공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	2016-03-21
기준일	2016-03-18

스마트인덱스모

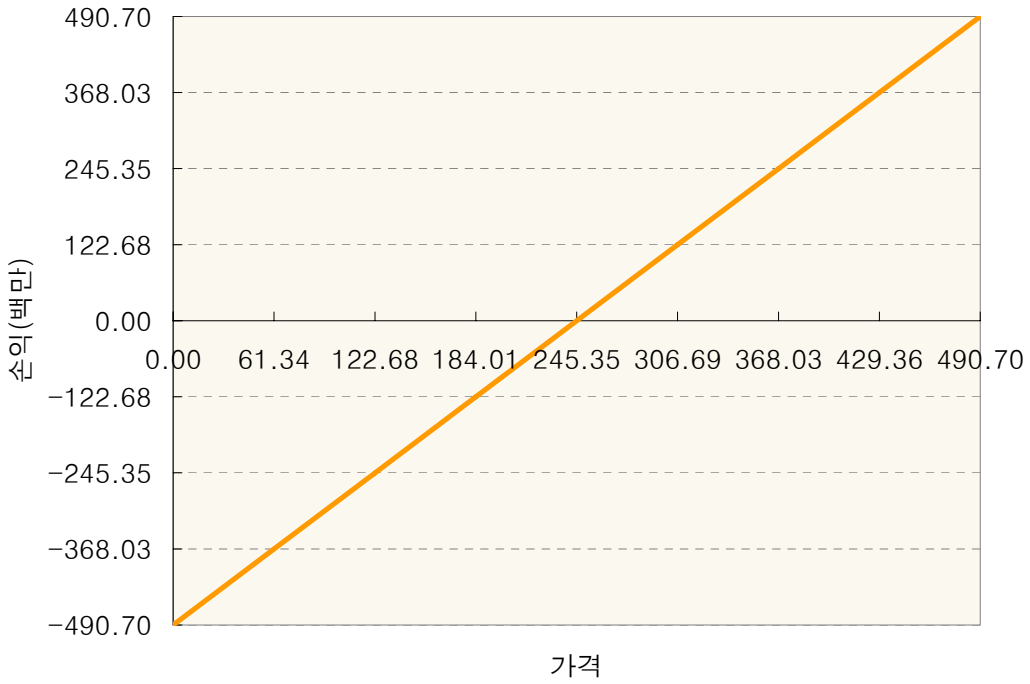
1. 계약금액

(단위:백만원)

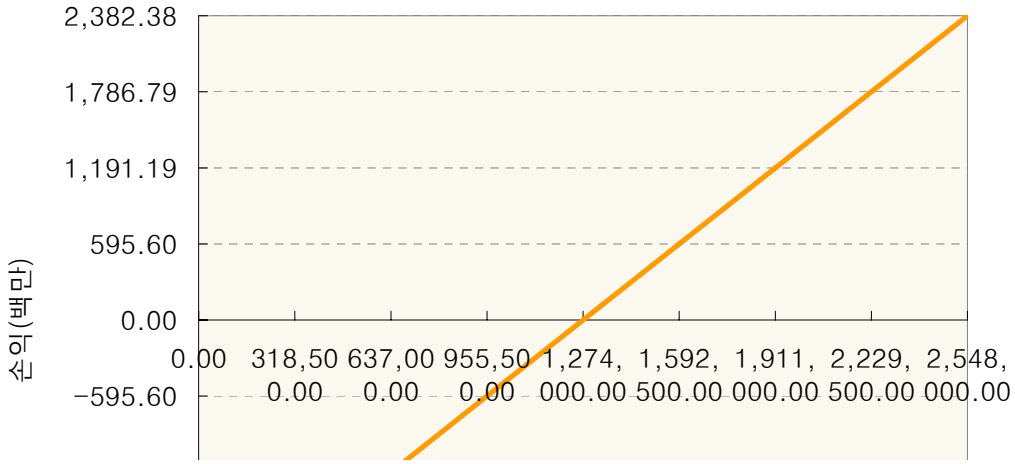
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,873	0	2,873	장내

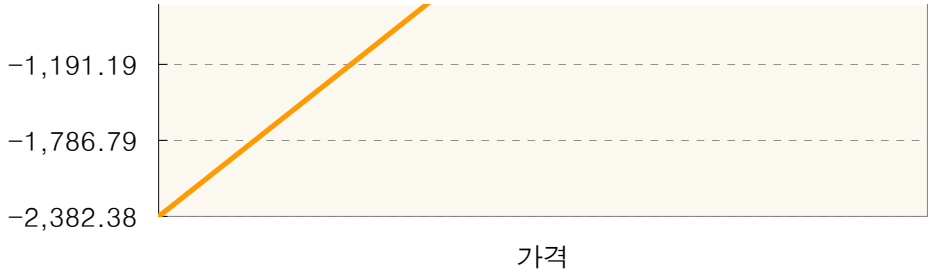
2. 만기시점의 손익구조

KR4101L60003-2016-06 지수선물



KR4111L40004-2016-04 삼성전자개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600	2016-06 지수선물						39
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	26	26	26	26	26	26	26
8.00%	39	39	39	39	39	39	39
KR4111L400	2016-04 삼성전자개별선물						190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
-5.33%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	127	127	127	127	127	127	127
8.00%	190	190	190	190	190	190	190

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

(단위:백만원)

213

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

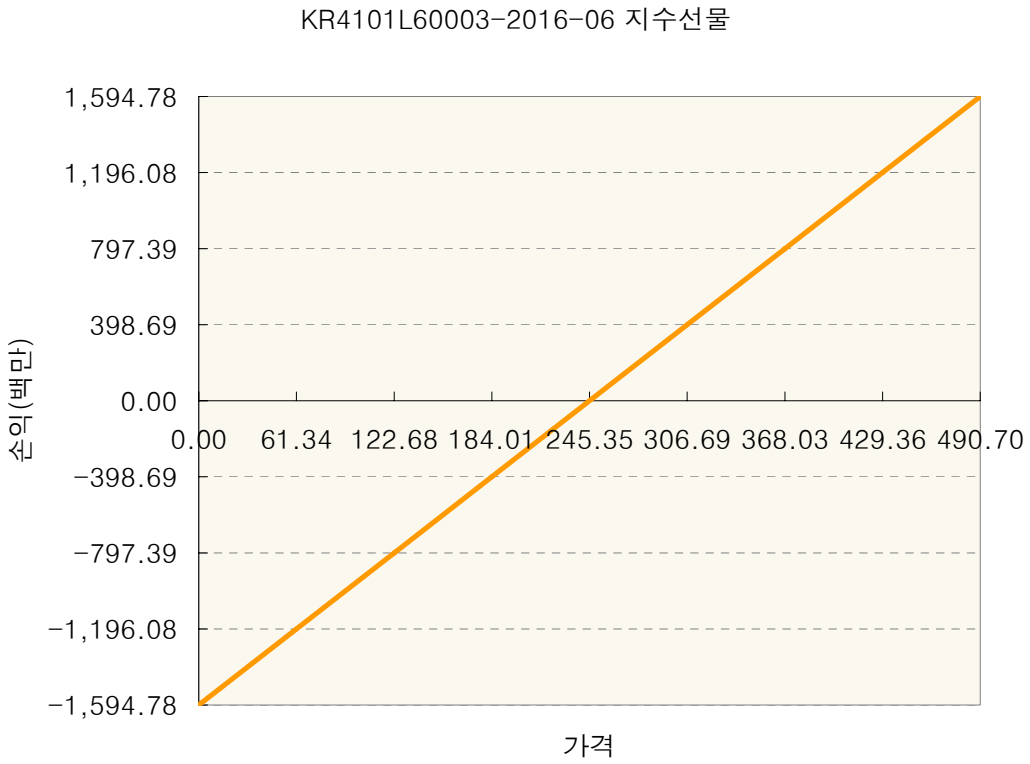
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,595	0	1,595	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 127

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	127	127	127	127	127	127	127

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

103

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

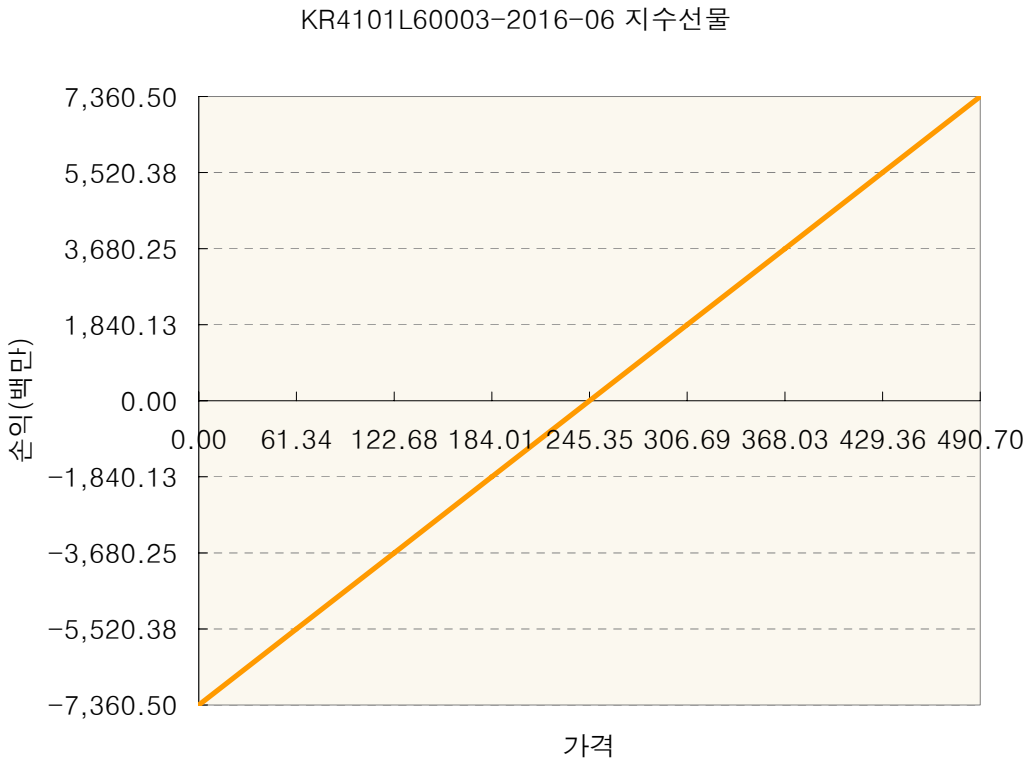
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	123	-123	장내
누계	유가증권	선물	7,361	0	7,361	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물							587
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-587	-587	-587	-587	-587	-587	-587
-5.33%	-391	-391	-391	-391	-391	-391	-391
-2.67%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	196	196	196	196	196	196	196
5.33%	391	391	391	391	391	391	391
8.00%	587	587	587	587	587	587	587

