

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

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)

67

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

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 | 14,259 | 0 | 14,259 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180822

1,161

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

489

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

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 | 3,685 | 0 | 3,685 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180910

293

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

374

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

유로인덱스모(주식-파생형)

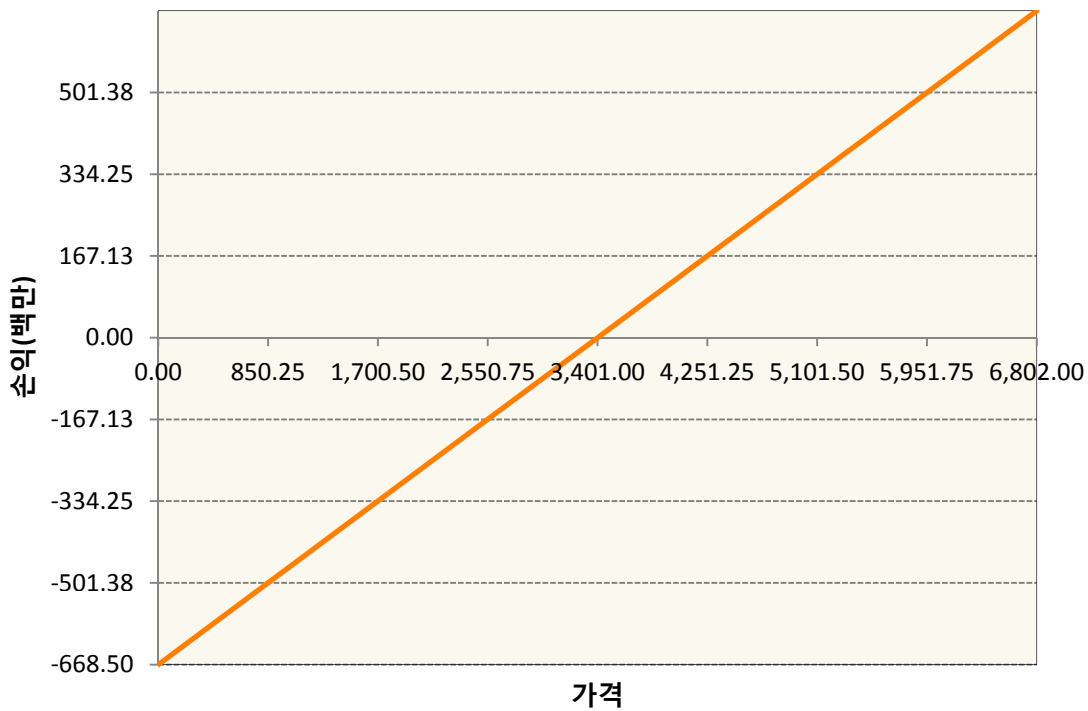
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 669 | 0 | 669 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGZ8 | EURO STOXX 50 DEC18 | 53 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 33 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

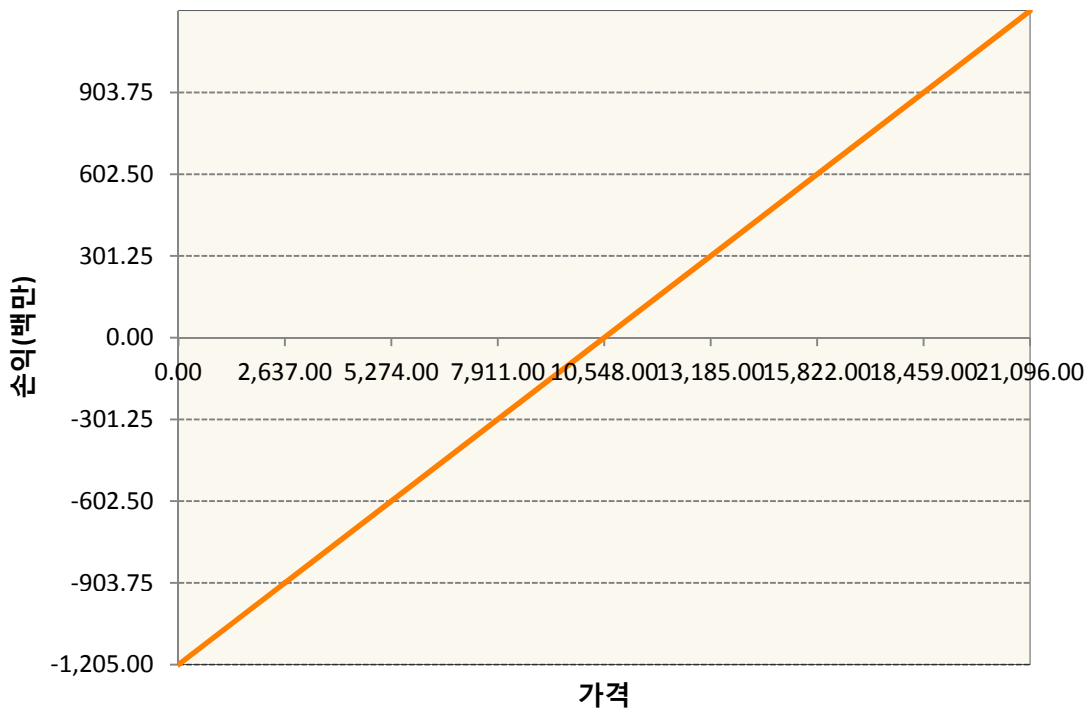
1. 계약금액

(단위:백만원)

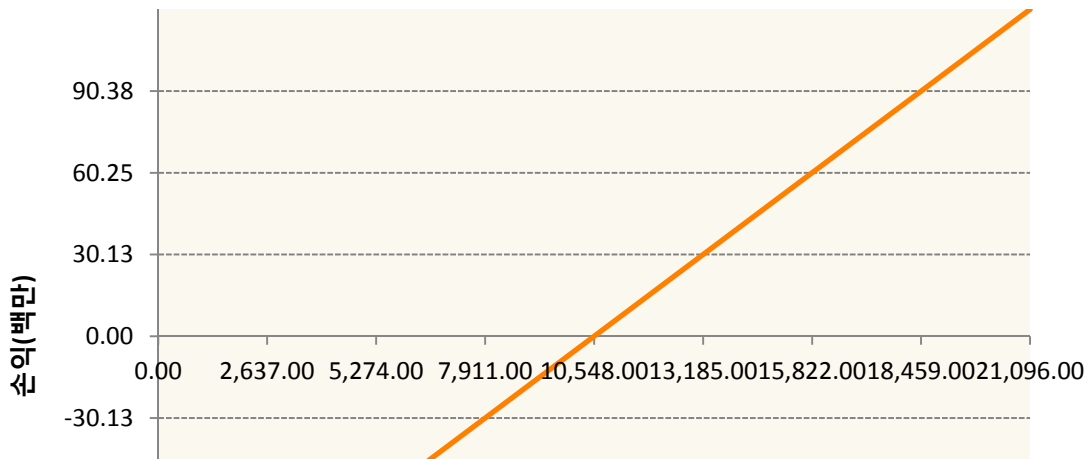
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,326 | 0 | 1,326 | 장내 |

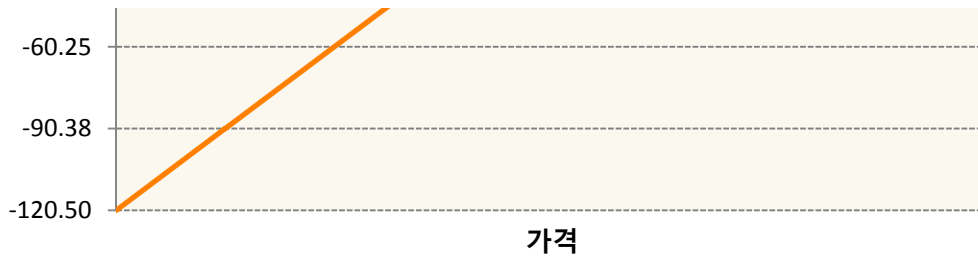
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|--------------------------|----|
| HCV8 | HSCEI FUTURES OCT 18 | 96 |
| MHCV8 | MINI H-SHR IDX FU OCT 18 | 10 |

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

| |
|------------|
| 100 |
|------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

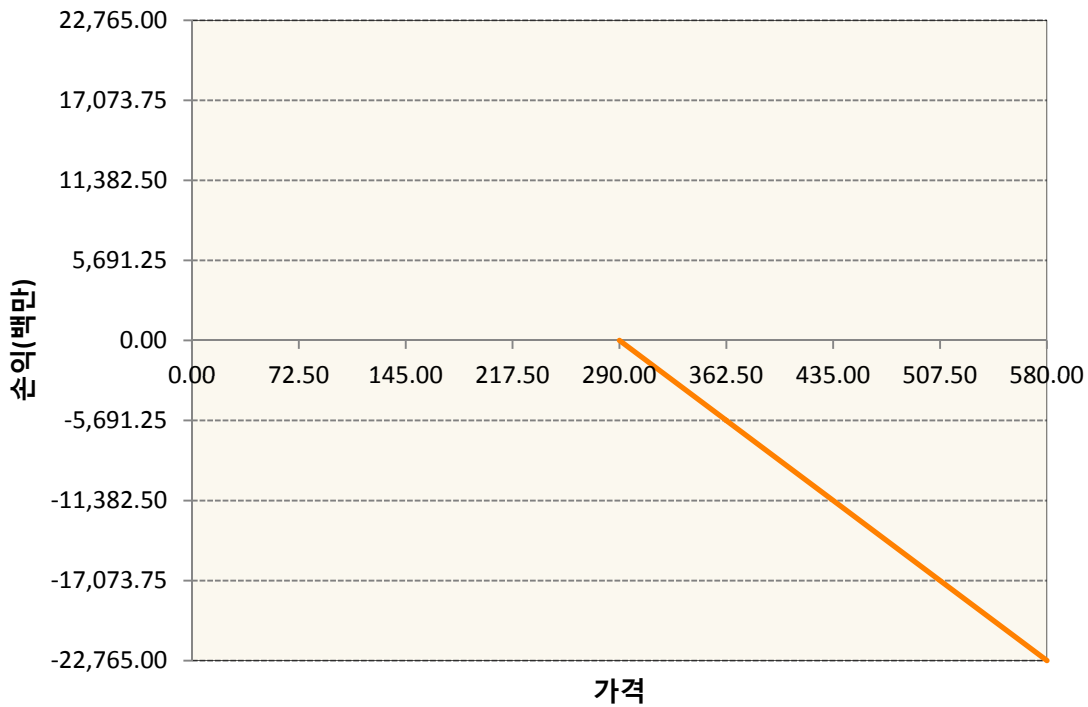
1. 계약금액

(단위:백만원)

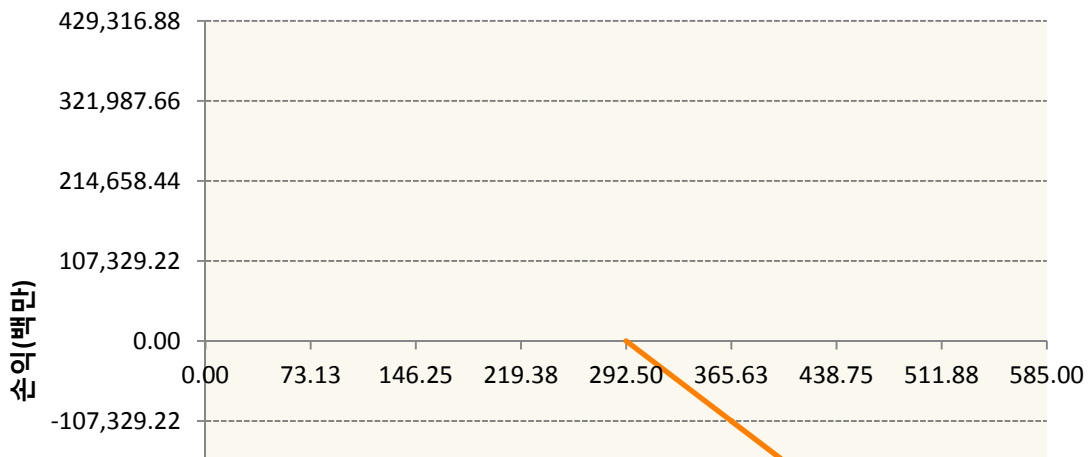
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 727,032 | -727,032 | 장내 |

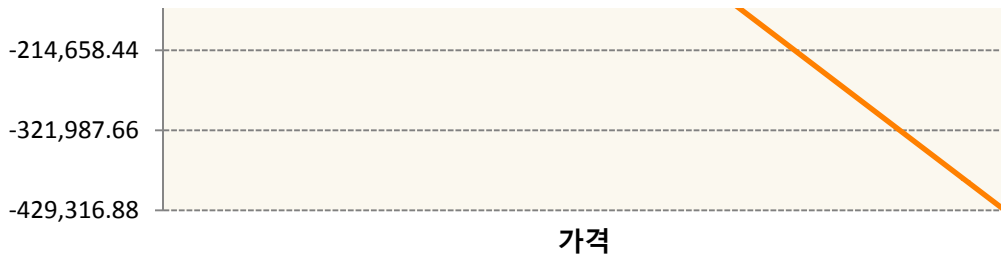
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2902-2018-10 콜290

