| 공시일 | 2017-09-07 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-06 |

# 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 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

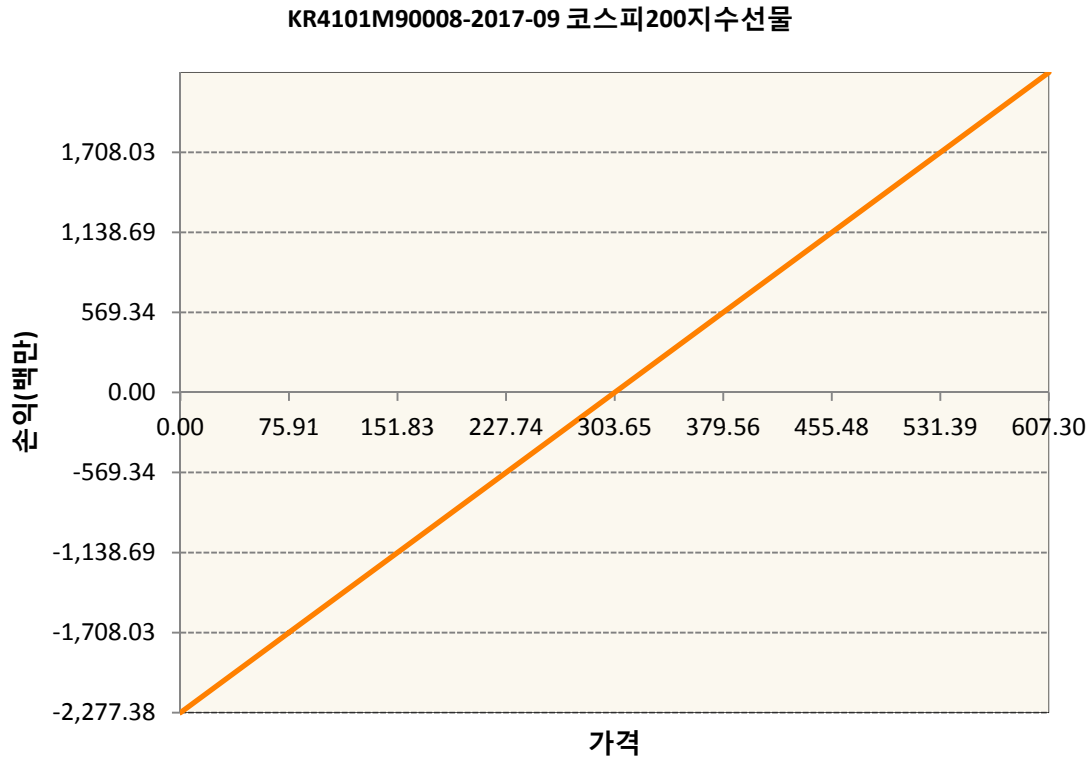
# 스마트인덱스모

## 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 | 2,277 | 0 | 2,277 | 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% | -121 | -121 | -121 | -121 | -121 | -121 | -121 |
| -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% | 121 | 121 | 121 | 121 | 121 | 121 | 121 |
| 8.00% | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 | 182 |

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

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

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

# 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 | 1,020 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **460** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

# 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 | 428 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **369** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

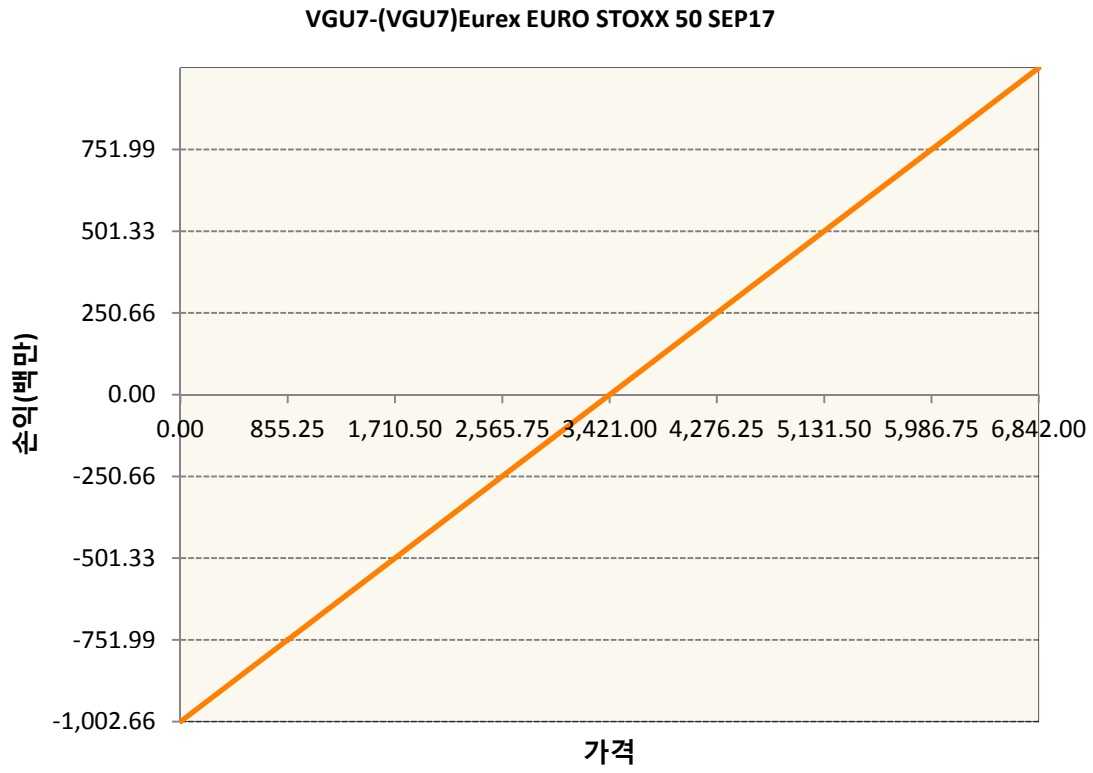
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,003 | 0 | 1,003 | |

## 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)

**63**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

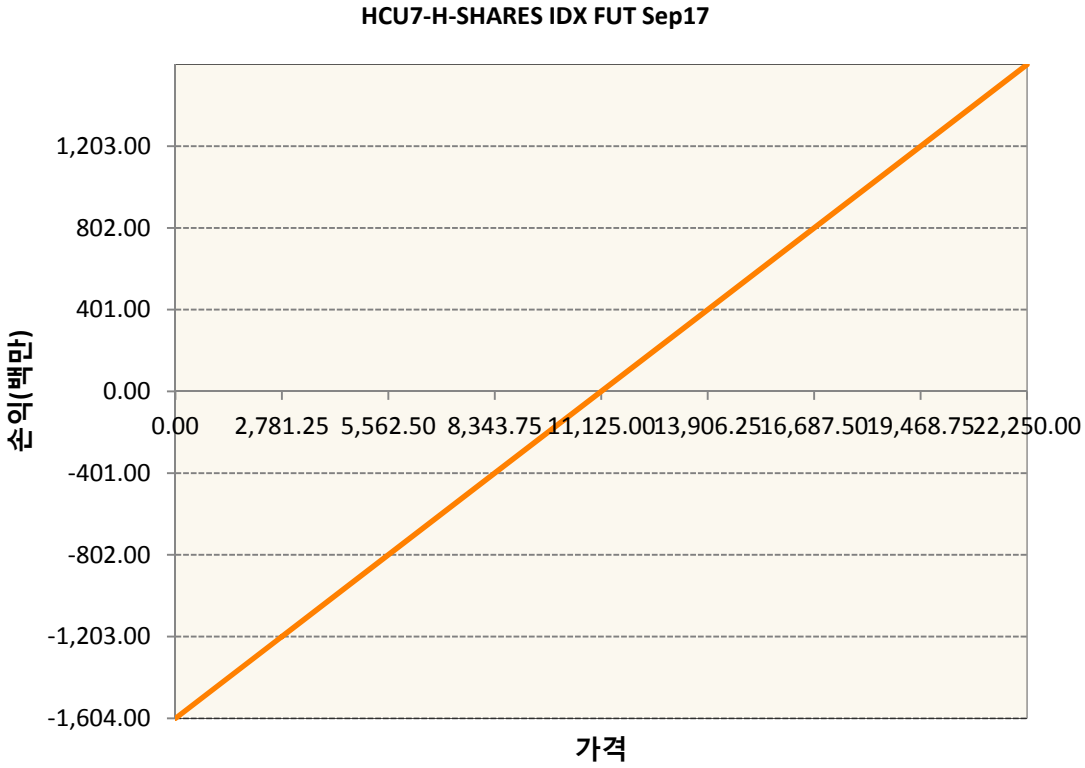
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

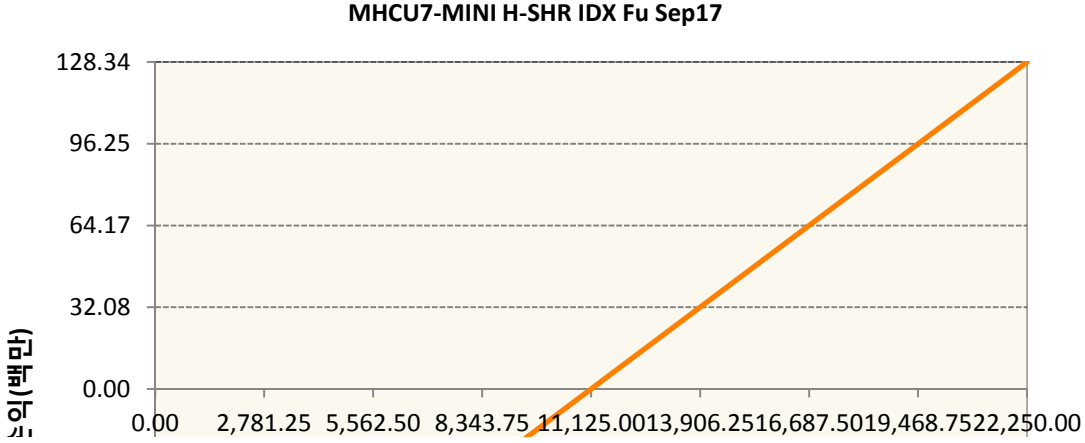
## 1. 계약금액

(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 | 128 | 0 | 128 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,604 | 0 | 1,604 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCU7 | H-SHARES IDX FUT Sep17 | 128 |
| MHCU7 | MINI H-SHR IDX Fu Sep17 | 10 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **119** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

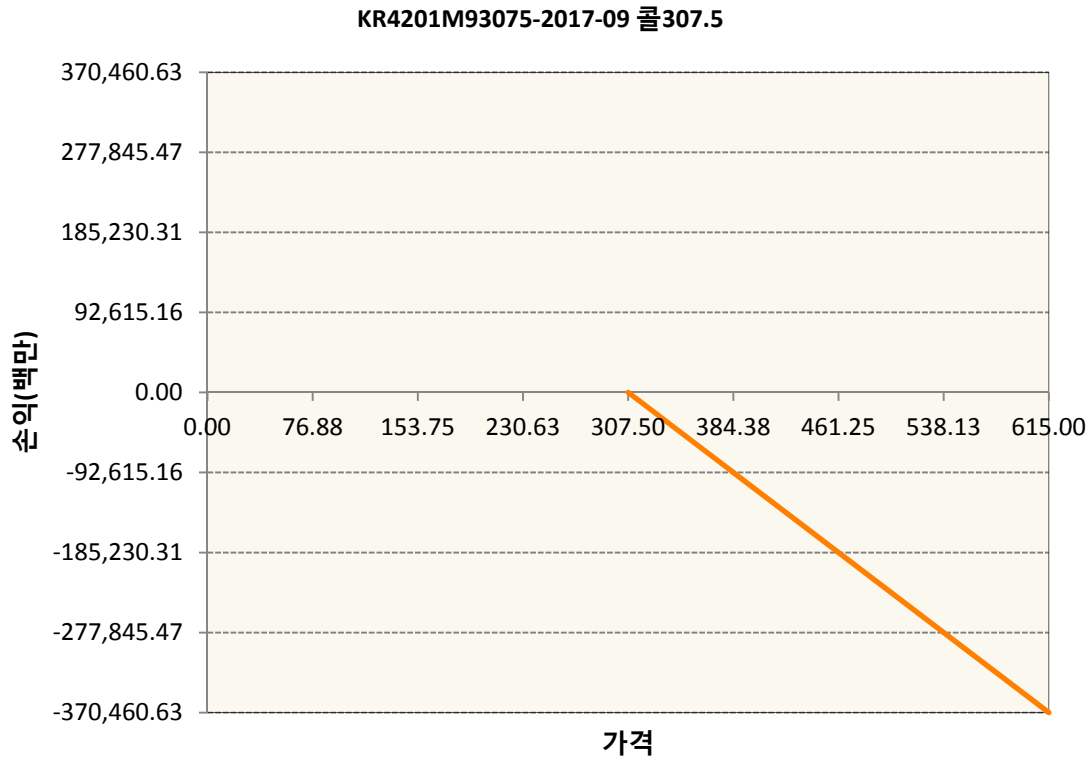
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

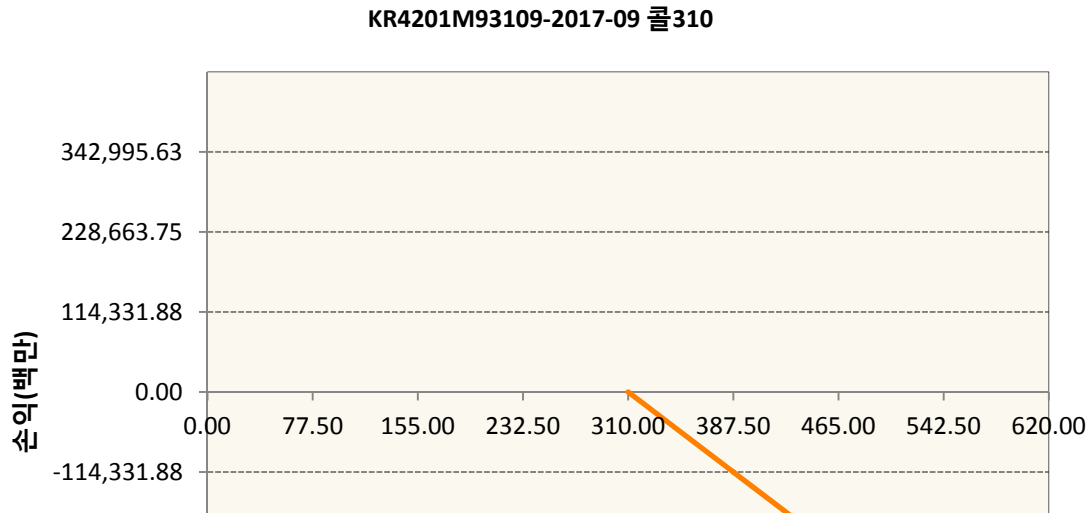
## 1. 계약금액

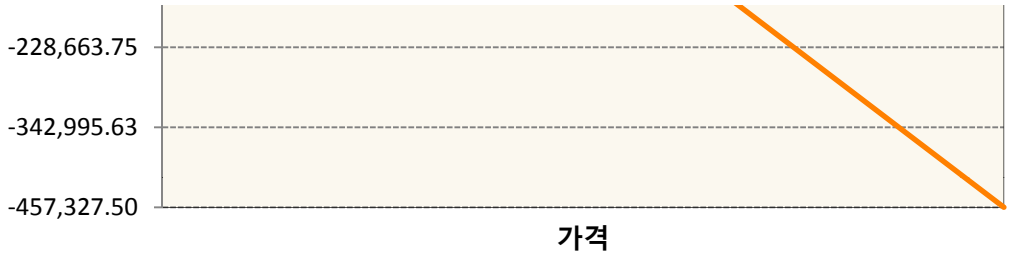
(단위:백만원)