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

478

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

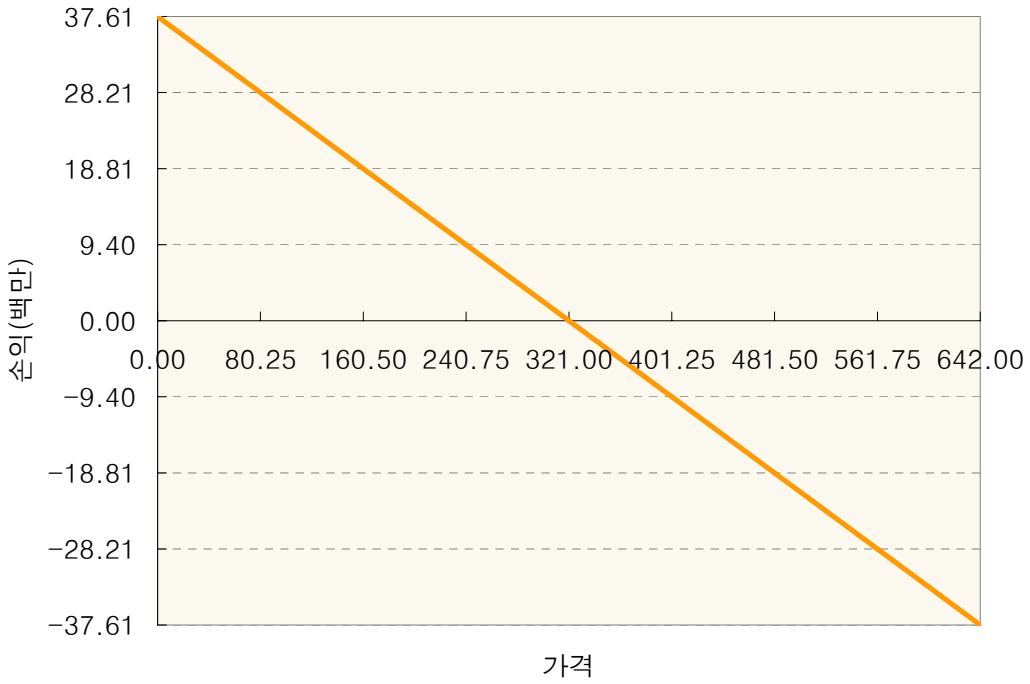
1. 계약금액

(단위:백만원)

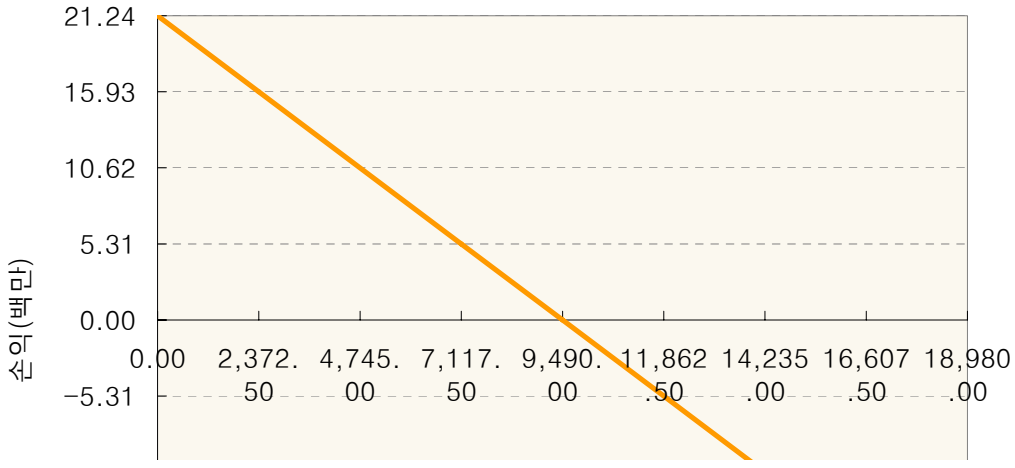
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	59	-59	

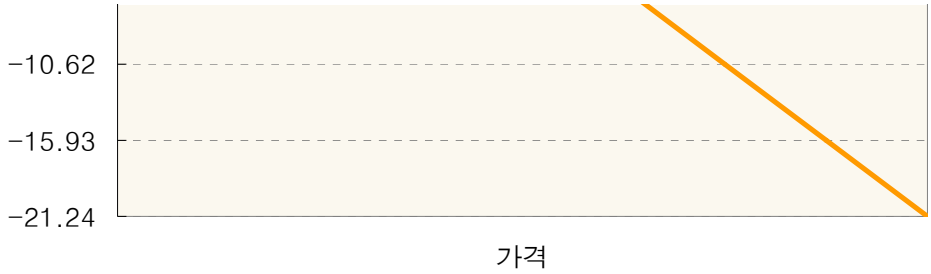
2. 만기시점의 손익구조

TWH6-MSCI TAIWAN INDEX MAR16



XUH6-SGX FTSE CHINA A50 FUTURES CONTRACT MAR1





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

TWH6	MSCI TAIWAN INDEX MAR16	3
XUH6	SGX FTSE CHINA A50 FUTURES CONTRACT MAR1	2

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

(단위:백만원)

6

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	836

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

713

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	51

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

123

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	6,120	0	6,120	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S160308	387
SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1	120

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,506

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

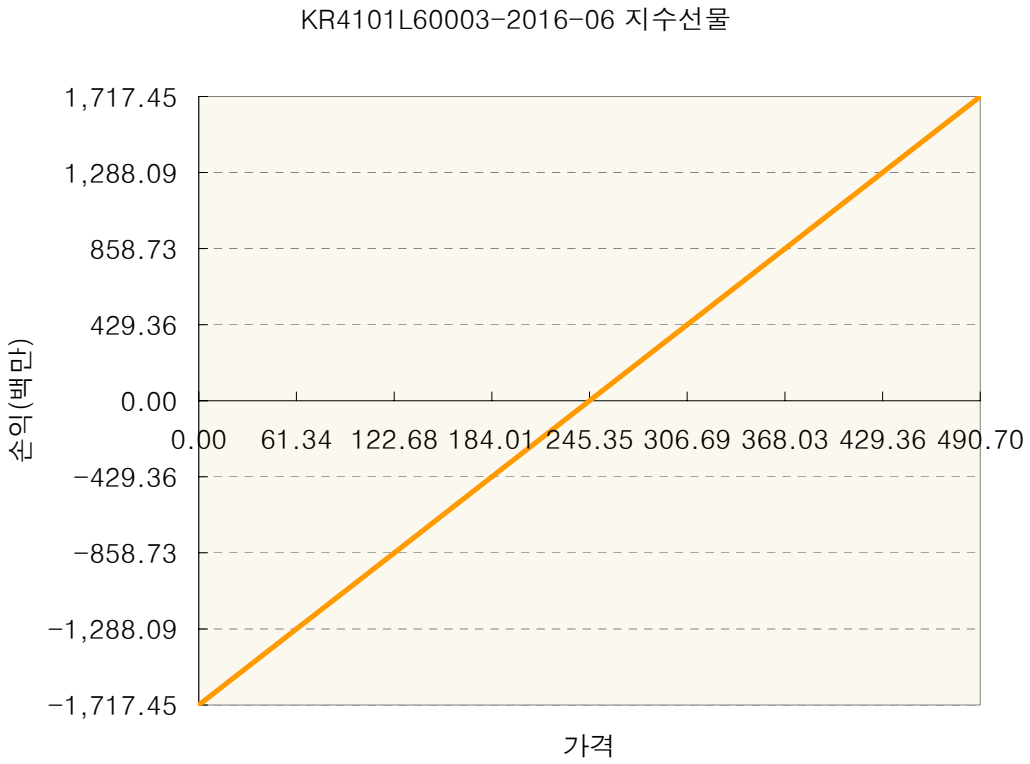
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	1,717	0	1,717	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 137

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	91	91	91	91	91	91	91
8.00%	137	137	137	137	137	137	137

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

111

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	68
KR65433325 ELS신영증권플랜업(ELS)5447	61
KR65533AF5 ELSNH투자증권(ELS)11930	61
KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269	61

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

(단위:백만원)

154

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	225
KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957	237
KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298	226
KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483	226

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

(단위:백만원)

593

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	194
KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454	195
KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956	233
KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297	194

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

(단위:백만원)

507

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	137
KR65533446 ELSNH투자증권(ELS)11973	137
KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319	149
KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513	138

