공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	2016-03-09
기준일	2016-03-08

스마트인덱스모

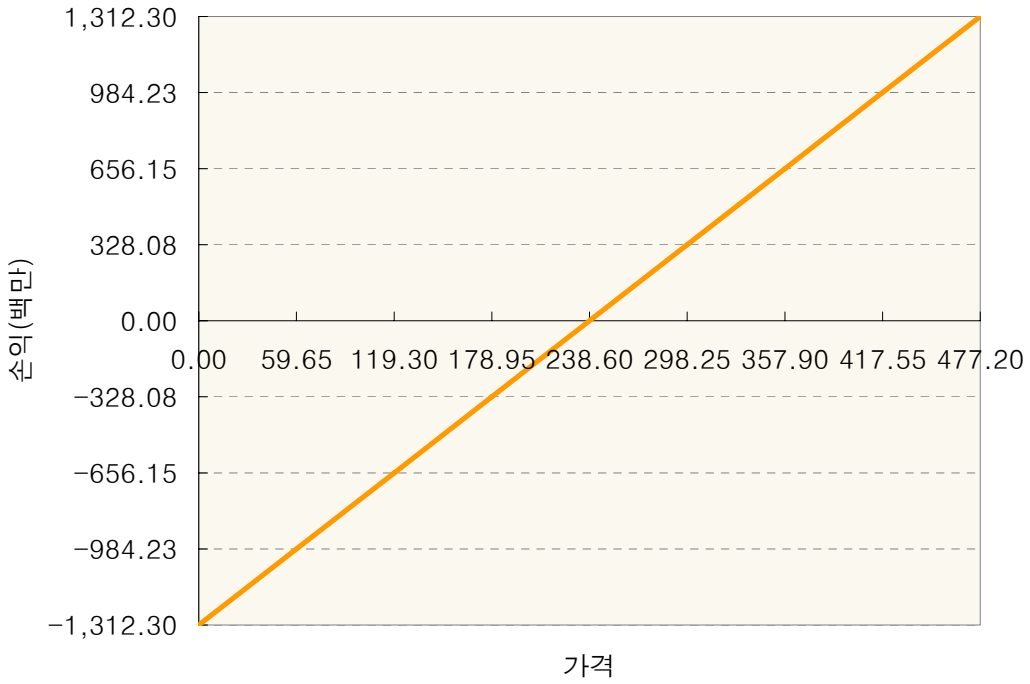
1. 계약금액

(단위:백만원)

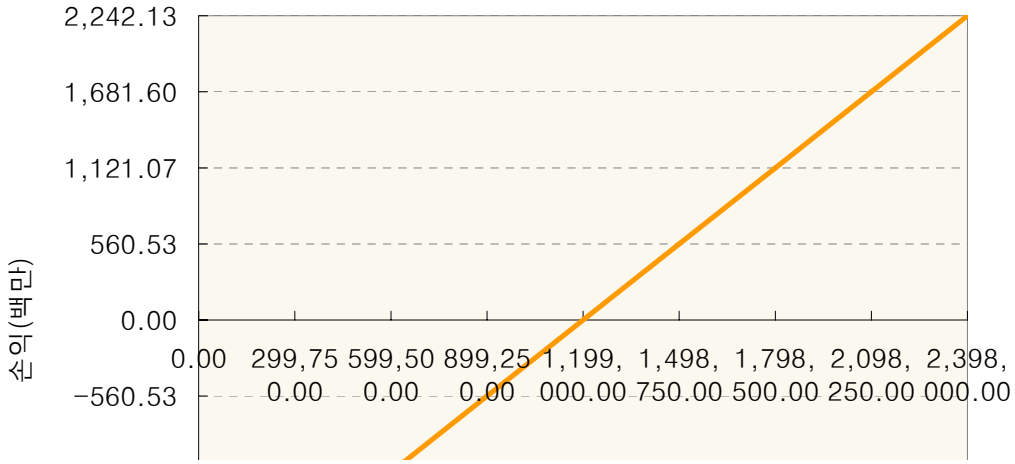
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,554	0	3,554	장내

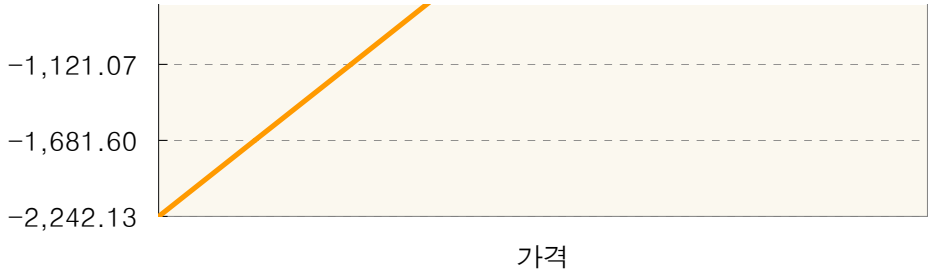
2. 만기시점의 손익구조

KR4101L30006-2016-03 코스피200지수선물



KR4111L30005-2016-03 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L3002016-03 코스피200지수선물							105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	105	105	105	105	105	105	105
KR4111L3002016-03 삼성전자개별선물							178
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178
-5.33%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	119	119	119	119	119	119	119
8.00%	178	178	178	178	178	178	178

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

(단위:백만원)

260

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

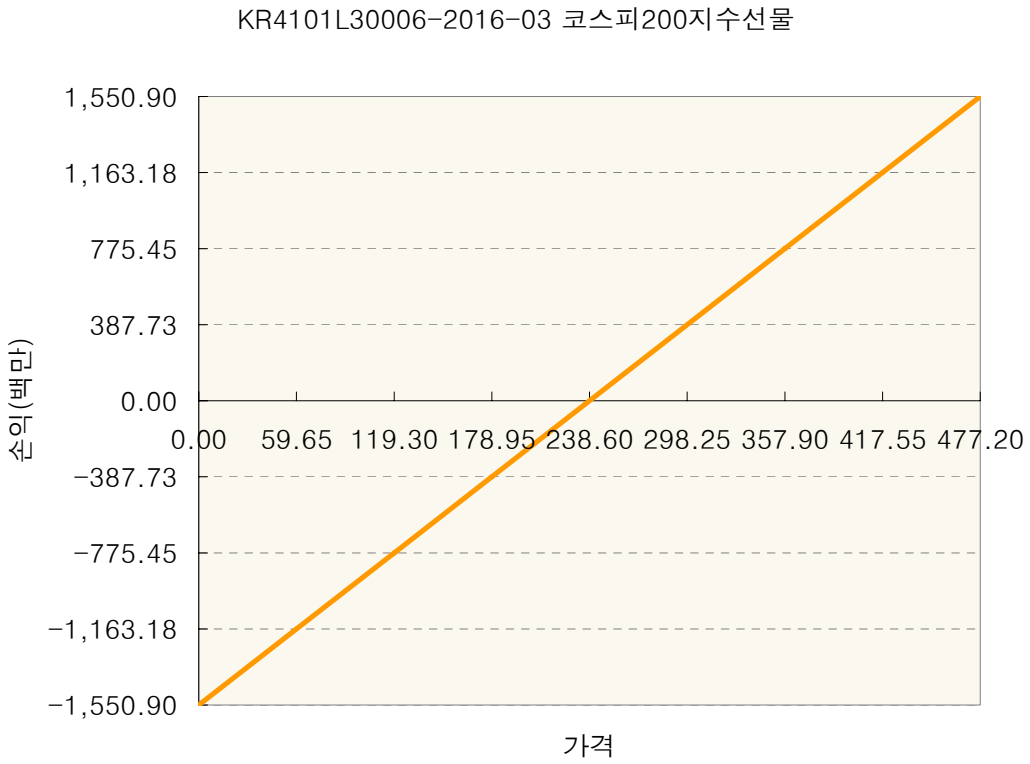
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,551	0	1,551	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물 124

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-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%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

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

103

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

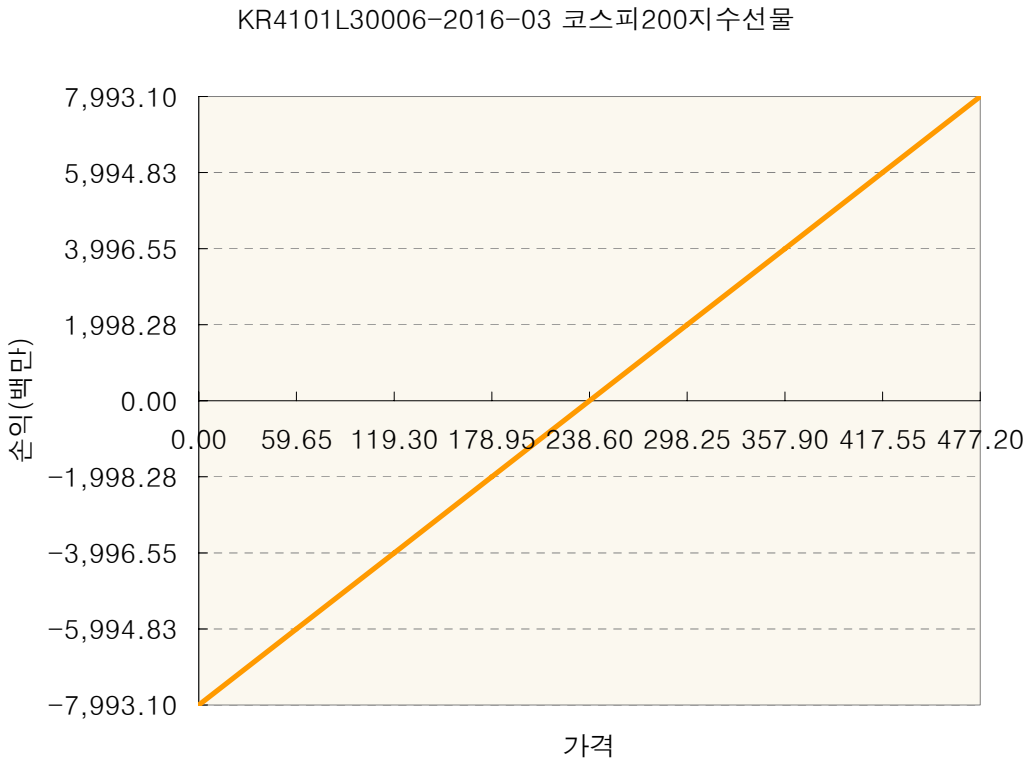
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	7,993	0	7,993	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							639
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-639	-639	-639	-639	-639	-639	-639
-5.33%	-426	-426	-426	-426	-426	-426	-426
-2.67%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	213	213	213	213	213	213	213
5.33%	426	426	426	426	426	426	426
8.00%	639	639	639	639	639	639	639

