

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

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

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

(단위:백만원)

83

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

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 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

450

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

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 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

435

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

유로인덱스모(주식-파생형)

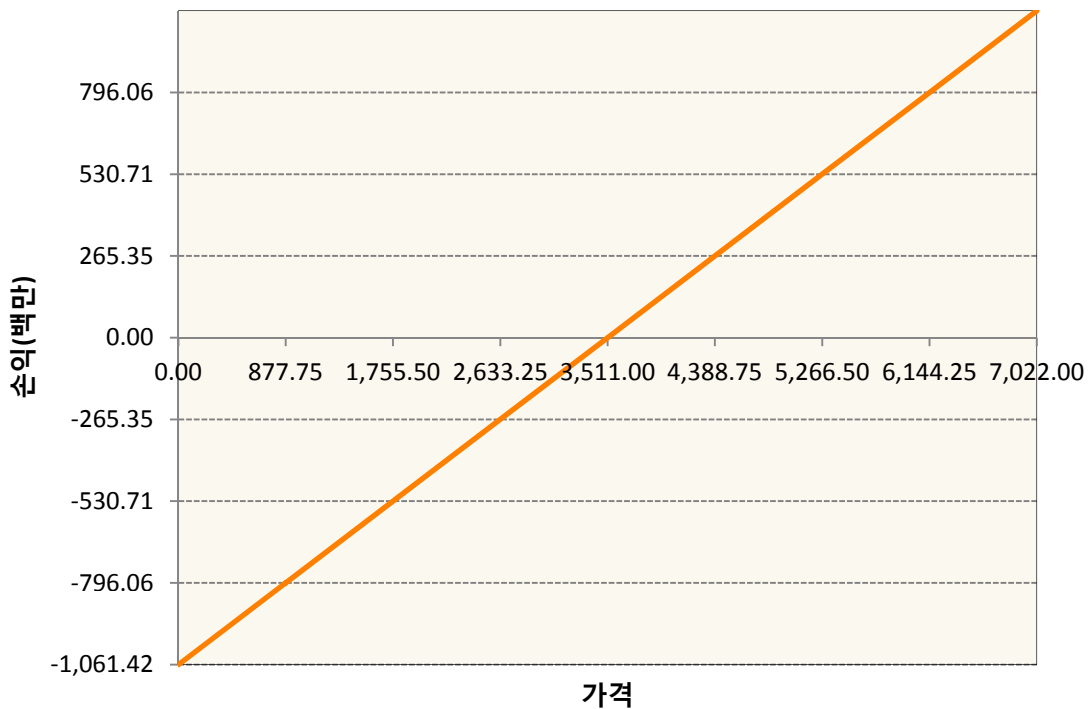
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,061 | 0 | 1,061 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGM8 | EURO STOXX 50 JUN18 | 85 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 52 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

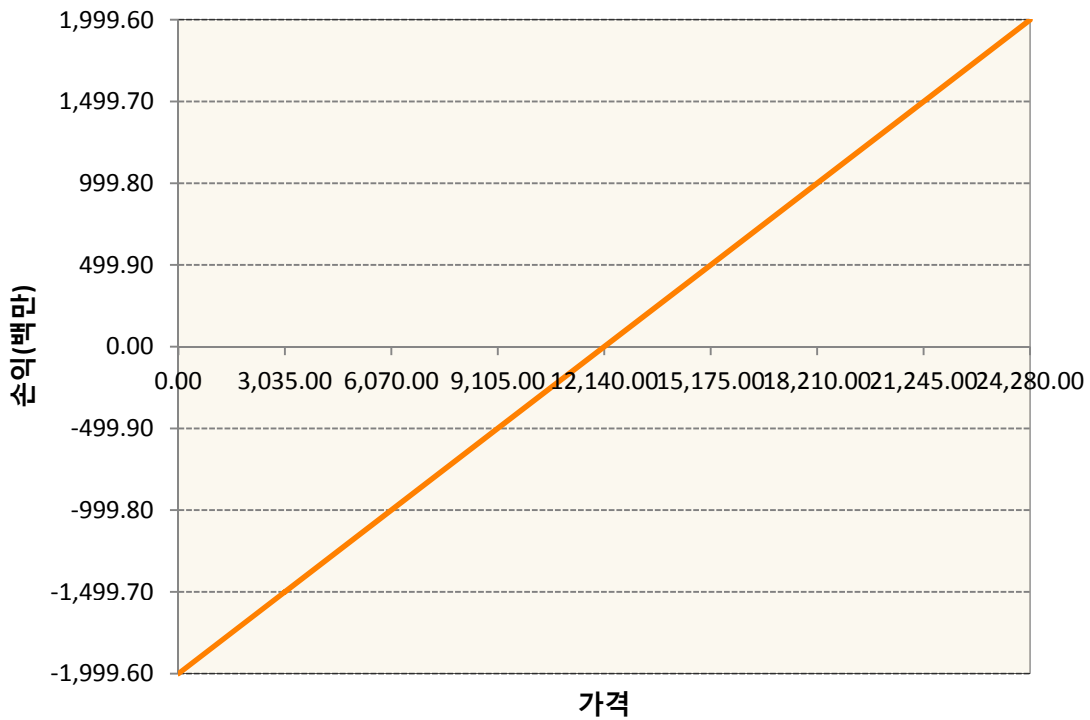
1. 계약금액

(단위:백만원)

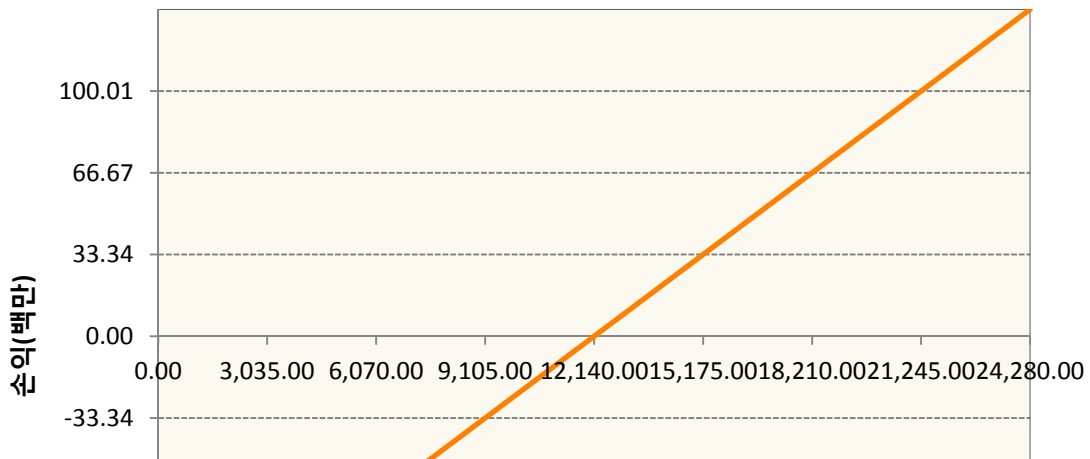
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,133 | 0 | 2,133 | 장내 |

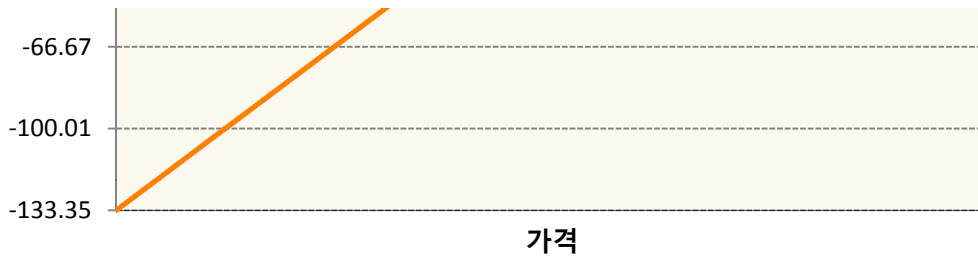
2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18



MHCK8-MINI H-SHR IDX FU May18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|-------------------------|-----|
| HCK8 | H-SHARES FUT May18 | 160 |
| MHCK8 | MINI H-SHR IDX FU May18 | 11 |

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

| |
|------------|
| 150 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

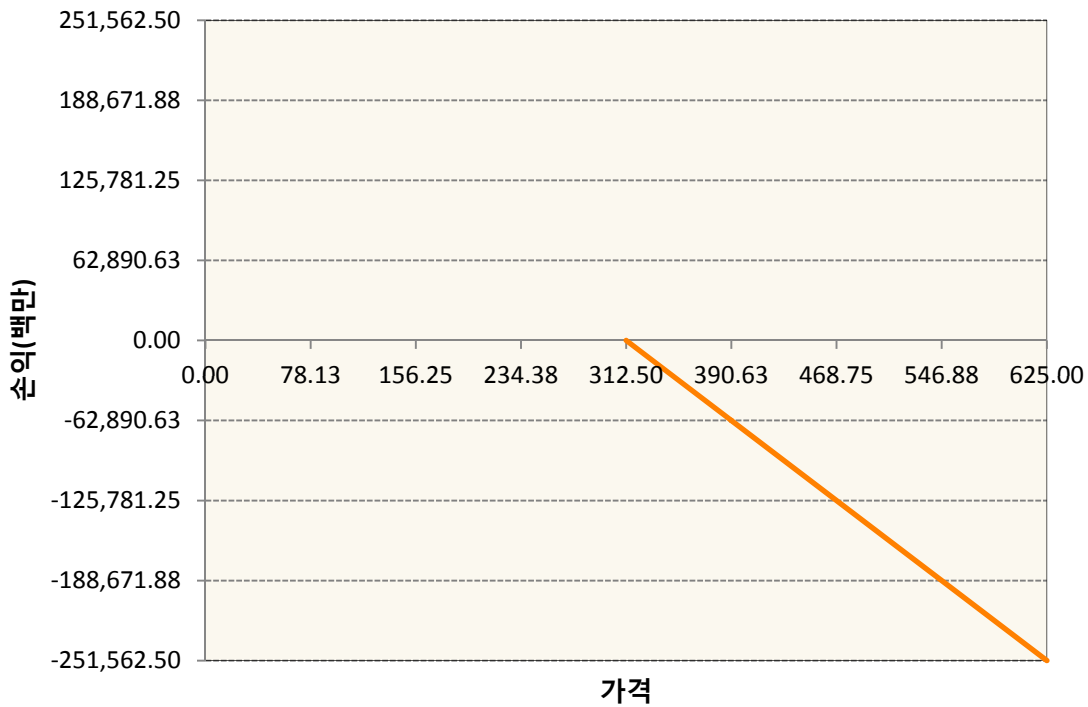
1. 계약금액

(단위:백만원)

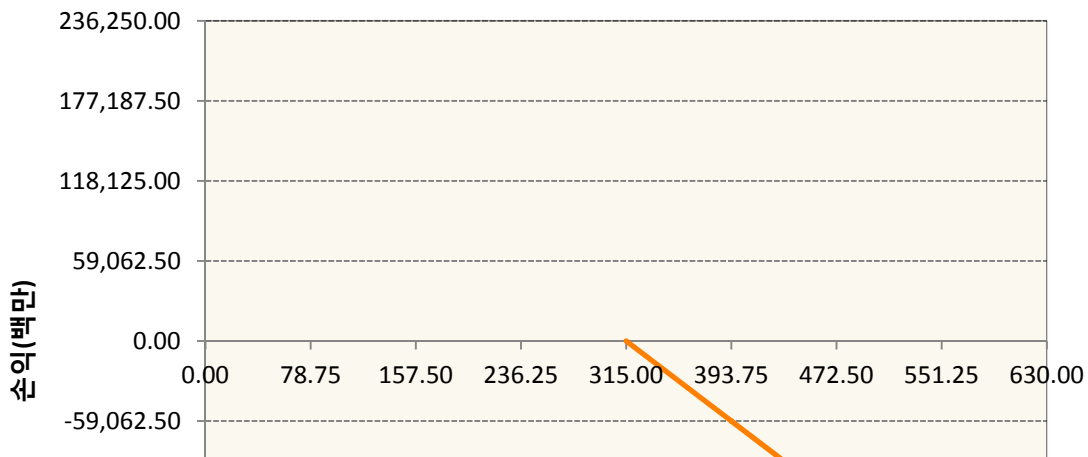
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 35,151 | 23,974 | 11,177 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 847,375 | -847,375 | 장내 |

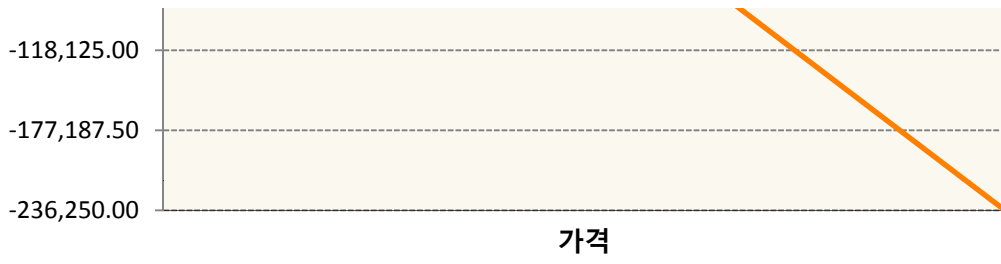
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N53127-2018-05 콜312.5

