공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	2016-04-08
기준일	2016-04-07

스마트인덱스모

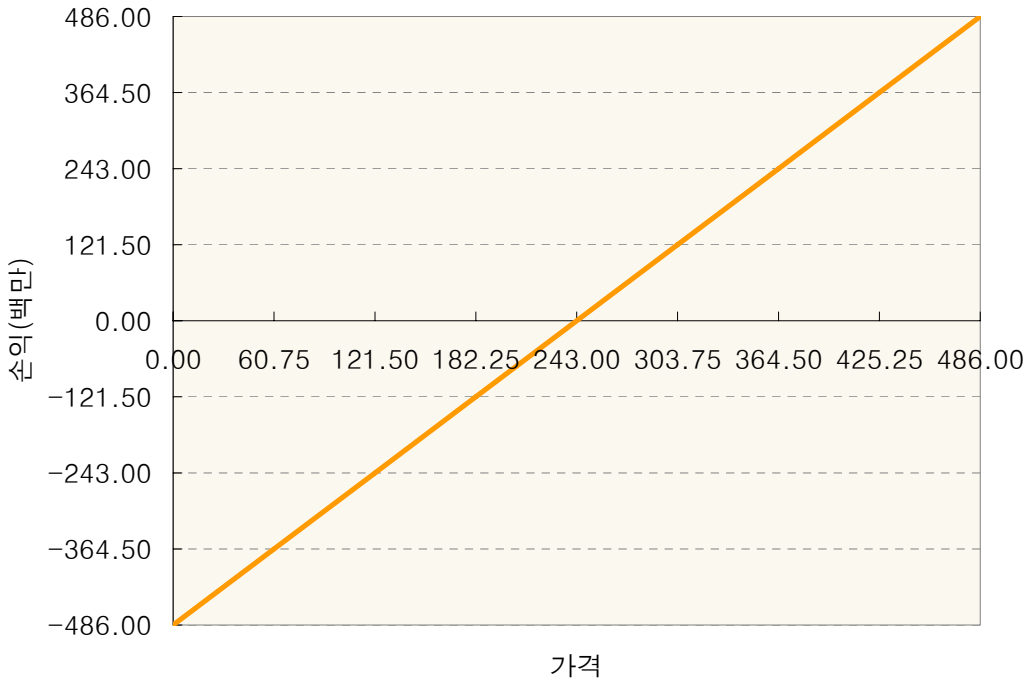
1. 계약금액

(단위:백만원)

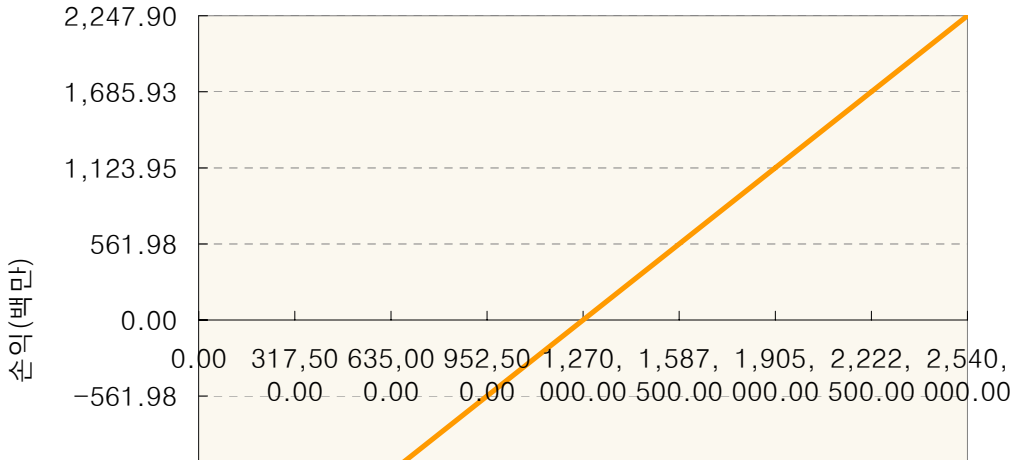
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,734	0	2,734	장내

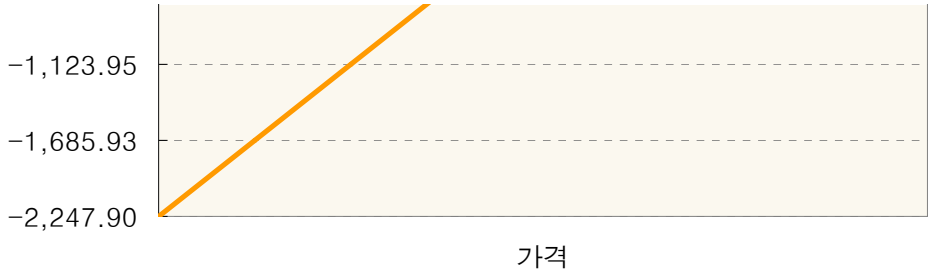
2. 만기시점의 손익구조

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						180
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
-5.33%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	120	120	120	120	120	120	120
8.00%	180	180	180	180	180	180	180

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

(단위:백만원)

206

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

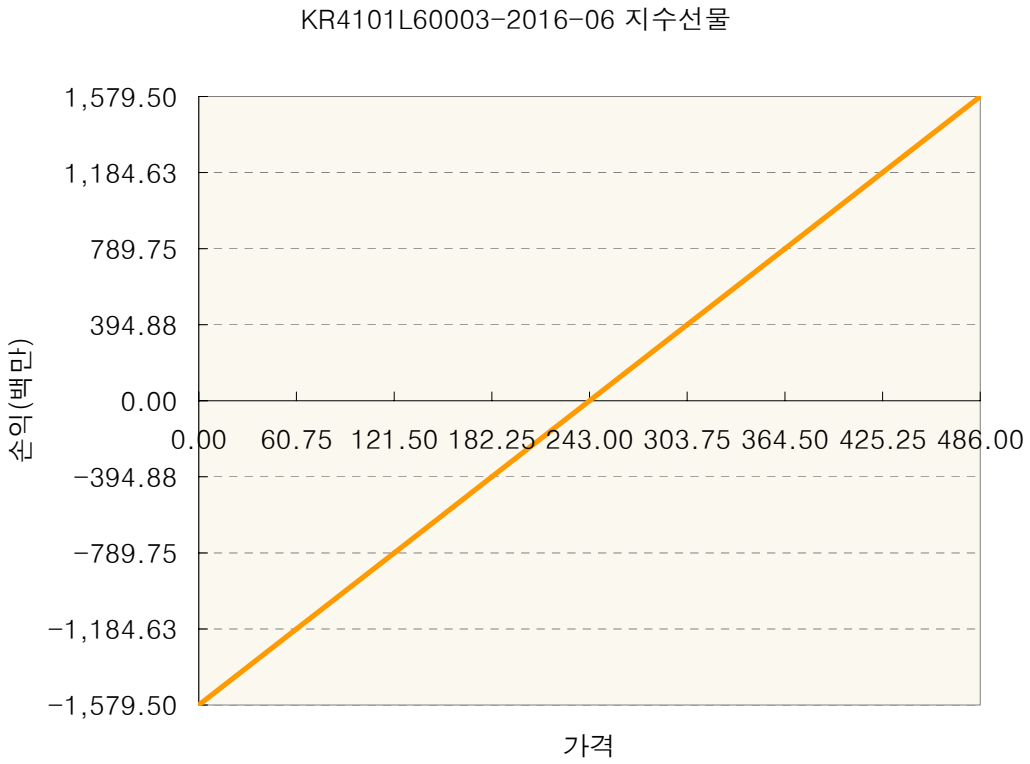
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,580	0	1,580	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 126

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-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%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	126	126	126	126	126	126	126

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

103

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

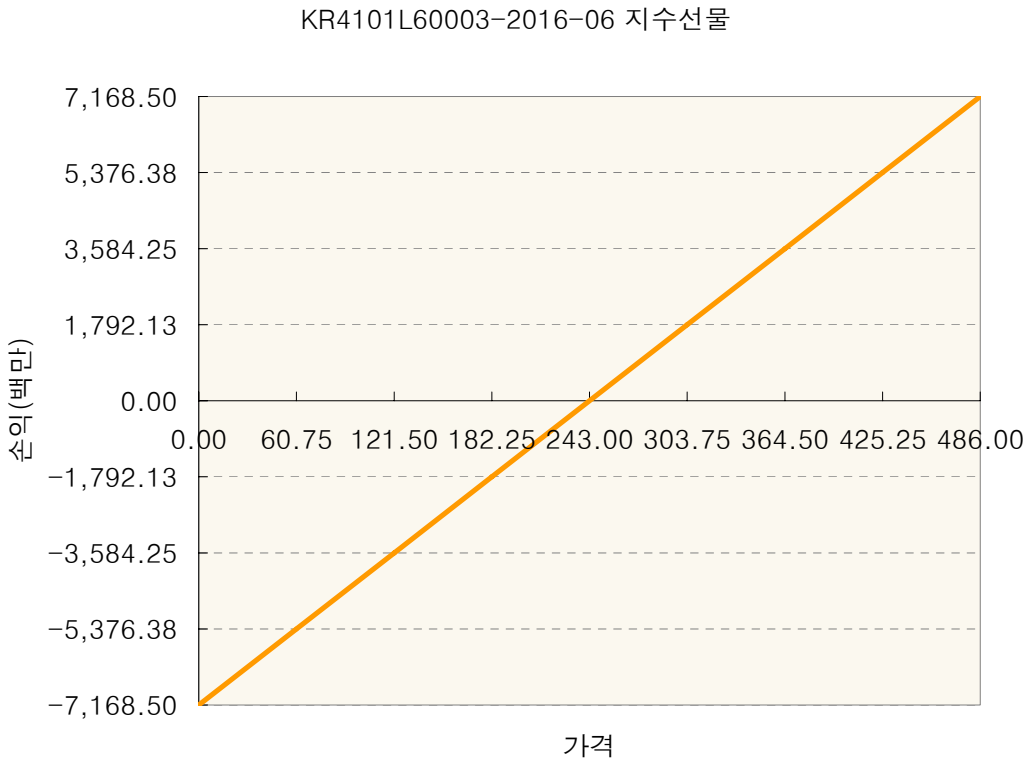
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

