

공시일 2021-12-13

기준일 2021-12-10

포커스농산물모(채권-파생형)

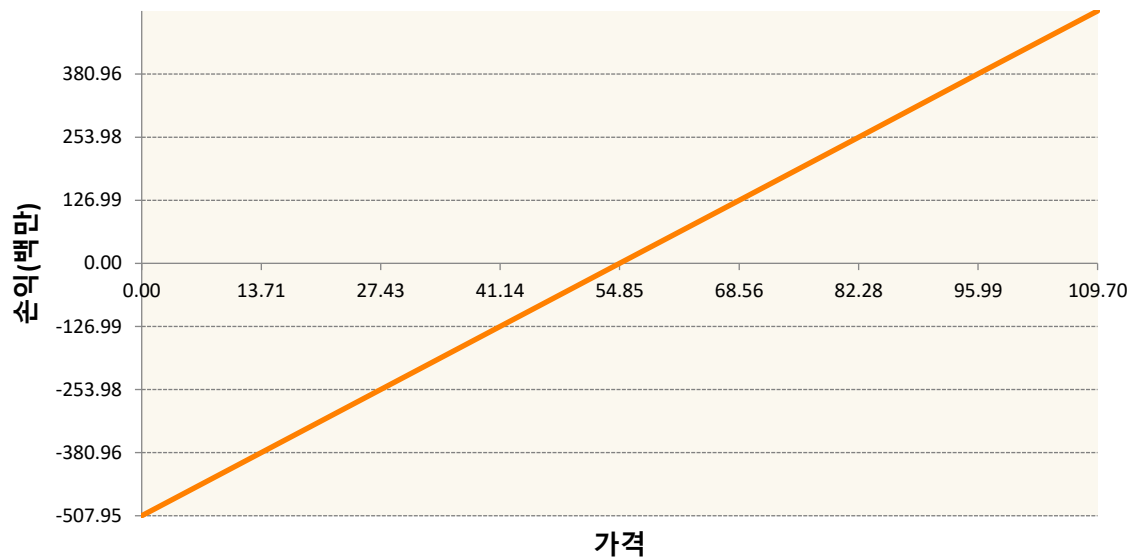
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

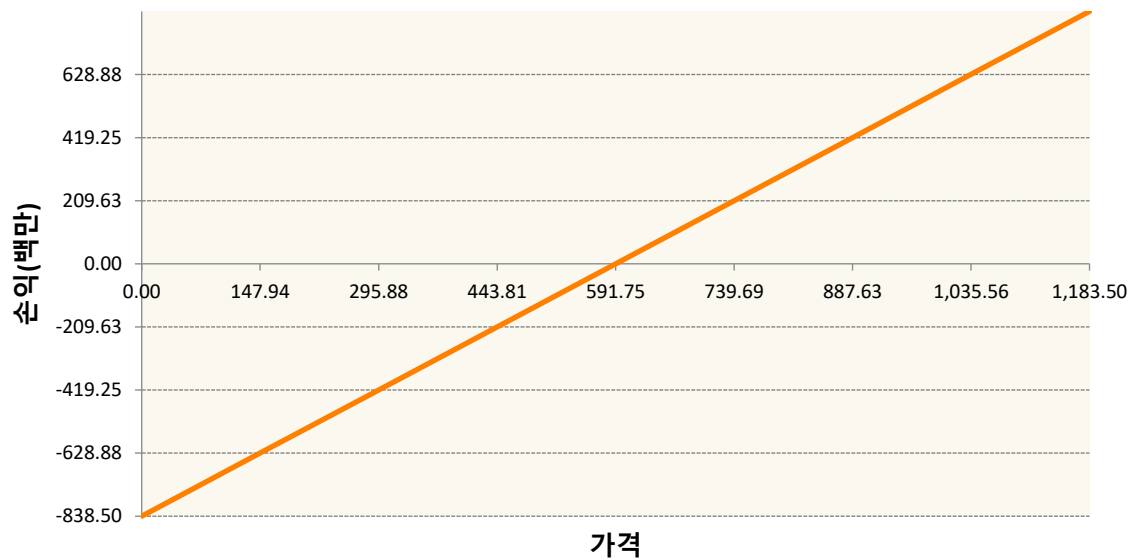
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,527	531	3,995	

2. 만기시점의 손익구조

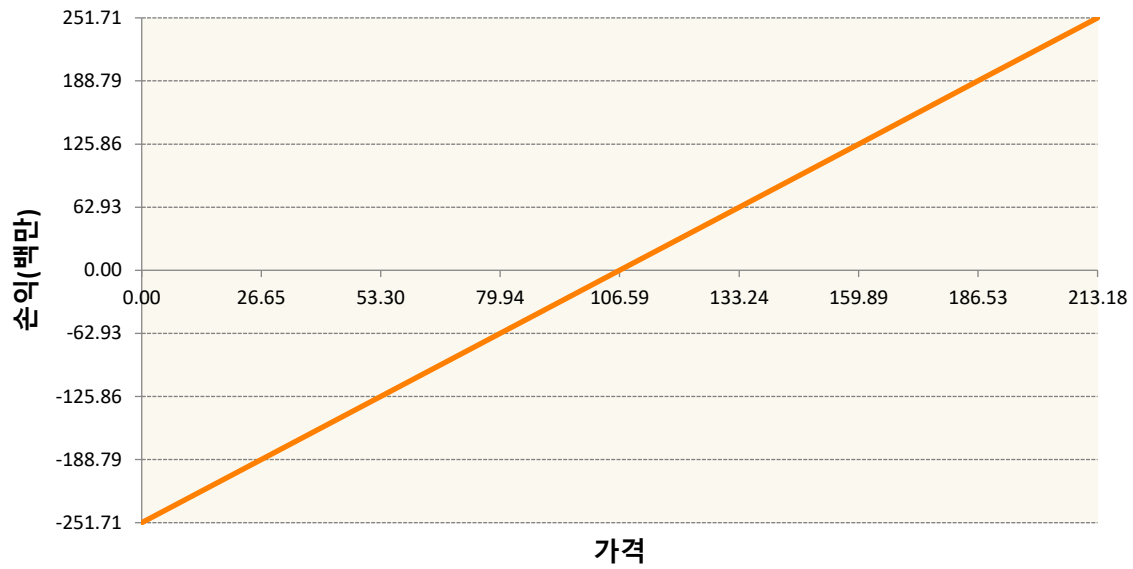
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



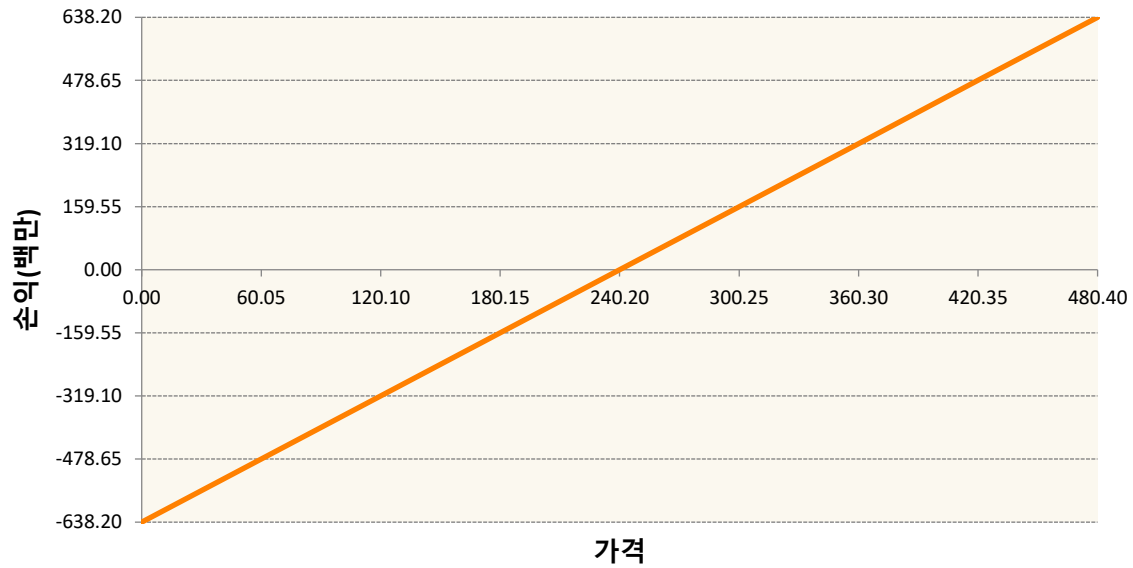
CH2-CORN FUTURE Mar22



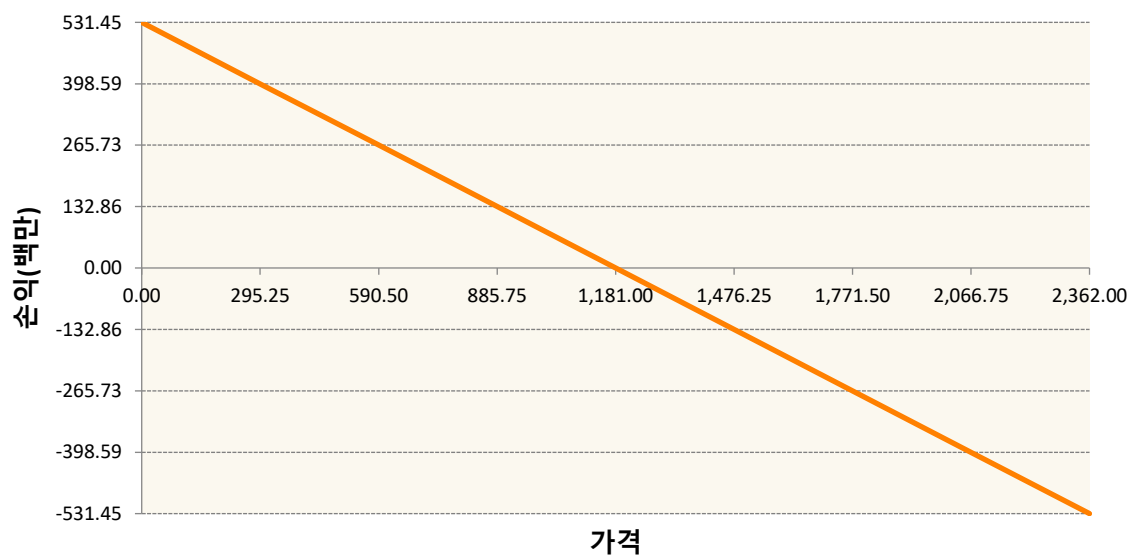
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



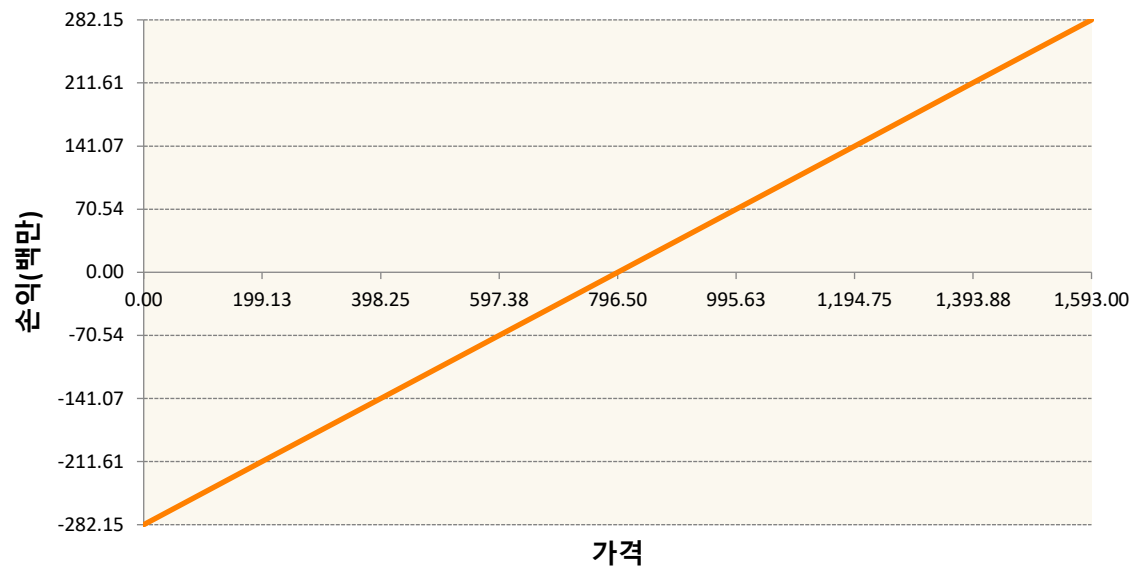
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



