| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

# 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 | 10 | 0 | 10 | 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

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

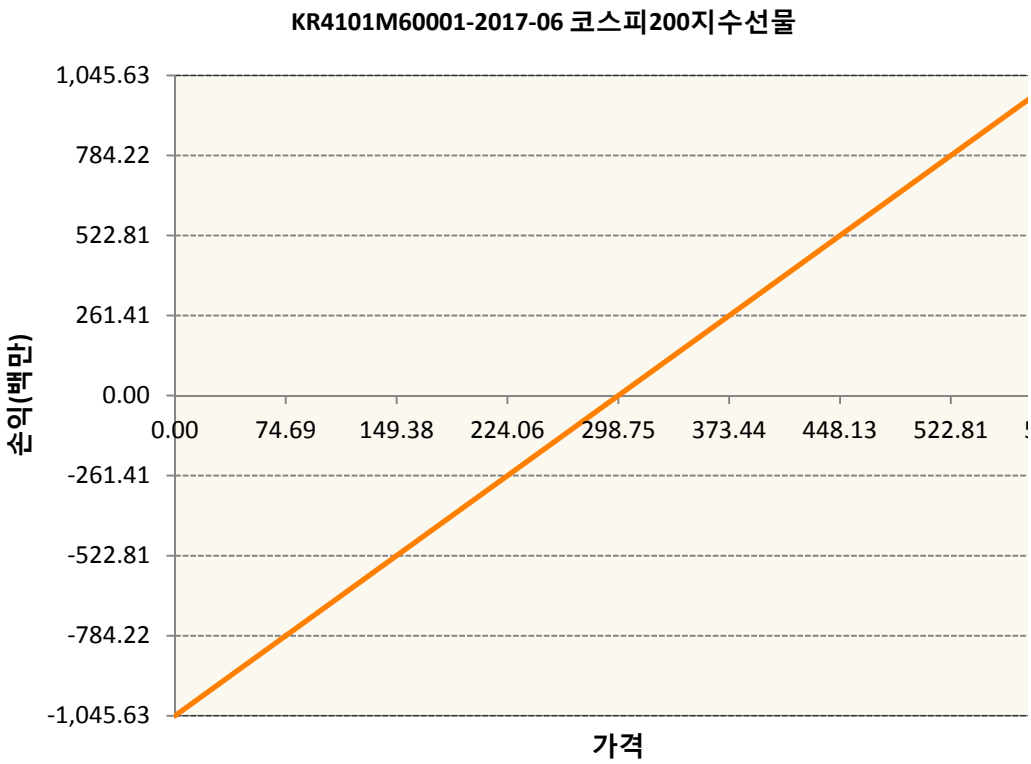
# 스마트인덱스모

## 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 | 1,046 | 0 | 1,046 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M60( 2017-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 84 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 | -84 |
| -5.33% | -56 | -56 | -56 | -56 | -56 | -56 | -56 |
| -2.67% | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 | -28 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 | 28 |
| 5.33% | 56 | 56 | 56 | 56 | 56 | 56 | 56 |
| 8.00% | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 | 84 |

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

| |
|---|
| **55** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

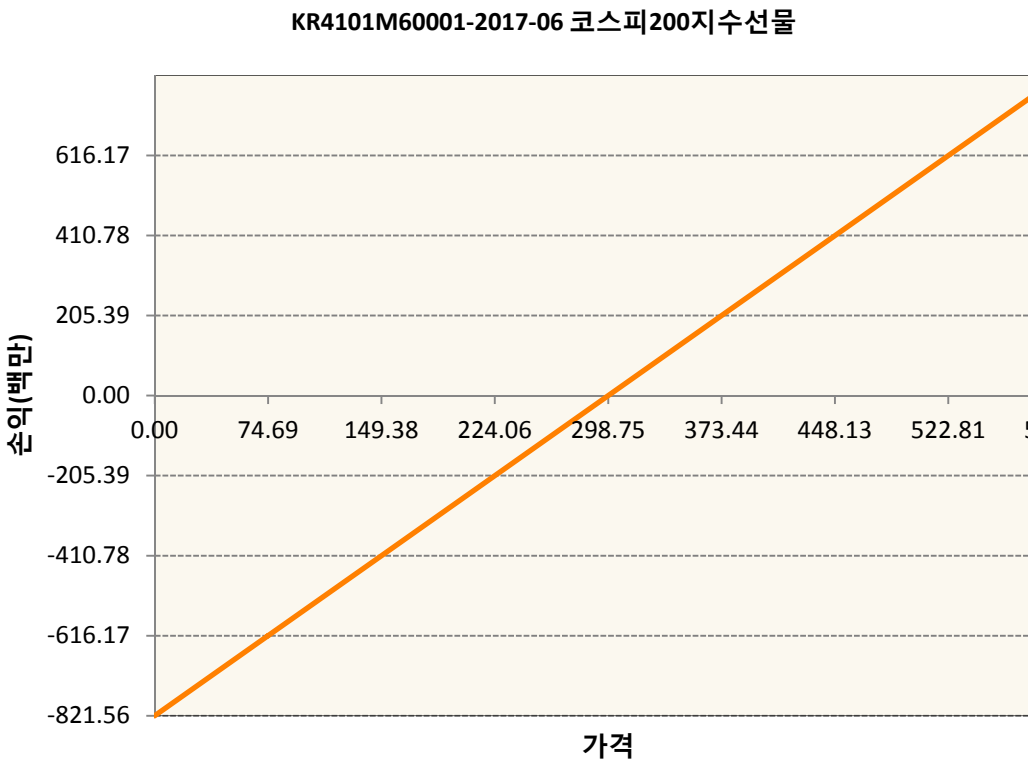
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 822 | 0 | 822 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101M60( 2017-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 66 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 |
| -5.33% | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 |
| -2.67% | -22 | -22 | -22 | -22 | -22 | -22 | -22 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 |
| 5.33% | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 |
| 8.00% | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 |

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

| 43 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

# 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 | 11,879 | 0 | 11,879 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWMXWO0( 신한MXWO 미래S170222 | 978 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **547** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2017-05-19 |
|---|---|
| 기준일 | 2017-05-18 |

# 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 | 4,939 | 0 | 4,939 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S170308 | 363 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **341** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

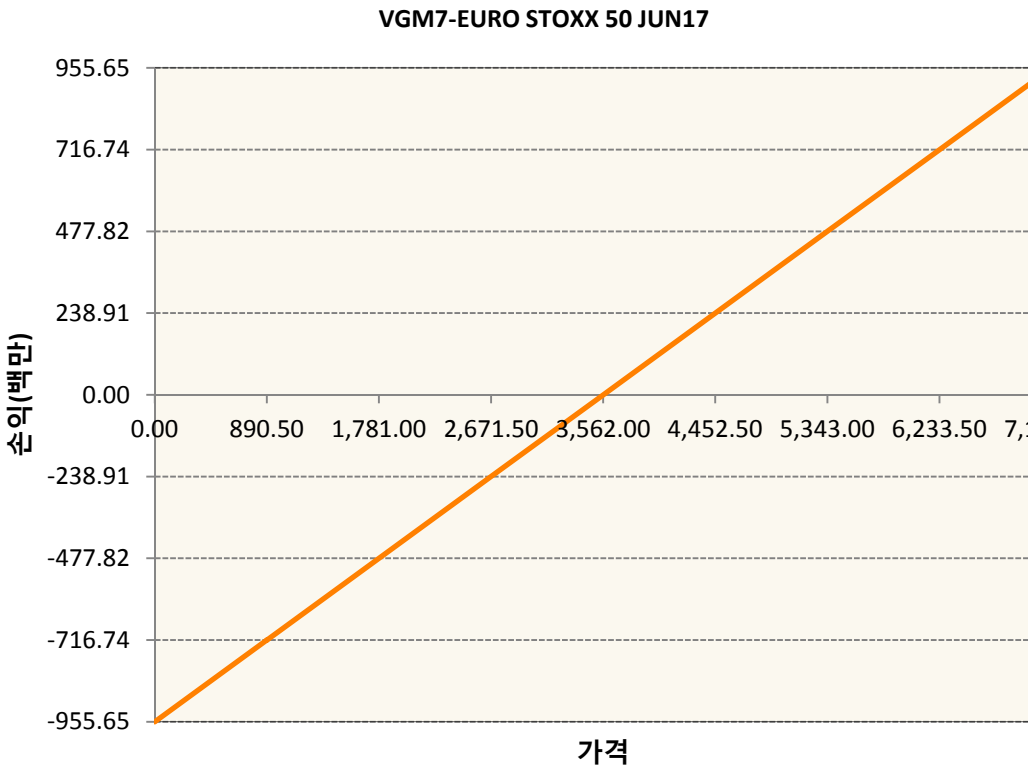
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 956 | 0 | 956 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGM7 | EURO STOXX 50 JUN17 | 76 |

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

(단위:백만원)

**75**

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

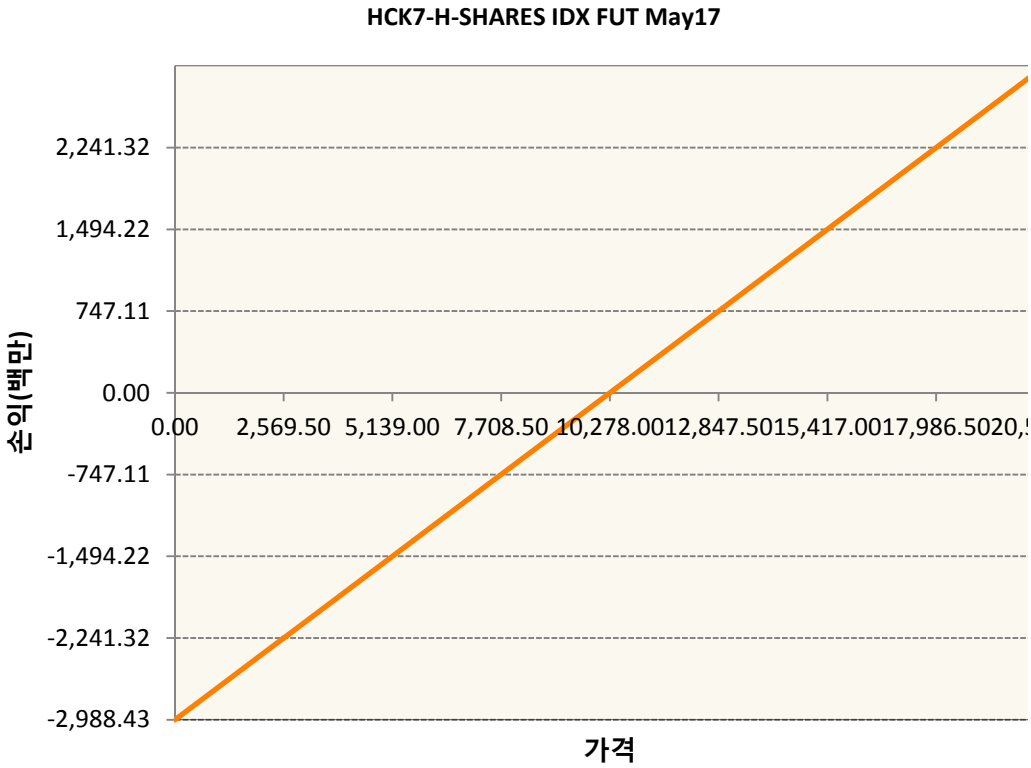
# 차이나인덱스모(주식-파생형)

