| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-03-23 |
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 스마트인덱스모

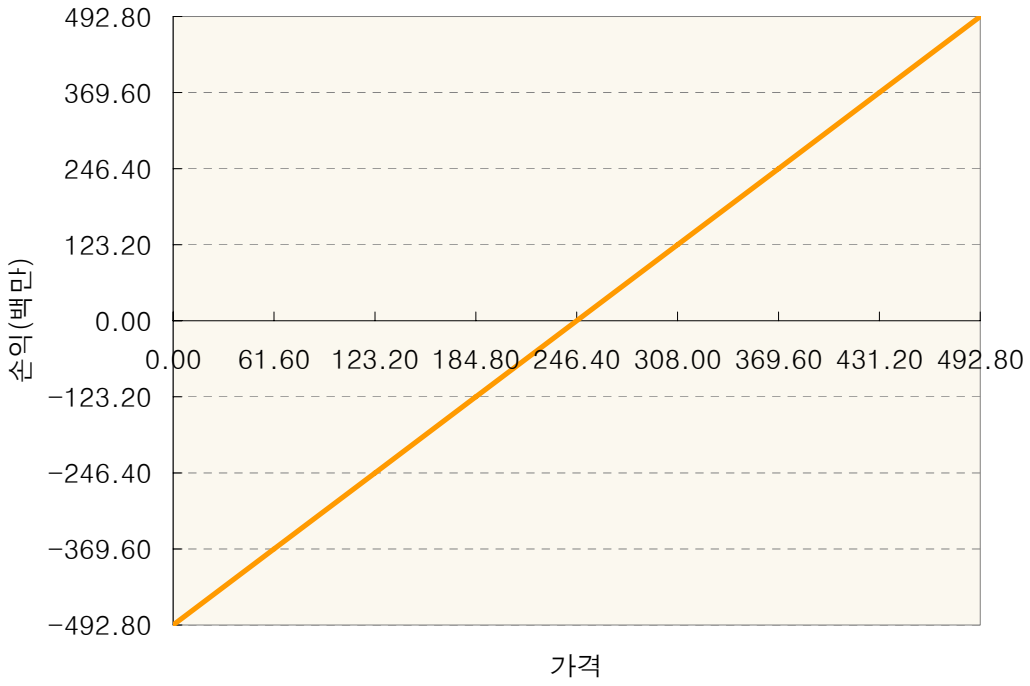
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

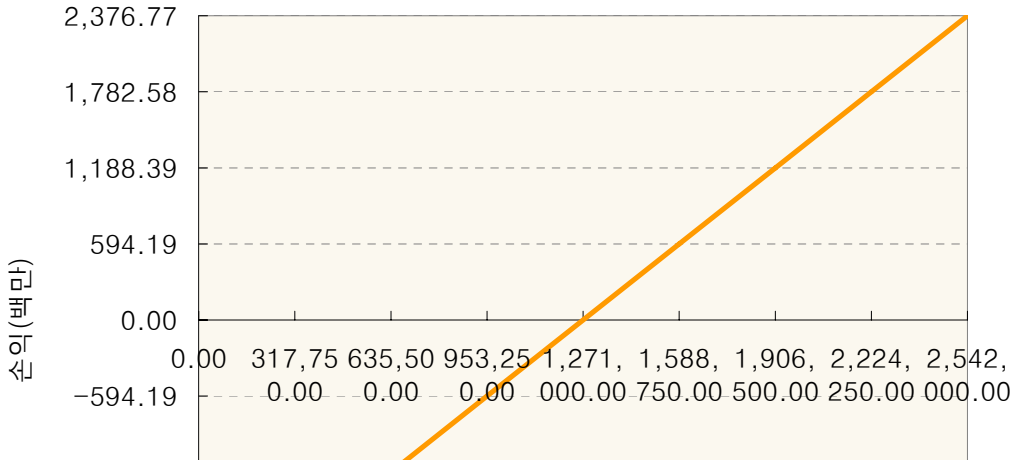
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,870 | 0 | 2,870 | 장내 |

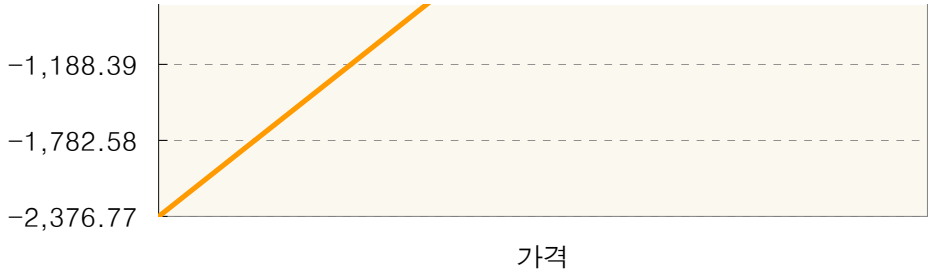
## 2. 만기시점의 손익구조

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)

| 215 |
|---|

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-03-23 |
| 기준일 | 2016-03-22 |

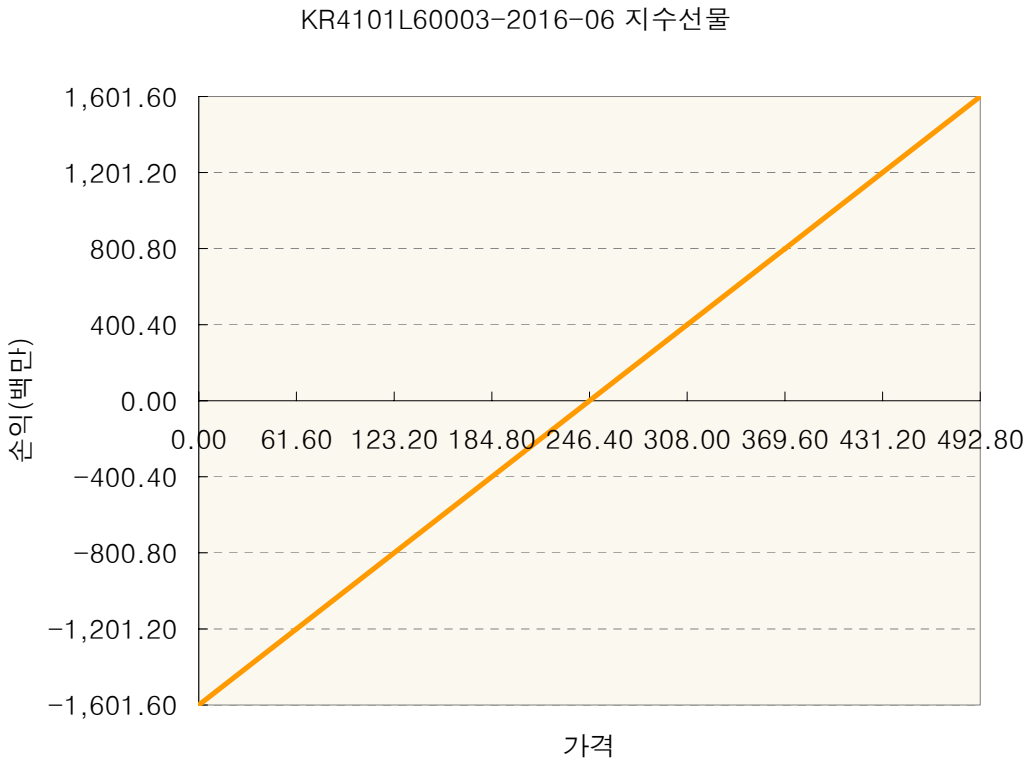
# 스마트레버리지목표전환형1호

## 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 | 1,602 | 0 | 1,602 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 128

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -128 | -128 | -128 | -128 | -128 | -128 | -128 |
| -5.33% | -85 | -85 | -85 | -85 | -85 | -85 | -85 |
| -2.67% | -43 | -43 | -43 | -43 | -43 | -43 | -43 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 | 43 |
| 5.33% | 85 | 85 | 85 | 85 | 85 | 85 | 85 |
| 8.00% | 128 | 128 | 128 | 128 | 128 | 128 | 128 |

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

| 104 |
|---|

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

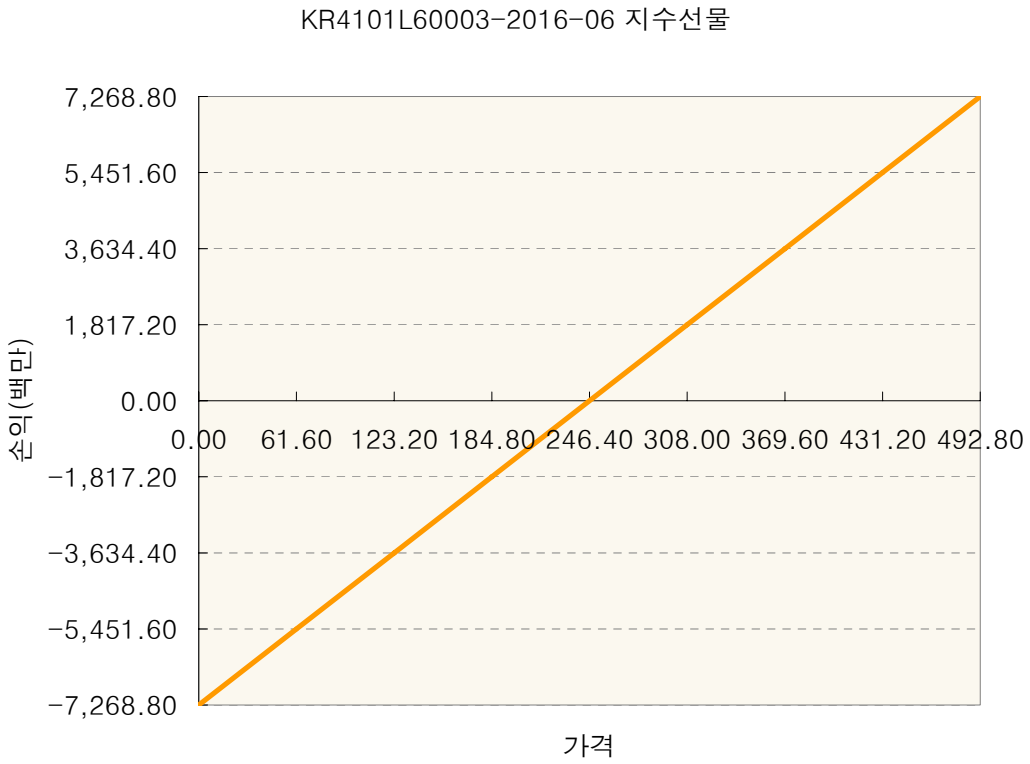
# 1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