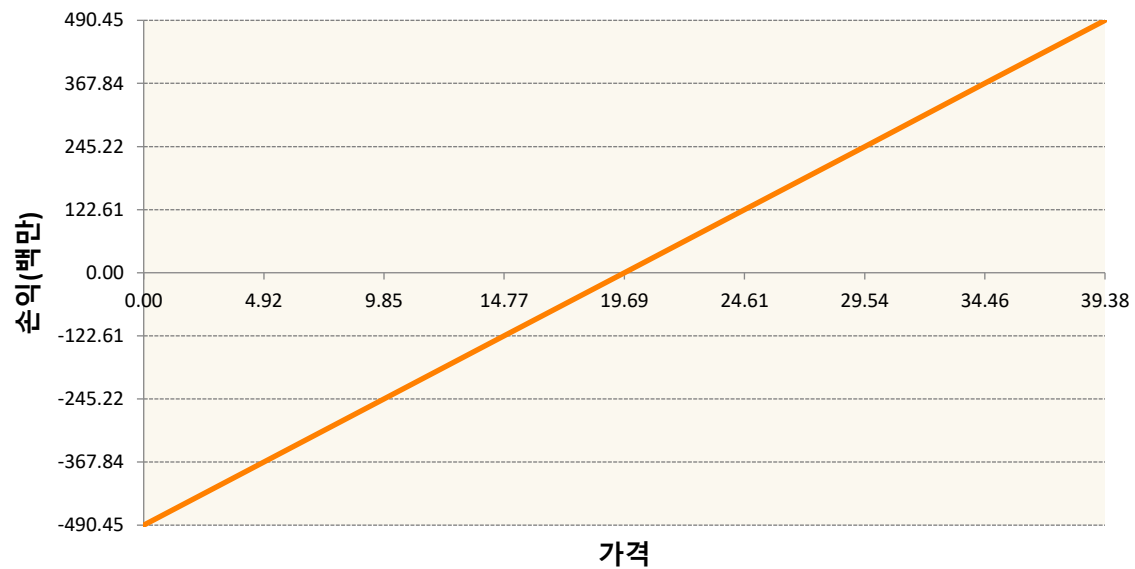
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



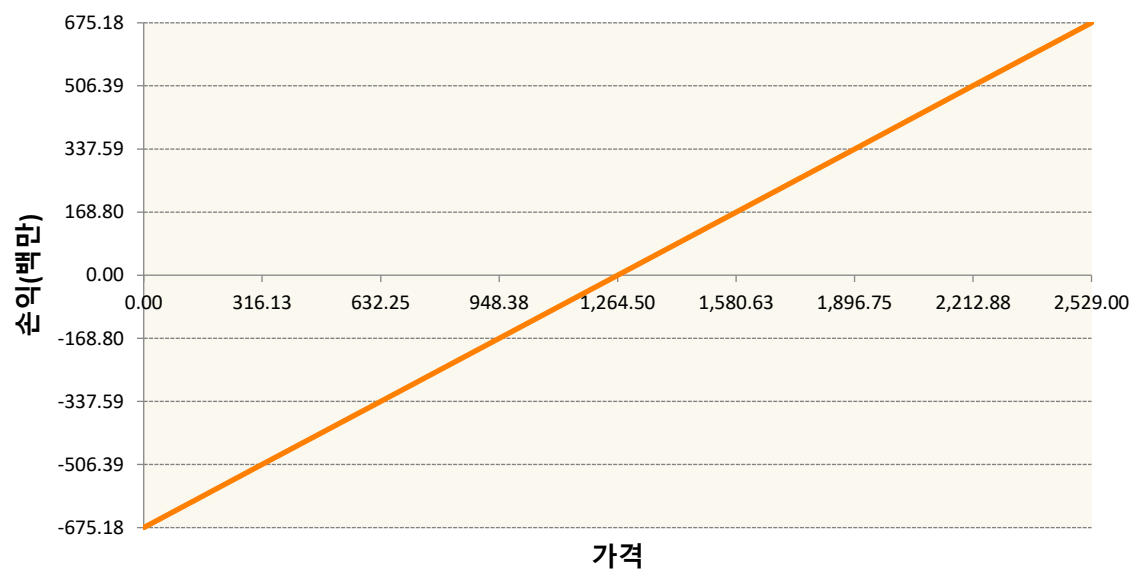
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



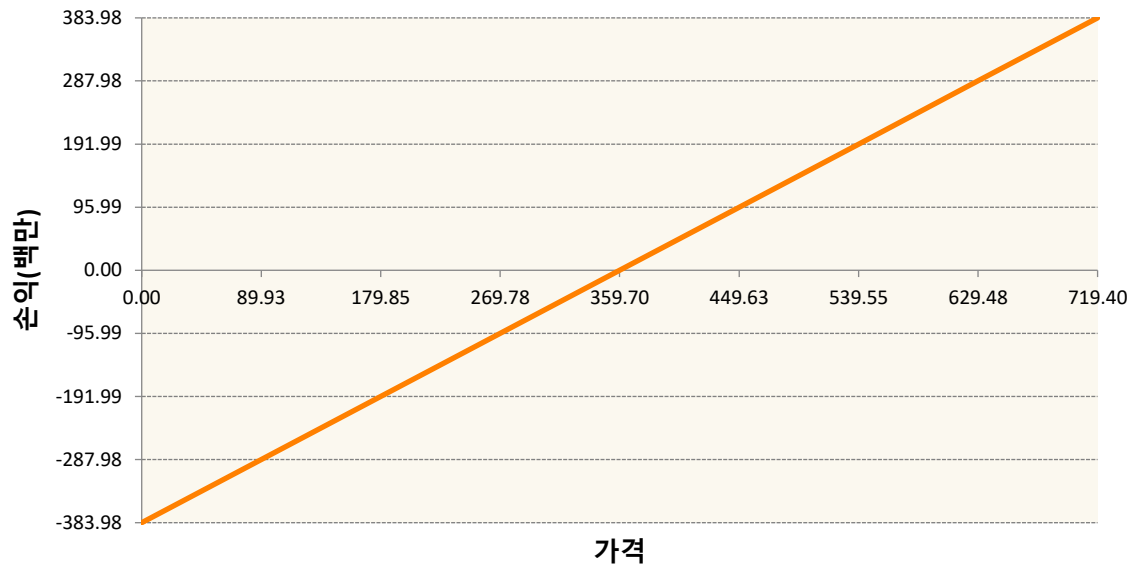
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



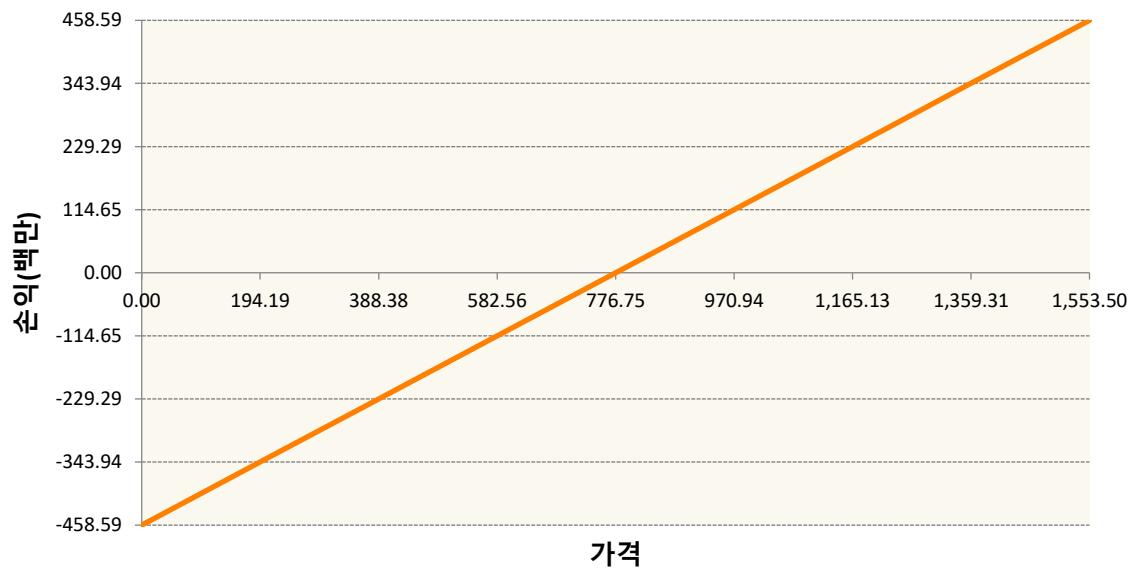
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	2021-12-13
기준일	2021-12-10

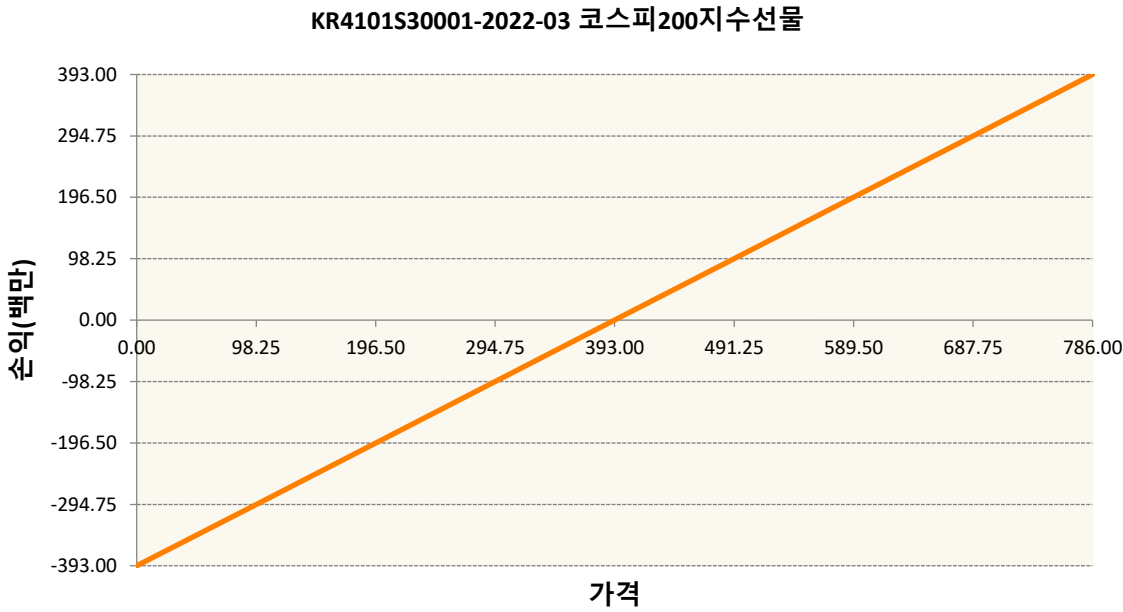
스마트인덱스모

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	393	0	393	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 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	2021-12-13
기준일	2021-12-10

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

911

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

545

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-13
기준일	2021-12-10

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

444

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

432

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-13
기준일	2021-12-10

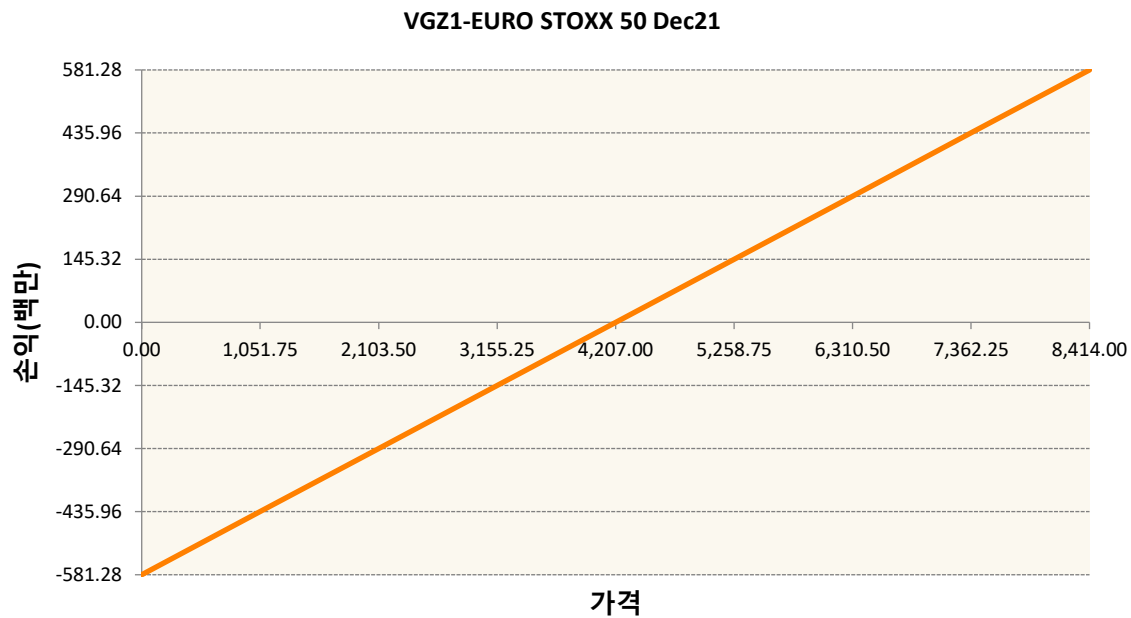
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	581	0	581	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ1	EURO STOXX 50 Dec21	47
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2021-12-13
기준일	2021-12-10

