공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

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	2017-12-15
기준일	2017-12-14

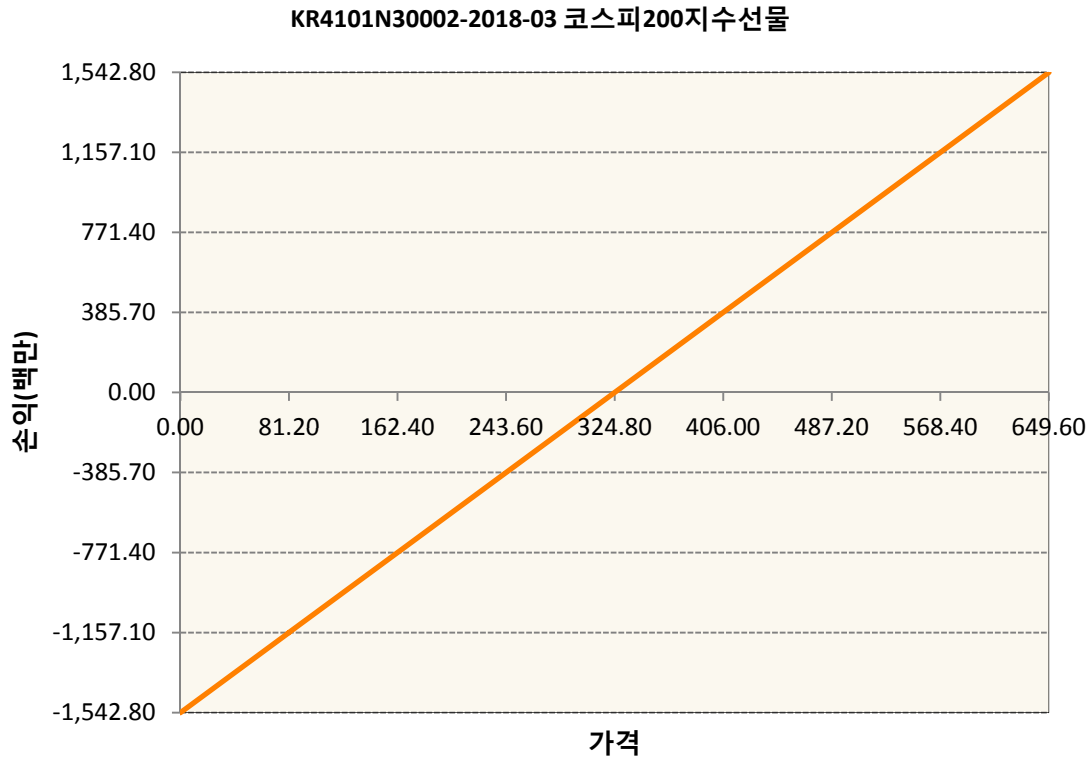
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	817	0	817	장내
누계	유가증권	선물	1,543	0	1,543	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123

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

71

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

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	13,365	0	13,365	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S171122	1,090

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

350

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

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	4,901	0	4,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S171208	402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

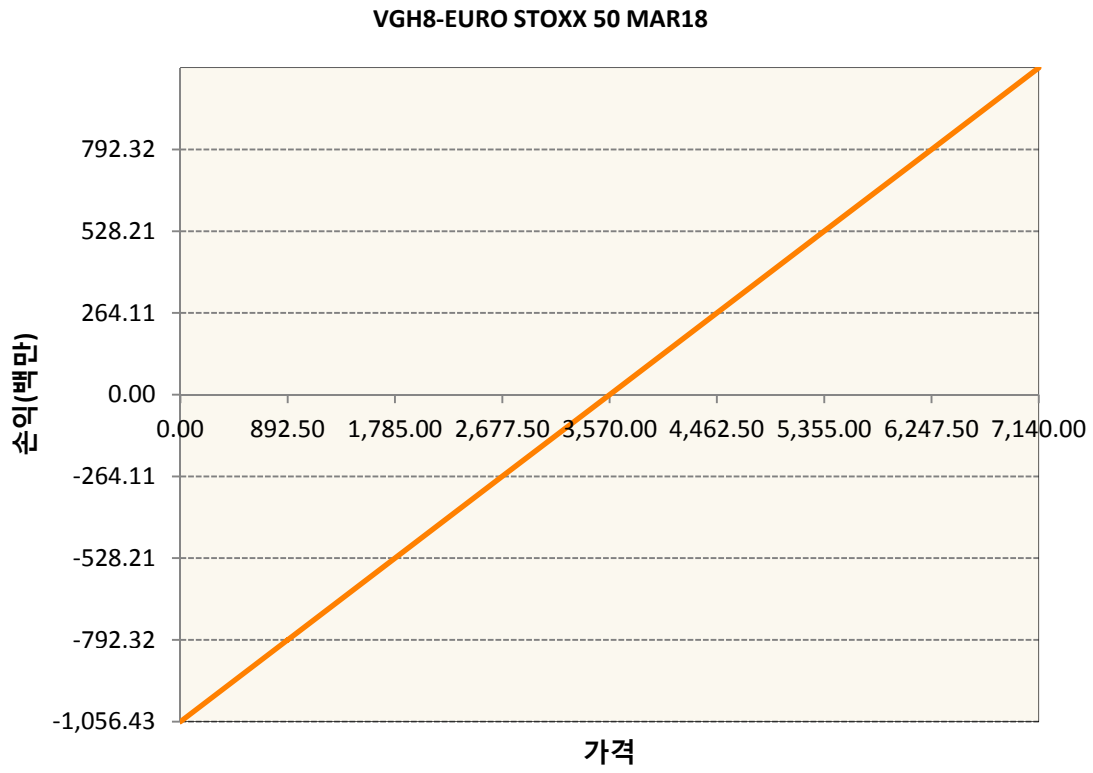
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,056	0	1,056	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	85

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

(단위:백만원)

48

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

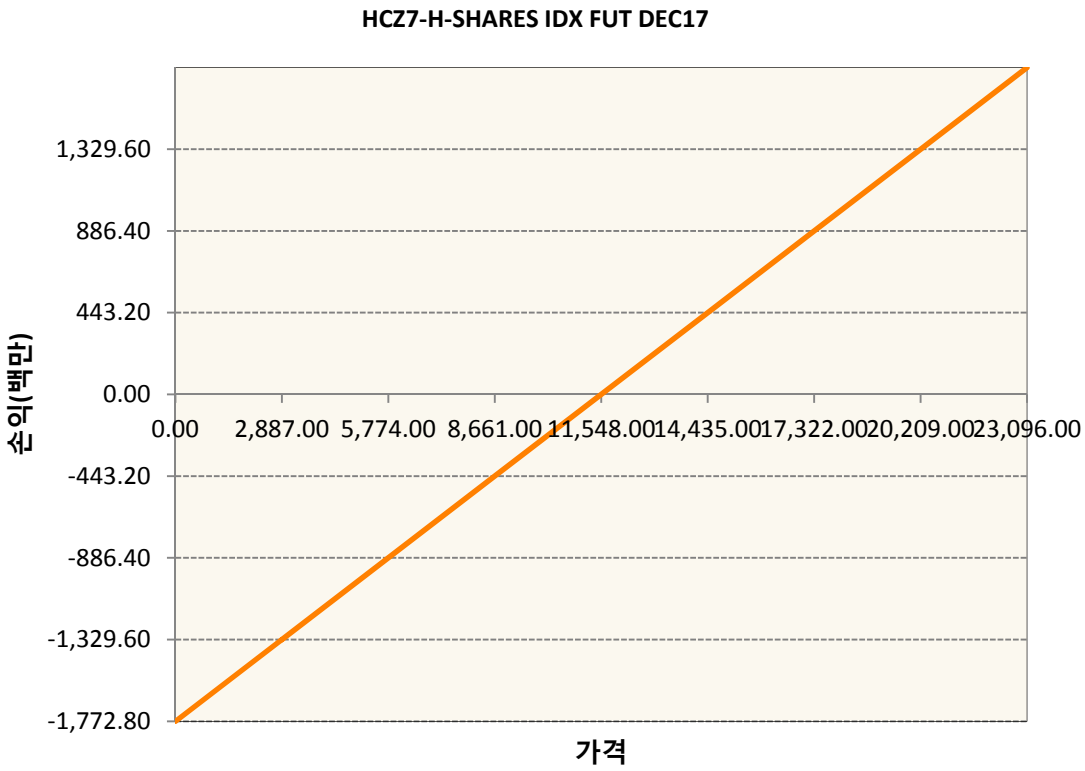
차이나인덱스모(주식-파생형)

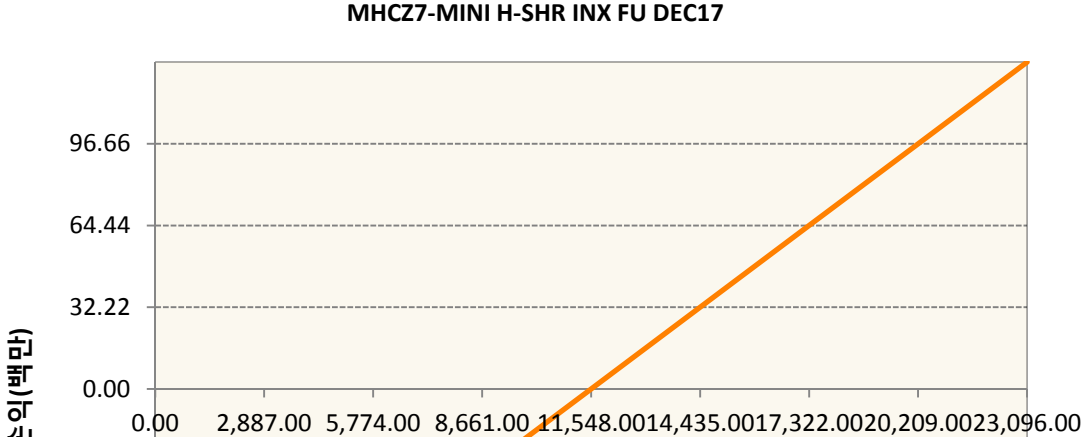
1. 계약금액

(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	1,773	0	1,773	
누계	유가증권	선물	129	0	129	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	142
MHCZ7	MINI H-SHR INX FU DEC17	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	98

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

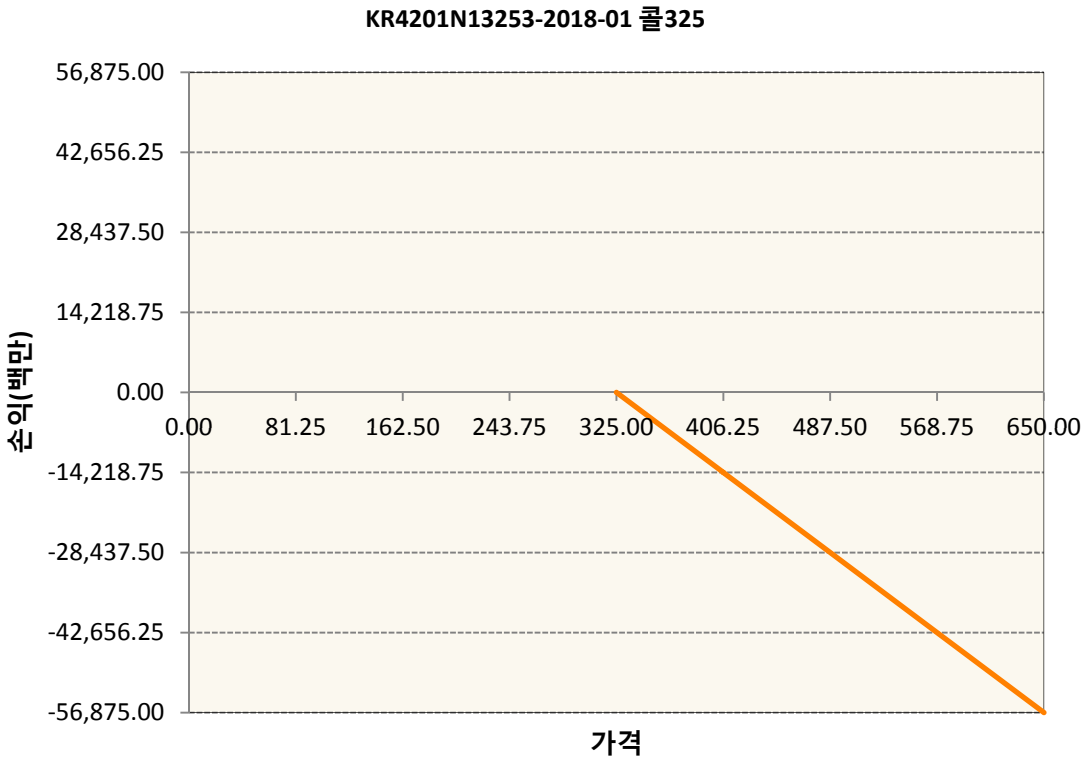
커버드콜모(주식혼합-파생형)

