

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

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 | 6 | 0 | 6 | 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)

68

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

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 | 14,040 | 0 | 14,040 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180523

1,138

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

480

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

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 | 4,755 | 0 | 4,755 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180608

304

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

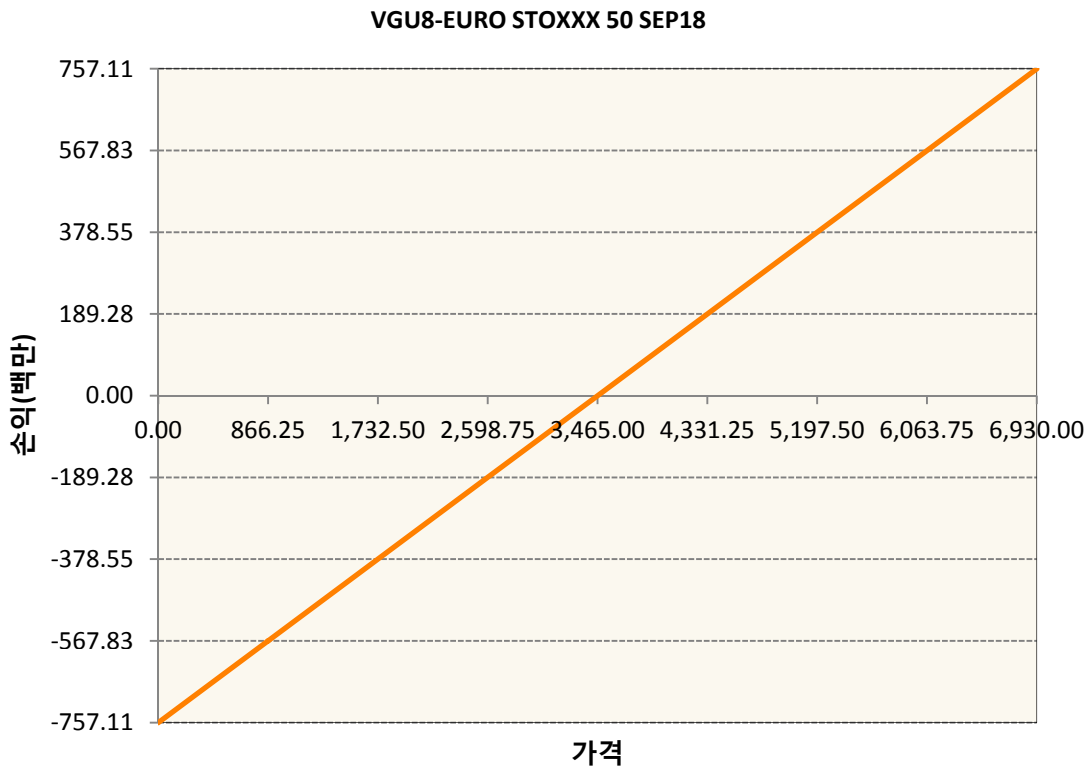
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 757 | 0 | 757 | |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|----------------------|----|
| VGU8 | EURO STOXXX 50 SEP18 | 61 |
|------|----------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 38 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

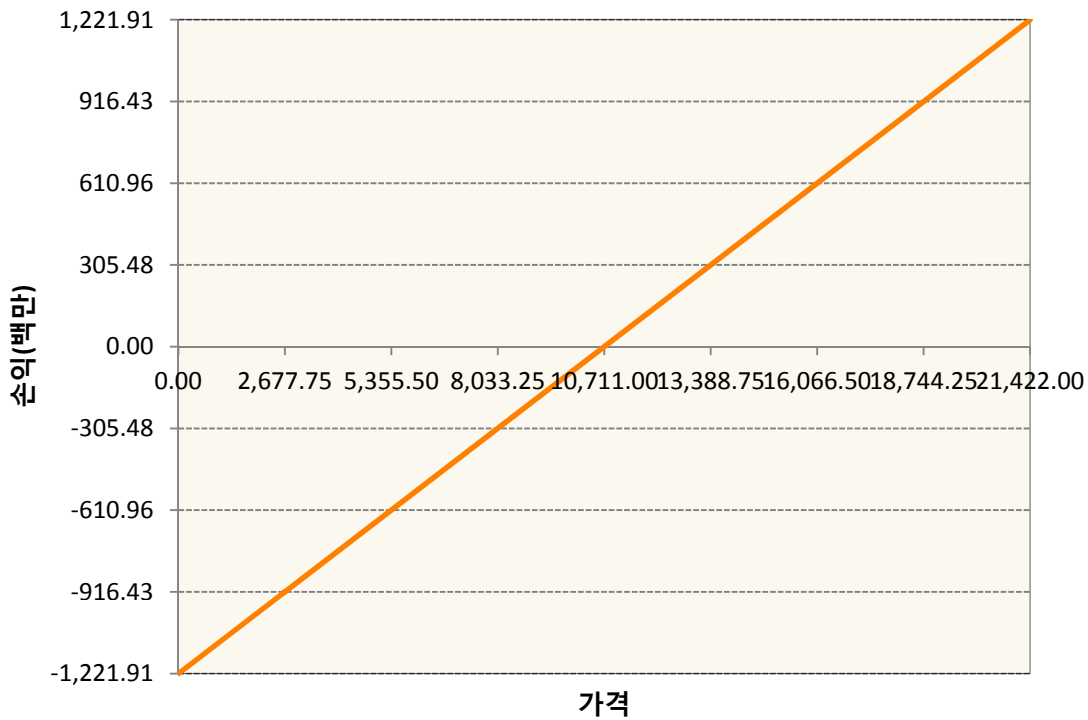
1. 계약금액

(단위:백만원)

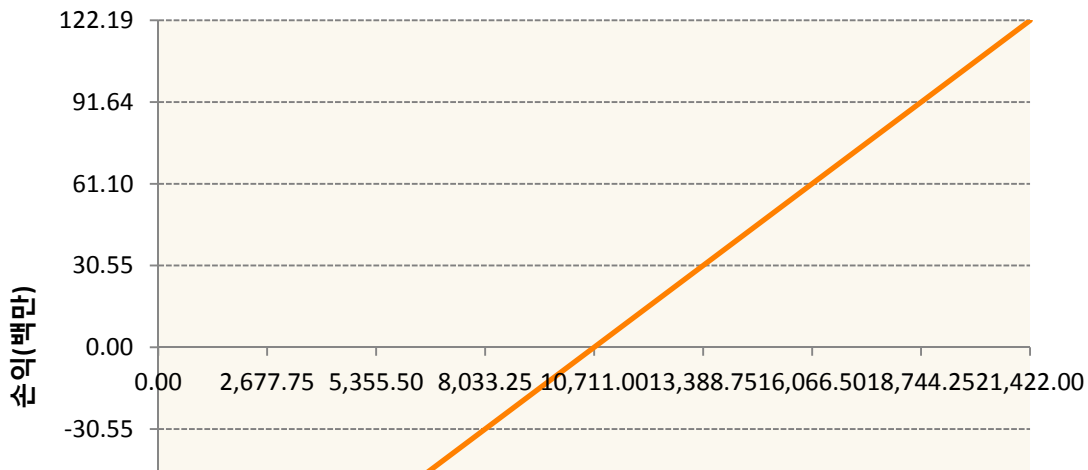
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,344 | 0 | 1,344 | 장내 |

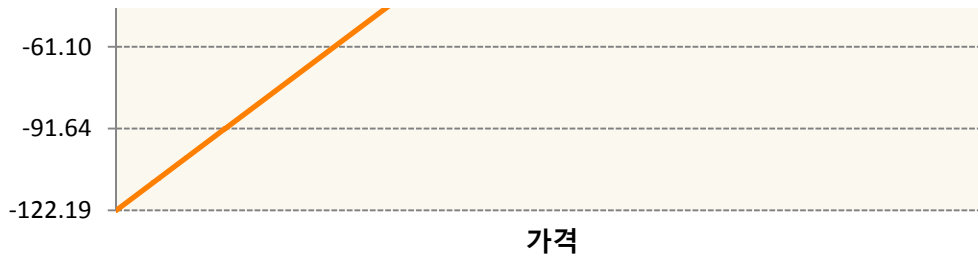
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18



MHCQ8-MINI H-SHR IDX FU Aug18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|-------------------------|----|
| HCQ8 | HSCEI Futures Aug18 | 98 |
| MHCQ8 | MINI H-SHR IDX FU Aug18 | 10 |

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

| |
|-----------|
| 98 |
|-----------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

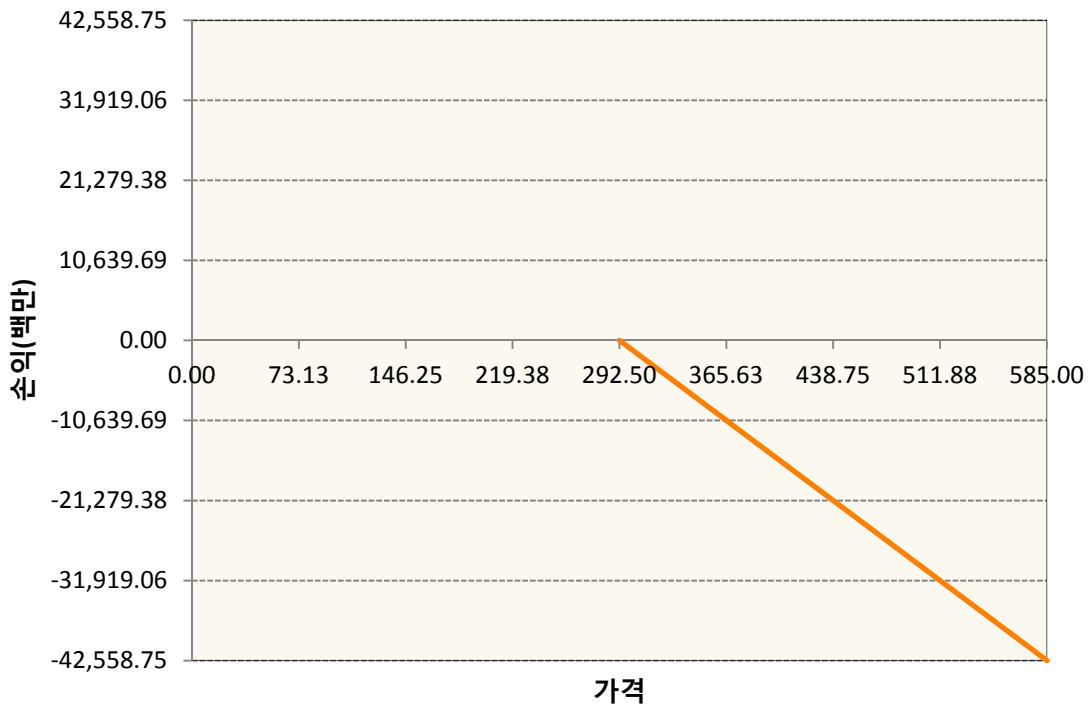
1. 계약금액

(단위:백만원)

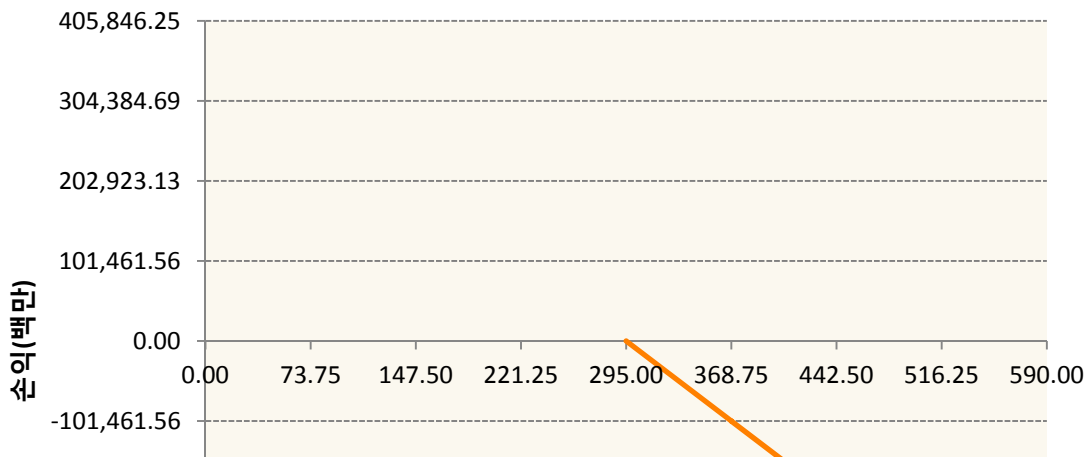
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 727,405 | -727,405 | 장내 |

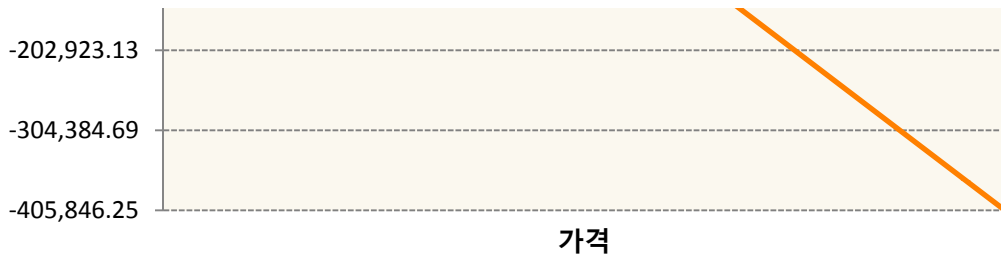
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82928-2018-08 콜292.5

