공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	2016-04-01
기준일	2016-03-31

스마트인덱스모

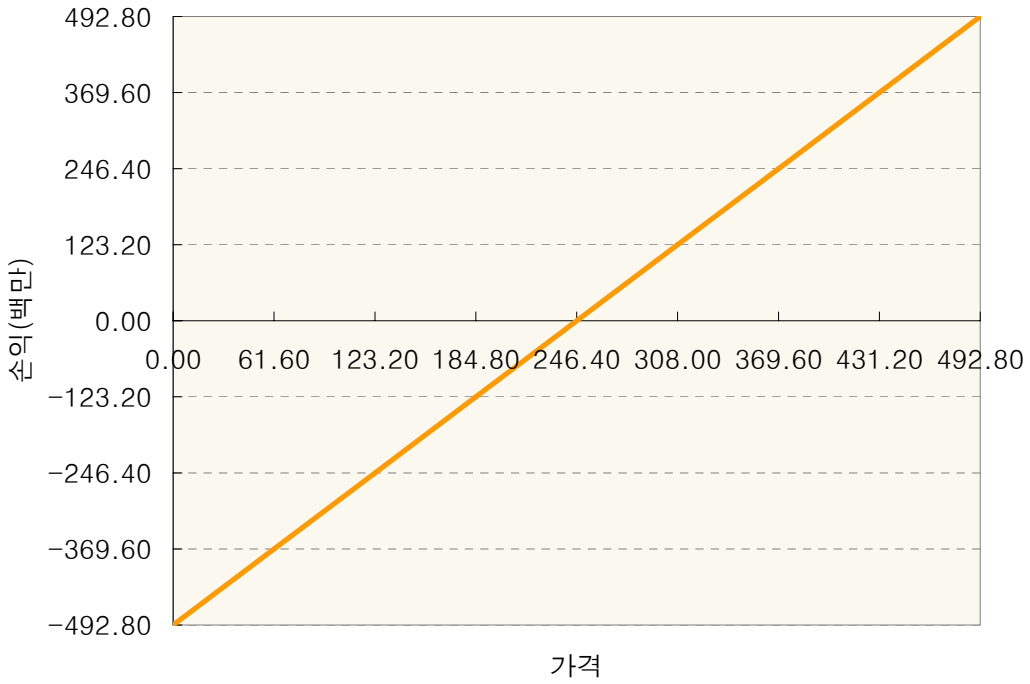
1. 계약금액

(단위:백만원)

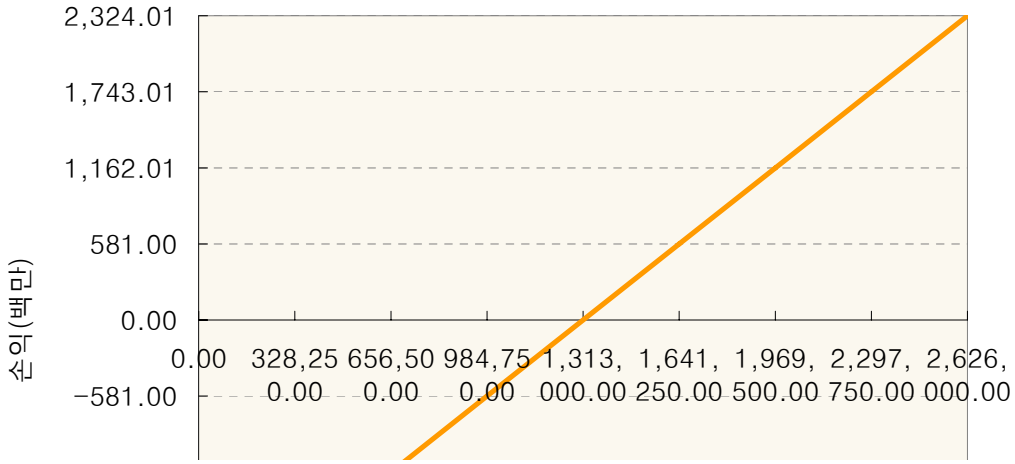
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	131	-131	장내
누계	유가증권	선물	2,817	0	2,817	장내

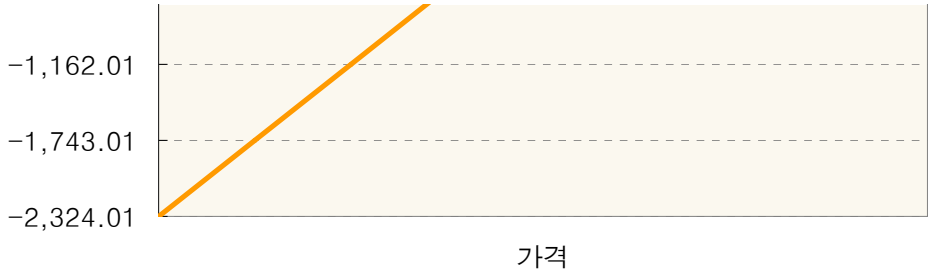
2. 만기시점의 손익구조

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						186
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-5.33%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	62	62	62	62	62	62	62
5.33%	124	124	124	124	124	124	124
8.00%	186	186	186	186	186	186	186

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

(단위:백만원)

209

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

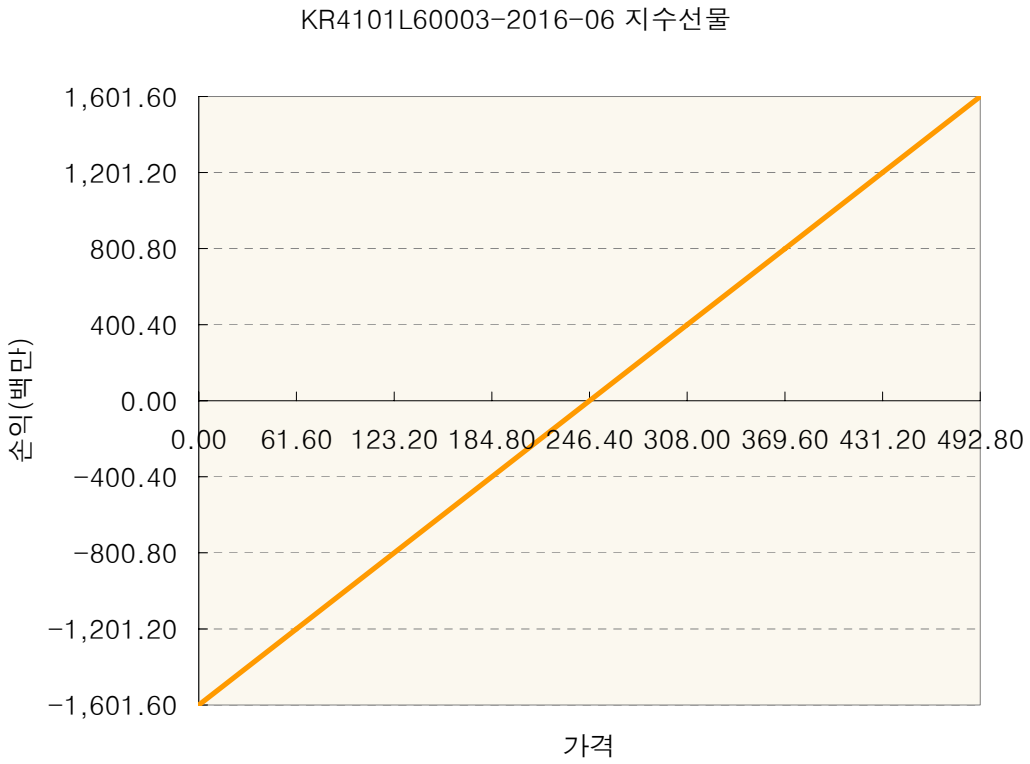
스마트레버리지목표전환형1호

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	2016-04-01
기준일	2016-03-31

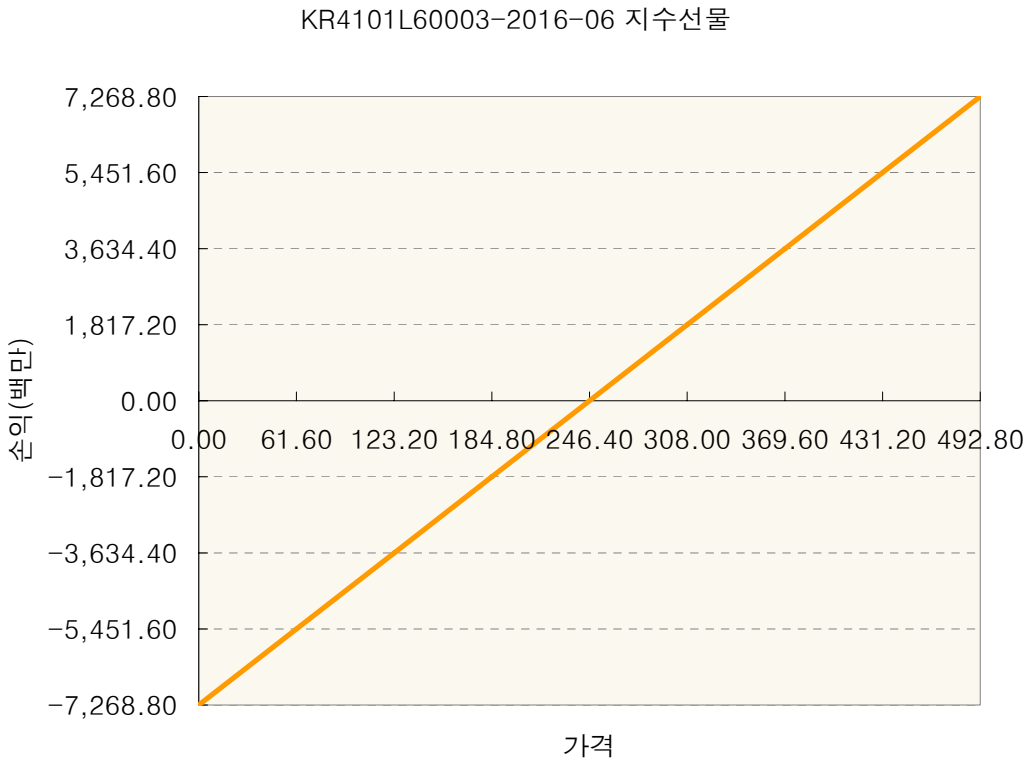
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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 580

