

공시일	2021-12-03
기준일	2021-12-02

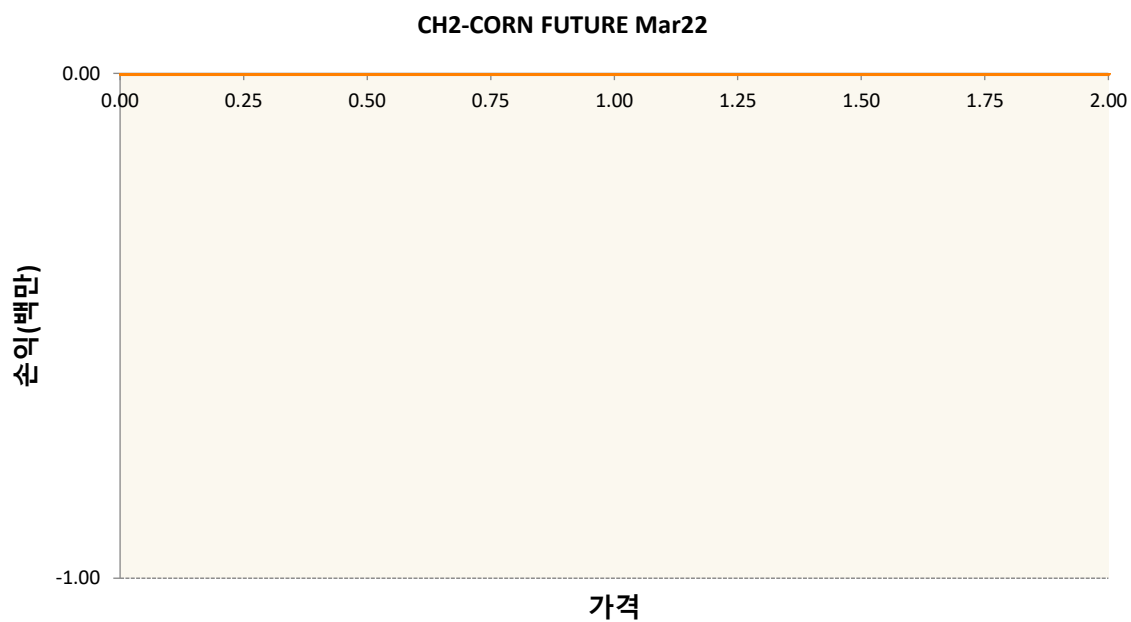
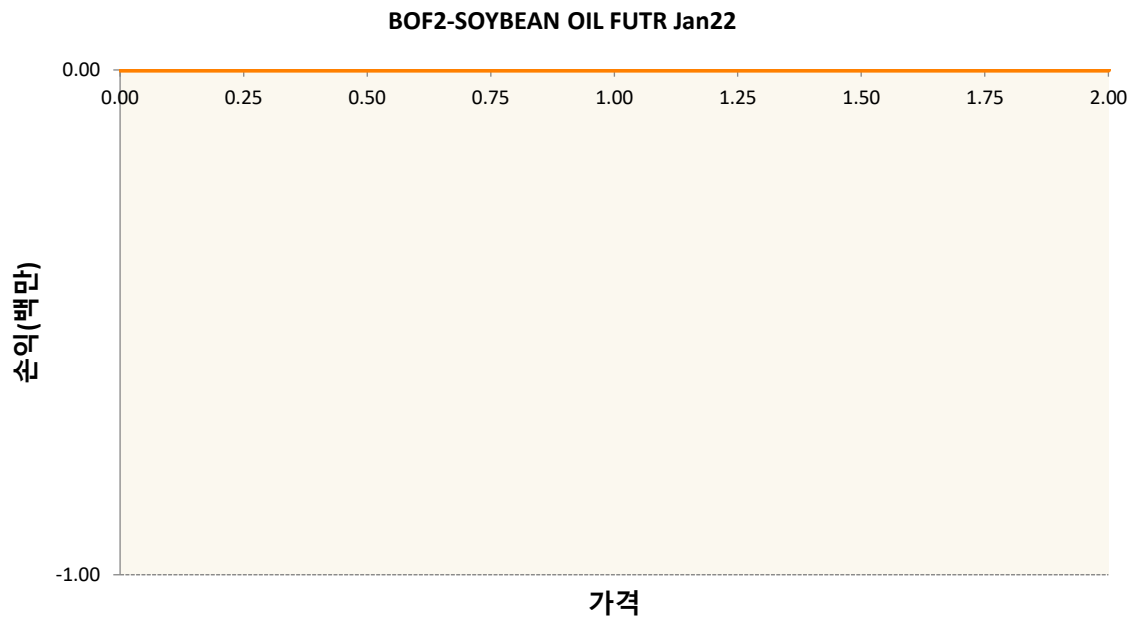
포커스농산물모(채권-파생형)

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	0	531	-531	

2. 만기시점의 손익구조



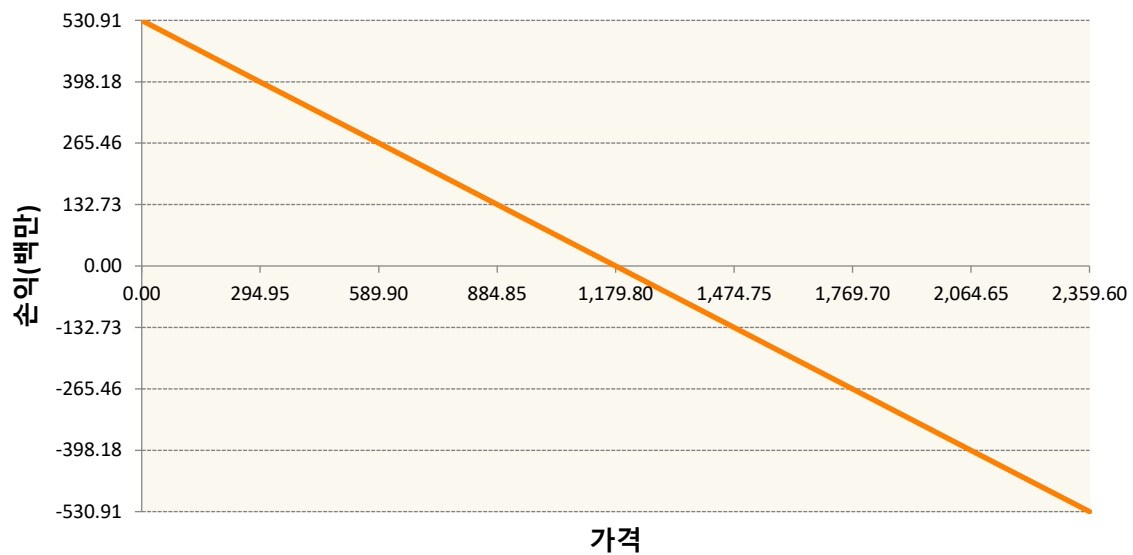
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



KR4175RC0001-2021-12 달러선물



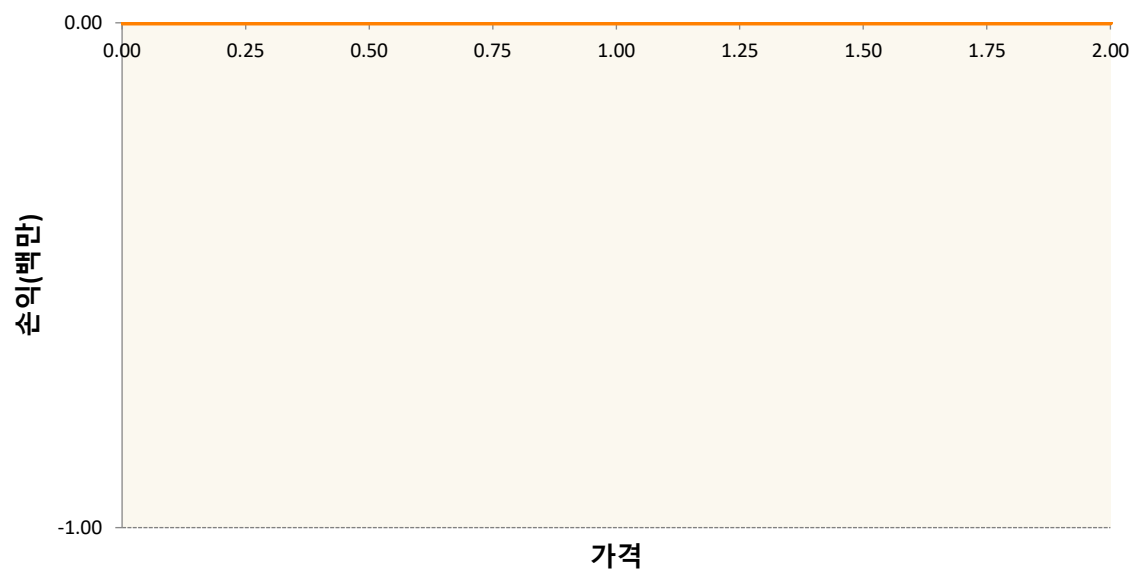
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

