

공시일 2021-12-14

기준일 2021-12-13

포커스농산물모(채권-파생형)

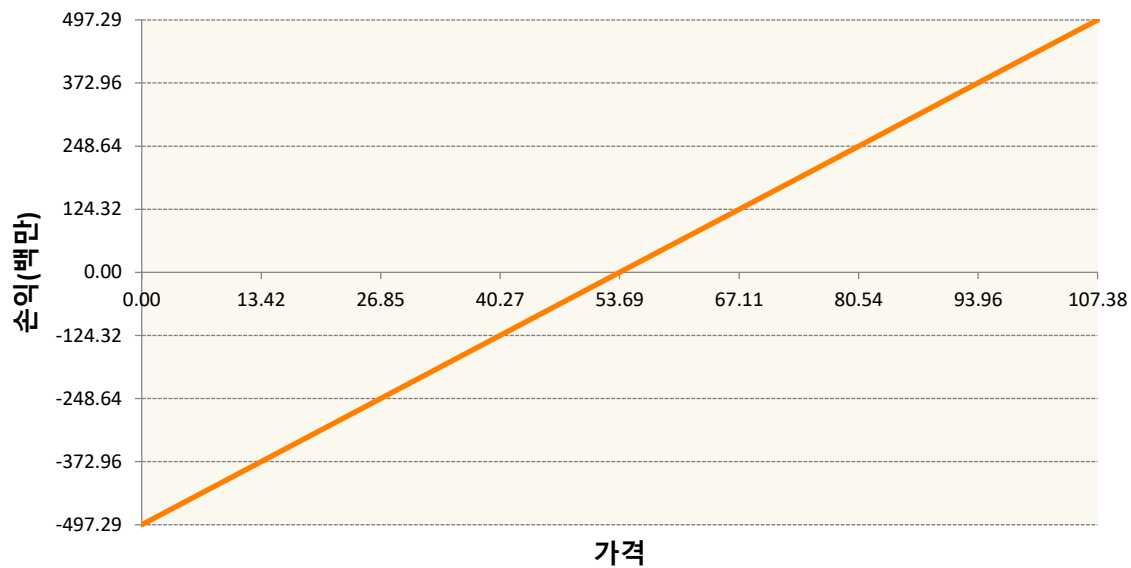
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

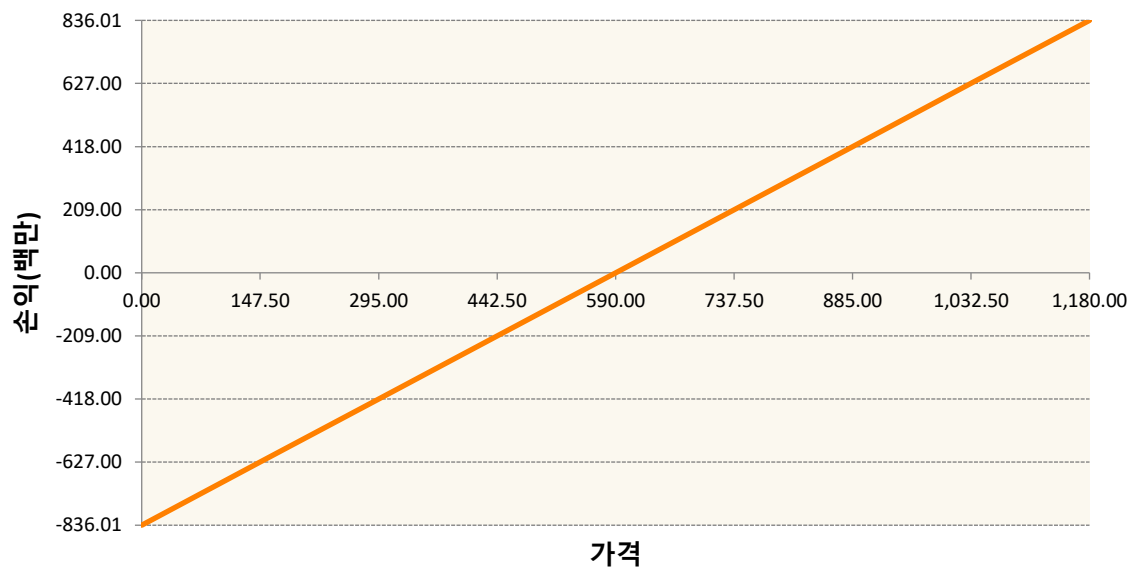
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,510	532	3,979	

2. 만기시점의 손익구조

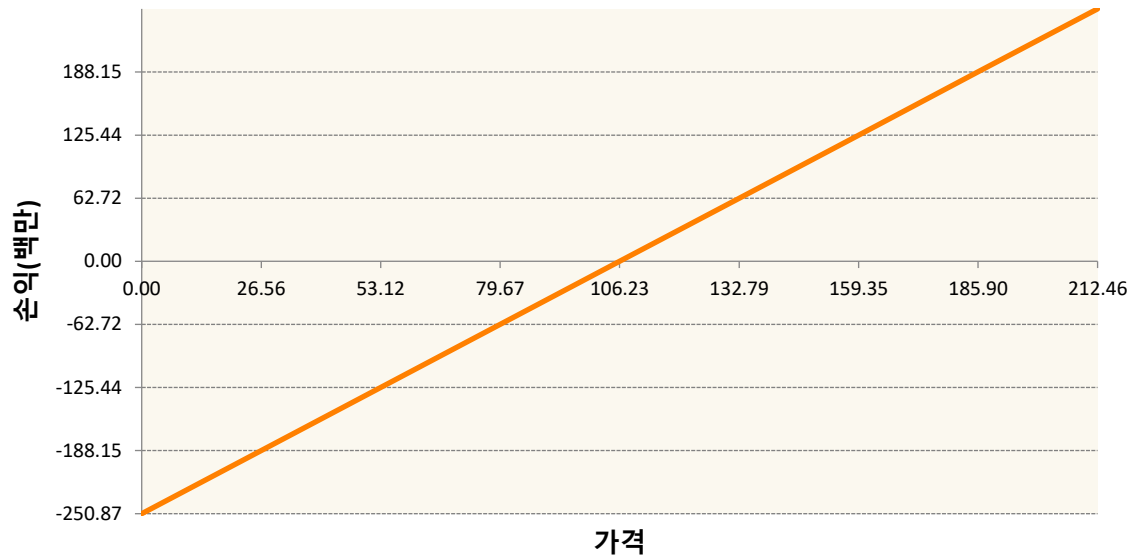
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



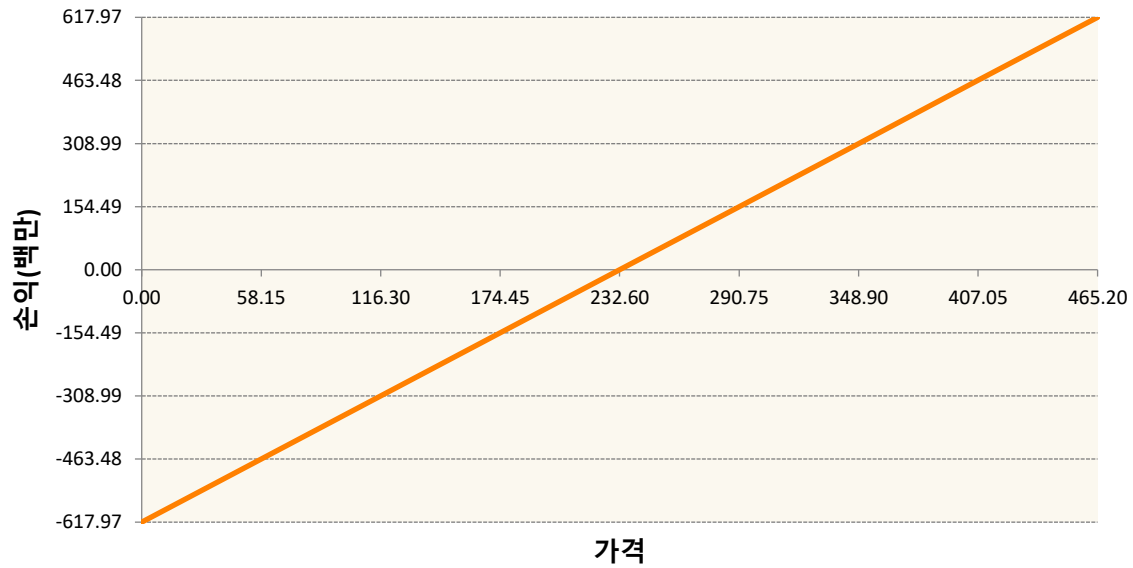
CH2-CORN FUTURE Mar22



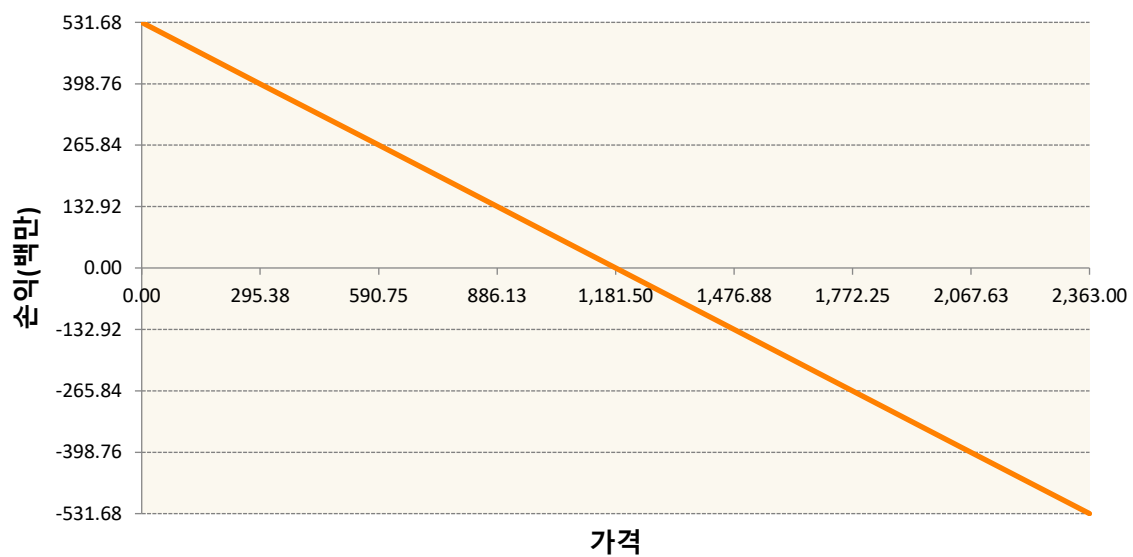
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