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-580	-580	-580	-580	-580	-580	-580
-5.33%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
-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%	387	387	387	387	387	387	387
8.00%	580	580	580	580	580	580	580

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

472

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

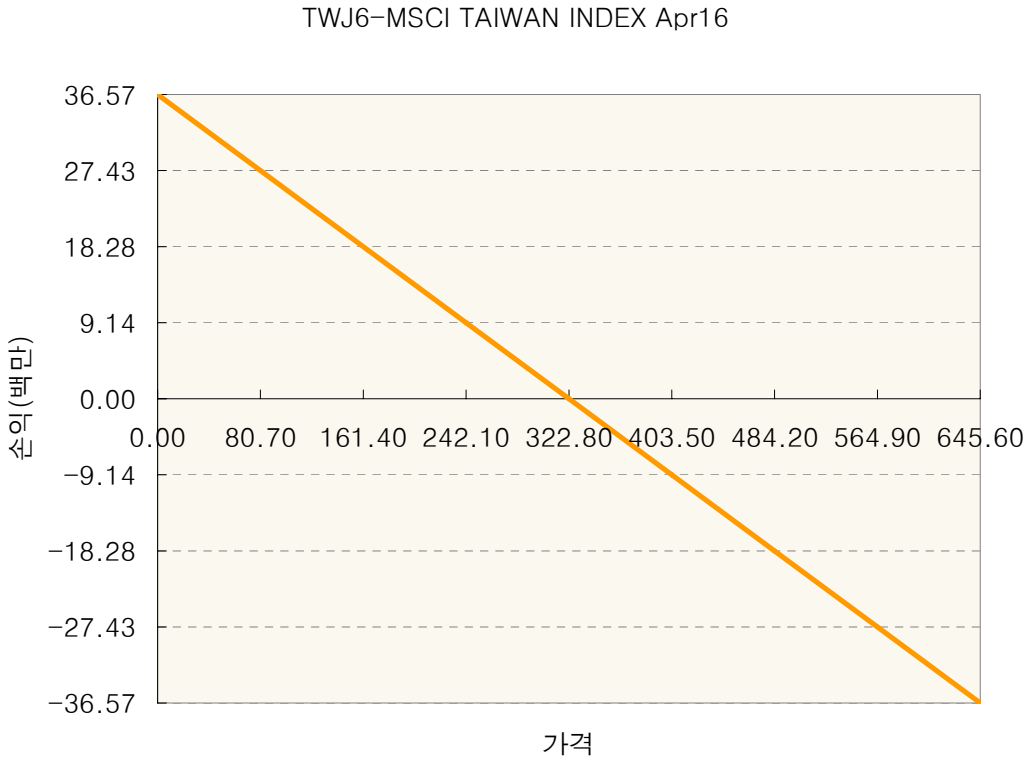
아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

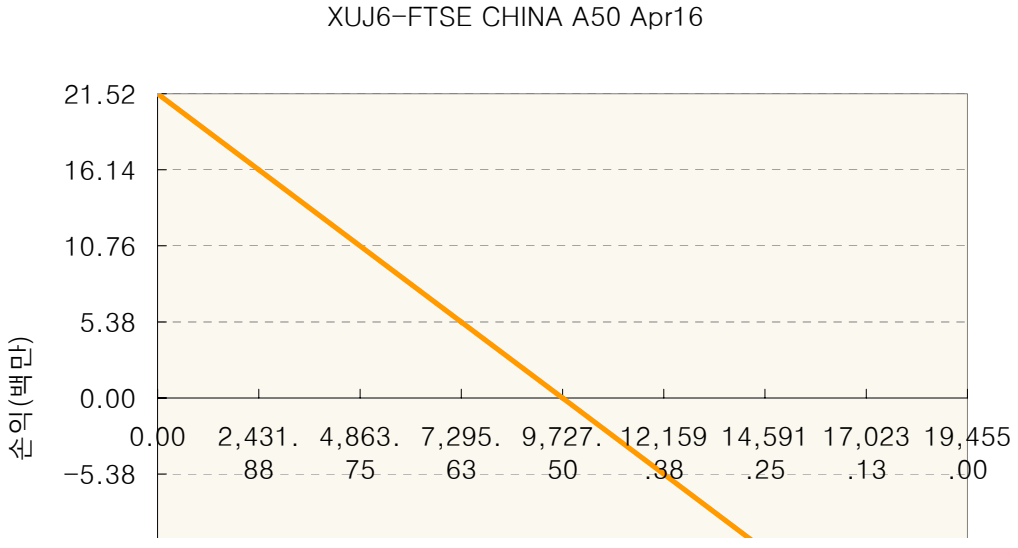
1. 계약금액

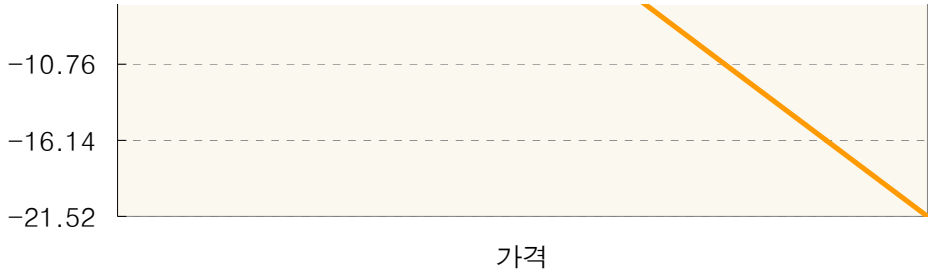
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

TWJ6	MSCI TAIWAN INDEX Apr16	3
XUJ6	FTSE CHINA A50 Apr16	2

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

(단위:백만원)

6

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	841

* 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	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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)

38

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	400
SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1	125

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,566

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

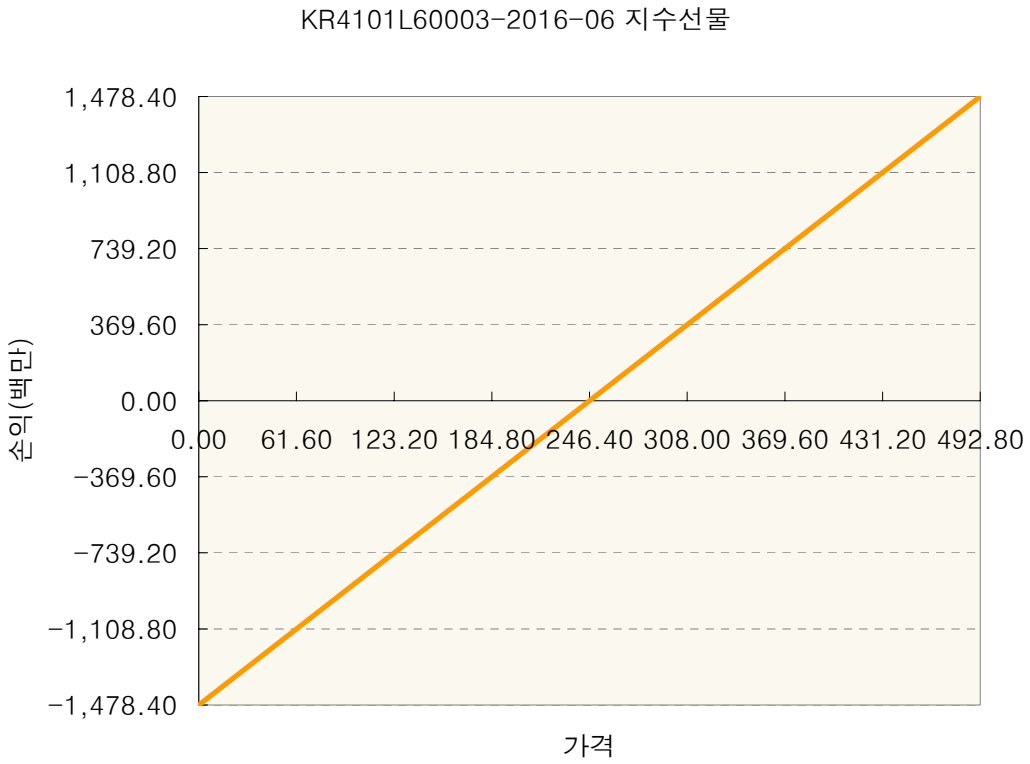
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	1,478	0	1,478	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 118

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	118	118	118	118	118	118	118

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	96

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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)

157

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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

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

(단위:백만원)

618

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	195
KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956	234
KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297	195

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

(단위:백만원)

547

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	134
KR65533446 ELSNH투자증권(ELS)11973	134
KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319	145
KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513	134

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

(단위:백만원)

320

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	121
KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472	112
KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987	112
KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343	112

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

(단위:백만원)

245

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	92
KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170	79
KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036	79
KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359	79

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

(단위:백만원)

177

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	139
KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180	129
KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056	148
KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388	134

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

(단위:백만원)

298

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	134
KR65233676 ELS대우증권(ELS) 15190	133
KR65533526 ELSNH투자증권(ELS) 12077	133
KR65733986 ELS한국투자증권(ELS) 5399	146