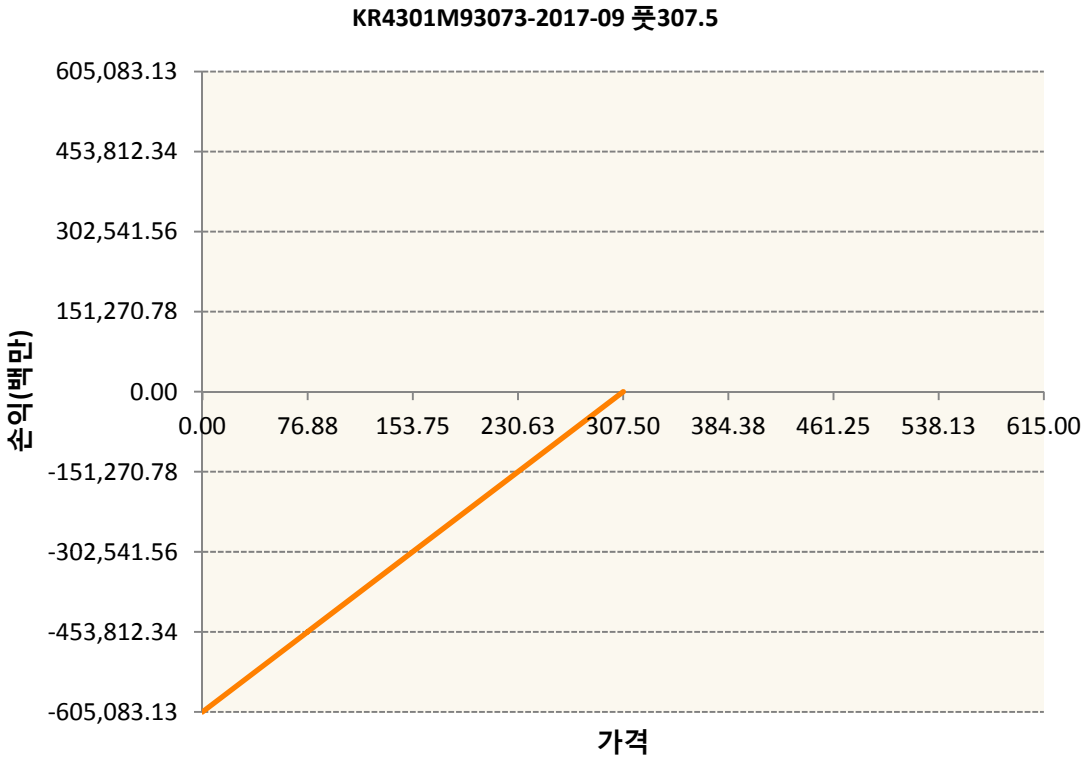
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,497,119 | -1,497,119 | 장내 |

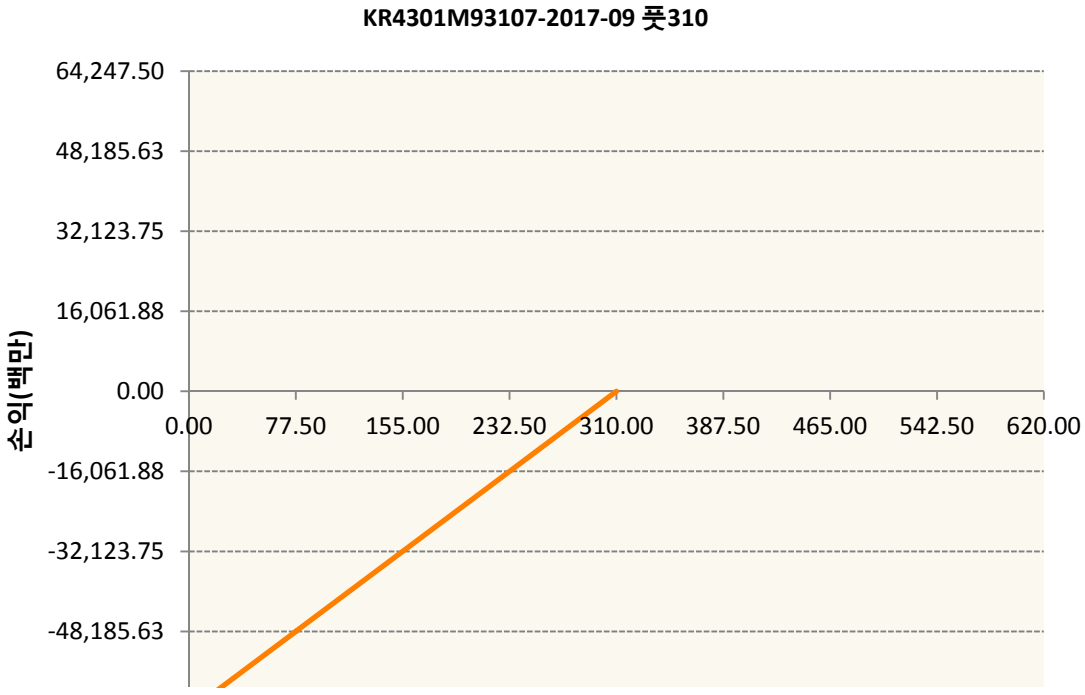
## 2. 만기시점의 손익구조

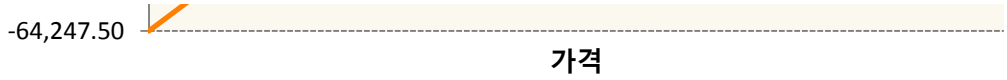



-228,663.75
-342,995.63
-457,327.50
가격


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 | | | | | | | 21,461 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 3,287 | 3,284 | 3,279 | 3,268 | 3,248 | 3,218 | 3,174 |
| -5.33% | 3,264 | 3,233 | 3,184 | 3,113 | 3,019 | 2,902 | 2,761 |
| -2.67% | 2,962 | 2,790 | 2,584 | 2,349 | 2,089 | 1,808 | 1,509 |
| 0% | 1,252 | 842 | 424 | 0 | -430 | -863 | -1,300 |
| 2.67% | -3,541 | -3,969 | -4,403 | -4,842 | -5,285 | -5,731 | -6,179 |
| 5.33% | -11,414 | -11,623 | -11,866 | -12,137 | -12,432 | -12,748 | -13,080 |
| 8.00% | -20,756 | -20,808 | -20,885 | -20,989 | -21,120 | -21,278 | -21,461 |
| KR4201M93: 2017-09 콜310 | | | | | | | 24,131 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 2,892 | 2,891 | 2,888 | 2,881 | 2,867 | 2,843 | 2,807 |
| -5.33% | 2,881 | 2,862 | 2,827 | 2,771 | 2,693 | 2,589 | 2,459 |
| -2.67% | 2,690 | 2,550 | 2,369 | 2,152 | 1,901 | 1,620 | 1,312 |
| 0% | 1,339 | 914 | 466 | 0 | -479 | -970 | -1,470 |
| 2.67% | -3,230 | -3,797 | -4,364 | -4,932 | -5,500 | -6,069 | -6,639 |
| 5.33% | -11,861 | -12,212 | -12,597 | -13,009 | -13,442 | -13,894 | -14,362 |
| 8.00% | -22,935 | -23,042 | -23,189 | -23,374 | -23,594 | -23,847 | -24,131 |
| KR4301M93( 2017-09 풋307.5 | | | | | | | 42,526 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -42,342 | -42,346 | -42,355 | -42,373 | -42,405 | -42,455 | -42,526 |
| -5.33% | -26,476 | -26,526 | -26,606 | -26,722 | -26,876 | -27,068 | -27,297 |
| -2.67% | -11,065 | -11,347 | -11,683 | -12,067 | -12,491 | -12,950 | -13,439 |
| 0% | 2,044 | 1,376 | 693 | 0 | -702 | -1,410 | -2,123 |
| 2.67% | 10,120 | 9,421 | 8,712 | 7,995 | 7,271 | 6,543 | 5,810 |
| 5.33% | 13,165 | 12,822 | 12,426 | 11,983 | 11,501 | 10,986 | 10,442 |
| 8.00% | 13,808 | 13,724 | 13,599 | 13,429 | 13,215 | 12,957 | 12,658 |
| KR4301M93: 2017-09 풋310 | | | | | | | 4,631 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -4,619 | -4,619 | -4,619 | -4,620 | -4,622 | -4,626 | -4,631 |
| -5.33% | -2,945 | -2,948 | -2,953 | -2,961 | -2,972 | -2,986 | -3,005 |
| -2.67% | -1,297 | -1,317 | -1,342 | -1,373 | -1,408 | -1,447 | -1,491 |
| 0% | 188 | 128 | 65 | 0 | -67 | -136 | -207 |
| 2.67% | 1,221 | 1,142 | 1,062 | 982 | 902 | 822 | 742 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5.33% | 1,684 | 1,634 | 1,580 | 1,523 | 1,462 | 1,398 | 1,332 |
| 8.00% | 1,803 | 1,788 | 1,767 | 1,741 | 1,710 | 1,675 | 1,635 |

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

| |
|---|
| **98,570** |

| 공시일 | 2017-09-07 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-06 |

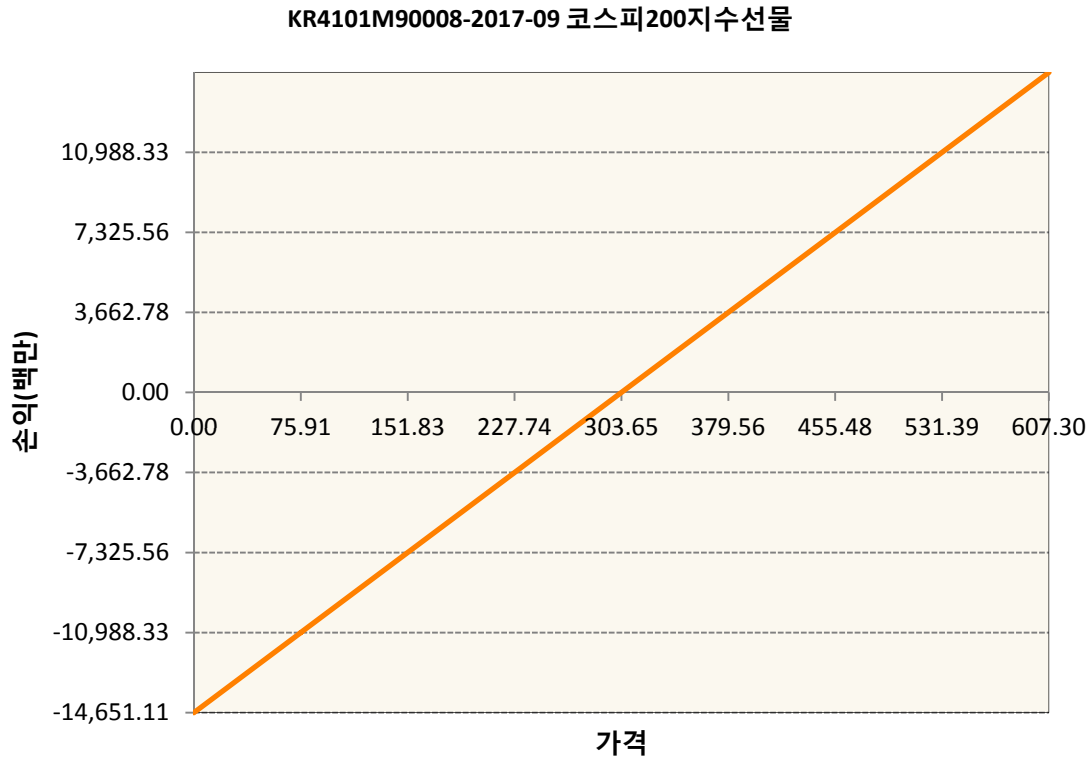
# ETF스마트레버리지목표전환형6호

## 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 | 14,651 | 0 | 14,651 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M90( 2017-09 코스피200지수선물 | | | | | | | 1,170 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,170 | -1,170 | -1,170 | -1,170 | -1,170 | -1,170 | -1,170 |
| -5.33% | -780 | -780 | -780 | -780 | -780 | -780 | -780 |
| -2.67% | -390 | -390 | -390 | -390 | -390 | -390 | -390 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 390 | 390 | 390 | 390 | 390 | 390 | 390 |
| 5.33% | 780 | 780 | 780 | 780 | 780 | 780 | 780 |
| 8.00% | 1,170 | 1,170 | 1,170 | 1,170 | 1,170 | 1,170 | 1,170 |

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

| |
|---|
| **734** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

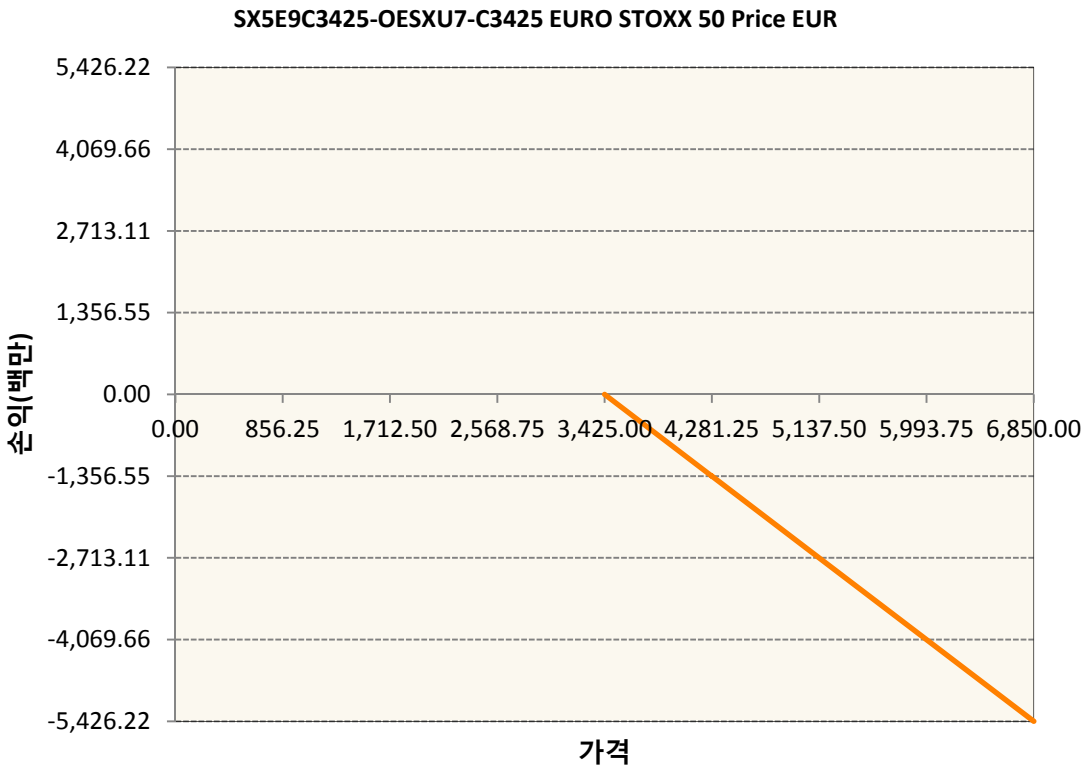
# 유로커버드콜(주식혼합-파생형)

