공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	2016-04-14
기준일	2016-04-12

스마트인덱스모

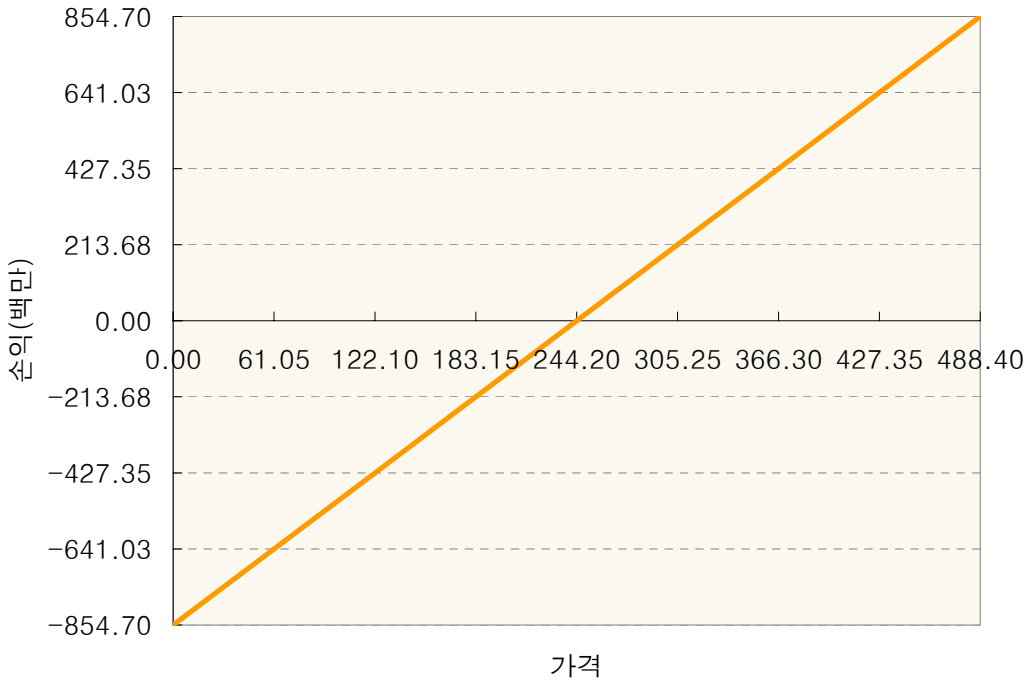
1. 계약금액

(단위:백만원)

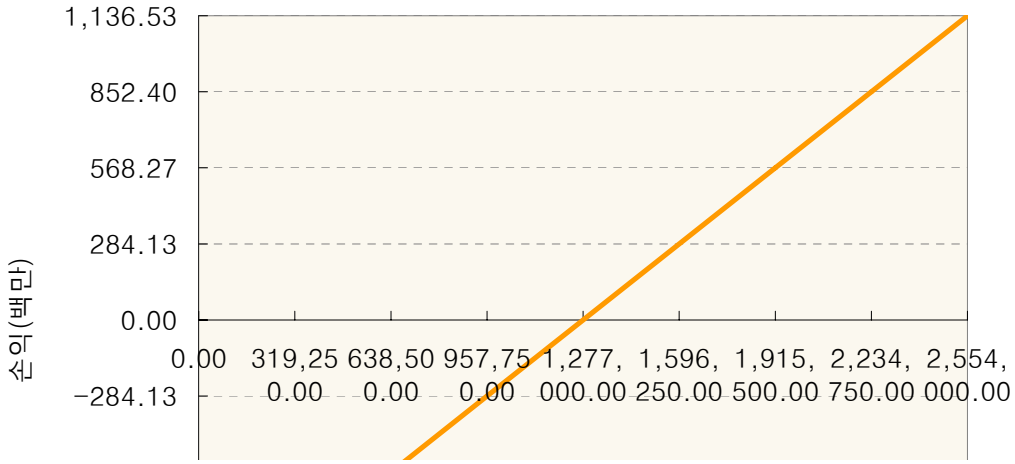
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,246	1,122	124	장내
누계	유가증권	선물	3,115	0	3,115	장내

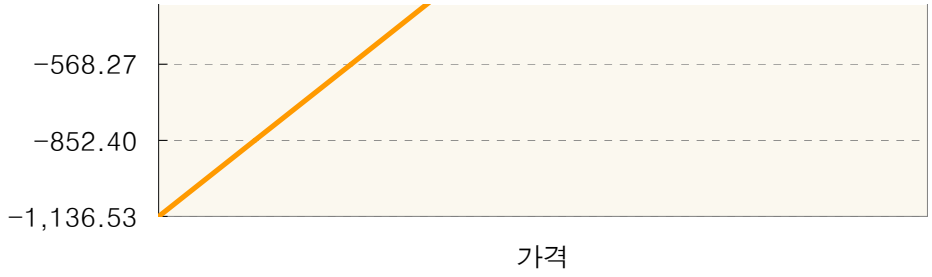
2. 만기시점의 손익구조

KR4101L60003-2016-06 지수선물

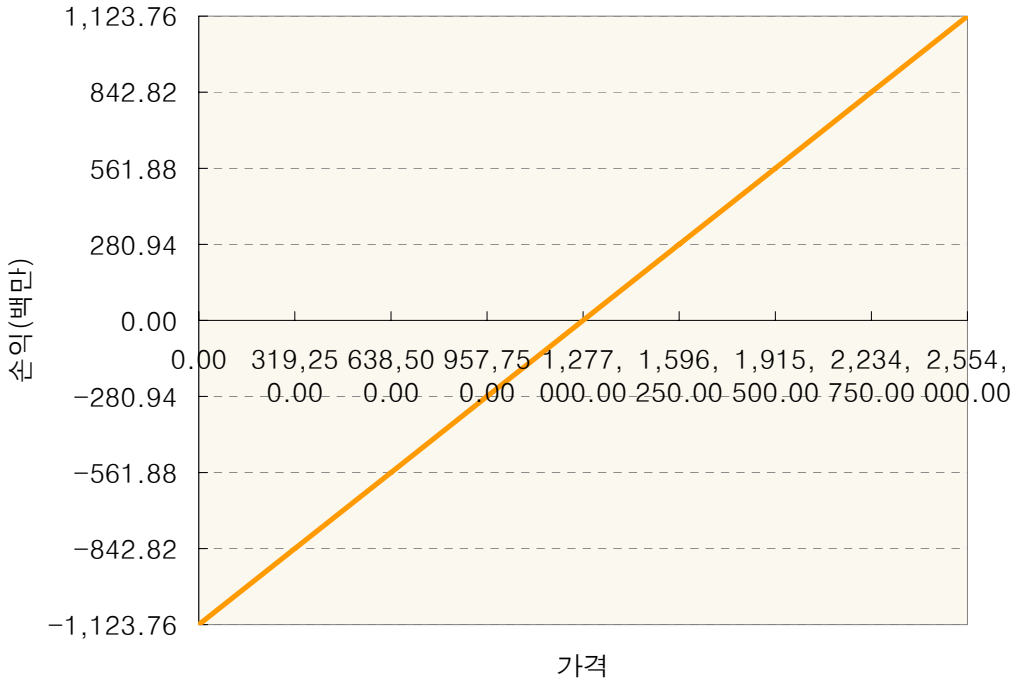


KR4111L40004-2016-04 삼성전자개별선물





KR4111L50003-2016-05 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물							68
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	45	45	45	45	45	45	45
8.00%	68	68	68	68	68	68	68
KR4111L400 2016-04 삼성전자개별선물							91
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	91	91	91	91	91	91	91
	KR4111L500 2016-05 삼성전자개별선물						90
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	90	90	90	90	90	90	90

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

232

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

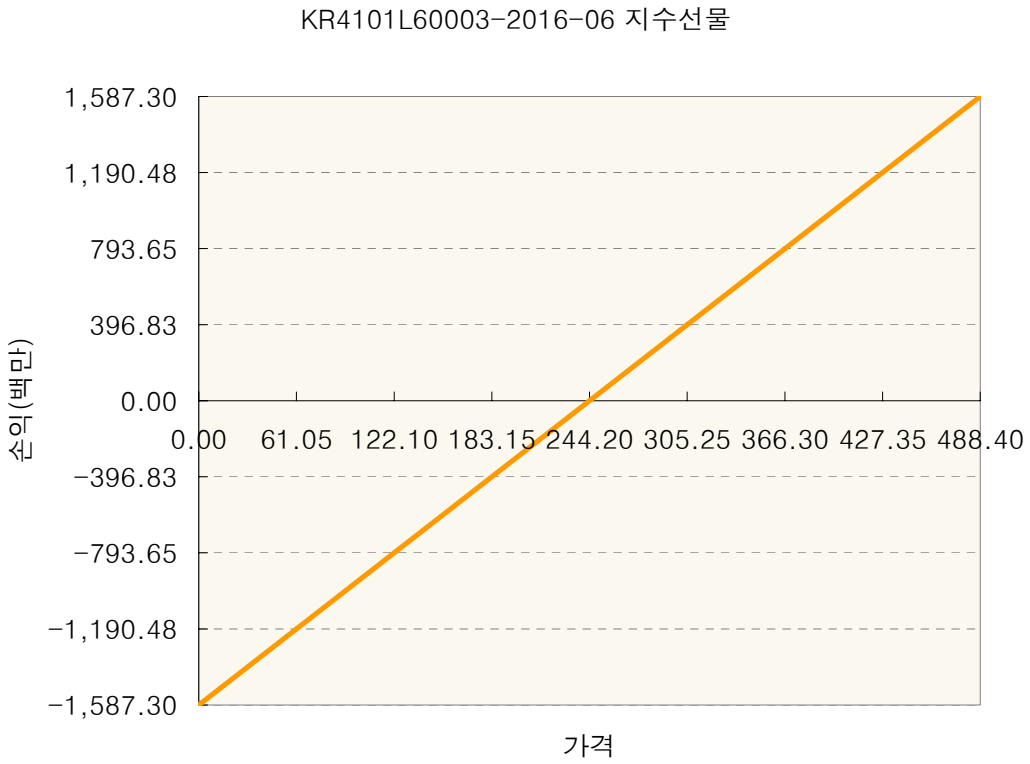
스마트레버리지목표전환형1호

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	1,587	0	1,587	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%	-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%	127	127	127	127	127	127	127

