

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

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 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

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

1,056

* 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 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

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)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180910

256

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

360

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

유로인덱스모(주식-파생형)

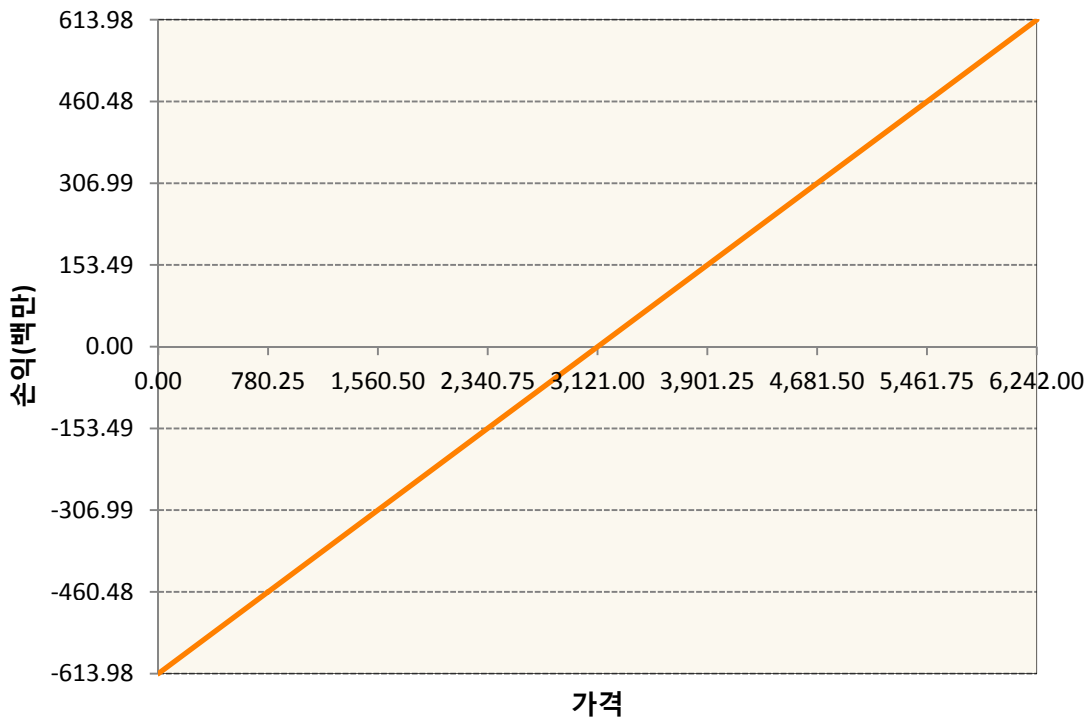
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 614 | 0 | 614 | |

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 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

차이나인덱스모(주식-파생형)

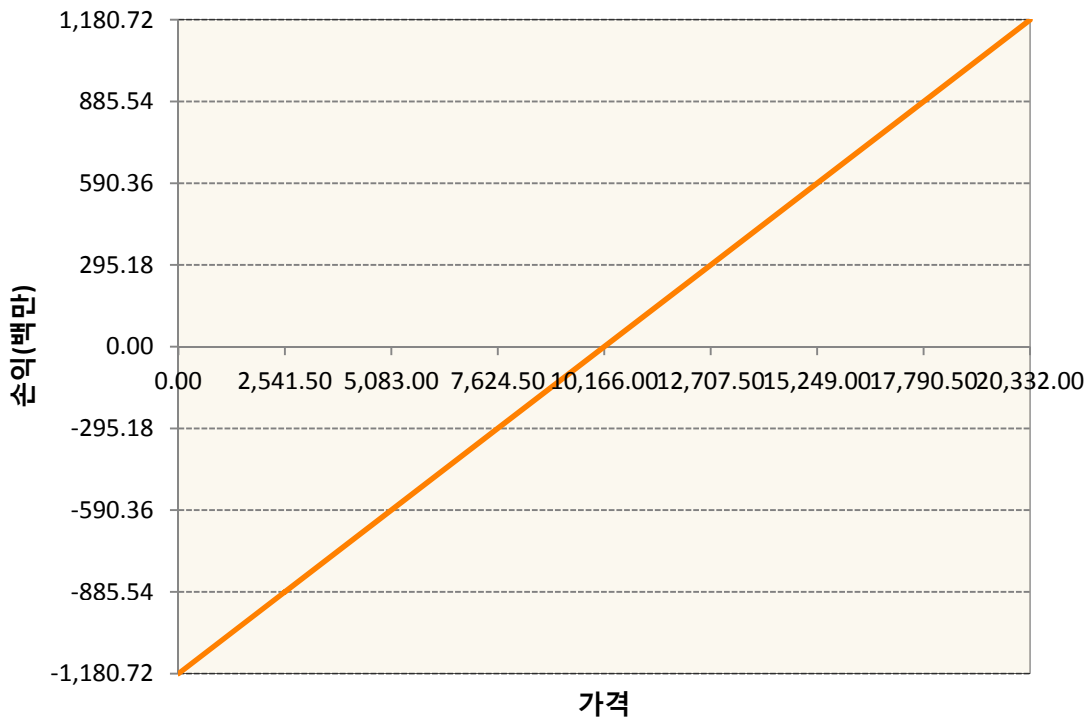
1. 계약금액

(단위:백만원)

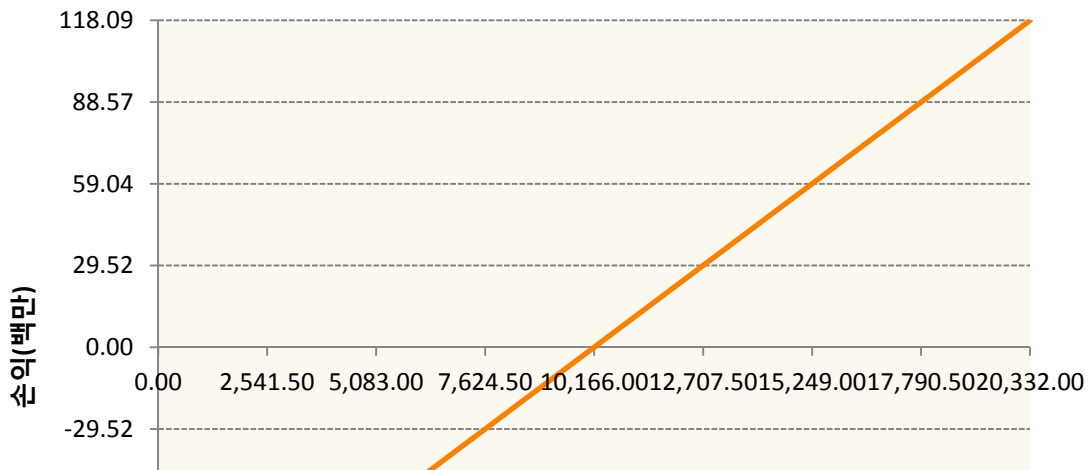
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,299 | 0 | 1,299 | 장내 |

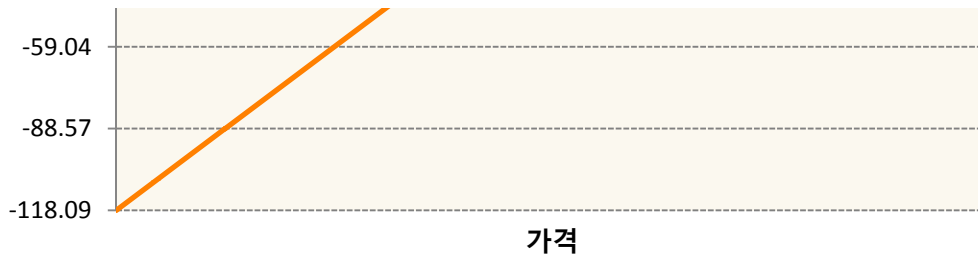
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



MHCX8-MINI H-SHR IDX FU NOV 18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|--------------------------|----|
| HCX8 | HSCEI FUTURES NOV 18 | 94 |
| MHCX8 | MINI H-SHR IDX FU NOV 18 | 9 |

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

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

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

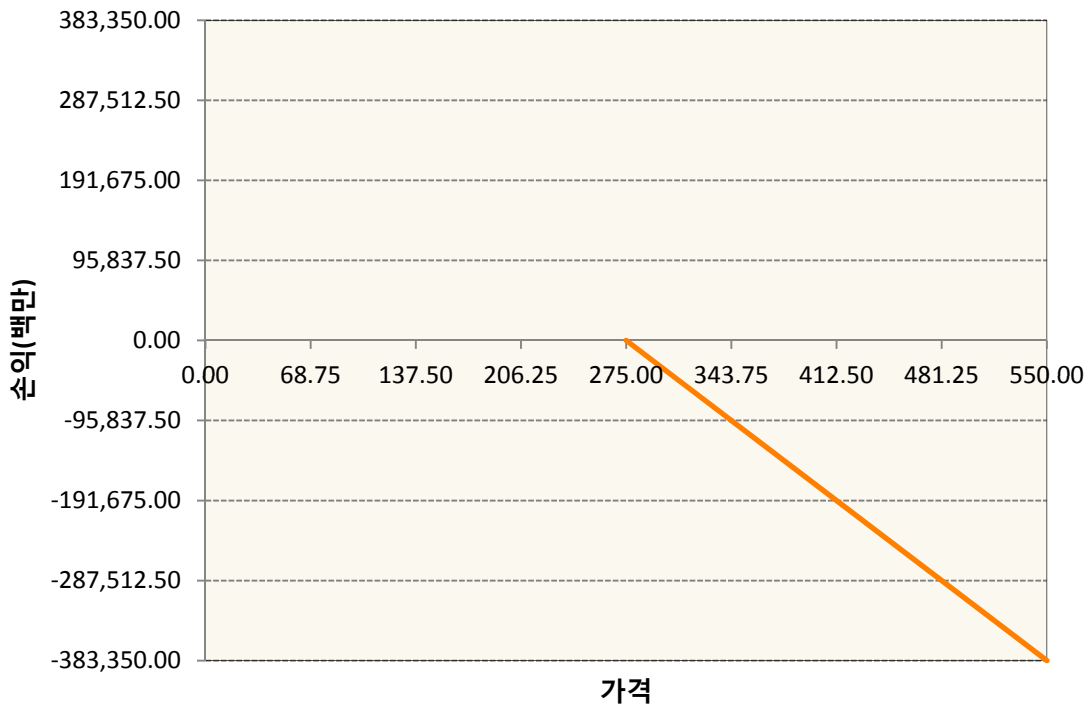
1. 계약금액

(단위:백만원)

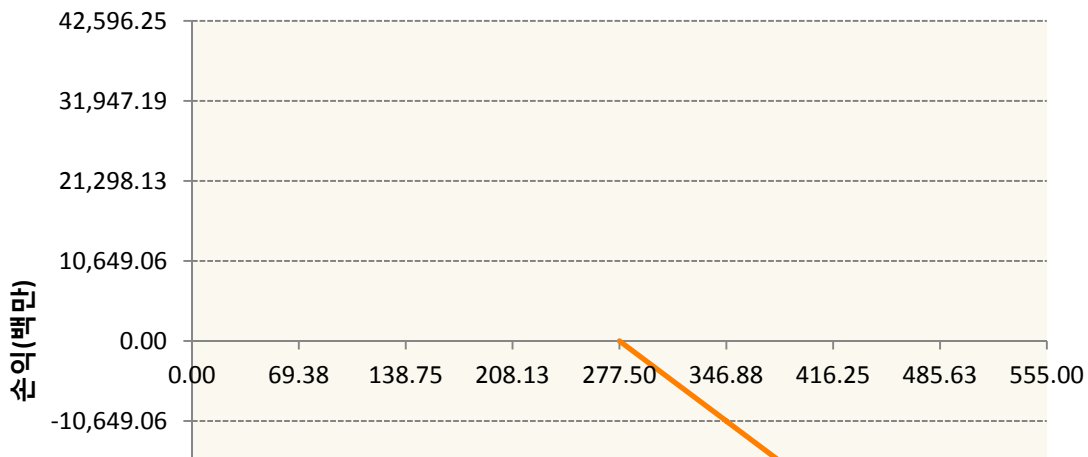
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|---------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 721,571 | -721,571 | 장내 |

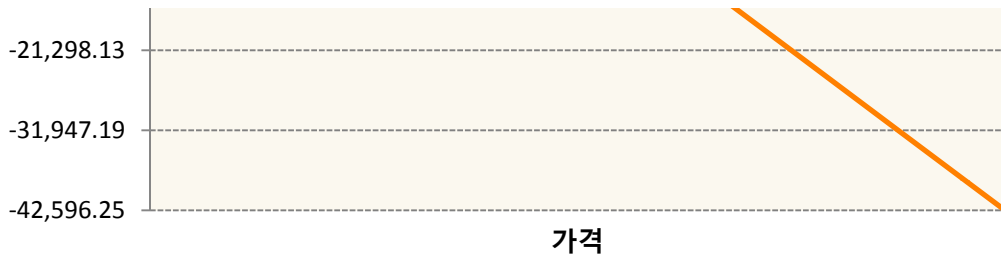
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

