

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

포커스농산물모(채권-파생형)

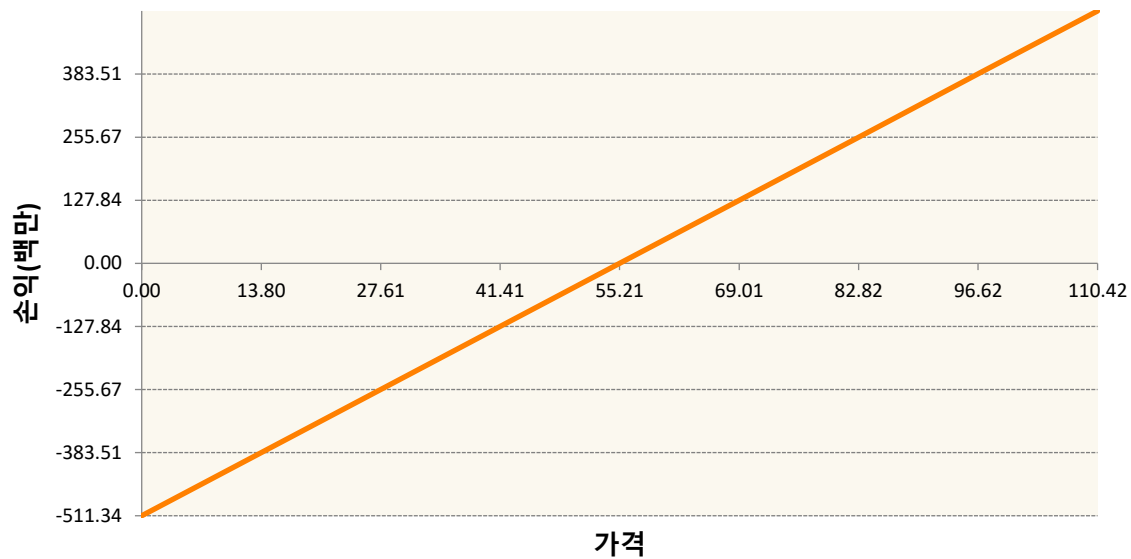
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

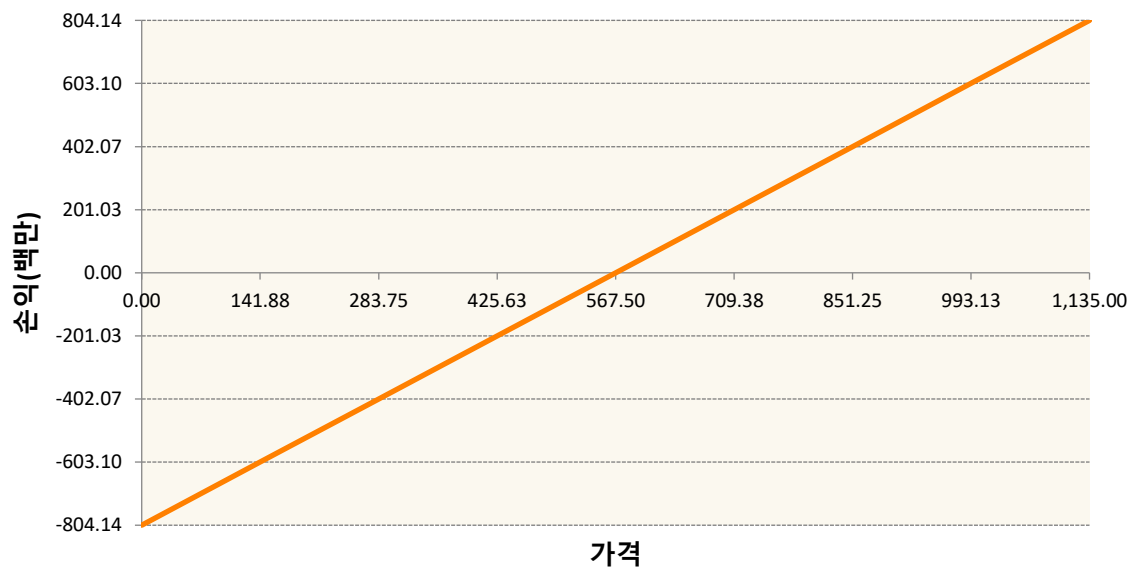
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,418	531	3,887	

2. 만기시점의 손익구조

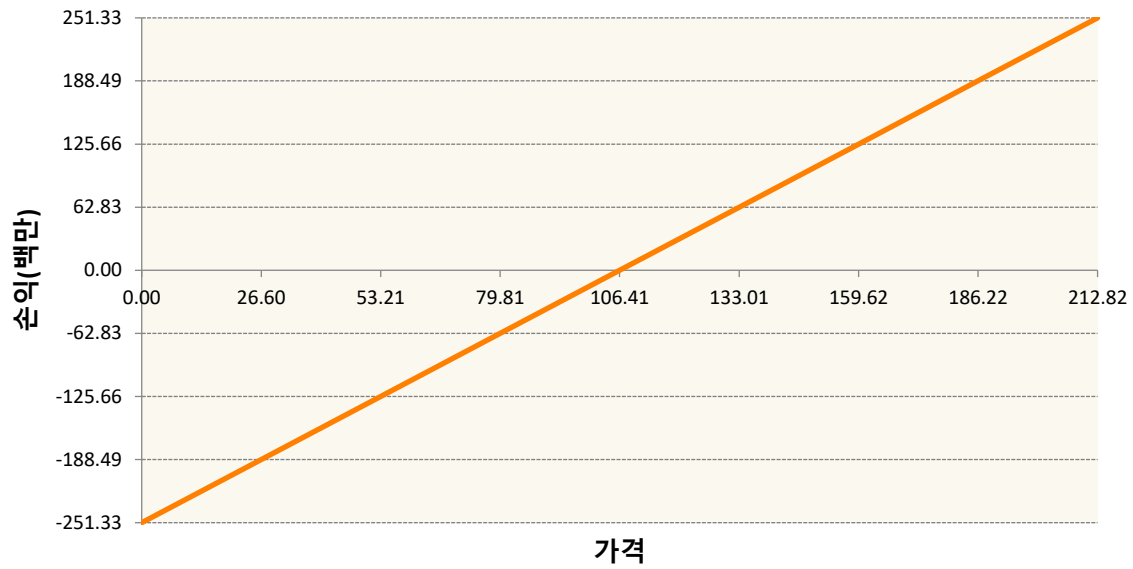
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



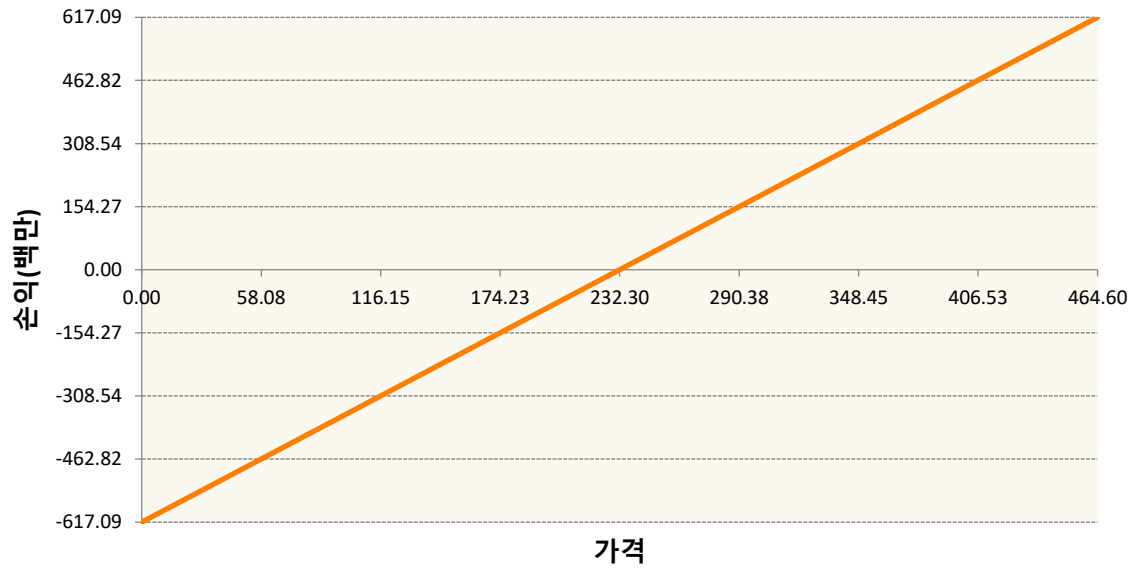
CH2-CORN FUTURE Mar22



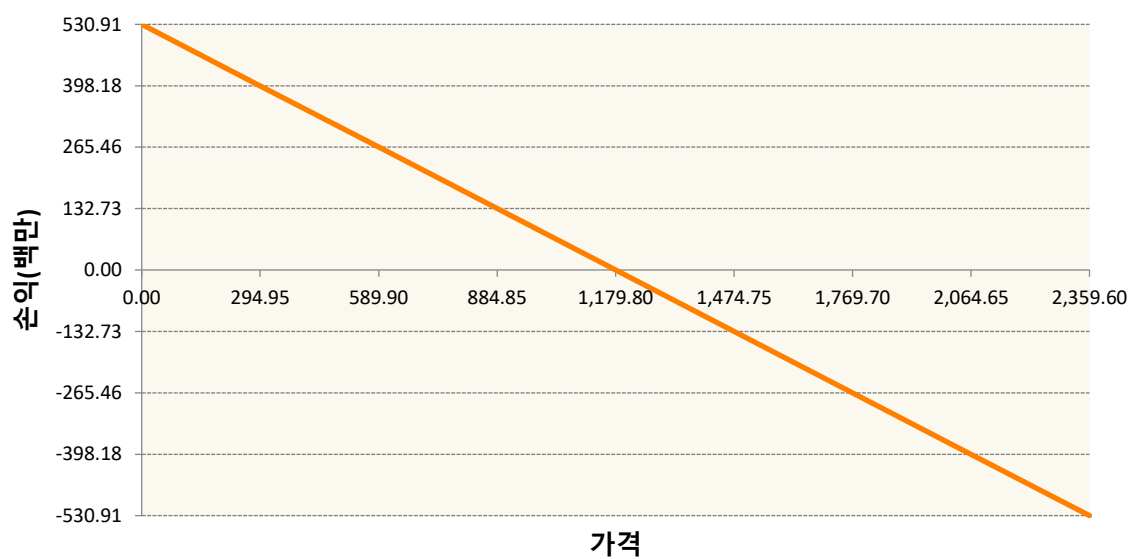
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



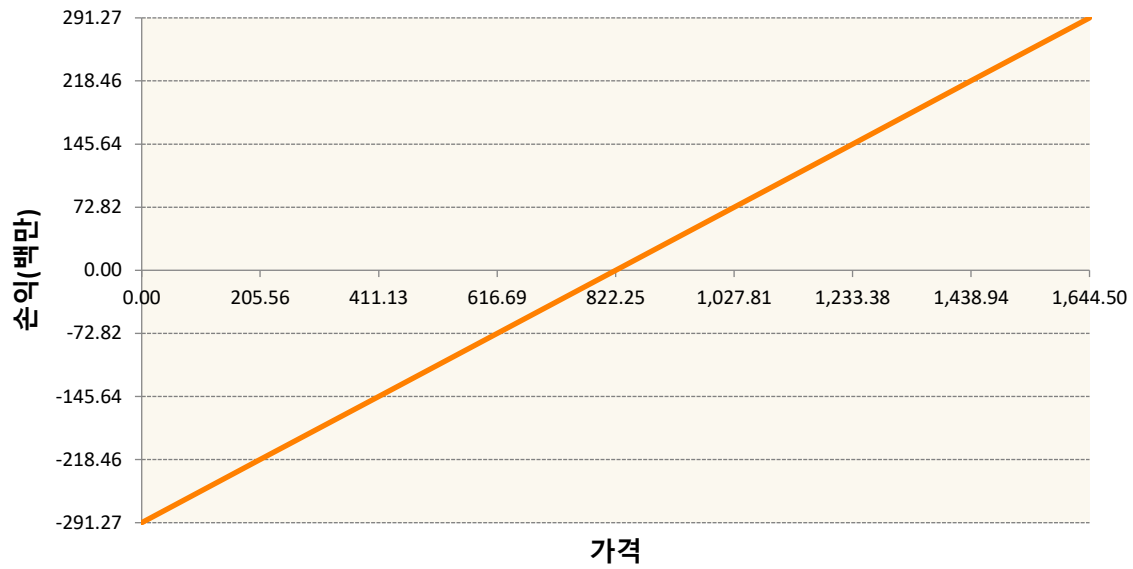
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



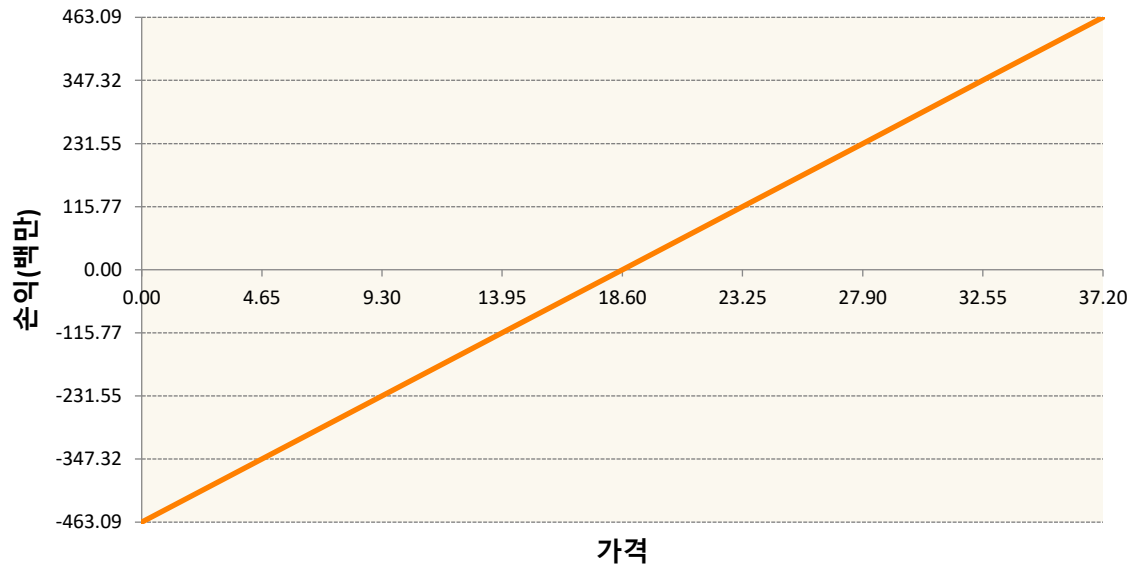
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