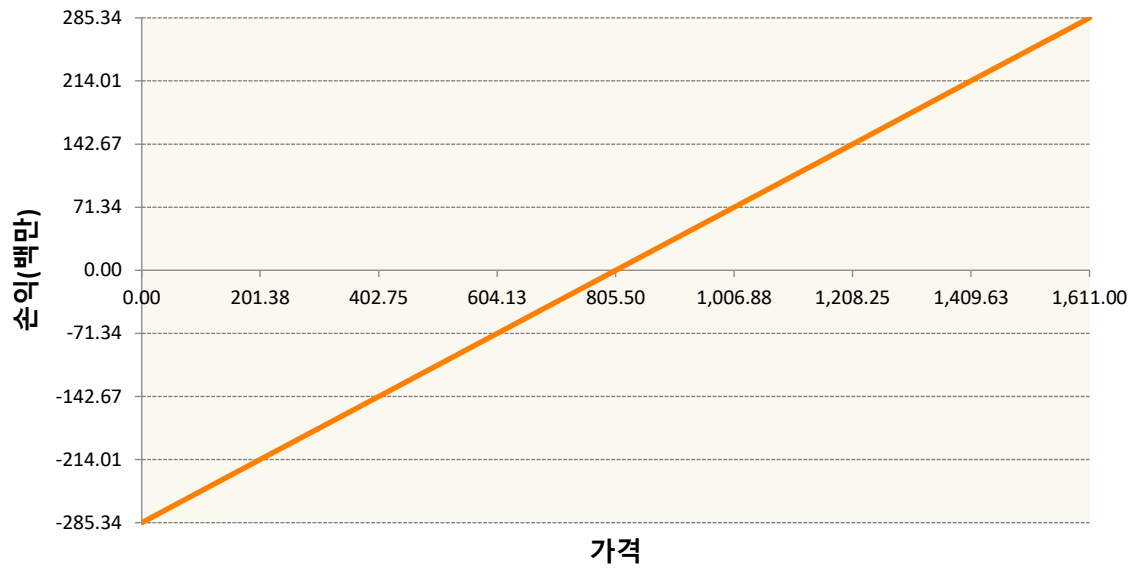
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



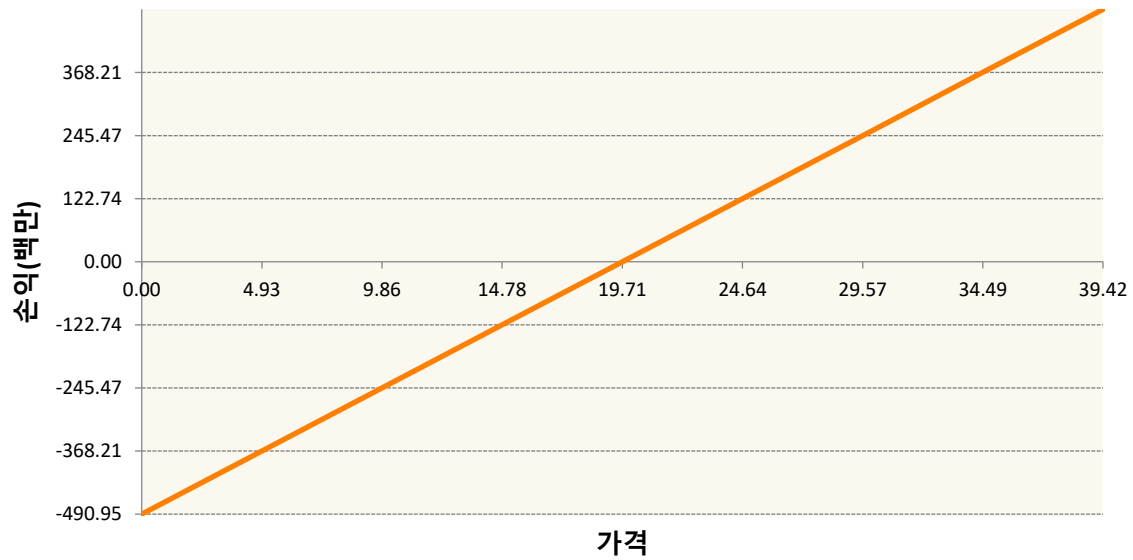
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



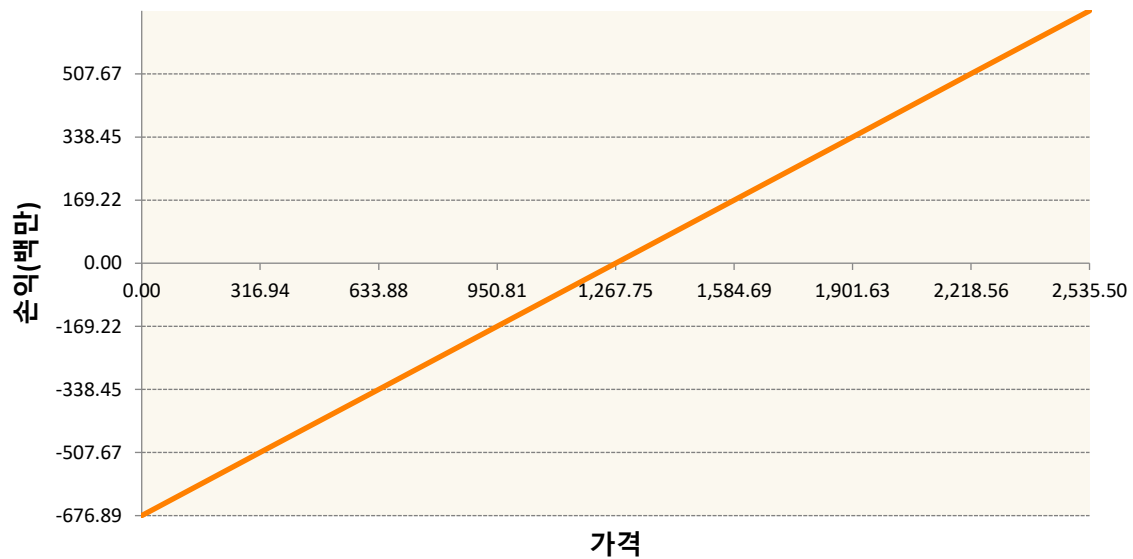
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



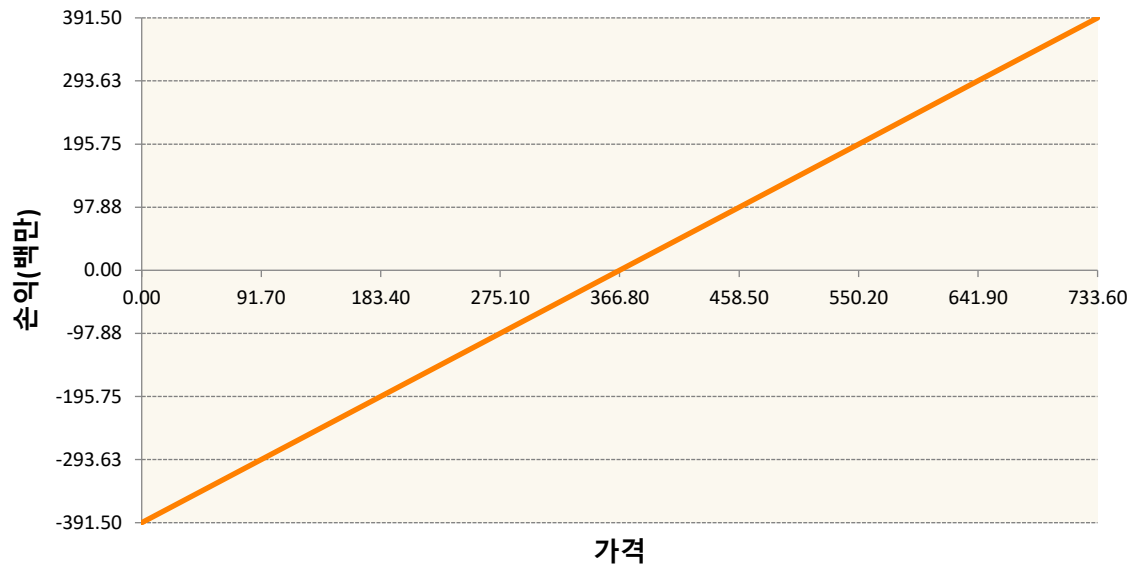
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



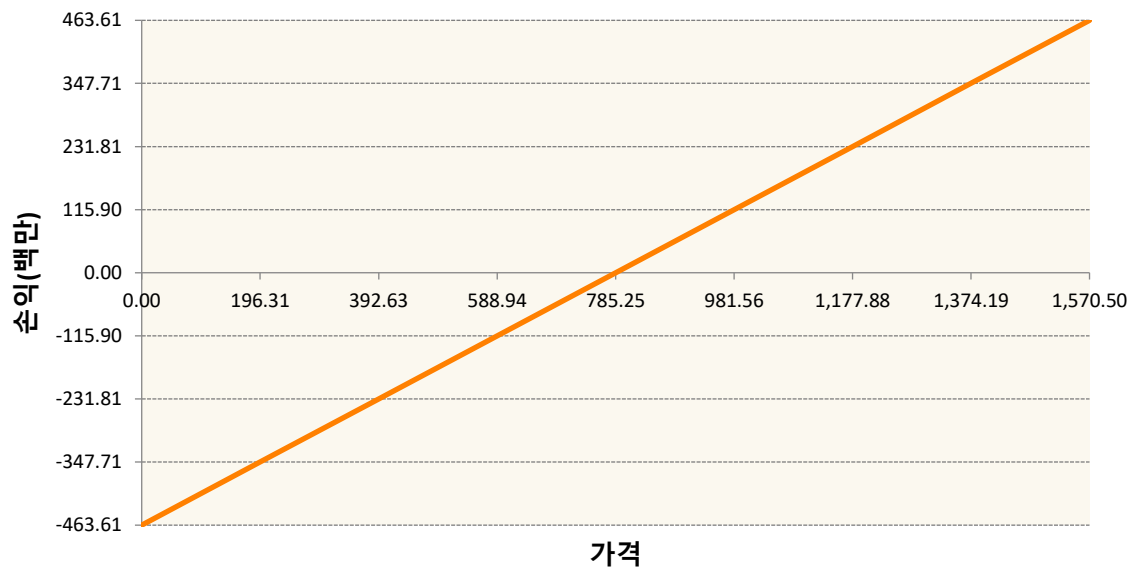
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	2021-12-14
기준일	2021-12-13

