공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

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	2018-03-05
기준일	2018-03-02

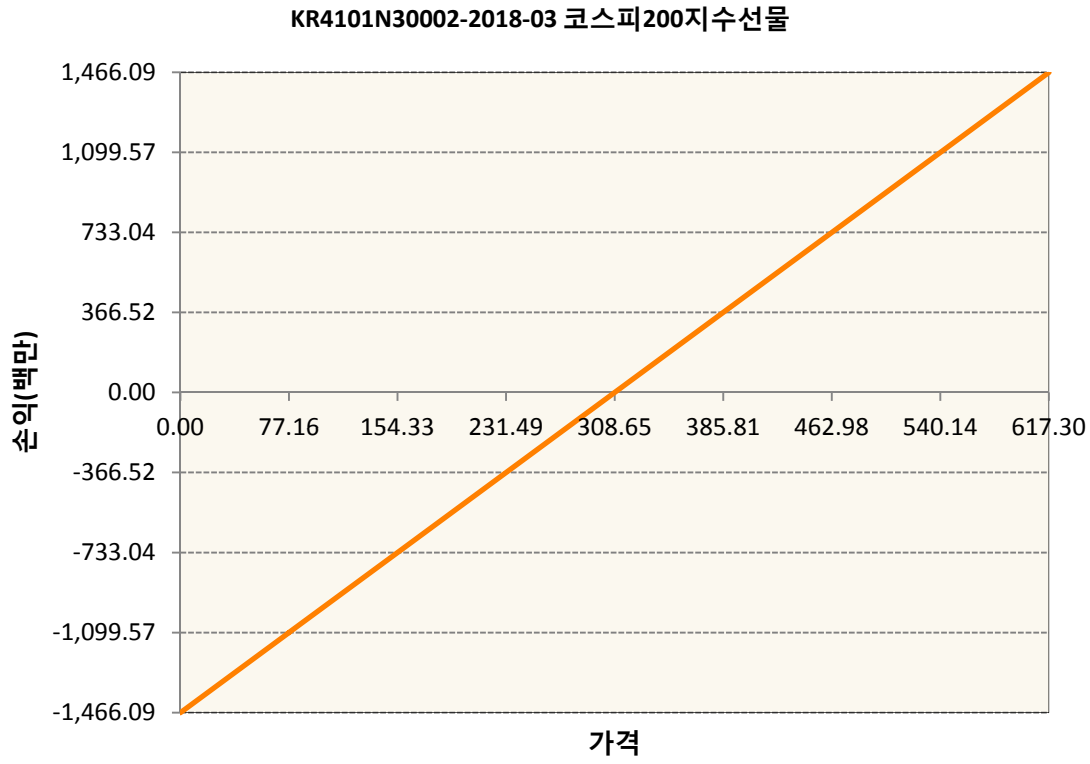
스마트인덱스모

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	1,466	0	1,466	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117

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

80

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

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	13,869	0	13,869	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S180222	1,096

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

409

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

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	404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

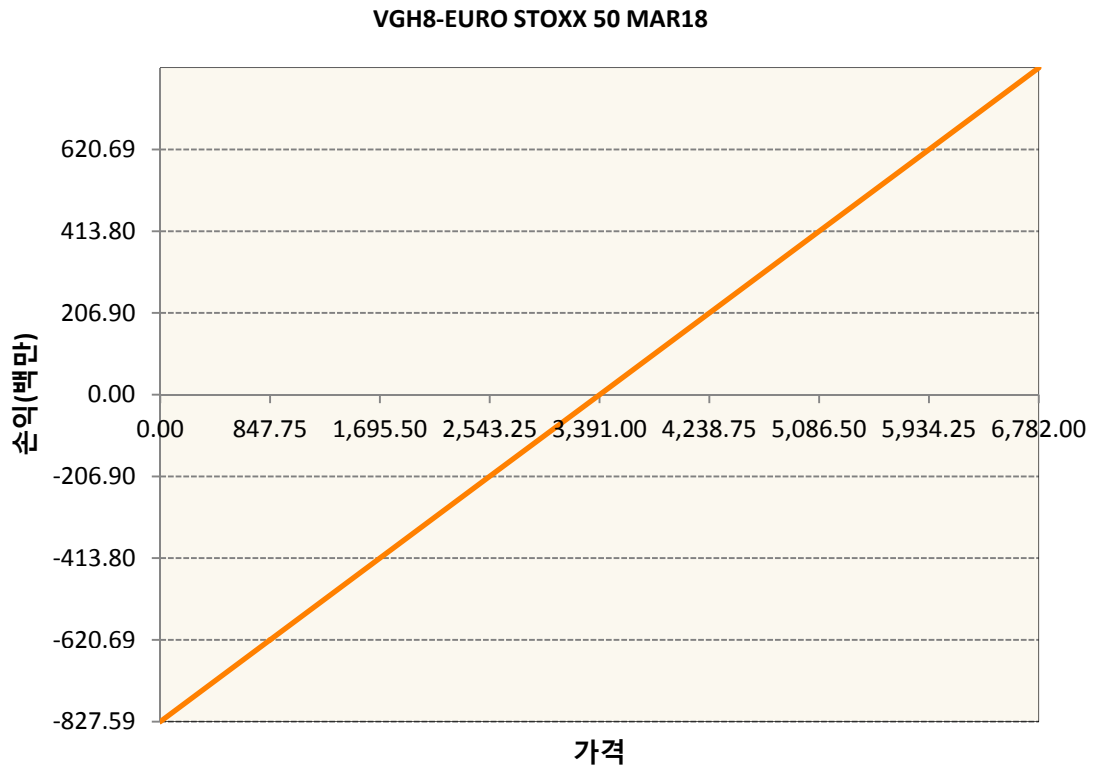
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	828	0	828	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	66

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

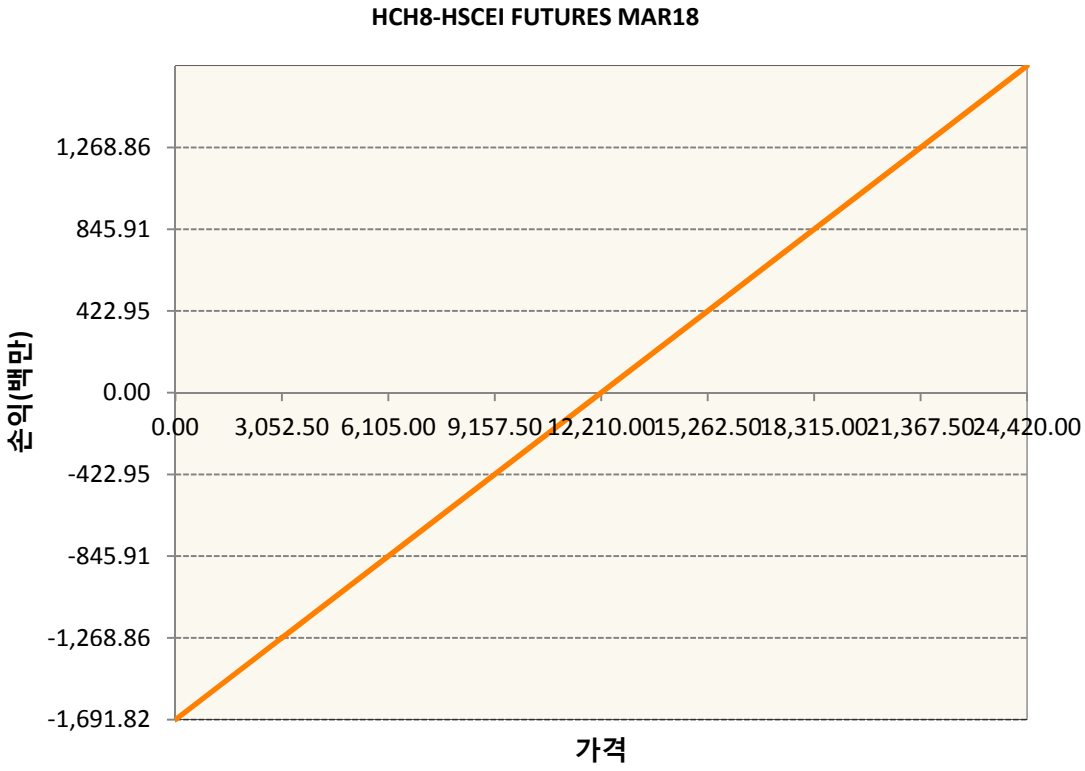
차이나인덱스모(주식-파생형)

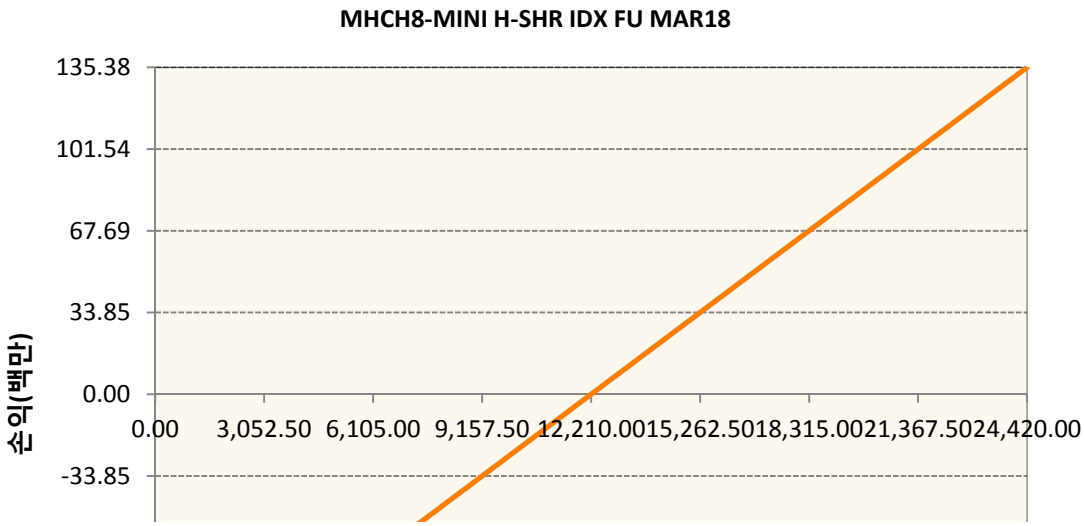
1. 계약금액

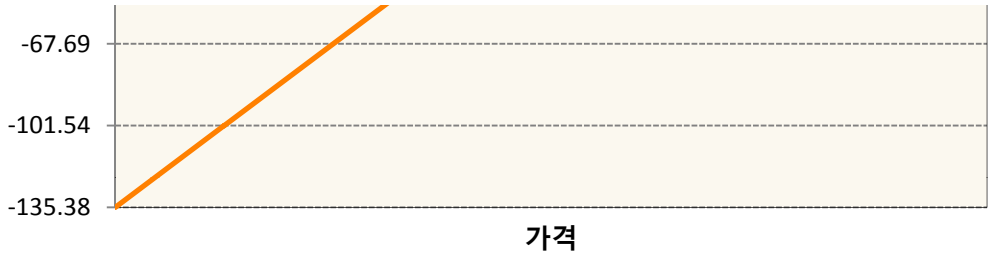
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,827	0	1,827	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	135
MHCH8	MINI H-SHR IDX FU MAR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	127

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

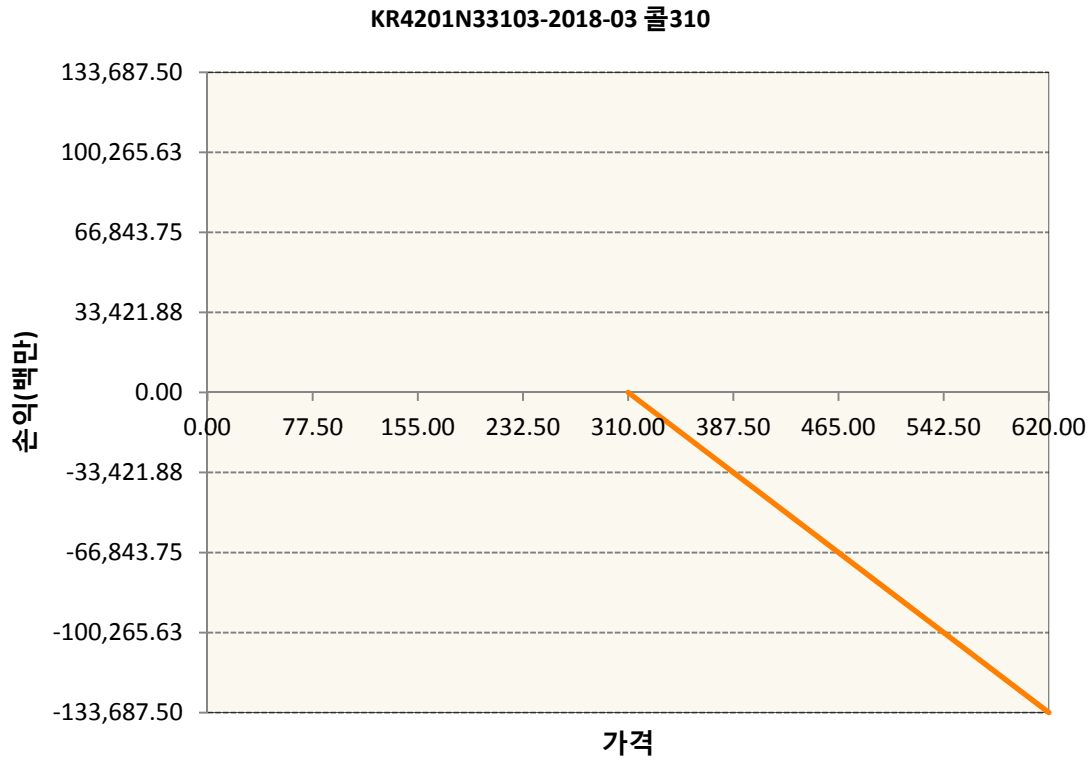
커버드콜모(주식혼합-파생형)

