

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

포커스농산물모(채권-파생형)

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	6	0	6	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

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

(단위:백만원)

70

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

SMART합성-MSCI선진국증권상장

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	13,197	0	13,197	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S181122

1,063

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

521

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

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	3,685	0	3,685	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180910

266

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

유로인덱스모(주식-파생형)

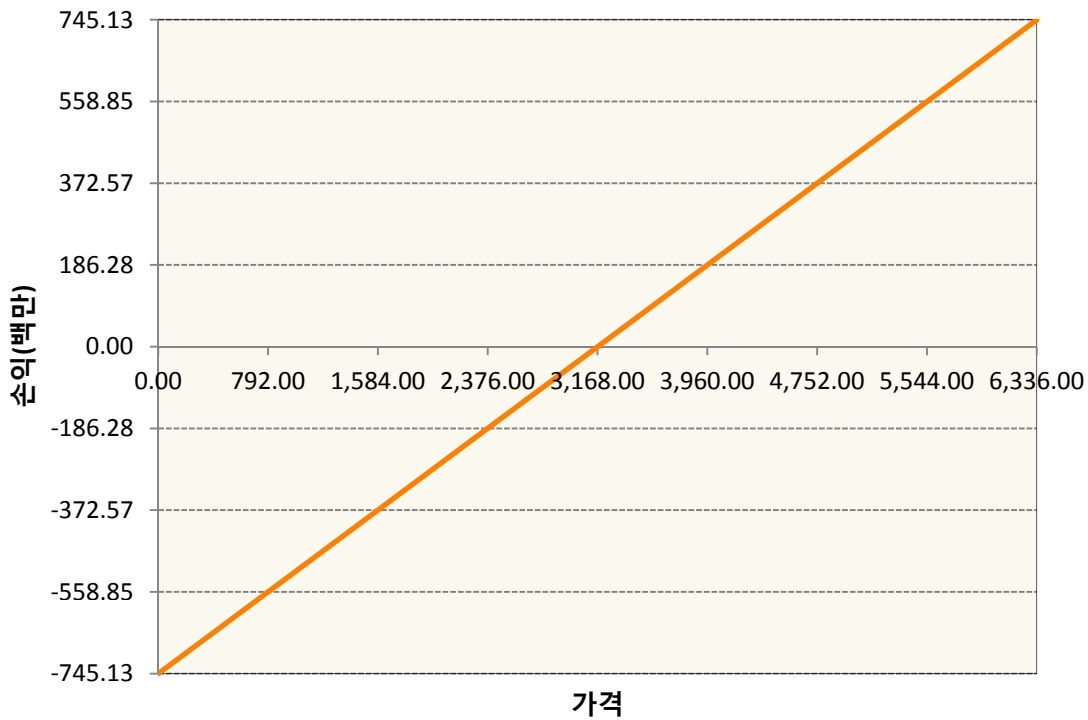
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	745	0	745	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ8-EURO STOXX 50 DEC18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

차이나인덱스모(주식-파생형)

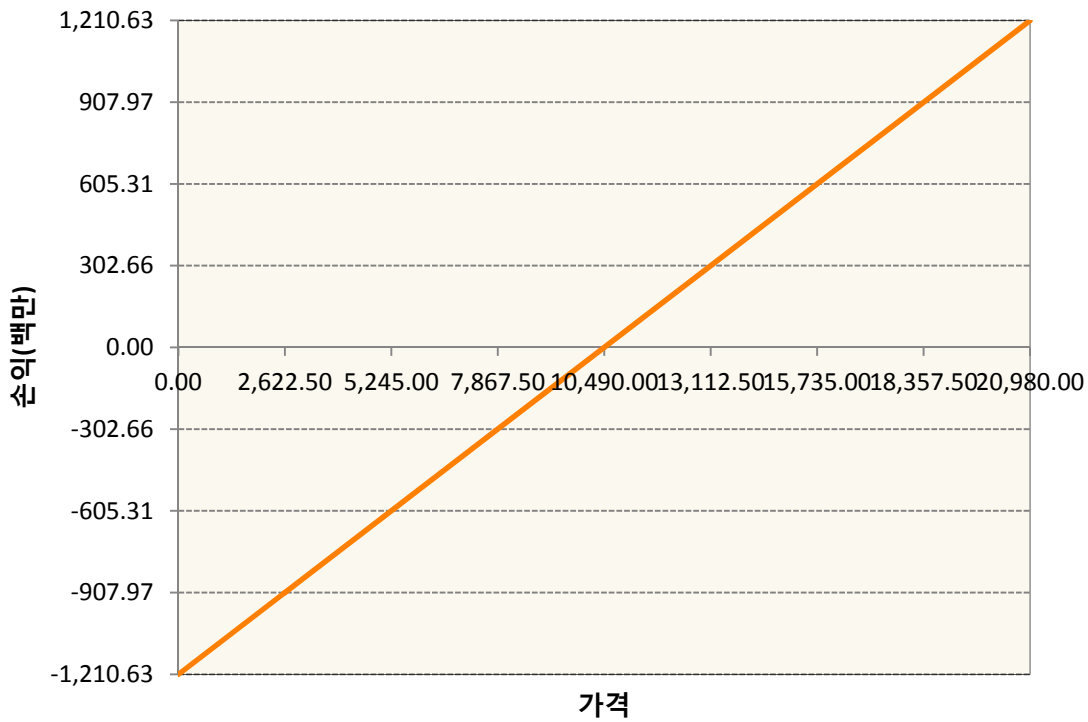
1. 계약금액

(단위:백만원)

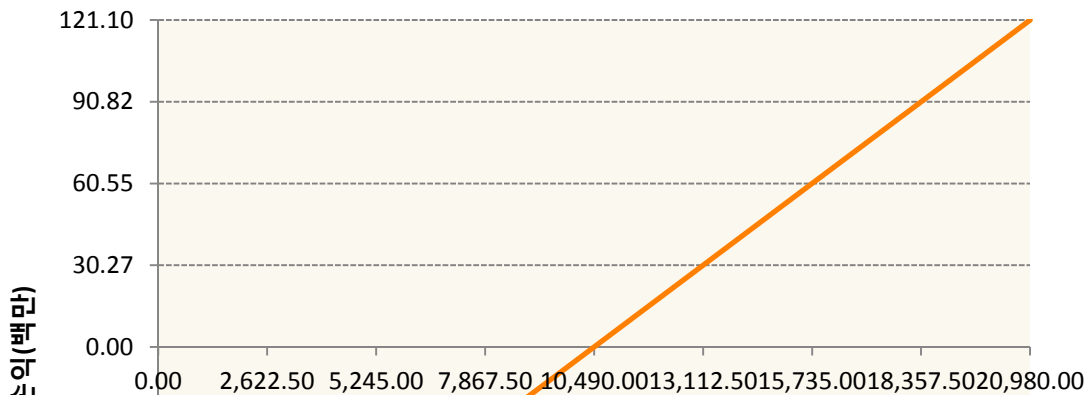
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,211	0	1,211	
누계	유가증권	선물	121	0	121	장내

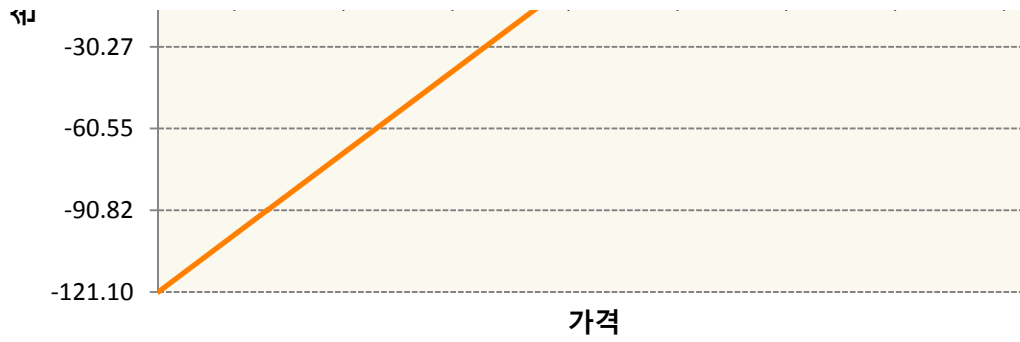
2. 만기시점의 손익구조

HCZ8-HSCEI FUTURES DEC 18



MHCZ8-MINI H-SHR IDX FU DEC18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ8	HSCEI FUTURES DEC 18	97
MHCZ8	MINI H-SHR IDX FU DEC18	10

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

95

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

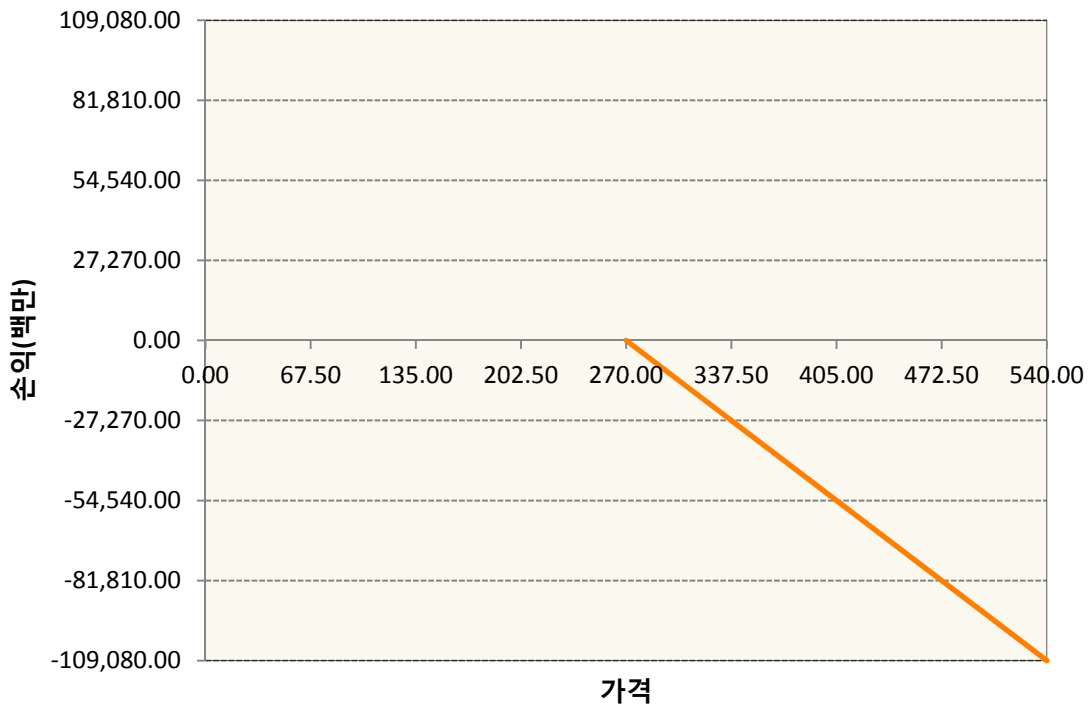
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	706,809	-706,809	장내

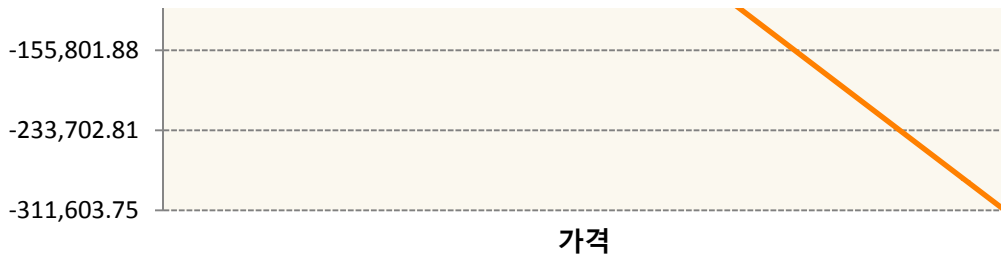
2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2702-2018-12 콜270