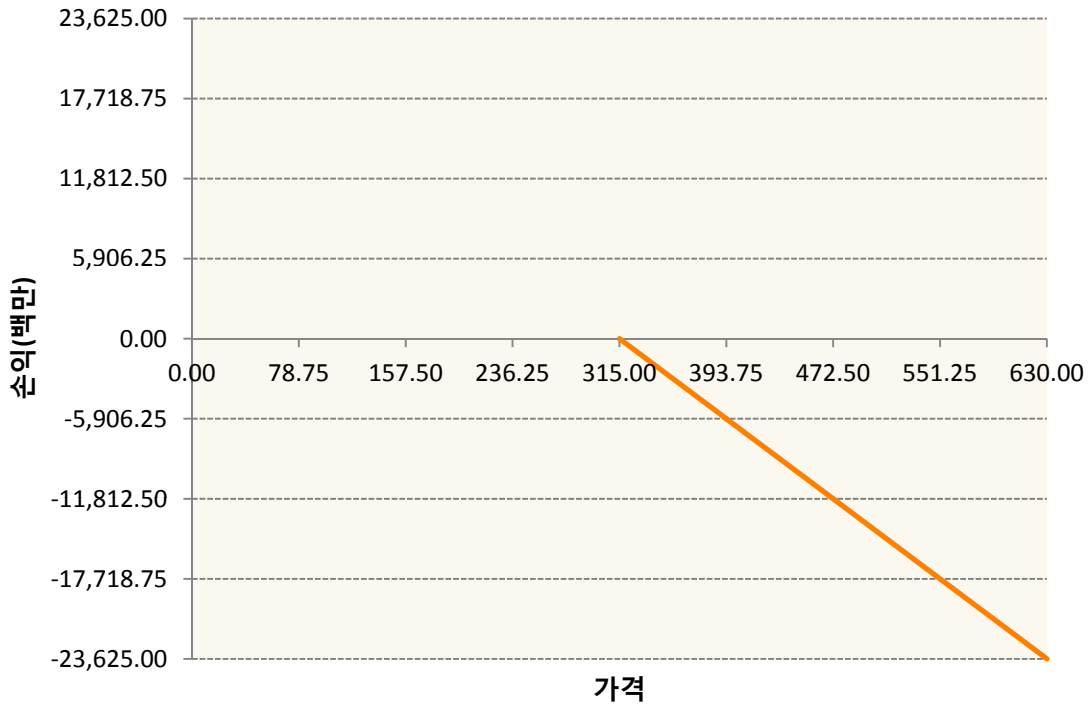


KR4201N53150-2018-05 콜315

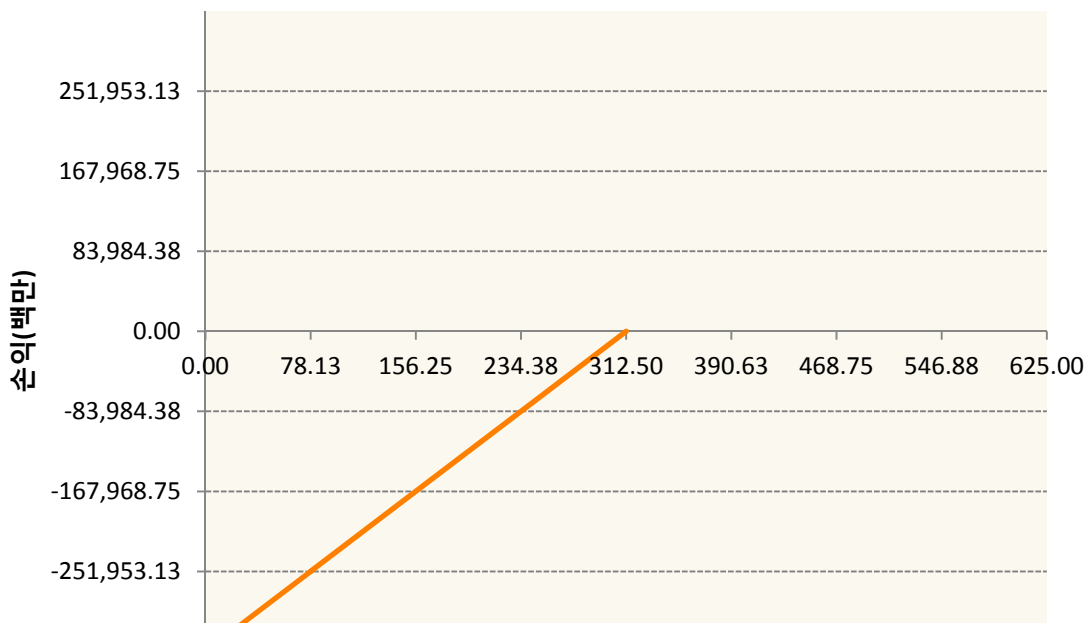




KR4201N63159-2018-06 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5



| | | | | | | | |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 5.33% | 193 | 193 | 193 | 193 | 193 | 193 | 193 |
| 8.00% | 193 | 193 | 193 | 193 | 193 | 193 | 193 |

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

(단위:백만원)

92,027

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

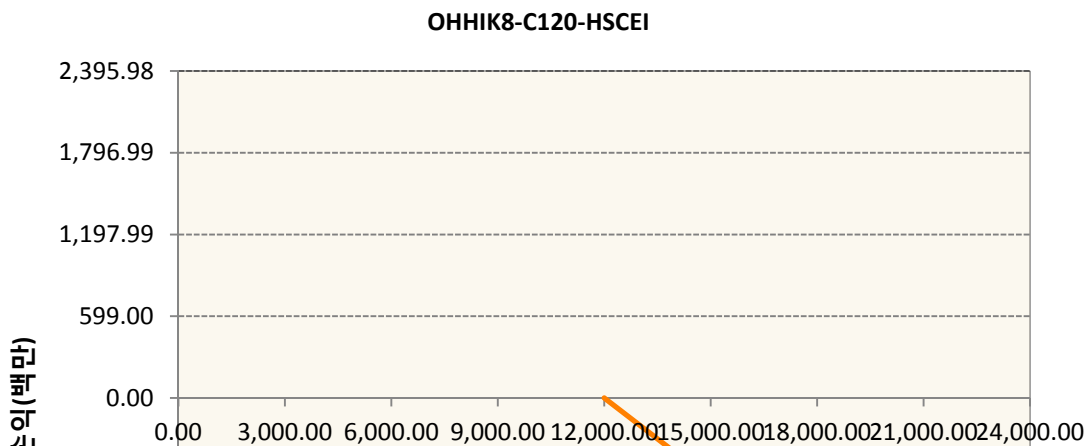
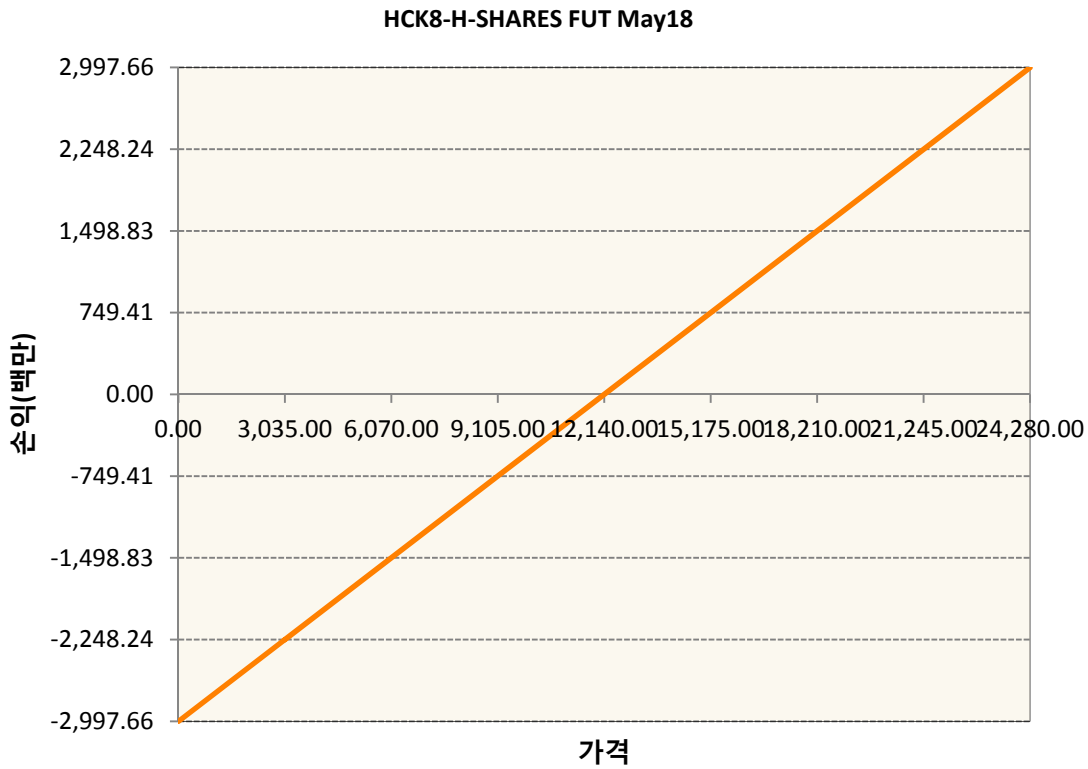
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

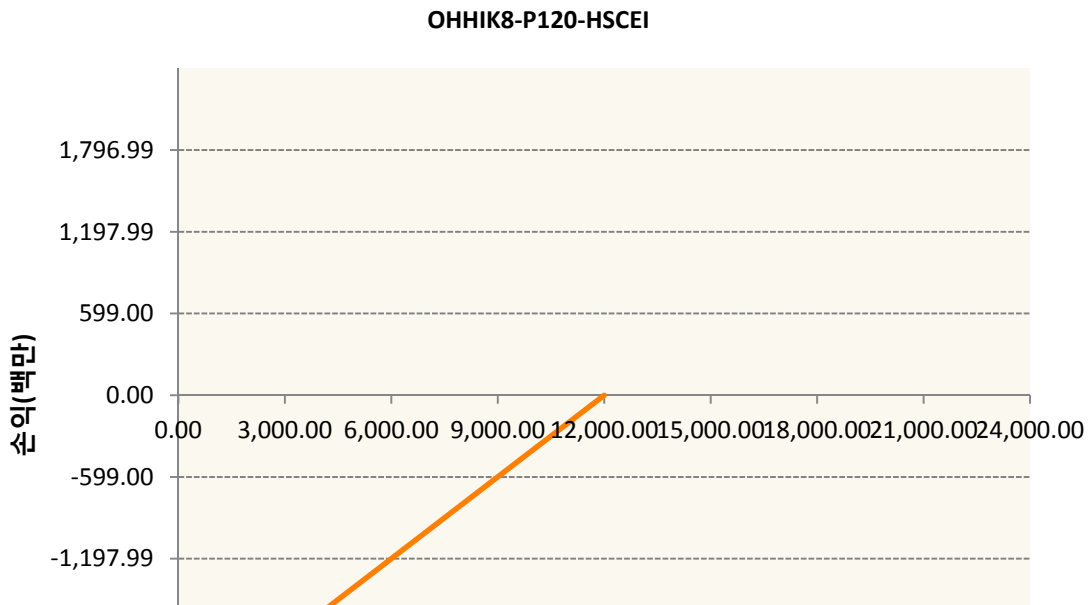
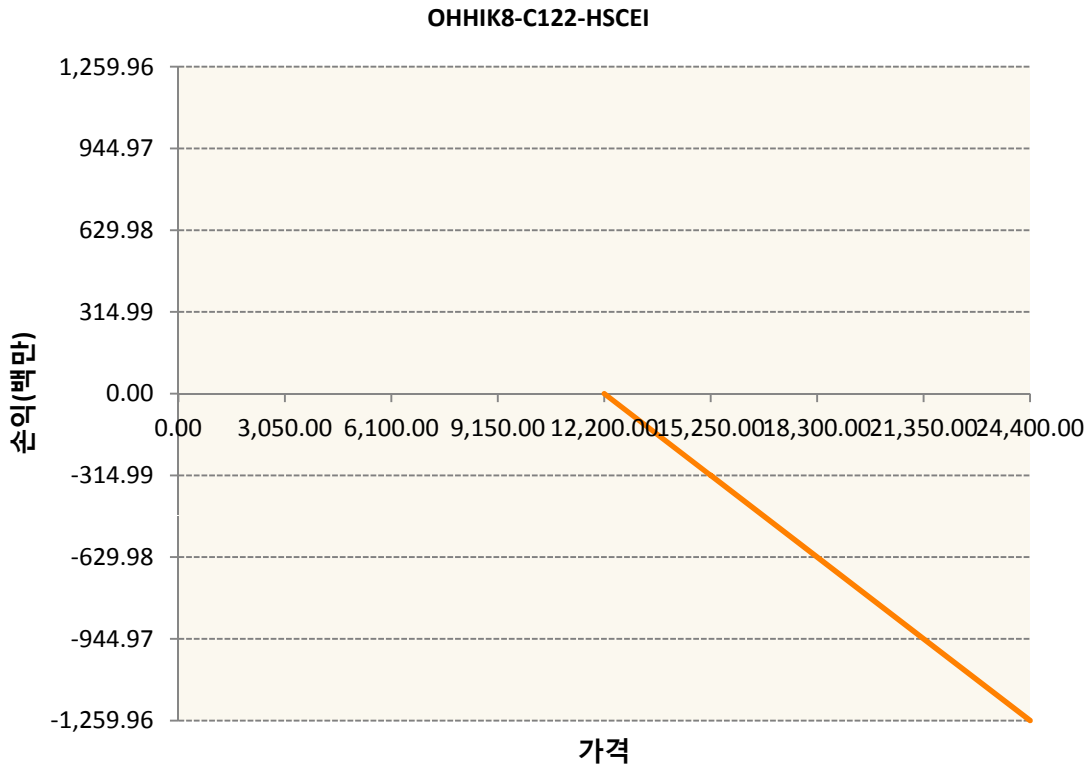
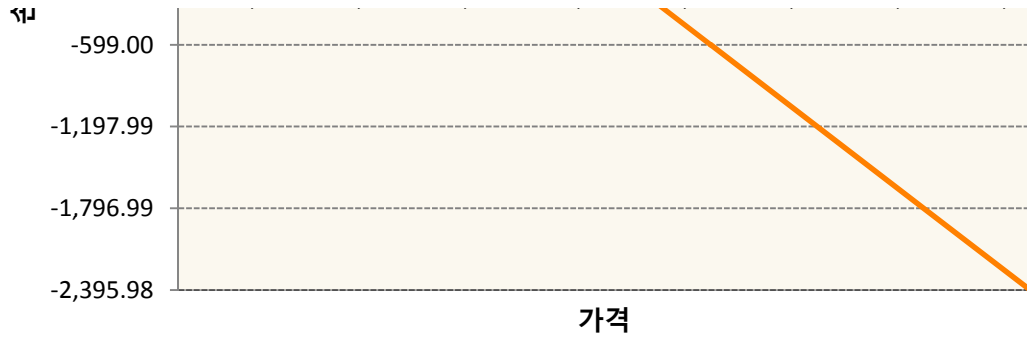
1. 계약금액

