| 공시일 | 2017-10-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-29 |

# 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 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

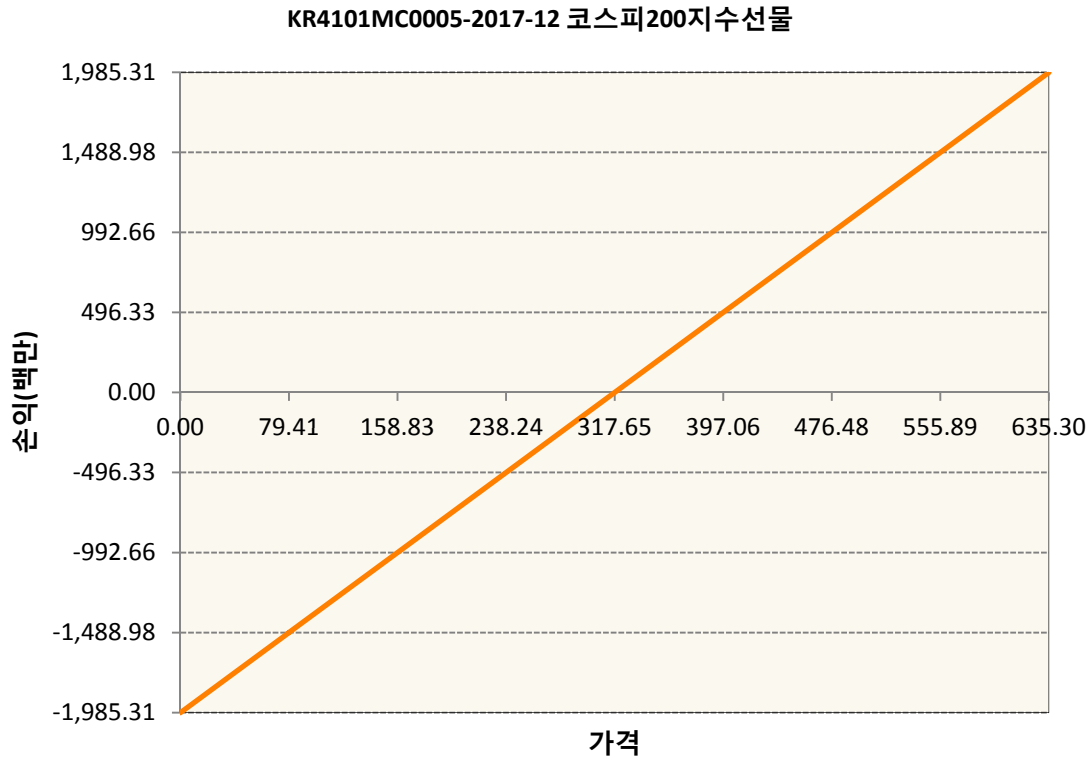
# 스마트인덱스모

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 79 | 0 | 79 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,985 | 0 | 1,985 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101MC0 | 2017-12 코스피200지수선물 | | | | | | 158 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -158 | -158 | -158 | -158 | -158 | -158 | -158 |
| -5.33% | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 |
| -2.67% | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 | -53 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 | 53 |
| 5.33% | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 |
| 8.00% | 158 | 158 | 158 | 158 | 158 | 158 | 158 |

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

| |
|---|
| **95** |

| 공시일 | 2017-10-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-29 |

# 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 | 1,042 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| **463** |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2017-10-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-29 |

# 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 | 5,301 | 0 | 5,301 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S170908 | 419 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **357** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

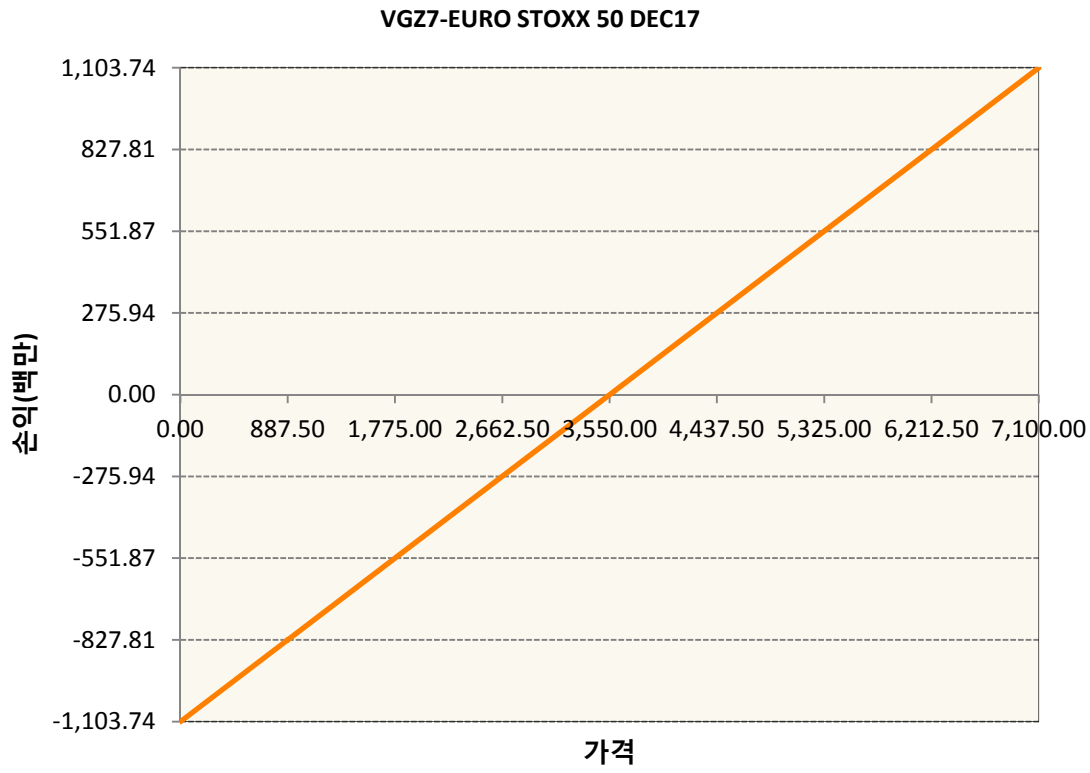
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,104 | 0 | 1,104 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGZ7 | EURO STOXX 50 DEC17 | 88 |

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

(단위:백만원)

**68**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

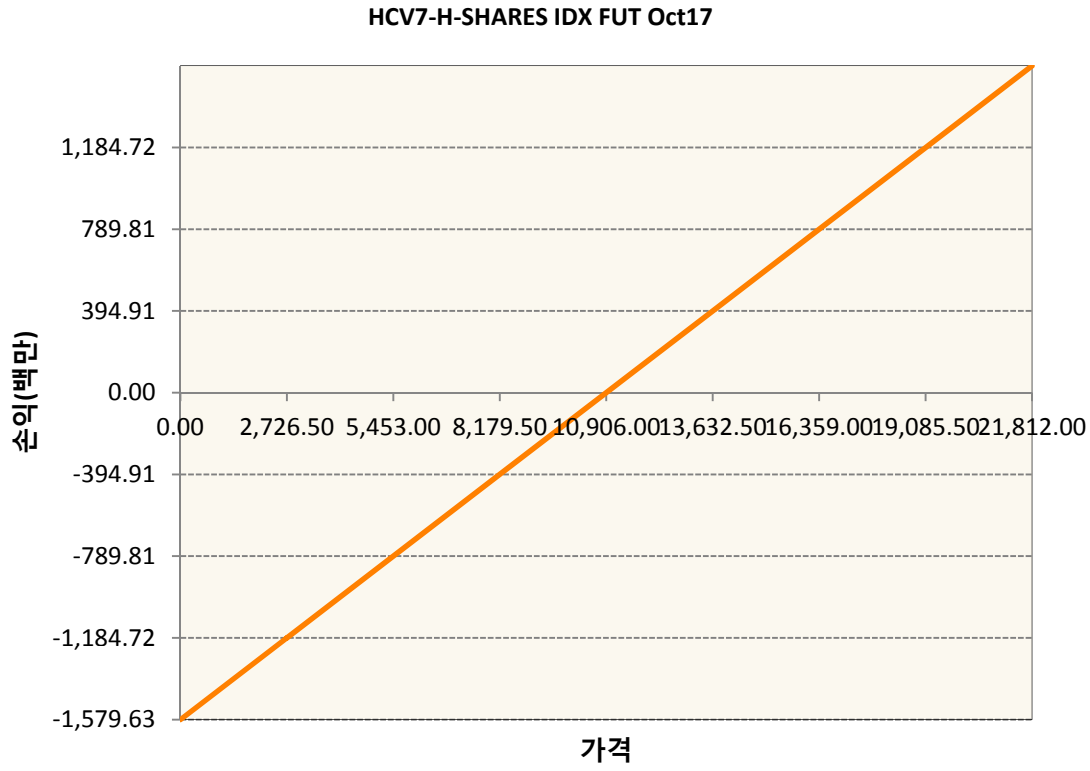
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

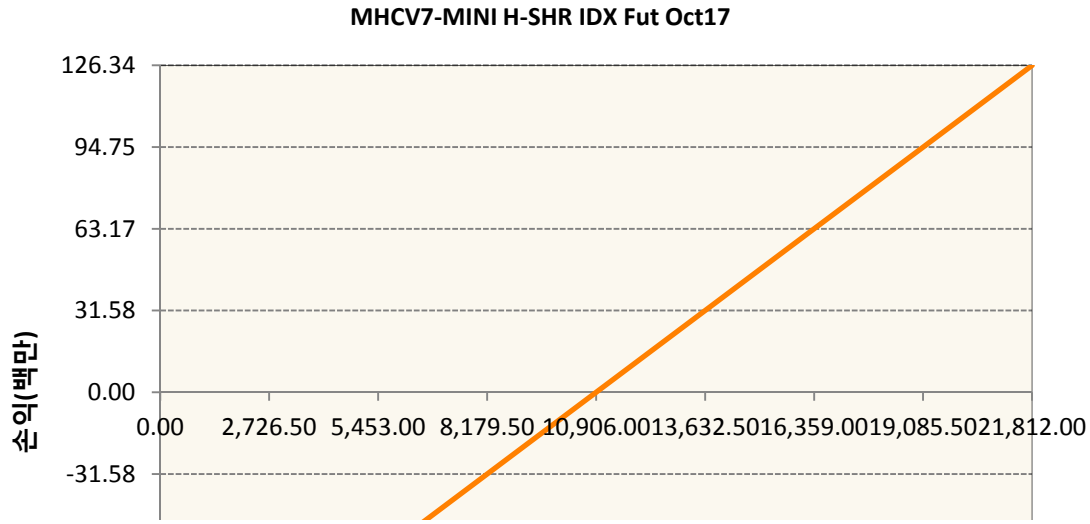
## 1. 계약금액

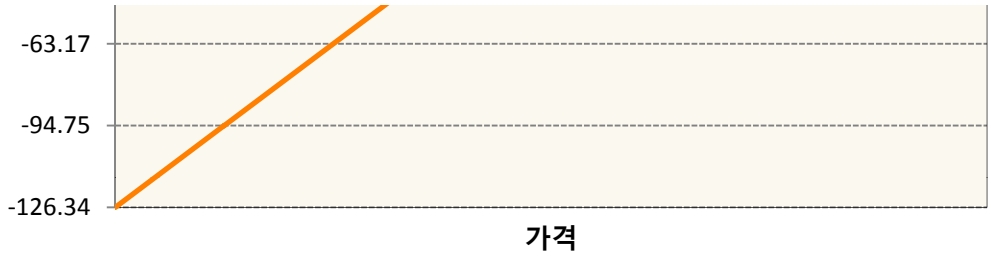
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,706 | 0 | 1,706 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCV7 | H-SHARES IDX FUT Oct17 | 126 |
| MHCV7 | MINI H-SHR IDX Fut Oct17 | 10 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **112** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

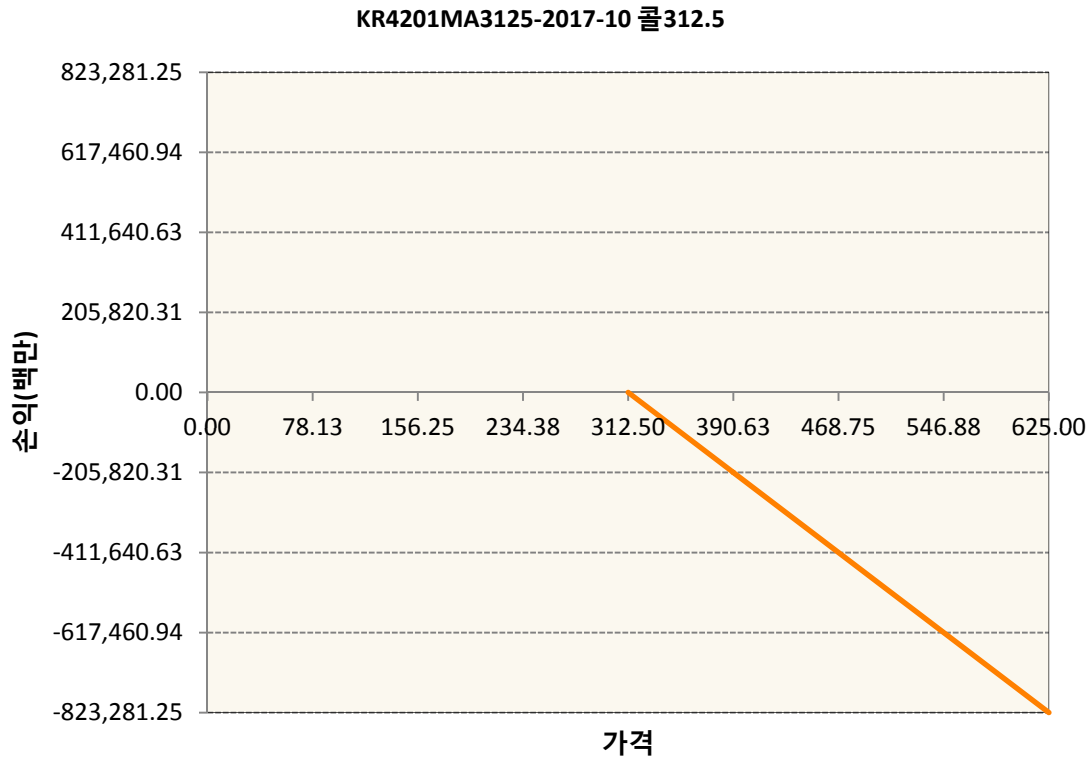
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

