

공시일 2021-12-07

기준일 2021-12-06

## 포커스농산물모(채권-파생형)

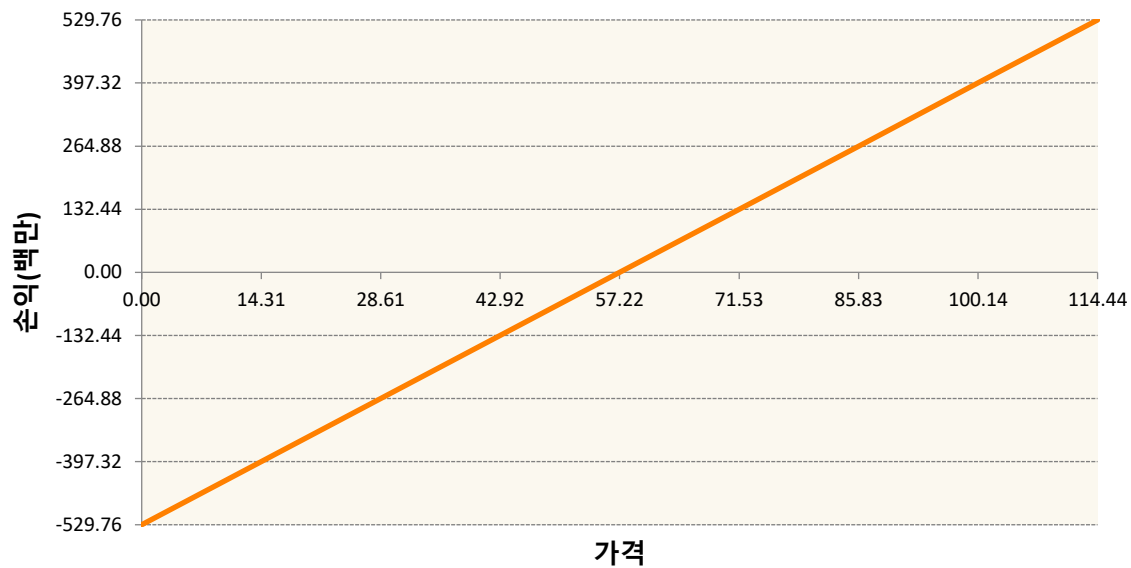
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

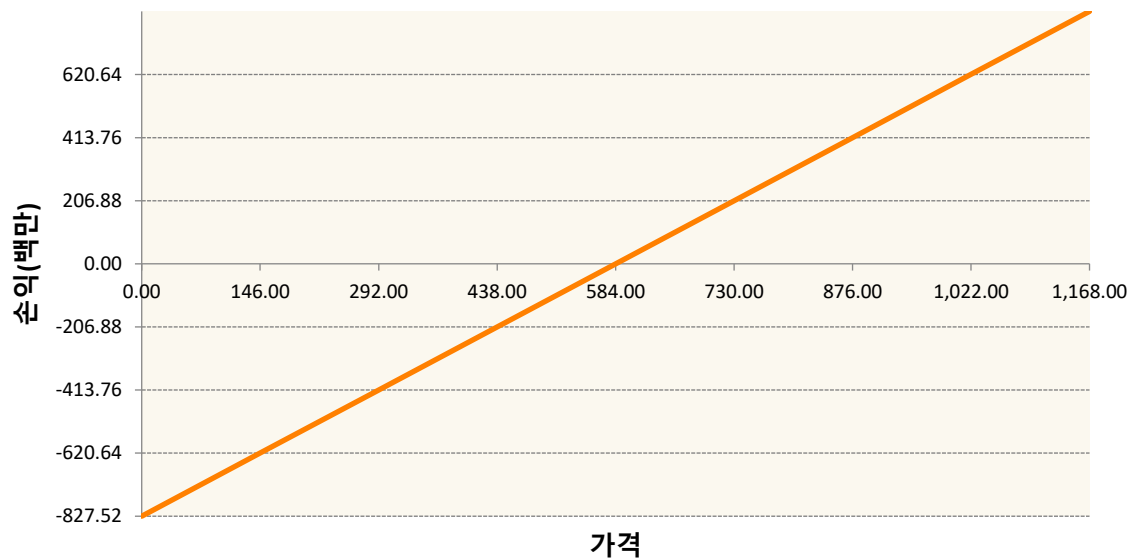
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 4,543 | 533   | 4,010     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

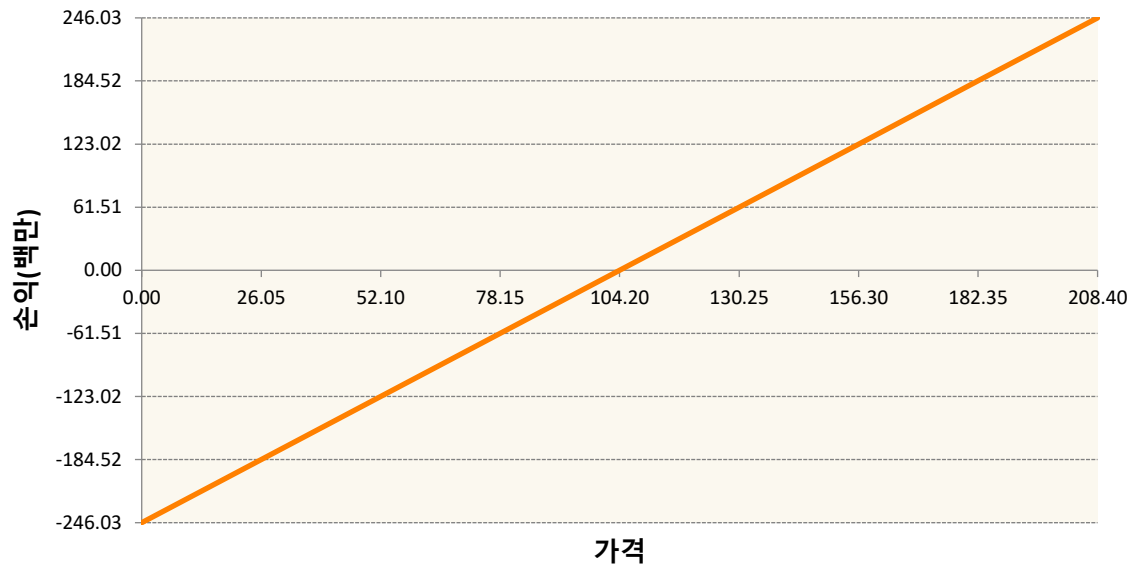
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



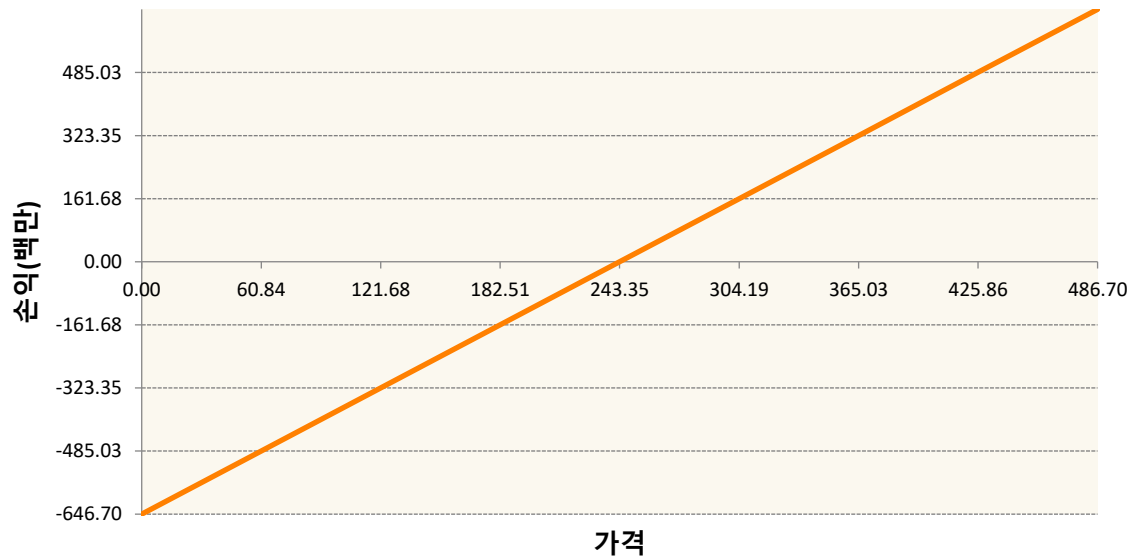
CH2-CORN FUTURE Mar22



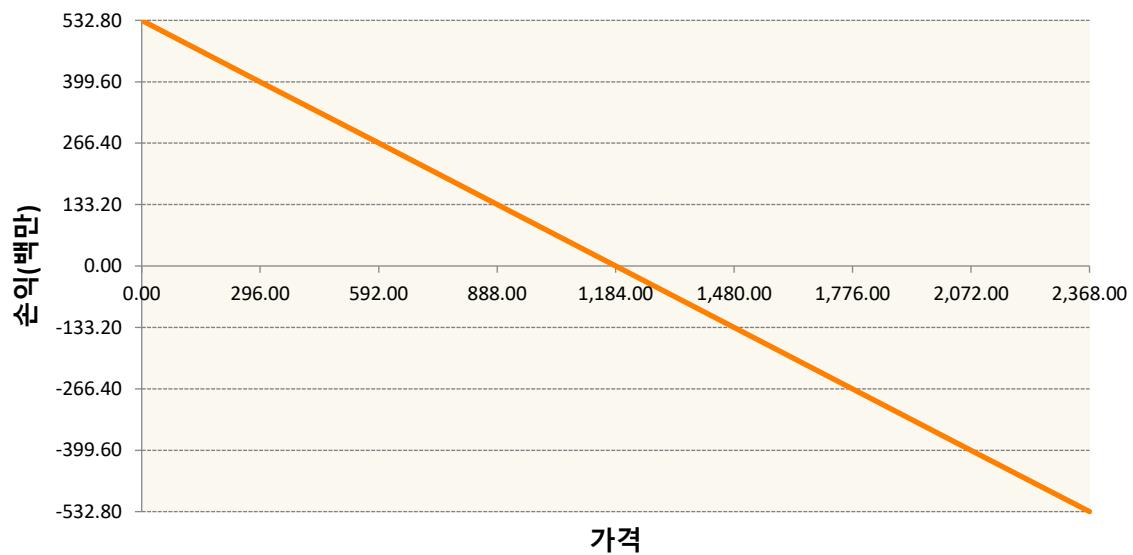
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



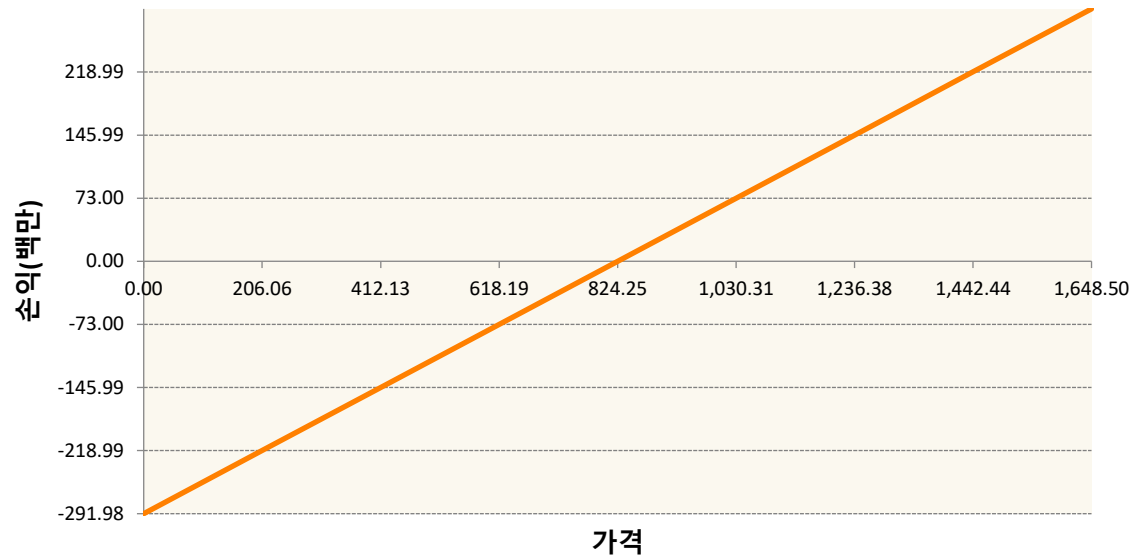
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



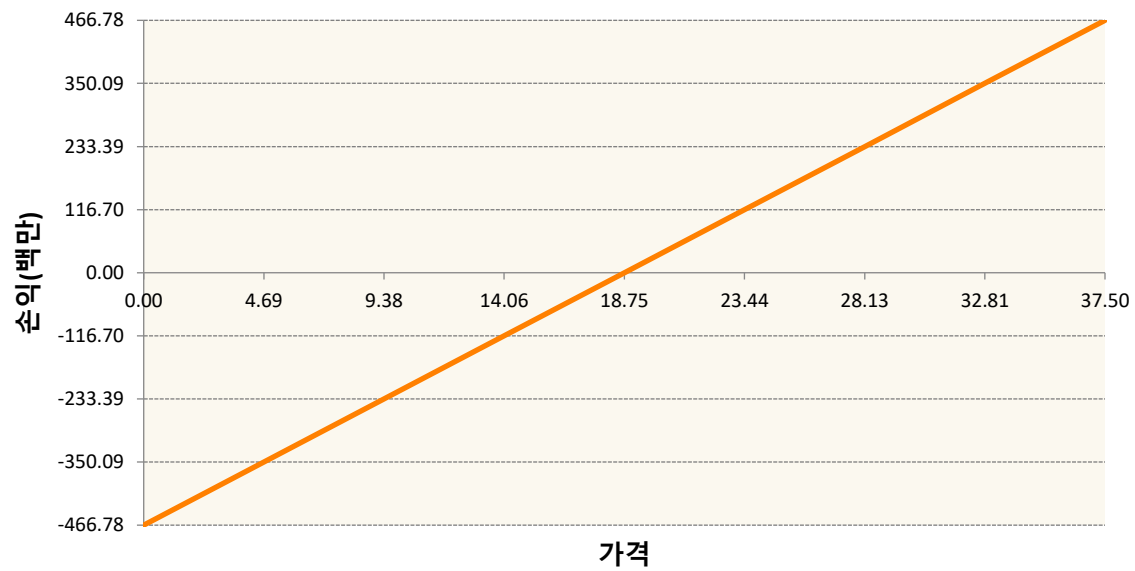
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



