공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

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	2018-04-26
기준일	2018-04-25

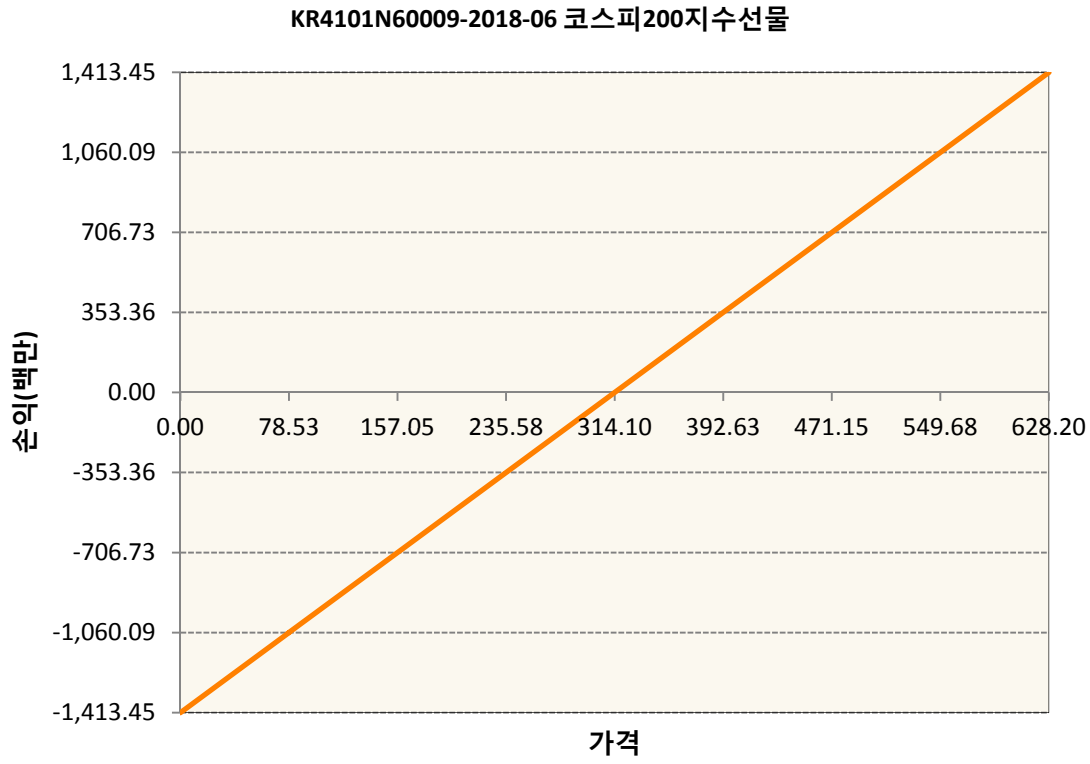
스마트인덱스모

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	1,413	0	1,413	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-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%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

83

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

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	1,096

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

445

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

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	398

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

433

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

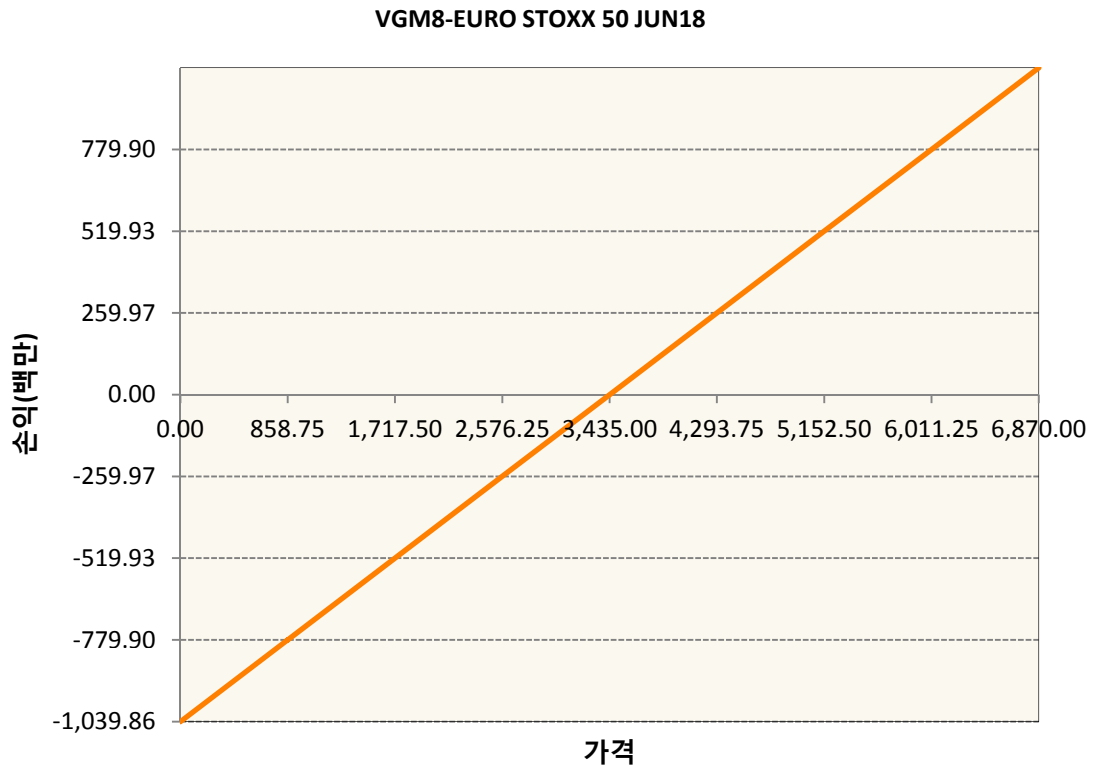
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,040	0	1,040	

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	2018-04-26
기준일	2018-04-25

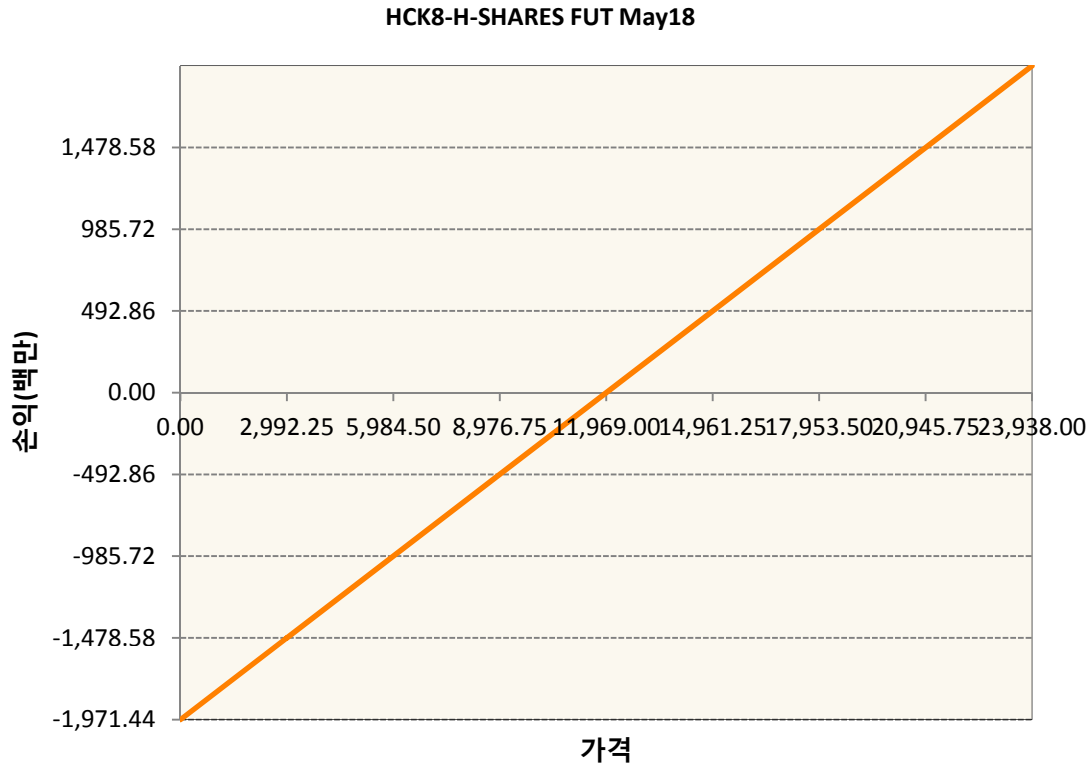
차이나인덱스모(주식-파생형)

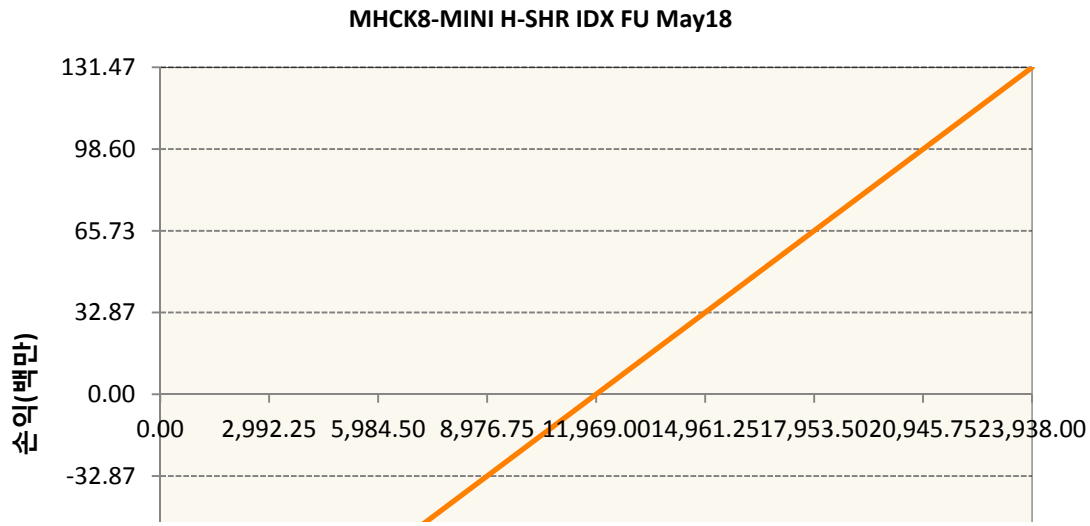
1. 계약금액

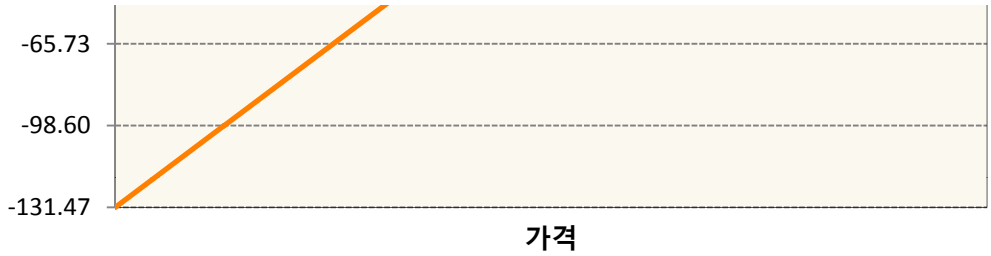
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,103	0	2,103	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCK8	H-SHARES FUT May18	158
MHCK8	MINI H-SHR IDX FU May18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	149

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

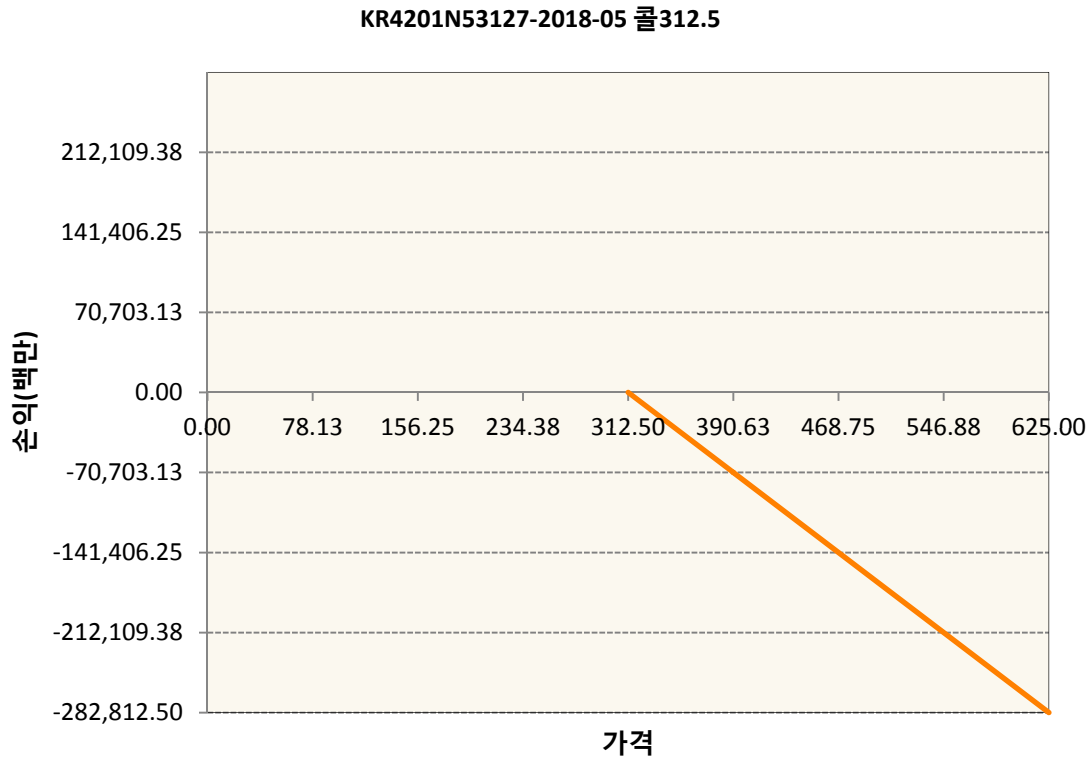
커버드콜모(주식혼합-파생형)

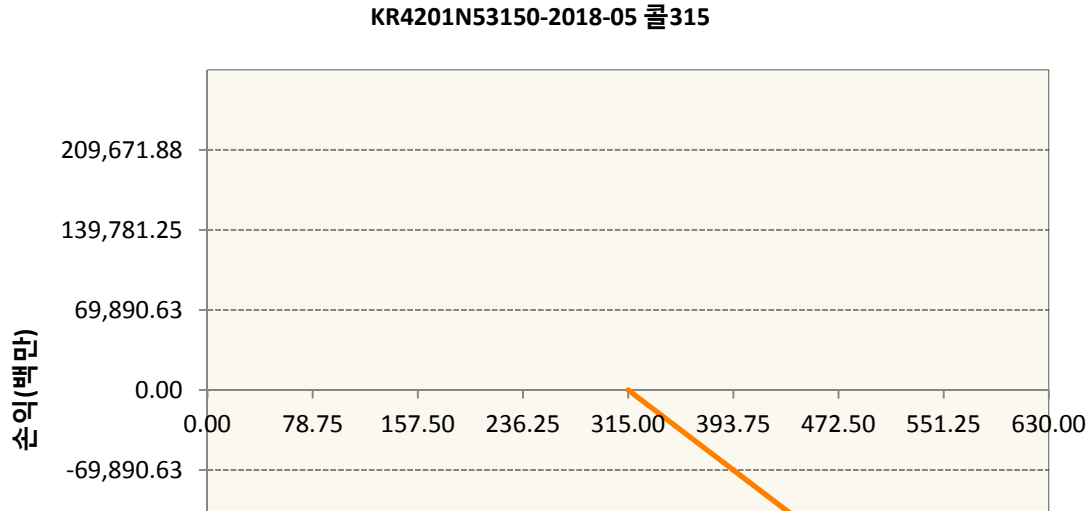
1. 계약금액

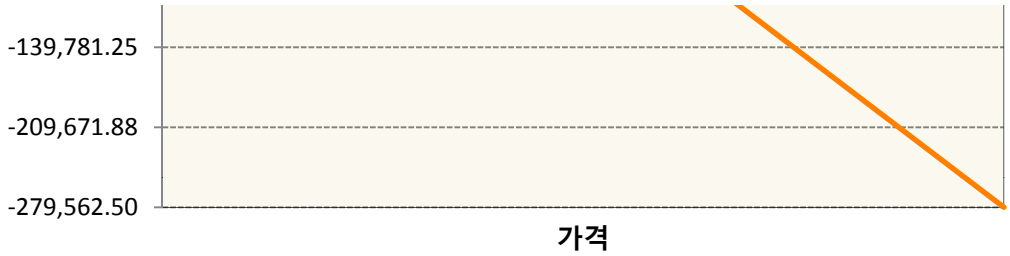
(단위:백만원)