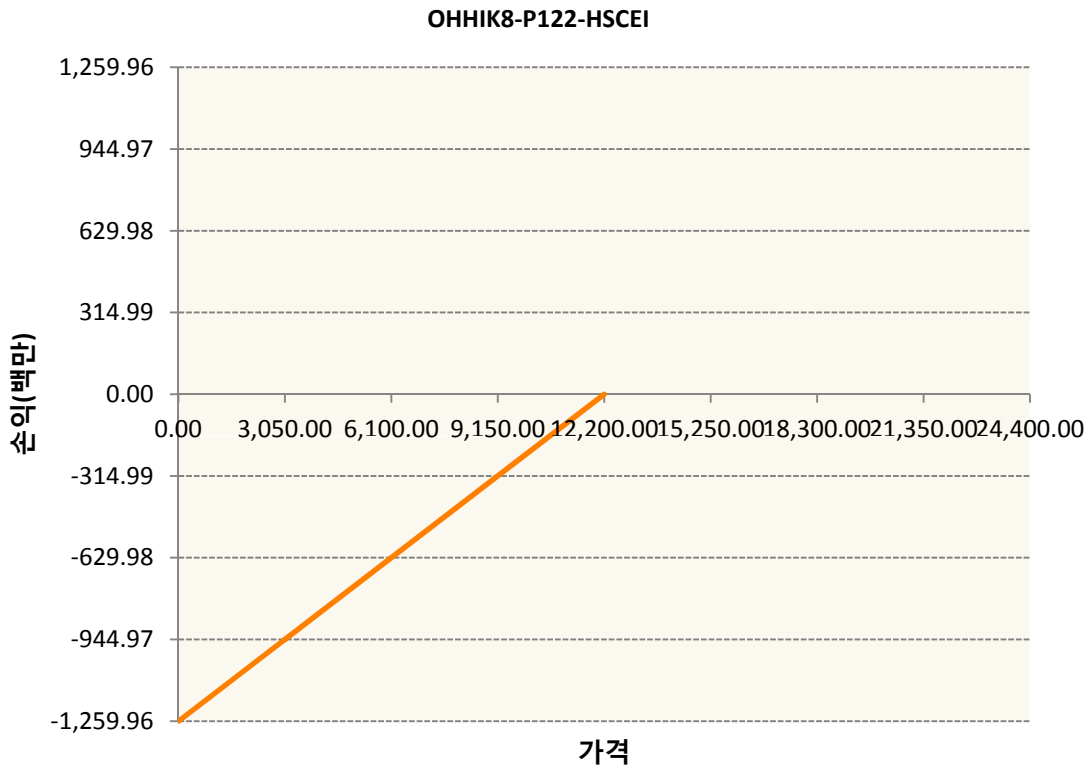
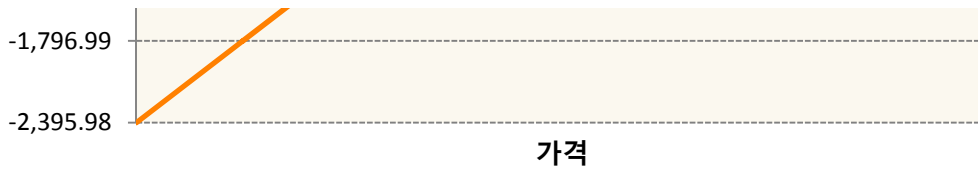
(단위:백만원)

| 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 | 2,998 | 0 | 2,998 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 7,312 | -7,312 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조







| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------|----------|
| HCK8 | H-SHARES FUT May18 | 240 |
| OHHIK8-C12 | HSCEI | 192 |
| OHHIK8-C12 | HSCEI | 101 |
| OHHIK8-P12 | HSCEI | 192 |
| OHHIK8-P12 | HSCEI | 101 |

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

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

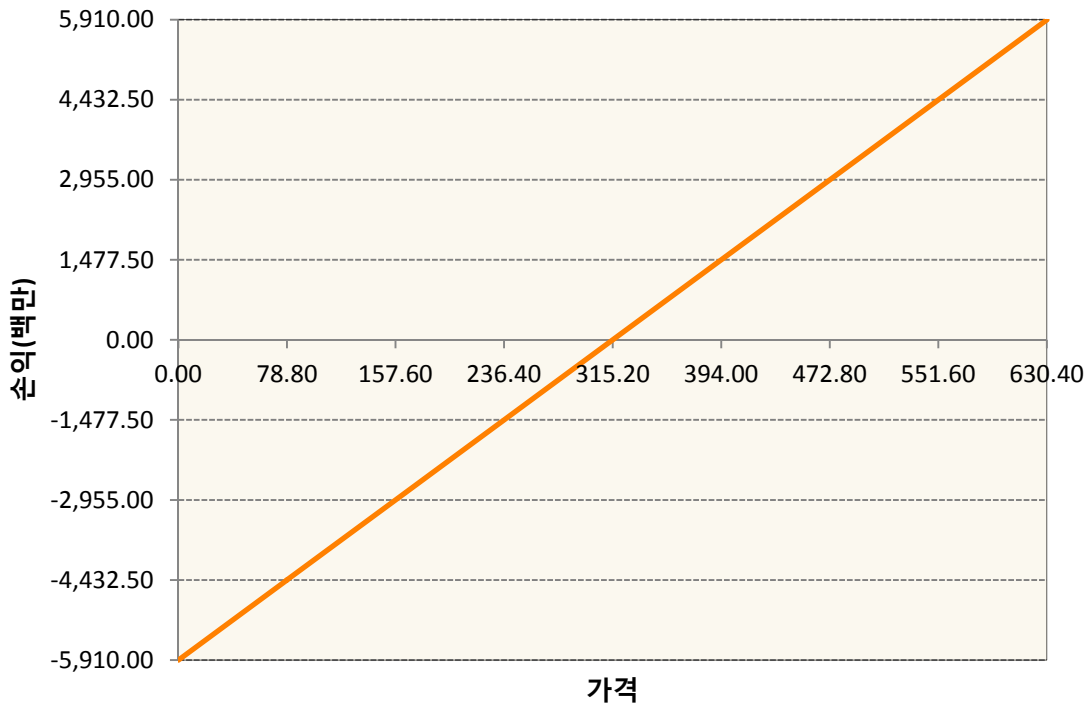
1. 계약금액

(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 | 5,910 | 0 | 5,910 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 49,700 | 0 | 49,700 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 50,285 | -50,285 | 장내 |

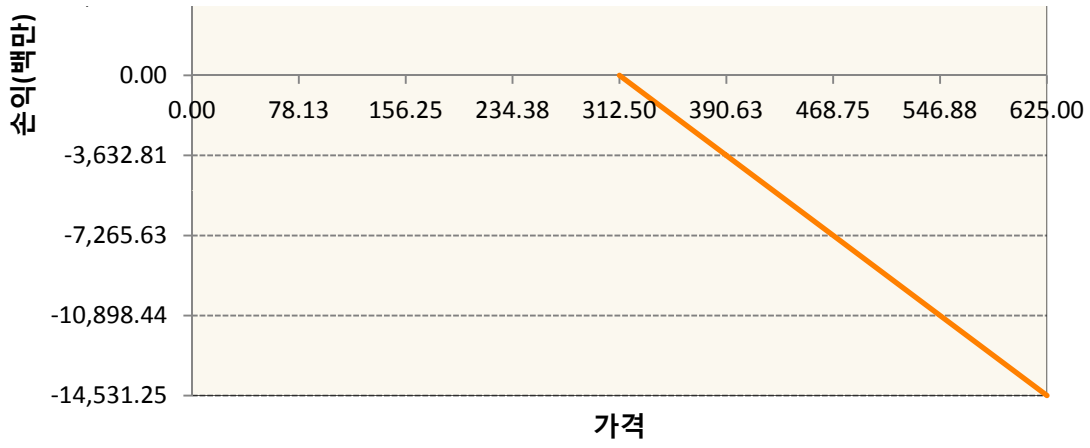
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

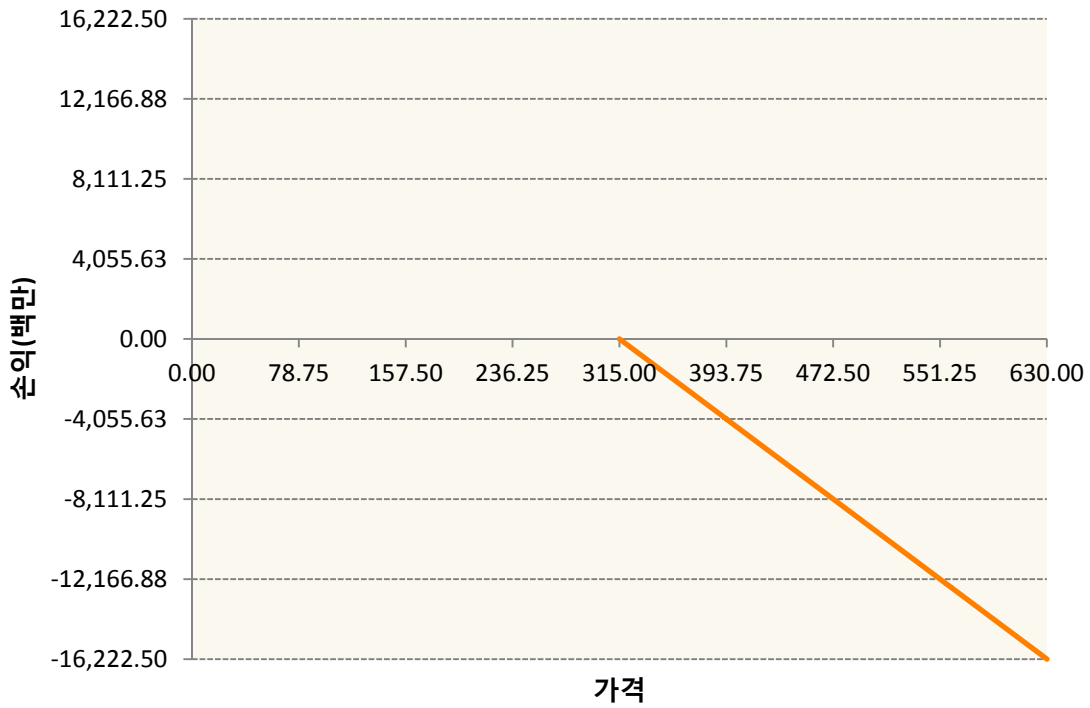


KR4201N53127-2018-05 콜312.5

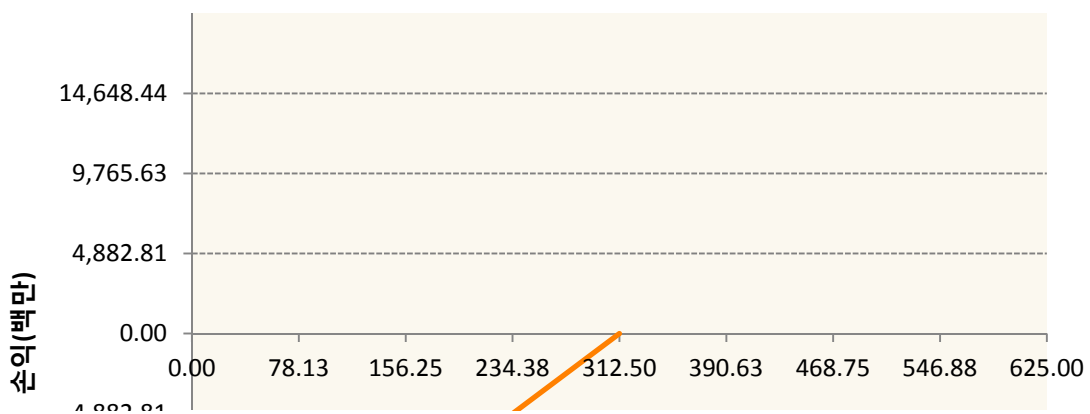




KR4201N53150-2018-05 콜315



KR4301N53125-2018-05 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| 2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,474 |
|----------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,474 | -1,474 | -1,474 | -1,474 | -1,474 | -1,474 | -1,474 |
| -5.33% | -983 | -983 | -983 | -983 | -983 | -983 | -983 |
| -2.67% | -491 | -491 | -491 | -491 | -491 | -491 | -491 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 491 | 491 | 491 | 491 | 491 | 491 | 491 |
| 5.33% | 983 | 983 | 983 | 983 | 983 | 983 | 983 |
| 8.00% | 1,474 | 1,474 | 1,474 | 1,474 | 1,474 | 1,474 | 1,474 |
| 2.529E+11 UBSCFXC1 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 UBSCFXC1 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% | -159 | -159 | -159 | -159 | -159 | -159 | -159 |
| -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% | 159 | 159 | 159 | 159 | 159 | 159 | 159 |
| 8.00% | 239 | 239 | 239 | 239 | 239 | 239 | 239 |
| 2.529E+11 UBSCFXC1 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% | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 |
| -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% | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 |
| 8.00% | 472 | 472 | 472 | 472 | 472 | 472 | 472 |

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10 120

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -120 | -120 | -120 | -120 | -120 | -120 | -120 |
| -5.33% | -80 | -80 | -80 | -80 | -80 | -80 | -80 |
| -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% | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 | 80 |
| 8.00% | 120 | 120 | 120 | 120 | 120 | 120 | 120 |

