

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

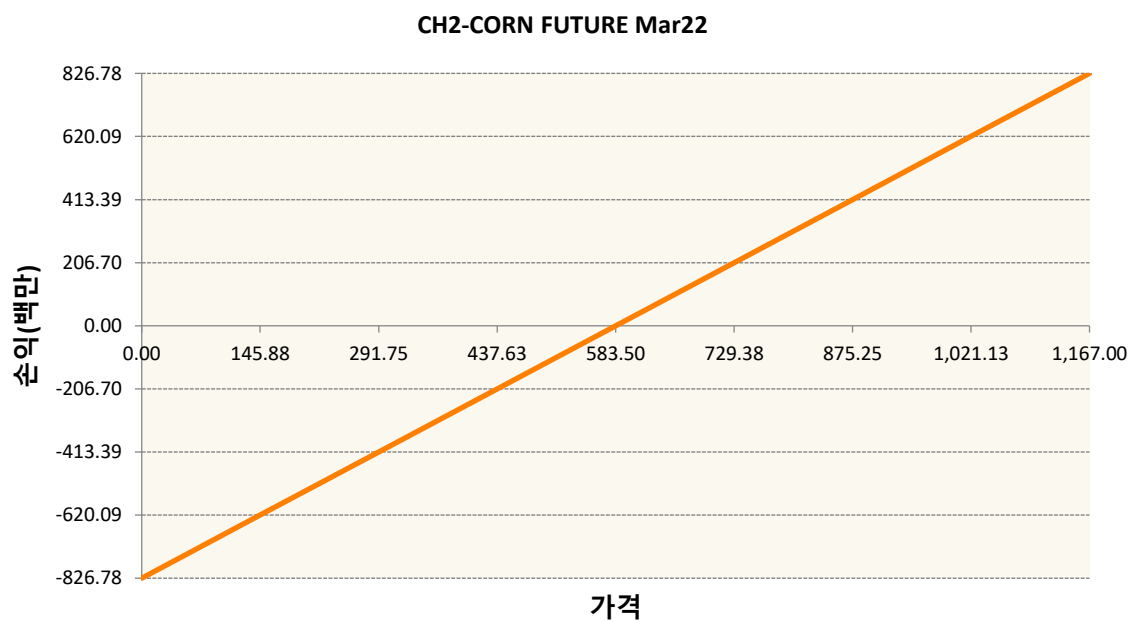
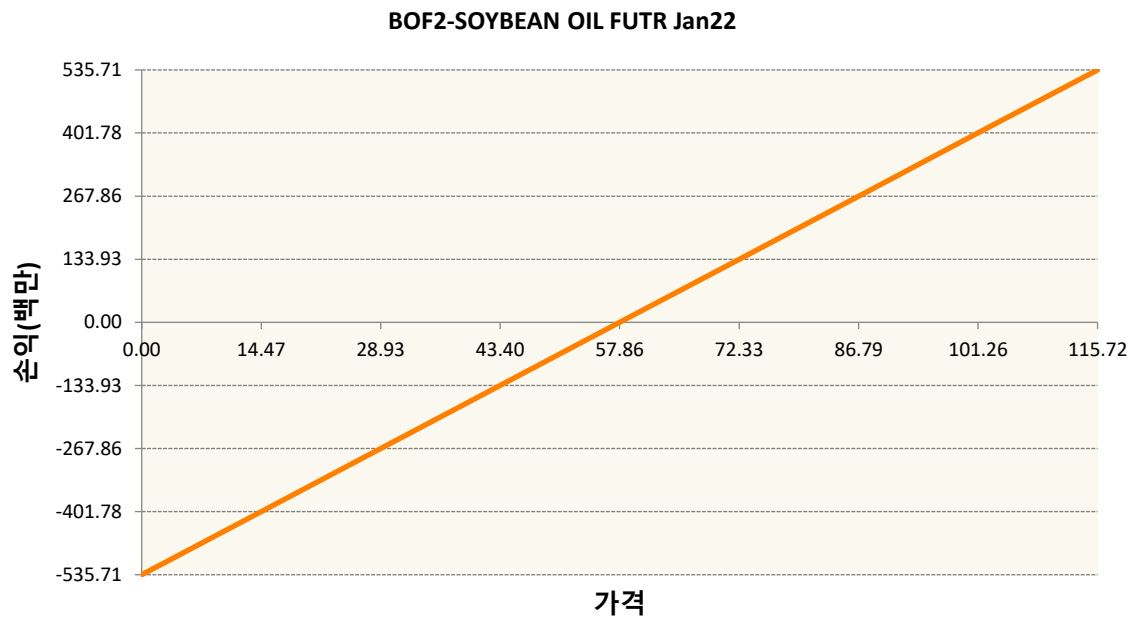
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

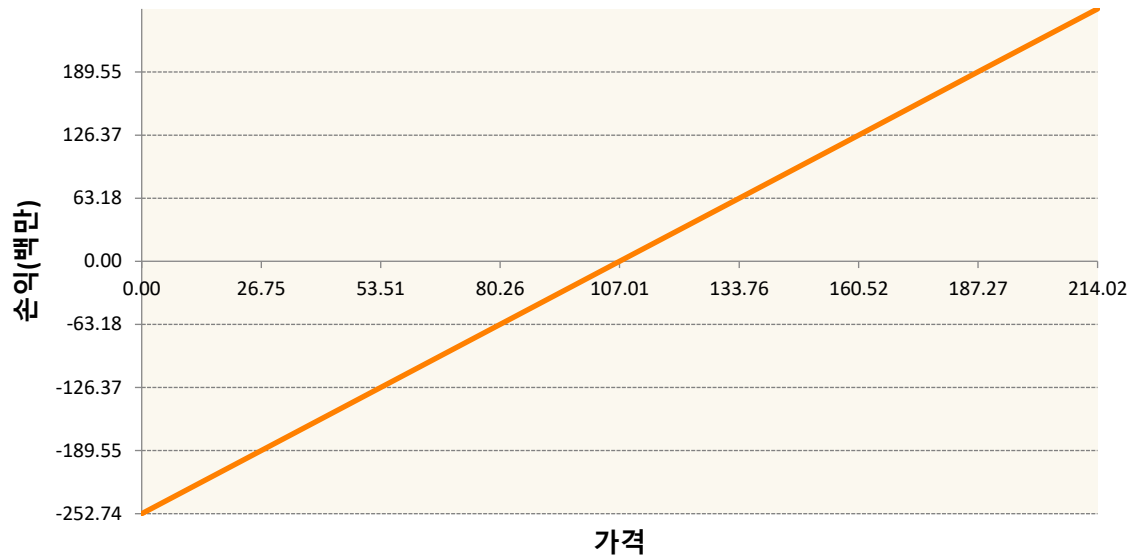
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,573	531	4,043	

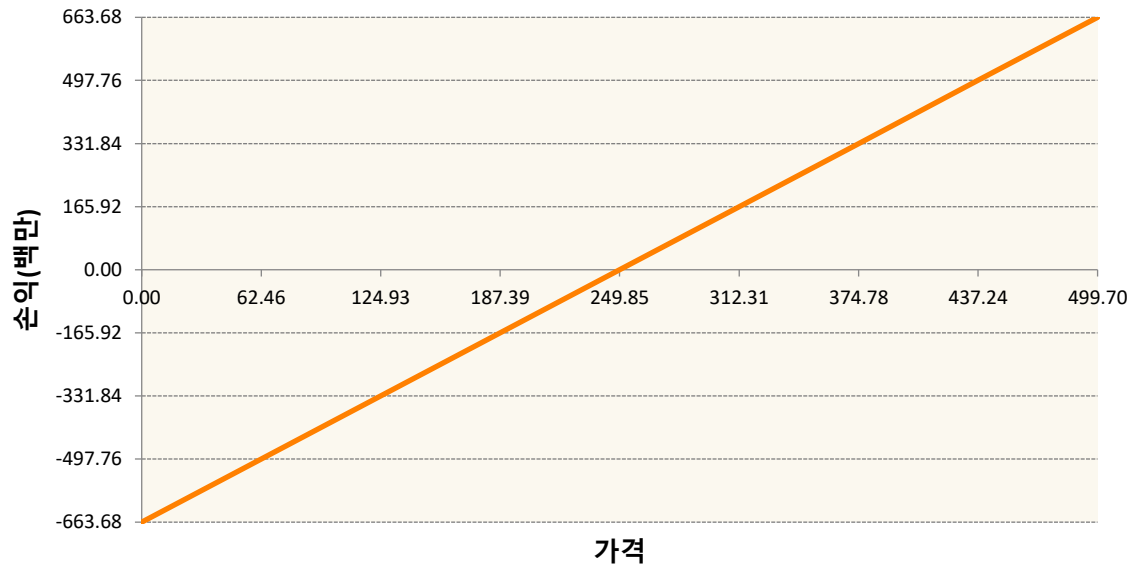
2. 만기시점의 손익구조



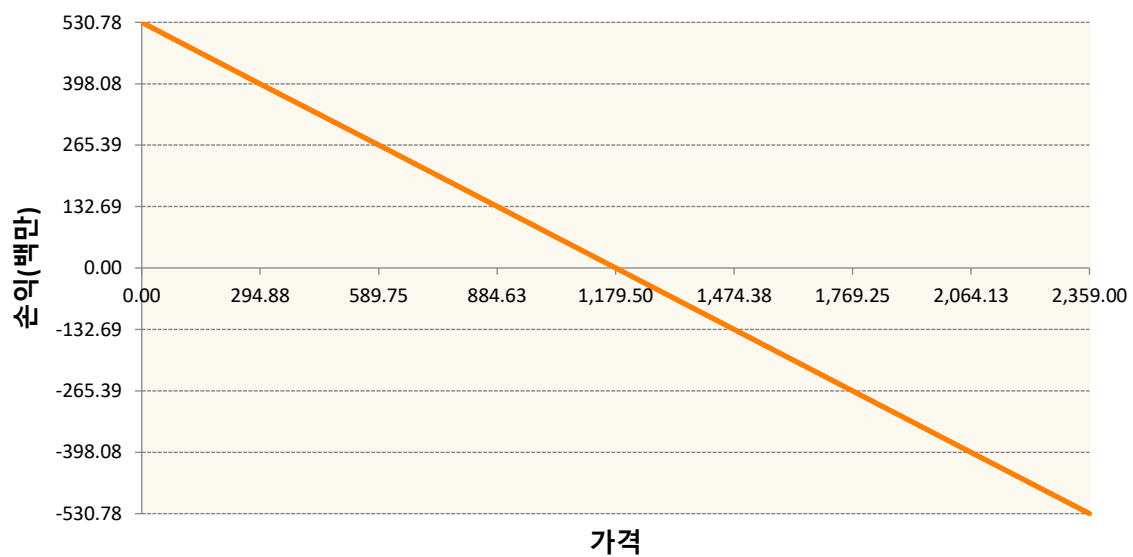
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



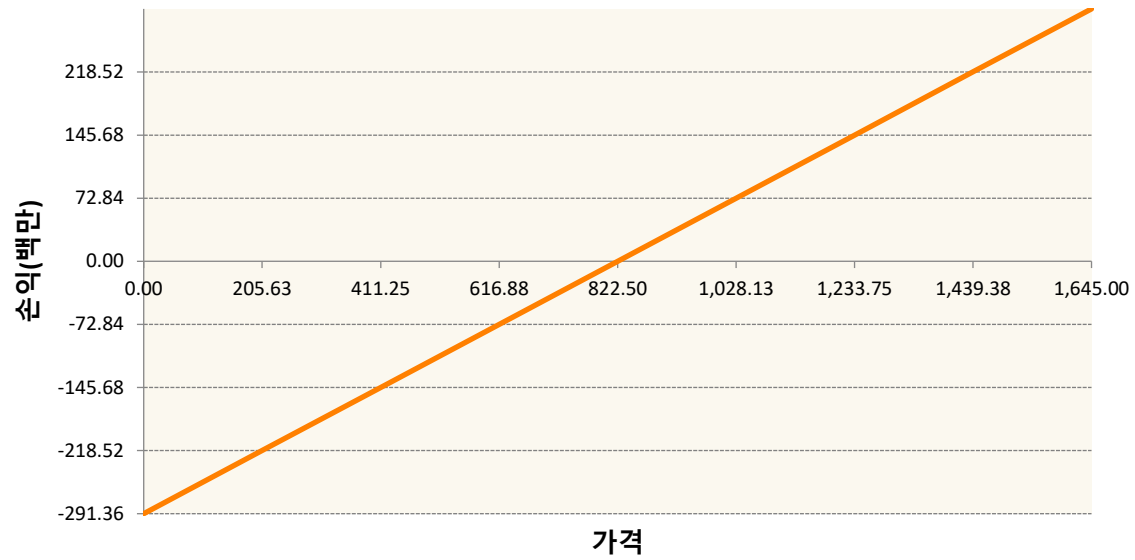
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