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	7,169	0	7,169	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 572

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572
-5.33%	-381	-381	-381	-381	-381	-381	-381
-2.67%	-191	-191	-191	-191	-191	-191	-191
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	191	191	191	191	191	191	191
5.33%	381	381	381	381	381	381	381
8.00%	572	572	572	572	572	572	572

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

467

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

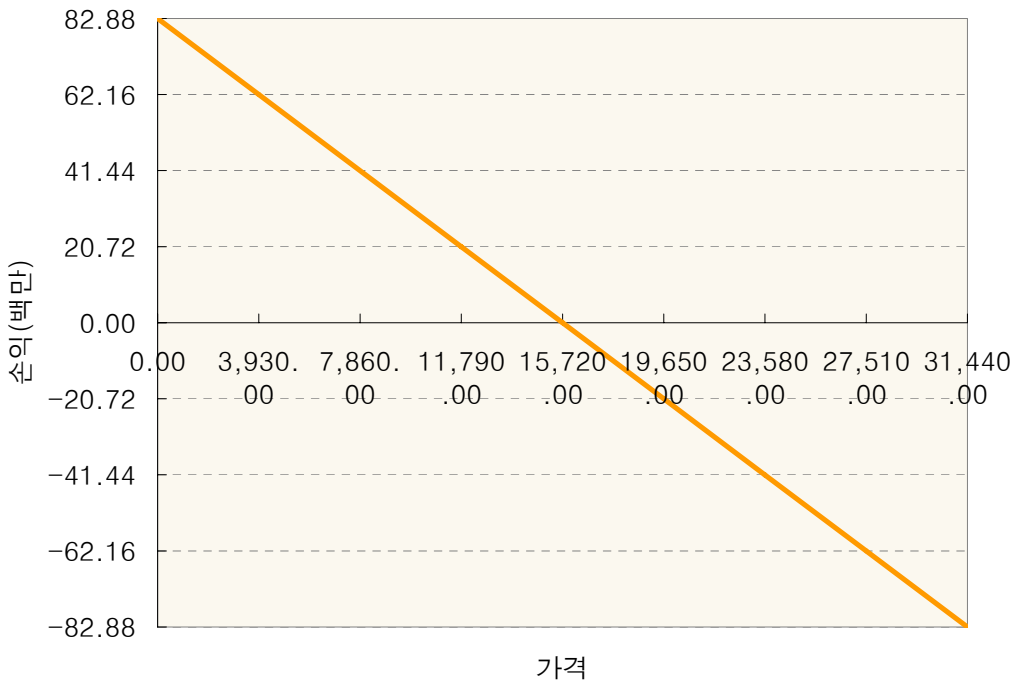
1. 계약금액

(단위:백만원)

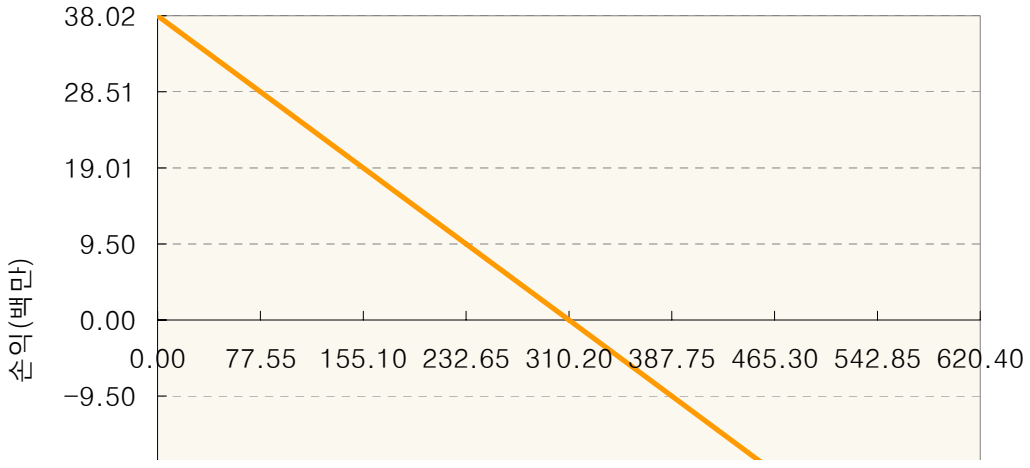
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	143	-143	

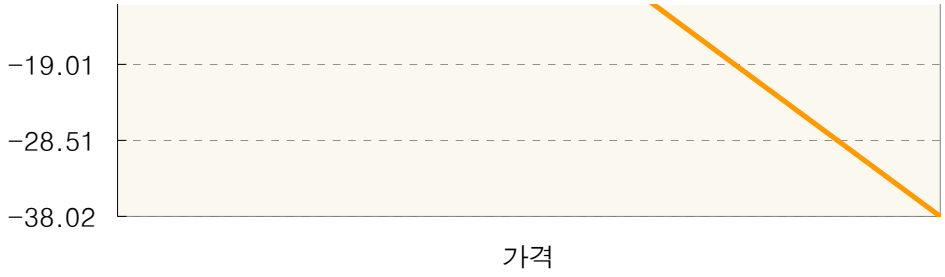
2. 만기시점의 손익구조

NIM6-NIKKEI 225 (SGX) JUN16

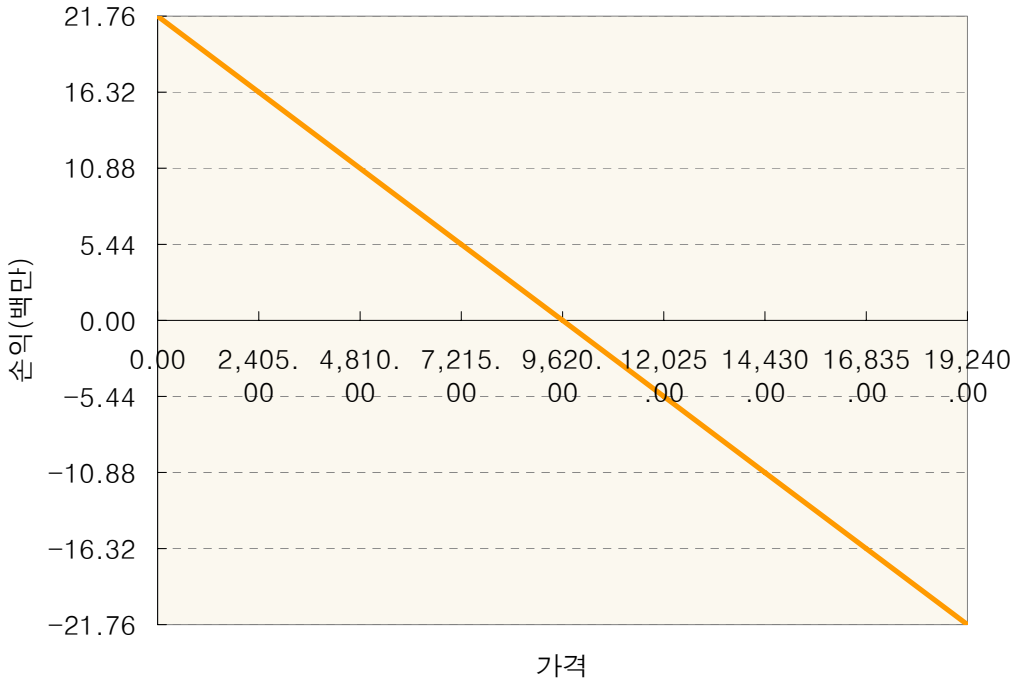


TWJ6-MSCI TAIWAN INDEX Apr16





XUJ6-FTSE CHINA A50 Apr16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

NIM6	NIKKEI 225 (SGX) JUN16	7
TWJ6	MSCI TAIWAN INDEX Apr16	3
XUJ6	FTSE CHINA A50 Apr16	2

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

(단위:백만원)

14

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	832

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

707

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	15

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

37

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	406
SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1	126

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,586

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

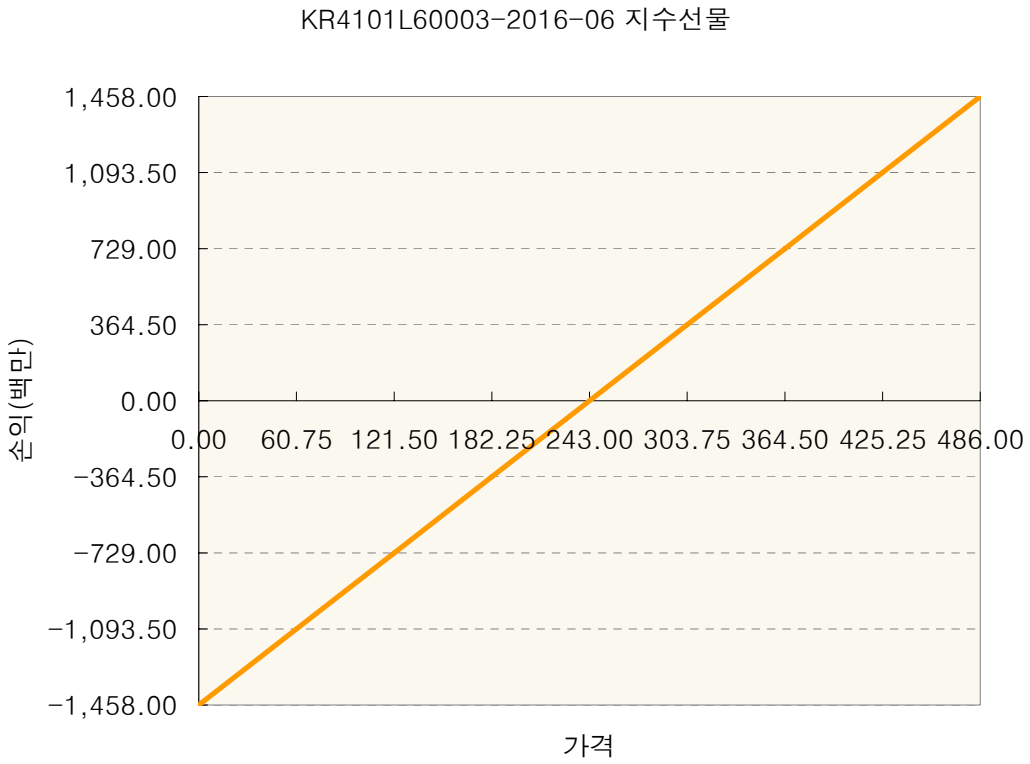
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	1,458	0	1,458	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 116