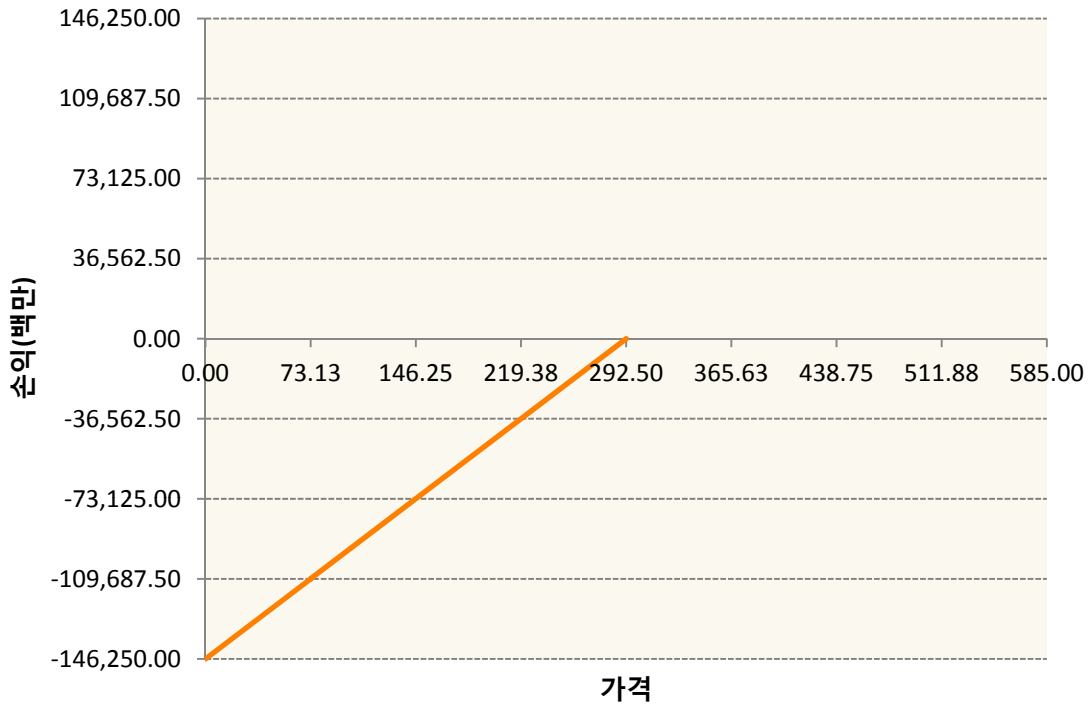


KR4201N82951-2018-08 콜295

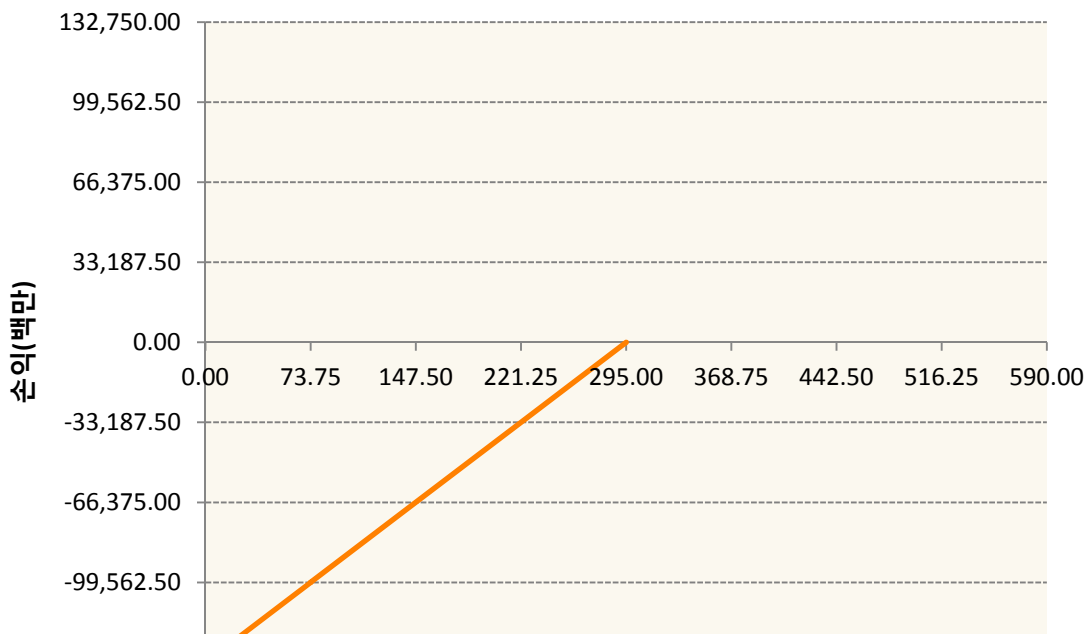




KR4301N82926-2018-08 풋292.5



KR4301N82959-2018-08 풋295



-132,750.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201N829 2018-08 콜292.5 | | | | | | | 3,055 |
|---------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 851 | 849 | 846 | 842 | 835 | 826 | 815 |
| -5.33% | 831 | 817 | 800 | 779 | 756 | 730 | 702 |
| -2.67% | 672 | 631 | 588 | 544 | 500 | 454 | 409 |
| 0% | 141 | 95 | 48 | 0 | -48 | -96 | -145 |
| 2.67% | -787 | -808 | -833 | -861 | -891 | -924 | -959 |
| 5.33% | -1,895 | -1,899 | -1,906 | -1,915 | -1,927 | -1,942 | -1,959 |
| 8.00% | -3,039 | -3,039 | -3,040 | -3,042 | -3,045 | -3,049 | -3,055 |
| KR4201N829 2018-08 콜295 | | | | | | | 27,496 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 6,113 | 6,106 | 6,092 | 6,067 | 6,029 | 5,974 | 5,901 |
| -5.33% | 6,028 | 5,951 | 5,845 | 5,710 | 5,547 | 5,357 | 5,144 |
| -2.67% | 5,146 | 4,833 | 4,497 | 4,142 | 3,771 | 3,388 | 2,994 |
| 0% | 1,421 | 947 | 474 | 0 | -474 | -948 | -1,422 |
| 2.67% | -6,329 | -6,615 | -6,930 | -7,267 | -7,623 | -7,995 | -8,380 |
| 5.33% | -16,471 | -16,545 | -16,649 | -16,784 | -16,948 | -17,140 | -17,357 |
| 8.00% | -27,234 | -27,243 | -27,262 | -27,293 | -27,342 | -27,409 | -27,496 |
| KR4301N829 2018-08 풋292.5 | | | | | | | 9,933 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -9,933 | -9,933 | -9,933 | -9,933 | -9,933 | -9,933 | -9,933 |
| -5.33% | -5,993 | -5,993 | -5,994 | -5,994 | -5,996 | -5,999 | -6,004 |
| -2.67% | -2,113 | -2,143 | -2,179 | -2,220 | -2,264 | -2,312 | -2,363 |
| 0% | 168 | 115 | 59 | 0 | -61 | -125 | -190 |
| 2.67% | 339 | 338 | 336 | 332 | 326 | 318 | 307 |
| 5.33% | 339 | 339 | 339 | 339 | 339 | 339 | 338 |
| 8.00% | 339 | 339 | 339 | 339 | 339 | 339 | 339 |
| KR4301N829 2018-08 풋295 | | | | | | | 9,673 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -9,673 | -9,673 | -9,673 | -9,673 | -9,673 | -9,673 | -9,673 |
| -5.33% | -6,127 | -6,127 | -6,127 | -6,127 | -6,128 | -6,128 | -6,130 |
| -2.67% | -2,590 | -2,598 | -2,611 | -2,627 | -2,648 | -2,672 | -2,700 |
| 0% | 204 | 136 | 68 | 0 | -68 | -136 | -205 |
| 2.67% | 693 | 688 | 680 | 668 | 653 | 634 | 612 |

| | | | | | | | |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 5.33% | 696 | 696 | 696 | 696 | 696 | 695 | 694 |
| 8.00% | 696 | 696 | 696 | 696 | 696 | 696 | 696 |

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

(단위:백만원)

60,140

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

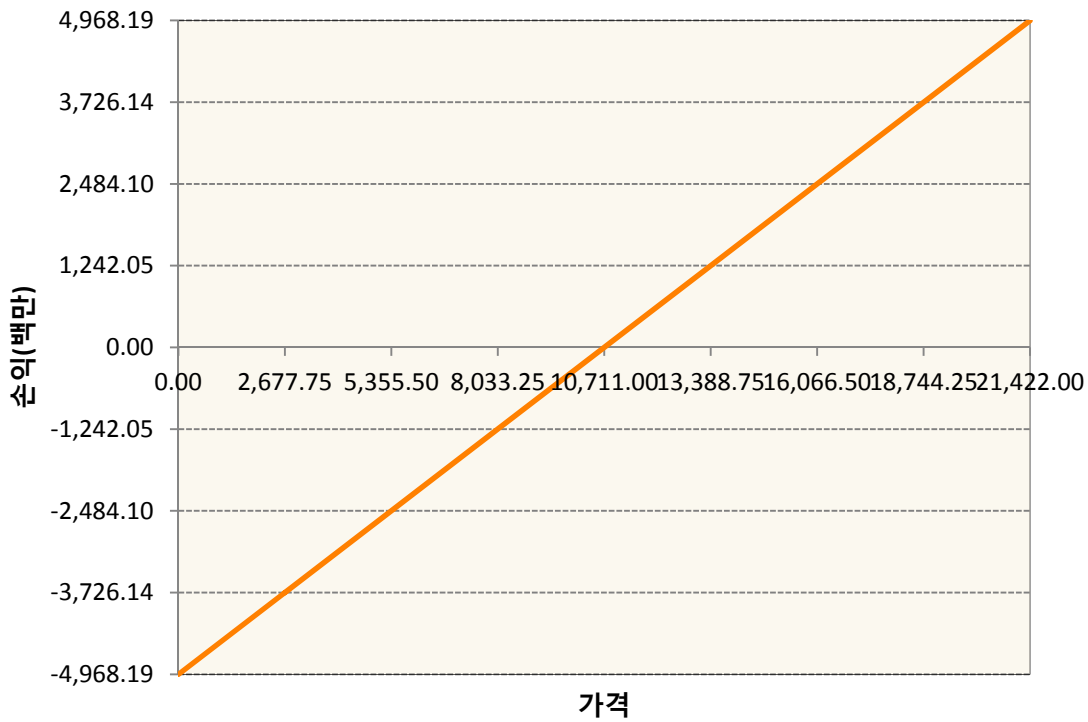
1. 계약금액

(단위:백만원)

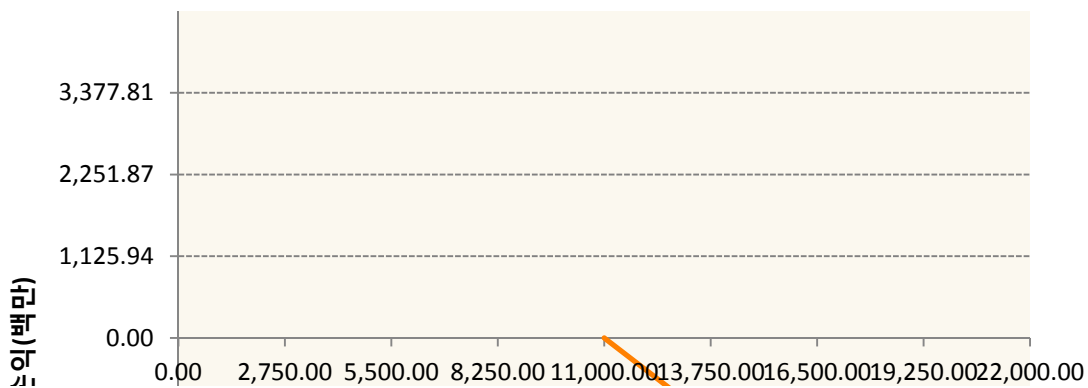
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,968 | 0 | 4,968 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 11,582 | -11,582 | 장내 |

