| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

# 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 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

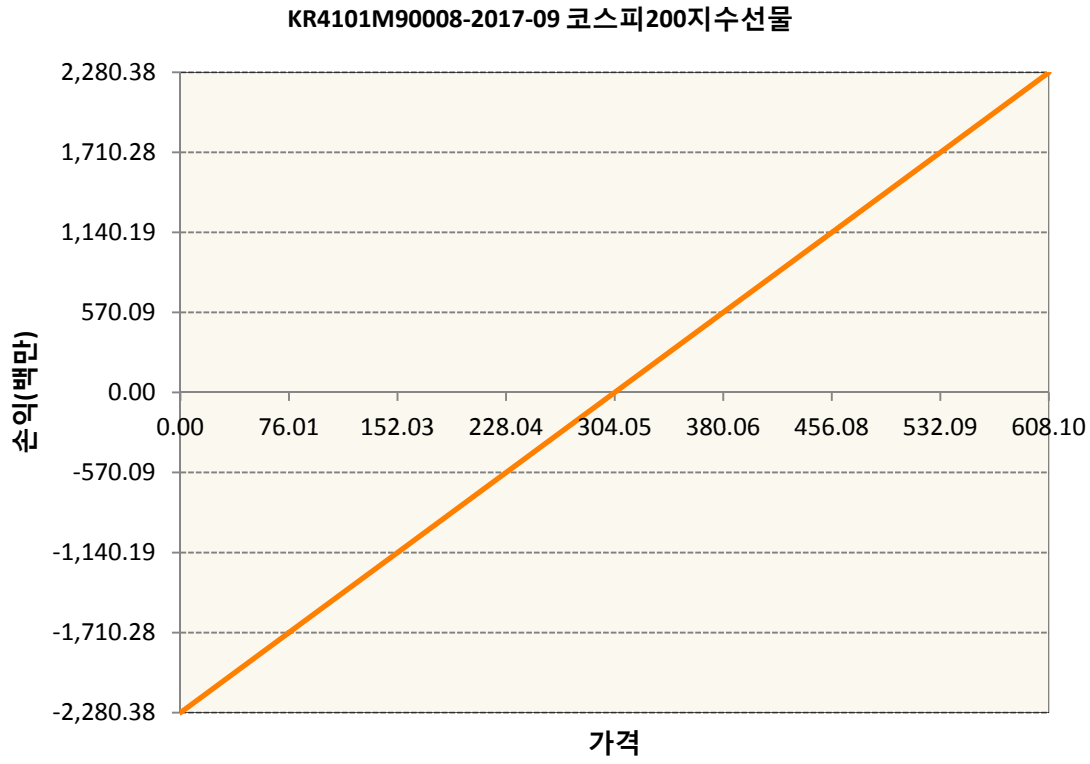
# 스마트인덱스모

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 685 | 0 | 685 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,280 | 0 | 2,280 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M90( 2017-09 코스피200지수선물 | | | | | | | 182 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -182 | -182 | -182 | -182 | -182 | -182 | -182 |
| -5.33% | -122 | -122 | -122 | -122 | -122 | -122 | -122 |
| -2.67% | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 61 | 61 | 61 | 61 | 61 | 61 | 61 |
| 5.33% | 122 | 122 | 122 | 122 | 122 | 122 | 122 |
| 8.00% | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 |

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

| |
|---|
| **114** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

# 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 | 12,592 | 0 | 12,592 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWMXWO0( 신한MXWO 미래S170822 | 1,024 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **462** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2017-09-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-05 |

# 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 | 4,599 | 0 | 4,599 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S170608 | 422 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **365** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

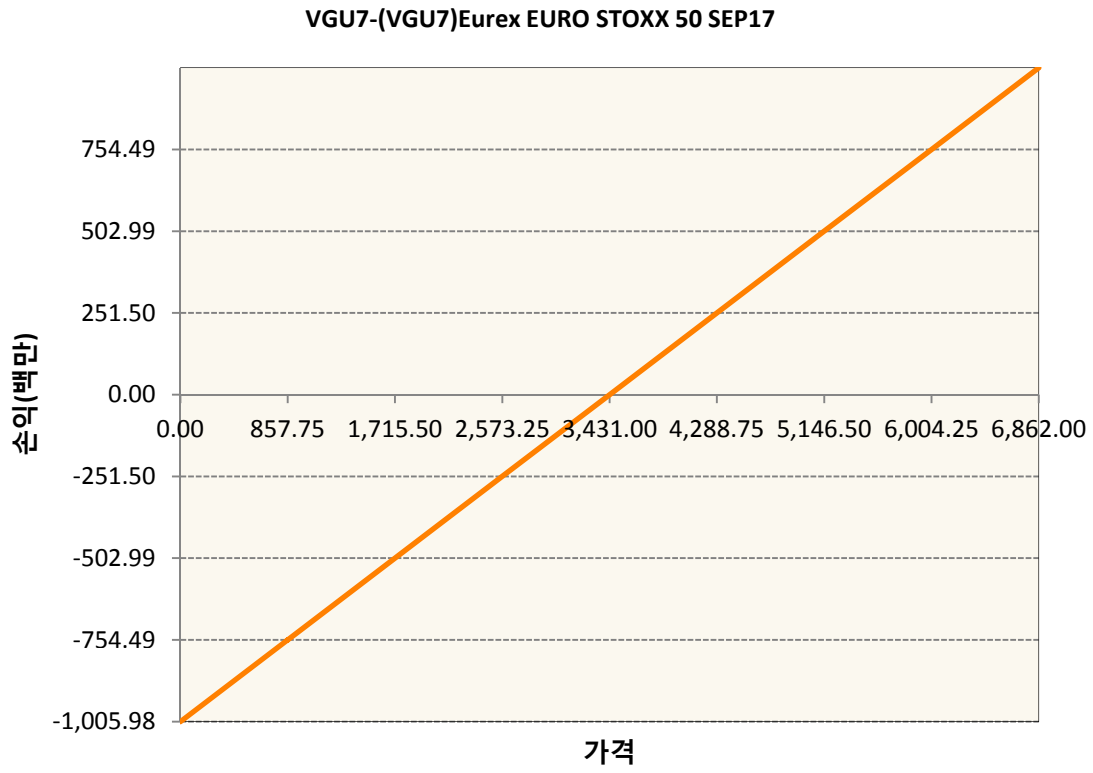
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,006 | 0 | 1,006 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGU7 | (VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17 | 80 |

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

(단위:백만원)

**64**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

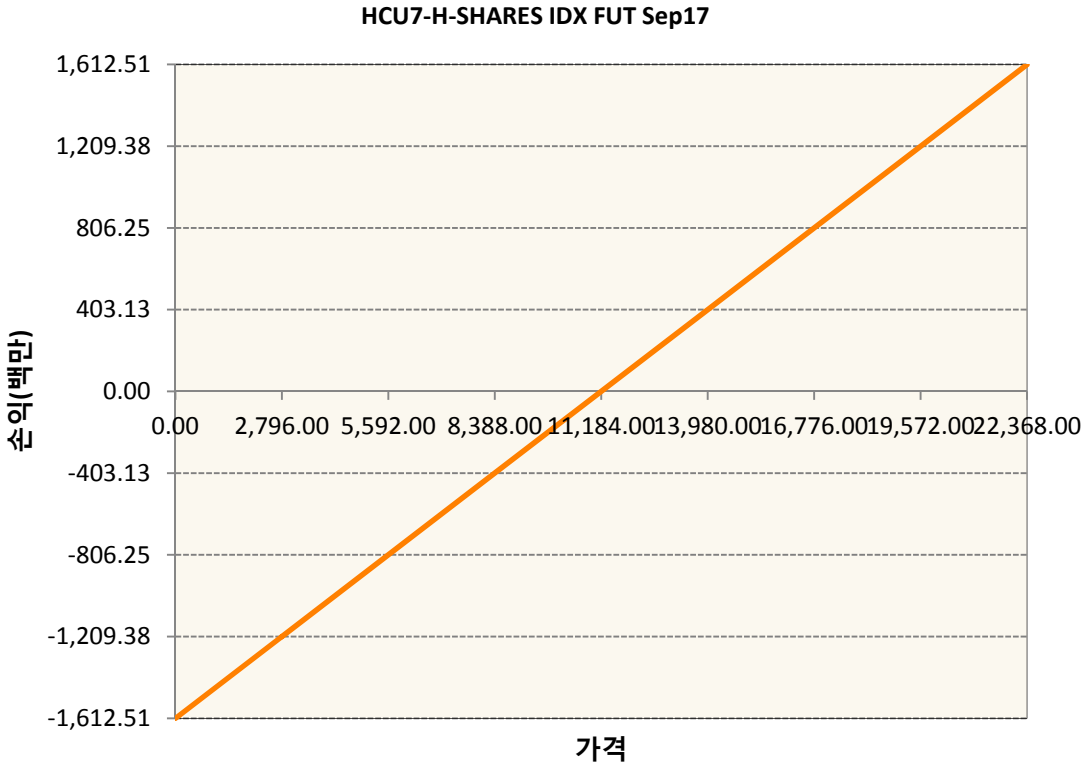
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

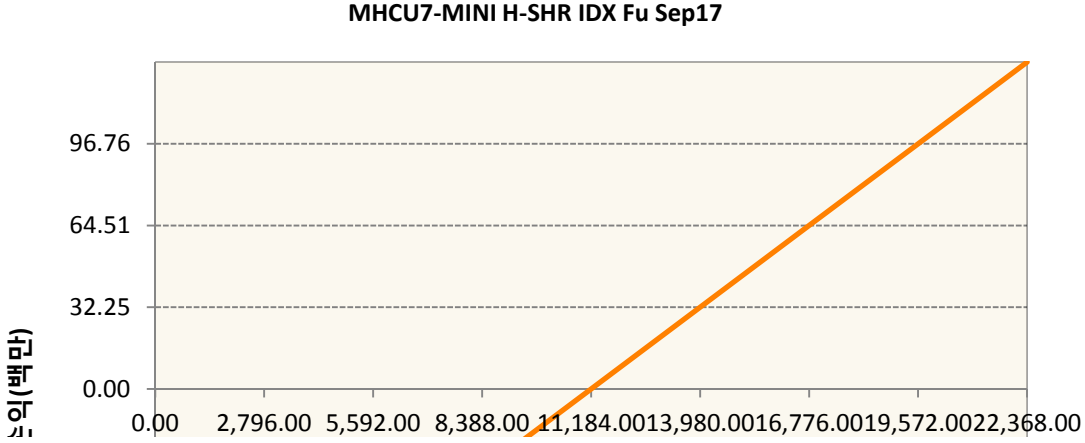
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 129 | 0 | 129 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,613 | 0 | 1,613 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCU7 | H-SHARES IDX FUT Sep17 | 129 |
| MHCU7 | MINI H-SHR IDX Fu Sep17 | 10 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **120** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

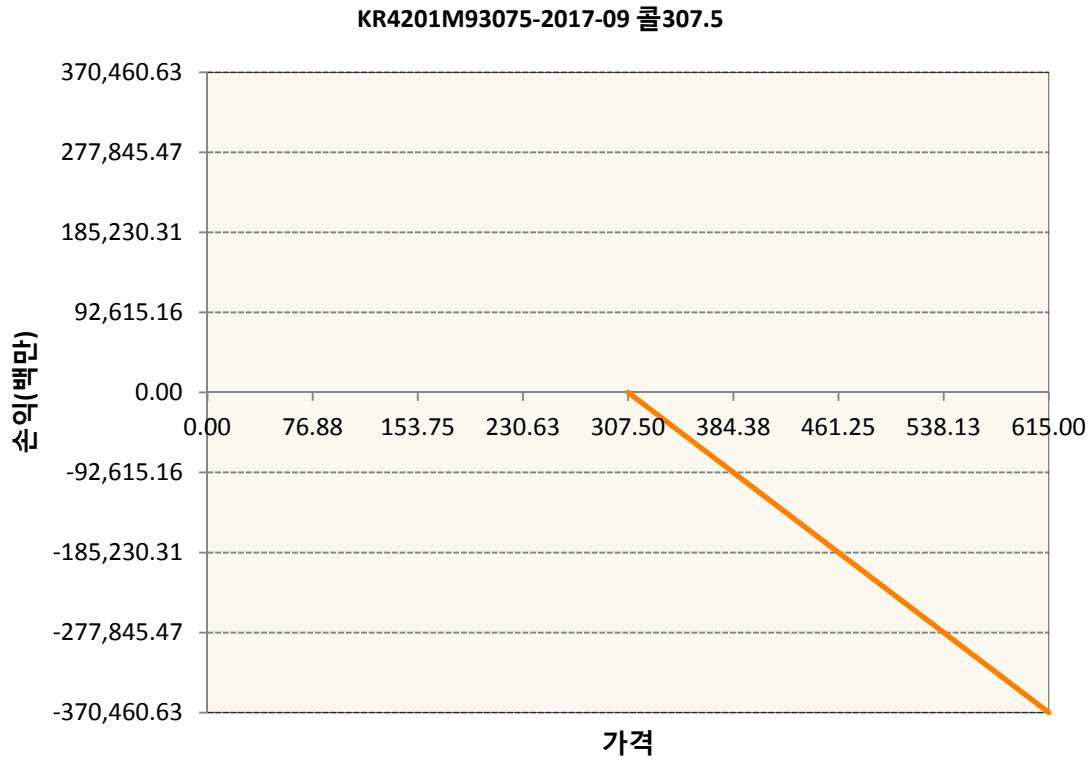
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

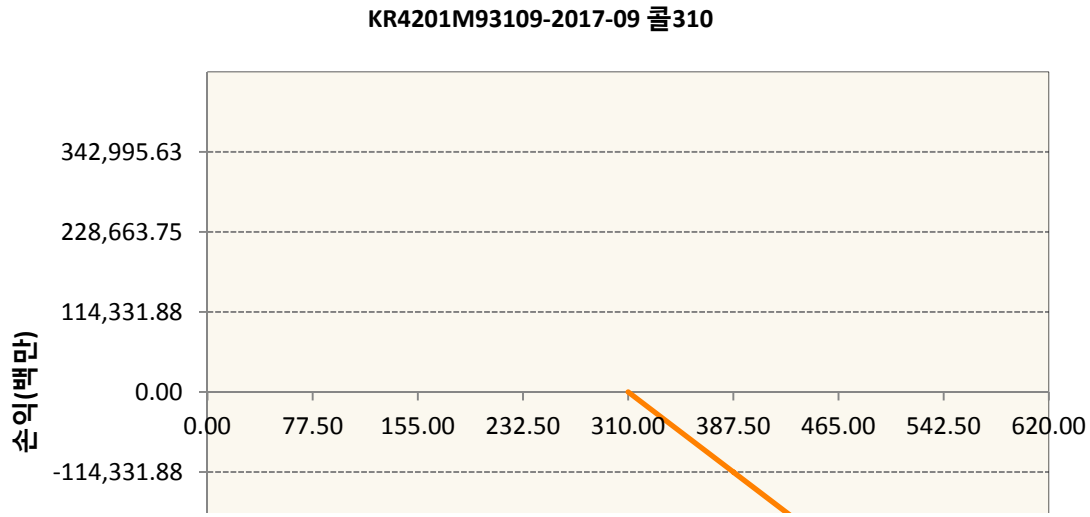
## 1. 계약금액

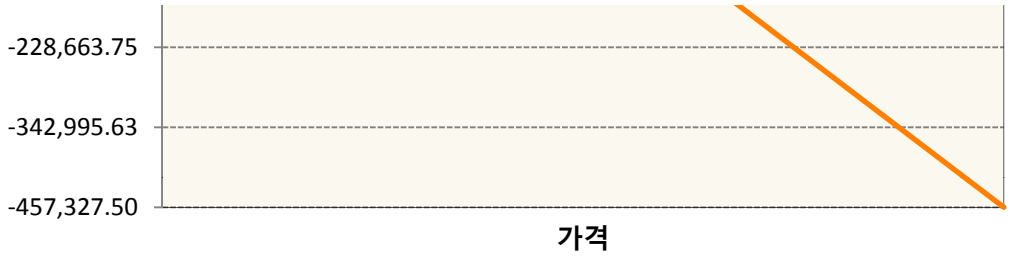
(단위:백만원)

