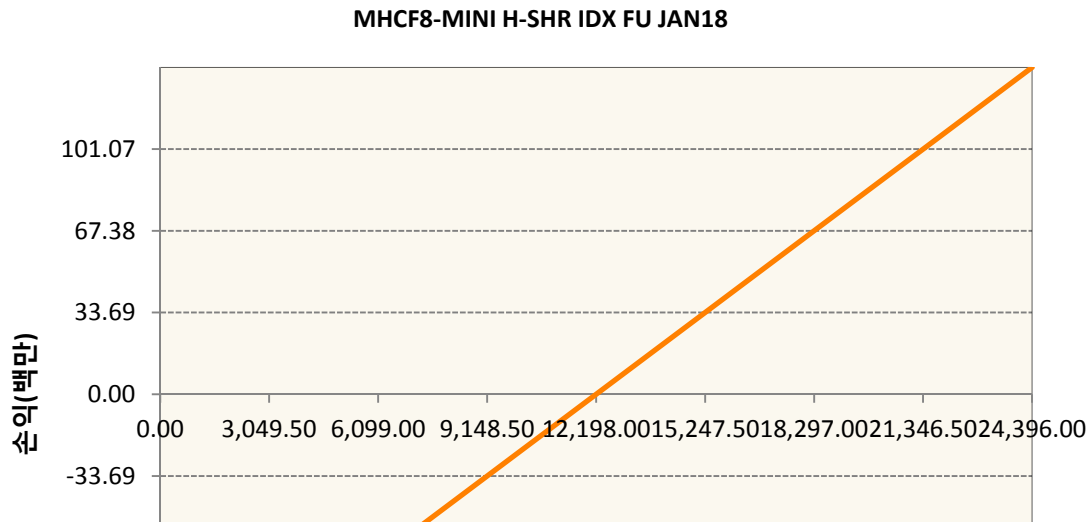
1. 계약금액

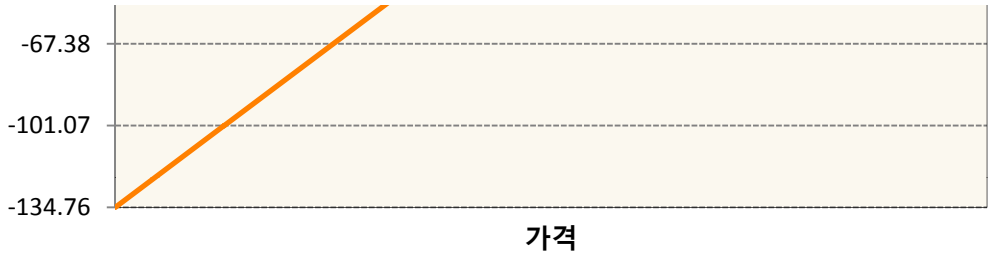
(단위:백만원)

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	2018-01-09
기준일	2018-01-08

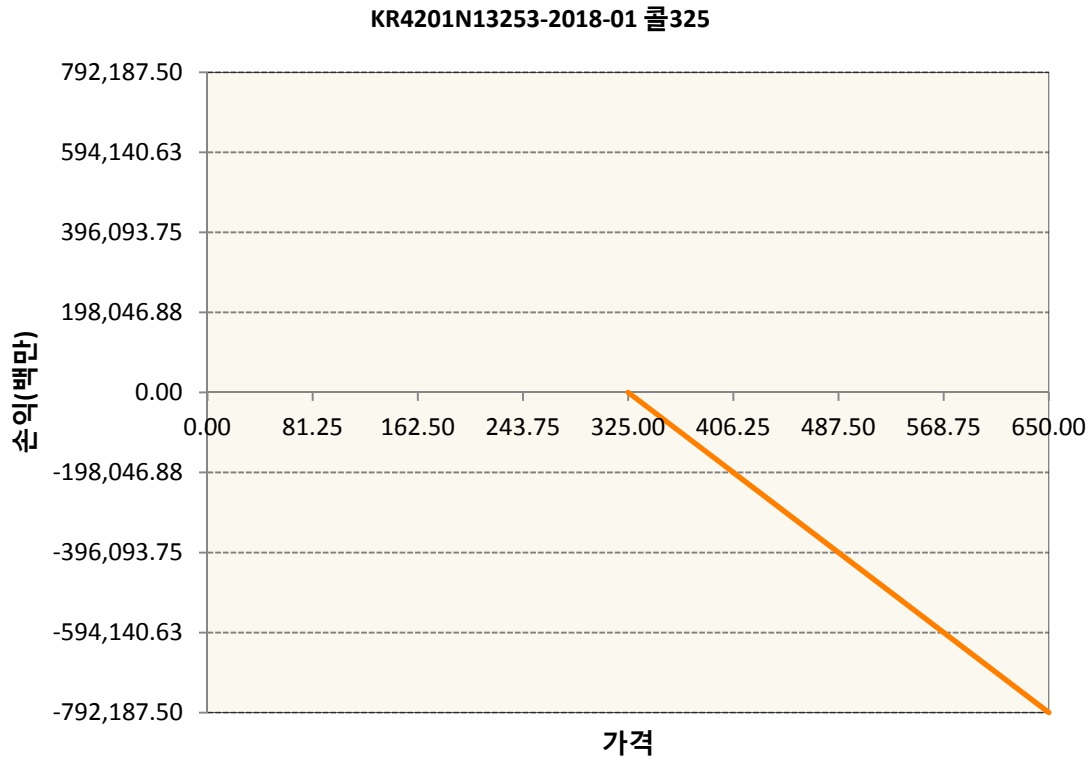
커버드콜모(주식혼합-파생형)

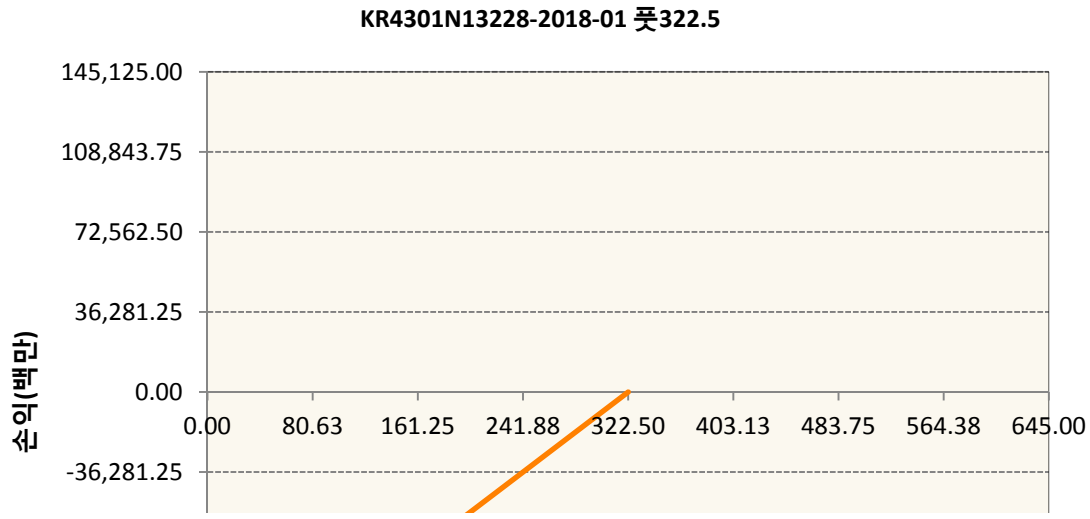
1. 계약금액

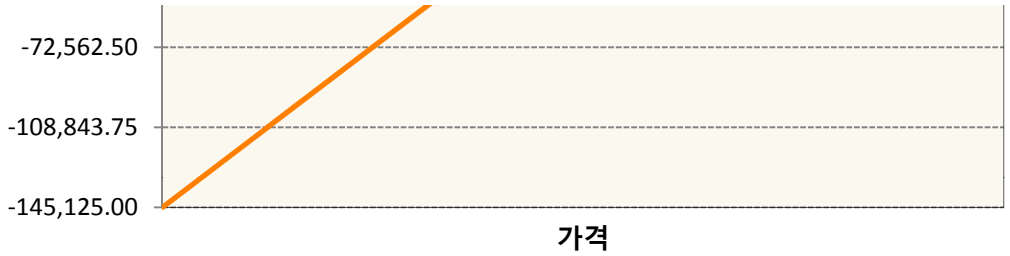
(단위:백만원)

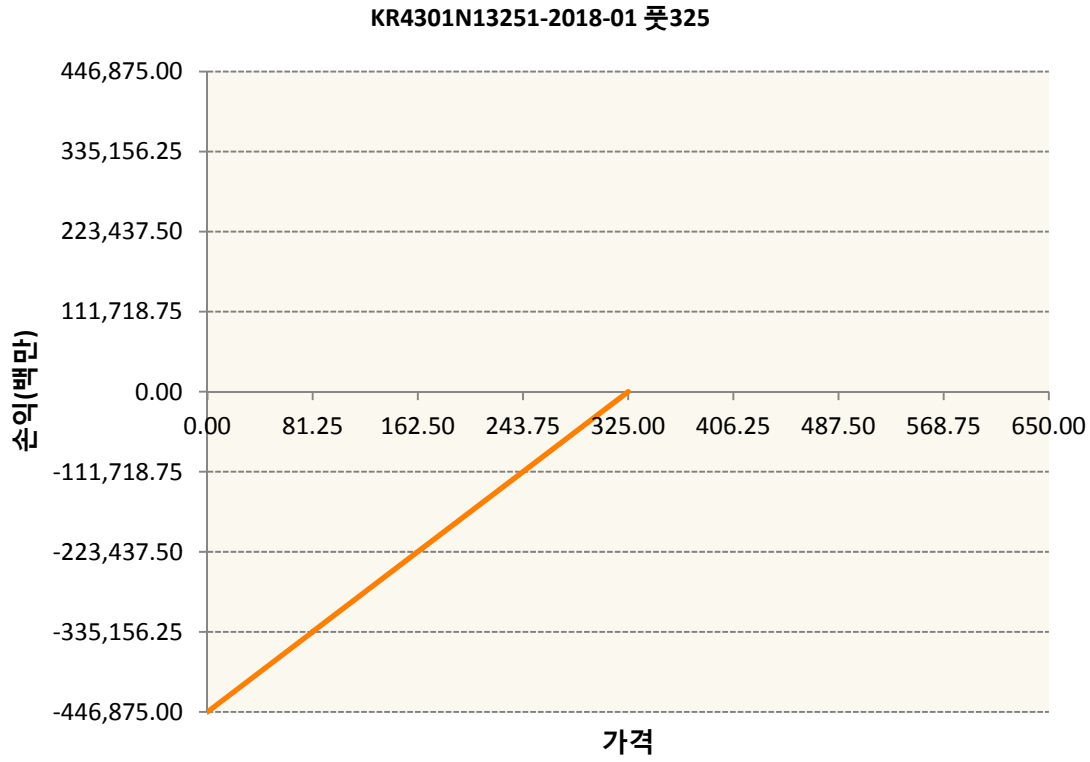
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,976	0	7,976	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,384,188	-1,384,188	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N132 2018-01 콜325							62,676
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17,290	17,289	17,286	17,280	17,267	17,246	17,212
-5.33%	17,212	17,136	17,027	16,883	16,704	16,493	16,252
-2.67%	14,542	14,012	13,472	12,925	12,372	11,815	11,254
0%	1,088	761	396	0	-421	-863	-1,323
2.67%	-19,624	-19,646	-19,686	-19,748	-19,836	-19,952	-20,096
5.33%	-41,142	-41,143	-41,143	-41,146	-41,152	-41,163	-41,181
8.00%	-62,674	-62,674	-62,674	-62,674	-62,674	-62,675	-62,676
KR4301N132 2018-01 풋322.5							7,959
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,959	-7,959	-7,959	-7,959	-7,959	-7,959	-7,959

-5.33%	-3,984	-3,984	-3,985	-3,987	-3,990	-3,994	-4,000
-2.67%	-484	-537	-591	-644	-698	-751	-805
0%	4	3	2	0	-4	-9	-16
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					27,684

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27,684	-27,684	-27,684	-27,684	-27,684	-27,684	-27,684
-5.33%	-15,538	-15,538	-15,538	-15,539	-15,540	-15,543	-15,548
-2.67%	-3,738	-3,848	-3,967	-4,092	-4,222	-4,357	-4,495
0%	71	56	32	0	-42	-92	-152
2.67%	84	84	84	84	84	84	83
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	84	84	84	84	84	84	84

