| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

# 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 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

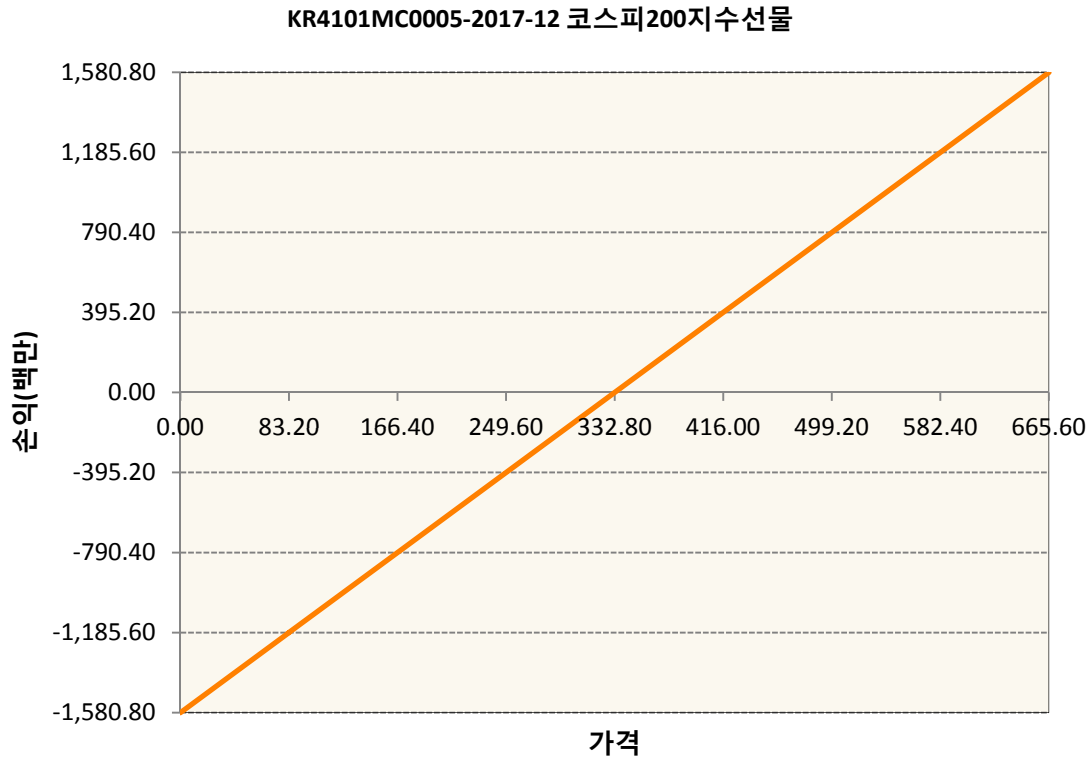
# 스마트인덱스모

## 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 | 1,581 | 0 | 1,581 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101MC0 | 2017-12 코스피200지수선물 | | | | | | 127 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -127 | -127 | -127 | -127 | -127 | -127 | -127 |
| -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% | 127 | 127 | 127 | 127 | 127 | 127 | 127 |

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

| 72 |
|---|

| 공시일 | 2017-11-21 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-11-20 |

# 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 | 1,063 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| **348** |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

# 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 | 409 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **368** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

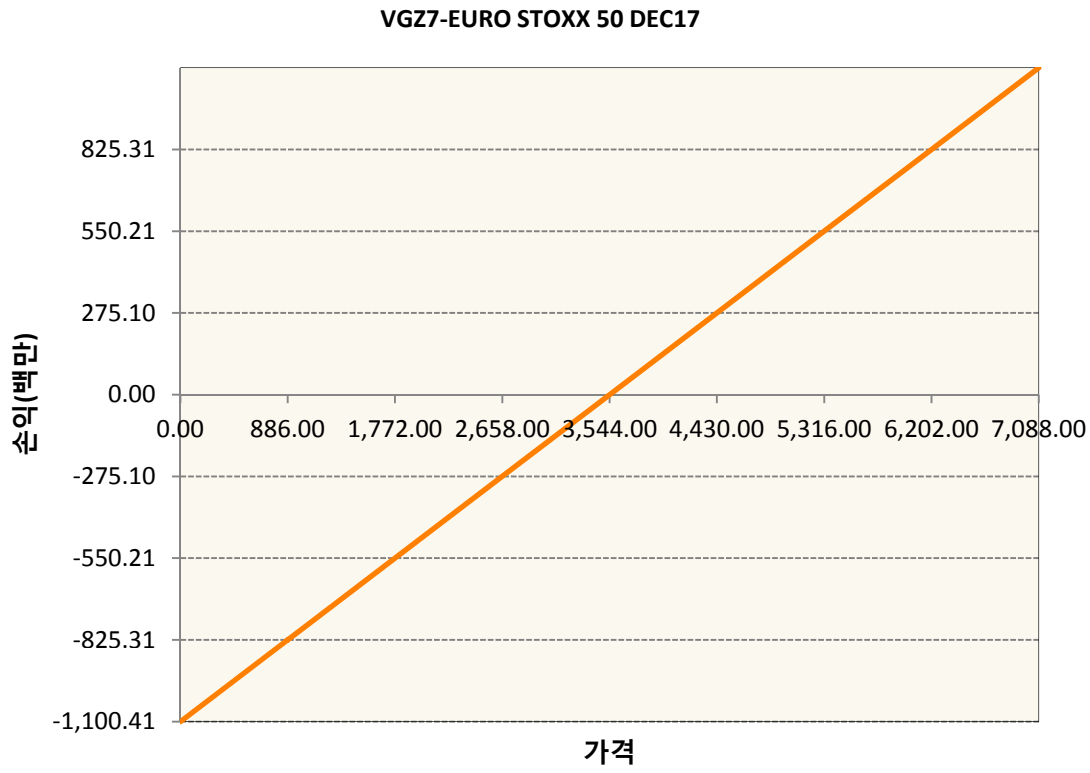
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,100 | 0 | 1,100 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

**53**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

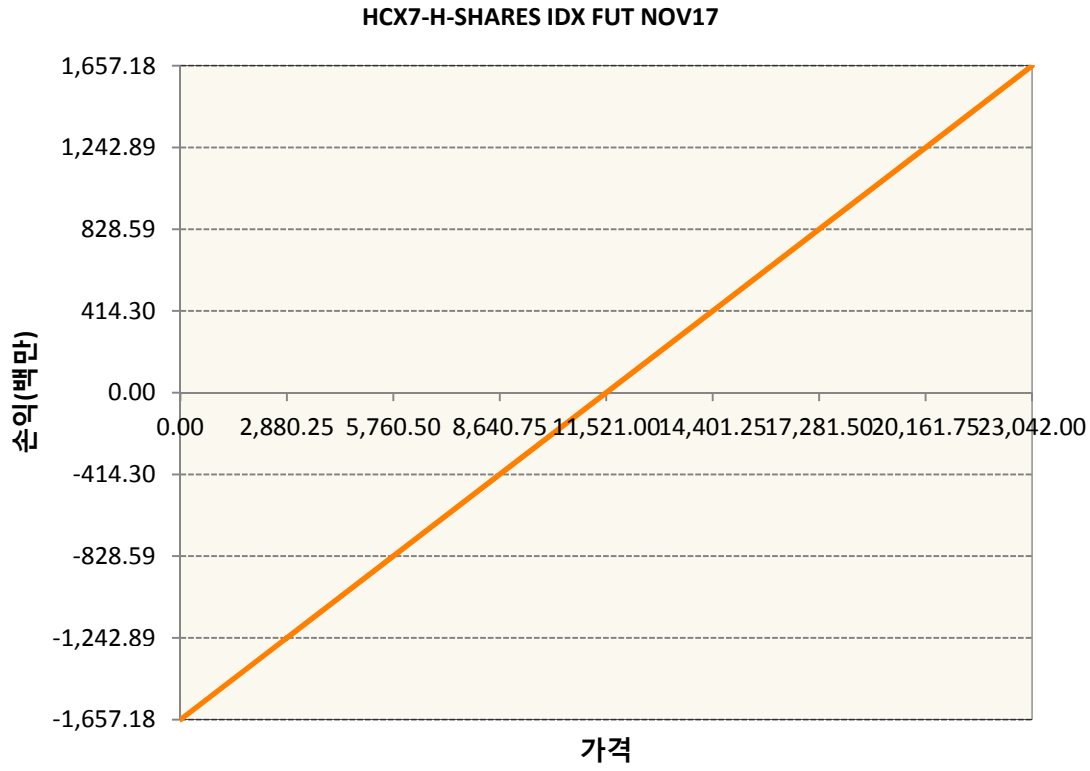
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

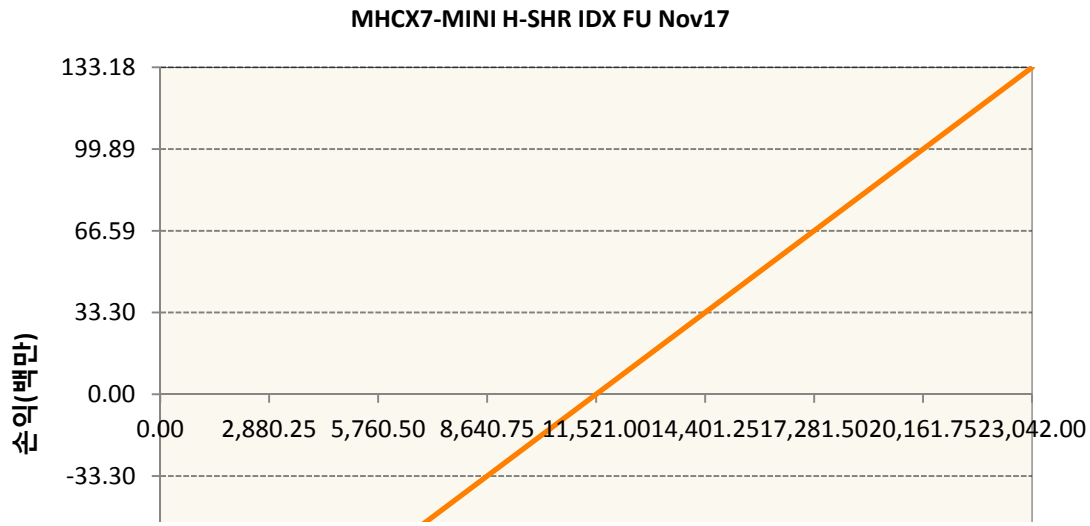
## 1. 계약금액

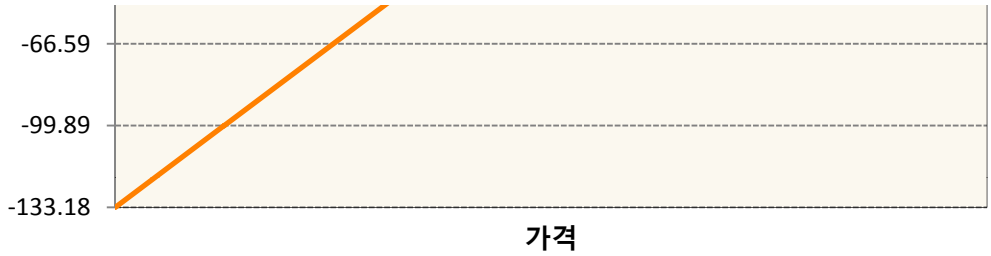
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,790 | 0 | 1,790 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCX7 | H-SHARES IDX FUT NOV17 | 133 |
| MHCX7 | MINI H-SHR IDX FU Nov17 | 11 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **115** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

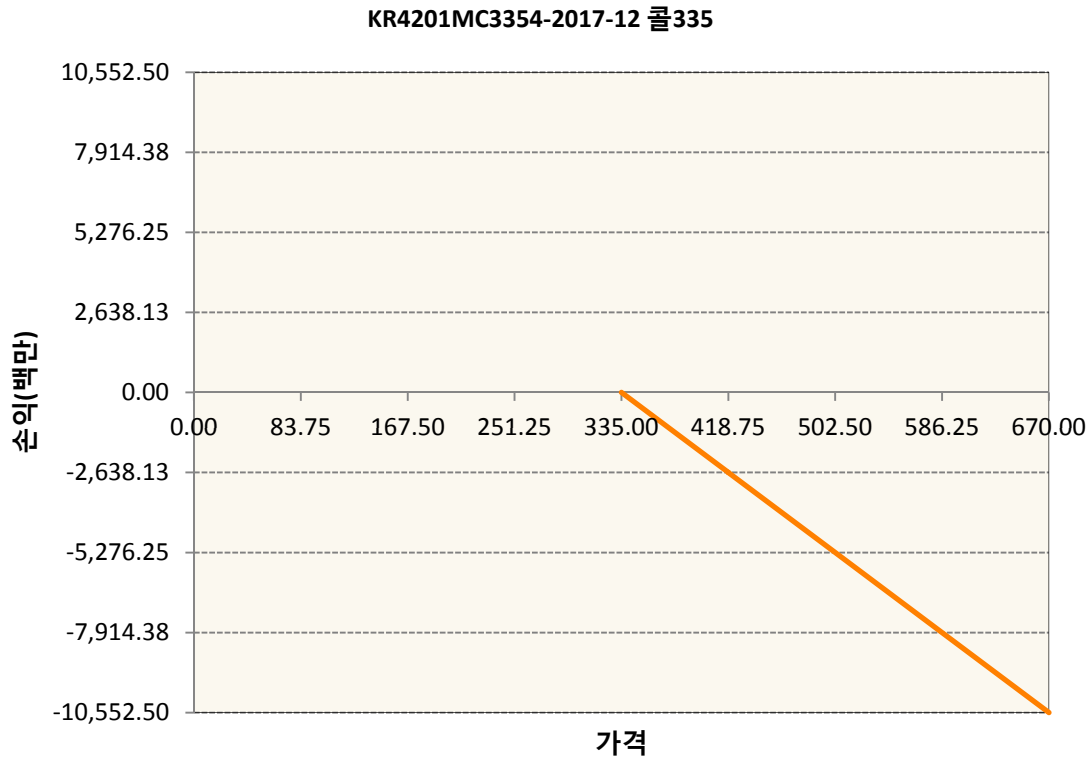
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

