

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

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)

81

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

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

1,120

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

460

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

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)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180308

397

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

423

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

유로인덱스모(주식-파생형)

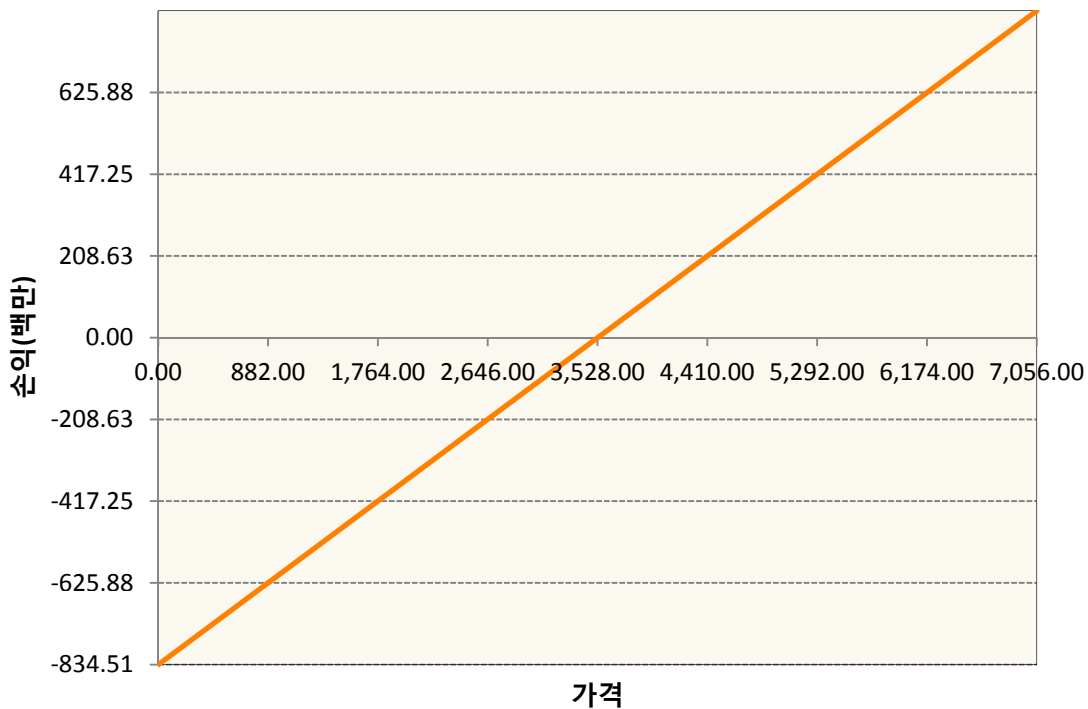
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 835 | 0 | 835 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGM8-EURO STOXX 50 JUN18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGM8 | EURO STOXX 50 JUN18 | 67 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 40 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

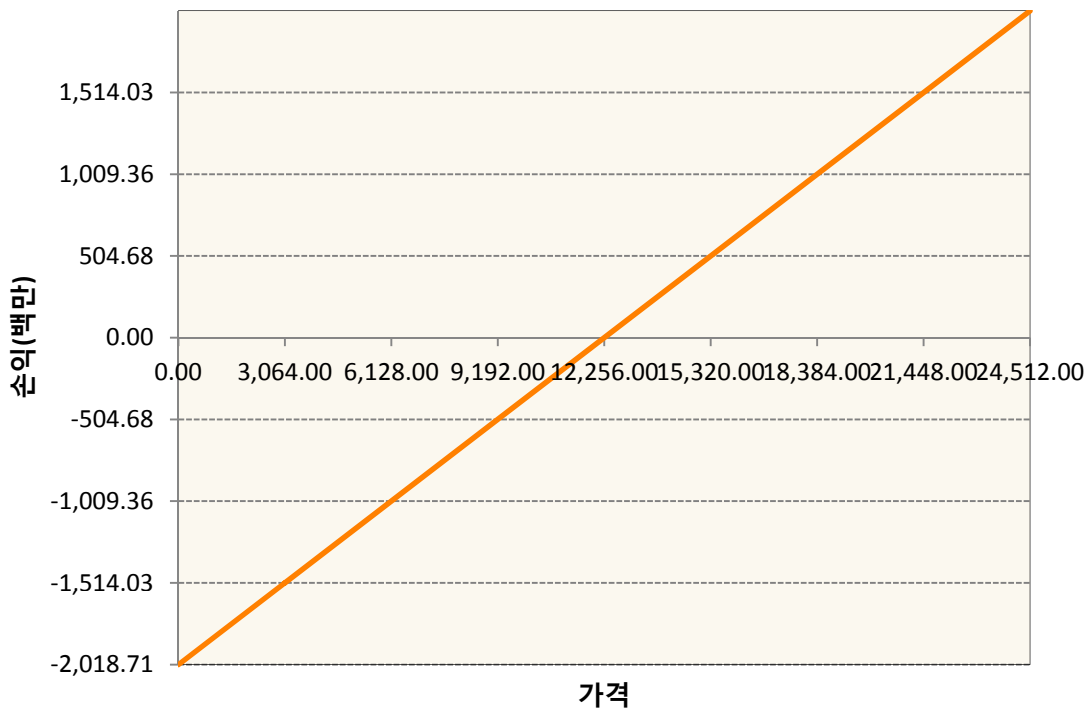
1. 계약금액

(단위:백만원)

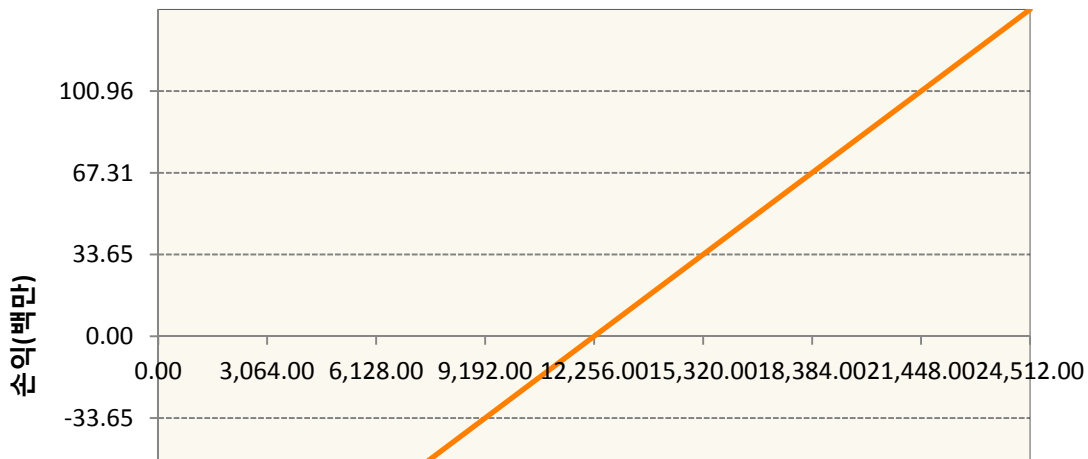
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,153 | 0 | 2,153 | 장내 |

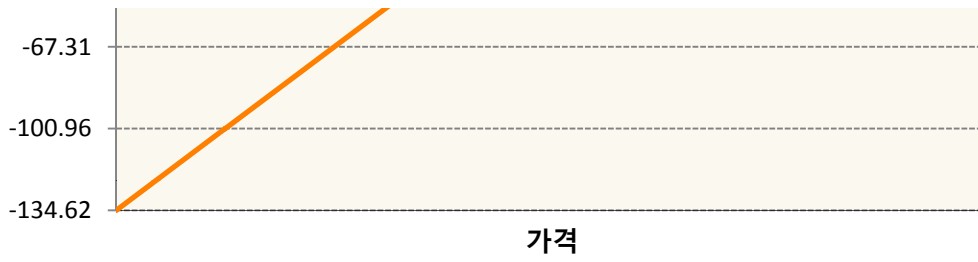
2. 만기시점의 손익구조

HCK8-H-SHARES FUT May18



MHCK8-MINI H-SHR IDX FU May18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|-------------------------|-----|
| HCK8 | H-SHARES FUT May18 | 162 |
| MHCK8 | MINI H-SHR IDX FU May18 | 11 |

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

| |
|------------|
| 151 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

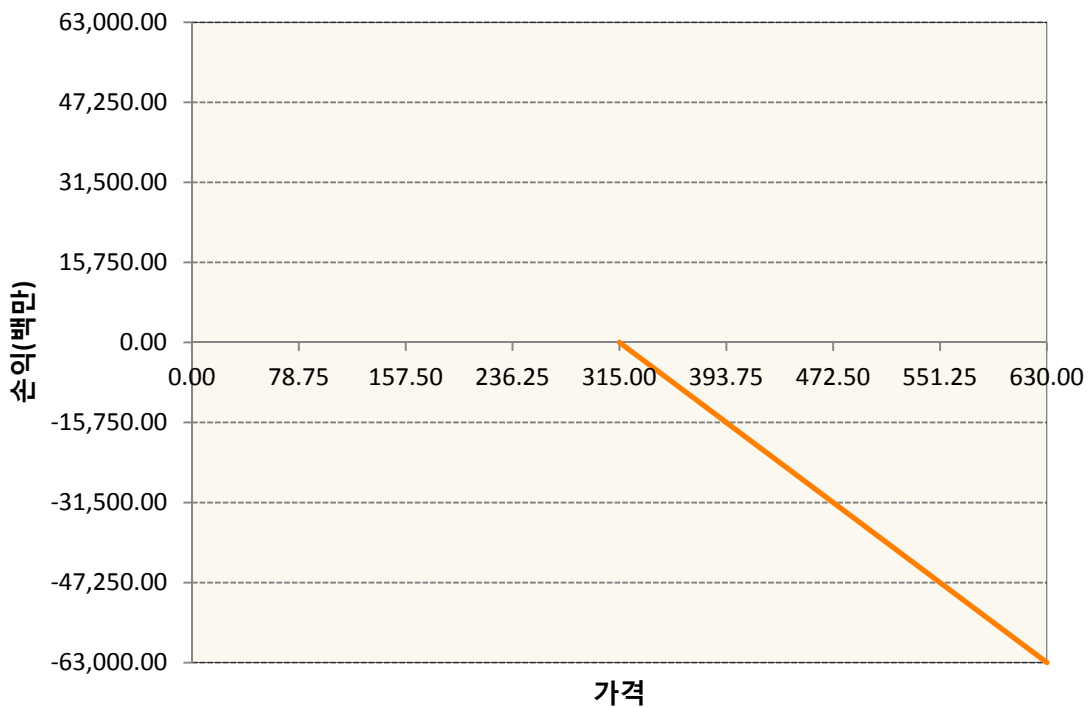
1. 계약금액

(단위:백만원)

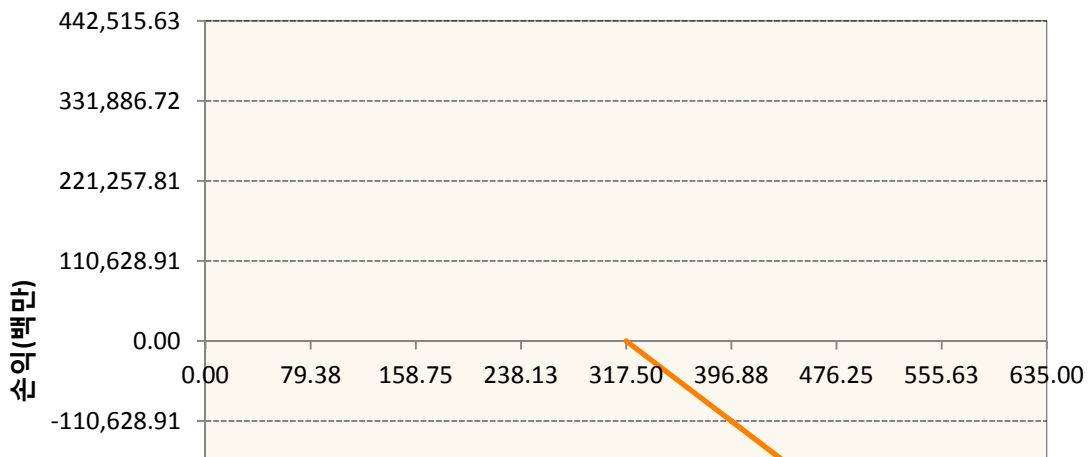
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 1,568 | 0 | 1,568 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 813,491 | -813,491 | 장내 |

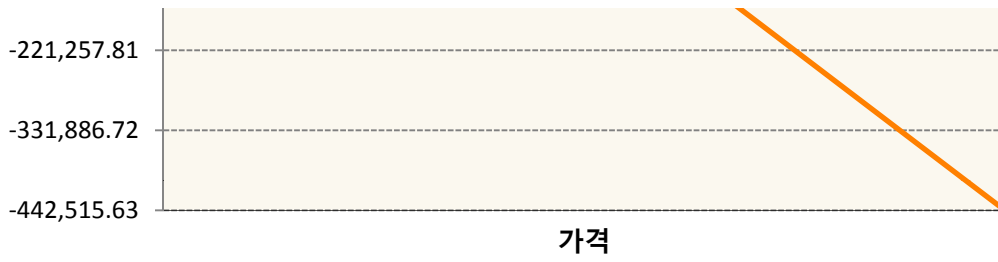
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63159-2018-06 콜315

