공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

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	2017-09-13
기준일	2017-09-12

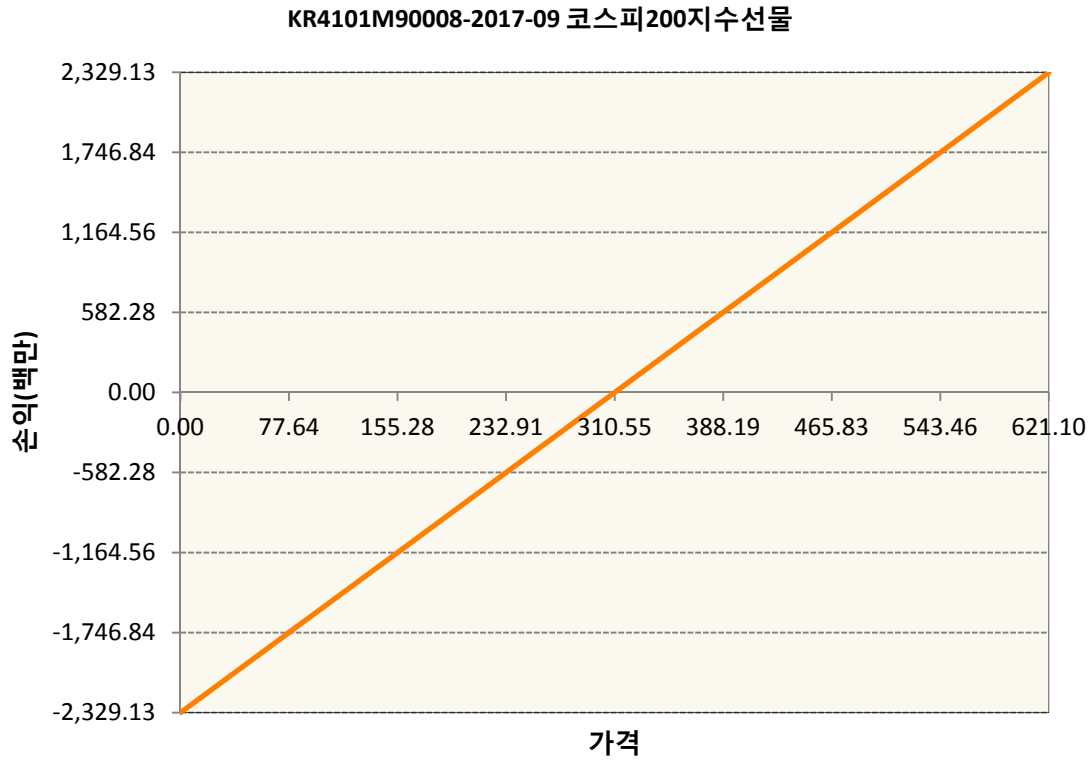
스마트인덱스모

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	2,329	0	2,329	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							186
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-5.33%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	62	62	62	62	62	62	62
5.33%	124	124	124	124	124	124	124
8.00%	186	186	186	186	186	186	186

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

117

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

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	1,034

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

468

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

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	5,301	0	5,301	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S170908	429

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

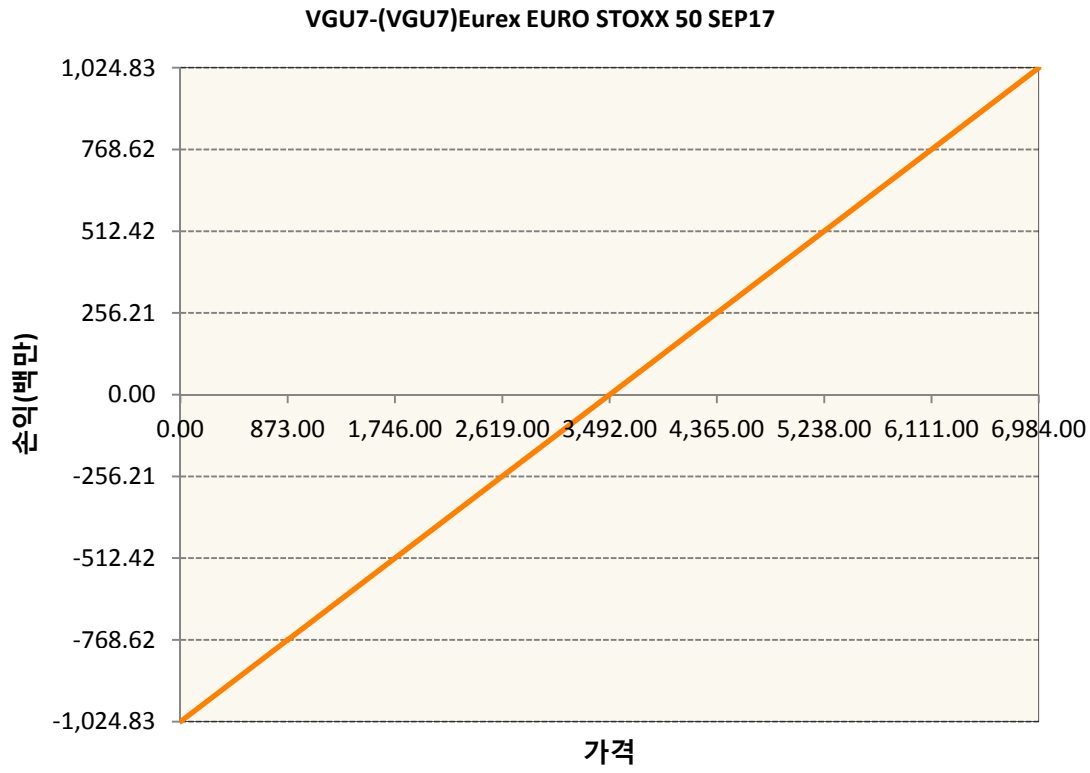
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,025	0	1,025	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	82

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

(단위:백만원)

65

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

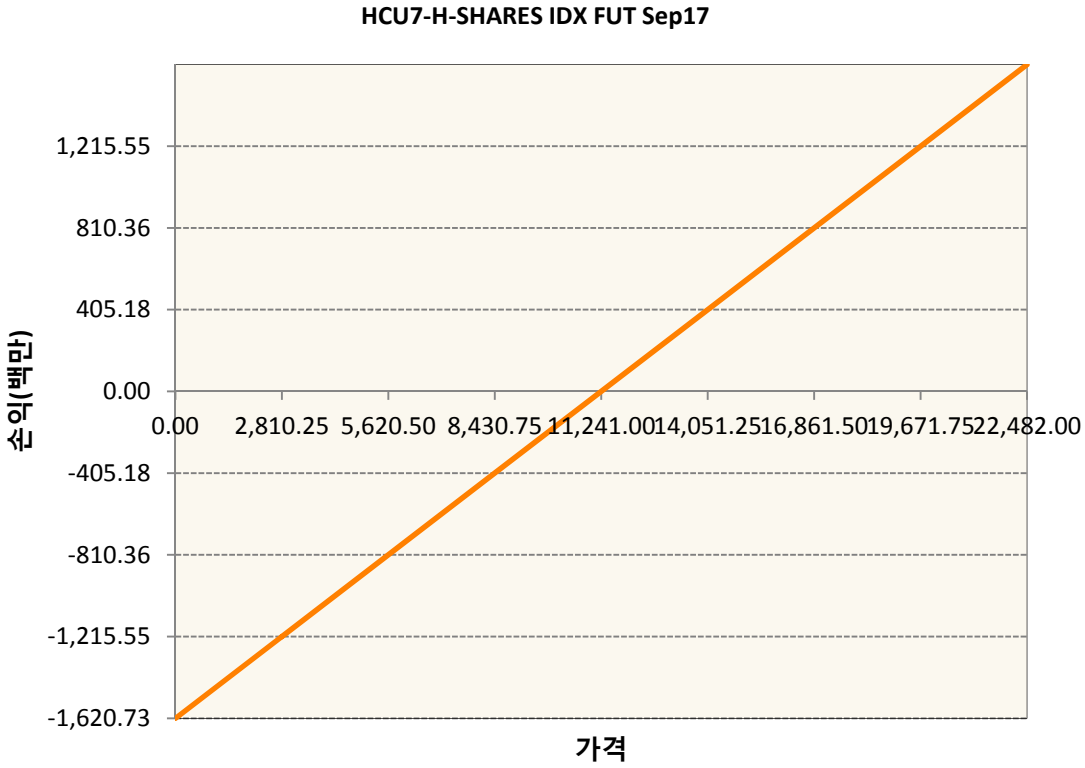
차이나인덱스모(주식-파생형)

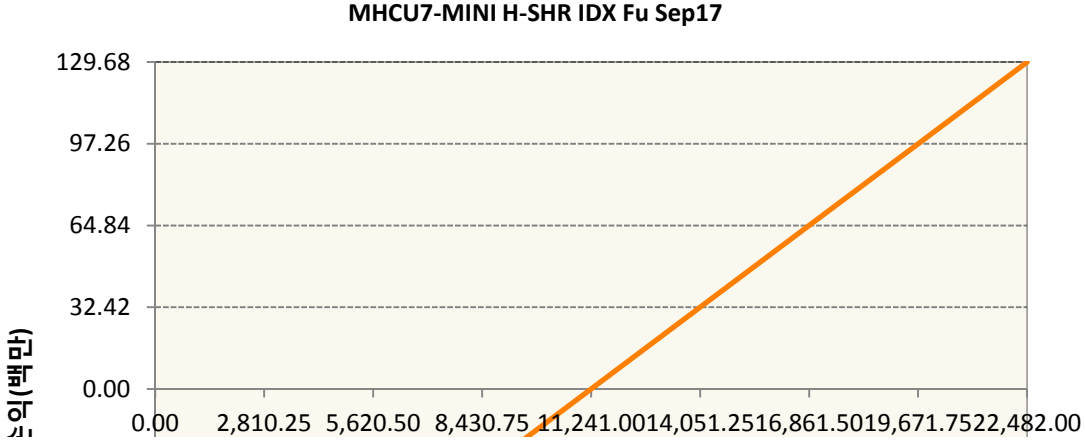
1. 계약금액

(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	130	0	130	
누계	유가증권	선물	1,621	0	1,621	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	130
MHCU7	MINI H-SHR IDX Fu Sep17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	119

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

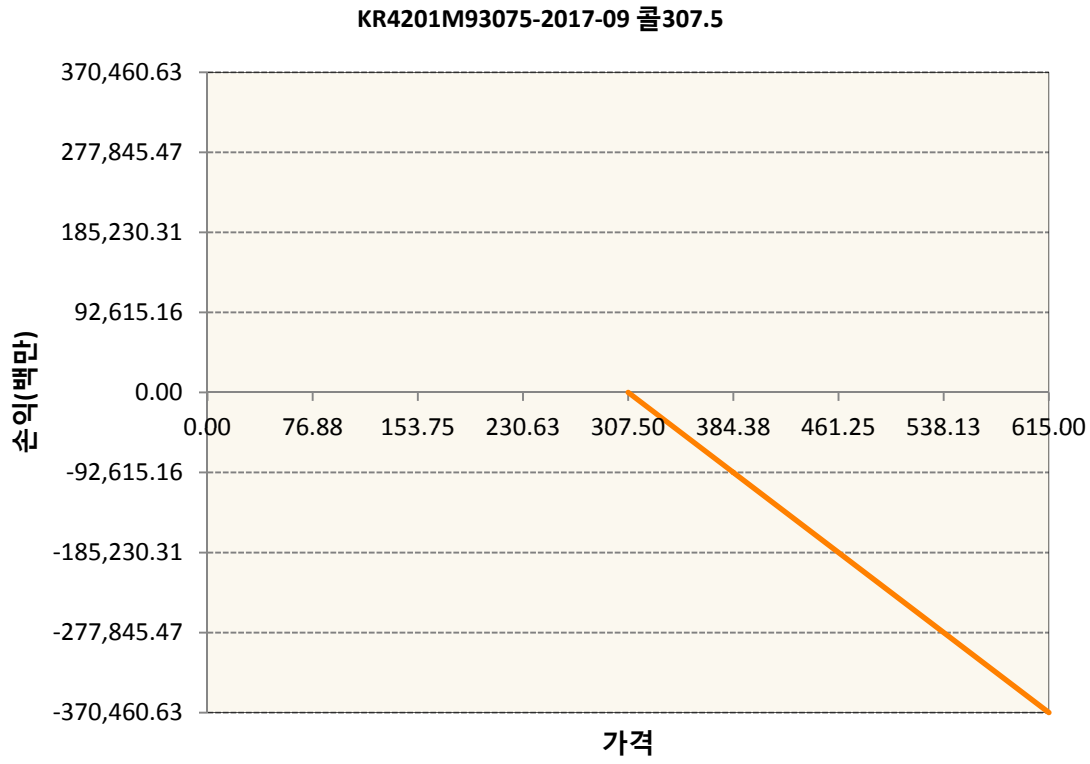
커버드콜모(주식혼합-파생형)

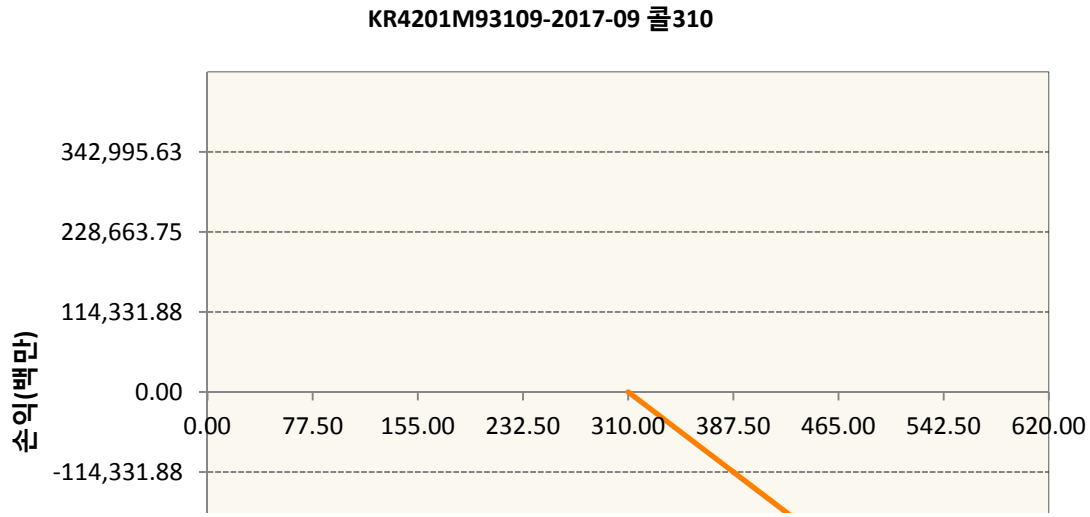
1. 계약금액

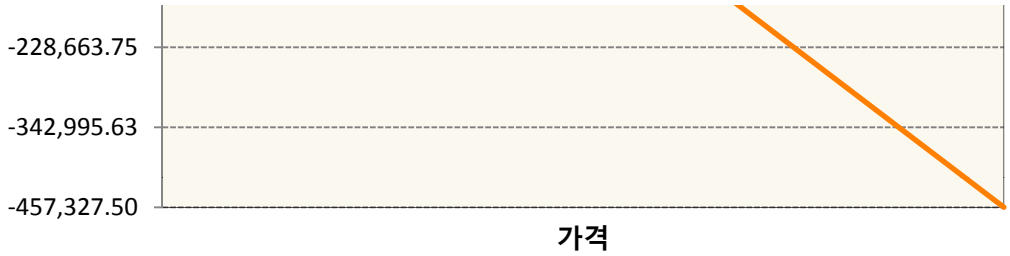
(단위:백만원)