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

(단위:백만원)

212

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	146
KR65433166 ELS신영증권플랜업(ELS) 5495	146
KR65533956 ELSNH투자증권(ELS) 12098	153
KR65733AY6 ELS한국투자증권(ELS) 5385	146

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

(단위:백만원)

316

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	247
KR65233306 ELS대우증권(ELS)15315	264
KR65533226 ELSNH투자증권(ELS)12137	288
KR65733066 ELS한국투자증권(ELS)5421	246

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

(단위:백만원)

533

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	365
KR65233776 ELS대우증권(ELS)15342	388
KR65433106 ELS신영증권플랜업(ELS)5516	365
KR65733196 ELS한국투자증권(ELS)5445	365

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

(단위:백만원)

742

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

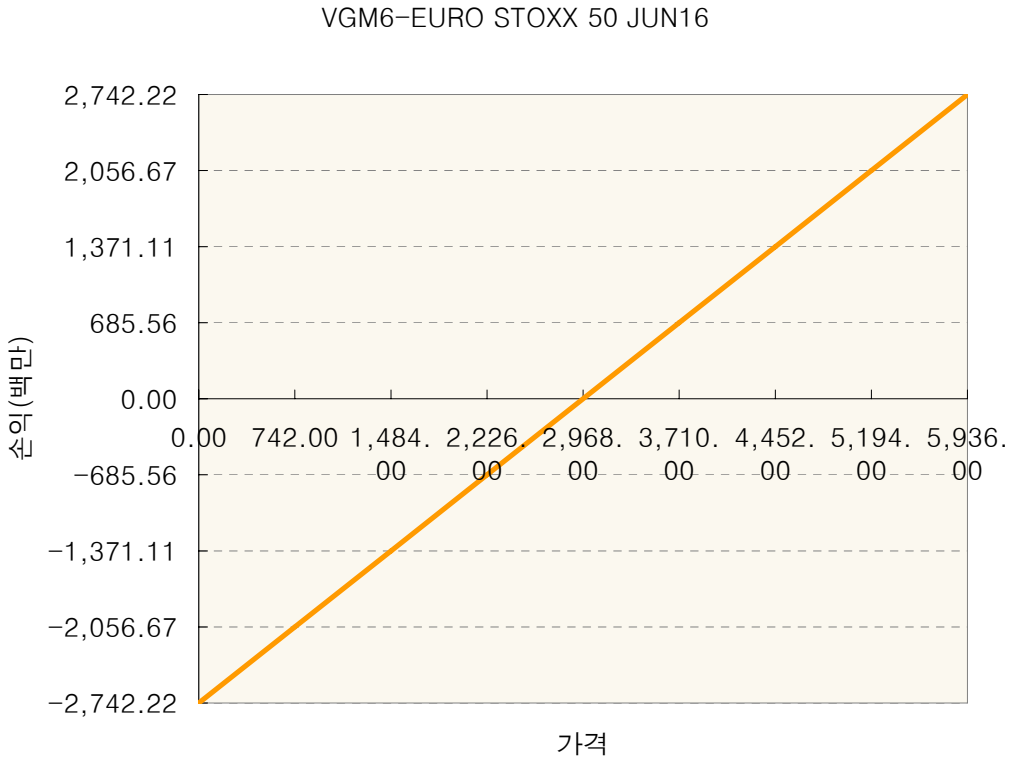
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,742	0	2,742	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 JUN16	219

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

(단위:백만원)

262

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

차이나인덱스모(주식-파생형)

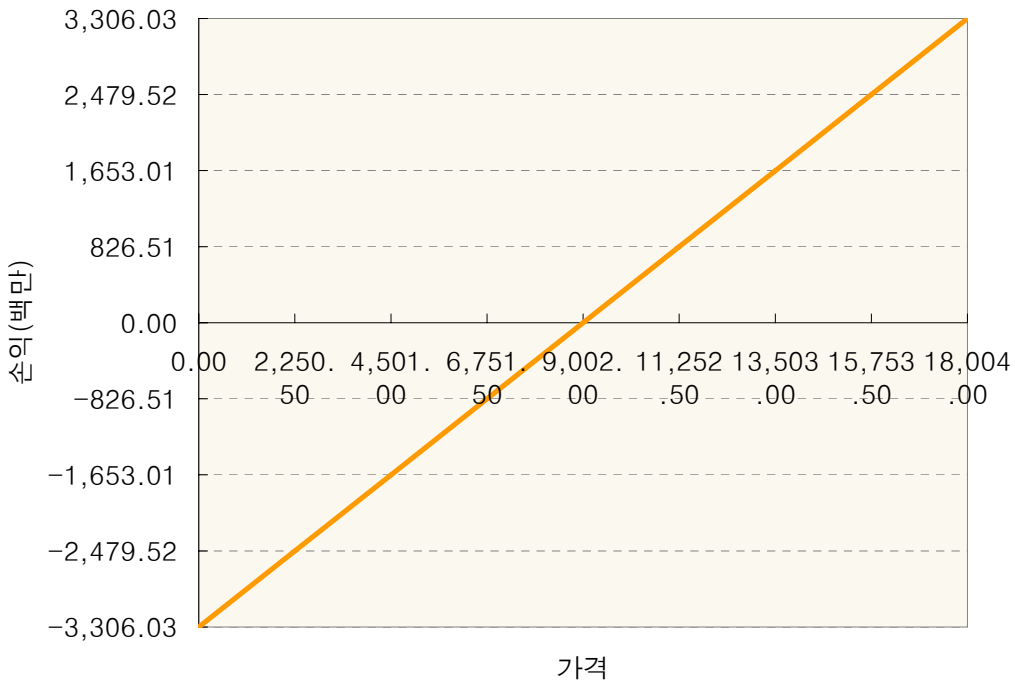
1. 계약금액

(단위:백만원)

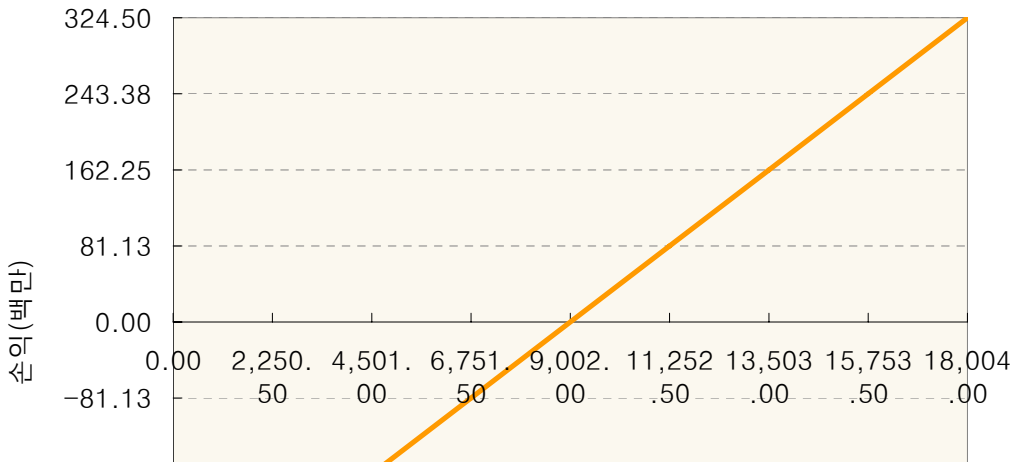
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,631	0	3,631	장내

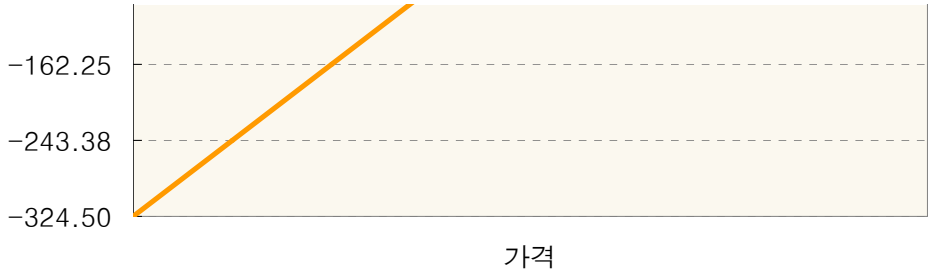
2. 만기시점의 손익구조

HCJ6-H-SHARES IDX FUT APR16



MHCJ6-MINI H-SHR IDX FU APR16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ6	H-SHARES IDX FUT APR16	264
MHCJ6	MINI H-SHR IDX FU APR16	26

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

(단위:백만원)

416

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	492
KR65433236 ELS신영증권플랜업(ELS)5530	578
KR65533A86 ELSNH투자증권(ELS)12195	599
KR65733A46 ELS한국투자증권(ELS)5456	493

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

(단위:백만원)

1,196

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

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	43
KR65733926 ELS한국투자증권(ELS)5432	48
KR67233096 ELS아이비케이증권(ELS)1795	44
KR67733226 ELSKB STAR(ELS)1103	44

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

(단위:백만원)

101

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

KOSPI200지수연계2호(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	2,215	0	2,215	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133AK6 ELS대신증권(ELS)6459	42
KR65433416 ELS신영증권플랜업(ELS)5527	36
KR67233136 ELS아이비케이증권(ELS)1797	36
KR67733456 ELSKB STAR(ELS)1108	36

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

(단위:백만원)

87

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

지수연계미래설계SN-1호(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	476	0	476	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133AY6 ELS대신증권(ELS)6471	14
KR65233BQ6 ELS대우증권(ELS)15376	14
KR65533BE6 ELSNH투자증권(ELS)12232	14
KR65733AH6 ELS한국투자증권(ELS)5477	16

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

(단위:백만원)