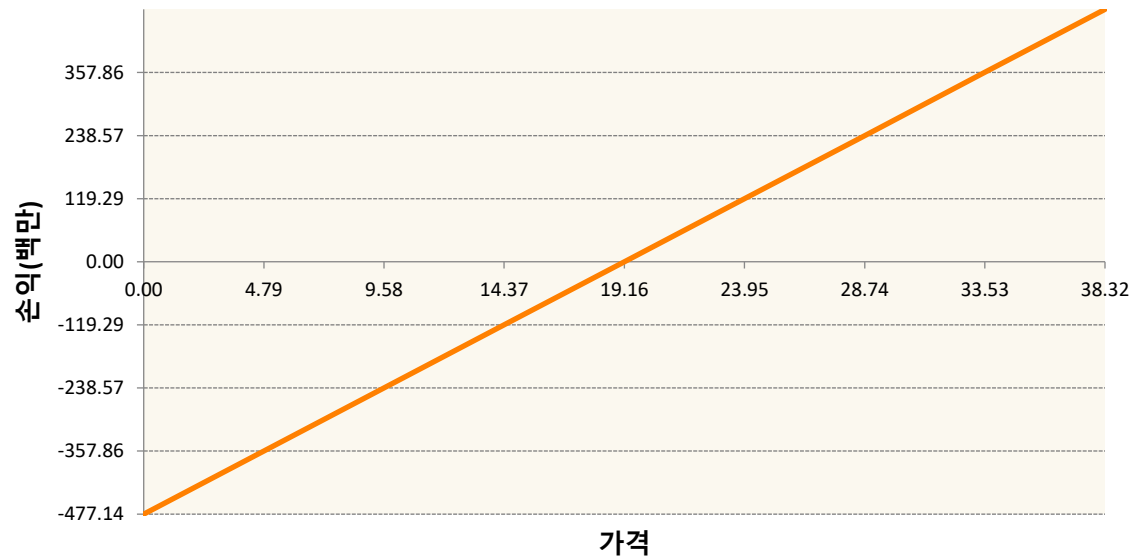
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



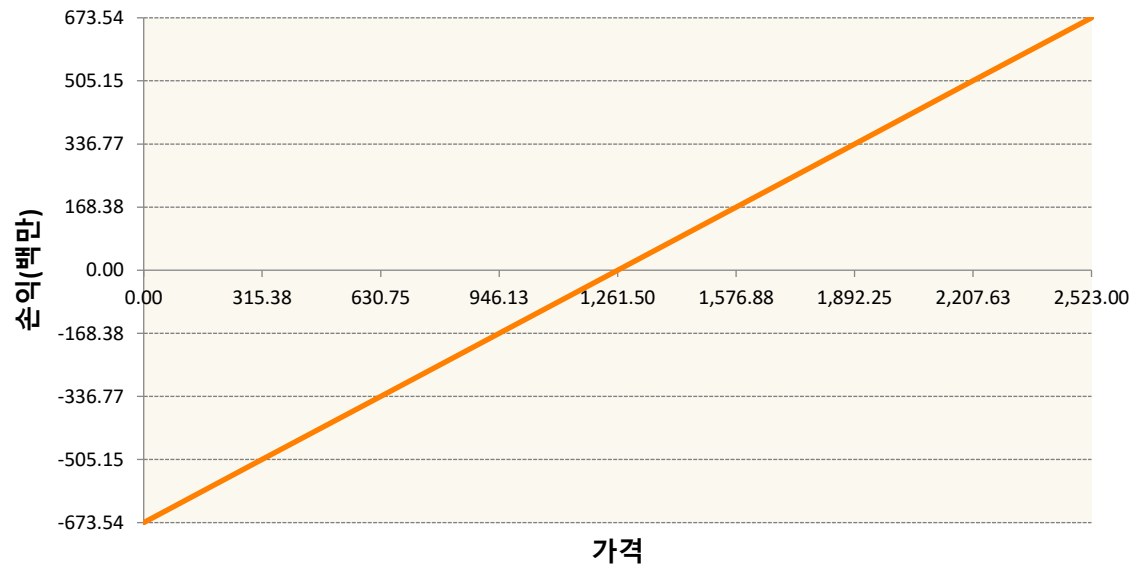
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



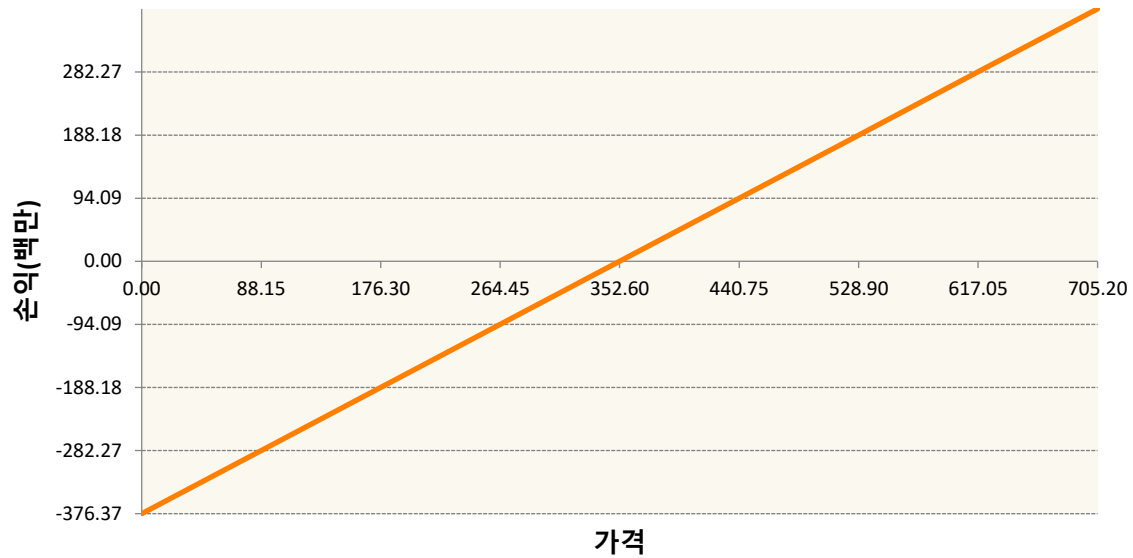
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



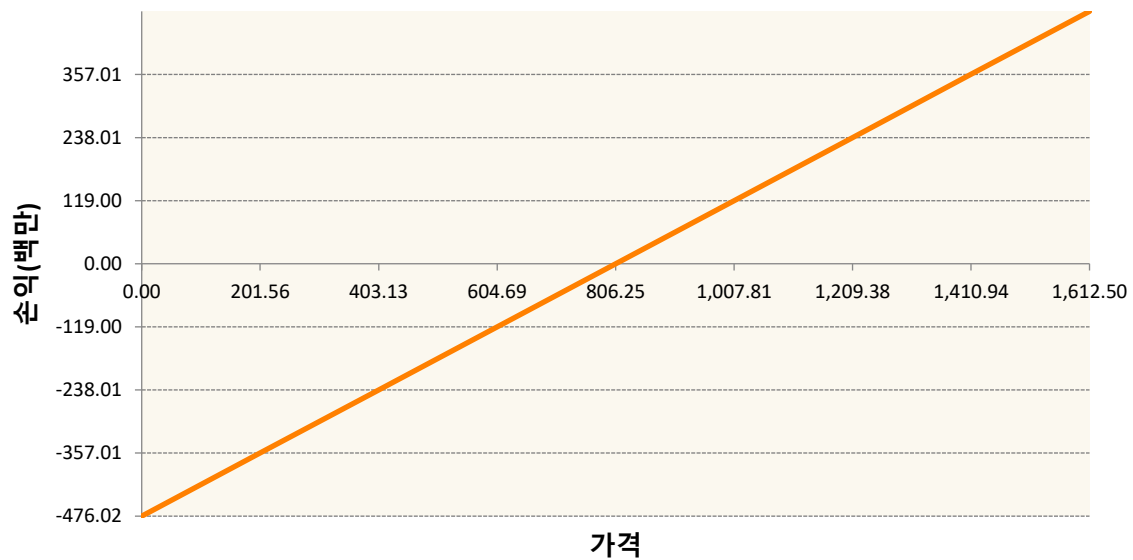
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	2021-12-08
기준일	2021-12-07

스마트인덱스모

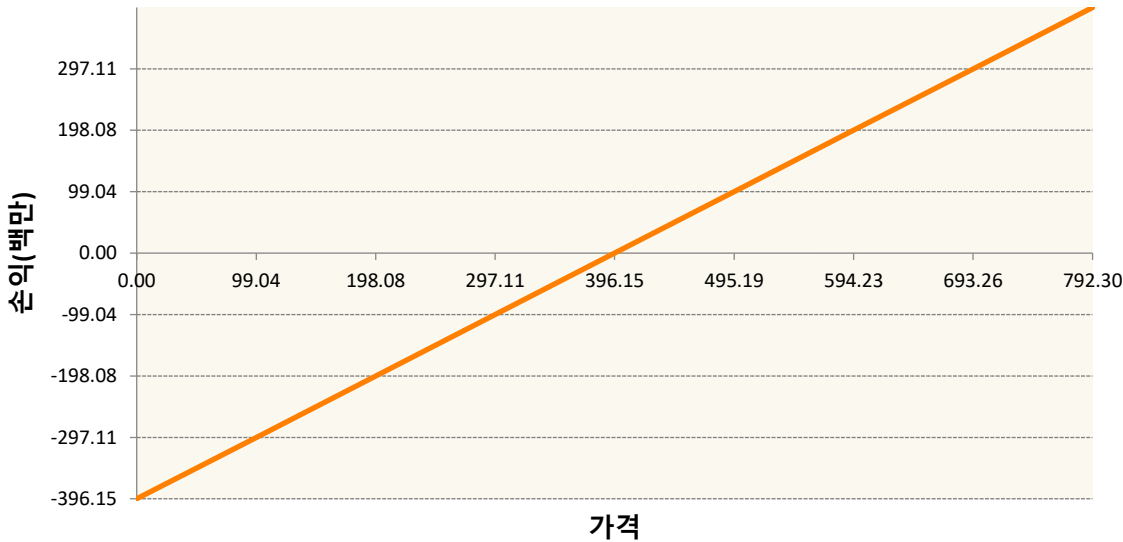
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	396	0	396	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101RC0000			2021-12 코스피200지수선물				32
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	32	32	32	32	32	32	32

공시일	2021-12-08
기준일	2021-12-07

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

895

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

531

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-08
기준일	2021-12-07

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)

424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

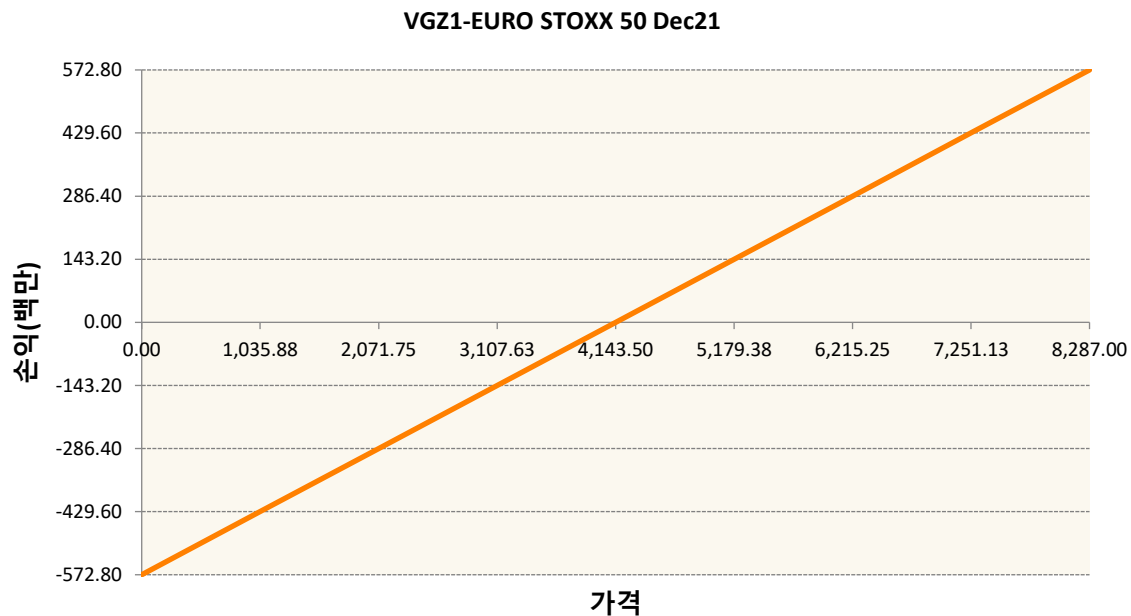
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	573	0	573	

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	2021-12-08
기준일	2021-12-07

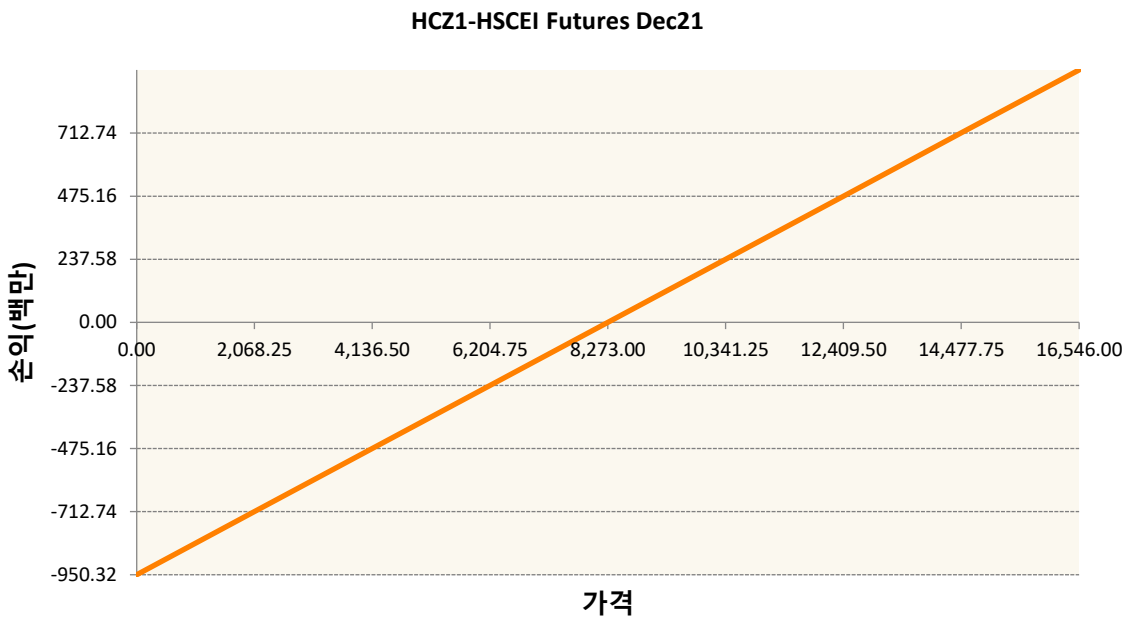
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	950	0	950	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