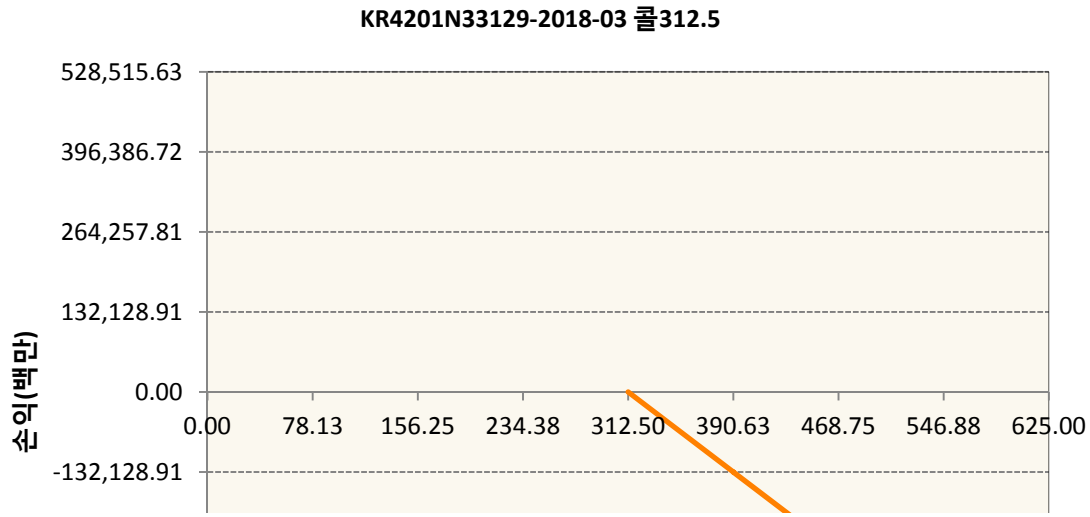
1. 계약금액

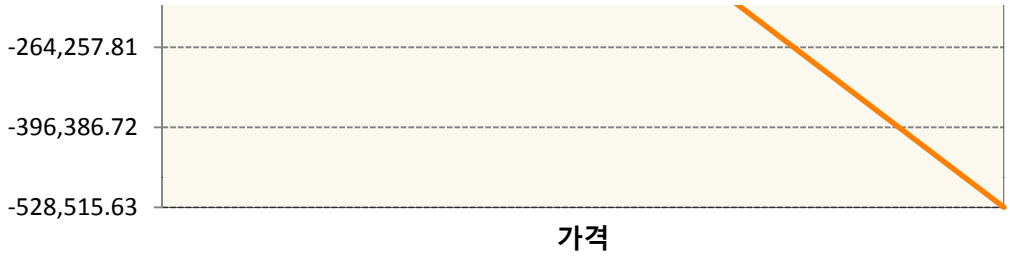
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,121,059	-1,121,059	장내

2. 만기시점의 손익구조



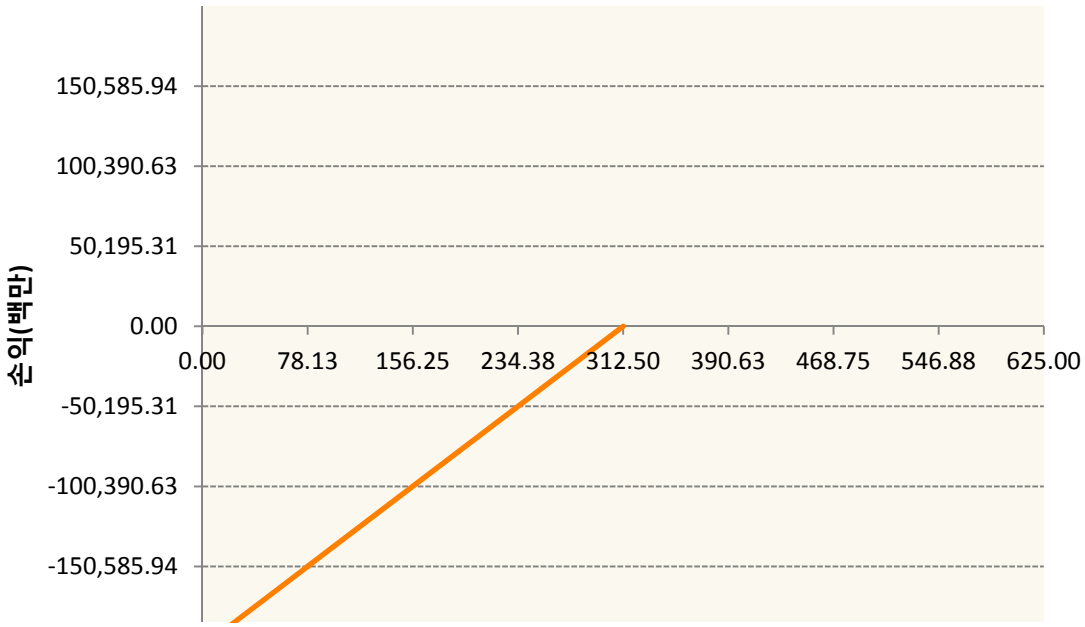




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N3312018-03 콜310							8,519
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,540	1,539	1,537	1,532	1,524	1,512	1,494
-5.33%	1,527	1,512	1,489	1,458	1,419	1,371	1,315
-2.67%	1,355	1,276	1,188	1,090	986	876	760
0%	461	308	154	0	-154	-309	-464
2.67%	-1,729	-1,848	-1,974	-2,104	-2,238	-2,375	-2,515
5.33%	-4,898	-4,937	-4,988	-5,050	-5,121	-5,201	-5,289
8.00%	-8,390	-8,396	-8,407	-8,424	-8,448	-8,480	-8,519
KR4201N3312018-03 콜312.5							31,104
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,397	4,395	4,391	4,381	4,363	4,332	4,288
-5.33%	4,376	4,346	4,293	4,215	4,109	3,972	3,806
-2.67%	4,021	3,809	3,552	3,255	2,924	2,564	2,177
0%	1,676	1,128	568	0	-575	-1,156	-1,741
2.67%	-5,320	-5,879	-6,449	-7,027	-7,612	-8,202	-8,797
5.33%	-16,859	-17,101	-17,388	-17,716	-18,079	-18,471	-18,889
8.00%	-30,345	-30,393	-30,469	-30,577	-30,719	-30,895	-31,104
KR4301N3312018-03 풋310							18,815
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18,813	-18,813	-18,813	-18,813	-18,813	-18,814	-18,815
-5.33%	-11,970	-11,971	-11,973	-11,977	-11,985	-11,997	-12,014
-2.67%	-5,175	-5,213	-5,265	-5,329	-5,405	-5,491	-5,588
0%	564	377	189	0	-190	-381	-572
2.67%	2,849	2,749	2,636	2,512	2,379	2,238	2,091
5.33%	3,080	3,073	3,060	3,040	3,011	2,973	2,925
8.00%	3,084	3,084	3,084	3,083	3,081	3,077	3,070
KR4301N3312018-03 풋312.5							15,062
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15,062	-15,062	-15,062	-15,062	-15,062	-15,062	-15,062
-5.33%	-9,780	-9,780	-9,781	-9,782	-9,784	-9,788	-9,795
-2.67%	-4,509	-4,521	-4,540	-4,567	-4,602	-4,645	-4,695
0%	360	246	125	0	-129	-261	-395
2.67%	2,999	2,881	2,757	2,629	2,498	2,363	2,226

5.33%	3,430	3,414	3,390	3,358	3,317	3,267	3,209
8.00%	3,444	3,444	3,443	3,440	3,436	3,429	3,418

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

84,955

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

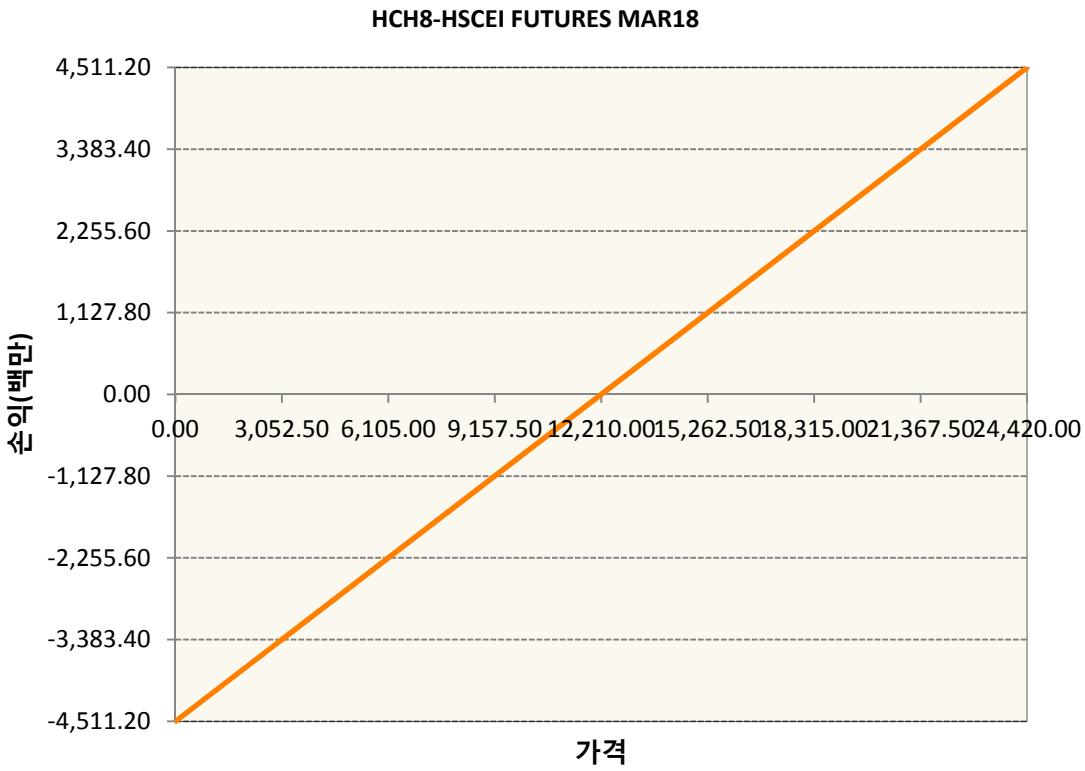
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

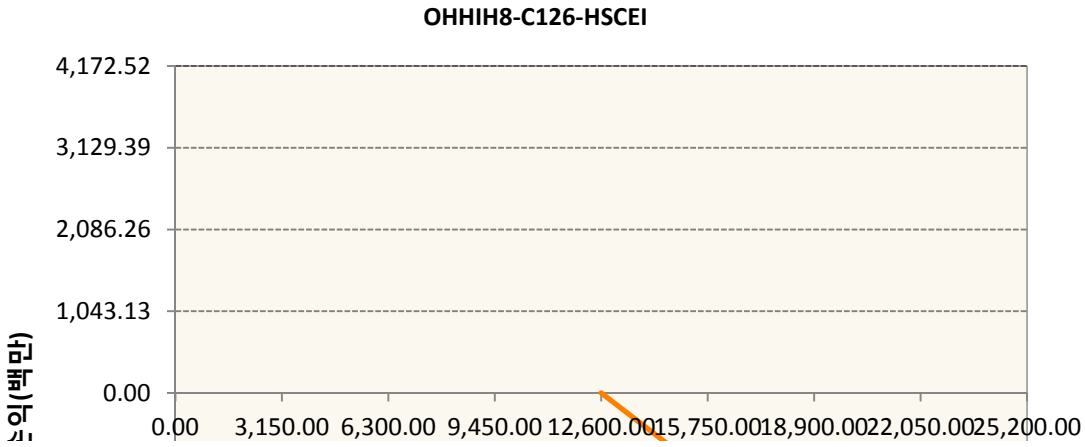
1. 계약금액

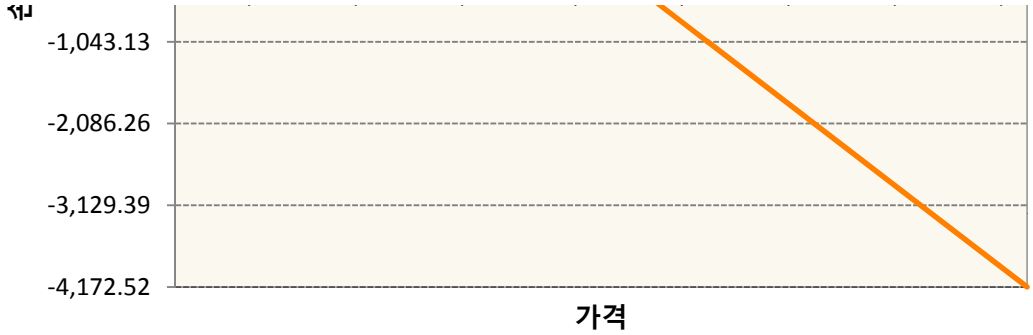
(단위:백만원)

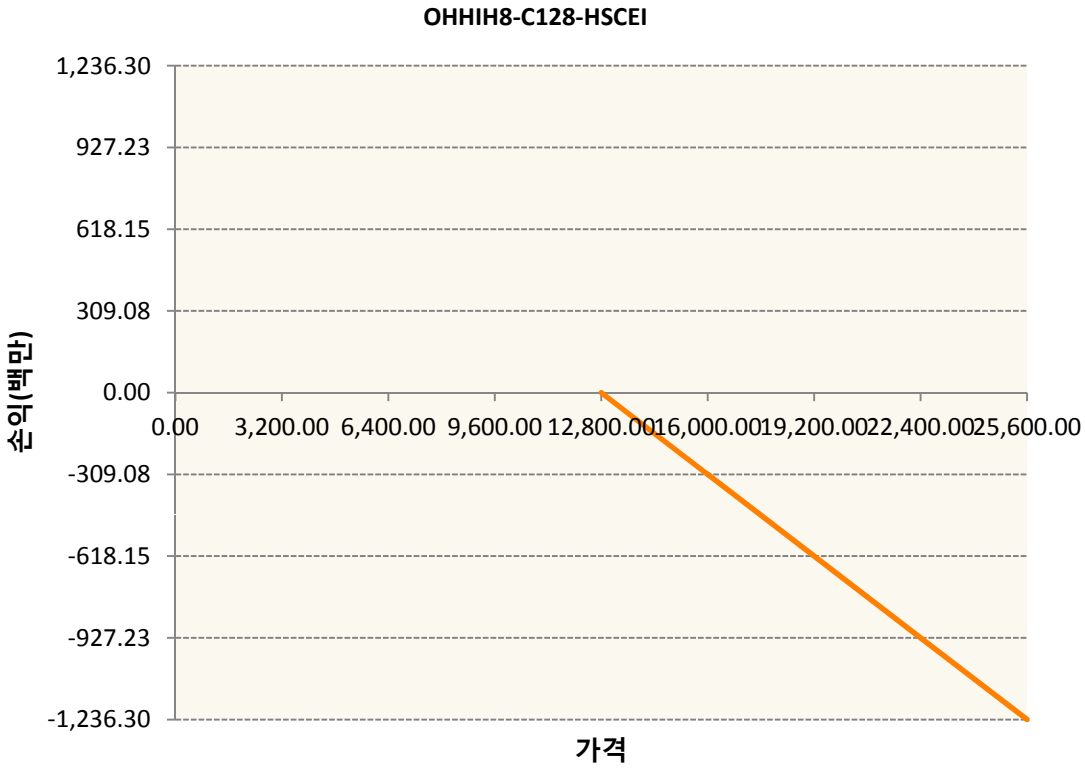
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,511	0	4,511	장내
누계	유가증권	옵션	0	10,818	-10,818	장내