28

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

KOSPI200지수연계3호(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	2,601	0	2,601	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133BW(ELS대신증권(ELS)6479	46
KR65433506 ELS신영증권플랜업(ELS)5533	43
KR67233166 ELS아이비케이증권(ELS)1802	44
KR67733656 ELSKB STAR(ELS)1113	44

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

(단위:백만원)

102

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

지수연계미래설계SN-2호(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	1,198	0	1,198	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133BX6 ELS대신증권(ELS) 6480	31
KR65233BZ6 ELS대우증권(ELS) 15382	38
KR65533BN6 ELSNH투자증권(ELS) 12276	34
KR65733CX6 ELS한국투자증권(ELS) 5492	41

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

(단위:백만원)

69

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

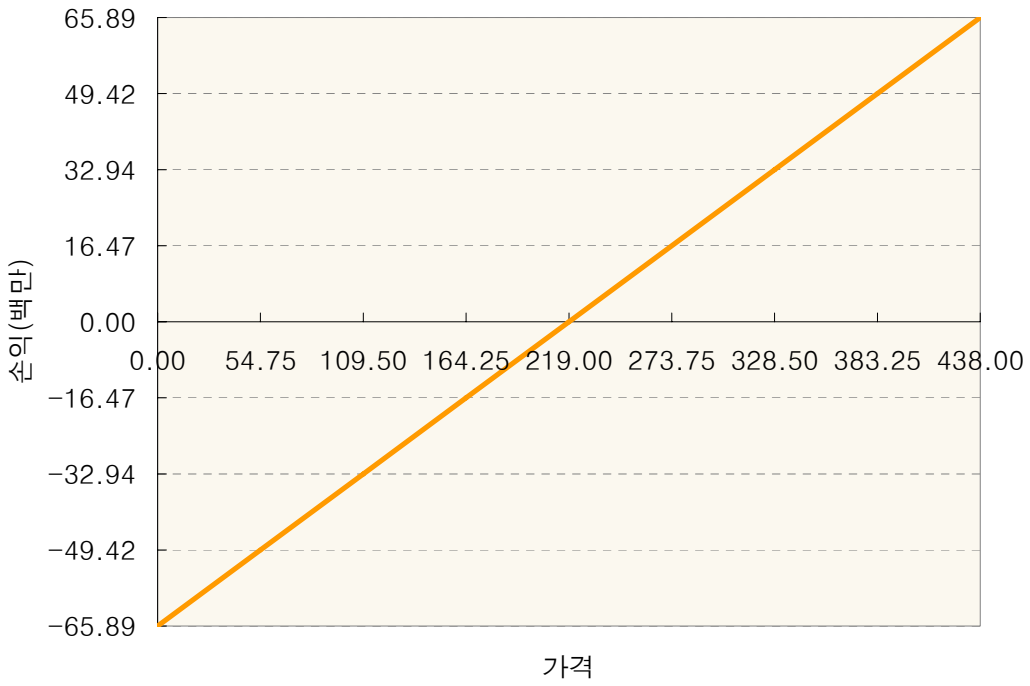
1. 계약금액

(단위:백만원)

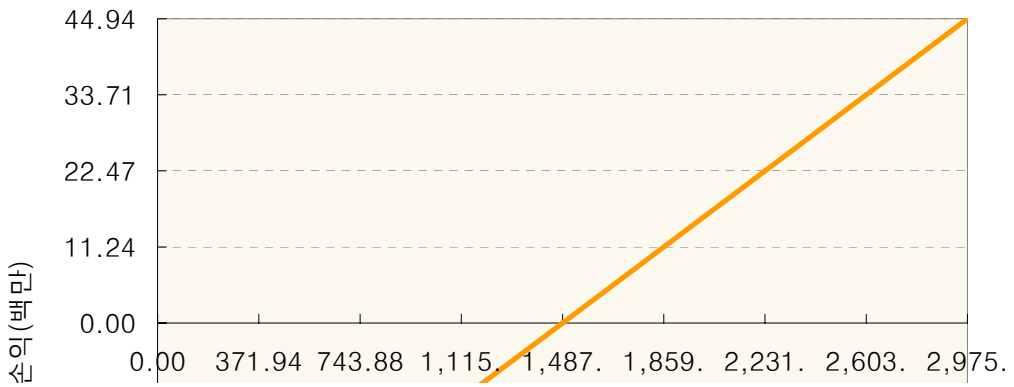
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	55	0	55	
누계	유가증권	선물	306	0	306	