81

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

커버드콜모(주식혼합-파생형)

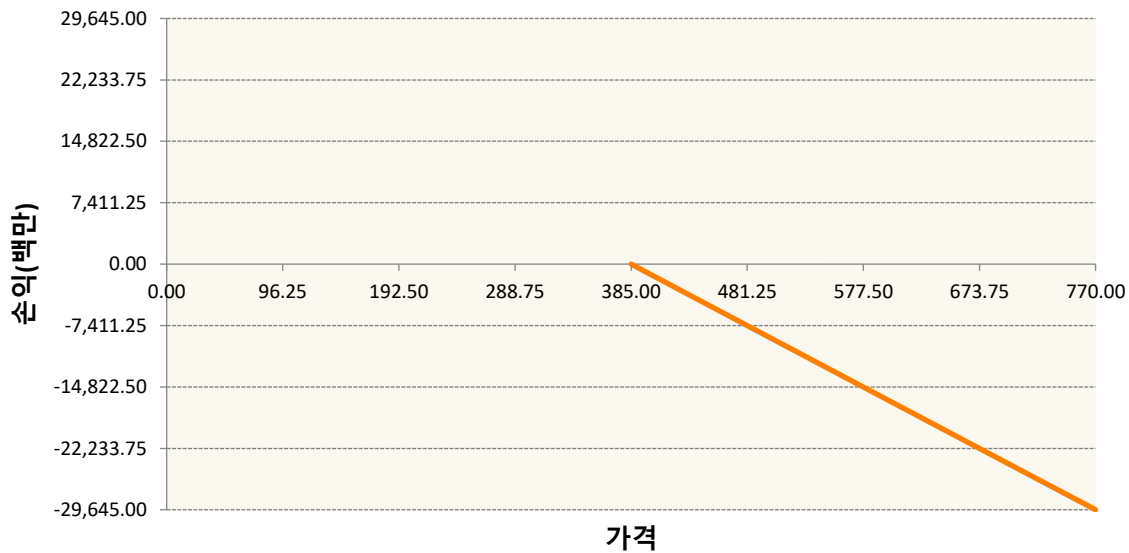
1. 계약금액

(단위:백만원)

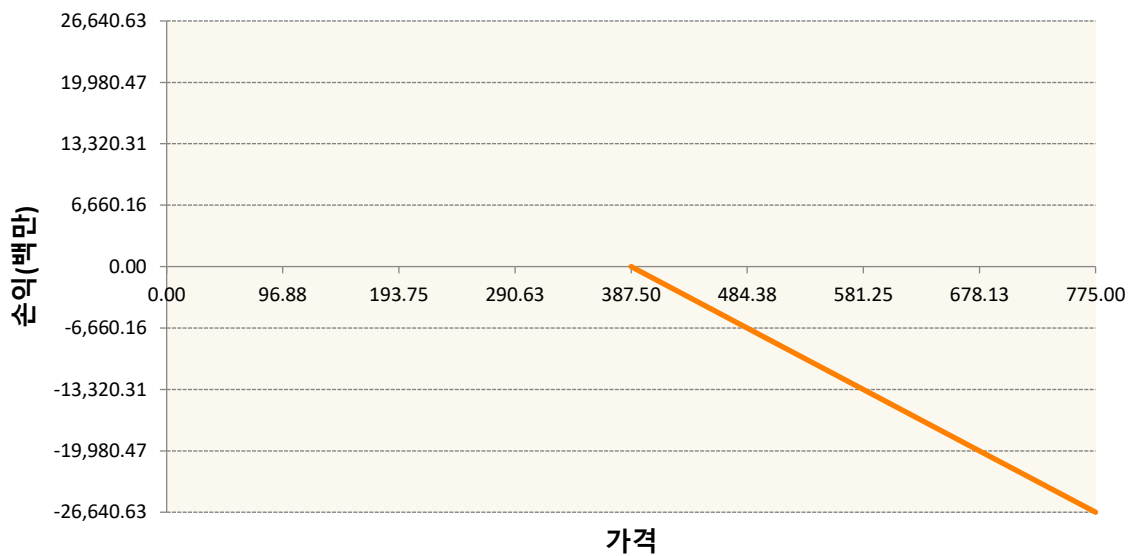
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,517	-76,517	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201RC3854-2021-12 콜385



KR4201RC3870-2021-12 콜387.5



가격	손익(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). The line starts at a price of 0.00 with a profit/loss of -2,906.25 and reaches a profit/loss of 0.00 at a price of 387.50.

가격	손익 (백만)
0.00	-2,906.25
387.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201RC3854				2021-12 콜385			2,419
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	891	891	891	891	890	889	887
-5.33%	883	877	870	862	852	842	830
-2.67%	680	660	640	620	600	580	560
0%	17	13	7	0	-8	-18	-28
2.67%	-792	-792	-792	-792	-793	-794	-796
5.33%	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605	-1,605
8.00%	-2,419	-2,419	-2,419	-2,419	-2,419	-2,419	-2,419
KR4201RC3870				2021-12 콜387.5			2,141
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	643	643	643	642	642	642	641
-5.33%	640	638	634	630	624	617	610
-2.67%	533	516	499	481	463	445	428
0%	25	18	10	0	-11	-22	-34
2.67%	-688	-688	-689	-690	-691	-693	-696
5.33%	-1,415	-1,415	-1,415	-1,415	-1,415	-1,415	-1,415
8.00%	-2,141	-2,141	-2,141	-2,141	-2,141	-2,141	-2,141
KR4301RC3853 2021-12 풋385							917

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-916	-916	-916	-916	-916	-916	-917
-5.33%	-441	-442	-443	-444	-446	-448	-451
-2.67%	-57	-65	-74	-82	-90	-98	-106
0%	2	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4301RC3879 2021-12 풋387.5							171
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-2.67%	-19	-20	-22	-23	-24	-26	-27
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
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)

6,226

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

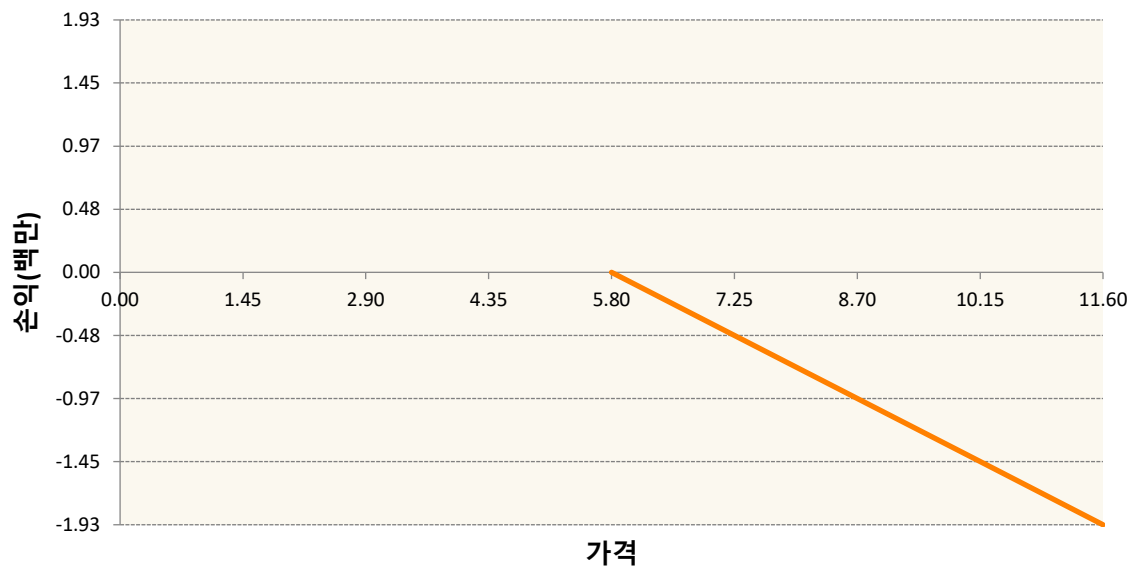
1. 계약금액

(단위:백만원)

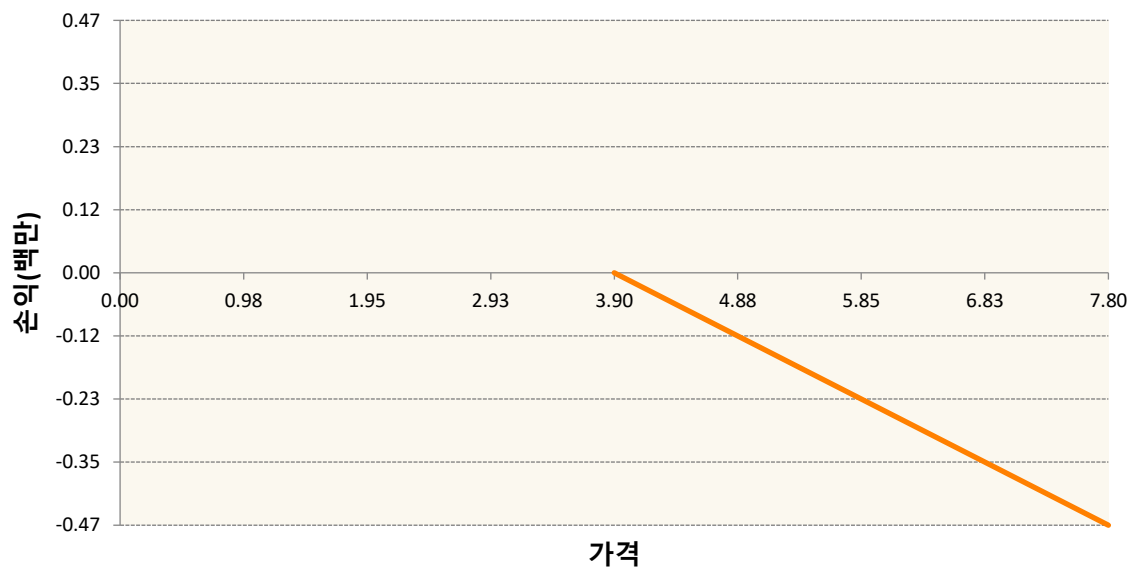
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	125	-125	장내

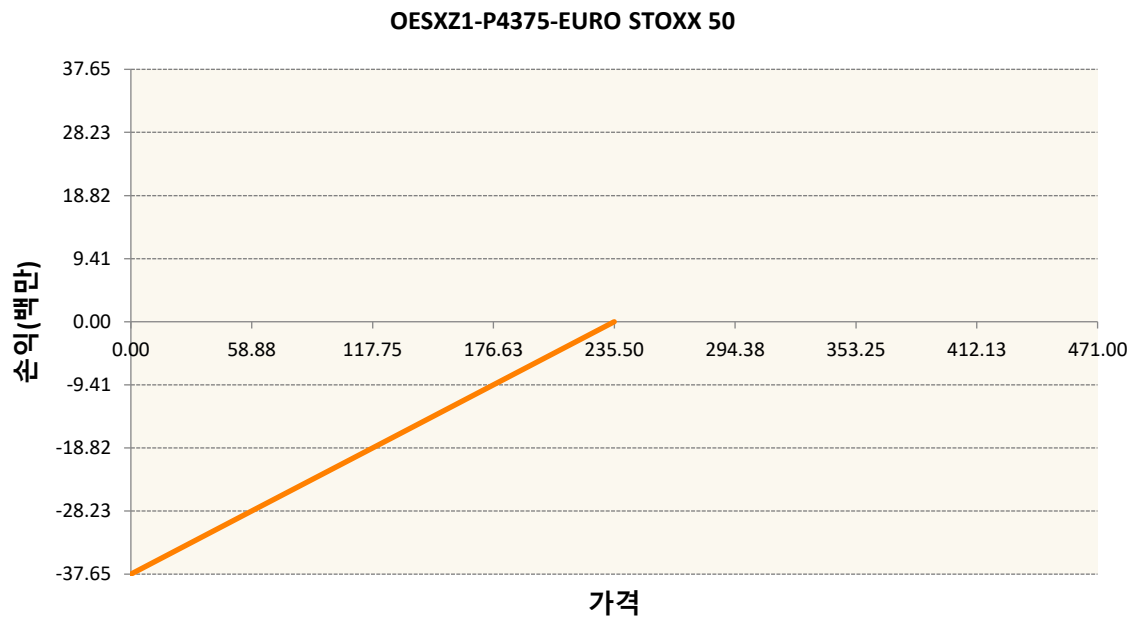
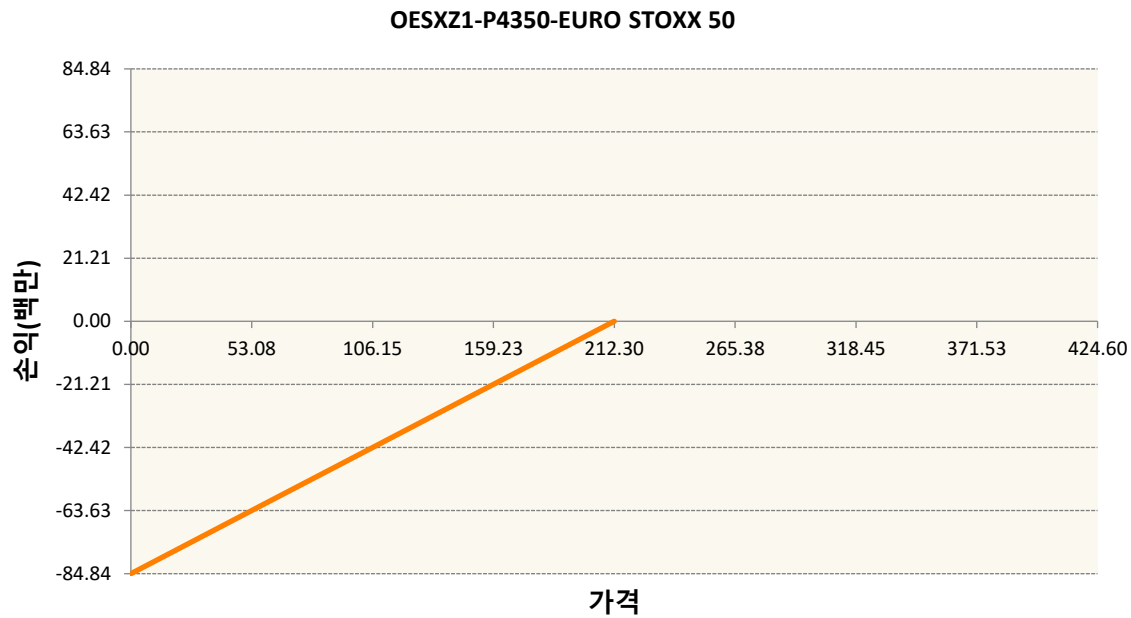
2. 만기시점의 손익구조