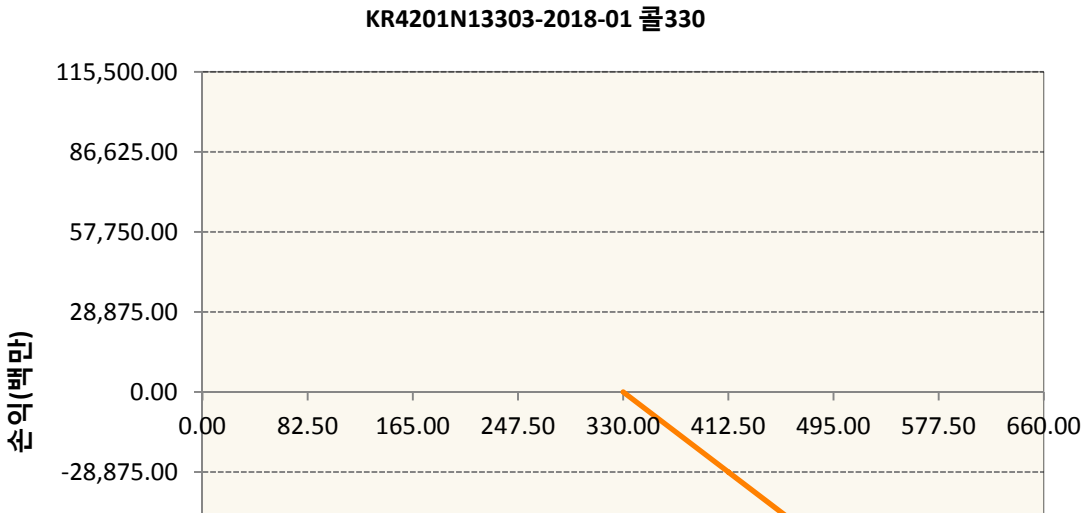
1. 계약금액

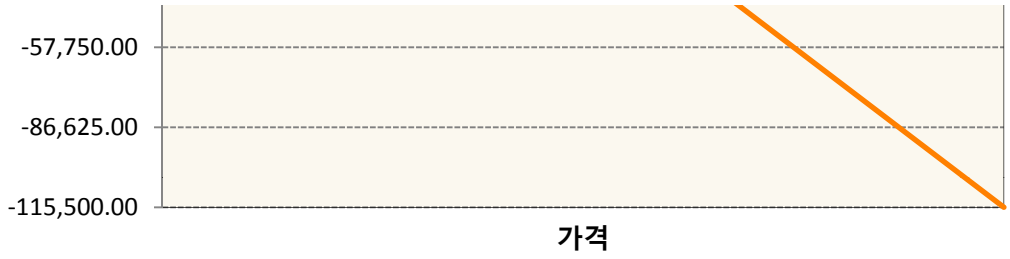
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	116,181	-116,181	장내
누계	유가증권	옵션	0	172,375	-172,375	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N13	2018-01 콜325						3,489
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,483	1,445	1,398	1,343	1,280	1,211	1,136
-5.33%	1,338	1,263	1,180	1,091	997	899	798
-2.67%	1,002	889	774	656	537	417	296
0%	390	260	130	0	-130	-260	-389
2.67%	-528	-646	-766	-888	-1,011	-1,135	-1,261
5.33%	-1,707	-1,792	-1,884	-1,983	-2,086	-2,193	-2,303
8.00%	-3,062	-3,112	-3,172	-3,241	-3,318	-3,400	-3,489
KR4201N13	2018-01 콜330						6,391
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,263	2,215	2,150	2,069	1,972	1,862	1,739
-5.33%	2,096	1,986	1,857	1,714	1,557	1,389	1,212
-2.67%	1,657	1,467	1,266	1,057	841	620	394
0%	758	507	254	0	-255	-512	-769
2.67%	-728	-988	-1,249	-1,511	-1,773	-2,036	-2,299
5.33%	-2,794	-3,009	-3,234	-3,465	-3,701	-3,942	-4,186
8.00%	-5,312	-5,457	-5,619	-5,796	-5,985	-6,183	-6,391

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

9,252

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

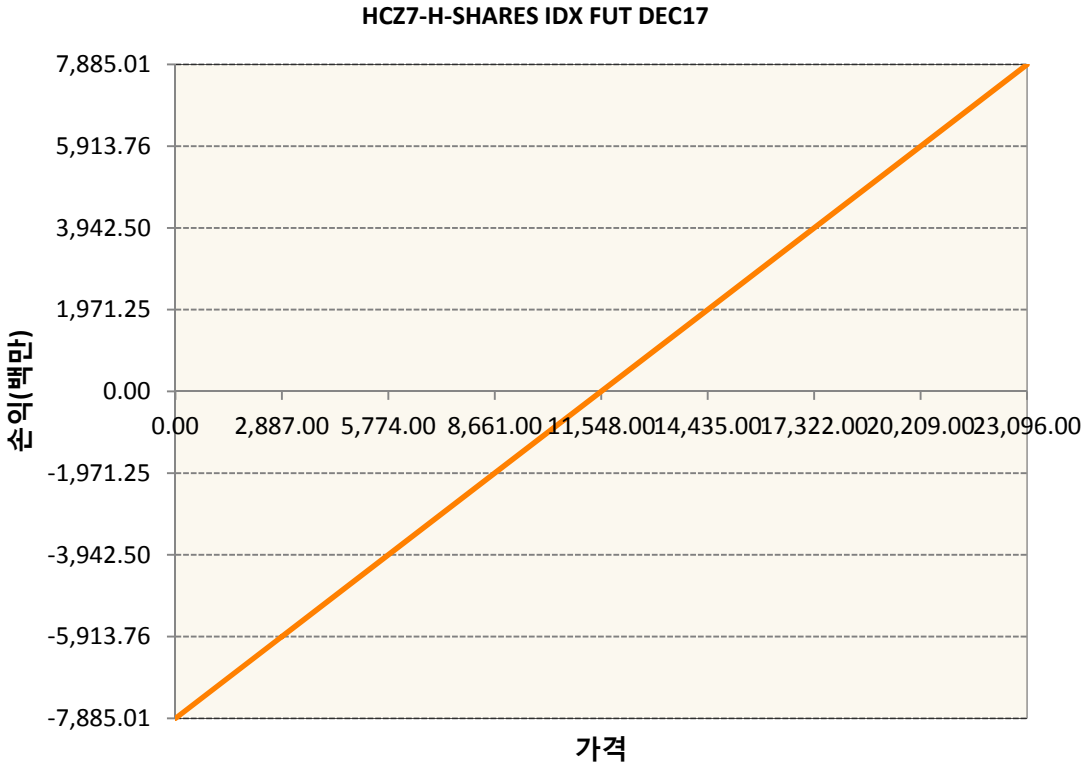
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

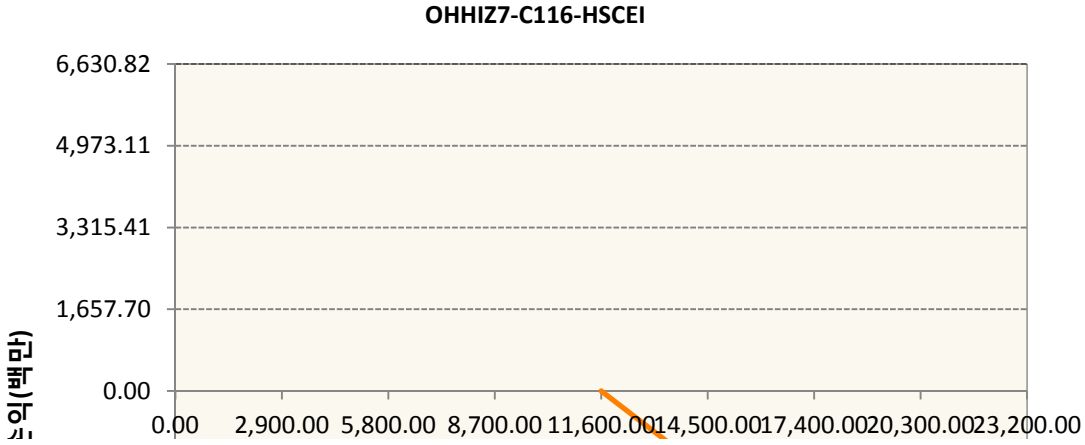
1. 계약금액

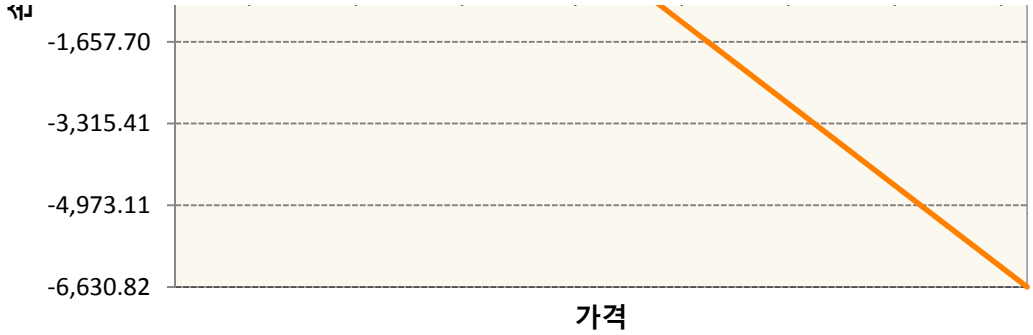
(단위:백만원)

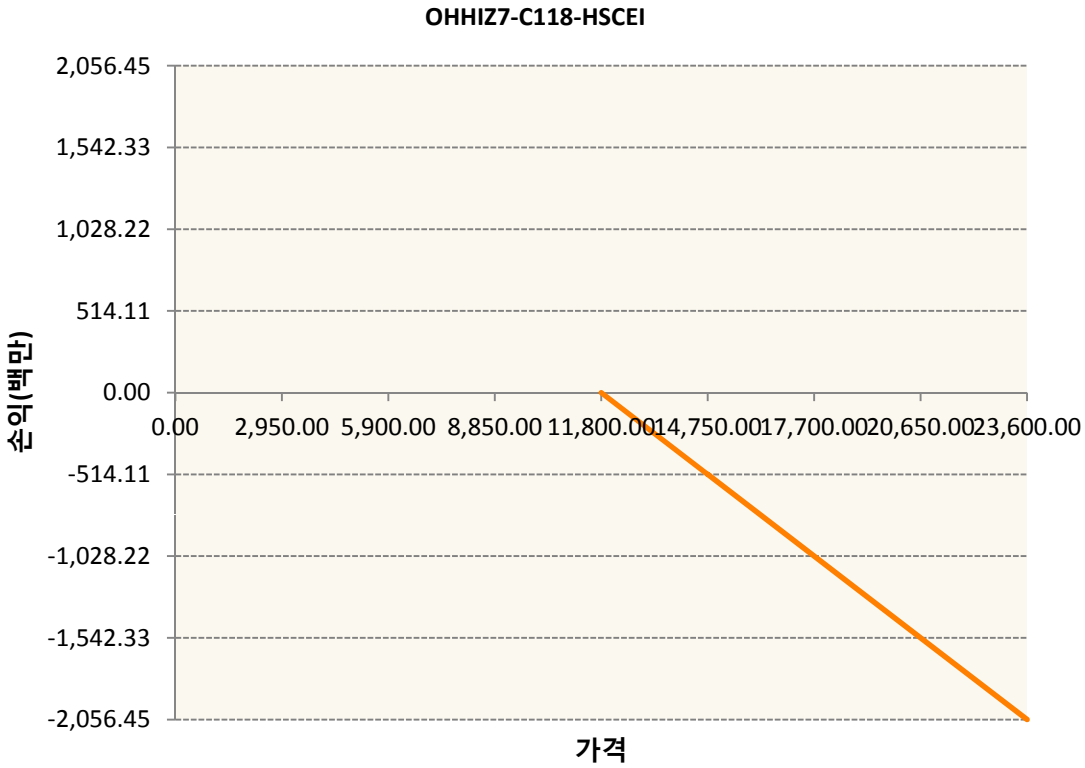
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,885	0	7,885	
누계	유가증권	옵션	0	17,375	-17,375	장내