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

104

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

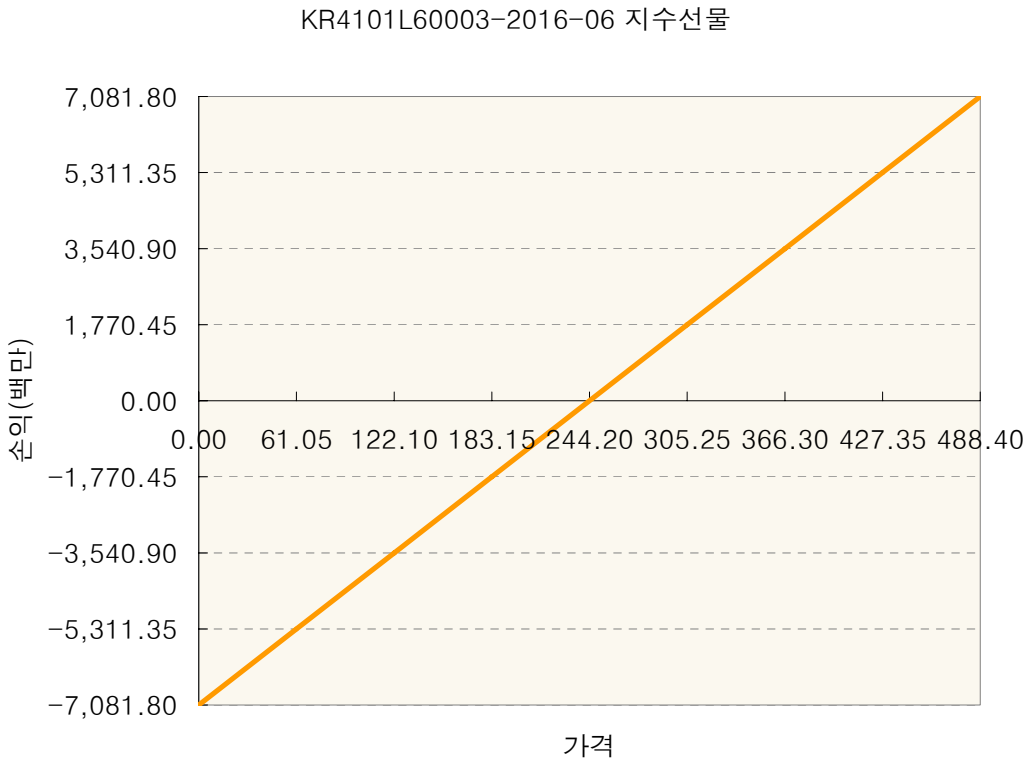
1.3배 레버리지 인덱스(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	122	-122	장내
누계	유가증권	선물	7,082	0	7,082	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물 565

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-565	-565	-565	-565	-565	-565	-565
-5.33%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-377
-2.67%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	188	188	188	188	188	188	188
5.33%	377	377	377	377	377	377	377
8.00%	565	565	565	565	565	565	565

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

462

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

아시아롱숏모(주식혼합-파생형)

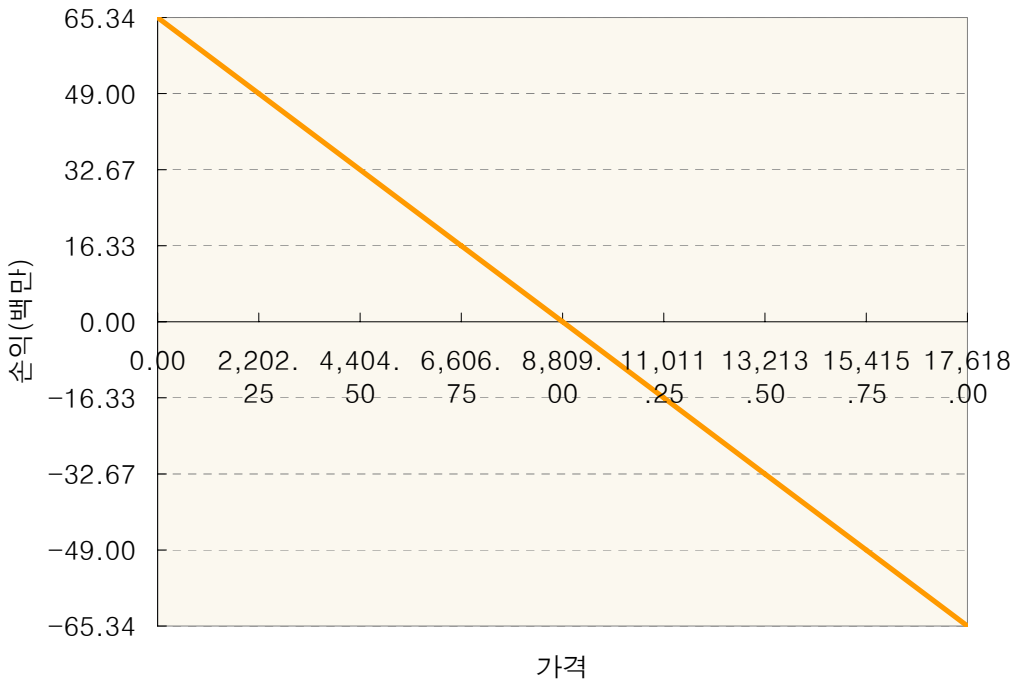
1. 계약금액

(단위:백만원)

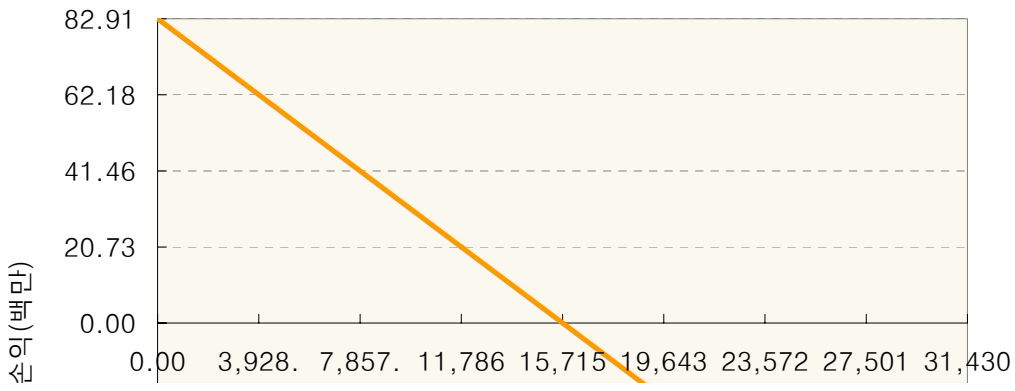
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	132	-132	
누계	유가증권	선물	0	65	-65	장내