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		0.15
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.04
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		7
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	39

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

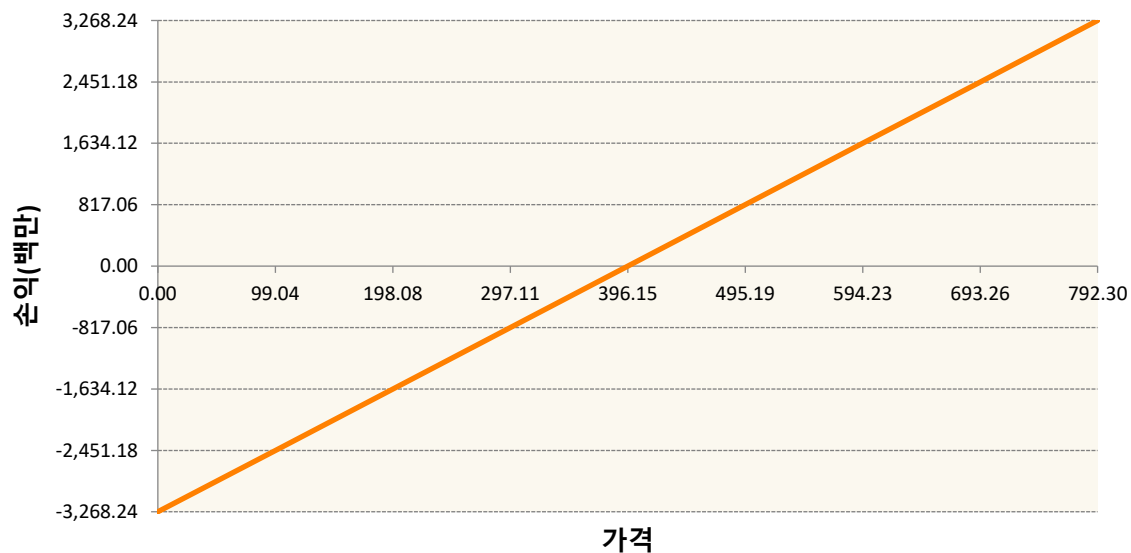
1. 계약금액

(단위:백만원)

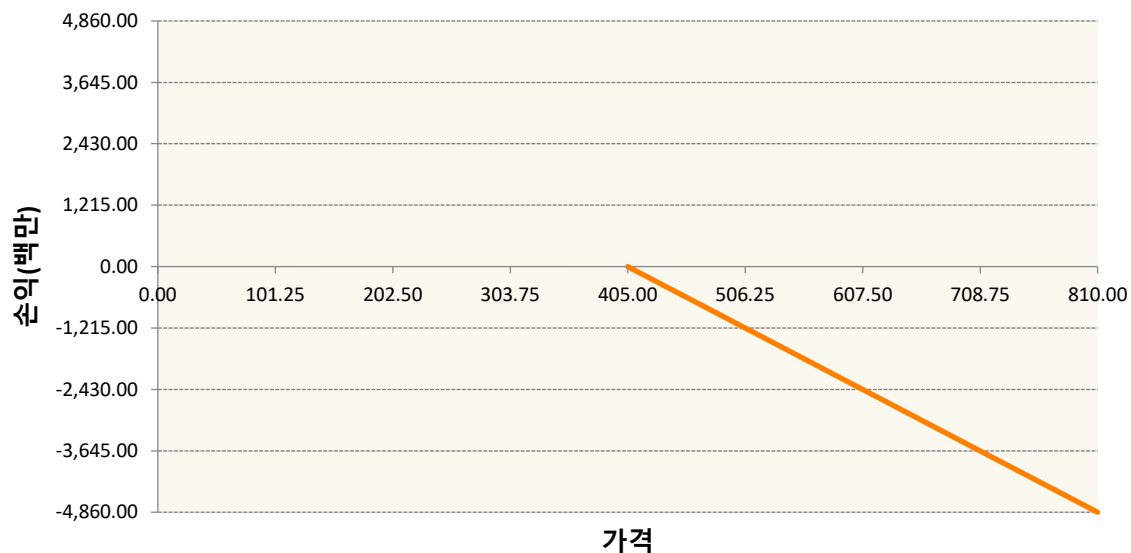
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,268	0	3,268	장내
누계	유가증권	옵션	579	5,369	-4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조

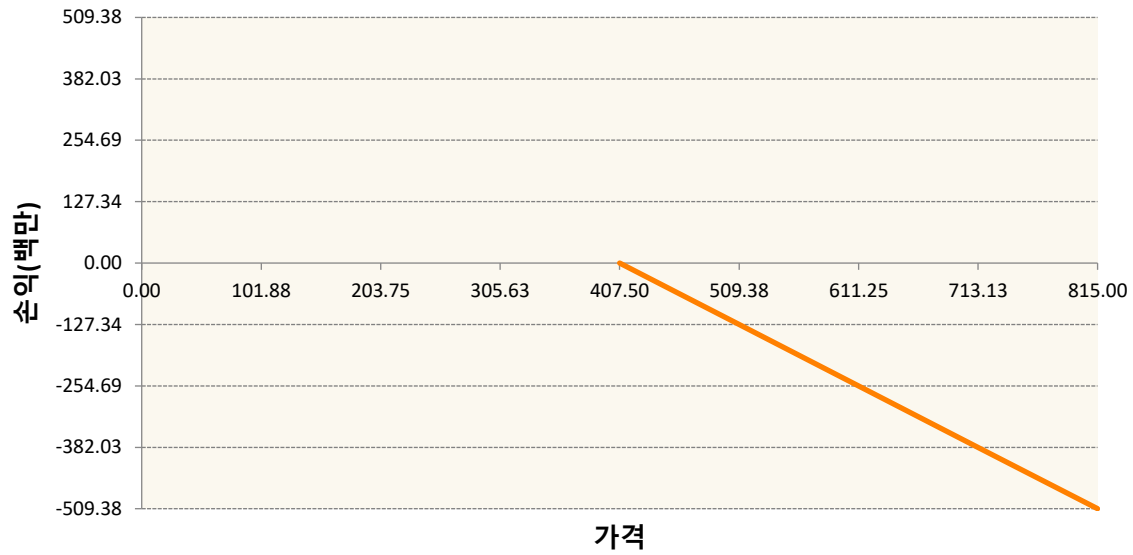
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



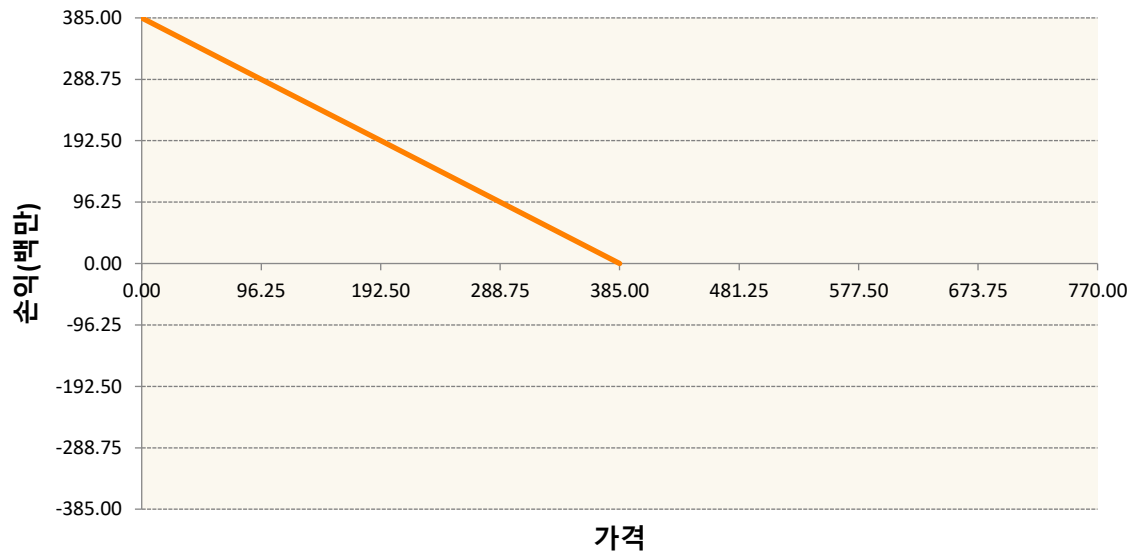
KR4201RC4050-2021-12 콜405



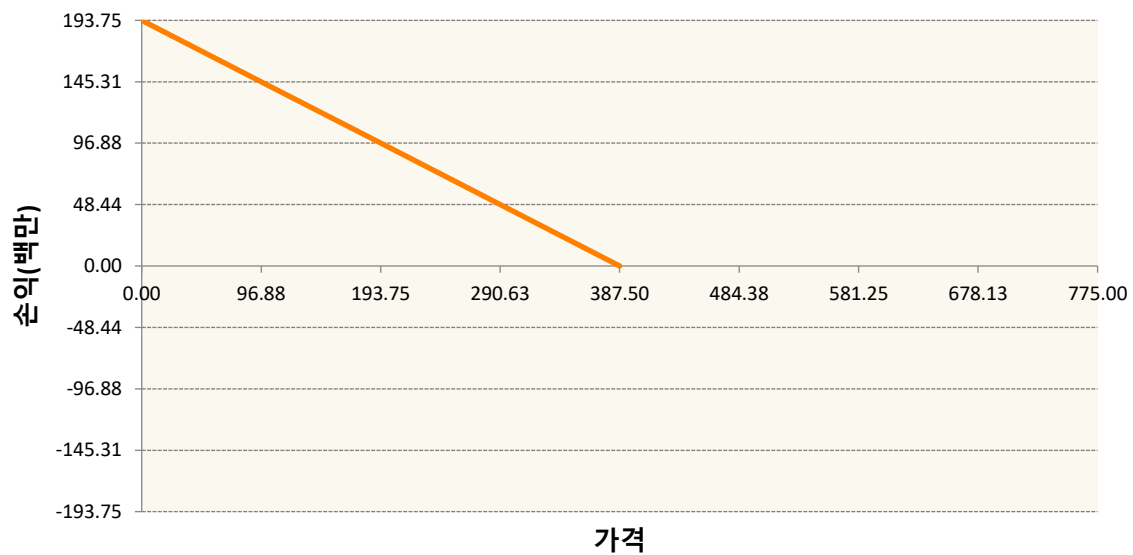
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



KR4301RC3853-2021-12 풋385



KR4301RC3879-2021-12 풋387.5



(단위:백만원)

KR4101RC0000							2021-12 코스피200지수선물		262		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262				
-5.33%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174				
-2.67%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	87	87	87	87	87	87	87				
5.33%	174	174	174	174	174	174	174				
8.00%	262	262	262	262	262	262	262				
KR4201RC4050							2021-12 콜405		269		
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	7	7	6				
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6				
2.67%	-35	-38	-41	-45	-48	-51	-54				
5.33%	-143	-143	-144	-145	-146	-148	-149				
8.00%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269				
KR4201RC4076							2021-12 콜407.5		25		
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	0				
2.67%	-2	-3	-3	-3	-4	-4	-4				
5.33%	-12	-12	-12	-13	-13	-13	-13				
8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25				
KR4301RC3853							2021-12 풋385		20		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	20	20	20	20	20	20	20				
-5.33%	10	10	10	10	10	10	10				
-2.67%	1	1	2	2	2	2	2				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	0	0	0	0	0	0	0				
5.33%	0	0	0	0	0	0	0				
8.00%	0	0	0	0	0	0	0				
KR4301RC3879							2021-12 풋387.5		11		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	6	6	6	6	6	6	6
-2.67%	1	1	1	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

546

공시일	2021-12-08
기준일	2021-12-07

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	17,857	0	17,857	

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	2021-12-08
기준일	2021-12-07

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	9,621	0	9,621	

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	2021-12-08
기준일	2021-12-07

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	45,443	0	45,443	
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

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Profit/Loss (손익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 792.30. The y-axis represents Profit/Loss in millions, ranging from -1,881.71 to 1,881.71. A solid orange line shows the relationship, starting at a price of 0.00 with a loss of 1,881.71 million and reaching a profit of 1,881.71 million at a price of 792.30.