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-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%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	116	116	116	116	116	116	116

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

95

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	69
KR65433325 ELS신영증권플랜업(ELS)5447	62
KR65533AF5 ELSNH투자증권(ELS)11930	61
KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269	61

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

(단위:백만원)

171

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	238
KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957	250
KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298	238
KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483	238

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

(단위:백만원)

677

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	201
KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454	202
KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956	242
KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297	201

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

(단위:백만원)

533

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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

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

(단위:백만원)

345

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	134
KR65433286 ELS신영증권플랜업(ELS)5472	124
KR65533846 ELSNH투자증권(ELS)11987	123
KR65733AL6 ELS한국투자증권(ELS)5343	124

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

(단위:백만원)

277

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	101
KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170	87
KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036	87
KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359	87

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

(단위:백만원)

198

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	151
KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180	141
KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056	160
KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388	146

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

(단위:백만원)

308

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	148
KR65233676 ELS대우증권(ELS) 15190	147
KR65533526 ELSNH투자증권(ELS) 12077	147
KR65733986 ELS한국투자증권(ELS) 5399	161

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

(단위:백만원)

266

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	157
KR65433166 ELS신영증권플랜업(ELS) 5495	157
KR65533956 ELSNH투자증권(ELS) 12098	165
KR65733AY6 ELS한국투자증권(ELS) 5385	157

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

(단위:백만원)

309

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	266
KR65233306 ELS대우증권(ELS)15315	285
KR65533226 ELSNH투자증권(ELS)12137	310
KR65733066 ELS한국투자증권(ELS)5421	265

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

(단위:백만원)

557

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	389
KR65233776 ELS대우증권(ELS)15342	415
KR65433106 ELS신영증권플랜업(ELS)5516	389
KR65733196 ELS한국투자증권(ELS)5445	389

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

(단위:백만원)

921

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

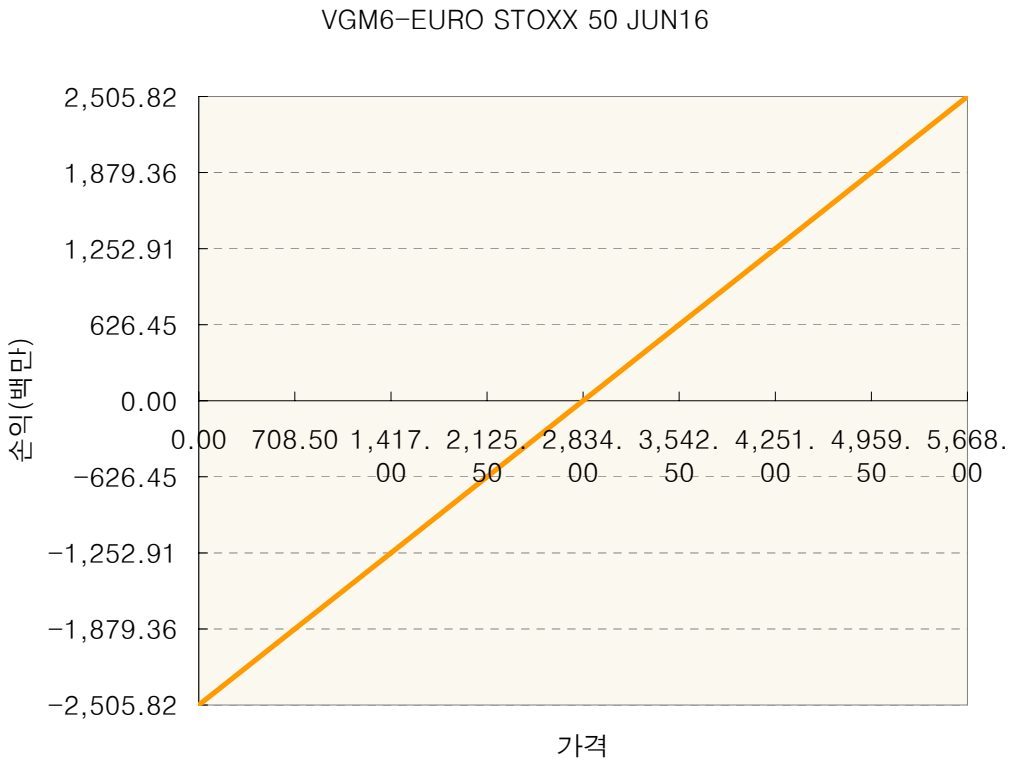
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,506	0	2,506	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 JUN16	200

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

(단위:백만원)

239

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

차이나인덱스모(주식-파생형)

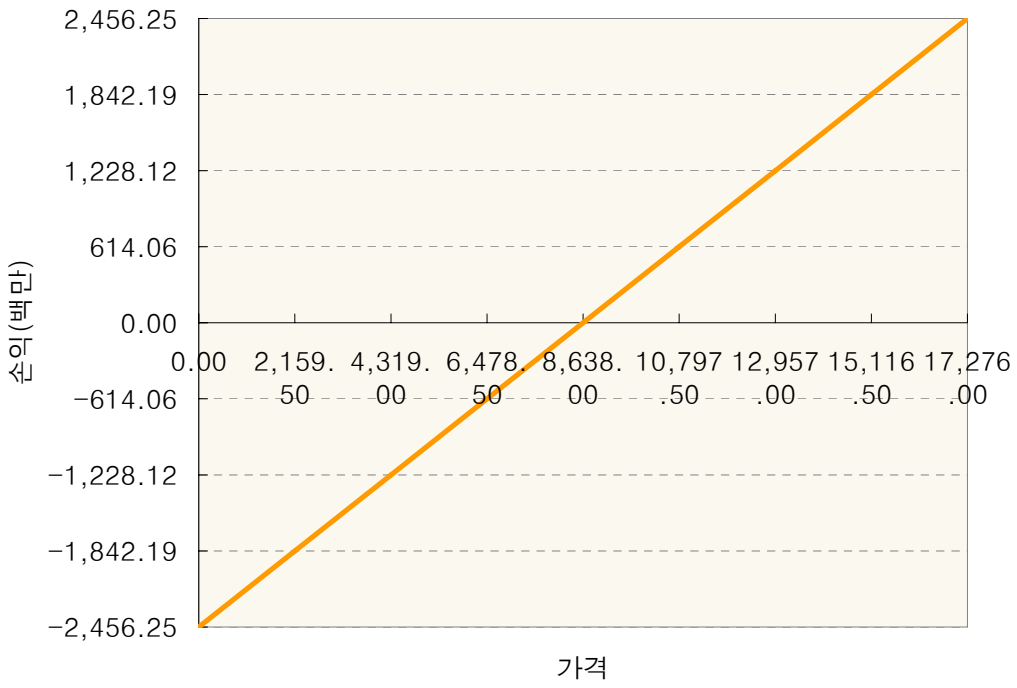
1. 계약금액

(단위:백만원)

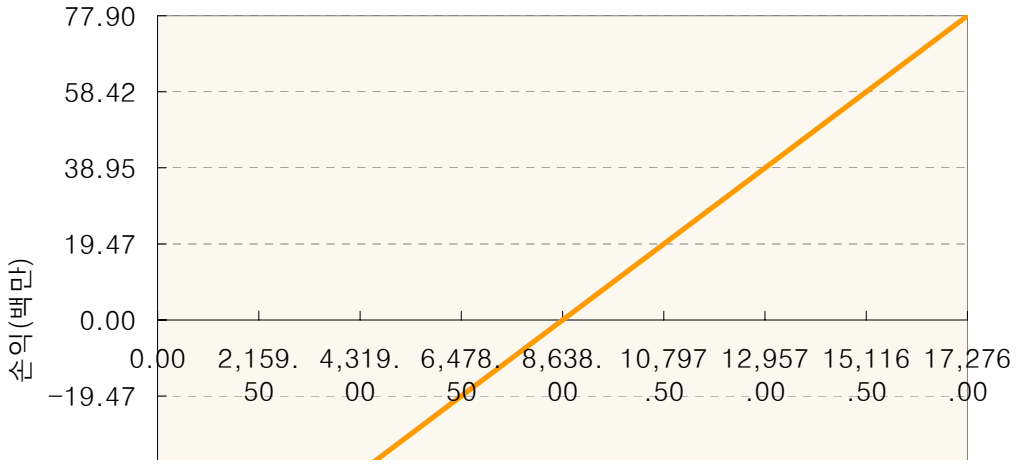
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,534	0	2,534	장내

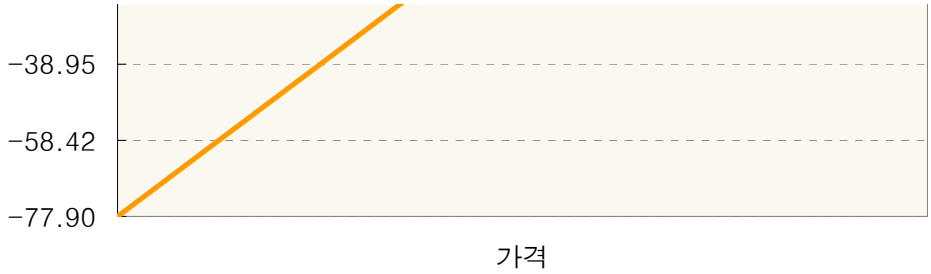
2. 만기시점의 손익구조

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	197
MHCJ6	MINI H-SHR IDX FU APR16	6

