| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-16 |
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 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 | 10 | 0 | 10 | 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 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 스마트인덱스모

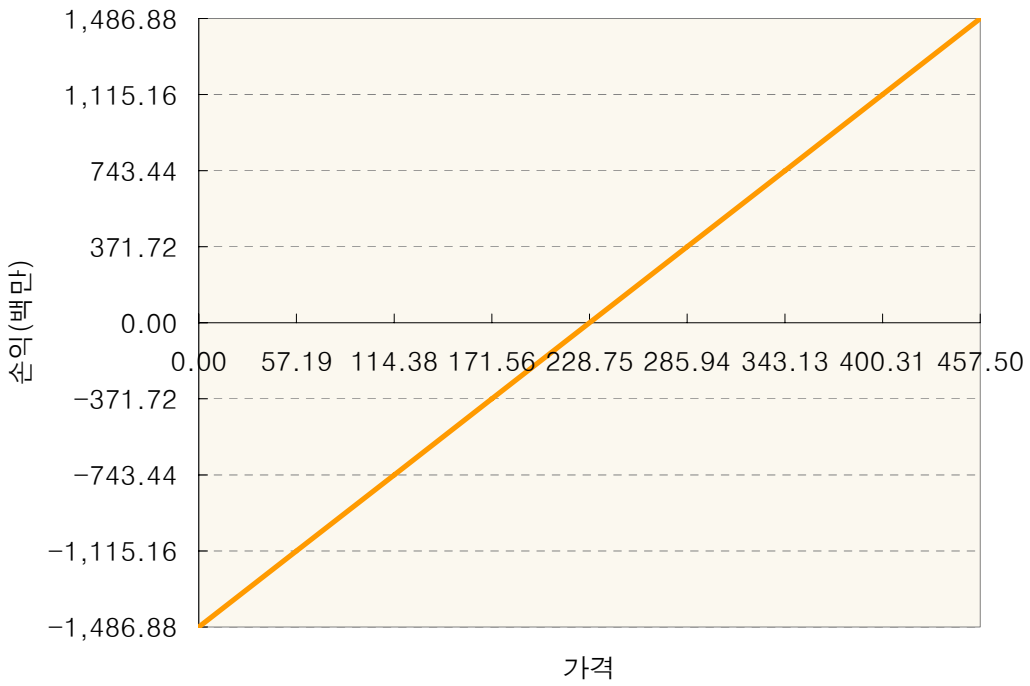
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

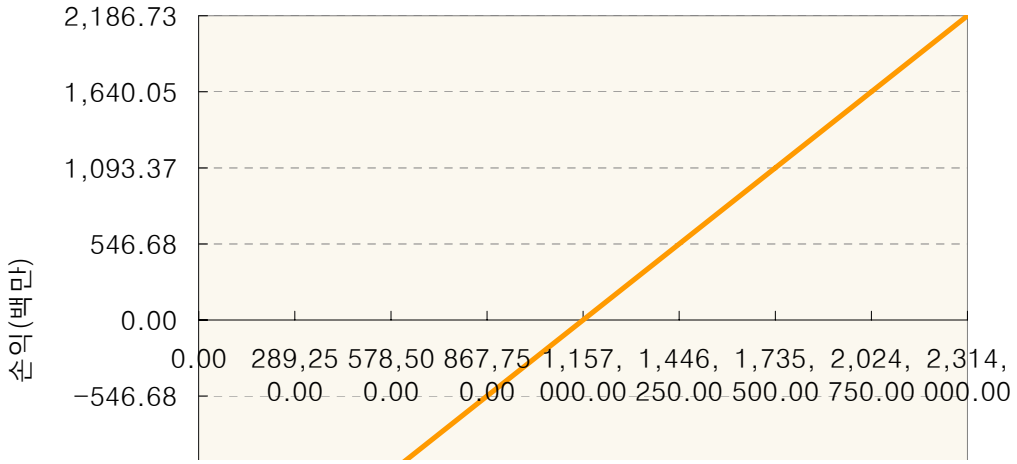
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 185 | 0 | 185 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,674 | 0 | 3,674 | 장내 |

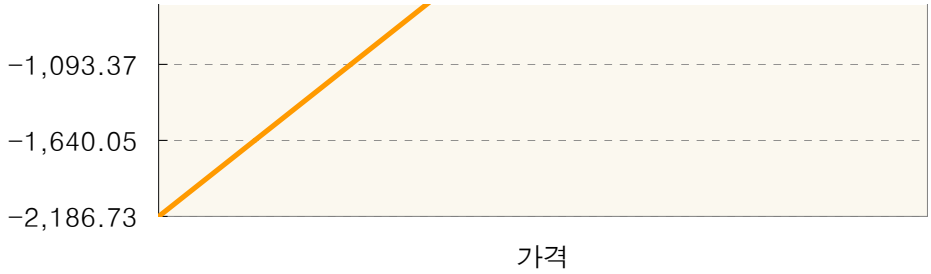
## 2. 만기시점의 손익구조

KR4101L30006-2016-03 코스피200지수선물




KR4111L30005-2016-03 삼성전자개별선물






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L3001 2016-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 119 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -119 | -119 | -119 | -119 | -119 | -119 | -119 |
| -5.33% | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 |
| -2.67% | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 |
| 5.33% | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 |
| 8.00% | 119 | 119 | 119 | 119 | 119 | 119 | 119 |
| KR4111L3001 2016-03 삼성전자개별선물 | | | | | | | 174 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -174 | -174 | -174 | -174 | -174 | -174 | -174 |
| -5.33% | -116 | -116 | -116 | -116 | -116 | -116 | -116 |
| -2.67% | -58 | -58 | -58 | -58 | -58 | -58 | -58 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 58 | 58 | 58 | 58 | 58 | 58 | 58 |
| 5.33% | 116 | 116 | 116 | 116 | 116 | 116 | 116 |
| 8.00% | 174 | 174 | 174 | 174 | 174 | 174 | 174 |

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

(단위:백만원)

| 270 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-16 |
| 기준일 | 2016-02-15 |

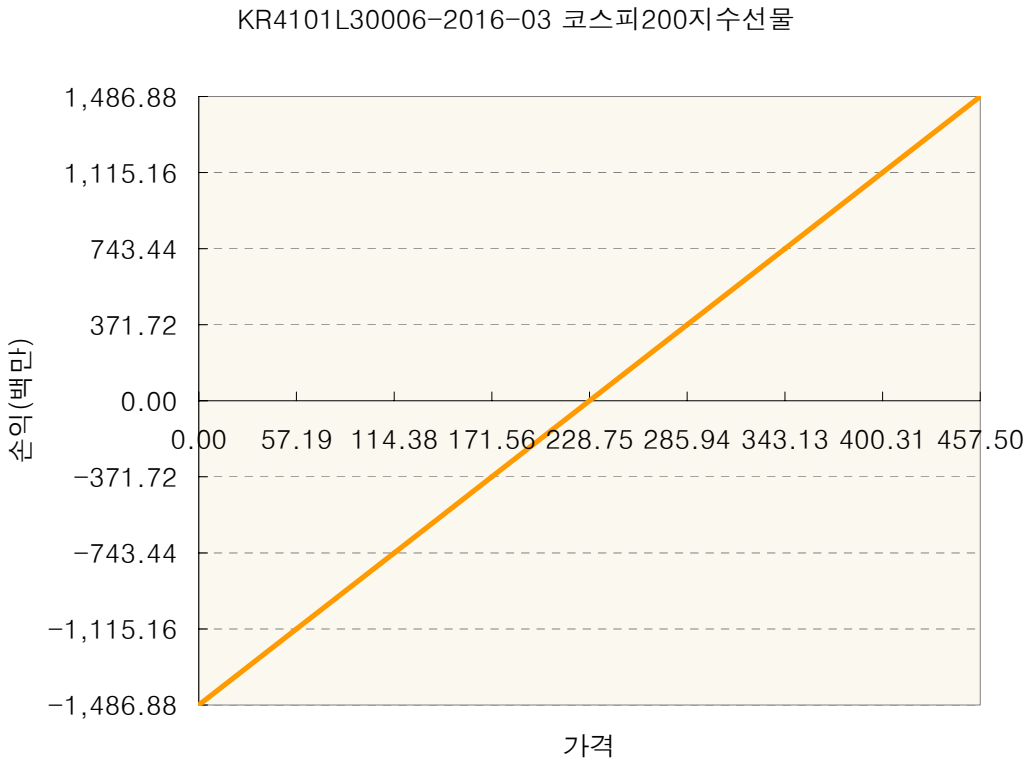
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 1,487 | 0 | 1,487 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 119 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -119 | -119 | -119 | -119 | -119 | -119 | -119 |
| -5.33% | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 |
| -2.67% | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 |
| 5.33% | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 |
| 8.00% | 119 | 119 | 119 | 119 | 119 | 119 | 119 |

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

| 97 |
|---|

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

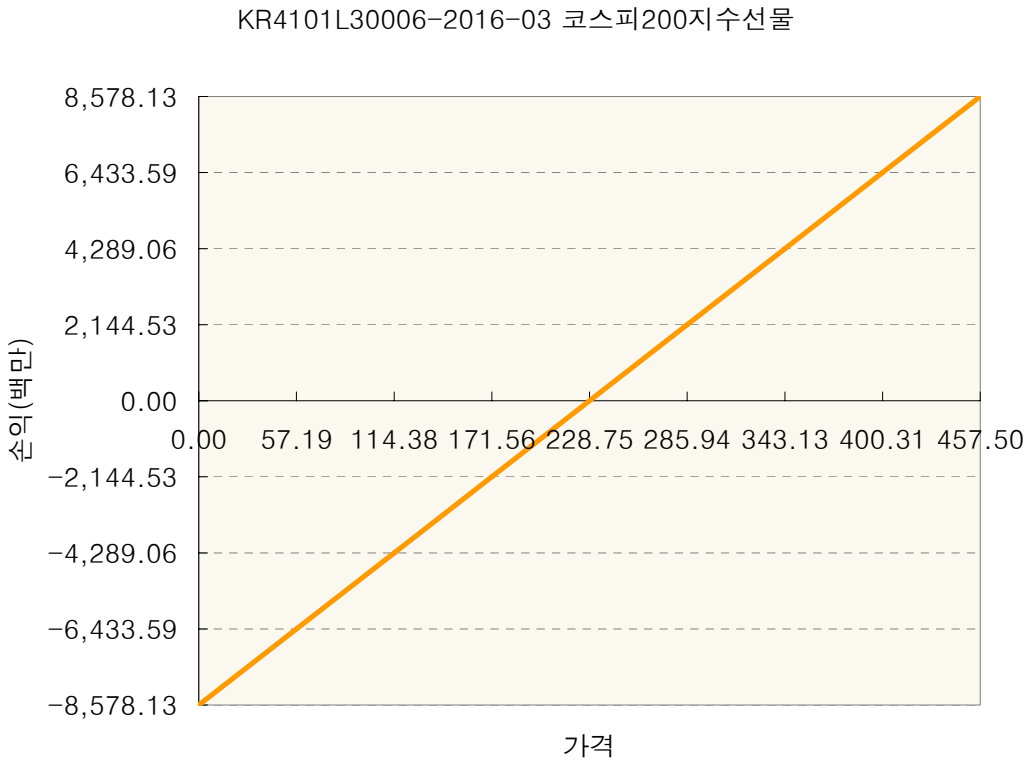
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 8,578 | 0 | 8,578 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 685 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -685 | -685 | -685 | -685 | -685 | -685 | -685 |
| -5.33% | -457 | -457 | -457 | -457 | -457 | -457 | -457 |
| -2.67% | -228 | -228 | -228 | -228 | -228 | -228 | -228 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 228 | 228 | 228 | 228 | 228 | 228 | 228 |
| 5.33% | 457 | 457 | 457 | 457 | 457 | 457 | 457 |
| 8.00% | 685 | 685 | 685 | 685 | 685 | 685 | 685 |

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

| 561 |
|---|

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

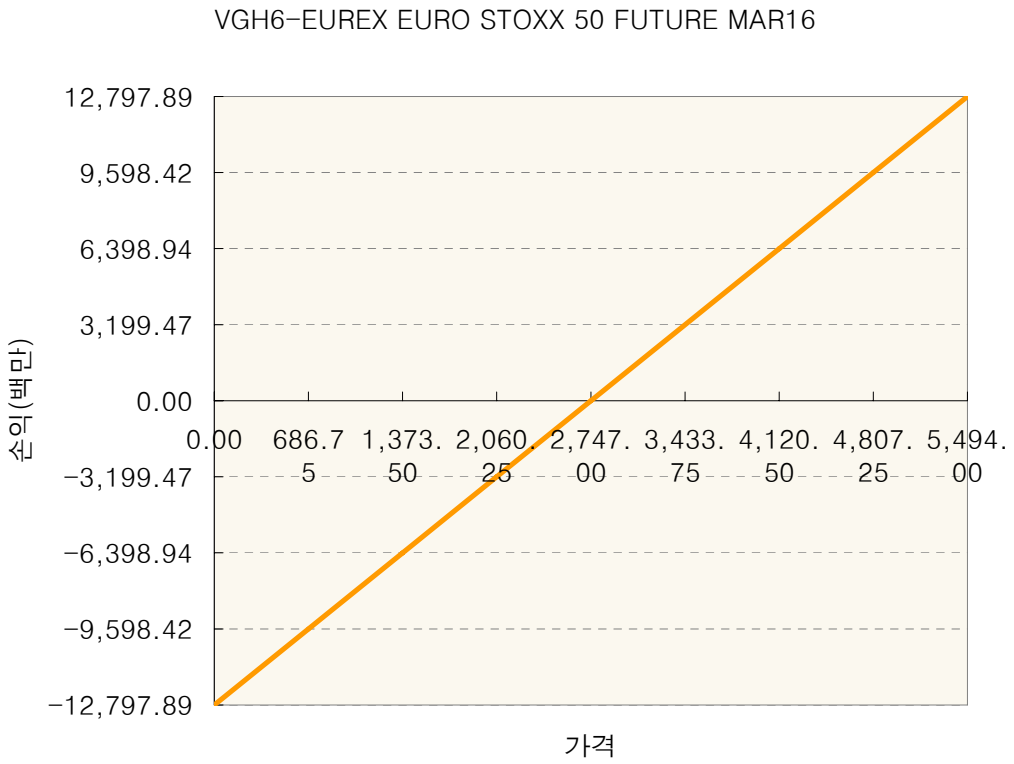
# 유로인덱스1호(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 12,798 | 0 | 12,798 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGH6 | EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR16 | 1,024 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,213 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