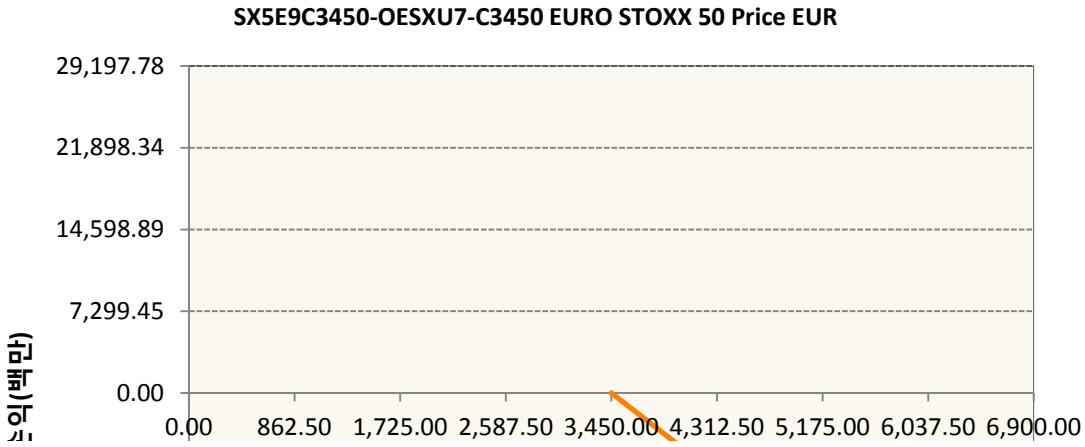
## 1. 계약금액

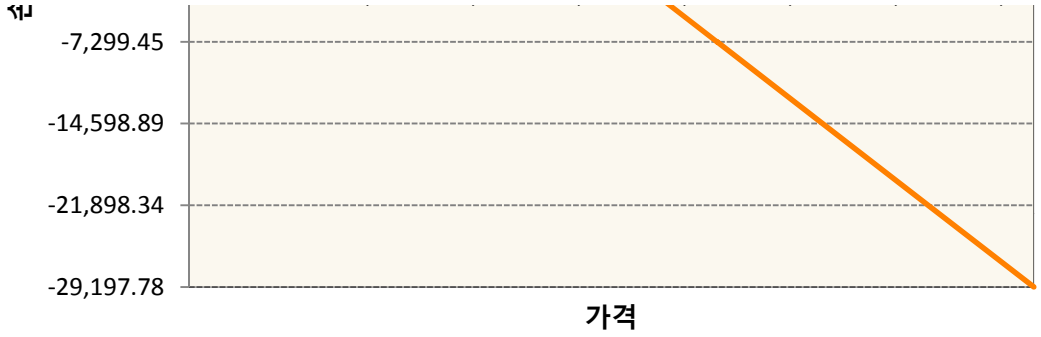
(단위:백만원)

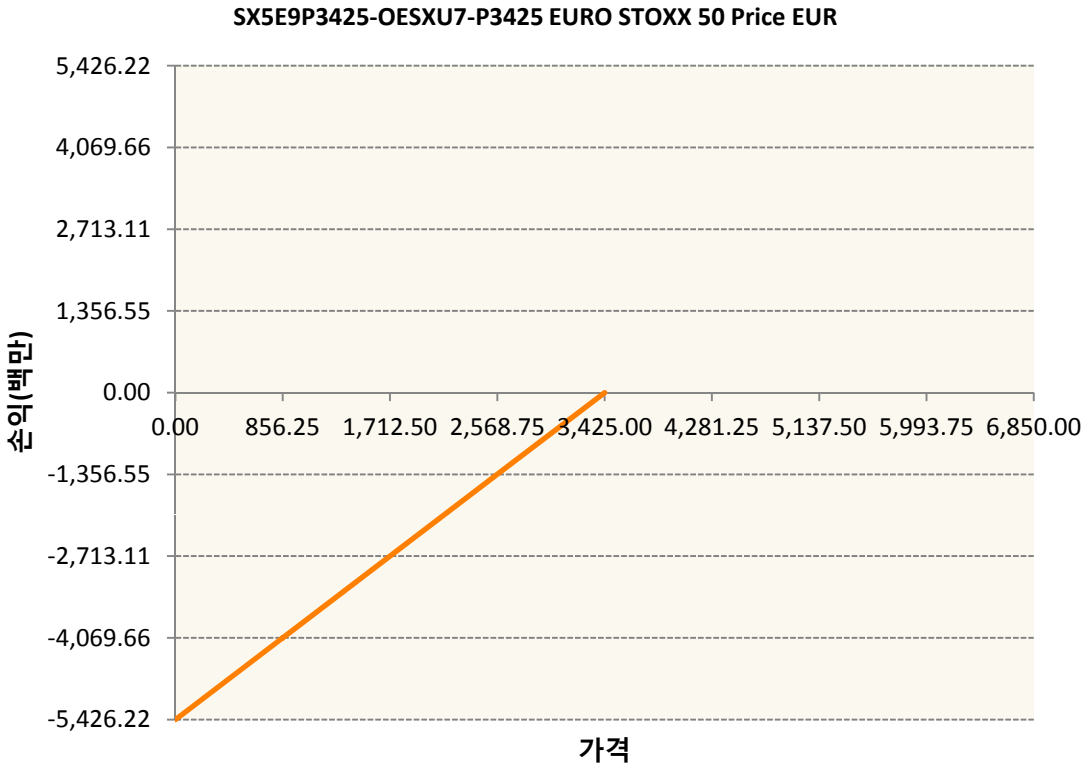
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 29,774 | 0 | 29,774 | |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 69,248 | -69,248 | 장내 |

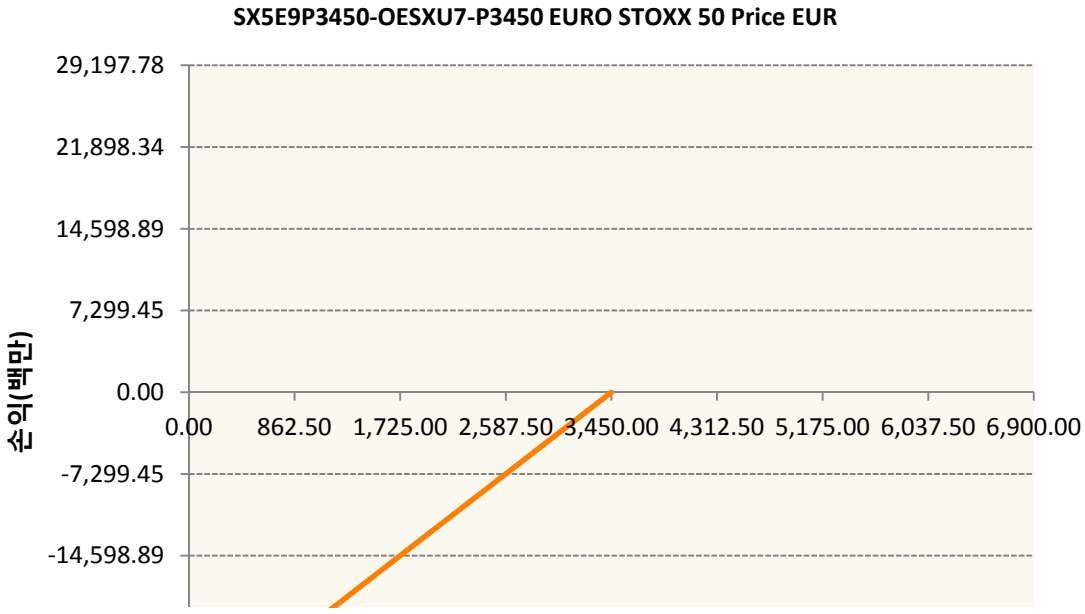
## 2. 만기시점의 손익구조

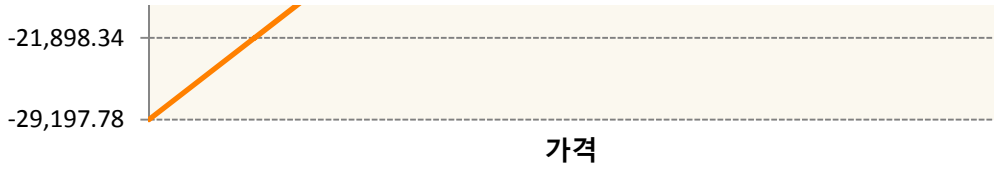


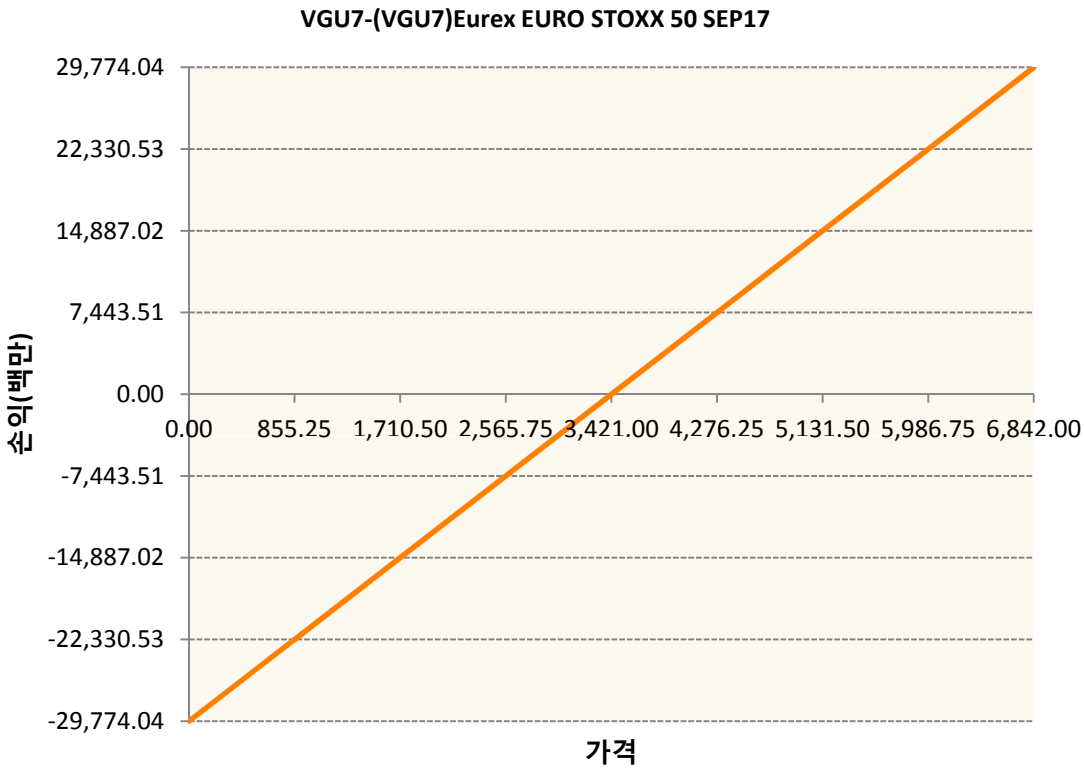




-7,299.45
-14,598.89
-21,898.34
-29,197.78
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
5,426.22
4,069.66
2,713.11
1,356.55
0.00
-1,356.55
-2,713.11
-4,069.66
-5,426.22
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
29,197.78
21,898.34
14,598.89
7,299.45
0.00
-7,299.45
-14,598.89
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 | 434 |
| SX5E9C3450 | OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR | 2,336 |
| SX5E9P3425 | OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR | 434 |
| SX5E9P3450 | OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR | 2,336 |
| VGU7 | (VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17 | 2,382 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **6,260** |

| 공시일 | 2017-09-07 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-06 |

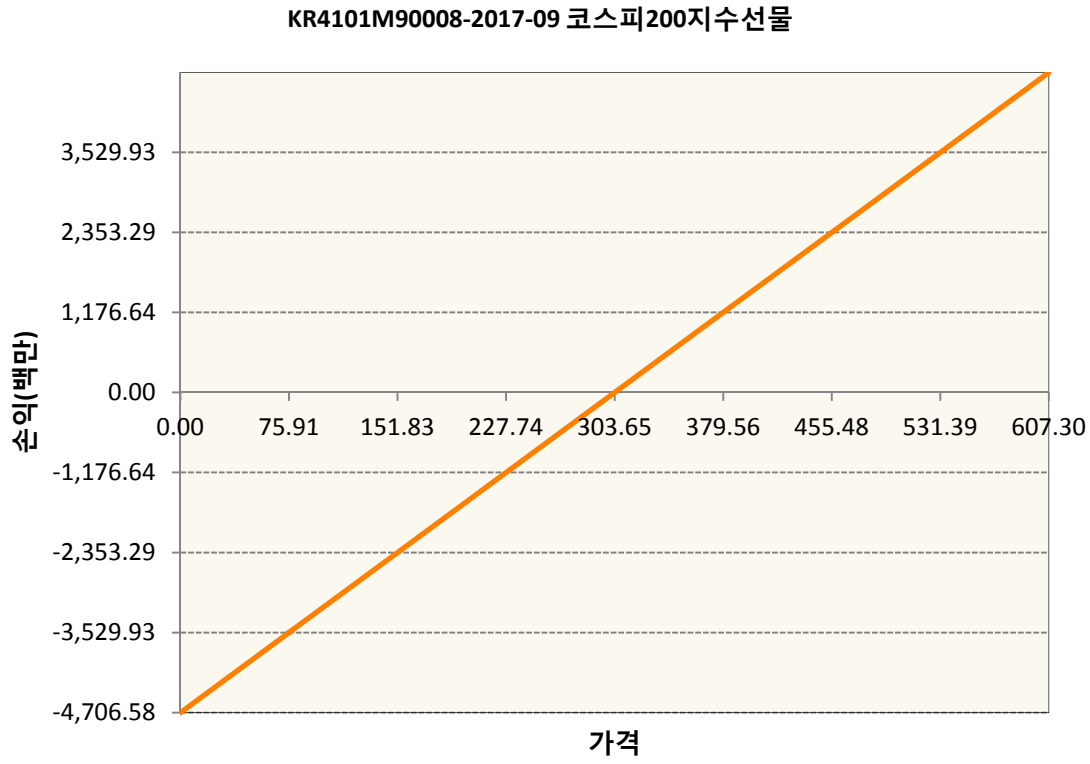
# ETF스마트레버리지목표전환형7호

## 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 | 4,707 | 0 | 4,707 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M90( 2017-09 코스피200지수선물 | | | | | | | 376 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -376 | -376 | -376 | -376 | -376 | -376 | -376 |
| -5.33% | -251 | -251 | -251 | -251 | -251 | -251 | -251 |
| -2.67% | -125 | -125 | -125 | -125 | -125 | -125 | -125 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 | 125 |
| 5.33% | 251 | 251 | 251 | 251 | 251 | 251 | 251 |
| 8.00% | 376 | 376 | 376 | 376 | 376 | 376 | 376 |

