

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

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)

66

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

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

1,081

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

490

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

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

| |
|-----|
| 257 |
|-----|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|-----|
| 361 |
|-----|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

유로인덱스모(주식-파생형)

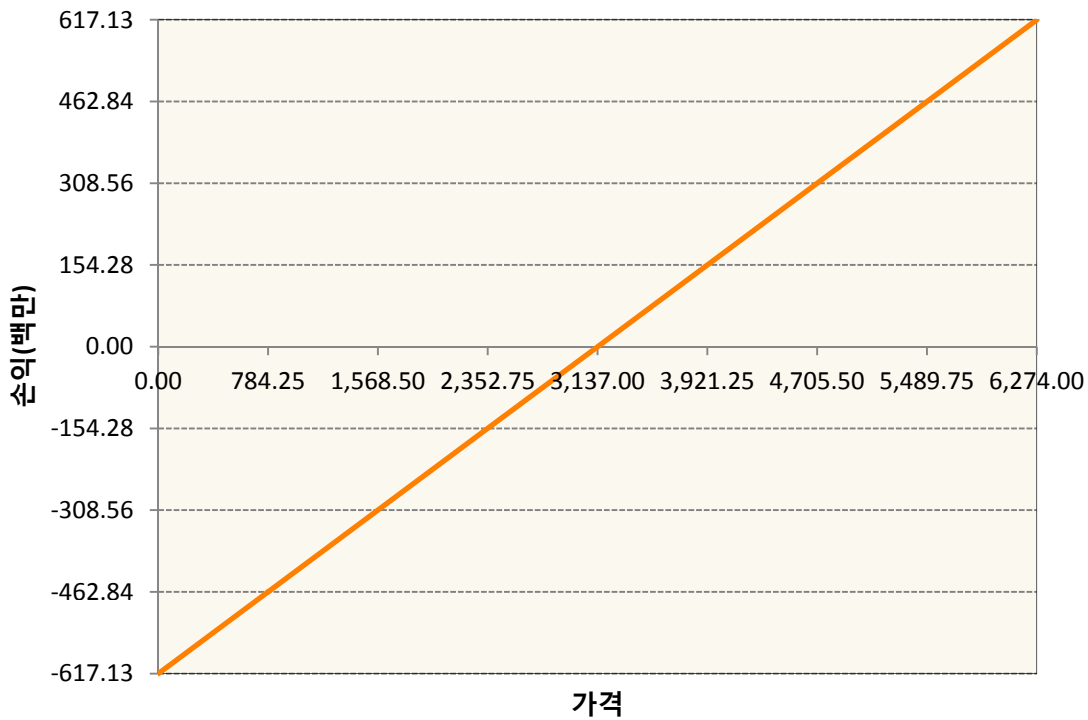
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 617 | 0 | 617 | |

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGZ8 | EURO STOXX 50 DEC18 | 49 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

| |
|----|
| 31 |
|----|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

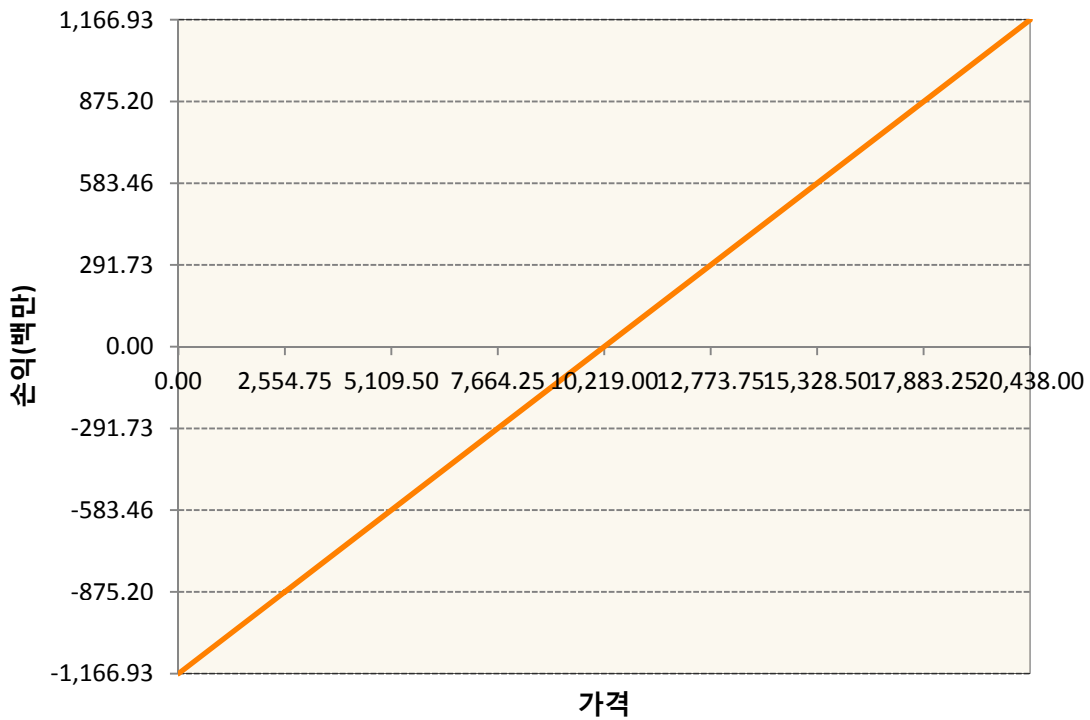
1. 계약금액

(단위:백만원)

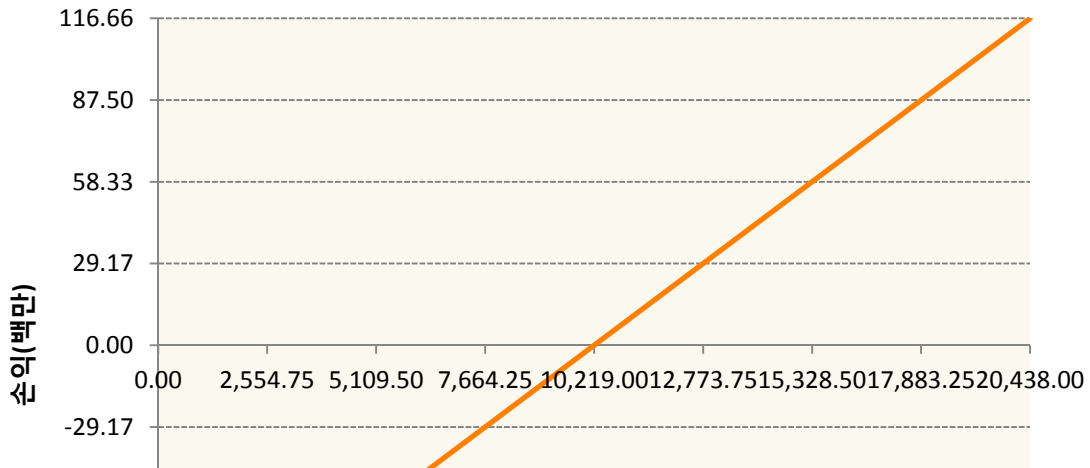
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,284 | 0 | 1,284 | 장내 |

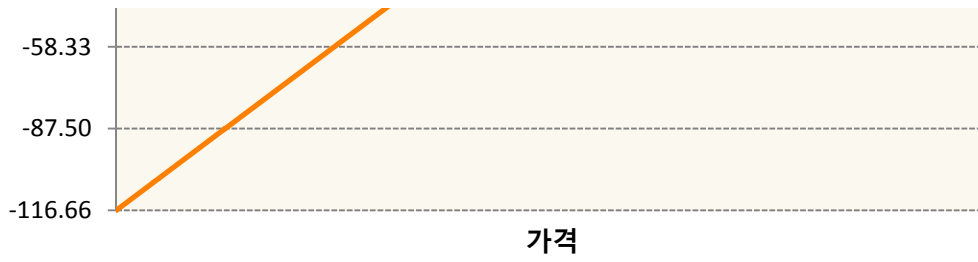
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



MHCV8-MINI H-SHR IDX FU OCT 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|--------------------------|----|
| HCV8 | HSCEI FUTURES OCT 18 | 93 |
| MHCV8 | MINI H-SHR IDX FU OCT 18 | 9 |

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

| |
|-----------|
| 99 |
|-----------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

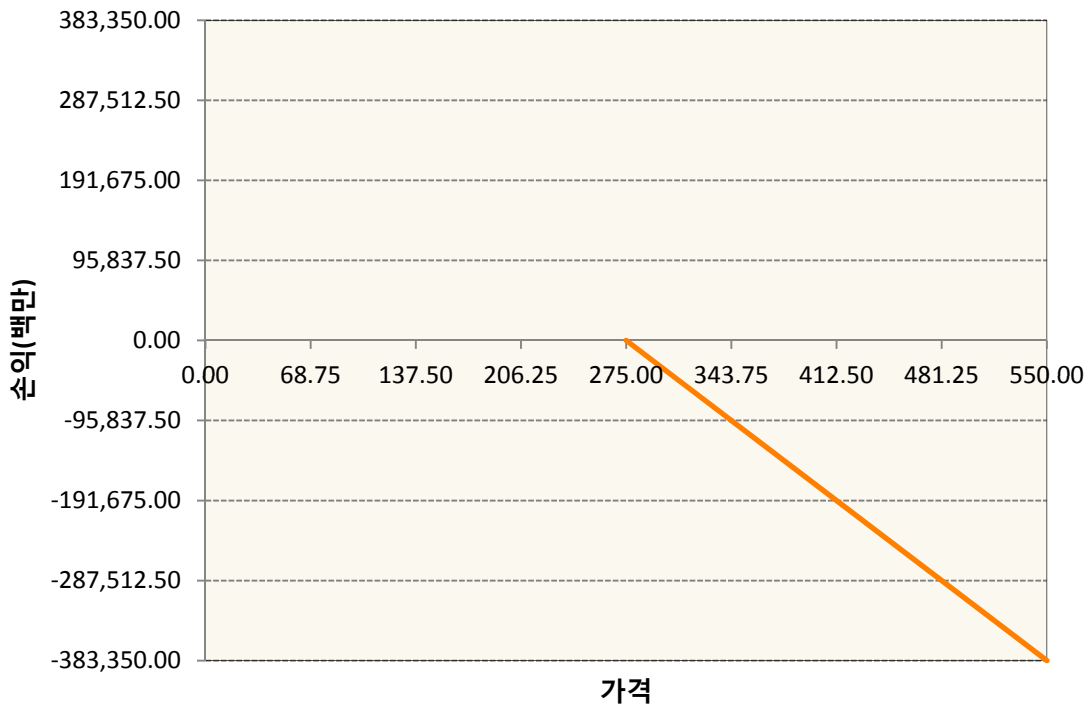
1. 계약금액

(단위:백만원)

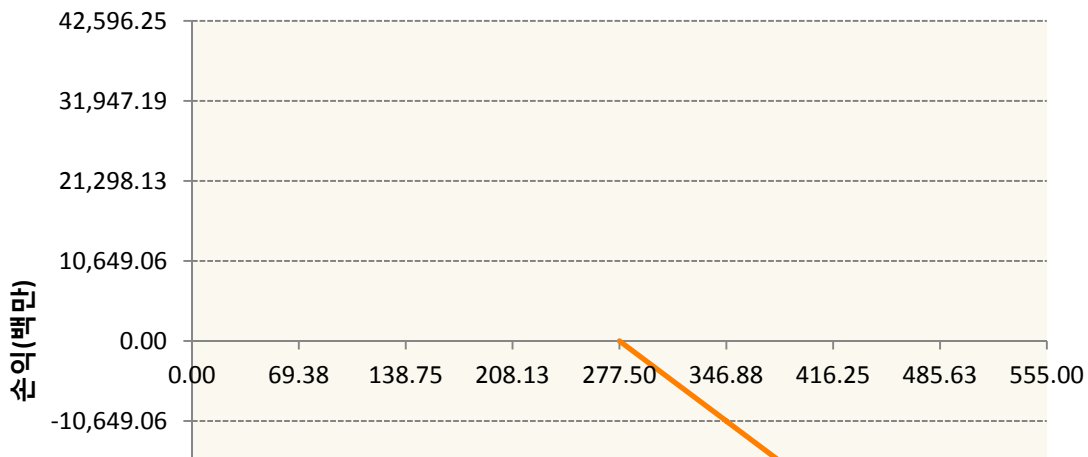
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 7,005 | -7,005 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 721,571 | -721,571 | 장내 |

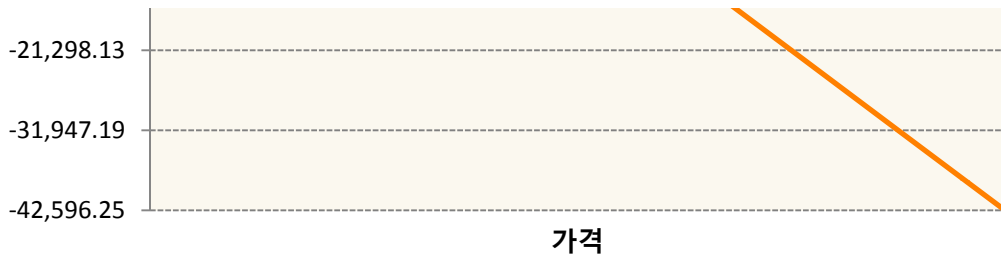
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