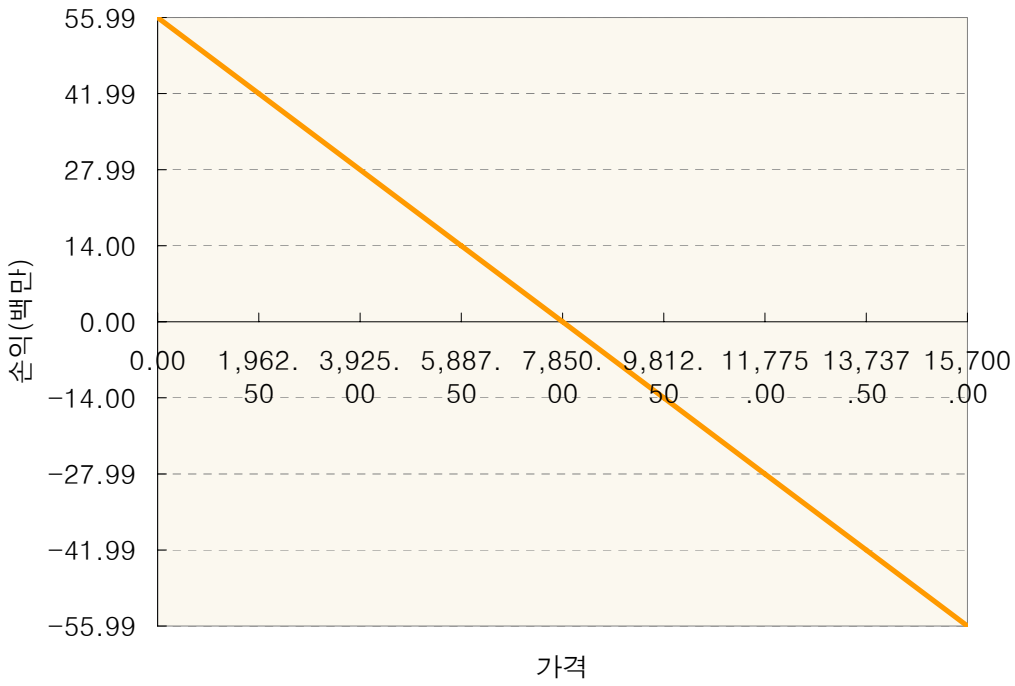
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

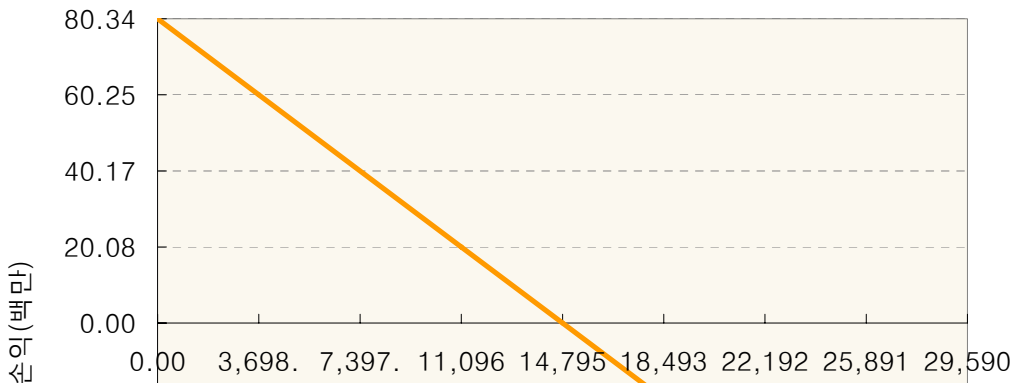
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 116 | -116 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 56 | -56 | 장내 |

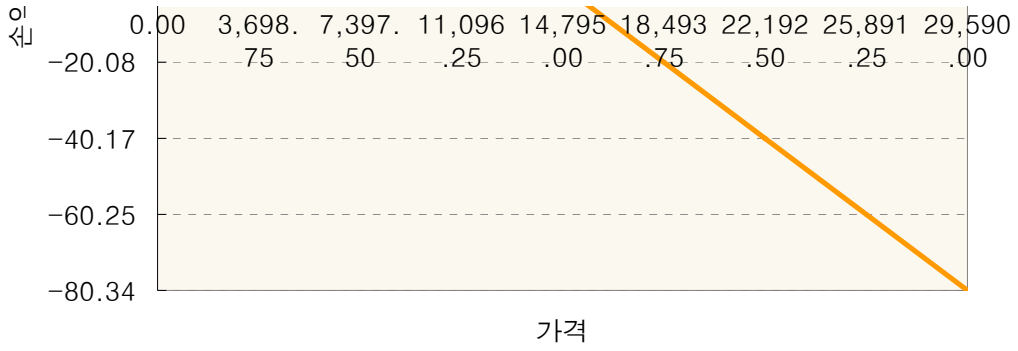
## 2. 만기시점의 손익구조

HCG6-HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu

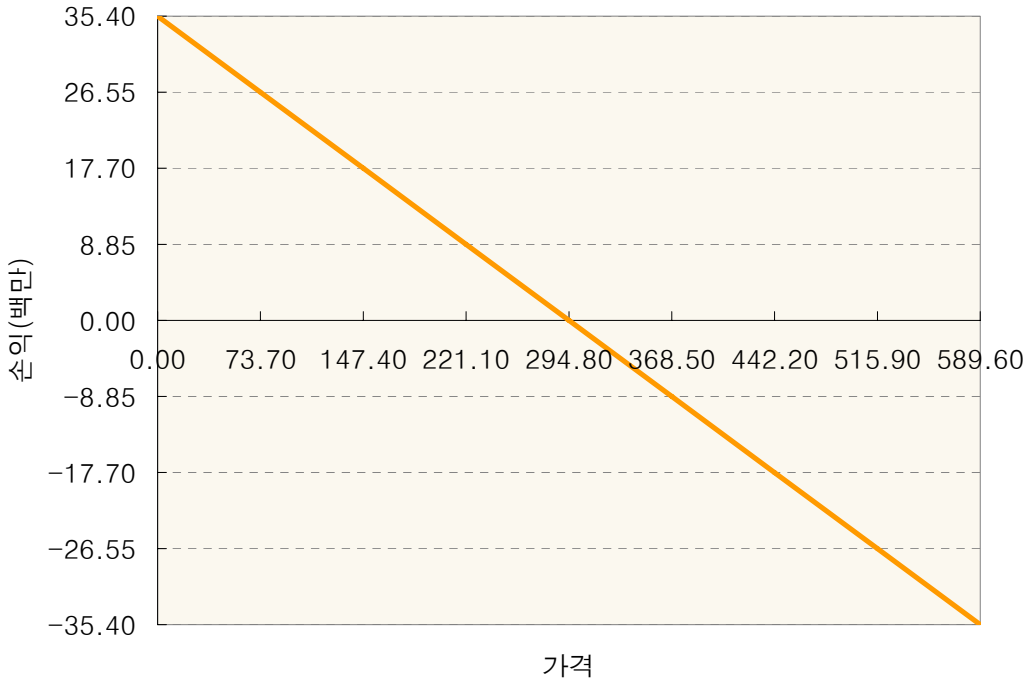



NIH6-SGX NIKKEI 225 STOCK INDEX FUTURE (SGX)






TWG6-SGX MSCI TAIWAN INDEX FUTURE FEB16




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCG6 | HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu | 4 |
| NIH6 | SGX NIKKEI 225 STOCK INDEX FUTURE (SGX) | 6 |
| TWG6 | SGX MSCI TAIWAN INDEX FUTURE FEB16 | 3 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 16 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 차이나인덱스(주식-파생형)(종)

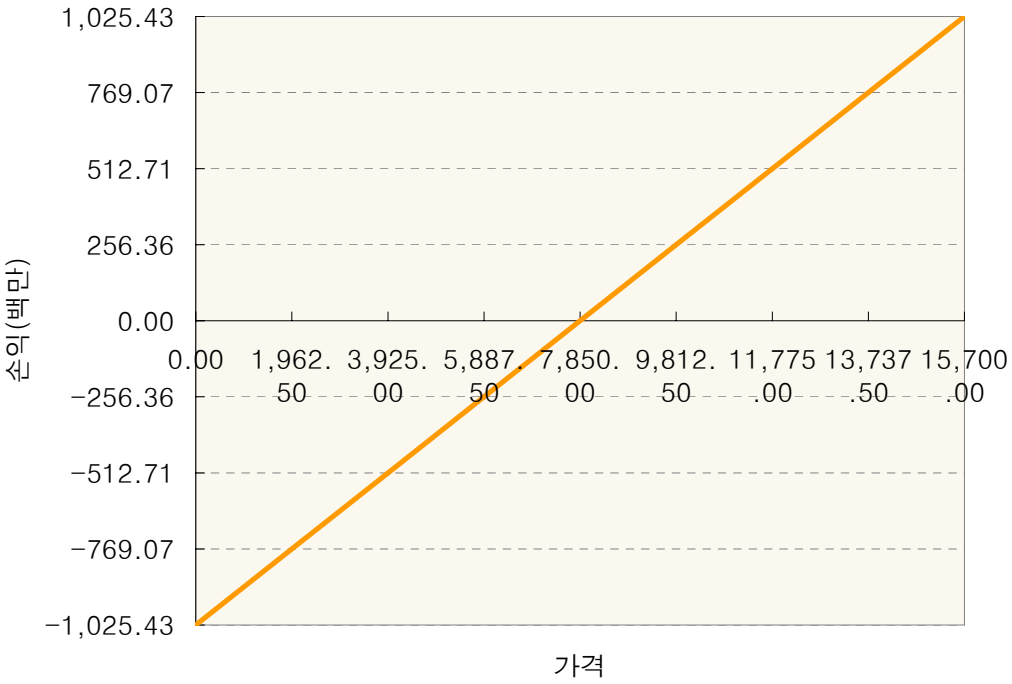
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

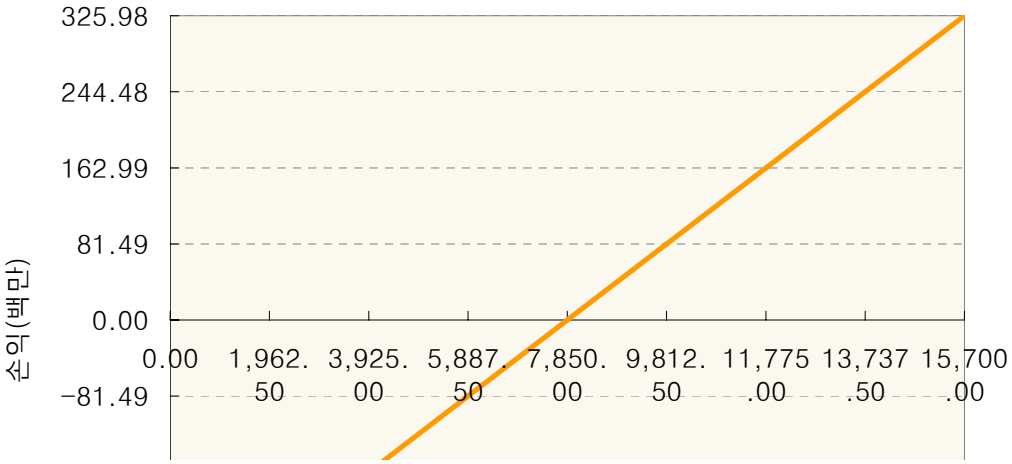
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,351 | 0 | 1,351 | 장내 |

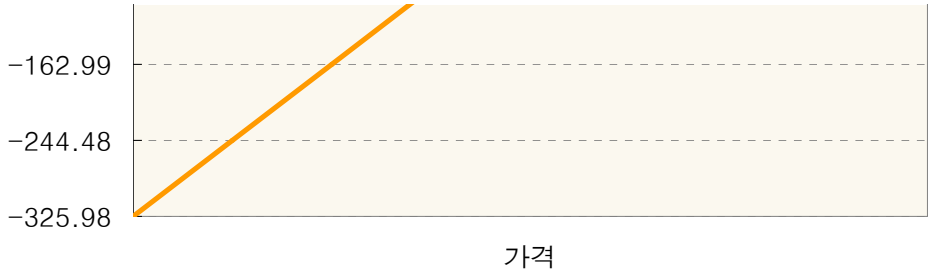
## 2. 만기시점의 손익구조

HCG6-HKG Hang Seng China Enterprises Index FU




MHCG6-HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT F






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCG6 | HKG Hang Seng China Enterprises Index FU | 82 |
| MHCG6 | HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT F | 26 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 151 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 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 | 10,856 | 0 | 10,856 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| SWMXWO00( 신한MXWO 미래S1120 | 758 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| 625 |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 중국본토인덱스RQFII모(주식-파

