공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8	0	8	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

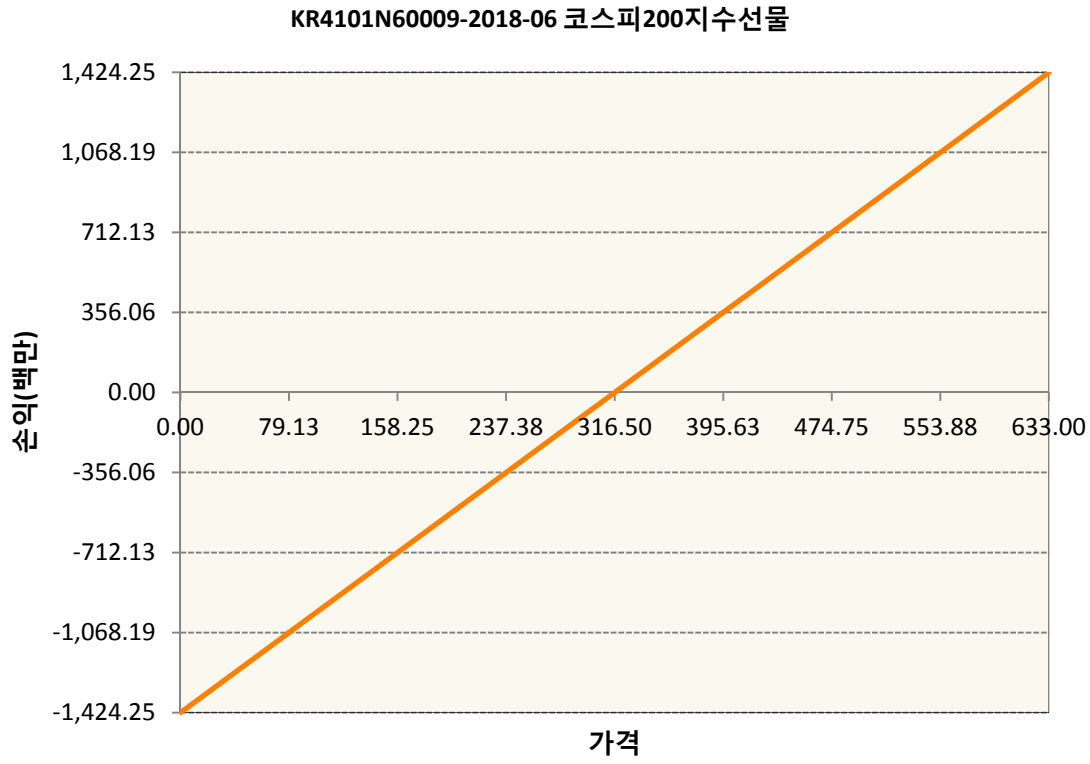
스마트인덱스모

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	1,424	0	1,424	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							114
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	114	114	114	114	114	114	114

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

83

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,869	0	13,869	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222	1,104

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

451

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

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	5,081	0	5,081	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180308	400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

434

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

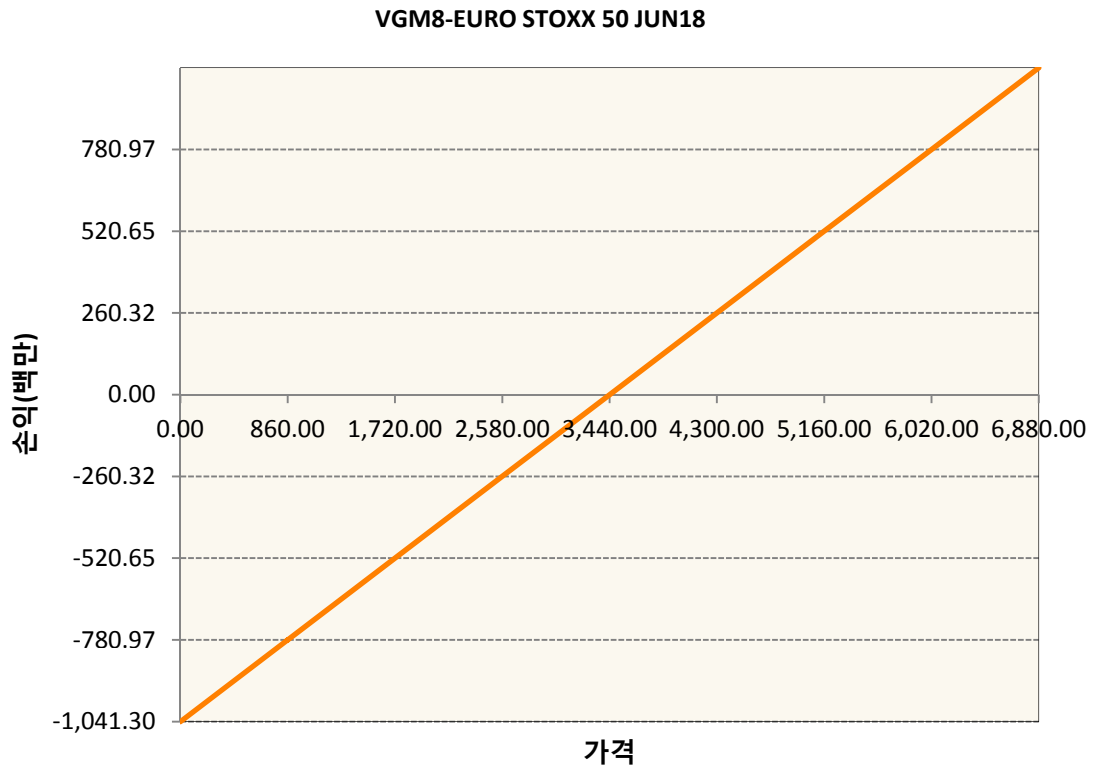
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,041	0	1,041	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	83

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

(단위:백만원)

51

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

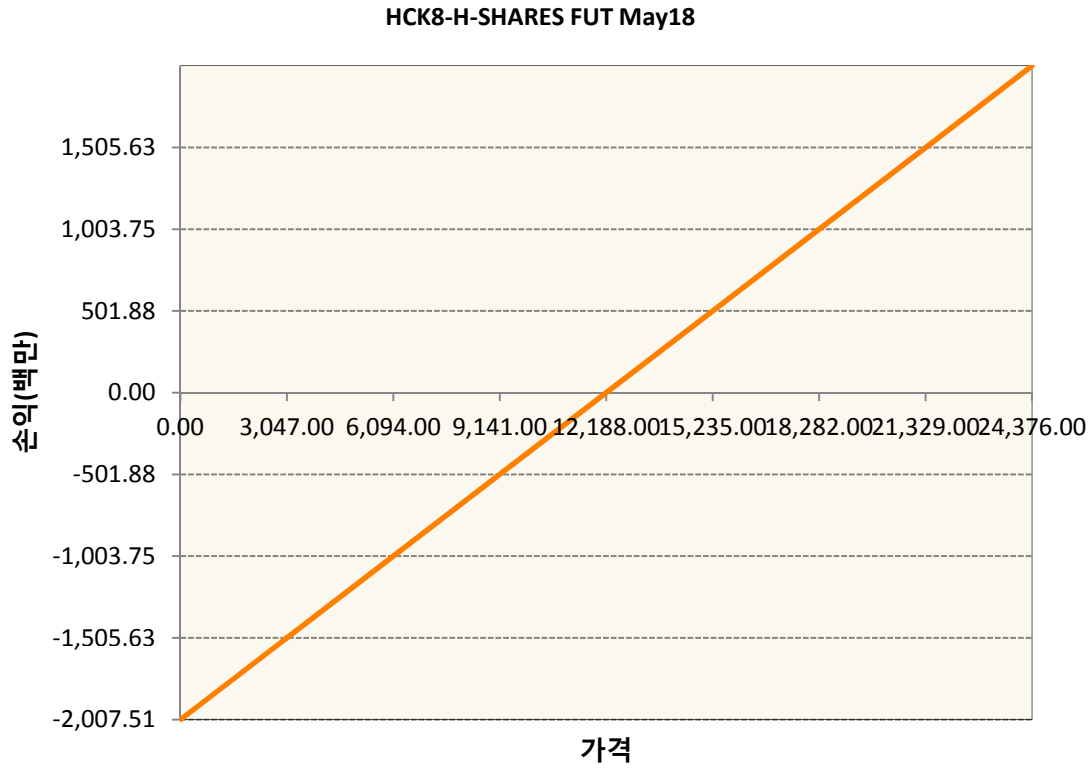
차이나인덱스모(주식-파생형)

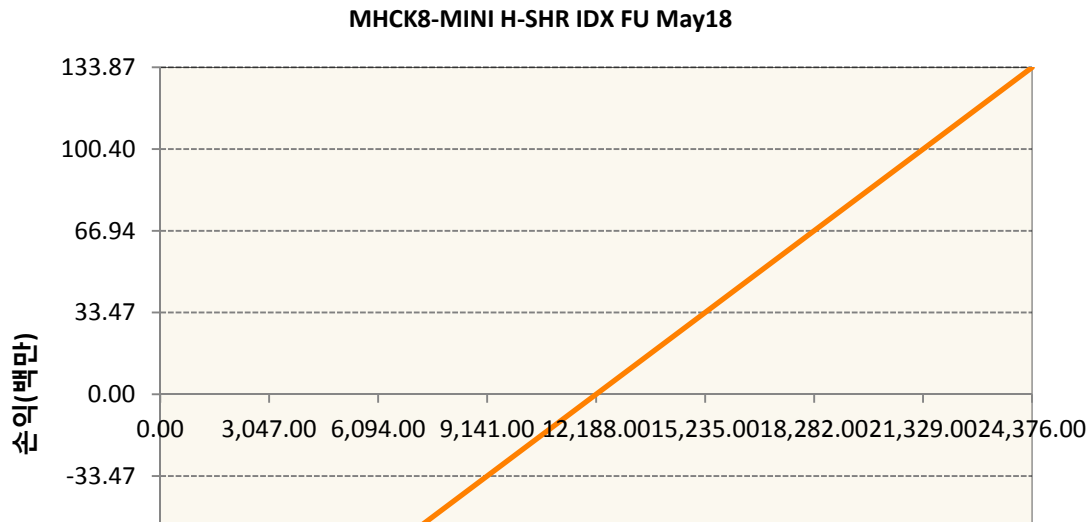
1. 계약금액

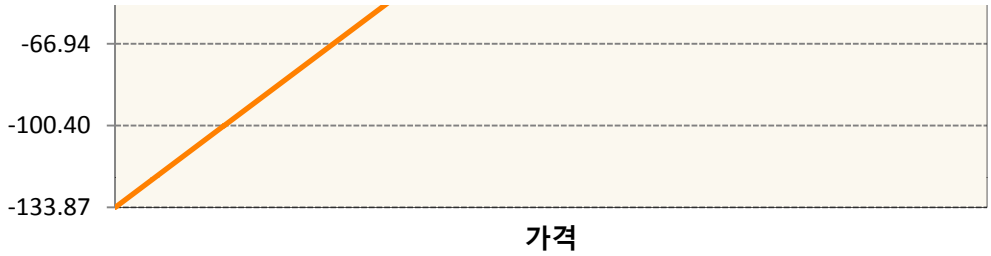
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,141	0	2,141	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	161
MHCK8	MINI H-SHR IDX FU May18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	151

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

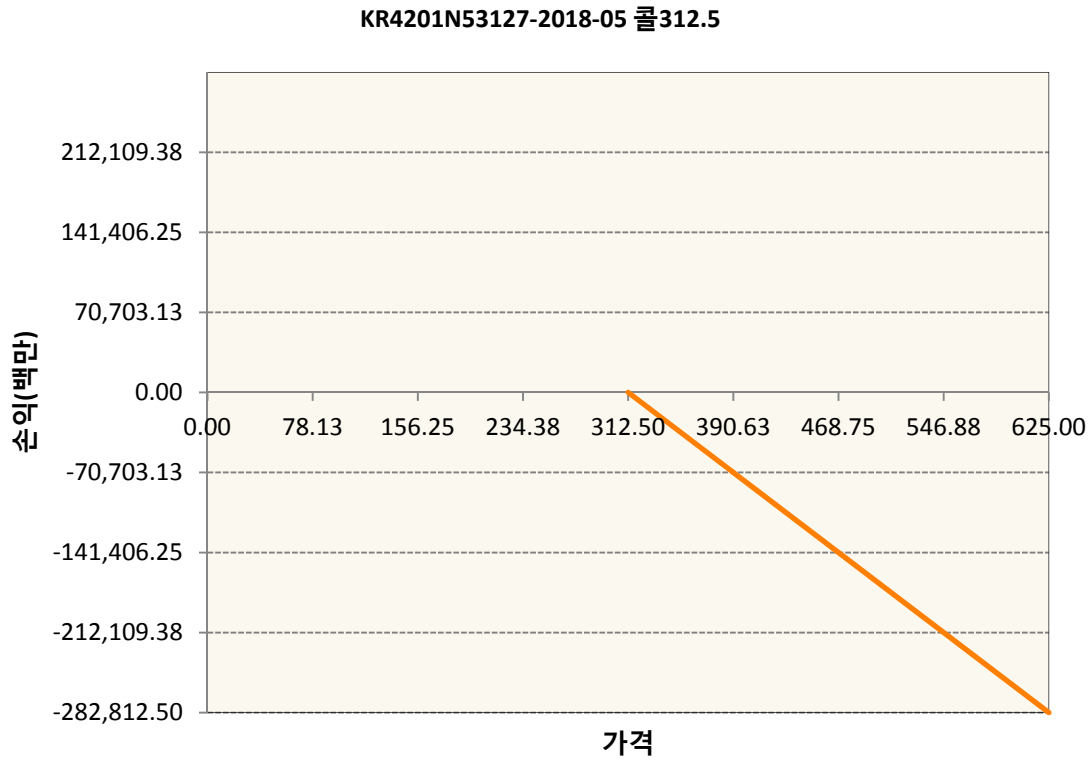
커버드콜모(주식혼합-파생형)