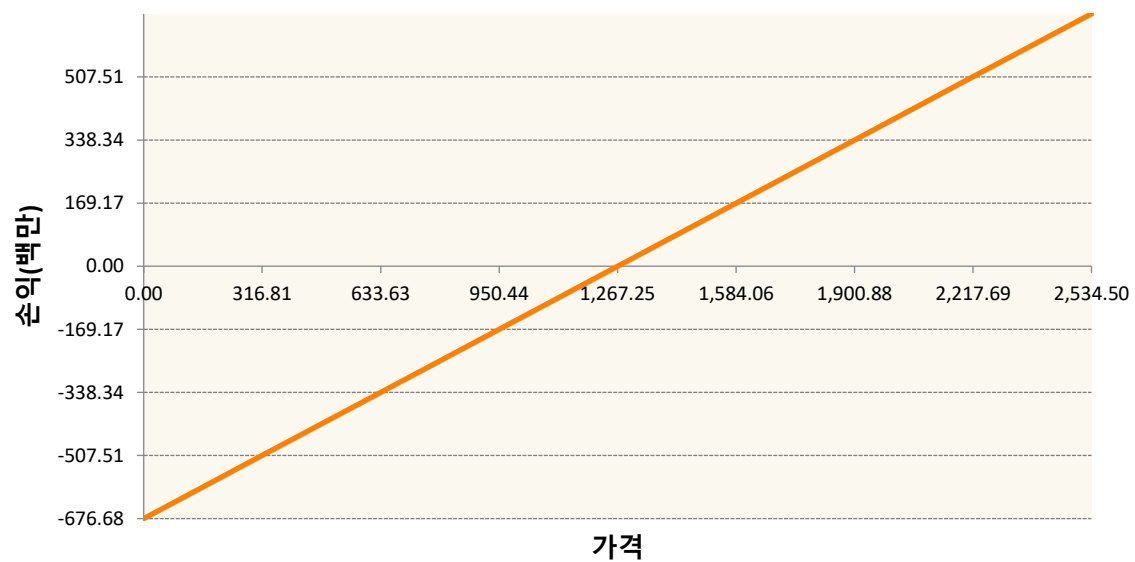
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



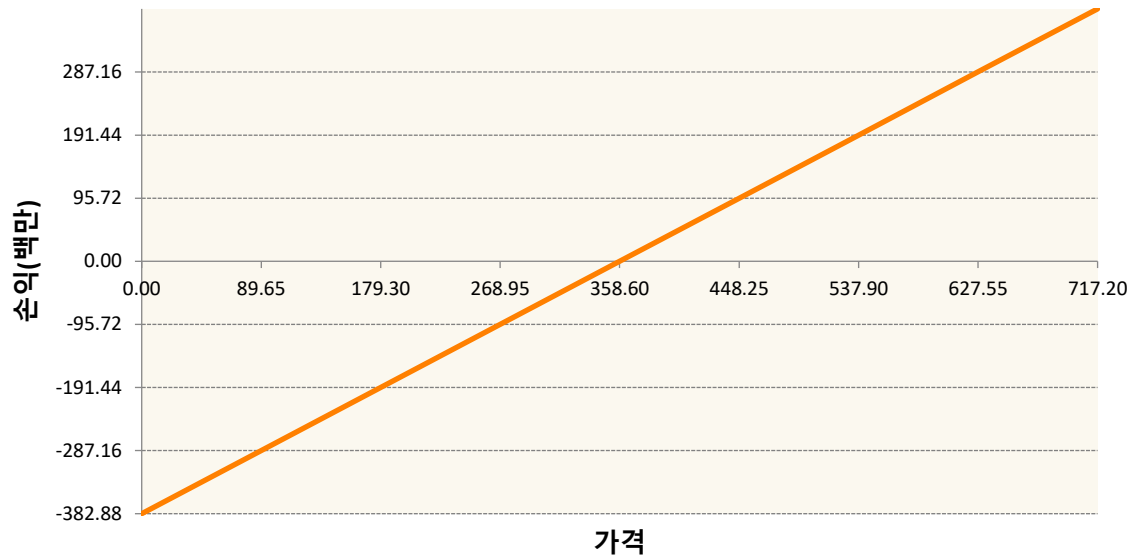
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



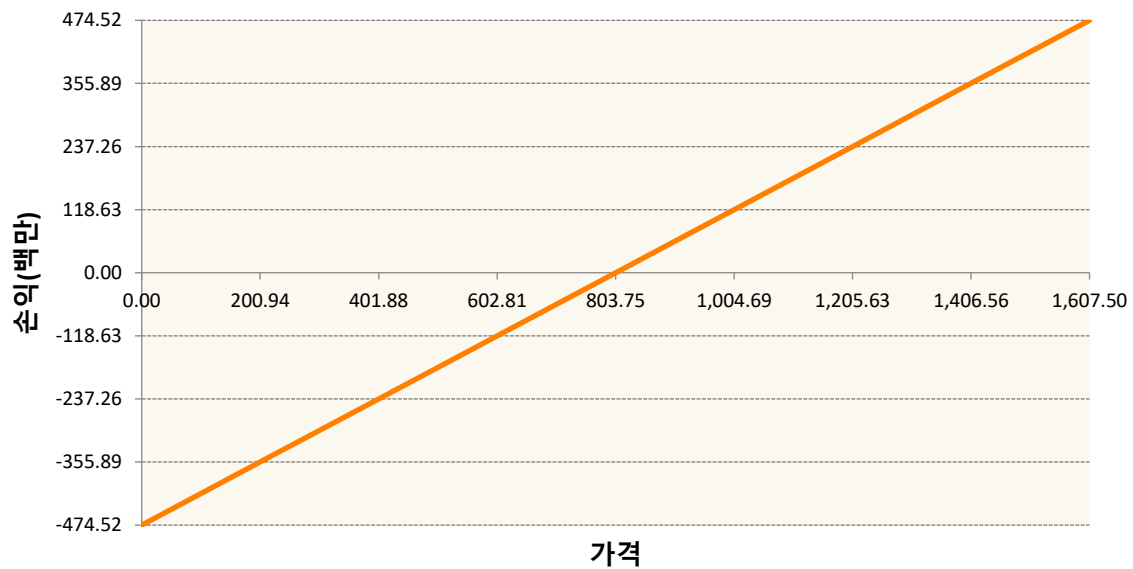
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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 2021-12-07

기준일 2021-12-06

## 스마트인덱스모

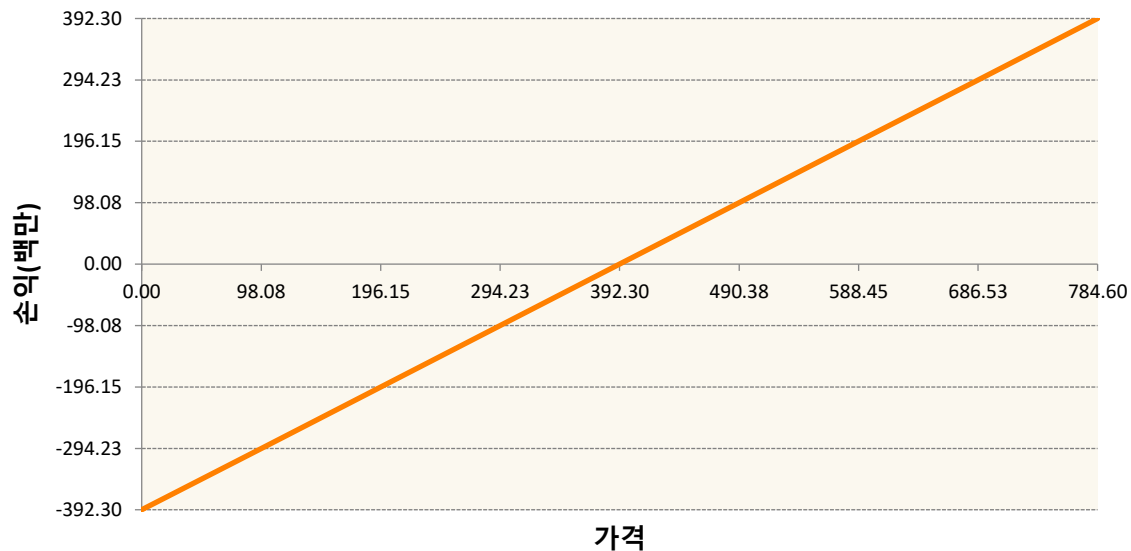
### 1. 계약금액

(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

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%    | -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 | 2021-12-07 |
| 기준일 | 2021-12-06 |

# 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

886

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

525

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2021-12-07 |
| 기준일 | 2021-12-06 |

## 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

441

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

427

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2021-12-07 |
| 기준일 | 2021-12-06 |

## 유로인덱스모(주식-파생형)

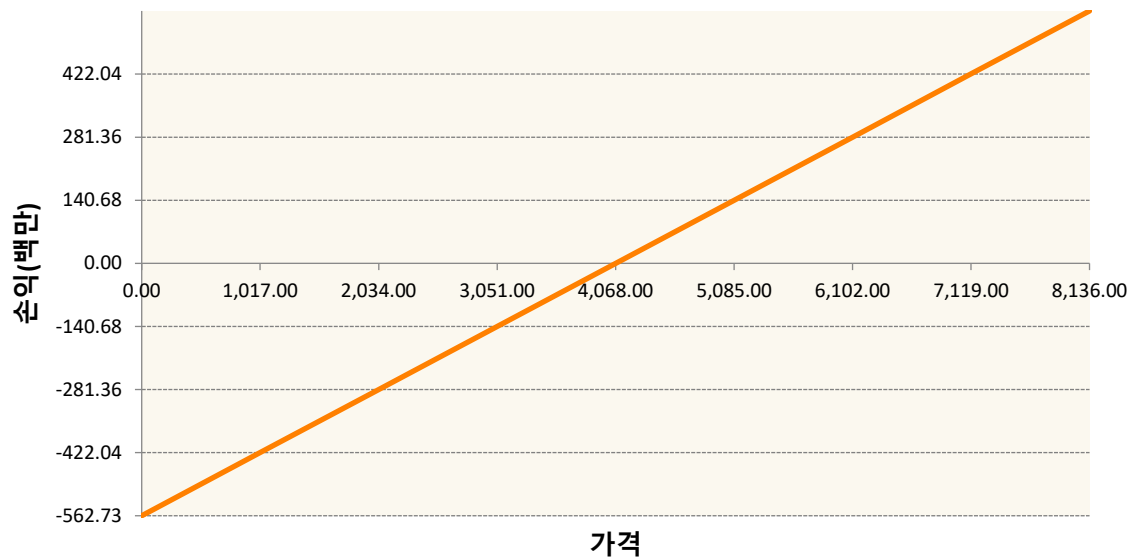
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 563   | 0     | 563       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

VGZ1-EURO STOXX 50 Dec21



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

40

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2021-12-07 |
| 기준일 | 2021-12-06 |

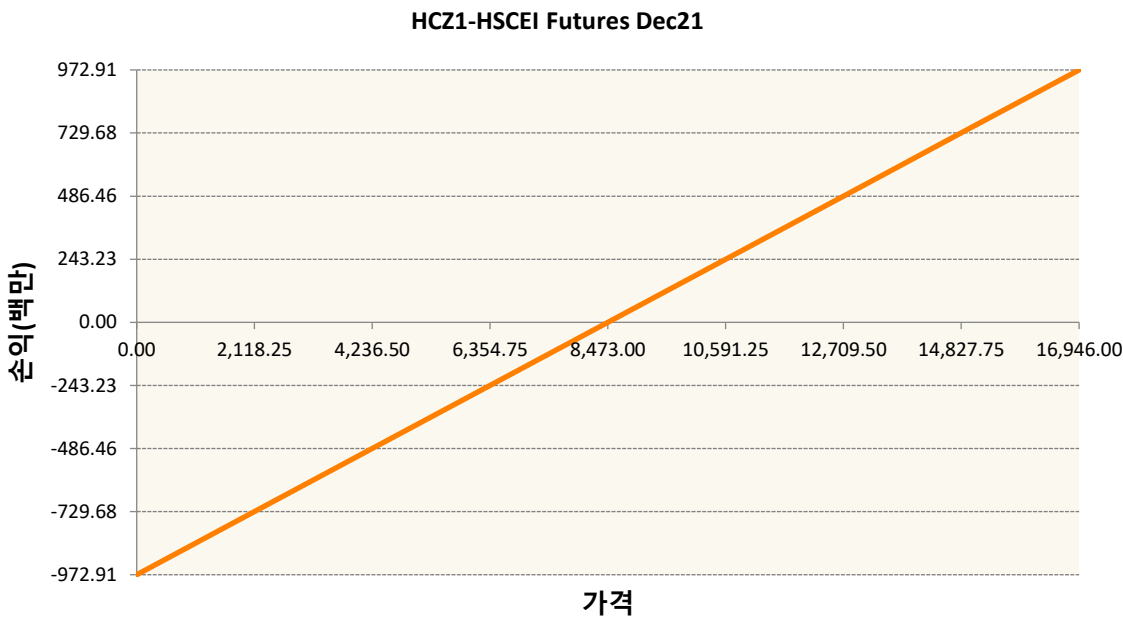
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 973   | 0     | 973       | 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 2021-12-07