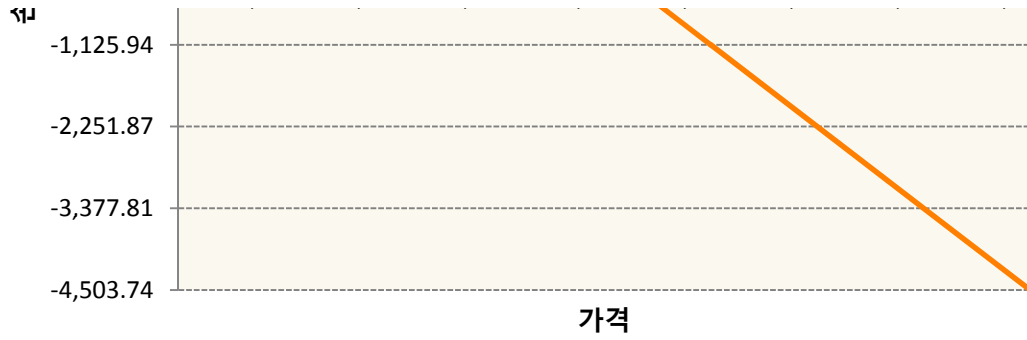
2. 만기시점의 손익구조

HCQ8-HSCEI Futures Aug18

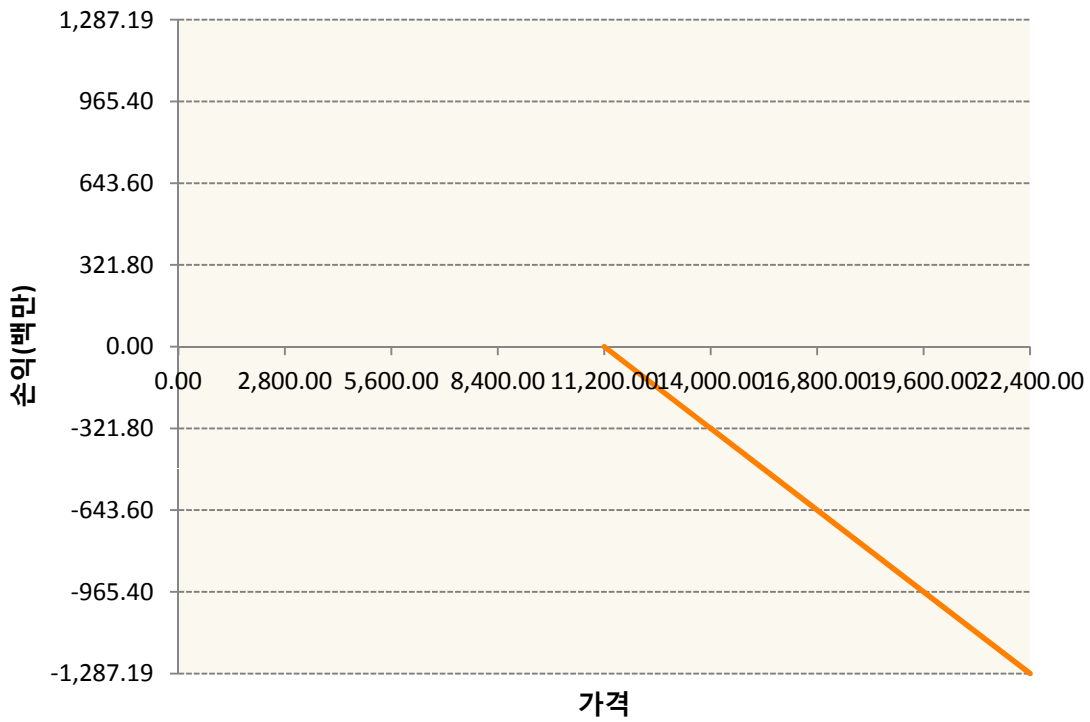


OHHIQ8-C110-HSCEI

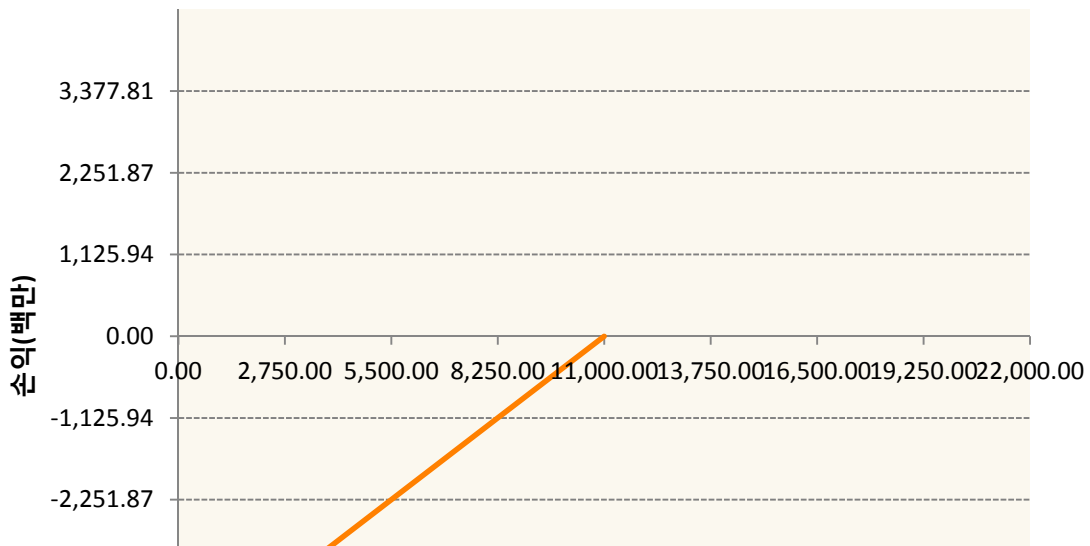


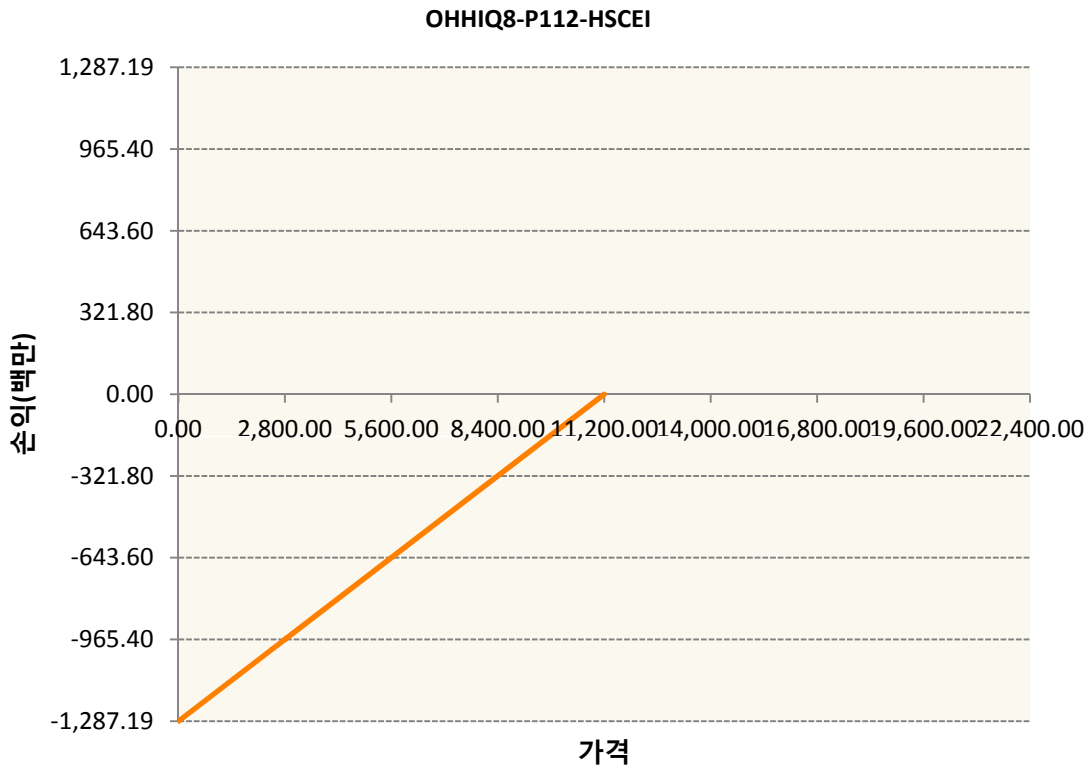
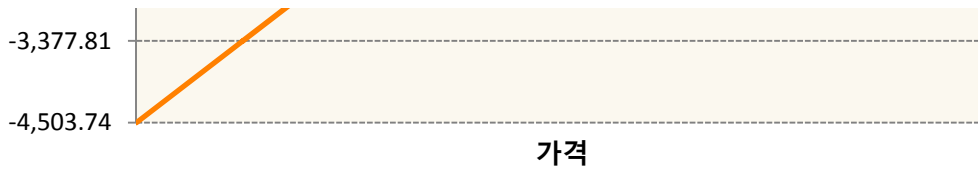


OHHIQ8-C112-HSCEI



OHHIQ8-P110-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|---------------------|----------|
| HCQ8 | HSCEI Futures Aug18 | 397 |
| OHHIQ8-C1 | HSCEI | 360 |
| OHHIQ8-C1 | HSCEI | 103 |
| OHHIQ8-P11 | HSCEI | 360 |
| OHHIQ8-P11 | HSCEI | 103 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|--------------|
| | 1,206 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

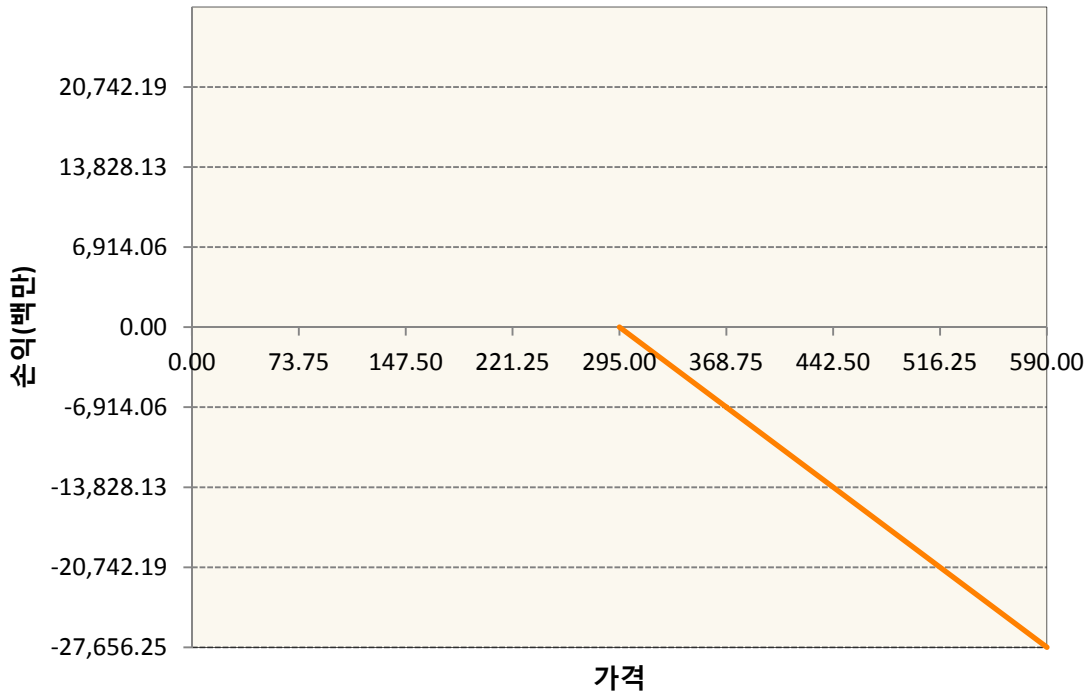
1. 계약금액

(단위:백만원)

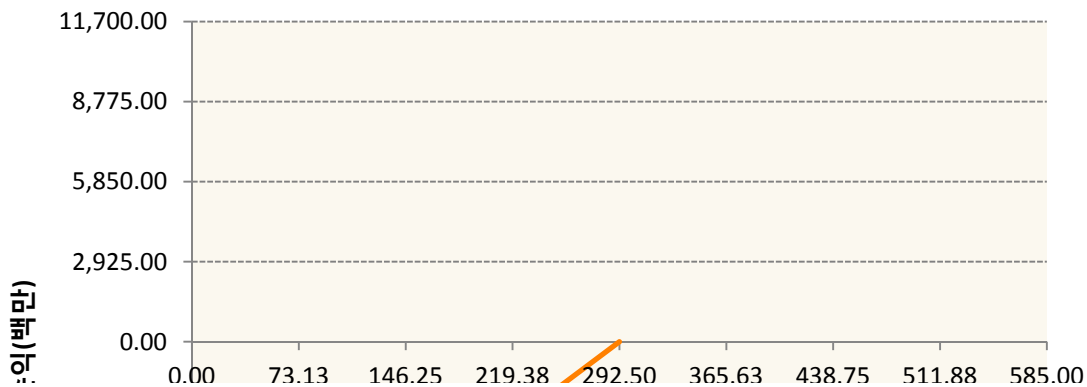
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 48,200 | 0 | 48,200 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 48,575 | -48,575 | 장내 |

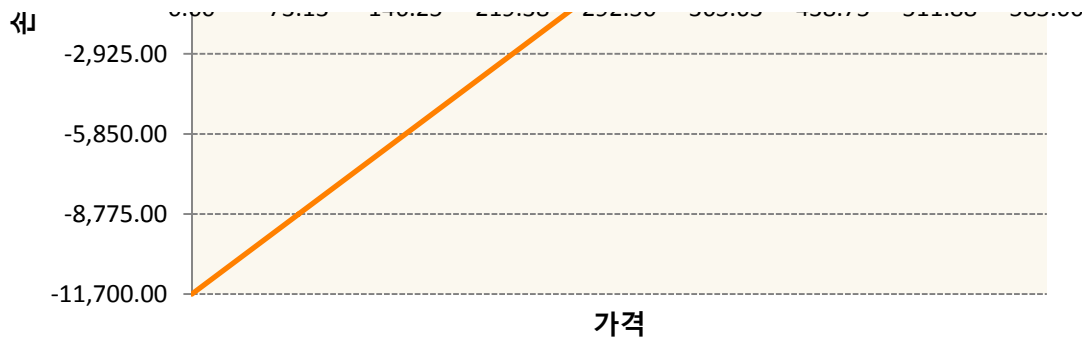
2. 만기시점의 손익구조

KR4201N82951-2018-08 콜295

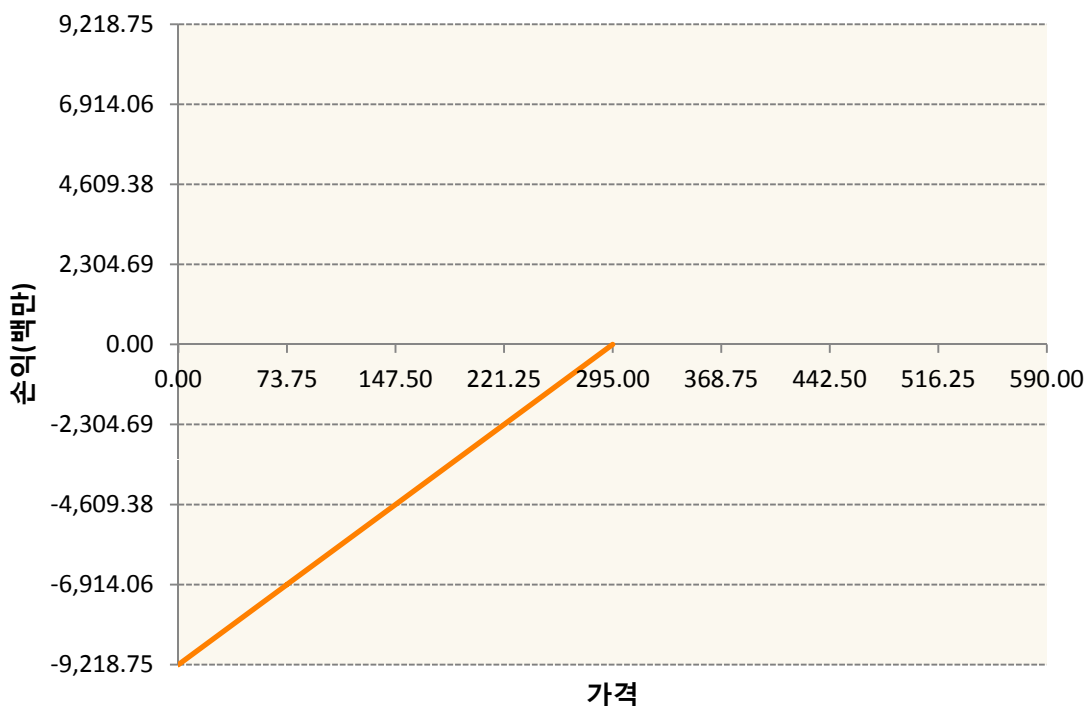


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | |
|----------------------------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_2 | | | | | | | 1,506 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,506 | -1,506 | -1,506 | -1,506 | -1,506 | -1,506 | -1,506 |
| -5.33% | -1,004 | -1,004 | -1,004 | -1,004 | -1,004 | -1,004 | -1,004 |
| -2.67% | -502 | -502 | -502 | -502 | -502 | -502 | -502 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 502 | 502 | 502 | 502 | 502 | 502 | 502 |
| 5.33% | 1,004 | 1,004 | 1,004 | 1,004 | 1,004 | 1,004 | 1,004 |
| 8.00% | 1,506 | 1,506 | 1,506 | 1,506 | 1,506 | 1,506 | 1,506 |
| 2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_3 | | | | | | | 285 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |

| | | | | | | | |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 163 | 163 | 163 | 163 | 163 | 163 | 163 |
| 5.33% | 326 | 326 | 326 | 326 | 326 | 326 | 326 |
| 8.00% | 488 | 488 | 488 | 488 | 488 | 488 | 488 |

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_13

244

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -244 | -244 | -244 | -244 | -244 | -244 | -244 |
| -5.33% | -163 | -163 | -163 | -163 | -163 | -163 | -163 |
| -2.67% | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 81 | 81 | 81 | 81 | 81 | 81 | 81 |
| 5.33% | 163 | 163 | 163 | 163 | 163 | 163 | 163 |
| 8.00% | 244 | 244 | 244 | 244 | 244 | 244 | 244 |