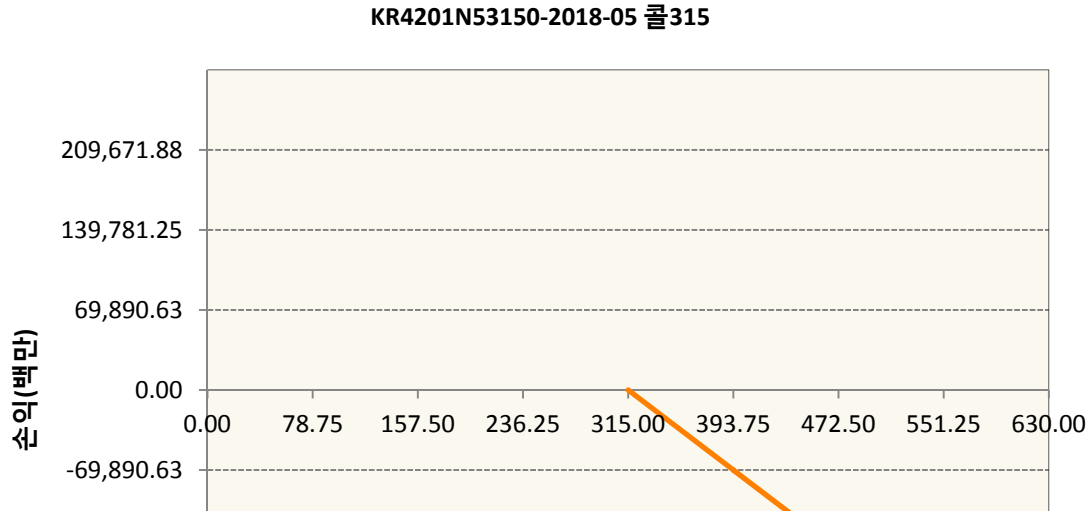
1. 계약금액

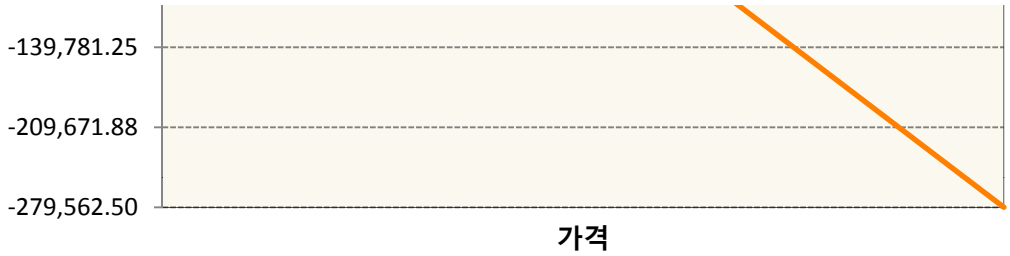
(단위:백만원)

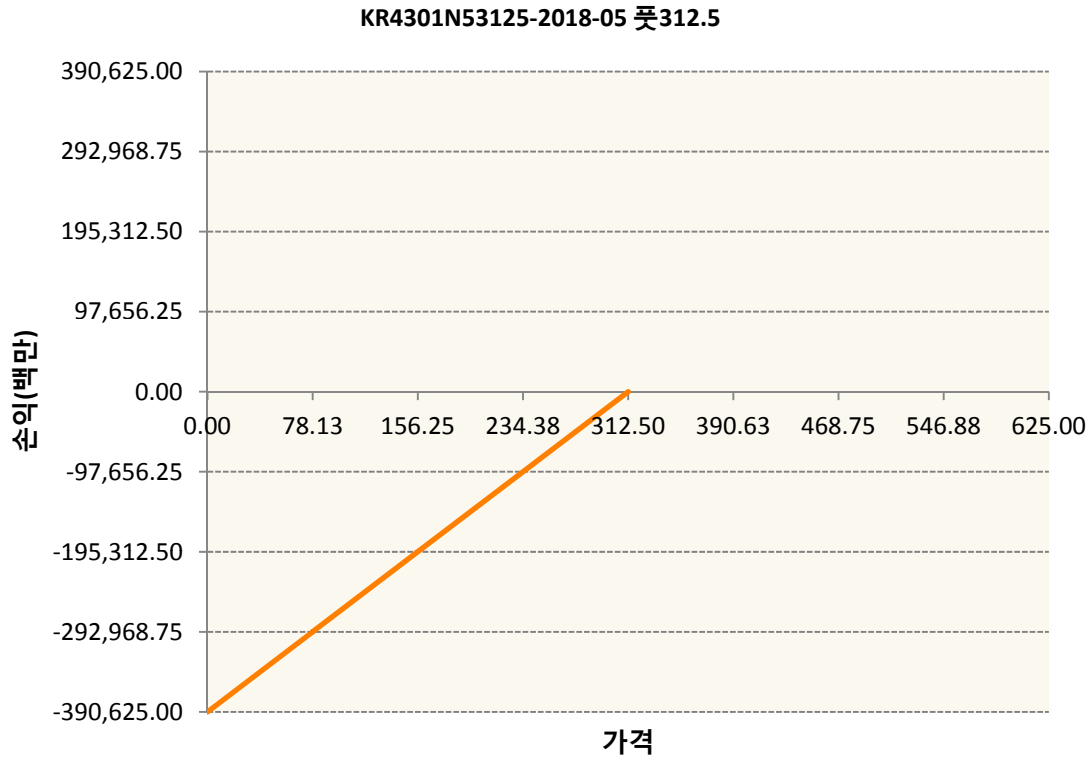
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	11,552	0	11,552	장내
누계	유가증권	옵션	0	953,000	-953,000	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5							18,839
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,065	7,906	7,709	7,476	7,212	6,920	6,603
-5.33%	7,294	6,948	6,573	6,174	5,756	5,323	4,877
-2.67%	5,325	4,809	4,287	3,761	3,232	2,700	2,166
0%	1,630	1,089	546	0	-547	-1,096	-1,645
2.67%	-3,789	-4,199	-4,633	-5,087	-5,555	-6,036	-6,528
5.33%	-10,435	-10,665	-10,937	-11,244	-11,581	-11,945	-12,332
8.00%	-17,717	-17,815	-17,950	-18,122	-18,330	-18,570	-18,839
KR4201N5312018-05 콜315							17,743
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,812	6,695	6,540	6,351	6,130	5,879	5,603

-5.33%	6,265	5,980	5,660	5,312	4,941	4,549	4,142
-2.67%	4,738	4,266	3,783	3,290	2,791	2,286	1,777
0%	1,639	1,093	547	0	-547	-1,093	-1,640
2.67%	-3,201	-3,657	-4,129	-4,614	-5,109	-5,613	-6,122
5.33%	-9,413	-9,694	-10,013	-10,363	-10,740	-11,138	-11,556
8.00%	-16,410	-16,541	-16,712	-16,921	-17,165	-17,440	-17,743
KR4301N5312018-05 풋312.5							24,674

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24,552	-24,555	-24,562	-24,575	-24,597	-24,629	-24,674
-5.33%	-14,101	-14,162	-14,247	-14,356	-14,487	-14,640	-14,811
-2.67%	-4,646	-4,941	-5,250	-5,568	-5,896	-6,230	-6,569
0%	1,047	704	355	0	-359	-721	-1,086
2.67%	2,612	2,504	2,368	2,207	2,022	1,817	1,594
5.33%	2,770	2,760	2,740	2,708	2,660	2,596	2,515
8.00%	2,775	2,775	2,774	2,771	2,764	2,753	2,735

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

63,729

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

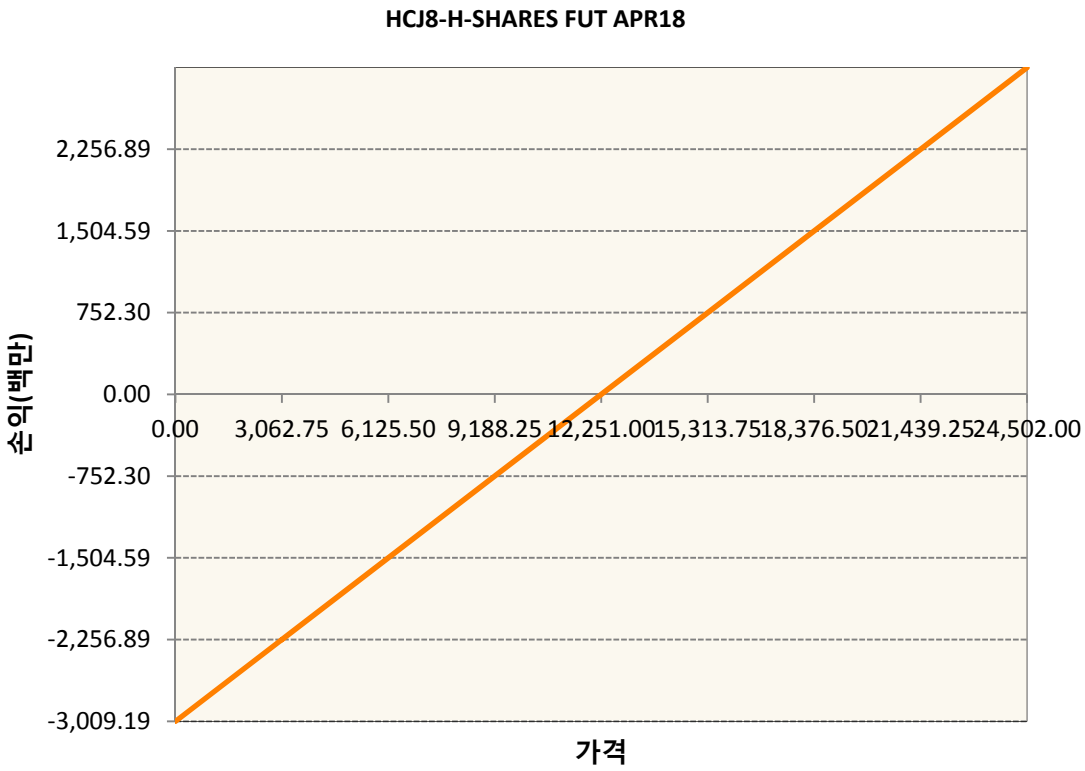
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

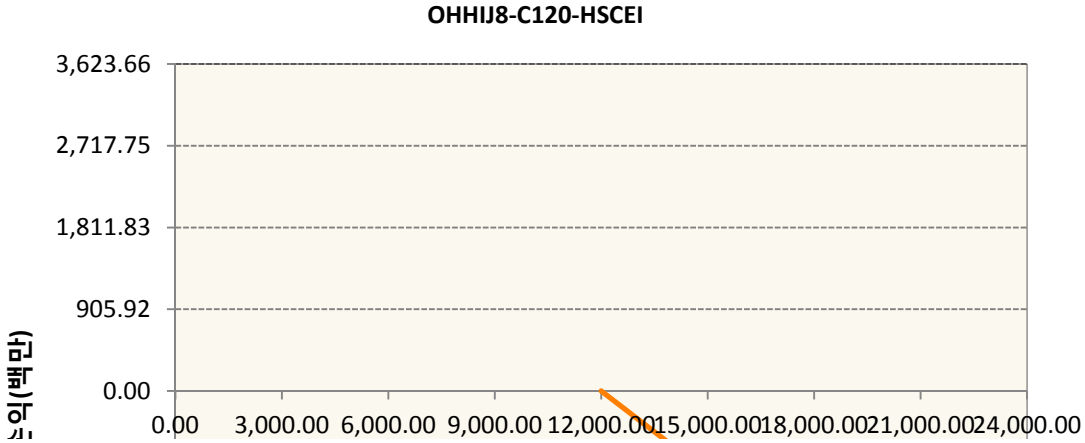
1. 계약금액

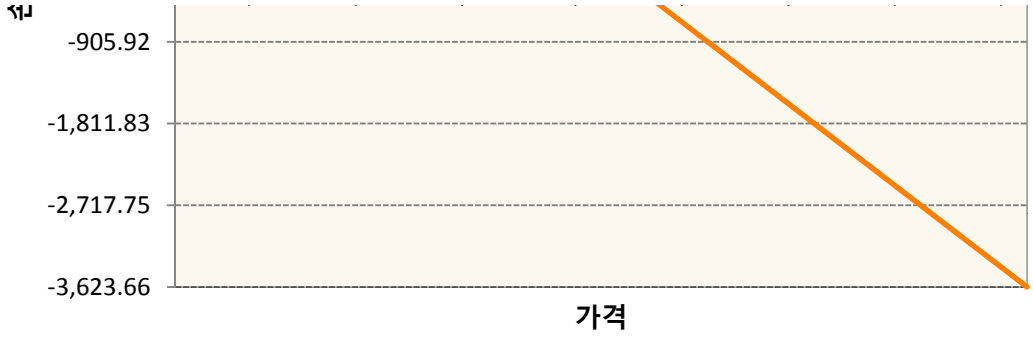
(단위:백만원)

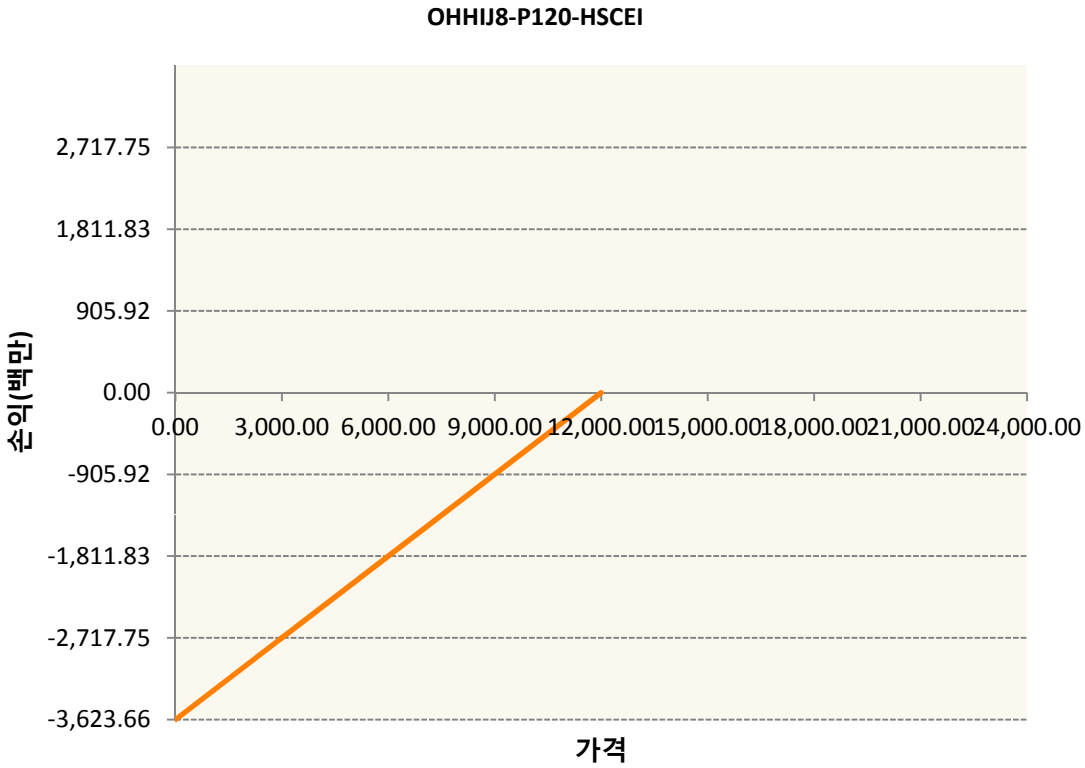
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,009	0	3,009	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,247	-7,247	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	241
OHHIJ8-C12	HSCEI	290
OHHIJ8-P12	HSCEI	290