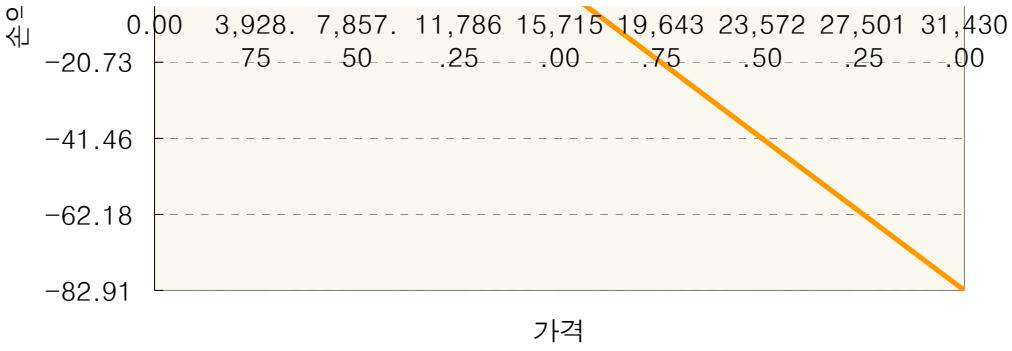
2. 만기시점의 손익구조

HCJ6-H-SHARES IDX FUT Apr16

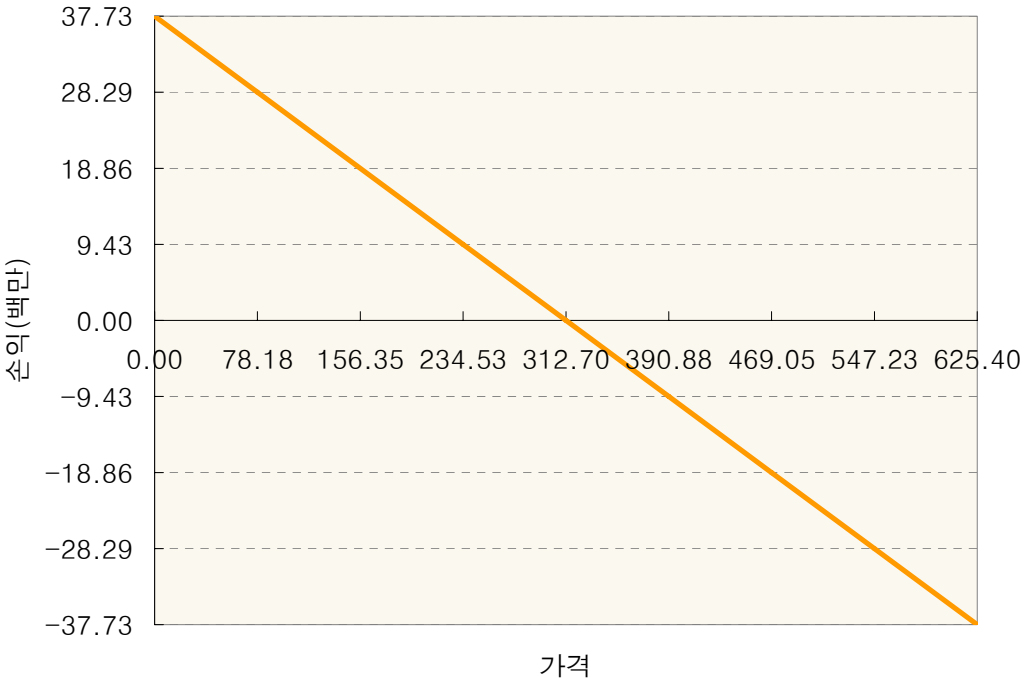


NIM6-NIKKEI 225 (SGX) JUN16

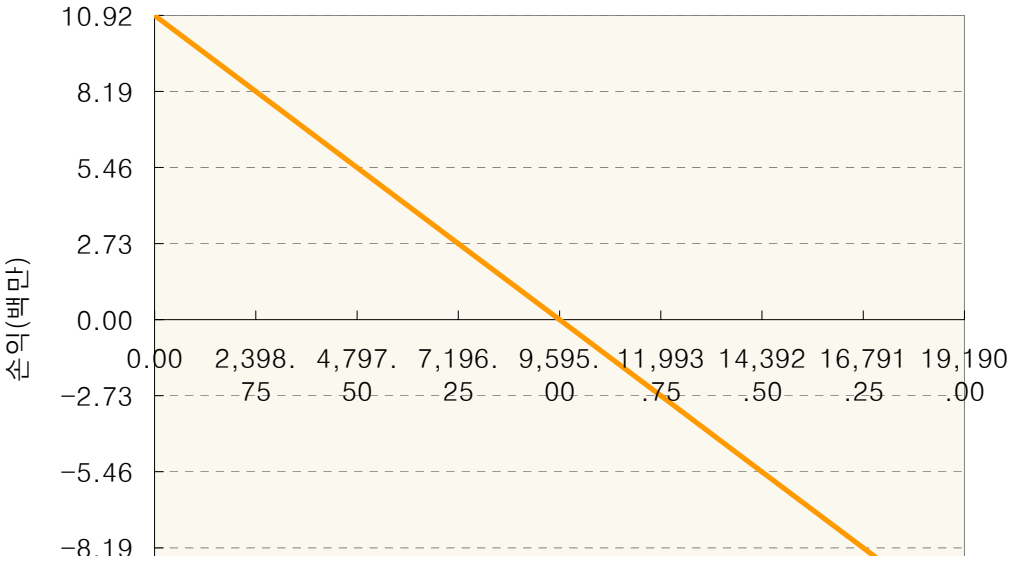


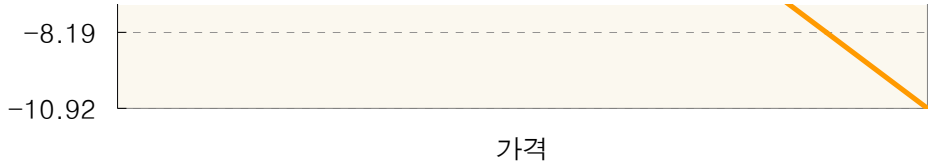


TWJ6-MSCI TAIWAN INDEX Apr16



XUJ6-FTSE CHINA A50 Apr16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ6	H-SHARES IDX FUT Apr16	5
NIM6	NIKKEI 225 (SGX) JUN16	7
TWJ6	MSCI TAIWAN INDEX Apr16	3
XUJ6	FTSE CHINA A50 Apr16	1

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

(단위:백만원)

20

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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)

708

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	407
SWCSI50000 신한CSI500미래S160308-1	127

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

1,592

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

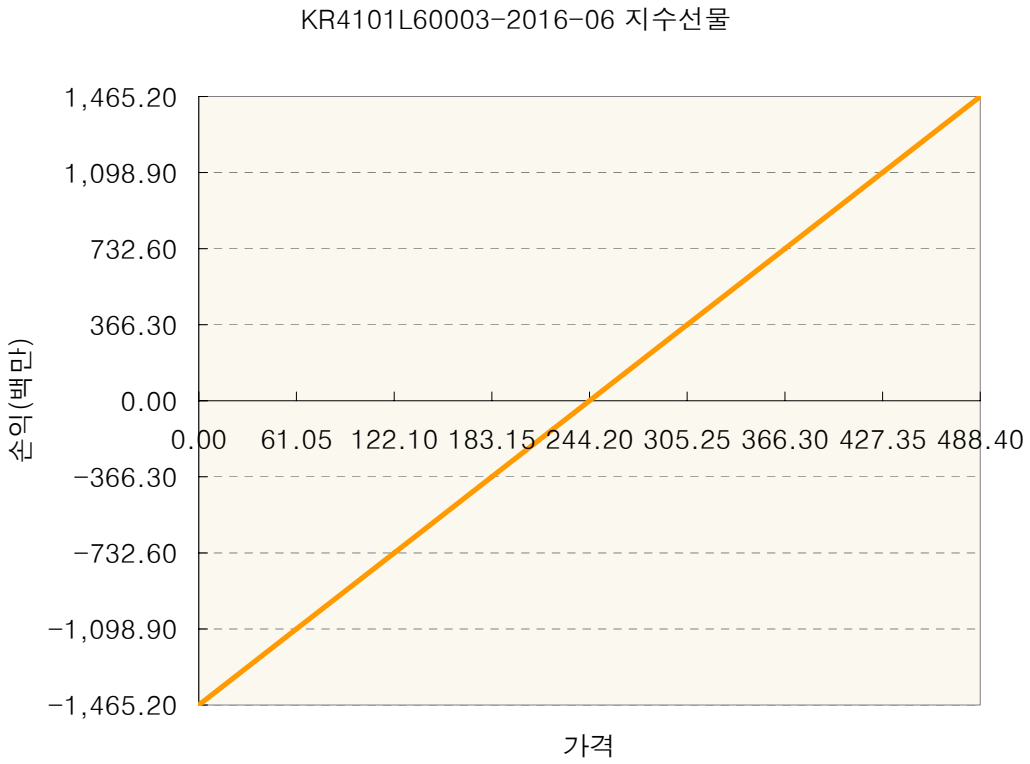
KOSPI200 레버리지 목표전환형 3

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	1,465	0	1,465	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101L600 2016-06 지수선물							117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-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%	117	117	117	117	117	117	117

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

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	62
KR65733E15 ELS한국투자증권(ELS)5269	62

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

(단위:백만원)

171

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	239
KR65533B85 ELSNH투자증권(ELS)11957	251
KR65733FJ5 ELS한국투자증권(ELS)5298	239
KR65933C95 ELS미래에셋증권(ELS)8483	239

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

(단위:백만원)

672

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	203
KR65433515 ELS신영증권플랜업(ELS)5454	203
KR65533B75 ELSNH투자증권(ELS)11956	243
KR65733FH5 ELS한국투자증권(ELS)5297	203

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

(단위:백만원)

568

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	149
KR65733686 ELS한국투자증권(ELS)5319	161
KR65933566 ELS미래에셋증권(ELS)8513	149

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

(단위:백만원)

357

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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)

272

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

지수연계미래설계SE-10호(ELS-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	3,825	0	3,825	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133A46 ELS대신증권(ELS) 6376	102
KR65233BD6 ELS대우증권(ELS) 15170	88
KR65533AP6 ELSNH투자증권(ELS) 12036	87
KR65733C46 ELS한국투자증권(ELS) 5359	88

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

(단위:백만원)

205

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	152
KR65233336 ELS대우증권(ELS)15180	141
KR65533236 ELSNH투자증권(ELS)12056	161
KR65733536 ELS한국투자증권(ELS)5388	146

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

(단위:백만원)

316

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	150
KR65233676 ELS대우증권(ELS) 15190	150
KR65533526 ELSNH투자증권(ELS) 12077	149
KR65733986 ELS한국투자증권(ELS) 5399	164

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

(단위:백만원)

262

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	159
KR65433166 ELS신영증권플랜업(ELS) 5495	159
KR65533956 ELSNH투자증권(ELS) 12098	167
KR65733AY6 ELS한국투자증권(ELS) 5385	159

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

(단위:백만원)

317

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	268
KR65233306 ELS대우증권(ELS)15315	288
KR65533226 ELSNH투자증권(ELS)12137	313
KR65733066 ELS한국투자증권(ELS)5421	268

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

(단위:백만원)

589

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	392
KR65233776 ELS대우증권(ELS)15342	418
KR65433106 ELS신영증권플랜업(ELS)5516	392
KR65733196 ELS한국투자증권(ELS)5445	391

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

(단위:백만원)

938

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

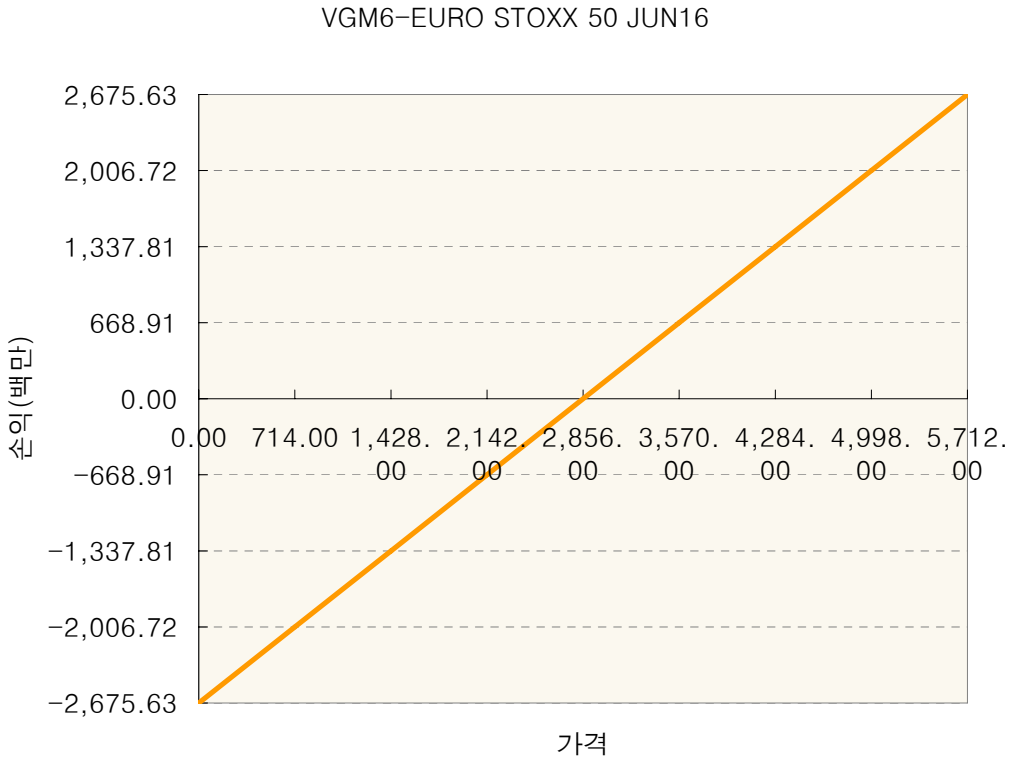
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,676	0	2,676	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 JUN16	214

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

(단위:백만원)

