| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-22 |
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 스마트인덱스모

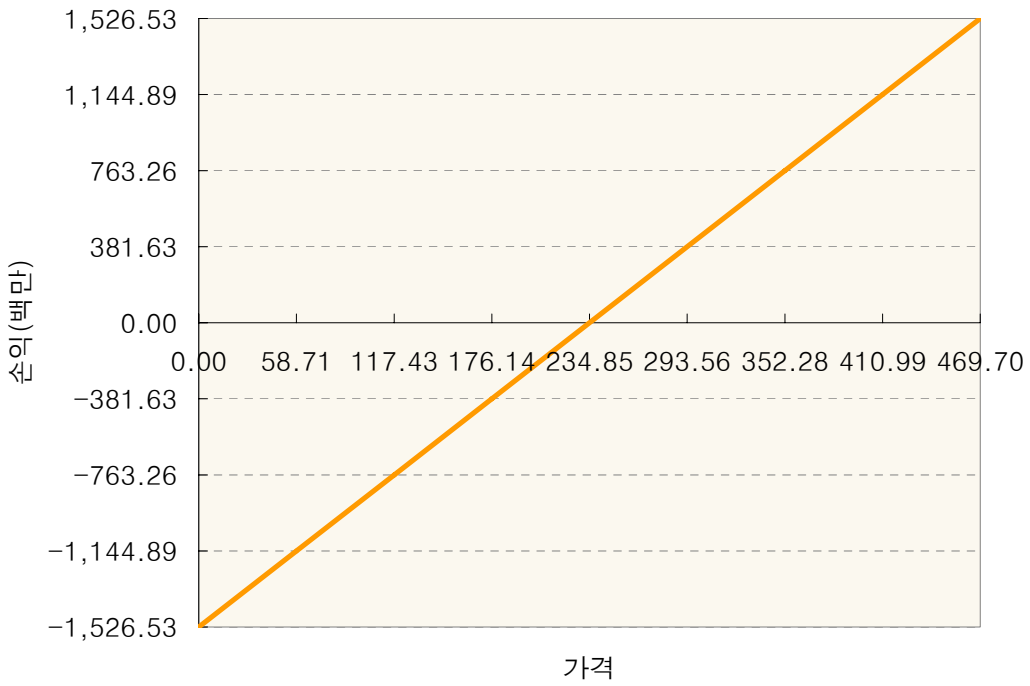
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

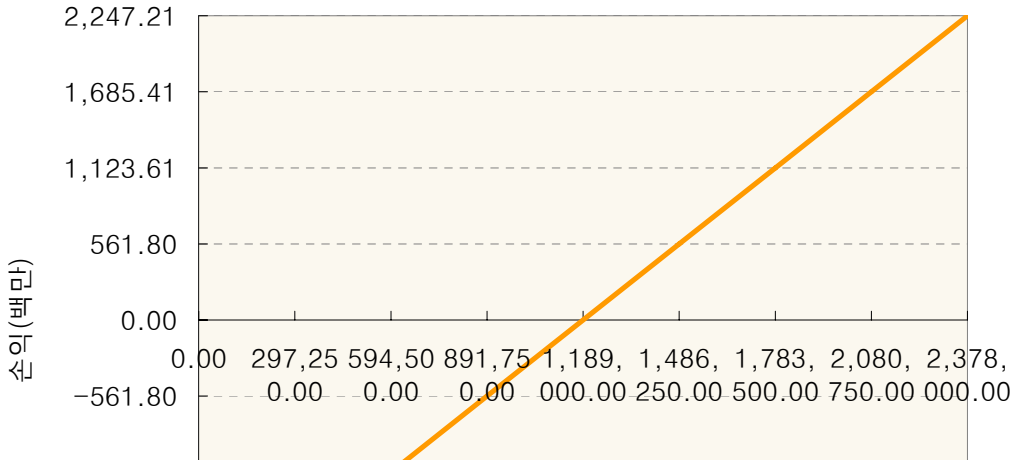
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 235 | -235 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,774 | 0 | 3,774 | 장내 |

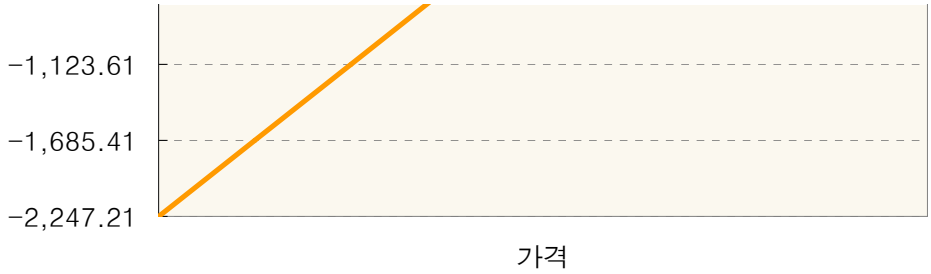
## 2. 만기시점의 손익구조

KR4101L30006-2016-03 코스피200지수선물




KR4111L30005-2016-03 삼성전자개별선물






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L3002016-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 122 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -122 | -122 | -122 | -122 | -122 | -122 | -122 |
| -5.33% | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 |
| -2.67% | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 |
| 5.33% | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 |
| 8.00% | 122 | 122 | 122 | 122 | 122 | 122 | 122 |
| KR4111L3002016-03 삼성전자개별선물 | | | | | | | 180 |
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -180 | -180 | -180 | -180 | -180 | -180 | -180 |
| -5.33% | -120 | -120 | -120 | -120 | -120 | -120 | -120 |
| -2.67% | -60 | -60 | -60 | -60 | -60 | -60 | -60 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 |
| 5.33% | 120 | 120 | 120 | 120 | 120 | 120 | 120 |
| 8.00% | 180 | 180 | 180 | 180 | 180 | 180 | 180 |

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

(단위:백만원)

| 276 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-22 |
| 기준일 | 2016-02-19 |

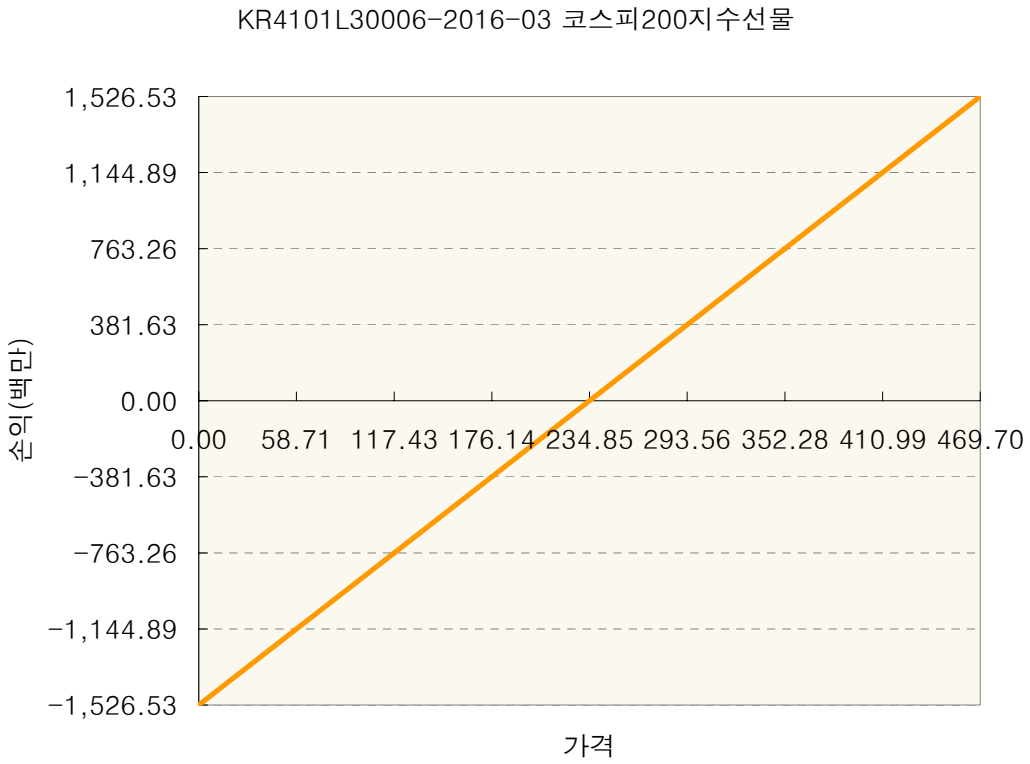
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 1,527 | 0 | 1,527 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 122

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -122 | -122 | -122 | -122 | -122 | -122 | -122 |
| -5.33% | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 | -82 |
| -2.67% | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 | -41 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 | 41 |
| 5.33% | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 | 82 |
| 8.00% | 122 | 122 | 122 | 122 | 122 | 122 | 122 |

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

| 101 |
|---|

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

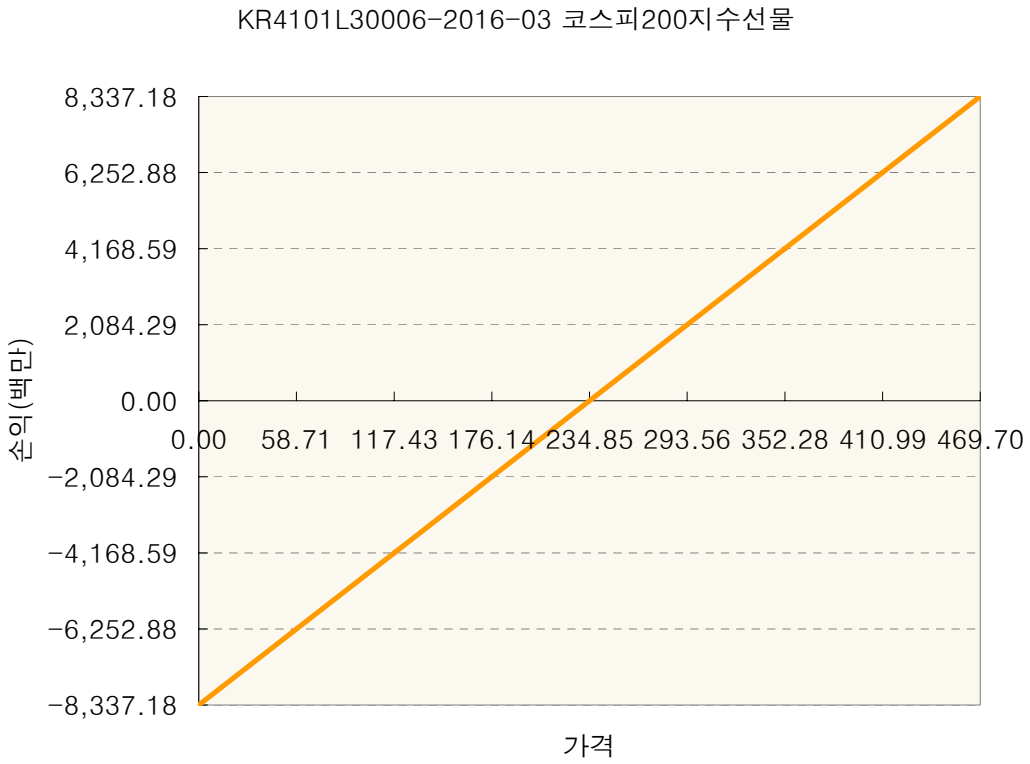
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 8,337 | 0 | 8,337 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 668 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -668 | -668 | -668 | -668 | -668 | -668 | -668 |
| -5.33% | -445 | -445 | -445 | -445 | -445 | -445 | -445 |
| -2.67% | -223 | -223 | -223 | -223 | -223 | -223 | -223 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 223 | 223 | 223 | 223 | 223 | 223 | 223 |
| 5.33% | 445 | 445 | 445 | 445 | 445 | 445 | 445 |
| 8.00% | 668 | 668 | 668 | 668 | 668 | 668 | 668 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
| --- | --- |
| | 550 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

