공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

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	8	0	8	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	2017-09-08
기준일	2017-09-07

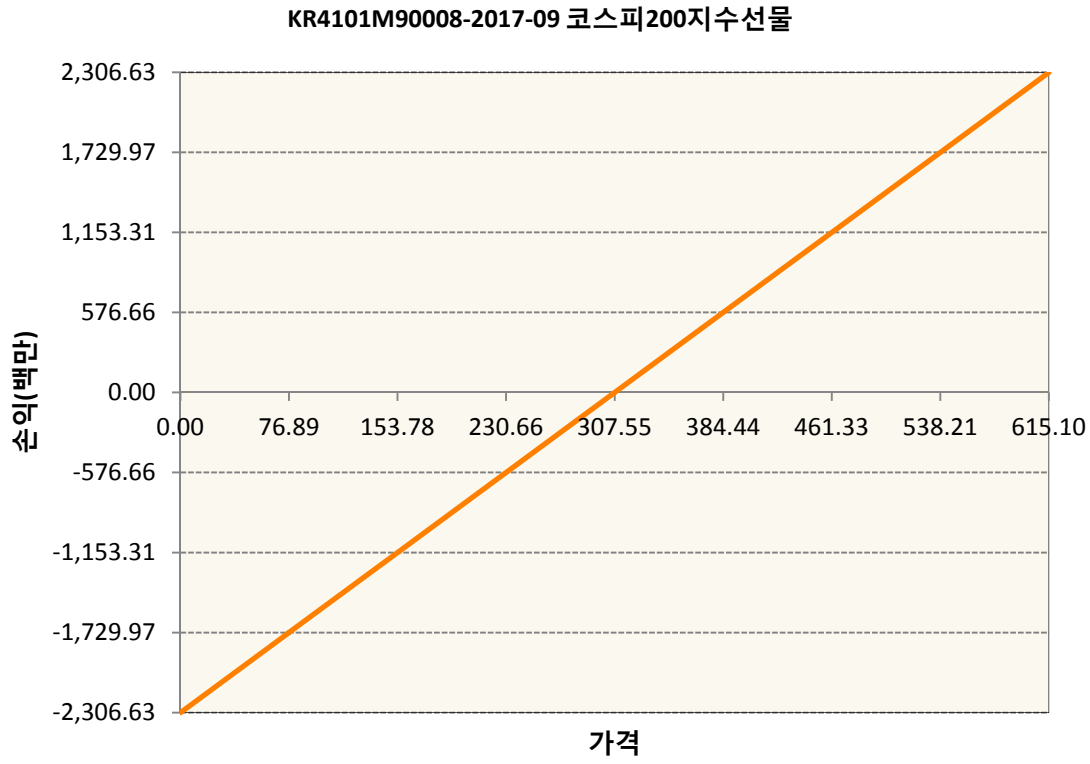
스마트인덱스모

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	2,307	0	2,307	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							184
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-5.33%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-2.67%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	61	61	61	61	61	61	61
5.33%	123	123	123	123	123	123	123
8.00%	184	184	184	184	184	184	184

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

115

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

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	12,592	0	12,592	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S170822	1,022

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

461

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

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	4,599	0	4,599	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170608	424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

366

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

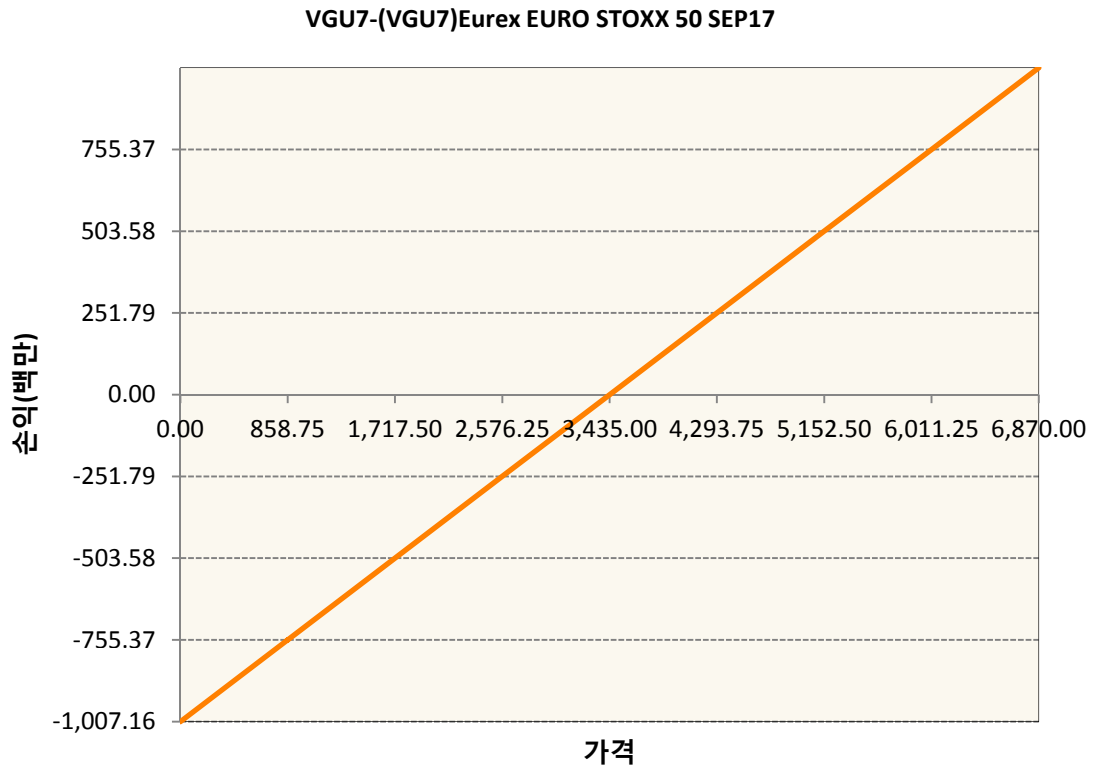
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,007	0	1,007	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	81

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

(단위:백만원)

64

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

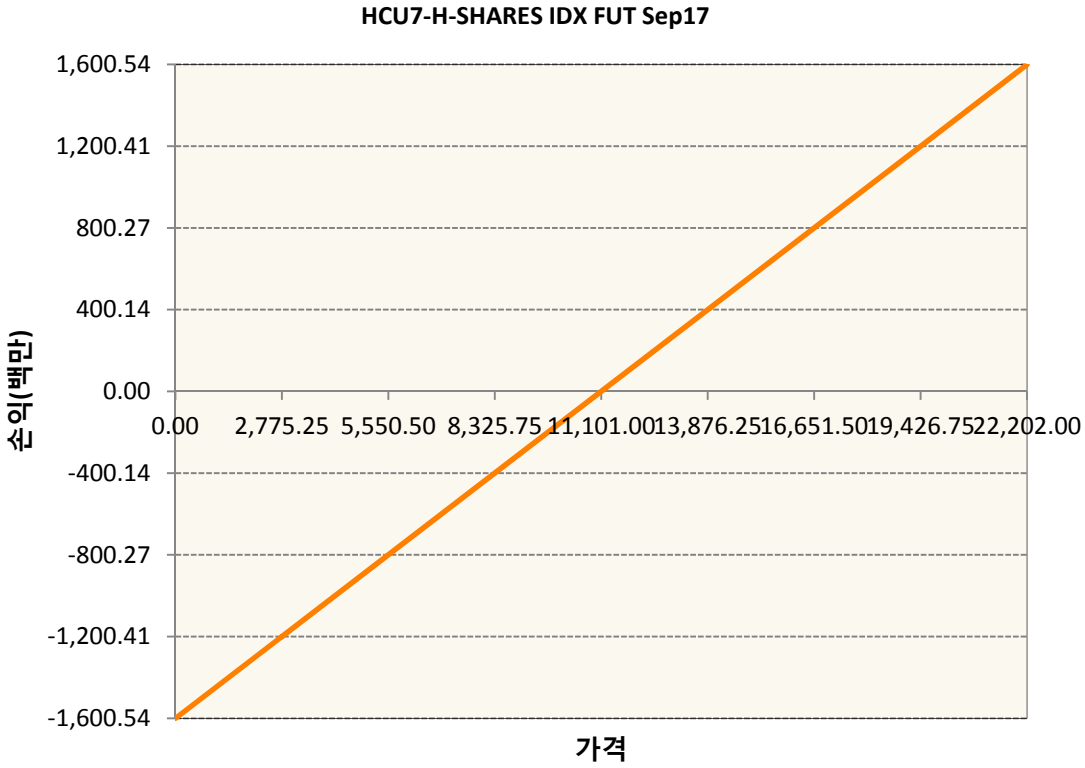
차이나인덱스모(주식-파생형)

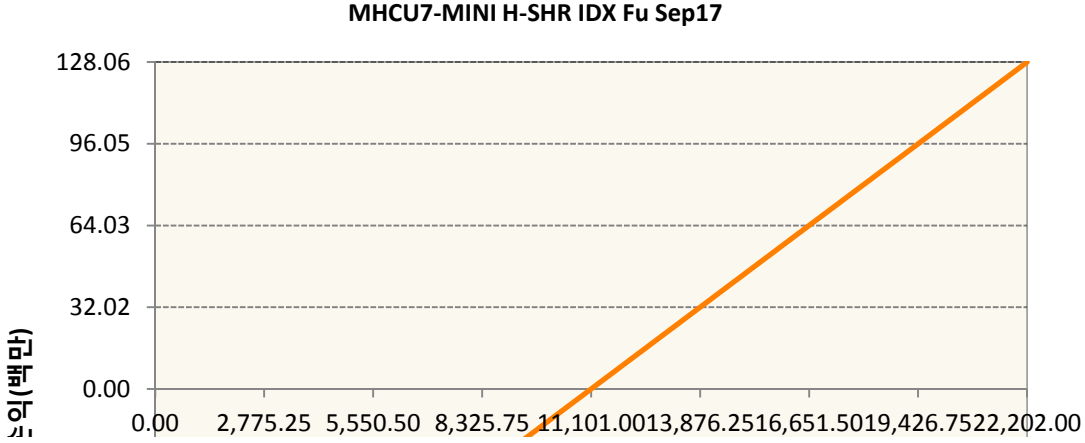
1. 계약금액

(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	128	0	128	
누계	유가증권	선물	1,601	0	1,601	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	128
MHCU7	MINI H-SHR IDX Fu Sep17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	118

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

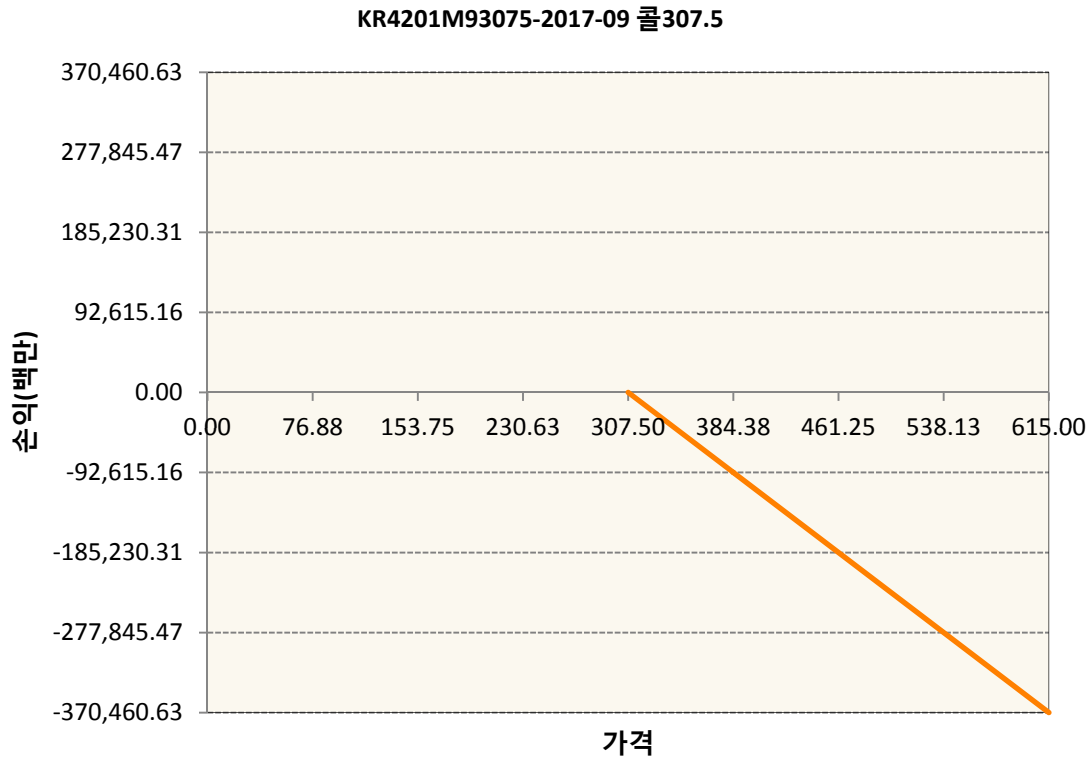
커버드콜모(주식혼합-파생형)

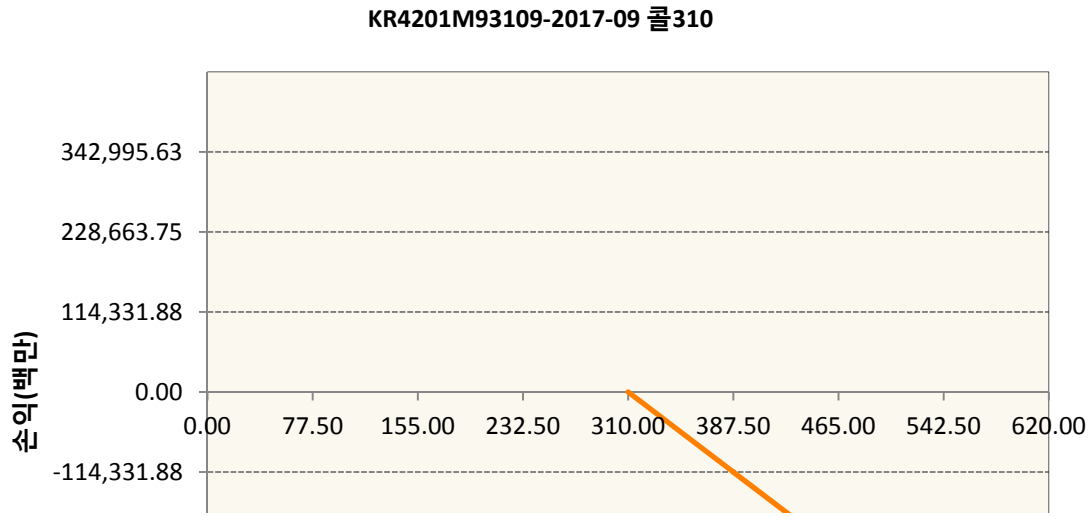
1. 계약금액

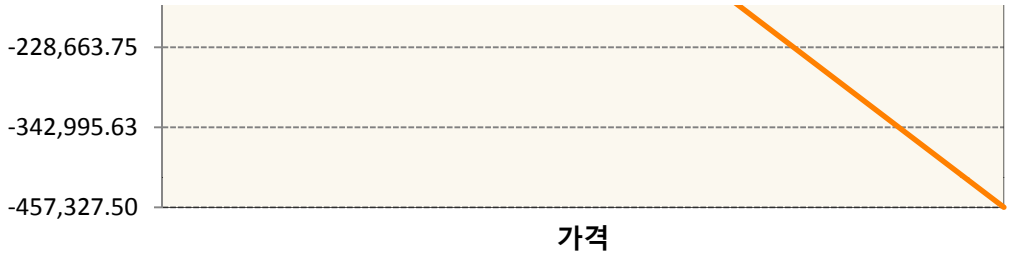
(단위:백만원)