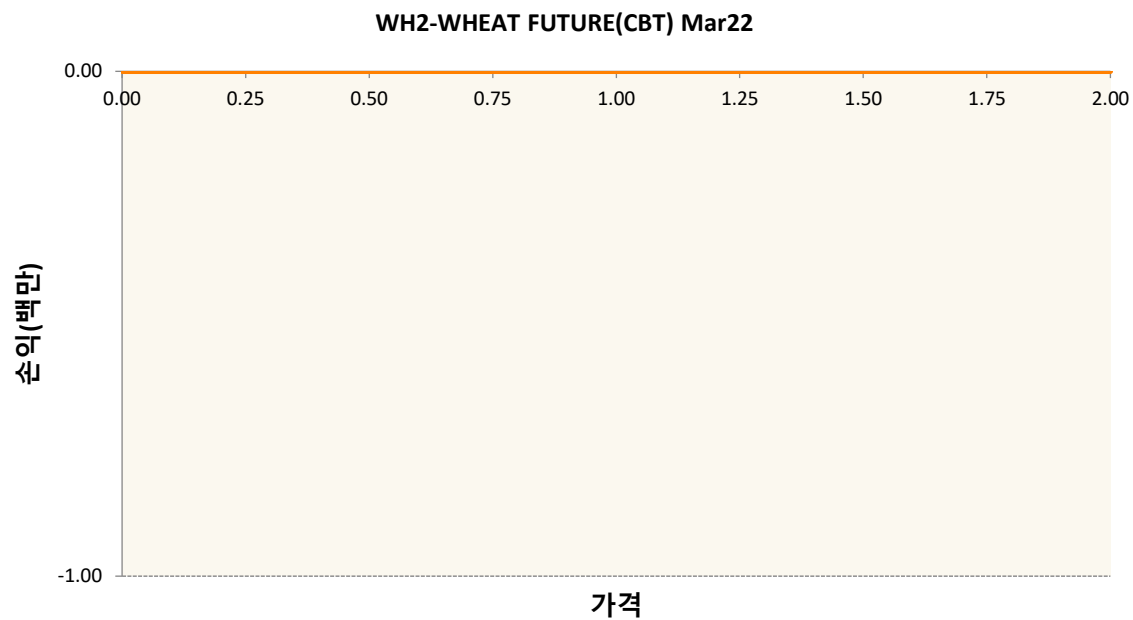
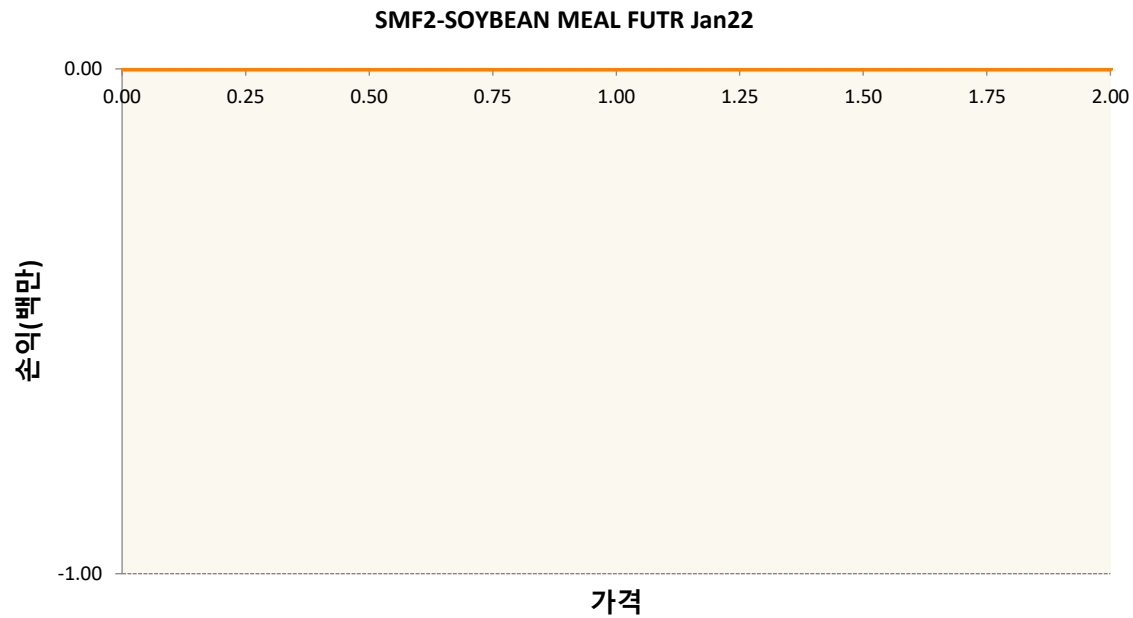


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2021-12-03
기준일	2021-12-02

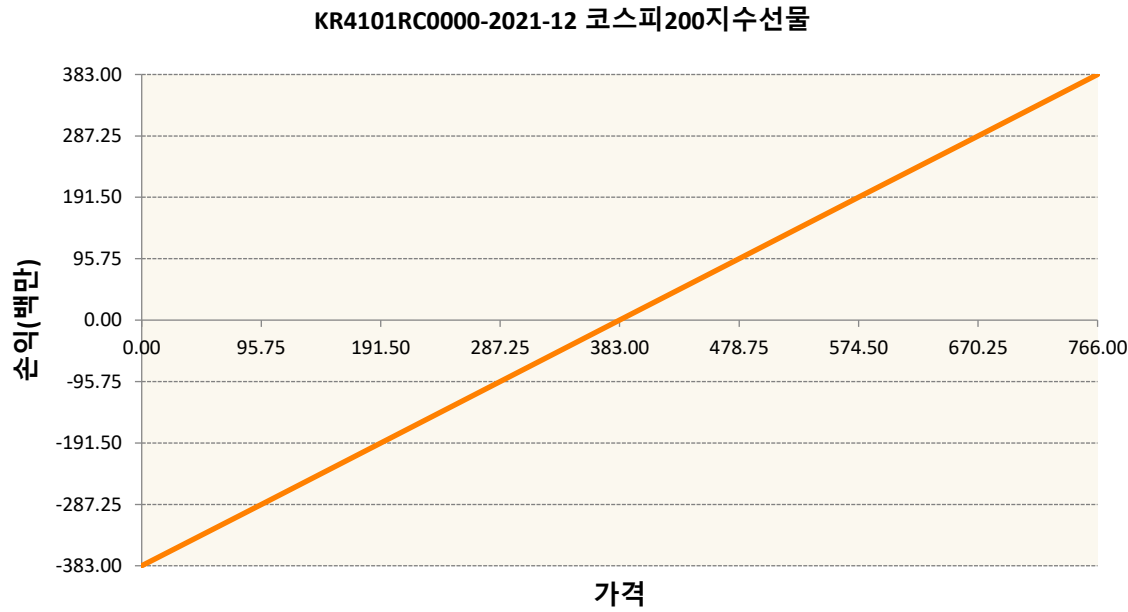
스마트인덱스모

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



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%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-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%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

공시일	2021-12-03
기준일	2021-12-02

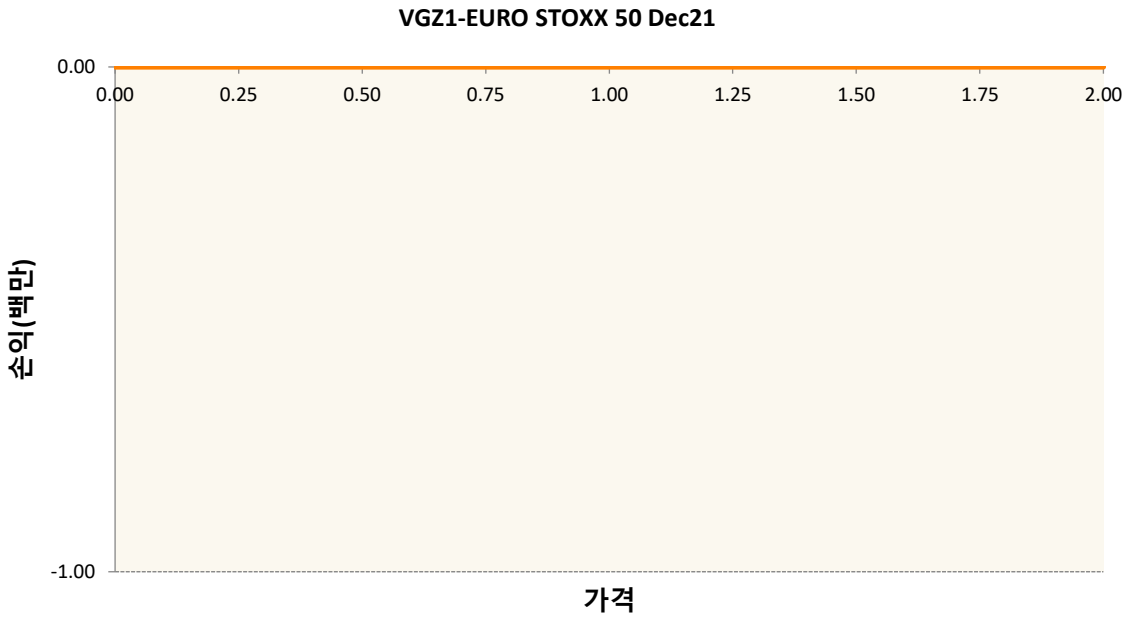
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ1	EURO STOXX 50 Dec21	46
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2021-12-03
기준일	2021-12-02