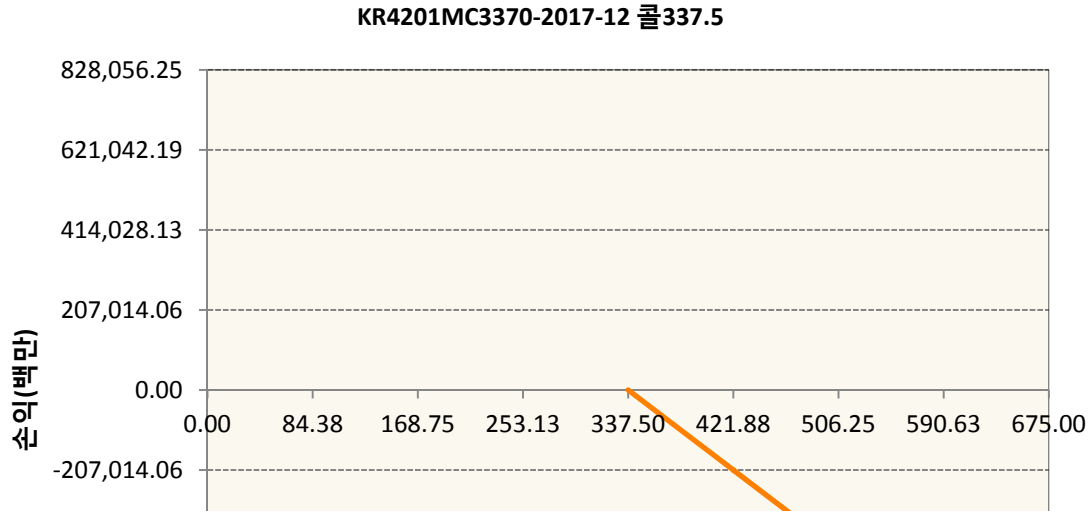
## 1. 계약금액

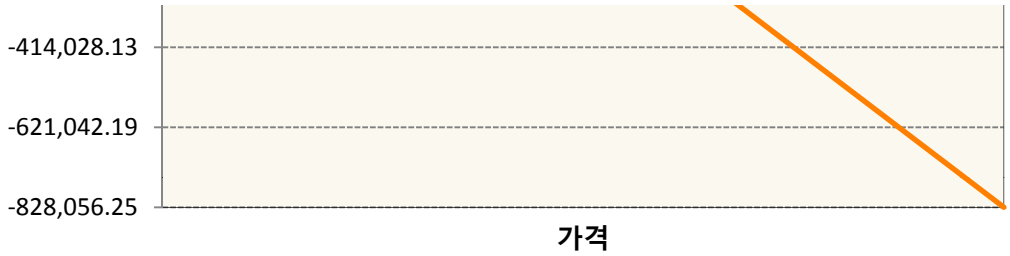
(단위:백만원)

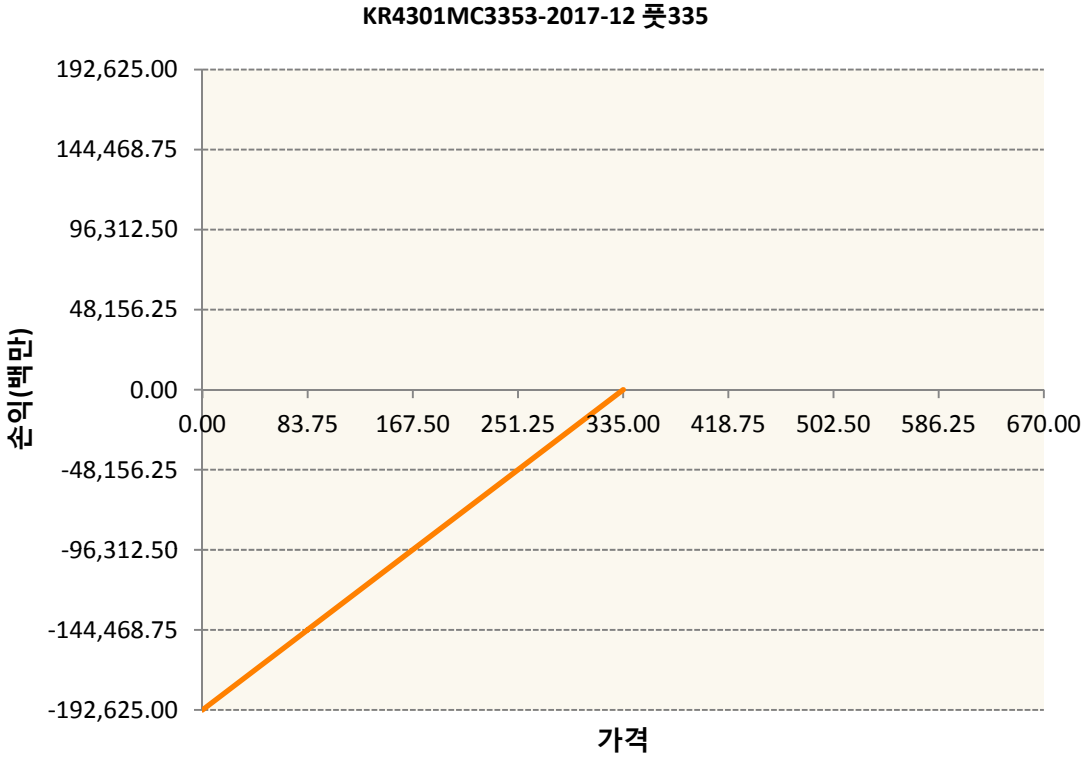
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 1,453,109 | -1,453,109 | 장내 |

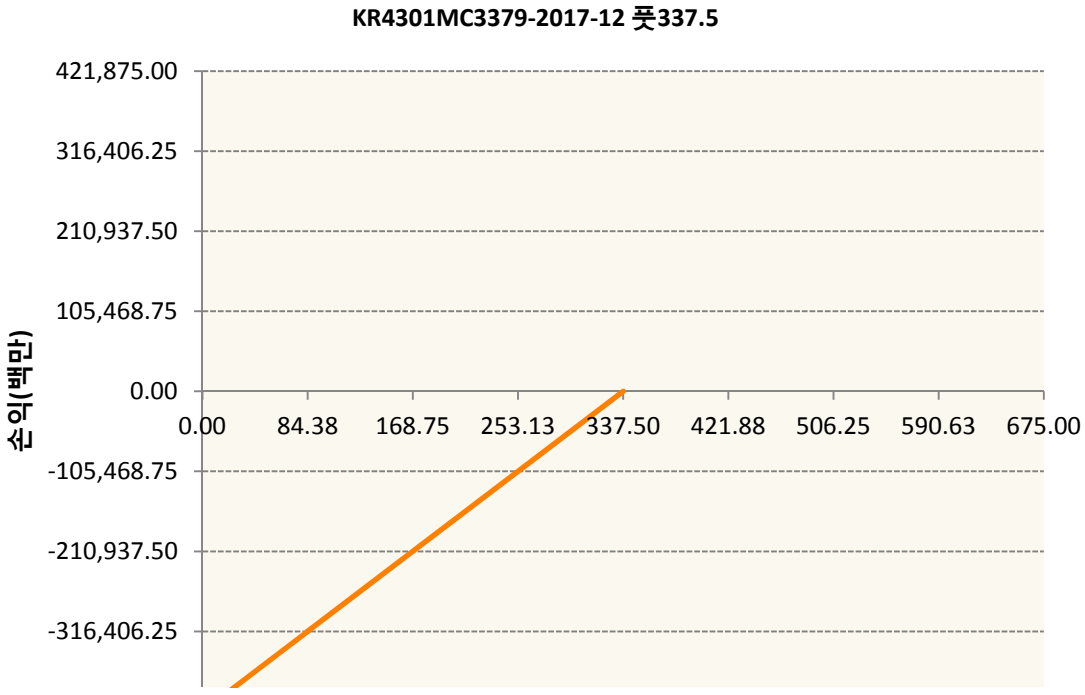
## 2. 만기시점의 손익구조




-414,028.13
-621,042.19
-828,056.25
가격


KR4301MC3353-2017-12 풋335
192,625.00
144,468.75
96,312.50
48,156.25
0.00
-48,156.25
-96,312.50
-144,468.75
-192,625.00
0.00
83.75
167.50
251.25
335.00
418.75
502.50
586.25
670.00
손익(백만)
가격


KR4301MC3379-2017-12 풋337.5
421,875.00
316,406.25
210,937.50
105,468.75
0.00
-105,468.75
-210,937.50
-316,406.25
0.00
84.38
168.75
253.13
337.50
421.88
506.25
590.63
675.00
손익(백만)




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

| KR4201MC3 2017-12 콜335 | | | | | | | 627 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 234 | 229 | 223 | 216 | 207 | 197 | 185 |
| -5.33% | 215 | 205 | 192 | 179 | 164 | 149 | 133 |
| -2.67% | 166 | 148 | 130 | 110 | 91 | 71 | 50 |
| 0% | 67 | 45 | 22 | 0 | -22 | -45 | -67 |
| 2.67% | -92 | -113 | -134 | -156 | -177 | -199 | -221 |
| 5.33% | -304 | -319 | -336 | -353 | -371 | -390 | -410 |
| 8.00% | -552 | -561 | -572 | -584 | -597 | -612 | -627 |
| KR4201MC3 2017-12 콜337.5 | | | | | | | 46,640 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 15,759 | 15,479 | 15,092 | 14,597 | 14,000 | 13,307 | 12,528 |
| -5.33% | 14,697 | 13,996 | 13,172 | 12,242 | 11,220 | 10,121 | 8,954 |
| -2.67% | 11,662 | 10,394 | 9,051 | 7,650 | 6,202 | 4,716 | 3,199 |
| 0% | 5,130 | 3,430 | 1,719 | 0 | -1,725 | -3,455 | -5,188 |
| 2.67% | -5,930 | -7,657 | -9,393 | -11,137 | -12,887 | -14,642 | -16,400 |
| 5.33% | -21,369 | -22,725 | -24,154 | -25,639 | -27,170 | -28,737 | -30,334 |
| 8.00% | -40,034 | -40,875 | -41,842 | -42,918 | -44,086 | -45,330 | -46,640 |
| KR4301MC3 2017-12 풋335 | | | | | | | 13,561 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -13,542 | -13,542 | -13,543 | -13,544 | -13,547 | -13,553 | -13,561 |
| -5.33% | -8,446 | -8,453 | -8,466 | -8,485 | -8,512 | -8,548 | -8,593 |
| -2.67% | -3,474 | -3,544 | -3,629 | -3,725 | -3,832 | -3,948 | -4,071 |
| 0% | 556 | 372 | 186 | 0 | -187 | -374 | -562 |
| 2.67% | 2,470 | 2,337 | 2,195 | 2,045 | 1,890 | 1,730 | 1,565 |
| 5.33% | 2,866 | 2,837 | 2,795 | 2,742 | 2,677 | 2,600 | 2,514 |
| 8.00% | 2,897 | 2,895 | 2,890 | 2,881 | 2,866 | 2,845 | 2,817 |
| KR4301MC3 2017-12 풋337.5 | | | | | | | 30,609 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -30,587 | -30,587 | -30,588 | -30,589 | -30,592 | -30,599 | -30,609 |
| -5.33% | -19,503 | -19,509 | -19,523 | -19,546 | -19,583 | -19,634 | -19,702 |
| -2.67% | -8,543 | -8,637 | -8,761 | -8,912 | -9,088 | -9,286 | -9,504 |
| 0% | 1,089 | 736 | 372 | 0 | -378 | -762 | -1,149 |
| 2.67% | 6,616 | 6,254 | 5,882 | 5,503 | 5,117 | 4,727 | 4,332 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5.33% | 8,108 | 7,996 | 7,853 | 7,682 | 7,485 | 7,265 | 7,025 |
| 8.00% | 8,267 | 8,255 | 8,233 | 8,197 | 8,143 | 8,072 | 7,981 |

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

| |
|---|
| **97,201** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

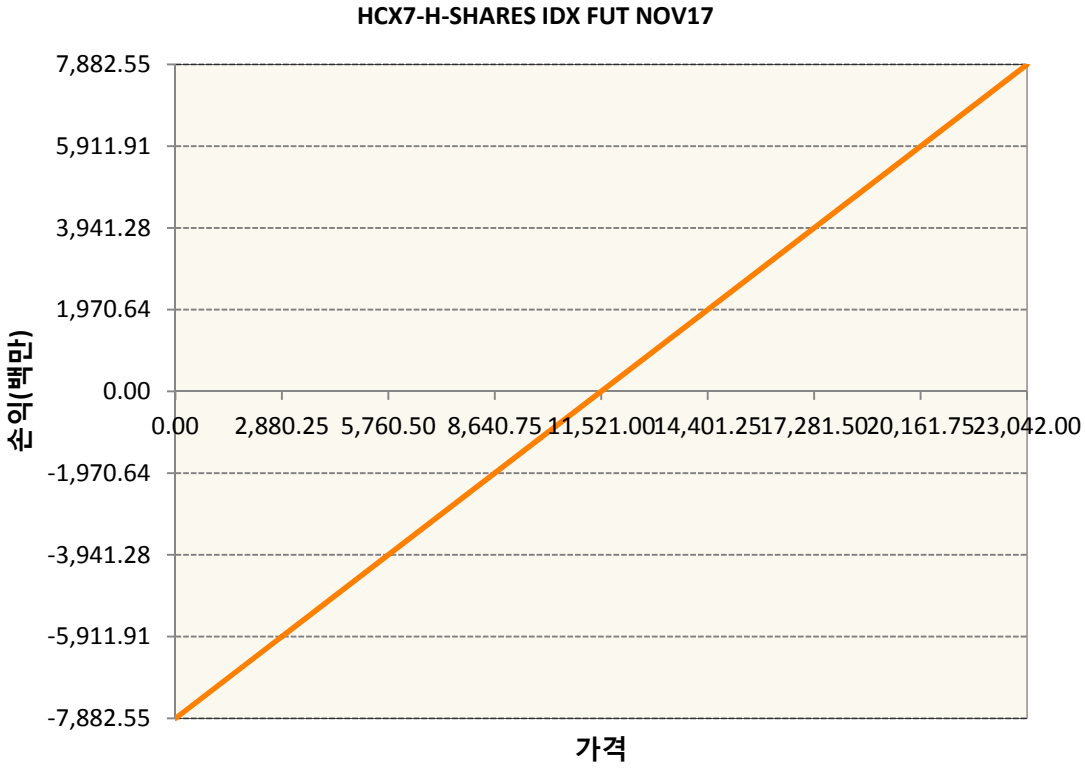
# 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