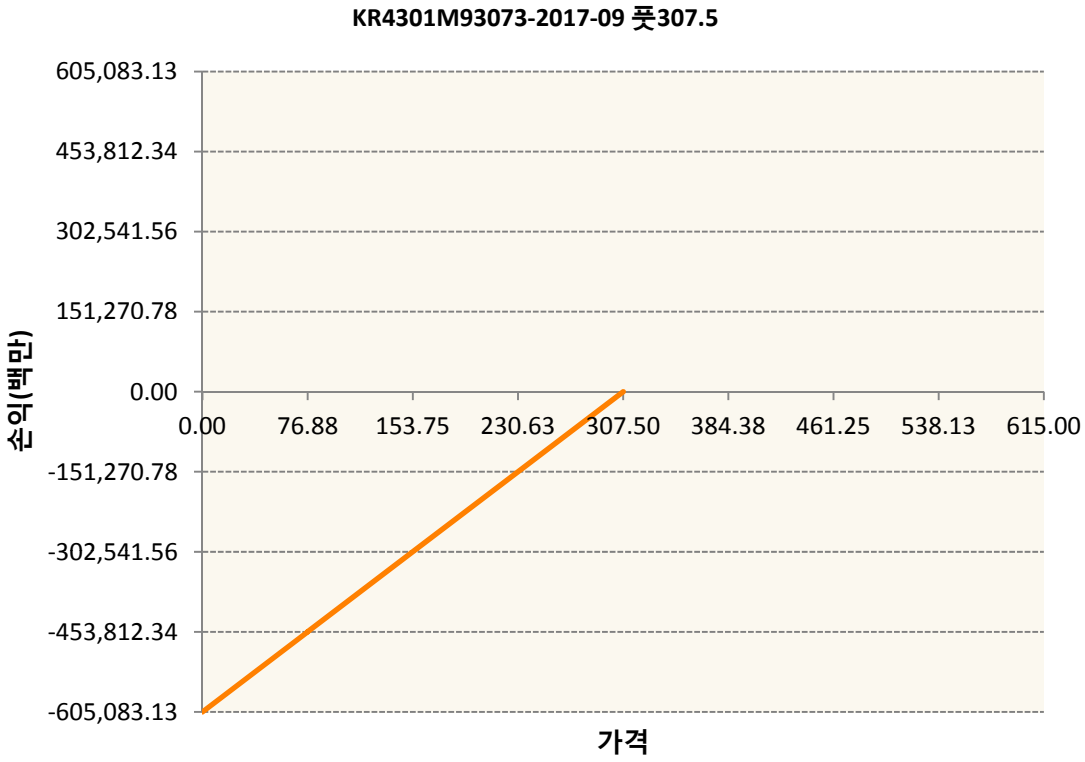
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,497,119	-1,497,119	장내

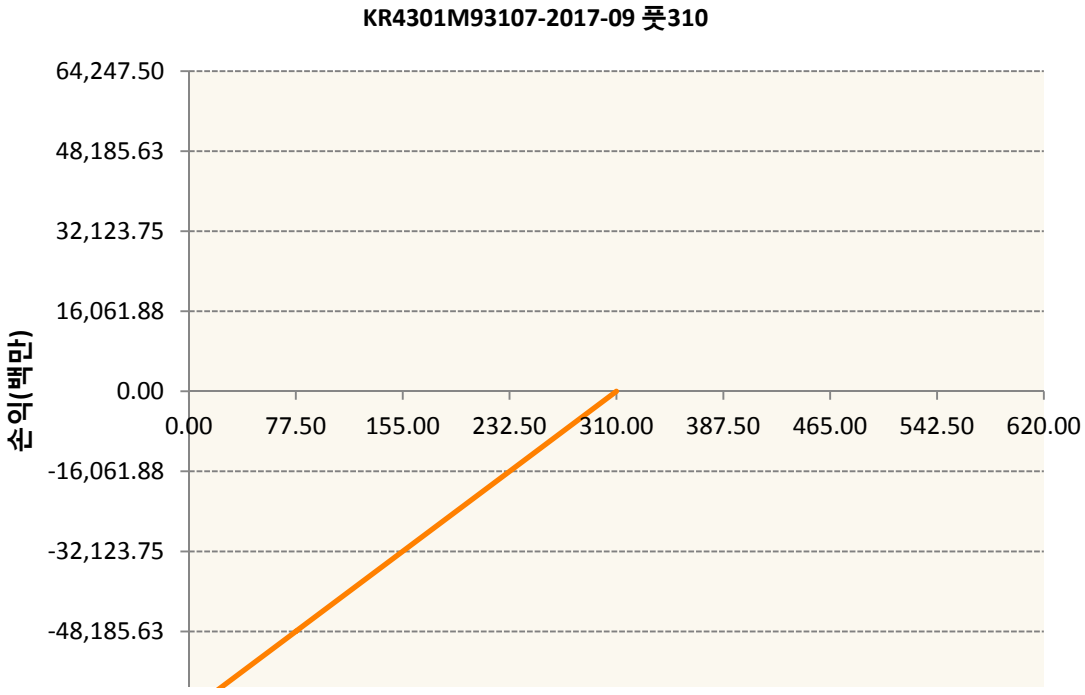
2. 만기시점의 손익구조

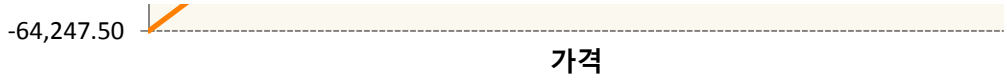





-228,663.75
-342,995.63
-457,327.50
가격


KR4301M93073-2017-09 풋307.5
605,083.13
453,812.34
302,541.56
151,270.78
0.00
-151,270.78
-302,541.56
-453,812.34
-605,083.13
0.00
76.88
153.75
230.63
307.50
384.38
461.25
538.13
615.00
손익(백만)
가격


KR4301M93107-2017-09 풋310
64,247.50
48,185.63
32,123.75
16,061.88
0.00
-16,061.88
-32,123.75
-48,185.63
0.00
77.50
155.00
232.50
310.00
387.50
465.00
542.50
620.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201M93(2017-09 콜307.5							24,474
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,707	4,704	4,698	4,684	4,662	4,628	4,580
-5.33%	4,665	4,620	4,553	4,462	4,348	4,211	4,053
-2.67%	4,102	3,869	3,610	3,330	3,033	2,722	2,398
0%	1,254	836	418	0	-418	-837	-1,255
2.67%	-5,360	-5,640	-5,941	-6,261	-6,594	-6,940	-7,295
5.33%	-14,452	-14,528	-14,632	-14,763	-14,921	-15,103	-15,307
8.00%	-24,226	-24,235	-24,253	-24,283	-24,329	-24,393	-24,474
KR4201M93: 2017-09 콜310							28,036
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,195	4,194	4,190	4,182	4,166	4,140	4,102
-5.33%	4,175	4,147	4,099	4,029	3,933	3,813	3,667
-2.67%	3,815	3,616	3,380	3,112	2,816	2,497	2,157
0%	1,461	979	492	0	-495	-993	-1,494
2.67%	-5,241	-5,673	-6,121	-6,580	-7,048	-7,524	-8,005
5.33%	-15,716	-15,872	-16,066	-16,296	-16,557	-16,845	-17,158
8.00%	-27,558	-27,583	-27,625	-27,690	-27,779	-27,894	-28,036
KR4301M93(2017-09 풋307.5							40,828
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40,620	-40,625	-40,636	-40,658	-40,695	-40,751	-40,828
-5.33%	-24,586	-24,660	-24,770	-24,918	-25,104	-25,328	-25,586
-2.67%	-9,403	-9,784	-10,207	-10,664	-11,149	-11,658	-12,186
0%	2,048	1,366	683	0	-683	-1,366	-2,050
2.67%	7,349	6,892	6,399	5,877	5,332	4,768	4,188
5.33%	8,601	8,477	8,308	8,093	7,835	7,538	7,205
8.00%	8,741	8,726	8,697	8,646	8,571	8,468	8,334
KR4301M93: 2017-09 풋310							4,512
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,499	-4,499	-4,499	-4,501	-4,503	-4,506	-4,512
-5.33%	-2,806	-2,810	-2,816	-2,826	-2,839	-2,856	-2,877
-2.67%	-1,160	-1,188	-1,221	-1,259	-1,300	-1,345	-1,393
0%	205	138	69	0	-70	-140	-210
2.67%	960	899	836	772	706	639	571

5.33%	1,184	1,162	1,135	1,103	1,066	1,026	982
8.00%	1,217	1,213	1,207	1,198	1,186	1,169	1,149

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

108,780

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

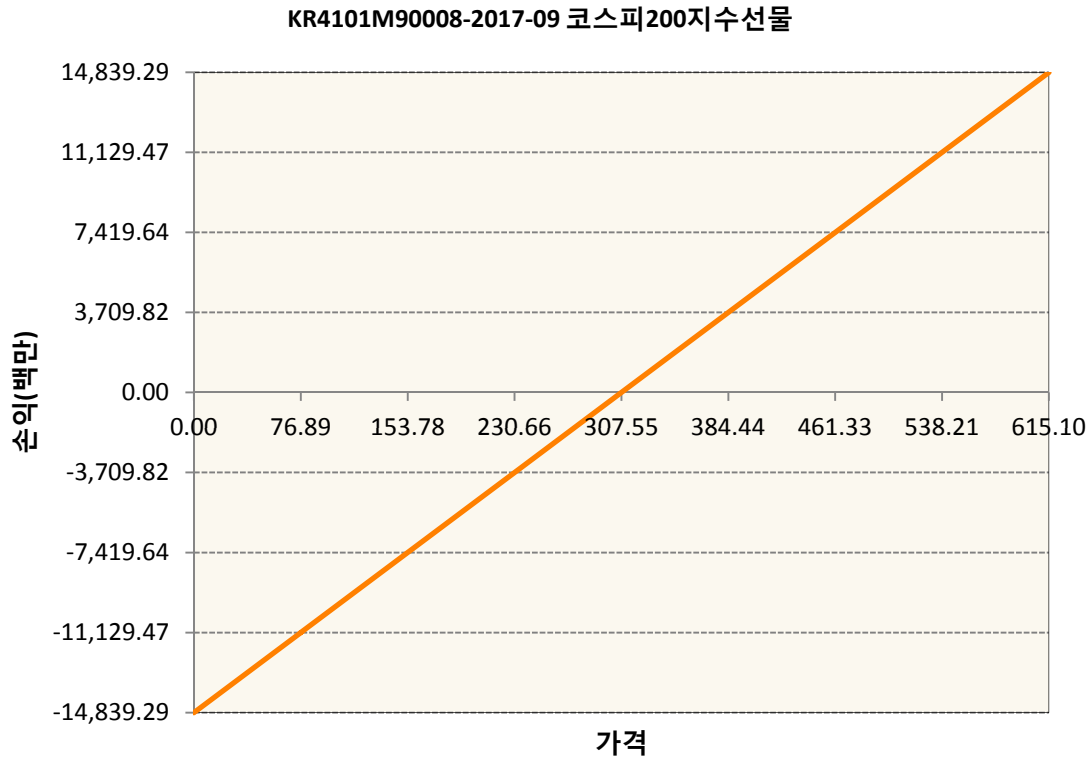
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,839	0	14,839	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,185
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,185	-1,185	-1,185	-1,185	-1,185	-1,185	-1,185
-5.33%	-790	-790	-790	-790	-790	-790	-790
-2.67%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	395	395	395	395	395	395	395
5.33%	790	790	790	790	790	790	790
8.00%	1,185	1,185	1,185	1,185	1,185	1,185	1,185

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

743

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

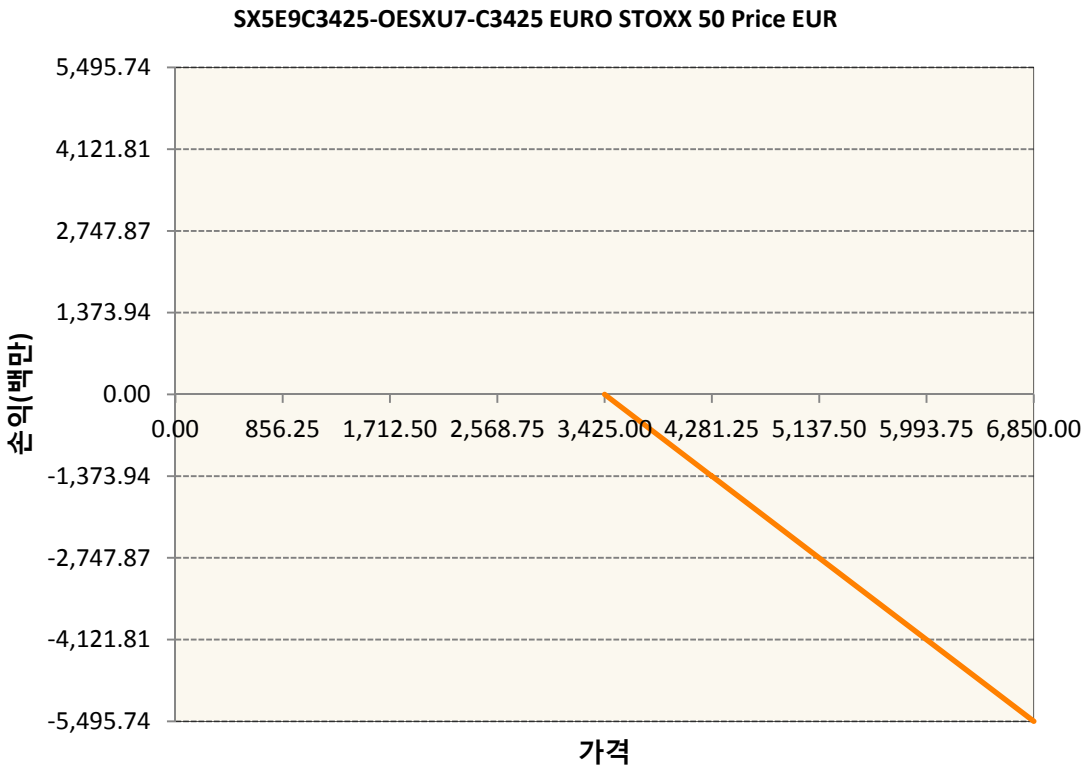
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