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	725

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

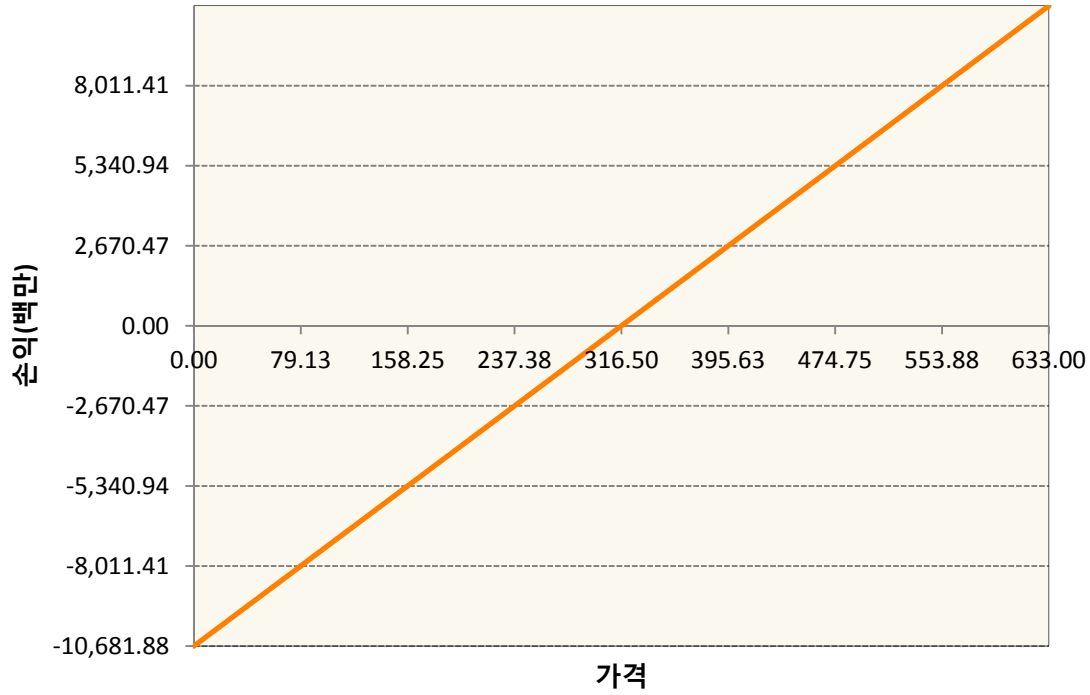
1. 계약금액

(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	10,682	0	10,682	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

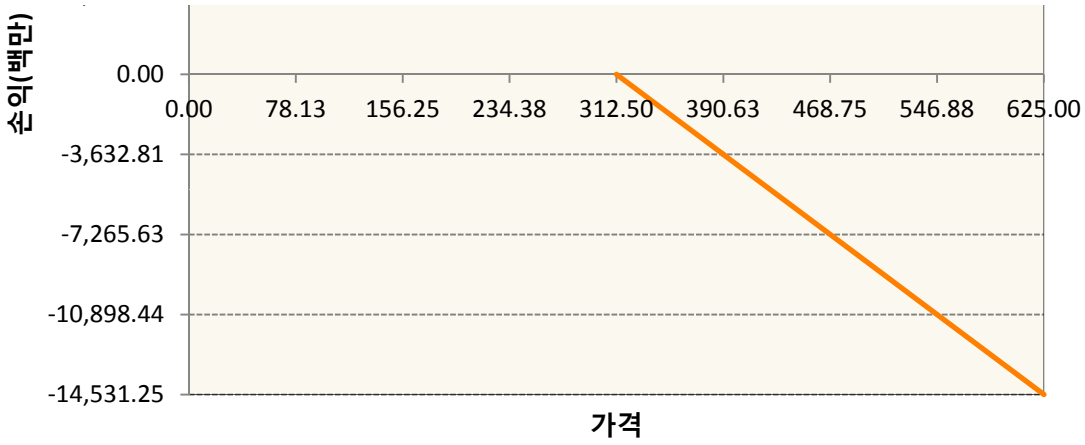
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

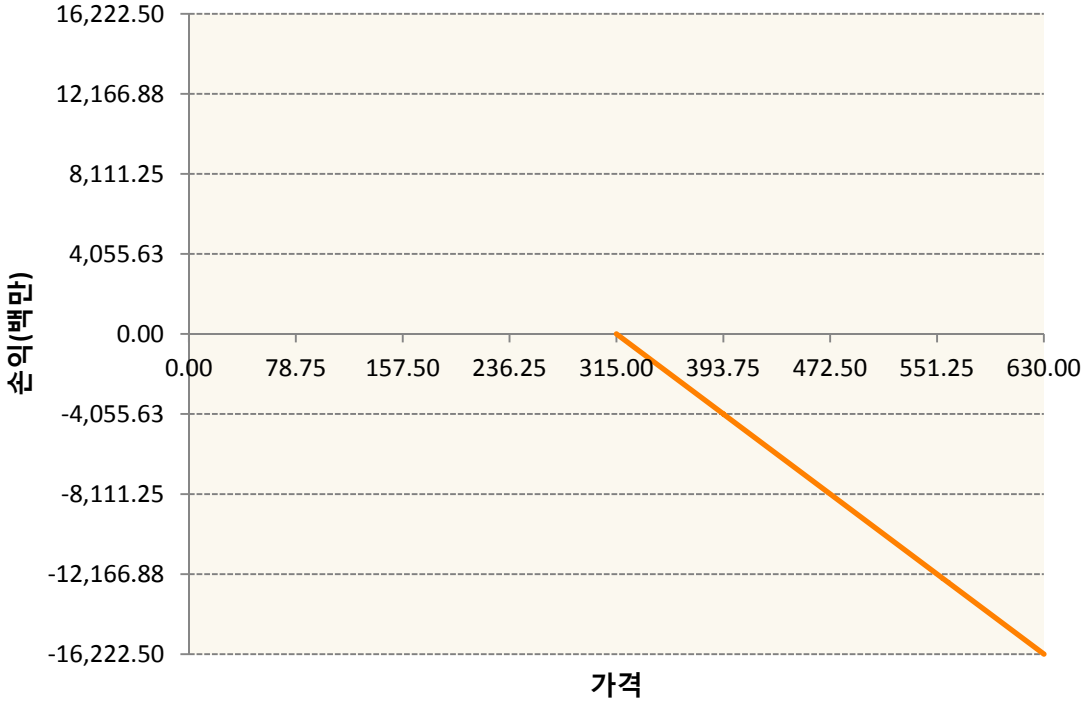


KR4201N53127-2018-05 콜312.5

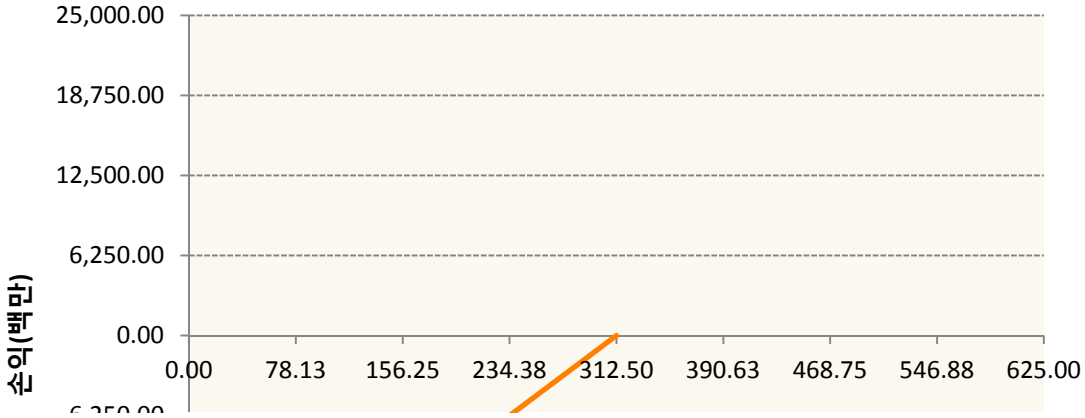




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464
-5.33%	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488
5.33%	976	976	976	976	976	976	976
8.00%	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							237
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	237	237	237	237	237	237	237
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6							198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						253
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						468
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-468	-468	-468	-468	-468	-468	-468
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	468	468	468	468	468	468	468
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						633
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633
-5.33%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	422	422	422	422	422	422	422
8.00%	633	633	633	633	633	633	633
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						475
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	475	475	475	475	475	475	475
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						853
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-853	-853	-853	-853	-853	-853	-853
-5.33%	-569	-569	-569	-569	-569	-569	-569
-2.67%	-284	-284	-284	-284	-284	-284	-284
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	284	284	284	284	284	284	284
5.33%	569	569	569	569	569	569	569
8.00%	853	853	853	853	853	853	853
	KR4201N531 2018-05 콜312.5						968
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	414	406	396	384	371	356	339
-5.33%	375	357	338	317	296	274	251
-2.67%	274	247	220	193	166	139	111
0%	84	56	28	0	-28	-56	-85
2.67%	-195	-216	-238	-261	-285	-310	-335
5.33%	-536	-548	-562	-578	-595	-614	-634
8.00%	-910	-915	-922	-931	-942	-954	-968
	KR4201N531 2018-05 콜315						1,030
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	395	388	380	369	356	341	325
-5.33%	364	347	328	308	287	264	240
-2.67%	275	248	220	191	162	133	103
0%	95	63	32	0	-32	-63	-95
2.67%	-186	-212	-240	-268	-296	-326	-355
5.33%	-546	-563	-581	-601	-623	-646	-671
8.00%	-952	-960	-970	-982	-996	-1,012	-1,030
	KR4301N531 2018-05 풋312.5						1,579

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,571	-1,572	-1,572	-1,573	-1,574	-1,576	-1,579
-5.33%	-902	-906	-912	-919	-927	-937	-948
-2.67%	-297	-316	-336	-356	-377	-399	-420
0%	67	45	23	0	-23	-46	-69
2.67%	167	160	152	141	129	116	102
5.33%	177	177	175	173	170	166	161
8.00%	178	178	178	177	177	176	175

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

8,481

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

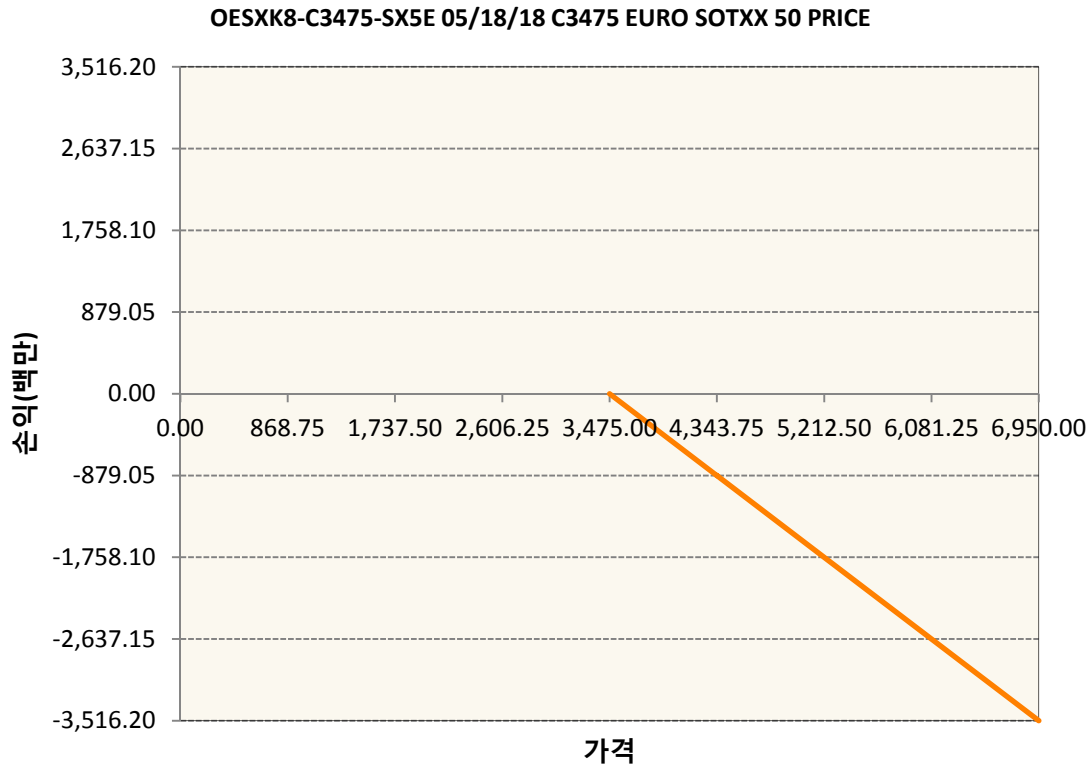
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

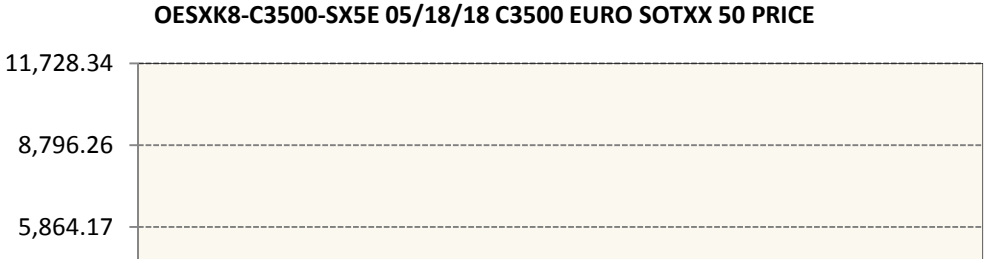
1. 계약금액

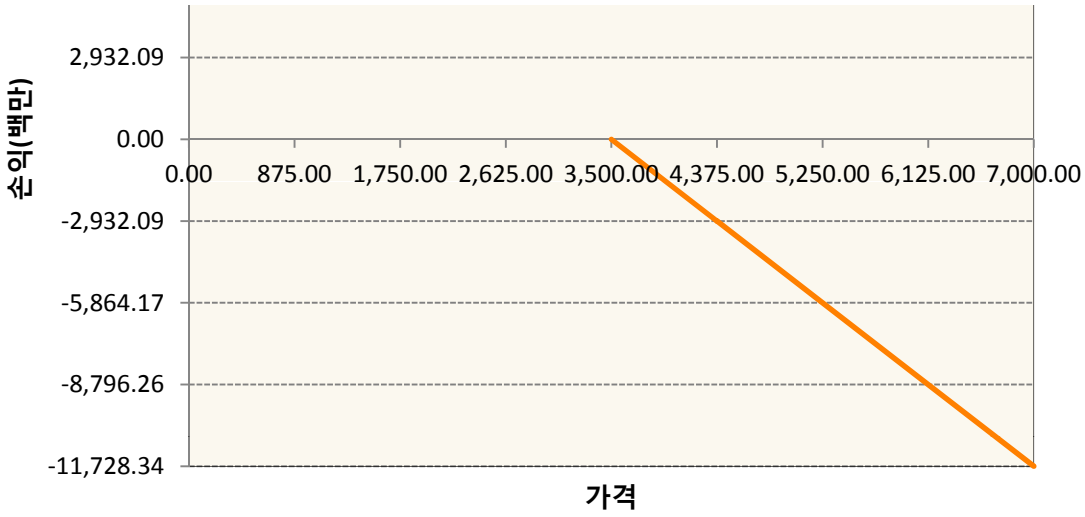
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,854	0	6,854	
누계	유가증권	스왑	75,905	0	75,905	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,489	-30,489	장내
누계	지수	스왑	52,566	0	52,566	장외