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% | -425 | -425 | -425 | -425 | -425 | -425 | -425 |
| -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% | 425 | 425 | 425 | 425 | 425 | 425 | 425 |
| 8.00% | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 | 638 |

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12 478

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -478 | -478 | -478 | -478 | -478 | -478 | -478 |
| -5.33% | -319 | -319 | -319 | -319 | -319 | -319 | -319 |
| -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% | 319 | 319 | 319 | 319 | 319 | 319 | 319 |
| 8.00% | 478 | 478 | 478 | 478 | 478 | 478 | 478 |

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물 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% | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 | -314 |
| -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% | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 | 314 |
| 8.00% | 472 | 472 | 472 | 472 | 472 | 472 | 472 |

KR4201N5312018-05 콜312.5 1,123

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 136 | 136 | 136 | 136 | 136 | 136 | 136 |
| -5.33% | 136 | 136 | 136 | 136 | 136 | 136 | 136 |
| -2.67% | 134 | 133 | 131 | 129 | 127 | 124 | 120 |
| 0% | 19 | 13 | 6 | 0 | -6 | -13 | -20 |
| 2.67% | -343 | -343 | -344 | -344 | -345 | -346 | -347 |
| 5.33% | -733 | -733 | -733 | -733 | -733 | -733 | -733 |
| 8.00% | -1,123 | -1,123 | -1,123 | -1,123 | -1,123 | -1,123 | -1,123 |

KR4201N5312018-05 콜315 1,186

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 |
| -5.33% | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 |
| -2.67% | 79 | 79 | 78 | 77 | 76 | 74 | 72 |
| 0% | 23 | 15 | 8 | 0 | -8 | -15 | -23 |
| 2.67% | -324 | -324 | -326 | -327 | -329 | -332 | -335 |
| 5.33% | -755 | -755 | -755 | -755 | -755 | -755 | -755 |
| 8.00% | -1,186 | -1,186 | -1,186 | -1,186 | -1,186 | -1,186 | -1,186 |

KR4301N5312018-05 풋312.5 1,441

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,441 | -1,441 | -1,441 | -1,441 | -1,441 | -1,441 | -1,441 |
| -5.33% | -917 | -917 | -917 | -917 | -917 | -917 | -917 |
| -2.67% | -393 | -393 | -393 | -393 | -393 | -393 | -393 |
| 0% | 7 | 5 | 3 | 0 | -3 | -6 | -9 |
| 2.67% | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 |
| 5.33% | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 |
| 8.00% | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 |

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

(단위:백만원)

9,825

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

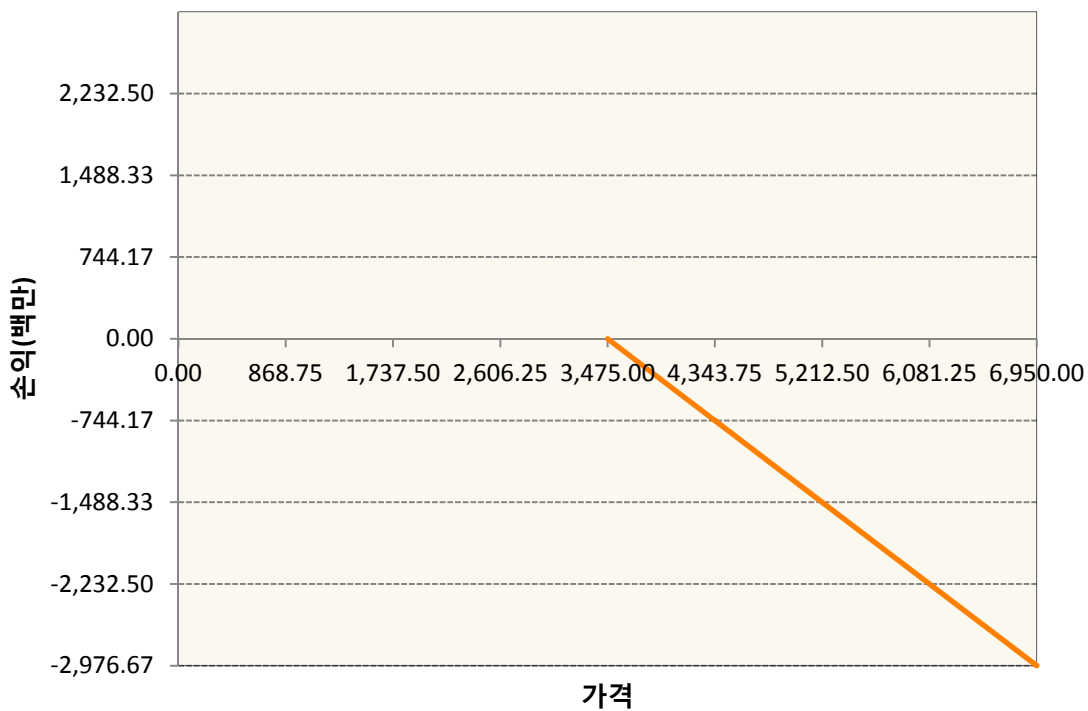
1. 계약금액

(단위:백만원)

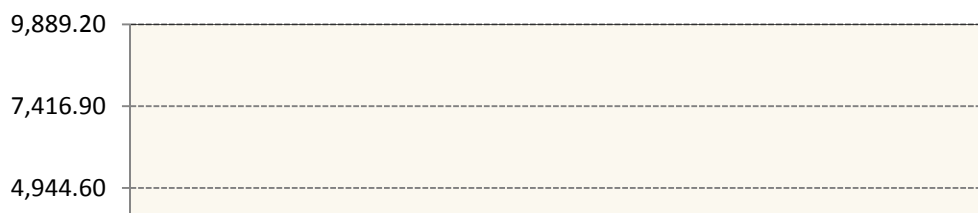
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,957 | 0 | 4,957 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 73,850 | 0 | 73,850 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 25,732 | -25,732 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 51,142 | 0 | 51,142 | 장외 |

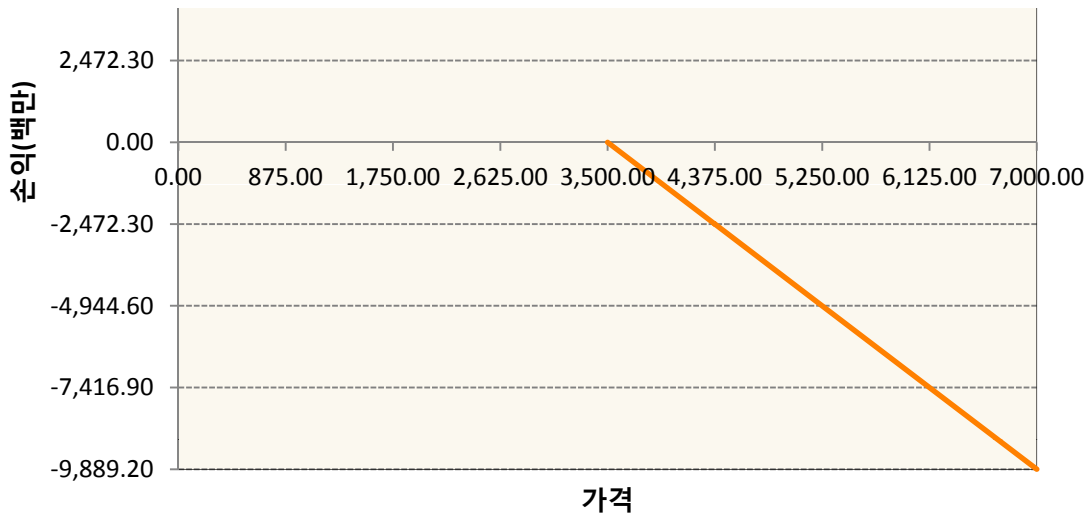
2. 만기시점의 손익구조

OESXK8-C3475-EURO STOXX 50

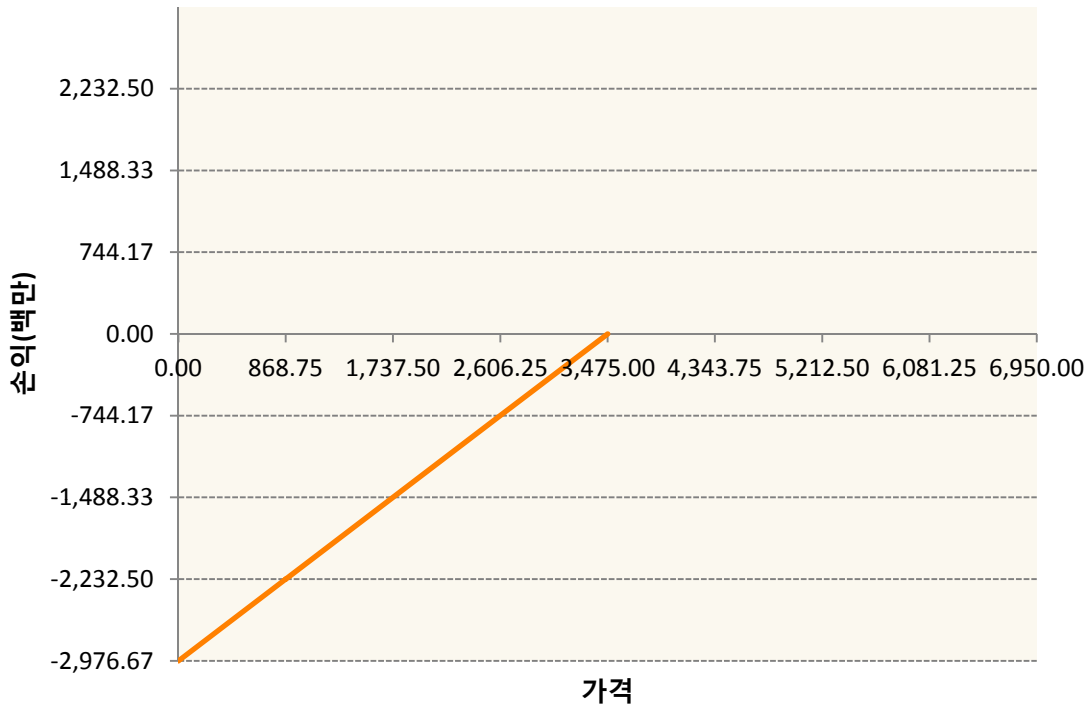


OESXK8-C3500-EURO STOXX 50

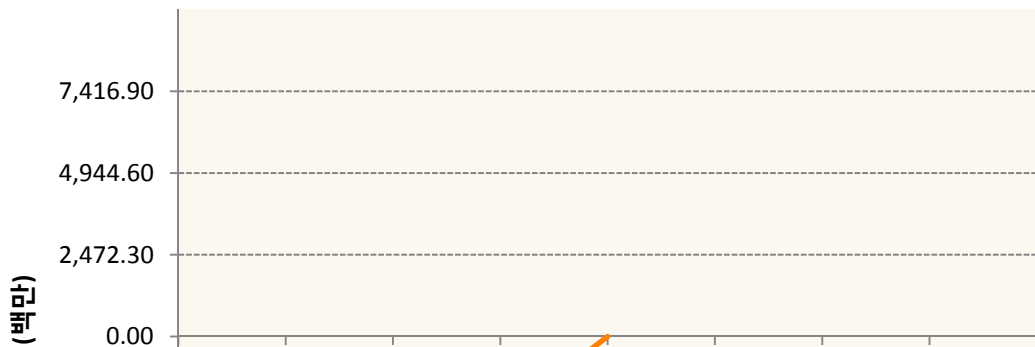


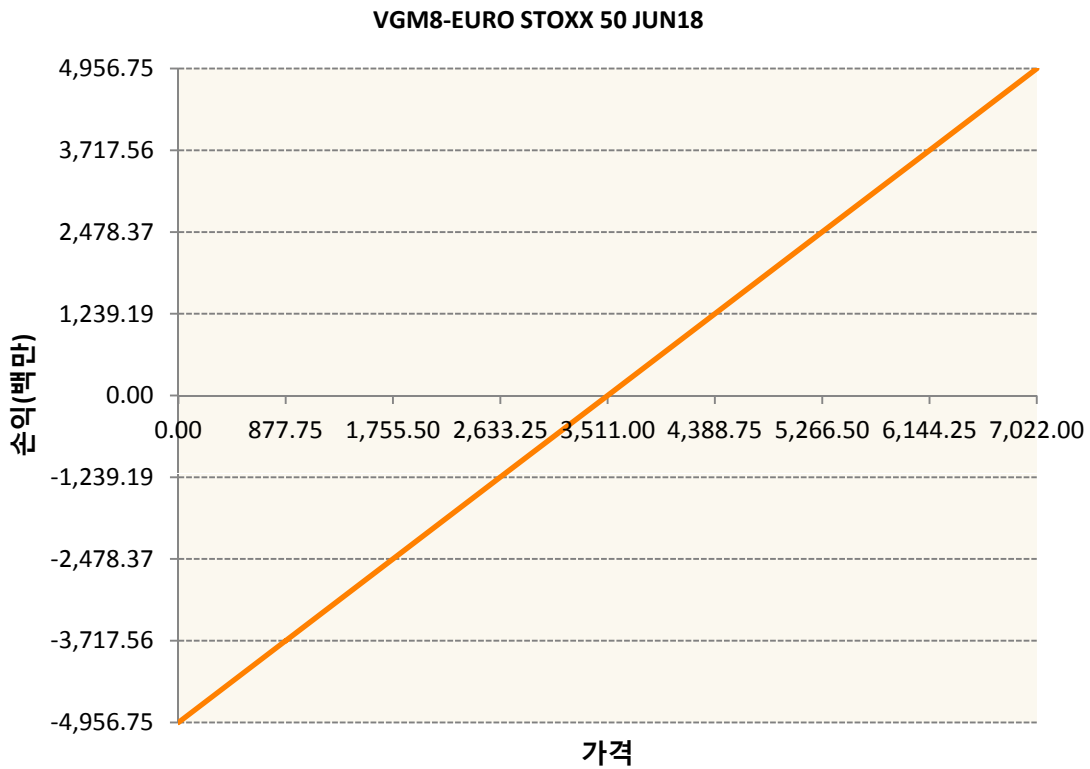
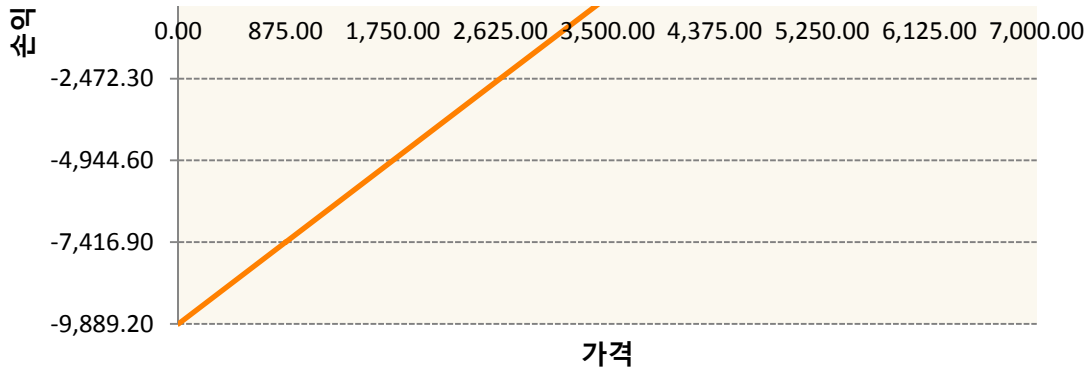


OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



OESXK8-P3500-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|--|--|----------|
| 260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569 | | 59 |
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 85 |
| OESXK8-C34 EURO STOXX 50 | | 238 |
| OESXK8-C35 EURO STOXX 50 | | 791 |
| OESXK8-P34 EURO STOXX 50 | | 238 |
| OESXK8-P35 EURO STOXX 50 | | 791 |
| VGM8 EURO STOXX 50 JUN18 | | 397 |

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

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

(단위:백만원)

1,190

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

(단위:백만원)

60

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

(단위:백만원)

97

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

(단위:백만원)

219

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1

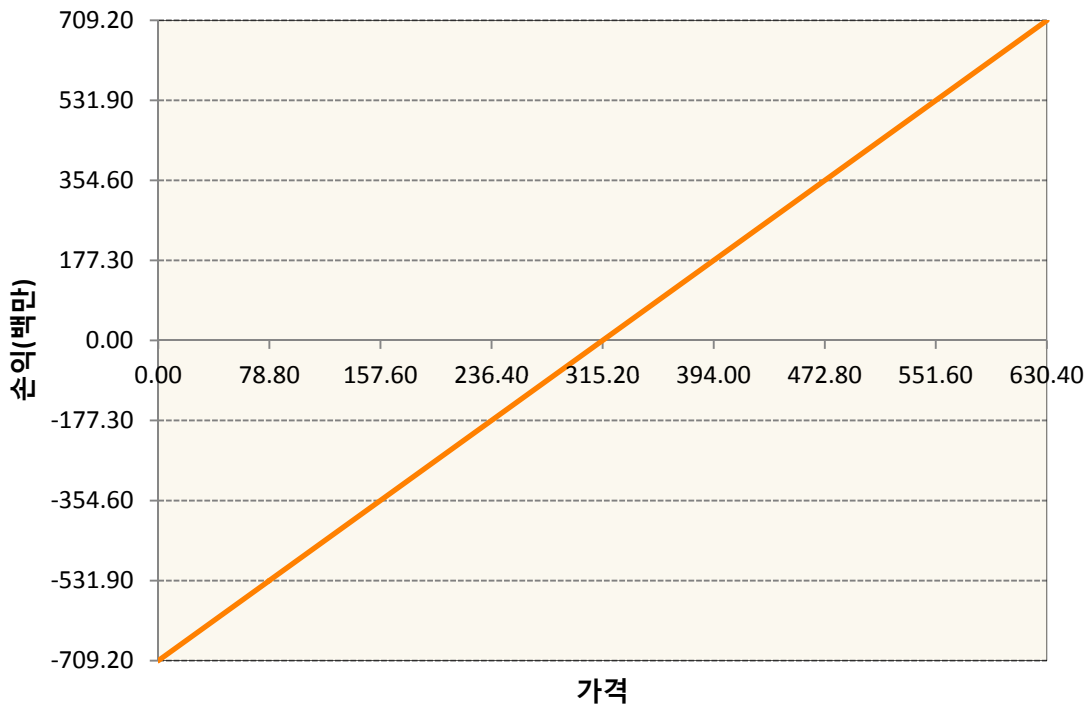
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 709 | 0 | 709 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물

57

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| | -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 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간

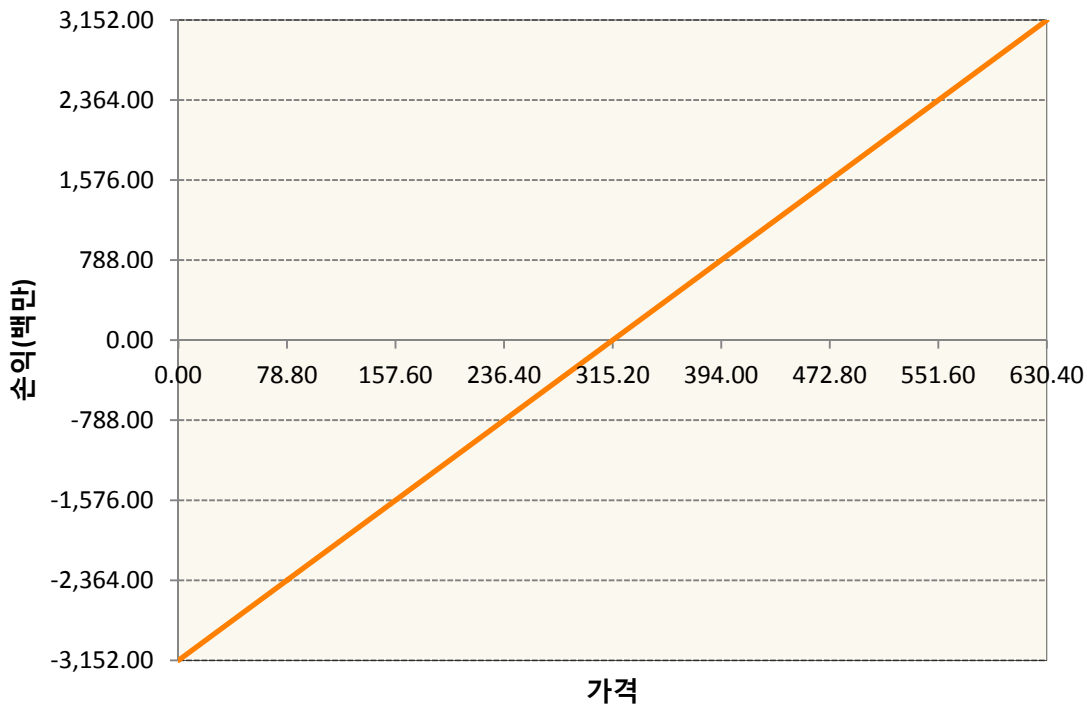
1. 계약금액

(단위:백만원)

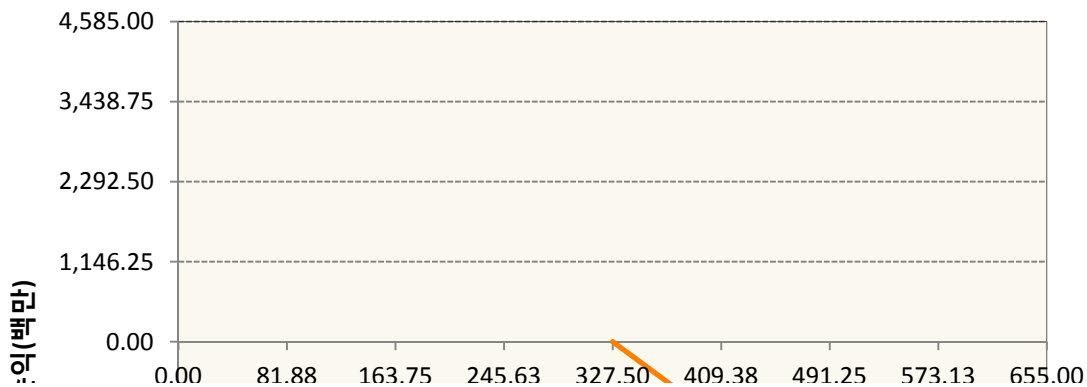
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,152 | 0 | 3,152 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 313 | 4,585 | -4,273 | 장내 |

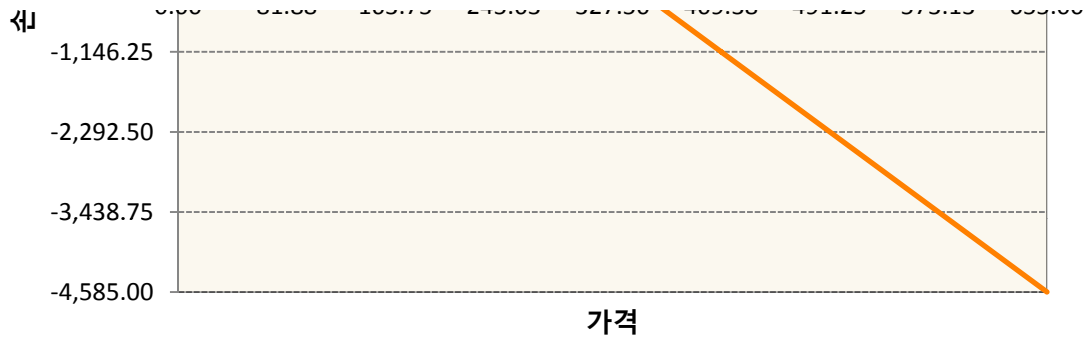
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

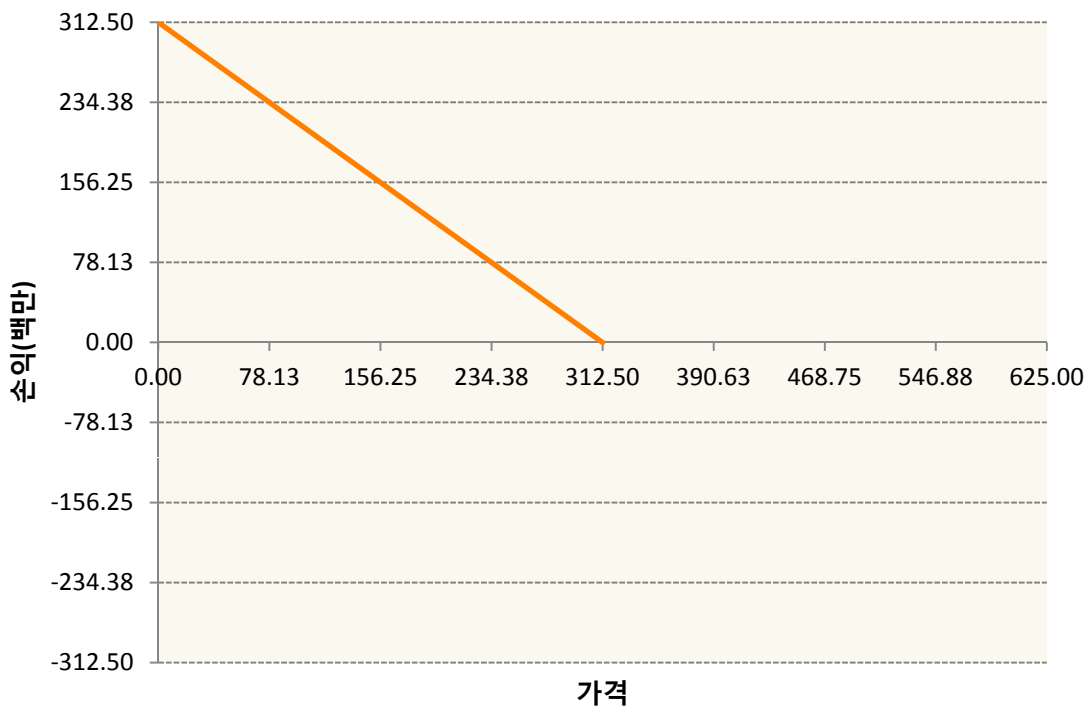


KR4201N53275-2018-05 콜327.5





KR4301N53125-2018-05 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | |
|-------------------------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 252 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -252 | -252 | -252 | -252 | -252 | -252 | -252 |
| -5.33% | -168 | -168 | -168 | -168 | -168 | -168 | -168 |
| -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% | 168 | 168 | 168 | 168 | 168 | 168 | 168 |
| 8.00% | 252 | 252 | 252 | 252 | 252 | 252 | 252 |
| KR4201N532 2018-05 콜327.5 | | | | | | | 170 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| -5.33% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| -2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | -2 | -3 | -4 | -5 | -7 | -8 | -10 |
| 5.33% | -55 | -57 | -58 | -60 | -62 | -63 | -65 |
| 8.00% | -169 | -169 | -169 | -169 | -169 | -169 | -170 |

KR4301N5312018-05 풋312.5

23

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 | 23 |
| -5.33% | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 |
| -2.67% | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5.33% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8.00% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

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

(단위:백만원)