스마트인덱스모

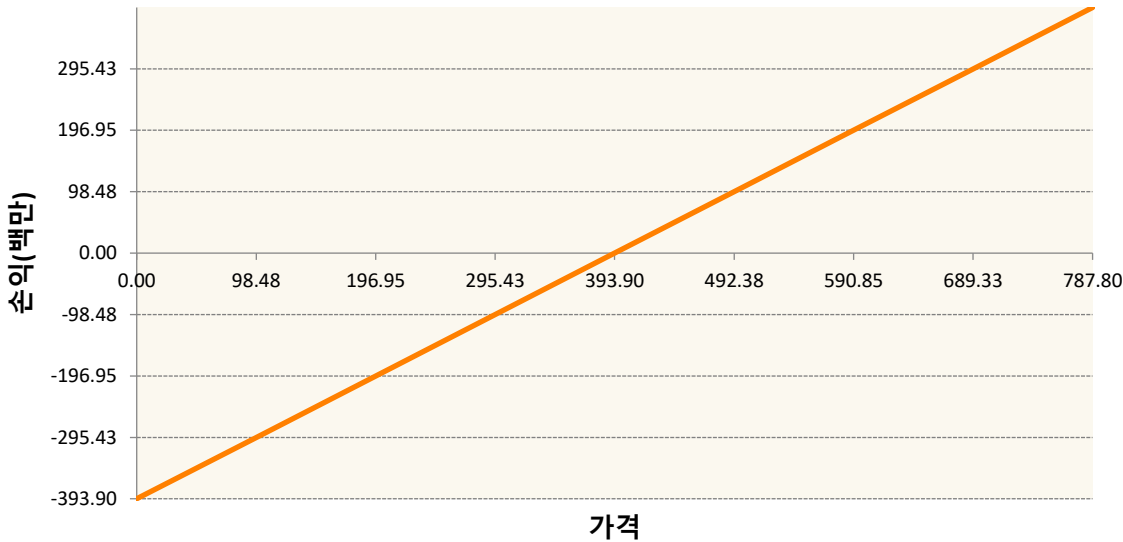
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	394	0	394	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



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	2021-12-14
기준일	2021-12-13

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

915

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-14
기준일	2021-12-13

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	5,505	0	5,505	장외
누계	지수	스왑	5,505	0	5,505	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래211213

438

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

425

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-14
기준일	2021-12-13

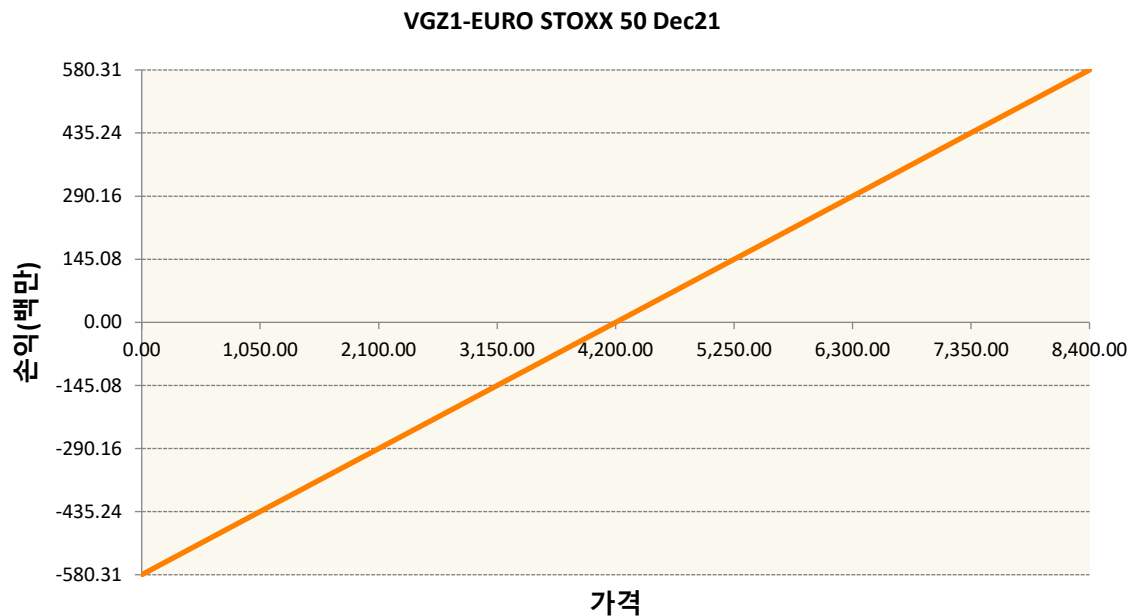
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	580	0	580	

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	2021-12-14
기준일	2021-12-13

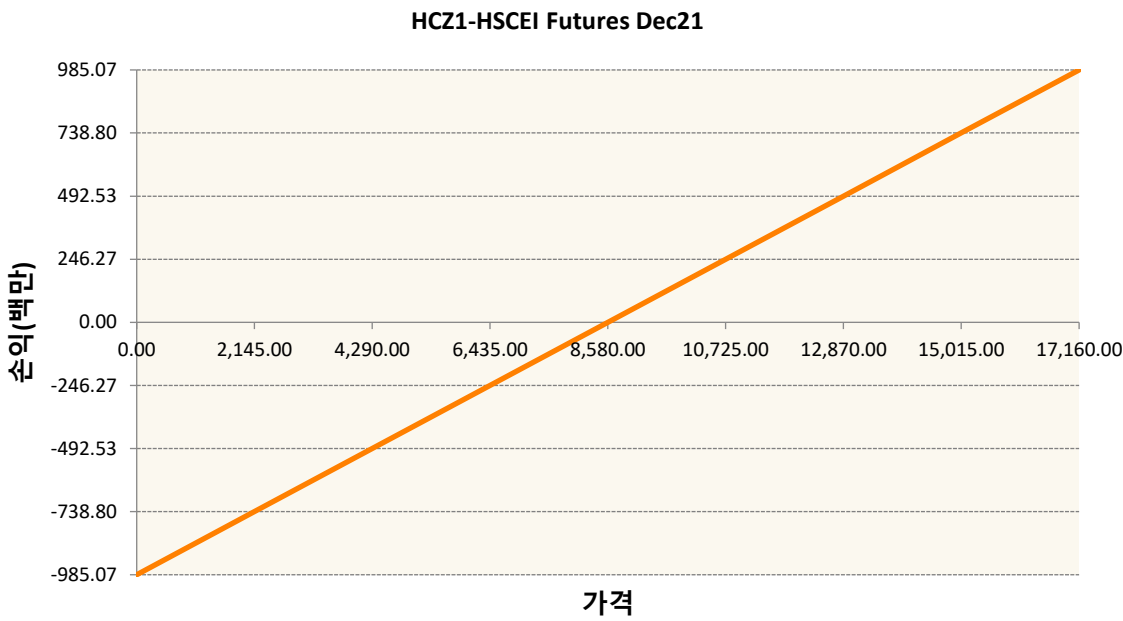
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	985	0	985	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

83

공시일 2021-12-14

기준일 2021-12-13

커버드콜모(주식혼합-파생형)

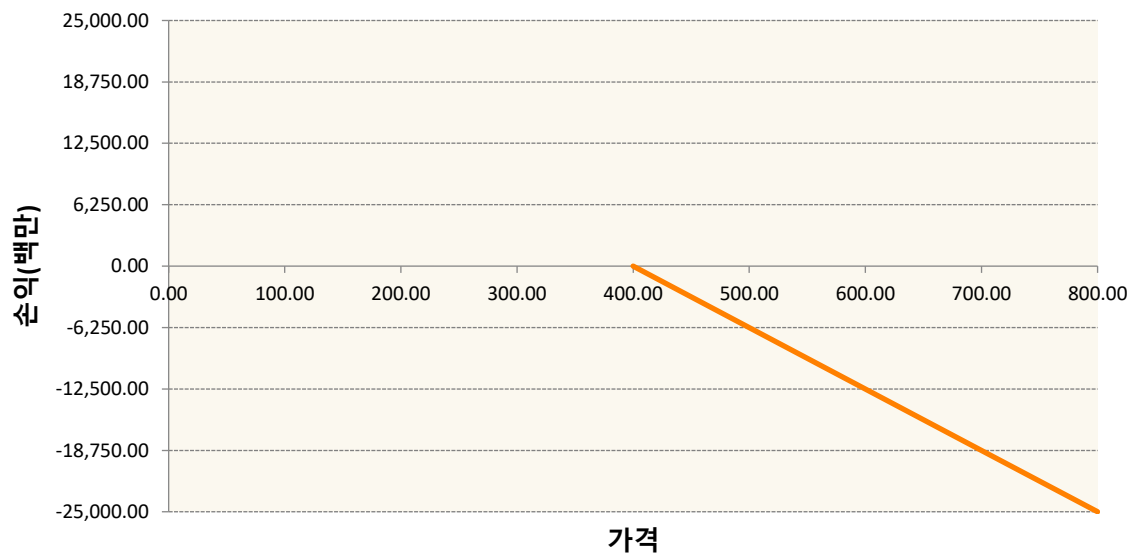
1. 계약금액

(단위:백만원)

