

공시일 2021-12-06

기준일 2021-12-03

포커스농산물모(채권-파생형)

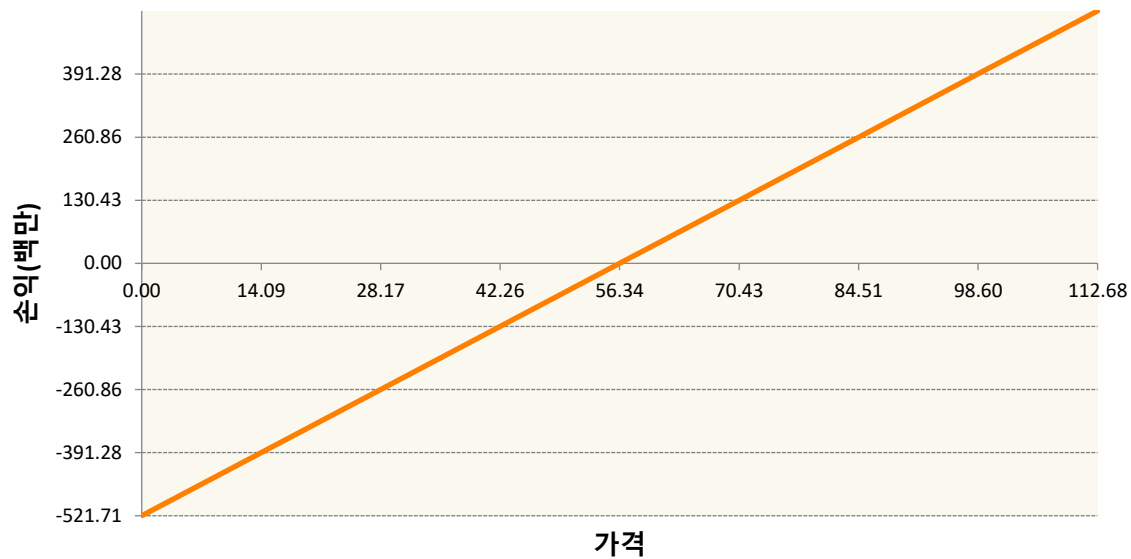
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

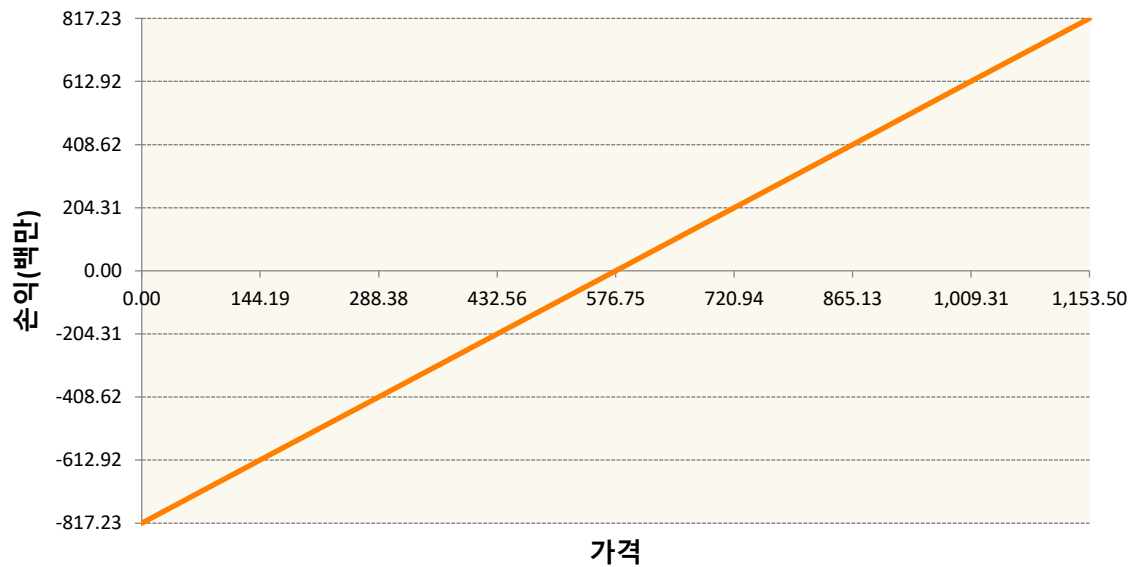
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,492	531	3,961	

2. 만기시점의 손익구조

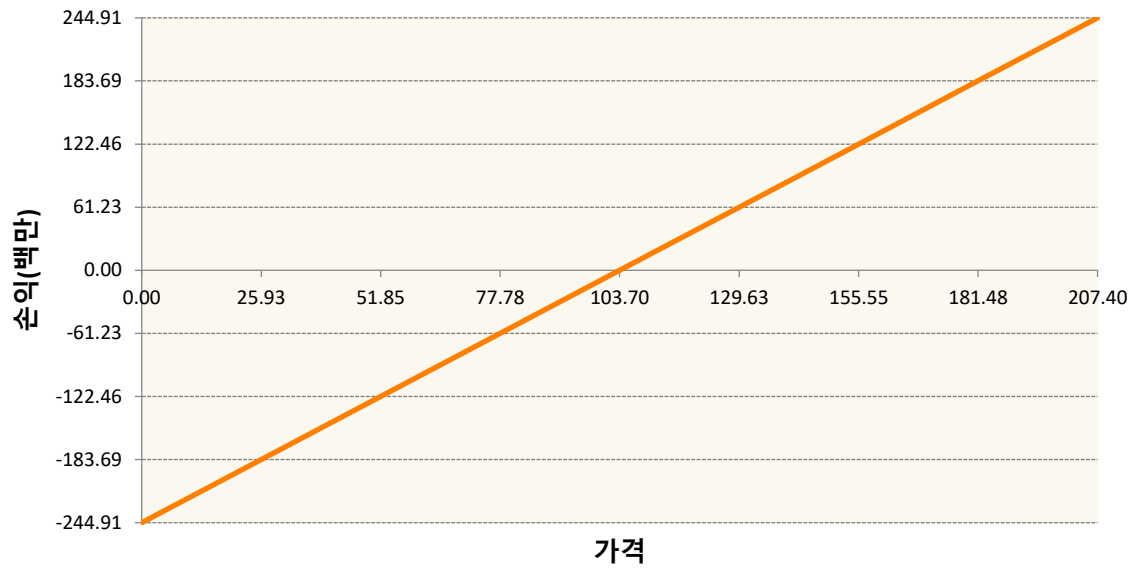
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



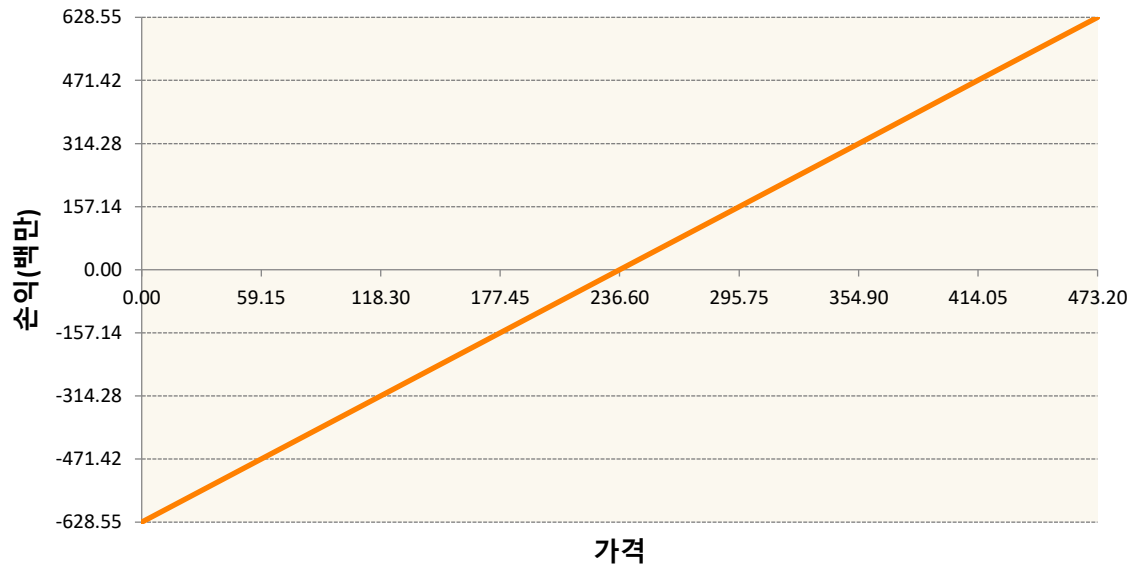
CH2-CORN FUTURE Mar22



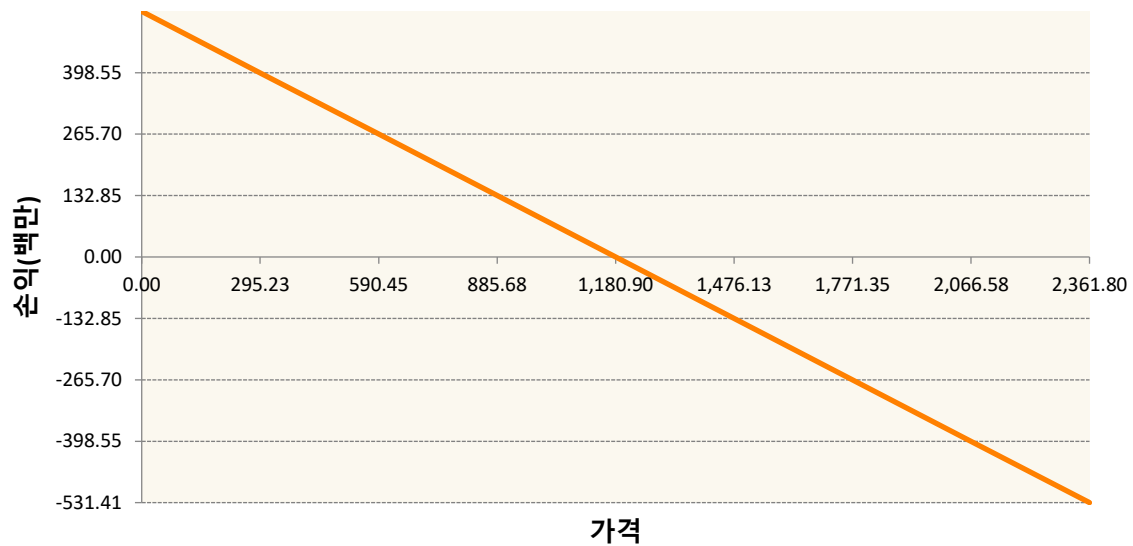
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



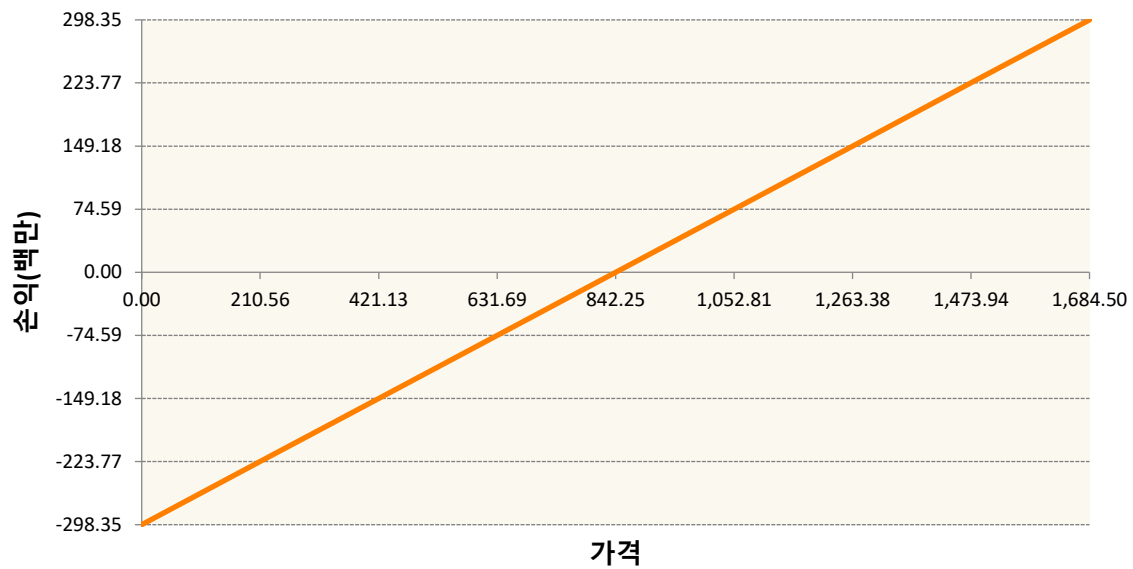
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