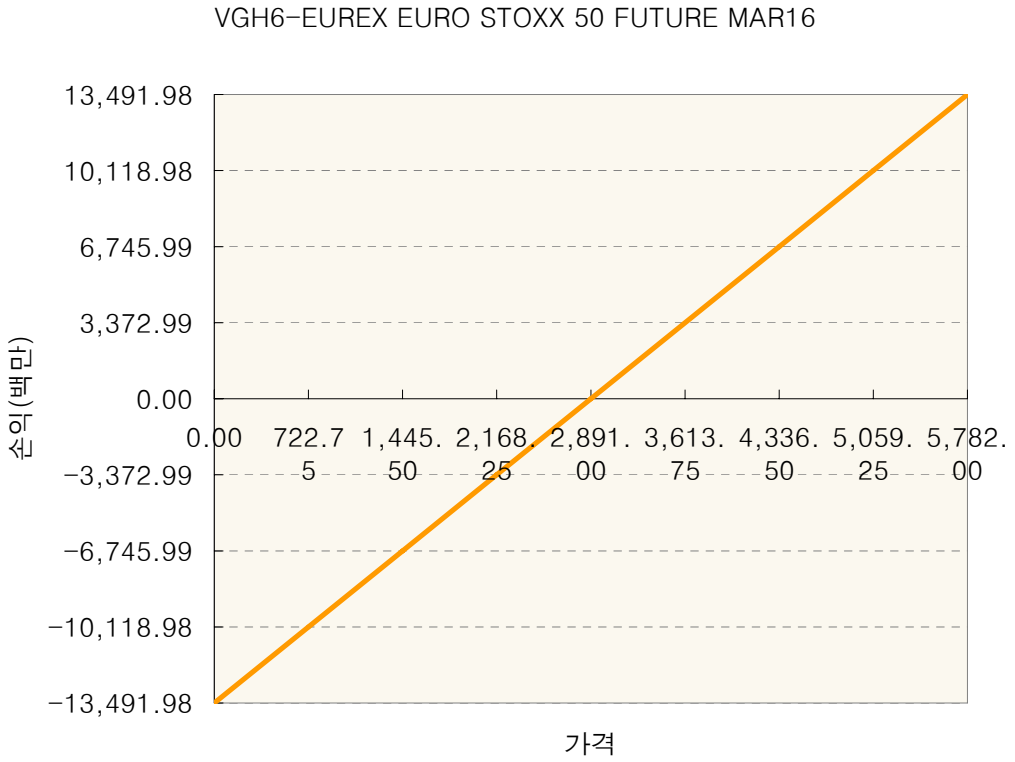
# 유로인덱스1호(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 13,492 | 0 | 13,492 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGH6 | EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR16 | 1,079 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,288 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

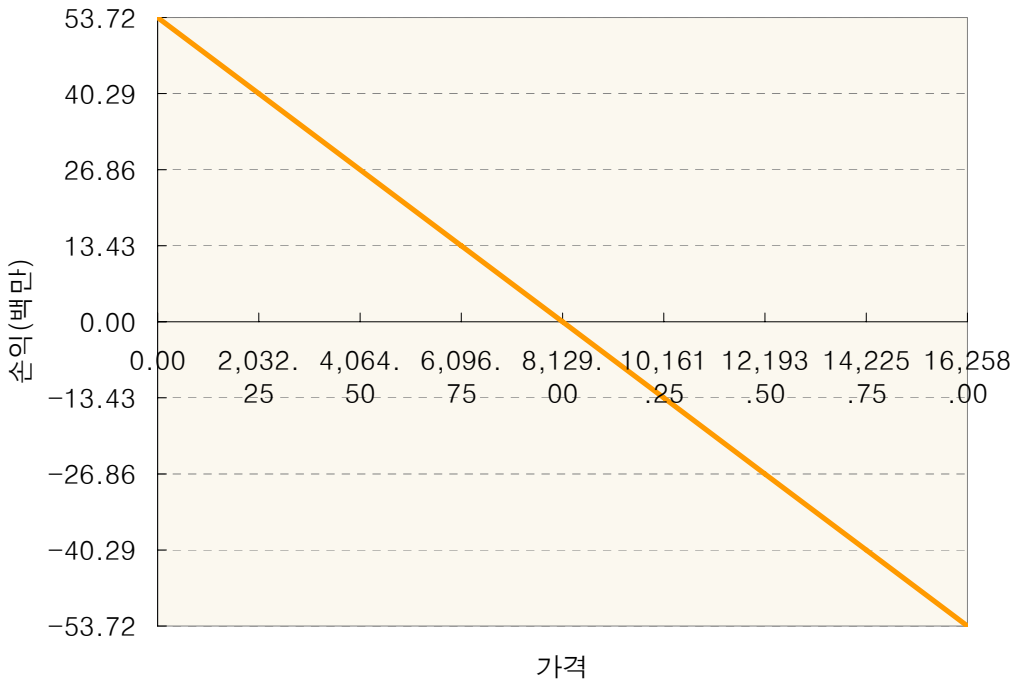
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

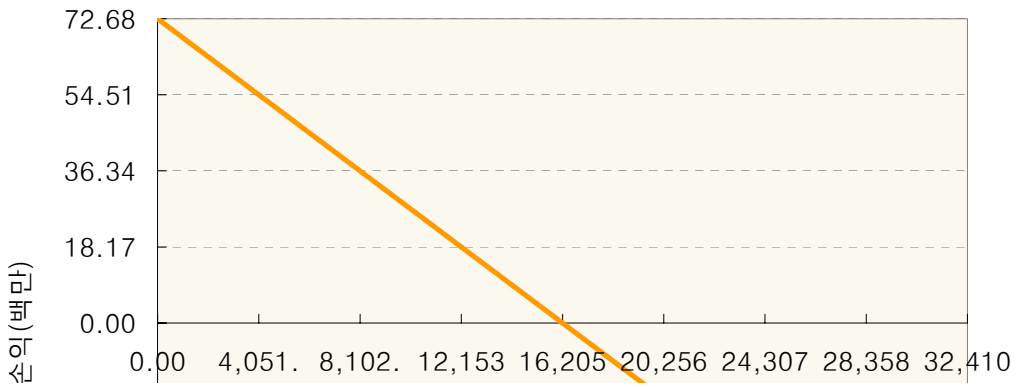
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 107 | -107 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 54 | -54 | 장내 |

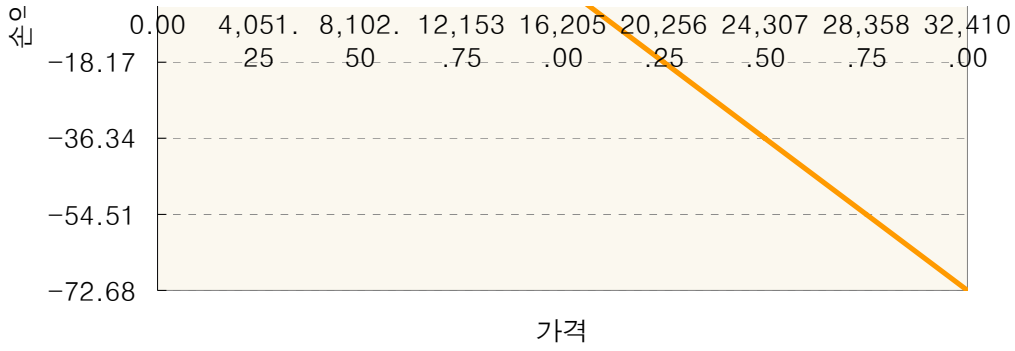
## 2. 만기시점의 손익구조

HCG6-HKG Hang Seng China Enterprises Index Fu

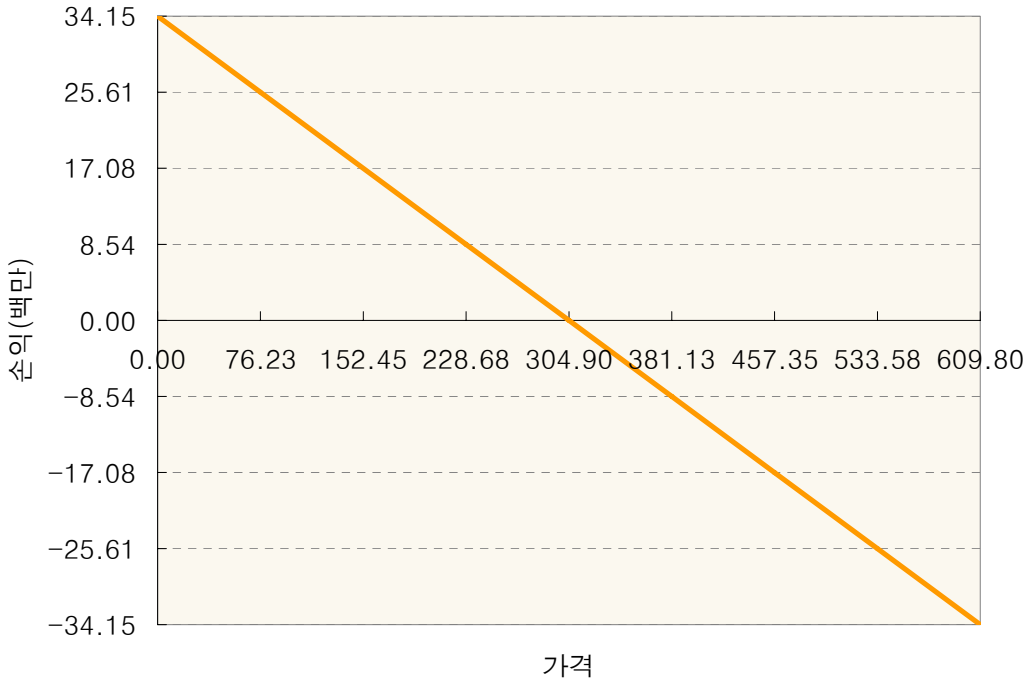



NIH6-SGX NIKKEI 225 STOCK INDEX FUTURE (SGX)