235

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

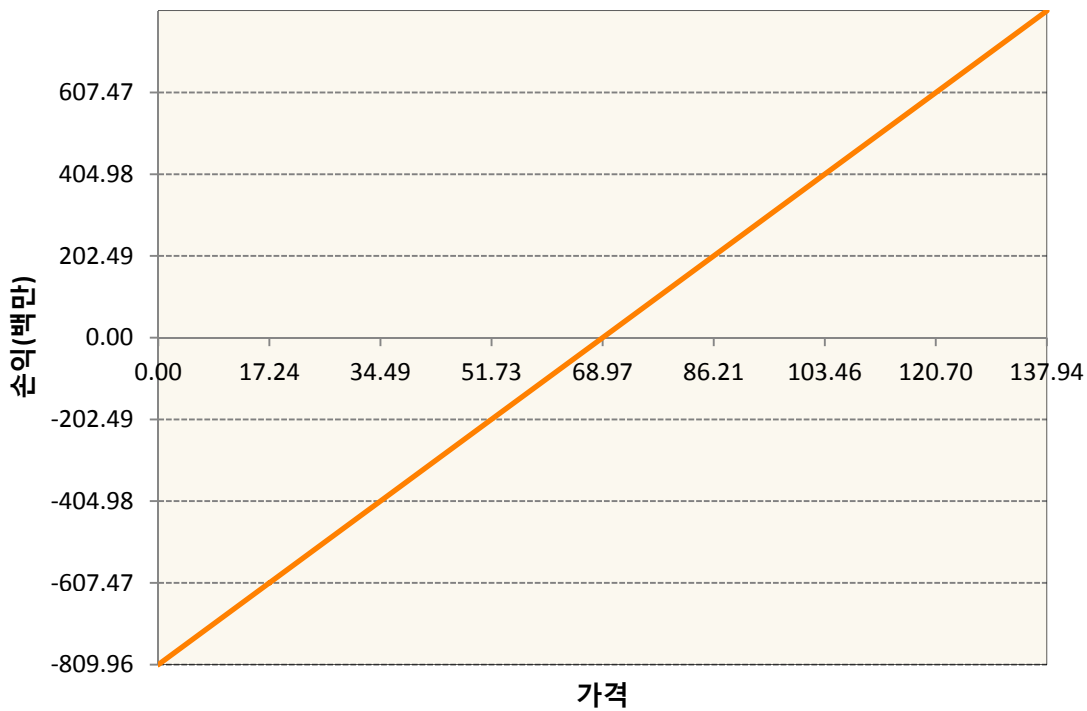
1. 계약금액

(단위:백만원)

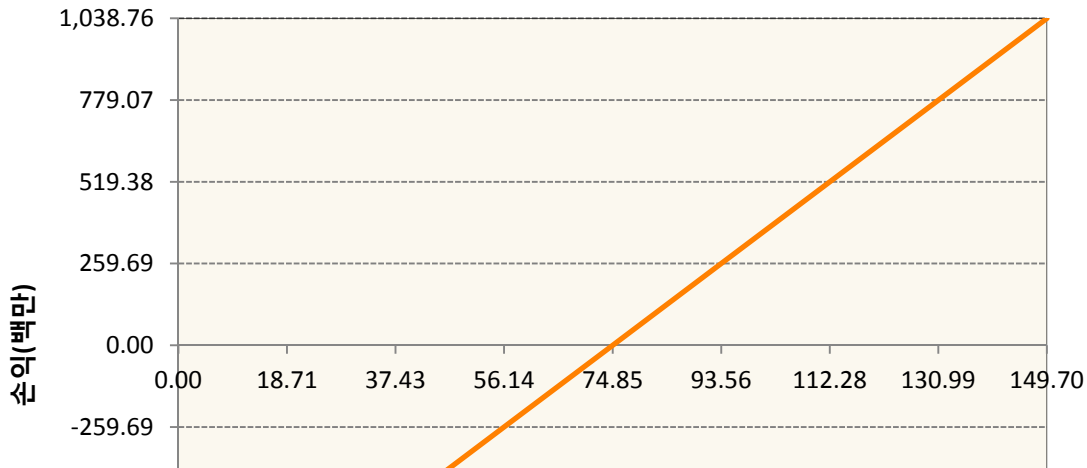
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,930 | 595 | 3,335 | |

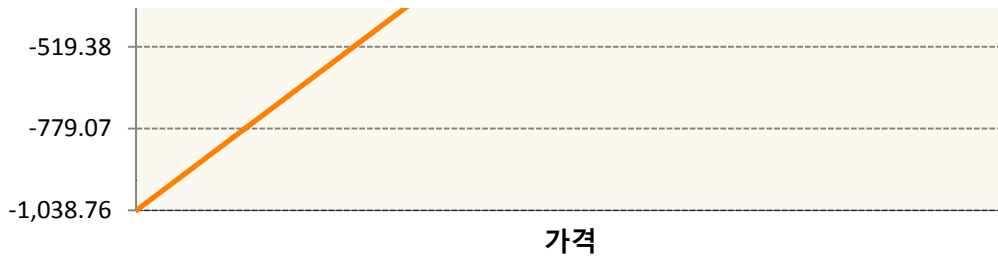
2. 만기시점의 손익구조

CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18

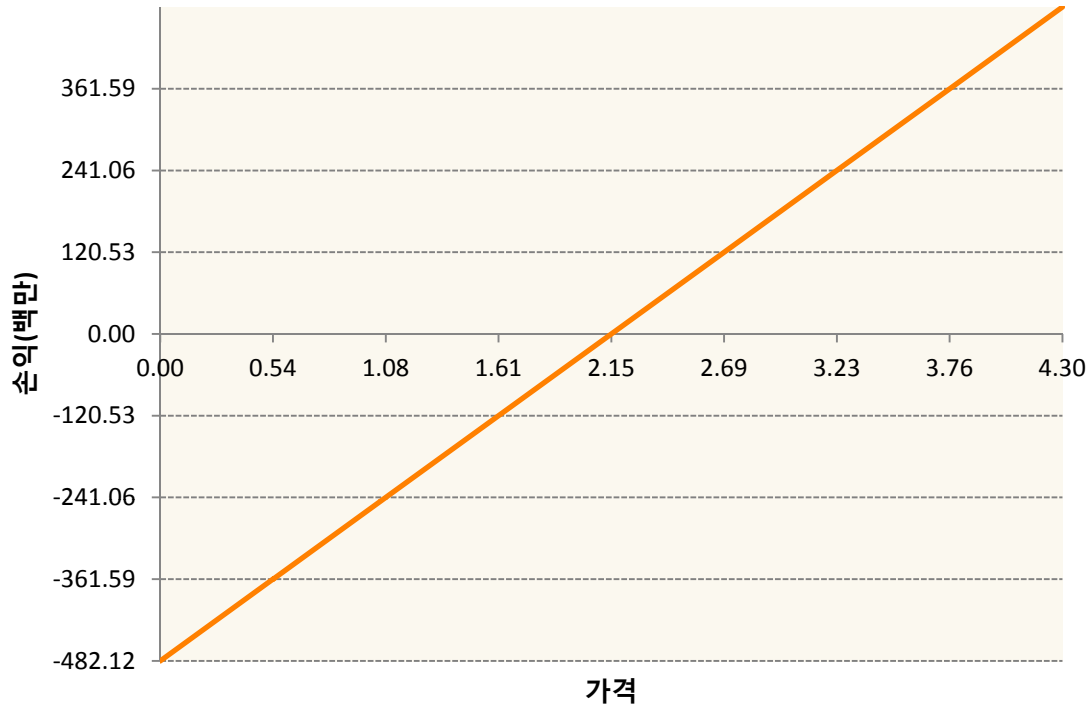


CON8-BRENT CRUDE FUTR JUL18

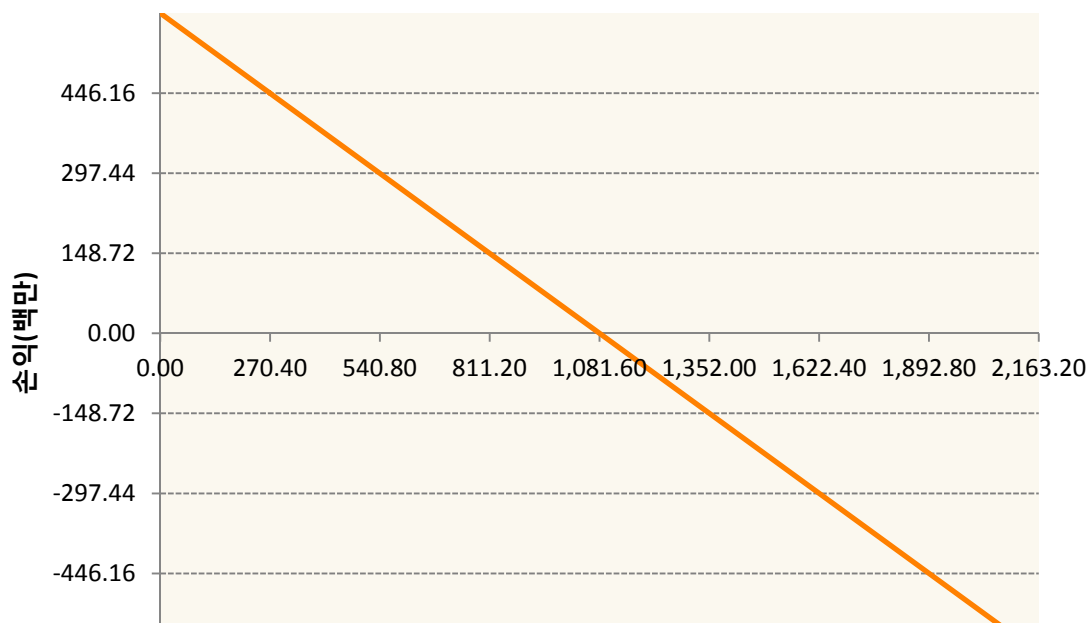


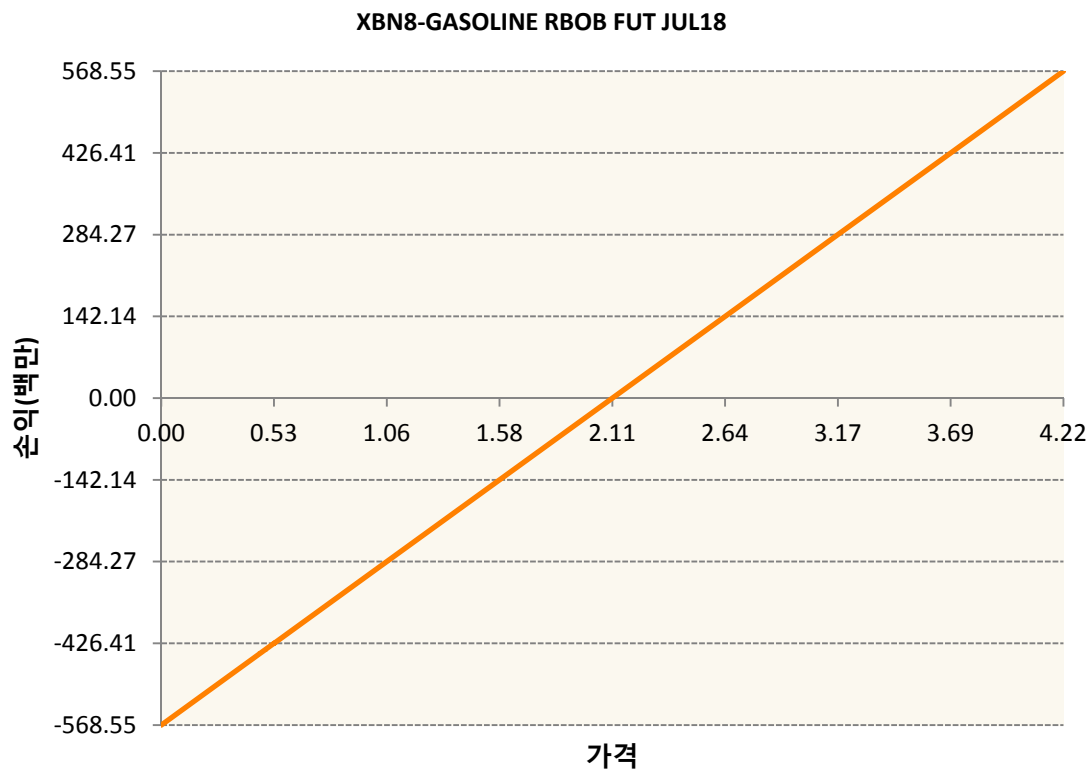
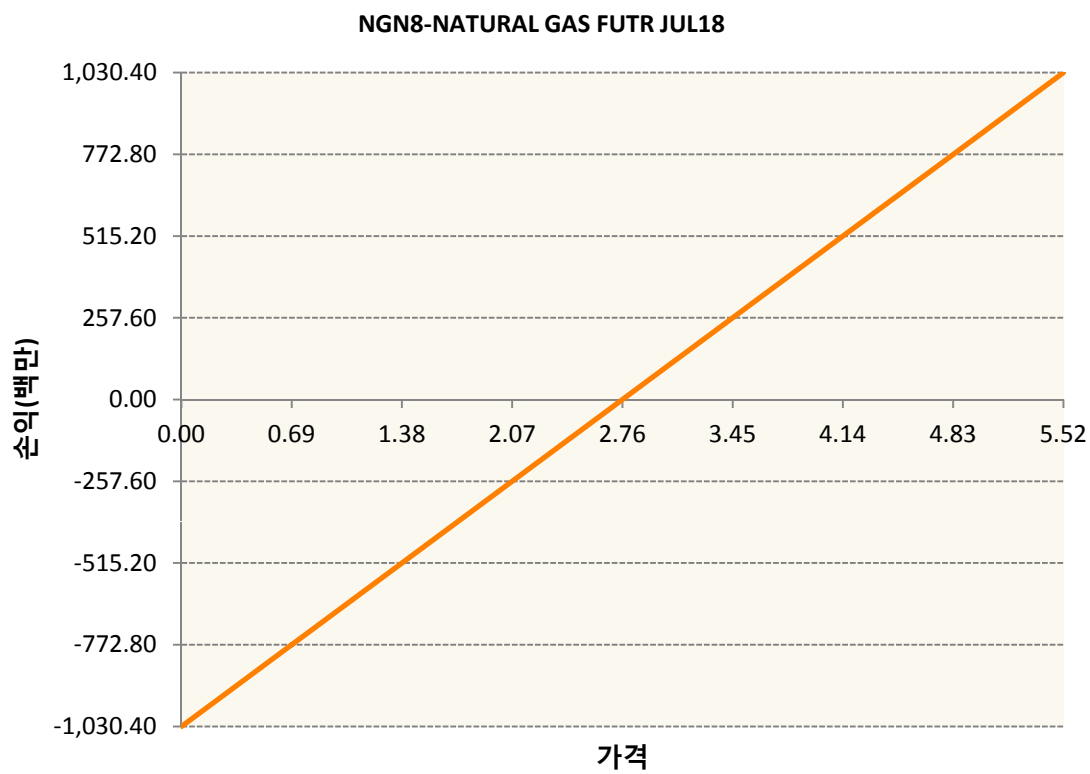
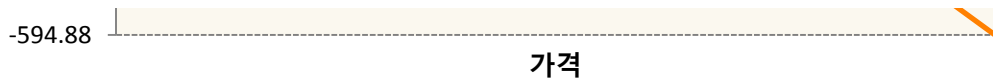