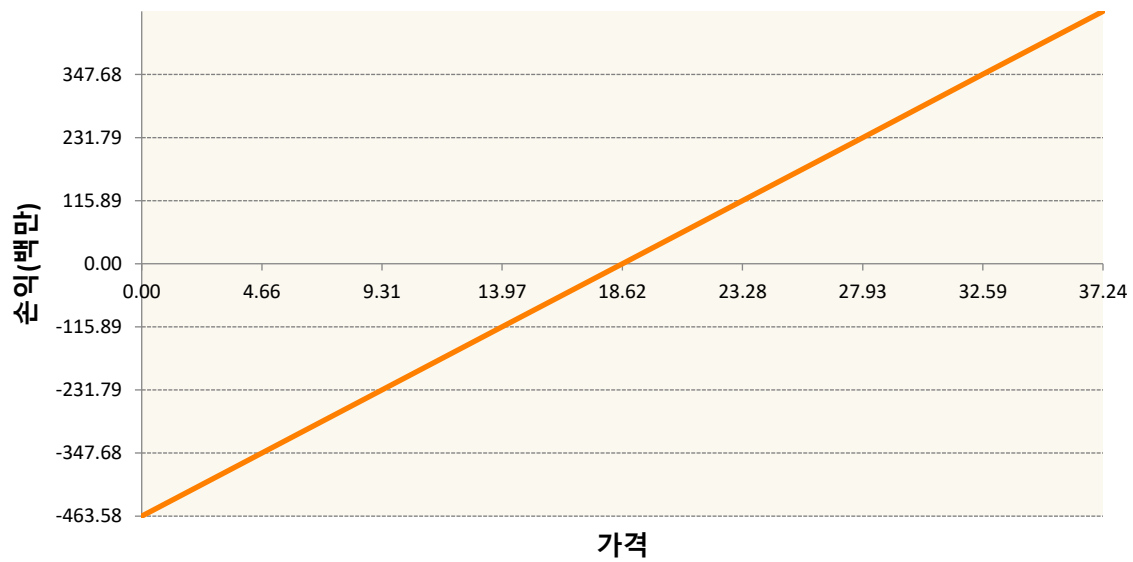
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



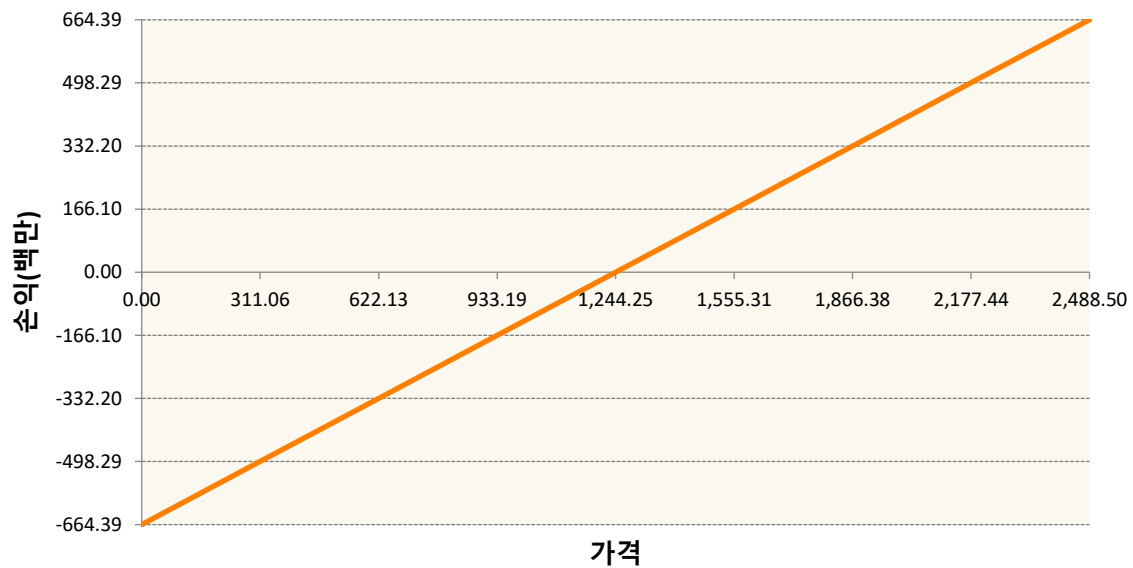
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



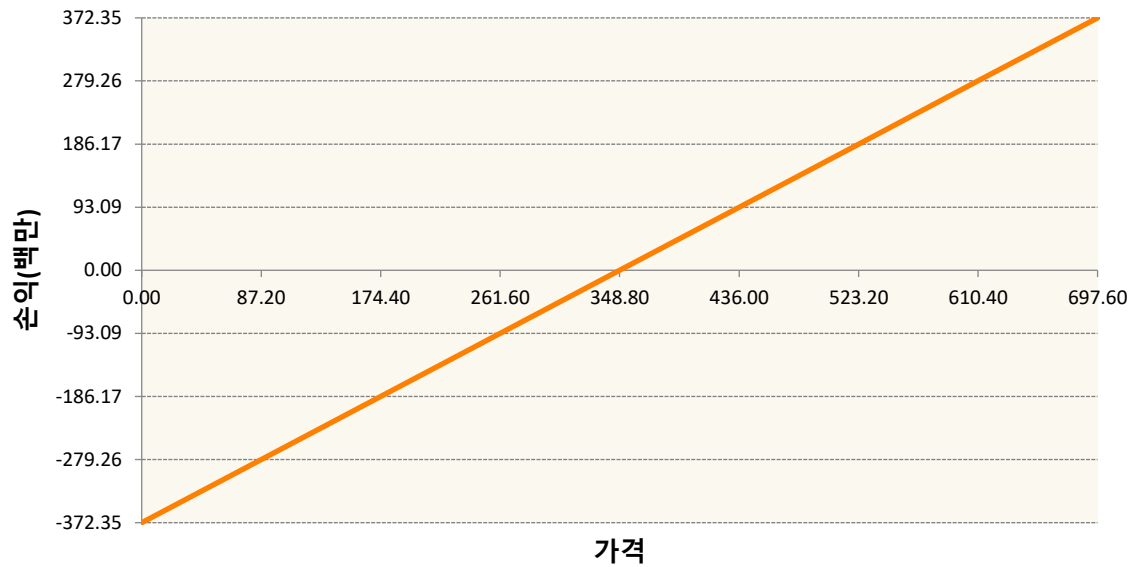
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



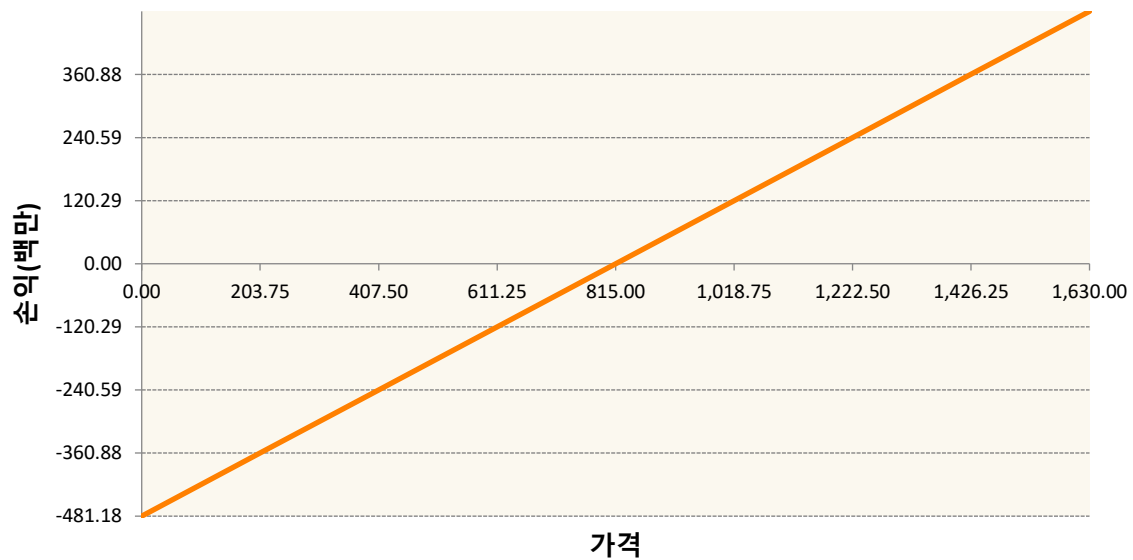
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	2021-12-06
기준일	2021-12-03

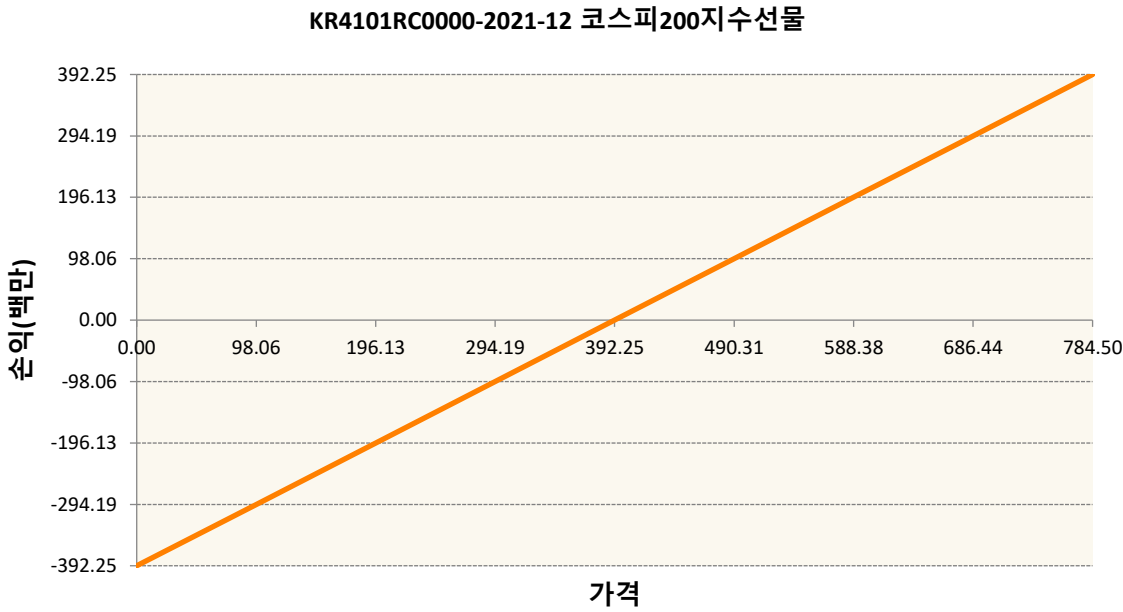
스마트인덱스모

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	392	0	392	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	2021-12-06
기준일	2021-12-03

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

893

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

529

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-06
기준일	2021-12-03

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

436

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

422

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-06
기준일	2021-12-03

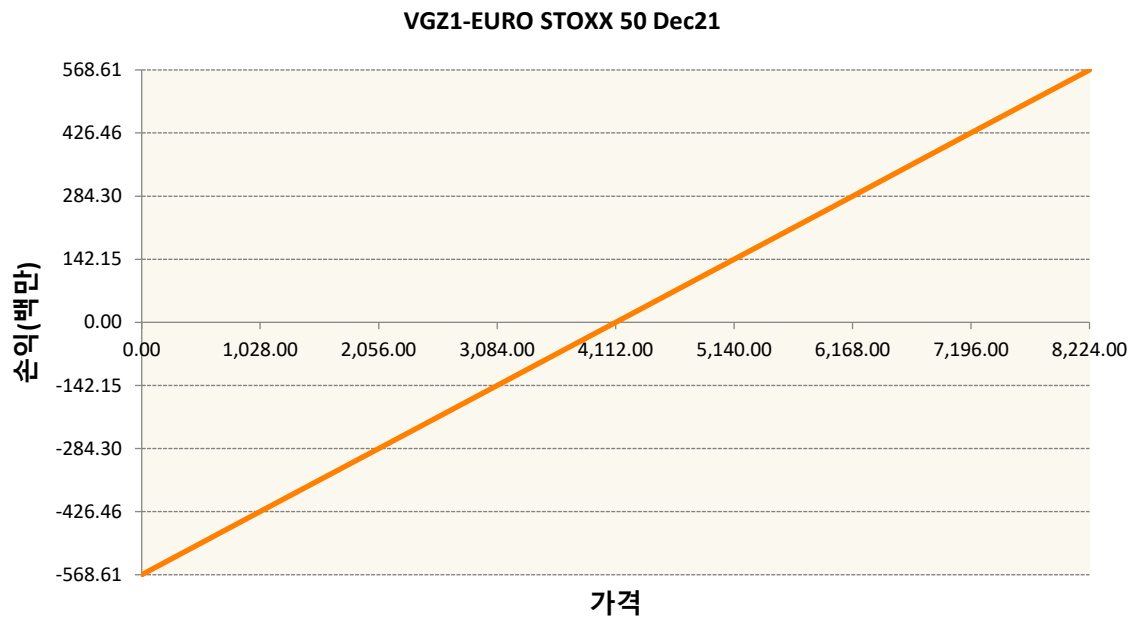
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	569	0	569	

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	2021-12-06
기준일	2021-12-03

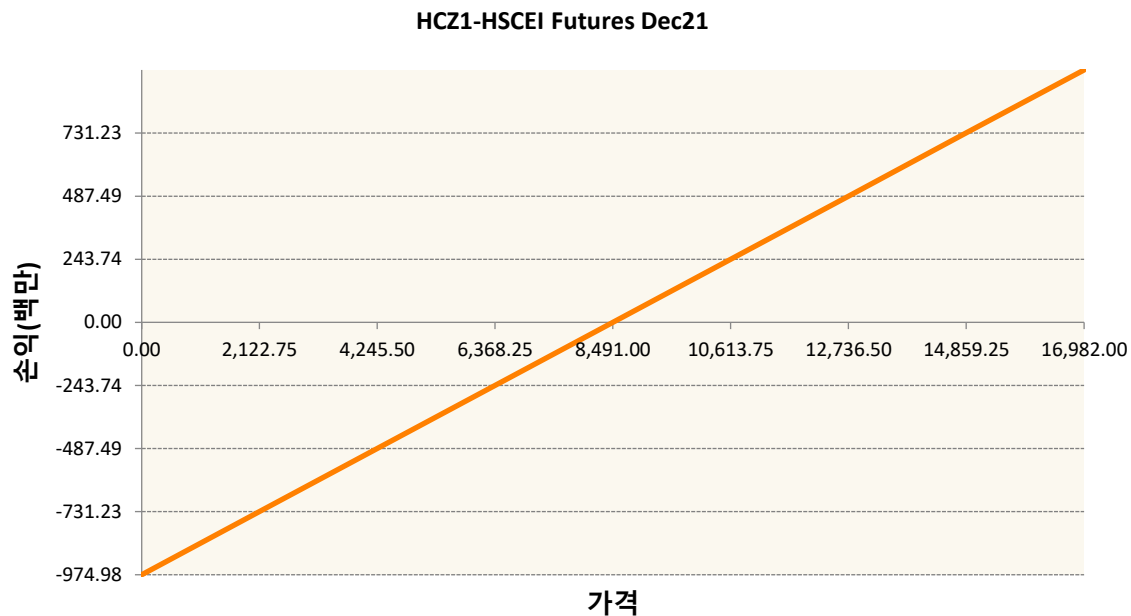
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	975	0	975	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	78
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