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

(단위:백만원)

291

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	517
KR65433236 ELS신영증권플랜업(ELS)5530	606
KR65533A86 ELSNH투자증권(ELS)12195	628
KR65733A46 ELS한국투자증권(ELS)5456	517

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

(단위:백만원)

1,273

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	45
KR65733926 ELS한국투자증권(ELS)5432	50
KR67233096 ELS아이비케이증권(ELS)1795	46
KR67733226 ELSKB STAR(ELS)1103	46

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

(단위:백만원)

111

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	44
KR65433416 ELS신영증권플랜업(ELS)5527	37
KR67233136 ELS아이비케이증권(ELS)1797	38
KR67733456 ELSKB STAR(ELS)1108	38

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

(단위:백만원)

90

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	15
KR65233BQ6 ELS대우증권(ELS)15376	15
KR65533BE6 ELSNH투자증권(ELS)12232	15
KR65733AH6 ELS한국투자증권(ELS)5477	17

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

(단위:백만원)

35

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	48
KR65433506 ELS신영증권플랜업(ELS)5533	45
KR67233166 ELS아이비케이증권(ELS)1802	46
KR67733656 ELSKB STAR(ELS)1113	46

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

(단위:백만원)

105

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

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	33
KR65233BZ6 ELS대우증권(ELS) 15382	41
KR65533BN6 ELSNH투자증권(ELS) 12276	36
KR65733CX6 ELS한국투자증권(ELS) 5492	43

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

(단위:백만원)

81

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

지수연계미래설계HE-26호(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	5,744	0	5,744	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65233446 ELS대우증권(ELS) 15508	170
KR65533366 ELSNH투자증권(ELS) 12307	169
KR65733056 ELS한국투자증권(ELS) 5516	170
KR67033416 ELS하나금융투자(ELS) 6061	170

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

(단위:백만원)

410

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

지수연계미래설계HE-27호(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	25,000	0	25,000	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65433046 ELS신영증권플랜업(ELS) 5558	475
KR65533356 ELSNH투자증권(ELS) 12306	830
KR65733046 ELS한국투자증권(ELS) 5515	831
KR65933116 ELS미래에셋증권(ELS) 8737	831

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

(단위:백만원)

1,802

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

KOSPI200지수연계4호(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	4,320	0	4,320	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65433066 ELS신영증권플랜업(ELS)5537	73
KR65733096 ELS한국투자증권(ELS)5483	82
KR67233066 ELS아이비케이증권(ELS)1803	75
KR67733056 ELSKB STAR(ELS)1119	75

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

(단위:백만원)

169

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

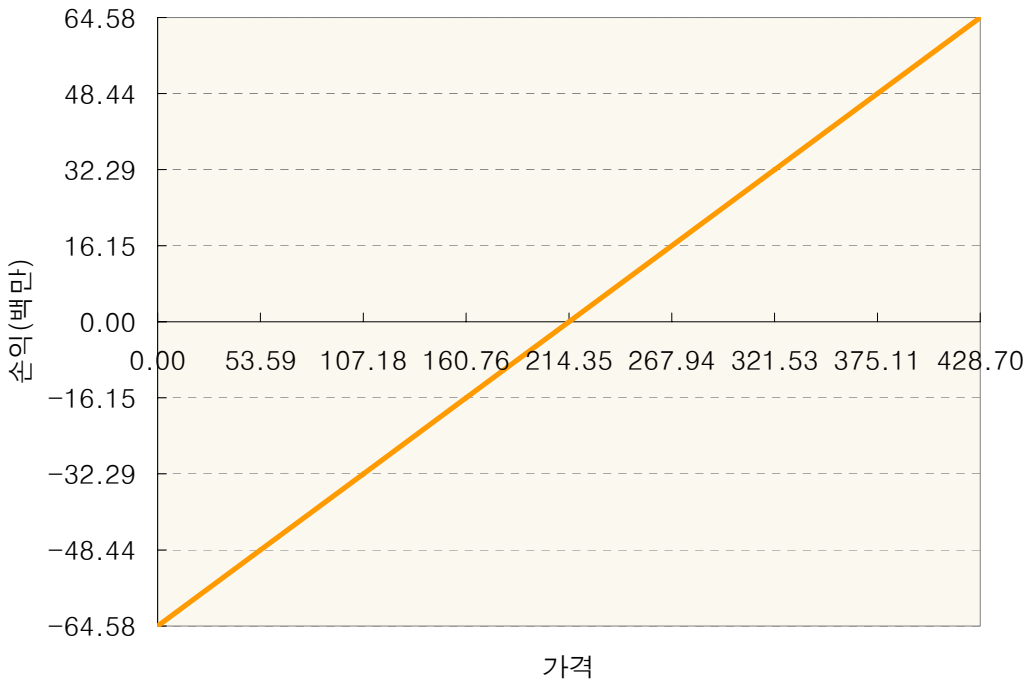
1. 계약금액

(단위:백만원)

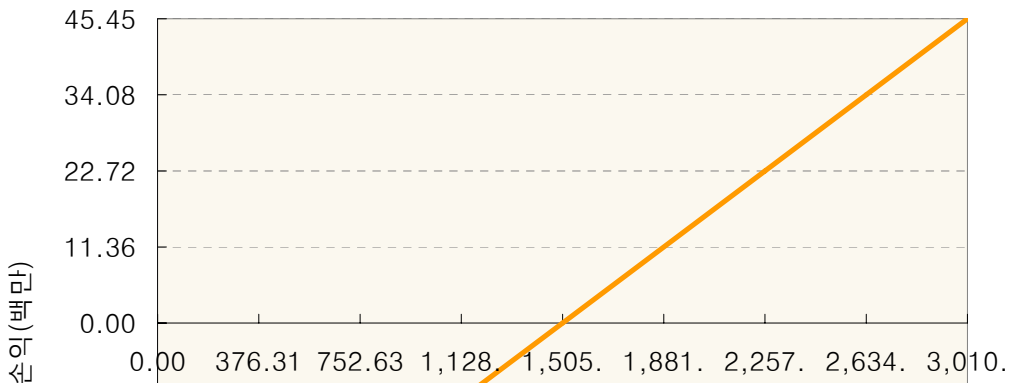
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	55	0	55	
누계	유가증권	선물	305	0	305	