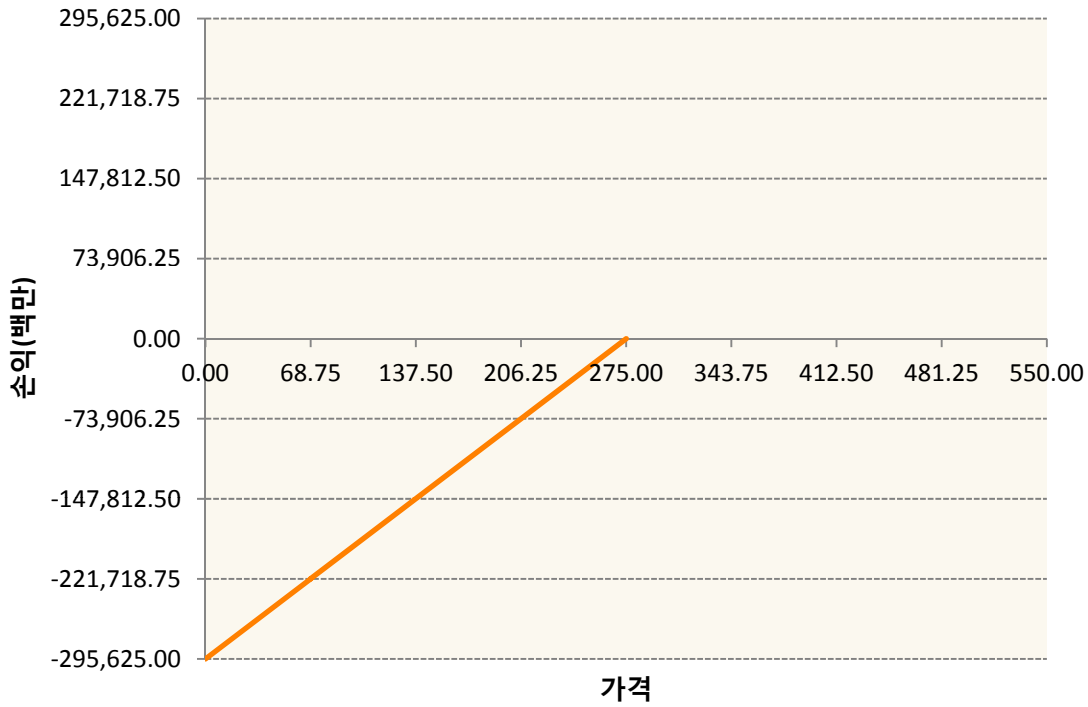


KR4201NB2778-2018-11 콜277.5





KR4301NB2751-2018-11 풋275



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201NB27 2018-11 콜275

18,411

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 3,678 | 3,658 | 3,620 | 3,559 | 3,471 | 3,354 | 3,207 |
| -5.33% | 3,590 | 3,496 | 3,361 | 3,186 | 2,971 | 2,719 | 2,432 |
| -2.67% | 3,144 | 2,867 | 2,542 | 2,175 | 1,772 | 1,338 | 878 |
| 0% | 1,664 | 1,133 | 576 | 0 | -592 | -1,195 | -1,809 |
| 2.67% | -1,750 | -2,440 | -3,131 | -3,822 | -4,513 | -5,205 | -5,897 |
| 5.33% | -7,581 | -8,203 | -8,839 | -9,486 | -10,141 | -10,803 | -11,470 |
| 8.00% | -15,482 | -15,883 | -16,328 | -16,809 | -17,320 | -17,855 | -18,411 |

KR4201NB27 2018-11 콜277.5

1,848

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 310 | 308 | 306 | 301 | 294 | 284 | 272 |

| | | | | | | | |
|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -5.33% | 304 | 298 | 287 | 273 | 254 | 232 | 205 |
| -2.67% | 274 | 251 | 223 | 190 | 153 | 111 | 66 |
| 0% | 160 | 110 | 57 | 0 | -59 | -121 | -184 |
| 2.67% | -133 | -206 | -280 | -354 | -429 | -504 | -579 |
| 5.33% | -681 | -756 | -831 | -907 | -983 | -1,059 | -1,135 |
| 8.00% | -1,479 | -1,533 | -1,591 | -1,652 | -1,716 | -1,781 | -1,848 |

KR4301NB27 2018-11 풋275

21,409

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -21,344 | -21,345 | -21,347 | -21,353 | -21,364 | -21,382 | -21,409 |
| -5.33% | -13,711 | -13,724 | -13,747 | -13,783 | -13,836 | -13,906 | -13,993 |
| -2.67% | -6,169 | -6,250 | -6,358 | -6,492 | -6,650 | -6,829 | -7,029 |
| 0% | 823 | 569 | 293 | 0 | -307 | -626 | -954 |
| 2.67% | 6,201 | 5,802 | 5,403 | 5,003 | 4,602 | 4,201 | 3,800 |
| 5.33% | 9,172 | 8,842 | 8,500 | 8,147 | 7,787 | 7,420 | 7,048 |
| 8.00% | 10,238 | 10,087 | 9,907 | 9,700 | 9,470 | 9,219 | 8,952 |

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

(단위:백만원)

41,843

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

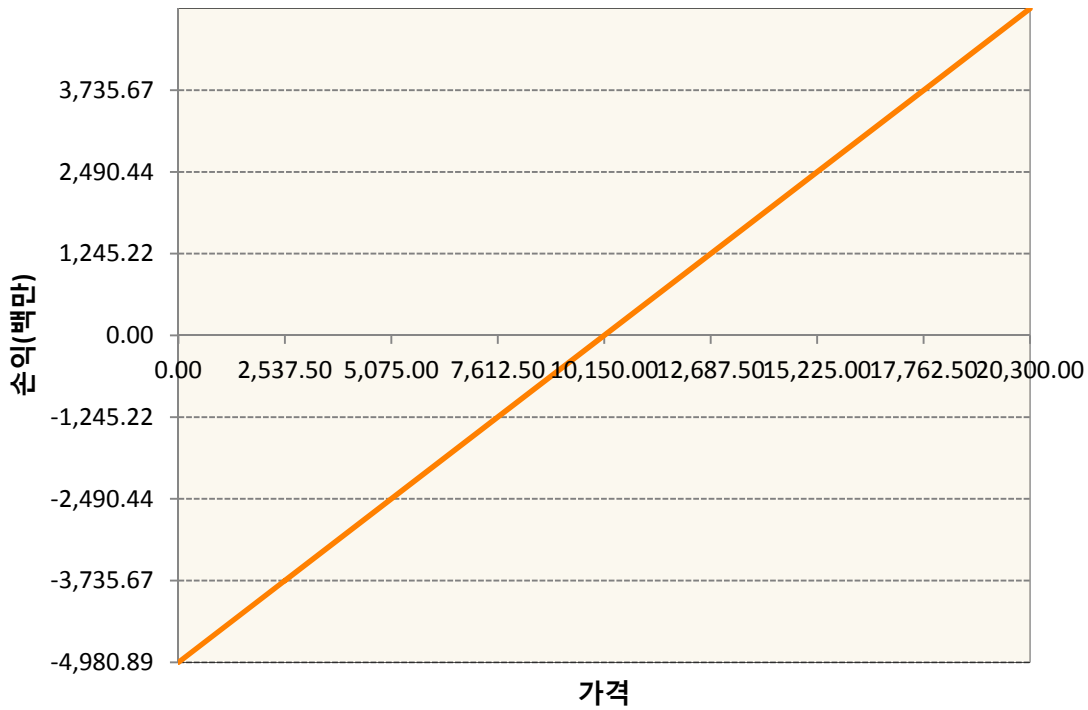
1. 계약금액

(단위:백만원)

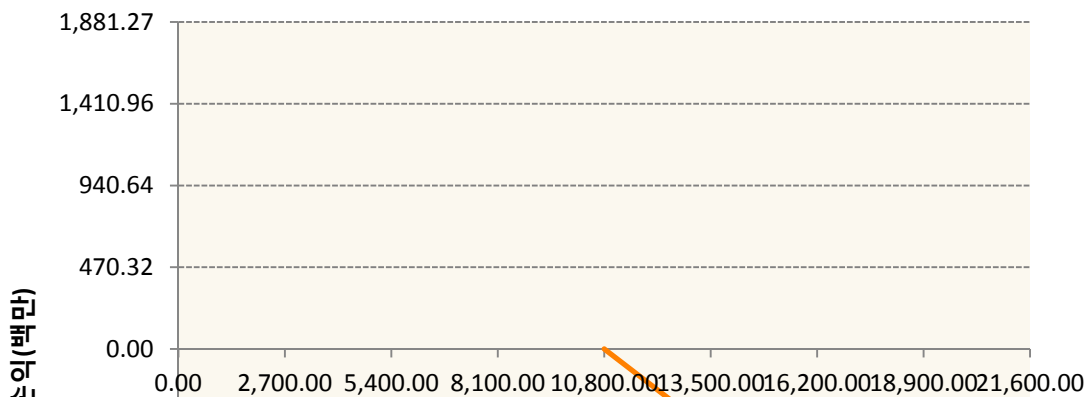
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,981 | 0 | 4,981 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 12,225 | -12,225 | 장내 |