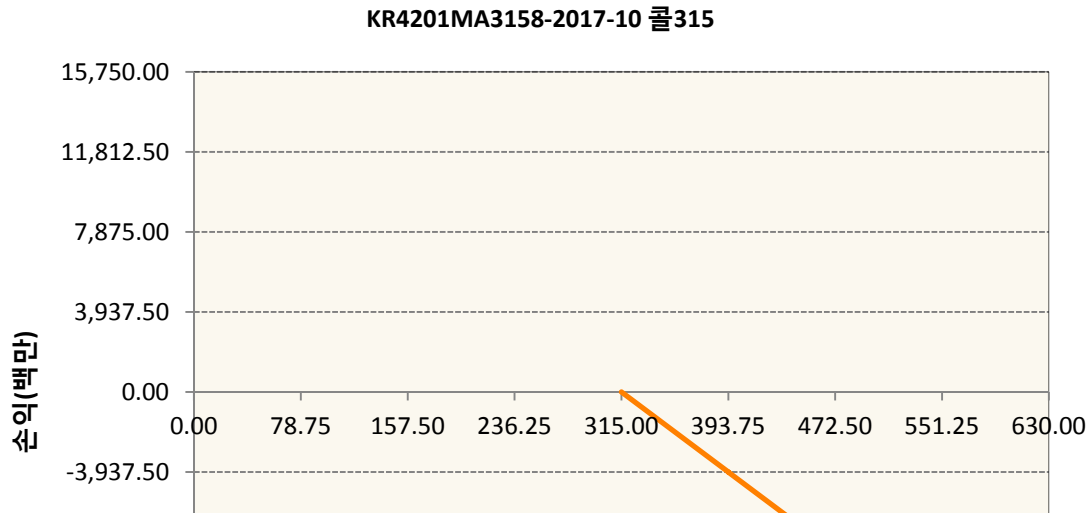
## 1. 계약금액

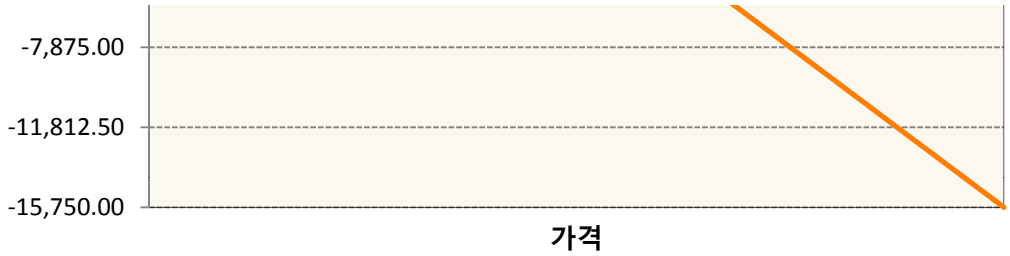
(단위:백만원)

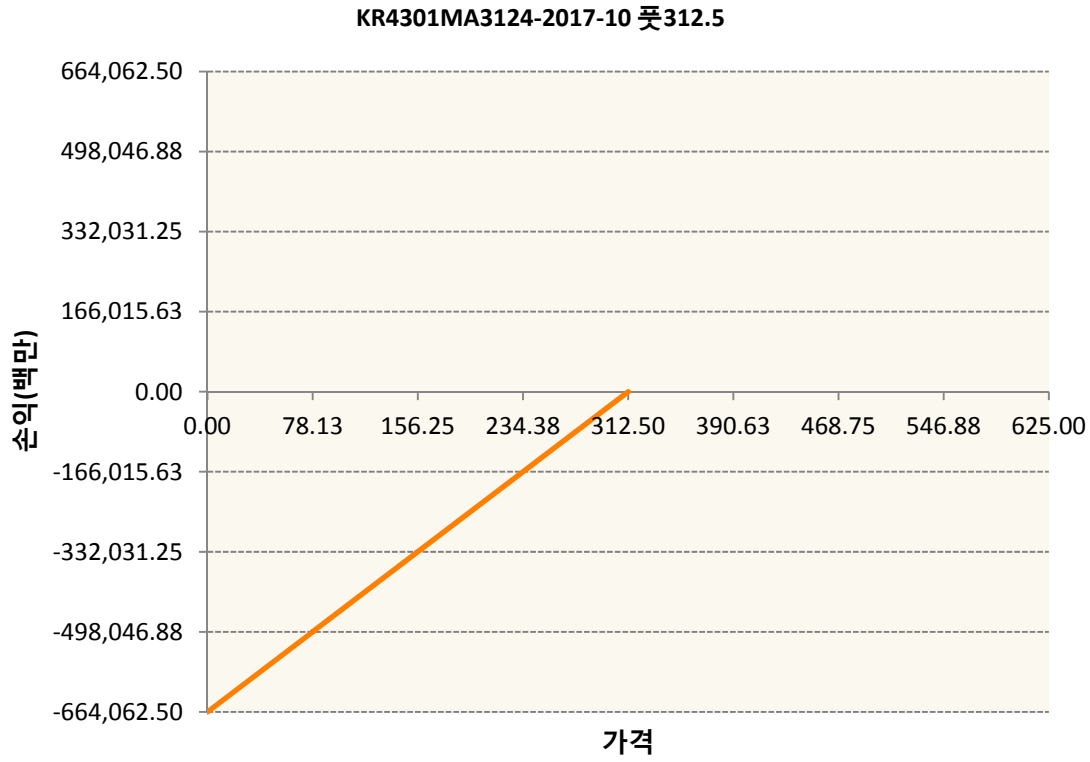
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,503,094 | -1,503,094 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






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

| KR4201MA3 2017-10 콜312.5 | | | | | | | 57,550 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 19,944 | 19,799 | 19,587 | 19,306 | 18,957 | 18,542 | 18,066 |
| -5.33% | 18,856 | 18,298 | 17,658 | 16,950 | 16,183 | 15,368 | 14,512 |
| -2.67% | 14,342 | 13,249 | 12,138 | 11,012 | 9,876 | 8,731 | 7,579 |
| 0% | 3,469 | 2,324 | 1,167 | 0 | -1,174 | -2,354 | -3,538 |
| 2.67% | -13,762 | -14,436 | -15,188 | -16,004 | -16,874 | -17,787 | -18,738 |
| 5.33% | -34,557 | -34,790 | -35,107 | -35,504 | -35,978 | -36,522 | -37,129 |
| 8.00% | -56,509 | -56,559 | -56,649 | -56,787 | -56,982 | -57,236 | -57,550 |
| KR4201MA3 2017-10 콜315 | | | | | | | 1,046 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 310 | 308 | 305 | 301 | 296 | 290 | 283 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -5.33% | 297 | 289 | 280 | 269 | 257 | 243 | 229 |
| -2.67% | 237 | 218 | 199 | 179 | 159 | 139 | 118 |
| 0% | 69 | 46 | 23 | 0 | -23 | -46 | -69 |
| 2.67% | -226 | -242 | -259 | -277 | -296 | -316 | -336 |
| 5.33% | -606 | -612 | -621 | -631 | -642 | -655 | -668 |
| 8.00% | -1,019 | -1,020 | -1,023 | -1,027 | -1,032 | -1,038 | -1,046 |
| KR4301MA3 2017-10 풋312.5 | | | | | | | 42,419 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -42,346 | -42,347 | -42,349 | -42,355 | -42,367 | -42,388 | -42,419 |
| -5.33% | -24,478 | -24,529 | -24,607 | -24,713 | -24,851 | -25,017 | -25,211 |
| -2.67% | -7,983 | -8,390 | -8,819 | -9,265 | -9,725 | -10,196 | -10,677 |
| 0% | 1,417 | 959 | 486 | 0 | -495 | -998 | -1,508 |
| 2.67% | 3,277 | 3,193 | 3,075 | 2,922 | 2,735 | 2,516 | 2,269 |
| 5.33% | 3,368 | 3,365 | 3,357 | 3,342 | 3,315 | 3,274 | 3,215 |
| 8.00% | 3,369 | 3,369 | 3,369 | 3,368 | 3,367 | 3,363 | 3,356 |

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

| |
|---|
| **110,588** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

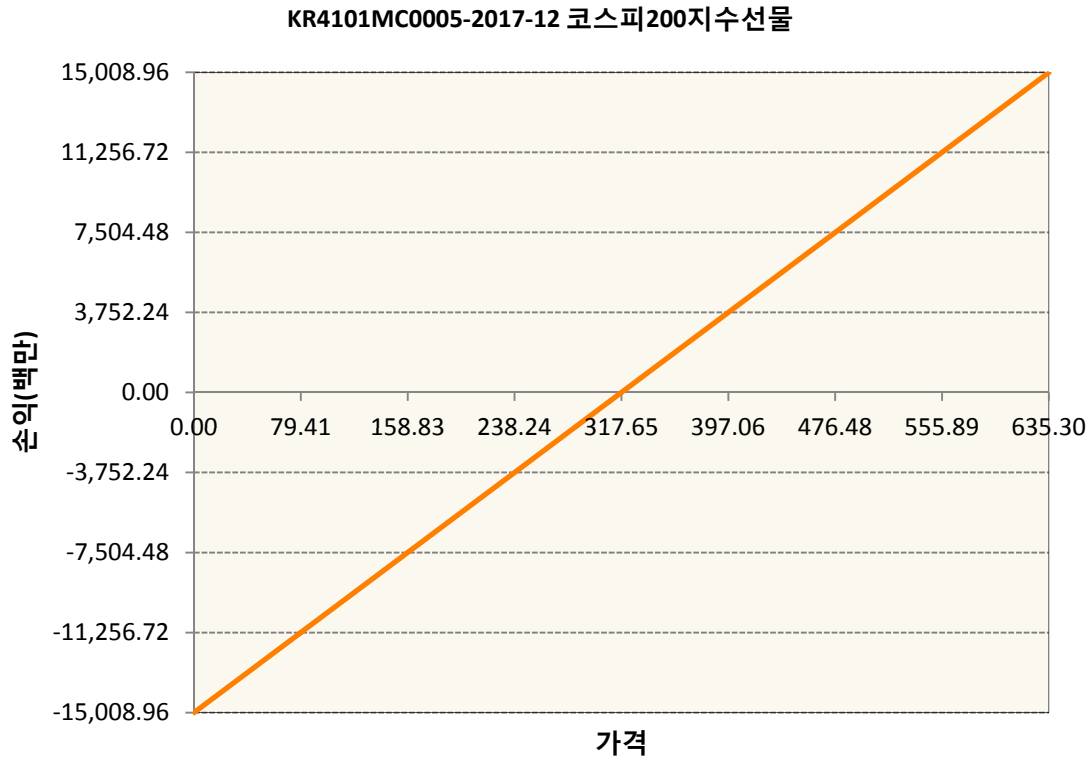
# ETF스마트레버리지목표전환형6호

## 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 | 15,009 | 0 | 15,009 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101MC0 | 2017-12 코스피200지수선물 | | | | | | 1,196 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,196 | -1,196 | -1,196 | -1,196 | -1,196 | -1,196 | -1,196 |
| -5.33% | -797 | -797 | -797 | -797 | -797 | -797 | -797 |
| -2.67% | -399 | -399 | -399 | -399 | -399 | -399 | -399 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 399 | 399 | 399 | 399 | 399 | 399 | 399 |
| 5.33% | 797 | 797 | 797 | 797 | 797 | 797 | 797 |
| 8.00% | 1,196 | 1,196 | 1,196 | 1,196 | 1,196 | 1,196 | 1,196 |

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

| |
|---|
| **719** |

| 공시일 | 2017-10-10 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-09-29 |

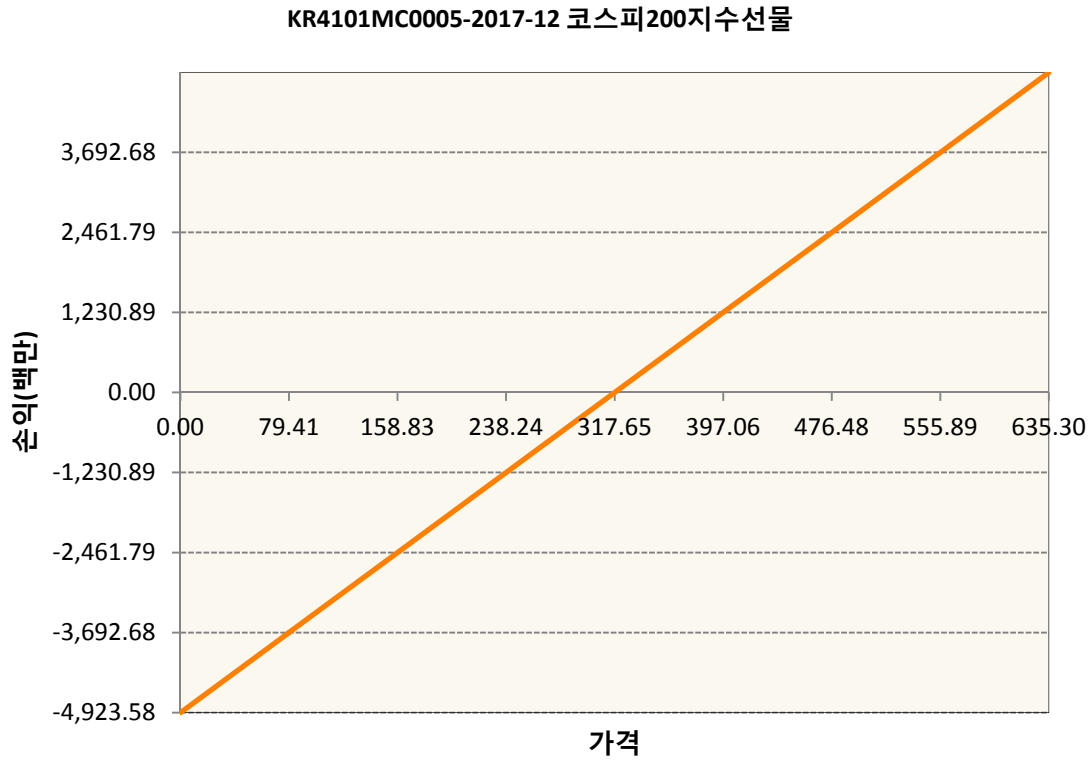
# ETF스마트레버리지목표전환형7호

## 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 | 4,924 | 0 | 4,924 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101MC0 | 2017-12 코스피200지수선물 | | | | | | 392 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -392 | -392 | -392 | -392 | -392 | -392 | -392 |
| -5.33% | -261 | -261 | -261 | -261 | -261 | -261 | -261 |
| -2.67% | -131 | -131 | -131 | -131 | -131 | -131 | -131 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 131 | 131 | 131 | 131 | 131 | 131 | 131 |
| 5.33% | 261 | 261 | 261 | 261 | 261 | 261 | 261 |
| 8.00% | 392 | 392 | 392 | 392 | 392 | 392 | 392 |