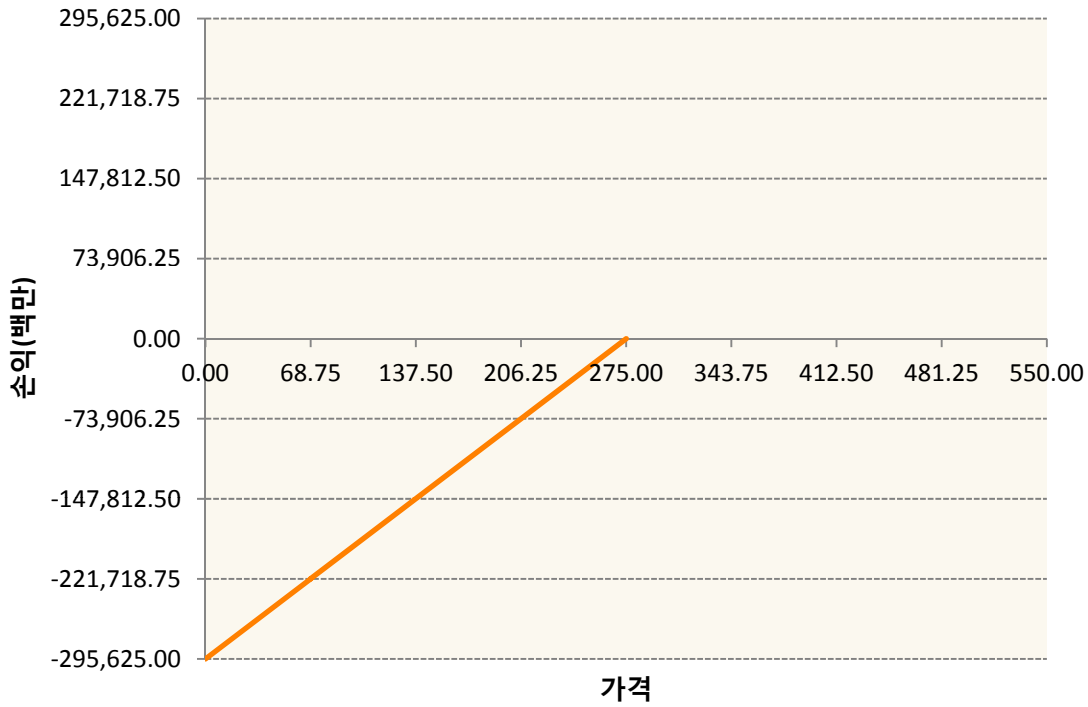


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

21,686

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 6,015 | 5,957 | 5,868 | 5,742 | 5,580 | 5,382 | 5,149 |
| -5.33% | 5,748 | 5,547 | 5,297 | 5,002 | 4,667 | 4,296 | 3,894 |
| -2.67% | 4,715 | 4,267 | 3,783 | 3,269 | 2,732 | 2,175 | 1,603 |
| 0% | 2,013 | 1,347 | 676 | 0 | -679 | -1,361 | -2,045 |
| 2.67% | -3,084 | -3,762 | -4,444 | -5,131 | -5,821 | -6,513 | -7,207 |
| 5.33% | -10,505 | -10,991 | -11,512 | -12,062 | -12,634 | -13,225 | -13,831 |
| 8.00% | -19,491 | -19,743 | -20,049 | -20,402 | -20,796 | -21,225 | -21,686 |

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

2,222

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 526 | 522 | 516 | 506 | 492 | 475 | 454 |

| | | | | | | | |
|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -5.33% | 509 | 493 | 472 | 446 | 416 | 381 | 343 |
| -2.67% | 432 | 392 | 347 | 298 | 245 | 190 | 132 |
| 0% | 207 | 140 | 71 | 0 | -72 | -144 | -217 |
| 2.67% | -259 | -337 | -415 | -493 | -571 | -649 | -728 |
| 5.33% | -994 | -1,057 | -1,122 | -1,190 | -1,260 | -1,331 | -1,403 |
| 8.00% | -1,933 | -1,969 | -2,012 | -2,059 | -2,110 | -2,165 | -2,222 |

KR4301NB27 2018-11 풋275

20,592

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -20,475 | -20,478 | -20,484 | -20,496 | -20,517 | -20,548 | -20,592 |
| -5.33% | -12,729 | -12,760 | -12,809 | -12,878 | -12,967 | -13,076 | -13,204 |
| -2.67% | -5,246 | -5,403 | -5,587 | -5,794 | -6,020 | -6,263 | -6,521 |
| 0% | 1,049 | 705 | 355 | 0 | -358 | -720 | -1,083 |
| 2.67% | 4,917 | 4,566 | 4,208 | 3,846 | 3,481 | 3,114 | 2,744 |
| 5.33% | 6,412 | 6,234 | 6,030 | 5,802 | 5,555 | 5,291 | 5,013 |
| 8.00% | 6,748 | 6,701 | 6,632 | 6,540 | 6,425 | 6,288 | 6,130 |

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

(단위:백만원)

46,152

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

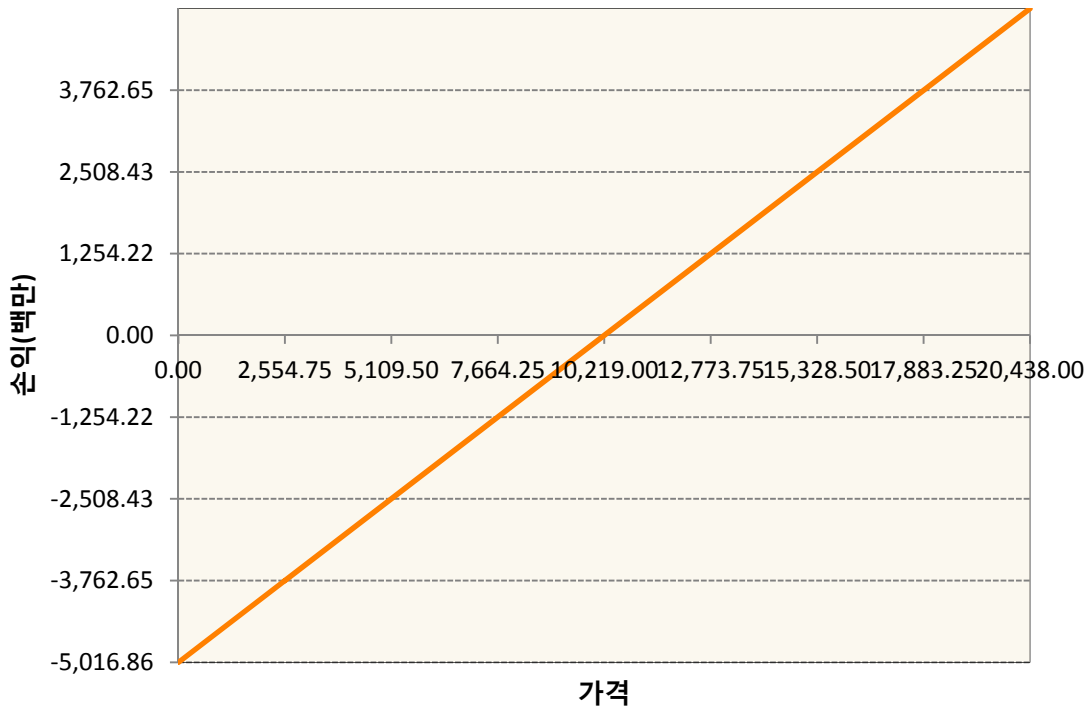
1. 계약금액

(단위:백만원)

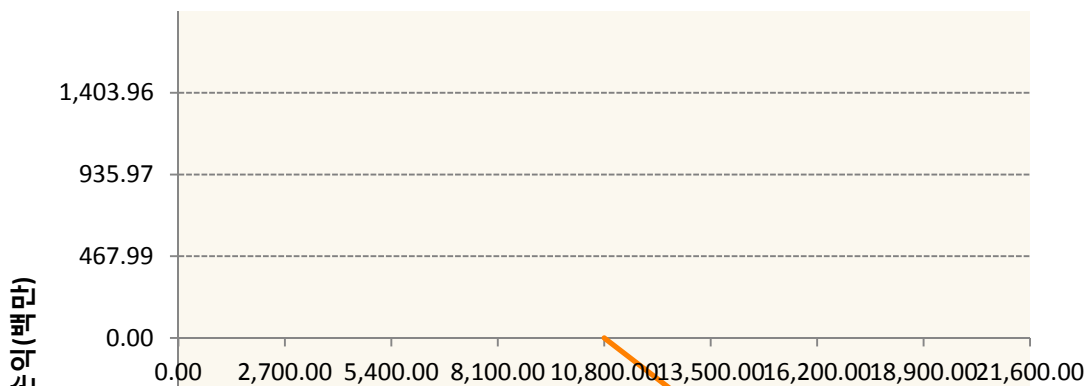
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,017 | 0 | 5,017 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 12,165 | -12,165 | 장내 |

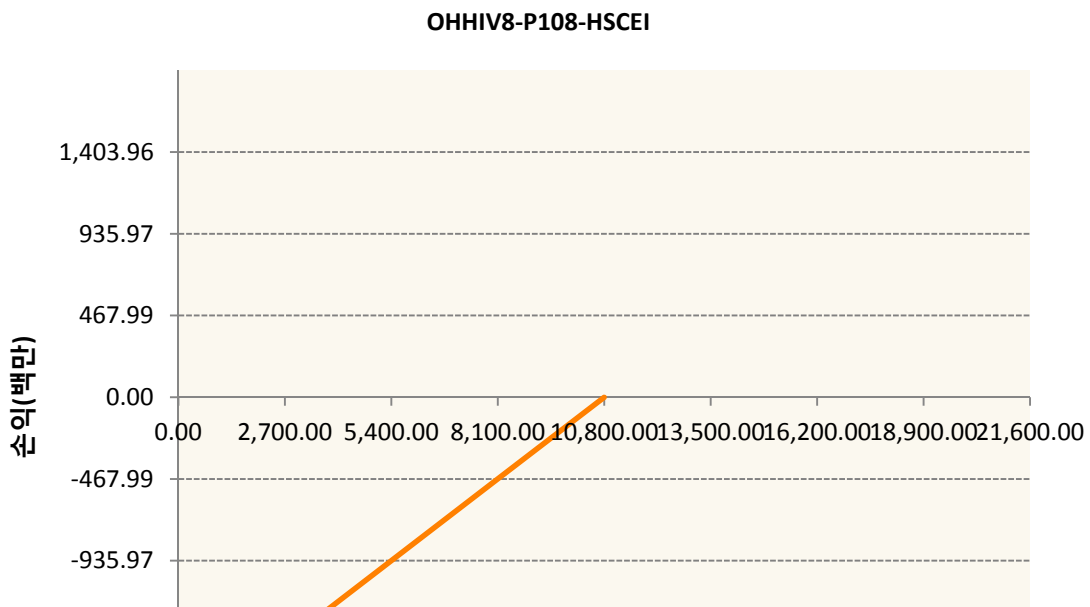
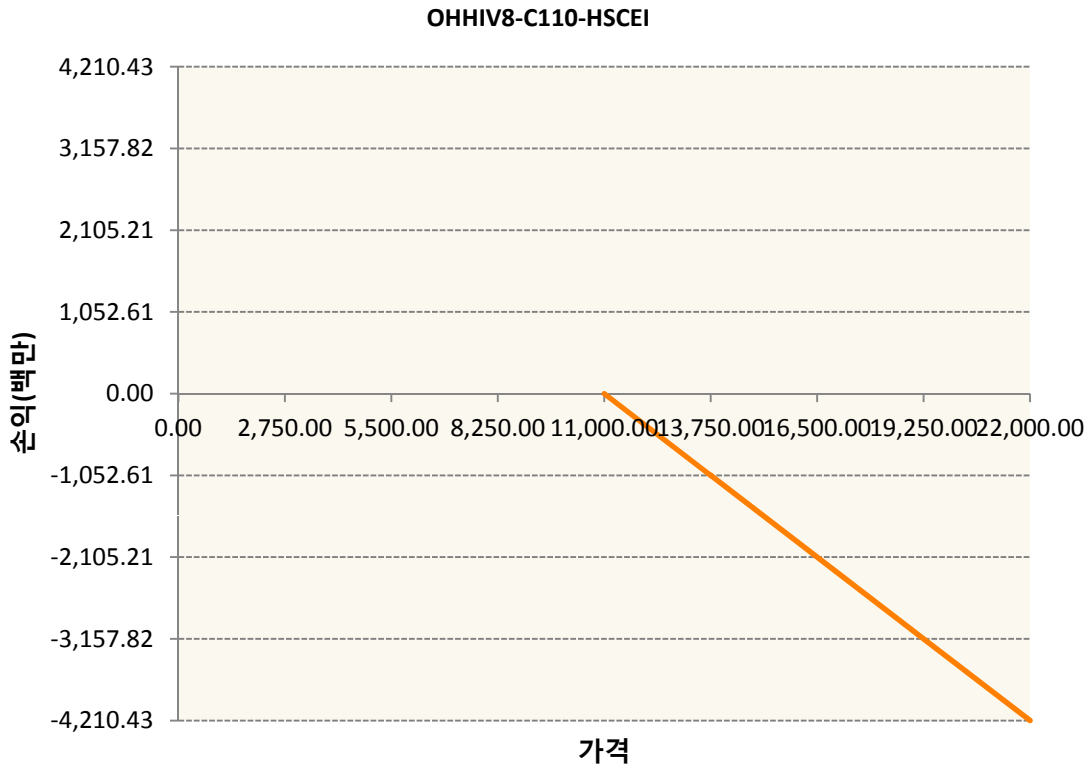
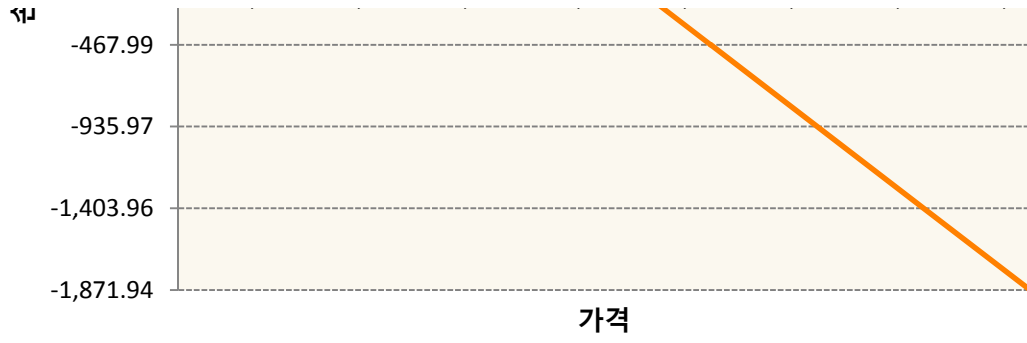
2. 만기시점의 손익구조