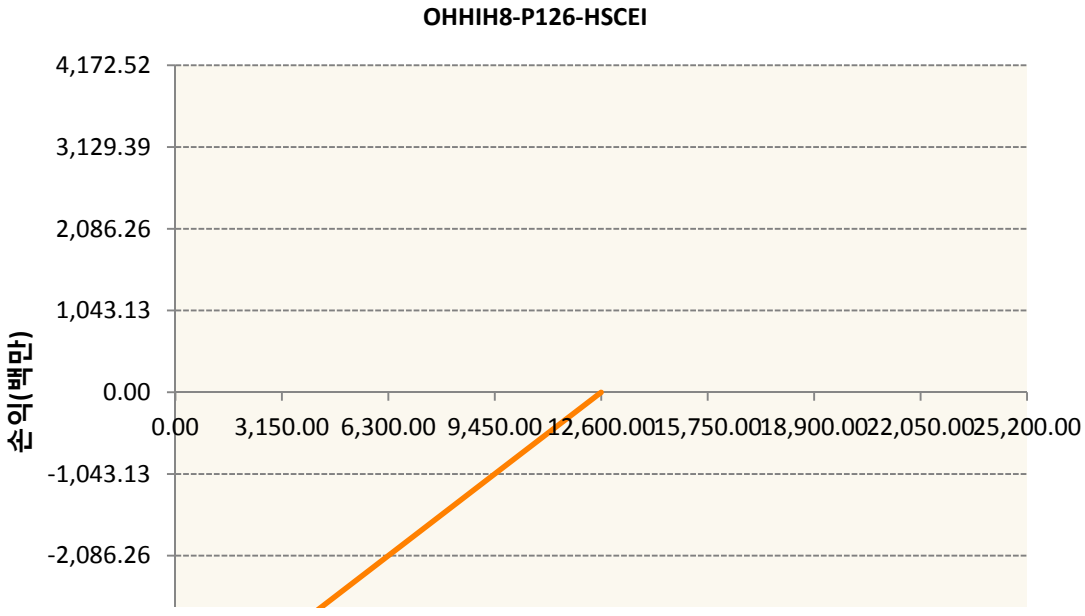
2. 만기시점의 손익구조

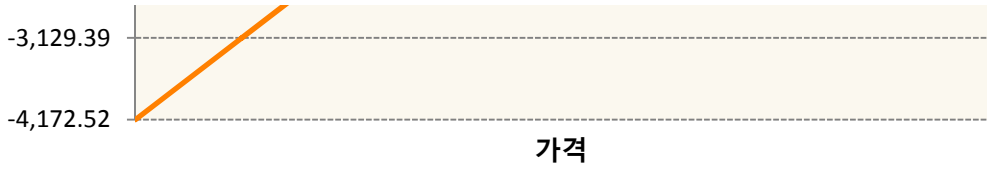


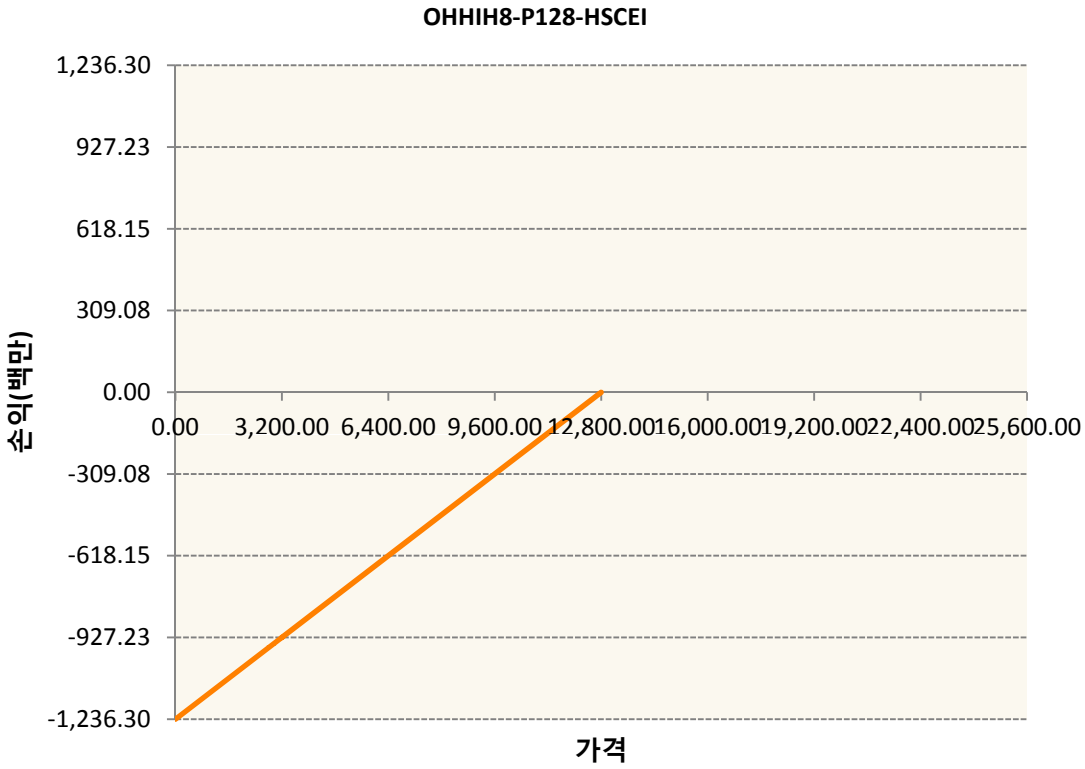



-1,043.13
-2,086.26
-3,129.39
-4,172.52
가격


OHHIH8-C128-HSCEI
1,236.30
927.23
618.15
309.08
0.00
-309.08
-618.15
-927.23
-1,236.30
0.00
3,200.00
6,400.00
9,600.00
12,800.00
16,000.00
19,200.00
22,400.00
25,600.00
손익(백만)
가격


OHHIH8-P126-HSCEI
4,172.52
3,129.39
2,086.26
1,043.13
0.00
-1,043.13
-2,086.26
0.00
3,150.00
6,300.00
9,450.00
12,600.00
15,750.00
18,900.00
22,050.00
25,200.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCH8	HSCEI FUTURES MAR18	361
OHHIH8-C12	HSCEI	334
OHHIH8-C12	HSCEI	99
OHHIH8-P12	HSCEI	334
OHHIH8-P12	HSCEI	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,063

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

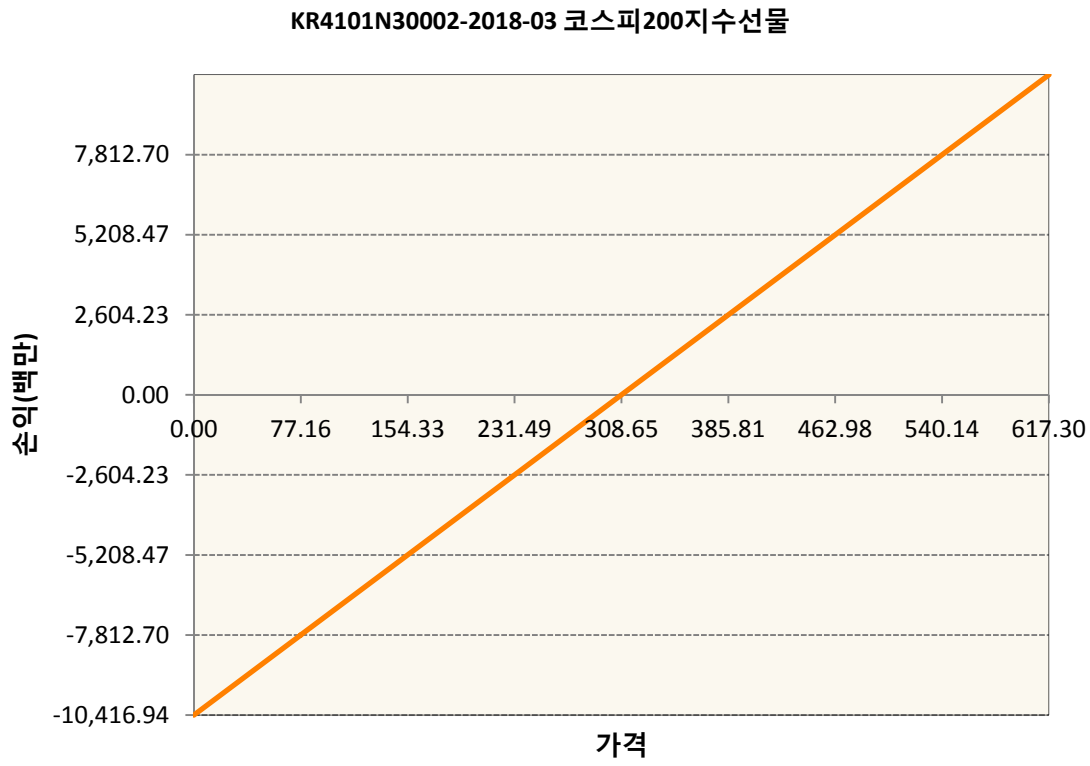
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

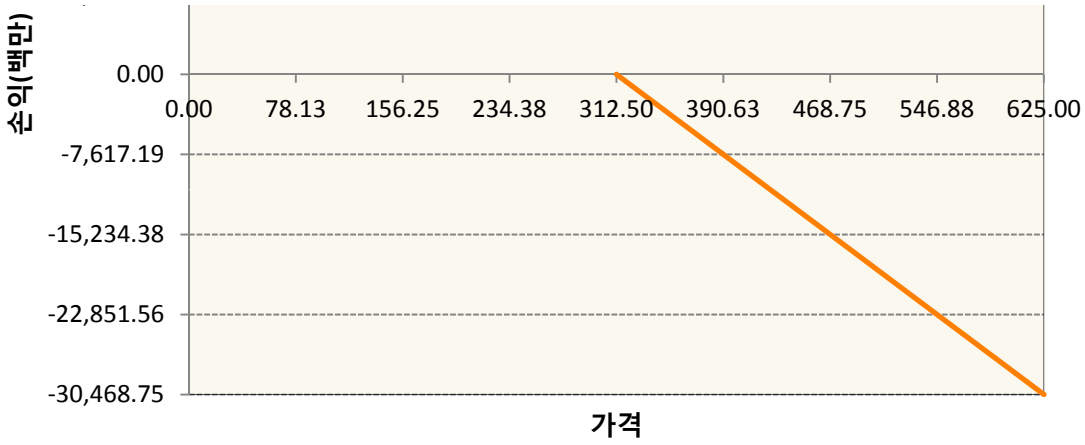
(단위:백만원)

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	10,417	0	10,417	장내
누계	유가증권	스왑	56,200	0	56,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	55,313	-55,313	장내