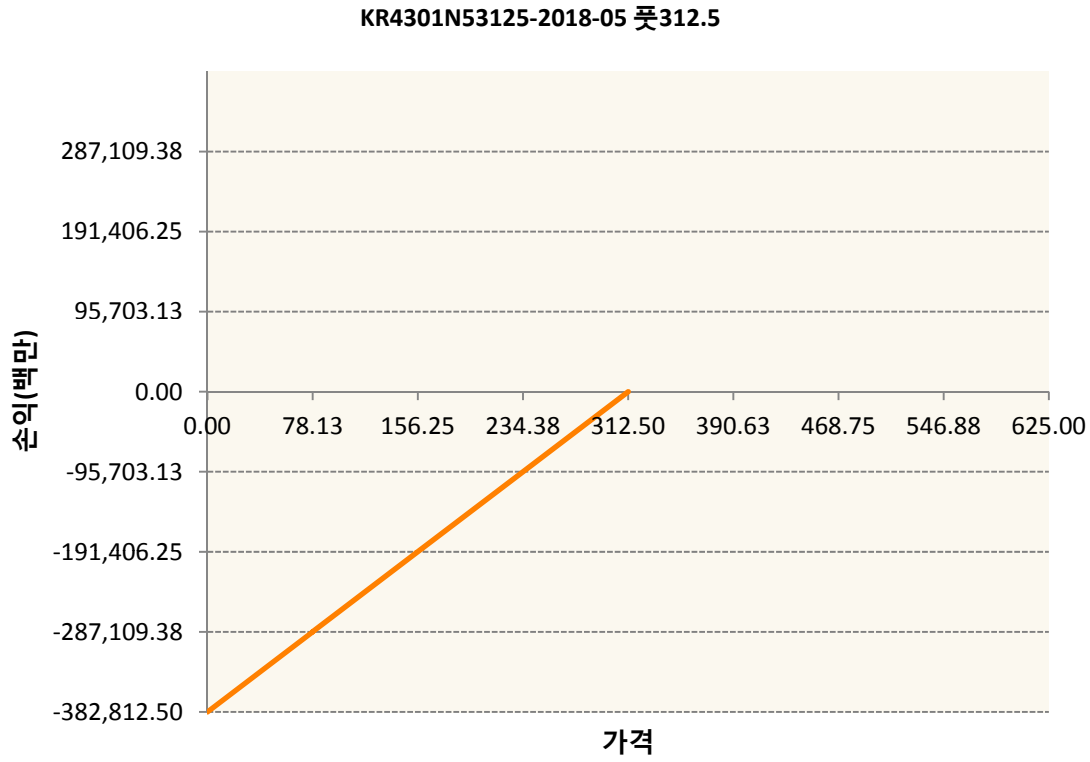
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	7,728	0	7,728	장내
누계	유가증권	옵션	0	945,188	-945,188	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5							18,231
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,042	6,925	6,772	6,585	6,366	6,119	5,846
-5.33%	6,477	6,190	5,869	5,521	5,150	4,760	4,354
-2.67%	4,874	4,400	3,916	3,425	2,927	2,424	1,917
0%	1,614	1,077	539	0	-539	-1,078	-1,617
2.67%	-3,444	-3,876	-4,328	-4,795	-5,273	-5,761	-6,256
5.33%	-9,867	-10,121	-10,413	-10,739	-11,092	-11,469	-11,866
8.00%	-17,032	-17,144	-17,293	-17,479	-17,699	-17,951	-18,231
KR4201N5312018-05 콜315							17,085
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5,868	5,785	5,669	5,520	5,341	5,132	4,898

-5.33%	5,481	5,251	4,985	4,687	4,363	4,017	3,651
-2.67%	4,270	3,849	3,411	2,959	2,496	2,025	1,548
0%	1,594	1,063	531	0	-532	-1,063	-1,595
2.67%	-2,858	-3,331	-3,816	-4,310	-4,810	-5,315	-5,825
5.33%	-8,809	-9,116	-9,456	-9,824	-10,216	-10,626	-11,052
8.00%	-15,665	-15,813	-16,001	-16,225	-16,483	-16,771	-17,085
KR4301N5312018-05 풋312.5							25,323

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25,242	-25,243	-25,247	-25,255	-25,269	-25,291	-25,323
-5.33%	-15,026	-15,063	-15,120	-15,197	-15,295	-15,413	-15,551
-2.67%	-5,438	-5,675	-5,931	-6,205	-6,491	-6,788	-7,094
0%	1,109	741	371	0	-372	-744	-1,117
2.67%	3,338	3,182	2,997	2,789	2,561	2,316	2,055
5.33%	3,635	3,614	3,580	3,528	3,458	3,368	3,259
8.00%	3,649	3,648	3,645	3,639	3,628	3,609	3,580

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

64,138

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

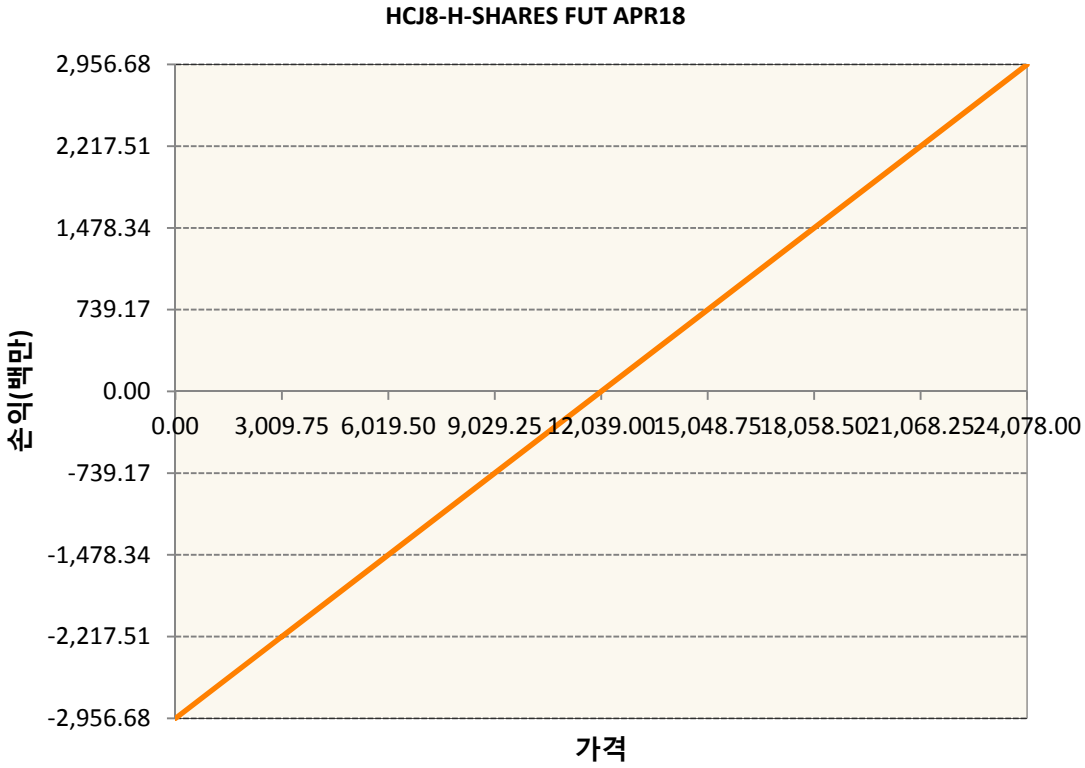
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

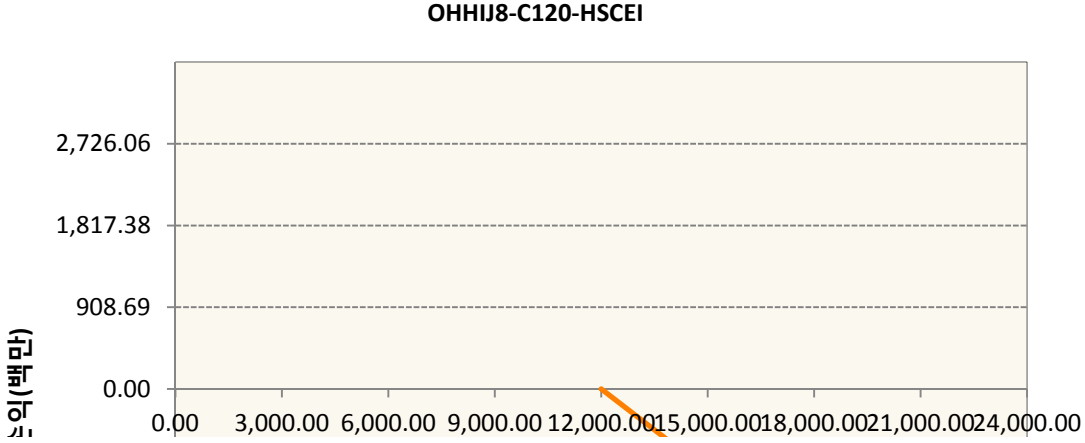
1. 계약금액

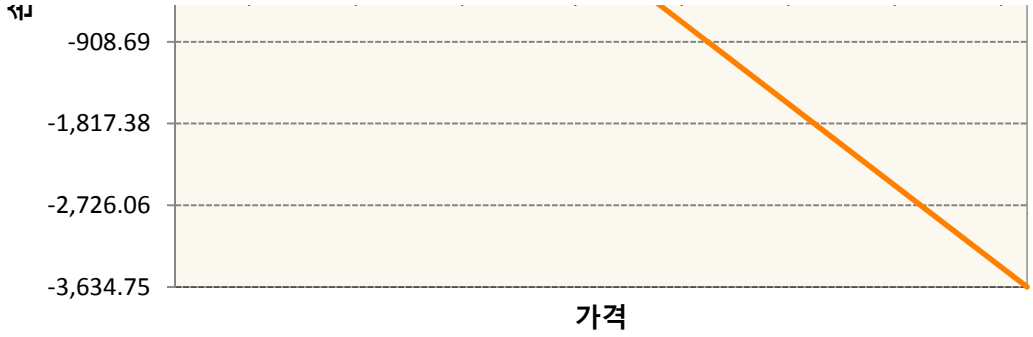
(단위:백만원)

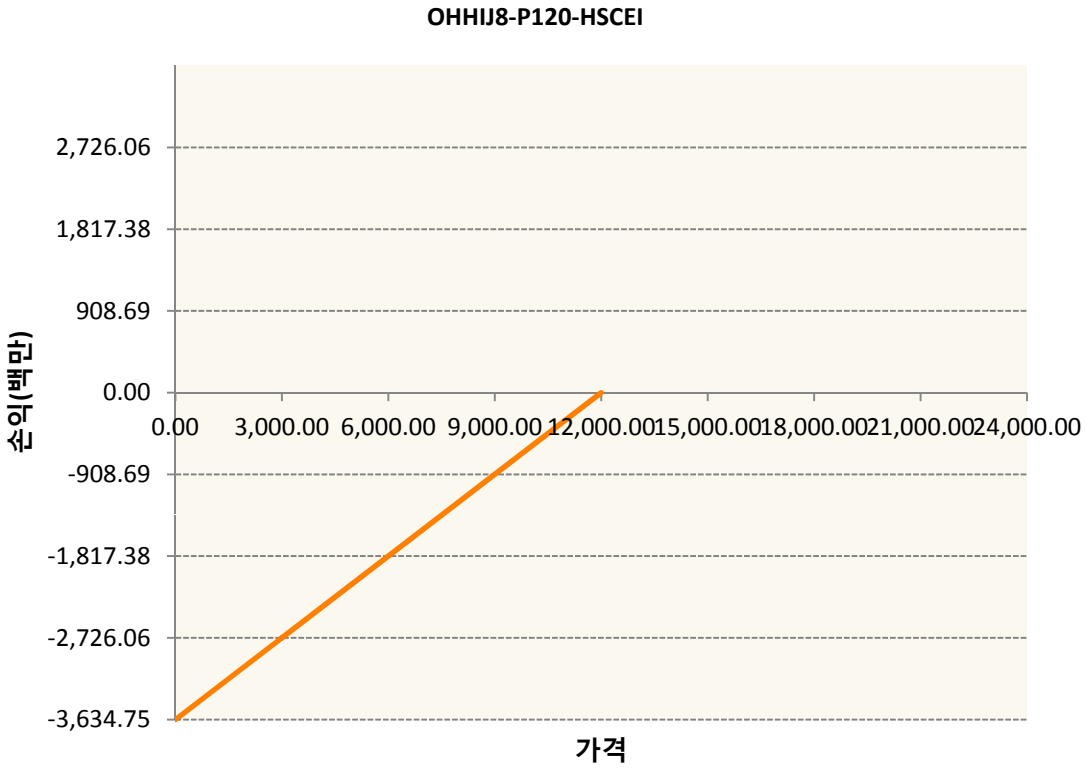
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,957	0	2,957	장내
누계	유가증권	옵션	0	7,270	-7,270	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	237
OHHIJ8-C12	HSCEI	291
OHHIJ8-P12	HSCEI	291