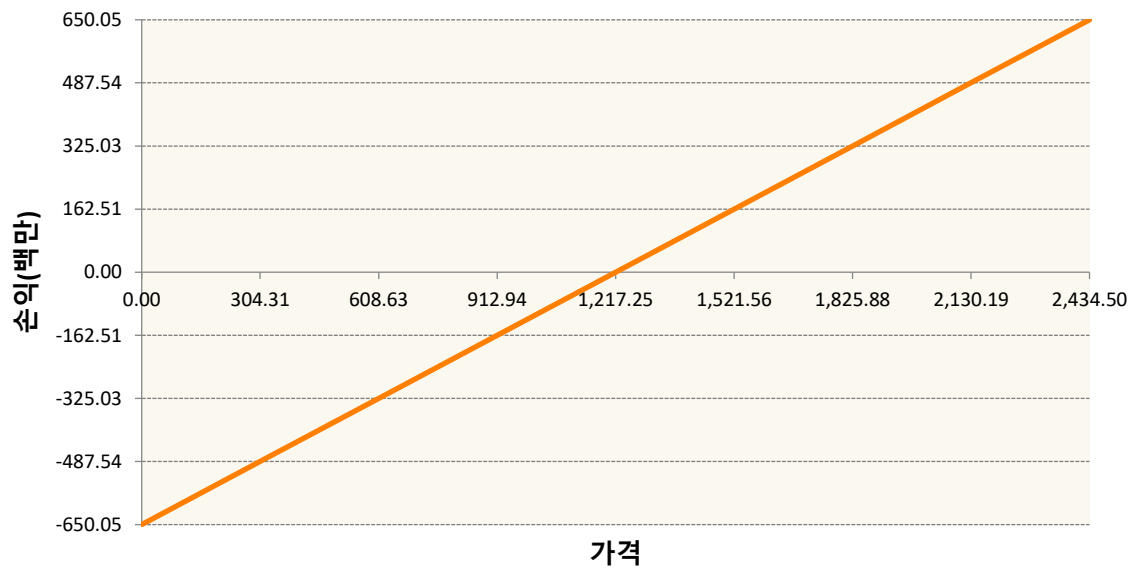
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



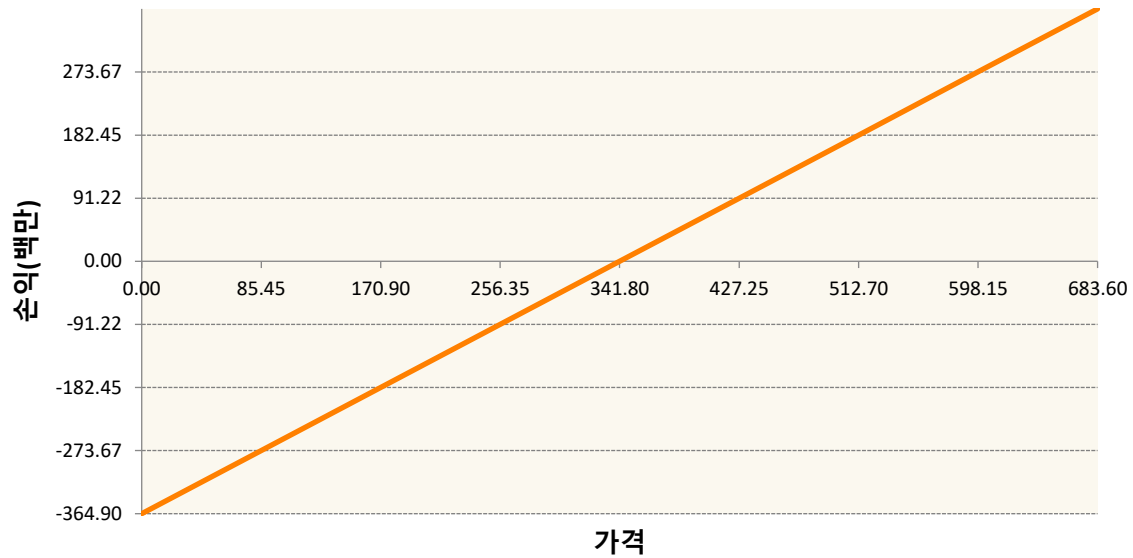
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



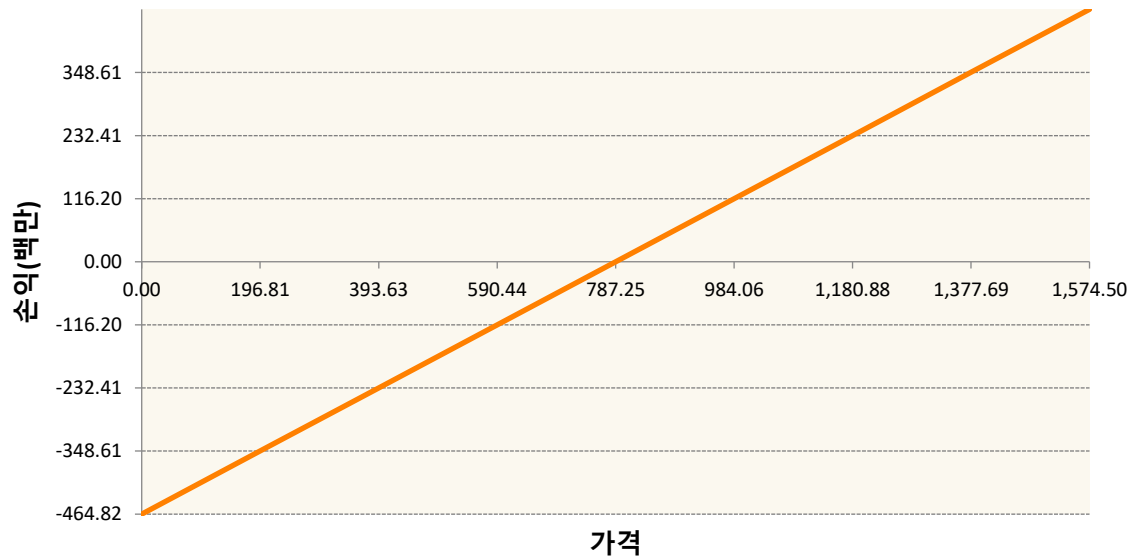
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



SMF2-SOYBEAN MEAL FUTR Jan22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

스마트인덱스모

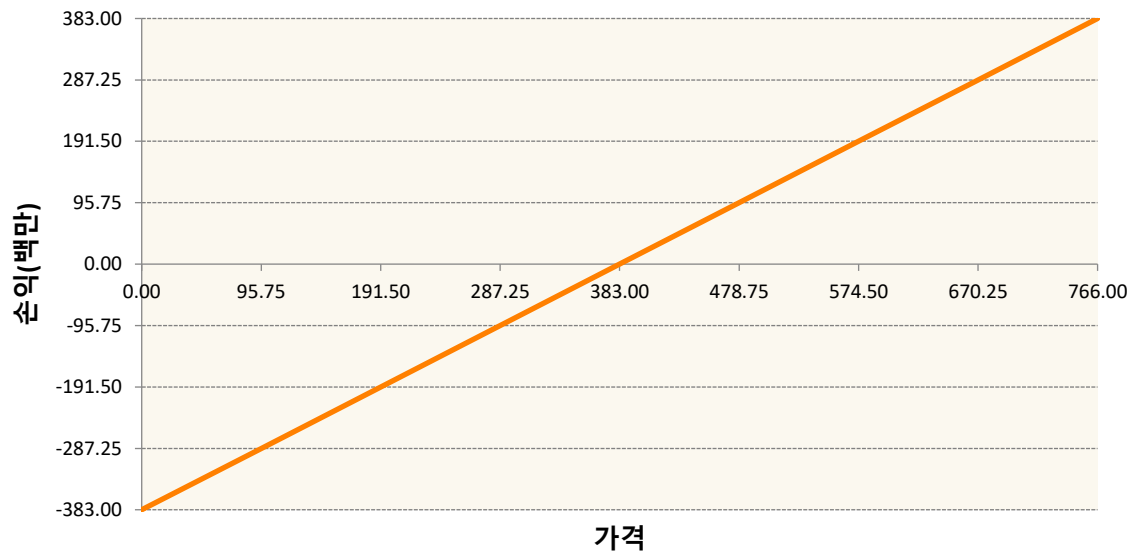
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	383	0	383	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101RC0000

2021-12 코스피200지수선물

31

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

공시일	2021-12-02
기준일	2021-12-01

SMART합성-MSCI선진국증권상장

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	11,469	0	11,469	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20211125

891

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

527

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-02
기준일	2021-12-01

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	5,623	0	5,623	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래210913

437

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

426

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

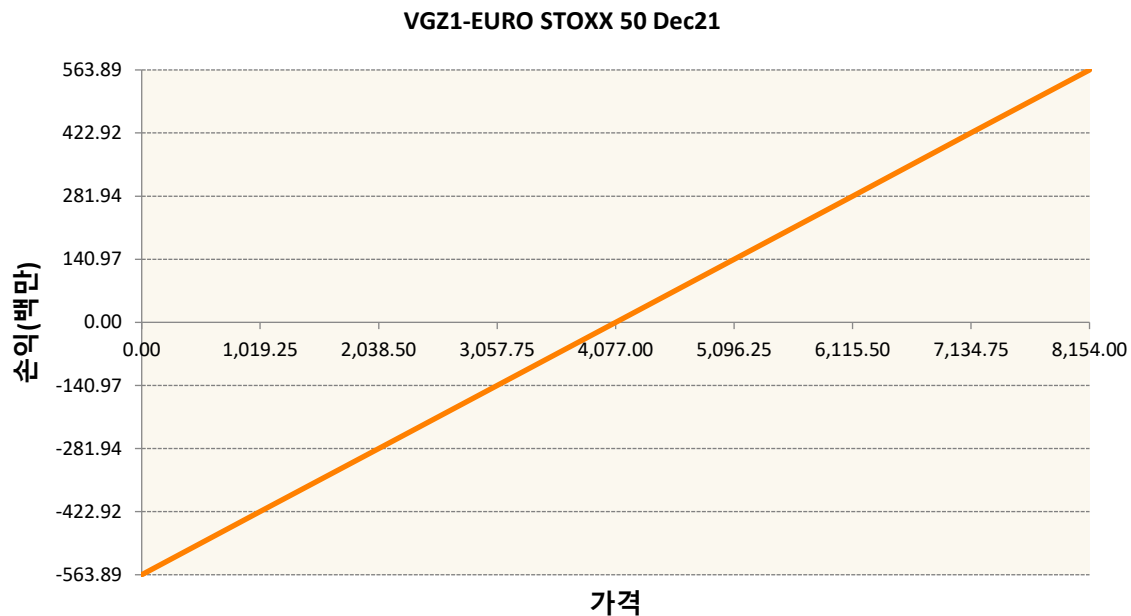
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	564	0	564	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ1	EURO STOXX 50 Dec21	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

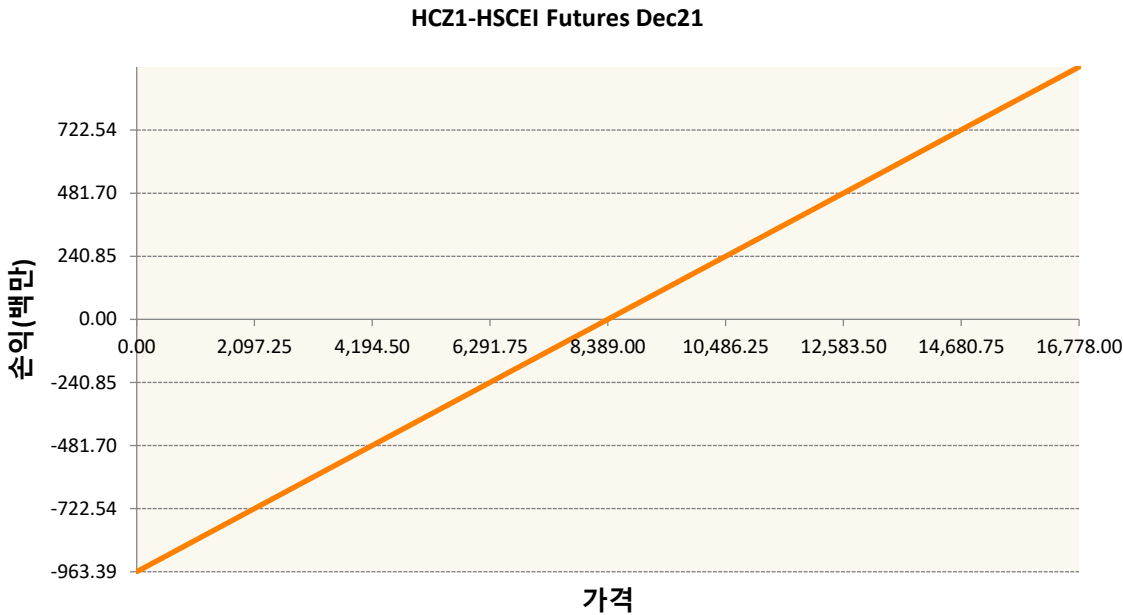
공시일	2021-12-02
기준일	2021-12-01

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	963	0	963	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	77
------	---------------------	----