82

공시일 2021-12-06

기준일 2021-12-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

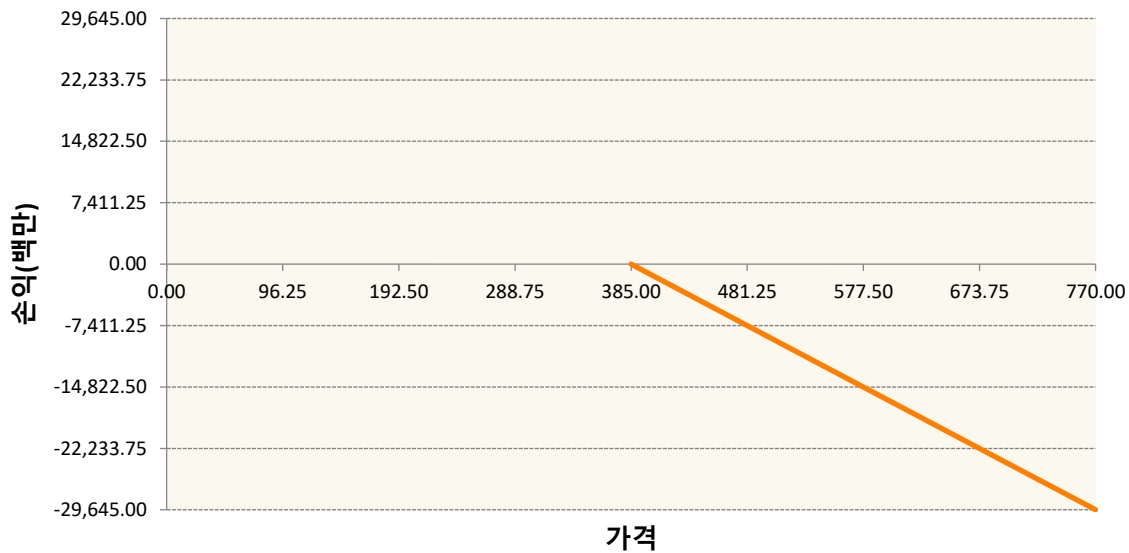
1. 계약금액

(단위:백만원)

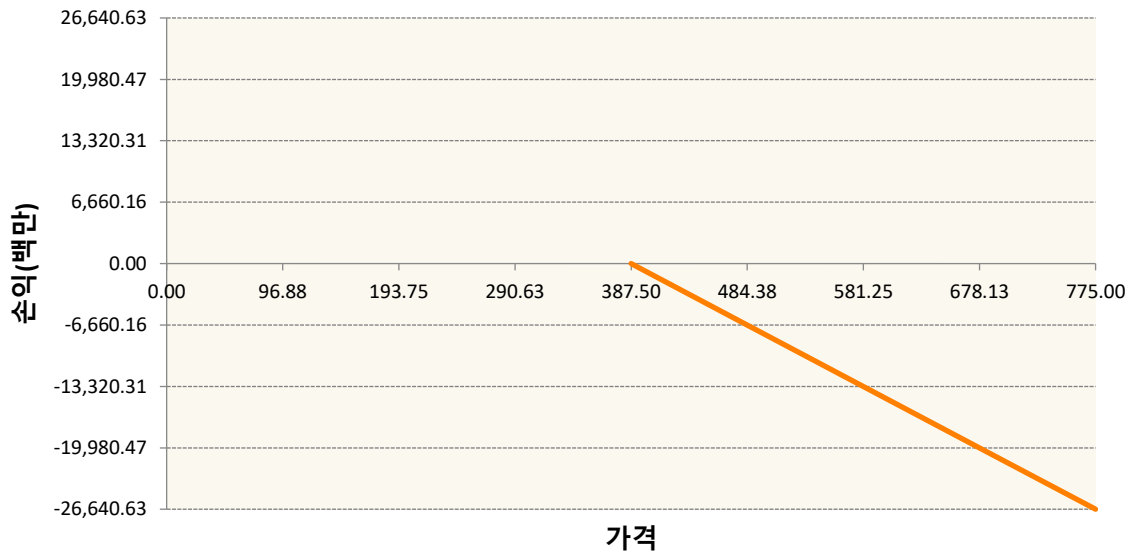
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,517	-76,517	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201RC3854-2021-12 콜385



KR4201RC3870-2021-12 콜387.5



The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis represents '가격' (Price) and the y-axis represents '순이익(백만)' (Net Income in millions). A solid orange line shows a linear relationship, starting at a price of 0 with a net income of -17,325 and reaching a net income of 0 at a price of 385.

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			2,212
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	739	737	733	728	721	712	702
-5.33%	712	698	681	662	641	619	595
-2.67%	546	513	479	446	412	378	344
0%	90	61	31	0	-31	-63	-96
2.67%	-611	-622	-635	-650	-668	-687	-708
5.33%	-1,401	-1,402	-1,405	-1,410	-1,416	-1,424	-1,433
8.00%	-2,204	-2,204	-2,205	-2,205	-2,207	-2,209	-2,212
KR4201RC3870				2021-12 콜387.5			1,919
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	549	548	546	542	538	532	524
-5.33%	535	525	514	500	485	468	450
-2.67%	429	403	375	347	319	290	261
0%	89	59	30	0	-30	-60	-91
2.67%	-497	-510	-526	-543	-562	-582	-604
5.33%	-1,192	-1,195	-1,199	-1,204	-1,212	-1,221	-1,232
8.00%	-1,908	-1,909	-1,909	-1,910	-1,912	-1,915	-1,919
KR4301RC3853 2021-12 풋385							1,038

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,035	-1,036	-1,038
-5.33%	-567	-570	-574	-579	-584	-591	-598
-2.67%	-162	-176	-189	-203	-217	-231	-245
0%	33	23	12	0	-12	-25	-37
2.67%	65	63	61	58	54	49	43
5.33%	66	66	66	66	65	64	63
8.00%	66	66	66	66	66	66	66

KR4301RC3879 2021-12 풋387.5							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%	-107	-108	-108	-109	-109	-110	-111
-2.67%	-35	-37	-39	-41	-43	-46	-48
0%	7	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	16	15	15	14	13	12	11
5.33%	17	16	16	16	16	16	16
8.00%	17	17	17	17	17	16	16

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

(단위:백만원)

6,003

공시일 2021-12-06

기준일 2021-12-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

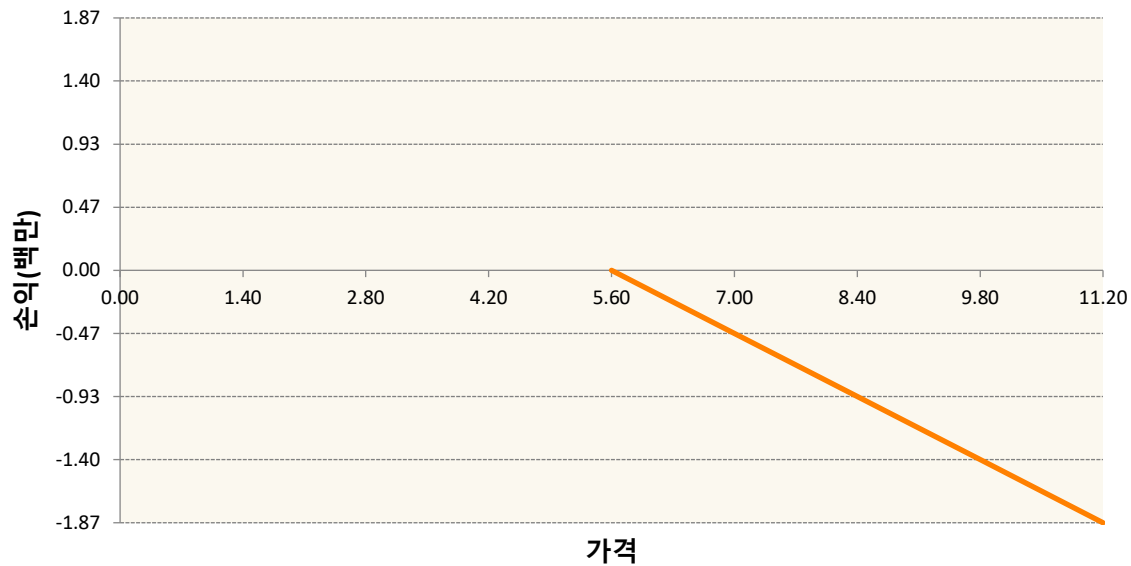
1. 계약금액

(단위:백만원)

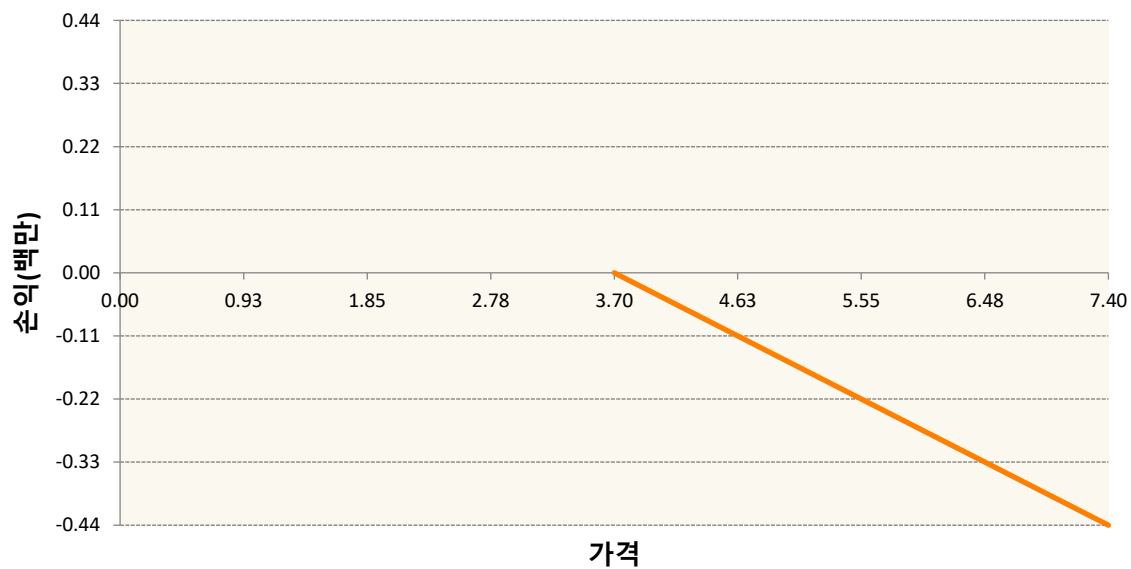
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	142	-142	장내