기준일 2021-12-06

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

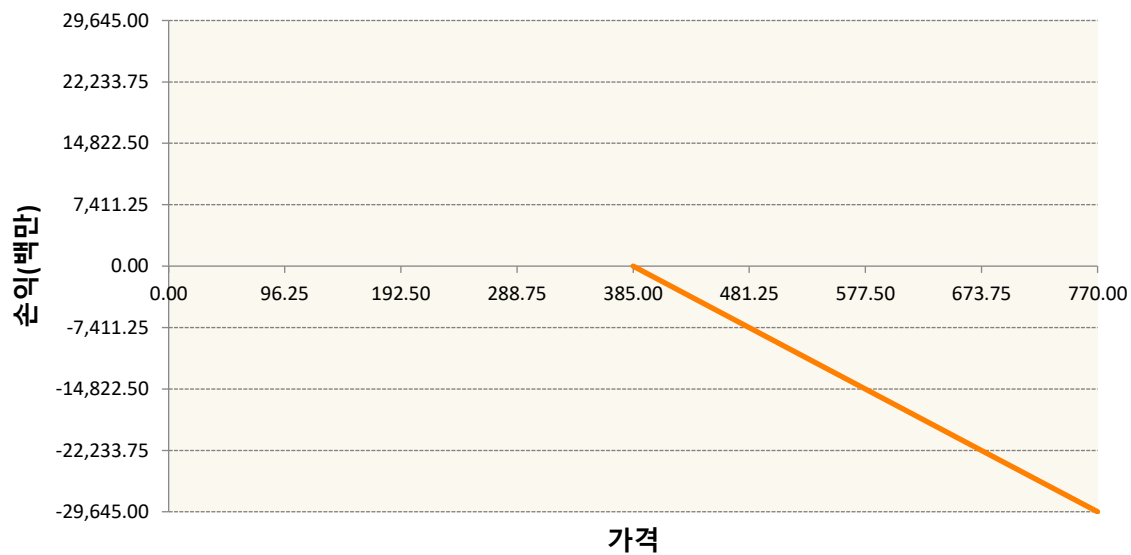
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

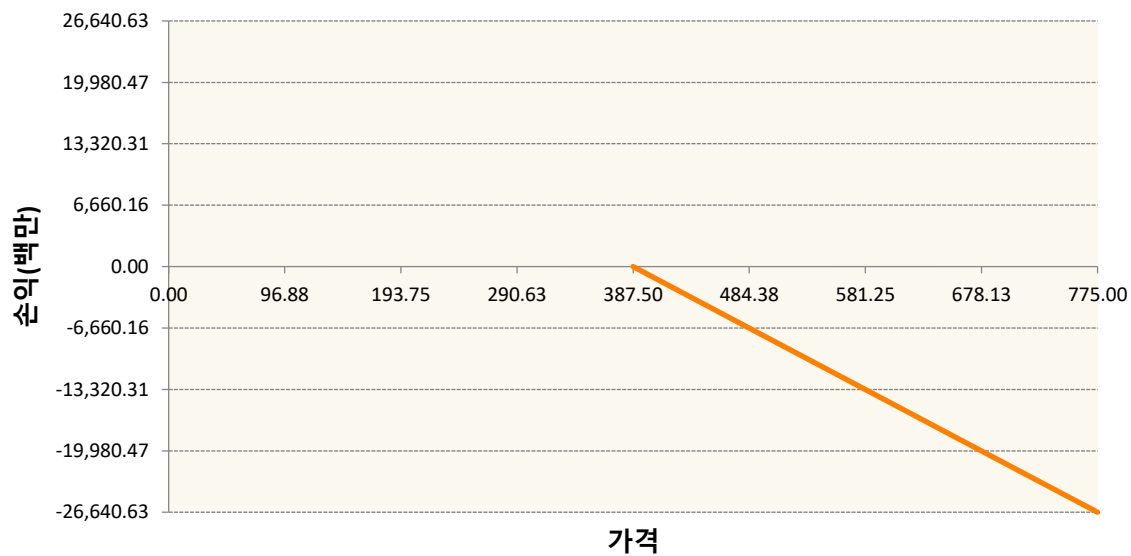
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 76,517 | -76,517   | 장내 |

### 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(백만원)' (Net Income in 100 million won). A solid orange line shows a linear increase in net income as price increases, starting from a negative value at zero price and reaching zero net income at a price of 385.00.

| 가격     | 순이익(백만원)   |
|--------|------------|
| 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   |        |        |        |        | 2,323  |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 699       | 699            | 698    | 697    | 696    | 693    | 690    |
| -5.33%       | 691       | 685            | 677    | 668    | 657    | 644    | 631    |
| -2.67%       | 558       | 534            | 510    | 485    | 461    | 436    | 411    |
| 0%           | 52        | 36             | 19     | 0      | -20    | -40    | -61    |
| 2.67%        | -711      | -713           | -716   | -721   | -727   | -734   | -743   |
| 5.33%        | -1,516    | -1,516         | -1,516 | -1,517 | -1,517 | -1,519 | -1,520 |
| 8.00%        | -2,322    | -2,322         | -2,322 | -2,323 | -2,323 | -2,323 | -2,323 |
| KR4201RC3870 |           | 2021-12 콜387.5 |        |        |        |        | 2,029  |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |        |        |        |        |

| 가격                             | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
|--------------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -8.00%                         | 497     | 497     | 497    | 497    | 496    | 495    | 493    |
| -5.33%                         | 494     | 491     | 487    | 481    | 474    | 466    | 457    |
| -2.67%                         | 423     | 404     | 385    | 366    | 345    | 325    | 304    |
| 0%                             | 58      | 39      | 20     | 0      | -20    | -41    | -62    |
| 2.67%                          | -592    | -596    | -601   | -607   | -615   | -624   | -634   |
| 5.33%                          | -1,309  | -1,309  | -1,309 | -1,310 | -1,311 | -1,313 | -1,316 |
| 8.00%                          | -2,029  | -2,029  | -2,029 | -2,029 | -2,029 | -2,029 | -2,029 |
| KR4301RC3853      2021-12 풋385 |         |         |        |        |        |        | 1,037  |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |        |        |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -1,036  | -1,036  | -1,036 | -1,036 | -1,036 | -1,036 | -1,037 |
| -5.33%    | -565    | -566    | -568   | -569   | -572   | -575   | -579   |
| -2.67%    | -145    | -155    | -165   | -175   | -186   | -196   | -207   |
| 0%        | 17      | 12      | 6      | 0      | -7     | -14    | -22    |
| 2.67%     | 26      | 26      | 26     | 25     | 24     | 23     | 22     |
| 5.33%     | 26      | 26      | 26     | 26     | 26     | 26     | 26     |
| 8.00%     | 26      | 26      | 26     | 26     | 26     | 26     | 26     |

| KR4301RC3879      2021-12 풋387.5 |         |         |        |      |       |        | 188    |
|----------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                        |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                               | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                           | -188    | -188    | -188   | -188 | -188  | -188   | -188   |
| -5.33%                           | -109    | -109    | -109   | -110 | -110  | -110   | -110   |
| -2.67%                           | -35     | -36     | -37    | -39  | -40   | -42    | -43    |
| 0%                               | 4       | 3       | 1      | 0    | -1    | -3     | -5     |
| 2.67%                            | 8       | 8       | 8      | 8    | 7     | 7      | 7      |
| 5.33%                            | 8       | 8       | 8      | 8    | 8     | 8      | 8      |
| 8.00%                            | 8       | 8       | 8      | 8    | 8     | 8      | 8      |

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

(단위:백만원)

6,558

공시일 2021-12-07

기준일 2021-12-06

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

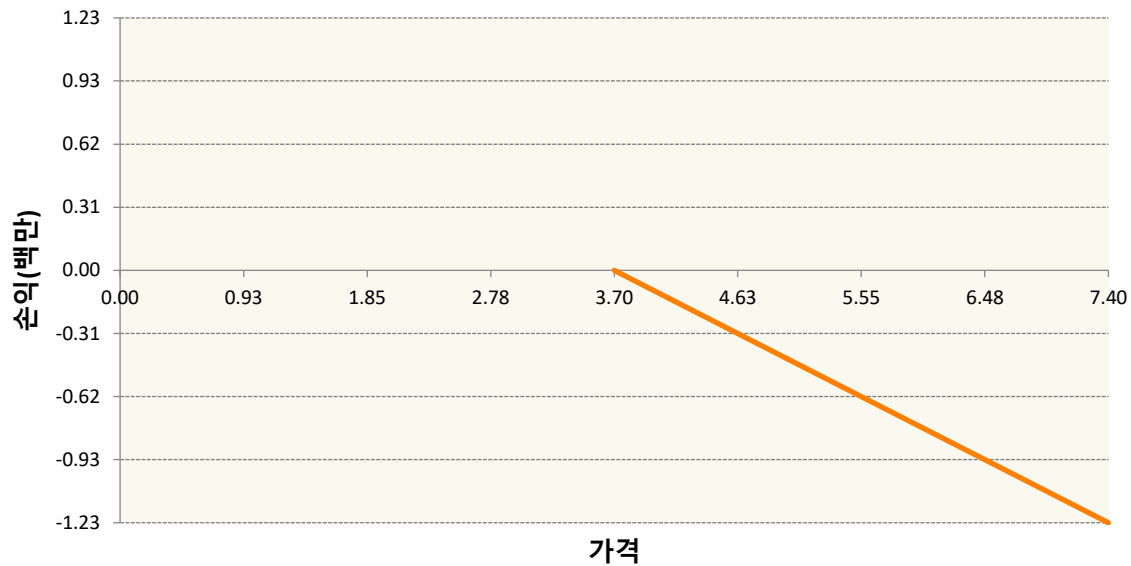
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

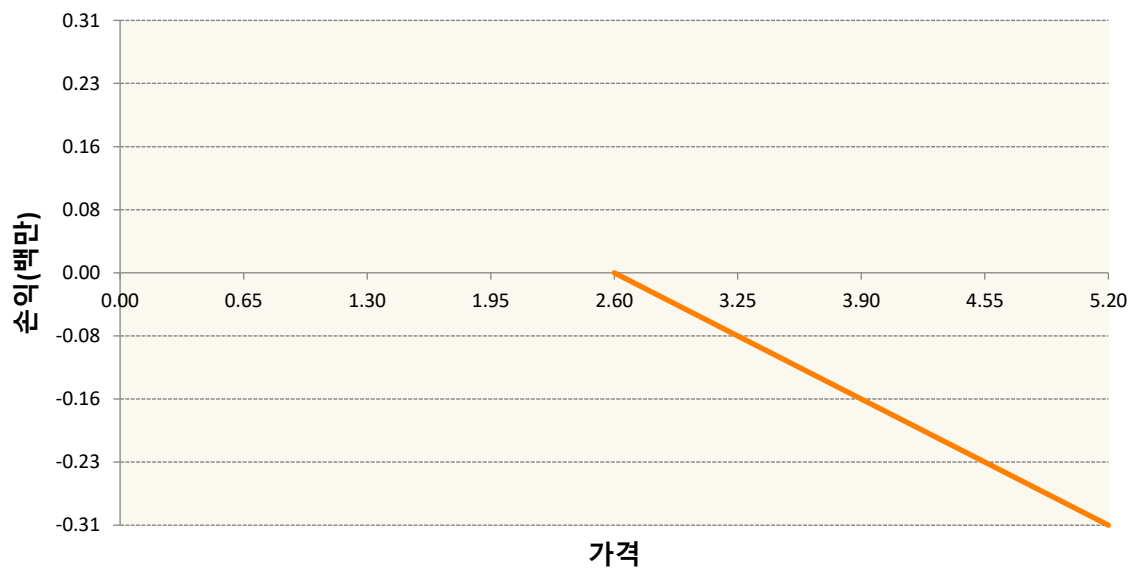
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 166   | -166      | 장내 |