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

529

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

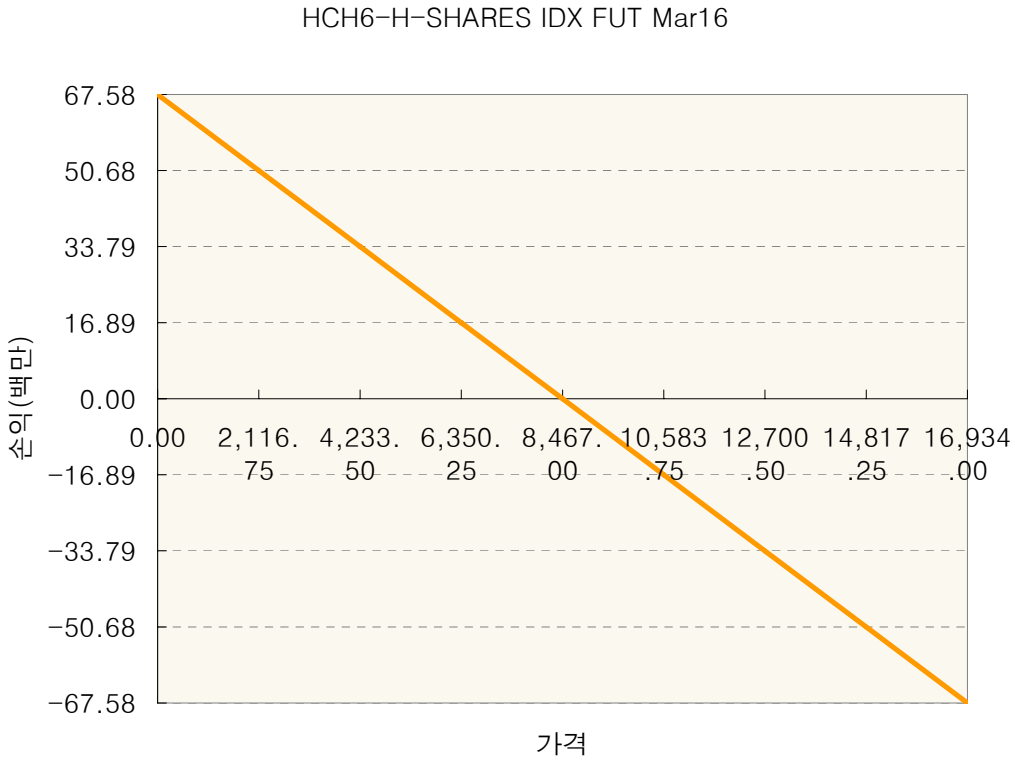
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	68	-68	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH6	H-SHARES IDX FUT Mar16	5

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

(단위:백만원)

6

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	9,797	0	9,797	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO00(신한MXWO 미래S160222	819

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

700

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	40

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

97

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	6,148	0	6,148	장외
누계	지수	스왑	6,148	0	6,148	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160308	377
SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1	117

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,460

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

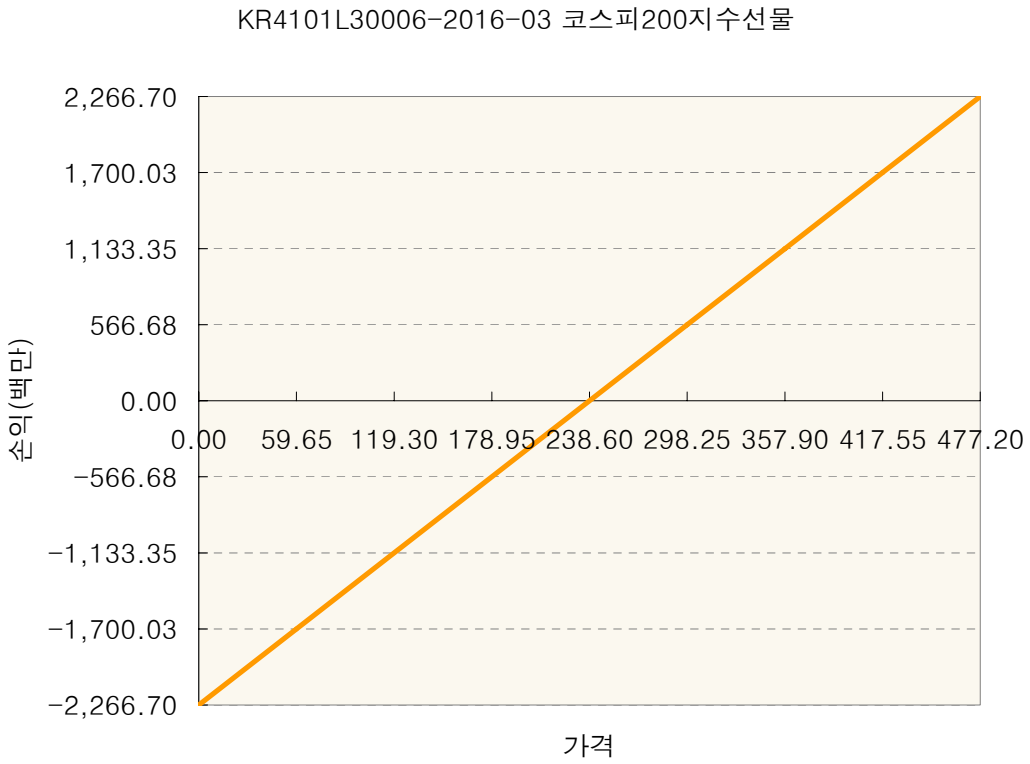
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	2,267	0	2,267	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							181
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181
-5.33%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-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%	121	121	121	121	121	121	121
8.00%	181	181	181	181	181	181	181

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	150

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	1,934	0	1,934	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65233AS5 ELS대우증권(ELS)15120	67
KR65433325 ELS신영증권플랜업(ELS)5447	60
KR65533AF5 ELSNH투자증권(ELS)11930	60
KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269	60

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

(단위:백만원)

151

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	231
KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957	243
KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298	232
KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483	232

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

(단위:백만원)

592

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	197
KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454	198
KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956	237
KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297	198

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

(단위:백만원)

508

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	148
KR65533446 ELSNH투자증권(ELS)11973	148
KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319	161
KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513	149

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

(단위:백만원)

315

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

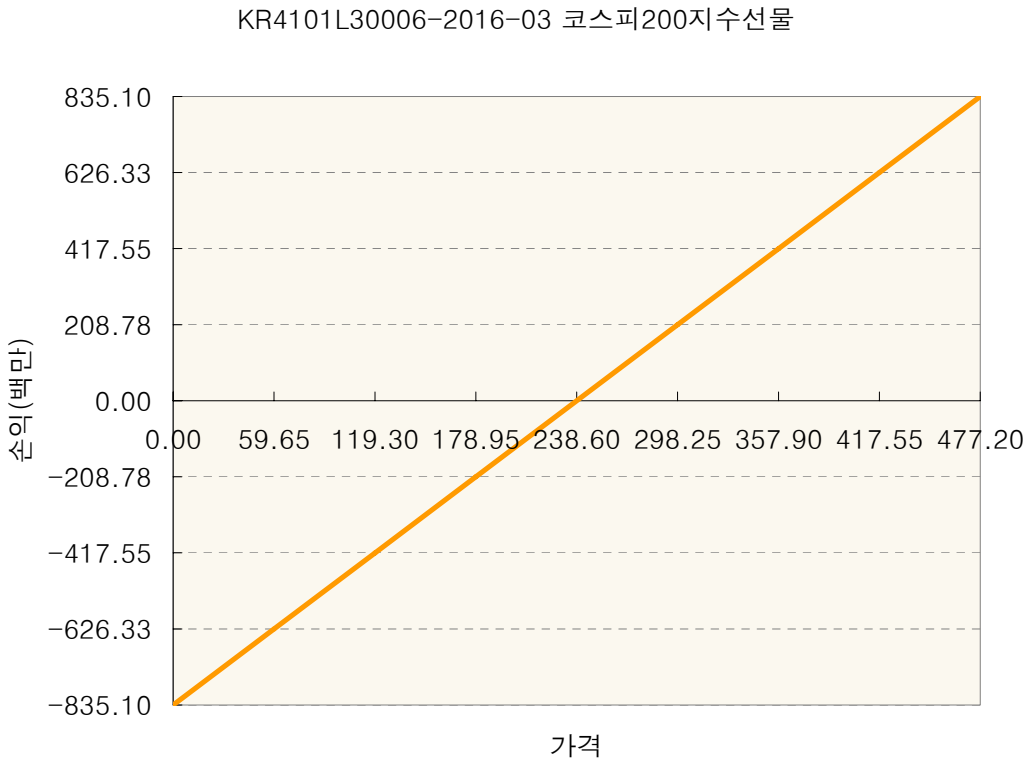
ETF스마트레버리지목표전환형5호

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	835	0	835	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L300 2016-03 코스피200지수선물							67
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-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%	45	45	45	45	45	45	45
8.00%	67	67	67	67	67	67	67

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	55

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	136
KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472	126
KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987	125
KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343	125

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

(단위:백만원)

270

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	102
KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170	88
KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036	88
KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359	88

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

(단위:백만원)

178

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	152
KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180	142
KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056	162
KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388	147

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

(단위:백만원)

319

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

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	163
KR65233676 ELS대우증권(ELS) 15190	162
KR65533526 ELSNH투자증권(ELS) 12077	162
KR65733986 ELS한국투자증권(ELS) 5399	178

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

(단위:백만원)

280

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

지수연계미래설계SE-13호(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	6,483	0	6,483	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133A76 ELS대신증권(ELS) 6419	160
KR65433166 ELS신영증권플랜업(ELS) 5495	160
KR65533956 ELSNH투자증권(ELS) 12098	168
KR65733AY6 ELS한국투자증권(ELS) 5385	160