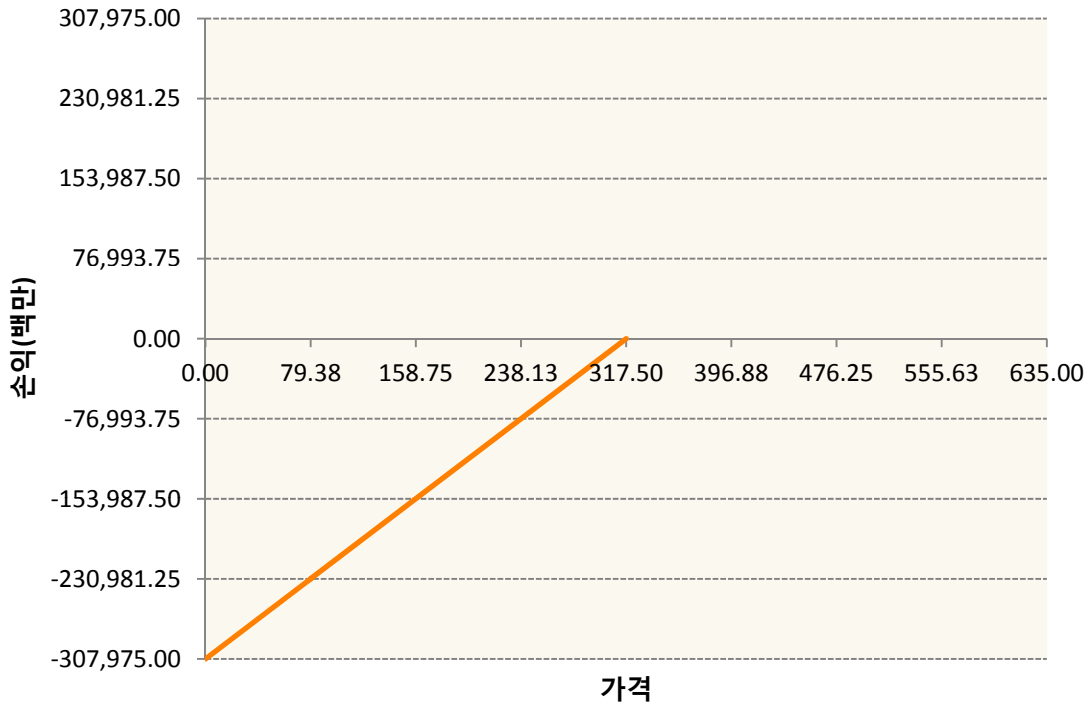


KR4201N63175-2018-06 콜317.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N6312018-06 콜315

3,808

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 1,751 | 1,694 | 1,625 | 1,547 | 1,461 | 1,367 | 1,266 |
| -5.33% | 1,557 | 1,456 | 1,348 | 1,232 | 1,111 | 986 | 857 |
| -2.67% | 1,158 | 1,017 | 873 | 727 | 579 | 430 | 280 |
| 0% | 481 | 320 | 160 | 0 | -160 | -320 | -481 |
| 2.67% | -501 | -651 | -803 | -957 | -1,112 | -1,268 | -1,425 |
| 5.33% | -1,751 | -1,869 | -1,994 | -2,125 | -2,260 | -2,399 | -2,542 |
| 8.00% | -3,198 | -3,277 | -3,366 | -3,466 | -3,573 | -3,688 | -3,808 |

KR4201N6312018-06 풋317.5

25,488

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 10,823 | 10,493 | 10,085 | 9,605 | 9,063 | 8,464 | 7,817 |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| -5.33% | 9,756 | 9,140 | 8,456 | 7,717 | 6,932 | 6,110 | 5,257 |
| -2.67% | 7,444 | 6,527 | 5,577 | 4,603 | 3,610 | 2,602 | 1,581 |
| 0% | 3,326 | 2,220 | 1,111 | 0 | -1,112 | -2,226 | -3,341 |
| 2.67% | -2,886 | -3,983 | -5,087 | -6,196 | -7,309 | -8,426 | -9,544 |
| 5.33% | -11,071 | -11,979 | -12,927 | -13,906 | -14,909 | -15,933 | -16,972 |
| 8.00% | -20,786 | -21,422 | -22,133 | -22,904 | -23,725 | -24,589 | -25,488 |

KR4301N6312018-06 풋317.5

21,593

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -21,528 | -21,529 | -21,531 | -21,537 | -21,549 | -21,567 | -21,593 |
| -5.33% | -13,424 | -13,444 | -13,477 | -13,526 | -13,591 | -13,674 | -13,774 |
| -2.67% | -5,552 | -5,687 | -5,848 | -6,030 | -6,231 | -6,449 | -6,680 |
| 0% | 990 | 664 | 333 | 0 | -336 | -674 | -1,013 |
| 2.67% | 4,637 | 4,341 | 4,035 | 3,721 | 3,401 | 3,077 | 2,749 |
| 5.33% | 5,746 | 5,636 | 5,500 | 5,340 | 5,159 | 4,959 | 4,744 |
| 8.00% | 5,912 | 5,894 | 5,863 | 5,817 | 5,753 | 5,672 | 5,572 |

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

(단위:백만원)

51,802

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

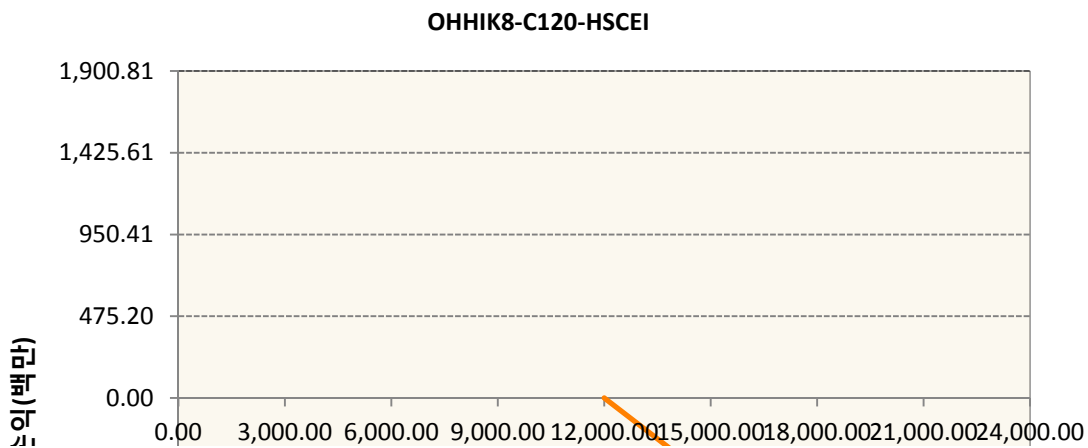
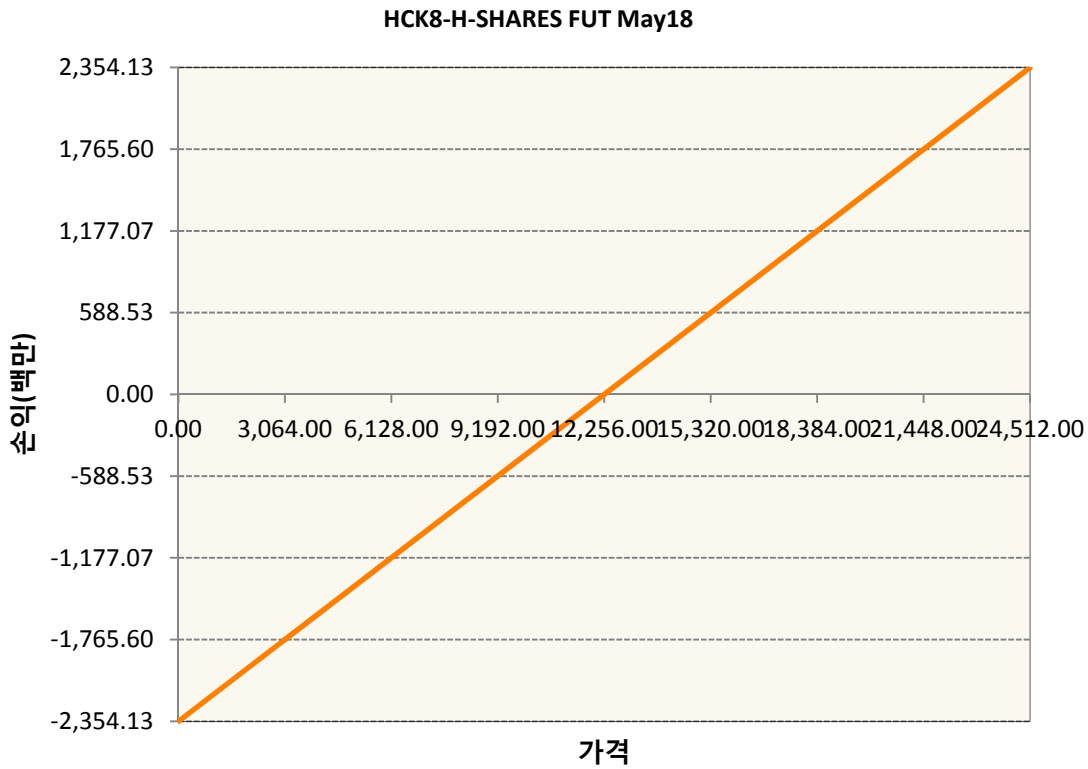
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

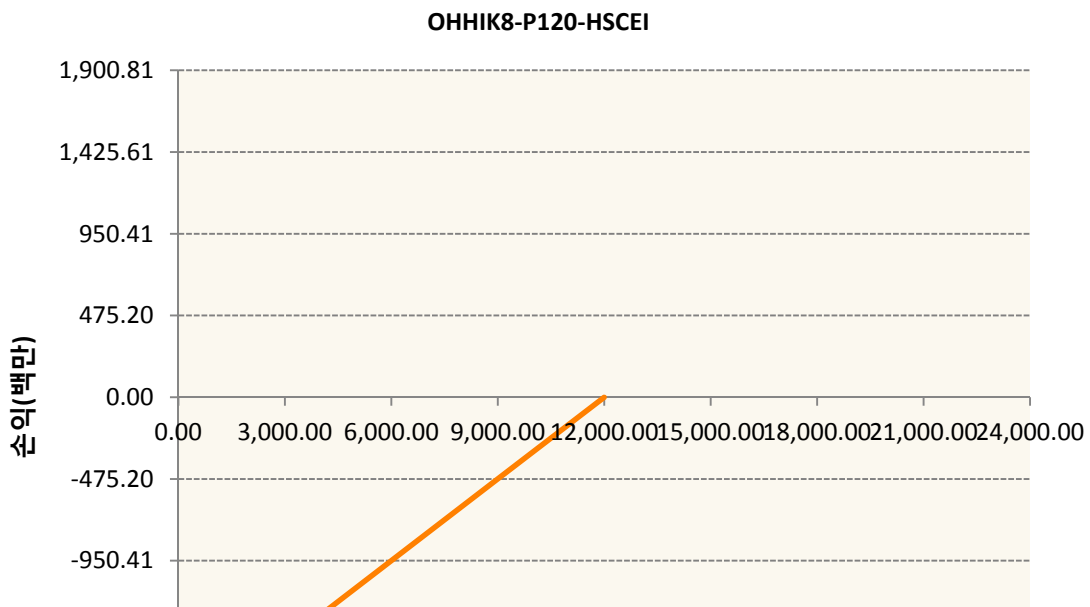
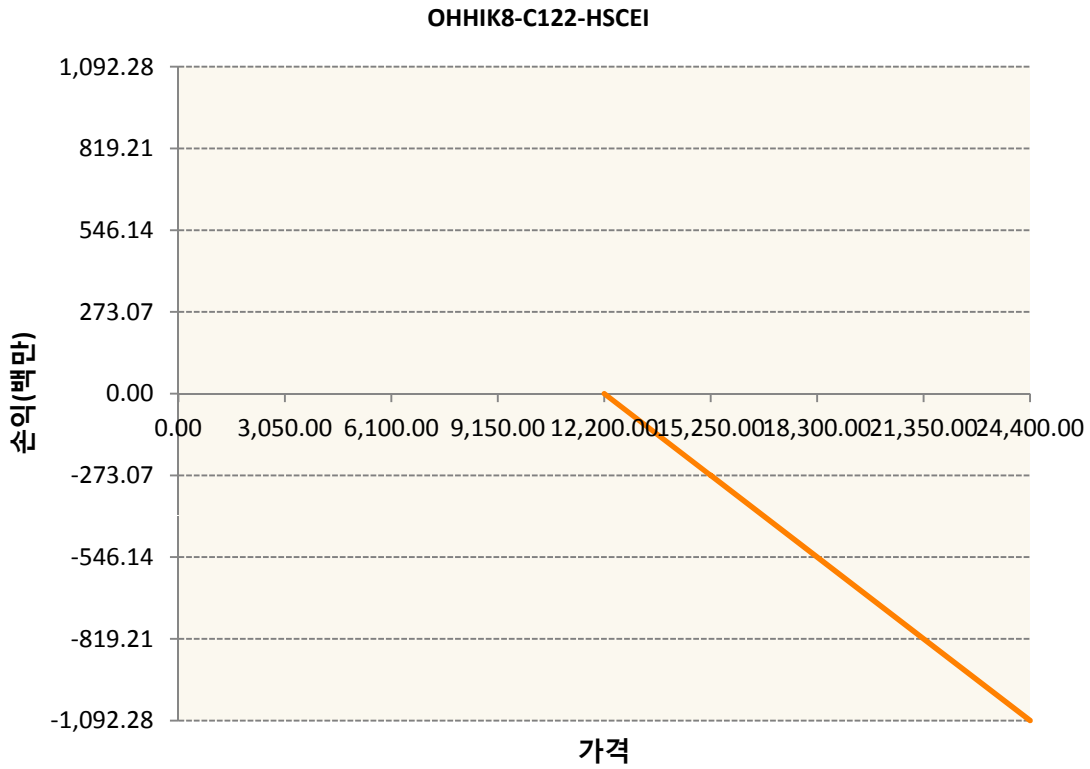
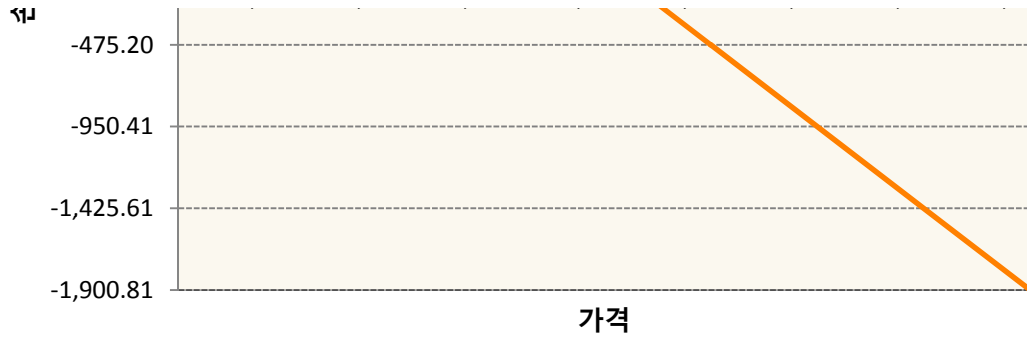
1. 계약금액