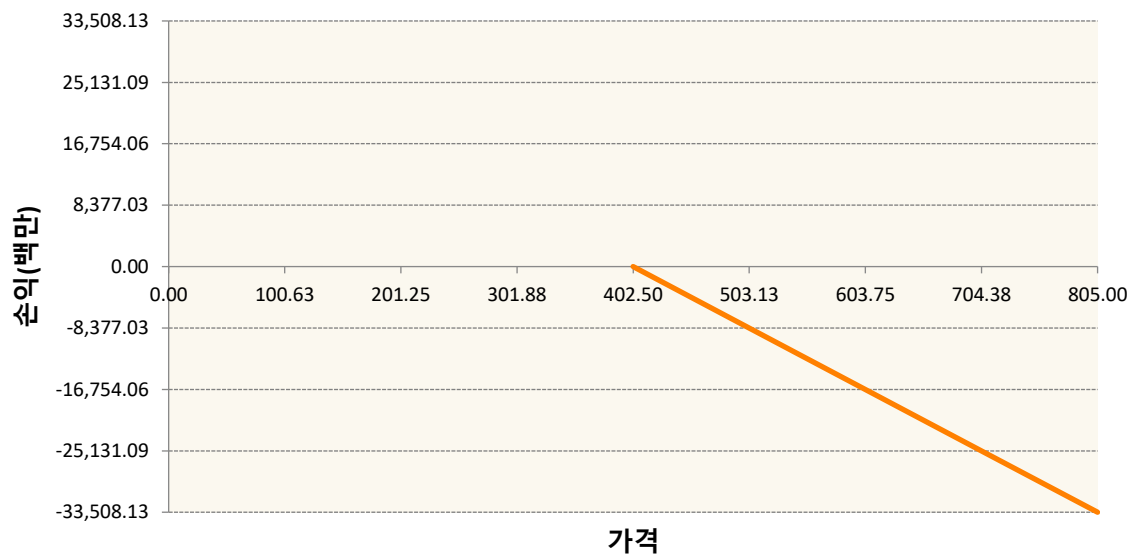
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201S14003-2022-01 콜400



KR4201S14029-2022-01 콜402.5



The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis represents '가격' (Price) from 0.00 to 800.00. The y-axis represents '순이익(백만)' (Net Income in millions) from -17,500.00 to 17,500.00. A solid orange line shows a linear relationship, starting at (0, -17,500) and ending at (400, 0). This indicates that net income is zero when the price is 400.00.

가격	순이익(백만)
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 '순이익 (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	순이익 (백만원)
0.00	-2,012.50
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003				2022-01 콜400			1,464
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	656	634	608	577	543	506	466
-5.33%	586	548	505	460	412	362	311
-2.67%	442	387	330	272	212	153	92
0%	195	130	65	0	-65	-130	-196
2.67%	-168	-231	-295	-359	-424	-489	-554
5.33%	-638	-690	-745	-801	-860	-919	-979
8.00%	-1,191	-1,228	-1,269	-1,313	-1,361	-1,411	-1,464
KR4201S14029				2022-01 콜402.5			1,887
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	796	771	739	702	661	614	564
-5.33%	718	672	619	563	503	440	374
-2.67%	552	482	410	335	259	181	103
0%	257	172	86	0	-86	-173	-259
2.67%	-190	-277	-364	-451	-539	-627	-714
5.33%	-784	-858	-936	-1,015	-1,095	-1,177	-1,260
8.00%	-1,496	-1,551	-1,611	-1,675	-1,743	-1,814	-1,887
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,128

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,090	-1,093	-1,097	-1,102	-1,109	-1,118	-1,128
-5.33%	-641	-650	-662	-675	-690	-707	-725
-2.67%	-232	-253	-275	-299	-323	-348	-374
0%	89	60	30	0	-30	-60	-90
2.67%	291	264	235	207	178	149	120
5.33%	387	370	351	330	308	284	260
8.00%	421	414	404	392	378	362	345

KR4301S14027 2022-01 풋402.5							133
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-131	-131	-132	-133
-5.33%	-78	-79	-80	-81	-83	-84	-86
-2.67%	-30	-32	-34	-36	-39	-42	-44
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	36	33	30	26	23	19	16
5.33%	50	47	45	42	40	37	34
8.00%	55	54	52	51	49	47	45

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

(단위:백만원)

4,355

공시일 2021-12-14

기준일 2021-12-13

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

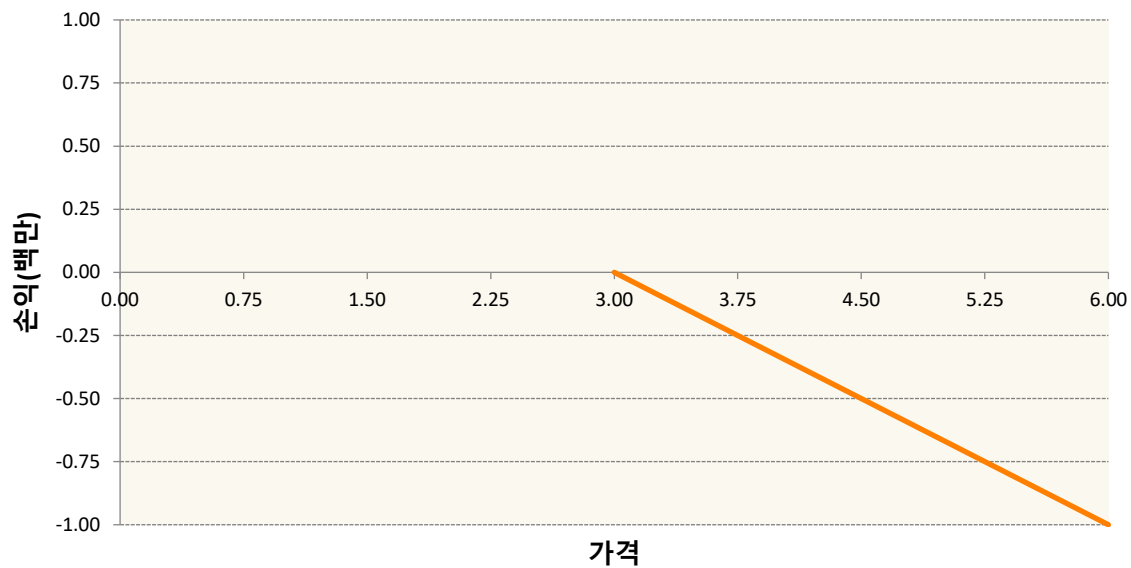
1. 계약금액

(단위:백만원)

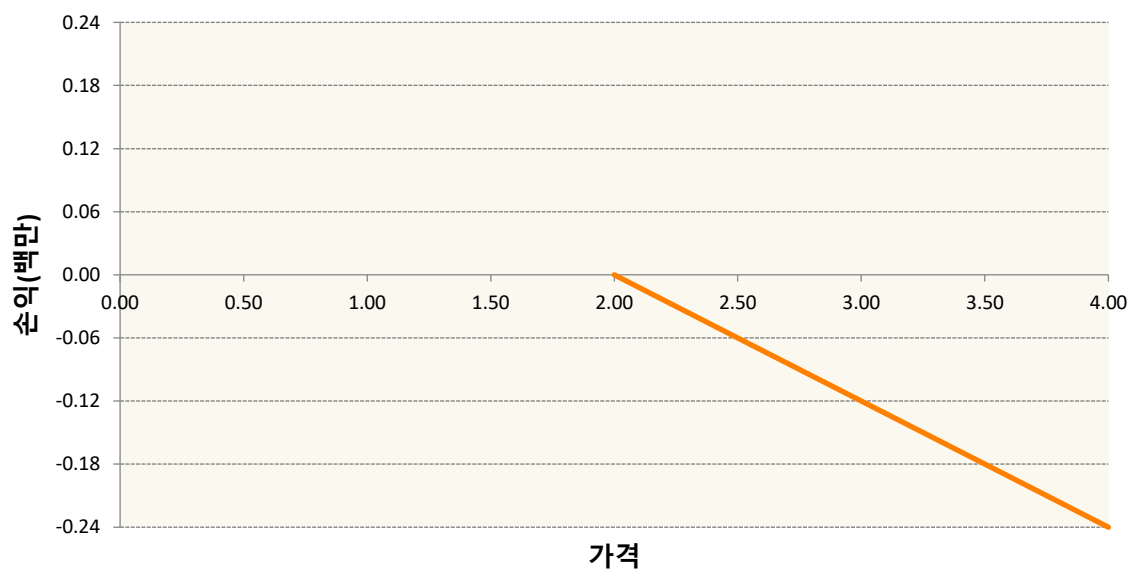
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	91	-91	장내