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

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

| 공시일 | 2017-09-07 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-06 |

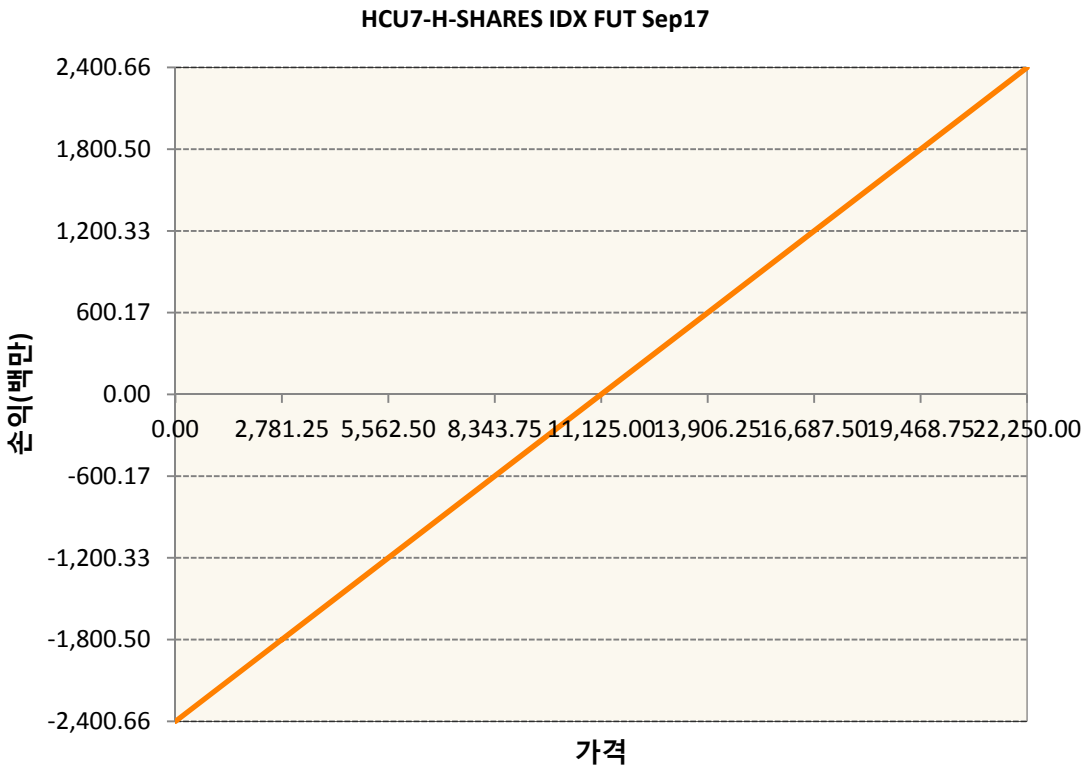
# 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

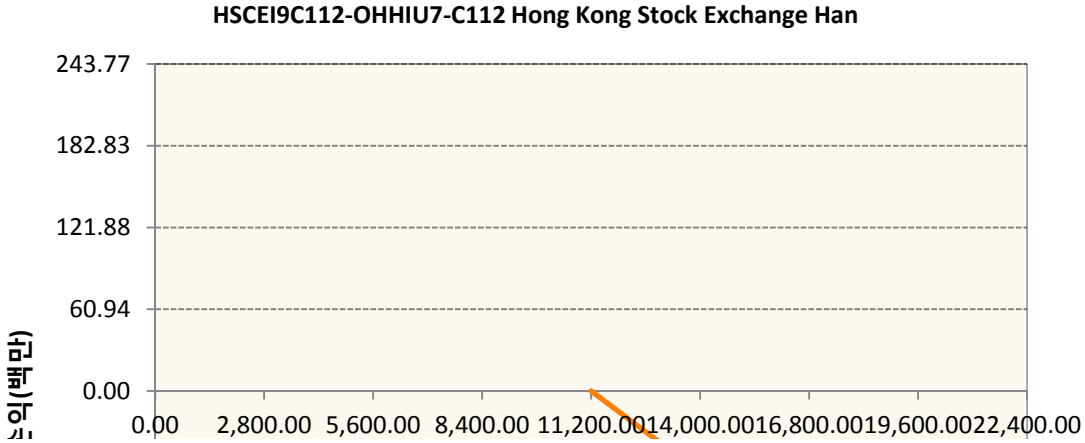
## 1. 계약금액

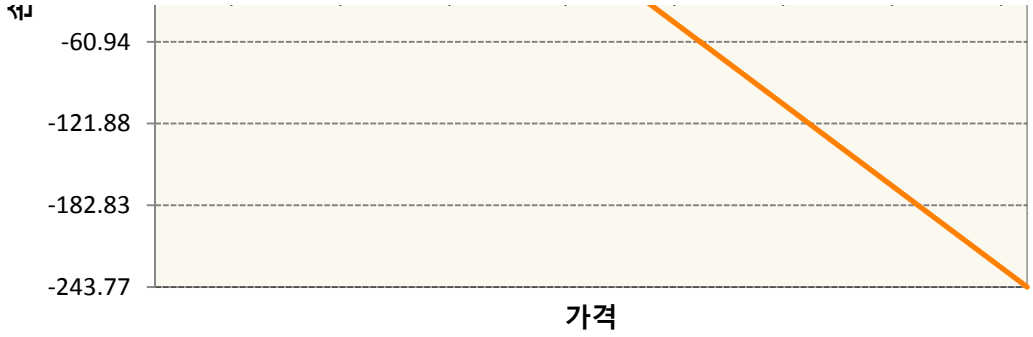
(단위:백만원)

| 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 | 2,401 | 0 | 2,401 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 4,954 | -4,954 | 장내 |

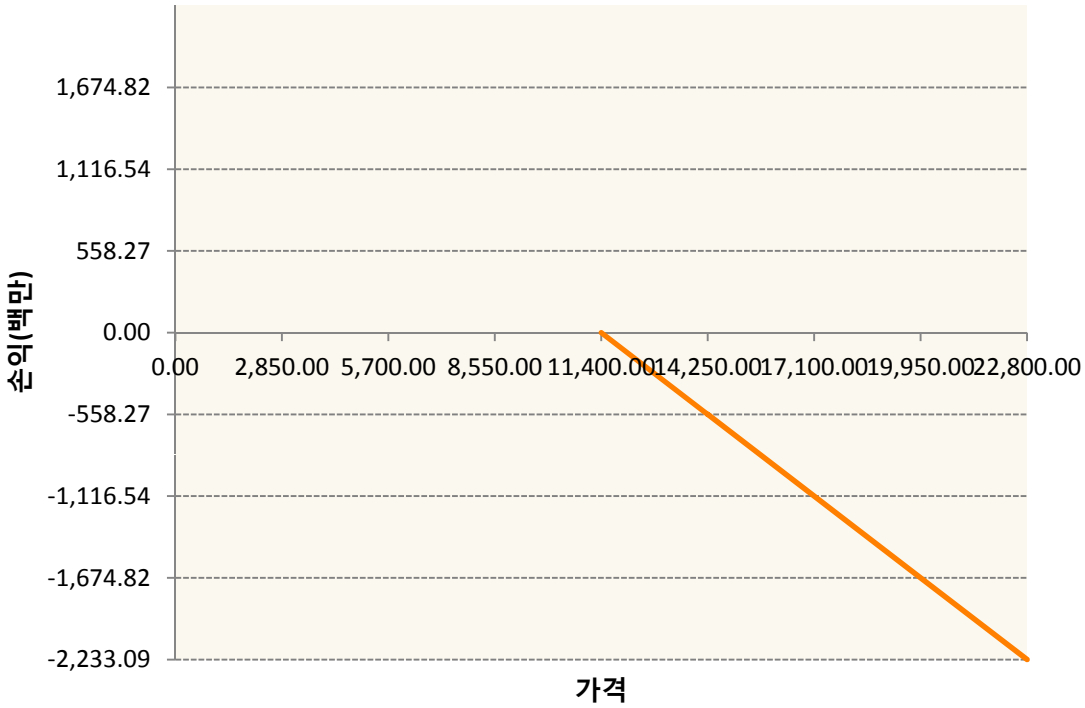
## 2. 만기시점의 손익구조



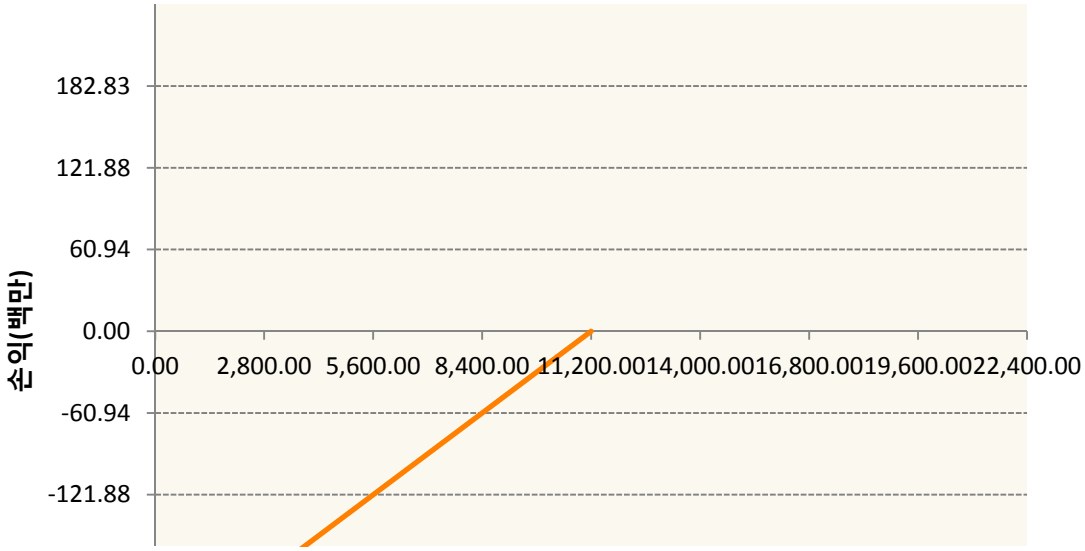



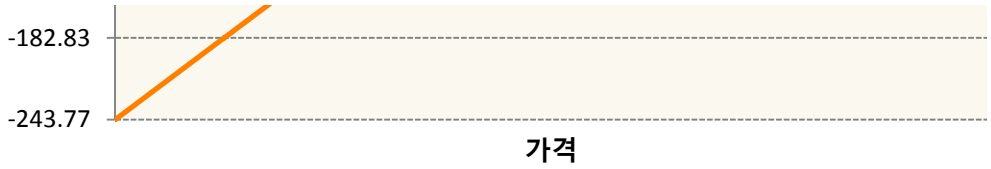


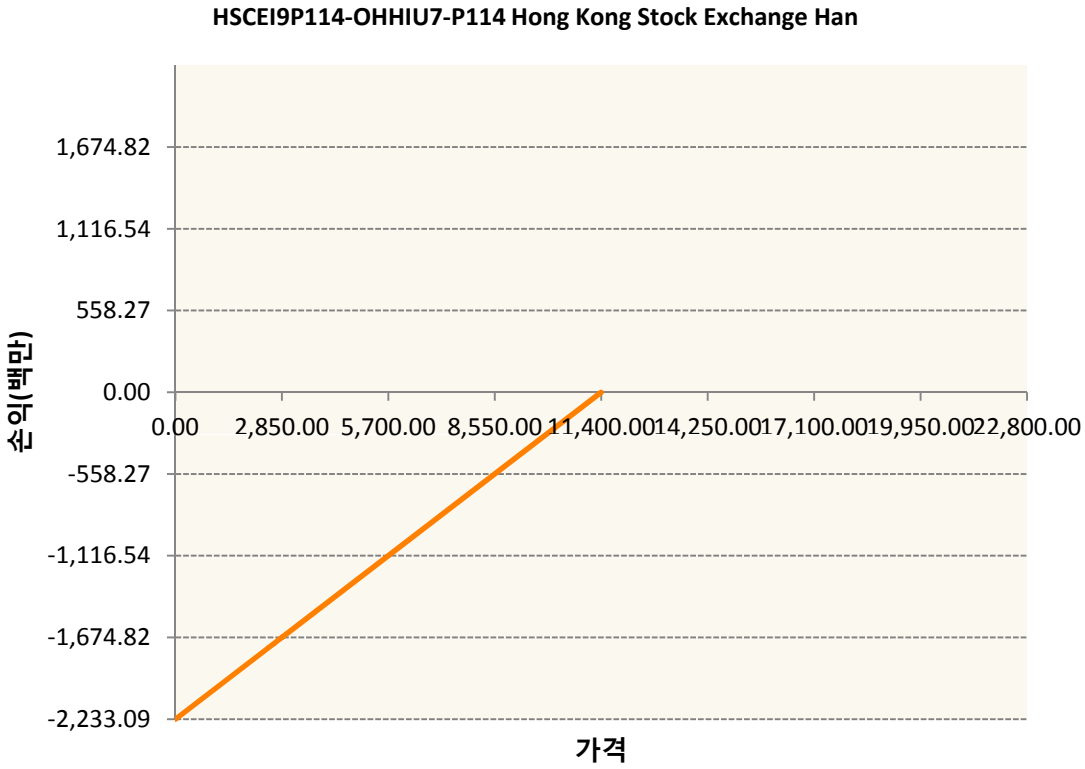

HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han




HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|---|---|
| HCU7 H-SHARES IDX FUT Sep17 | 192 |
| HSCEI9C112 OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han | 20 |
| HSCEI9C114 OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han | 179 |
| HSCEI9P112 OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han | 20 |
| HSCEI9P114 OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han | 179 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **505** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