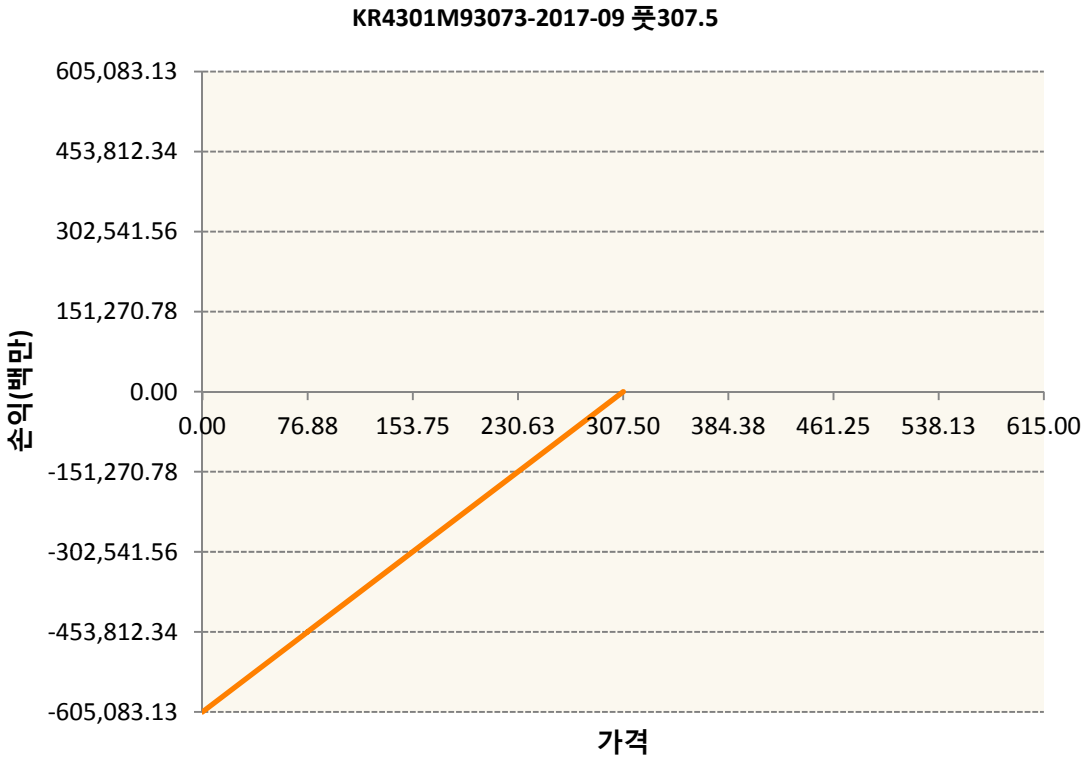
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,497,119	-1,497,119	장내

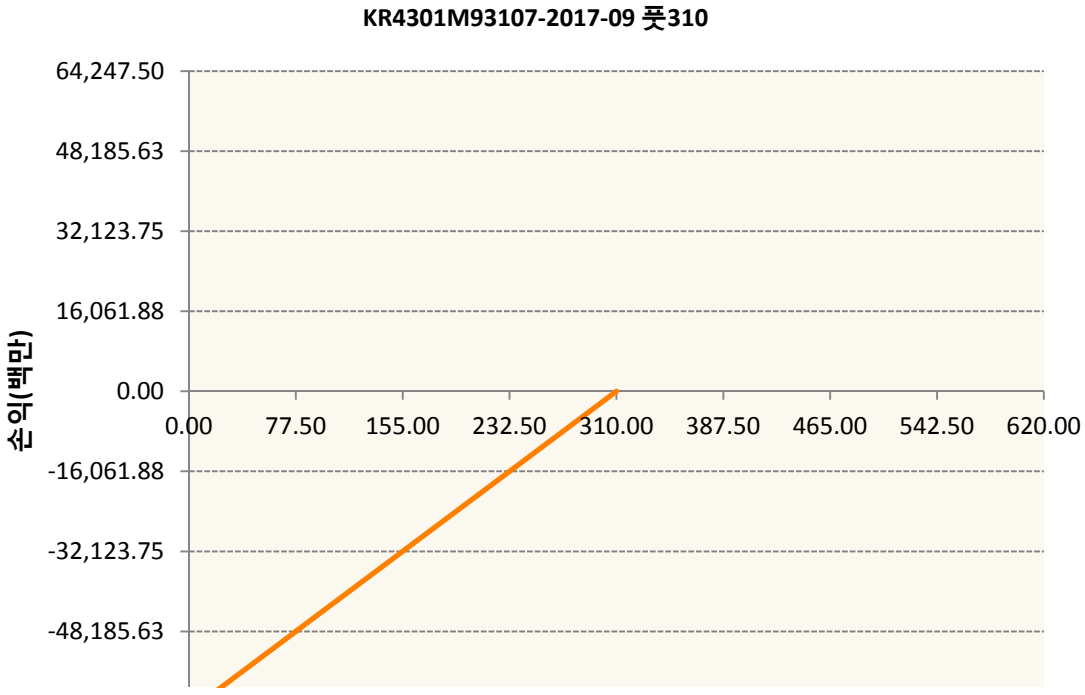
2. 만기시점의 손익구조

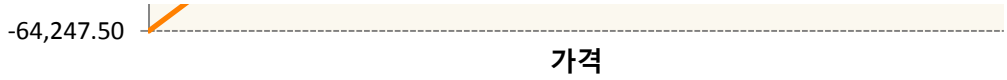





-228,663.75
-342,995.63
-457,327.50
가격


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							28,678
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,753	4,753	4,753	4,753	4,753	4,753	4,752
-5.33%	4,753	4,751	4,748	4,742	4,732	4,716	4,693
-2.67%	4,542	4,443	4,330	4,204	4,066	3,920	3,766
0%	544	370	188	0	-192	-388	-587
2.67%	-8,740	-8,748	-8,764	-8,788	-8,822	-8,867	-8,922
5.33%	-18,706	-18,706	-18,706	-18,707	-18,708	-18,710	-18,713
8.00%	-28,678	-28,678	-28,678	-28,678	-28,678	-28,678	-28,678
KR4201M93: 2017-09 콜310							33,699
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,551	3,551	3,551	3,551	3,551	3,551	3,551
-5.33%	3,551	3,551	3,550	3,549	3,545	3,537	3,526
-2.67%	3,491	3,441	3,373	3,289	3,188	3,072	2,943
0%	805	537	269	0	-269	-538	-806
2.67%	-9,318	-9,357	-9,413	-9,485	-9,574	-9,678	-9,796
5.33%	-21,487	-21,488	-21,488	-21,490	-21,495	-21,503	-21,515
8.00%	-33,698	-33,698	-33,698	-33,698	-33,698	-33,698	-33,699
KR4301M93(2017-09 풋307.5							41,100
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41,099	-41,099	-41,099	-41,099	-41,099	-41,100	-41,100
-5.33%	-24,812	-24,814	-24,819	-24,829	-24,846	-24,872	-24,909
-2.67%	-8,869	-9,030	-9,215	-9,422	-9,646	-9,885	-10,137
0%	889	604	307	0	-314	-634	-959
2.67%	2,012	1,998	1,973	1,933	1,878	1,805	1,716
5.33%	2,021	2,021	2,021	2,021	2,019	2,016	2,010
8.00%	2,021	2,021	2,021	2,021	2,021	2,021	2,021
KR4301M93: 2017-09 풋310							4,647
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4,647	-4,647	-4,647	-4,647	-4,647	-4,647	-4,647
-5.33%	-2,932	-2,932	-2,932	-2,932	-2,933	-2,934	-2,936
-2.67%	-1,225	-1,232	-1,242	-1,253	-1,268	-1,284	-1,302
0%	113	75	38	0	-38	-76	-113
2.67%	406	401	393	383	370	356	339

5.33%	412	412	412	412	411	410	408
8.00%	412	412	412	412	412	412	412

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

141,682

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

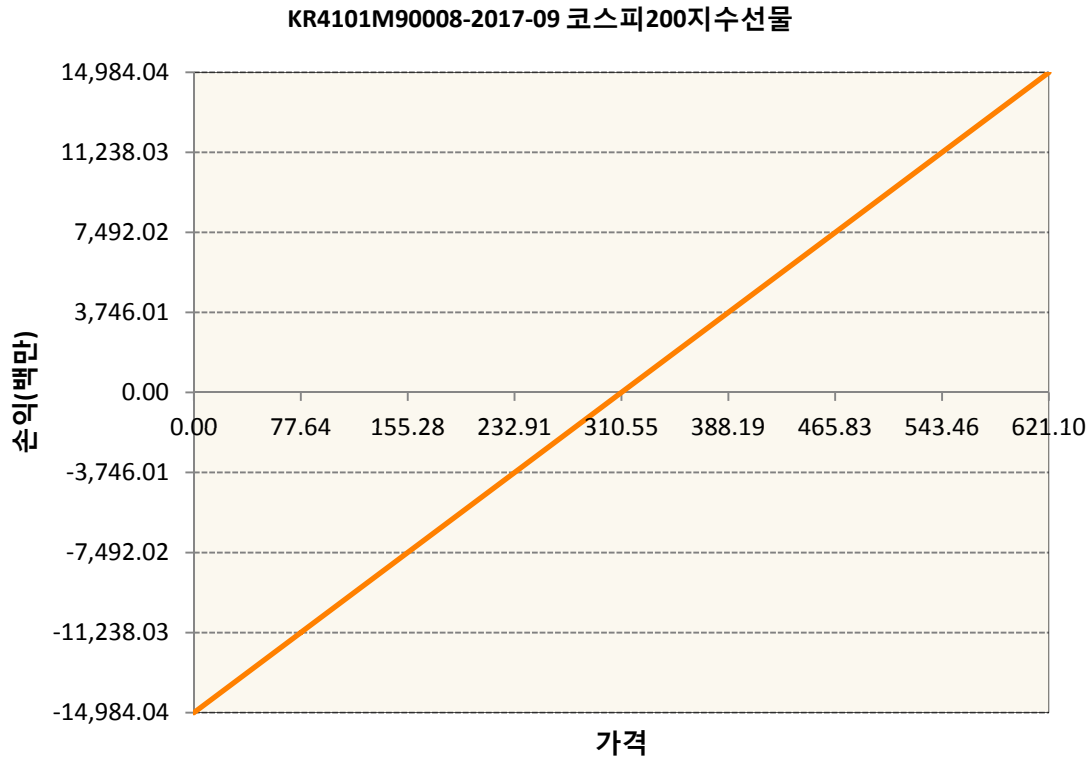
ETF스마트레버리지목표전환형6호

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	14,984	0	14,984	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							1,198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198	-1,198
-5.33%	-799	-799	-799	-799	-799	-799	-799
-2.67%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	399	399	399	399	399	399	399
5.33%	799	799	799	799	799	799	799
8.00%	1,198	1,198	1,198	1,198	1,198	1,198	1,198

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

752

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

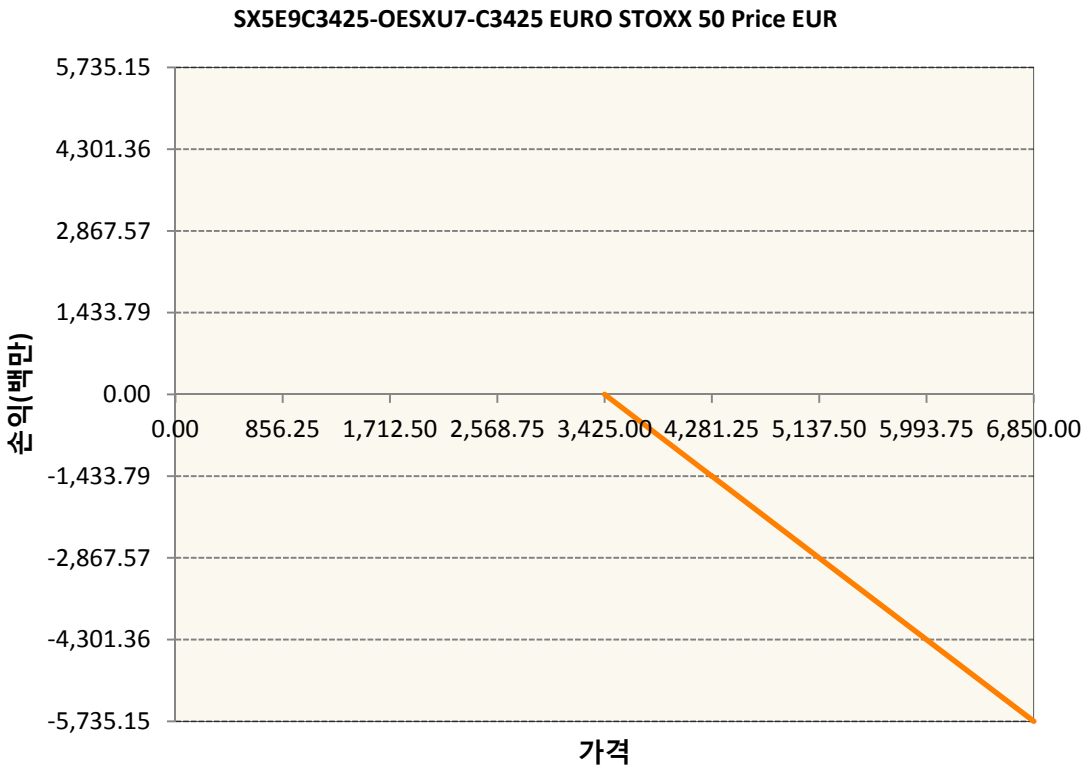
유로커버드콜(주식혼합-파생형)