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)

| |
|---|
| 15 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 차이나인덱스(주식-파생형)(종)

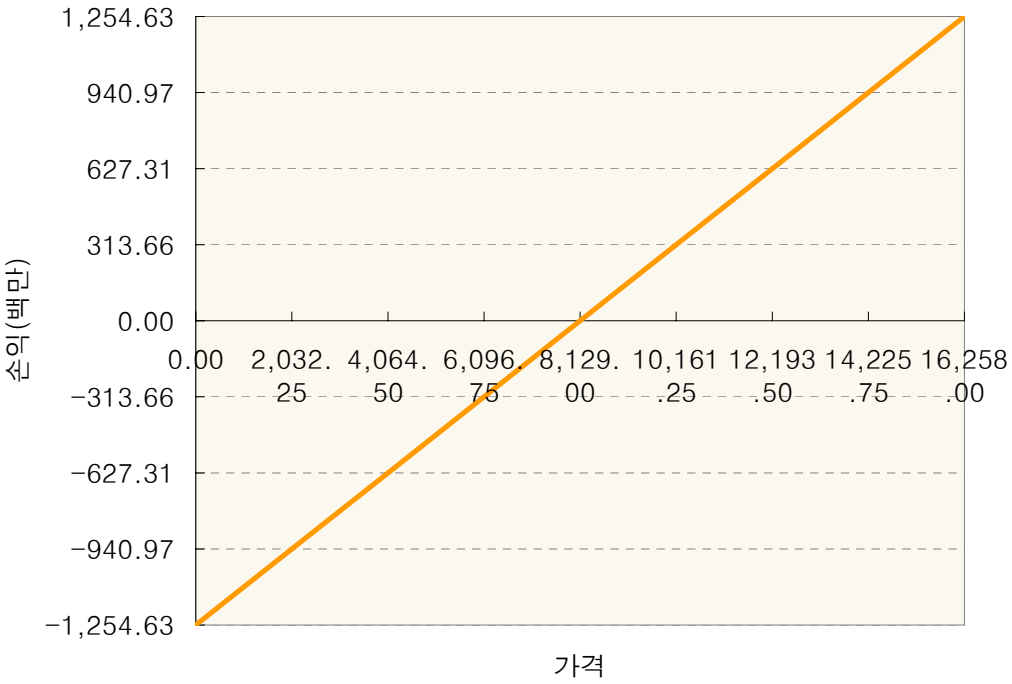
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

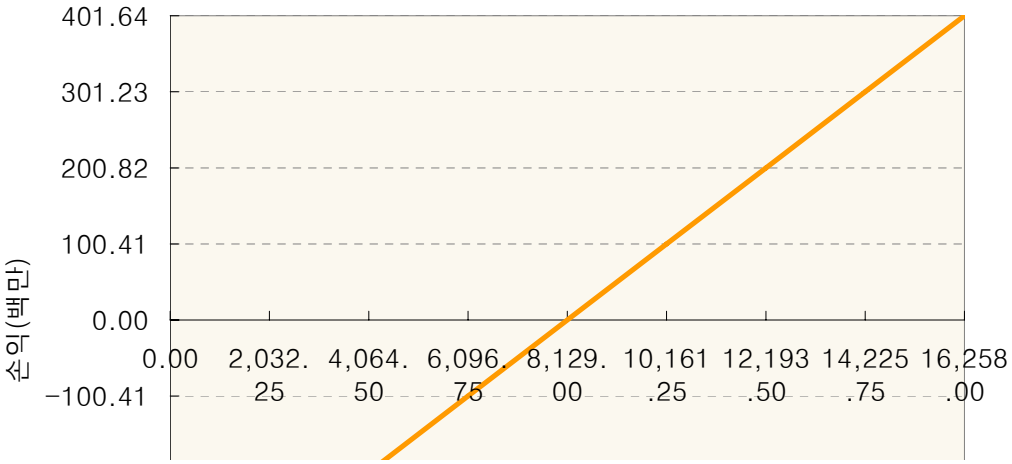
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,656 | 0 | 1,656 | 장내 |

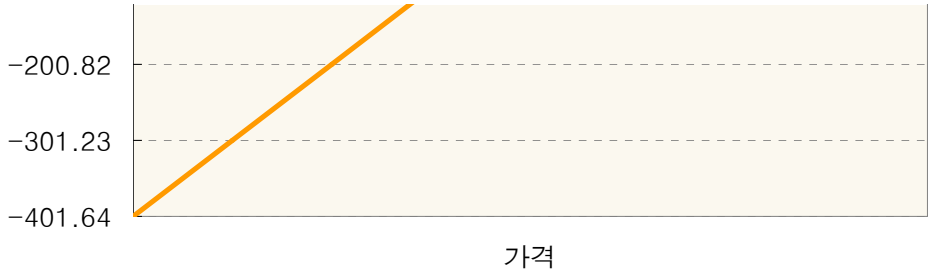
## 2. 만기시점의 손익구조

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 | 100 |
| MHCG6 | HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT F | 32 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 188 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 787 |
|---|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| 654 |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-22 |
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 32 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **74** |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-22 |
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 387 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S12082 | 120 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,454 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-22 |
| 기준일 | 2016-02-19 |

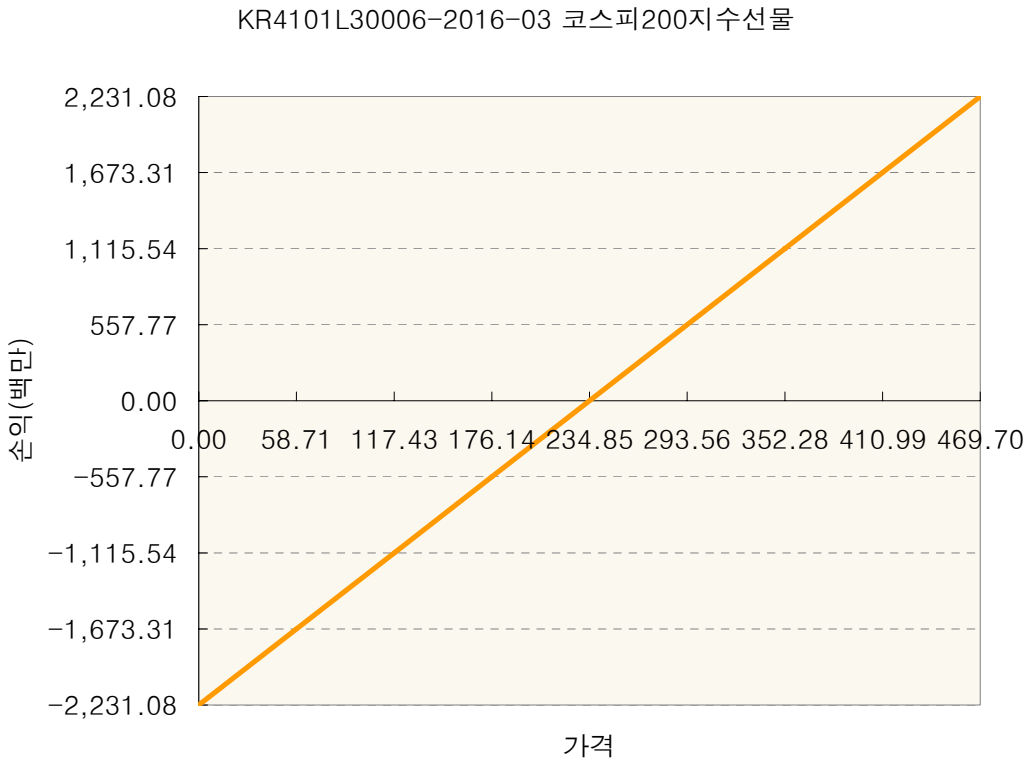
# KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

## 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 | 2,231 | 0 | 2,231 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 | | | | | | | 179 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -179 | -179 | -179 | -179 | -179 | -179 | -179 |
| -5.33% | -119 | -119 | -119 | -119 | -119 | -119 | -119 |
| -2.67% | -60 | -60 | -60 | -60 | -60 | -60 | -60 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 | 60 |
| 5.33% | 119 | 119 | 119 | 119 | 119 | 119 | 119 |
| 8.00% | 179 | 179 | 179 | 179 | 179 | 179 | 179 |

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

| 147 |
|---|

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 1,944 | 0 | 1,944 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65233AS5 ELS대우증권(ELS)15120 | 68 |
| KR65433325 ELS신영증권플랜업(ELS)5447 | 60 |
| KR65533AF5 ELSNH투자증권(ELS)11930 | 60 |
| KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269 | 60 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 162 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 243 |
| KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957 | 256 |
| KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298 | 243 |
| KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483 | 243 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 654 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 204 |
| KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454 | 204 |
| KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956 | 246 |
| KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297 | 204 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 558 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 6,119 | 0 | 6,119 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65233746 ELS대우증권(ELS)15148 | 170 |
| KR65533446 ELSNH투자증권(ELS)11973 | 170 |
| KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319 | 184 |
| KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513 | 170 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 421 |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-22 |
| 기준일 | 2016-02-19 |

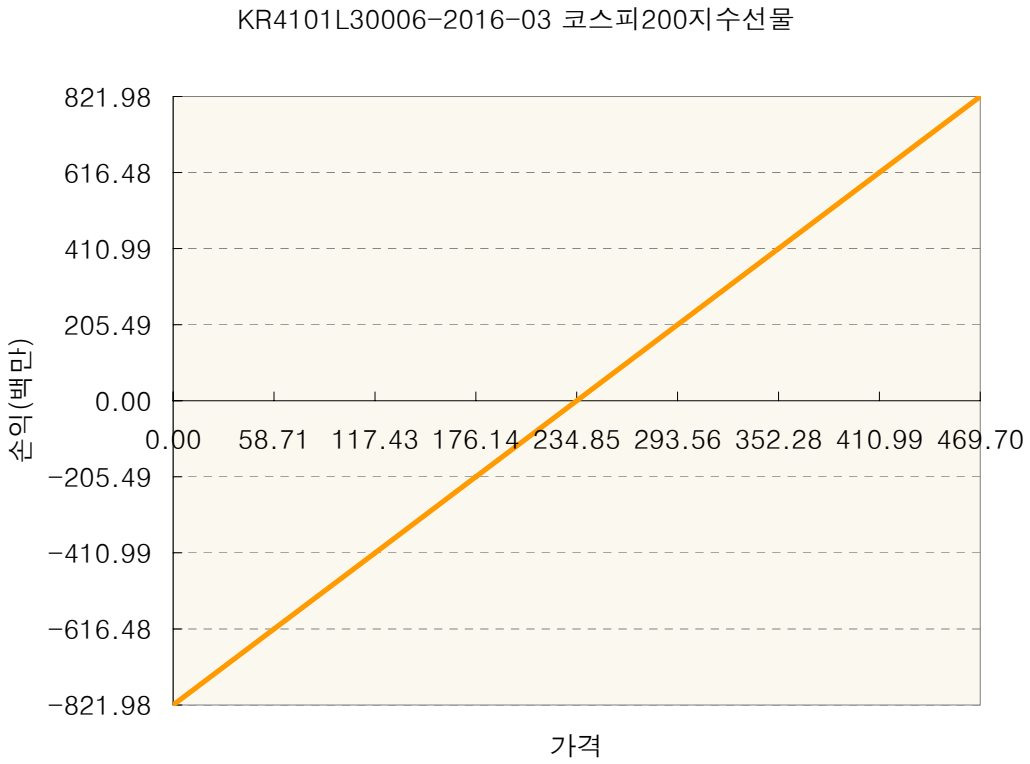
# ETF스마트레버리지목표전환형5호

## 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 | 822 | 0 | 822 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 66