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

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

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

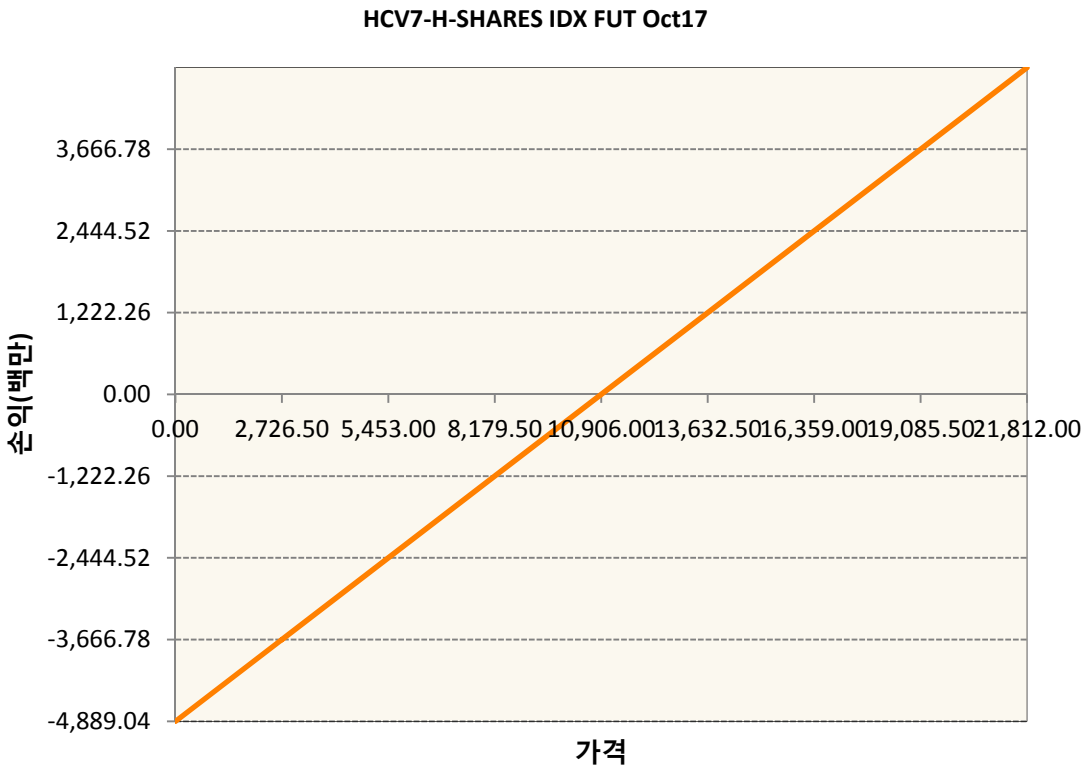
# 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

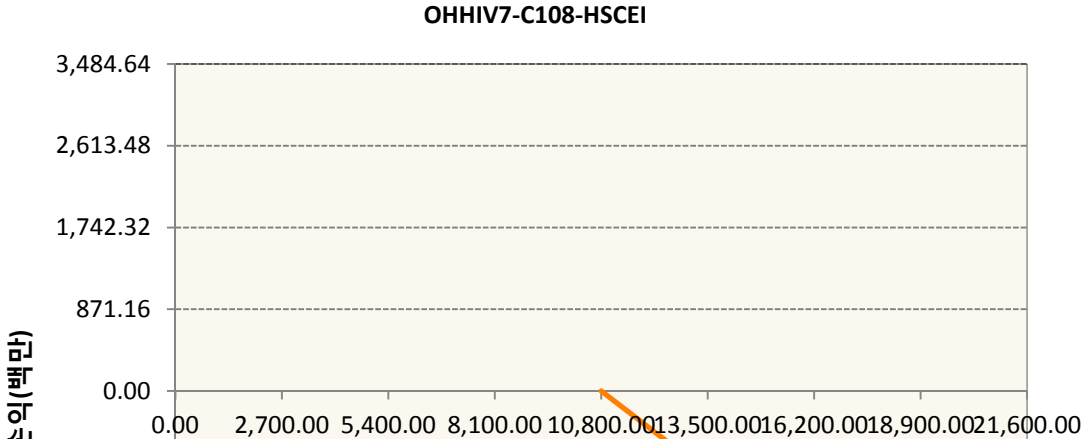
## 1. 계약금액

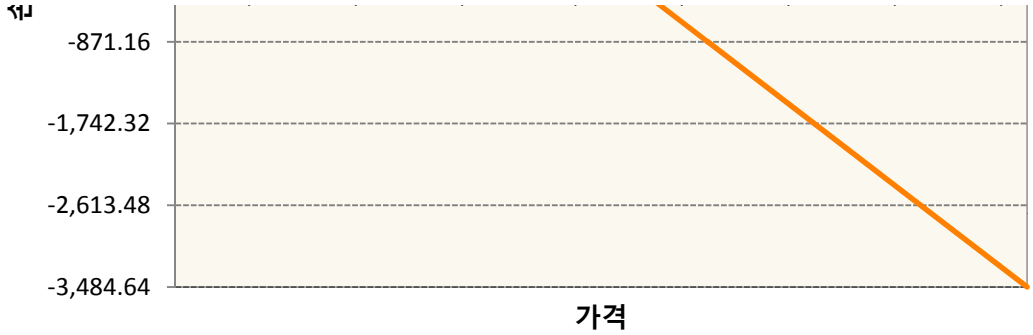
(단위:백만원)

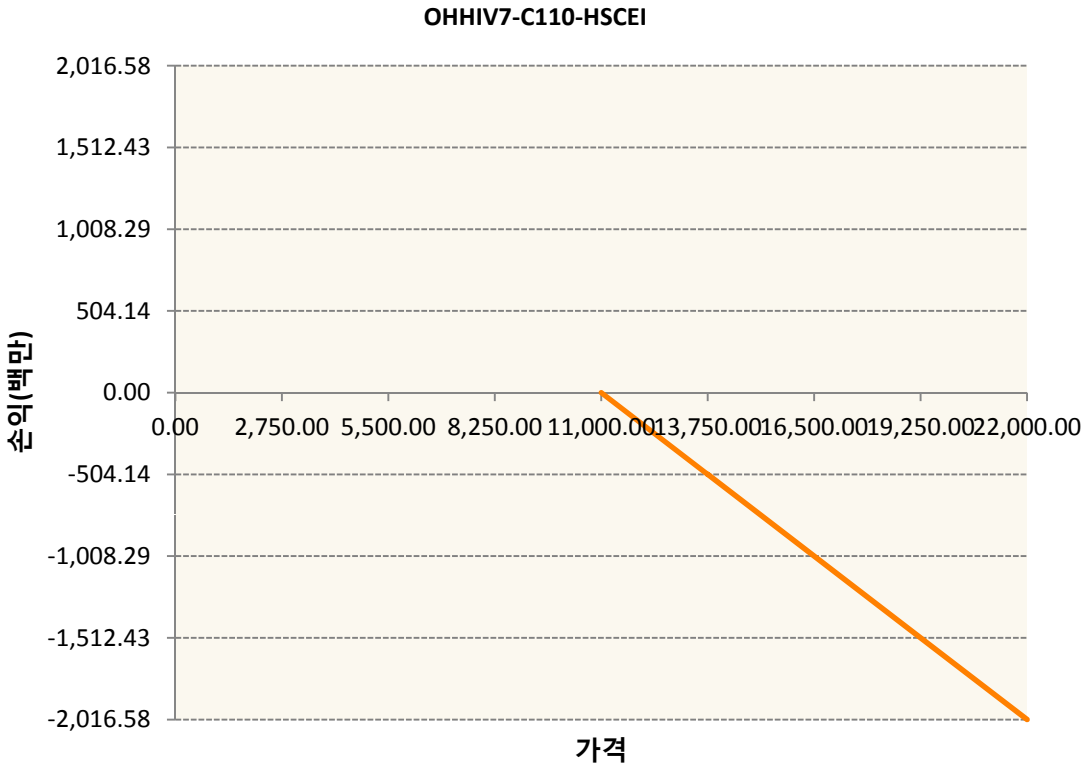
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,889 | 0 | 4,889 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 11,002 | -11,002 | 장내 |

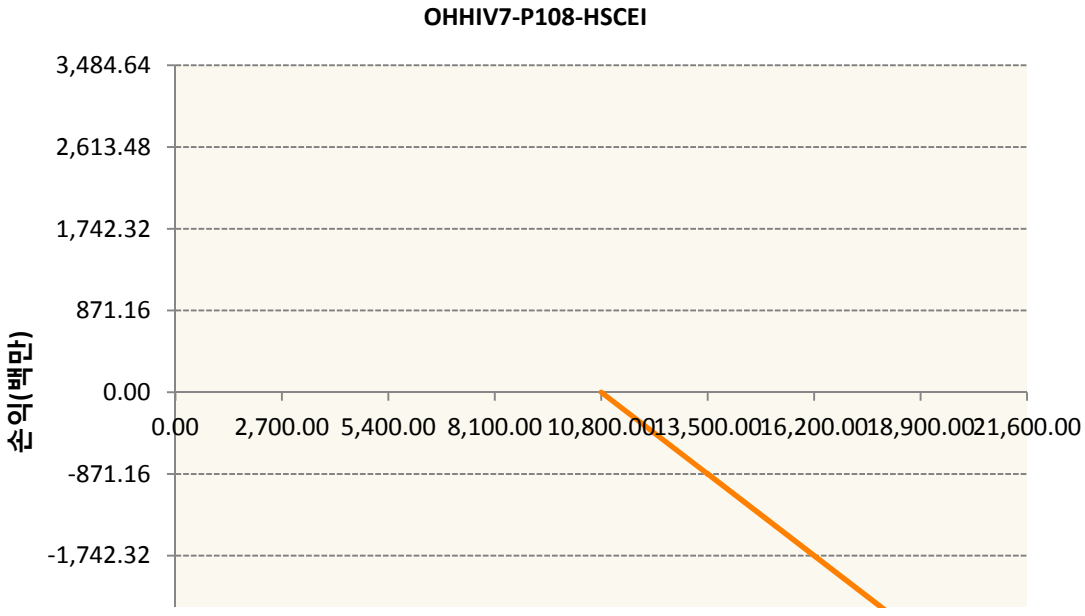
## 2. 만기시점의 손익구조

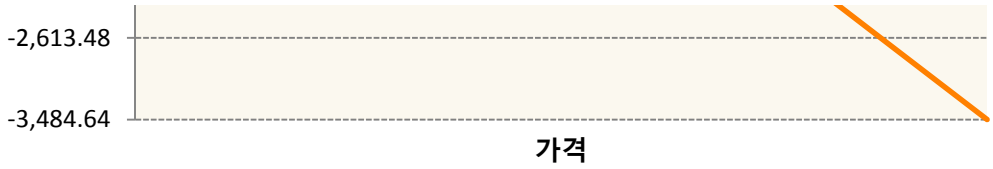


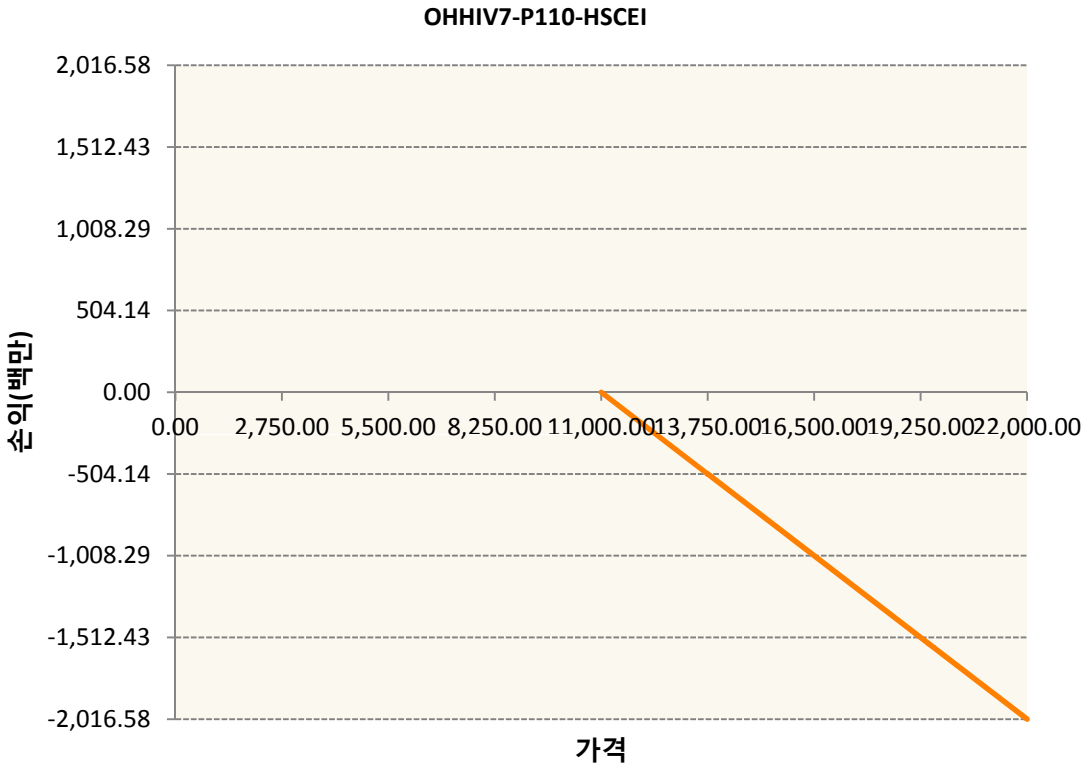




-871.16
-1,742.32
-2,613.48
-3,484.64
가격


OHHIV7-C110-HSCEI
2,016.58
1,512.43
1,008.29
504.14
0.00
-504.14
-1,008.29
-1,512.43
-2,016.58
0.00
2,750.00
5,500.00
8,250.00
11,000.00
13,750.00
16,500.00
19,250.00
22,000.00
손익(백만)
가격