## 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 | 0 | 0 | 0 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| SWSG20150‹CSI 300 Net Return Index | 17 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| 39 |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-16 |
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 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 | 8,333 | 0 | 8,333 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWCSI50000 신한CSI500미래S12081 | 371 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S12082 | 115 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,387 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

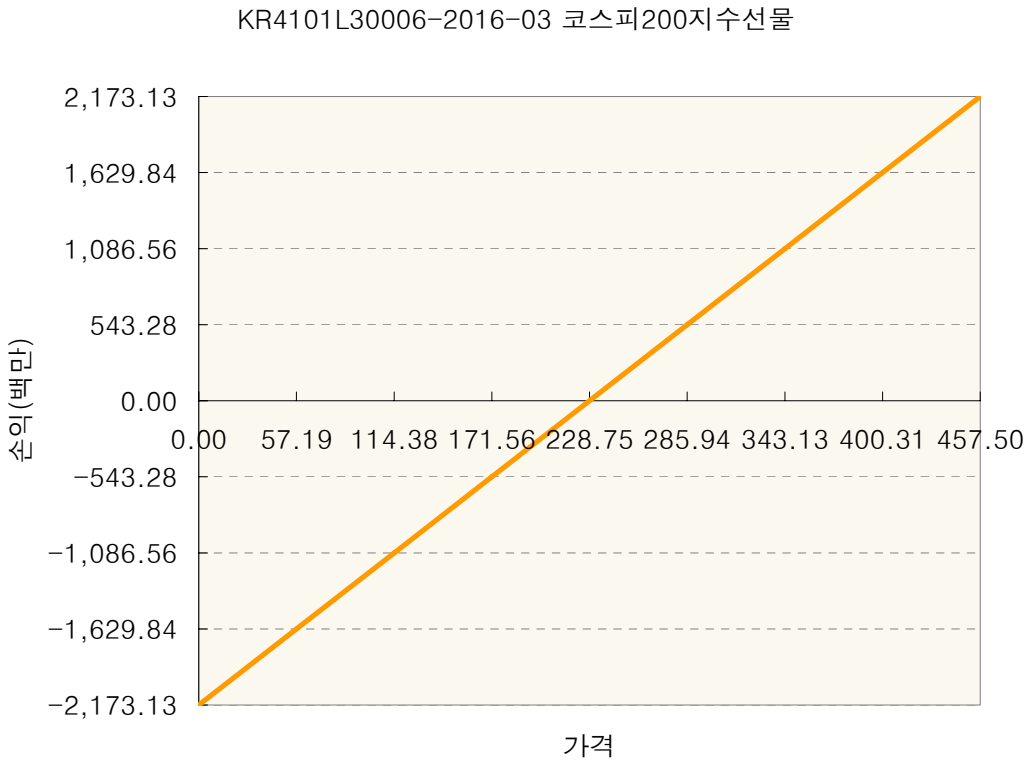
# KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

## 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 | 2,173 | 0 | 2,173 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 174 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -174 | -174 | -174 | -174 | -174 | -174 | -174 |
| -5.33% | -116 | -116 | -116 | -116 | -116 | -116 | -116 |
| -2.67% | -58 | -58 | -58 | -58 | -58 | -58 | -58 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 58 | 58 | 58 | 58 | 58 | 58 | 58 |
| 5.33% | 116 | 116 | 116 | 116 | 116 | 116 | 116 |
| 8.00% | 174 | 174 | 174 | 174 | 174 | 174 | 174 |

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

| 142 |
|---|

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# NE-1호(ELS-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 1,952 | 0 | 1,952 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65233AS5 ELS대우증권(ELS)15120 | 71 |
| KR65433325 ELS신영증권플랜업(ELS)5447 | 62 |
| KR65533AF5 ELSNH투자증권(ELS)11930 | 61 |
| KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269 | 62 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 163 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 미래설계SE-7호(ELS-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,104 | 0 | 8,104 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65233BD5 ELS대우증권(ELS)15129 | 242 |
| KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957 | 255 |
| KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298 | 242 |
| KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483 | 242 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 719 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# SE-8호(ELS-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 7,143 | 0 | 7,143 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65233BE5 ELS대우증권(ELS)15130 | 201 |
| KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454 | 202 |
| KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956 | 242 |
| KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297 | 201 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 587 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 지수연계미래설계SE-8호(ELS-파

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 6,139 | 0 | 6,139 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65233746 ELS대우증권(ELS)15148 | 175 |
| KR65533446 ELSNH투자증권(ELS)11973 | 175 |
| KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319 | 191 |
| KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513 | 175 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 436 |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-16 |
| 기준일 | 2016-02-15 |

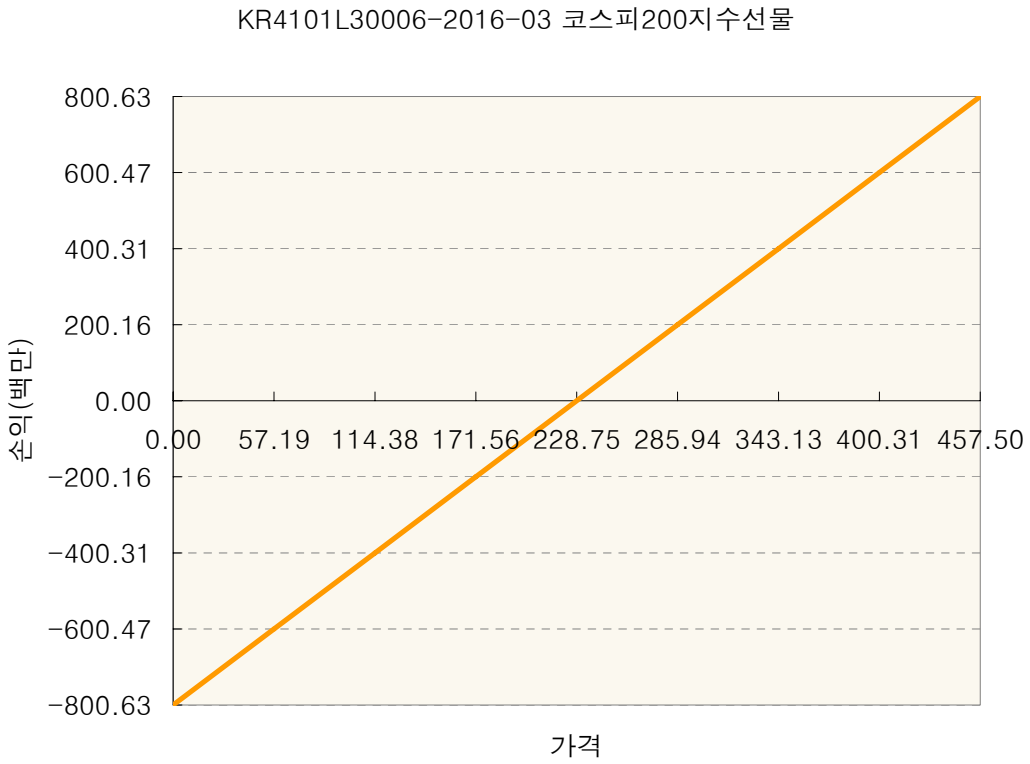
# ETF스마트레버리지목표전환형5호

## 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 | 801 | 0 | 801 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 64 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -64 | -64 | -64 | -64 | -64 | -64 | -64 |
| -5.33% | -43 | -43 | -43 | -43 | -43 | -43 | -43 |
| -2.67% | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 |
| 5.33% | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 |
| 8.00% | 64 | 64 | 64 | 64 | 64 | 64 | 64 |

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

| 52 |
|---|

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 지수연계미래설계SE-9호(ELS-파

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,432 | 0 | 5,432 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65233AK6 ELS대우증권(ELS)15162 | 166 |
| KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472 | 153 |
| KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987 | 153 |
| KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343 | 153 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 410 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 지수연계미래설계SE-10호(ELS-파

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 3,825 | 0 | 3,825 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65133A46 ELS대신증권(ELS) 6376 | 122 |
| KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170 | 106 |
| KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036 | 106 |
| KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359 | 106 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 275 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 지수연계미래설계SE-11호(ELS-파

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 10 | -10 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 5,952 | 0 | 5,952 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65133226 ELS대신증권(ELS)6386 | 176 |
| KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180 | 164 |
| KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056 | 188 |
| KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388 | 170 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 389 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 지수연계미래설계SE-12호(ELS-파

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 8,601 | 0 | 8,601 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65133626 ELS대신증권(ELS) 6401 | 224 |
| KR65233676 ELS대우증권(ELS) 15190 | 223 |
| KR65533526 ELSNH투자증권(ELS) 12077 | 223 |
| KR65733986 ELS한국투자증권(ELS) 5399 | 245 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 478 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

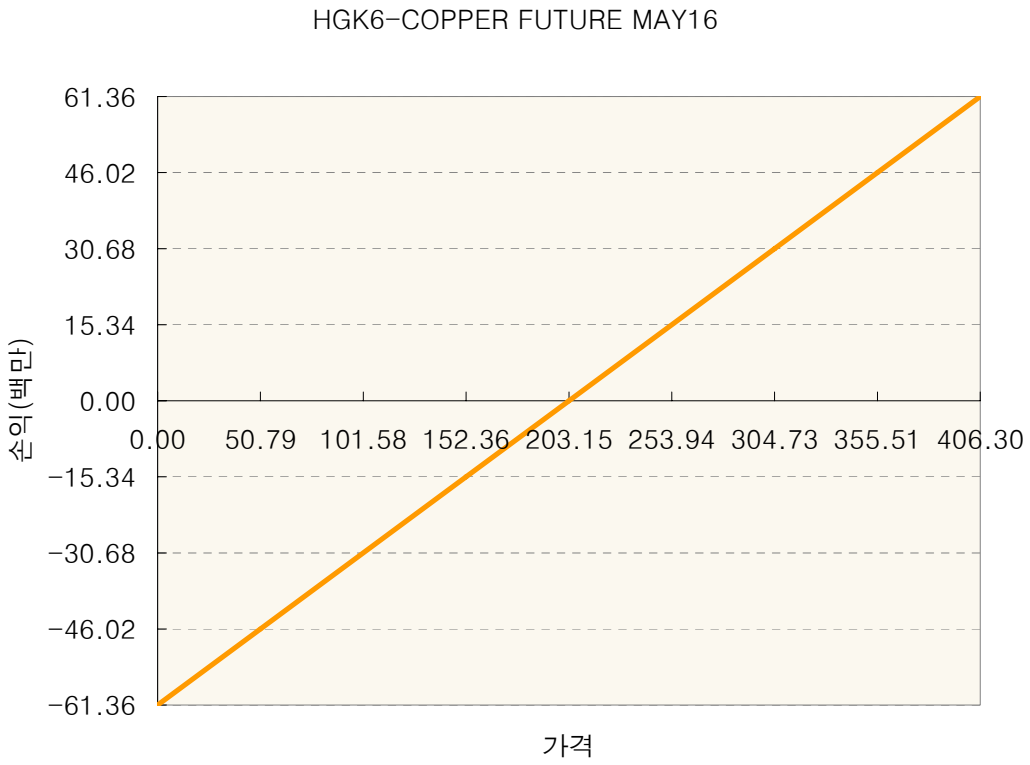
# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

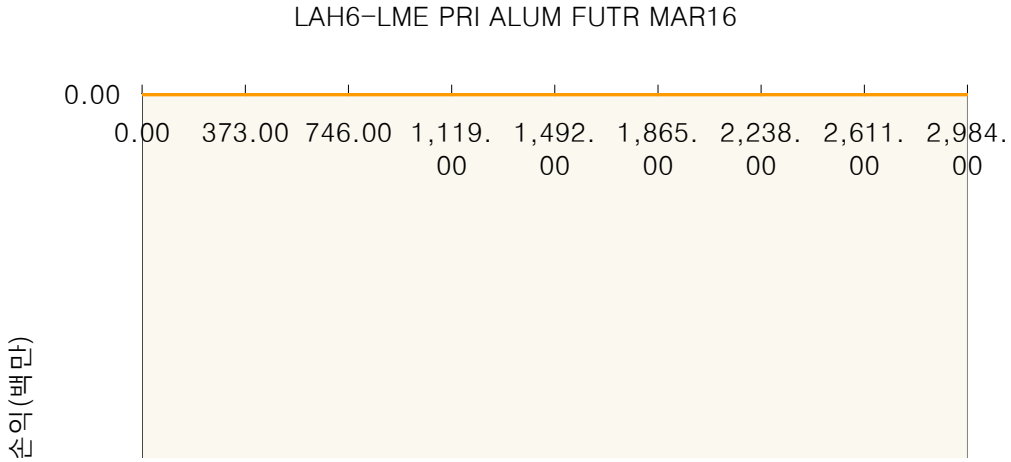
## 1. 계약금액

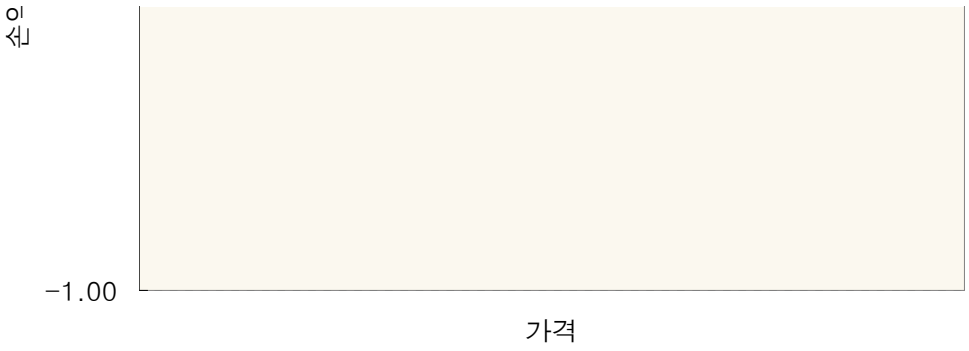
(단위:백만원)

| 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 | 57 | 0 | 57 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 397 | 96 | 301 | |