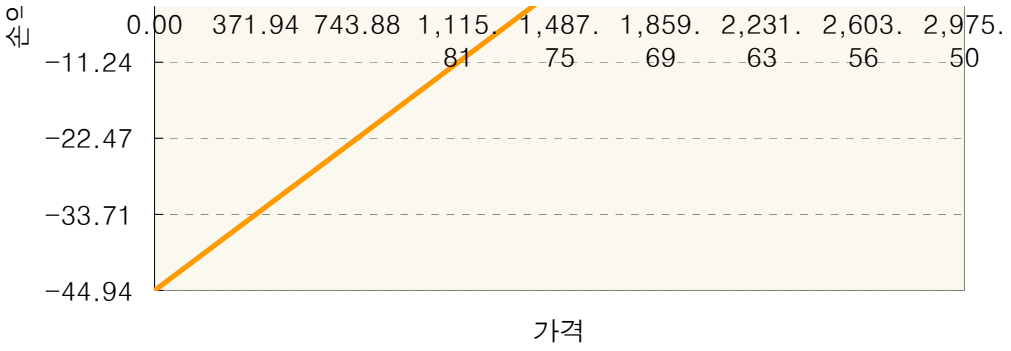
2. 만기시점의 손익구조

HGK6-COPPER FUTURE MAY16

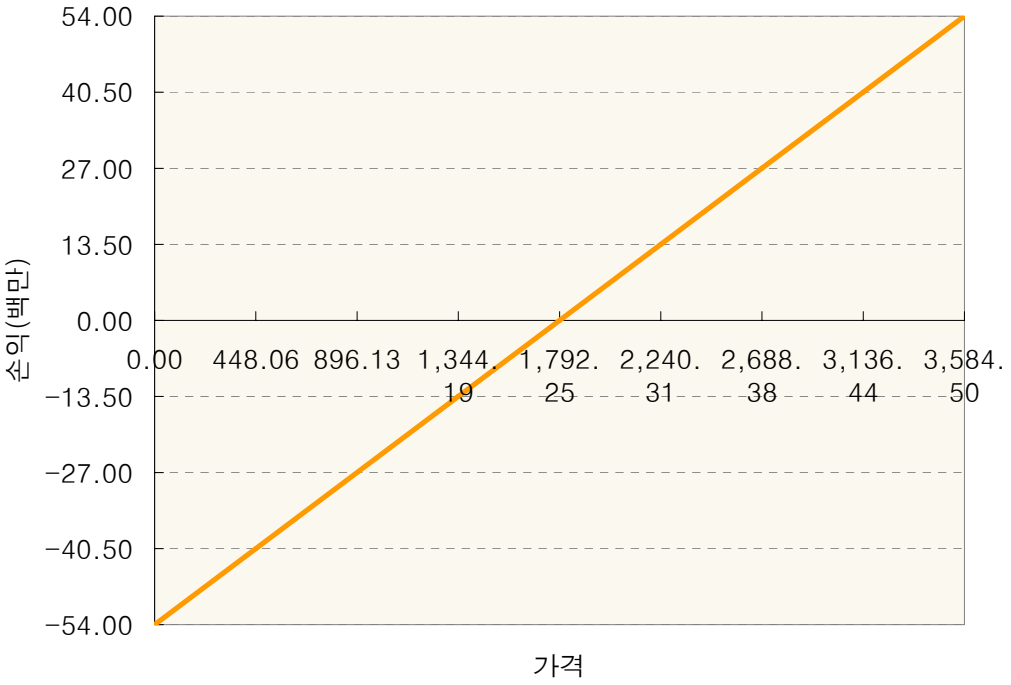


LAK6-LME PRI ALUM FUTR MAY16

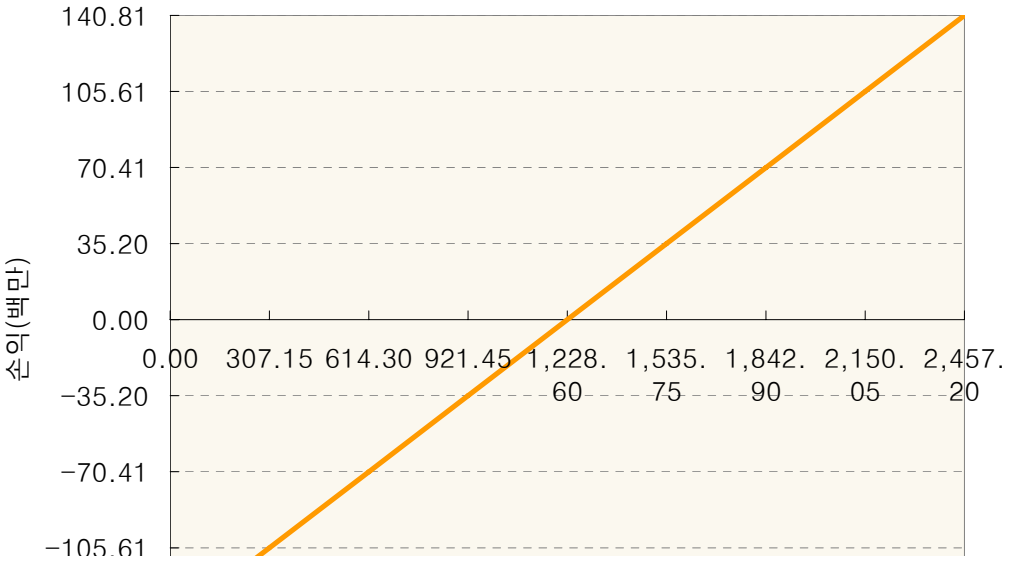


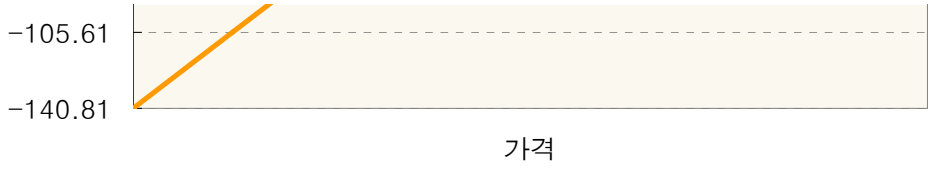


LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16

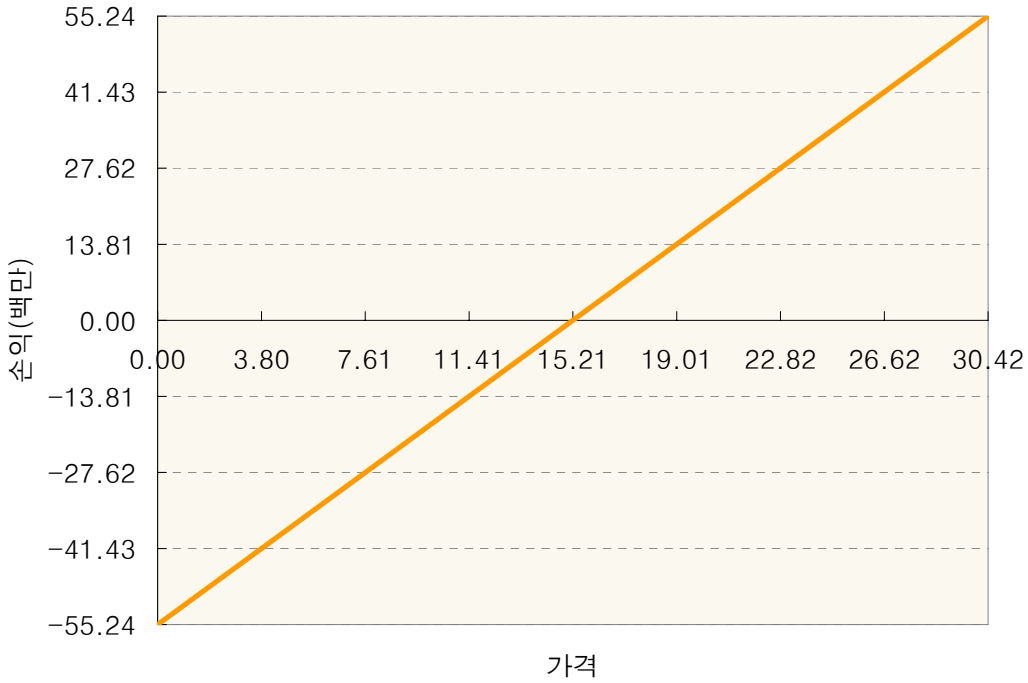


XGM6-MINI GOLD FUTURE JUN16





YSK6-MINI SILVER FUT MAY16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGK6	COPPER FUTURE MAY16	5
LAK6	LME PRI ALUM FUTR MAY16	4
LXK6	LME ZINC FUTURE MAY16	4
XGM6	MINI GOLD FUTURE JUN16	11
YSK6	MINI SILVER FUT MAY16	4

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

(단위:백만원)

30

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

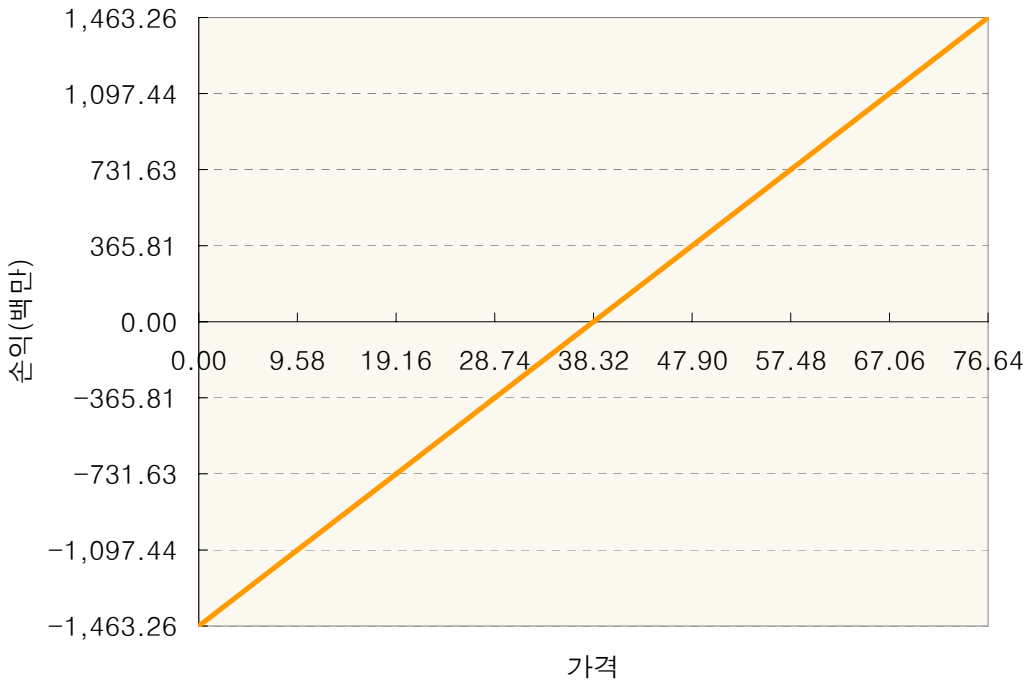
1. 계약금액

(단위:백만원)

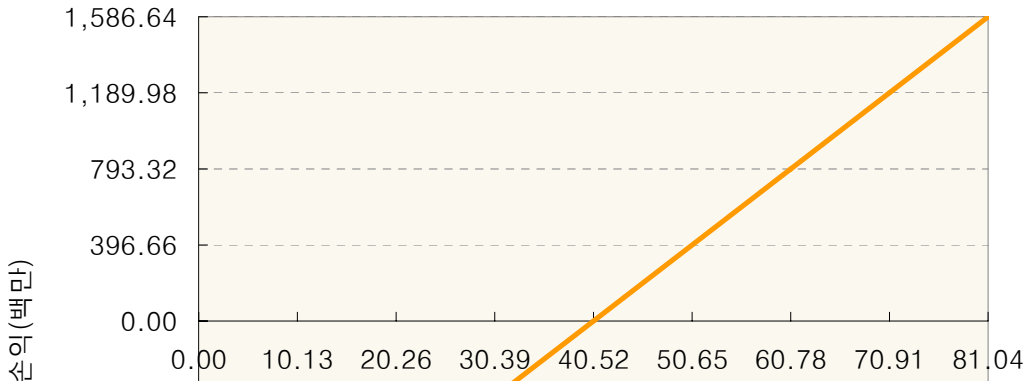
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,463	0	1,463	
누계	유가증권	선물	4,355	0	4,355	