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

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

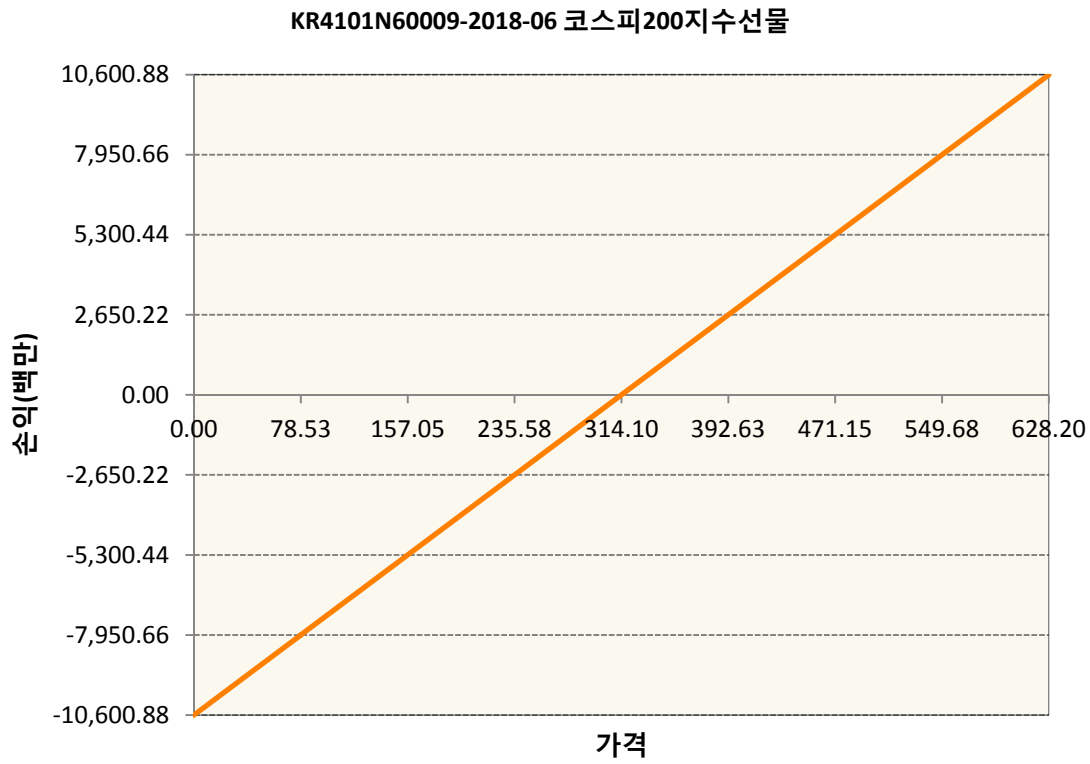
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

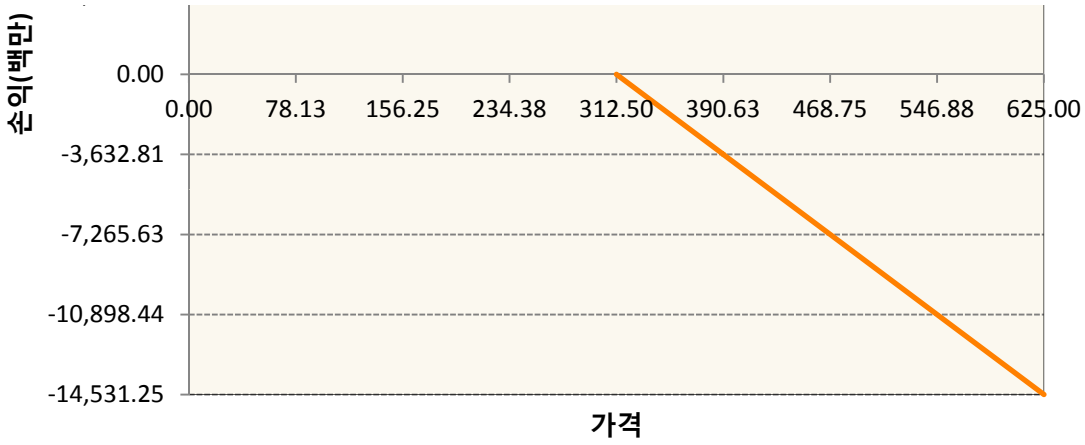
(단위:백만원)

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	10,601	0	10,601	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,754	-55,754	장내

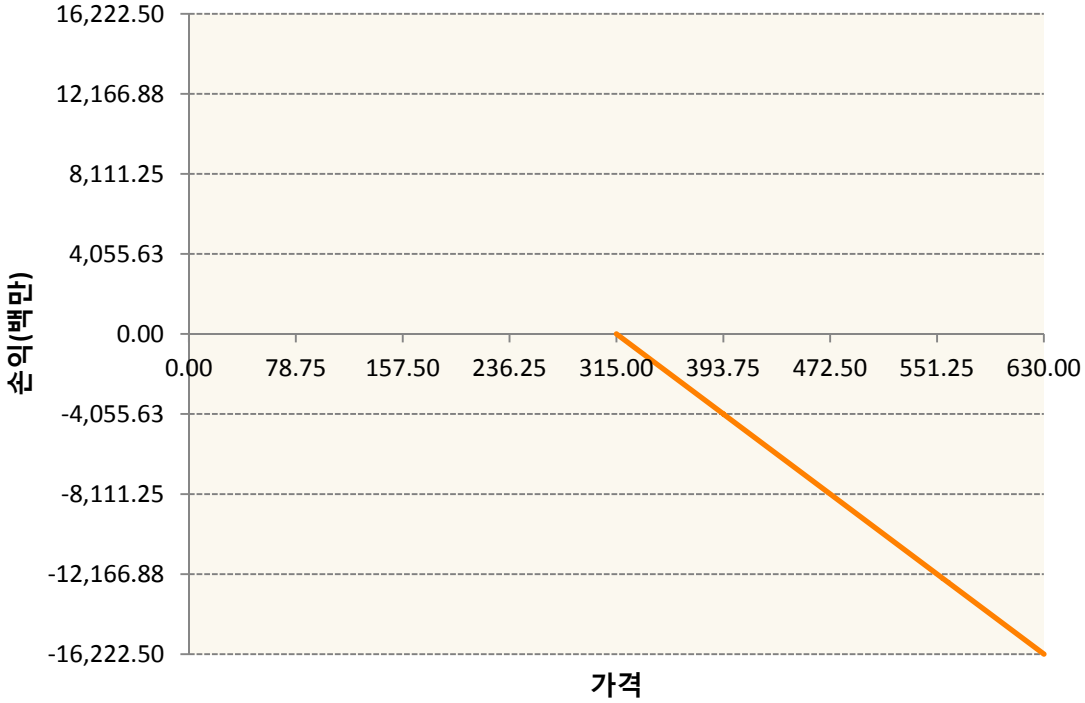
2. 만기시점의 손익구조



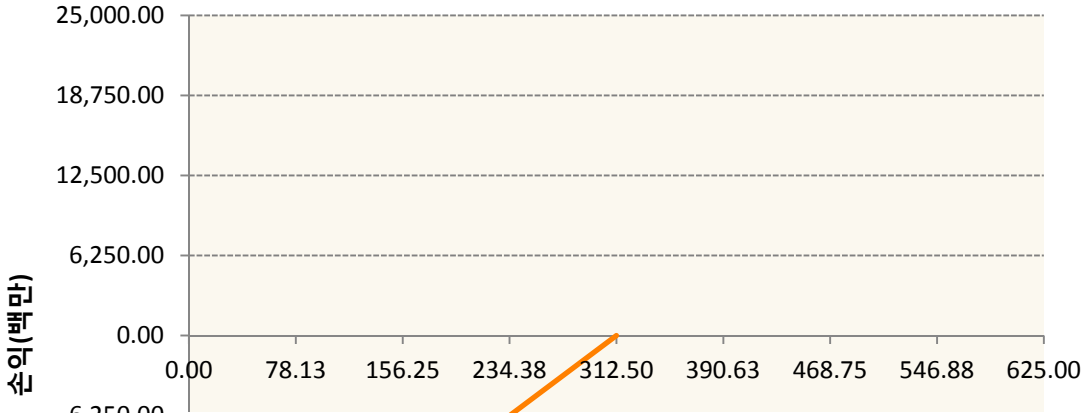




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469	-1,469
-5.33%	-980	-980	-980	-980	-980	-980	-980
-2.67%	-490	-490	-490	-490	-490	-490	-490
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	490	490	490	490	490	490	490
5.33%	980	980	980	980	980	980	980
8.00%	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469	1,469
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							278
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-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%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	278	278	278	278	278	278	278
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							238
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-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%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	238	238	238	238	238	238	238
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%	-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%	199	199	199	199	199	199	199
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						254
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-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%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	254	254	254	254	254	254	254
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						470
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-470	-470	-470	-470	-470	-470
-5.33%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
-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%	313	313	313	313	313	313	313
8.00%	470	470	470	470	470	470	470
	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						635
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-635	-635	-635	-635	-635	-635	-635
-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%	635	635	635	635	635	635	635
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						477
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-477	-477	-477	-477	-477	-477	-477
-5.33%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
-2.67%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	159	159	159	159	159	159	159
5.33%	318	318	318	318	318	318	318
8.00%	477	477	477	477	477	477	477
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						848
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-848	-848	-848	-848	-848	-848	-848
-5.33%	-565	-565	-565	-565	-565	-565	-565
-2.67%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	283	283	283	283	283	283	283
5.33%	565	565	565	565	565	565	565
8.00%	848	848	848	848	848	848	848
	KR4201N531 2018-05 콜312.5						937
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	362	356	348	338	327	314	300
-5.33%	333	318	302	284	265	245	224
-2.67%	250	226	201	176	150	125	99
0%	83	55	28	0	-28	-55	-83
2.67%	-177	-199	-222	-246	-271	-296	-321
5.33%	-507	-520	-535	-552	-570	-589	-610
8.00%	-875	-881	-889	-898	-909	-922	-937
	KR4201N531 2018-05 콜315						991
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	341	336	329	320	310	298	284
-5.33%	318	305	289	272	253	233	212
-2.67%	248	223	198	172	145	118	90
0%	92	62	31	0	-31	-62	-93
2.67%	-166	-193	-221	-250	-279	-308	-338
5.33%	-511	-529	-549	-570	-593	-617	-641
8.00%	-909	-918	-928	-942	-957	-973	-991
	KR4301N531 2018-05 풋312.5						1,654

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,648	-1,649	-1,649	-1,649	-1,650	-1,652	-1,654
-5.33%	-981	-984	-987	-992	-999	-1,007	-1,016
-2.67%	-355	-371	-387	-405	-424	-443	-463
0%	72	48	24	0	-24	-49	-73
2.67%	218	208	196	182	167	151	134
5.33%	237	236	234	230	226	220	213
8.00%	238	238	238	238	237	236	234

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

8,570

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

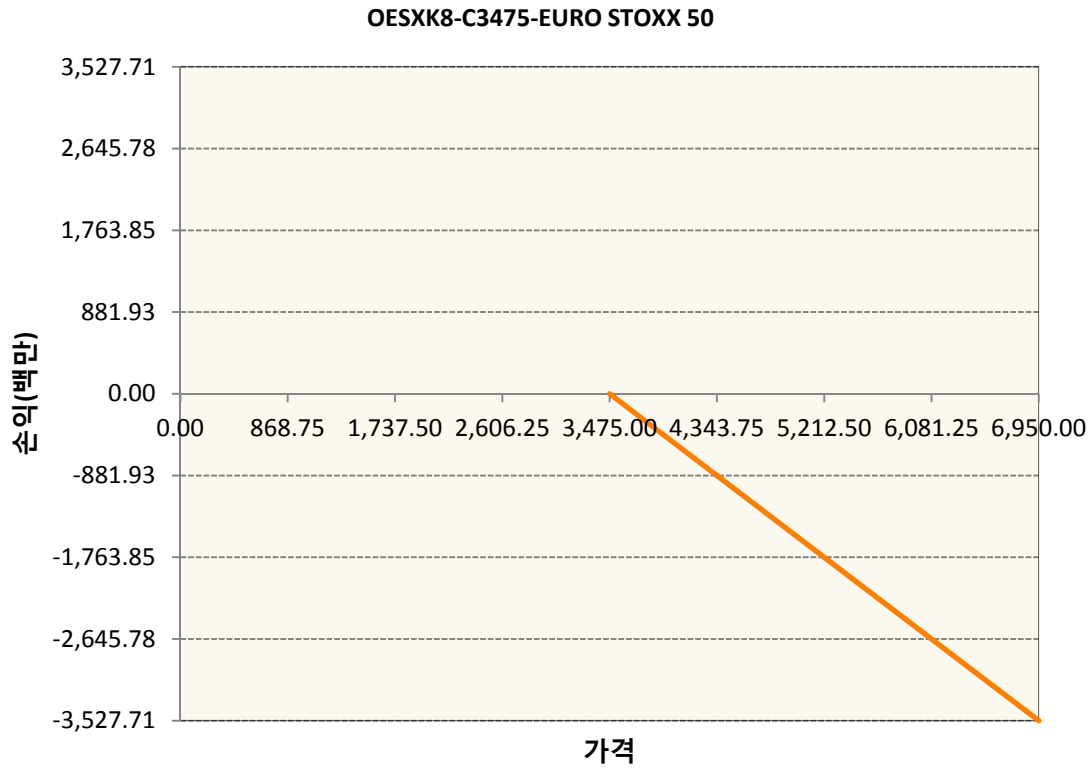
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

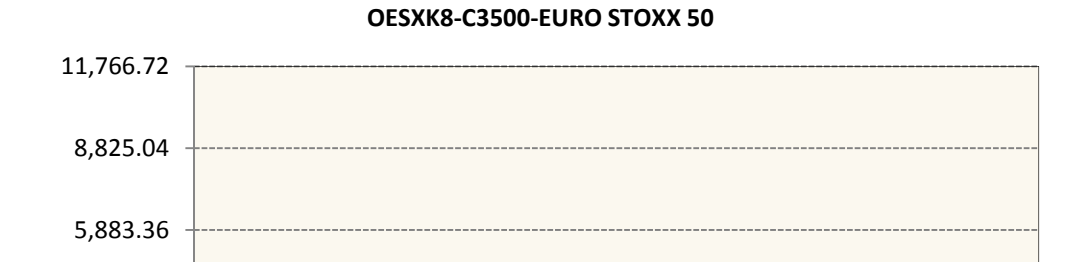
1. 계약금액

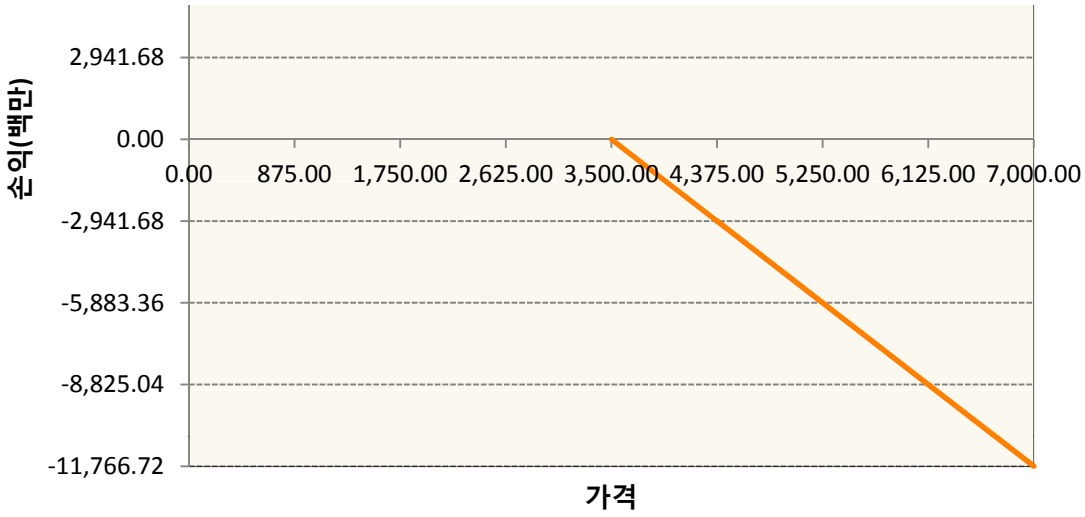
(단위:백만원)

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	6,844	0	6,844	
누계	유가증권	스왑	76,154	0	76,154	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,589	-30,589	장내
누계	지수	스왑	52,738	0	52,738	장외