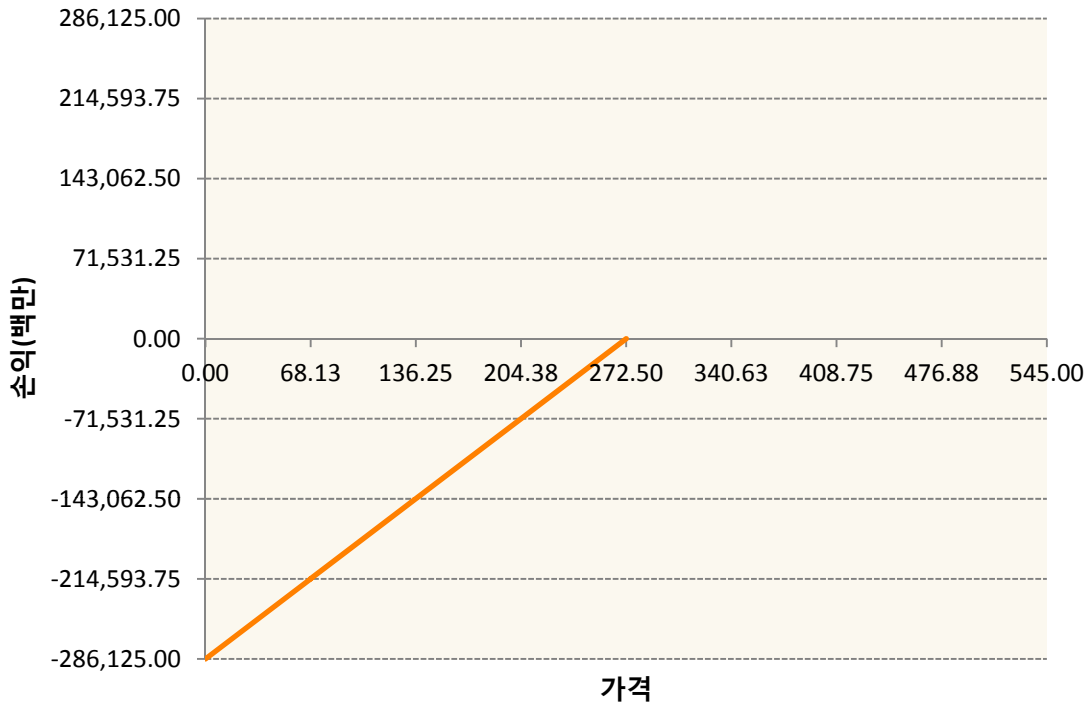


KR4201NC2728-2018-12 콜272.5





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201NC2702		2018-12 콜270					7,132
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,890	2,838	2,771	2,691	2,598	2,495	2,382
-5.33%	2,638	2,517	2,383	2,240	2,088	1,930	1,766
-2.67%	1,958	1,768	1,574	1,378	1,179	980	779
0%	628	419	210	0	-210	-420	-631
2.67%	-1,383	-1,547	-1,719	-1,898	-2,081	-2,269	-2,460
5.33%	-3,897	-3,991	-4,101	-4,225	-4,359	-4,503	-4,655
8.00%	-6,679	-6,720	-6,776	-6,846	-6,930	-7,025	-7,132
KR4201NC2728		2018-12 콜272.5					19,195
		기초자산의 변동성					
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,819	6,714	6,572	6,392	6,177	5,930	5,653

-5.33%	6,339	6,064	5,749	5,399	5,021	4,618	4,195
-2.67%	4,900	4,412	3,906	3,387	2,857	2,318	1,772
0%	1,804	1,203	601	0	-601	-1,203	-1,804
2.67%	-3,250	-3,779	-4,322	-4,875	-5,437	-6,006	-6,579
5.33%	-9,935	-10,276	-10,656	-11,069	-11,507	-11,968	-12,446
8.00%	-17,600	-17,765	-17,976	-18,228	-18,518	-18,842	-19,195
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							18,994
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18,823	-18,829	-18,840	-18,861	-18,892	-18,936	-18,994
-5.33%	-11,274	-11,329	-11,407	-11,506	-11,626	-11,766	-11,924
-2.67%	-4,225	-4,443	-4,681	-4,934	-5,201	-5,478	-5,764
0%	1,064	710	355	0	-355	-710	-1,065
2.67%	3,671	3,416	3,144	2,859	2,564	2,260	1,949
5.33%	4,407	4,320	4,207	4,070	3,911	3,731	3,534
8.00%	4,519	4,504	4,477	4,436	4,378	4,303	4,210

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

(단위:백만원)

47,262

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

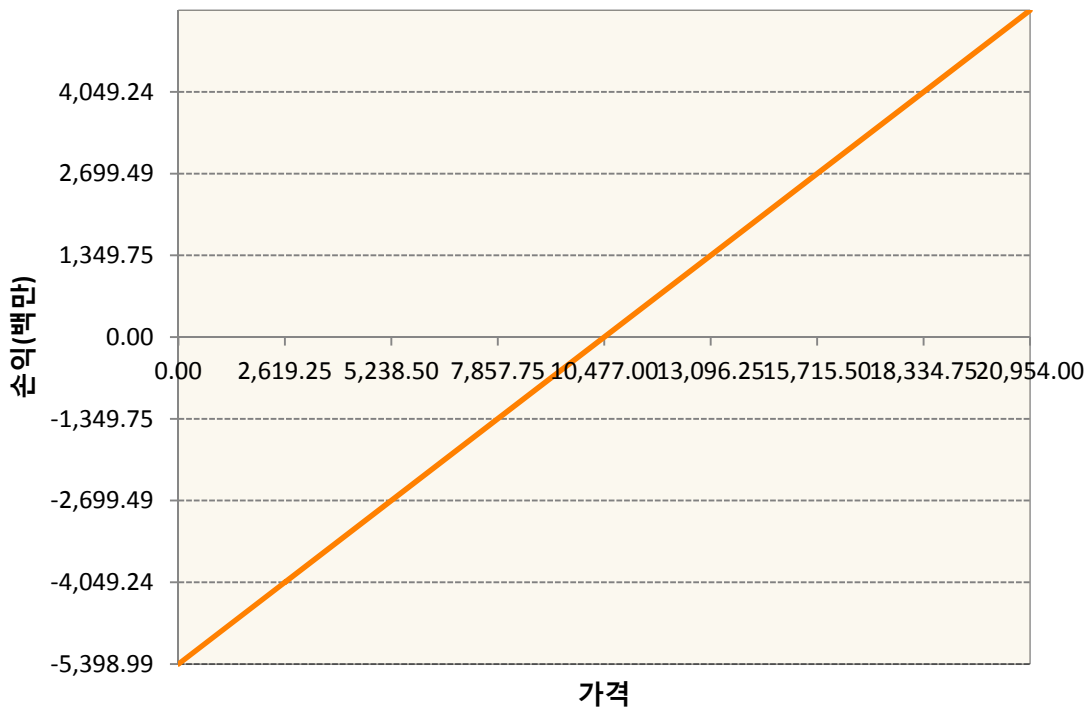
1. 계약금액

(단위:백만원)

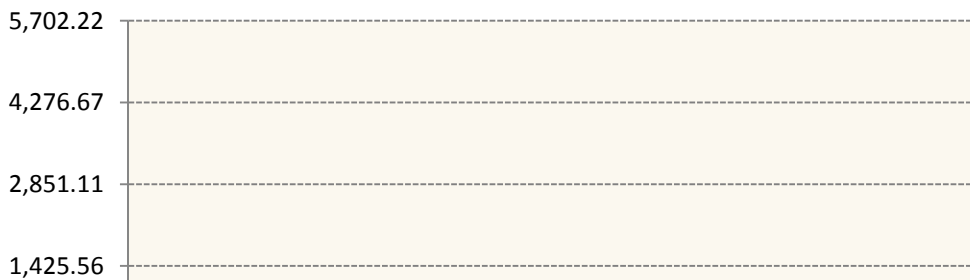
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,399	0	5,399	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,404	-11,404	장내
누계	통화	선도	433	3,176	-2,743	장외

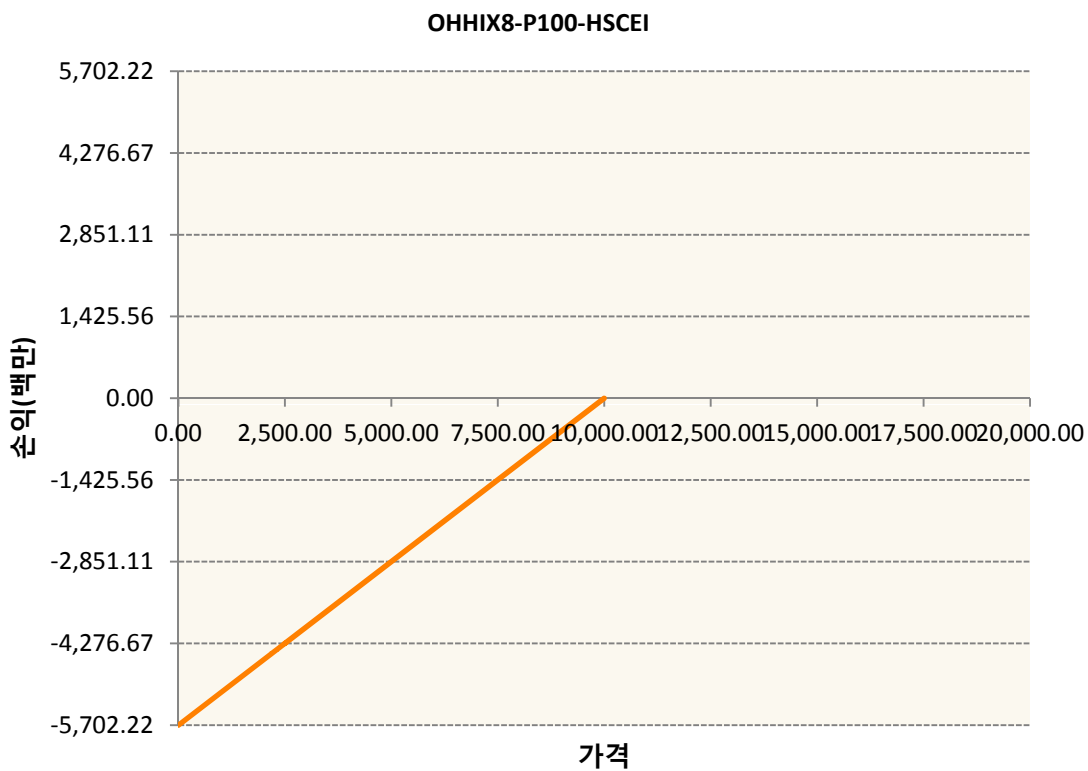
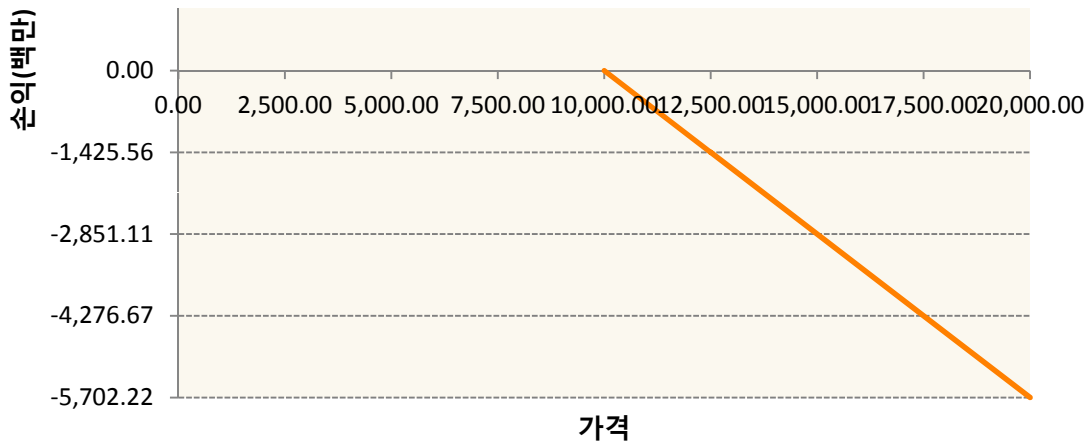
2. 만기시점의 손익구조

HCX8-HSCEI FUTURES NOV 18



OHHIX8-C100-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FX21018U00	KRW/HKD 10-12-18E	219
FX21018U03	KRW/HKD 10-12-18E	35
FX21018V01	HKD/KRW 10-12-18E	35
HCX8	HSCEI FUTURES NOV 18	432
OHHIX8-C1C	HSCEI	456
OHHIX8-P10	HSCEI	456

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

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

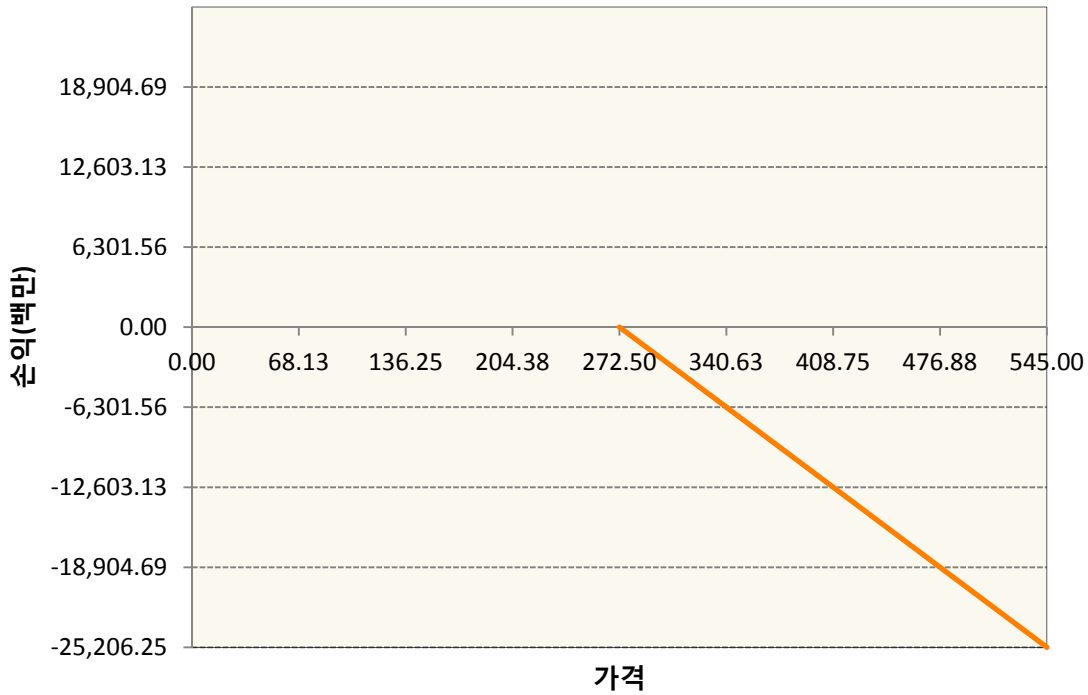
1. 계약금액

(단위:백만원)