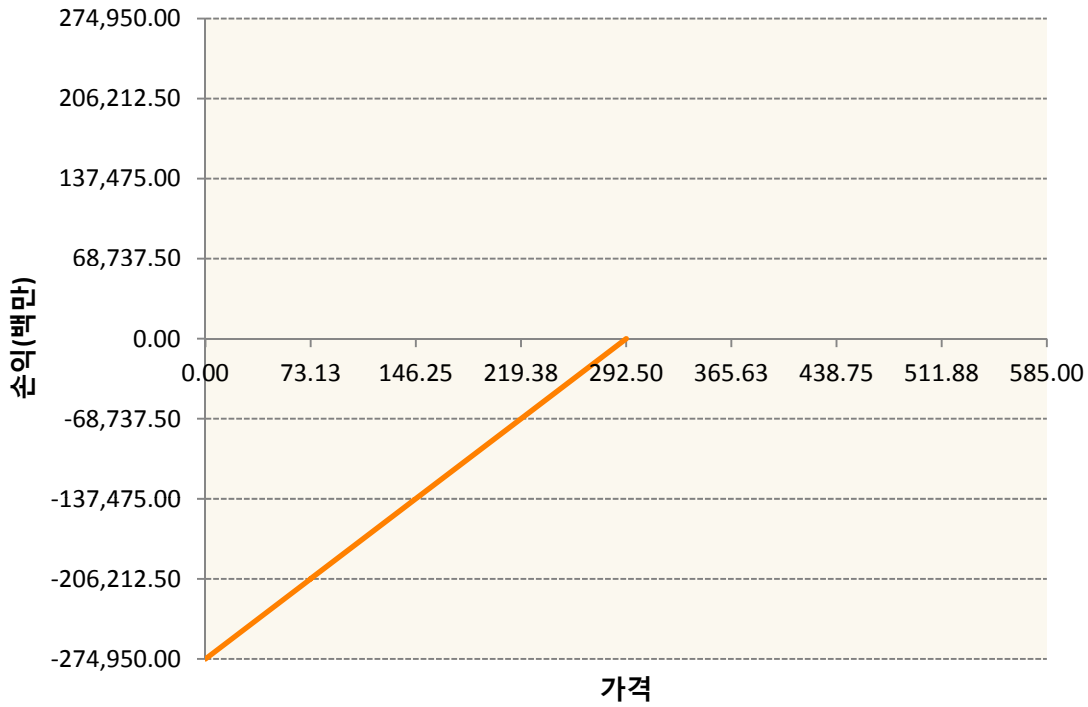


KR4201NA2928-2018-10 콜292.5





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NA2927-2018-10 콜290

1,571

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 416 | 415 | 413 | 411 | 407 | 401 | 395 |
| -5.33% | 406 | 399 | 389 | 378 | 365 | 351 | 335 |
| -2.67% | 332 | 310 | 287 | 263 | 239 | 214 | 189 |
| 0% | 84 | 56 | 28 | 0 | -28 | -56 | -85 |
| 2.67% | -374 | -390 | -407 | -427 | -447 | -469 | -491 |
| 5.33% | -948 | -953 | -959 | -967 | -977 | -988 | -1,001 |
| 8.00% | -1,554 | -1,555 | -1,556 | -1,558 | -1,562 | -1,566 | -1,571 |

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5

27,773

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 5,909 | 5,900 | 5,883 | 5,853 | 5,806 | 5,740 | 5,654 |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| -5.33% | 5,820 | 5,738 | 5,624 | 5,476 | 5,297 | 5,089 | 4,854 |
| -2.67% | 5,003 | 4,680 | 4,326 | 3,948 | 3,550 | 3,136 | 2,708 |
| 0% | 1,603 | 1,069 | 535 | 0 | -535 | -1,070 | -1,605 |
| 2.67% | -5,796 | -6,190 | -6,608 | -7,044 | -7,496 | -7,959 | -8,432 |
| 5.33% | -16,050 | -16,189 | -16,366 | -16,581 | -16,829 | -17,106 | -17,410 |
| 8.00% | -27,283 | -27,308 | -27,351 | -27,417 | -27,509 | -27,627 | -27,773 |

KR4301NA29 2018-10 풋 292.5

20,311

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -20,311 | -20,311 | -20,311 | -20,311 | -20,311 | -20,311 | -20,311 |
| -5.33% | -13,000 | -13,000 | -13,000 | -13,000 | -13,002 | -13,004 | -13,009 |
| -2.67% | -5,705 | -5,723 | -5,749 | -5,785 | -5,830 | -5,884 | -5,946 |
| 0% | 480 | 320 | 160 | 0 | -161 | -322 | -483 |
| 2.67% | 2,252 | 2,213 | 2,162 | 2,101 | 2,029 | 1,948 | 1,860 |
| 5.33% | 2,307 | 2,306 | 2,305 | 2,303 | 2,298 | 2,290 | 2,279 |
| 8.00% | 2,307 | 2,307 | 2,307 | 2,307 | 2,307 | 2,307 | 2,306 |

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

(단위:백만원)

59,813

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

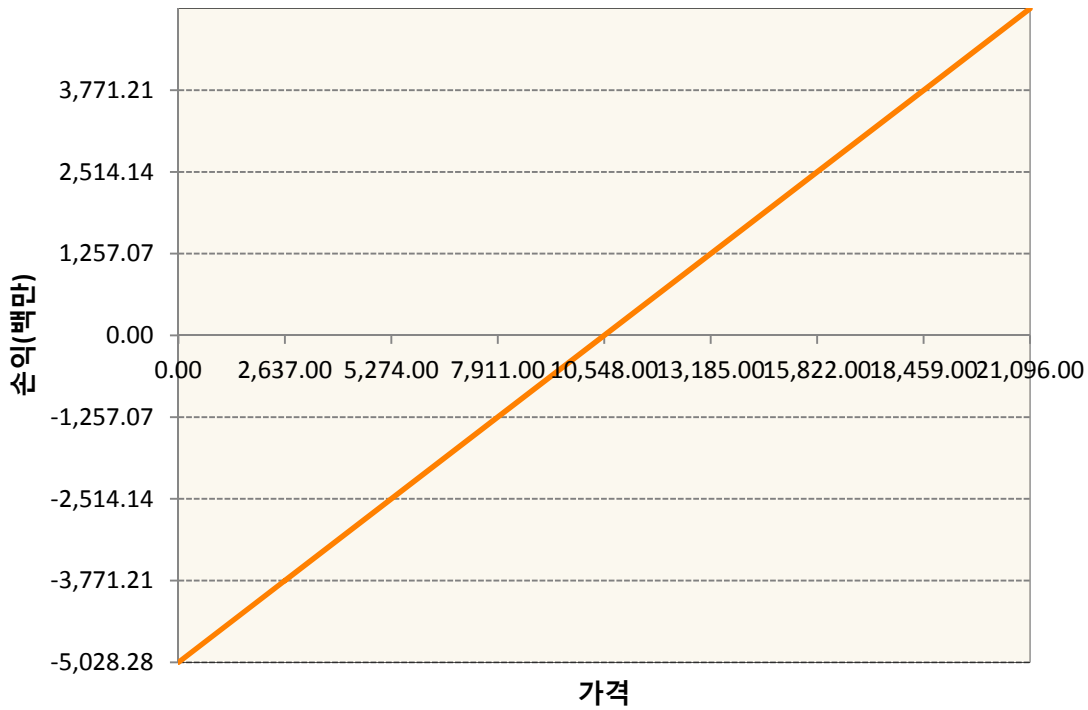
1. 계약금액

(단위:백만원)

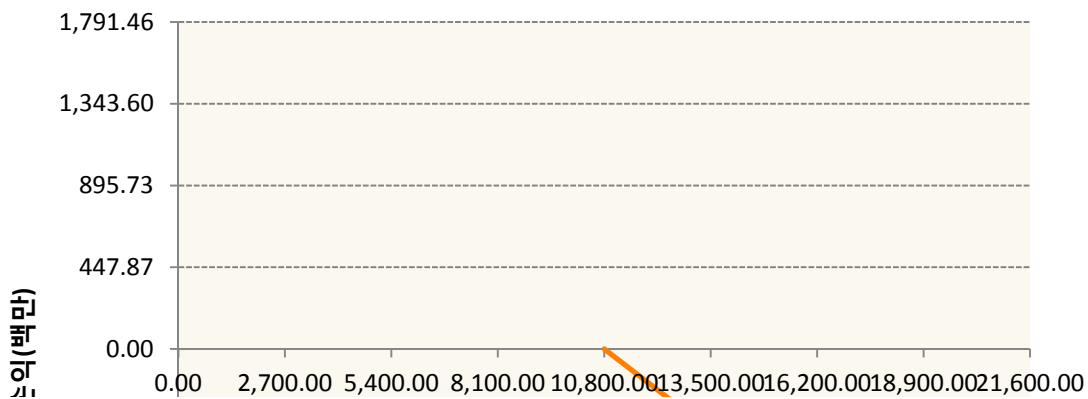
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,028 | 0 | 5,028 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 11,833 | -11,833 | 장내 |

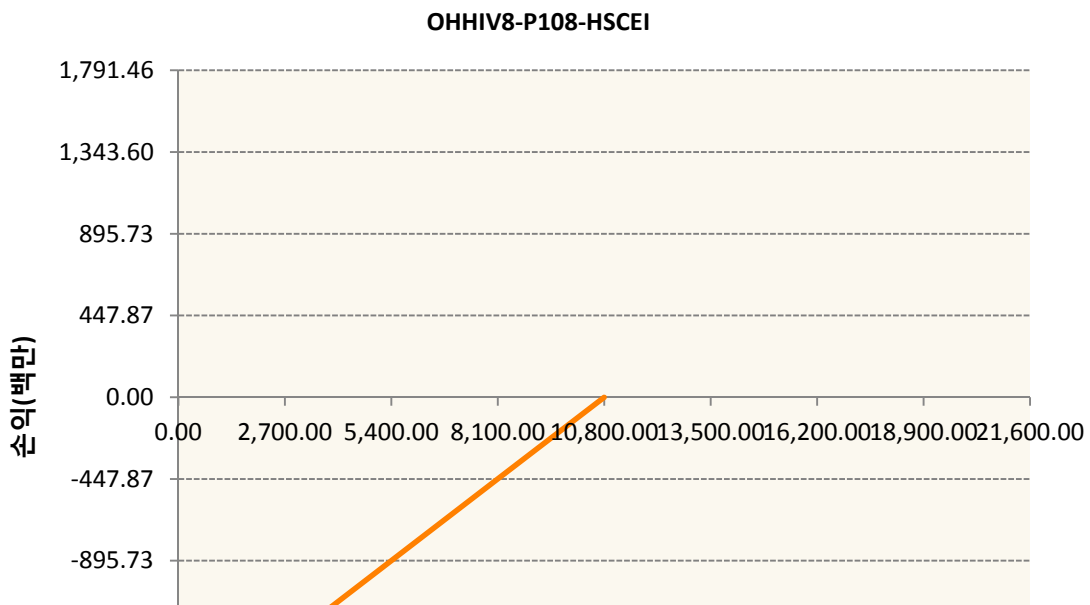
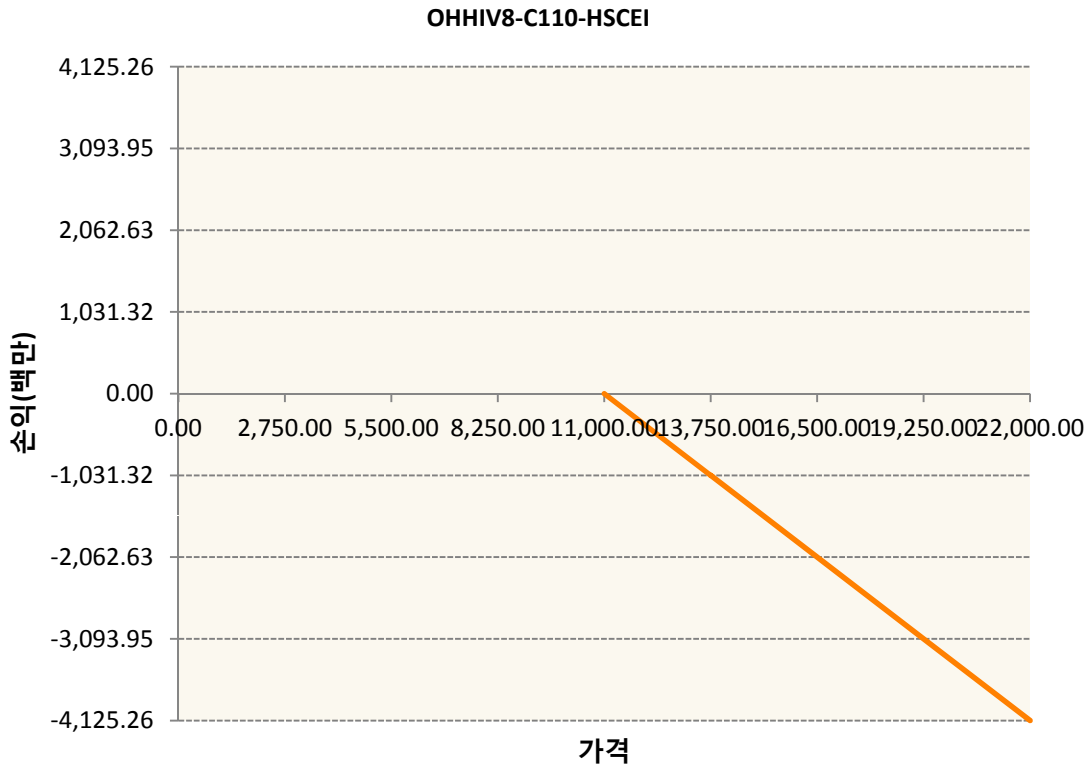
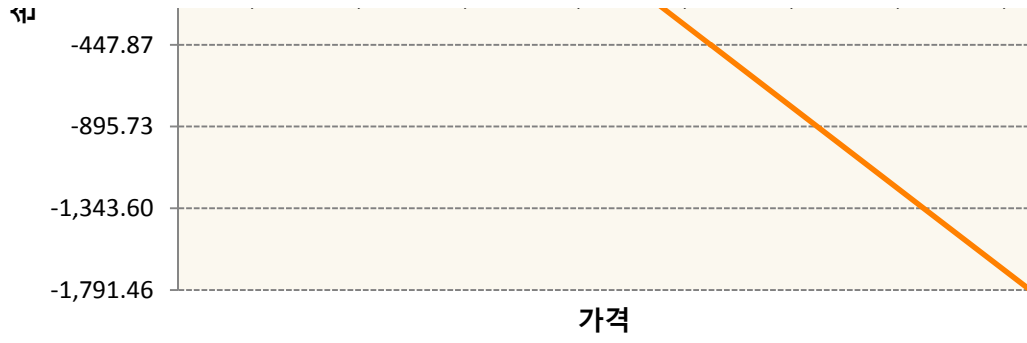
2. 만기시점의 손익구조