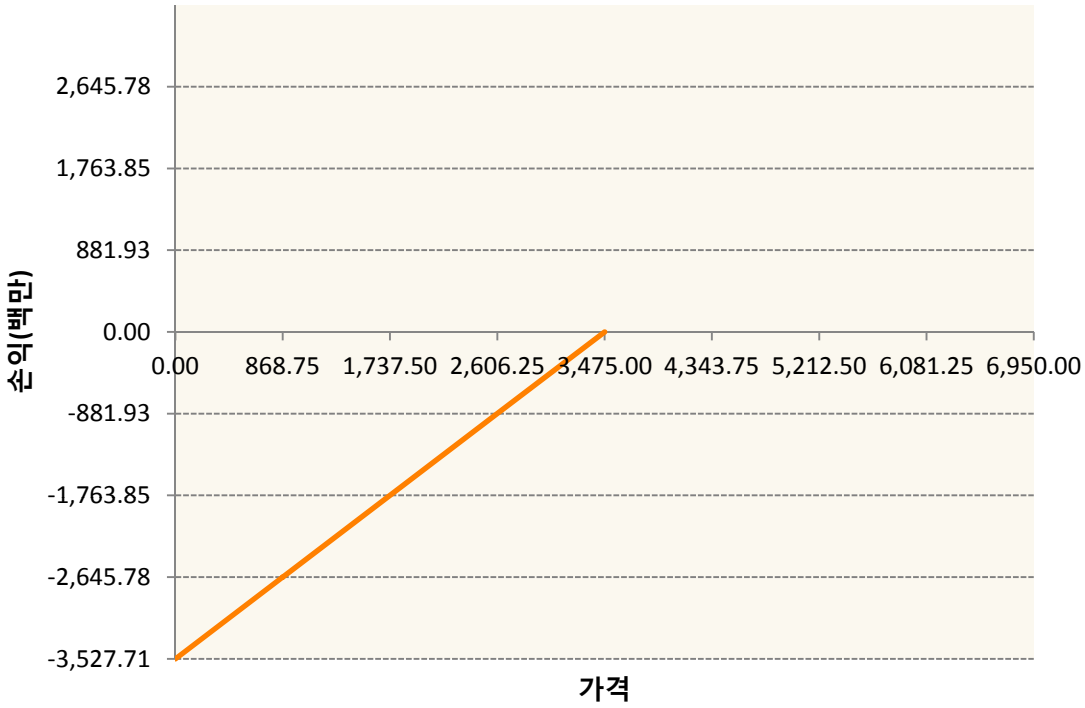
2. 만기시점의 손익구조



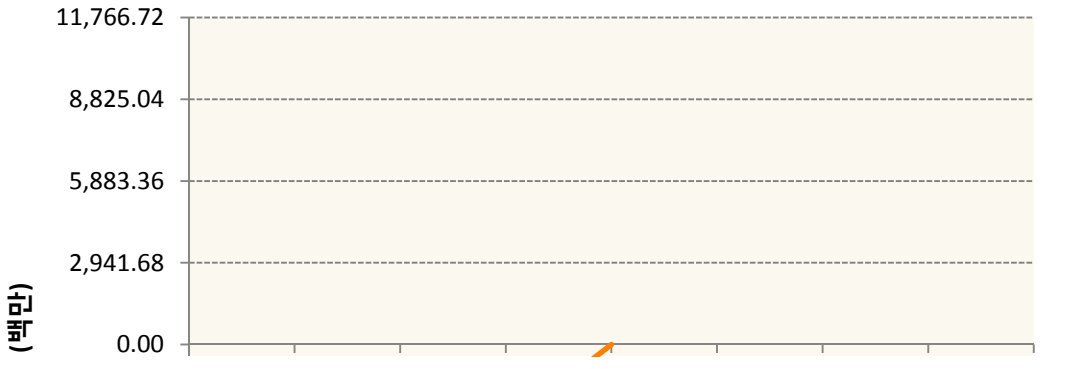


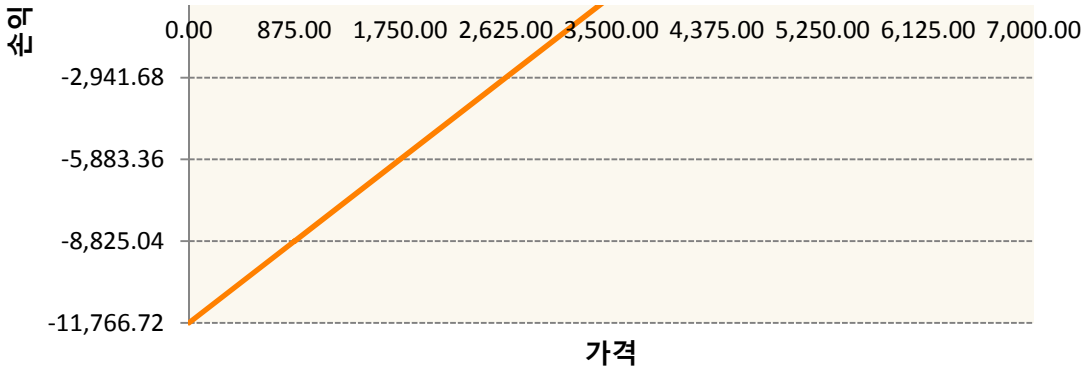


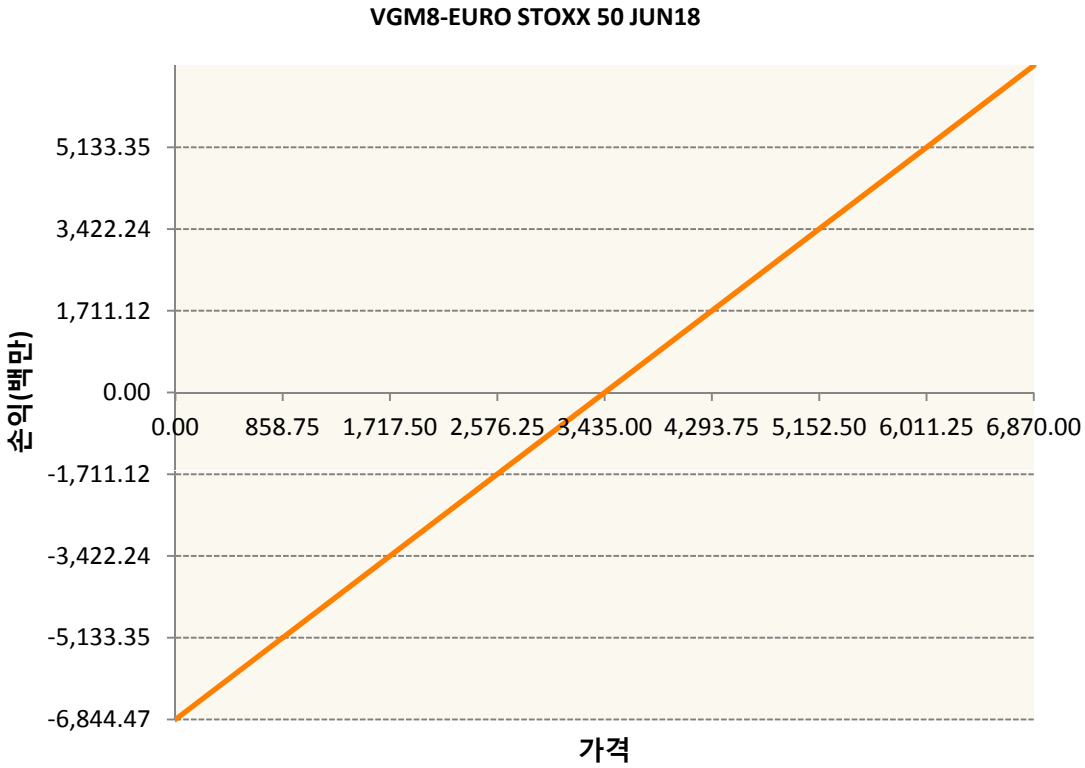
OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



OESXK8-P3500-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	16
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	23
OESXK8-C34 EURO STOXX 50	282
OESXK8-C35 EURO STOXX 50	941
OESXK8-P34 EURO STOXX 50	282
OESXK8-P35 EURO STOXX 50	941
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	548

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

1,868

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

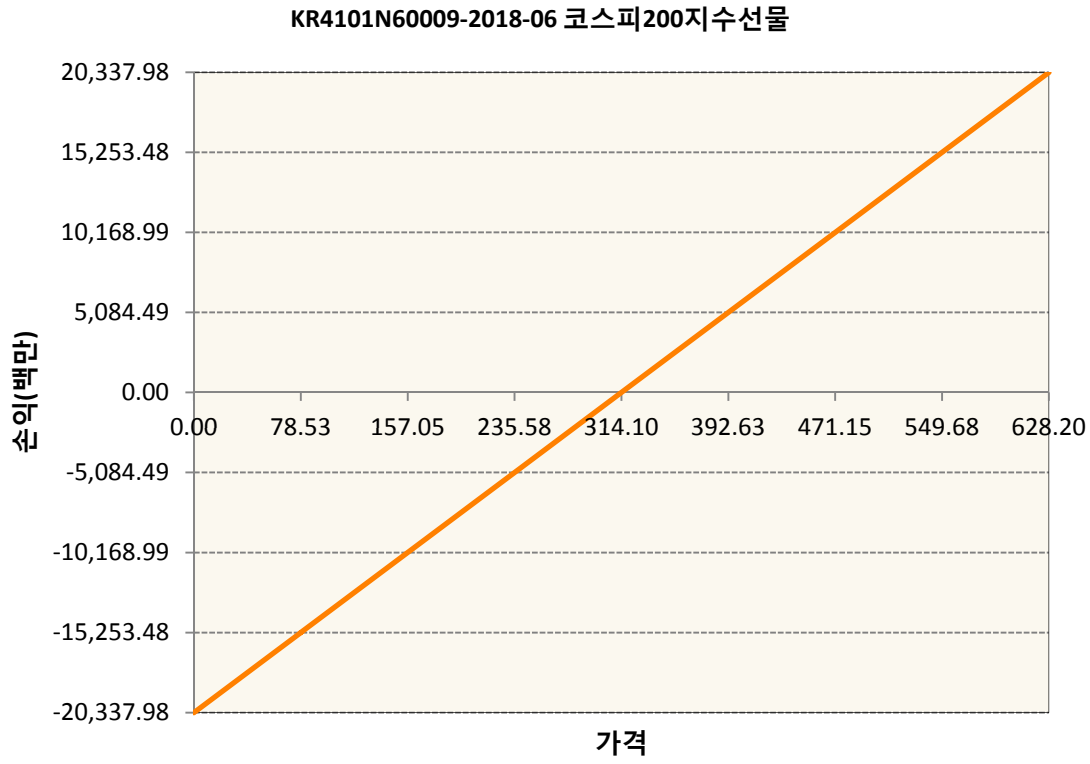
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,338	0	20,338	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626	-1,626
-5.33%	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084
-2.67%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	542	542	542	542	542	542	542
5.33%	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084
8.00%	1,626	1,626	1,626	1,626	1,626	1,626	1,626

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

1,190

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

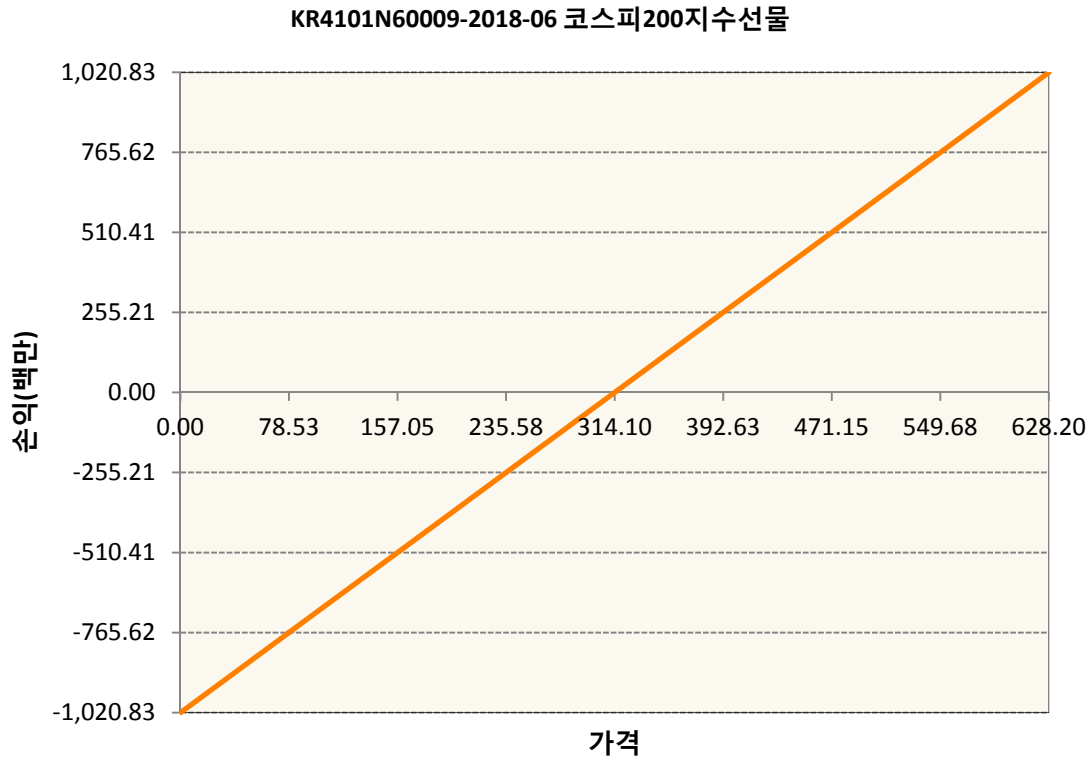
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,021	0	1,021	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%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-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%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

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

60

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

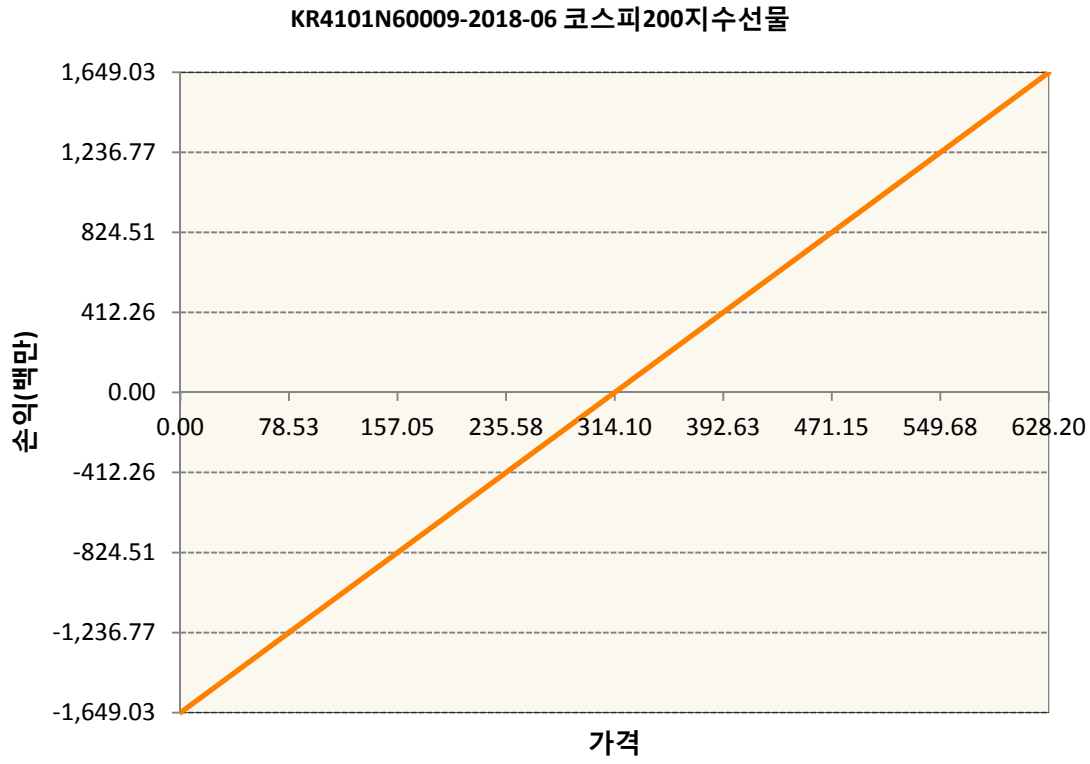
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,649	0	1,649	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132