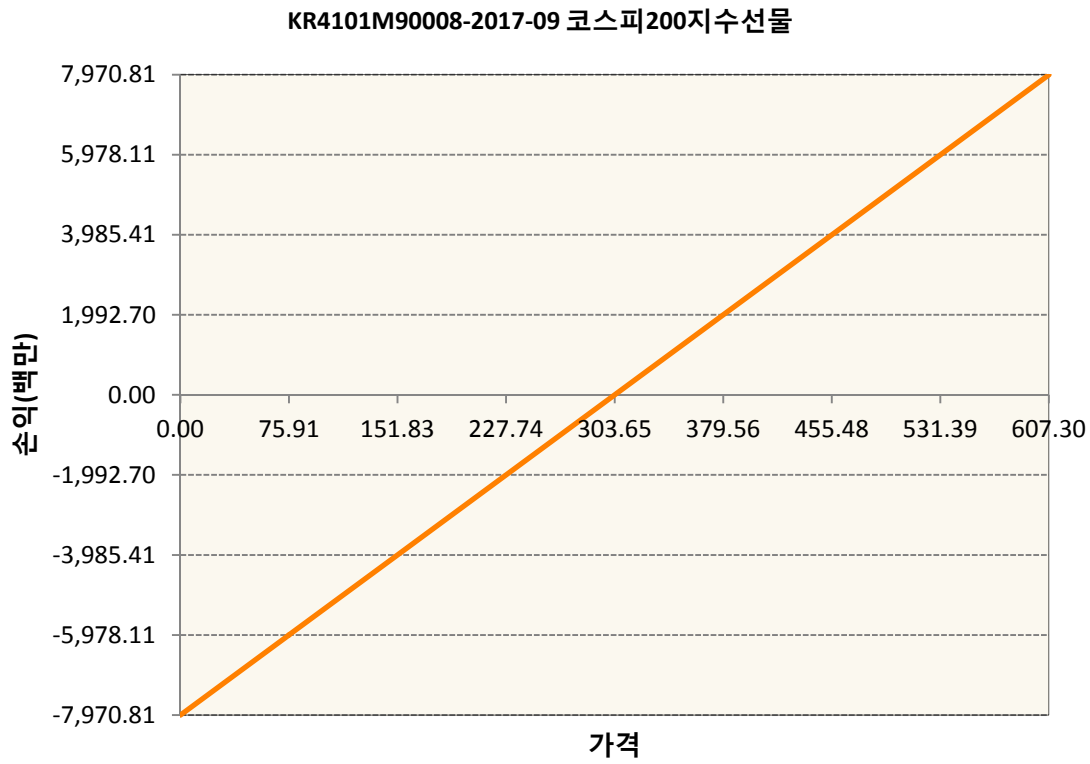
# 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

## 1. 계약금액

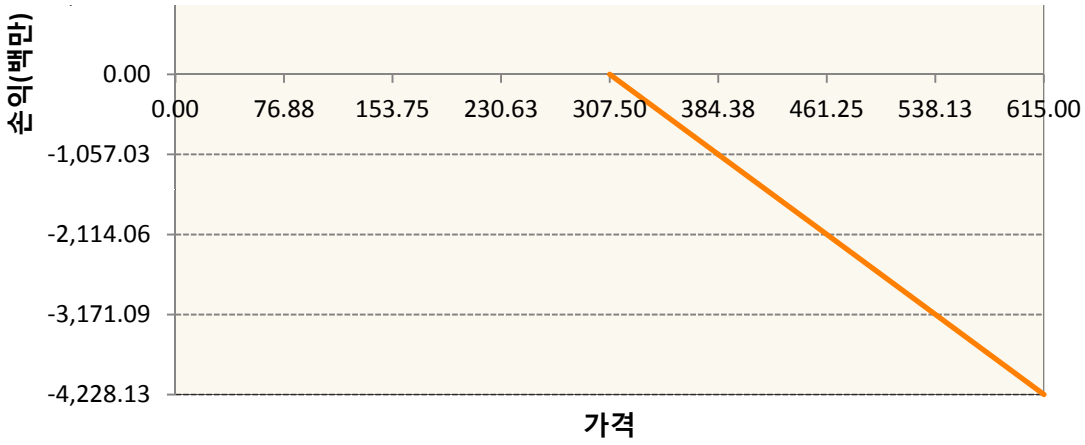
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 3,500 | 0 | 3,500 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,971 | 0 | 7,971 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 22,000 | 0 | 22,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 21,972 | -21,972 | 장내 |

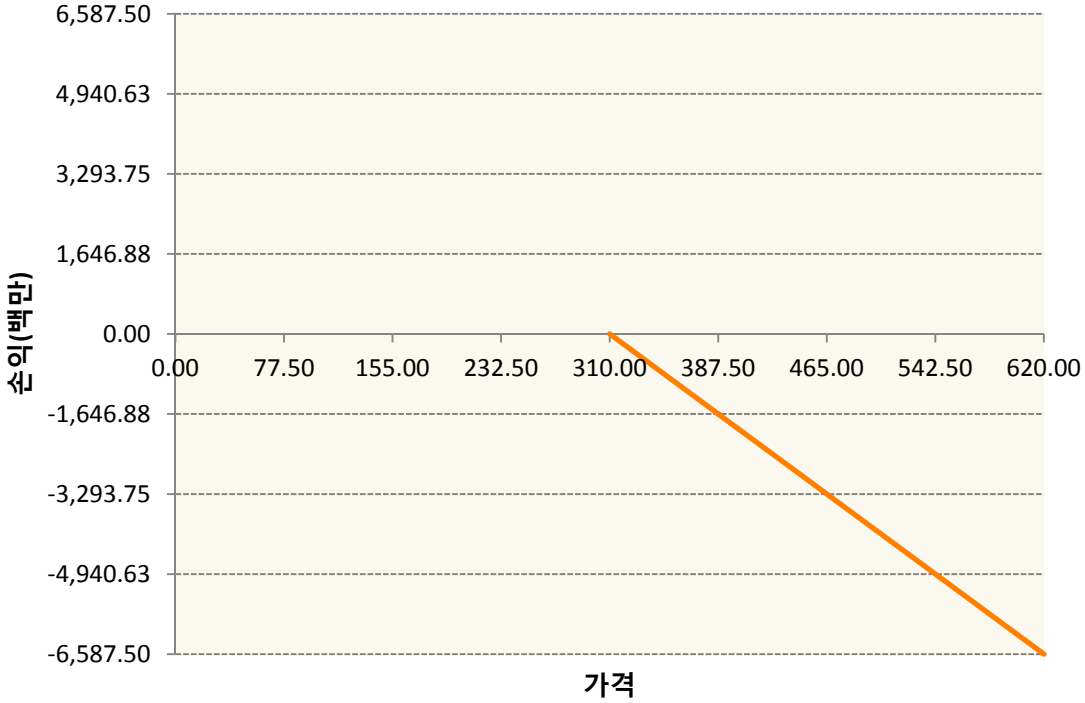
## 2. 만기시점의 손익구조



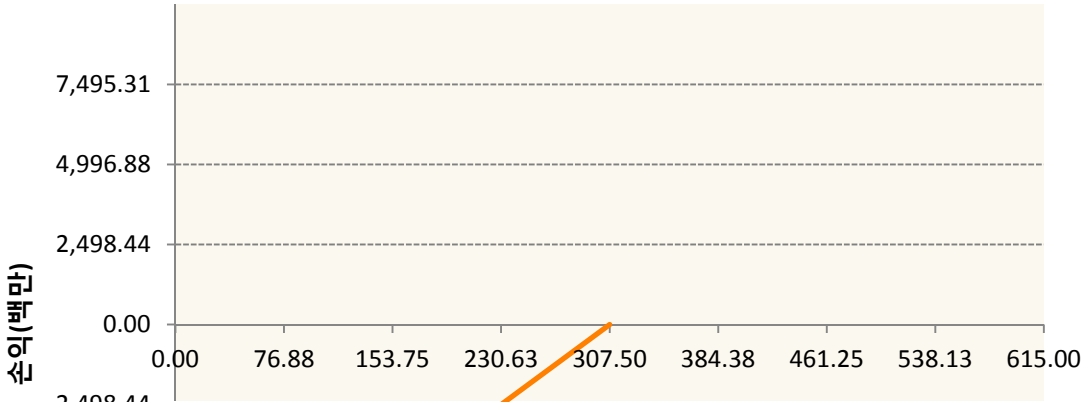


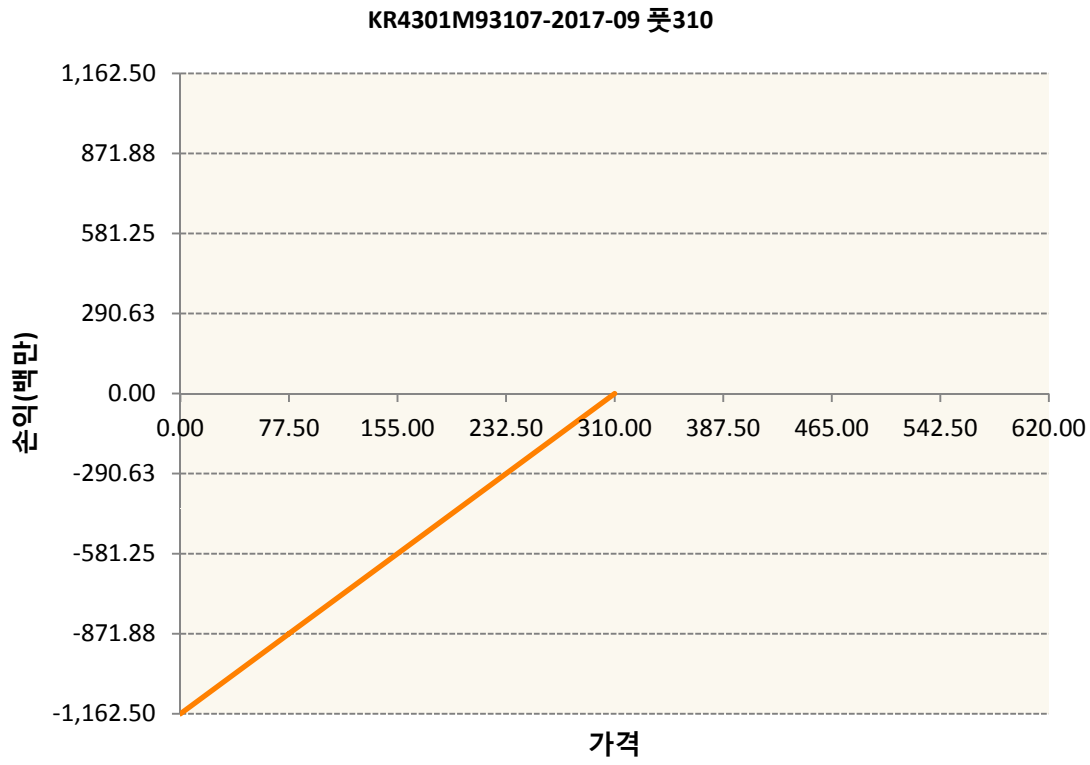

KR4201M93109-2017-09 콜310




KR4301M93073-2017-09 풋307.5






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

| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,482 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,482 | -1,482 | -1,482 | -1,482 | -1,482 | -1,482 | -1,482 |
| -5.33% | -988 | -988 | -988 | -988 | -988 | -988 | -988 |
| -2.67% | -494 | -494 | -494 | -494 | -494 | -494 | -494 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 494 | 494 | 494 | 494 | 494 | 494 | 494 |
| 5.33% | 988 | 988 | 988 | 988 | 988 | 988 | 988 |
| 8.00% | 1,482 | 1,482 | 1,482 | 1,482 | 1,482 | 1,482 | 1,482 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3 | | | | | | | 280 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | -280 | -280 | -280 | -280 | -280 | -280 | -280 |
| -5.33% | -187 | -187 | -187 | -187 | -187 | -187 | -187 |
| -2.67% | -93 | -93 | -93 | -93 | -93 | -93 | -93 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 93 | 93 | 93 | 93 | 93 | 93 | 93 |
| 5.33% | 187 | 187 | 187 | 187 | 187 | 187 | 187 |
| 8.00% | 280 | 280 | 280 | 280 | 280 | 280 | 280 |
| | KR4101M90( 2017-09 코스피200지수선물 | | | | | | 637 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -637 | -637 | -637 | -637 | -637 | -637 | -637 |
| -5.33% | -424 | -424 | -424 | -424 | -424 | -424 | -424 |
| -2.67% | -212 | -212 | -212 | -212 | -212 | -212 | -212 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 212 | 212 | 212 | 212 | 212 | 212 | 212 |
| 5.33% | 424 | 424 | 424 | 424 | 424 | 424 | 424 |
| 8.00% | 637 | 637 | 637 | 637 | 637 | 637 | 637 |
| | KR4201M93( 2017-09 콜307.5 | | | | | | 245 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 38 | 37 | 37 | 37 | 37 | 37 | 36 |
| -5.33% | 37 | 37 | 36 | 36 | 34 | 33 | 32 |
| -2.67% | 34 | 32 | 29 | 27 | 24 | 21 | 17 |
| 0% | 14 | 10 | 5 | 0 | -5 | -10 | -15 |
| 2.67% | -40 | -45 | -50 | -55 | -60 | -65 | -71 |
| 5.33% | -130 | -133 | -135 | -139 | -142 | -145 | -149 |
| 8.00% | -237 | -237 | -238 | -240 | -241 | -243 | -245 |
| | KR4201M93: 2017-09 콜310 | | | | | | 348 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 42 | 42 | 42 | 41 | 41 | 41 | 40 |
| -5.33% | 41 | 41 | 41 | 40 | 39 | 37 | 35 |
| -2.67% | 39 | 37 | 34 | 31 | 27 | 23 | 19 |
| 0% | 19 | 13 | 7 | 0 | -7 | -14 | -21 |
| 2.67% | -47 | -55 | -63 | -71 | -79 | -87 | -96 |
| 5.33% | -171 | -176 | -181 | -187 | -194 | -200 | -207 |
| 8.00% | -330 | -332 | -334 | -337 | -340 | -344 | -348 |
| | KR4301M93( 2017-09 풋307.5 | | | | | | 702 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -699 | -699 | -700 | -700 | -700 | -701 | -702 |
| -5.33% | -437 | -438 | -439 | -441 | -444 | -447 | -451 |
| -2.67% | -183 | -187 | -193 | -199 | -206 | -214 | -222 |
| 0% | 34 | 23 | 11 | 0 | -12 | -23 | -35 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2.67% | 167 | 156 | 144 | 132 | 120 | 108 | 96 |
| 5.33% | 217 | 212 | 205 | 198 | 190 | 181 | 172 |
| 8.00% | 228 | 227 | 225 | 222 | 218 | 214 | 209 |
| | KR4301M93:2017-09 풋310 | | | | | | 84 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 |
| -5.33% | -53 | -53 | -53 | -54 | -54 | -54 | -54 |
| -2.67% | -23 | -24 | -24 | -25 | -25 | -26 | -27 |
| 0% | 3 | 2 | 1 | 0 | -1 | -2 | -4 |
| 2.67% | 22 | 21 | 19 | 18 | 16 | 15 | 13 |
| 5.33% | 30 | 30 | 29 | 28 | 26 | 25 | 24 |
| 8.00% | 33 | 32 | 32 | 32 | 31 | 30 | 30 |