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 |
| -5.33% | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 |
| -2.67% | -22 | -22 | -22 | -22 | -22 | -22 | -22 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 |
| 5.33% | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 |
| 8.00% | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 |

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

| 54 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-02-22 |
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 159 |
| KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472 | 147 |
| KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987 | 147 |
| KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343 | 147 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 342 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 118 |
| KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170 | 102 |
| KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036 | 102 |
| KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359 | 102 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 234 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 지수연계미래설계SE-11호(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 | 5,952 | 0 | 5,952 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65133226 ELS대신증권(ELS)6386 | 171 |
| KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180 | 159 |
| KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056 | 182 |
| KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388 | 165 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 385 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 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 | 205 |
| KR65233676 ELS대우증권(ELS) 15190 | 204 |
| KR65533526 ELSNH투자증권(ELS) 12077 | 204 |
| KR65733986 ELS한국투자증권(ELS) 5399 | 225 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 387 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

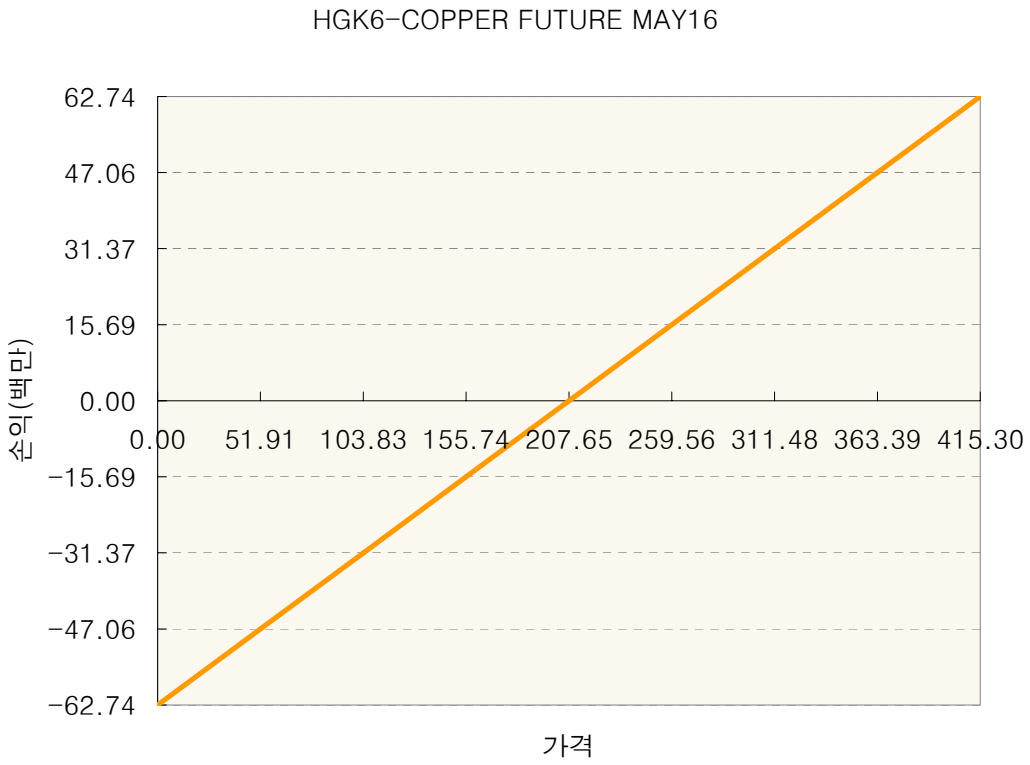
# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

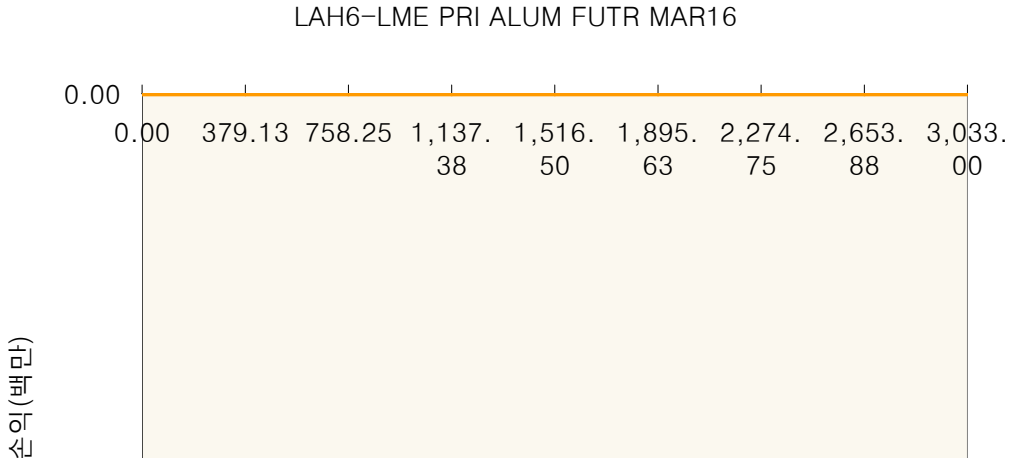
## 1. 계약금액

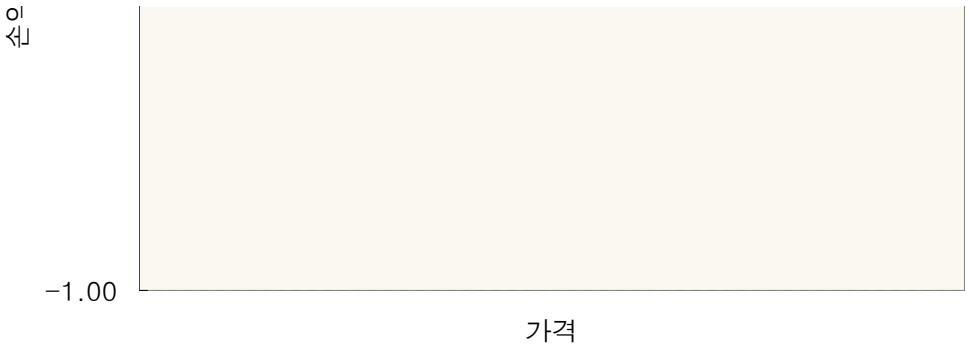
(단위:백만원)

| 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 | 56 | 0 | 56 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 398 | 96 | 302 | |