KR4201N829 2018-08 콜295

1,874

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 417 | 416 | 415 | 413 | 411 | 407 | 402 |
| -5.33% | 411 | 406 | 398 | 389 | 378 | 365 | 351 |
| -2.67% | 351 | 329 | 306 | 282 | 257 | 231 | 204 |
| 0% | 97 | 65 | 32 | 0 | -32 | -65 | -97 |
| 2.67% | -431 | -451 | -472 | -495 | -519 | -545 | -571 |
| 5.33% | -1,122 | -1,127 | -1,135 | -1,144 | -1,155 | -1,168 | -1,183 |
| 8.00% | -1,856 | -1,856 | -1,858 | -1,860 | -1,863 | -1,868 | -1,874 |

KR4301N829 2018-08 풋292.5

795

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -795 | -795 | -795 | -795 | -795 | -795 | -795 |
| -5.33% | -479 | -479 | -479 | -480 | -480 | -480 | -480 |
| -2.67% | -169 | -171 | -174 | -178 | -181 | -185 | -189 |
| 0% | 13 | 9 | 5 | 0 | -5 | -10 | -15 |
| 2.67% | 27 | 27 | 27 | 27 | 26 | 25 | 25 |
| 5.33% | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 |
| 8.00% | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 |

KR4301N829 2018-08 풋295

672

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -672 | -672 | -672 | -672 | -672 | -672 | -672 |
| -5.33% | -425 | -425 | -425 | -426 | -426 | -426 | -426 |
| -2.67% | -180 | -180 | -181 | -182 | -184 | -186 | -188 |
| 0% | 14 | 9 | 5 | 0 | -5 | -9 | -14 |
| 2.67% | 48 | 48 | 47 | 46 | 45 | 44 | 43 |
| 5.33% | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 |
| 8.00% | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 | 48 |

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

(단위:백만원)

7,939

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

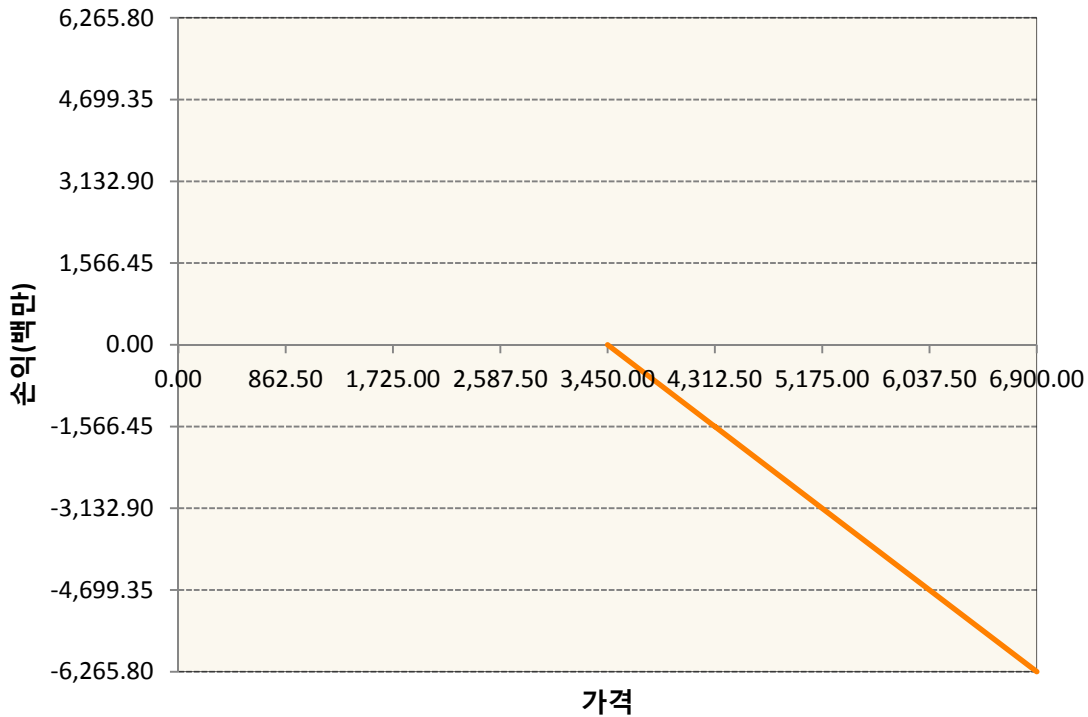
1. 계약금액

(단위:백만원)

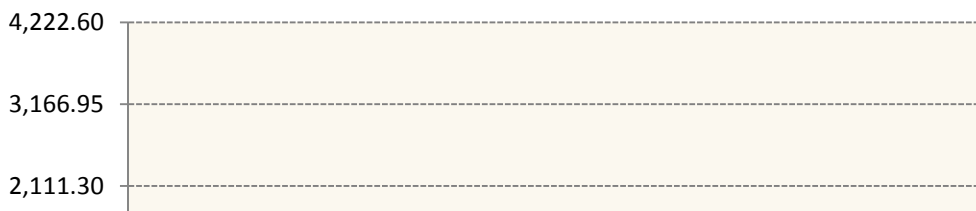
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,147 | 0 | 3,147 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 45,053 | 0 | 45,053 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 16,758 | -16,758 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 53,043 | 0 | 53,043 | 장외 |

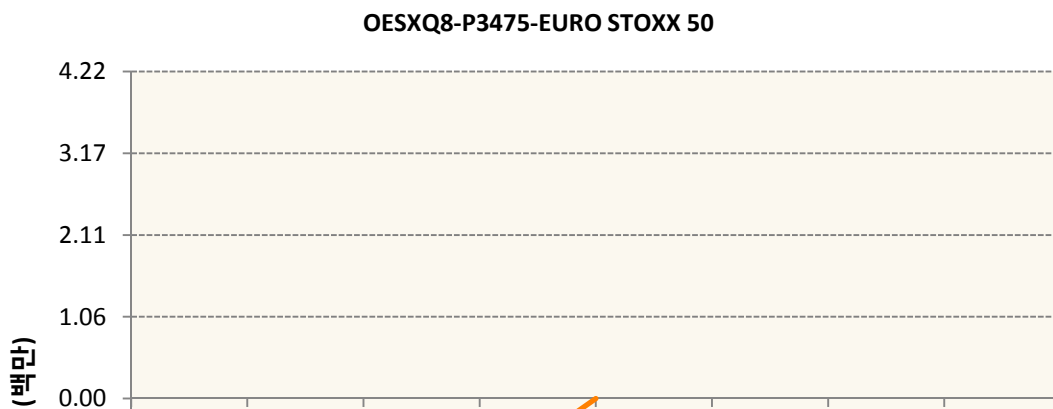
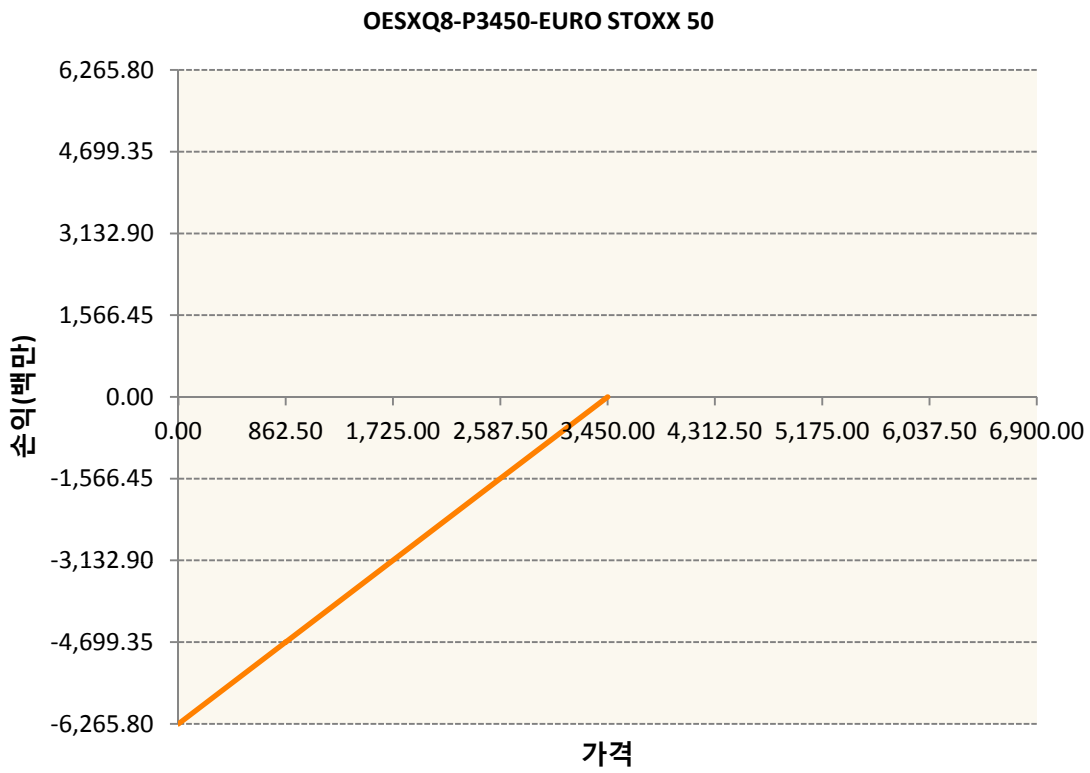
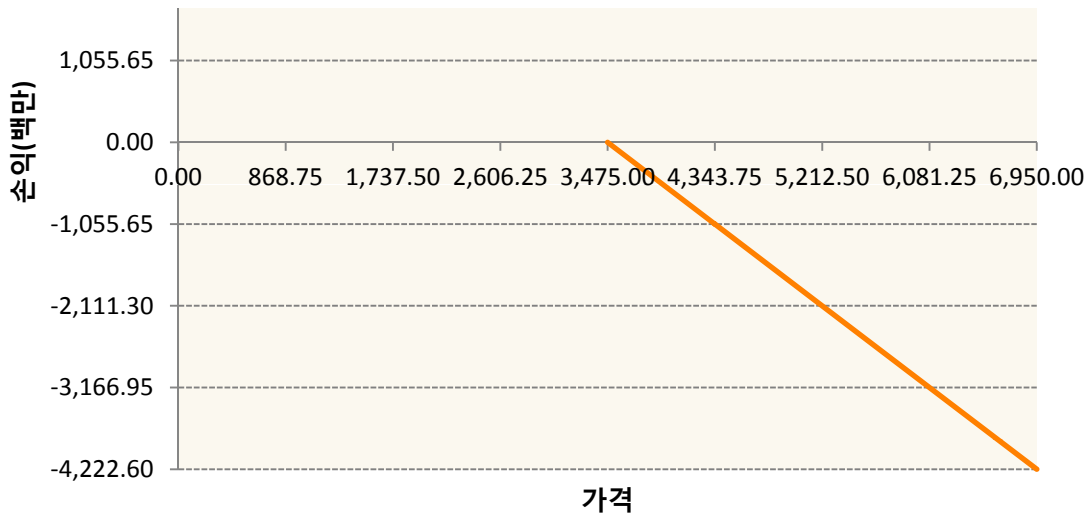
2. 만기시점의 손익구조

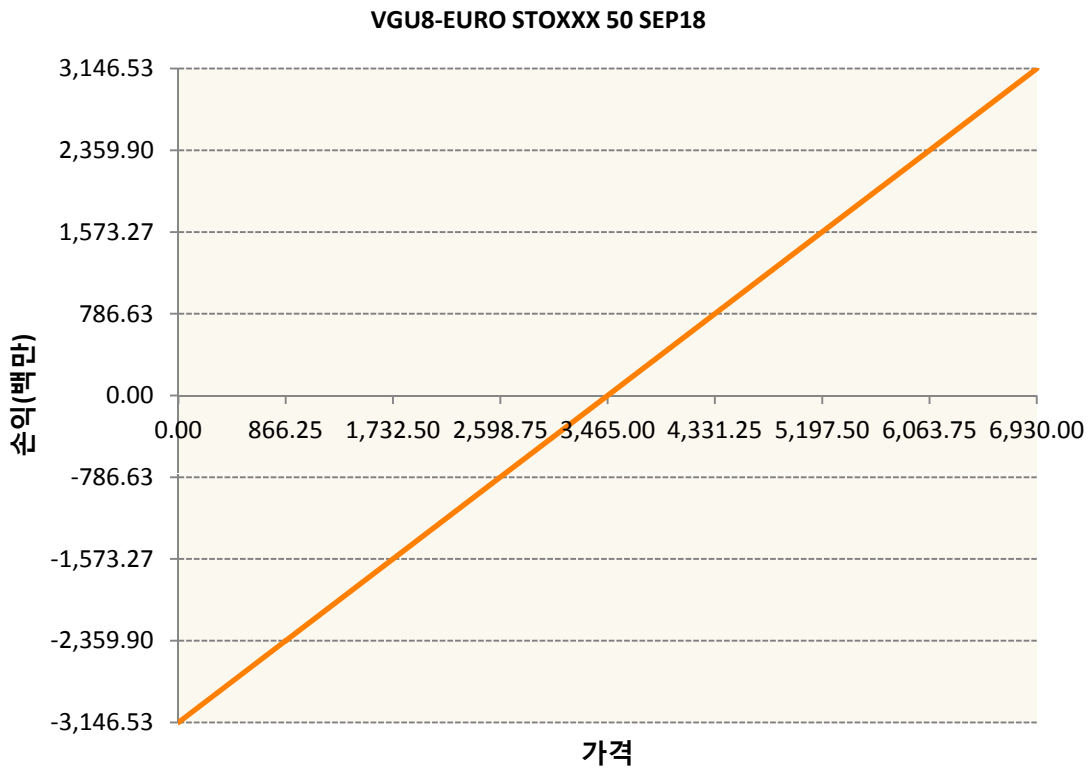
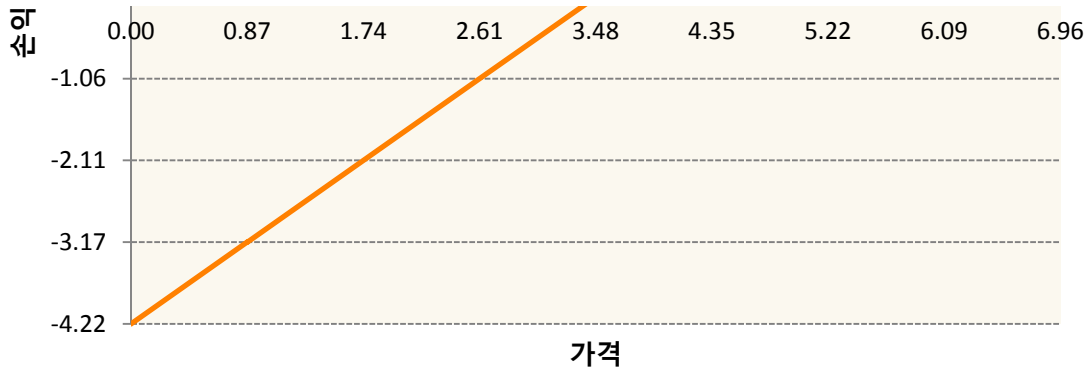
OESXQ8-C3450-EURO STOXX 50 OPT