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

(단위:백만원)

334

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

지수연계미래설계SE-14호(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	11,465	0	11,465	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133196 ELS대신증권(ELS)6422	270
KR65233306 ELS대우증권(ELS)15315	289
KR65533226 ELSNH투자증권(ELS)12137	315
KR65733066 ELS한국투자증권(ELS)5421	270

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

(단위:백만원)

562

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

지수연계미래설계SE-15호(ELS-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	14,847	0	14,847	장외
누계	유가증권	ELS	14,847	0	14,847	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133546 ELS대신증권(ELS)6436	398
KR65233776 ELS대우증권(ELS)15342	423
KR65433106 ELS신영증권플랜업(ELS)5516	398
KR65733196 ELS한국투자증권(ELS)5445	397

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

(단위:백만원)

898

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

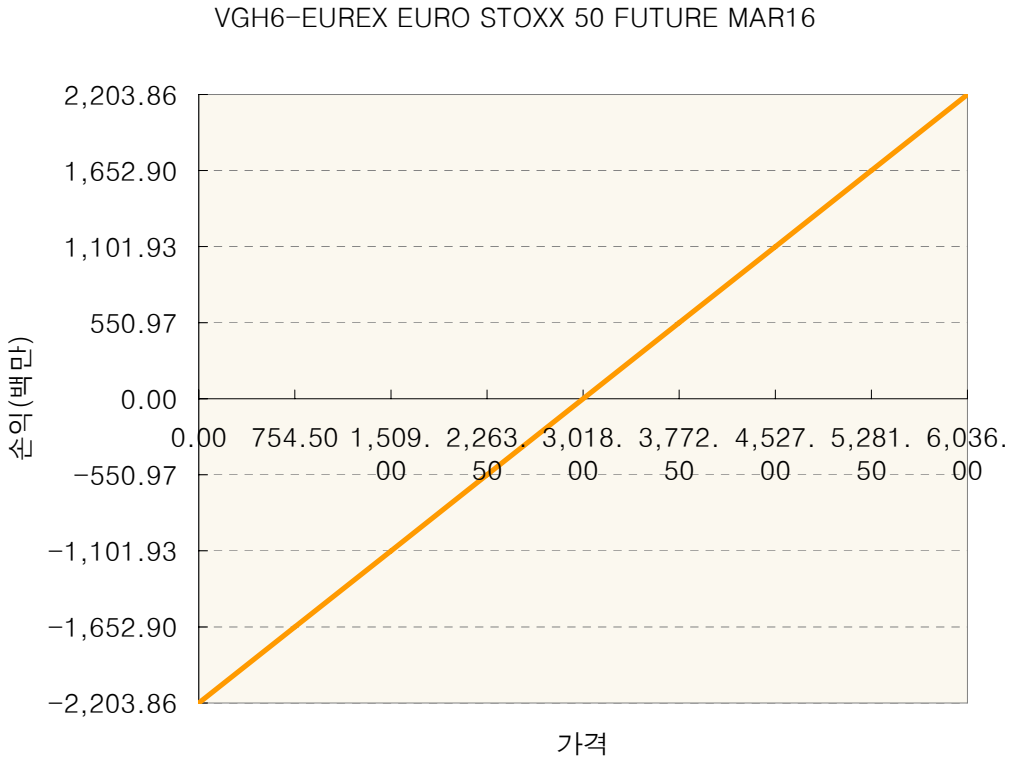
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,204	0	2,204	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EUREX EURO STOXX 50 FUTURE MAR16	176

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

(단위:백만원)

212

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

차이나인덱스모(주식-파생형)

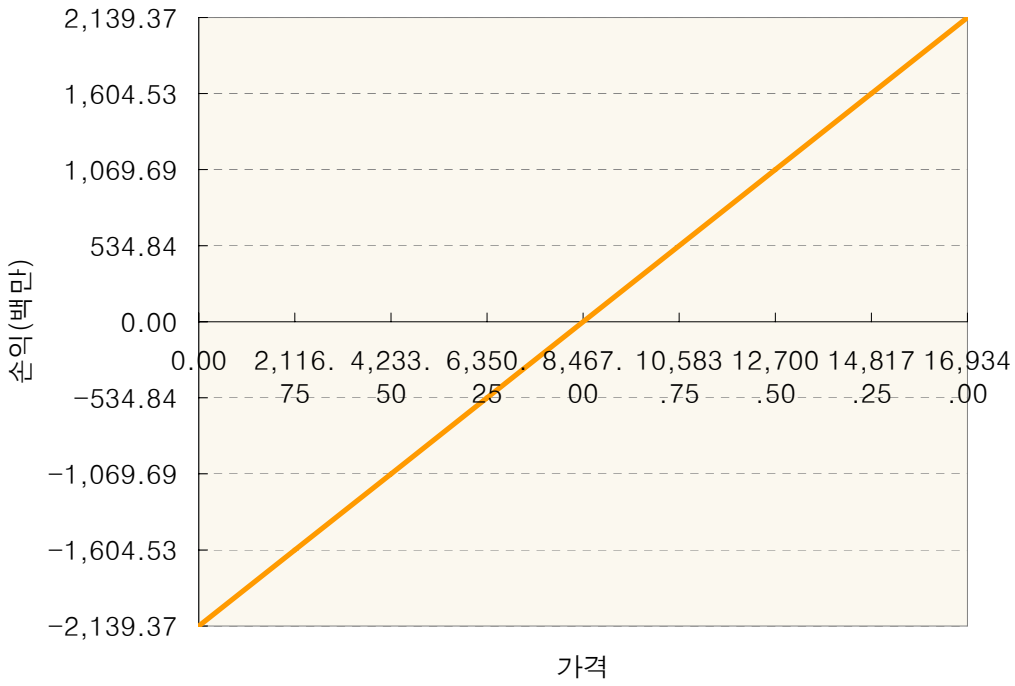
1. 계약금액

(단위:백만원)

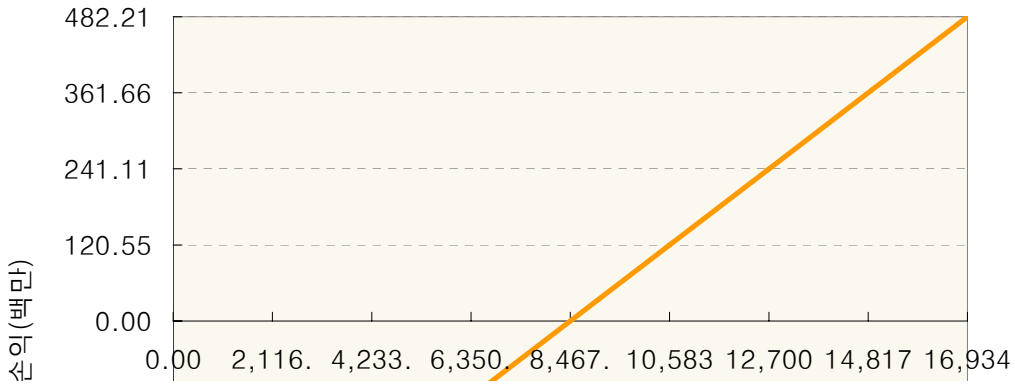
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,139	0	2,139	
누계	유가증권	선물	482	0	482	장내

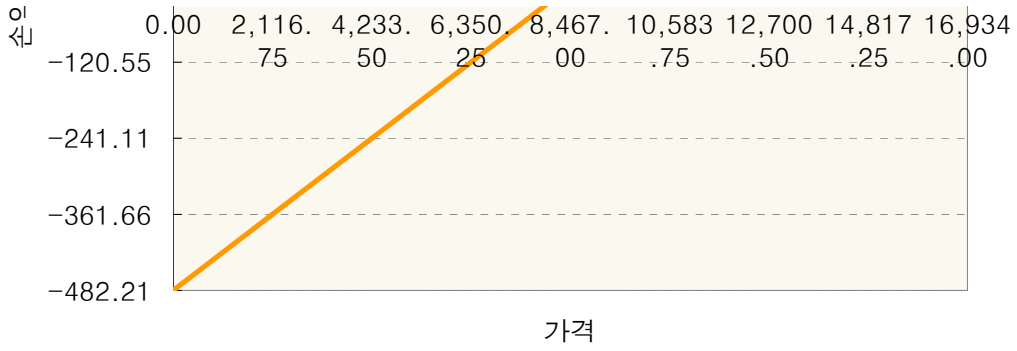
2. 만기시점의 손익구조

HCH6-HKG Hang Seng China Enterprises Index FU



MHCH6-HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT M





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH6	HKG Hang Seng China Enterprises Index FU	171
MHCH6	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT M	39

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

(단위:백만원)

247

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

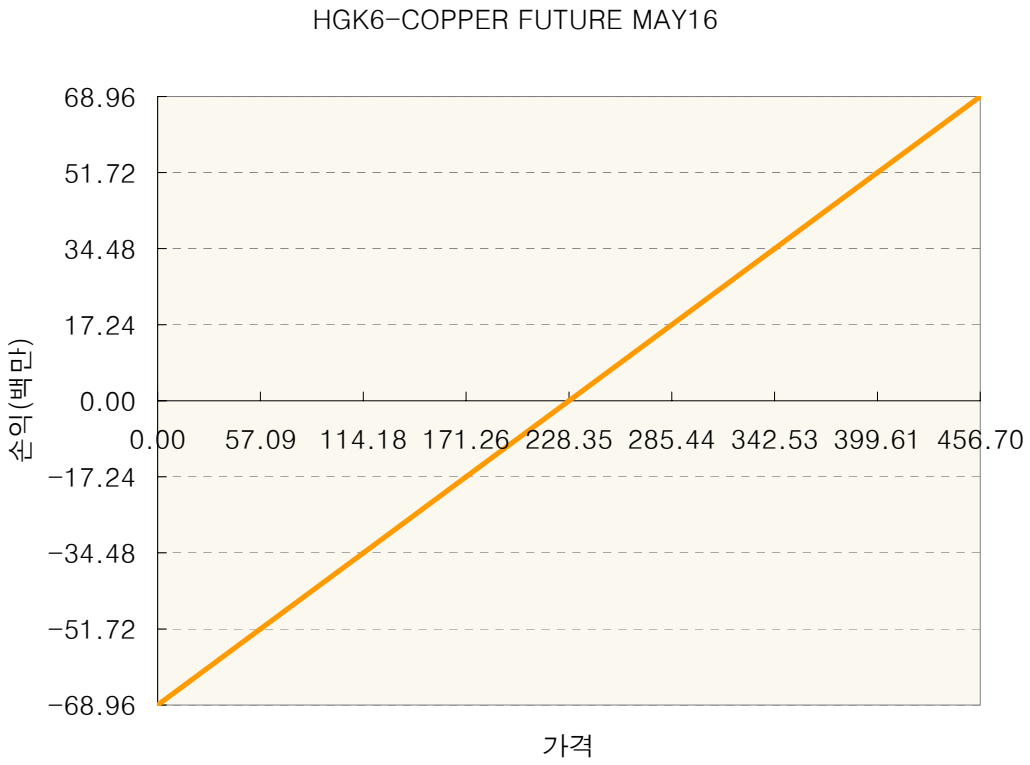
메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