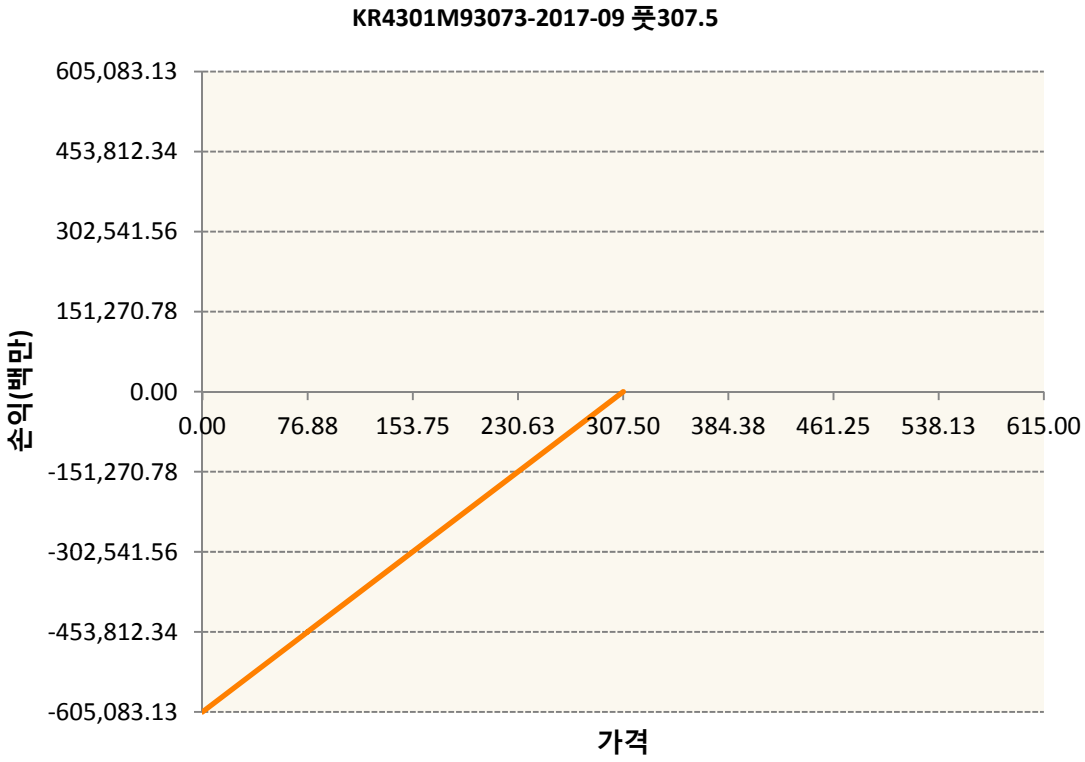
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,497,119 | -1,497,119 | 장내 |

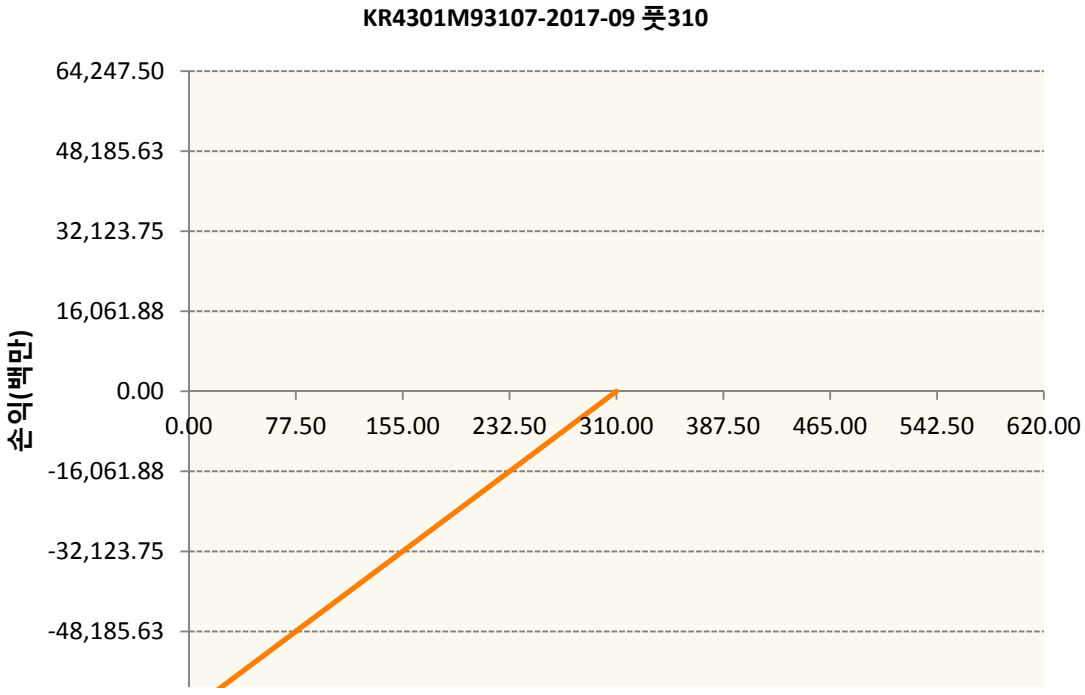
## 2. 만기시점의 손익구조

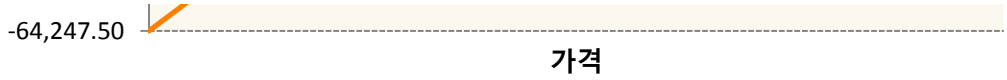



-228,663.75
-342,995.63
-457,327.50
가격


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
605,083.13
453,812.34
302,541.56
151,270.78
0.00
-151,270.78
-302,541.56
-453,812.34
-605,083.13
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
615.00
손익(백만)
가격


KR4301M93107-2017-09 풋310
64,247.50
48,185.63
32,123.75
16,061.88
0.00
-16,061.88
-32,123.75
-48,185.63
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
손익(백만)




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201M93( 2017-09 콜307.5 | | | | | | | 21,965 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 4,003 | 3,997 | 3,985 | 3,964 | 3,929 | 3,879 | 3,811 |
| -5.33% | 3,954 | 3,902 | 3,823 | 3,717 | 3,584 | 3,425 | 3,240 |
| -2.67% | 3,493 | 3,263 | 3,001 | 2,710 | 2,397 | 2,063 | 1,713 |
| 0% | 1,386 | 929 | 466 | 0 | -470 | -942 | -1,416 |
| 2.67% | -3,797 | -4,237 | -4,687 | -5,144 | -5,606 | -6,073 | -6,543 |
| 5.33% | -11,819 | -12,036 | -12,289 | -12,572 | -12,881 | -13,212 | -13,562 |
| 8.00% | -21,190 | -21,248 | -21,334 | -21,449 | -21,593 | -21,766 | -21,965 |
| KR4201M93: 2017-09 콜310 | | | | | | | 24,891 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 3,639 | 3,636 | 3,628 | 3,613 | 3,586 | 3,544 | 3,486 |
| -5.33% | 3,612 | 3,575 | 3,514 | 3,426 | 3,309 | 3,161 | 2,983 |
| -2.67% | 3,294 | 3,095 | 2,851 | 2,569 | 2,253 | 1,908 | 1,537 |
| 0% | 1,536 | 1,040 | 527 | 0 | -537 | -1,083 | -1,635 |
| 2.67% | -3,563 | -4,156 | -4,751 | -5,348 | -5,947 | -6,547 | -7,148 |
| 5.33% | -12,469 | -12,829 | -13,226 | -13,653 | -14,104 | -14,576 | -15,065 |
| 8.00% | -23,601 | -23,718 | -23,877 | -24,077 | -24,314 | -24,586 | -24,891 |
| KR4301M93( 2017-09 풋307.5 | | | | | | | 41,622 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -41,309 | -41,318 | -41,337 | -41,373 | -41,429 | -41,511 | -41,622 |
| -5.33% | -25,439 | -25,525 | -25,654 | -25,826 | -26,044 | -26,305 | -26,606 |
| -2.67% | -10,244 | -10,619 | -11,048 | -11,522 | -12,034 | -12,579 | -13,150 |
| 0% | 2,264 | 1,517 | 762 | 0 | -767 | -1,538 | -2,312 |
| 2.67% | 9,748 | 9,028 | 8,293 | 7,547 | 6,792 | 6,030 | 5,262 |
| 5.33% | 12,594 | 12,239 | 11,826 | 11,363 | 10,859 | 10,318 | 9,747 |
| 8.00% | 13,237 | 13,142 | 13,002 | 12,814 | 12,578 | 12,296 | 11,970 |
| KR4301M93: 2017-09 풋310 | | | | | | | 4,550 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -4,528 | -4,529 | -4,530 | -4,532 | -4,536 | -4,541 | -4,550 |
| -5.33% | -2,852 | -2,857 | -2,866 | -2,878 | -2,895 | -2,916 | -2,940 |
| -2.67% | -1,217 | -1,245 | -1,279 | -1,319 | -1,363 | -1,412 | -1,464 |
| 0% | 216 | 146 | 74 | 0 | -75 | -152 | -230 |
| 2.67% | 1,179 | 1,096 | 1,012 | 928 | 844 | 760 | 676 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5.33% | 1,608 | 1,557 | 1,502 | 1,442 | 1,378 | 1,312 | 1,243 |
| 8.00% | 1,724 | 1,707 | 1,685 | 1,657 | 1,624 | 1,585 | 1,543 |

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

| |
|---|
| **98,472** |

| 공시일 | 2017-09-06 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-05 |

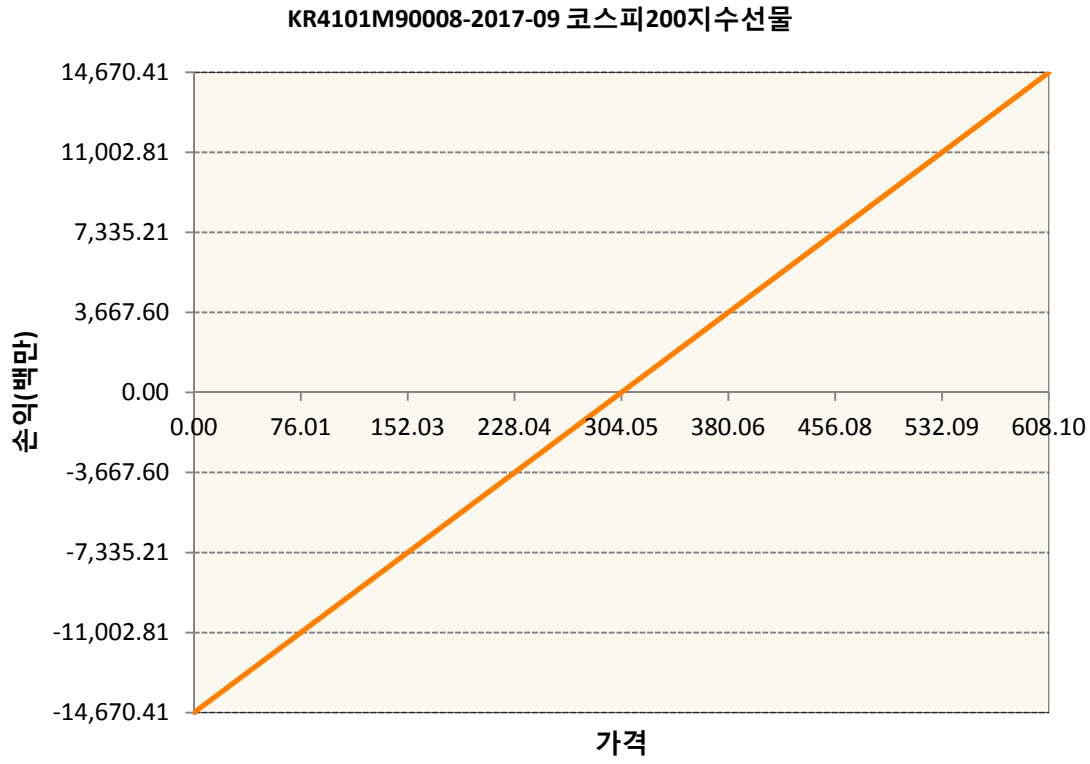
# ETF스마트레버리지목표전환형6호

## 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 | 14,670 | 0 | 14,670 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M90( 2017-09 코스피200지수선물 | | | | | | | 1,174 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,174 | -1,174 | -1,174 | -1,174 | -1,174 | -1,174 | -1,174 |
| -5.33% | -782 | -782 | -782 | -782 | -782 | -782 | -782 |
| -2.67% | -391 | -391 | -391 | -391 | -391 | -391 | -391 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 391 | 391 | 391 | 391 | 391 | 391 | 391 |
| 5.33% | 782 | 782 | 782 | 782 | 782 | 782 | 782 |
| 8.00% | 1,174 | 1,174 | 1,174 | 1,174 | 1,174 | 1,174 | 1,174 |