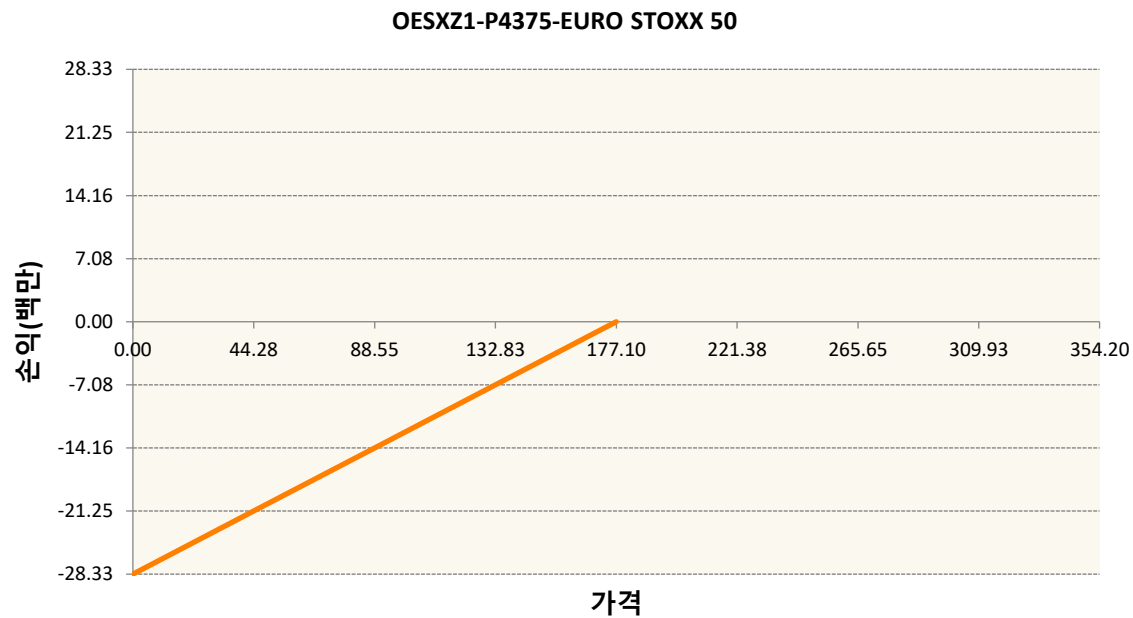
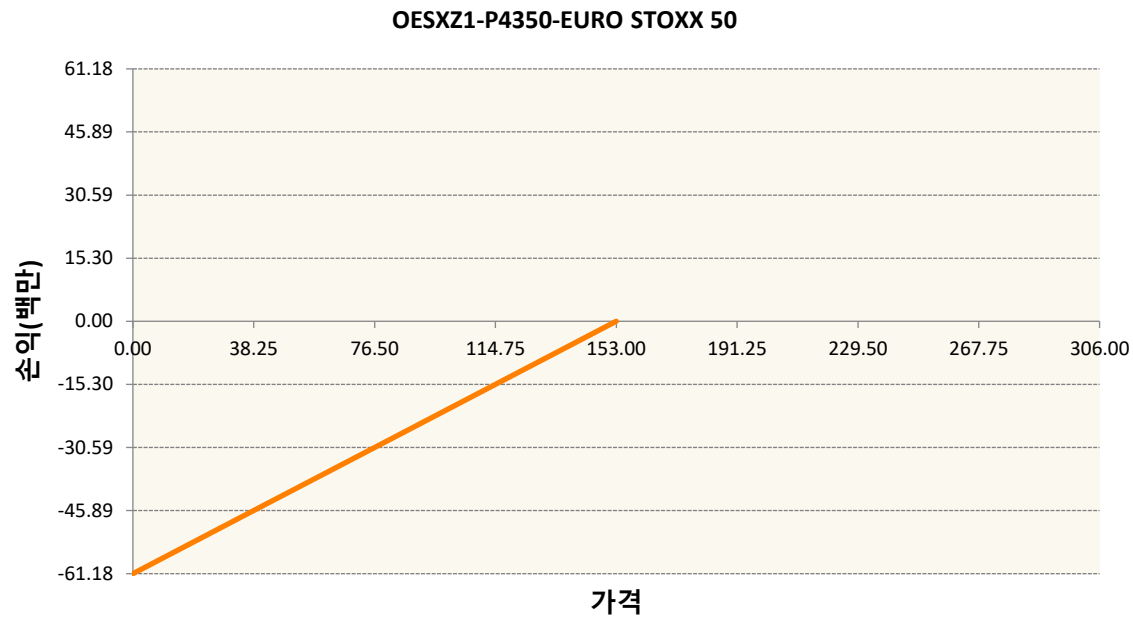
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		4
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.08
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.02
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		5
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		11

공시일 2021-12-14

기준일 2021-12-13

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

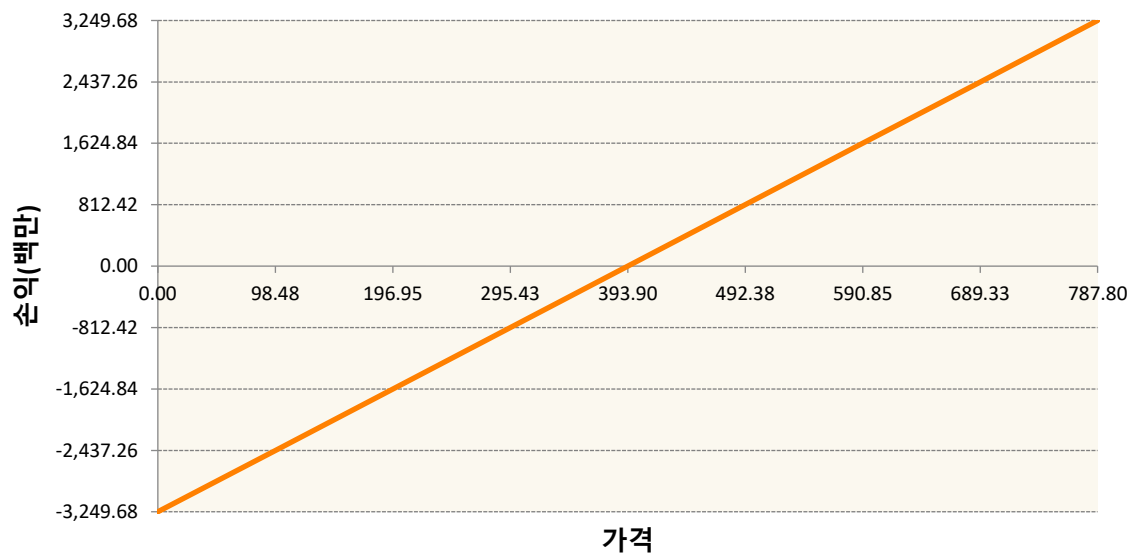
1. 계약금액

(단위:백만원)

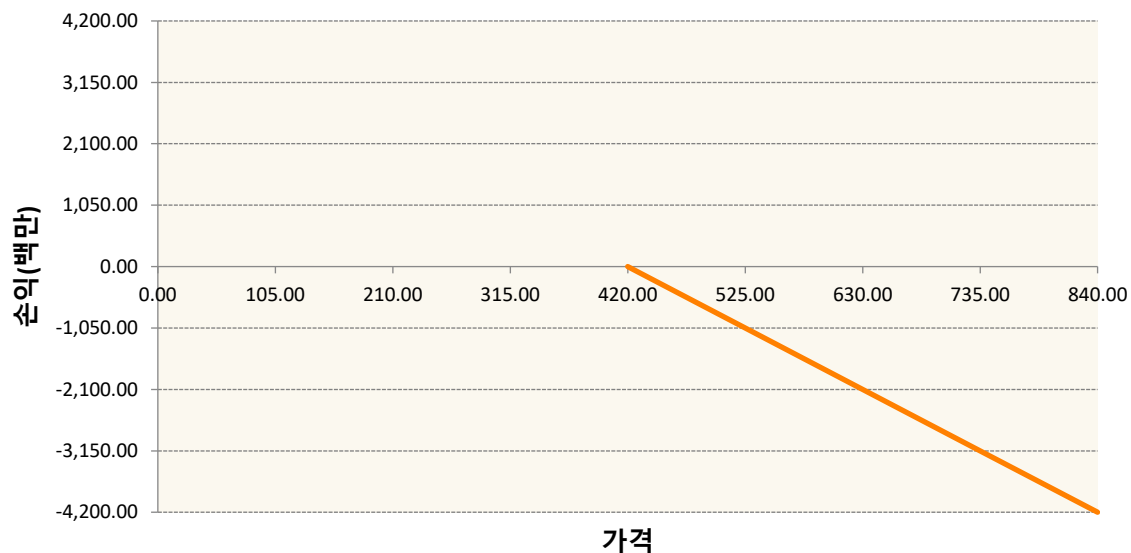
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,250	0	3,250	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

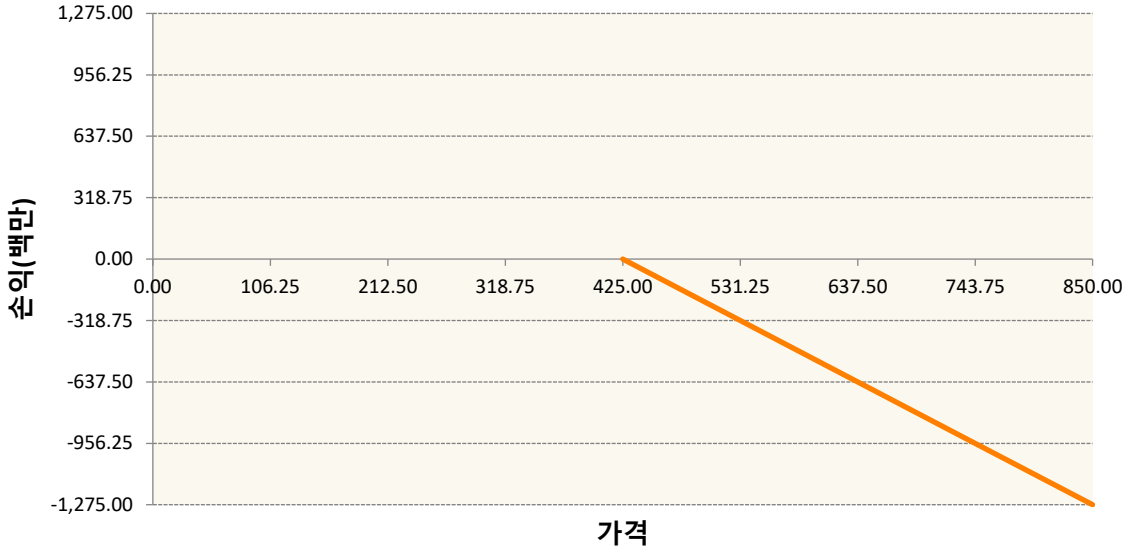
2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물