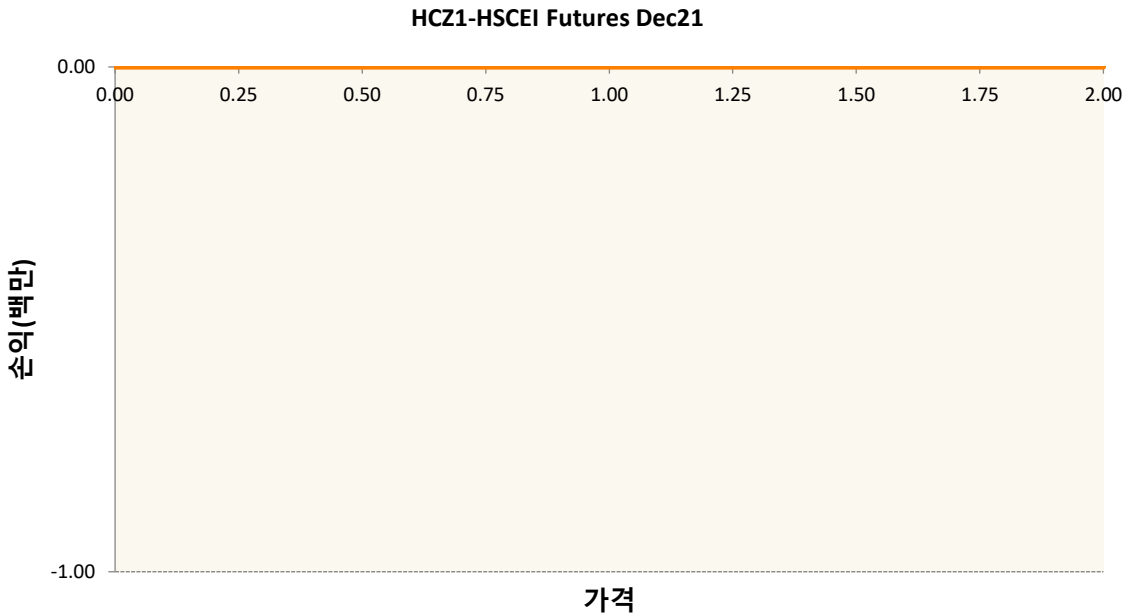
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	0	0	0	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 2021-12-03

기준일 2021-12-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

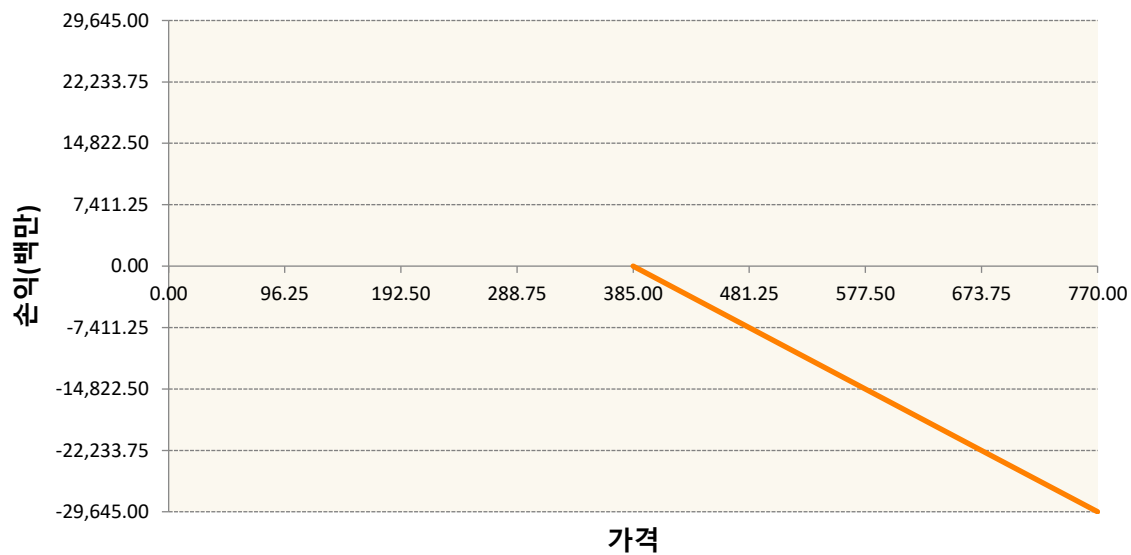
1. 계약금액

(단위:백만원)

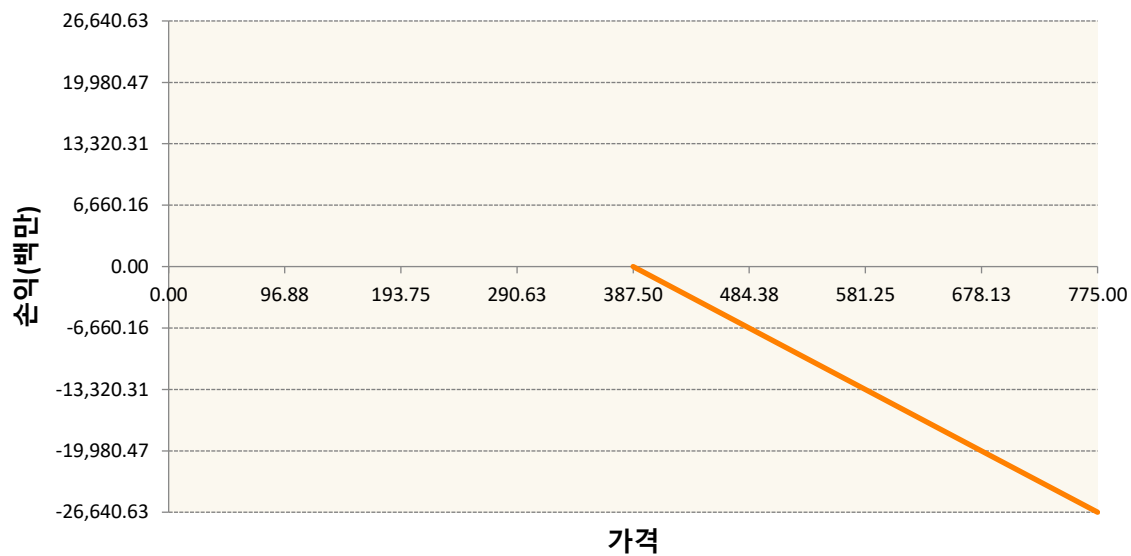
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,517	-76,517	장내

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 profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions). The line starts at a price of 0.00 with a profit of -2,906.25 and increases linearly to a profit of 0.00 at a price of 387.50. This point represents the break-even price.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-2,906.25
387.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201RC3854				2021-12 콜385			2,109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	661	659	654	648	640	630	618
-5.33%	636	622	604	585	563	540	514
-2.67%	497	463	428	393	357	321	285
0%	110	74	37	0	-37	-75	-112
2.67%	-529	-548	-569	-592	-618	-645	-673
5.33%	-1,293	-1,298	-1,305	-1,314	-1,326	-1,340	-1,356
8.00%	-2,088	-2,089	-2,090	-2,093	-2,096	-2,102	-2,109
KR4201RC3870				2021-12 콜387.5			1,818
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	492	491	488	484	479	472	463
-5.33%	478	469	457	443	426	408	389
-2.67%	389	362	334	305	275	245	214
0%	103	69	34	0	-35	-69	-104
2.67%	-421	-442	-465	-490	-516	-543	-571
5.33%	-1,085	-1,092	-1,101	-1,112	-1,125	-1,141	-1,158
8.00%	-1,792	-1,793	-1,795	-1,799	-1,803	-1,810	-1,818
KR4301RC3853 2021-12 풋385							1,086

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,081	-1,081	-1,081	-1,082	-1,083	-1,084	-1,086
-5.33%	-617	-620	-624	-629	-635	-641	-649
-2.67%	-200	-213	-227	-241	-256	-271	-286
0%	45	31	15	0	-16	-31	-47
2.67%	109	105	100	93	85	76	67
5.33%	115	115	114	113	111	109	105
8.00%	116	116	116	116	115	115	114

KR4301RC3879 2021-12 풋387.5							192
-----------------------------	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
-5.33%	-114	-114	-115	-115	-116	-117	-118
-2.67%	-41	-43	-45	-47	-49	-51	-53
0%	8	6	3	0	-3	-6	-8
2.67%	24	23	22	21	19	17	15
5.33%	27	26	26	26	25	25	24
8.00%	27	27	27	27	26	26	26

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

(단위:백만원)