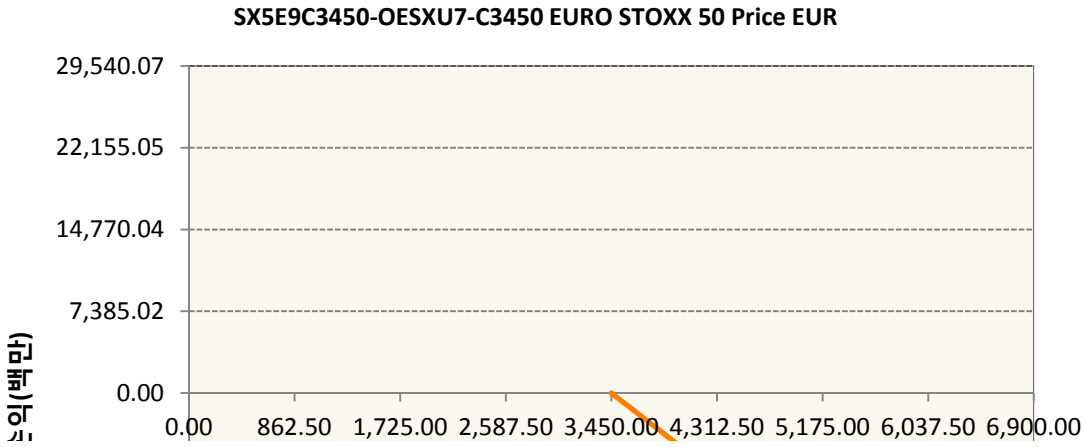
1. 계약금액

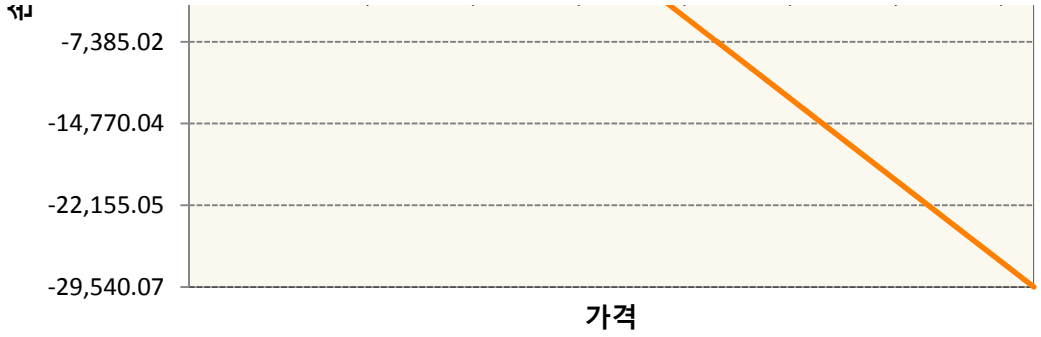
(단위:백만원)

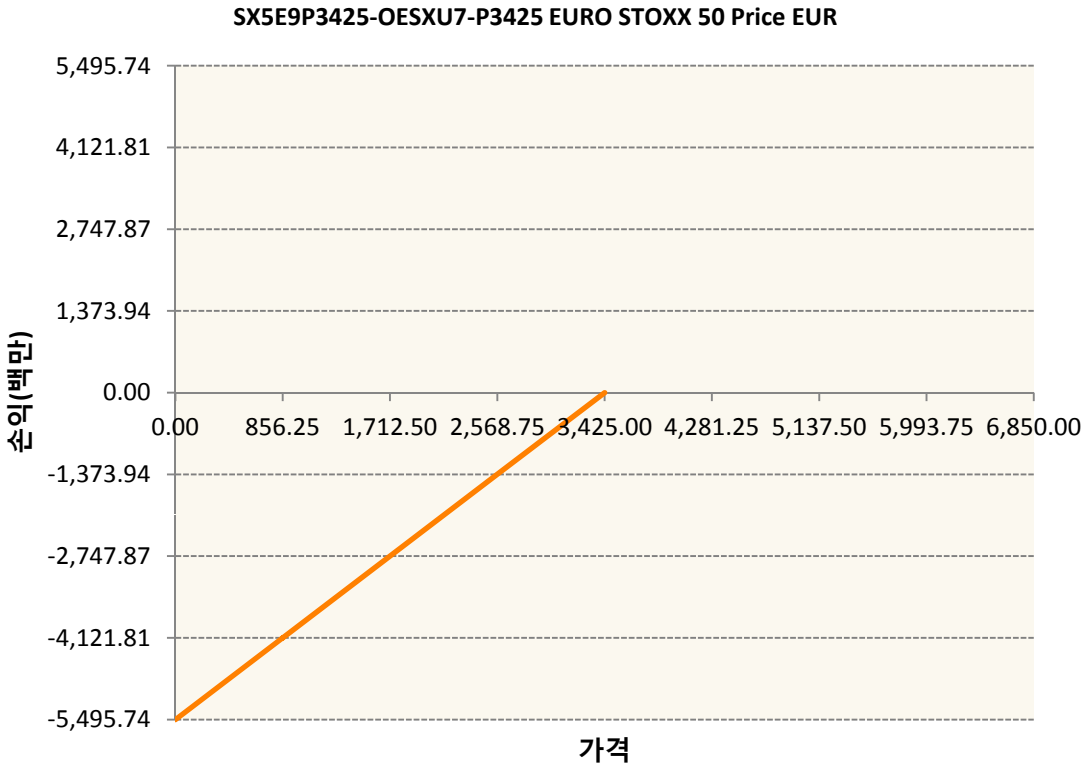
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,459	0	30,459	
누계	유가증권	옵션	0	70,072	-70,072	장내

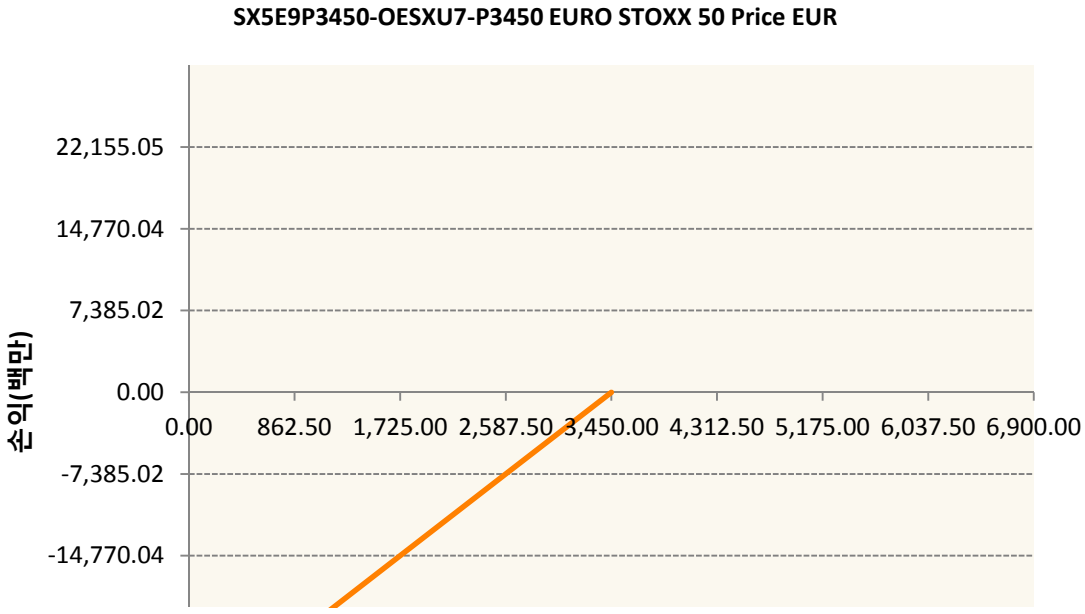
2. 만기시점의 손익구조

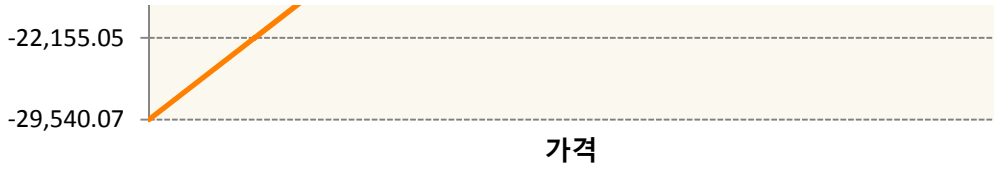


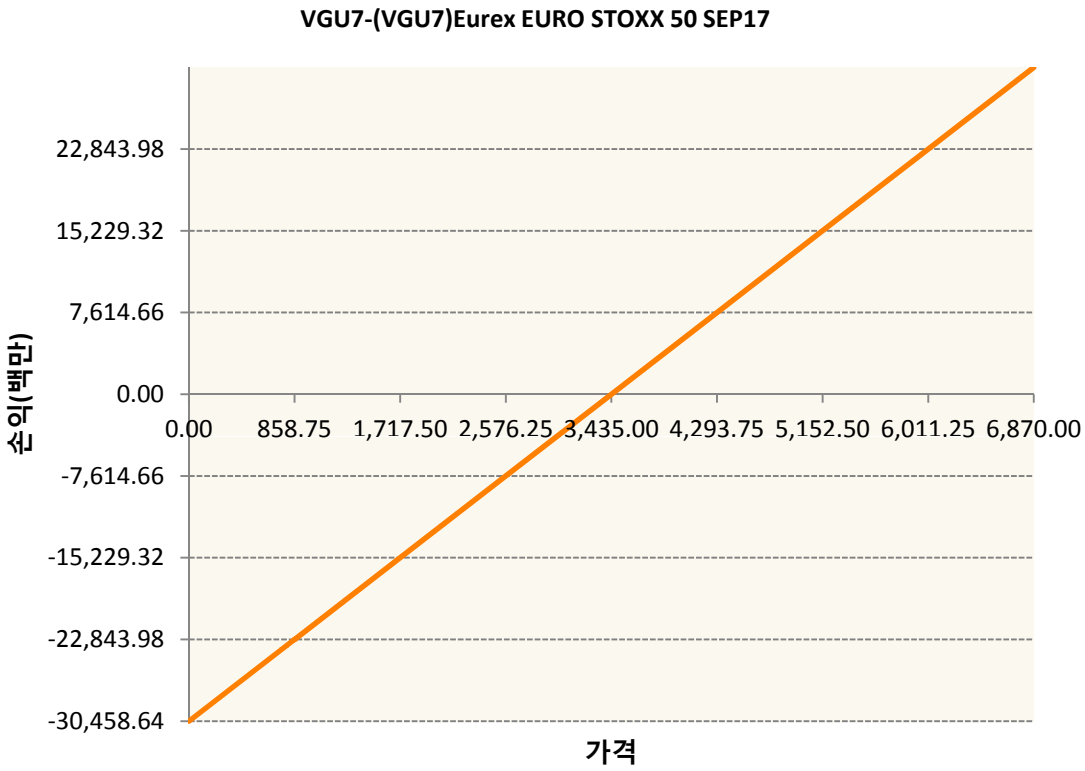



-7,385.02
-14,770.04
-22,155.05
-29,540.07
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
5,495.74
4,121.81
2,747.87
1,373.94
0.00
-1,373.94
-2,747.87
-4,121.81
-5,495.74
0.00
856.25
1,712.50
2,568.75
3,425.00
4,281.25
5,137.50
5,993.75
6,850.00
손익(백만)
가격


SX5E9P3450-OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR
22,155.05
14,770.04
7,385.02
0.00
-7,385.02
-14,770.04
0.00
862.50
1,725.00
2,587.50
3,450.00
4,312.50
5,175.00
6,037.50
6,900.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SX5E9C3425	OESXU7-C3425 EURO STOXX 50 Price EUR	440
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,363
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	440
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,363
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,437

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6,359

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

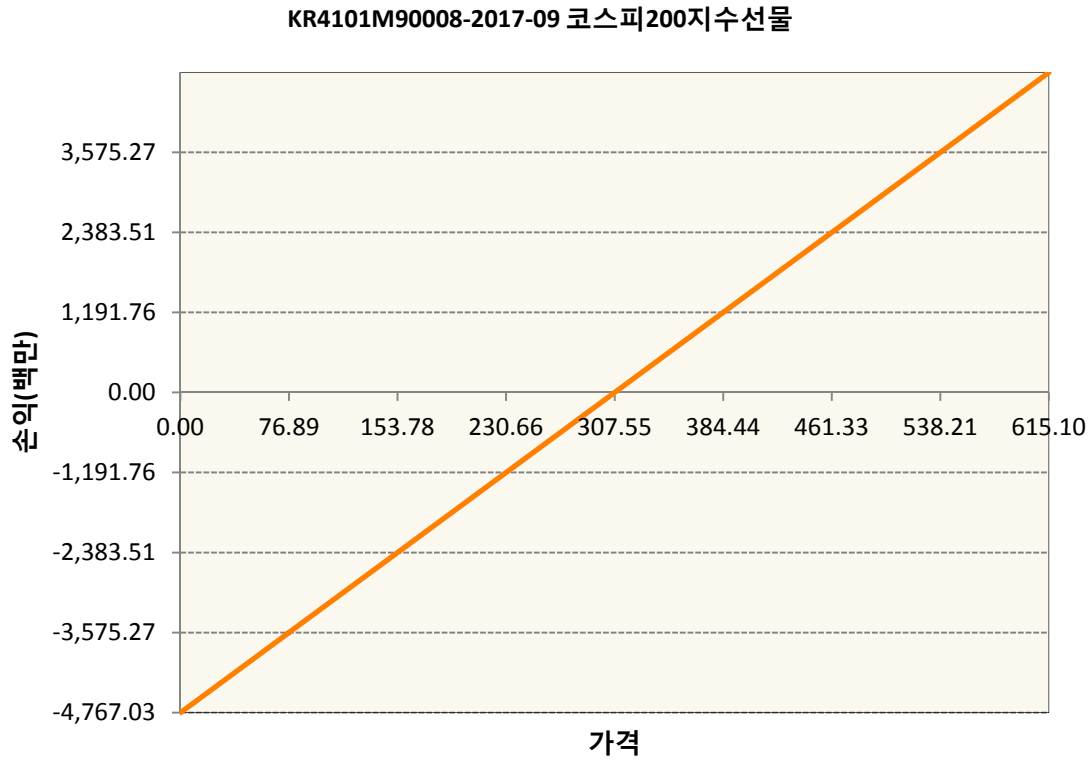
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,767	0	4,767	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							381
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-381	-381	-381	-381	-381	-381	-381
-5.33%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-2.67%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	127	127	127	127	127	127	127
5.33%	254	254	254	254	254	254	254
8.00%	381	381	381	381	381	381	381