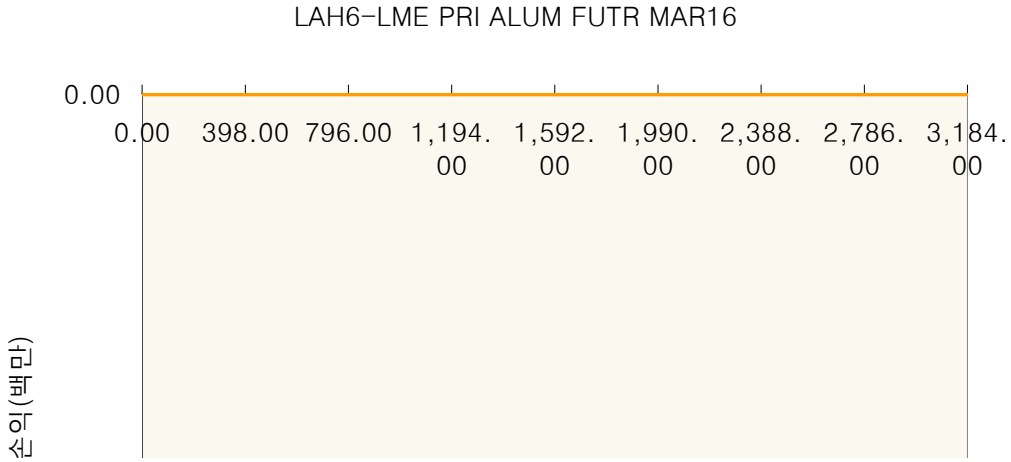
1. 계약금액

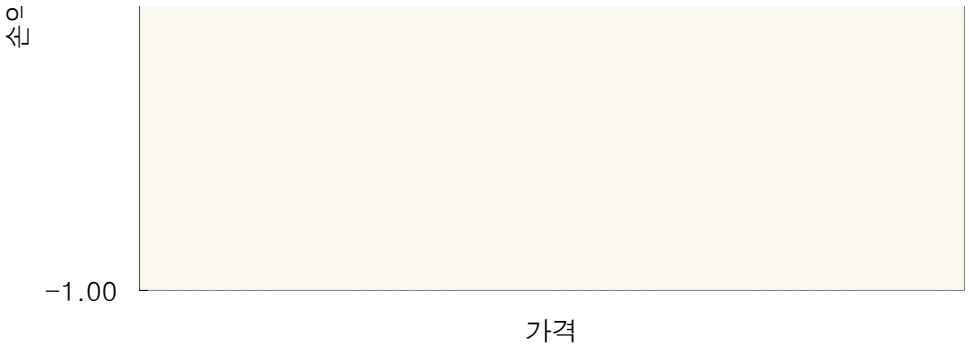
(단위:백만원)