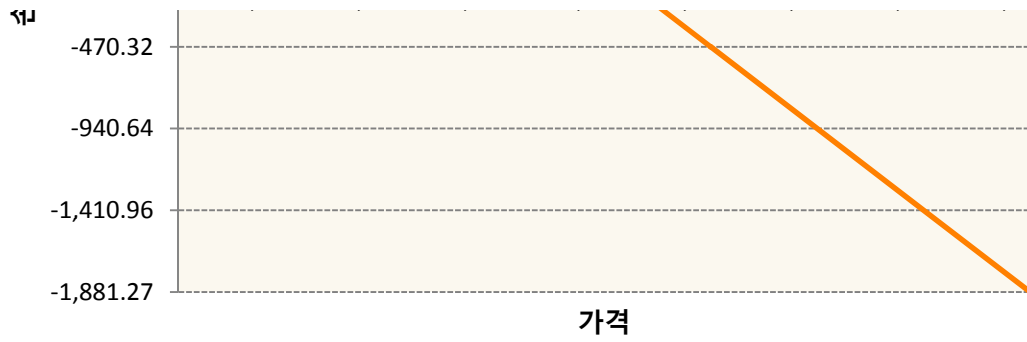
2. 만기시점의 손익구조

HCV8-HSCEI FUTURES OCT 18

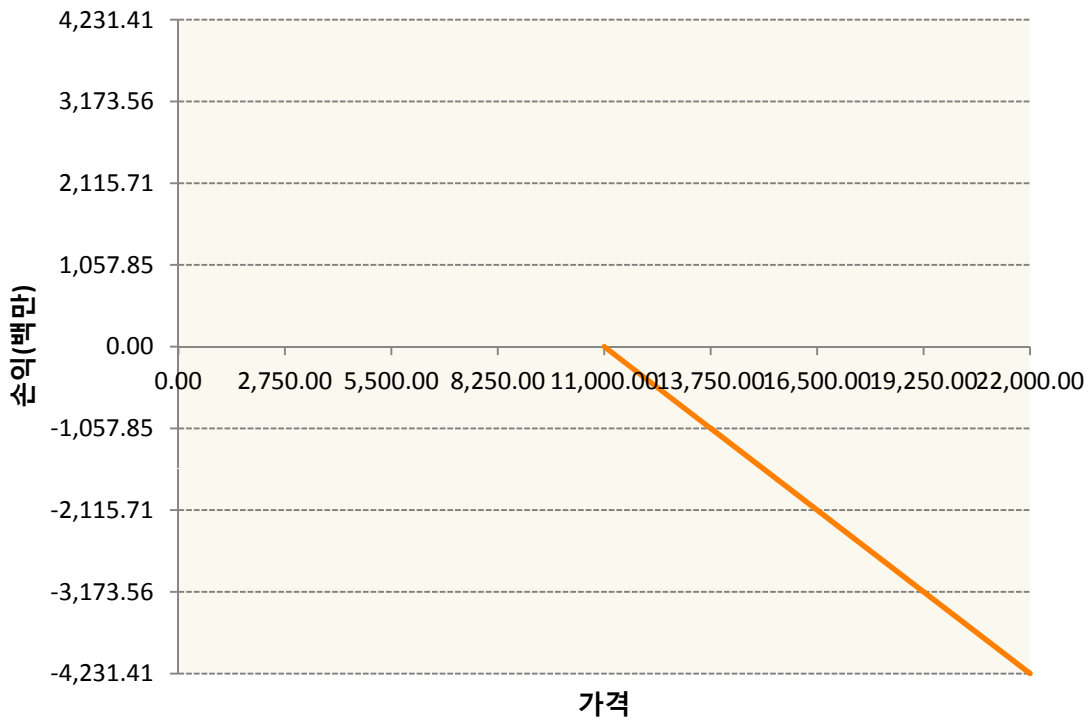


OHHIV8-C108-HSCEI

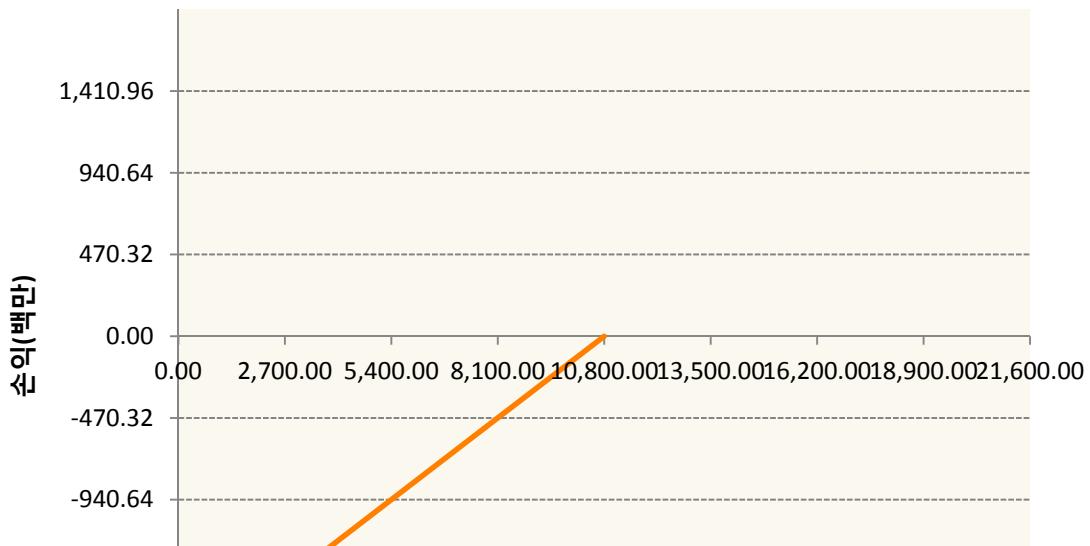


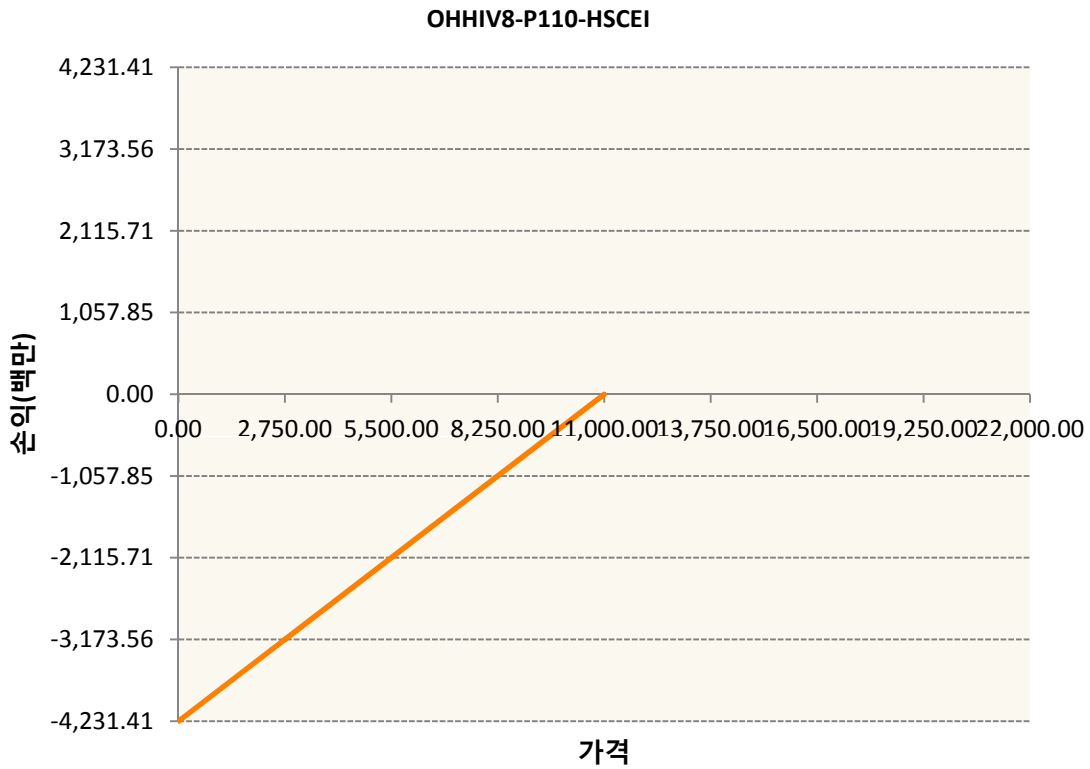
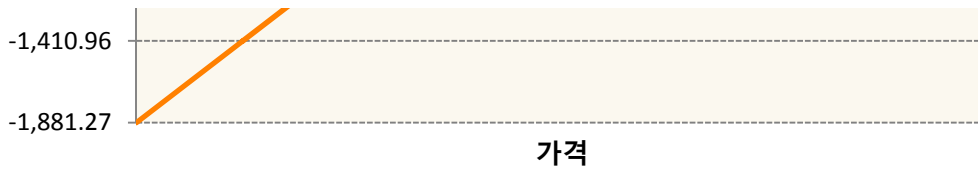


OHHIV8-C110-HSCEI



OHHIV8-P108-HSCEI





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|----------------------|----------|
| HCV8 | HSCEI FUTURES OCT 18 | 398 |
| OHHIV8-C1 | HSCEI | 151 |
| OHHIV8-C11 | HSCEI | 339 |
| OHHIV8-P1C | HSCEI | 151 |
| OHHIV8-P11 | HSCEI | 339 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|--------------|
| | 1,331 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

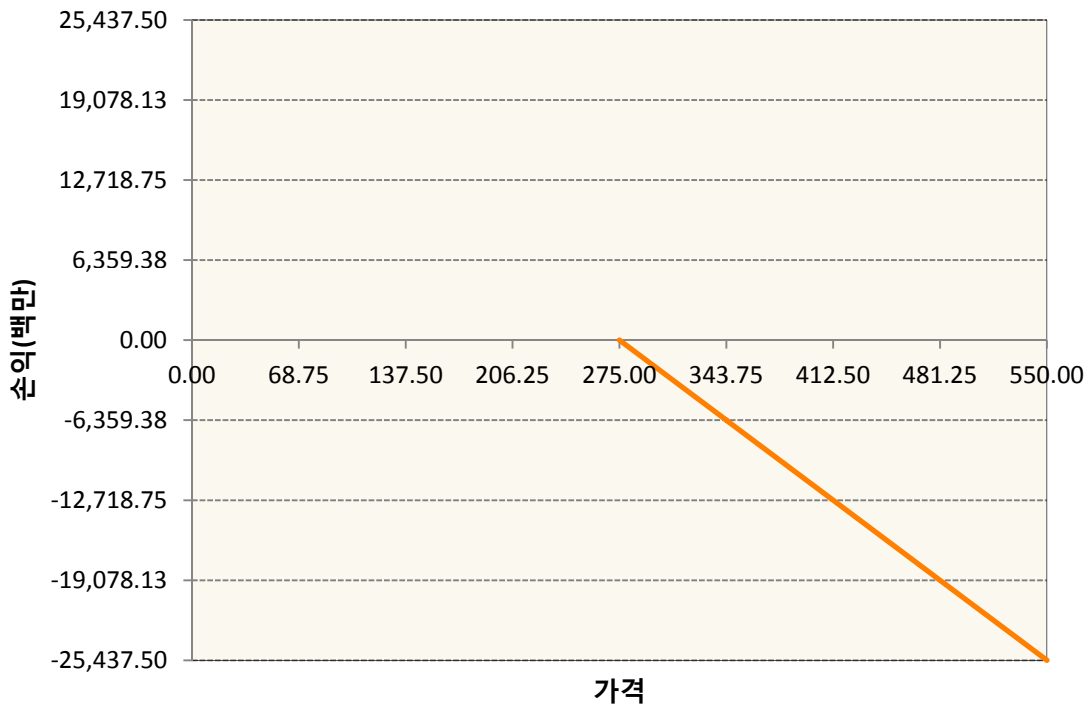
1. 계약금액

(단위:백만원)

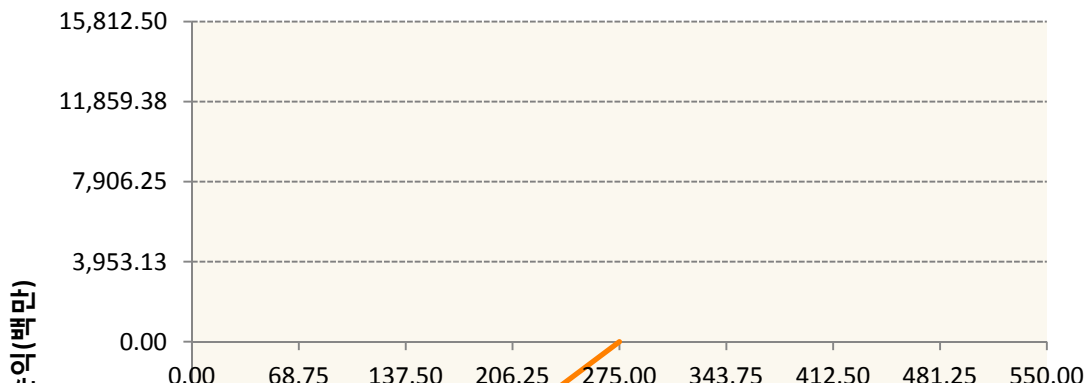
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 48,836 | 0 | 48,836 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 44,025 | -44,025 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4201NB2752-2018-11 콜275

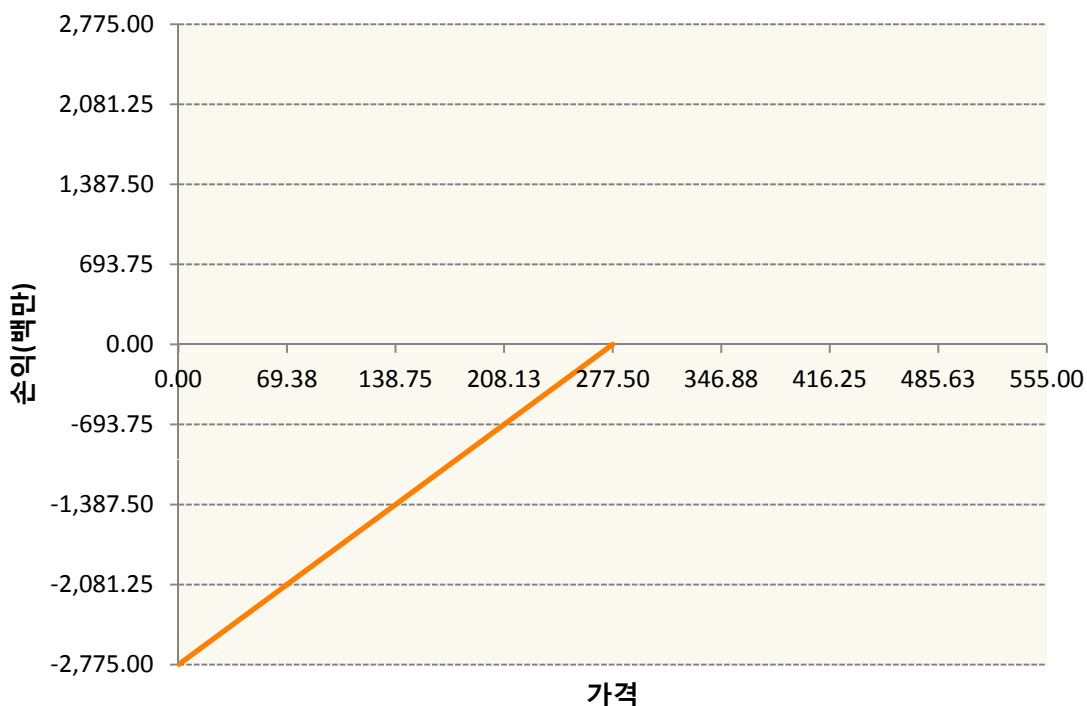


KR4301NB2751-2018-11 풋275





KR4301NB2777-2018-11 풋277.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | | |
|-----------------------------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--|
| 2.529E+11 UBSCFXC1 INDEX_14 | | | | | | | 4,027 | |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -4,027 | -4,027 | -4,027 | -4,027 | -4,027 | -4,027 | -4,027 | |
| -5.33% | -2,685 | -2,685 | -2,685 | -2,685 | -2,685 | -2,685 | -2,685 | |
| -2.67% | -1,342 | -1,342 | -1,342 | -1,342 | -1,342 | -1,342 | -1,342 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 1,342 | 1,342 | 1,342 | 1,342 | 1,342 | 1,342 | 1,342 | |
| 5.33% | 2,685 | 2,685 | 2,685 | 2,685 | 2,685 | 2,685 | 2,685 | |
| 8.00% | 4,027 | 4,027 | 4,027 | 4,027 | 4,027 | 4,027 | 4,027 | |
| KR4201NB27 2018-11 콜275 | | | | | | | 1,222 | |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 244 | 243 | 240 | 236 | 230 | 223 | 213 |
| -5.33% | 238 | 232 | 223 | 211 | 197 | 180 | 161 |
| -2.67% | 209 | 190 | 169 | 144 | 118 | 89 | 58 |
| 0% | 110 | 75 | 38 | 0 | -39 | -79 | -120 |
| 2.67% | -116 | -162 | -208 | -254 | -299 | -345 | -391 |
| 5.33% | -503 | -544 | -587 | -629 | -673 | -717 | -761 |
| 8.00% | -1,027 | -1,054 | -1,083 | -1,115 | -1,149 | -1,185 | -1,222 |

KR4301NB27 2018-11 풋275

1,145

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,142 | -1,142 | -1,142 | -1,142 | -1,143 | -1,144 | -1,145 |
| -5.33% | -733 | -734 | -735 | -737 | -740 | -744 | -748 |
| -2.67% | -330 | -334 | -340 | -347 | -356 | -365 | -376 |
| 0% | 44 | 30 | 16 | 0 | -16 | -33 | -51 |
| 2.67% | 332 | 310 | 289 | 268 | 246 | 225 | 203 |
| 5.33% | 491 | 473 | 455 | 436 | 417 | 397 | 377 |
| 8.00% | 548 | 540 | 530 | 519 | 507 | 493 | 479 |

KR4301NB27 2018-11 풋277.5

204

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -203 | -203 | -203 | -203 | -203 | -204 | -204 |
| -5.33% | -132 | -132 | -132 | -133 | -133 | -133 | -134 |
| -2.67% | -62 | -62 | -63 | -64 | -65 | -66 | -67 |
| 0% | 6 | 4 | 2 | 0 | -2 | -5 | -8 |
| 2.67% | 62 | 59 | 55 | 52 | 48 | 45 | 41 |
| 5.33% | 98 | 95 | 91 | 87 | 84 | 80 | 76 |
| 8.00% | 113 | 111 | 109 | 106 | 104 | 101 | 98 |

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

(단위:백만원)