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

82

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

커버드콜모(주식혼합-파생형)

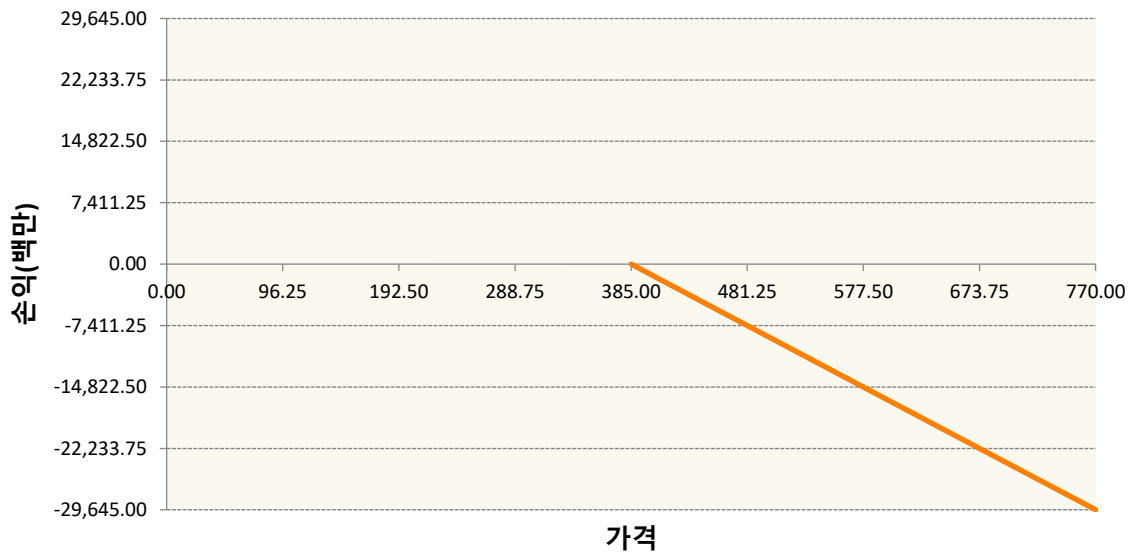
1. 계약금액

(단위:백만원)

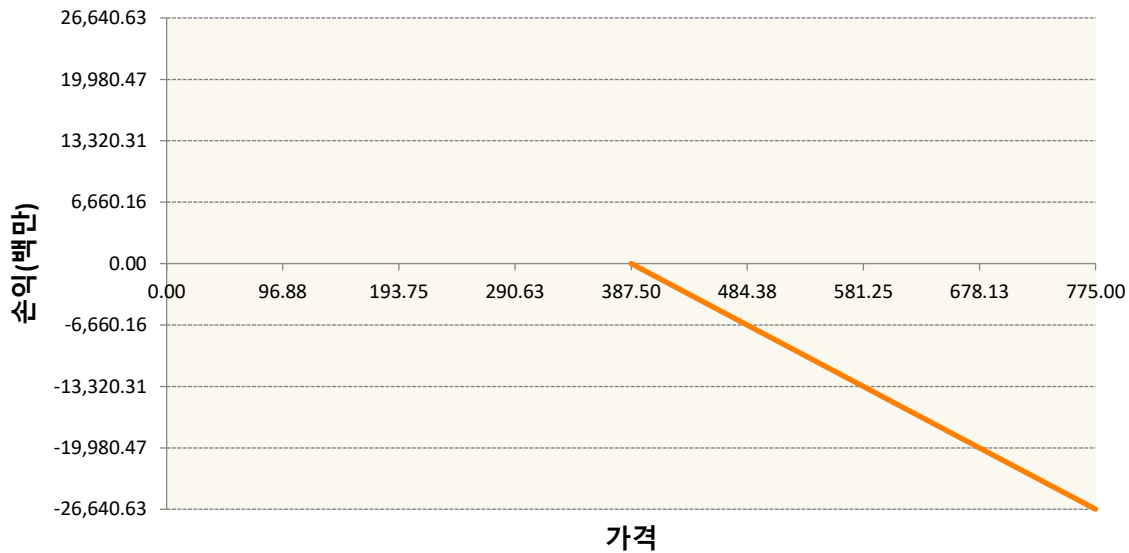
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,517	-76,517	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201RC3854-2021-12 콜385



KR4201RC3870-2021-12 콜387.5



가격	순이익(백만)
0.00	-17,325.00
96.25	-12,993.75
192.50	-8,662.50
288.75	-4,331.25
385.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price and profit/loss. The x-axis represents '가격' (Price) and the y-axis represents '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions). A solid orange line shows a linear relationship, starting at a price of 0.00 with a loss of 2,906.25 million and reaching a profit of 0 million at a price of 387.50 million.

가격	손익 (백만)
0.00	-2,906.25
387.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201RC3854							2021-12 콜385		1,850	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	420	419	417	413	408	402	393			
-5.33%	411	403	393	380	364	347	327			
-2.67%	348	323	296	266	236	204	171			
0%	122	81	41	0	-41	-81	-122			
2.67%	-354	-388	-423	-459	-496	-534	-572			
5.33%	-1,030	-1,045	-1,064	-1,085	-1,108	-1,134	-1,161			
8.00%	-1,792	-1,796	-1,802	-1,810	-1,821	-1,834	-1,850			
KR4201RC3870							2021-12 콜387.5		1,568	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	304	304	303	300	297	293	287
-5.33%	300	295	288	279	268	255	240
-2.67%	262	243	223	200	176	150	123
0%	105	70	35	0	-35	-71	-107
2.67%	-265	-299	-333	-368	-403	-438	-474
5.33%	-833	-851	-871	-894	-918	-944	-972
8.00%	-1,501	-1,507	-1,514	-1,524	-1,537	-1,551	-1,568
KR4301RC3853 2021-12 풋385							1,210

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,208	-1,208	-1,208	-1,208	-1,209	-1,209	-1,210
-5.33%	-749	-750	-751	-754	-756	-760	-765
-2.67%	-304	-311	-319	-329	-339	-351	-363
0%	52	35	17	0	-17	-35	-52
2.67%	219	207	194	180	166	151	136
5.33%	255	252	248	243	237	230	222
8.00%	258	258	257	256	255	253	250

KR4301RC3879 2021-12 풋387.5							209
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-133	-133	-134
-2.67%	-57	-58	-59	-60	-61	-63	-64
0%	8	5	3	0	-3	-6	-8
2.67%	44	41	39	36	34	31	28
5.33%	53	53	52	51	49	48	46
8.00%	54	54	54	54	54	53	52

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

(단위:백만원)

5,224

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

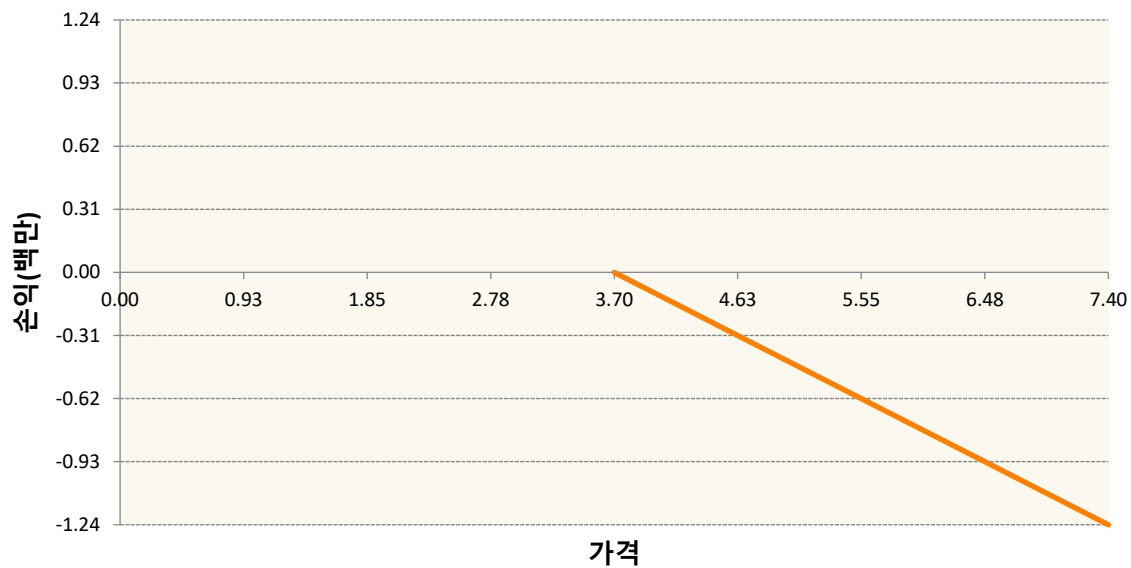
1. 계약금액

(단위:백만원)

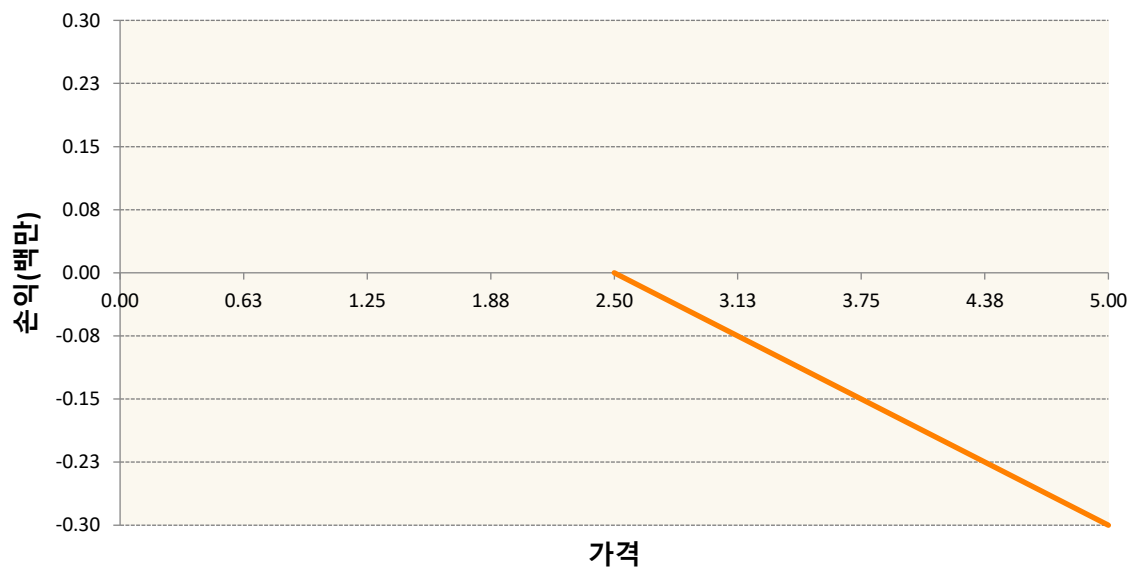
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	161	-161	장내

2. 만기시점의 손익구조

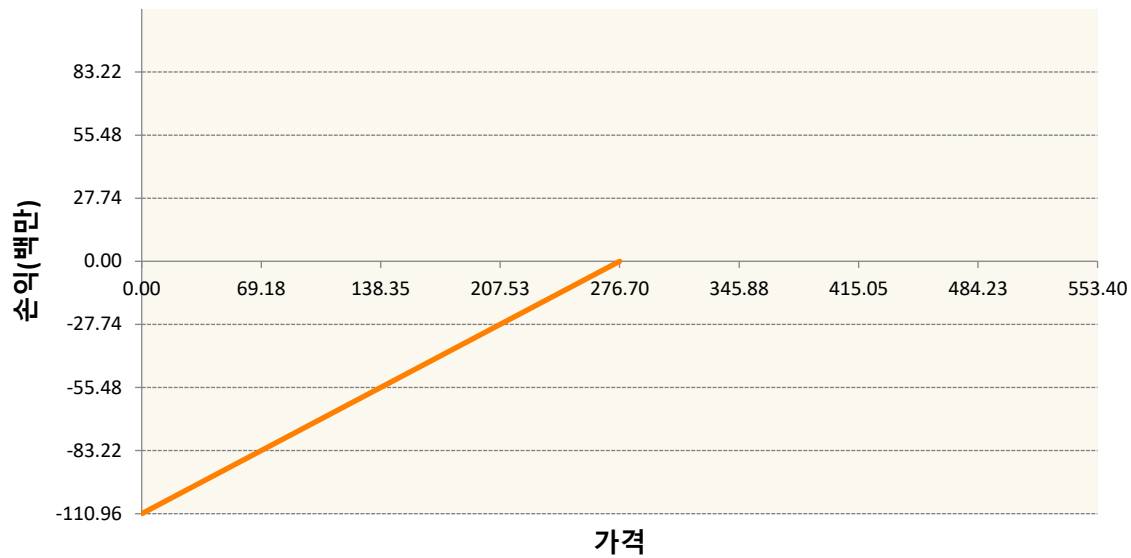
OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



