공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

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	2018-04-13
기준일	2018-04-12

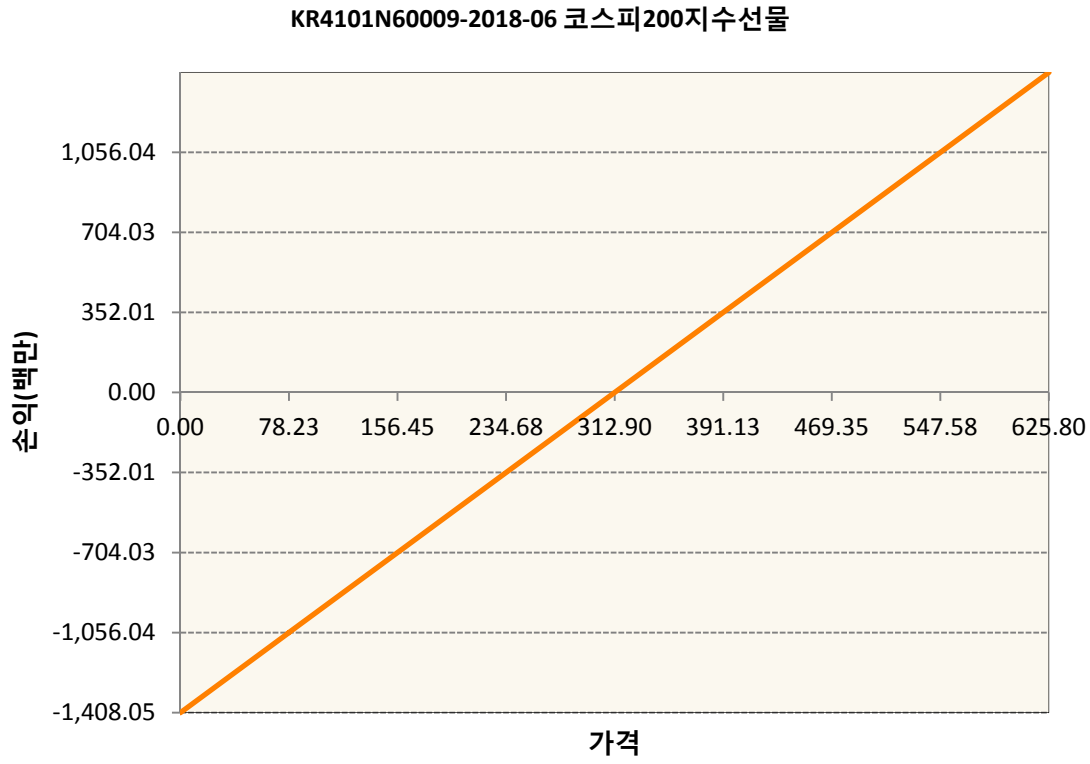
스마트인덱스모

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	1,408	0	1,408	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

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

82

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

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	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)

445

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

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	5,081	0	5,081	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S180308	406

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

438

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

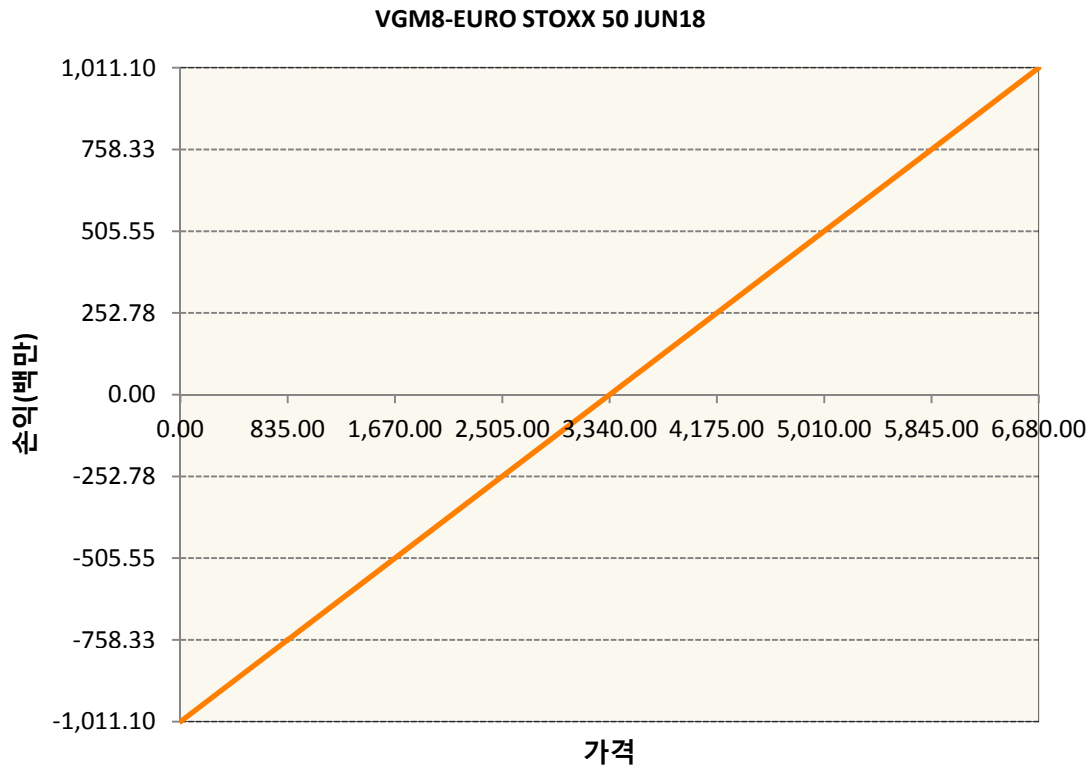
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,011	0	1,011	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM8	EURO STOXX 50 JUN18	81

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

(단위:백만원)

50

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

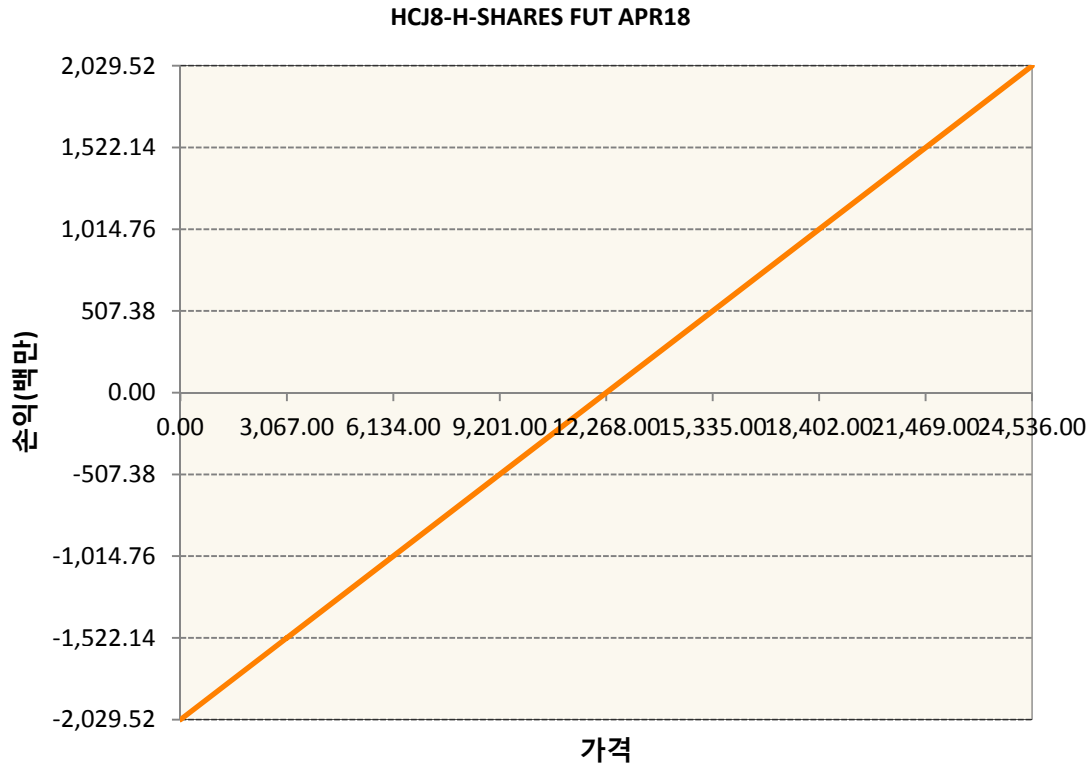
차이나인덱스모(주식-파생형)

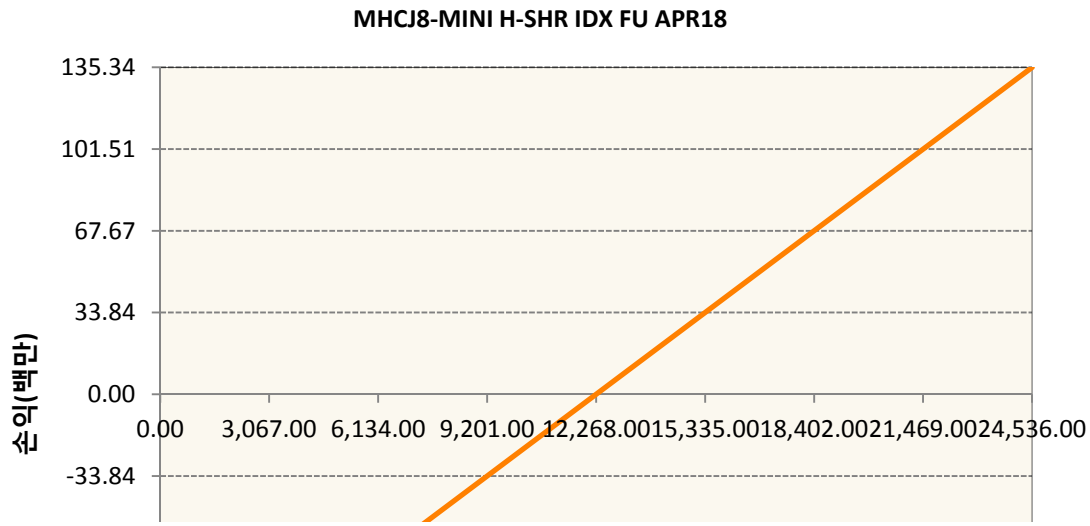
1. 계약금액

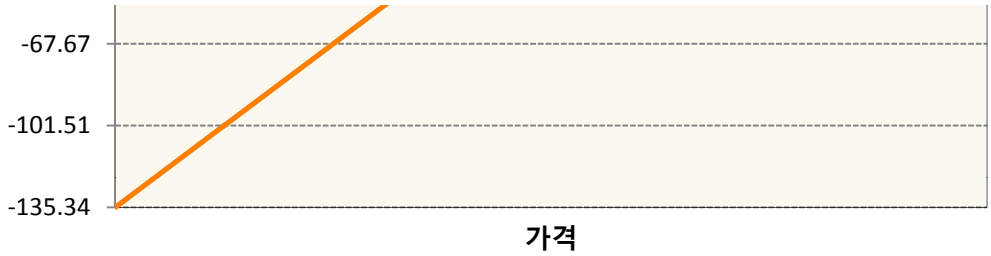
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,165	0	2,165	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	162
MHCJ8	MINI H-SHR IDX FU APR18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	152

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

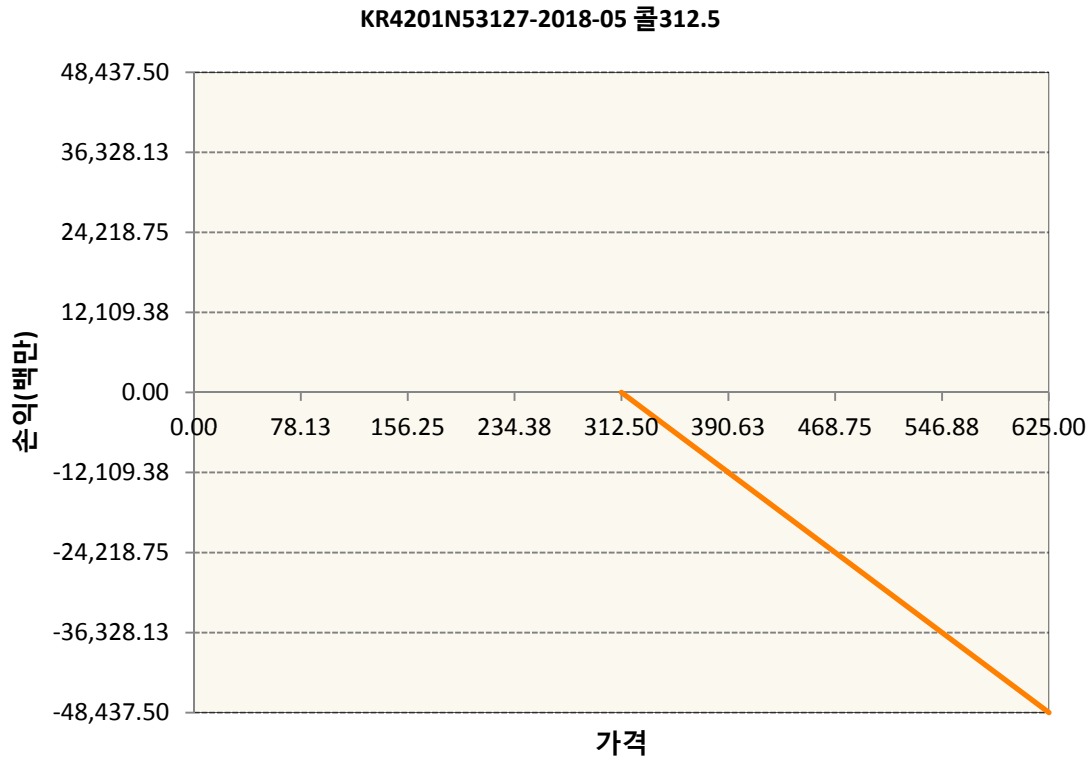
커버드콜모(주식혼합-파생형)