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

109,025

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

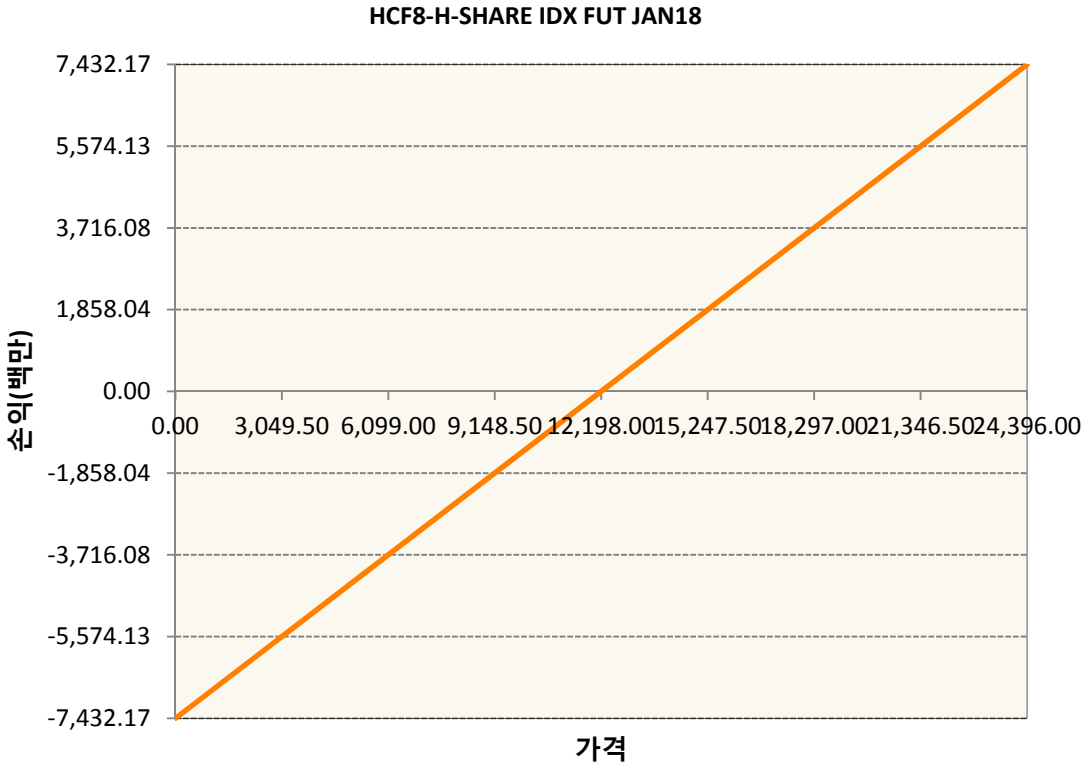
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

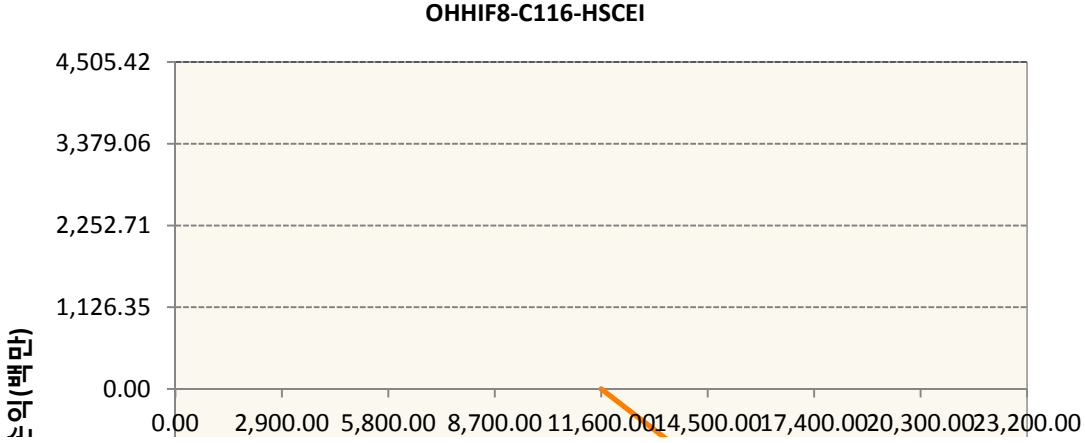
1. 계약금액

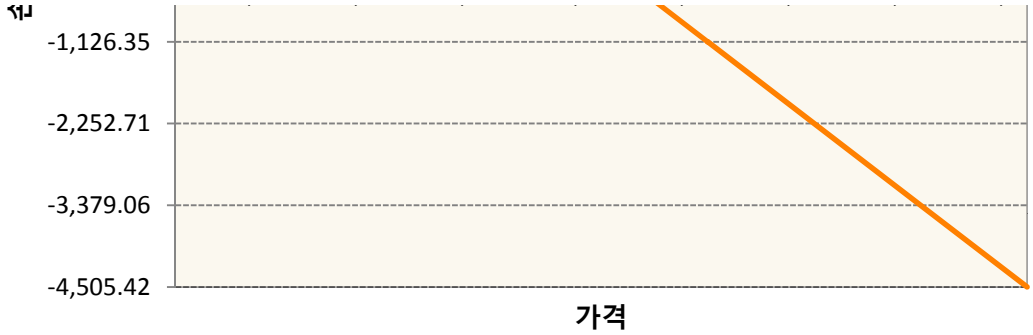
(단위:백만원)

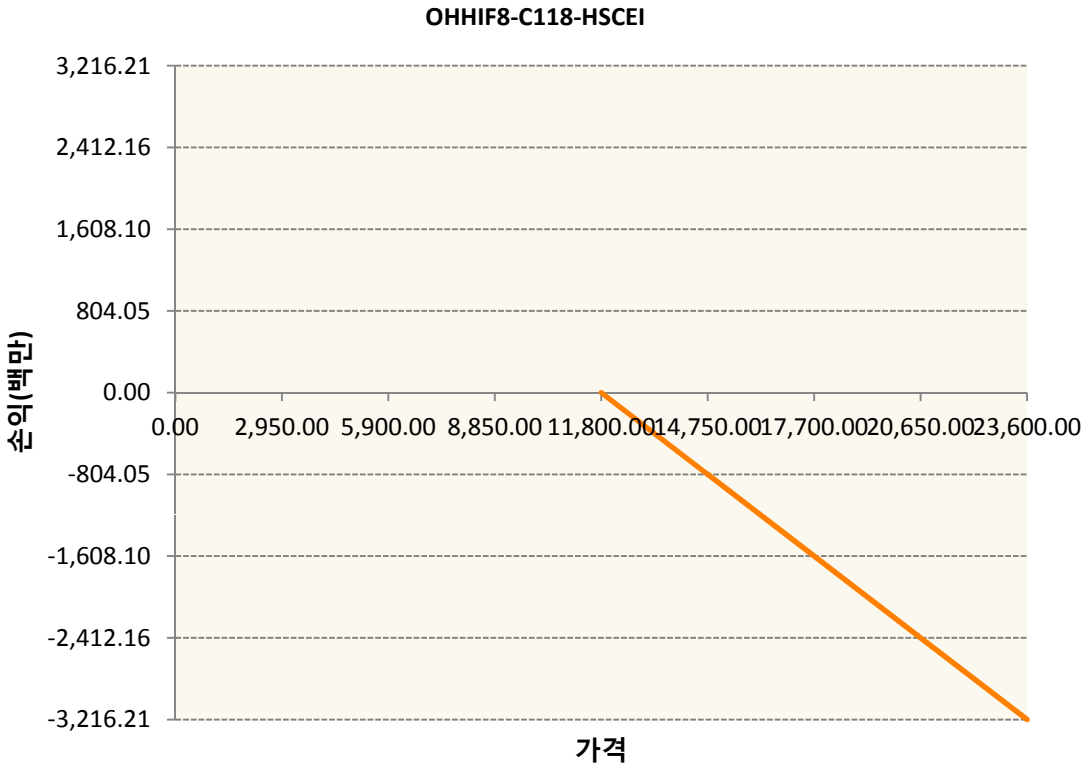
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,432	0	7,432	장내
누계	유가증권	옵션	0	15,443	-15,443	장내

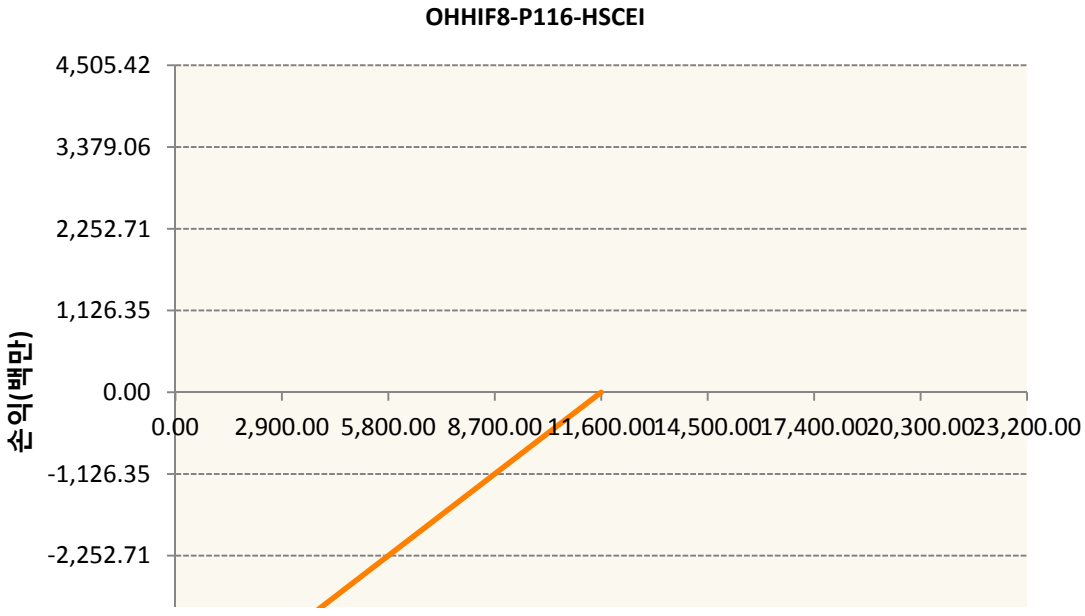
2. 만기시점의 손익구조

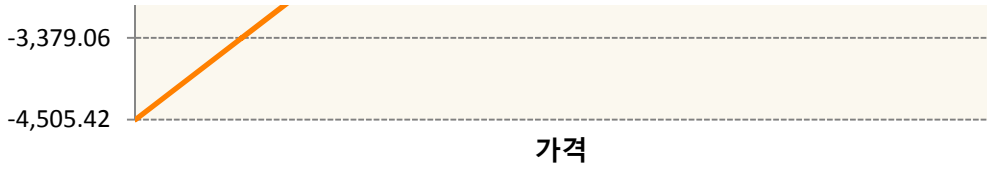


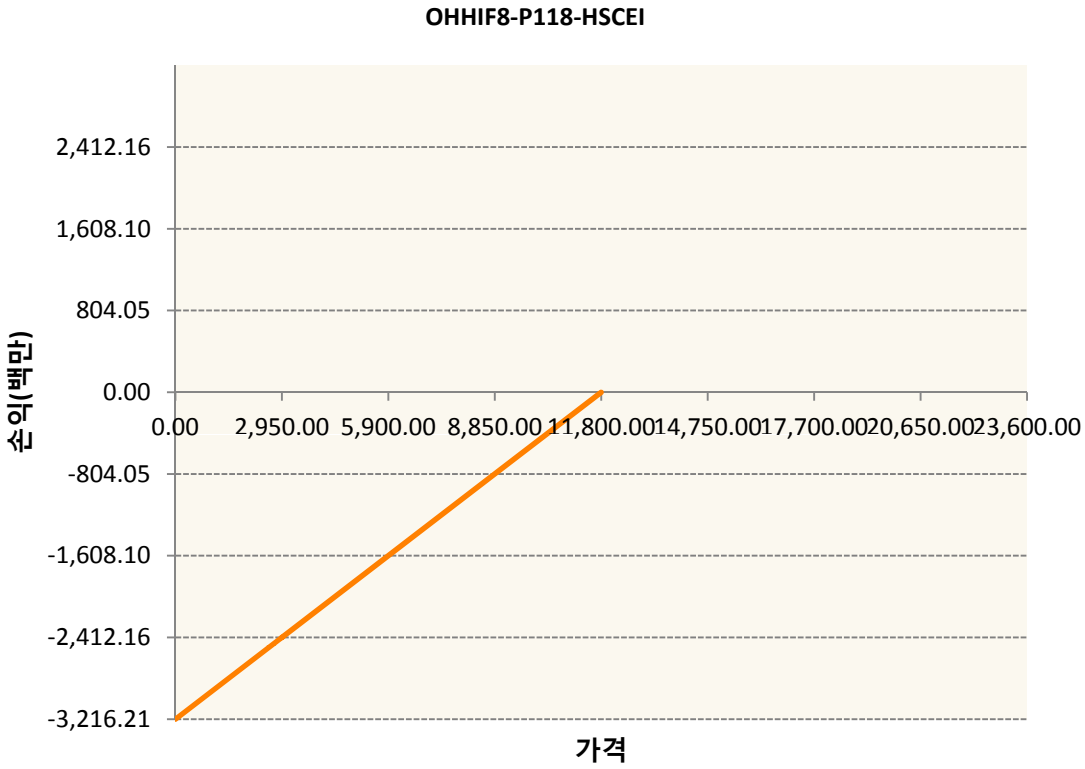



-1,126.35
-2,252.71
-3,379.06
-4,505.42
가격


OHHIF8-C118-HSCEI
3,216.21
2,412.16
1,608.10
804.05
0.00
-804.05
-1,608.10
-2,412.16
-3,216.21
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
4,505.42
3,379.06
2,252.71
1,126.35
0.00
-1,126.35
-2,252.71
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	595
OHHIF8-C11	HSCEI	360
OHHIF8-C11	HSCEI	257
OHHIF8-P11	HSCEI	360
OHHIF8-P11	HSCEI	257