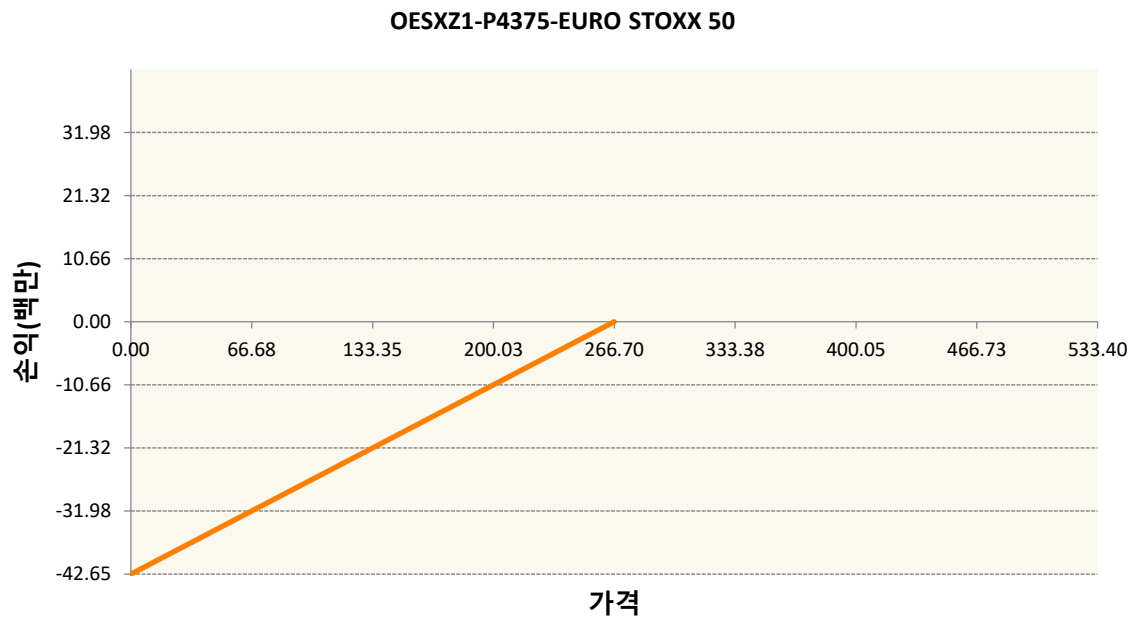
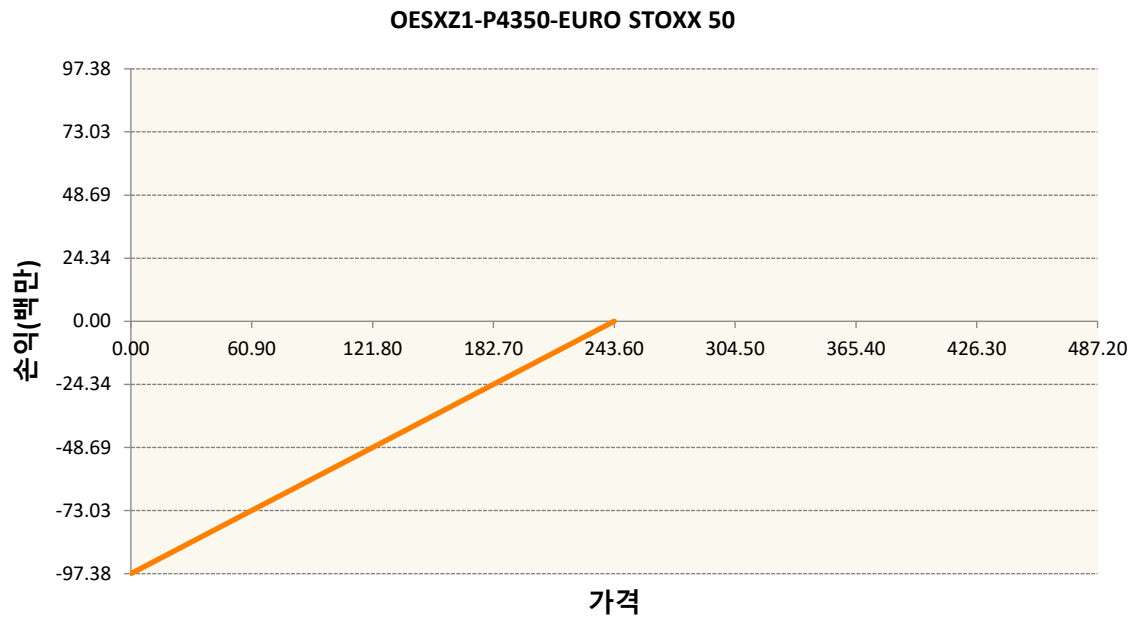
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		23
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.15
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.04
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		8
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	35

공시일 2021-12-06

기준일 2021-12-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

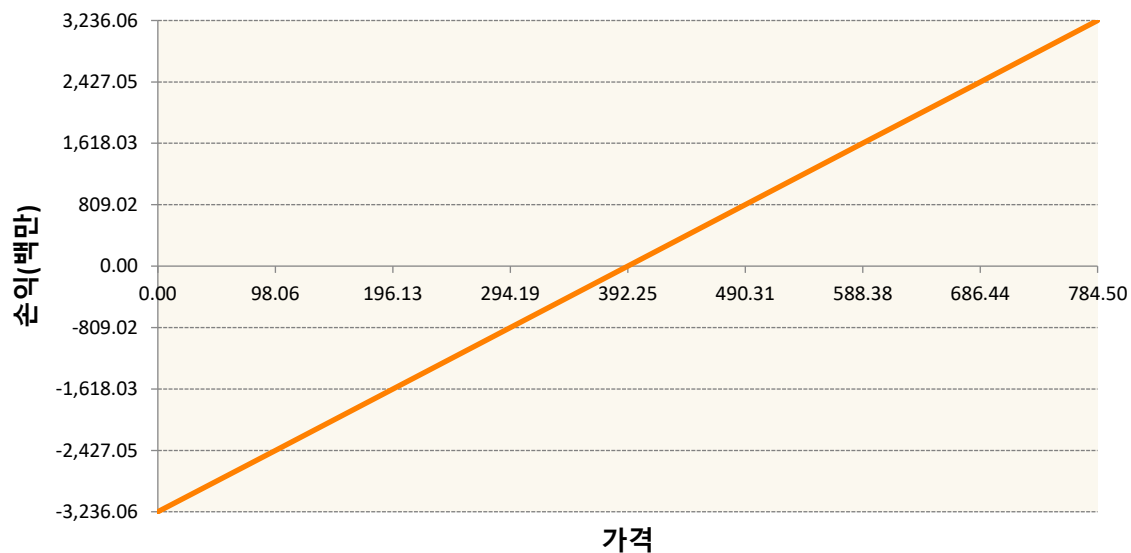
1. 계약금액

(단위:백만원)

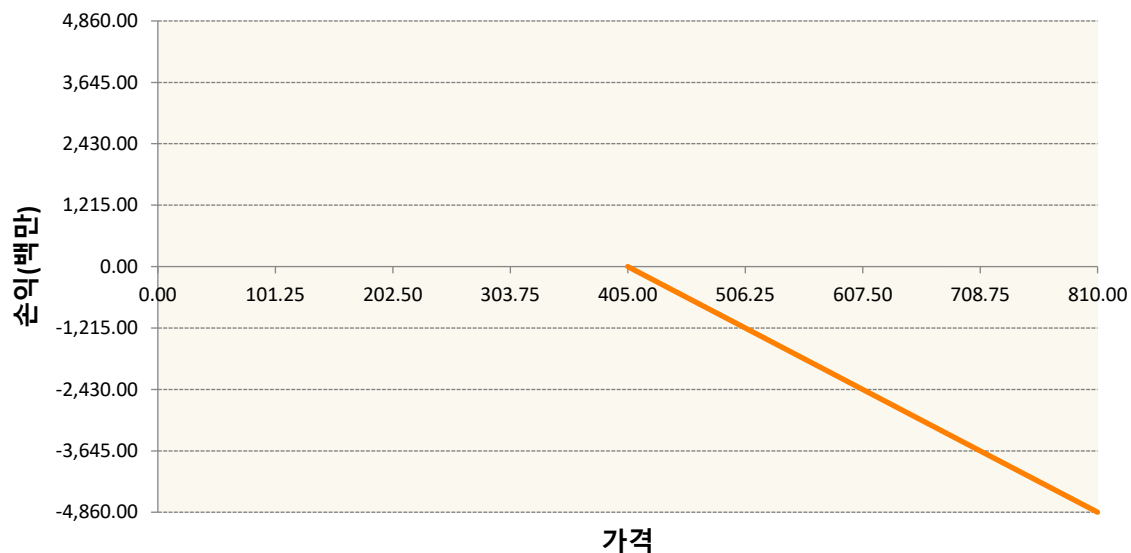
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,236	0	3,236	장내
누계	유가증권	옵션	579	5,369	-4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조

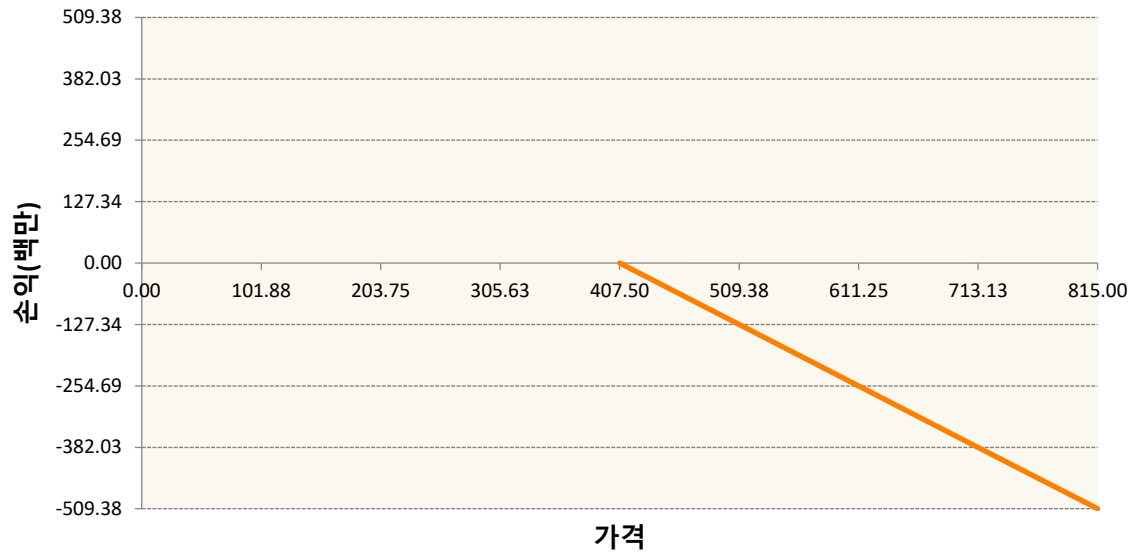
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



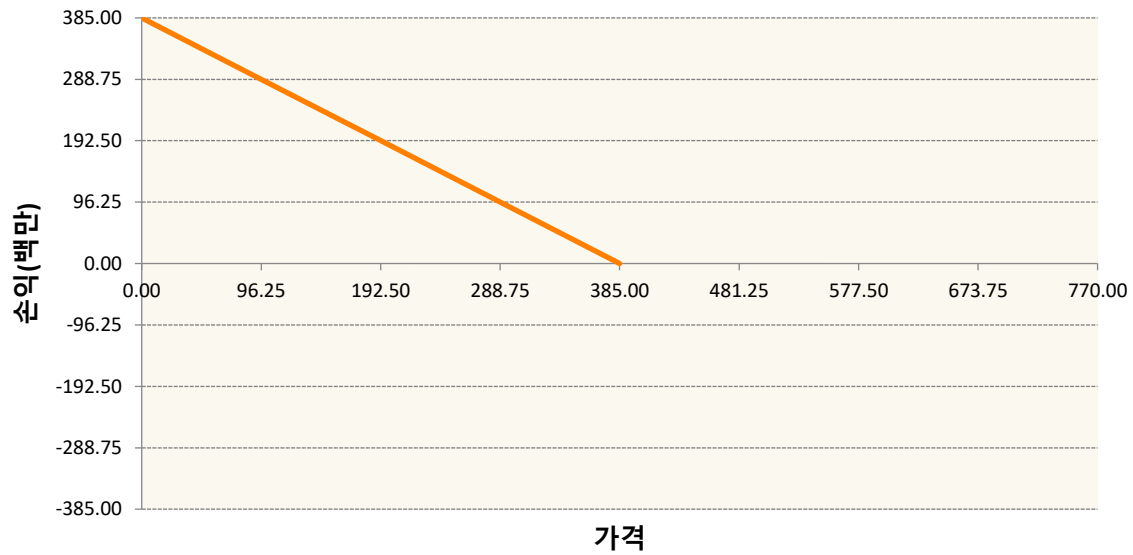
KR4201RC4050-2021-12 콜405



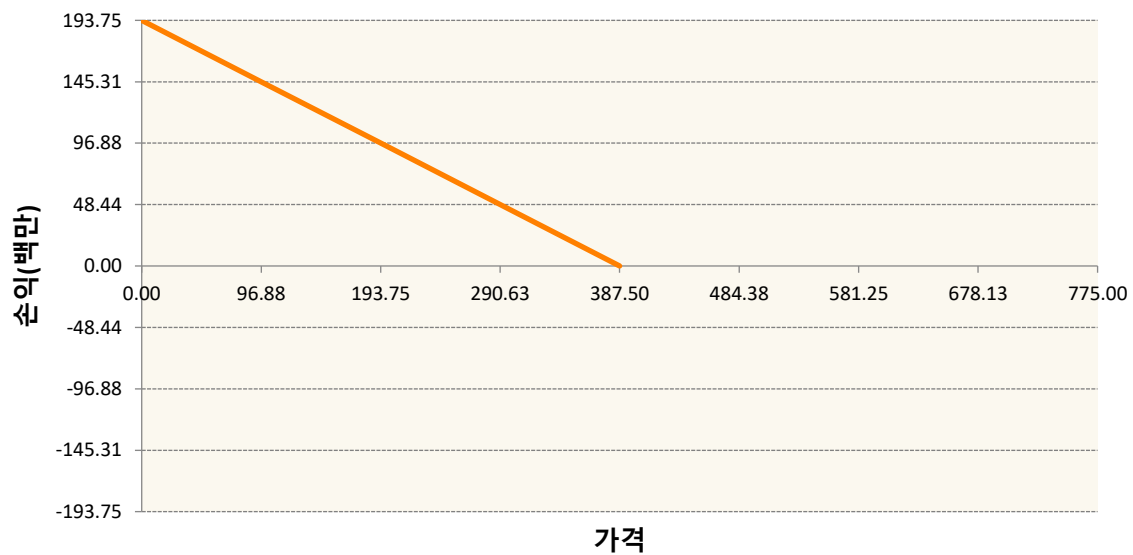
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



KR4301RC3853-2021-12 풋385



KR4301RC3879-2021-12 풋387.5



(단위:백만원)

KR4101RC0000							2021-12 코스피200지수선물	259
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259	
-5.33%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172	
-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%	172	172	172	172	172	172	172	
8.00%	259	259	259	259	259	259	259	
KR4201RC4050							2021-12 콜405	221
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	16	16	16	16	16	16	16	
-5.33%	16	16	16	16	16	15	14	
-2.67%	16	15	14	13	12	10	8	
0%	10	7	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	-21	-26	-32	-38	-43	-49	-55	
5.33%	-96	-100	-105	-110	-115	-120	-125	
8.00%	-205	-207	-209	-212	-215	-218	-221	
KR4201RC4076							2021-12 콜407.5	21
	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	1	
0%	1	1	0	0	0	-1	-1	
2.67%	-2	-2	-3	-3	-4	-4	-5	
5.33%	-8	-9	-9	-10	-10	-11	-12	
8.00%	-19	-19	-19	-20	-20	-21	-21	
KR4301RC3853							2021-12 풋385	23
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	23	23	23	23	23	23	23	
-5.33%	13	13	13	13	13	13	13	
-2.67%	4	4	4	5	5	5	5	
0%	-1	-1	0	0	0	1	1	
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
KR4301RC3879							2021-12 풋387.5	12
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7
-2.67%	2	2	3	3	3	3	3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