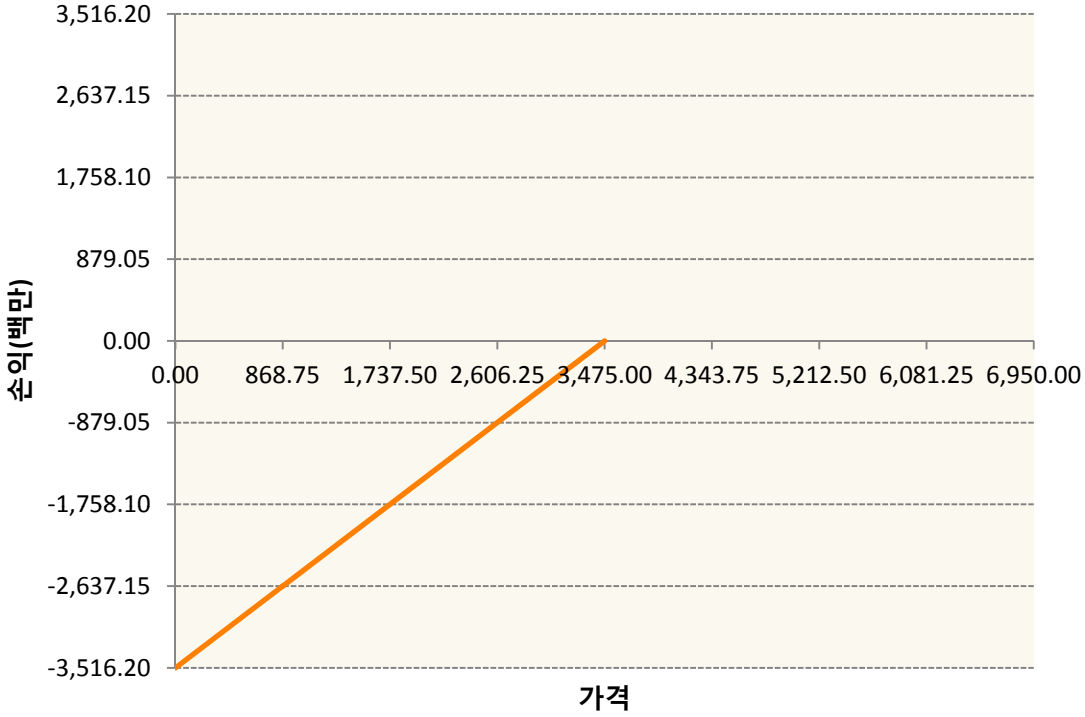
2. 만기시점의 손익구조



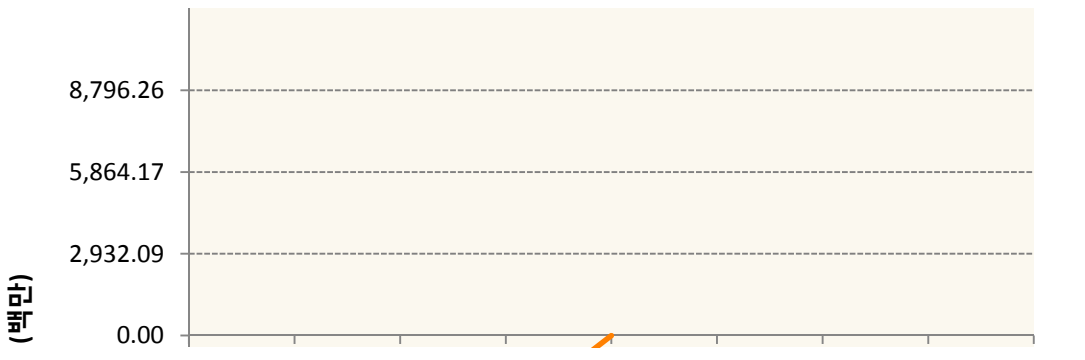


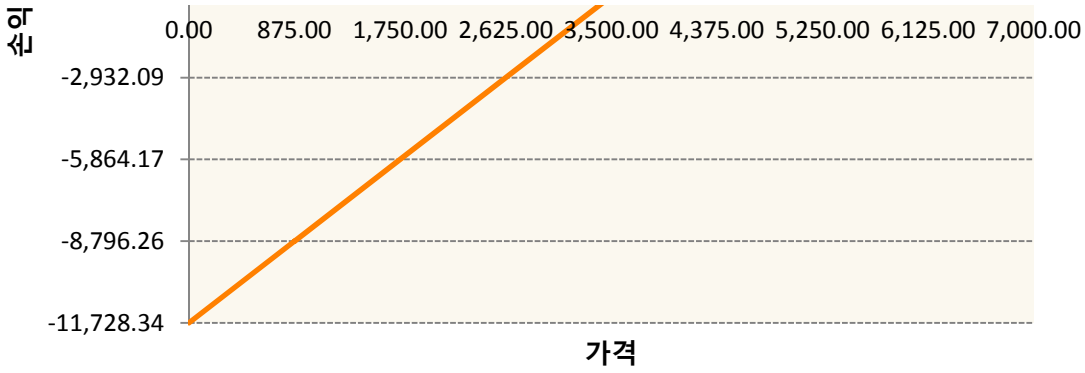


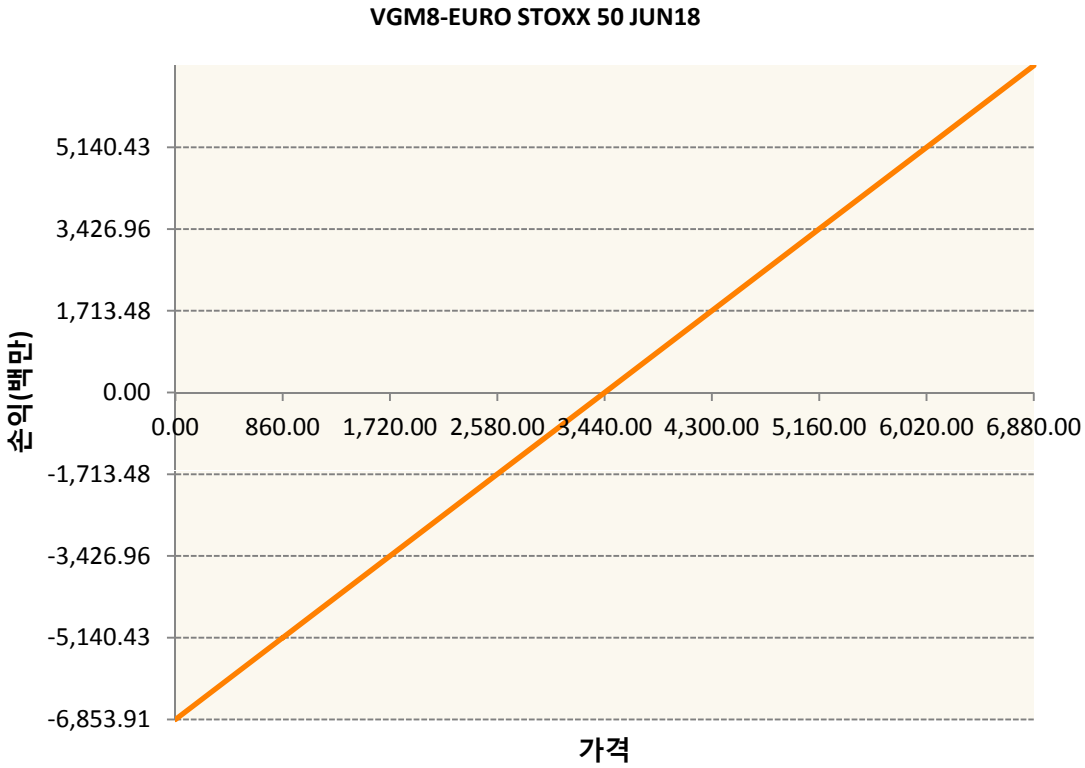
OESXK8-P3475-SX5E 05/18/18 P3475 EURO SOTXX 50 PRICE



OESXK8-P3500-SX5E 05/18/18 P3500 EURO SOTXX 50 PRICE







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	16
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	23
OESXK8-C34 SX5E 05/18/18 C3475 EURO SOTXX 50 PRICE	281
OESXK8-C35 SX5E 05/18/18 C3500 EURO SOTXX 50 PRICE	938
OESXK8-P34 SX5E 05/18/18 P3475 EURO SOTXX 50 PRICE	281
OESXK8-P35 SX5E 05/18/18 P3500 EURO SOTXX 50 PRICE	938
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	548

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

1,864

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

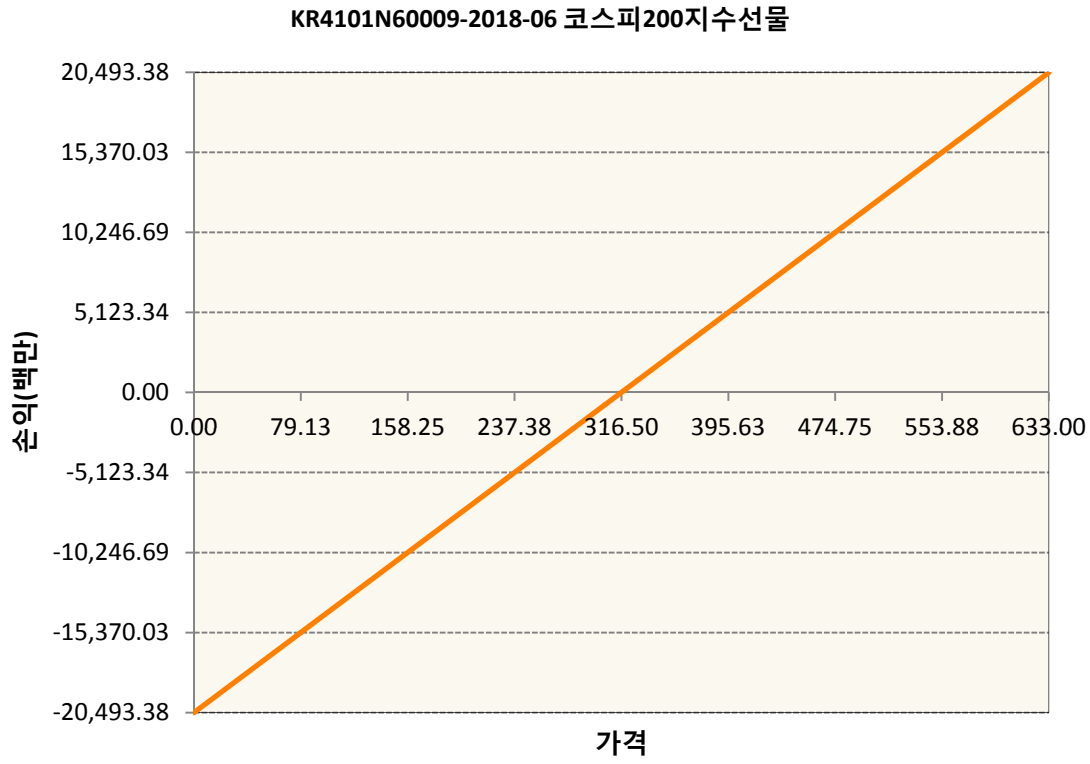
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	20,493	0	20,493	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,636
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636	-1,636
-5.33%	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091
-2.67%	-545	-545	-545	-545	-545	-545	-545
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	545	545	545	545	545	545	545
5.33%	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091
8.00%	1,636	1,636	1,636	1,636	1,636	1,636	1,636

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

1,196

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

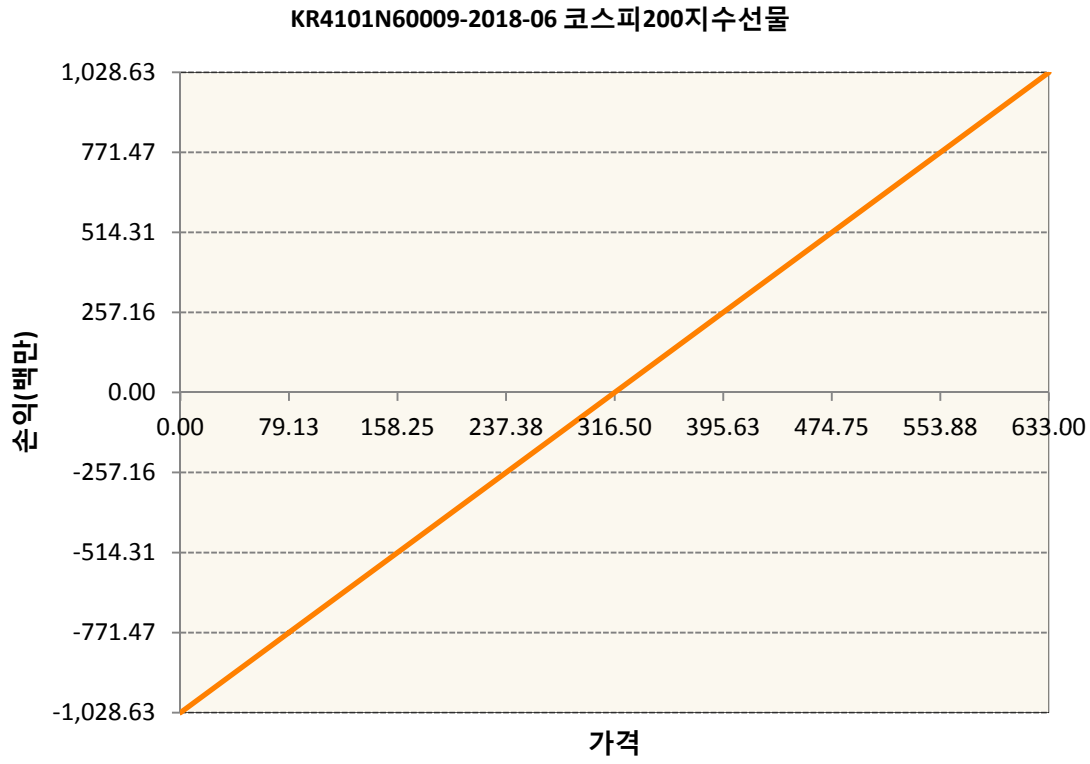
ETF스마트레버리지목표전환형9호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,029	0	1,029	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							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%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