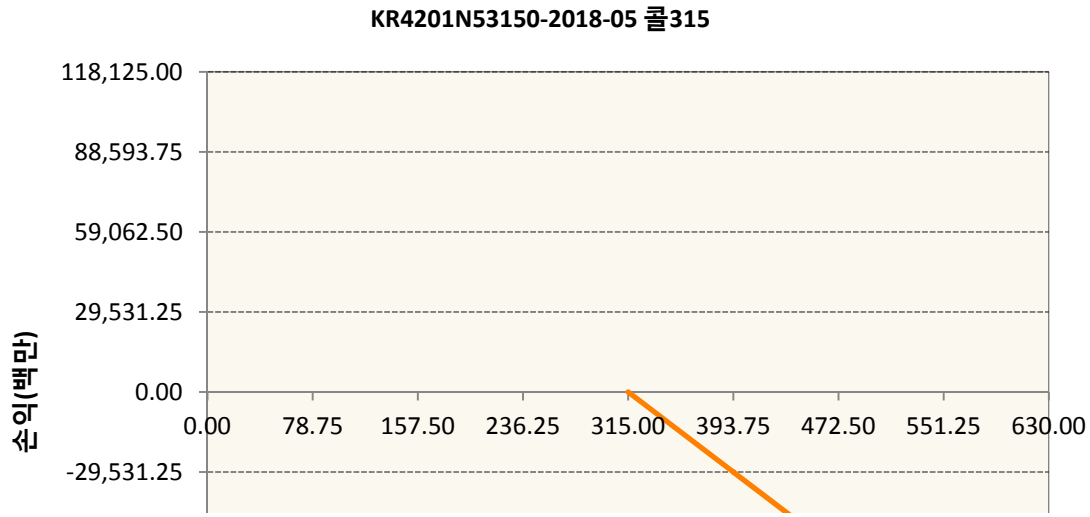
1. 계약금액

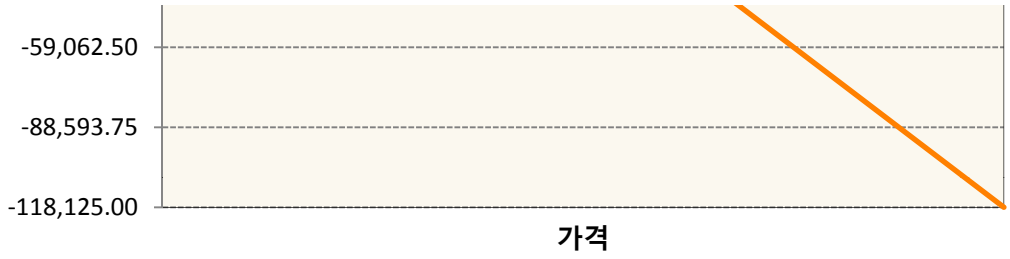
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	169,073	-169,073	장내
누계	유가증권	옵션	0	166,563	-166,563	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N5312018-05 콜312.5 3,007

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,449	1,400	1,342	1,277	1,206	1,129	1,048
-5.33%	1,277	1,194	1,105	1,011	914	814	711
-2.67%	936	823	709	593	477	359	241
0%	371	248	124	0	-124	-248	-371
2.67%	-427	-539	-653	-770	-887	-1,006	-1,126
5.33%	-1,424	-1,510	-1,601	-1,698	-1,799	-1,903	-2,010
8.00%	-2,563	-2,618	-2,683	-2,755	-2,833	-2,918	-3,007

KR4201N5312018-05 콜315 7,002

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,123	3,023	2,902	2,763	2,607	2,437	2,254
-5.33%	2,792	2,613	2,417	2,207	1,987	1,757	1,520
-2.67%	2,099	1,841	1,577	1,308	1,035	758	479
0%	900	600	300	0	-300	-600	-900
2.67%	-865	-1,152	-1,443	-1,736	-2,030	-2,326	-2,624
5.33%	-3,143	-3,373	-3,617	-3,870	-4,131	-4,398	-4,671
8.00%	-5,806	-5,963	-6,141	-6,337	-6,547	-6,769	-7,002

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

(단위:백만원)

9,333

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

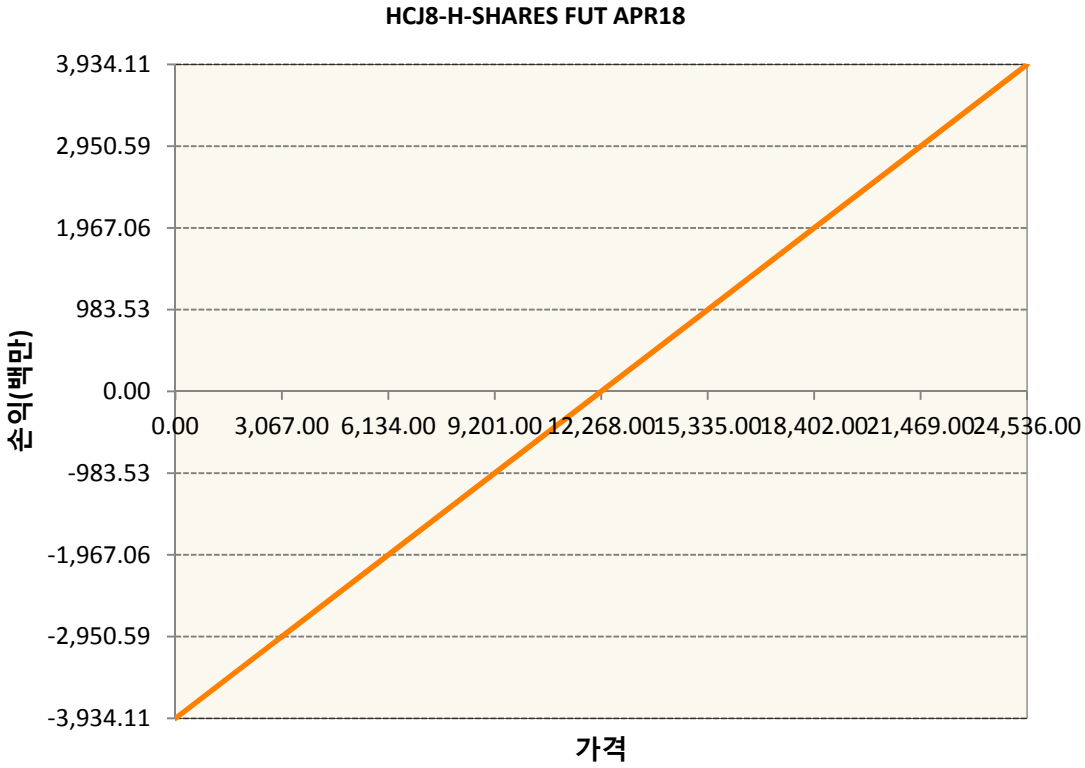
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

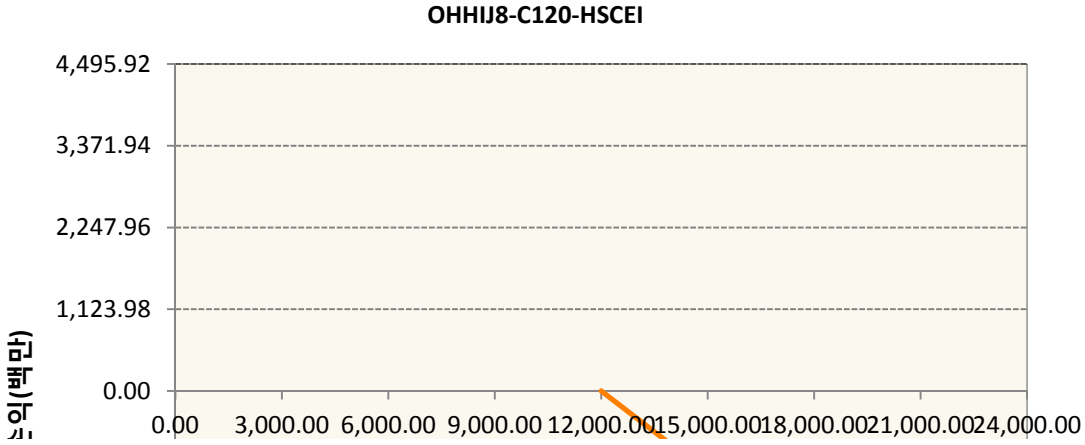
1. 계약금액

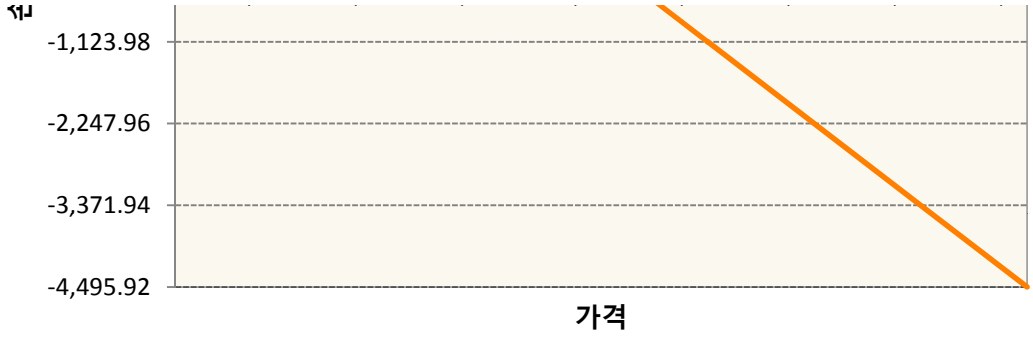
(단위:백만원)

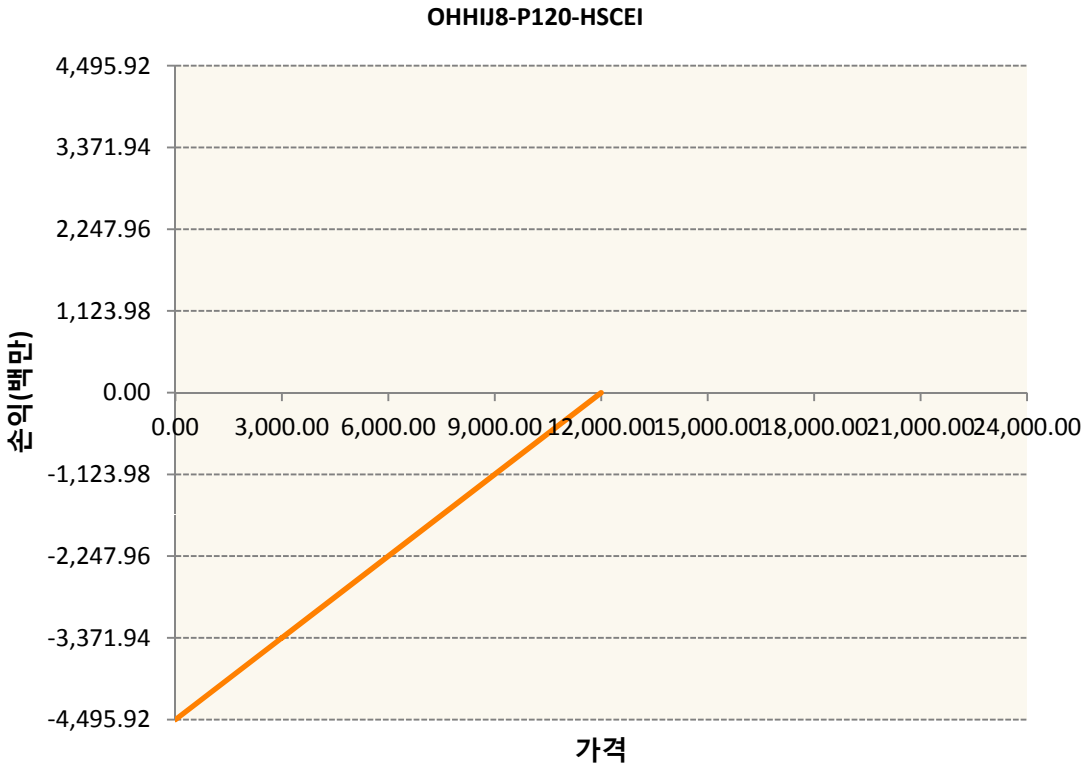
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,934	0	3,934	장내
누계	유가증권	옵션	0	8,992	-8,992	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCJ8	H-SHARES FUT APR18	315
OHHIJ8-C12	HSCEI	360
OHHIJ8-P12	HSCEI	360