OHHIV7-P108-HSCEI
3,484.64
2,613.48
1,742.32
871.16
0.00
-871.16
-1,742.32
0.00
2,700.00
5,400.00
8,100.00
10,800.00
13,500.00
16,200.00
18,900.00
21,600.00
손익(백만)




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

| | | |
|---|---|---|
| HCV7 | H-SHARES IDX FUT Oct17 | 391 |
| OHHIV7-C1( | HSCEI | 279 |
| OHHIV7-C11 | HSCEI | 161 |
| OHHIV7-P1( | HSCEI | 279 |
| OHHIV7-P11 | HSCEI | 161 |

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

| |
|---|
| **1,043** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

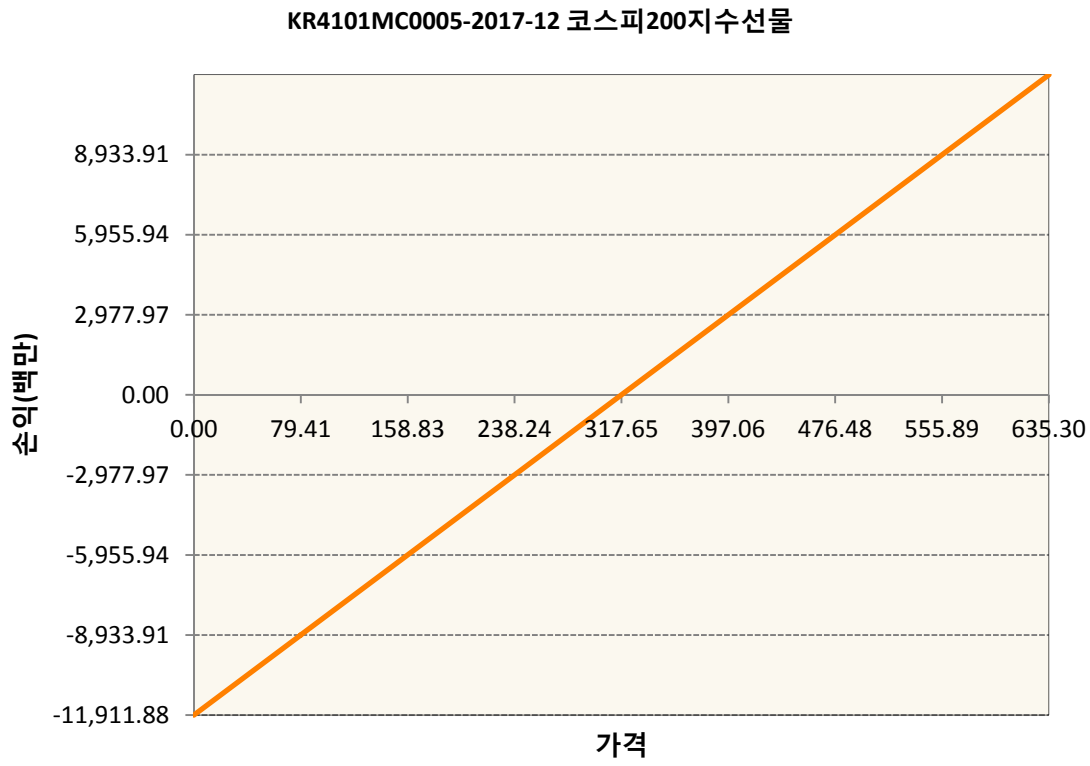
# 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

## 1. 계약금액

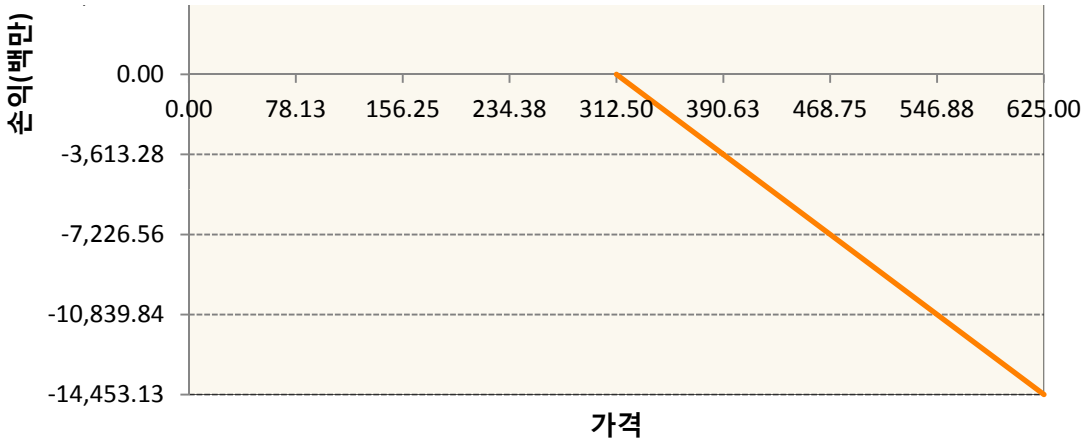
(단위:백만원)

| 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 | 11,912 | 0 | 11,912 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 27,000 | 0 | 27,000 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 25,781 | -25,781 | 장내 |

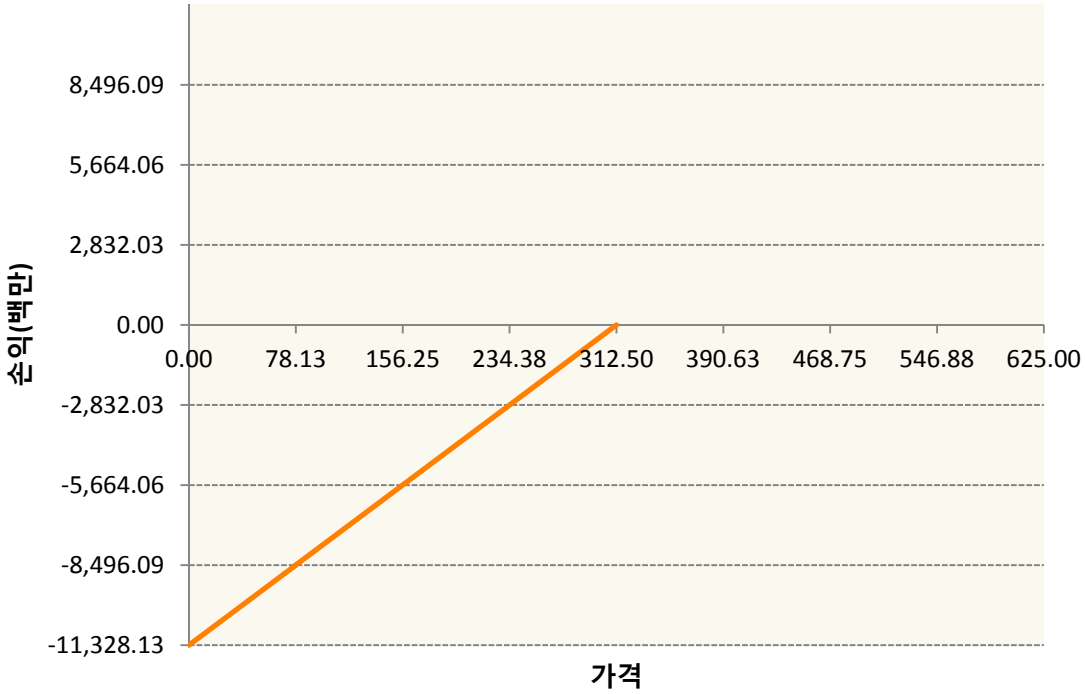
## 2. 만기시점의 손익구조






KR4301MA3124-2017-10 풋312.5




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

| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,498 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,498 | -1,498 | -1,498 | -1,498 | -1,498 | -1,498 | -1,498 |
| -5.33% | -999 | -999 | -999 | -999 | -999 | -999 | -999 |
| -2.67% | -499 | -499 | -499 | -499 | -499 | -499 | -499 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 499 | 499 | 499 | 499 | 499 | 499 | 499 |
| 5.33% | 999 | 999 | 999 | 999 | 999 | 999 | 999 |
| 8.00% | 1,498 | 1,498 | 1,498 | 1,498 | 1,498 | 1,498 | 1,498 |

| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3 | | | | | | | 283 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -283 | -283 | -283 | -283 | -283 | -283 | -283 |
| -5.33% | -189 | -189 | -189 | -189 | -189 | -189 | -189 |
| -2.67% | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 | 94 |
| 5.33% | 189 | 189 | 189 | 189 | 189 | 189 | 189 |
| 8.00% | 283 | 283 | 283 | 283 | 283 | 283 | 283 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4 | | | | | | | 162 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -162 | -162 | -162 | -162 | -162 | -162 | -162 |
| -5.33% | -108 | -108 | -108 | -108 | -108 | -108 | -108 |
| -2.67% | -54 | -54 | -54 | -54 | -54 | -54 | -54 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 54 | 54 | 54 | 54 | 54 | 54 | 54 |
| 5.33% | 108 | 108 | 108 | 108 | 108 | 108 | 108 |
| 8.00% | 162 | 162 | 162 | 162 | 162 | 162 | 162 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5 | | | | | | | 243 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -243 | -243 | -243 | -243 | -243 | -243 | -243 |
| -5.33% | -162 | -162 | -162 | -162 | -162 | -162 | -162 |
| -2.67% | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 81 | 81 | 81 | 81 | 81 | 81 | 81 |
| 5.33% | 162 | 162 | 162 | 162 | 162 | 162 | 162 |
| 8.00% | 243 | 243 | 243 | 243 | 243 | 243 | 243 |
| KR4101MC0( 2017-12 코스피200지수선물 | | | | | | | 949 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -949 | -949 | -949 | -949 | -949 | -949 | -949 |
| -5.33% | -633 | -633 | -633 | -633 | -633 | -633 | -633 |
| -2.67% | -316 | -316 | -316 | -316 | -316 | -316 | -316 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 316 | 316 | 316 | 316 | 316 | 316 | 316 |
| 5.33% | 633 | 633 | 633 | 633 | 633 | 633 | 633 |
| 8.00% | 949 | 949 | 949 | 949 | 949 | 949 | 949 |
| KR4201MA3 2017-10 콜312.5 | | | | | | | 1,010 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 350 | 348 | 344 | 339 | 333 | 326 | 317 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -5.33% | 331 | 321 | 310 | 298 | 284 | 270 | 255 |
| -2.67% | 252 | 233 | 213 | 193 | 173 | 153 | 133 |
| 0% | 61 | 41 | 20 | 0 | -21 | -41 | -62 |
| 2.67% | -242 | -253 | -267 | -281 | -296 | -312 | -329 |
| 5.33% | -607 | -611 | -616 | -623 | -632 | -641 | -652 |
| 8.00% | -992 | -993 | -994 | -997 | -1,000 | -1,005 | -1,010 |
| KR4301MA3 2017-10 풋312.5 | | | | | | | 724 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -722 | -722 | -722 | -723 | -723 | -723 | -724 |
| -5.33% | -418 | -418 | -420 | -422 | -424 | -427 | -430 |
| -2.67% | -136 | -143 | -150 | -158 | -166 | -174 | -182 |
| 0% | 24 | 16 | 8 | 0 | -8 | -17 | -26 |
| 2.67% | 56 | 54 | 52 | 50 | 47 | 43 | 39 |
| 5.33% | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 56 | 55 |
| 8.00% | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 |