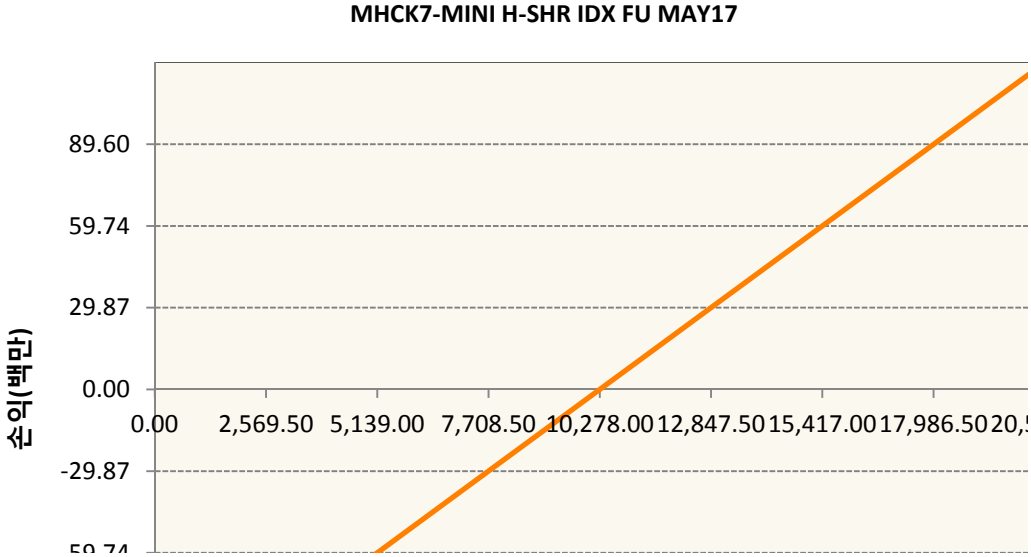
## 1. 계약금액

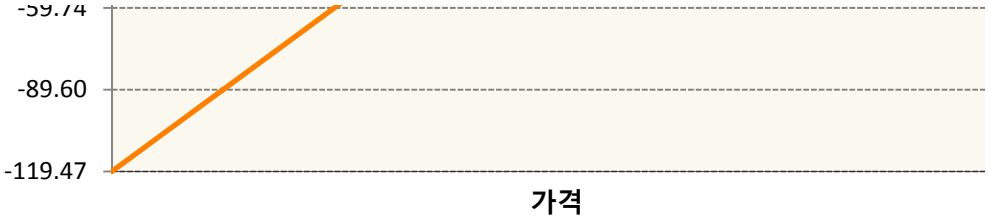
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,108 | 0 | 3,108 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조






**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCK7 | H-SHARES IDX FUT May17 | 239 |
| MHCK7 | MINI H-SHR IDX FU MAY17 | 10 |

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

| |
|---|
| **263** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

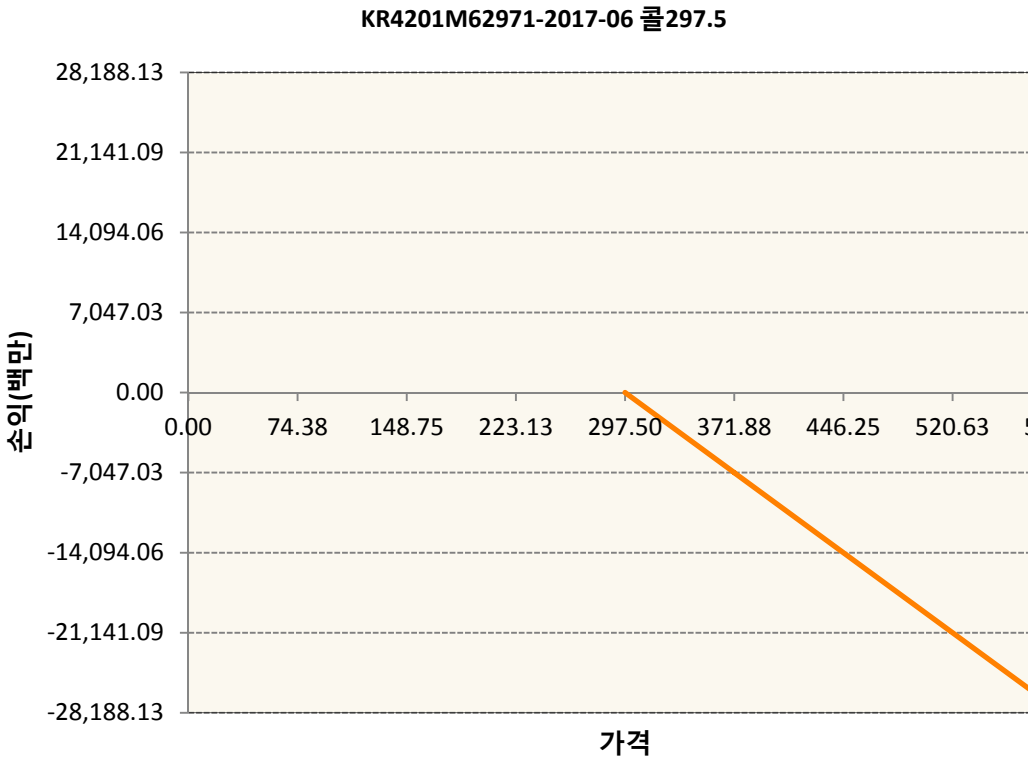
# 커버드콜모(주식혼합-파생형)

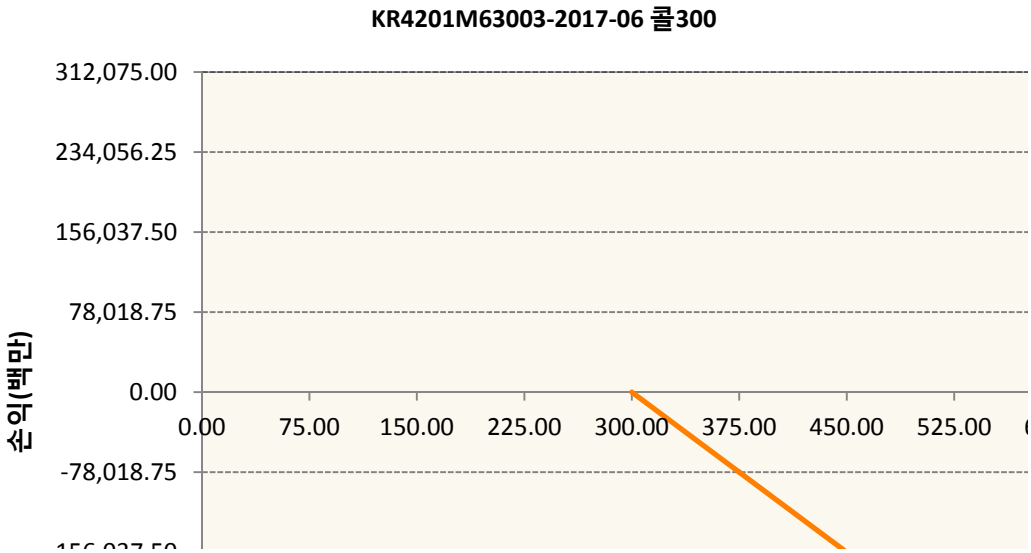
## 1. 계약금액

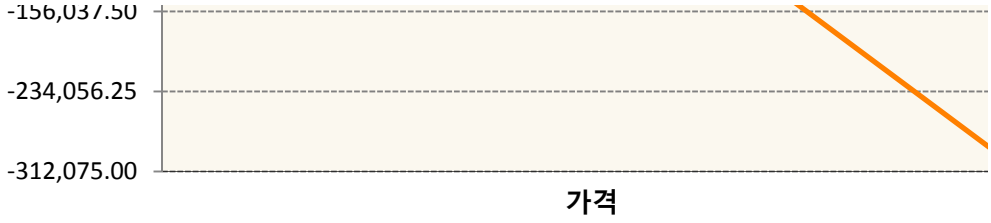
(단위:백만원)

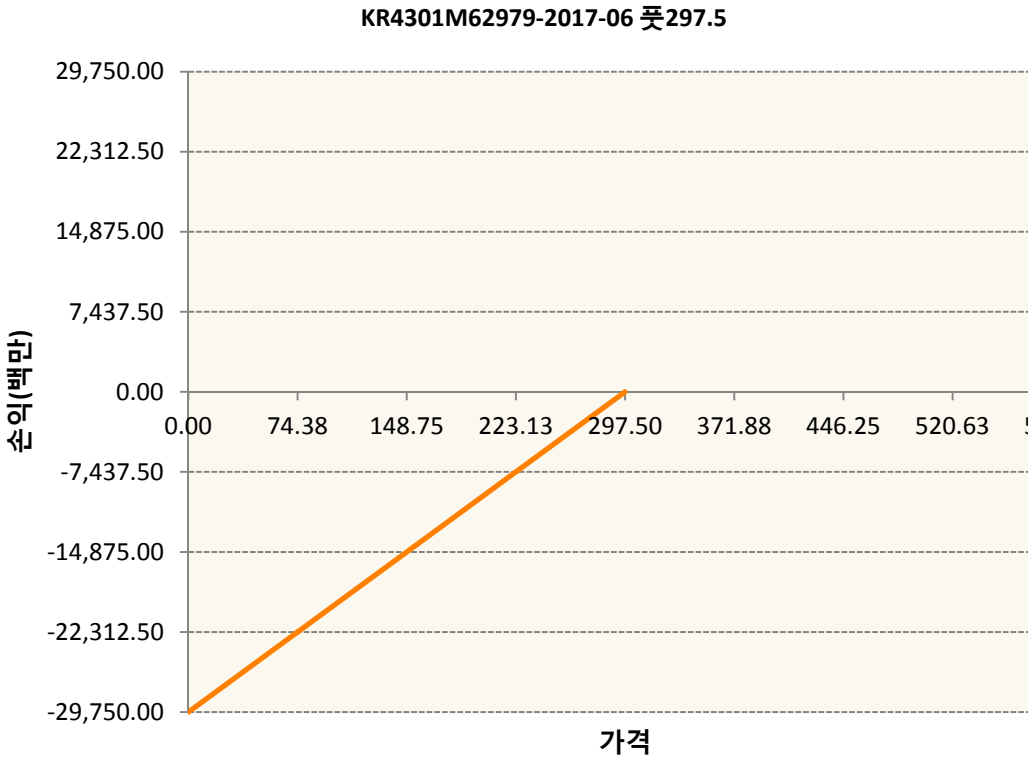
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 580,013 | -580,013 | 장내 |