487

공시일	2021-12-06
기준일	2021-12-03

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	17,883	0	17,883	

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	2021-12-06
기준일	2021-12-03

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	9,636	0	9,636	

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	2021-12-06
기준일	2021-12-03

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	45,510	0	45,510	
누계	통화	선도	1,416	0	1,416	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 2021-12-06

기준일 2021-12-03

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

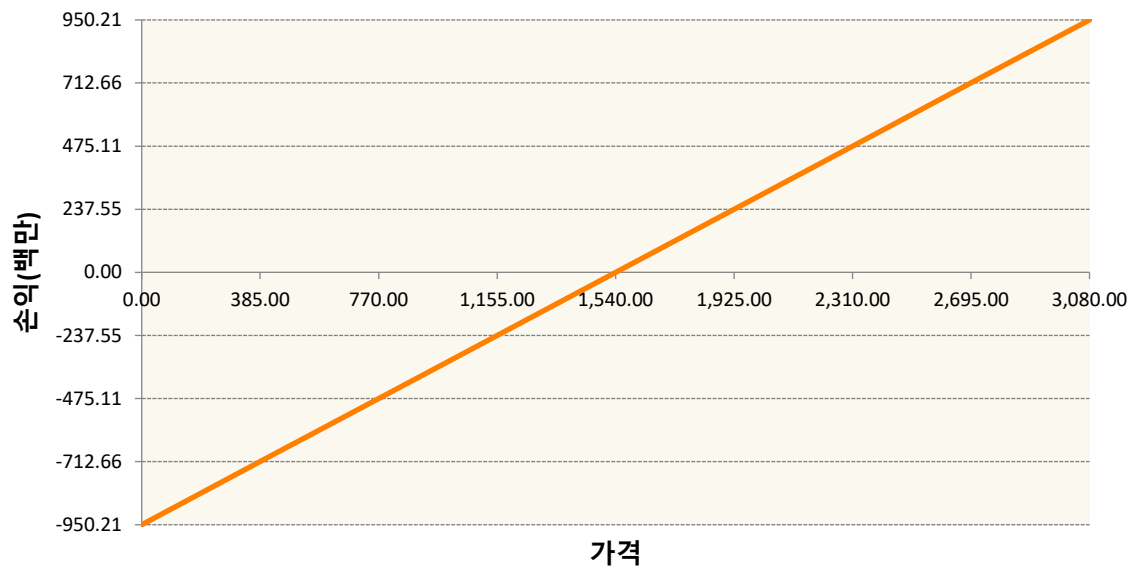
1. 계약금액

(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	950	0	950	
누계	유가증권	스왑	1,779	0	1,779	장외
누계	통화	선도	0	573	-573	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCZ1-VN30 Index Future Dec21



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	142
FXW213BBQ KRW/EUR 25-02-22E	35
FXW213BBS KRW/EUR 25-02-22E	11
VNCZ1 VN30 Index Future Dec21	76

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

(단위:백만원)

254

공시일 2021-12-06

기준일 2021-12-03

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

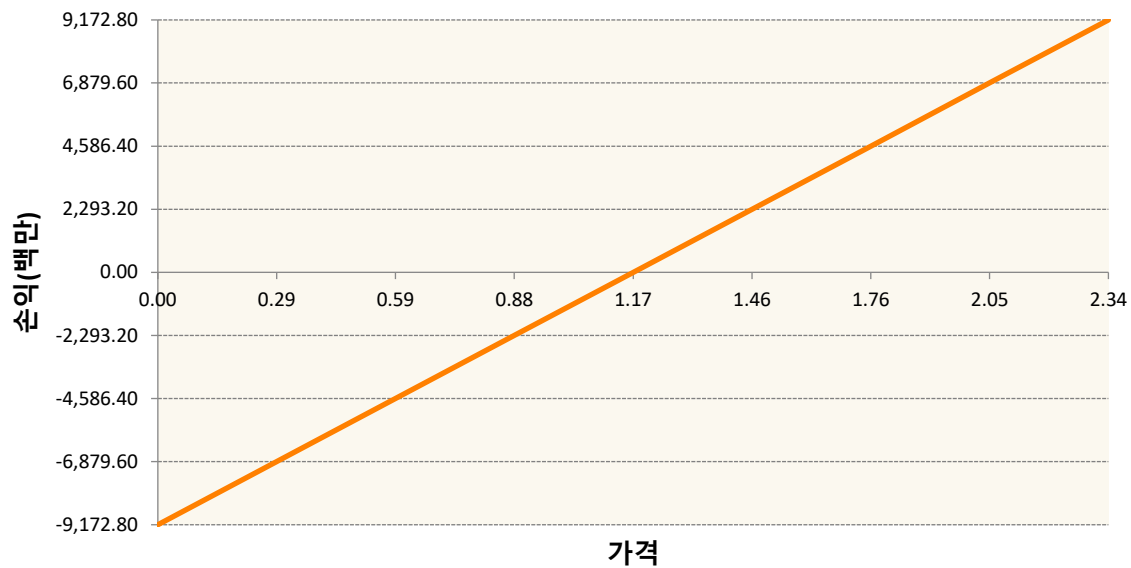
1. 계약금액

(단위:백만원)

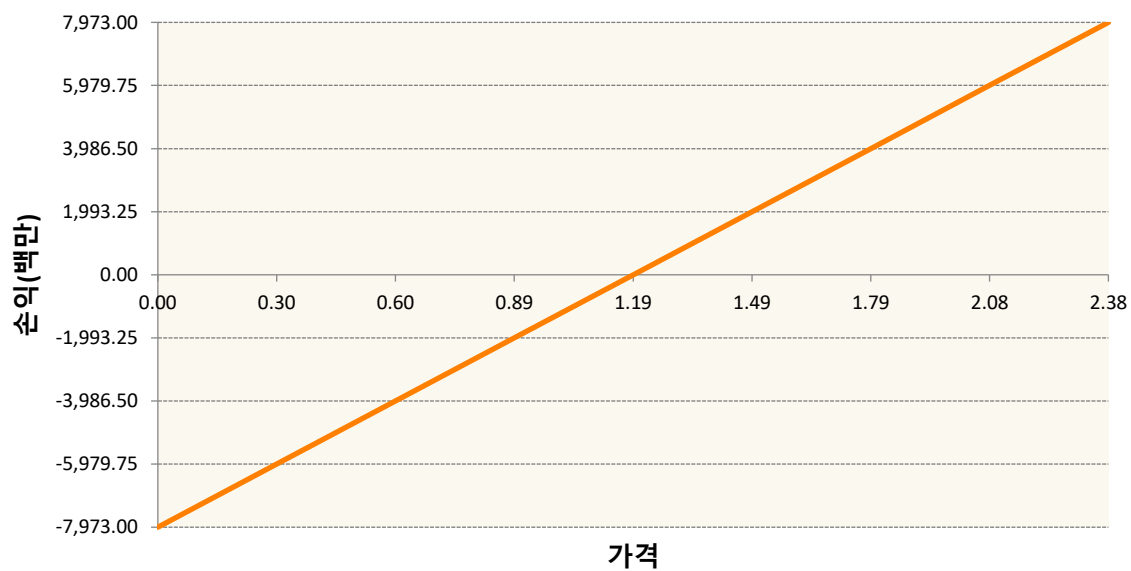
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,162	0	25,162	

2. 만기시점의 손익구조

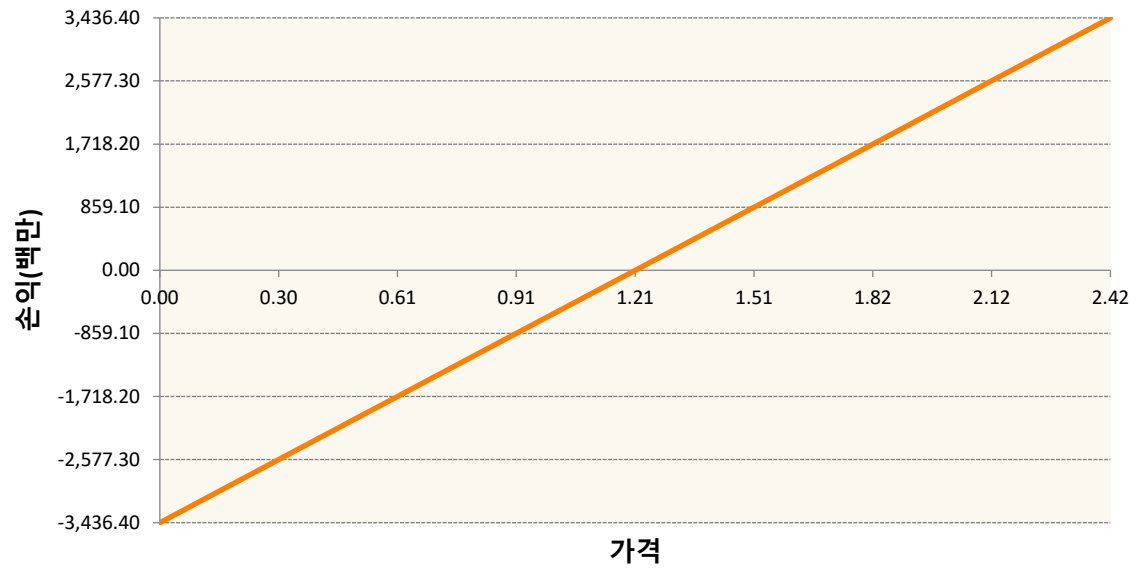
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



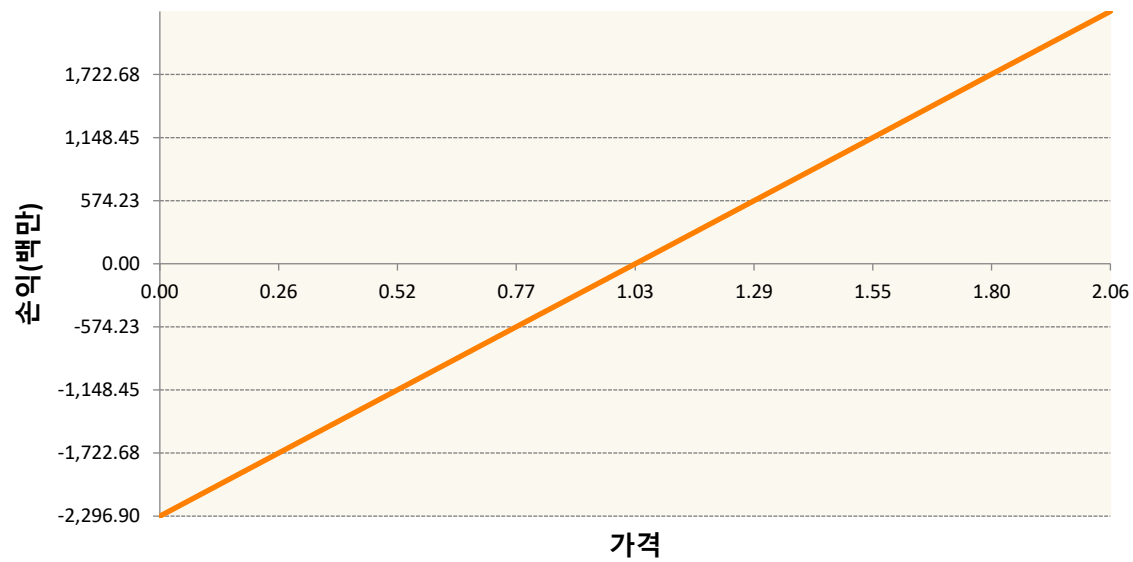
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



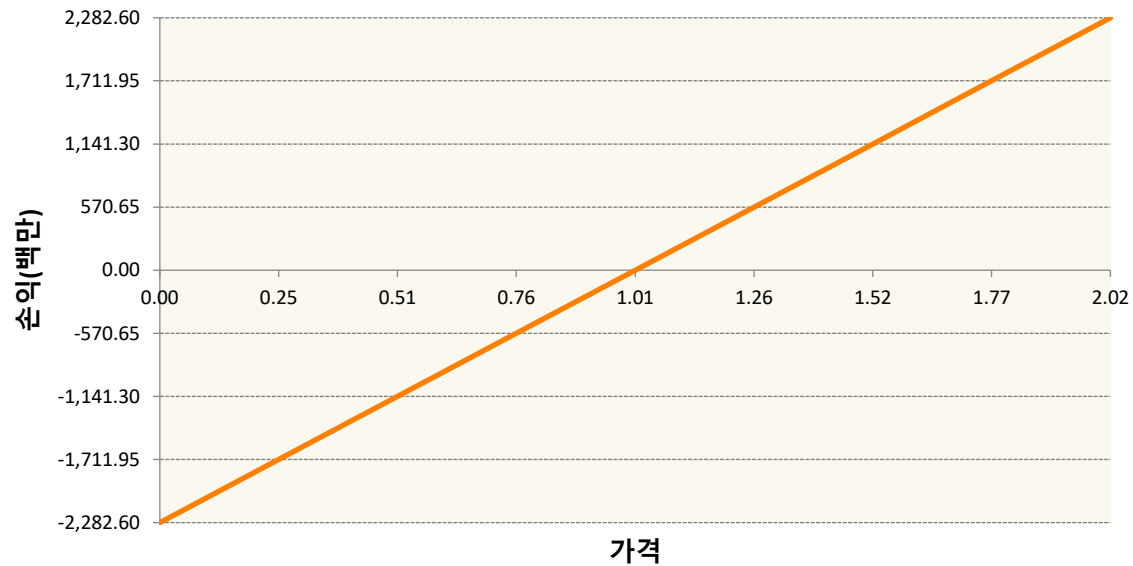
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)		735
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		640
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		276
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		183
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		183