60

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

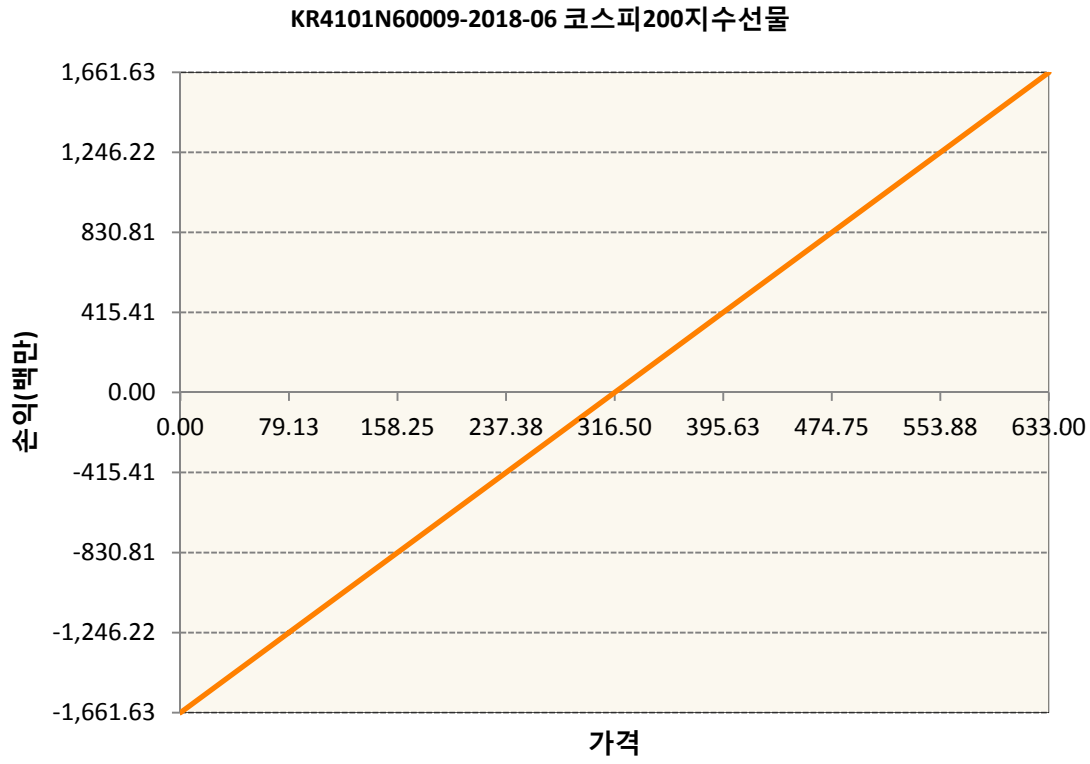
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,662	0	1,662	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	133	133	133	133	133	133	133

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

97

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

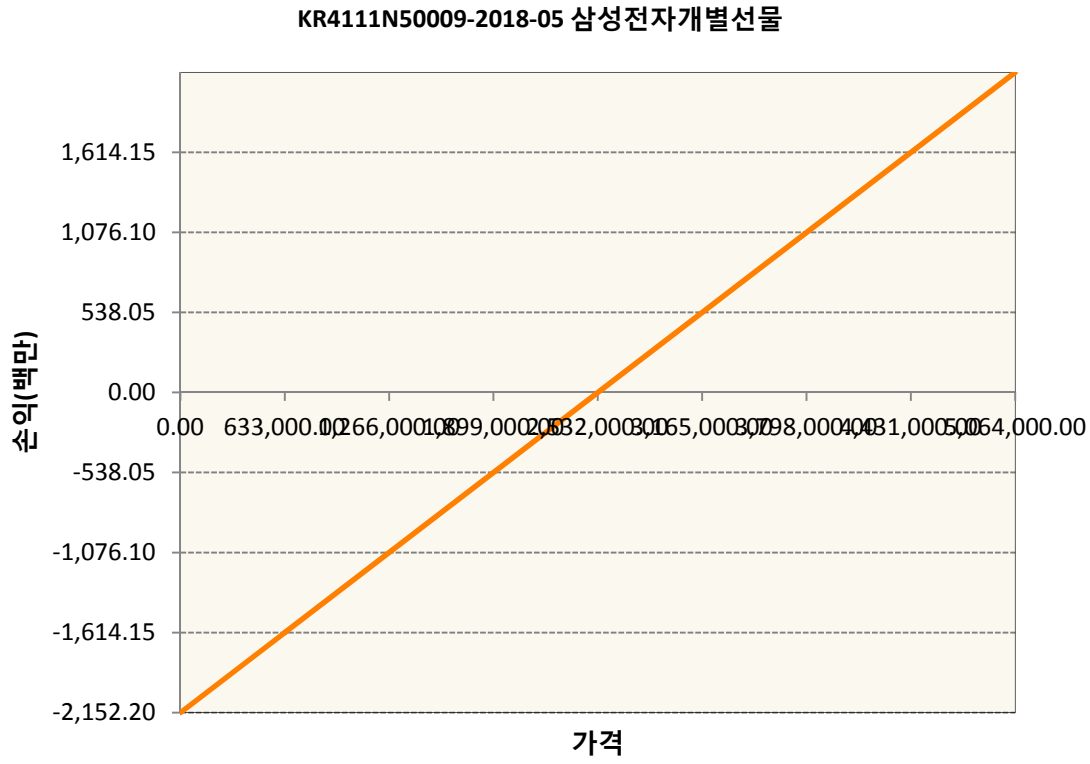
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,152	0	2,152	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N50(2018-05 삼성전자개별선물							172
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	57	57	57	57	57	57	57
5.33%	114	114	114	114	114	114	114
8.00%	172	172	172	172	172	172	172

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

215

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

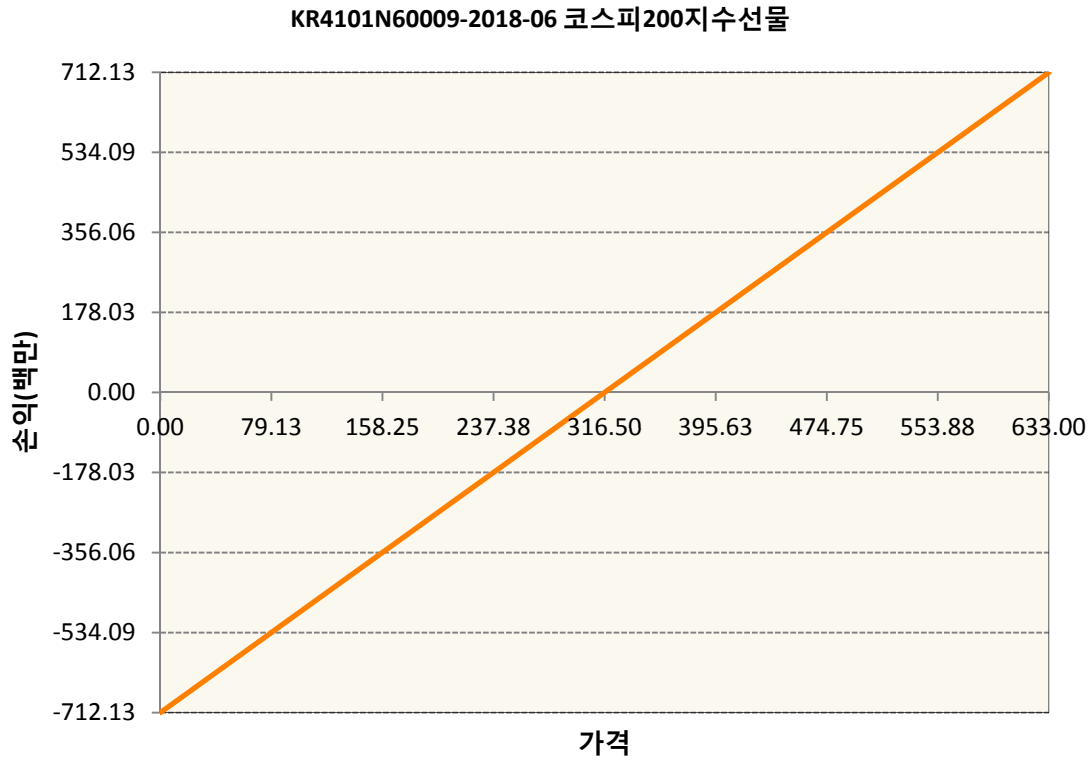
스마트KRX300인덱스목표전환형1

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	158	1,592	-1,435	장내
누계	유가증권	선물	712	0	712	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							57
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	38	38	38	38	38	38	38
8.00%	57	57	57	57	57	57	57

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

42

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

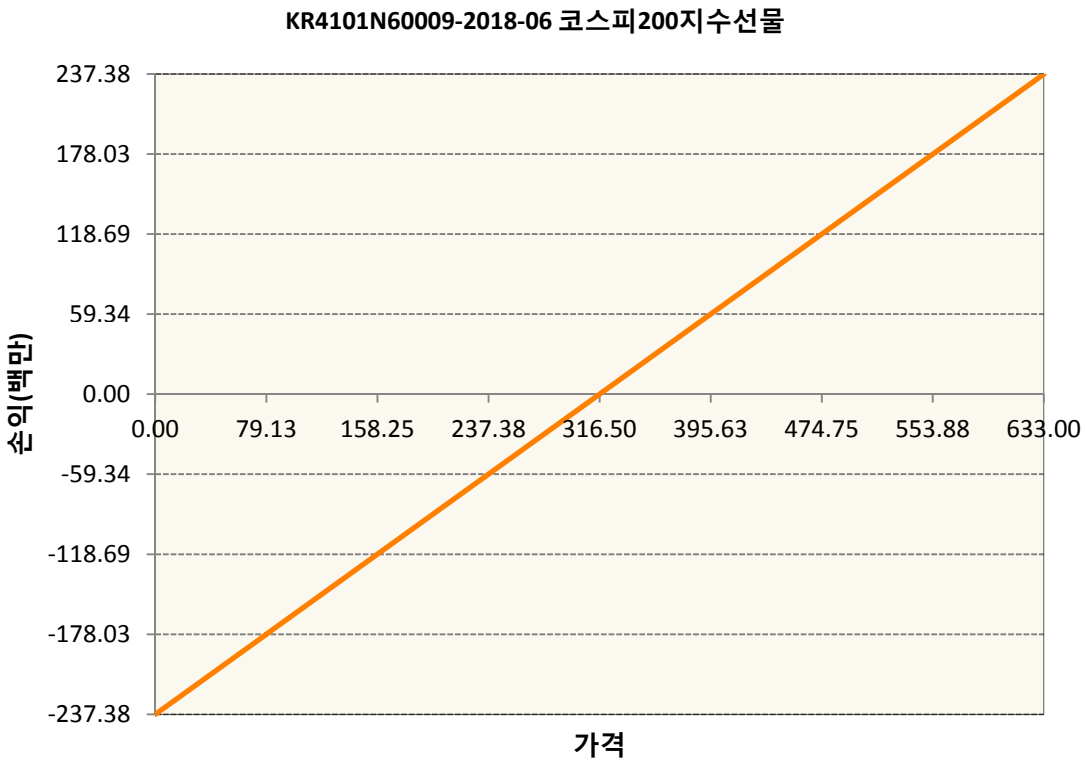
리디파인K200(주식혼합-파생재간

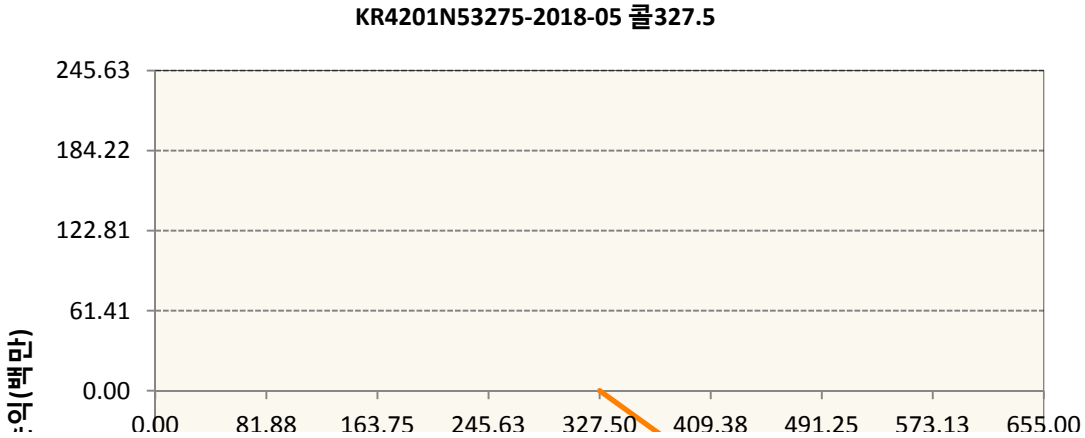
1. 계약금액

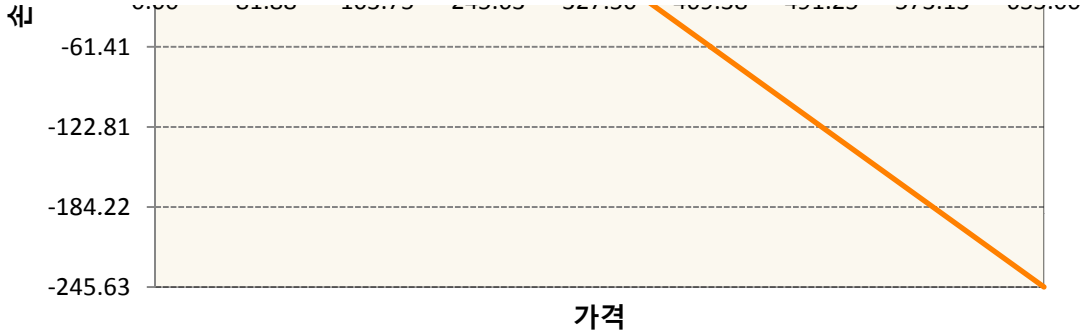
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	238	0	238	장내
신규	유가증권	옵션	0	246	-246	장내
누계	유가증권	선물	237	0	237	장내
누계	유가증권	옵션	0	246	-246	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							19
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	19	19	19	19	19	19	19
KR4201N532 2018-05 콜327.5							11
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	1
-2.67%	2	2	2	1	1	1	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-1	-1	-2	-2	-3	-3	-4
5.33%	-4	-5	-5	-6	-6	-7	-7
8.00%	-9	-9	-10	-10	-10	-11	-11