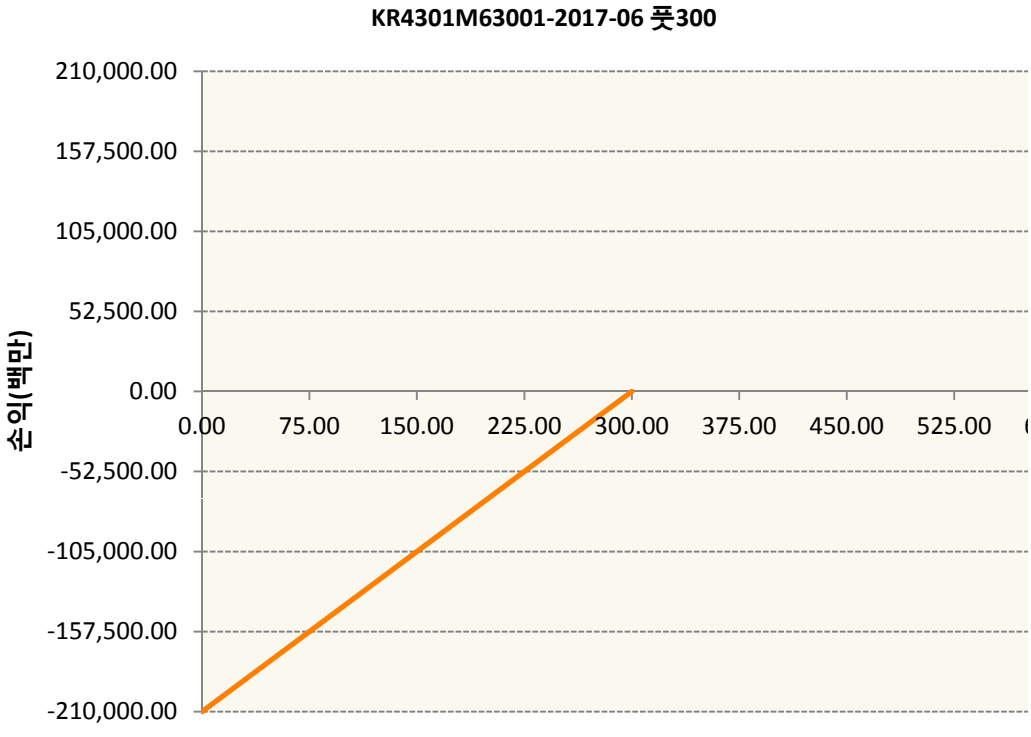
## 2. 만기시점의 손익구조




-156,037.50
-234,056.25
-312,075.00
가격


KR4301M62979-2017-06 풋297.5
29,750.00
22,312.50
14,875.00
7,437.50
0.00
-7,437.50
-14,875.00
-22,312.50
-29,750.00
0.00
74.38
148.75
223.13
297.50
371.88
446.25
520.63
손익(백만)
가격


KR4301M63001-2017-06 풋300
210,000.00
157,500.00
105,000.00
52,500.00
0.00
-52,500.00
-105,000.00
-157,500.00
-210,000.00
0.00
75.00
150.00
225.00
300.00
375.00
450.00
525.00
손익(백만)

가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4201M62( | 2017-06 콜297.5 | | | | | | 1,957 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 401 | 401 | 400 | 400 | 398 | 396 | 393 |
| -5.33% | 398 | 394 | 389 | 383 | 374 | 364 | 353 |
| -2.67% | 347 | 329 | 309 | 287 | 265 | 242 | 218 |
| 0% | 88 | 59 | 29 | 0 | -29 | -59 | -88 |
| 2.67% | -476 | -491 | -508 | -526 | -546 | -567 | -590 |
| 5.33% | -1,197 | -1,200 | -1,204 | -1,210 | -1,217 | -1,226 | -1,237 |
| 8.00% | -1,948 | -1,948 | -1,949 | -1,950 | -1,951 | -1,954 | -1,957 |
| KR4201M63( | 2017-06 콜300 | | | | | | 20,213 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 3,154 | 3,153 | 3,151 | 3,147 | 3,139 | 3,125 | 3,104 |
| -5.33% | 3,141 | 3,123 | 3,094 | 3,049 | 2,990 | 2,914 | 2,822 |
| -2.67% | 2,866 | 2,726 | 2,564 | 2,382 | 2,184 | 1,971 | 1,747 |
| 0% | 960 | 641 | 321 | 0 | -322 | -644 | -967 |
| 2.67% | -4,255 | -4,486 | -4,732 | -4,991 | -5,259 | -5,536 | -5,819 |
| 5.33% | -11,836 | -11,894 | -11,974 | -12,075 | -12,196 | -12,337 | -12,494 |
| 8.00% | -20,043 | -20,048 | -20,060 | -20,080 | -20,111 | -20,155 | -20,213 |
| KR4301M62( | 2017-06 풋297.5 | | | | | | 1,971 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,962 | -1,963 | -1,963 | -1,964 | -1,965 | -1,968 | -1,971 |
| -5.33% | -1,171 | -1,174 | -1,179 | -1,186 | -1,195 | -1,206 | -1,218 |
| -2.67% | -429 | -448 | -469 | -492 | -515 | -540 | -565 |
| 0% | 93 | 62 | 31 | 0 | -31 | -62 | -93 |
| 2.67% | 293 | 277 | 259 | 240 | 219 | 196 | 173 |
| 5.33% | 327 | 324 | 320 | 314 | 306 | 296 | 285 |
| 8.00% | 329 | 329 | 329 | 328 | 326 | 323 | 320 |
| KR4301M63( | 2017-06 풋300 | | | | | | 14,610 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -14,576 | -14,577 | -14,578 | -14,581 | -14,587 | -14,596 | -14,610 |
| -5.33% | -9,019 | -9,031 | -9,051 | -9,080 | -9,121 | -9,172 | -9,233 |
| -2.67% | -3,638 | -3,732 | -3,841 | -3,963 | -4,097 | -4,240 | -4,391 |
| 0% | 646 | 431 | 216 | 0 | -217 | -433 | -651 |
| 2.67% | 2,703 | 2,548 | 2,382 | 2,208 | 2,027 | 1,841 | 1,651 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 5.33% | 3,168 | 3,129 | 3,075 | 3,007 | 2,925 | 2,831 | 2,725 |
| 8.00% | 3,212 | 3,208 | 3,200 | 3,186 | 3,165 | 3,136 | 3,097 |

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

| |
|---|
| **44,198** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

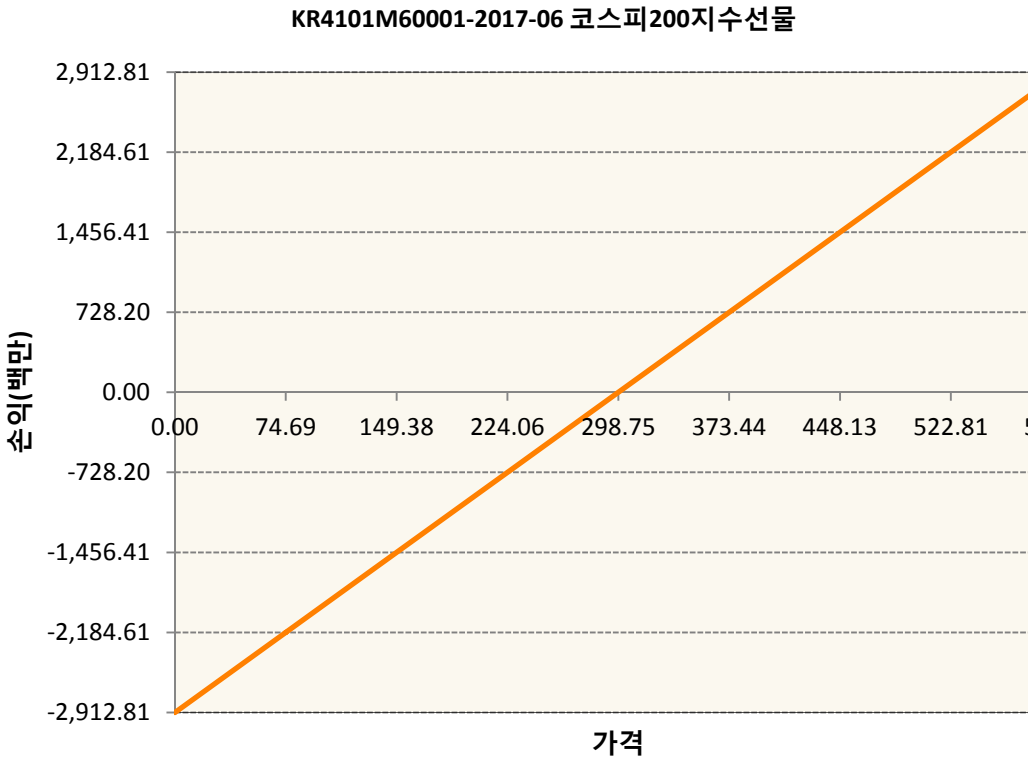
# 커버드콜목표전환형증권투자신탁

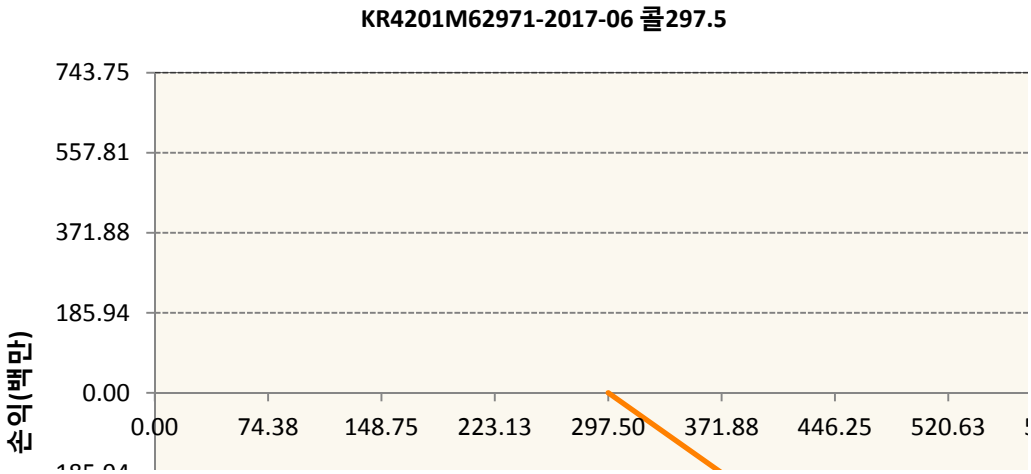
## 1. 계약금액

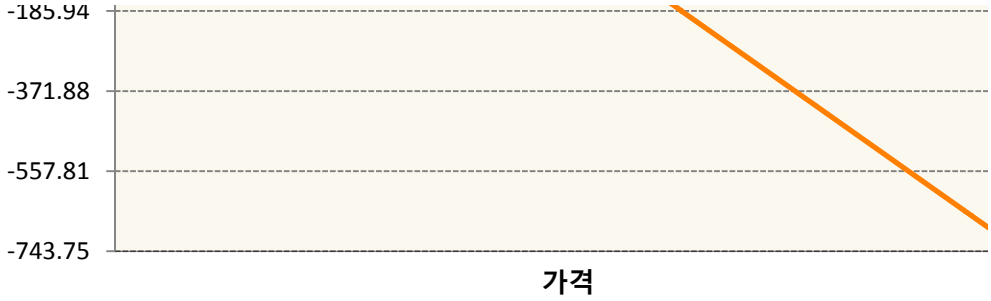
(단위:백만원)