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

| |
|---|
| **3,637** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

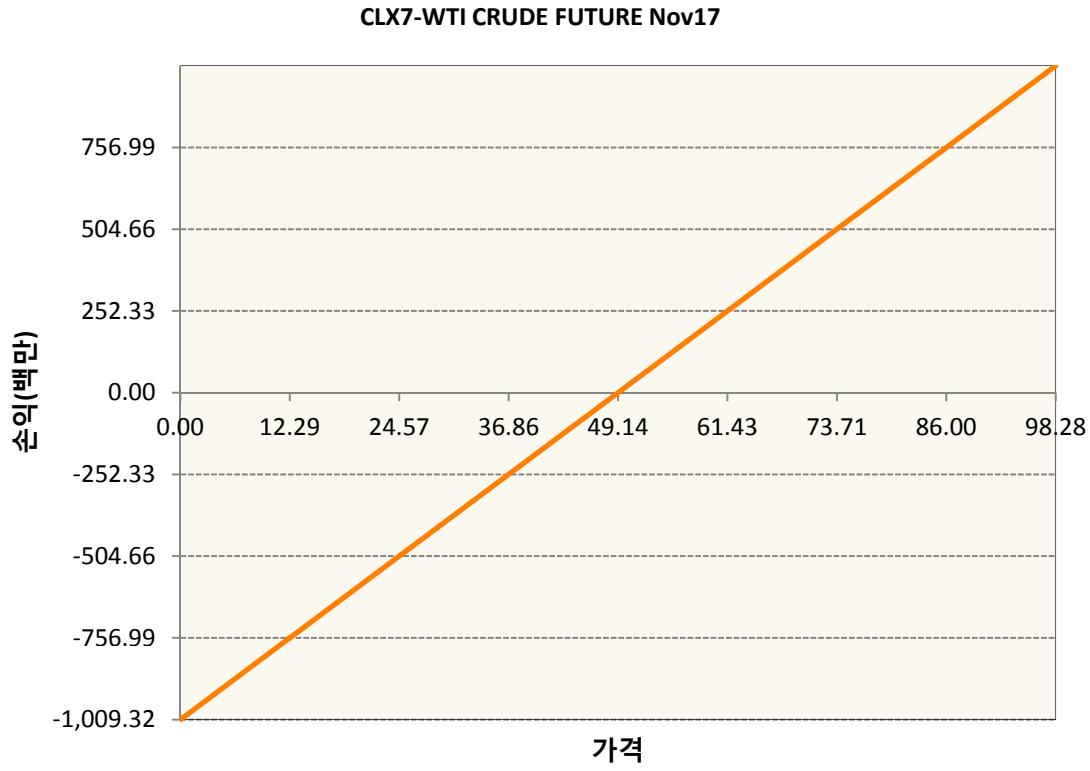
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

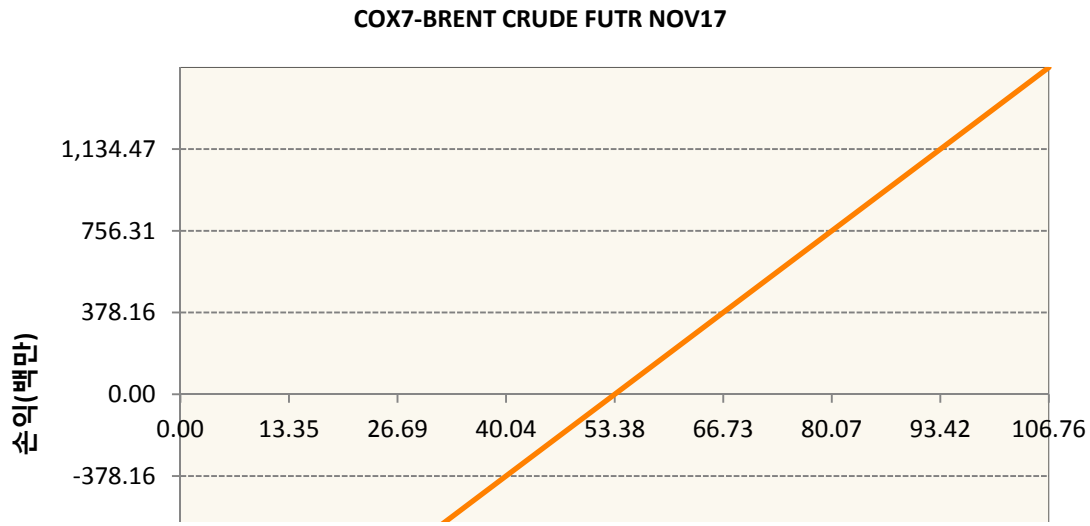
## 1. 계약금액

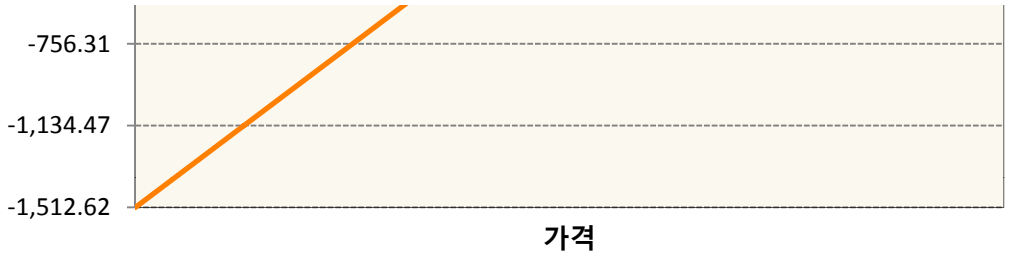
(단위:백만원)

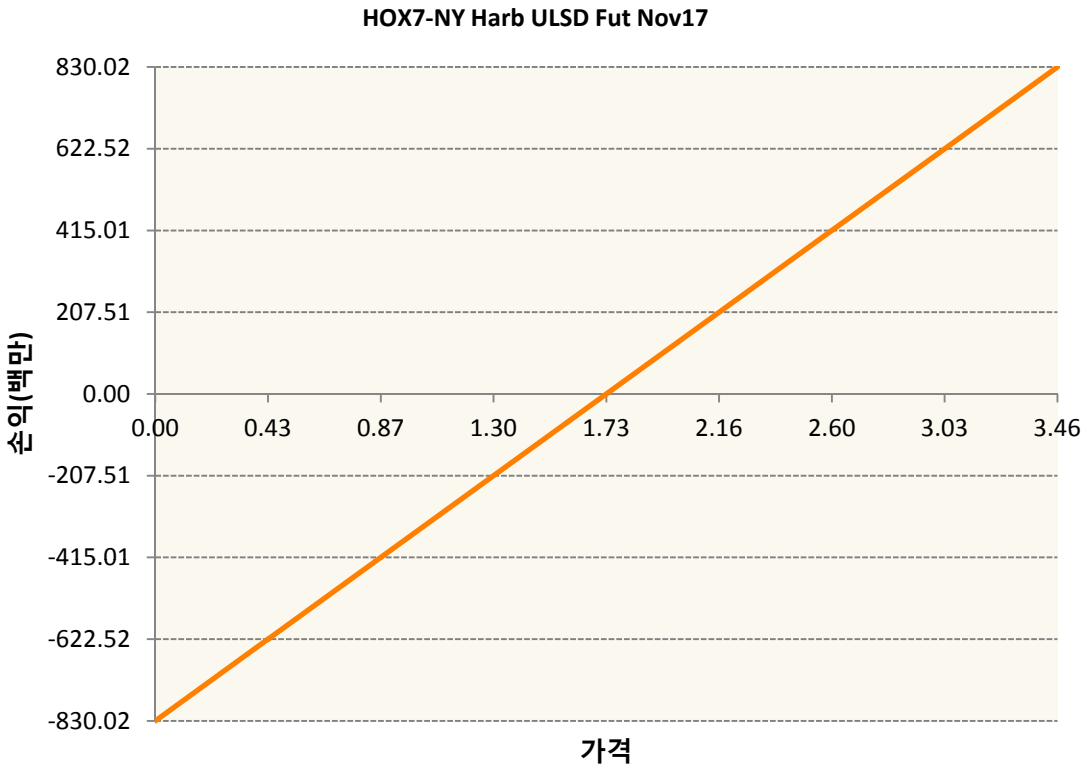
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,572 | 624 | 4,948 | |

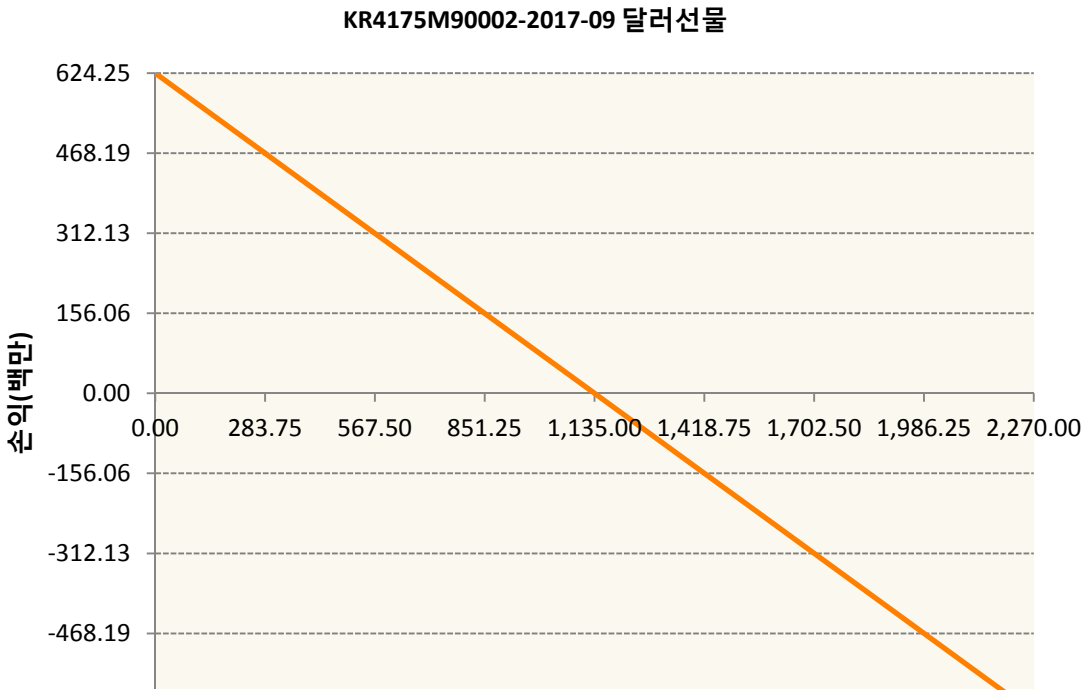
## 2. 만기시점의 손익구조

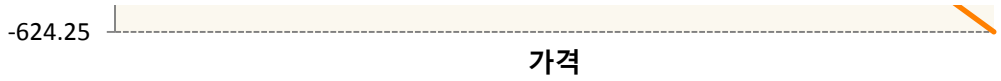


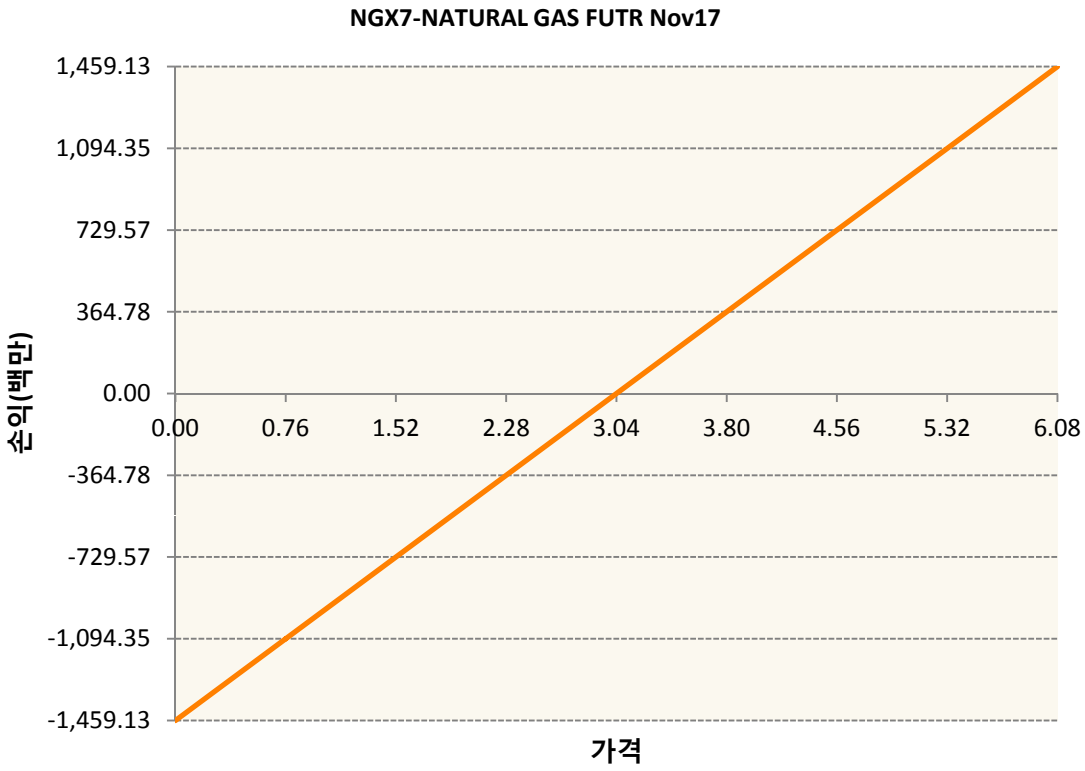



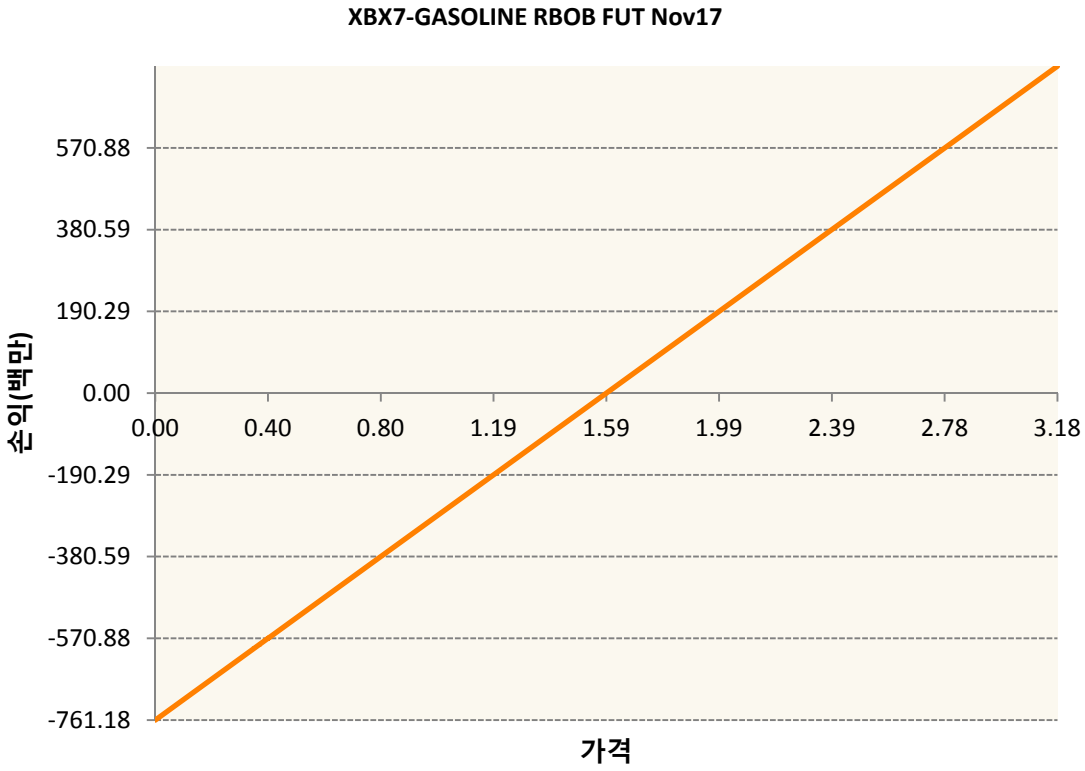

-756.31
-1,134.47
-1,512.62
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
830.02
622.52
415.01
207.51
0.00
-207.51
-415.01
-622.52
-830.02
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
624.25
468.19
312.13
156.06
0.00
-156.06
-312.13
-468.19
0.00
283.75
567.50
851.25
1,135.00
1,418.75
1,702.50
1,986.25
2,270.00
손익(백만)