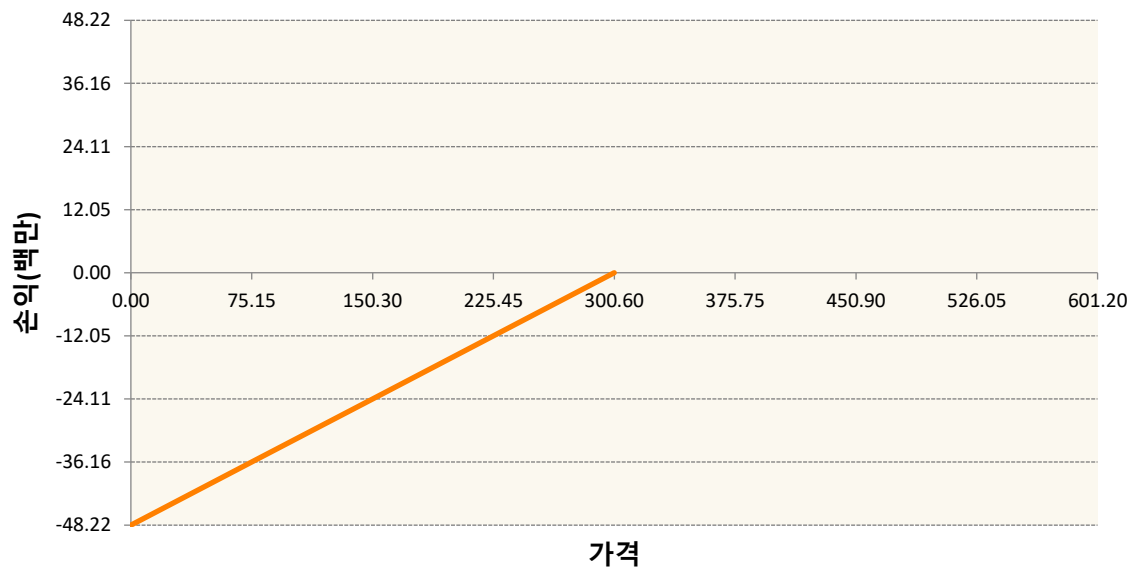
OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50



OESXZ1-P4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-P4375-EURO STOXX 50



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY

31

OESXZ1-C43 EURO STOXX 50

0.1

OESXZ1-C43 EURO STOXX 50

0.02

OESXZ1-P43 EURO STOXX 50

9

OESXZ1-P43 EURO STOXX 50

4

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

(단위:백만원)

44

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

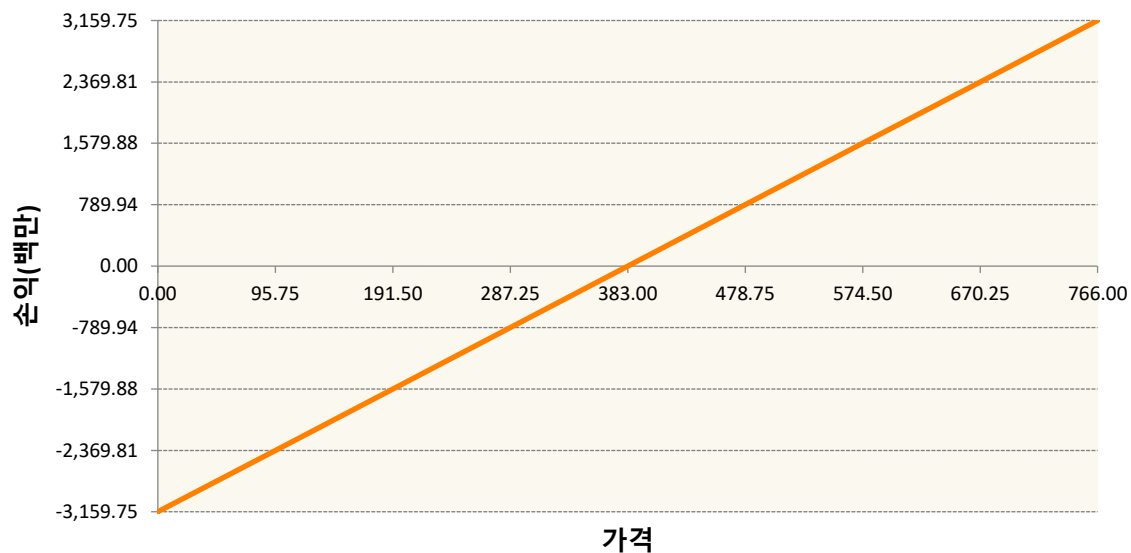
1. 계약금액

(단위:백만원)

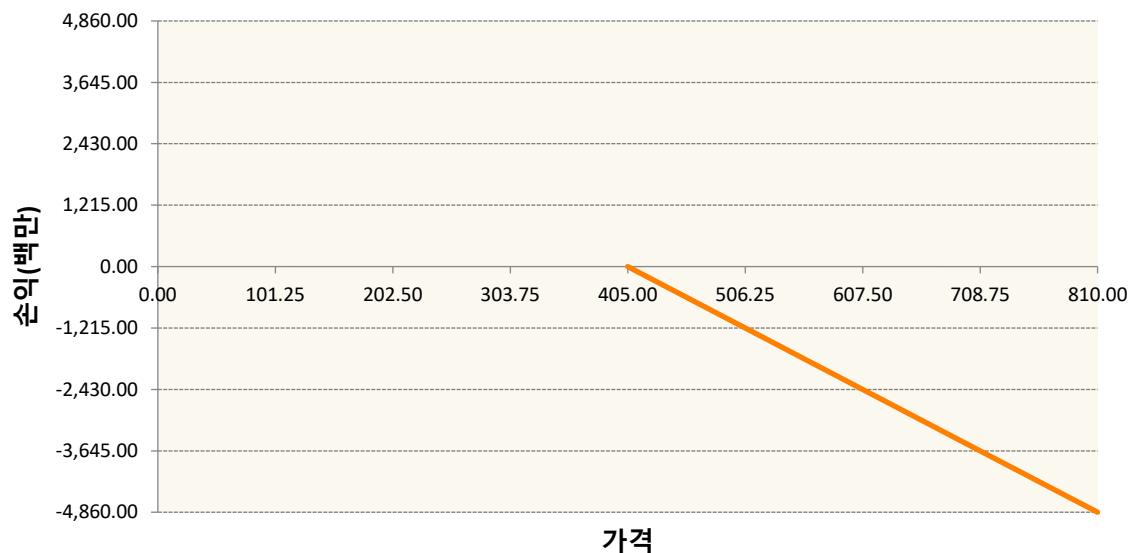
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,160	0	3,160	장내
누계	유가증권	옵션	579	5,369	-4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조

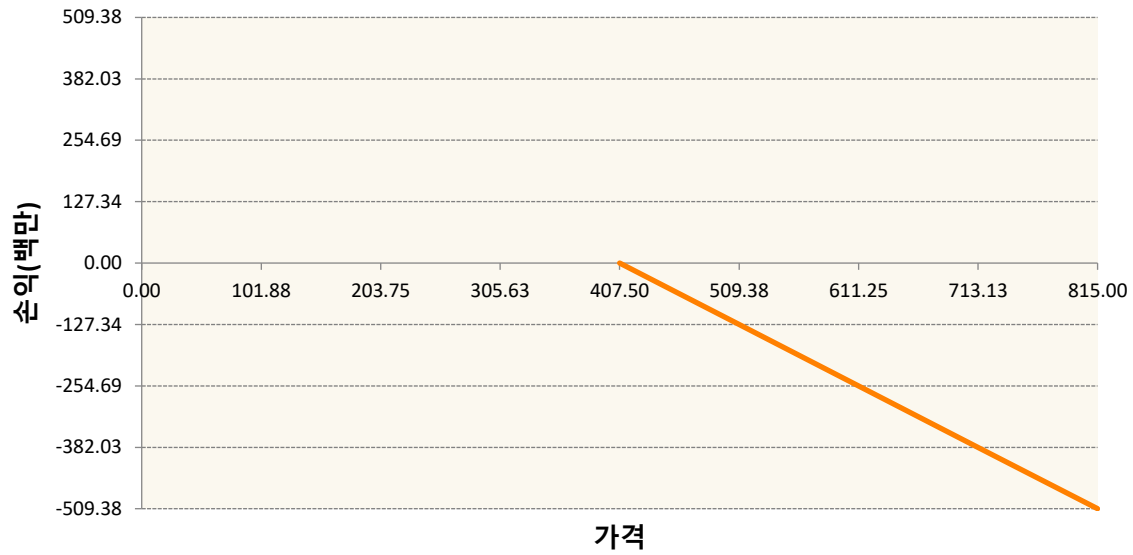
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



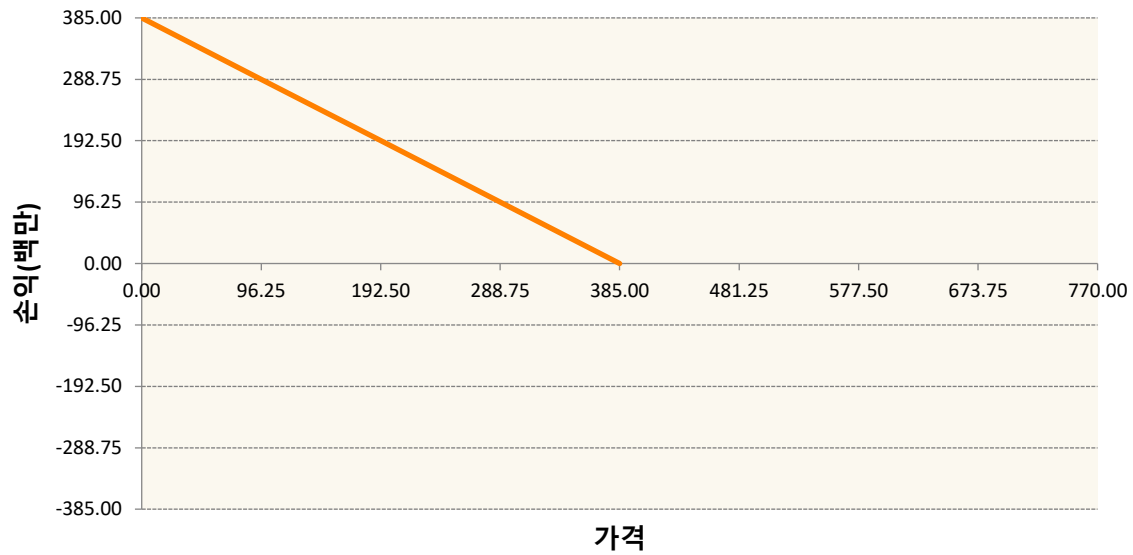
KR4201RC4050-2021-12 콜405



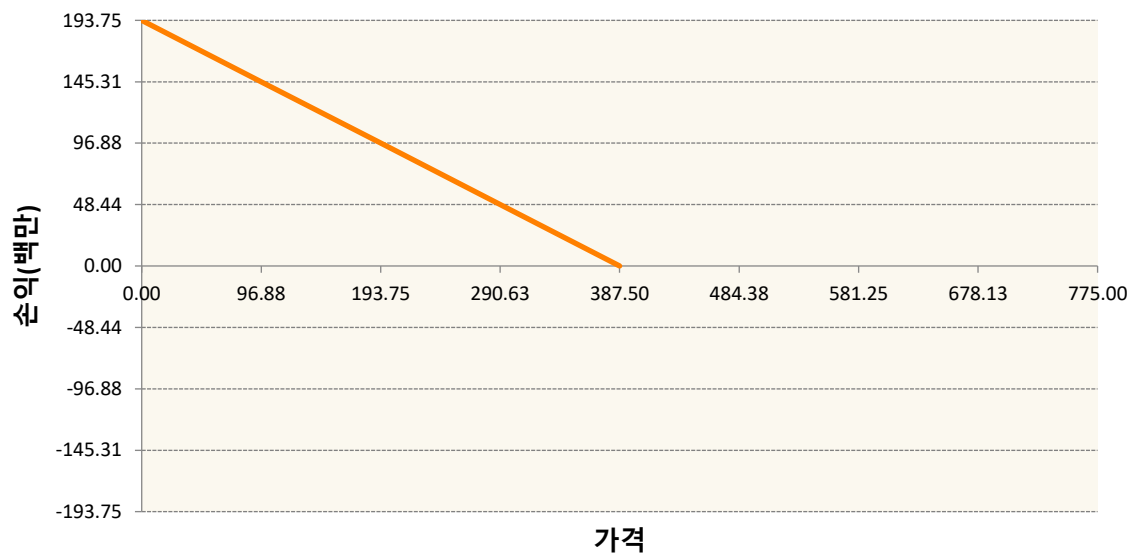
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



KR4301RC3853-2021-12 풋385



KR4301RC3879-2021-12 풋387.5



(단위:백만원)

KR4101RC0000							2021-12 코스피200지수선물		253		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253				
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169				
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	84	84	84	84	84	84	84				
5.33%	169	169	169	169	169	169	169				
8.00%	253	253	253	253	253	253	253				
KR4201RC4050							2021-12 콜405		154		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8				
-5.33%	8	8	8	8	8	7	7				
-2.67%	8	8	7	7	6	4	2				
0%	6	5	2	0	-3	-6	-10				
2.67%	-6	-10	-15	-20	-25	-31	-36				
5.33%	-44	-50	-57	-64	-70	-77	-84				
8.00%	-119	-124	-130	-136	-142	-148	-154				
KR4201RC4076							2021-12 콜407.5		14		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1				
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1				
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0				
0%	0	0	0	0	0	-1	-1				
2.67%	0	-1	-1	-2	-2	-3	-3				
5.33%	-4	-4	-5	-6	-6	-7	-8				
8.00%	-10	-11	-12	-12	-13	-14	-14				
KR4301RC3853							2021-12 풋385		27		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	27	27	27	27	27	27	27				
-5.33%	17	17	17	17	17	17	17				
-2.67%	7	7	7	7	8	8	8				
0%	-1	-1	0	0	0	1	1				
2.67%	-5	-5	-4	-4	-4	-3	-3				
5.33%	-6	-6	-6	-5	-5	-5	-5				
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6				
KR4301RC3879							2021-12 풋387.5		14		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	14	14	14
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-2.67%	4	4	4	4	4	4	4
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-2
5.33%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3