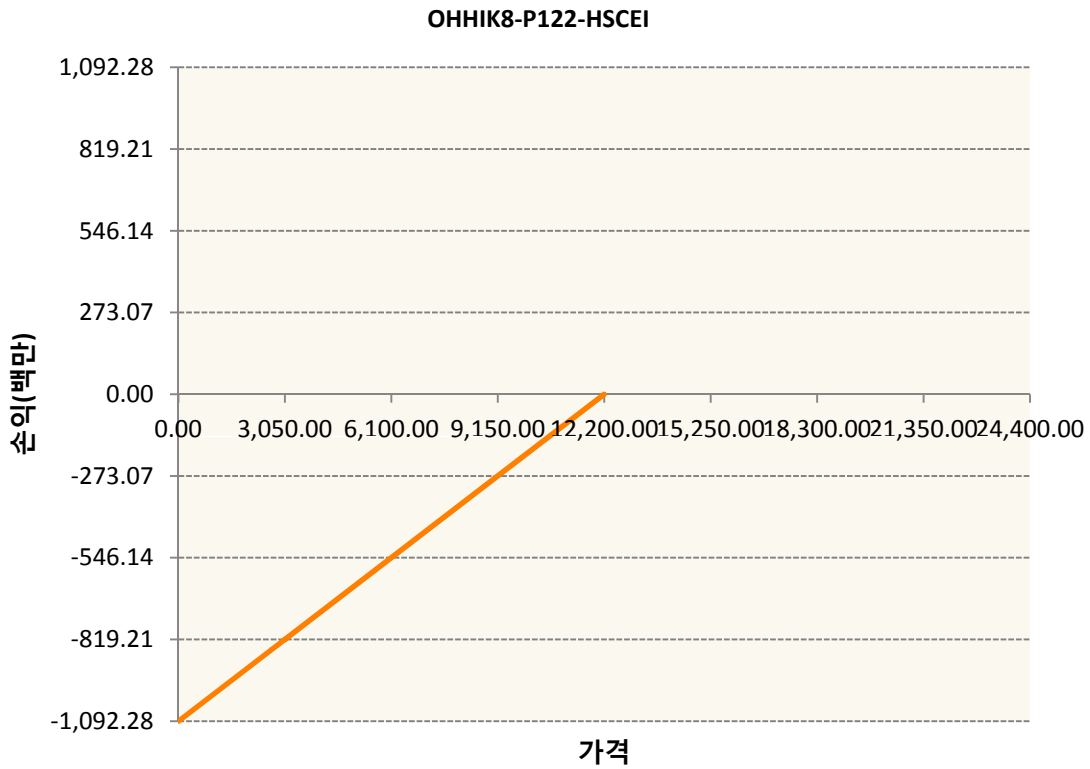
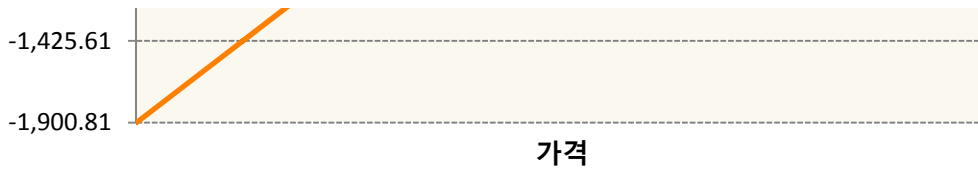
(단위:백만원)

| 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 | 2,354 | 0 | 2,354 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 5,986 | -5,986 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조







| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------|----------|
| HCK8 | H-SHARES FUT May18 | 188 |
| OHHIK8-C12 | HSCEI | 152 |
| OHHIK8-C12 | HSCEI | 87 |
| OHHIK8-P12 | HSCEI | 152 |
| OHHIK8-P12 | HSCEI | 87 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 586 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

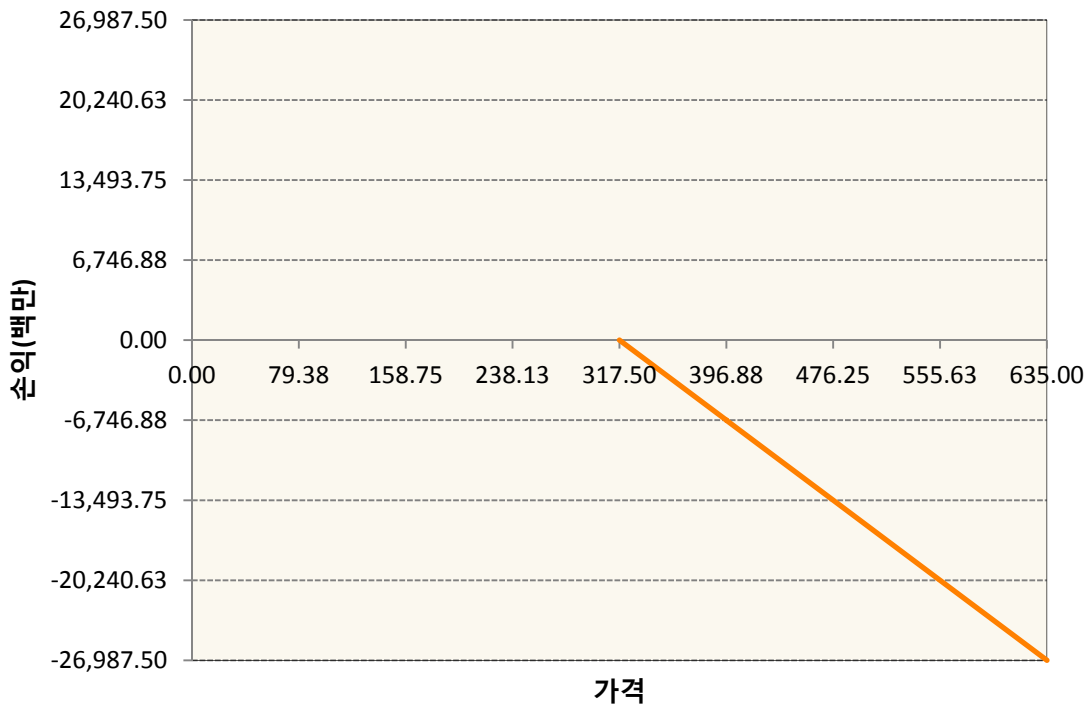
1. 계약금액

(단위:백만원)

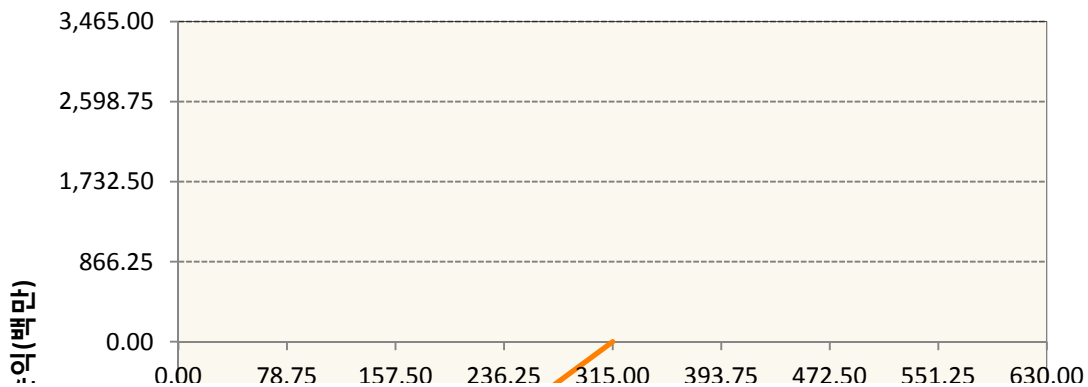
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 48,200 | 0 | 48,200 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 46,804 | -46,804 | 장내 |

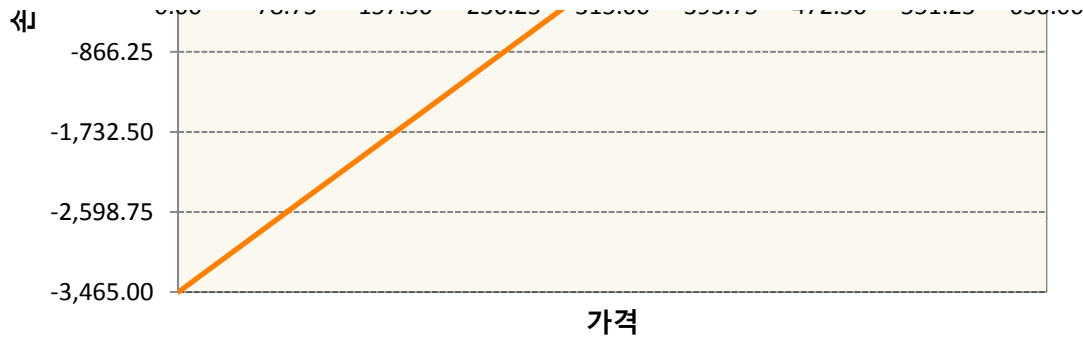
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N63175-2018-06 콜317.5

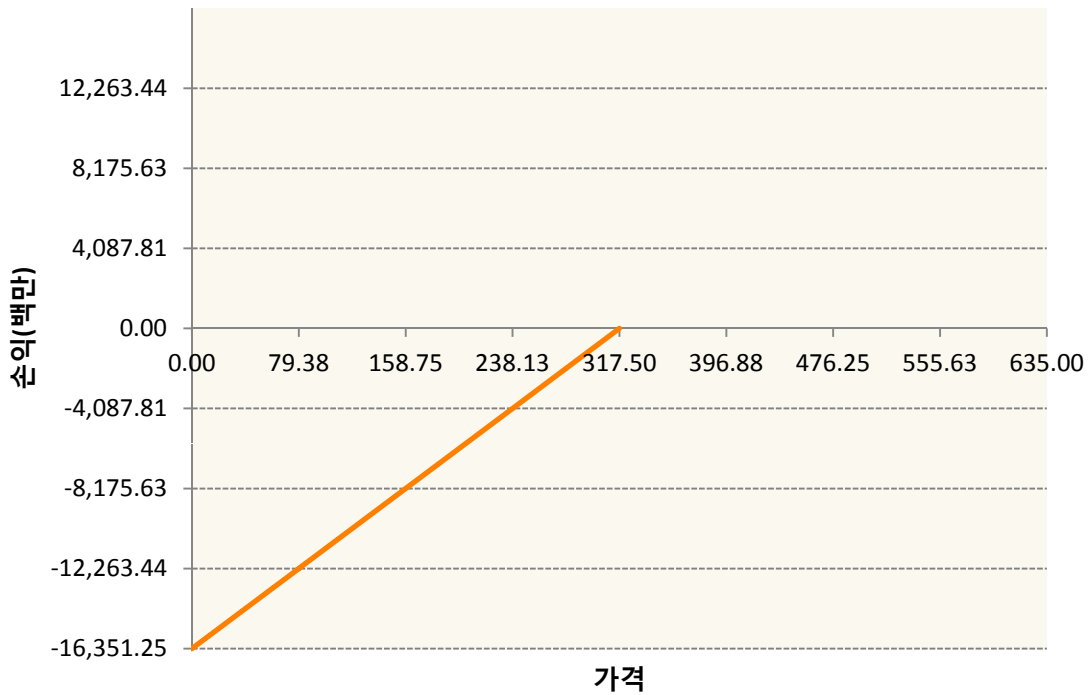


KR4301N63157-2018-06 풋315





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | |
|----------------------------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,478 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,478 | -1,478 | -1,478 | -1,478 | -1,478 | -1,478 | -1,478 |
| -5.33% | -985 | -985 | -985 | -985 | -985 | -985 | -985 |
| -2.67% | -493 | -493 | -493 | -493 | -493 | -493 | -493 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 493 | 493 | 493 | 493 | 493 | 493 | 493 |
| 5.33% | 985 | 985 | 985 | 985 | 985 | 985 | 985 |
| 8.00% | 1,478 | 1,478 | 1,478 | 1,478 | 1,478 | 1,478 | 1,478 |
| 2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3 | | | | | | | 280 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| | | | | | | | |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 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% | 639 | 639 | 639 | 639 | 639 | 639 | 639 |

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12 479

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -479 | -479 | -479 | -479 | -479 | -479 | -479 |
| -5.33% | -320 | -320 | -320 | -320 | -320 | -320 | -320 |
| -2.67% | -160 | -160 | -160 | -160 | -160 | -160 | -160 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 160 | 160 | 160 | 160 | 160 | 160 | 160 |
| 5.33% | 320 | 320 | 320 | 320 | 320 | 320 | 320 |
| 8.00% | 479 | 479 | 479 | 479 | 479 | 479 | 479 |

KR4201N6312018-06 콜317.5 1,554

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 660 | 640 | 615 | 586 | 553 | 516 | 477 |
| -5.33% | 595 | 557 | 516 | 471 | 423 | 373 | 321 |
| -2.67% | 454 | 398 | 340 | 281 | 220 | 159 | 96 |
| 0% | 203 | 135 | 68 | 0 | -68 | -136 | -204 |
| 2.67% | -176 | -243 | -310 | -378 | -446 | -514 | -582 |
| 5.33% | -675 | -731 | -788 | -848 | -909 | -972 | -1,035 |
| 8.00% | -1,268 | -1,306 | -1,350 | -1,397 | -1,447 | -1,500 | -1,554 |