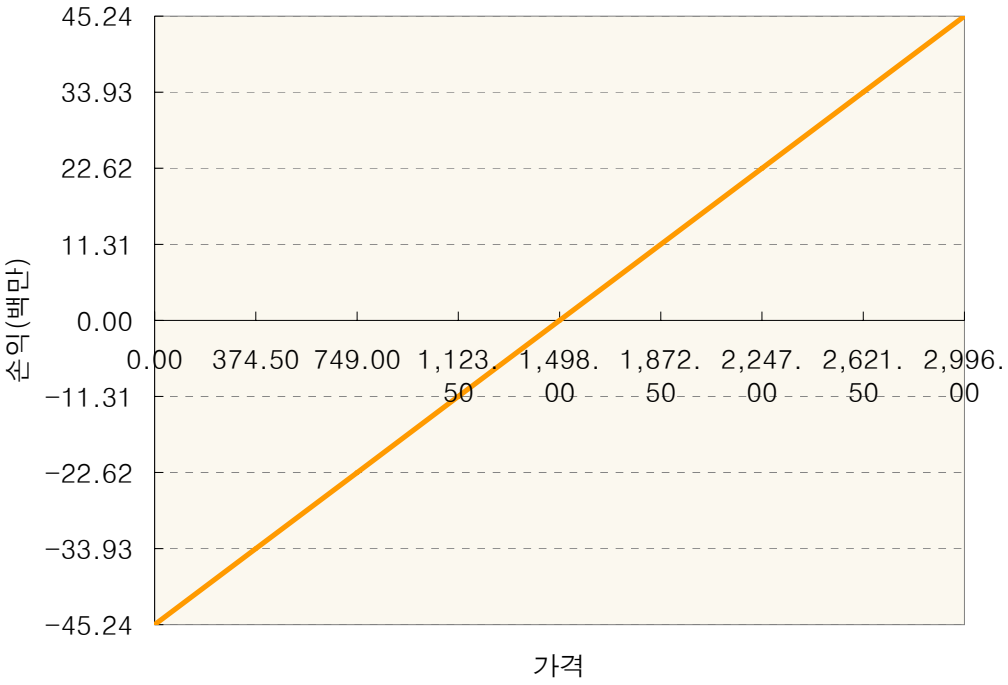
## 2. 만기시점의 손익구조



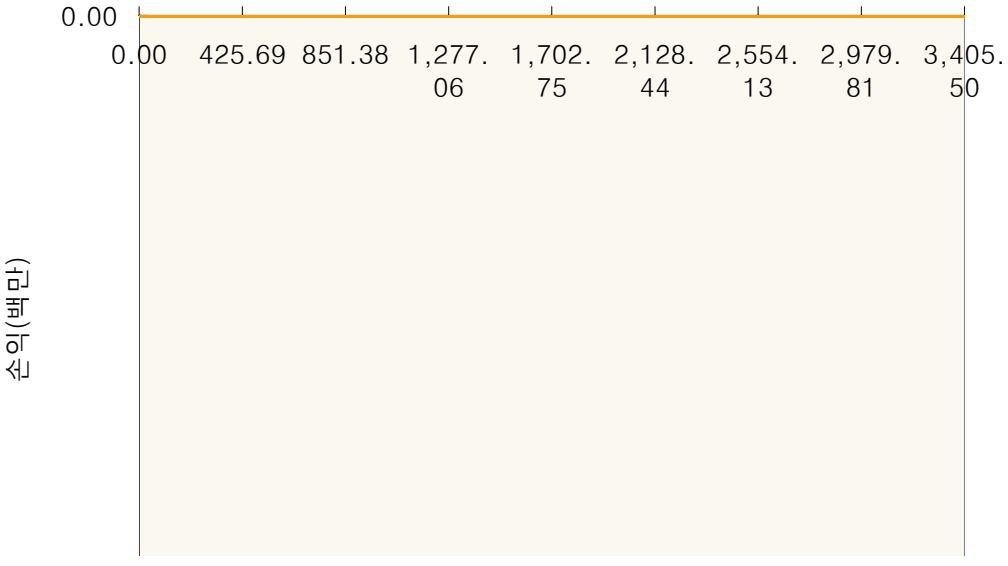



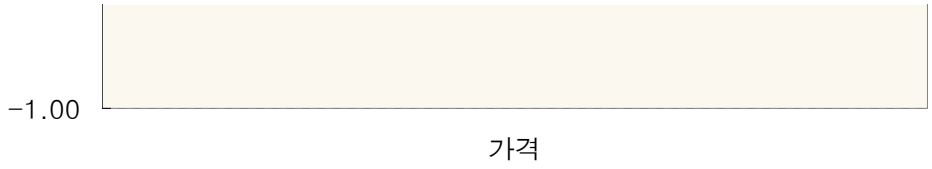



LAK6-LME PRI ALUM FUTR MAY16



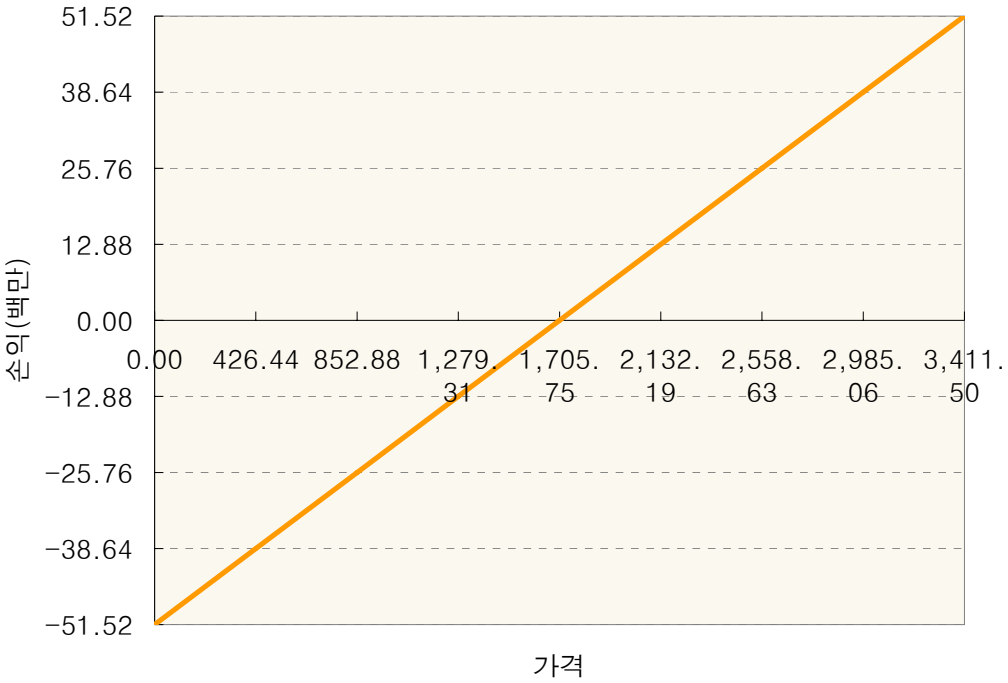

LXH6-LME ZINC FUTURE MAR16





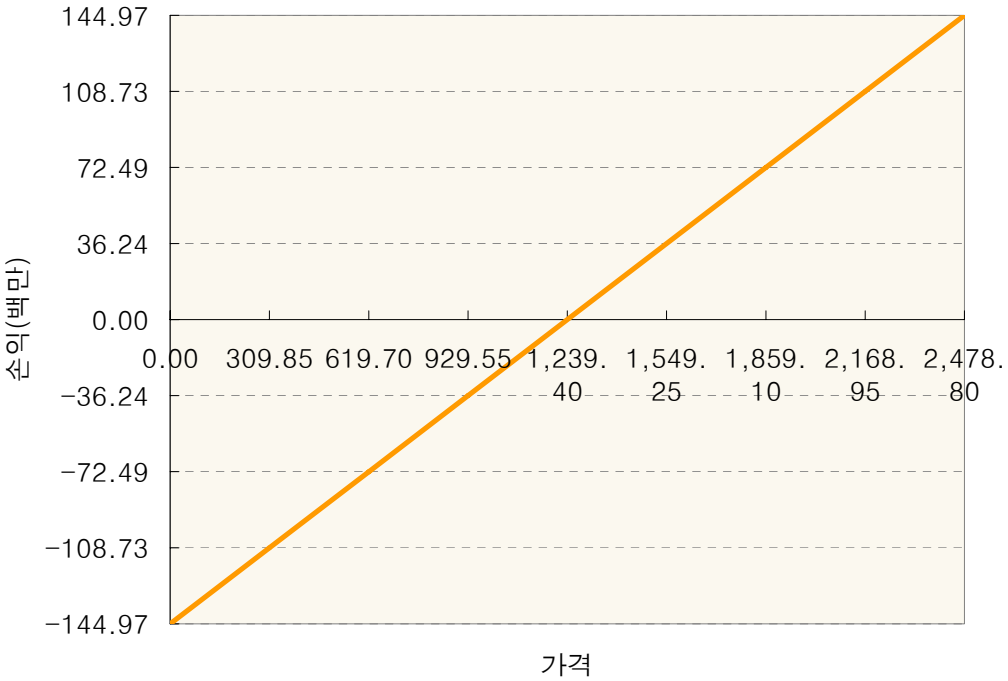

가격

LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16

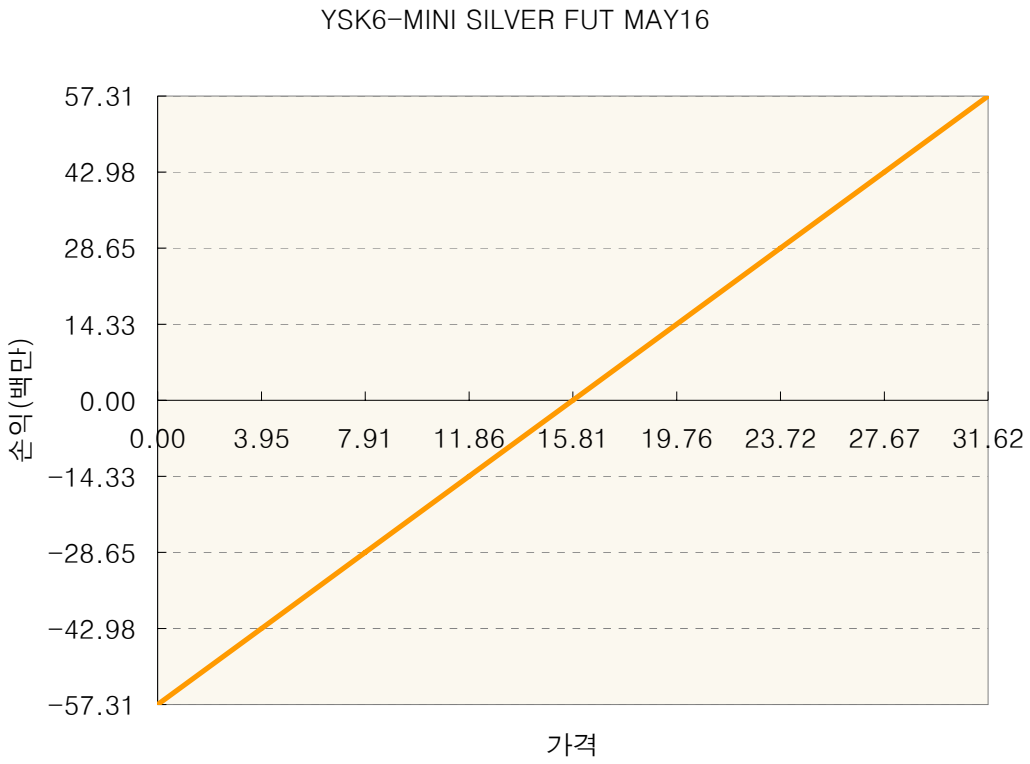



가격

XGJ6-MINI GOLD FUTURE APR16




가격




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HGK6 | COPPER FUTURE MAY16 | 5 |
| LAH6 | LME PRI ALUM FUTR MAR16 | 0.1 |
| LAK6 | LME PRI ALUM FUTR MAY16 | 4 |
| LXH6 | LME ZINC FUTURE MAR16 | 0.1 |
| LXK6 | LME ZINC FUTURE MAY16 | 4 |
| XGJ6 | MINI GOLD FUTURE APR16 | 12 |
| YSK6 | MINI SILVER FUT MAY16 | 5 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 30 |

| 공시일 | 2016-02-16 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-15 |

# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

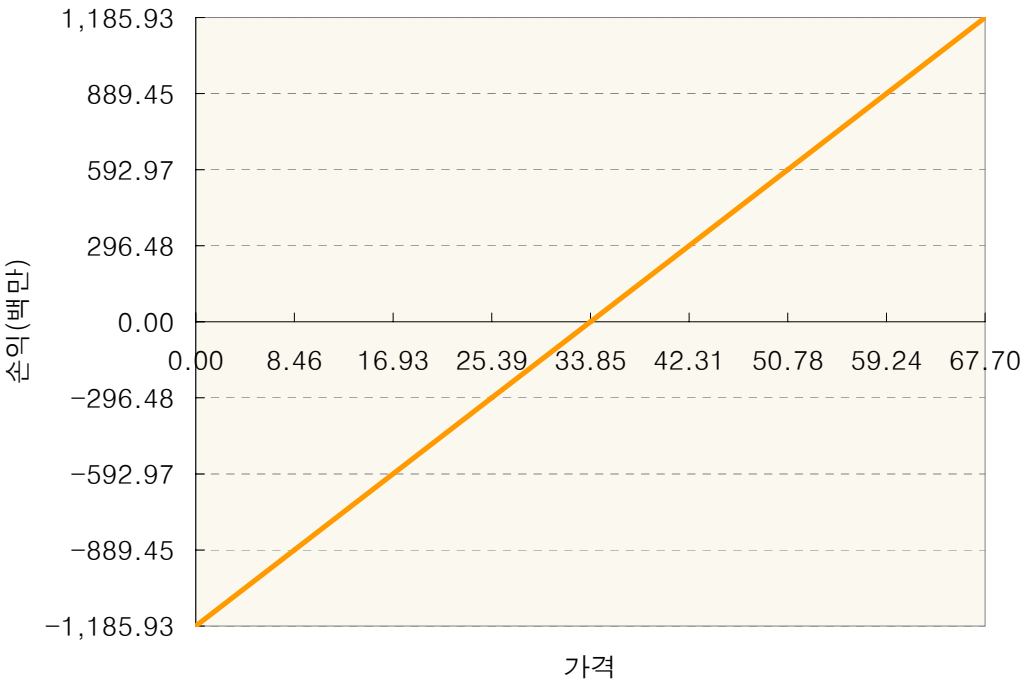
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