6,619

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

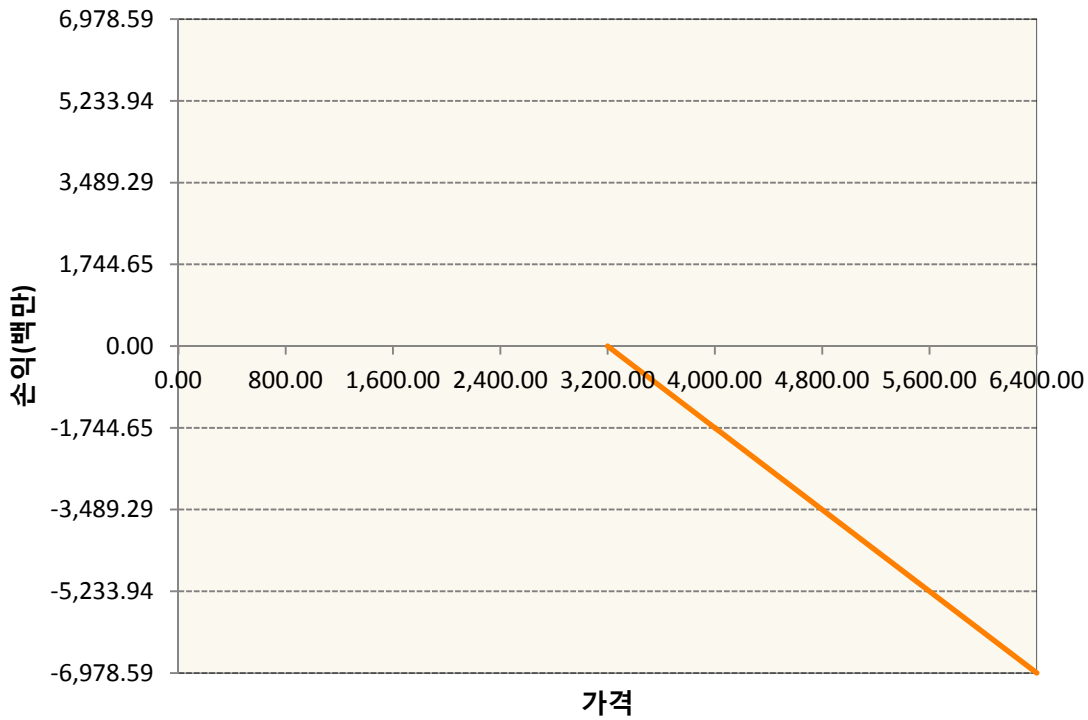
1. 계약금액

(단위:백만원)

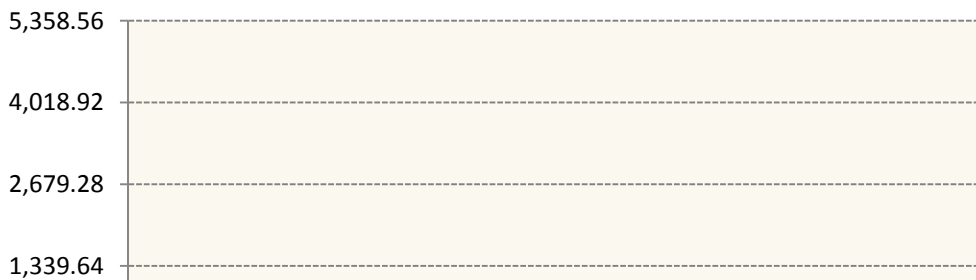
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,734 | 0 | 5,734 | |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 72,504 | 0 | 72,504 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 24,674 | -24,674 | 장내 |

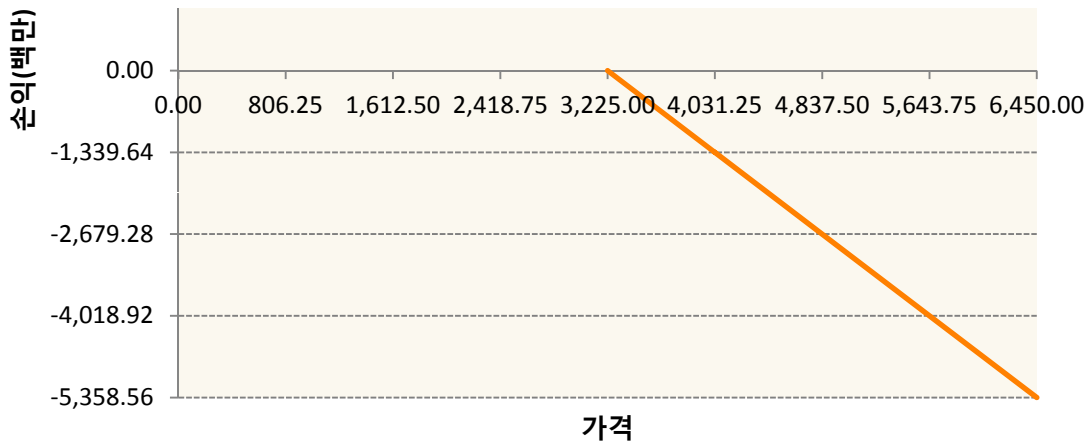
2. 만기시점의 손익구조

OESXX8-C3200-EURO STOXX 50

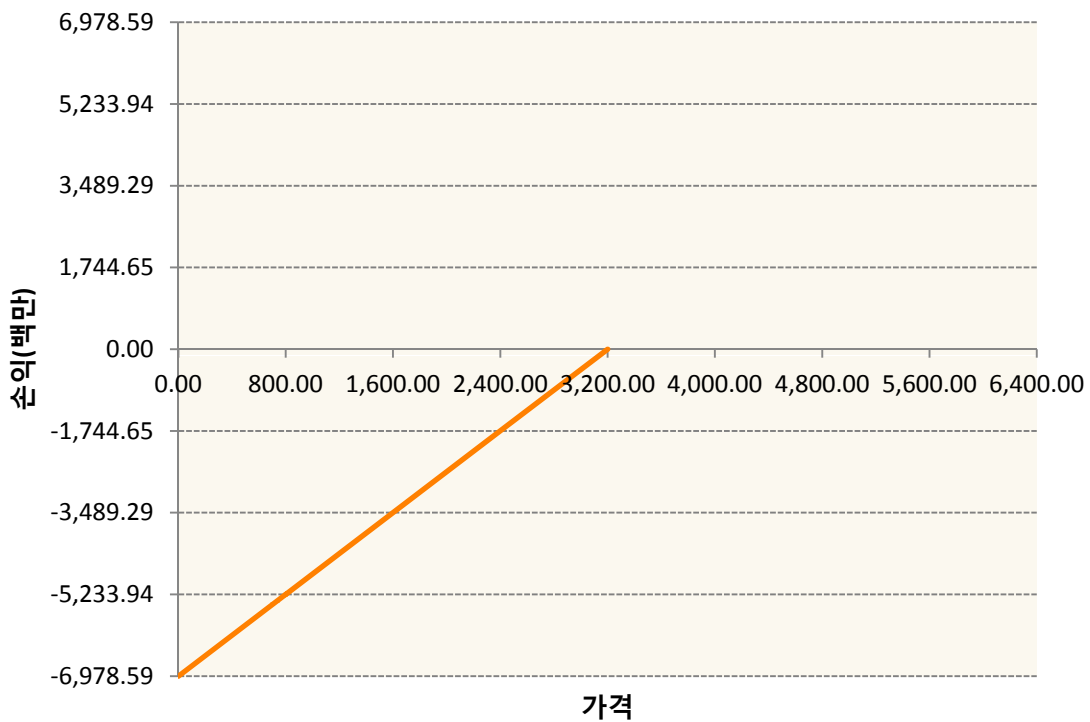


OESXX8-C3225-EURO STOXX 50

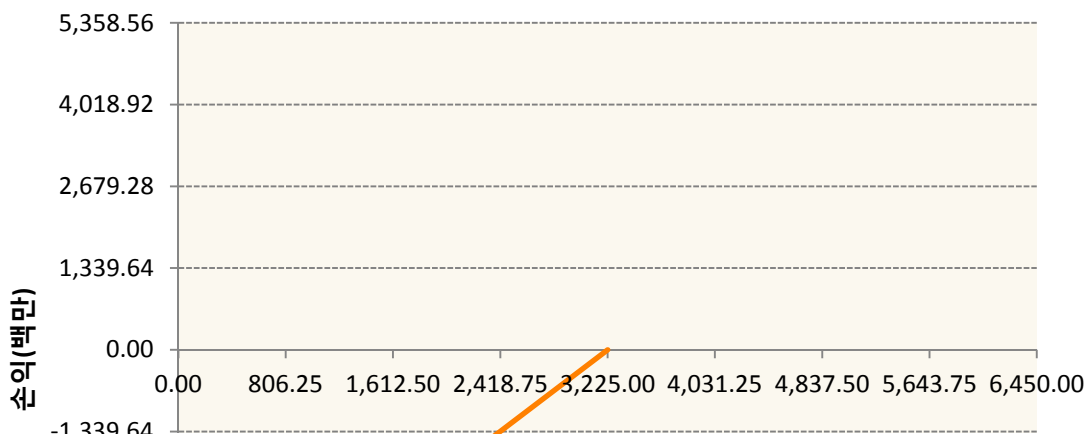


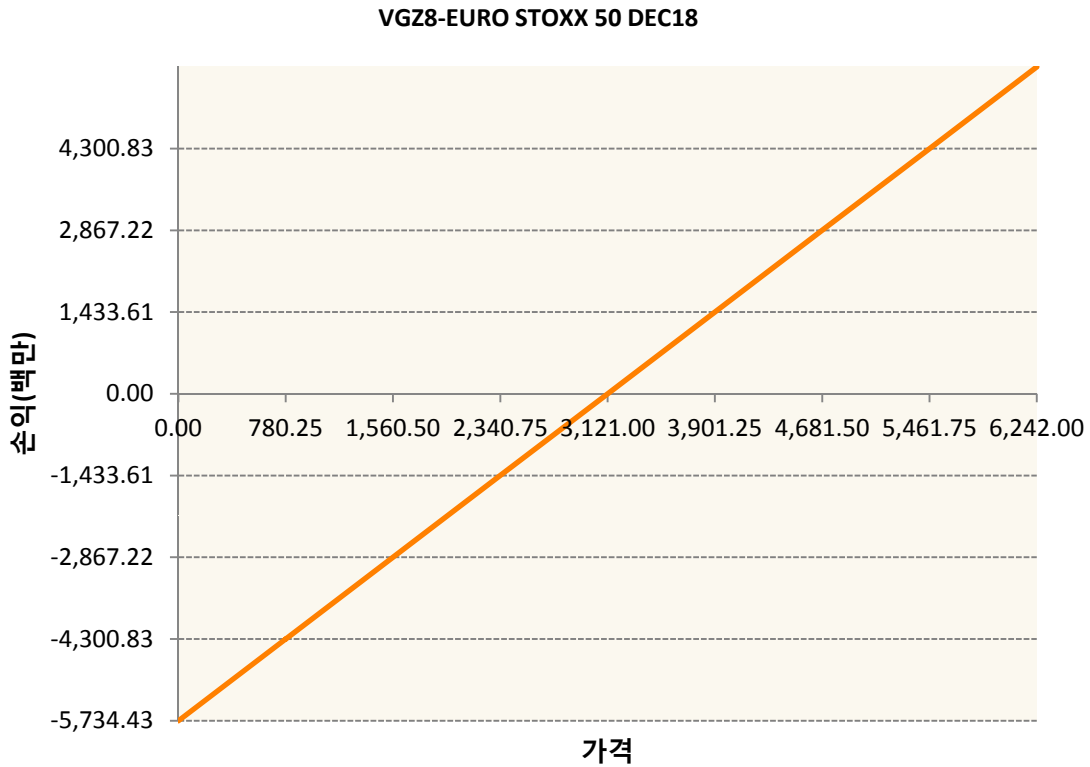


OESXX8-P3200-EURO STOXX 50



OESXX8-P3225-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | |
|---|-----|
| 260105SQP×SG EURO Covered CALL STRATEGY | 90 |
| 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 | 459 |

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

1,620

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

(단위:백만원)

1,110

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

(단위:백만원)

87

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

(단위:백만원)

131

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

(단위:백만원)

145

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

(단위:백만원)

39

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

리디파인K200(주식혼합-파생재간

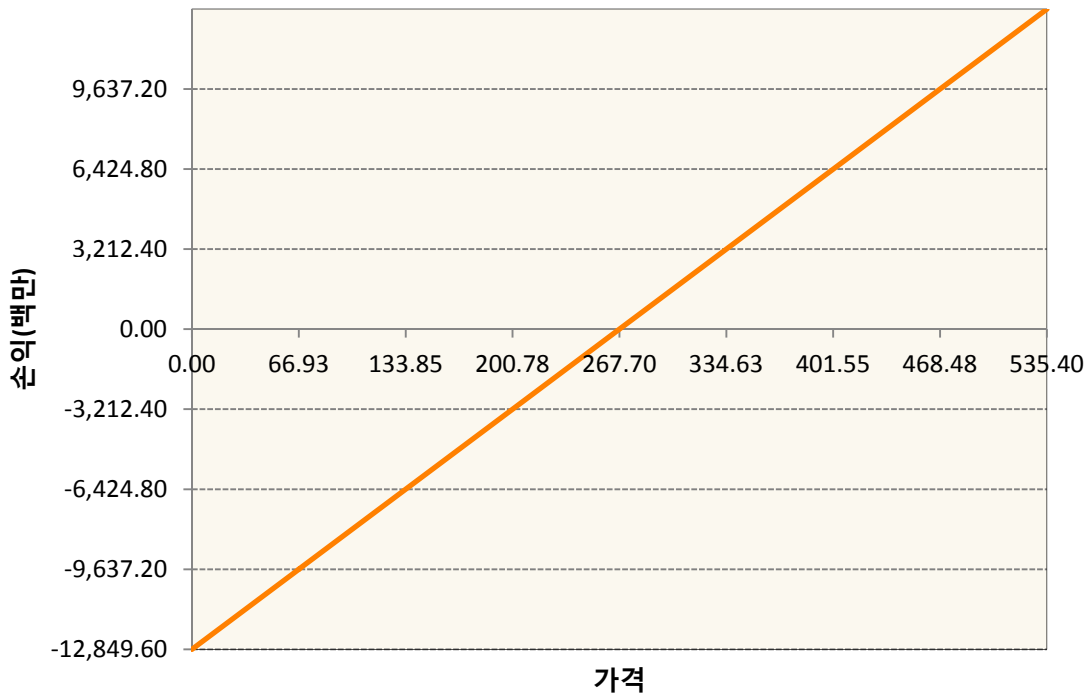
1. 계약금액

(단위:백만원)