## 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 | 7,269 | 0 | 7,269 | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 579

| | 기초자산의 변동성 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -579 | -579 | -579 | -579 | -579 | -579 | -579 |
| -5.33% | -386 | -386 | -386 | -386 | -386 | -386 | -386 |
| -2.67% | -193 | -193 | -193 | -193 | -193 | -193 | -193 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 193 | 193 | 193 | 193 | 193 | 193 | 193 |
| 5.33% | 386 | 386 | 386 | 386 | 386 | 386 | 386 |
| 8.00% | 579 | 579 | 579 | 579 | 579 | 579 | 579 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
| --- | --- |
| | 471 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

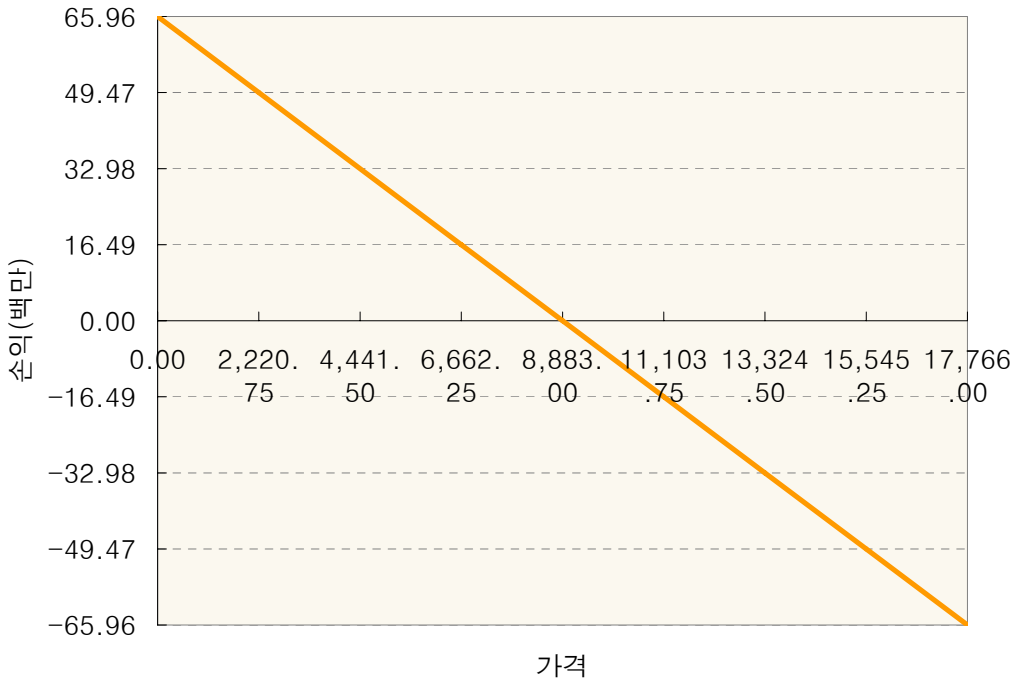
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

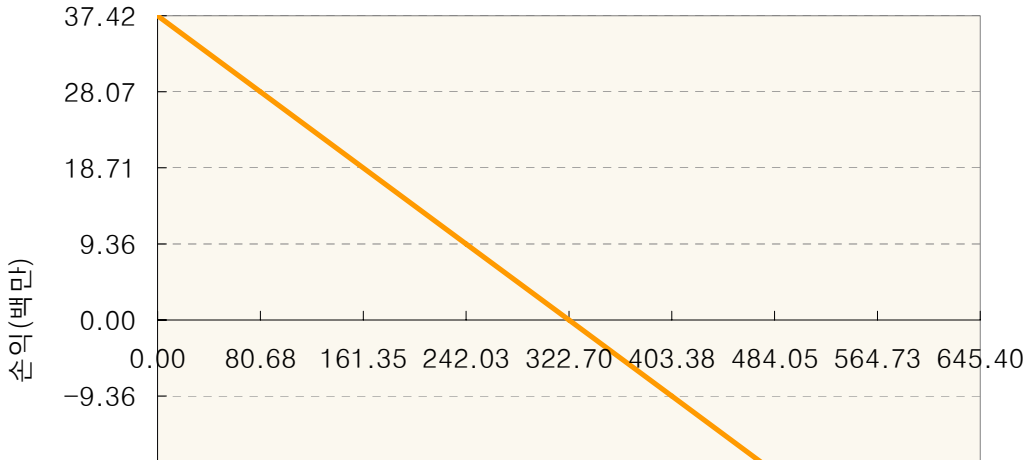
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 114 | -114 | |

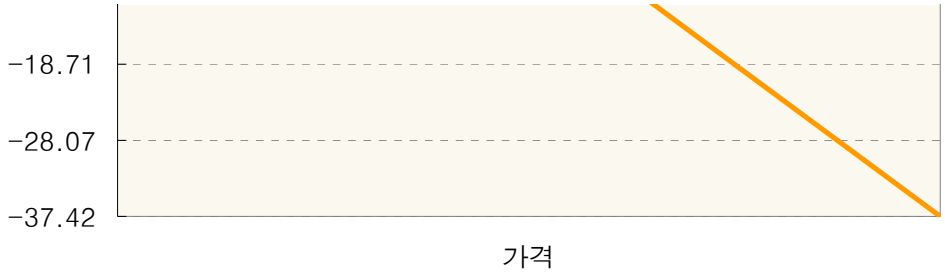
## 2. 만기시점의 손익구조

HCH6-H-SHARES IDX FUT Mar16

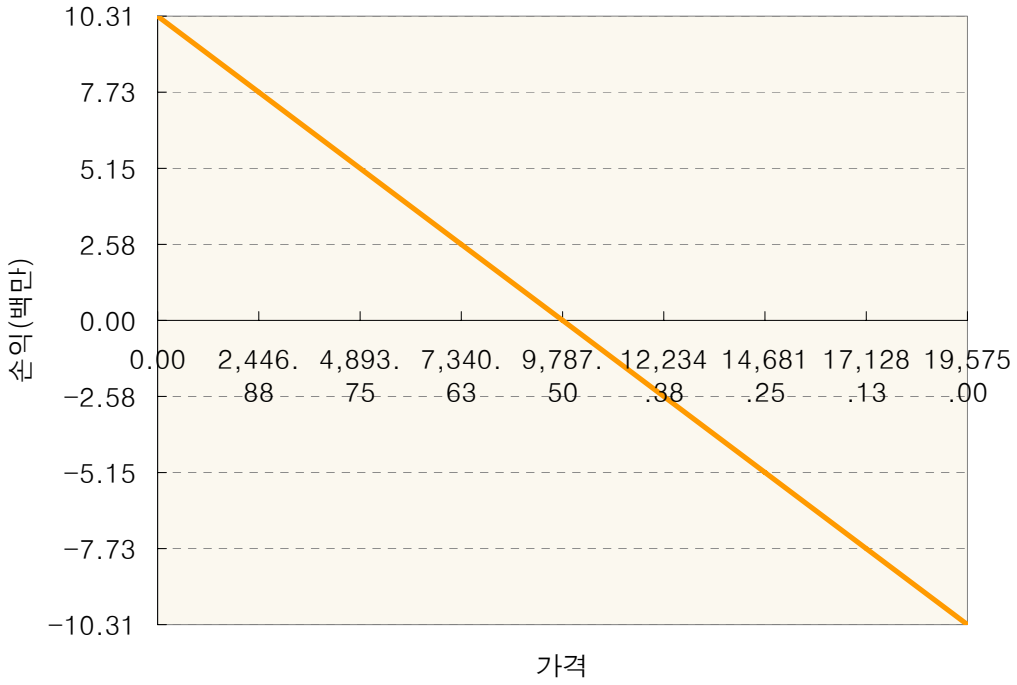



TWH6-MSCI TAIWAN INDEX MAR16






XUH6-SGX FTSE CHINA A50 FUTURES CONTRACT MAR1




**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| HCH6 | H-SHARES IDX FUT Mar16 | 5 |
| TWH6 | MSCI TAIWAN INDEX MAR16 | 3 |
| XUH6 | SGX FTSE CHINA A50 FUTURES CONTRACT MAR1 | 1 |

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

| |
|---|
| 10 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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)

| 711 |
|---|

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 16 |
|---|---|

* 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 | 2016-03-23 |
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 395 |
| SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1 | 123 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,541 |

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-03-23 |
| 기준일 | 2016-03-22 |