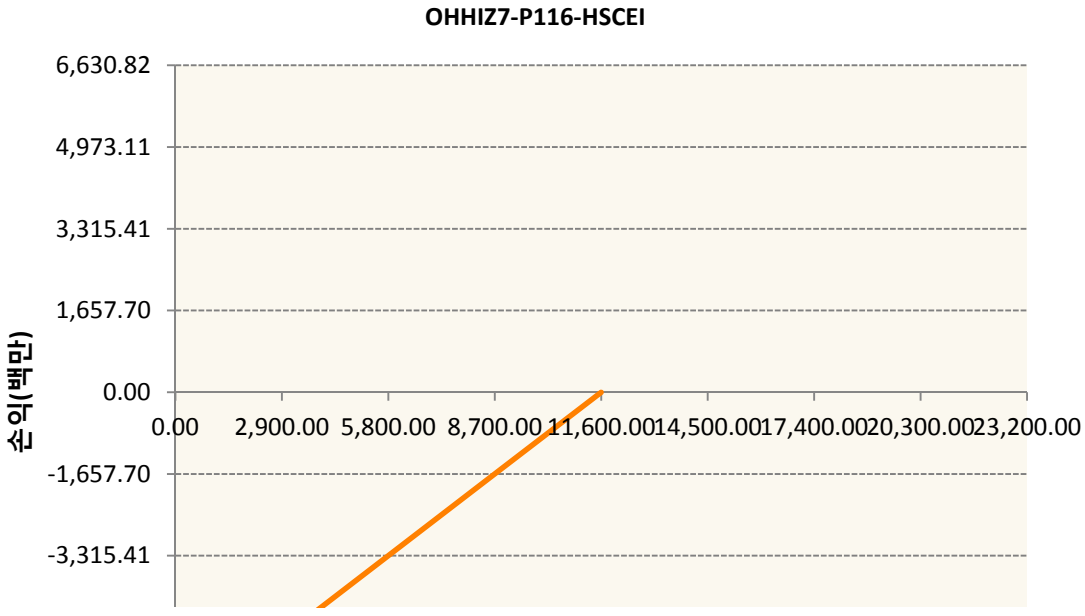
2. 만기시점의 손익구조

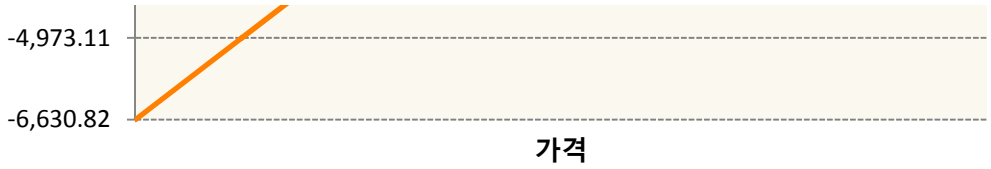


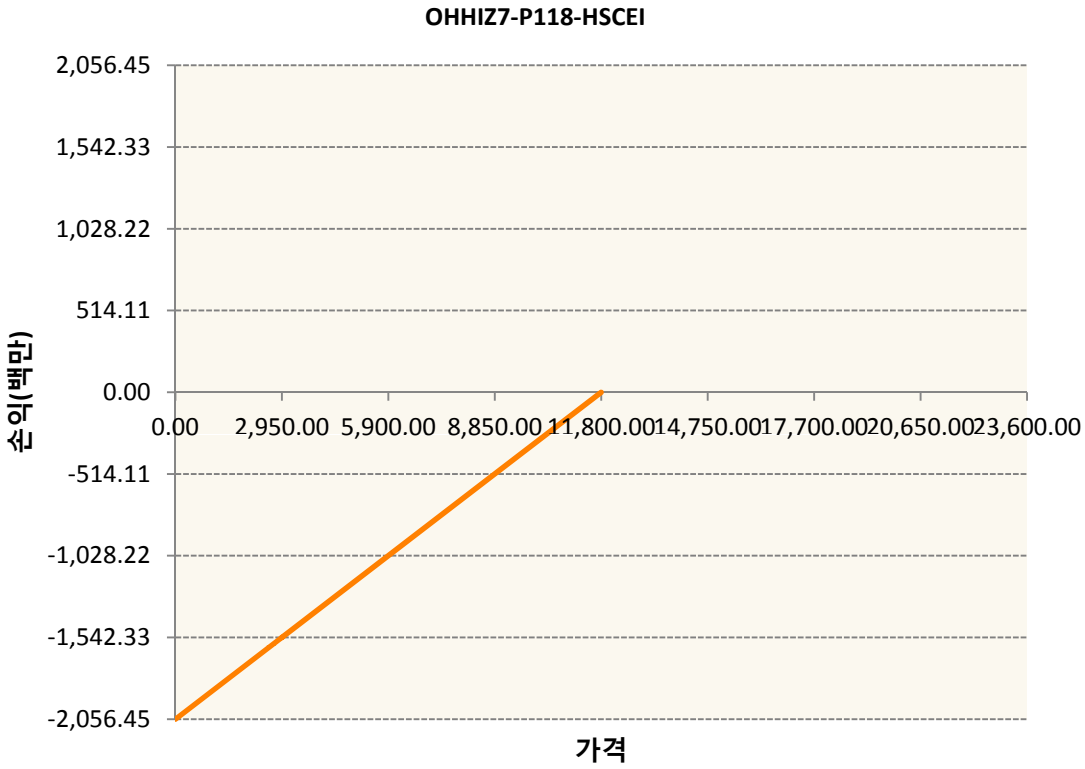



-1,657.70
-3,315.41
-4,973.11
-6,630.82
가격


OHHIZ7-C118-HSCEI
2,056.45
1,542.33
1,028.22
514.11
0.00
-514.11
-1,028.22
-1,542.33
-2,056.45
손익(백만)
0.00
2,950.00
5,900.00
8,850.00
11,800.00
14,750.00
17,700.00
20,650.00
23,600.00
가격


OHHIZ7-P116-HSCEI
6,630.82
4,973.11
3,315.41
1,657.70
0.00
-1,657.70
-3,315.41
손익(백만)
0.00
2,900.00
5,800.00
8,700.00
11,600.00
14,500.00
17,400.00
20,300.00
23,200.00





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ7	H-SHARES IDX FUT DEC17	631
OHHIZ7-C11	HSCEI	530
OHHIZ7-C11	HSCEI	165
OHHIZ7-P11	HSCEI	530
OHHIZ7-P11	HSCEI	165

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

1,504

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

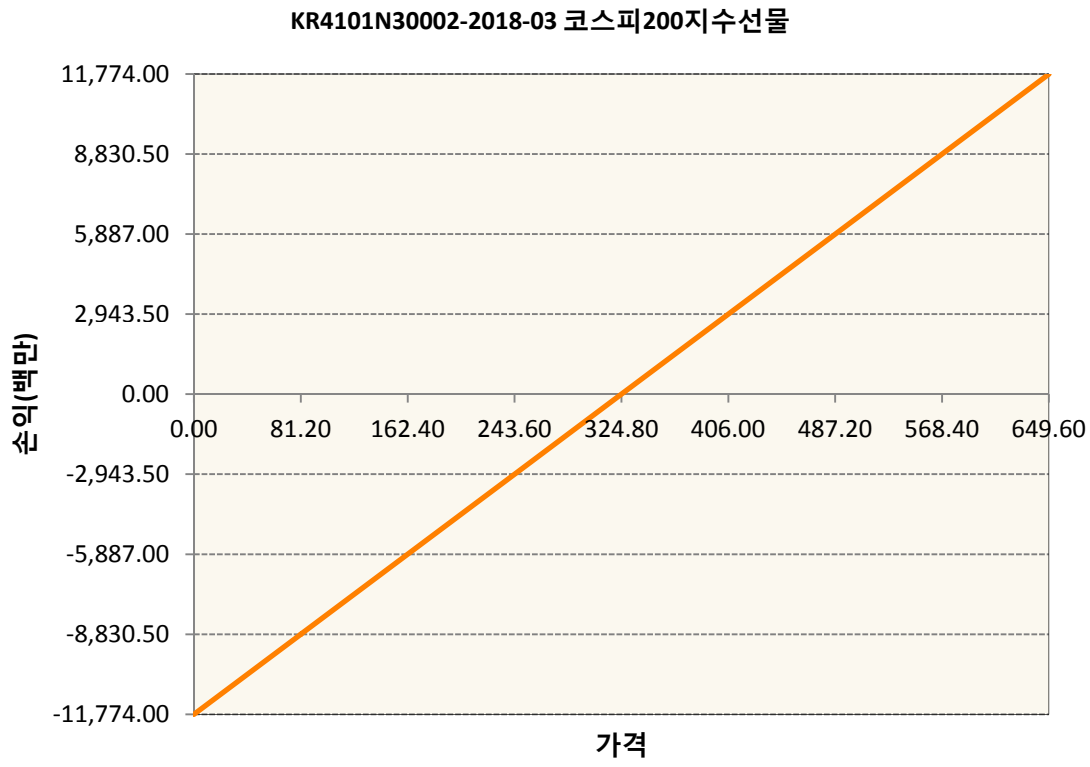
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,968	0	5,968	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	11,774	0	11,774	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465	-1,465
-5.33%	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488

5.33%	976	976	976	976	976	976	976
8.00%	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465	1,465
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3						277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						158
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	106	106	106	106	106	106	106
8.00%	158	158	158	158	158	158	158
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						238
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238
-5.33%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	158	158	158	158	158	158	158
8.00%	238	238	238	238	238	238	238
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						198
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	198	198	198	198	198	198	198
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						253
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	169	169	169	169	169	169	169
8.00%	253	253	253	253	253	253	253
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8							469
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-5.33%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-2.67%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	156	156	156	156	156	156	156
5.33%	312	312	312	312	312	312	312
8.00%	469	469	469	469	469	469	469
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9							312
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
-5.33%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-2.67%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	104	104	104	104	104	104	104
5.33%	208	208	208	208	208	208	208
8.00%	312	312	312	312	312	312	312
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10							277
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11							633
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633
-5.33%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	422	422	422	422	422	422	422
8.00%	633	633	633	633	633	633	633
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12							475
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	475	475	475	475	475	475	475
KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							942
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-942	-942	-942	-942	-942	-942	-942
-5.33%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-2.67%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	314	314	314	314	314	314	314
5.33%	628	628	628	628	628	628	628
8.00%	942	942	942	942	942	942	942

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

5,300

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

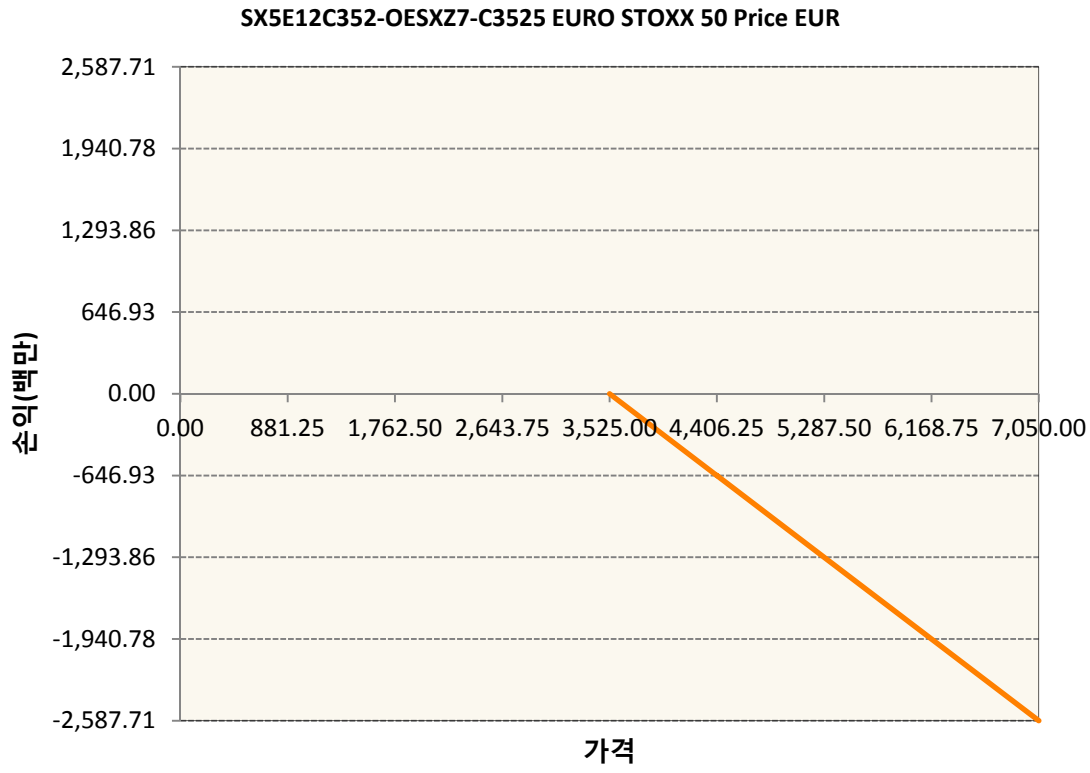
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