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

(단위:백만원)

401

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	17,718	0	17,718	

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	2021-12-02
기준일	2021-12-01

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	9,547	0	9,547	

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	2021-12-02
기준일	2021-12-01

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	45,091	0	45,091	
누계	통화	선도	1,415	0	1,415	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBW USD/KRW 24-12-21E	113
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

38

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

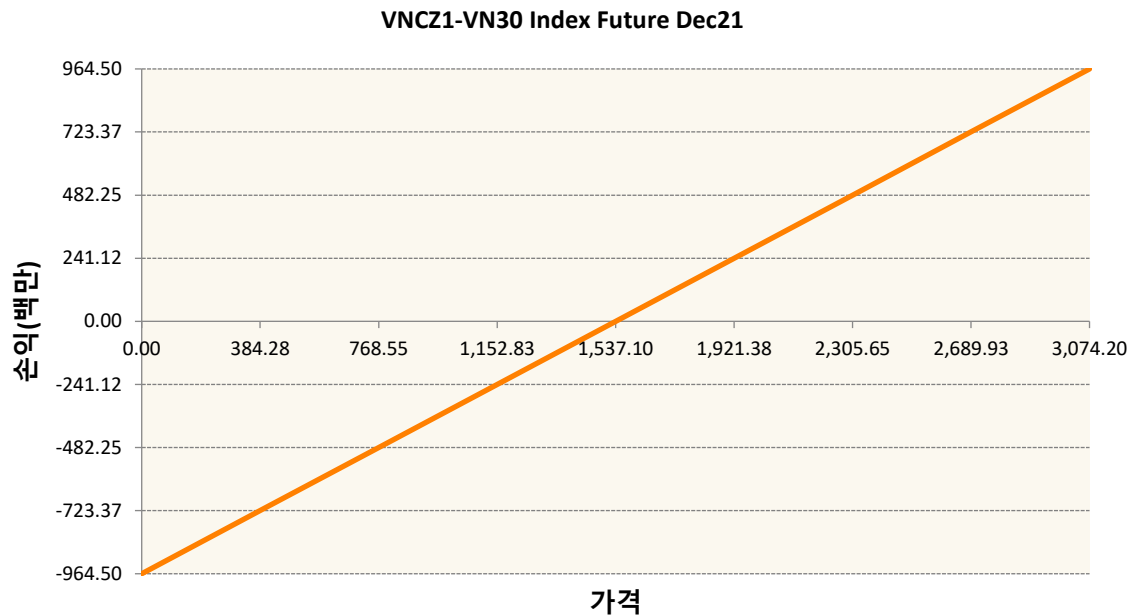
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	964	0	964	
누계	유가증권	스왑	1,785	0	1,785	장외
누계	통화	선도	0	575	-575	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	143
FXW213BBQ KRW/EUR 25-02-22E	35
FXW213BBS KRW/EUR 25-02-22E	11
VNCZ1 VN30 Index Future Dec21	77

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

(단위:백만원)

256

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

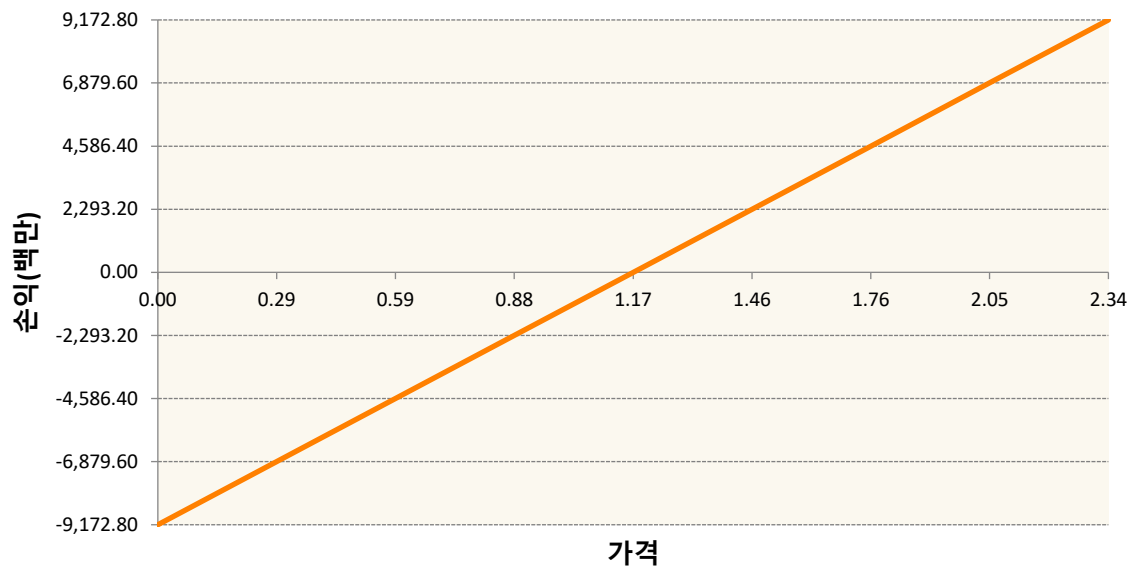
1. 계약금액

(단위:백만원)

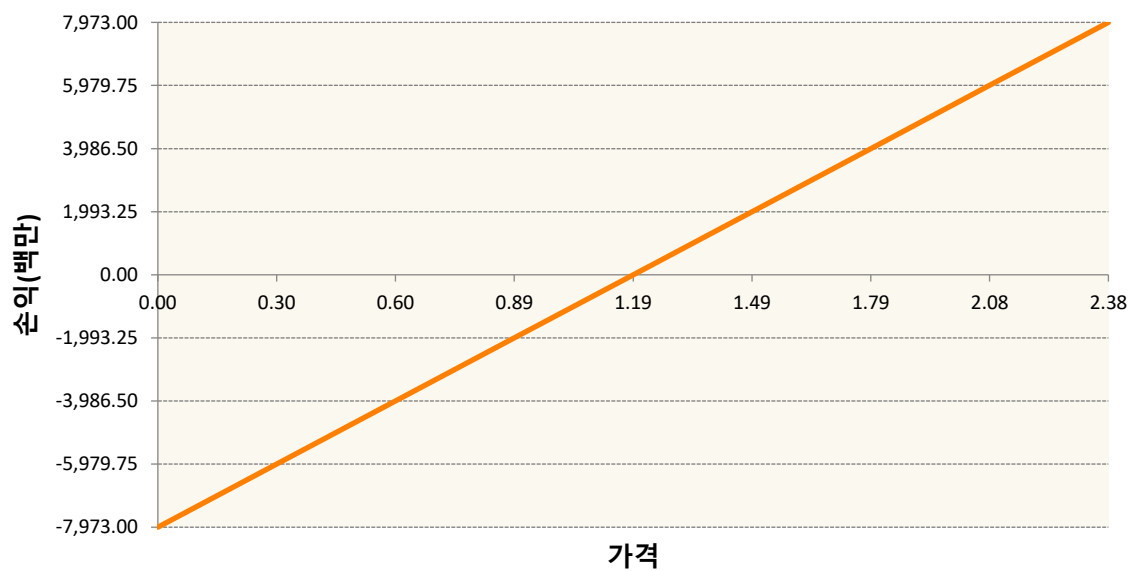
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,139	0	25,139	

2. 만기시점의 손익구조

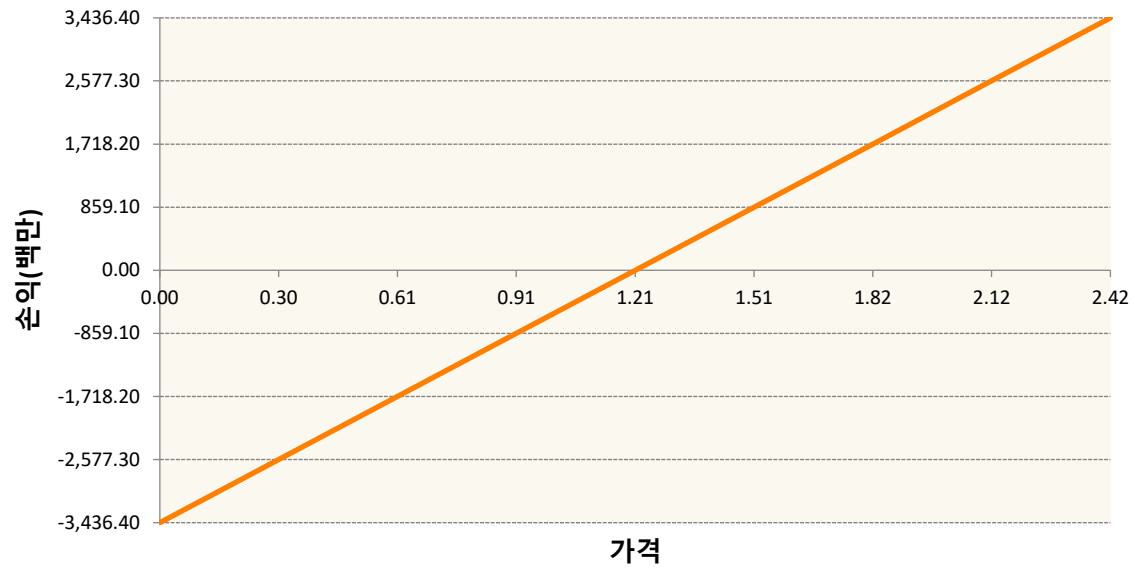
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



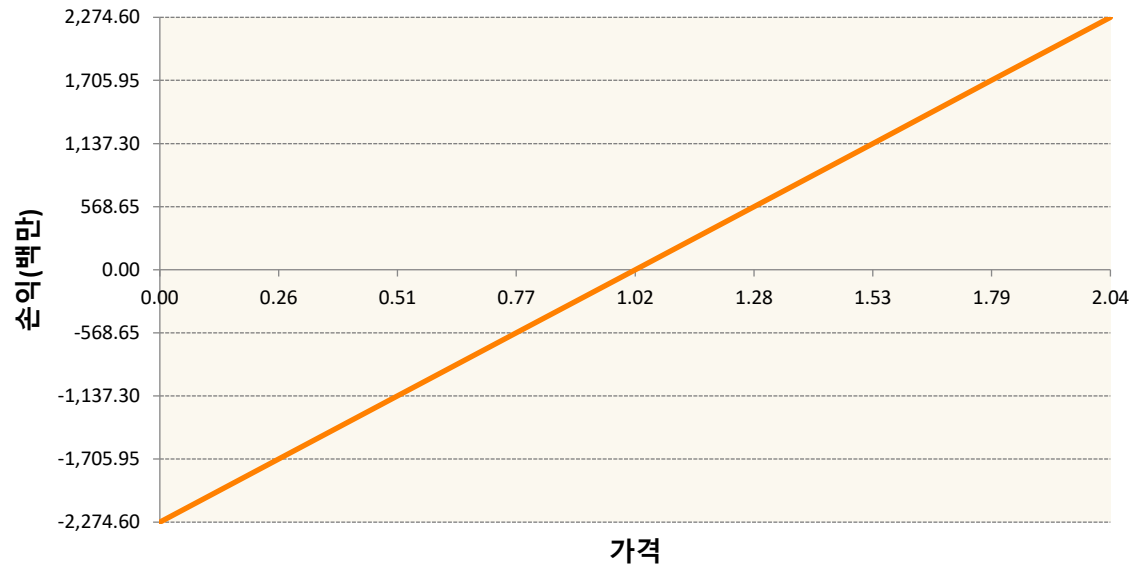
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



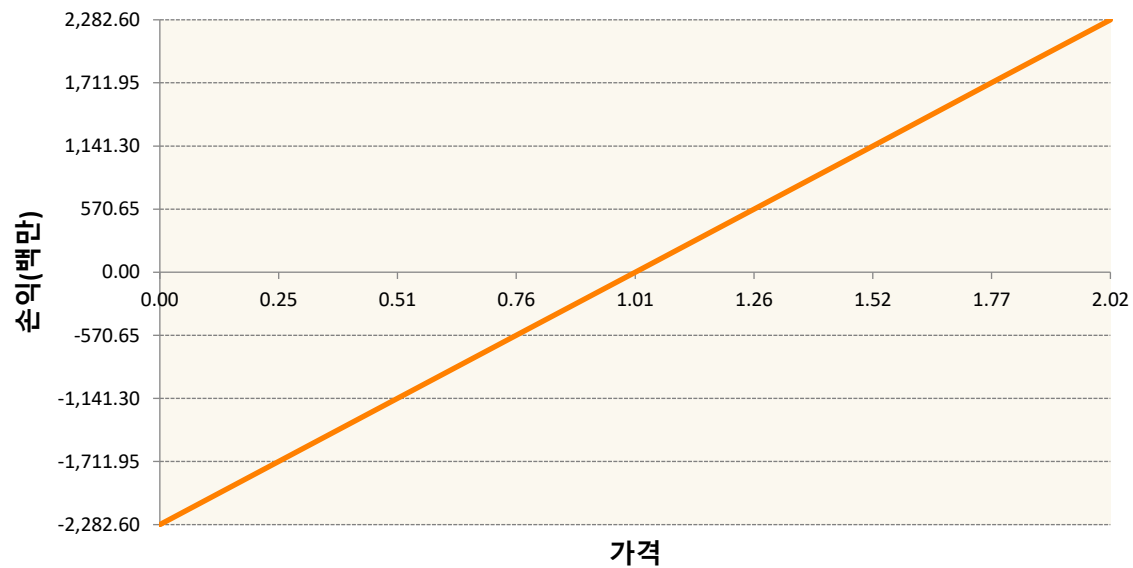
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		731
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		637
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		274
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		182
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		183