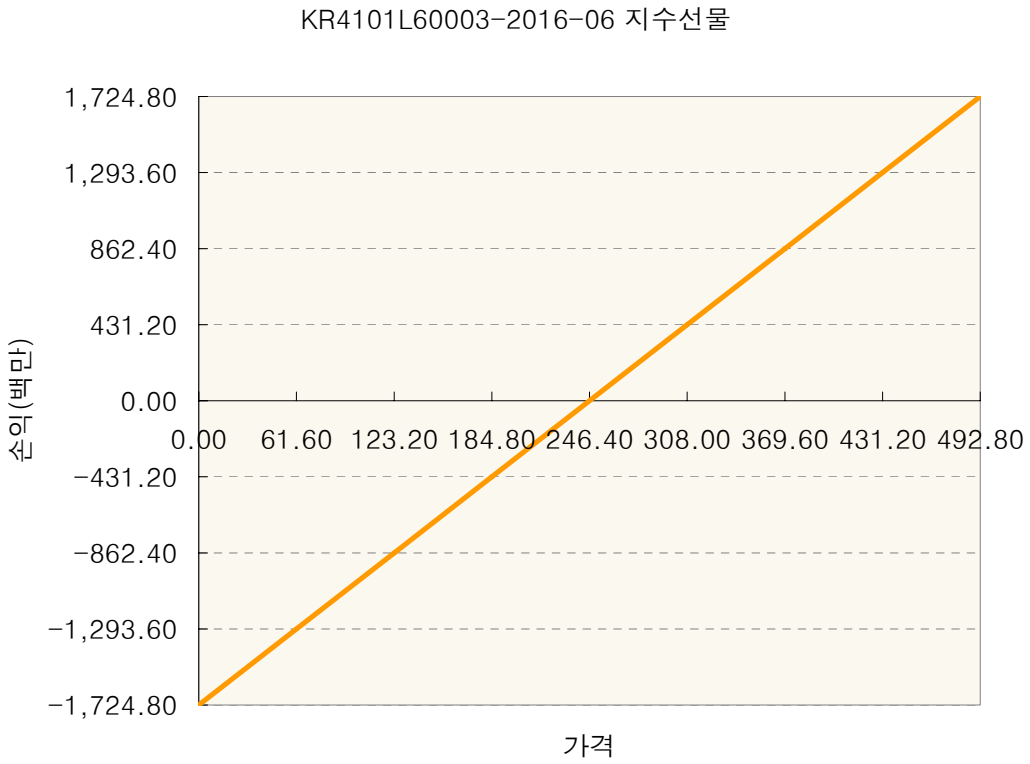
# KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

## 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 | 1,725 | 0 | 1,725 | 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% | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 | -92 |
| -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% | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 | 92 |
| 8.00% | 137 | 137 | 137 | 137 | 137 | 137 | 137 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
| --- | --- |
| | 112 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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)

| |
|---|
| 160 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 227 |
| KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957 | 239 |
| KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298 | 227 |
| KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483 | 227 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 617 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 195 |
| KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454 | 196 |
| KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956 | 234 |
| KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297 | 195 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 552 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 136 |
| KR65533446 ELSNH투자증권(ELS)11973 | 136 |
| KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319 | 147 |
| KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513 | 136 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 284 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 124 |
| KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472 | 115 |
| KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987 | 114 |
| KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343 | 115 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 259 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 93 |
| KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170 | 80 |
| KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036 | 80 |
| KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359 | 80 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 160 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 5,950 | 0 | 5,950 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65133226 ELS대신증권(ELS)6386 | 141 |
| KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180 | 131 |
| KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056 | 150 |
| KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388 | 136 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 282 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 139 |
| KR65233676 ELS대우증권(ELS) 15190 | 138 |
| KR65533526 ELSNH투자증권(ELS) 12077 | 138 |
| KR65733986 ELS한국투자증권(ELS) 5399 | 152 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 217 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 149 |
| KR65433166 ELS신영증권플랜업(ELS) 5495 | 149 |
| KR65533956 ELSNH투자증권(ELS) 12098 | 156 |
| KR65733AY6 ELS한국투자증권(ELS) 5385 | 148 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 304 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 251 |
| KR65233306 ELS대우증권(ELS)15315 | 268 |
| KR65533226 ELSNH투자증권(ELS)12137 | 292 |
| KR65733066 ELS한국투자증권(ELS)5421 | 250 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 529 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 370 |
| KR65233776 ELS대우증권(ELS)15342 | 393 |
| KR65433106 ELS신영증권플랜업(ELS)5516 | 370 |
| KR65733196 ELS한국투자증권(ELS)5445 | 369 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 746 |

| | |
|---|---|
| 공시일 | 2016-03-23 |
| 기준일 | 2016-03-22 |

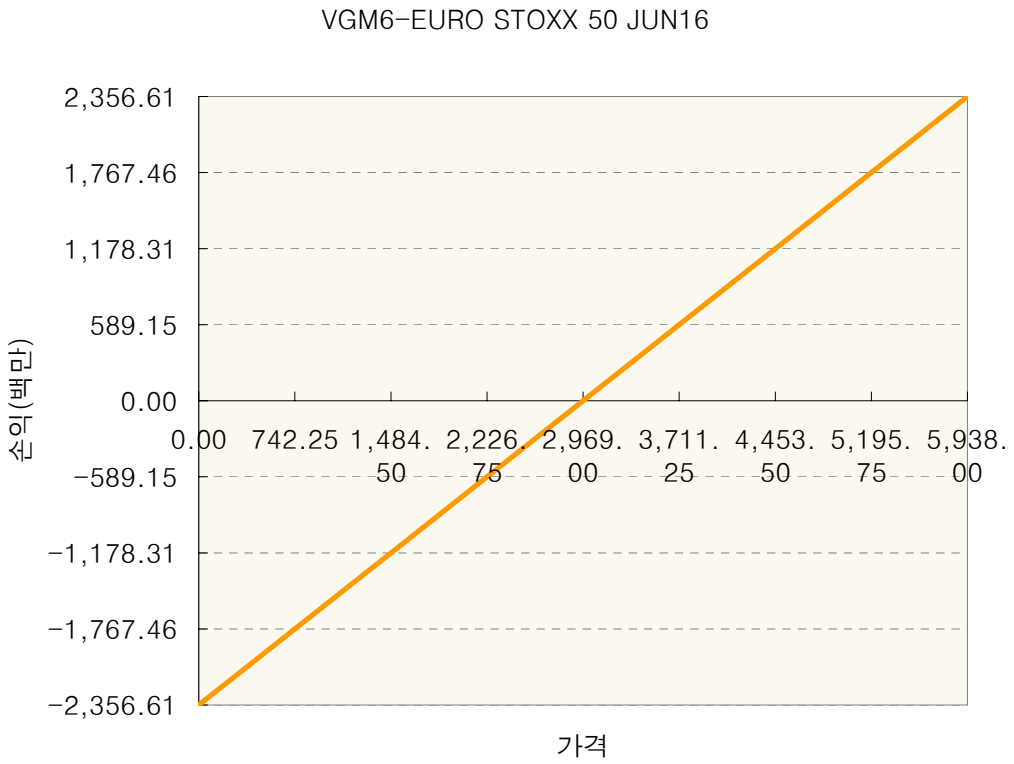
# 유로인덱스모(주식-파생형)

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,357 | 0 | 2,357 | |

## 2. 만기시점의 손익구조




## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| VGM6 | EURO STOXX 50 JUN16 | 189 |

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

(단위:백만원)

225

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 차이나인덱스모(주식-파생형)

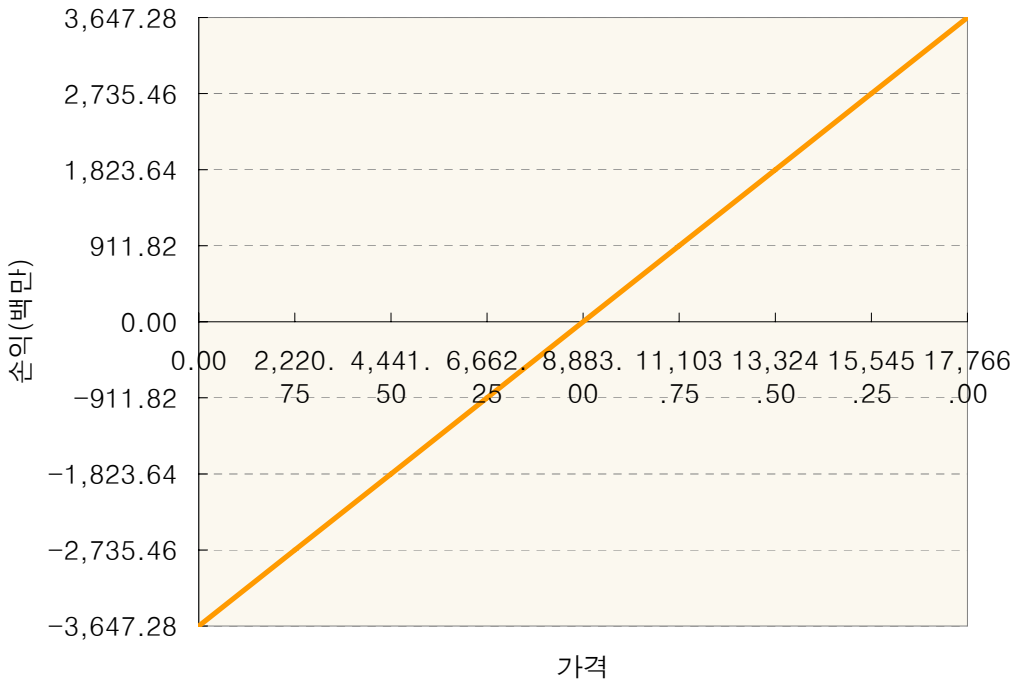
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

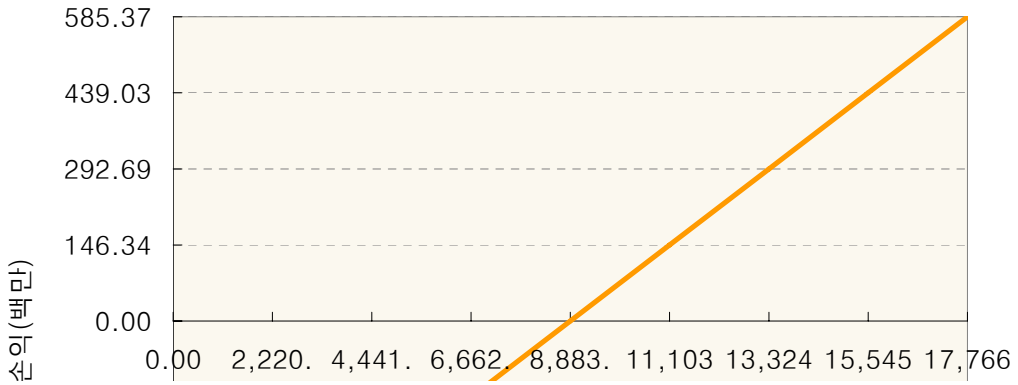
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,647 | 0 | 3,647 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 585 | 0 | 585 | 장내 |