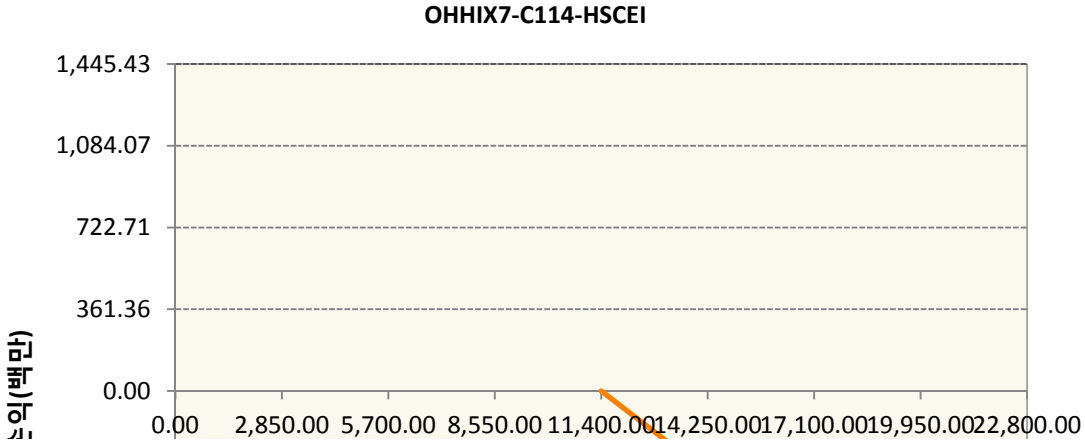
## 1. 계약금액

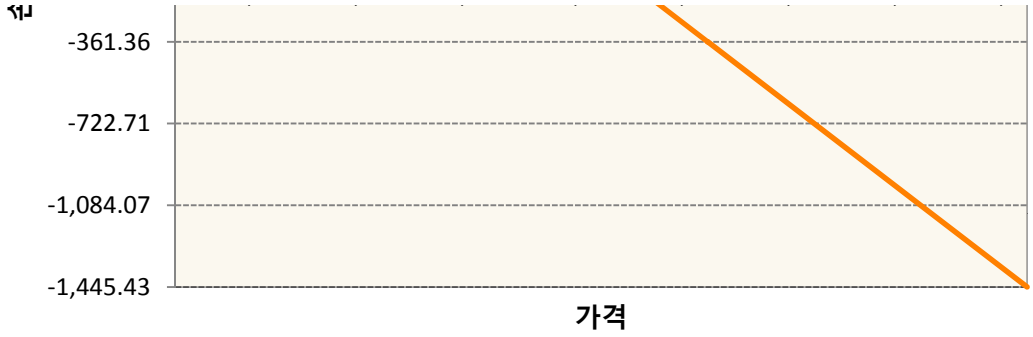
(단위:백만원)

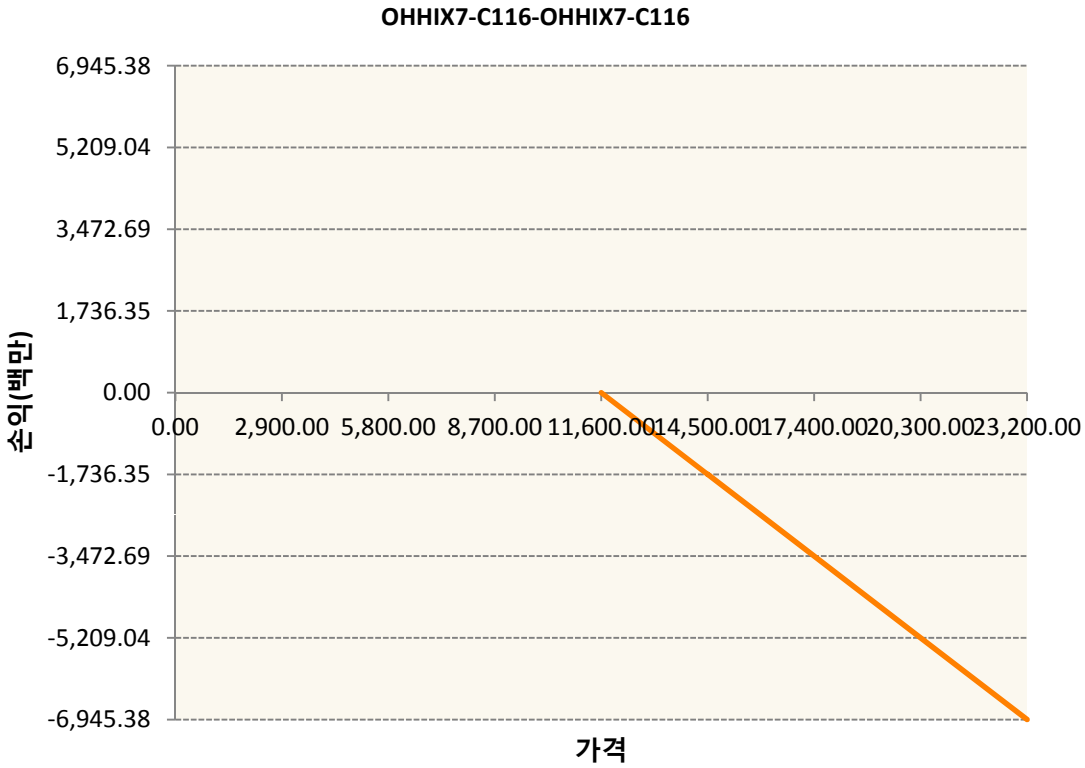
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7,883 | 0 | 7,883 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 16,782 | -16,782 | 장내 |

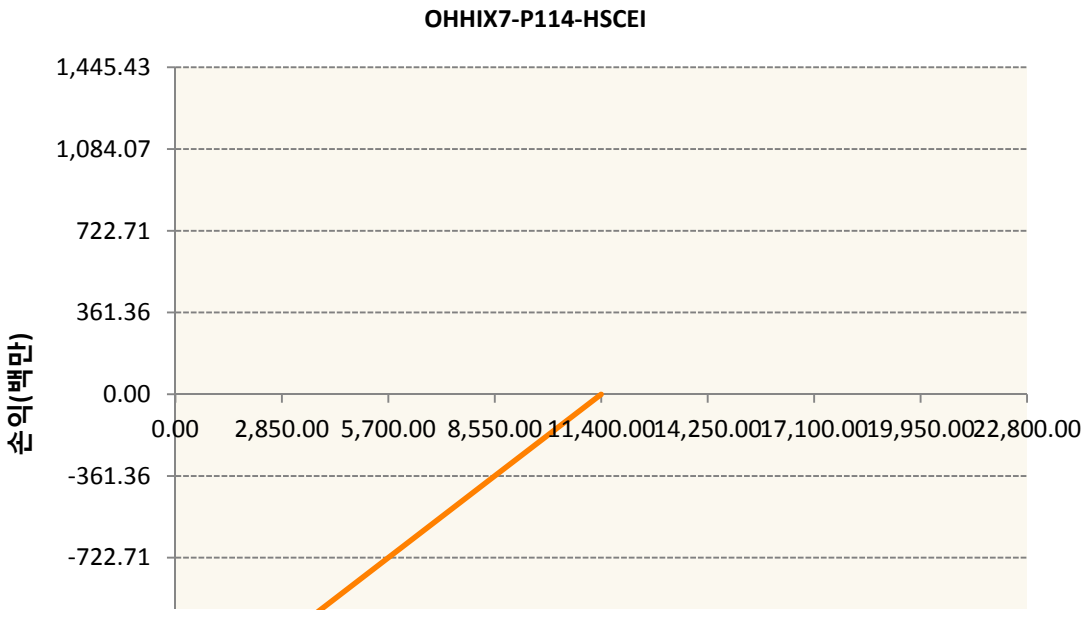
## 2. 만기시점의 손익구조

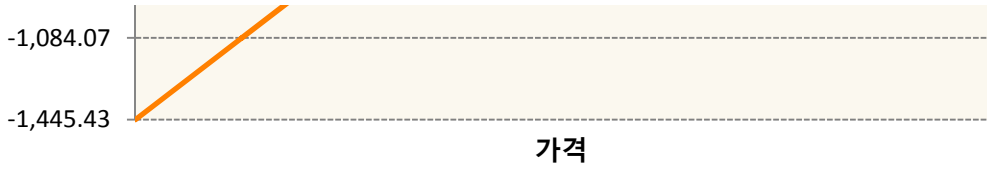


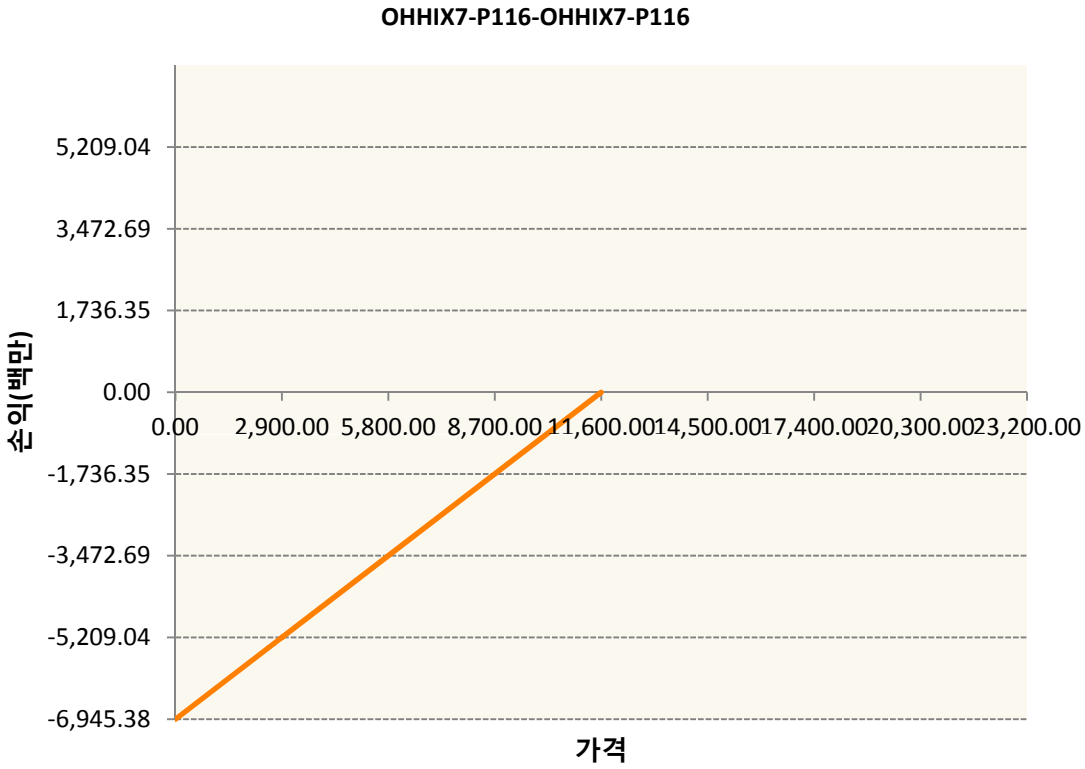




-361.36
-722.71
-1,084.07
-1,445.43
가격


OHHIX7-C116-OHHIX7-C116
6,945.38
5,209.04
3,472.69
1,736.35
0.00
-1,736.35
-3,472.69
-5,209.04
-6,945.38
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)
가격


OHHIX7-P114-HSCEI
1,445.43
1,084.07
722.71
361.36
0.00
-361.36
-722.71
0.00
2,850.00
5,700.00
8,550.00
11,400.00
14,250.00
17,100.00
19,950.00
22,800.00
손익(백만)




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| HCX7 | H-SHARES IDX FUT NOV17 | 631 |
| OHHIX7-C11 | HSCEI | 116 |
| OHHIX7-C11 | OHHIX7-C116 | 556 |
| OHHIX7-P11 | HSCEI | 116 |
| OHHIX7-P11 | OHHIX7-P116 | 556 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | **1,582** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