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,462

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

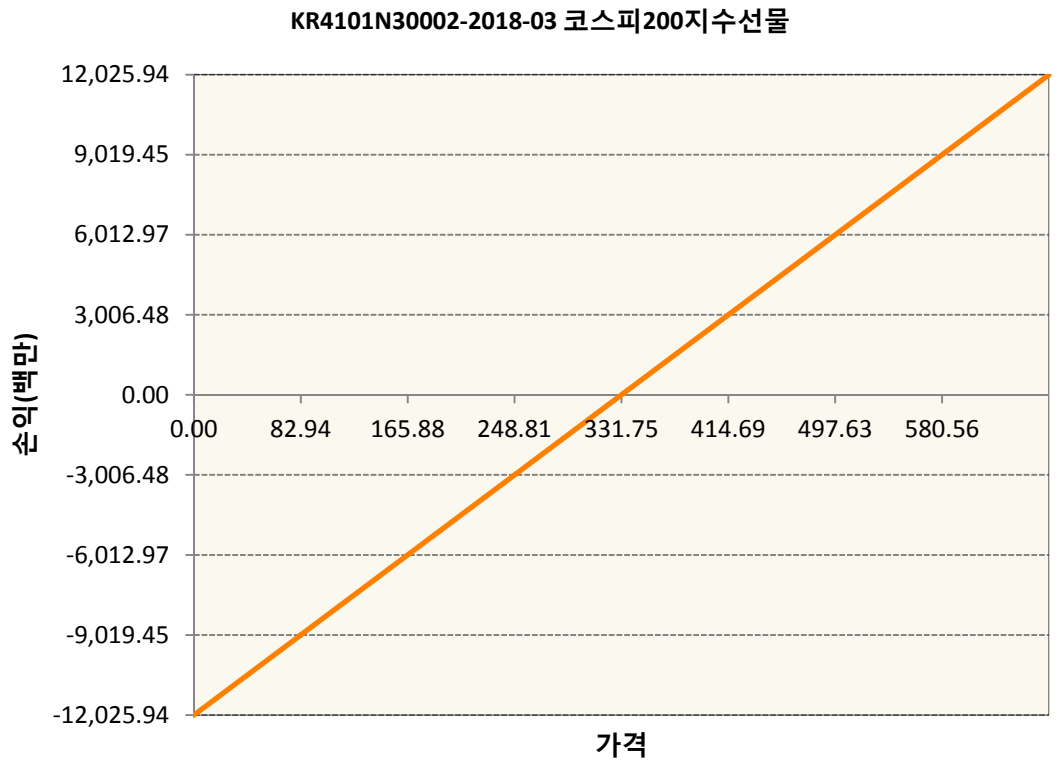
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

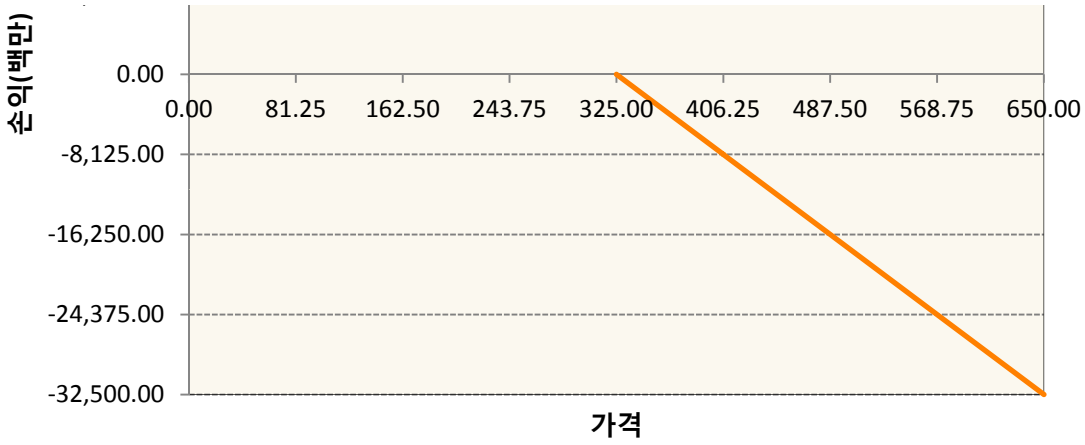
(단위:백만원)

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	12,026	0	12,026	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	59,263	-59,263	장내

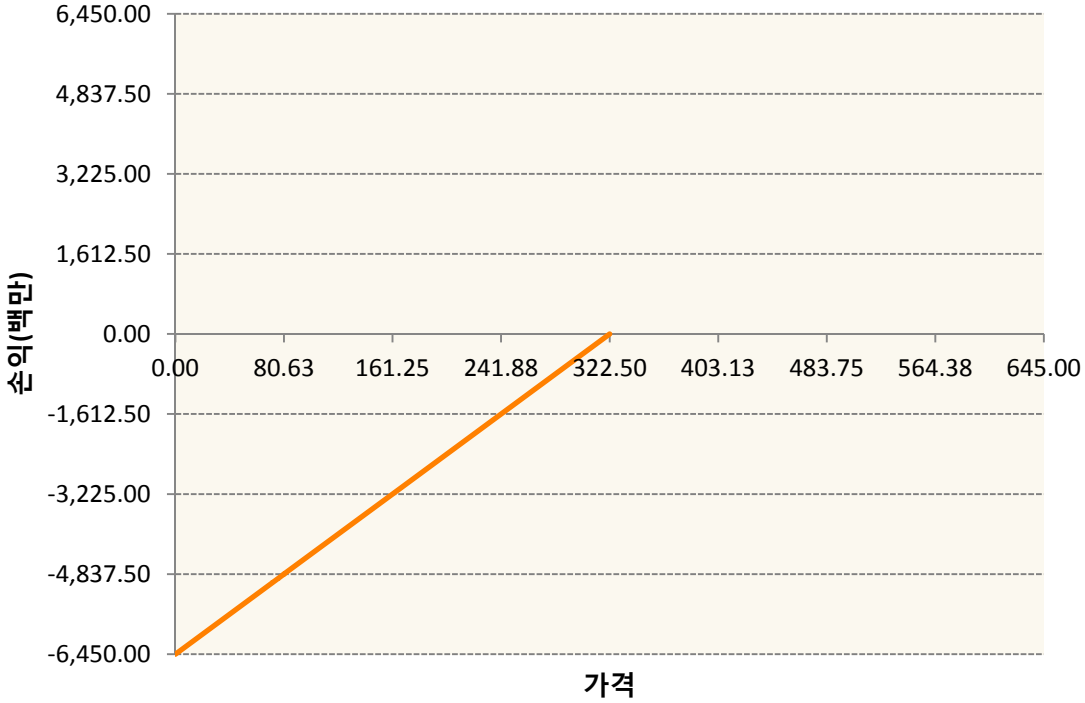
2. 만기시점의 손익구조



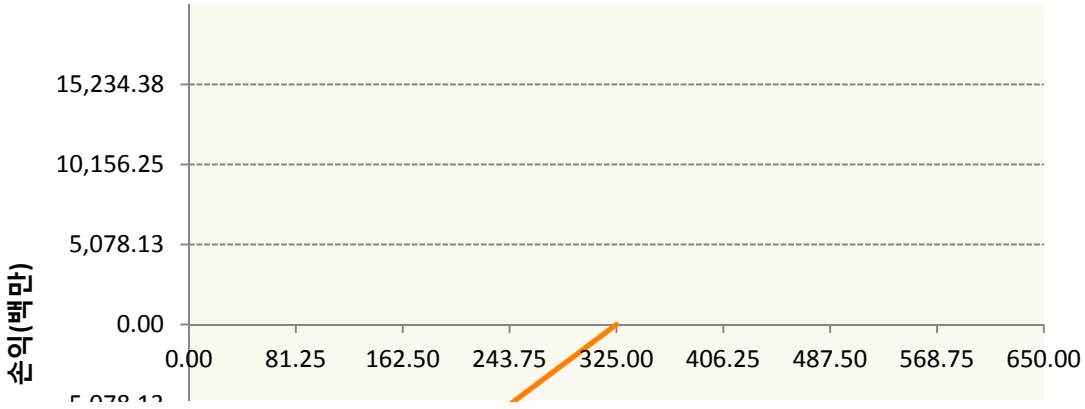




KR4301N13228-2018-01 풋322.5



KR4301N13251-2018-01 풋325





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,446
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446	-1,446
-5.33%	-964	-964	-964	-964	-964	-964	-964
-2.67%	-482	-482	-482	-482	-482	-482	-482
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	482	482	482	482	482	482	482
5.33%	964	964	964	964	964	964	964
8.00%	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446	1,446
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-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%	274	274	274	274	274	274	274
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						463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
-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%	463	463	463	463	463	463	463
	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%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
-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%	206	206	206	206	206	206	206
8.00%	308	308	308	308	308	308	308
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						274
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-274	-274	-274	-274	-274	-274	-274
-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%	274	274	274	274	274	274	274
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						625
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-625	-625	-625	-625	-625	-625	-625
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-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%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	625	625	625	625	625	625	625
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
	KR4101N30(	2018-03 코스피200지수선물					961
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-961	-961	-961	-961	-961	-961	-961
-5.33%	-640	-640	-640	-640	-640	-640	-640
-2.67%	-320	-320	-320	-320	-320	-320	-320
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	320	320	320	320	320	320	320
5.33%	640	640	640	640	640	640	640
8.00%	961	961	961	961	961	961	961
	KR4201N13:	2018-01 콜325					2,571

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	709	709	709	709	708	708	706
-5.33%	706	703	699	693	685	677	667
-2.67%	597	575	553	530	508	485	462
0%	45	31	16	0	-17	-35	-54
2.67%	-805	-806	-808	-810	-814	-819	-824
5.33%	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688	-1,689	-1,689
8.00%	-2,571	-2,571	-2,571	-2,571	-2,571	-2,571	-2,571
	KR4301N132 2018-01 풋322.5						354

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-354	-354	-354	-354	-354	-354	-354
-5.33%	-177	-177	-177	-177	-177	-178	-178
-2.67%	-22	-24	-26	-29	-31	-33	-36
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
	KR4301N132 2018-01 풋325						1,258

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,258	-1,258	-1,258	-1,258	-1,258	-1,258	-1,258
-5.33%	-706	-706	-706	-706	-706	-707	-707
-2.67%	-170	-175	-180	-186	-192	-198	-204
0%	3	3	1	0	-2	-4	-7
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

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

9,873

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

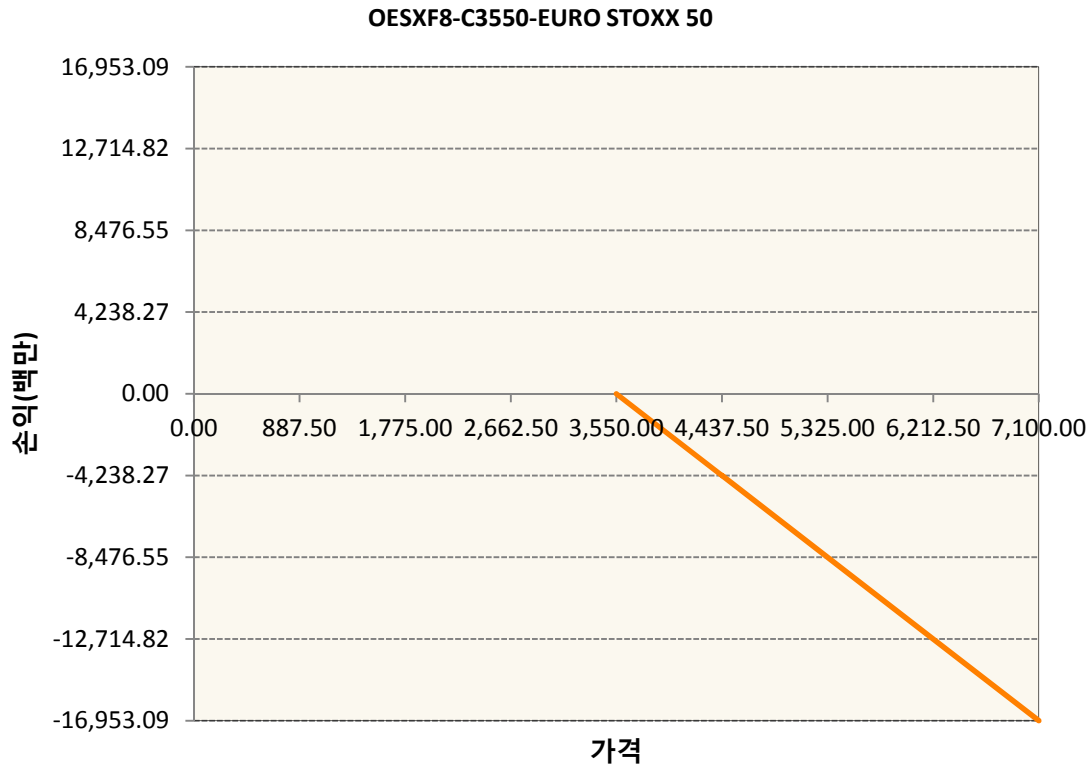
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