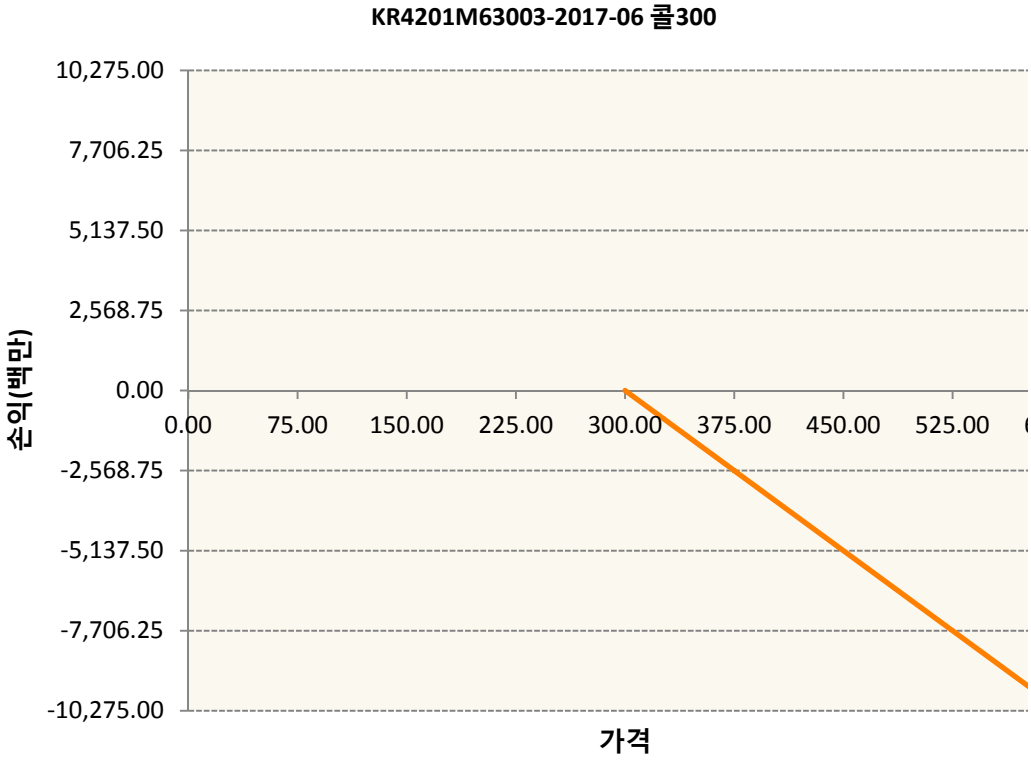
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,913 | 0 | 2,913 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 12,889 | -12,889 | 장내 |

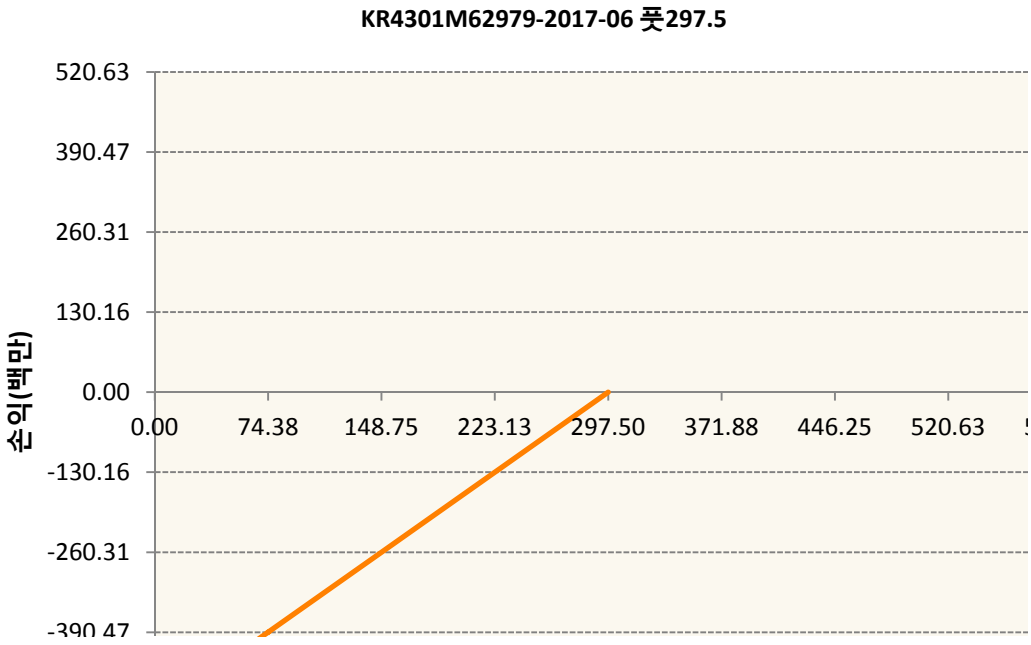
## 2. 만기시점의 손익구조



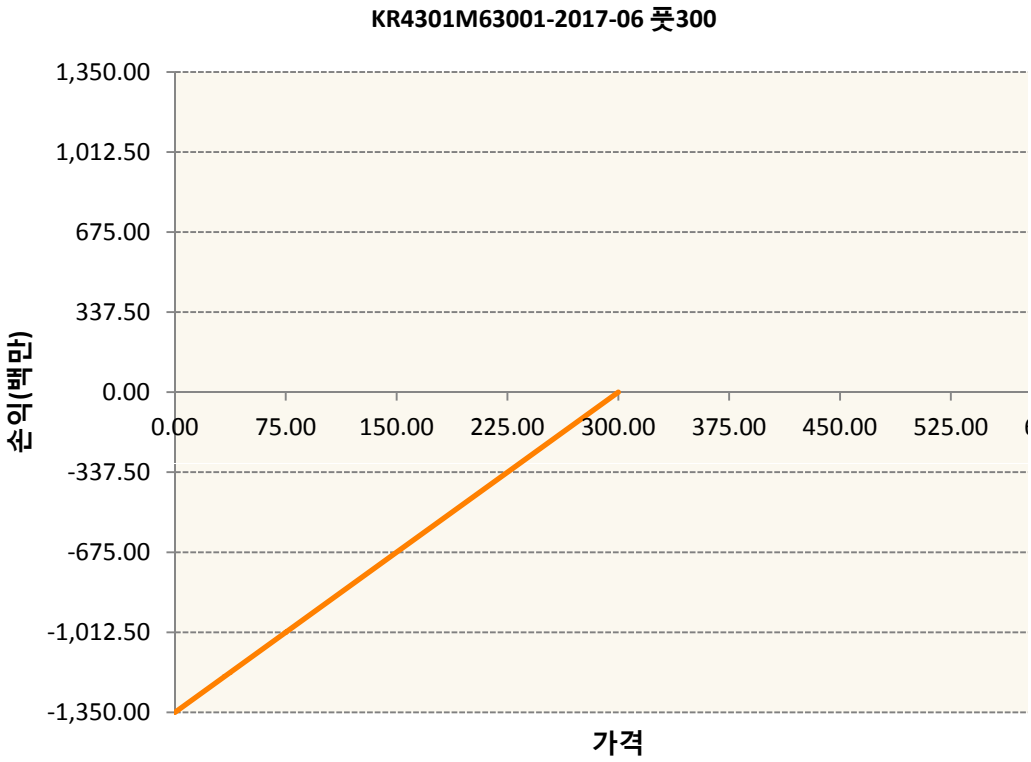




-185.94
-371.88
-557.81
-743.75
가격


KR4201M63003-2017-06 콜300
10,275.00
7,706.25
5,137.50
2,568.75
0.00
-2,568.75
-5,137.50
-7,706.25
-10,275.00
0.00
75.00
150.00
225.00
300.00
375.00
450.00
525.00
순익(백만)
가격


KR4301M62979-2017-06 풋297.5
520.63
390.47
260.31
130.16
0.00
-130.16
-260.31
-390.47
0.00
74.38
148.75
223.13
297.50
371.88
446.25
520.63
순익(백만)




**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4101M60( 2017-06 코스피200지수선물 | | | | | | | 233 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -233 | -233 | -233 | -233 | -233 | -233 | -233 |
| -5.33% | -155 | -155 | -155 | -155 | -155 | -155 | -155 |
| -2.67% | -78 | -78 | -78 | -78 | -78 | -78 | -78 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 | 78 |
| 5.33% | 155 | 155 | 155 | 155 | 155 | 155 | 155 |
| 8.00% | 233 | 233 | 233 | 233 | 233 | 233 | 233 |
| KR4201M62( 2017-06 콜297.5 | | | | | | | 52 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 10 | 10 |
| -5.33% | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 9 |
| -2.67% | 9 | 9 | 8 | 8 | 7 | 6 | 6 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0% | 2 | 2 | 1 | 0 | -1 | -2 | -2 |
| 2.67% | -13 | -13 | -13 | -14 | -14 | -15 | -16 |
| 5.33% | -32 | -32 | -32 | -32 | -32 | -32 | -33 |
| 8.00% | -51 | -51 | -51 | -51 | -51 | -52 | -52 |
| | KR4201M63( | 2017-06 콜300 | | | | | 665 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 104 | 104 | 104 | 104 | 103 | 103 | 102 |
| -5.33% | 103 | 103 | 102 | 100 | 98 | 96 | 93 |
| -2.67% | 94 | 90 | 84 | 78 | 72 | 65 | 58 |
| 0% | 32 | 21 | 11 | 0 | -11 | -21 | -32 |
| 2.67% | -140 | -148 | -156 | -164 | -173 | -182 | -192 |
| 5.33% | -390 | -392 | -394 | -398 | -402 | -406 | -411 |
| 8.00% | -660 | -660 | -660 | -661 | -662 | -664 | -665 |
| | KR4301M62( | 2017-06 풋297.5 | | | | | 34 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 | -34 |
| -5.33% | -20 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 |
| -2.67% | -8 | -8 | -8 | -9 | -9 | -9 | -10 |
| 0% | 2 | 1 | 1 | 0 | -1 | -1 | -2 |
| 2.67% | 5 | 5 | 5 | 4 | 4 | 3 | 3 |
| 5.33% | 6 | 6 | 6 | 5 | 5 | 5 | 5 |
| 8.00% | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 | 6 |
| | KR4301M63( | 2017-06 풋300 | | | | | 94 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 | -94 |
| -5.33% | -58 | -58 | -58 | -58 | -59 | -59 | -59 |
| -2.67% | -23 | -24 | -25 | -25 | -26 | -27 | -28 |
| 0% | 4 | 3 | 1 | 0 | -1 | -3 | -4 |
| 2.67% | 17 | 16 | 15 | 14 | 13 | 12 | 11 |
| 5.33% | 20 | 20 | 20 | 19 | 19 | 18 | 18 |
| 8.00% | 21 | 21 | 21 | 20 | 20 | 20 | 20 |