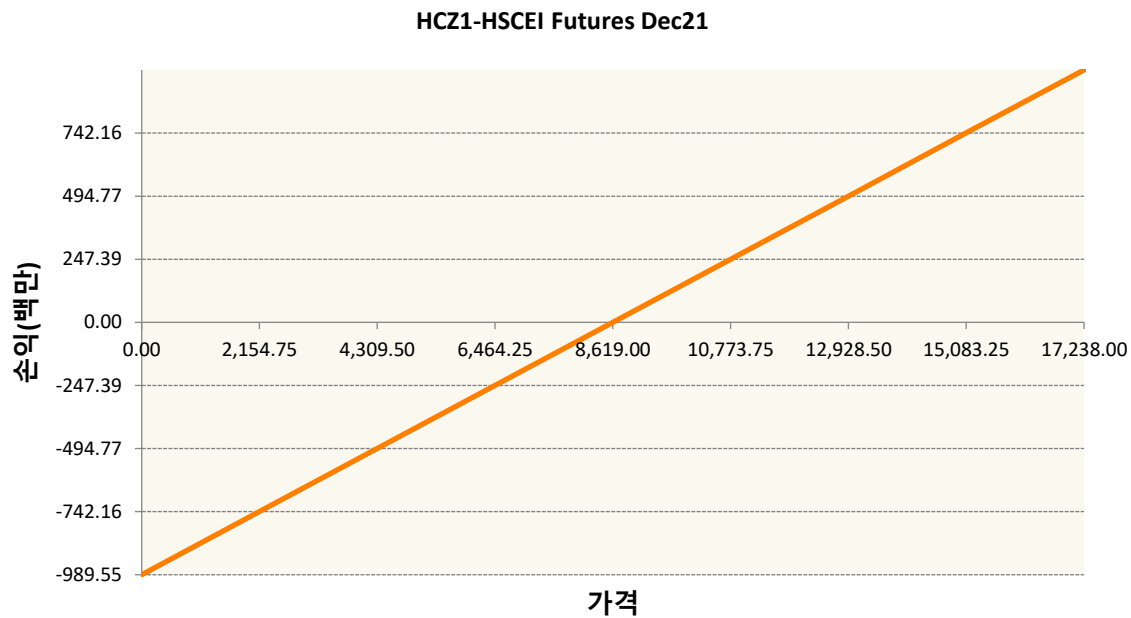
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	990	0	990	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	79
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일 2021-12-13

기준일 2021-12-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

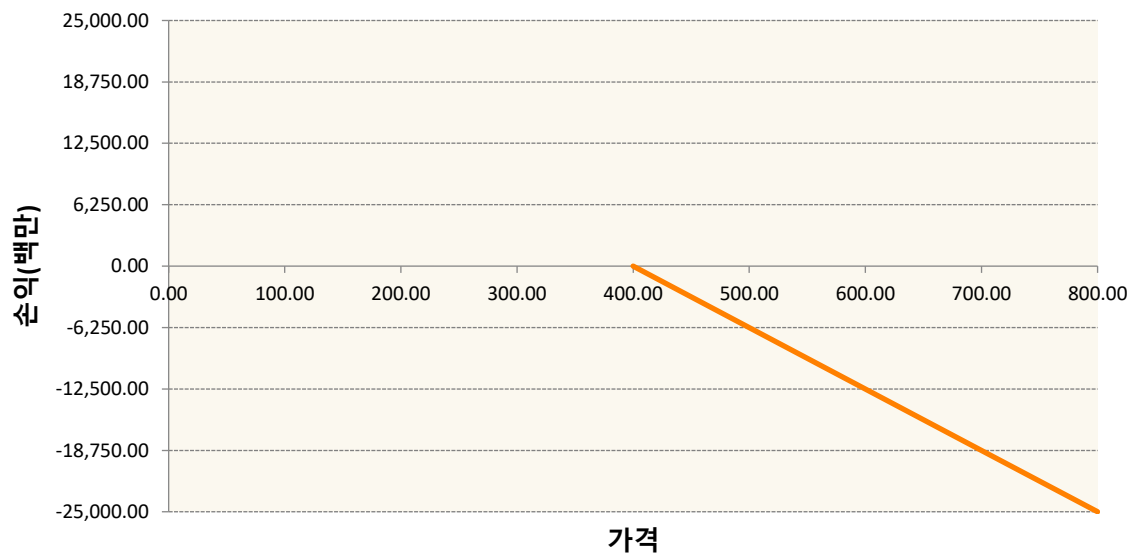
1. 계약금액

(단위:백만원)

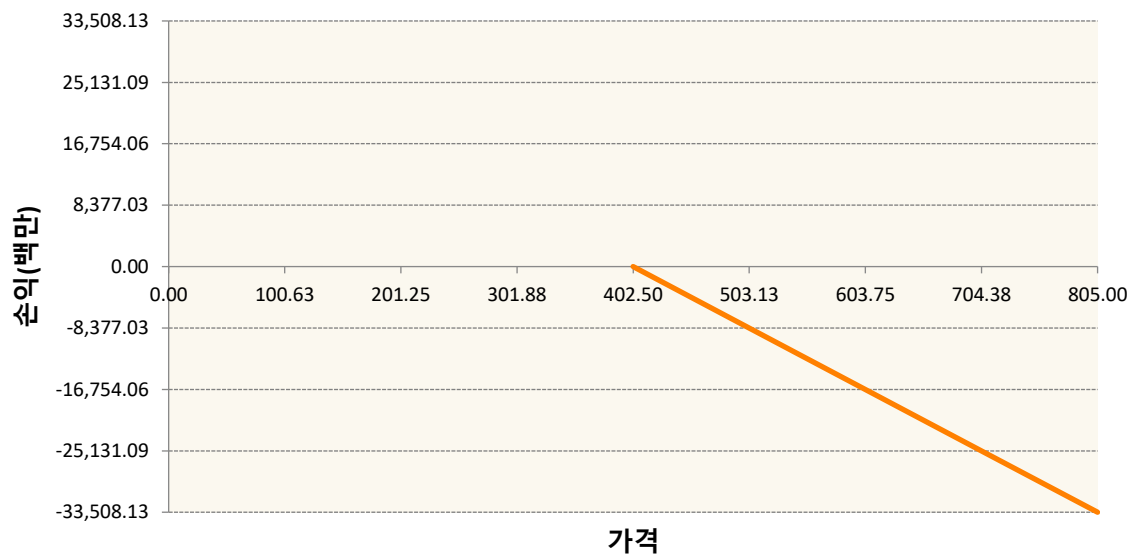
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	53,849	-53,849	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201S14003-2022-01 콜400



KR4201S14029-2022-01 콜402.5



The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 800.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), ranges from -17,500.00 to 17,500.00. A solid orange line represents the net income function, starting at a price of 0 with a net income of -17,500 and reaching a net income of 0 at a price of 400.

가격 (Price)	순이익 (Net Income in millions)
0.00	-17,500.00
100.00	-13,125.00
200.00	-8,750.00
300.00	-4,375.00
400.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis represents '가격' (Price) and the y-axis represents '순익 (백만원)' (Net Income in 100 million won). The line starts at a price of 0.00 with a net income of -2,012.50 and reaches a net income of 0.00 at a price of 402.50.

가격	순익 (백만원)
0.00	-2,012.50
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003							2022-01 콜400		1,479	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	695	669	639	605	568	527	484			
-5.33%	616	573	527	478	427	374	319			
-2.67%	460	401	341	280	218	155	92			
0%	203	135	68	0	-68	-135	-203			
2.67%	-167	-233	-299	-365	-432	-499	-566			
5.33%	-640	-694	-751	-810	-870	-931	-994			
8.00%	-1,193	-1,232	-1,275	-1,322	-1,372	-1,424	-1,479			
KR4201S14029							2022-01 콜402.5		1,909	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	847	817	782	740	694	643	588
-5.33%	758	706	649	588	523	455	385
-2.67%	577	503	426	347	266	185	102
0%	268	179	90	0	-90	-180	-269
2.67%	-190	-279	-369	-460	-550	-641	-732
5.33%	-789	-866	-946	-1,027	-1,111	-1,196	-1,281
8.00%	-1,502	-1,560	-1,622	-1,689	-1,760	-1,833	-1,909
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,118

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,077	-1,080	-1,084	-1,090	-1,098	-1,107	-1,118
-5.33%	-629	-639	-651	-665	-681	-699	-718
-2.67%	-224	-246	-269	-293	-318	-344	-370
0%	91	60	30	0	-30	-61	-91
2.67%	285	258	230	202	173	144	115
5.33%	377	360	341	321	299	276	252
8.00%	409	402	392	381	367	352	335

KR4301S14027 2022-01 풋402.5							132
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-129	-129	-130	-131	-132
-5.33%	-76	-77	-79	-80	-82	-83	-85
-2.67%	-29	-31	-33	-36	-38	-41	-44
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	36	32	29	26	22	19	15
5.33%	49	46	44	41	38	36	33
8.00%	53	52	51	49	48	46	43

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

(단위:백만원)

4,360

공시일 2021-12-13

기준일 2021-12-10

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

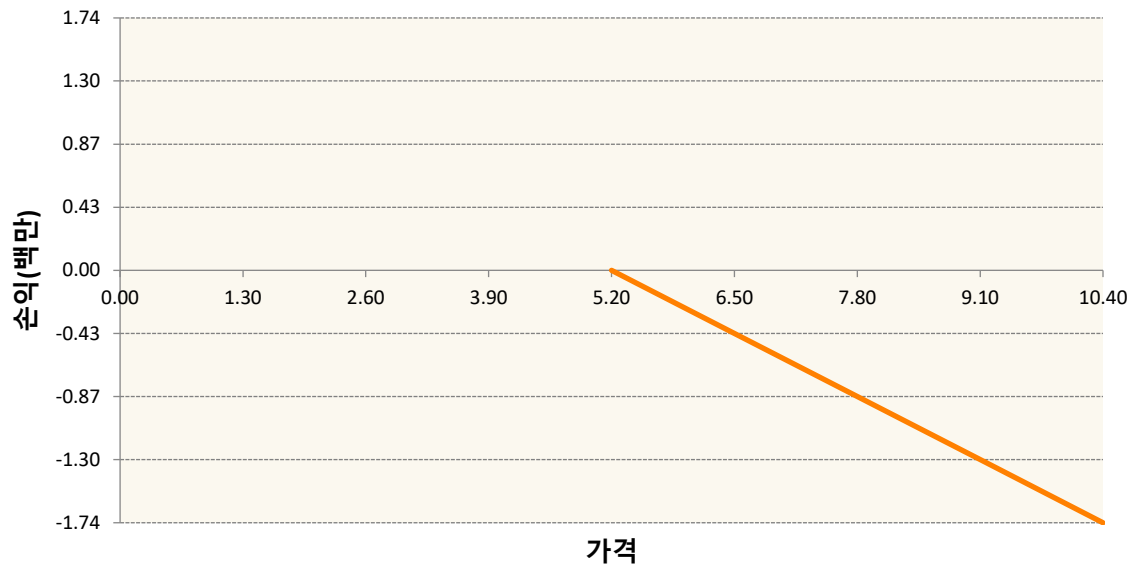
1. 계약금액

(단위:백만원)

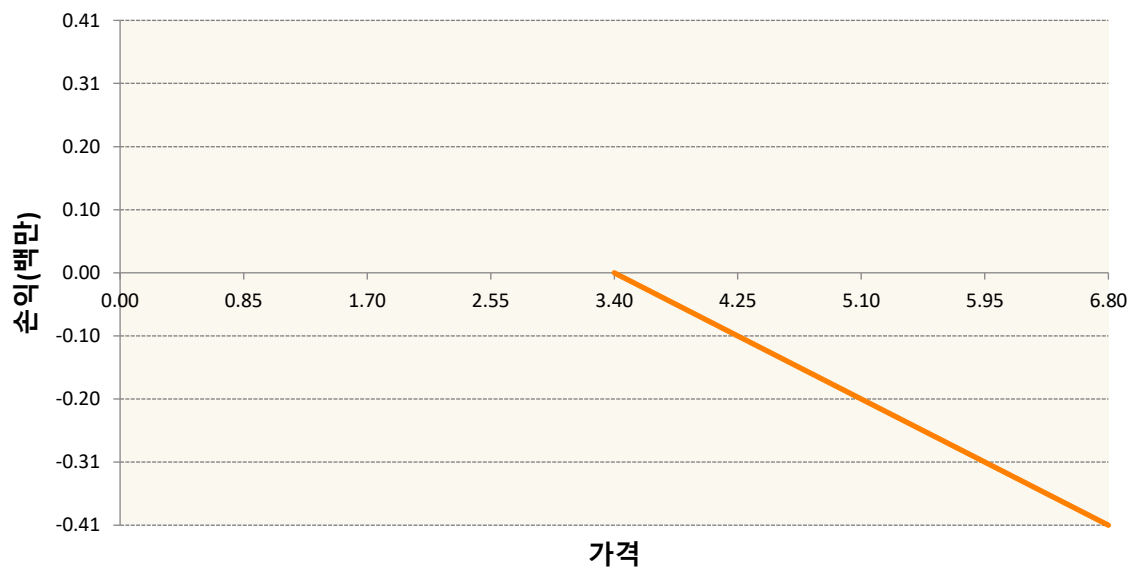
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	89	-89	장내