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,030

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

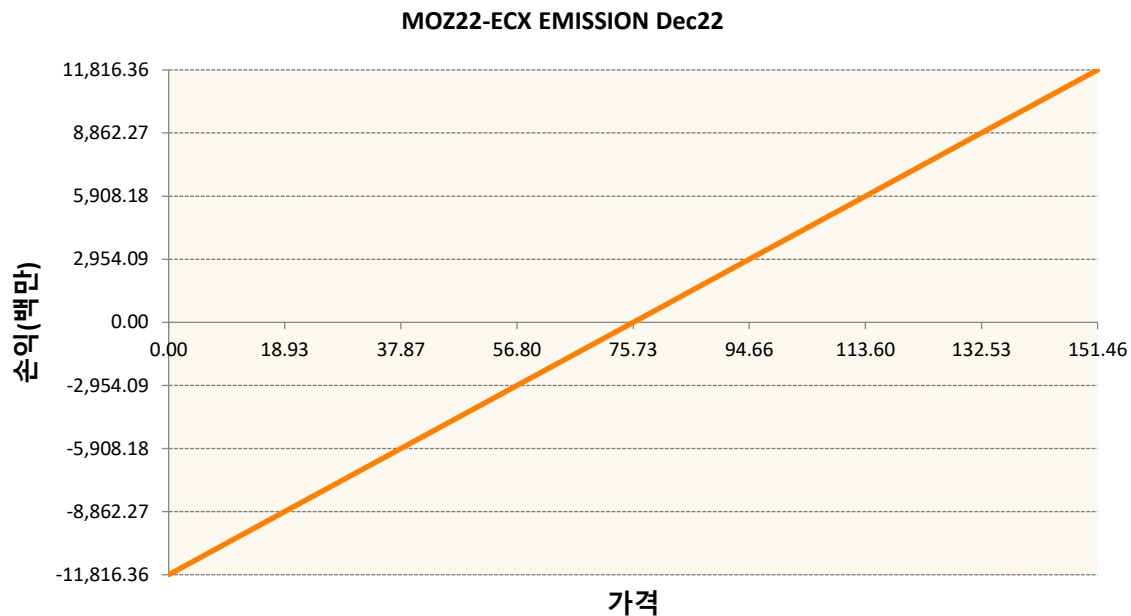
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	11,816	0	11,816	
누계	통화	선도	0	4,771	-4,771	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX KRW/EUR 28-12-21E

382

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

945

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

(단위:백만원)

2,077

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

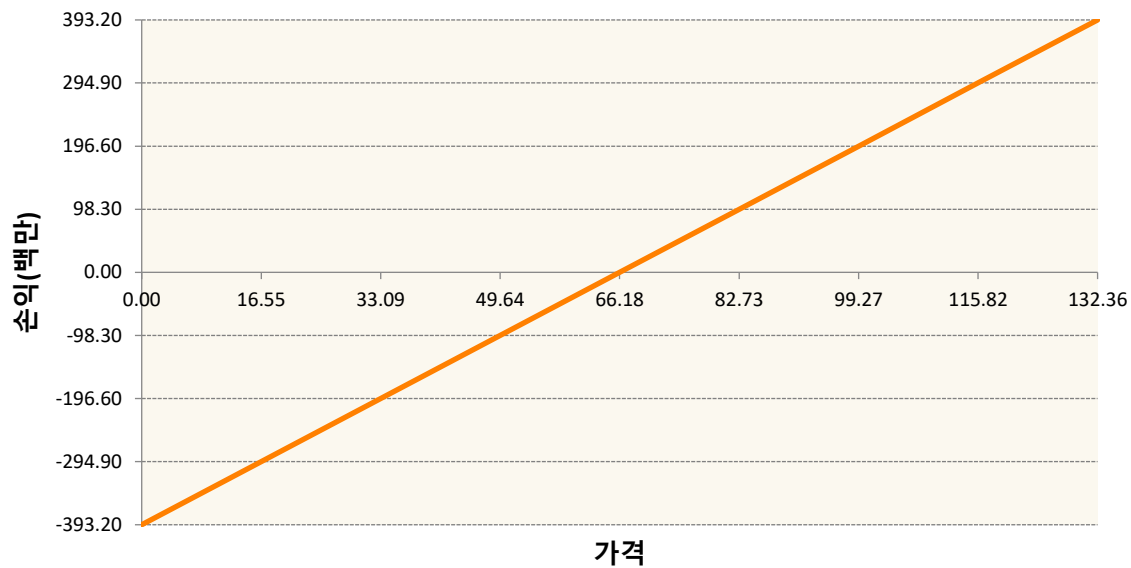
1. 계약금액

(단위:백만원)

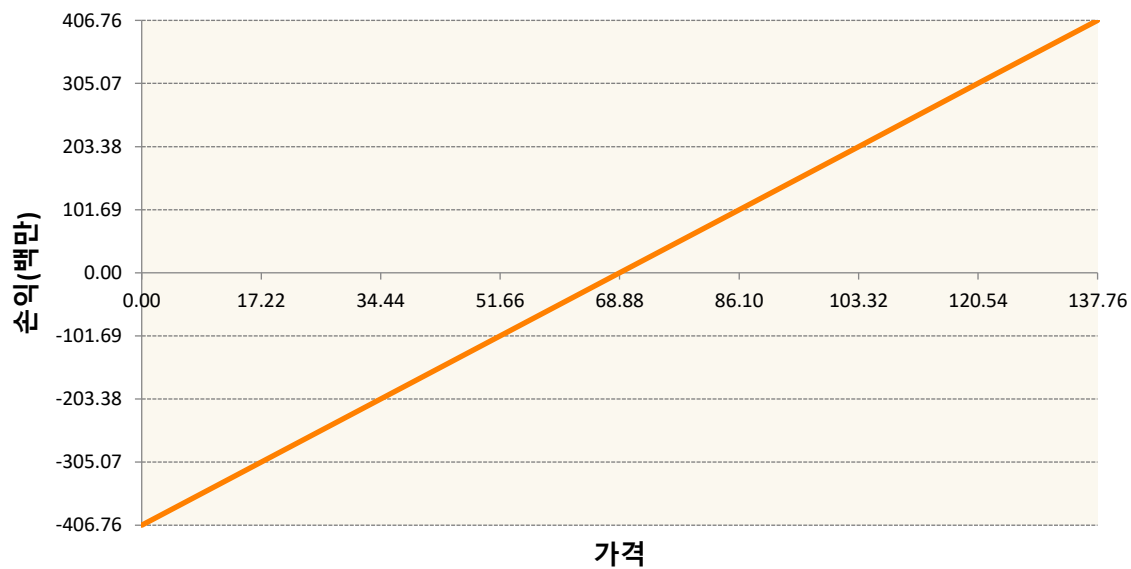
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,864	413	1,451	

2. 만기시점의 손익구조

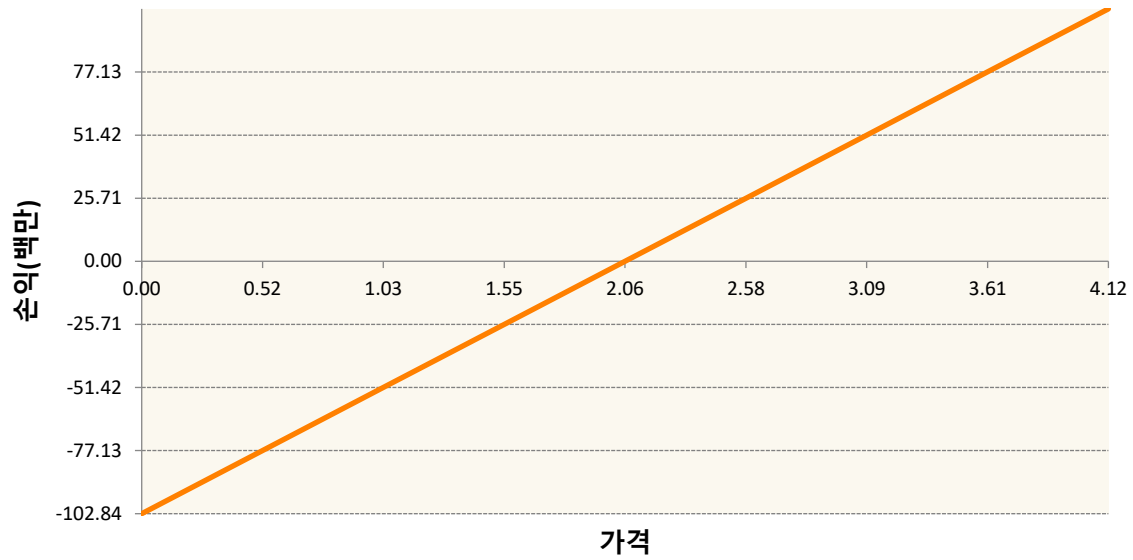
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



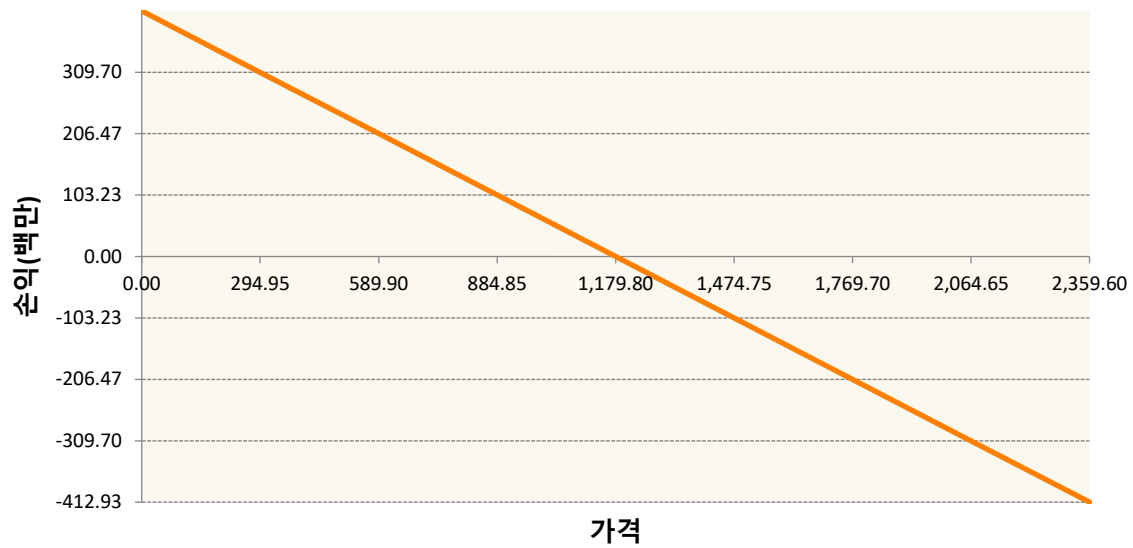
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



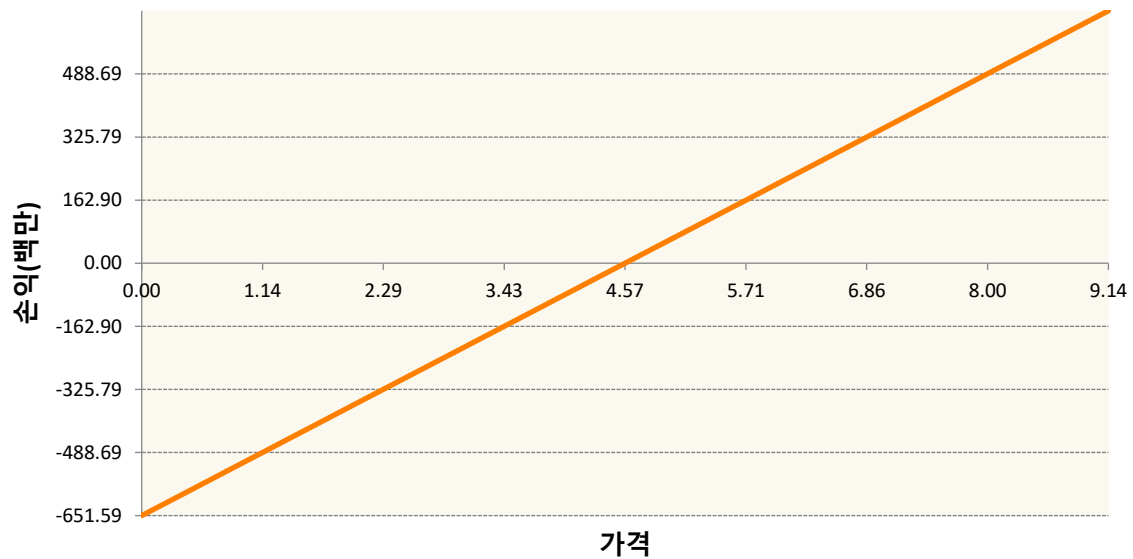
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22



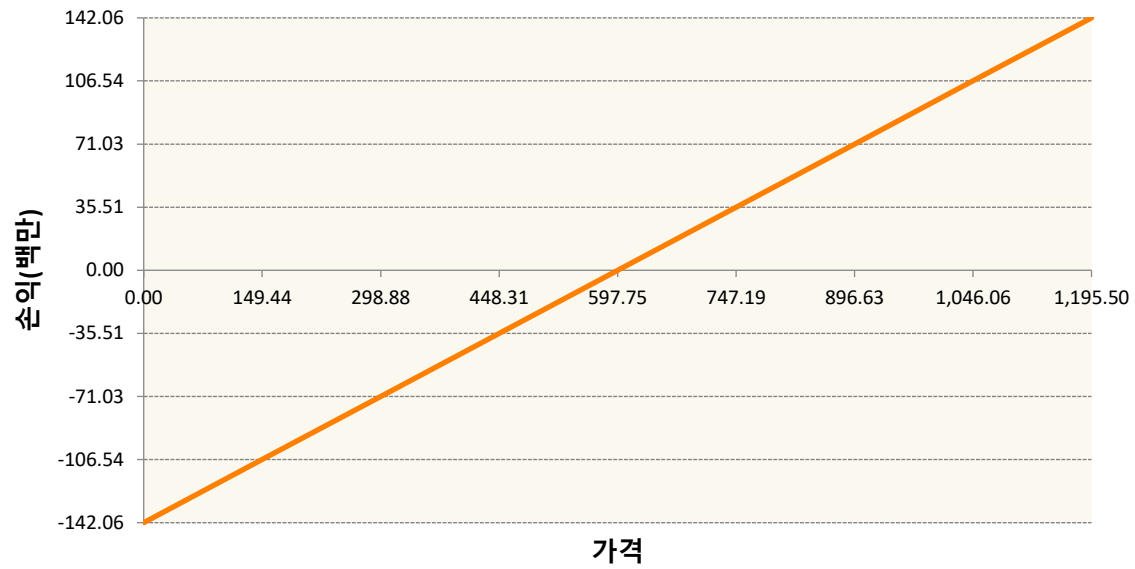
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