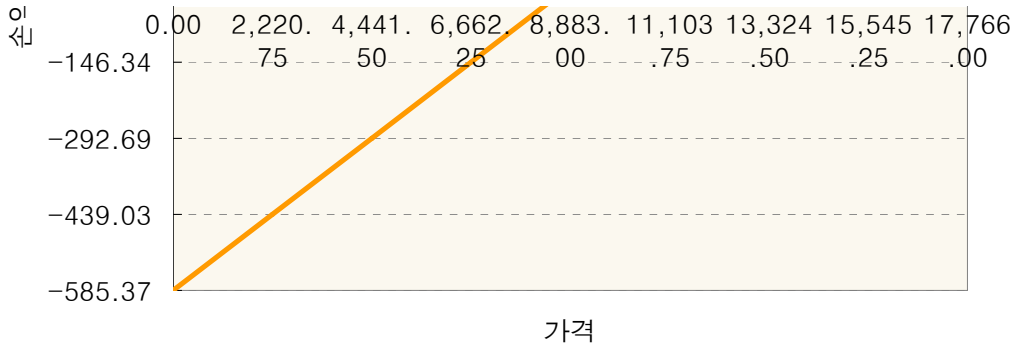
## 2. 만기시점의 손익구조

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 | 292 |
| MHCH6 | HKG MINI HANG SENG CHINA H-SHR IDX FUT M | 47 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 392 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 496 |
| KR65433236 ELS신영증권플랜업(ELS)5530 | 582 |
| KR65533A86 ELSNH투자증권(ELS)12195 | 603 |
| KR65733A46 ELS한국투자증권(ELS)5456 | 497 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,171 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 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 | 46 |
| KR67233096 ELS아이비케이증권(ELS)1795 | 43 |
| KR67733226 ELSKB STAR(ELS)1103 | 43 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 95 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# KOSPI200지수연계2호(ELS-파생형

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | ELS | 2,215 | 0 | 2,215 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | ELS | 2,215 | 0 | 2,215 | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| KR65133AK6 ELS대신증권(ELS)6459 | 41 |
| KR65433416 ELS신영증권플랜업(ELS)5527 | 35 |
| KR67233136 ELS아이비케이증권(ELS)1797 | 35 |
| KR67733456 ELSKB STAR(ELS)1108 | 35 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 81 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

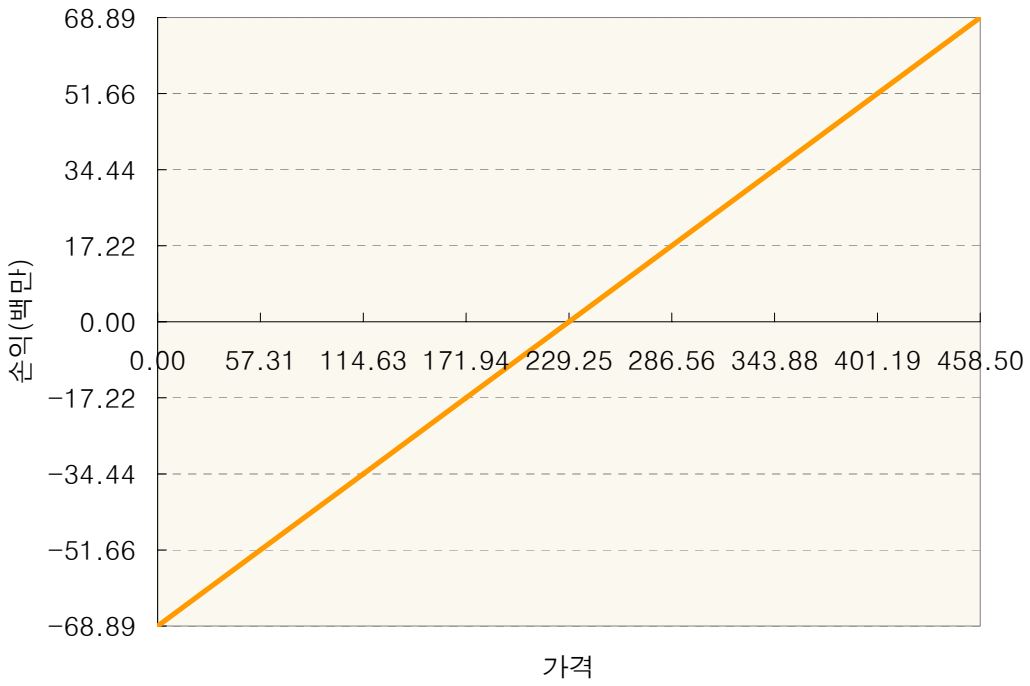
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

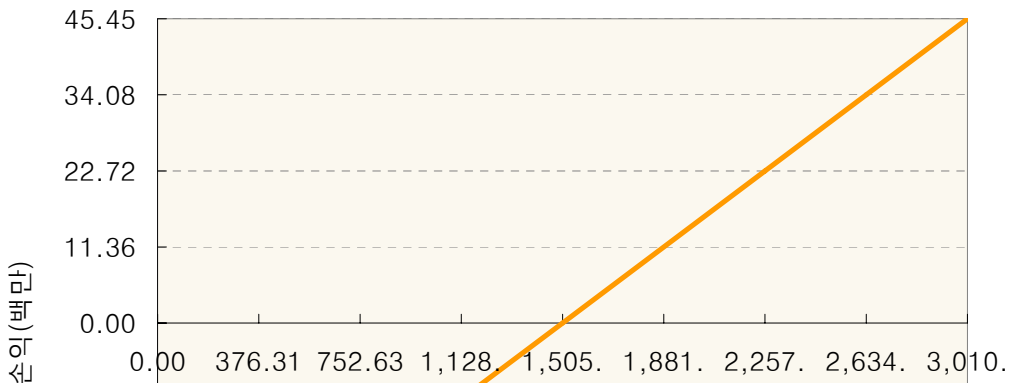
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 57 | 0 | 57 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 313 | 0 | 313 | |