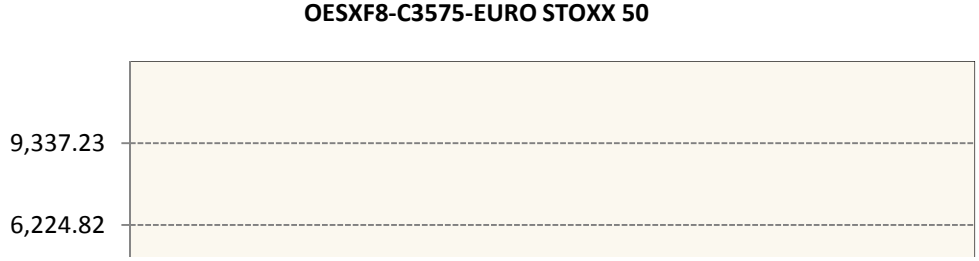
1. 계약금액

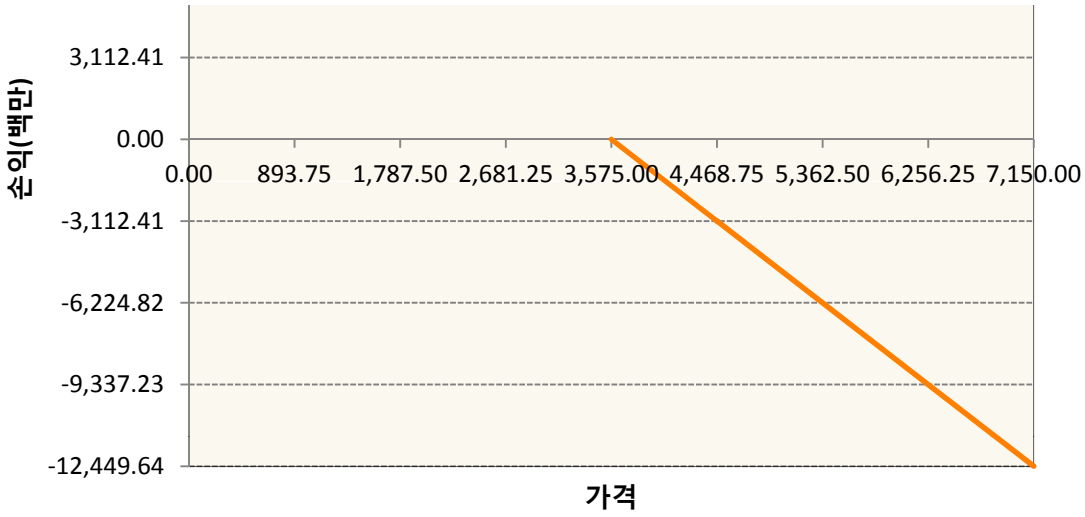
(단위:백만원)

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	21,359	0	21,359	
누계	유가증권	스왑	96,024	0	96,024	장외
누계	유가증권	옵션	0	58,805	-58,805	장내
누계	지수	스왑	51,214	0	51,214	장외

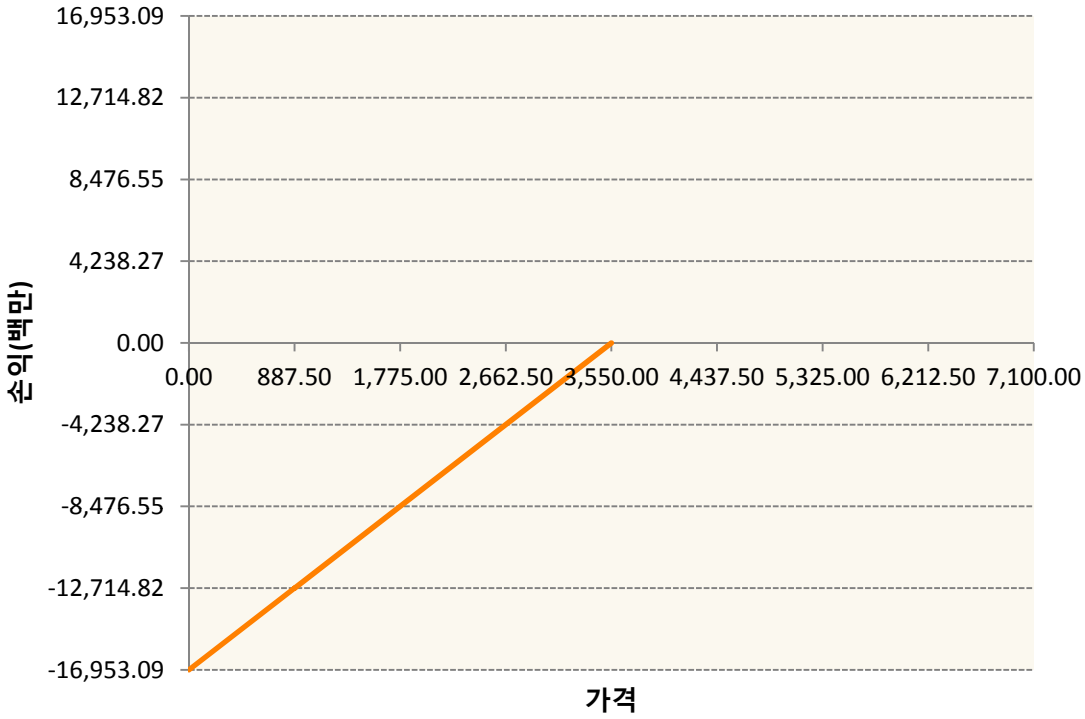
2. 만기시점의 손익구조



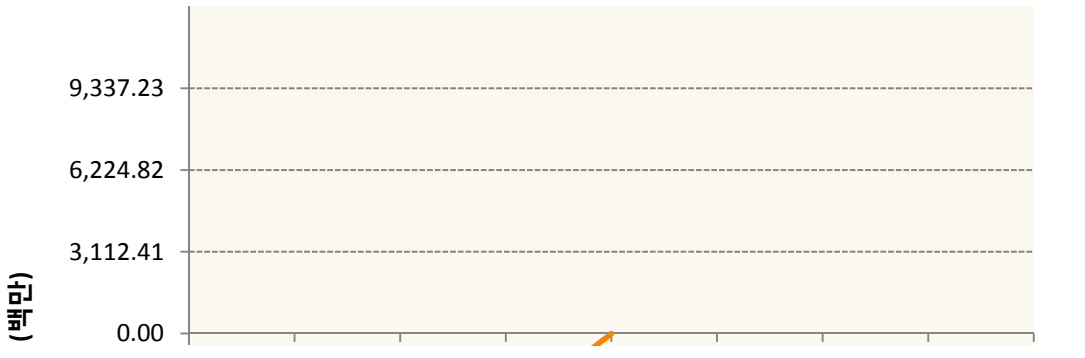


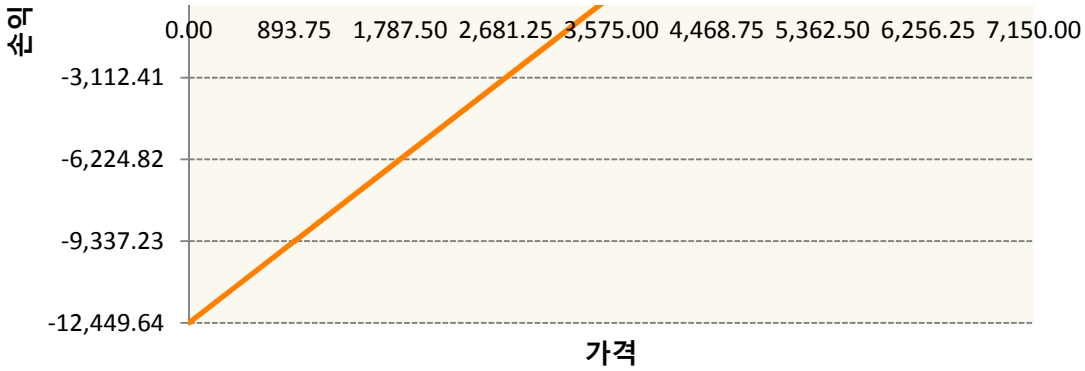


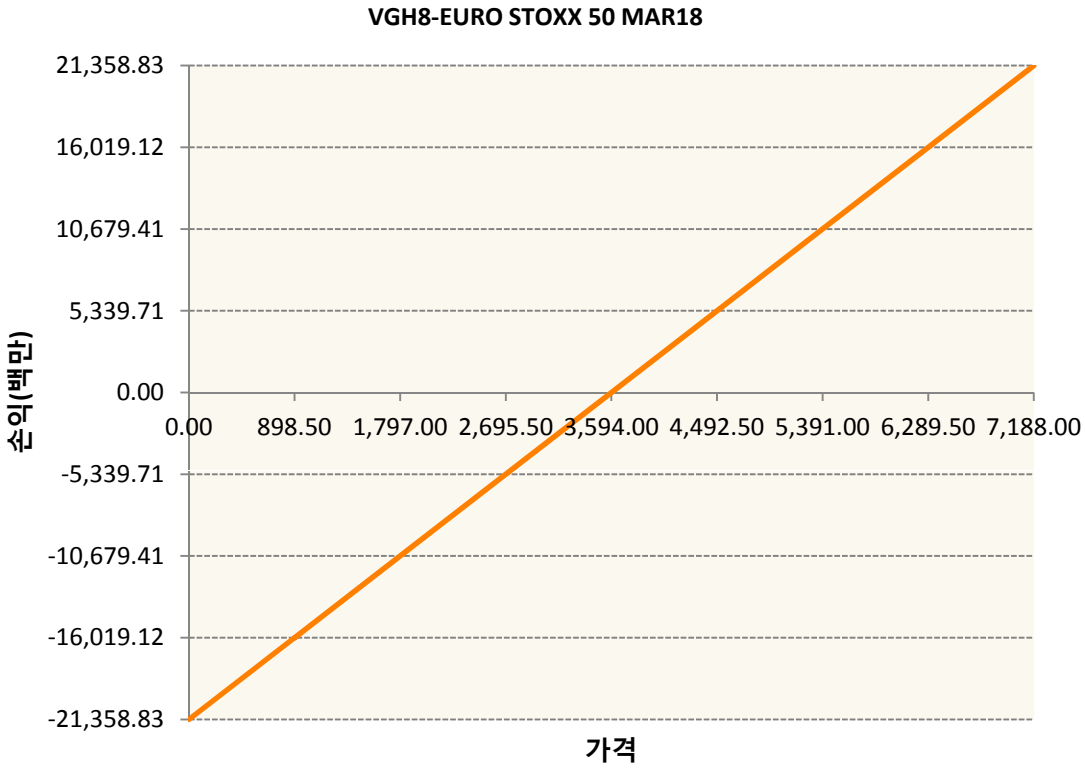
OESXF8-P3550-EURO STOXX 50



OESXF8-P3575-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	98
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	140
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	1,356
OESXF8-C35 EURO STOXX 50	996
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	1,356
OESXF8-P35 EURO STOXX 50	996
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,709