5,761

공시일	2021-12-03
기준일	2021-12-02

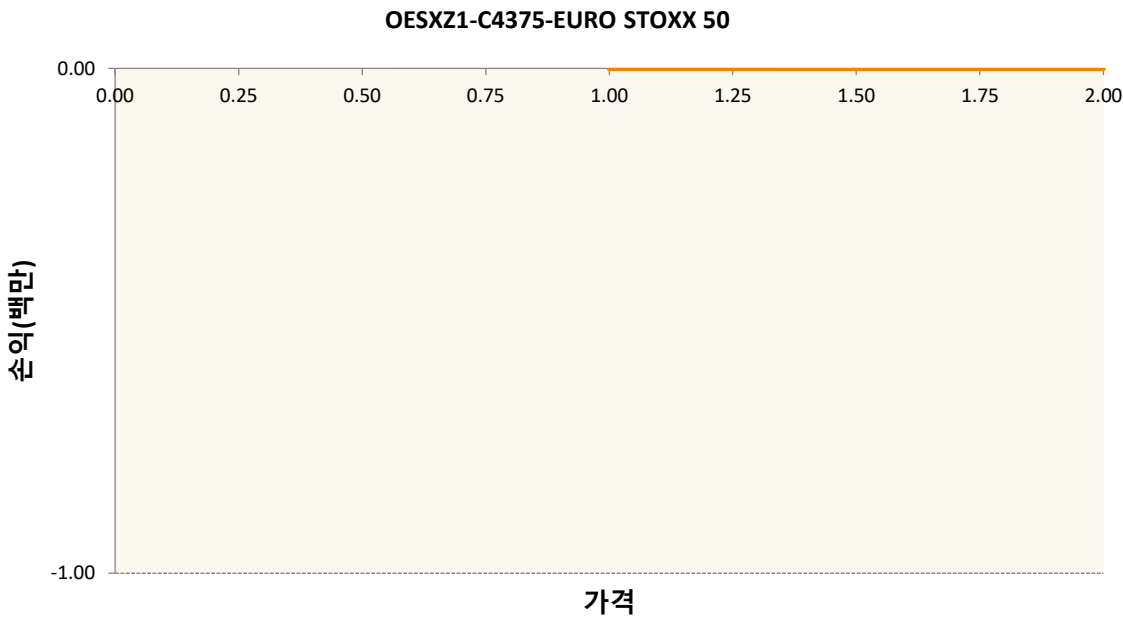
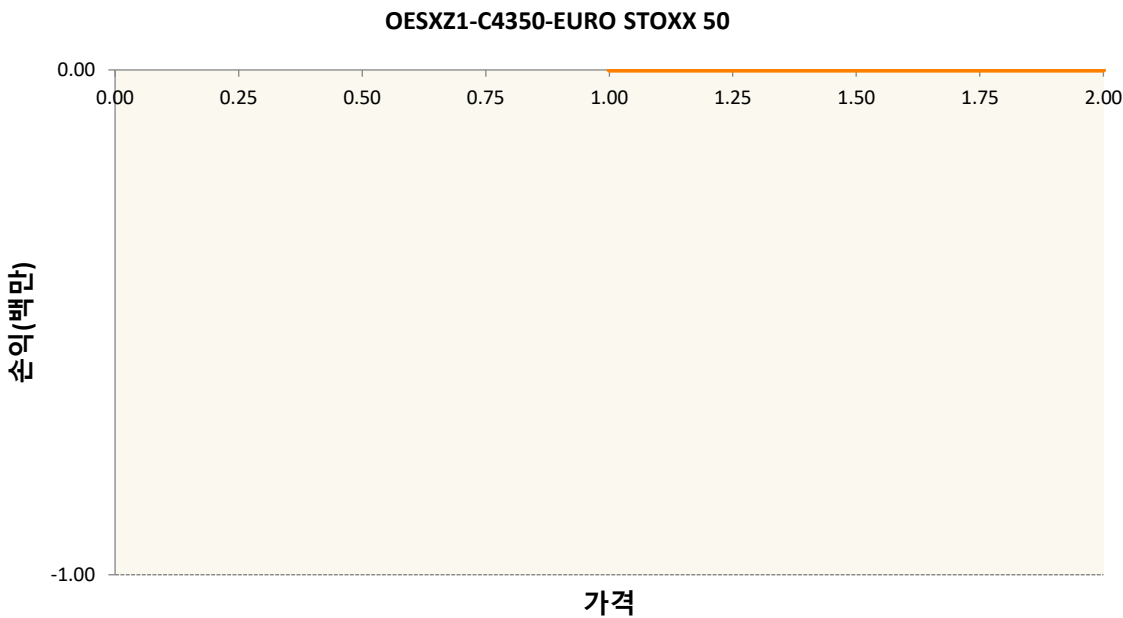
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

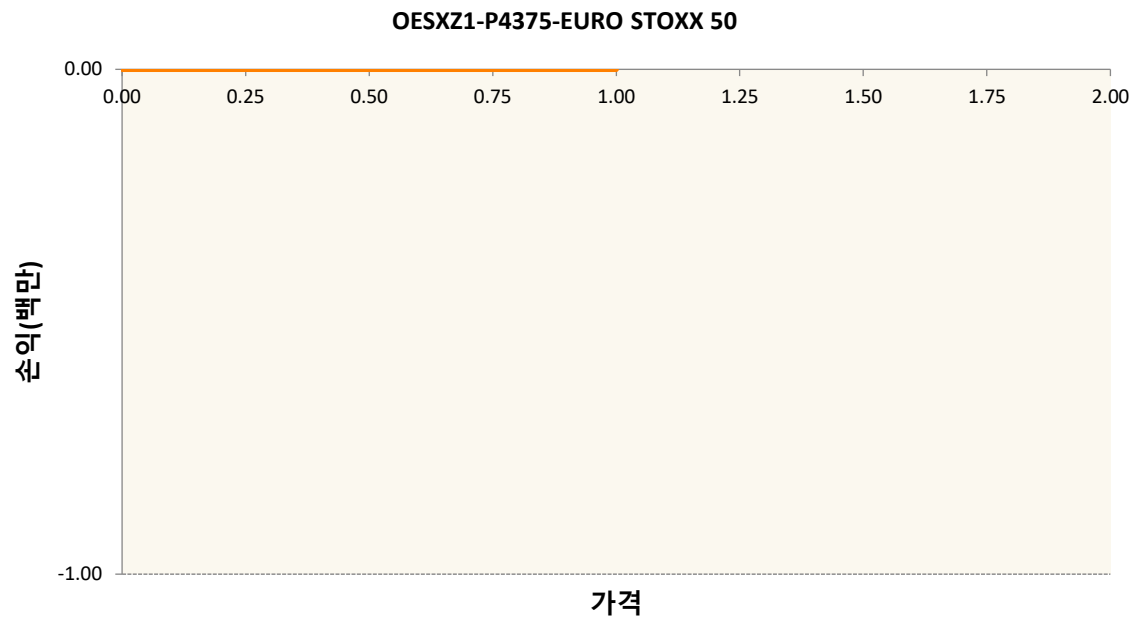
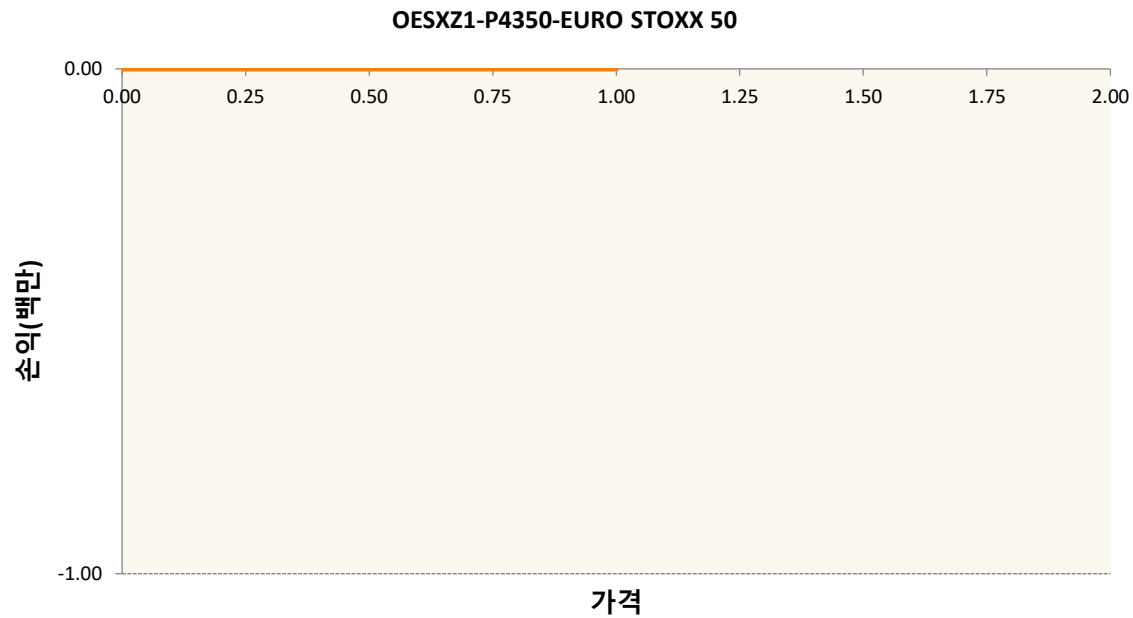
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		0
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		0