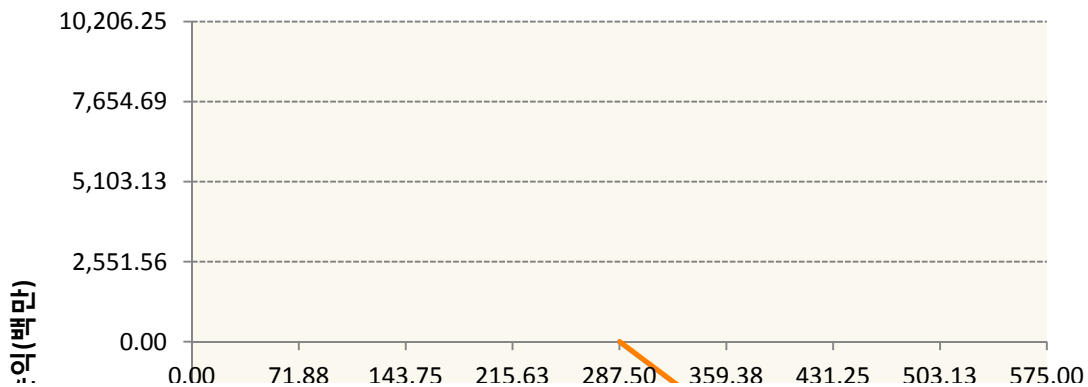
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 12,850 | 0 | 12,850 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 4,059 | 23,401 | -19,343 | 장내 |

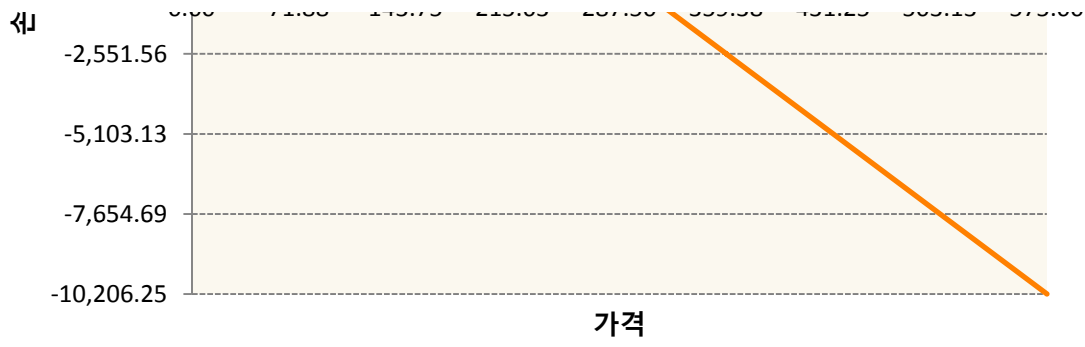
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

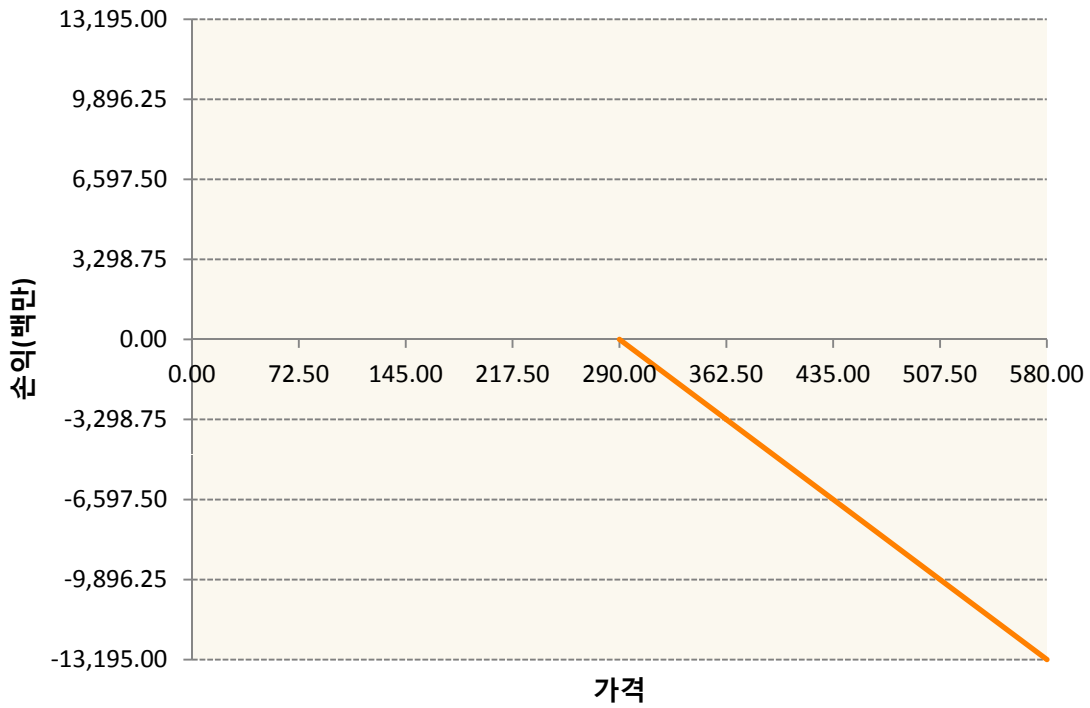


KR4201NB2877-2018-11 콜287.5

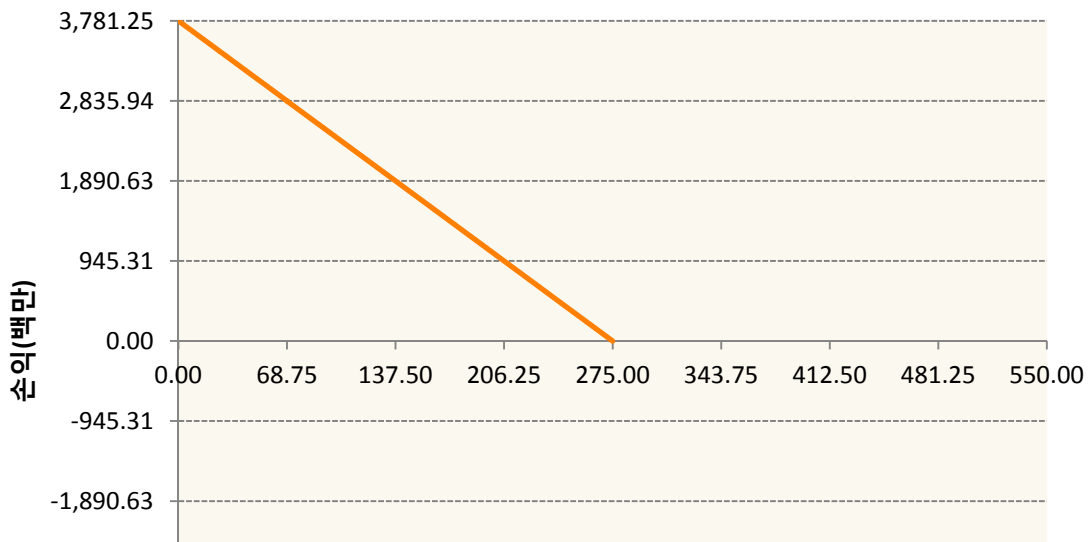


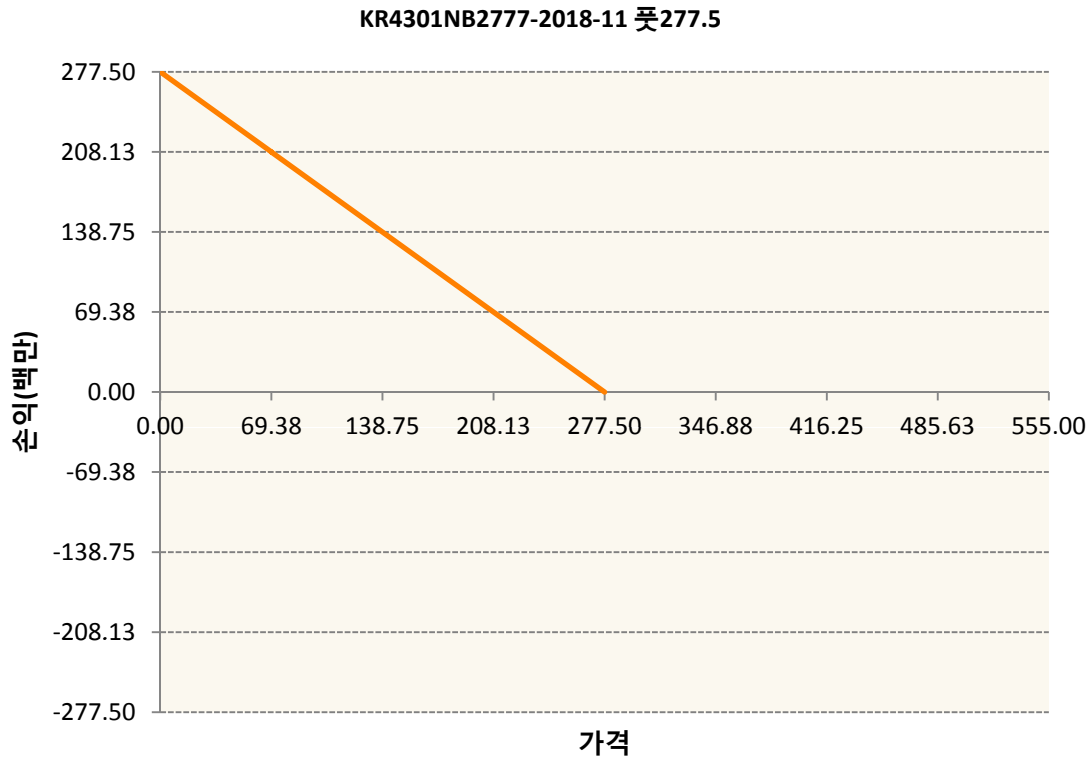
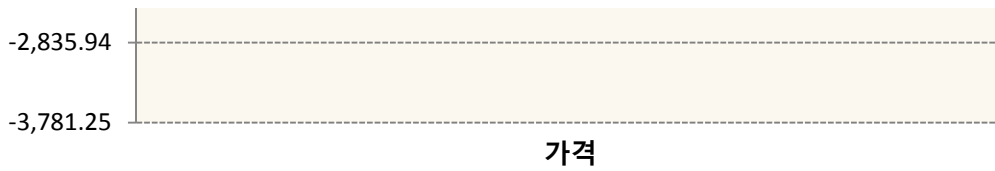


KR4201NB2901-2018-11 콜290



KR4301NB2751-2018-11 풋275





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0(2018-12 코스피200지수선물) 1,024

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,024 | -1,024 | -1,024 | -1,024 | -1,024 | -1,024 | -1,024 |
| -5.33% | -683 | -683 | -683 | -683 | -683 | -683 | -683 |
| -2.67% | -341 | -341 | -341 | -341 | -341 | -341 | -341 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 341 | 341 | 341 | 341 | 341 | 341 | 341 |
| 5.33% | 683 | 683 | 683 | 683 | 683 | 683 | 683 |
| 8.00% | 1,024 | 1,024 | 1,024 | 1,024 | 1,024 | 1,024 | 1,024 |

KR4201NB282018-11 콜287.5 266

| 가격 | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|--------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 21 | 21 | 21 | 20 | 20 | 19 | 18 |
| -5.33% | 21 | 20 | 20 | 19 | 18 | 16 | 14 |
| -2.67% | 20 | 19 | 17 | 14 | 11 | 6 | 1 |

| | | | | | | | |
|-------|------|------|------|------|------|------|------|
| 0% | 15 | 12 | 6 | 0 | -7 | -16 | -25 |
| 2.67% | -3 | -12 | -23 | -34 | -47 | -60 | -74 |
| 5.33% | -53 | -69 | -85 | -101 | -118 | -135 | -153 |
| 8.00% | -155 | -174 | -192 | -211 | -229 | -248 | -266 |

KR4201NB27 2018-11 콜290

296

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 19 | 19 | 19 | 18 | 18 | 18 | 17 |
| -5.33% | 19 | 18 | 18 | 17 | 16 | 15 | 12 |
| -2.67% | 18 | 17 | 16 | 13 | 10 | 5 | 0 |
| 0% | 15 | 11 | 6 | 0 | -8 | -17 | -27 |
| 2.67% | 0 | -10 | -21 | -34 | -48 | -63 | -79 |
| 5.33% | -48 | -66 | -85 | -104 | -124 | -145 | -166 |
| 8.00% | -154 | -177 | -201 | -225 | -248 | -272 | -296 |

KR4301NB27 2018-11 풋275

274

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 273 | 273 | 273 | 273 | 273 | 273 | 274 |
| -5.33% | 175 | 176 | 176 | 176 | 177 | 178 | 179 |
| -2.67% | 79 | 80 | 81 | 83 | 85 | 87 | 90 |
| 0% | -11 | -7 | -4 | 0 | 4 | 8 | 12 |
| 2.67% | -79 | -74 | -69 | -64 | -59 | -54 | -49 |
| 5.33% | -117 | -113 | -109 | -104 | -100 | -95 | -90 |
| 8.00% | -131 | -129 | -127 | -124 | -121 | -118 | -115 |

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 | 7 | 7 |
| 0% | -1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| 2.67% | -6 | -6 | -6 | -5 | -5 | -4 | -4 |
| 5.33% | -10 | -9 | -9 | -9 | -8 | -8 | -8 |
| 8.00% | -11 | -11 | -11 | -11 | -10 | -10 | -10 |

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

(단위:백만원)