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

| |
|---|
| **4,656** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

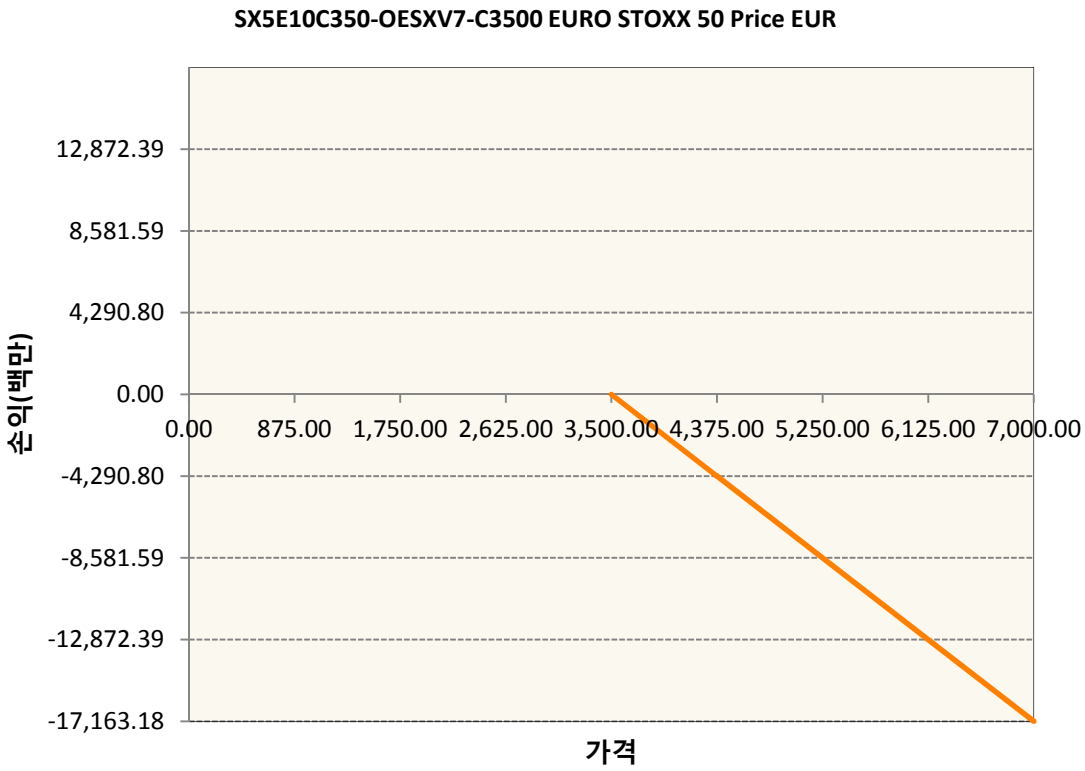
# 유로커버드콜모(주식혼합-파생형

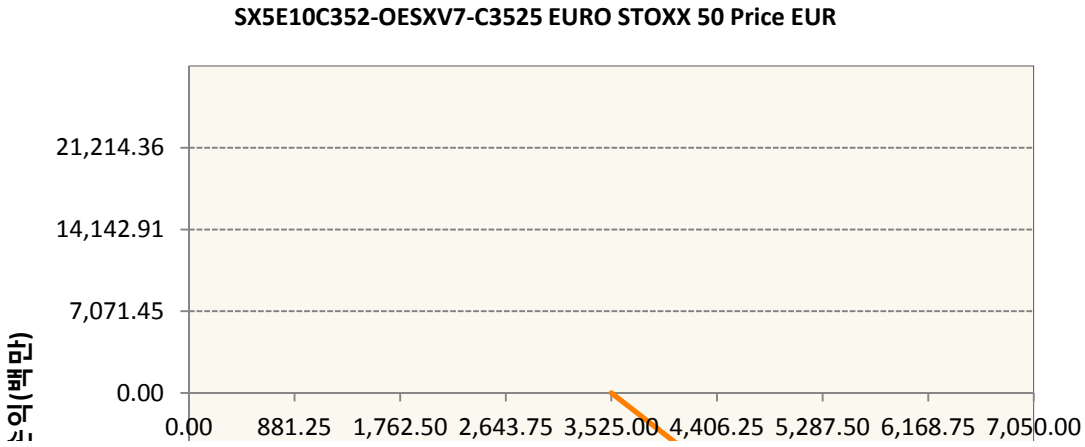
## 1. 계약금액

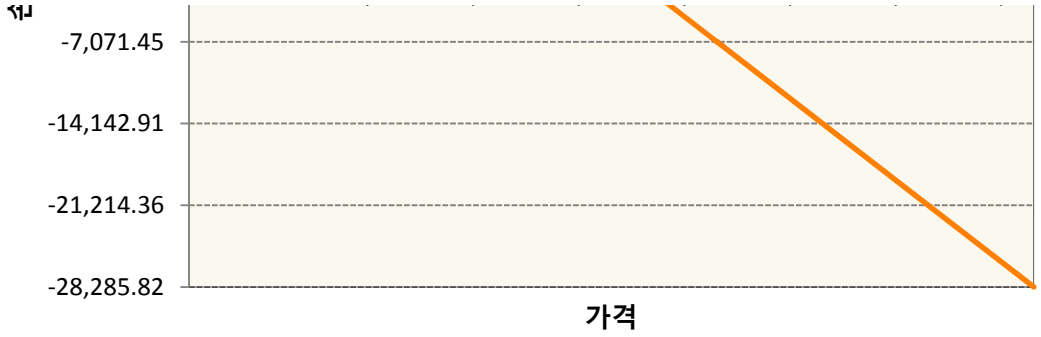
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 41,636 | 0 | 41,636 | |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 90,898 | -90,898 | 장내 |

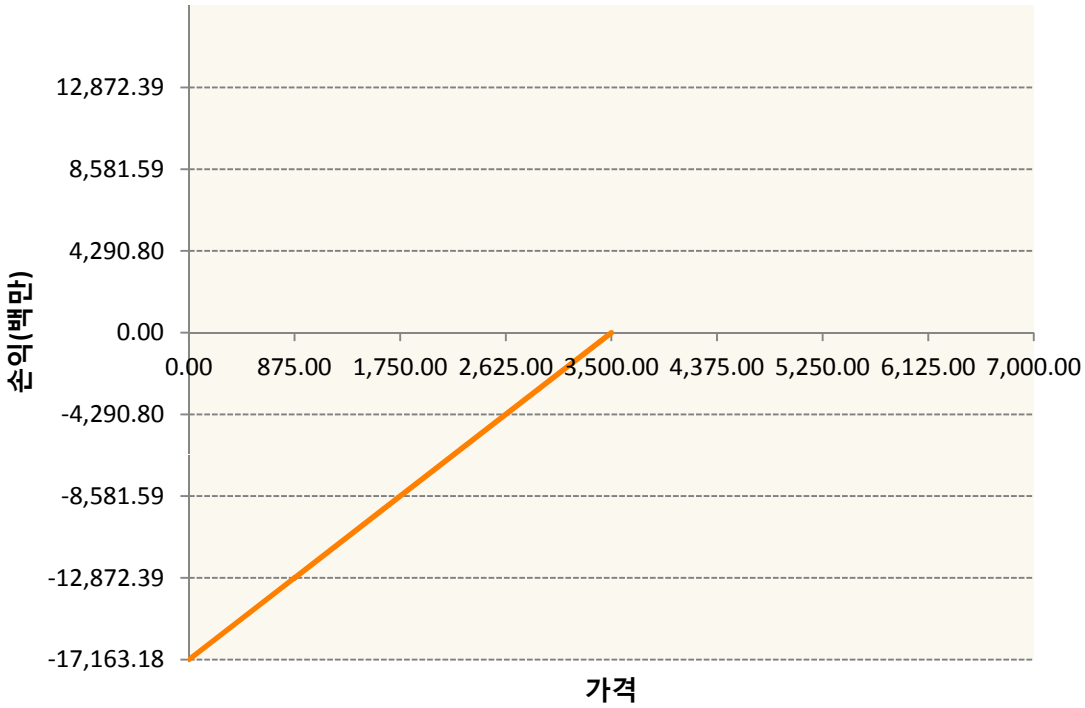
## 2. 만기시점의 손익구조



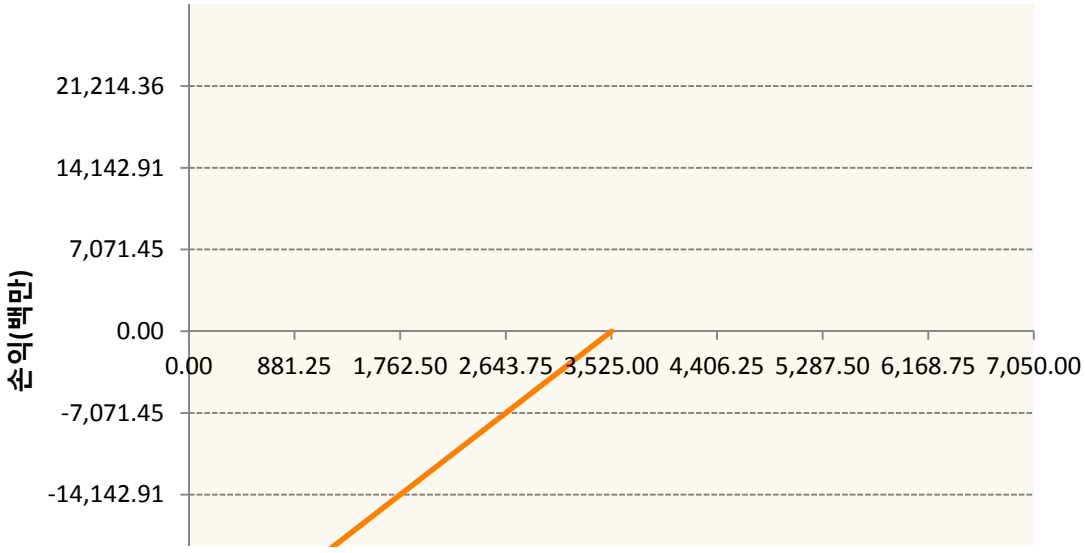



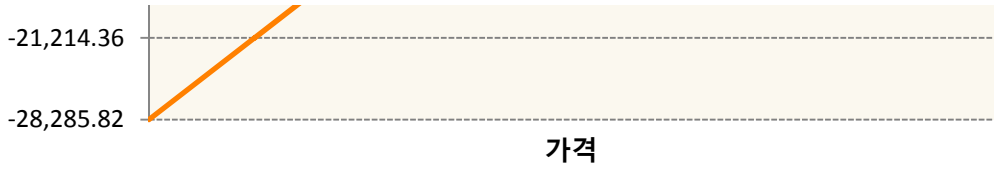


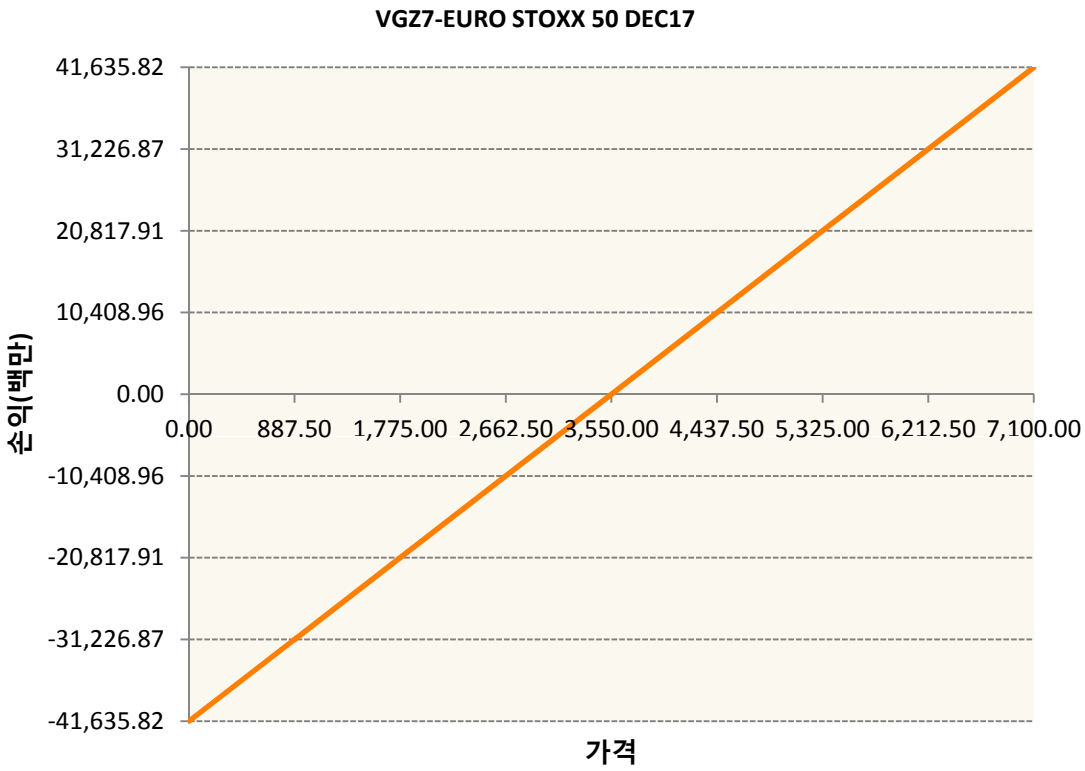

SX5E10P350-OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR




SX5E10P352-OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | (단위:백만원) |
|---|---|
| SX5E10C350 OESXV7-C3500 EURO STOXX 50 Price EUR | 1,373 |
| SX5E10C352 OESXV7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR | 2,263 |
| SX5E10P350 OESXV7-P3500 EURO STOXX 50 Price EUR | 1,373 |
| SX5E10P352 OESXV7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR | 2,263 |
| VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17 | 3,331 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **8,204** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

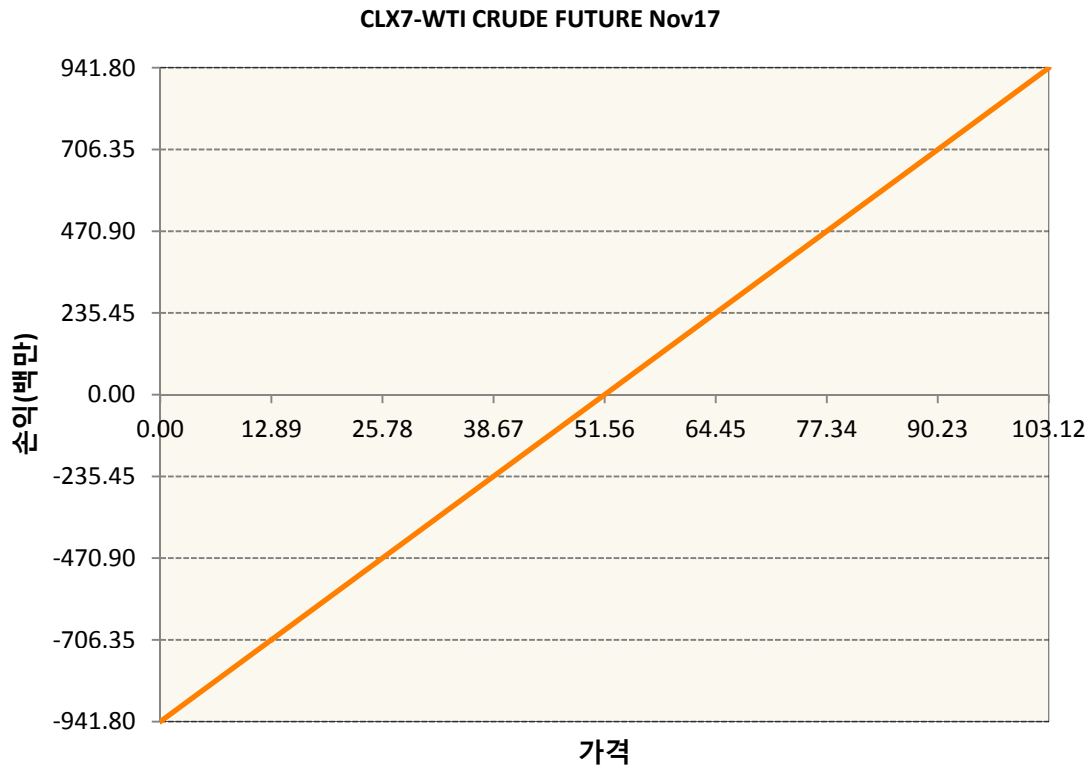
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