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	420	90	330	

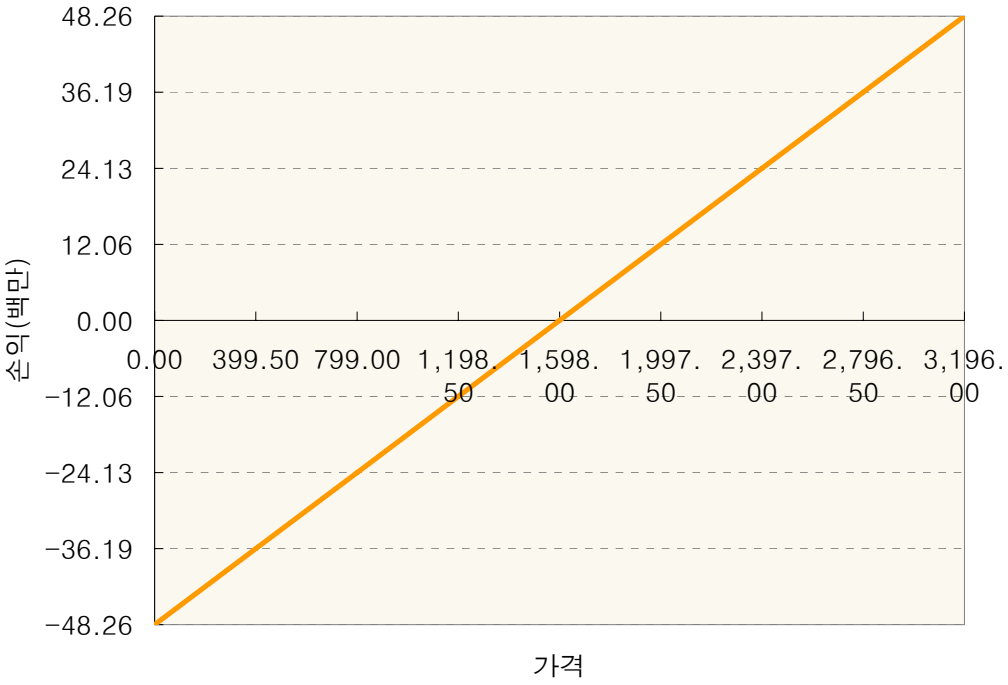
2. 만기시점의 손익구조



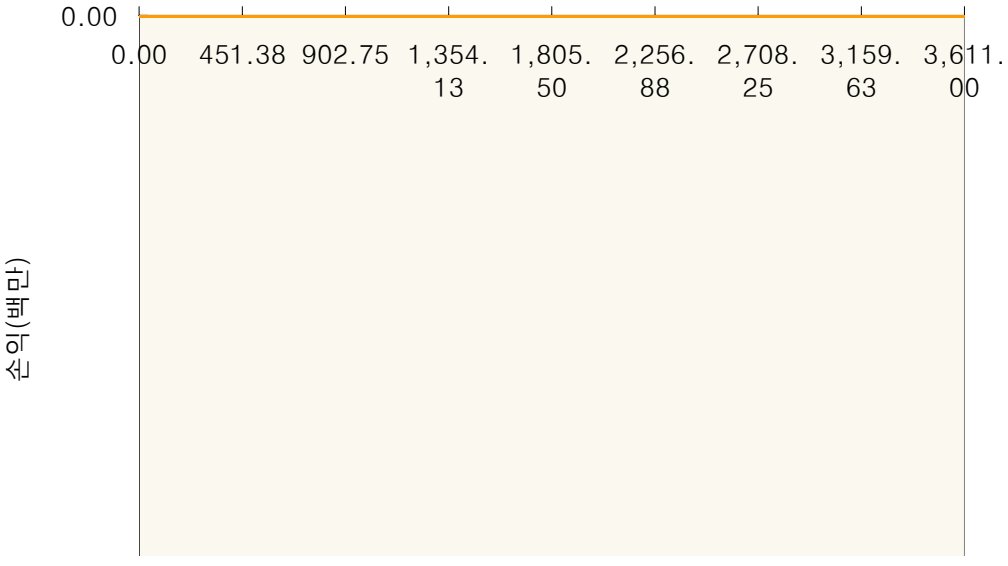


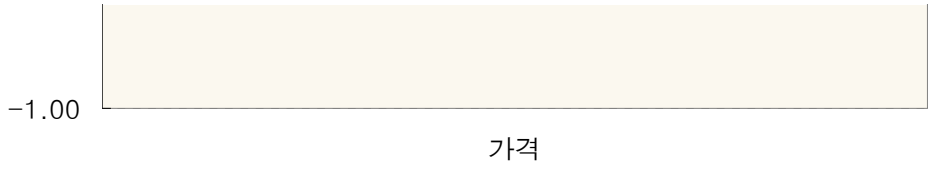


LAK6-LME PRI ALUM FUTR MAY16



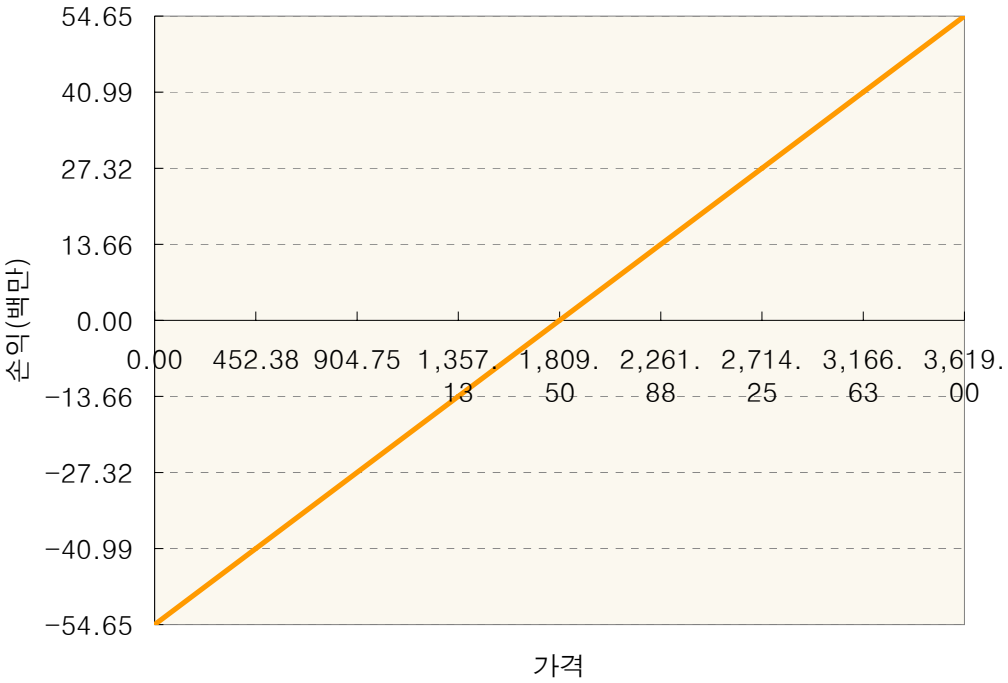
LXH6-LME ZINC FUTURE MAR16





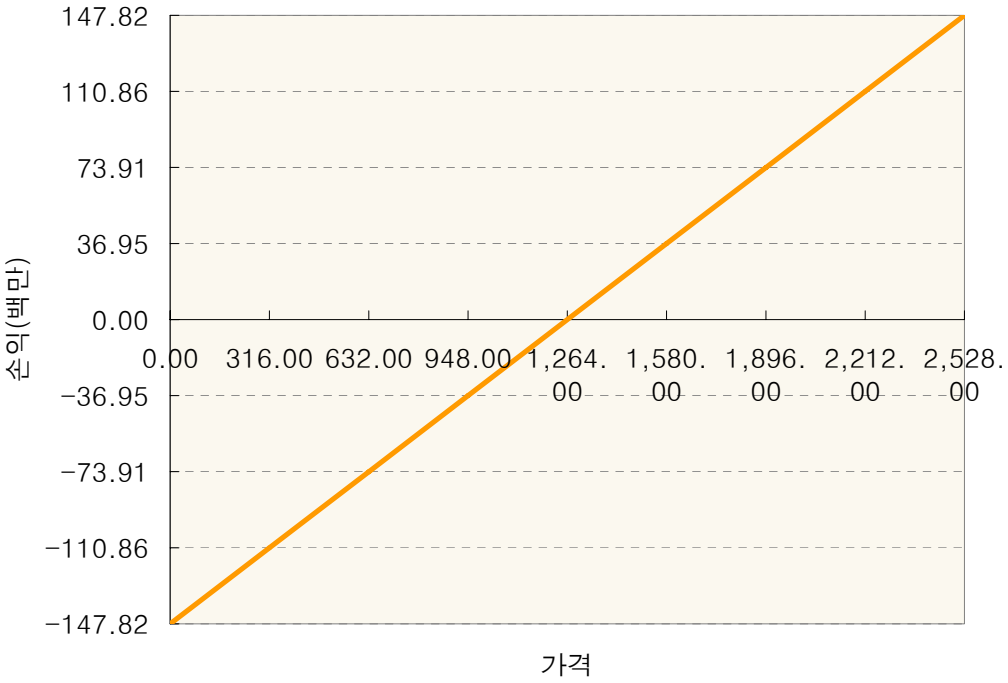
가격

LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16

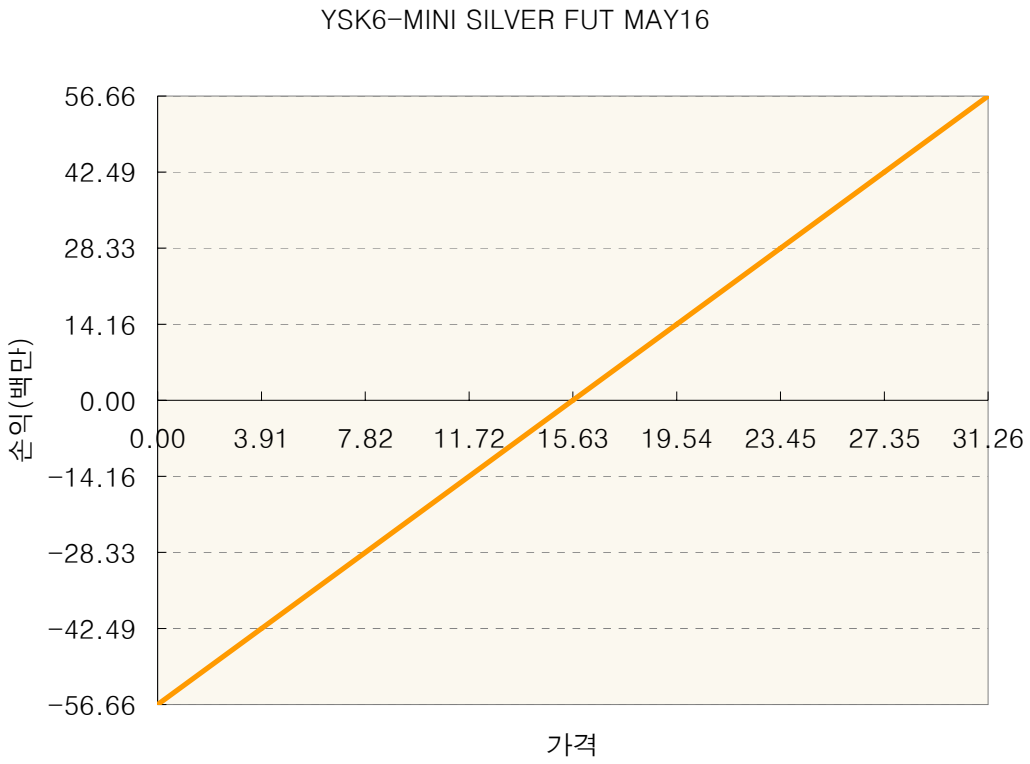


가격

XGJ6-MINI GOLD FUTURE APR16



가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGK6	COPPER FUTURE MAY16	6
LAH6	LME PRI ALUM FUTR MAR16	0.4
LAK6	LME PRI ALUM FUTR MAY16	4
LXH6	LME ZINC FUTURE MAR16	0.4
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)

32

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

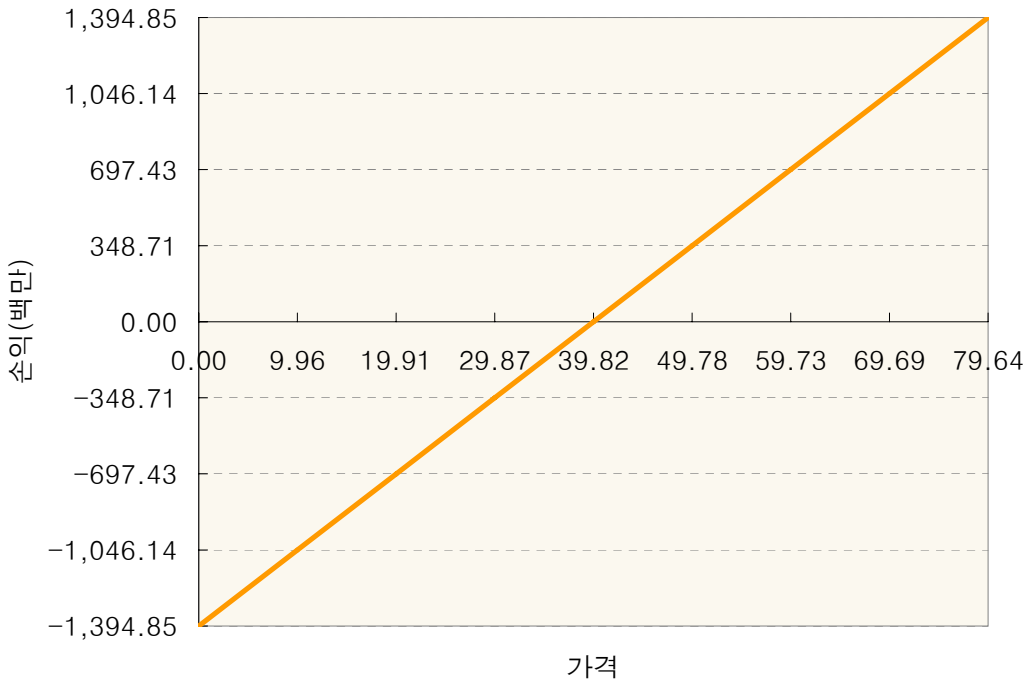
1. 계약금액

(단위:백만원)

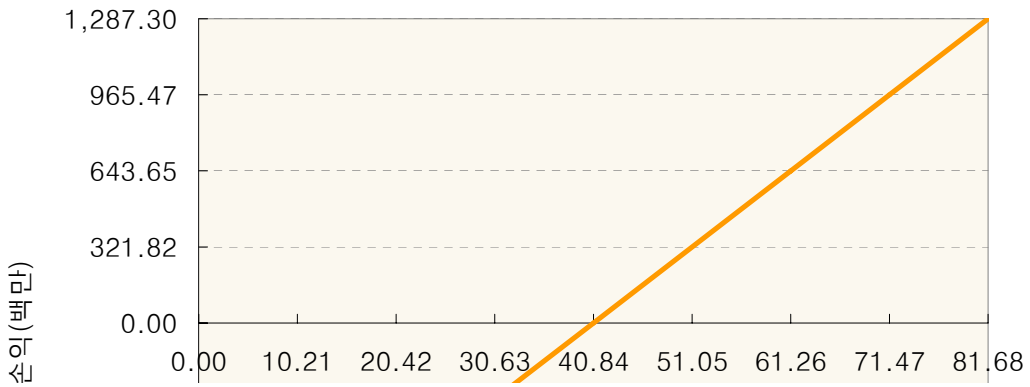
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,395	0	1,395	
누계	유가증권	선물	3,891	0	3,891	