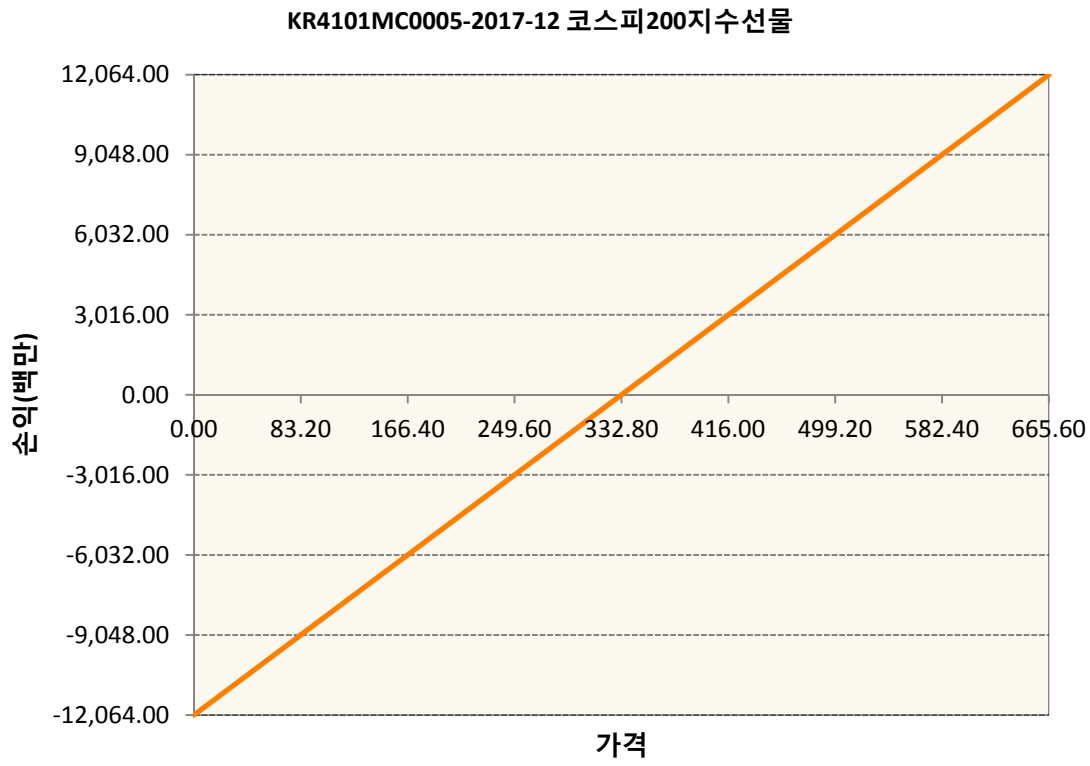
# 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

## 1. 계약금액

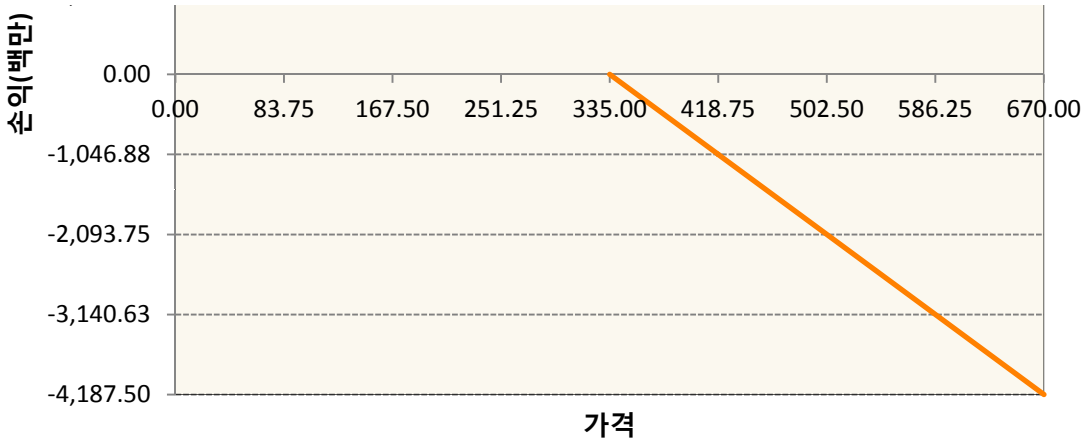
(단위:백만원)

| 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 | 12,064 | 0 | 12,064 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 54,200 | 0 | 54,200 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 52,659 | -52,659 | 장내 |

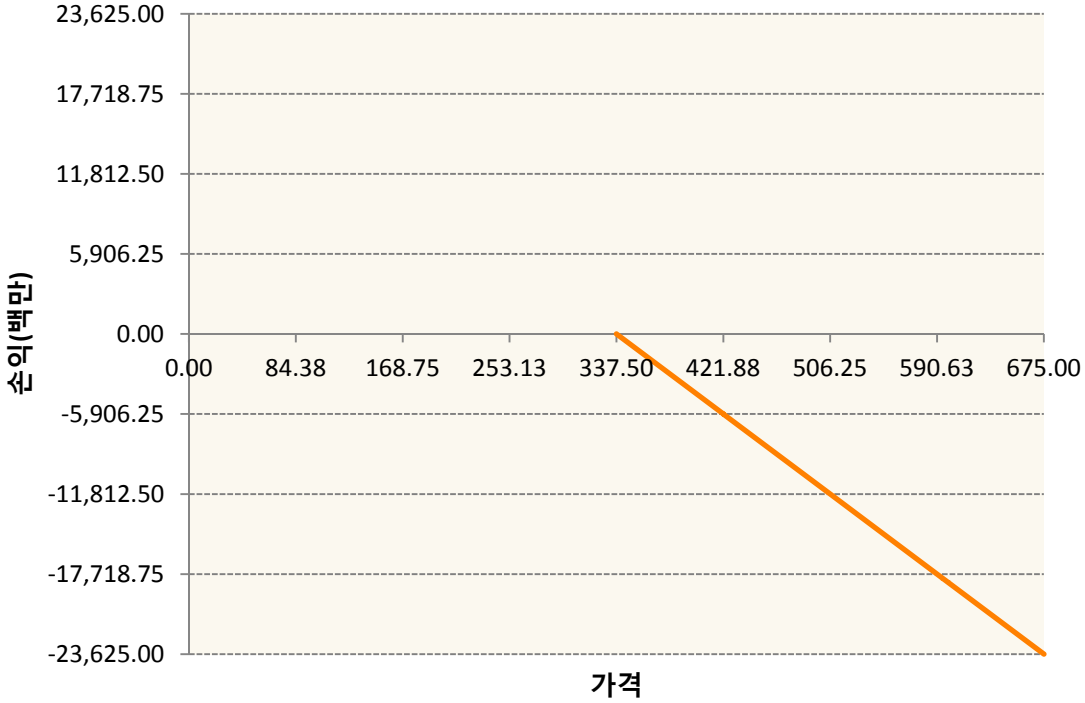
## 2. 만기시점의 손익구조



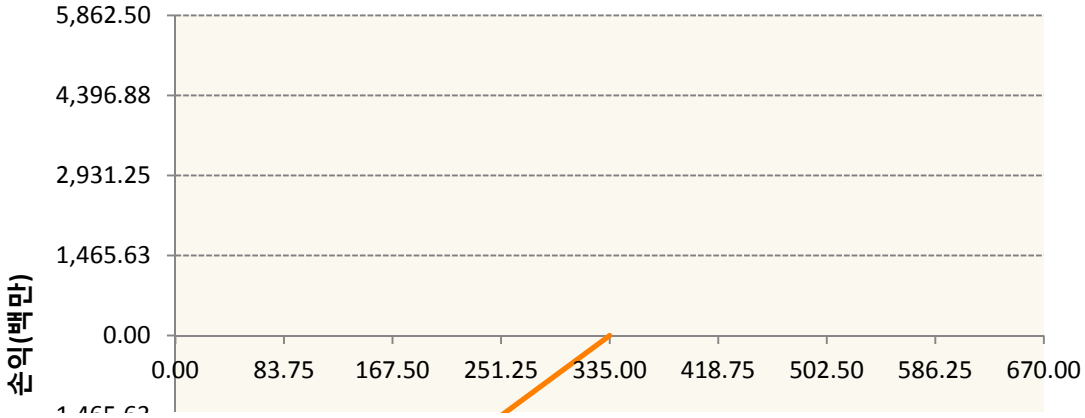


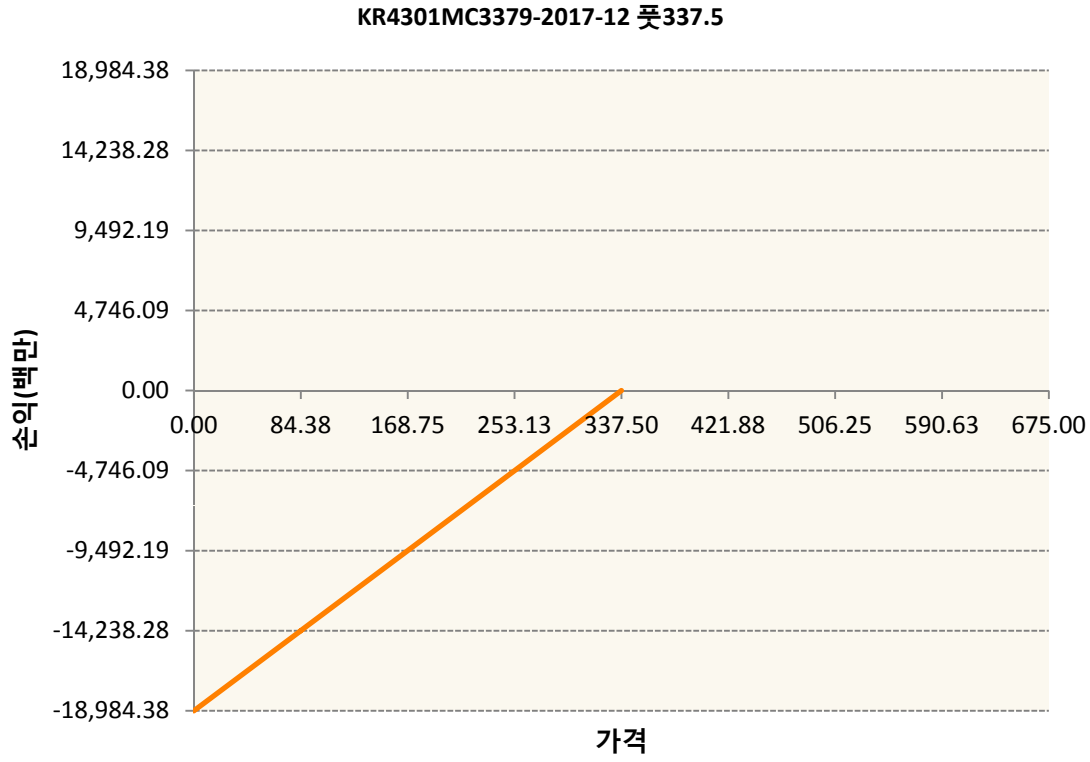

KR4201MC3370-2017-12 콜337.5




KR4301MC3353-2017-12 풋335






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

| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,476 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,476 | -1,476 | -1,476 | -1,476 | -1,476 | -1,476 | -1,476 |
| -5.33% | -984 | -984 | -984 | -984 | -984 | -984 | -984 |
| -2.67% | -492 | -492 | -492 | -492 | -492 | -492 | -492 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 492 | 492 | 492 | 492 | 492 | 492 | 492 |
| 5.33% | 984 | 984 | 984 | 984 | 984 | 984 | 984 |
| 8.00% | 1,476 | 1,476 | 1,476 | 1,476 | 1,476 | 1,476 | 1,476 |
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3 | | | | | | | 279 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -8.00% | -279 | -279 | -279 | -279 | -279 | -279 | -279 |
| -5.33% | -186 | -186 | -186 | -186 | -186 | -186 | -186 |
| -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% | 186 | 186 | 186 | 186 | 186 | 186 | 186 |
| 8.00% | 279 | 279 | 279 | 279 | 279 | 279 | 279 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4 | | | | | | 160 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -160 | -160 | -160 | -160 | -160 | -160 | -160 |
| -5.33% | -106 | -106 | -106 | -106 | -106 | -106 | -106 |
| -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% | 106 | 106 | 106 | 106 | 106 | 106 | 106 |
| 8.00% | 160 | 160 | 160 | 160 | 160 | 160 | 160 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5 | | | | | | 239 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -239 | -239 | -239 | -239 | -239 | -239 | -239 |
| -5.33% | -160 | -160 | -160 | -160 | -160 | -160 | -160 |
| -2.67% | -80 | -80 | -80 | -80 | -80 | -80 | -80 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 |
| 5.33% | 160 | 160 | 160 | 160 | 160 | 160 | 160 |
| 8.00% | 239 | 239 | 239 | 239 | 239 | 239 | 239 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6 | | | | | | 199 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -199 | -199 | -199 | -199 | -199 | -199 | -199 |
| -5.33% | -133 | -133 | -133 | -133 | -133 | -133 | -133 |
| -2.67% | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 |
| 5.33% | 133 | 133 | 133 | 133 | 133 | 133 | 133 |
| 8.00% | 199 | 199 | 199 | 199 | 199 | 199 | 199 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7 | | | | | | 255 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -255 | -255 | -255 | -255 | -255 | -255 | -255 |
| -5.33% | -170 | -170 | -170 | -170 | -170 | -170 | -170 |
| -2.67% | -85 | -85 | -85 | -85 | -85 | -85 | -85 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2.67% | 85 | 85 | 85 | 85 | 85 | 85 | 85 |
| 5.33% | 170 | 170 | 170 | 170 | 170 | 170 | 170 |
| 8.00% | 255 | 255 | 255 | 255 | 255 | 255 | 255 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8 | | | | | | 472 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -472 | -472 | -472 | -472 | -472 | -472 | -472 |
| -5.33% | -315 | -315 | -315 | -315 | -315 | -315 | -315 |
| -2.67% | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 |
| 5.33% | 315 | 315 | 315 | 315 | 315 | 315 | 315 |
| 8.00% | 472 | 472 | 472 | 472 | 472 | 472 | 472 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9 | | | | | | 315 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -315 | -315 | -315 | -315 | -315 | -315 | -315 |
| -5.33% | -210 | -210 | -210 | -210 | -210 | -210 | -210 |
| -2.67% | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 | -105 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 | 105 |
| 5.33% | 210 | 210 | 210 | 210 | 210 | 210 | 210 |
| 8.00% | 315 | 315 | 315 | 315 | 315 | 315 | 315 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10 | | | | | | 279 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -279 | -279 | -279 | -279 | -279 | -279 | -279 |
| -5.33% | -186 | -186 | -186 | -186 | -186 | -186 | -186 |
| -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% | 186 | 186 | 186 | 186 | 186 | 186 | 186 |
| 8.00% | 279 | 279 | 279 | 279 | 279 | 279 | 279 |
| | 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11 | | | | | | 638 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -638 | -638 | -638 | -638 | -638 | -638 | -638 |
| -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% | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 |
| | KR4101MC0 | 2017-12 코스피200지수선물 | | | | | 965 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -965 | -965 | -965 | -965 | -965 | -965 | -965 |
| -5.33% | -644 | -644 | -644 | -644 | -644 | -644 | -644 |
| -2.67% | -322 | -322 | -322 | -322 | -322 | -322 | -322 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 322 | 322 | 322 | 322 | 322 | 322 | 322 |
| 5.33% | 644 | 644 | 644 | 644 | 644 | 644 | 644 |
| 8.00% | 965 | 965 | 965 | 965 | 965 | 965 | 965 |
| | KR4201MC3. 2017-12 콜335 | | | | | | 249 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 93 | 91 | 89 | 86 | 82 | 78 | 74 |
| -5.33% | 85 | 81 | 76 | 71 | 65 | 59 | 53 |
| -2.67% | 66 | 59 | 51 | 44 | 36 | 28 | 20 |
| 0% | 27 | 18 | 9 | 0 | -9 | -18 | -27 |
| 2.67% | -36 | -45 | -53 | -62 | -70 | -79 | -88 |
| 5.33% | -121 | -127 | -133 | -140 | -147 | -155 | -163 |
| 8.00% | -219 | -223 | -227 | -232 | -237 | -243 | -249 |
| | KR4201MC3. 2017-12 콜337.5 | | | | | | 1,331 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 450 | 442 | 431 | 416 | 399 | 380 | 357 |
| -5.33% | 419 | 399 | 376 | 349 | 320 | 289 | 255 |
| -2.67% | 333 | 297 | 258 | 218 | 177 | 135 | 91 |
| 0% | 146 | 98 | 49 | 0 | -49 | -99 | -148 |
| 2.67% | -169 | -218 | -268 | -318 | -368 | -418 | -468 |
| 5.33% | -610 | -648 | -689 | -732 | -775 | -820 | -865 |
| 8.00% | -1,142 | -1,166 | -1,194 | -1,224 | -1,258 | -1,293 | -1,331 |
| | KR4301MC3. 2017-12 풋335 | | | | | | 413 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -412 | -412 | -412 | -412 | -412 | -412 | -413 |
| -5.33% | -257 | -257 | -258 | -258 | -259 | -260 | -262 |
| -2.67% | -106 | -108 | -110 | -113 | -117 | -120 | -124 |
| 0% | 17 | 11 | 6 | 0 | -6 | -11 | -17 |
| 2.67% | 75 | 71 | 67 | 62 | 58 | 53 | 48 |
| 5.33% | 87 | 86 | 85 | 83 | 81 | 79 | 77 |
| 8.00% | 88 | 88 | 88 | 88 | 87 | 87 | 86 |
| | KR4301MC3. 2017-12 풋337.5 | | | | | | 1,377 |