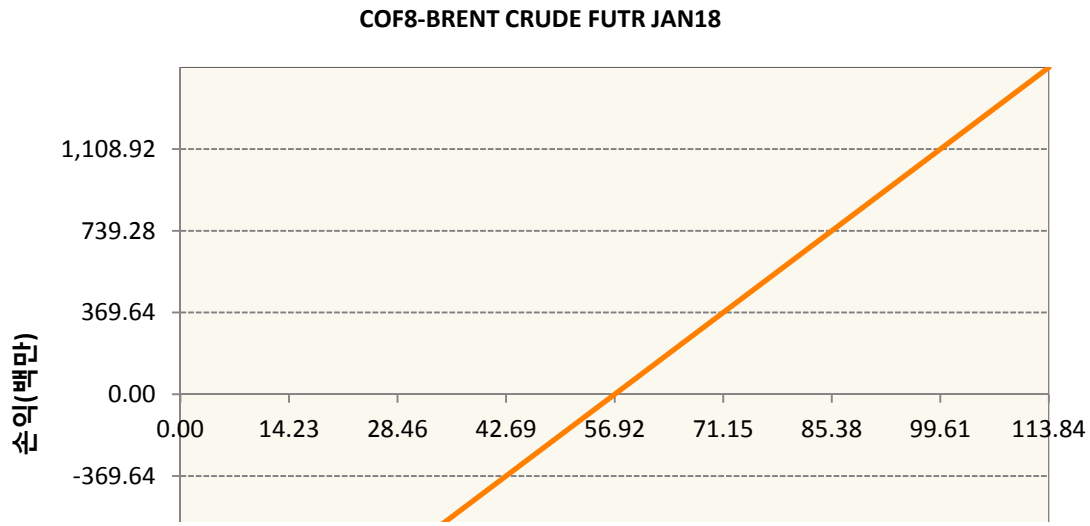
## 1. 계약금액

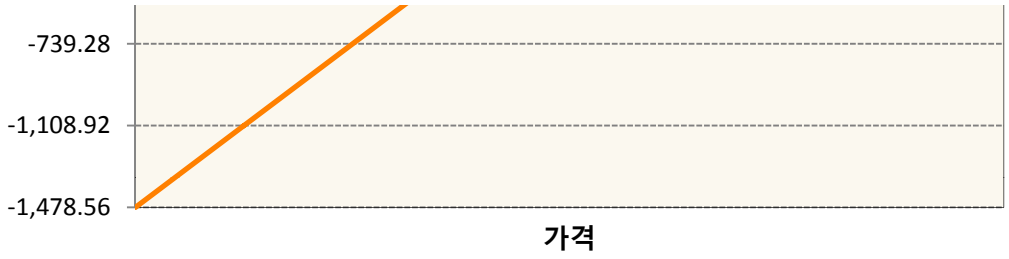
(단위:백만원)

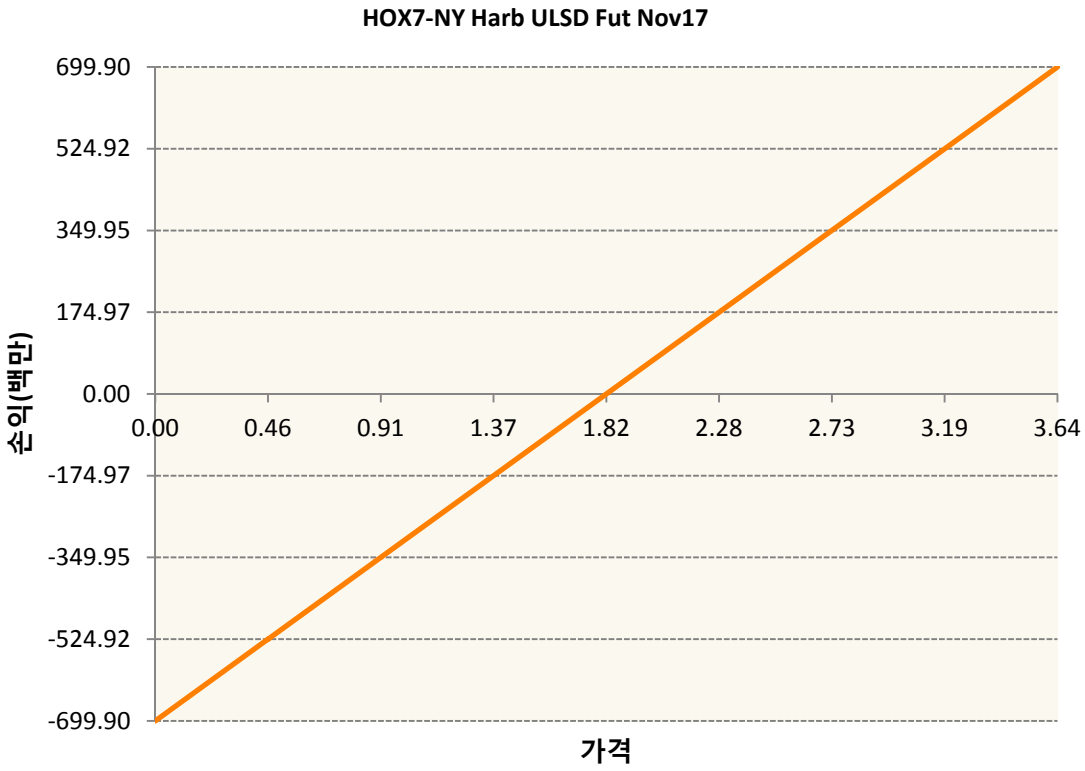
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,194 | 916 | 4,278 | |

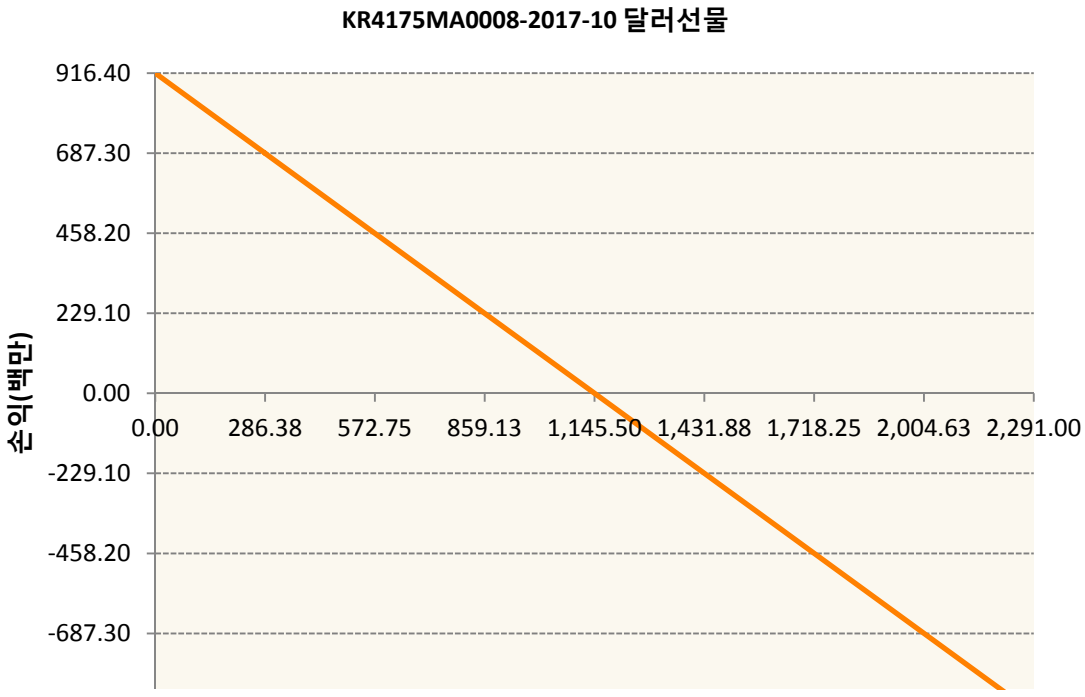
## 2. 만기시점의 손익구조

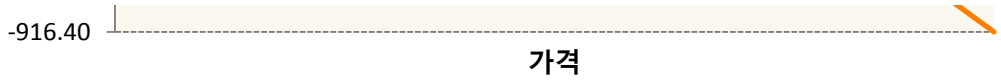


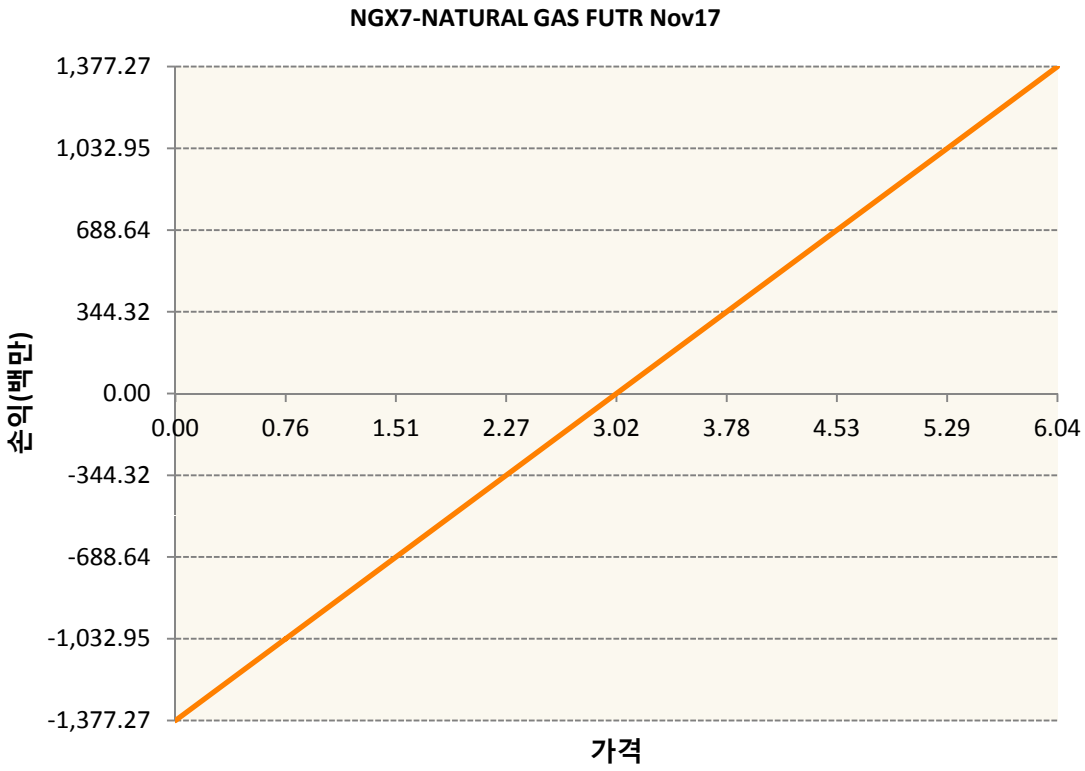



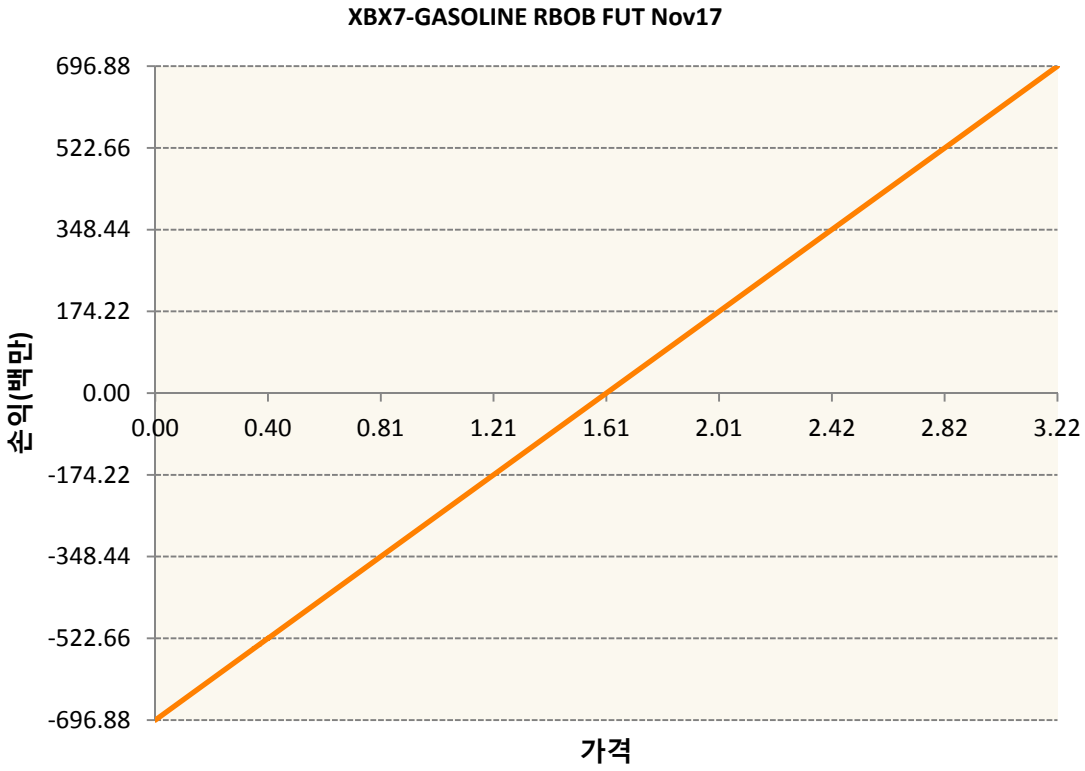

-739.28
-1,108.92
-1,478.56
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
699.90
524.92
349.95
174.97
0.00
-174.97
-349.95
-524.92
-699.90
0.00
0.46
0.91
1.37
1.82
2.28
2.73
3.19
3.64
손익(백만)
가격


KR4175MA0008-2017-10 달러선물
916.40
687.30
458.20
229.10
0.00
-229.10
-458.20
-687.30
0.00
286.38
572.75
859.13
1,145.50
1,431.88
1,718.25
2,004.63
2,291.00
손익(백만)


-916.40
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,377.27
1,032.95
688.64
344.32
0.00
-344.32
-688.64
-1,032.95
-1,377.27
0.00
0.76
1.51
2.27
3.02
3.78
4.53
5.29
6.04
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
696.88
522.66
348.44
174.22
0.00
-174.22
-348.44
-522.66
-696.88
0.00
0.40
0.81
1.21
1.61
2.01
2.42
2.82
3.22
손익(백만)
가격

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

| | | |
|---|---|---|
| CLX7 | WTI CRUDE FUTURE Nov17 | 75 |
| COF8 | BRENT CRUDE FUTR JAN18 | 118 |
| HOX7 | NY Harb ULSD Fut Nov17 | 56 |
| KR4175MA0 | 2017-10 달러선물 | 73 |
| NGX7 | NATURAL GAS FUTR Nov17 | 110 |
| XBX7 | GASOLINE RBOB FUT Nov17 | 56 |

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

| |
|---|
| **749** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-10-10 |
| 기준일 | 2017-09-29 |