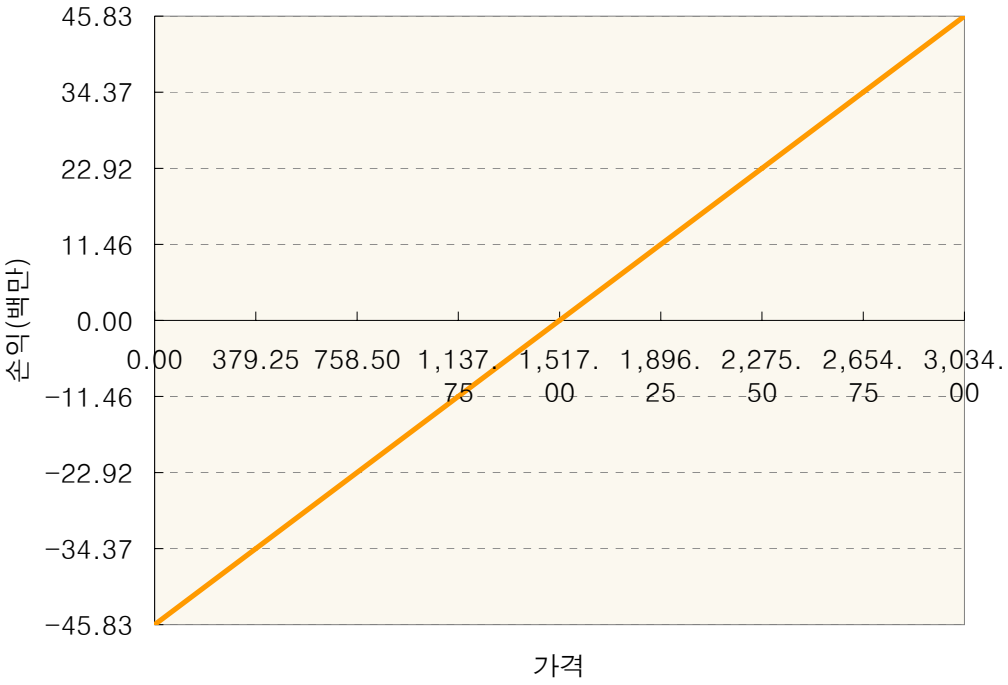
## 2. 만기시점의 손익구조



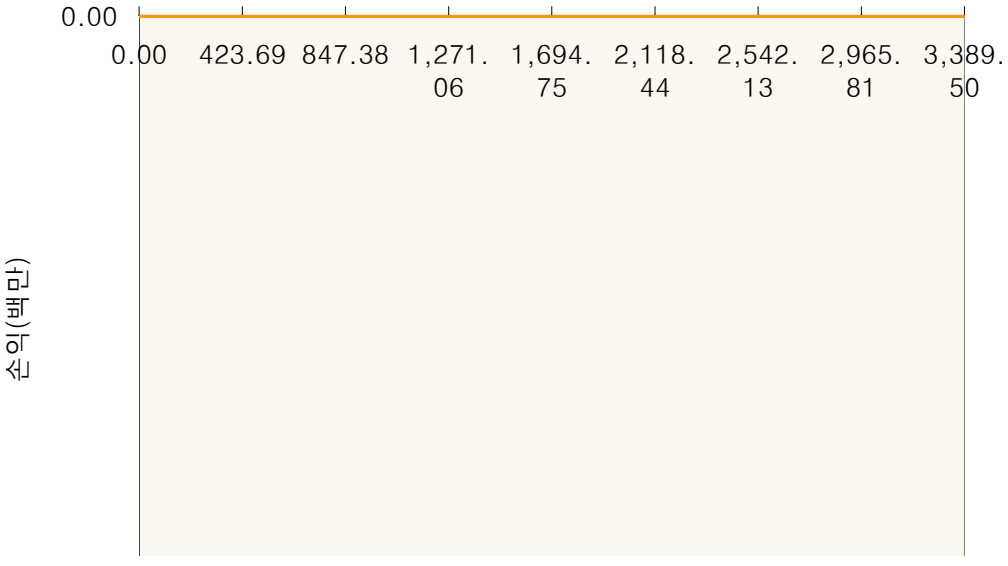



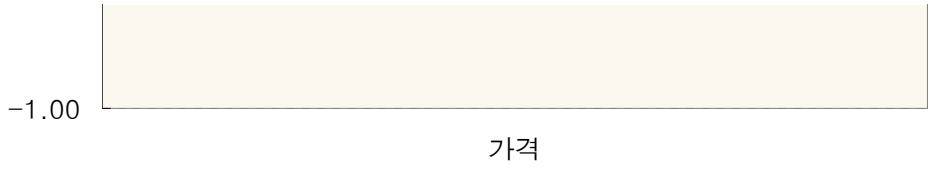



LAK6-LME PRI ALUM FUTR MAY16



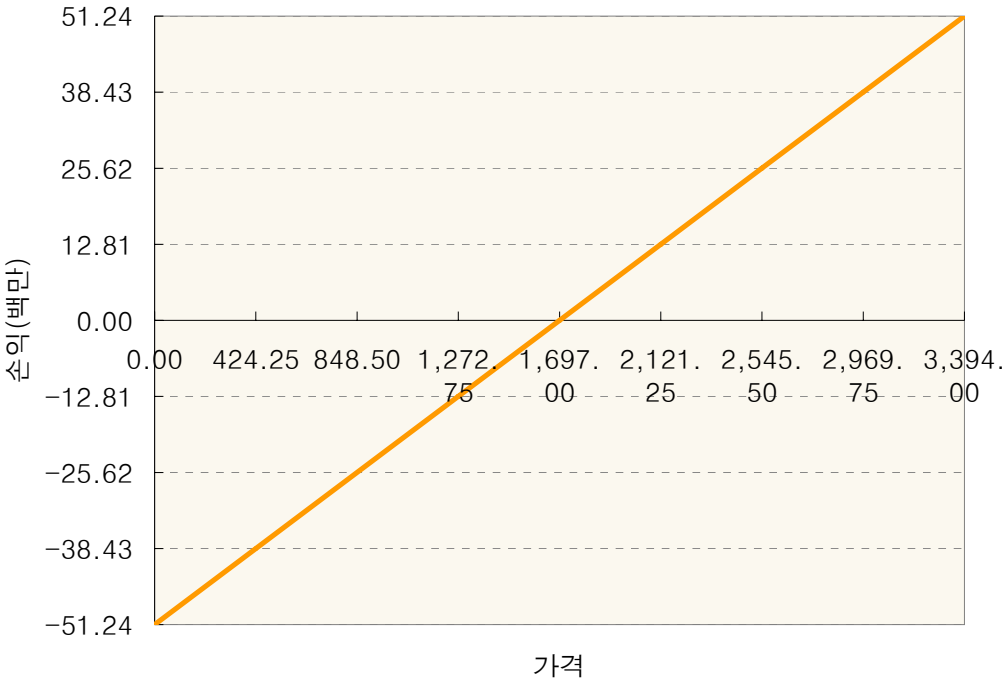

LXH6-LME ZINC FUTURE MAR16





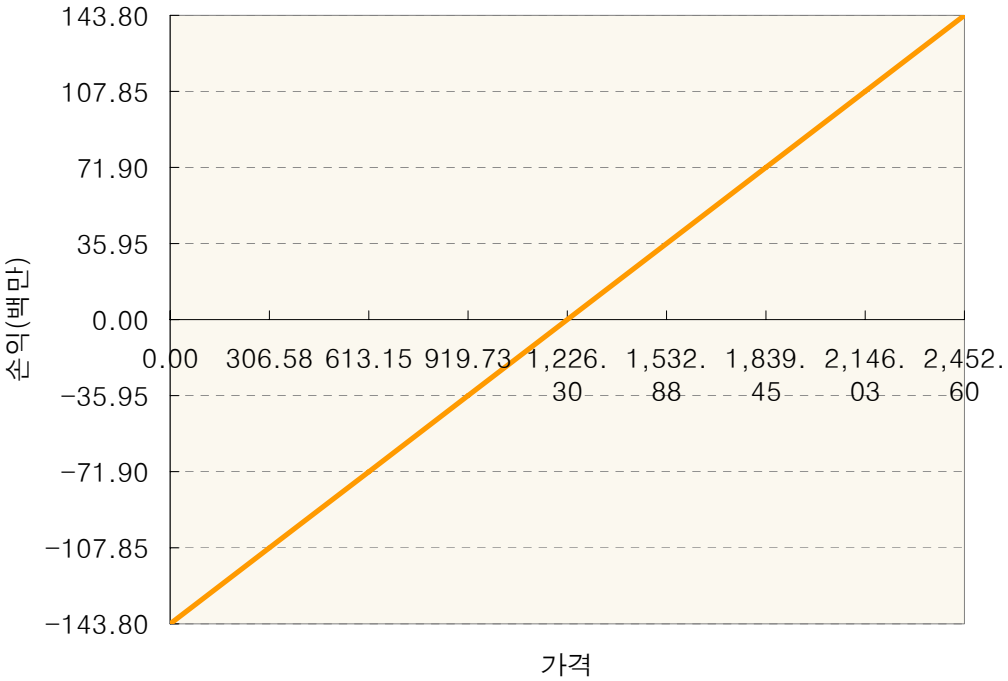

가격

LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16

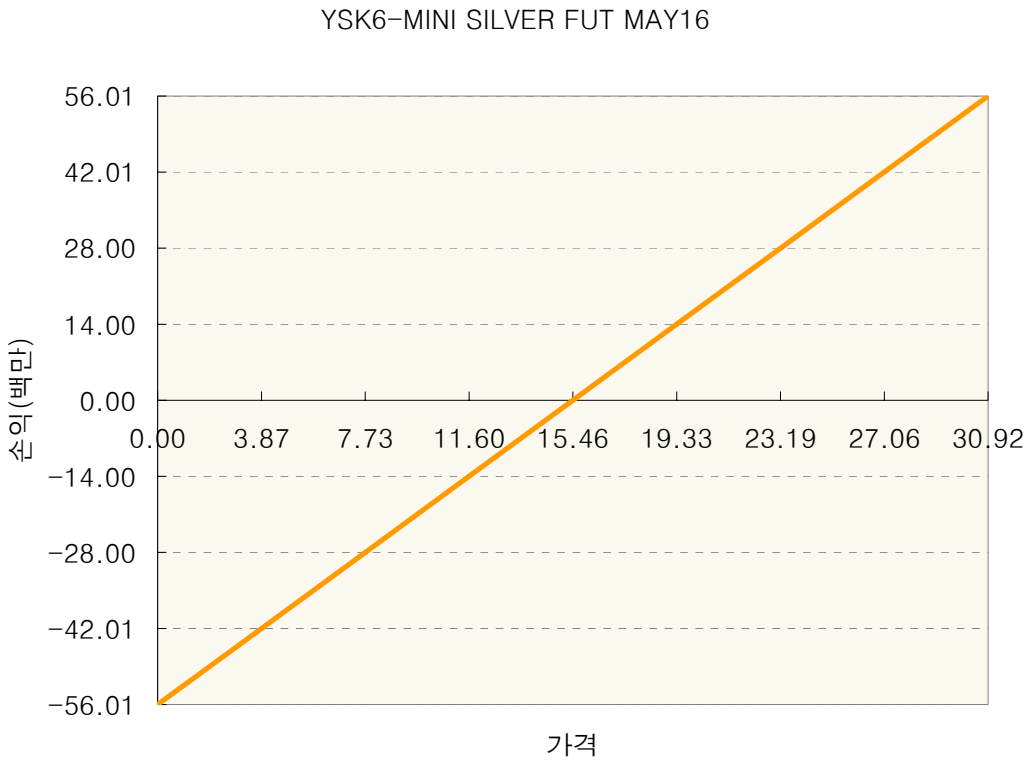



가격

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 | 4 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 30 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

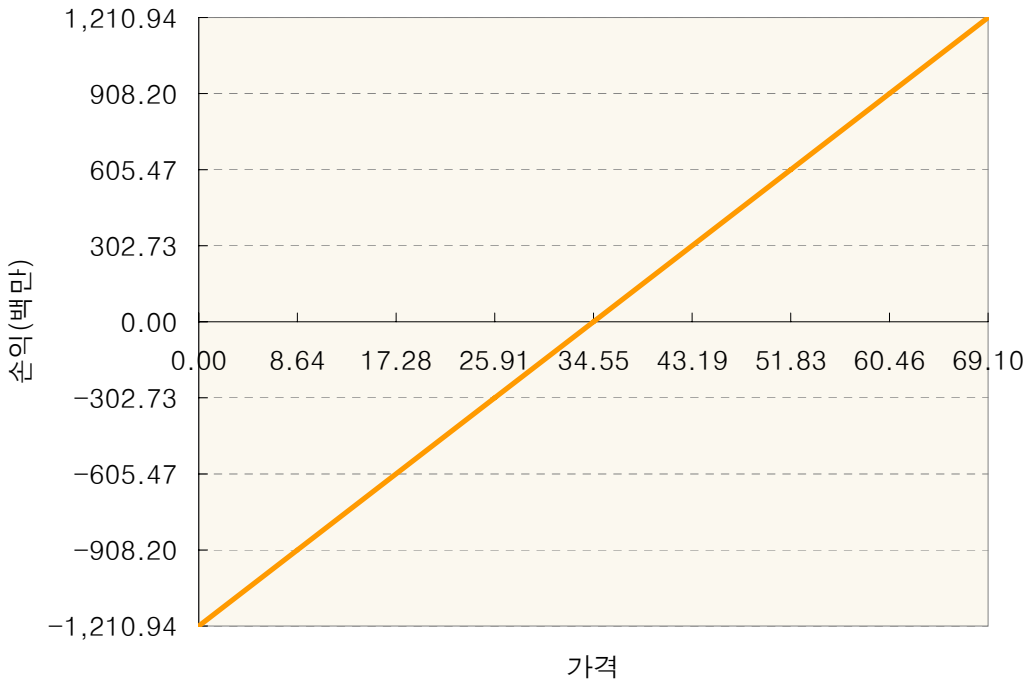
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