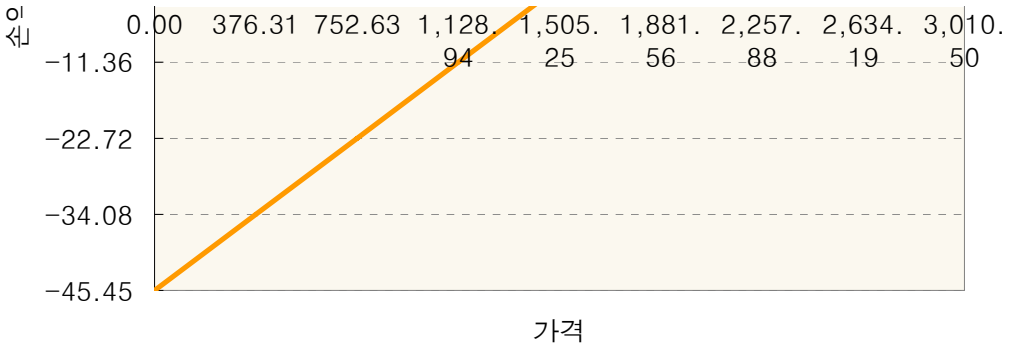
2. 만기시점의 손익구조

HGK6-COPPER FUTURE MAY16

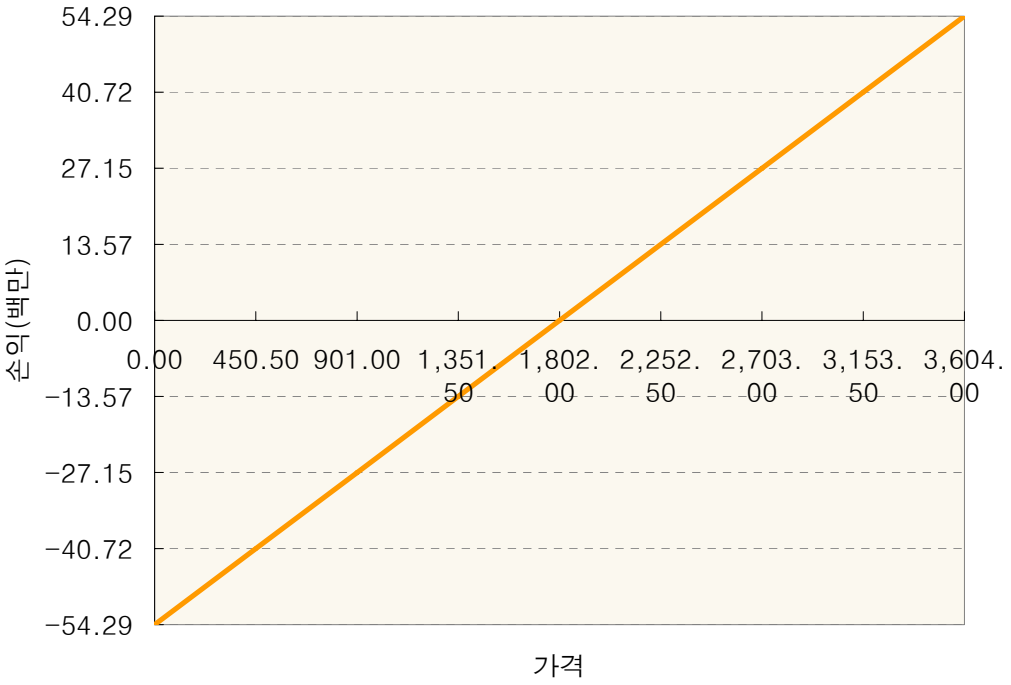


LAK6-LME PRI ALUM FUTR MAY16

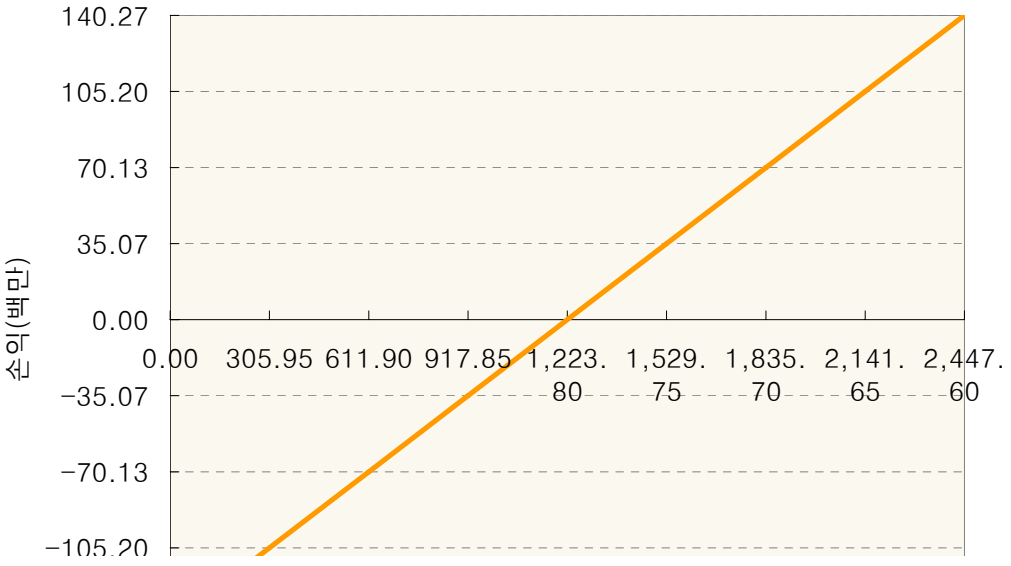


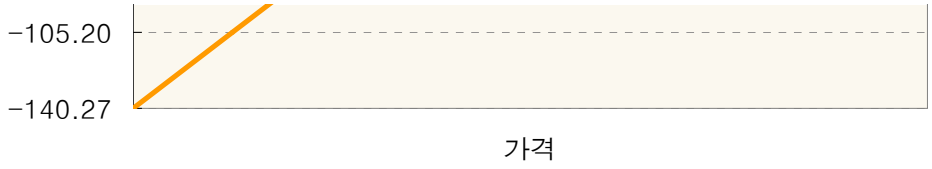


LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16

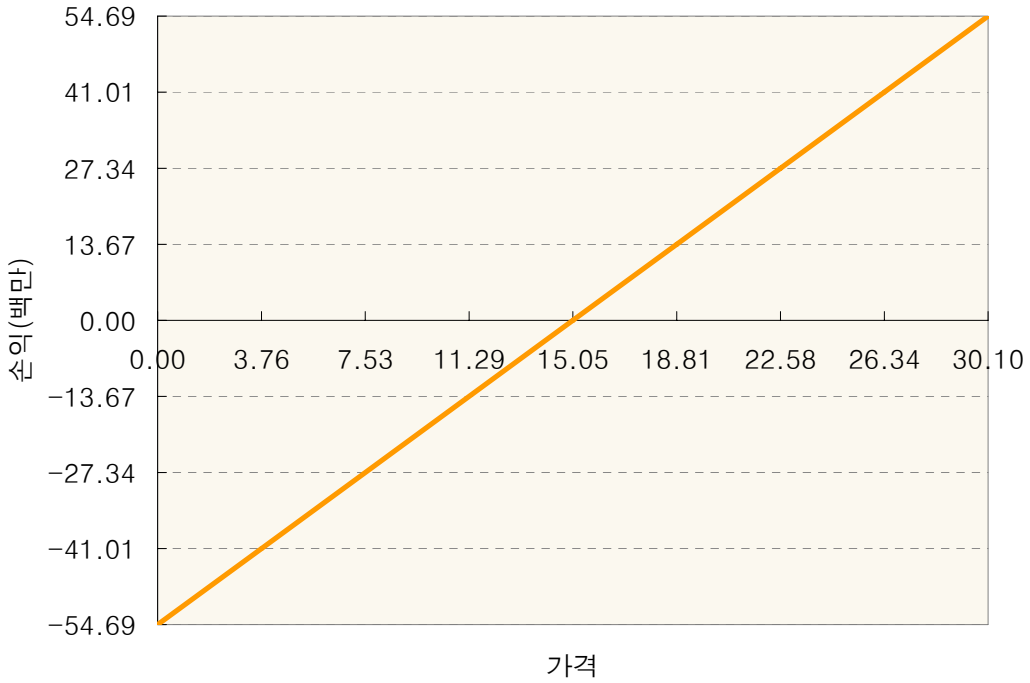


XGM6-MINI GOLD FUTURE JUN16





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	2016-04-08
기준일	2016-04-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

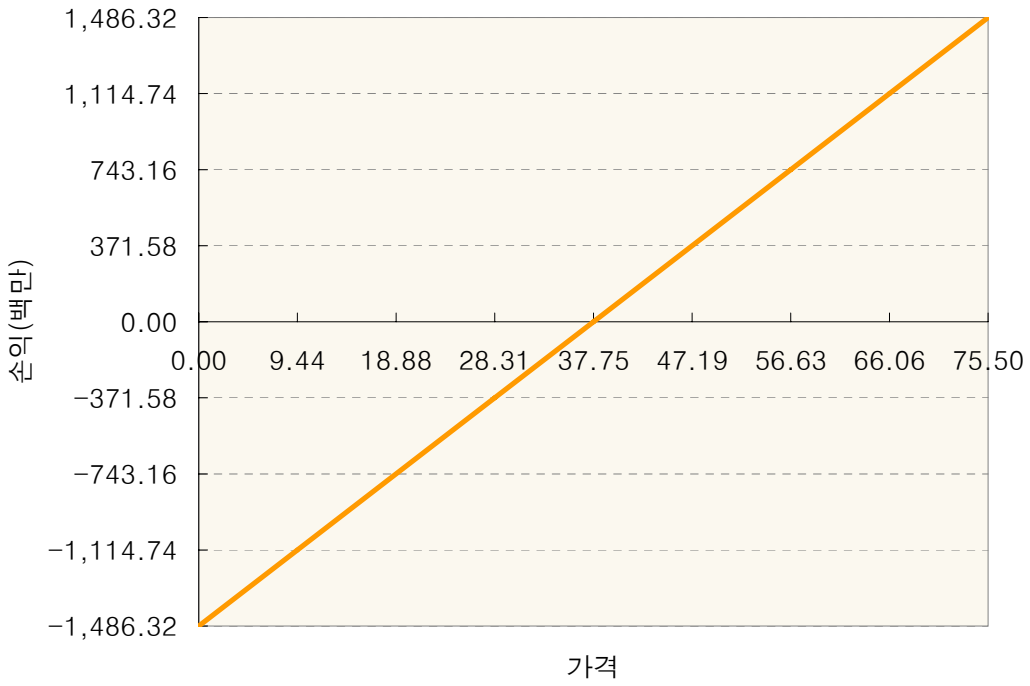
1. 계약금액

(단위:백만원)

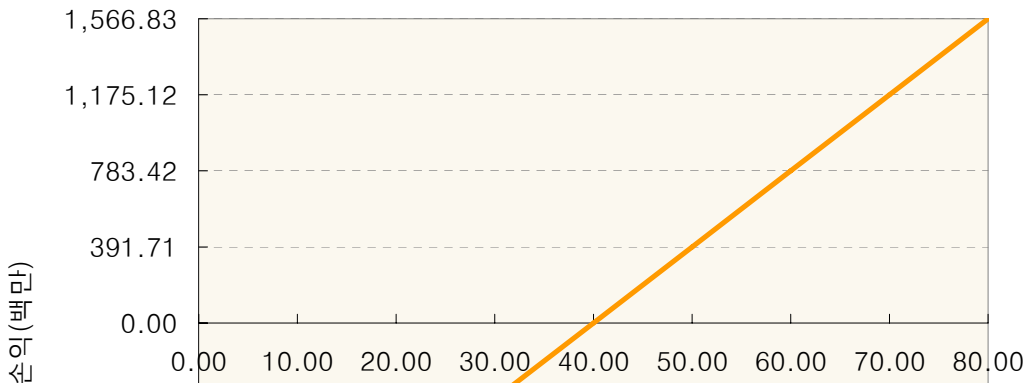
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,486	0	1,486	
누계	유가증권	선물	4,305	0	4,305	