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

| |
|---|
| **735** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

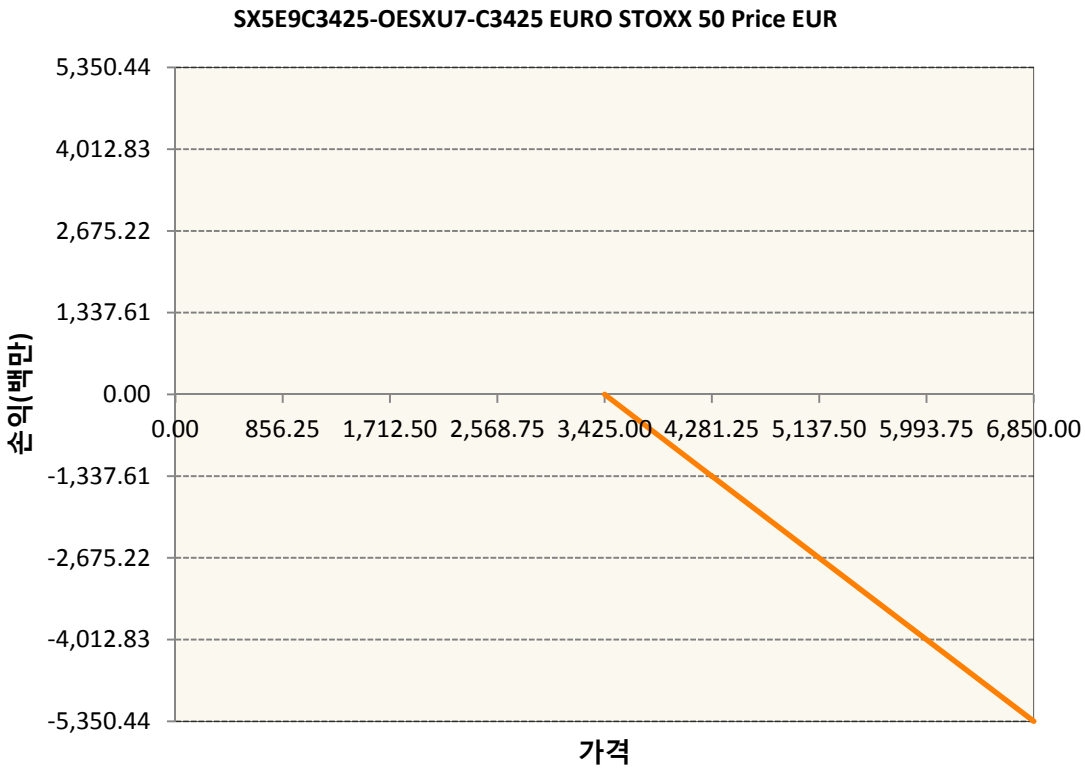
# 유로커버드콜(주식혼합-파생형)

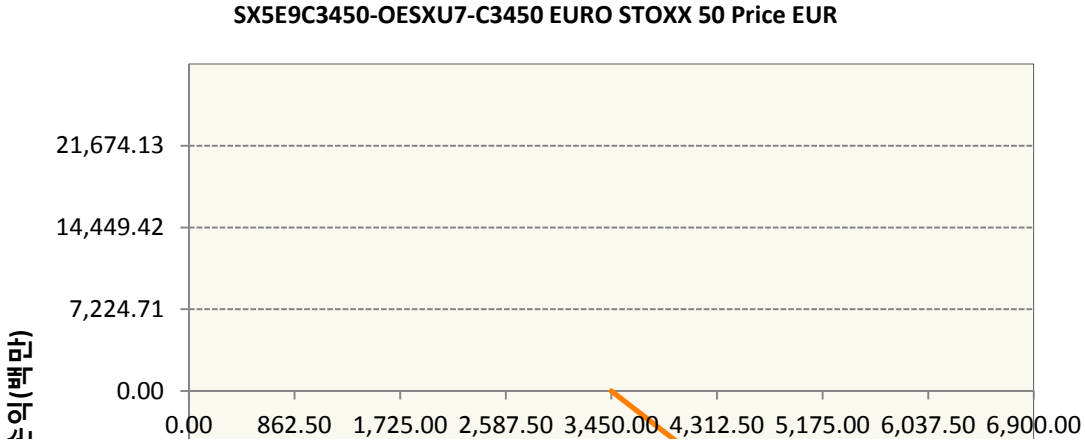
## 1. 계약금액

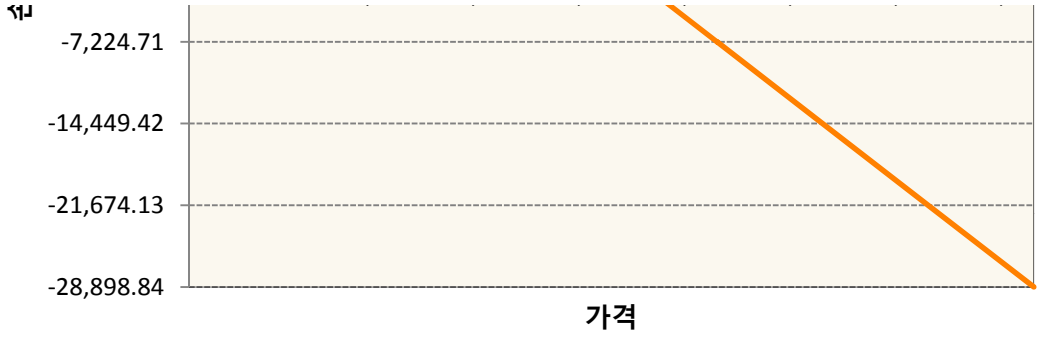
(단위:백만원)

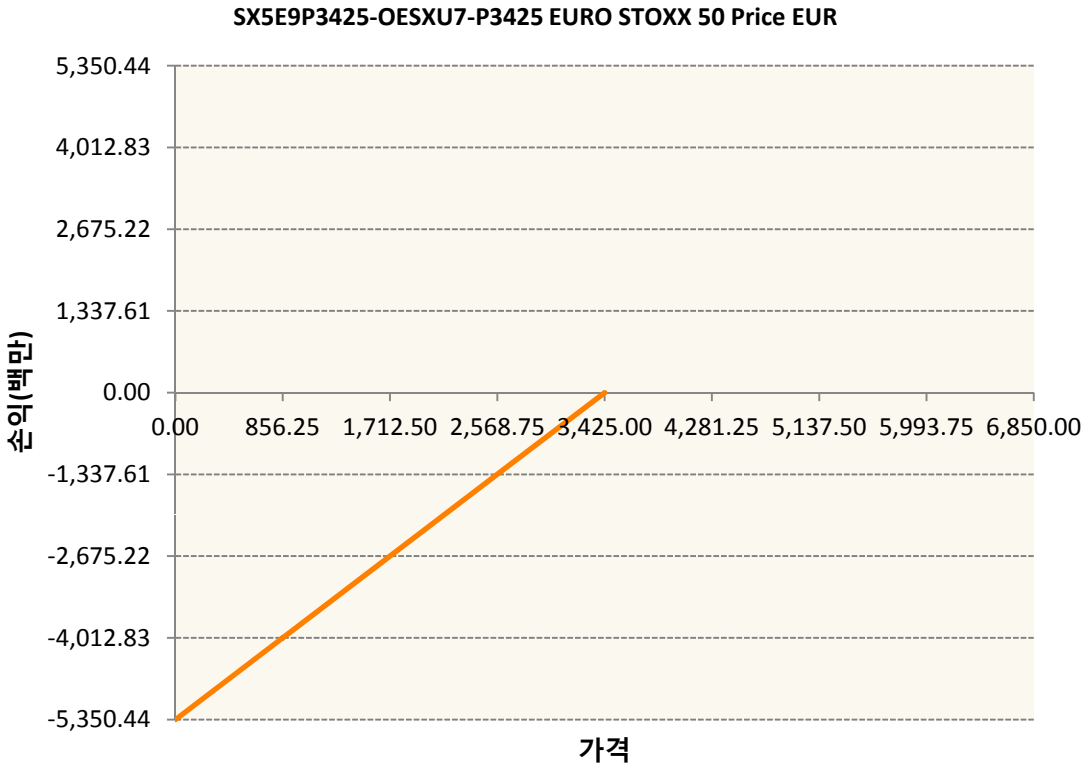
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 29,681 | 0 | 29,681 | |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 68,499 | -68,499 | 장내 |

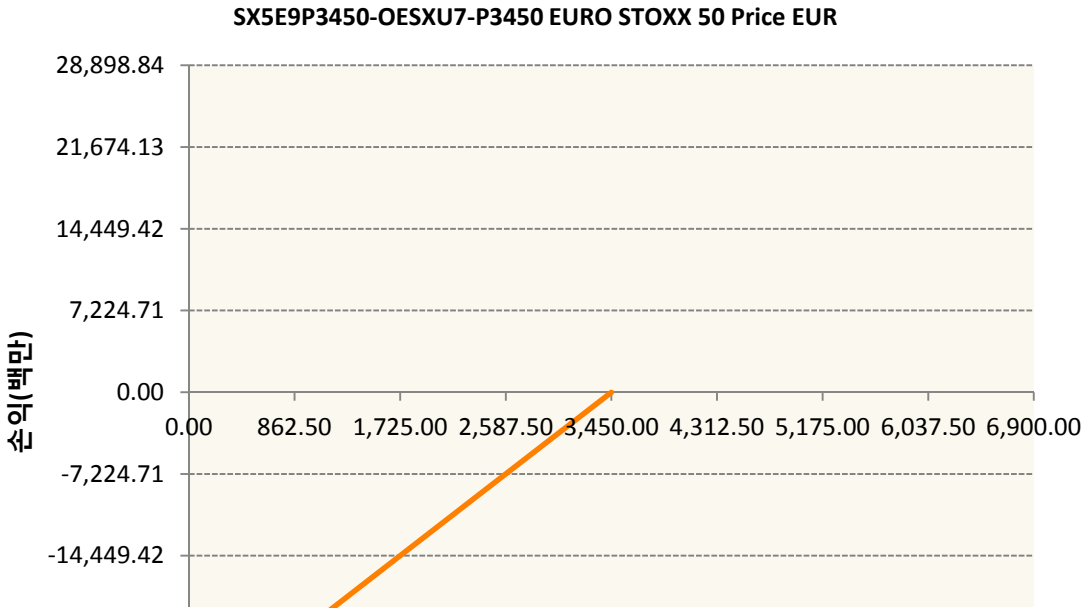
## 2. 만기시점의 손익구조

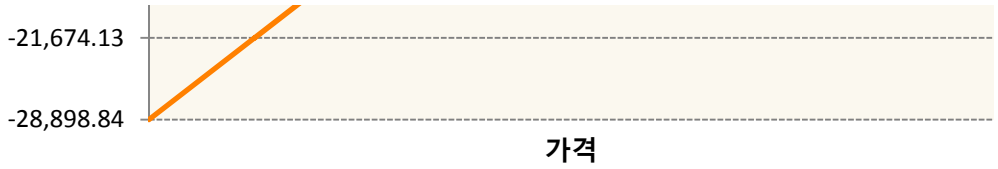


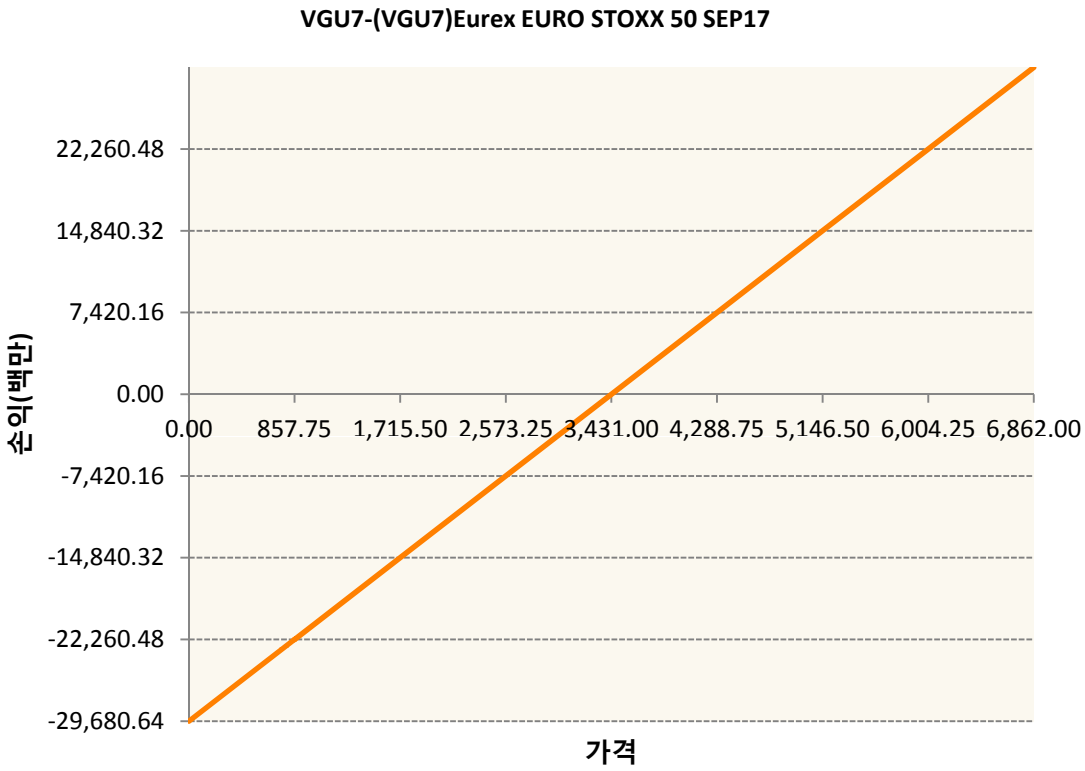




-7,224.71
-14,449.42
-21,674.13
-28,898.84
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
5,350.44
4,012.83
2,675.22
1,337.61
0.00
-1,337.61
-2,675.22
-4,012.83
-5,350.44
손익(백만)
0.00
856.25
1,712.50
2,568.75
3,425.00
4,281.25
5,137.50
5,993.75
6,850.00
가격


SX5E9P3450-OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR
28,898.84
21,674.13
14,449.42
7,224.71
0.00
-7,224.71
-14,449.42
손익(백만)
0.00
862.50
1,725.00
2,587.50
3,450.00
4,312.50
5,175.00
6,037.50
6,900.00




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| SX5E9C3425 | OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR | 428 |
| SX5E9C3450 | OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR | 2,312 |
| SX5E9P3425 | OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR | 428 |
| SX5E9P3450 | OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR | 2,312 |
| VGU7 | (VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17 | 2,374 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **6,215** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

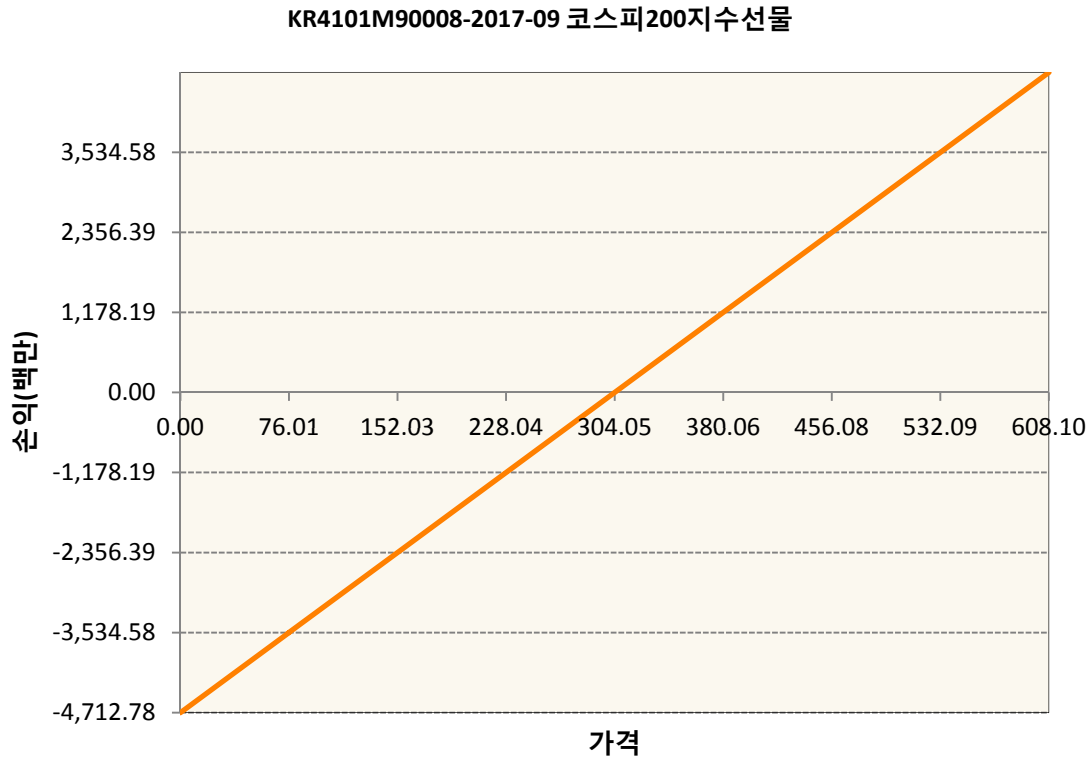
# ETF스마트레버리지목표전환형7호

## 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 | 4,713 | 0 | 4,713 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M90( 2017-09 코스피200지수선물 | | | | | | | 377 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -377 | -377 | -377 | -377 | -377 | -377 | -377 |
| -5.33% | -251 | -251 | -251 | -251 | -251 | -251 | -251 |
| -2.67% | -126 | -126 | -126 | -126 | -126 | -126 | -126 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 126 | 126 | 126 | 126 | 126 | 126 | 126 |
| 5.33% | 251 | 251 | 251 | 251 | 251 | 251 | 251 |
| 8.00% | 377 | 377 | 377 | 377 | 377 | 377 | 377 |