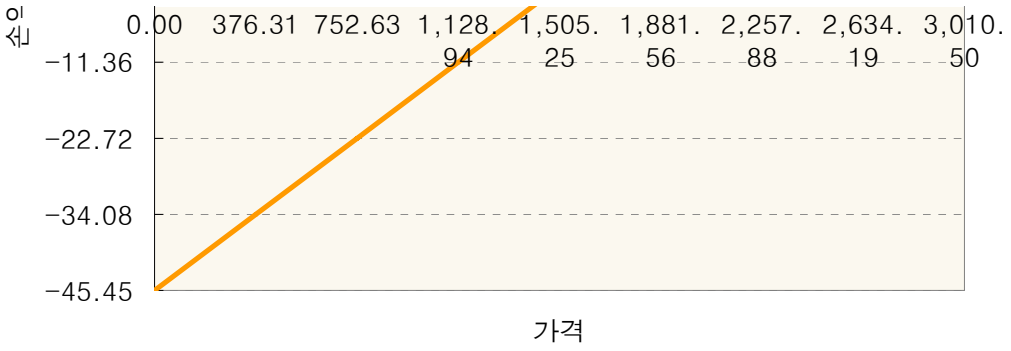
## 2. 만기시점의 손익구조

HGK6-COPPER FUTURE MAY16

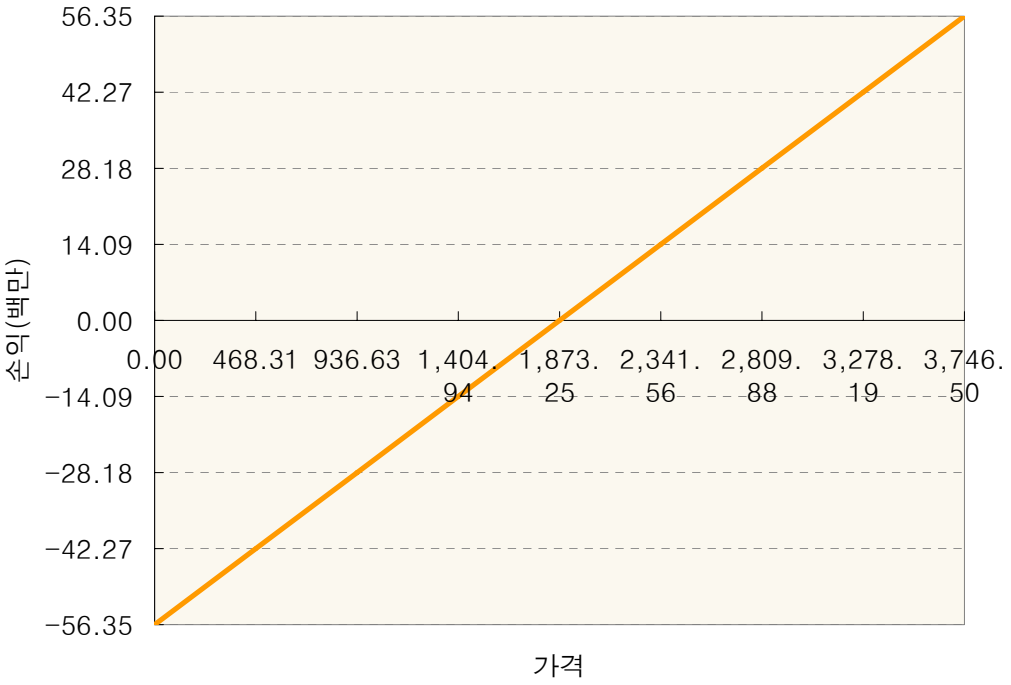



LAK6-LME PRI ALUM FUTR MAY16

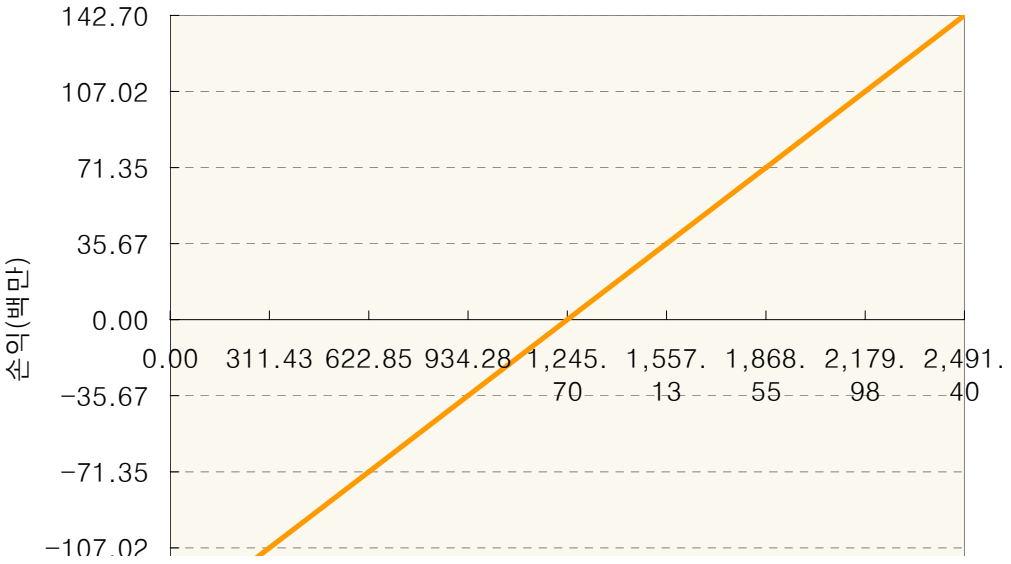


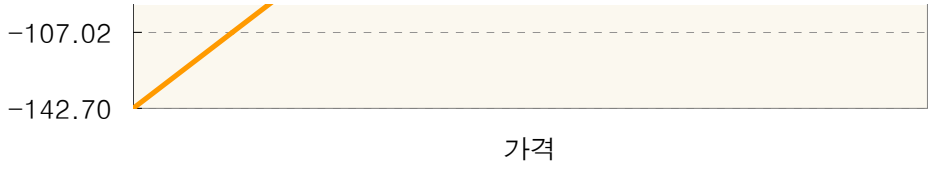



LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16

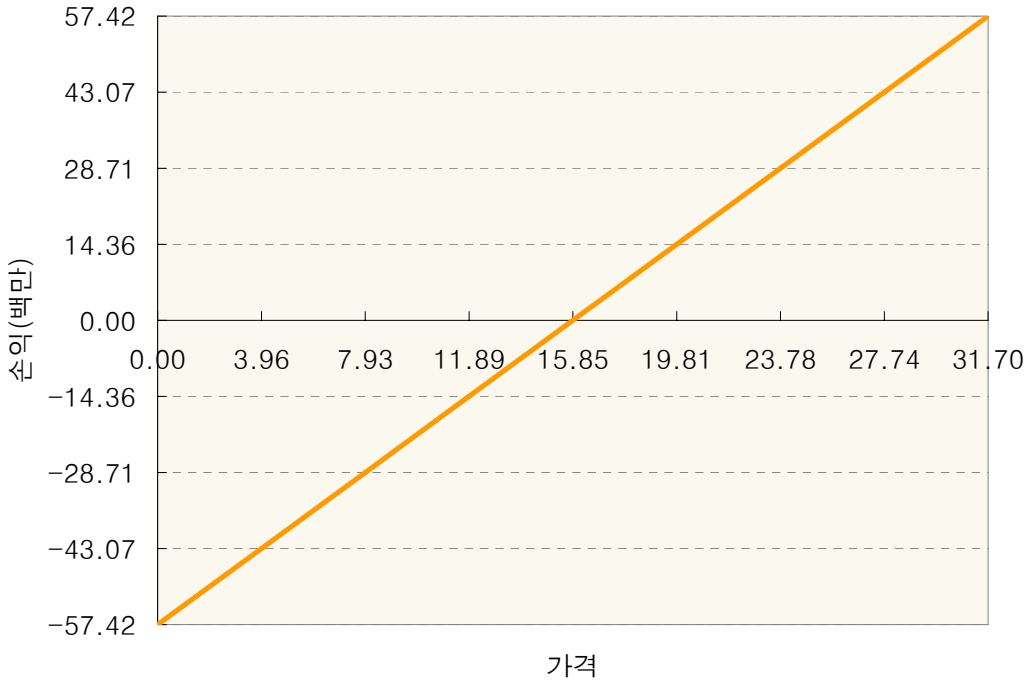



XGM6-MINI GOLD FUTURE JUN16






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 | 5 |
| XGM6 | MINI GOLD FUTURE JUN16 | 11 |
| YSK6 | MINI SILVER FUT MAY16 | 5 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 31 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

# 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

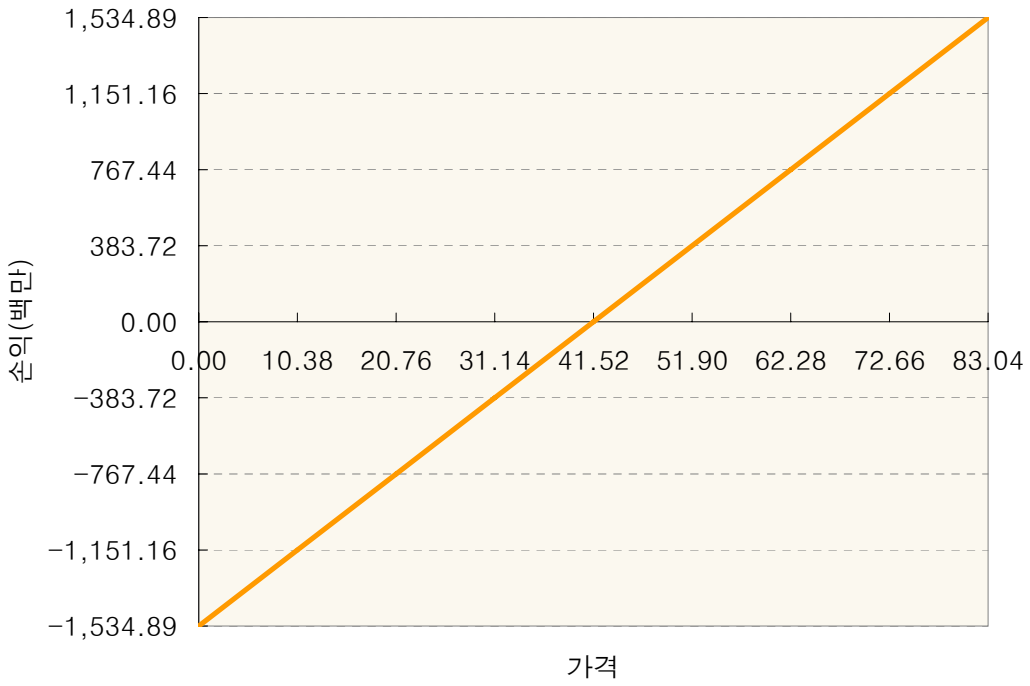
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

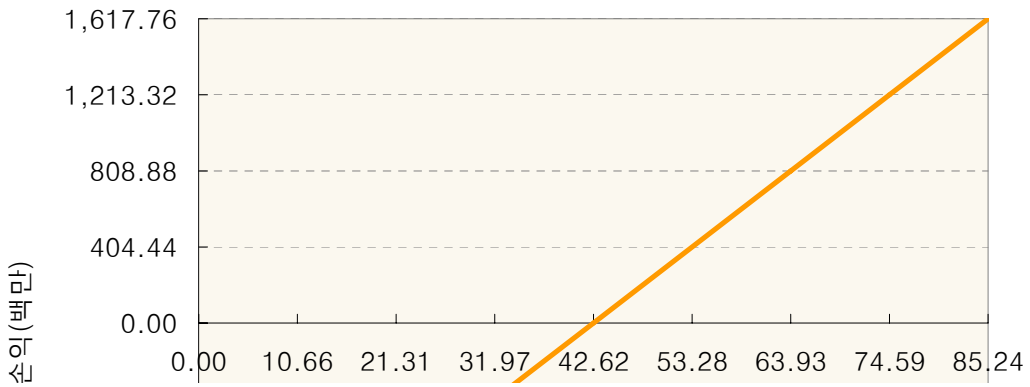
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 선물 | 유가증권 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 선물 | 유가증권 | 1,535 | 0 | 1,535 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 4,384 | 0 | 4,384 | |