256

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

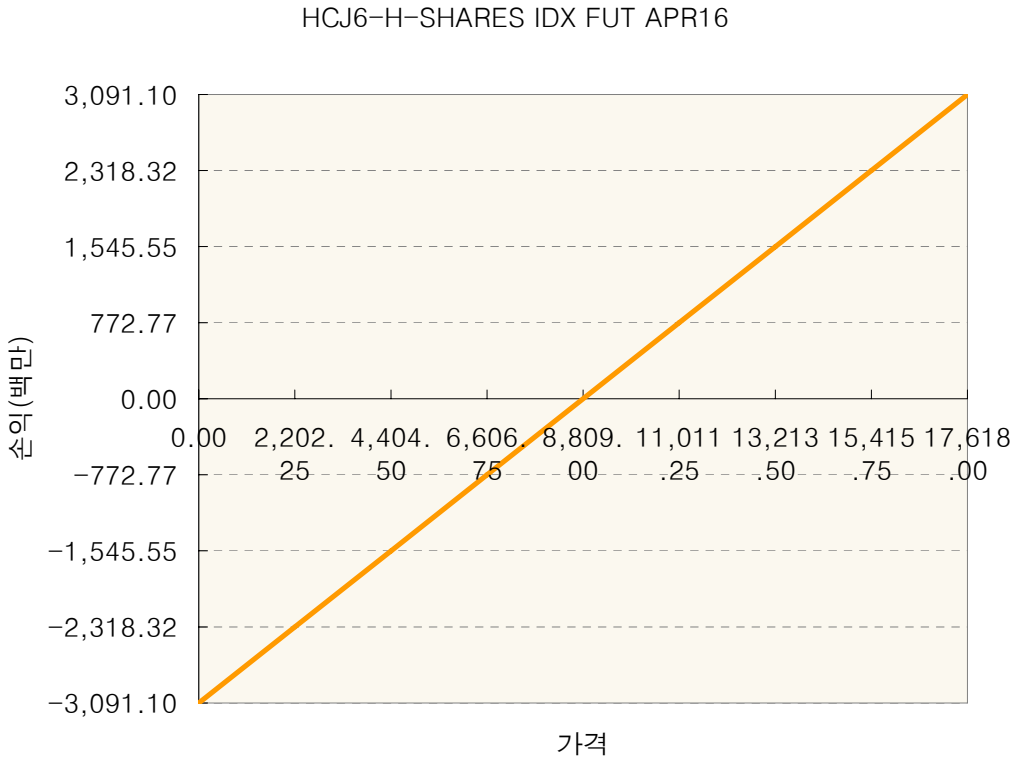
차이나인덱스모(주식-파생형)

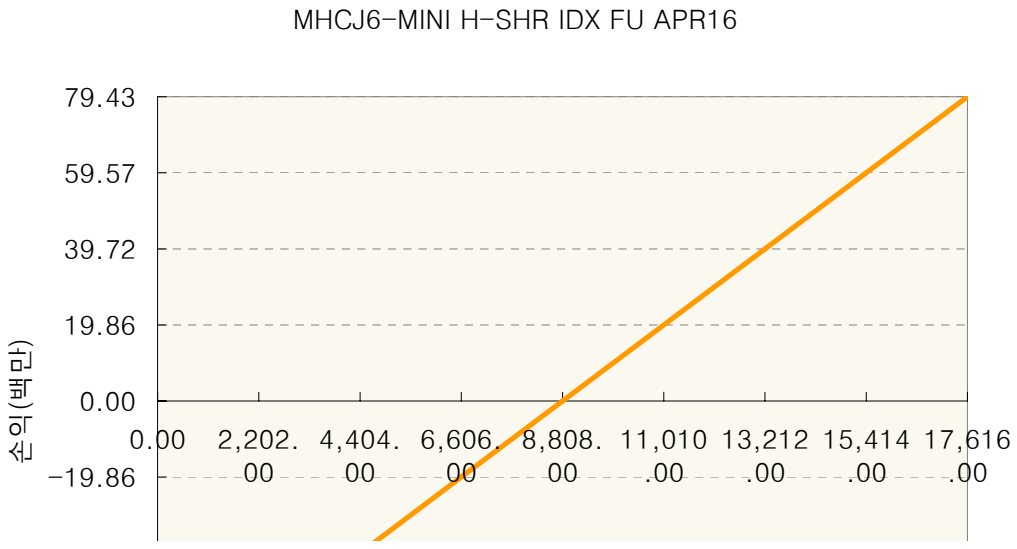
1. 계약금액

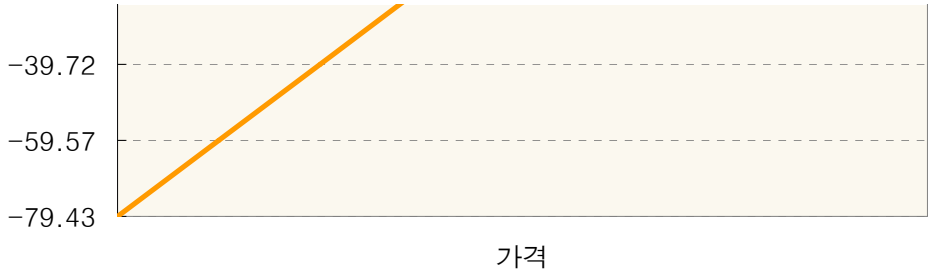
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,171	0	3,171	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ6	H-SHARES IDX FUT APR16	247
MHCJ6	MINI H-SHR IDX FU APR16	6

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

(단위:백만원)

364

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	519
KR65433236 ELS신영증권플랜업(ELS)5530	608
KR65533A86 ELSNH투자증권(ELS)12195	630
KR65733A46 ELS한국투자증권(ELS)5456	519

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

(단위:백만원)

1,228

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	47
KR67233096 ELS아이비케이증권(ELS)1795	44
KR67733226 ELSKB STAR(ELS)1103	44

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

(단위:백만원)

99

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	35
KR67233136 ELS아이비케이증권(ELS)1797	36
KR67733456 ELSKB STAR(ELS)1108	36

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

(단위:백만원)

86

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	45
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)

101

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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)

89

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	167
KR65533366 ELSNH투자증권(ELS) 12307	167
KR65733056 ELS한국투자증권(ELS) 5516	167
KR67033416 ELS하나금융투자(ELS) 6061	167

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

(단위:백만원)

361

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	469
KR65533356 ELSNH투자증권(ELS) 12306	818
KR65733046 ELS한국투자증권(ELS) 5515	819
KR65933116 ELS미래에셋증권(ELS) 8737	819

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

(단위:백만원)

1,548

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

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	70
KR65733096 ELS한국투자증권(ELS)5483	78
KR67233066 ELS아이비케이증권(ELS)1803	71
KR67733056 ELSKB STAR(ELS)1119	71

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

(단위:백만원)

167

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

지수연계미래설계NE-2호(ELS-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	2,632	0	2,632	장외
누계	유가증권	ELS	2,632	0	2,632	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65433216 ELS신영증권플랜업(ELS) 5579	69
KR65533946 ELSNH투자증권(ELS) 12332	69
KR65733246 ELS한국투자증권(ELS) 5528	69
KR67033756 ELS하나금융투자(ELS) 6078	81

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

(단위:백만원)

144

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

KOSPI200지수연계5호(ELS-파생형

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	3,431	0	3,431	장외
누계	유가증권	ELS	3,431	0	3,431	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR65133536 ELS대신증권(ELS) 6505	62
KR65433206 ELS신영증권플랜업(ELS) 5554	55
KR67233096 ELS아이비케이투자증권(ELS) 1808	56
KR67333016 ELSHMC투자증권(ELS) 1513	56

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

(단위:백만원)

130

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

메탈인덱스플러스모(채권-파생형)

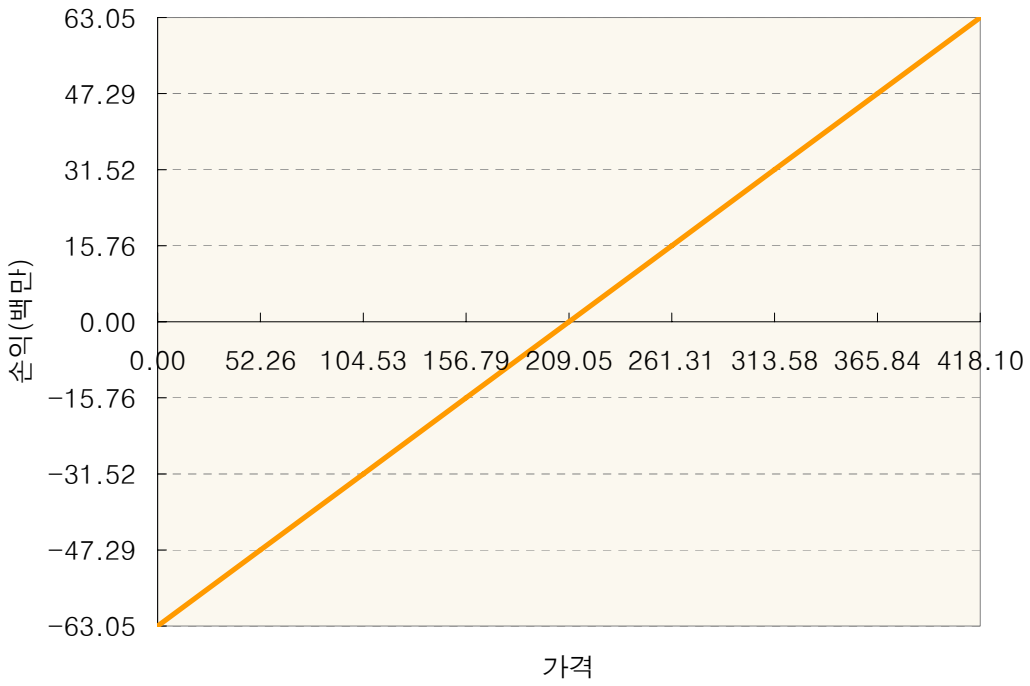
1. 계약금액

(단위:백만원)

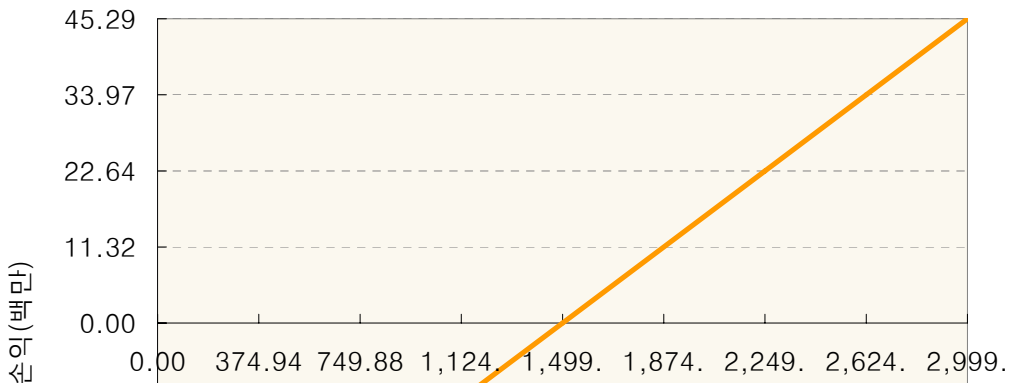
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	58	0	58	
누계	유가증권	선물	305	0	305	