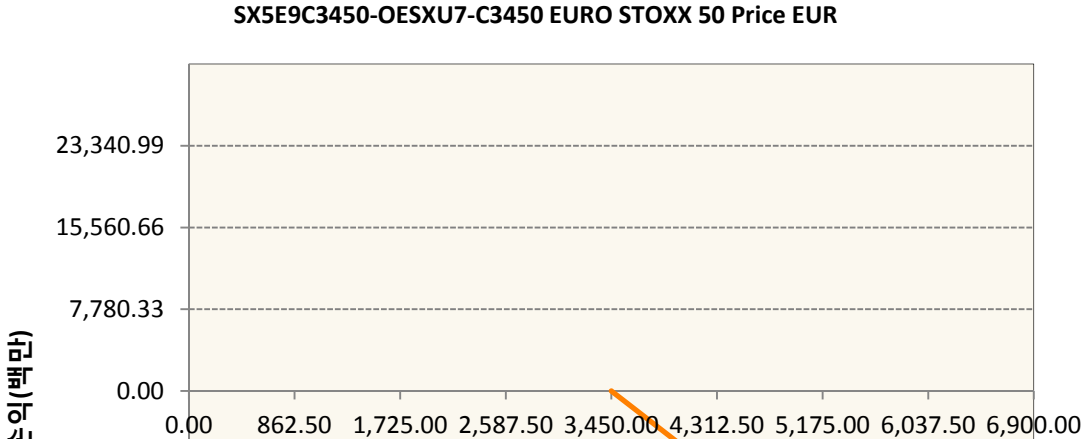
1. 계약금액

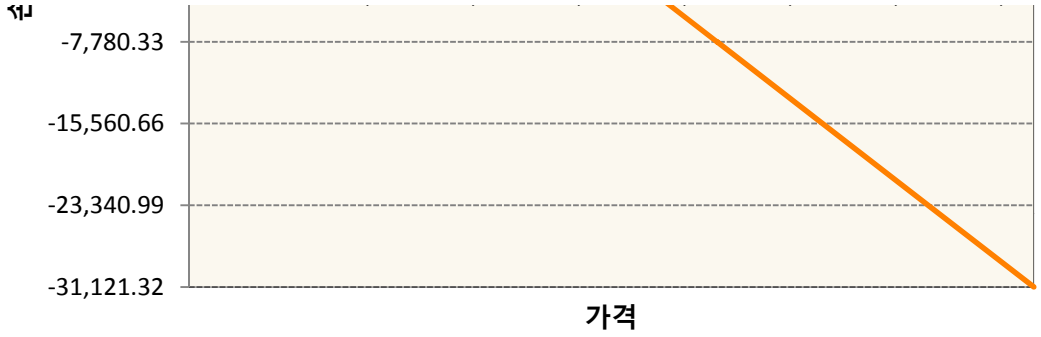
(단위:백만원)

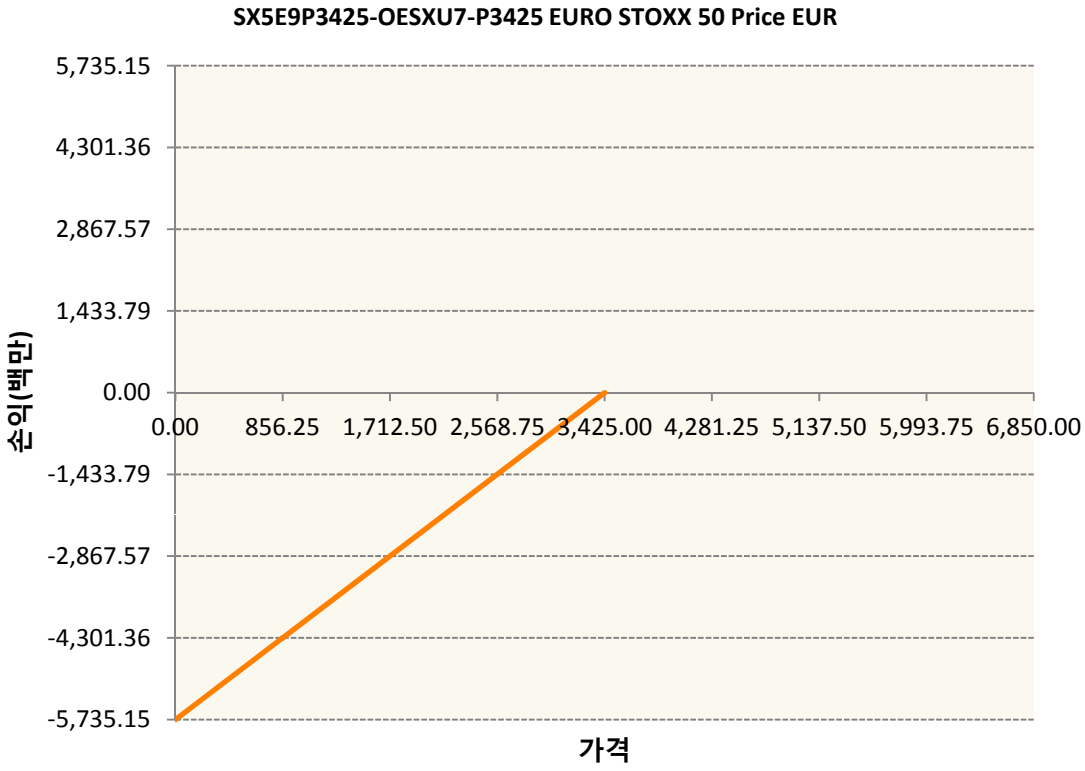
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	32,774	0	32,774	
누계	유가증권	옵션	0	73,713	-73,713	장내

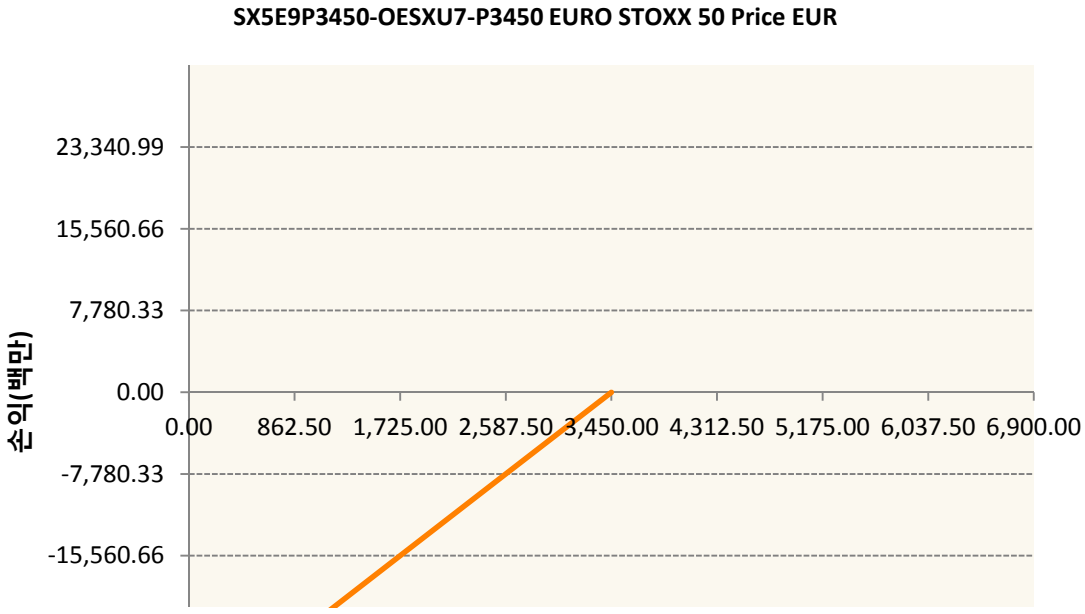
2. 만기시점의 손익구조

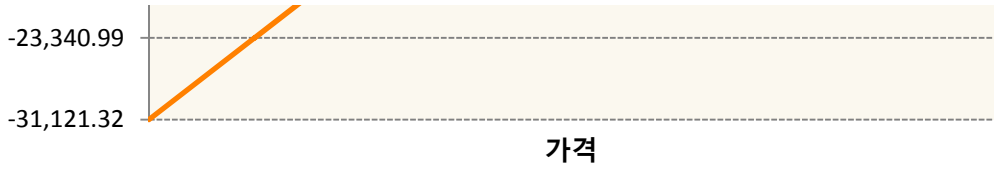


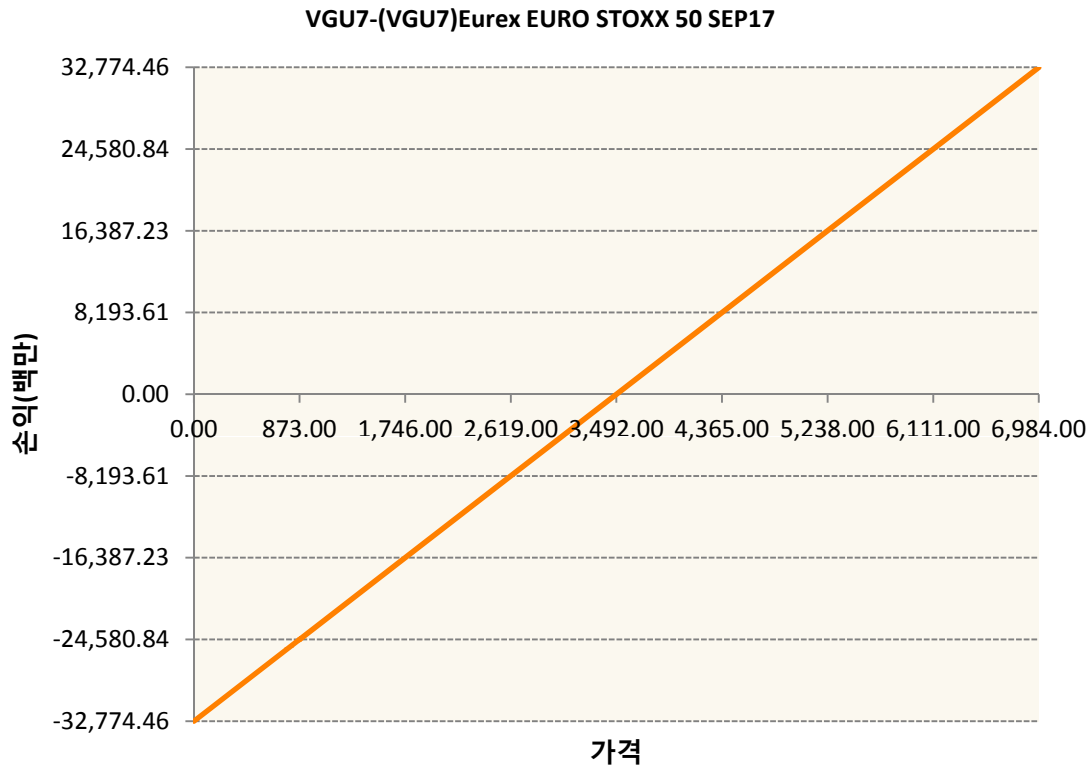



-7,780.33
-15,560.66
-23,340.99
-31,121.32
가격


SX5E9P3425-OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR
5,735.15
4,301.36
2,867.57
1,433.79
0.00
-1,433.79
-2,867.57
-4,301.36
-5,735.15
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
23,340.99
15,560.66
7,780.33
0.00
-7,780.33
-15,560.66
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	459
SX5E9C3450	OESXU7-C3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,490
SX5E9P3425	OESXU7-P3425 EURO STOXX 50 Price EUR	459
SX5E9P3450	OESXU7-P3450 EURO STOXX 50 Price EUR	2,490
VGU7	(VGU7)Eurex EURO STOXX 50 SEP17	2,622

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6,720

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

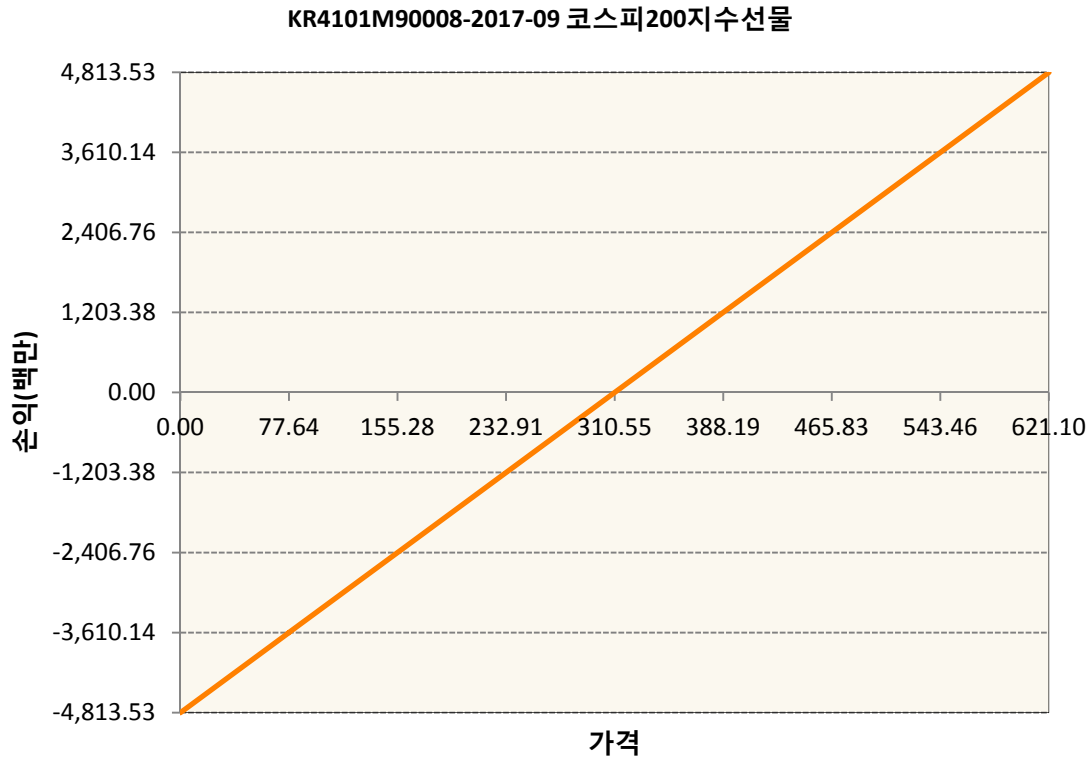
ETF스마트레버리지목표전환형7호

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	4,814	0	4,814	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물							385
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385
-5.33%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-2.67%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	128	128	128	128	128	128	128
5.33%	257	257	257	257	257	257	257
8.00%	385	385	385	385	385	385	385