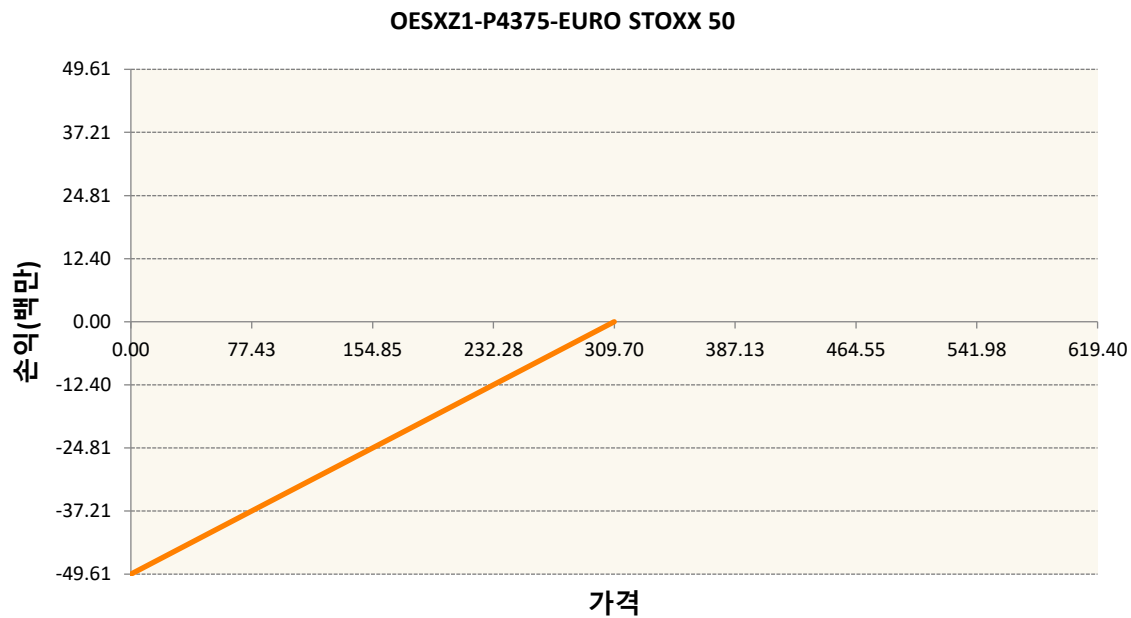
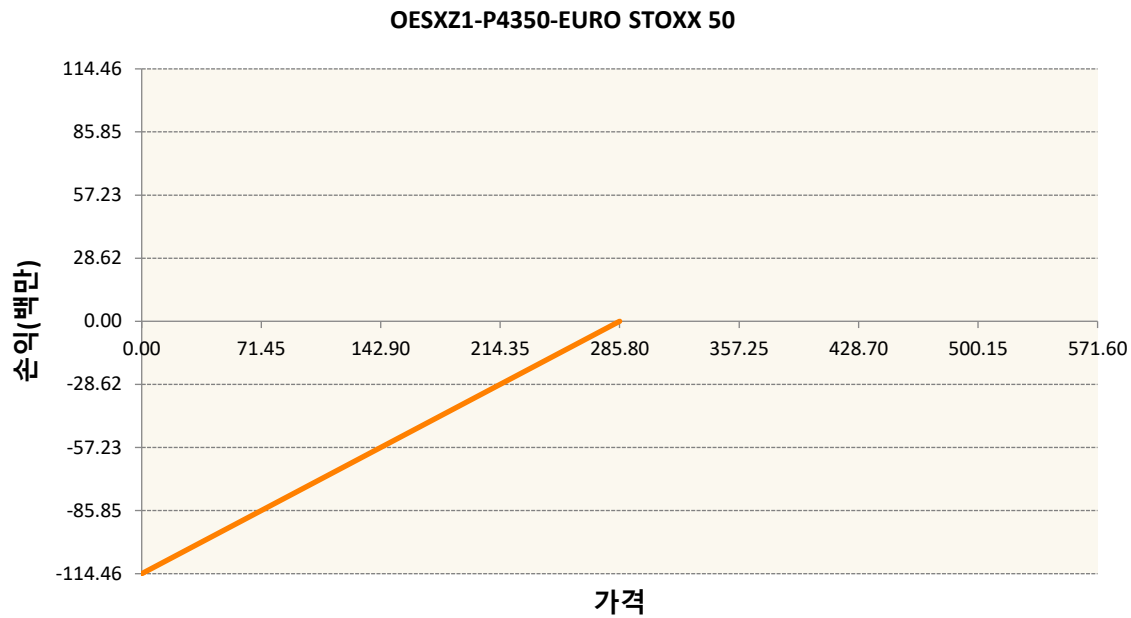
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                |  | (단위:백만원) |
|------------------------------------------|--|----------|
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY |  | 28       |
| 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) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 42       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2021-12-07 |
| 기준일 | 2021-12-06 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

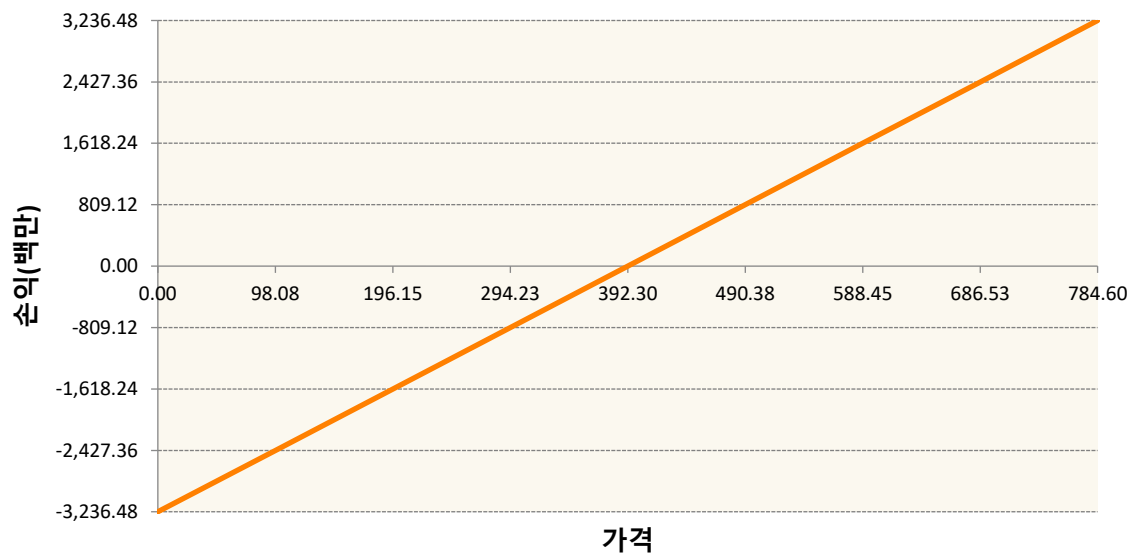
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

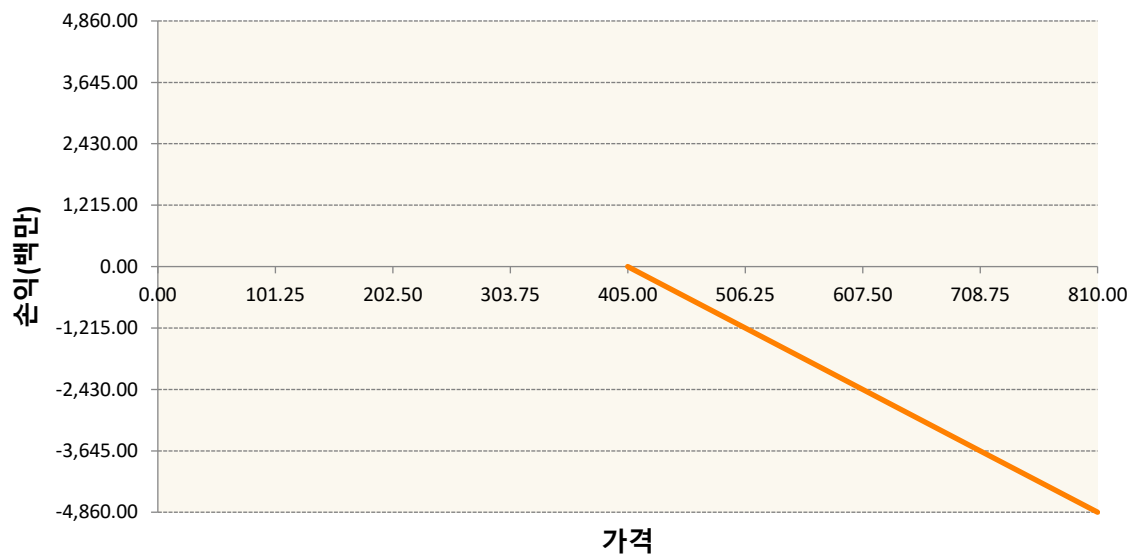
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,236 | 0     | 3,236     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 579   | 5,369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

### 2. 만기시점의 손익구조

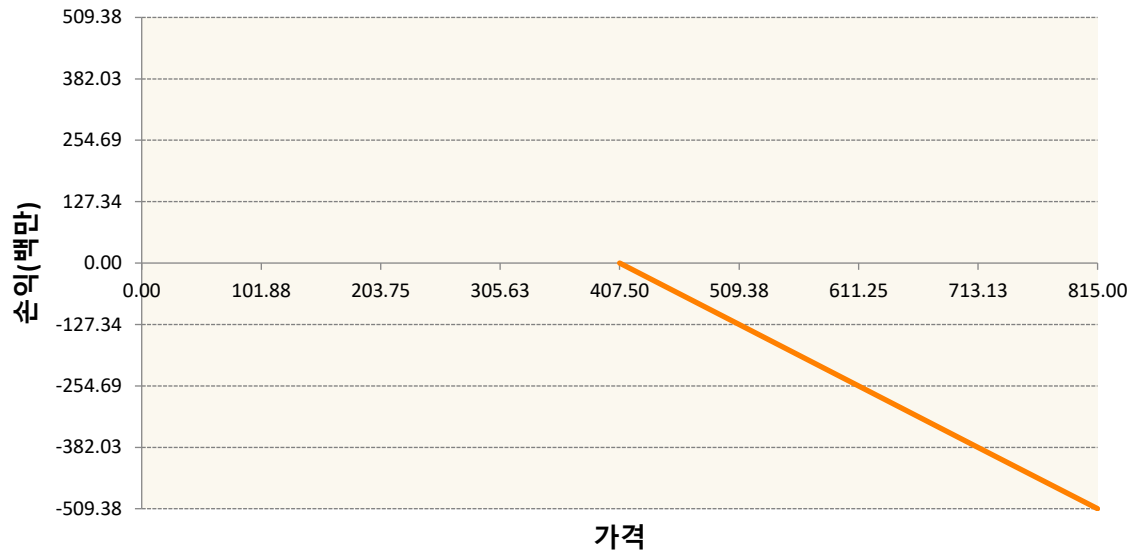
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



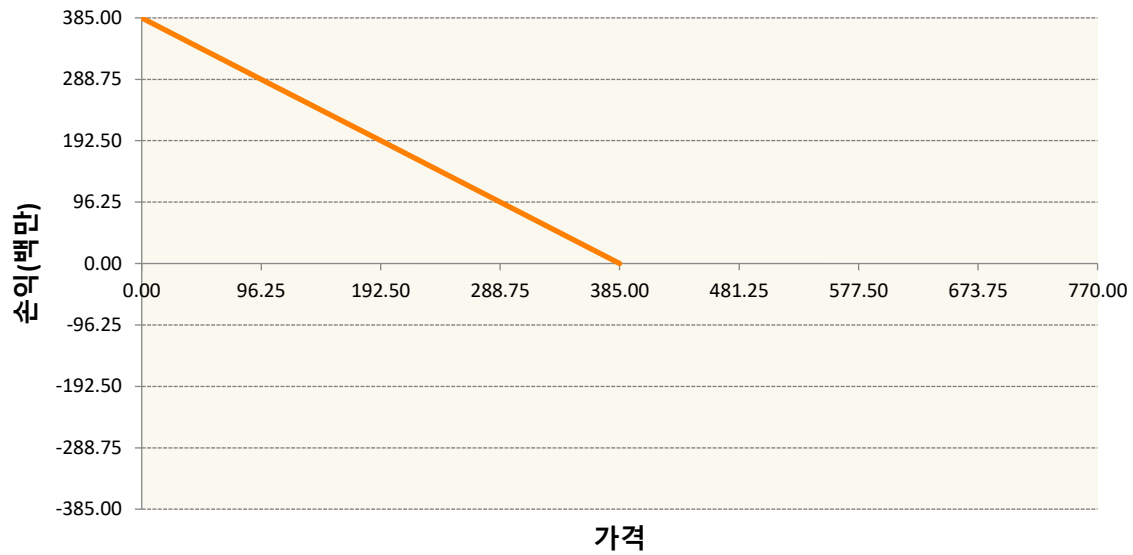
KR4201RC4050-2021-12 콜405



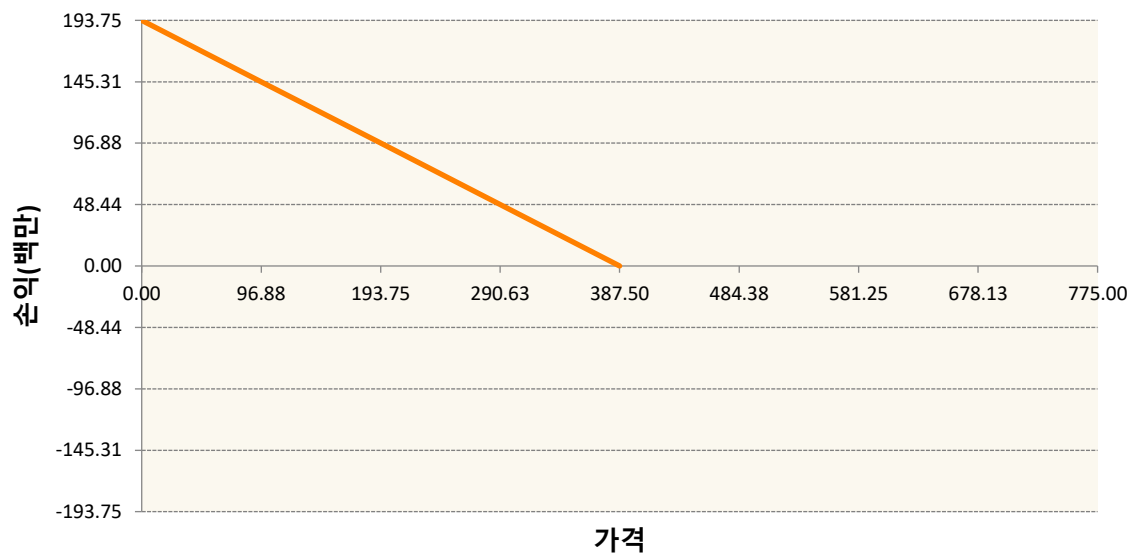
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