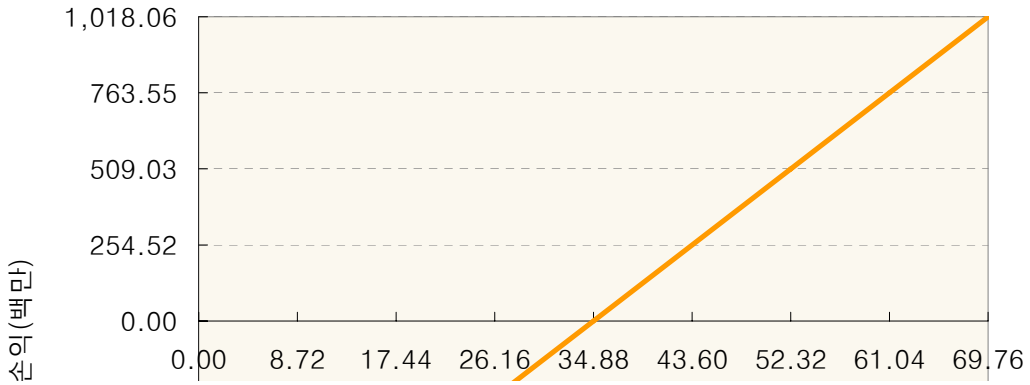
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 1,211 | 0 | 1,211 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,291 | 0 | 3,291 | |

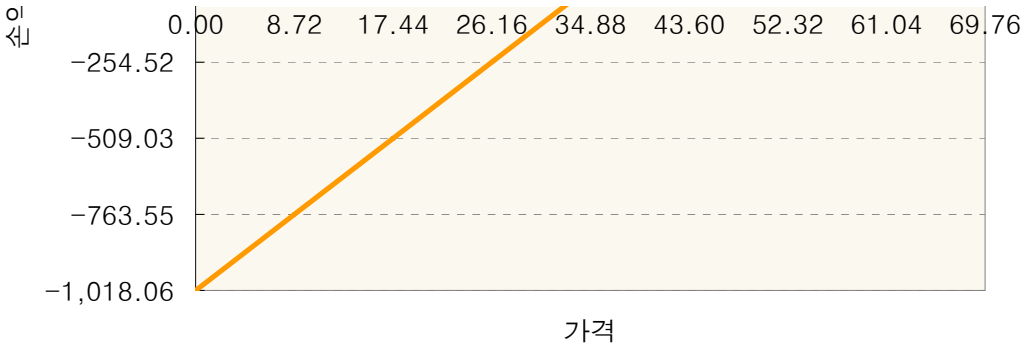
## 2. 만기시점의 손익구조

CLK6-WTI CRUDE FUTURE MAY16

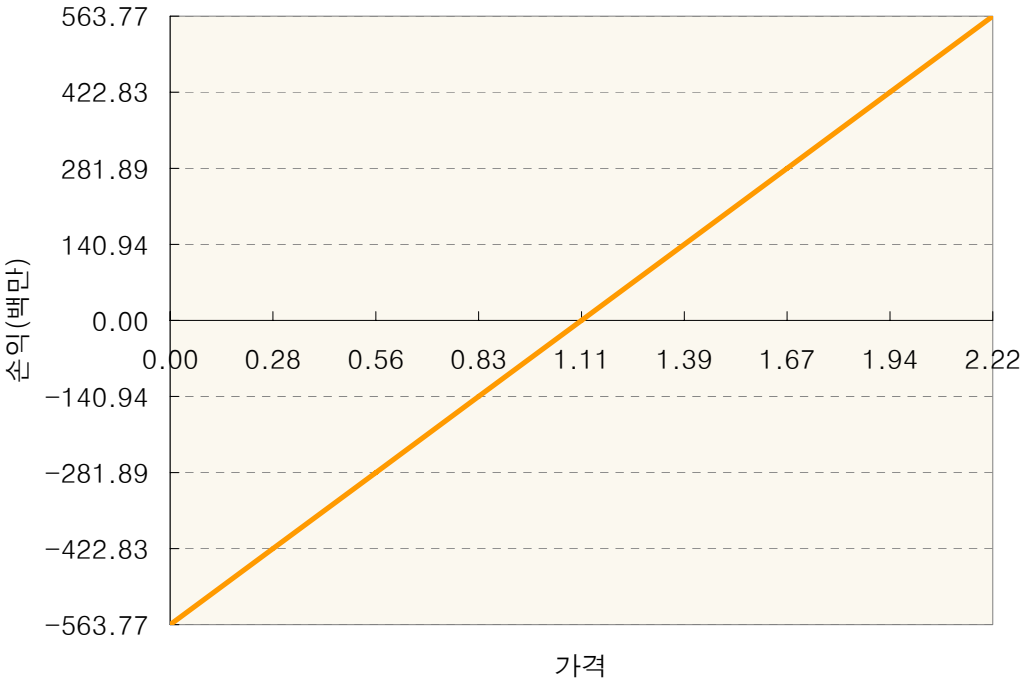



COK6-BRENT CRUDE FUTR MAY16

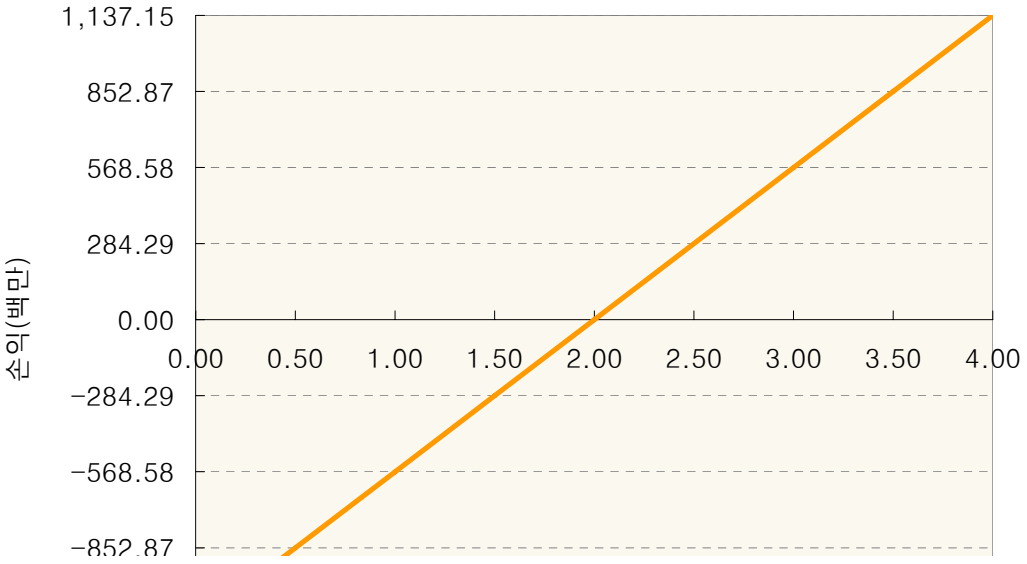


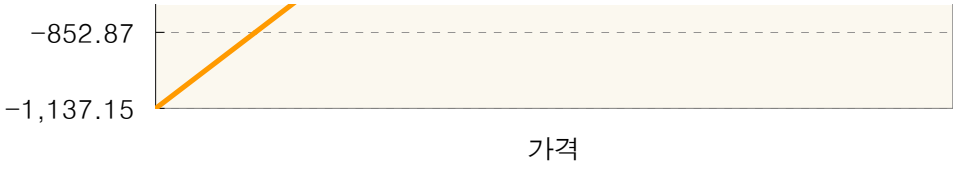



HOK6-NY Harb ULSD Fut MAY16

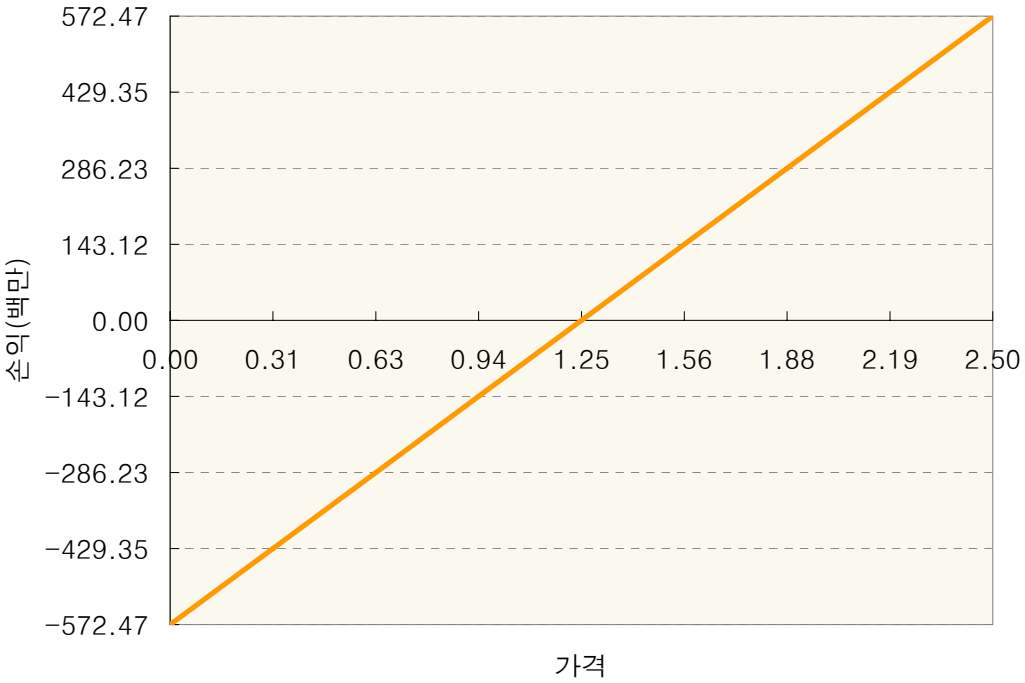



NGK6-NATURAL GAS FUTR MAY16






XBK6-GASOLINE RBOB FUT MAY16




| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|---|---|
| CLK6 | WTI CRUDE FUTURE MAY16 | 97 |
| COK6 | BRENT CRUDE FUTR MAY16 | 81 |
| HOK6 | NY Harb ULSD Fut MAY16 | 45 |
| NGK6 | NATURAL GAS FUTR MAY16 | 91 |
| XBK6 | GASOLINE RBOB FUT MAY16 | 46 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|---|---|
| | 984 |