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

242

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

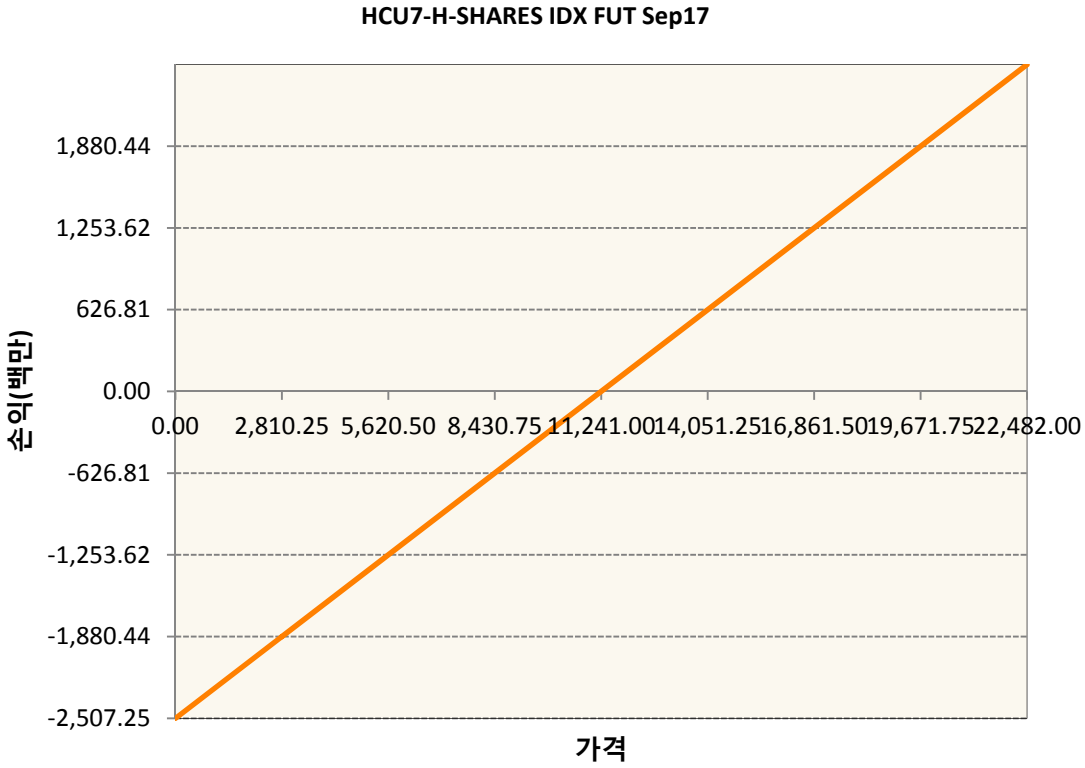
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

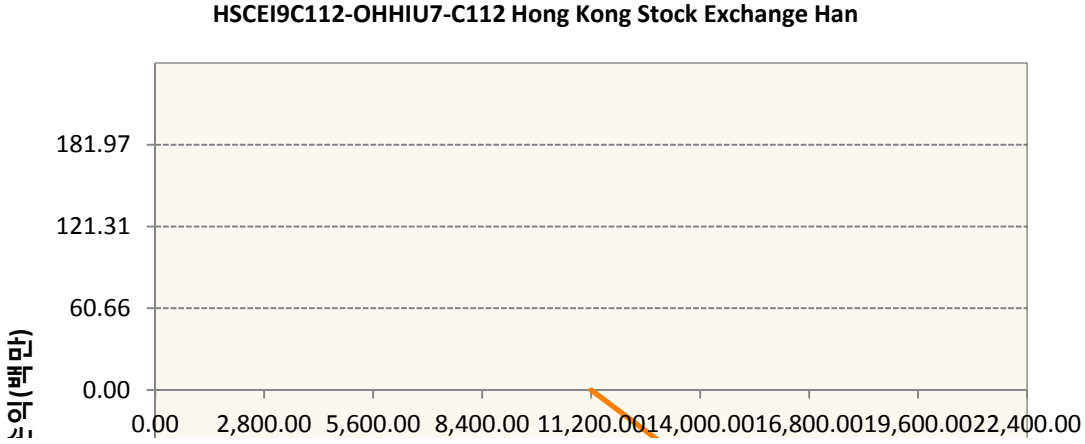
1. 계약금액

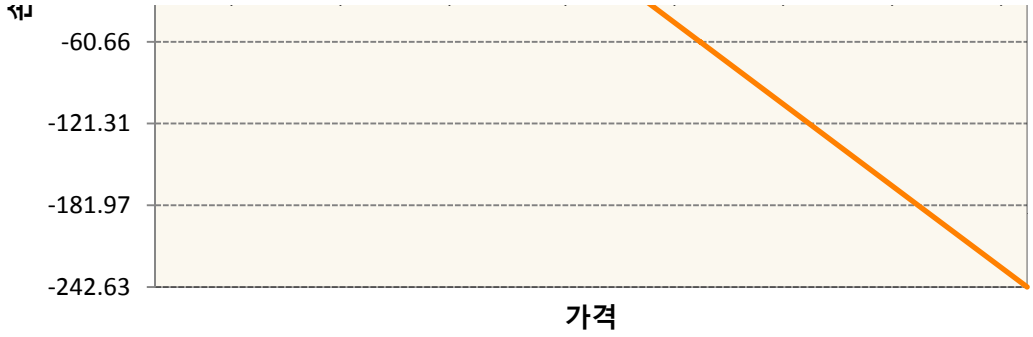
(단위:백만원)

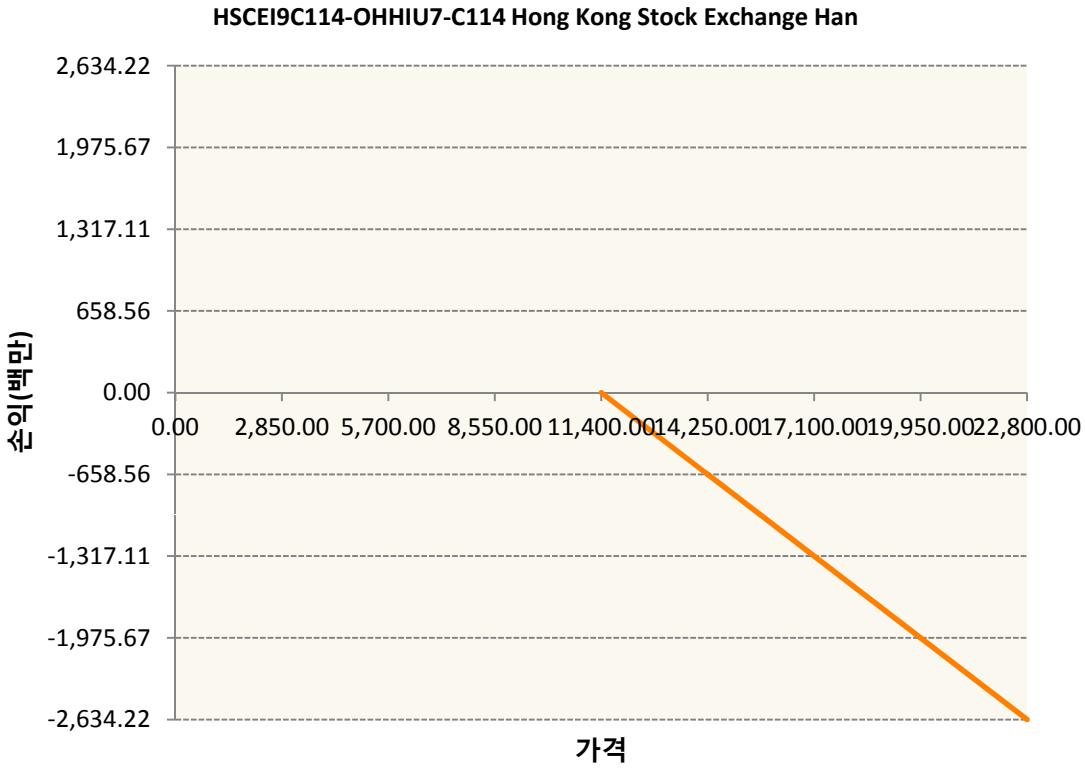
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,507	0	2,507	장내
누계	유가증권	옵션	0	5,754	-5,754	장내

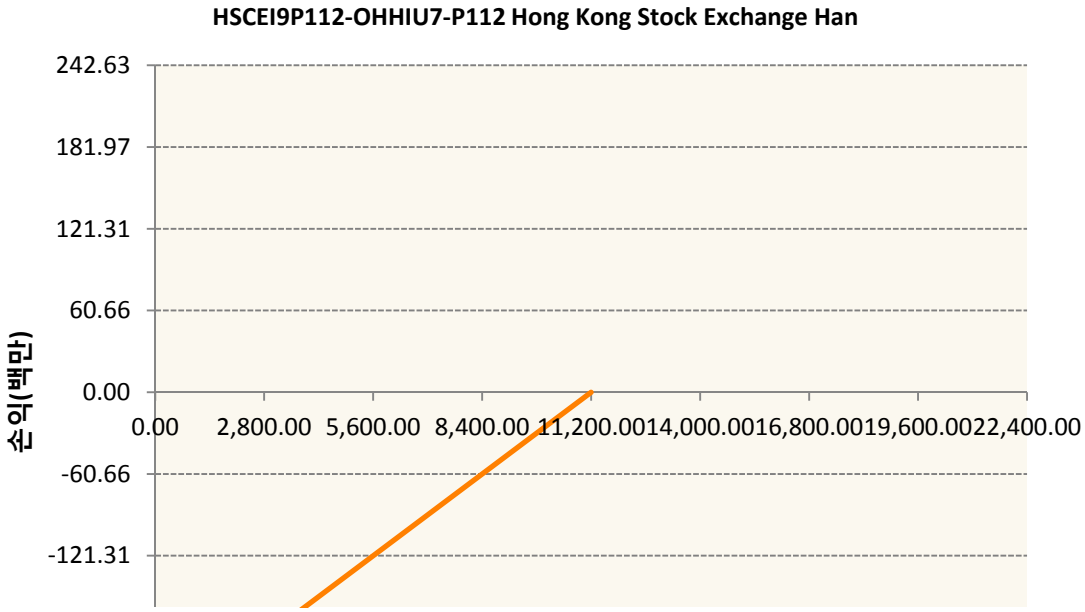
2. 만기시점의 손익구조

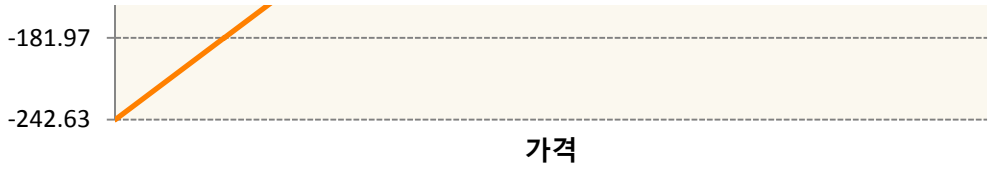


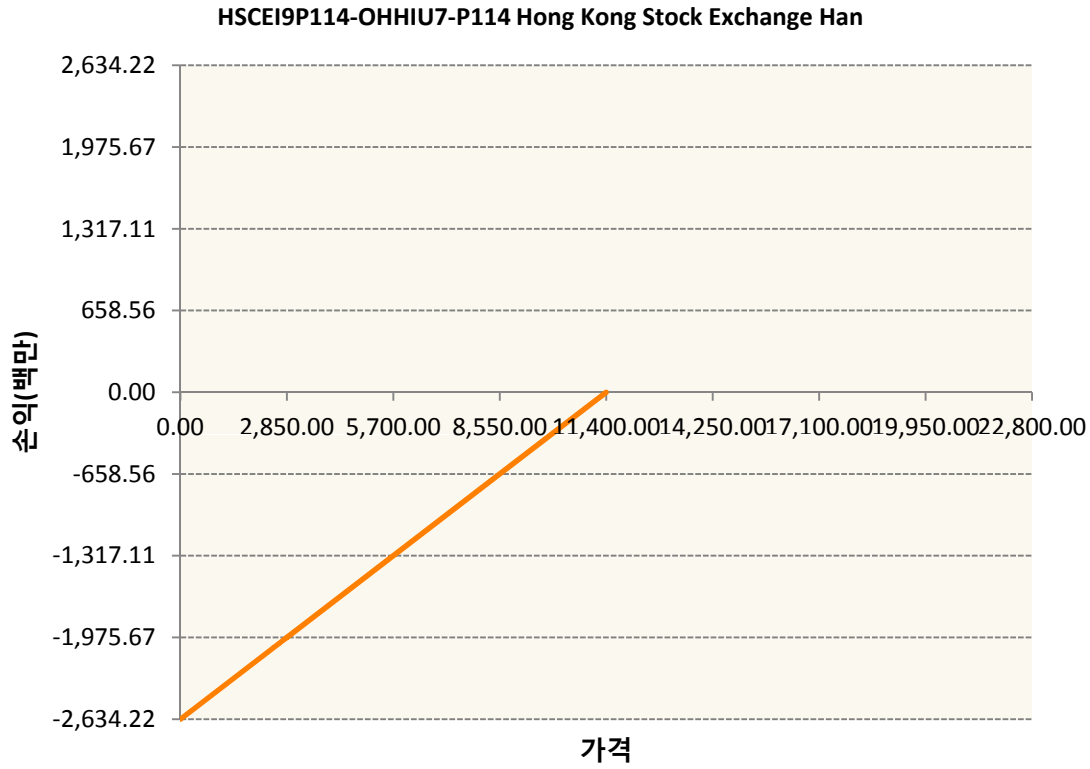



-60.66
-121.31
-181.97
-242.63
가격


HSCEI9C114-OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han
2,634.22
1,975.67
1,317.11
658.56
0.00
-658.56
-1,317.11
-1,975.67
-2,634.22
0.00
2,850.00
5,700.00
8,550.00
11,400.00
14,250.00
17,100.00
19,950.00
22,800.00
손익(백만)
가격


HSCEI9P112-OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han
242.63
181.97
121.31
60.66
0.00
-60.66
-121.31
0.00
2,800.00
5,600.00
8,400.00
11,200.00
14,000.00
16,800.00
19,600.00
22,400.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCU7	H-SHARES IDX FUT Sep17	201
HSCEI9C112	OHHIU7-C112 Hong Kong Stock Exchange Han	19
HSCEI9C114	OHHIU7-C114 Hong Kong Stock Exchange Han	211
HSCEI9P112	OHHIU7-P112 Hong Kong Stock Exchange Han	19
HSCEI9P114	OHHIU7-P114 Hong Kong Stock Exchange Han	211