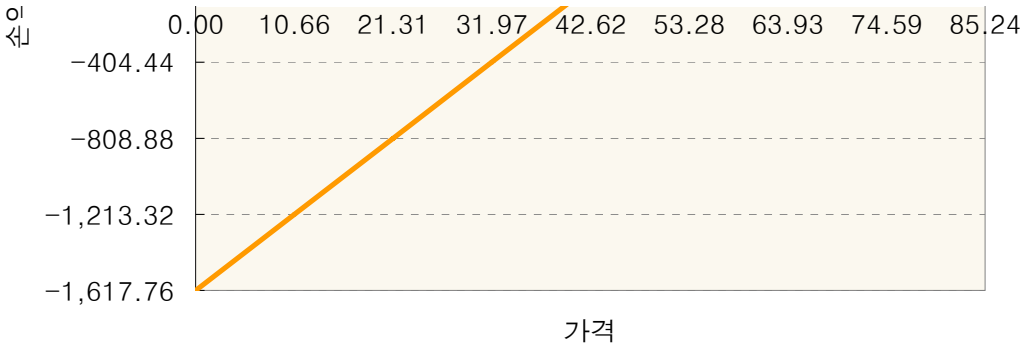
## 2. 만기시점의 손익구조

CLK6-WTI CRUDE FUTURE MAY16

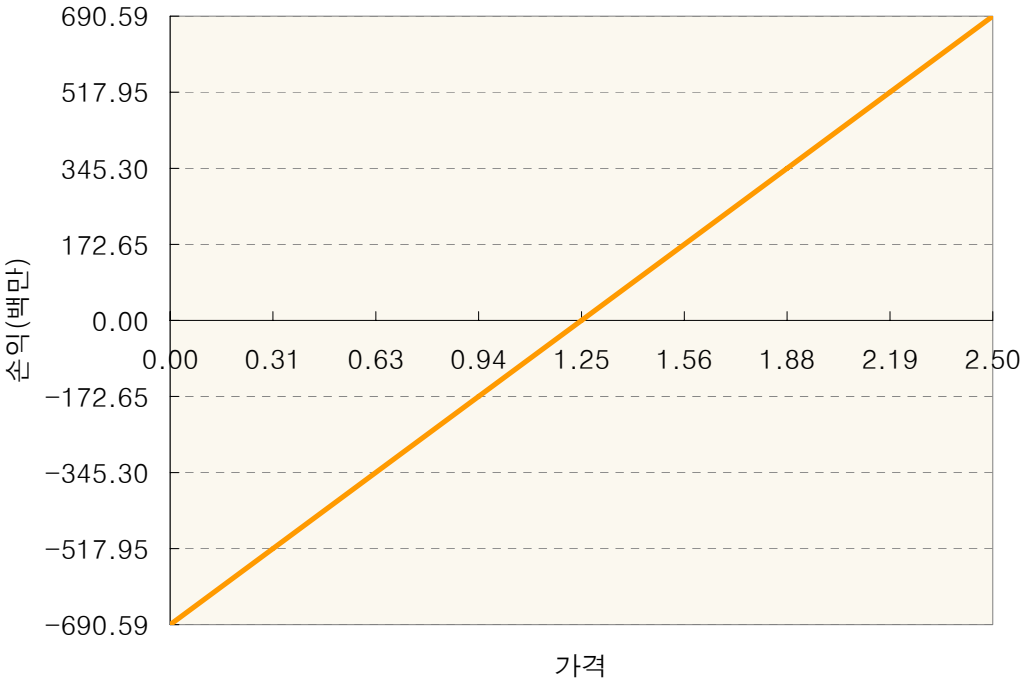



CON6-BRENT CRUDE FUTR JUL16

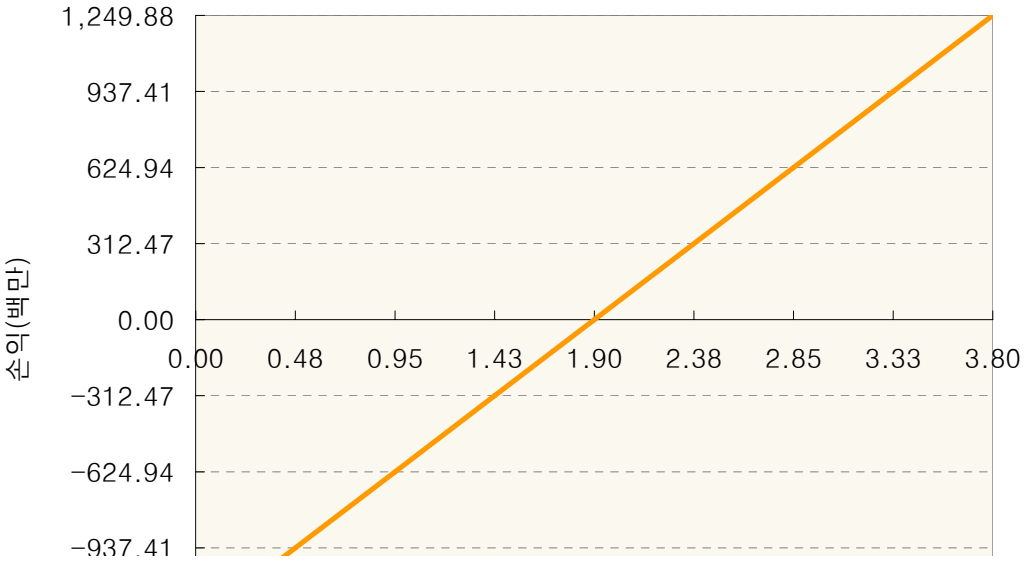


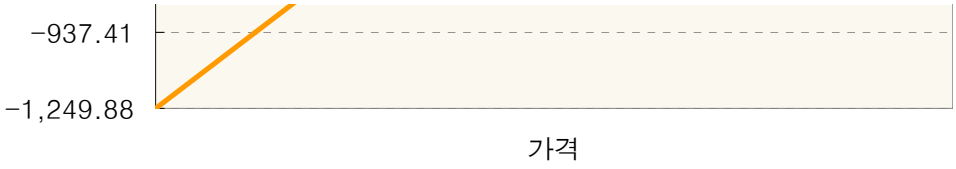



HOK6-NY Harb ULSD Fut MAY16

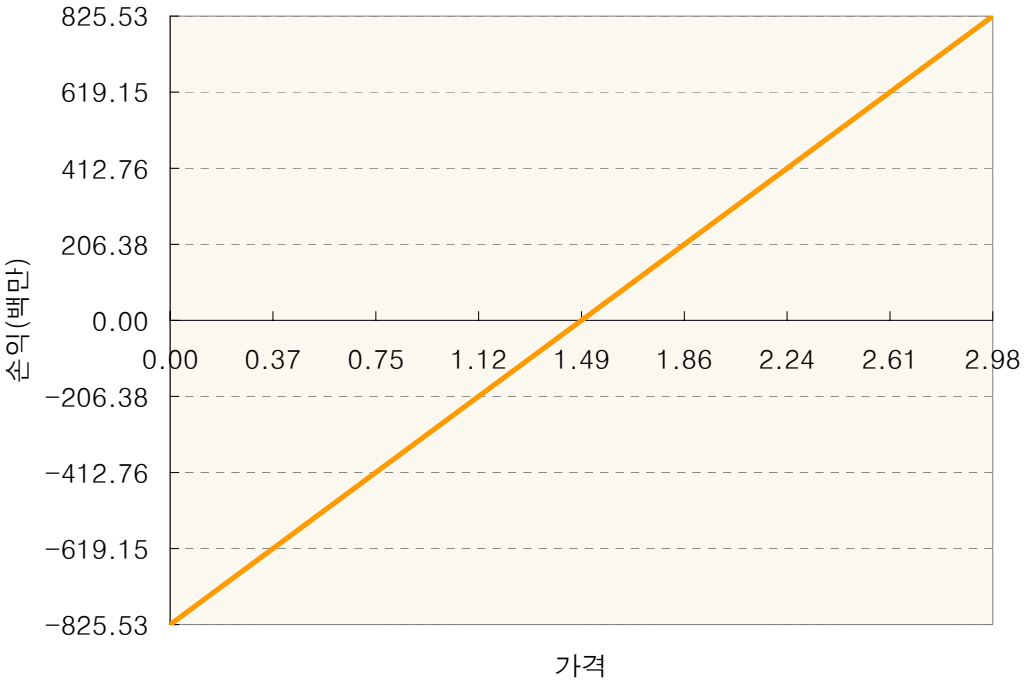



NGK6-NATURAL GAS FUTR MAY16






XBK6-GASOLINE RBOB FUT MAY16




### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| CLK6 | WTI CRUDE FUTURE MAY16 | 123 |
| CON6 | BRENT CRUDE FUTR JUL16 | 129 |
| HOK6 | NY Harb ULSD Fut MAY16 | 55 |
| NGK6 | NATURAL GAS FUTR MAY16 | 100 |
| XBK6 | GASOLINE RBOB FUT MAY16 | 66 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| 1,292 |

| 공시일 | 2016-03-23 |
|---|---|
| 기준일 | 2016-03-22 |

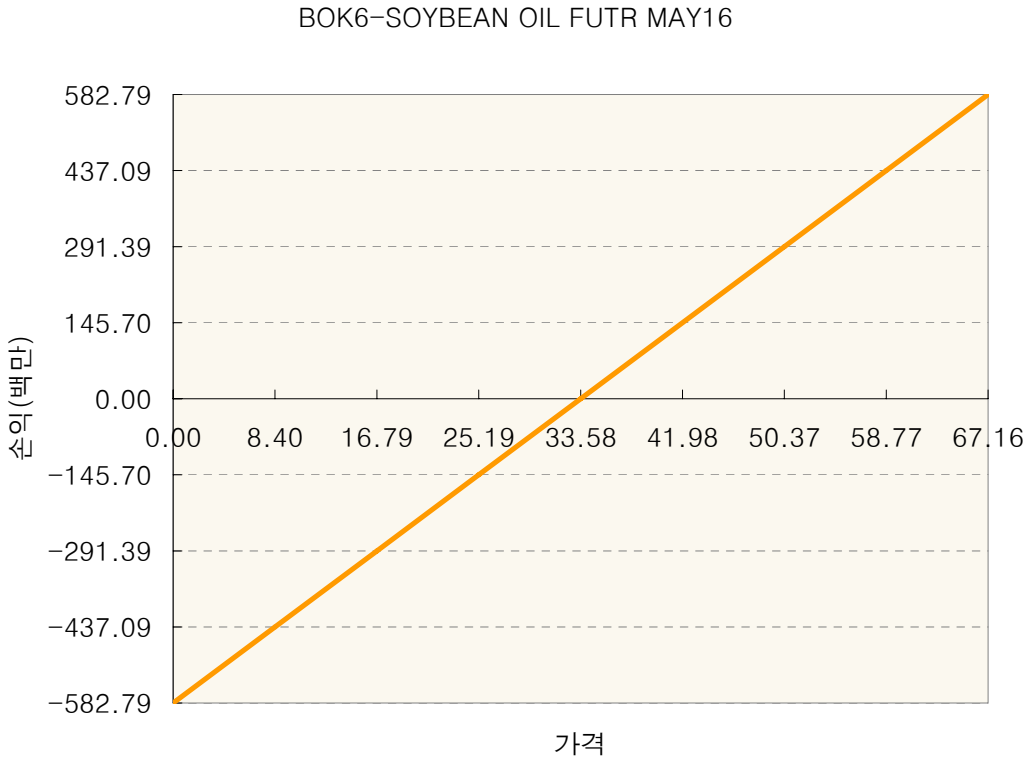
# 애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