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

24

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

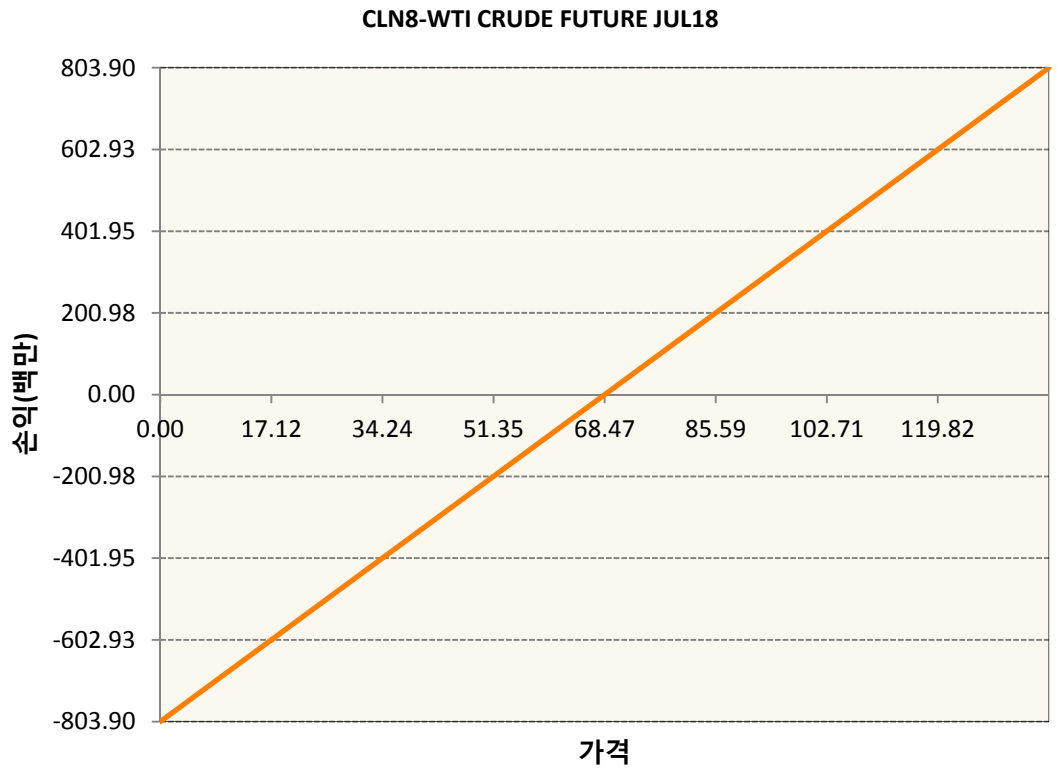
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

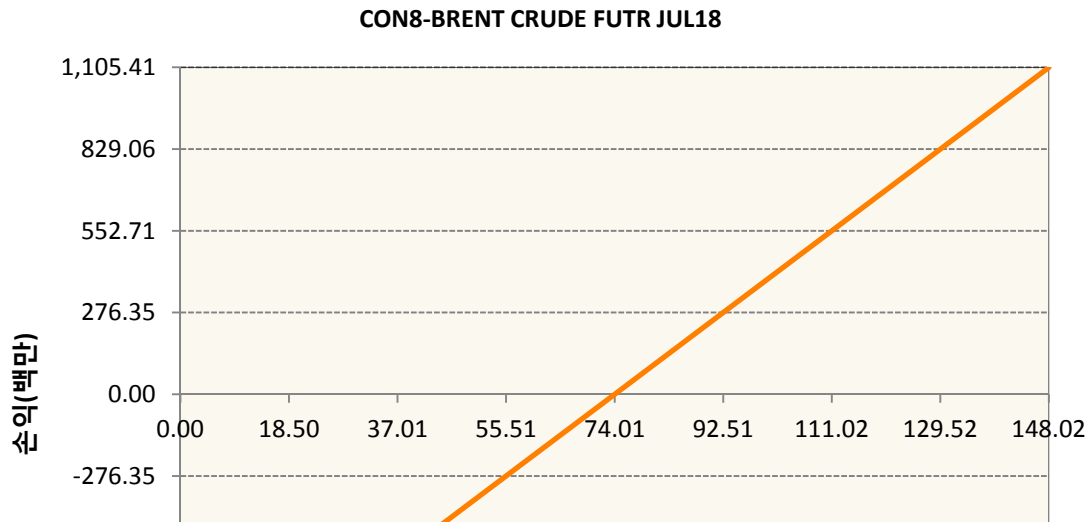
1. 계약금액

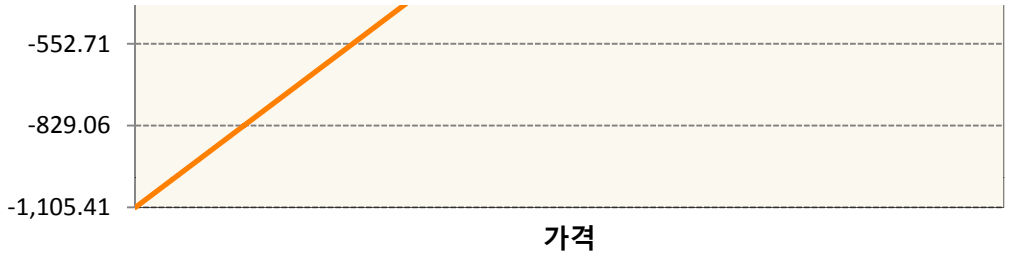
(단위:백만원)

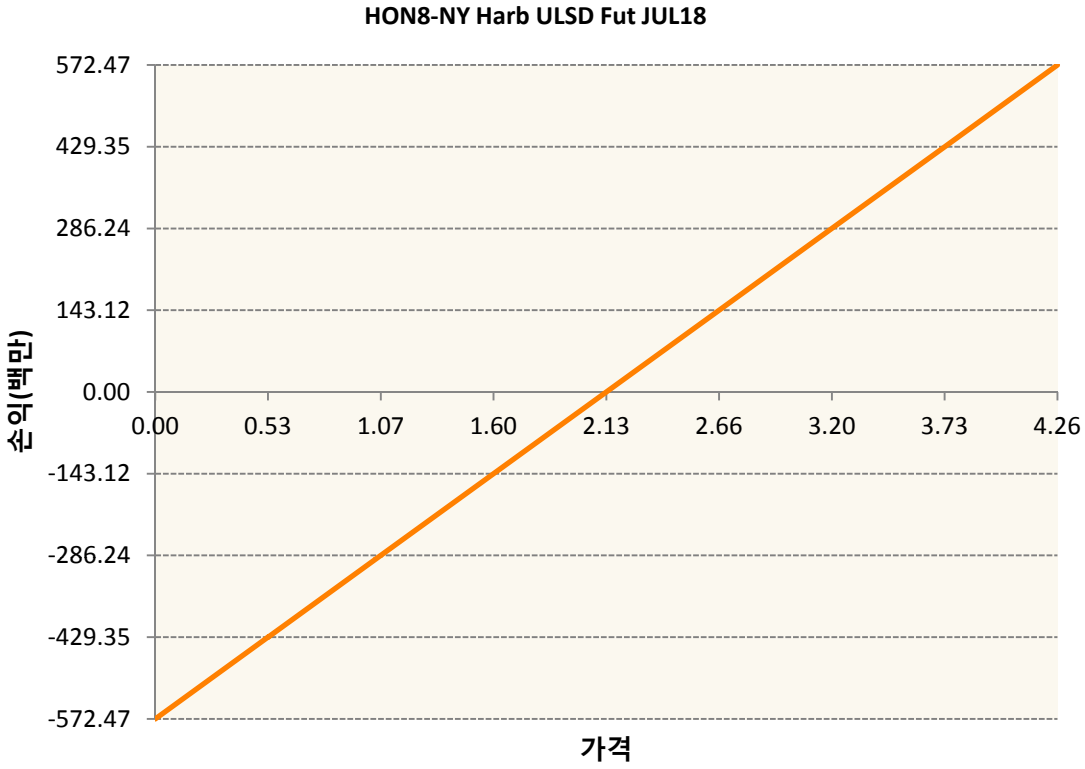
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,132	592	3,540	

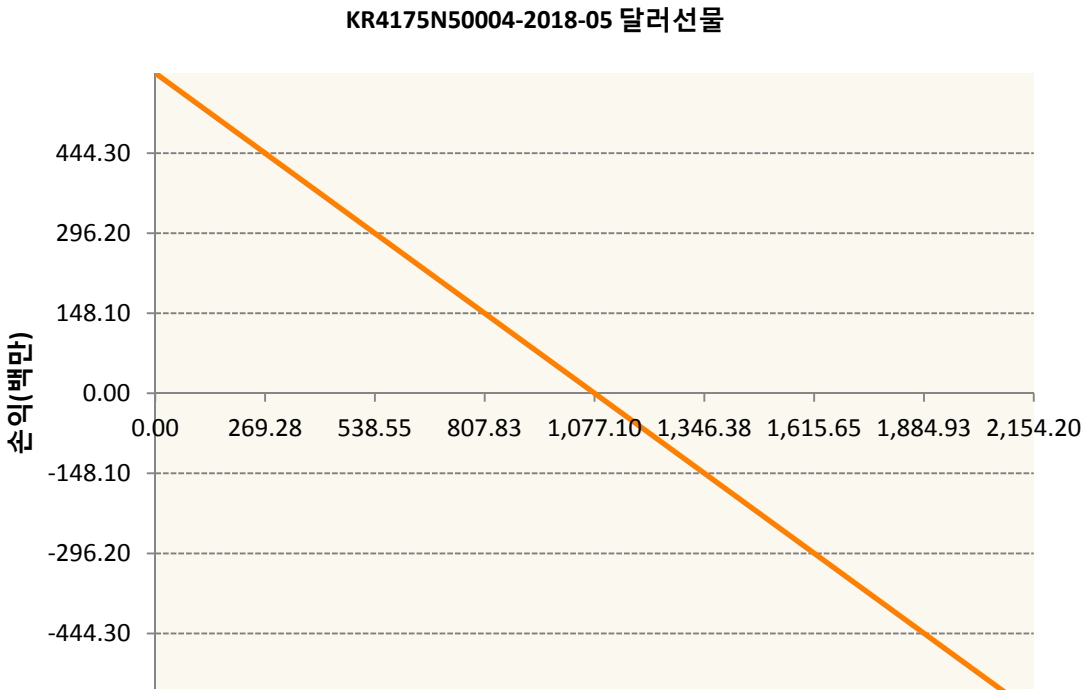
2. 만기시점의 손익구조

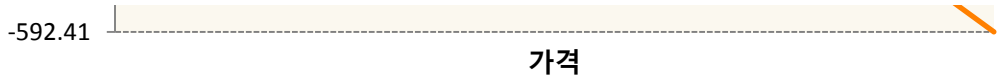


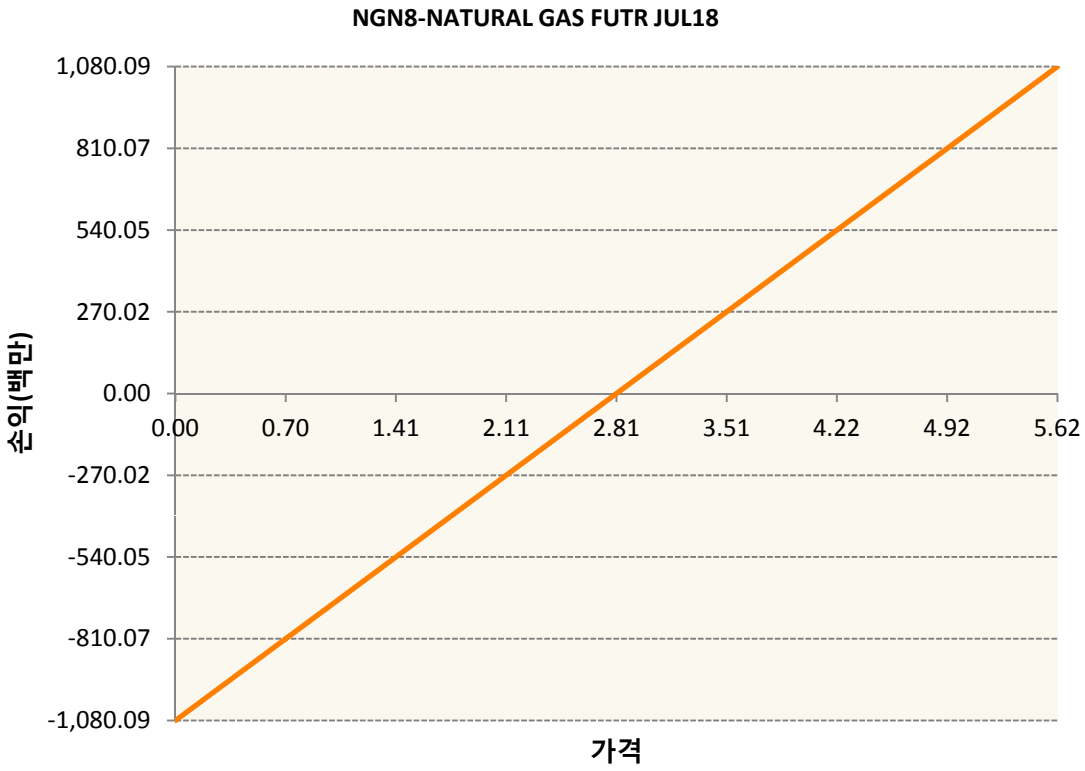


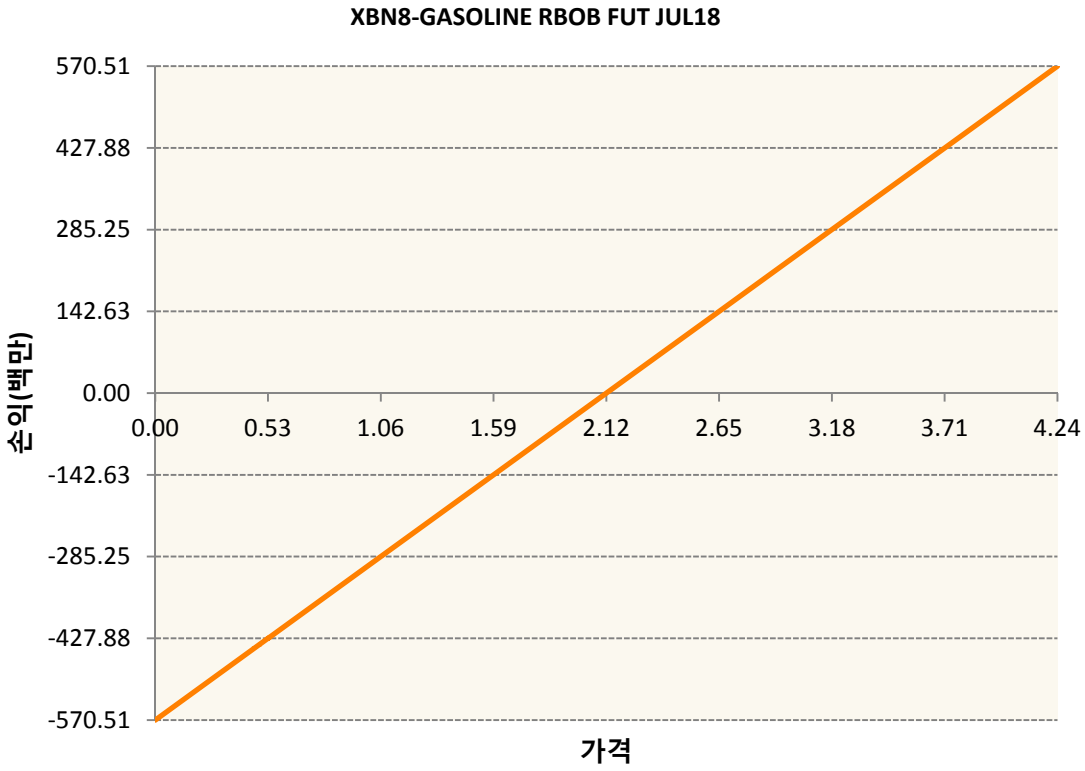

-552.71
-829.06
-1,105.41
가격


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18
572.47
429.35
286.24
143.12
0.00
-143.12
-286.24
-429.35
-572.47
0.00
0.53
1.07
1.60
2.13
2.66
3.20
3.73
4.26
손익(백만)
가격