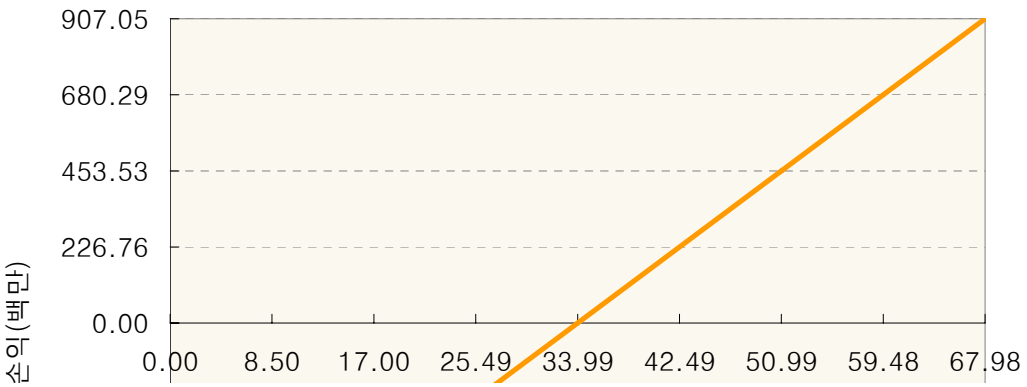
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 1,186 | 0 | 1,186 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,676 | 478 | 3,198 | |

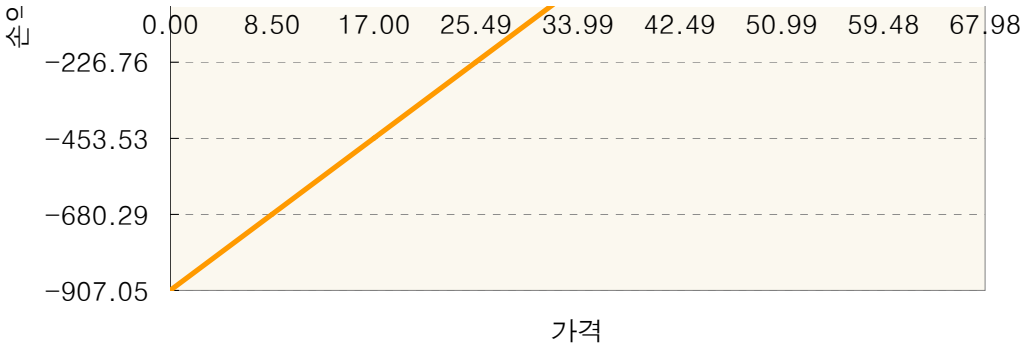
## 2. 만기시점의 손익구조

CLK6-WTI CRUDE FUTURE MAY16

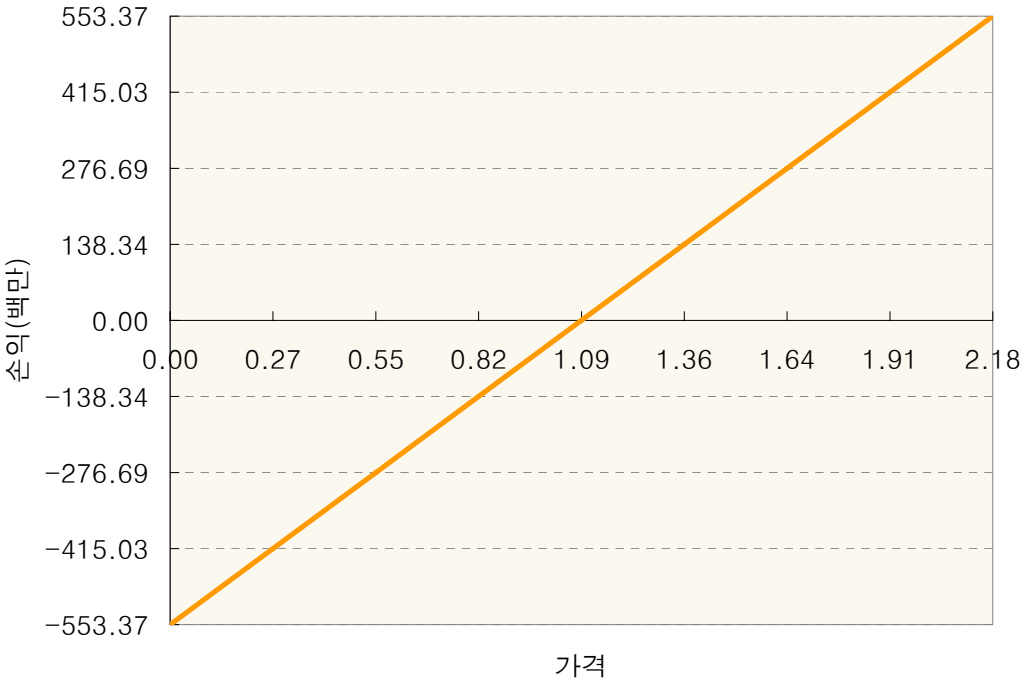



COK6-BRENT CRUDE FUTR MAY16

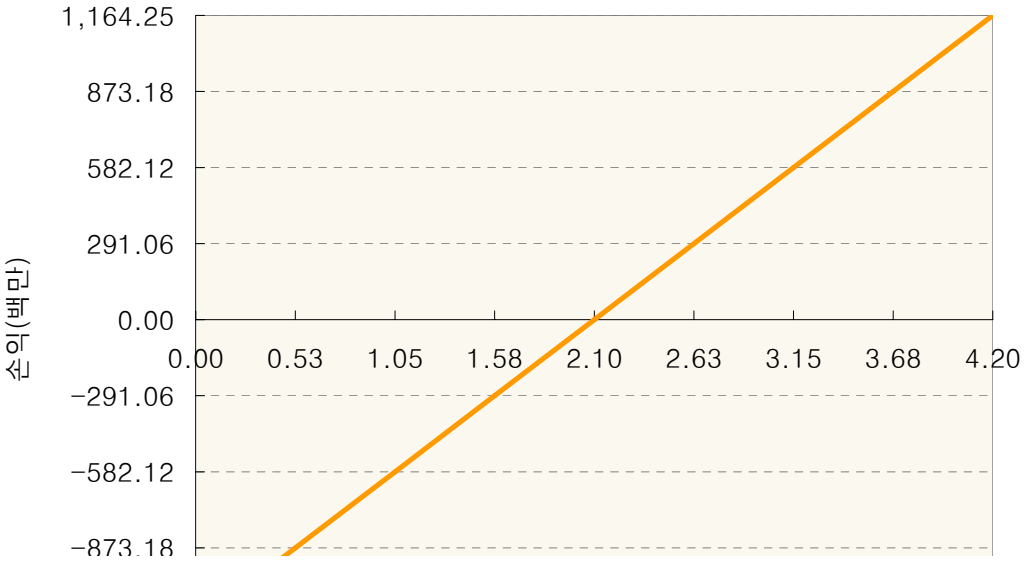


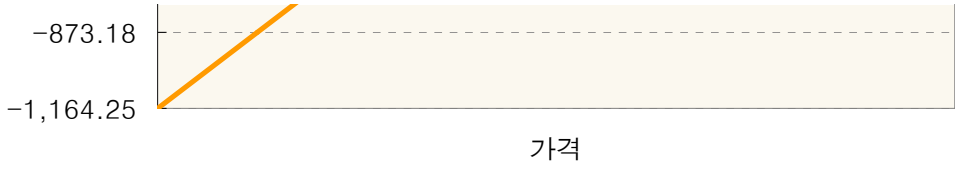



HOK6-NY Harb ULSD Fut MAY16



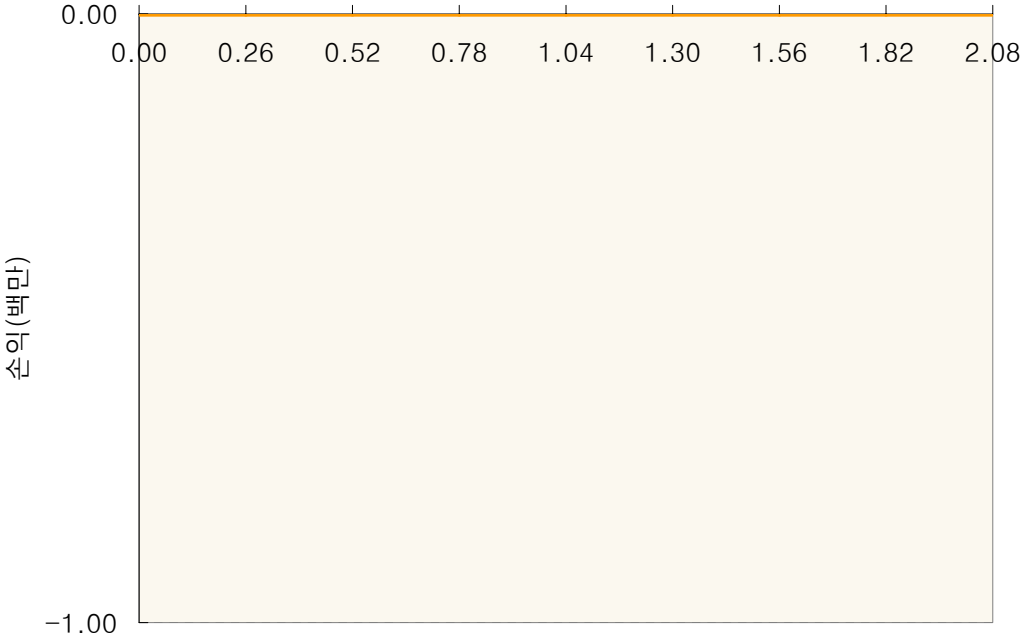

NGK6-NATURAL GAS FUTR MAY16






가격

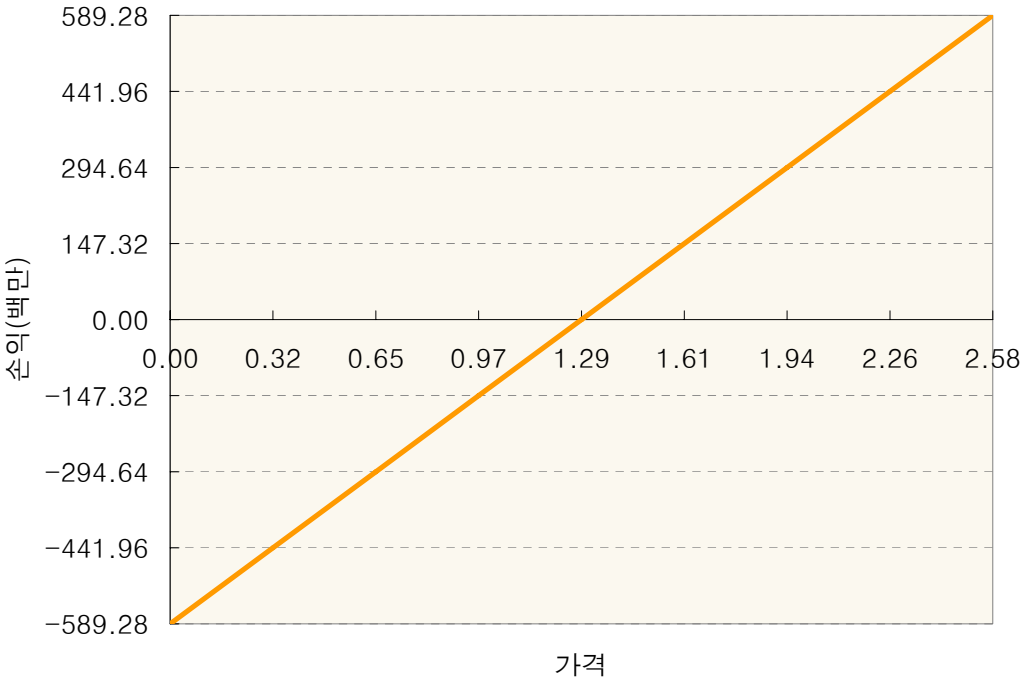
XBH6-GASOLINE RBOB FUT MAR16




손익(백만)