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

(단위:백만원)

289

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	125
KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472	116
KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987	115
KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343	115

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

(단위:백만원)

239

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	94
KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170	81
KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036	81
KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359	81

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

(단위:백만원)

159

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

지수연계미래설계SE-11호(ELS-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	2	-2	장외
누계	유가증권	ELS	5,950	0	5,950	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133226 ELS대신증권(ELS)6386	142
KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180	132
KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056	151
KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388	137

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

(단위:백만원)

278

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	142
KR65233676 ELS대우증권(ELS) 15190	141
KR65533526 ELSNH투자증권(ELS) 12077	141
KR65733986 ELS한국투자증권(ELS) 5399	155

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

(단위:백만원)

234

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	150
KR65433166 ELS신영증권플랜업(ELS) 5495	150
KR65533956 ELSNH투자증권(ELS) 12098	157
KR65733AY6 ELS한국투자증권(ELS) 5385	149

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

(단위:백만원)

305

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

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	252
KR65233306 ELS대우증권(ELS)15315	269
KR65533226 ELSNH투자증권(ELS)12137	294
KR65733066 ELS한국투자증권(ELS)5421	251

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

(단위:백만원)

488

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

지수연계미래설계SE-15호(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	14,847	0	14,847	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133546 ELS대신증권(ELS)6436	371
KR65233776 ELS대우증권(ELS)15342	395
KR65433106 ELS신영증권플랜업(ELS)5516	371
KR65733196 ELS한국투자증권(ELS)5445	371

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

(단위:백만원)

737

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

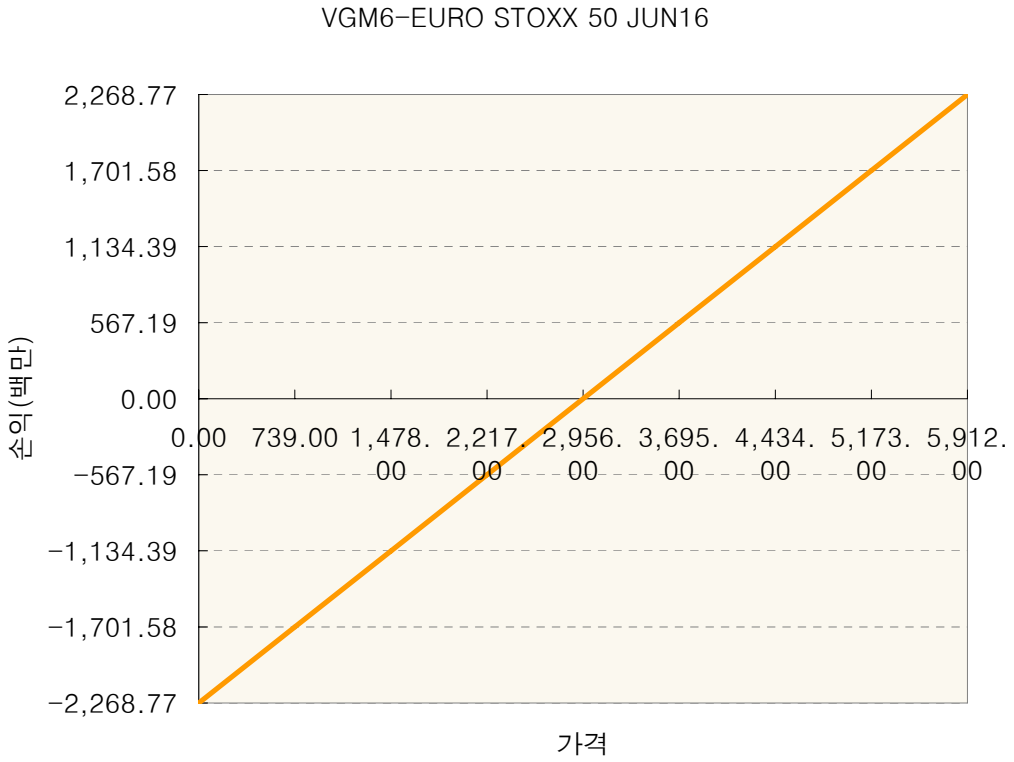
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,269	0	2,269	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 JUN16	181

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

(단위:백만원)

216

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

차이나인덱스모(주식-파생형)

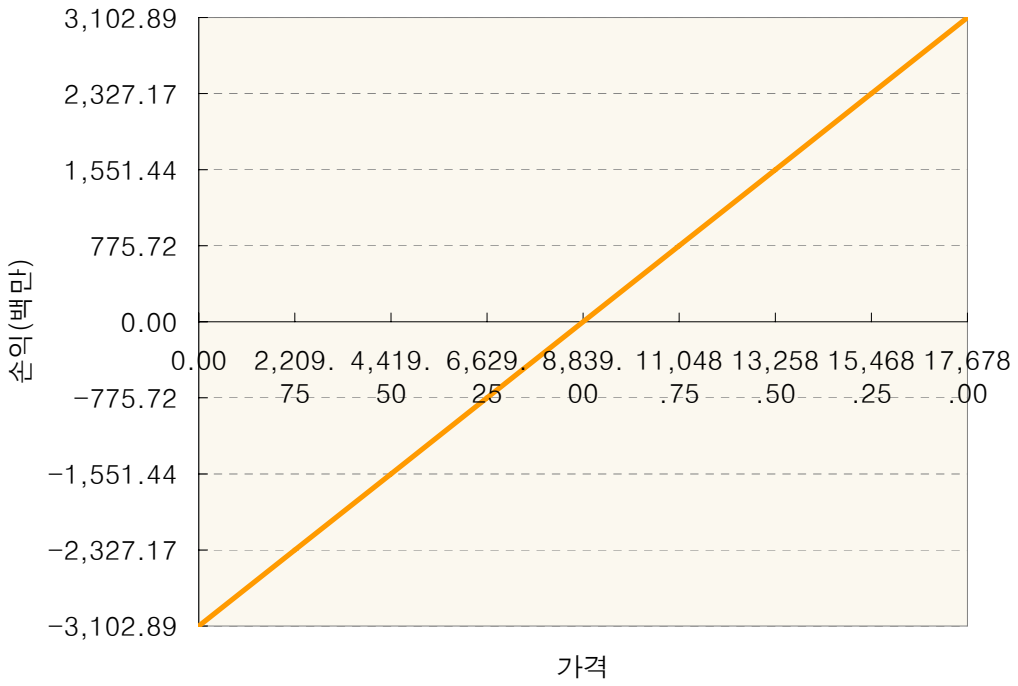
1. 계약금액

(단위:백만원)

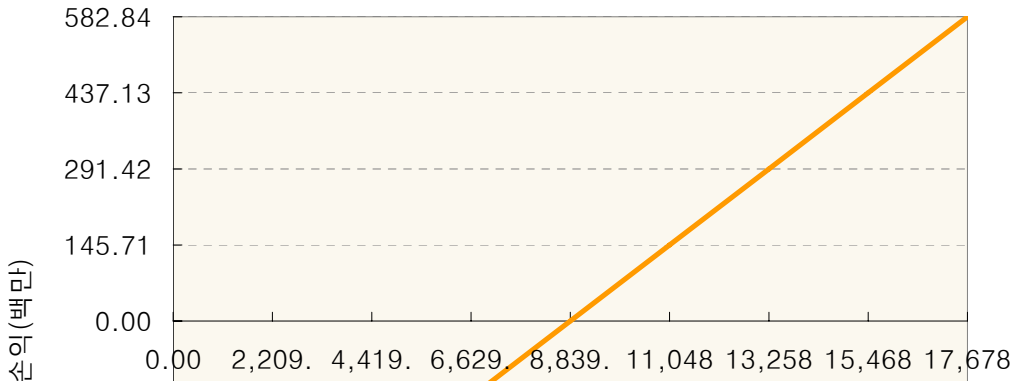
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,103	0	3,103	
누계	유가증권	선물	583	0	583	장내

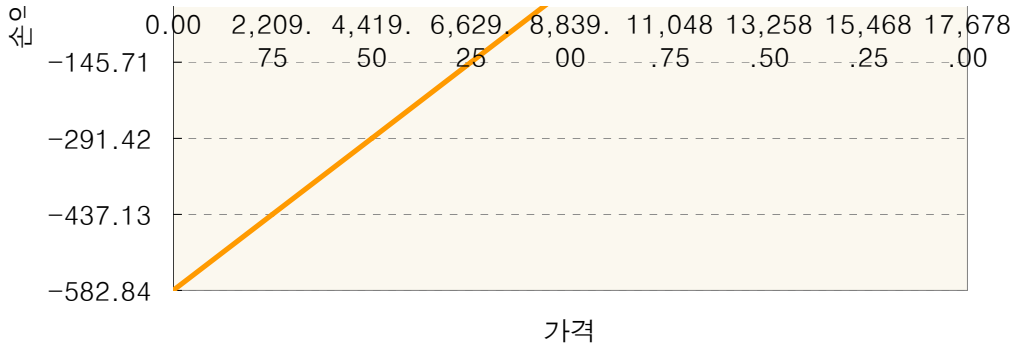
2. 만기시점의 손익구조

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	248
MHCH6	HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT M	47

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

(단위:백만원)

344

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

지수연계미래설계SE-16호(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	20,615	0	20,615	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65233AB6 ELS대우증권(ELS)15355	498
KR65433236 ELS신영증권플랜업(ELS)5530	584
KR65533A86 ELSNH투자증권(ELS)12195	605
KR65733A46 ELS한국투자증권(ELS)5456	498

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

(단위:백만원)