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

96

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

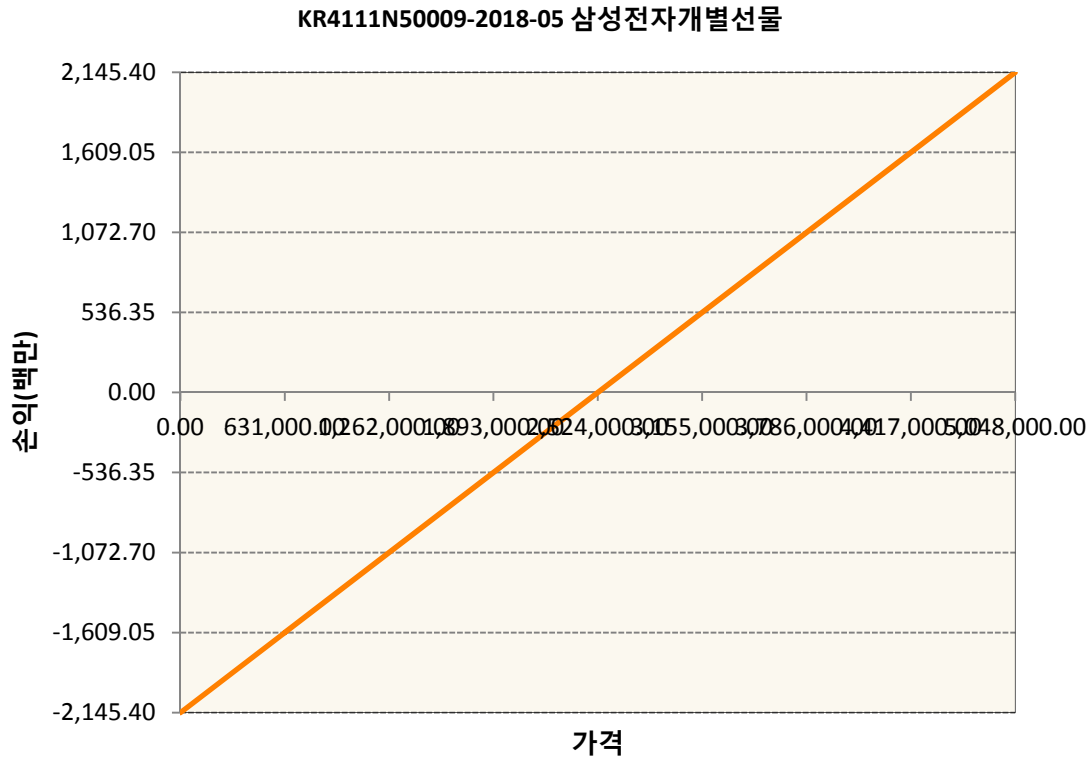
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

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	2,145	0	2,145	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N50(2018-05 삼성전자개별선물							171
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-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%	171	171	171	171	171	171	171

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

215

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

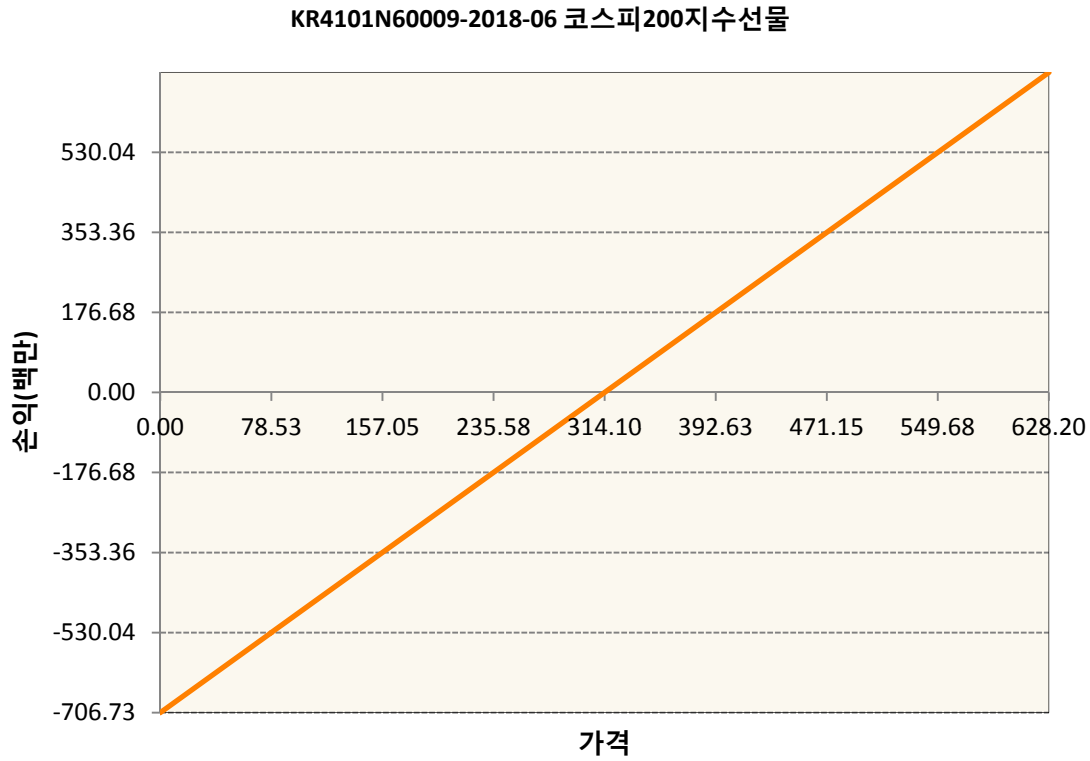
스마트KRX300인덱스목표전환형1

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	707	0	707	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)

41

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

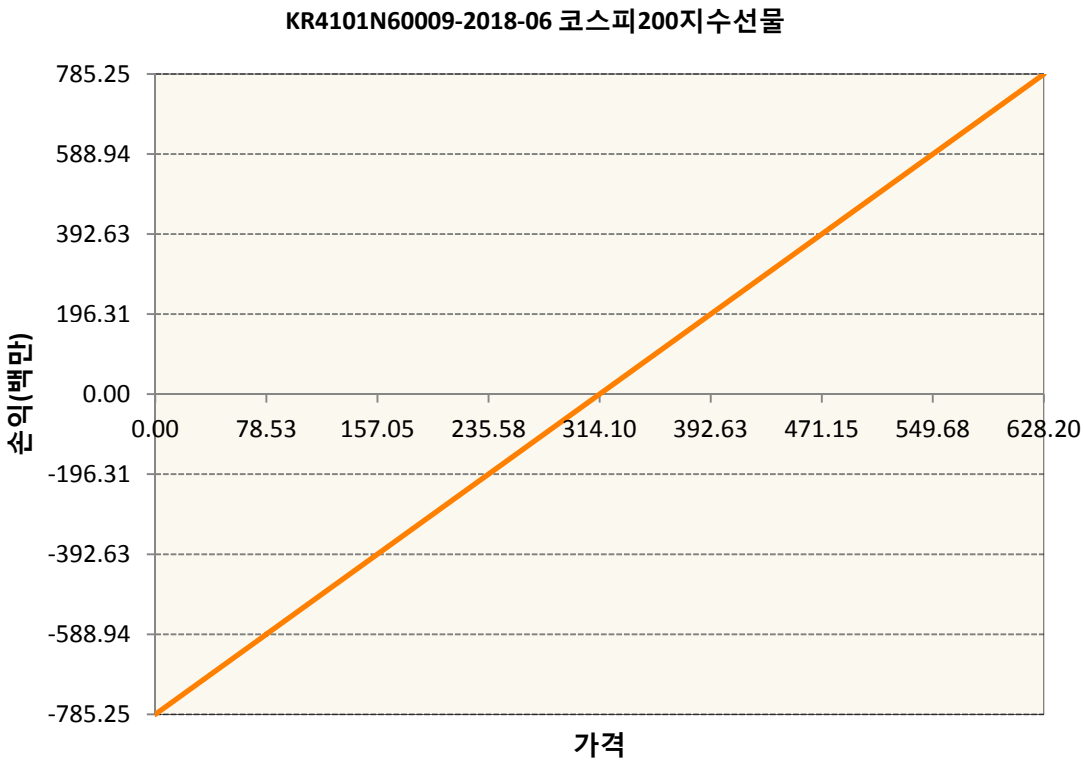
리디파인K200(주식혼합-파생재간

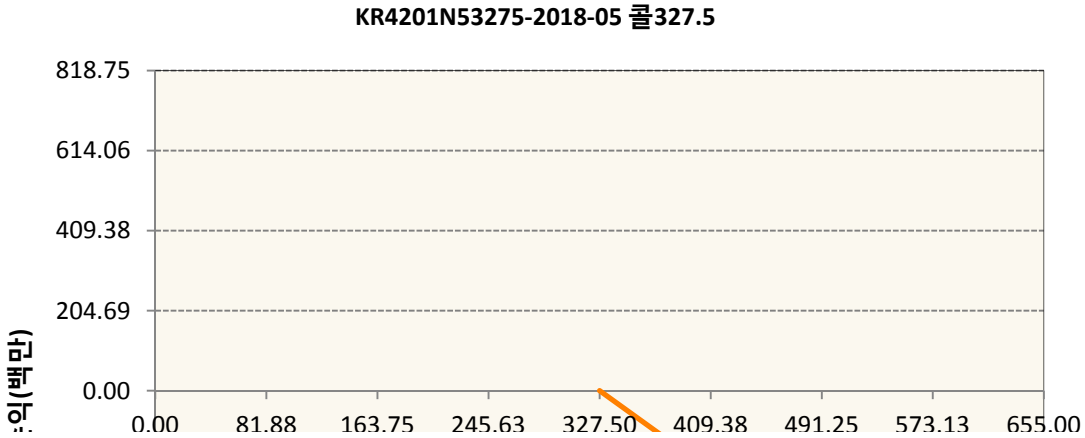
1. 계약금액

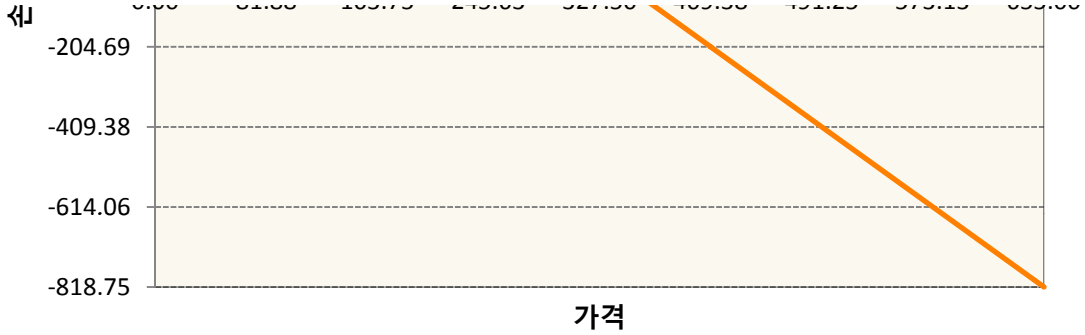
(단위:백만원)

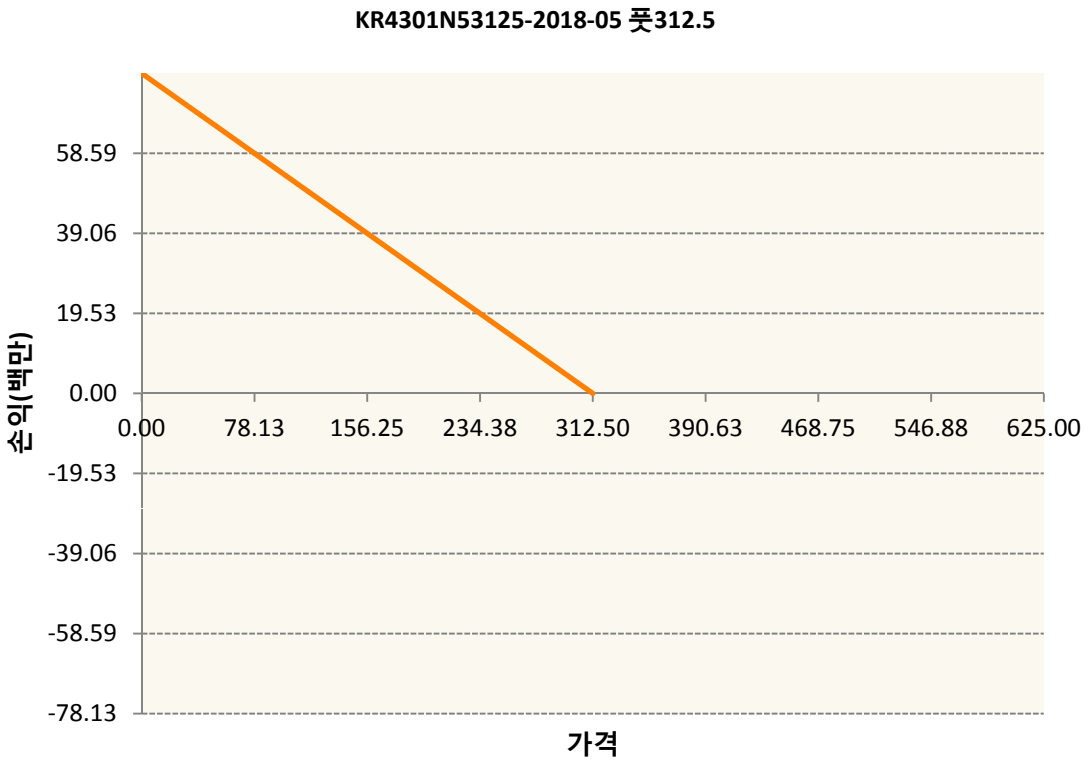
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	548	0	548	장내
신규	유가증권	옵션	77	574	-496	장내
누계	유가증권	선물	785	0	785	장내
누계	유가증권	옵션	78	819	-741	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	63	63	63	63	63	63	63
KR4201N532 2018-05 콜327.5							35
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	5
-5.33%	6	6	6	5	5	4	4
-2.67%	5	5	4	4	3	2	1
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	-2	-4	-5	-7	-8	-10	-11
5.33%	-12	-14	-15	-17	-19	-20	-22
8.00%	-27	-28	-30	-31	-32	-34	-35
KR4301N5312018-05 풋312.5							5
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	1	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