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,376 | -1,376 | -1,376 | -1,377 | -1,377 | -1,377 | -1,377 |
| -5.33% | -878 | -878 | -879 | -880 | -881 | -884 | -887 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| -2.67% | -384 | -389 | -394 | -401 | -409 | -418 | -428 |
| 0% | 49 | 33 | 17 | 0 | -17 | -34 | -52 |
| 2.67% | 298 | 281 | 265 | 248 | 230 | 213 | 195 |
| 5.33% | 365 | 360 | 353 | 346 | 337 | 327 | 316 |
| 8.00% | 372 | 371 | 370 | 369 | 366 | 363 | 359 |

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

| |
|---|
| **8,492** |

| 공시일 | 2017-11-21 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-11-20 |

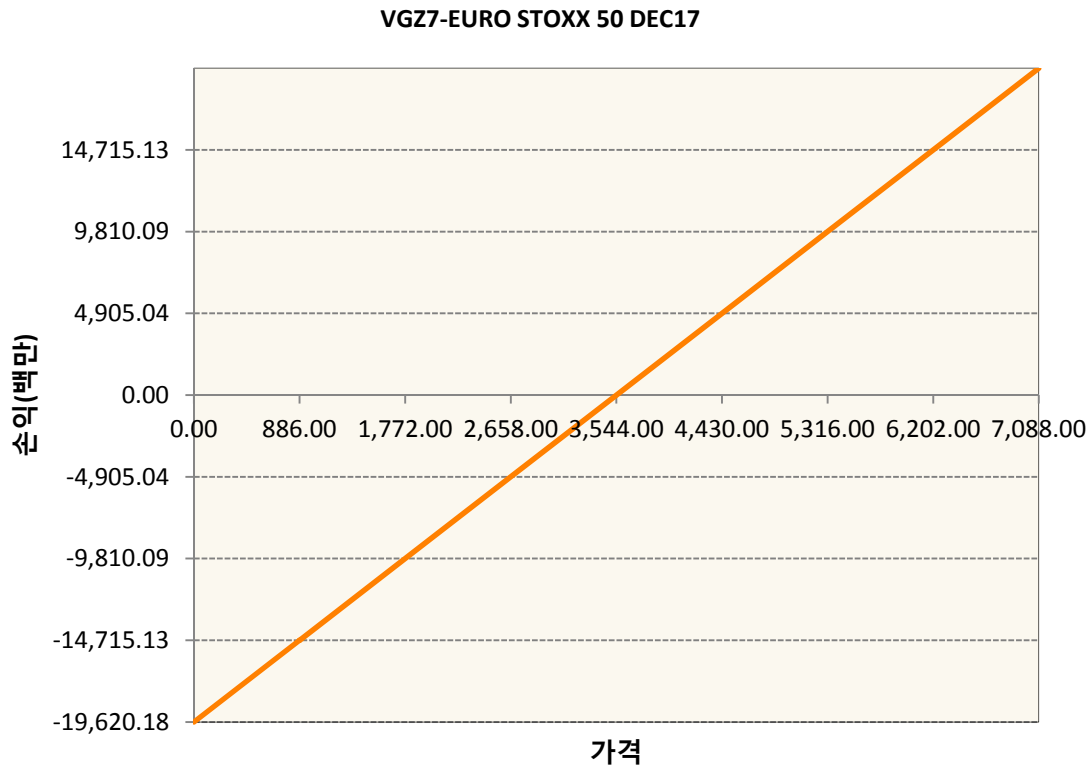
# 유로커버드콜모(주식혼합-파생형

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 2 | -2 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 지수 | 스왑 | 40 | 0 | 40 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 19,620 | 0 | 19,620 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 96,953 | 0 | 96,953 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 51,709 | 0 | 51,709 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| 260105SGPX | SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569 | 0 |
| 260105SQPX | SG EURO Covered CALL STRATEGY | 43 |
| VGZ7 | EURO STOXX 50 DEC17 | 1,570 |

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

| |
|---|
| **974** |

| 공시일 | 2017-11-21 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-11-20 |

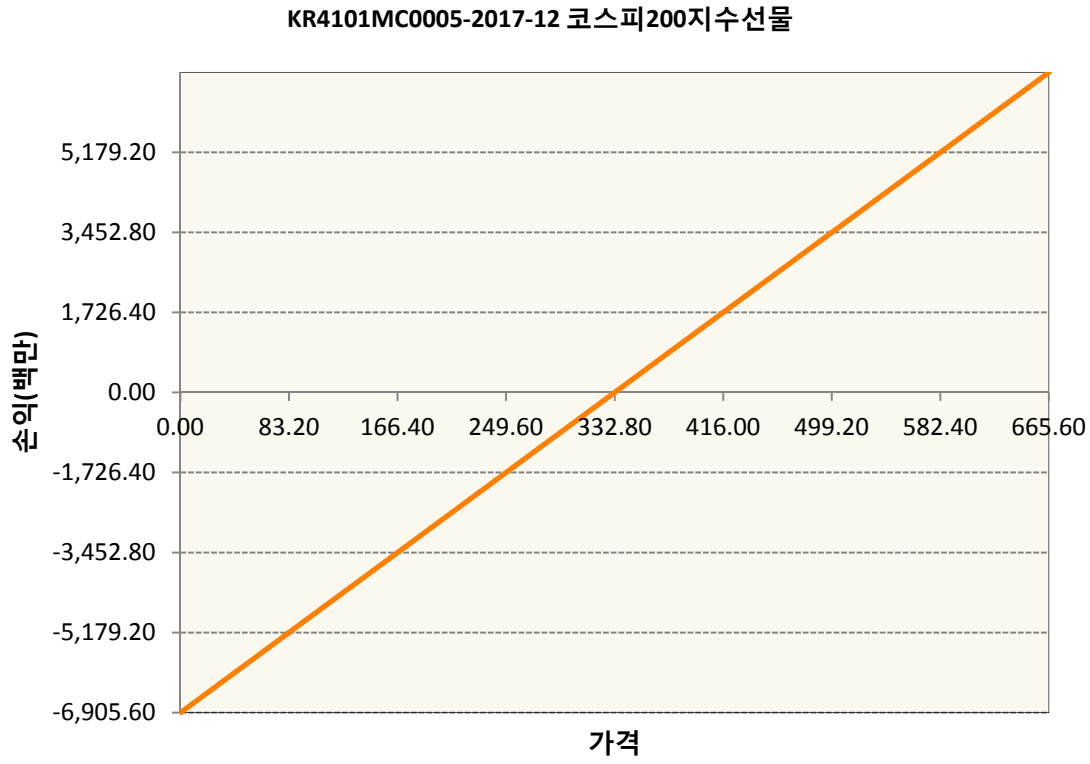
# ETF스마트레버리지목표전환형8호

## 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 | 6,906 | 0 | 6,906 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101MC0 | 2017-12 코스피200지수선물 | | | | | | 553 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -553 | -553 | -553 | -553 | -553 | -553 | -553 |
| -5.33% | -368 | -368 | -368 | -368 | -368 | -368 | -368 |
| -2.67% | -184 | -184 | -184 | -184 | -184 | -184 | -184 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 184 | 184 | 184 | 184 | 184 | 184 | 184 |
| 5.33% | 368 | 368 | 368 | 368 | 368 | 368 | 368 |
| 8.00% | 553 | 553 | 553 | 553 | 553 | 553 | 553 |

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

| |
|---|
| **314** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

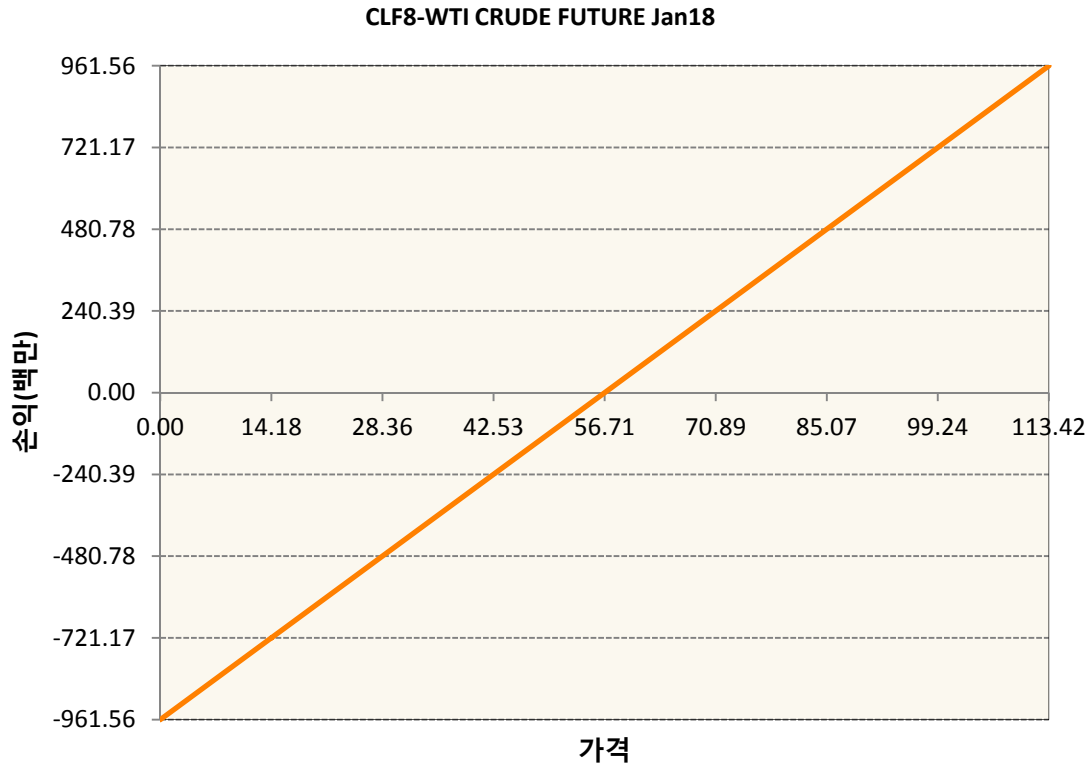
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