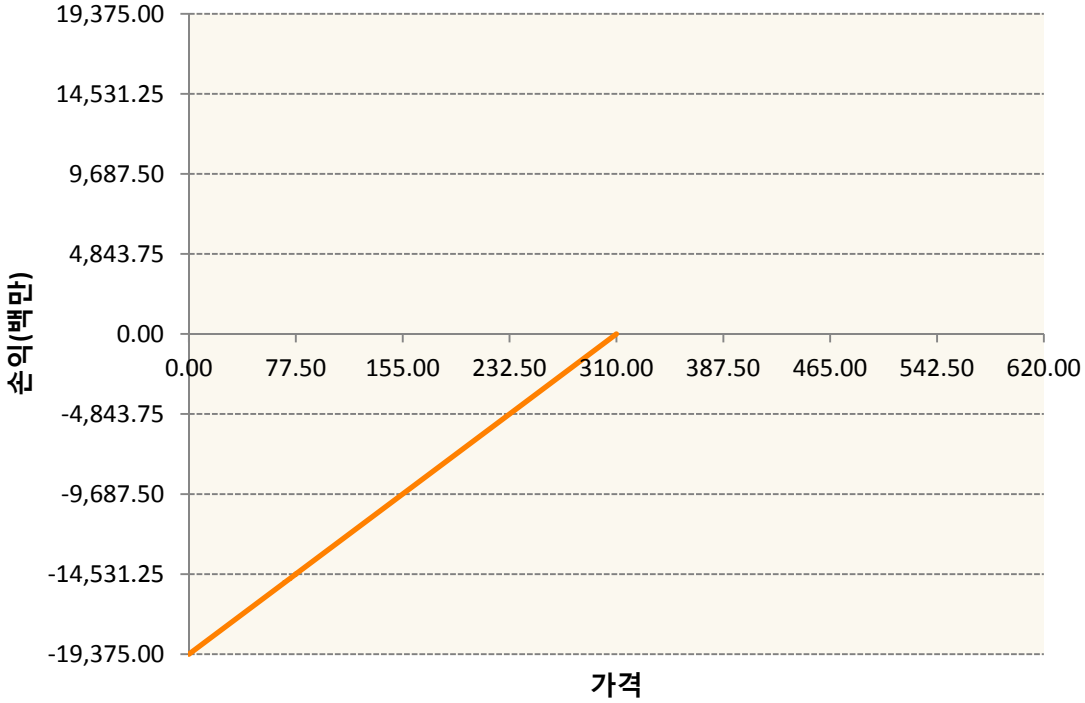
2. 만기시점의 손익구조



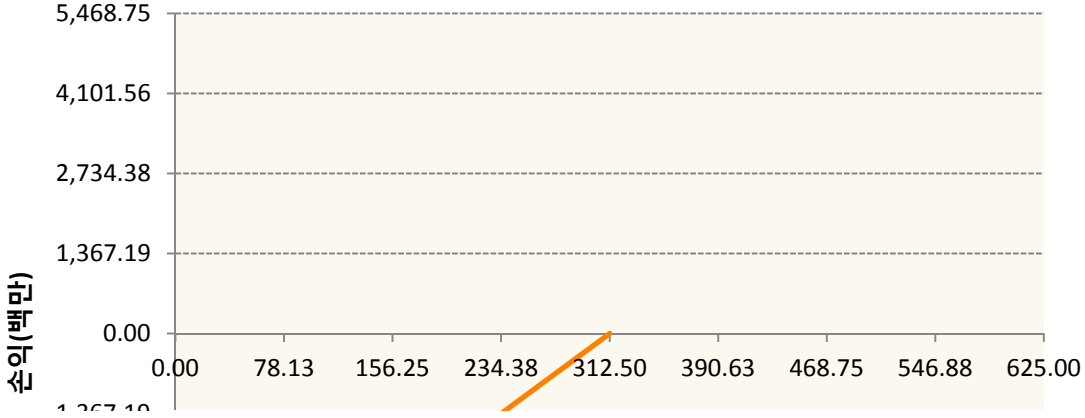




KR4301N33101-2018-03 풋310



KR4301N33127-2018-03 풋312.5





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(	2018-03	코스피200지수선물					833
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-833	-833	-833	-833	-833	-833	-833
-5.33%	-555	-555	-555	-555	-555	-555	-555
-2.67%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	278	278	278	278	278	278	278
5.33%	555	555	555	555	555	555	555
8.00%	833	833	833	833	833	833	833
KR4201N331	2018-03	콜312.5					1,793
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	253	253	253	253	251	250	247
-5.33%	252	251	248	243	237	229	219
-2.67%	232	220	205	188	169	148	126
0%	97	65	33	0	-33	-67	-100
2.67%	-307	-339	-372	-405	-439	-473	-507
5.33%	-972	-986	-1,002	-1,021	-1,042	-1,065	-1,089
8.00%	-1,749	-1,752	-1,757	-1,763	-1,771	-1,781	-1,793
KR4301N331	2018-03	풋310					1,413
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	-1,413
-5.33%	-899	-899	-899	-899	-900	-901	-902
-2.67%	-389	-391	-395	-400	-406	-412	-419
0%	42	28	14	0	-14	-29	-43
2.67%	214	206	198	189	179	168	157
5.33%	231	231	230	228	226	223	220
8.00%	232	232	232	231	231	231	230
	KR4301N3312018-03 풋312.5						410
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-410	-410	-410	-410	-410	-410	-410
-5.33%	-266	-266	-266	-266	-266	-267	-267
-2.67%	-123	-123	-124	-124	-125	-127	-128
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11
2.67%	82	78	75	72	68	64	61
5.33%	93	93	92	91	90	89	87
8.00%	94	94	94	94	94	93	93

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

9,193

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

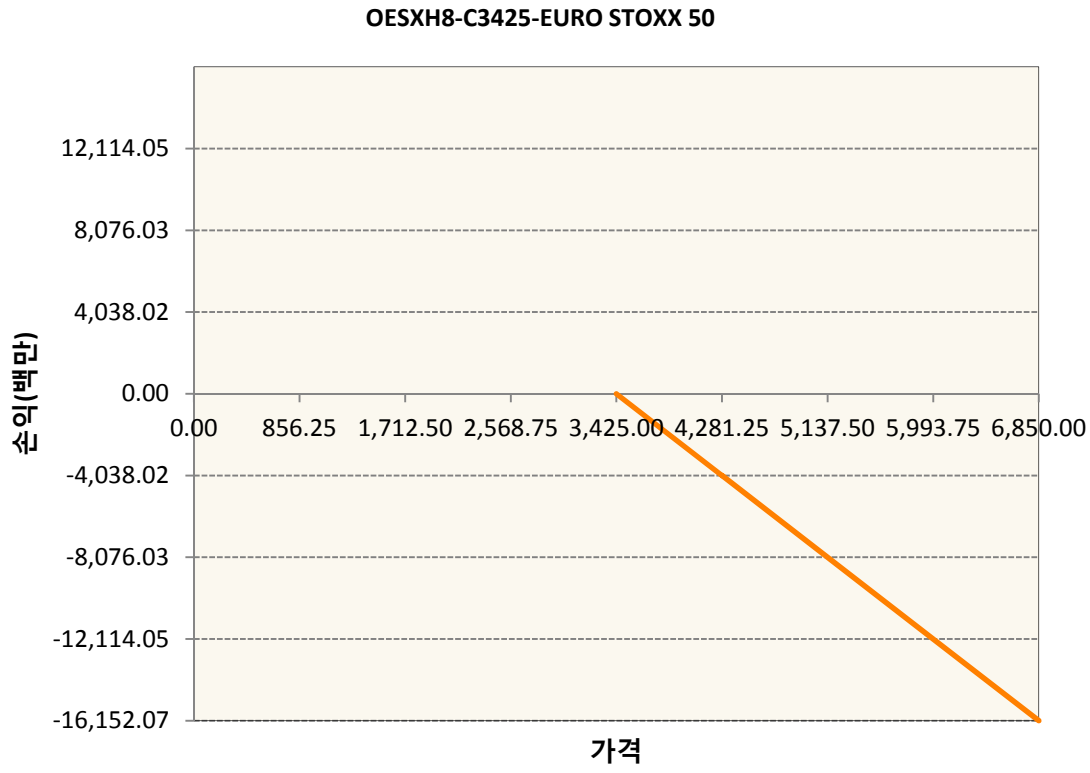
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

1. 계약금액

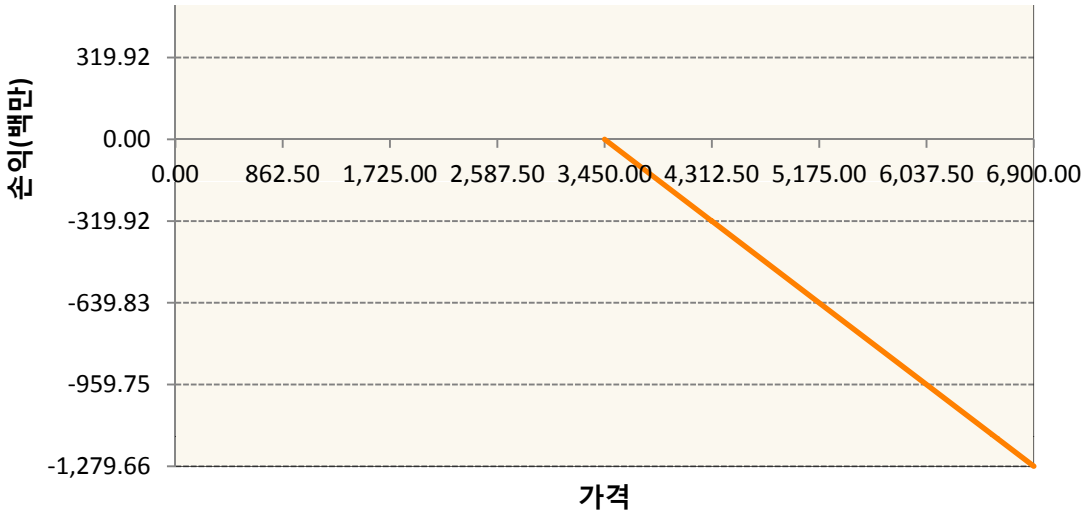
(단위:백만원)

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	9,168	0	9,168	
누계	유가증권	스왑	99,350	0	99,350	장외
누계	유가증권	옵션	0	34,863	-34,863	장내
누계	지수	스왑	52,987	0	52,987	장외

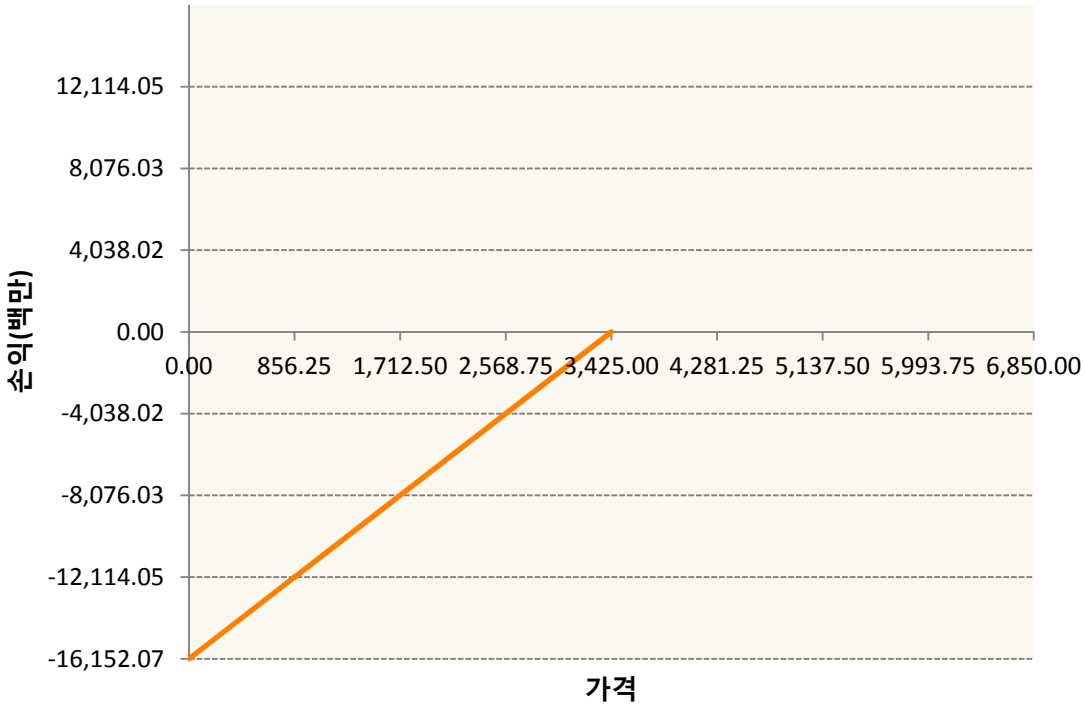
2. 만기시점의 손익구조



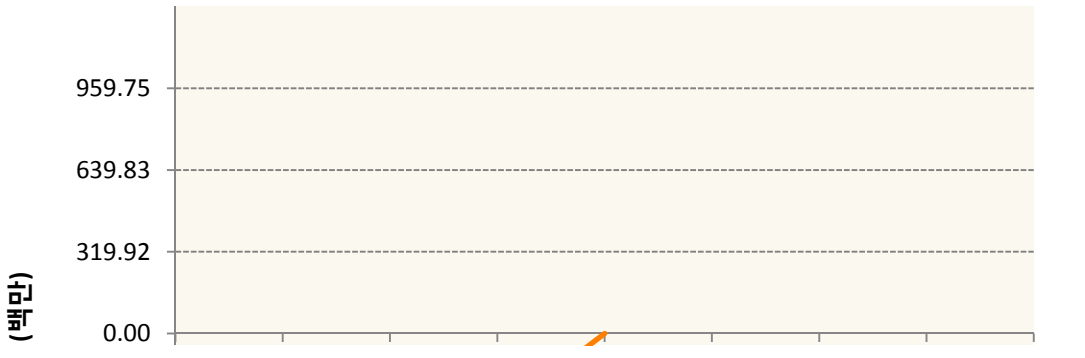


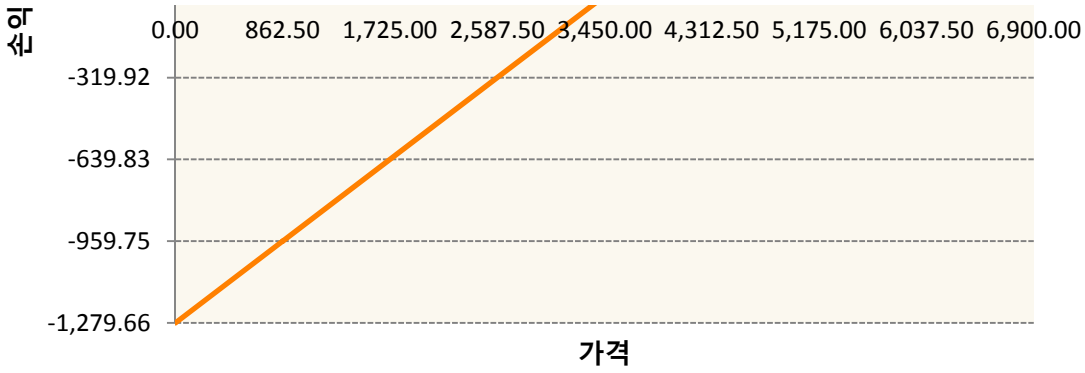


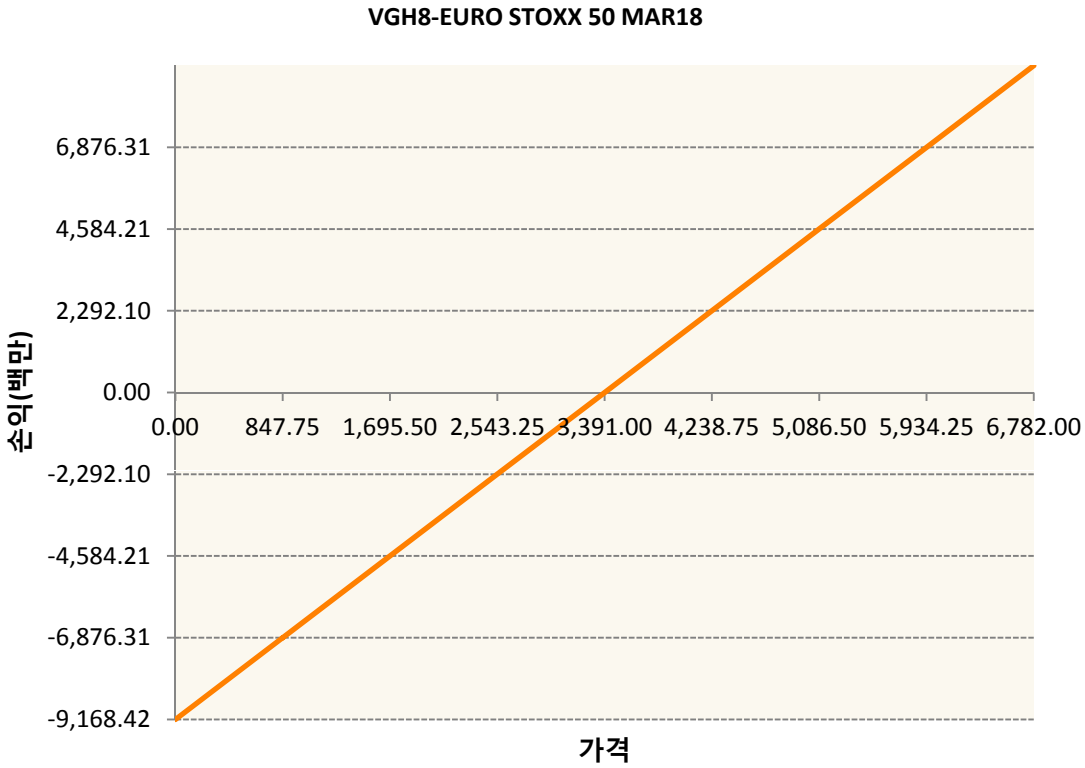
OESXH8-P3425-EURO STOXX 50



OESXH8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	226
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	423
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	1,292
OESXH8-C34 EURO STOXX 50	102
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	1,292
OESXH8-P34 EURO STOXX 50	102
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	733