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

3,753

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

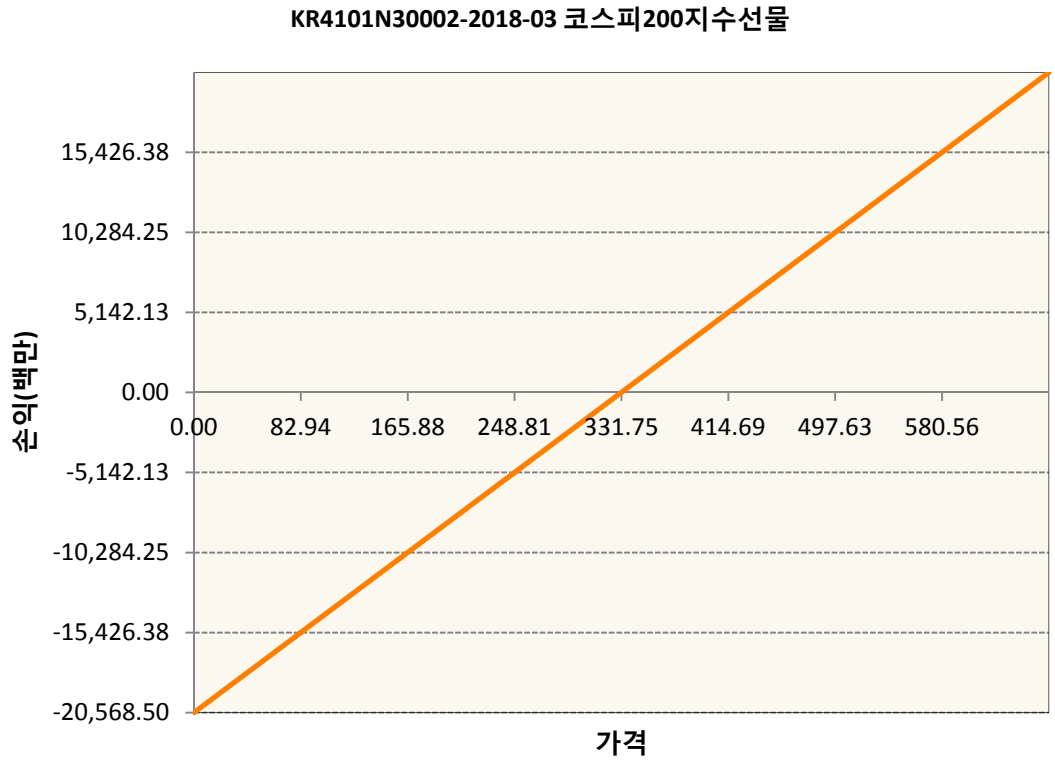
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,569	0	20,569	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,643
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,643	-1,643	-1,643	-1,643	-1,643	-1,643	-1,643
-5.33%	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095
-2.67%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	548	548	548	548	548	548	548
5.33%	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095
8.00%	1,643	1,643	1,643	1,643	1,643	1,643	1,643

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

982

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

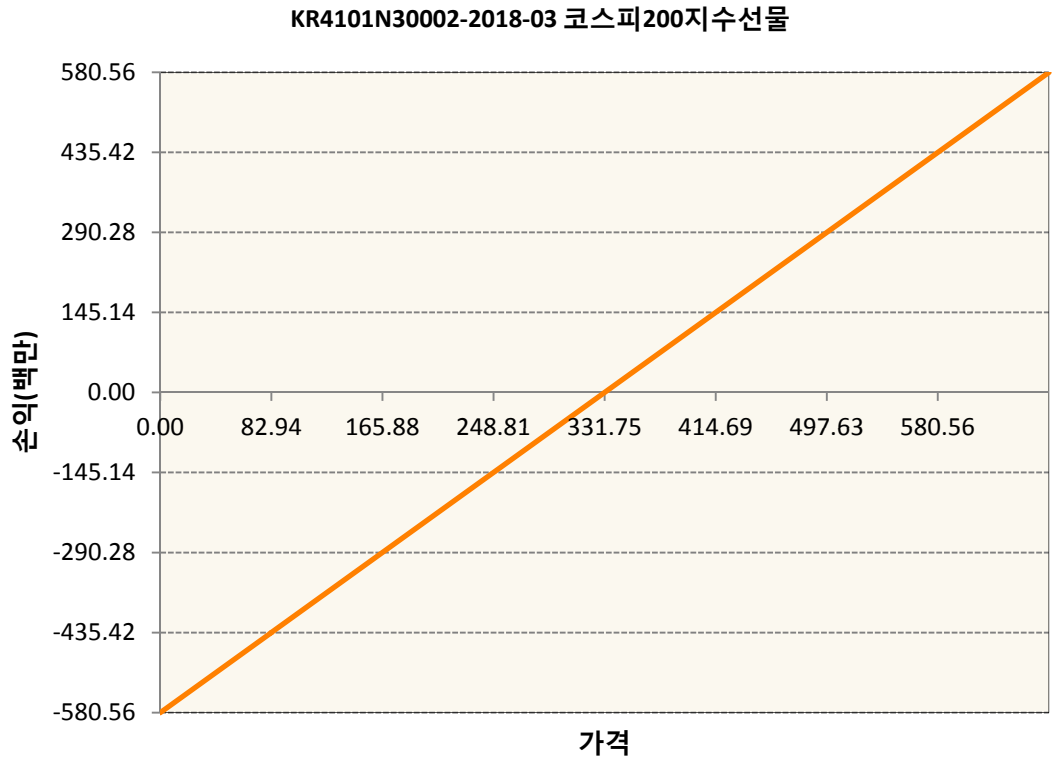
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	581	0	581	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)

28

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

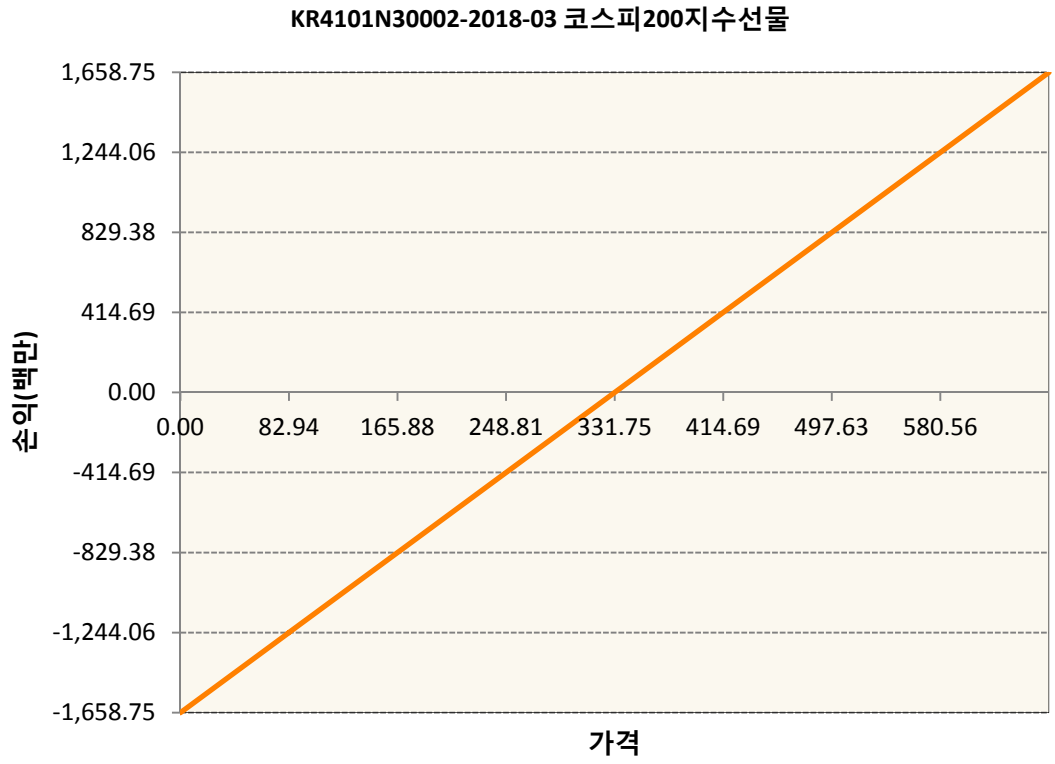
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,659	0	1,659	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-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%	133	133	133	133	133	133	133

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

79

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

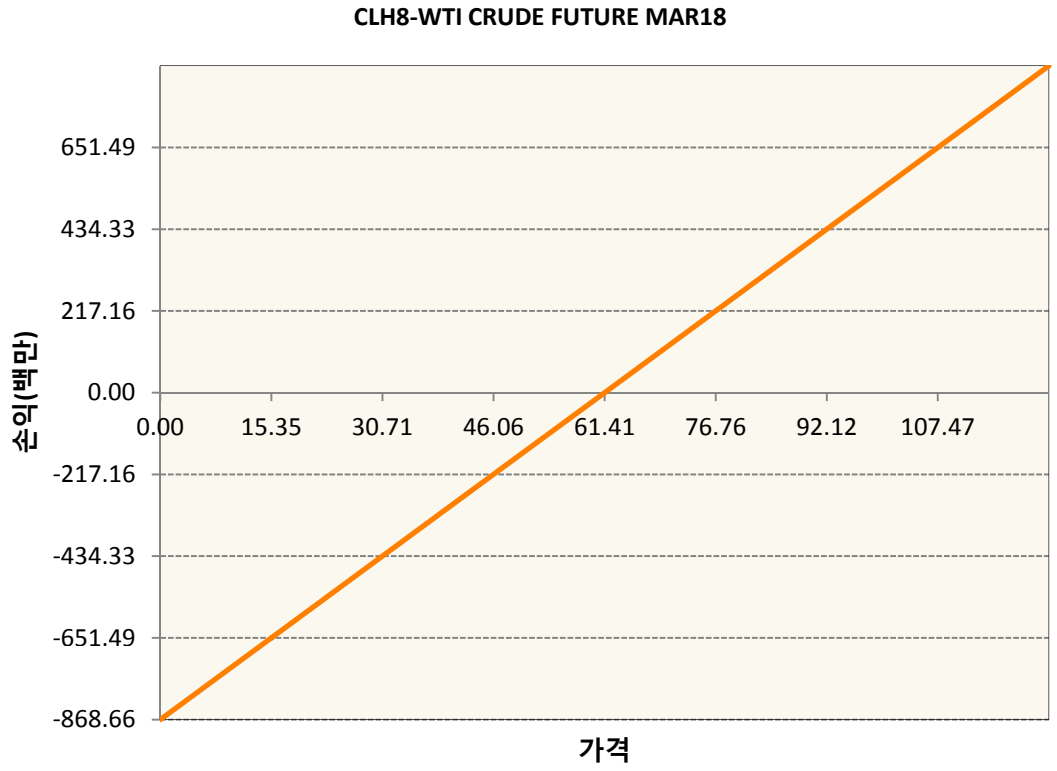
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

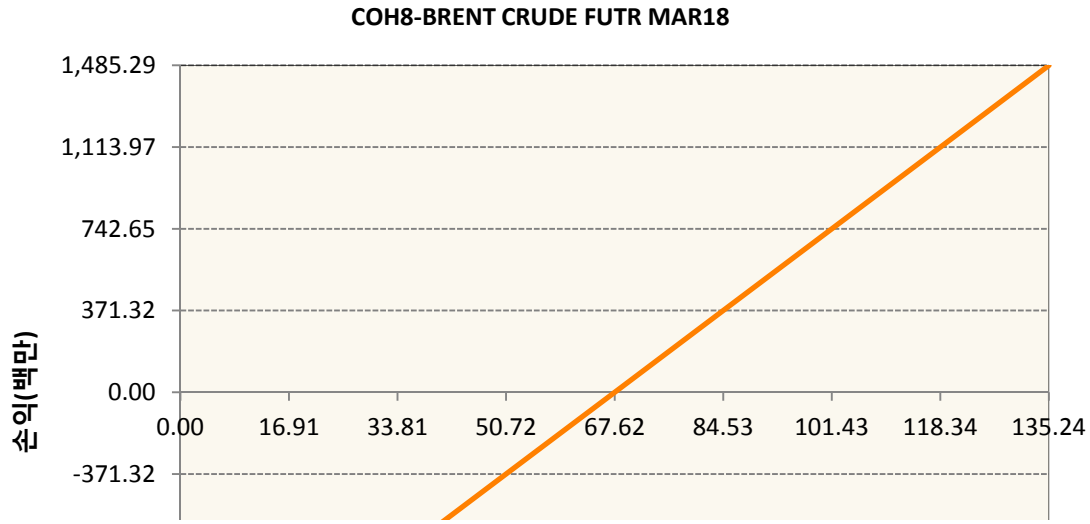
1. 계약금액

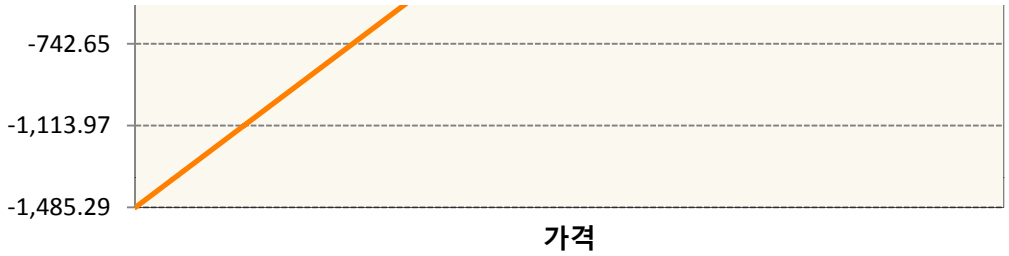
(단위:백만원)