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18



KR4175N50004-2018-05 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLN8 | WTI CRUDE FUTURE JUL18 | 65 |
| CON8 | BRENT CRUDE FUTR JUL18 | 83 |
| HON8 | NY Harb ULSD Fut JUL18 | 39 |
| KR4175N50C | 2018-05 달러선물 | 48 |
| NGN8 | NATURAL GAS FUTR JUL18 | 82 |
| XBN8 | GASOLINE RBOB FUT JUL18 | 45 |

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

474

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-10 |
| 기준일 | 2018-05-09 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

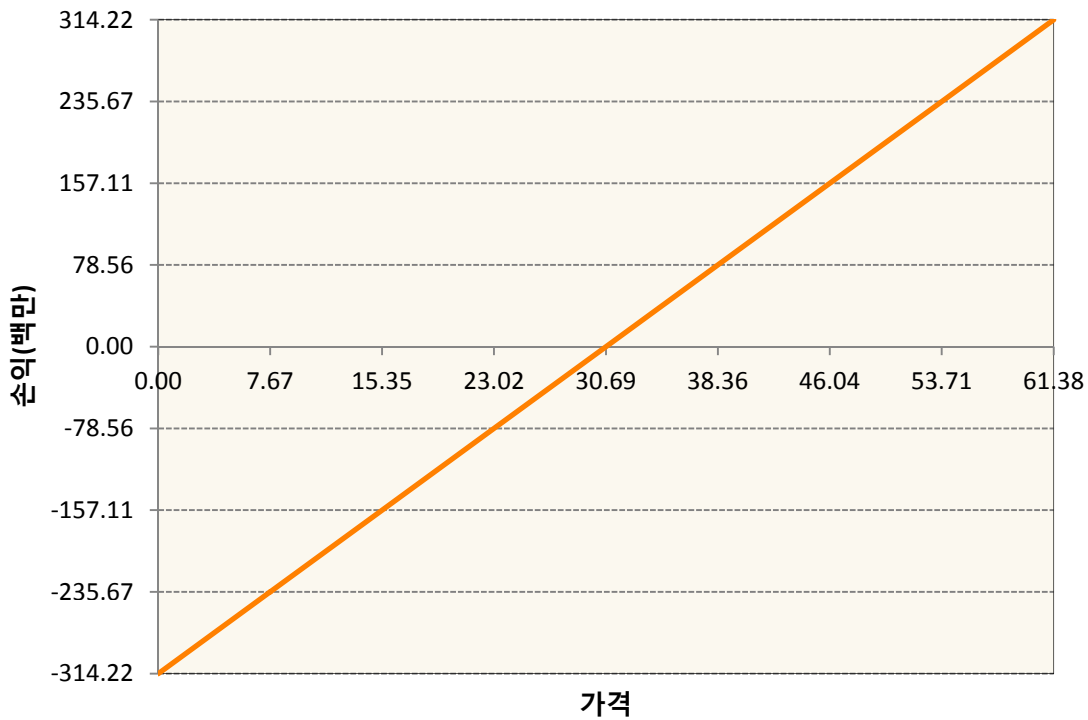
1. 계약금액

(단위:백만원)

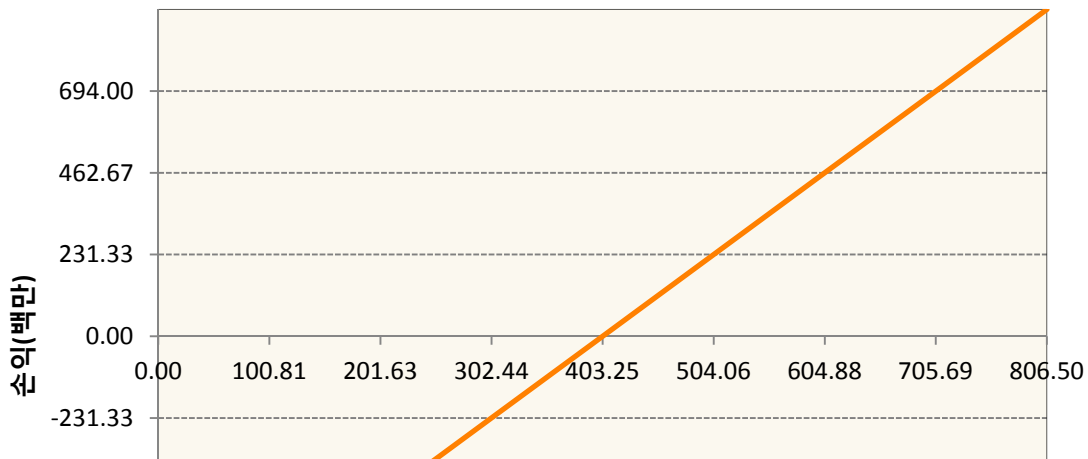
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,098 | 324 | 3,774 | |

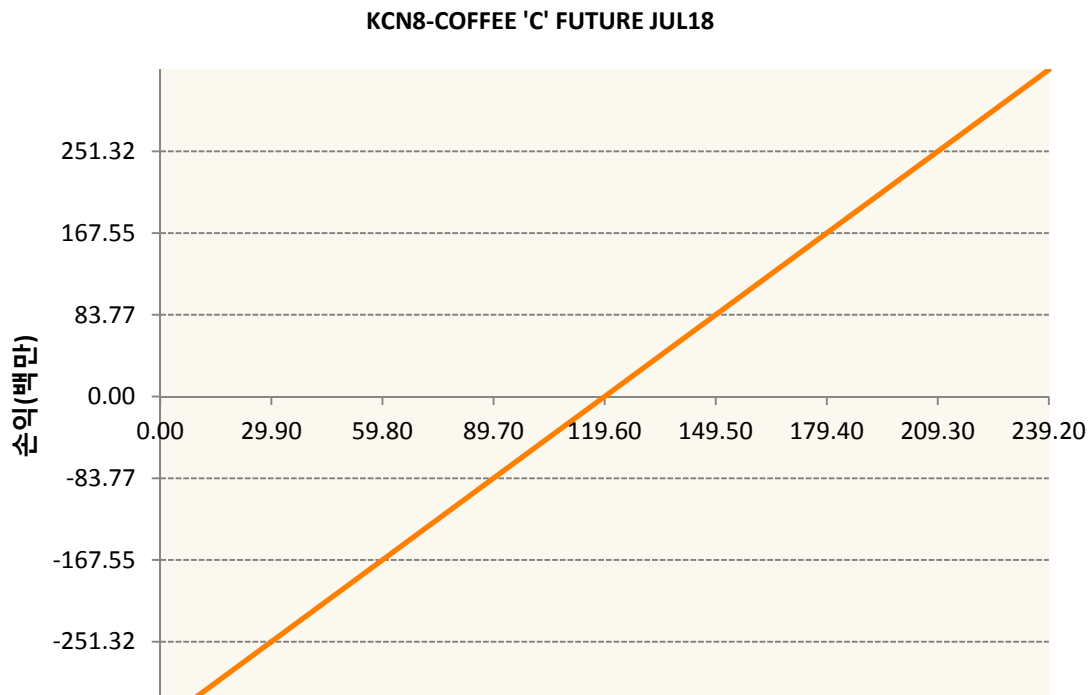
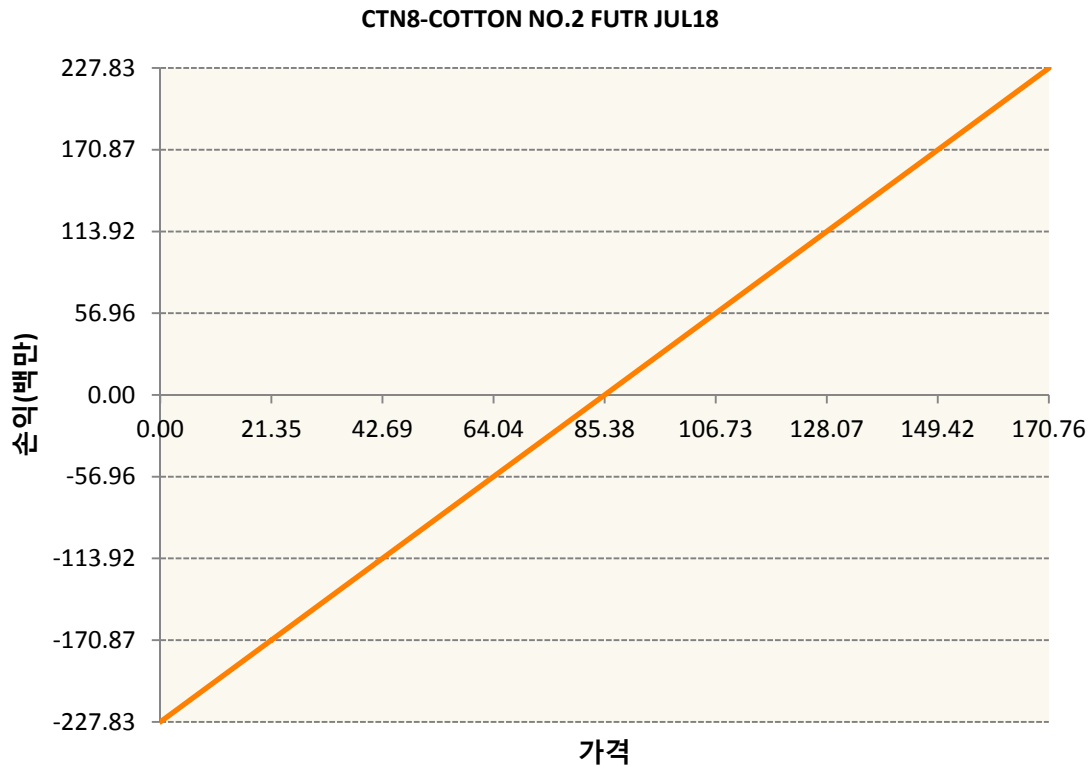
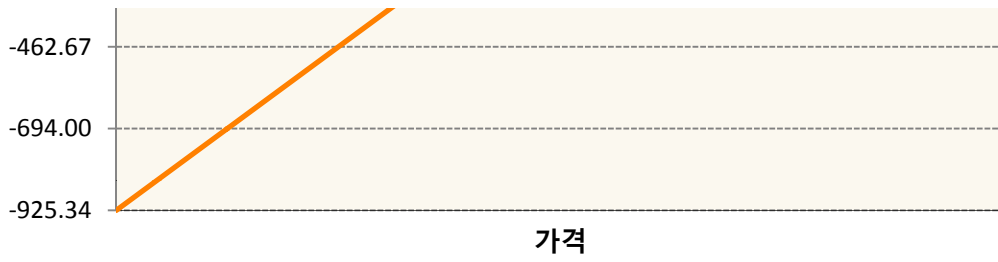
2. 만기시점의 손익구조

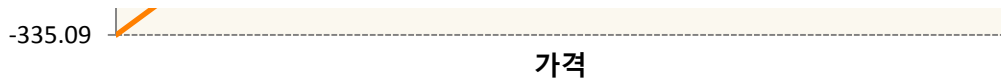
BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18