KR4301N6312018-06 풋315 234

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -233 | -233 | -233 | -233 | -233 | -233 | -234 |
| -5.33% | -141 | -141 | -142 | -143 | -144 | -145 | -147 |
| -2.67% | -54 | -56 | -59 | -61 | -64 | -67 | -70 |
| 0% | 12 | 8 | 4 | 0 | -4 | -8 | -12 |
| 2.67% | 43 | 40 | 37 | 34 | 31 | 28 | 24 |
| 5.33% | 50 | 50 | 49 | 47 | 46 | 44 | 42 |
| 8.00% | 51 | 51 | 51 | 51 | 50 | 50 | 49 |

KR4301N6312018-06 풋317.5 1,146

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,143 | -1,143 | -1,143 | -1,143 | -1,144 | -1,145 | -1,146 |
| -5.33% | -713 | -714 | -716 | -718 | -722 | -726 | -731 |
| -2.67% | -295 | -302 | -310 | -320 | -331 | -342 | -355 |
| 0% | 53 | 35 | 18 | 0 | -18 | -36 | -54 |
| 2.67% | 246 | 230 | 214 | 198 | 181 | 163 | 146 |
| 5.33% | 305 | 299 | 292 | 284 | 274 | 263 | 252 |
| 8.00% | 314 | 313 | 311 | 309 | 305 | 301 | 296 |

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

(단위:백만원)

6,855

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

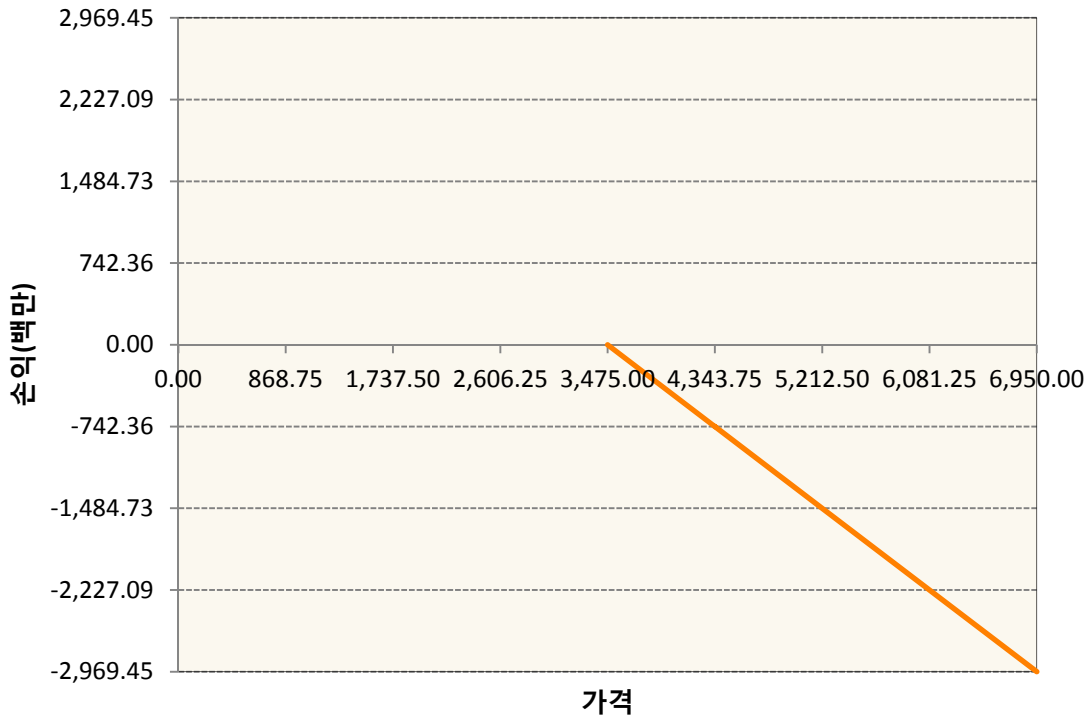
1. 계약금액

(단위:백만원)

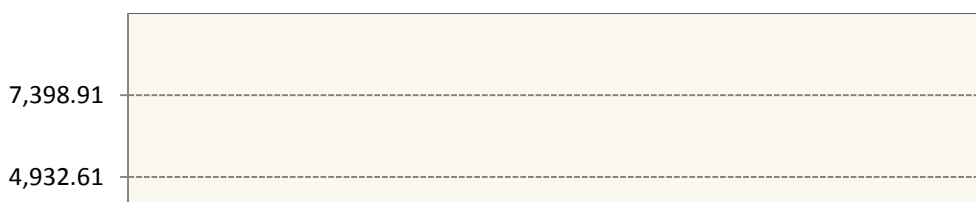
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,979 | 0 | 4,979 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 63,719 | 0 | 63,719 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 33,602 | -33,602 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 51,016 | 0 | 51,016 | 장외 |

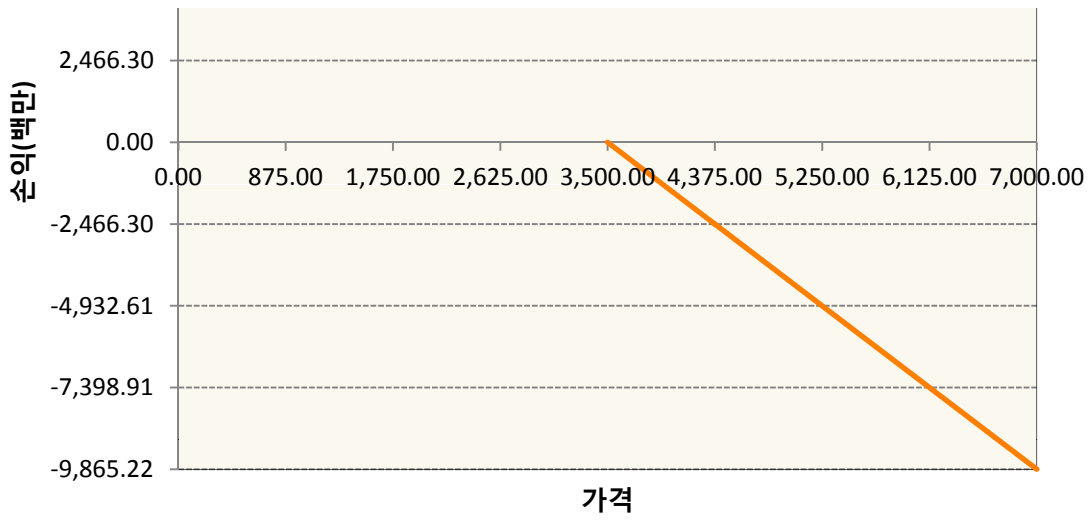
2. 만기시점의 손익구조

OESXK8-C3475-EURO STOXX 50

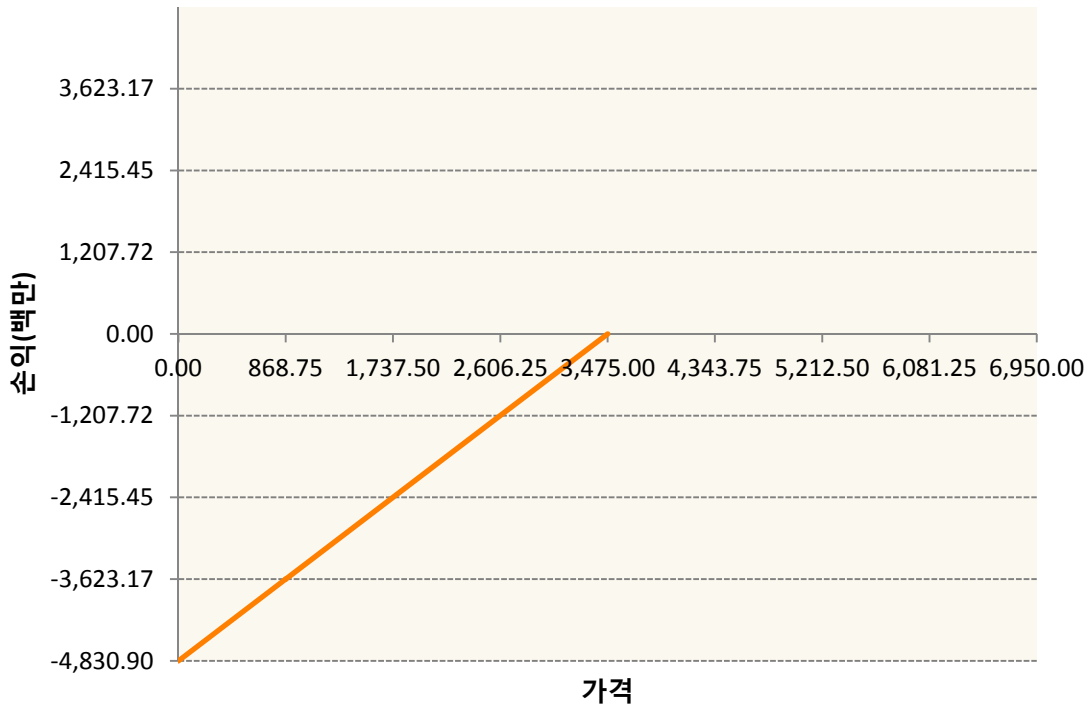


OESXK8-C3500-EURO STOXX 50

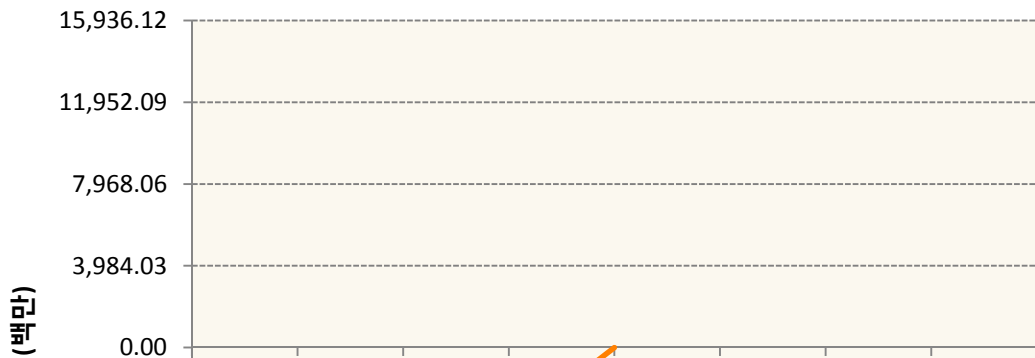


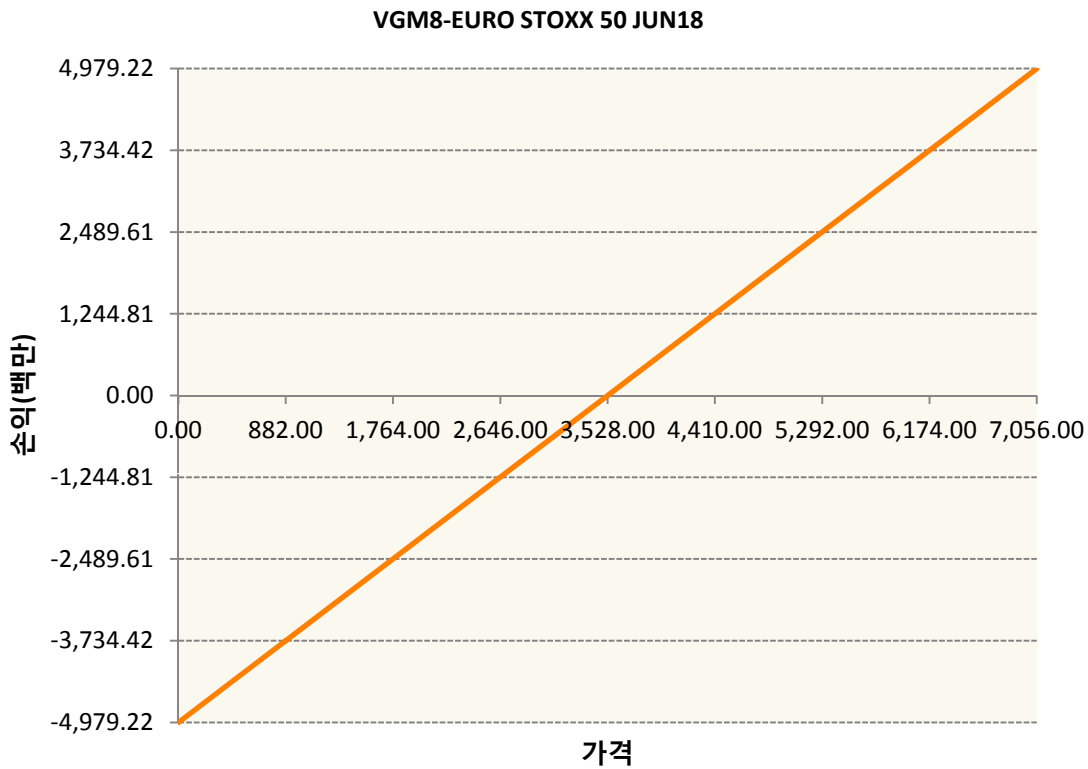
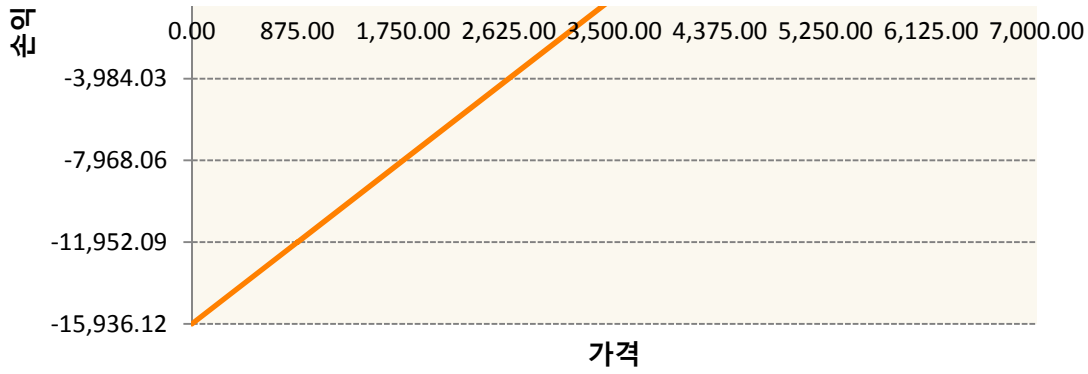