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		0

공시일 2021-12-03

기준일 2021-12-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

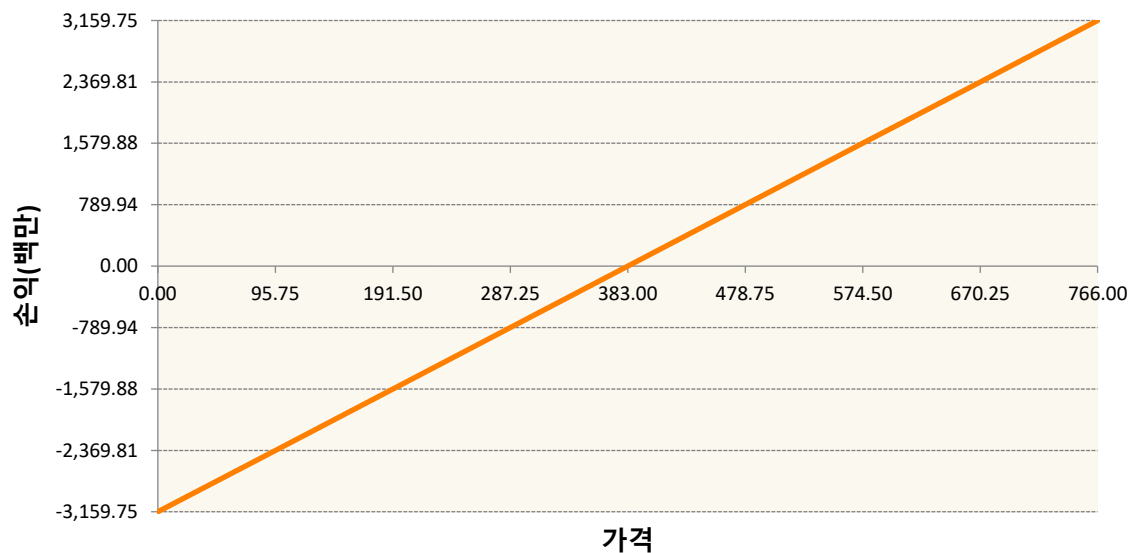
1. 계약금액

(단위:백만원)

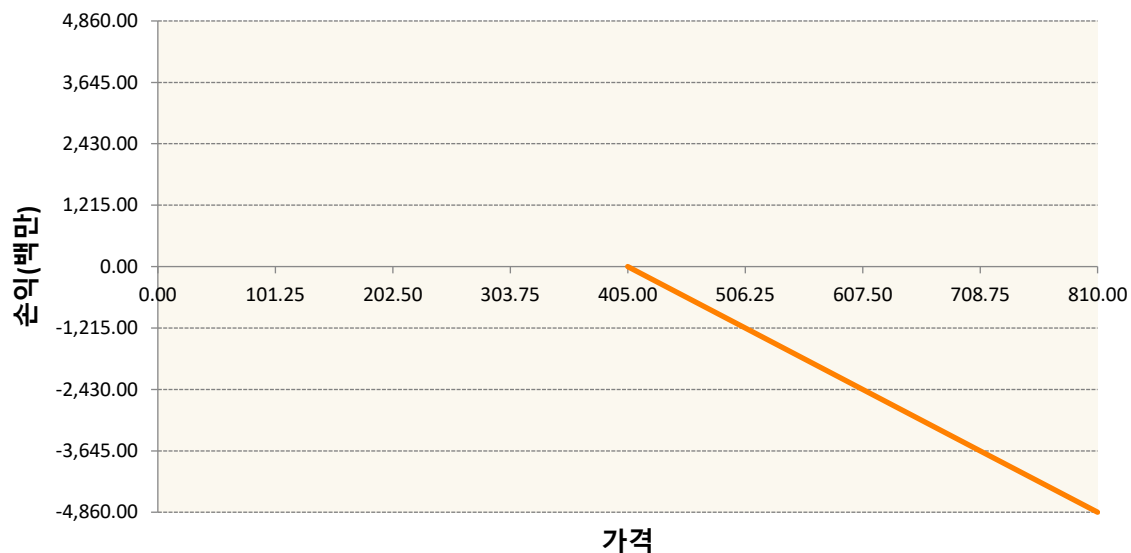
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,160	0	3,160	장내
누계	유가증권	옵션	579	5,369	-4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조

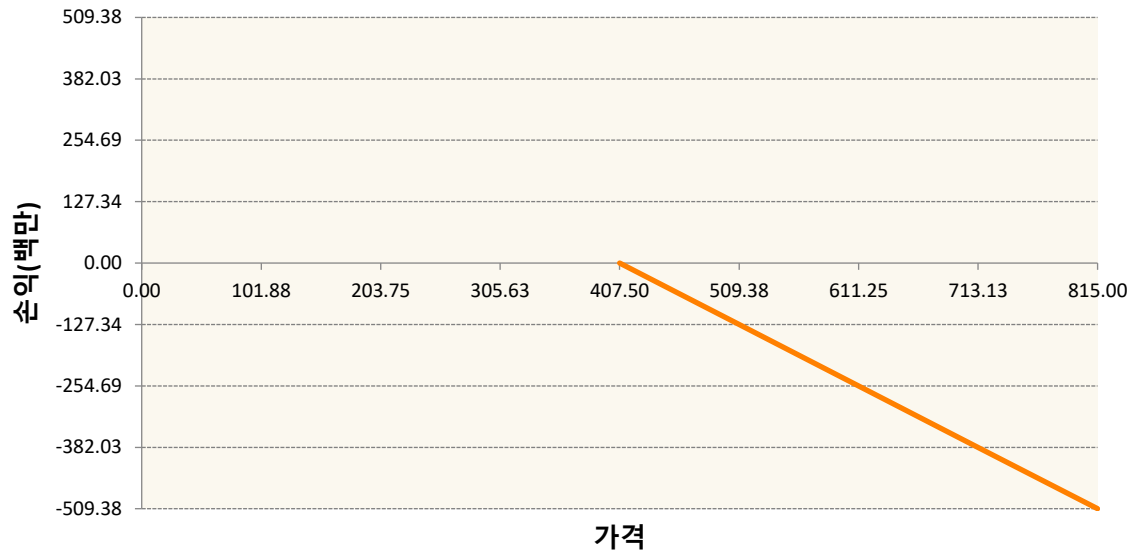
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



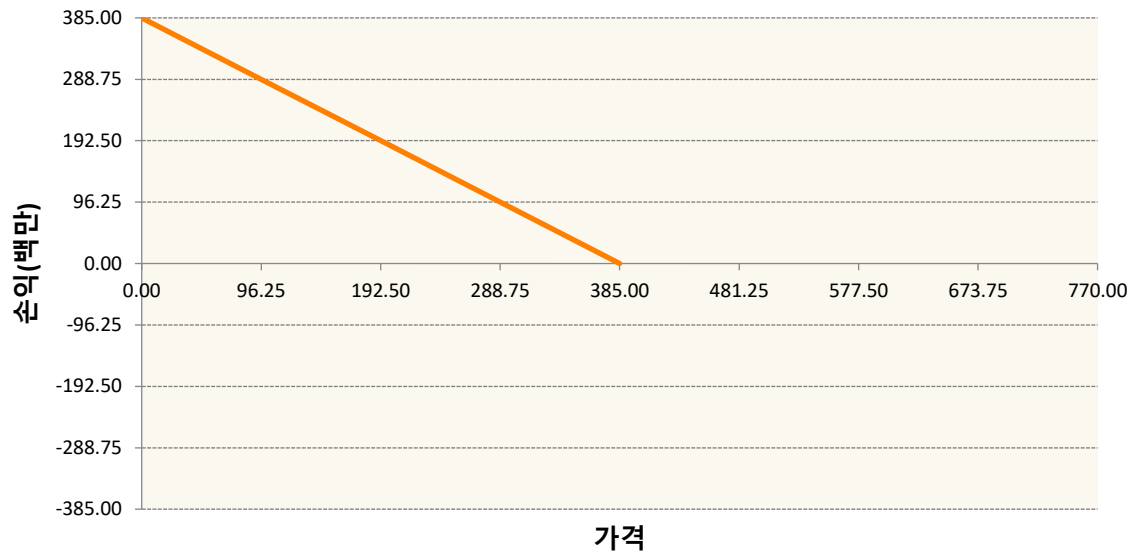
KR4201RC4050-2021-12 콜405



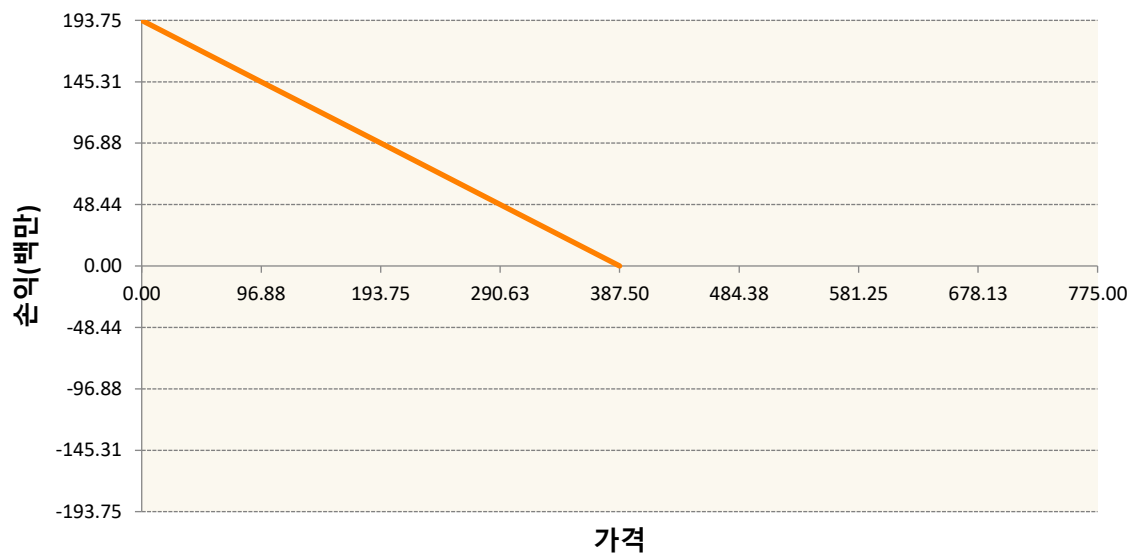
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