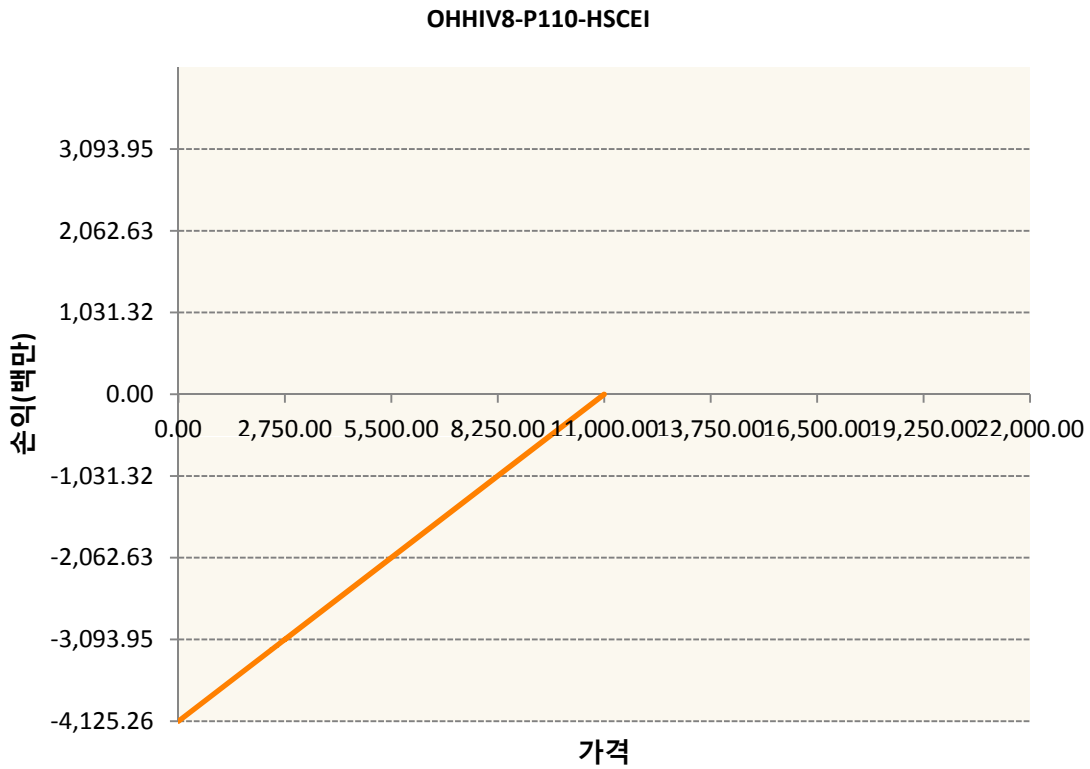
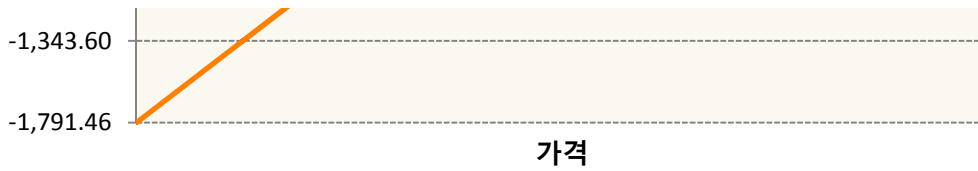
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|----------------------|----------|
| HCV8 | HSCEI FUTURES OCT 18 | 402 |
| OHHIV8-C1C | HSCEI | 143 |
| OHHIV8-C11 | HSCEI | 330 |
| OHHIV8-P1C | HSCEI | 143 |
| OHHIV8-P11 | HSCEI | 330 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 1,272 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

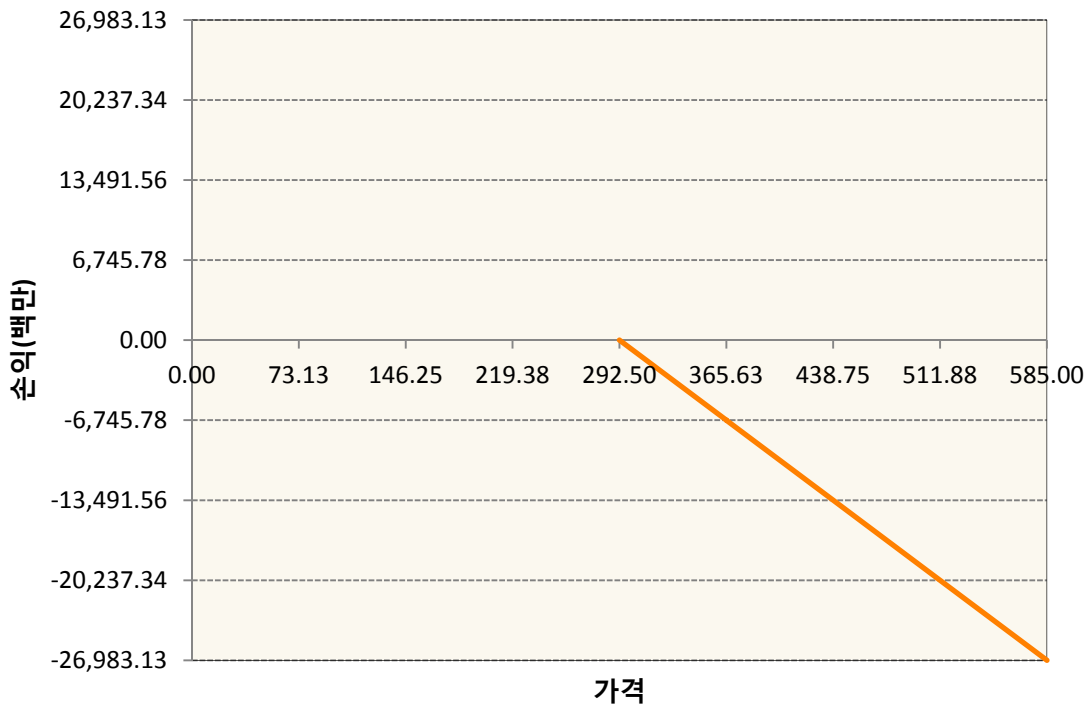
1. 계약금액

(단위:백만원)

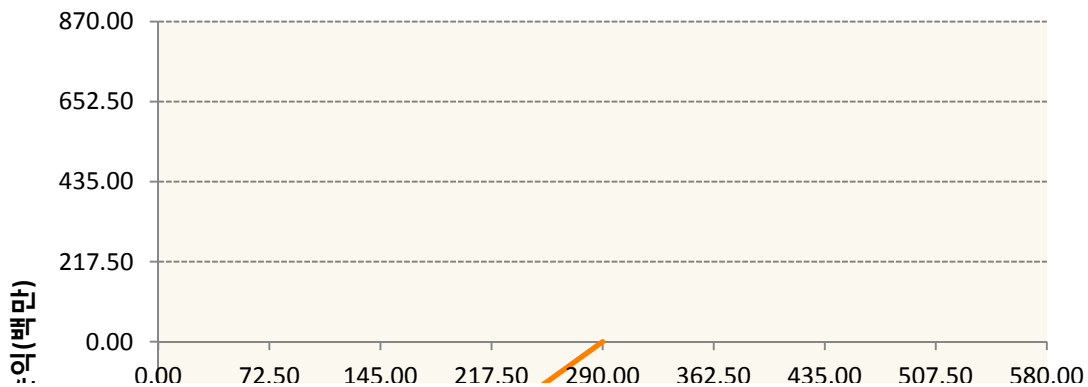
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 48,836 | 0 | 48,836 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 47,451 | -47,451 | 장내 |

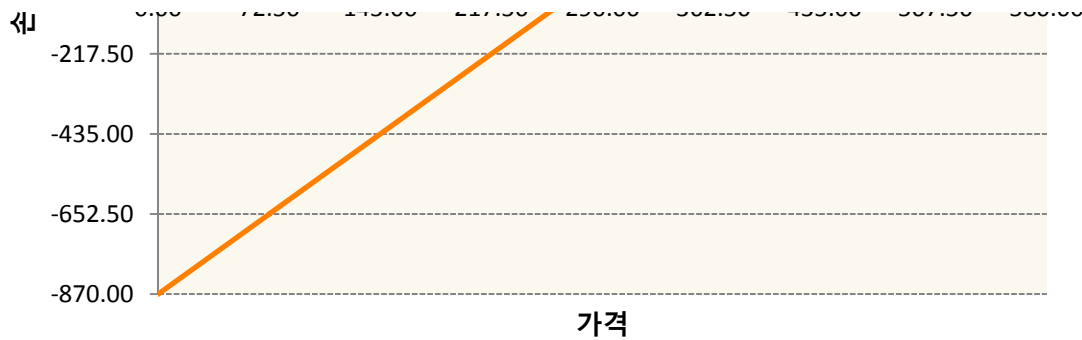
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NA2928-2018-10 콜292.5

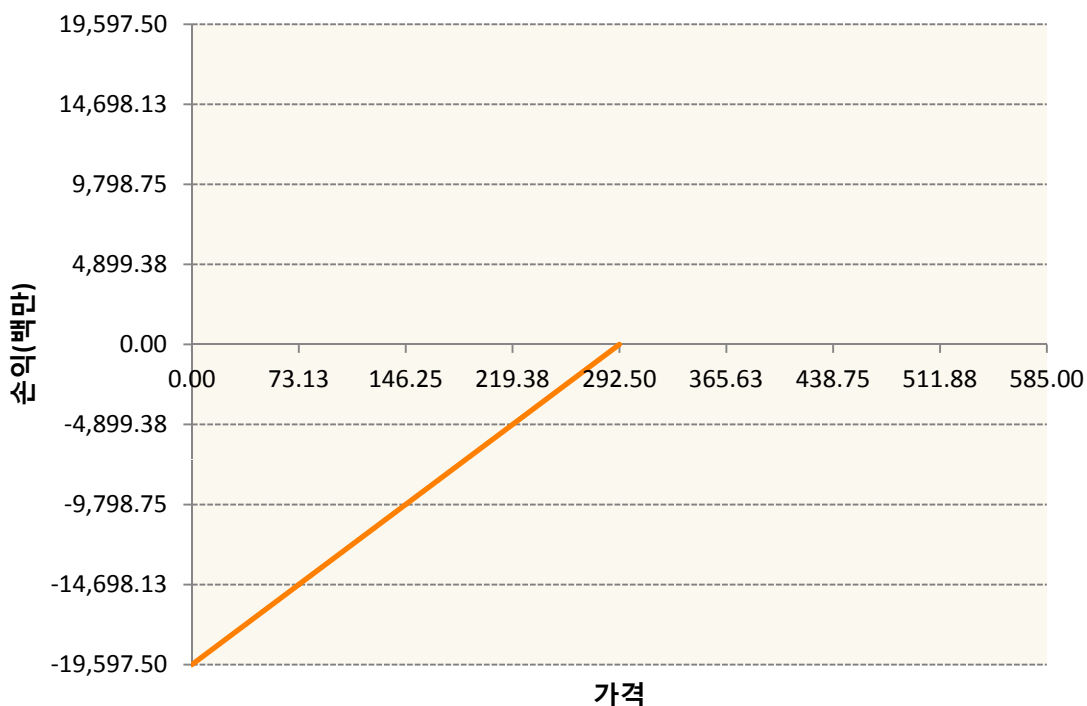


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14 4,007

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -4,007 | -4,007 | -4,007 | -4,007 | -4,007 | -4,007 | -4,007 |
| -5.33% | -2,671 | -2,671 | -2,671 | -2,671 | -2,671 | -2,671 | -2,671 |
| -2.67% | -1,336 | -1,336 | -1,336 | -1,336 | -1,336 | -1,336 | -1,336 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 1,336 | 1,336 | 1,336 | 1,336 | 1,336 | 1,336 | 1,336 |
| 5.33% | 2,671 | 2,671 | 2,671 | 2,671 | 2,671 | 2,671 | 2,671 |
| 8.00% | 4,007 | 4,007 | 4,007 | 4,007 | 4,007 | 4,007 | 4,007 |

KR4201NA2927-2018-10 풋292.5 1,746

| 기초자산의 변동성 | |
|-----------|--|
|-----------|--|

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 371 | 371 | 370 | 368 | 365 | 361 | 355 |
| -5.33% | 366 | 361 | 353 | 344 | 333 | 320 | 305 |
| -2.67% | 314 | 294 | 272 | 248 | 223 | 197 | 170 |
| 0% | 101 | 67 | 34 | 0 | -34 | -67 | -101 |
| 2.67% | -364 | -389 | -415 | -443 | -471 | -500 | -530 |
| 5.33% | -1,009 | -1,017 | -1,029 | -1,042 | -1,058 | -1,075 | -1,094 |
| 8.00% | -1,715 | -1,716 | -1,719 | -1,723 | -1,729 | -1,736 | -1,746 |

KR4301NA2☹ 2018-10 풋290

61

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 | -61 |
| -5.33% | -37 | -37 | -37 | -37 | -37 | -38 | -38 |
| -2.67% | -14 | -15 | -15 | -15 | -15 | -16 | -16 |
| 0% | 1 | 1 | 0 | 0 | 0 | -1 | -1 |
| 2.67% | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 3 | 3 |
| 5.33% | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 |
| 8.00% | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 | 4 |

KR4301NA2☹ 2018-10 풋292.5

1,448

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,448 | -1,448 | -1,448 | -1,448 | -1,448 | -1,448 | -1,448 |
| -5.33% | -927 | -927 | -927 | -927 | -927 | -927 | -927 |
| -2.67% | -407 | -408 | -410 | -412 | -416 | -419 | -424 |
| 0% | 34 | 23 | 11 | 0 | -11 | -23 | -34 |
| 2.67% | 161 | 158 | 154 | 150 | 145 | 139 | 133 |
| 5.33% | 164 | 164 | 164 | 164 | 164 | 163 | 162 |
| 8.00% | 164 | 164 | 164 | 164 | 164 | 164 | 164 |

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

(단위:백만원)