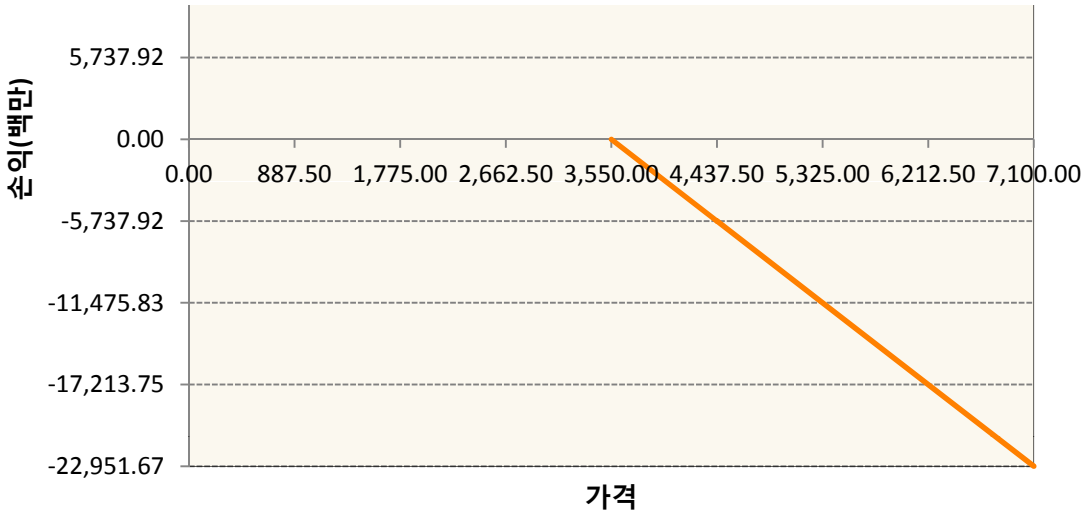
(단위:백만원)

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
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	17,616	0	17,616	
누계	유가증권	스왑	96,590	0	96,590	장외
누계	유가증권	옵션	0	51,079	-51,079	장내
누계	지수	스왑	51,515	0	51,515	장외

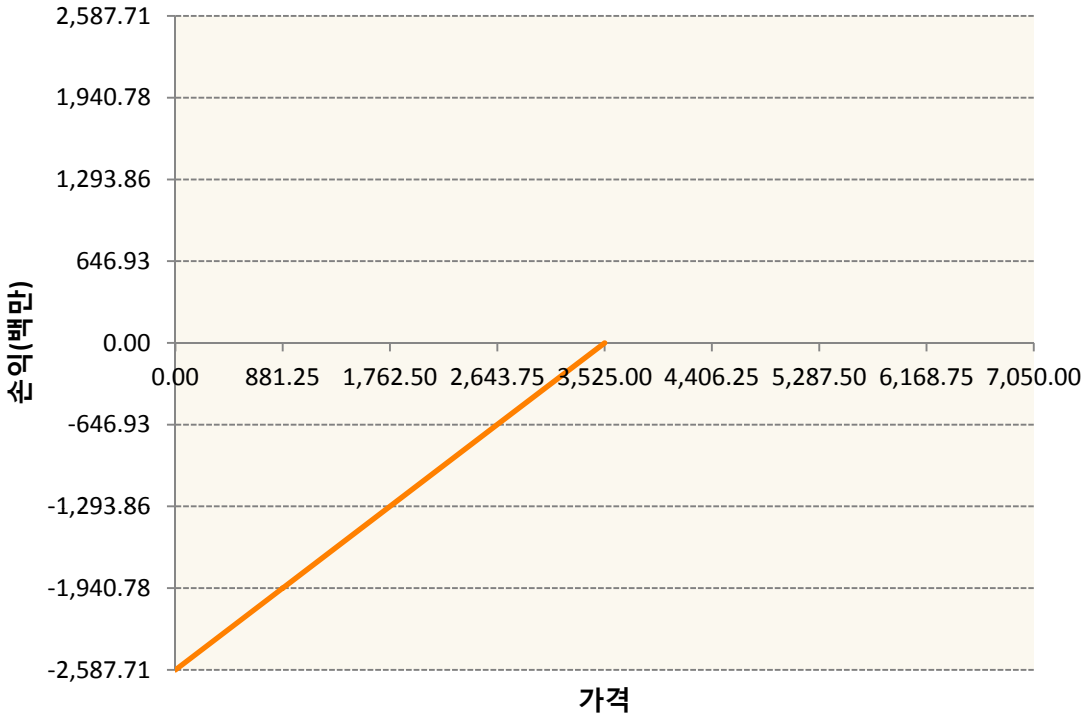
2. 만기시점의 손익구조



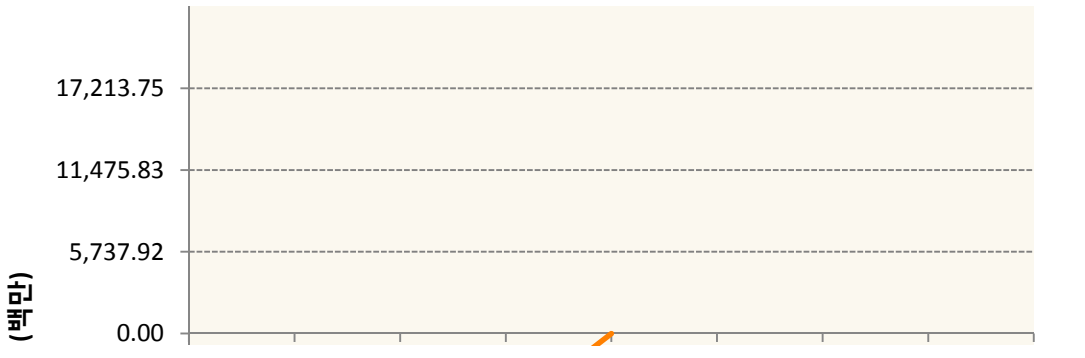


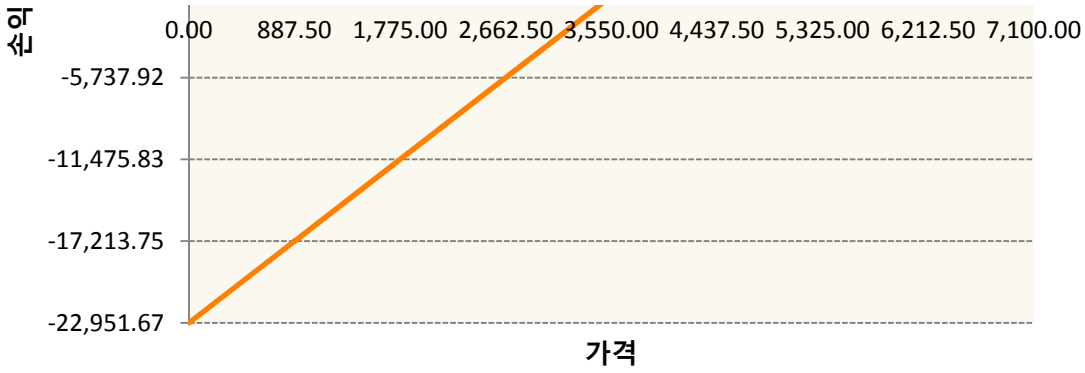


SX5E12P352-OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR

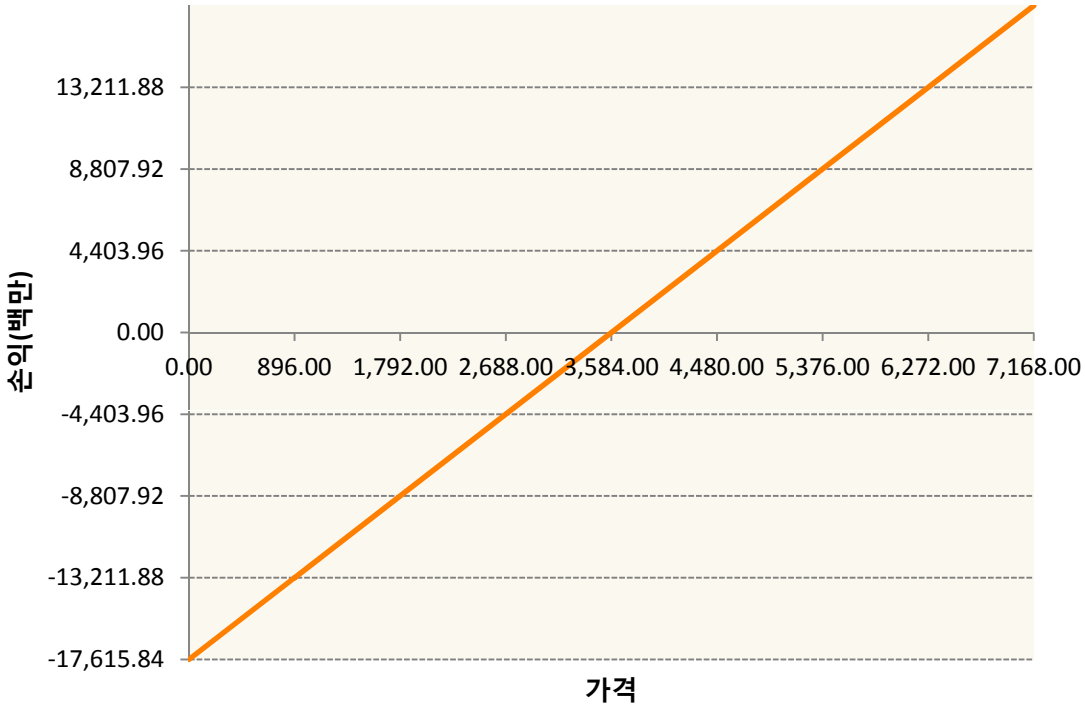


SX5E12P355-OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR





VGZ7-EURO STOXX 50 DEC17



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	53
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	56
SX5E12C352 OESXZ7-C3525 EURO STOXX 50 Price EUR	207
SX5E12C355 OESXZ7-C3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,836
SX5E12P352 OESXZ7-P3525 EURO STOXX 50 Price EUR	207
SX5E12P355 OESXZ7-P3550 EURO STOXX 50 Price EUR	1,836
VGZ7 EURO STOXX 50 DEC17	1,409

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

3,172

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

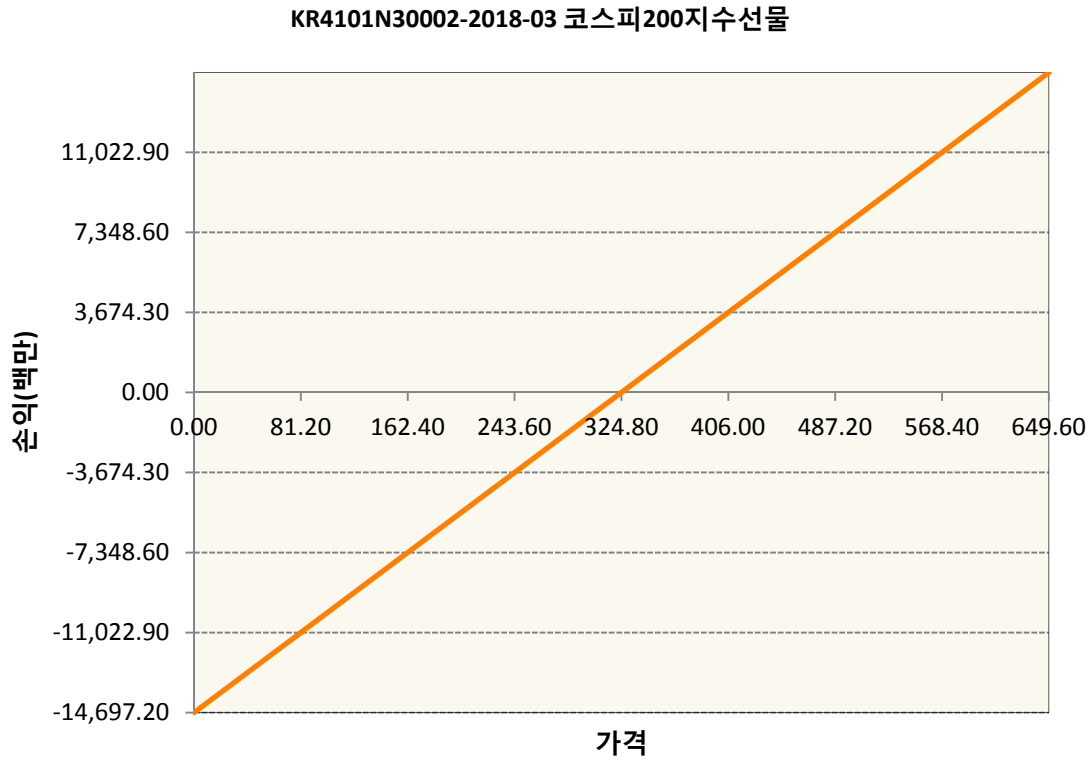
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,441	0	7,441	장내
누계	유가증권	선물	14,697	0	14,697	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176
-5.33%	-784	-784	-784	-784	-784	-784	-784
-2.67%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	392	392	392	392	392	392	392
5.33%	784	784	784	784	784	784	784
8.00%	1,176	1,176	1,176	1,176	1,176	1,176	1,176