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

| |
|---|
| **236** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

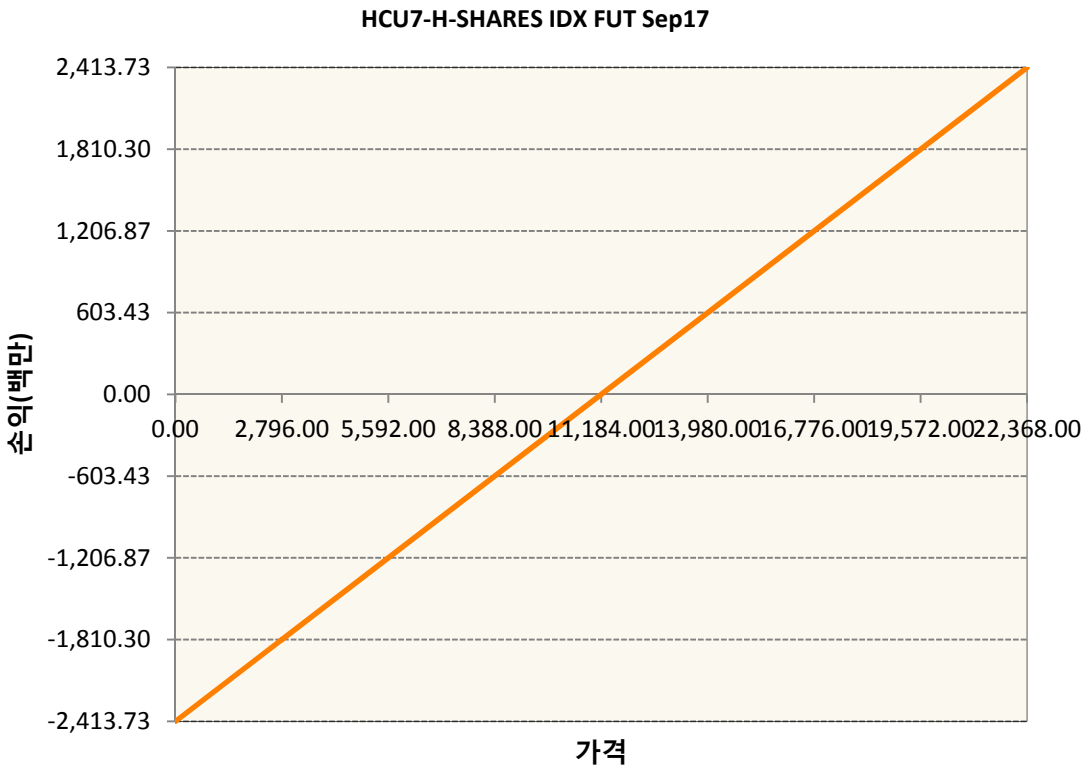
# 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

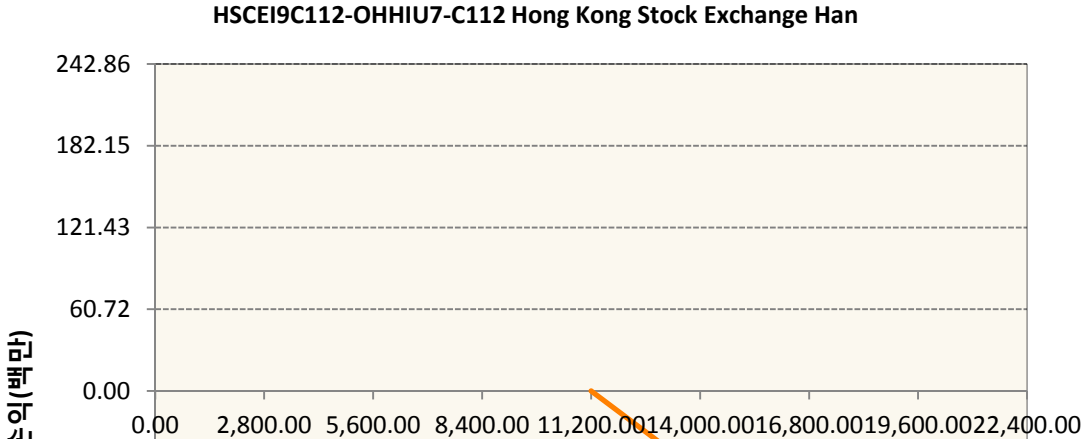
## 1. 계약금액

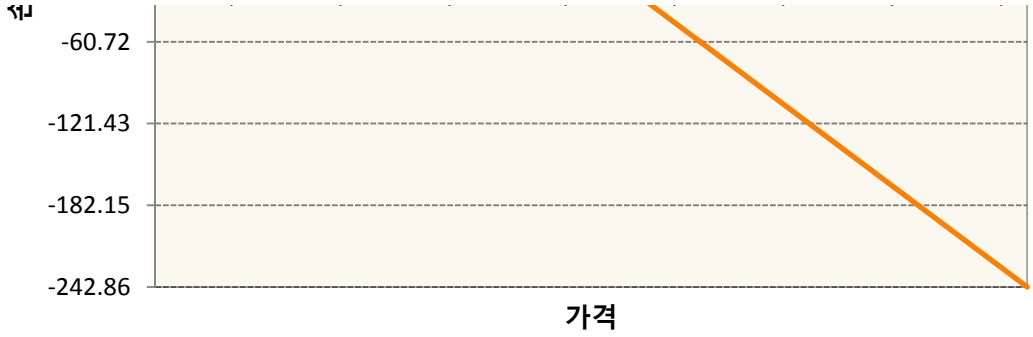
(단위:백만원)

| 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 | 2,414 | 0 | 2,414 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 4,935 | -4,935 | 장내 |

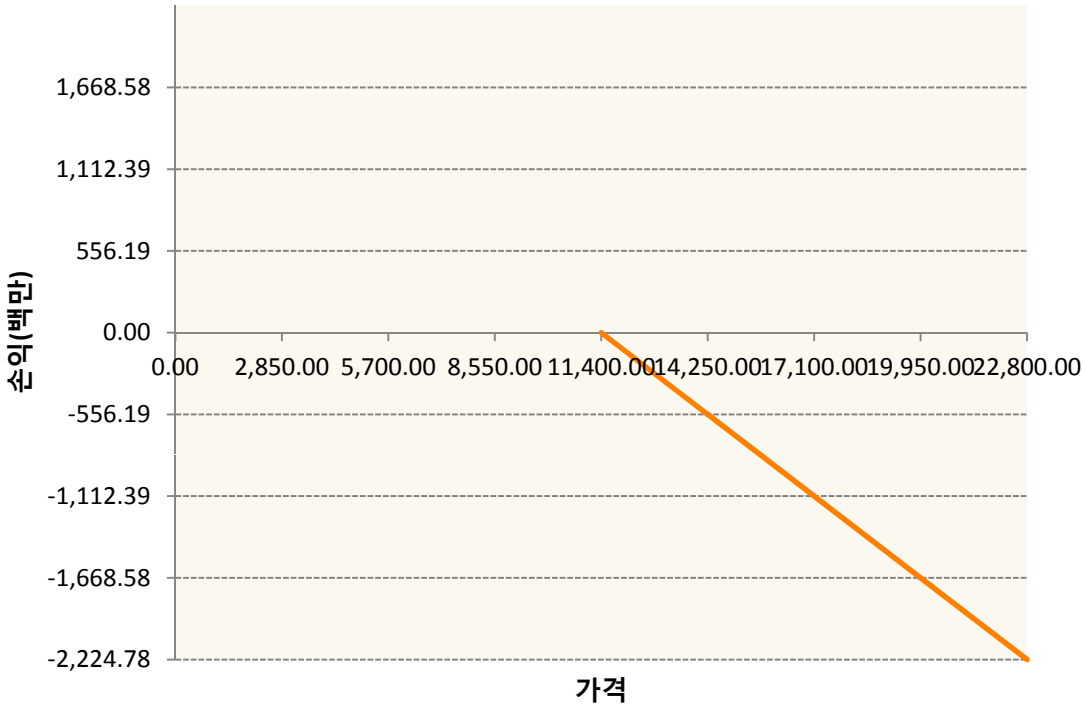
## 2. 만기시점의 손익구조



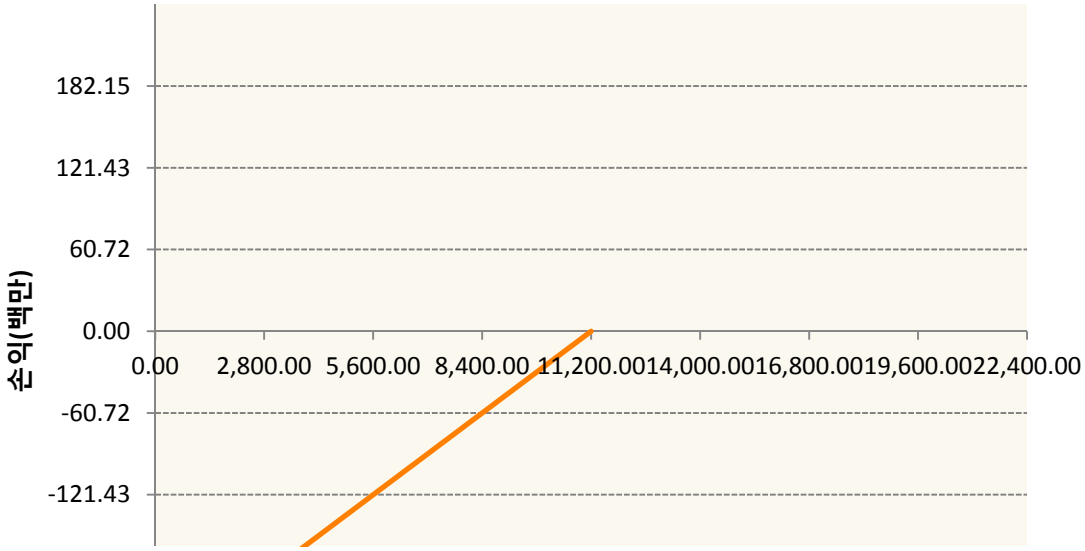



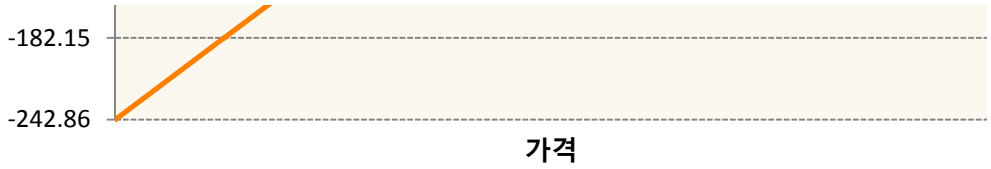


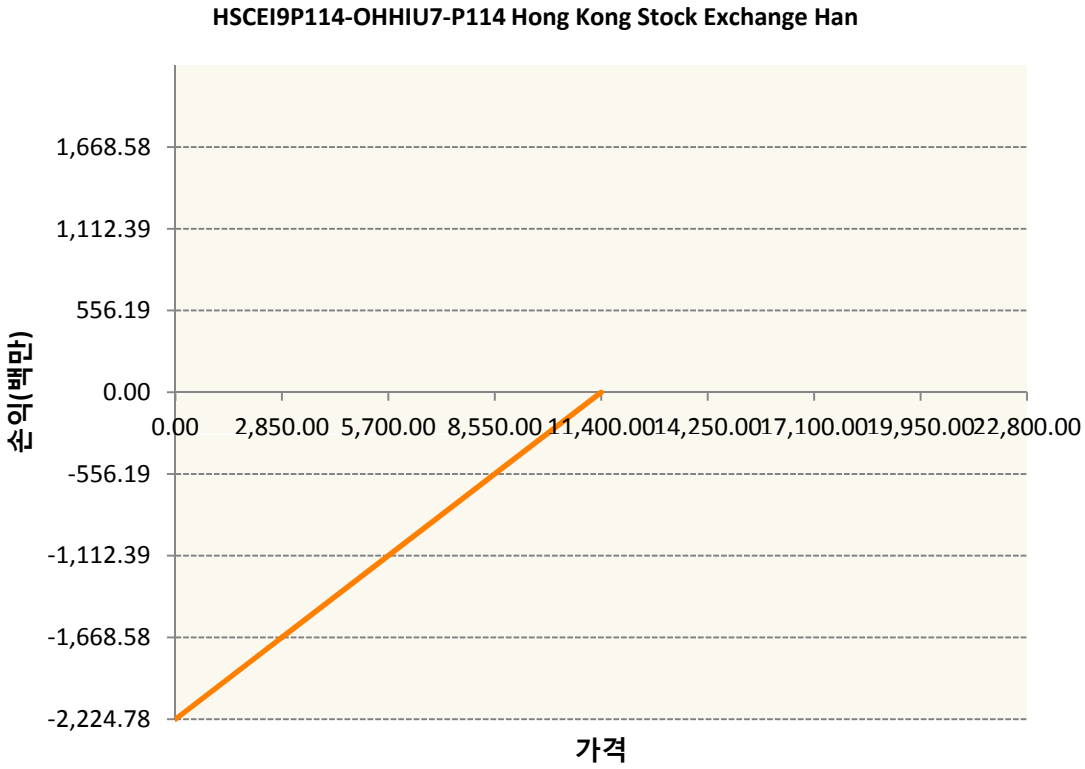

HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han




HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|---|---|
| HCU7 H-SHARES IDX FUT Sep17 | 193 |
| HSCEI9C112 OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han | 19 |
| HSCEI9C114 OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han | 178 |
| HSCEI9P112 OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han | 19 |
| HSCEI9P114 OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han | 178 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **508** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