-624.25
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,459.13
1,094.35
729.57
364.78
0.00
-364.78
-729.57
-1,094.35
-1,459.13
0.00
0.76
1.52
2.28
3.04
3.80
4.56
5.32
6.08
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
570.88
380.59
190.29
0.00
-190.29
-380.59
-570.88
-761.18
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
3.18
손익(백만)
가격

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

| | | |
|---|---|---|
| CLX7 | WTI CRUDE FUTURE Nov17 | 81 |
| COX7 | BRENT CRUDE FUTR NOV17 | 121 |
| HOX7 | NY Harb ULSD Fut Nov17 | 66 |
| KR4175M90( | 2017-09 달러선물 | 50 |
| NGX7 | NATURAL GAS FUTR Nov17 | 117 |
| XBX7 | GASOLINE RBOB FUT Nov17 | 61 |

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

| |
|---|
| **815** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-09-07 |
| 기준일 | 2017-09-06 |

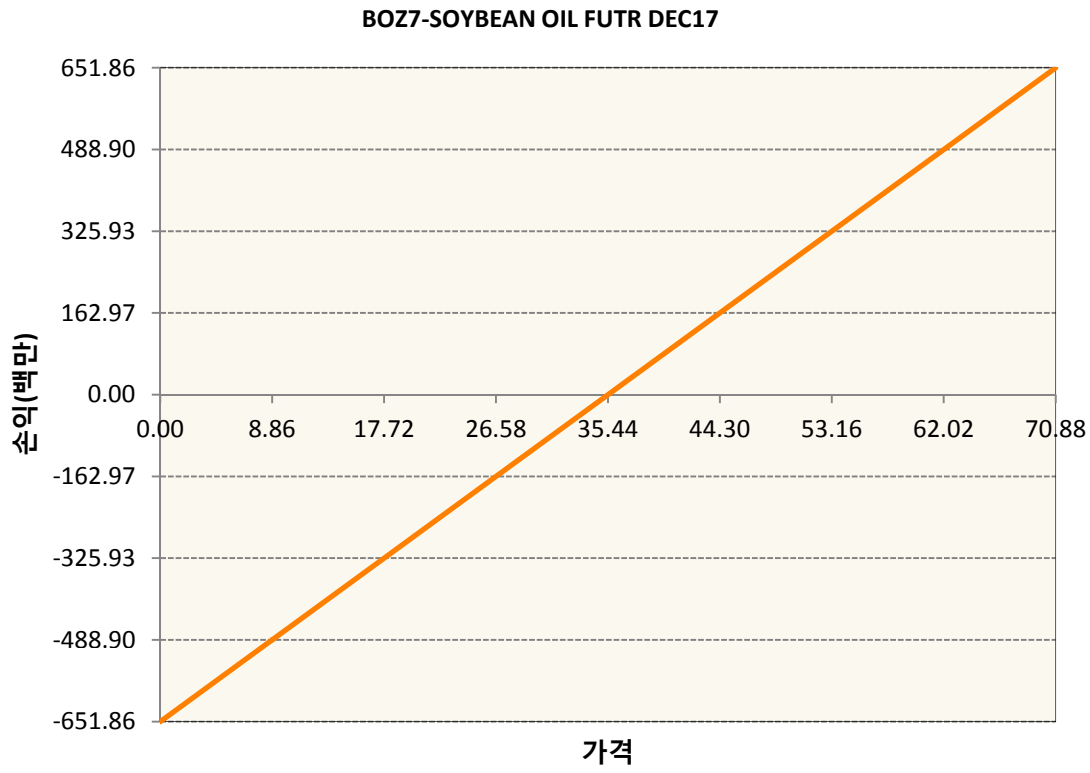
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

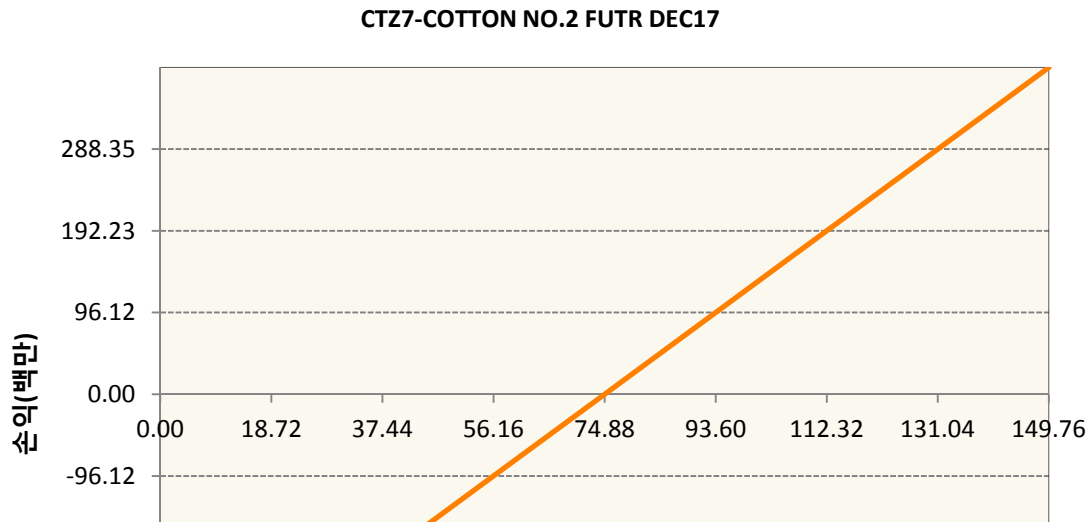
## 1. 계약금액

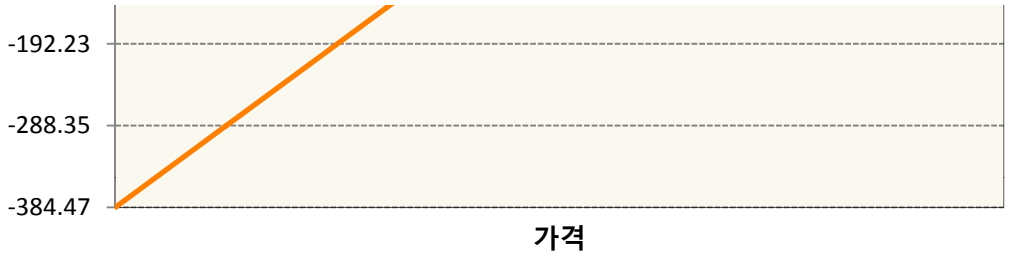
(단위:백만원)

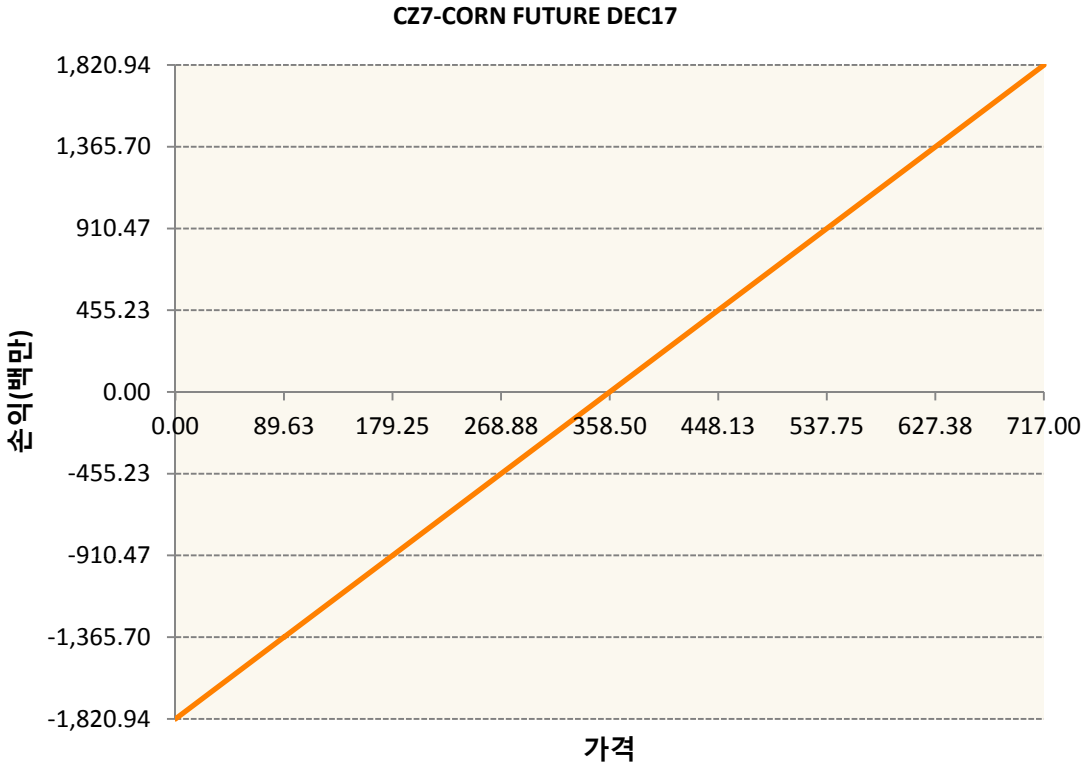
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,039 | 341 | 6,698 | |