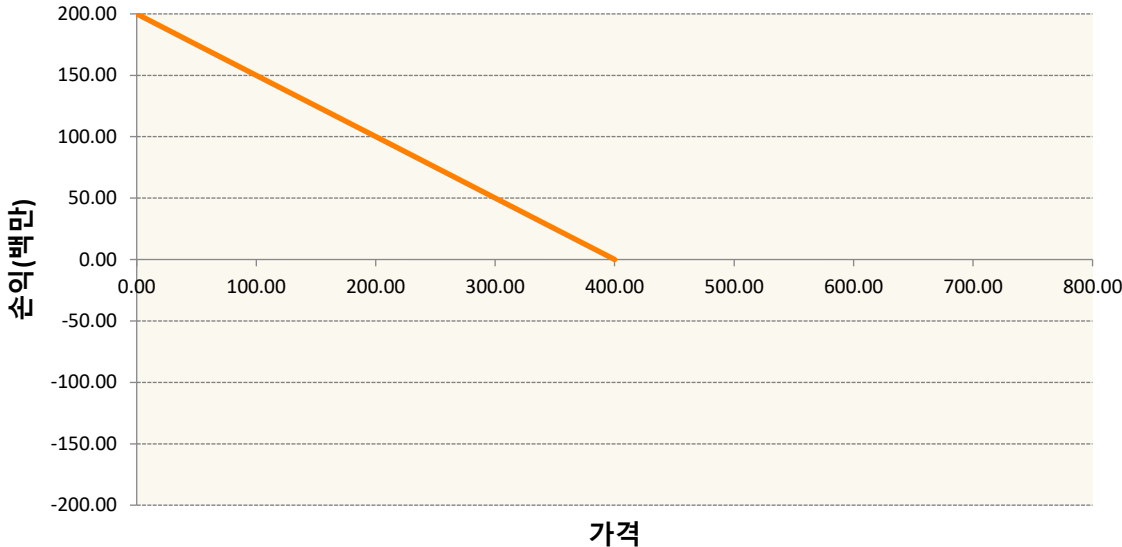


KR4201S14201-2022-01 콜420



KR4201S14250-2022-01 **콜**425

KR4301S14001-2022-01 ㄱ400



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001				2022-03 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%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175	
-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%	175	175	175	175	175	175	175	
8.00%	262	262	262	262	262	262	262	
KR4201S14201				2022-01 콜420				169
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	42	40	38	35	31
-5.33%	42	40	37	34	30	25	19
-2.67%	37	32	27	21	15	8	1
0%	23	16	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-3	-13	-22	-33	-43	-53	-63
5.33%	-45	-56	-67	-78	-89	-100	-111
8.00%	-105	-115	-126	-137	-148	-158	-169

KR4201S14250

2022-01 콜425

46

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	9	8	7
-5.33%	10	10	9	8	7	6	4
-2.67%	9	8	7	5	3	2	0
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	0	-3	-5	-8	-11	-14	-17
5.33%	-10	-13	-17	-20	-23	-27	-30
8.00%	-26	-29	-32	-36	-39	-42	-46

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	13	13	13	13	13
-5.33%	7	7	8	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	-4	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

441

공시일	2021-12-14
기준일	2021-12-13

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	17,971	0	17,971	

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	2021-12-14
기준일	2021-12-13

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	9,683	0	9,683	

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	2021-12-14
기준일	2021-12-13

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	45,734	0	45,734	
누계	통화	선도	1,417	0	1,417	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	2021-12-14
기준일	2021-12-13

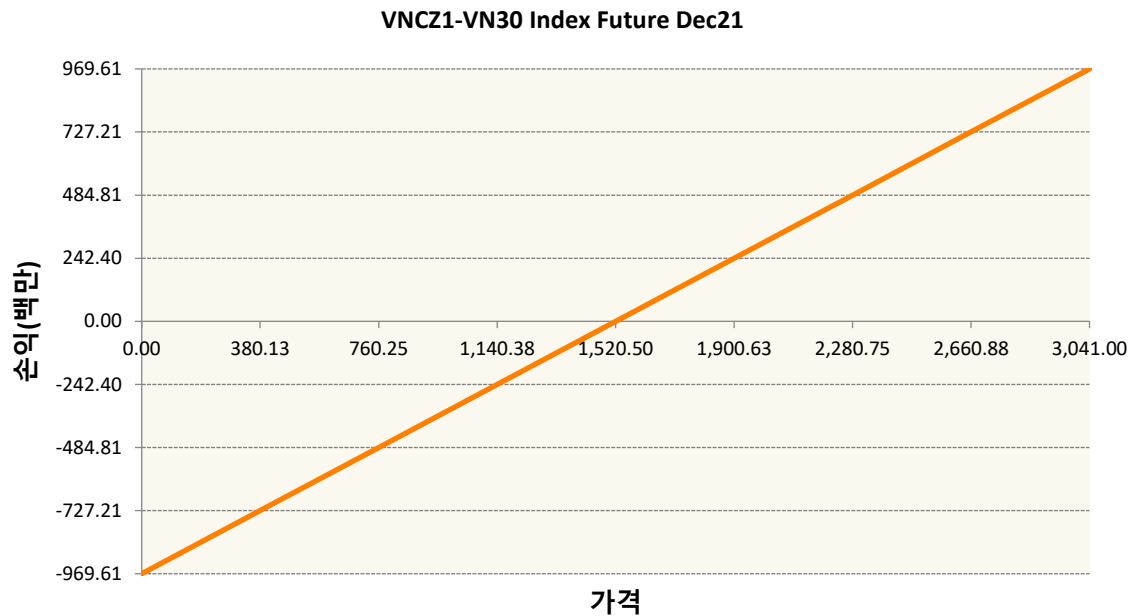
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	970	0	970	
누계	유가증권	스왑	1,780	0	1,780	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	78

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

(단위:백만원)

257

공시일 2021-12-14

기준일 2021-12-13

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

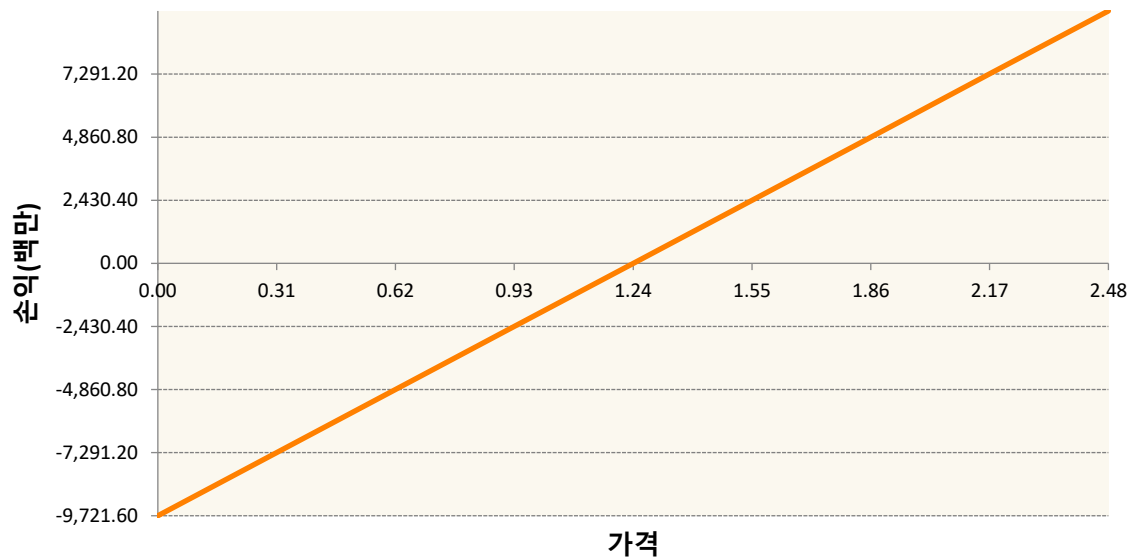
1. 계약금액

(단위:백만원)

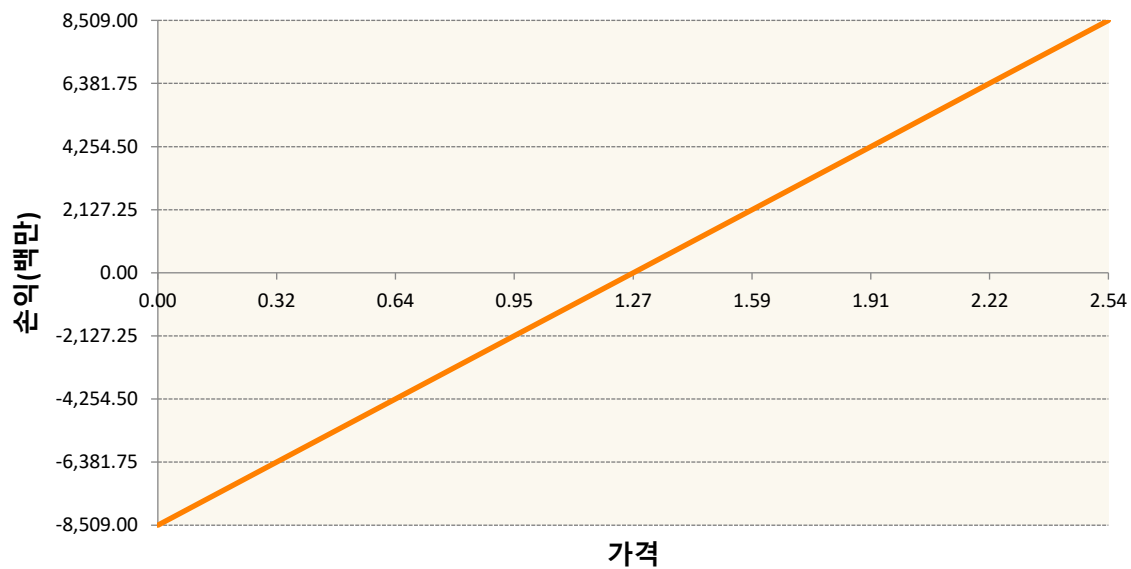
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	29,195	0	29,195	

2. 만기시점의 손익구조

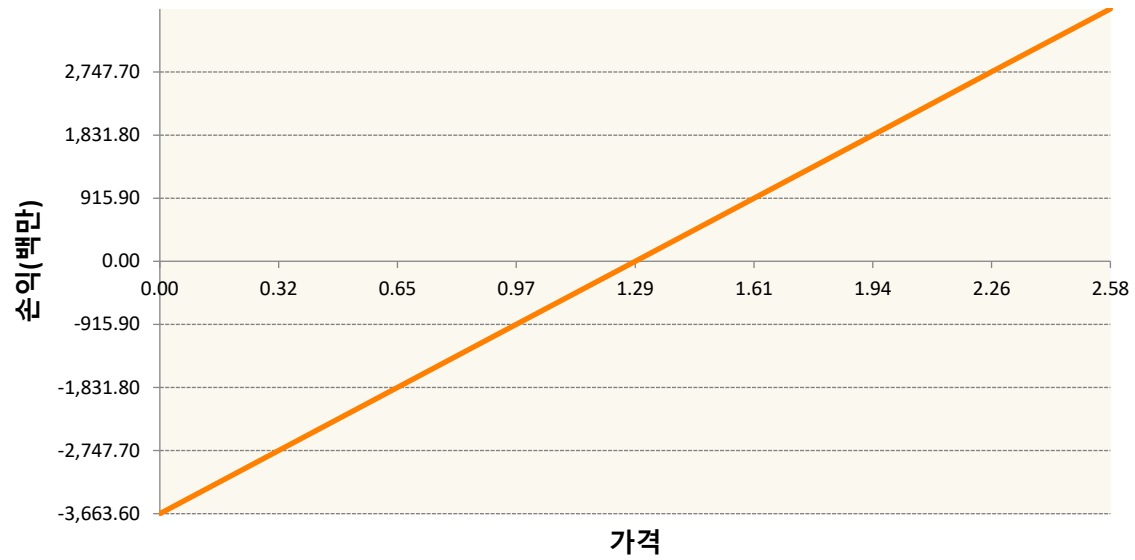
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