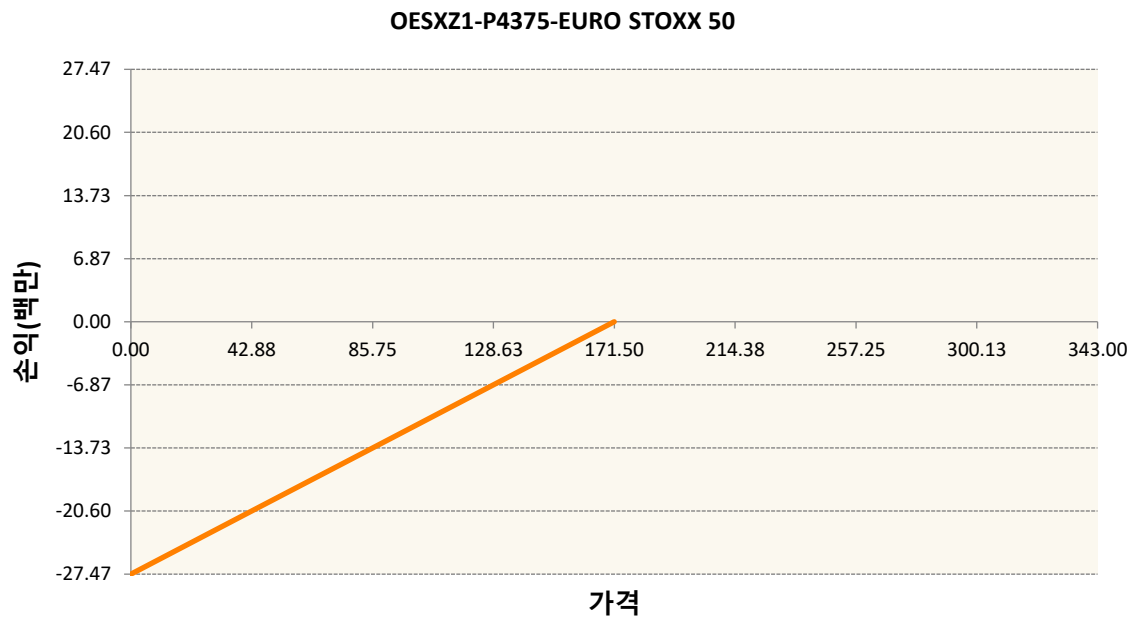
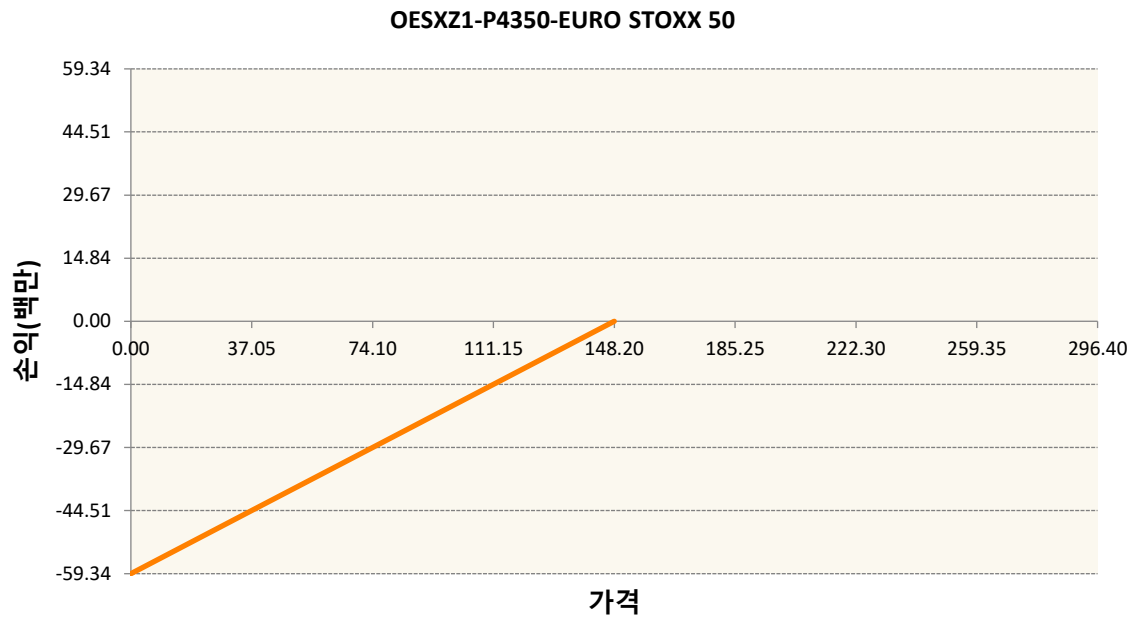
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		2
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.14
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.03
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		5
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		9

공시일 2021-12-13

기준일 2021-12-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

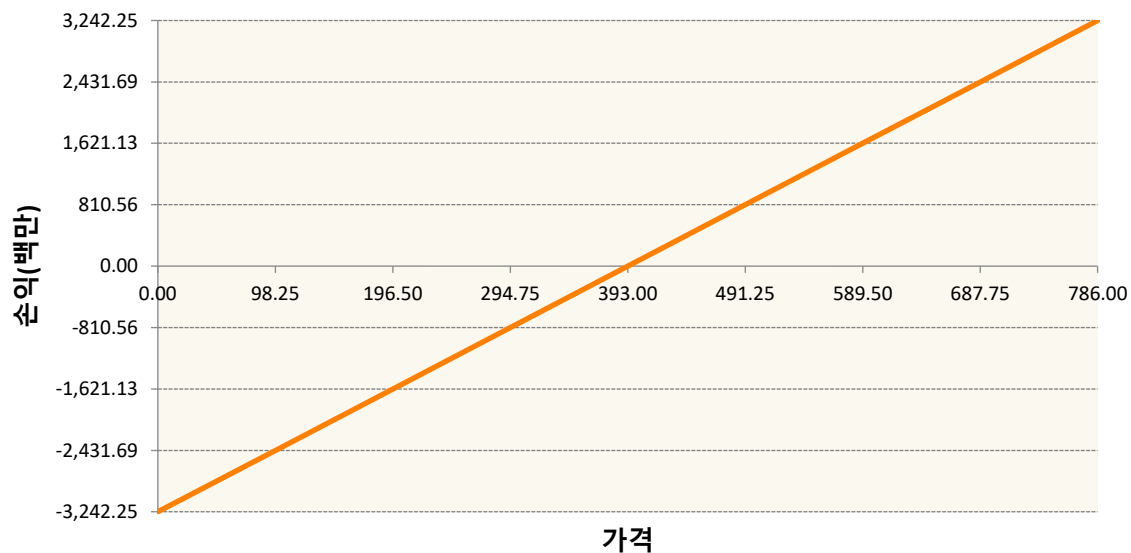
1. 계약금액

(단위:백만원)

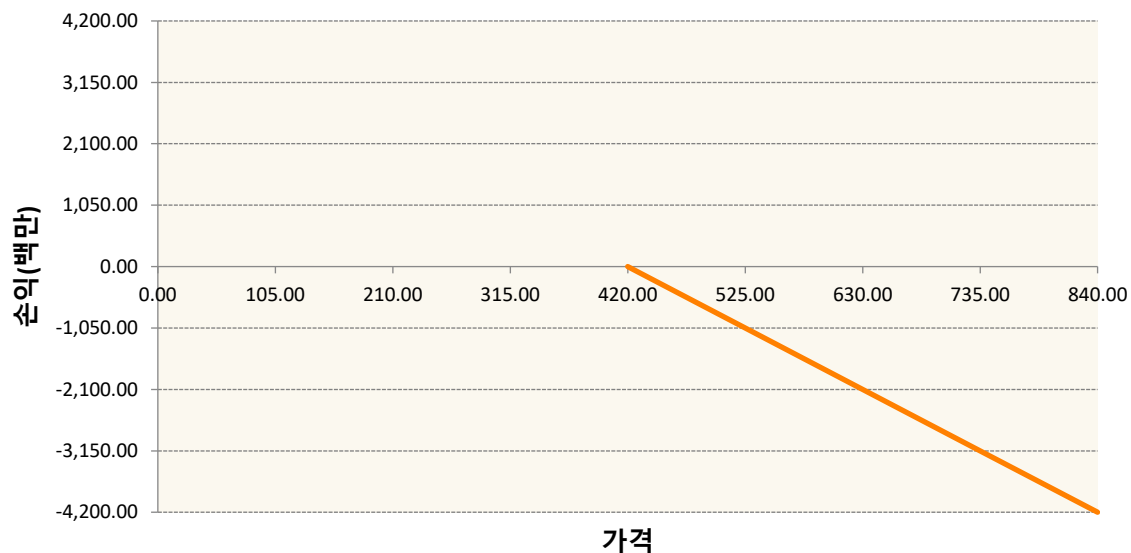
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	97	3,378	-3,281	장내
누계	유가증권	선물	3,242	0	3,242	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S14201-2022-01 콜420



가액	순이익(백만원)
425.00	0.00
850.00	-1,275.00

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 800.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from -200.00 to 200.00. A blue line starts at (0, 200) and ends at (400, 0), showing that profit is zero at a price of 400.00.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	200.00
100.00	150.00
200.00	100.00
300.00	50.00
400.00	0.00

(단위:백만원)

KR4101S30001				2022-03 코스피200지수선물				263
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263	
-5.33%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175	
-2.67%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	88	88	88	88	88	88	88	
5.33%	175	175	175	175	175	175	175	
8.00%	263	263	263	263	263	263	263	
KR4201S14201				2022-01 콜420				174
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	49	48	47	44	42	38	34
-5.33%	47	44	41	37	32	27	21
-2.67%	40	35	29	23	16	9	1
0%	25	17	9	0	-9	-18	-28
2.67%	-3	-13	-24	-34	-45	-55	-66
5.33%	-47	-58	-69	-81	-92	-104	-115
8.00%	-107	-118	-129	-140	-152	-163	-174

KR4201S14250

2022-01 콜425

47

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	11	11	11	10	9	8
-5.33%	11	11	10	9	8	6	5
-2.67%	10	9	7	6	4	2	0
0%	7	5	2	0	-2	-5	-8
2.67%	0	-3	-6	-9	-12	-15	-18
5.33%	-11	-14	-17	-21	-24	-28	-31
8.00%	-27	-30	-34	-37	-40	-44	-47

KR4301S14001

2022-01 풋400

13

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	13	13	13
-5.33%	7	7	7	8	8	8	8
-2.67%	3	3	3	3	4	4	4
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-1
5.33%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

449

공시일	2021-12-13
기준일	2021-12-10

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	17,958	0	17,958	

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	2021-12-13
기준일	2021-12-10

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	9,676	0	9,676	

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	2021-12-13
기준일	2021-12-10

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	45,701	0	45,701	
누계	통화	선도	1,418	0	1,418	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 2021-12-13

기준일 2021-12-10

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

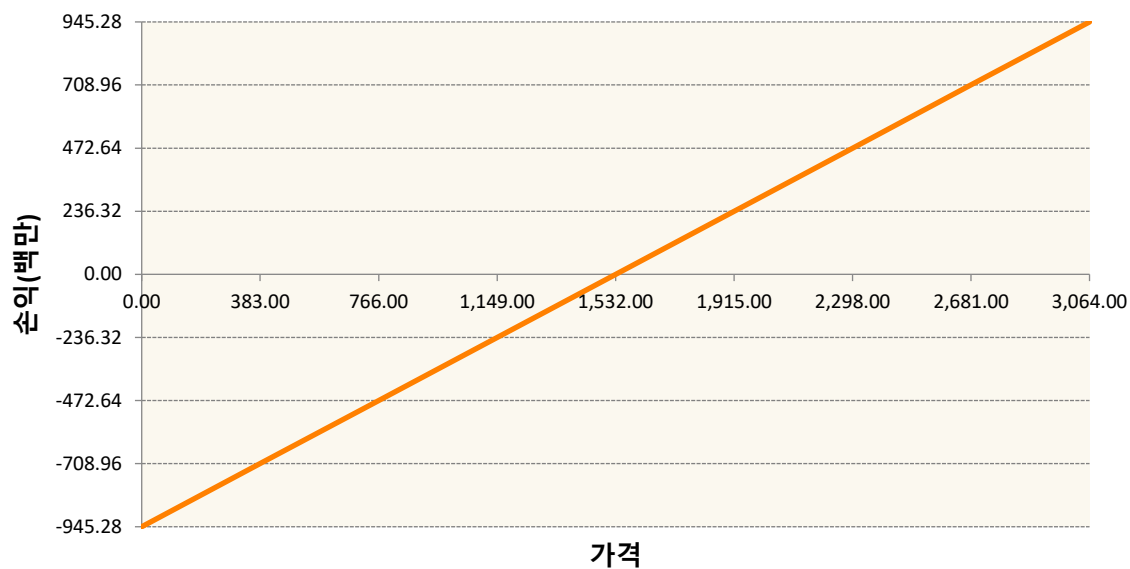
1. 계약금액

(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	945	0	945	
누계	유가증권	스왑	1,782	0	1,782	장외
누계	통화	선도	0	574	-574	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCZ1-VN30 Index Future Dec21



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	76

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

(단위:백만원)