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	907

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

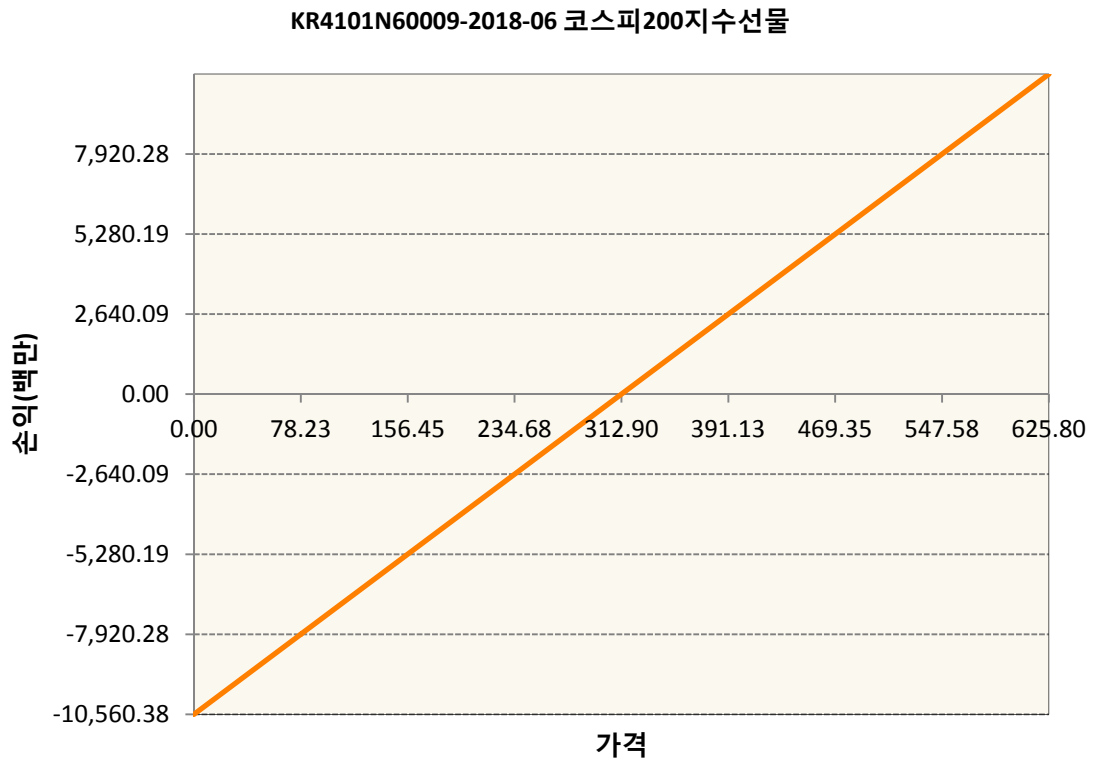
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

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	2,000	-2,000	장외
누계	유가증권	선물	10,560	0	10,560	장내
누계	유가증권	스왑	52,200	0	52,200	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,456
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456
-5.33%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971
-2.67%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	485	485	485	485	485	485	485

5.33%	971	971	971	971	971	971	971
8.00%	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3						276
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-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%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-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%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-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%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-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%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	252	252	252	252	252	252	252
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						466
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	311	311	311	311	311	311	311
8.00%	466	466	466	466	466	466	466
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-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%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	118	118	118	118	118	118	118
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						630
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630
-5.33%	-420	-420	-420	-420	-420	-420	-420
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	420	420	420	420	420	420	420
8.00%	630	630	630	630	630	630	630
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						472
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	472	472	472	472	472	472	472
	KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물						846
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-846	-846	-846	-846	-846	-846	-846
-5.33%	-564	-564	-564	-564	-564	-564	-564
-2.67%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	282	282	282	282	282	282	282
5.33%	564	564	564	564	564	564	564
8.00%	846	846	846	846	846	846	846

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

4,723

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

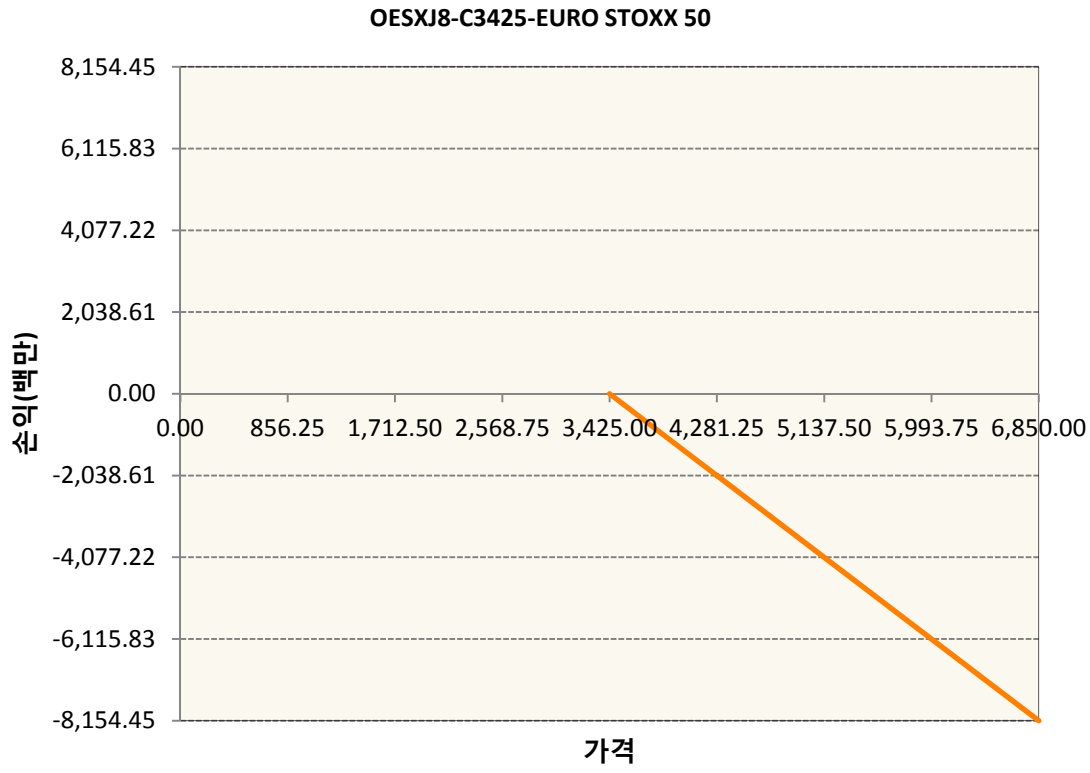
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

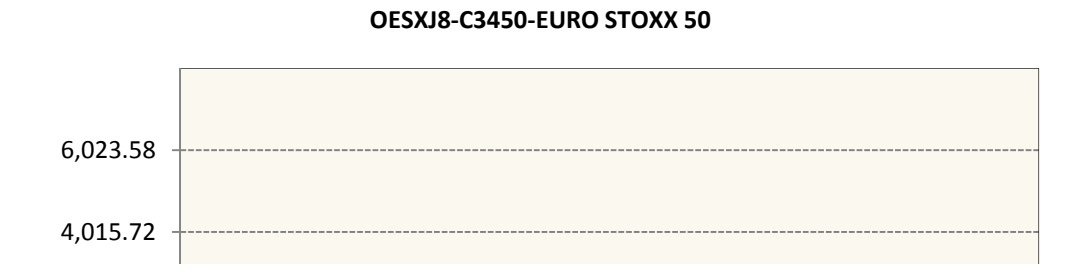
1. 계약금액

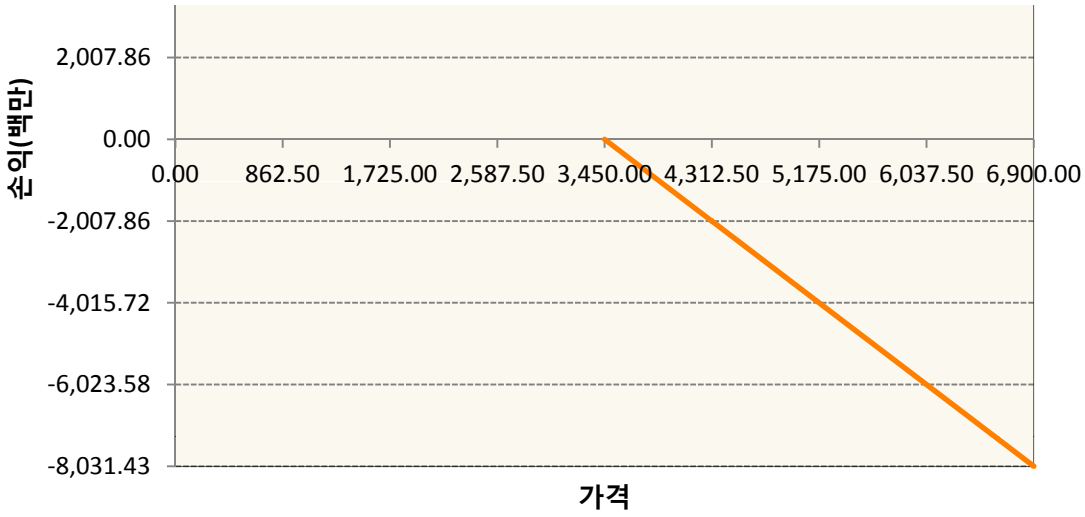
(단위:백만원)

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	7,533	0	7,533	
누계	유가증권	스왑	76,401	0	76,401	장외
누계	유가증권	옵션	0	32,372	-32,372	장내
누계	지수	스왑	52,909	0	52,909	장외