78

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

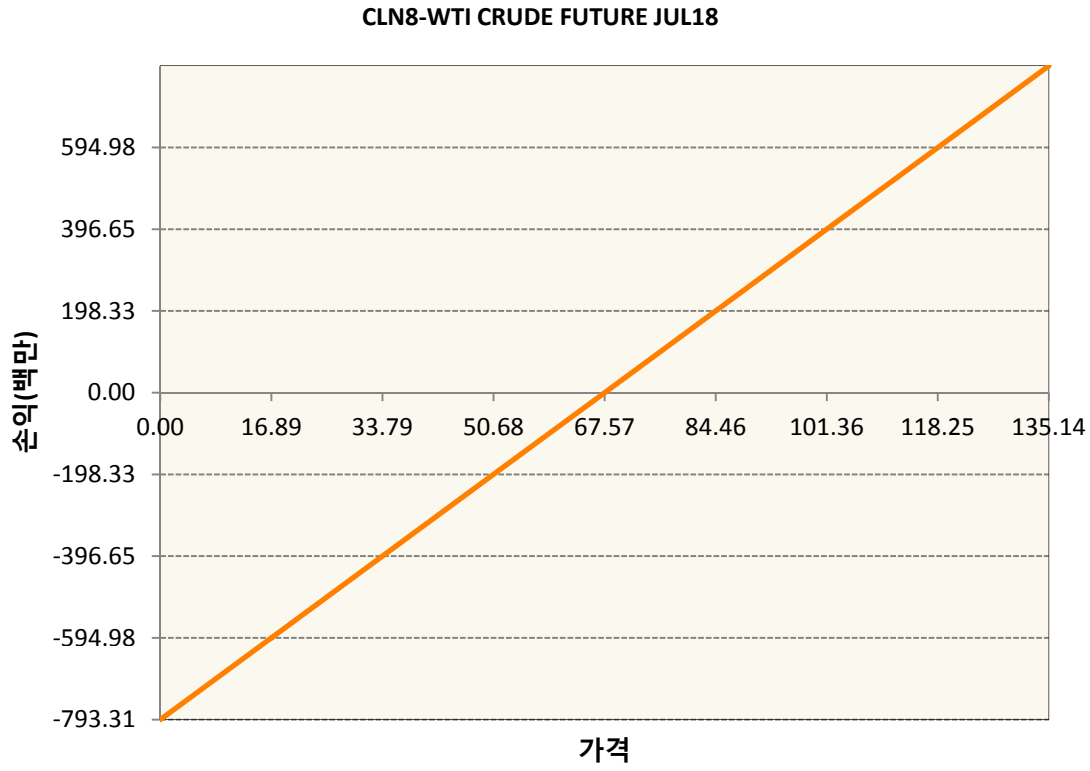
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

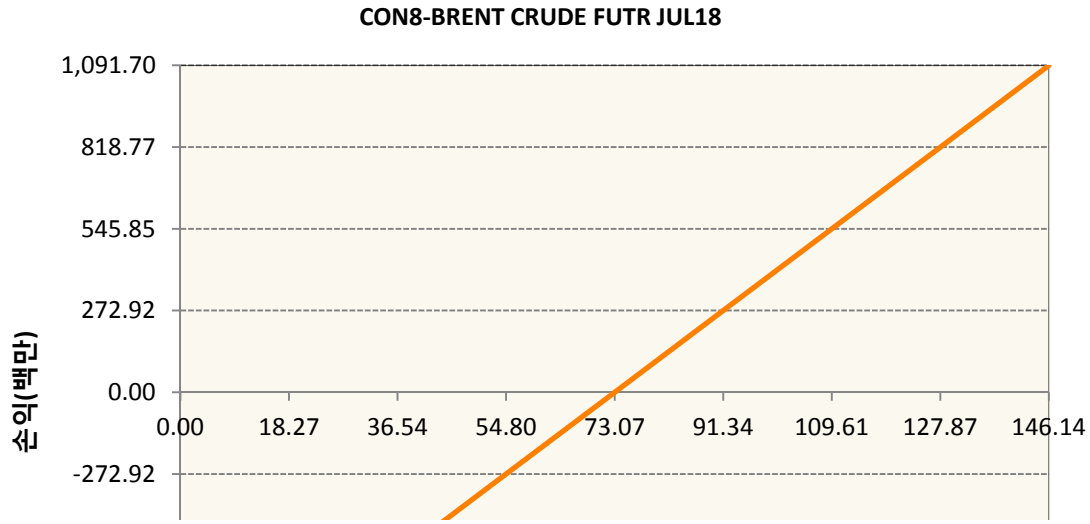
1. 계약금액

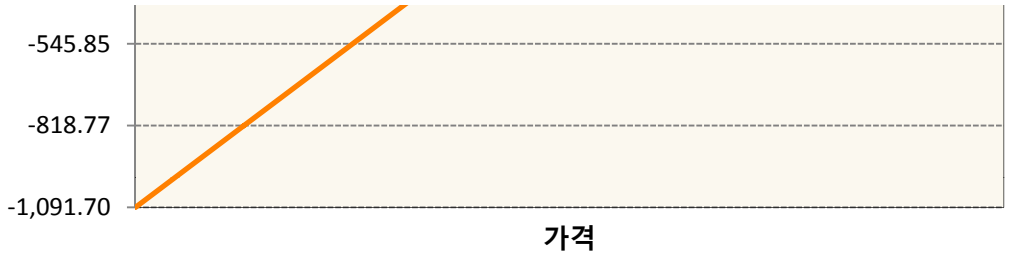
(단위:백만원)

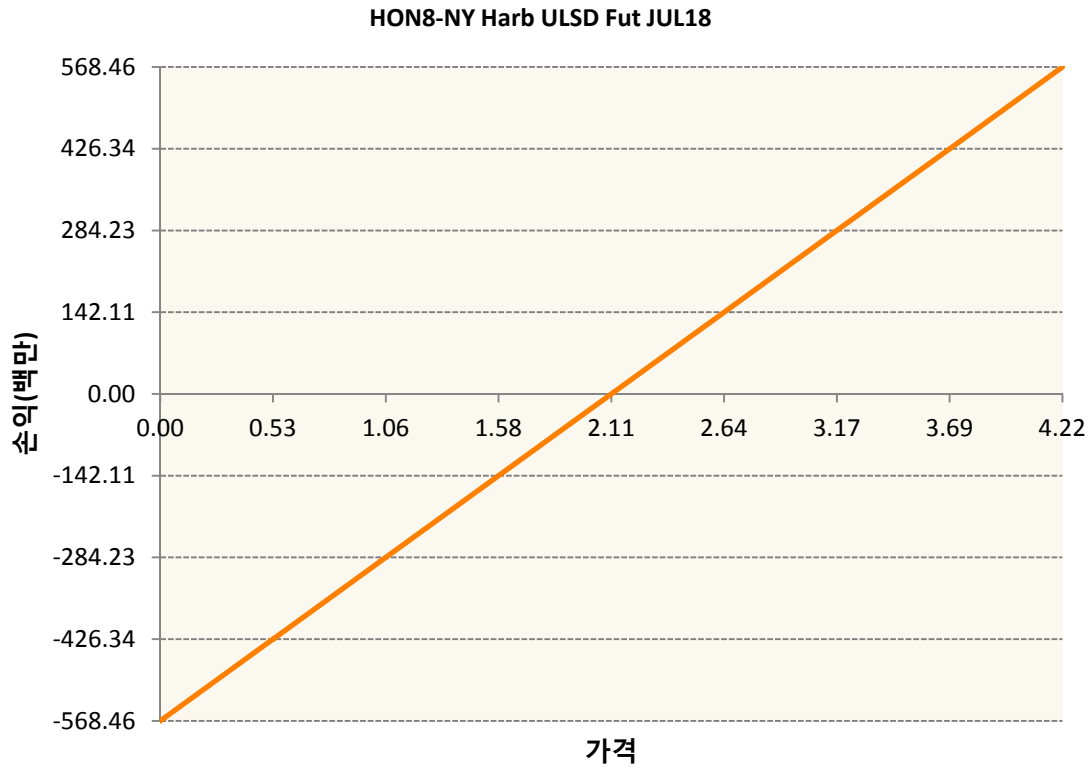
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,111	595	3,517	

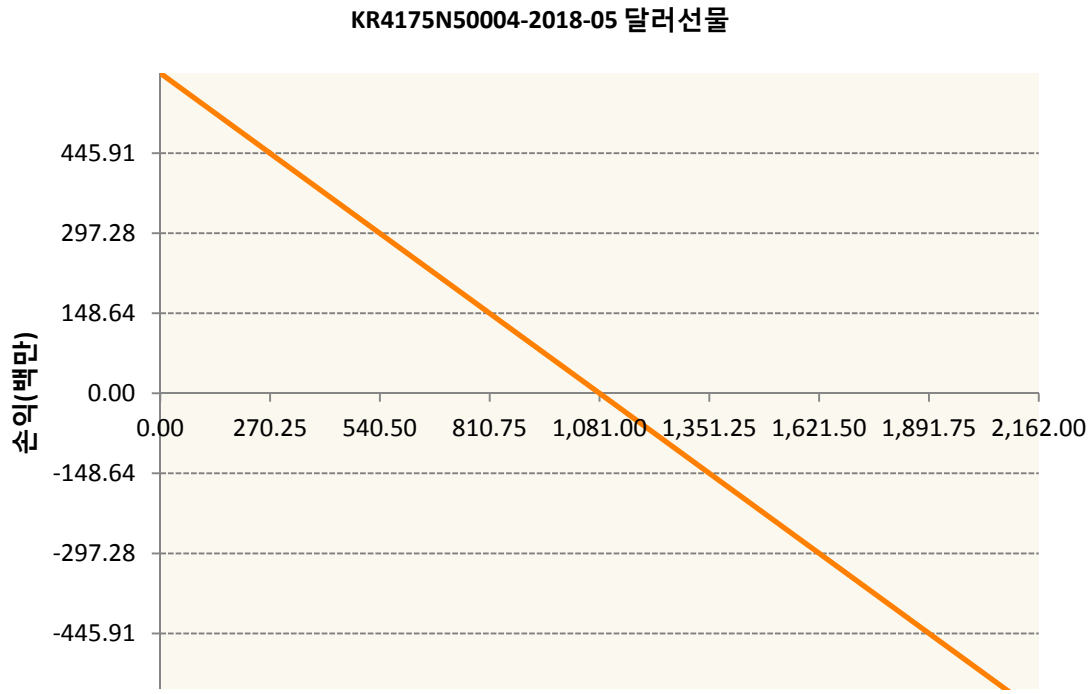
2. 만기시점의 손익구조

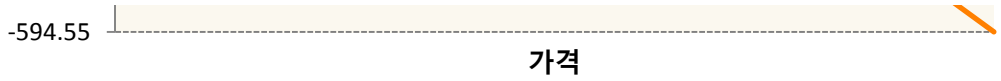


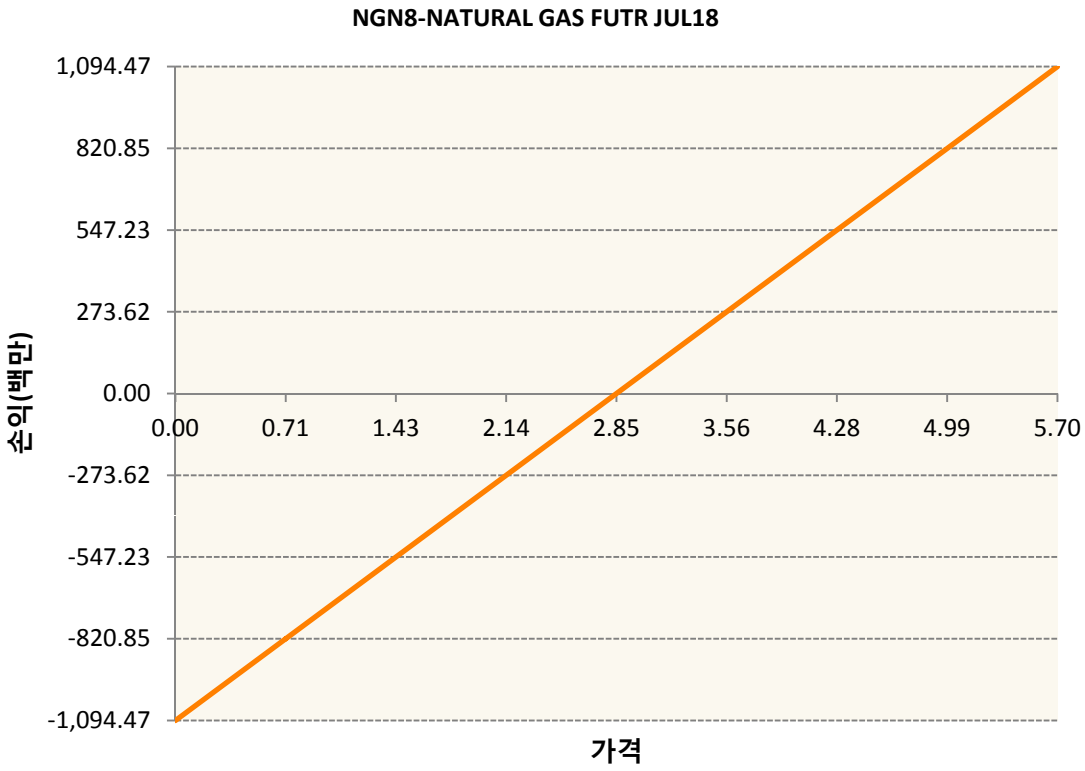


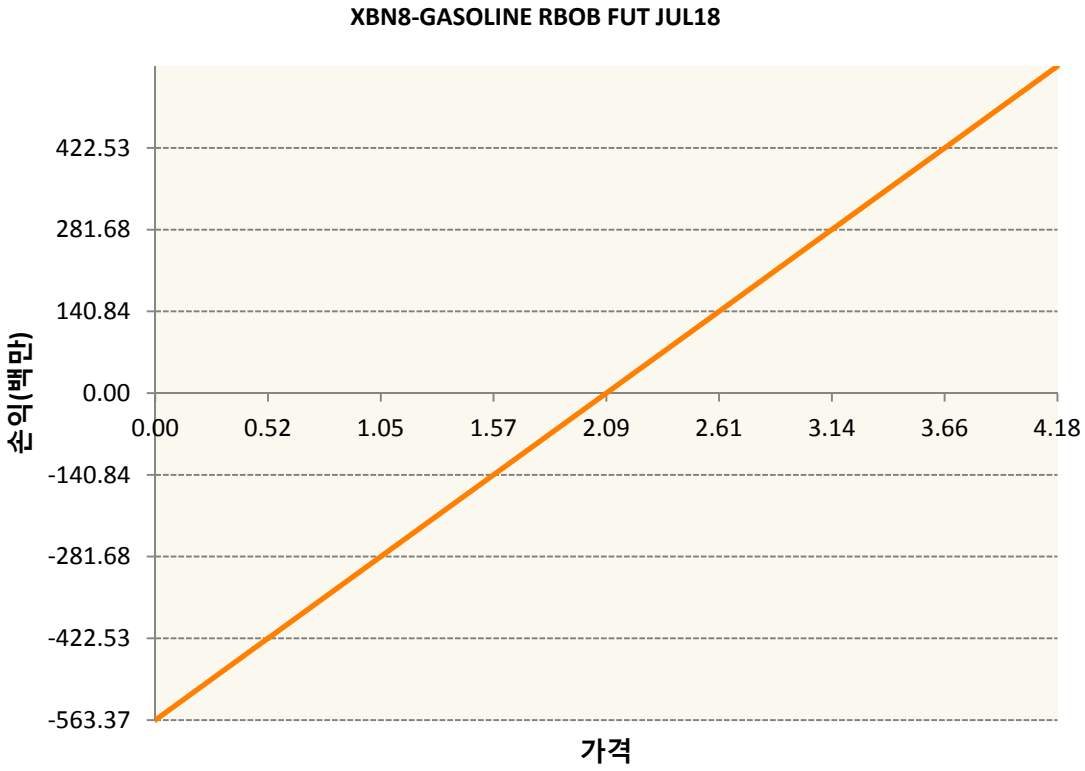

-545.85
-818.77
-1,091.70
가격


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18
568.46
426.34
284.23
142.11
0.00
-142.11
-284.23
-426.34
-568.46
0.00
0.53
1.06
1.58
2.11
2.64
3.17
3.69
4.22
손익(백만)
가격