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

| |
|---|
| **1,109** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

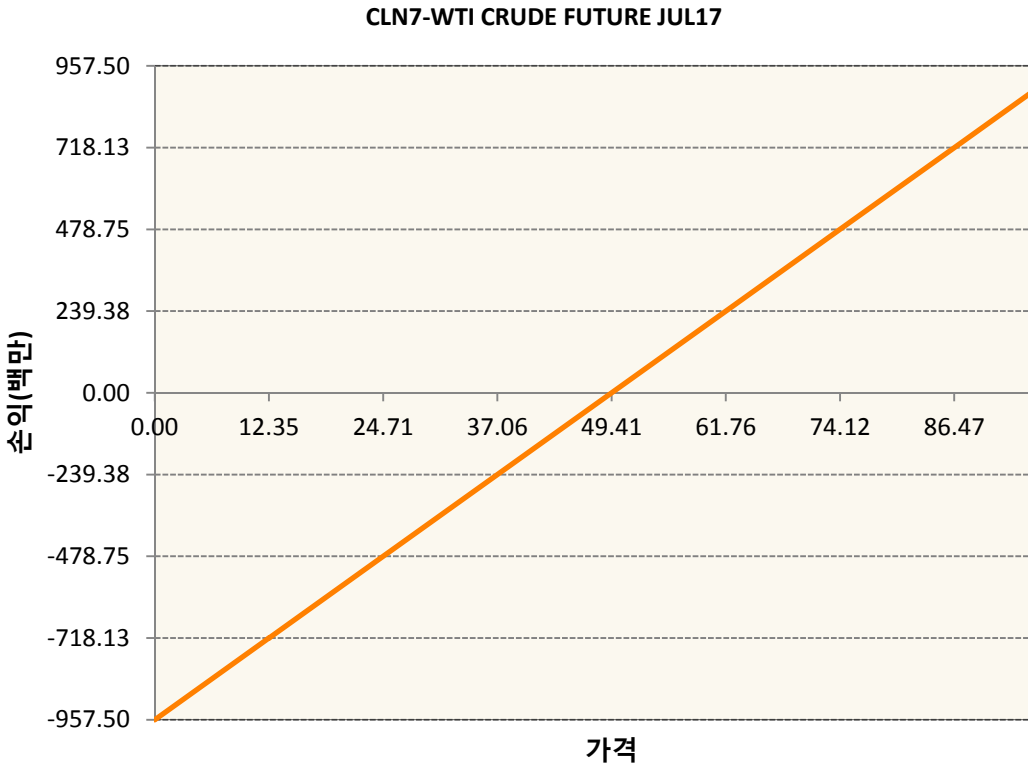
# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

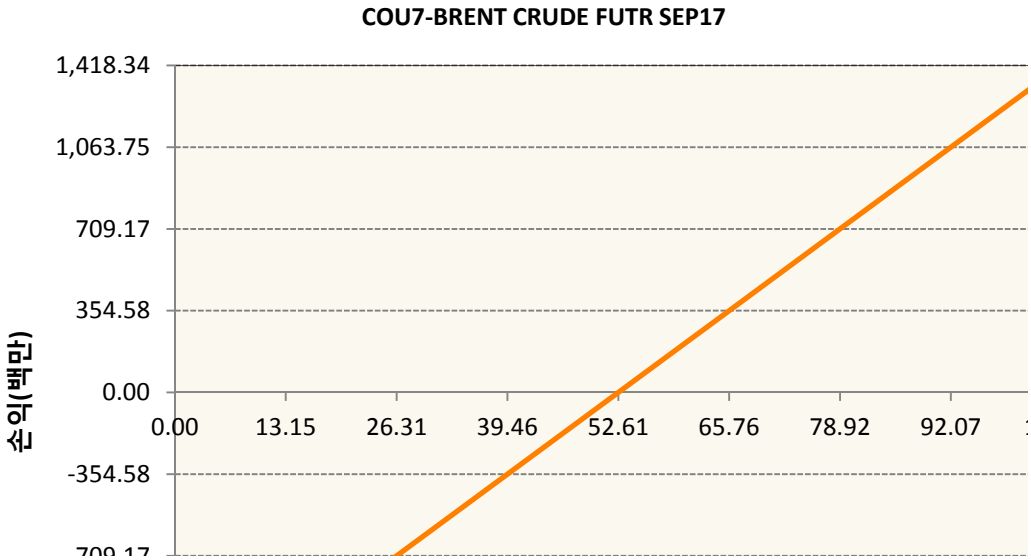
## 1. 계약금액

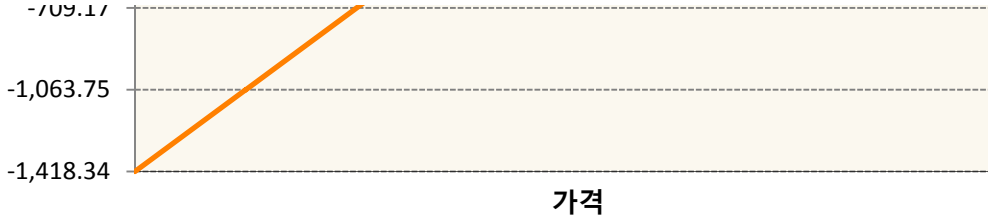
(단위:백만원)

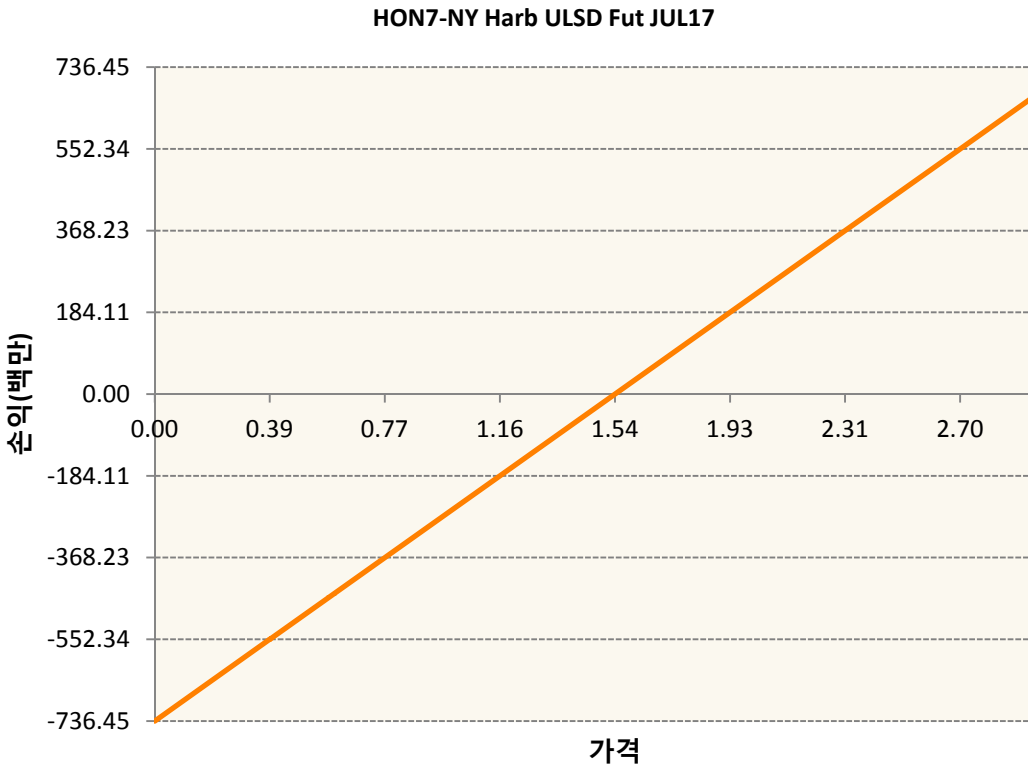
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 5,337 | 225 | 5,112 | |