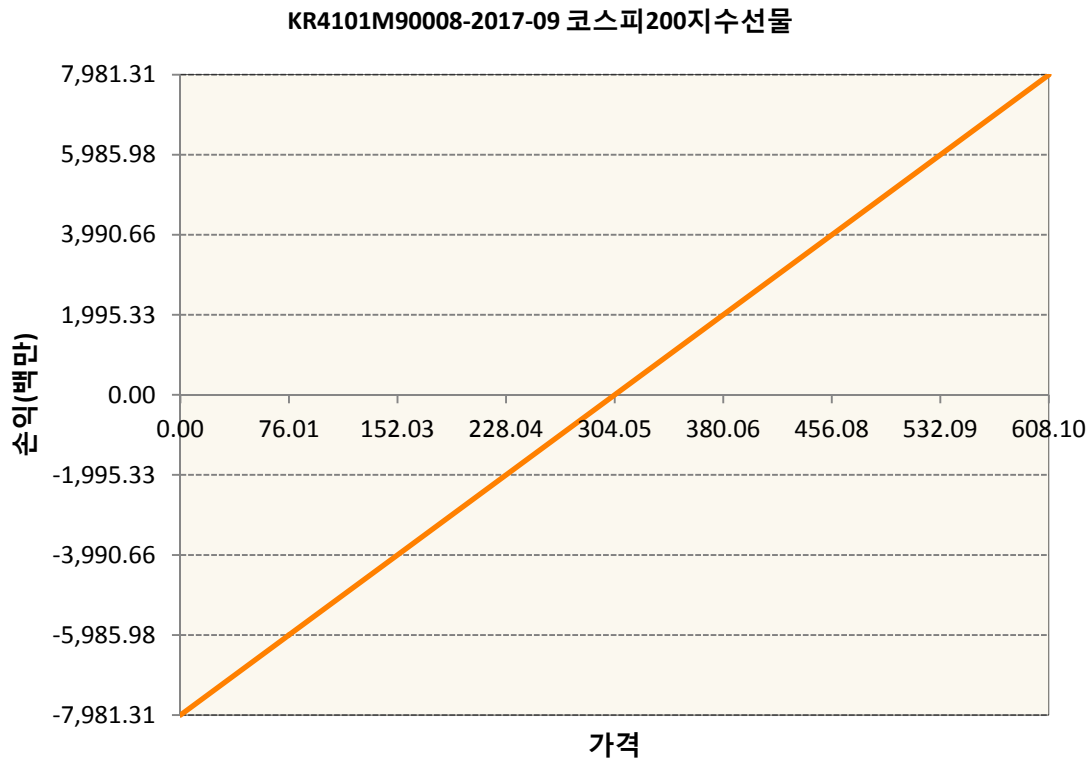
# 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

## 1. 계약금액

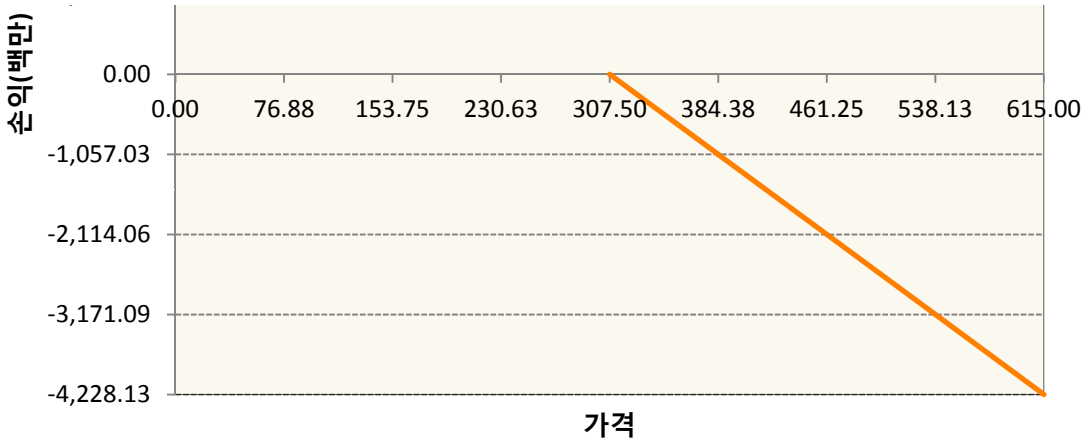
(단위:백만원)

| 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 | 3,918 | -3,918 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,981 | 0 | 7,981 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 18,500 | 0 | 18,500 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 21,972 | -21,972 | 장내 |

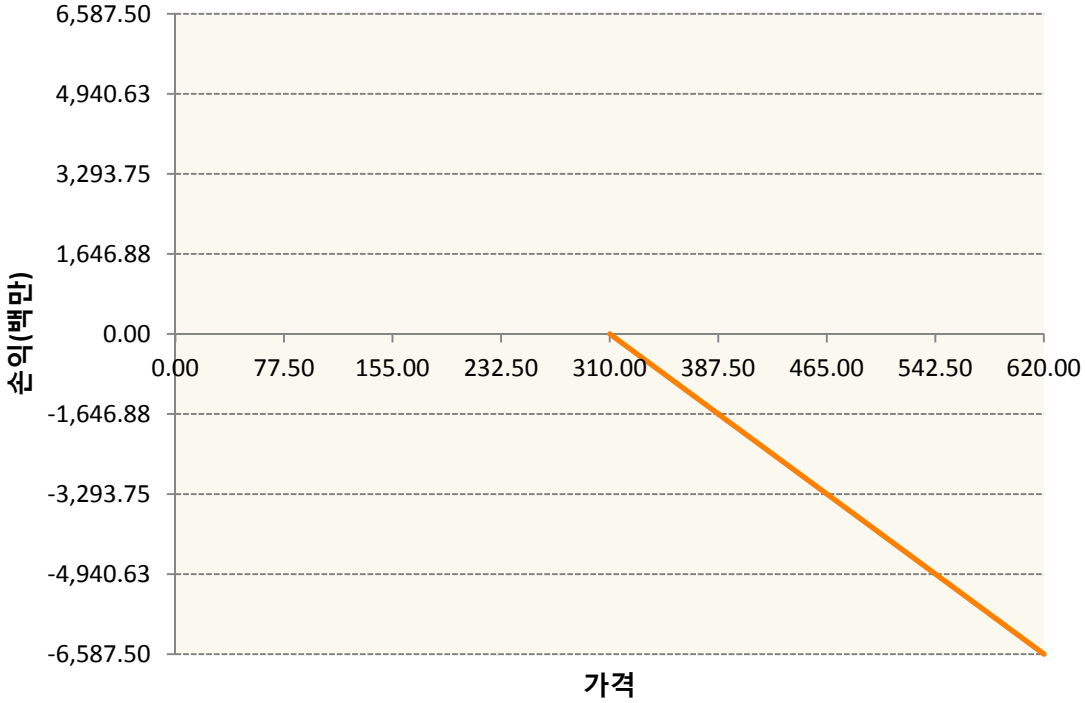
## 2. 만기시점의 손익구조



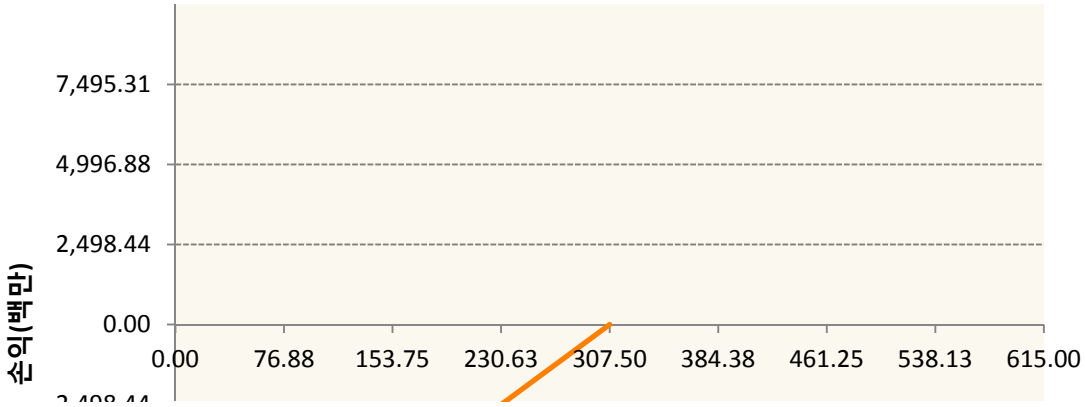


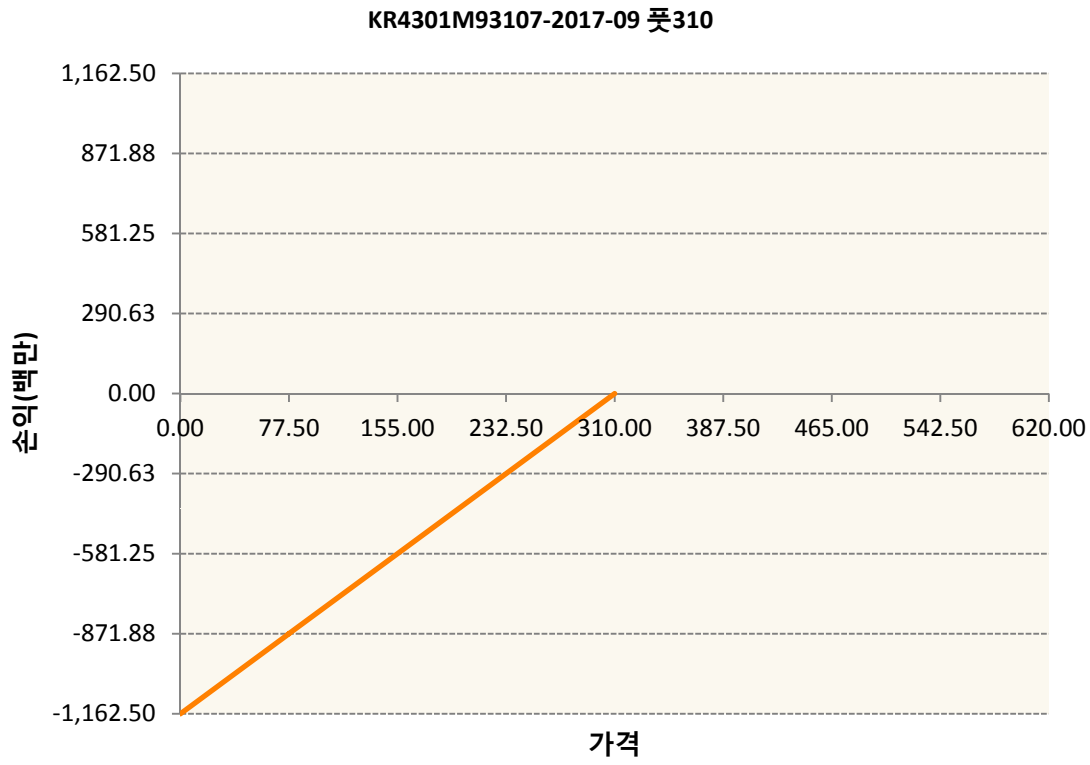

KR4201M93109-2017-09 콜310




KR4301M93073-2017-09 풋307.5






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,480 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,480 | -1,480 | -1,480 | -1,480 | -1,480 | -1,480 | -1,480 |
| -5.33% | -987 | -987 | -987 | -987 | -987 | -987 | -987 |
| -2.67% | -493 | -493 | -493 | -493 | -493 | -493 | -493 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 493 | 493 | 493 | 493 | 493 | 493 | 493 |
| 5.33% | 987 | 987 | 987 | 987 | 987 | 987 | 987 |
| 8.00% | 1,480 | 1,480 | 1,480 | 1,480 | 1,480 | 1,480 | 1,480 |
| KR4101M90( 2017-09 코스피200지수선물 | | | | | | | 639 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | -639 | -639 | -639 | -639 | -639 | -639 | -639 |
| -5.33% | -426 | -426 | -426 | -426 | -426 | -426 | -426 |
| -2.67% | -213 | -213 | -213 | -213 | -213 | -213 | -213 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 213 | 213 | 213 | 213 | 213 | 213 | 213 |
| 5.33% | 426 | 426 | 426 | 426 | 426 | 426 | 426 |
| 8.00% | 639 | 639 | 639 | 639 | 639 | 639 | 639 |
| | KR4201M93( 2017-09 콜307.5 | | | | | | 251 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 46 | 46 | 45 | 45 | 45 | 44 | 44 |
| -5.33% | 45 | 45 | 44 | 42 | 41 | 39 | 37 |
| -2.67% | 40 | 37 | 34 | 31 | 27 | 24 | 20 |
| 0% | 16 | 11 | 5 | 0 | -5 | -11 | -16 |
| 2.67% | -43 | -48 | -53 | -59 | -64 | -69 | -75 |
| 5.33% | -135 | -137 | -140 | -143 | -147 | -151 | -155 |
| 8.00% | -242 | -243 | -243 | -245 | -246 | -248 | -251 |
| | KR4201M93: 2017-09 콜310 | | | | | | 359 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 52 | 52 | 52 | 52 | 52 | 51 | 50 |
| -5.33% | 52 | 51 | 51 | 49 | 48 | 46 | 43 |
| -2.67% | 47 | 45 | 41 | 37 | 32 | 27 | 22 |
| 0% | 22 | 15 | 8 | 0 | -8 | -16 | -24 |
| 2.67% | -51 | -60 | -68 | -77 | -86 | -94 | -103 |
| 5.33% | -180 | -185 | -191 | -197 | -203 | -210 | -217 |
| 8.00% | -340 | -342 | -344 | -347 | -350 | -354 | -359 |
| | KR4301M93( 2017-09 풋307.5 | | | | | | 687 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -682 | -682 | -683 | -683 | -684 | -686 | -687 |
| -5.33% | -420 | -422 | -424 | -427 | -430 | -434 | -439 |
| -2.67% | -169 | -175 | -182 | -190 | -199 | -208 | -217 |
| 0% | 37 | 25 | 13 | 0 | -13 | -25 | -38 |
| 2.67% | 161 | 149 | 137 | 125 | 112 | 100 | 87 |
| 5.33% | 208 | 202 | 195 | 188 | 179 | 170 | 161 |
| 8.00% | 219 | 217 | 215 | 212 | 208 | 203 | 198 |
| | KR4301M93: 2017-09 풋310 | | | | | | 82 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 |
| -5.33% | -52 | -52 | -52 | -52 | -52 | -53 | -53 |
| -2.67% | -22 | -23 | -23 | -24 | -25 | -26 | -26 |
| 0% | 4 | 3 | 1 | 0 | -1 | -3 | -4 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2.67% | 21 | 20 | 18 | 17 | 15 | 14 | 12 |
| 5.33% | 29 | 28 | 27 | 26 | 25 | 24 | 22 |
| 8.00% | 31 | 31 | 30 | 30 | 29 | 29 | 28 |