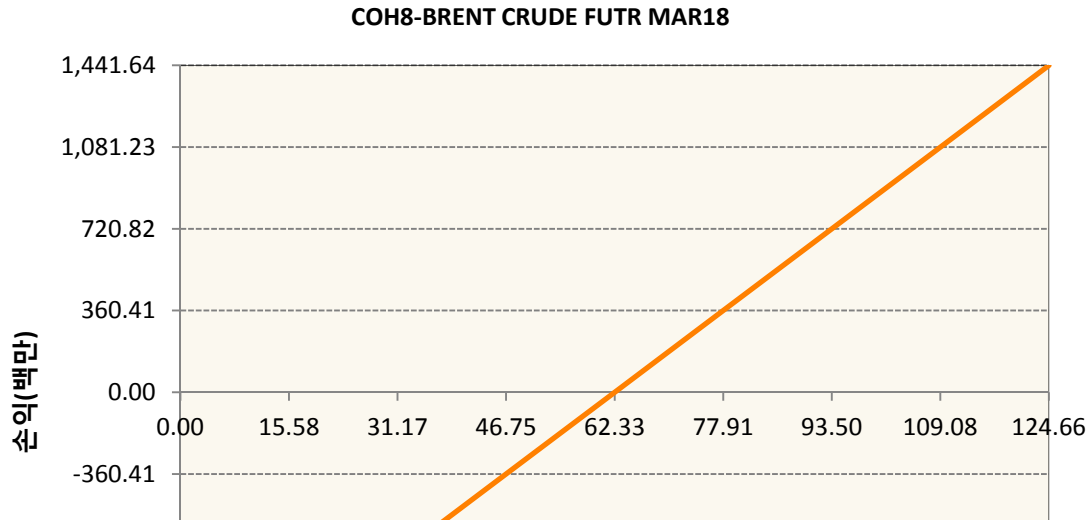
## 1. 계약금액

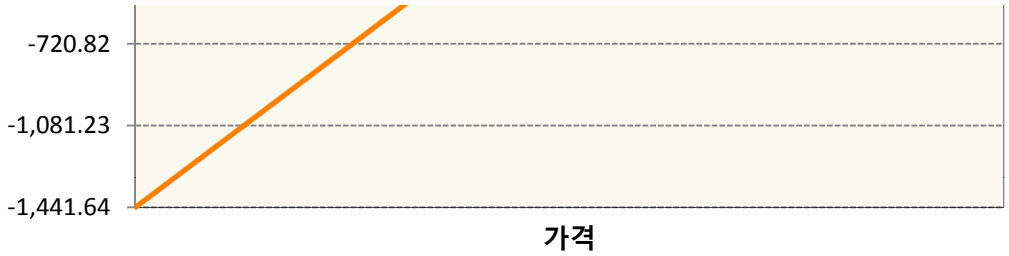
(단위:백만원)

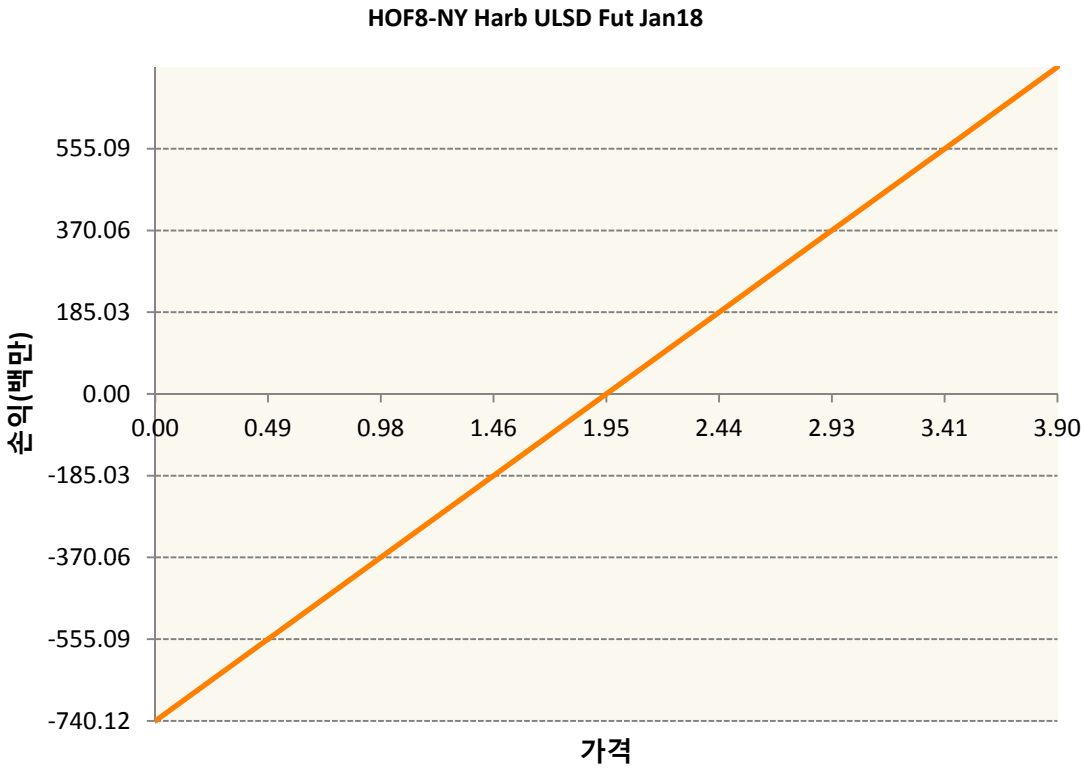
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,226 | 881 | 4,346 | |

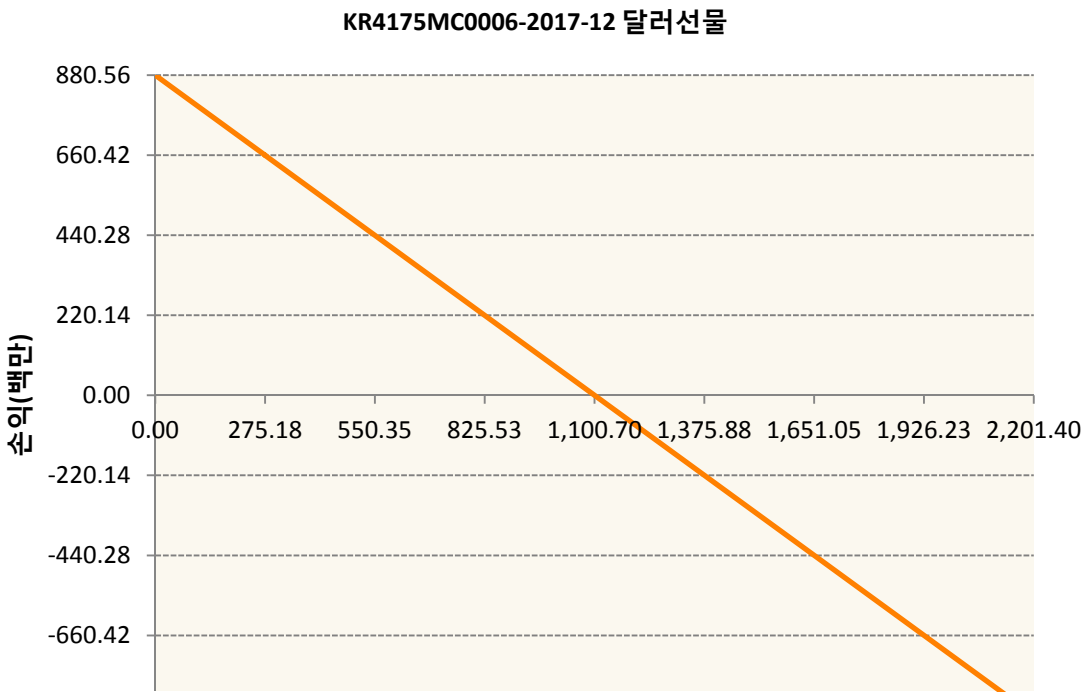
## 2. 만기시점의 손익구조

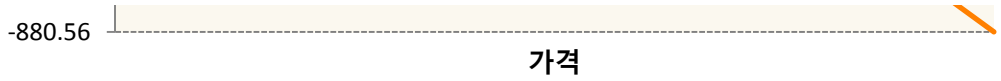


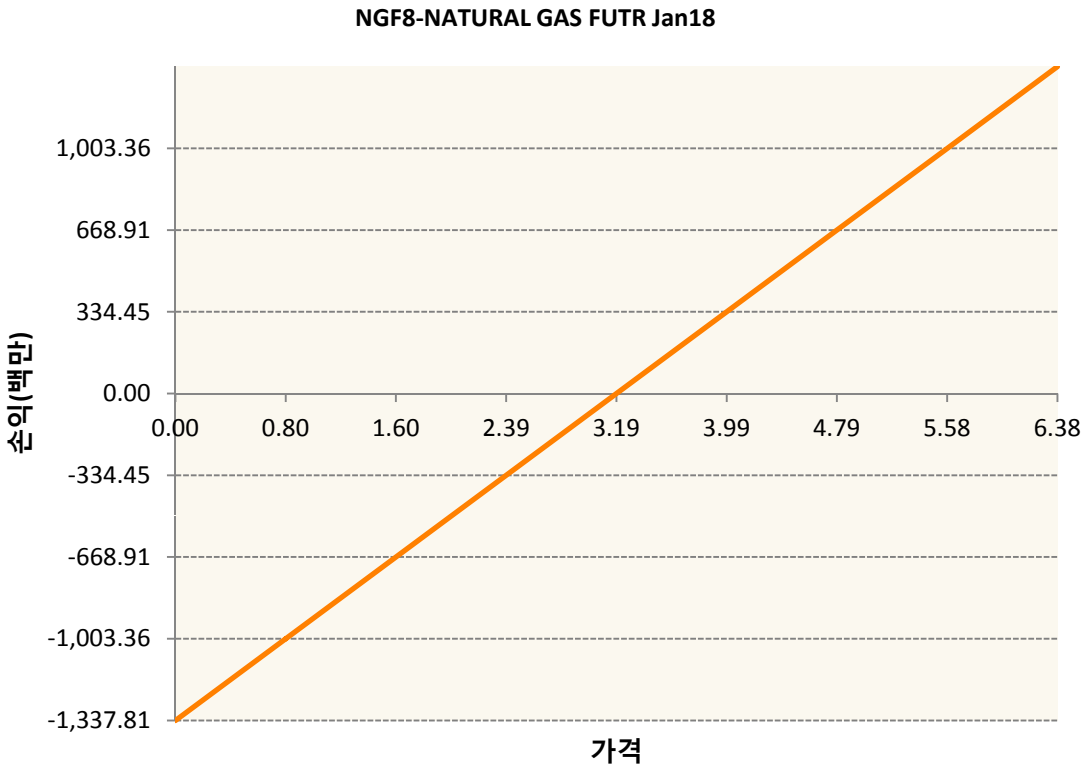



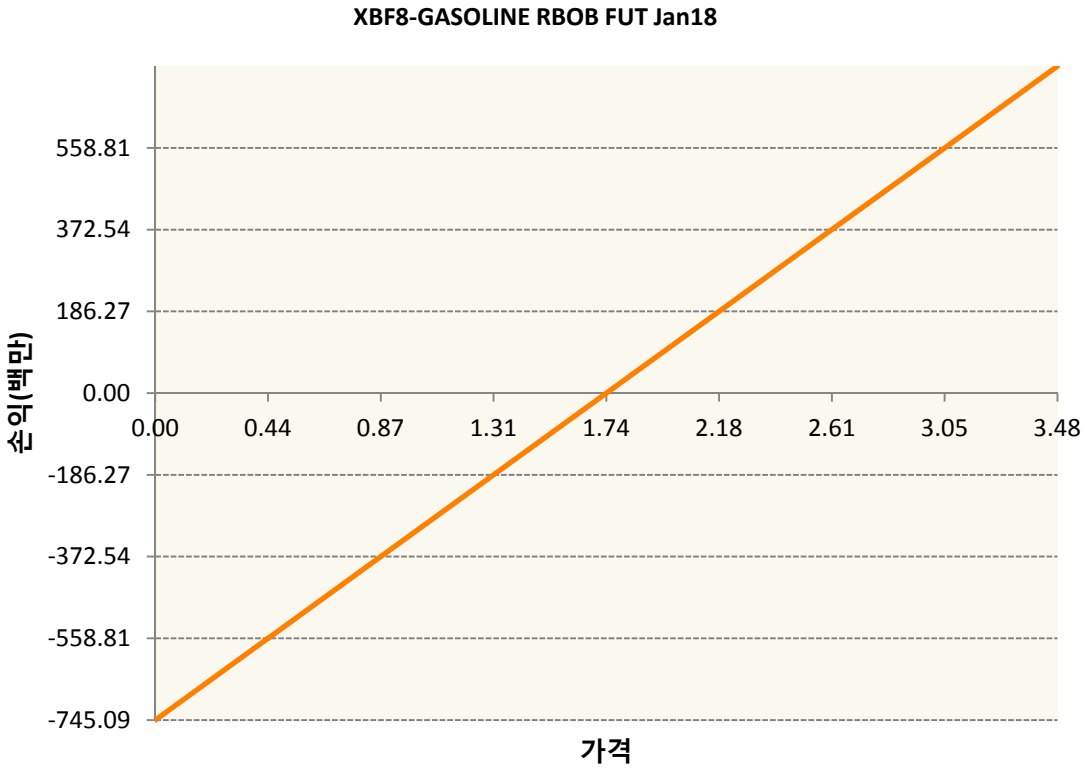

-720.82
-1,081.23
-1,441.64
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
555.09
370.06
185.03
0.00
-185.03
-370.06
-555.09
-740.12
0.00
0.49
0.98
1.46
1.95
2.44
2.93
3.41
3.90
손익(백만)
가격


KR4175MC0006-2017-12 달러선물
880.56
660.42
440.28
220.14
0.00
-220.14
-440.28
-660.42
0.00
275.18
550.35
825.53
1,100.70
1,375.88
1,651.05
1,926.23
2,201.40
손익(백만)


-880.56
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
손익(백만)
1,003.36
668.91
334.45
0.00
-334.45
-668.91
-1,003.36
-1,337.81
0.00
0.80
1.60
2.39
3.19
3.99
4.79
5.58
6.38
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
손익(백만)
558.81
372.54
186.27
0.00
-186.27
-372.54
-558.81
-745.09
0.00
0.44
0.87
1.31
1.74
2.18
2.61
3.05
3.48
가격

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

| | | |
|---|---|---|
| CLF8 | WTI CRUDE FUTURE Jan18 | 77 |
| COH8 | BRENT CRUDE FUTR MAR18 | 115 |
| HOF8 | NY Harb ULSD Fut Jan18 | 59 |
| KR4175MC0( | 2017-12 달러선물 | 70 |
| NGF8 | NATURAL GAS FUTR Jan18 | 107 |
| XBF8 | GASOLINE RBOB FUT Jan18 | 60 |

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

| |
|---|
| **732** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-11-21 |
| 기준일 | 2017-11-20 |