KR4301RC3853-2021-12 풋385



KR4301RC3879-2021-12 풋387.5



(단위:백만원)

KR4101RC0000							2021-12 코스피200지수선물	257
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257	
-5.33%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171	
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	86	86	86	86	86	86	86	
5.33%	171	171	171	171	171	171	171	
8.00%	257	257	257	257	257	257	257	
KR4201RC4050							2021-12 콜405	203
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	16	16	16	16	16	16	15	
-5.33%	16	16	16	15	15	14	13	
-2.67%	15	15	14	12	11	9	6	
0%	10	7	4	0	-4	-8	-13	
2.67%	-16	-21	-27	-33	-39	-45	-51	
5.33%	-79	-85	-91	-97	-103	-109	-115	
8.00%	-180	-183	-186	-190	-194	-199	-203	
KR4201RC4076							2021-12 콜407.5	19
	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	1	1	0	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	-1	-2	-2	-3	-3	-4	-5	
5.33%	-7	-7	-8	-9	-9	-10	-11	
8.00%	-16	-17	-17	-18	-18	-19	-19	
KR4301RC3853							2021-12 풋385	24
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	24	24	24	24	24	24	24	
-5.33%	14	14	14	14	14	14	14	
-2.67%	4	5	5	5	6	6	6	
0%	-1	-1	0	0	0	1	1	
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1	
5.33%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2	
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
KR4301RC3879							2021-12 풋387.5	13
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	3	3	3	3	3	3	4
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-2	-2	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

464

공시일	2021-12-03
기준일	2021-12-02

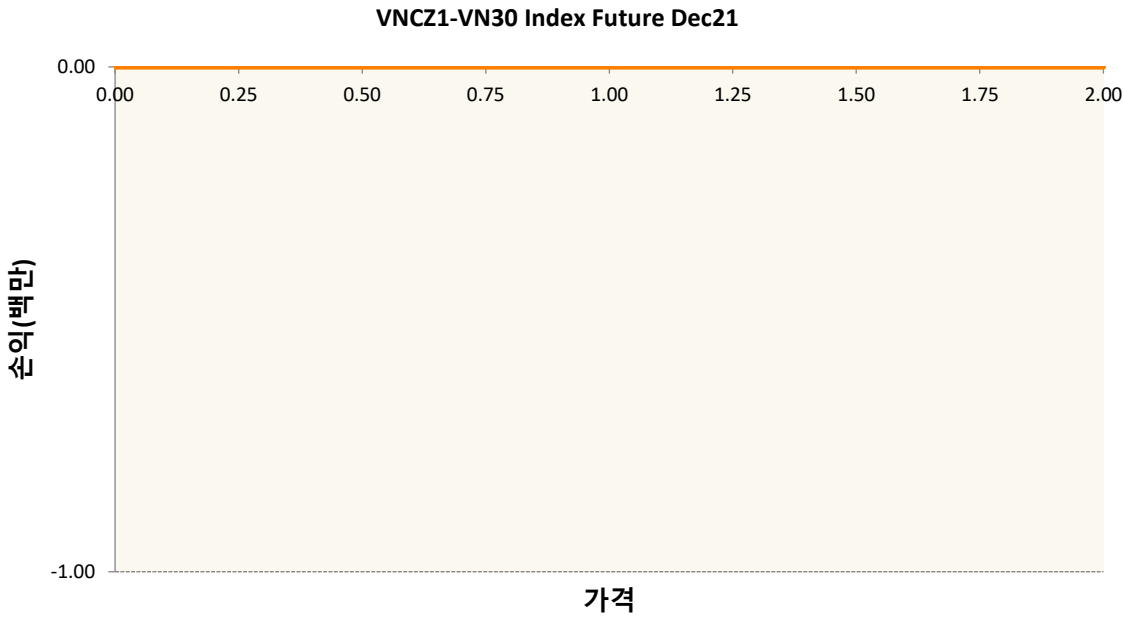
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VNCZ1	VN30 Index Future Dec21	77
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

82

공시일 2021-12-03

기준일 2021-12-02

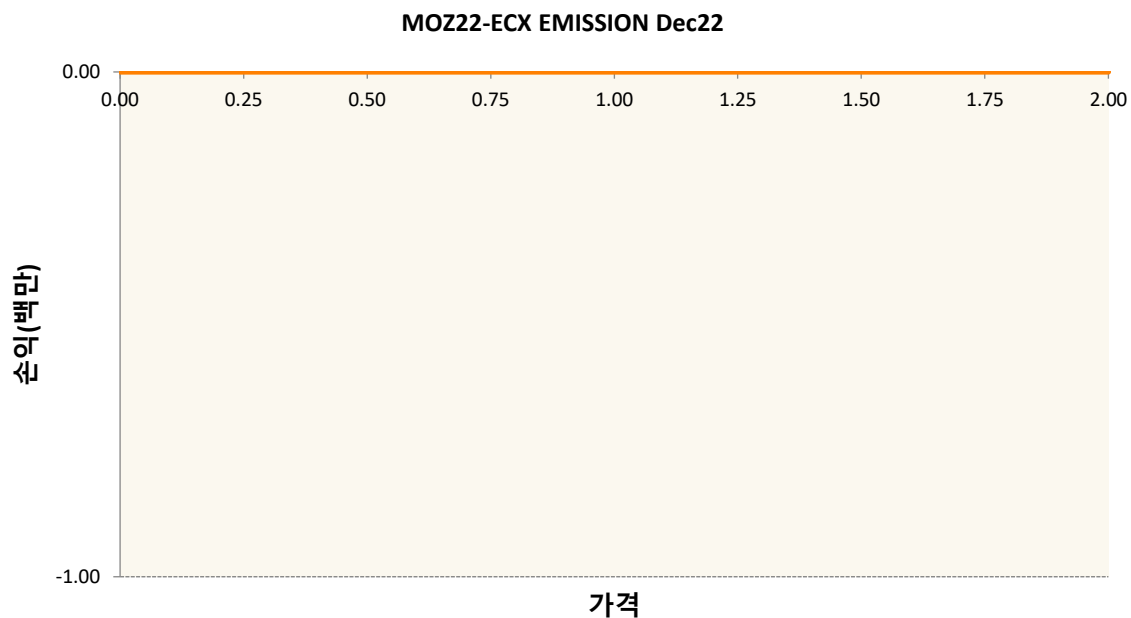
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

963

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

(단위:백만원)