KR4175N50004-2018-05 달러선물
445.91
297.28
148.64
0.00
-148.64
-297.28
-445.91
0.00
270.25
540.50
810.75
1,081.00
1,351.25
1,621.50
1,891.75
2,162.00
손익(백만)


-594.55
가격


NGN8-NATURAL GAS FUTR JUL18
1,094.47
820.85
547.23
273.62
0.00
-273.62
-547.23
-820.85
-1,094.47
0.00
0.71
1.43
2.14
2.85
3.56
4.28
4.99
5.70
손익(백만)
가격


XBN8-GASOLINE RBOB FUT JUL18
422.53
281.68
140.84
0.00
-140.84
-281.68
-422.53
-563.37
0.00
0.52
1.05
1.57
2.09
2.61
3.14
3.66
4.18
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLN8	WTI CRUDE FUTURE JUL18	63
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	87
HON8	NY Harb ULSD Fut JUL18	45
KR4175N50(	2018-05 달러선물	48
NGN8	NATURAL GAS FUTR JUL18	88
XBN8	GASOLINE RBOB FUT JUL18	45

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

513

공시일	2018-04-26
기준일	2018-04-25

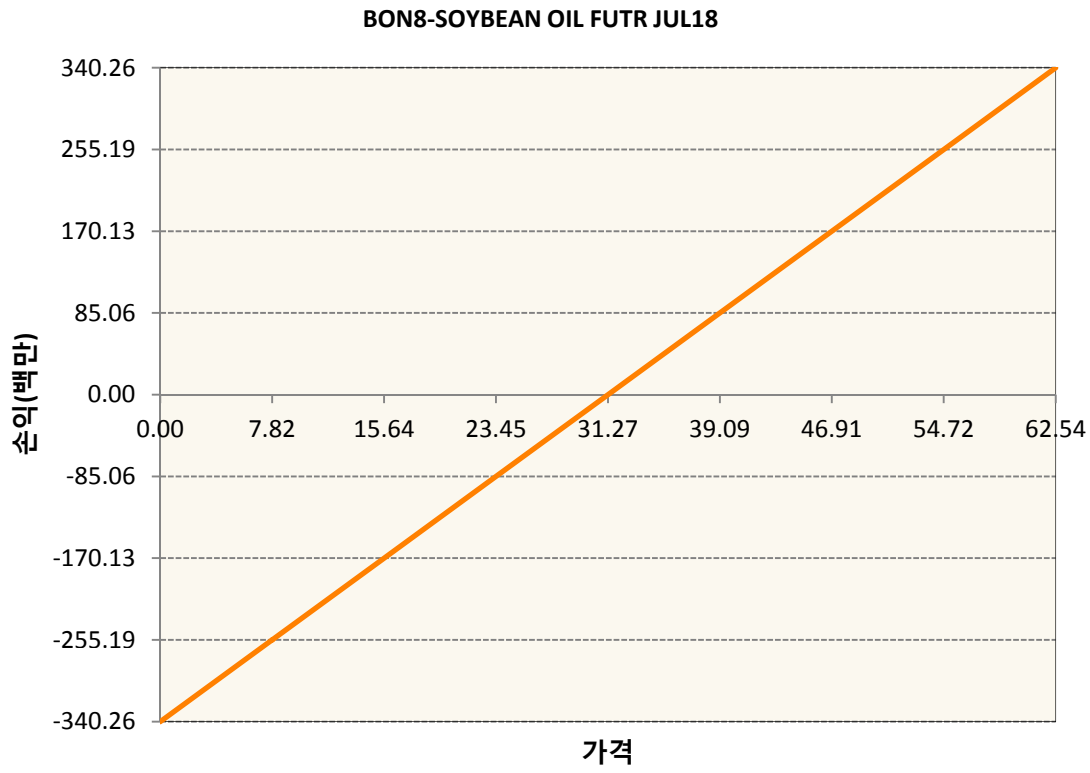
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

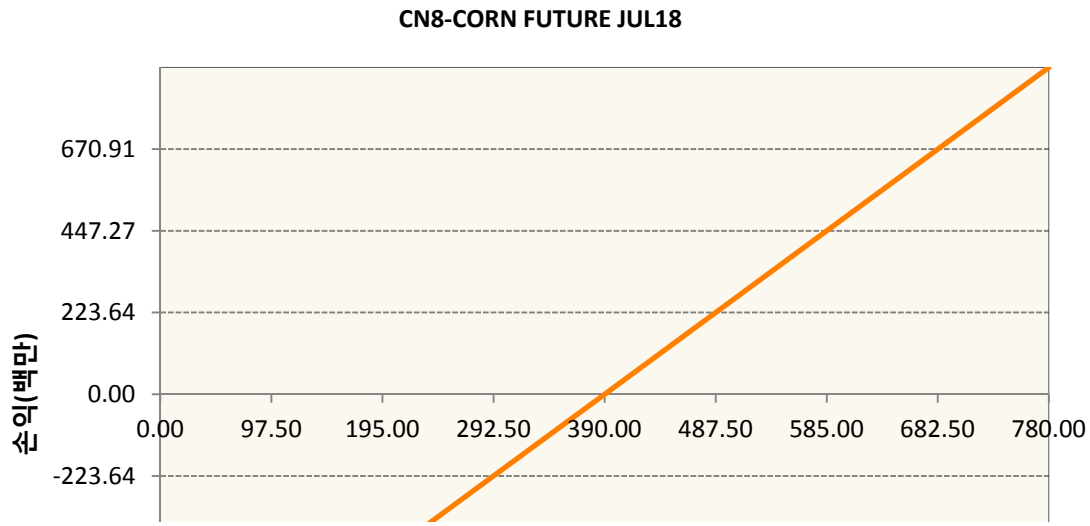
1. 계약금액

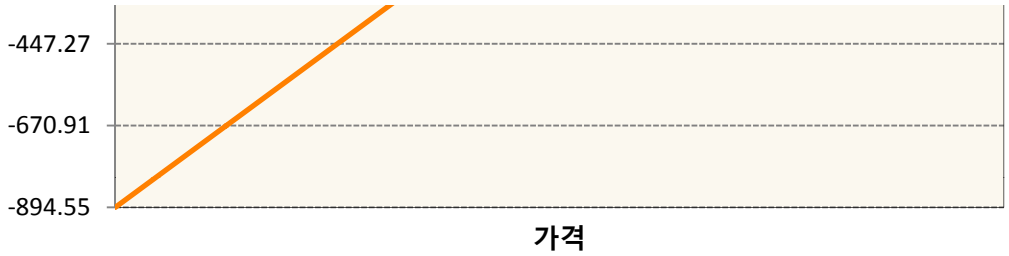
(단위:백만원)

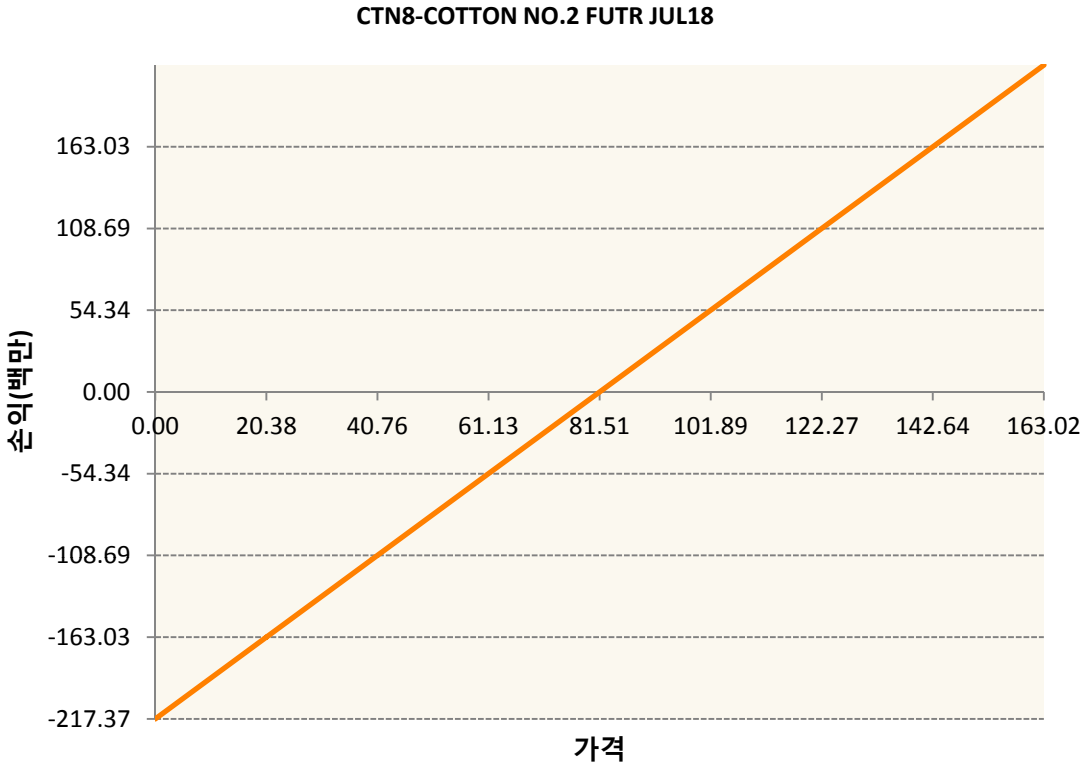
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,081	324	3,756	