OESXK8-P3475-EURO STOXX 50



OESXK8-P3500-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|--|--|----------|
| 260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569 | | 65 |
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 81 |
| OESXK8-C34 EURO STOXX 50 | | 238 |
| OESXK8-C35 EURO STOXX 50 | | 789 |
| OESXK8-P34 EURO STOXX 50 | | 386 |
| OESXK8-P35 EURO STOXX 50 | | 1,275 |
| VGM8 EURO STOXX 50 JUN18 | | 398 |

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

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

(단위:백만원)

1,158

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

(단위:백만원)

59

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

(단위:백만원)

95

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

(단위:백만원)

207

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

스마트KRX300인덱스목표전환형1

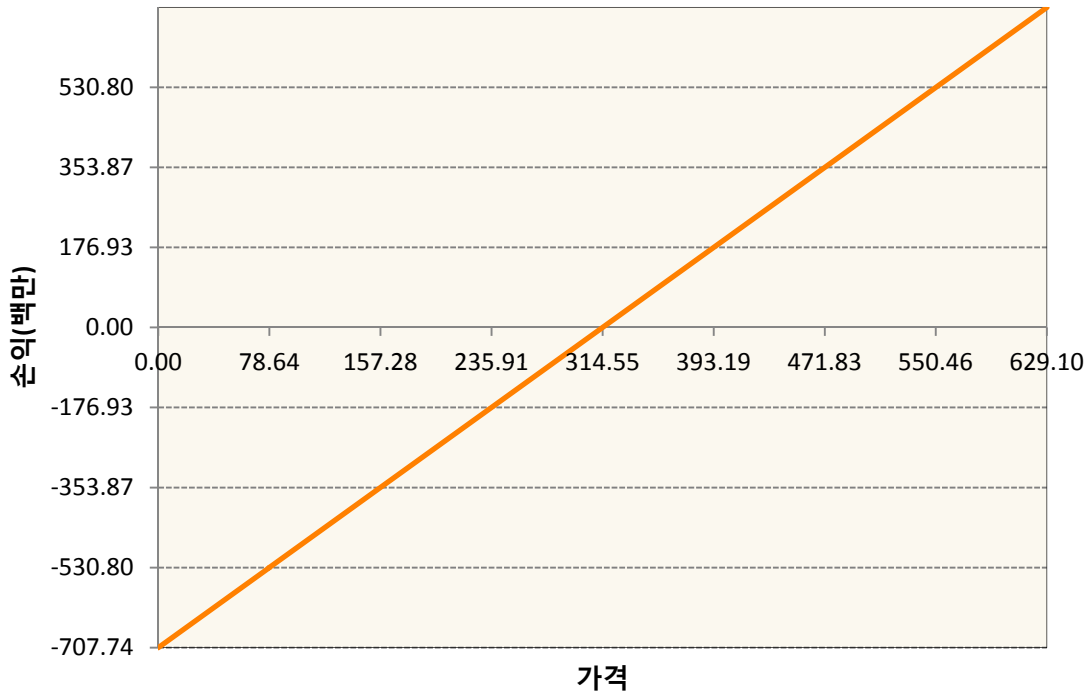
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 708 | 0 | 708 | 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)

41

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간

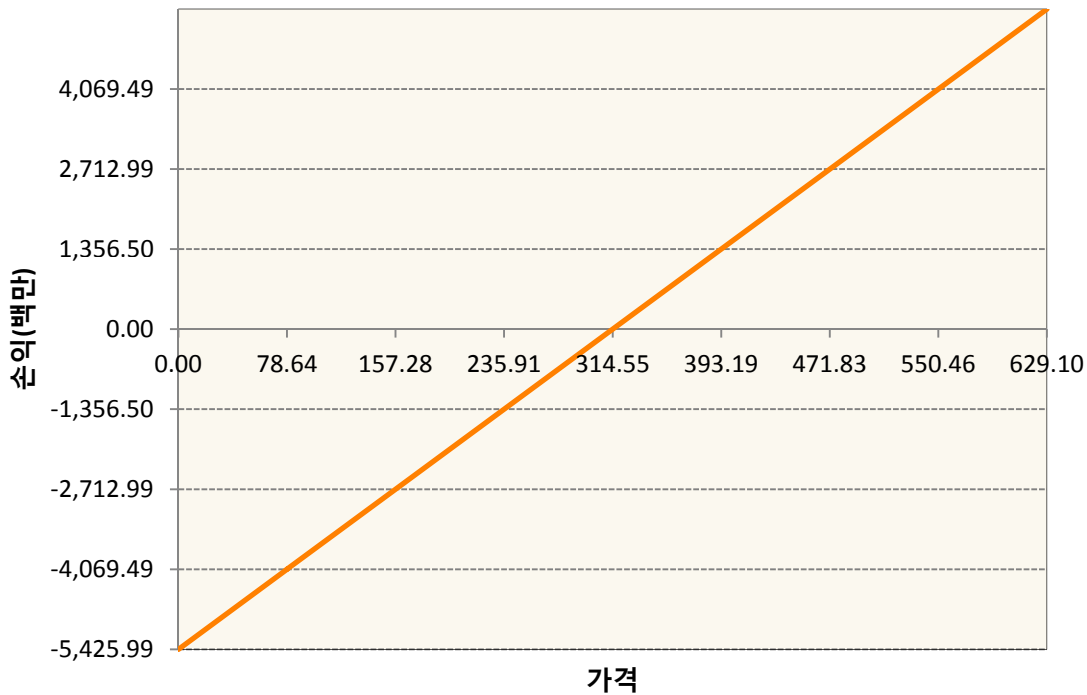
1. 계약금액

(단위:백만원)

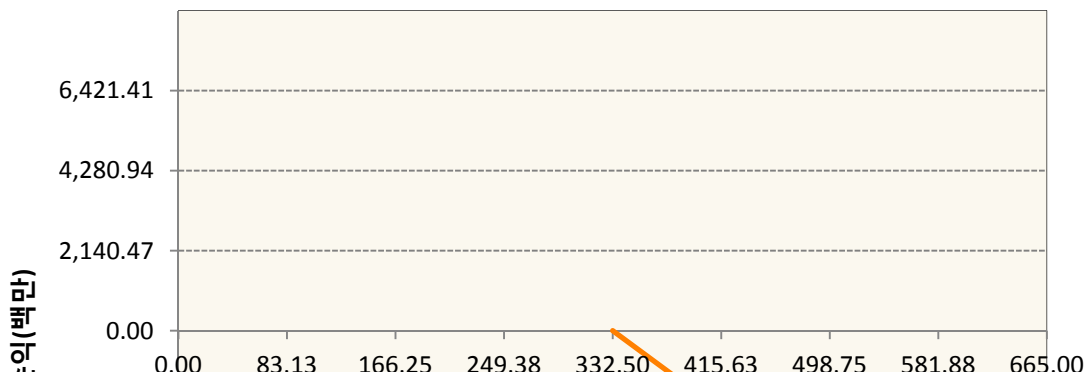
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 316 | 0 | 316 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 333 | -333 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,426 | 0 | 5,426 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 1,111 | 8,562 | -7,451 | 장내 |

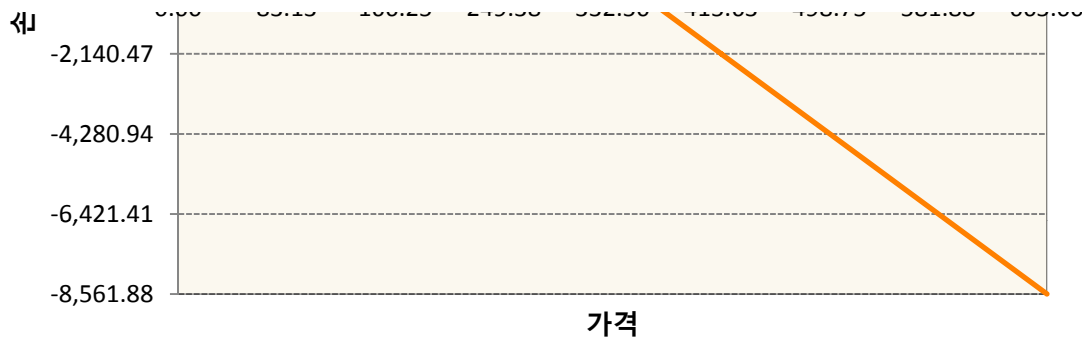
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N60009-2018-06 코스피200지수선물

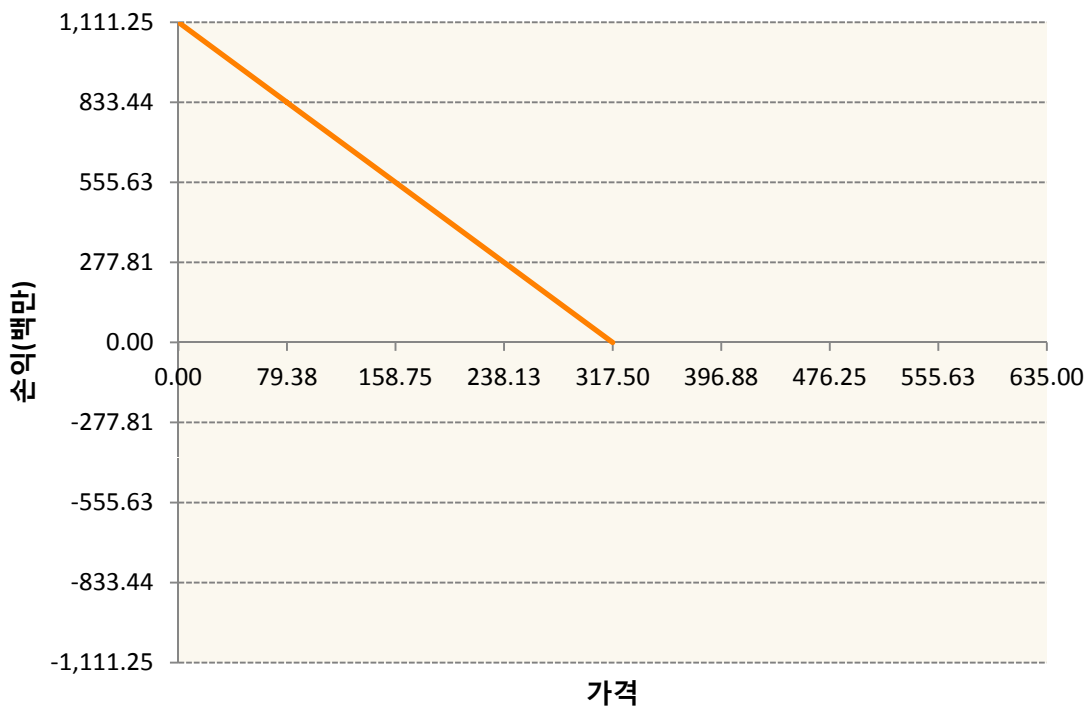


KR4201N63324-2018-06 콜332.5





KR4301N63173-2018-06 풋317.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | |
|-------------------------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| KR4101N60C 2018-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 434 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -434 | -434 | -434 | -434 | -434 | -434 | -434 |
| -5.33% | -289 | -289 | -289 | -289 | -289 | -289 | -289 |
| -2.67% | -145 | -145 | -145 | -145 | -145 | -145 | -145 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 145 | 145 | 145 | 145 | 145 | 145 | 145 |
| 5.33% | 289 | 289 | 289 | 289 | 289 | 289 | 289 |
| 8.00% | 434 | 434 | 434 | 434 | 434 | 434 | 434 |
| KR4201N63E 2018-06 콜332.5 | | | | | | | 341 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 85 | 84 | 81 | 78 | 73 | 68 | 61 |
| -5.33% | 81 | 78 | 72 | 66 | 58 | 49 | 39 |
| -2.67% | 71 | 62 | 53 | 42 | 30 | 16 | 2 |
| 0% | 45 | 31 | 16 | 0 | -17 | -34 | -51 |
| 2.67% | -7 | -26 | -45 | -65 | -85 | -105 | -126 |
| 5.33% | -92 | -114 | -135 | -157 | -179 | -201 | -222 |
| 8.00% | -214 | -235 | -256 | -277 | -299 | -320 | -341 |

KR4301N6312018-06 풋317.5

| | | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 |
| -5.33% | 48 | 49 | 49 | 49 | 49 | 49 | 50 |
| -2.67% | 20 | 21 | 21 | 22 | 22 | 23 | 24 |
| 0% | -4 | -2 | -1 | 0 | 1 | 2 | 4 |
| 2.67% | -17 | -16 | -15 | -13 | -12 | -11 | -10 |
| 5.33% | -21 | -20 | -20 | -19 | -19 | -18 | -17 |
| 8.00% | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -20 | -20 |

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

(단위:백만원)