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

| |
|---|
| **3,348** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

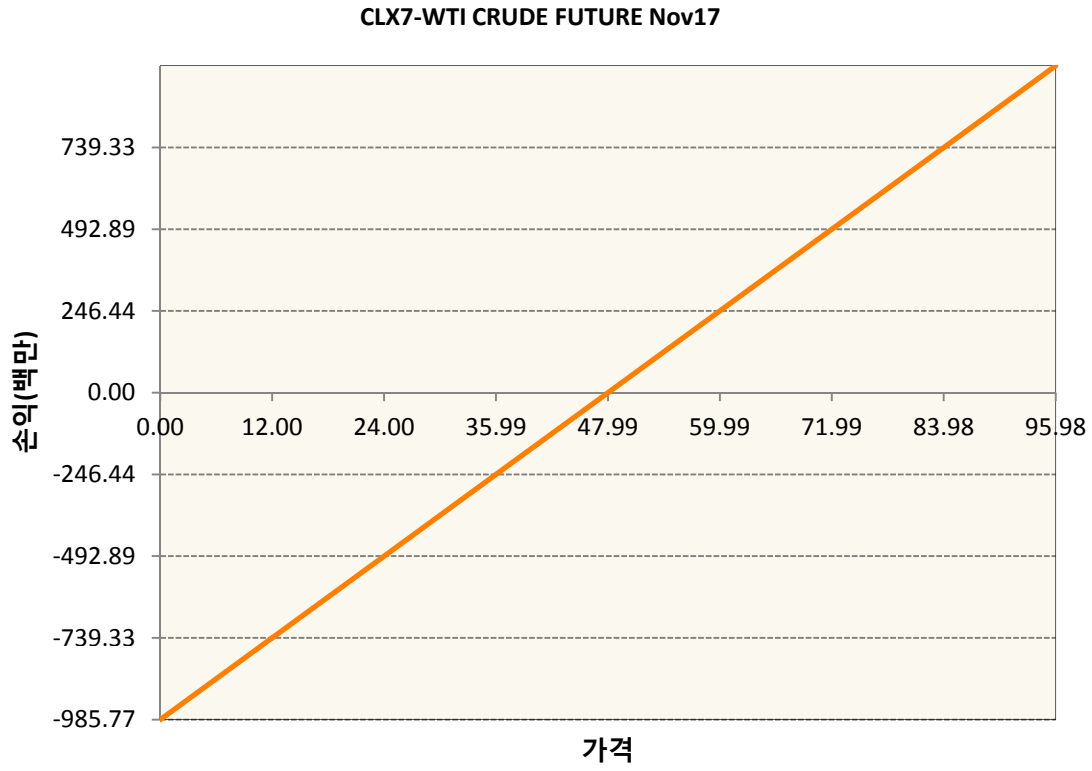
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

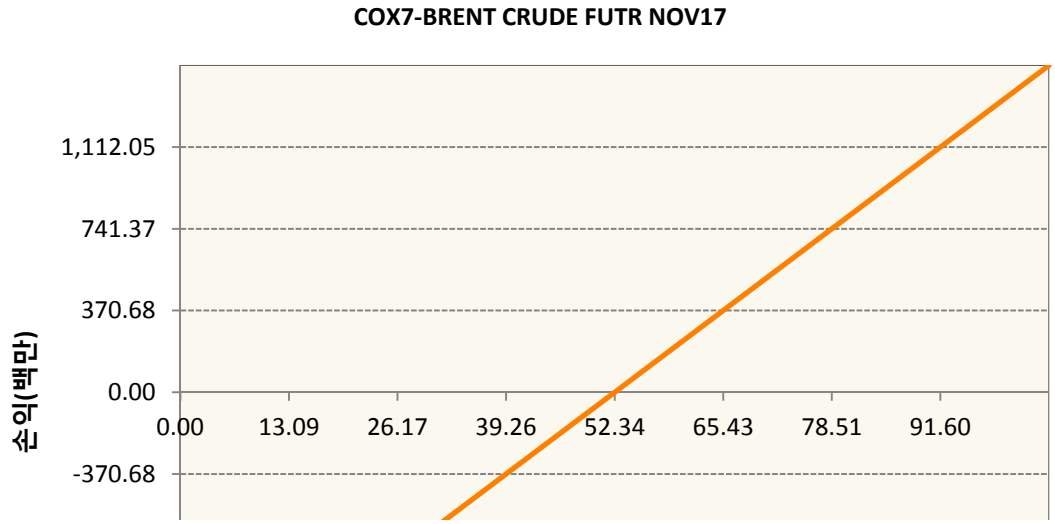
## 1. 계약금액

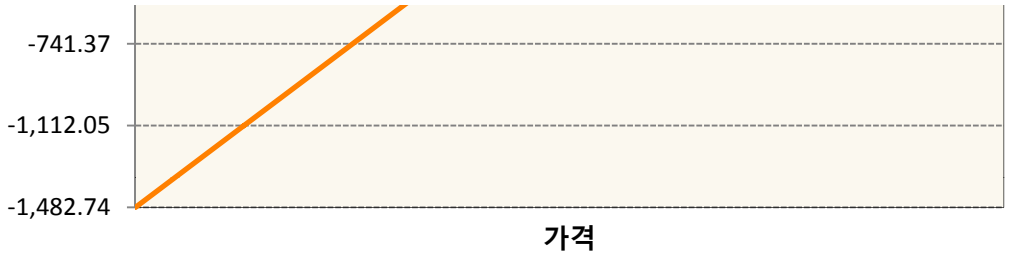
(단위:백만원)

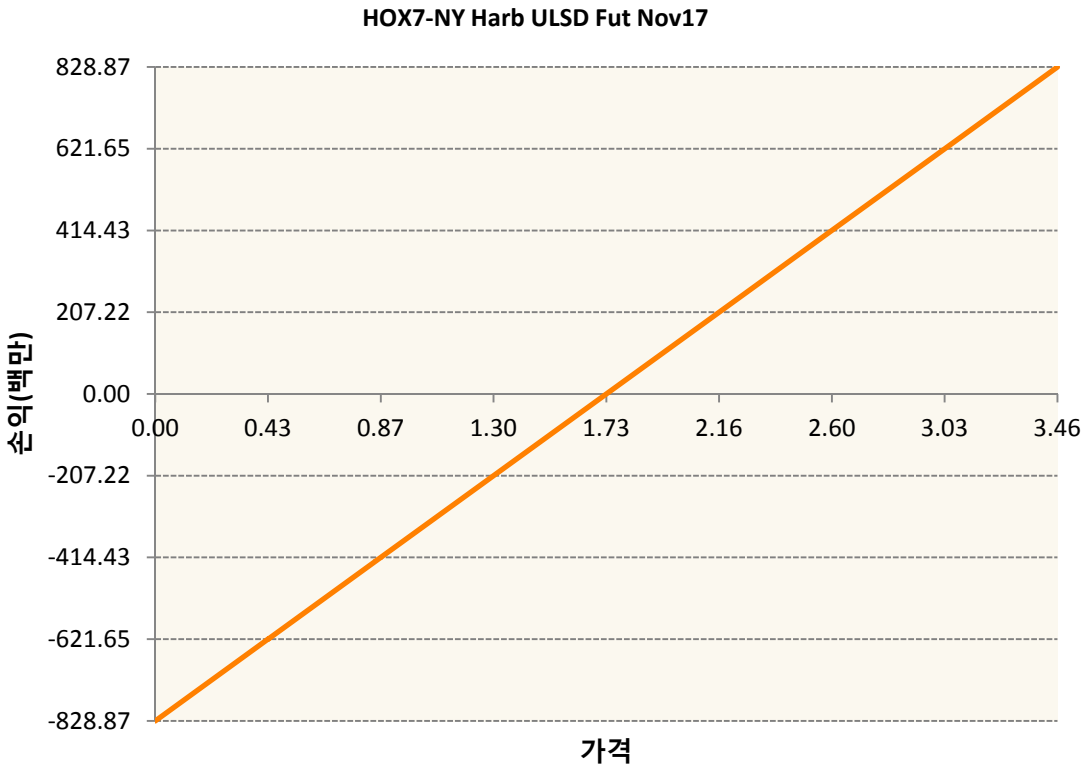
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,567 | 622 | 4,945 | |

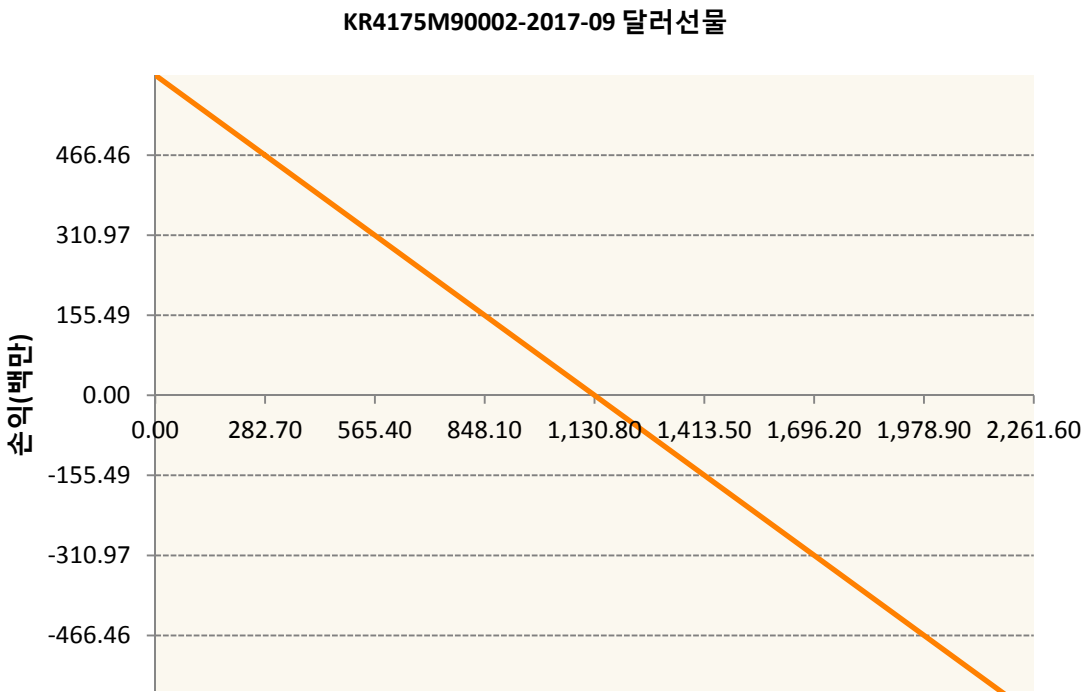
## 2. 만기시점의 손익구조

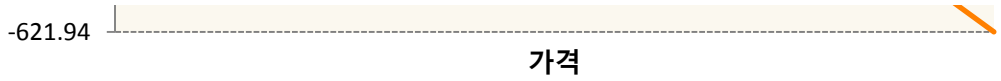


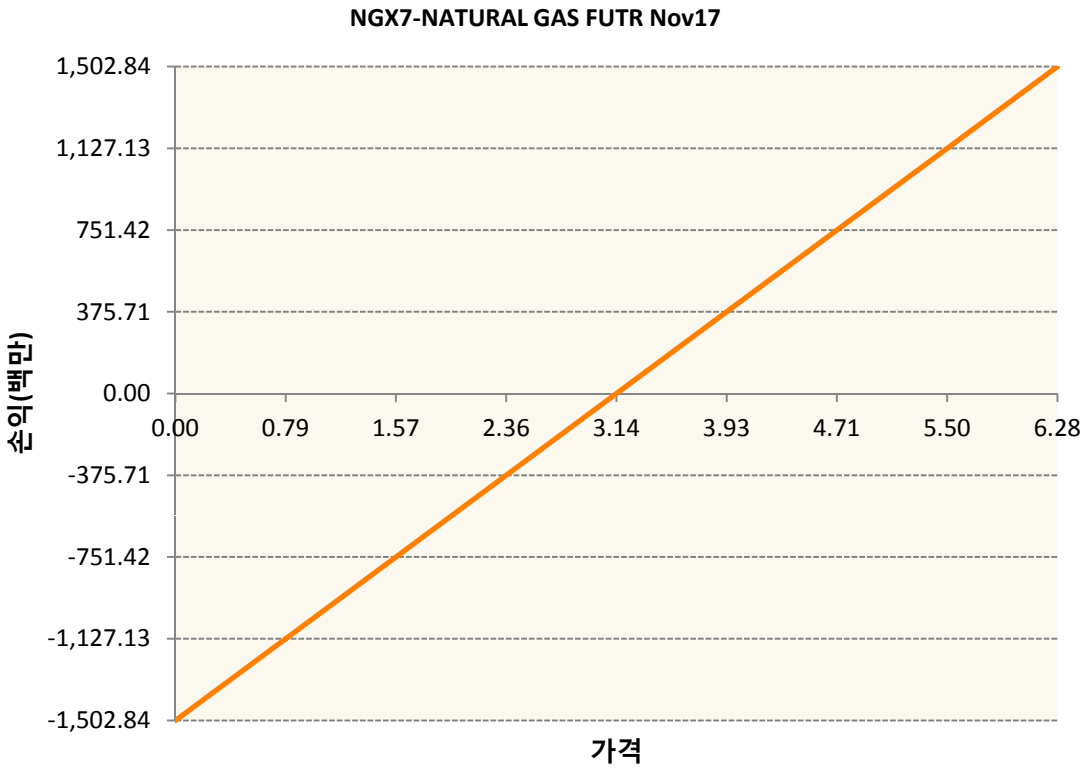



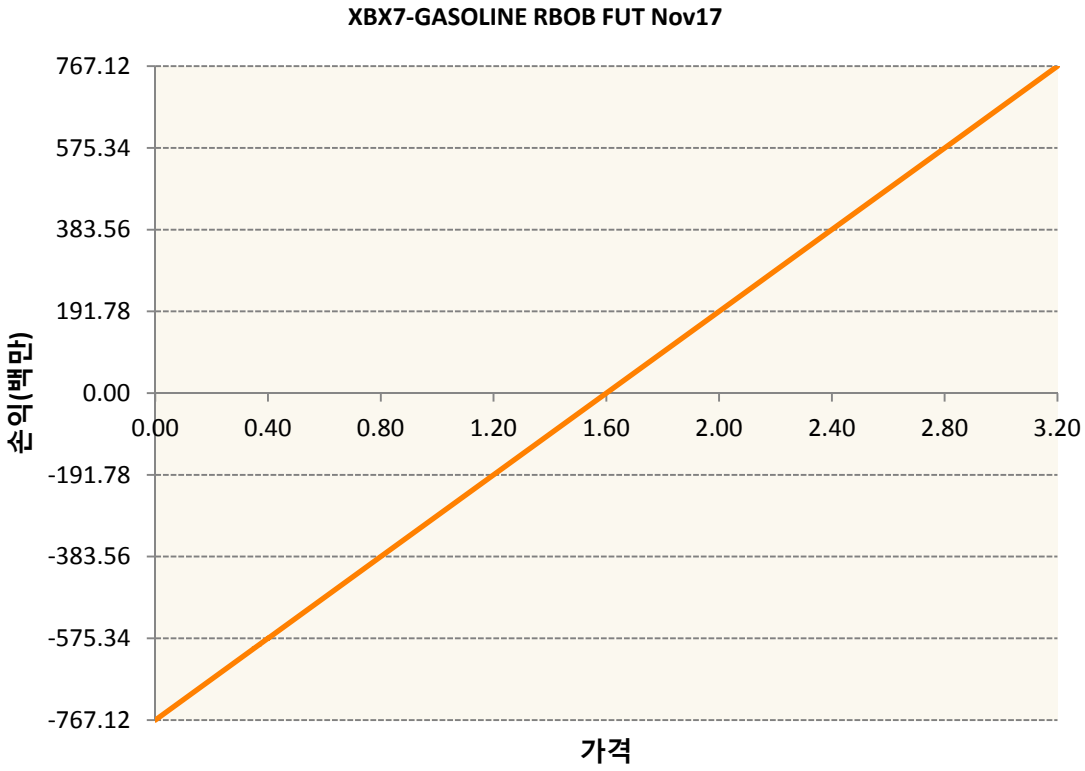

-741.37
-1,112.05
-1,482.74
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
828.87
621.65
414.43
207.22
0.00
-207.22
-414.43
-621.65
-828.87
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
3.46
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
466.46
310.97
155.49
0.00
-155.49
-310.97
-466.46
0.00
282.70
565.40
848.10
1,130.80
1,413.50
1,696.20
1,978.90
2,261.60
손익(백만)