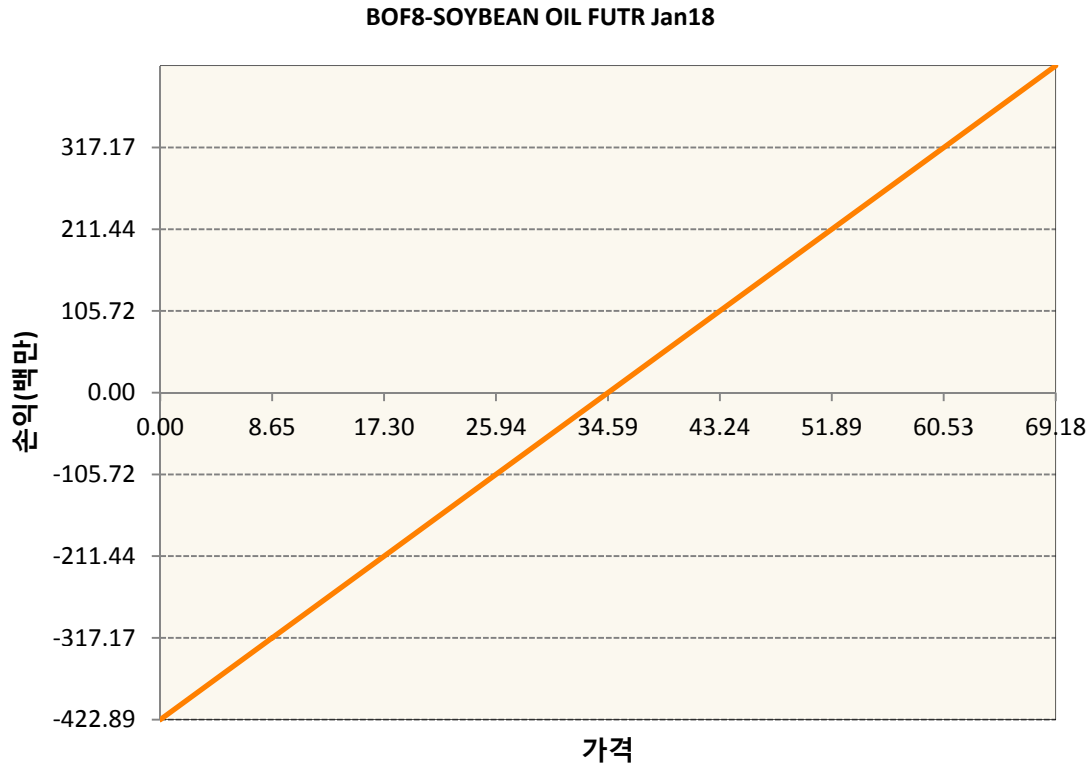
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

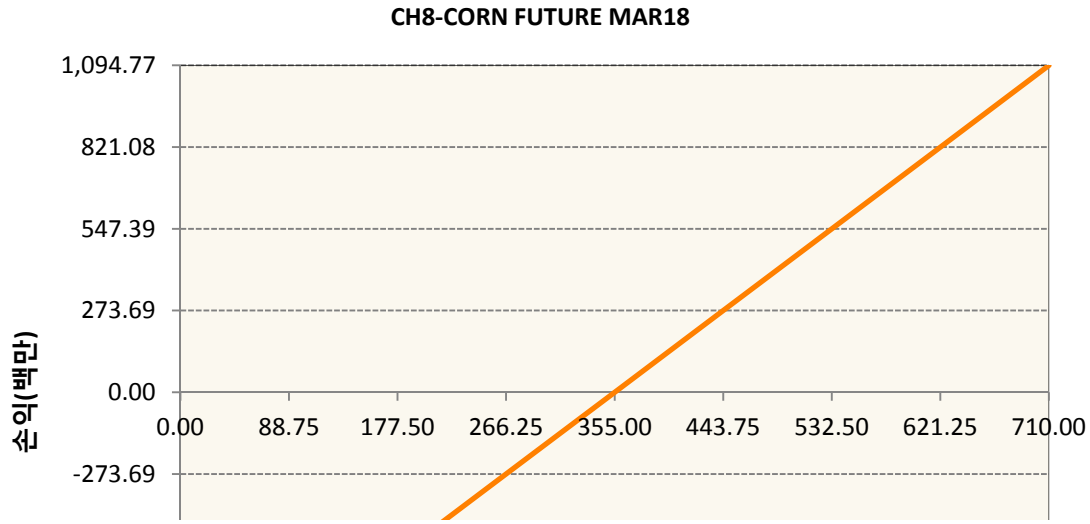
## 1. 계약금액

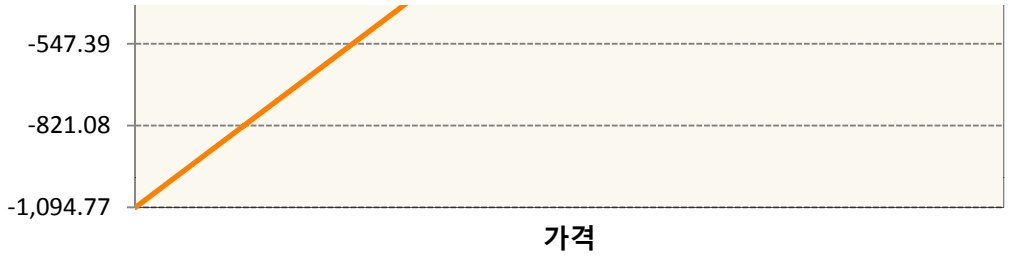
(단위:백만원)

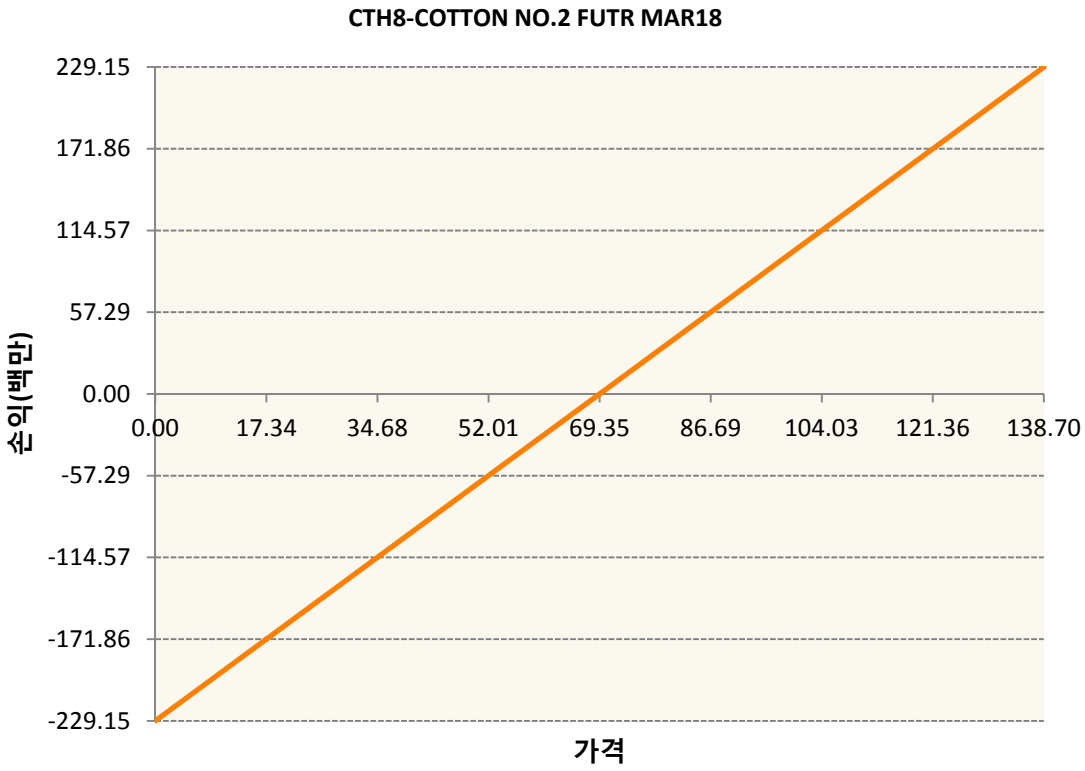
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,550 | 330 | 4,220 | |