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%       | -173    | -173    | -173   | -173 | -173  | -173   | -173               |  |     |  |  |
| -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%        | 173     | 173     | 173    | 173  | 173   | 173    | 173                |  |     |  |  |
| 8.00%        | 259     | 259     | 259    | 259  | 259   | 259    | 259                |  |     |  |  |
| KR4201RC4050 |         |         |        |      |       |        | 2021-12 콜405       |  | 229 |  |  |
| 기초자산의 변동성    |         |         |        |      |       |        |                    |  |     |  |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |  |     |  |  |
| -8.00%       | 7       | 7       | 7      | 7    | 7     | 7      | 7                  |  |     |  |  |
| -5.33%       | 7       | 7       | 7      | 7    | 7     | 7      | 7                  |  |     |  |  |
| -2.67%       | 7       | 7       | 7      | 7    | 6     | 6      | 5                  |  |     |  |  |
| 0%           | 5       | 4       | 2      | 0    | -2    | -5     | -7                 |  |     |  |  |
| 2.67%        | -21     | -25     | -29    | -33  | -37   | -42    | -46                |  |     |  |  |
| 5.33%        | -104    | -107    | -110   | -113 | -116  | -119   | -122               |  |     |  |  |
| 8.00%        | -224    | -224    | -225   | -226 | -227  | -228   | -229               |  |     |  |  |
| KR4201RC4076 |         |         |        |      |       |        | 2021-12 콜407.5     |  | 21  |  |  |
| 기초자산의 변동성    |         |         |        |      |       |        |                    |  |     |  |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |  |     |  |  |
| -8.00%       | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                  |  |     |  |  |
| -5.33%       | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                  |  |     |  |  |
| -2.67%       | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                  |  |     |  |  |
| 0%           | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | -1                 |  |     |  |  |
| 2.67%        | -1      | -2      | -2     | -3   | -3    | -3     | -4                 |  |     |  |  |
| 5.33%        | -9      | -9      | -9     | -10  | -10   | -10    | -11                |  |     |  |  |
| 8.00%        | -21     | -21     | -21    | -21  | -21   | -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%       | 3       | 3       | 4      | 4    | 4     | 4      | 5                  |  |     |  |  |
| 0%           | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                  |  |     |  |  |
| 2.67%        | -1      | -1      | -1     | -1   | -1    | -1     | 0                  |  |     |  |  |
| 5.33%        | -1      | -1      | -1     | -1   | -1    | -1     | -1                 |  |     |  |  |
| 8.00%        | -1      | -1      | -1     | -1   | -1    | -1     | -1                 |  |     |  |  |
| 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% | 7       | 7       | 7      | 7  | 7     | 7      | 7      |
| -2.67% | 2       | 2       | 2      | 3  | 3     | 3      | 3      |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | -1      | -1      | -1     | -1 | 0     | 0      | 0      |
| 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)

477

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2021-12-07 |
| 기준일 | 2021-12-06 |

## 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 | 17,961 | 0     | 17,961    |    |

### 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 | 2021-12-07 |
| 기준일 | 2021-12-06 |

## 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 | 9,678 | 0     | 9,678     |    |

### 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 | 2021-12-07 |
| 기준일 | 2021-12-06 |

## 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 | 45,708 | 0     | 45,708    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,420  | 0     | 1,420     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBW USD/KRW 24-12-21E

114

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

39

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2021-12-07 |
| 기준일 | 2021-12-06 |

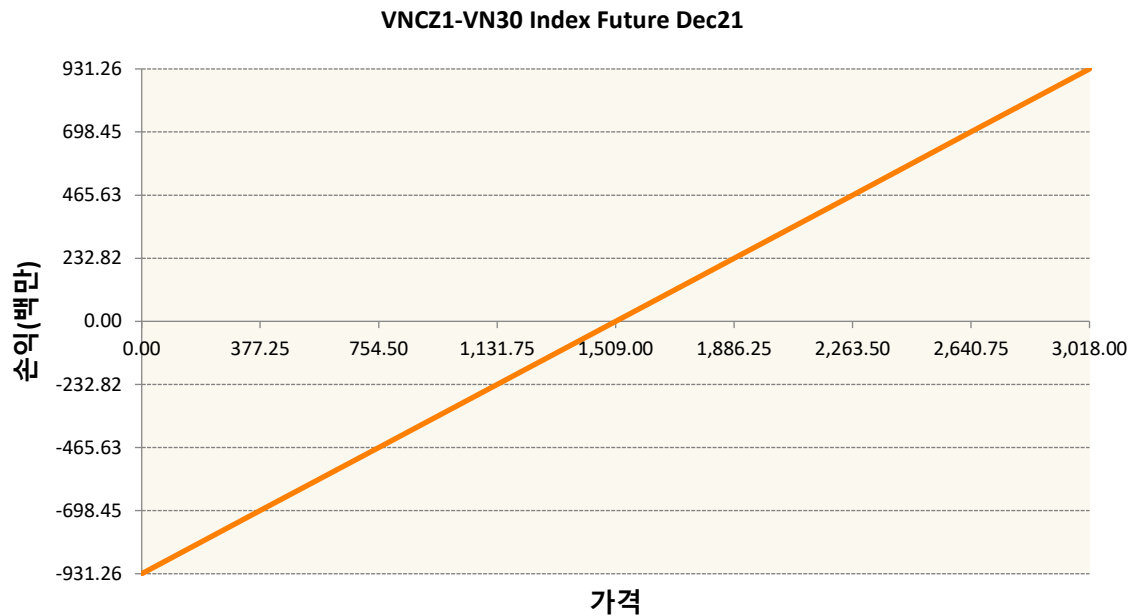
## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

### 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   | 931   | 0     | 931       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,783 | 0     | 1,783     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 574   | -574      | 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 | 75  |

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

(단위:백만원)

**254**

공시일 2021-12-07

기준일 2021-12-06

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

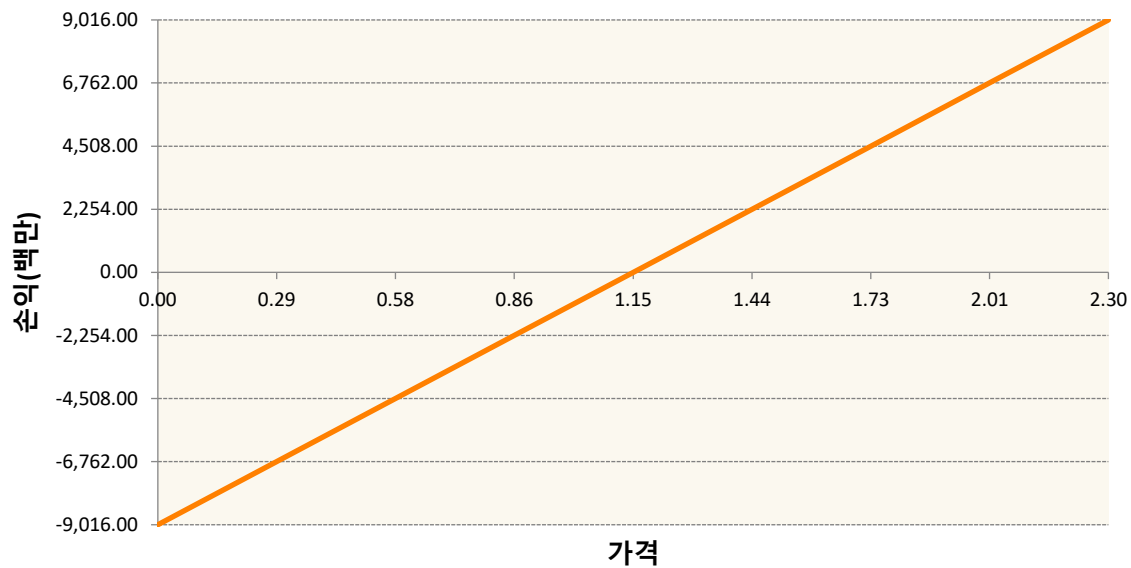
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

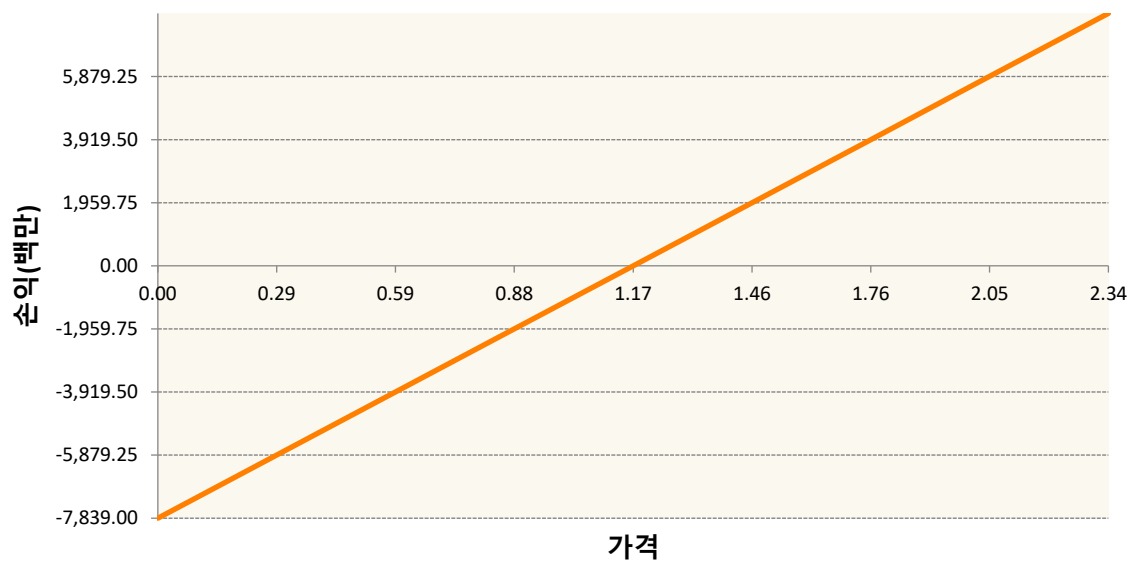
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 24,747 | 0     | 24,747    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

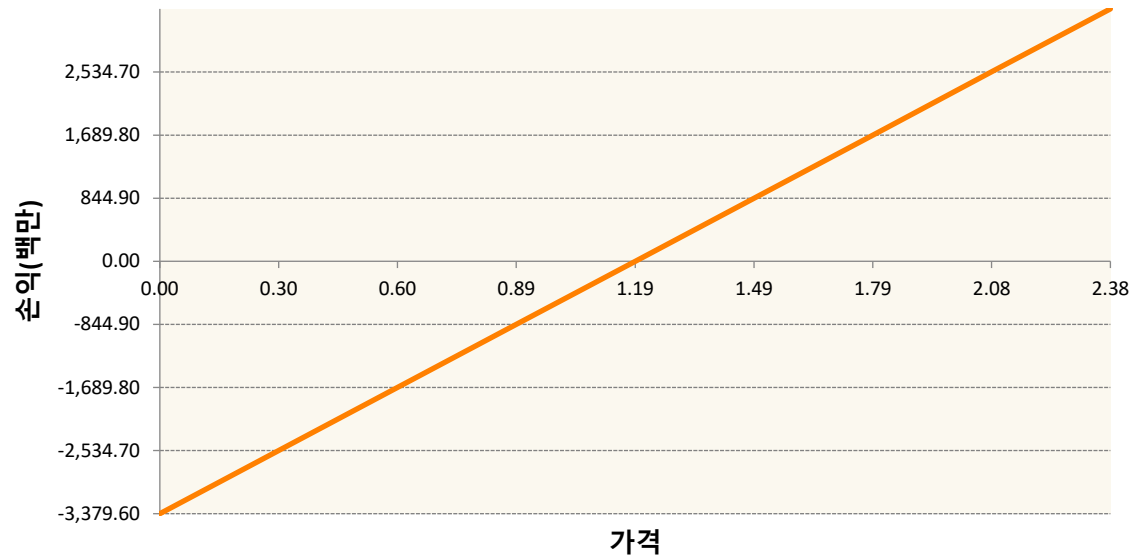
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



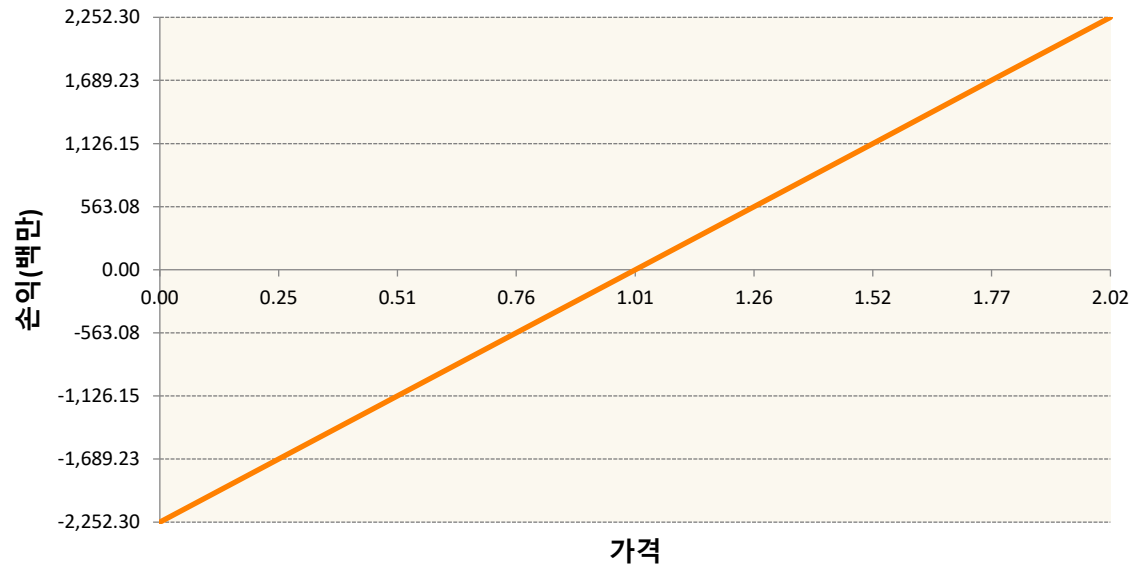
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



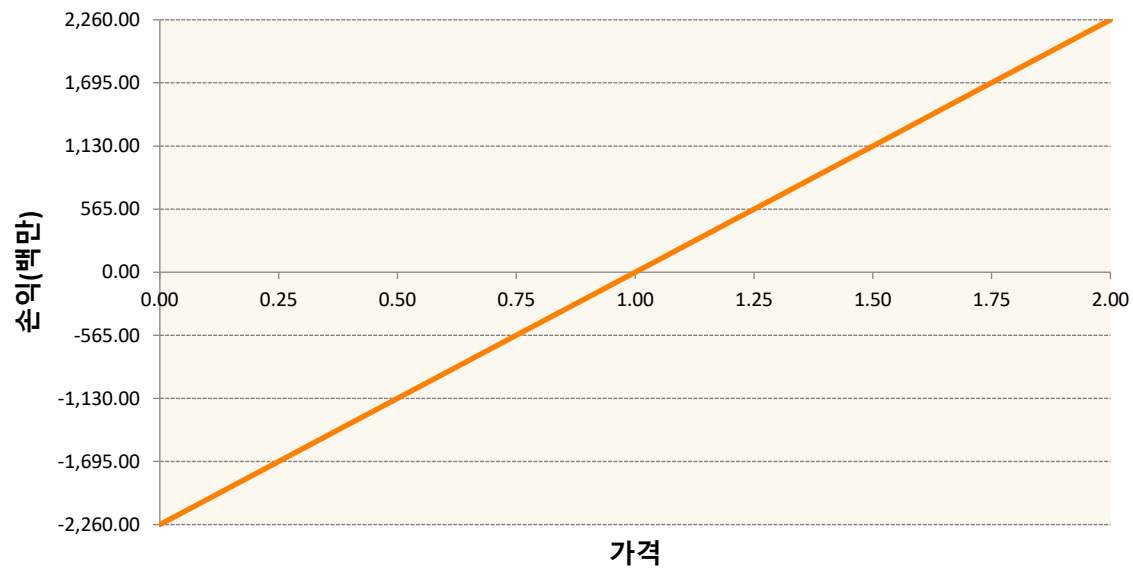
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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) |  | 723      |
| 2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR) |  | 629      |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 271      |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 180      |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 180      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 2,968    |