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

239

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

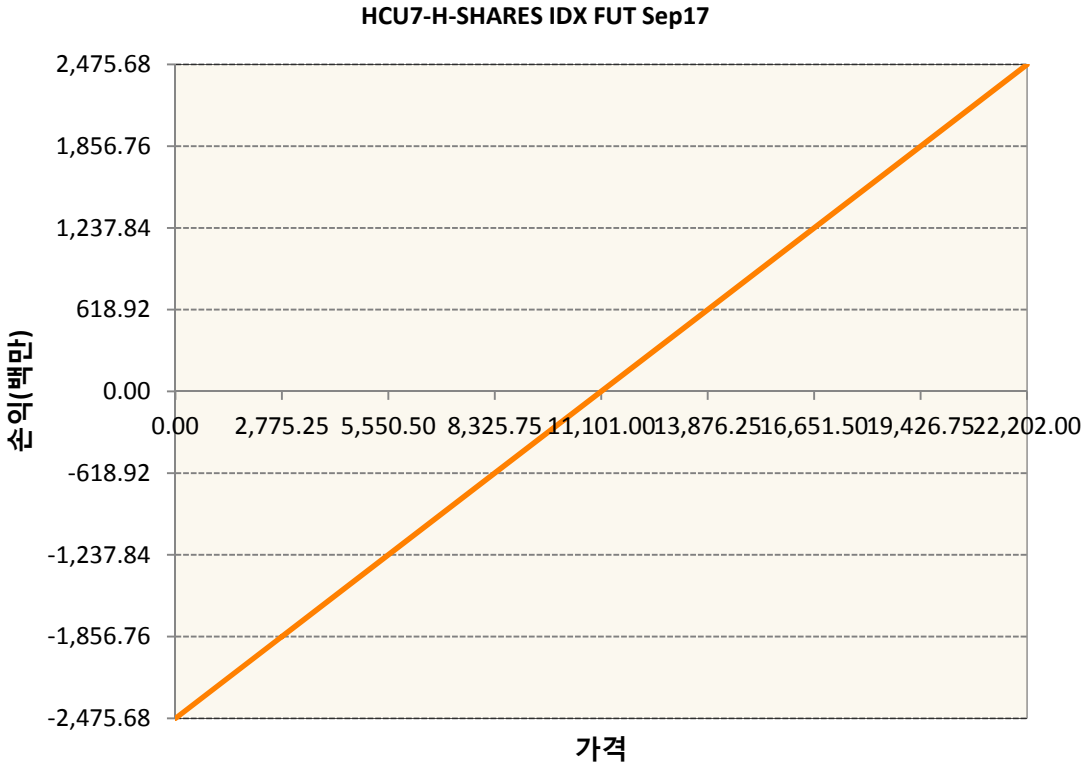
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

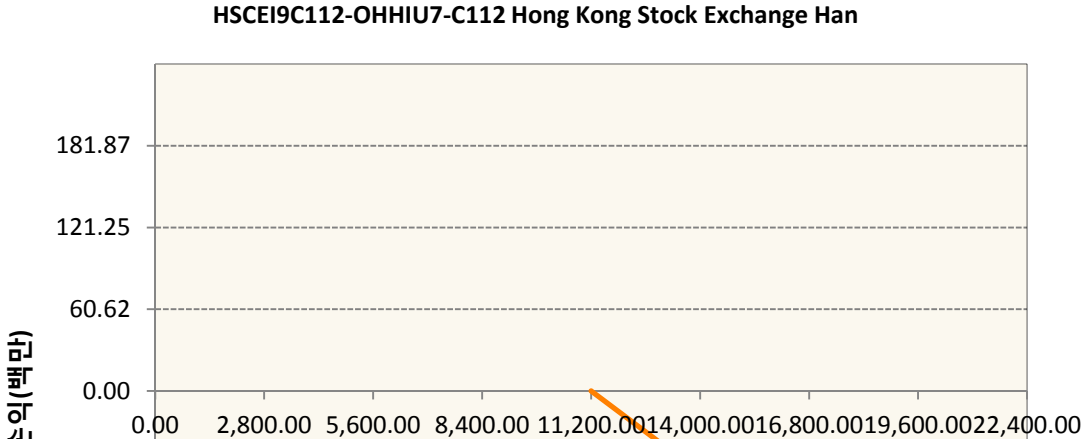
1. 계약금액

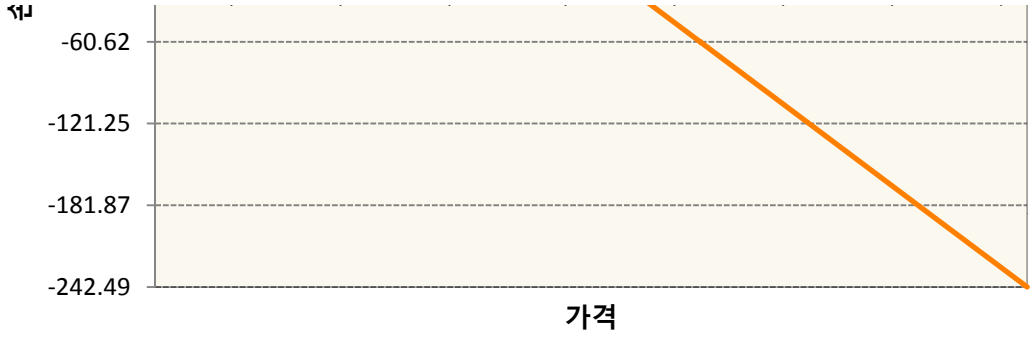
(단위:백만원)

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	2,476	0	2,476	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,092	-5,092	장내

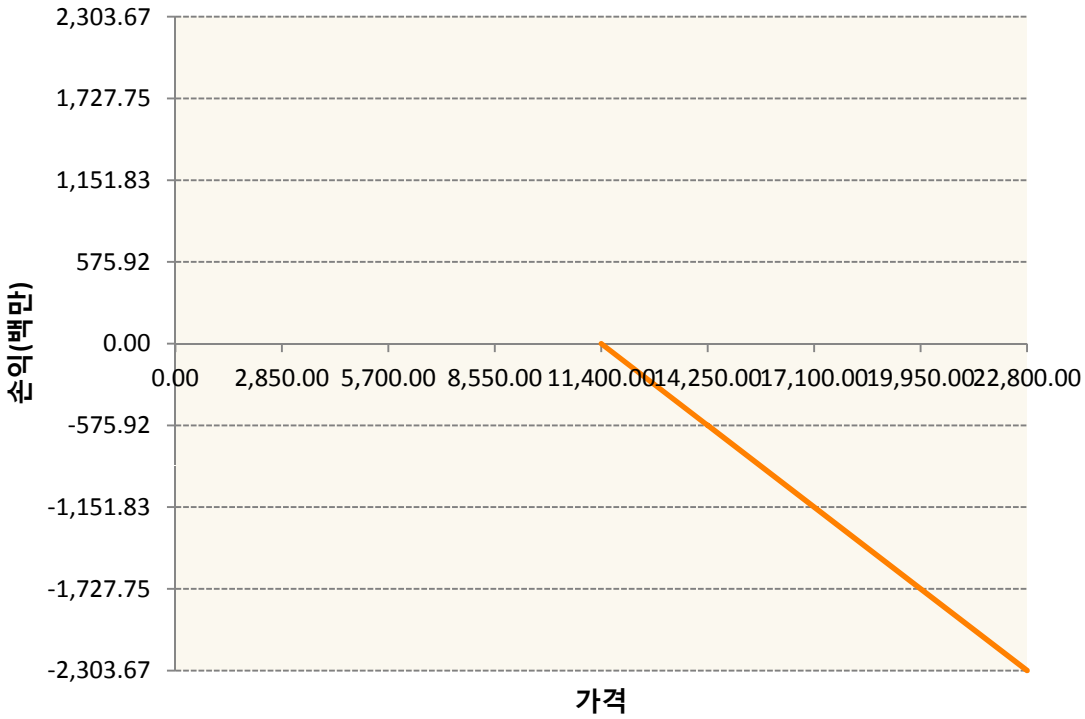
2. 만기시점의 손익구조



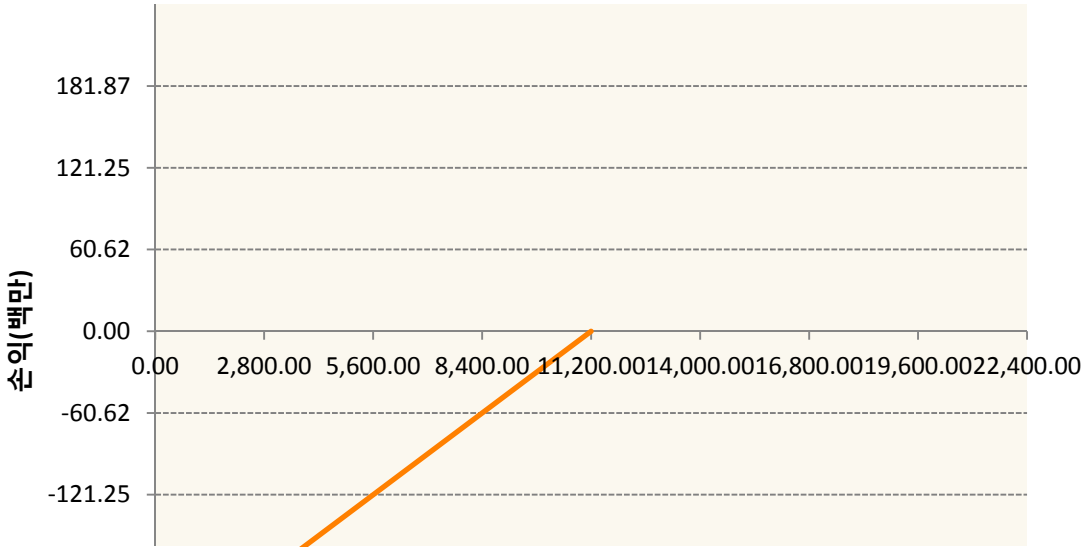


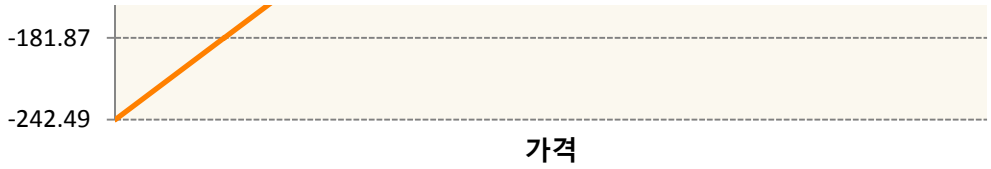


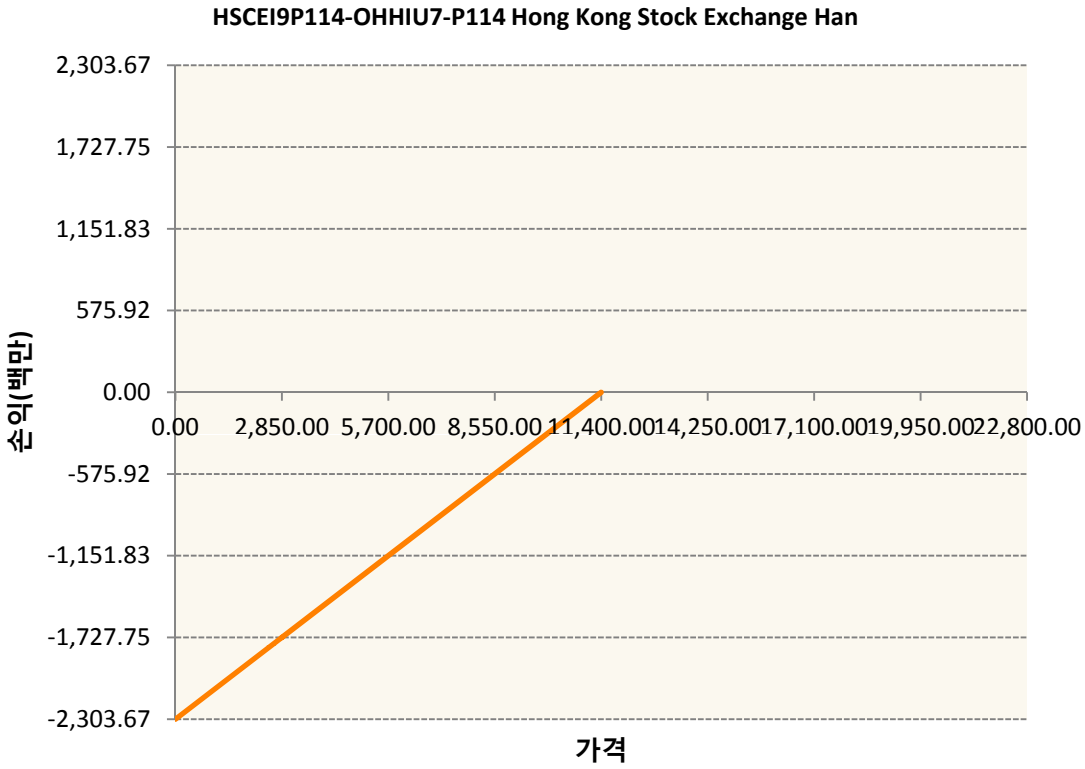
HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han



HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	198
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	19
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	184
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	19
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	184