OESXQ8-C3475-EURO STOXX 50 OPT







| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|--|--|----------|
| 260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569 | | 17 |
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 14 |
| OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT | | 501 |
| OESXQ8-C3 EURO STOXX 50 OPT | | 338 |
| OESXQ8-P3 EURO STOXX 50 | | 501 |
| OESXQ8-P3 EURO STOXX 50 | | 0.3 |
| VGU8 EURO STOXXX 50 SEP18 | | 252 |

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

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

(단위:백만원)

1,151

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

(단위:백만원)

91

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

(단위:백만원)

136

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

(단위:백만원)

166

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

(단위:백만원)

41

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간

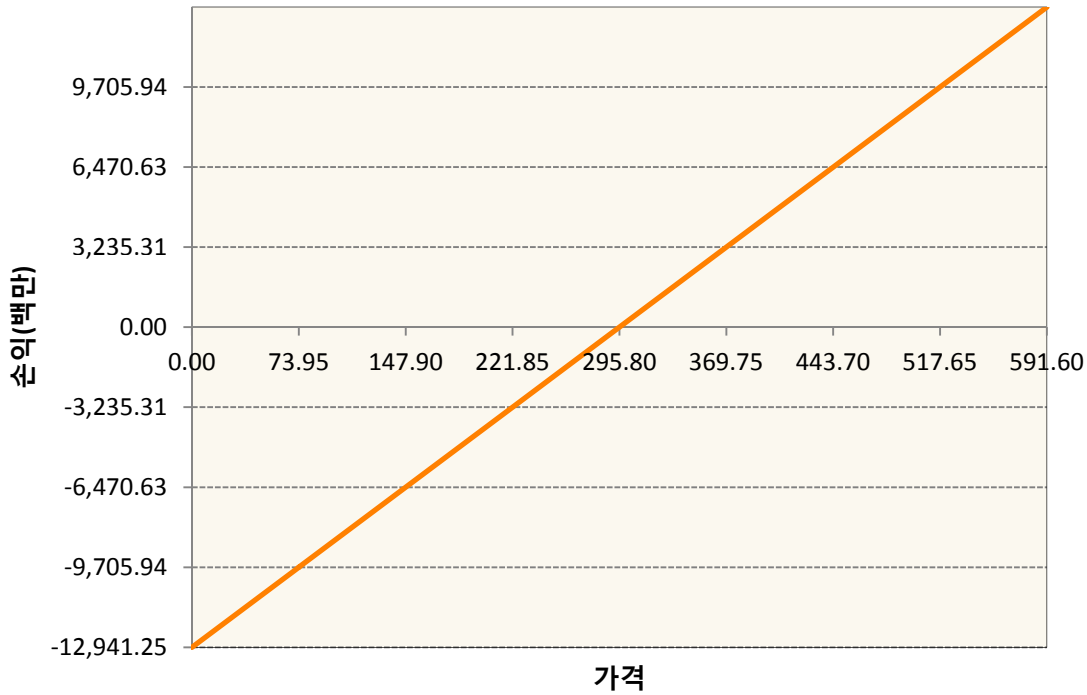
1. 계약금액

(단위:백만원)

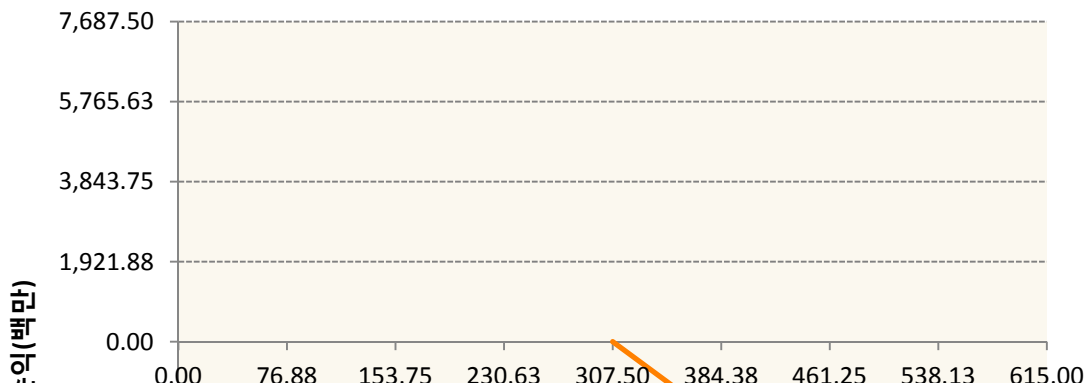
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 12,941 | 0 | 12,941 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 2,134 | 23,730 | -21,596 | 장내 |

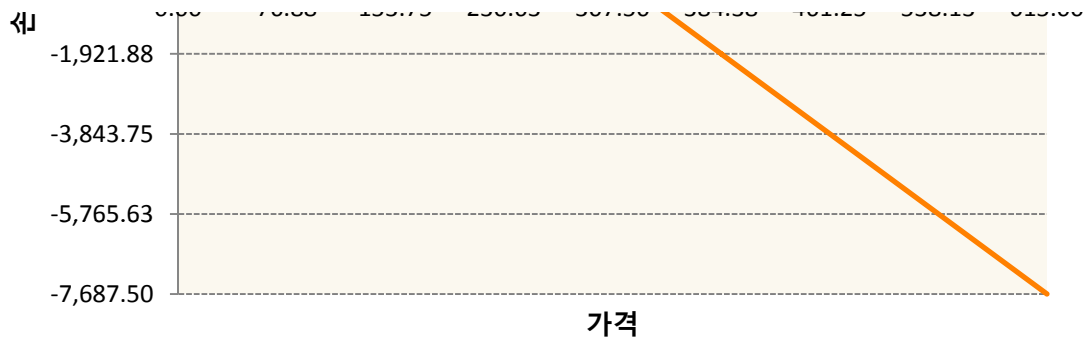
2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물

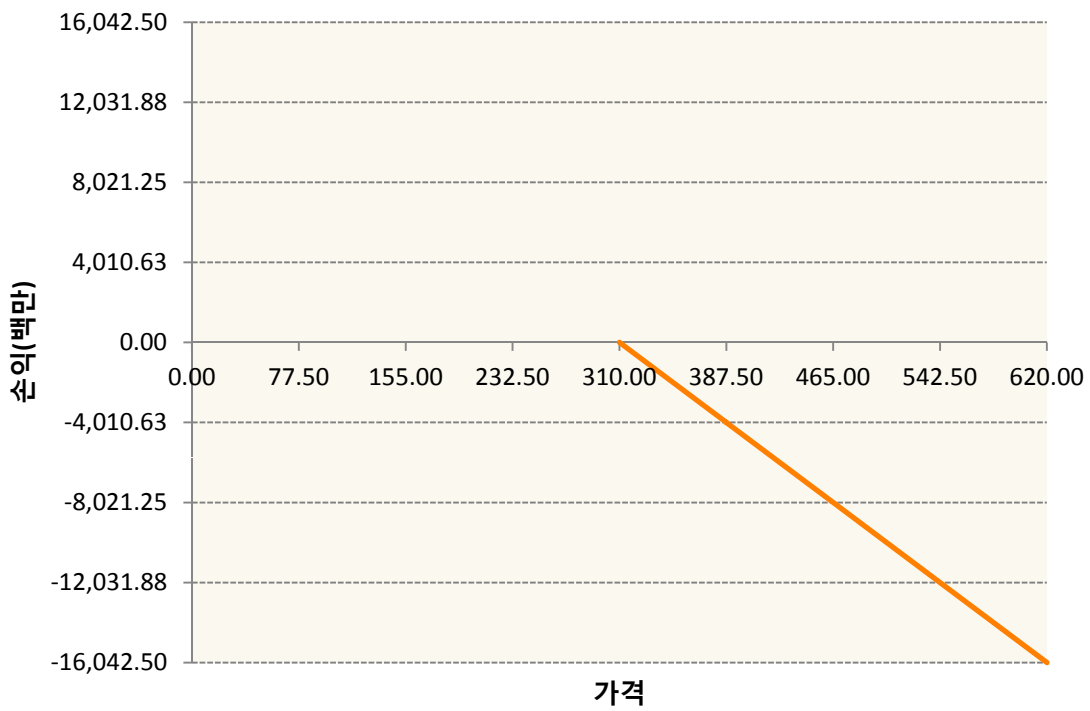


KR4201N83074-2018-08 콜307.5

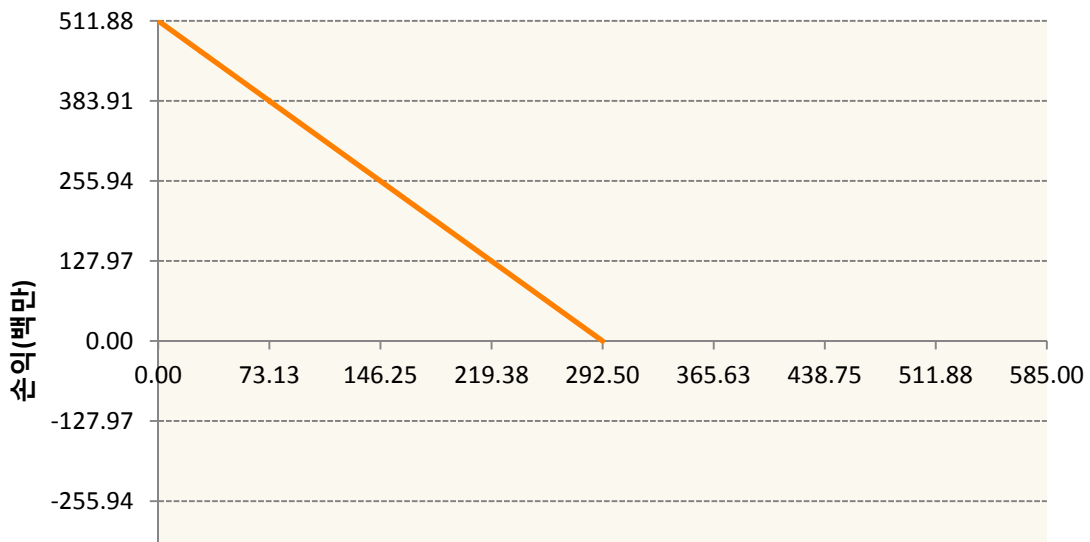


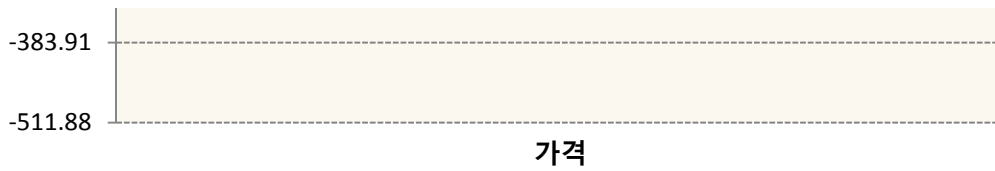


KR4201N83108-2018-08 콜310

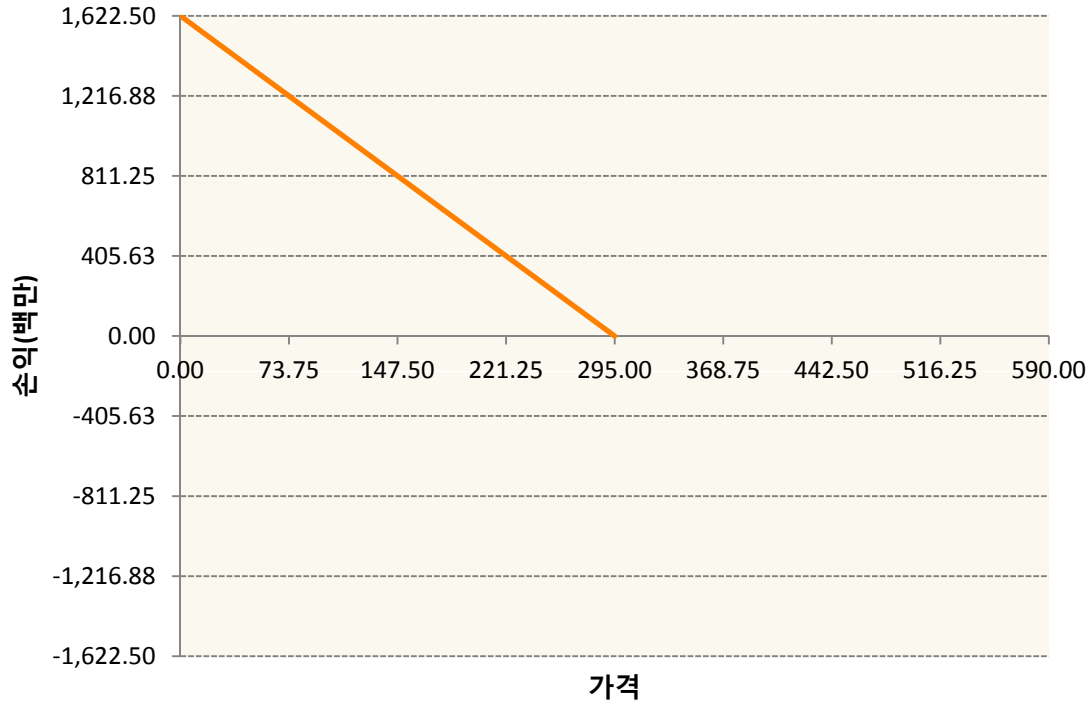


KR4301N82926-2018-08 풋292.5





KR4301N82959-2018-08 풋295



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 1,035

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,035 | -1,035 | -1,035 | -1,035 | -1,035 | -1,035 | -1,035 |
| -5.33% | -690 | -690 | -690 | -690 | -690 | -690 | -690 |
| -2.67% | -345 | -345 | -345 | -345 | -345 | -345 | -345 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 345 | 345 | 345 | 345 | 345 | 345 | 345 |
| 5.33% | 690 | 690 | 690 | 690 | 690 | 690 | 690 |
| 8.00% | 1,035 | 1,035 | 1,035 | 1,035 | 1,035 | 1,035 | 1,035 |