공시일 2021-12-07

기준일 2021-12-06

## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

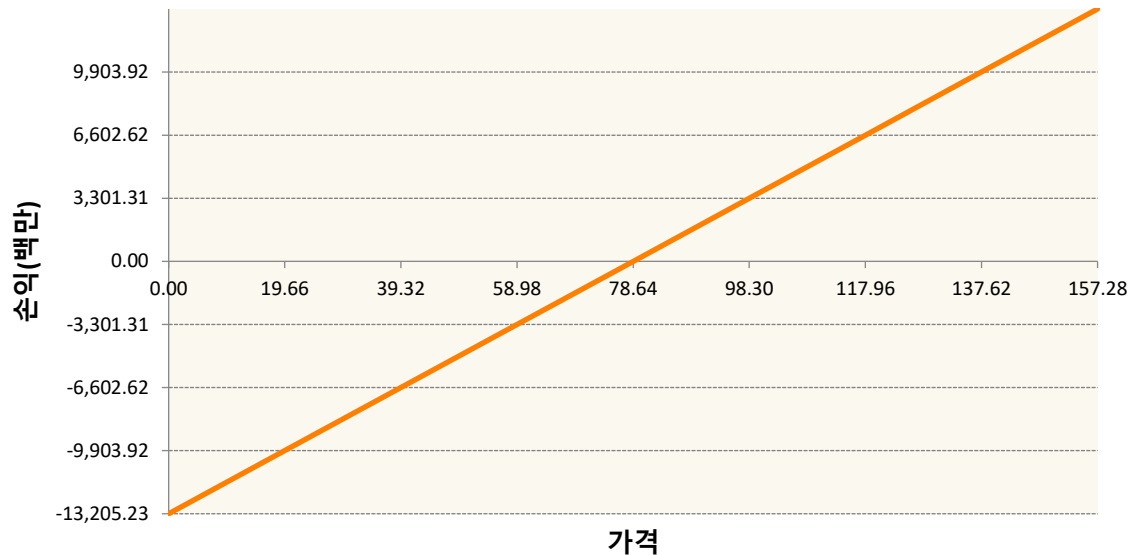
### 1. 계약금액

(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   | 13,205 | 0     | 13,205    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 4,765 | -4,765    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX KRW/EUR 28-12-21E

381

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,056

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

(단위:백만원)

2,307

공시일 2021-12-07

기준일 2021-12-06

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

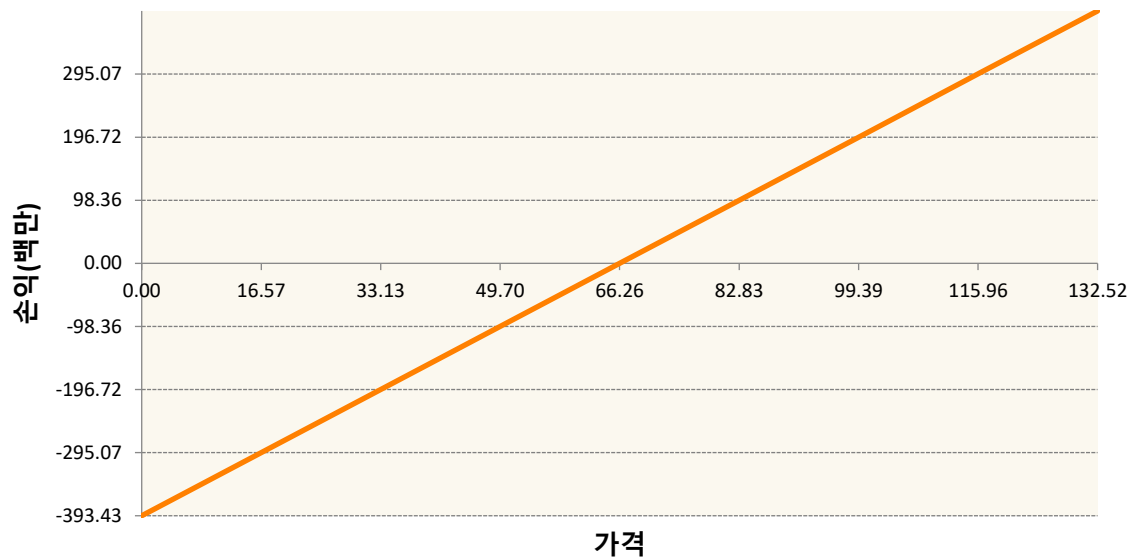
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

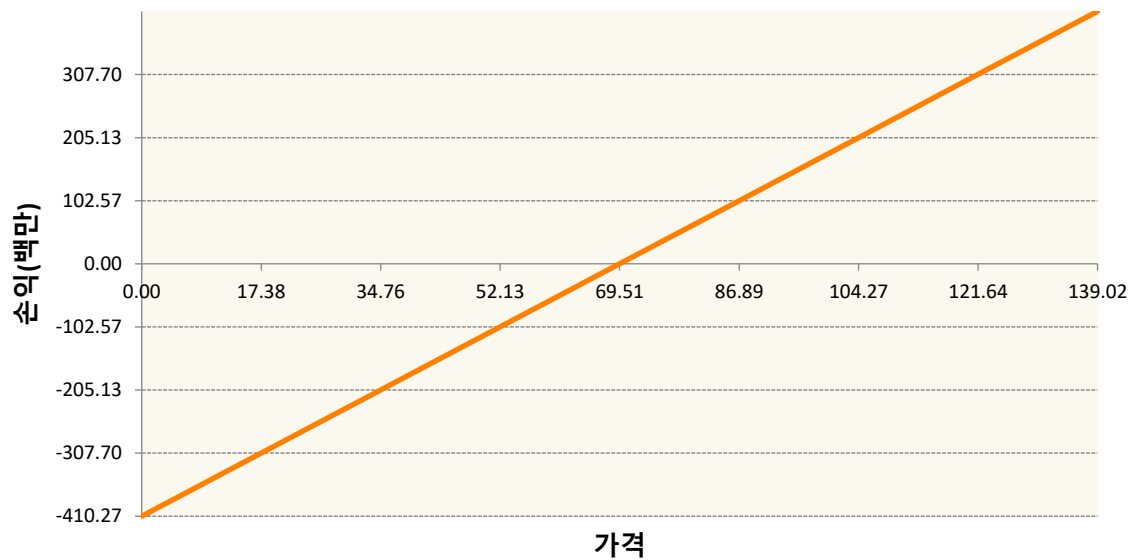
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,814 | 355   | 1,458     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

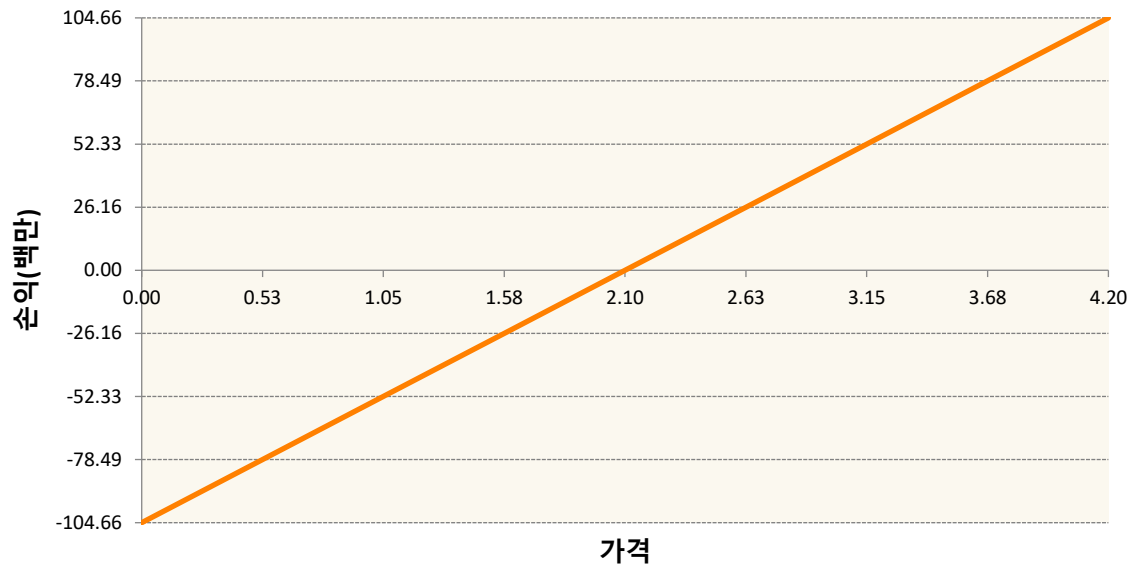
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



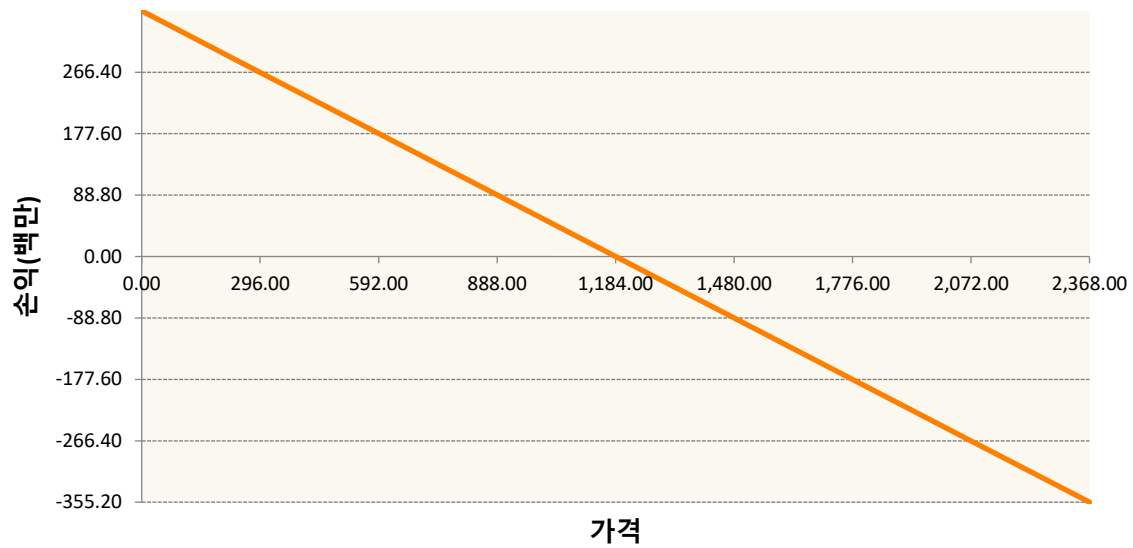
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



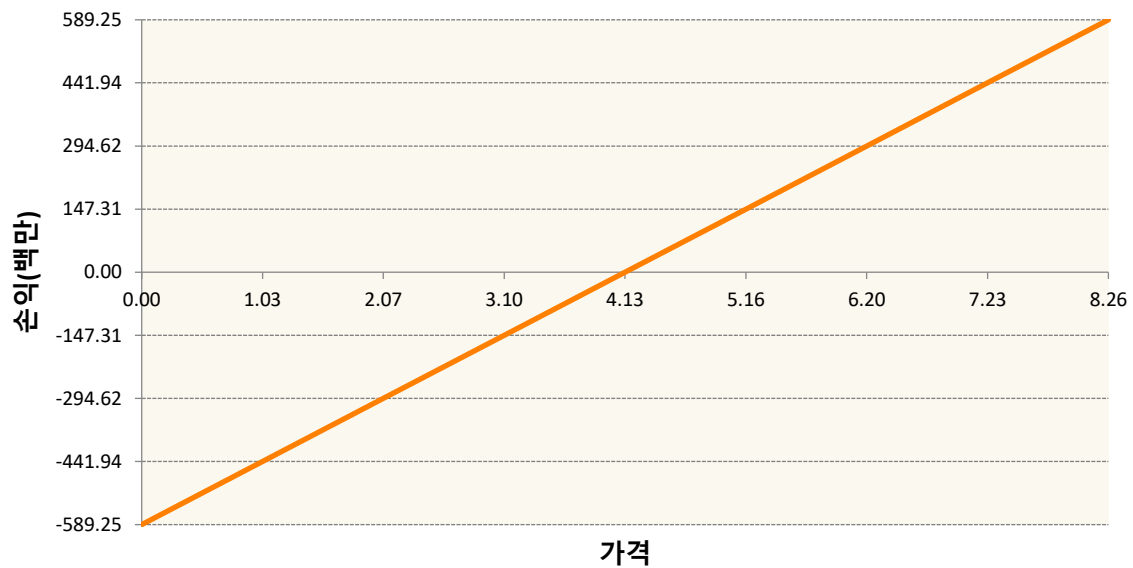
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22