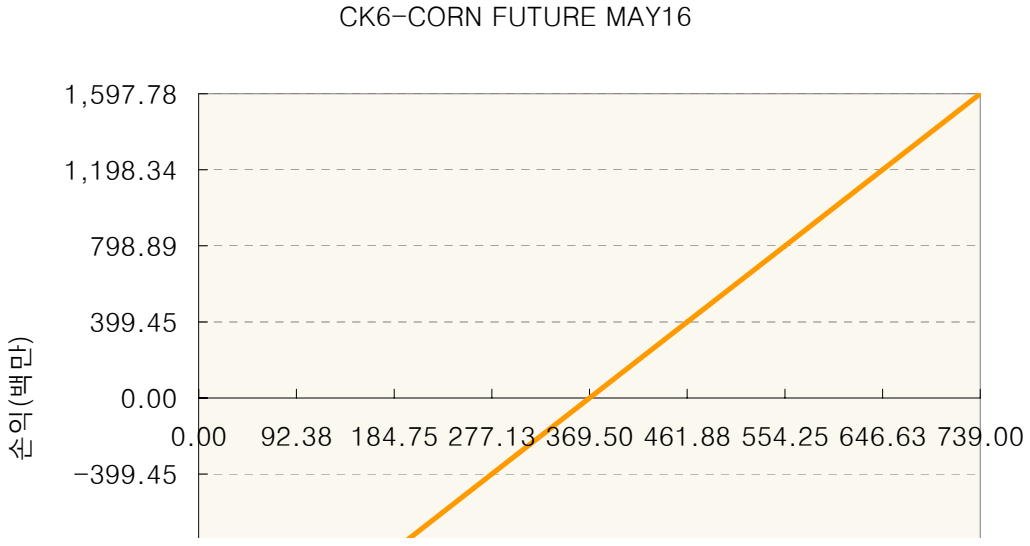
## 1. 계약금액

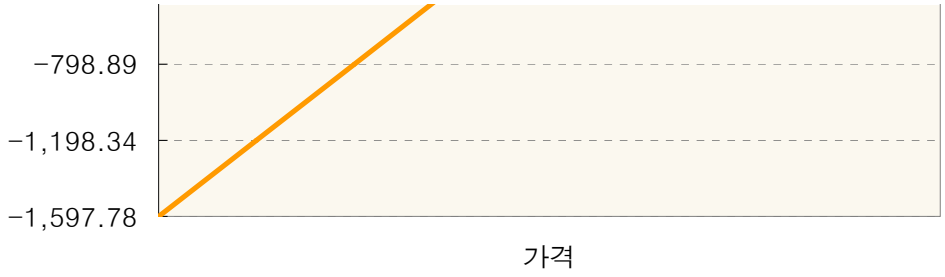
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 6,553 | 0 | 6,553 | |