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	561

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

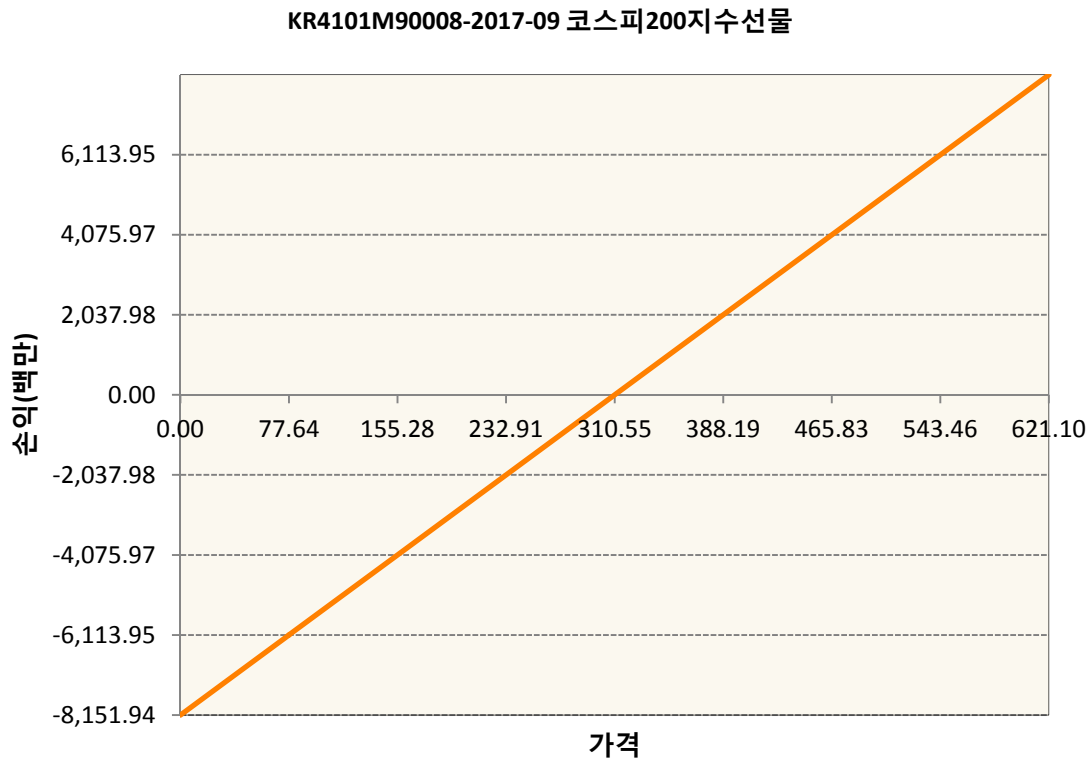
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

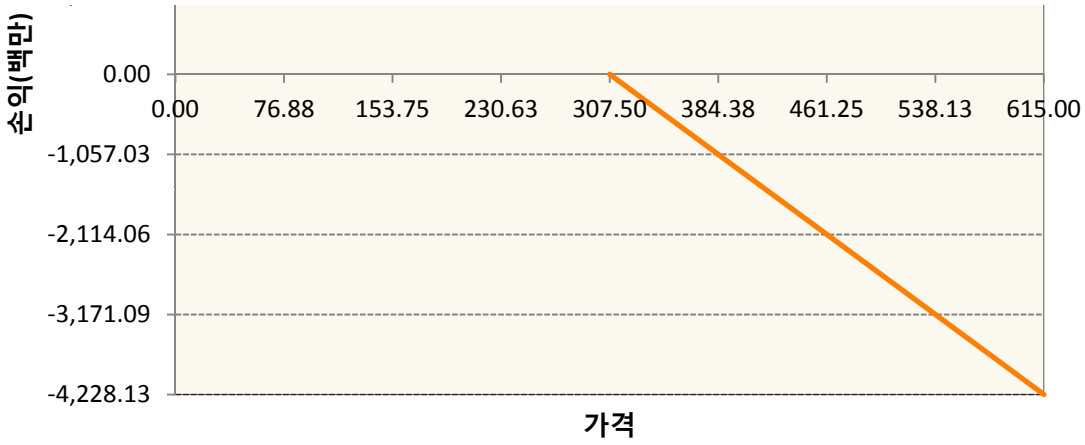
(단위:백만원)

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	8,152	0	8,152	장내
누계	유가증권	스왑	22,000	0	22,000	장외
누계	유가증권	옵션	0	21,972	-21,972	장내

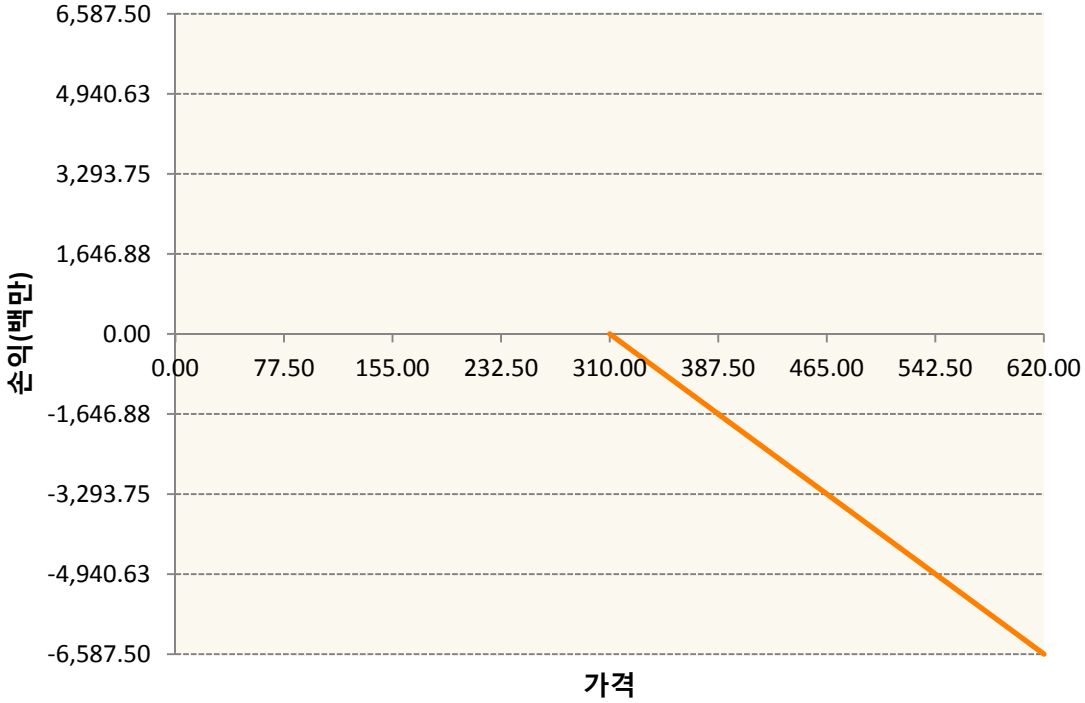
2. 만기시점의 손익구조



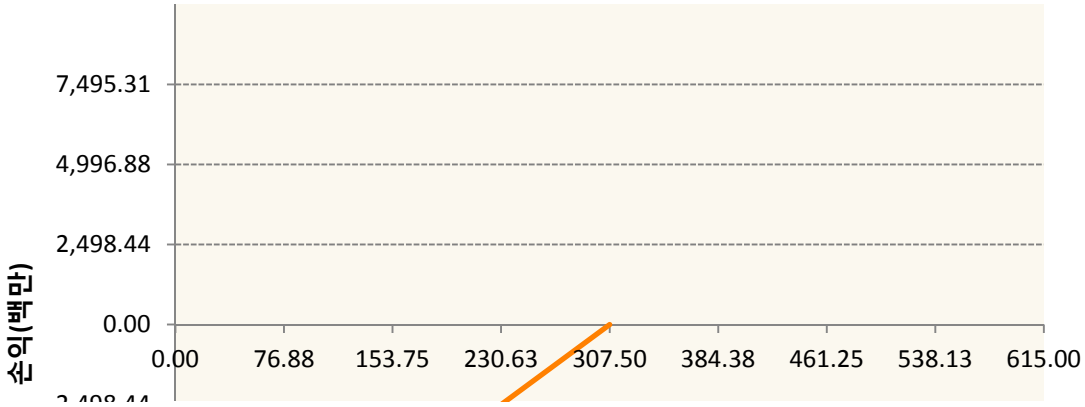




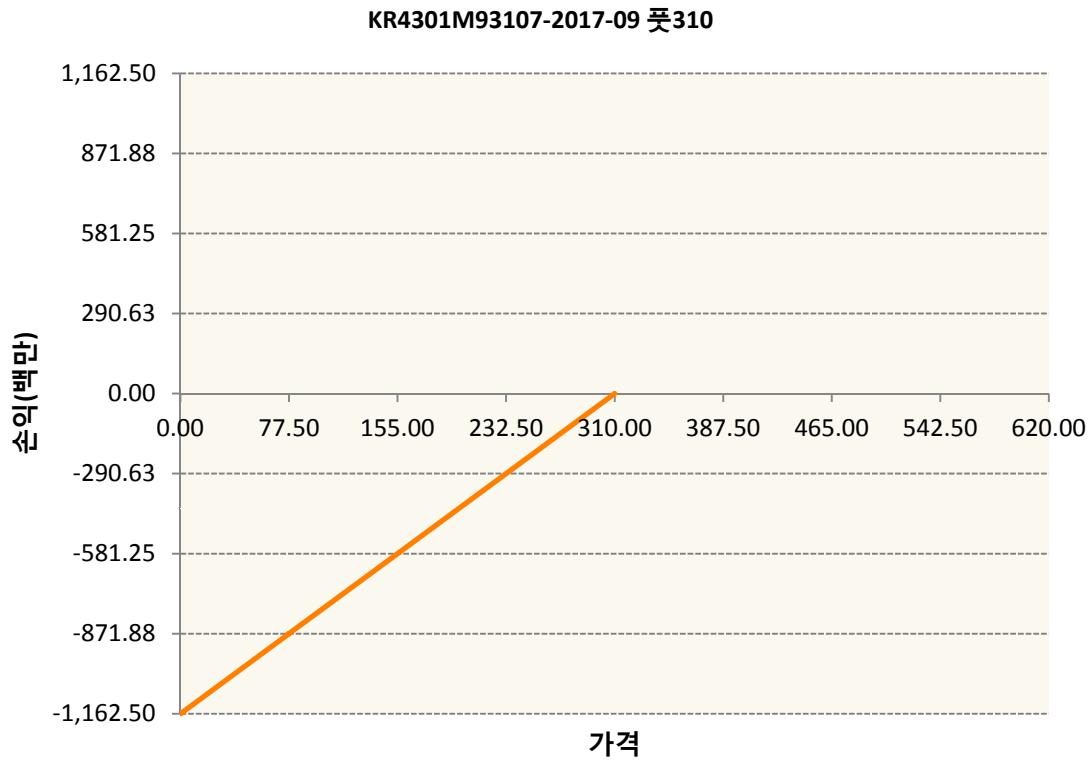
KR4201M93109-2017-09 콜310



KR4301M93073-2017-09 풋307.5







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,480
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,480	-1,480	-1,480	-1,480	-1,480	-1,480	-1,480
-5.33%	-987	-987	-987	-987	-987	-987	-987
-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%	987	987	987	987	987	987	987
8.00%	1,480	1,480	1,480	1,480	1,480	1,480	1,480
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%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
-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%	187	187	187	187	187	187	187
8.00%	280	280	280	280	280	280	280
	KR4101M90(2017-09 코스피200지수선물						652
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-652	-652	-652	-652	-652	-652	-652
-5.33%	-435	-435	-435	-435	-435	-435	-435
-2.67%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-217
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	217	217	217	217	217	217	217
5.33%	435	435	435	435	435	435	435
8.00%	652	652	652	652	652	652	652
	KR4201M93(2017-09 콜307.5						327
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54
-5.33%	54	54	54	54	54	54	54
-2.67%	52	51	49	48	46	45	43
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-100	-100	-100	-100	-101	-101	-102
5.33%	-213	-213	-213	-214	-214	-214	-214
8.00%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
	KR4201M93: 2017-09 콜310						485
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	51	51	51	51	51	51	51
-5.33%	51	51	51	51	51	51	51
-2.67%	50	50	49	47	46	44	42
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-134	-135	-136	-137	-138	-139	-141
5.33%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
8.00%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
	KR4301M93(2017-09 풋307.5						679
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-679	-679	-679	-679	-679	-679	-679
-5.33%	-410	-410	-410	-410	-410	-411	-411
-2.67%	-146	-149	-152	-156	-159	-163	-167
0%	15	10	5	0	-5	-10	-16

2.67%	33	33	33	32	31	30	28
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	33	33	33	33	33	33	33
	KR4301M93:2017-09 풋310						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%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-22	-22	-22	-23	-23	-23	-24
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	7	7	7	7	7	6	6
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

4,223

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

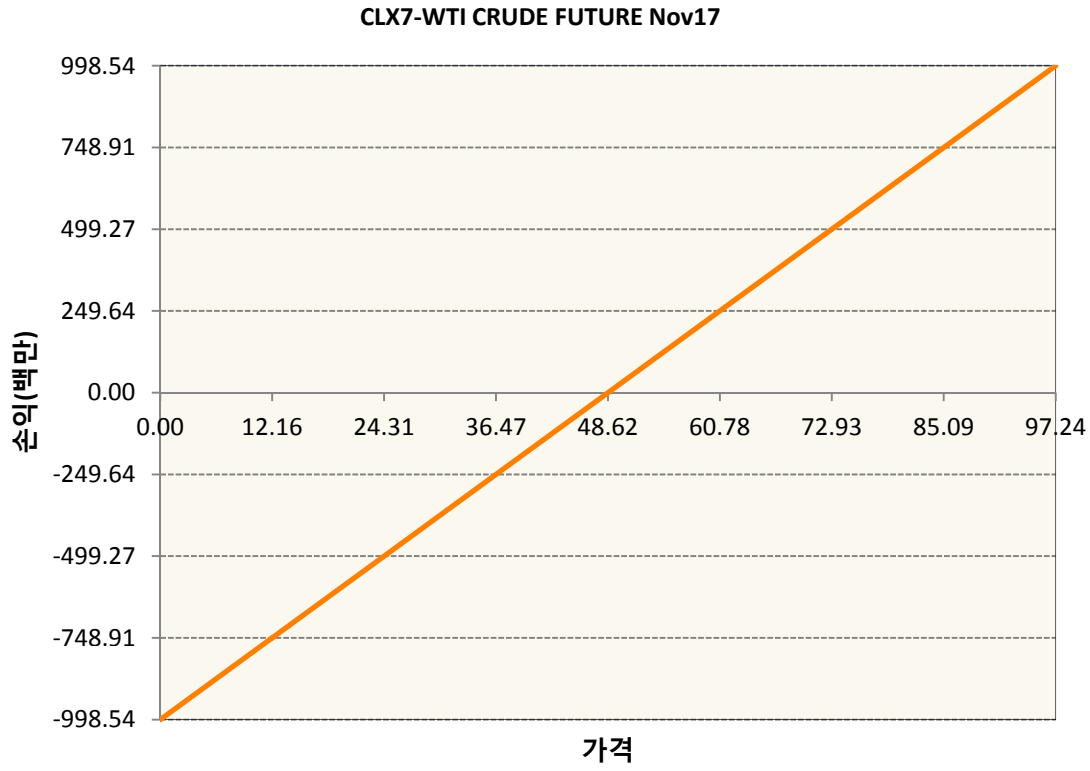
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