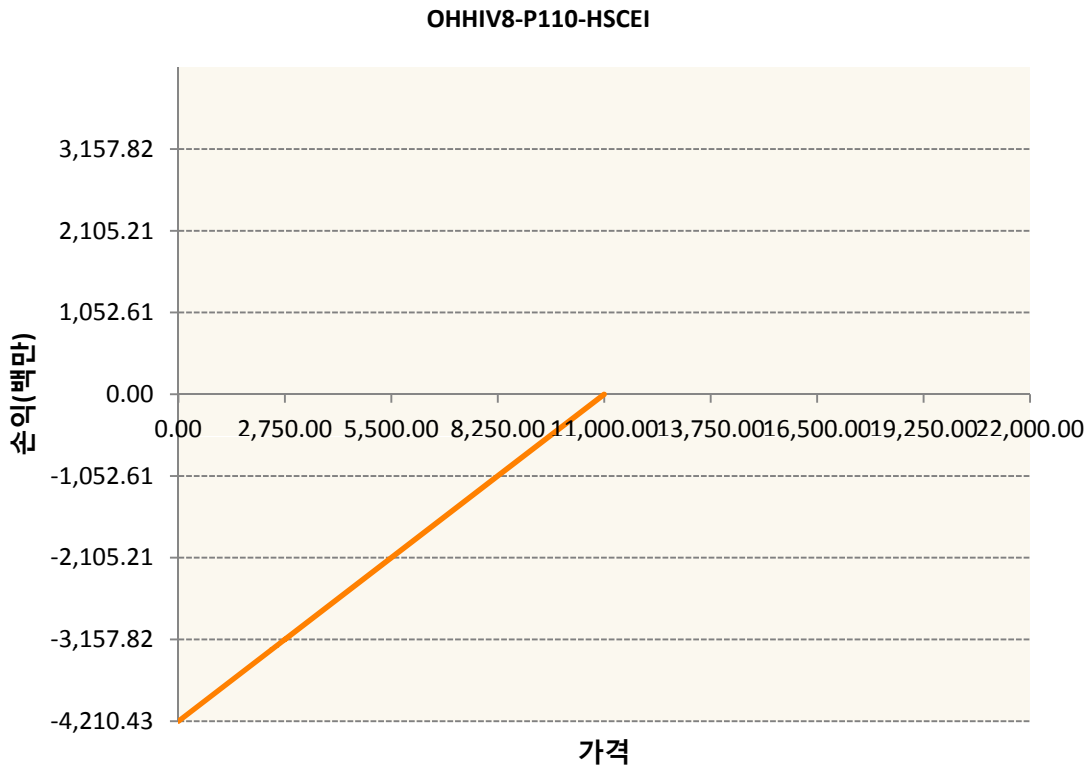
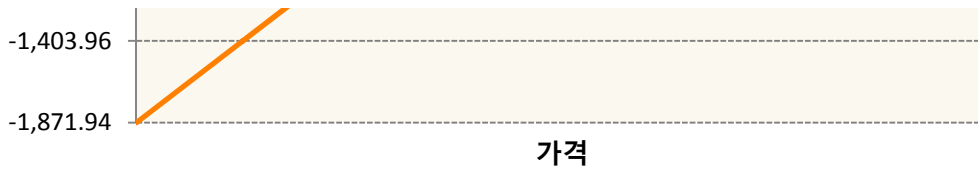
HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18



OHHIV8-C108-HSCEI







| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|----------------------|----------|
| HCV8 | HSCEI FUTURES OCT 18 | 401 |
| OHHIV8-C1 | HSCEI | 150 |
| OHHIV8-C11 | HSCEI | 337 |
| OHHIV8-P1C | HSCEI | 150 |
| OHHIV8-P11 | HSCEI | 337 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|--------------|
| | 1,332 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

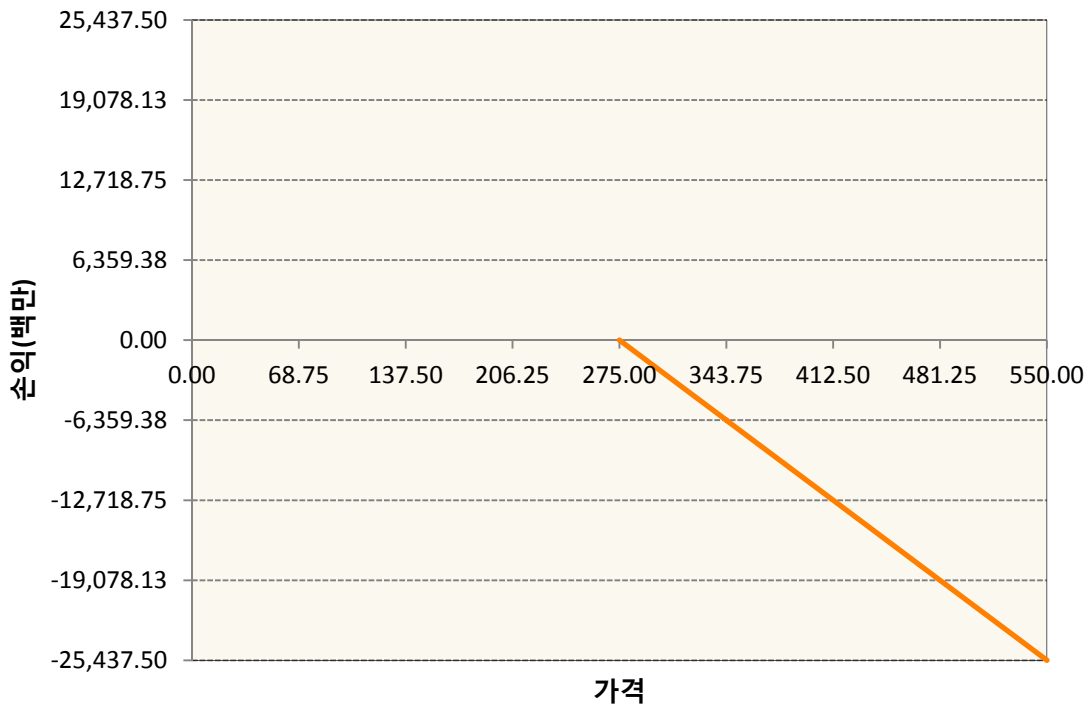
1. 계약금액

(단위:백만원)

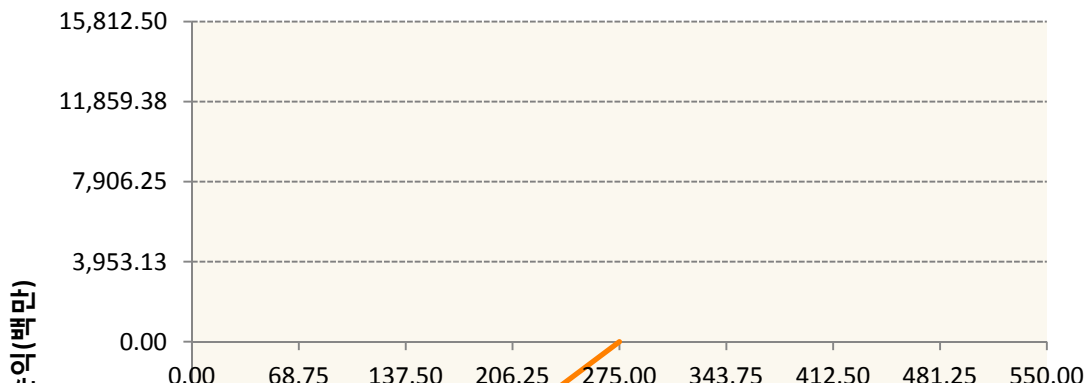
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 48,836 | 0 | 48,836 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 44,025 | -44,025 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

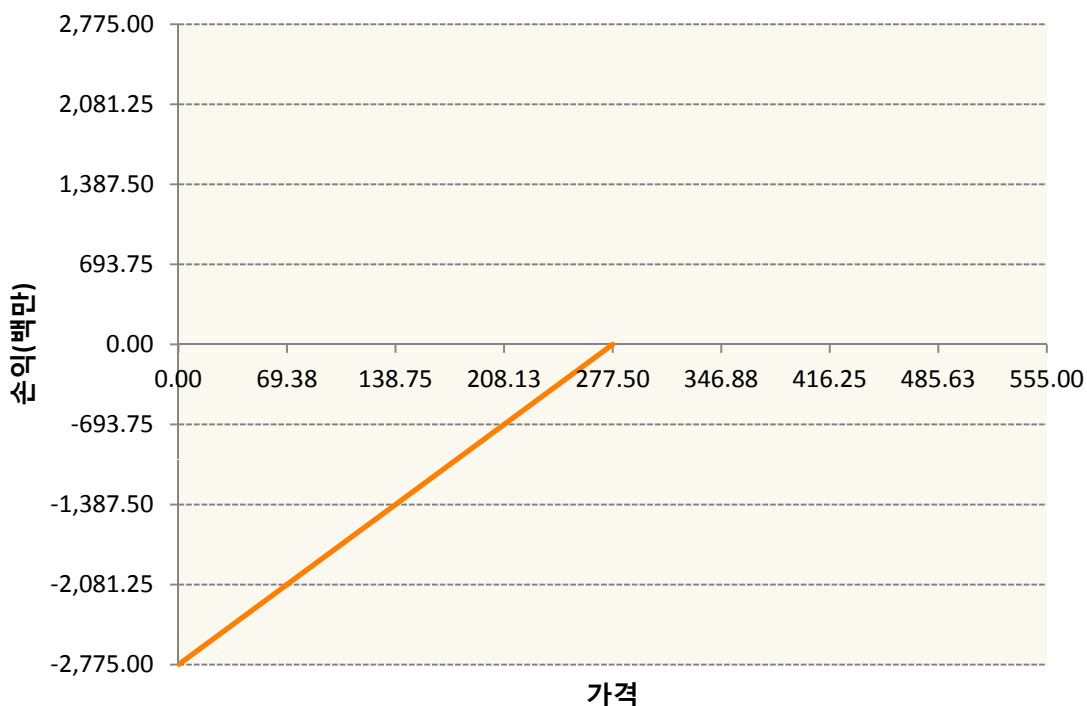


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | | |
|-----------------------------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--|
| 2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_14 | | | | | | | 4,010 | |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -4,010 | -4,010 | -4,010 | -4,010 | -4,010 | -4,010 | -4,010 | |
| -5.33% | -2,674 | -2,674 | -2,674 | -2,674 | -2,674 | -2,674 | -2,674 | |
| -2.67% | -1,337 | -1,337 | -1,337 | -1,337 | -1,337 | -1,337 | -1,337 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 1,337 | 1,337 | 1,337 | 1,337 | 1,337 | 1,337 | 1,337 | |
| 5.33% | 2,674 | 2,674 | 2,674 | 2,674 | 2,674 | 2,674 | 2,674 | |
| 8.00% | 4,010 | 4,010 | 4,010 | 4,010 | 4,010 | 4,010 | 4,010 | |
| KR4201NB27 2018-11 콜275 | | | | | | | 1,439 | |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 399 | 395 | 389 | 381 | 370 | 357 | 342 |
| -5.33% | 381 | 368 | 352 | 332 | 310 | 285 | 258 |
| -2.67% | 313 | 283 | 251 | 217 | 181 | 144 | 106 |
| 0% | 134 | 89 | 45 | 0 | -45 | -90 | -136 |
| 2.67% | -205 | -250 | -295 | -340 | -386 | -432 | -478 |
| 5.33% | -697 | -729 | -764 | -800 | -838 | -878 | -918 |
| 8.00% | -1,293 | -1,310 | -1,330 | -1,354 | -1,380 | -1,408 | -1,439 |

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,101

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,095 | -1,095 | -1,096 | -1,096 | -1,097 | -1,099 | -1,101 |
| -5.33% | -681 | -683 | -685 | -689 | -694 | -699 | -706 |
| -2.67% | -281 | -289 | -299 | -310 | -322 | -335 | -349 |
| 0% | 56 | 38 | 19 | 0 | -19 | -38 | -58 |
| 2.67% | 263 | 244 | 225 | 206 | 186 | 167 | 147 |
| 5.33% | 343 | 333 | 323 | 310 | 297 | 283 | 268 |
| 8.00% | 361 | 358 | 355 | 350 | 344 | 336 | 328 |

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

199

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -198 | -198 | -198 | -198 | -199 | -199 | -199 |
| -5.33% | -126 | -126 | -127 | -127 | -127 | -128 | -129 |
| -2.67% | -55 | -56 | -57 | -59 | -60 | -62 | -64 |
| 0% | 8 | 6 | 3 | 0 | -3 | -6 | -9 |
| 2.67% | 53 | 49 | 46 | 42 | 39 | 35 | 32 |
| 5.33% | 74 | 71 | 69 | 66 | 63 | 60 | 57 |
| 8.00% | 79 | 79 | 78 | 76 | 75 | 73 | 71 |

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

(단위:백만원)