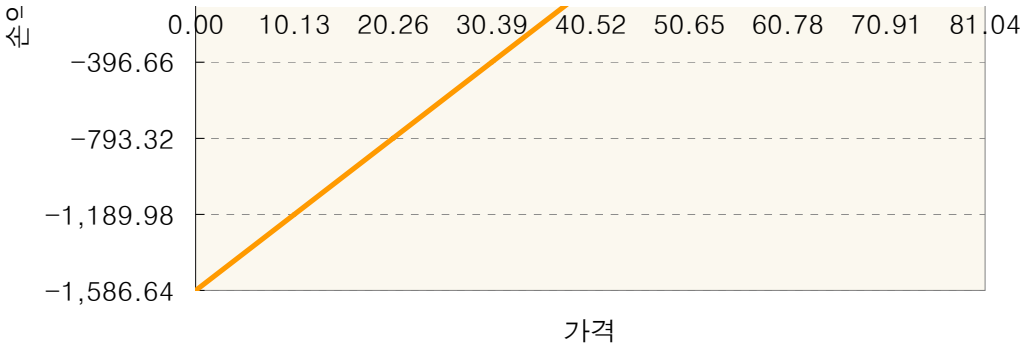
2. 만기시점의 손익구조

CLK6-WTI CRUDE FUTURE MAY16

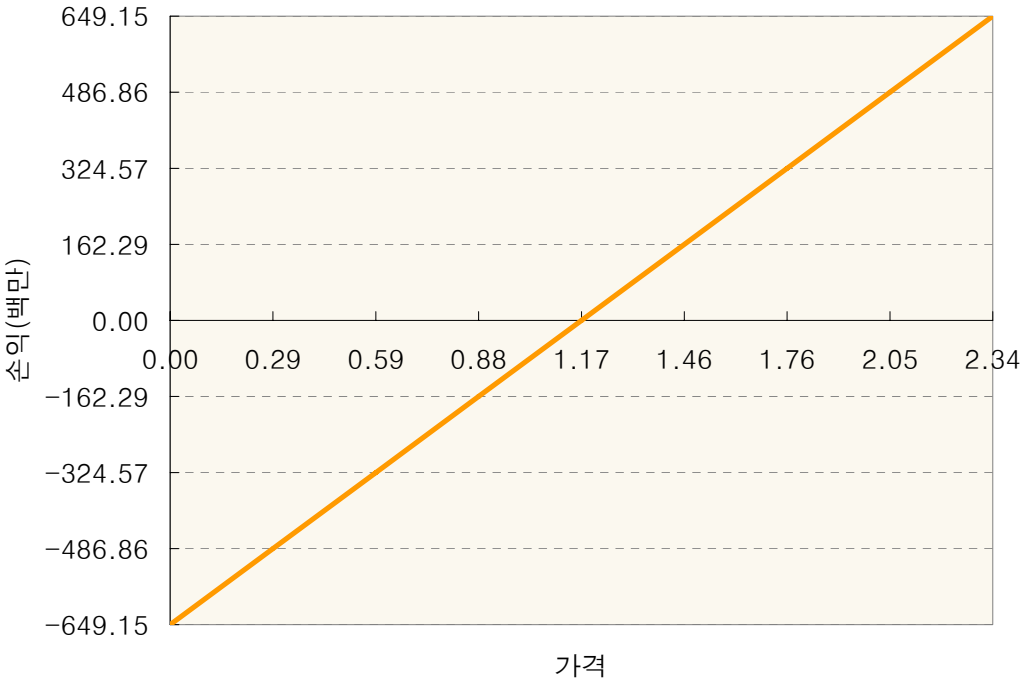


CON6-BRENT CRUDE FUTR JUL16

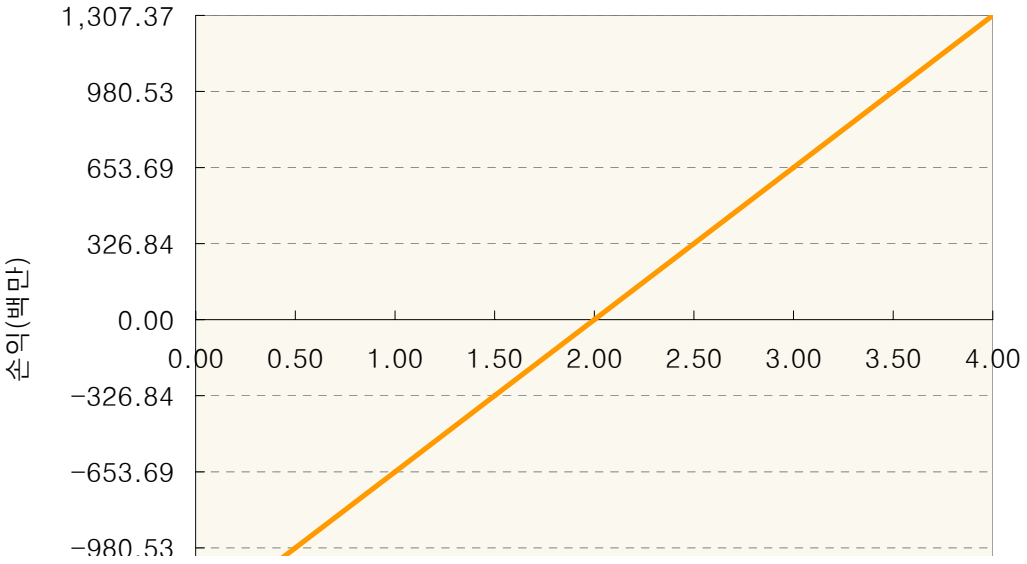


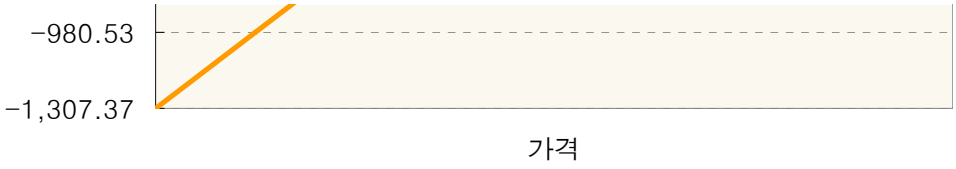


HOK6-NY Harb ULSD Fut MAY16

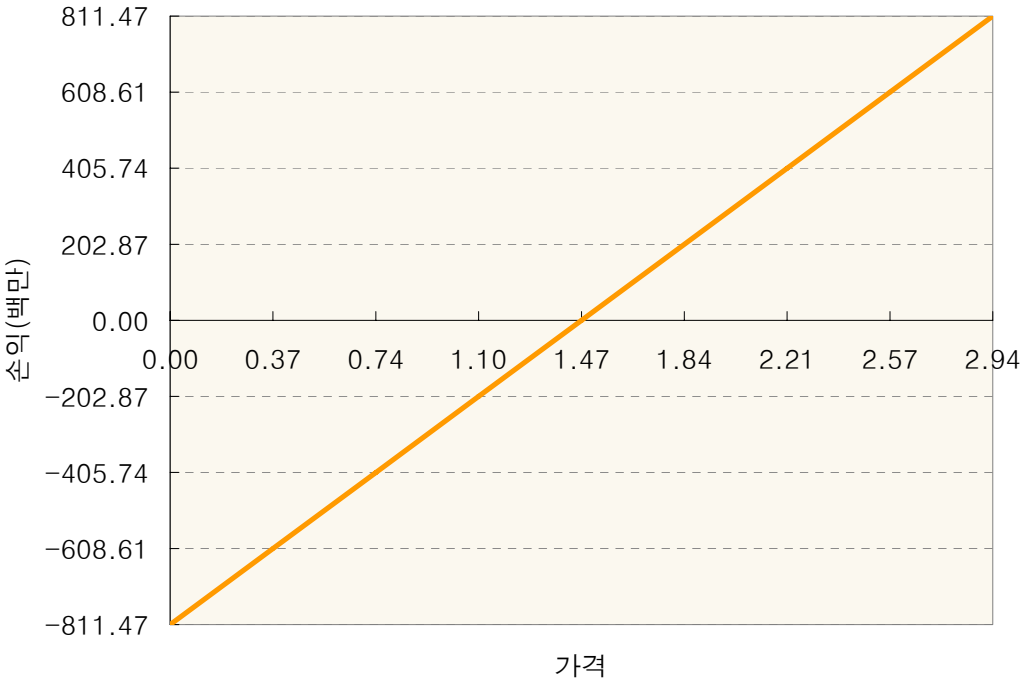


NGK6-NATURAL GAS FUTR MAY16





XBK6-GASOLINE RBOB FUT MAY16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK6	WTI CRUDE FUTURE MAY16	117
CON6	BRENT CRUDE FUTR JUL16	127
HOK6	NY Harb ULSD Fut MAY16	52
NGK6	NATURAL GAS FUTR MAY16	105
XBK6	GASOLINE RBOB FUT MAY16	65

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

(단위:백만원)

1,264

공시일	2016-04-01
기준일	2016-03-31

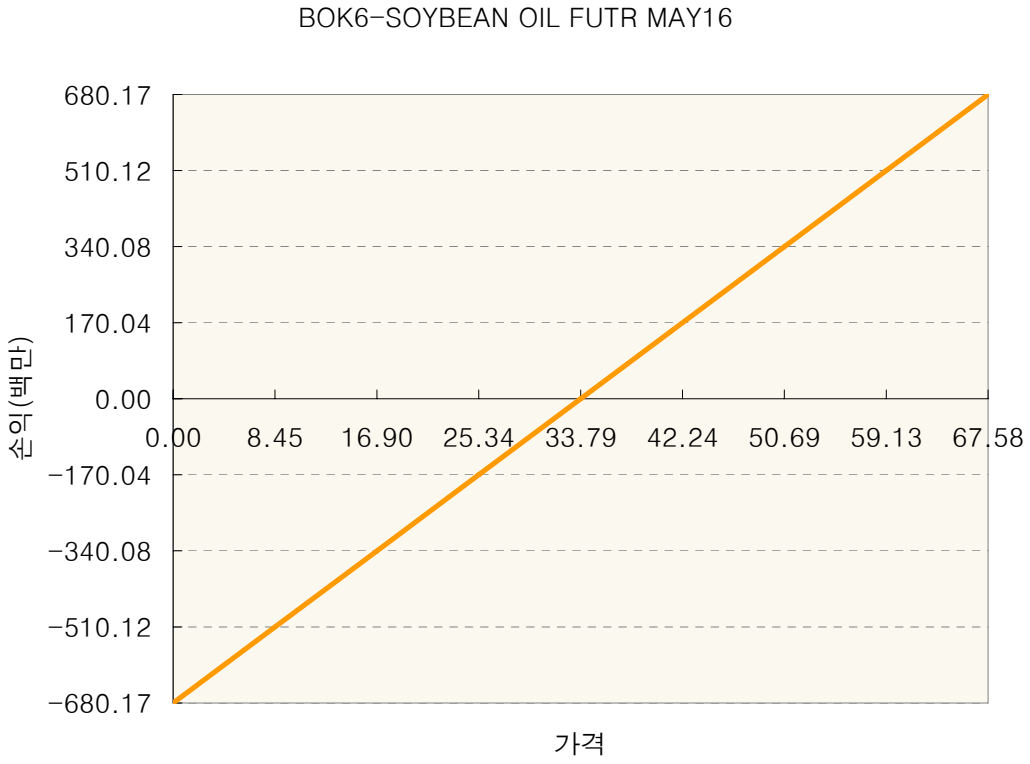
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