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

520

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

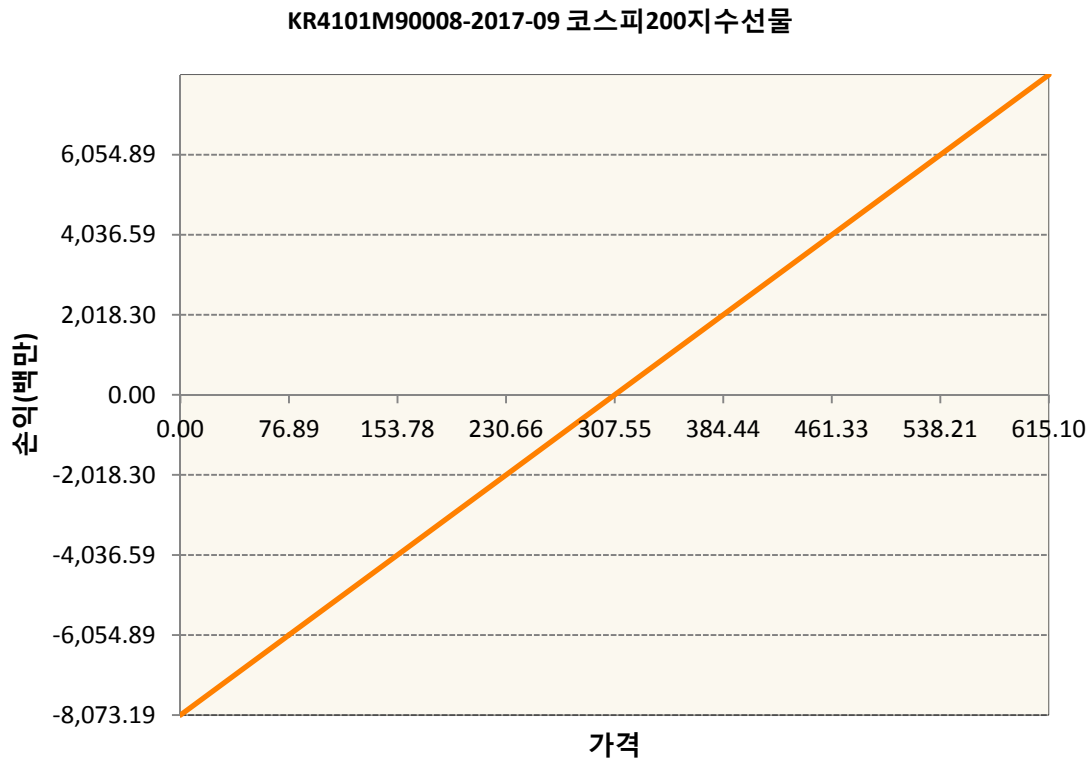
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

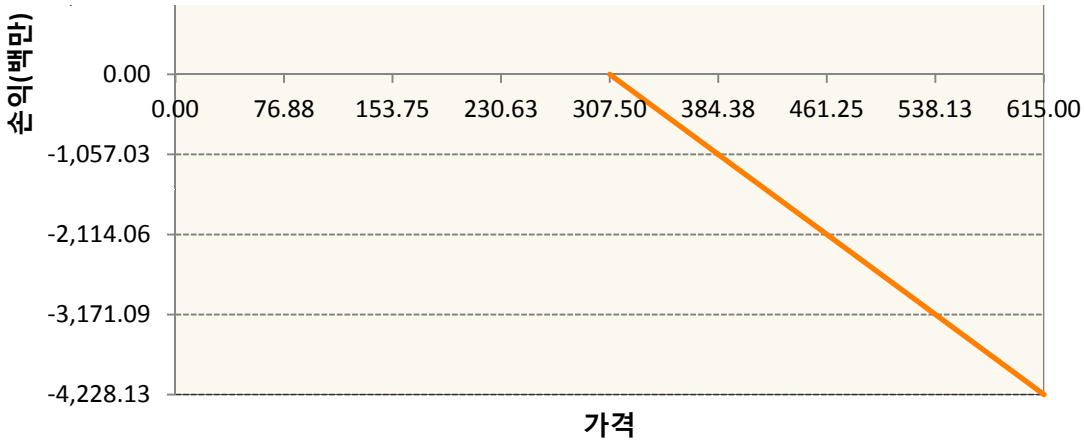
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,073	0	8,073	장내
누계	유가증권	스왑	22,000	0	22,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,972	-21,972	장내

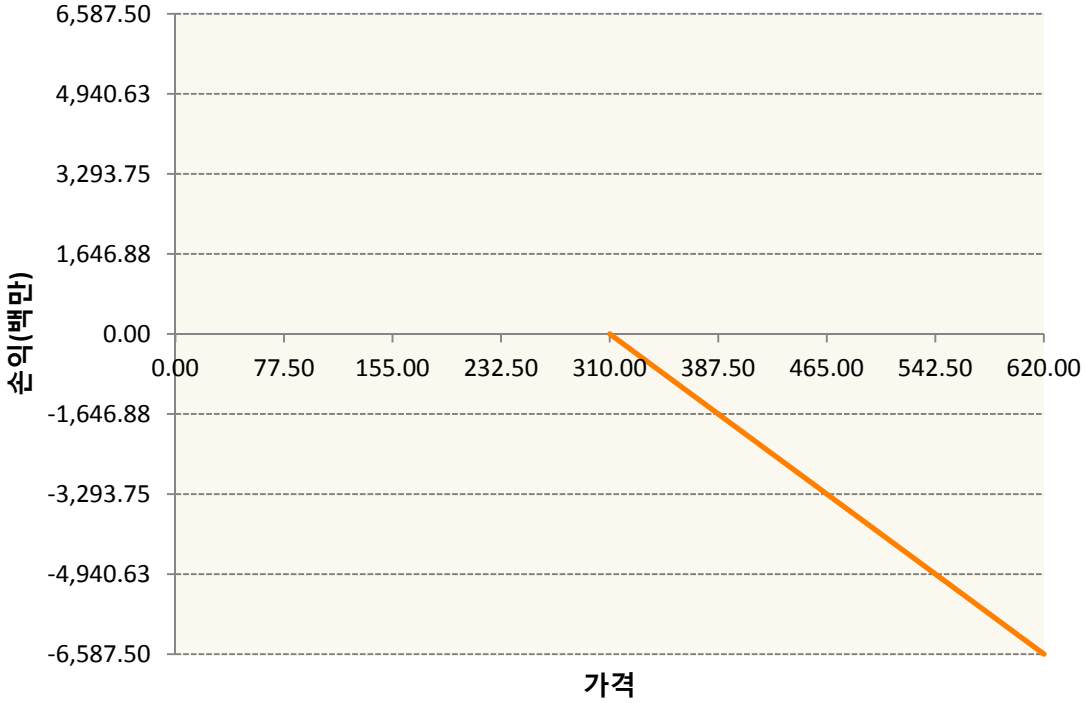
2. 만기시점의 손익구조



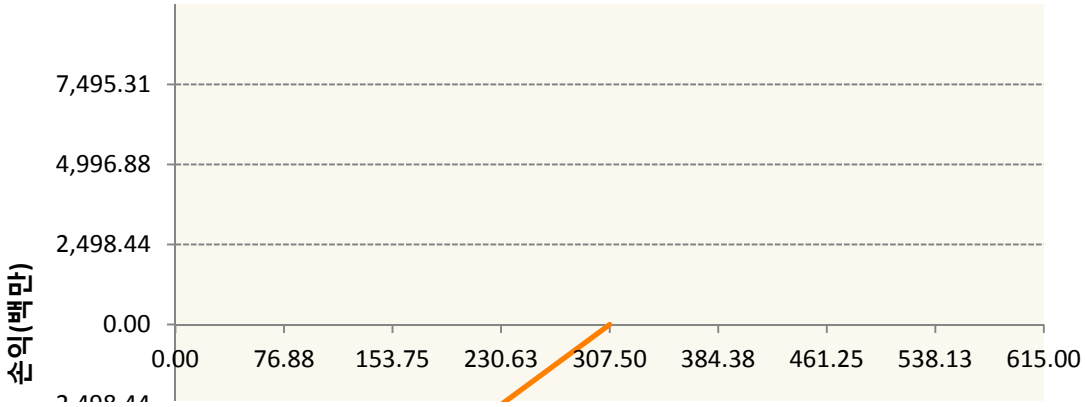




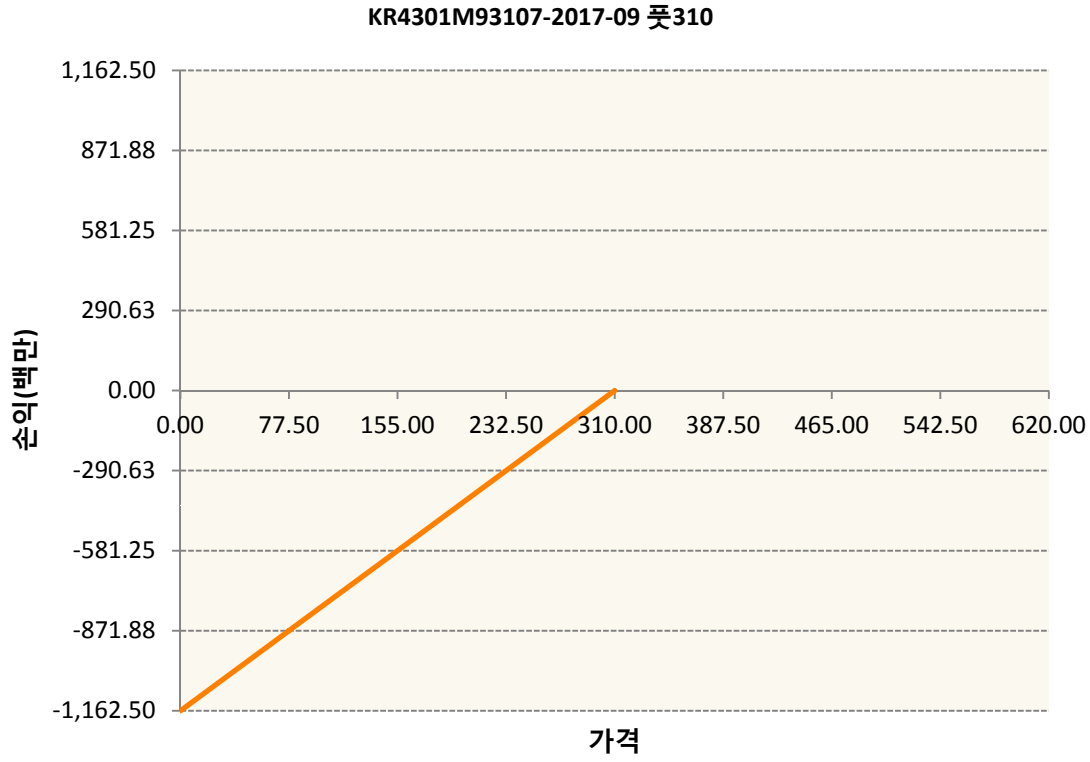
KR4201M93109-2017-09 콜310



KR4301M93073-2017-09 풋307.5







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,478
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478	-1,478
-5.33%	-985	-985	-985	-985	-985	-985	-985
-2.67%	-493	-493	-493	-493	-493	-493	-493
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	493	493	493	493	493	493	493
5.33%	985	985	985	985	985	985	985
8.00%	1,478	1,478	1,478	1,478	1,478	1,478	1,478
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							280
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	280	280	280	280	280	280	280
	KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물						645
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-645	-645	-645	-645	-645	-645	-645
-5.33%	-430	-430	-430	-430	-430	-430	-430
-2.67%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	215	215	215	215	215	215	215
5.33%	430	430	430	430	430	430	430
8.00%	645	645	645	645	645	645	645
	KR4201M93(2017-09 콜307.5						279
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	54	54	54	53	53	53	52
-5.33%	53	53	52	51	50	48	46
-2.67%	47	44	41	38	35	31	27
0%	14	10	5	0	-5	-10	-14
2.67%	-61	-64	-68	-71	-75	-79	-83
5.33%	-165	-166	-167	-168	-170	-172	-175
8.00%	-276	-277	-277	-277	-278	-278	-279
	KR4201M93: 2017-09 콜310						404
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	60	60	60	60	60	59
-5.33%	60	60	59	58	57	55	53
-2.67%	55	52	49	45	41	36	31
0%	21	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	-75	-82	-88	-95	-102	-108	-115
5.33%	-226	-229	-231	-235	-238	-243	-247
8.00%	-397	-397	-398	-399	-400	-402	-404
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						674
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-671	-671	-671	-672	-672	-673	-674
-5.33%	-406	-407	-409	-412	-415	-418	-423
-2.67%	-155	-162	-169	-176	-184	-193	-201
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34

2.67%	121	114	106	97	88	79	69
5.33%	142	140	137	134	129	125	119
8.00%	144	144	144	143	142	140	138
	KR4301M93:2017-09 풋310						82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-82	-82
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-52	-52
-2.67%	-21	-21	-22	-23	-24	-24	-25
0%	4	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	17	16	15	14	13	12	10
5.33%	21	21	21	20	19	19	18
8.00%	22	22	22	22	21	21	21

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

3,764

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

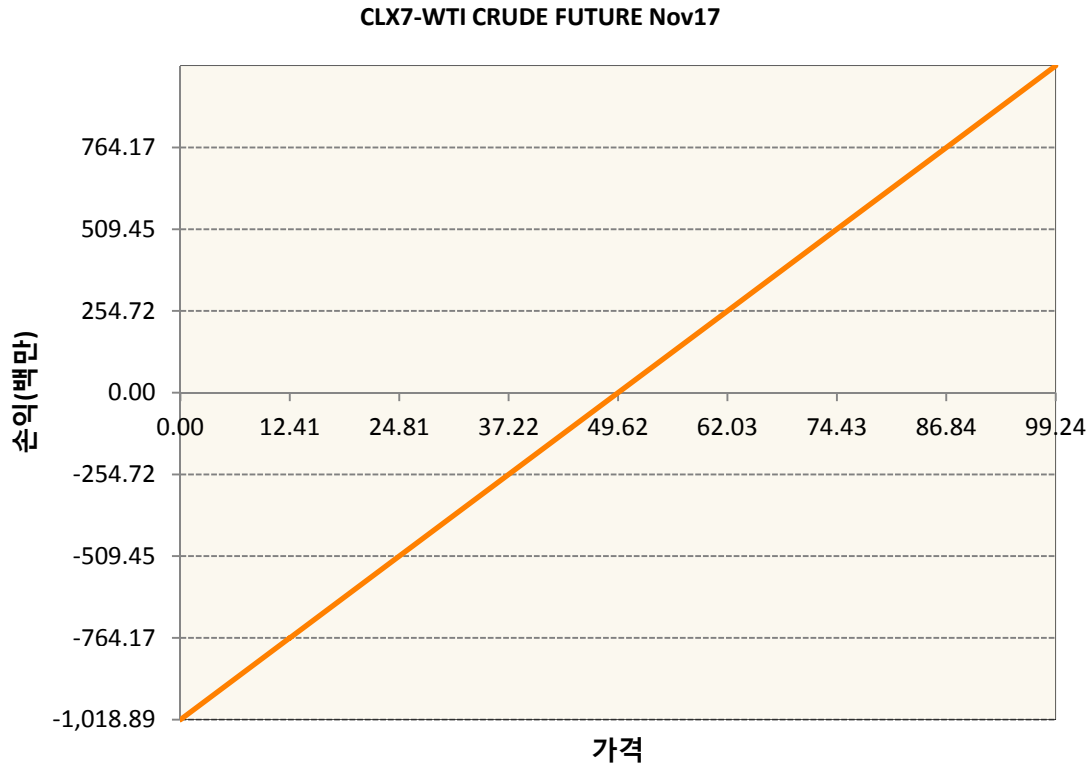
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