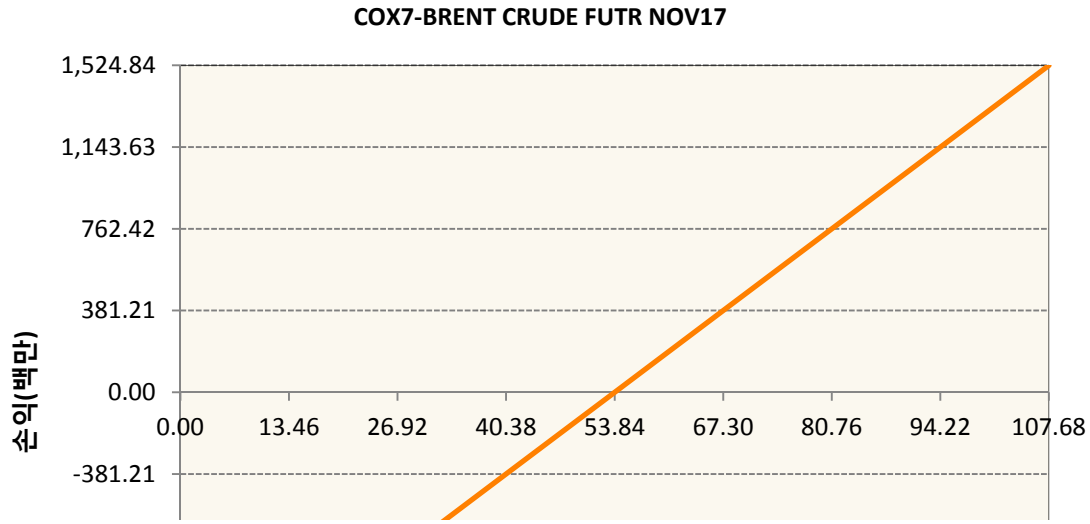
1. 계약금액

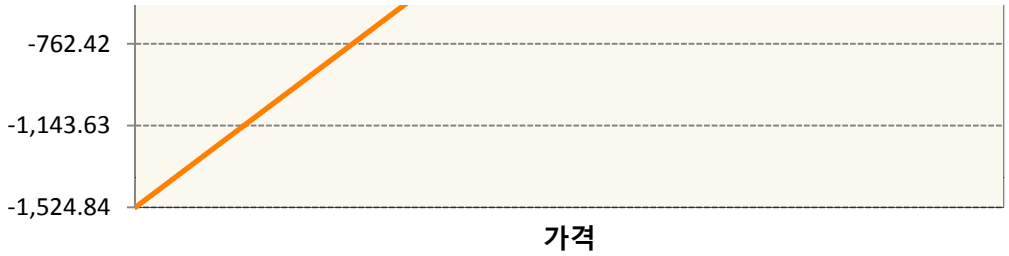
(단위:백만원)

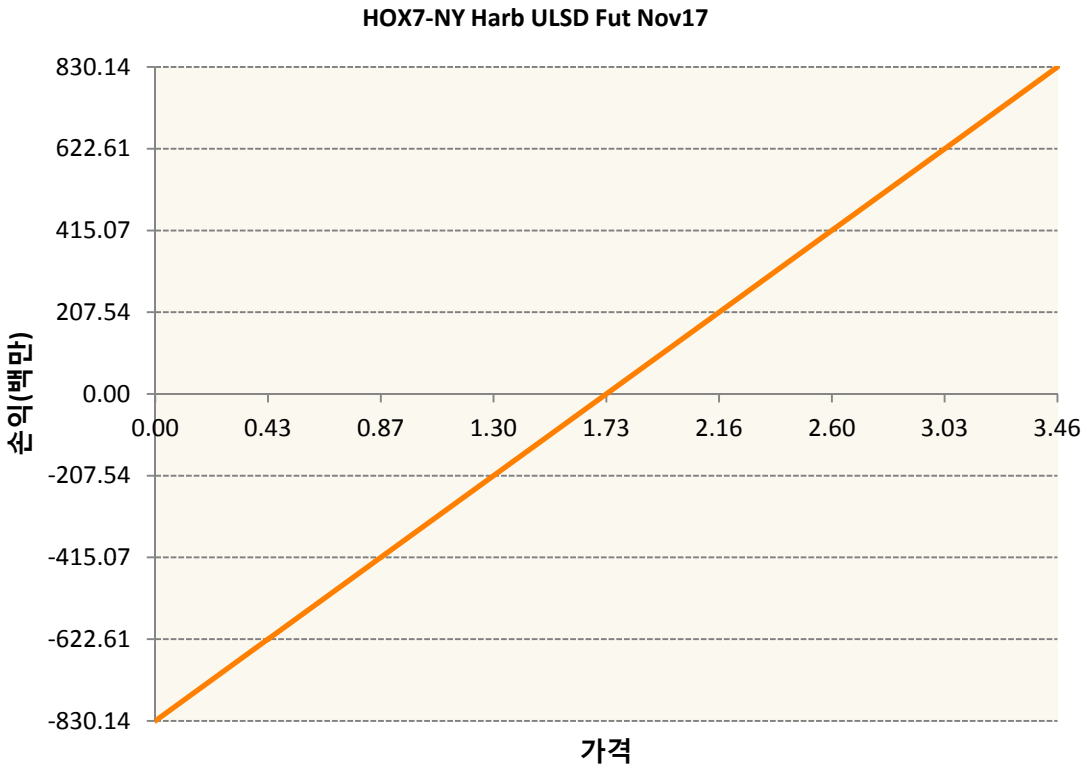
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,558	620	4,938	

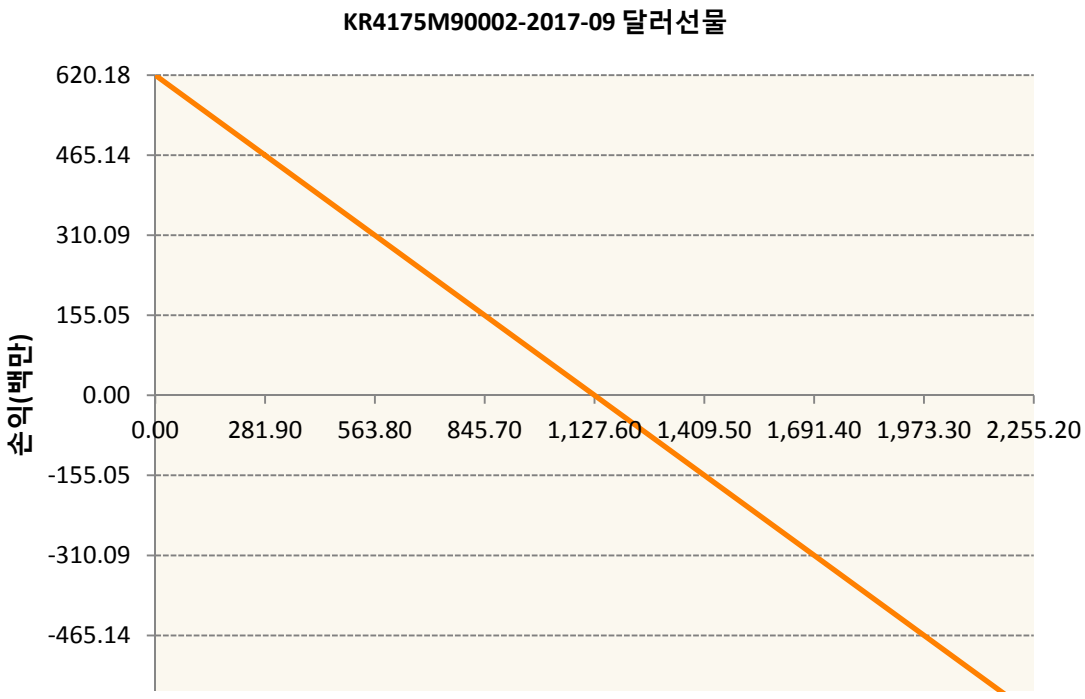
2. 만기시점의 손익구조

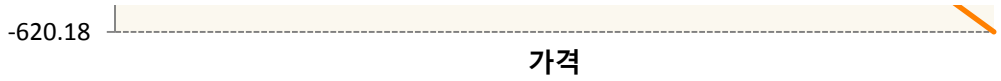


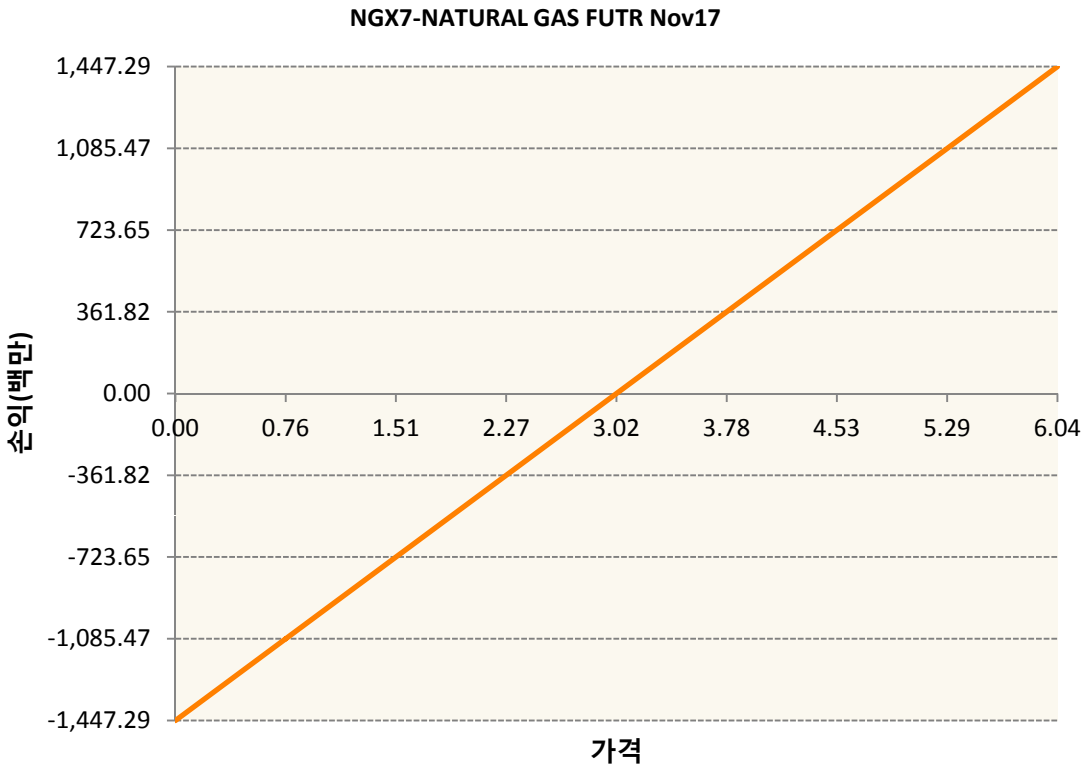


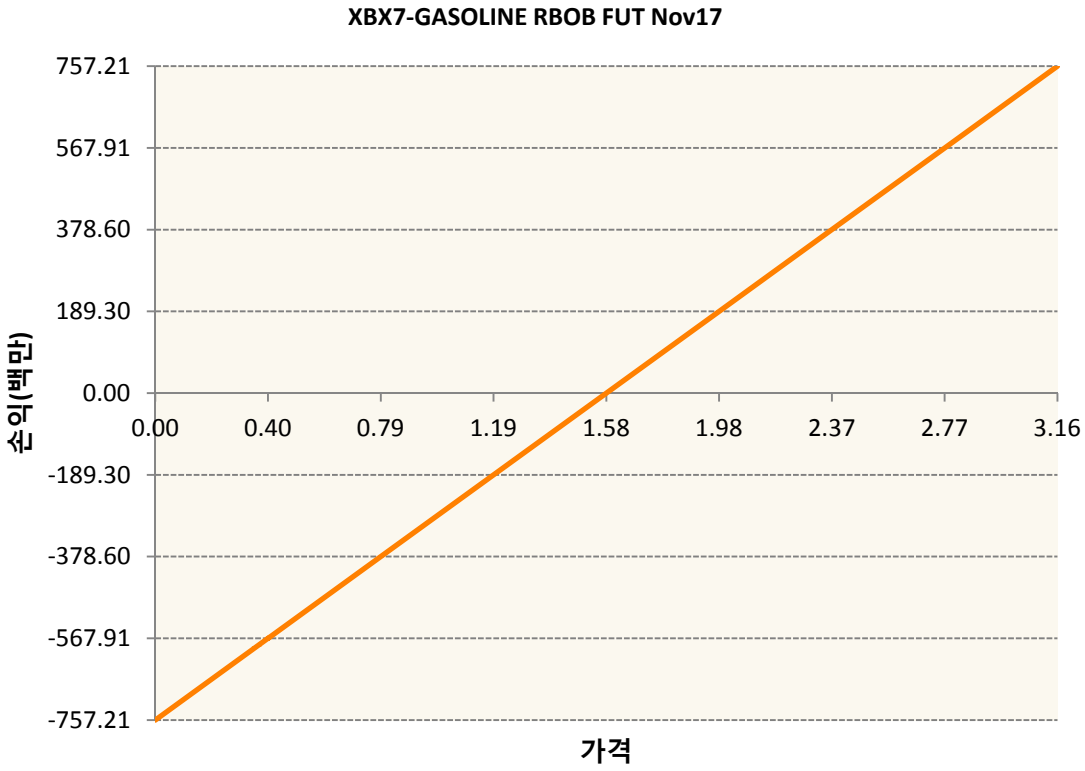

-762.42
-1,143.63
-1,524.84
가격


HOX7-NY Harb ULSD Fut Nov17
830.14
622.61
415.07
207.54
0.00
-207.54
-415.07
-622.61
-830.14
0.00
0.43
0.87
1.30
1.73
2.16
2.60
3.03
3.46
손익(백만)
가격


KR4175M90002-2017-09 달러선물
620.18
465.14
310.09
155.05
0.00
-155.05
-310.09
-465.14
0.00
281.90
563.80
845.70
1,127.60
1,409.50
1,691.40
1,973.30
2,255.20
손익(백만)


-620.18
가격


NGX7-NATURAL GAS FUTR Nov17
1,447.29
1,085.47
723.65
361.82
0.00
-361.82
-723.65
-1,085.47
-1,447.29
0.00
0.76
1.51
2.27
3.02
3.78
4.53
5.29
6.04
손익(백만)
가격