| 공시일 | 2016-02-22 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-02-19 |

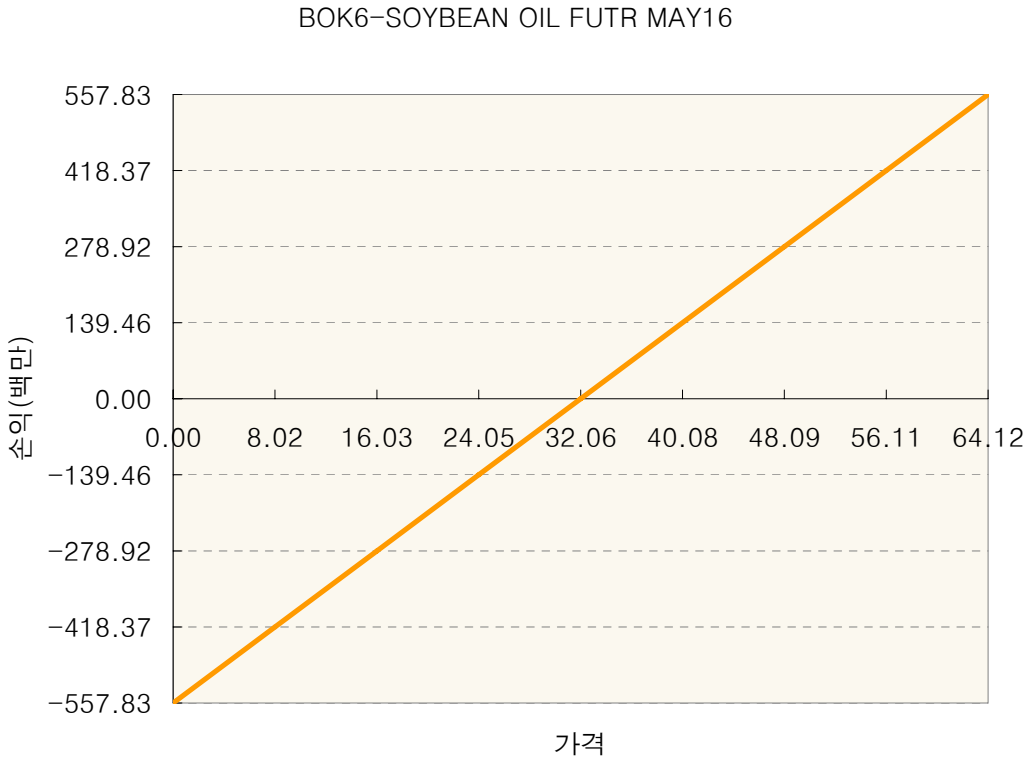
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

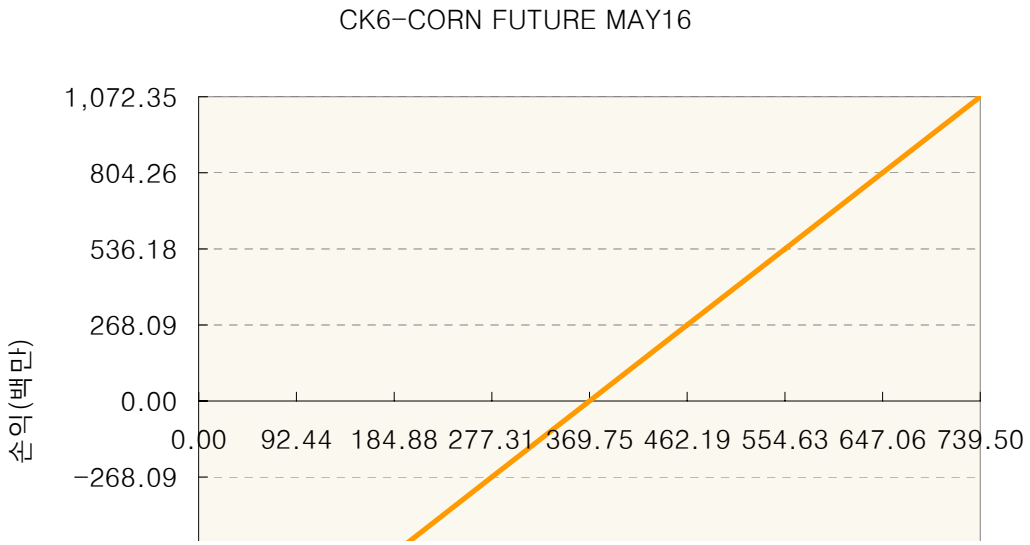
## 1. 계약금액

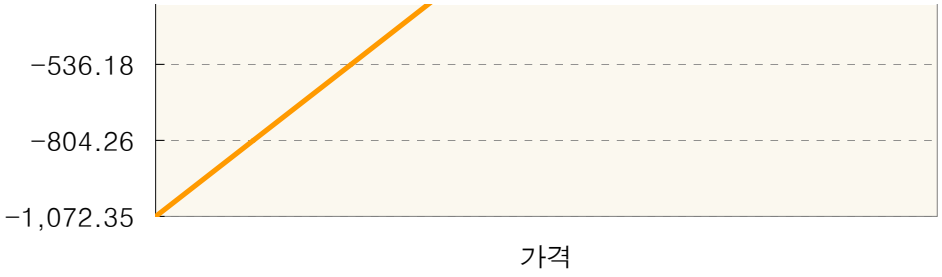
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,179 | 0 | 6,179 | |