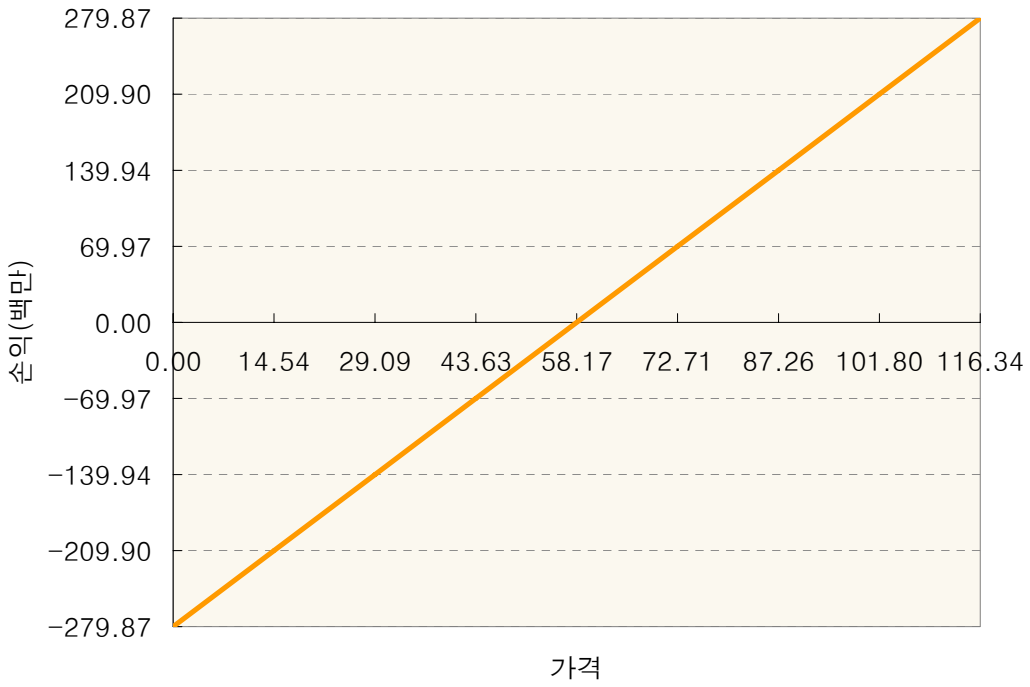
## 2. 만기시점의 손익구조



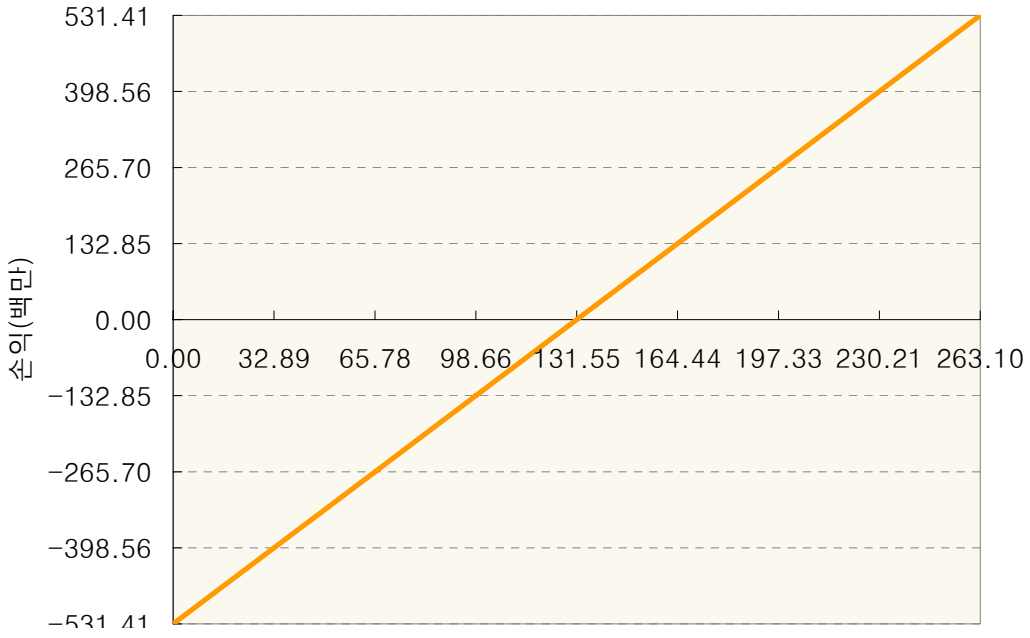



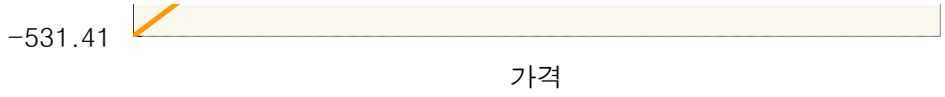



CTK6-COTTON NO.2 FUTR MAY16

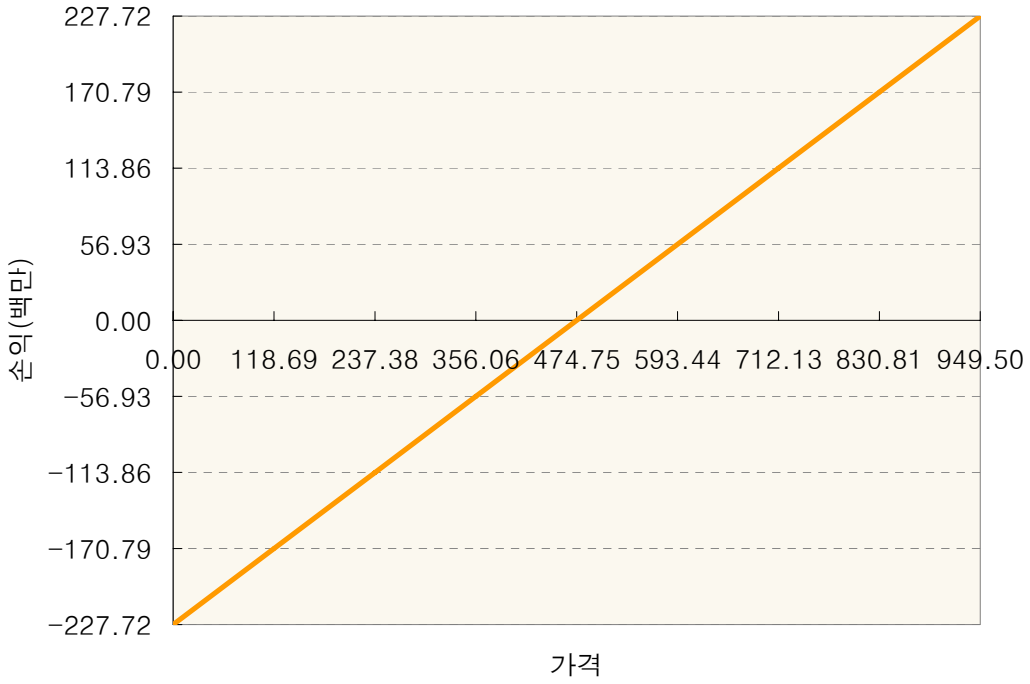



KCK6-COFFEE "C" FUTURE MAY16

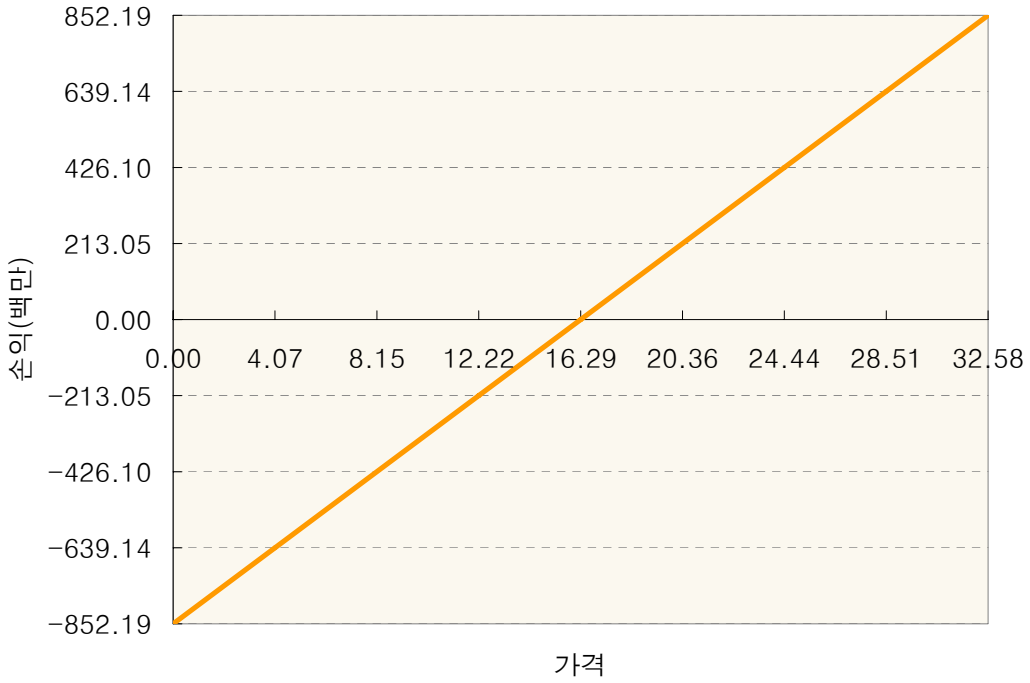




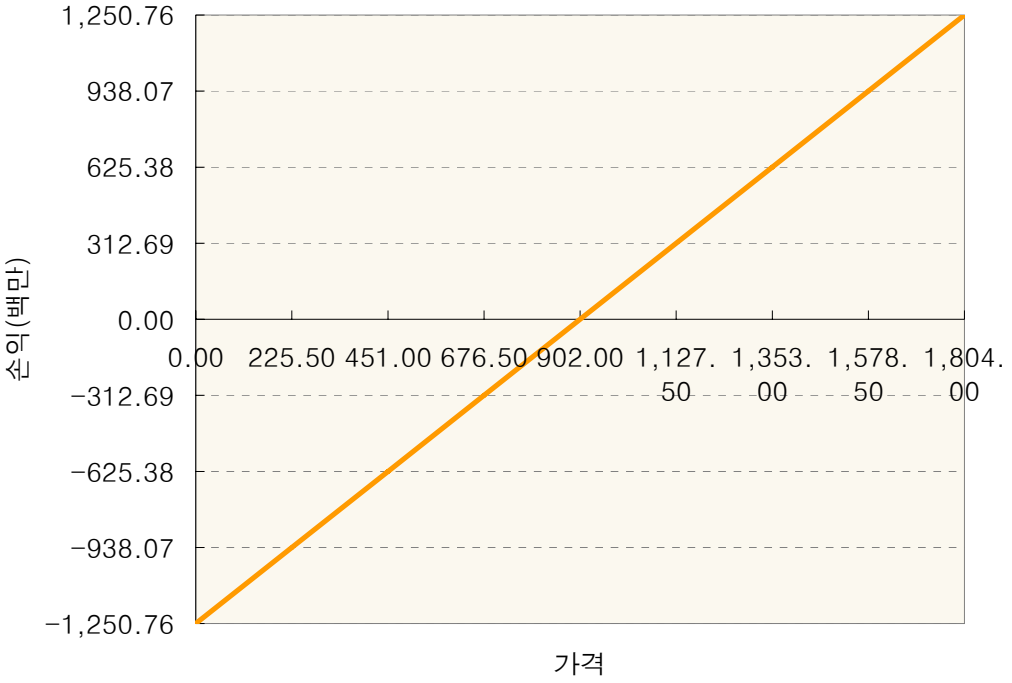

KWK6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16



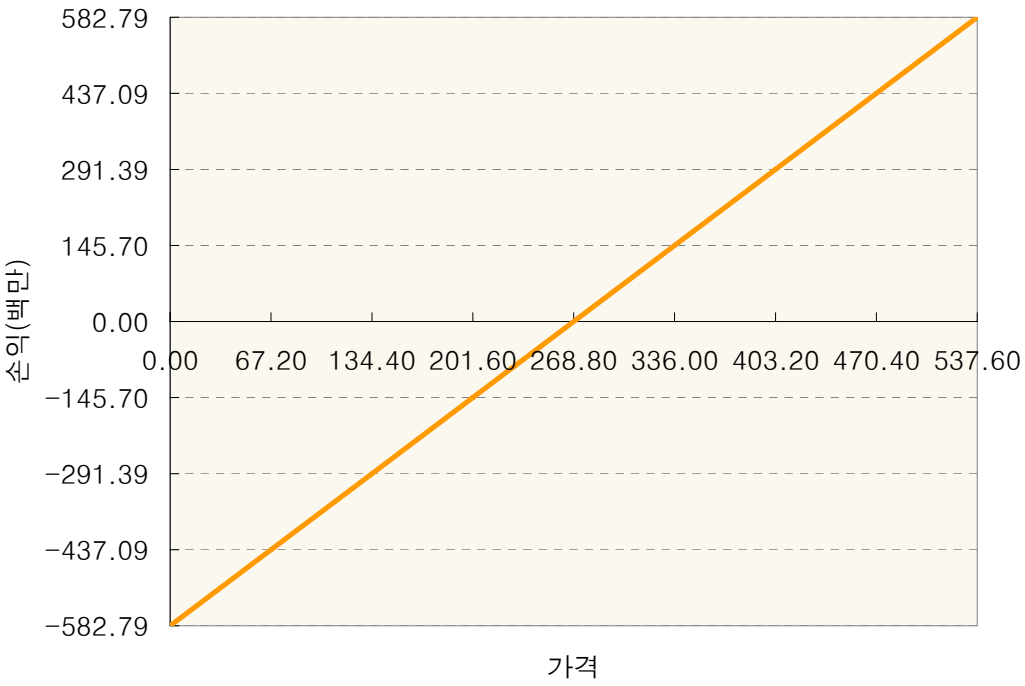

SBK6-Sugar #11 (WORLD) MAY16



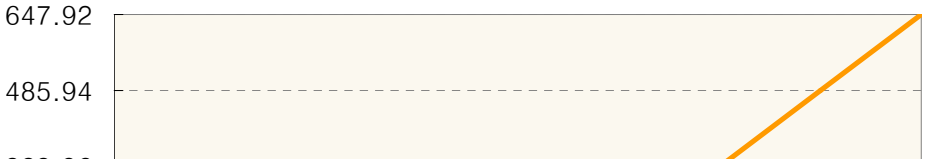

SK6-SOYBEAN FUTURE MAY16

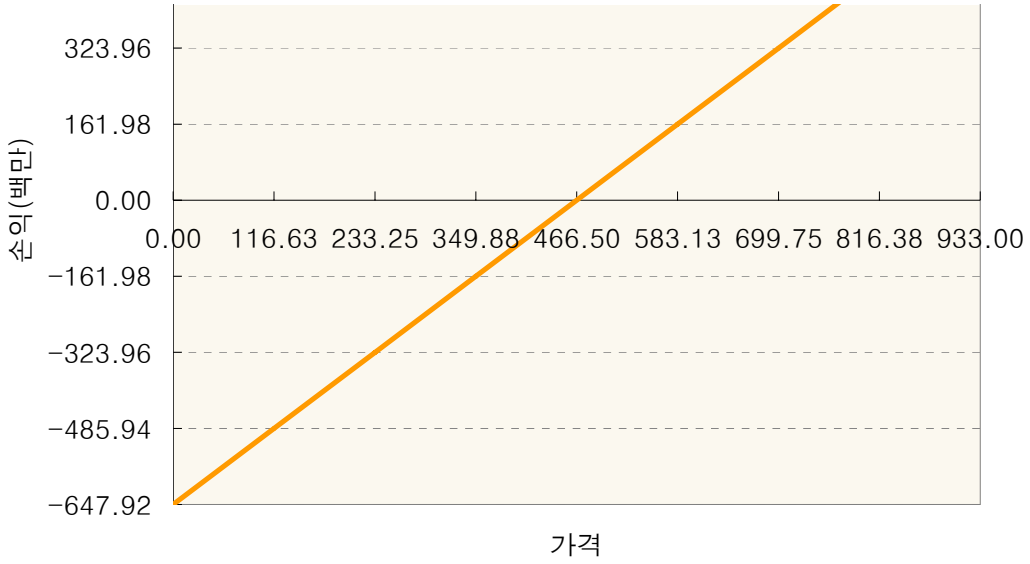



SMK6-SOYBEAN MEAL FUTR MAY16




WK6-WHEAT FUTURE(CBT) MAY16






### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|---|---|---|
| BOK6 | SOYBEAN OIL FUTR MAY16 | 47 |
| CK6 | CORN FUTURE MAY16 | 128 |
| CTK6 | COTTON NO.2 FUTR MAY16 | 22 |
| KCK6 | COFFEE "C" FUTURE MAY16 | 43 |
| KWK6 | KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16 | 18 |
| SBK6 | Sugar #11 (WORLD) MAY16 | 68 |
| SK6 | SOYBEAN FUTURE MAY16 | 100 |
| SMK6 | SOYBEAN MEAL FUTR MAY16 | 47 |
| WK6 | WHEAT FUTURE(CBT) MAY16 | 52 |

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

(단위:백만원)

| |
|---|
| **716** |