1,239

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

KOSPI200지수연계1호(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	2,706	0	2,706	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65433266 ELS신영증권플랜업(ELS)5509	42
KR65733926 ELS한국투자증권(ELS)5432	47
KR67233096 ELS아이비케이증권(ELS)1795	43
KR67733226 ELSKB STAR(ELS)1103	43

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

(단위:백만원)

97

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

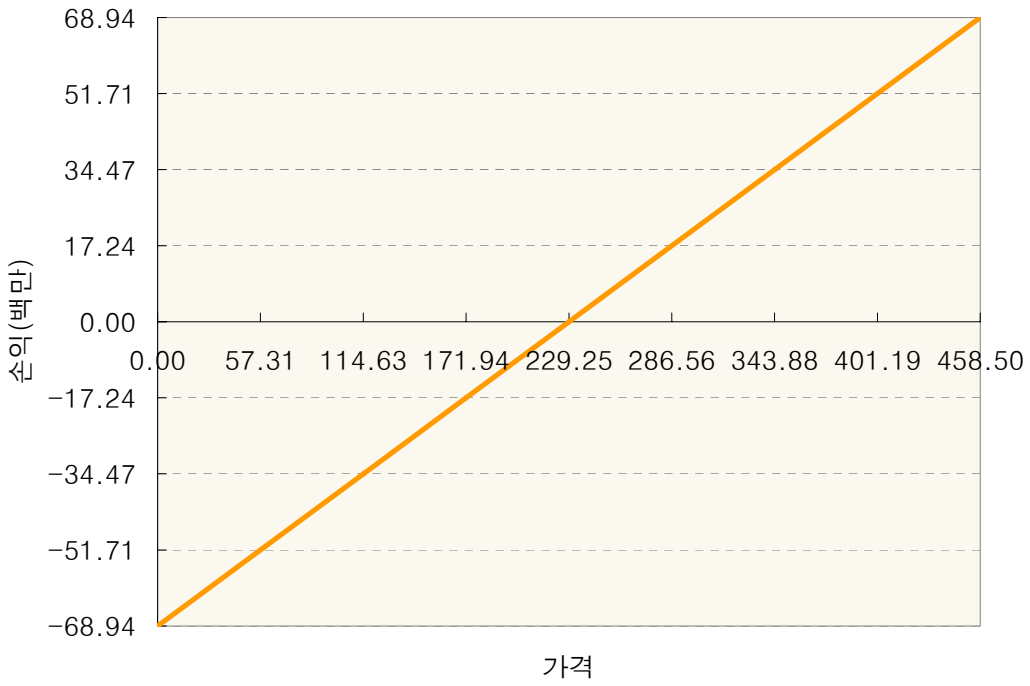
1. 계약금액

(단위:백만원)

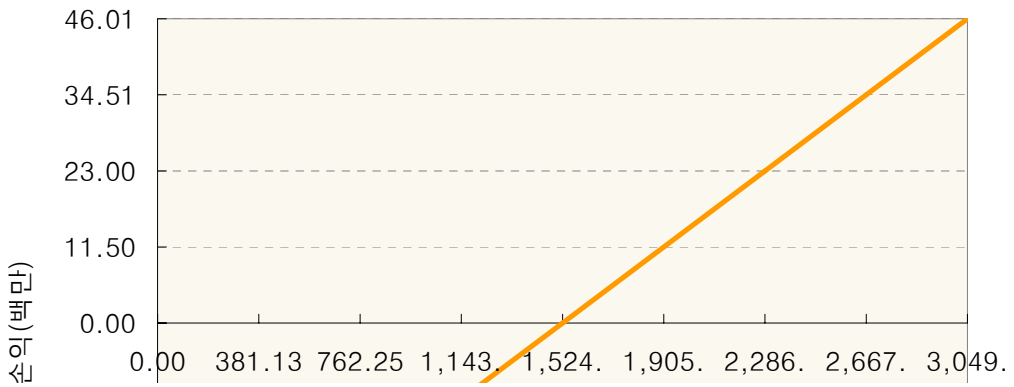
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	58	0	58	
누계	유가증권	선물	315	0	315	