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

678

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

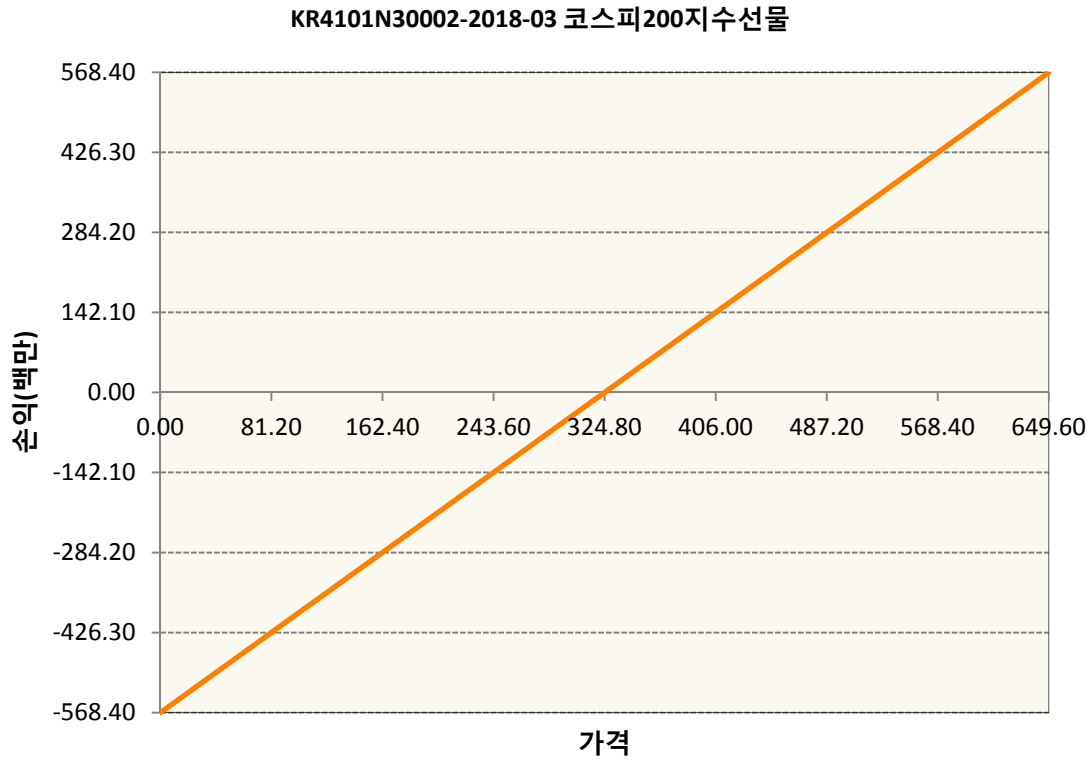
ETF스마트레버리지목표전환형9호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	327	0	327	장내
누계	유가증권	선물	568	0	568	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

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

26

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

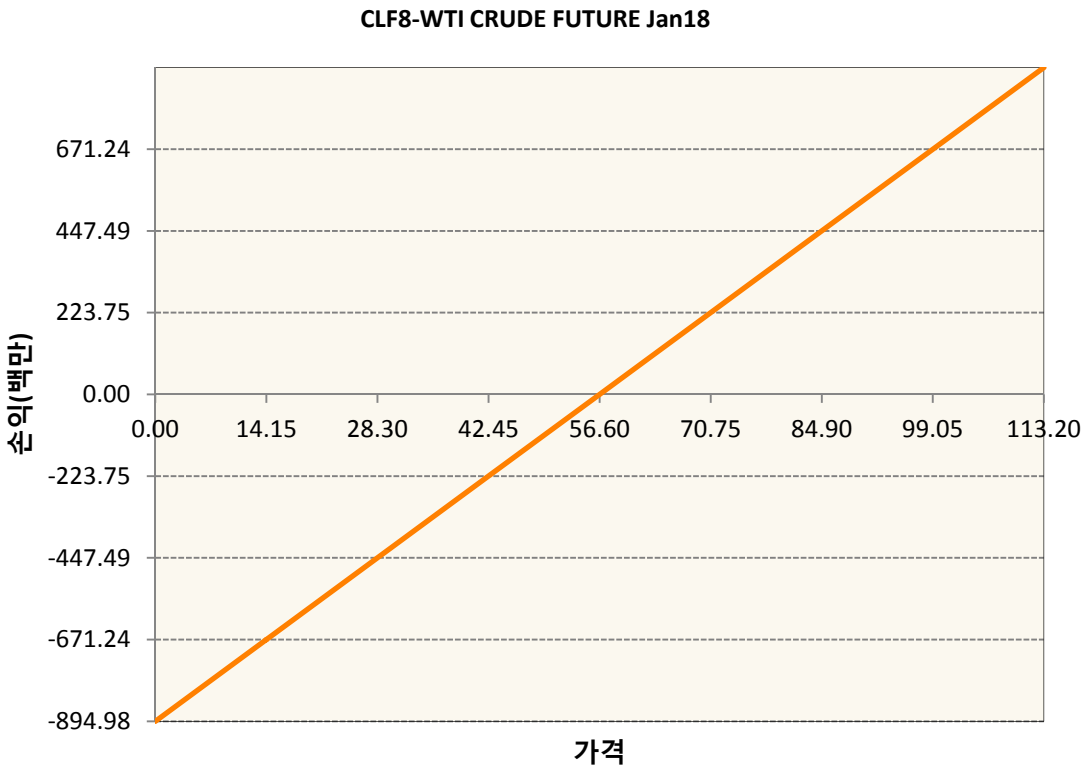
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

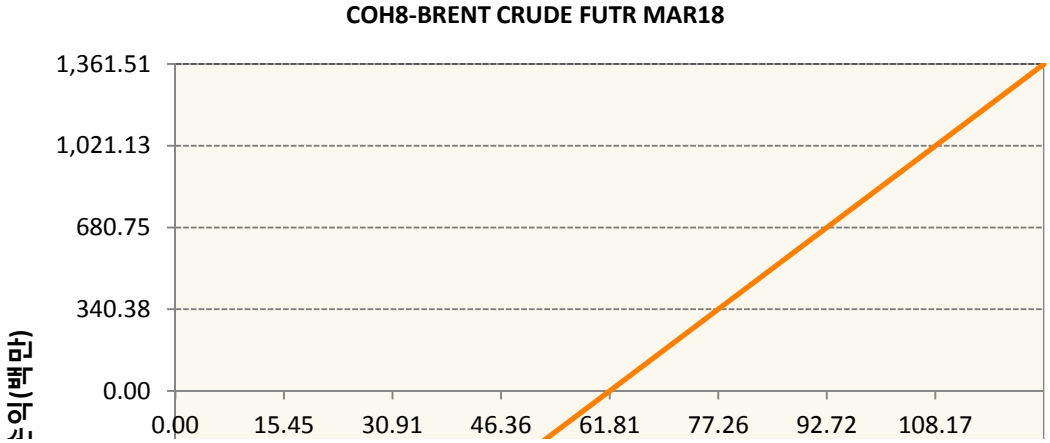
1. 계약금액

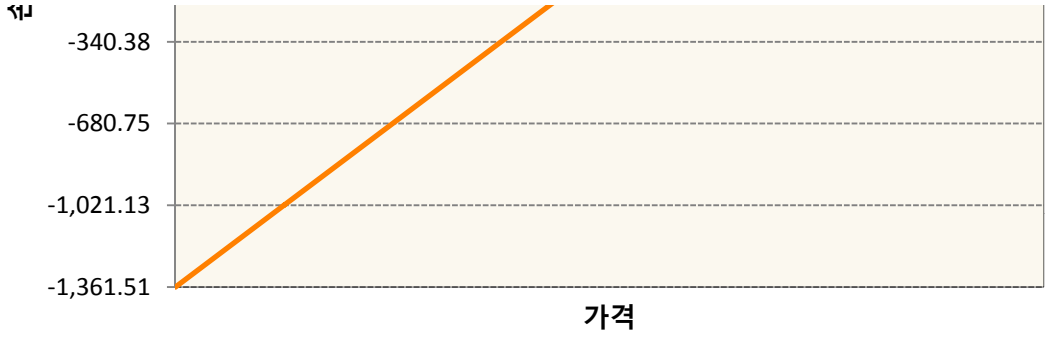
(단위:백만원)

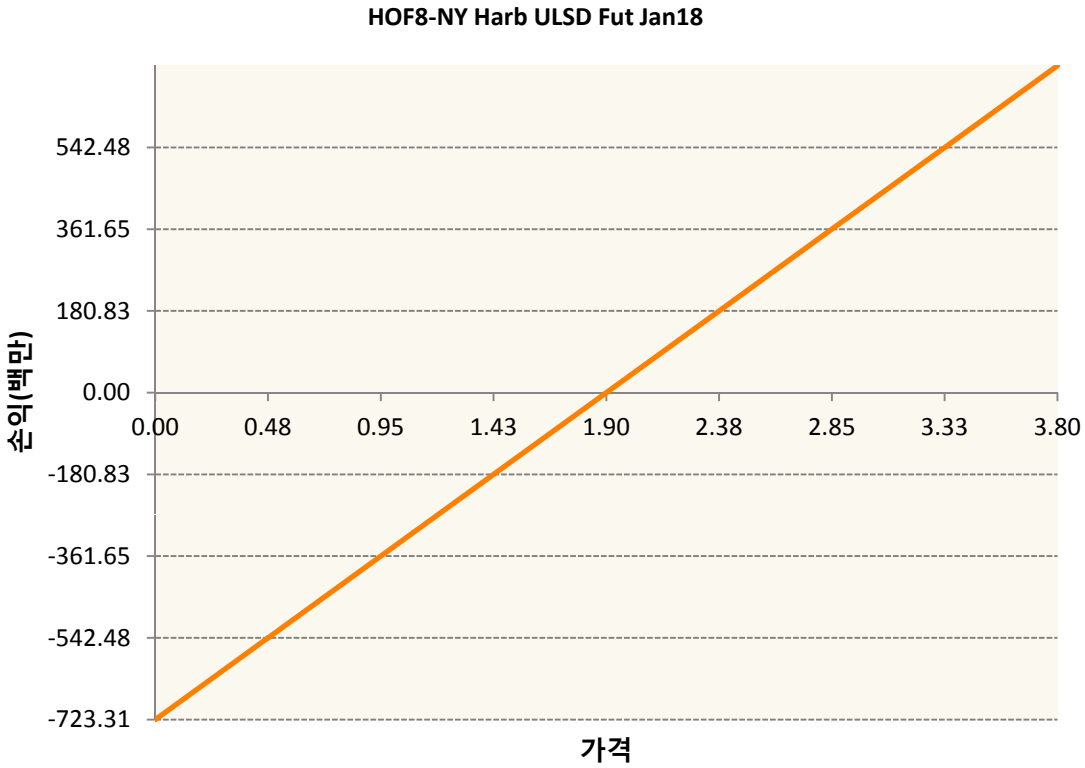
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	869	-869	장내
누계	유가증권	선물	4,799	0	4,799	
누계	통화	선물	0	870	-870	장내