가격	손익(백만)
0.00	-1,881.71
99.04	-1,411.28
198.08	-940.86
297.11	-470.43
396.15	0.00
495.19	470.43
594.23	940.86
693.26	1,411.28
792.30	1,881.71

(단위:백만원)

KR4101RC0000						2021-12 코스피200지수선물		151
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151	
-5.33%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	50	50	50	50	50	50	50	
5.33%	100	100	100	100	100	100	100	
8.00%	151	151	151	151	151	151	151	

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

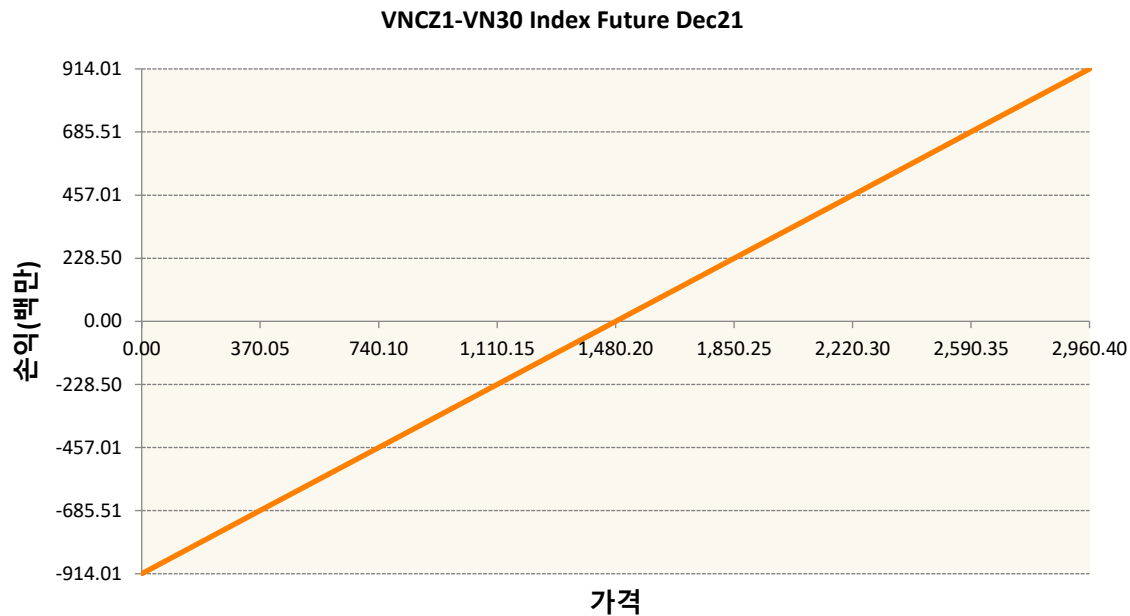
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	914	0	914	
누계	유가증권	스왑	1,779	0	1,779	장외
누계	통화	선도	0	573	-573	장외

2. 만기시점의 손익구조



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	73

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

(단위:백만원)

252

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

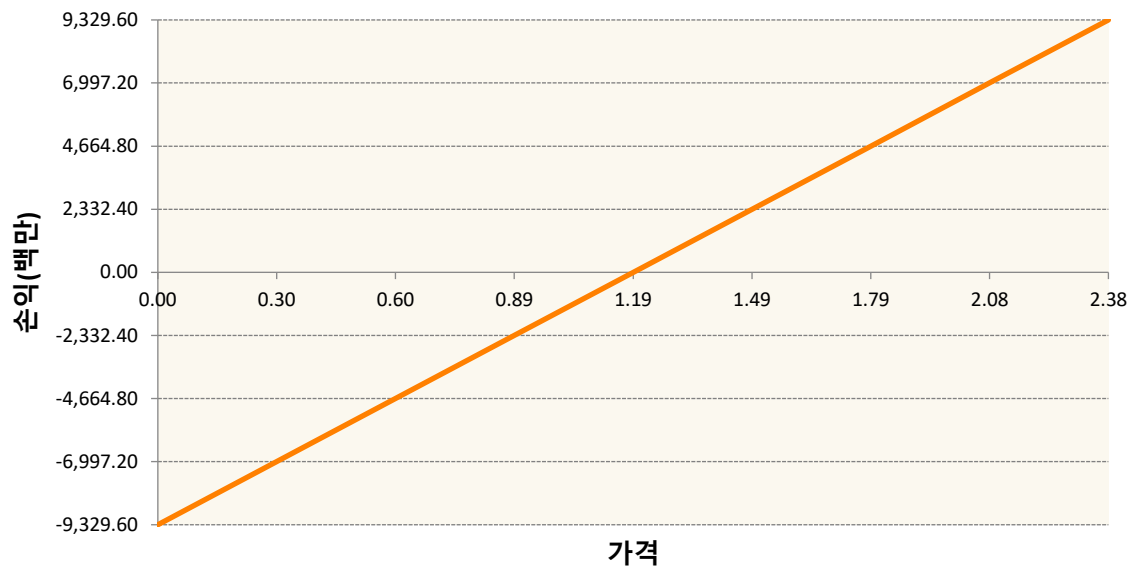
1. 계약금액

(단위:백만원)

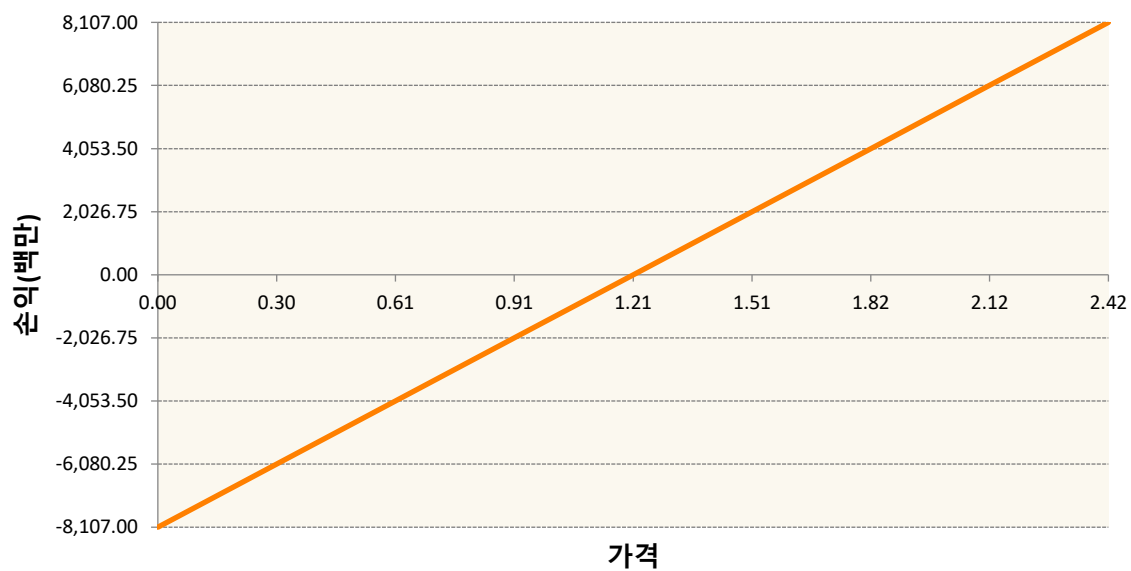
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,577	0	25,577	

2. 만기시점의 손익구조

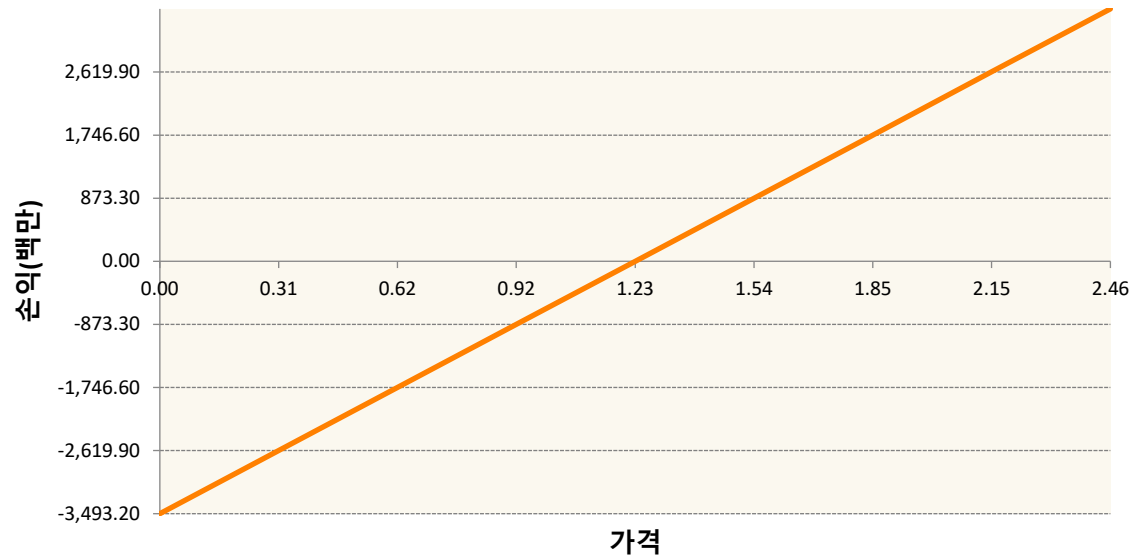
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



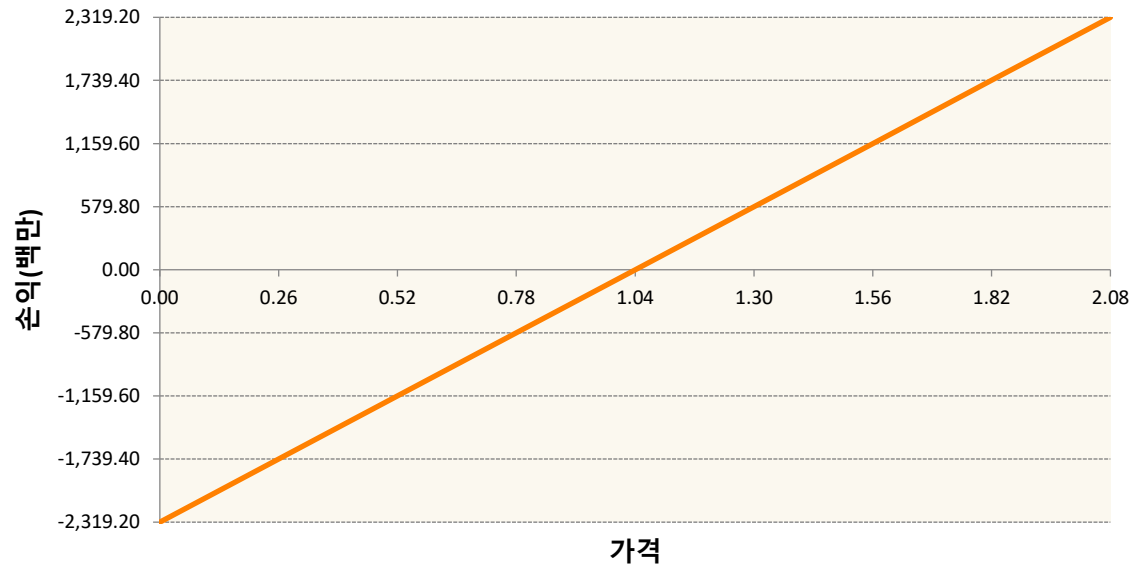
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



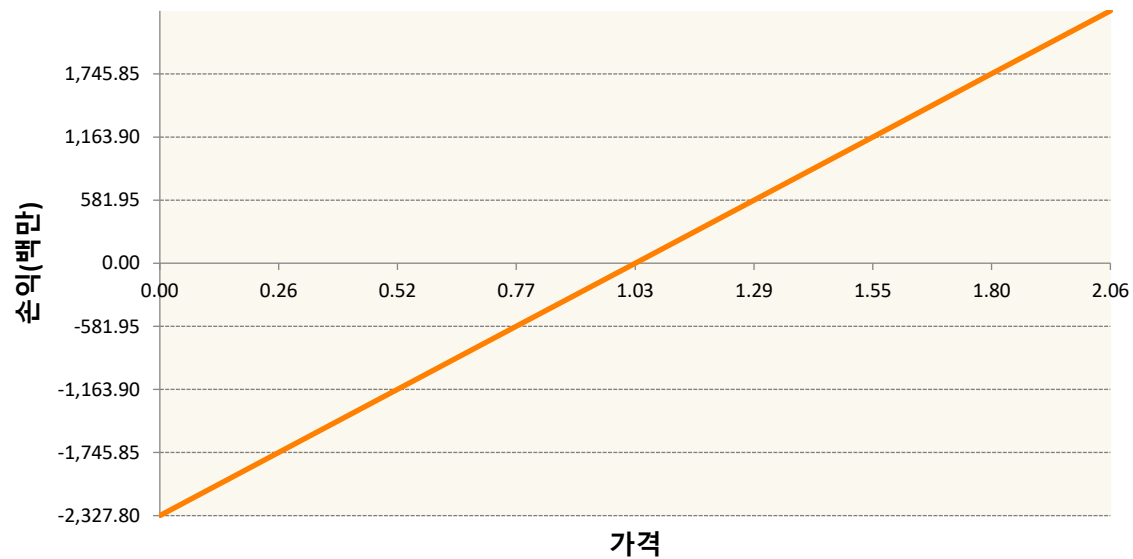
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)		747
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		650
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		280
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		186
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		186