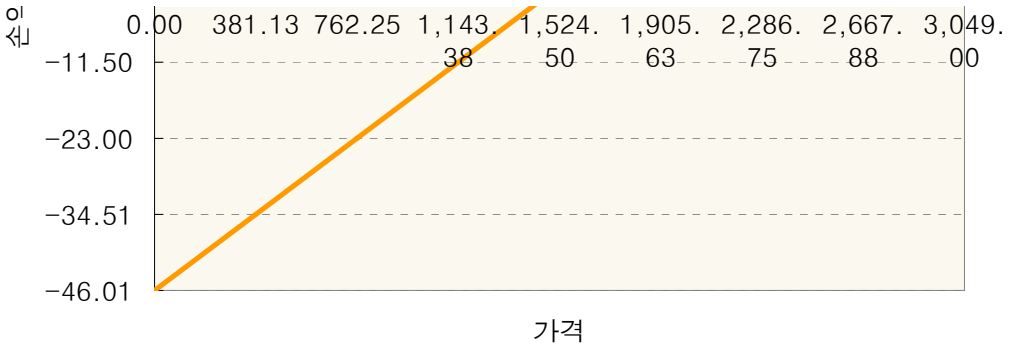
2. 만기시점의 손익구조

HGK6-COPPER FUTURE MAY16

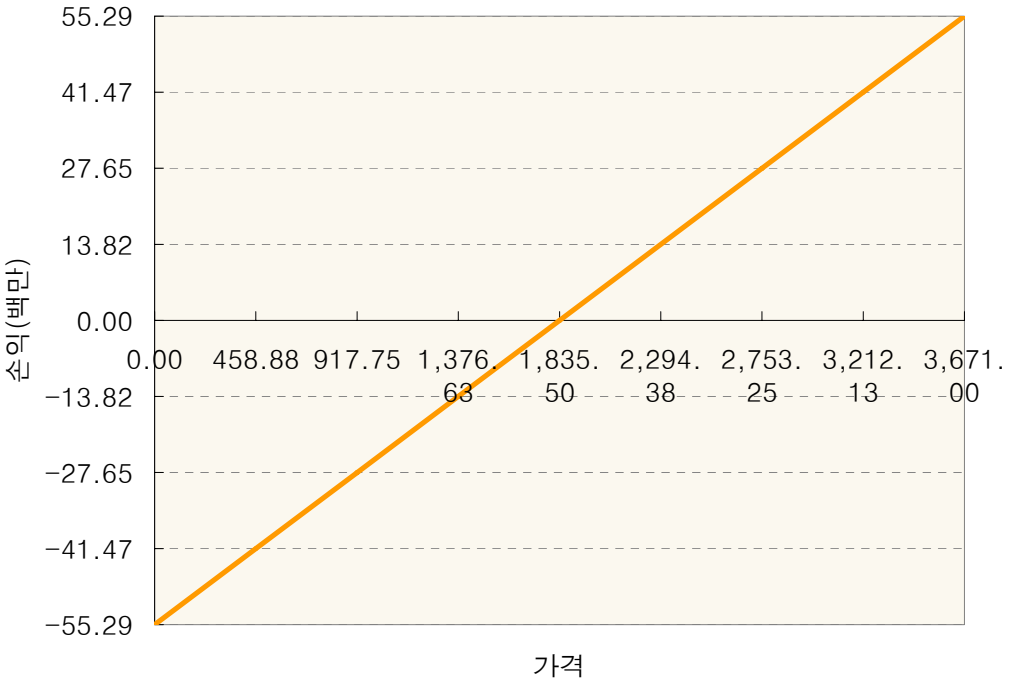


LAK6-LME PRI ALUM FUTR MAY16

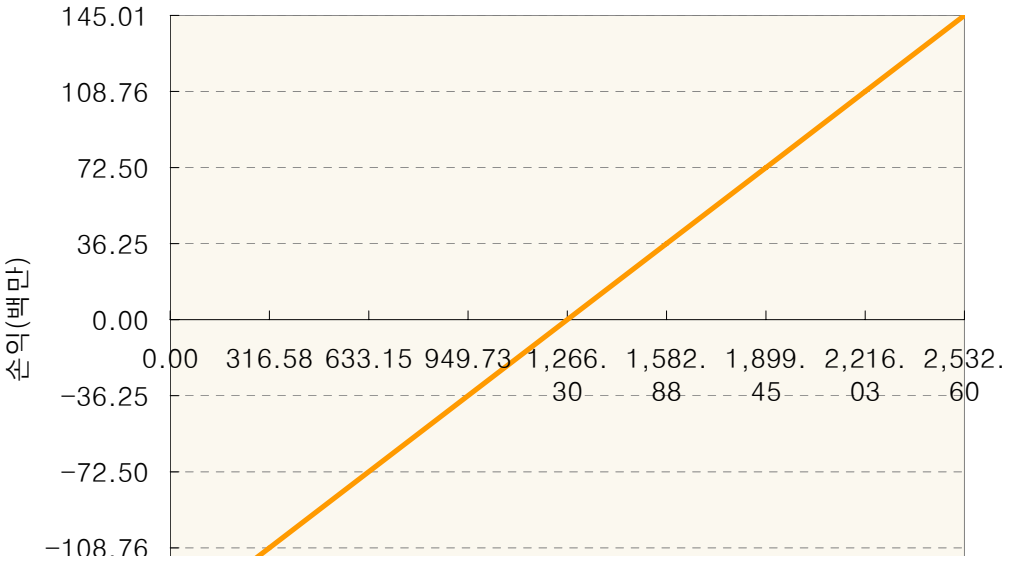


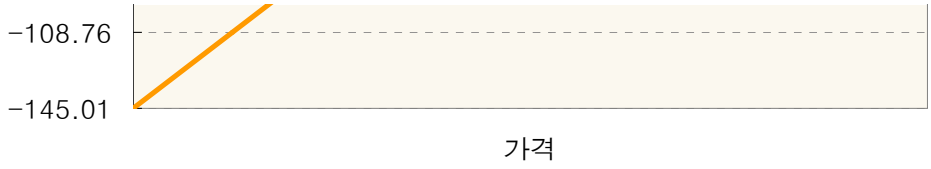


LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16

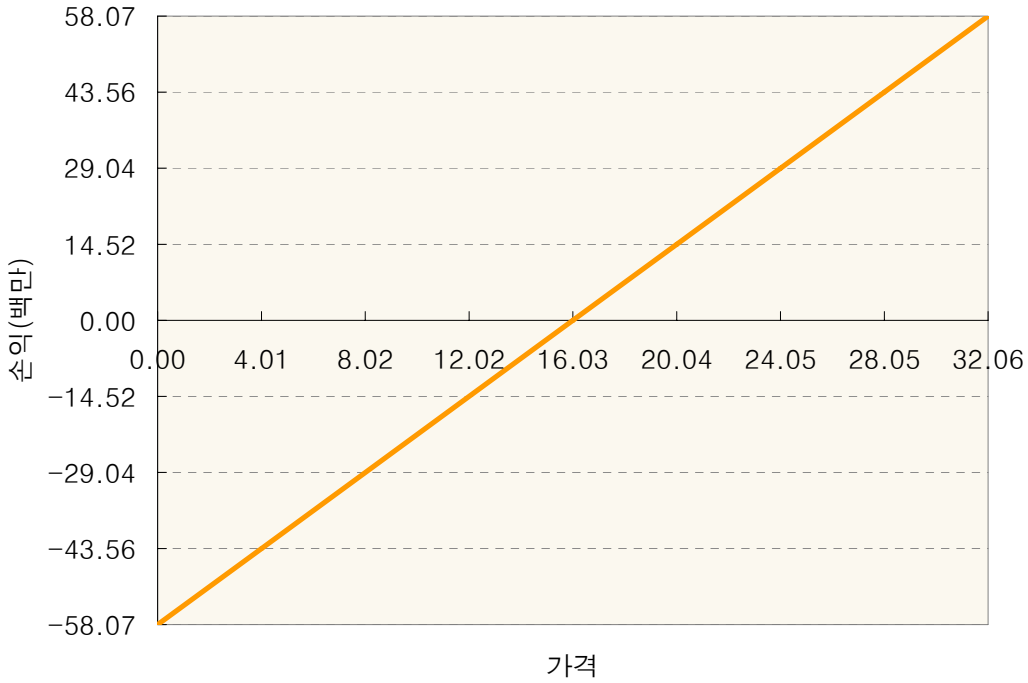


XGM6-MINI GOLD FUTURE JUN16





YSK6-MINI SILVER FUT MAY16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGK6	COPPER FUTURE MAY16	6
LAK6	LME PRI ALUM FUTR MAY16	4
LXK6	LME ZINC FUTURE MAY16	4
XGM6	MINI GOLD FUTURE JUN16	12
YSK6	MINI SILVER FUT MAY16	5

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

(단위:백만원)

31

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

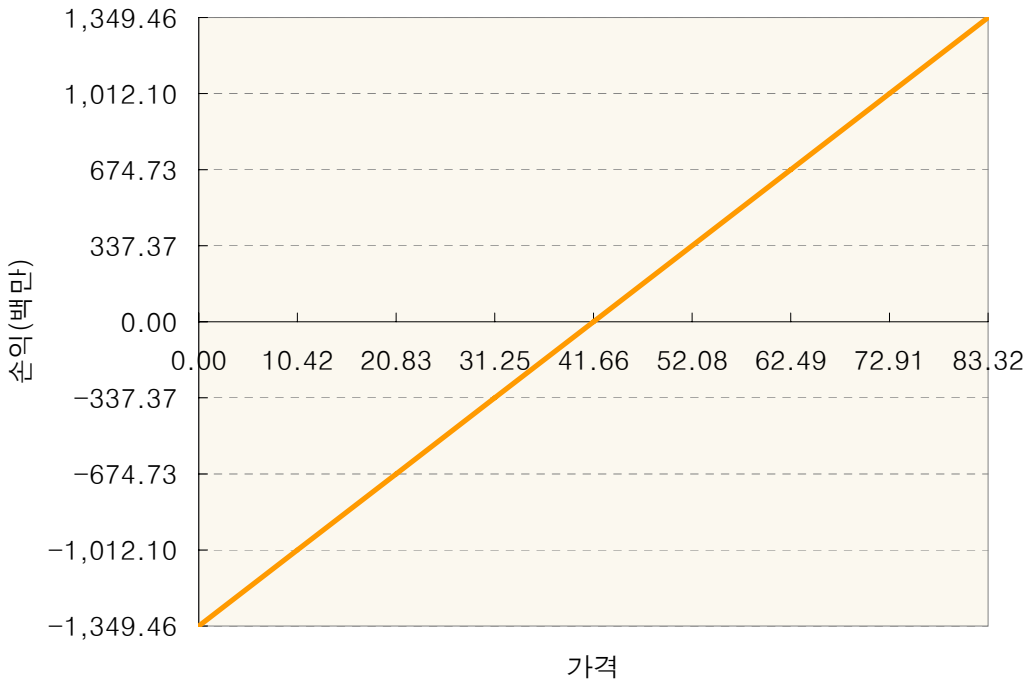
1. 계약금액

(단위:백만원)

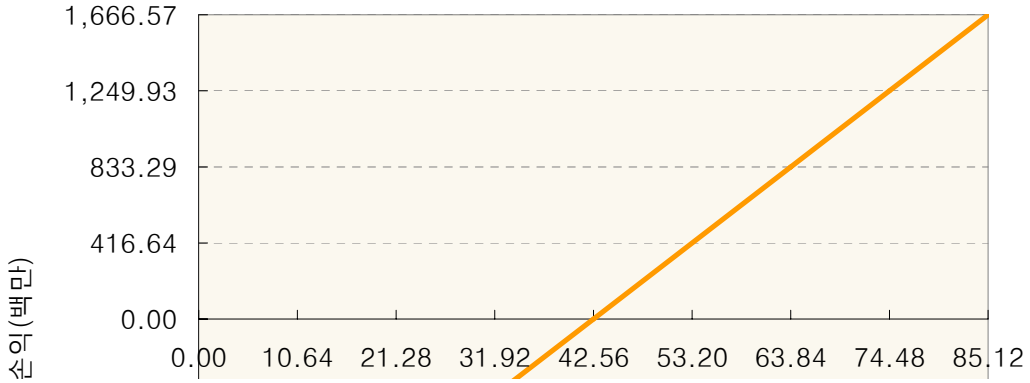
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,349	0	1,349	
누계	유가증권	선물	4,562	0	4,562	