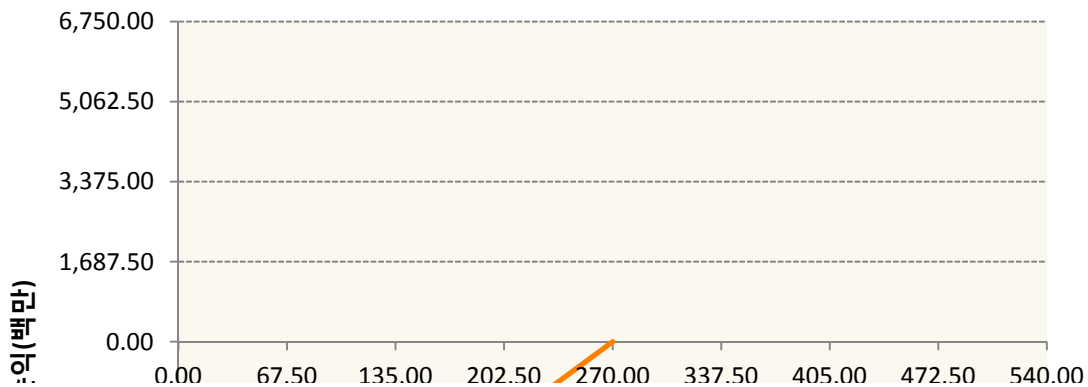
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	43,836	0	43,836	장외
누계	유가증권	옵션	0	43,538	-43,538	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201NC2728-2018-12 콜272.5

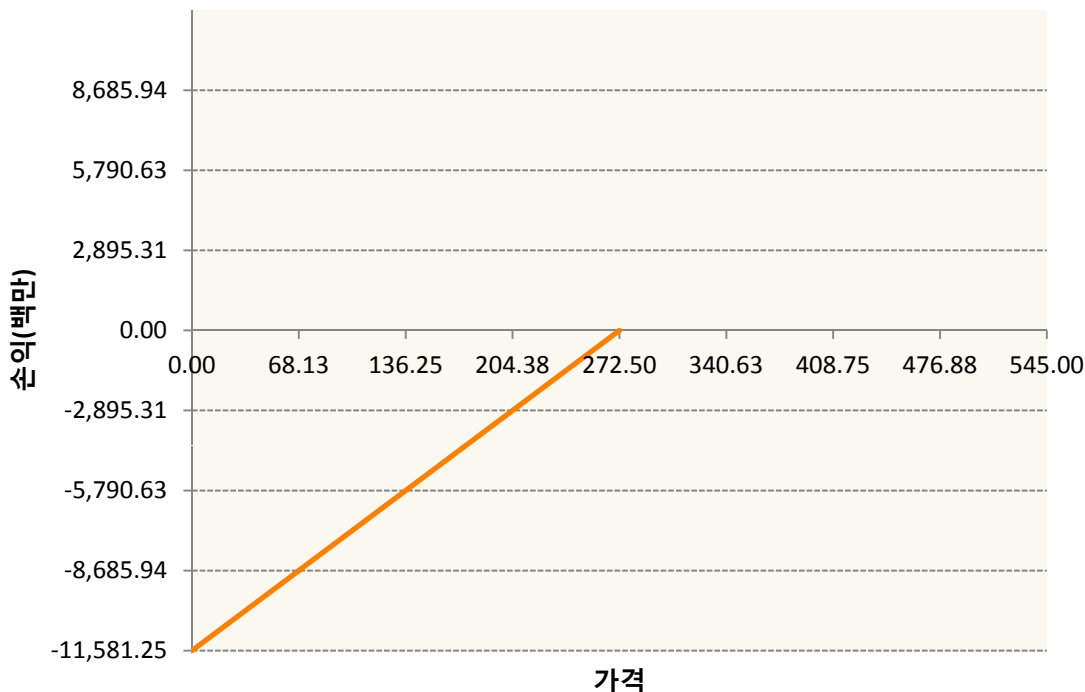


KR4301NC2701-2018-12 풋270





KR4301NC2727-2018-12 풋272.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_14				3,608
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,608	-3,608	-3,608	-3,608	-3,608	-3,608	-3,608
-5.33%	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405	-2,405
-2.67%	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203	-1,203
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,203	1,203	1,203	1,203	1,203	1,203	1,203
5.33%	2,405	2,405	2,405	2,405	2,405	2,405	2,405
8.00%	3,608	3,608	3,608	3,608	3,608	3,608	3,608
	KR4201NC2728		2018-12 콜272.5				1,553
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	552	543	532	517	500	480	457
-5.33%	513	491	465	437	406	374	339
-2.67%	396	357	316	274	231	187	143
0%	146	97	49	0	-49	-97	-146
2.67%	-263	-306	-350	-394	-440	-486	-532
5.33%	-804	-831	-862	-895	-931	-968	-1,007
8.00%	-1,424	-1,437	-1,454	-1,475	-1,498	-1,524	-1,553

KR4301NC2701 2018-12 풋270 422

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-416	-416	-417	-417	-419	-420	-422
-5.33%	-238	-240	-243	-246	-250	-255	-259
-2.67%	-80	-87	-94	-101	-108	-115	-123
0%	25	16	8	0	-8	-17	-25
2.67%	67	63	58	52	46	40	34
5.33%	77	76	74	72	69	66	62
8.00%	78	78	77	77	76	75	73

KR4301NC2727 2018-12 풋272.5 769

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-762	-762	-763	-763	-765	-766	-769
-5.33%	-456	-459	-462	-466	-471	-476	-483
-2.67%	-171	-180	-189	-200	-211	-222	-233
0%	43	29	14	0	-14	-29	-43
2.67%	149	138	127	116	104	91	79
5.33%	178	175	170	165	158	151	143
8.00%	183	182	181	180	177	174	170

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

(단위:백만원)

6,446

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

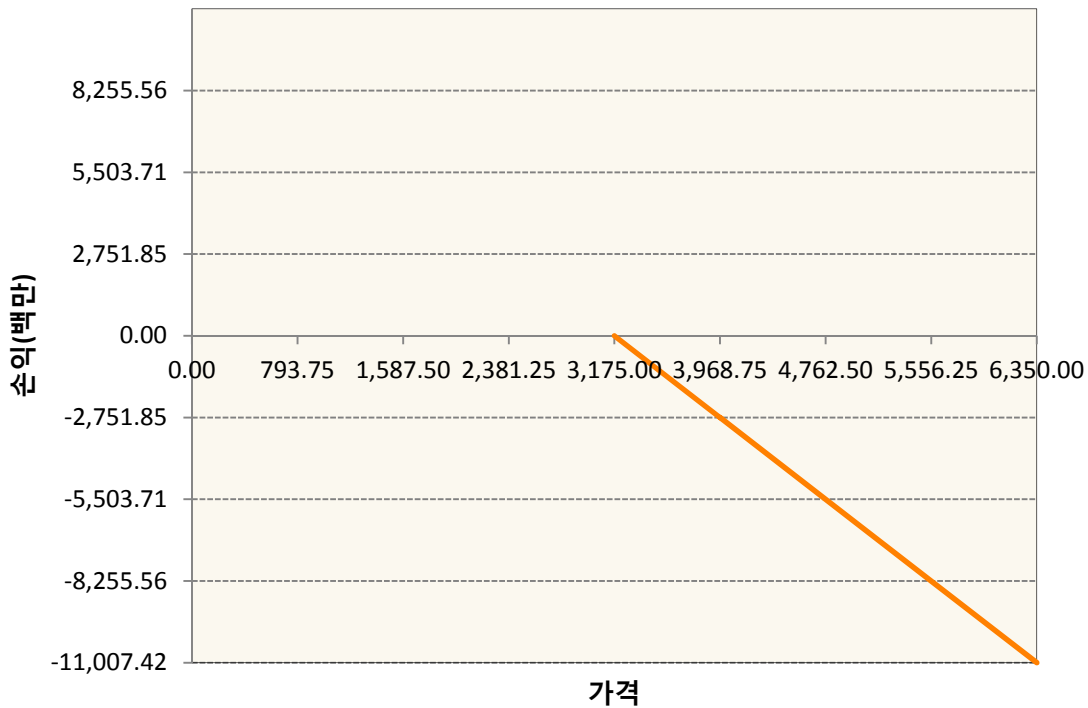
1. 계약금액

(단위:백만원)

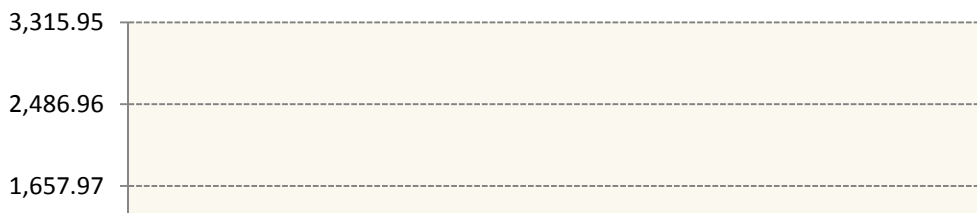
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,097	0	8,097	
누계	유가증권	스왑	71,451	0	71,451	장외
누계	유가증권	옵션	0	28,647	-28,647	장내
누계	통화	선도	0	15,351	-15,351	장외

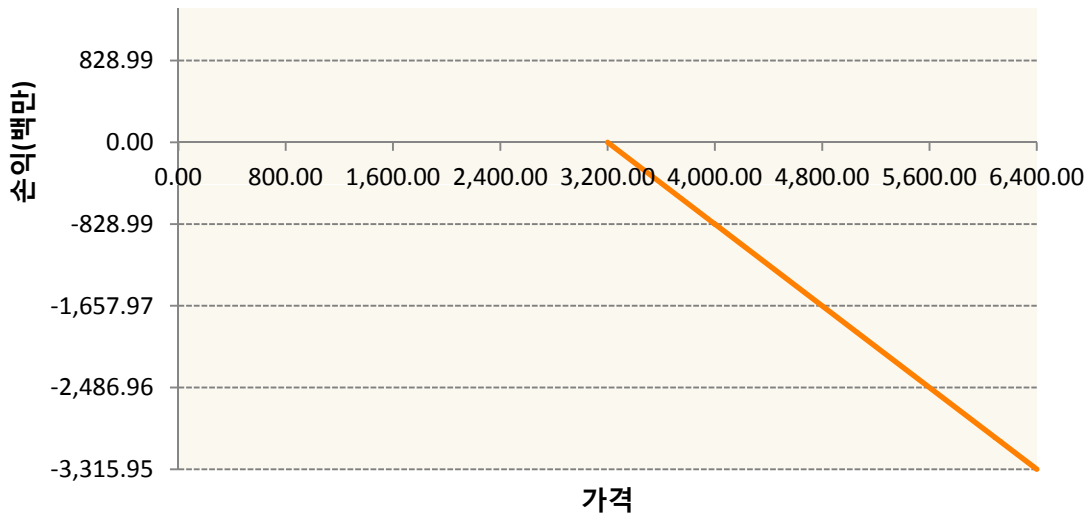
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ8-C3175-EURO STOXX 50