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

2,469

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

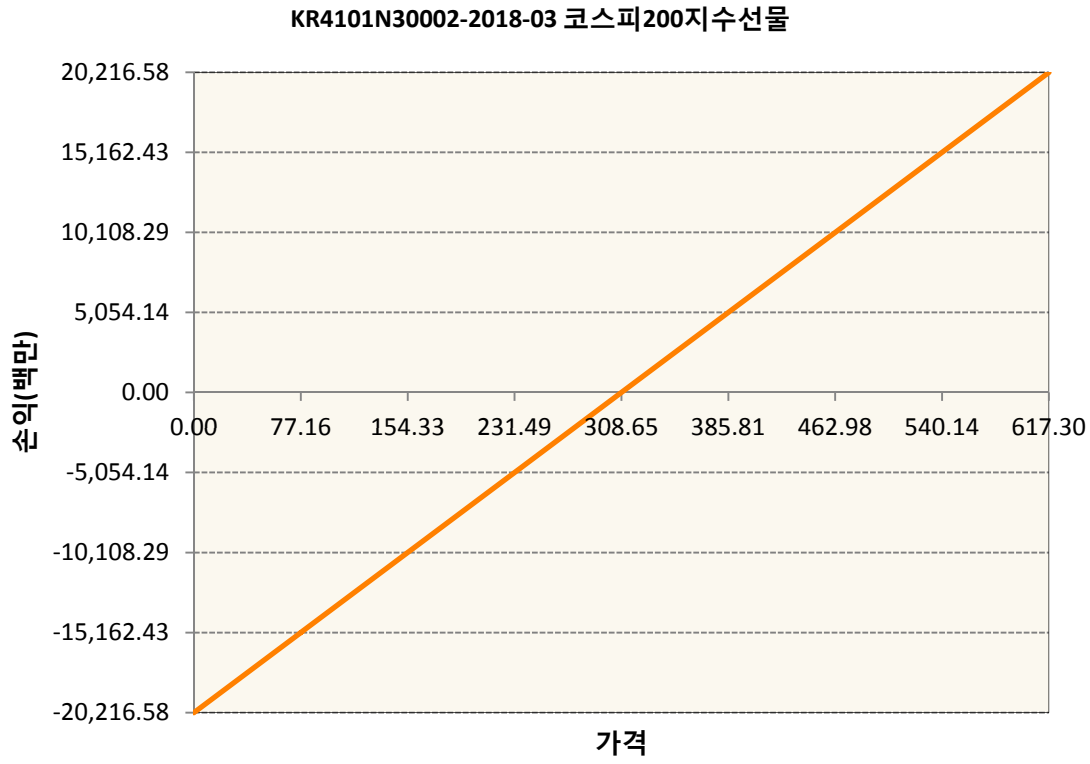
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,217	0	20,217	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,616
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,616	-1,616	-1,616	-1,616	-1,616	-1,616	-1,616
-5.33%	-1,077	-1,077	-1,077	-1,077	-1,077	-1,077	-1,077
-2.67%	-539	-539	-539	-539	-539	-539	-539
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	539	539	539	539	539	539	539
5.33%	1,077	1,077	1,077	1,077	1,077	1,077	1,077
8.00%	1,616	1,616	1,616	1,616	1,616	1,616	1,616

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

1,098

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

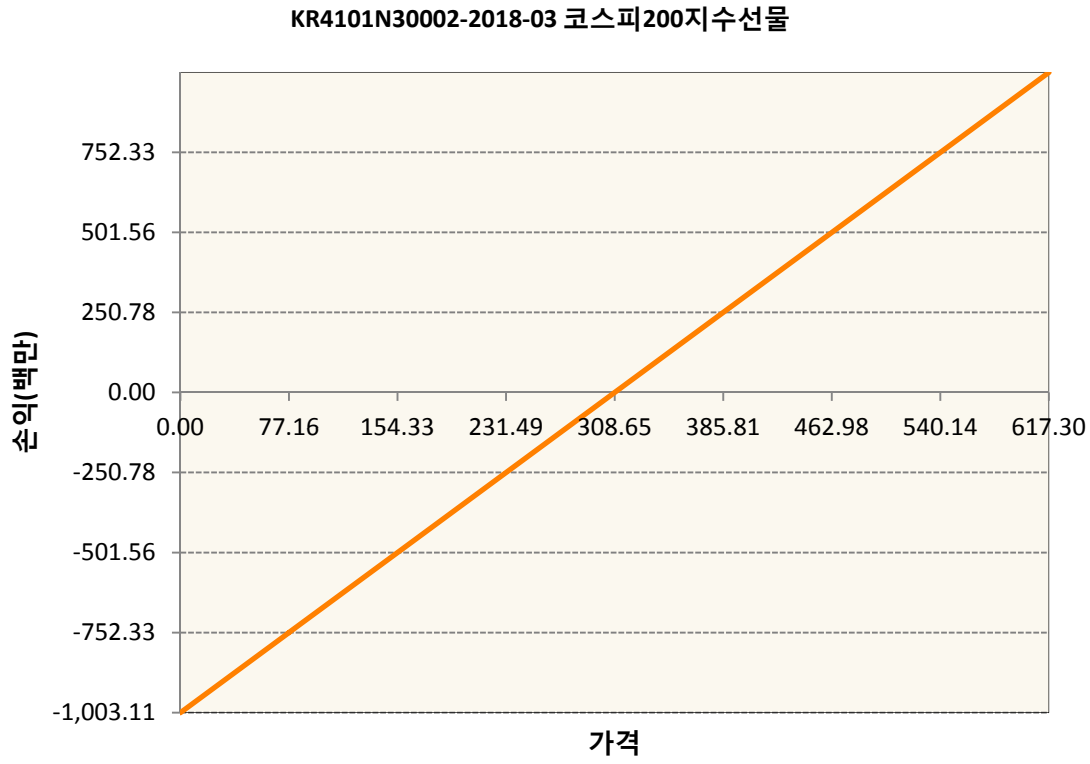
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,003	0	1,003	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

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

54

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

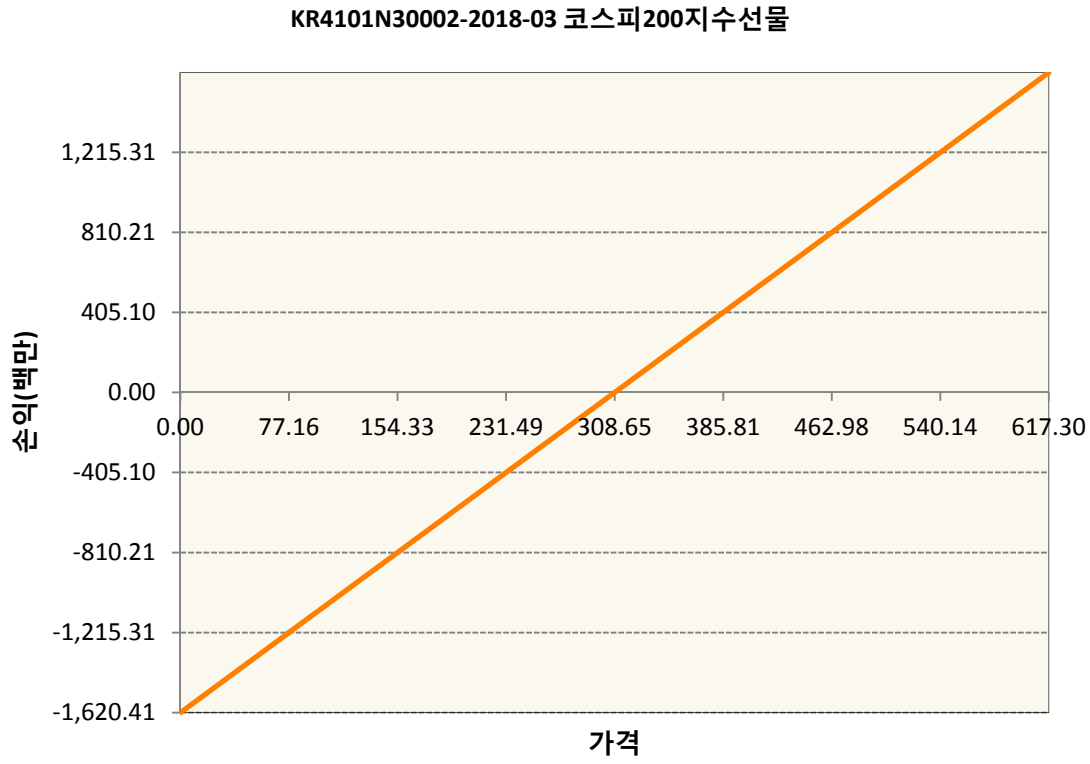
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,620	0	1,620	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	130	130	130	130	130	130	130

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

88

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

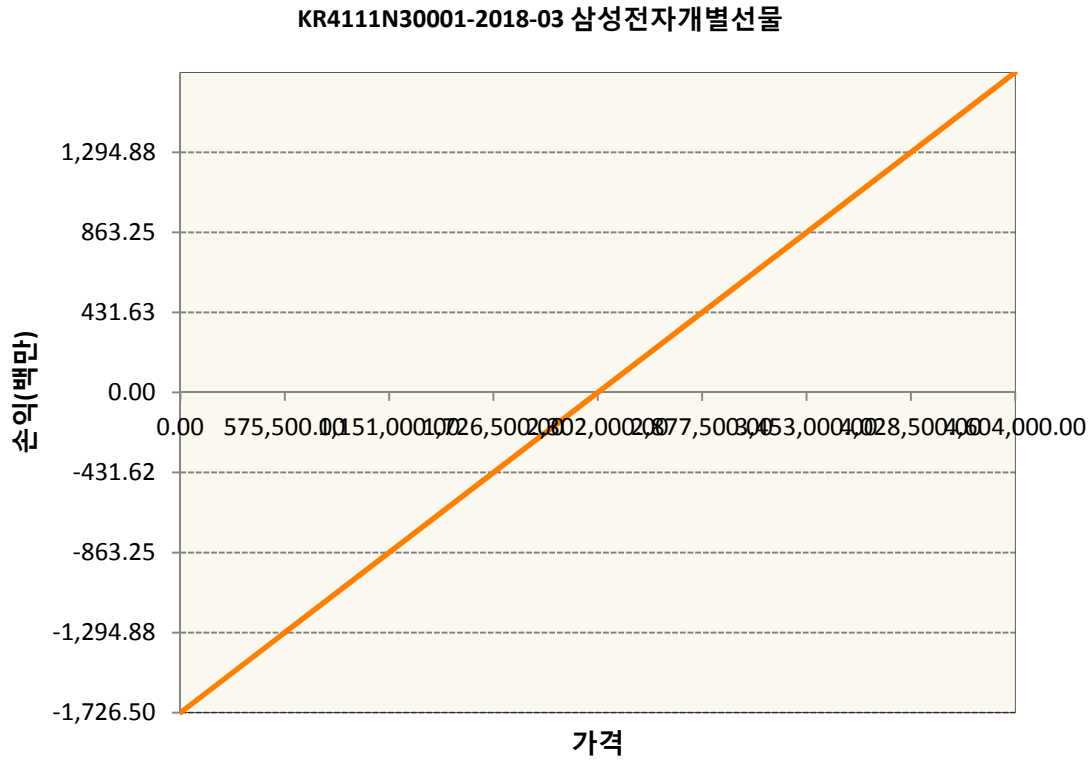
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	231	0	231	장내
누계	유가증권	선물	1,727	0	1,727	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N30(2018-03 삼성전자개별선물							138
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	92	92	92	92	92	92	92
8.00%	138	138	138	138	138	138	138

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

163

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

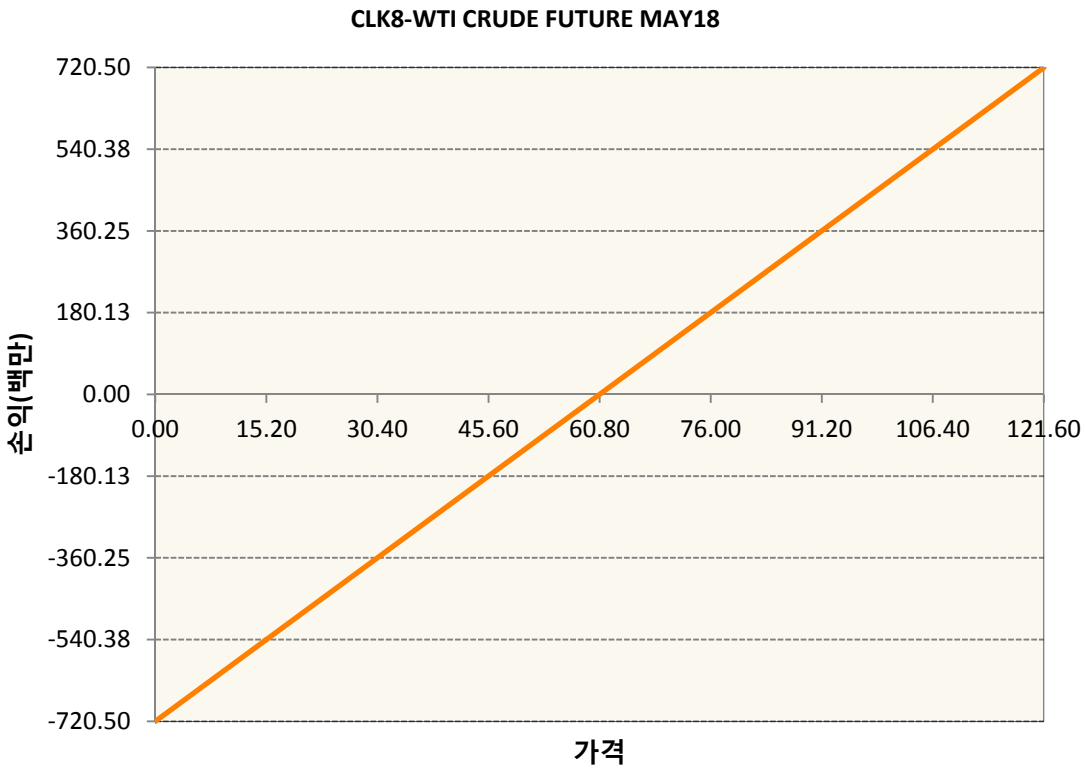
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