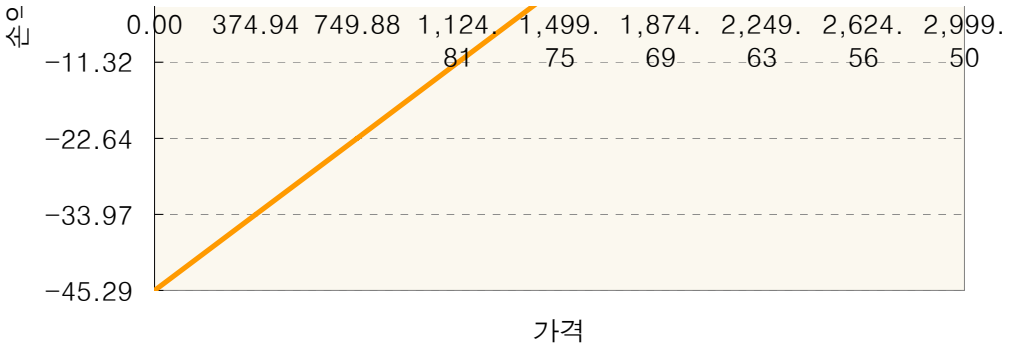
2. 만기시점의 손익구조

HGK6-COPPER FUTURE MAY16

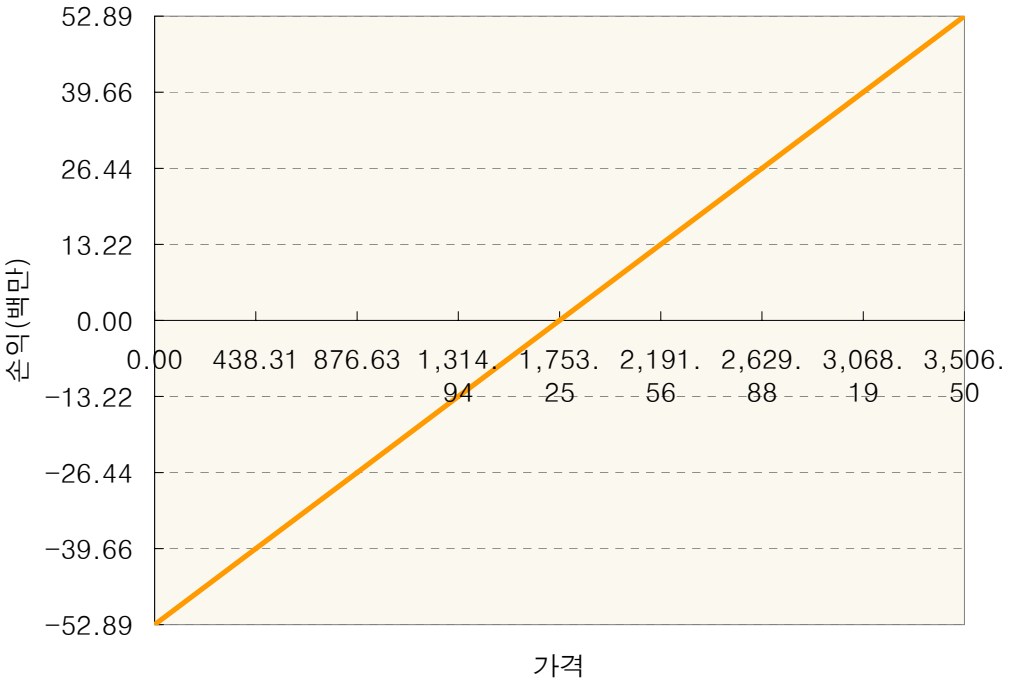


LAK6-LME PRI ALUM FUTR MAY16

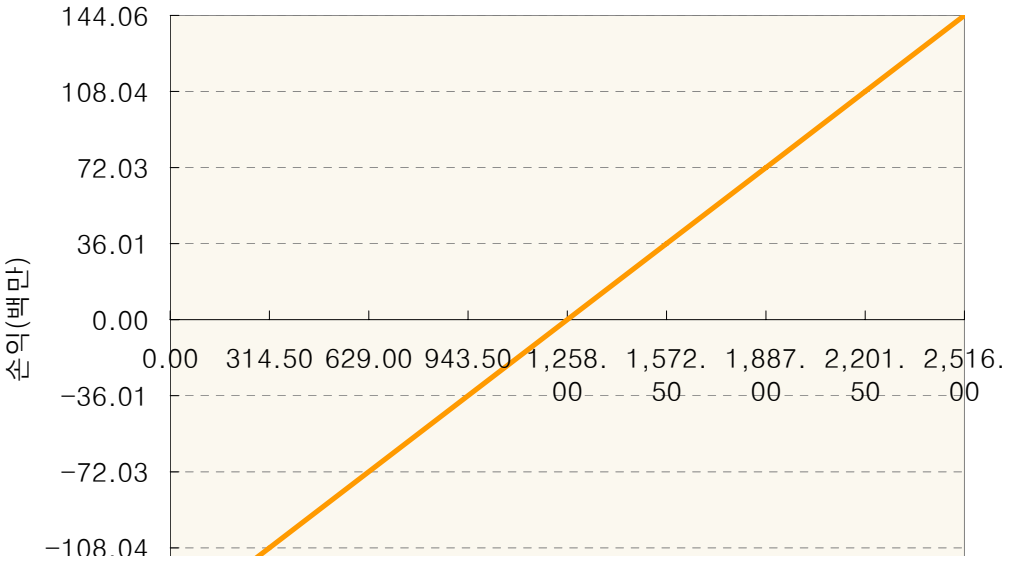


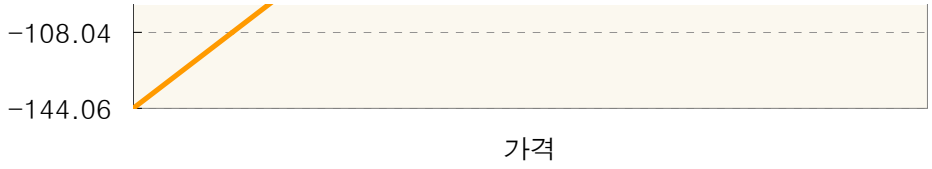


LXK6-LME ZINC FUTURE MAY16

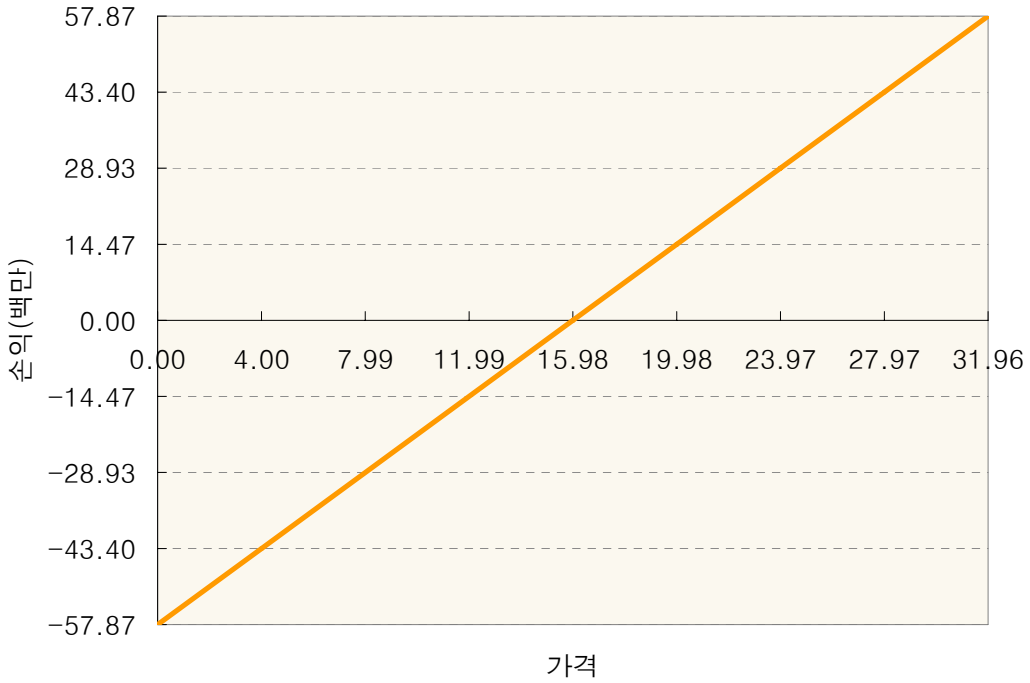


XGM6-MINI GOLD FUTURE JUN16





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	12
YSK6	MINI SILVER FUT MAY16	5

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

(단위:백만원)

30

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

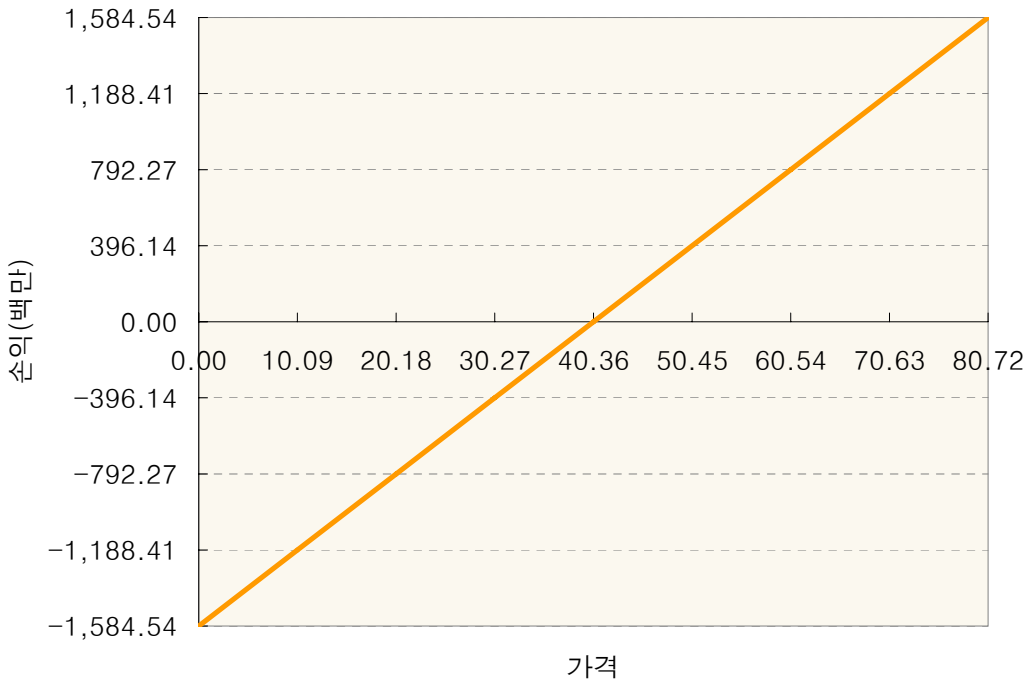
1. 계약금액

(단위:백만원)