629

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

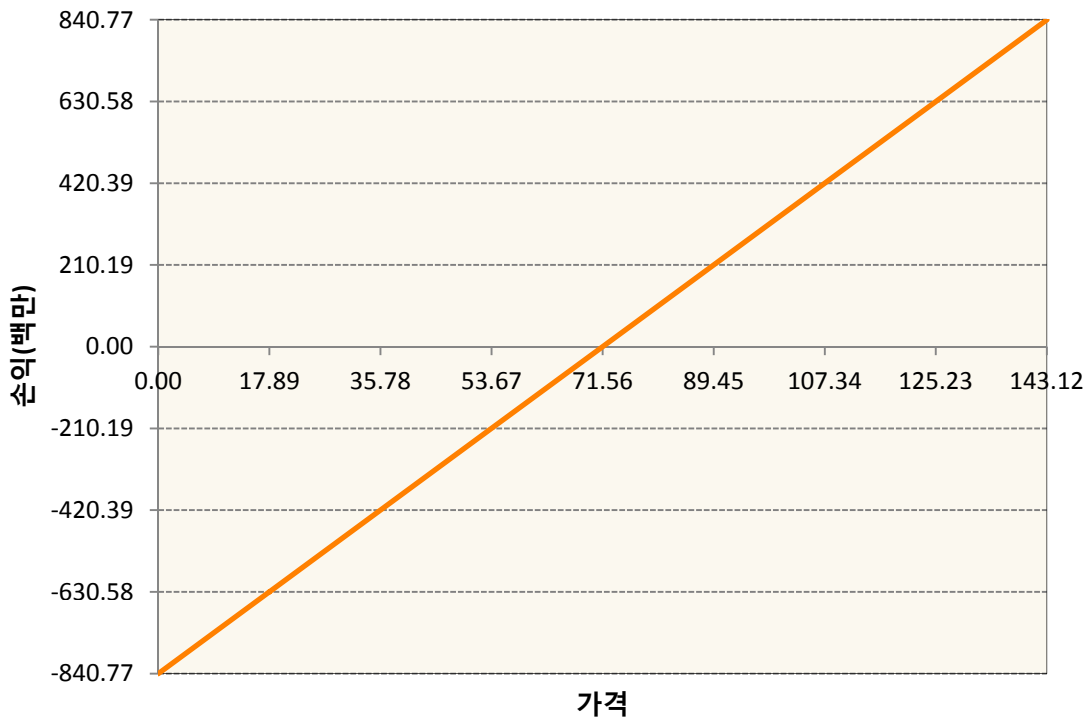
1. 계약금액

(단위:백만원)

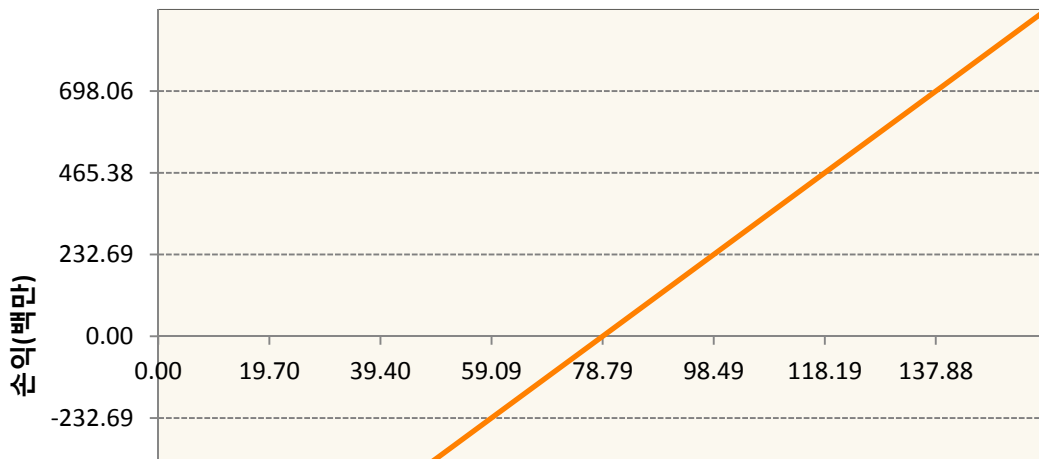
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,943 | 594 | 3,349 | |

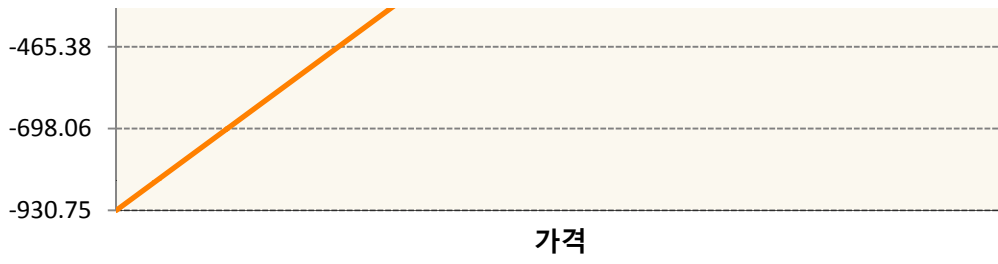
2. 만기시점의 손익구조

CLN8-WTI CRUDE FUTURE JUL18

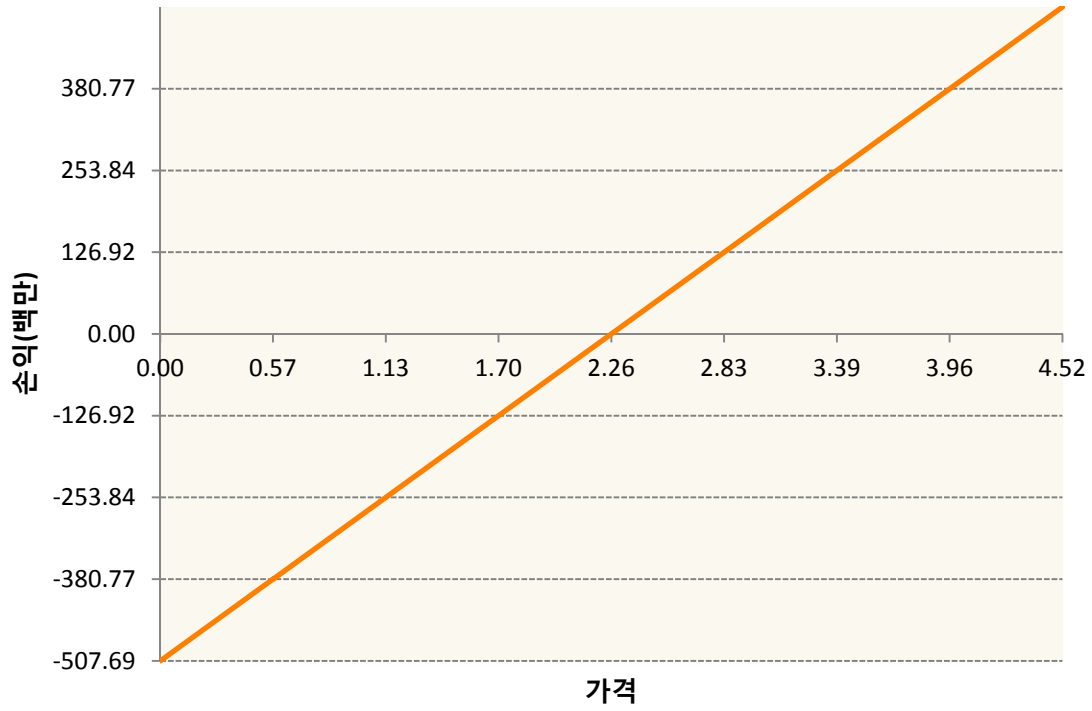


COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18

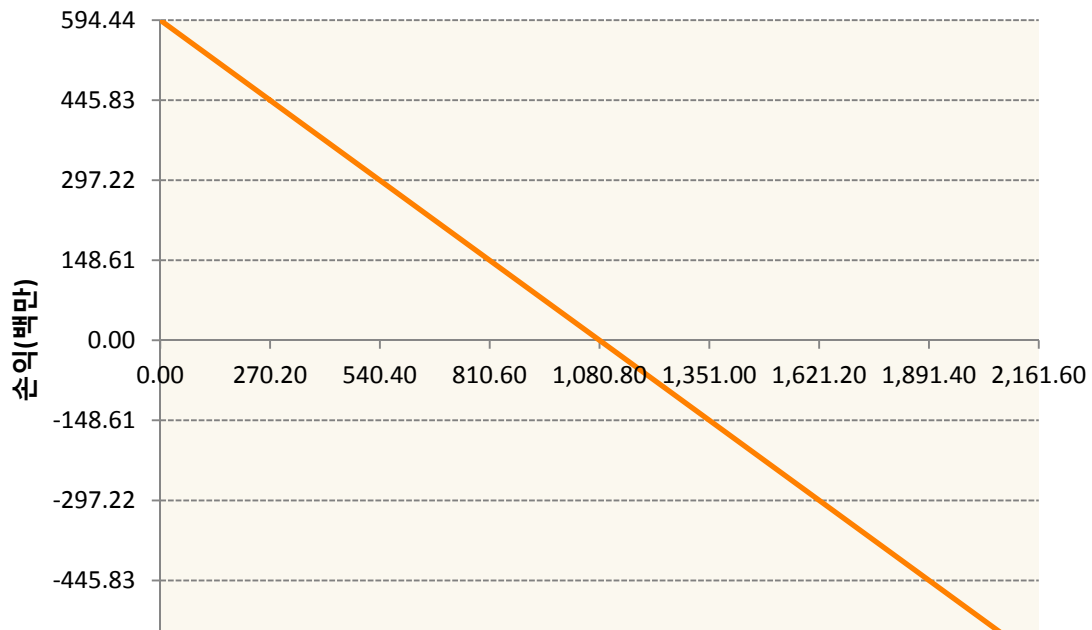


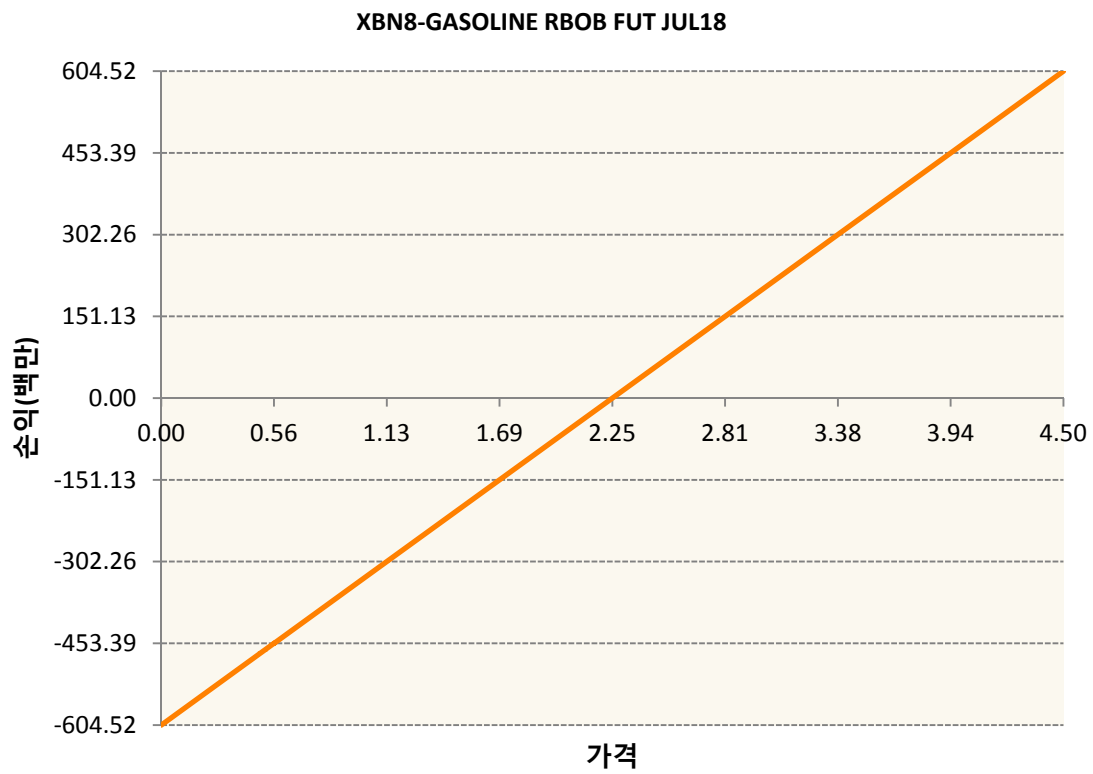
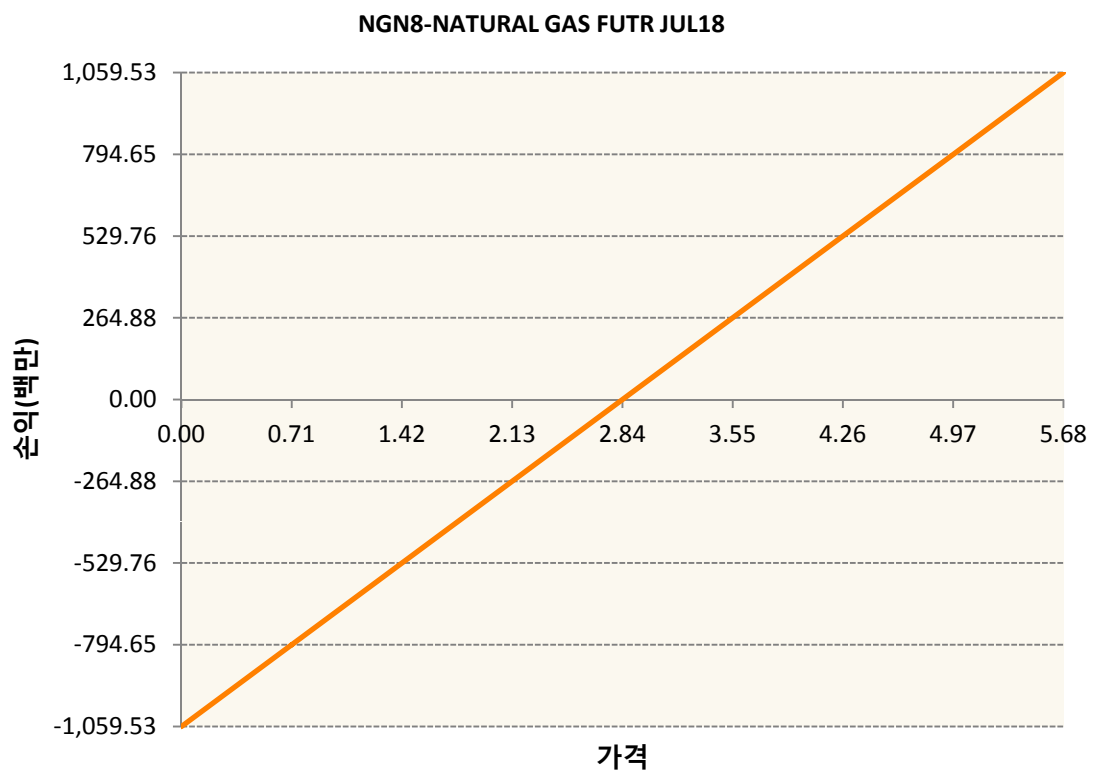
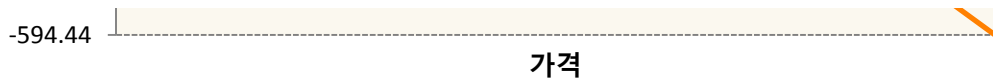