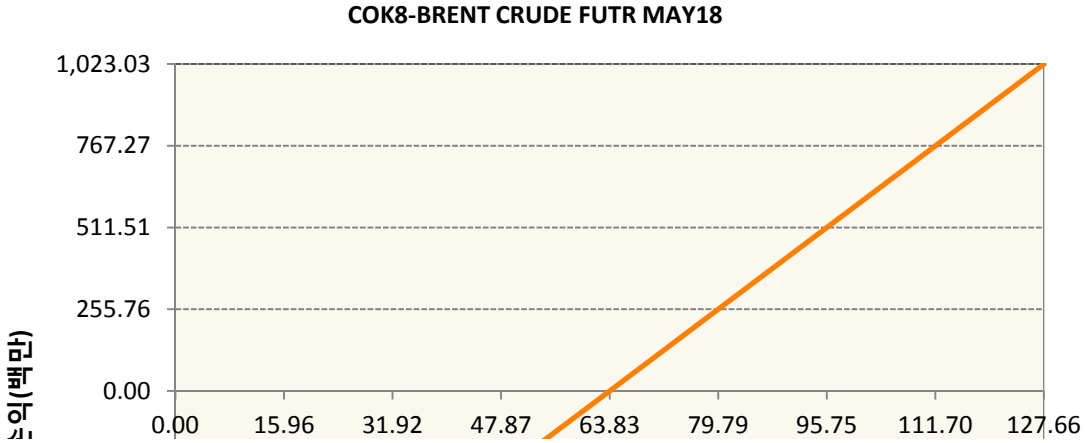
1. 계약금액

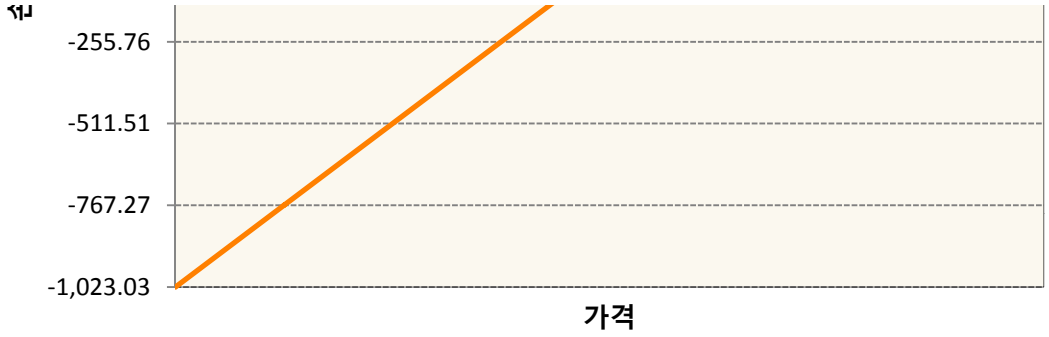
(단위:백만원)

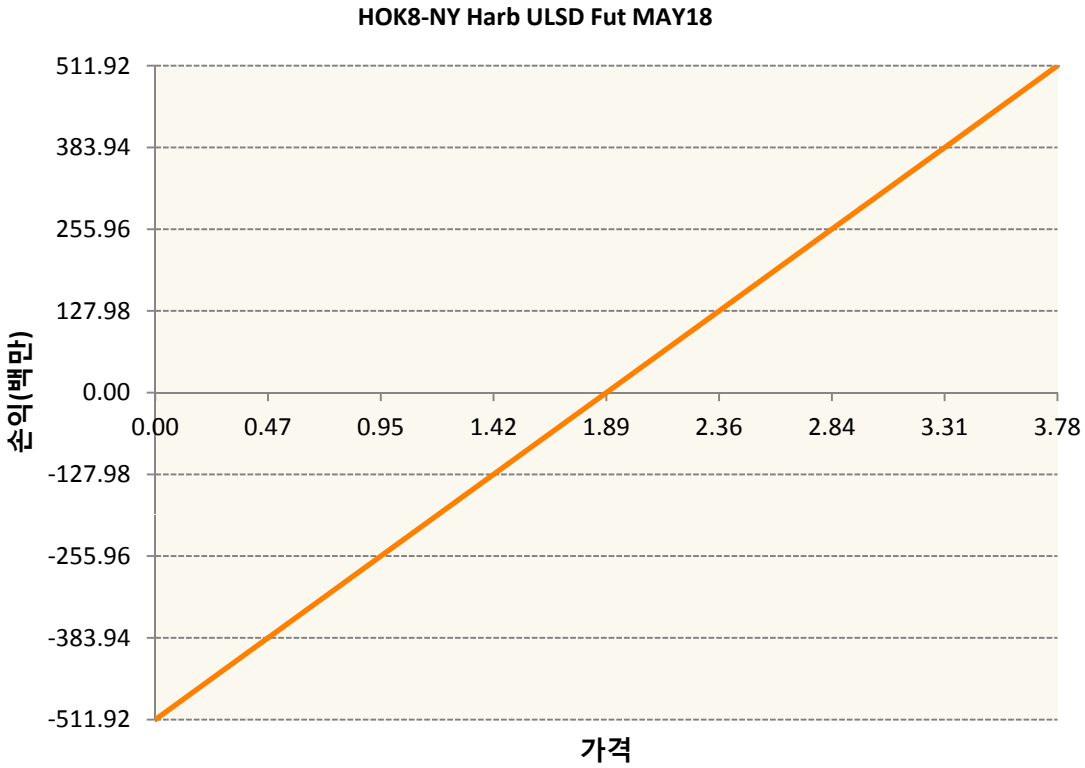
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	721	0	721	
누계	유가증권	선물	3,198	594	2,604	

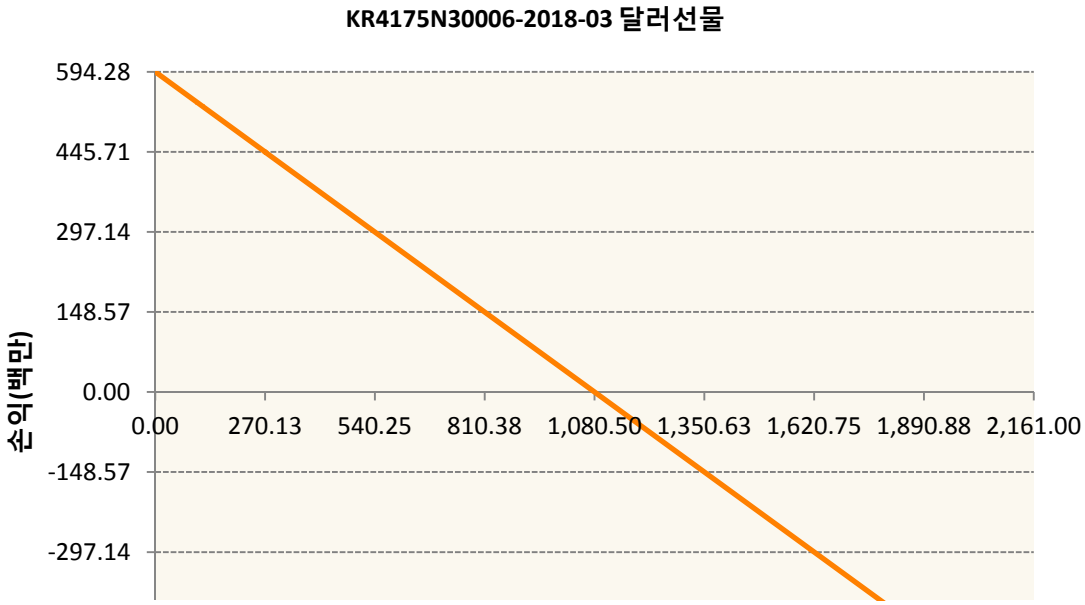
2. 만기시점의 손익구조

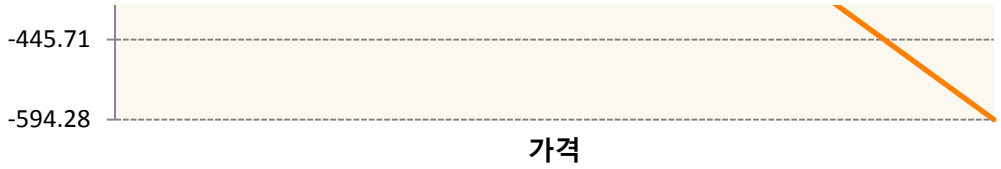


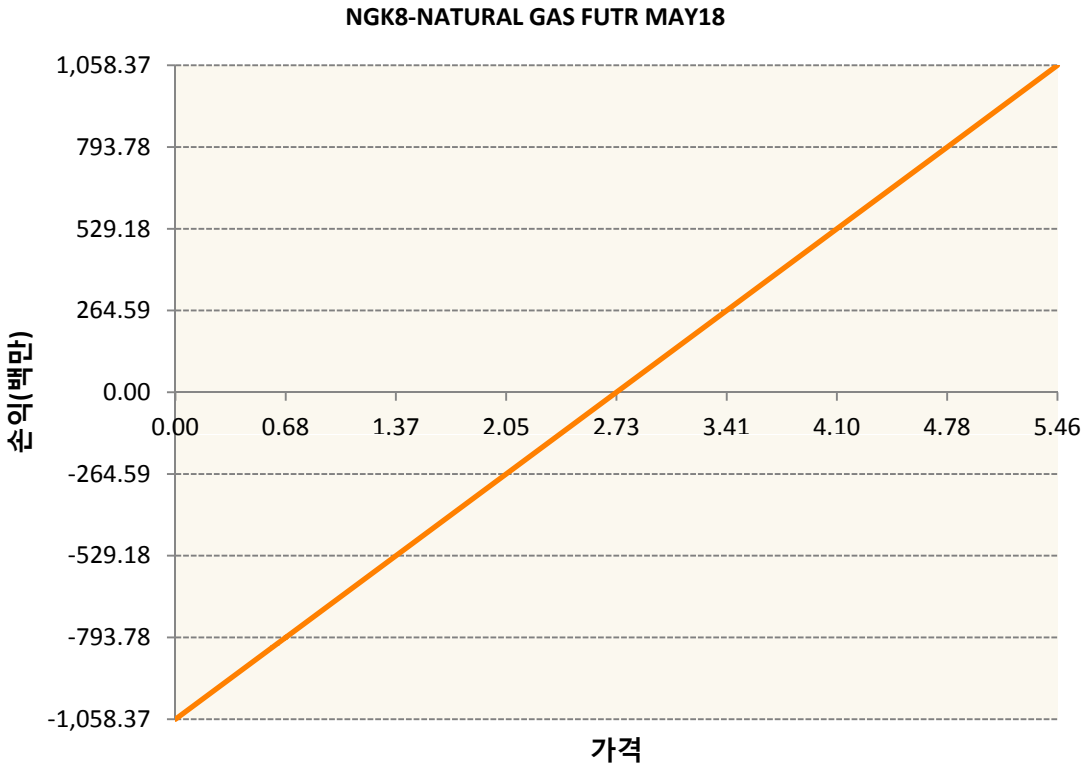


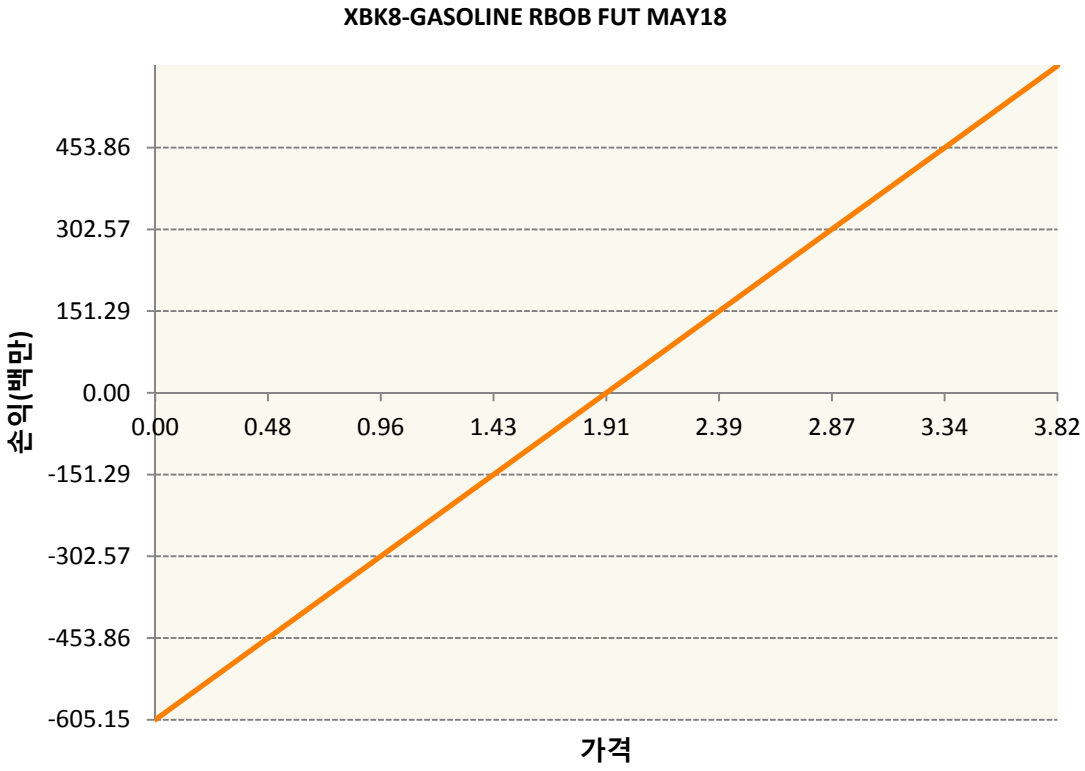

-255.76
-511.51
-767.27
-1,023.03
가격


HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
511.92
383.94
255.96
127.98
0.00
-127.98
-255.96
-383.94
-511.92
0.00
0.47
0.95
1.42
1.89
2.36
2.84
3.31
3.78
손익(백만)
가격