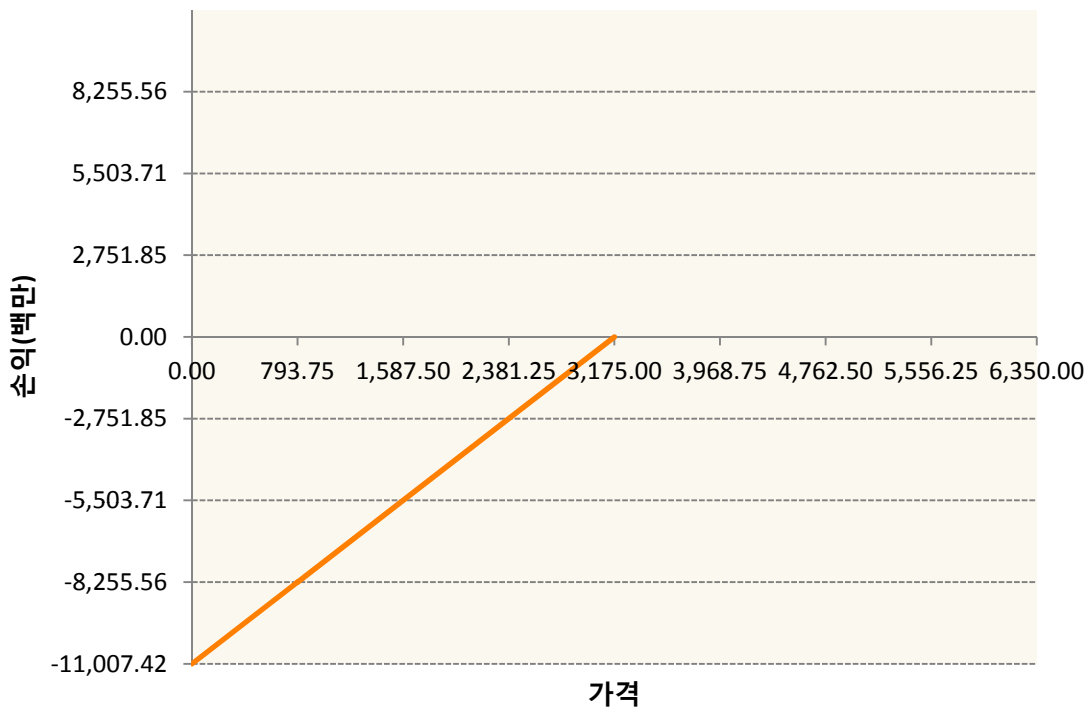


OESXZ8-C3200-EURO STOXX 50

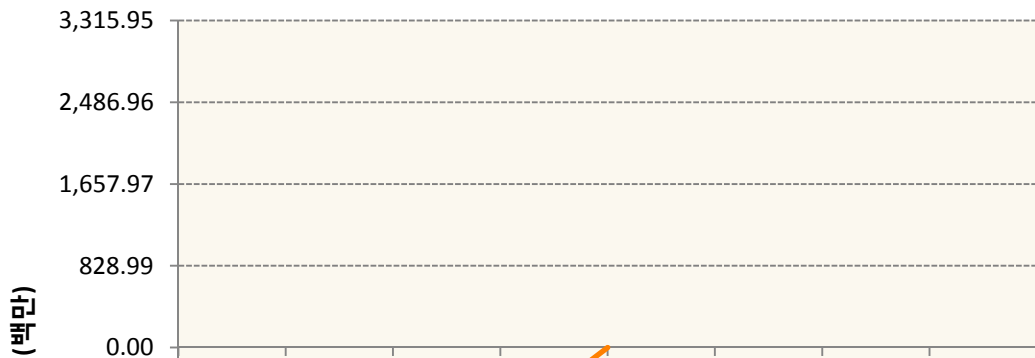


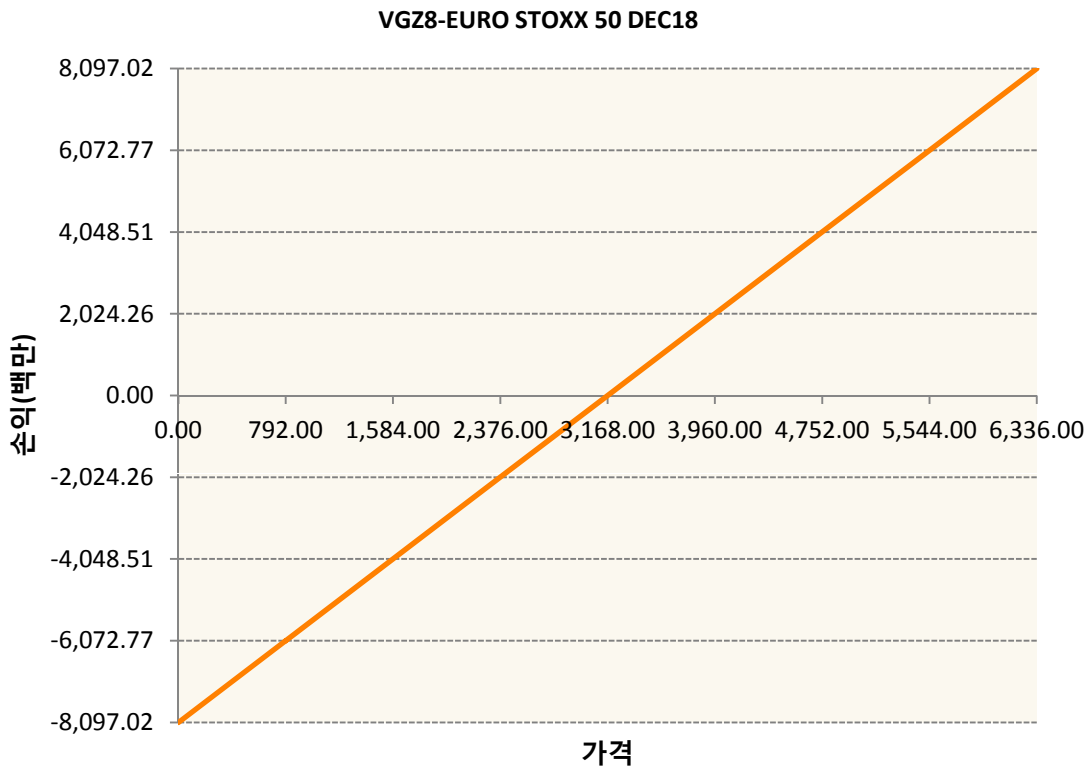
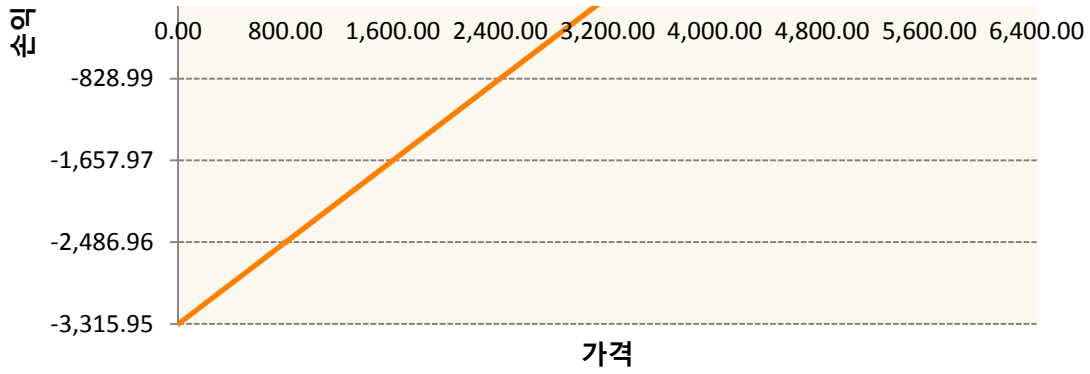


OESXZ8-P3175-EURO STOXX 50



OESXZ8-P3200-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		53
FX21018U03 KRW/EUR 21-12-18E		819
FX21018X02 KRW/EUR 22-02-19E		409
OESXZ8-C31 EURO STOXX 50		881
OESXZ8-C32 EURO STOXX 50		265
OESXZ8-P31 EURO STOXX 50		881
OESXZ8-P32 EURO STOXX 50		265
VGZ8	EURO STOXX 50 DEC18	648

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

(단위:백만원)

2,600

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

(단위:백만원)

1,102

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

(단위:백만원)

93

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

(단위:백만원)

140

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

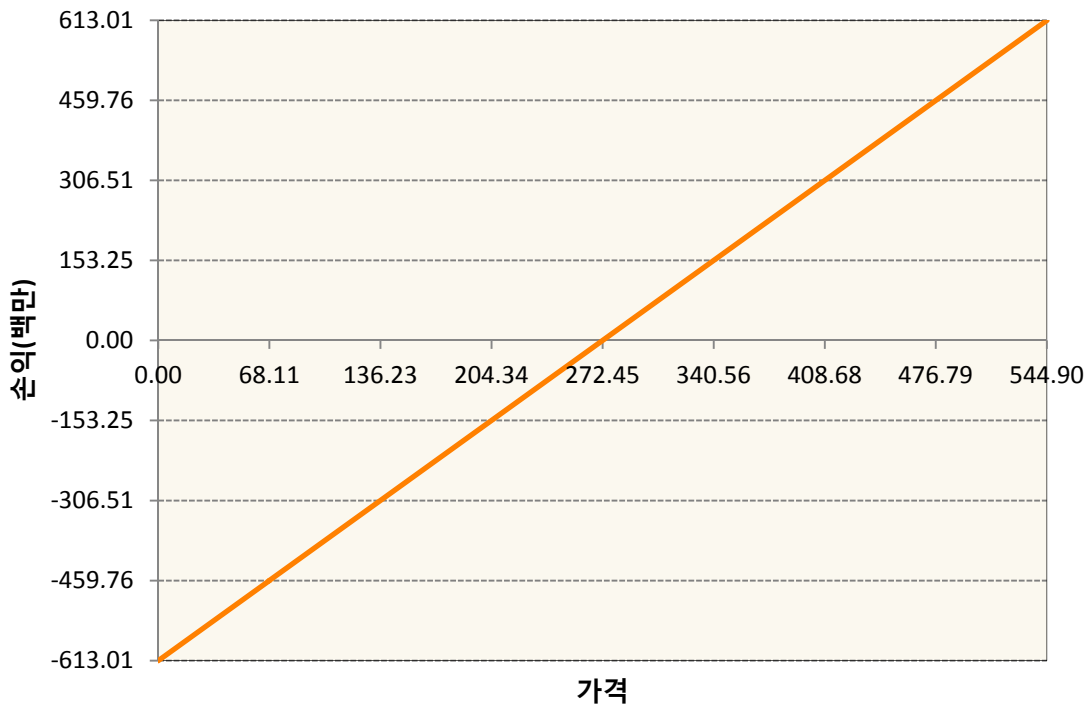
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	613	0	613	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						49
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

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

(단위:백만원)

42

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

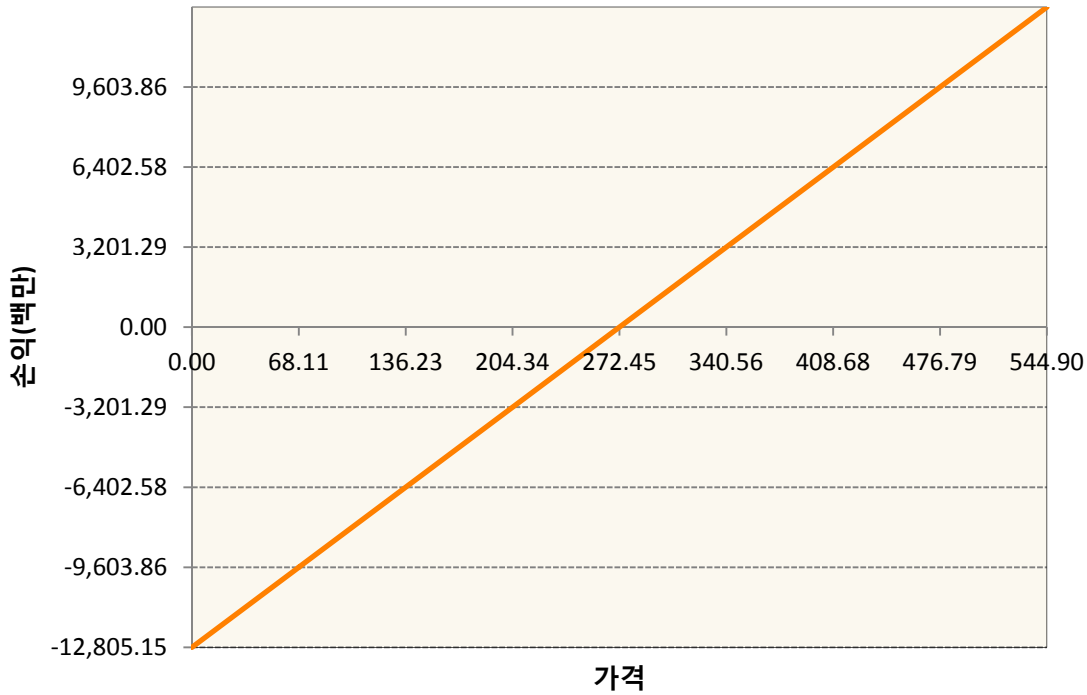
1. 계약금액

(단위:백만원)

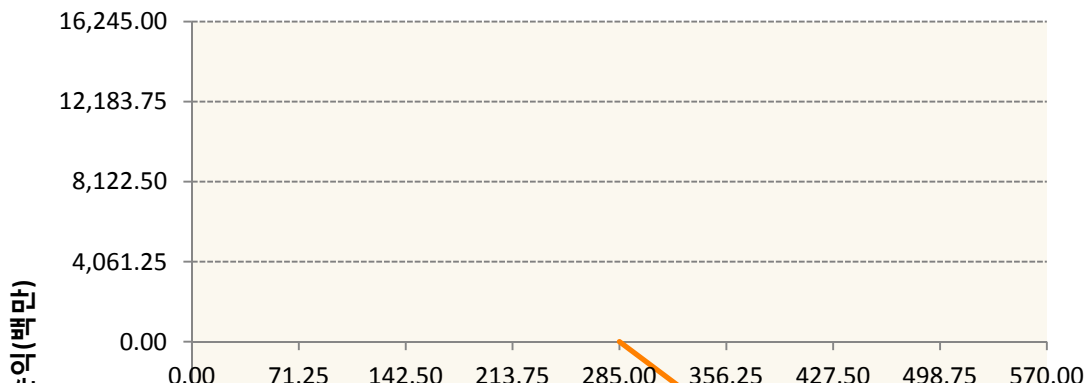
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,805	0	12,805	장내
누계	유가증권	옵션	3,743	22,858	-19,115	장내