6,864

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

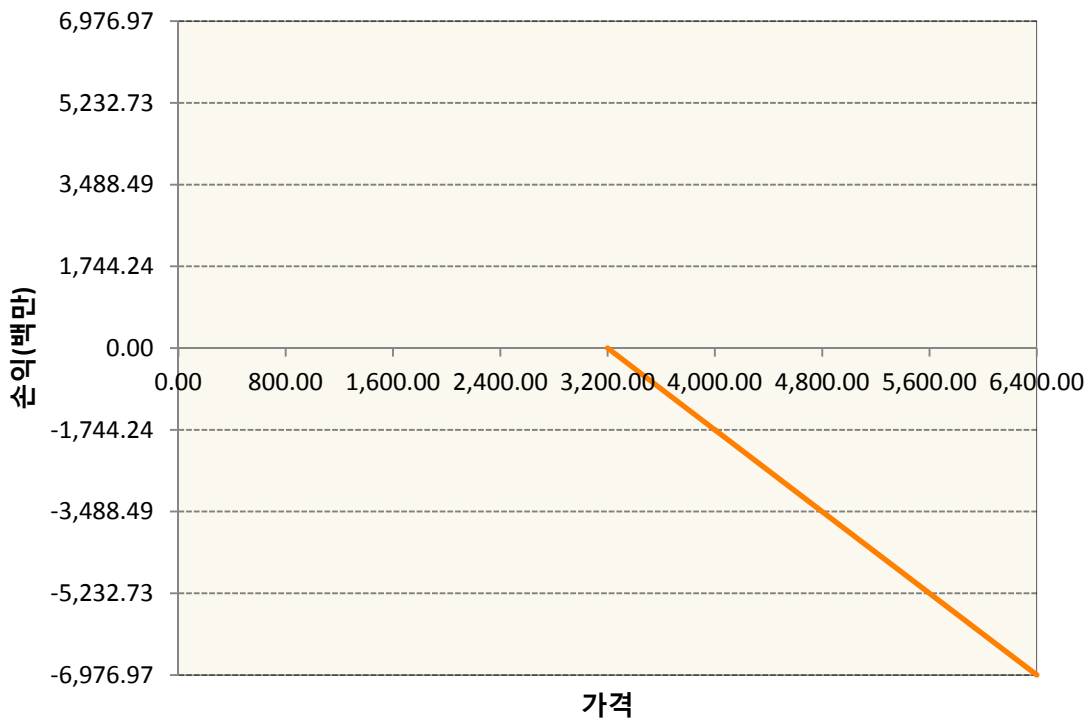
1. 계약금액

(단위:백만원)

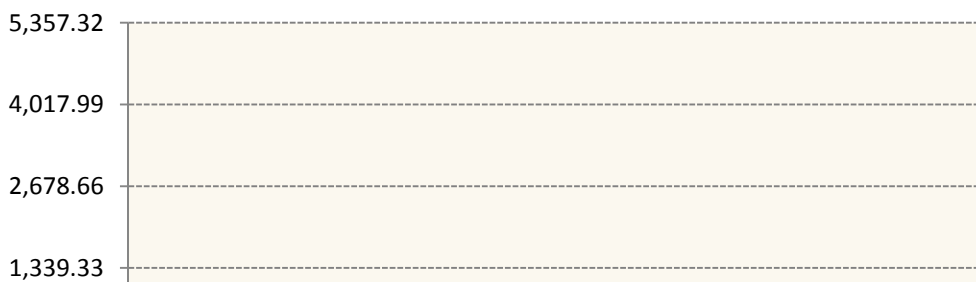
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,764 | 0 | 5,764 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 72,485 | 0 | 72,485 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 24,669 | -24,669 | 장내 |

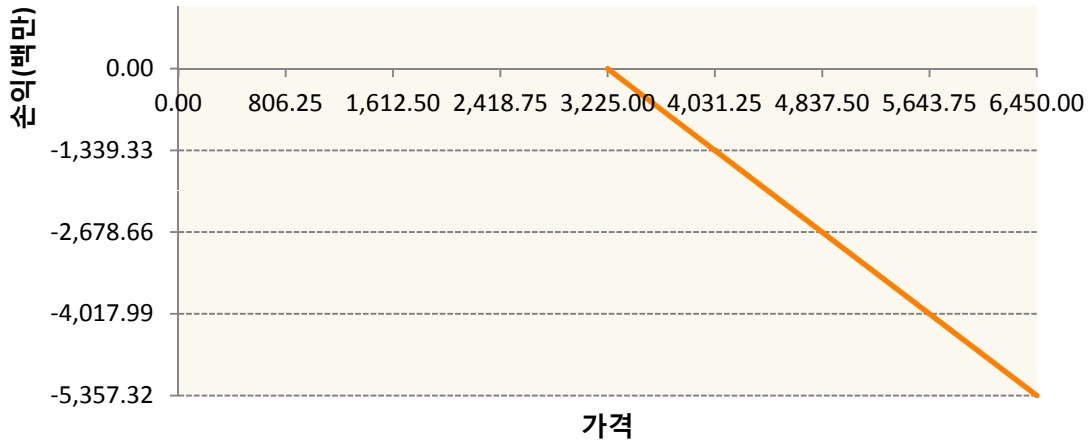
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

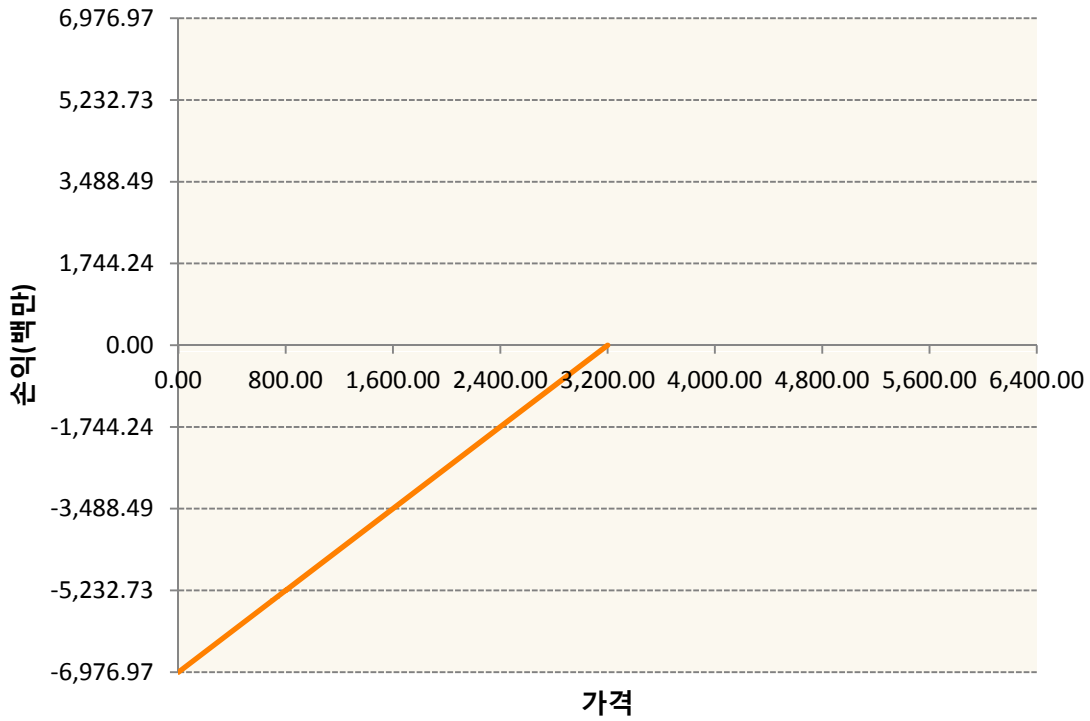


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

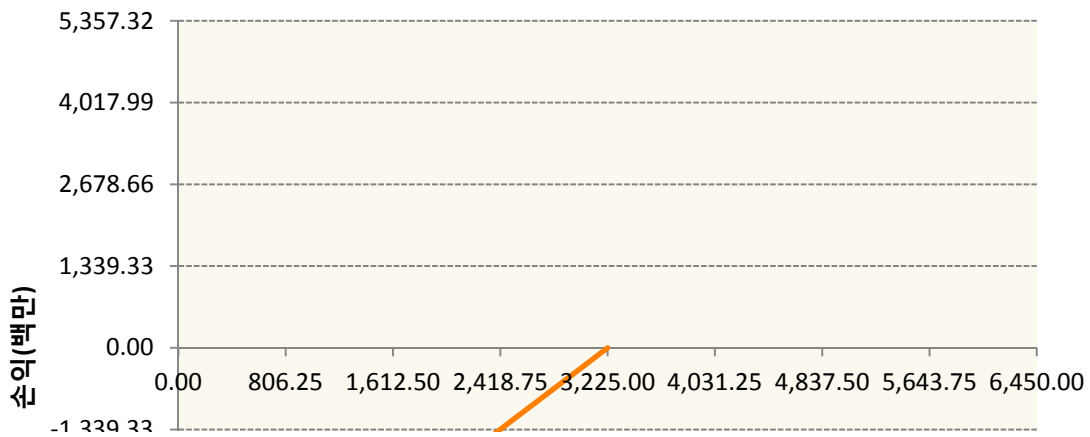


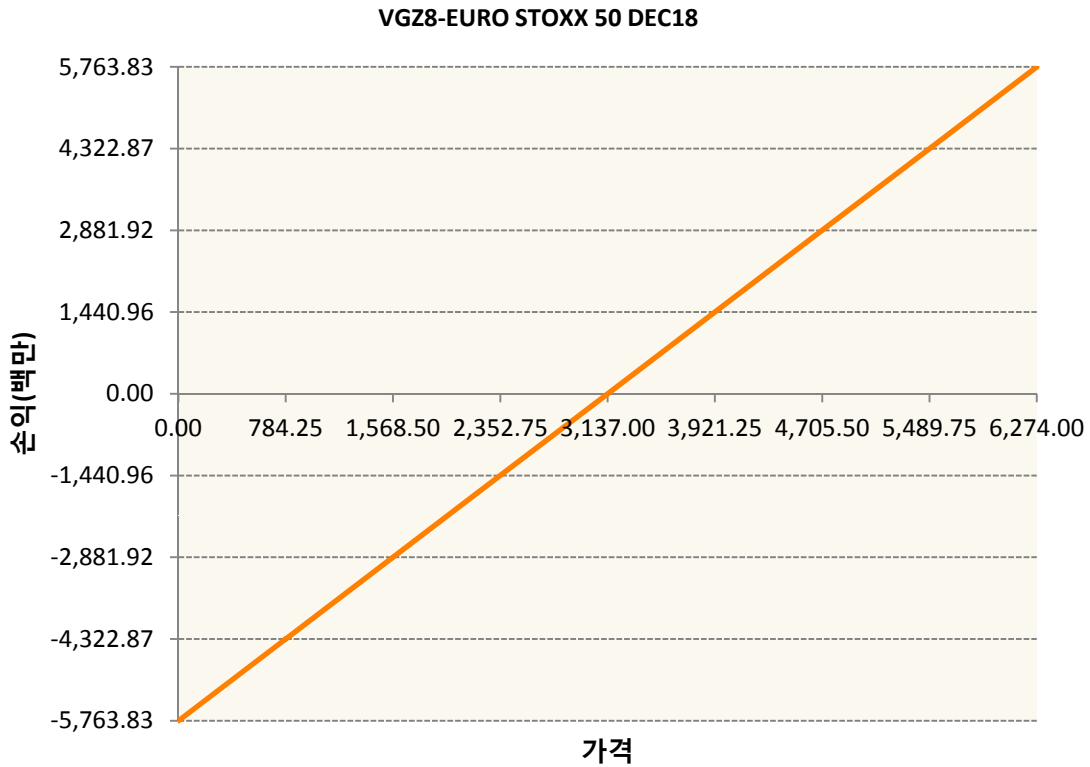
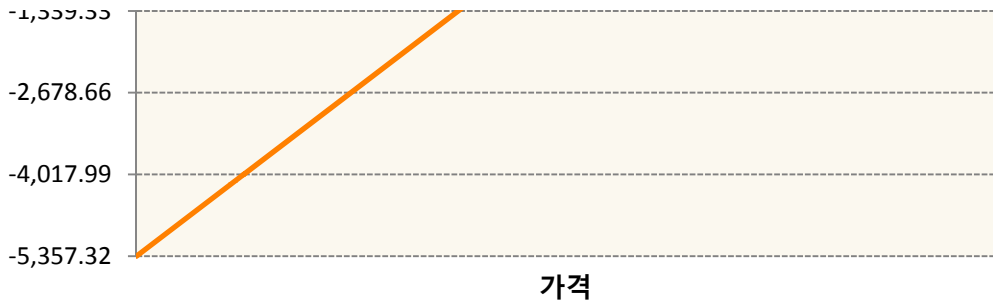


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|--|----------|
| 260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY | | 76 |
| OESXX8-C32 EURO STOXX 50 | | 558 |
| OESXX8-C32 EURO STOXX 50 | | 429 |
| OESXX8-P32 EURO STOXX 50 | | 558 |
| OESXX8-P32 EURO STOXX 50 | | 429 |
| VGZ8 EURO STOXX 50 DEC18 | | 461 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 1,606 |

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

(단위:백만원)

1,121

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

(단위:백만원)

88

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

(단위:백만원)

132

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

(단위:백만원)

148

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

(단위:백만원)

40

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간

1. 계약금액

(단위:백만원)