XBX7-GASOLINE RBOB FUT Nov17
757.21
567.91
378.60
189.30
0.00
-189.30
-378.60
-567.91
-757.21
0.00
0.40
0.79
1.19
1.58
1.98
2.37
2.77
3.16
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX7	WTI CRUDE FUTURE Nov17	80
COX7	BRENT CRUDE FUTR NOV17	122
HOX7	NY Harb ULSD Fut Nov17	66
KR4175M90(	2017-09 달러선물	50
NGX7	NATURAL GAS FUTR Nov17	116
XBX7	GASOLINE RBOB FUT Nov17	61

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

803

공시일	2017-09-13
기준일	2017-09-12

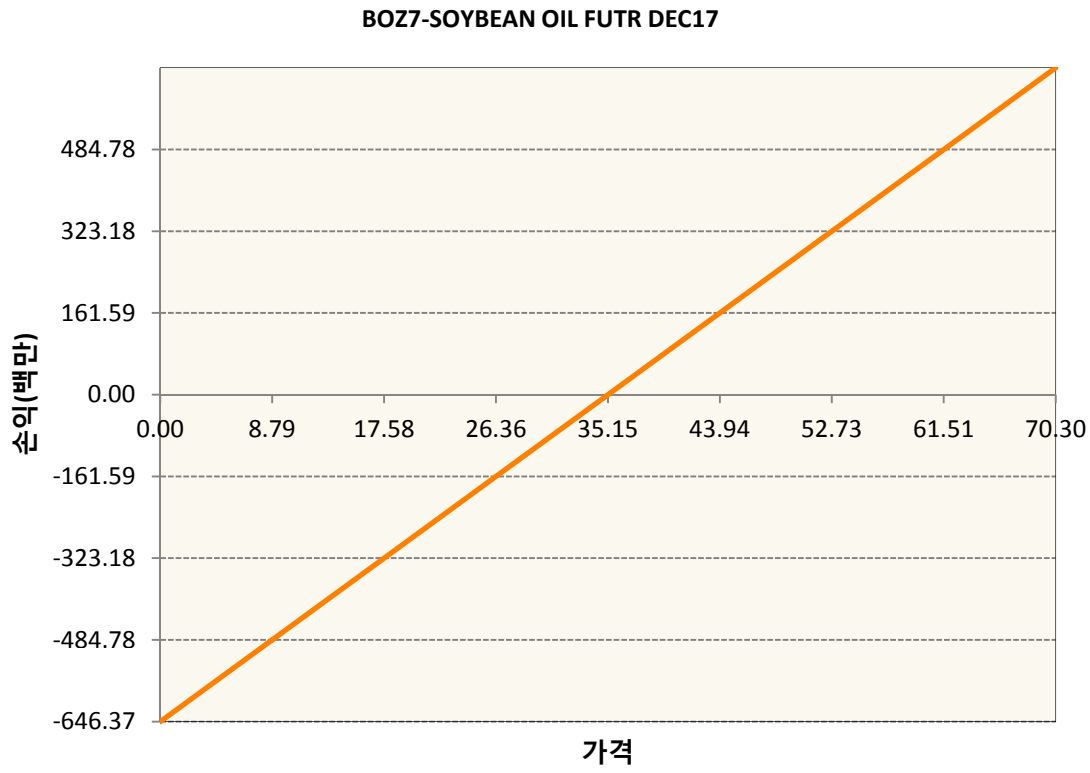
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

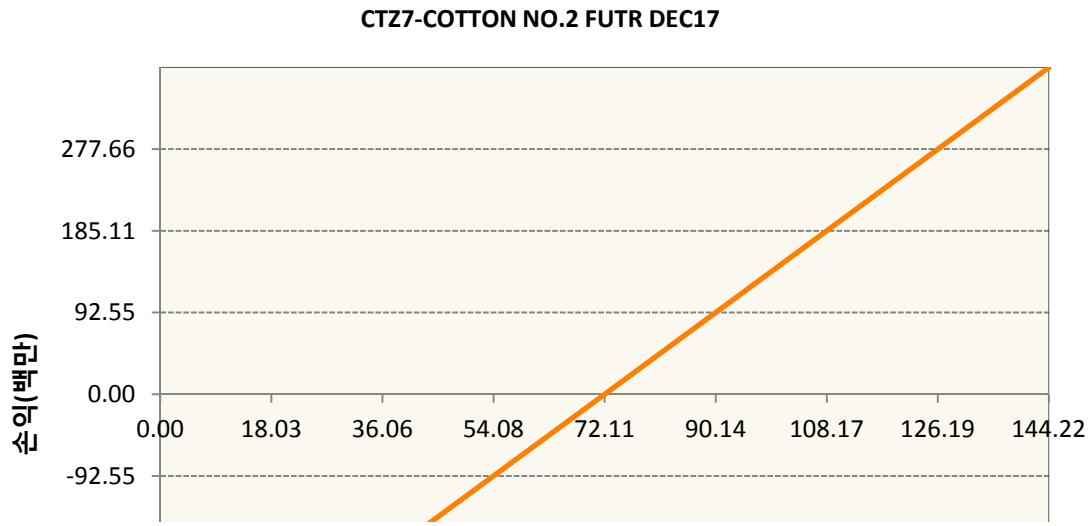
1. 계약금액

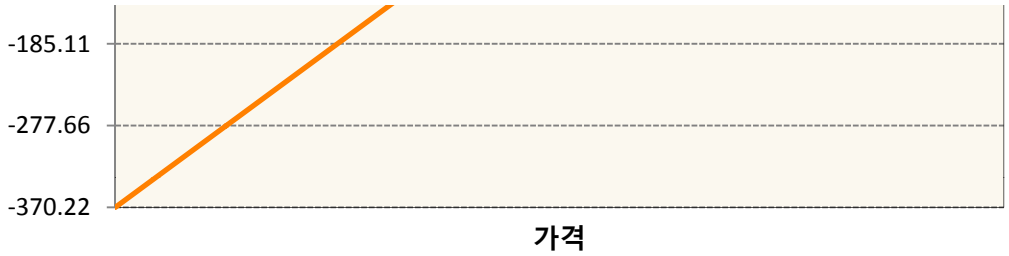
(단위:백만원)

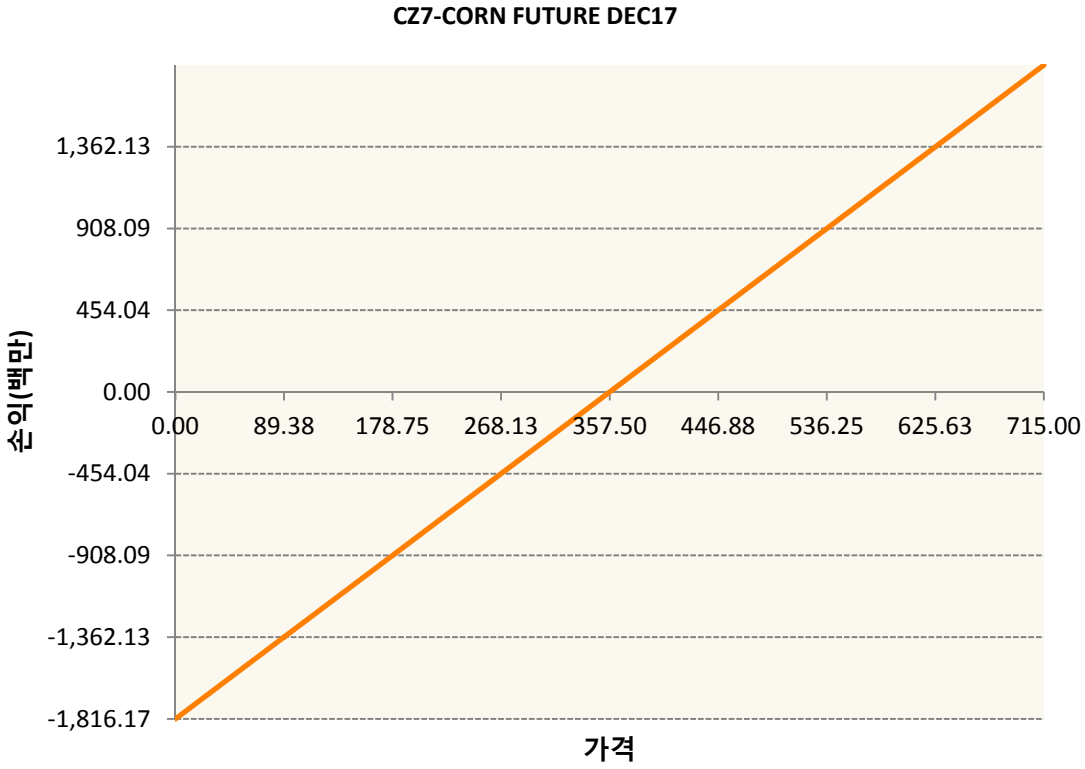
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,998	338	6,660	