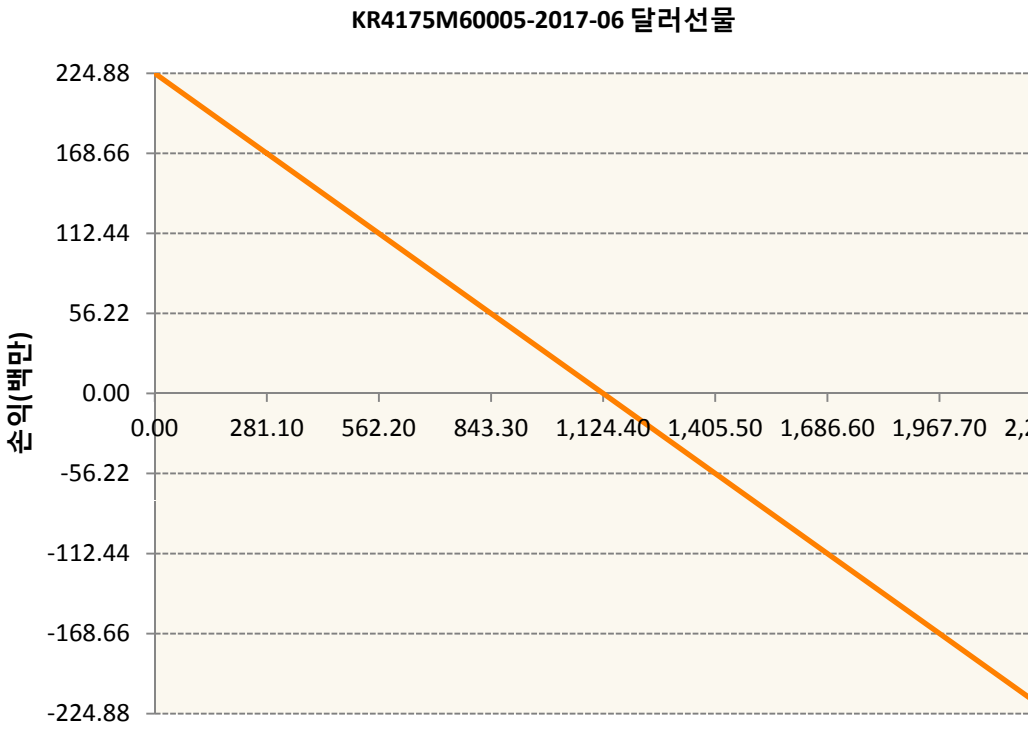
## 2. 만기시점의 손익구조



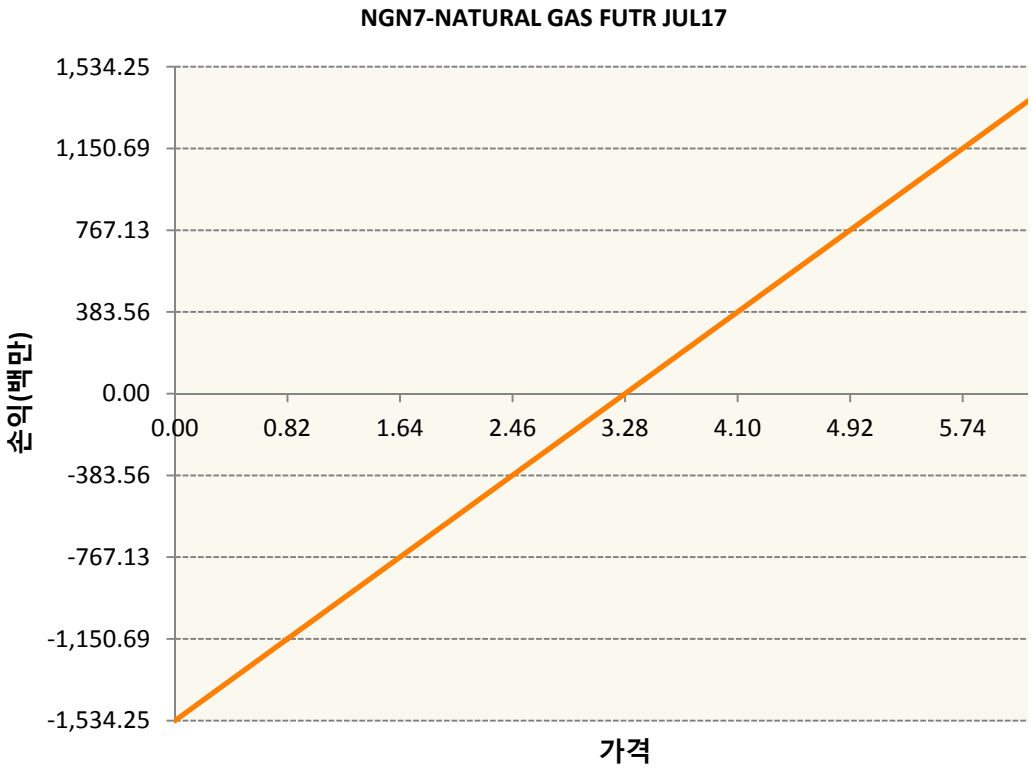



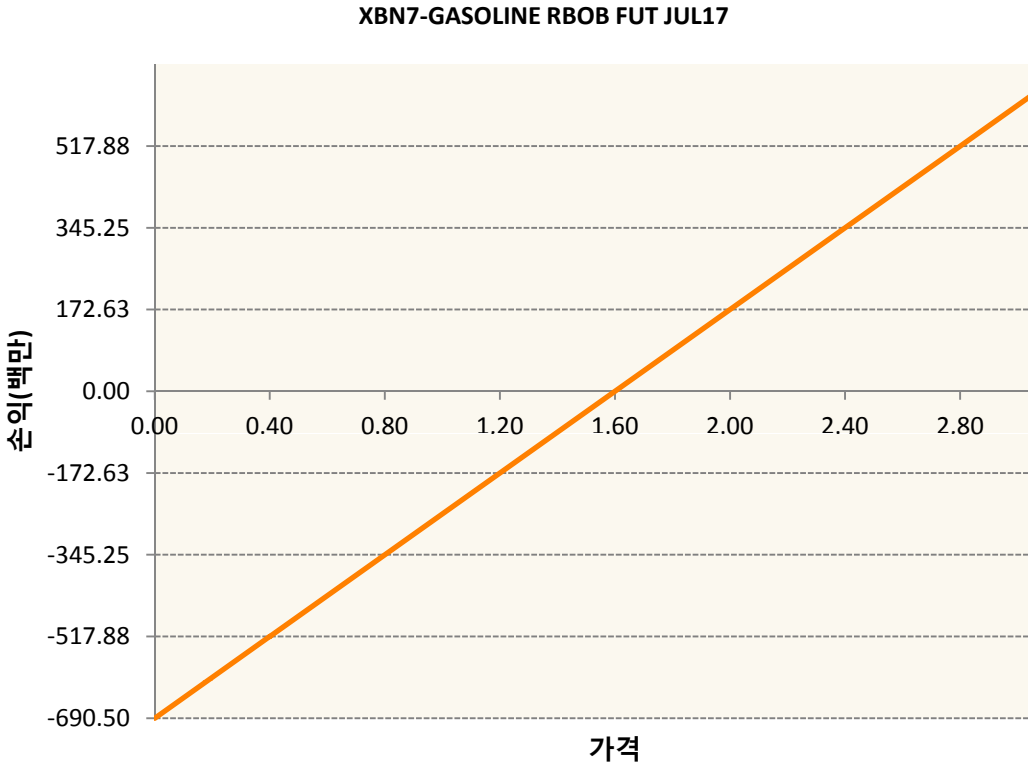

-1,063.75
-1,418.34
가격


HON7-NY Harb ULSD Fut JUL17
736.45
552.34
368.23
184.11
0.00
-184.11
-368.23
-552.34
-736.45
0.00
0.39
0.77
1.16
1.54
1.93
2.31
2.70
순이익(백만)
가격


KR4175M60005-2017-06 달러선물
224.88
168.66
112.44
56.22
0.00
-56.22
-112.44
-168.66
-224.88
0.00
281.10
562.20
843.30
1,124.40
1,405.50
1,686.60
1,967.70
순이익(백만)

가격


NGN7-NATURAL GAS FUTR JUL17
1,534.25
1,150.69
767.13
383.56
0.00
-383.56
-767.13
-1,150.69
-1,534.25
0.00
0.82
1.64
2.46
3.28
4.10
4.92
5.74
손익(백만)
가격


XBN7-GASOLINE RBOB FUT JUL17
517.88
345.25
172.63
0.00
-172.63
-345.25
-517.88
-690.50
0.00
0.40
0.80
1.20
1.60
2.00
2.40
2.80
손익(백만)
가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLN7 | WTI CRUDE FUTURE JUL17 | 77 |
| COU7 | BRENT CRUDE FUTR SEP17 | 113 |
| HON7 | NY Harb ULSD Fut JUL17 | 59 |
| KR4175M60( | 2017-06 달러선물 | 18 |
| NGN7 | NATURAL GAS FUTR JUL17 | 123 |
| XBN7 | GASOLINE RBOB FUT JUL17 | 55 |

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

| |
|---|
| **911** |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2017-05-19 |
| 기준일 | 2017-05-18 |

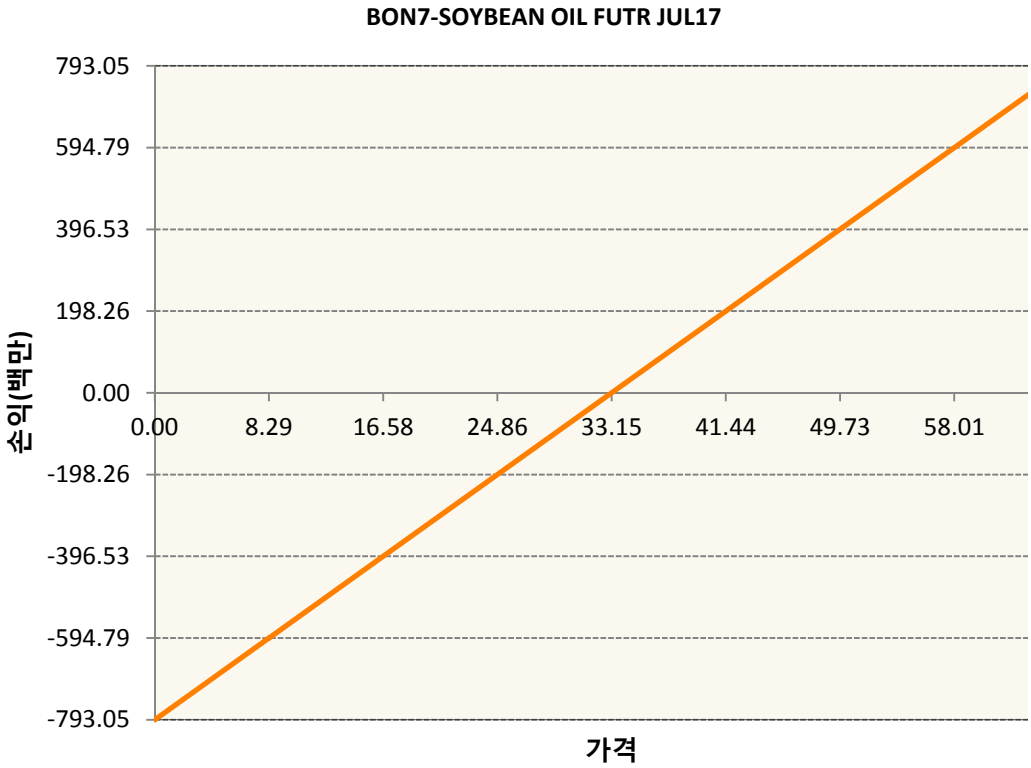
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

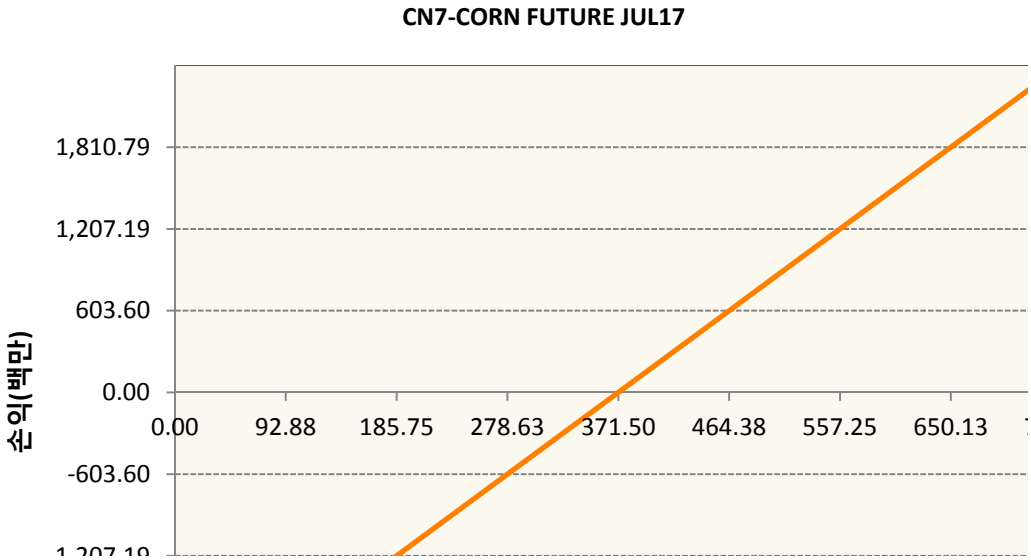
## 1. 계약금액

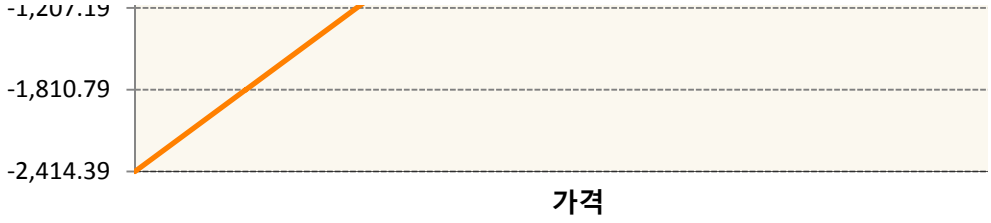
(단위:백만원)