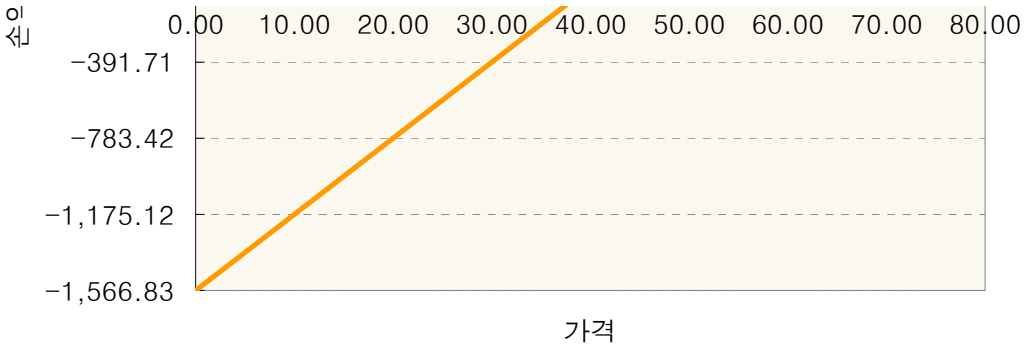
2. 만기시점의 손익구조

CLK6-WTI CRUDE FUTURE MAY16

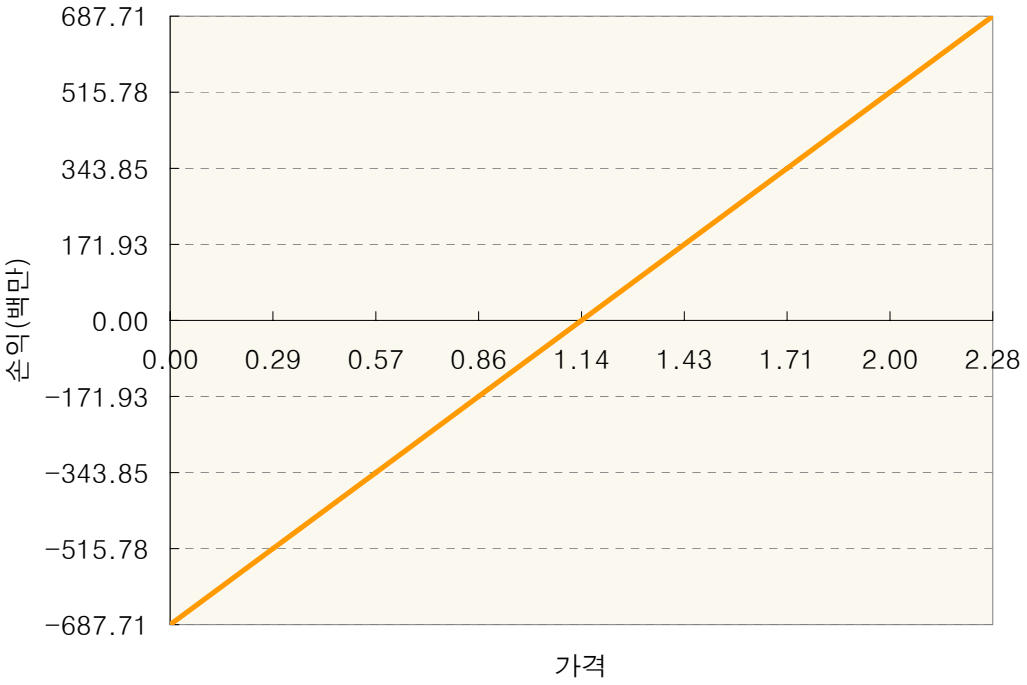


CON6-BRENT CRUDE FUTR JUL16

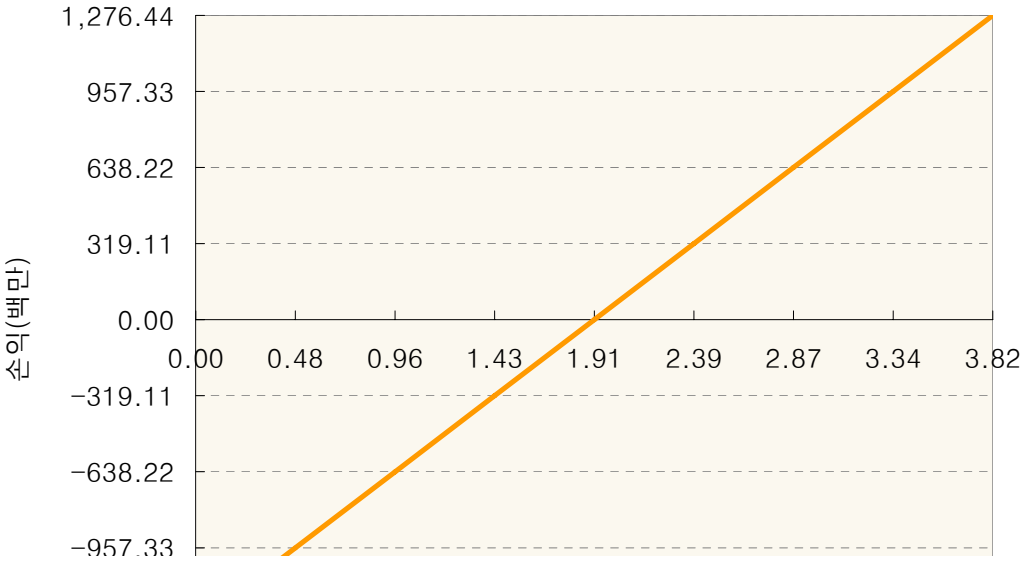


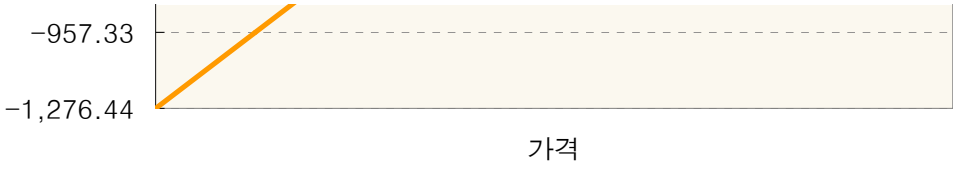


HOK6-NY Harb ULSD Fut MAY16

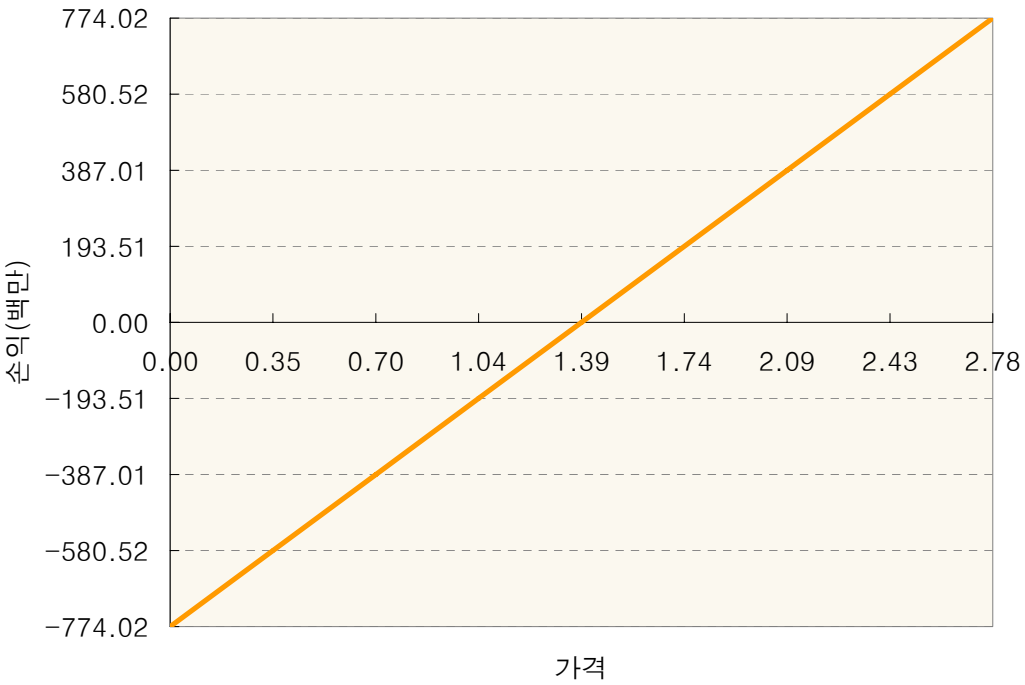


NGK6-NATURAL GAS FUTR MAY16





XBK6-GASOLINE RBOB FUT MAY16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK6	WTI CRUDE FUTURE MAY16	119
CON6	BRENT CRUDE FUTR JUL16	125
HOK6	NY Harb ULSD Fut MAY16	55
NGK6	NATURAL GAS FUTR MAY16	102
XBK6	GASOLINE RBOB FUT MAY16	62

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

(단위:백만원)

1,256

공시일	2016-04-08
기준일	2016-04-07

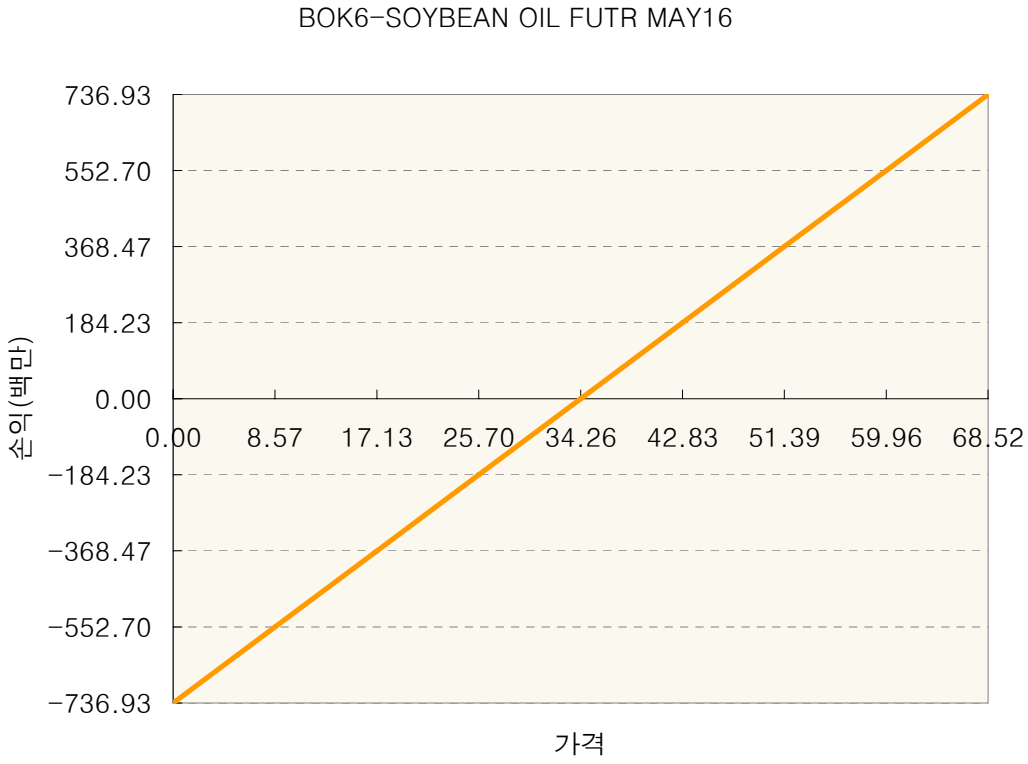
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