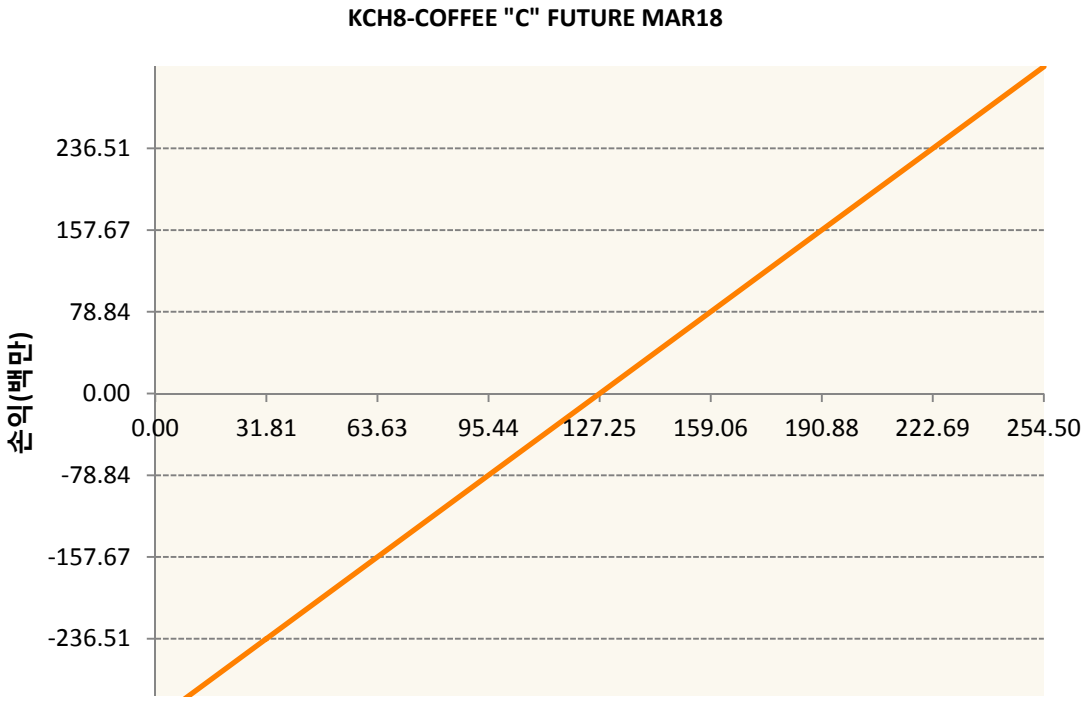
## 2. 만기시점의 손익구조

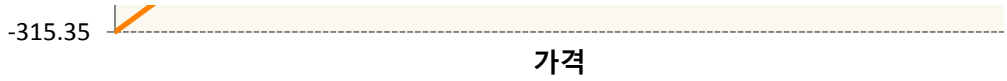


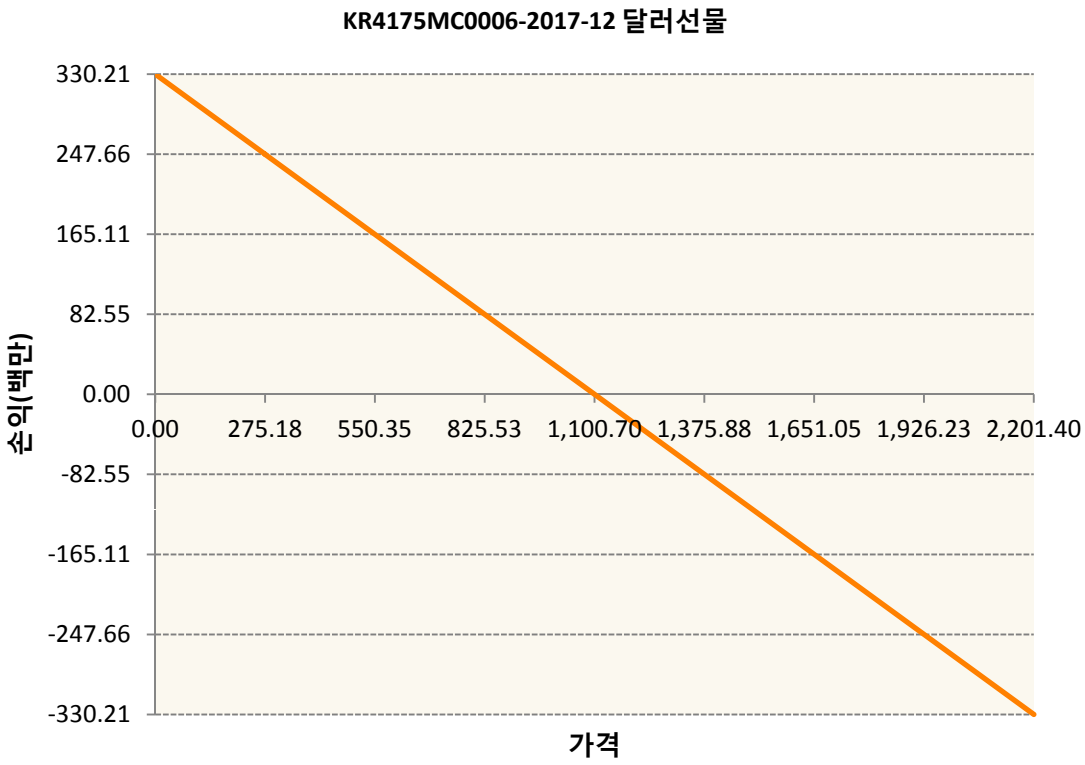



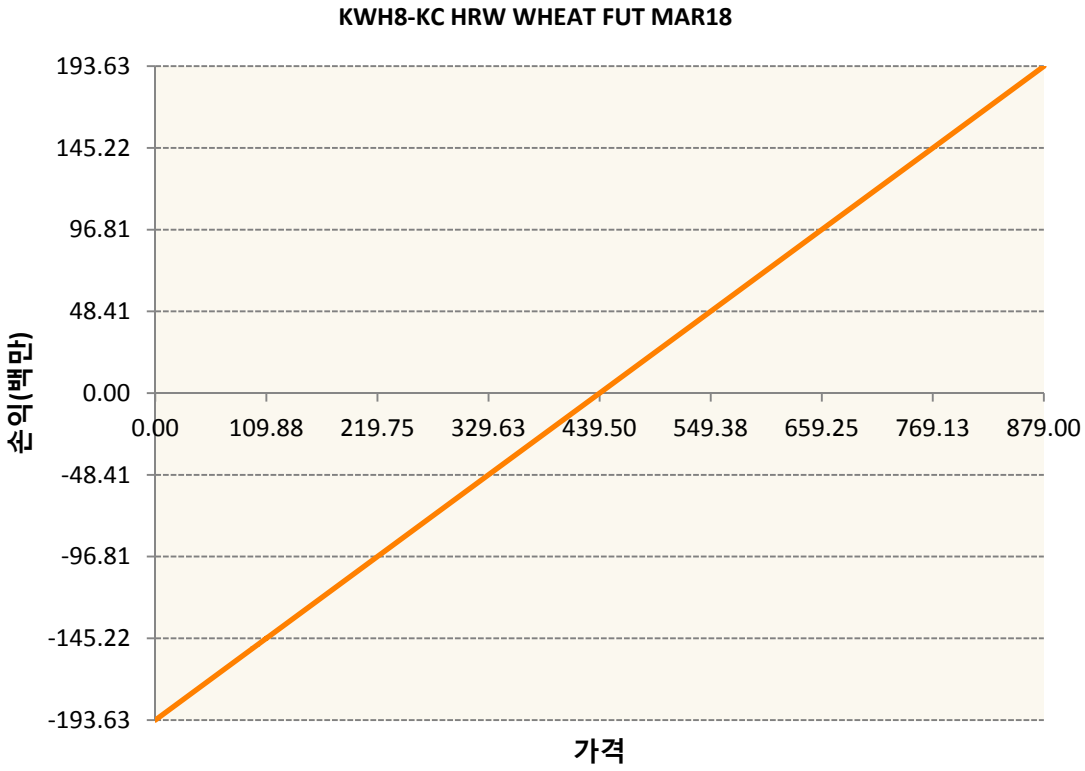

-547.39
-821.08
-1,094.77
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
229.15
171.86
114.57
57.29
0.00
-57.29
-114.57
-171.86
-229.15
0.00
17.34
34.68
52.01
69.35
86.69
104.03
121.36
138.70
손익(백만)
가격

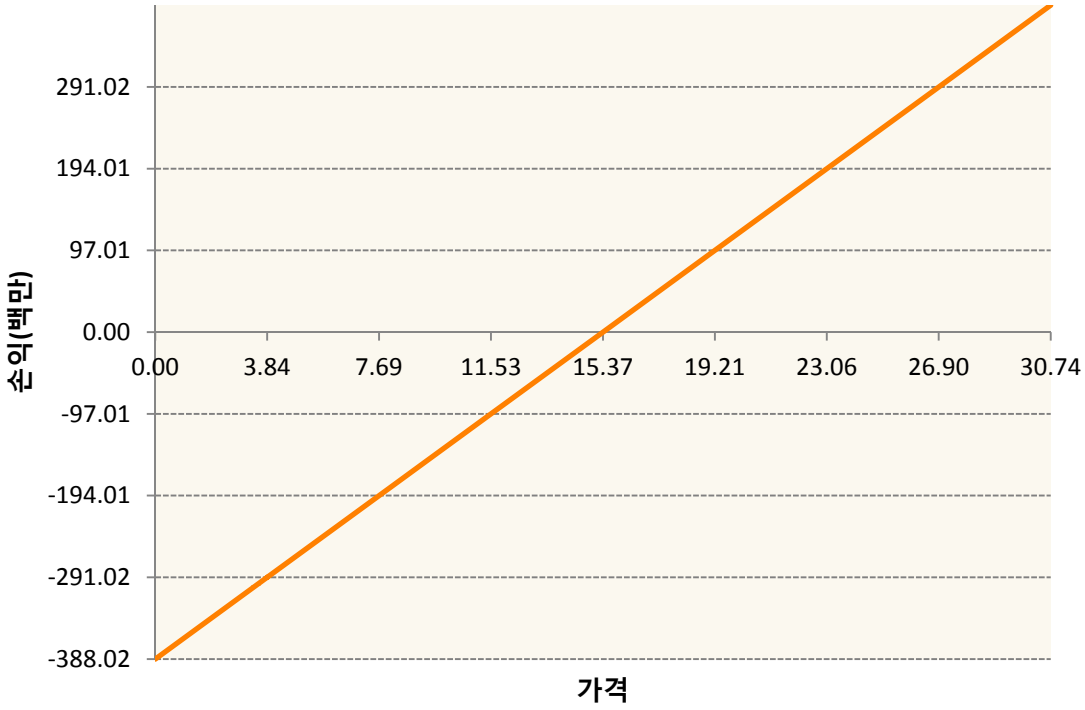

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
236.51
157.67
78.84
0.00
-78.84
-157.67
-236.51
0.00
31.81
63.63
95.44
127.25
159.06
190.88
222.69
254.50
손익(백만)


-315.35
가격

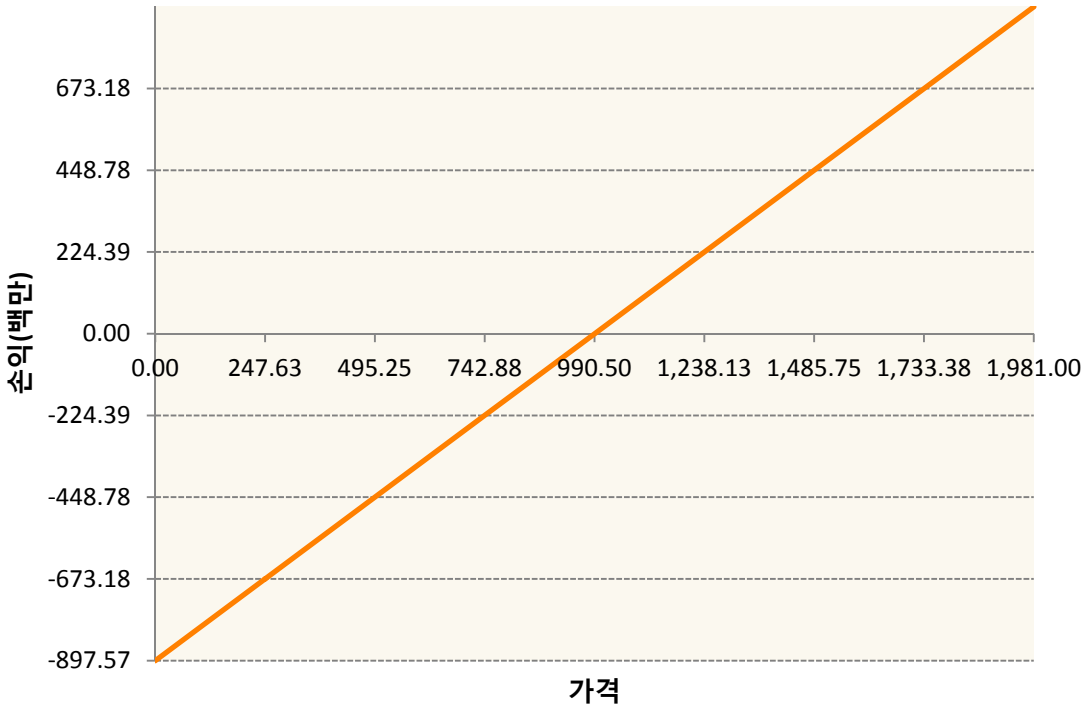

KR4175MC0006-2017-12 달러선물
330.21
247.66
165.11
82.55
0.00
-82.55
-165.11
-247.66
-330.21
0.00
275.18
550.35
825.53
1,100.70
1,375.88
1,651.05
1,926.23
2,201.40
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
193.63
145.22
96.81
48.41
0.00
-48.41
-96.81
-145.22
-193.63
0.00
109.88
219.75
329.63
439.50
549.38
659.25
769.13
879.00
손익(백만)
가격

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18

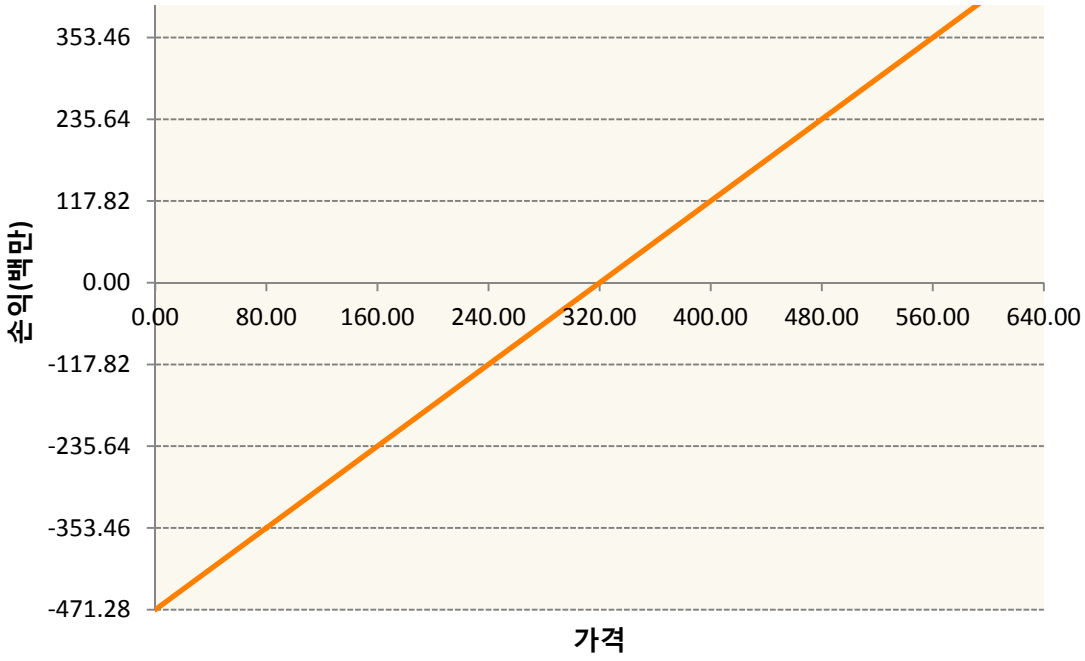



SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18

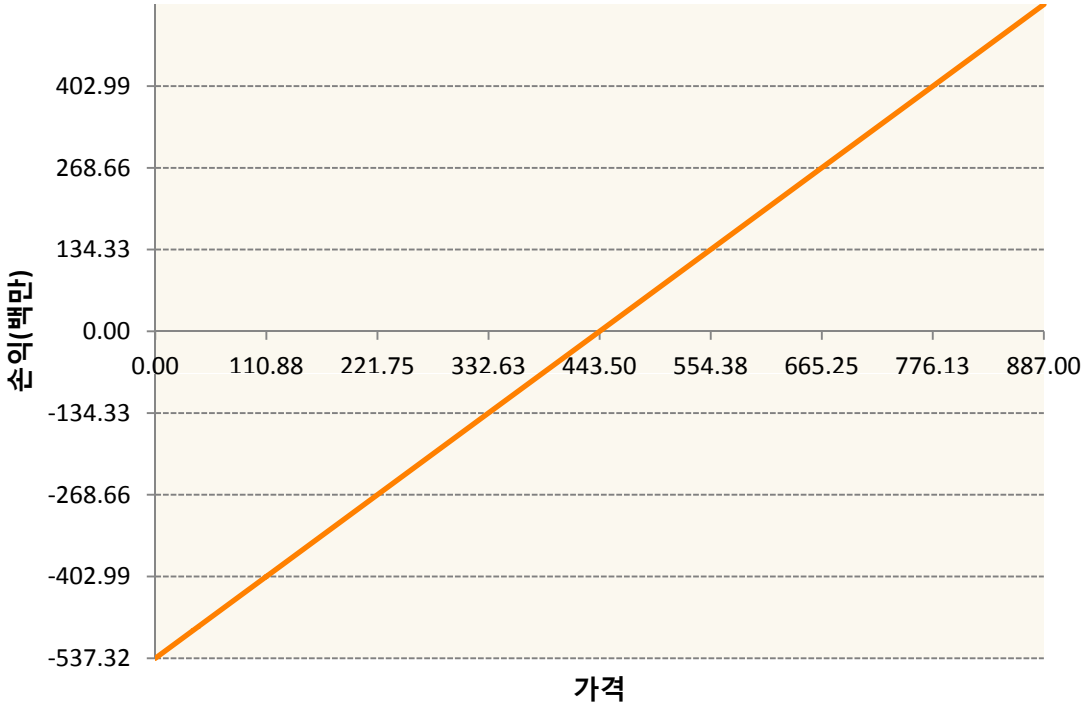



SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18






WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18




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

| | | |
|---|---|---|
| BOF8 | SOYBEAN OIL FUTR Jan18 | 34 |
| CH8 | CORN FUTURE MAR18 | 88 |
| CTH8 | COTTON NO.2 FUTR MAR18 | 18 |
| KCH8 | COFFEE "C" FUTURE MAR18 | 25 |
| KR4175MC0( | 2017-12 달러선물 | 26 |

| | | |
|---|---|---|
| KWH8 | KC HRW WHEAT FUT MAR18 | 15 |
| SBH8 | Sugar #11 (WORLD) MAR18 | 31 |
| SF8 | SOYBEAN FUTURE Jan18 | 72 |
| SMF8 | SOYBEAN MEAL FUTR Jan18 | 38 |
| WH8 | WHEAT FUTURE(CBT) MAR18 | 43 |

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

| |
|---|
| **407** |