1,939

공시일	2021-12-03
기준일	2021-12-02

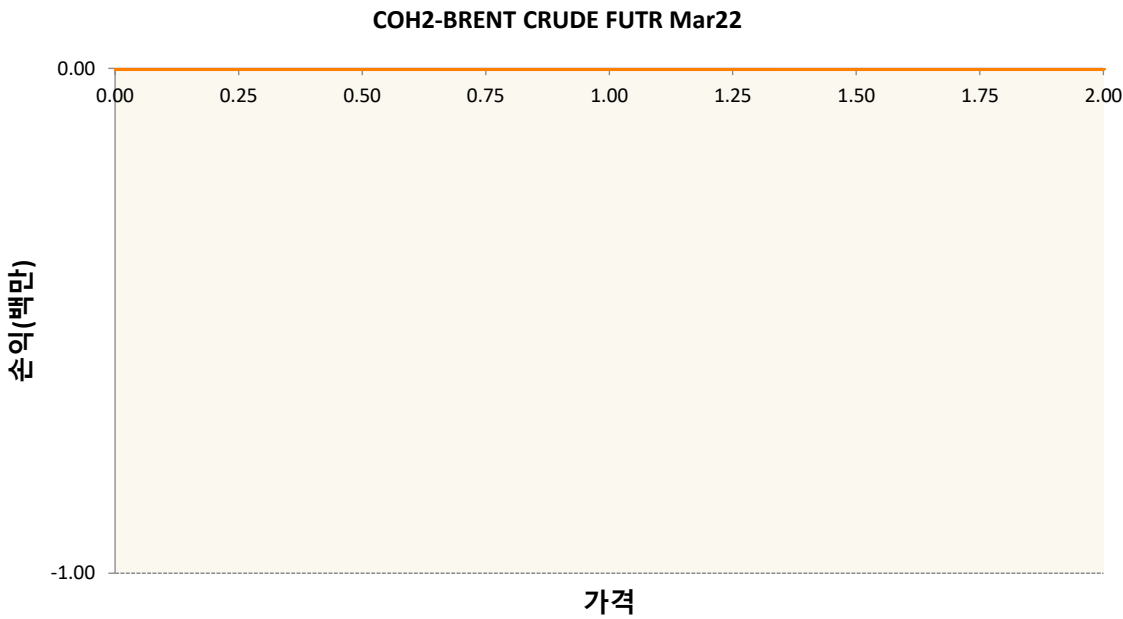
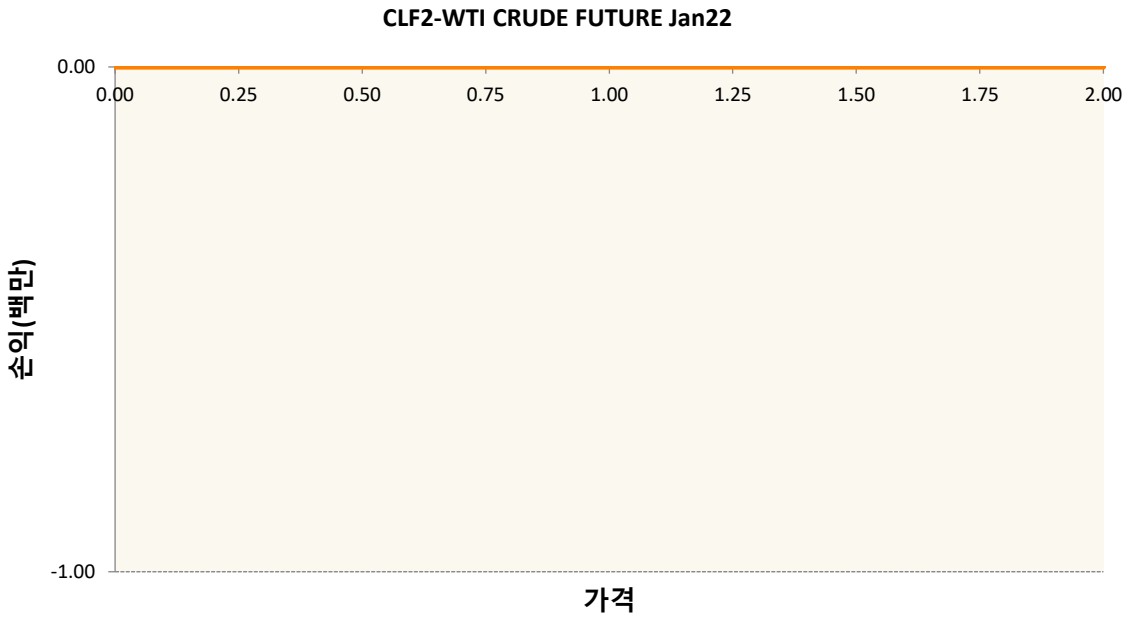
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	354	-354	

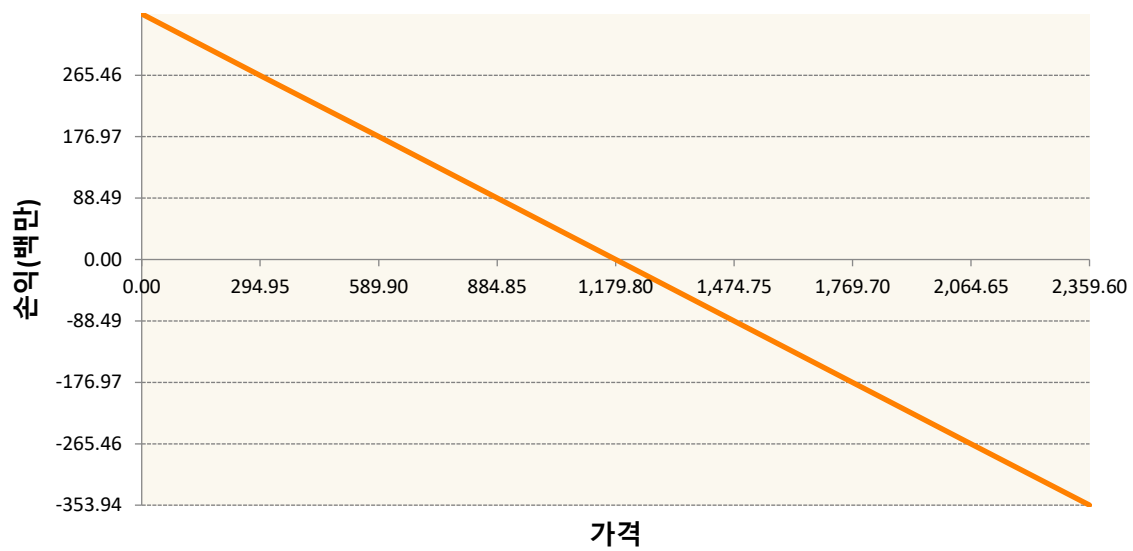
2. 만기시점의 손익구조



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	32
HOF2	NY Harb ULSD Fut Jan22	8
KR4175RC00 2021-12 달러선물		28
NGF22	NATURAL GAS FUTR Jan22	49
QSF2	Low Su Gasoil G Jan22	12
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	6
XBF2	GASOLINE RBOB FUT Jan22	8

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

334

공시일	2021-12-03
기준일	2021-12-02

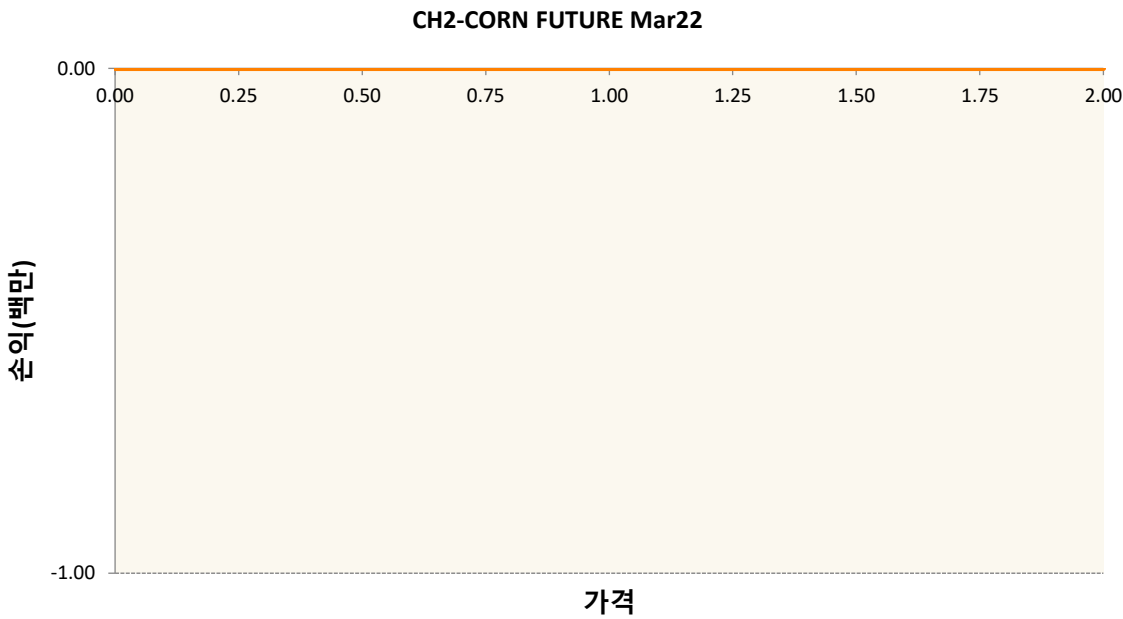
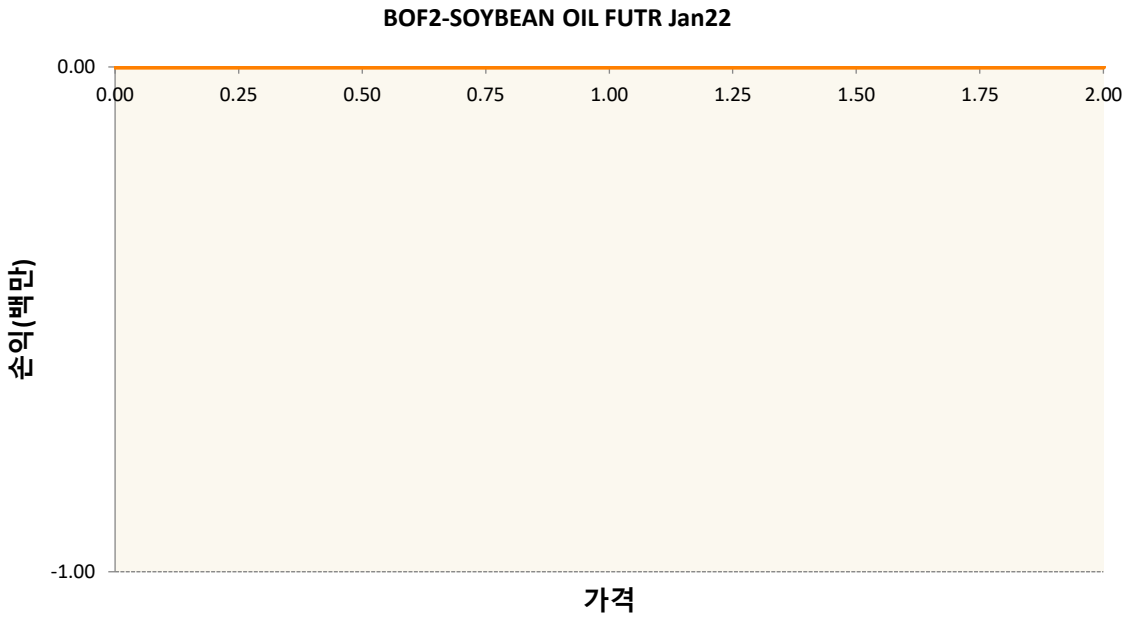
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