-621.94
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
손익(백만)
1,502.84
1,127.13
751.42
375.71
0.00
-375.71
-751.42
-1,127.13
-1,502.84
0.00
0.79
1.57
2.36
3.14
3.93
4.71
5.50
6.28
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
손익(백만)
767.12
575.34
383.56
191.78
0.00
-191.78
-383.56
-575.34
-767.12
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
3.20
가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLX7 | WTI CRUDE FUTURE Nov17 | 79 |
| COX7 | BRENT CRUDE FUTR NOV17 | 119 |
| HOX7 | NY Harb ULSD Fut Nov17 | 66 |
| KR4175M90( | 2017-09 달러선물 | 50 |
| NGX7 | NATURAL GAS FUTR Nov17 | 120 |
| XBX7 | GASOLINE RBOB FUT Nov17 | 61 |

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

| |
|---|
| **804** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-06 |
| 기준일 | 2017-09-05 |

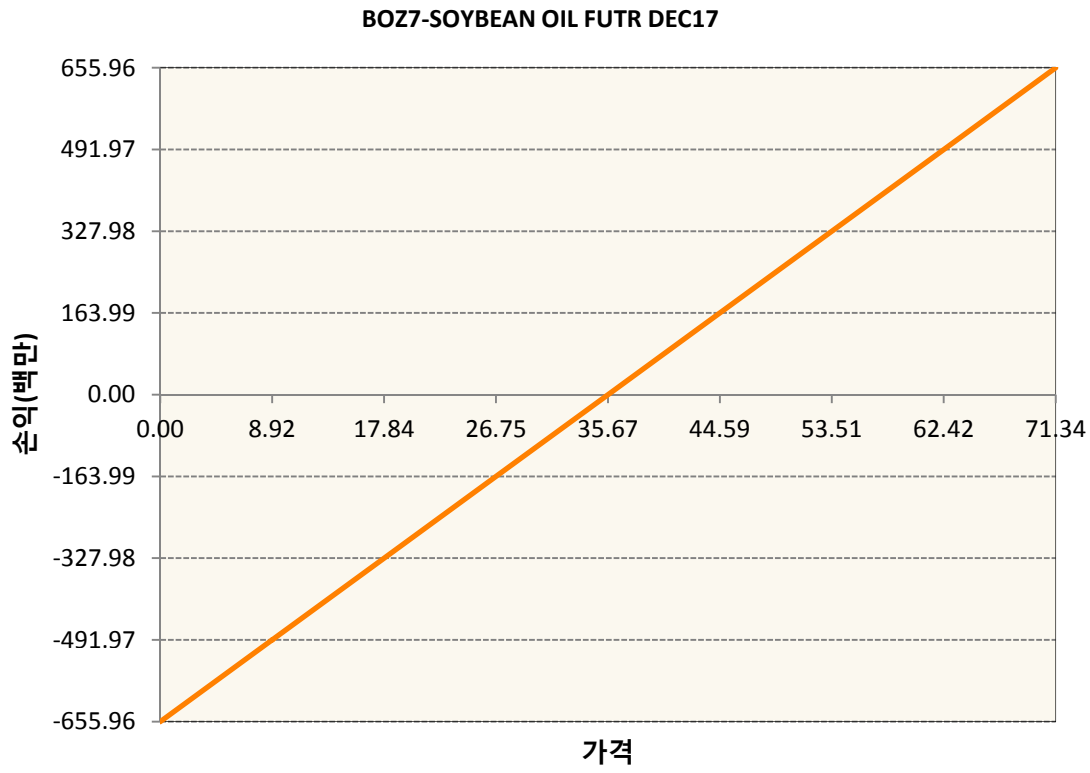
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

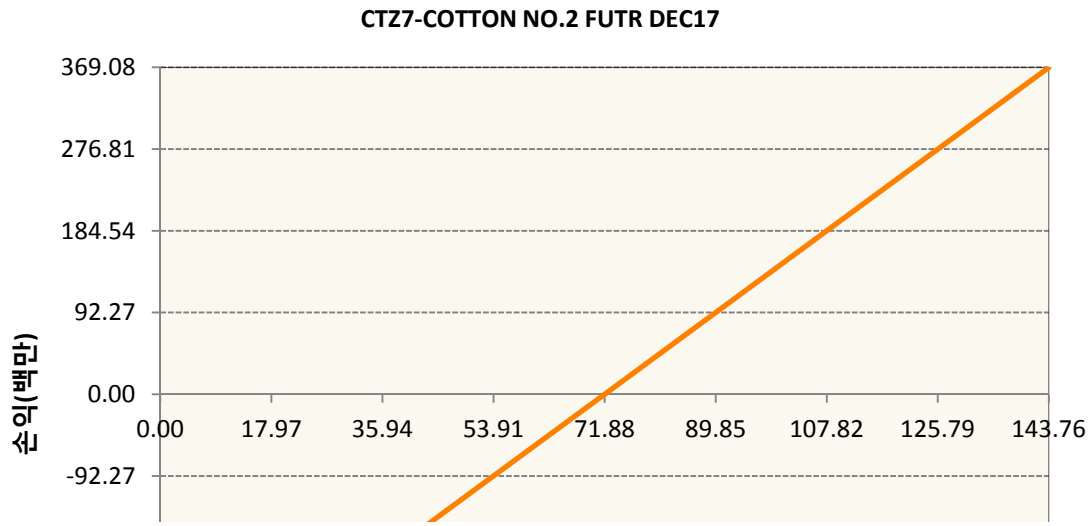
## 1. 계약금액

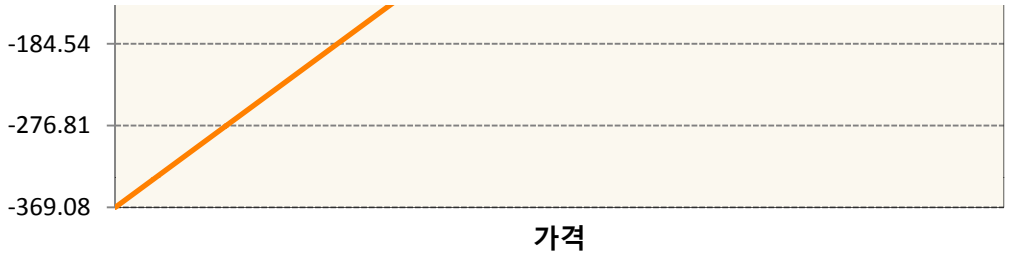
(단위:백만원)

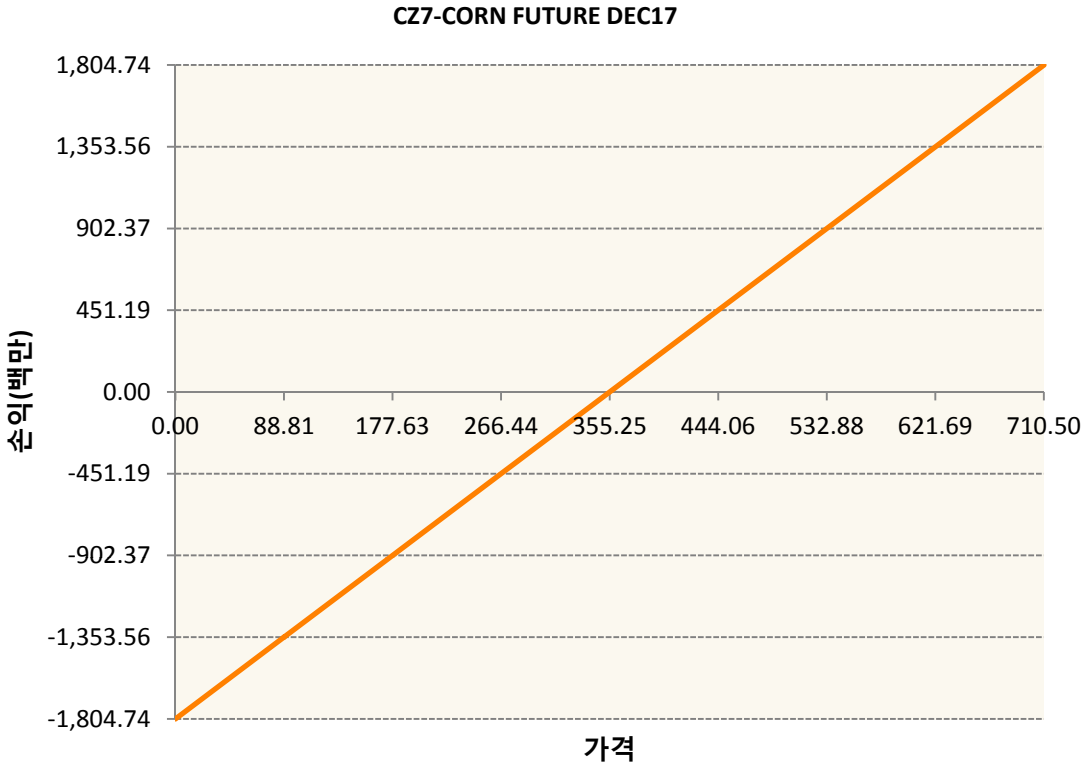
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,949 | 339 | 6,609 | |