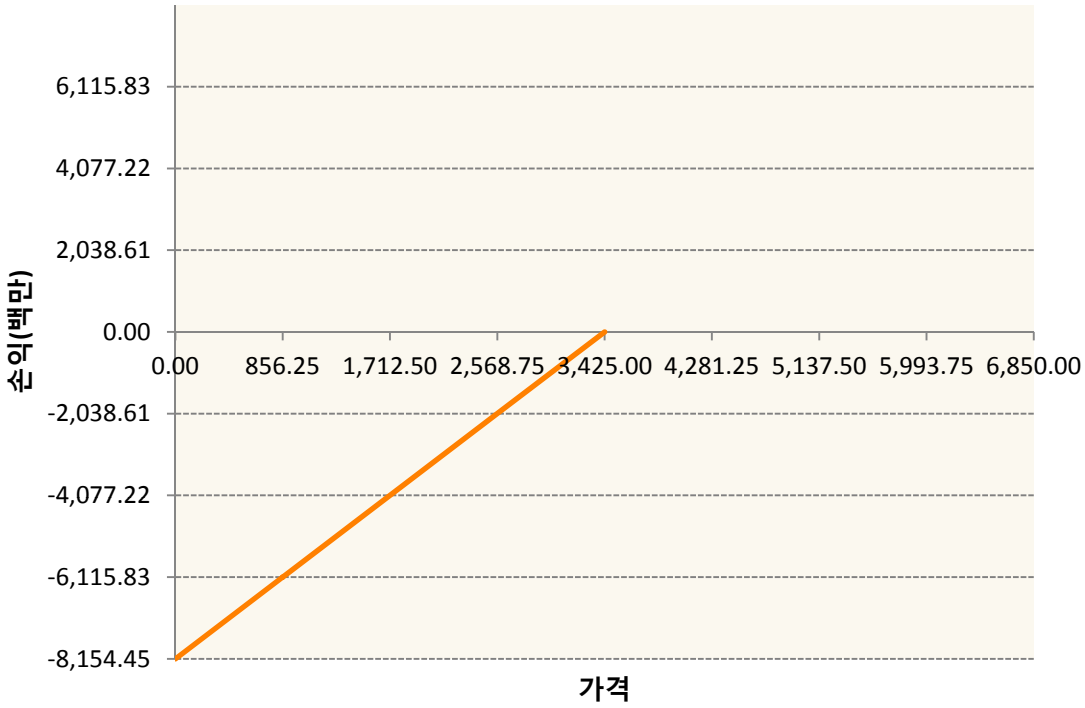
2. 만기시점의 손익구조



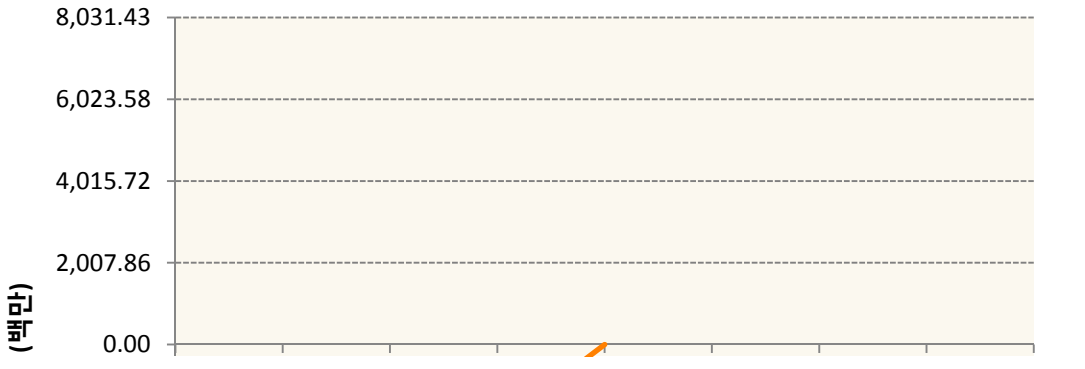


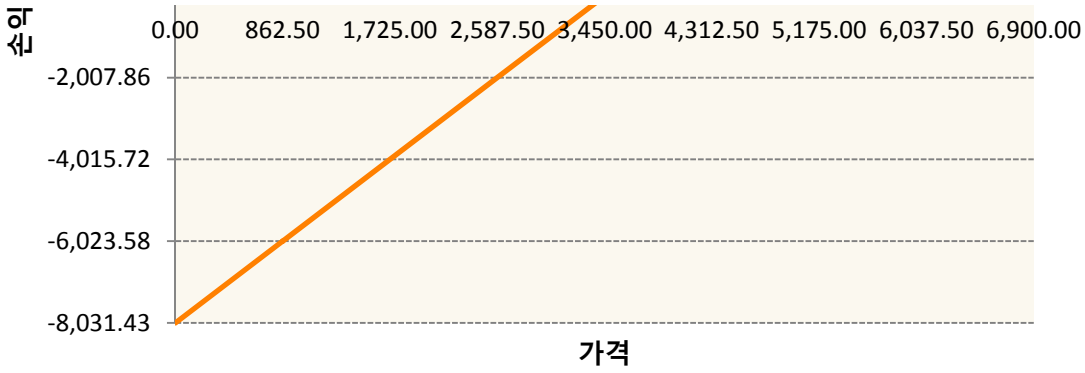


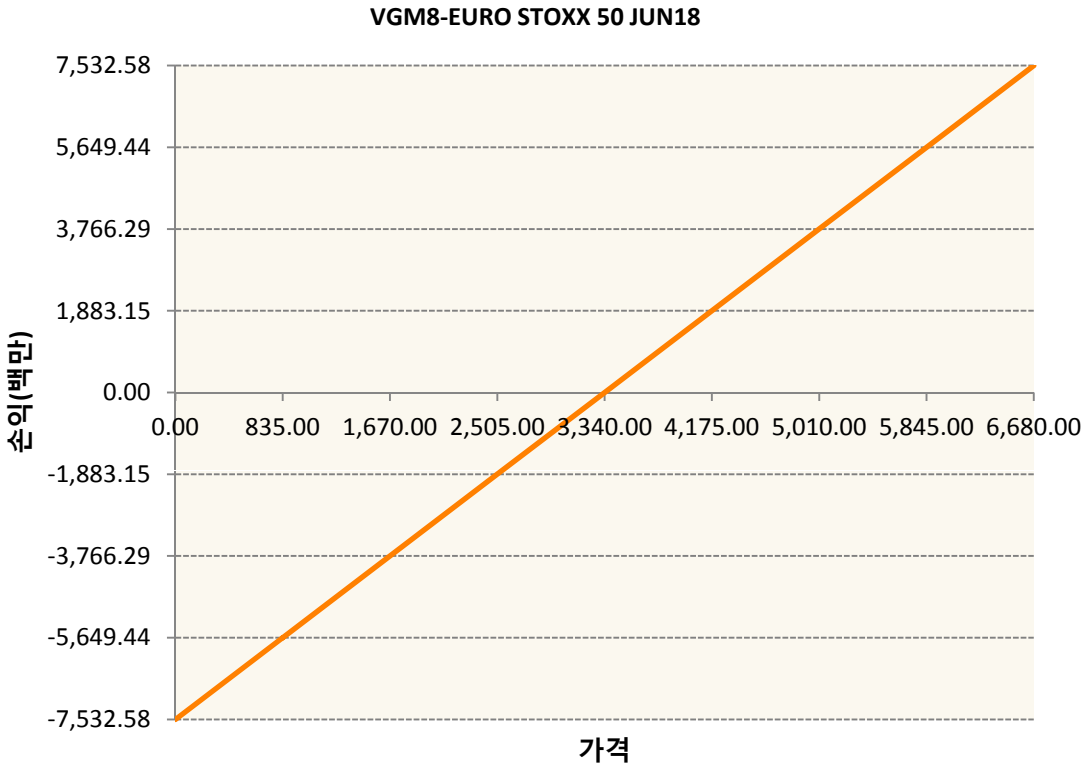
OESXJ8-P3425-EURO STOXX 50



OESXJ8-P3450-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	140
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	202
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	652
OESXJ8-C34 EURO STOXX 50	643
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	652
OESXJ8-P34 EURO STOXX 50	643
VGM8 EURO STOXX 50 JUN18	603

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

2,209

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

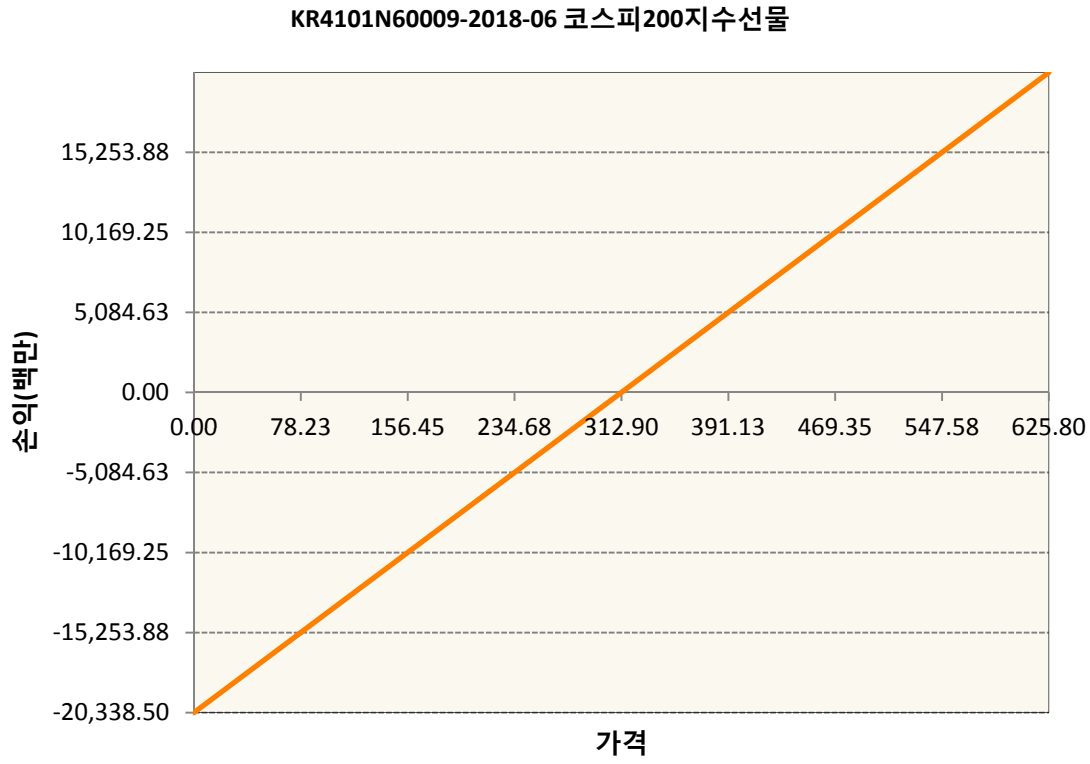
ETF스마트레버리지목표전환형8호

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	20,339	0	20,339	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							1,629
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,629	-1,629	-1,629	-1,629	-1,629	-1,629	-1,629
-5.33%	-1,086	-1,086	-1,086	-1,086	-1,086	-1,086	-1,086
-2.67%	-543	-543	-543	-543	-543	-543	-543
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	543	543	543	543	543	543	543
5.33%	1,086	1,086	1,086	1,086	1,086	1,086	1,086
8.00%	1,629	1,629	1,629	1,629	1,629	1,629	1,629

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

1,190

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

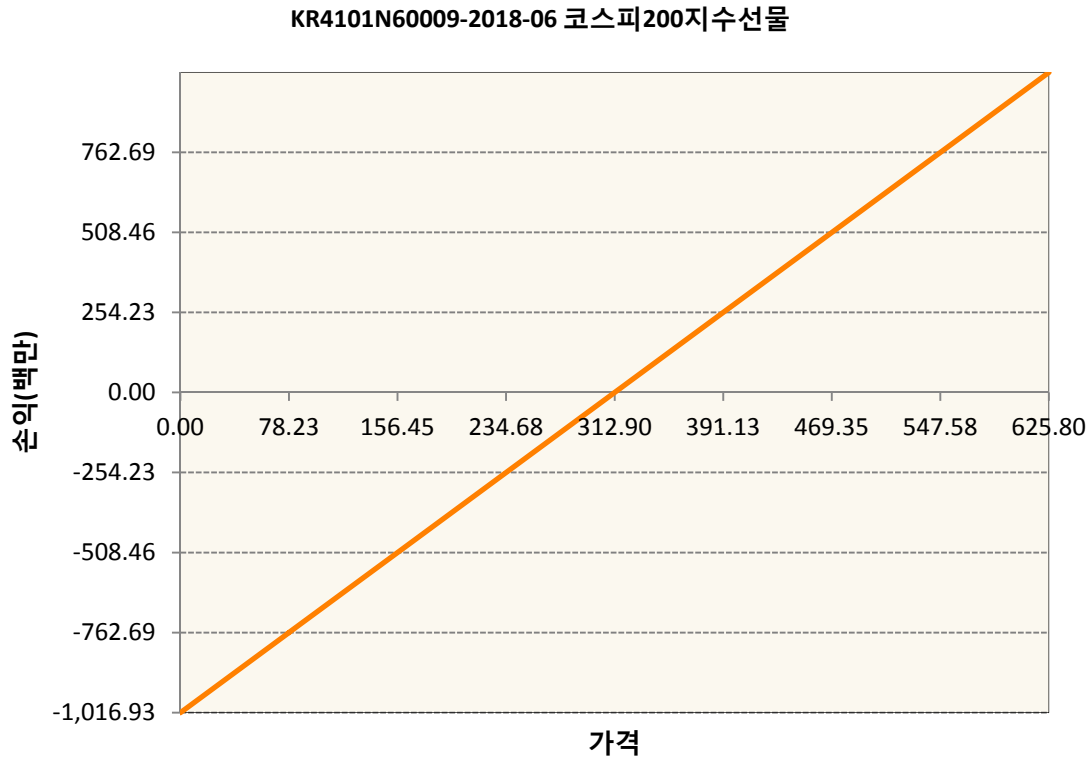
ETF스마트레버리지목표전환형9호

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	1,017	0	1,017	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							81
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-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%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	81	81	81	81	81	81	81