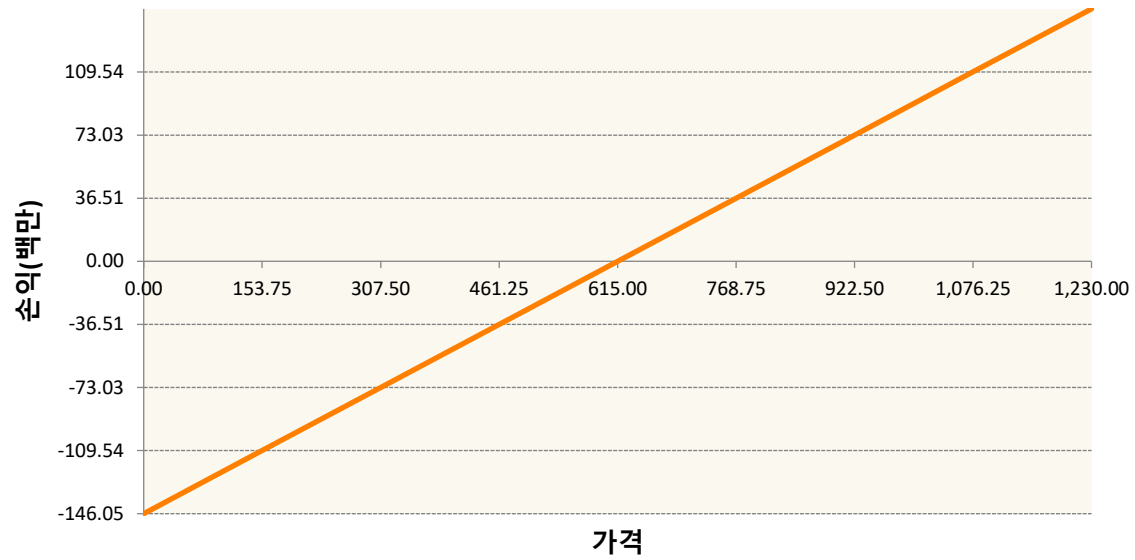
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



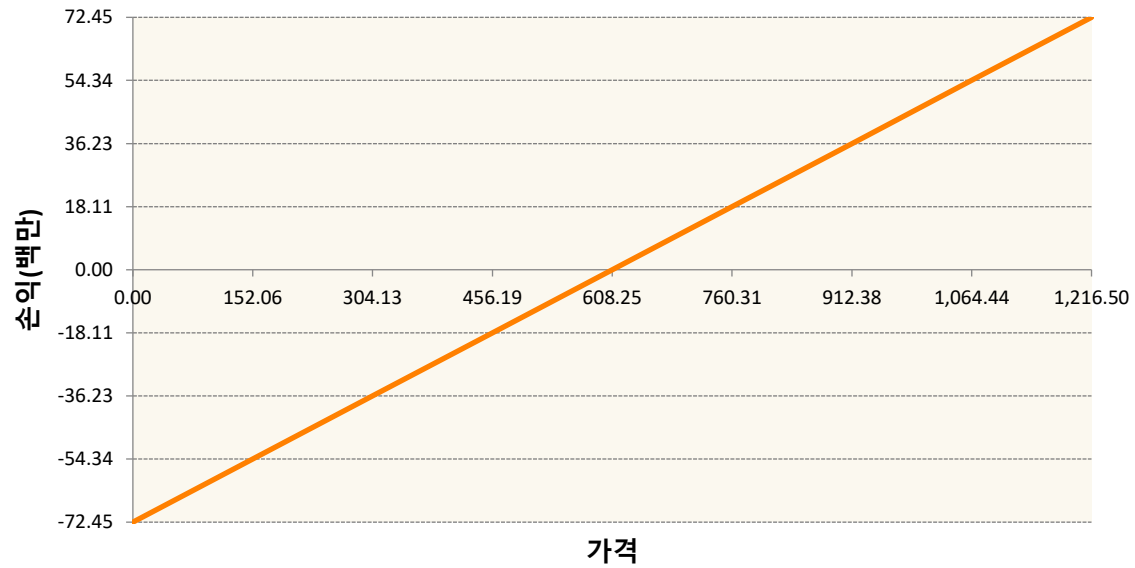
NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22



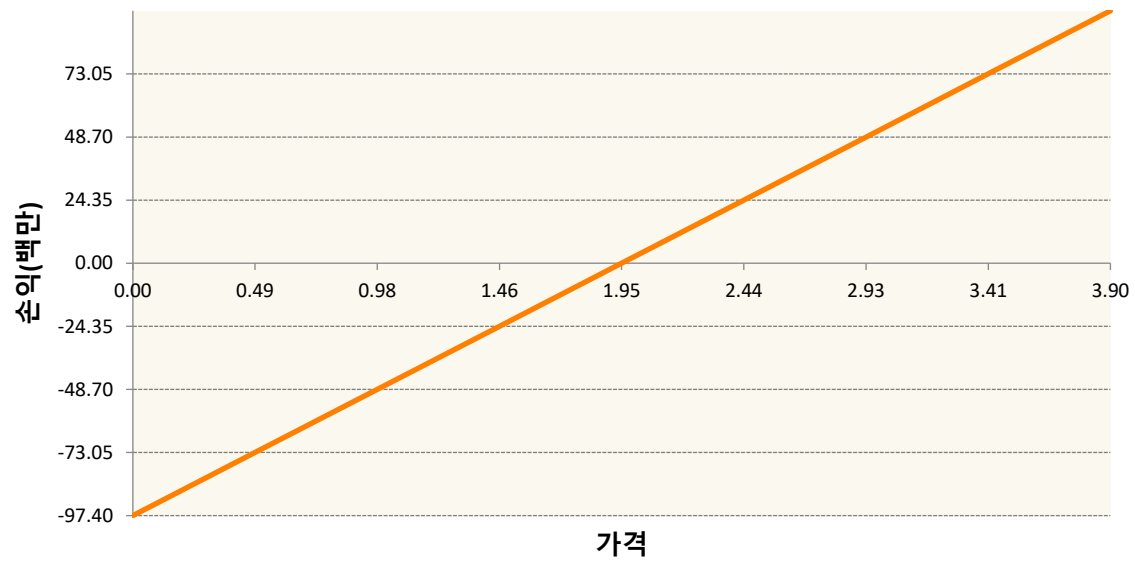
QSF2-Low Su Gasoil G Jan22



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 |                         | 28 |
| NGF22                   | NATURAL GAS FUTR Jan22  | 47 |
| 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)

330

공시일 2021-12-07

기준일 2021-12-06

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

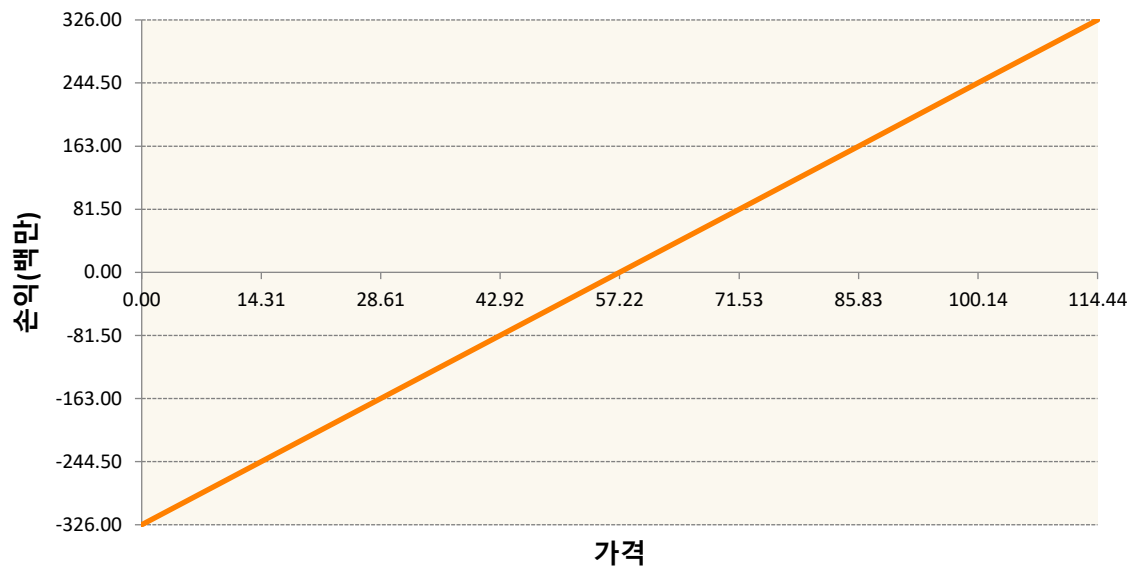
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

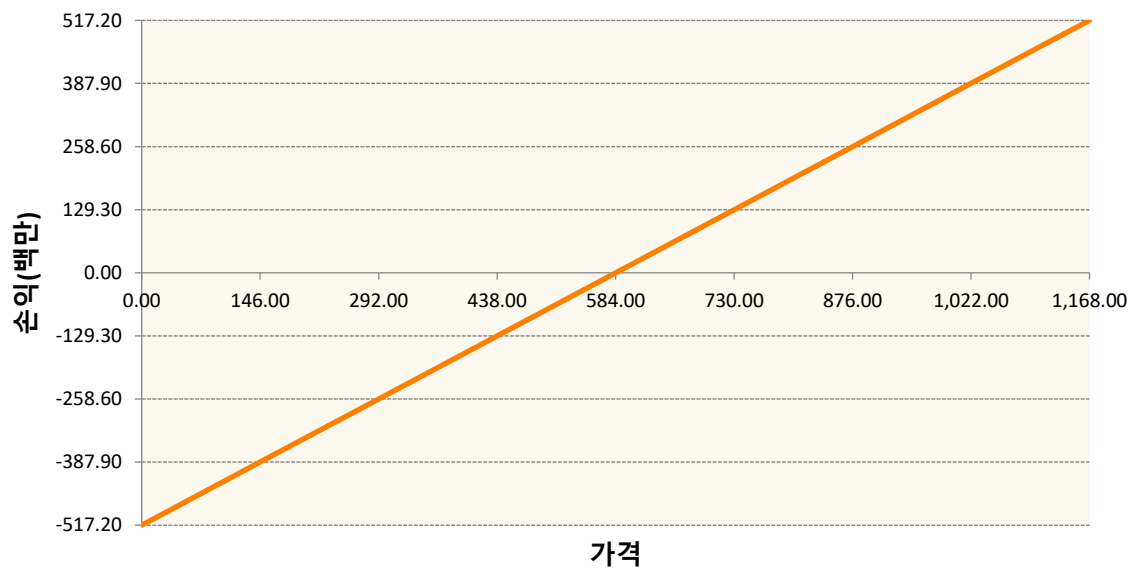
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,687 | 592   | 2,095     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

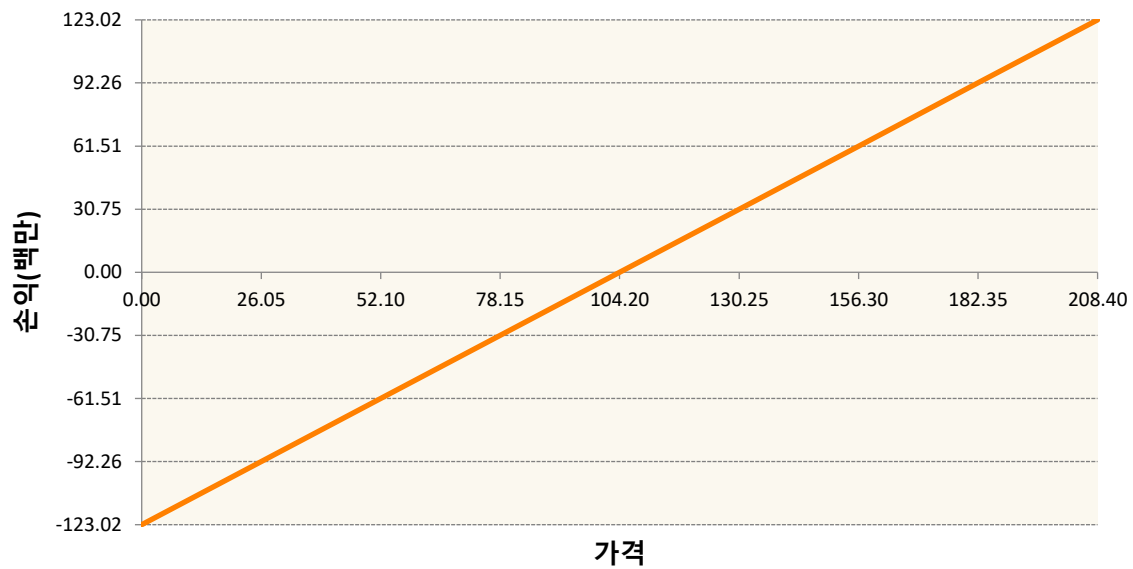
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