7,969

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

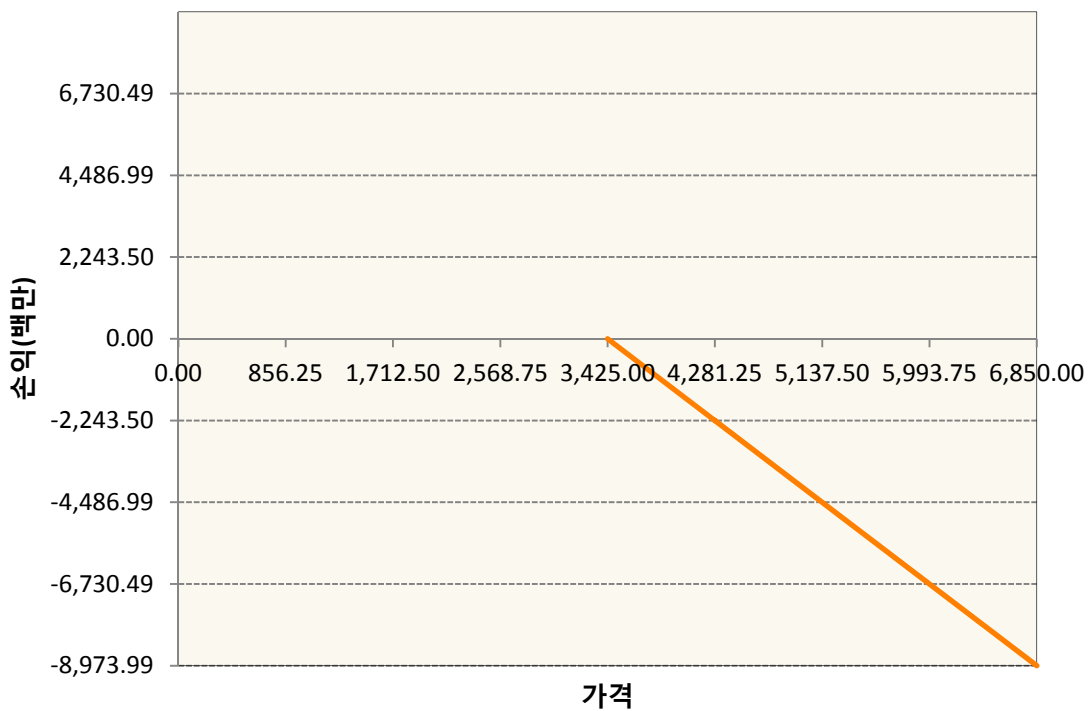
1. 계약금액

(단위:백만원)

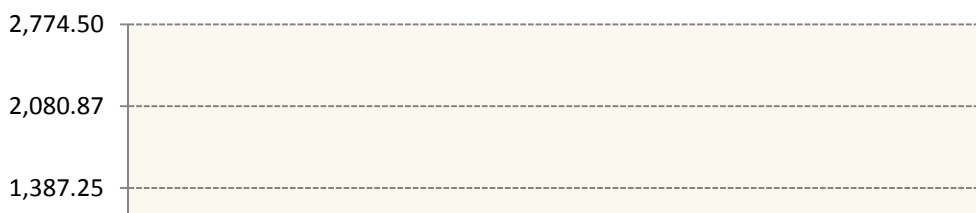
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,823 | 0 | 4,823 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 34,253 | 0 | 34,253 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 23,497 | -23,497 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 52,660 | 0 | 52,660 | 장외 |

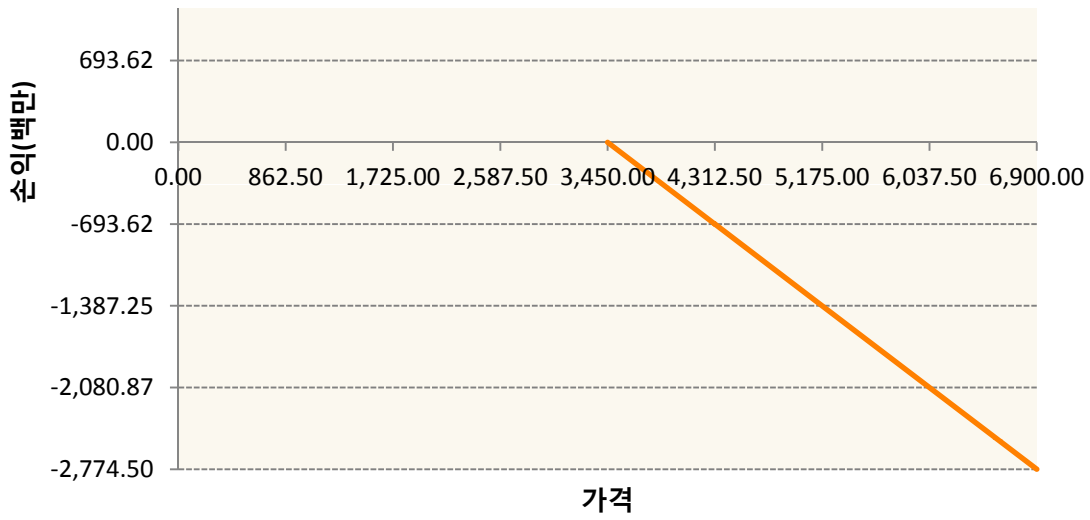
2. 만기시점의 손익구조

OESXV8-C3425-EURO STOXX 50

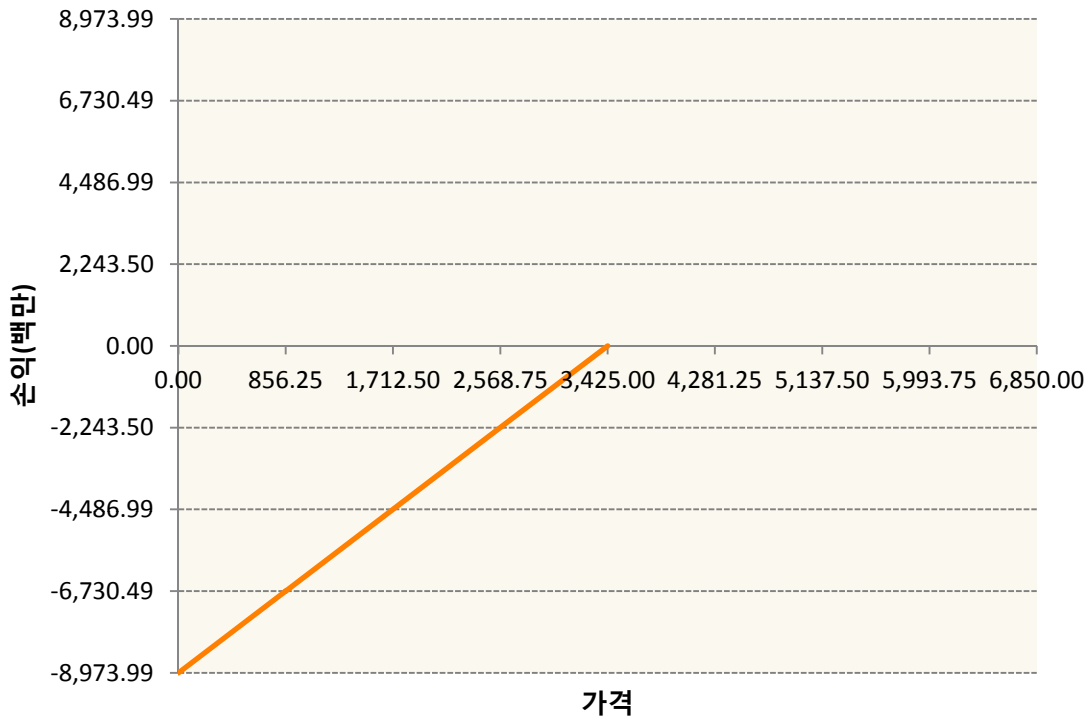


OESXV8-C3450-EURO STOXX 50

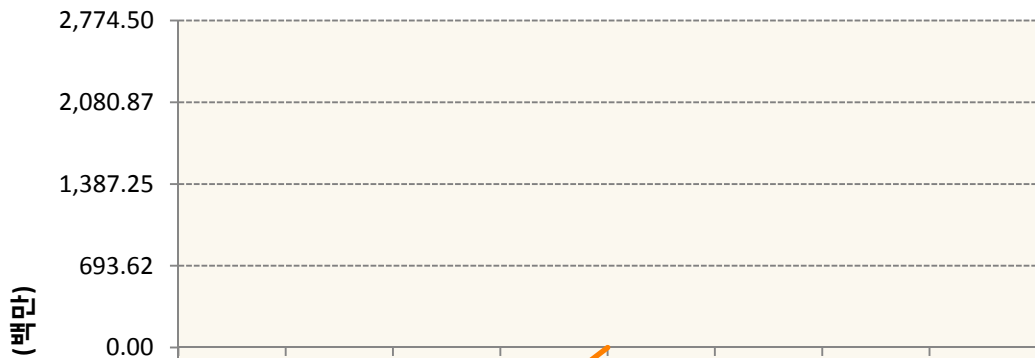


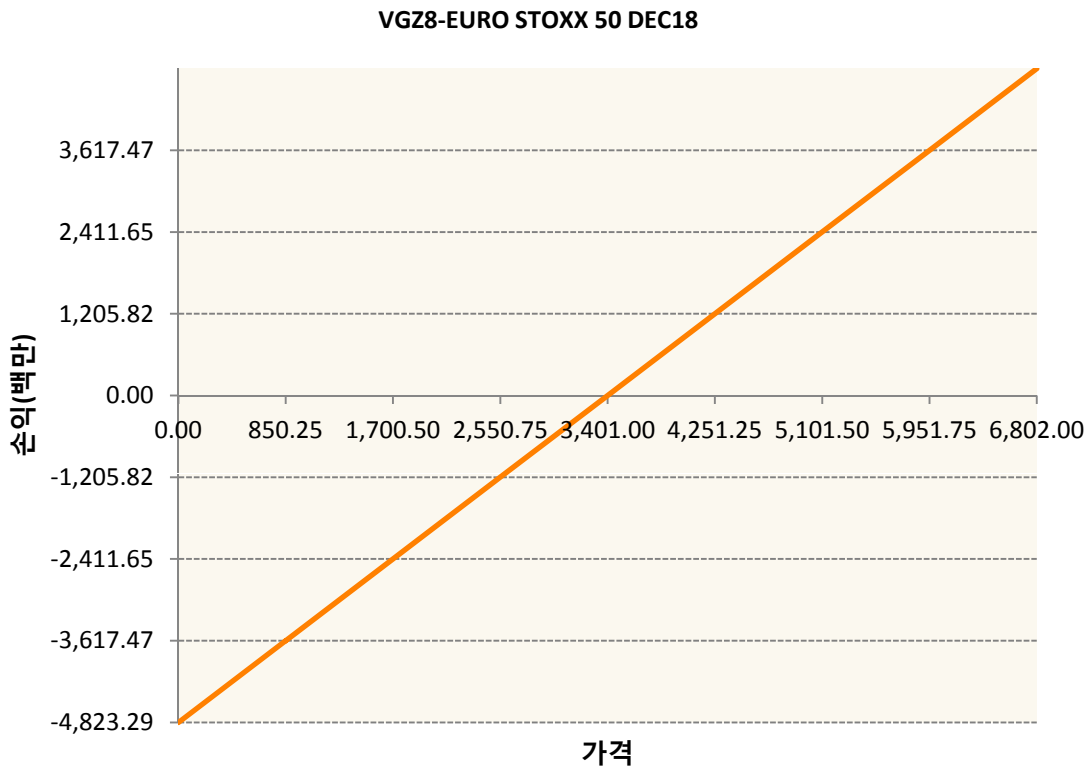
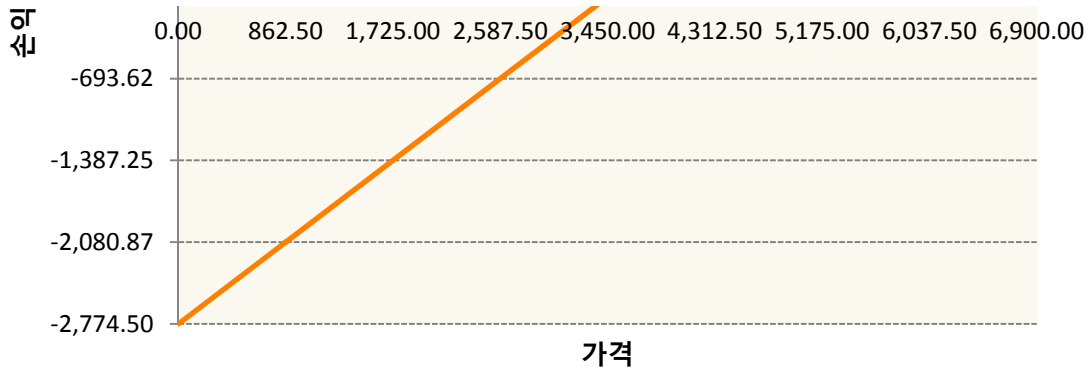


OESXV8-P3425-EURO STOXX 50



OESXV8-P3450-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|--|--|----------|
| 260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569 | | 3 |
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 2 |
| OESXV8-C34 EURO STOXX 50 | | 718 |
| OESXV8-C34 EURO STOXX 50 | | 222 |
| OESXV8-P34 EURO STOXX 50 | | 718 |
| OESXV8-P34 EURO STOXX 50 | | 222 |
| VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18 | | 386 |

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

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

(단위:백만원)

1,126

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

(단위:백만원)

89

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

(단위:백만원)

133

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

(단위:백만원)

161

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

(단위:백만원)

40

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간

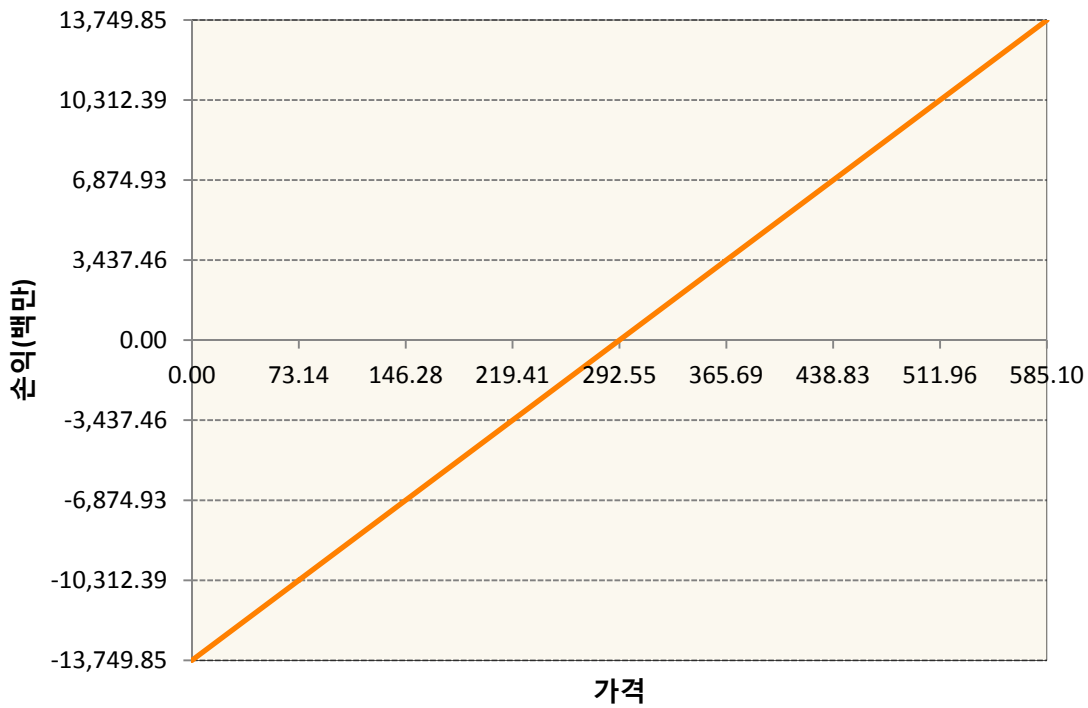
1. 계약금액

(단위:백만원)