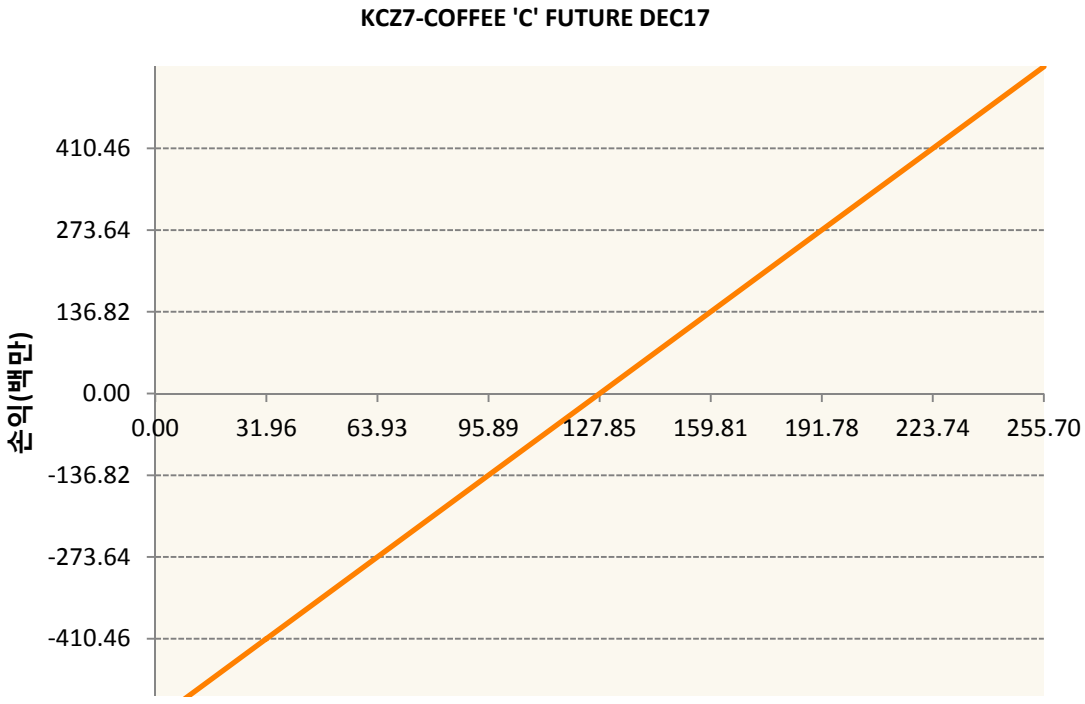
## 2. 만기시점의 손익구조

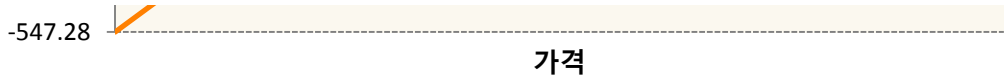


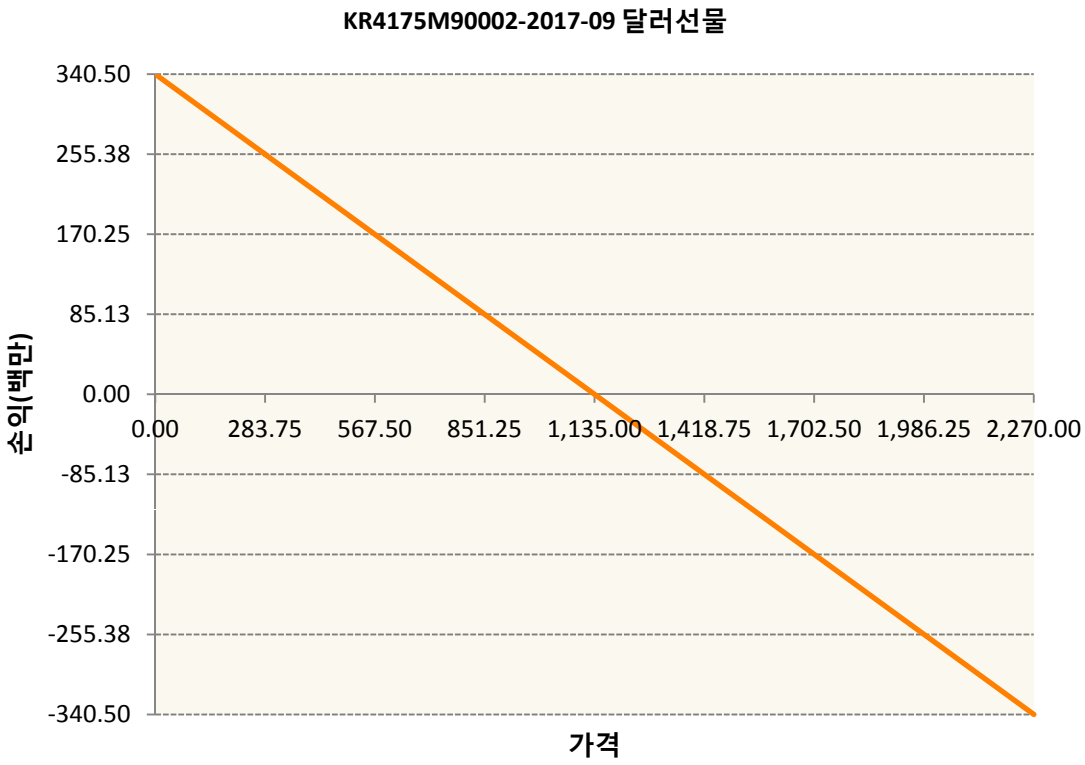



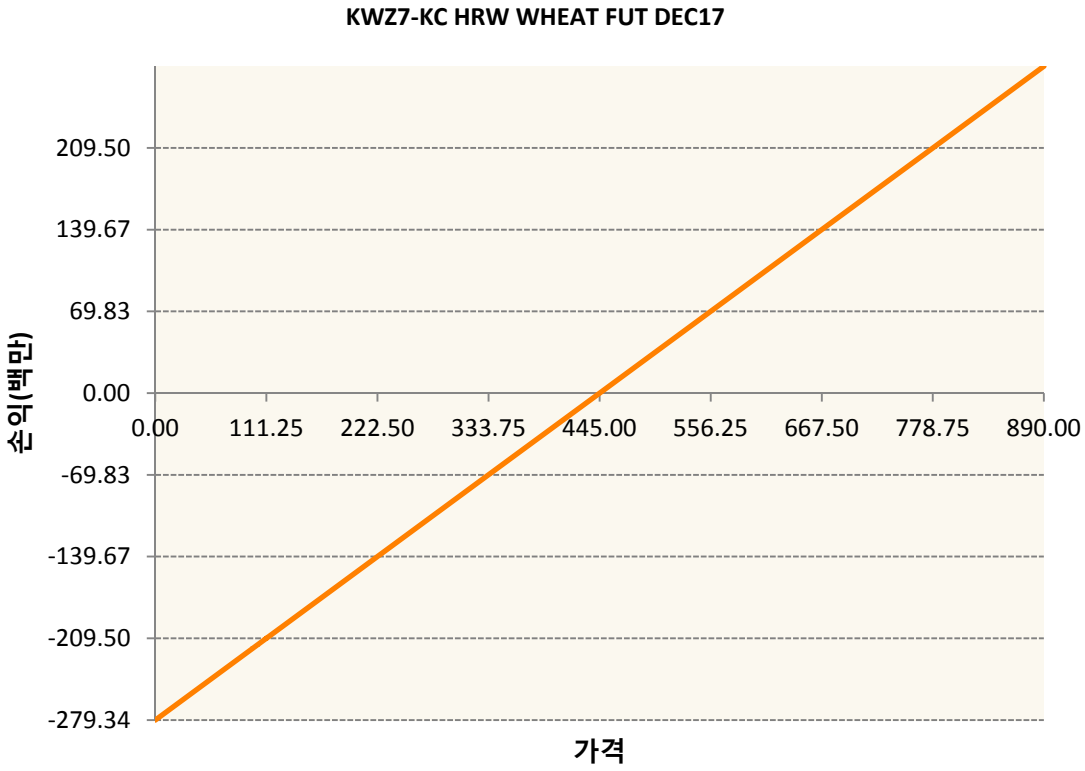

-192.23
-288.35
-384.47
가격


CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,820.94
1,365.70
910.47
455.23
0.00
-455.23
-910.47
-1,365.70
-1,820.94
손익(백만)
0.00
89.63
179.25
268.88
358.50
448.13
537.75
627.38
717.00
가격

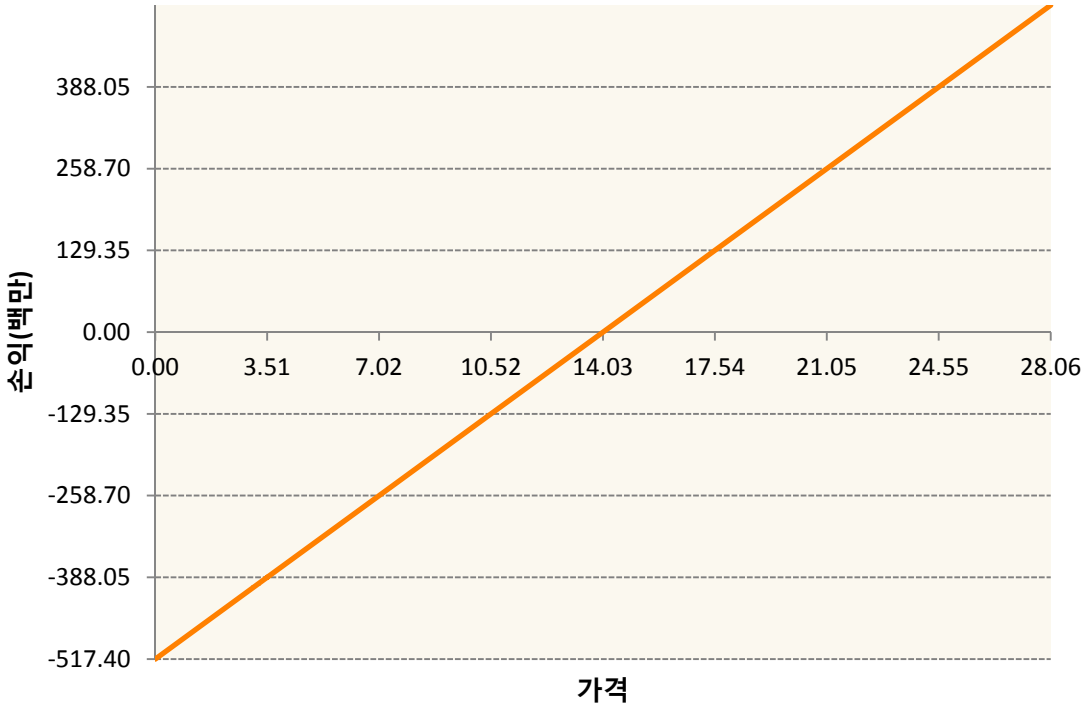

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
410.46
273.64
136.82
0.00
-136.82
-273.64
-410.46
손익(백만)
0.00
31.96
63.93
95.89
127.85
159.81
191.78
223.74
255.70


-547.28
가격

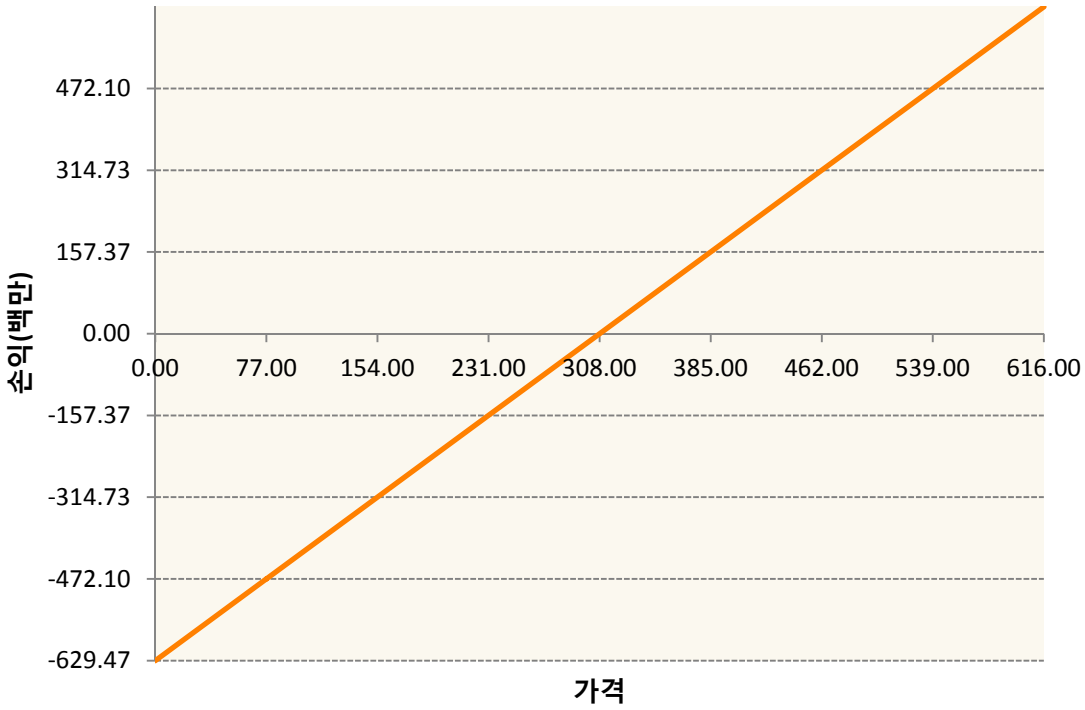

KR4175M90002-2017-09 달러선물
340.50
255.38
170.25
85.13
0.00
-85.13
-170.25
-255.38
-340.50
0.00
283.75
567.50
851.25
1,135.00
1,418.75
1,702.50
1,986.25
2,270.00
손익(백만)
가격


KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
209.50
139.67
69.83
0.00
-69.83
-139.67
-209.50
-279.34
0.00
111.25
222.50
333.75
445.00
556.25
667.50
778.75
890.00
손익(백만)
가격

SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17

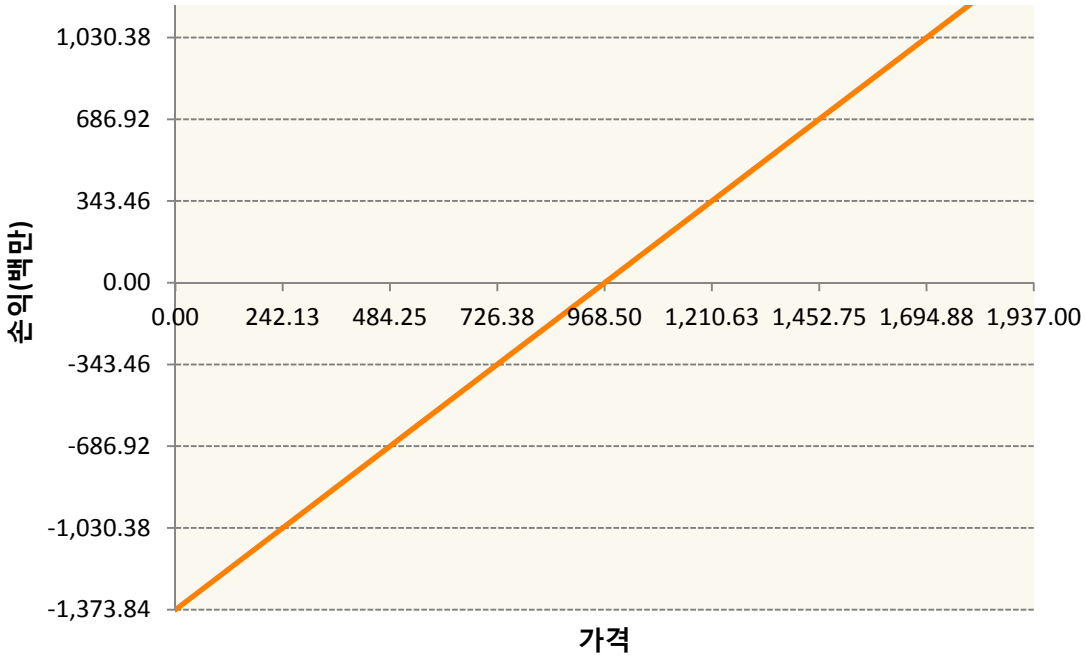



SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17

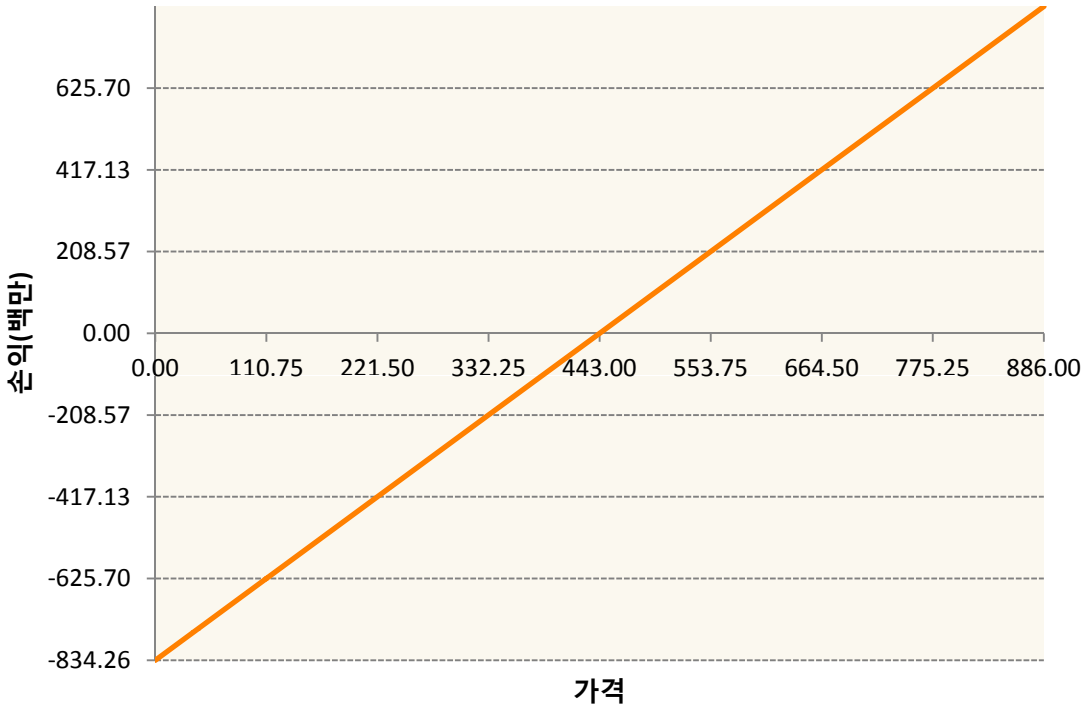



SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17






WZ7-WHEAT FUTURE(CBT) DEC17




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

| | | |
|---|---|---|
| BOZ7 | SOYBEAN OIL FUTR DEC17 | 52 |
| CTZ7 | COTTON NO.2 FUTR DEC17 | 31 |
| CZ7 | CORN FUTURE DEC17 | 146 |
| 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 | 50 |
| SX7 | SOYBEAN FUTURE NOV17 | 110 |
| WZ7 | WHEAT FUTURE(CBT) DEC17 | 67 |

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

| |
|---|
| **663** |