KR4175N50004-2018-05 달러선물
444.30
296.20
148.10
0.00
-148.10
-296.20
-444.30
0.00
269.28
538.55
807.83
1,077.10
1,346.38
1,615.65
1,884.93
2,154.20
손익(백만)


-592.41
가격


NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18
1,080.09
810.07
540.05
270.02
0.00
-270.02
-540.05
-810.07
-1,080.09
0.00
0.70
1.41
2.11
2.81
3.51
4.22
4.92
5.62
손익(백만)
가격


XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18
570.51
427.88
285.25
142.63
0.00
-142.63
-285.25
-427.88
-570.51
0.00
0.53
1.06
1.59
2.12
2.65
3.18
3.71
4.24
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	64
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	88
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	46
KR4175N50(	2018-05 달러선물	47
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	86
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	46

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

518

공시일	2018-04-25
기준일	2018-04-24

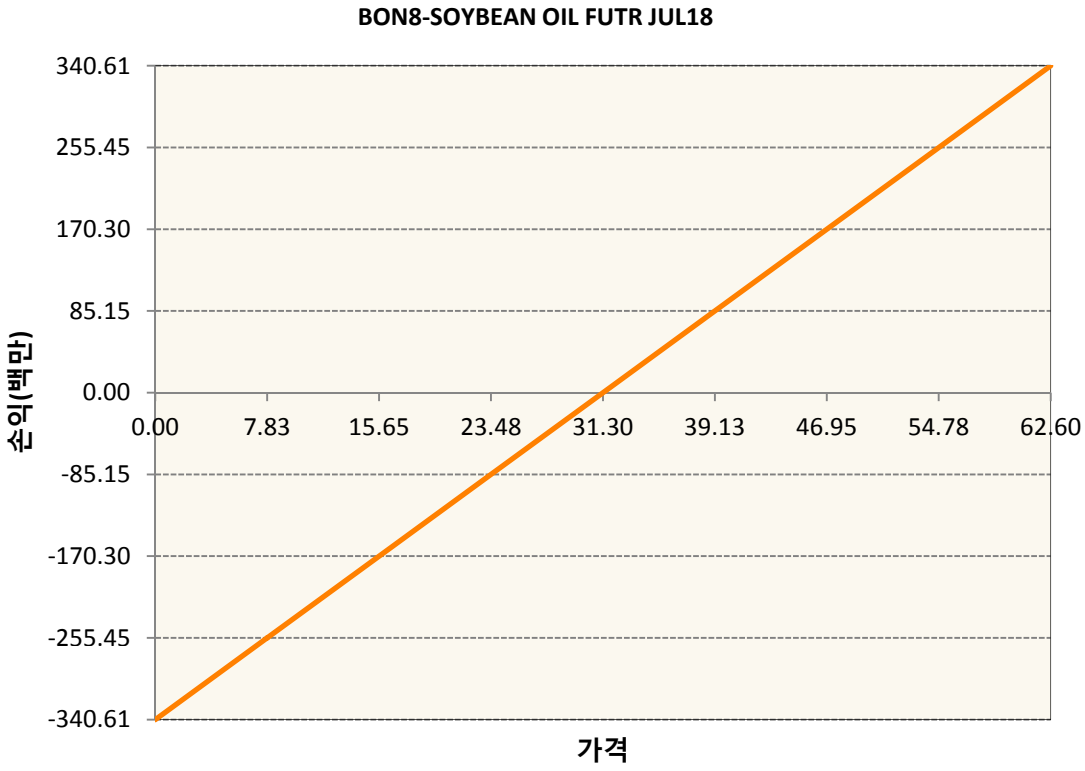
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

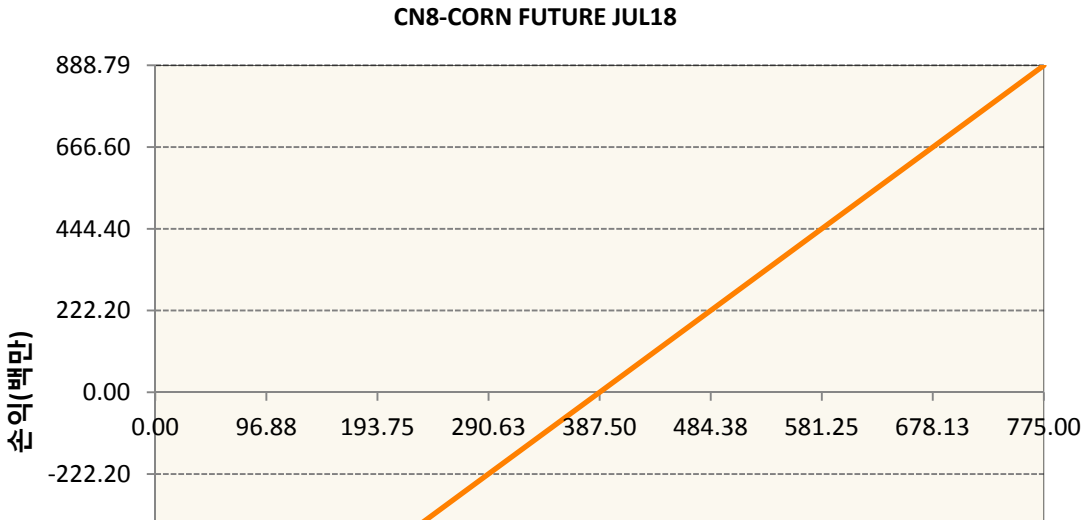
1. 계약금액

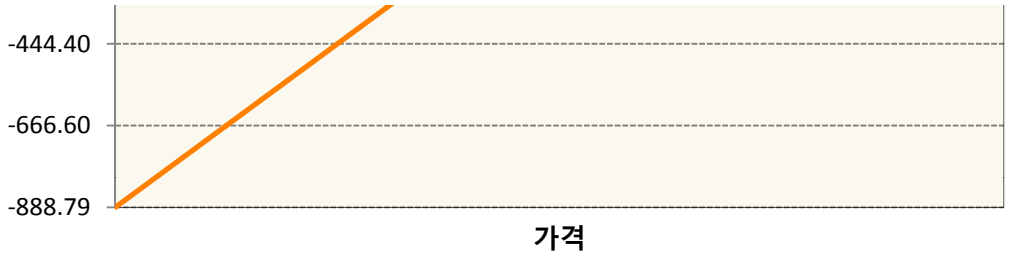
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,064	323	3,741	

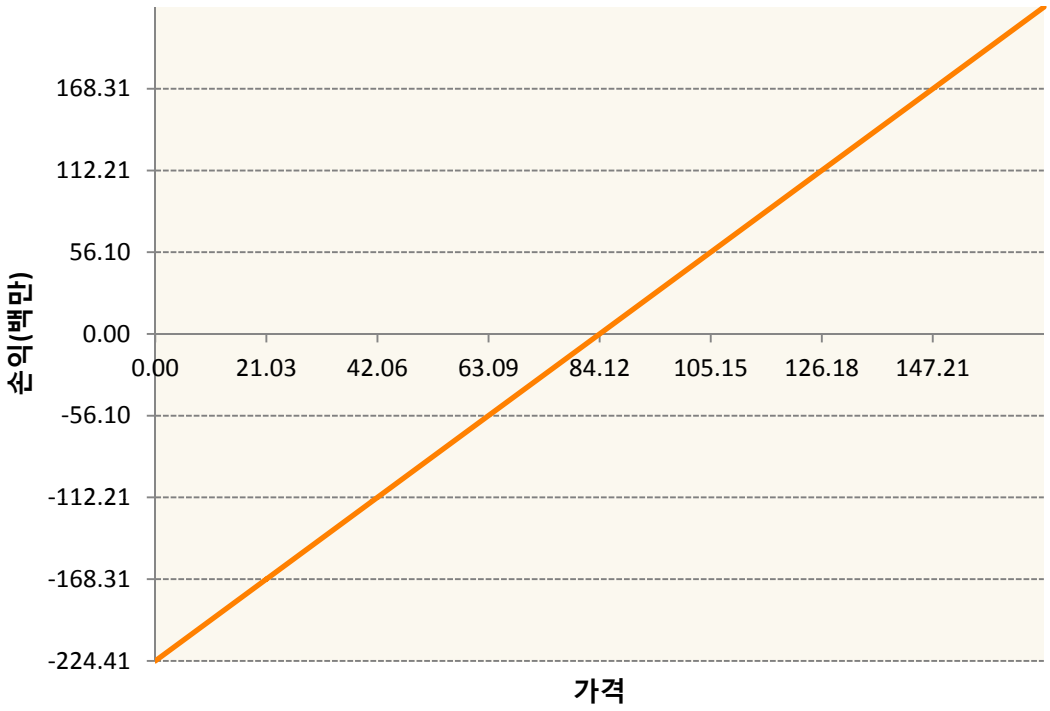
2. 만기시점의 손익구조



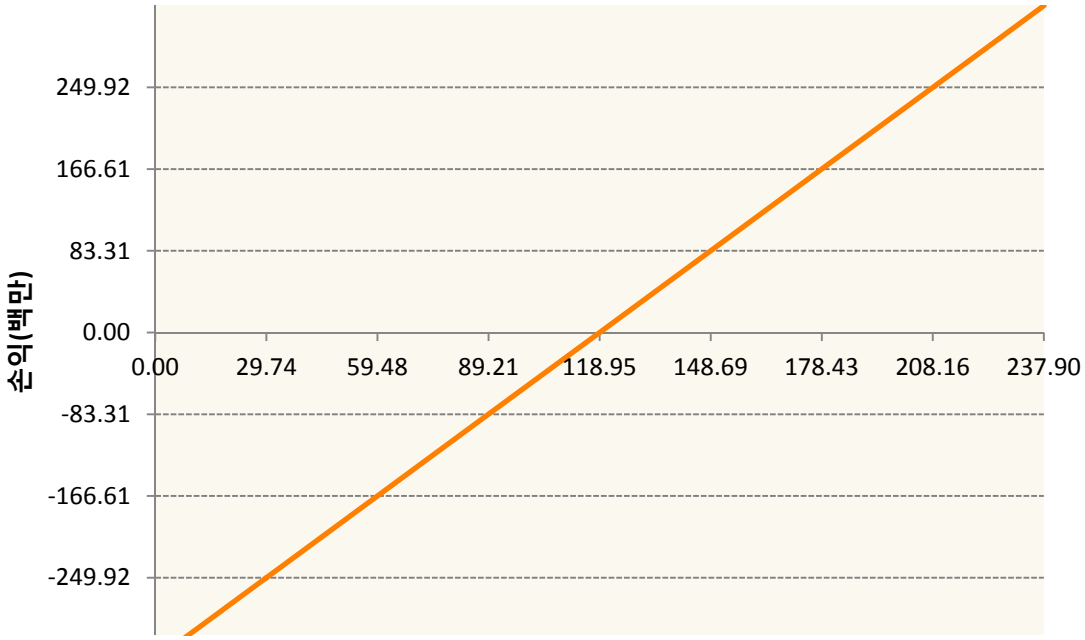


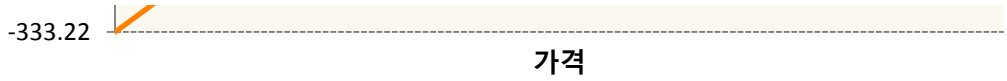


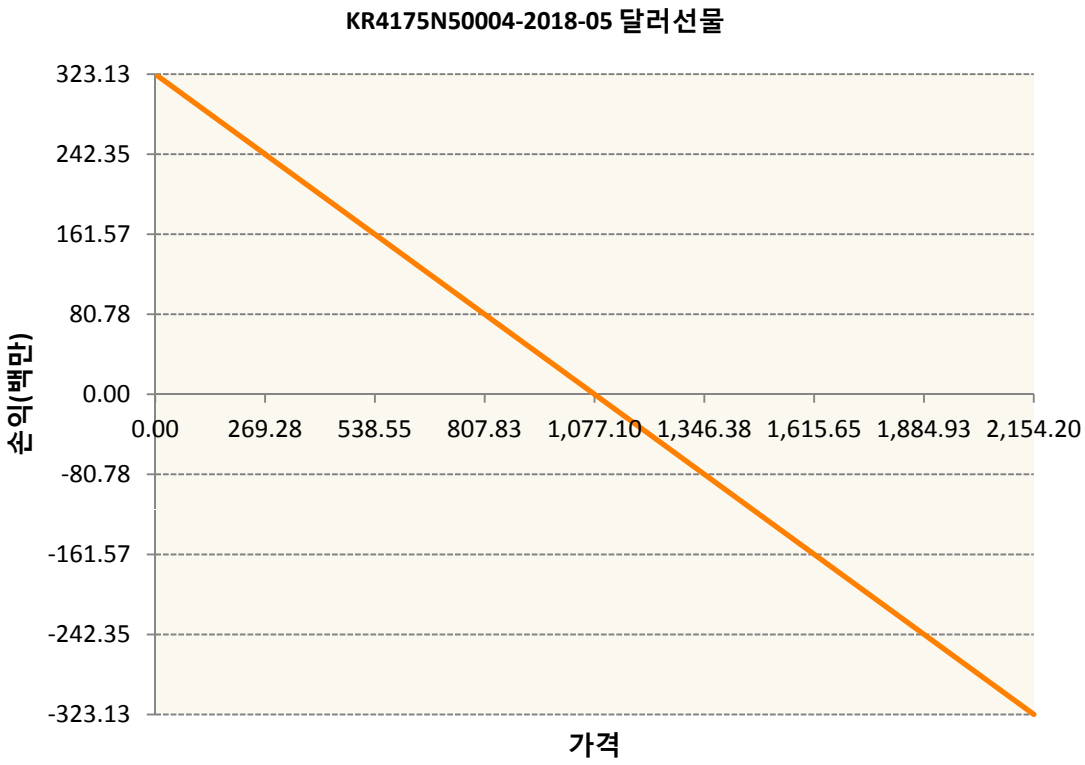
CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18