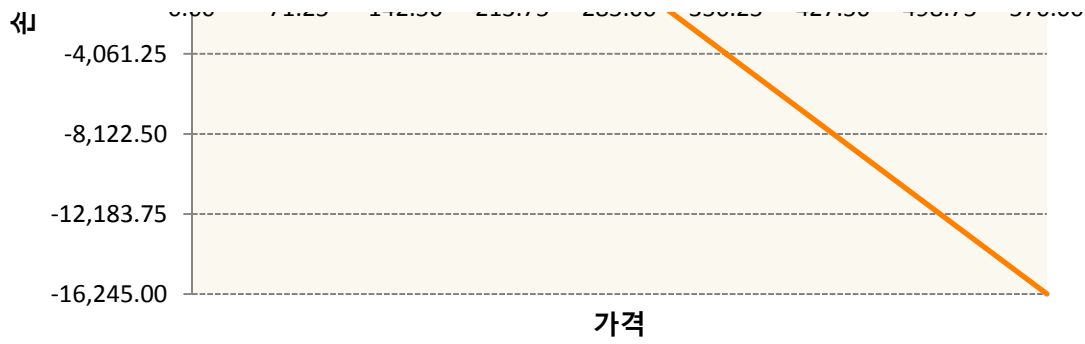
2. 만기시점의 손익구조

KR4101NC0004-2018-12 코스피200지수선물

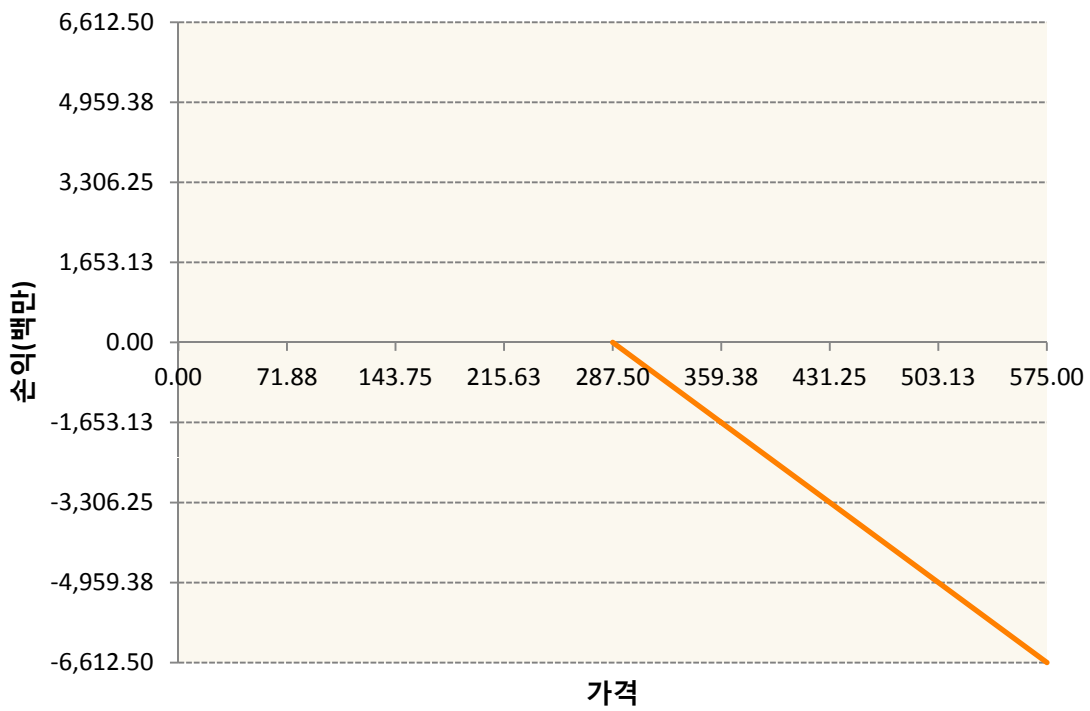


KR4201NC2850-2018-12 콜285

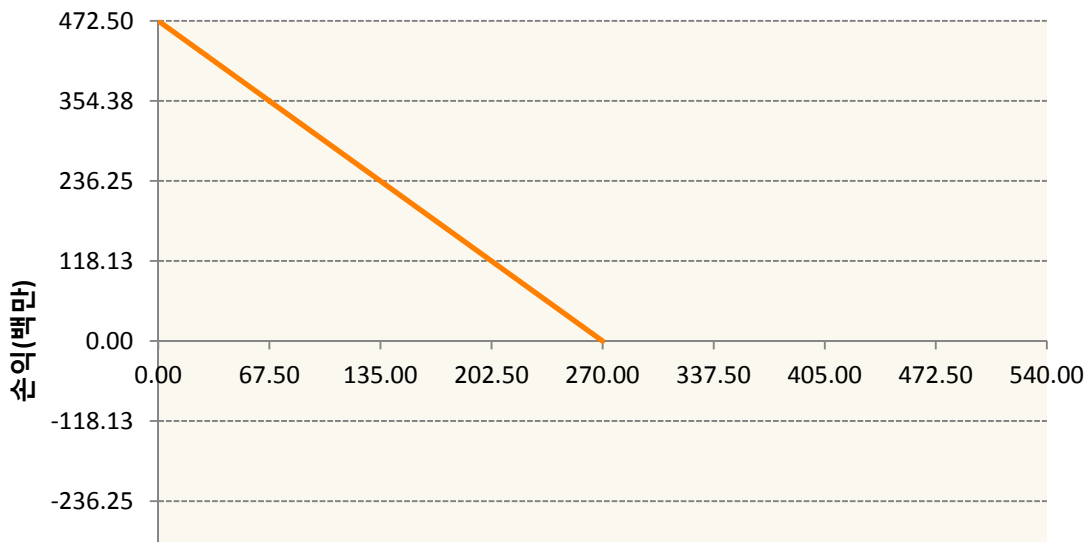


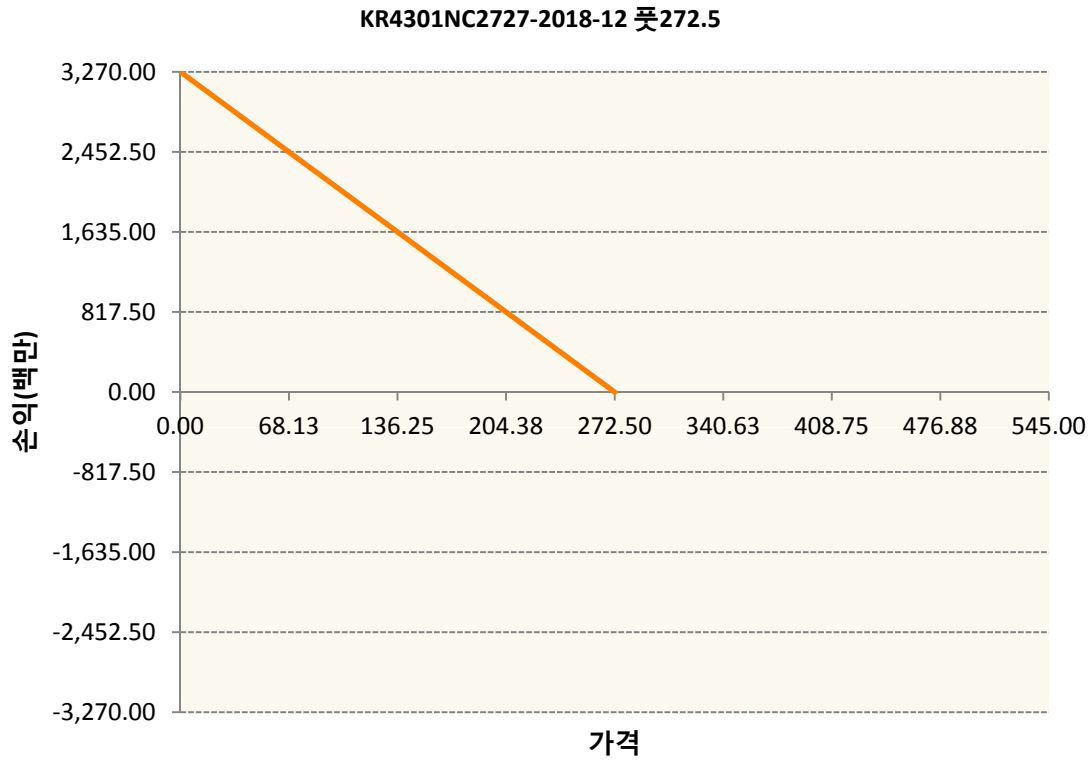
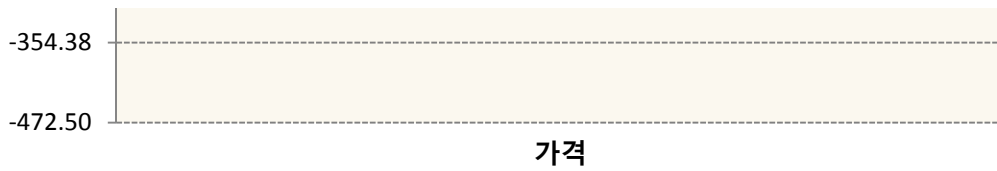


KR4201NC2876-2018-12 콜287.5



KR4301NC2701-2018-12 풋270





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101NC0004		2018-12 코스피200지수선물						1,023
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	
-5.33%	-682	-682	-682	-682	-682	-682	-682	
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	341	341	341	341	341	341	341	
5.33%	682	682	682	682	682	682	682	
8.00%	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	
KR4201NC2850		2018-12 콜285						658
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	110	110	109	107	104	100	94	
-5.33%	108	106	102	96	88	80	69	
-2.67%	98	89	79	66	52	36	18	

0%	60	42	22	0	-23	-47	-71
2.67%	-36	-64	-93	-122	-151	-181	-210
5.33%	-218	-249	-281	-312	-343	-375	-406
8.00%	-493	-518	-545	-572	-601	-629	-658
KR4201NC2876 2018-12 콜287.5							240
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	33	32	31	29
-5.33%	34	33	32	30	28	25	21
-2.67%	31	29	25	21	16	11	4
0%	20	14	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-9	-19	-30	-41	-52	-64	-75
5.33%	-70	-82	-95	-108	-121	-133	-146
8.00%	-168	-180	-191	-203	-216	-228	-240
KR4301NC2701 2018-12 풋270							30
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	30
-5.33%	17	17	17	17	18	18	18
-2.67%	6	6	7	7	8	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-4	-4	-4	-3	-3	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
KR4301NC2727 2018-12 풋272.5							217
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	215	215	215	216	216	216	217
-5.33%	129	129	130	131	133	134	136
-2.67%	48	51	53	56	59	63	66
0%	-12	-8	-4	0	4	8	12
2.67%	-42	-39	-36	-33	-29	-26	-22
5.33%	-50	-49	-48	-47	-45	-43	-40
8.00%	-52	-51	-51	-51	-50	-49	-48

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

(단위:백만원)

1,741

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	125	0	125	

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	2018-11-28
기준일	2018-11-27

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	1,453	0	1,453	

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	2018-11-28
기준일	2018-11-27

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	182	0	182	
누계	통화	선도	3	181	-179	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FX21018X01 KRW/USD 13-12-18E		9
FX21018X01 KRW/USD 30-11-18E		2
FX21018X01 KRW/USD 30-11-18E		3
FX21018X02 KRW/USD 30-11-18E		1
FX21018X03 USD/KRW 30-11-18E		0.2

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

(단위:백만원)

6

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

(단위:백만원)

151

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

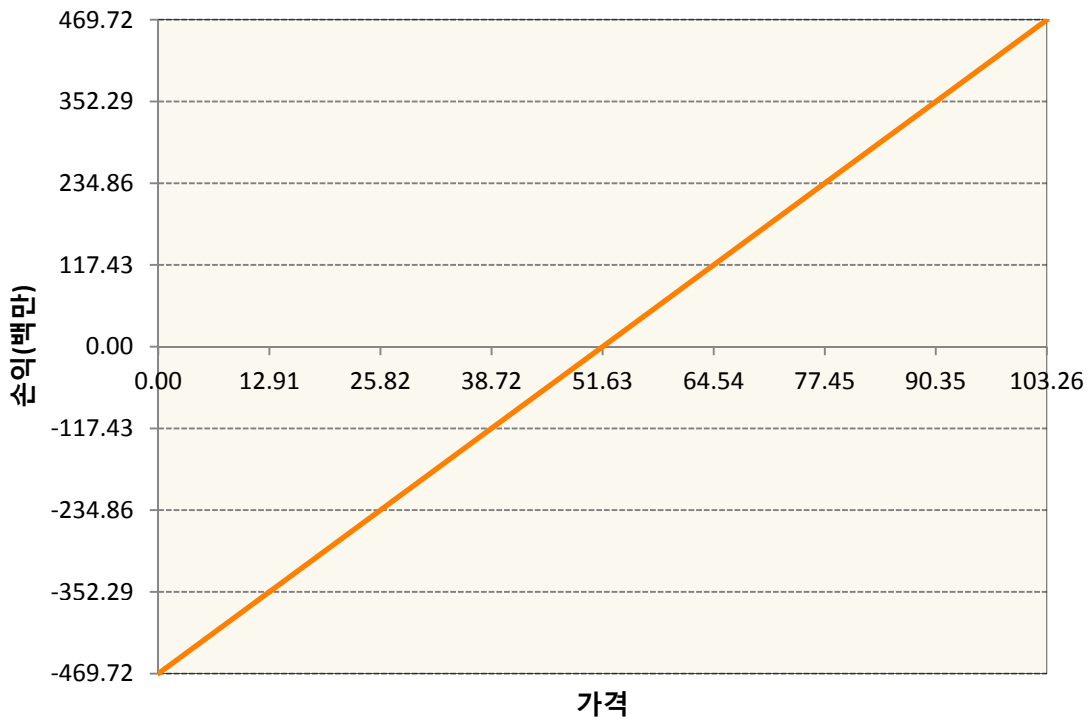
1. 계약금액

(단위:백만원)