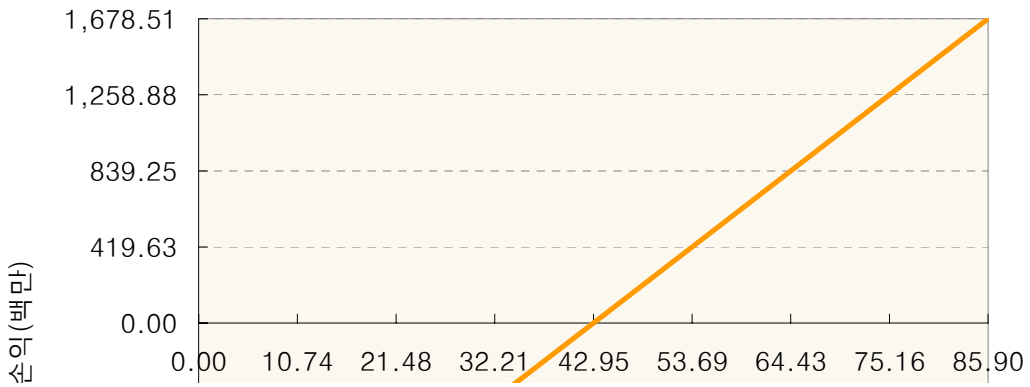
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	1,585	0	1,585	
누계	유가증권	선물	4,520	0	4,520	

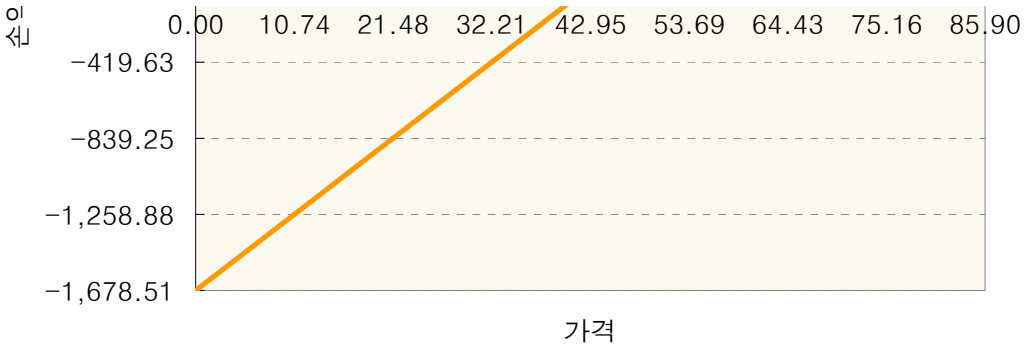
2. 만기시점의 손익구조

CLK6-WTI CRUDE FUTURE MAY16

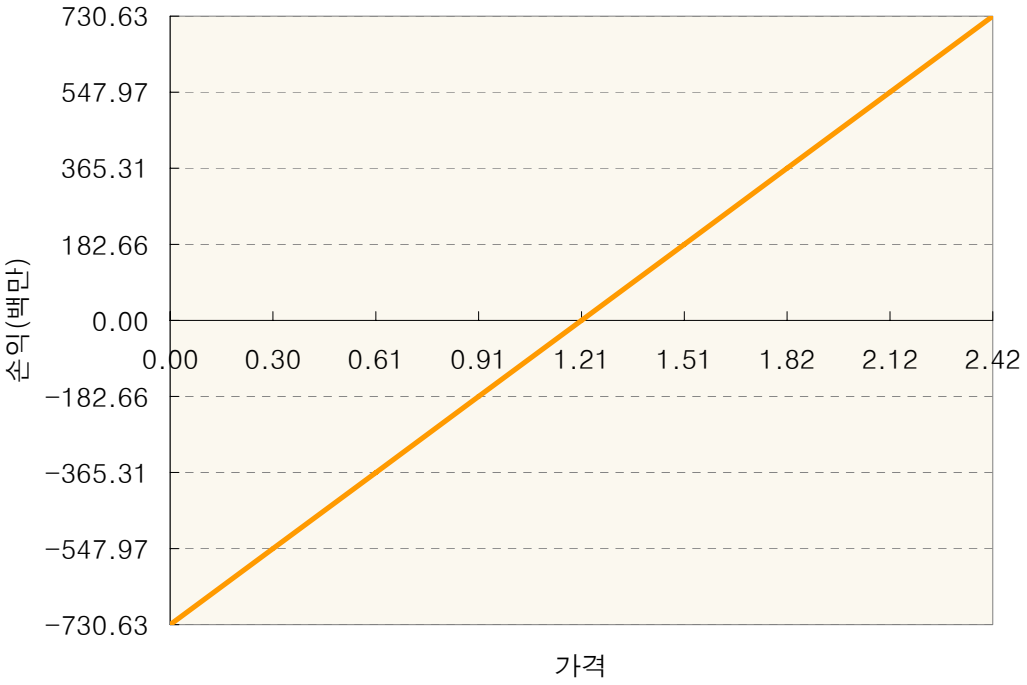


CON6-BRENT CRUDE FUTR JUL16

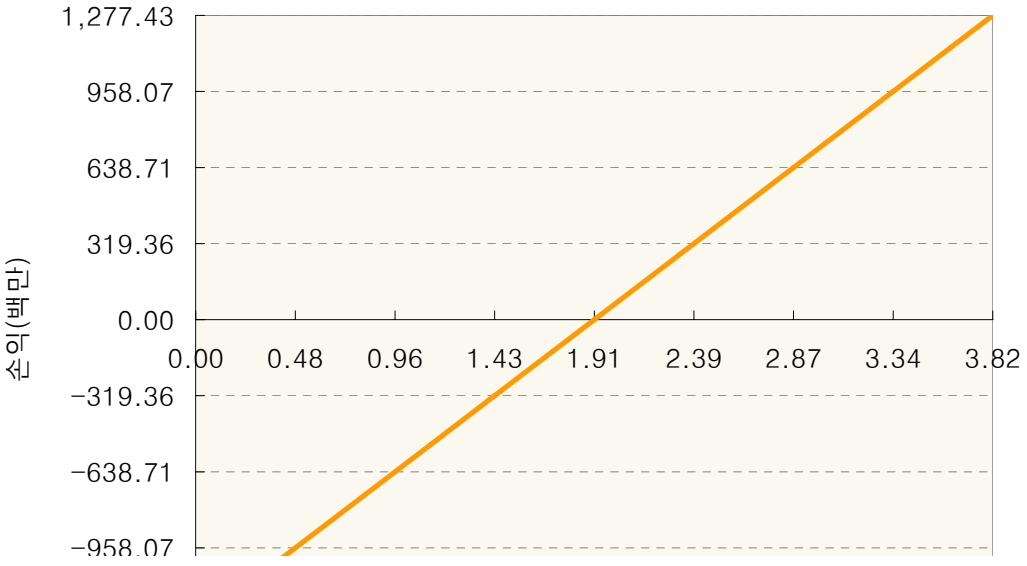


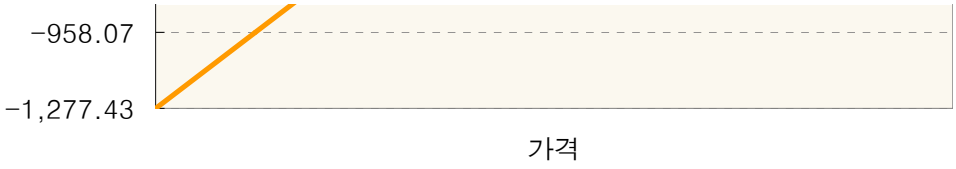


HOK6-NY Harb ULSD Fut MAY16

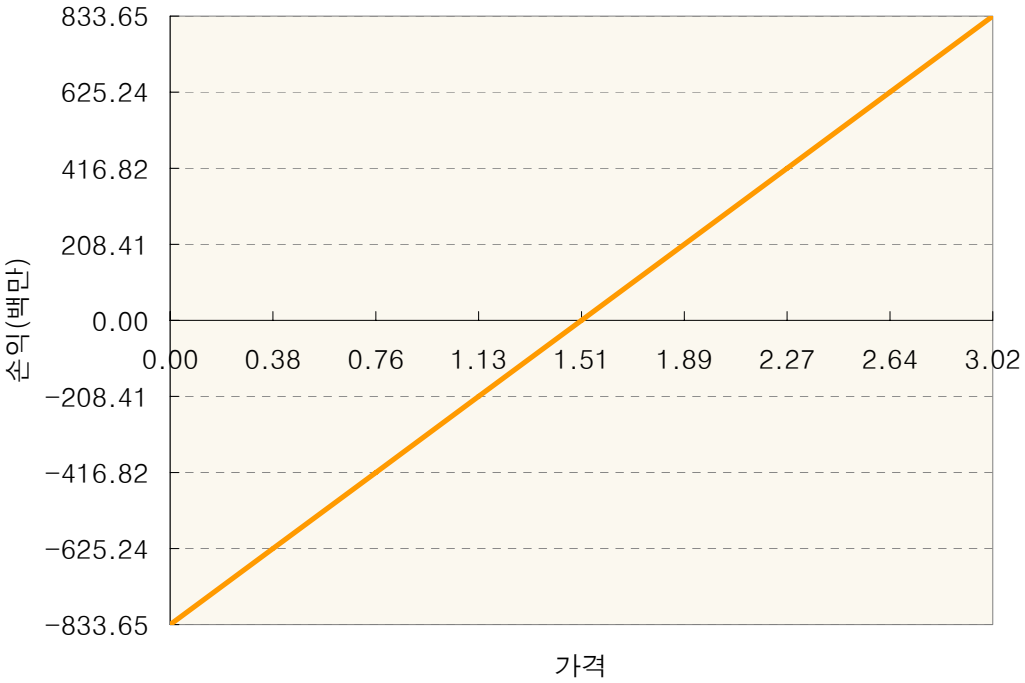


NGK6-NATURAL GAS FUTR MAY16





XBK6-GASOLINE RBOB FUT MAY16



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK6	WTI CRUDE FUTURE MAY16	127
CON6	BRENT CRUDE FUTR JUL16	134
HOK6	NY Harb ULSD Fut MAY16	58
NGK6	NATURAL GAS FUTR MAY16	102
XBK6	GASOLINE RBOB FUT MAY16	67

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

(단위:백만원)