KR4201N83C 2018-08 콜307.5 314

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 |
| -5.33% | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 16 | 16 |
| -2.67% | 17 | 16 | 16 | 14 | 13 | 11 | 8 |

| | | | | | | | |
|-------|------|------|------|------|------|------|------|
| 0% | 12 | 8 | 4 | 0 | -5 | -10 | -16 |
| 2.67% | -23 | -30 | -39 | -47 | -55 | -64 | -72 |
| 5.33% | -121 | -129 | -138 | -146 | -155 | -163 | -172 |
| 8.00% | -283 | -287 | -291 | -296 | -302 | -308 | -314 |

KR4201N8312018-08 콜310

564

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 |
| -5.33% | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 21 | 20 |
| -2.67% | 22 | 22 | 21 | 19 | 17 | 14 | 10 |
| 0% | 17 | 12 | 7 | 0 | -8 | -17 | -27 |
| 2.67% | -27 | -41 | -56 | -71 | -87 | -103 | -119 |
| 5.33% | -184 | -203 | -221 | -240 | -259 | -277 | -296 |
| 8.00% | -485 | -495 | -507 | -520 | -534 | -549 | -564 |

KR4301N829 2018-08 풋292.5

35

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 | 35 |
| -5.33% | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 |
| -2.67% | 7 | 8 | 8 | 8 | 8 | 8 | 8 |
| 0% | -1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| 2.67% | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 |
| 5.33% | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 |
| 8.00% | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 |

KR4301N829 2018-08 풋295

118

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 118 | 118 | 118 | 118 | 118 | 118 | 118 |
| -5.33% | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 | 75 |
| -2.67% | 32 | 32 | 32 | 32 | 32 | 33 | 33 |
| 0% | -2 | -2 | -1 | 0 | 1 | 2 | 3 |
| 2.67% | -8 | -8 | -8 | -8 | -8 | -8 | -7 |
| 5.33% | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | -8 | -8 |
| 8.00% | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 | -9 |

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

(단위:백만원)

1,486

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

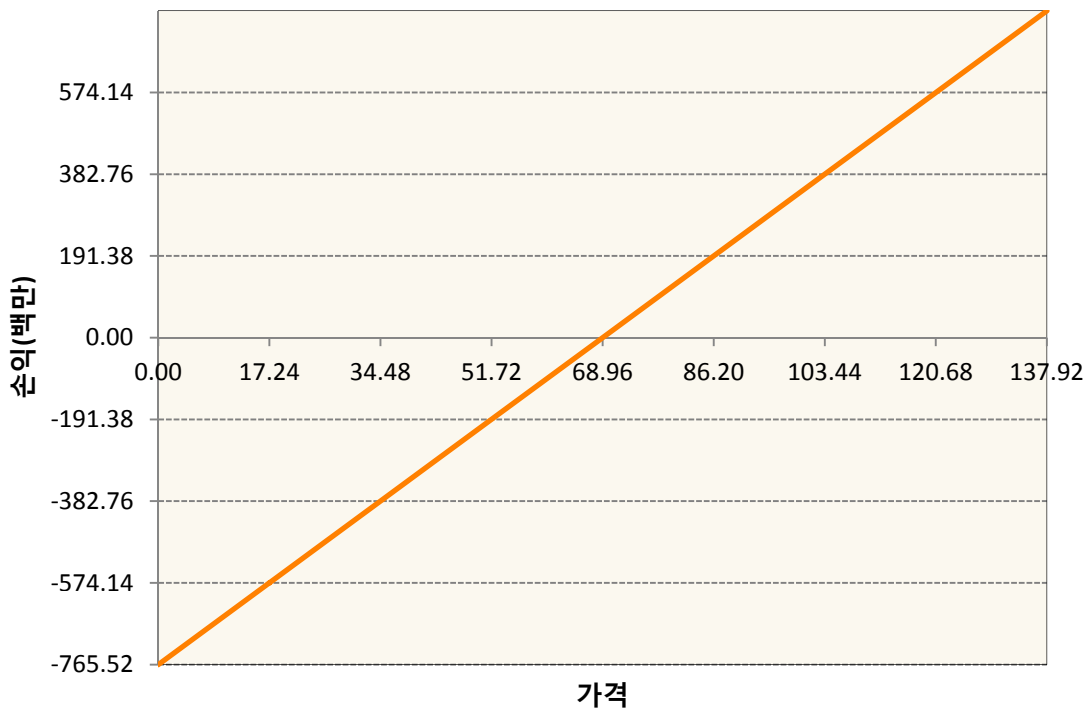
1. 계약금액

(단위:백만원)

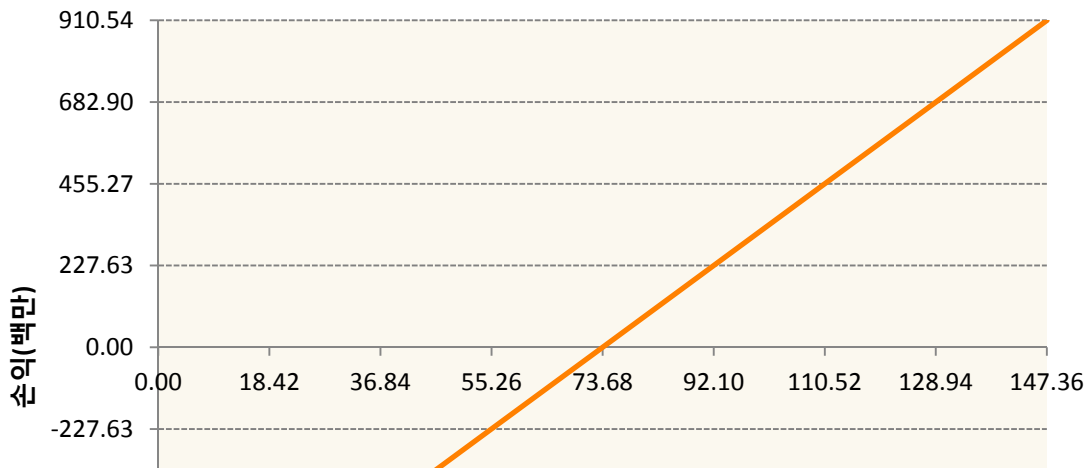
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,653 | 620 | 3,033 | |

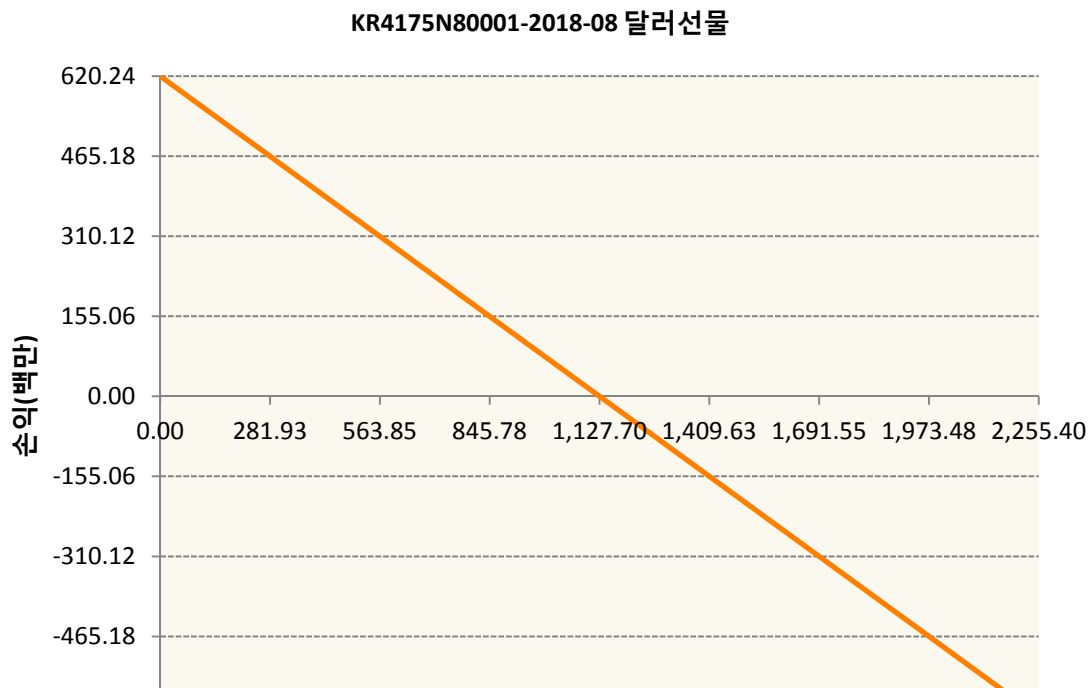
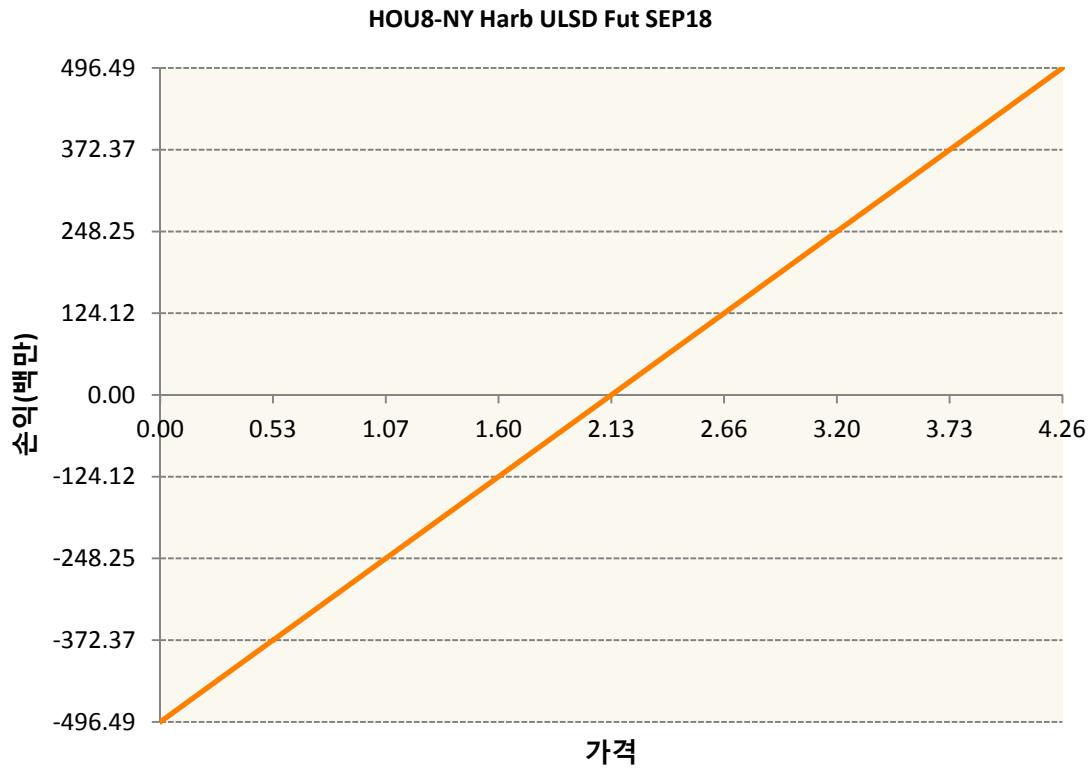
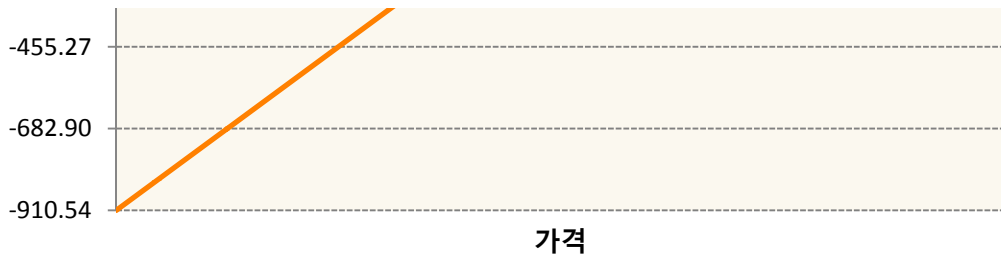
2. 만기시점의 손익구조

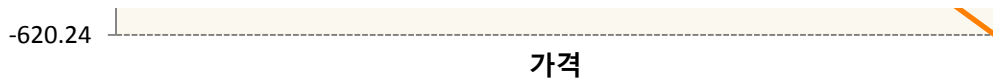
CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18