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,076

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

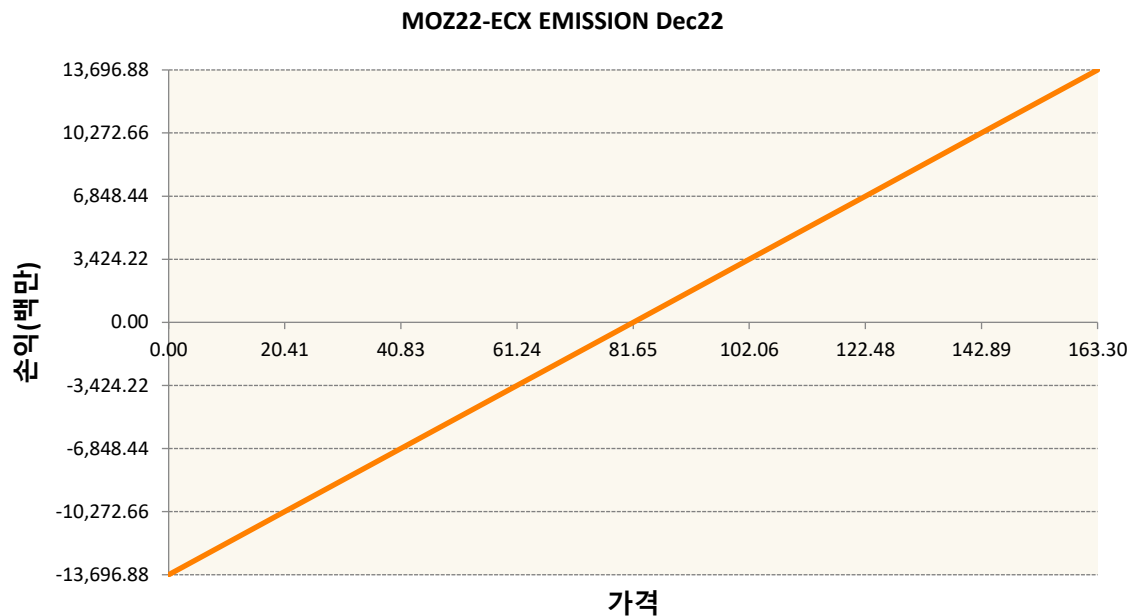
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,697	0	13,697	
누계	통화	선도	0	4,754	-4,754	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX KRW/EUR 28-12-21E

380

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,096

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

(단위:백만원)

2,388

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

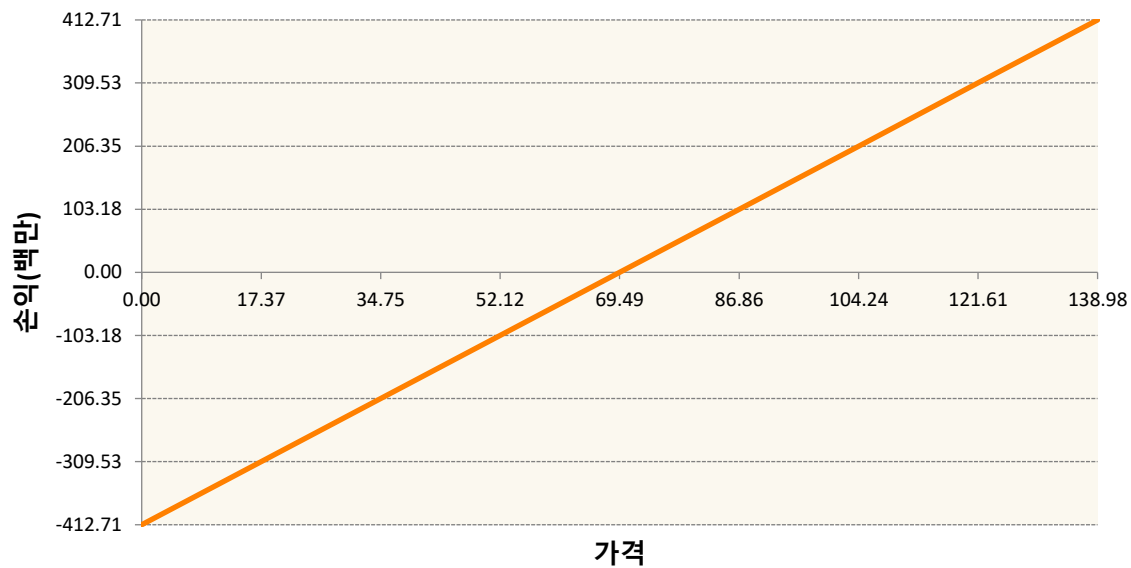
1. 계약금액

(단위:백만원)

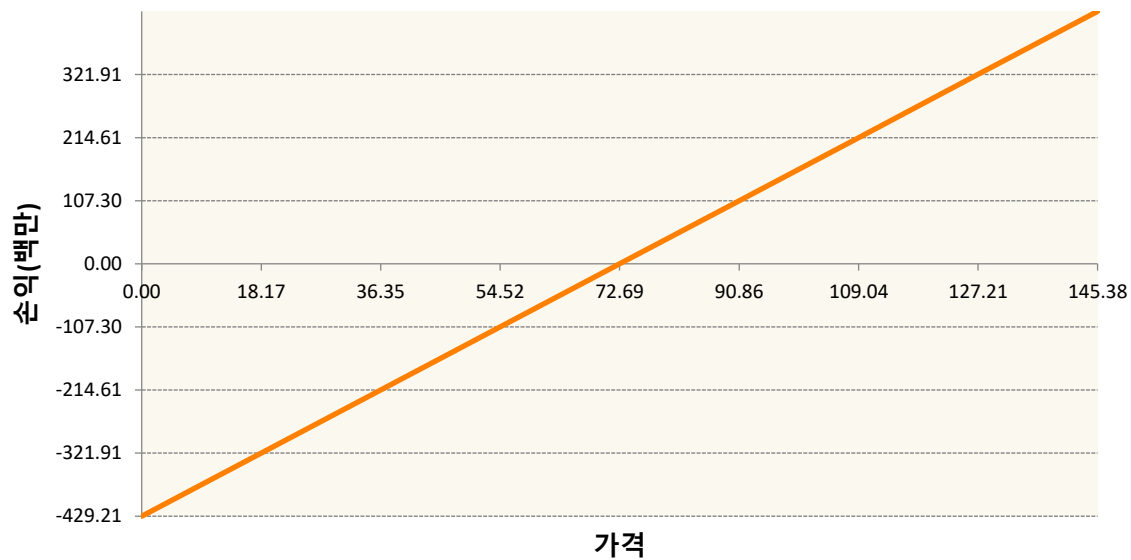
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,795	354	1,441	

2. 만기시점의 손익구조

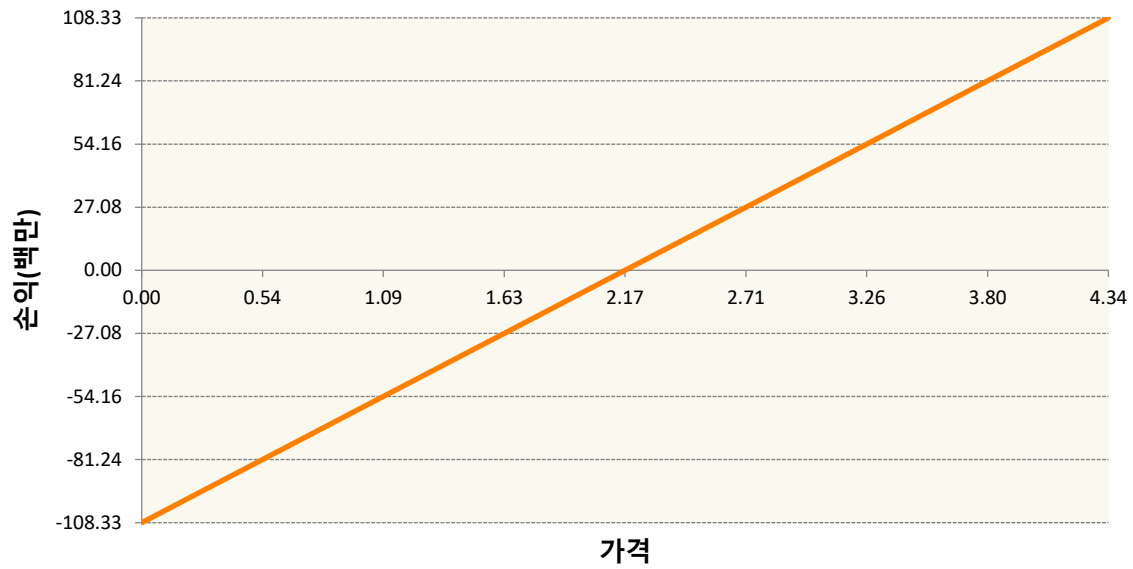
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



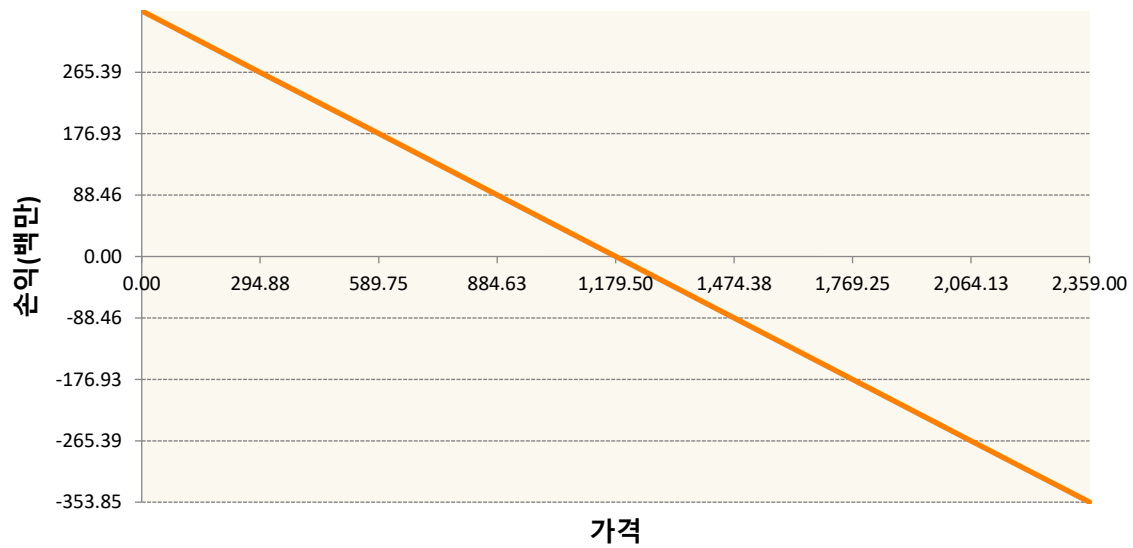
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



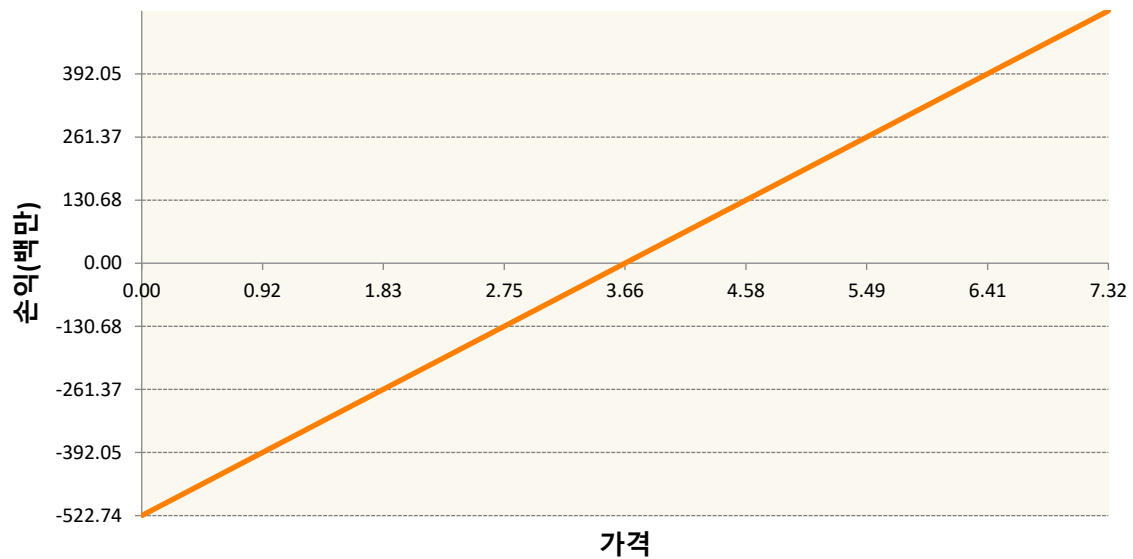
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22