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

59

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

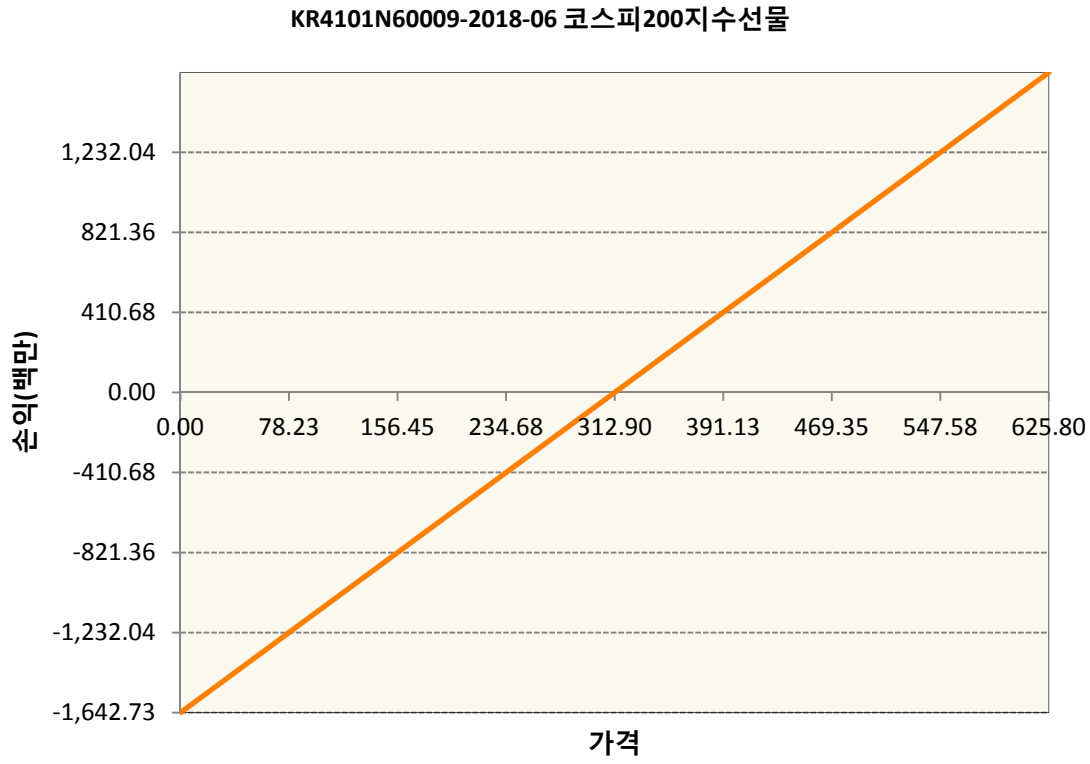
ETF스마트레버리지목표전환형10

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	1,643	0	1,643	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N60(2018-06 코스피200지수선물							132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

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

96

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

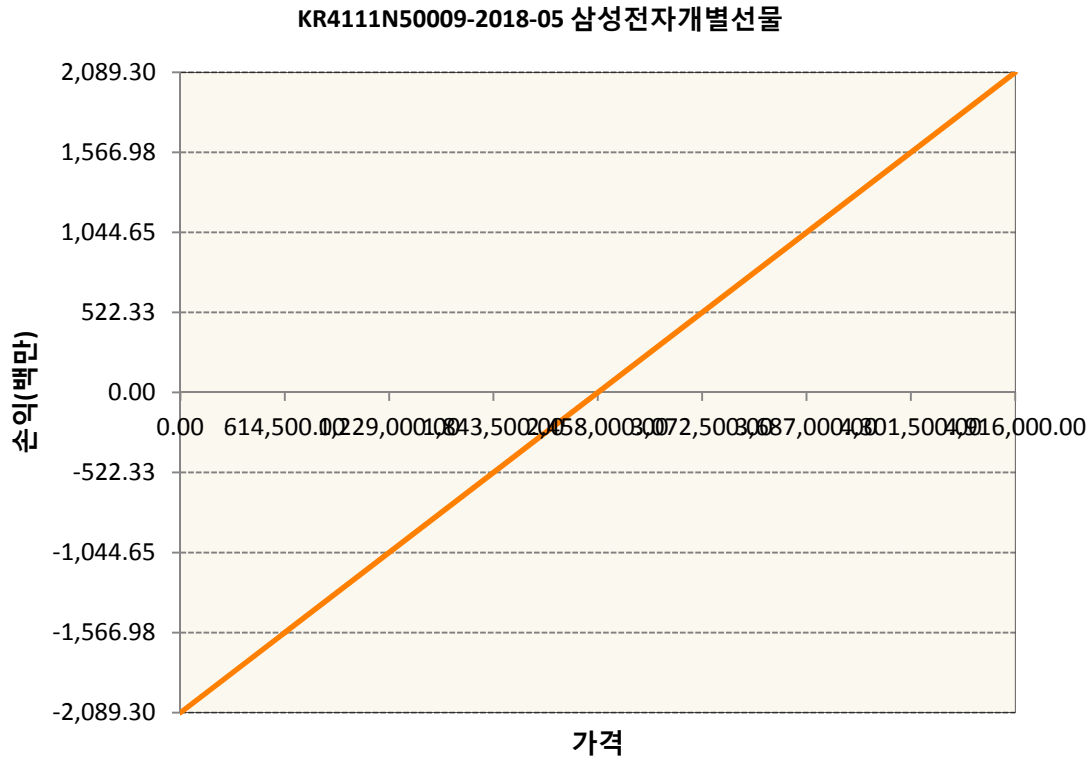
스마트KRX300인덱스1호(주식-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,093	0	2,093	장내
누계	유가증권	선물	2,089	0	2,089	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111N50(2018-05 삼성전자개별선물							167
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-5.33%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	56	56	56	56	56	56	56
5.33%	111	111	111	111	111	111	111
8.00%	167	167	167	167	167	167	167

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

206

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

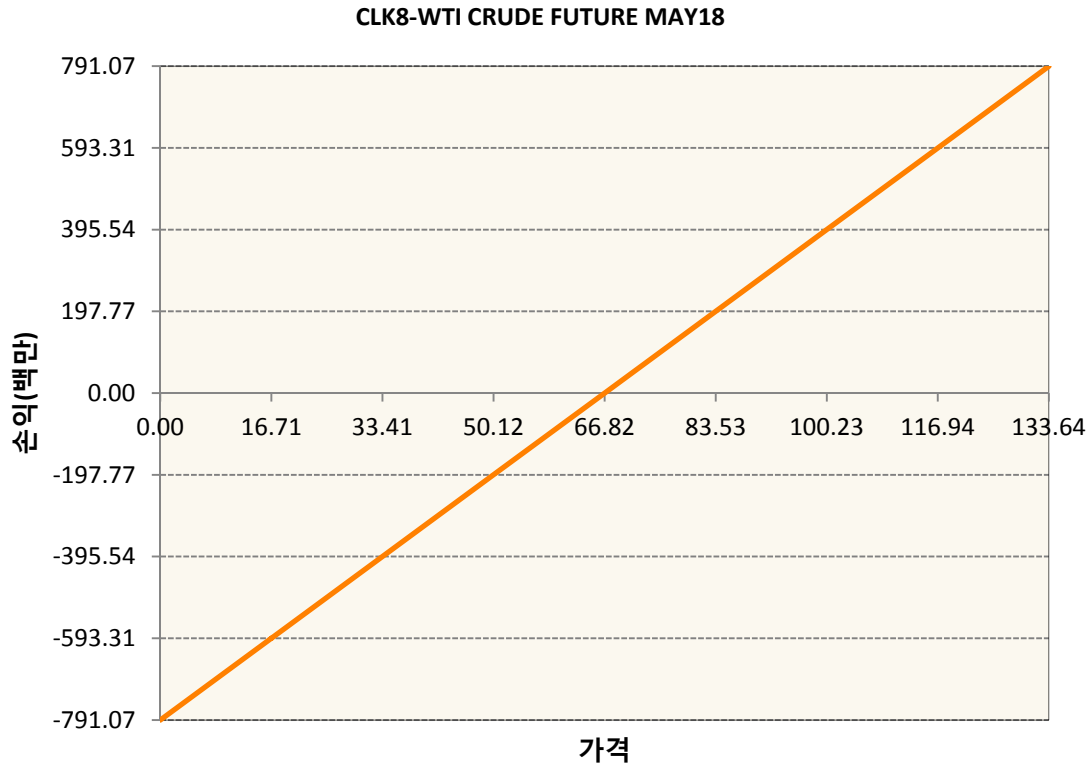
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

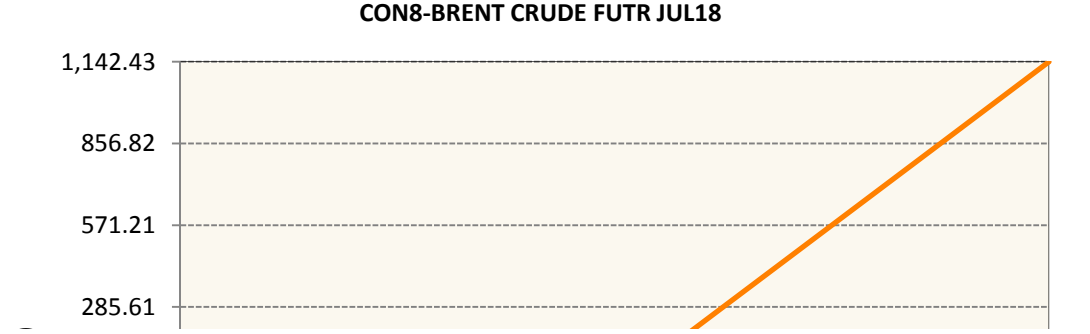
1. 계약금액

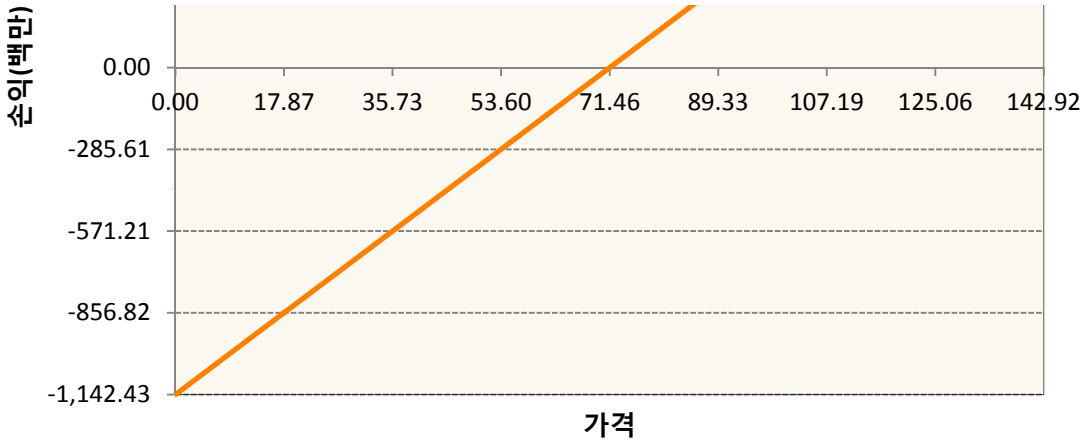
(단위:백만원)

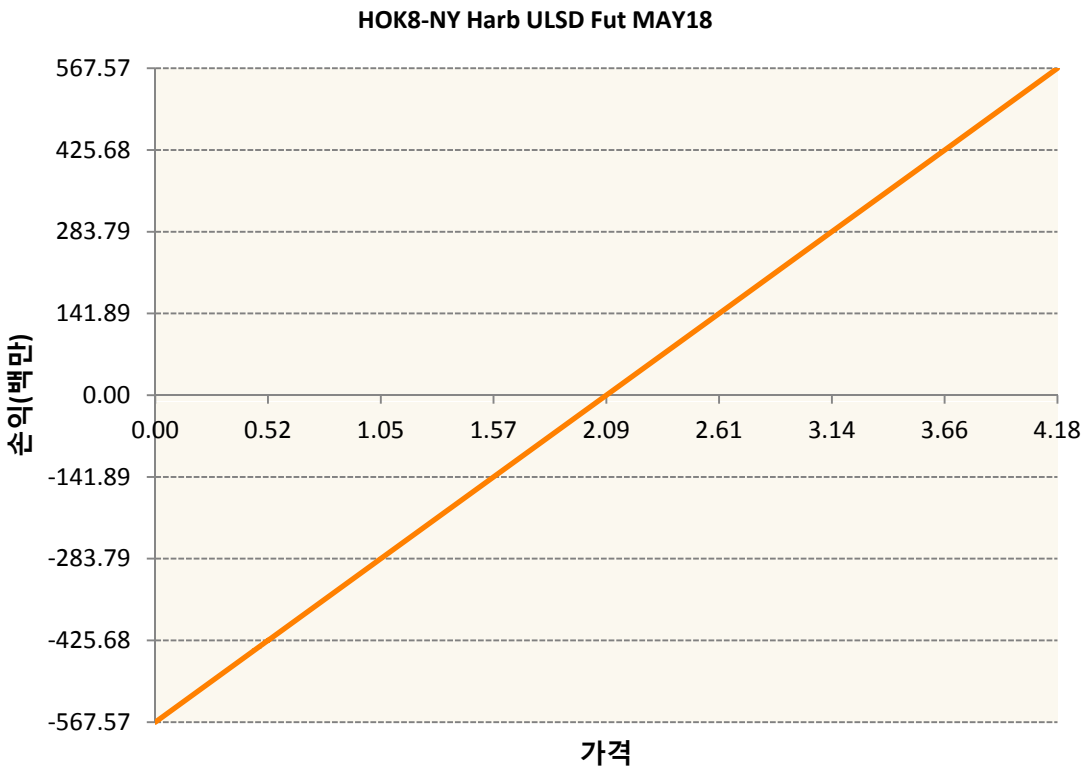
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	588	-588	장내
누계	선물	유가증권	791	0	791	
누계	유가증권	선물	3,308	0	3,308	
누계	통화	선물	0	588	-588	장내