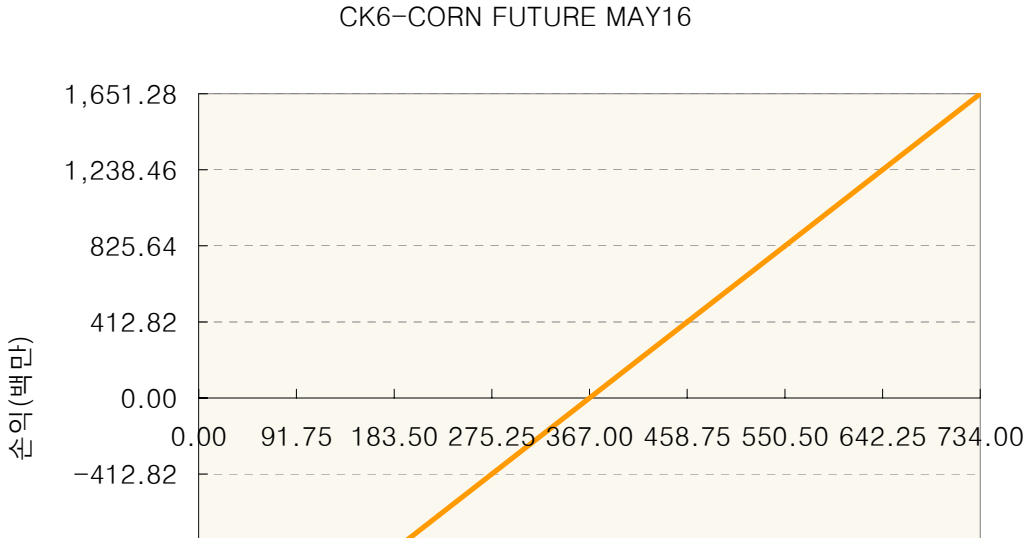
1. 계약금액

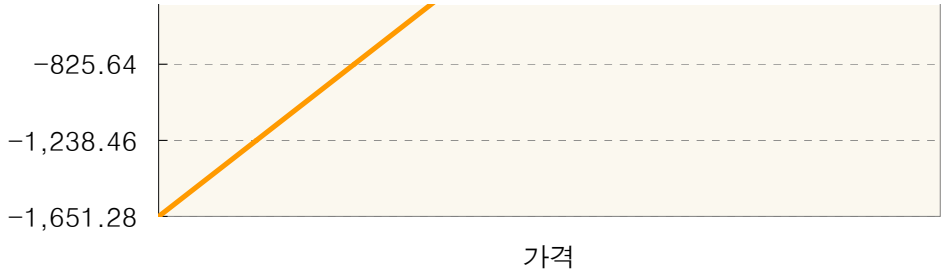
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,824	0	6,824	