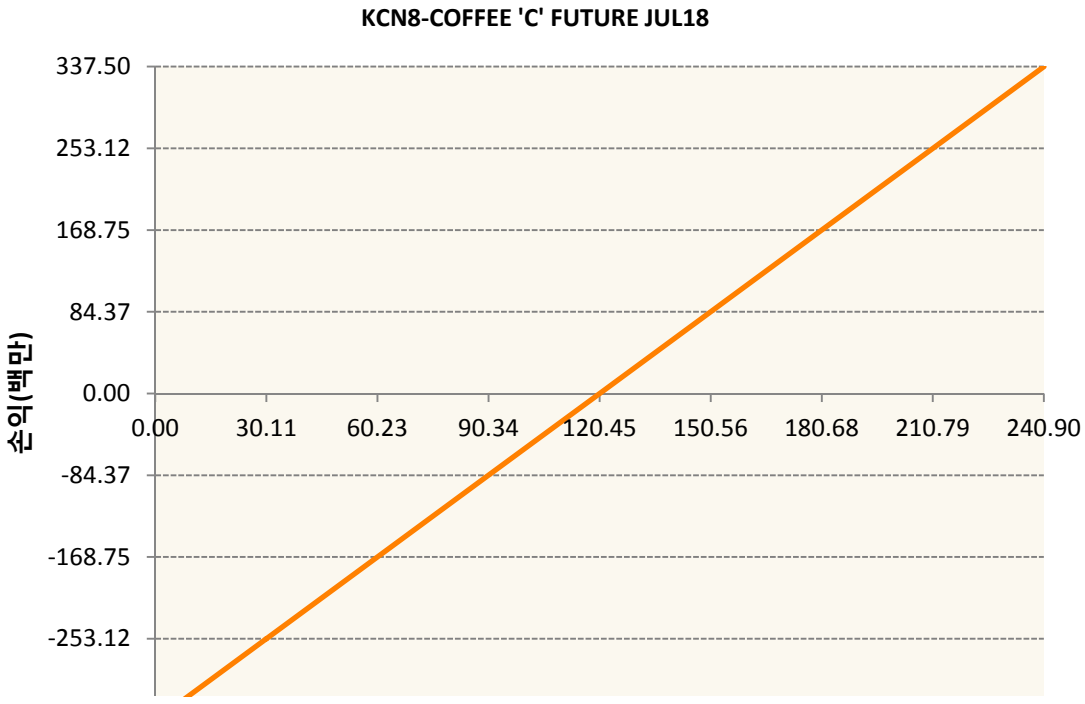
2. 만기시점의 손익구조

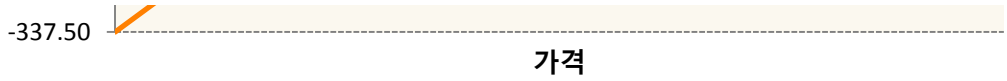


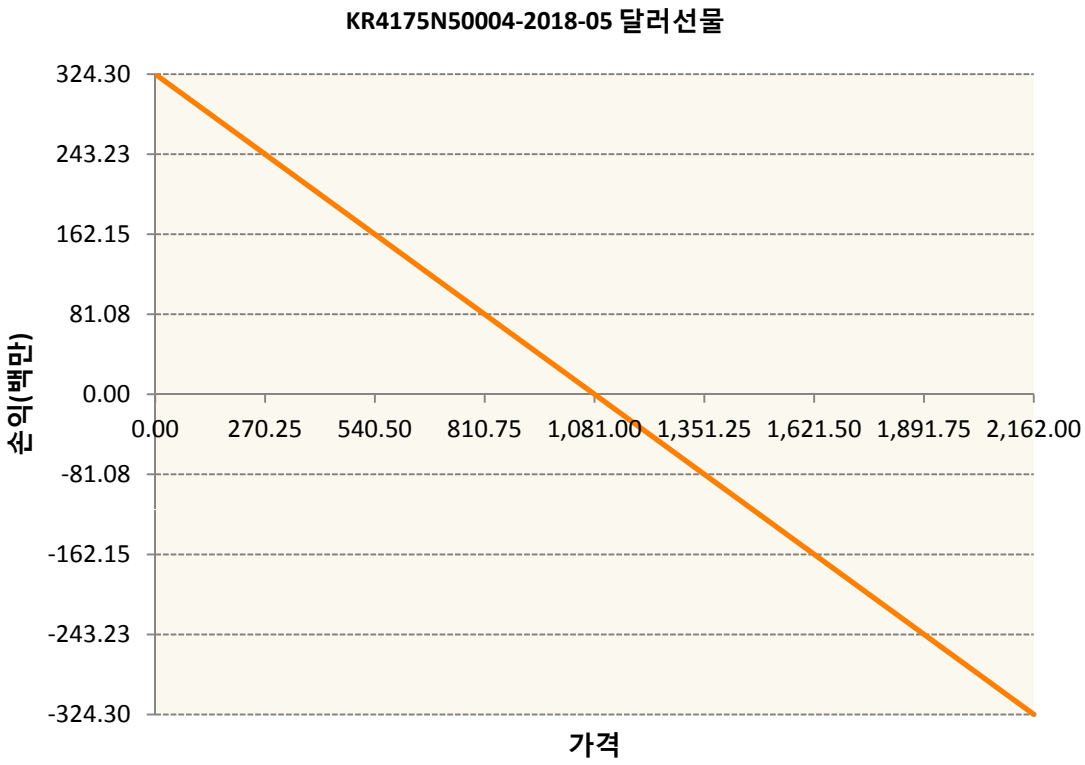


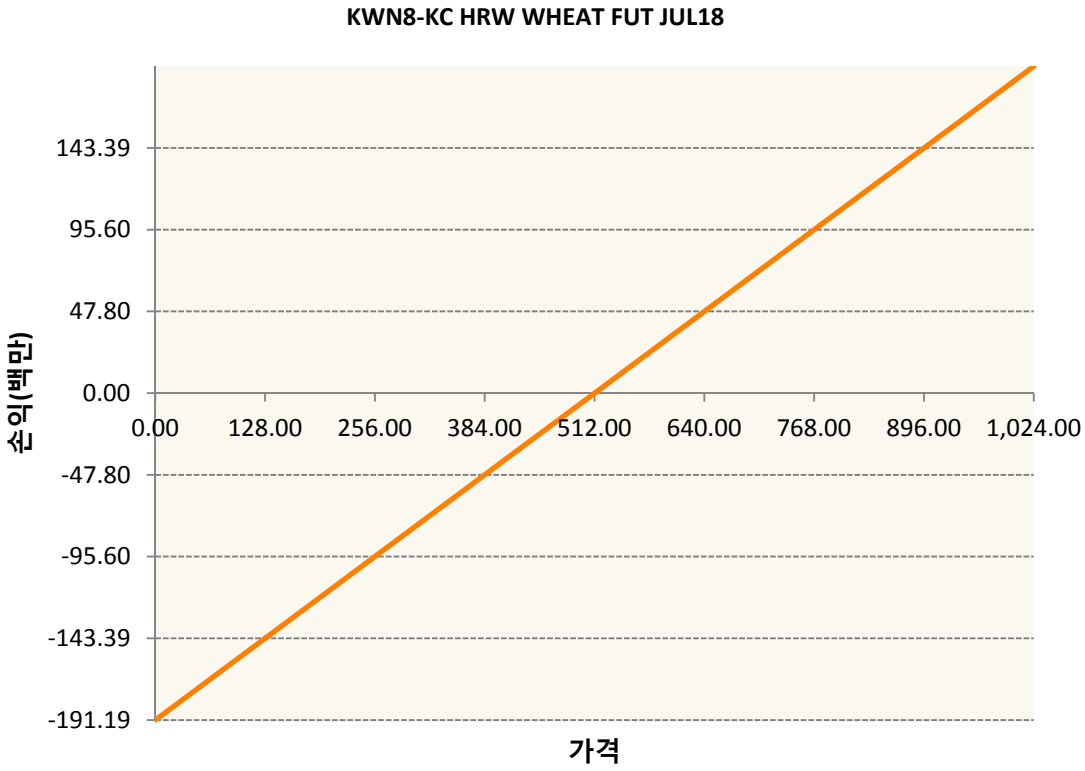

-447.27
-670.91
-894.55
가격

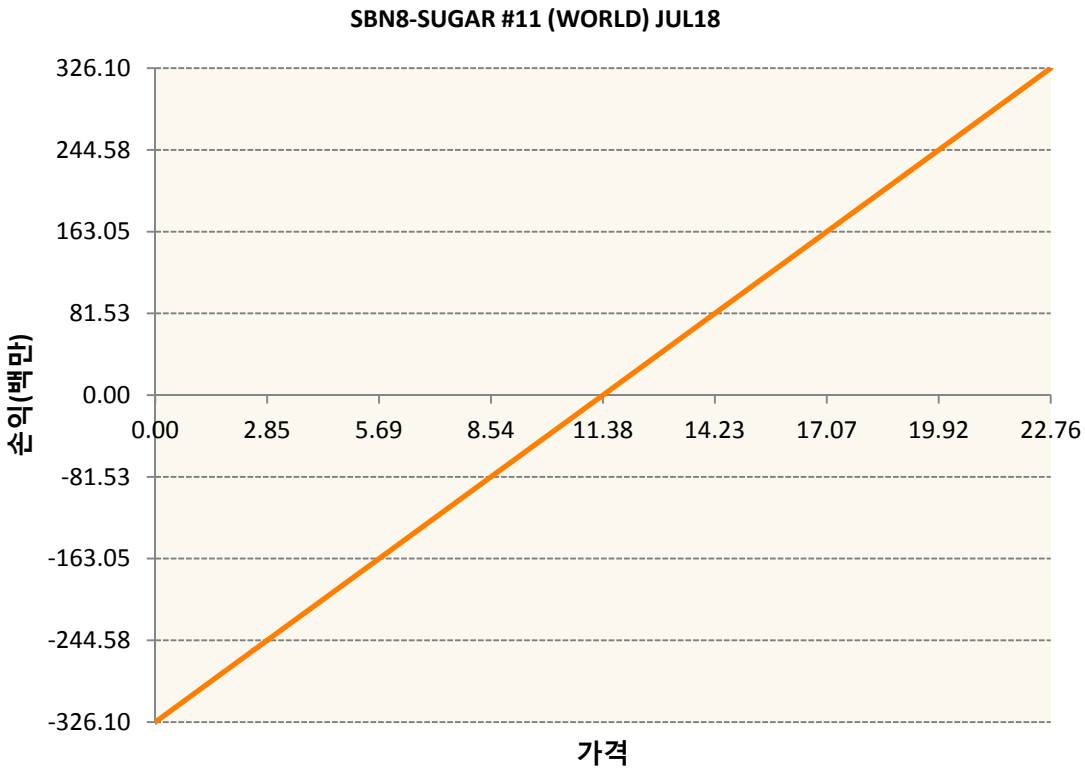

CTN8-COTTON NO.2 FUTR JUL18
163.03
108.69
54.34
0.00
-54.34
-108.69
-163.03
-217.37
0.00
20.38
40.76
61.13
81.51
101.89
122.27
142.64
163.02
손익(백만)
가격

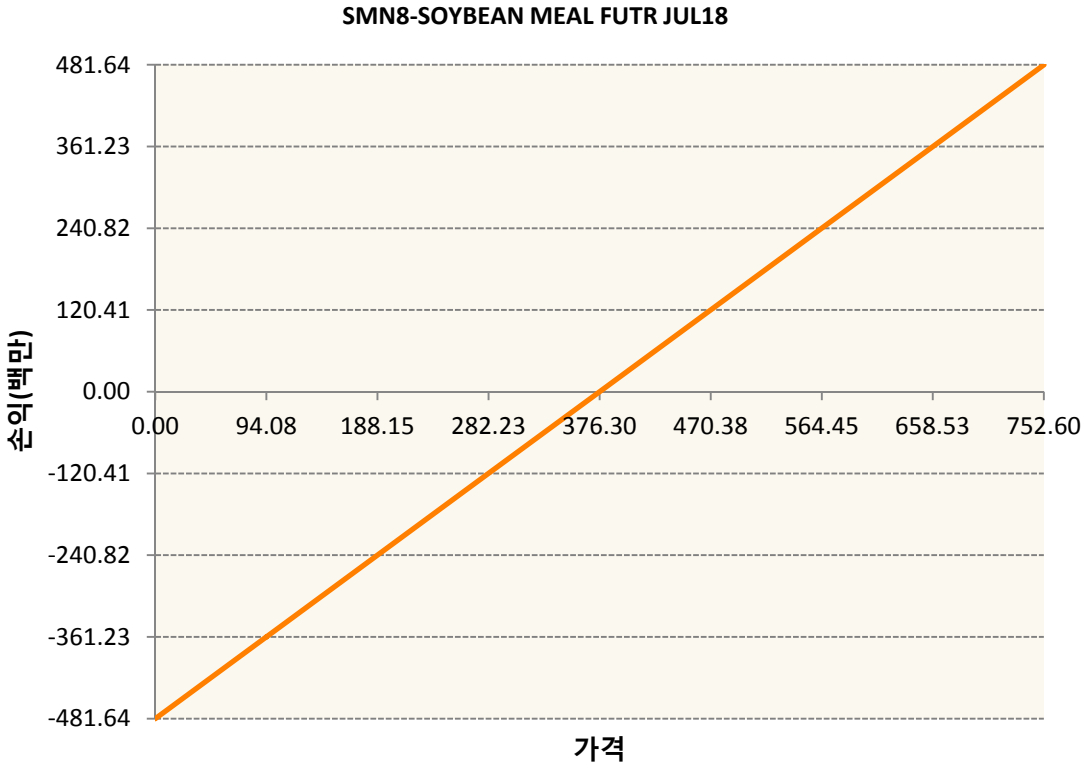

KCN8-COFFEE 'C' FUTURE JUL18
337.50
253.12
168.75
84.37
0.00
-84.37
-168.75
-253.12
0.00
30.11
60.23
90.34
120.45
150.56
180.68
210.79
240.90
손익(백만)

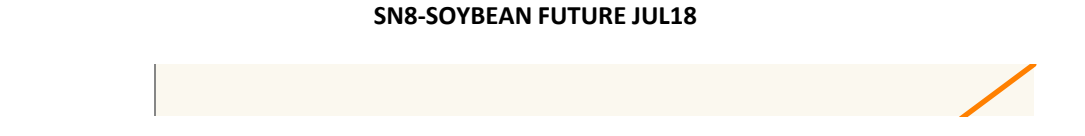

-337.50
가격

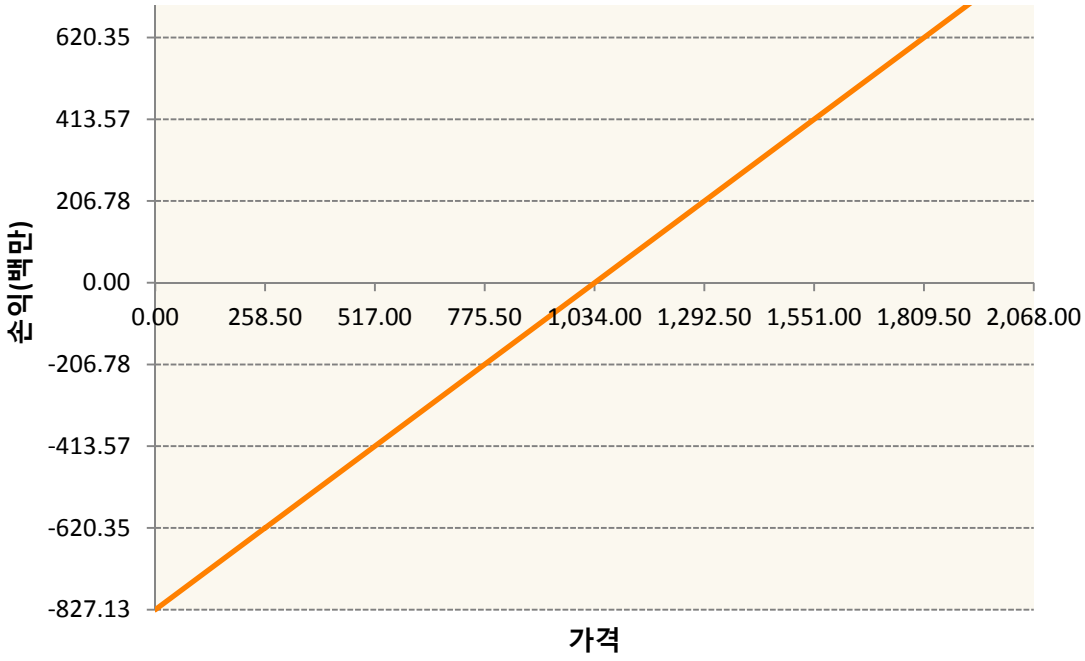

KR4175N50004-2018-05 달러선물
324.30
243.23
162.15
81.08
0.00
-81.08
-162.15
-243.23
-324.30
0.00
270.25
540.50
810.75
1,081.00
1,351.25
1,621.50
1,891.75
2,162.00
손익(백만)
가격

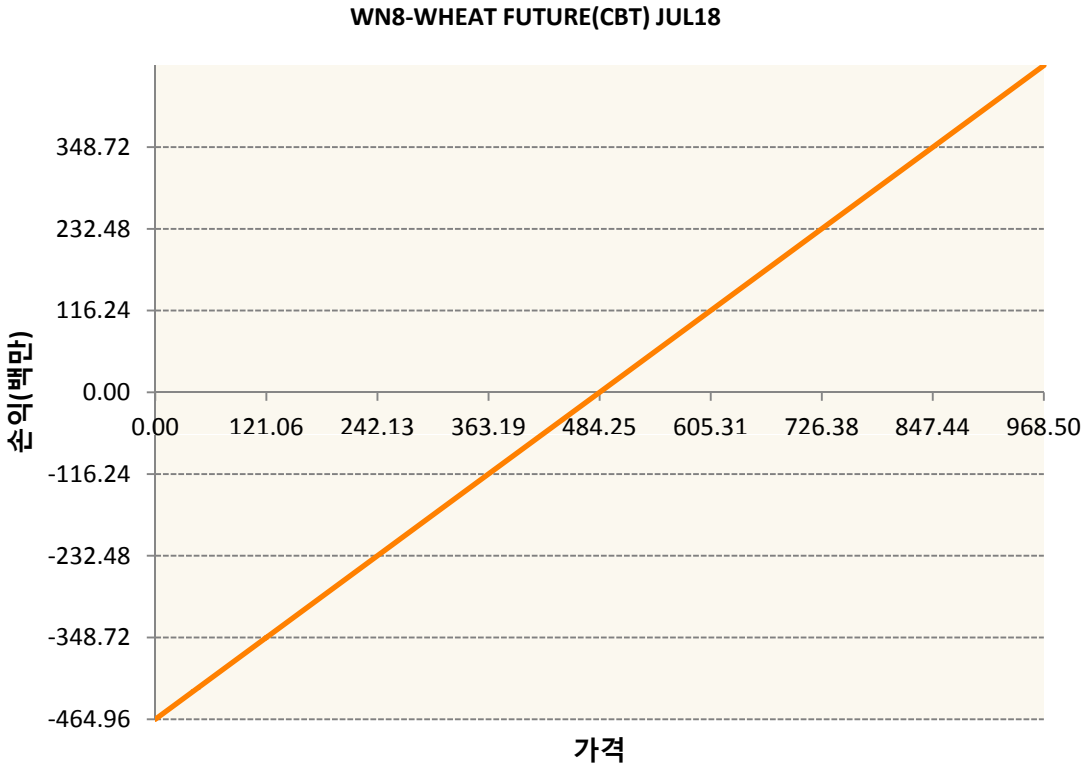

KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18
143.39
95.60
47.80
0.00
-47.80
-95.60
-143.39
-191.19
0.00
128.00
256.00
384.00
512.00
640.00
768.00
896.00
1,024.00
손익(백만)
가격


SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18
326.10
244.58
163.05
81.53
0.00
-81.53
-163.05
-244.58
-326.10
0.00
2.85
5.69
8.54
11.38
14.23
17.07
19.92
22.76
손익(백만)
가격


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18
481.64
361.23
240.82
120.41
0.00
-120.41
-240.82
-361.23
-481.64
0.00
94.08
188.15
282.23
376.30
470.38
564.45
658.53
752.60
손익(백만)
가격


SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BON8	SOYBEAN OIL FUTR JUL18	27
CN8	CORN FUTURE JUL18	72
CTN8	COTTON NO.2 FUTR JUL18	17
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	37

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

328