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,013

공시일 2021-12-06

기준일 2021-12-03

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

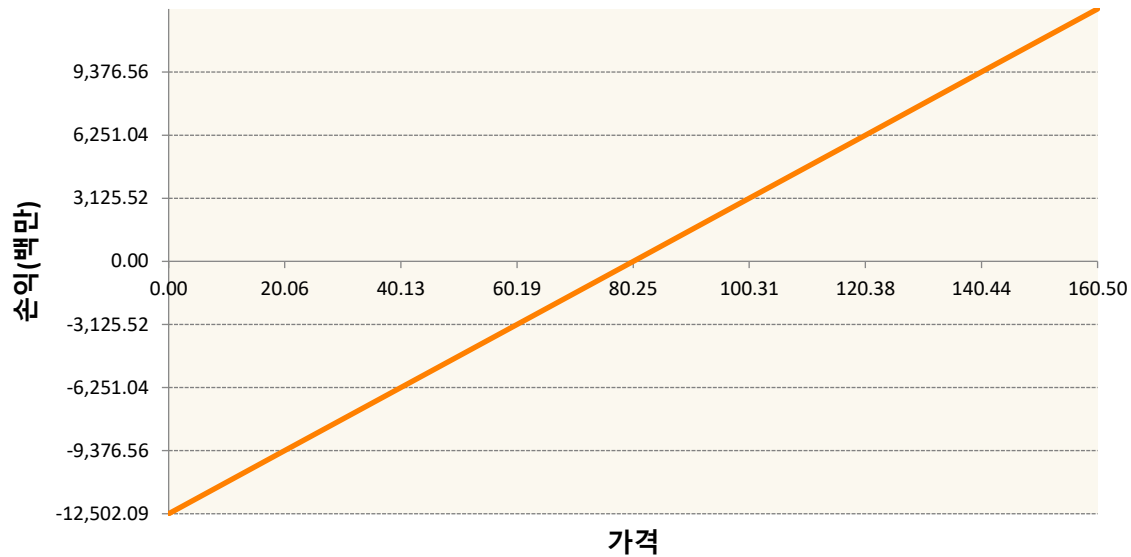
1. 계약금액

(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	12,502	0	12,502	
누계	통화	선도	0	4,756	-4,756	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX KRW/EUR 28-12-21E

380

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,000

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

(단위:백만원)

2,194

공시일 2021-12-06

기준일 2021-12-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

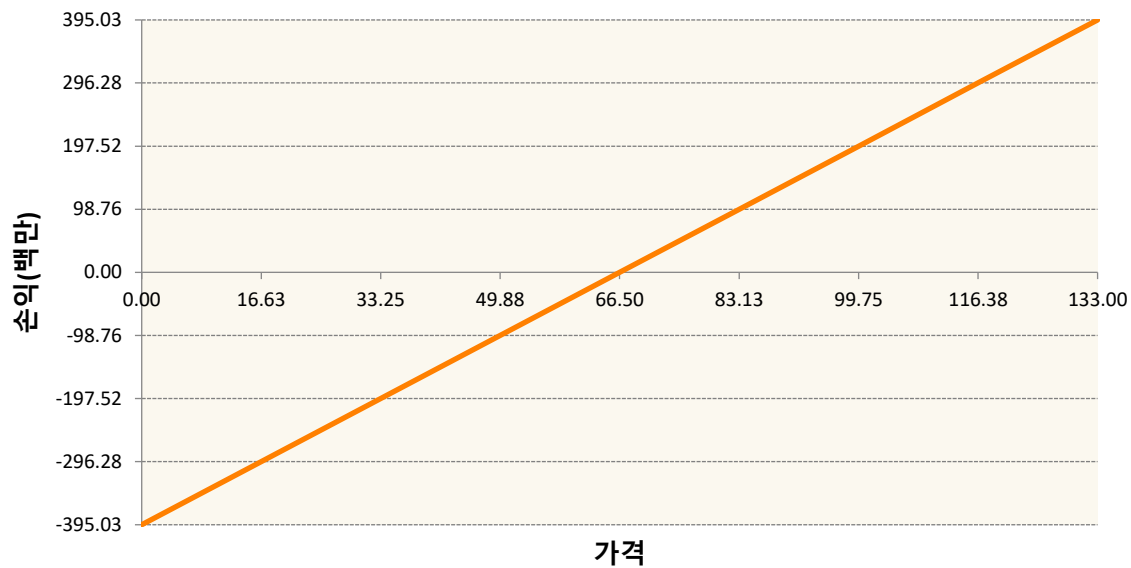
1. 계약금액

(단위:백만원)

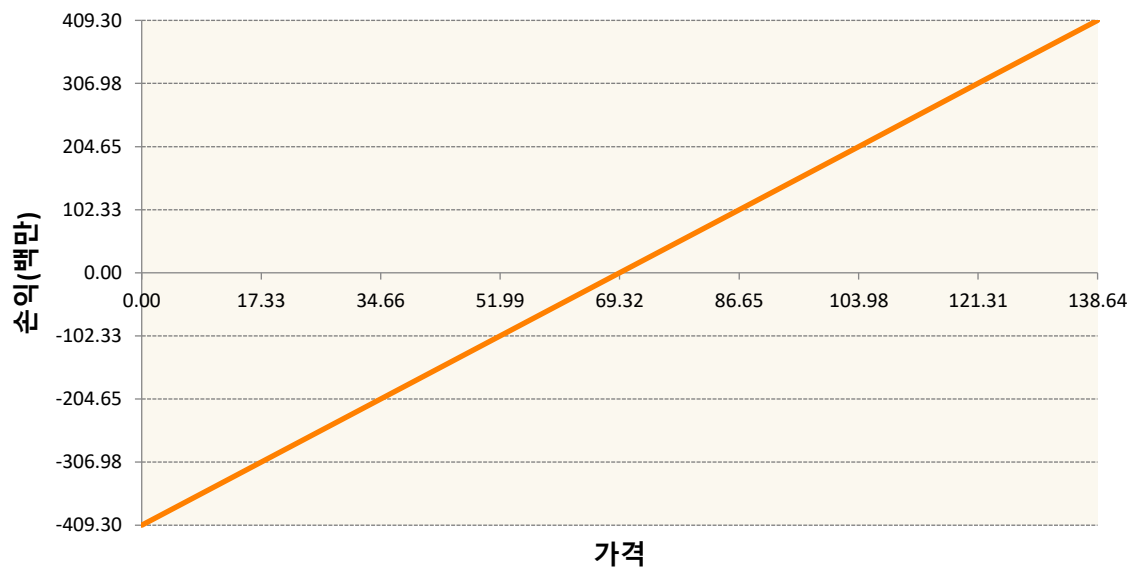
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,802	354	1,448	

2. 만기시점의 손익구조

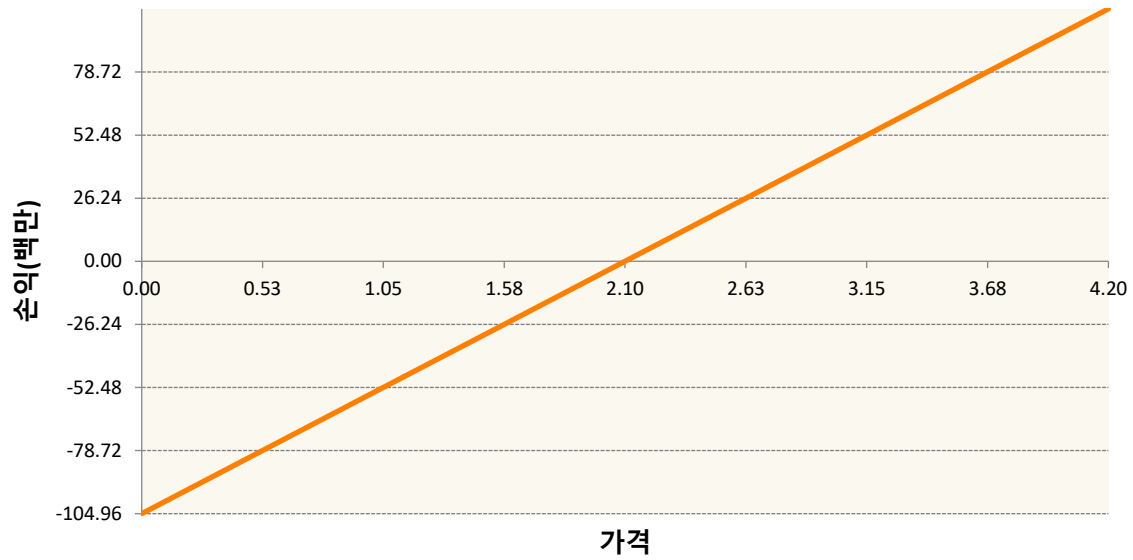
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



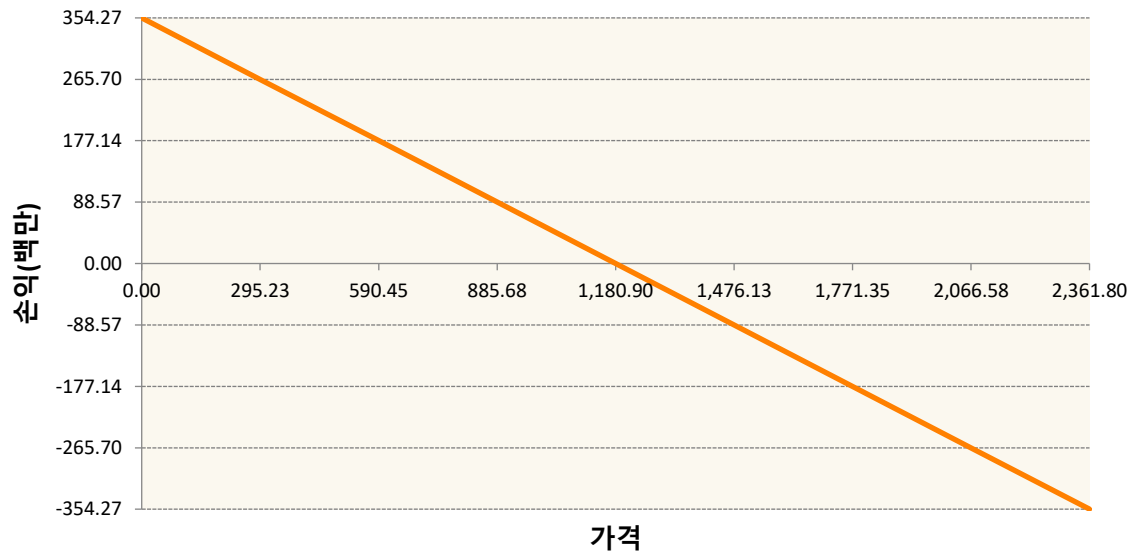
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



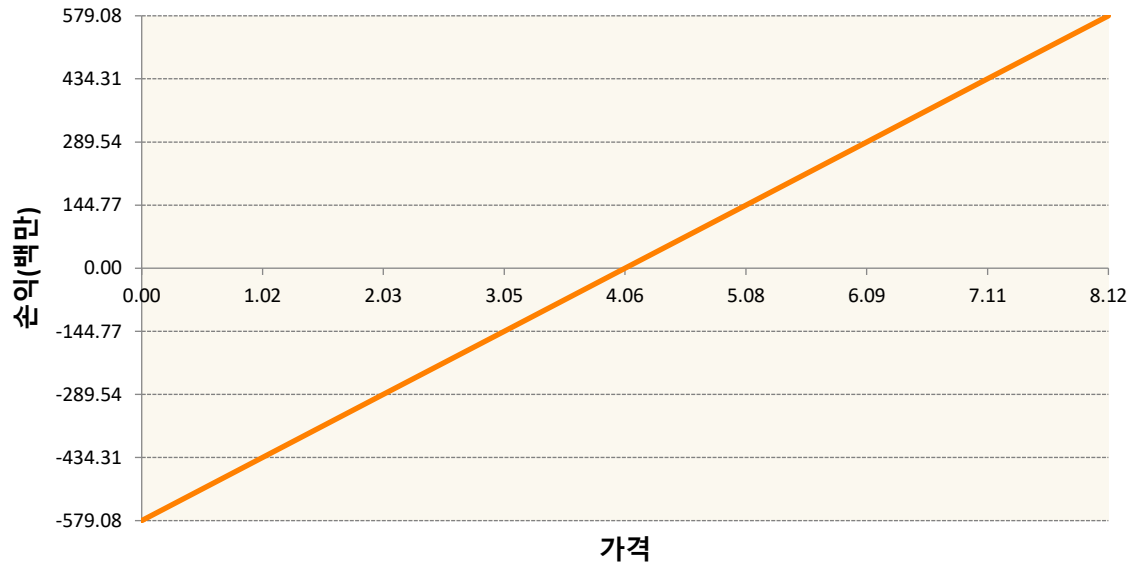
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22