HON8-NY Harb ULSD Fut JUL18



KR4175N50004-2018-05 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLN8 | WTI CRUDE FUTURE JUL18 | 67 |
| COU8 | BRENT CRUDE FUTR SEP18 | 74 |
| HON8 | NY Harb ULSD Fut JUL18 | 41 |
| KR4175N50C | 2018-05 달러선물 | 48 |
| NGN8 | NATURAL GAS FUTR JUL18 | 85 |
| XBN8 | GASOLINE RBOB FUT JUL18 | 48 |

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

477

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-05-18 |
| 기준일 | 2018-05-17 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

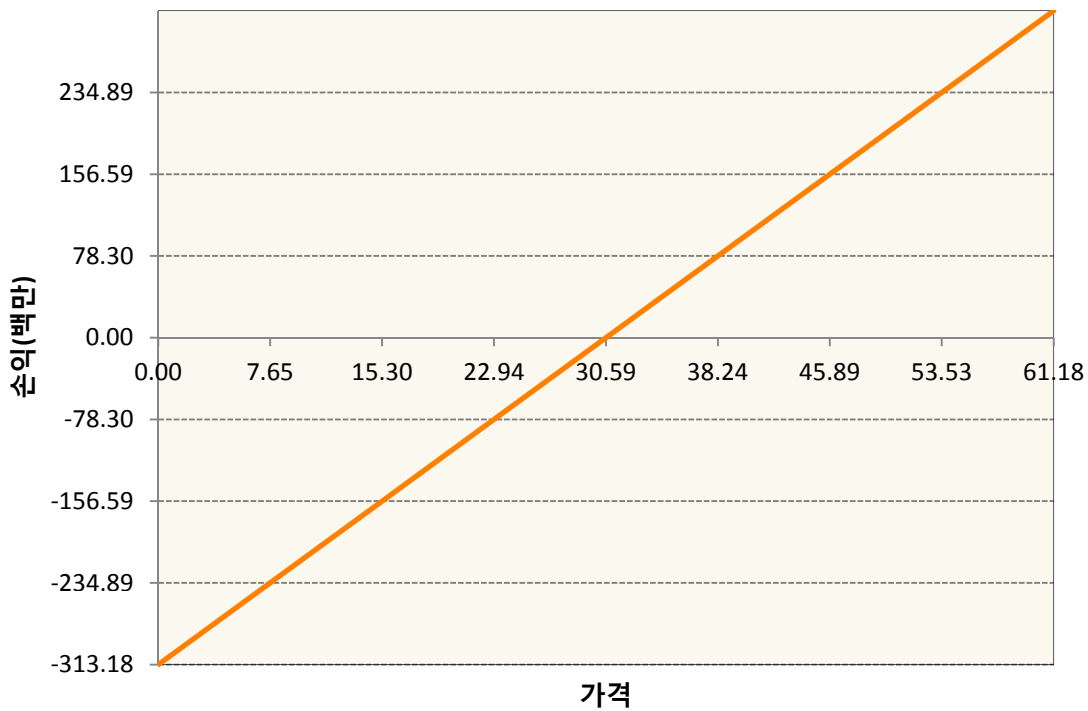
1. 계약금액

(단위:백만원)

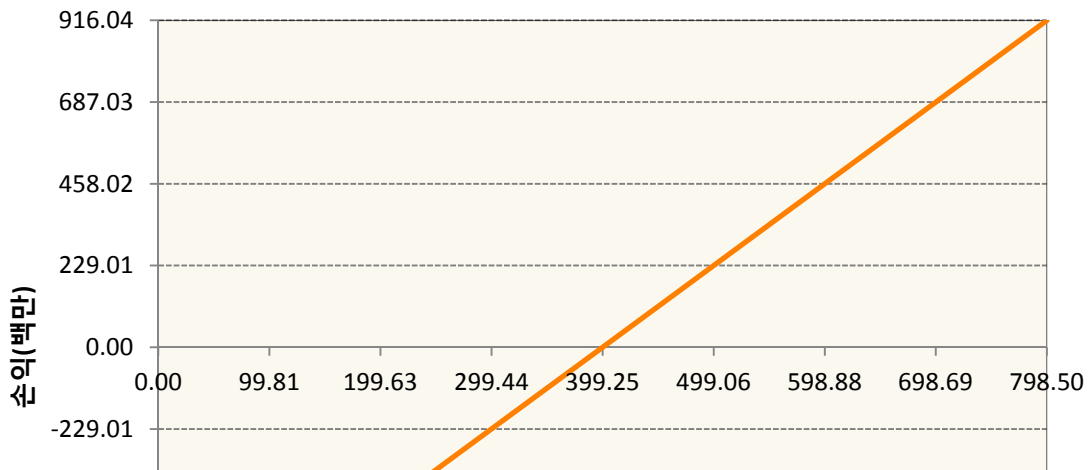
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,023 | 324 | 3,699 | |

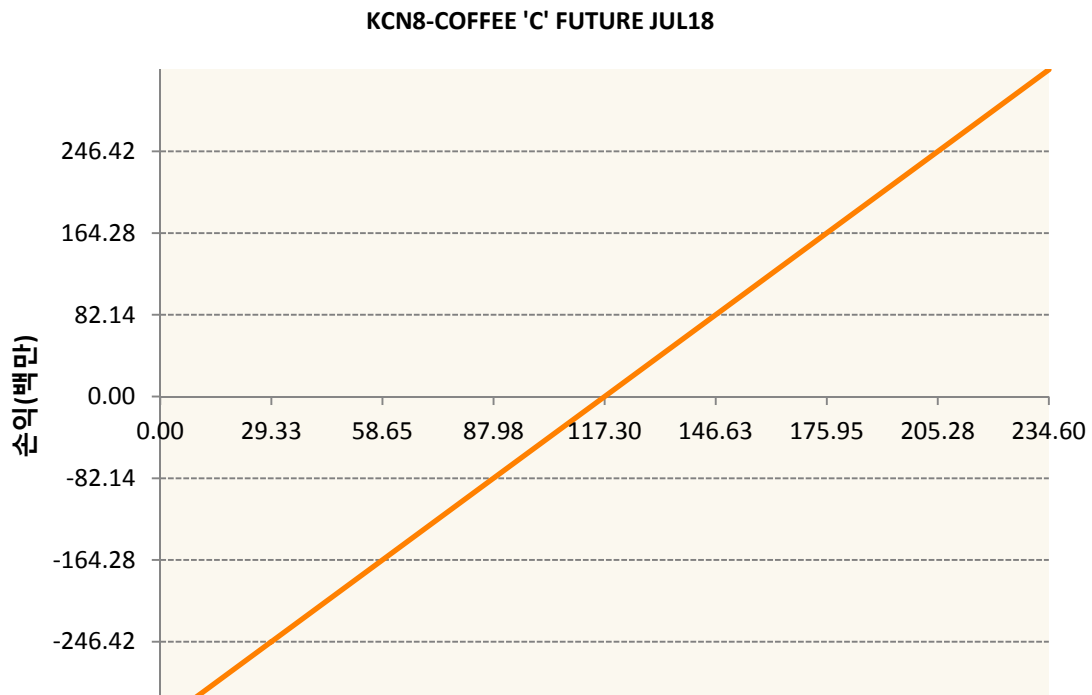
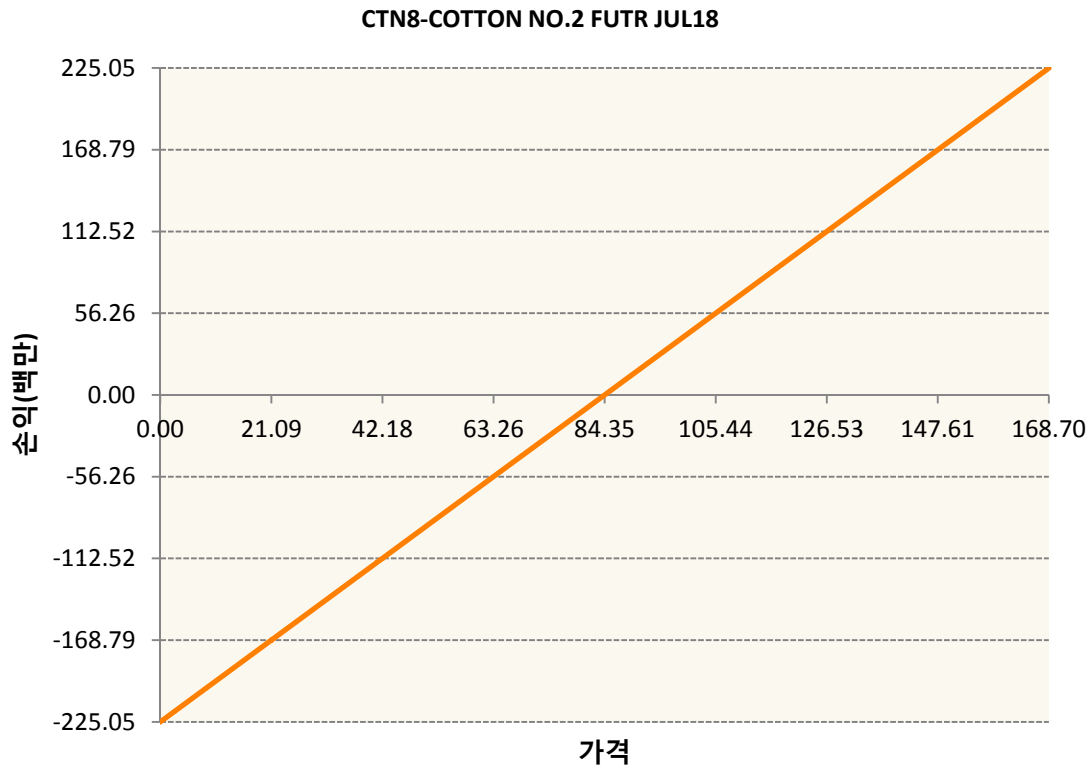
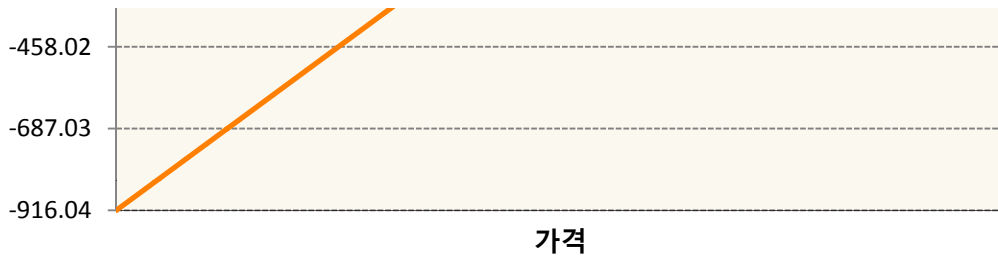
2. 만기시점의 손익구조