256

공시일 2021-12-13

기준일 2021-12-10

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

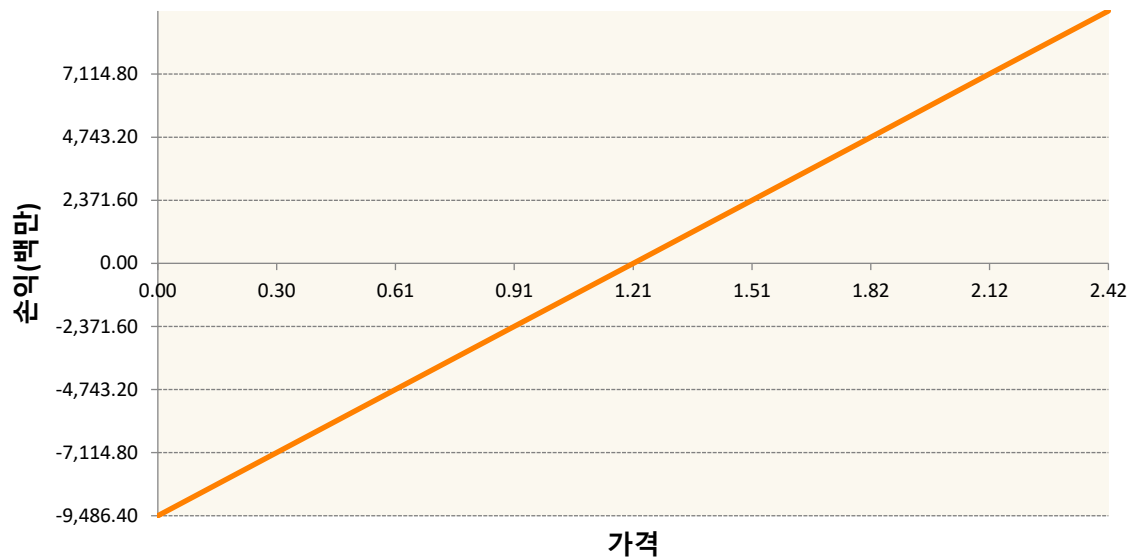
1. 계약금액

(단위:백만원)

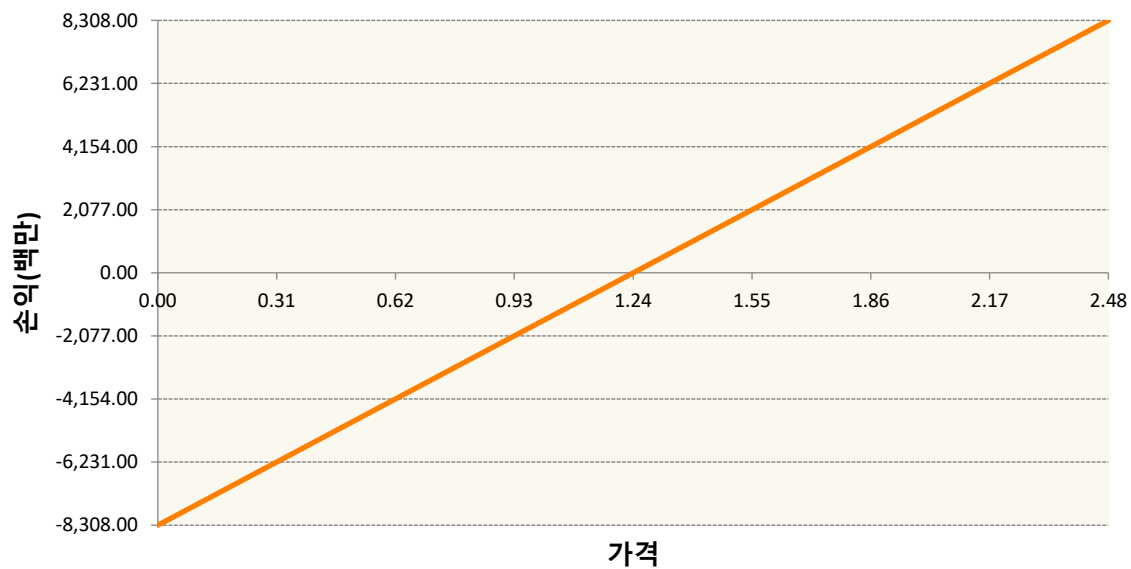
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,530	0	2,530	
누계	유가증권	선물	28,510	0	28,510	

2. 만기시점의 손익구조

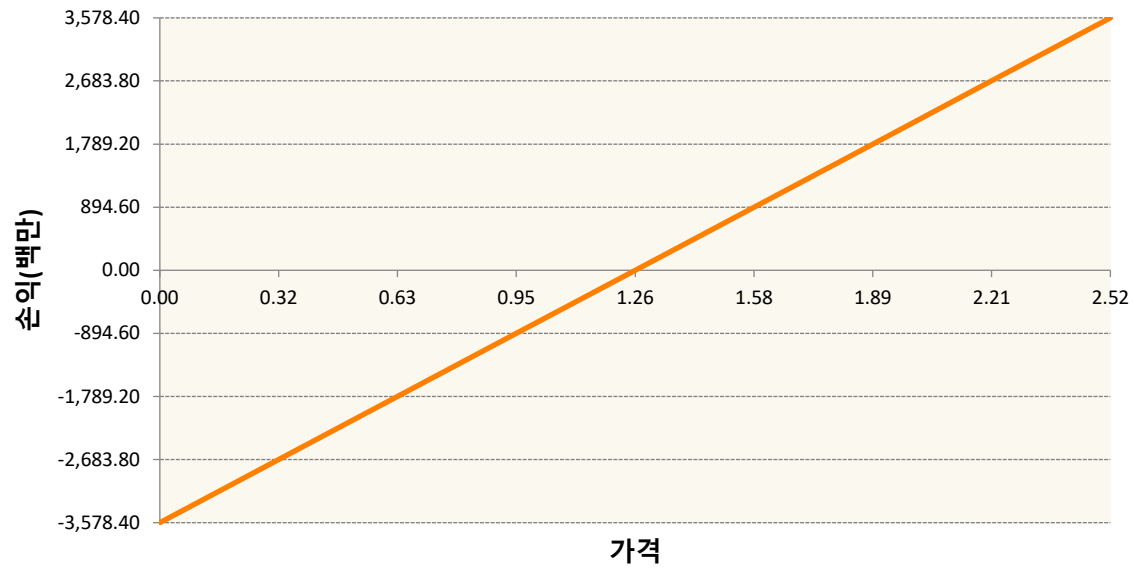
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



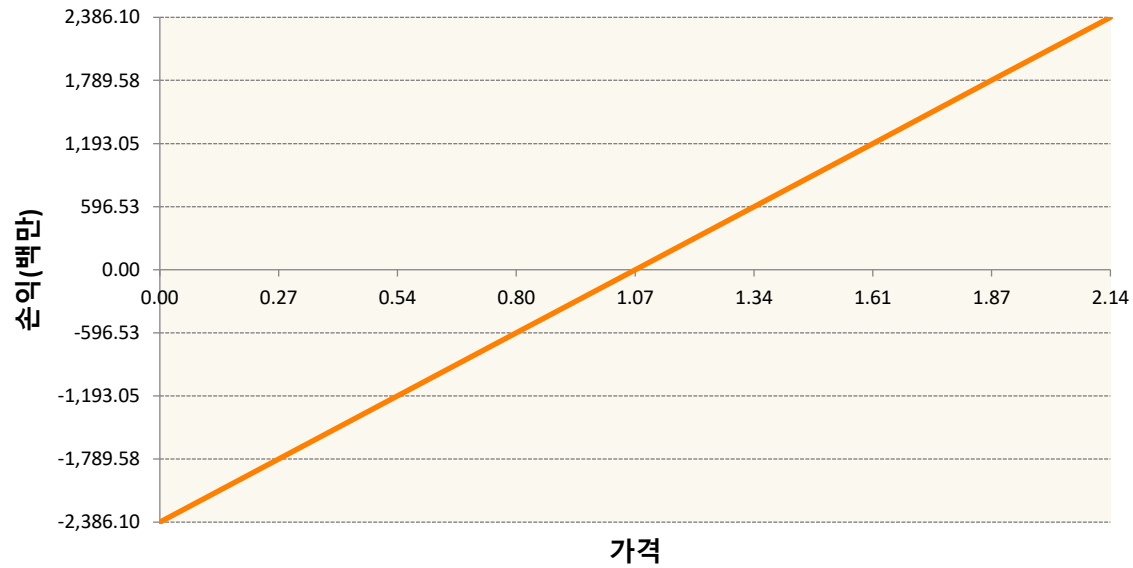
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



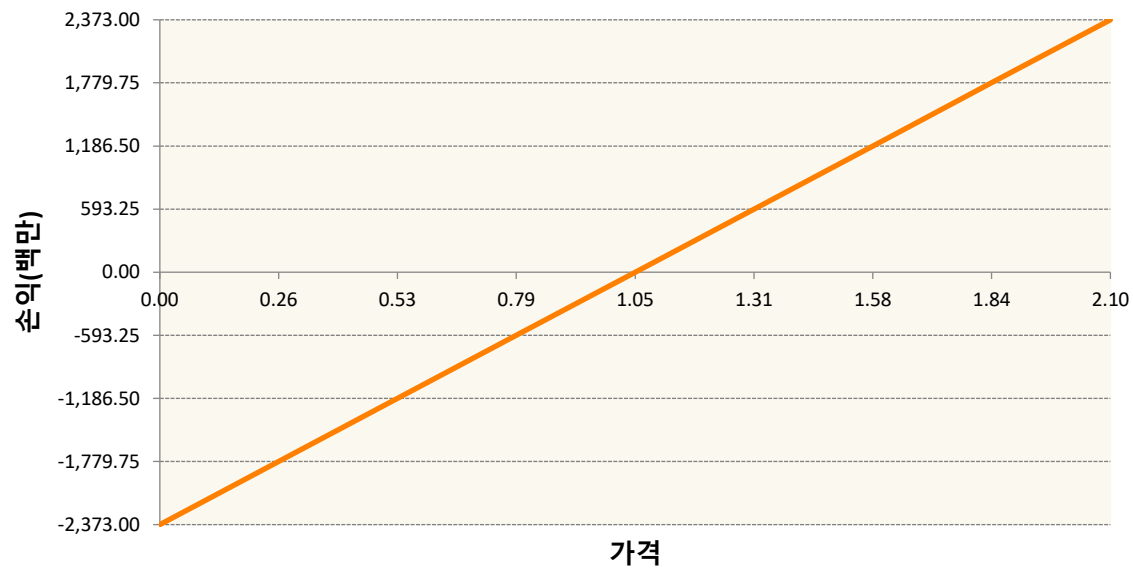
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)

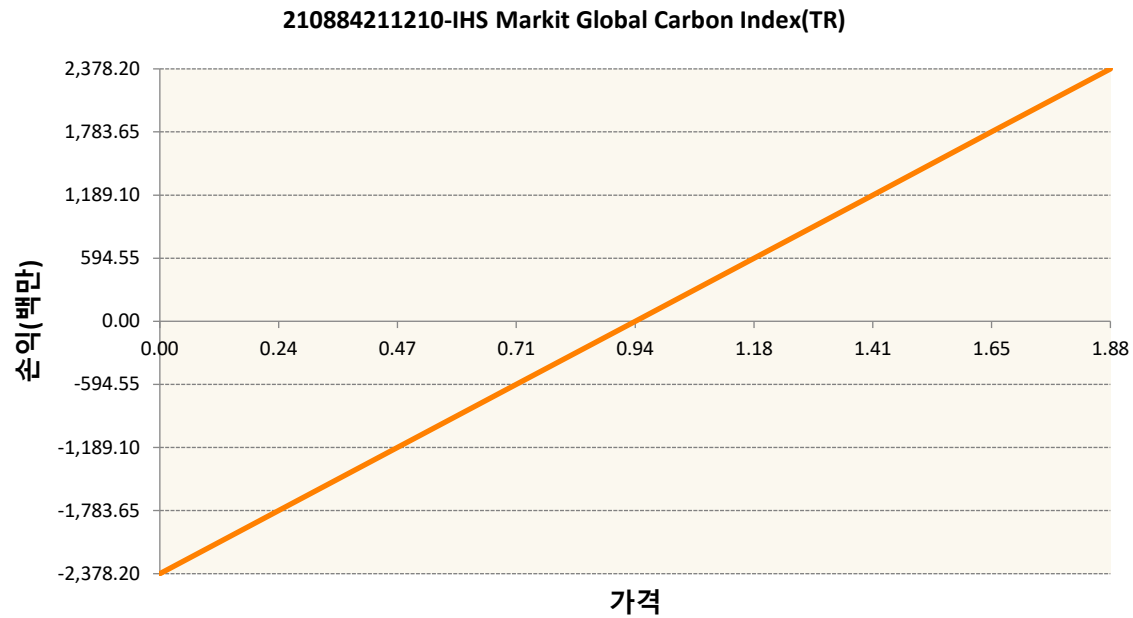


210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		762
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		663
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		286
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		190
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		190
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		190

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,496

공시일 2021-12-13

기준일 2021-12-10

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

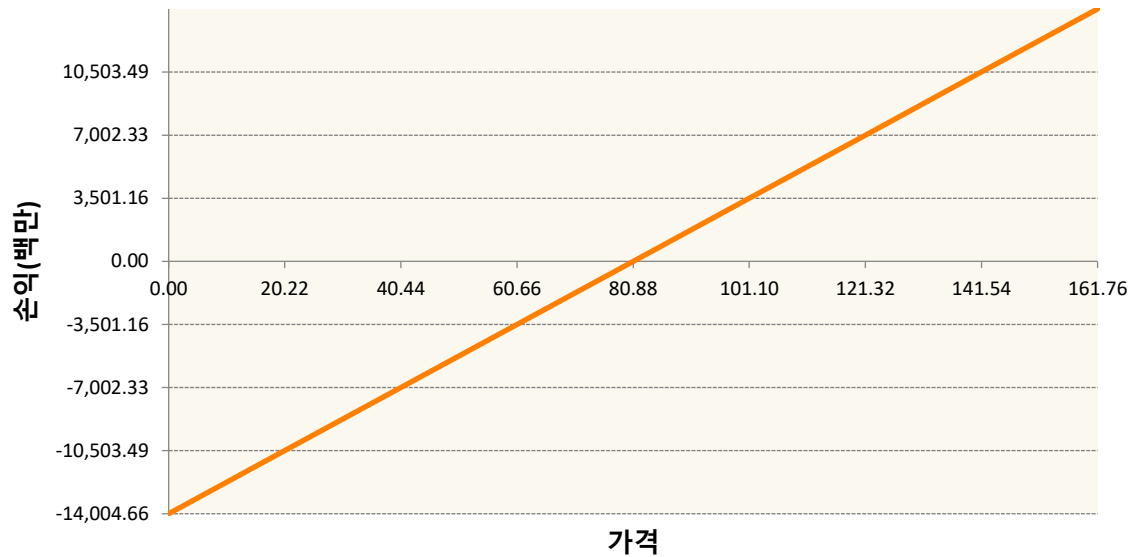
1. 계약금액

(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	14,005	0	14,005	
누계	통화	선도	0	6,699	-6,699	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX·KRW/EUR 28-12-21E	381
FXW213BCA·KRW/EUR 28-12-21E	155
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,120