가격

XBK6-GASOLINE RBOB FUT MAY16




손익(백만)

가격

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLK6 | WTI CRUDE FUTURE MAY16 | 95 |
| COK6 | BRENT CRUDE FUTR MAY16 | 73 |
| HOK6 | NY Harb ULSD Fut MAY16 | 44 |
| NGK6 | NATURAL GAS FUTR MAY16 | 93 |
| XBH6 | GASOLINE RBOB FUT MAR16 | 1 |
| XBK6 | GASOLINE RBOB FUT MAY16 | 47 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 965 |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-16 |
| 기준일 | 2016-02-15 |

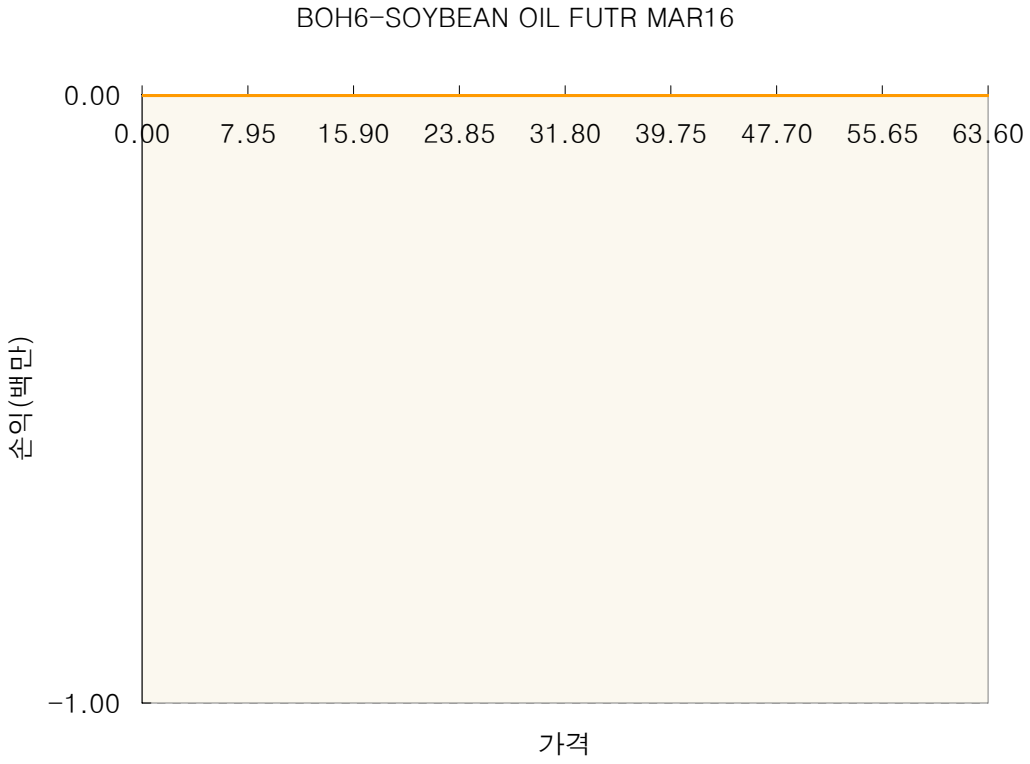
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

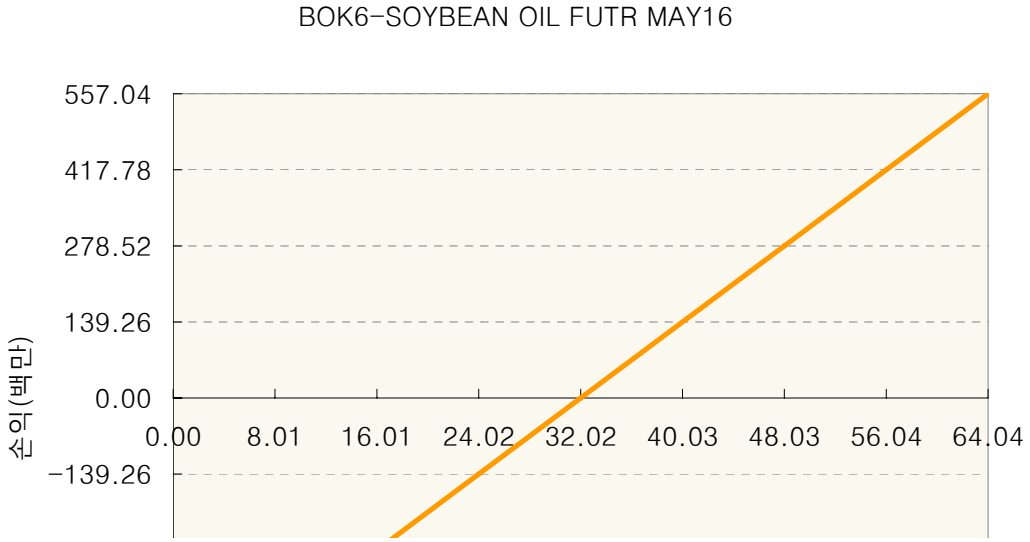
## 1. 계약금액

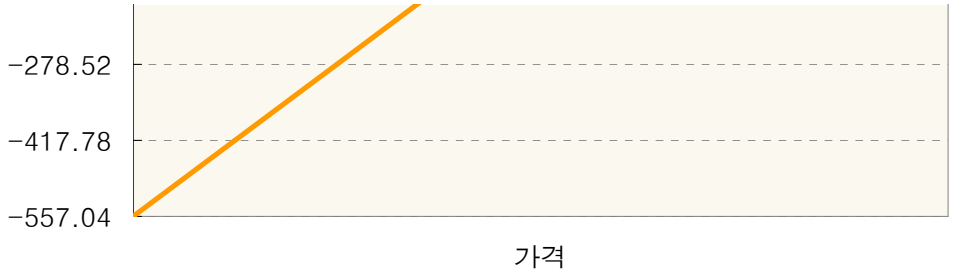
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 10,550 | 4,454 | 6,096 | |