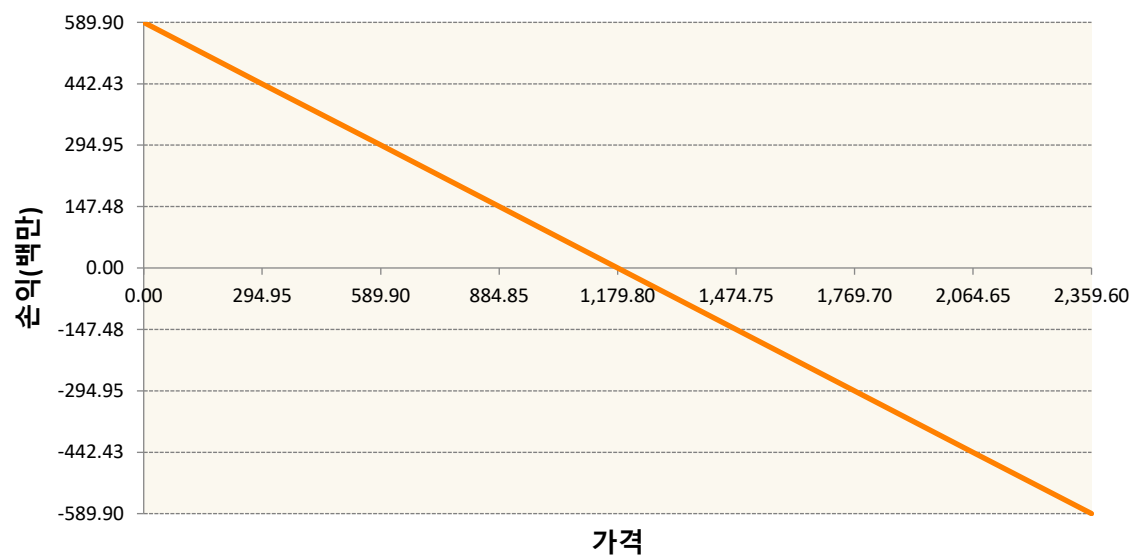
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



KR4175RC0001-2021-12 달러선물



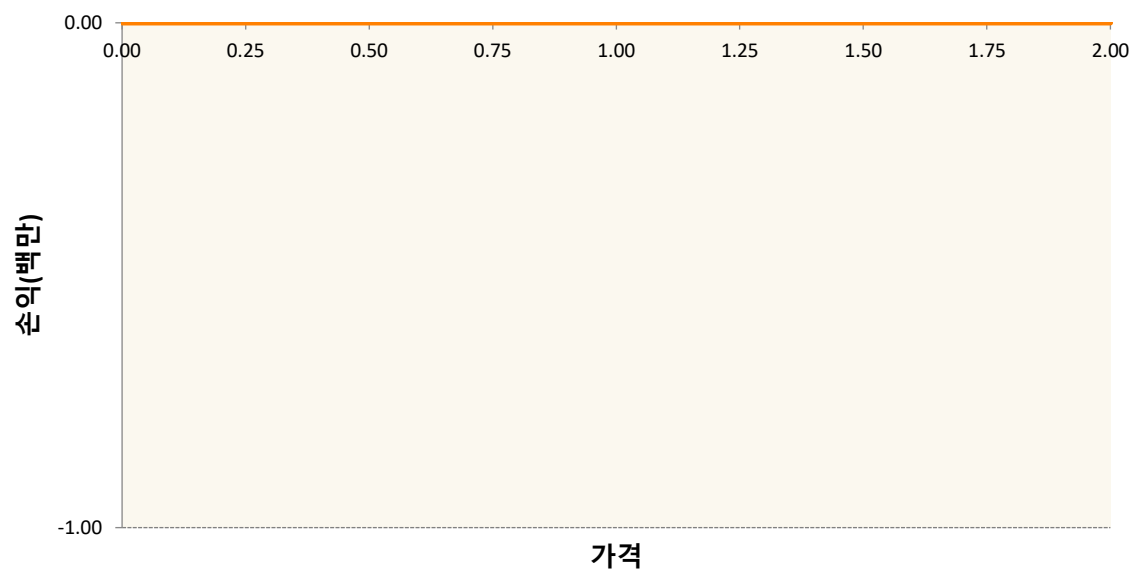
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

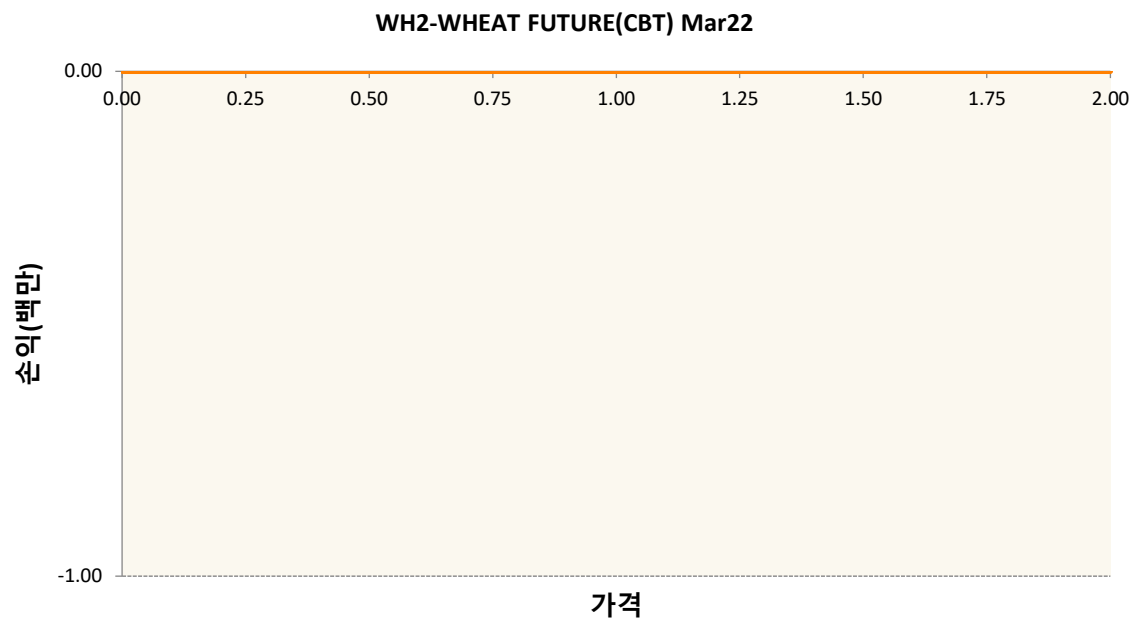
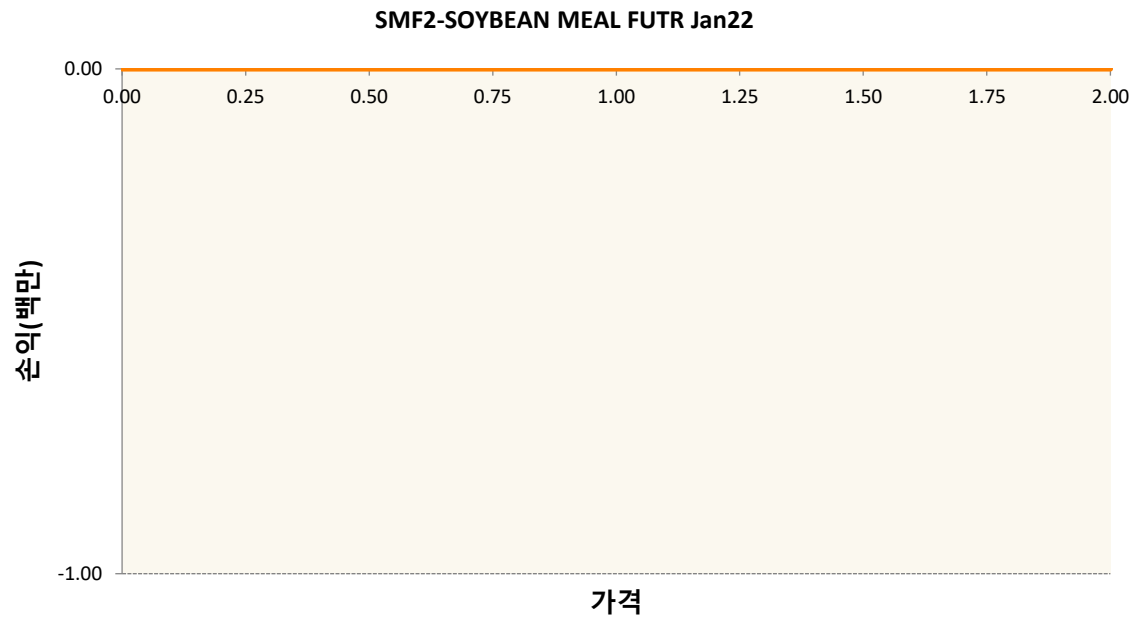


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



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		17
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22		22