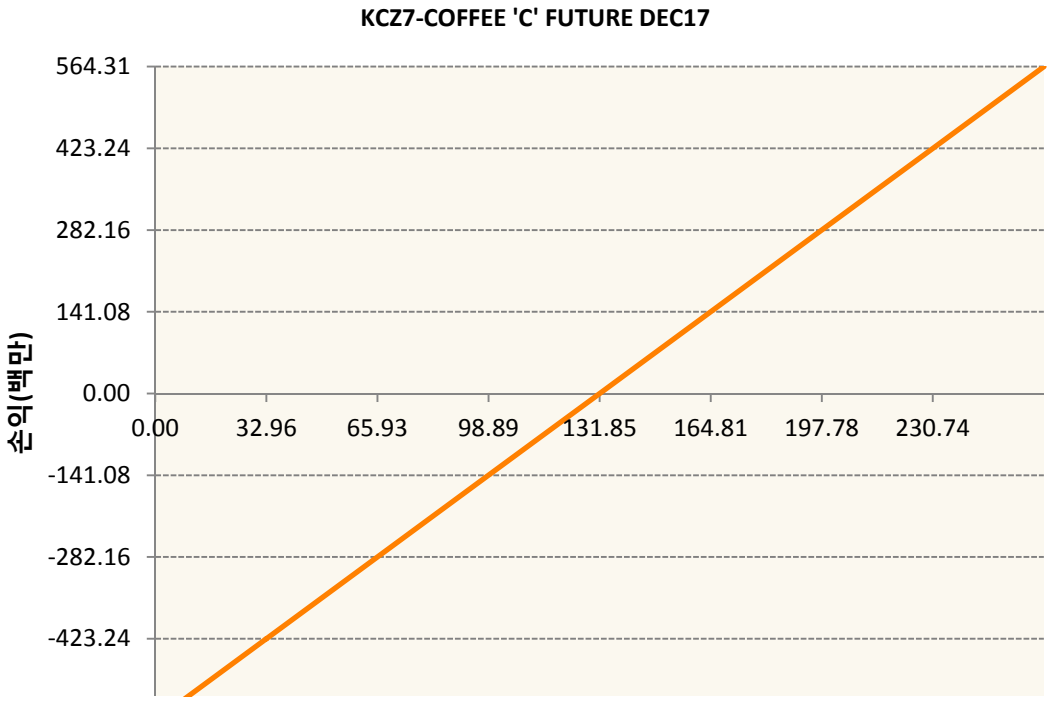
2. 만기시점의 손익구조

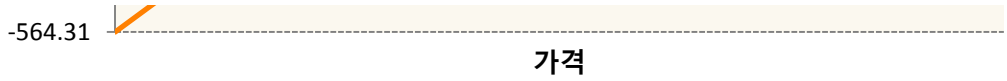


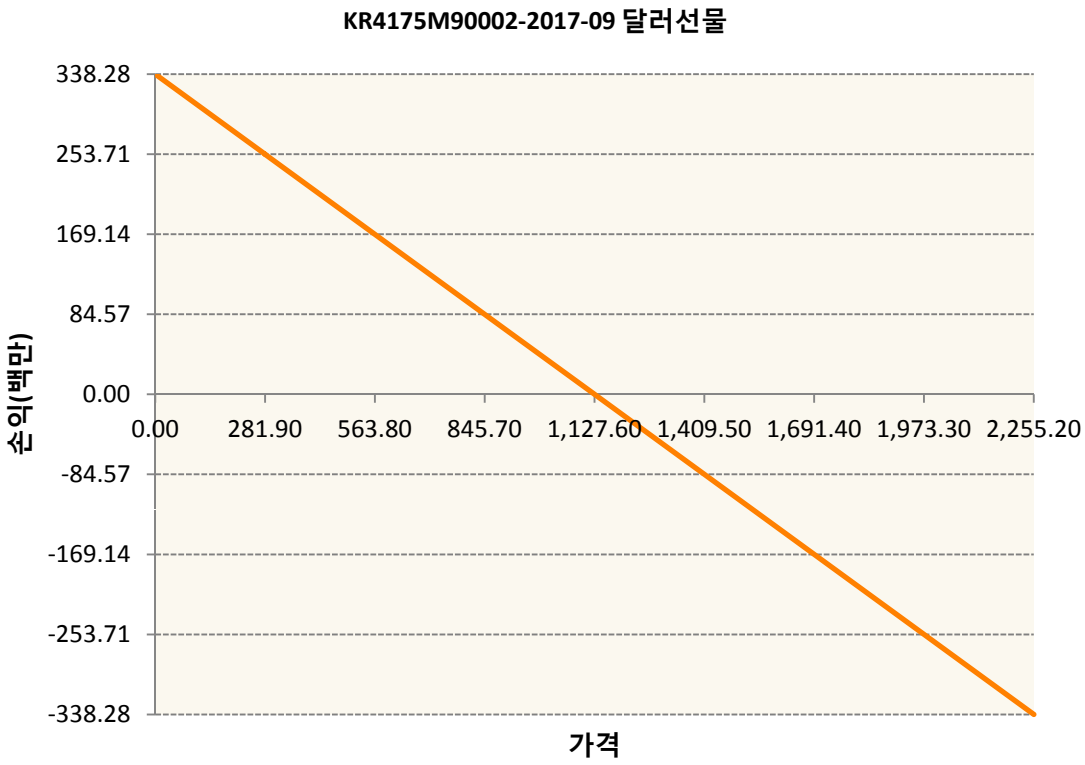


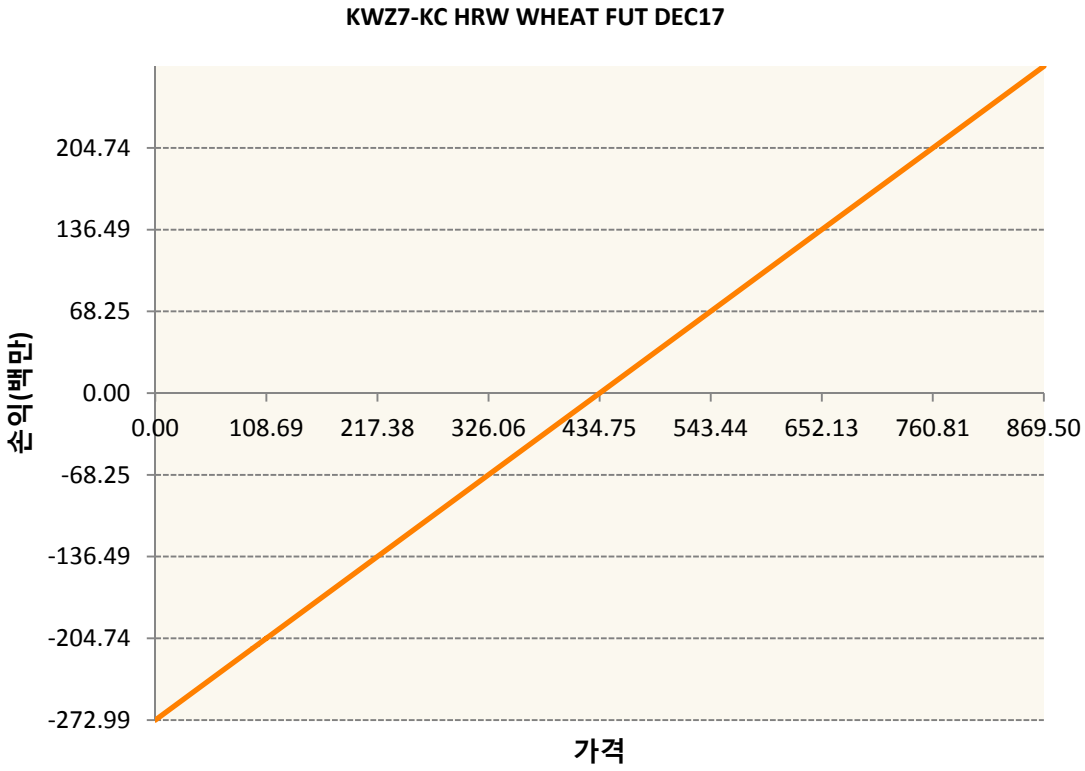

-185.11
-277.66
-370.22
가격

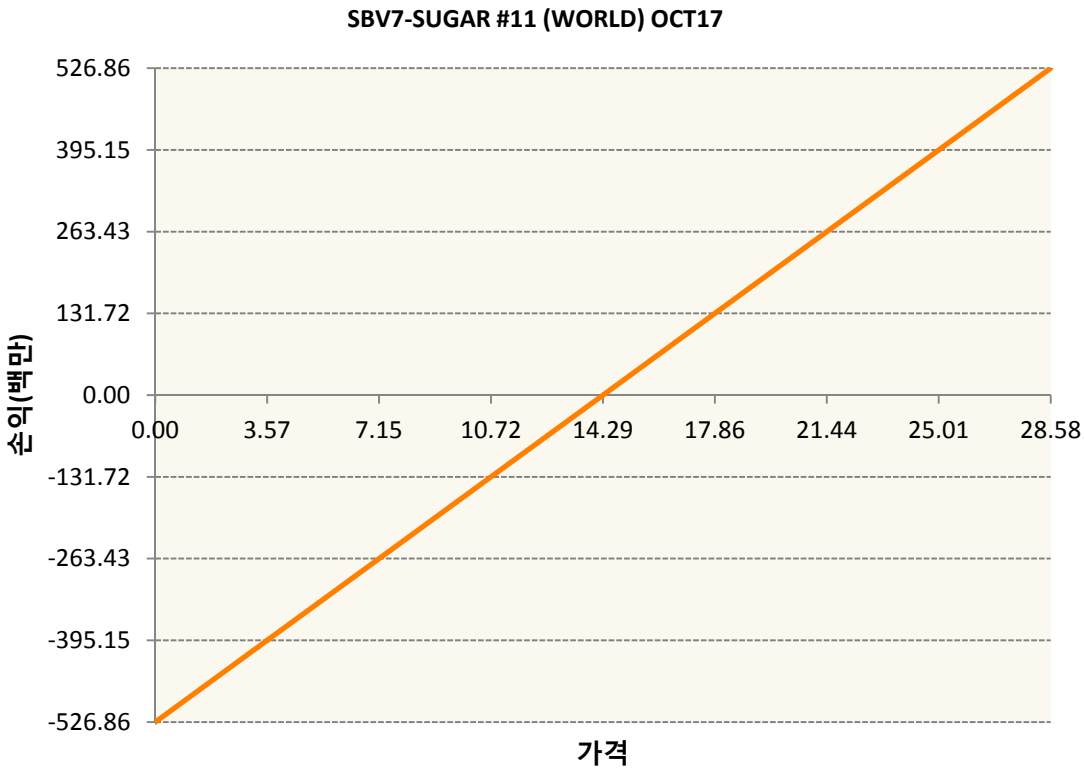

CZ7-CORN FUTURE DEC17
손익(백만)
1,362.13
908.09
454.04
0.00
-454.04
-908.09
-1,362.13
-1,816.17
0.00
89.38
178.75
268.13
357.50
446.88
536.25
625.63
715.00
가격

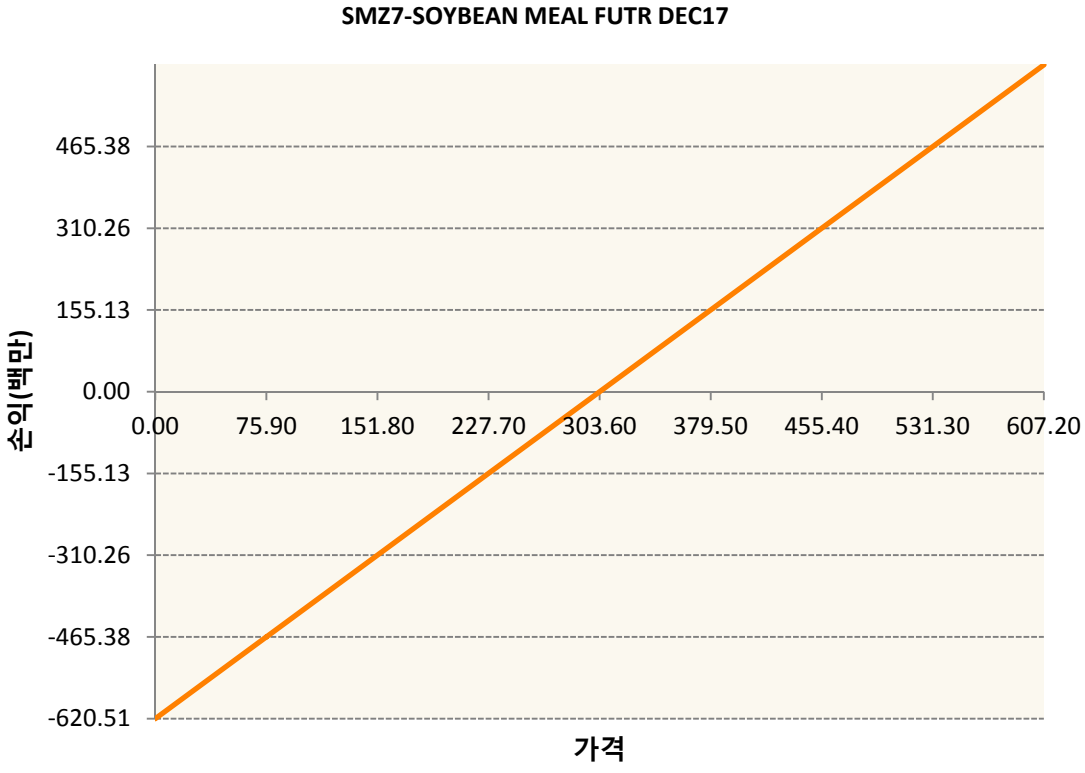

KCZ7-COFFEE 'C' FUTURE DEC17
손익(백만)
564.31
423.24
282.16
141.08
0.00
-141.08
-282.16
-423.24
0.00
32.96
65.93
98.89
131.85
164.81
197.78
230.74

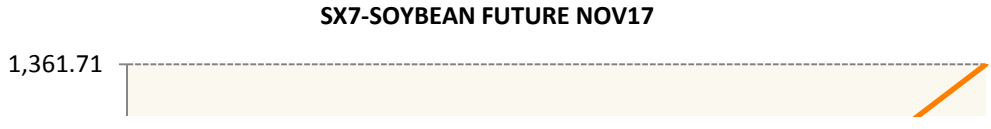

-564.31
가격

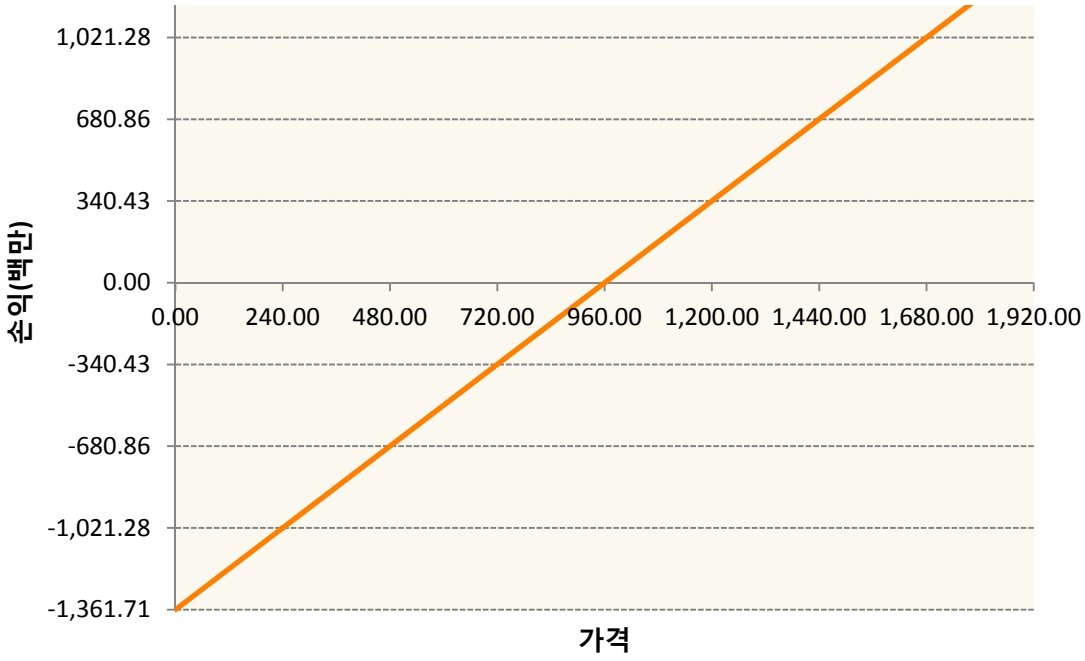

KR4175M90002-2017-09 달러선물
338.28
253.71
169.14
84.57
0.00
-84.57
-169.14
-253.71
-338.28
0.00
281.90
563.80
845.70
1,127.60
1,409.50
1,691.40
1,973.30
2,255.20
손익(백만)
가격

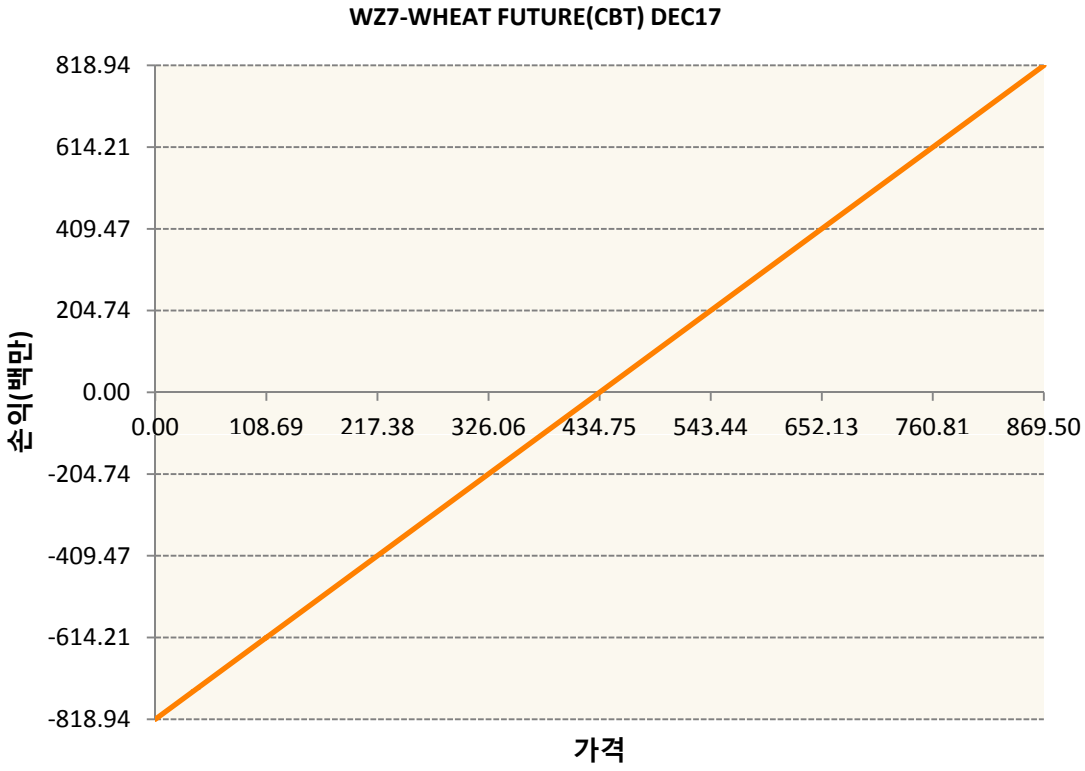

KWZ7-KC HRW WHEAT FUT DEC17
204.74
136.49
68.25
0.00
-68.25
-136.49
-204.74
-272.99
0.00
108.69
217.38
326.06
434.75
543.44
652.13
760.81
869.50
손익(백만)
가격


SBV7-SUGAR #11 (WORLD) OCT17
526.86
395.15
263.43
131.72
0.00
-131.72
-263.43
-395.15
-526.86
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
465.38
310.26
155.13
0.00
-155.13
-310.26
-465.38
-620.51
0.00
75.90
151.80
227.70
303.60
379.50
455.40
531.30
607.20
손익(백만)
가격


SX7-SOYBEAN FUTURE NOV17
1,361.71





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOZ7	SOYBEAN OIL FUTR DEC17	52
CTZ7	COTTON NO.2 FUTR DEC17	30
CZ7	CORN FUTURE DEC17	145
KCZ7	COFFEE 'C' FUTURE DEC17	45
KR4175M90(	2017-09 달러선물	27

KWZ7	KC HRW WHEAT FUT DEC17	22
SBV7	SUGAR #11 (WORLD) OCT17	42
SMZ7	SOYBEAN MEAL FUTR DEC17	50
SX7	SOYBEAN FUTURE NOV17	109
WZ7	WHEAT FUTURE(CBT) DEC17	66

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

659