1,328

공시일	2016-04-14
기준일	2016-04-12

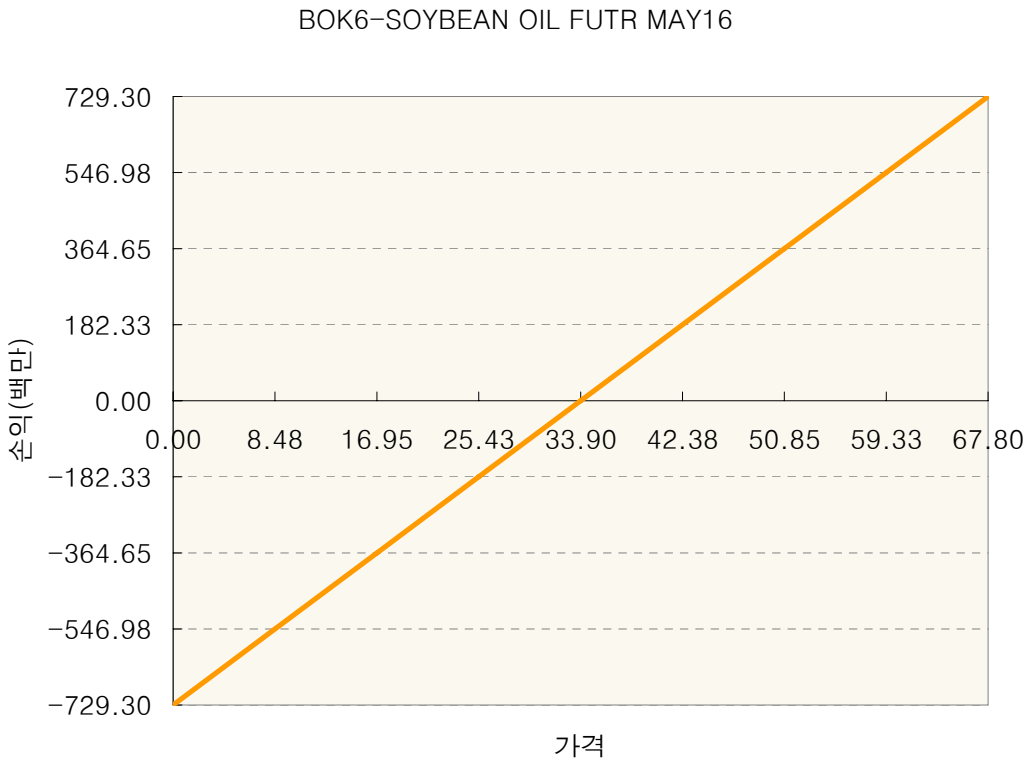
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

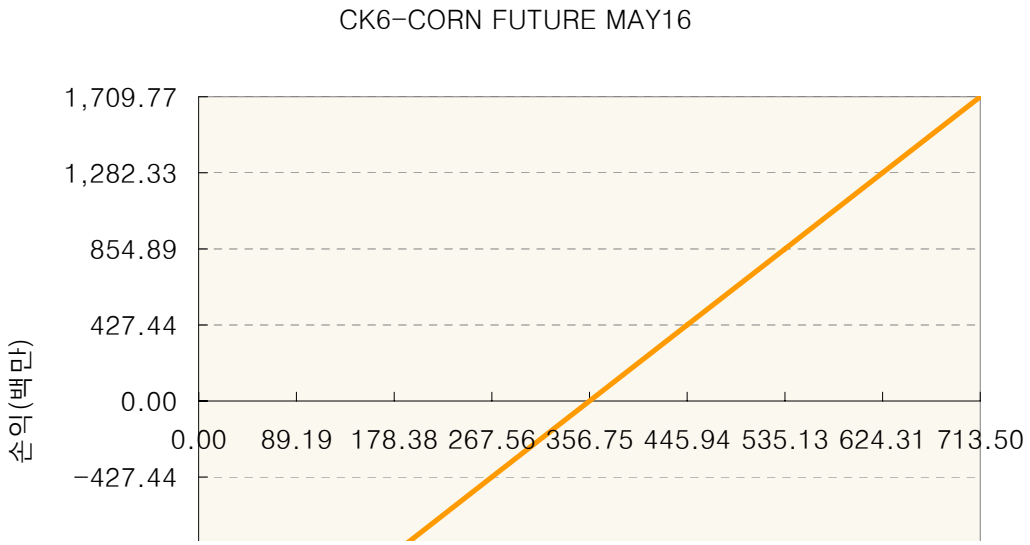
1. 계약금액

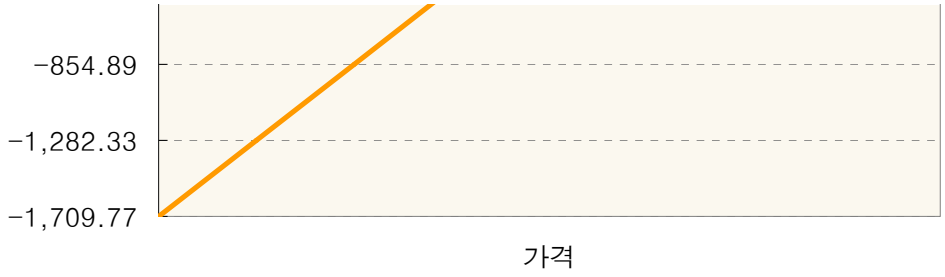
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,092	0	7,092	