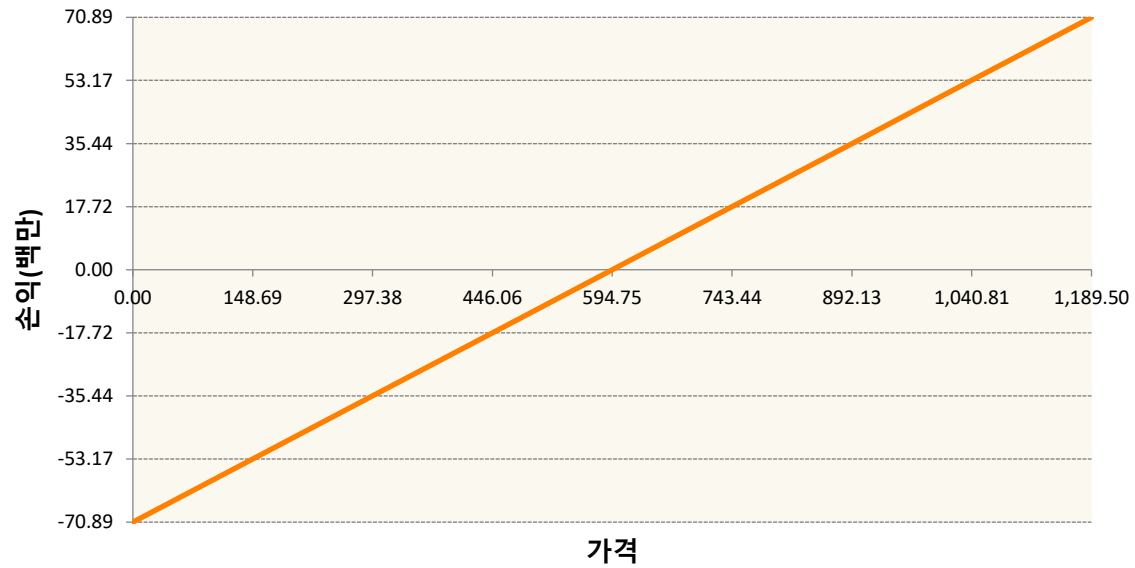
NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22



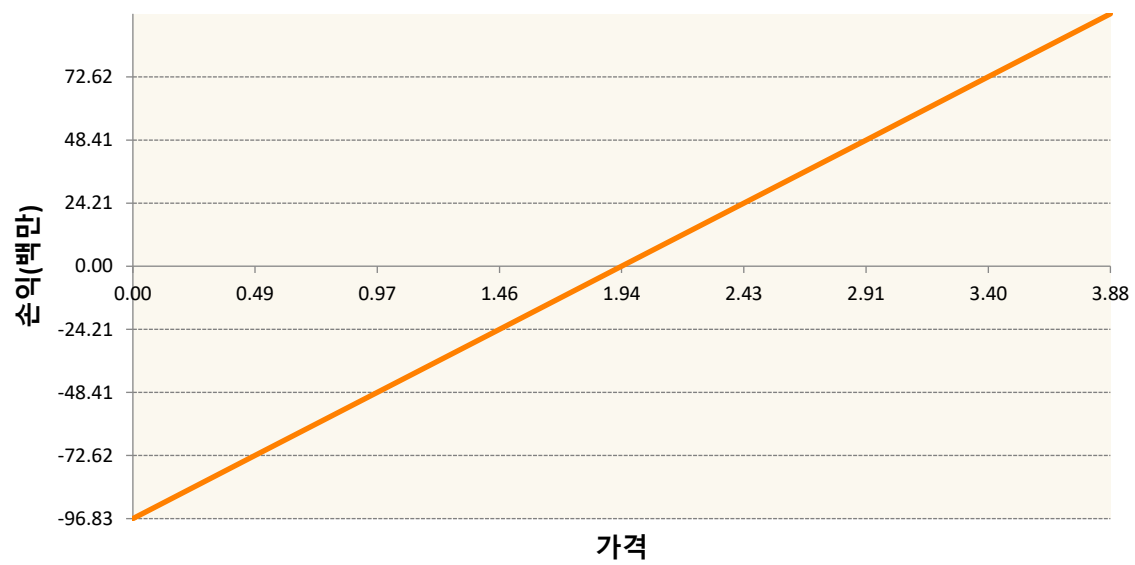
QSF2-Low Su Gasoil G Jan22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBF2-GASOLINE RBOB FUT Jan22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF2	WTI CRUDE FUTURE Jan22	31
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22	33
HOF2	NY Harb ULSD Fut Jan22	8
KR4175RC00 2021-12 달러선물		33
NGF22	NATURAL GAS FUTR Jan22	52
QSF2	Low Su Gasoil G Jan22	11
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	6
XBF2	GASOLINE RBOB FUT Jan22	8

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

345

공시일 2021-12-02

기준일 2021-12-01

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

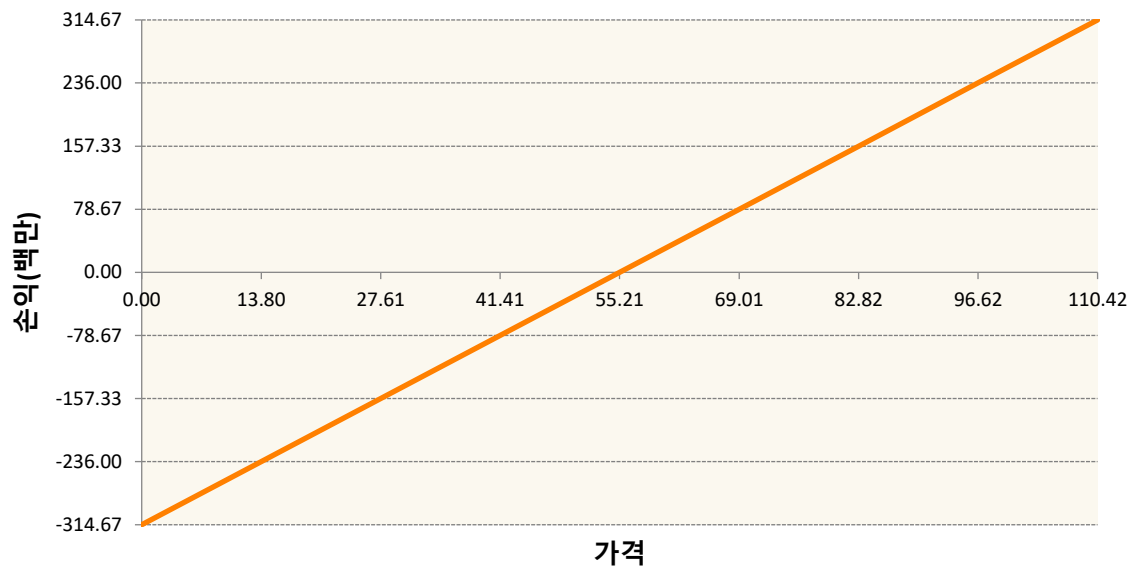
1. 계약금액

(단위:백만원)

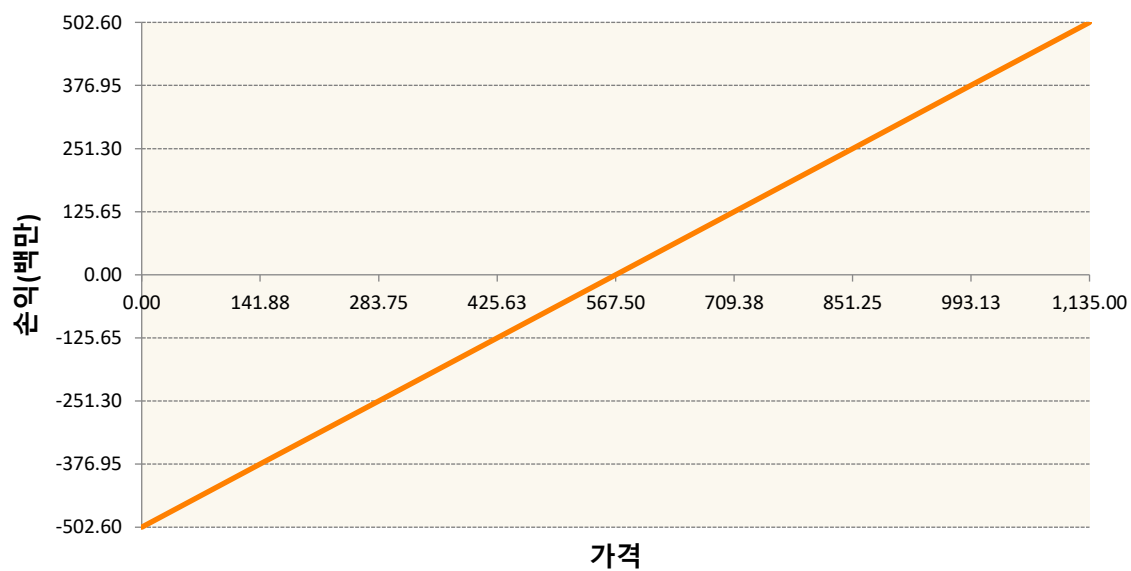
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,611	590	2,021	

2. 만기시점의 손익구조

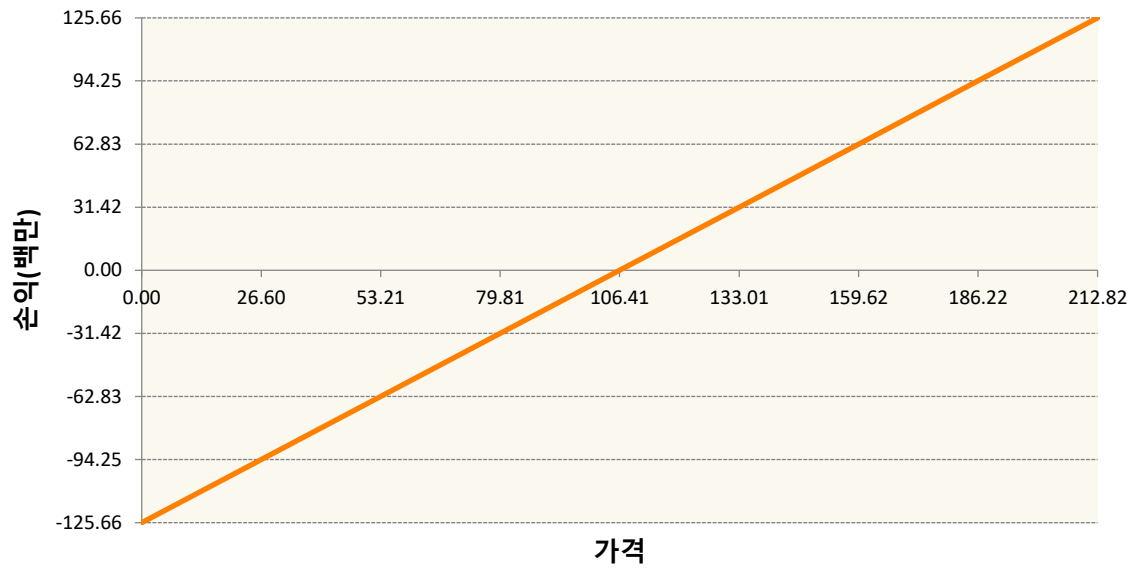
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