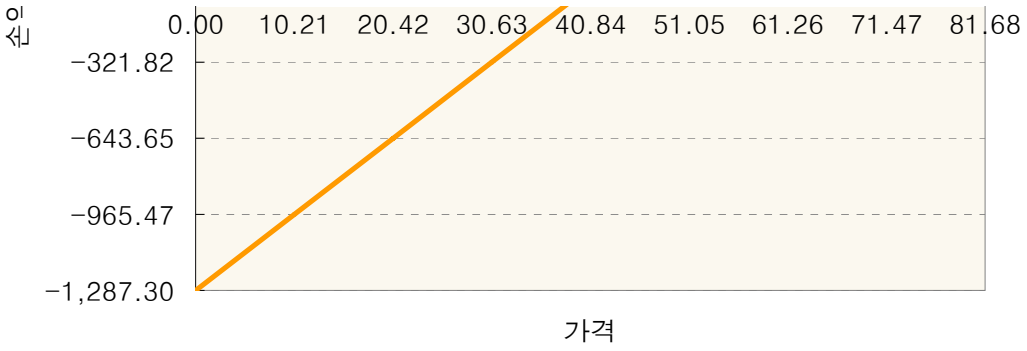
2. 만기시점의 손익구조

CLK6-WTI CRUDE FUTURE MAY16

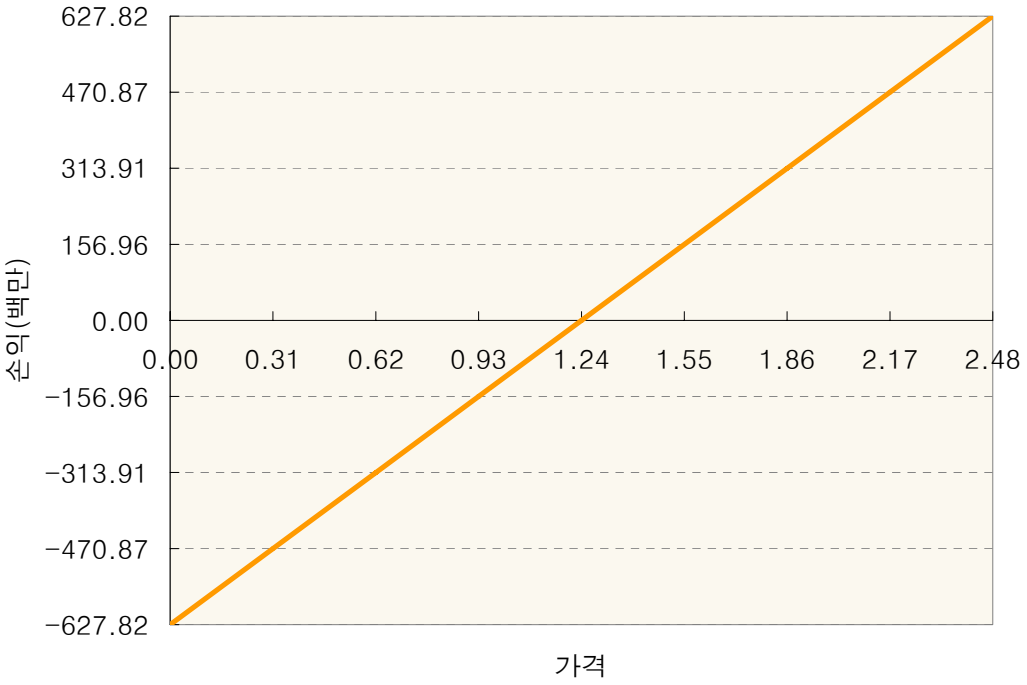


COK6-BRENT CRUDE FUTR MAY16

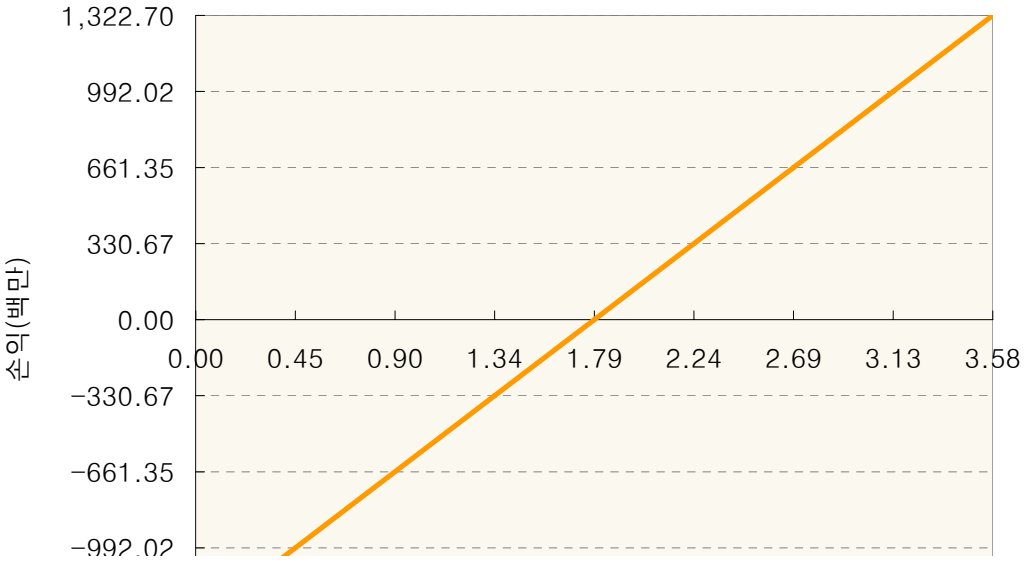


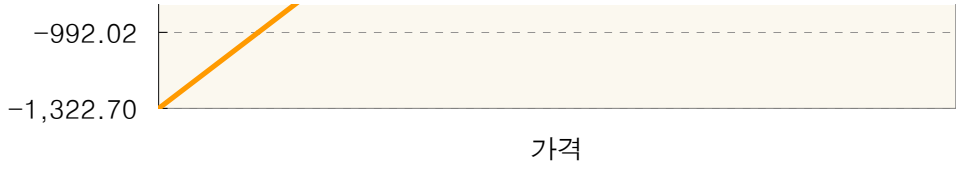


HOK6-NY Harb ULSD Fut MAY16

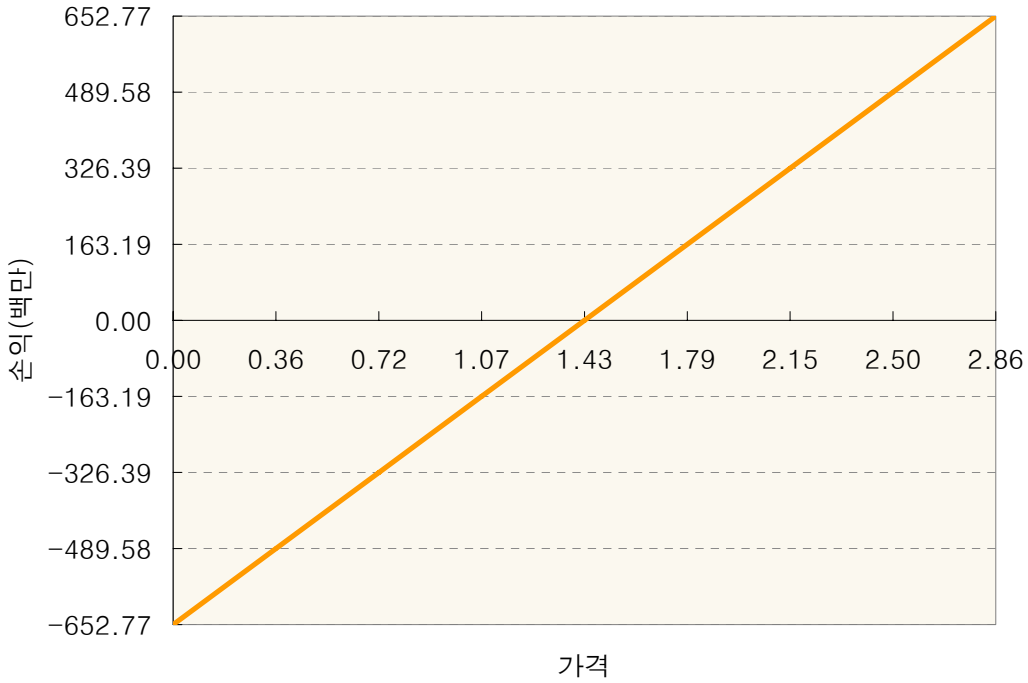


NGK6-NATURAL GAS FUTR MAY16





XBK6-GASOLINE RBOB FUT MAY16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK6	WTI CRUDE FUTURE MAY16	112
COK6	BRENT CRUDE FUTR MAY16	103
HOK6	NY Harb ULSD Fut MAY16	50
NGK6	NATURAL GAS FUTR MAY16	106
XBK6	GASOLINE RBOB FUT MAY16	52

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

(단위:백만원)

1,152

공시일	2016-03-09
기준일	2016-03-08

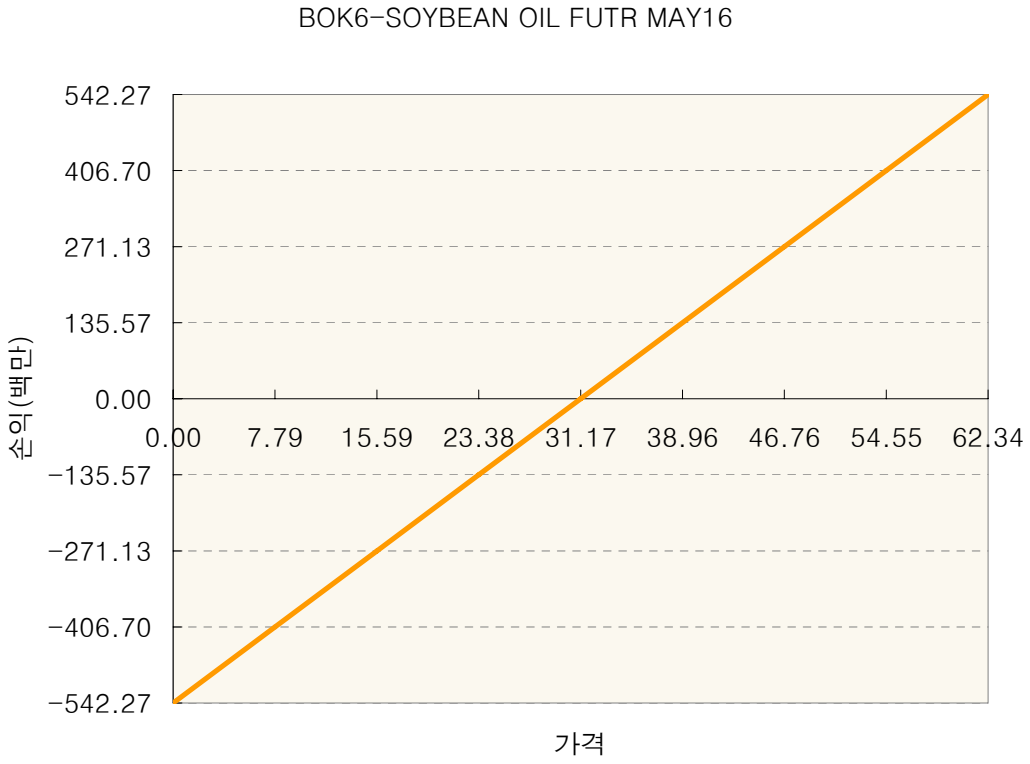
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