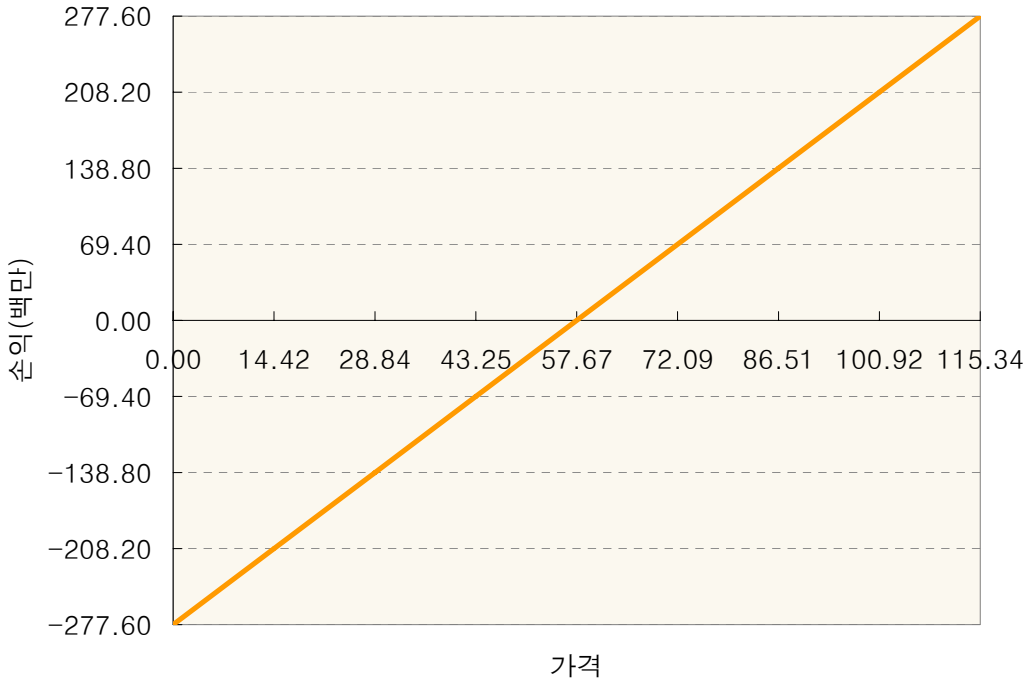
2. 만기시점의 손익구조



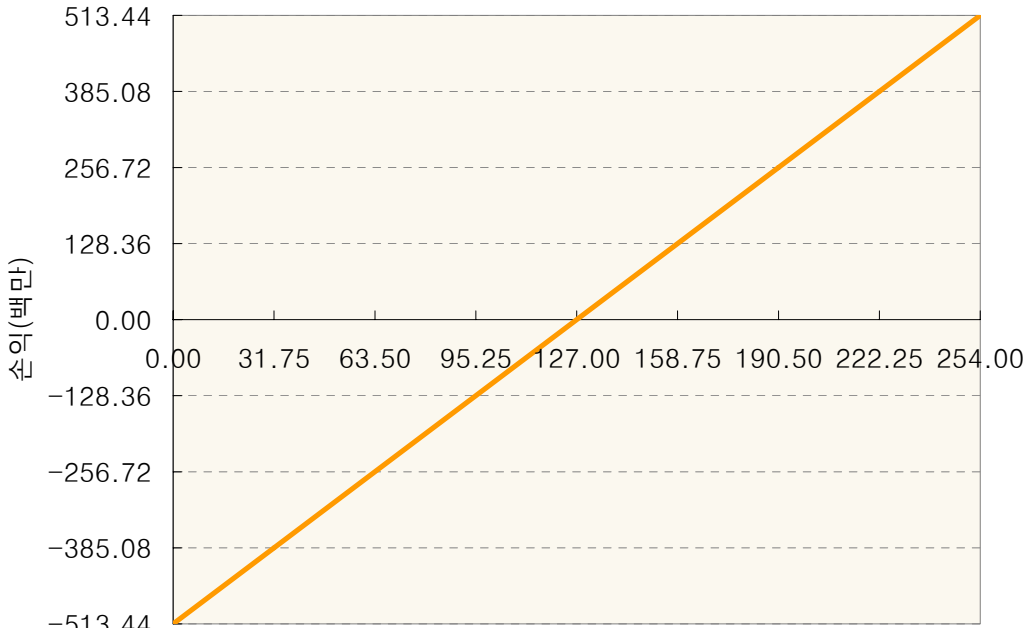


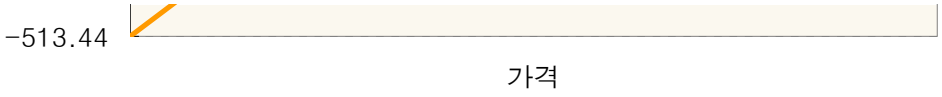


CTK6-COTTON NO.2 FUTR MAY16

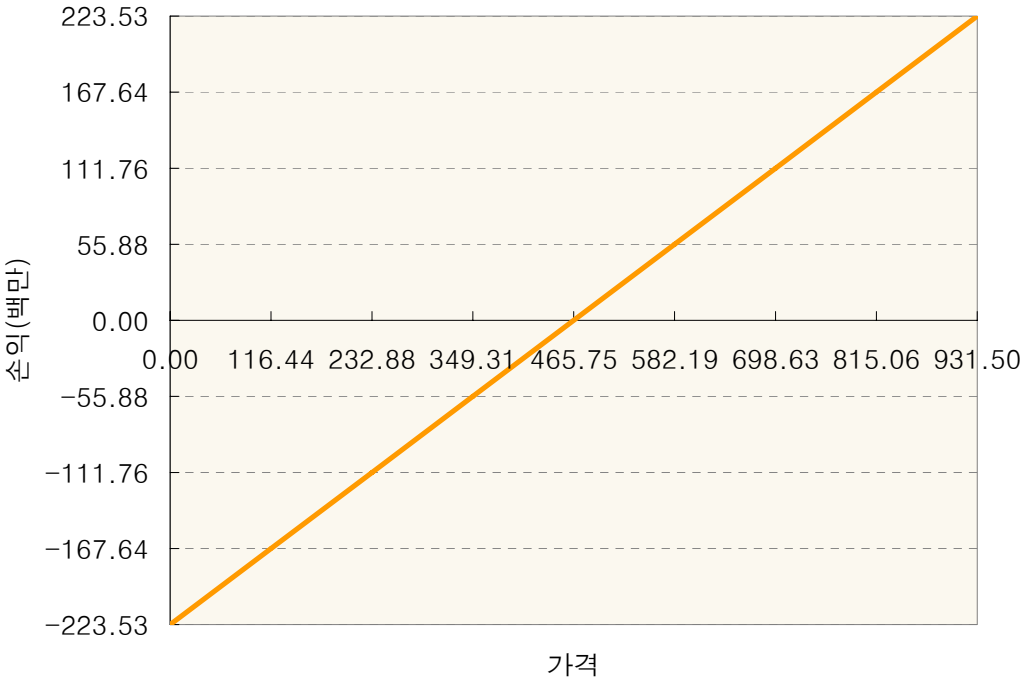


KCK6-COFFEE "C" FUTURE MAY16

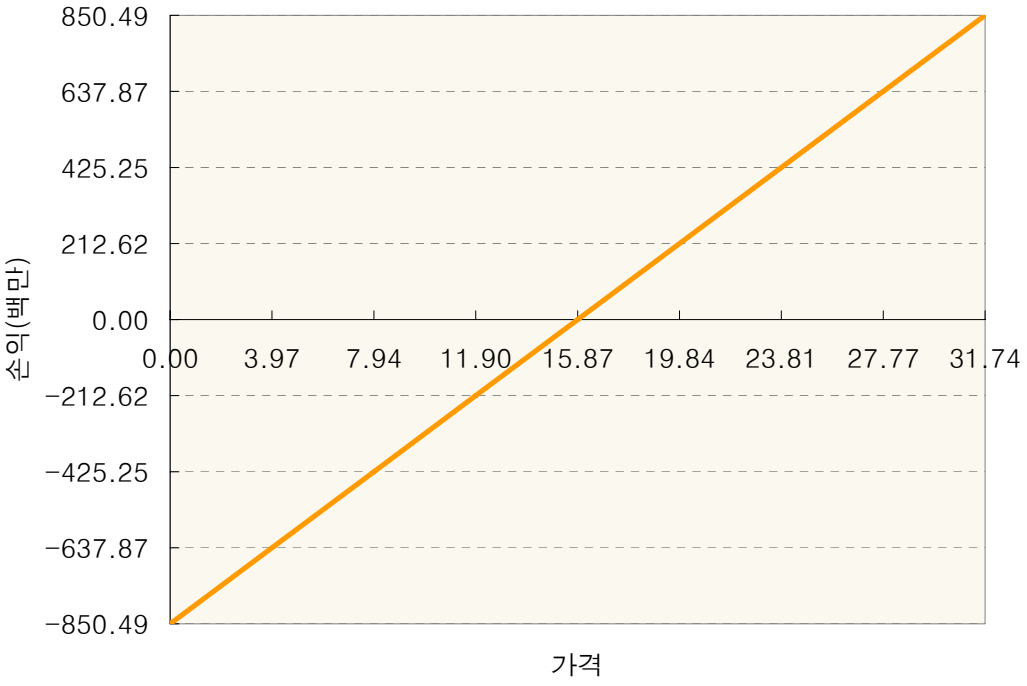




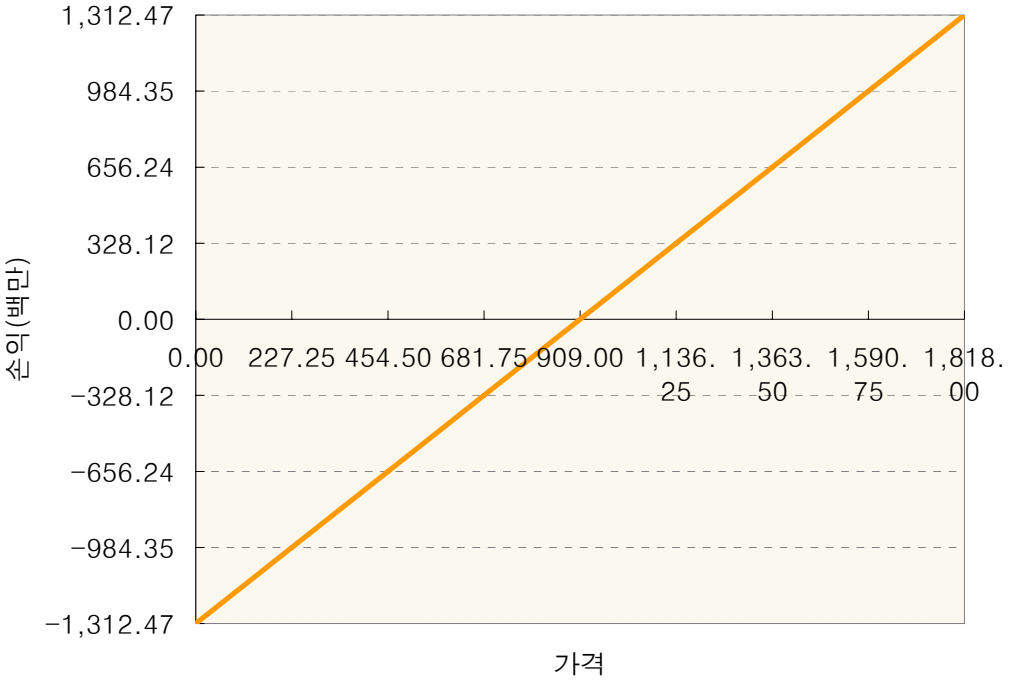
KWK6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16



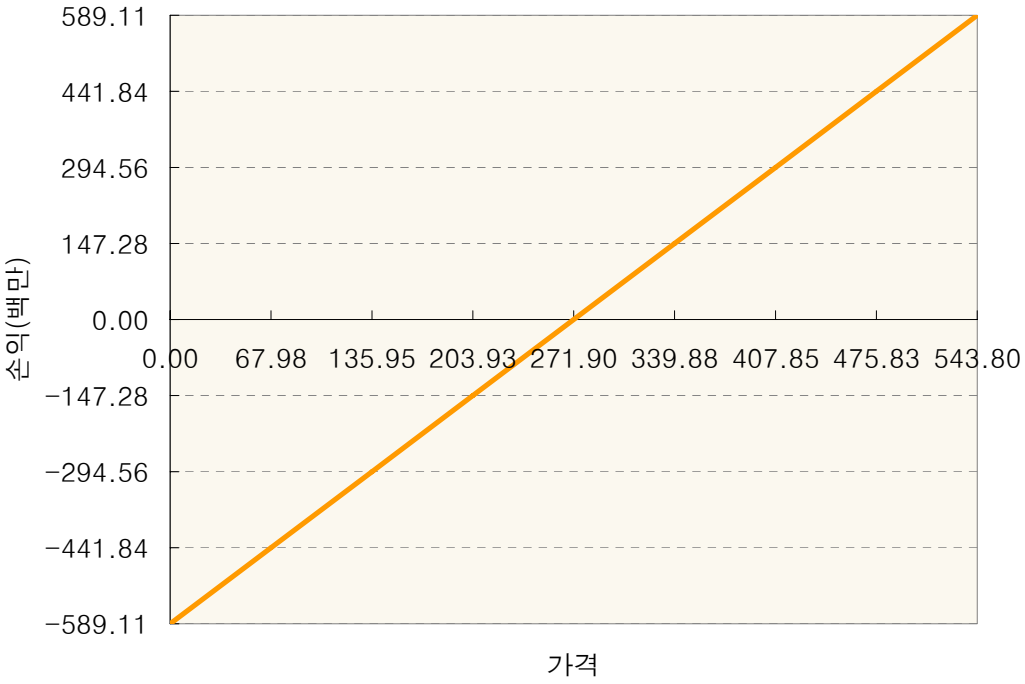
SBK6-Sugar #11 (WORLD) MAY16



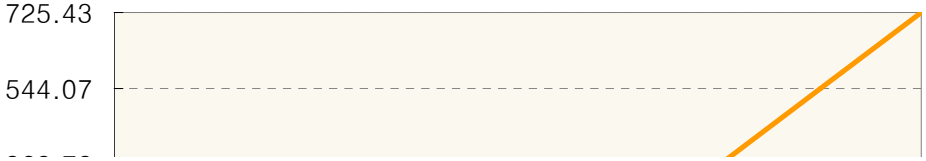
SK6-SOYBEAN FUTURE MAY16

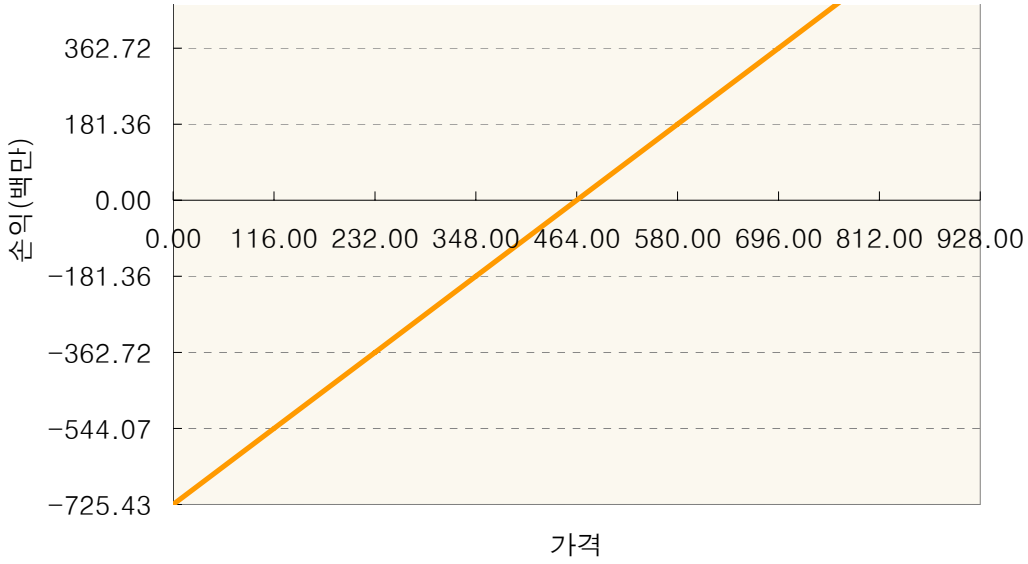


SMK6-SOYBEAN MEAL FUTR MAY16



WK6-WHEAT FUTURE(CBT) MAY16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK6	SOYBEAN OIL FUTR MAY16	54
CK6	CORN FUTURE MAY16	132
CTK6	COTTON NO.2 FUTR MAY16	22
KCK6	COFFEE "C" FUTURE MAY16	41
KWK6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16	18
SBK6	Sugar #11 (WORLD) MAY16	68
SK6	SOYBEAN FUTURE MAY16	105
SMK6	SOYBEAN MEAL FUTR MAY16	47
WK6	WHEAT FUTURE(CBT) MAY16	58

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

(단위:백만원)

739