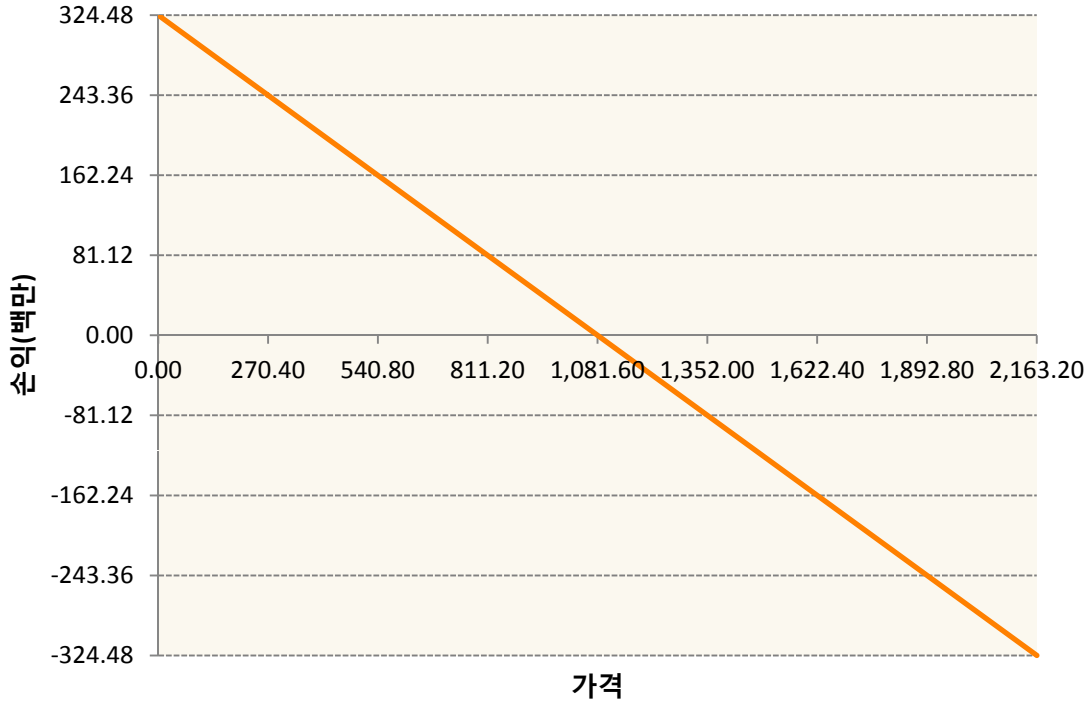
CN8-CORN FUTURE JUL18



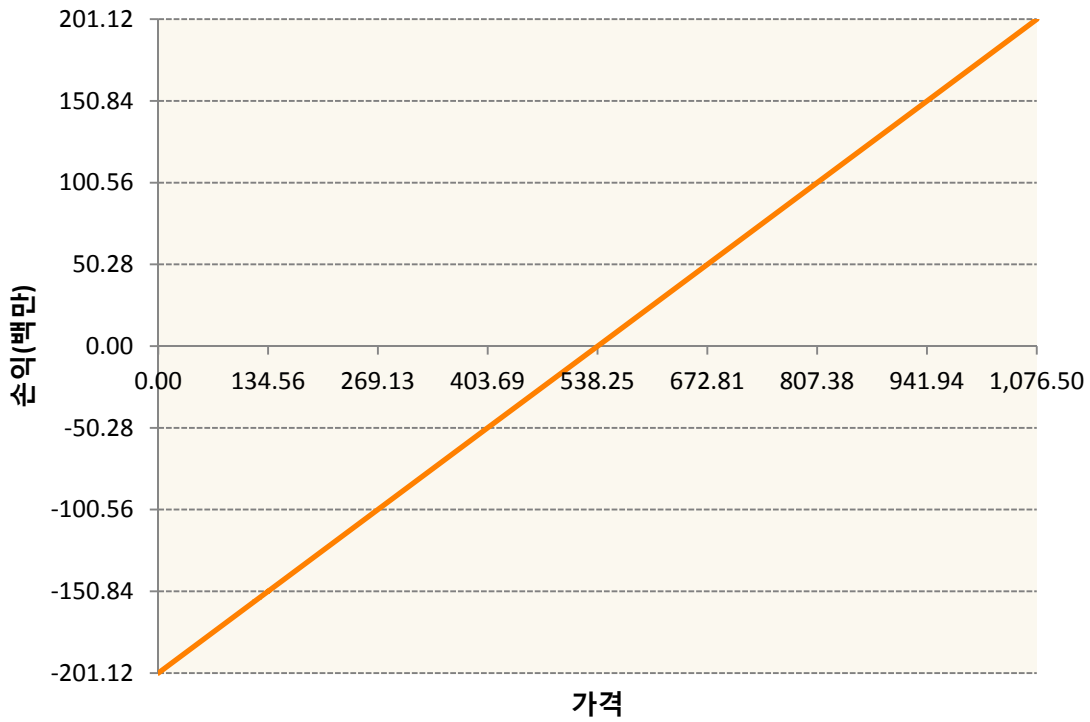




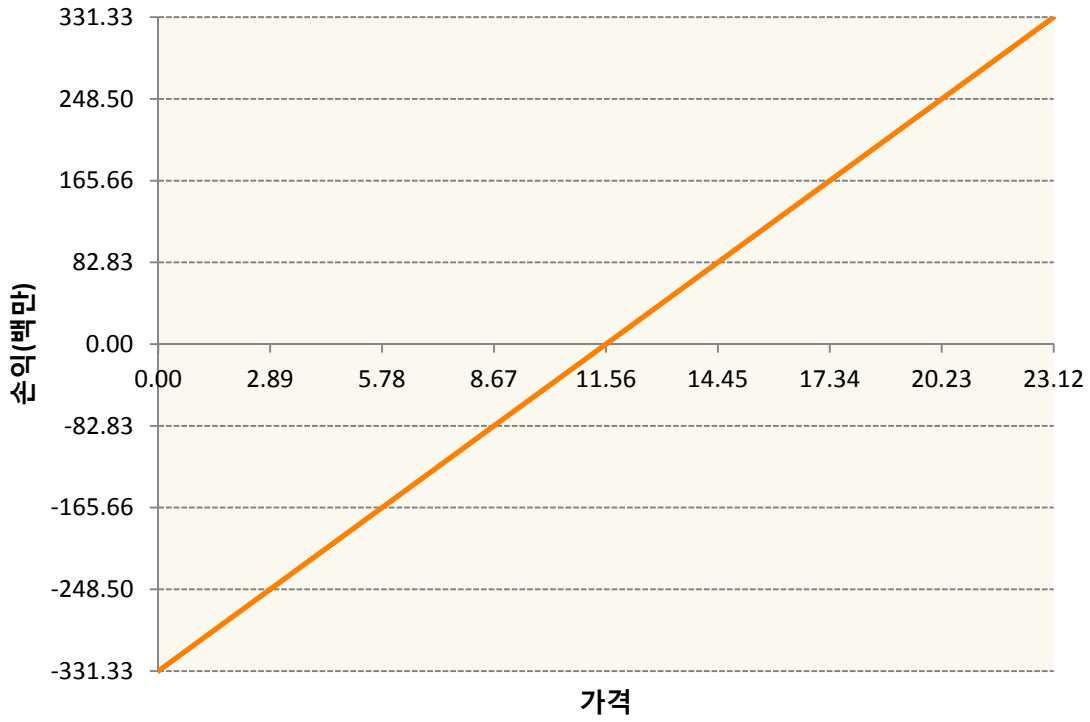
KR4175N50004-2018-05 달러선물



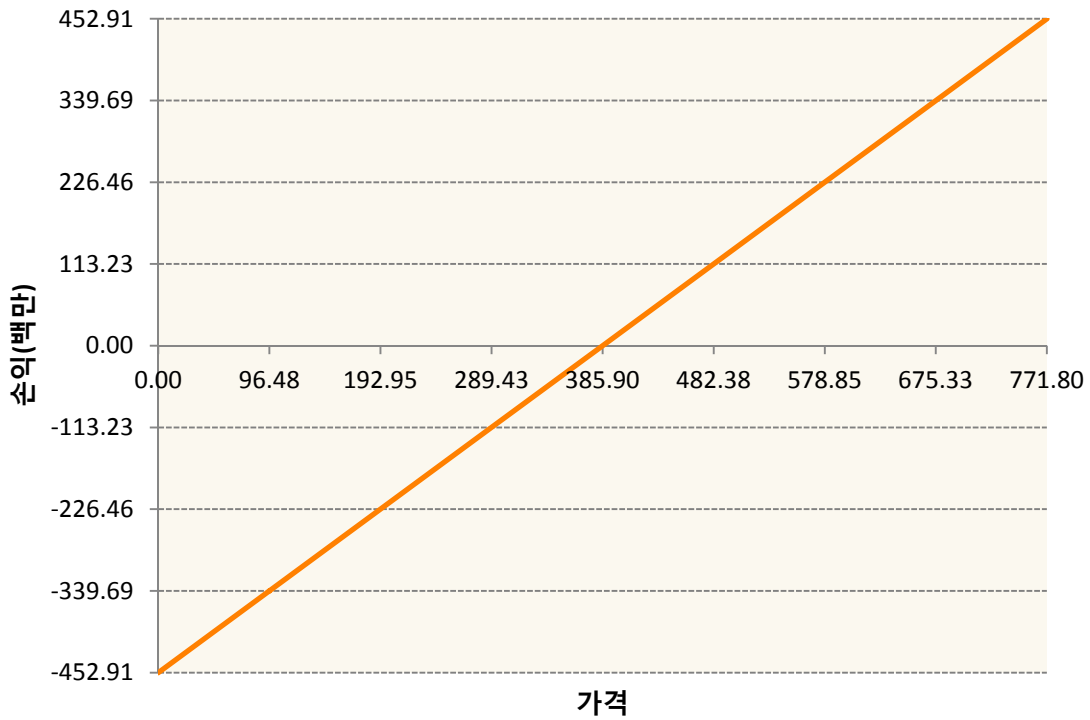
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



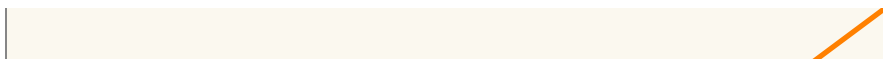
SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

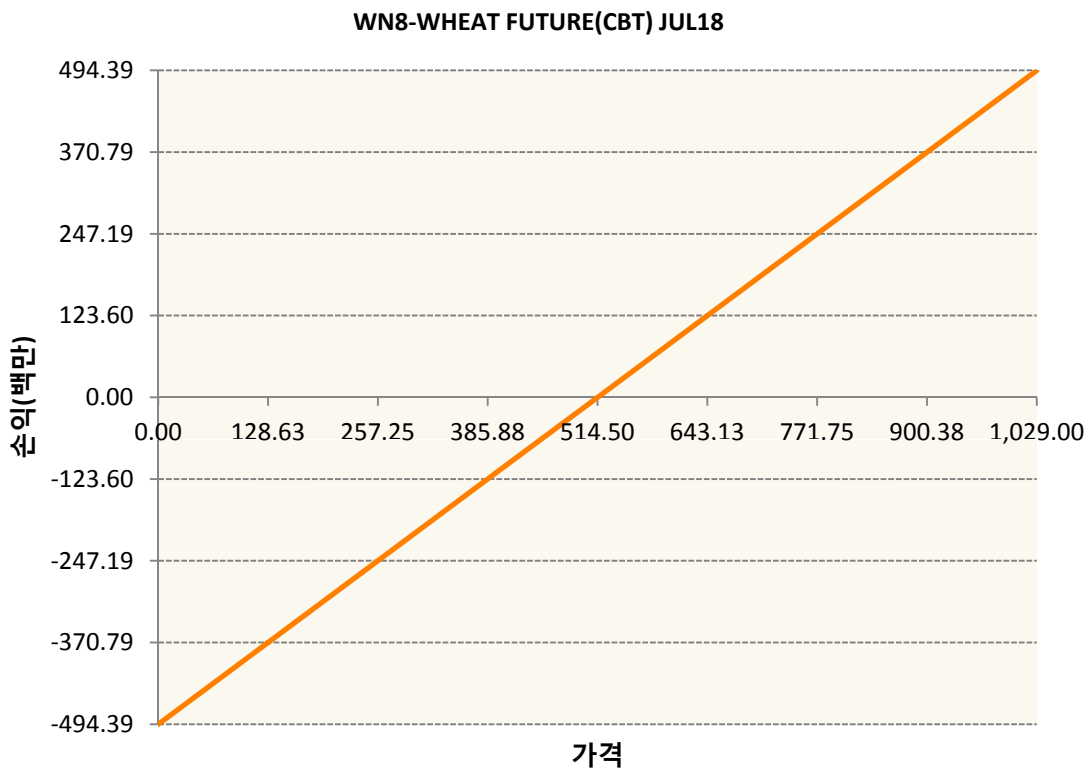
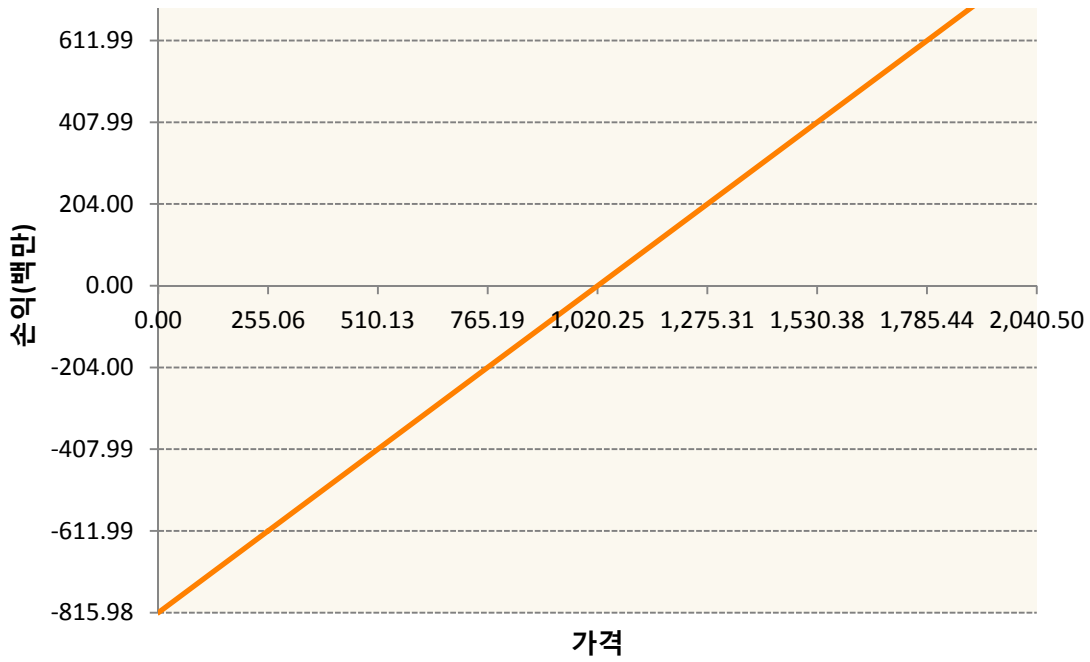


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BON8 | SOYBEAN OIL FUTR JUL18 | 25 |
| CN8 | CORN FUTURE JUL18 | 74 |
| CTN8 | COTTON NO.2 FUTR JUL18 | 18 |
| KCN8 | COFFEE 'C' FUTURE JUL18 | 27 |
| KR4175N50C | 2018-05 달러선물 | 26 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWN8 | KC HRW WHEAT FUT JUL18 | 16 |
| SBN8 | SUGAR #11 (WORLD) JUL18 | 27 |
| SMN8 | SOYBEAN MEAL FUTR JUL18 | 36 |
| SN8 | SOYBEAN FUTURE JUL18 | 65 |
| WN8 | WHEAT FUTURE(CBT) JUL18 | 40 |

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

(단위:백만원)

330