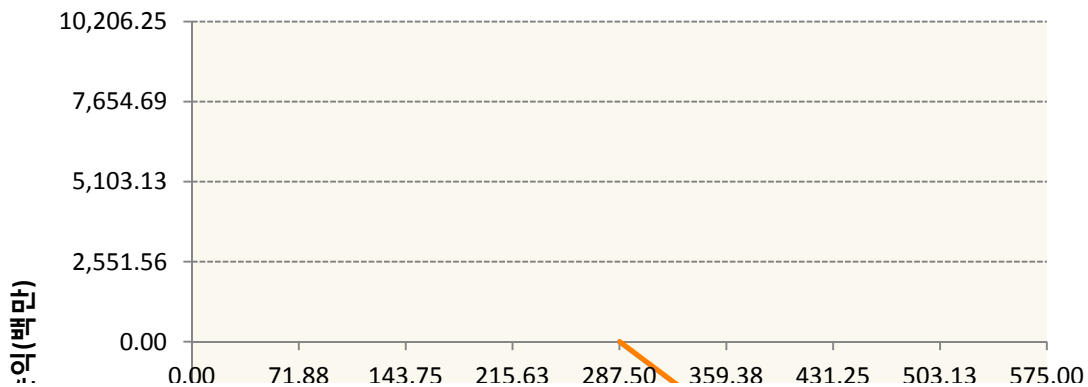
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 13,058 | 0 | 13,058 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 4,059 | 23,401 | -19,343 | 장내 |

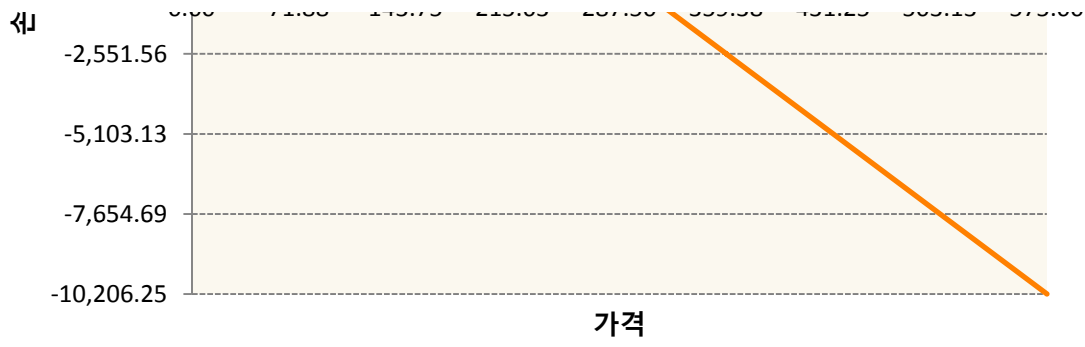
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

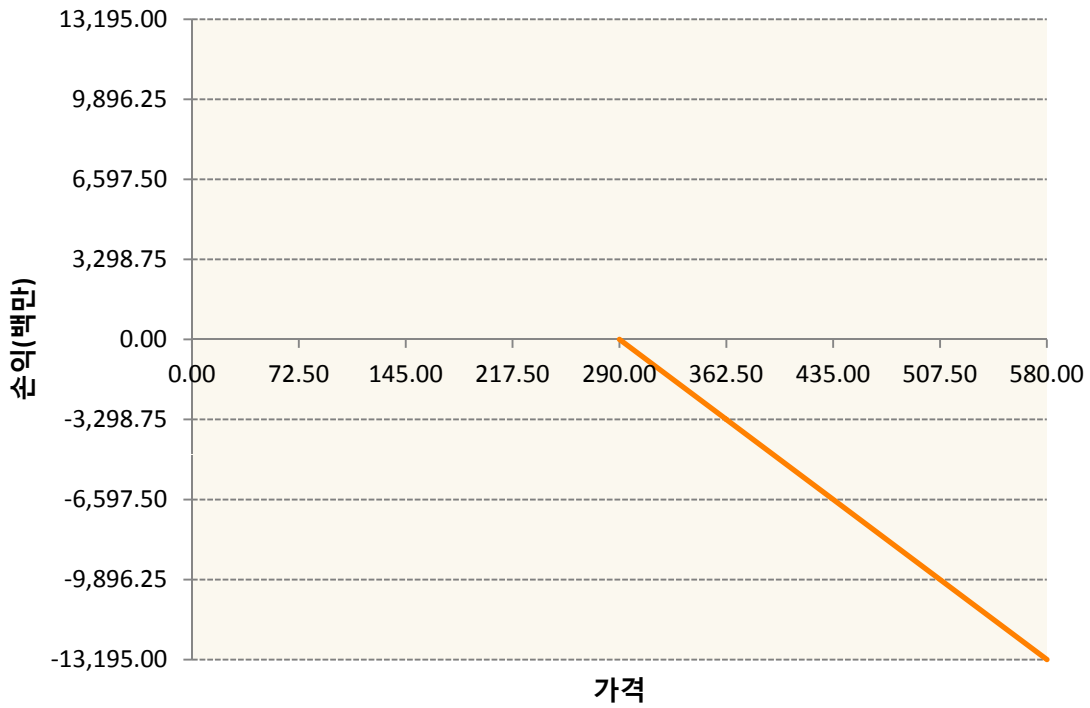


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

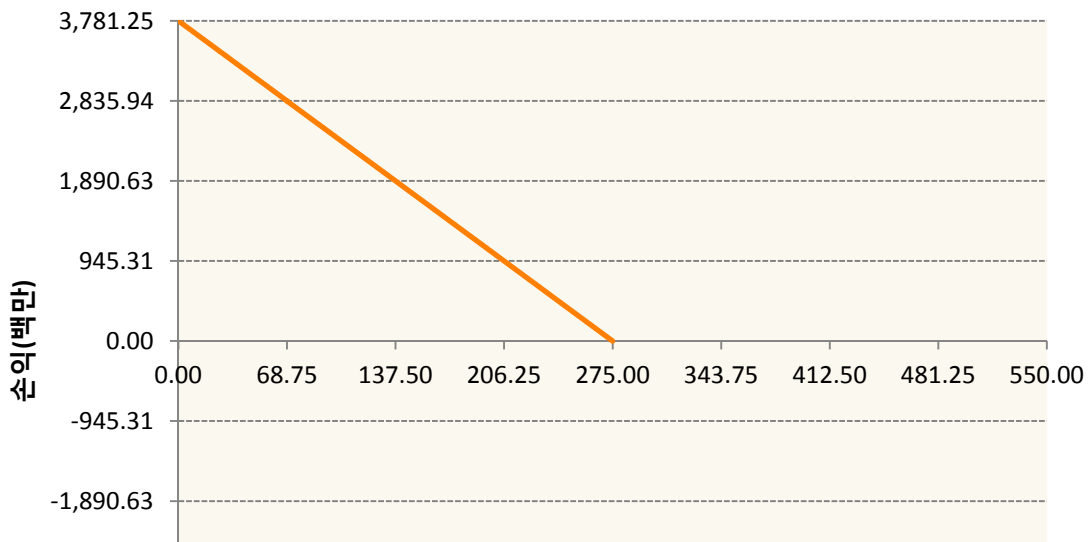


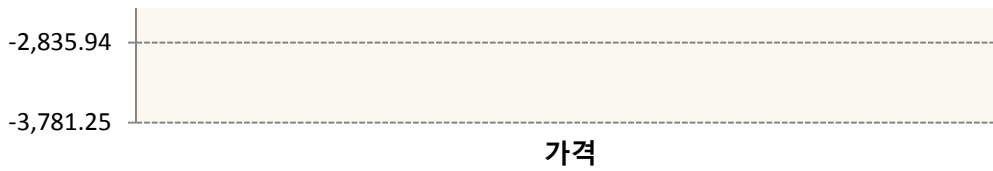


KR4201NB2901-2018-11 콜290

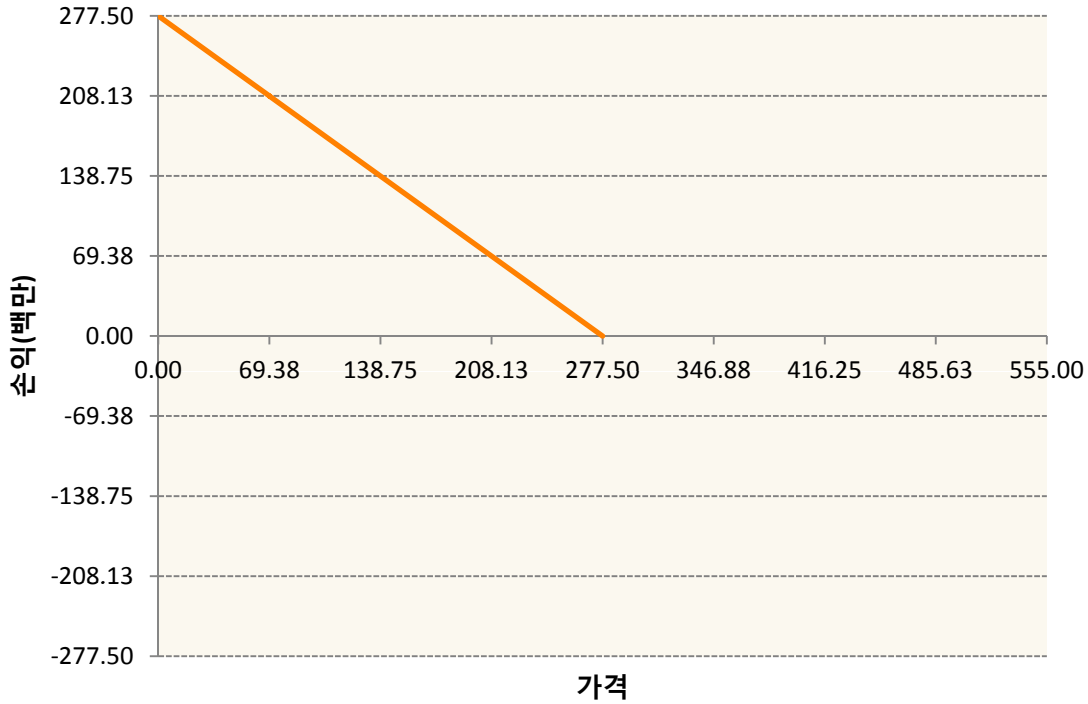


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,042

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,042 | -1,042 | -1,042 | -1,042 | -1,042 | -1,042 | -1,042 |
| -5.33% | -695 | -695 | -695 | -695 | -695 | -695 | -695 |
| -2.67% | -347 | -347 | -347 | -347 | -347 | -347 | -347 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 347 | 347 | 347 | 347 | 347 | 347 | 347 |
| 5.33% | 695 | 695 | 695 | 695 | 695 | 695 | 695 |
| 8.00% | 1,042 | 1,042 | 1,042 | 1,042 | 1,042 | 1,042 | 1,042 |

KR4201NB28 2018-11 콜287.5 351

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 41 | 41 | 41 | 41 | 40 | 38 | 37 |
| -5.33% | 41 | 40 | 39 | 37 | 35 | 31 | 27 |
| -2.67% | 38 | 36 | 32 | 27 | 21 | 14 | 6 |

| | | | | | | | |
|-------|------|------|------|------|------|------|------|
| 0% | 26 | 19 | 10 | 0 | -11 | -23 | -35 |
| 2.67% | -12 | -26 | -41 | -56 | -72 | -88 | -105 |
| 5.33% | -98 | -116 | -135 | -153 | -172 | -191 | -209 |
| 8.00% | -244 | -261 | -279 | -297 | -315 | -333 | -351 |

KR4201NB27 2018-11 콜290

399

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 39 | 39 | 39 | 38 | 38 | 36 | 35 |
| -5.33% | 39 | 38 | 37 | 36 | 33 | 30 | 25 |
| -2.67% | 37 | 35 | 31 | 26 | 20 | 13 | 4 |
| 0% | 27 | 20 | 11 | 0 | -12 | -25 | -39 |
| 2.67% | -8 | -23 | -40 | -58 | -76 | -96 | -115 |
| 5.33% | -95 | -118 | -140 | -164 | -187 | -210 | -234 |
| 8.00% | -256 | -279 | -303 | -327 | -351 | -375 | -399 |

KR4301NB27 2018-11 풋275

263

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 262 | 262 | 262 | 262 | 262 | 263 | 263 |
| -5.33% | 163 | 163 | 164 | 165 | 166 | 167 | 169 |
| -2.67% | 67 | 69 | 71 | 74 | 77 | 80 | 83 |
| 0% | -13 | -9 | -5 | 0 | 5 | 9 | 14 |
| 2.67% | -63 | -58 | -54 | -49 | -45 | -40 | -35 |
| 5.33% | -82 | -80 | -77 | -74 | -71 | -68 | -64 |
| 8.00% | -86 | -86 | -85 | -84 | -82 | -80 | -78 |

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

20

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 | 20 |
| -5.33% | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 | 13 |
| -2.67% | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 |
| 0% | -1 | -1 | 0 | 0 | 0 | 1 | 1 |
| 2.67% | -5 | -5 | -5 | -4 | -4 | -4 | -3 |
| 5.33% | -7 | -7 | -7 | -7 | -6 | -6 | -6 |
| 8.00% | -8 | -8 | -8 | -8 | -7 | -7 | -7 |

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

(단위:백만원)