1,407

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

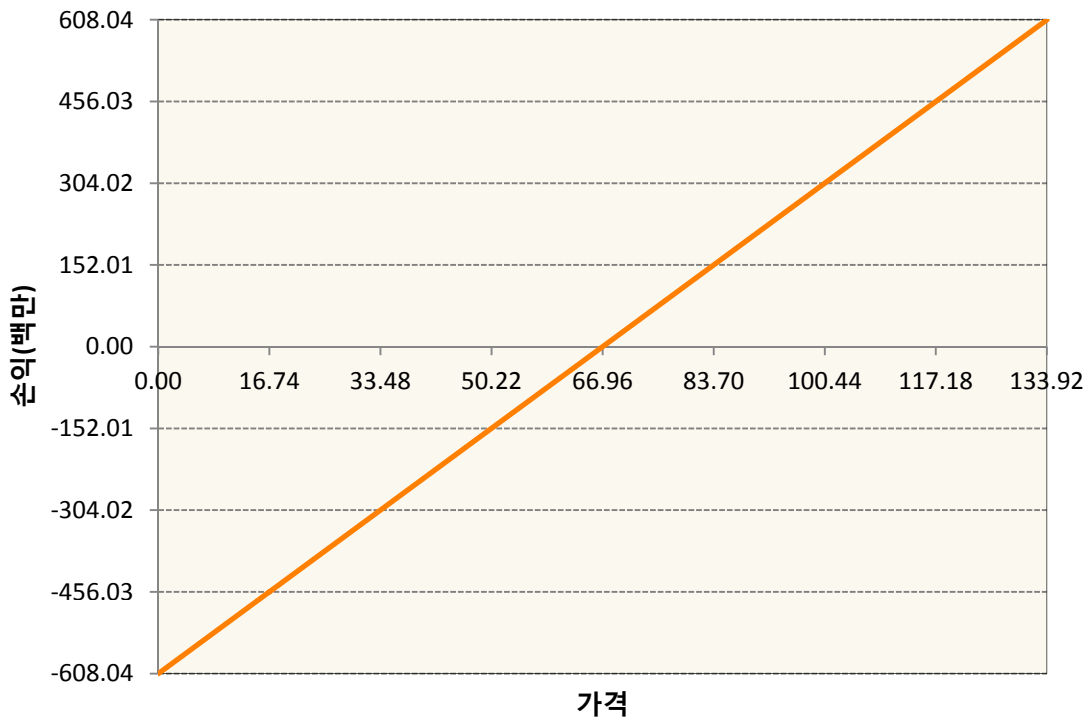
1. 계약금액

(단위:백만원)

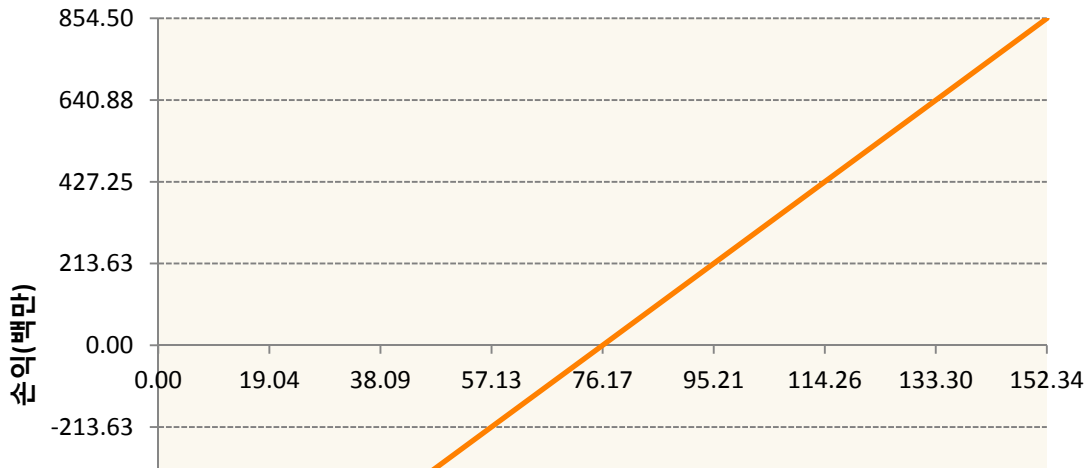
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,335 | 409 | 2,925 | |

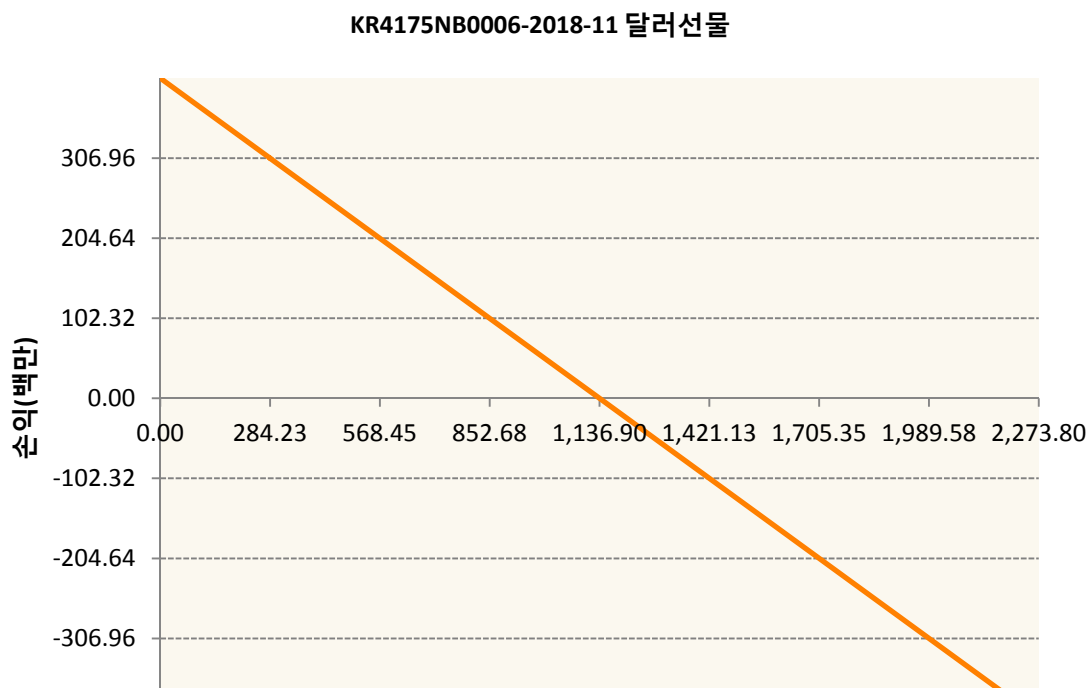
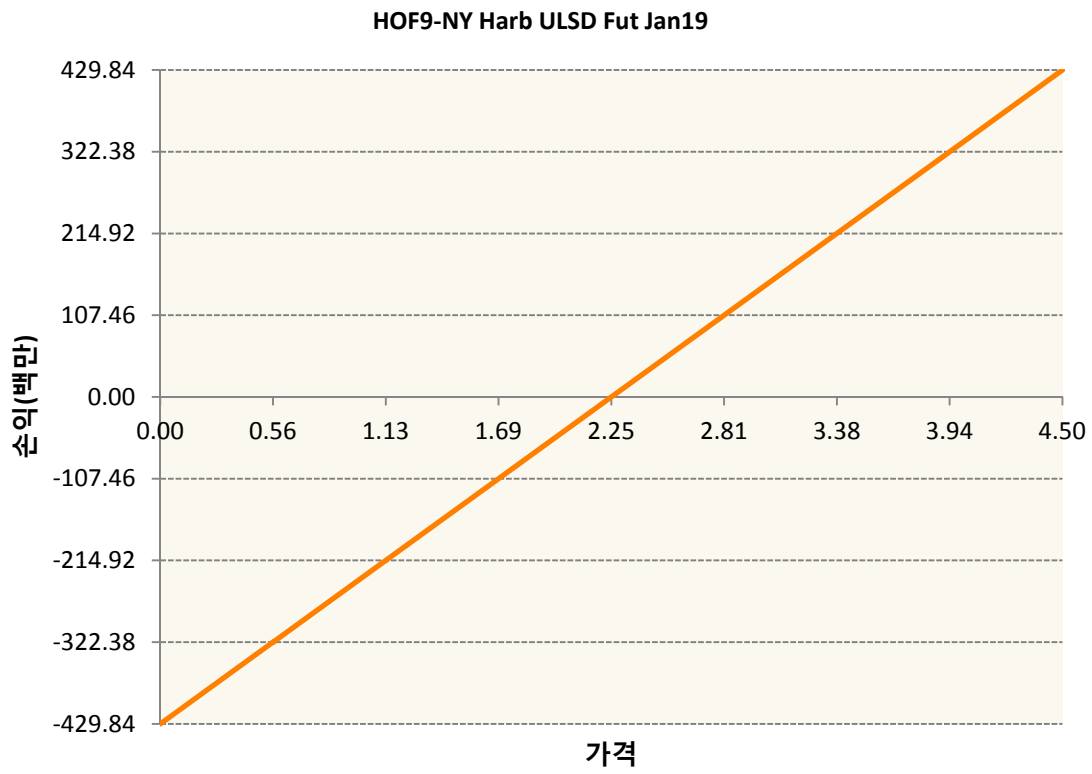
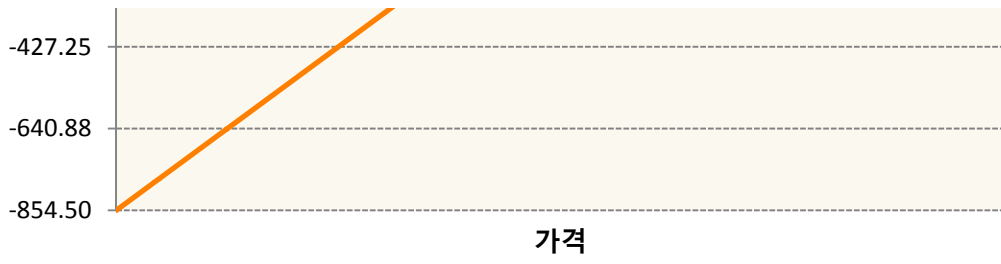
2. 만기시점의 손익구조

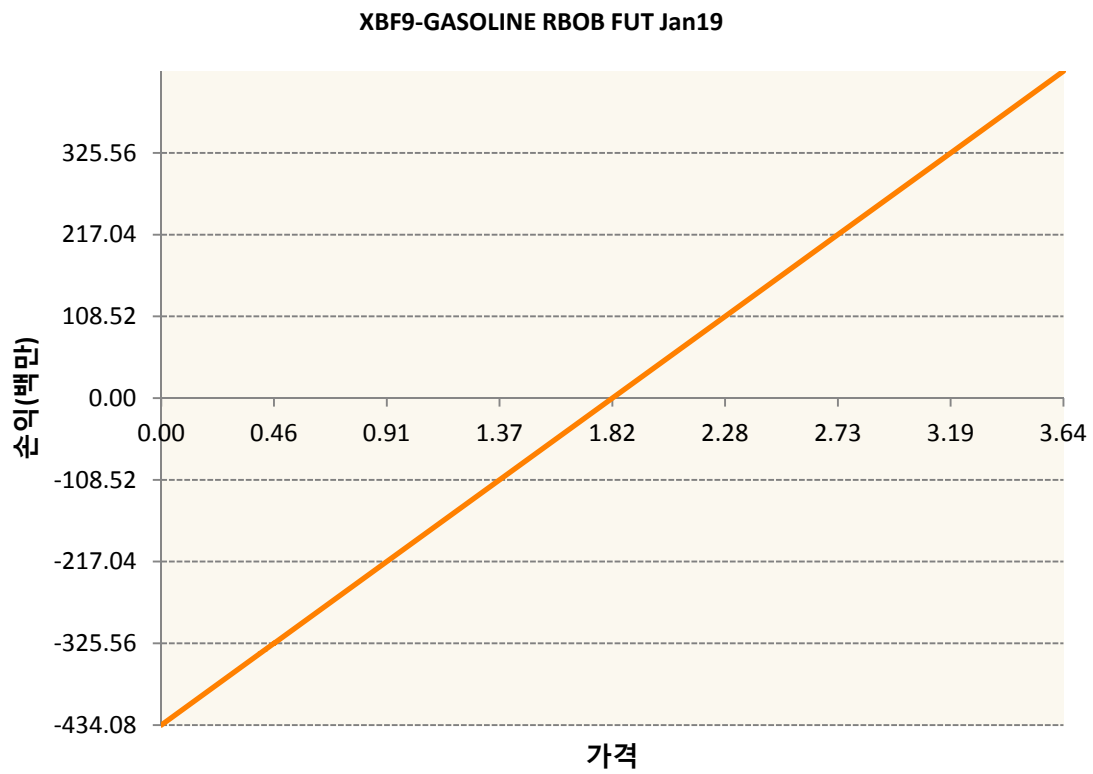
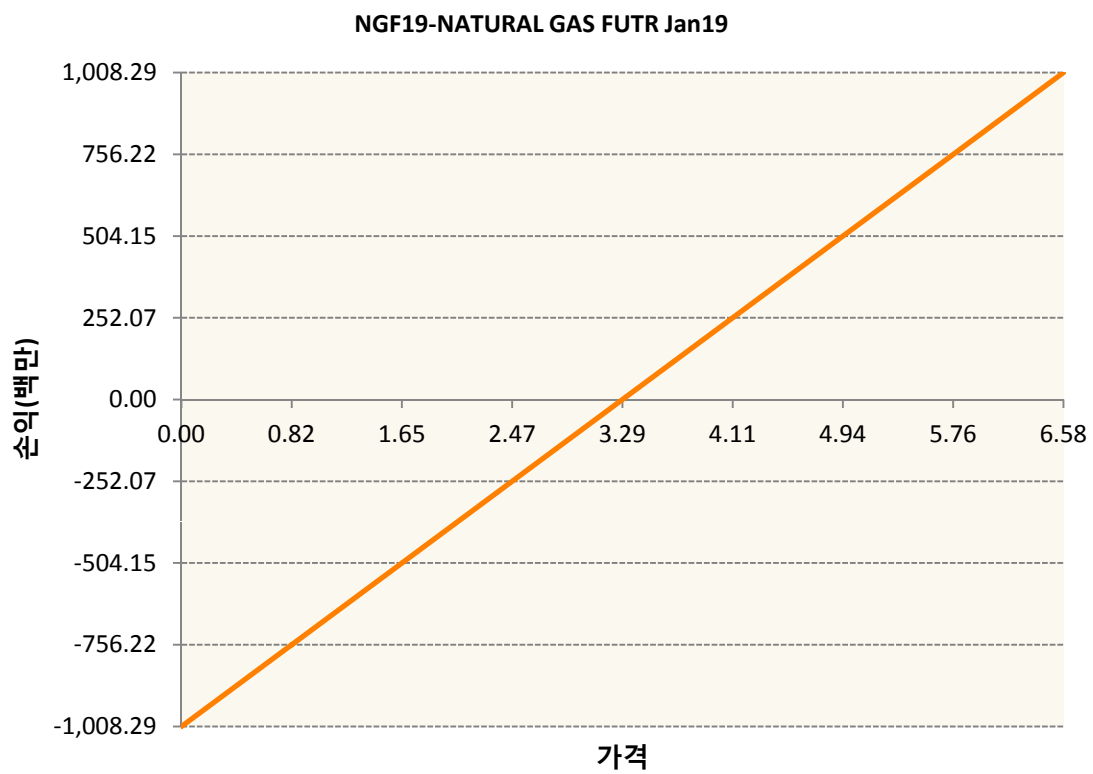
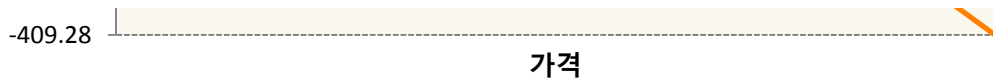
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