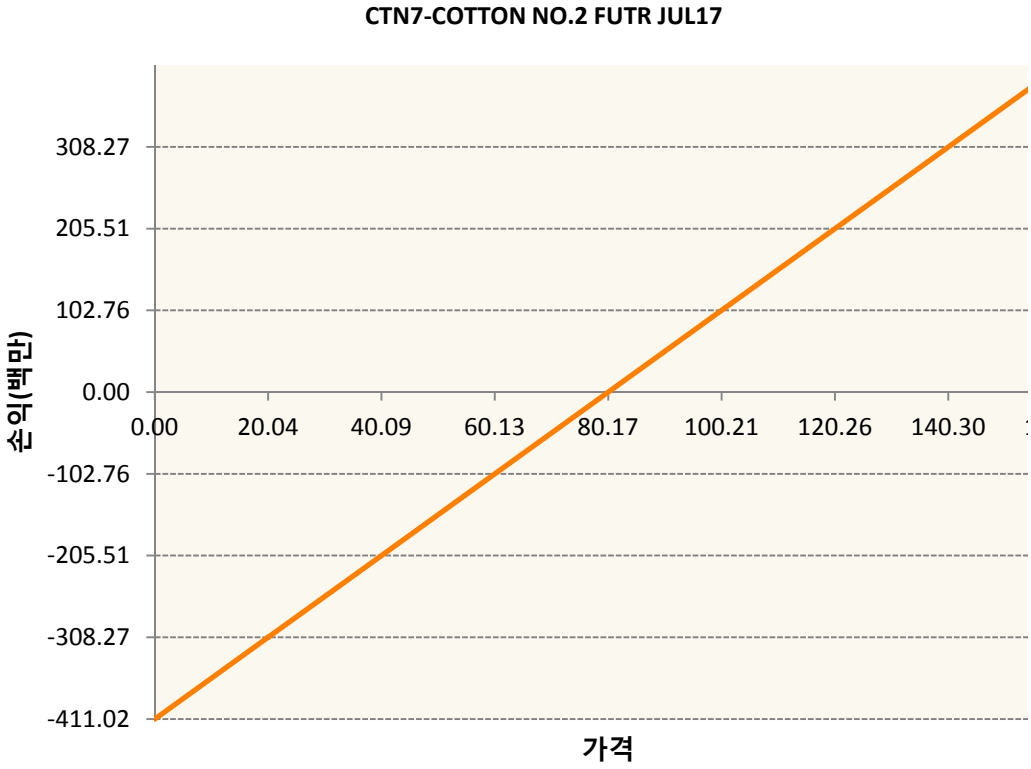
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 8,960 | 394 | 8,567 | |

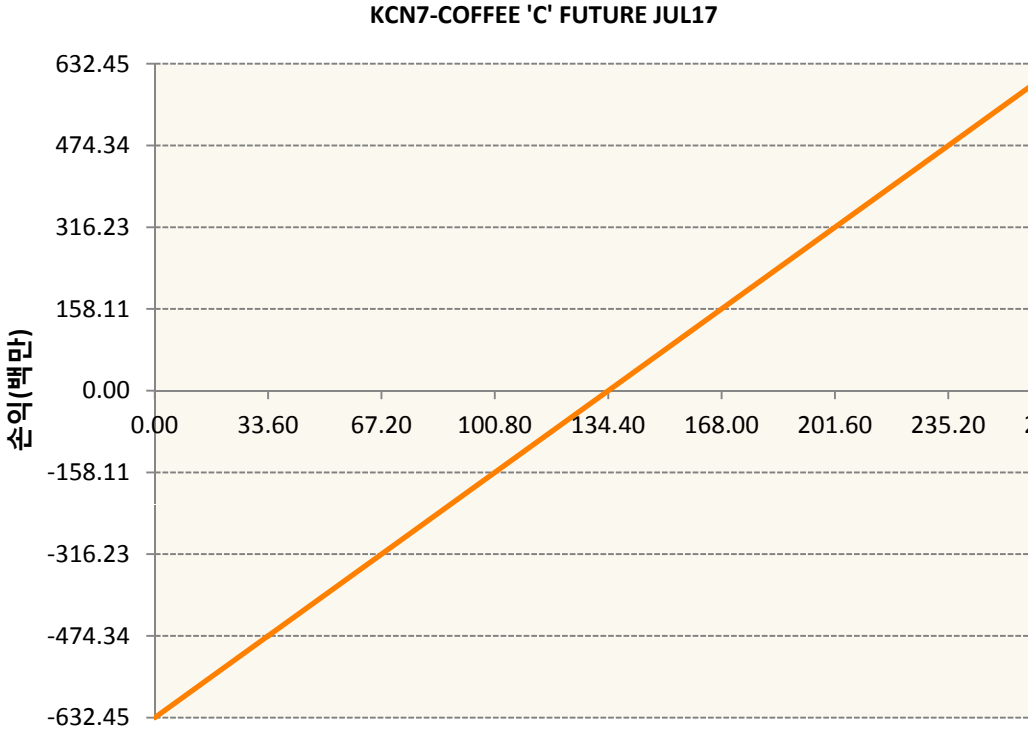
## 2. 만기시점의 손익구조



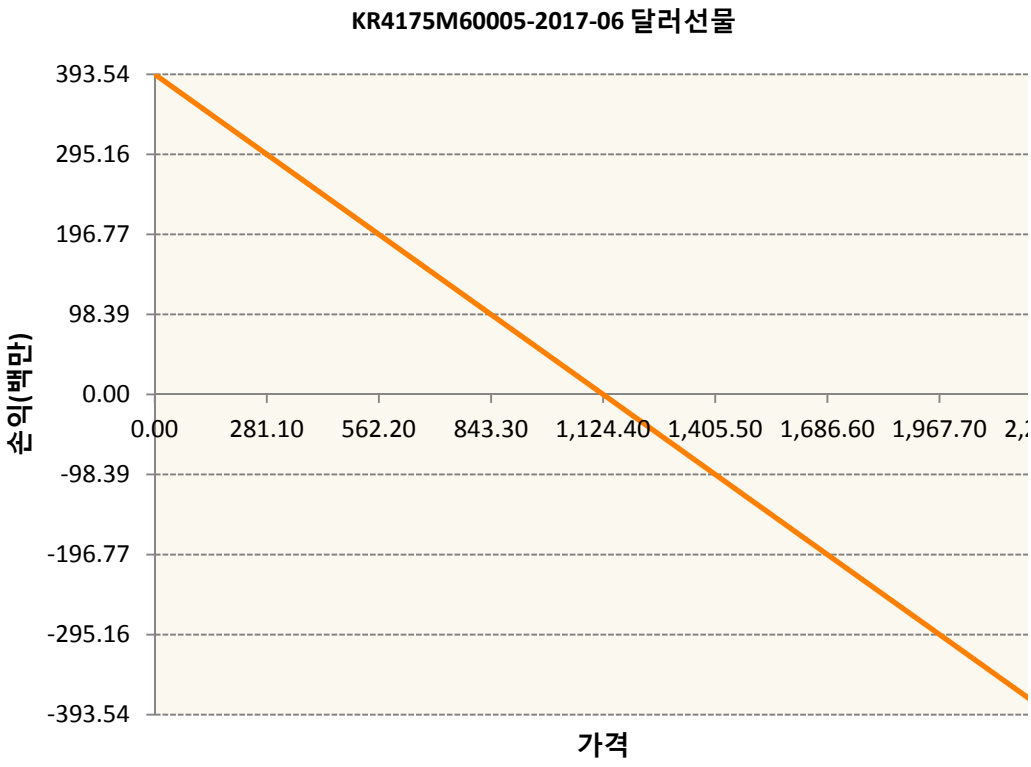



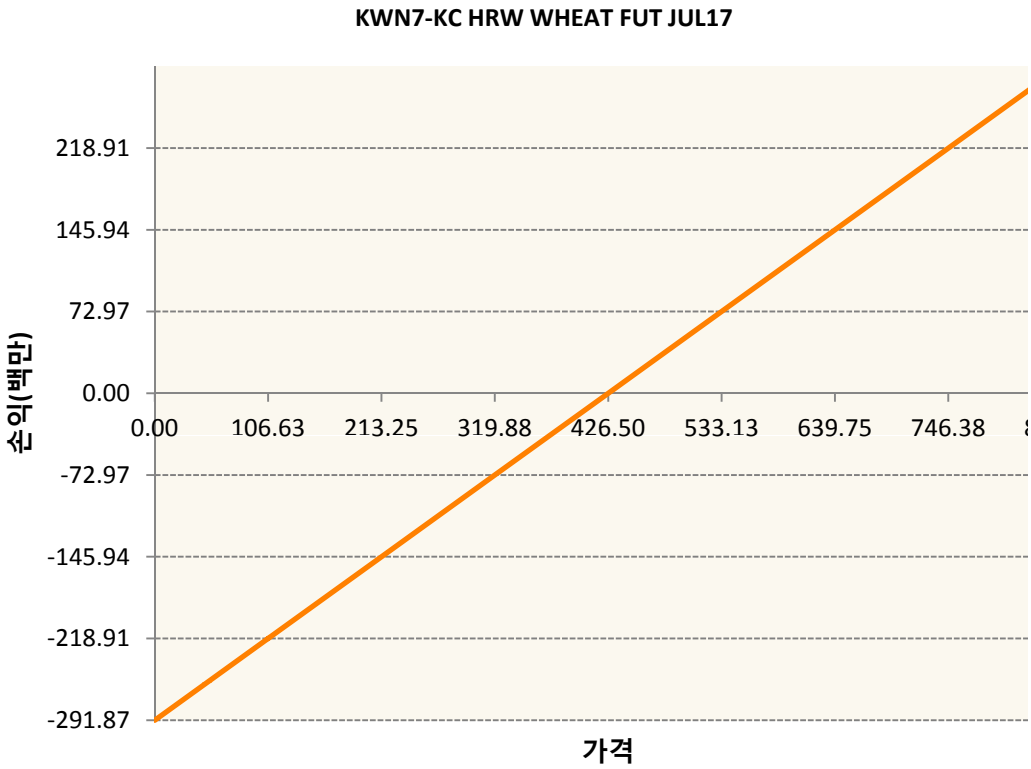

-1,810.79
-2,414.39
가격

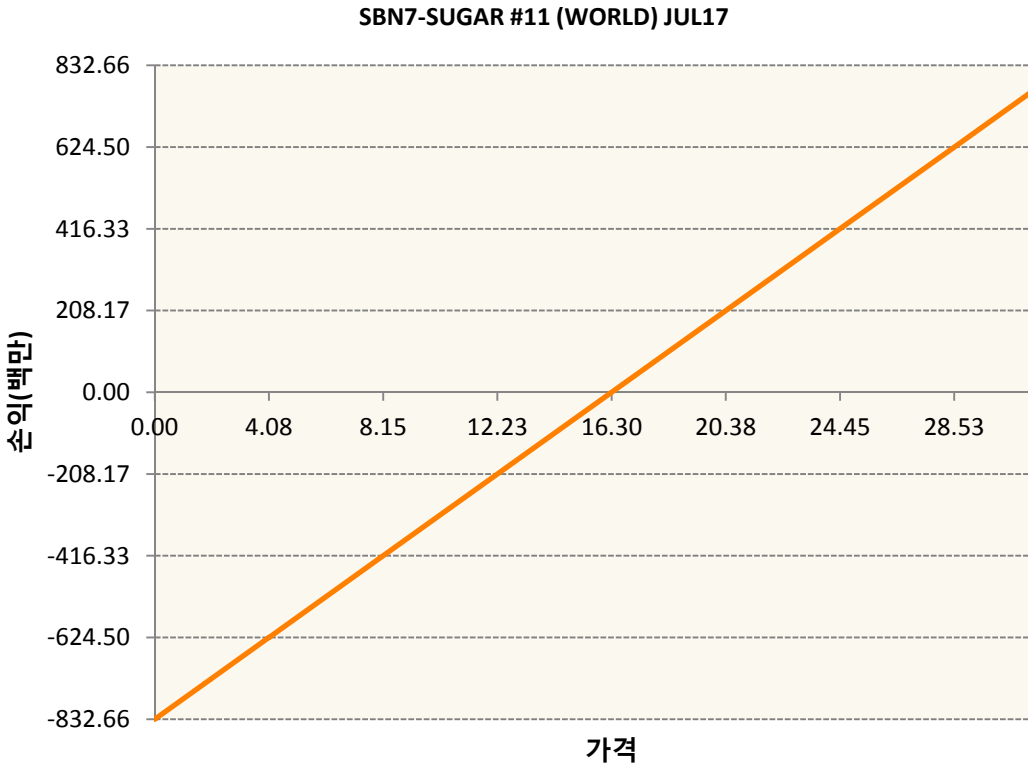

CTN7-COTTON NO.2 FUTR JUL17
308.27
205.51
102.76
0.00
-102.76
-205.51
-308.27
-411.02
0.00
20.04
40.09
60.13
80.17
100.21
120.26
140.30
손익(백만)
가격