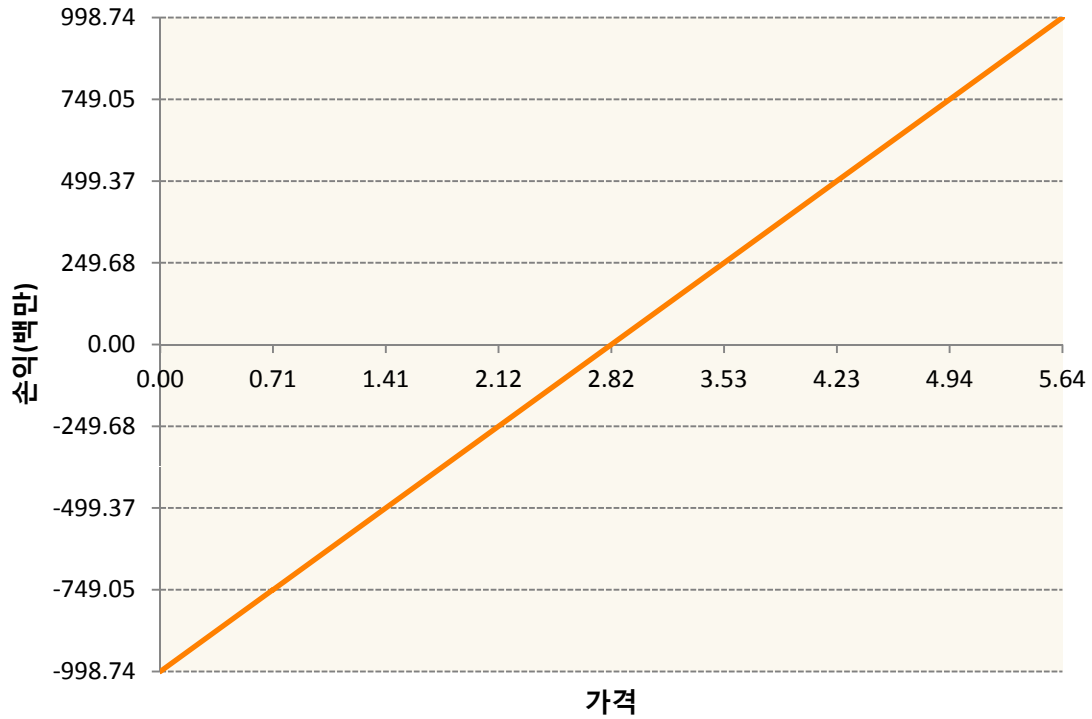
COX8-BRENT CRUDE FUTR Nov18



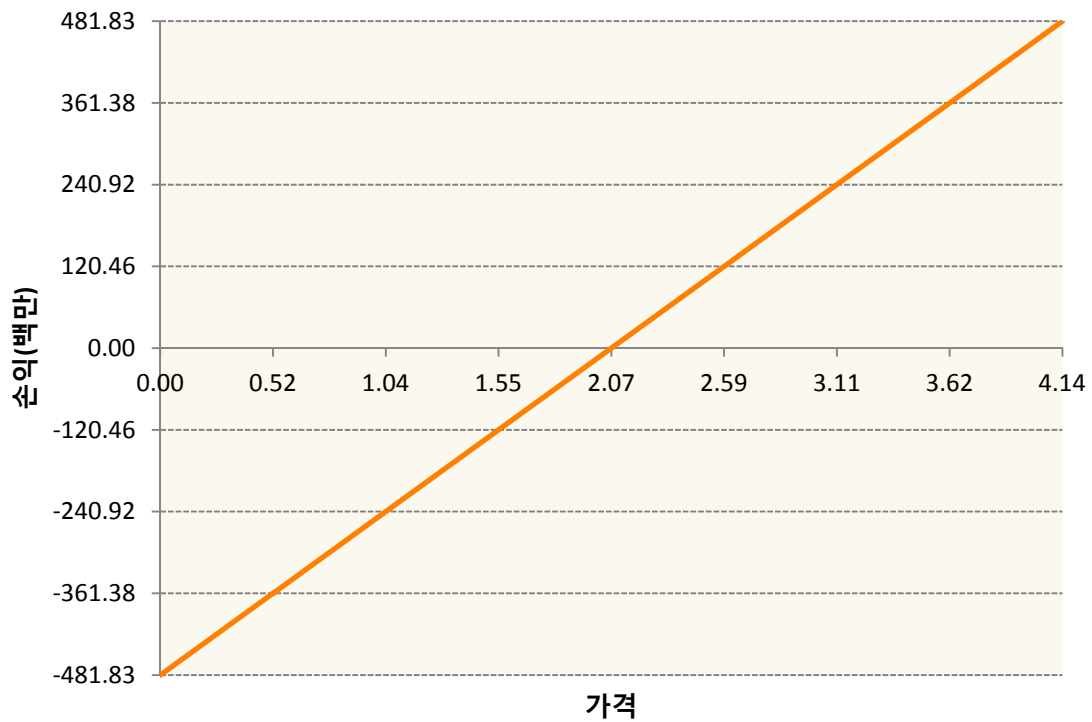




NGU18-NATURAL GAS FUTR SEP18



XBU8-GASOLINE RBOB FUT SEP18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| CLU8 | WTI CRUDE FUTURE SEP18 | 61 |
| COX8 | BRENT CRUDE FUTR Nov18 | 73 |
| HOU8 | NY Harb ULSD Fut SEP18 | 40 |
| KR4175N80C | 2018-08 달러선물 | 50 |
| NGU18 | NATURAL GAS FUTR SEP18 | 80 |
| XBU8 | GASOLINE RBOB FUT SEP18 | 39 |

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

446

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-08-06 |
| 기준일 | 2018-08-03 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

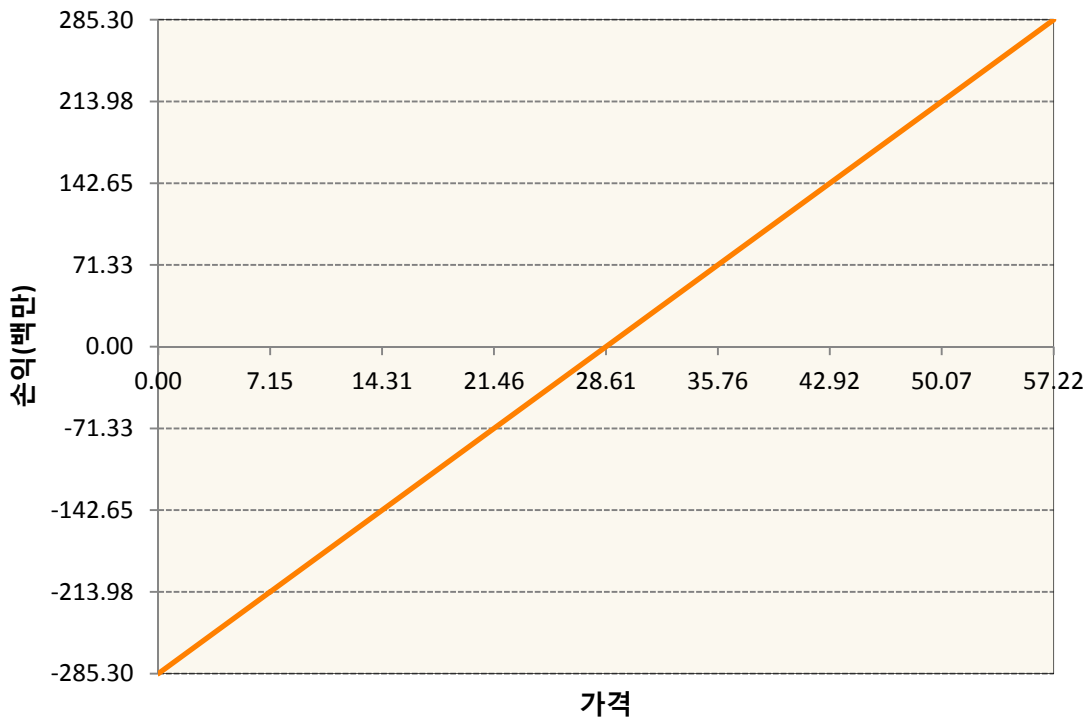
1. 계약금액

(단위:백만원)

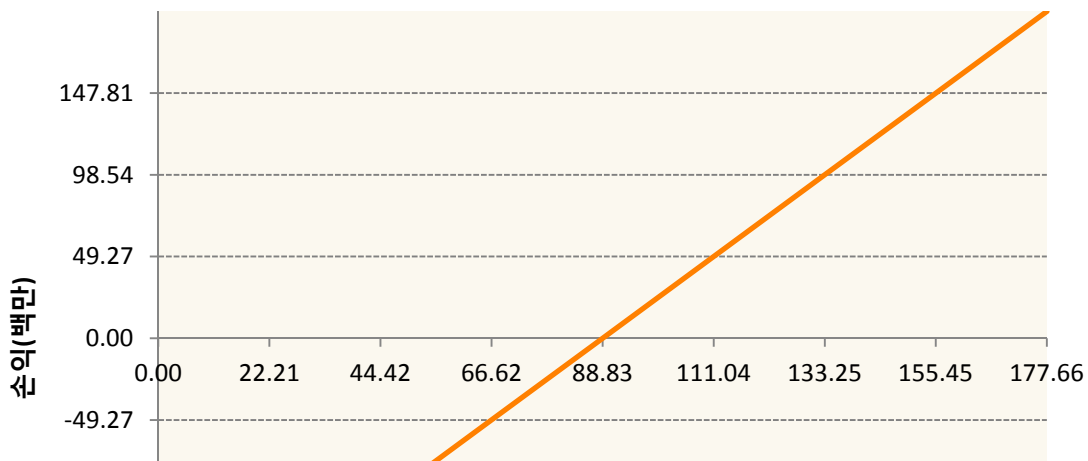
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,723 | 79 | 3,644 | |

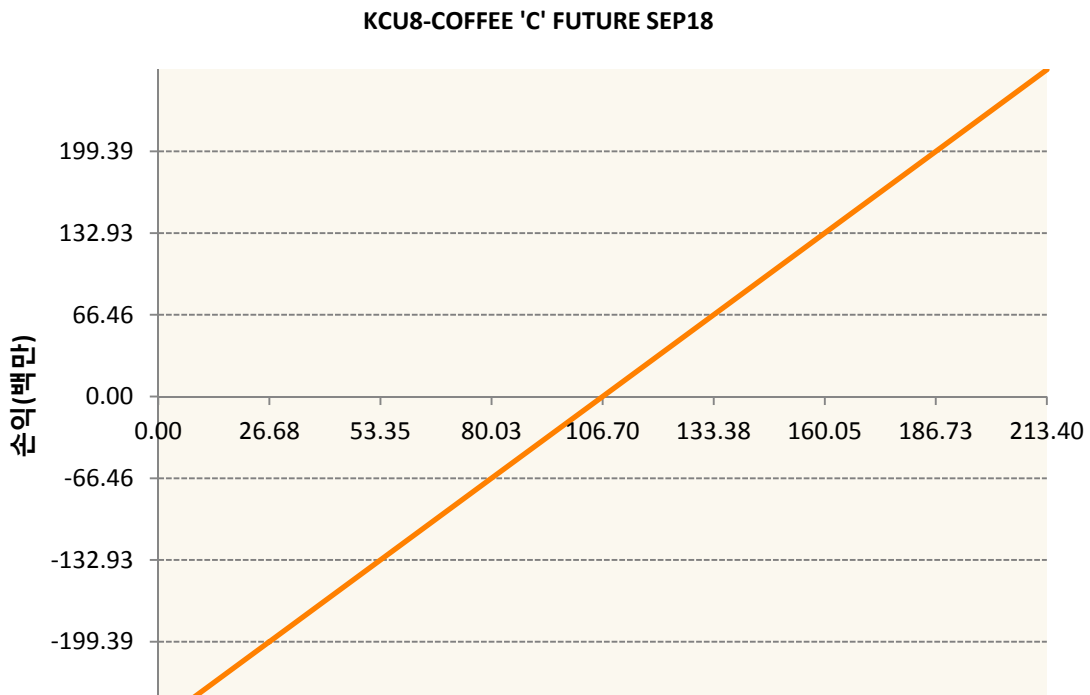
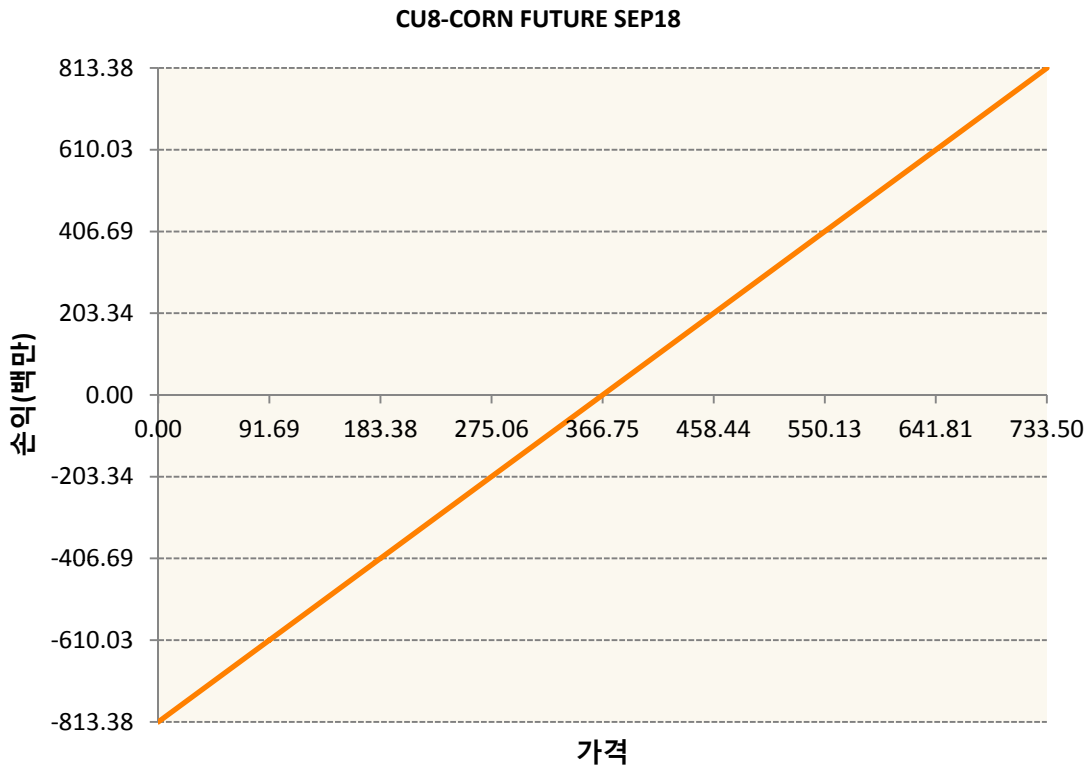
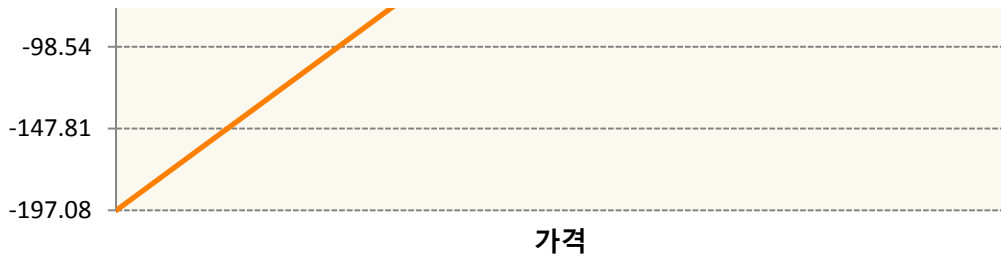
2. 만기시점의 손익구조

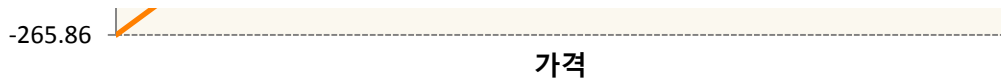
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