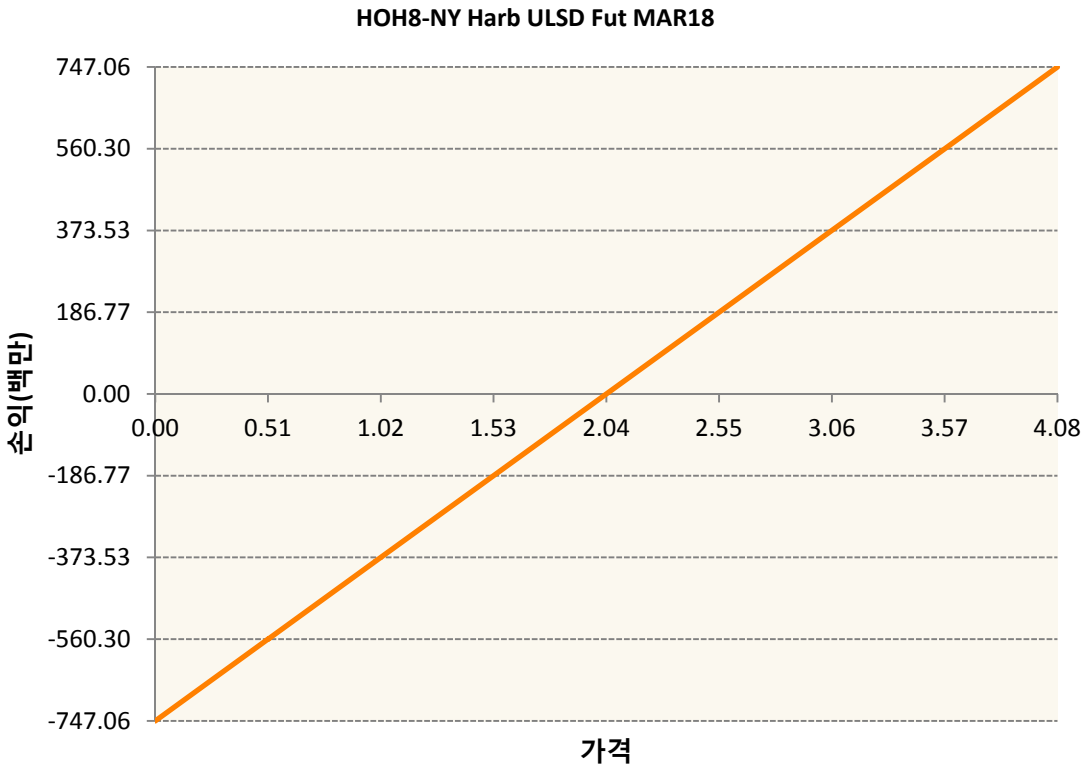
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,689	853	3,836	

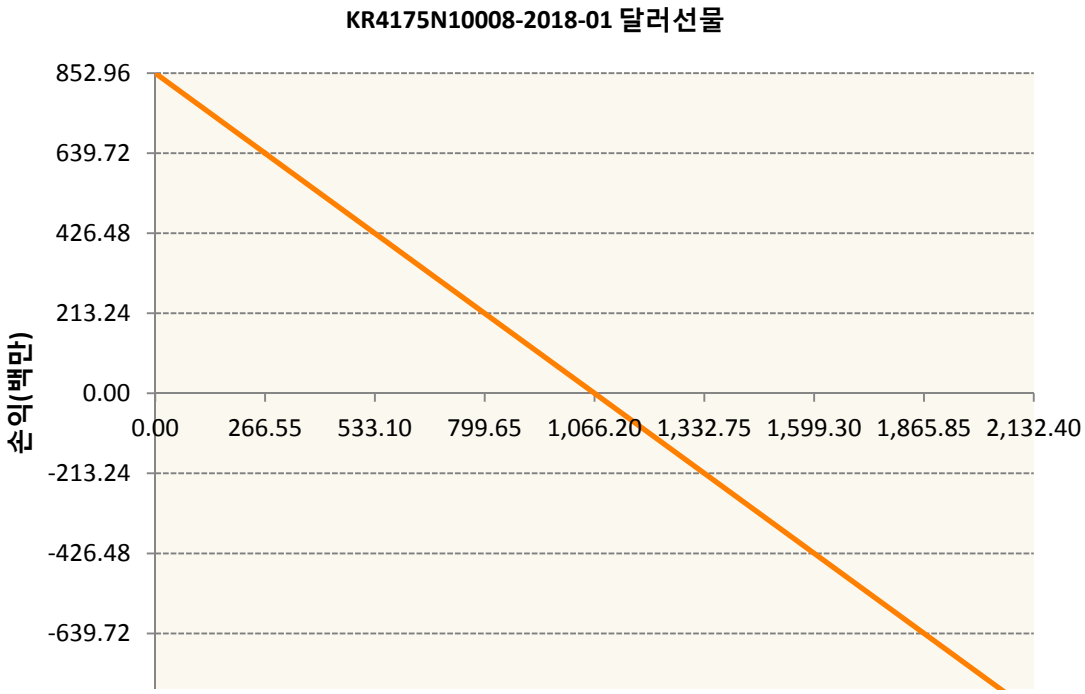
2. 만기시점의 손익구조

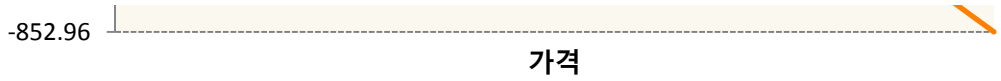


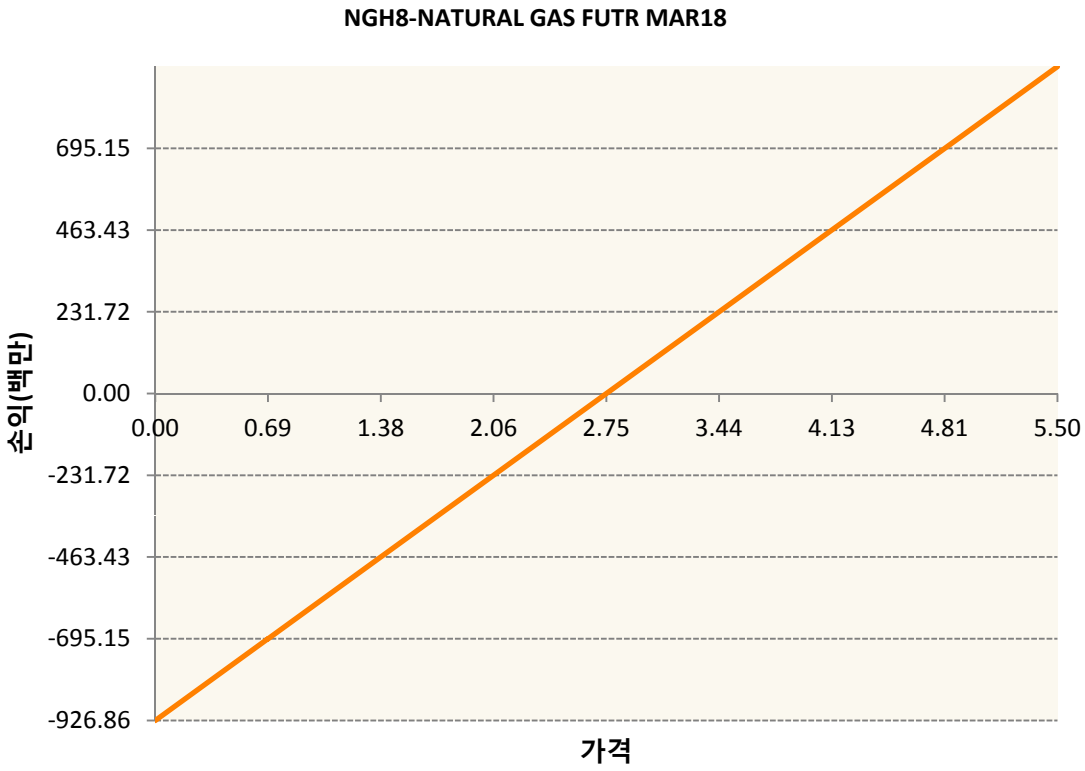


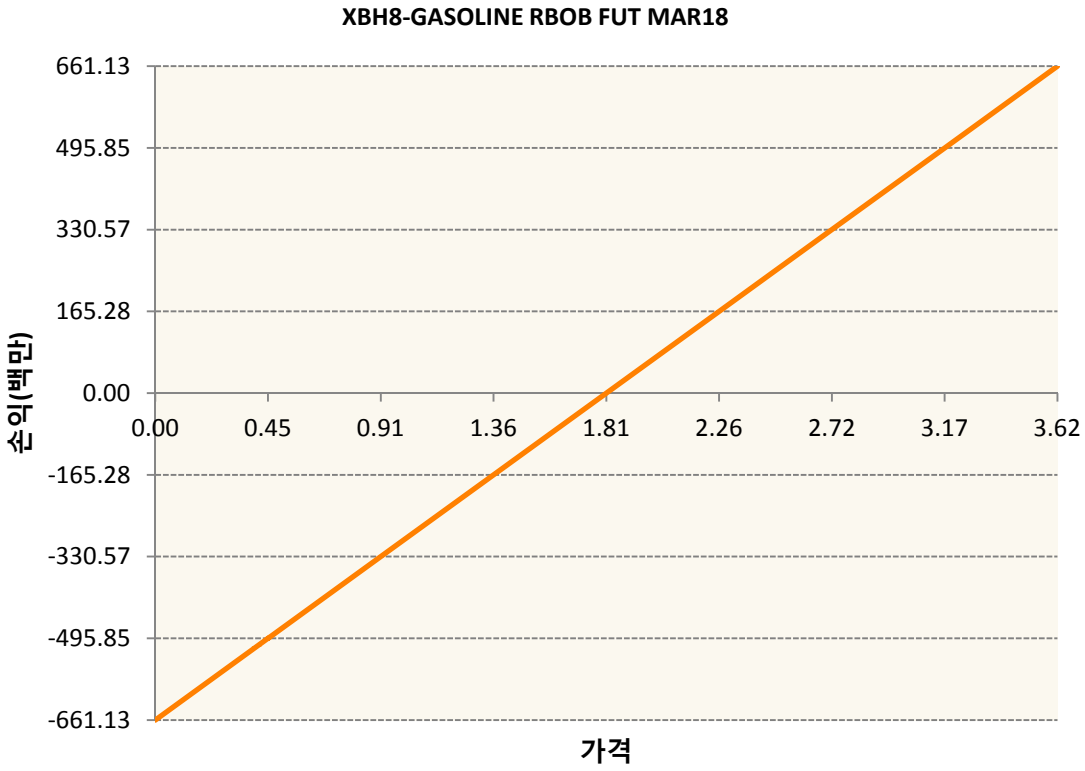

-742.65
-1,113.97
-1,485.29
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
747.06
560.30
373.53
186.77
0.00
-186.77
-373.53
-560.30
-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
852.96
639.72
426.48
213.24
0.00
-213.24
-426.48
-639.72
0.00
266.55
533.10
799.65
1,066.20
1,332.75
1,599.30
1,865.85
2,132.40
손익(백만)


-852.96
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
695.15
463.43
231.72
0.00
-231.72
-463.43
-695.15
-926.86
손익(백만)
0.00
0.69
1.38
2.06
2.75
3.44
4.13
4.81
5.50
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
661.13
495.85
330.57
165.28
0.00
-165.28
-330.57
-495.85
-661.13
손익(백만)
0.00
0.45
0.91
1.36
1.81
2.26
2.72
3.17
3.62
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	69
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	119
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	60
KR4175N10(	2018-01 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	74
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	53

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

618

공시일	2018-01-09
기준일	2018-01-08

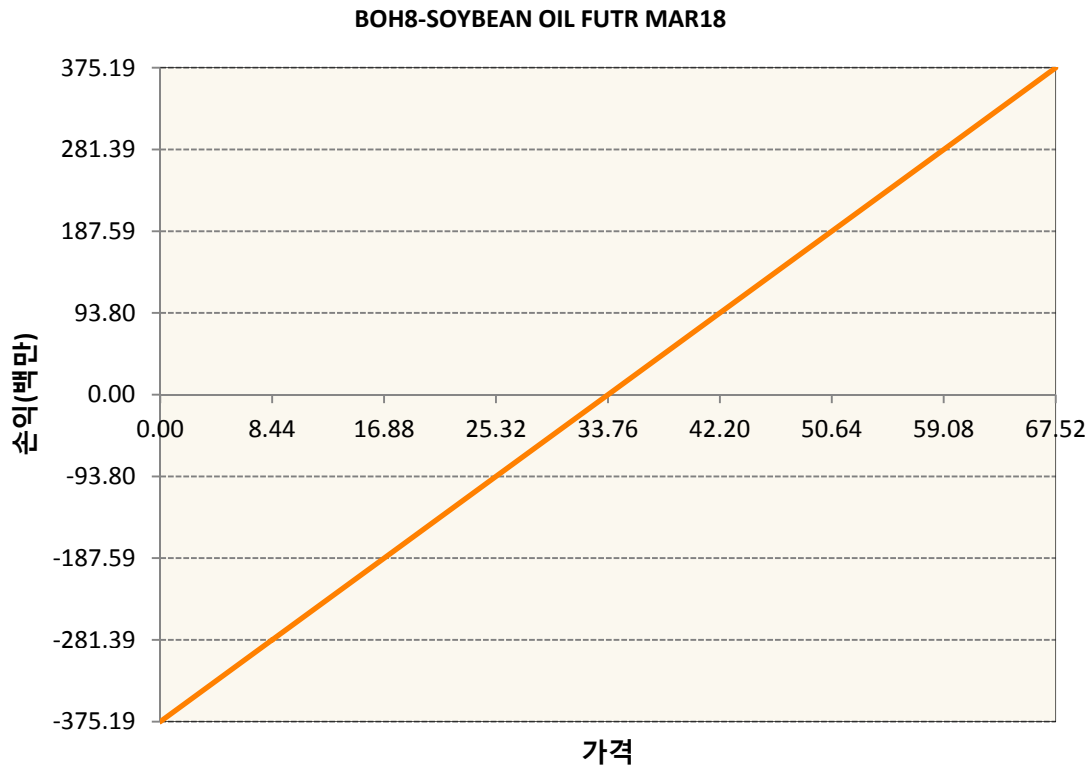
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