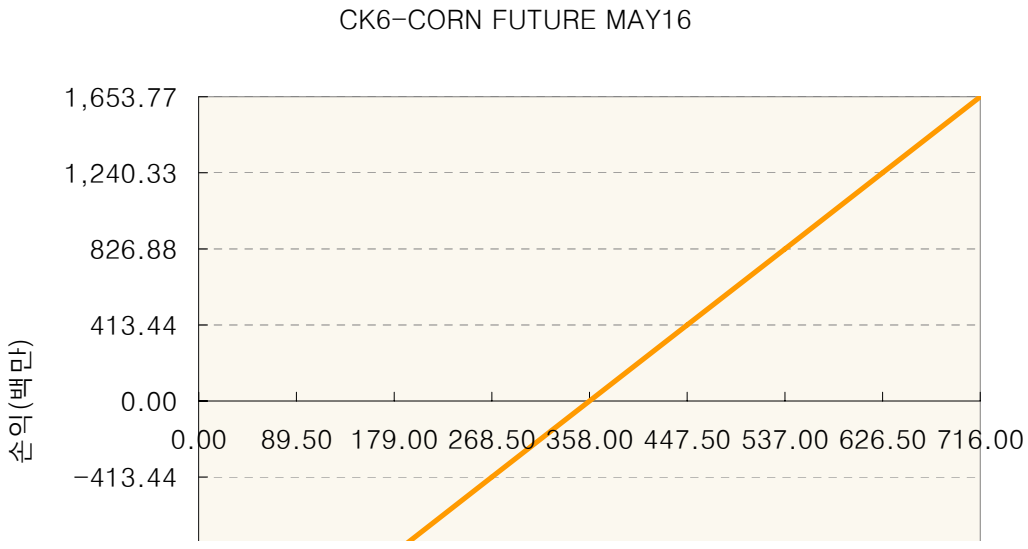
1. 계약금액

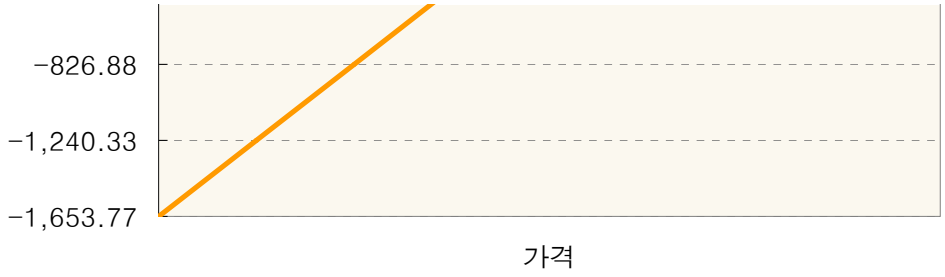
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,952	0	6,952	