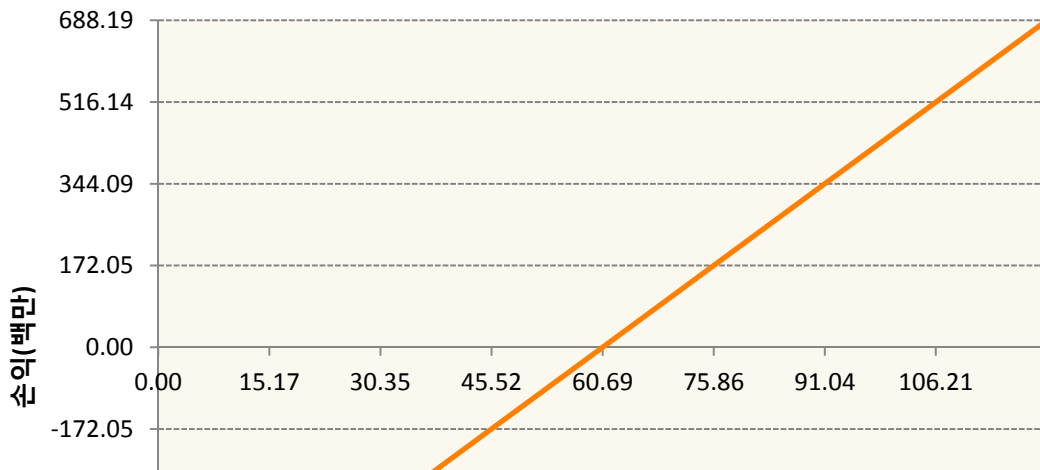
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,009	407	2,602	

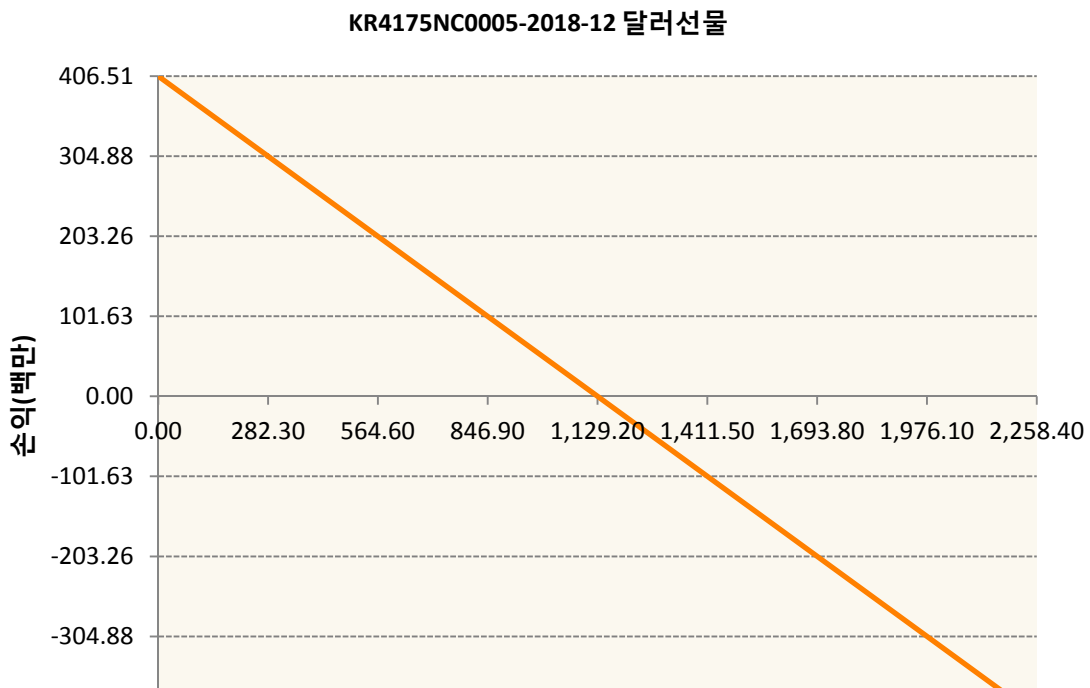
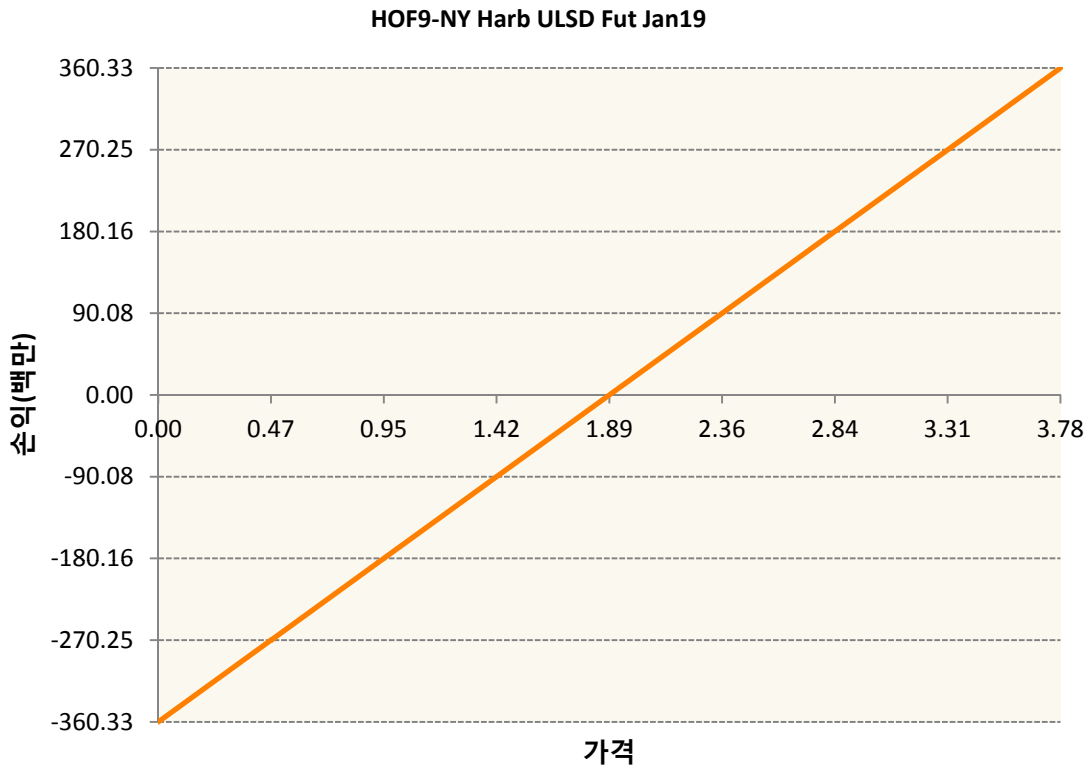
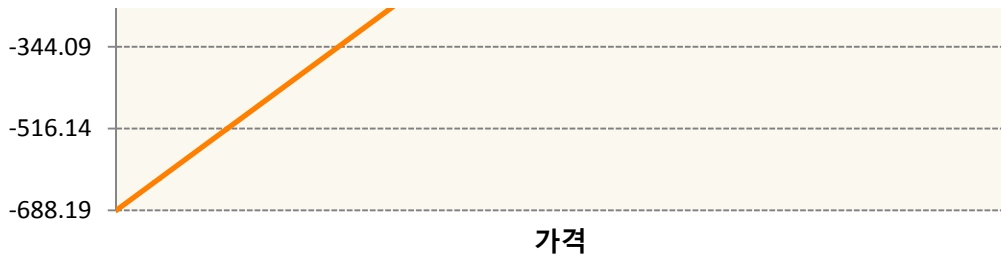
2. 만기시점의 손익구조

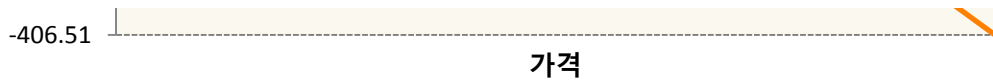
CLF9-WTI CRUDE FUTURE Jan19



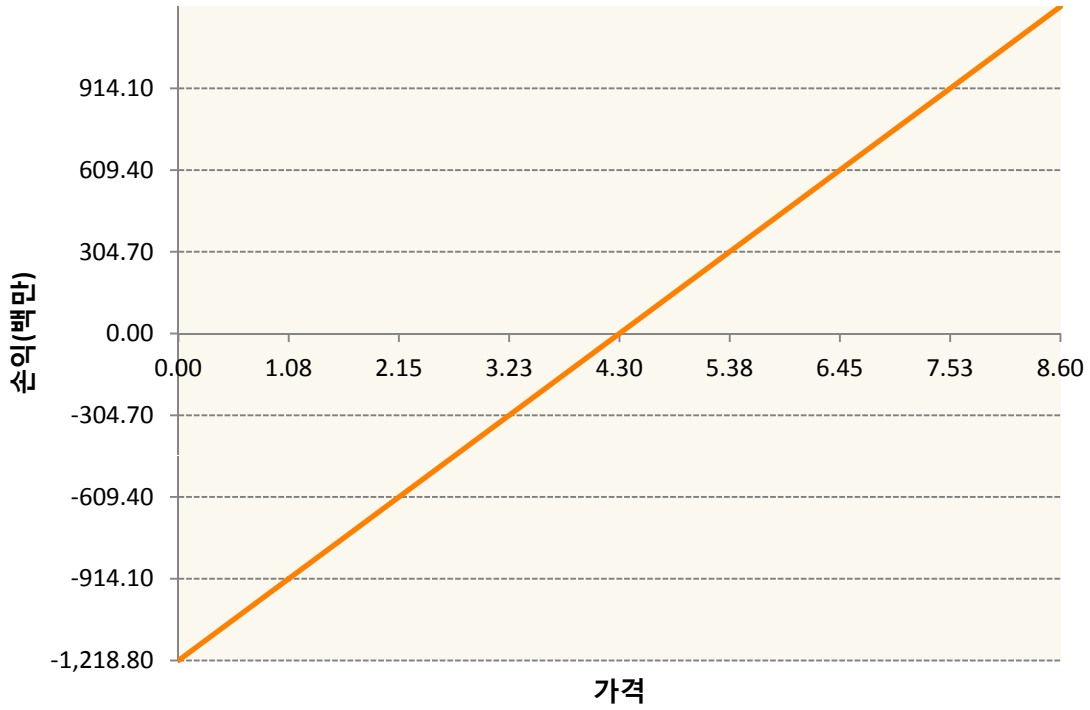
COH9-BRENT CRUDE FUTR Mar19



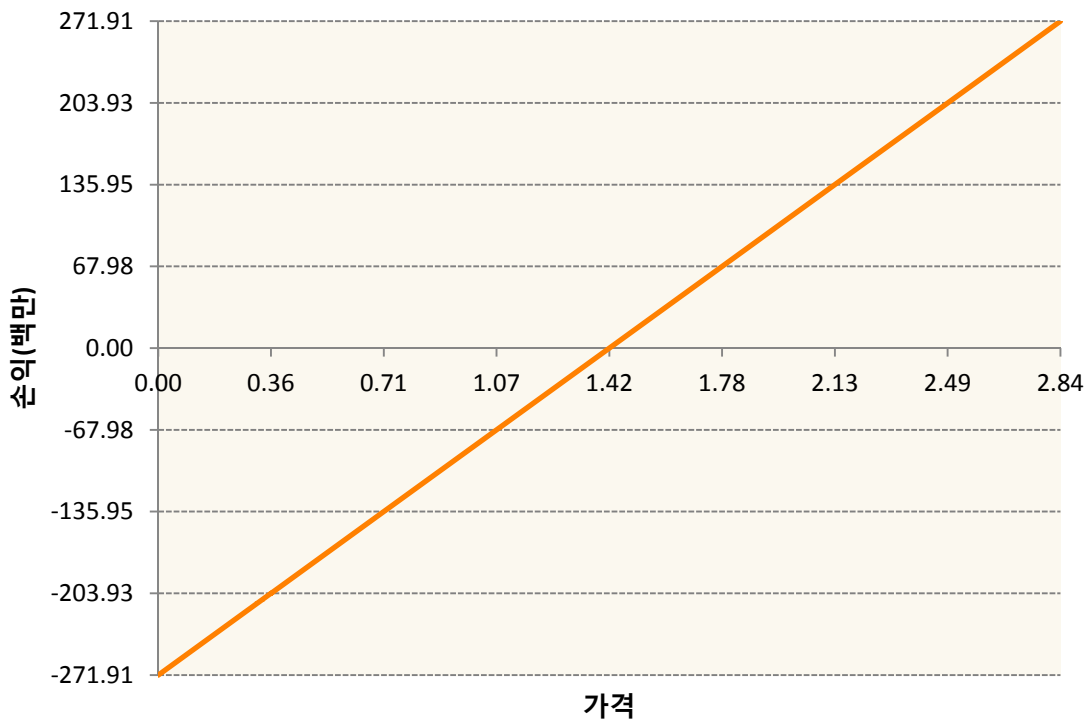




NGF19-NATURAL GAS FUTR Jan19



XBF9-GASOLINE RBOB FUT Jan19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF9	WTI CRUDE FUTURE Jan19	38
COH9	BRENT CRUDE FUTR Mar19	55
HOF9	NY Harb ULSD Fut Jan19	29
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	33
NGF19	NATURAL GAS FUTR Jan19	98
XBF9	GASOLINE RBOB FUT Jan19	22