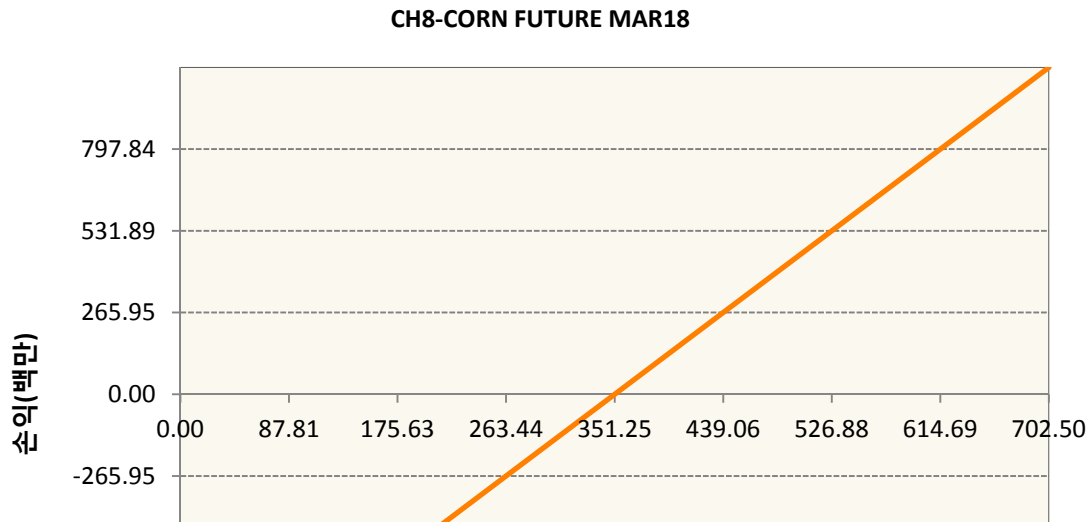
1. 계약금액

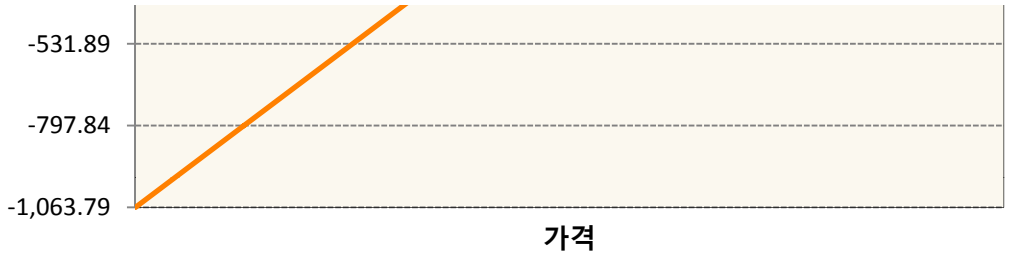
(단위:백만원)

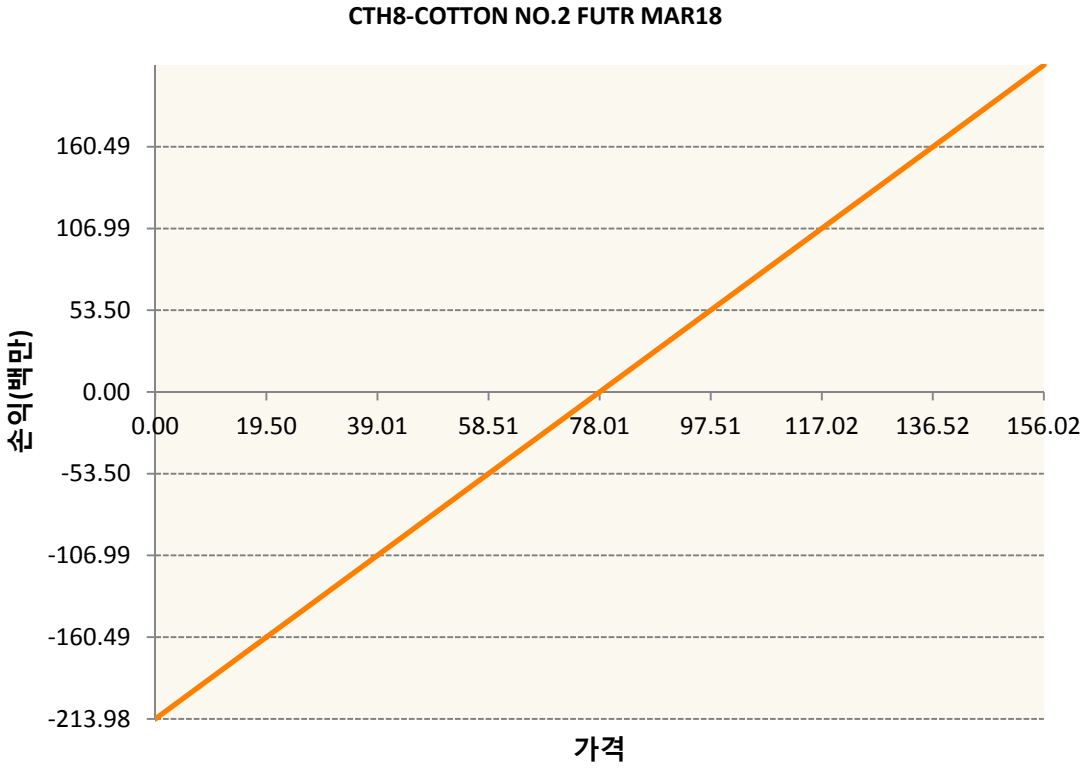
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,287	320	3,967	