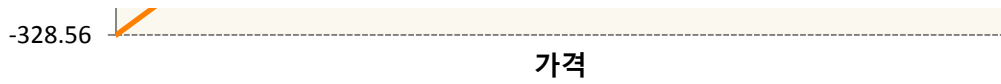
BON8-SOYBEAN OIL FUTR JUL18



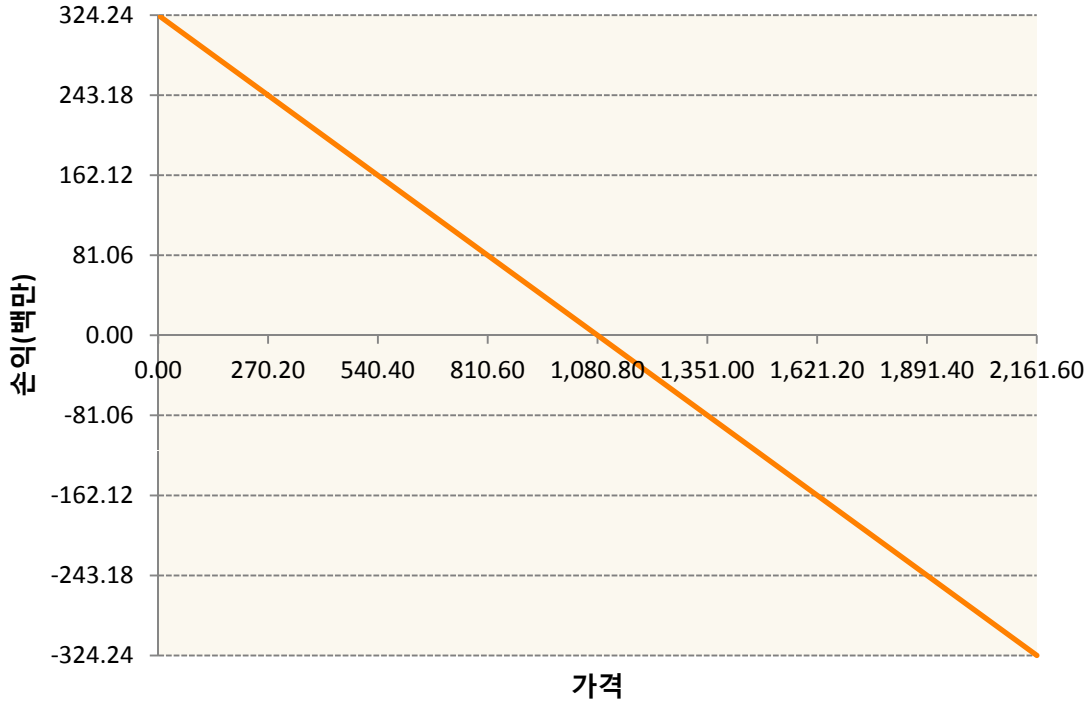
CN8-CORN FUTURE JUL18



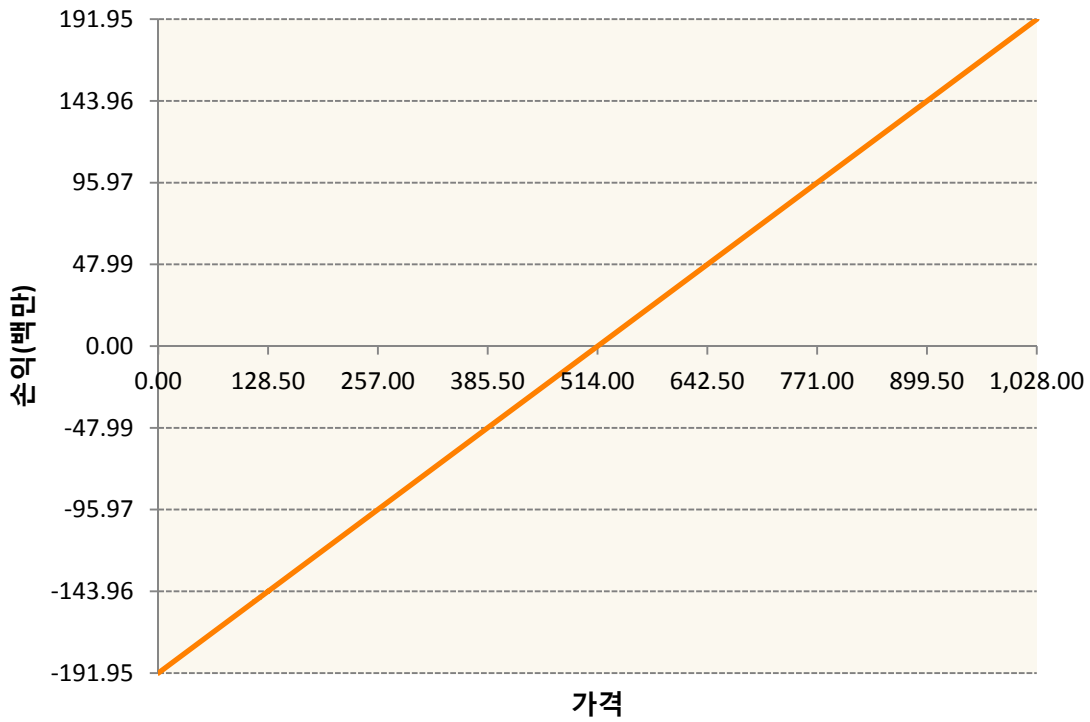




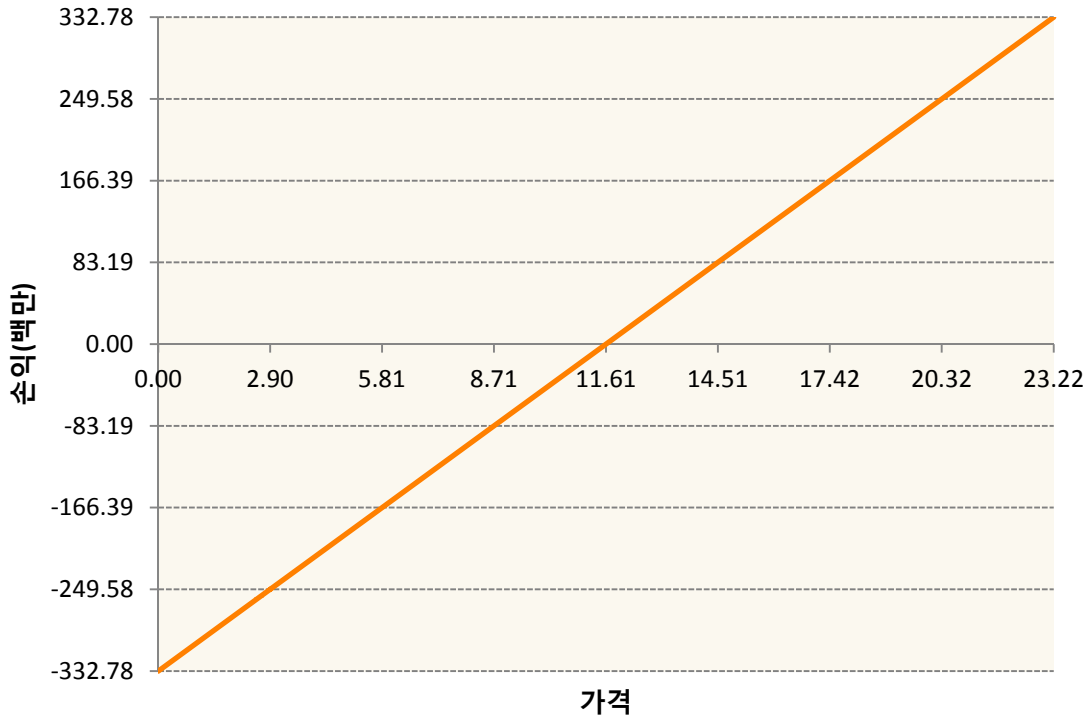
KR4175N50004-2018-05 달러선물



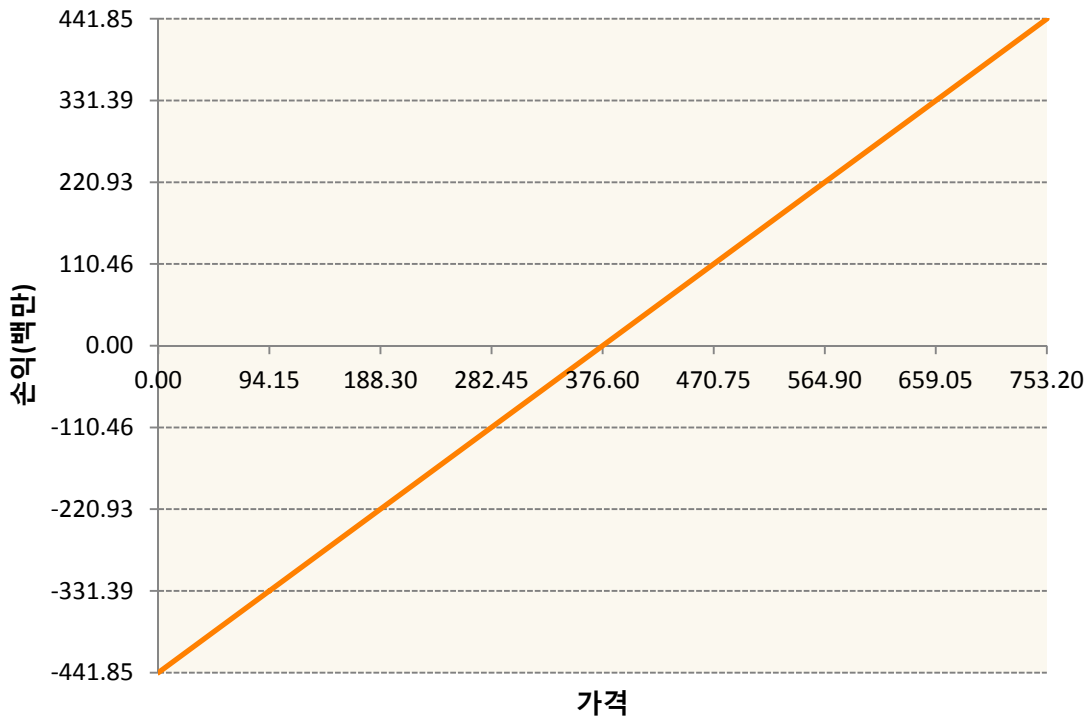
KWN8-KC HRW WHEAT FUT JUL18



SBN8-SUGAR #11 (WORLD) JUL18

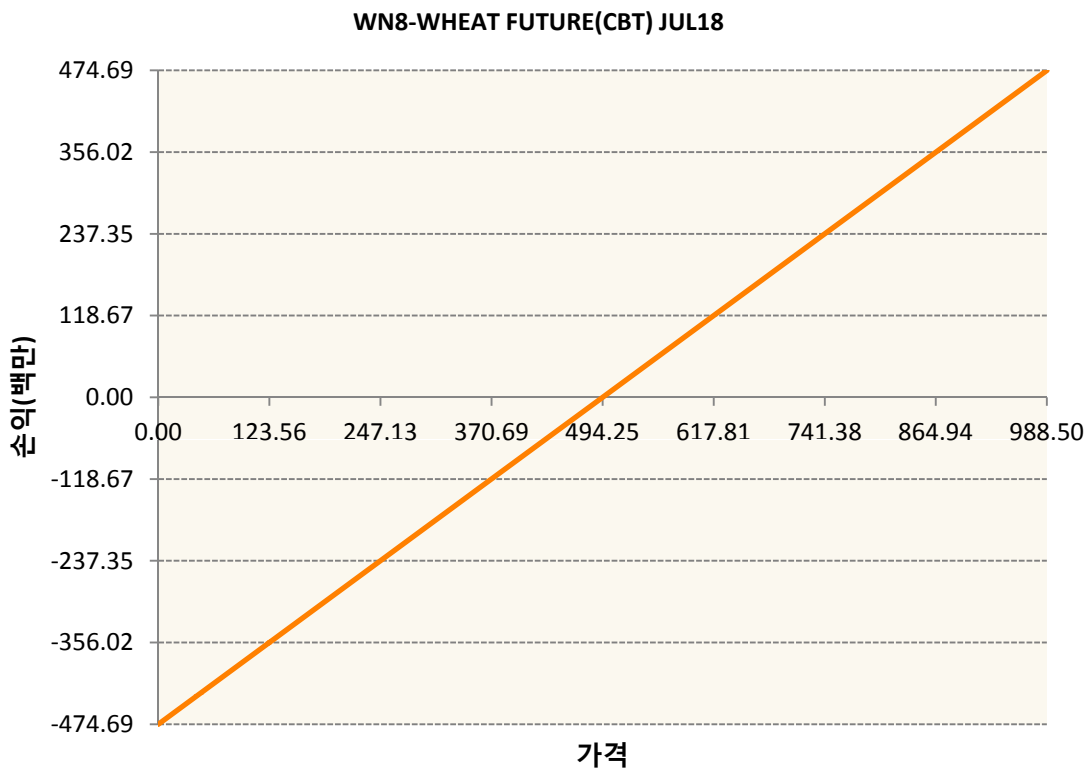
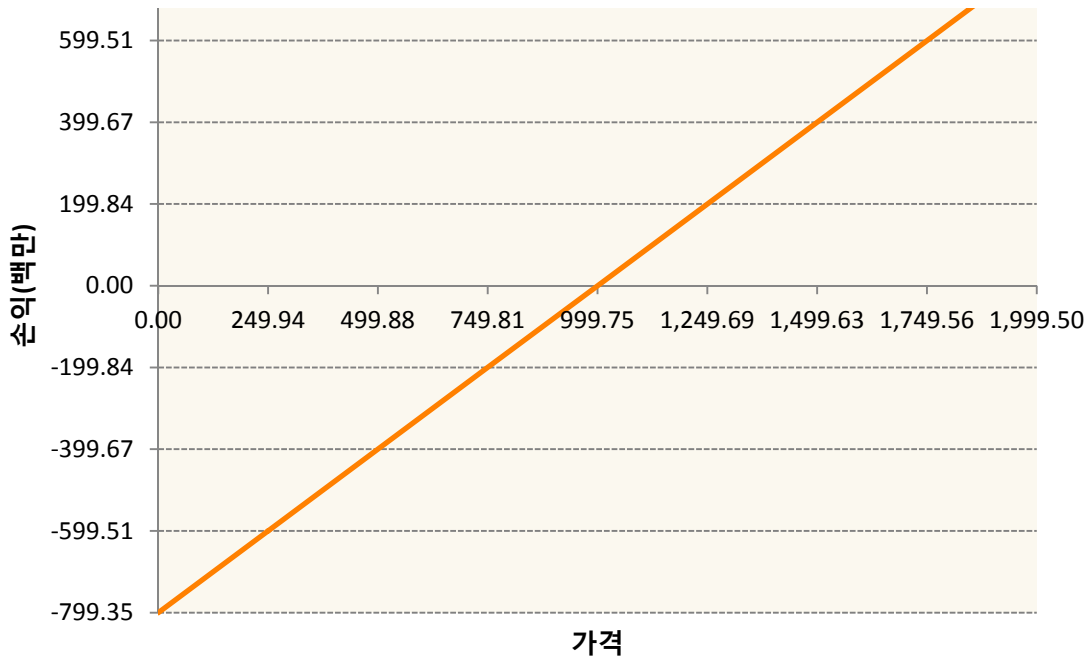


SMN8-SOYBEAN MEAL FUTR JUL18



SN8-SOYBEAN FUTURE JUL18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BON8 | SOYBEAN OIL FUTR JUL18 | 25 |
| CN8 | CORN FUTURE JUL18 | 73 |
| CTN8 | COTTON NO.2 FUTR JUL18 | 18 |
| KCN8 | COFFEE 'C' FUTURE JUL18 | 26 |
| KR4175N50C | 2018-05 달러선물 | 26 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWN8 | KC HRW WHEAT FUT JUL18 | 15 |
| SBN8 | SUGAR #11 (WORLD) JUL18 | 27 |
| SMN8 | SOYBEAN MEAL FUTR JUL18 | 35 |
| SN8 | SOYBEAN FUTURE JUL18 | 64 |
| WN8 | WHEAT FUTURE(CBT) JUL18 | 38 |

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

(단위:백만원)

324