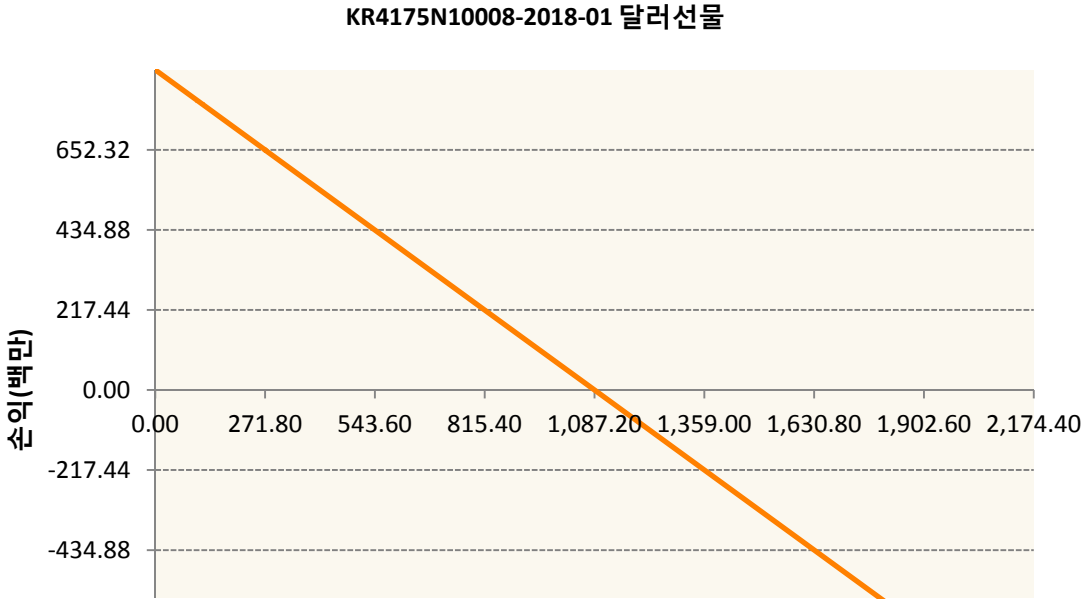
2. 만기시점의 손익구조

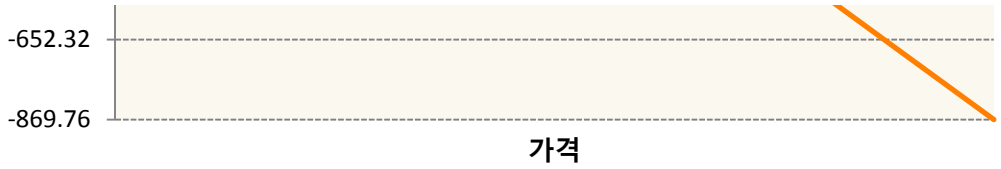


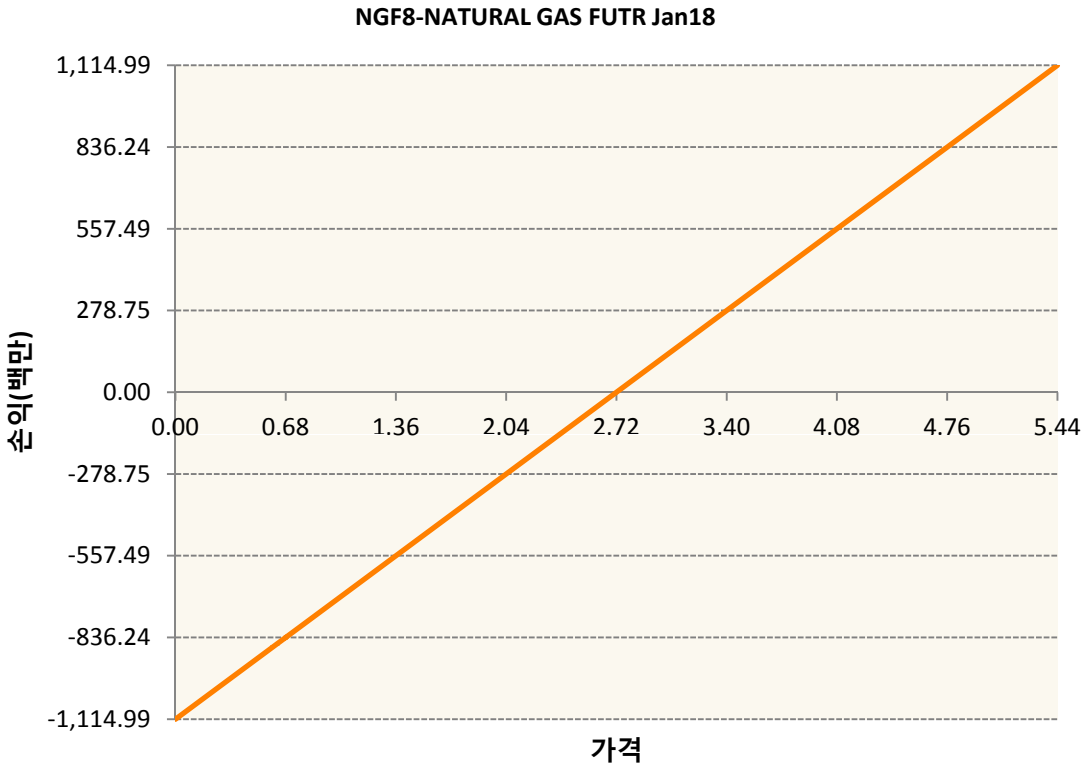


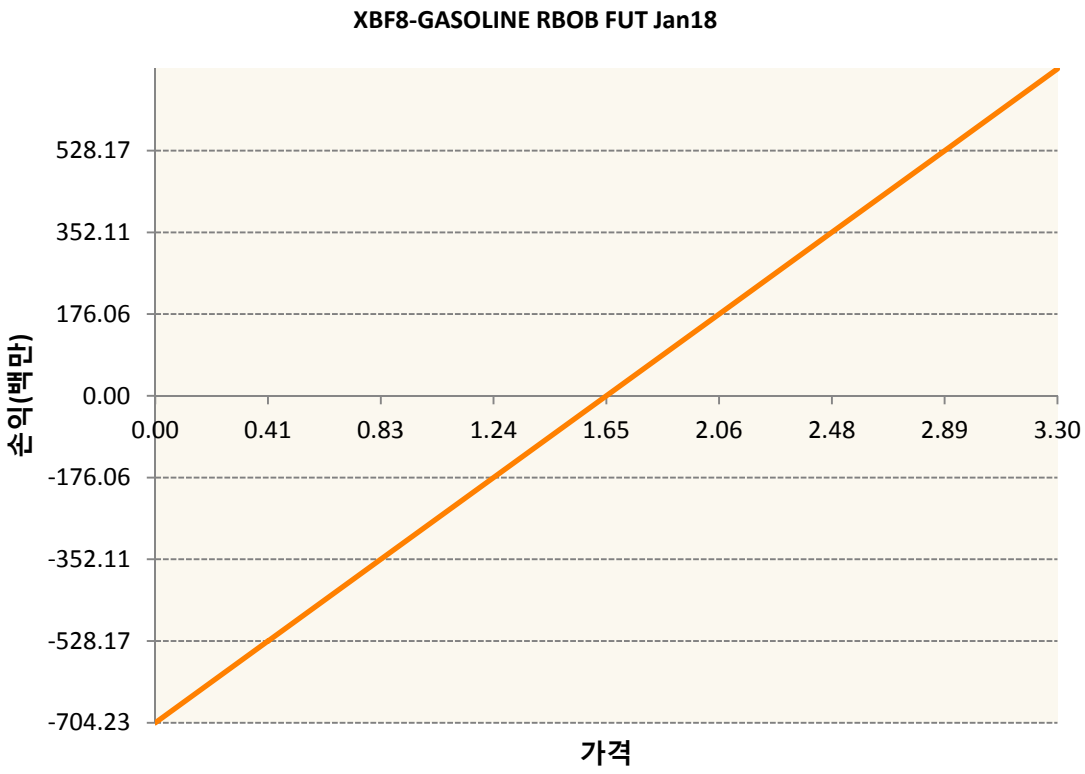

-340.38
-680.75
-1,021.13
-1,361.51
가격


HOF8-NY Harb ULSD Fut Jan18
542.48
361.65
180.83
0.00
-180.83
-361.65
-542.48
-723.31
0.00
0.48
0.95
1.43
1.90
2.38
2.85
3.33
3.80
손익(백만)
가격


KR4175N10008-2018-01 달러선물
652.32
434.88
217.44
0.00
-217.44
-434.88
0.00
271.80
543.60
815.40
1,087.20
1,359.00
1,630.80
1,902.60
2,174.40
손익(백만)


-652.32
-869.76
가격


NGF8-NATURAL GAS FUTR Jan18
1,114.99
836.24
557.49
278.75
0.00
-278.75
-557.49
-836.24
-1,114.99
0.00
0.68
1.36
2.04
2.72
3.40
4.08
4.76
5.44
손익(백만)
가격


XBF8-GASOLINE RBOB FUT Jan18
528.17
352.11
176.06
0.00
-176.06
-352.11
-528.17
-704.23
0.00
0.41
0.83
1.24
1.65
2.06
2.48
2.89
3.30
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF8	WTI CRUDE FUTURE Jan18	72
COH8	BRENT CRUDE FUTR MAR18	109
HOF8	NY Harb ULSD Fut Jan18	58
KR4175N10(	2018-01 달러선물	70
NGF8	NATURAL GAS FUTR Jan18	89
XBF8	GASOLINE RBOB FUT Jan18	56

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

650

공시일	2017-12-15
기준일	2017-12-14

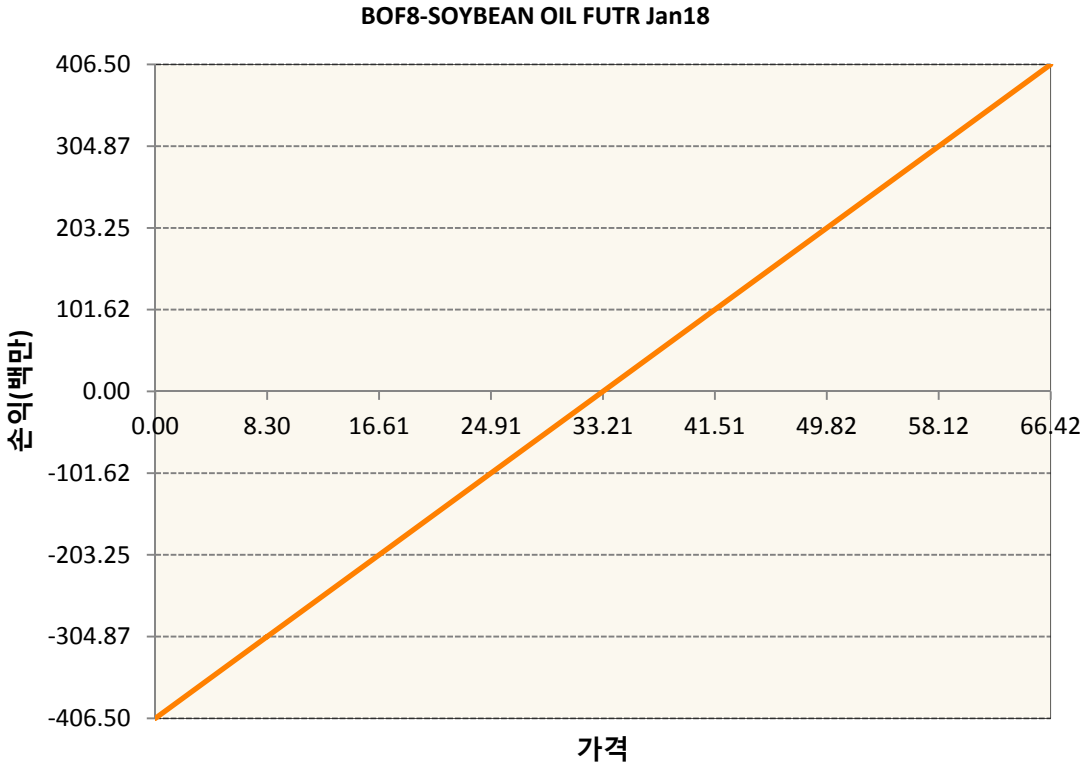
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