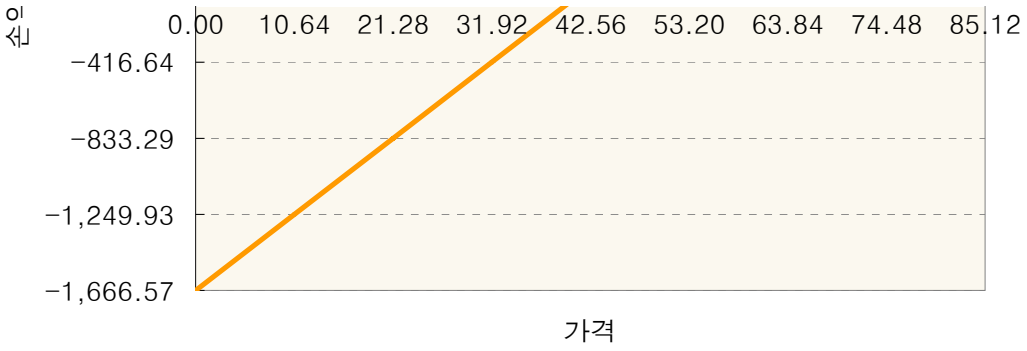
2. 만기시점의 손익구조

CLK6-WTI CRUDE FUTURE MAY16

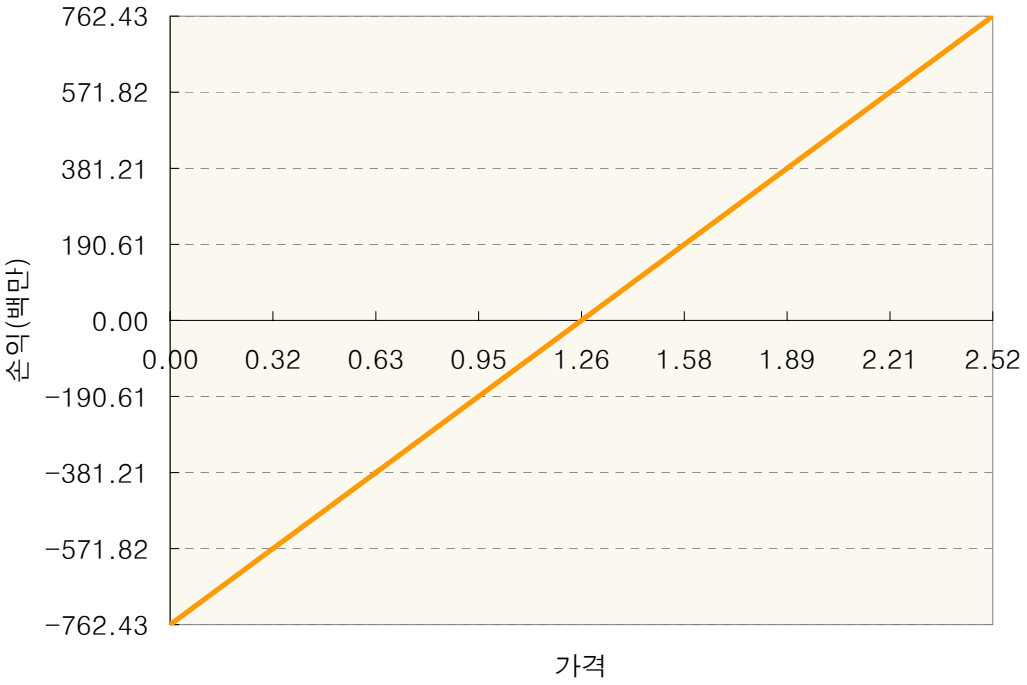


CON6-BRENT CRUDE FUTR JUL16

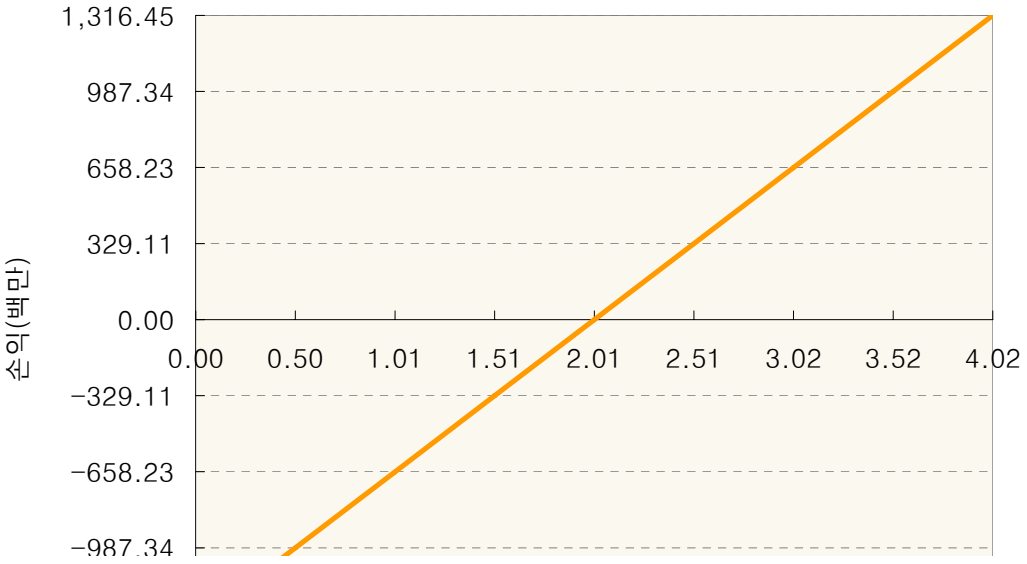


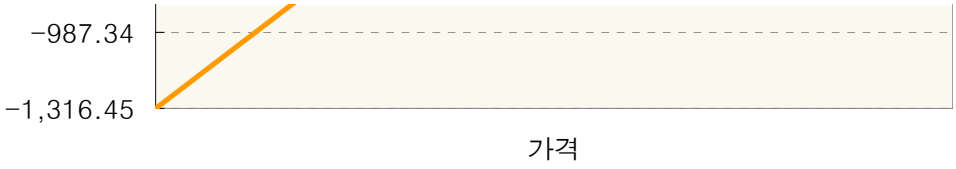


HOK6-NY Harb ULSD Fut MAY16

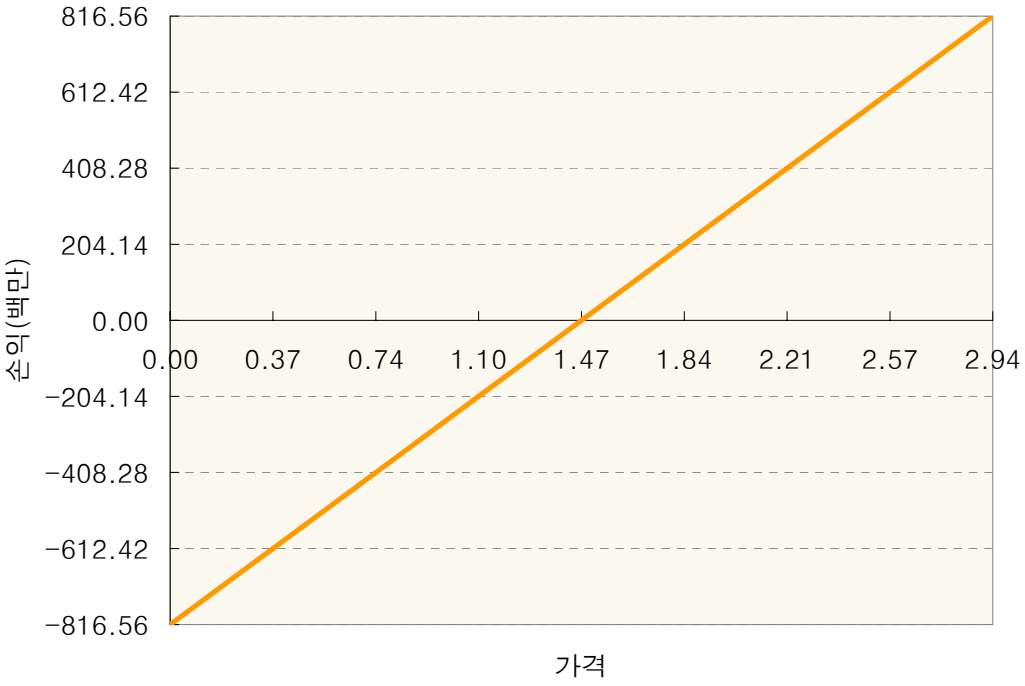


NGK6-NATURAL GAS FUTR MAY16





XBK6-GASOLINE RBOB FUT MAY16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK6	WTI CRUDE FUTURE MAY16	108
CON6	BRENT CRUDE FUTR JUL16	133
HOK6	NY Harb ULSD Fut MAY16	61
NGK6	NATURAL GAS FUTR MAY16	105
XBK6	GASOLINE RBOB FUT MAY16	65

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

(단위:백만원)

1,287

공시일	2016-03-21
기준일	2016-03-18

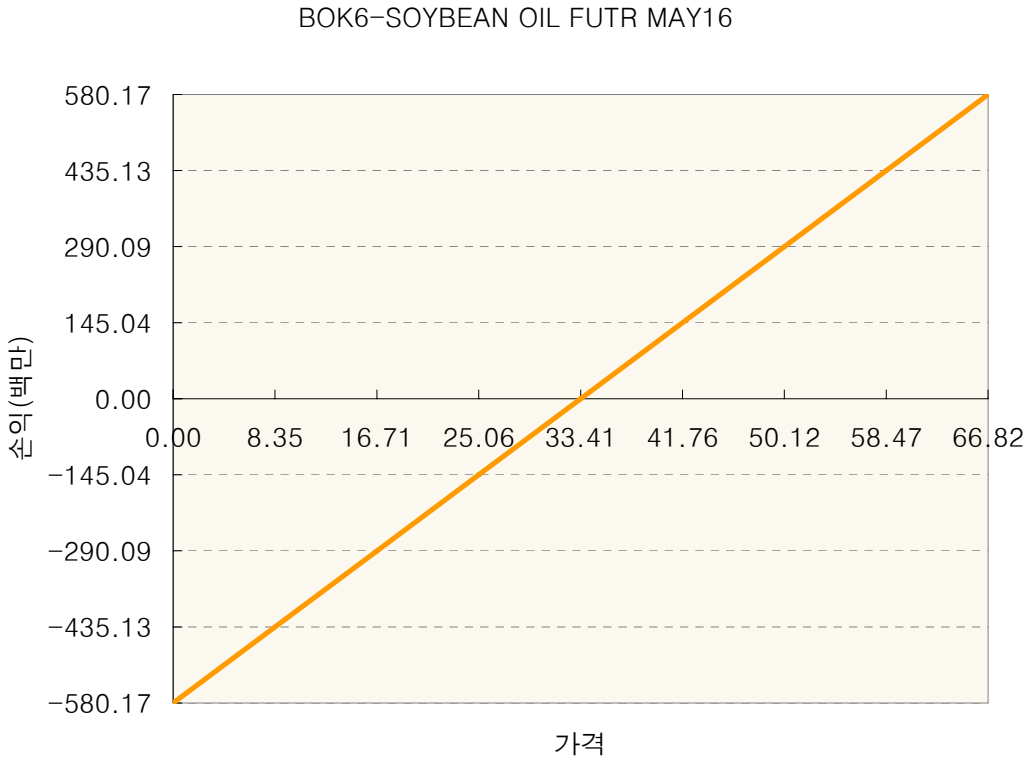
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