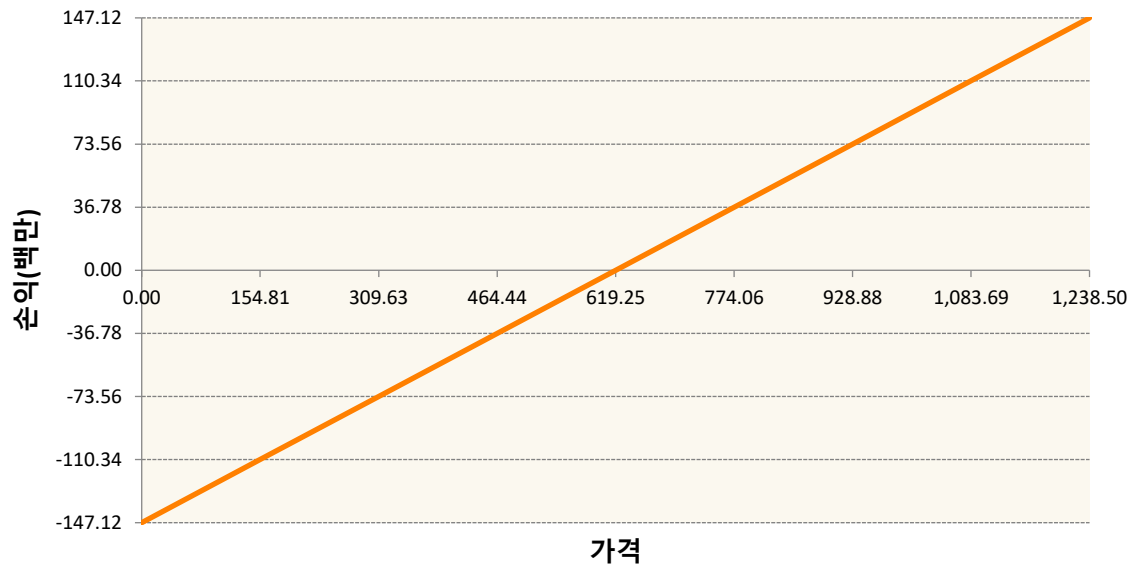
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



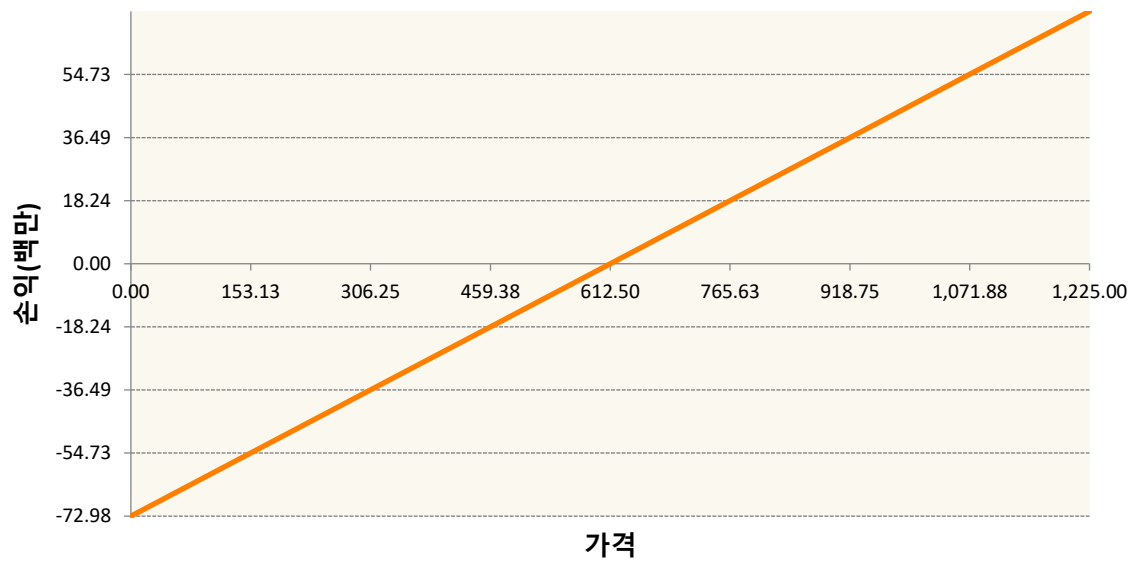
NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22



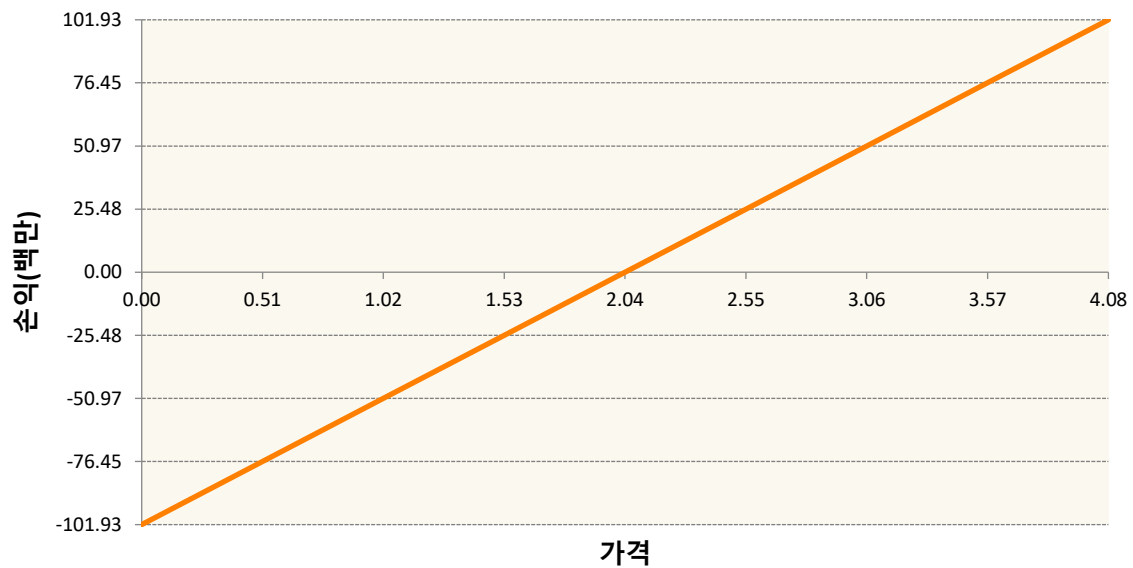
QSF2-Low Su Gasoil G Jan22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBF2-GASOLINE RBOB FUT Jan22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF2	WTI CRUDE FUTURE Jan22	33
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22	34
HOF2	NY Harb ULSD Fut Jan22	9
KR4175RC00 2021-12 달러선물		28
NGF22	NATURAL GAS FUTR Jan22	42
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)

324

공시일 2021-12-08

기준일 2021-12-07

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

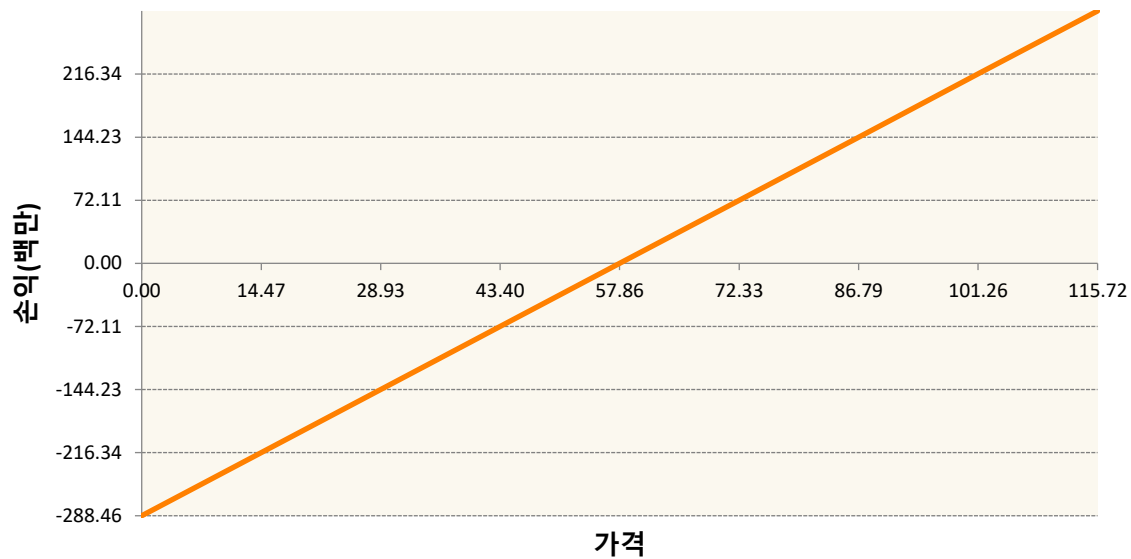
1. 계약금액

(단위:백만원)

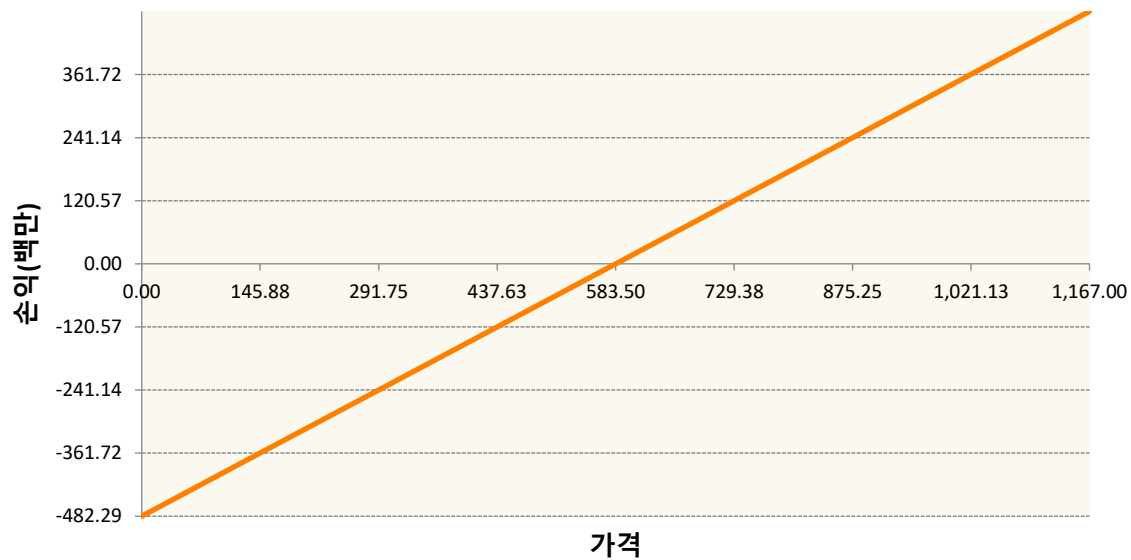
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,630	590	2,041	

2. 만기시점의 손익구조

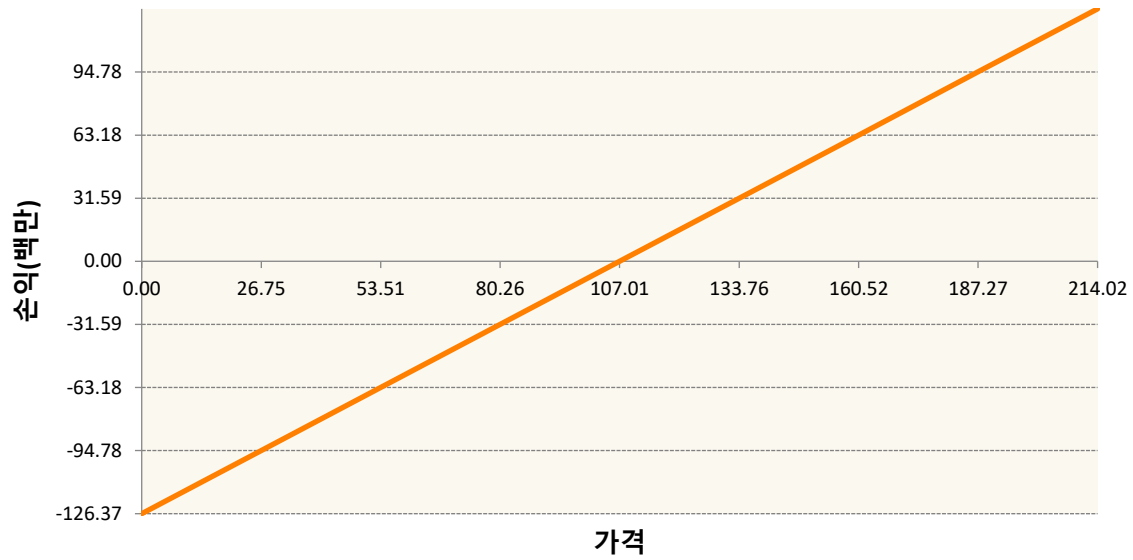
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