KR4175N30006-2018-03 달러선물
594.28
445.71
297.14
148.57
0.00
-148.57
-297.14
0.00
270.13
540.25
810.38
1,080.50
1,350.63
1,620.75
1,890.88
2,161.00
손익(백만)


-445.71
-594.28
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,058.37
793.78
529.18
264.59
0.00
-264.59
-529.18
-793.78
-1,058.37
0.00
0.68
1.37
2.05
2.73
3.41
4.10
4.78
5.46
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
453.86
302.57
151.29
0.00
-151.29
-302.57
-453.86
-605.15
0.00
0.48
0.96
1.43
1.91
2.39
2.87
3.34
3.82
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	58
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	82
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	41
KR4175N30(	2018-03 달러선물	48
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	85
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	48

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

518

공시일	2018-03-05
기준일	2018-03-02

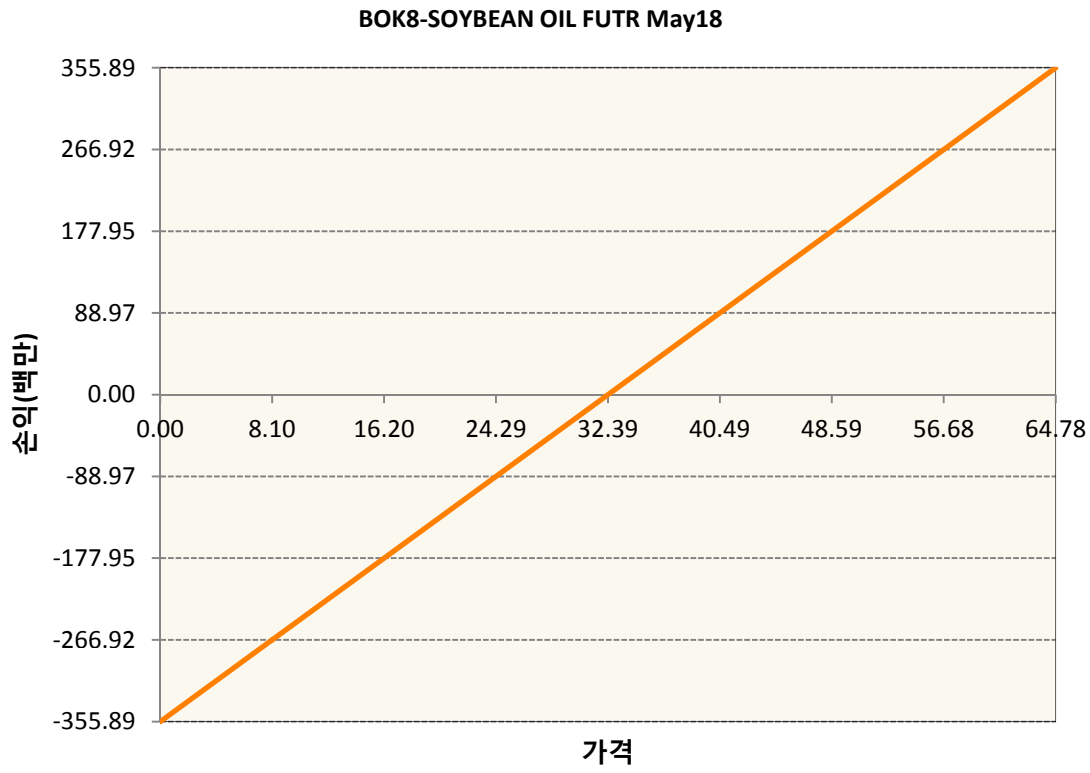
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

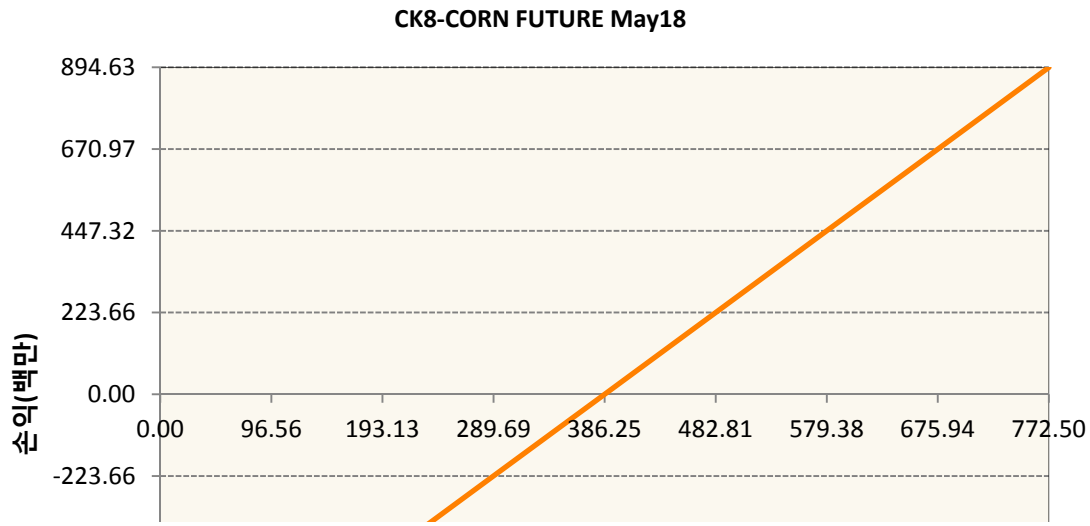
1. 계약금액

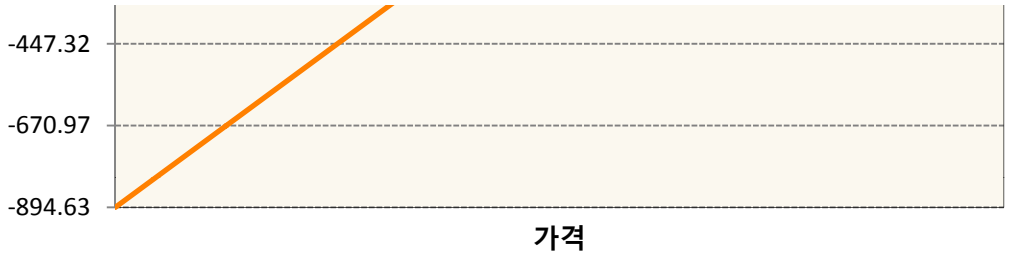
(단위:백만원)

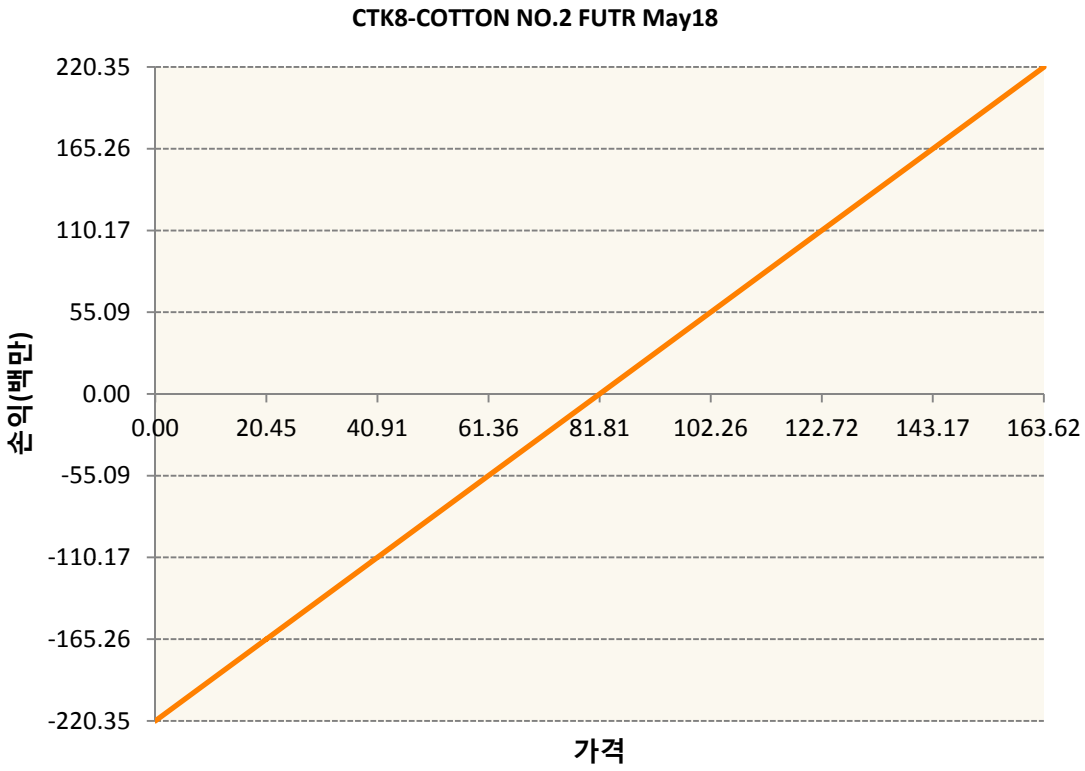
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,300	324	3,976	