1,578

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

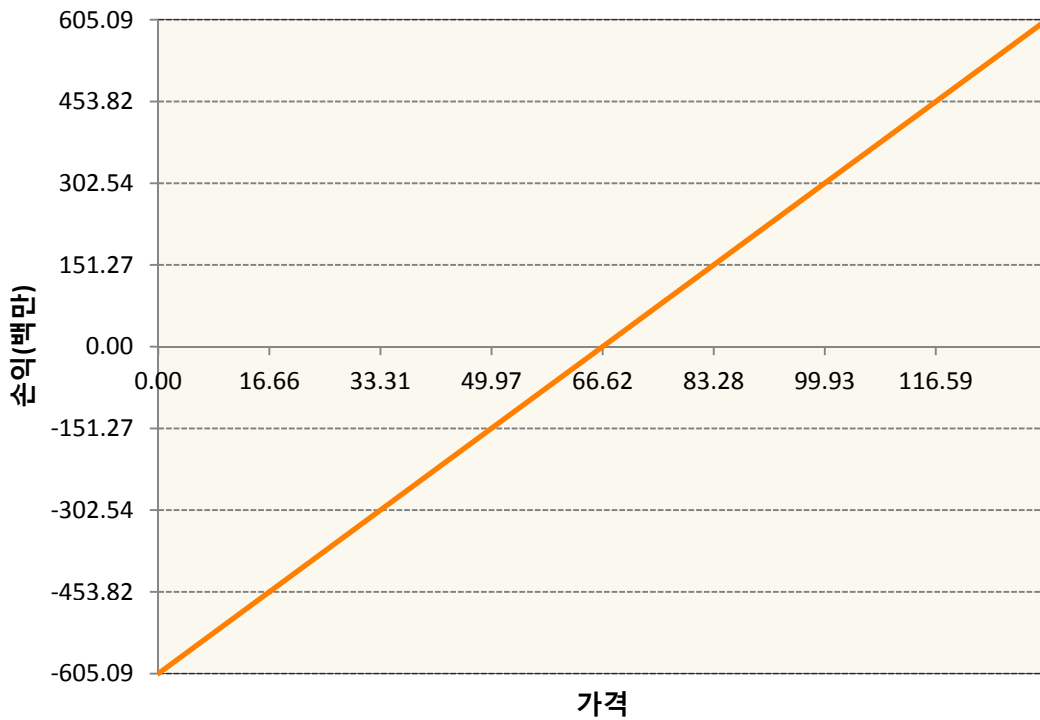
1. 계약금액

(단위:백만원)

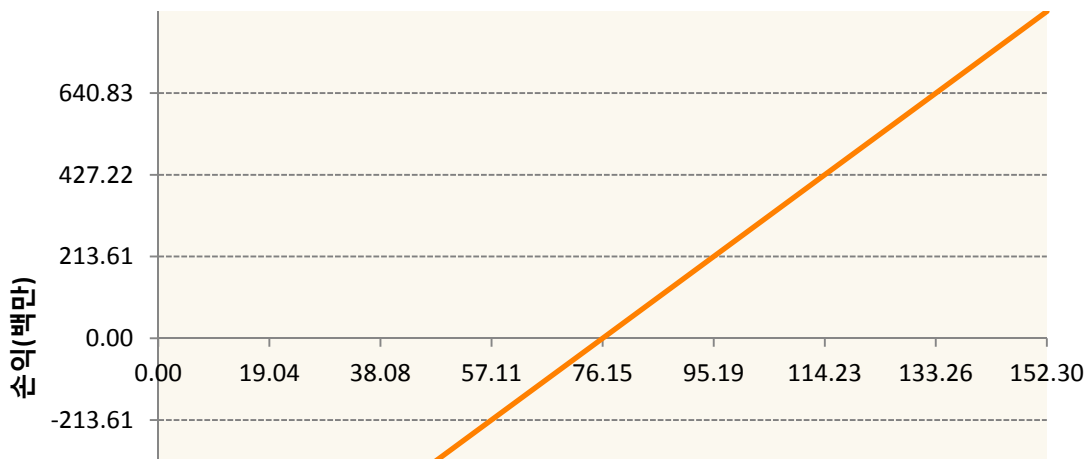
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,355 | 464 | 2,891 | |

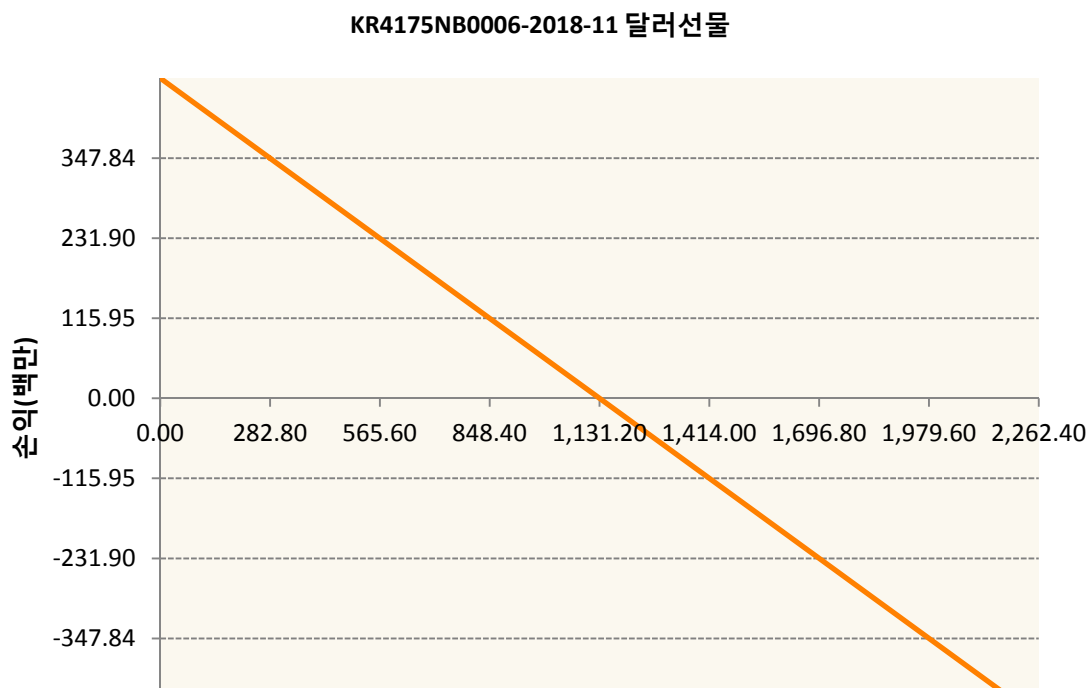
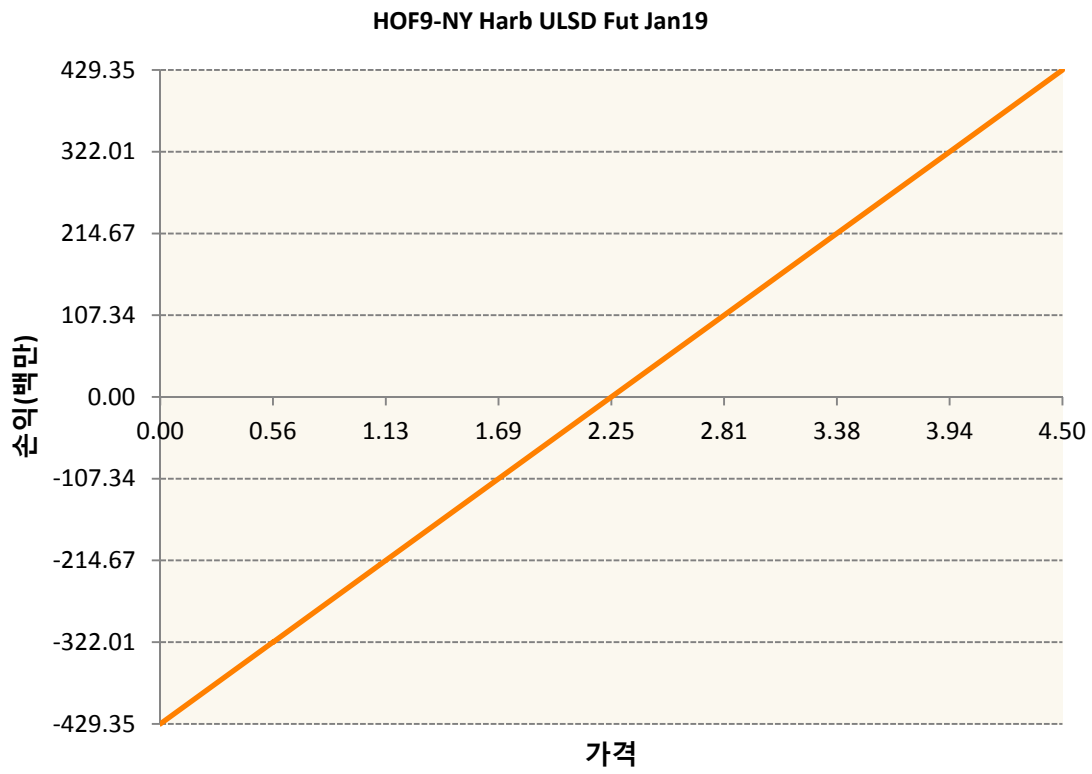
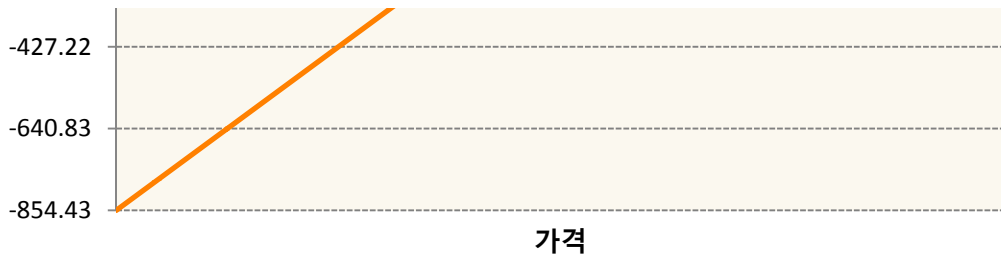
2. 만기시점의 손익구조

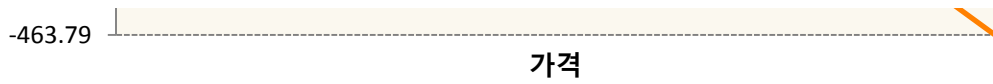
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



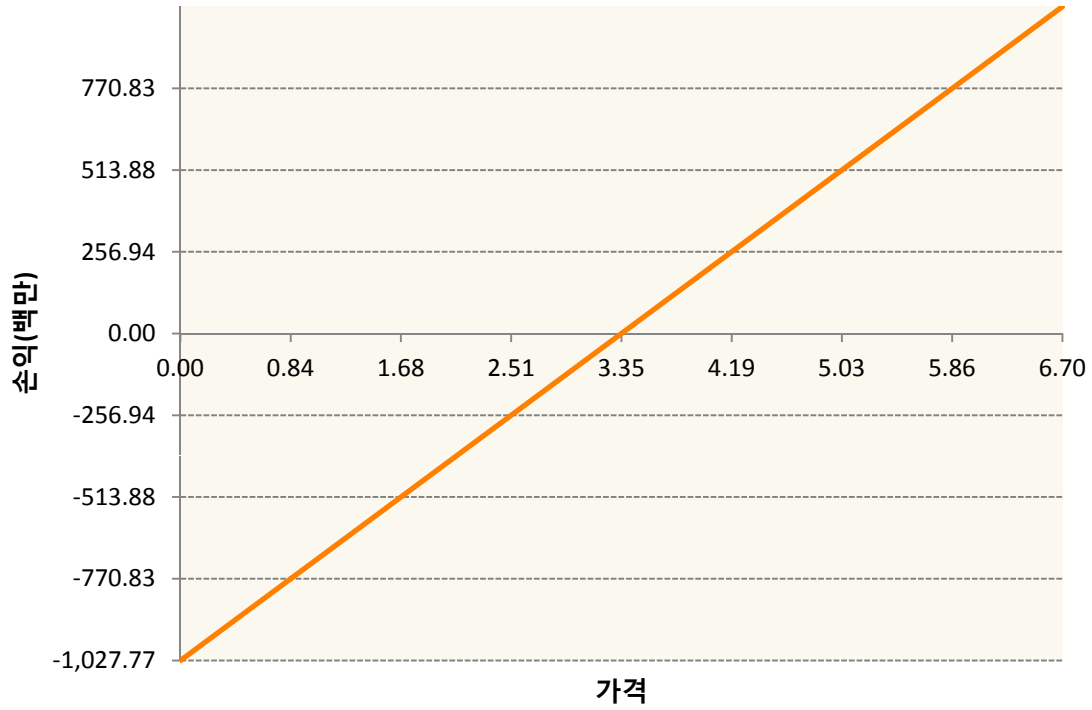
COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19



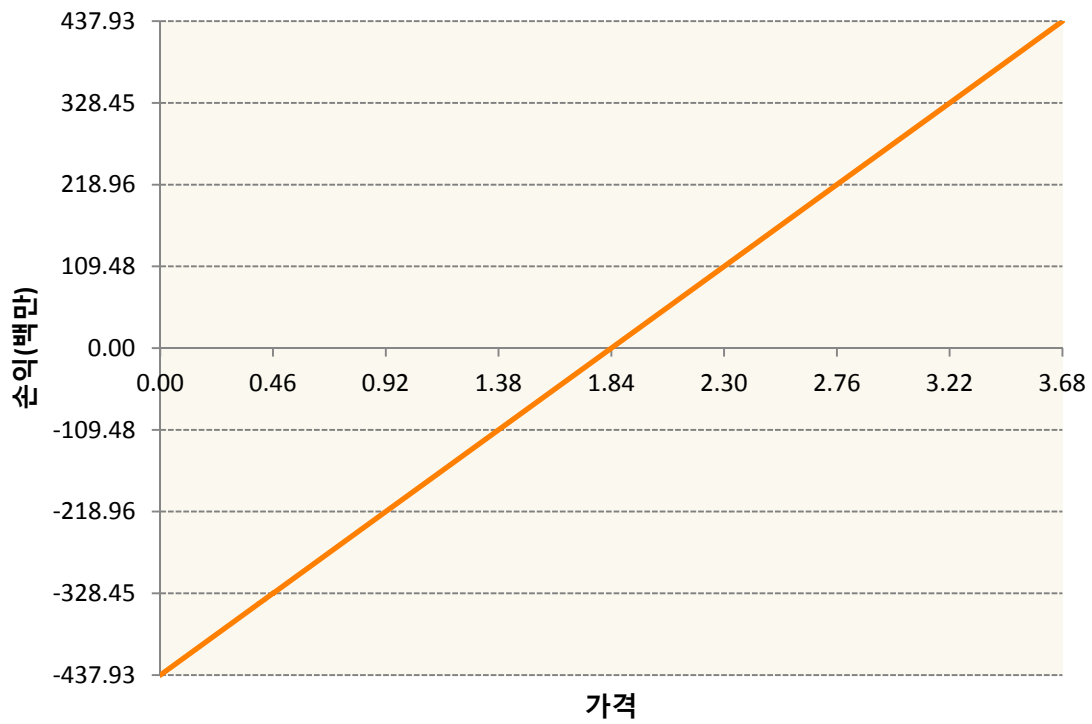




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|------------------------|-------------------------|----|
| CLF9 | WTI CRUDE FUTURE Jan19 | 48 |
| COF9 | BRENT CRUDE FUTR JAN19 | 68 |
| HOF9 | NY Harb ULSD Fut Jan19 | 34 |
| KR4175NB0(2018-11 달러선물 | | 37 |
| NGF19 | NATURAL GAS FUTR Jan19 | 82 |
| XBF9 | GASOLINE RBOB FUT Jan19 | 35 |