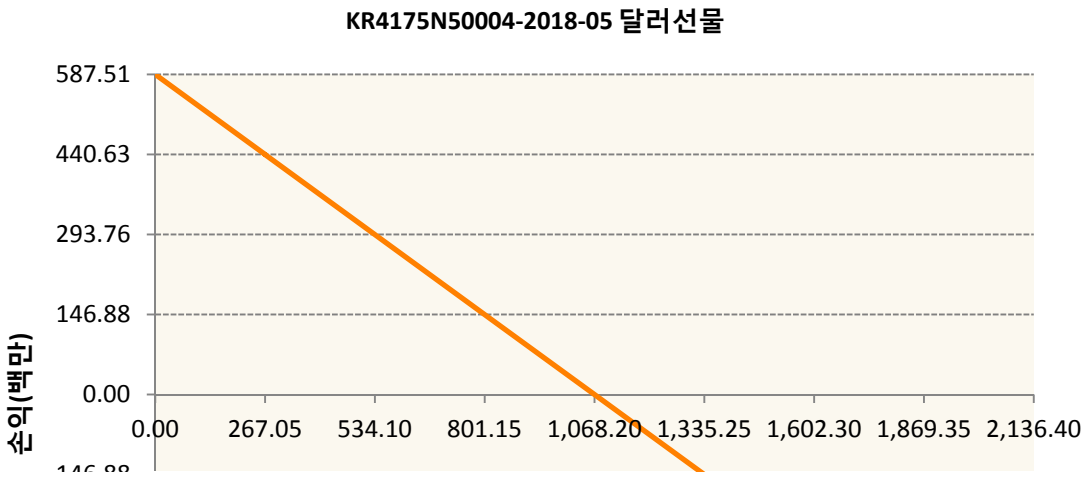
2. 만기시점의 손익구조

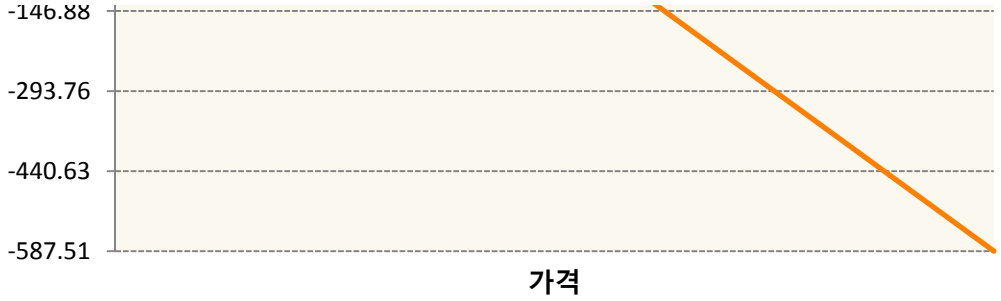


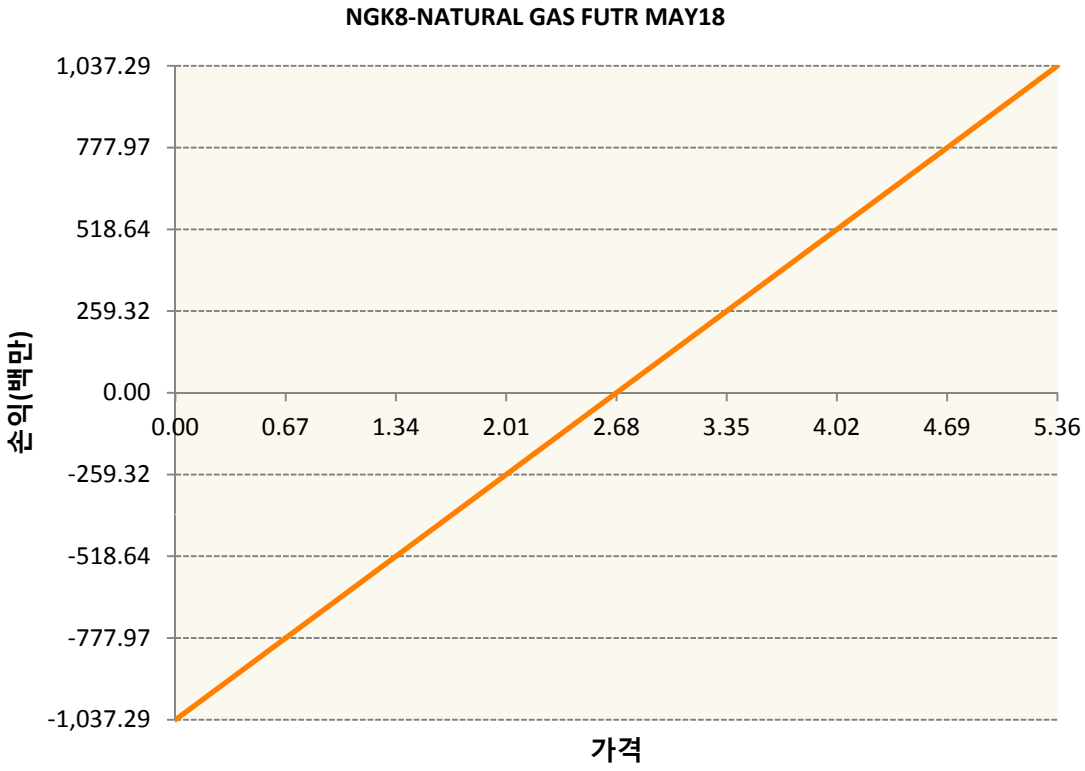


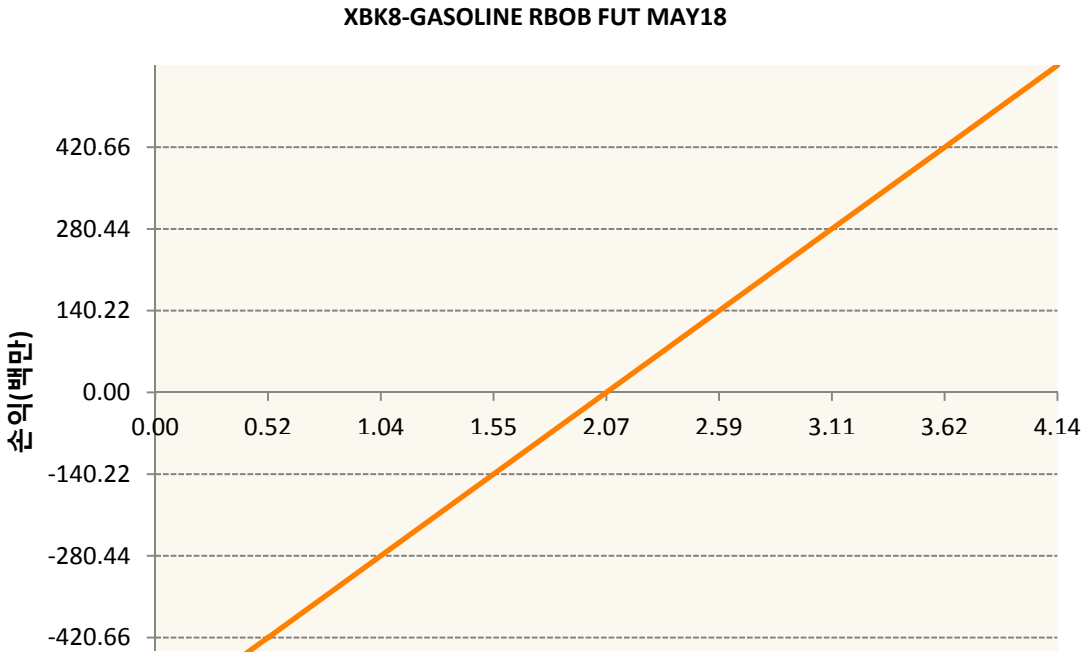

손익(백만)
0.00
-285.61
-571.21
-856.82
-1,142.43
0.00
17.87
35.73
53.60
71.46
89.33
107.19
125.06
142.92
가격

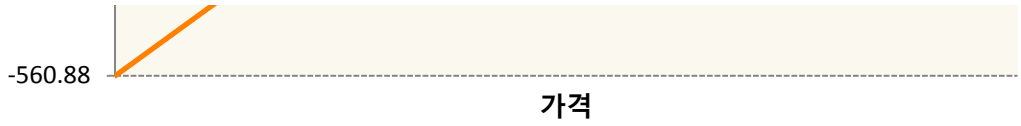

HOK8-NY Harb ULSD Fut MAY18
손익(백만)
567.57
425.68
283.79
141.89
0.00
-141.89
-283.79
-425.68
-567.57
0.00
0.52
1.05
1.57
2.09
2.61
3.14
3.66
4.18
가격


KR4175N50004-2018-05 달러선물
손익(백만)
587.51
440.63
293.76
146.88
0.00
0.00
267.05
534.10
801.15
1,068.20
1,335.25
1,602.30
1,869.35
2,136.40


-146.88
-293.76
-440.63
-587.51
가격


NGK8-NATURAL GAS FUTR MAY18
1,037.29
777.97
518.64
259.32
0.00
-259.32
-518.64
-777.97
-1,037.29
0.00
0.67
1.34
2.01
2.68
3.35
4.02
4.69
5.36
손익(백만)
가격


XBK8-GASOLINE RBOB FUT MAY18
420.66
280.44
140.22
0.00
-140.22
-280.44
-420.66
0.00
0.52
1.04
1.55
2.07
2.59
3.11
3.62
4.14
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLK8	WTI CRUDE FUTURE MAY18	63
CON8	BRENT CRUDE FUTR JUL18	91
HOK8	NY Harb ULSD Fut MAY18	45
KR4175N50(	2018-05 달러선물	47
NGK8	NATURAL GAS FUTR MAY18	83
XBK8	GASOLINE RBOB FUT MAY18	45

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	520

공시일	2018-04-13
기준일	2018-04-12

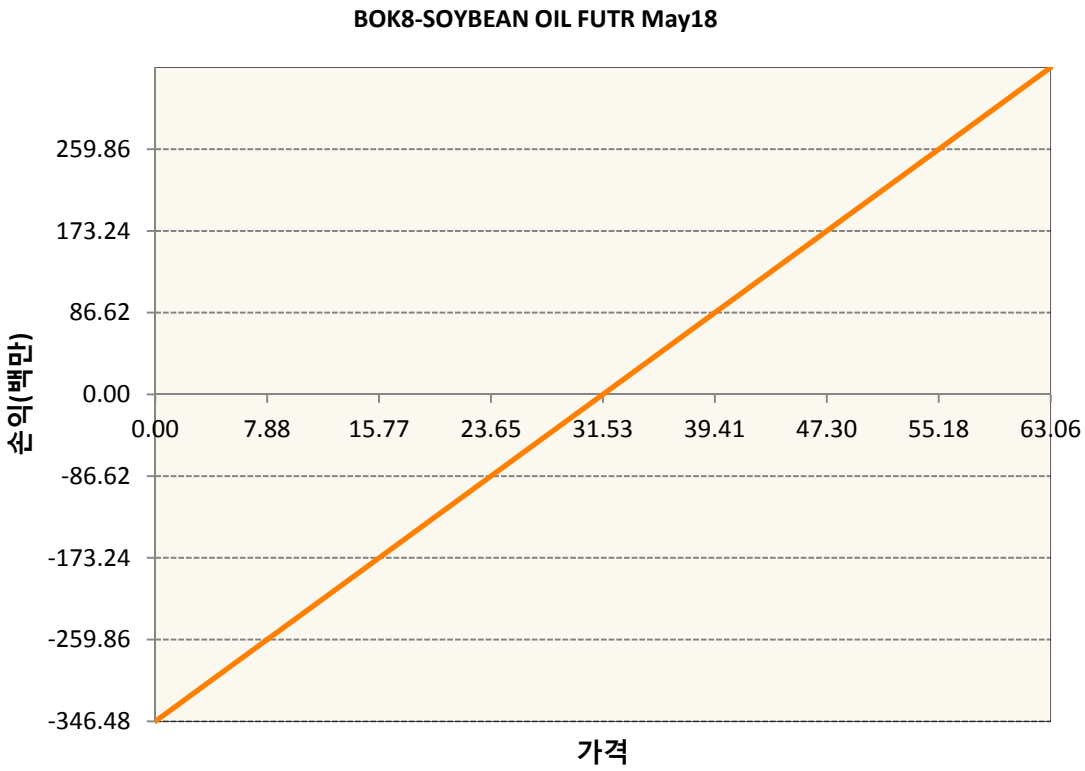
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