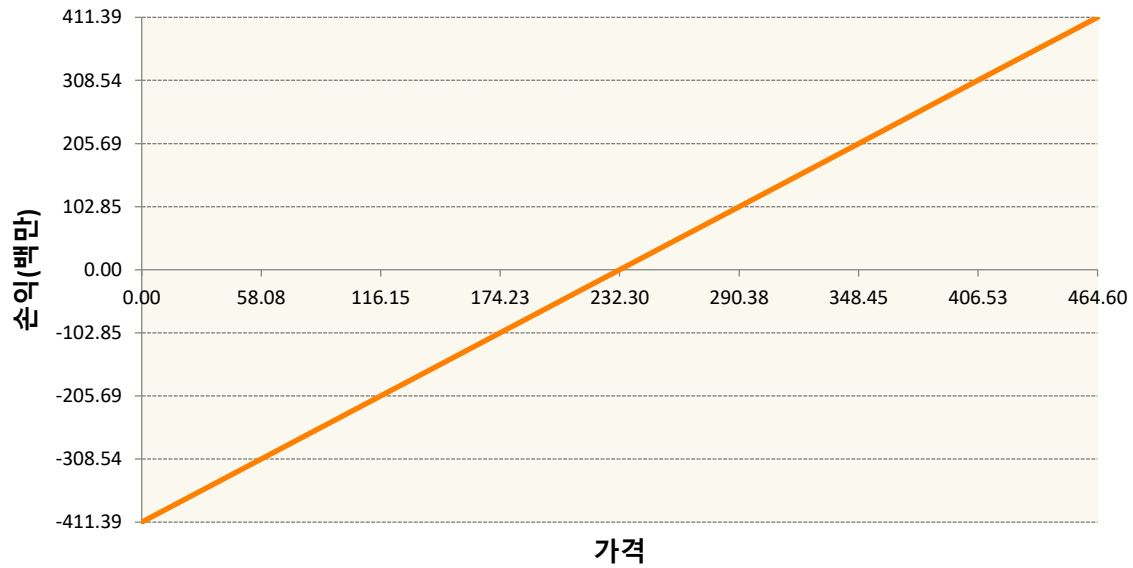
CH2-CORN FUTURE Mar22



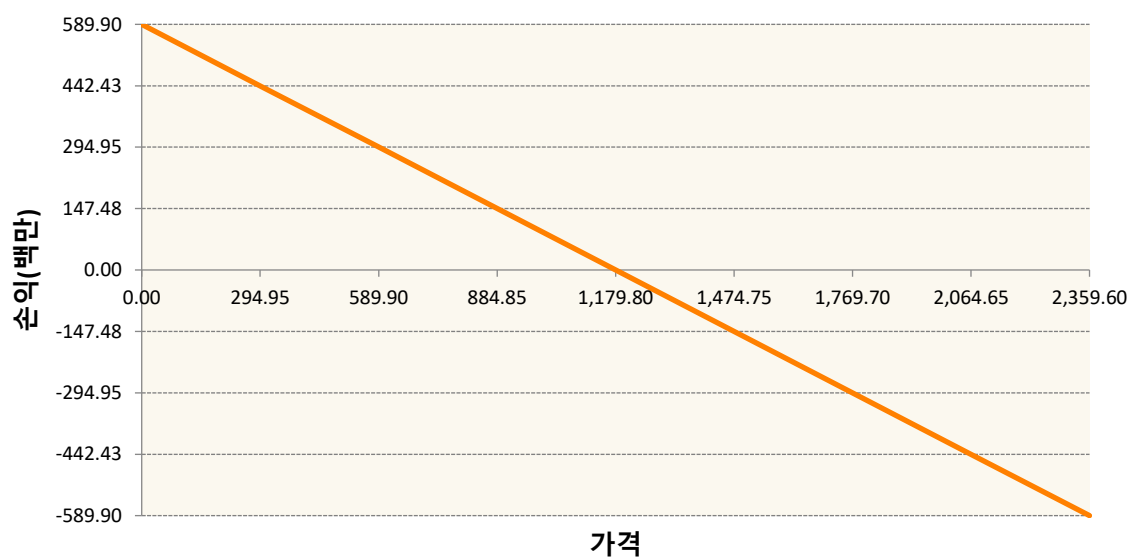
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



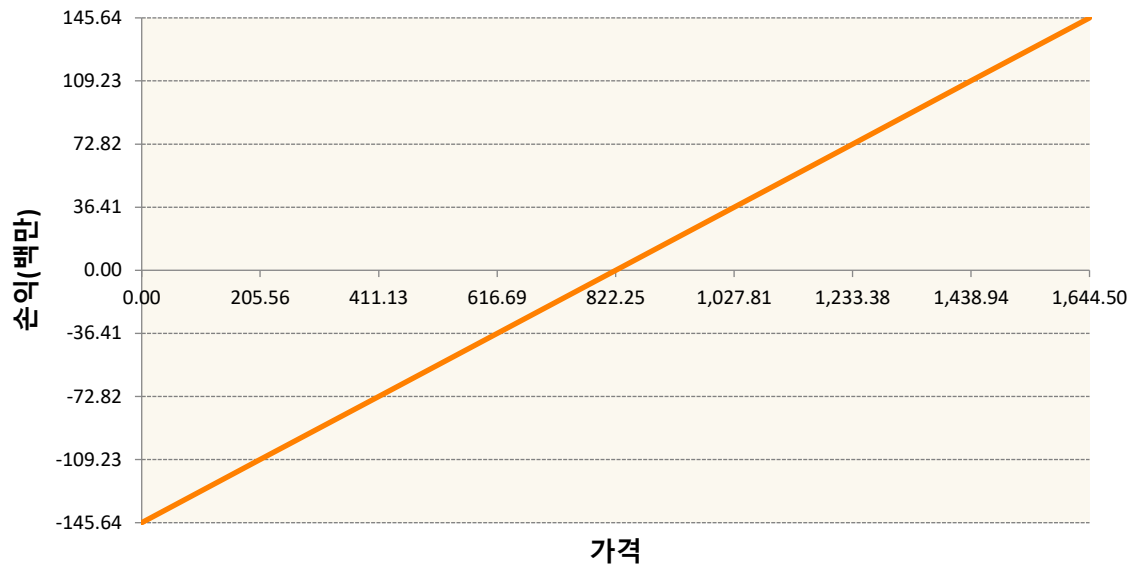
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



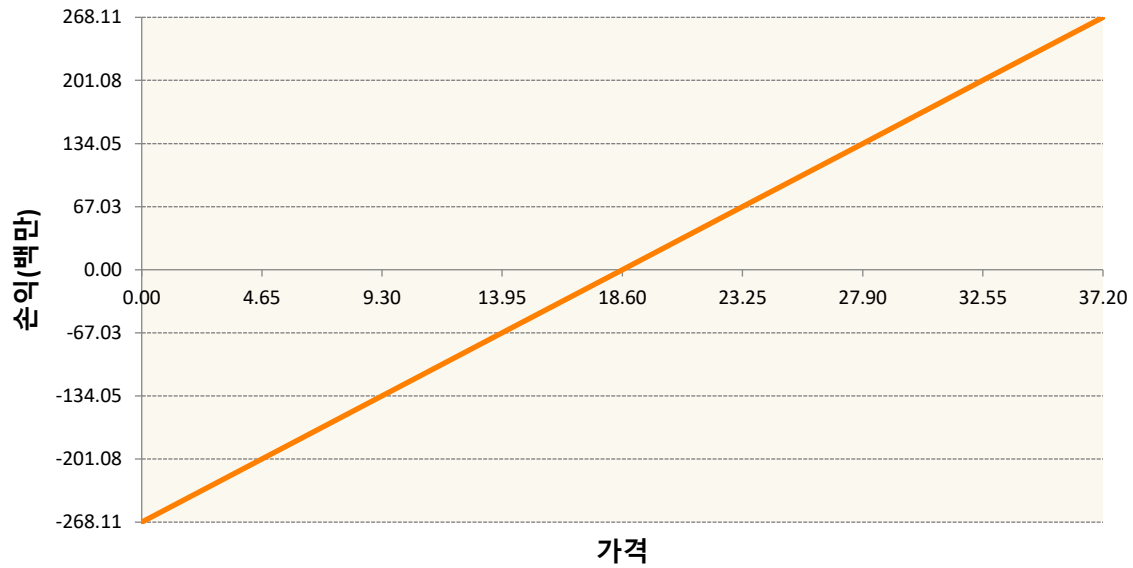
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



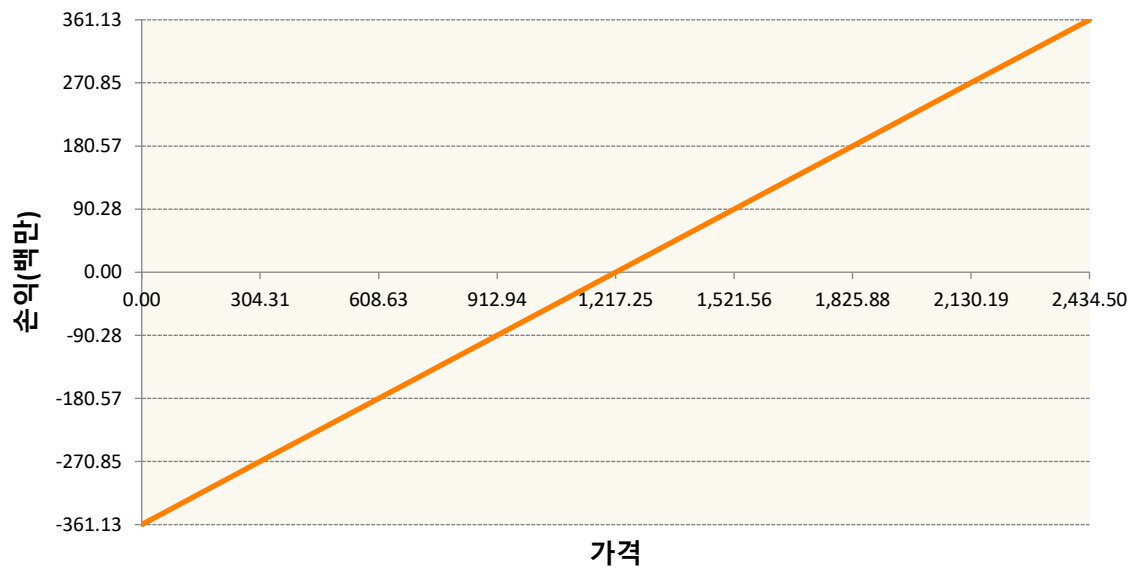
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

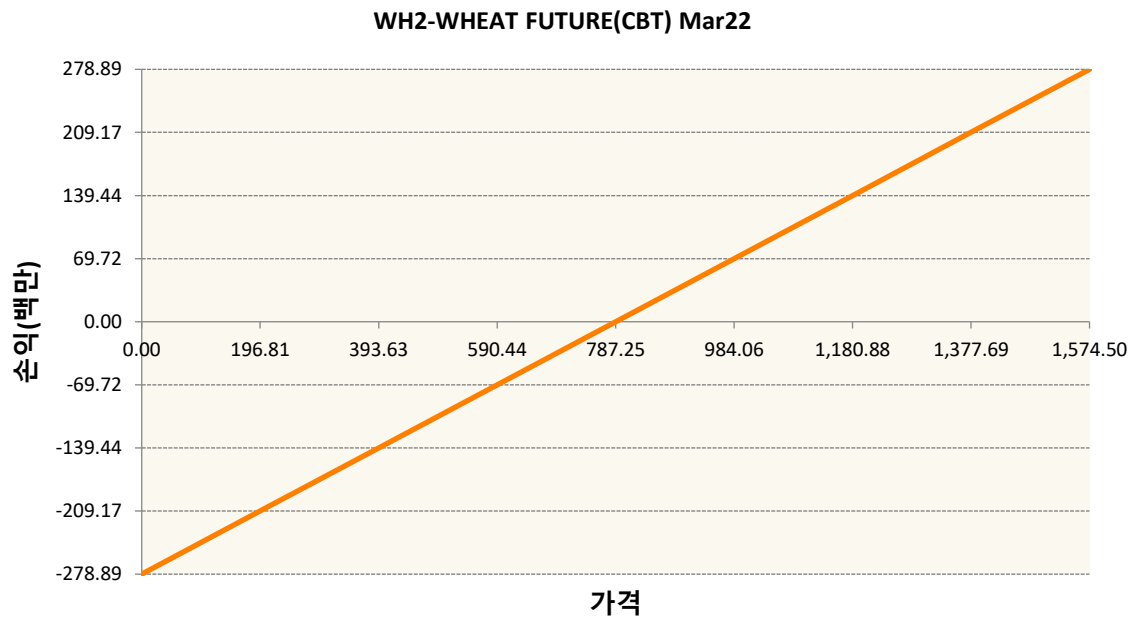
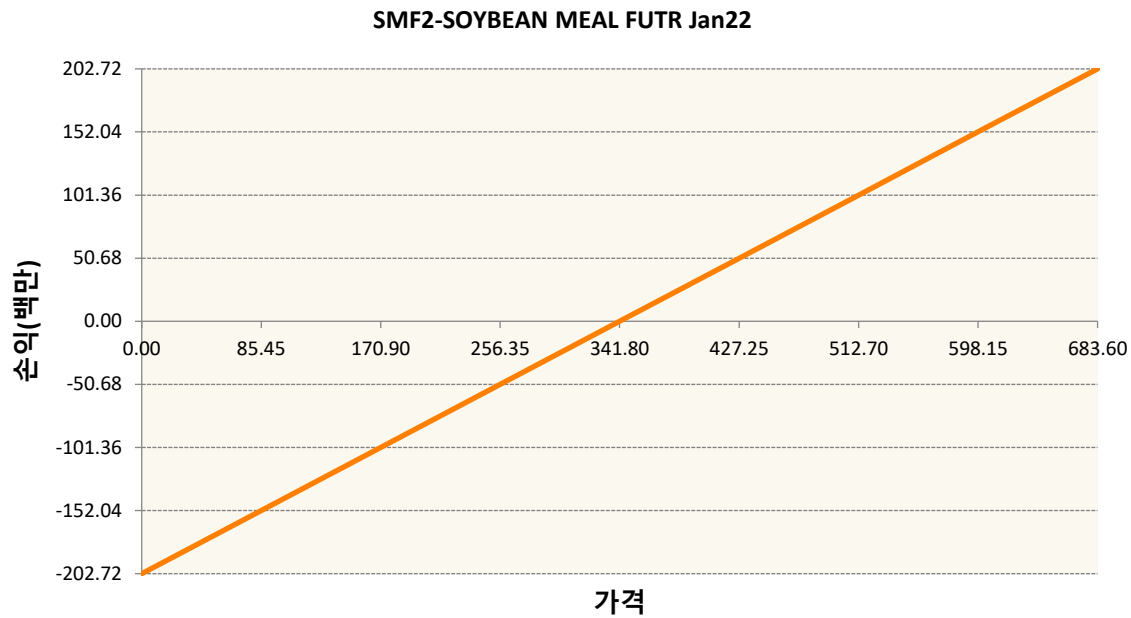


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22	25
CH2	CORN FUTURE Mar22	40
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22	10
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22	33
KR4175RC00 2021-12 달러선물		47
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22	12
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22	21
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22	29
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22	16
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22	22