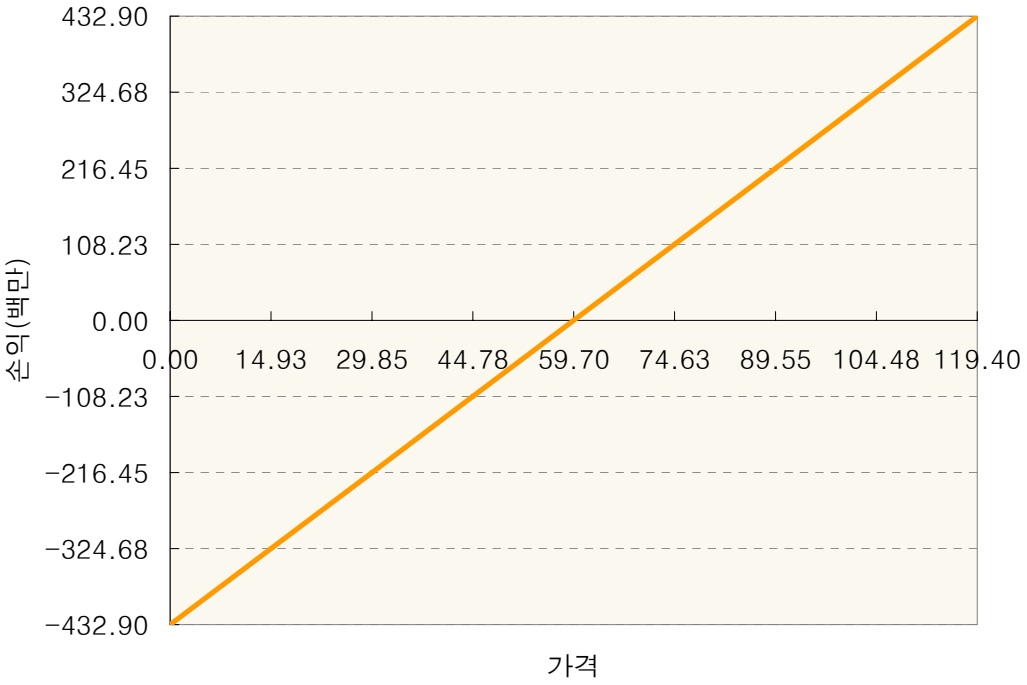
## 2. 만기시점의 손익구조



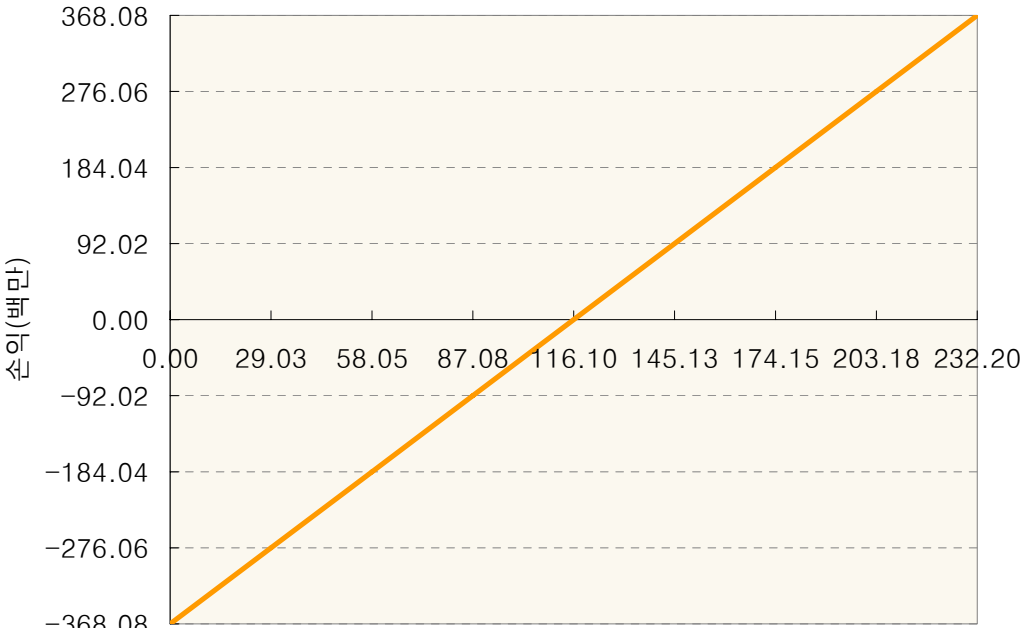



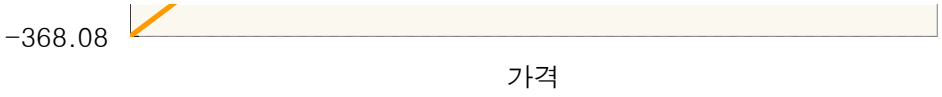



CTK6-COTTON NO.2 FUTR MAY16

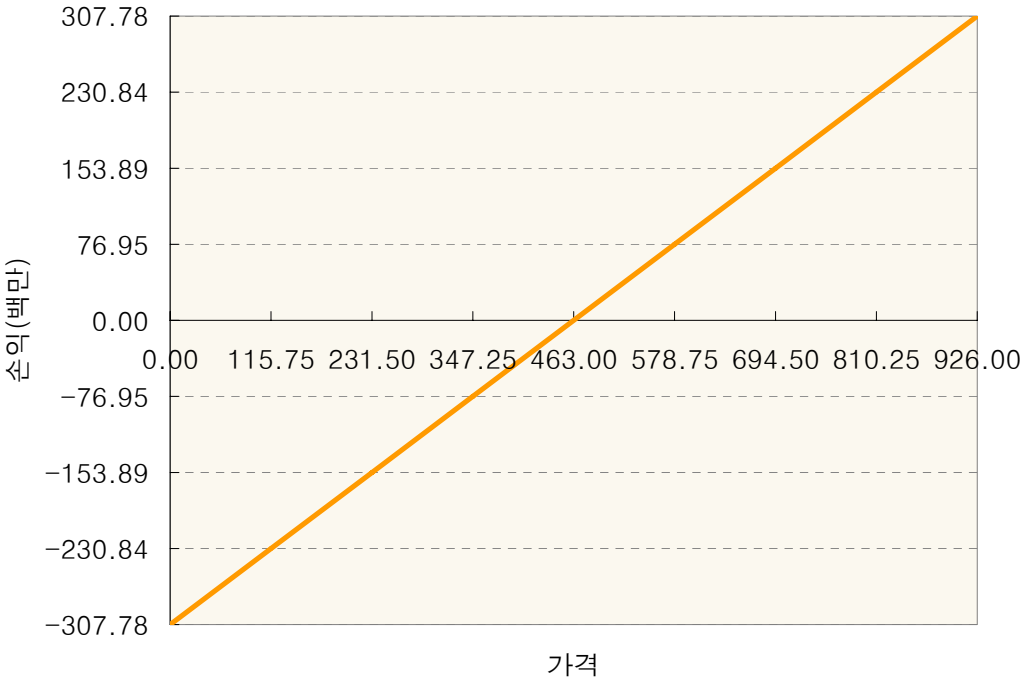



KCK6-COFFEE "C" FUTURE MAY16

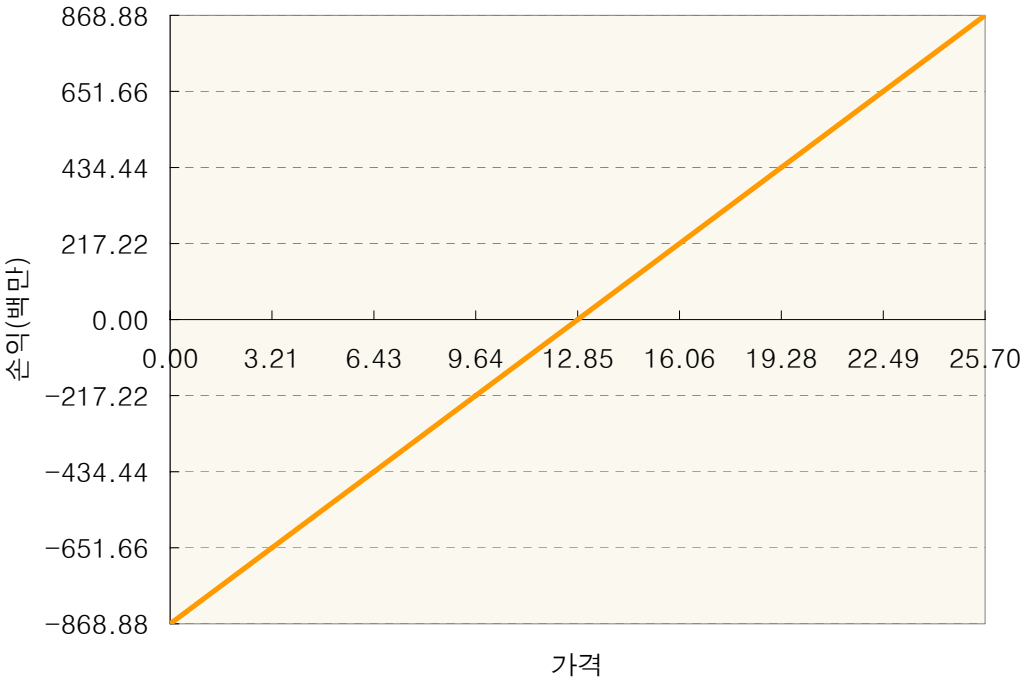




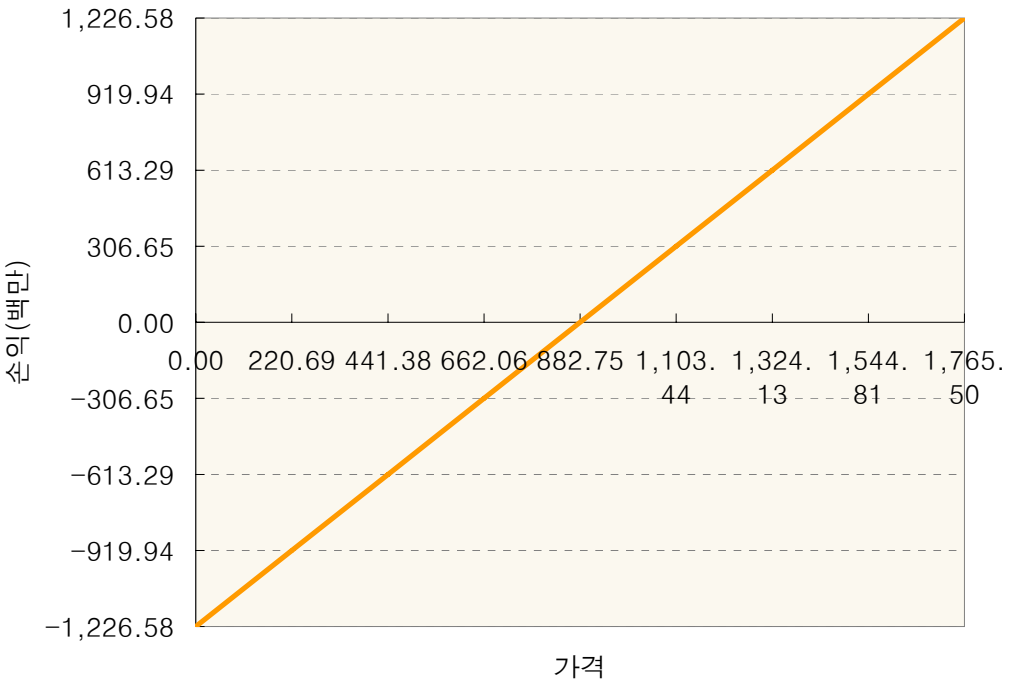

KWK6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16



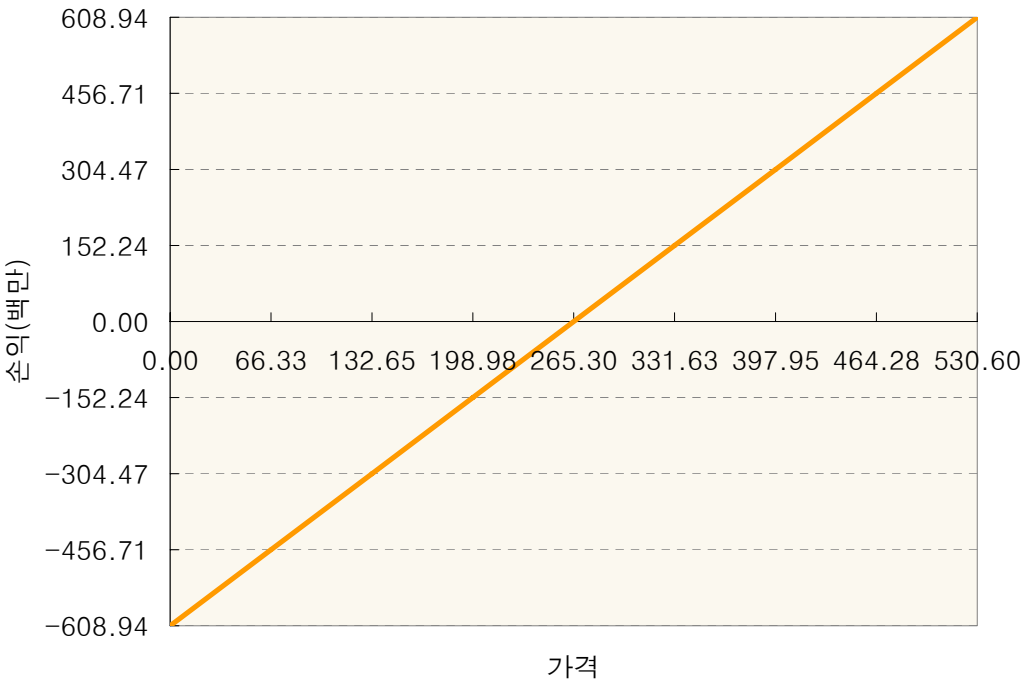

SBK6-Sugar #11 (WORLD) MAY16



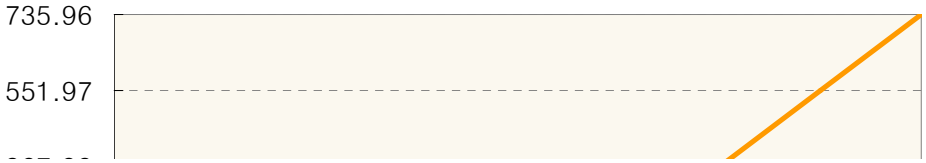

SK6-SOYBEAN FUTURE MAY16

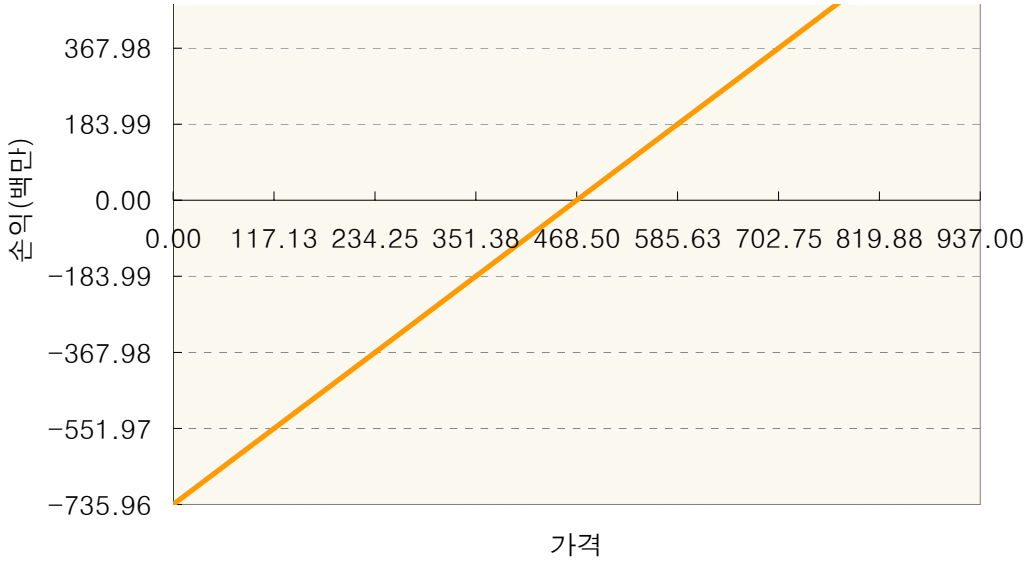



SMK6-SOYBEAN MEAL FUTR MAY16




WK6-WHEAT FUTURE(CBT) MAY16






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOK6 | SOYBEAN OIL FUTR MAY16 | 45 |
| CK6 | CORN FUTURE MAY16 | 86 |
| CTK6 | COTTON NO.2 FUTR MAY16 | 35 |
| KCK6 | COFFEE "C" FUTURE MAY16 | 29 |
| KWK6 | KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16 | 25 |
| SBK6 | Sugar #11 (WORLD) MAY16 | 70 |
| SK6 | SOYBEAN FUTURE MAY16 | 98 |
| SMK6 | SOYBEAN MEAL FUTR MAY16 | 49 |
| WK6 | WHEAT FUTURE(CBT) MAY16 | 59 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **679** |