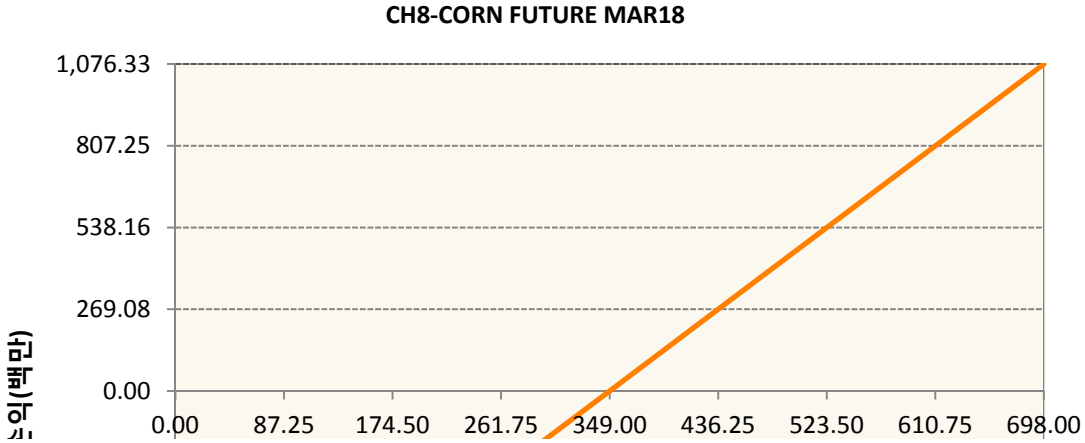
1. 계약금액

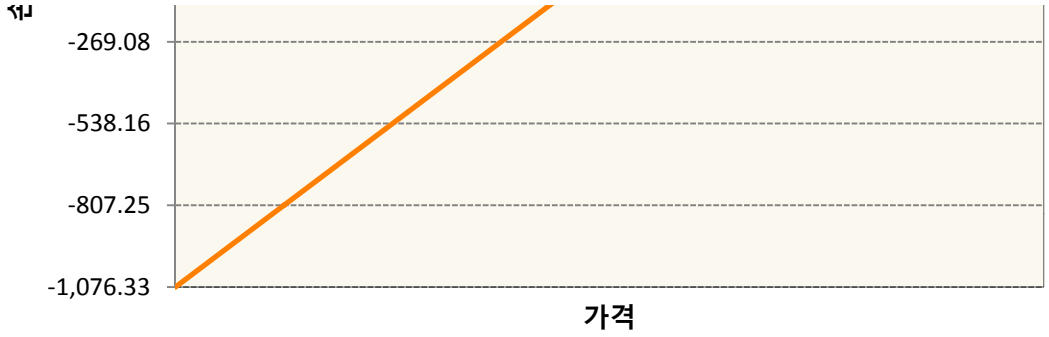
(단위:백만원)

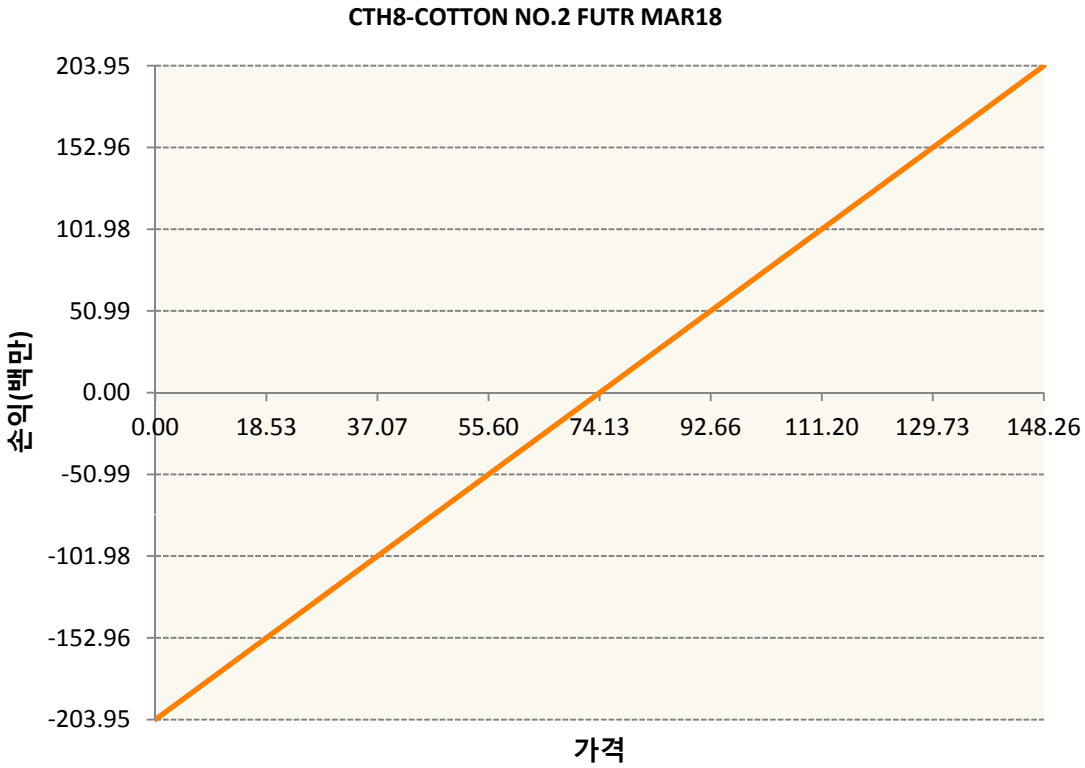
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	326	-326	장내
누계	유가증권	선물	4,347	0	4,347	
누계	통화	선물	0	326	-326	장내

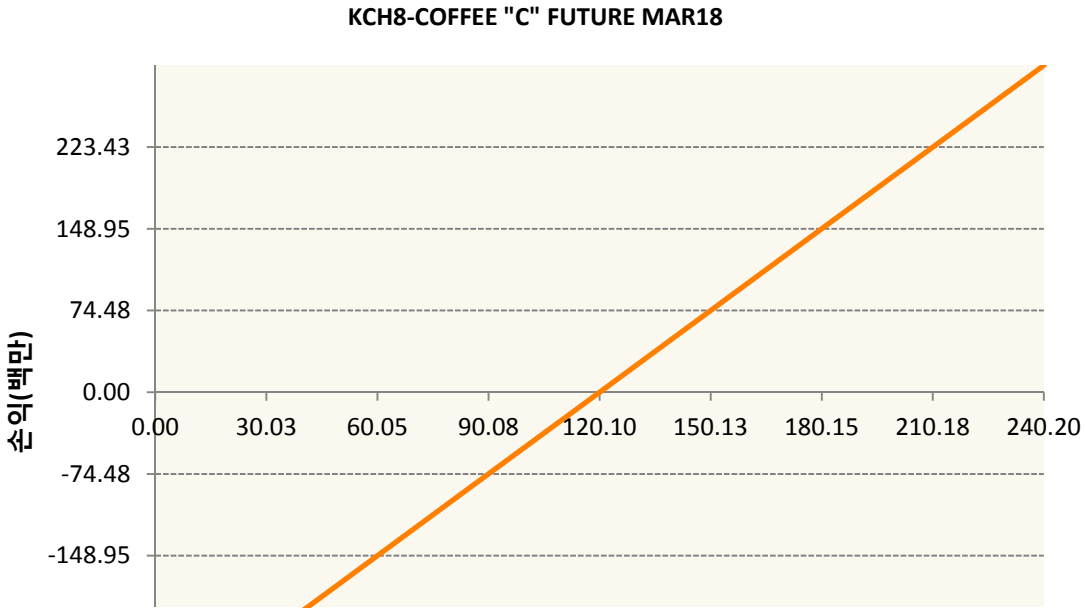
2. 만기시점의 손익구조

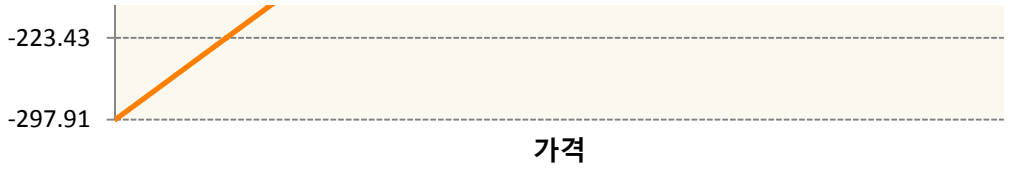


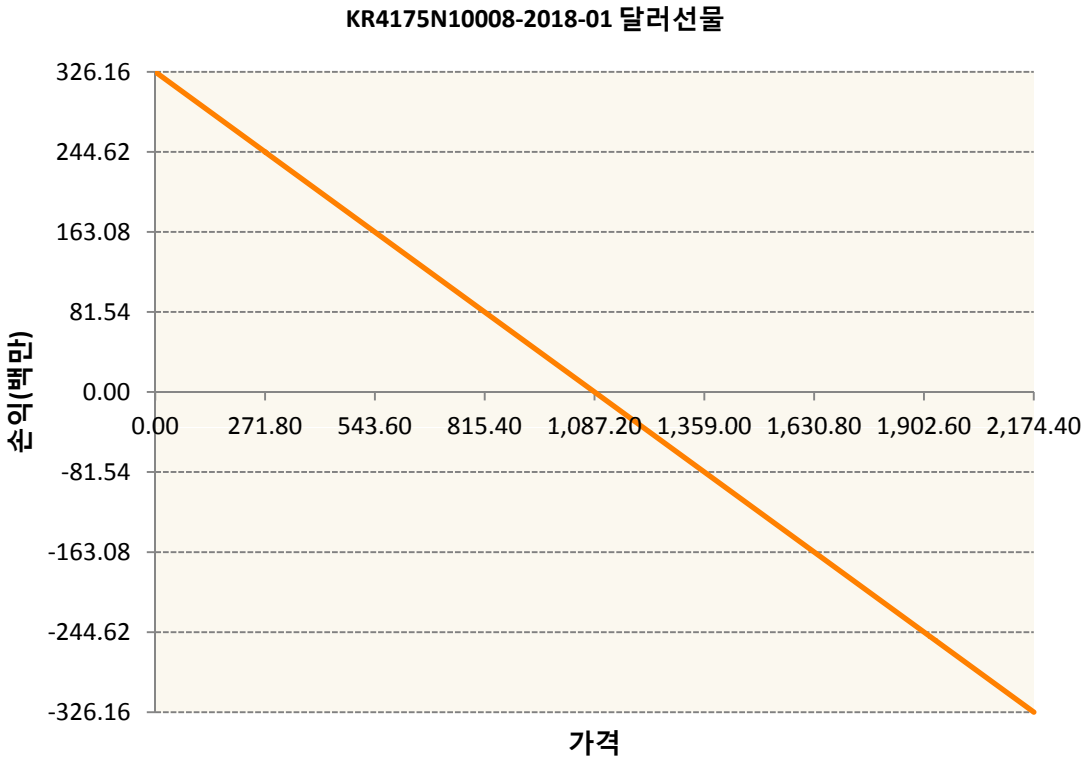


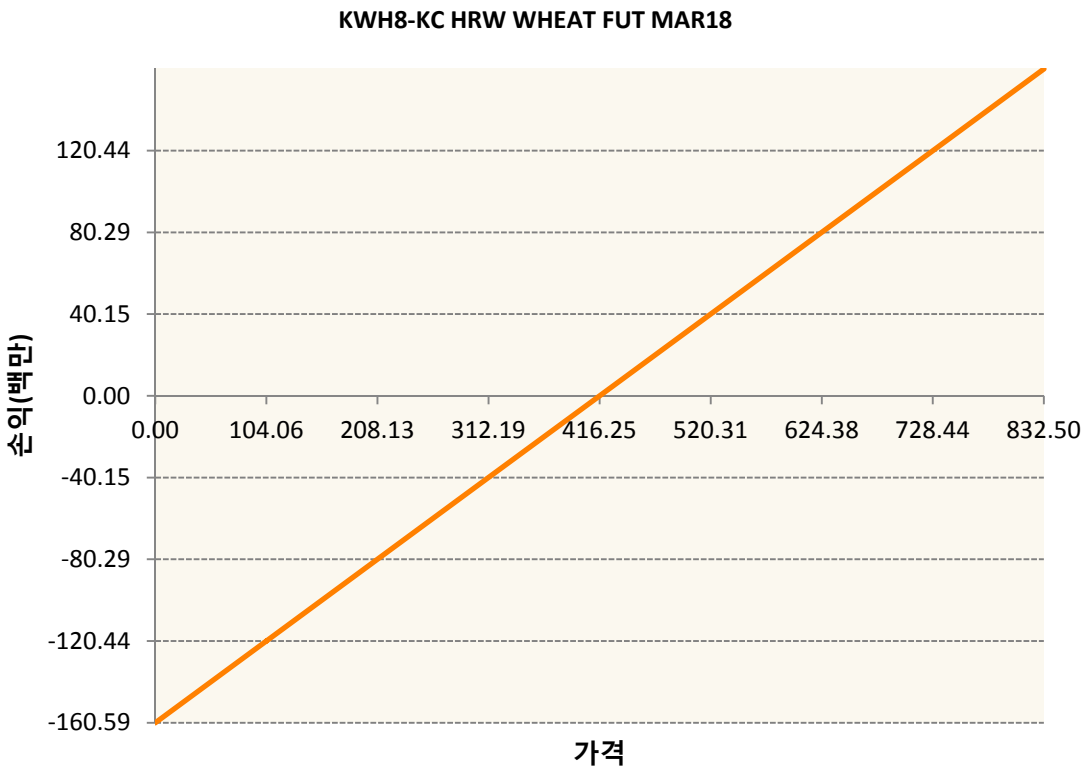

-269.08
-538.16
-807.25
-1,076.33
가격


CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
손익(백만)
203.95
152.96
101.98
50.99
0.00
-50.99
-101.98
-152.96
-203.95
0.00
18.53
37.07
55.60
74.13
92.66
111.20
129.73
148.26
가격