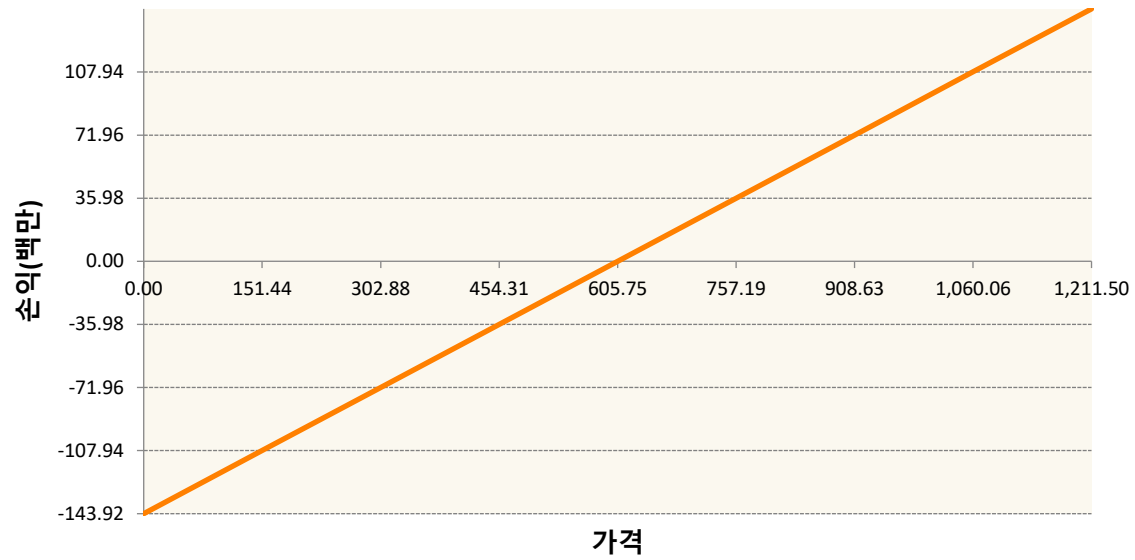
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



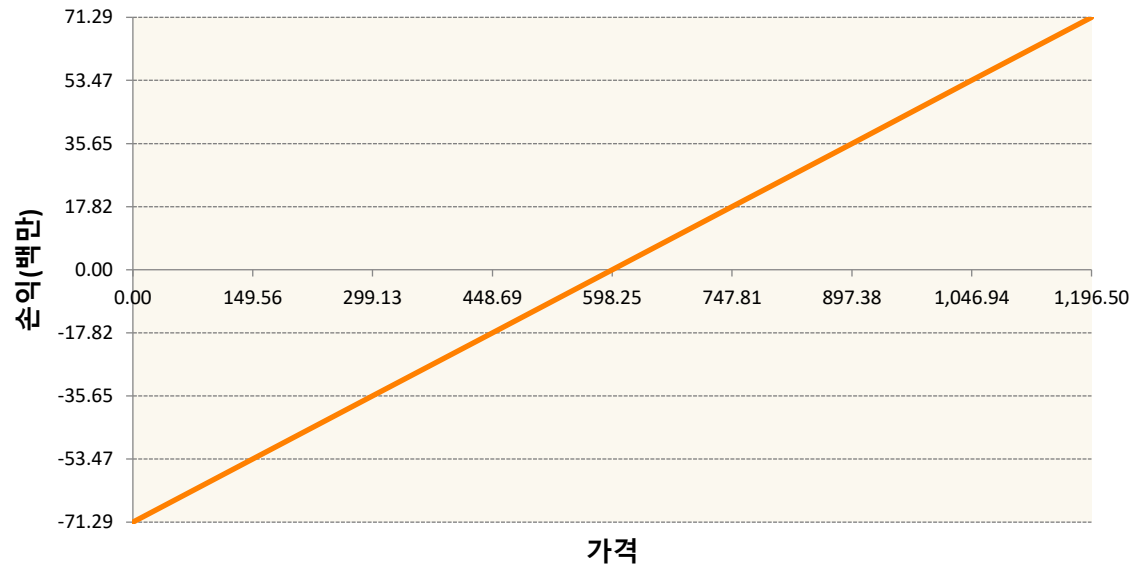
NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22



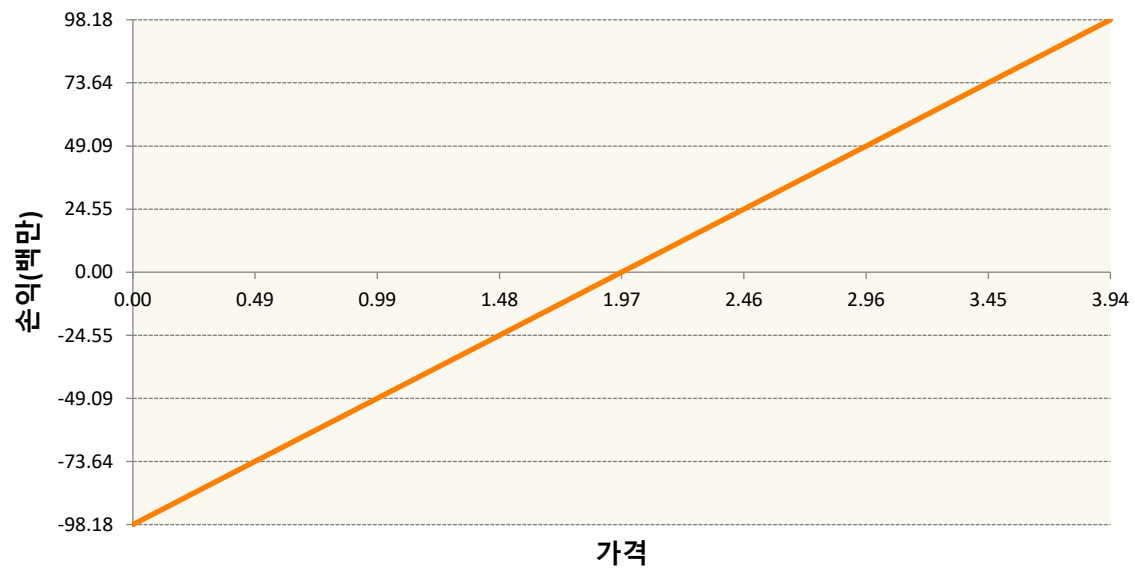
QSF2-Low Su Gasoil G Jan22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBF2-GASOLINE RBOB FUT Jan22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF2	WTI CRUDE FUTURE Jan22	32
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22	33
HOF2	NY Harb ULSD Fut Jan22	8
KR4175RC00 2021-12 달러선물		28
NGF22	NATURAL GAS FUTR Jan22	46
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)

328

공시일 2021-12-06

기준일 2021-12-03

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

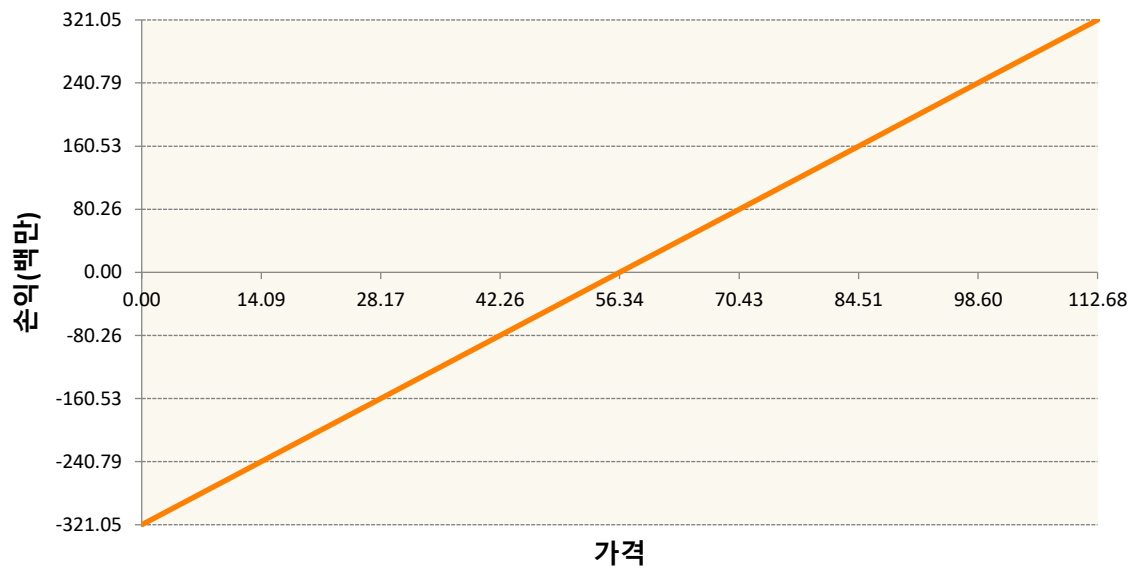
1. 계약금액

(단위:백만원)

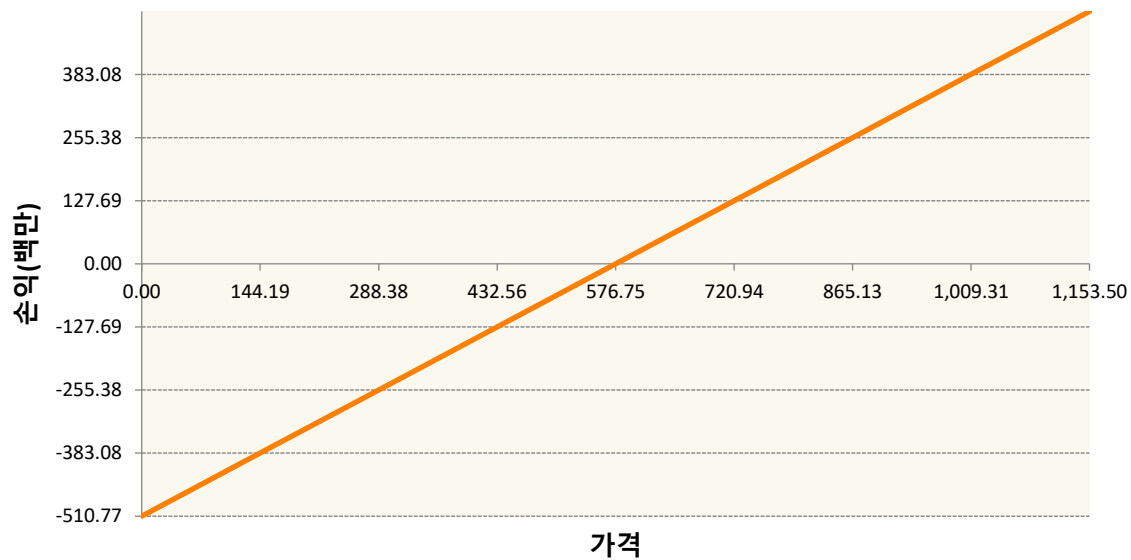
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,656	590	2,065	

2. 만기시점의 손익구조

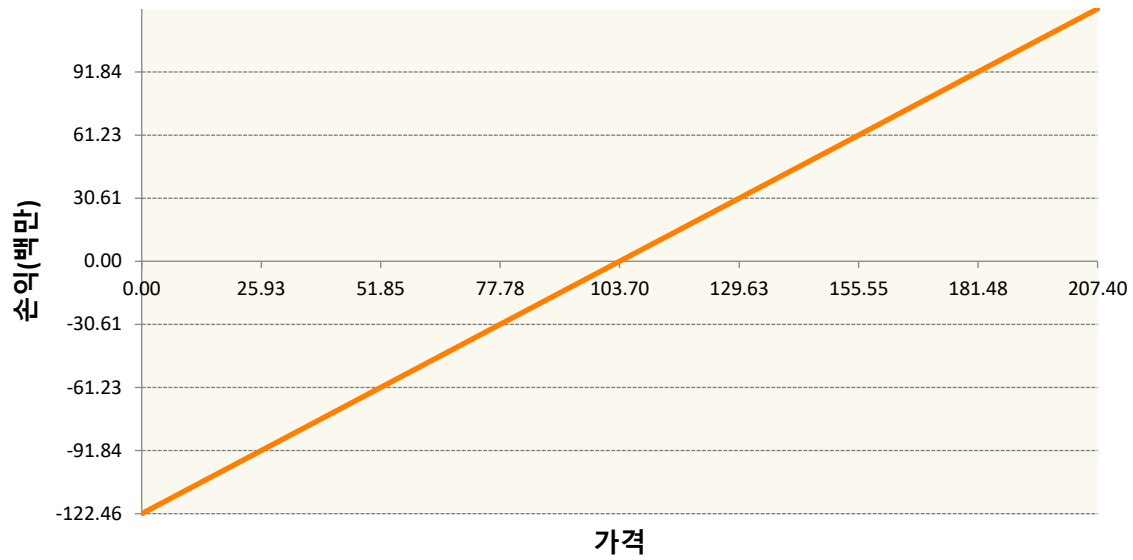
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