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

(단위:백만원)

2,513

공시일 2021-12-13

기준일 2021-12-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

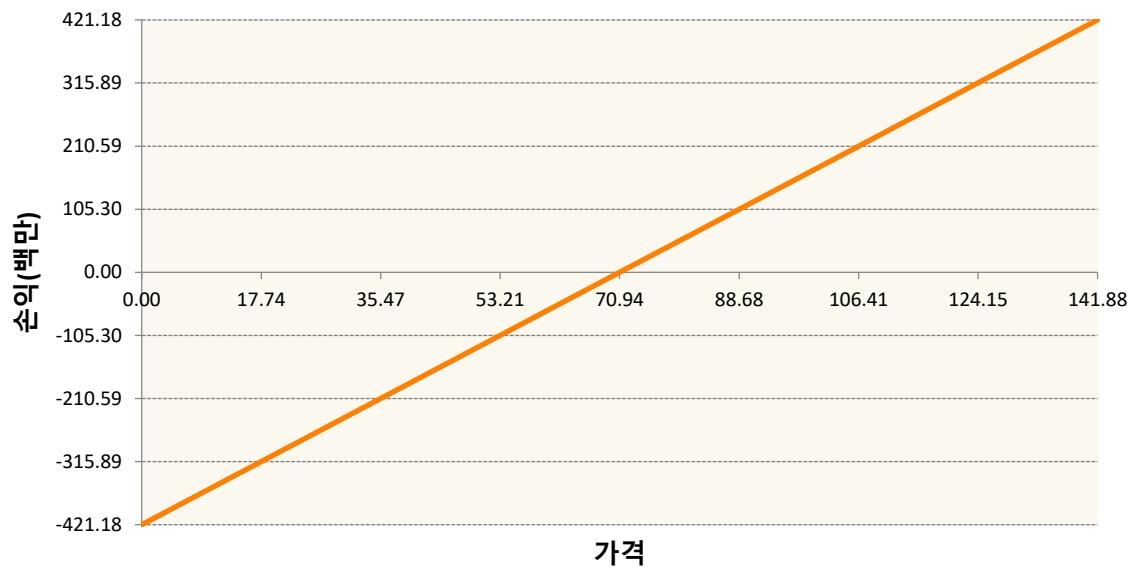
1. 계약금액

(단위:백만원)

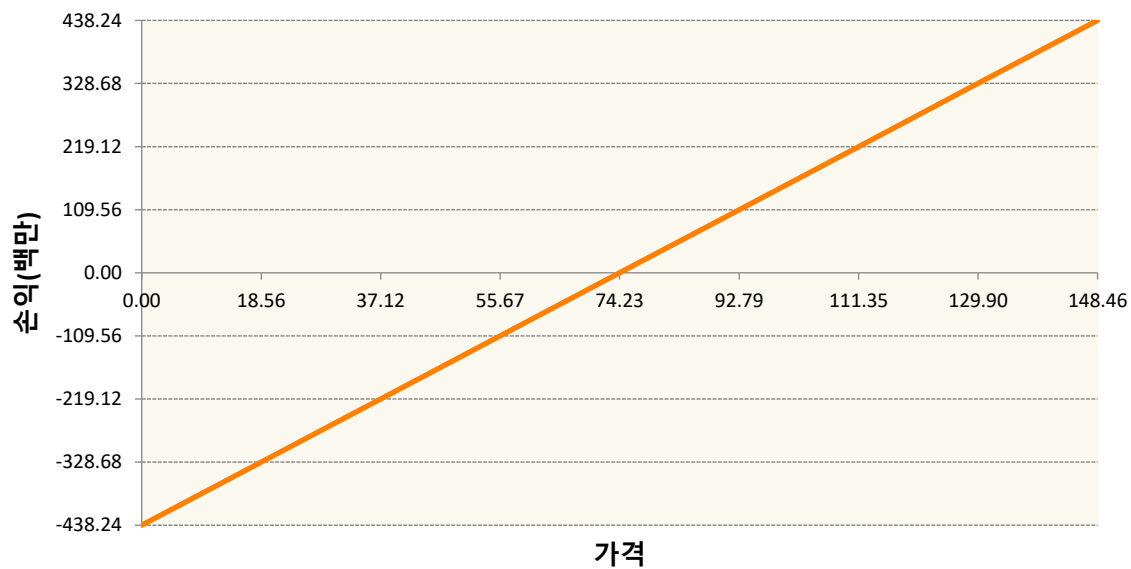
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,854	354	1,500	

2. 만기시점의 손익구조

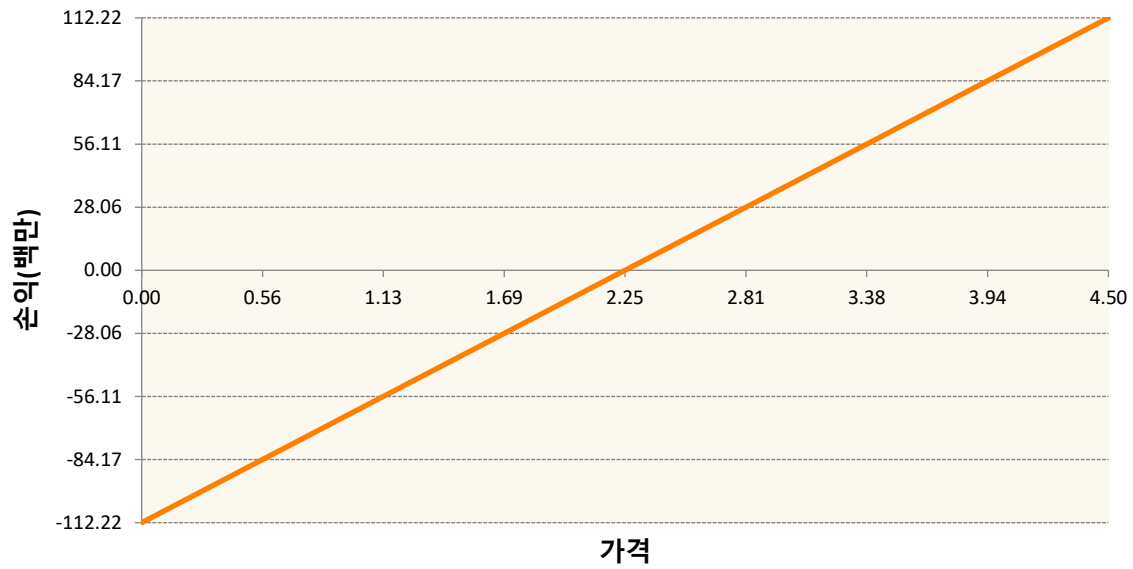
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



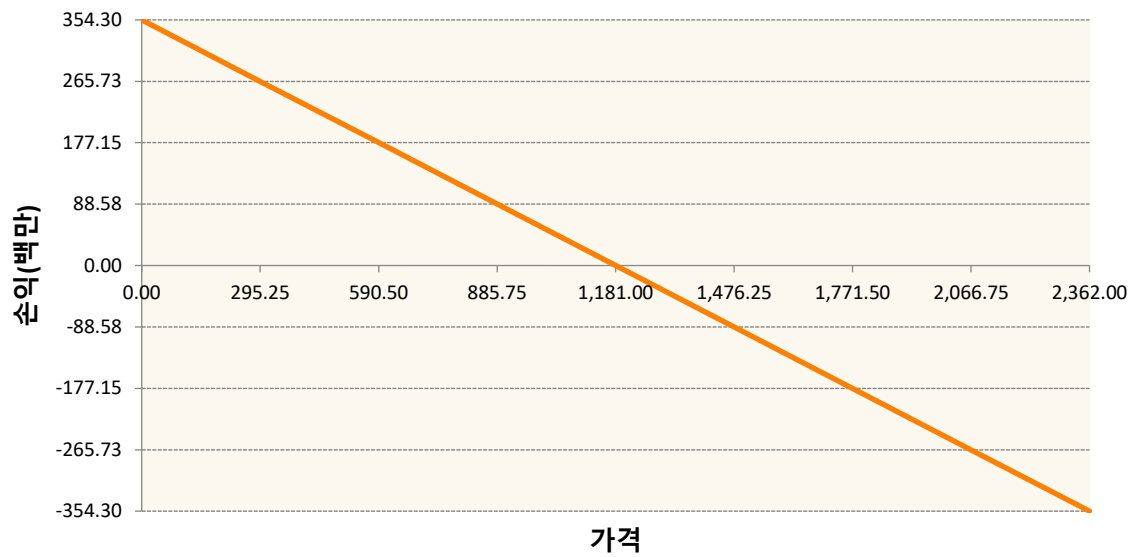
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



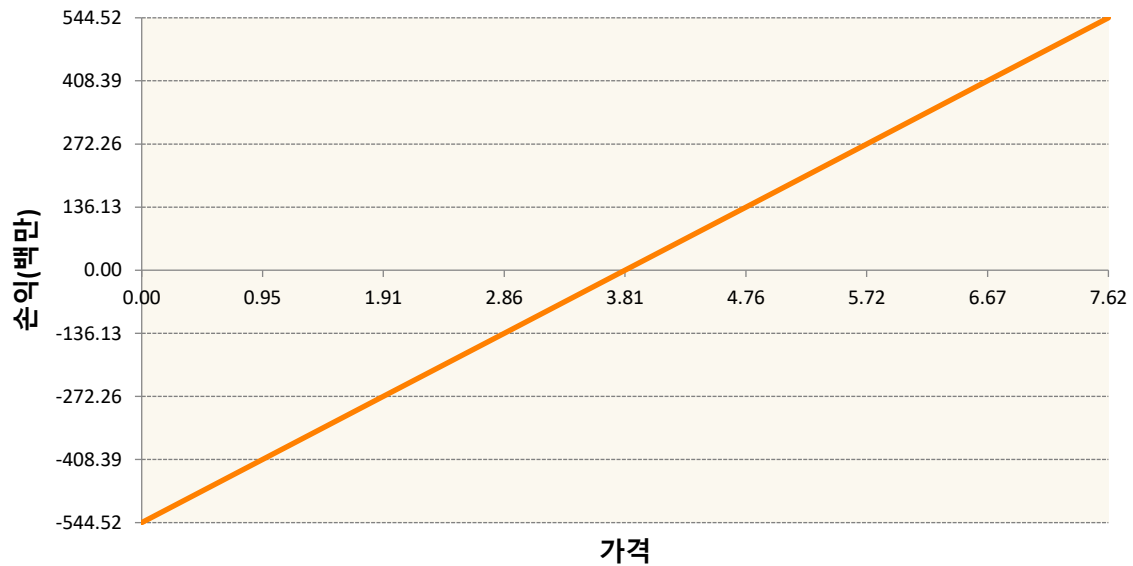
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22



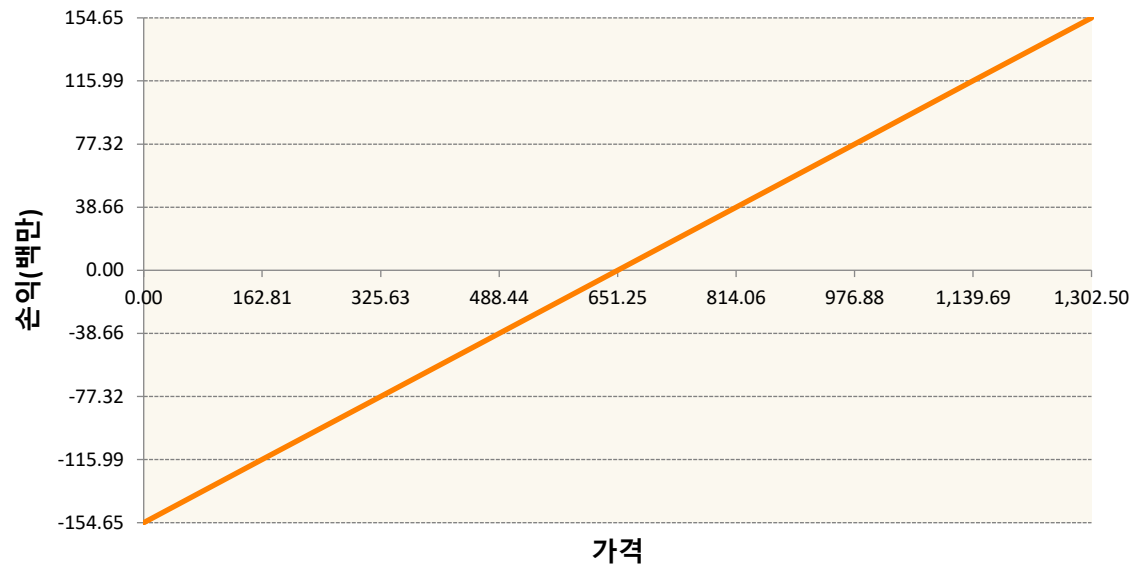
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