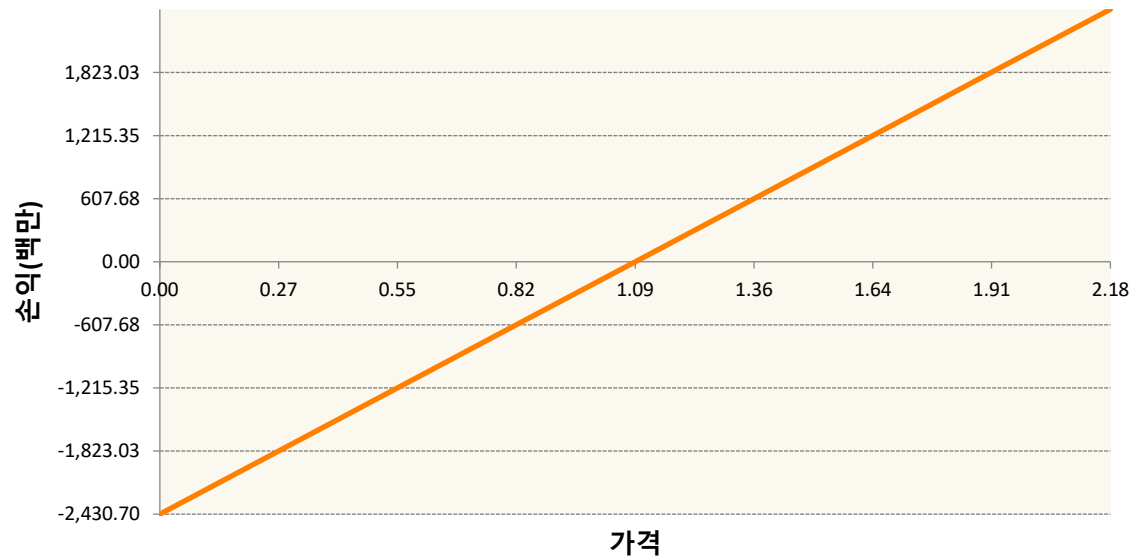
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



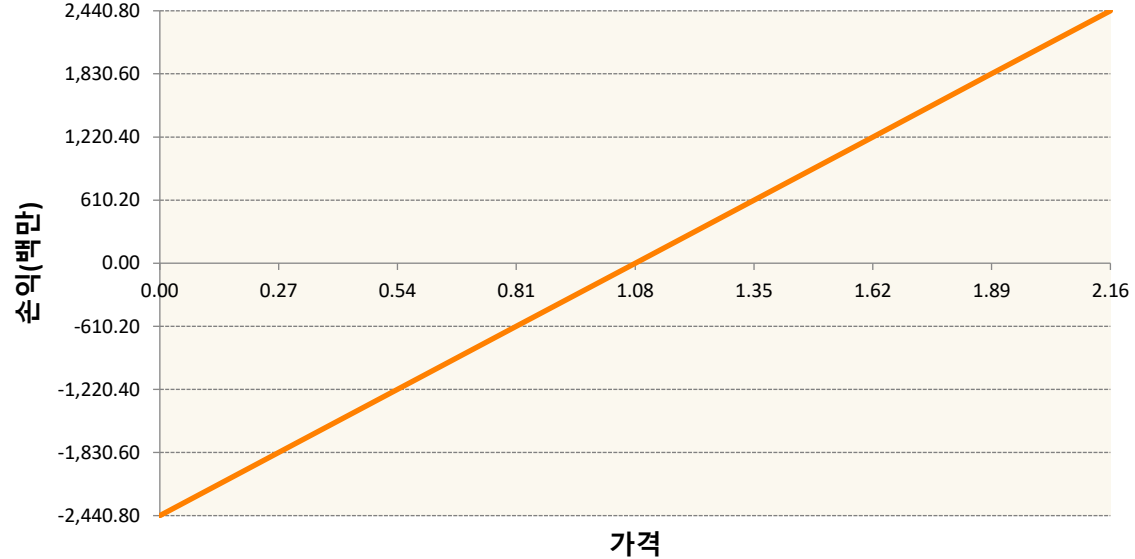
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)

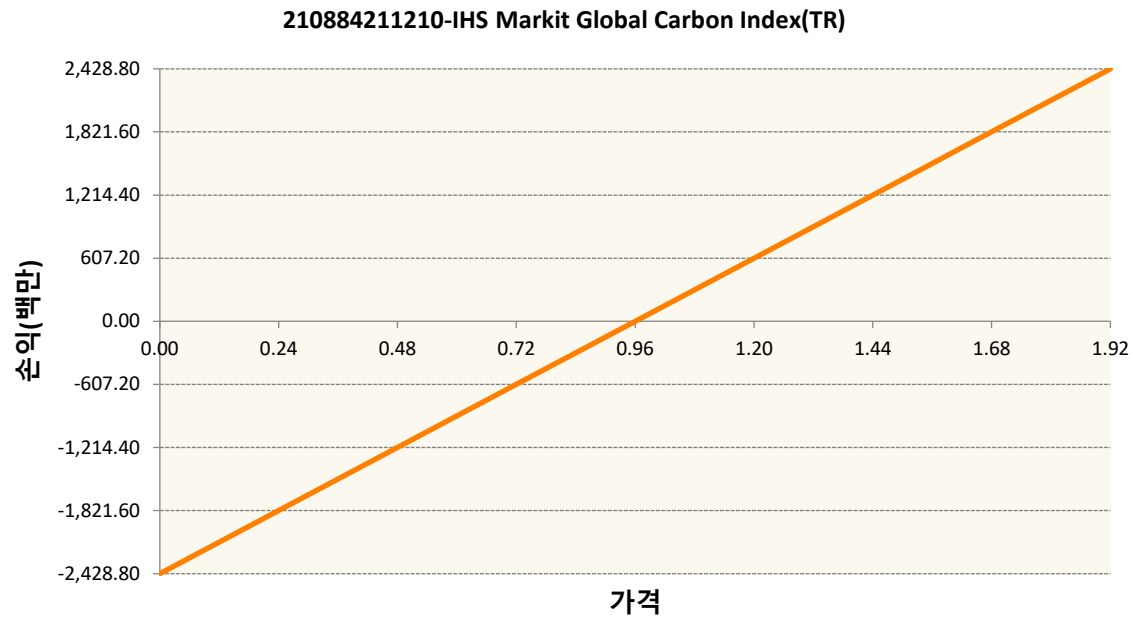


210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		780
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		679
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		292
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		194
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		195
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		195

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,583

공시일	2021-12-14
기준일	2021-12-13

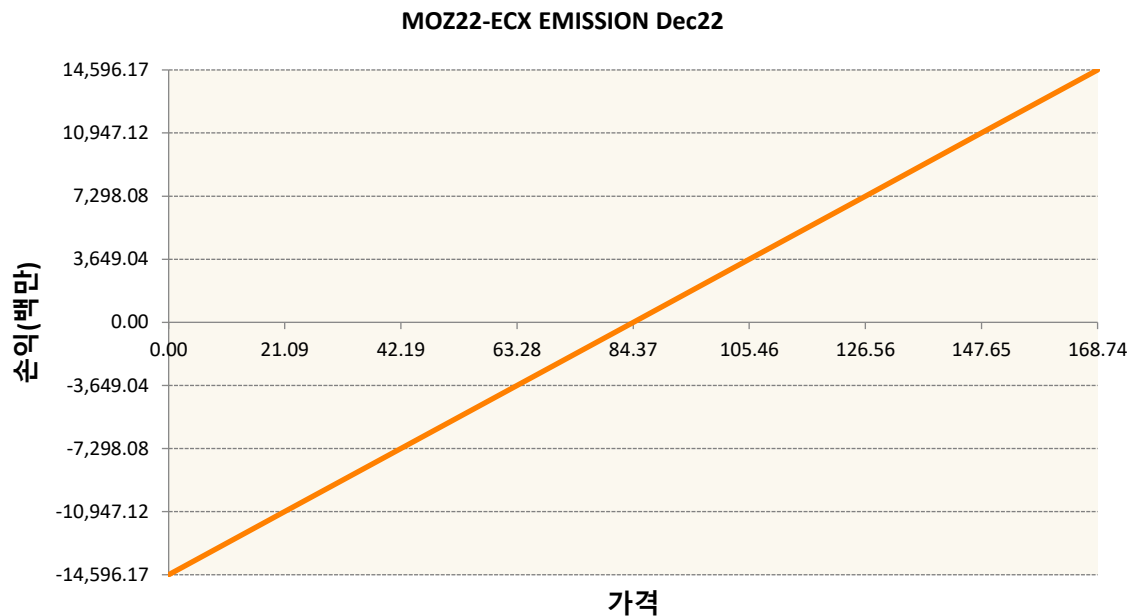
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	14,596	0	14,596	
누계	통화	선도	0	6,690	-6,690	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX·KRW/EUR 28-12-21E	381
FXW213BCA·KRW/EUR 28-12-21E	155
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,168

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

(단위:백만원)