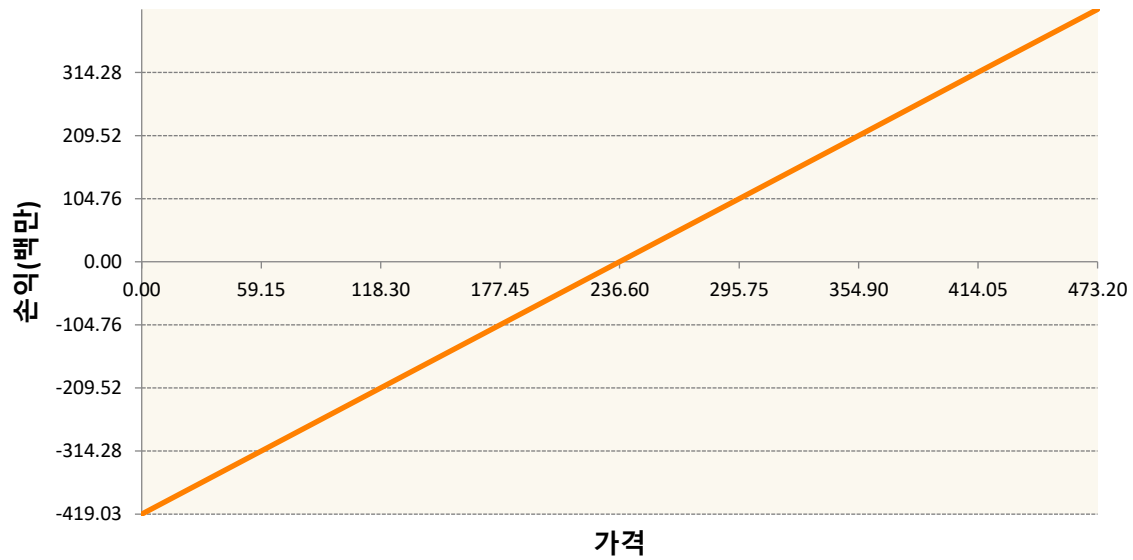
CH2-CORN FUTURE Mar22



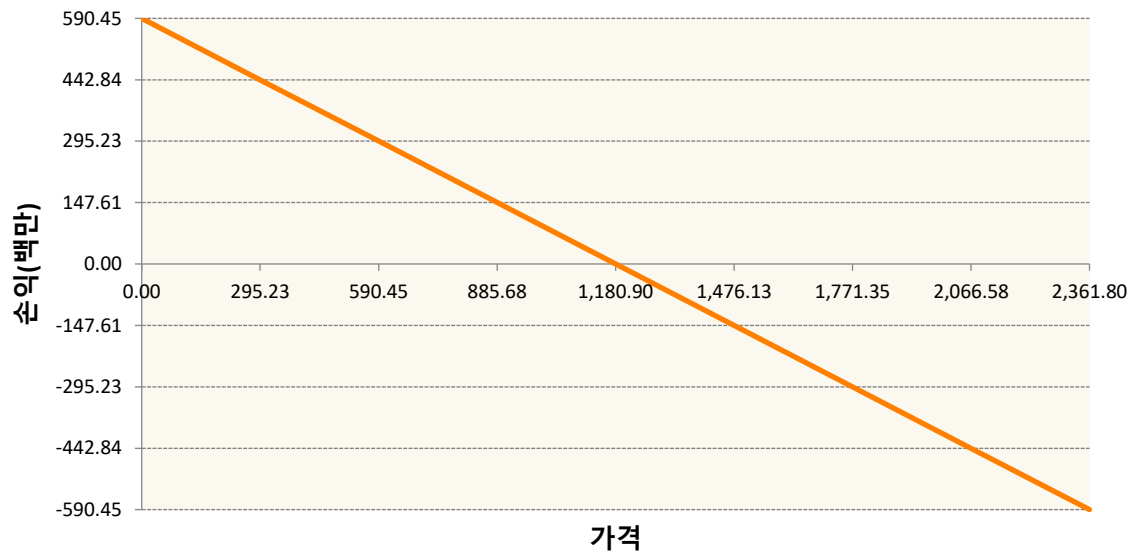
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



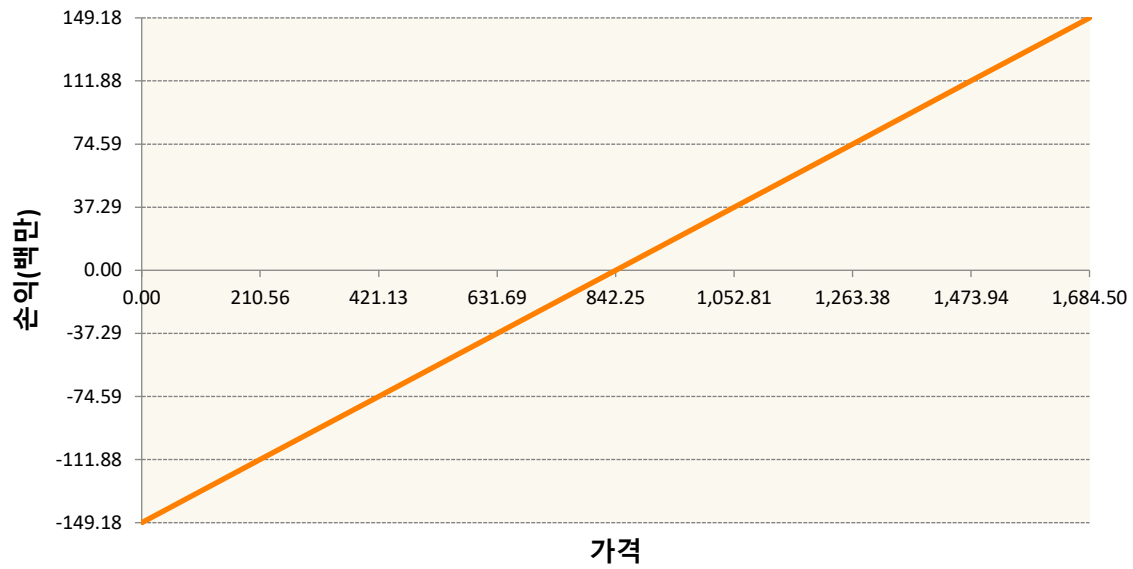
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



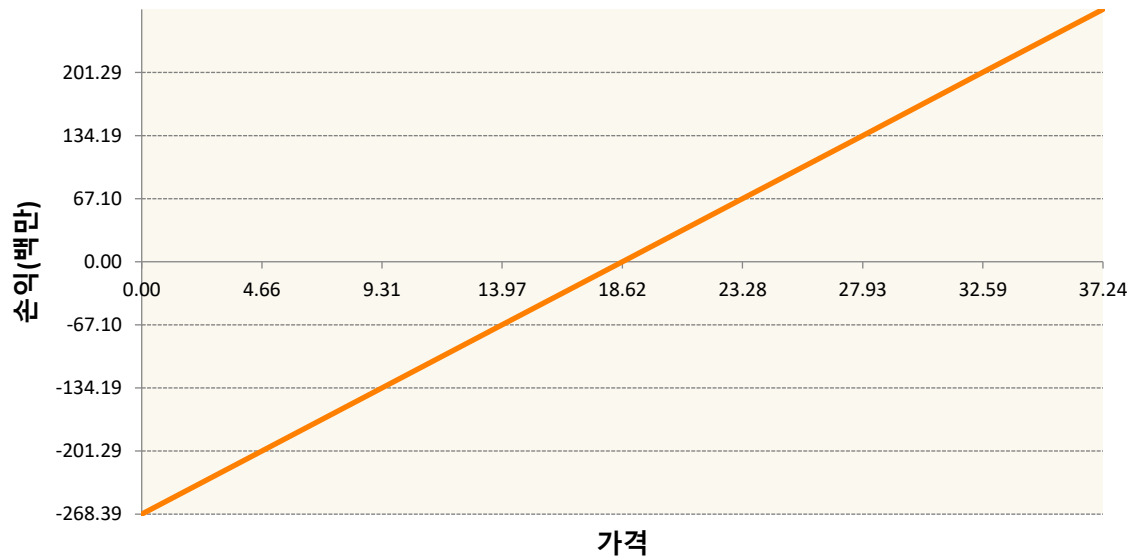
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



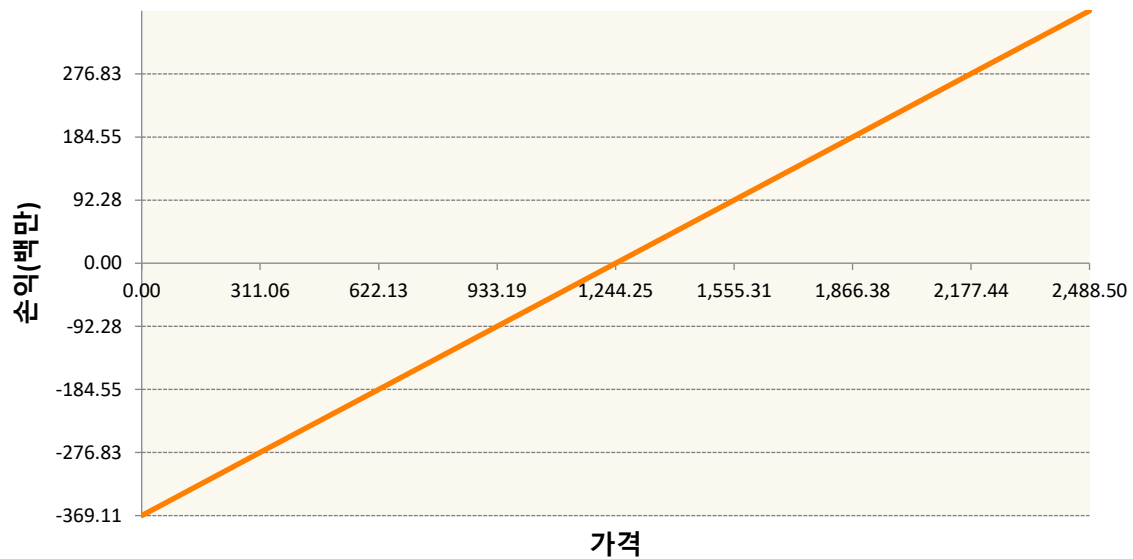
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



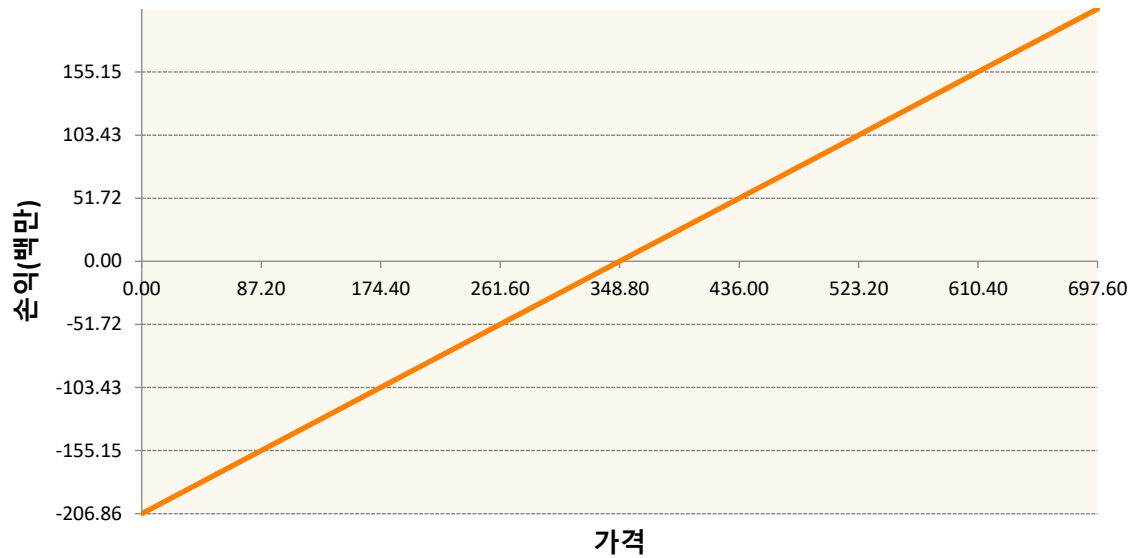
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



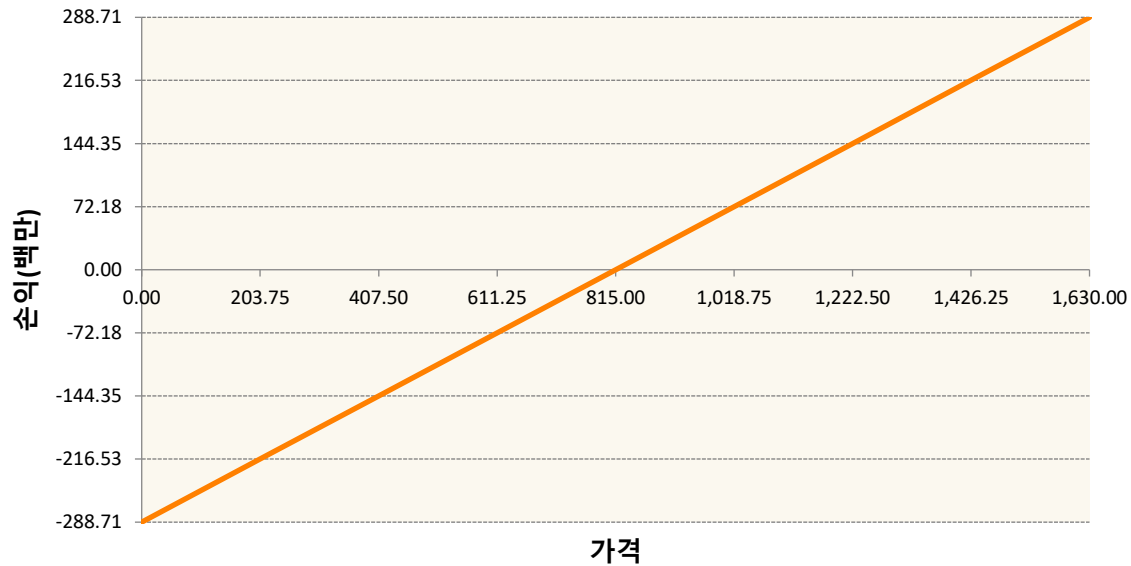
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



SMF2-SOYBEAN MEAL FUTR Jan22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22	26
CH2	CORN FUTURE Mar22	41
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22	10
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22	34
KR4175RC00 2021-12 달러선물		47
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22	12
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22	21
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22	30
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22	17
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22	23