COF9-BRENT CRUDE FUTR JAN19







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|------------------------|-------------------------|----|
| CLF9 | WTI CRUDE FUTURE Jan19 | 49 |
| COF9 | BRENT CRUDE FUTR JAN19 | 68 |
| HOF9 | NY Harb ULSD Fut Jan19 | 34 |
| KR4175NB0(2018-11 달러선물 | | 33 |
| NGF19 | NATURAL GAS FUTR Jan19 | 81 |
| XBF9 | GASOLINE RBOB FUT Jan19 | 35 |

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

403

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2018-10-26 |
| 기준일 | 2018-10-25 |

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

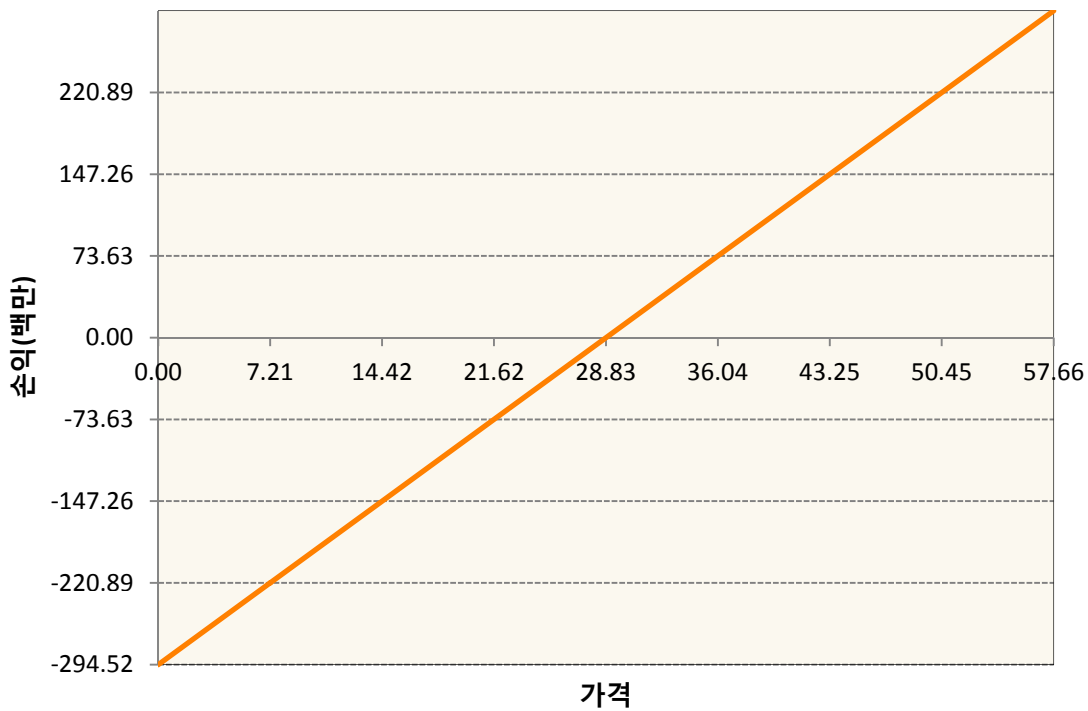
1. 계약금액

(단위:백만원)

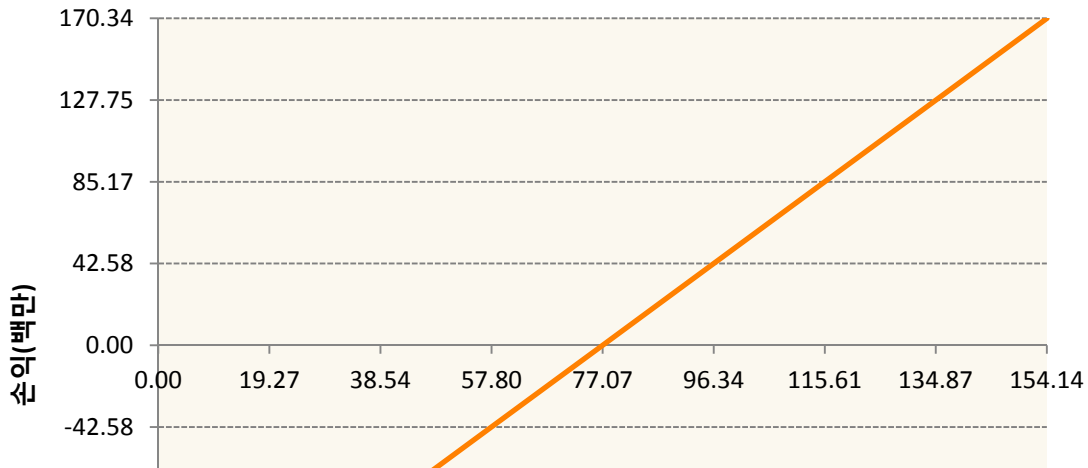
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,603 | 80 | 3,524 | |

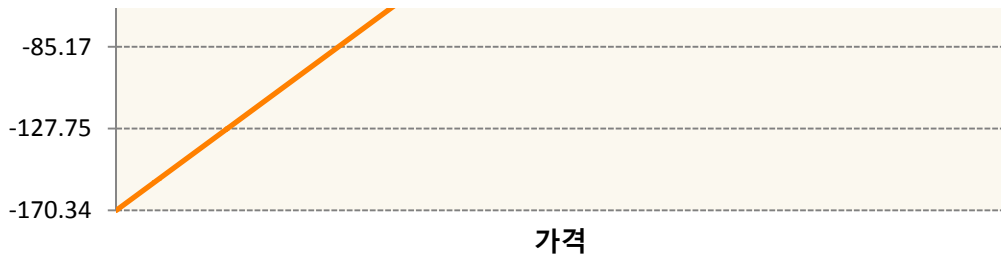
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