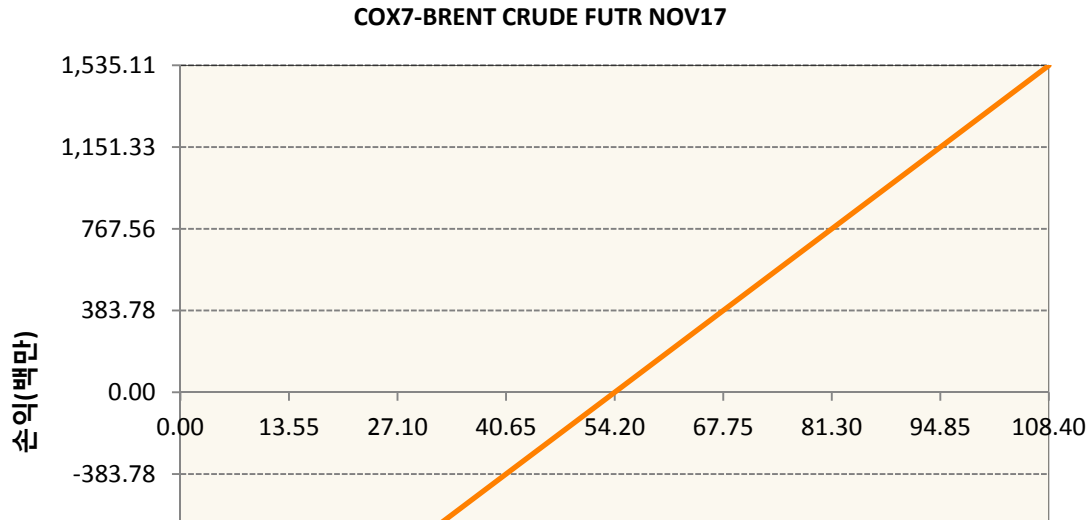
1. 계약금액

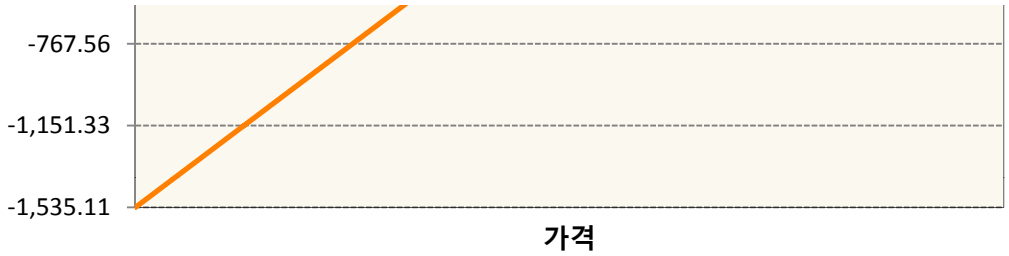
(단위:백만원)

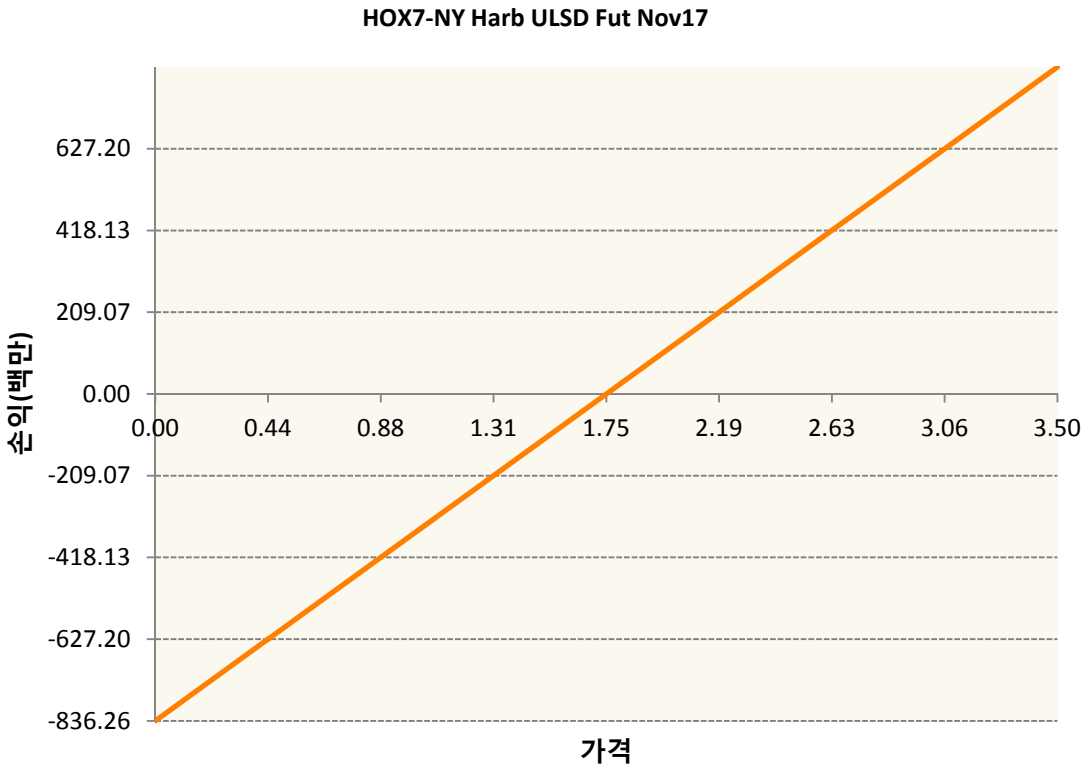
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,622	621	5,001	

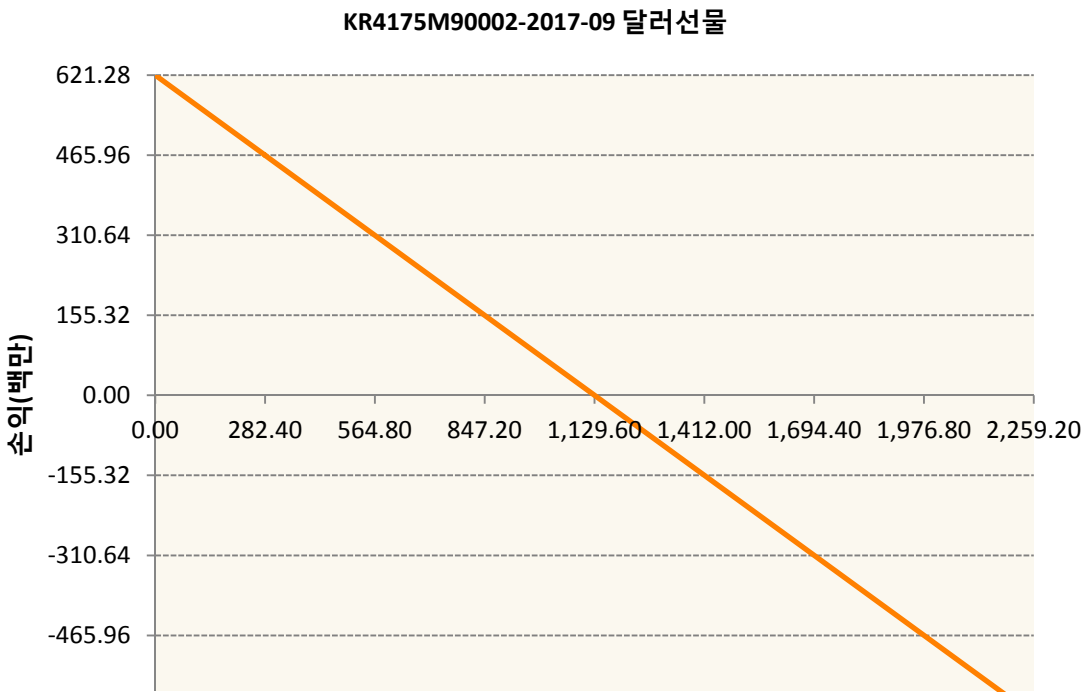
2. 만기시점의 손익구조

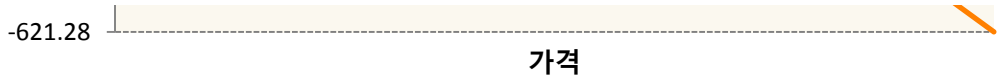


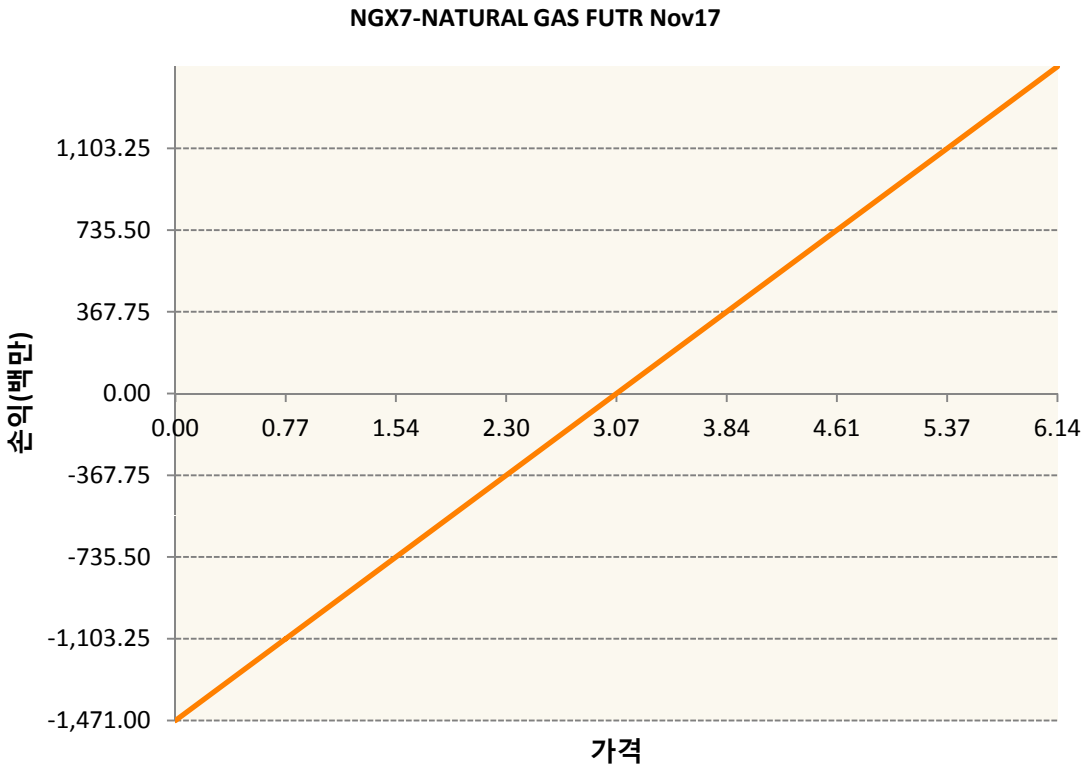


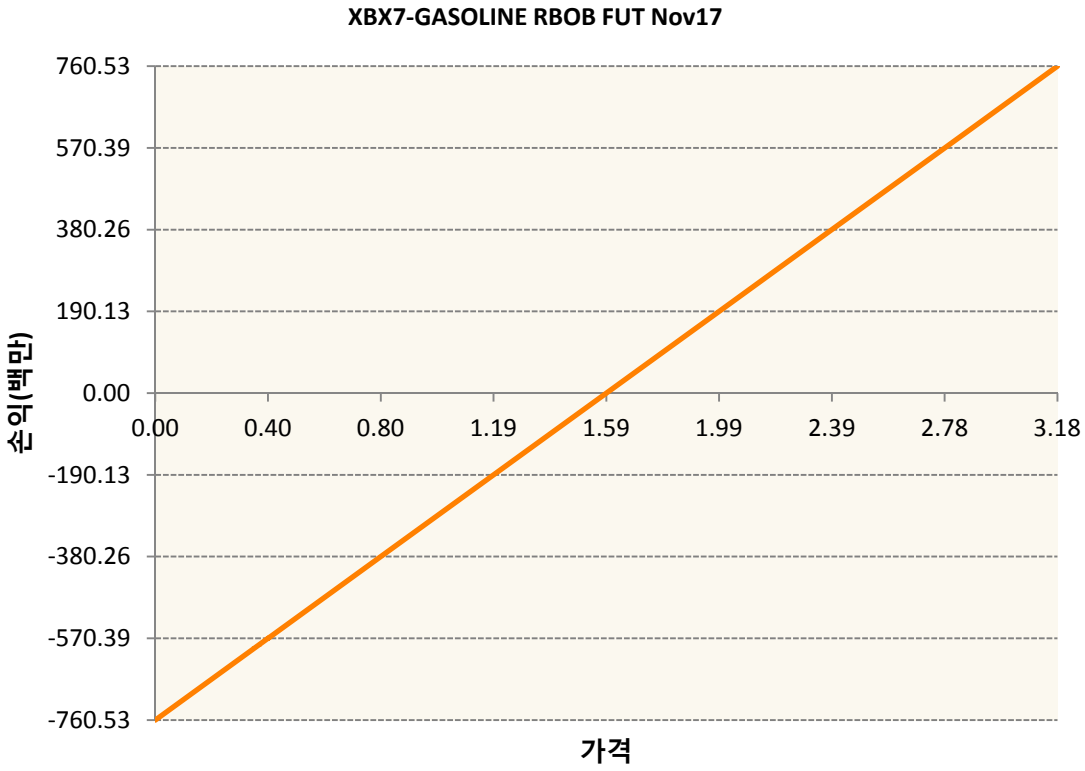

-767.56
-1,151.33
-1,535.11
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
627.20
418.13
209.07
0.00
-209.07
-418.13
-627.20
-836.26
0.00
0.44
0.88
1.31
1.75
2.19
2.63
3.06
3.50
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
621.28
465.96
310.64
155.32
0.00
-155.32
-310.64
-465.96
0.00
282.40
564.80
847.20
1,129.60
1,412.00
1,694.40
1,976.80
2,259.20
손익(백만)