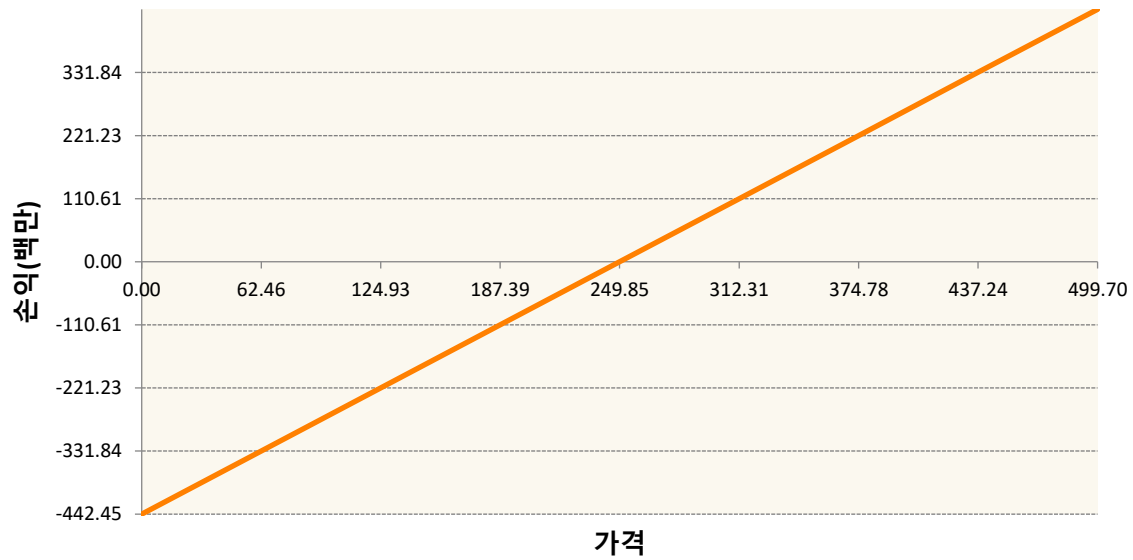
CH2-CORN FUTURE Mar22



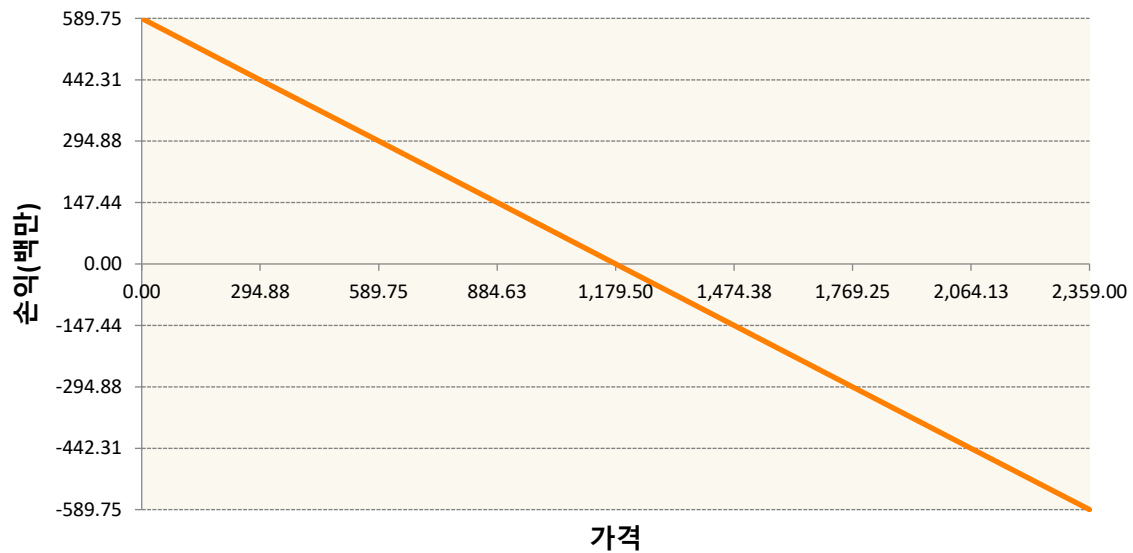
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



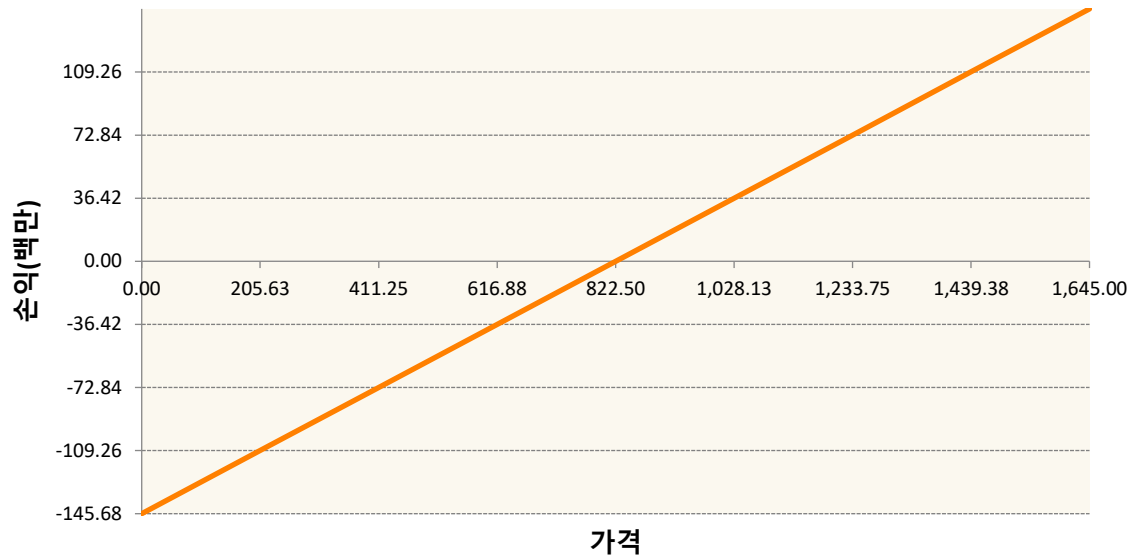
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



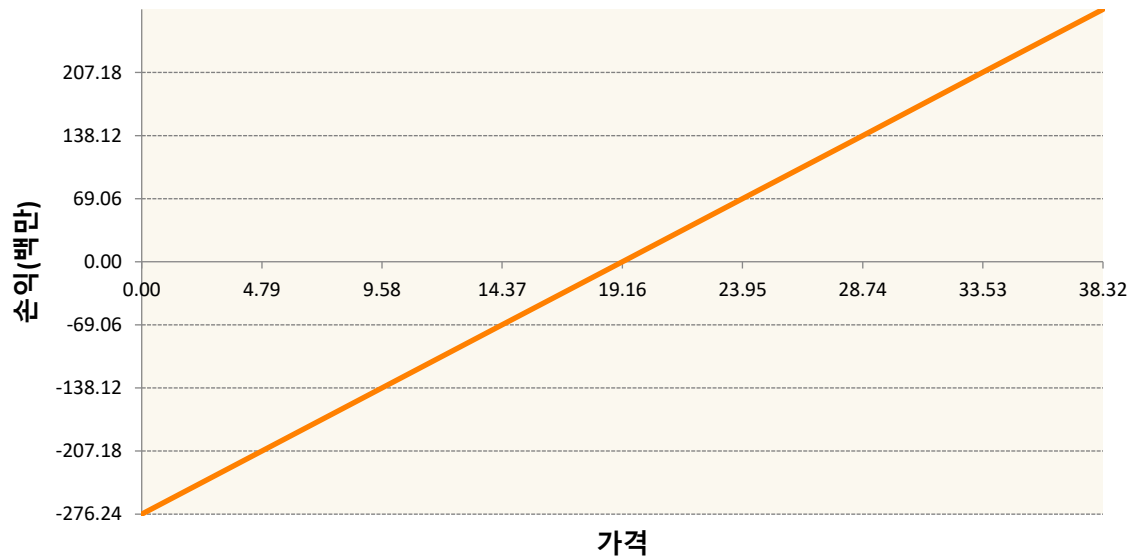
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



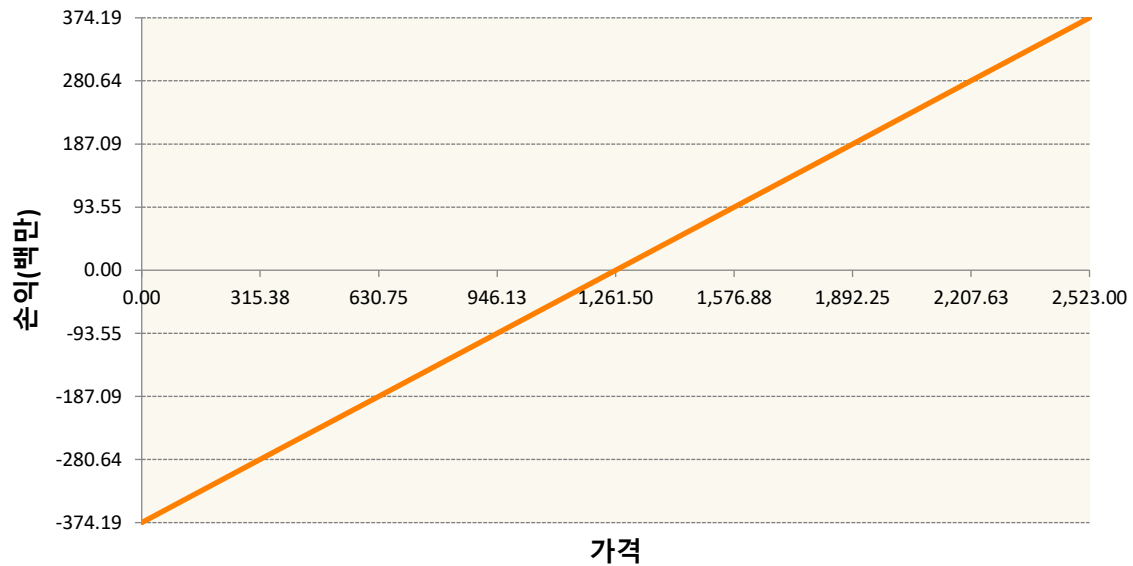
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



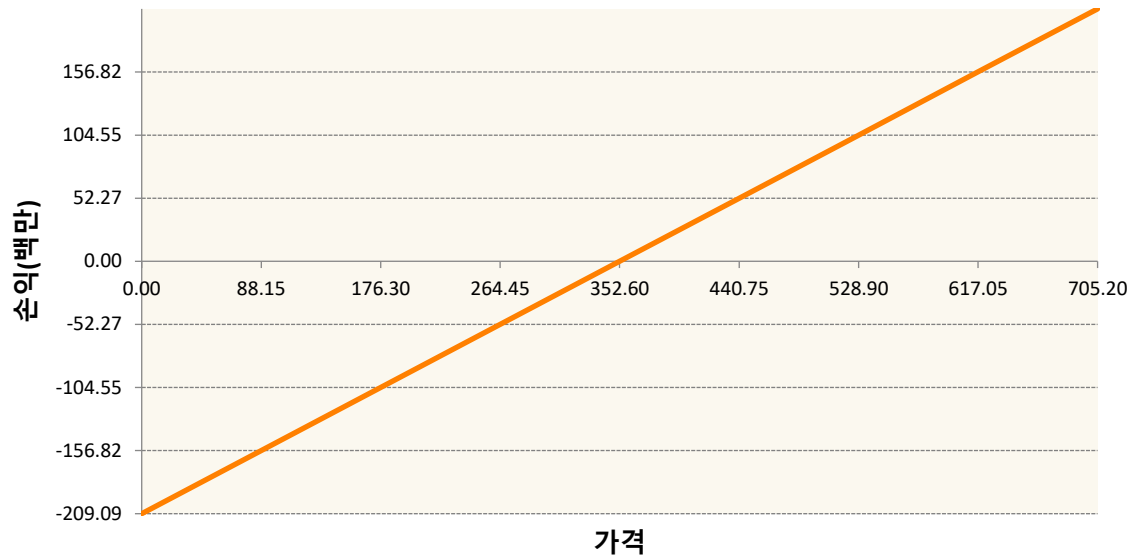
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



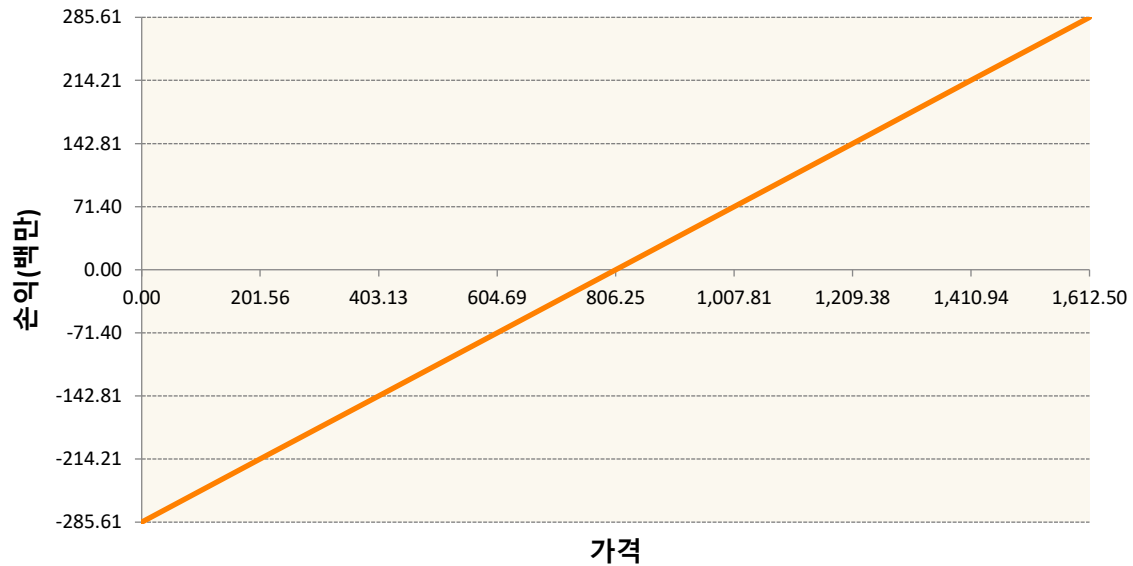
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



SMF2-SOYBEAN MEAL FUTR Jan22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22	23
CH2	CORN FUTURE Mar22	39
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22	10
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22	35
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