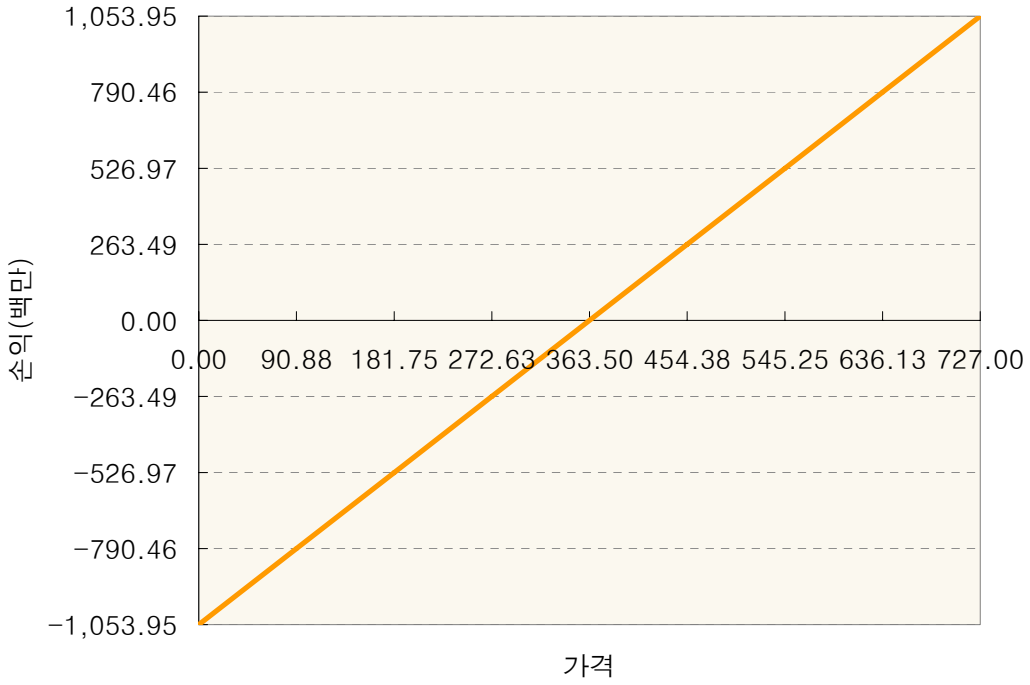
## 2. 만기시점의 손익구조



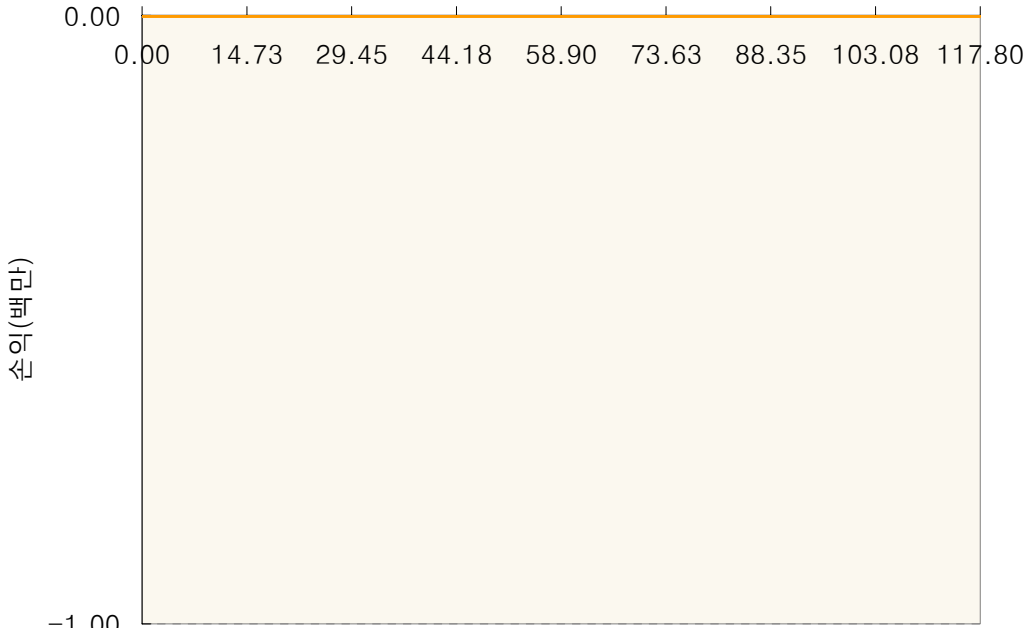



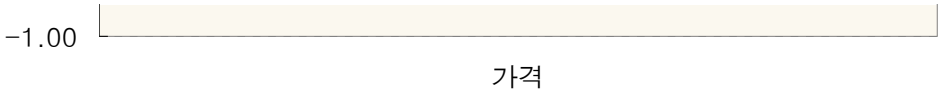



CK6-CORN FUTURE MAY16

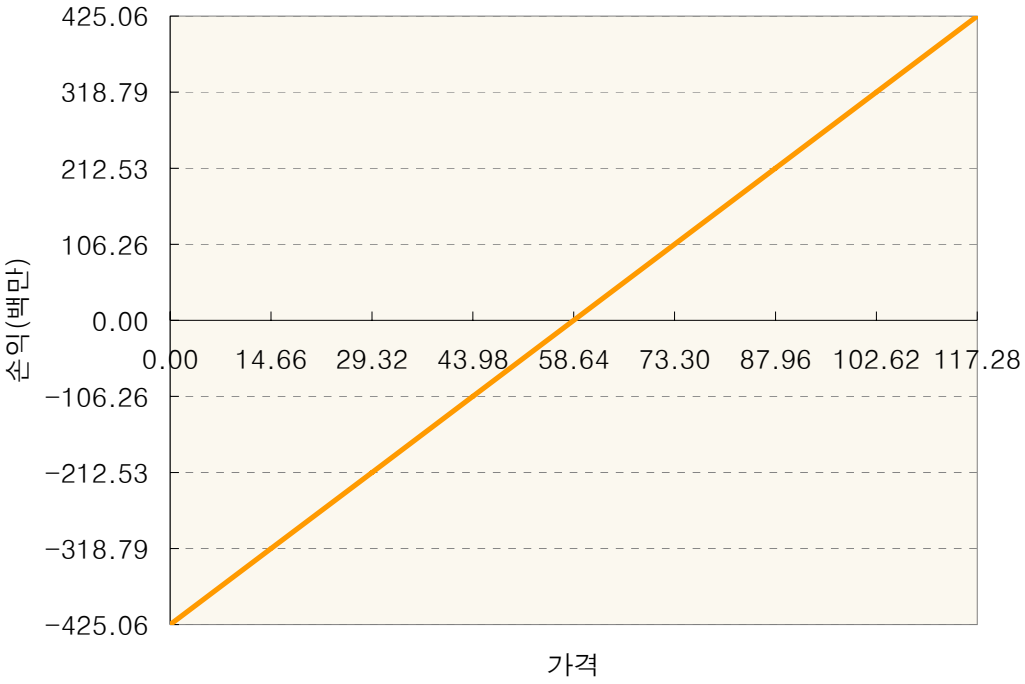



CTH6-COTTON NO.2 FUTR MAR16

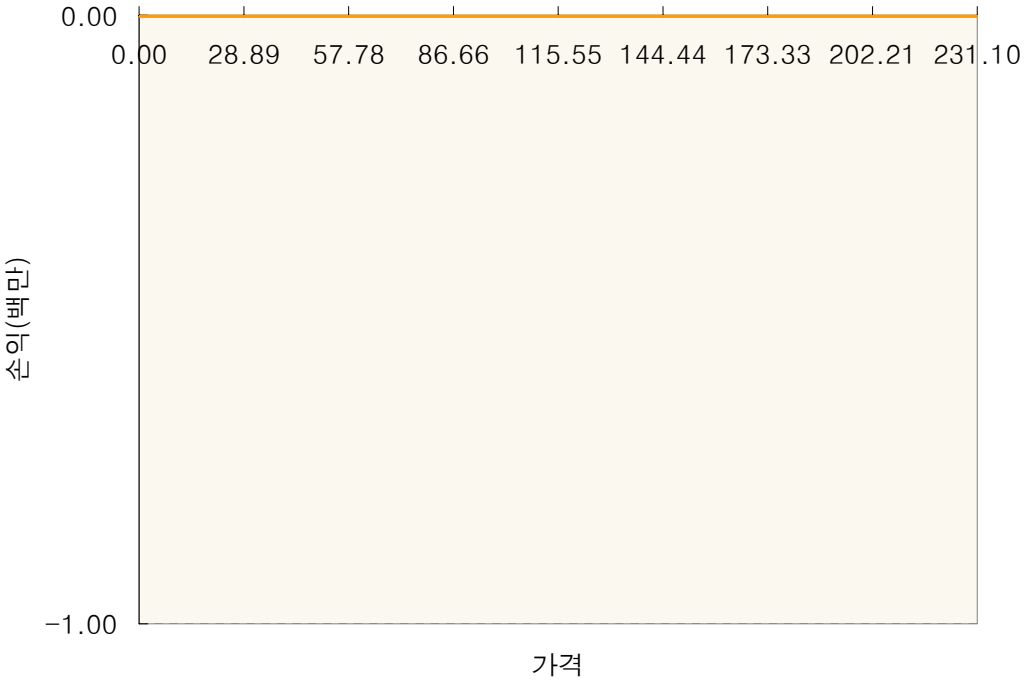




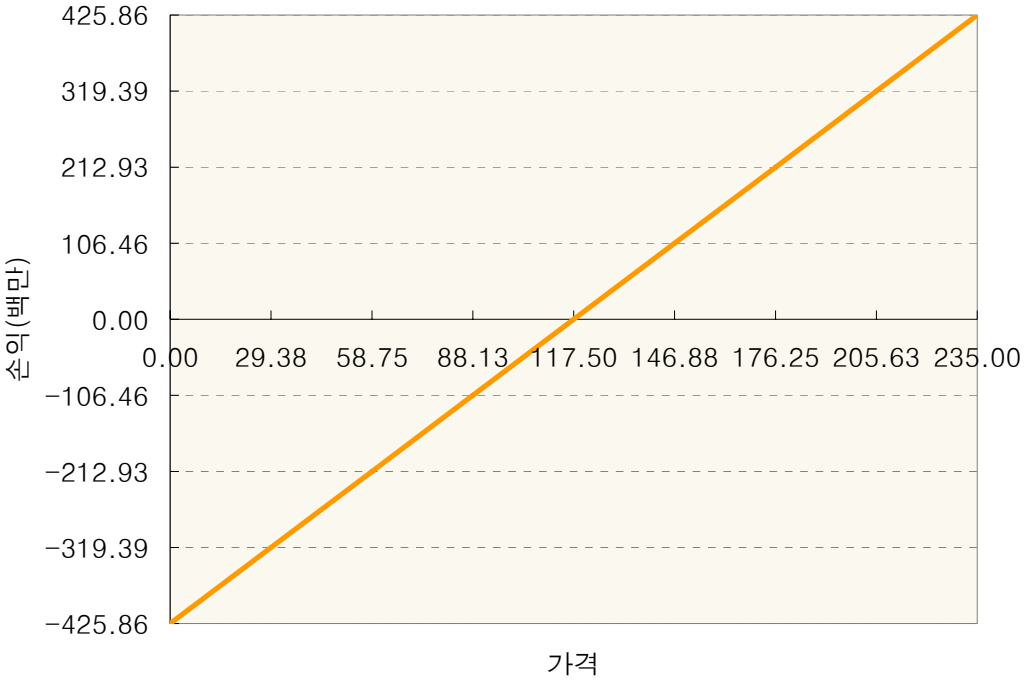

CTK6-COTTON NO.2 FUTR MAY16



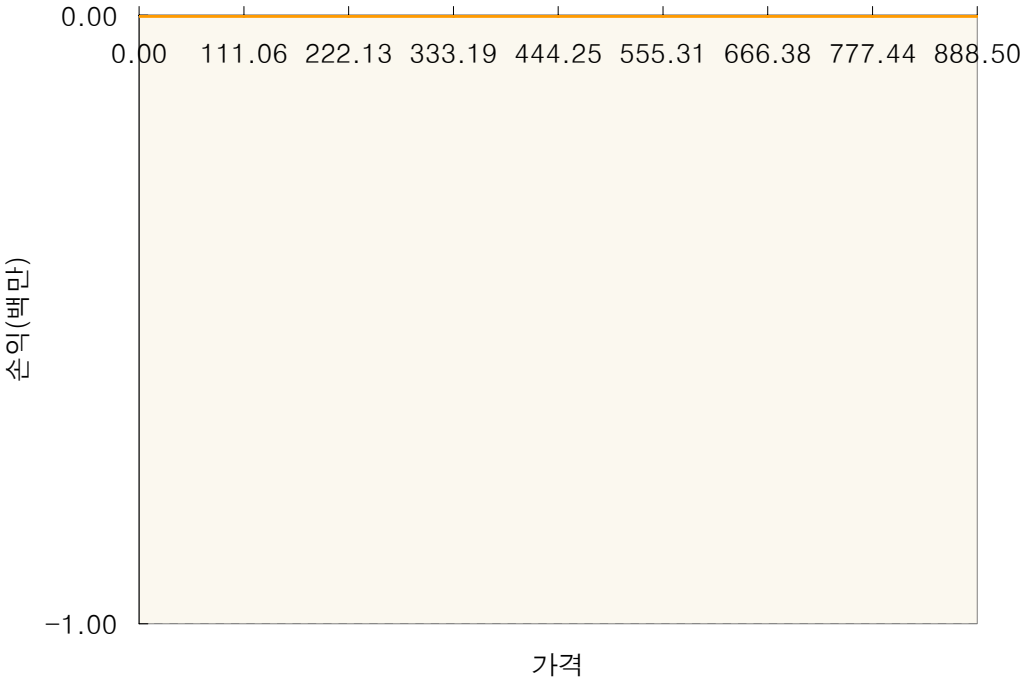

KCH6-COFFEE "C" FUTURE MAR16



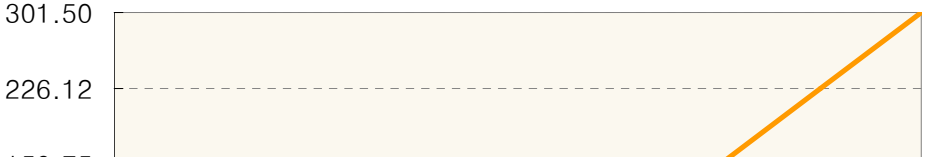

KCK6-COFFEE "C" FUTURE MAY16

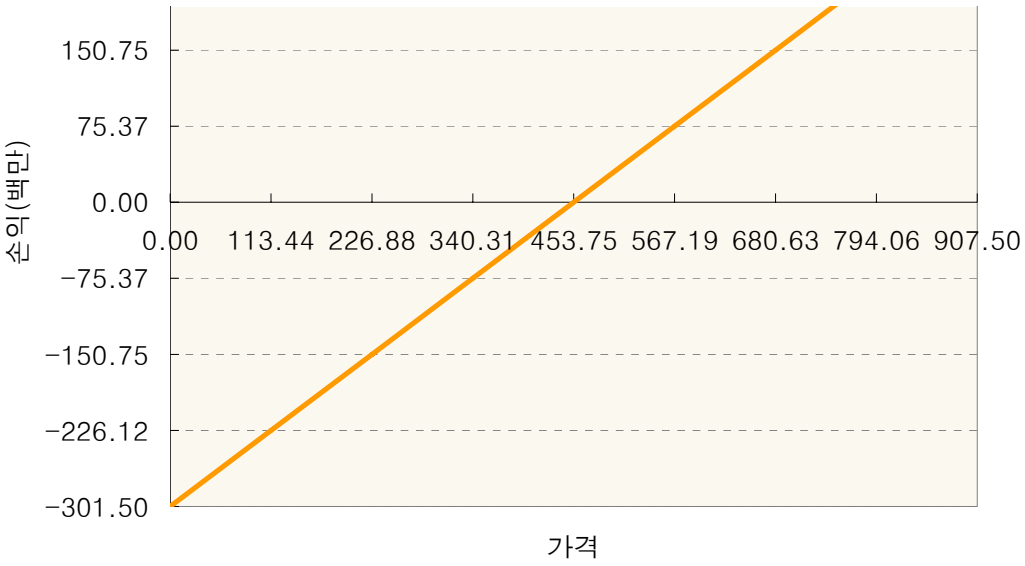



KWH6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16

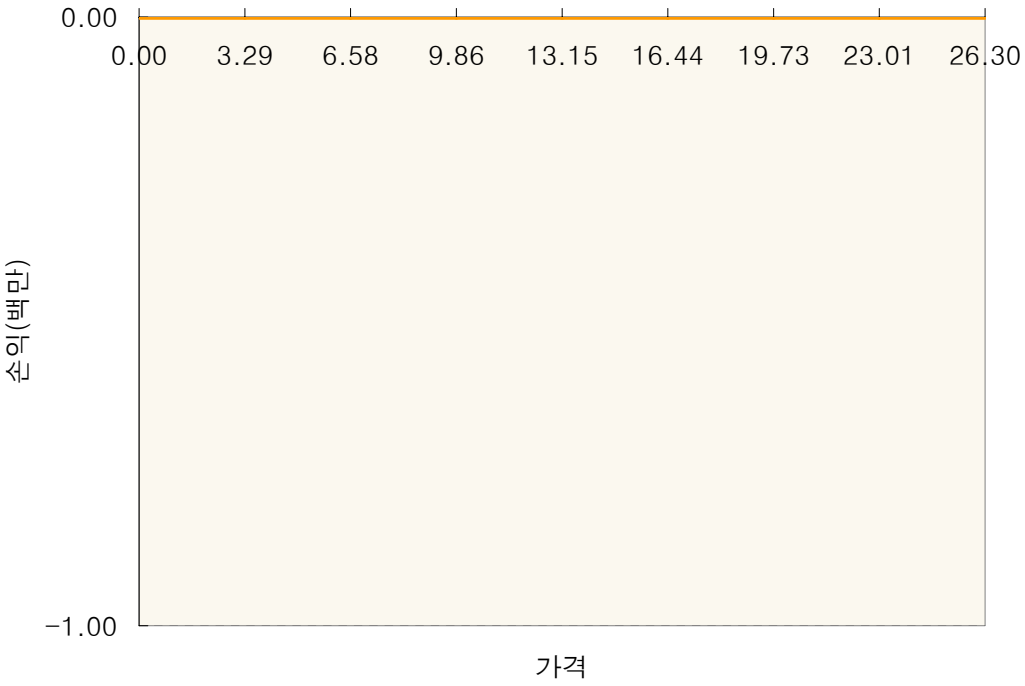



KWK6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16

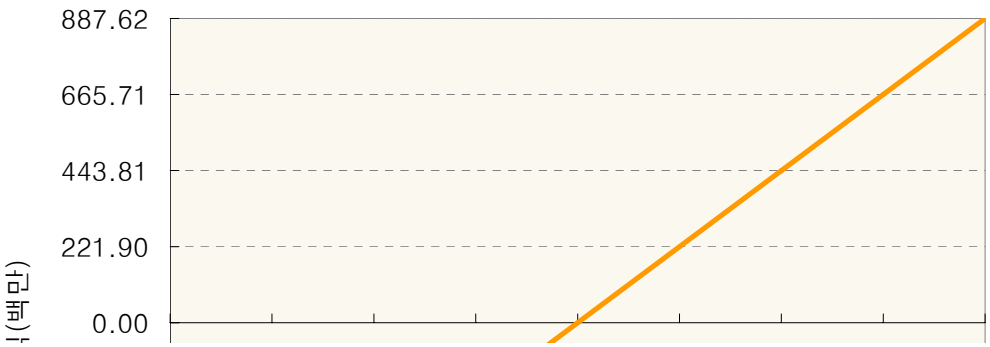


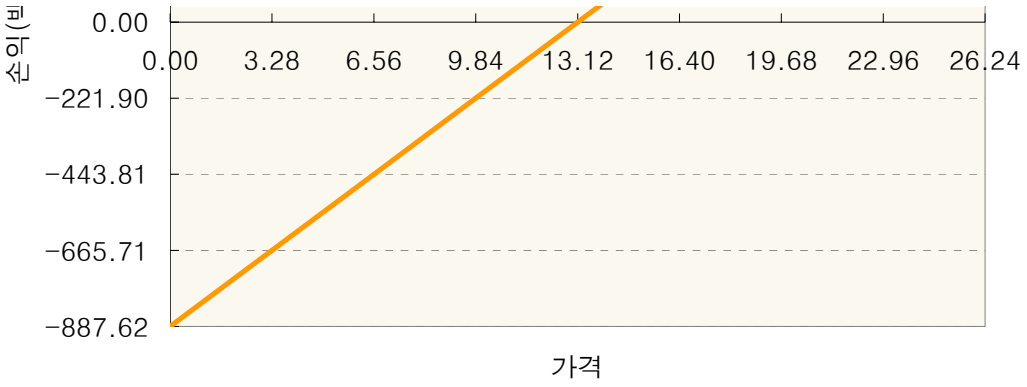



SBH6-Sugar #11 (WORLD) MAR16

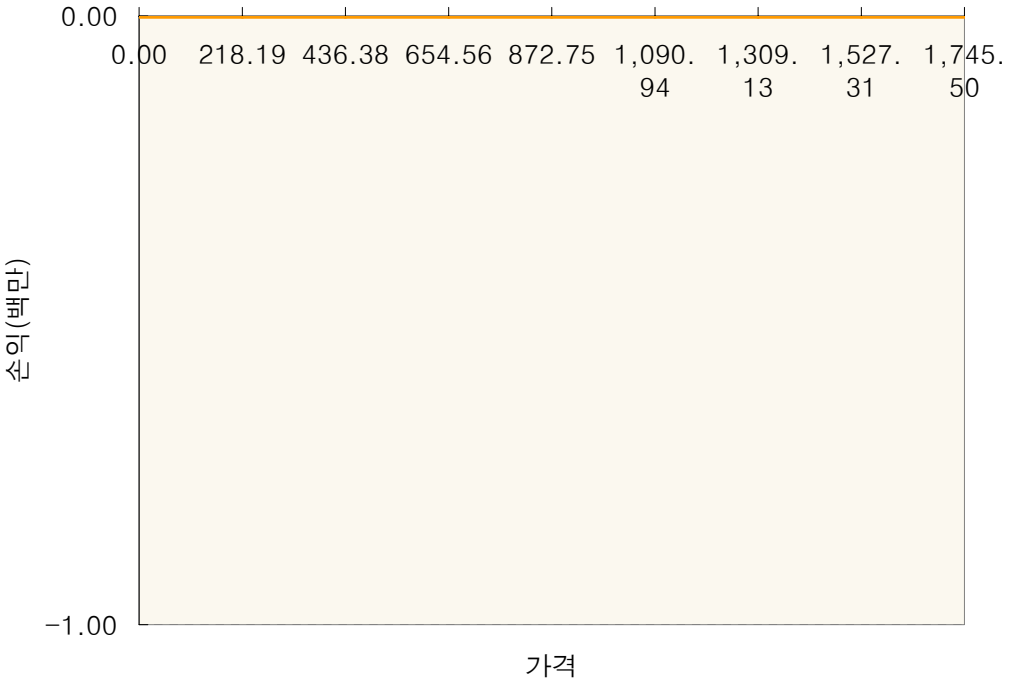



SBK6-Sugar #11 (WORLD) MAY16

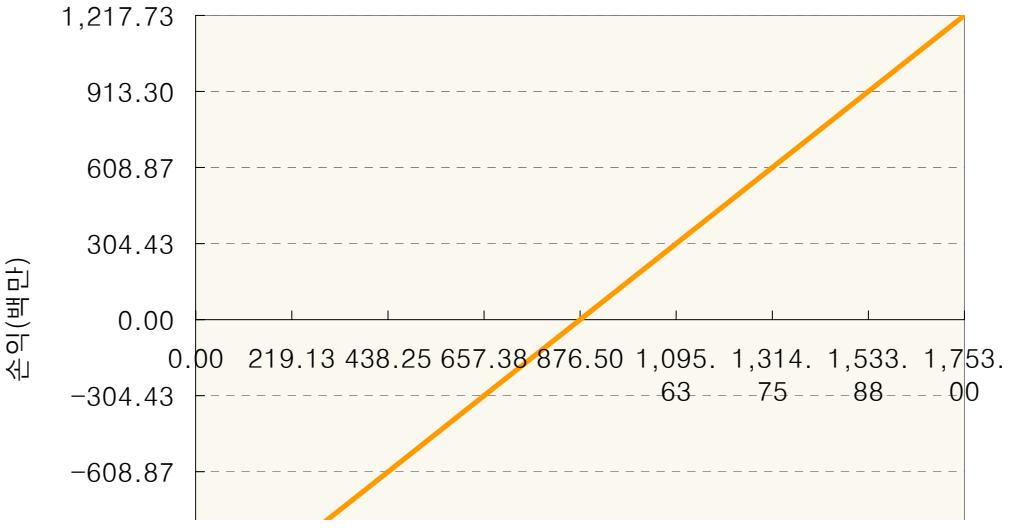


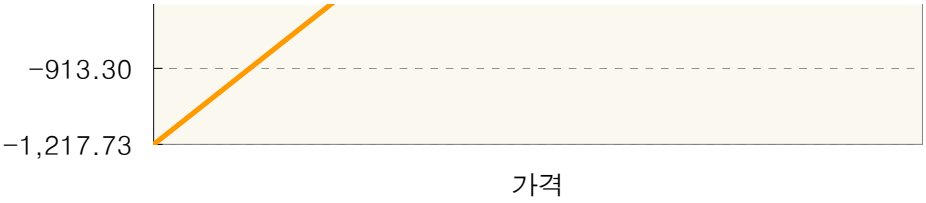



SH6-SOYBEAN FUTURE MAR16