-621.28
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,103.25
735.50
367.75
0.00
-367.75
-735.50
-1,103.25
-1,471.00
0.00
0.77
1.54
2.30
3.07
3.84
4.61
5.37
6.14
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
760.53
570.39
380.26
190.13
0.00
-190.13
-380.26
-570.39
-760.53
0.00
0.40
0.80
1.19
1.59
1.99
2.39
2.78
3.18
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	82
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	123
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	67
KR4175M90(	2017-09 달러선물	50
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	118
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	61

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

821

공시일	2017-09-08
기준일	2017-09-07

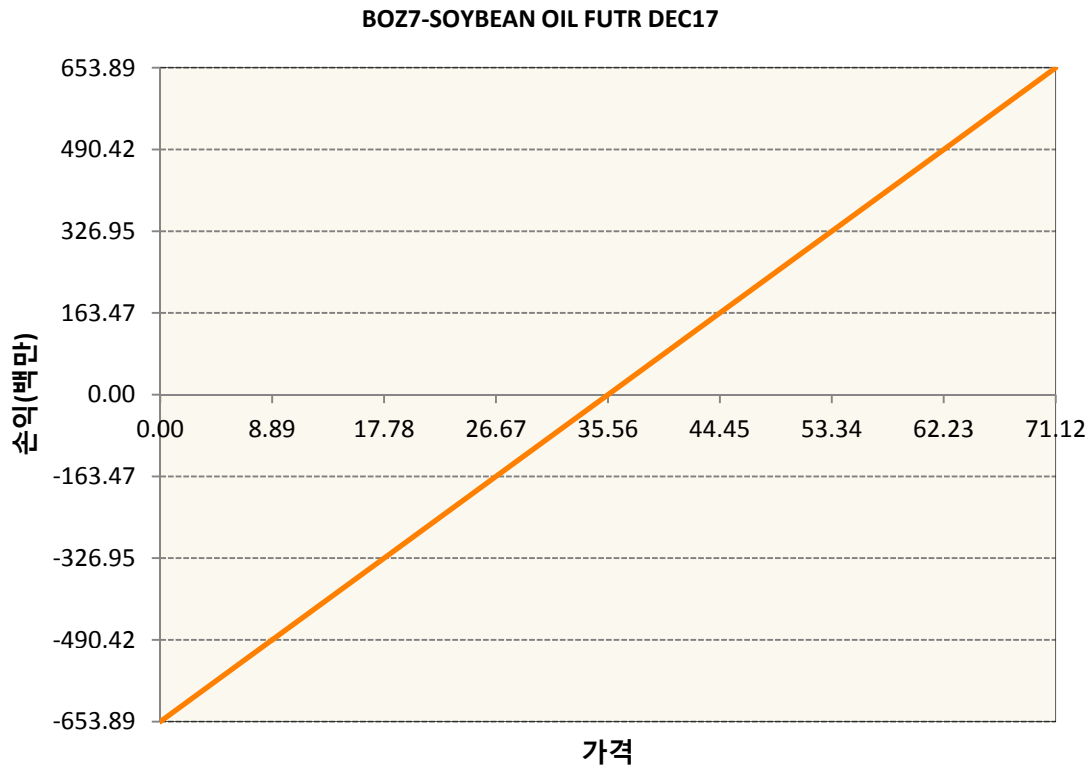
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

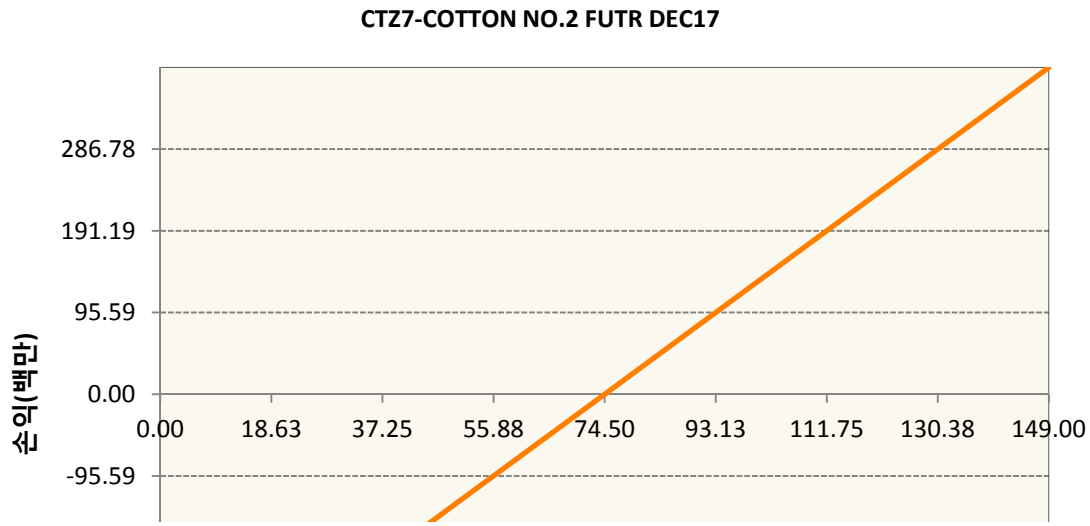
1. 계약금액

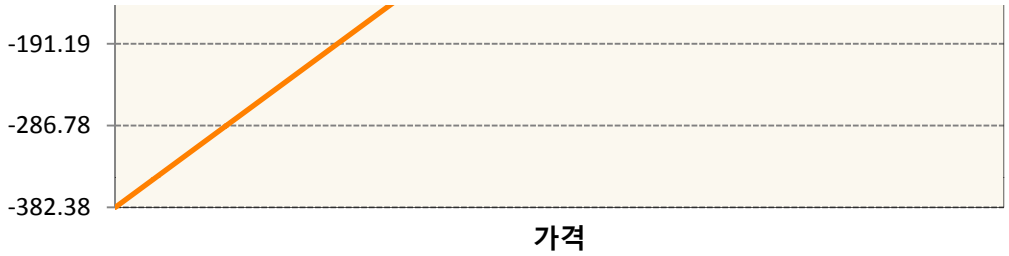
(단위:백만원)

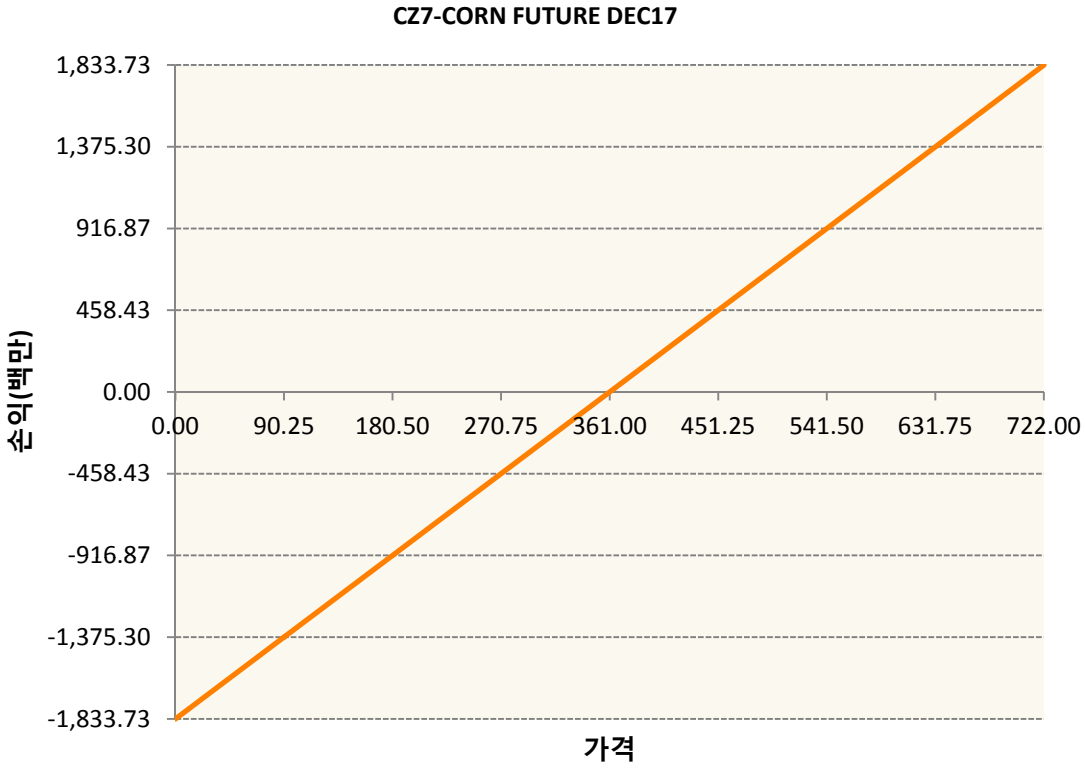
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,074	339	6,735	