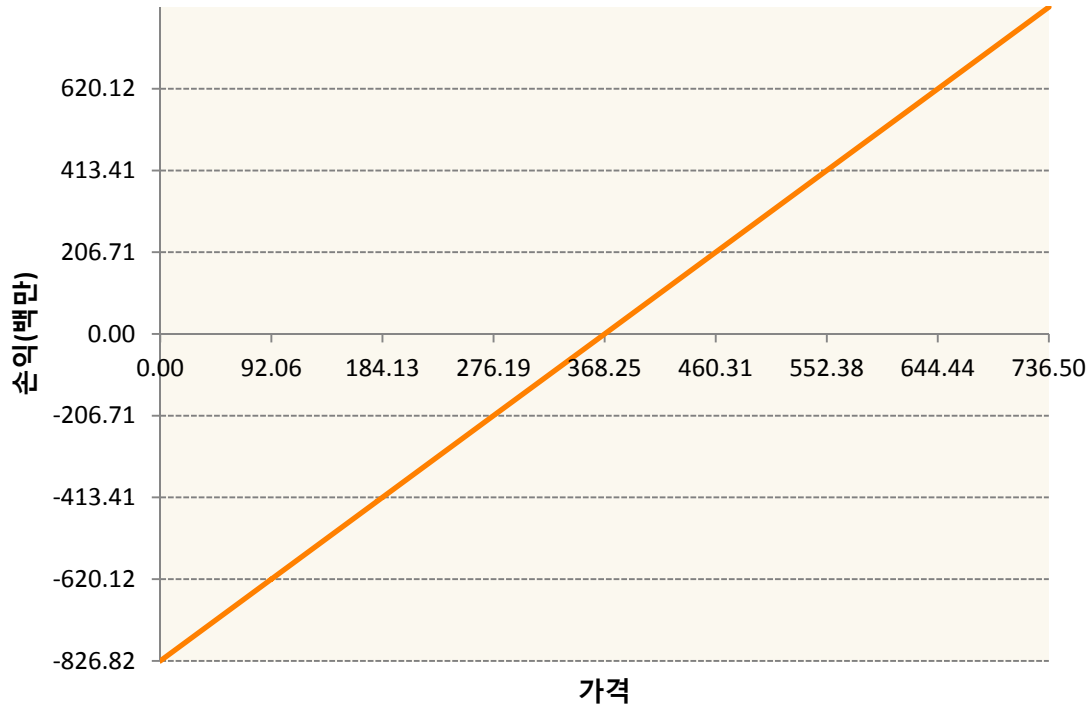


CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18

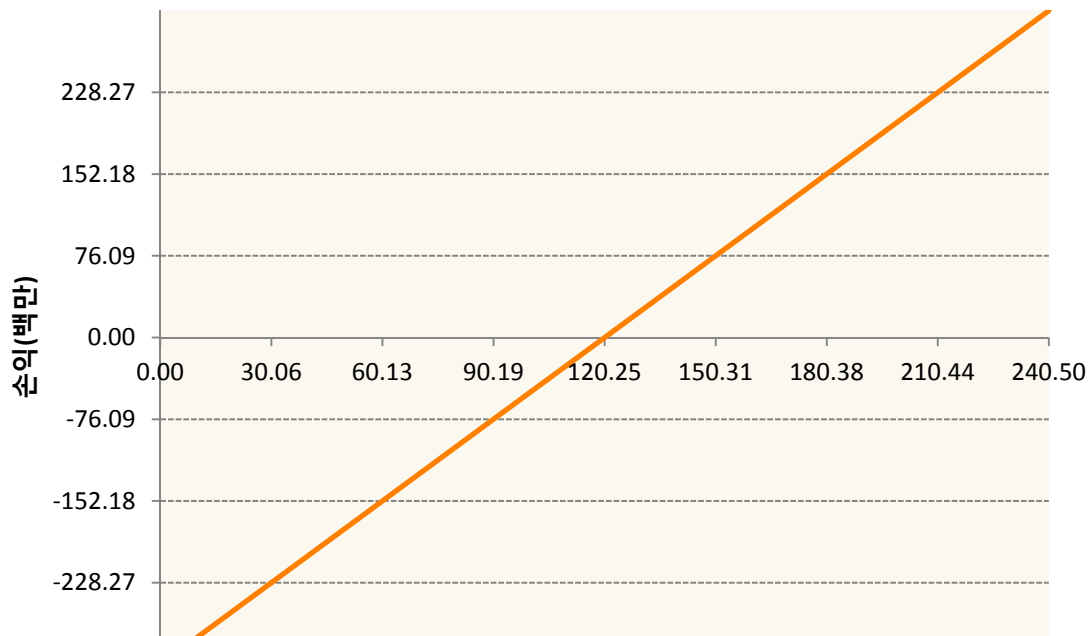


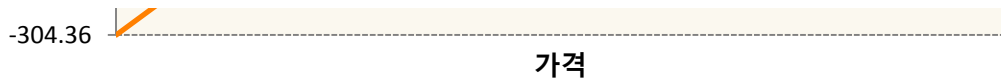


CZ8-CORN FUTURE DEC18

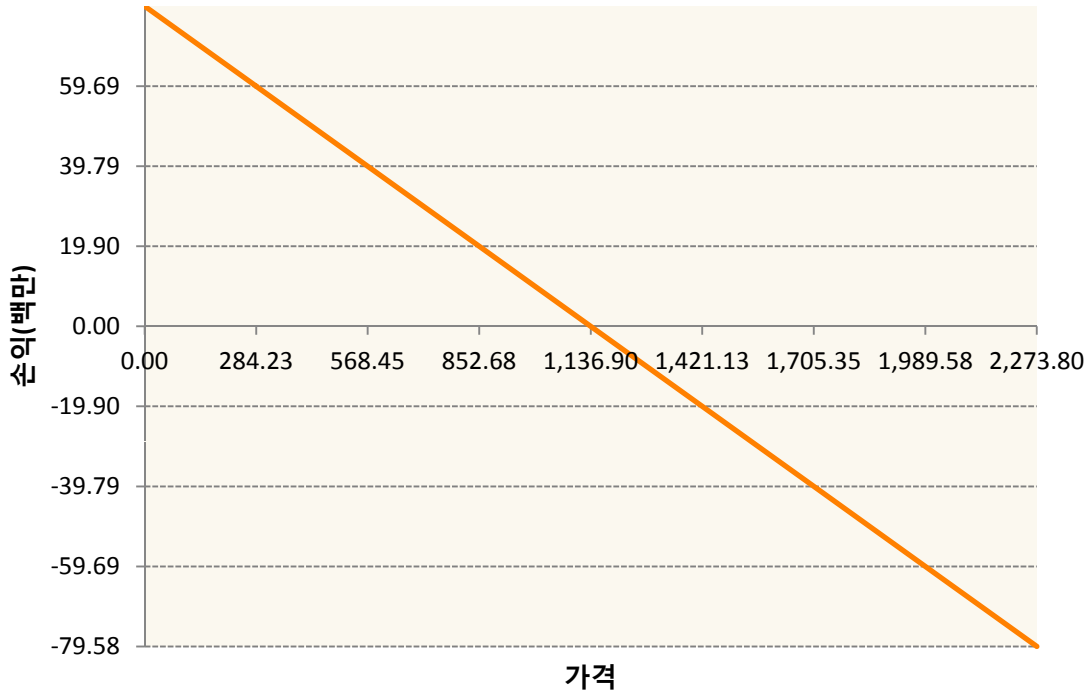


KCZ8-COFFEE 'C' FUTURE Dec18

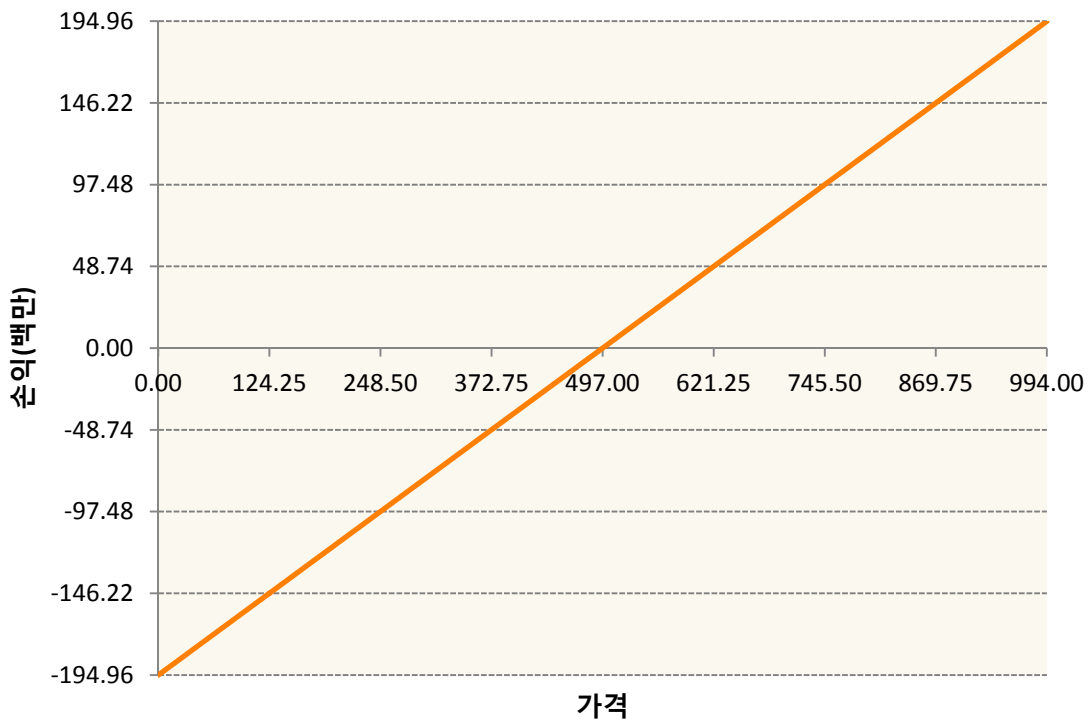




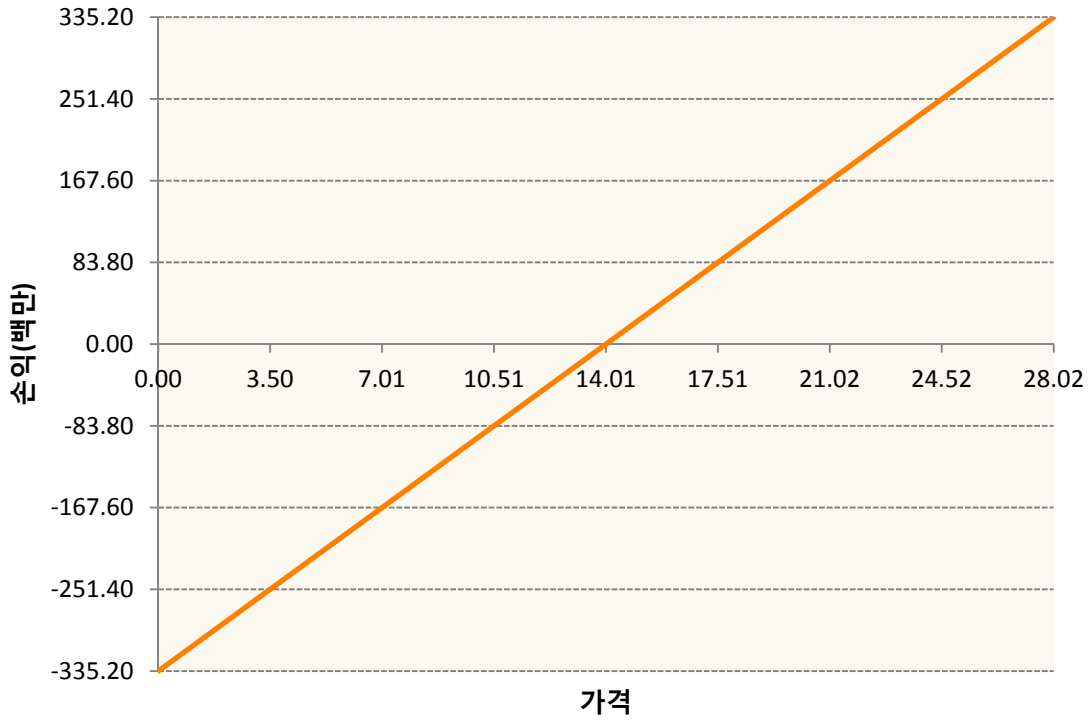
KR4175NB0006-2018-11 달러선물



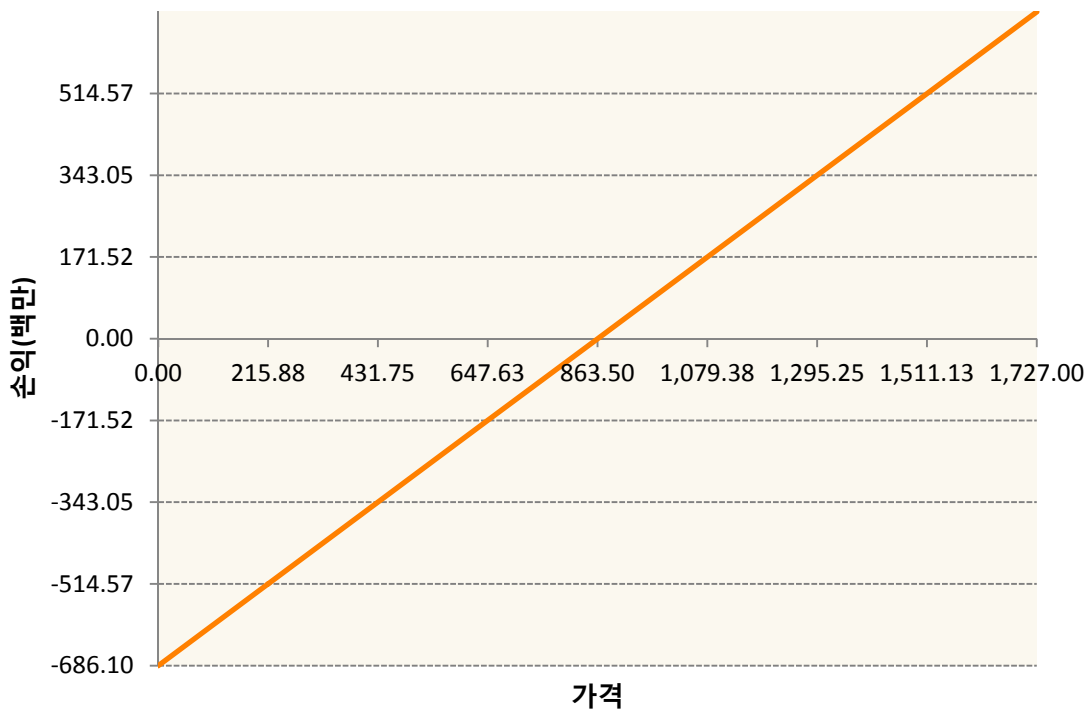
KWZ8-KC HRW WHEAT FUT DEC18



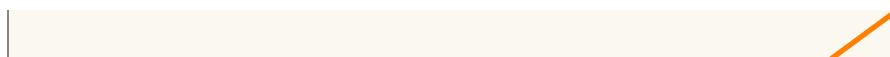
SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

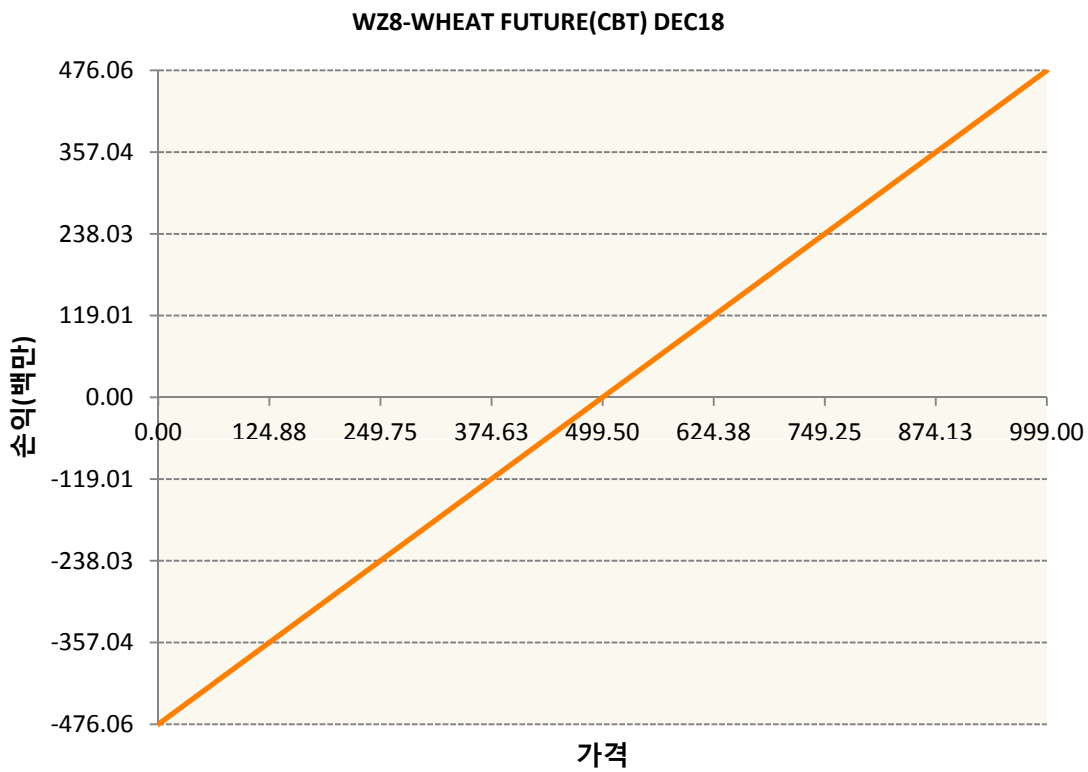
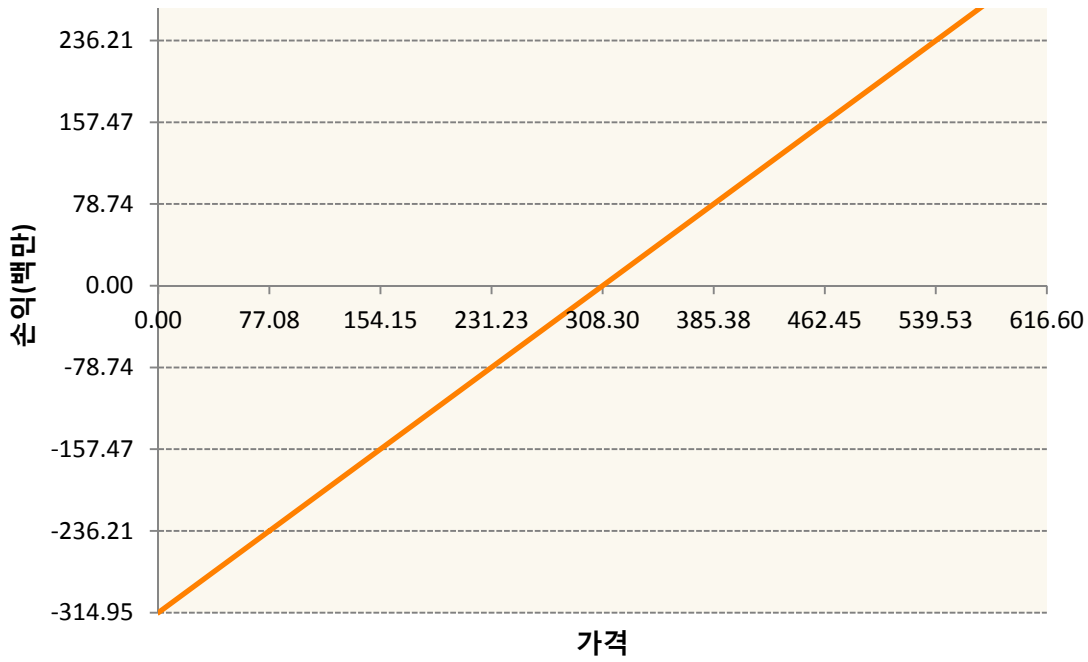


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19



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 | 66 |
| KCZ8 | COFFEE 'C' FUTURE Dec18 | 24 |
| KR4175NB0(| 2018-11 달러선물 | 6 |

| | | |
|------|-------------------------|----|
| KWZ8 | KC HRW WHEAT FUT DEC18 | 16 |
| SBH9 | SUGAR #11 (WORLD) MAR19 | 27 |
| SF9 | SOYBEAN FUTURE Jan19 | 55 |
| SMF9 | SOYBEAN MEAL FUTR Jan19 | 25 |
| WZ8 | WHEAT FUTURE(CBT) DEC18 | 38 |

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

(단위:백만원)

314