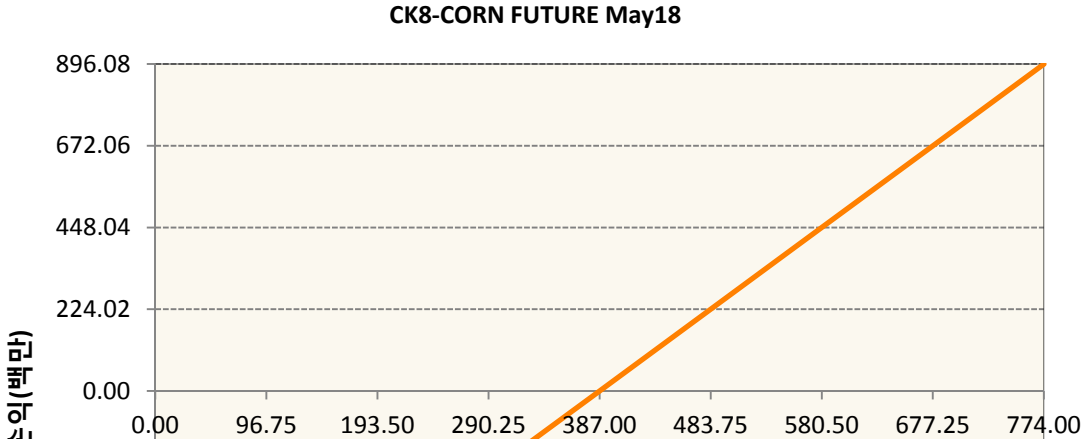
1. 계약금액

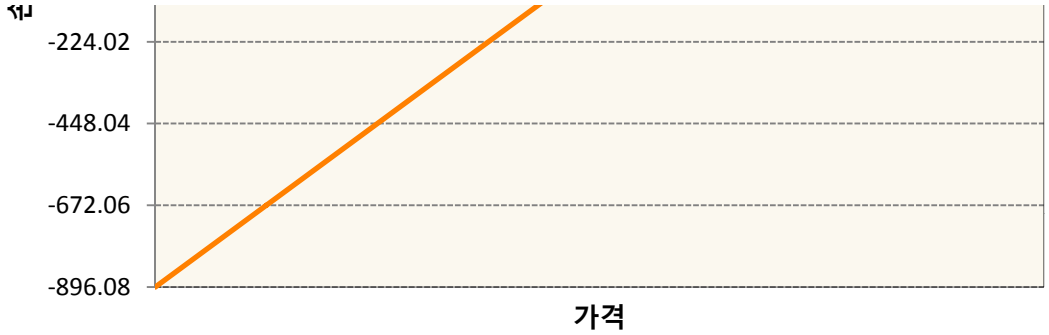
(단위:백만원)

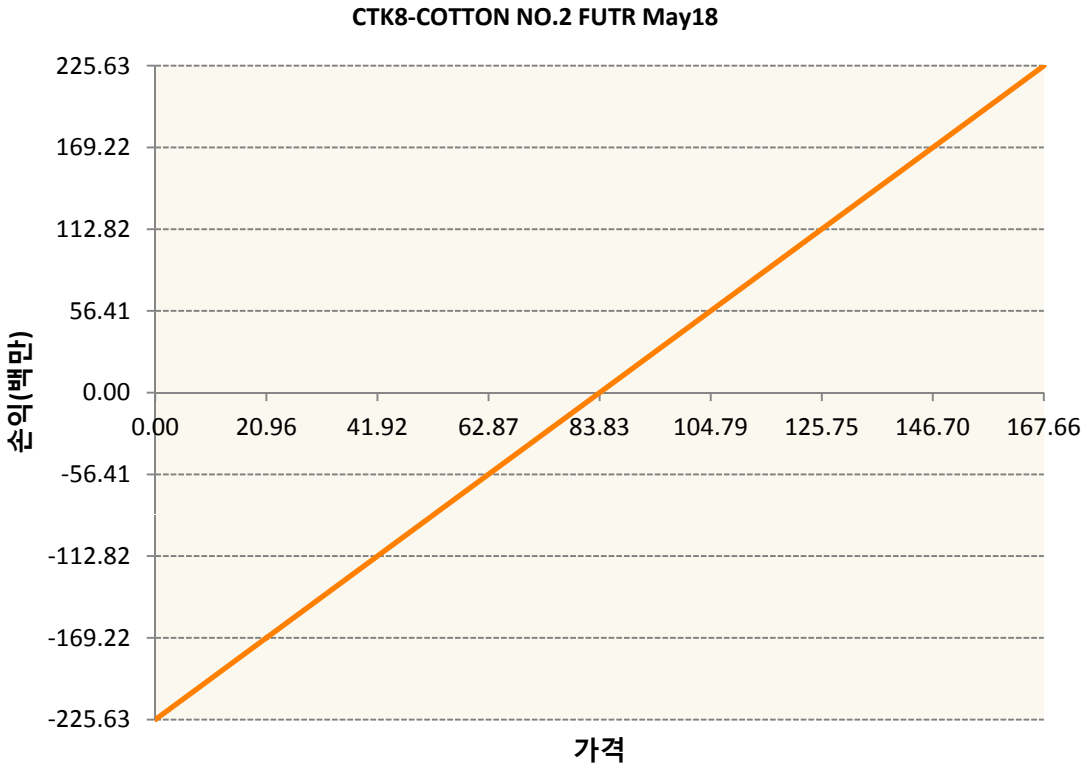
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	321	-321	장내
누계	유가증권	선물	4,157	0	4,157	
누계	통화	선물	0	320	-320	장내

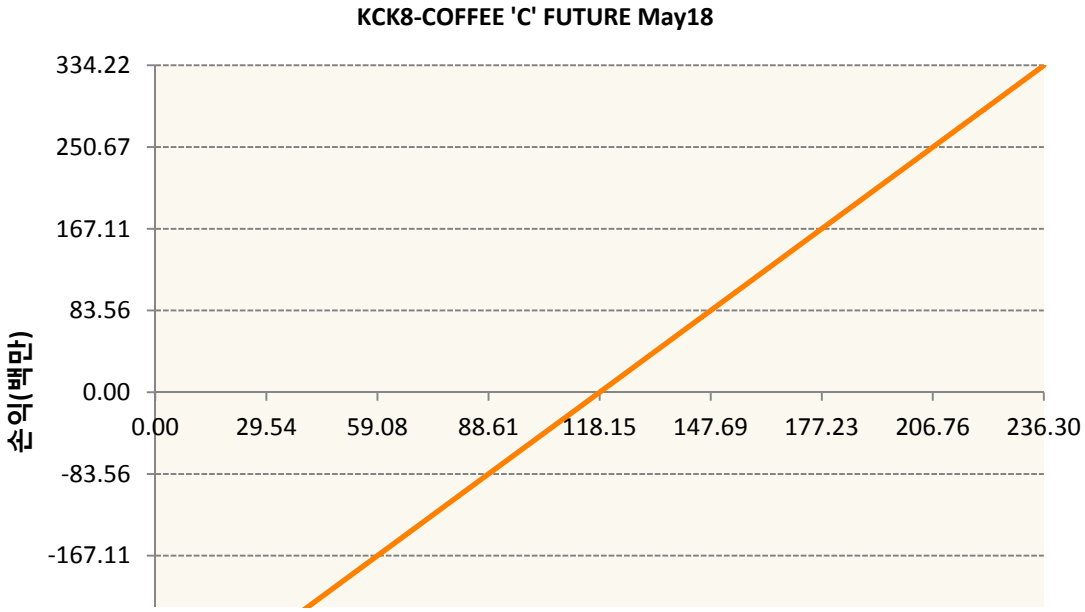
2. 만기시점의 손익구조

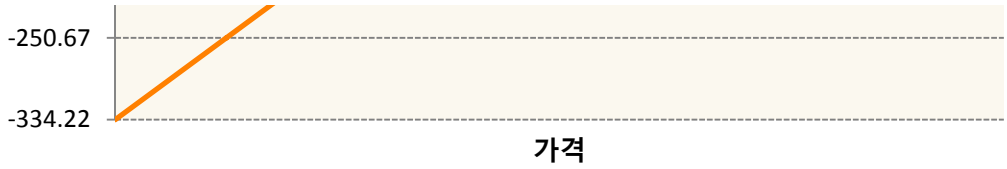


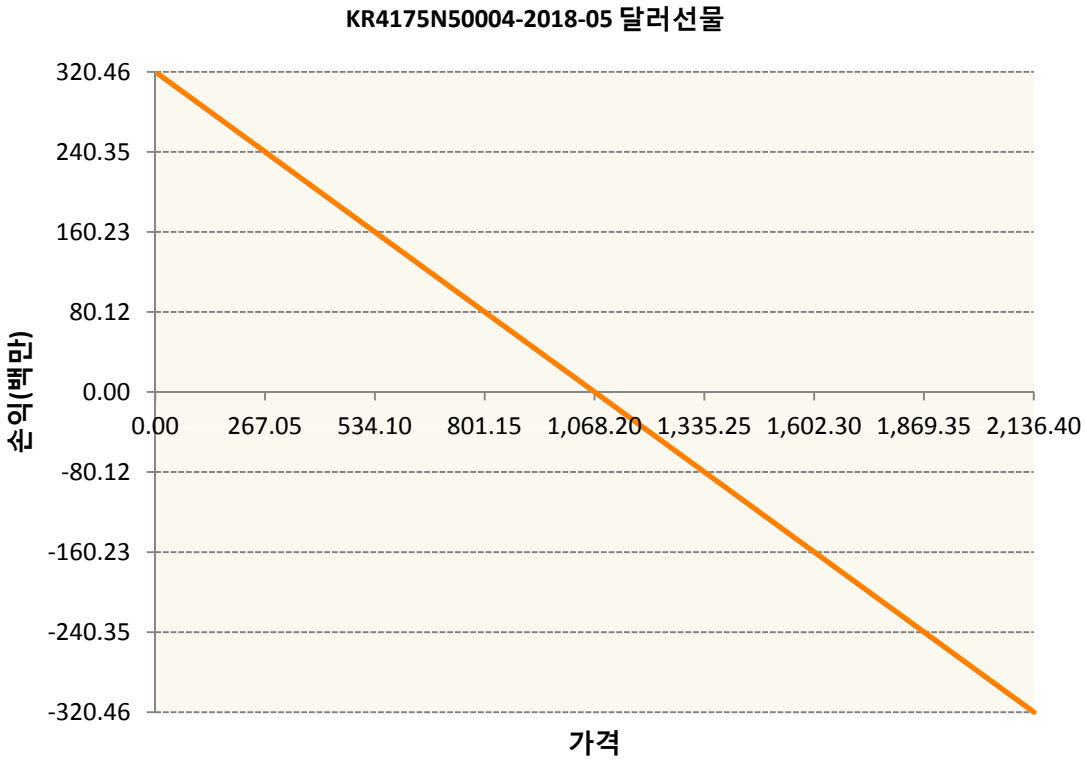


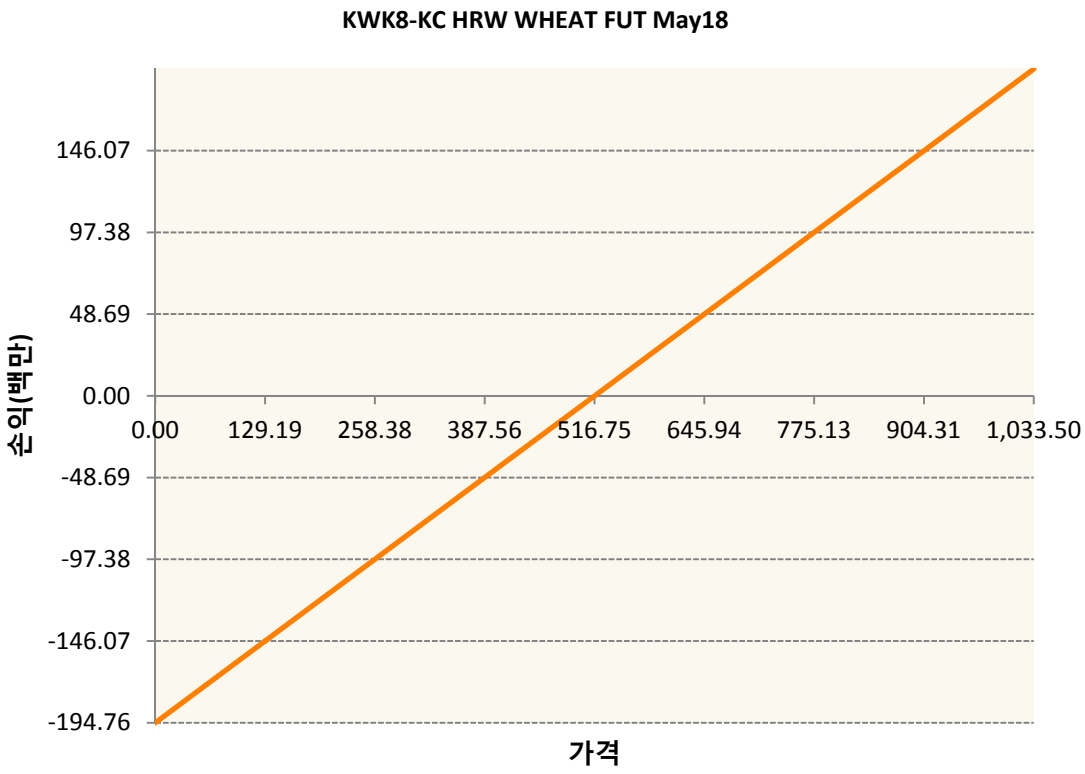

-224.02
-448.04
-672.06
-896.08
가격


CTK8-COTTON NO.2 FUTR May18
225.63
169.22
112.82
56.41
0.00
-56.41
-112.82
-169.22
-225.63
0.00
20.96
41.92
62.87
83.83
104.79
125.75
146.70
167.66
손익(백만)
가격