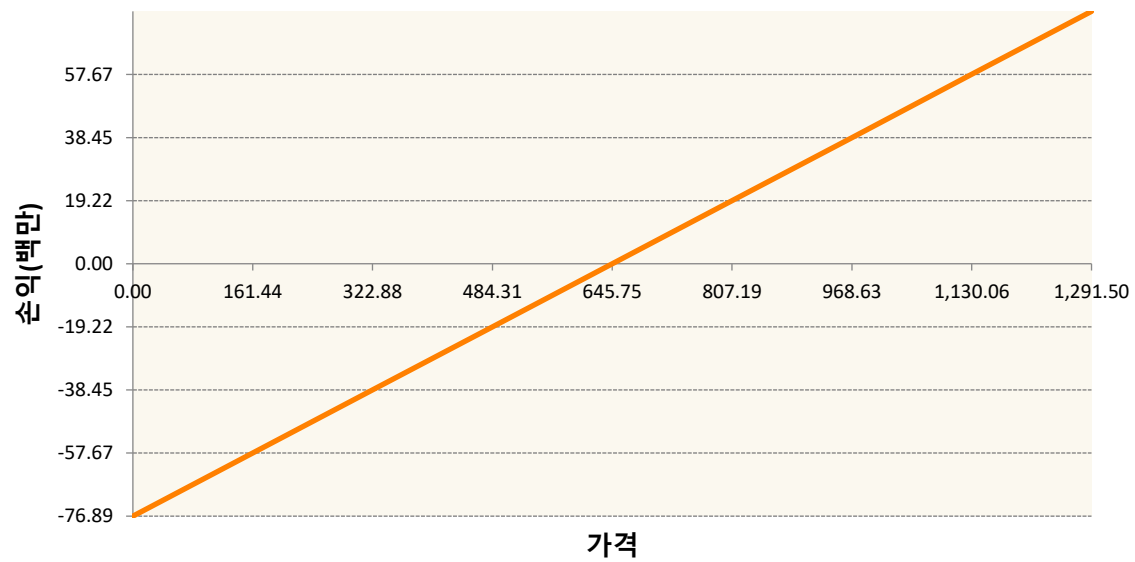
NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22



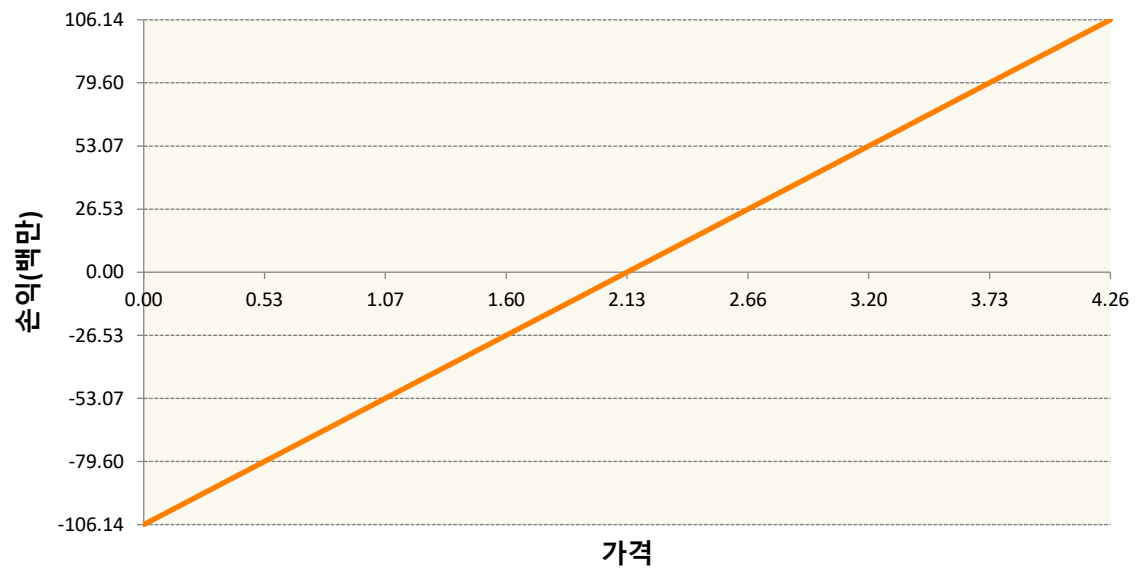
QSF2-Low Su Gasoil G Jan22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBF2-GASOLINE RBOB FUT Jan22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF2	WTI CRUDE FUTURE Jan22	34
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22	35
HOF2	NY Harb ULSD Fut Jan22	9
KR4175RC00 2021-12 달러선물		28
NGF22	NATURAL GAS FUTR Jan22	44
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)

336

공시일 2021-12-13

기준일 2021-12-10

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

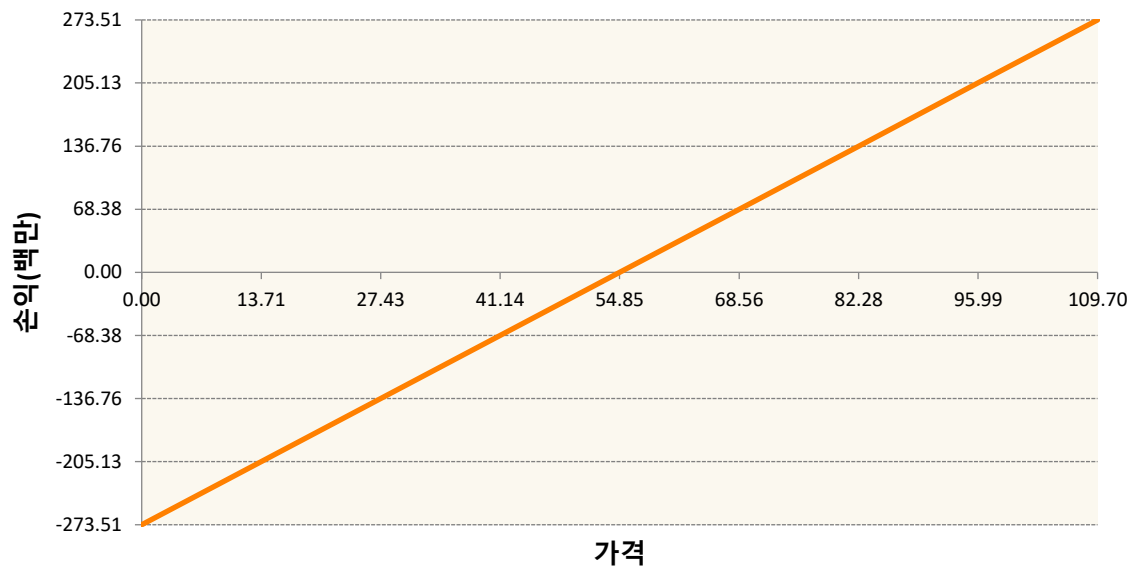
1. 계약금액

(단위:백만원)

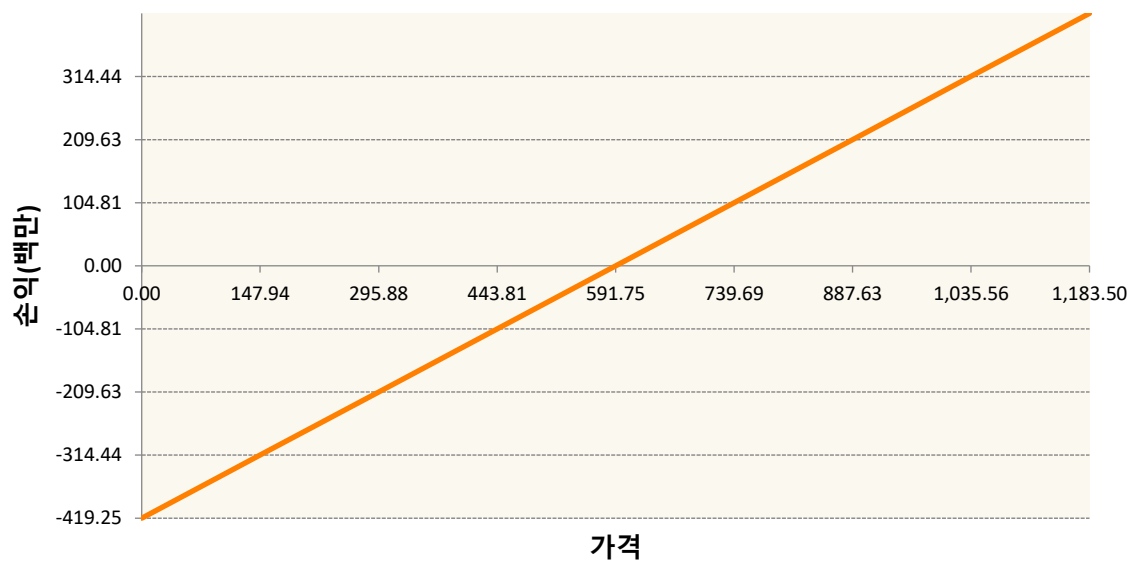
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,329	591	1,738	

2. 만기시점의 손익구조

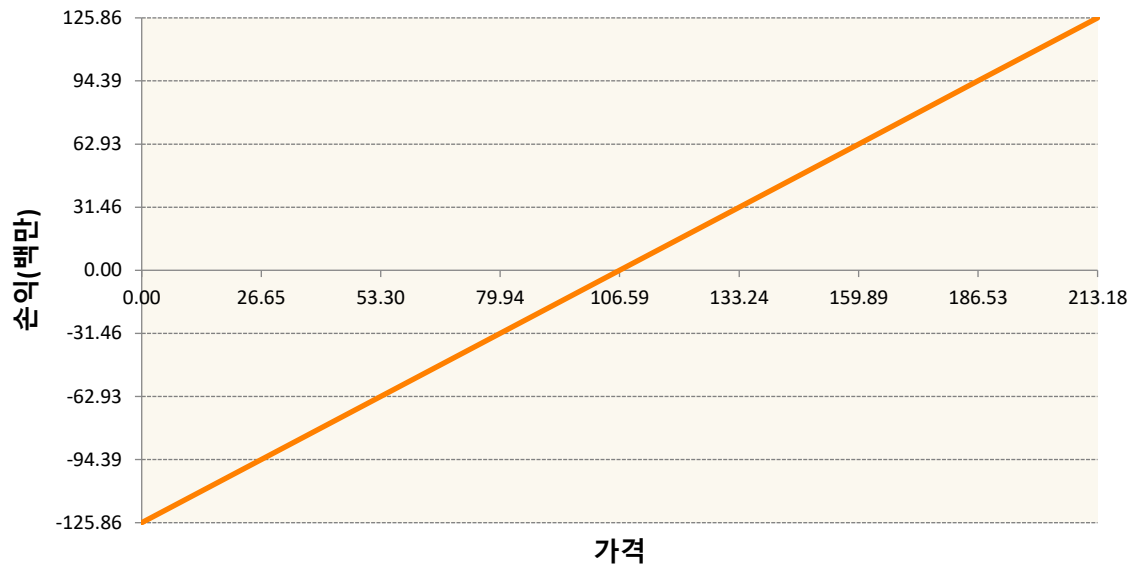
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