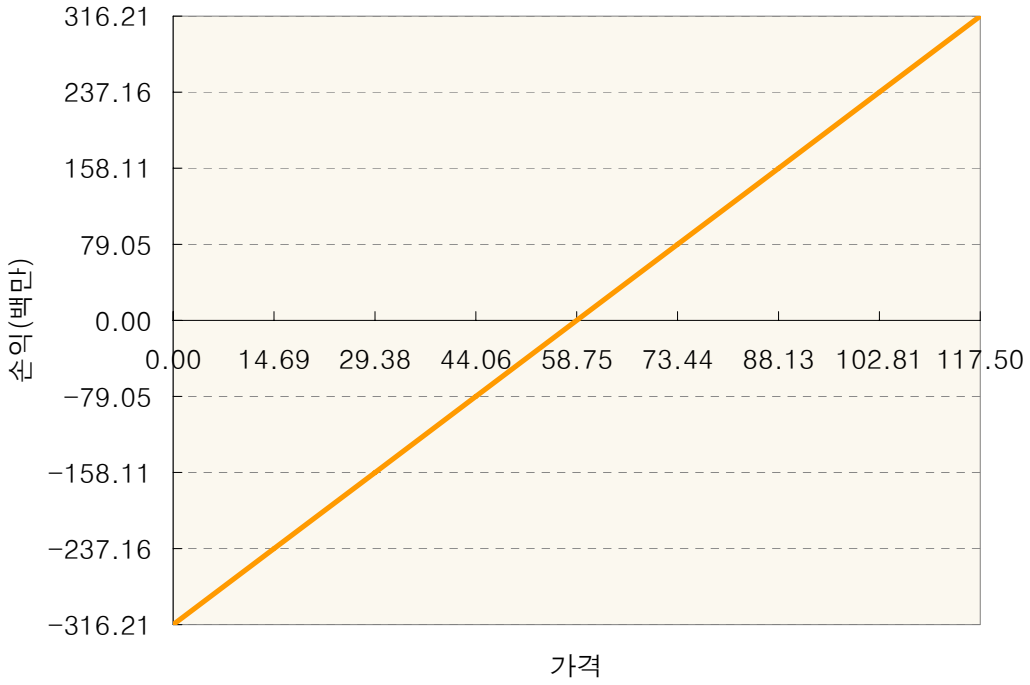
2. 만기시점의 손익구조



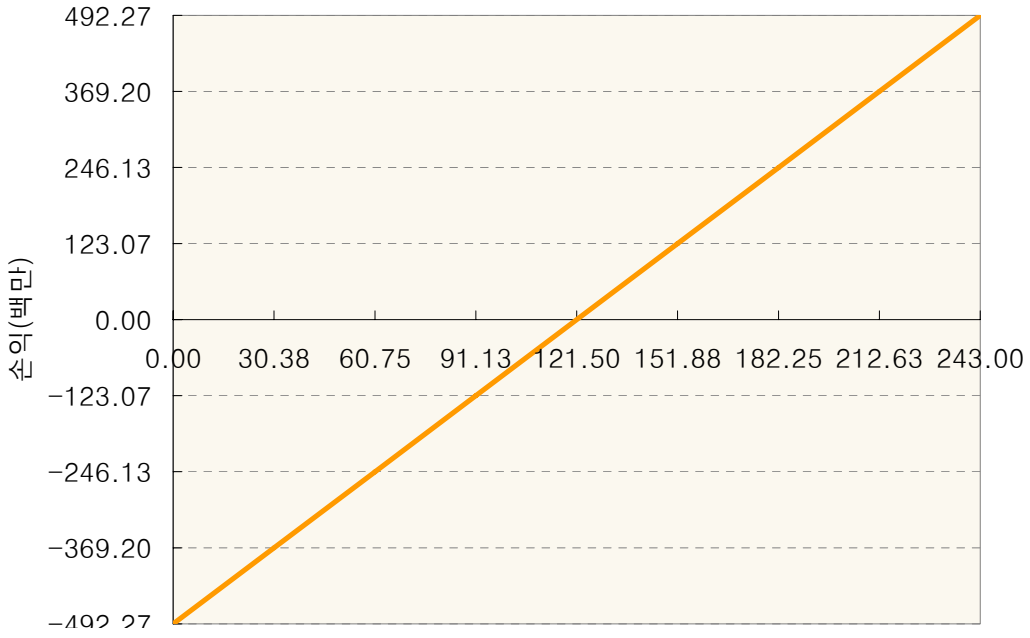


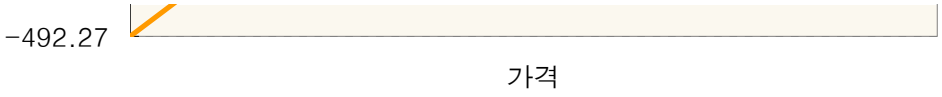


CTK6-COTTON NO.2 FUTR MAY16

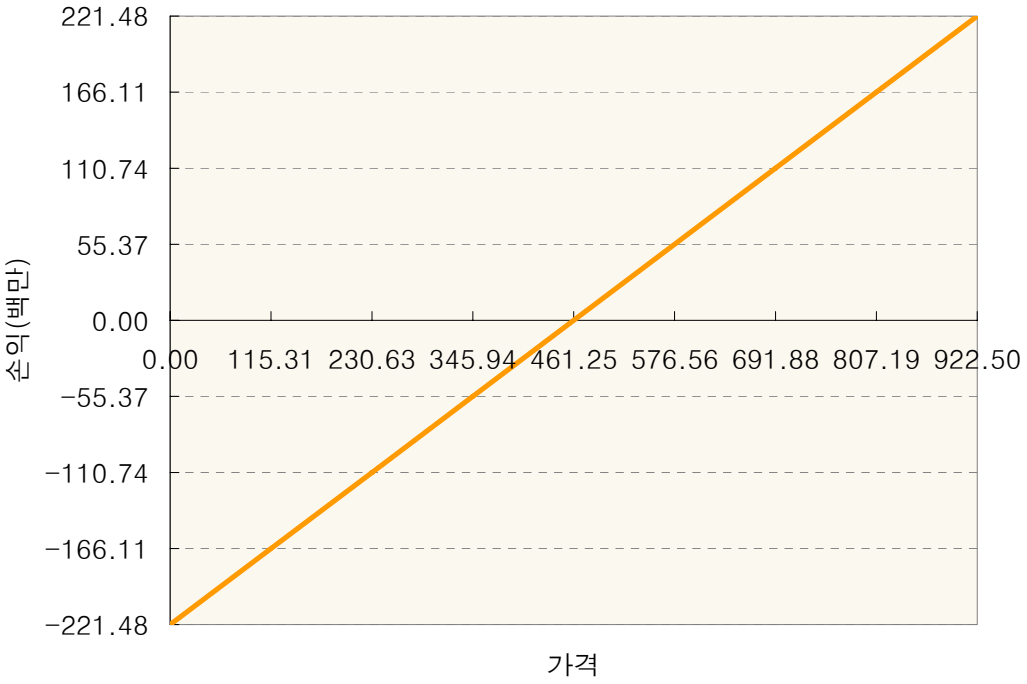


KCK6-COFFEE "C" FUTURE MAY16

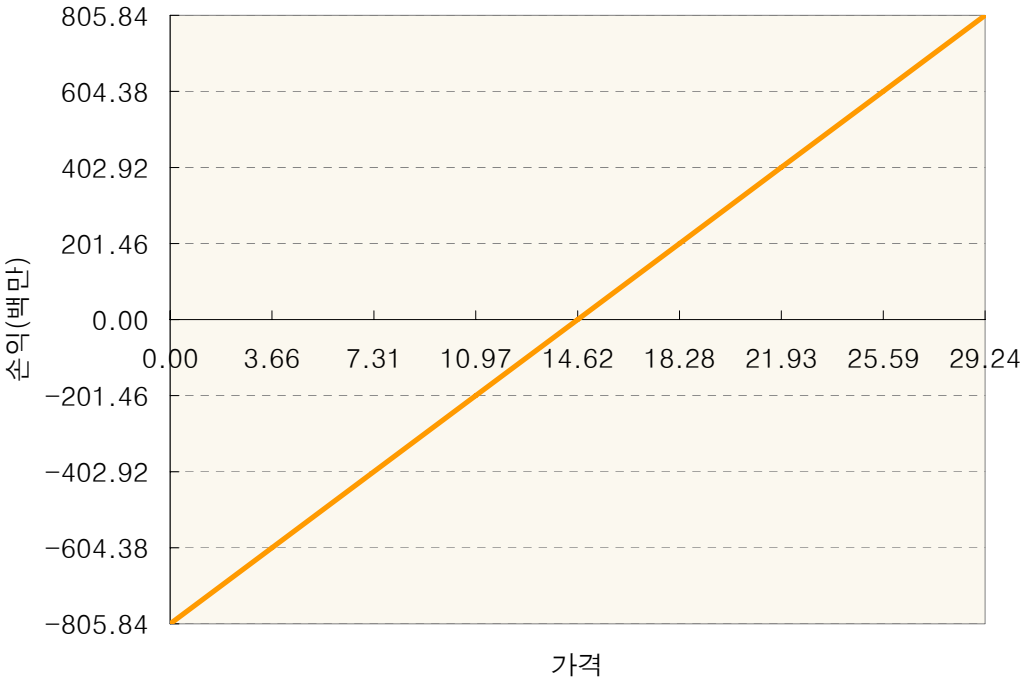




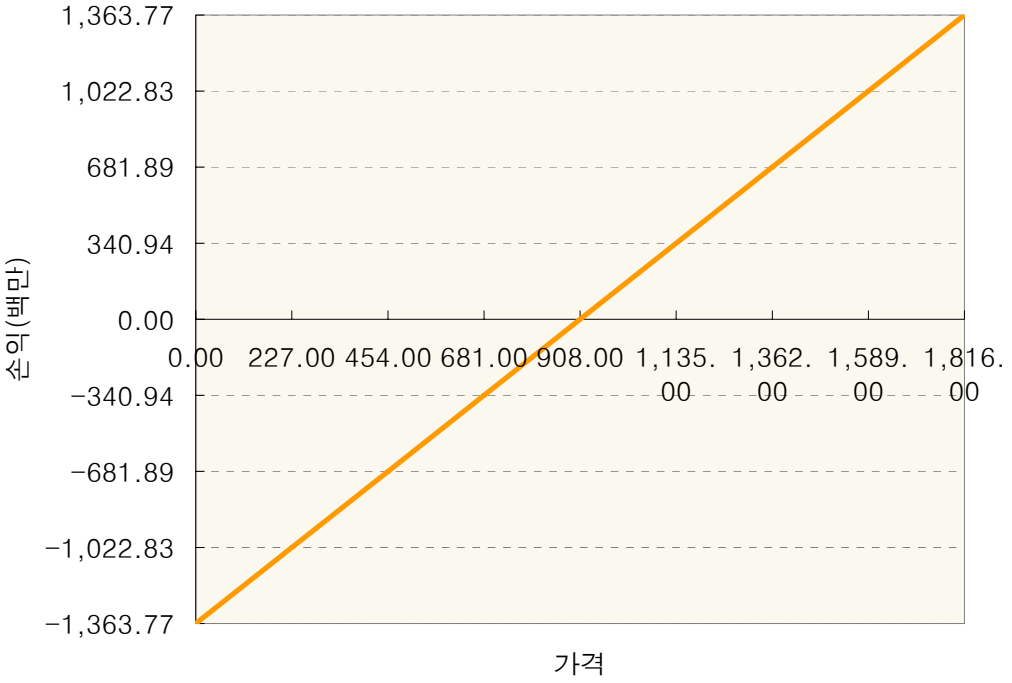
KWK6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16



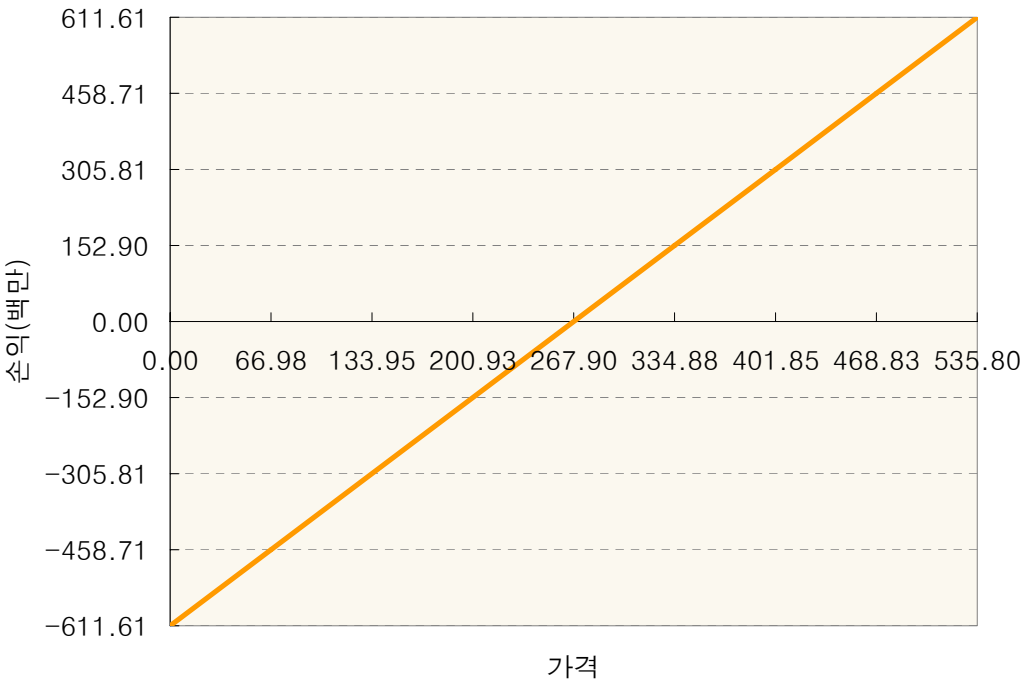
SBK6-Sugar #11 (WORLD) MAY16



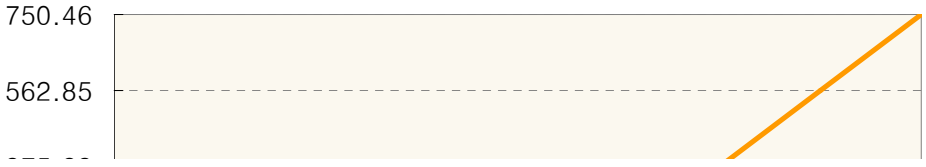
SK6-SOYBEAN FUTURE MAY16

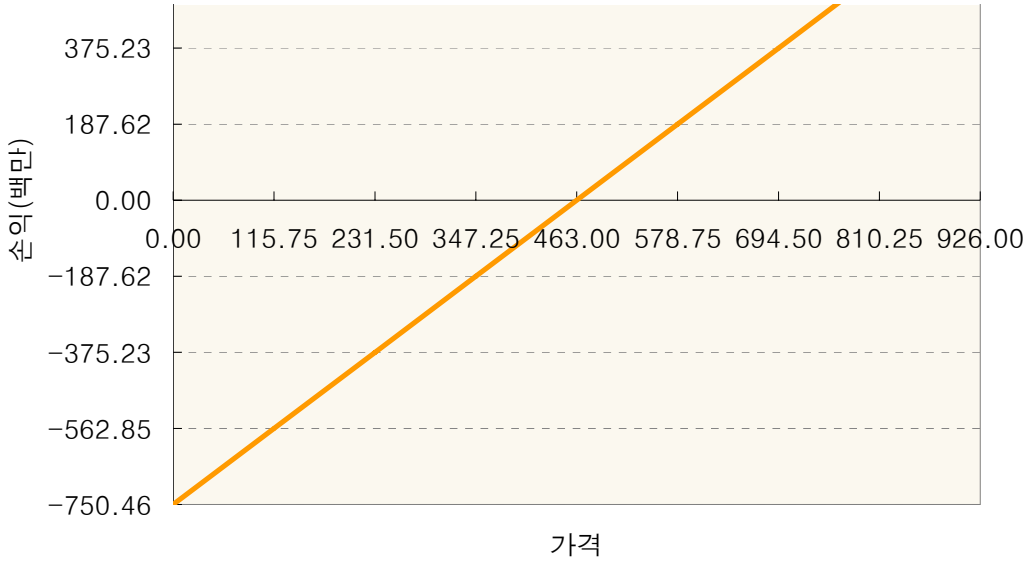


SMK6-SOYBEAN MEAL FUTR MAY16



WK6-WHEAT FUTURE(CBT) MAY16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK6	SOYBEAN OIL FUTR MAY16	59
CK6	CORN FUTURE MAY16	132
CTK6	COTTON NO.2 FUTR MAY16	25
KCK6	COFFEE "C" FUTURE MAY16	39
KWK6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16	18
SBK6	Sugar #11 (WORLD) MAY16	64
SK6	SOYBEAN FUTURE MAY16	109
SMK6	SOYBEAN MEAL FUTR MAY16	49
WK6	WHEAT FUTURE(CBT) MAY16	60

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

(단위:백만원)

744