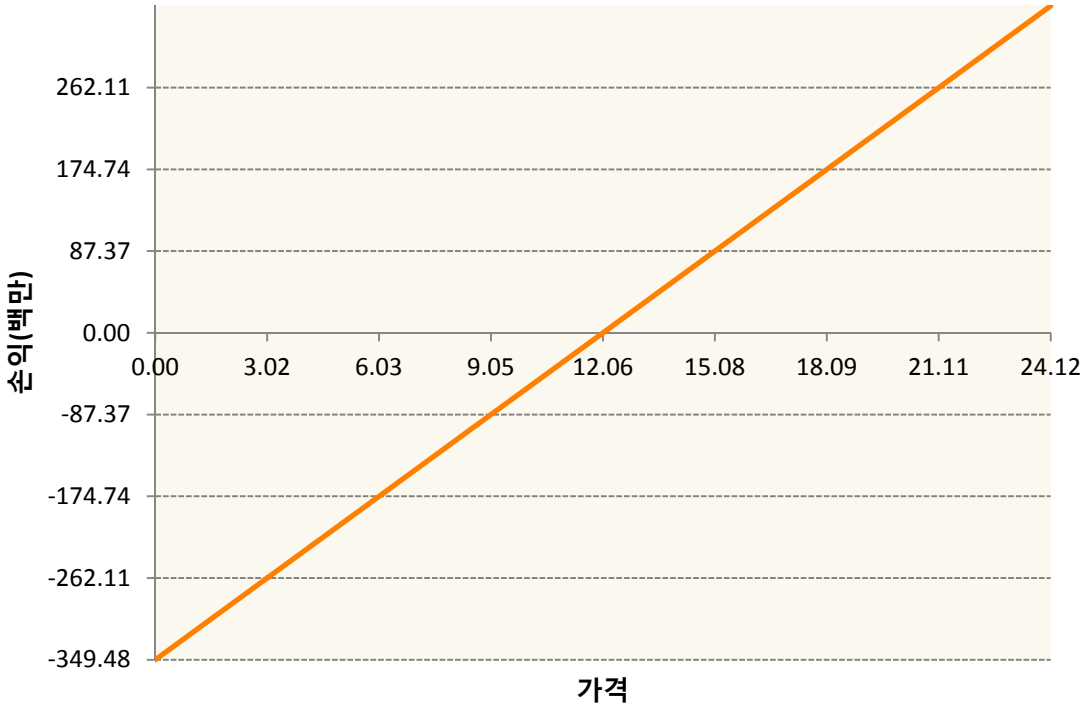

KCK8-COFFEE 'C' FUTURE May18
334.22
250.67
167.11
83.56
0.00
-83.56
-167.11
0.00
29.54
59.08
88.61
118.15
147.69
177.23
206.76
236.30
손익(백만)


-250.67
-334.22
가격

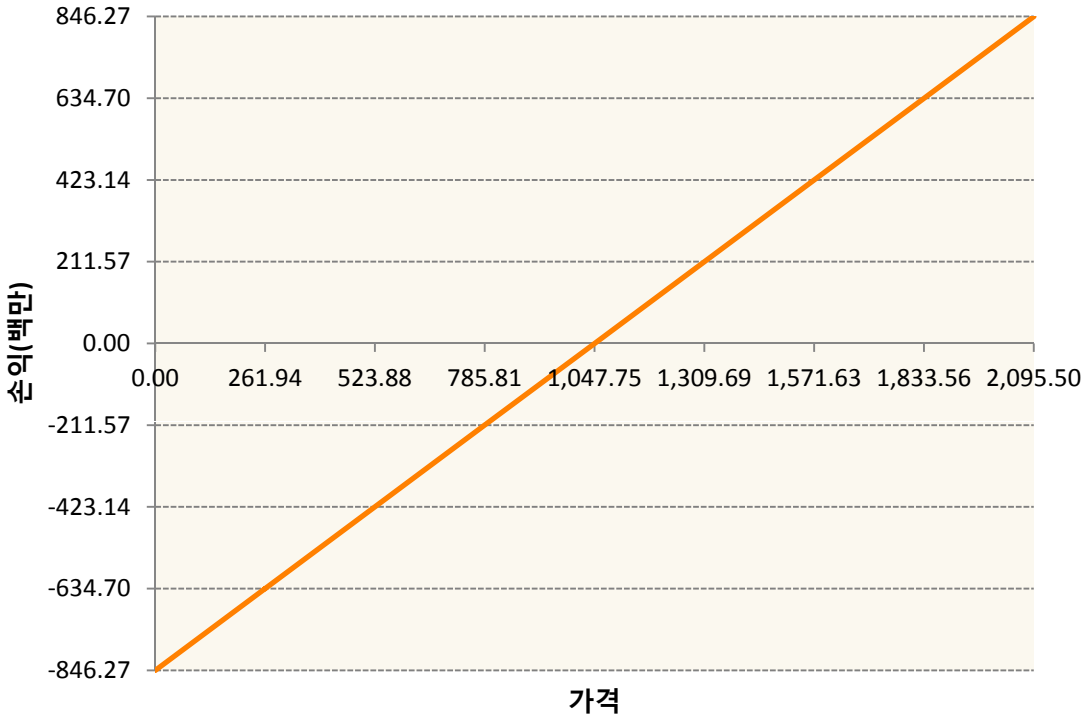

KR4175N50004-2018-05 달러선물
320.46
240.35
160.23
80.12
0.00
-80.12
-160.23
-240.35
-320.46
0.00
267.05
534.10
801.15
1,068.20
1,335.25
1,602.30
1,869.35
2,136.40
손익(백만)
가격


KWK8-KC HRW WHEAT FUT May18
146.07
97.38
48.69
0.00
-48.69
-97.38
-146.07
-194.76
0.00
129.19
258.38
387.56
516.75
645.94
775.13
904.31
1,033.50
손익(백만)
가격

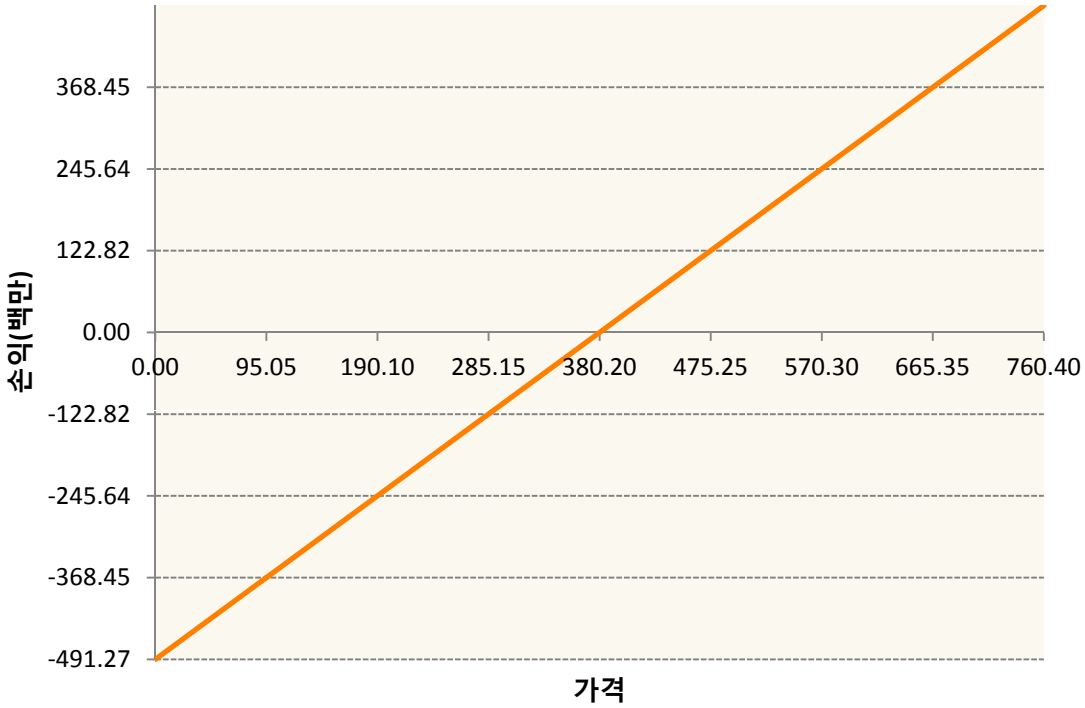
SBK8-SUGAR #11 (WORLD) May18



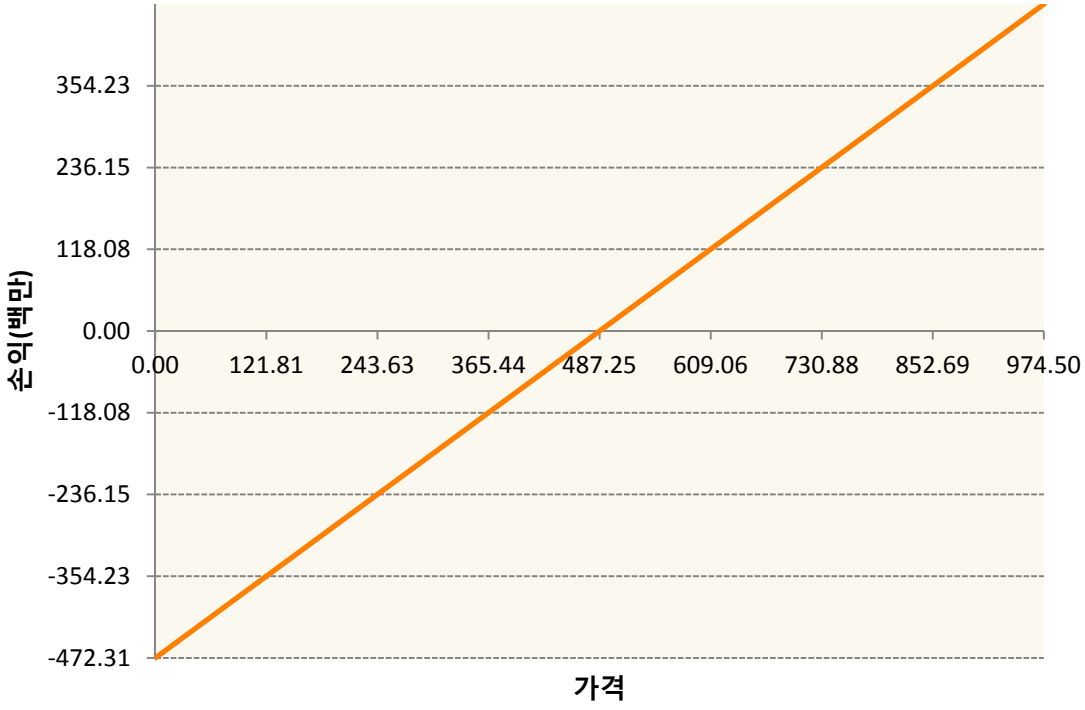
SK8-SOYBEAN FUTRUE May18



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	27
KR4175N50(	2018-05 달러선물	26
KWK8	KC HRW WHEAT FUT May18	16
SBK8	SUGAR #11 (WORLD) May18	28
SK8	SOYBEAN FUTRUE May18	68
SMK8	SOYBEAN MEAL FUTR May18	39
WK8	WHEAT FUTURE(CBT) May18	38

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

337