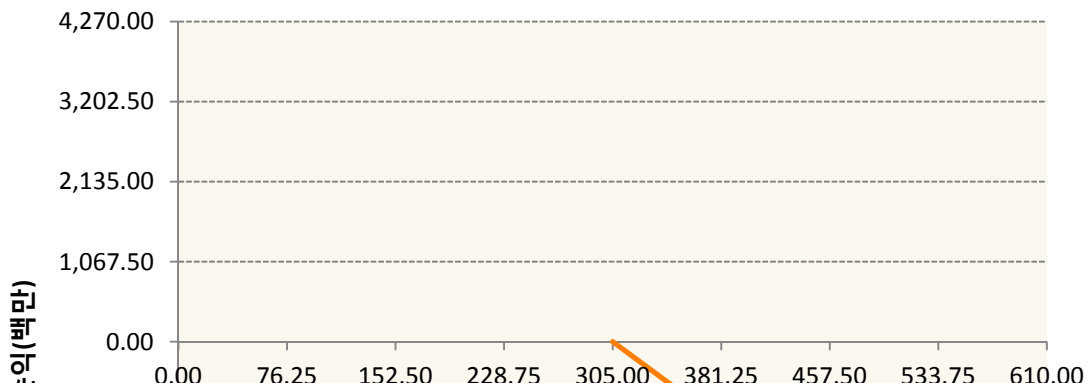
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 13,750 | 0 | 13,750 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 2,119 | 24,488 | -22,369 | 장내 |

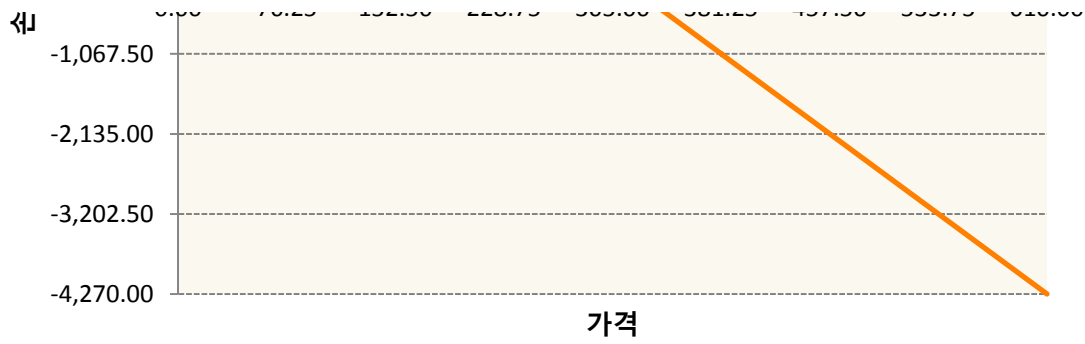
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

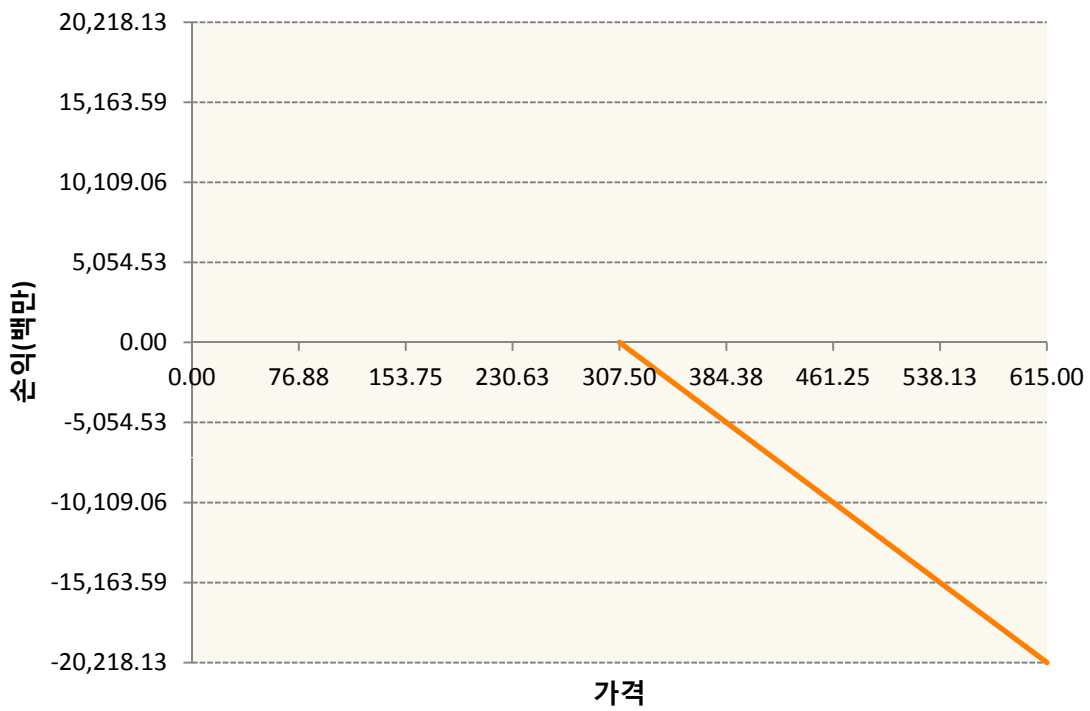


KR4201NA3058-2018-10 콜305

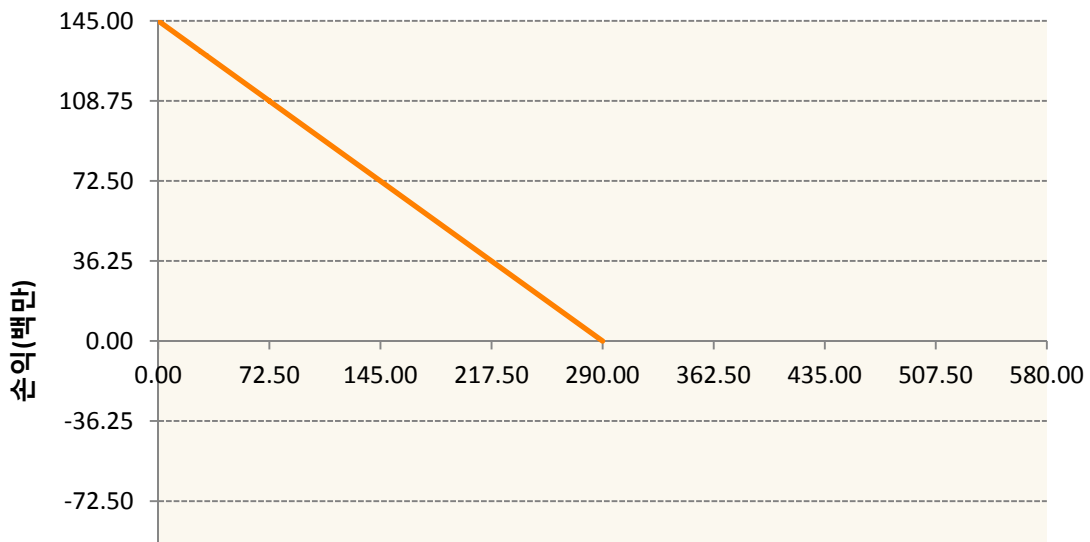


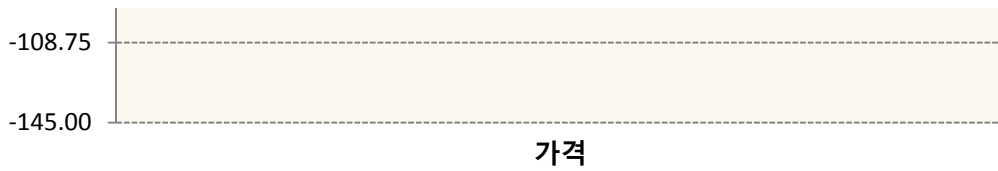


KR4201NA3074-2018-10 콜307.5

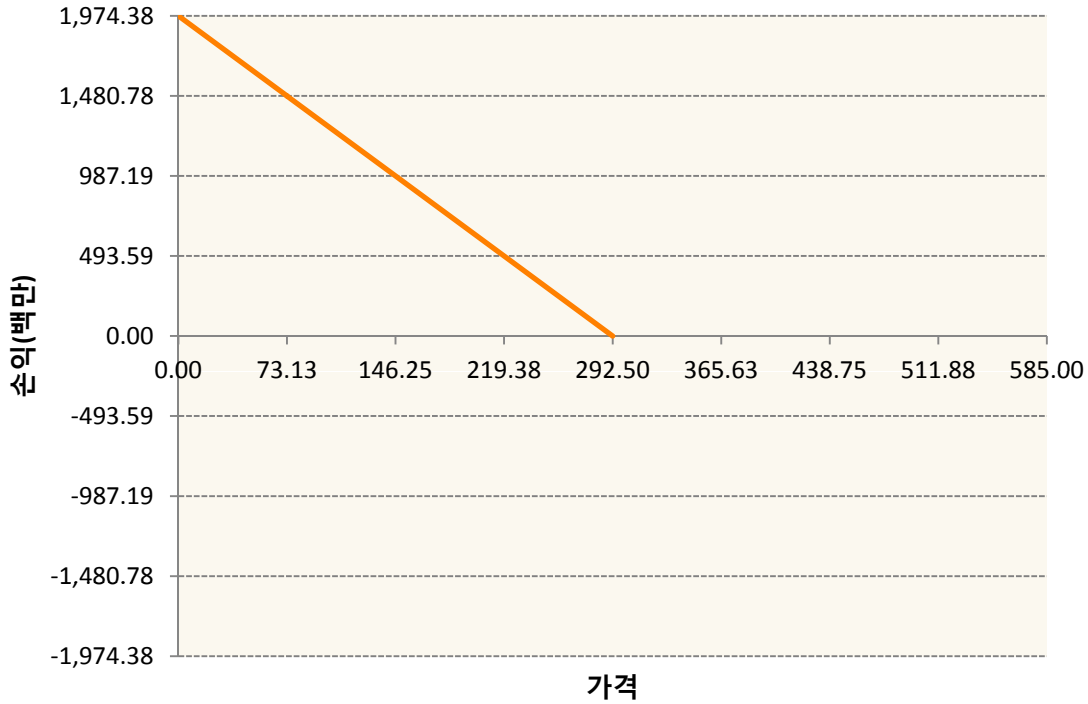


KR4301NA2901-2018-10 풋290





KR4301NA2927-2018-10 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,097

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,097 | -1,097 | -1,097 | -1,097 | -1,097 | -1,097 | -1,097 |
| -5.33% | -731 | -731 | -731 | -731 | -731 | -731 | -731 |
| -2.67% | -366 | -366 | -366 | -366 | -366 | -366 | -366 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 366 | 366 | 366 | 366 | 366 | 366 | 366 |
| 5.33% | 731 | 731 | 731 | 731 | 731 | 731 | 731 |
| 8.00% | 1,097 | 1,097 | 1,097 | 1,097 | 1,097 | 1,097 | 1,097 |

KR4201NA3(2018-10 콜305) 162

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 |
| -5.33% | 9 | 9 | 9 | 9 | 9 | 8 | 8 |
| -2.67% | 9 | 9 | 8 | 7 | 6 | 5 | 4 |

| | | | | | | | |
|-------|------|------|------|------|------|------|------|
| 0% | 6 | 5 | 2 | 0 | -3 | -6 | -9 |
| 2.67% | -10 | -14 | -19 | -23 | -28 | -33 | -38 |
| 5.33% | -57 | -62 | -67 | -73 | -78 | -83 | -89 |
| 8.00% | -140 | -143 | -146 | -150 | -154 | -158 | -162 |

KR4201NA3(2018-10 콜307.5

657

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 | 27 |
| -5.33% | 27 | 27 | 27 | 27 | 26 | 25 | 24 |
| -2.67% | 27 | 26 | 25 | 23 | 20 | 16 | 10 |
| 0% | 21 | 15 | 9 | 0 | -10 | -21 | -34 |
| 2.67% | -26 | -43 | -61 | -81 | -100 | -121 | -142 |
| 5.33% | -195 | -220 | -245 | -270 | -296 | -321 | -346 |
| 8.00% | -535 | -553 | -572 | -593 | -614 | -635 | -657 |

KR4301NA2(2018-10 풋290

10

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| -5.33% | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 |
| -2.67% | 2 | 2 | 2 | 3 | 3 | 3 | 3 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 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 |

KR4301NA2(2018-10 풋292.5

146

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 146 | 146 | 146 | 146 | 146 | 146 | 146 |
| -5.33% | 93 | 93 | 93 | 93 | 93 | 93 | 93 |
| -2.67% | 41 | 41 | 41 | 42 | 42 | 42 | 43 |
| 0% | -3 | -2 | -1 | 0 | 1 | 2 | 3 |
| 2.67% | -16 | -16 | -16 | -15 | -15 | -14 | -13 |
| 5.33% | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -16 | -16 |
| 8.00% | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 |

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

(단위:백만원)