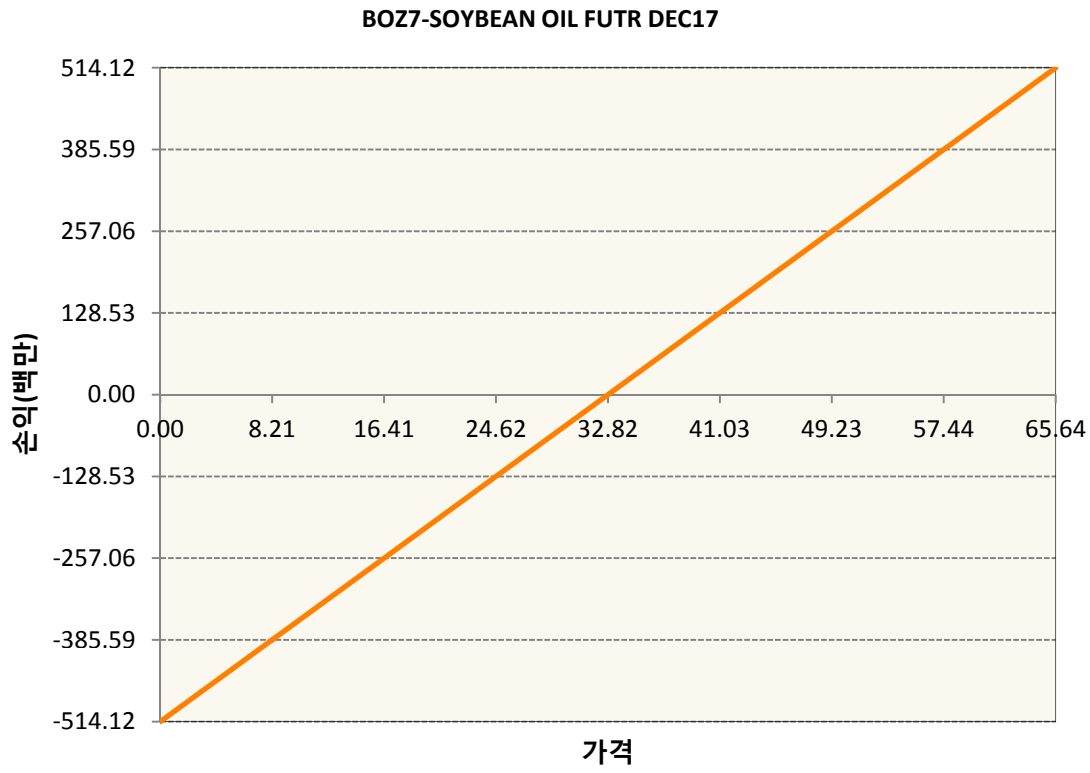
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

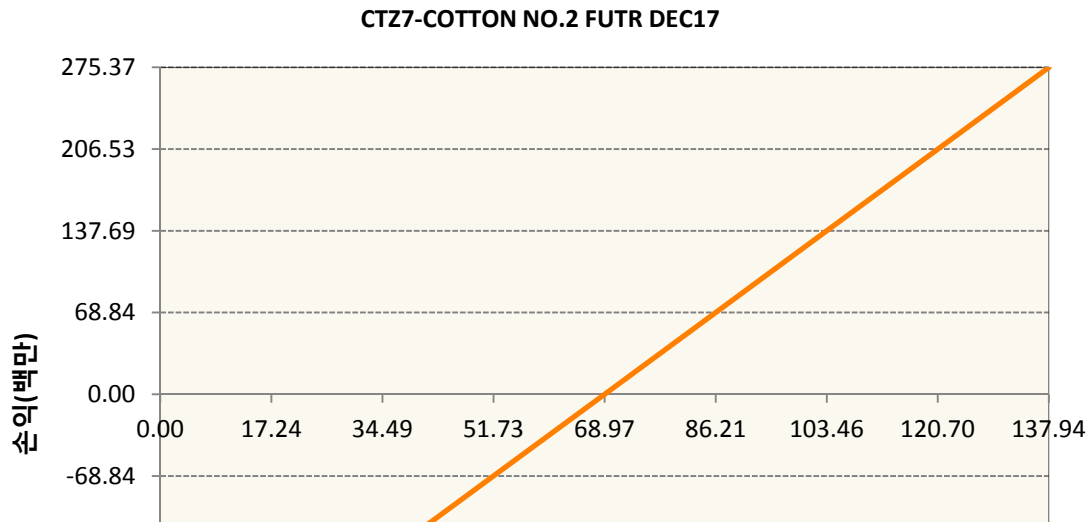
## 1. 계약금액

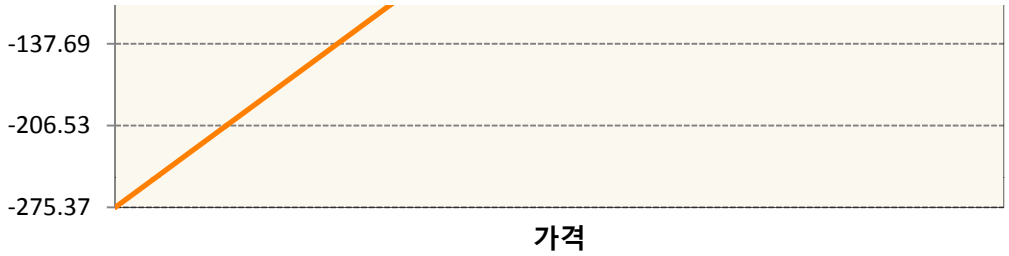
(단위:백만원)

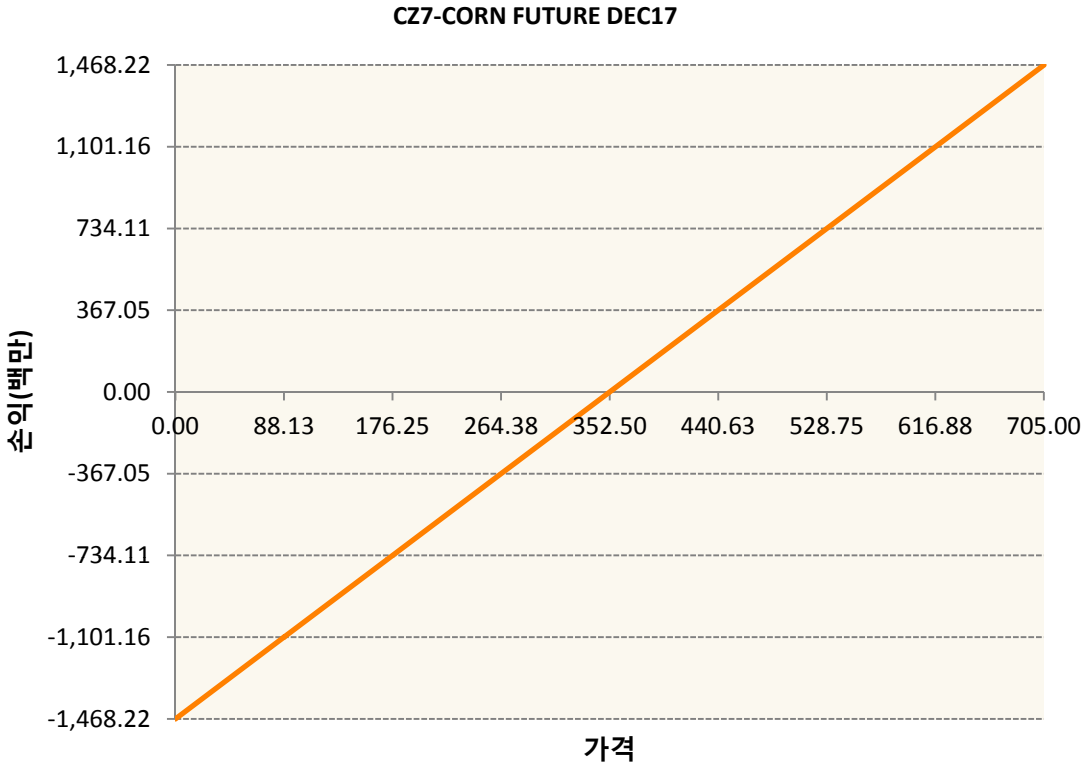
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,602 | 344 | 5,258 | |