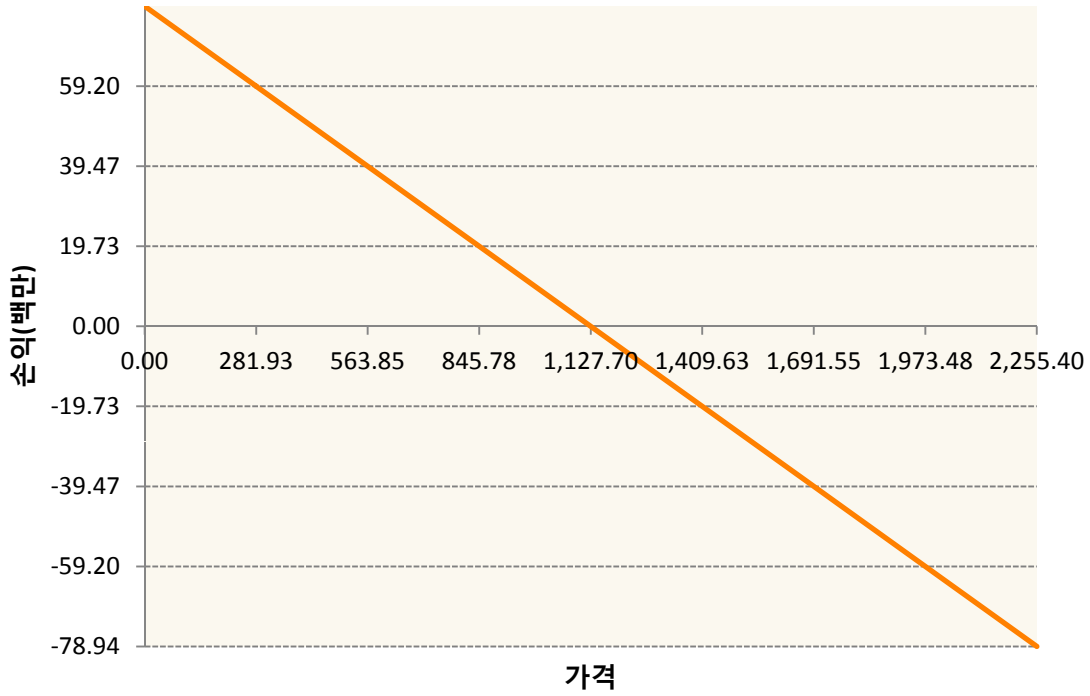
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



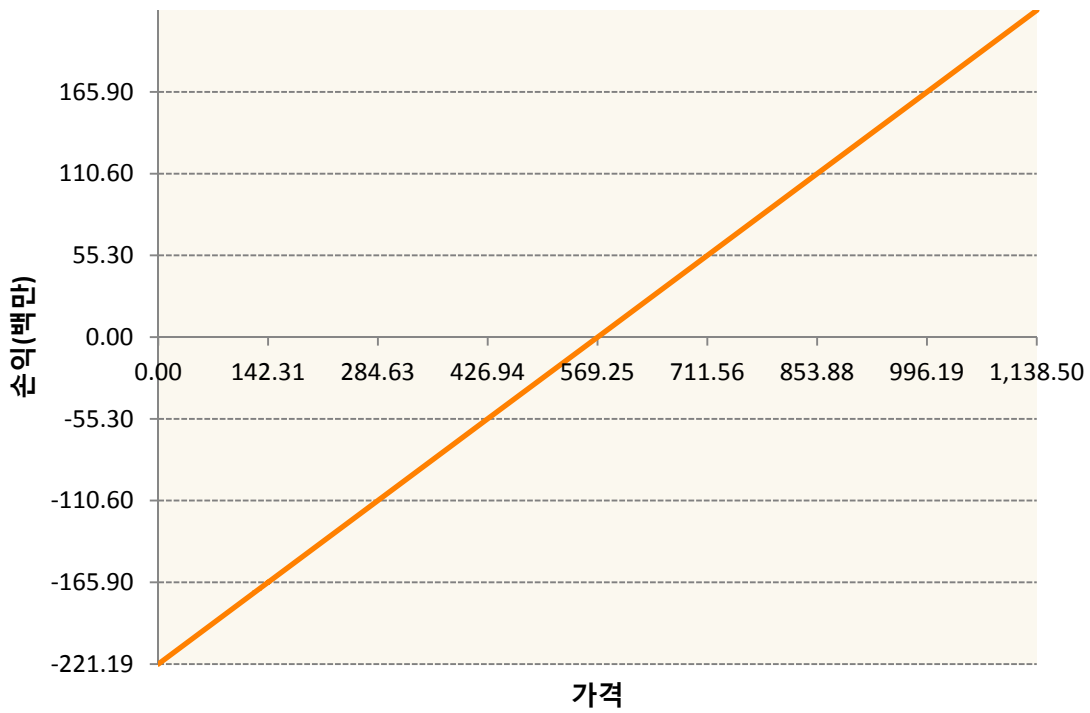




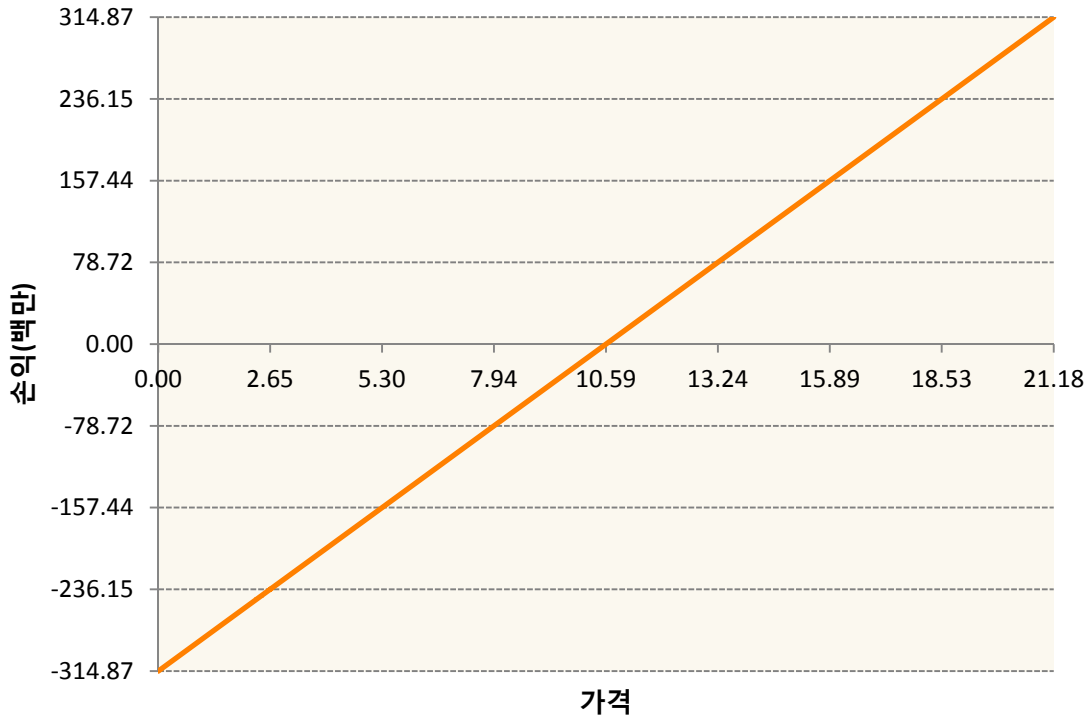
KR4175N80001-2018-08 달러선물



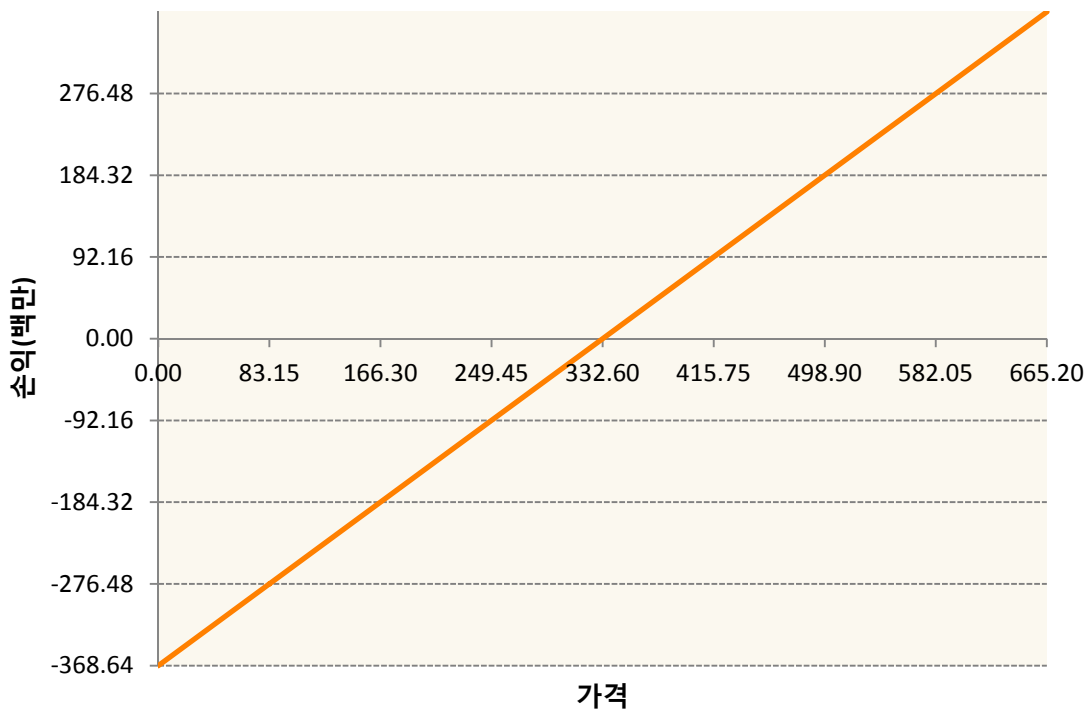
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



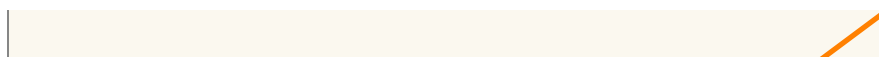
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

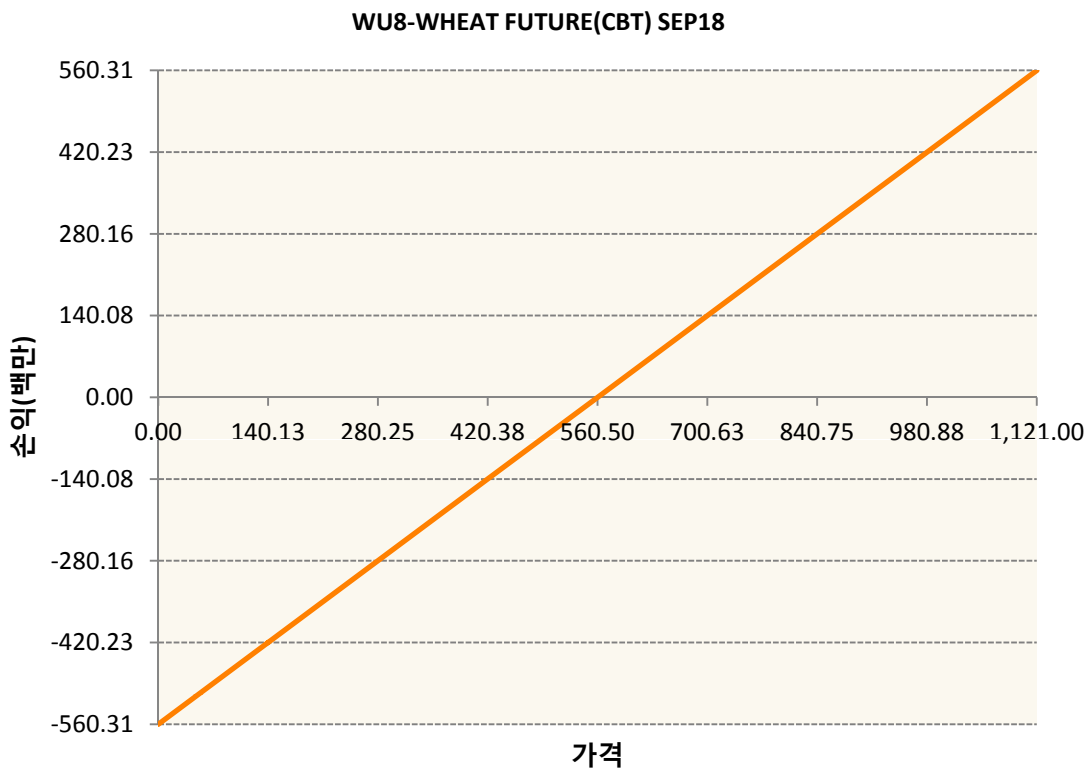
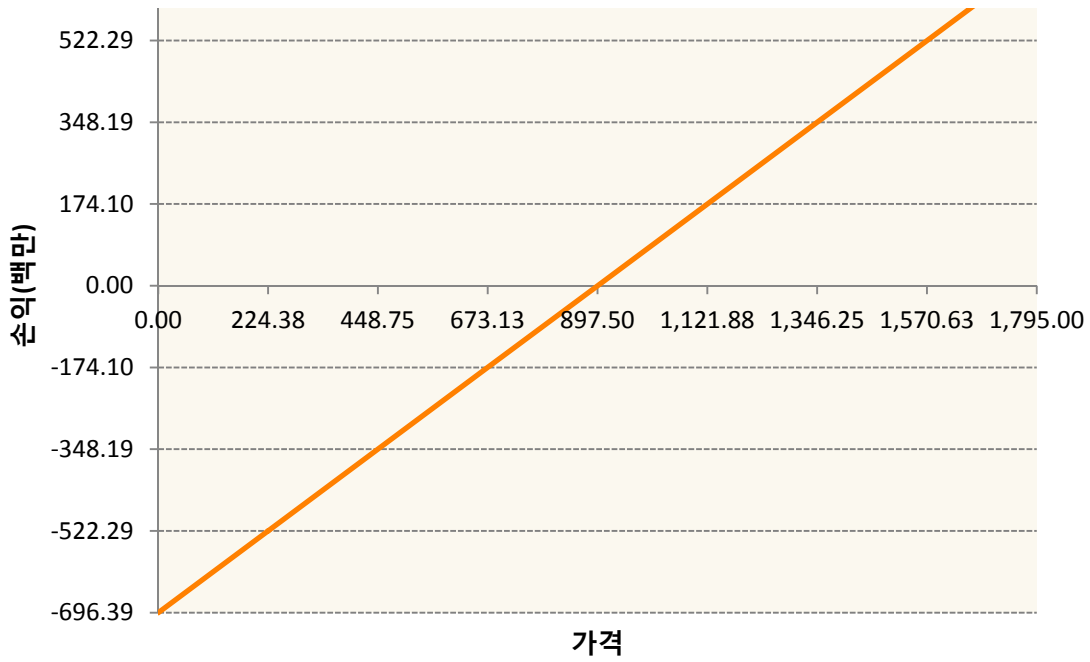


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BOZ8 | SOYBEAN OIL FUTR DEC18 | 23 |
| CTZ8 | COTTON NO.2 FUTR DEC18 | 16 |
| CU8 | CORN FUTURE SEP18 | 65 |
| KCU8 | COFFEE 'C' FUTURE SEP18 | 21 |
| KR4175N80C | 2018-08 달러선물 | 6 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWU8 | KC HRW WHEAT FUT SEP18 | 18 |
| SBV8 | SUGAR #11 (WORLD) OCT18 | 25 |
| SMZ8 | SOYBEAN MEAL FUTR DEC18 | 29 |
| SX8 | SOYBEAN FUTURE NOV18 | 56 |
| WU8 | WHEAT FUTURE(CBT) SEP18 | 45 |

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

(단위:백만원)

314