1,465

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

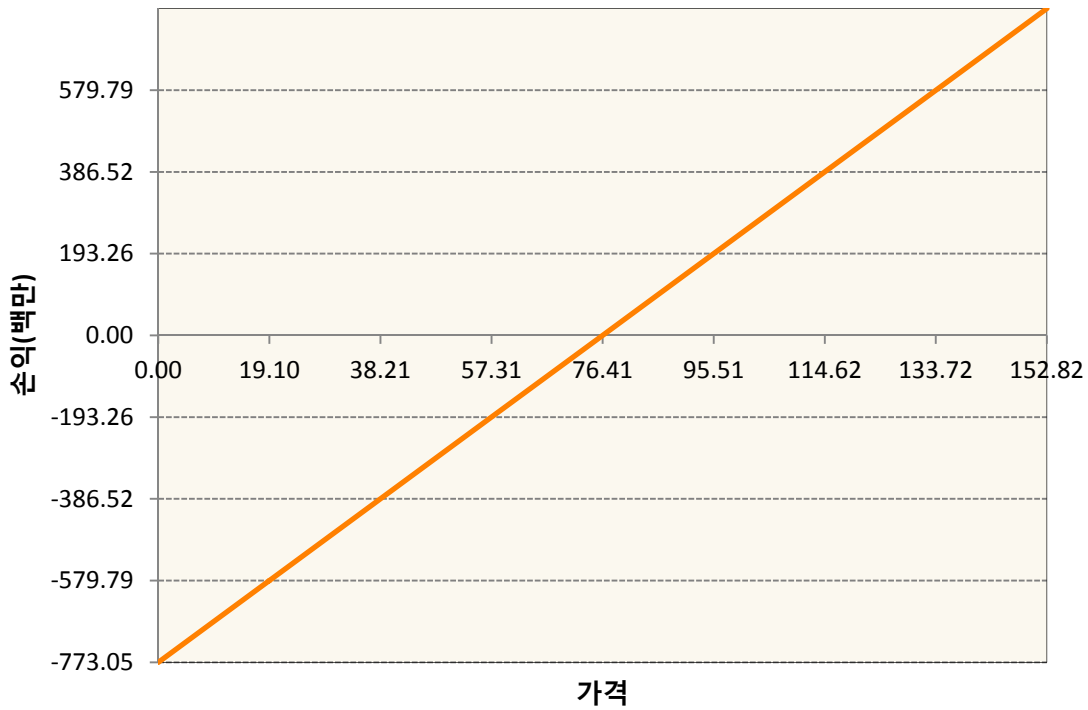
1. 계약금액

(단위:백만원)

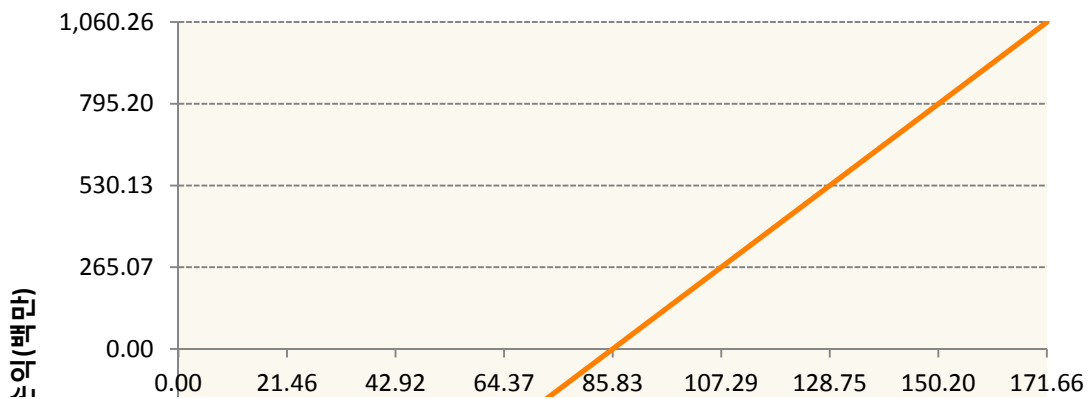
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,390 | 621 | 2,769 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 460 | 0 | 460 | 장내 |

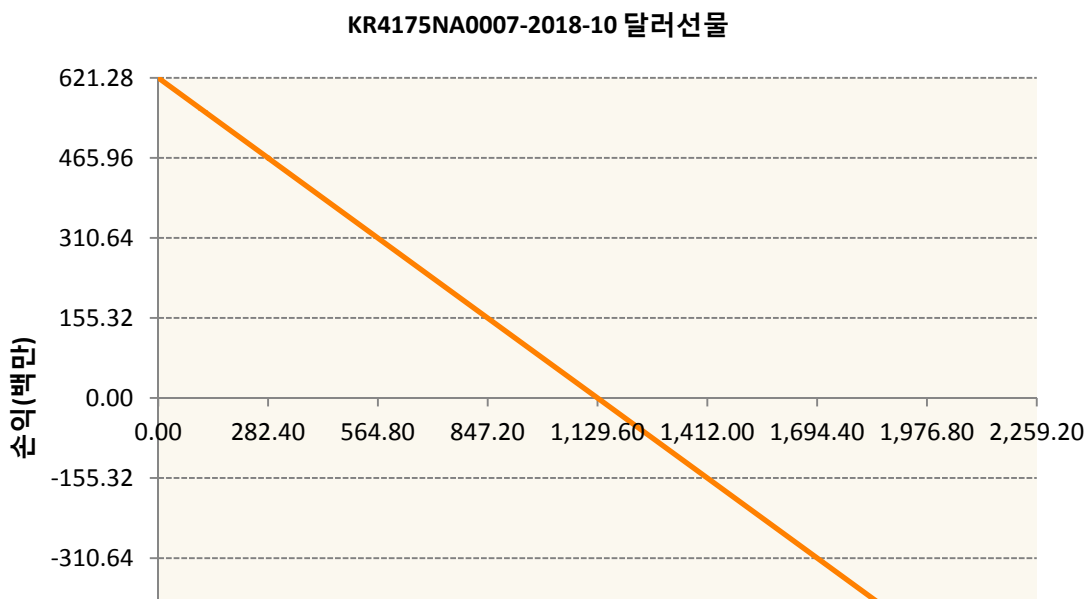
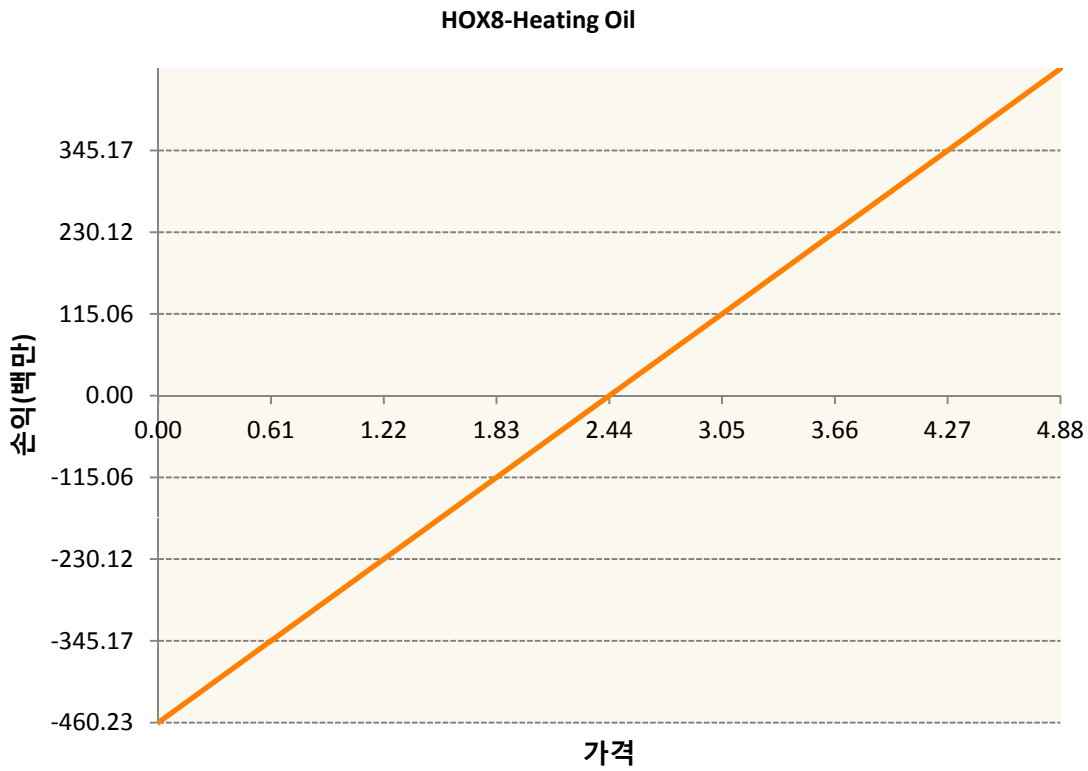
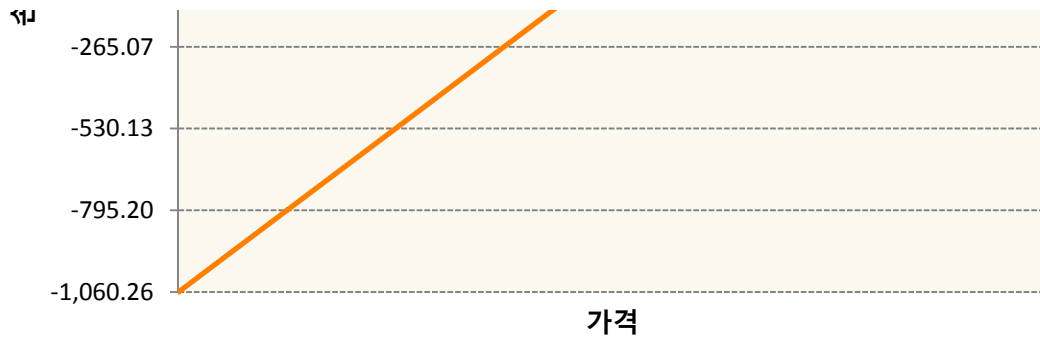
2. 만기시점의 손익구조

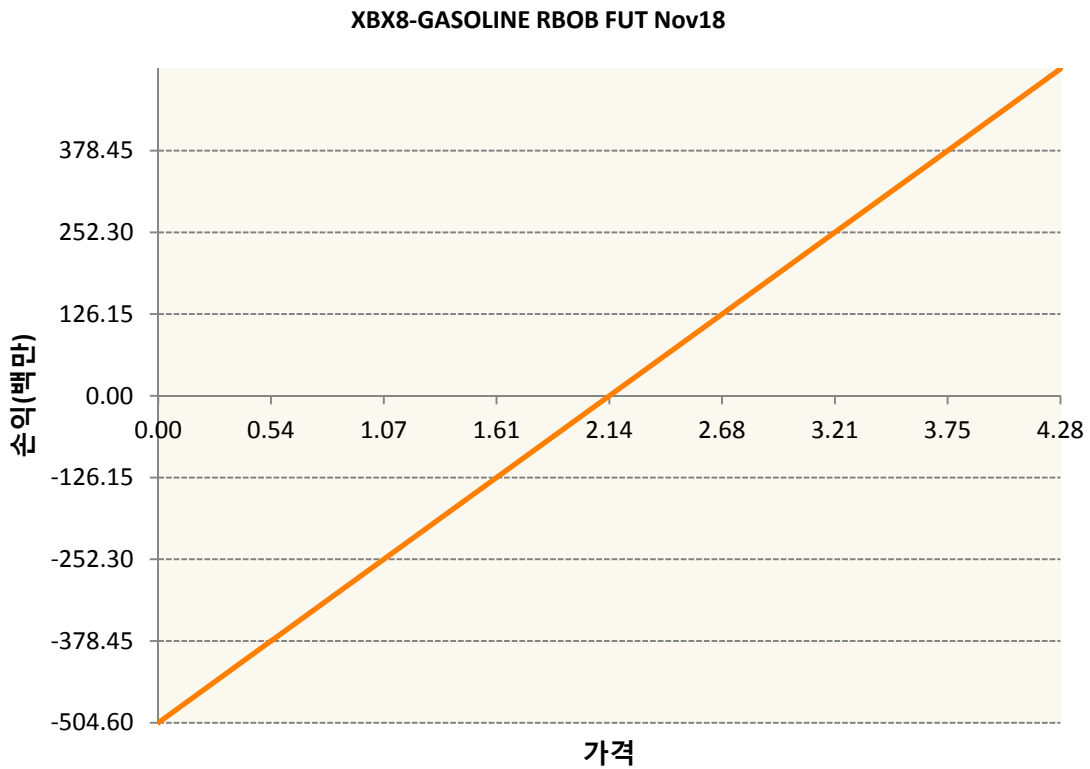
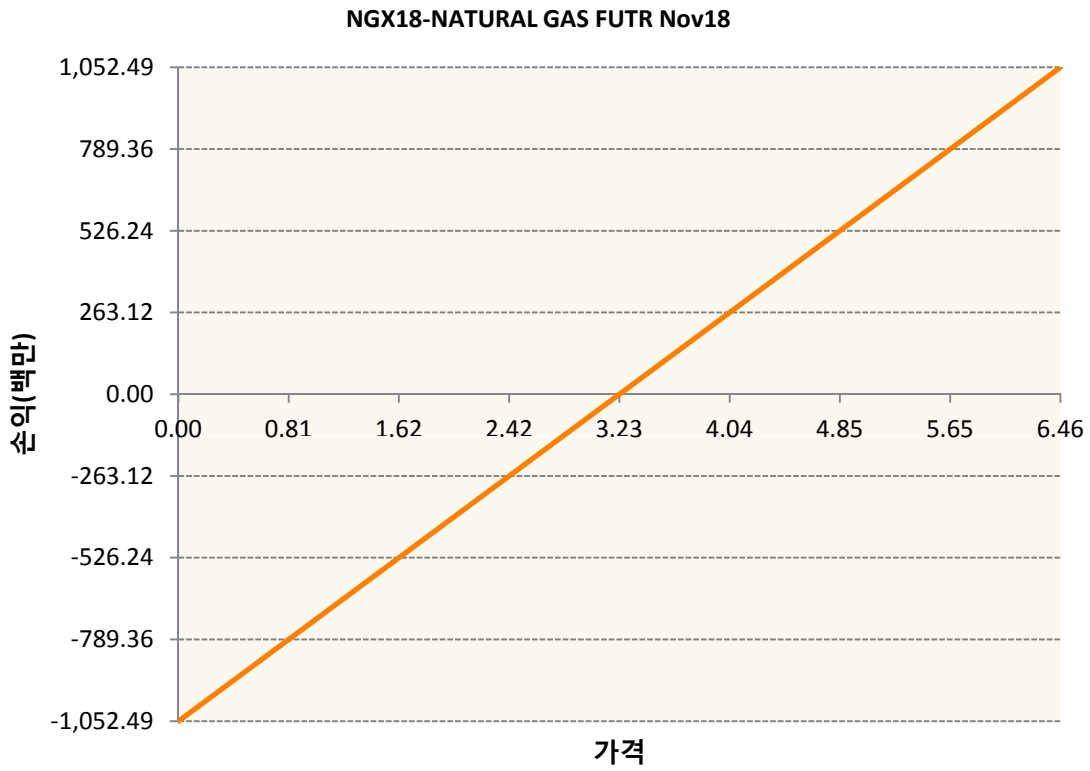
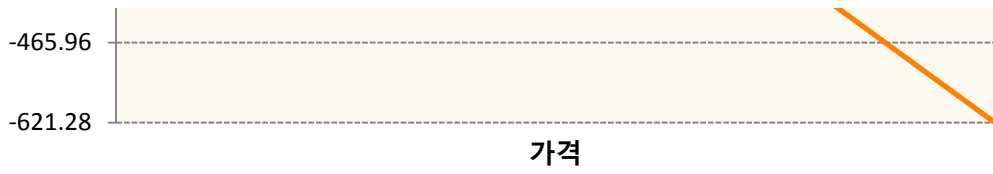
CLX8-WTI CRUDE FUTURE Nov18



COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19







| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| CLX8 | WTI CRUDE FUTURE Nov18 | 62 |
| COF9 | BRENT CRUDE FUTR JAN19 | 85 |
| HOX8 | Heating Oil | 37 |
| | KR4175NA0(2018-10 달러선물 | 50 |
| NGX18 | NATURAL GAS FUTR Nov18 | 84 |
| XBX8 | GASOLINE RBOB FUT Nov18 | 40 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 464 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-05 |
| 기준일 | 2018-10-04 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

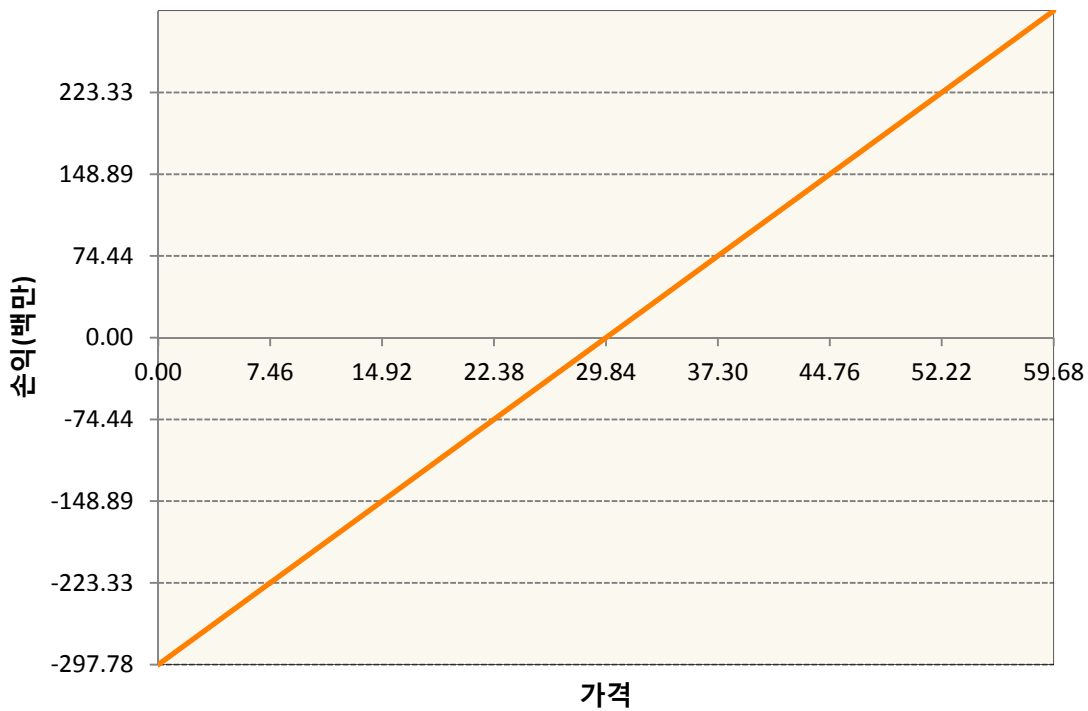
1. 계약금액

(단위:백만원)

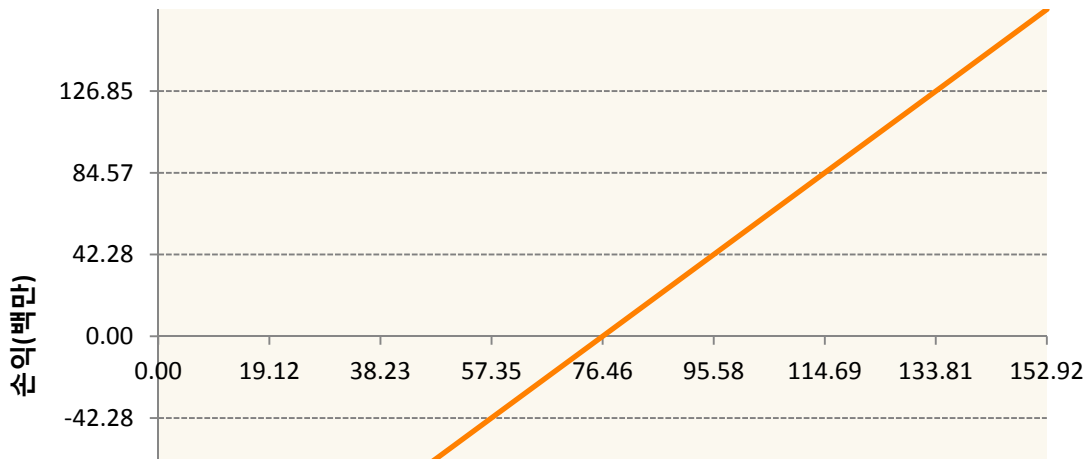
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,566 | 79 | 3,487 | |

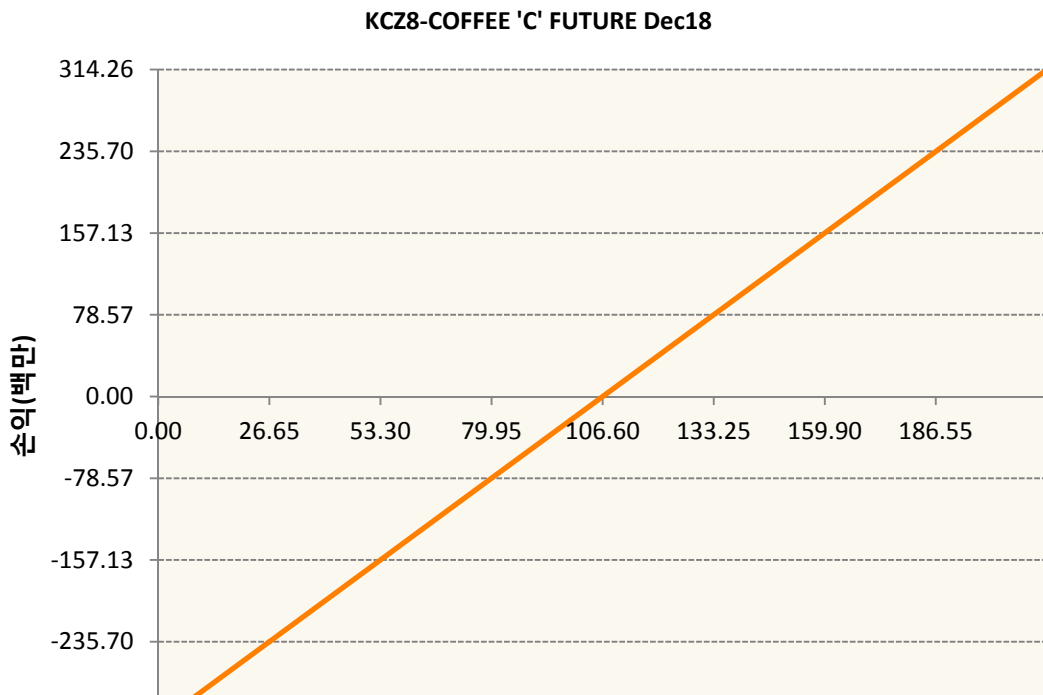
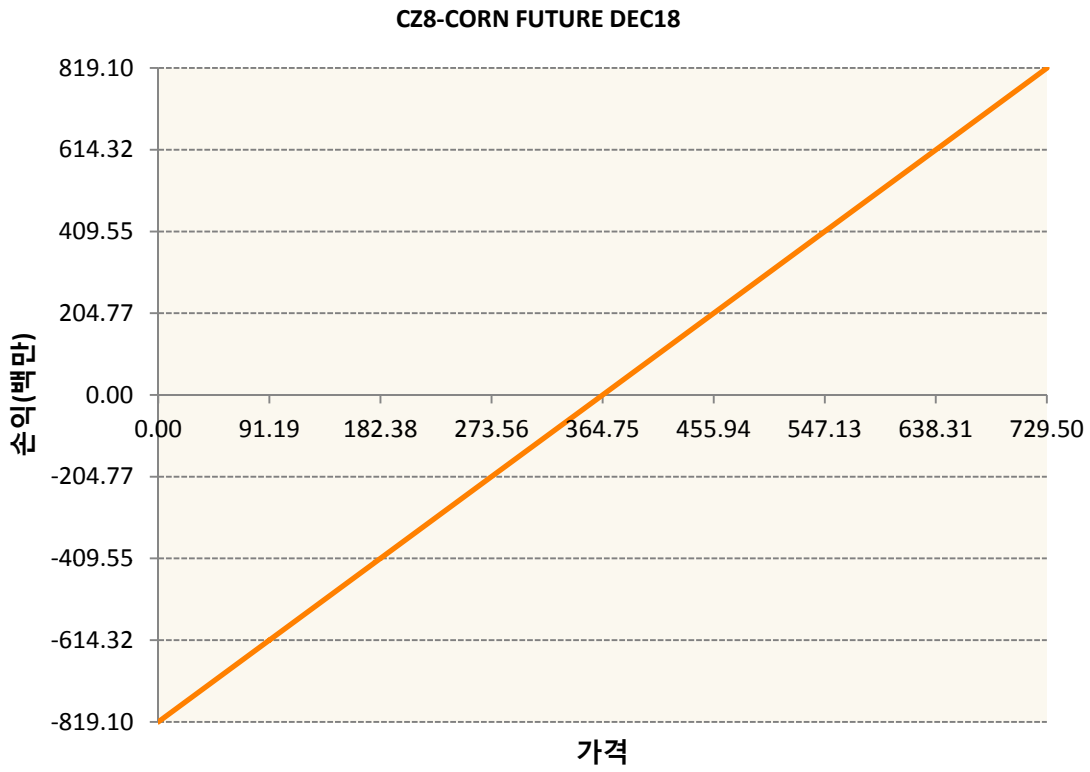
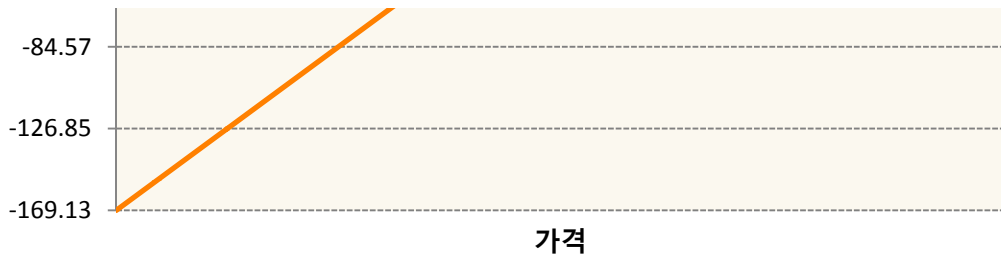
2. 만기시점의 손익구조

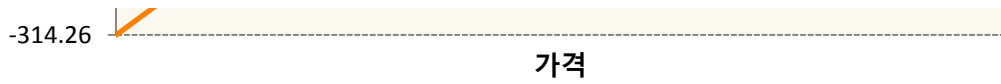
BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18



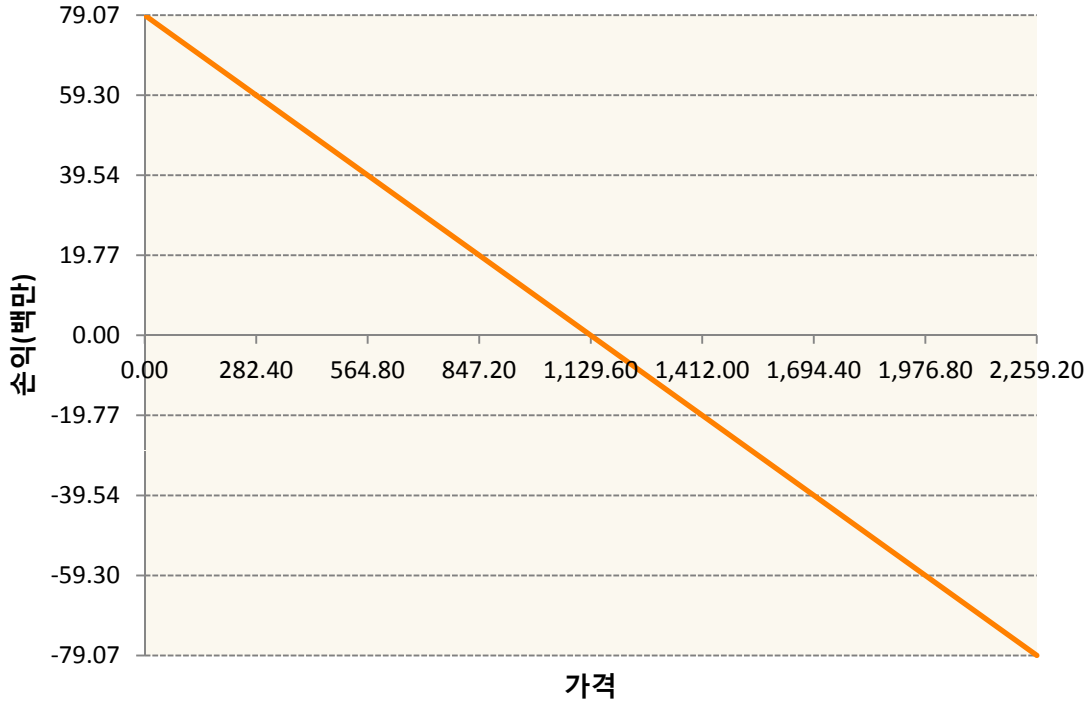
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