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

408

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-25 |
| 기준일 | 2018-10-24 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

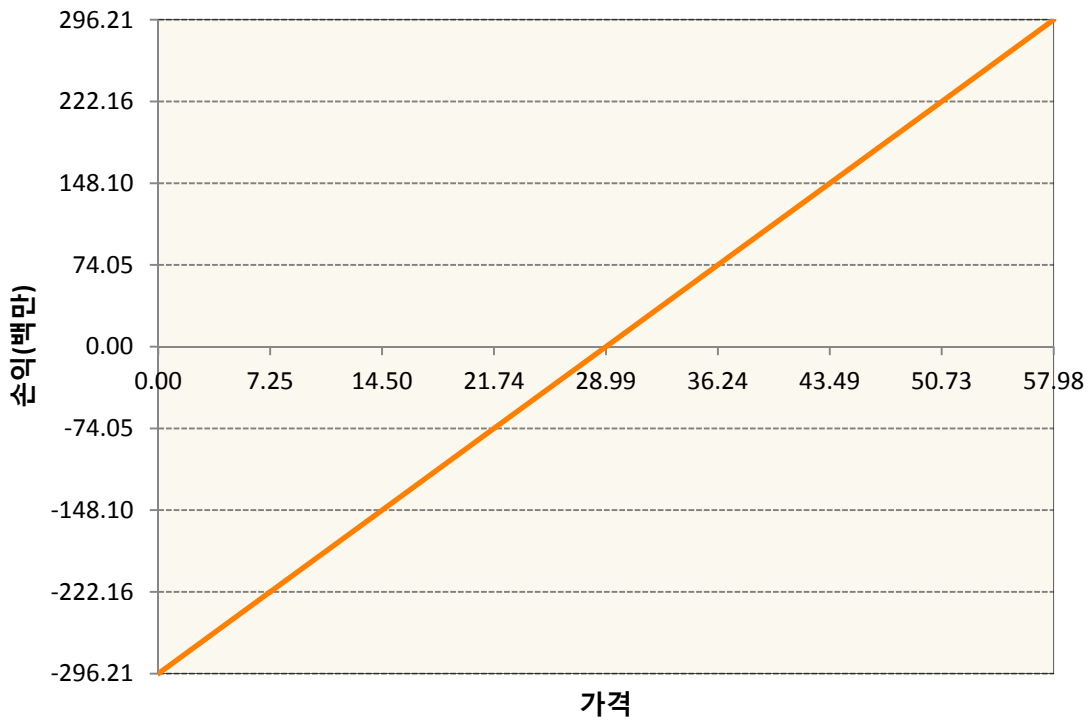
1. 계약금액

(단위:백만원)

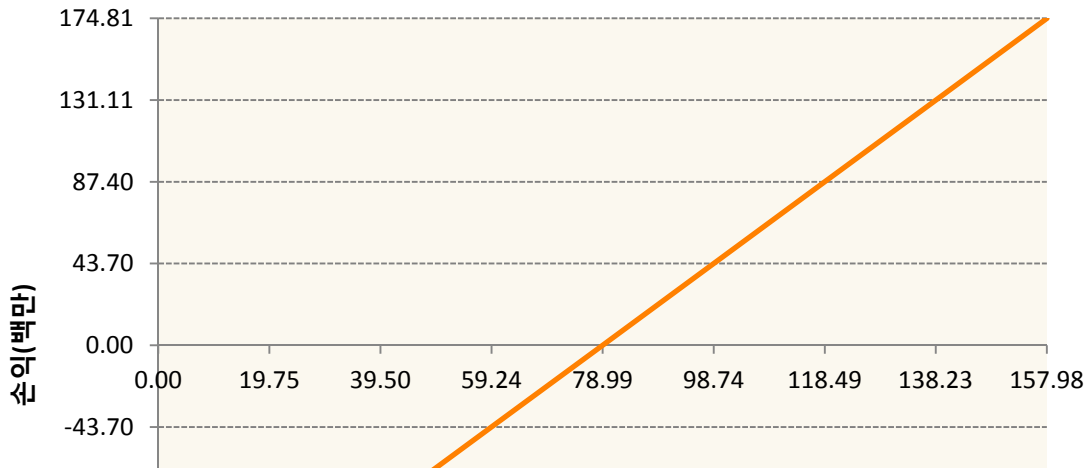
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,636 | 79 | 3,556 | |

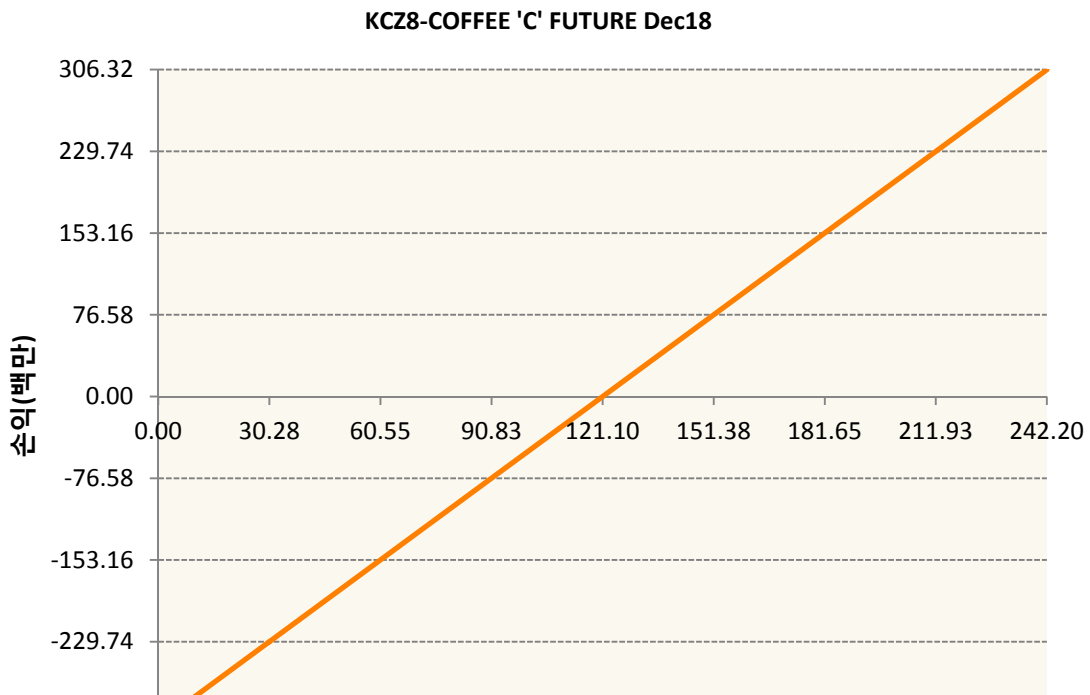
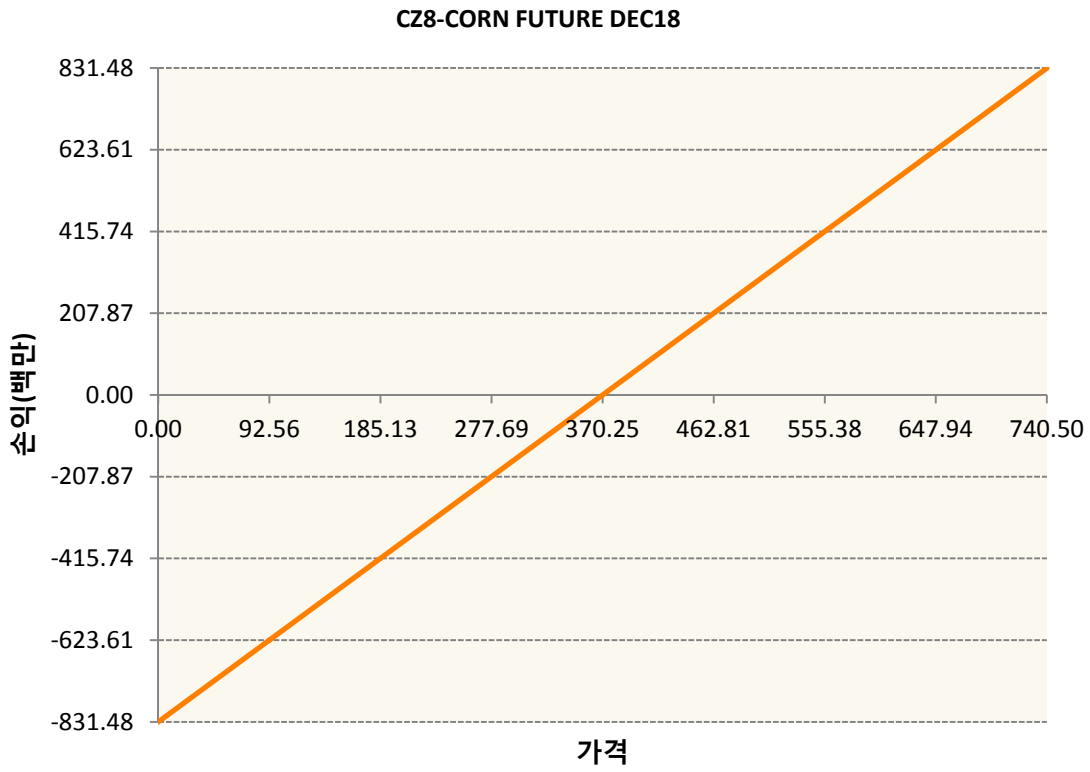
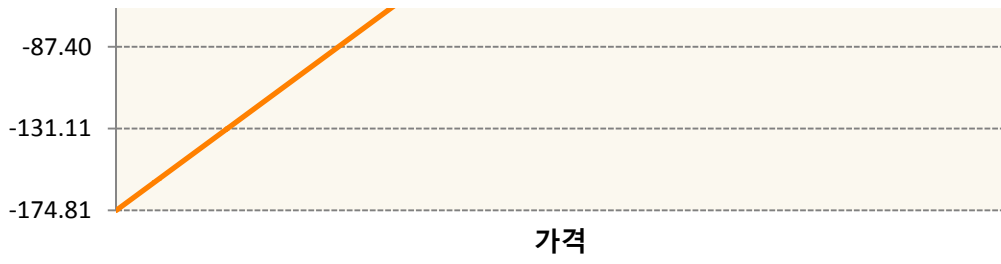
2. 만기시점의 손익구조

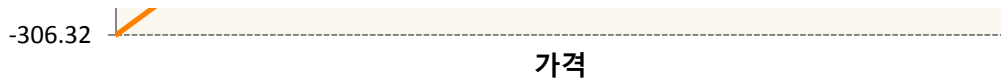
BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19



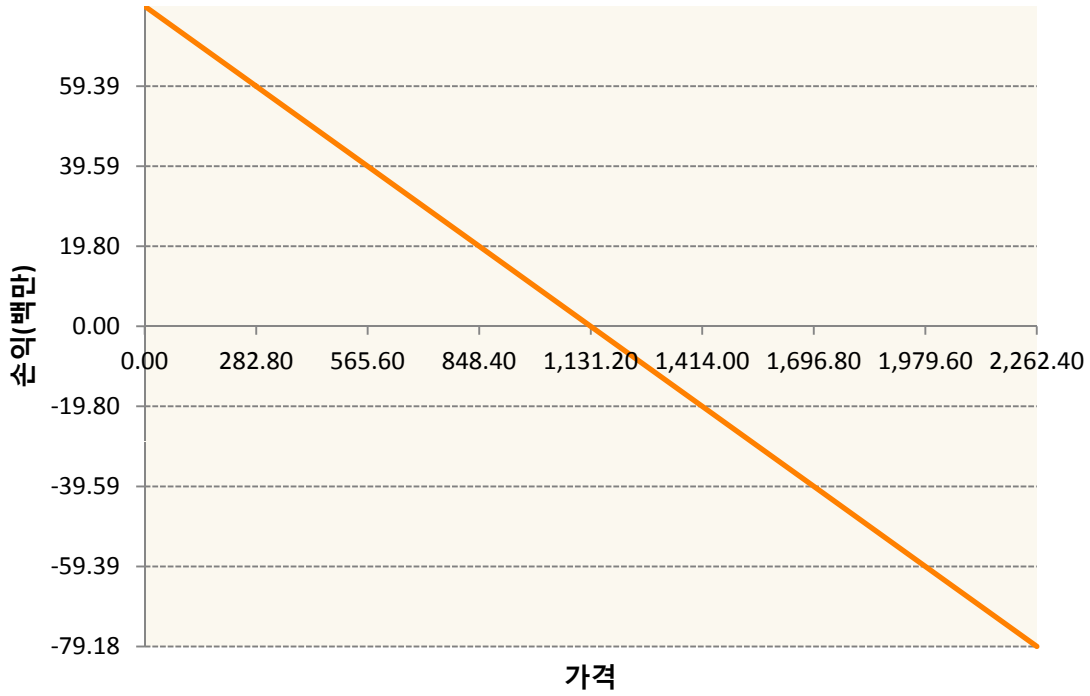
CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18