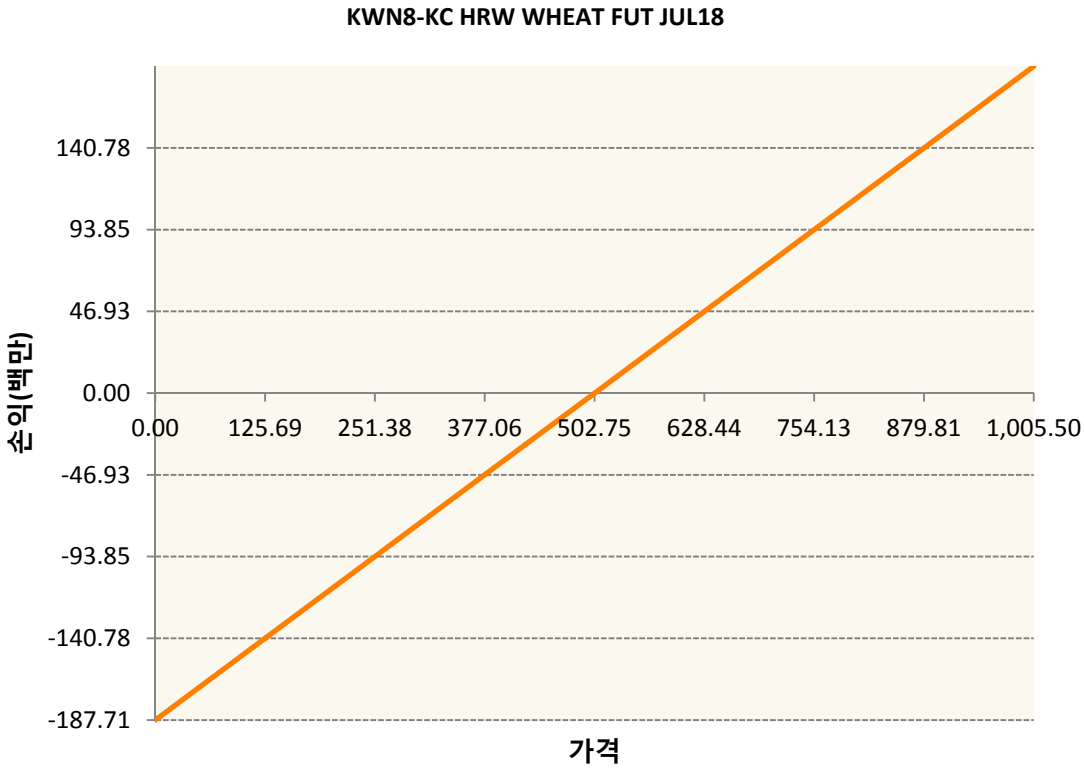


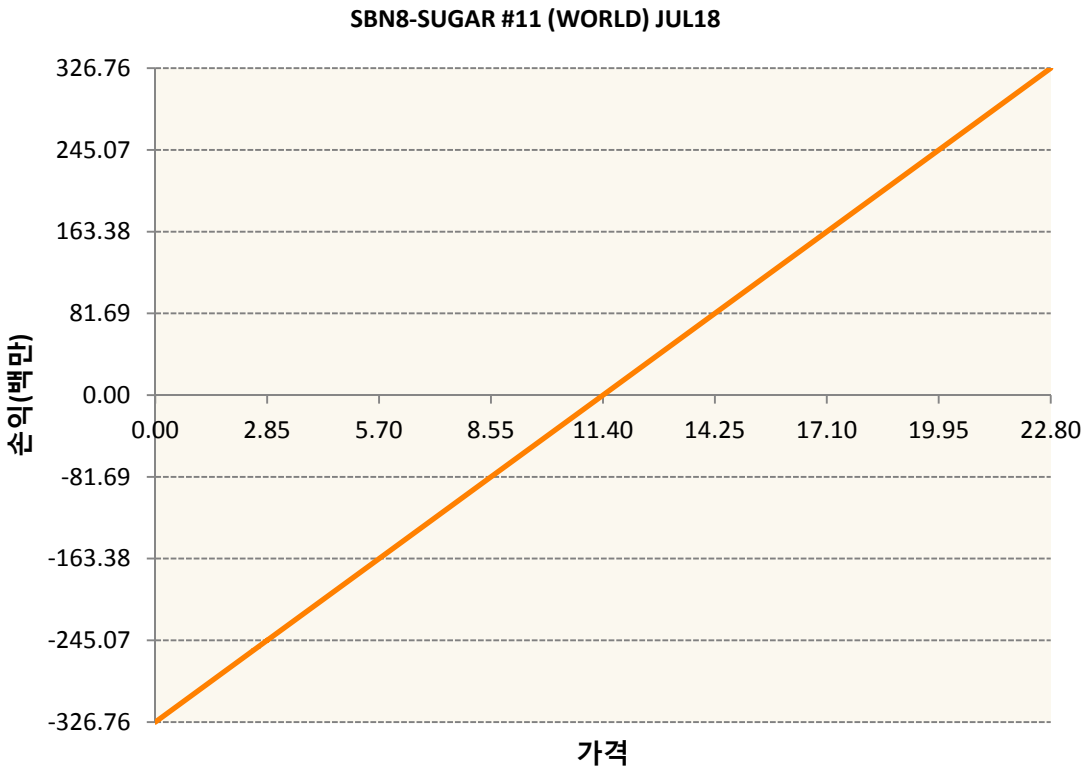
KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18

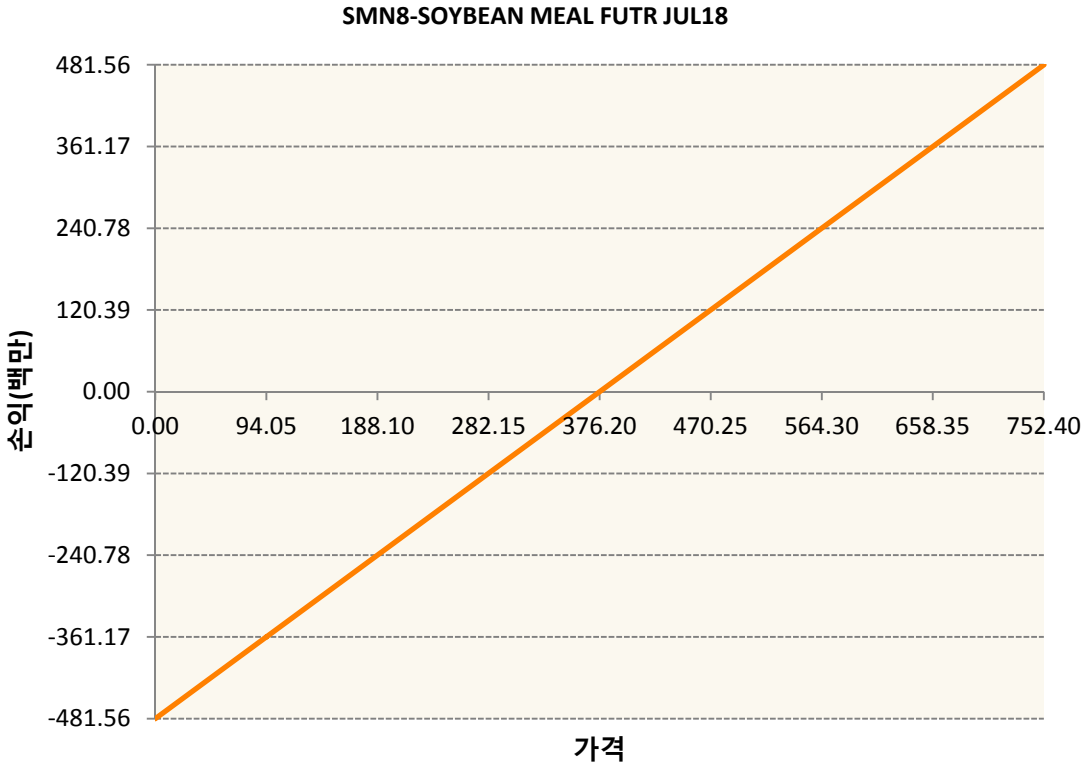


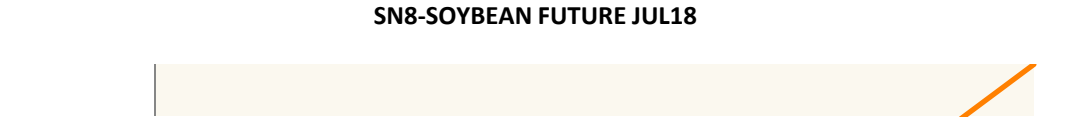

-333.22
가격

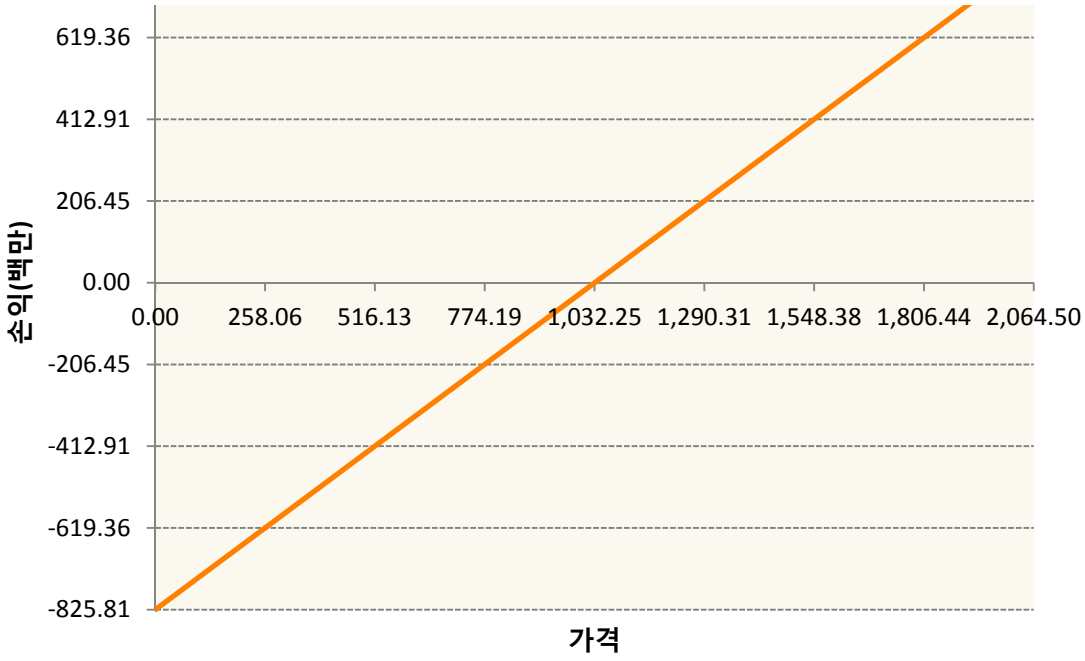

KR4175N50004-2018-05 달러선물
323.13
242.35
161.57
80.78
0.00
-80.78
-161.57
-242.35
-323.13
0.00
269.28
538.55
807.83
1,077.10
1,346.38
1,615.65
1,884.93
2,154.20
손익(백만)
가격

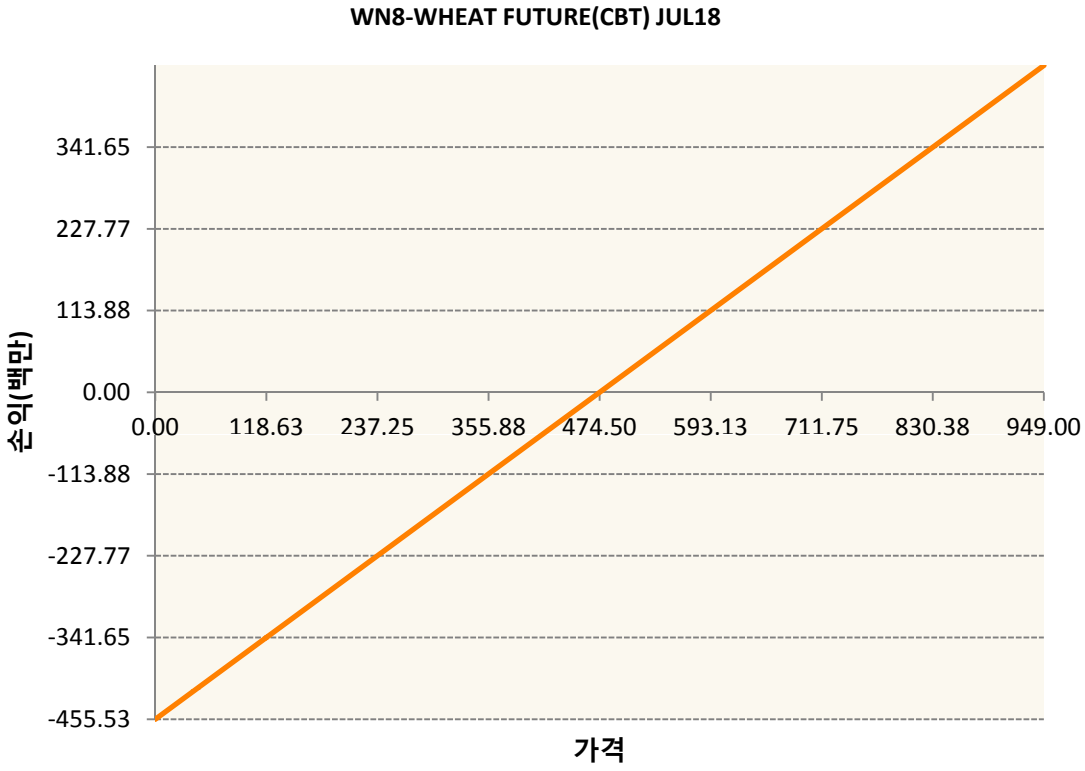

KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18
140.78
93.85
46.93
0.00
-46.93
-93.85
-140.78
-187.71
0.00
125.69
251.38
377.06
502.75
628.44
754.13
879.81
1,005.50
손익(백만)
가격


SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18
326.76
245.07
163.38
81.69
0.00
-81.69
-163.38
-245.07
-326.76
0.00
2.85
5.70
8.55
11.40
14.25
17.10
19.95
22.80
손익(백만)
가격


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18
481.56
361.17
240.78
120.39
0.00
-120.39
-240.78
-361.17
-481.56
0.00
94.05
188.10
282.15
376.20
470.25
564.30
658.35
752.40
손익(백만)
가격


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	27
CN8	CORN FUTURE JUL18	71
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	18
KCN8	COFFEE 'C' FUTURE JUL18	27
KR4175N50(	2018-05 달러선물	26

KWN8	KC HRW WHEAT FUT JUL18	15
SBN8	SUGAR #11 (WORLD) JUL18	26
SMN8	SOYBEAN MEAL FUTR JUL18	39
SN8	SOYBEAN FUTURE JUL18	66
WN8	WHEAT FUTURE(CBT) JUL18	36

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

326