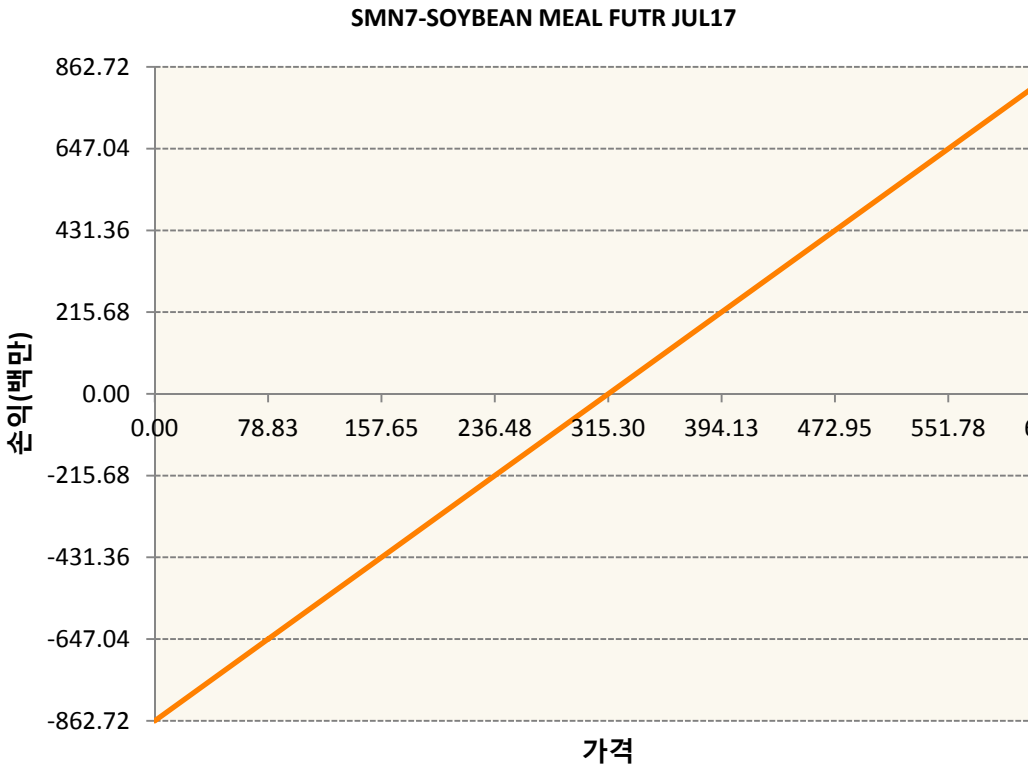

KCN7-COFFEE 'C' FUTURE JUL17
632.45
474.34
316.23
158.11
0.00
-158.11
-316.23
-474.34
-632.45
0.00
33.60
67.20
100.80
134.40
168.00
201.60
235.20
손익(백만)

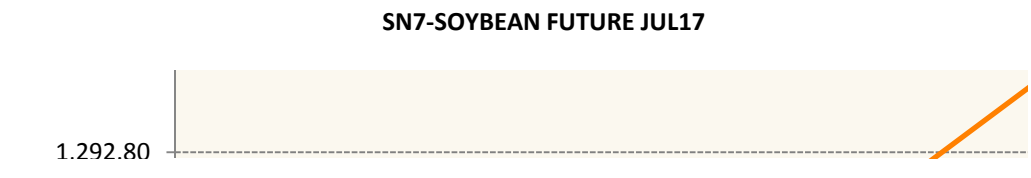
가격

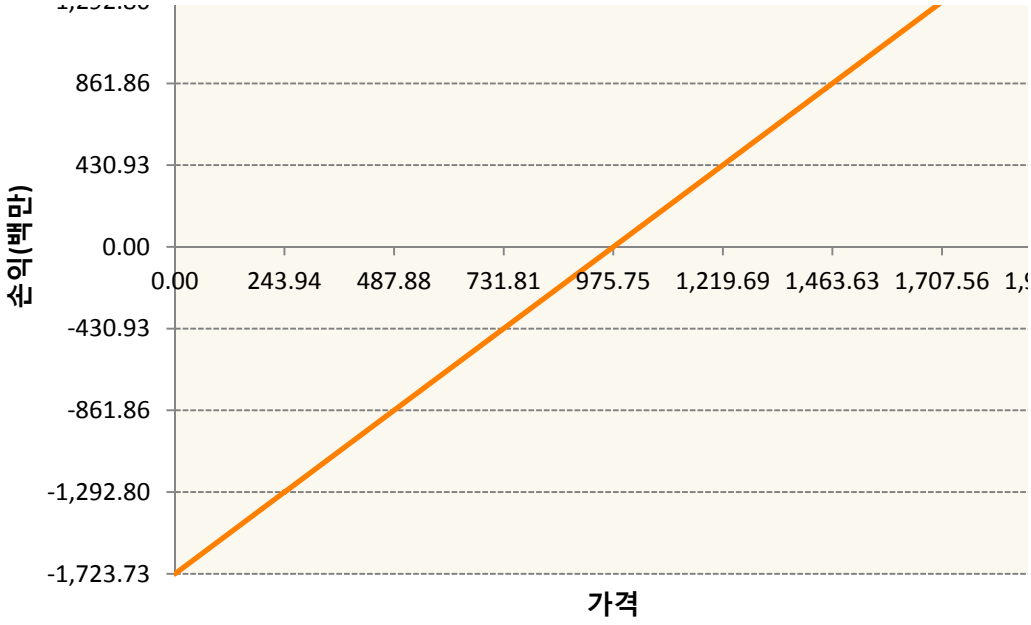

KR4175M60005-2017-06 달러선물
393.54
295.16
196.77
98.39
0.00
-98.39
-196.77
-295.16
-393.54
0.00
281.10
562.20
843.30
1,124.40
1,405.50
1,686.60
1,967.70
손익(백만)
가격

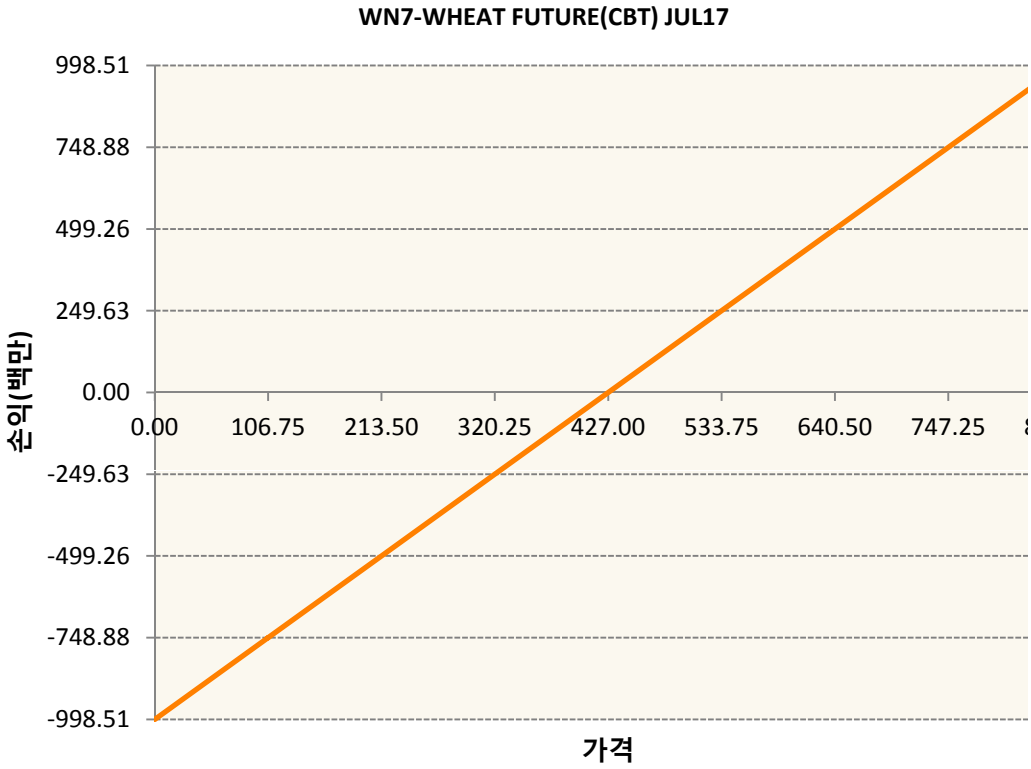

KWN7-KC HRW WHEAT FUT JUL17
218.91
145.94
72.97
0.00
-72.97
-145.94
-218.91
-291.87
0.00
106.63
213.25
319.88
426.50
533.13
639.75
746.38
손익(백만)
가격


SBN7-SUGAR #11 (WORLD) JUL17
832.66
624.50
416.33
208.17
0.00
-208.17
-416.33
-624.50
-832.66
0.00
4.08
8.15
12.23
16.30
20.38
24.45
28.53
손익(백만)
가격


SMN7-SOYBEAN MEAL FUTR JUL17
862.72
647.04
431.36
215.68
0.00
-215.68
-431.36
-647.04
-862.72
0.00
78.83
157.65
236.48
315.30
394.13
472.95
551.78
손익(백만)
가격


SN7-SOYBEAN FUTURE JUL17
1,292.80




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| BON7 | SOYBEAN OIL FUTR JUL17 | 63 |
| CN7 | CORN FUTURE JUL17 | 193 |
| CTN7 | COTTON NO.2 FUTR JUL17 | 33 |
| KCN7 | COFFEE 'C' FUTURE JUL17 | 51 |
| KR4175M60( | 2017-06 달러선물 | 31 |

| | | |
|---|---|---|
| KWN7 | KC HRW WHEAT FUT JUL17 | 23 |
| SBN7 | SUGAR #11 (WORLD) JUL17 | 67 |
| SMN7 | SOYBEAN MEAL FUTR JUL17 | 69 |
| SN7 | SOYBEAN FUTURE JUL17 | 138 |
| WN7 | WHEAT FUTURE(CBT) JUL17 | 80 |

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

| |
|---|
| **813** |