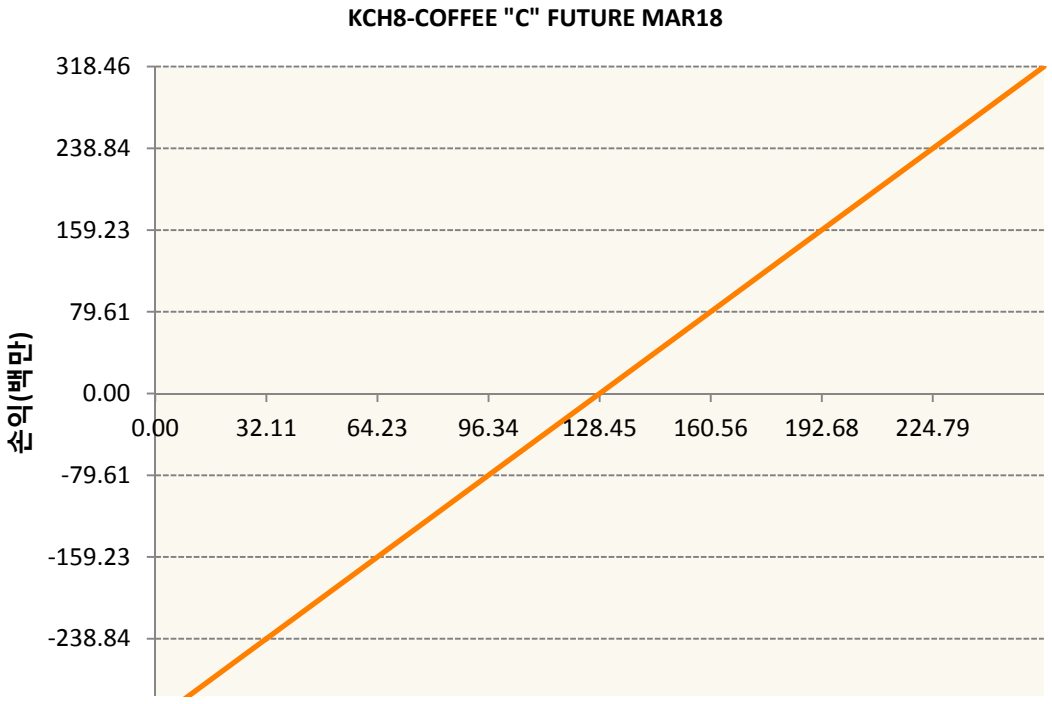
2. 만기시점의 손익구조

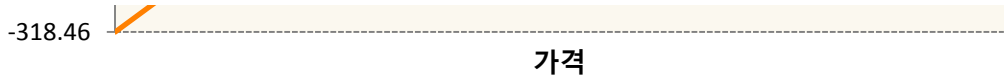


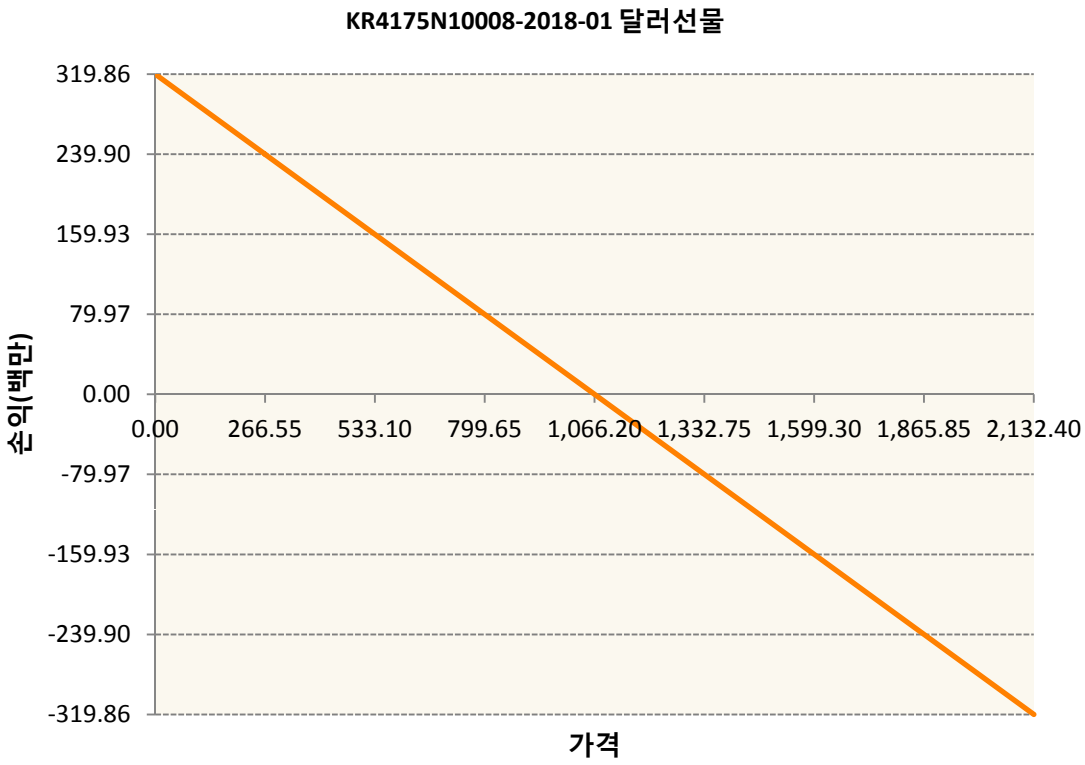


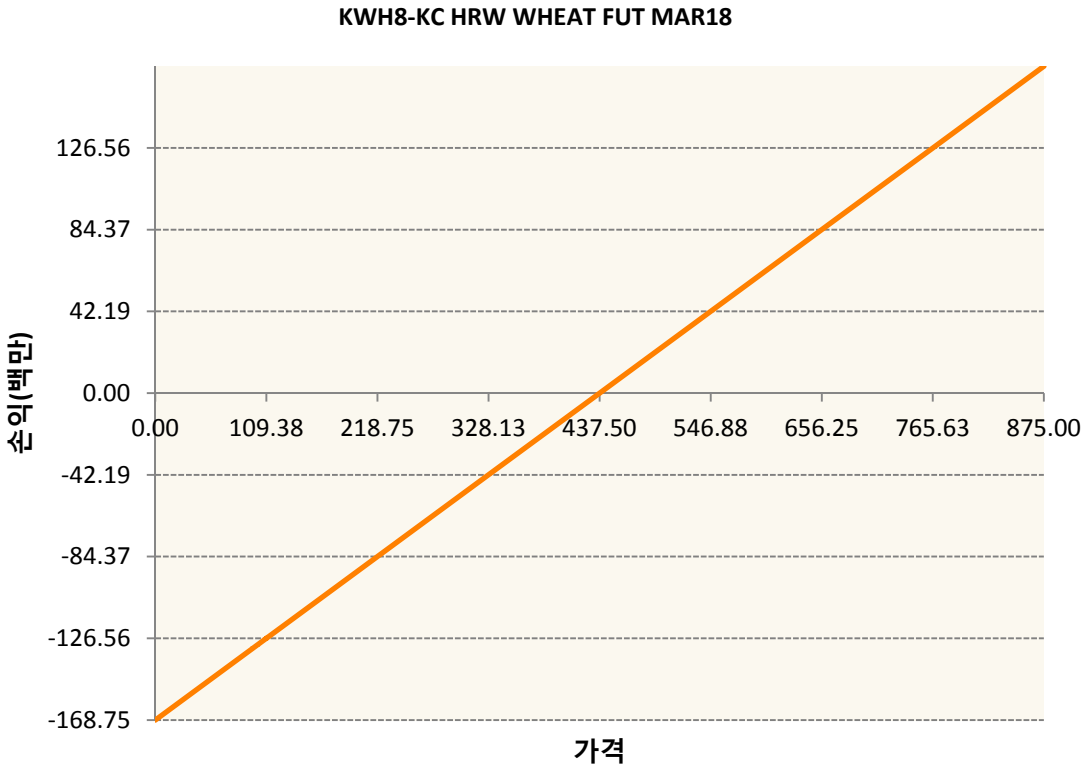

-531.89
-797.84
-1,063.79
가격

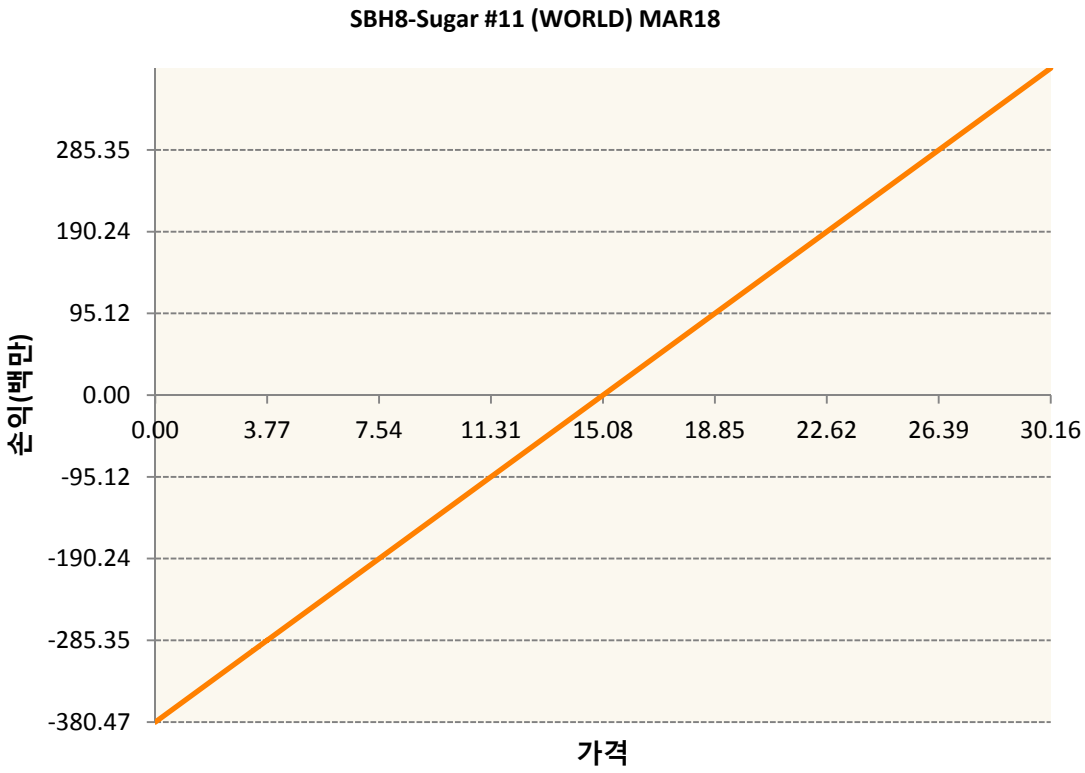

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
160.49
106.99
53.50
0.00
-53.50
-106.99
-160.49
-213.98
0.00
19.50
39.01
58.51
78.01
97.51
117.02
136.52
156.02
손익(백만)
가격

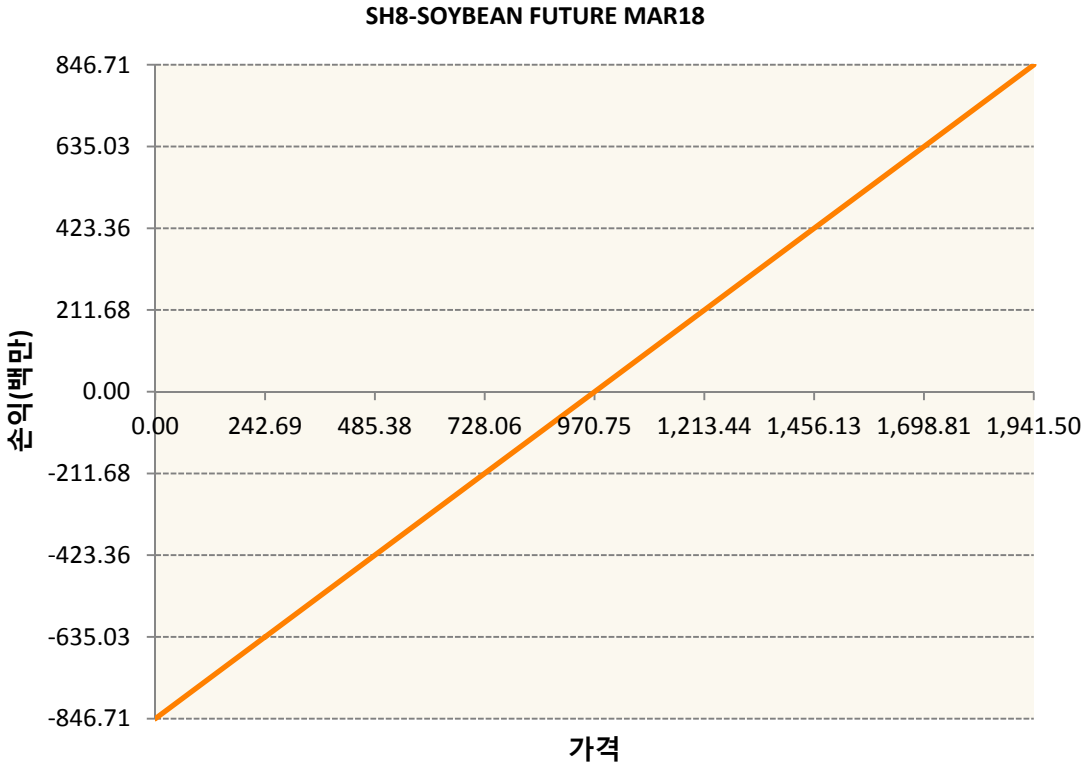

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
318.46
238.84
159.23
79.61
0.00
-79.61
-159.23
-238.84
0.00
32.11
64.23
96.34
128.45
160.56
192.68
224.79
손익(백만)


-318.46
가격

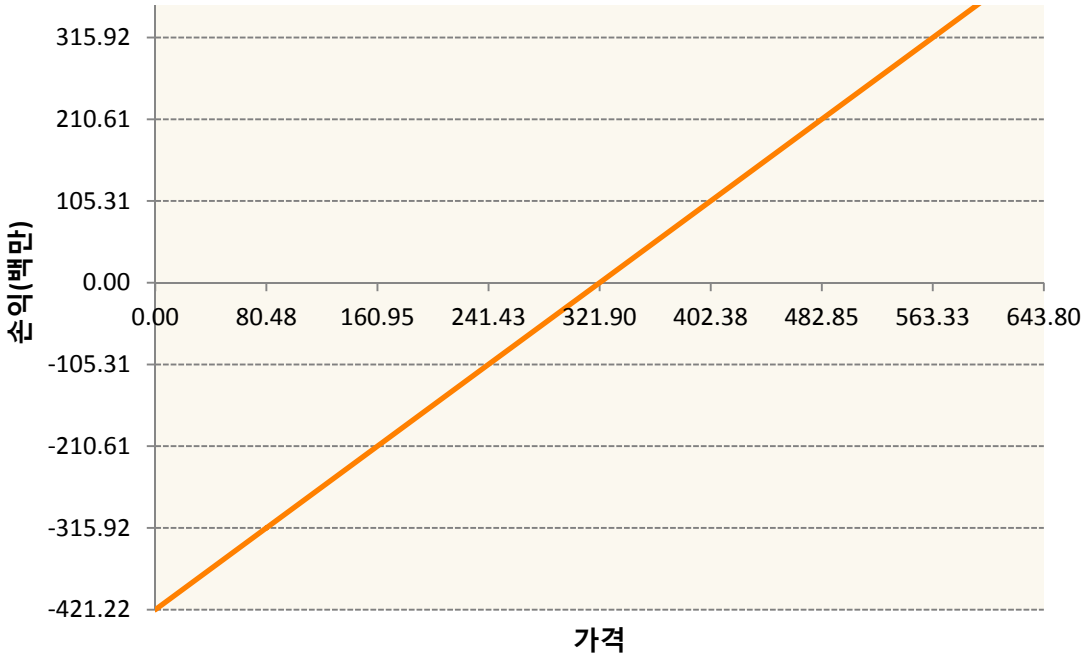

KR4175N10008-2018-01 달러선물
319.86
239.90
159.93
79.97
0.00
-79.97
-159.93
-239.90
-319.86
0.00
266.55
533.10
799.65
1,066.20
1,332.75
1,599.30
1,865.85
2,132.40
손익(백만)
가격

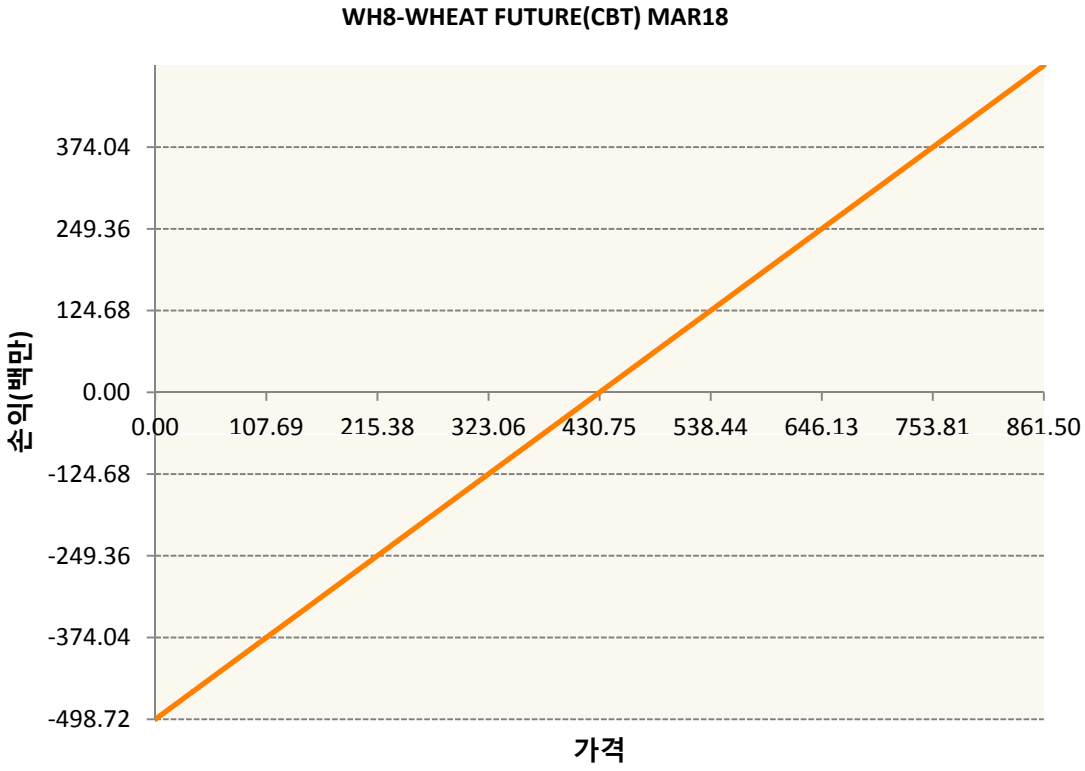

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
126.56
84.37
42.19
0.00
-42.19
-84.37
-126.56
-168.75
0.00
109.38
218.75
328.13
437.50
546.88
656.25
765.63
875.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
285.35
190.24
95.12
0.00
-95.12
-190.24
-285.35
-380.47
손익(백만)
0.00
3.77
7.54
11.31
15.08
18.85
22.62
26.39
30.16
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
846.71
635.03
423.36
211.68
0.00
-211.68
-423.36
-635.03
-846.71
손익(백만)
0.00
242.69
485.38
728.06
970.75
1,213.44
1,456.13
1,698.81
1,941.50
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18
421.22





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	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	14
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	30
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	68
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	34
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	40

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

359