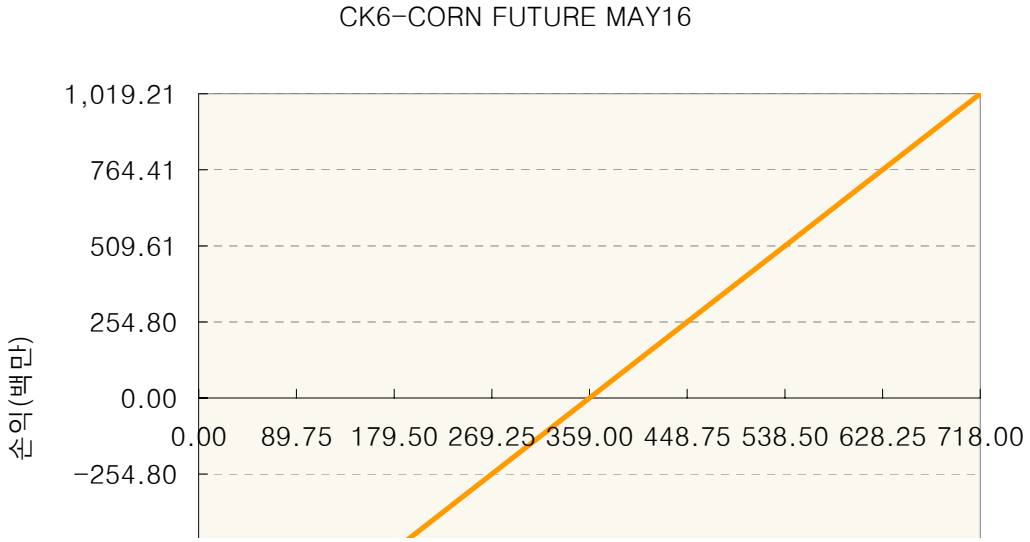
1. 계약금액

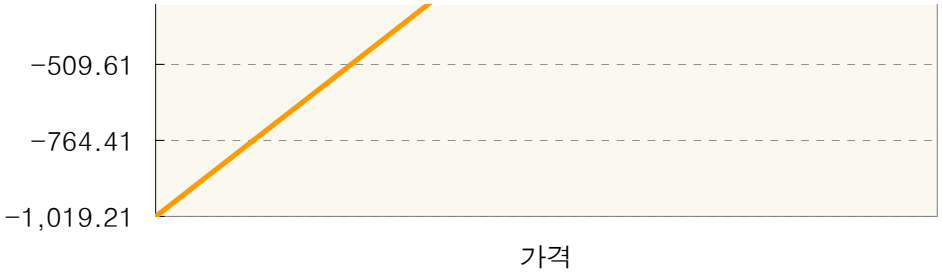
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,052	0	6,052	