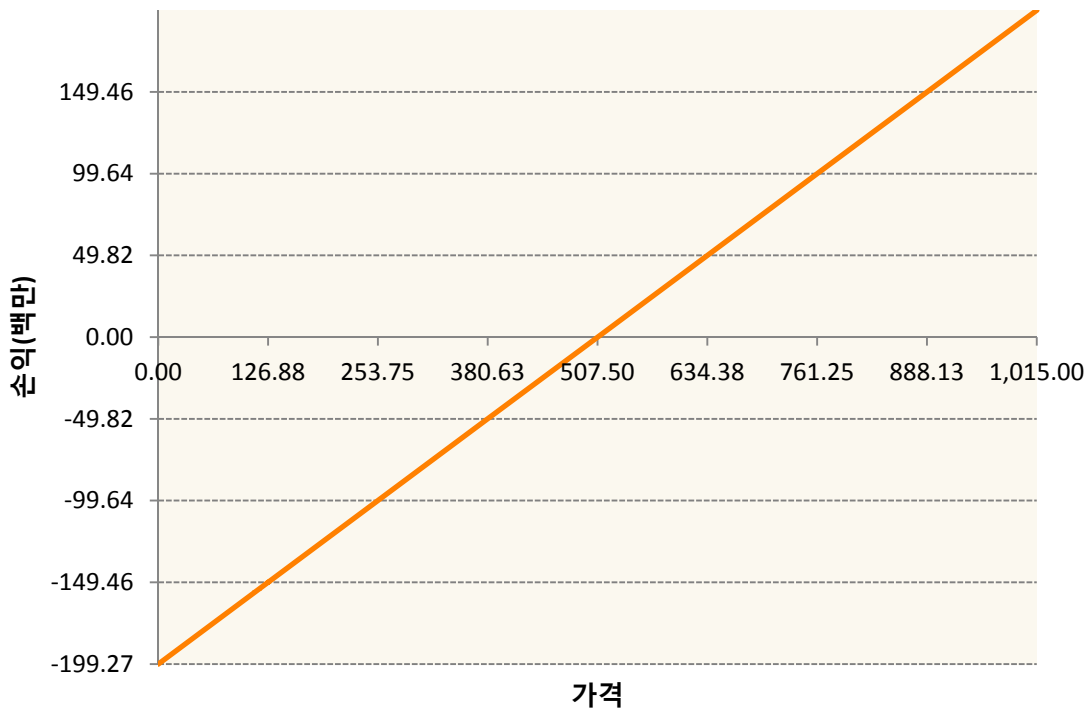




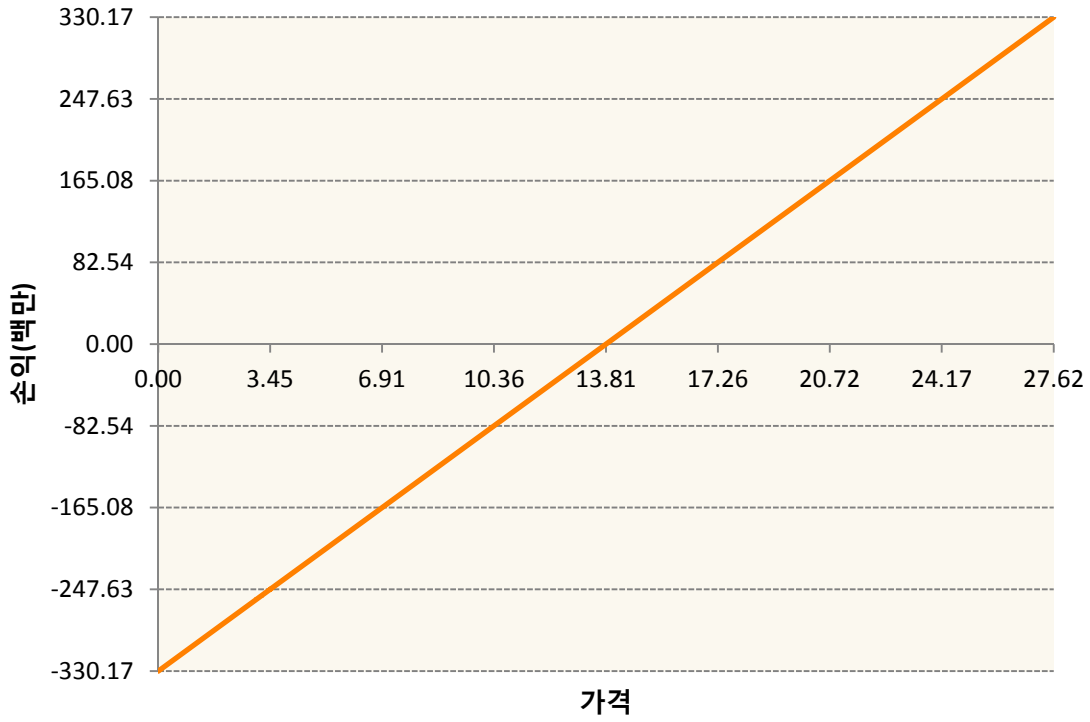
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



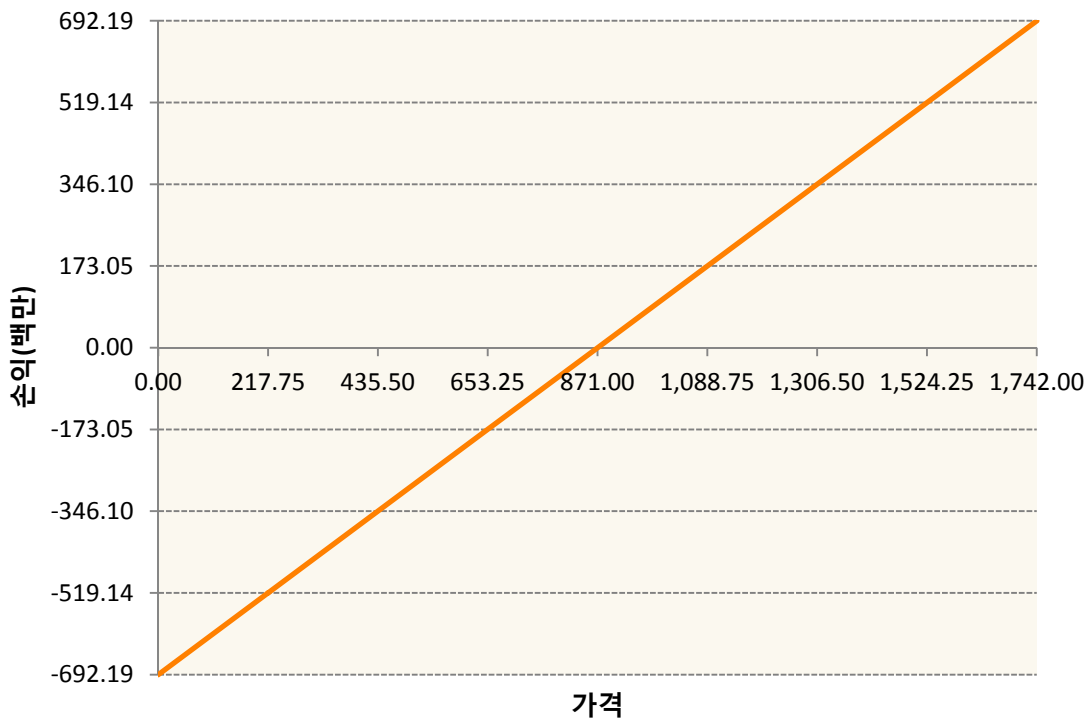
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

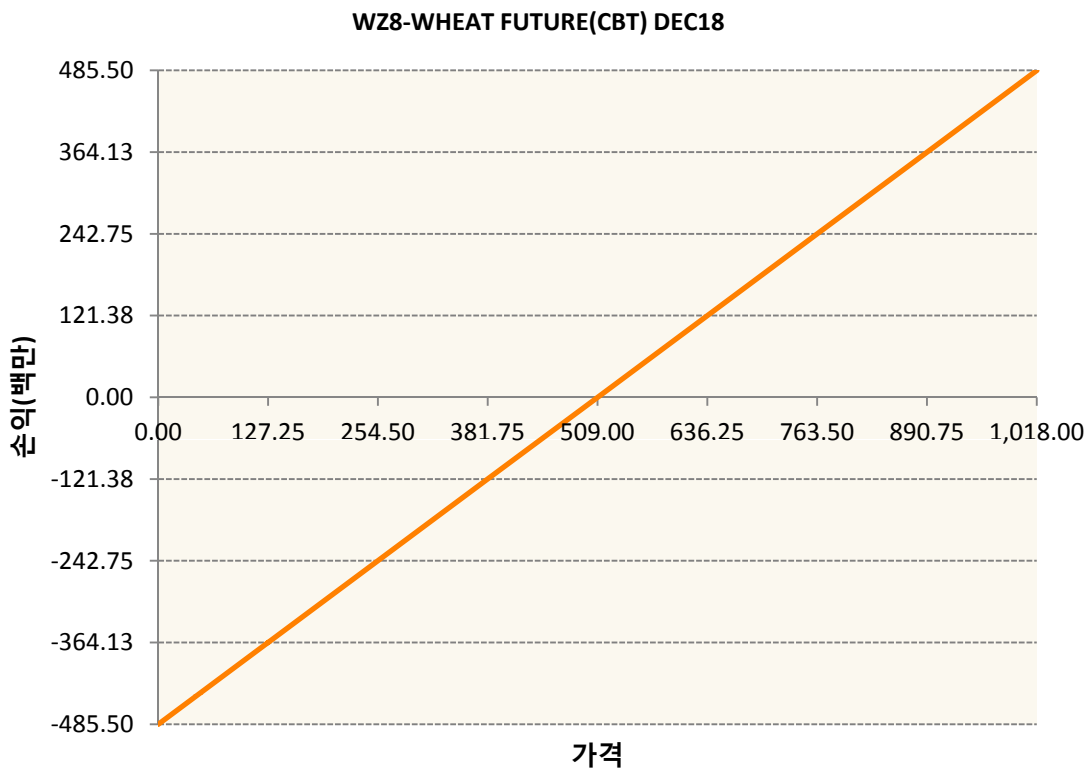
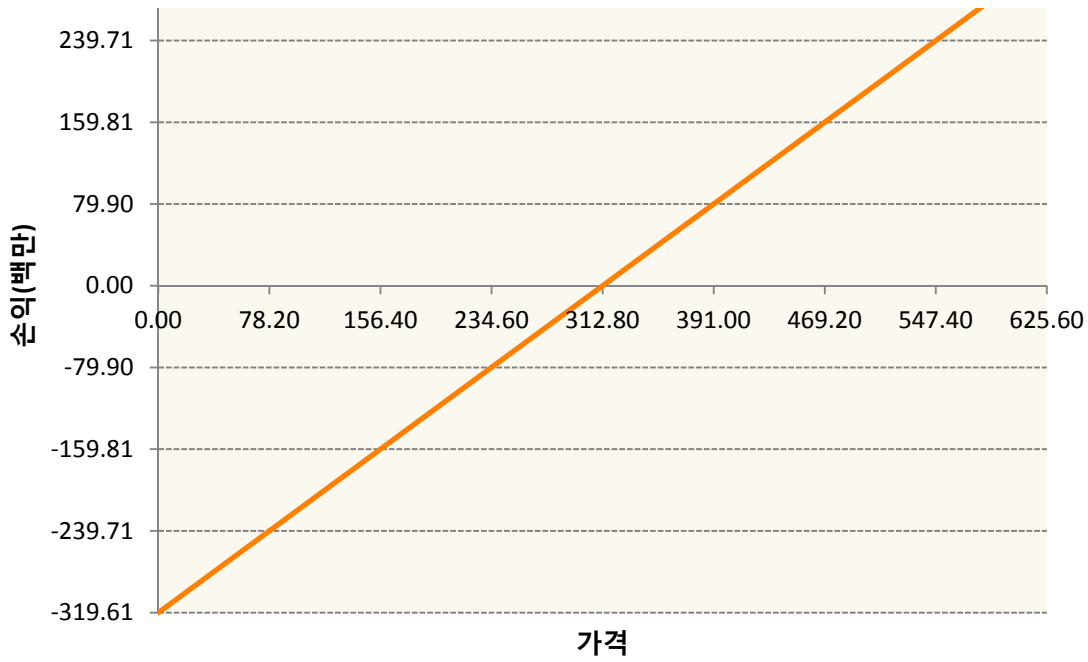


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|-------------------------|----|
| BOF9 | SOYBEAN OIL FUTR Jan19 | 24 |
| CTZ8 | COTTON NO.2 FUTR DEC18 | 14 |
| CZ8 | CORN FUTURE DEC18 | 67 |
| KCZ8 | COFFEE 'C' FUTURE Dec18 | 25 |
| KR4175NB0(| 2018-11 달러선물 | 6 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWZ8 | KC HRW WHEAT FUT DEC18 | 16 |
| SBH9 | SUGAR #11 (WORLD) MAR19 | 26 |
| SF9 | SOYBEAN FUTURE Jan19 | 55 |
| SMF9 | SOYBEAN MEAL FUTR Jan19 | 26 |
| WZ8 | WHEAT FUTURE(CBT) DEC18 | 39 |

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

(단위:백만원)

317