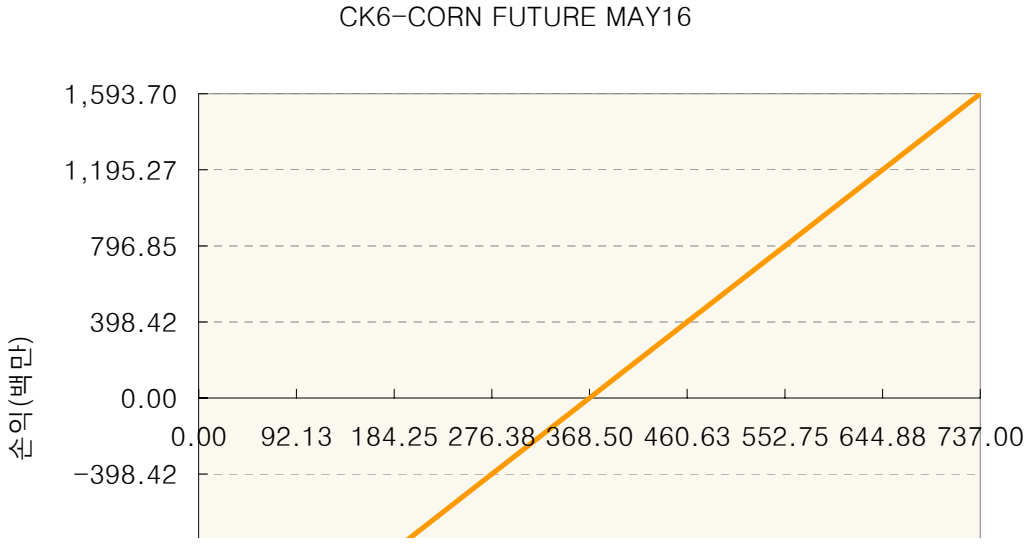
1. 계약금액

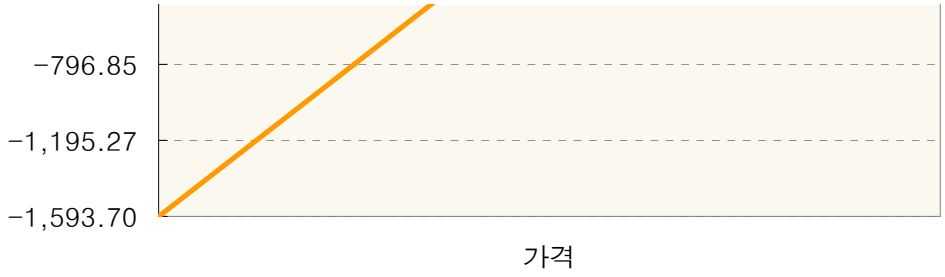
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,406	0	6,406	