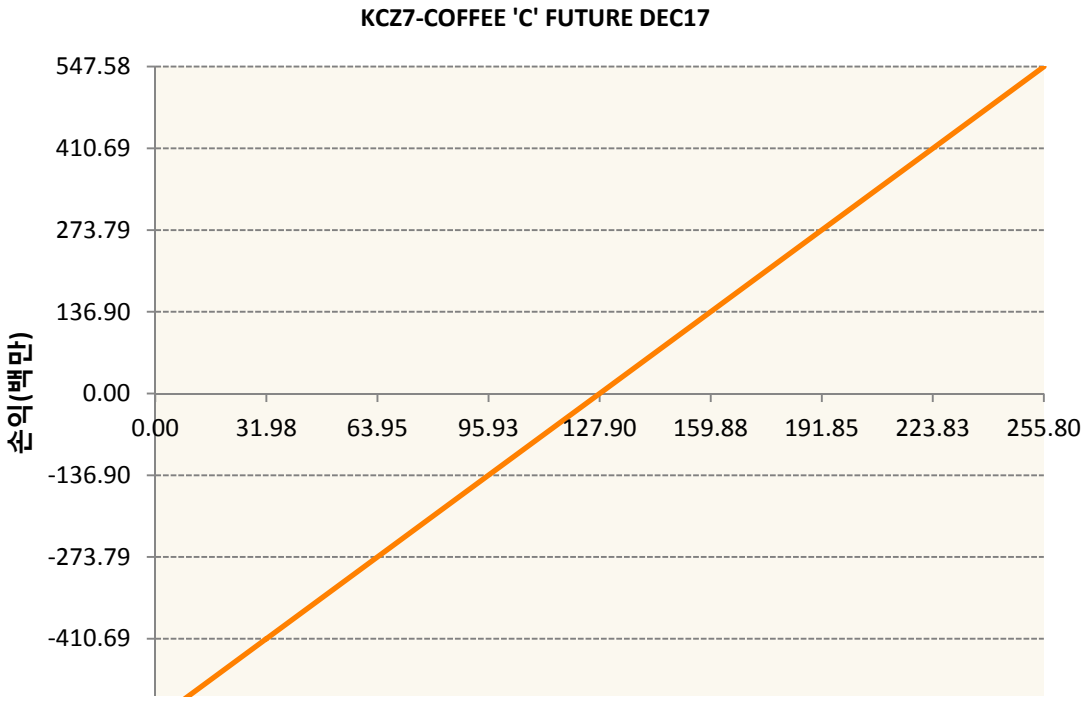
2. 만기시점의 손익구조

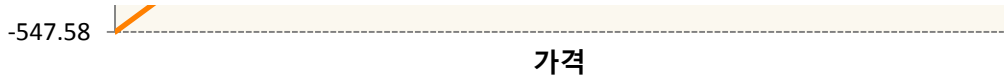


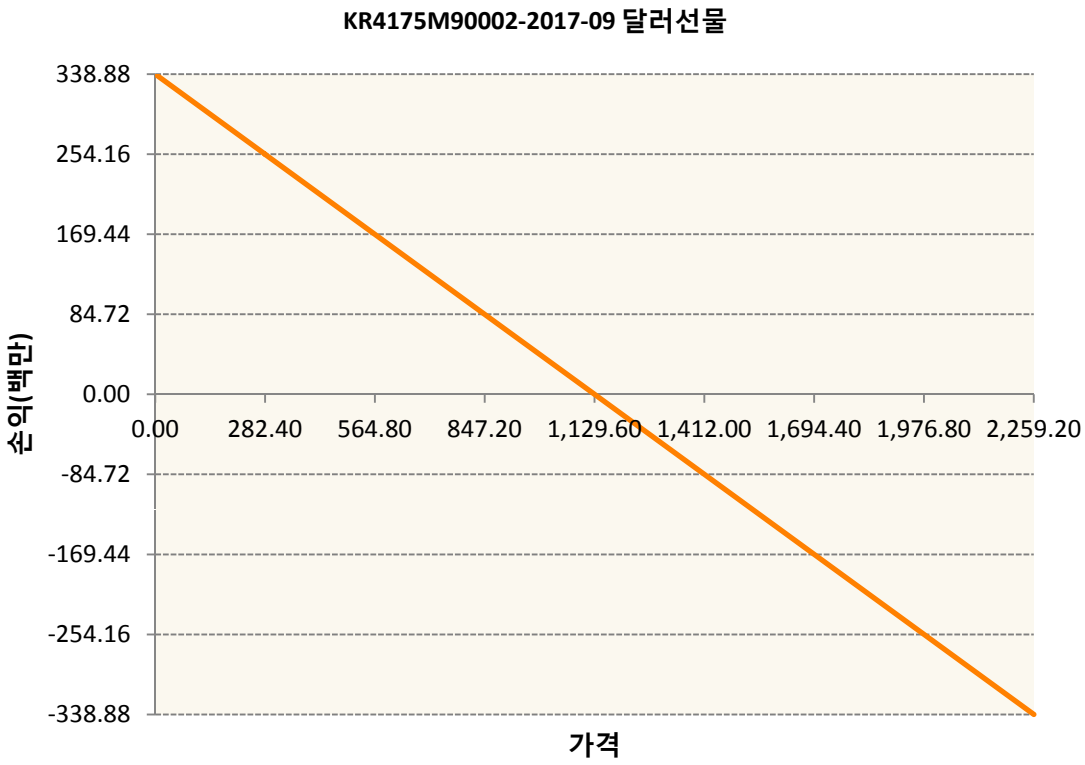


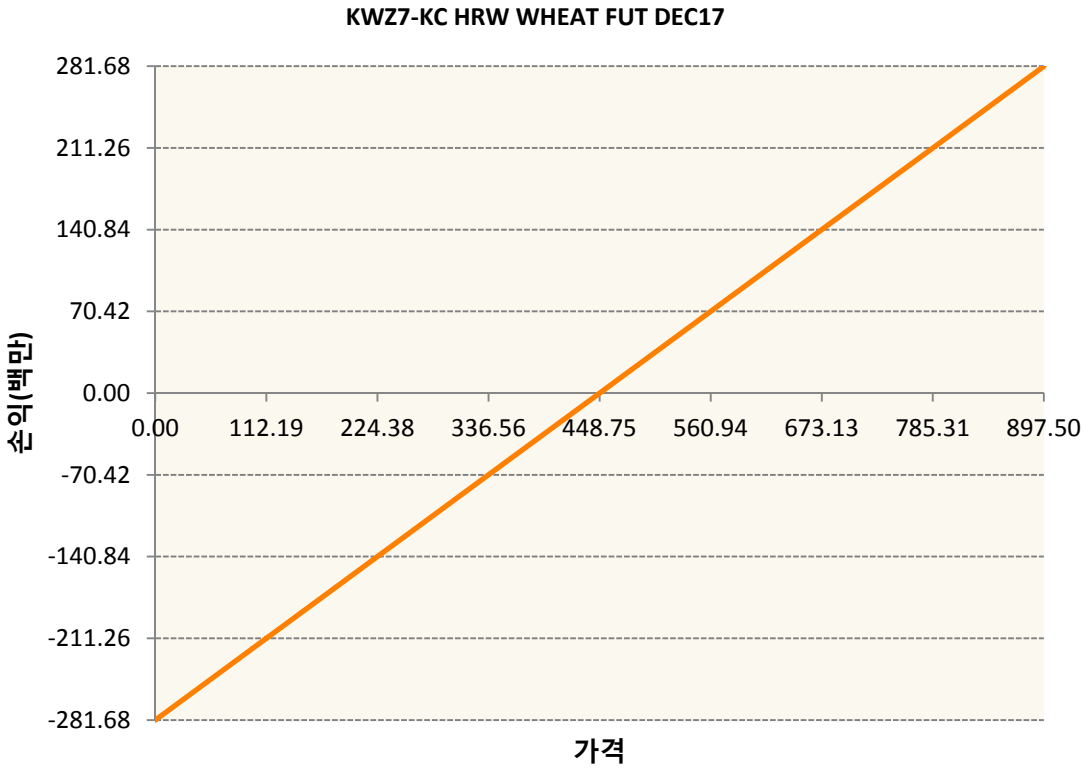

-191.19
-286.78
-382.38
가격

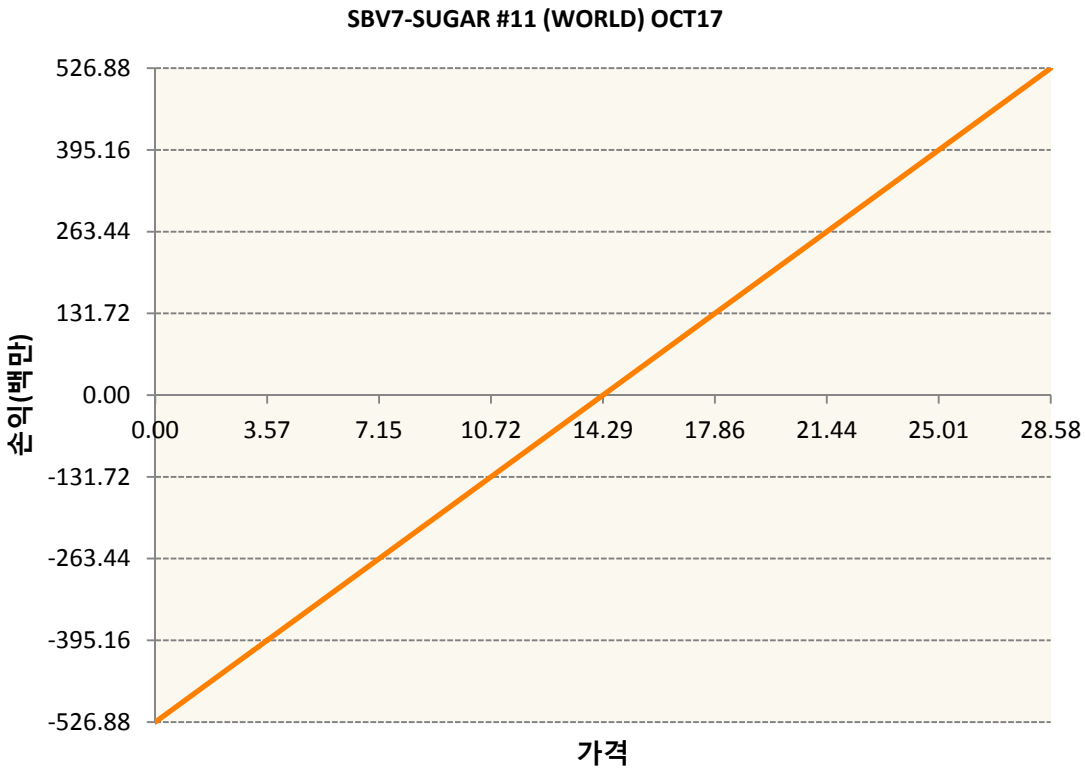

CZ7-CORN FUTURE DEC17
1,833.73
1,375.30
916.87
458.43
0.00
-458.43
-916.87
-1,375.30
-1,833.73
0.00
90.25
180.50
270.75
361.00
451.25
541.50
631.75
722.00
손익(백만)
가격

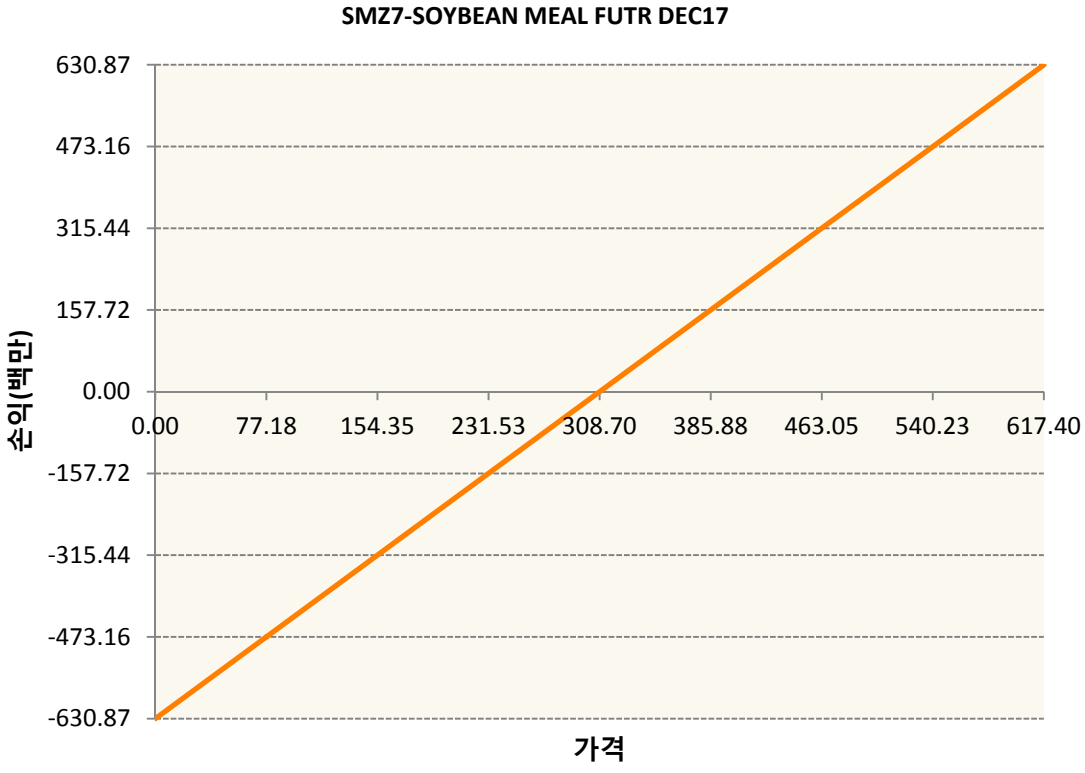

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
547.58
410.69
273.79
136.90
0.00
-136.90
-273.79
-410.69
0.00
31.98
63.95
95.93
127.90
159.88
191.85
223.83
255.80
손익(백만)

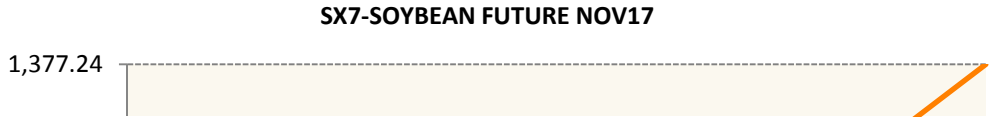

-547.58
가격

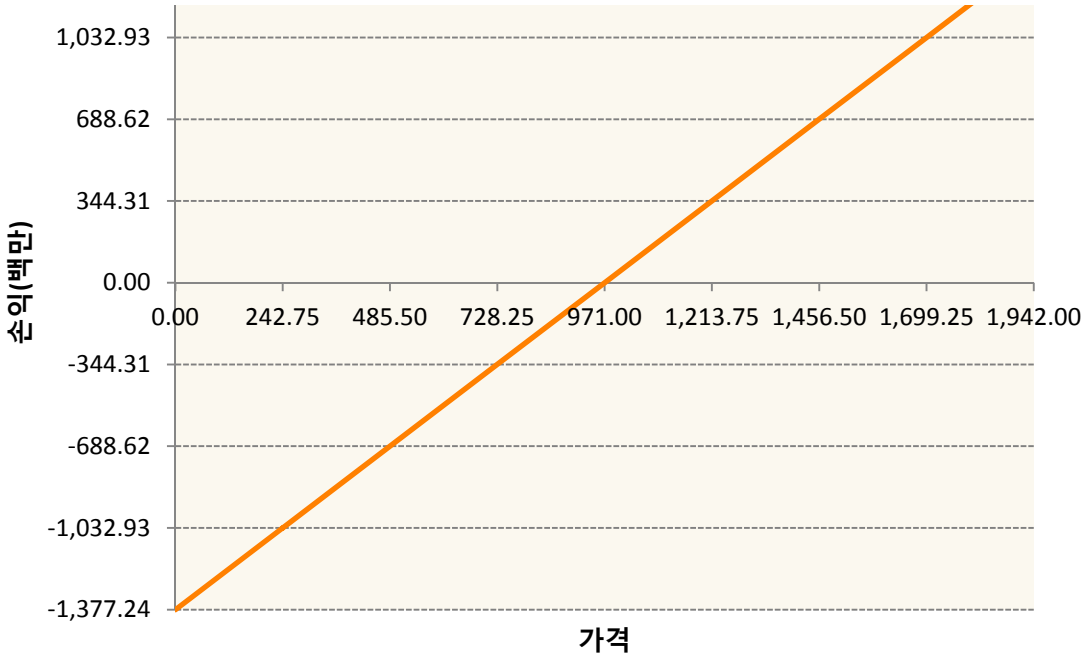

KR4175M90002-2017-09 달러선물
338.88
254.16
169.44
84.72
0.00
-84.72
-169.44
-254.16
-338.88
0.00
282.40
564.80
847.20
1,129.60
1,412.00
1,694.40
1,976.80
2,259.20
손익(백만)
가격

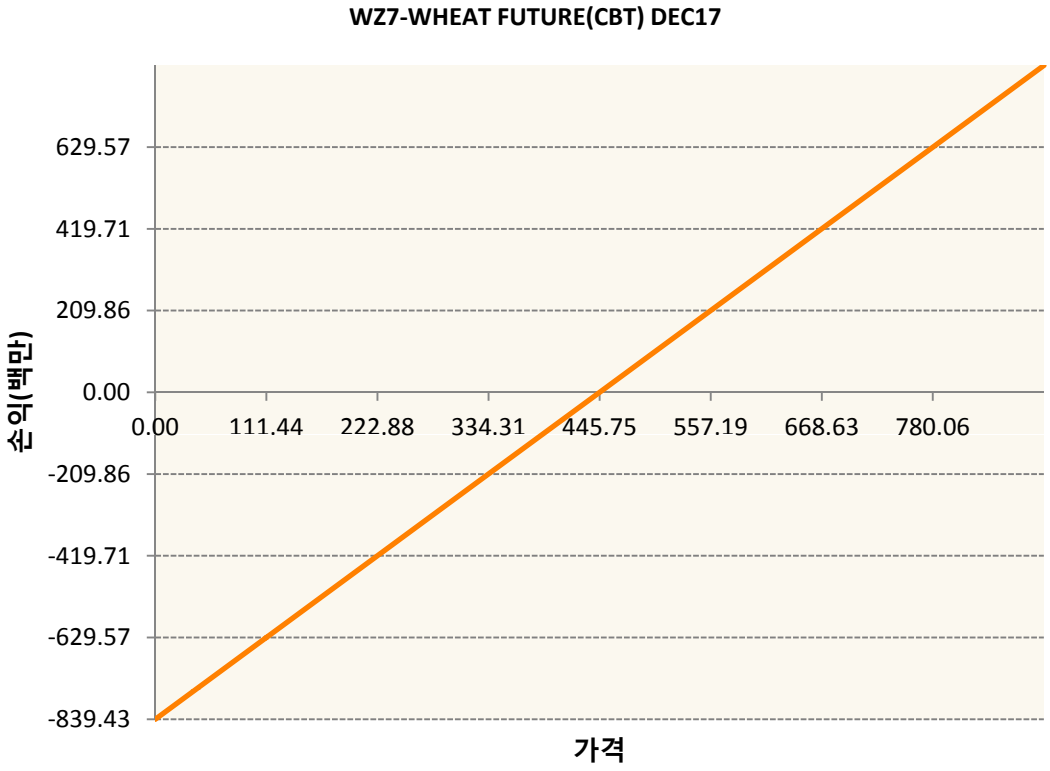

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
281.68
211.26
140.84
70.42
0.00
-70.42
-140.84
-211.26
-281.68
0.00
112.19
224.38
336.56
448.75
560.94
673.13
785.31
897.50
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
526.88
395.16
263.44
131.72
0.00
-131.72
-263.44
-395.16
-526.88
0.00
3.57
7.15
10.72
14.29
17.86
21.44
25.01
28.58
손익(백만)
가격


SMZ7-SOYBEAN MEAL FUTR DEC17
630.87
473.16
315.44
157.72
0.00
-157.72
-315.44
-473.16
-630.87
0.00
77.18
154.35
231.53
308.70
385.88
463.05
540.23
617.40
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,377.24





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	52
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	31
CZ7	CORN FUTURE DEC17	147
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	44
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	23
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	50
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	110
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	67

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

667