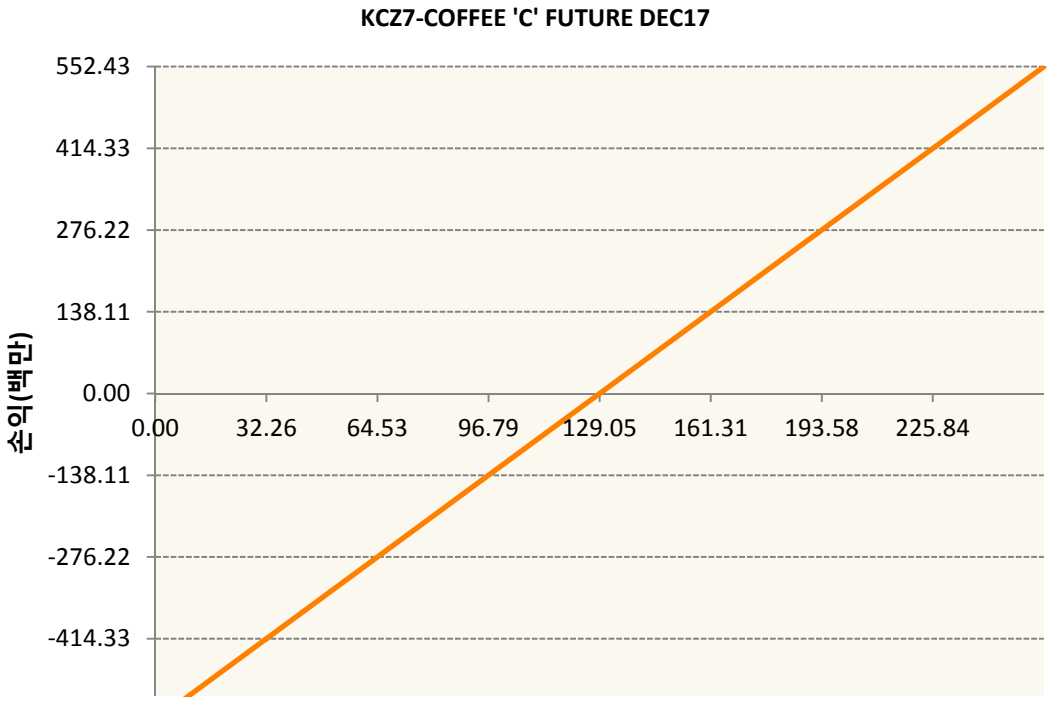
## 2. 만기시점의 손익구조

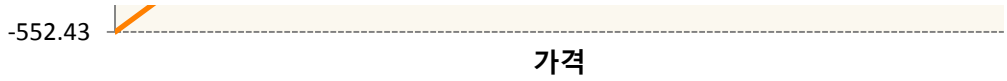


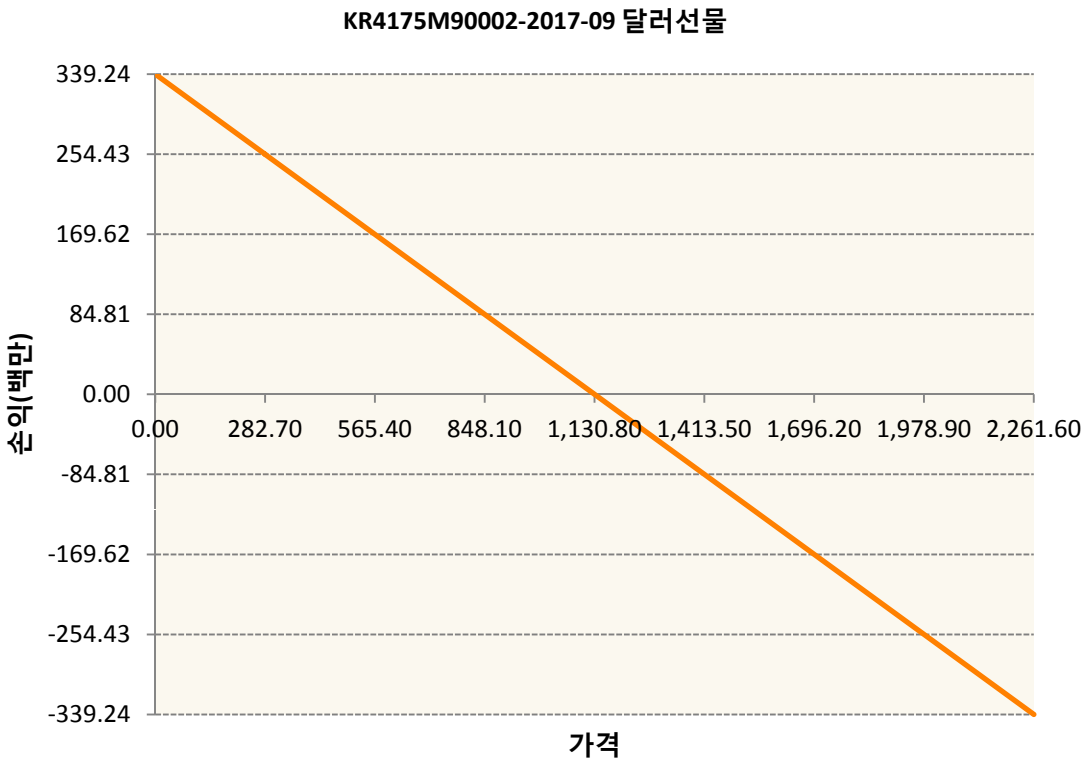



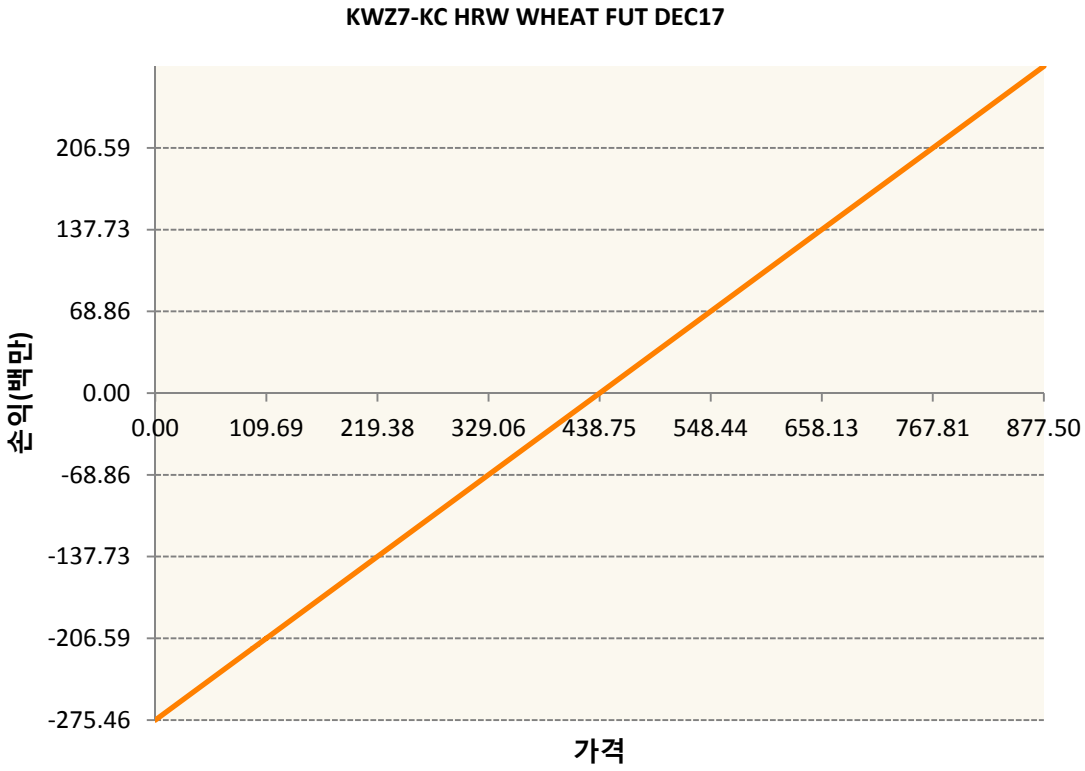

-184.54
-276.81
-369.08
가격

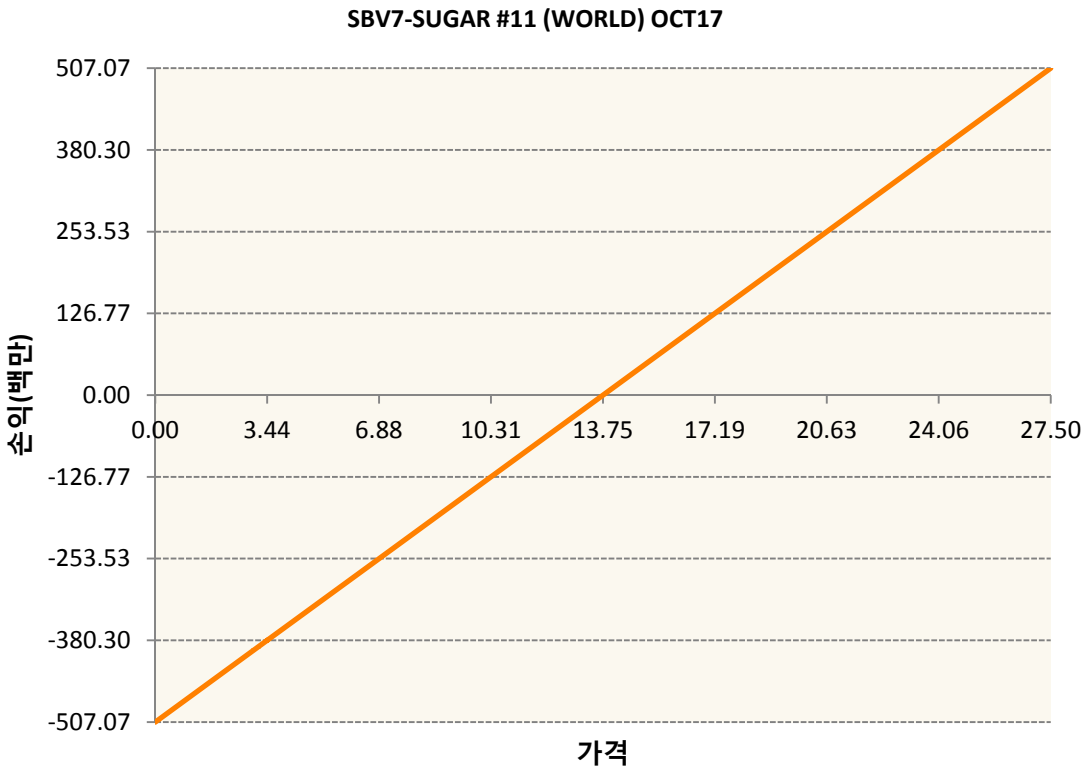

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,804.74
1,353.56
902.37
451.19
0.00
-451.19
-902.37
-1,353.56
-1,804.74
0.00
88.81
177.63
266.44
355.25
444.06
532.88
621.69
710.50
손익(백만)
가격

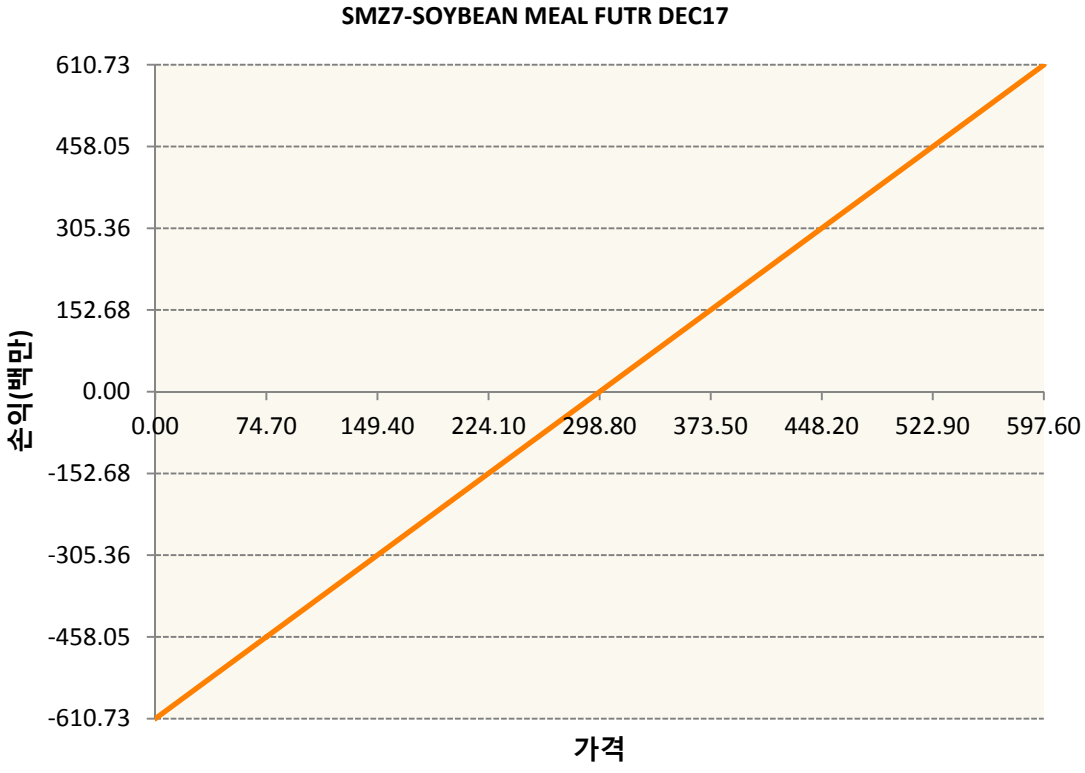

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
552.43
414.33
276.22
138.11
0.00
-138.11
-276.22
-414.33
0.00
32.26
64.53
96.79
129.05
161.31
193.58
225.84
손익(백만)


-552.43
가격

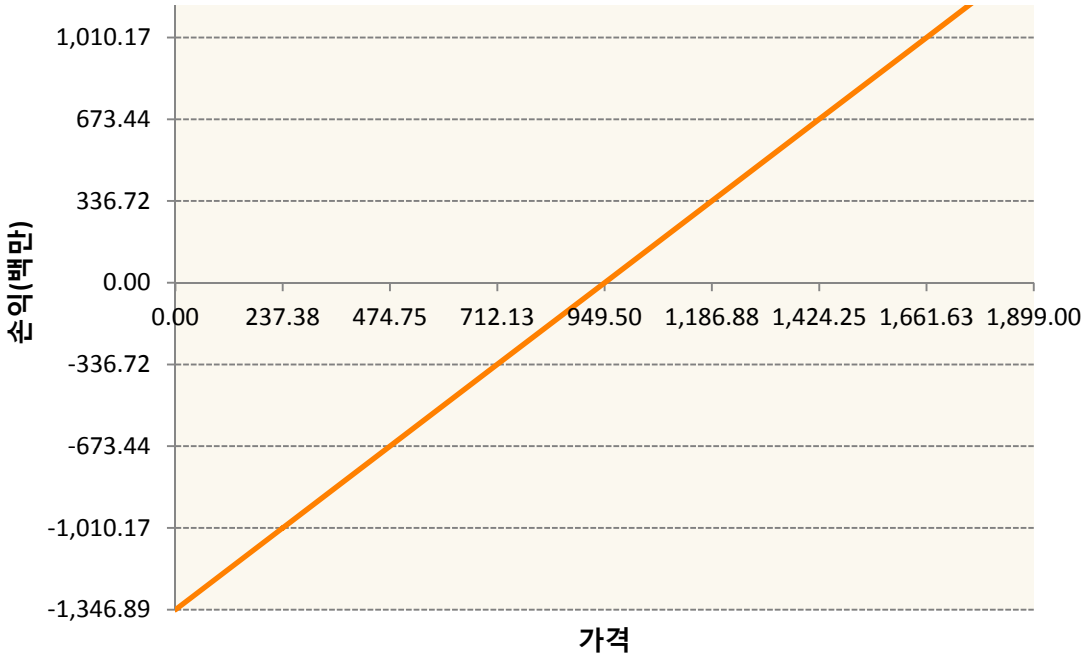

KR4175M90002-2017-09 달러선물
339.24
254.43
169.62
84.81
0.00
-84.81
-169.62
-254.43
-339.24
0.00
282.70
565.40
848.10
1,130.80
1,413.50
1,696.20
1,978.90
2,261.60
손익(백만)
가격

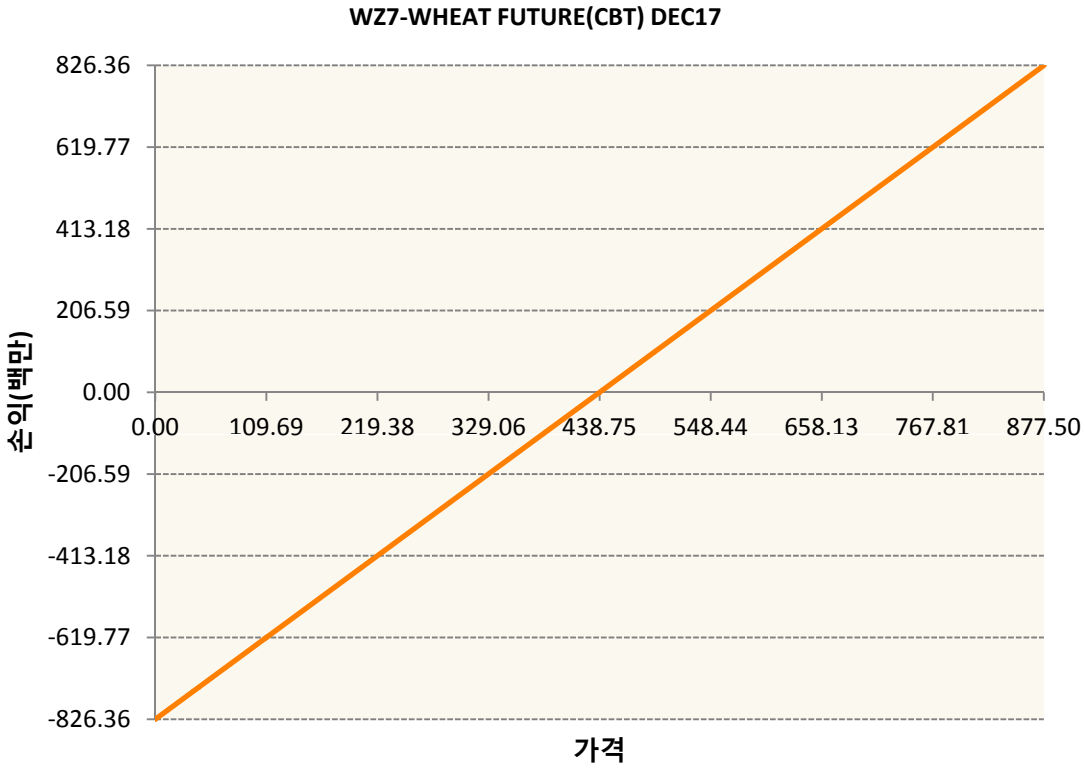

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
206.59
137.73
68.86
0.00
-68.86
-137.73
-206.59
-275.46
0.00
109.69
219.38
329.06
438.75
548.44
658.13
767.81
877.50
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
507.07
380.30
253.53
126.77
0.00
-126.77
-253.53
-380.30
-507.07
0.00
3.44
6.88
10.31
13.75
17.19
20.63
24.06
27.50
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
610.73
458.05
305.36
152.68
0.00
-152.68
-305.36
-458.05
-610.73
0.00
74.70
149.40
224.10
298.80
373.50
448.20
522.90
597.60
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| BOZ7 | SOYBEAN OIL FUTR DEC17 | 52 |
| CTZ7 | COTTON NO.2 FUTR DEC17 | 30 |
| CZ7 | CORN FUTURE DEC17 | 144 |
| KCZ7 | COFFEE 'C' FUTURE DEC17 | 44 |
| KR4175M90( | 2017-09 달러선물 | 27 |

| | | |
|---|---|---|
| KWZ7 | KC HRW WHEAT FUT DEC17 | 22 |
| SBV7 | SUGAR #11 (WORLD) OCT17 | 41 |
| SMZ7 | SOYBEAN MEAL FUTR DEC17 | 49 |
| SX7 | SOYBEAN FUTURE NOV17 | 108 |
| WZ7 | WHEAT FUTURE(CBT) DEC17 | 66 |

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

| |
|---|
| **654** |