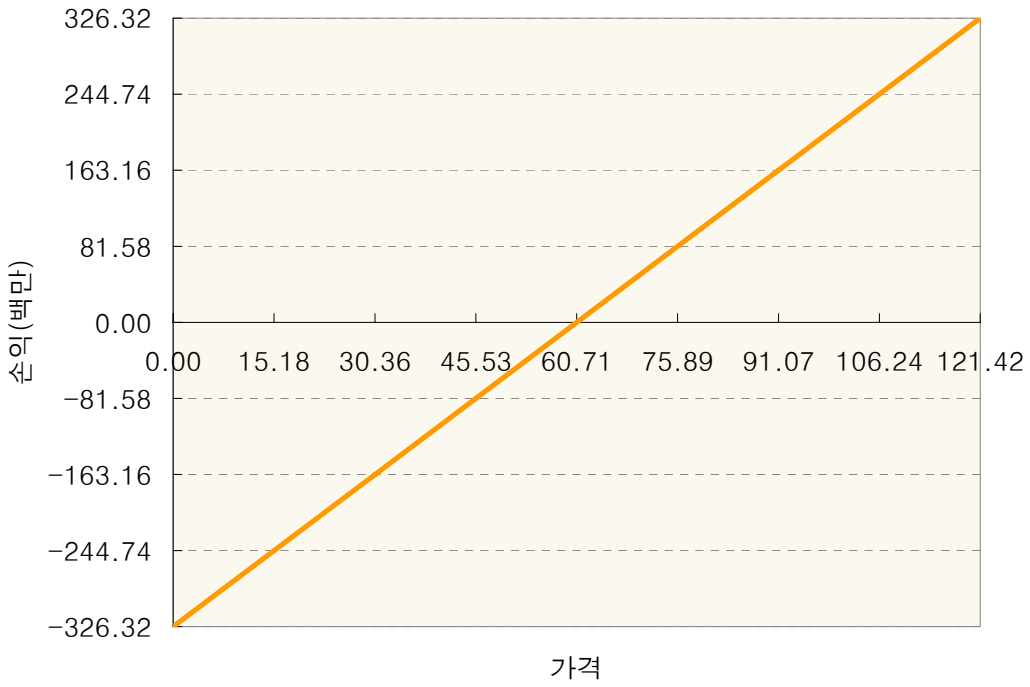
2. 만기시점의 손익구조



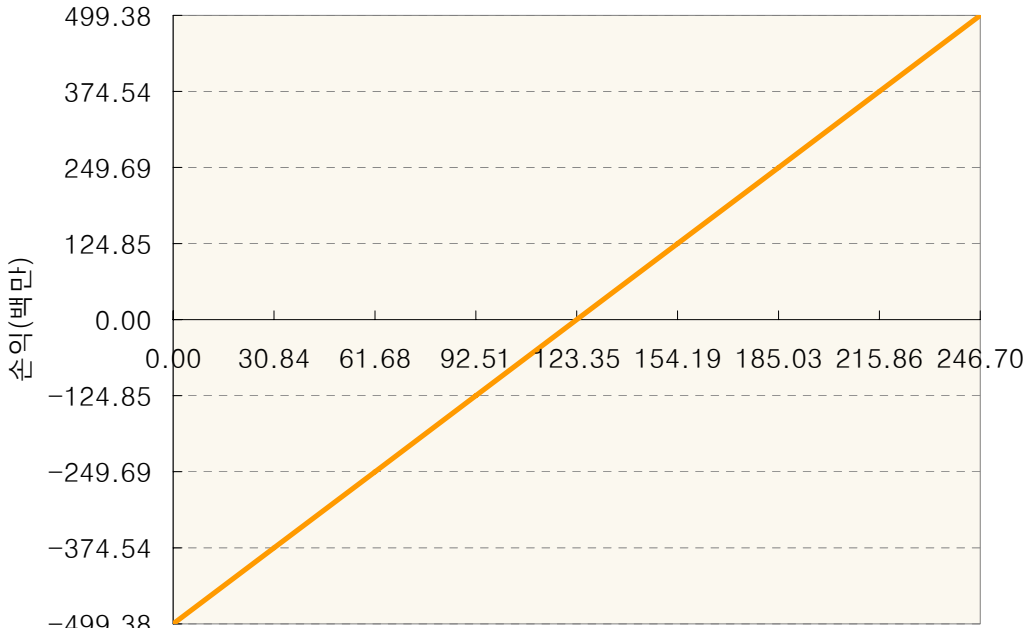


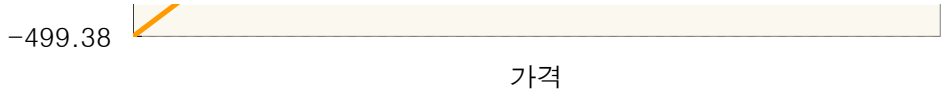


CTK6-COTTON NO.2 FUTR MAY16

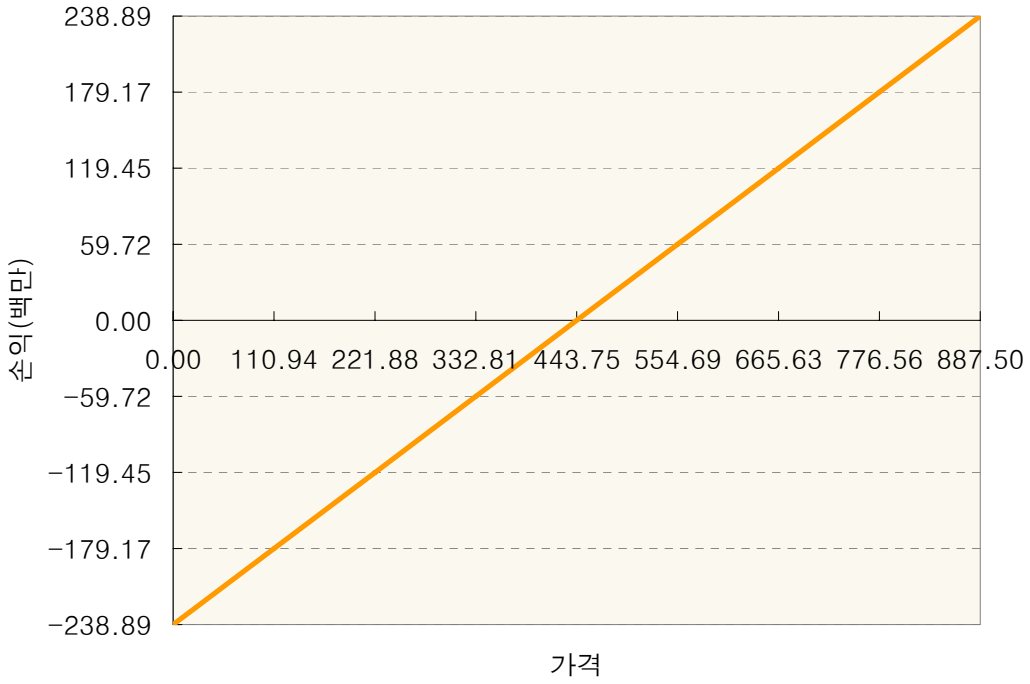


KCK6-COFFEE "C" FUTURE MAY16

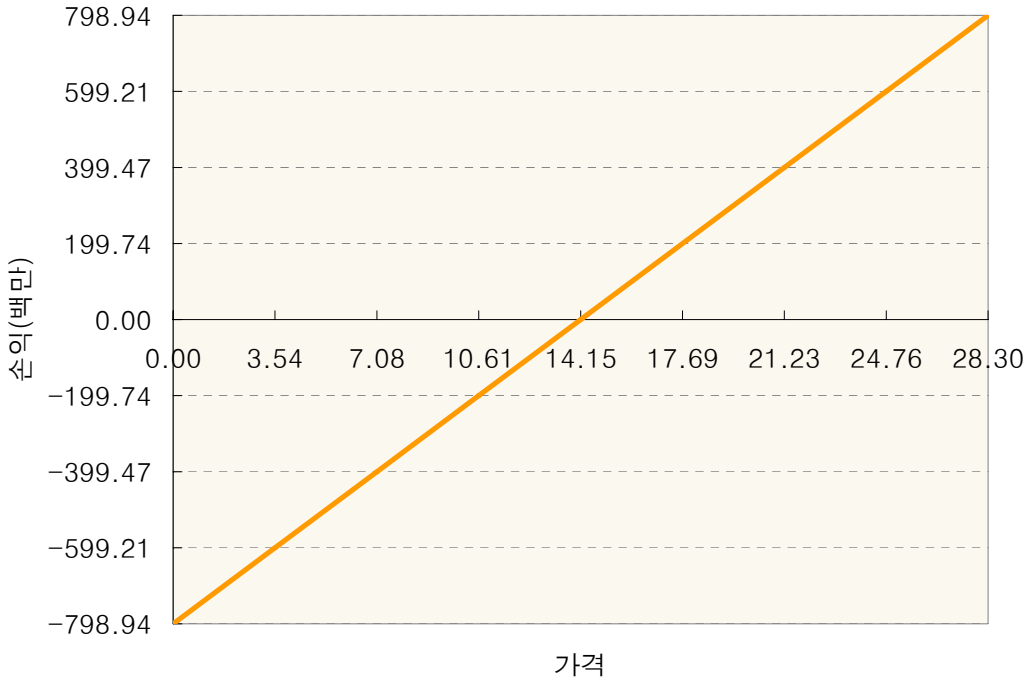




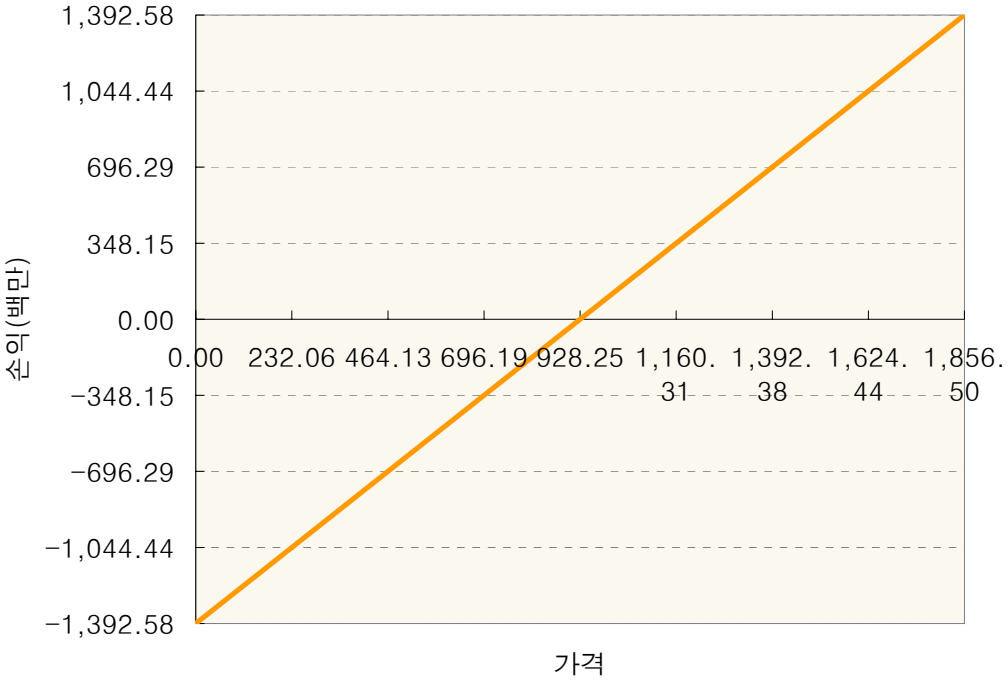
KWK6-KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16



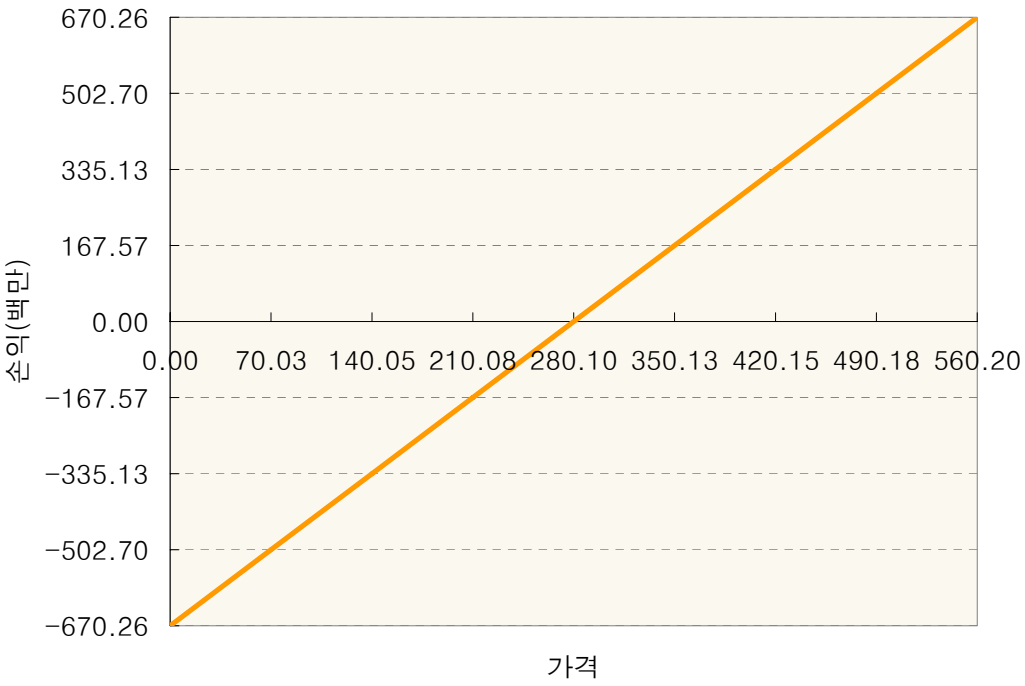
SBK6-Sugar #11 (WORLD) MAY16



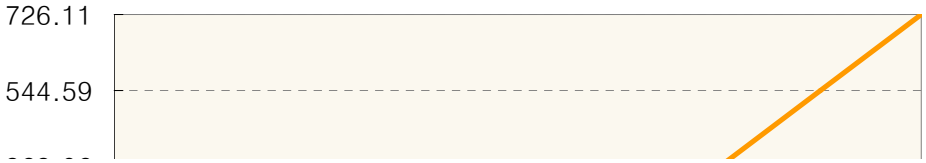
SK6-SOYBEAN FUTURE MAY16

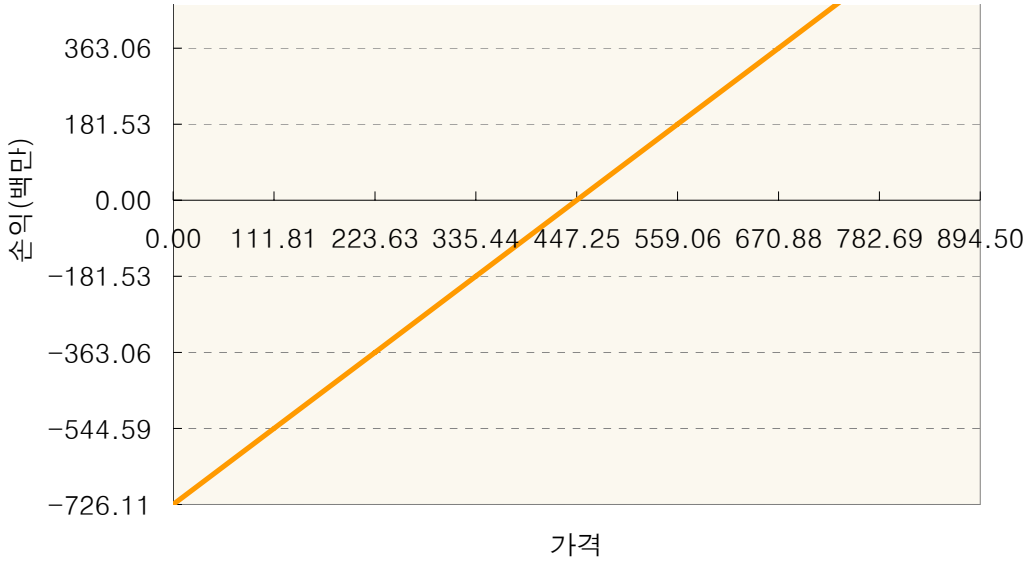


SMK6-SOYBEAN MEAL FUTR MAY16



WK6-WHEAT FUTURE(CBT) MAY16





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOK6	SOYBEAN OIL FUTR MAY16	58
CK6	CORN FUTURE MAY16	137
CTK6	COTTON NO.2 FUTR MAY16	26
KCK6	COFFEE "C" FUTURE MAY16	40
KWK6	KC HRW WHEAT FUTURE(KCB) MAY16	19
SBK6	Sugar #11 (WORLD) MAY16	64
SK6	SOYBEAN FUTURE MAY16	111
SMK6	SOYBEAN MEAL FUTR MAY16	54
WK6	WHEAT FUTURE(CBT) MAY16	58

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

(단위:백만원)

758