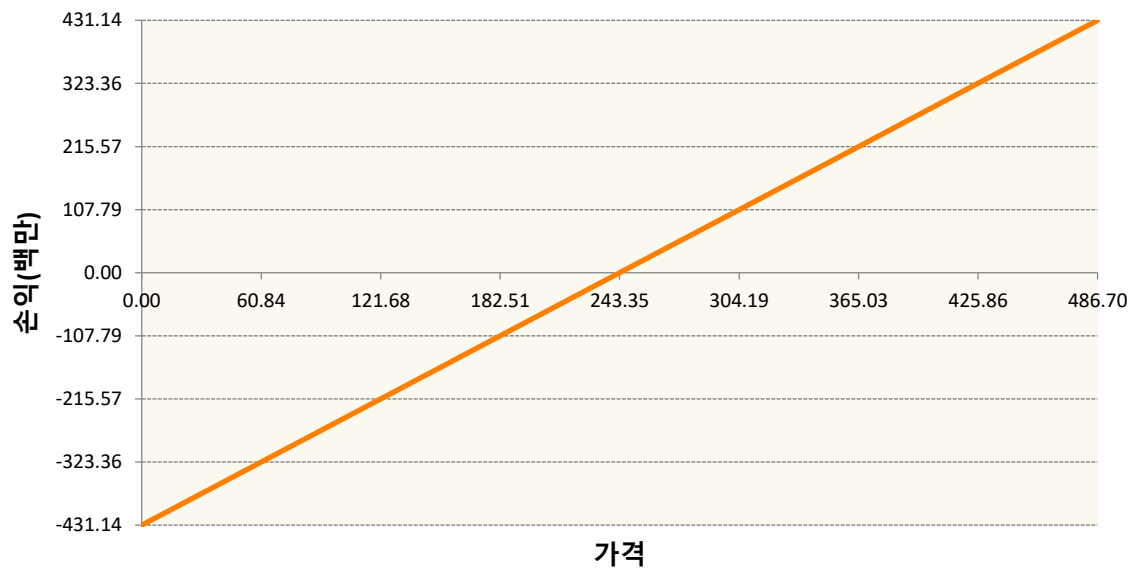
CH2-CORN FUTURE Mar22



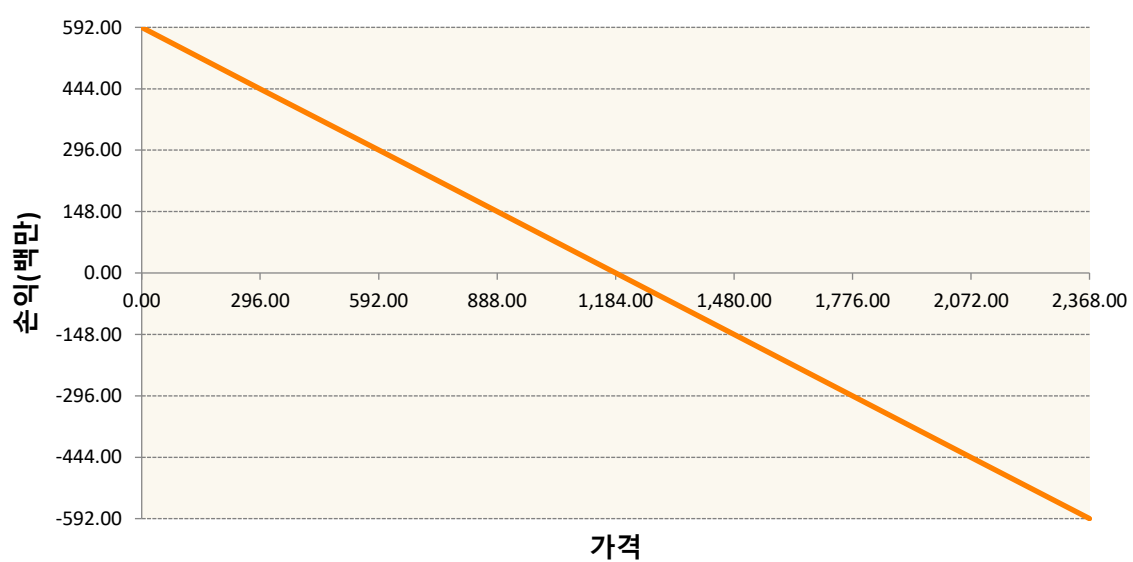
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



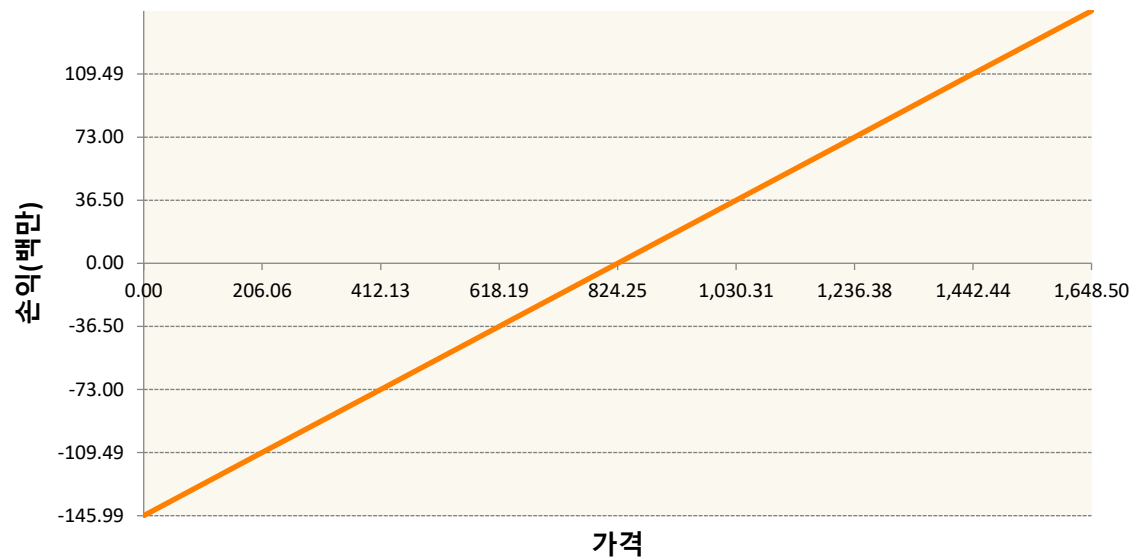
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



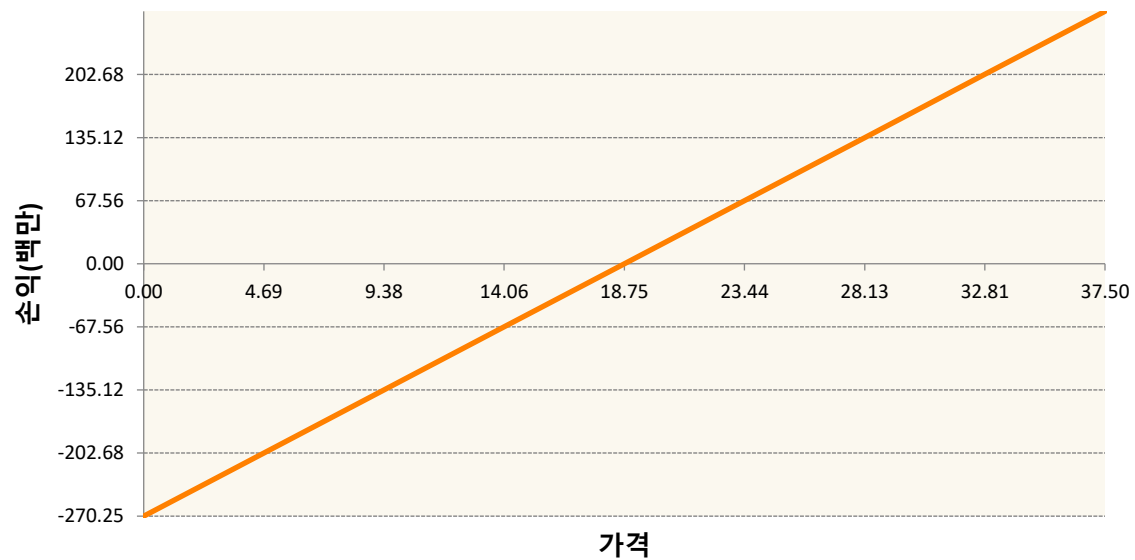
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



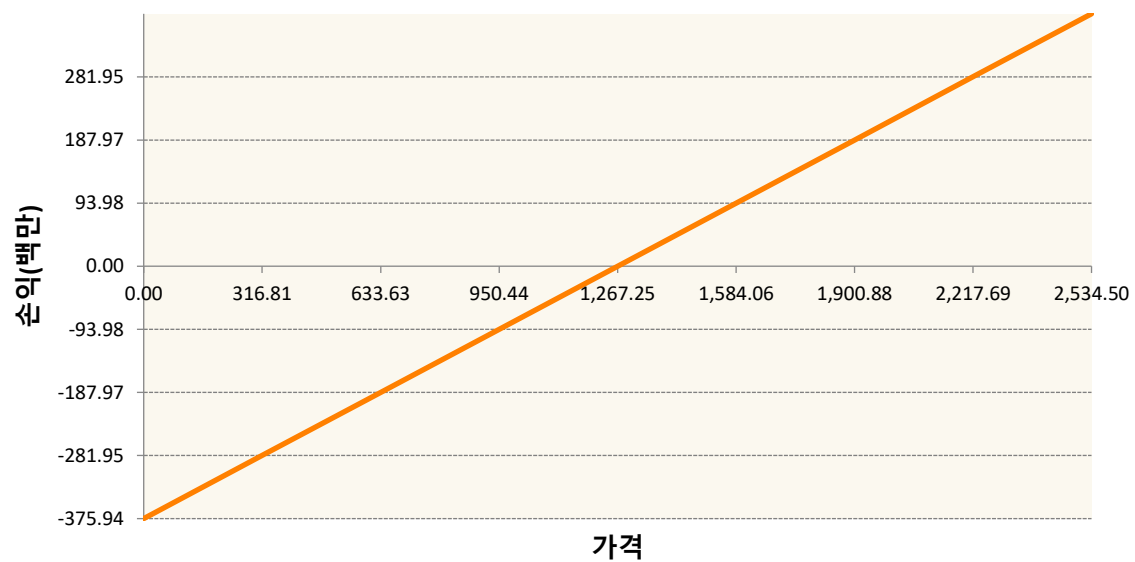
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

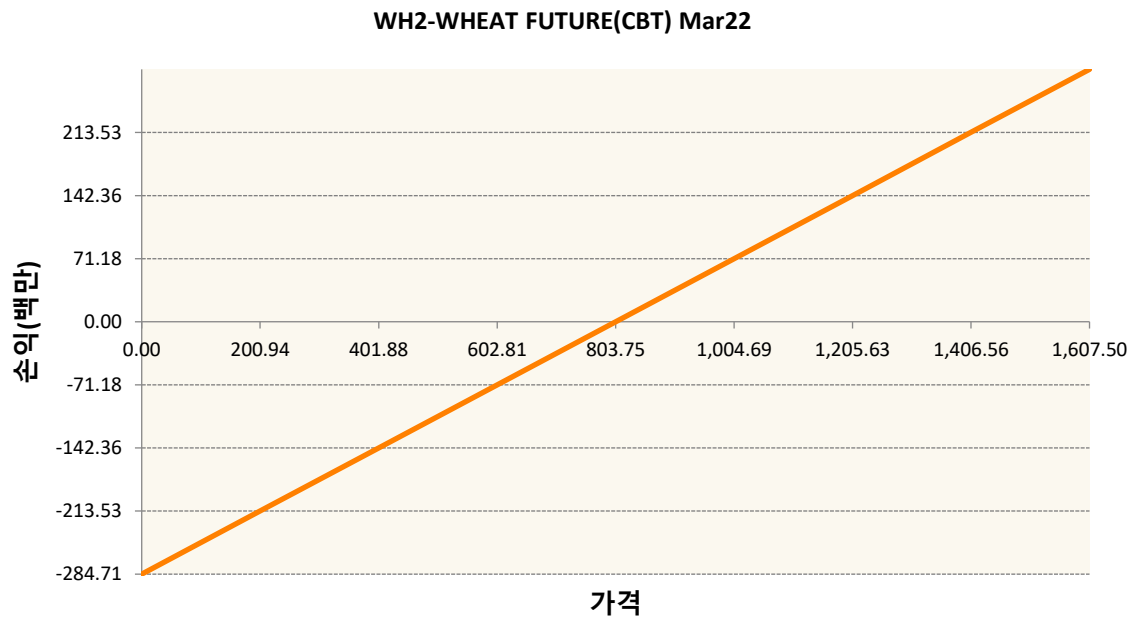
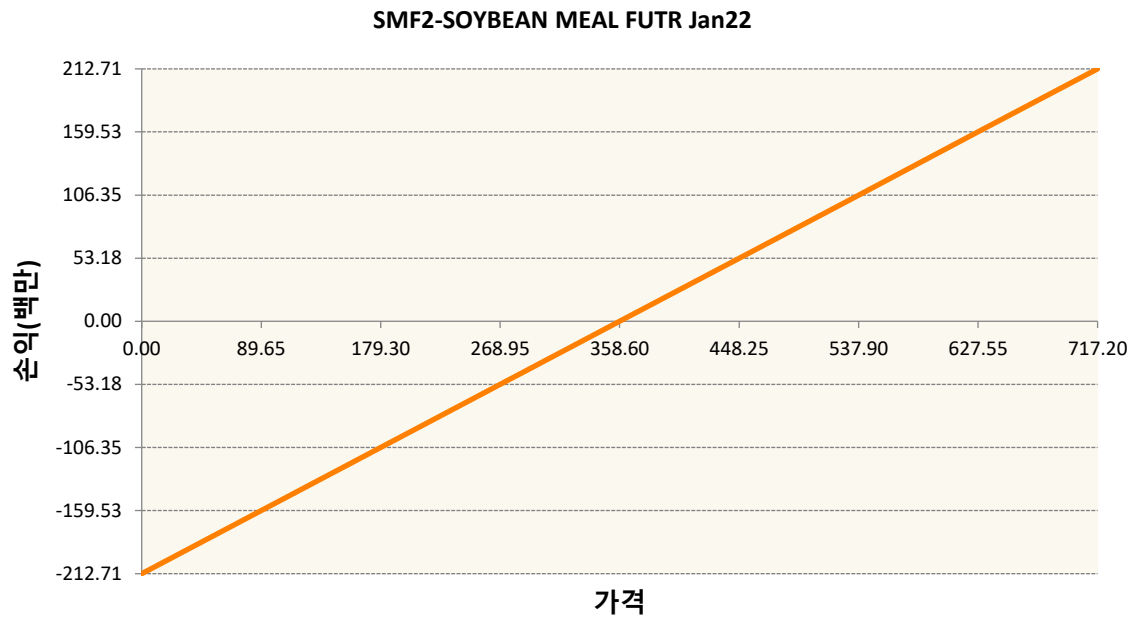


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| BOF2                      | SOYBEAN OIL FUTR Jan22  |  | 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 |  | 22       |
| SF2                       | SOYBEAN FUTURE Jan22    |  | 30       |
| SMF2                      | SOYBEAN MEAL FUTR Jan22 |  | 17       |
| WH2                       | WHEAT FUTURE(CBT) Mar22 |  | 23       |