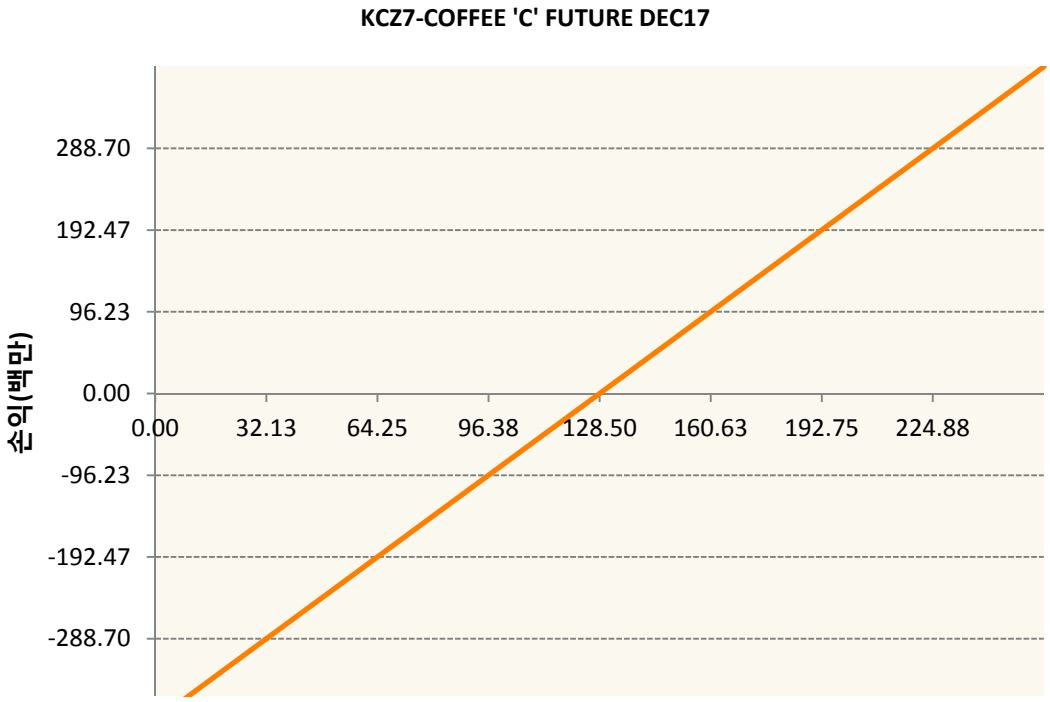
## 2. 만기시점의 손익구조

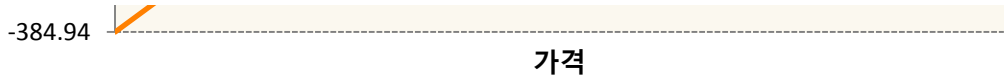


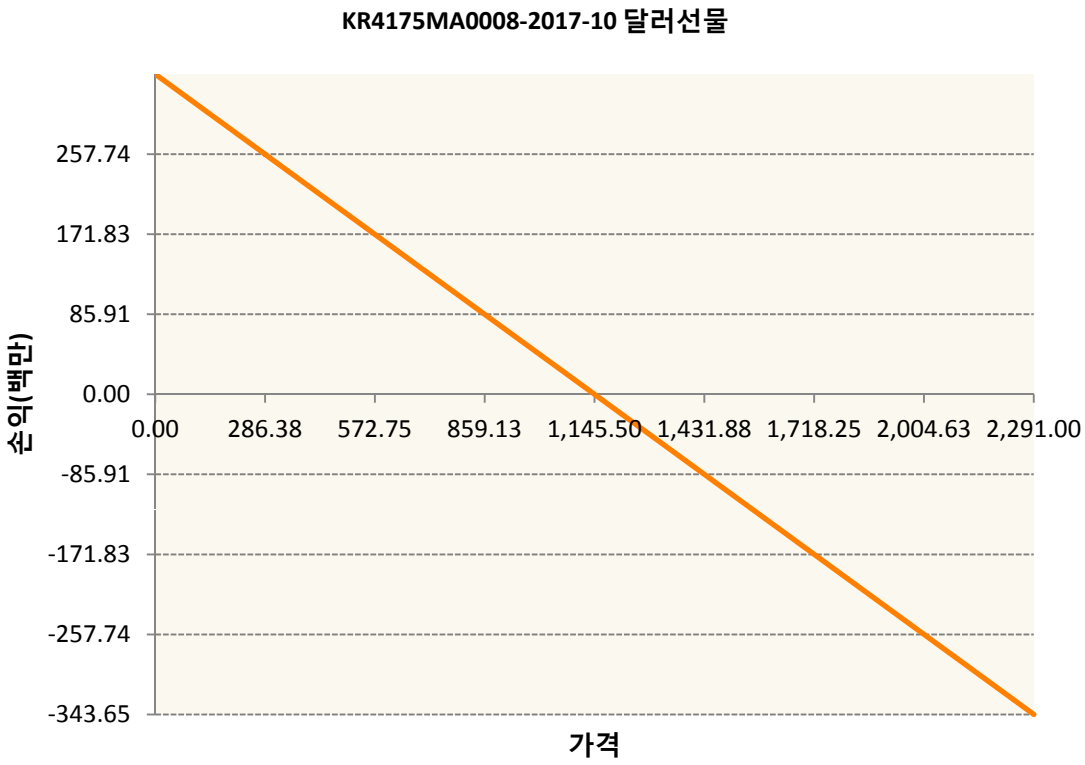



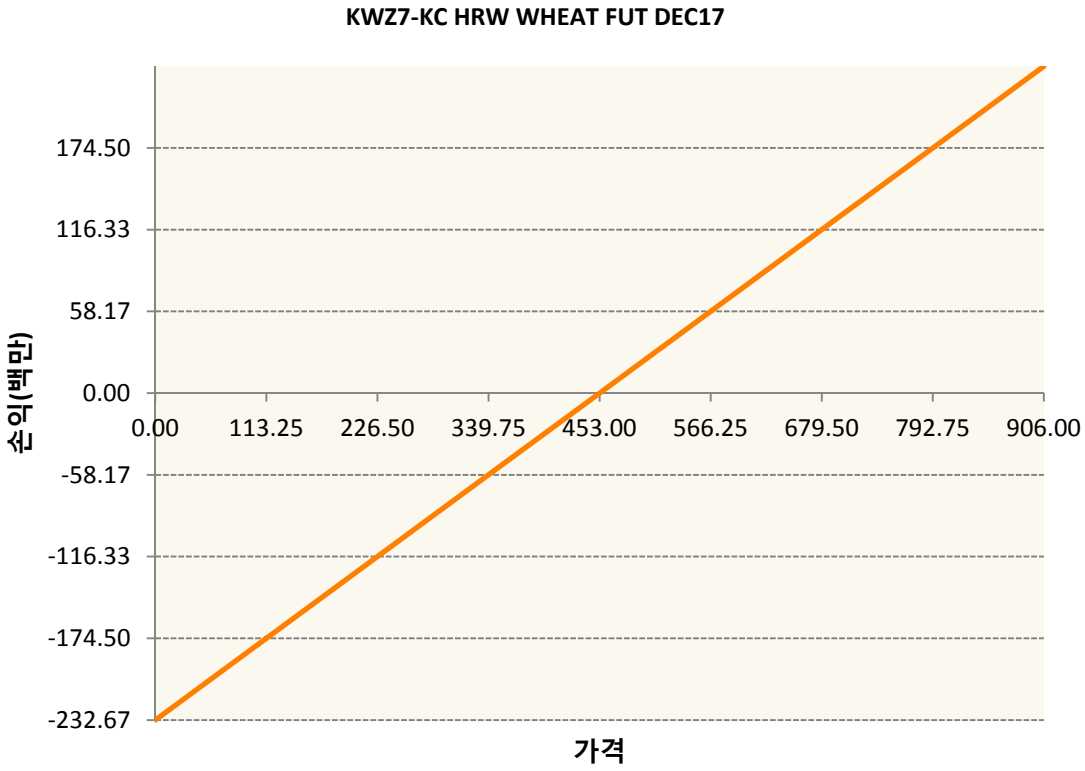

-137.69
-206.53
-275.37
가격

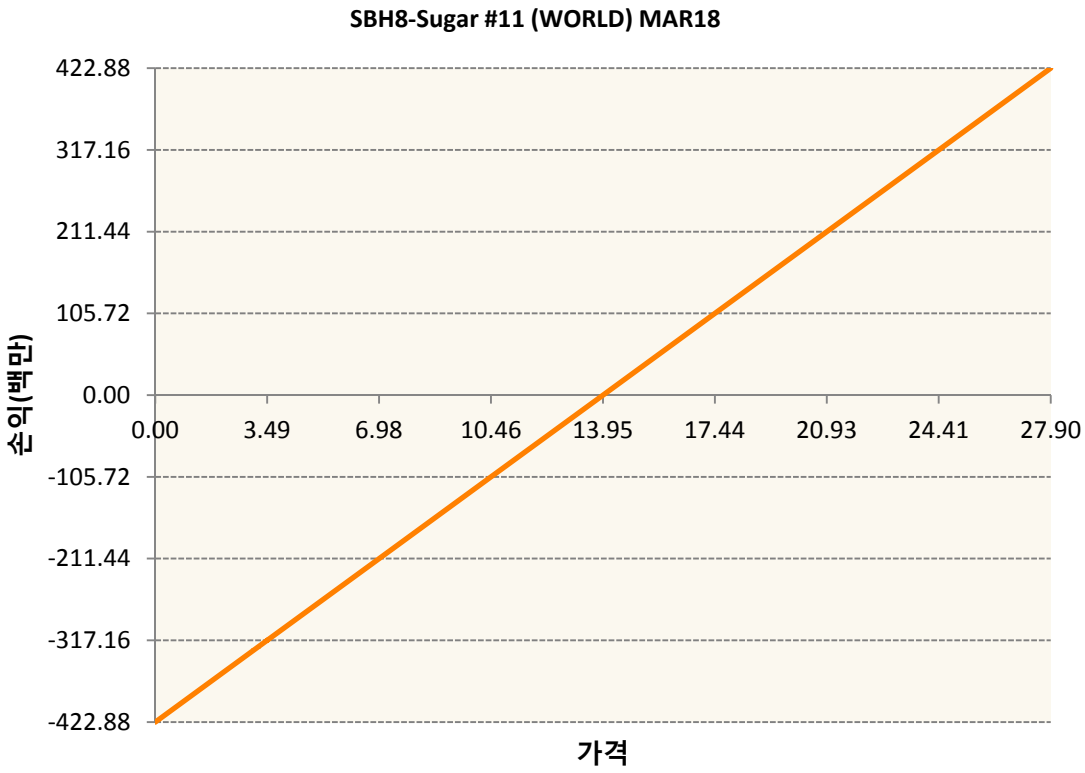

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,468.22
1,101.16
734.11
367.05
0.00
-367.05
-734.11
-1,101.16
-1,468.22
0.00
88.13
176.25
264.38
352.50
440.63
528.75
616.88
705.00
손익(백만)
가격

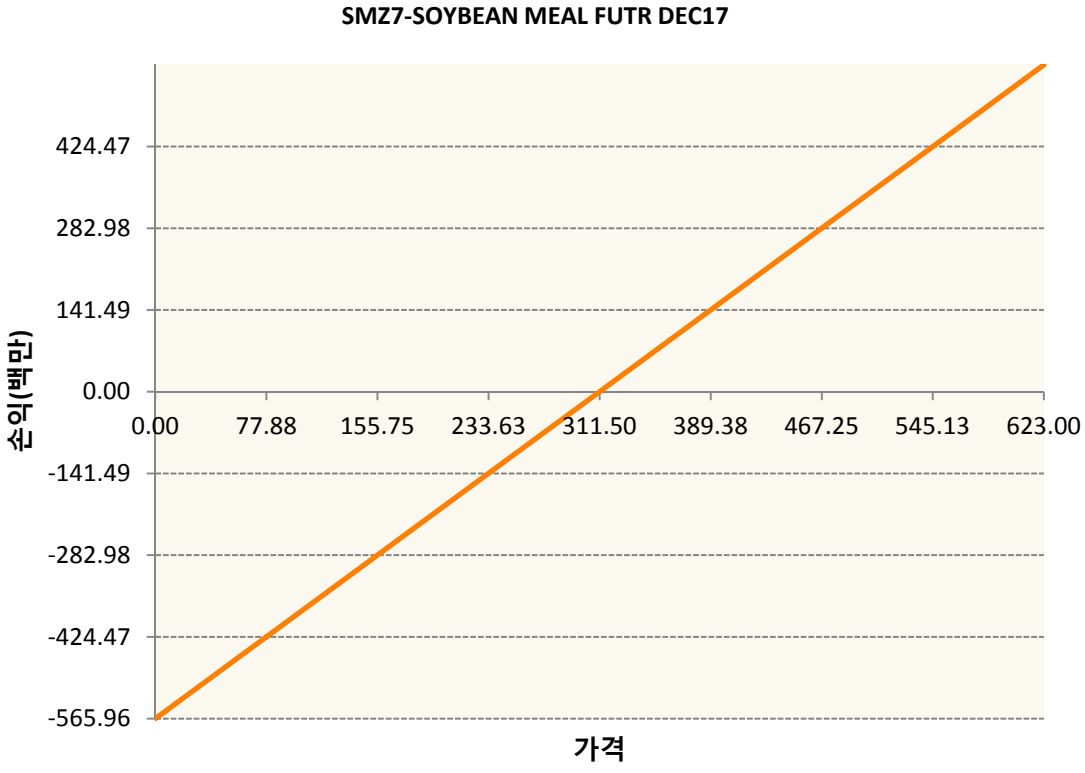

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
288.70
192.47
96.23
0.00
-96.23
-192.47
-288.70
0.00
32.13
64.25
96.38
128.50
160.63
192.75
224.88
손익(백만)


-384.94
가격

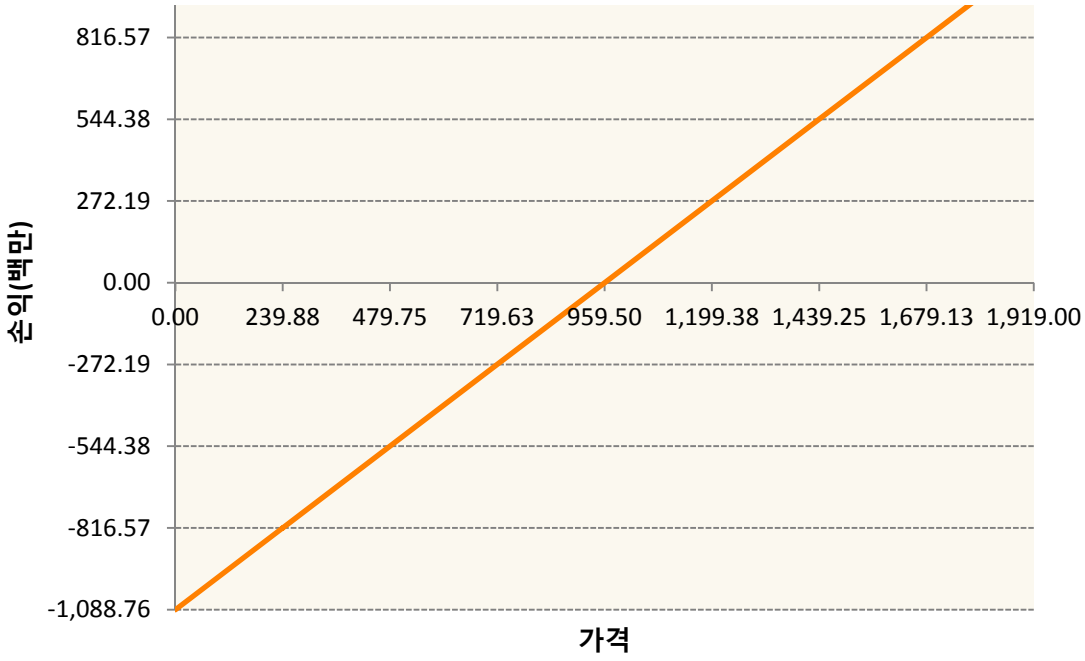

KR4175MA0008-2017-10 달러선물
257.74
171.83
85.91
0.00
-85.91
-171.83
-257.74
-343.65
0.00
286.38
572.75
859.13
1,145.50
1,431.88
1,718.25
2,004.63
2,291.00
손익(백만)
가격

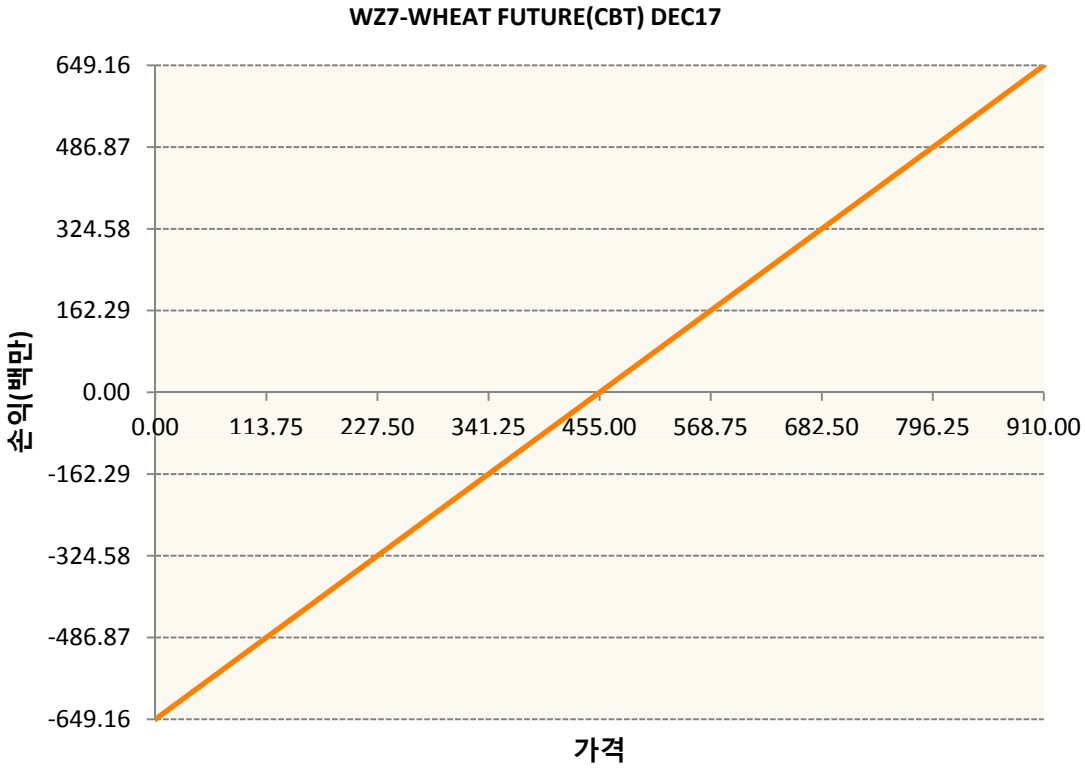

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
174.50
116.33
58.17
0.00
-58.17
-116.33
-174.50
-232.67
0.00
113.25
226.50
339.75
453.00
566.25
679.50
792.75
906.00
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
422.88
317.16
211.44
105.72
0.00
-105.72
-211.44
-317.16
-422.88
0.00
3.49
6.98
10.46
13.95
17.44
20.93
24.41
27.90
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
424.47
282.98
141.49
0.00
-141.49
-282.98
-424.47
-565.96
0.00
77.88
155.75
233.63
311.50
389.38
467.25
545.13
623.00
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| BOZ7 | SOYBEAN OIL FUTR DEC17 | 41 |
| CTZ7 | COTTON NO.2 FUTR DEC17 | 22 |
| CZ7 | CORN FUTURE DEC17 | 117 |
| KCZ7 | COFFEE 'C' FUTURE DEC17 | 31 |
| KR4175MA0 | 2017-10 달러선물 | 27 |

| | | |
|---|---|---|
| KWZ7 | KC HRW WHEAT FUT DEC17 | 19 |
| SBH8 | Sugar #11 (WORLD) MAR18 | 34 |
| SMZ7 | SOYBEAN MEAL FUTR DEC17 | 45 |
| SX7 | SOYBEAN FUTURE NOV17 | 87 |
| WZ7 | WHEAT FUTURE(CBT) DEC17 | 52 |

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

| |
|---|
| **520** |