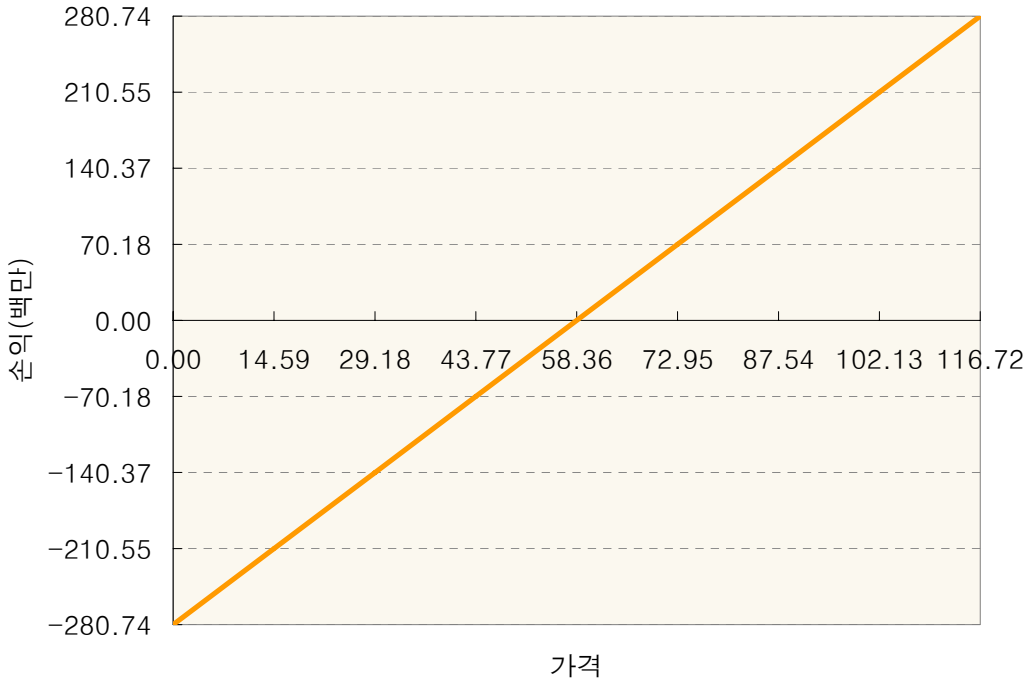
2. 만기시점의 손익구조



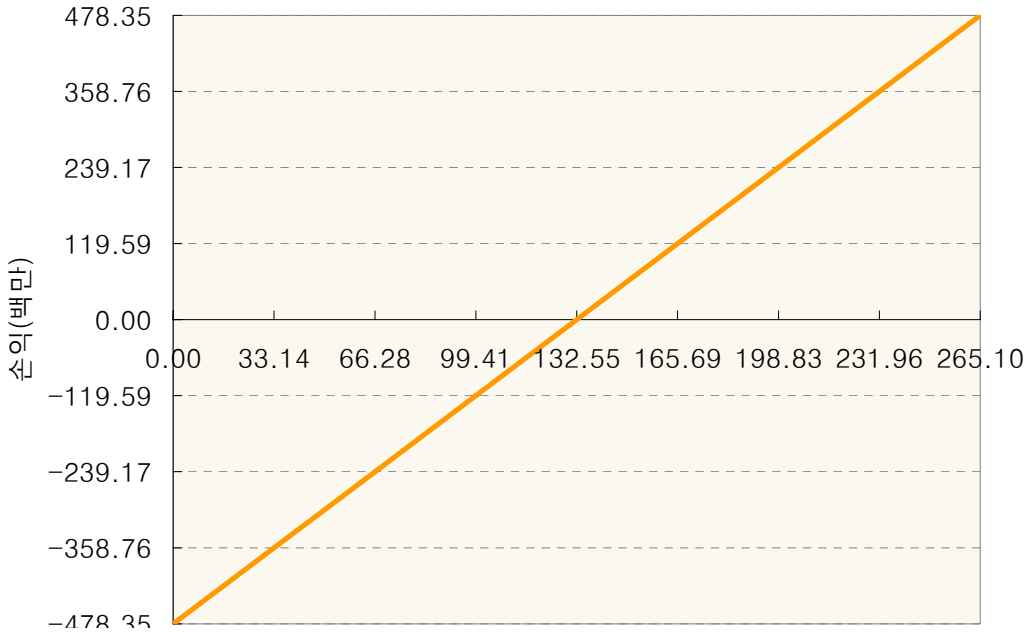


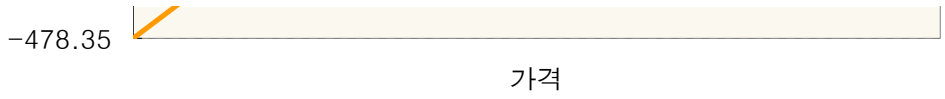


CTK6-COTTON NO.2 FUTR MAY16

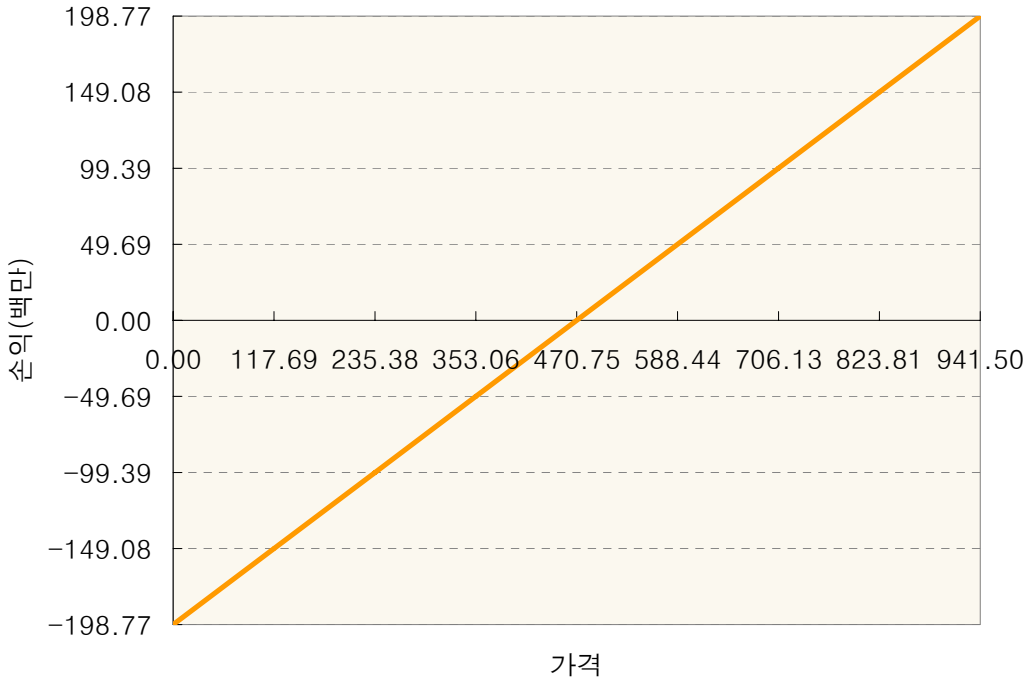


KCK6-COFFEE "C" FUTURE MAY16

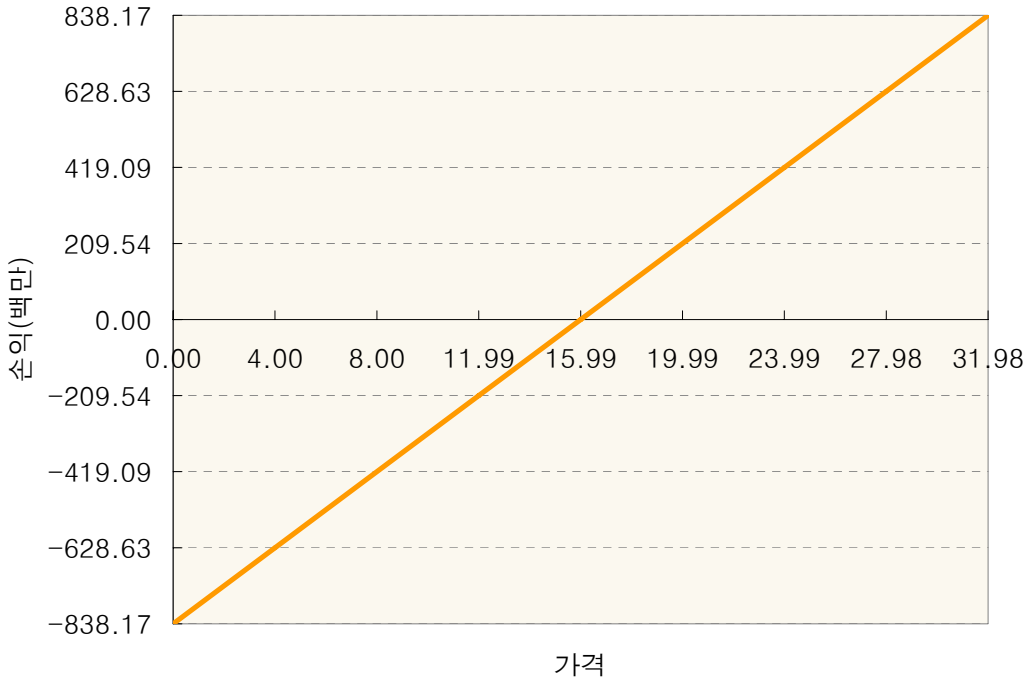




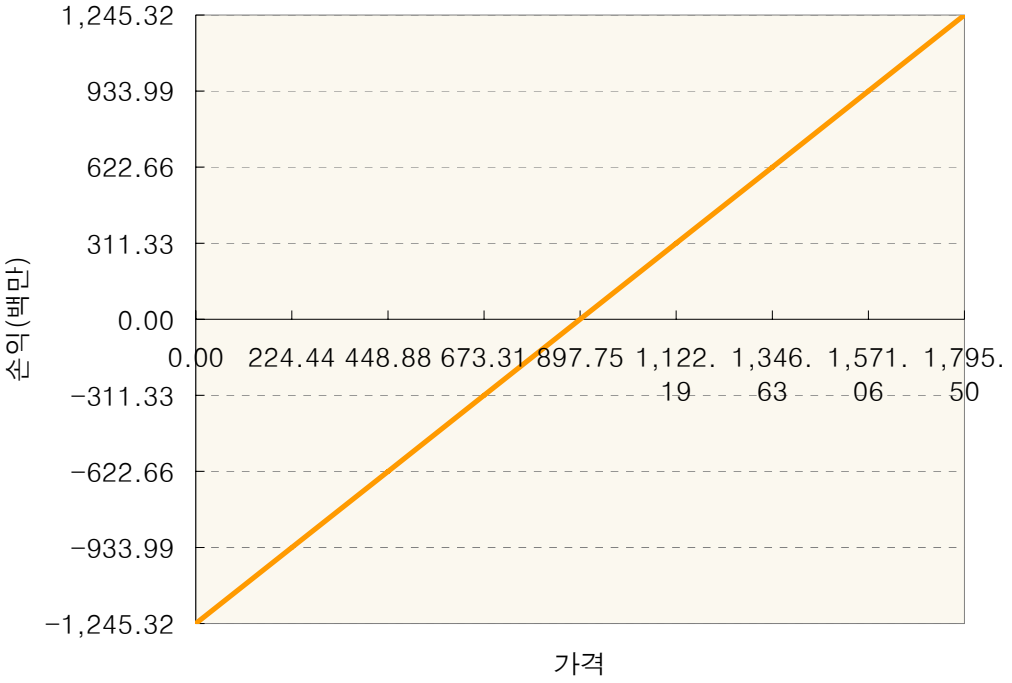
KWK6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16



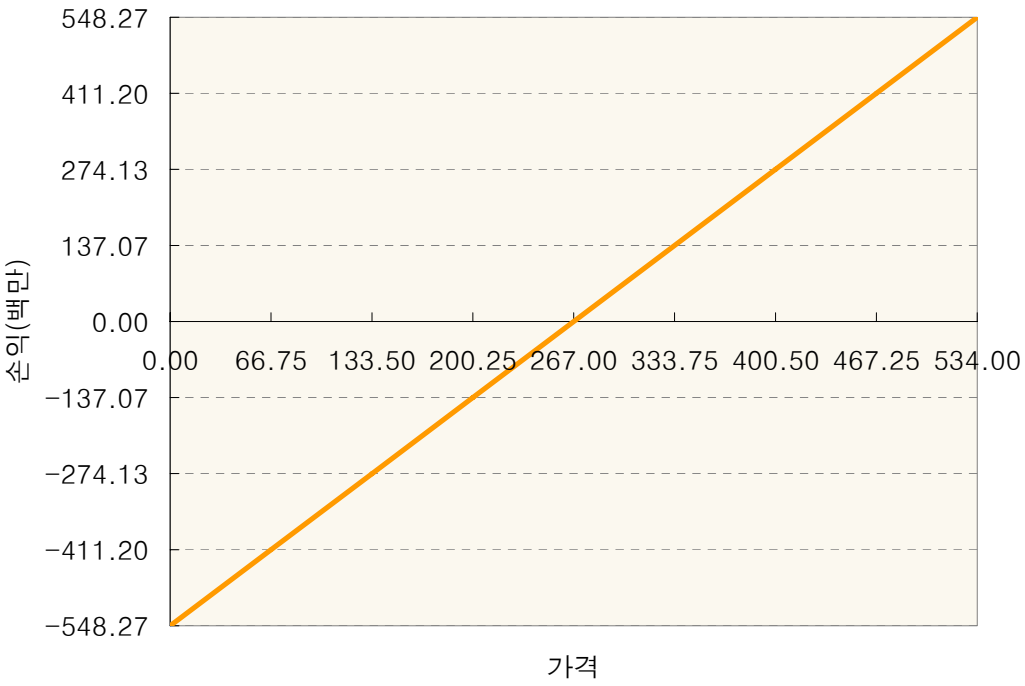
SBK6-Sugar #11 (WORLD) MAY16



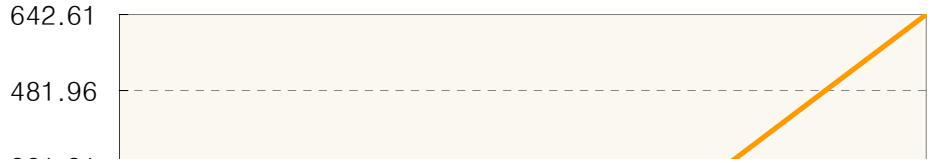
SK6-SOYBEAN FUTURE MAY16

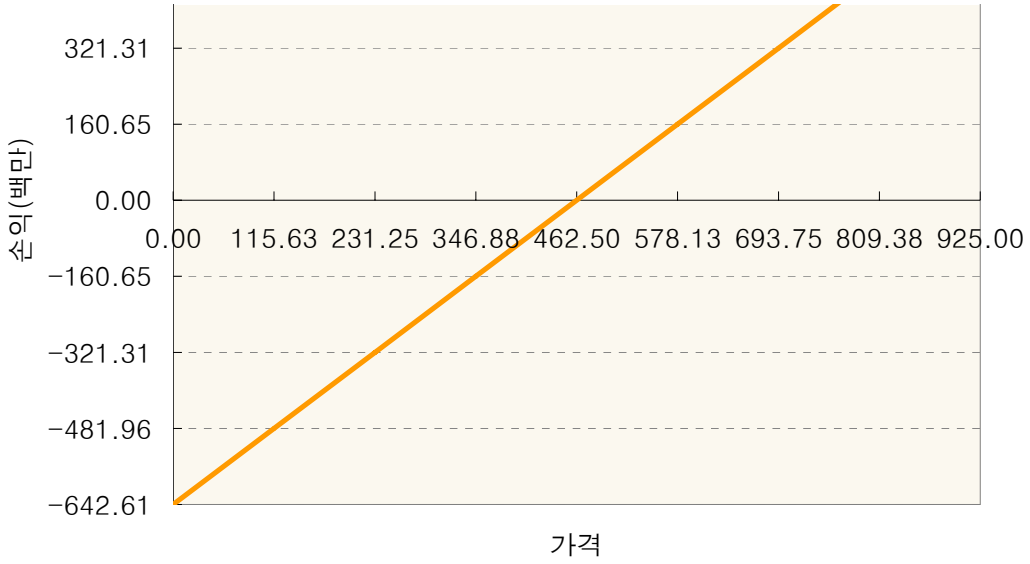


SMK6-SOYBEAN MEAL FUTR MAY16



WK6-WHEAT FUTURE(CBT) MAY16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK6	SOYBEAN OIL FUTR MAY16	46
CK6	CORN FUTURE MAY16	127
CTK6	COTTON NO.2 FUTR MAY16	22
KCK6	COFFEE "C" FUTURE MAY16	38
KWK6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16	16
SBK6	Sugar #11 (WORLD) MAY16	67
SK6	SOYBEAN FUTURE MAY16	100
SMK6	SOYBEAN MEAL FUTR MAY16	44
WK6	WHEAT FUTURE(CBT) MAY16	51

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

(단위:백만원)

700