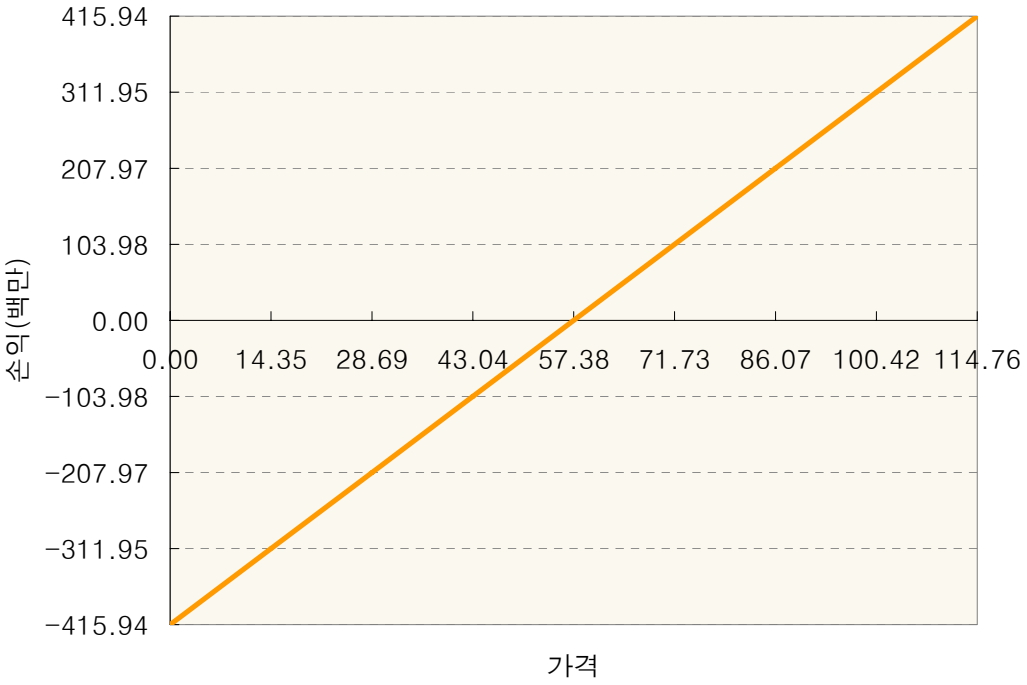
2. 만기시점의 손익구조



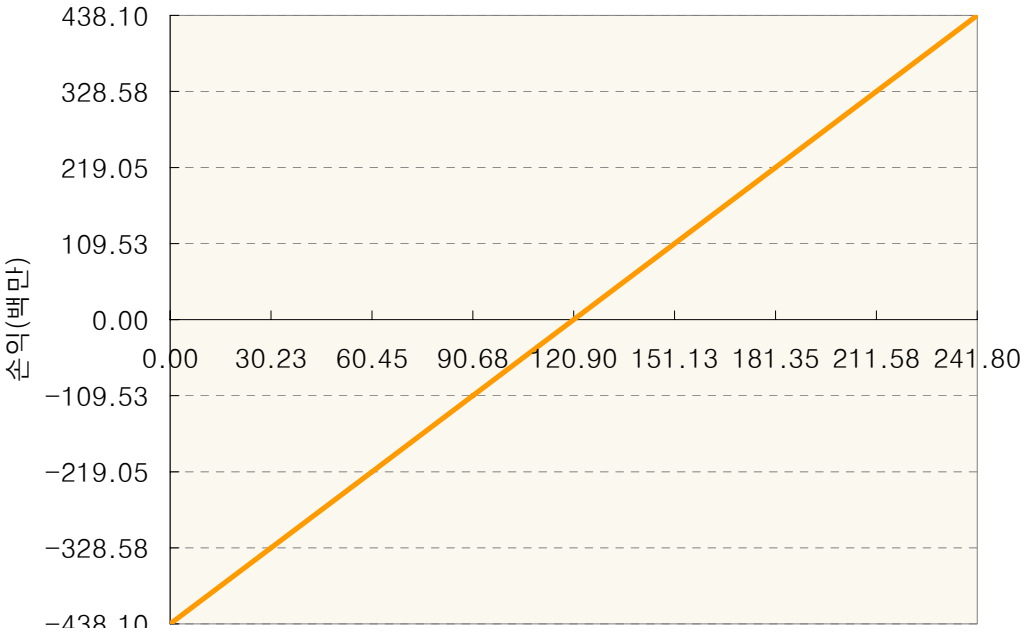


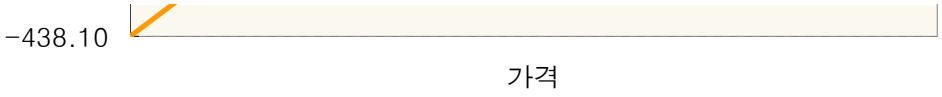


CTK6-COTTON NO.2 FUTR MAY16

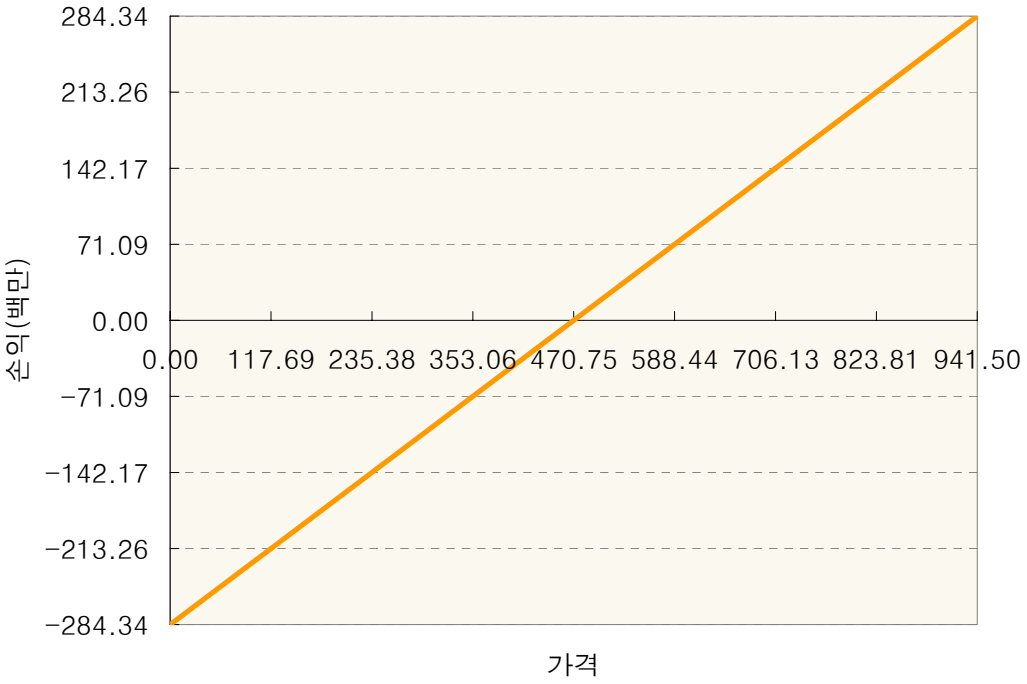


KCK6-COFFEE "C" FUTURE MAY16

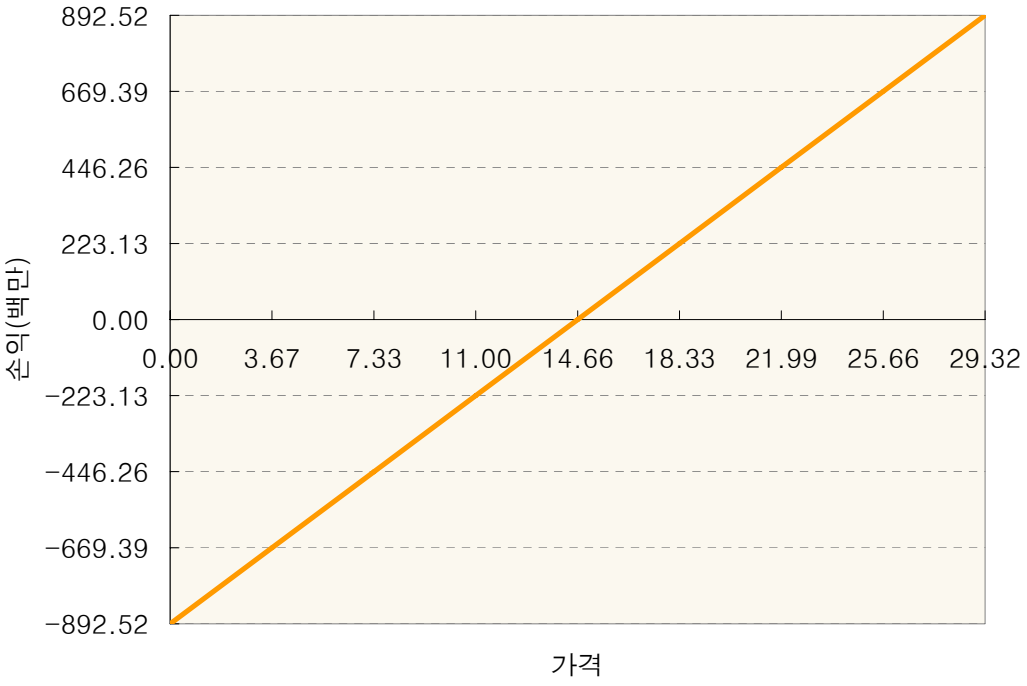




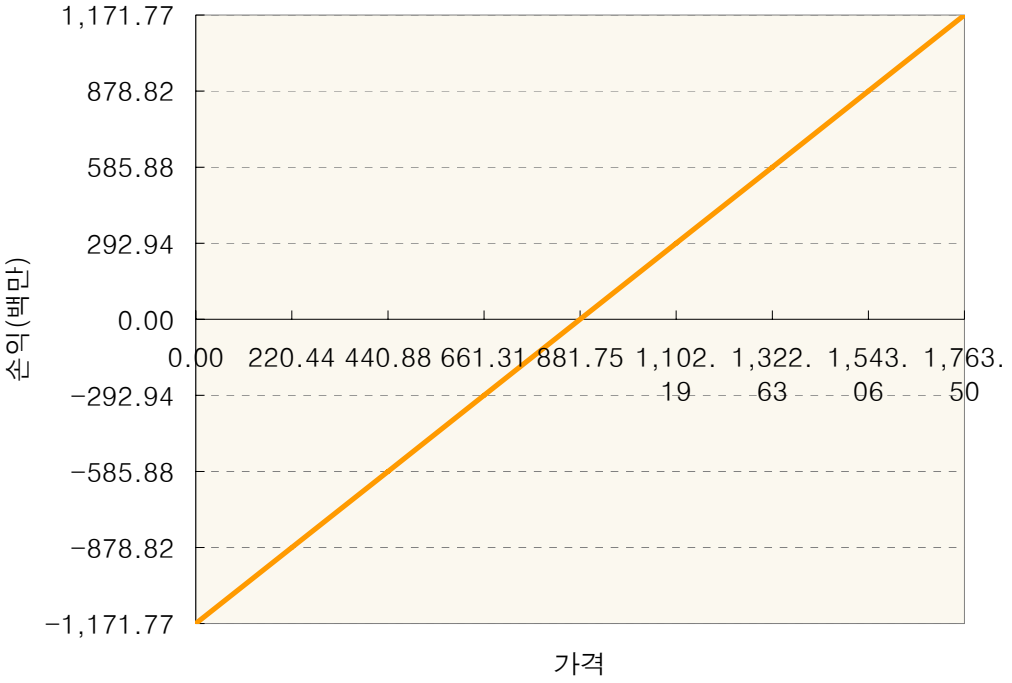
KWK6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16



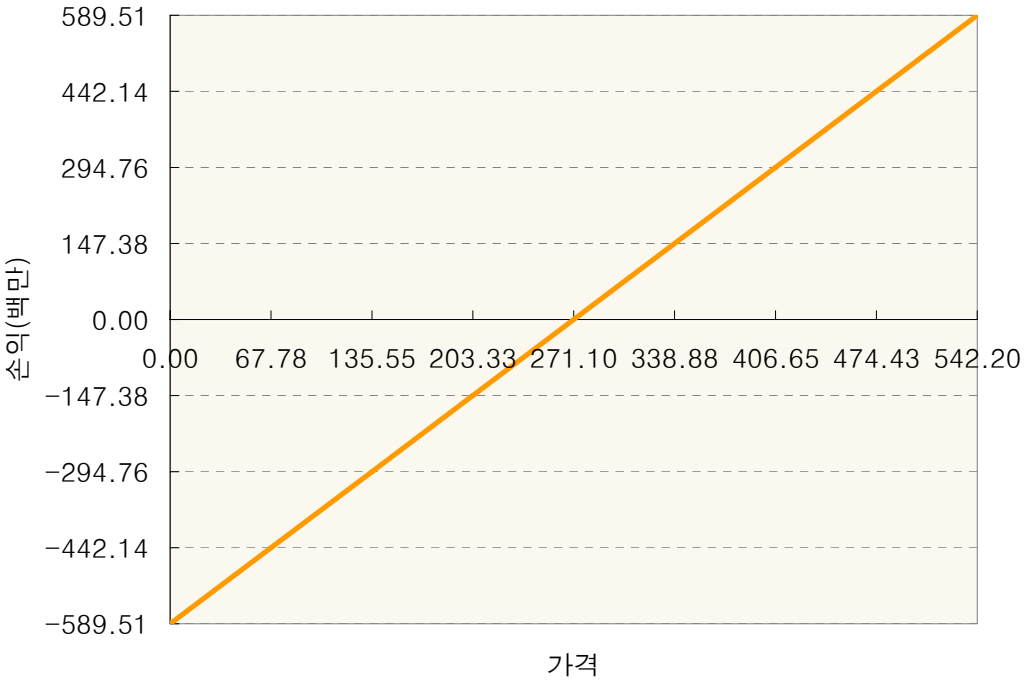
SBK6-Sugar #11 (WORLD) MAY16



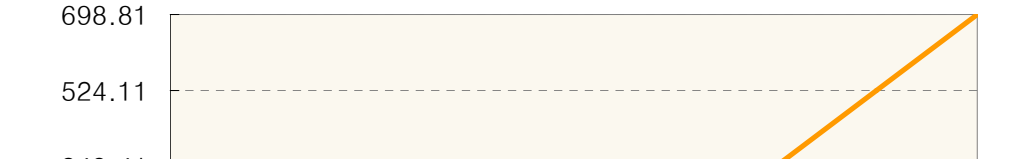
SK6-SOYBEAN FUTURE MAY16

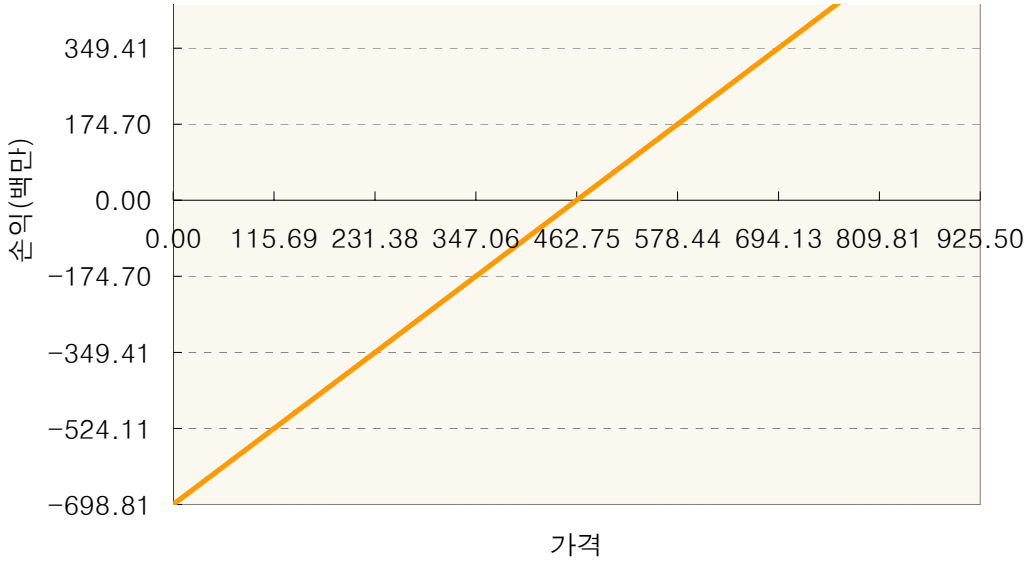


SMK6-SOYBEAN MEAL FUTR MAY16



WK6-WHEAT FUTURE(CBT) MAY16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK6	SOYBEAN OIL FUTR MAY16	43
CK6	CORN FUTURE MAY16	82
CTK6	COTTON NO.2 FUTR MAY16	33
KCK6	COFFEE "C" FUTURE MAY16	35
KWK6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16	23
SBK6	Sugar #11 (WORLD) MAY16	71
SK6	SOYBEAN FUTURE MAY16	94
SMK6	SOYBEAN MEAL FUTR MAY16	47
WK6	WHEAT FUTURE(CBT) MAY16	56

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

(단위:백만원)

670