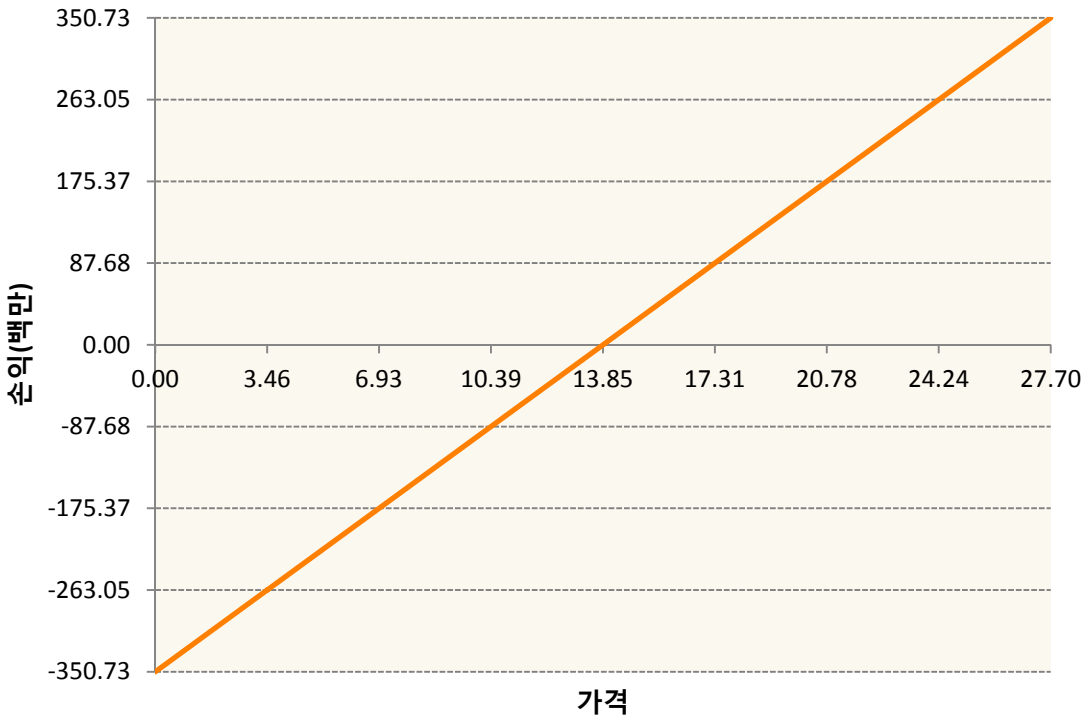

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
손익(백만)
223.43
148.95
74.48
0.00
-74.48
-148.95
0.00
30.03
60.05
90.08
120.10
150.13
180.15
210.18
240.20


-223.43
-297.91
가격

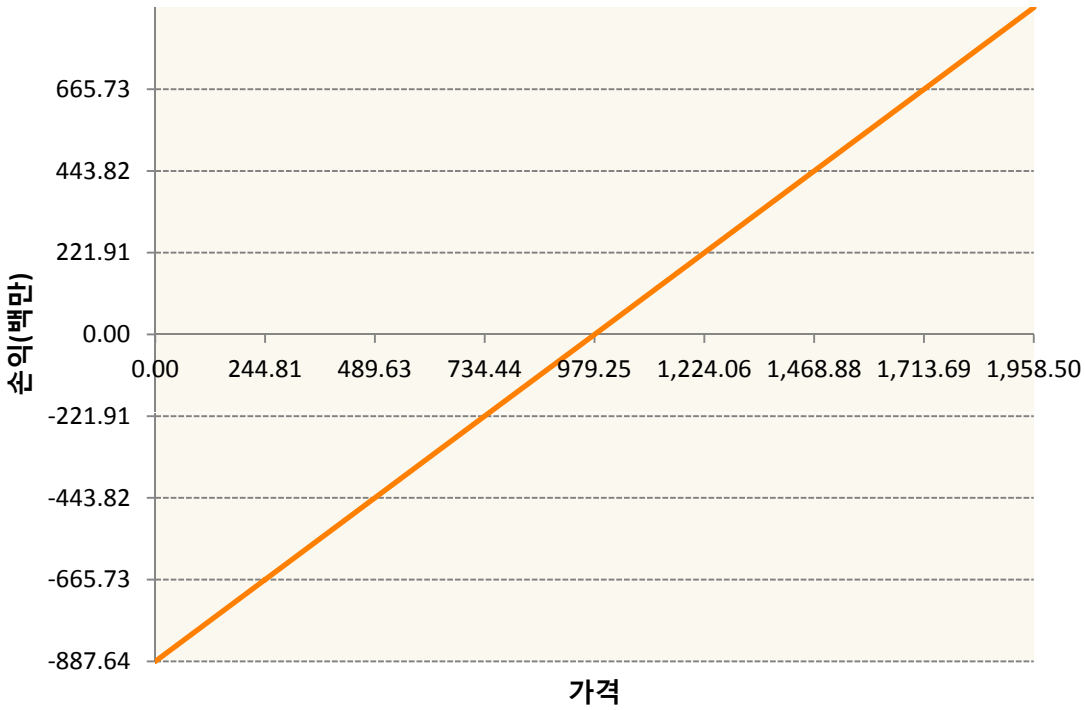

KR4175N10008-2018-01 달러선물
326.16
244.62
163.08
81.54
0.00
-81.54
-163.08
-244.62
-326.16
0.00
271.80
543.60
815.40
1,087.20
1,359.00
1,630.80
1,902.60
2,174.40
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
120.44
80.29
40.15
0.00
-40.15
-80.29
-120.44
-160.59
0.00
104.06
208.13
312.19
416.25
520.31
624.38
728.44
832.50
손익(백만)
가격

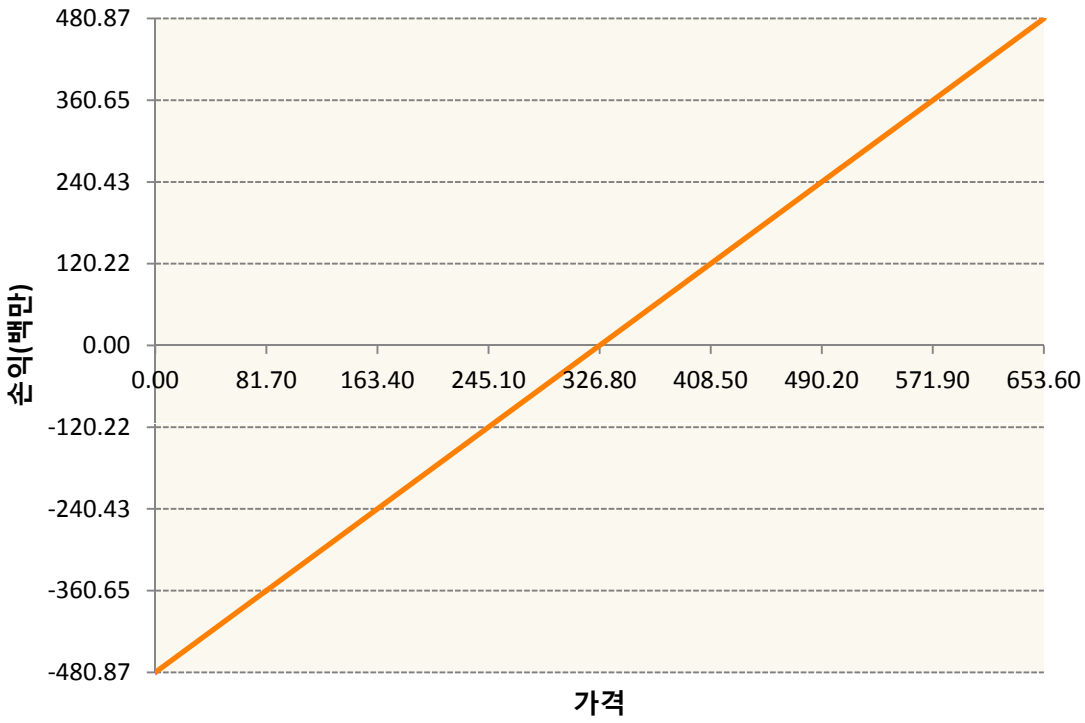
SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18



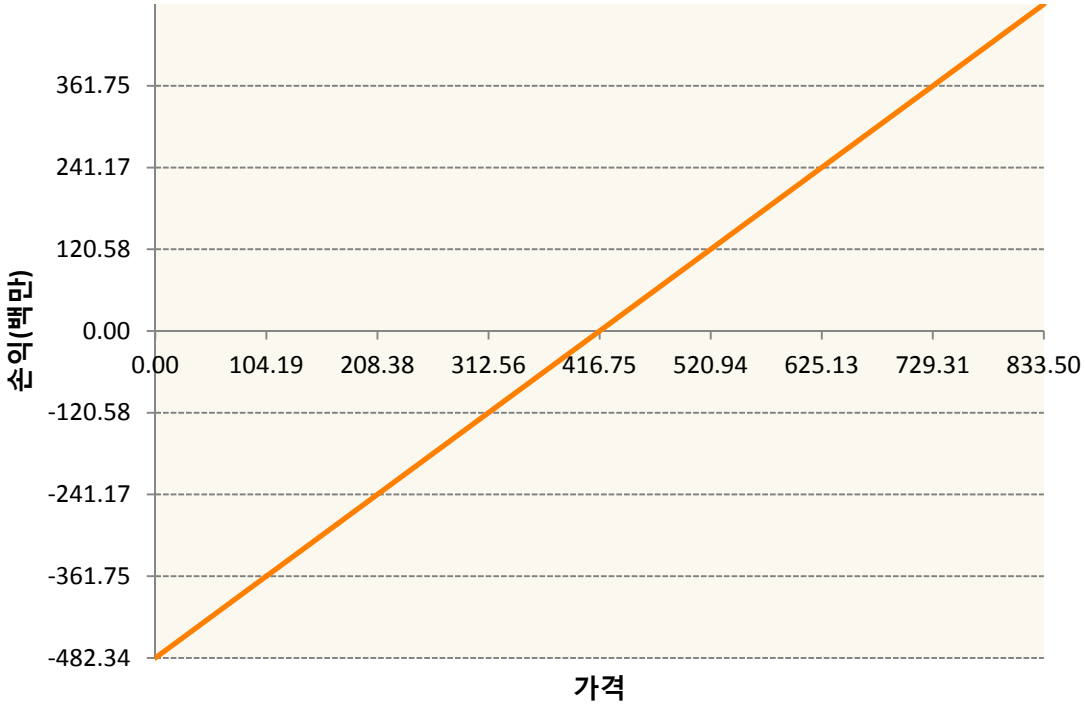
SF8-SOYBEAN FUTURE Jan18



SMF8-SOYBEAN MEAL FUTR Jan18



WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOF8	SOYBEAN OIL FUTR Jan18	33
CH8	CORN FUTURE MAR18	86
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	16

KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	24
KR4175N10(	2018-01 달러선물	26
KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	13
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	28
SF8	SOYBEAN FUTURE Jan18	71
SMF8	SOYBEAN MEAL FUTR Jan18	38
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	39

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

366