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

425

공시일	2018-11-28
기준일	2018-11-27

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

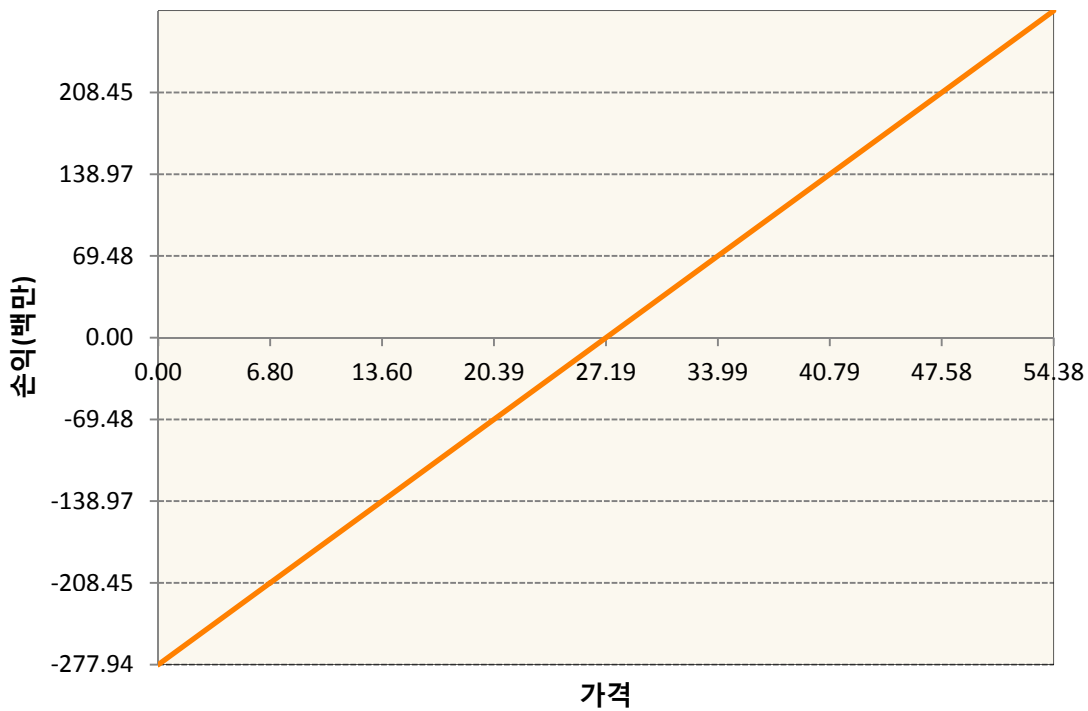
1. 계약금액

(단위:백만원)

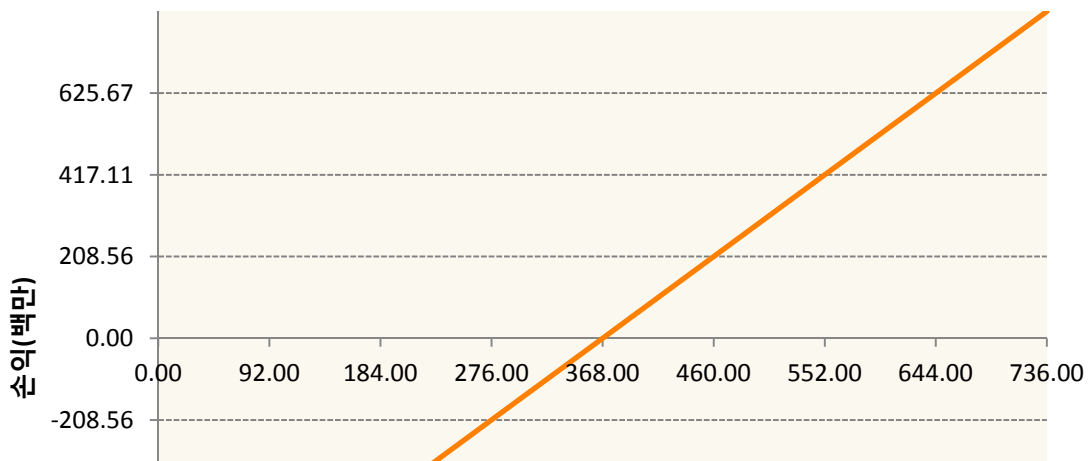
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,621	79	3,542	