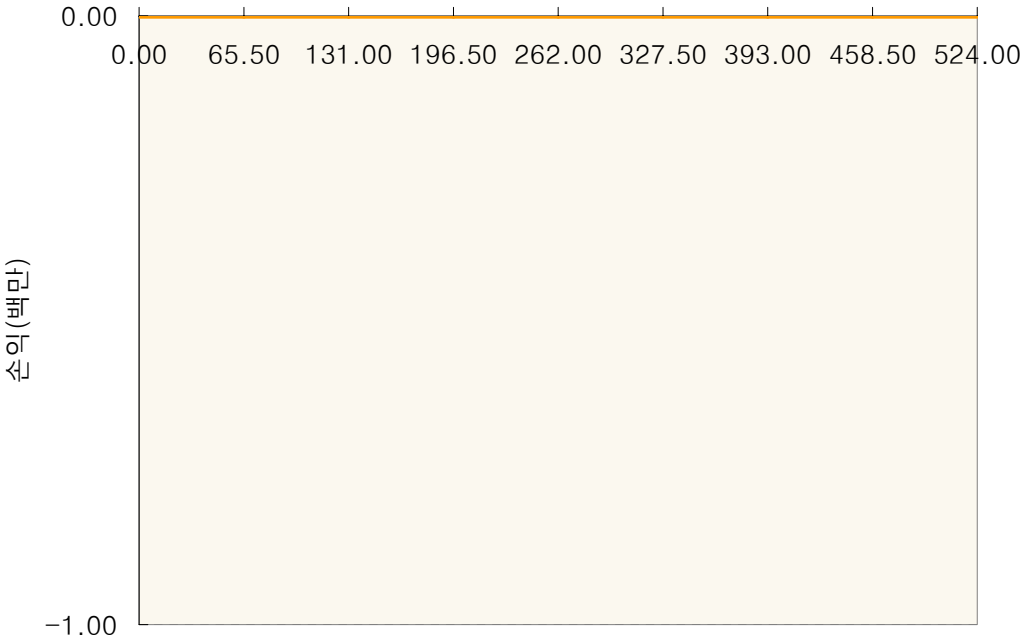

SK6-SOYBEAN FUTURE MAY16






가격

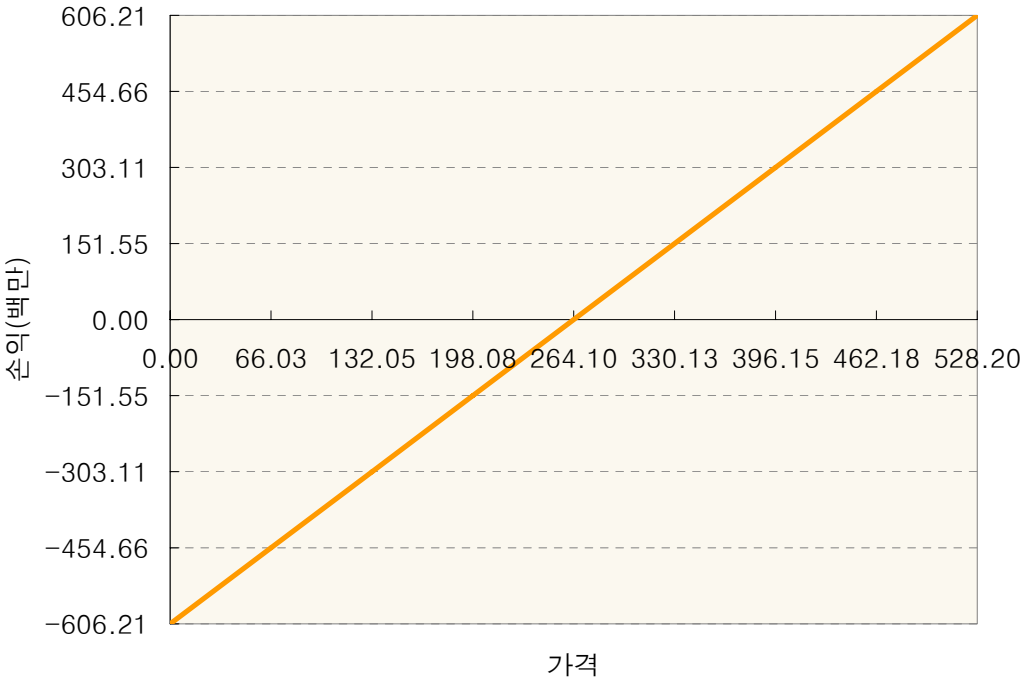
SMH6-SOYBEAN MEAL FUTR MAR16




손익(백만)

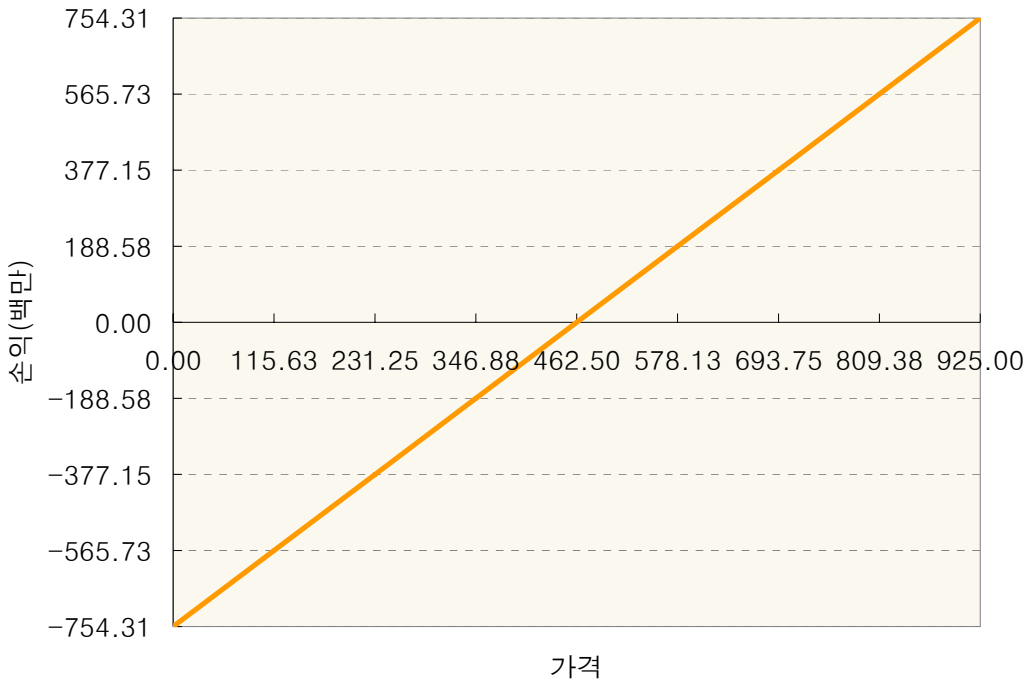
가격

SMK6-SOYBEAN MEAL FUTR MAY16




손익(백만)

가격




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOH6 | SOYBEAN OIL FUTR MAR16 | 1 |
| BOK6 | SOYBEAN OIL FUTR MAY16 | 45 |
| CK6 | CORN FUTURE MAY16 | 84 |
| CTH6 | COTTON NO.2 FUTR MAR16 | 1 |
| CTK6 | COTTON NO.2 FUTR MAY16 | 34 |
| KCH6 | COFFEE "C" FUTURE MAR16 | 1 |
| KCK6 | COFFEE "C" FUTURE MAY16 | 34 |
| KWH6 | KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAR16 | 1 |
| KWK6 | KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16 | 24 |
| SBH6 | Sugar #11 (WORLD) MAR16 | 2 |
| SBK6 | Sugar #11 (WORLD) MAY16 | 71 |
| SH6 | SOYBEAN FUTURE MAR16 | 3 |
| SK6 | SOYBEAN FUTURE MAY16 | 97 |
| SMH6 | SOYBEAN MEAL FUTR MAR16 | 2 |
| SMK6 | SOYBEAN MEAL FUTR MAY16 | 48 |
| WK6 | WHEAT FUTURE(CBT) MAY16 | 60 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 702 |