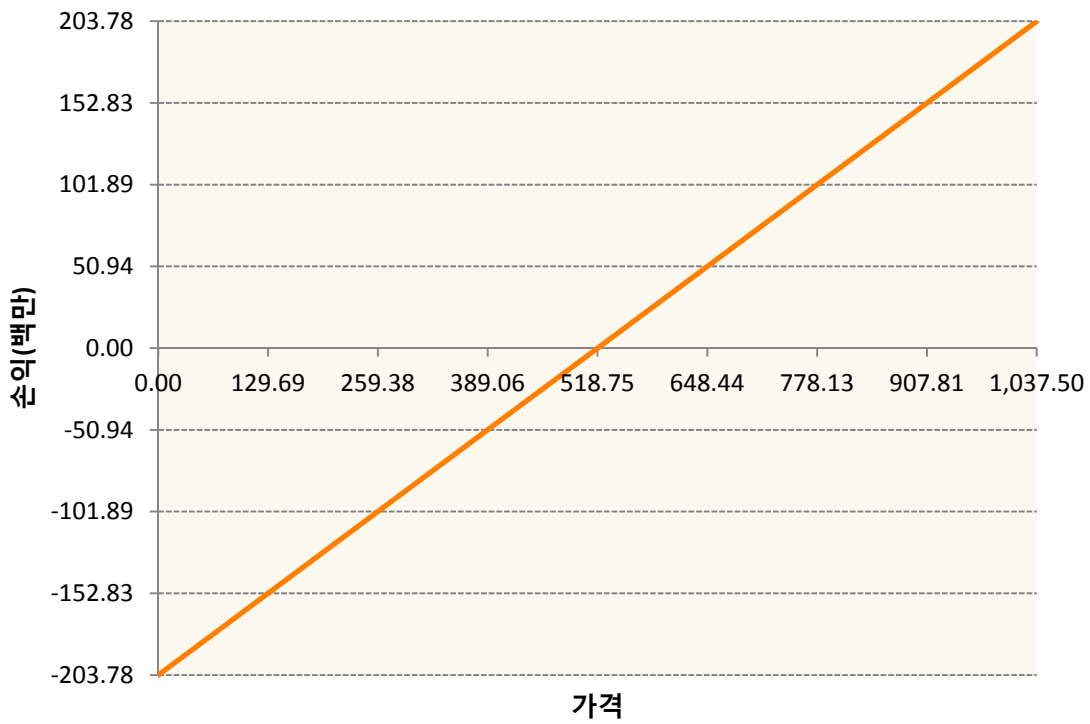




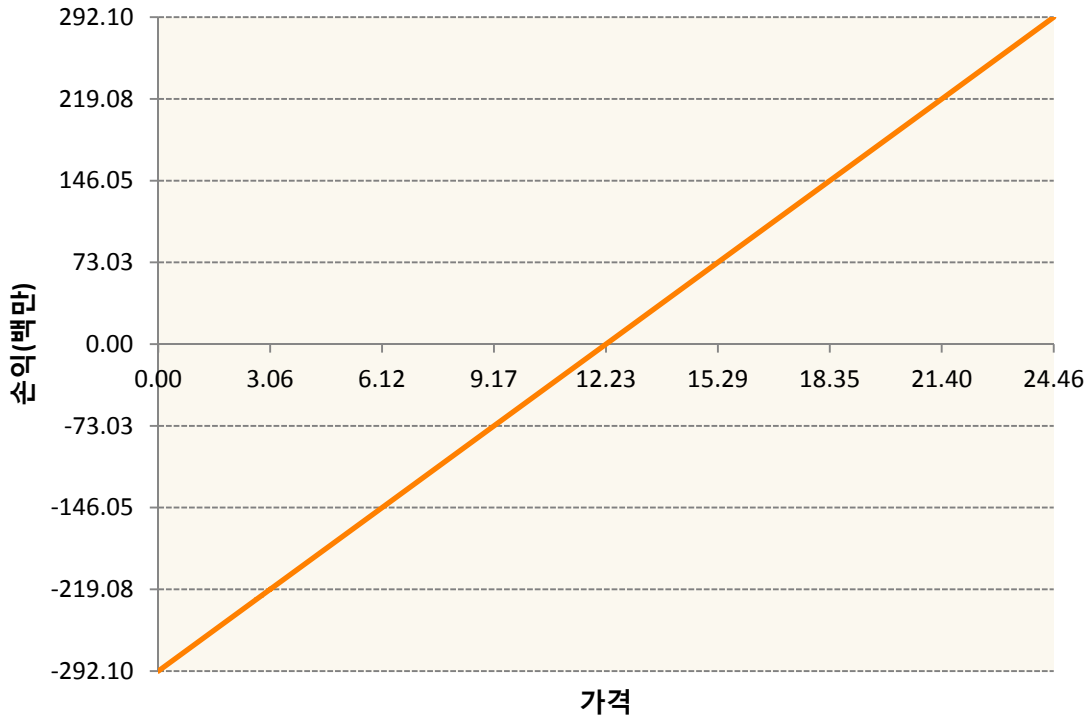
KR4175NA0007-2018-10 달러선물



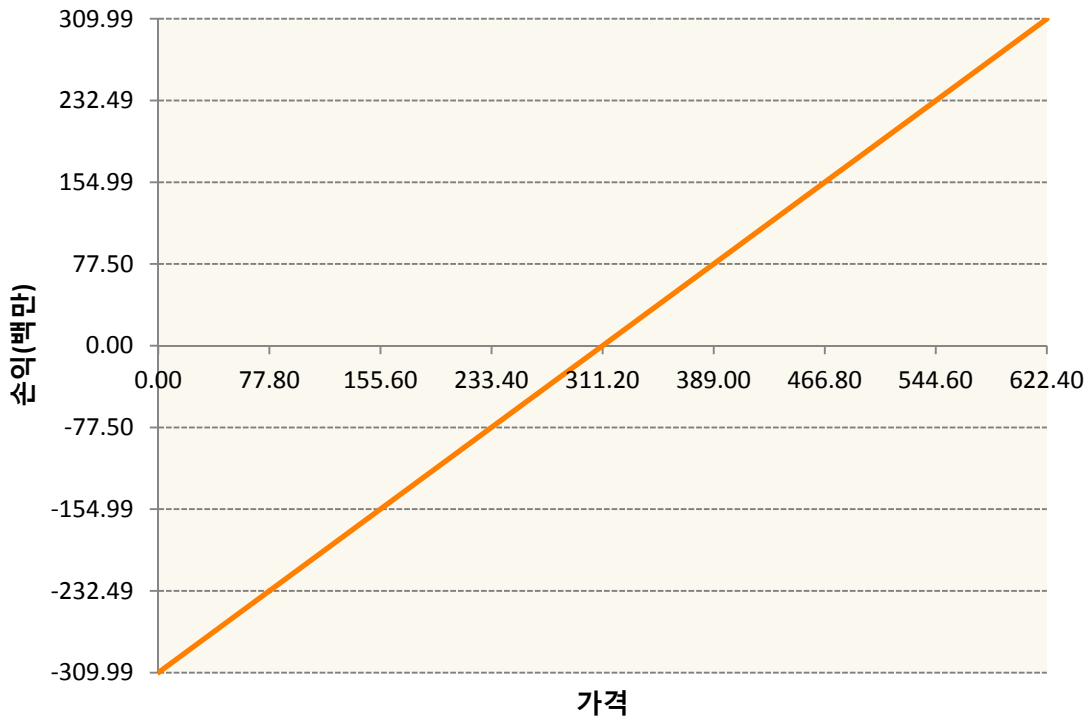
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



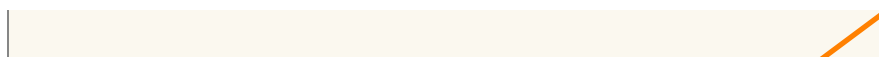
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

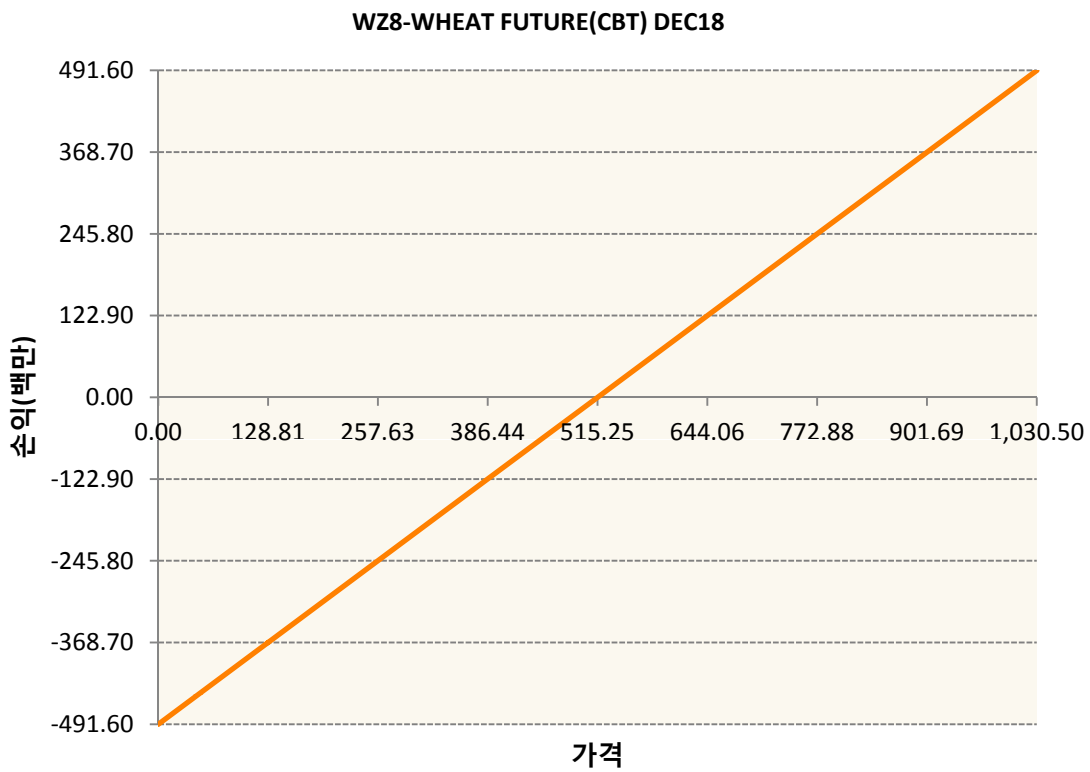
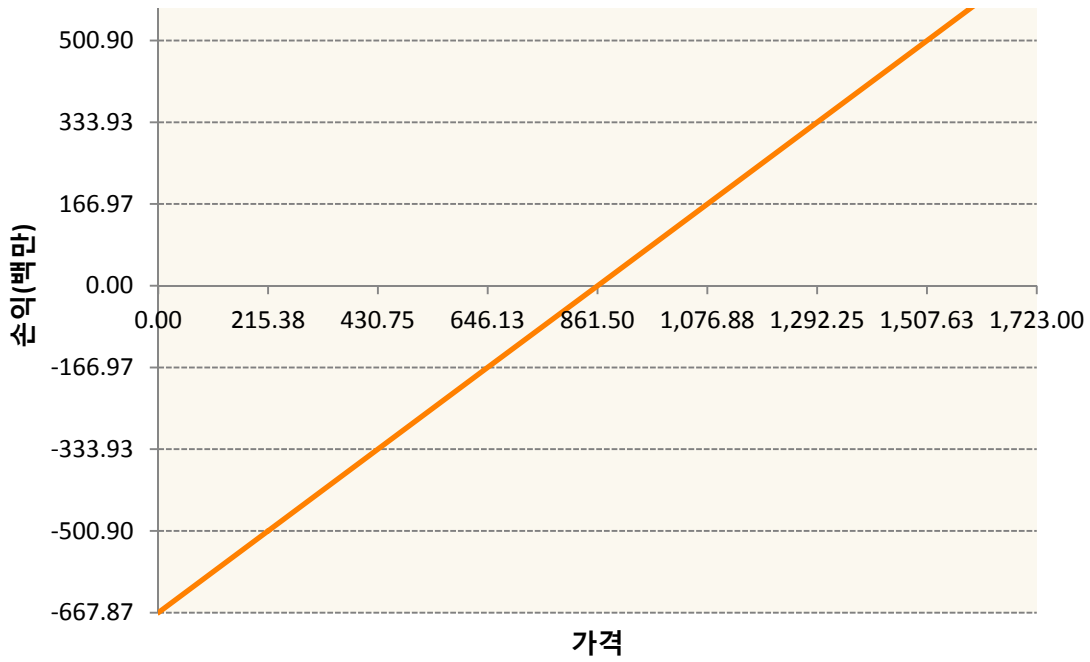


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| BOZ8 | SOYBEAN OIL FUTR DEC18 | 24 |
| CTZ8 | COTTON NO.2 FUTR DEC18 | 14 |
| CZ8 | CORN FUTURE DEC18 | 66 |
| KCZ8 | COFFEE 'C' FUTURE Dec18 | 25 |
| KR4175NA0 | (2018-10 달러선물 | 6 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWZ8 | KC HRW WHEAT FUT DEC18 | 16 |
| SBH9 | SUGAR #11 (WORLD) MAR19 | 23 |
| SMZ8 | SOYBEAN MEAL FUTR DEC18 | 25 |
| SX8 | SOYBEAN FUTURE NOV18 | 53 |
| WZ8 | WHEAT FUTURE(CBT) DEC18 | 39 |

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

(단위:백만원)

311