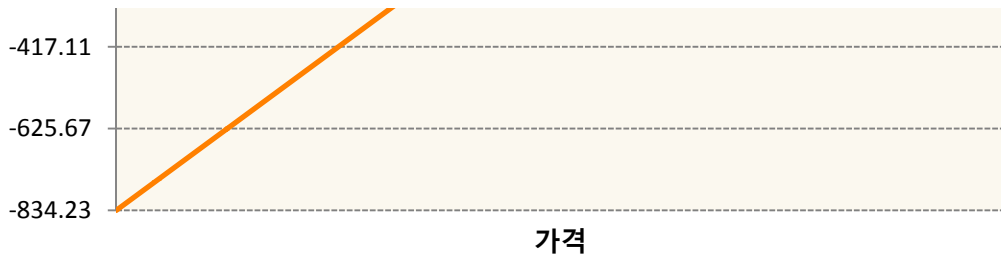
2. 만기시점의 손익구조

BOF9-SOYBEAN OIL FUTR Jan19

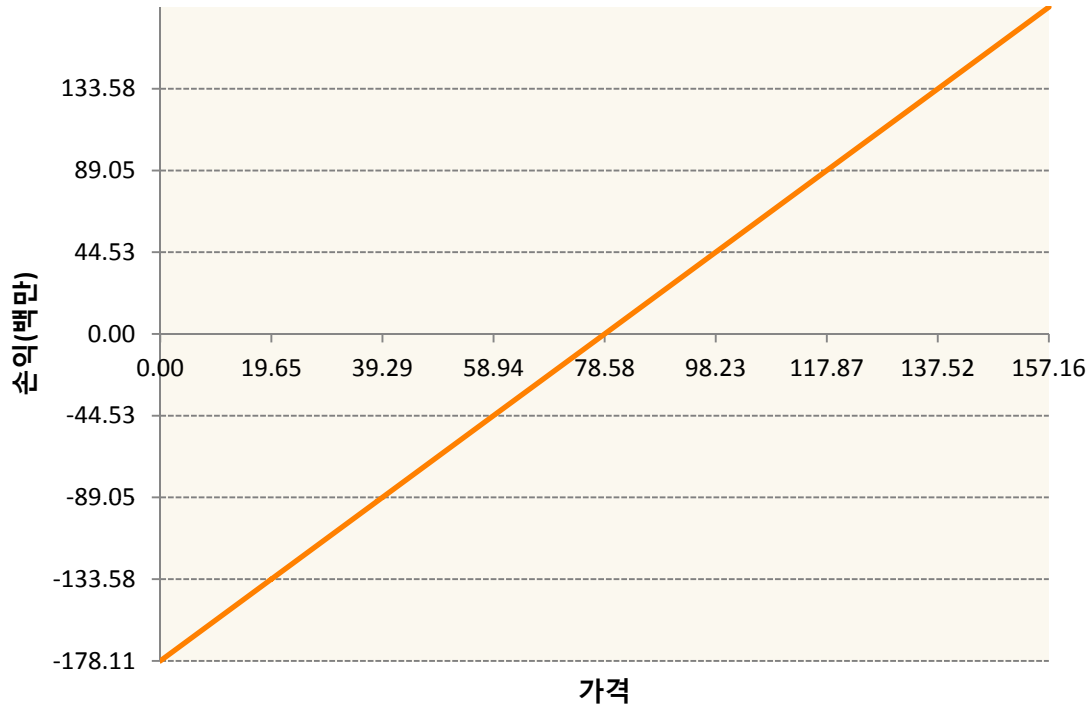


CH9-CORN FUTURE Mar19

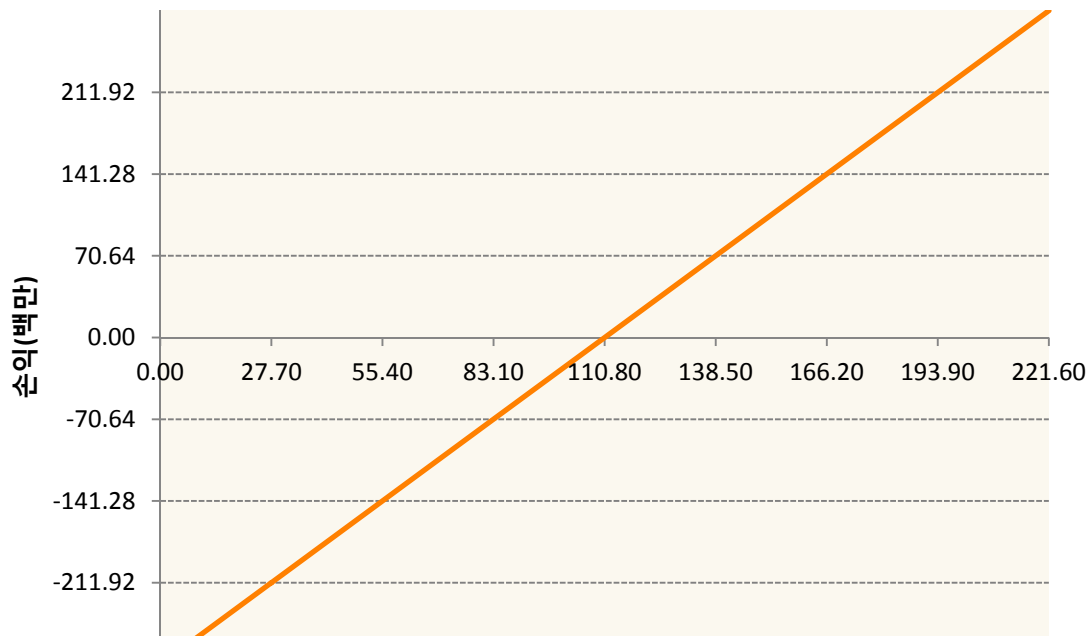


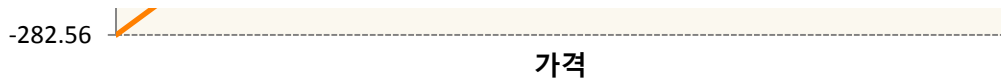


CTH9-COTTON NO.2 FUTR Mar19

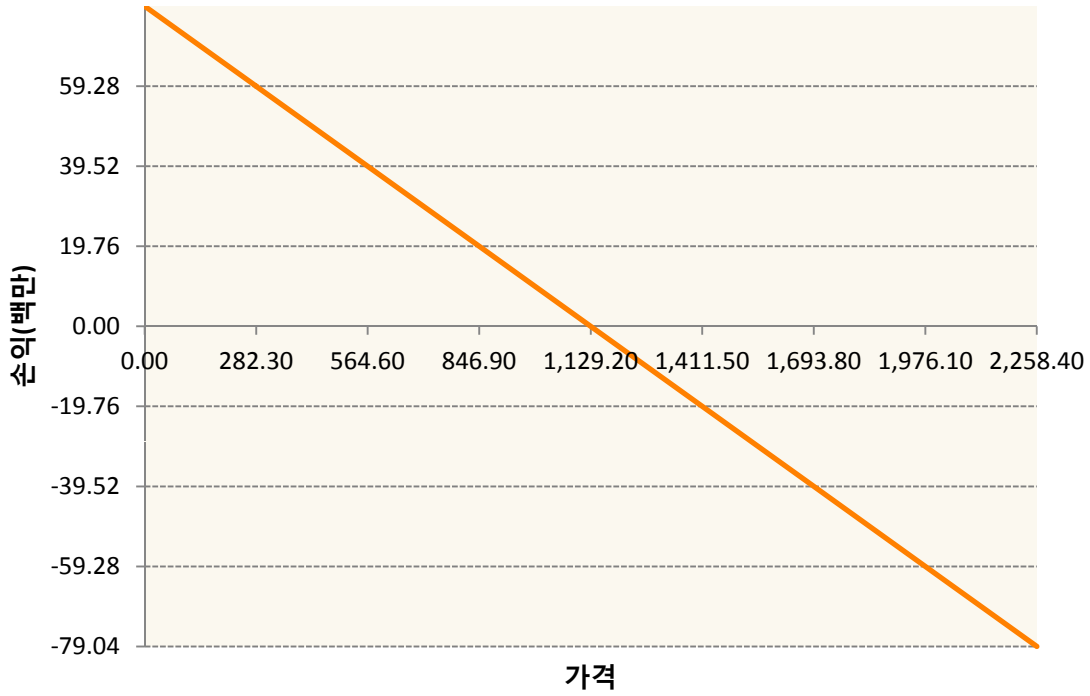


KCH9-COFFEE 'C' FUTURE Mar19

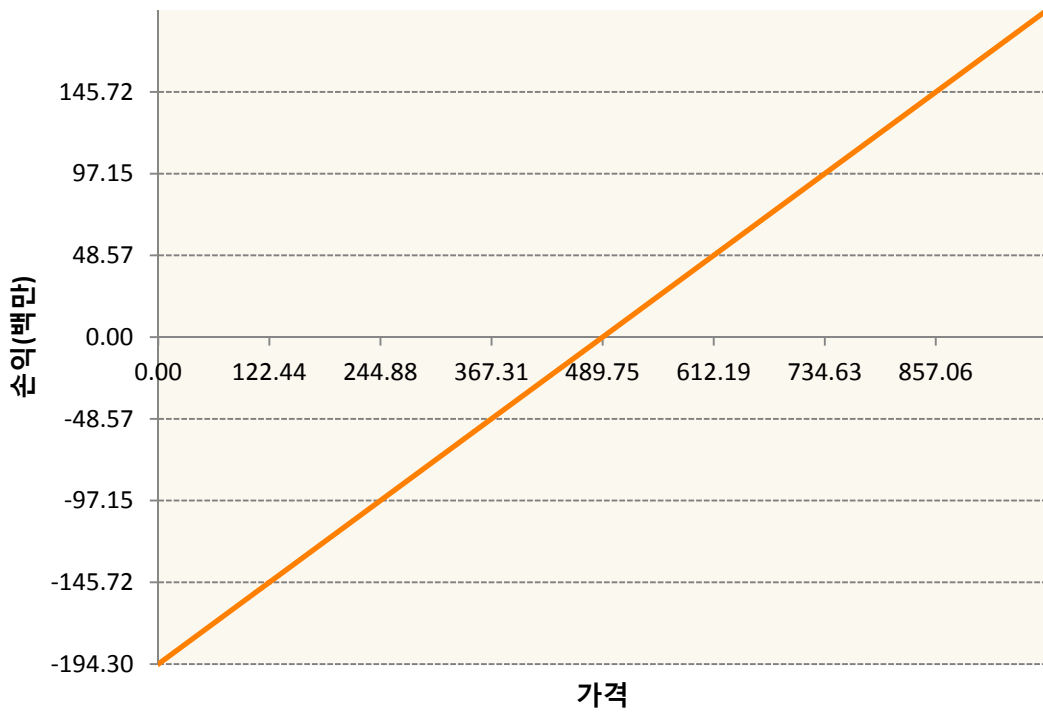




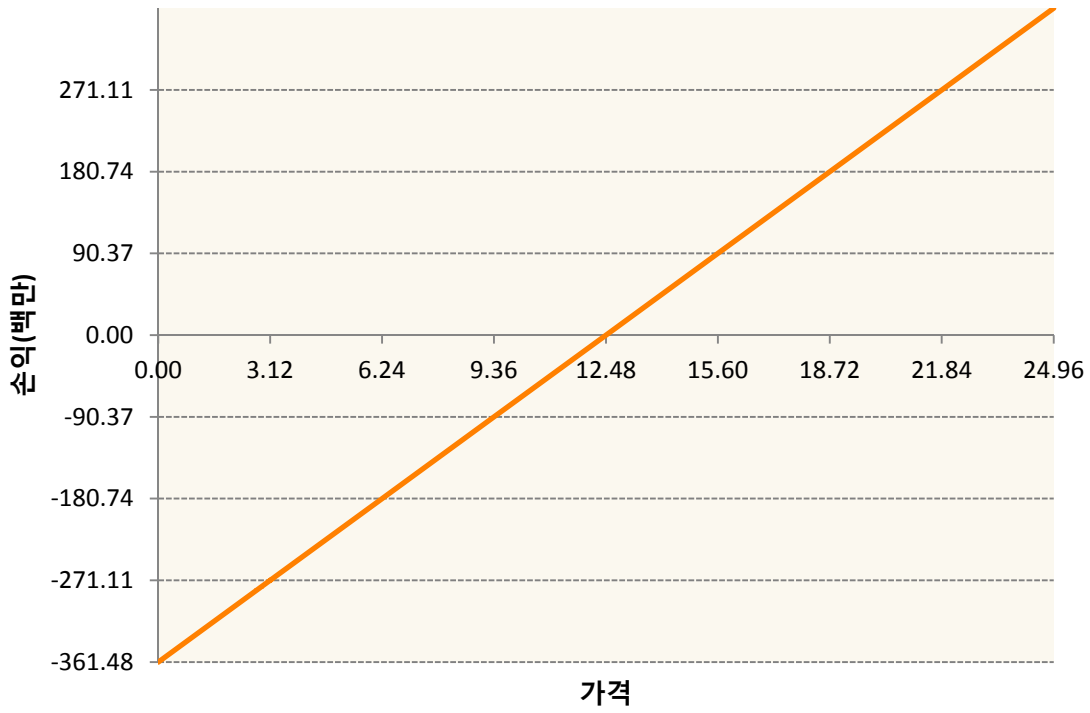
KR4175NC0005-2018-12 달러선물



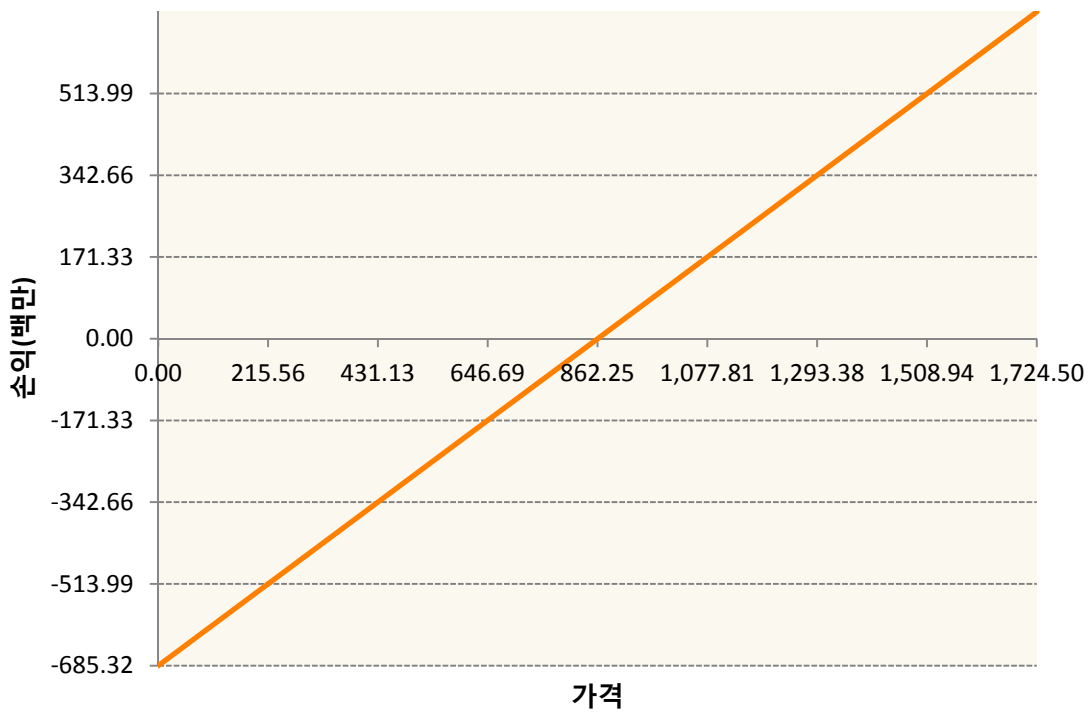
KWH9-KC HRW WHEAT FUT Mar19



SBH9-SUGAR #11 (WORLD) MAR19

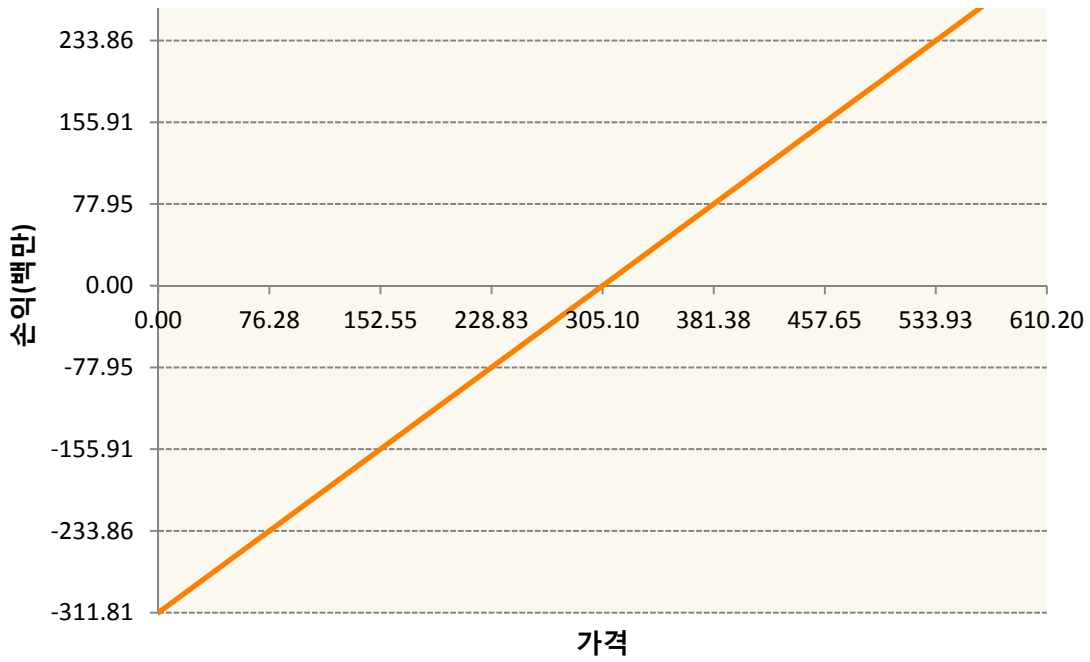


SF9-SOYBEAN FUTURE Jan19

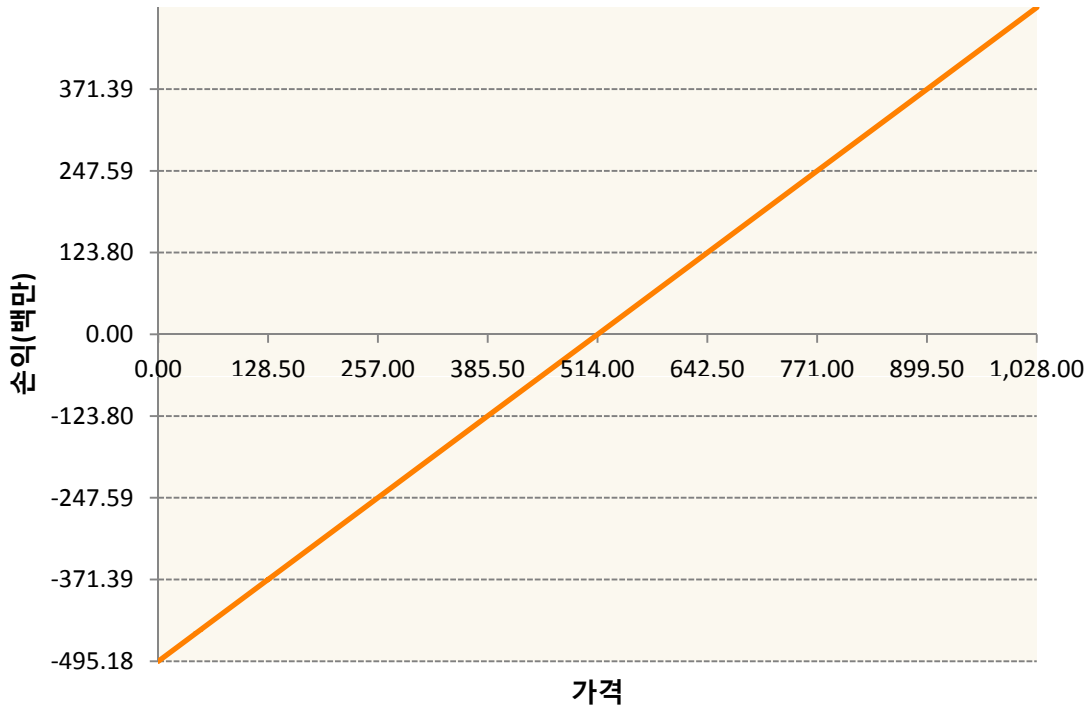


SMF9-SOYBEAN MEAL FUTR Jan19





WH9-WHEAT FUTURE(CBT) Mar19



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF9	SOYBEAN OIL FUTR Jan19	22
CH9	CORN FUTURE Mar19	67
CTH9	COTTON NO.2 FUTR Mar19	14
KCH9	COFFEE 'C' FUTURE Mar19	23
KR4175NC0	(2018-12 달러선물	6

KWH9	KC HRW WHEAT FUT Mar19	16
SBH9	SUGAR #11 (WORLD) MAR19	29
SF9	SOYBEAN FUTURE Jan19	55
SMF9	SOYBEAN MEAL FUTR Jan19	25
WH9	WHEAT FUTURE(CBT) Mar19	40

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

(단위:백만원)

317