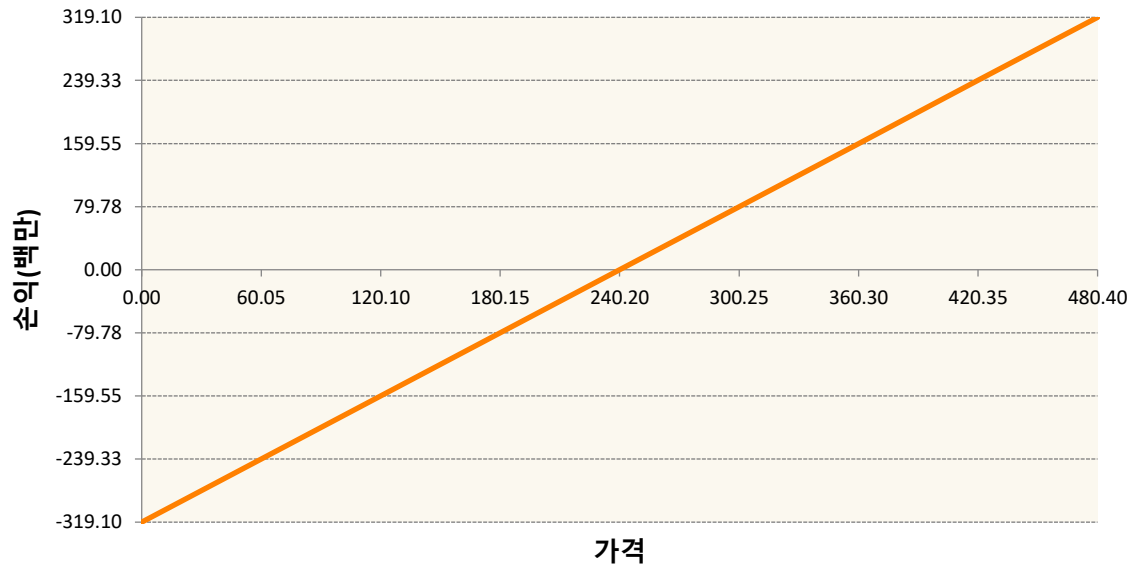
CH2-CORN FUTURE Mar22



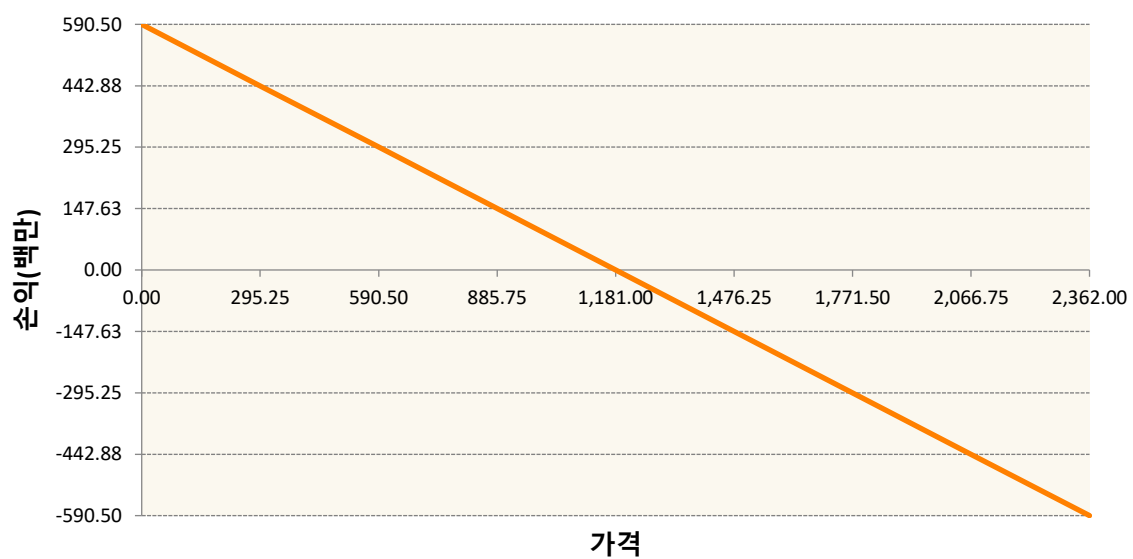
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



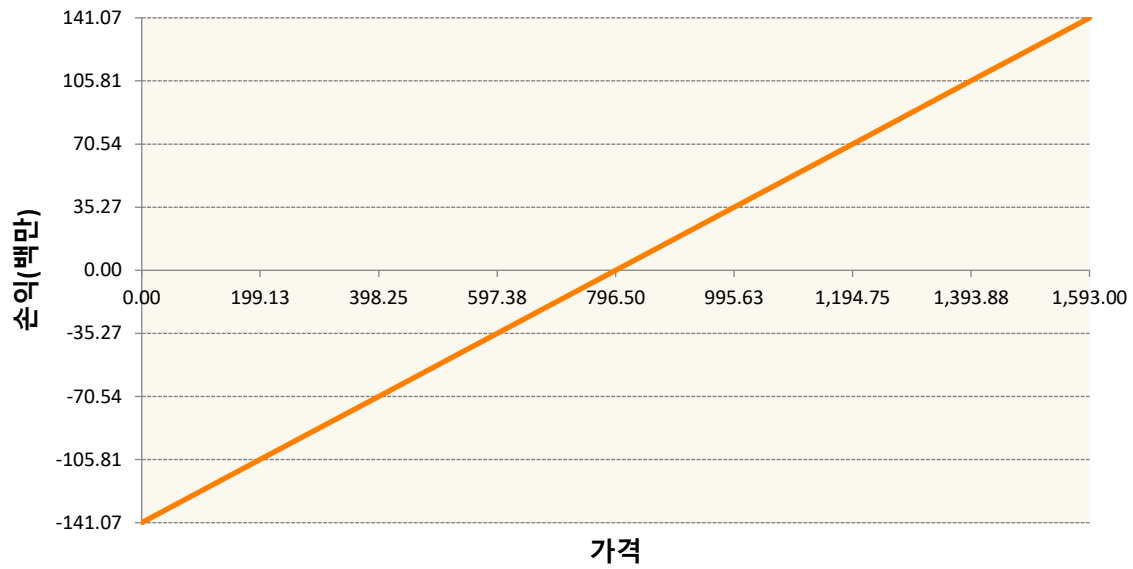
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



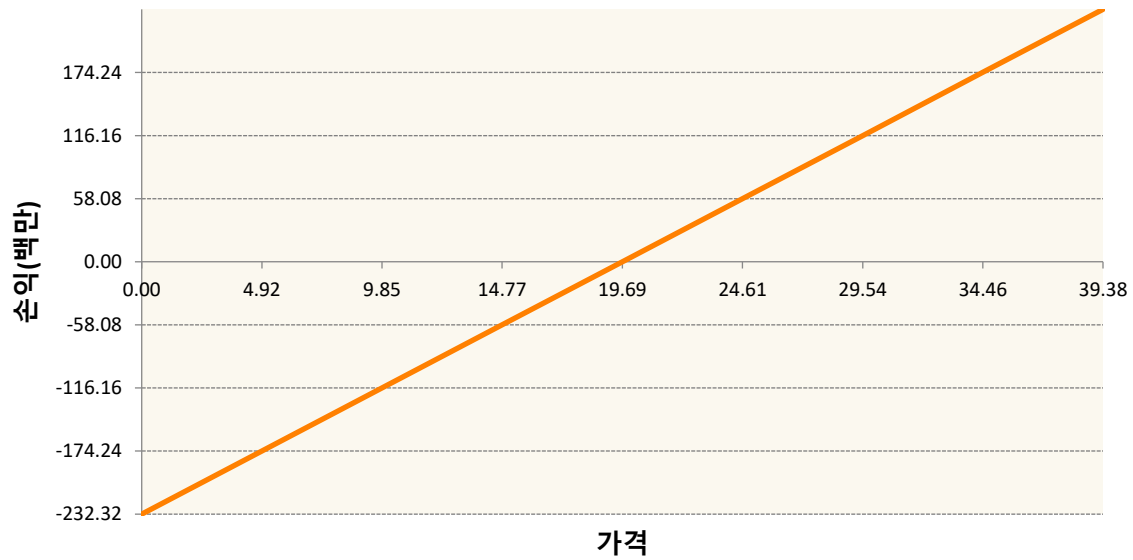
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



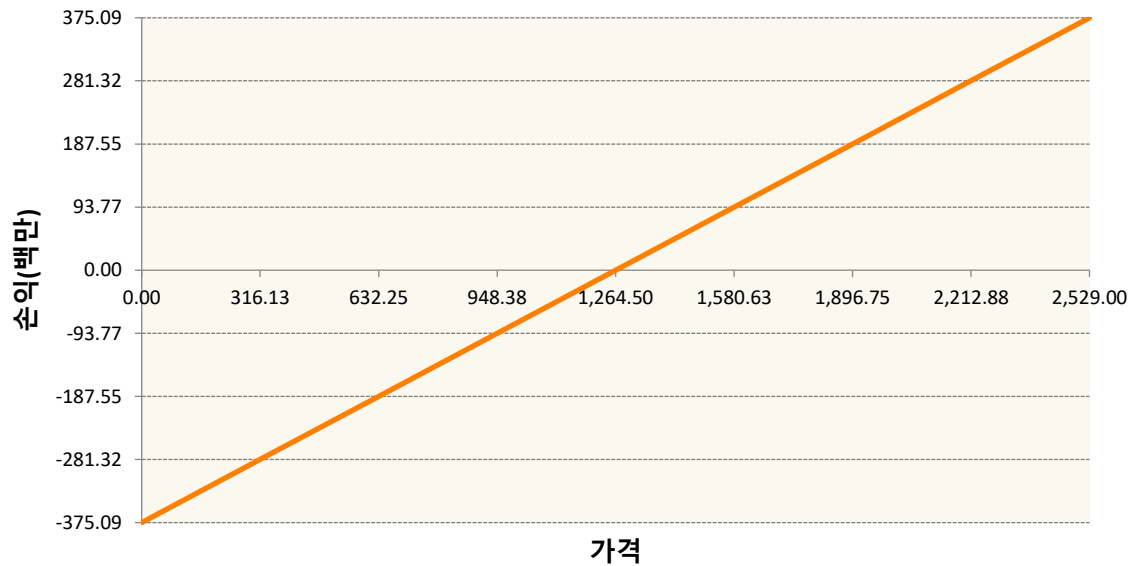
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

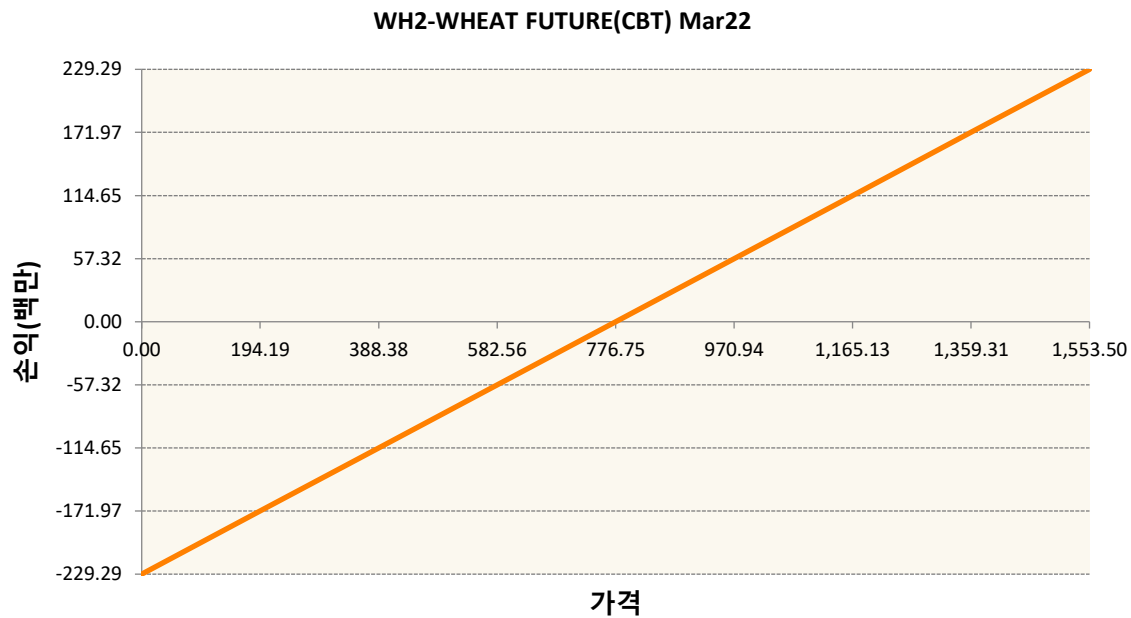
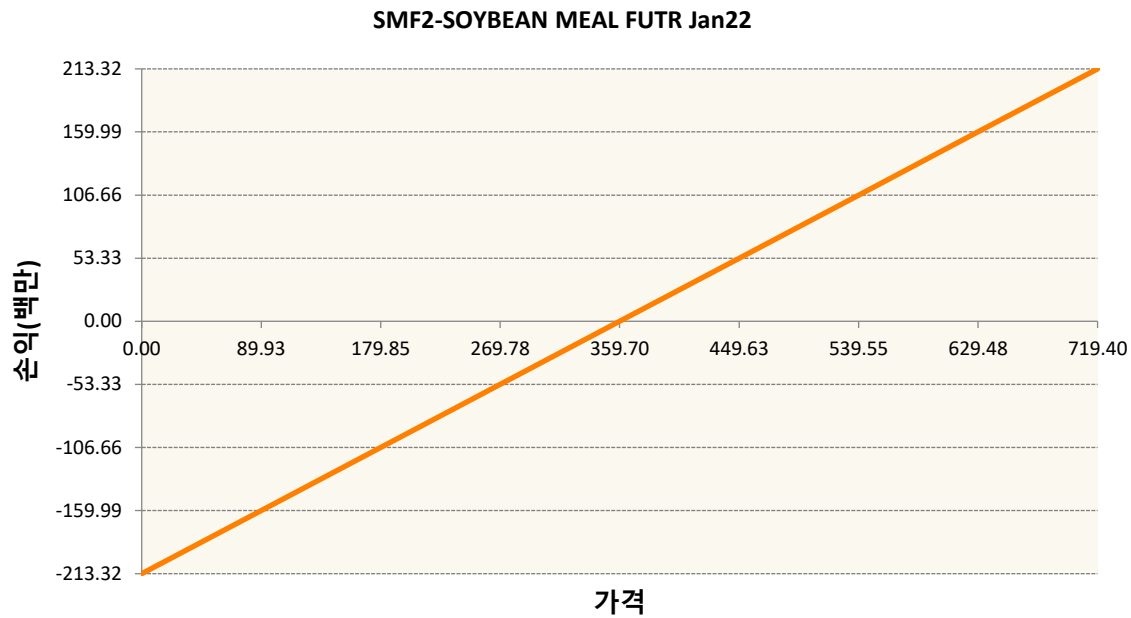


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22		22
CH2	CORN FUTURE Mar22		34
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22		10
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22		26
KR4175RC00 2021-12 달러선물			47
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22		11
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22		19
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22		30
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22		17
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22		18