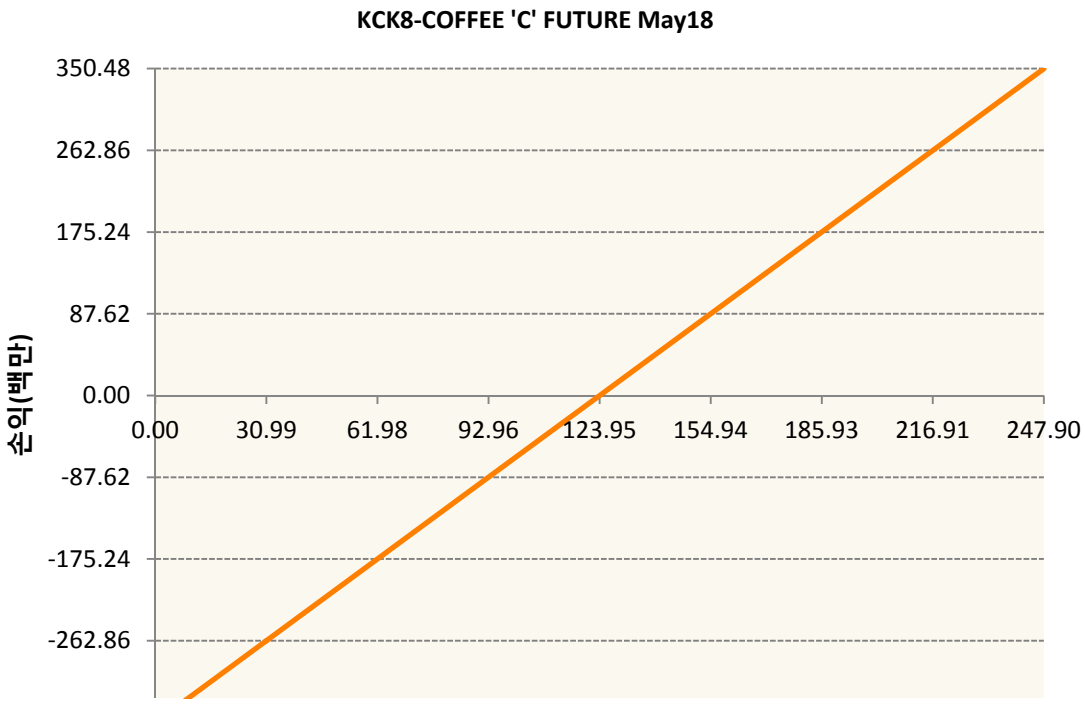
2. 만기시점의 손익구조

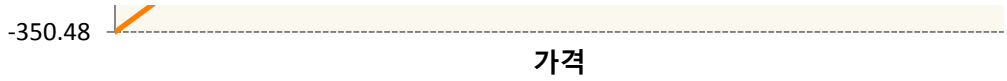


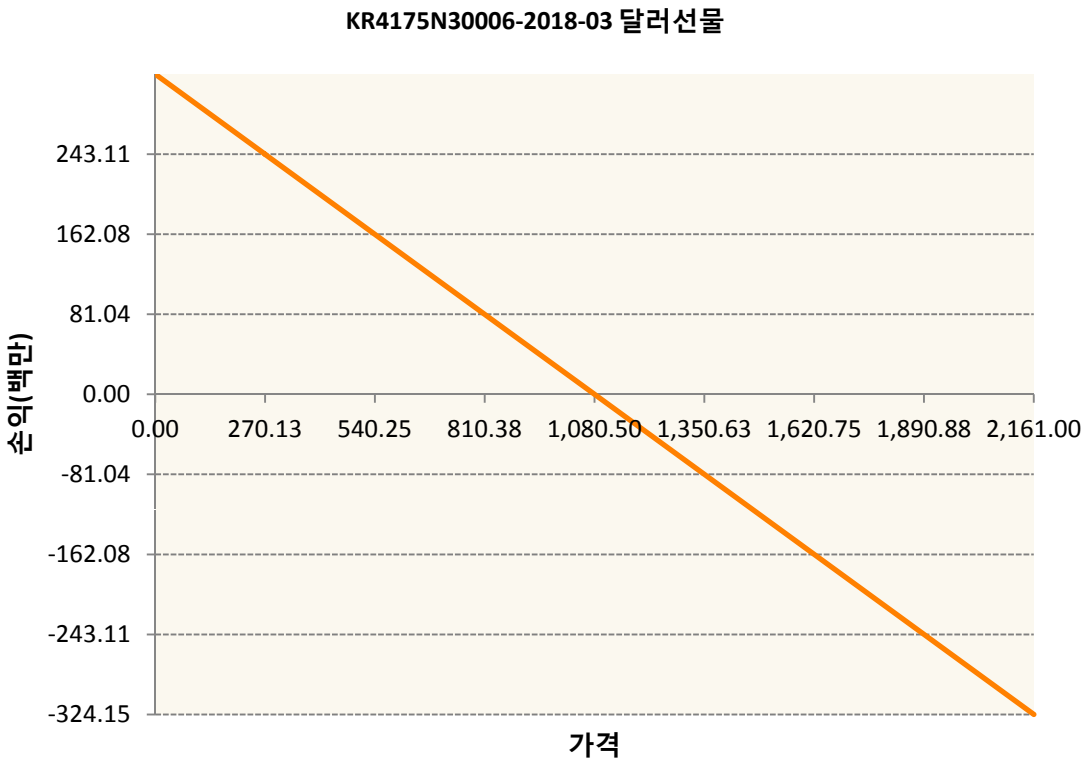


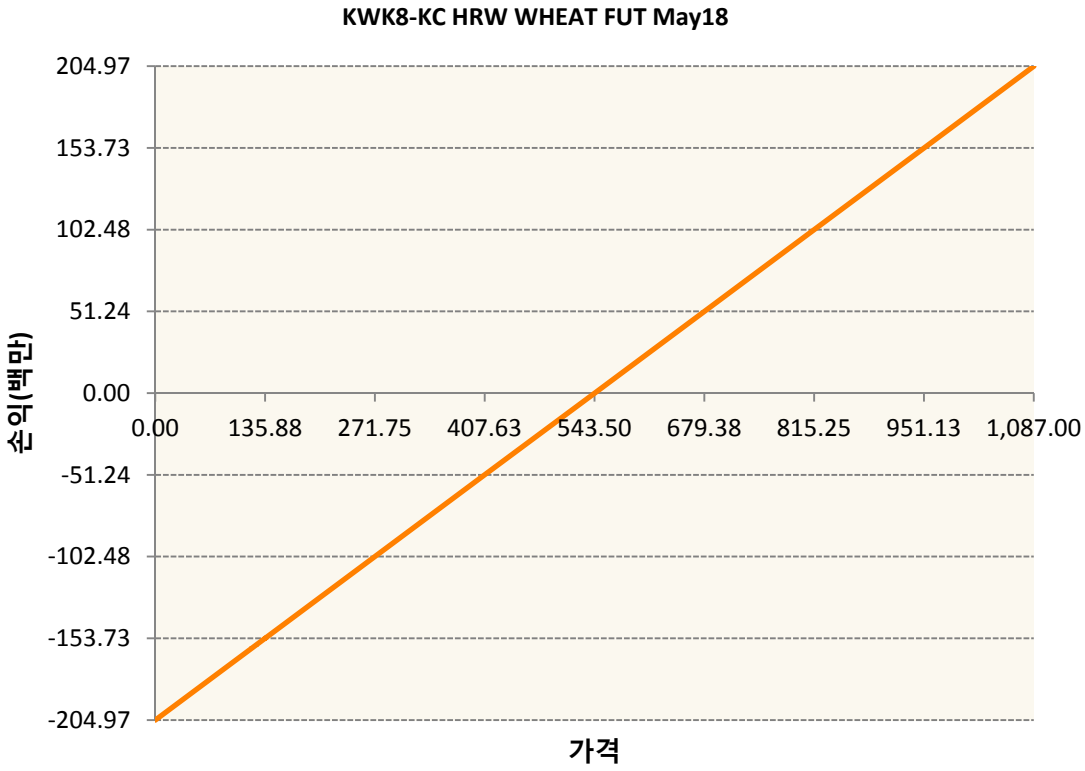

-447.32
-670.97
-894.63
가격

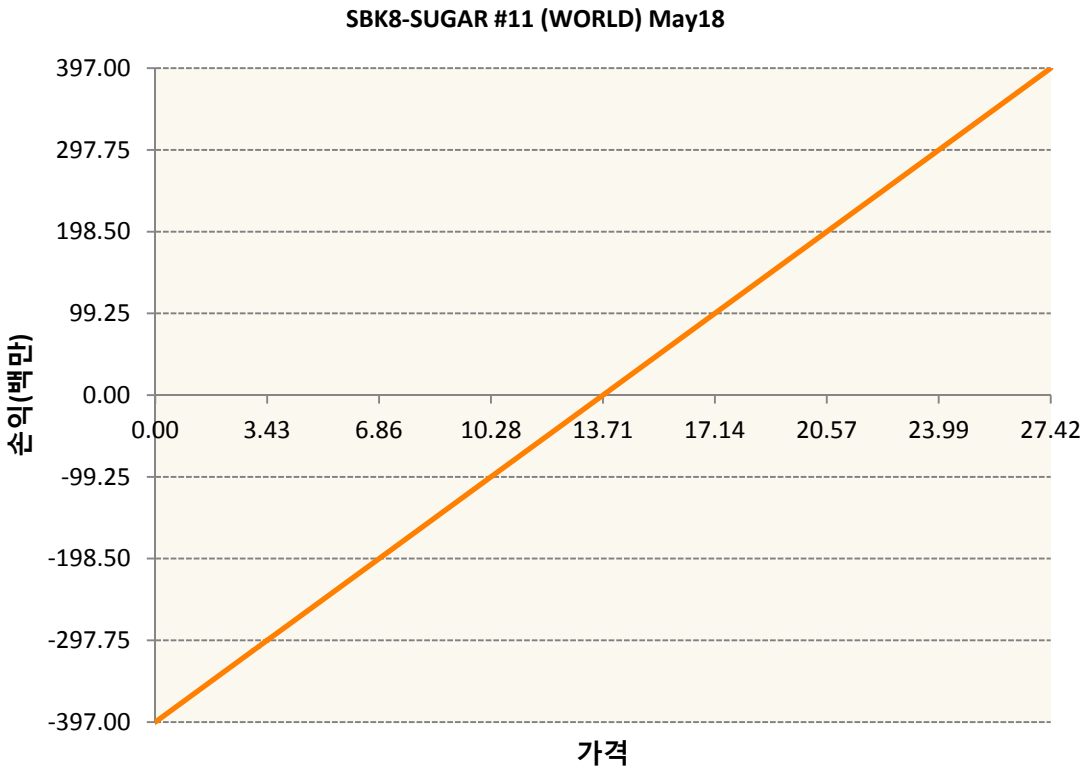

CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
220.35
165.26
110.17
55.09
0.00
-55.09
-110.17
-165.26
-220.35
0.00
20.45
40.91
61.36
81.81
102.26
122.72
143.17
163.62
손익(백만)
가격

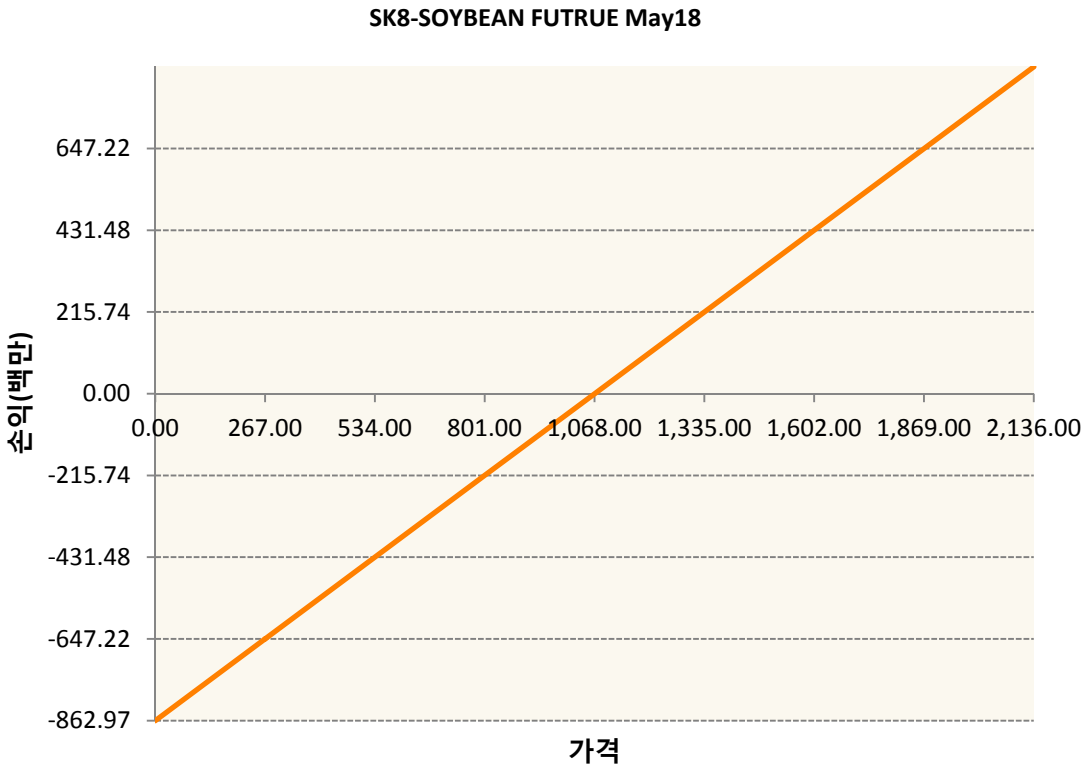

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
350.48
262.86
175.24
87.62
0.00
-87.62
-175.24
-262.86
0.00
30.99
61.98
92.96
123.95
154.94
185.93
216.91
247.90
손익(백만)


-350.48
가격

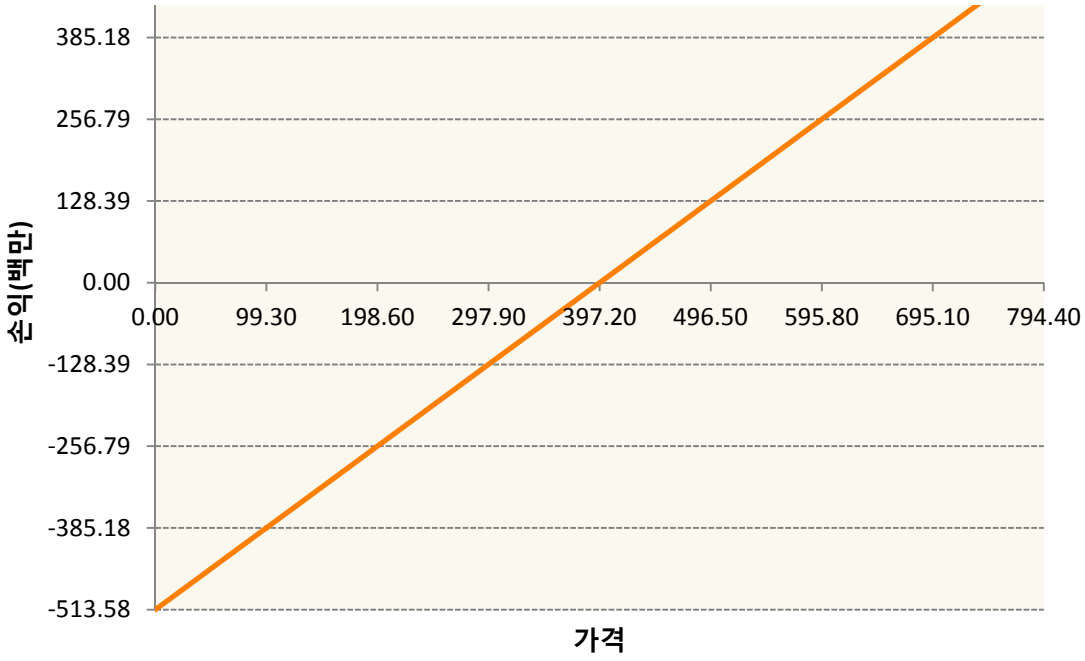

KR4175N30006-2018-03 달러선물
243.11
162.08
81.04
0.00
-81.04
-162.08
-243.11
-324.15
0.00
270.13
540.25
810.38
1,080.50
1,350.63
1,620.75
1,890.88
2,161.00
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
204.97
153.73
102.48
51.24
0.00
-51.24
-102.48
-153.73
-204.97
0.00
135.88
271.75
407.63
543.50
679.38
815.25
951.13
1,087.00
손익(백만)
가격

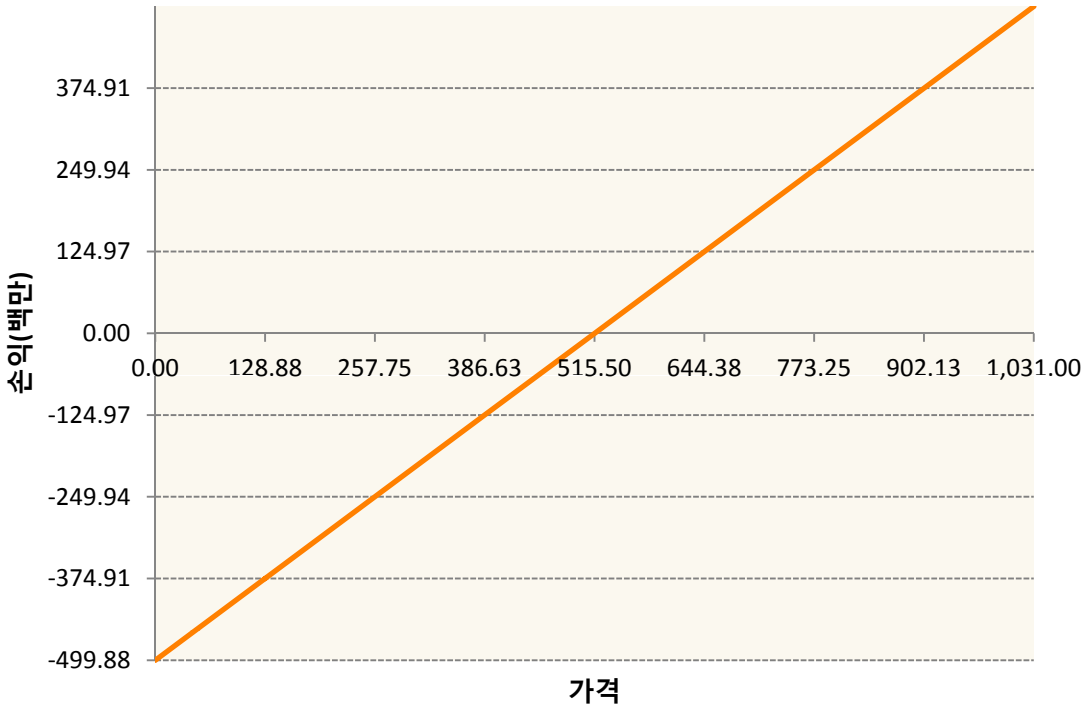

SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18
397.00
297.75
198.50
99.25
0.00
-99.25
-198.50
-297.75
-397.00
0.00
3.43
6.86
10.28
13.71
17.14
20.57
23.99
27.42
손익(백만)
가격


SK8-SOYBEAN FUTRUE May18
647.22
431.48
215.74
0.00
-215.74
-431.48
-647.22
-862.97
0.00
267.00
534.00
801.00
1,068.00
1,335.00
1,602.00
1,869.00
2,136.00
손익(백만)
가격


SMK8-SOYBEAN MEAL FUTR May18



WK8-WHEAT FUTURE(CBT) May18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOK8	SOYBEAN OIL FUTR May18	28
CK8	CORN FUTURE May18	72
CTK8	COTTON NO.2 FUTR May18	18
KCK8	COFFEE 'C' FUTURE May18	28
KR4175N30(	2018-03 달러선물	26

KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	16
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	32
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	69
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	41
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	40

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

350