2,616

공시일 2021-12-14

기준일 2021-12-13

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

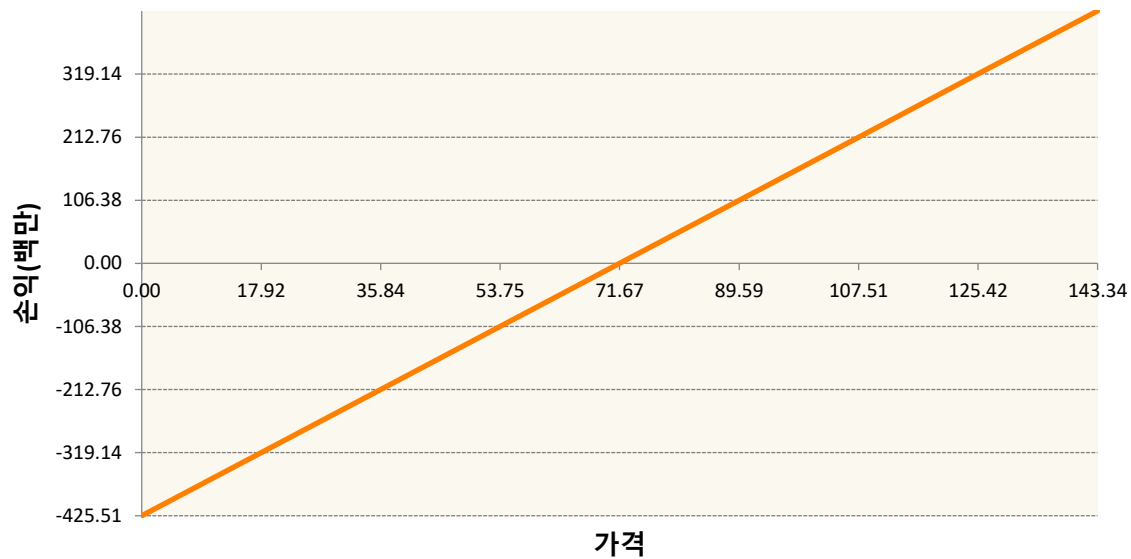
1. 계약금액

(단위:백만원)

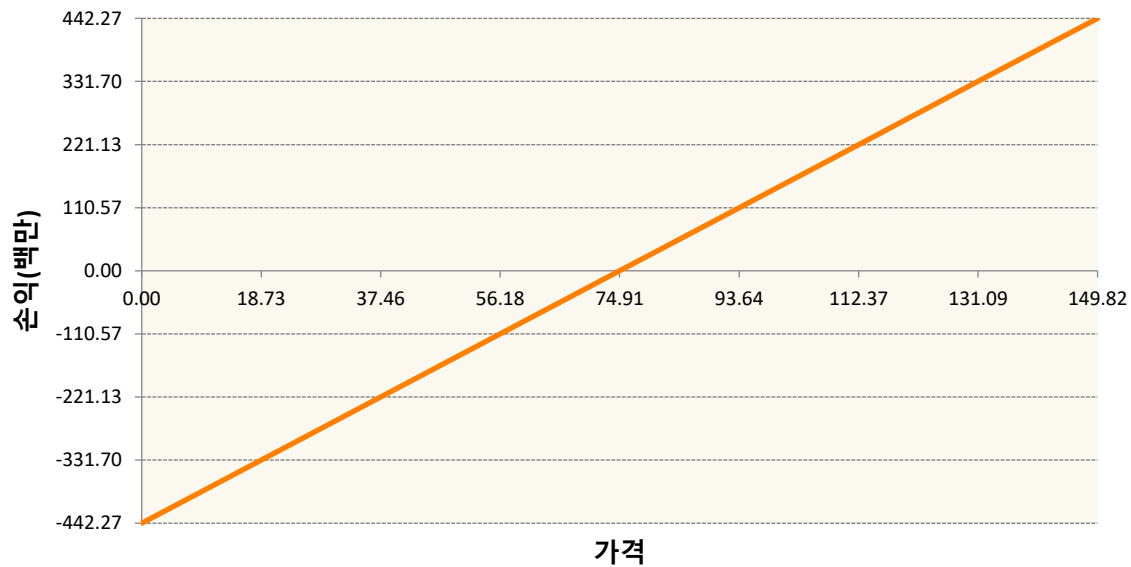
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,877	354	1,522	

2. 만기시점의 손익구조

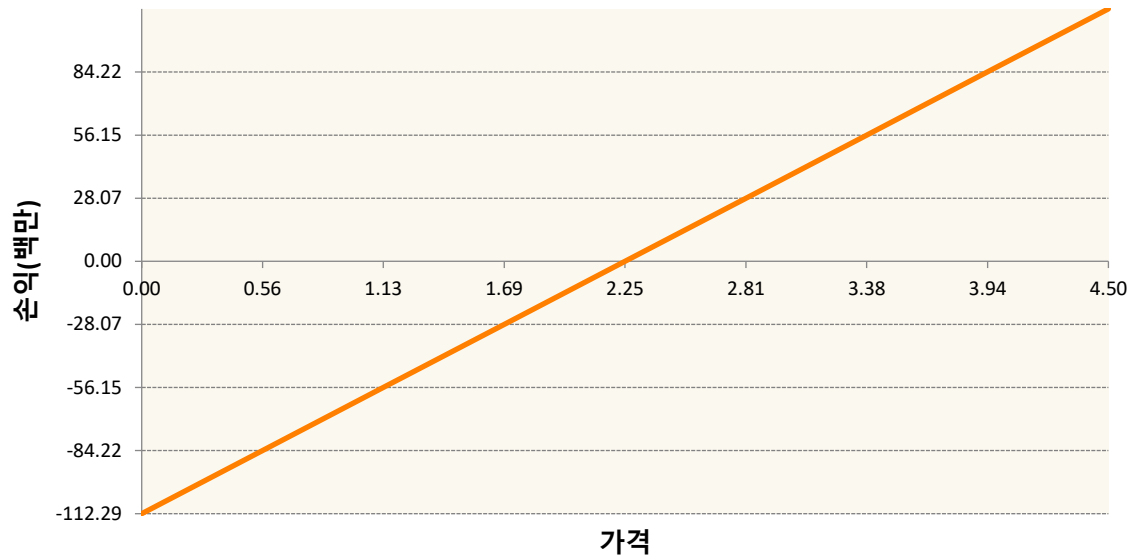
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



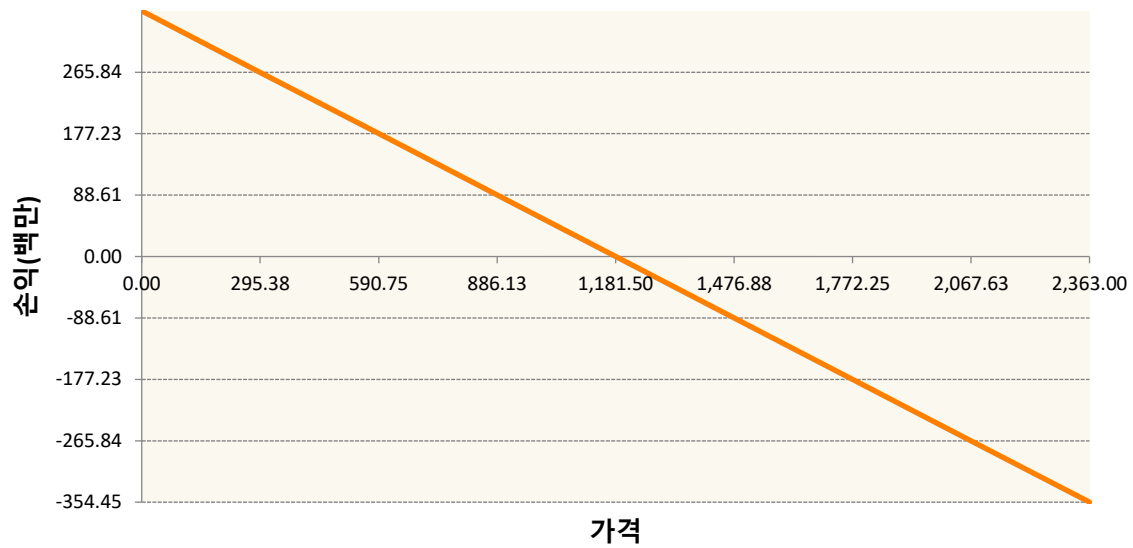
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



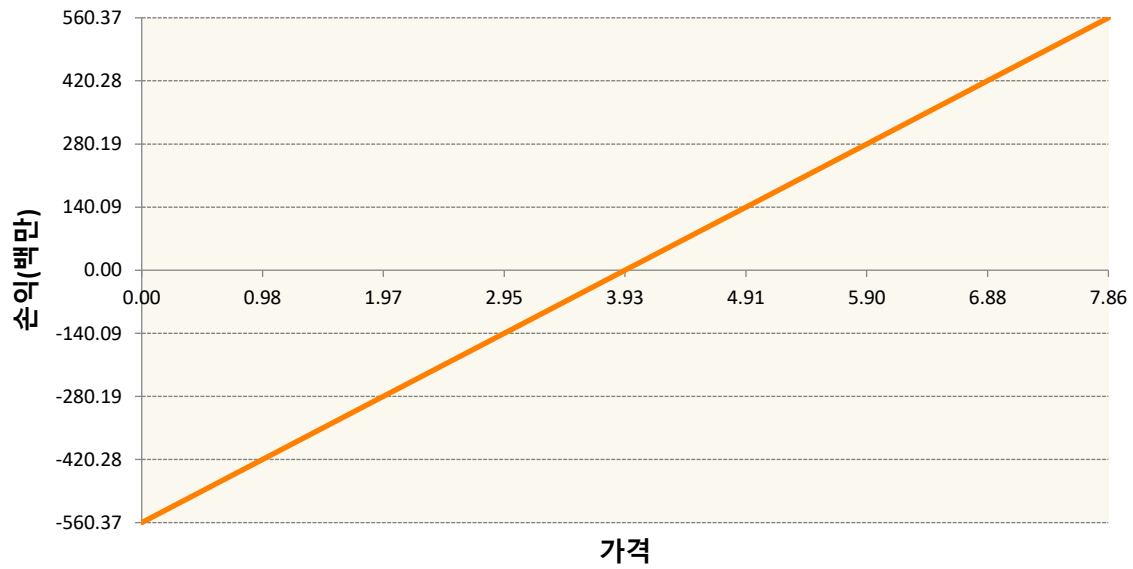
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22



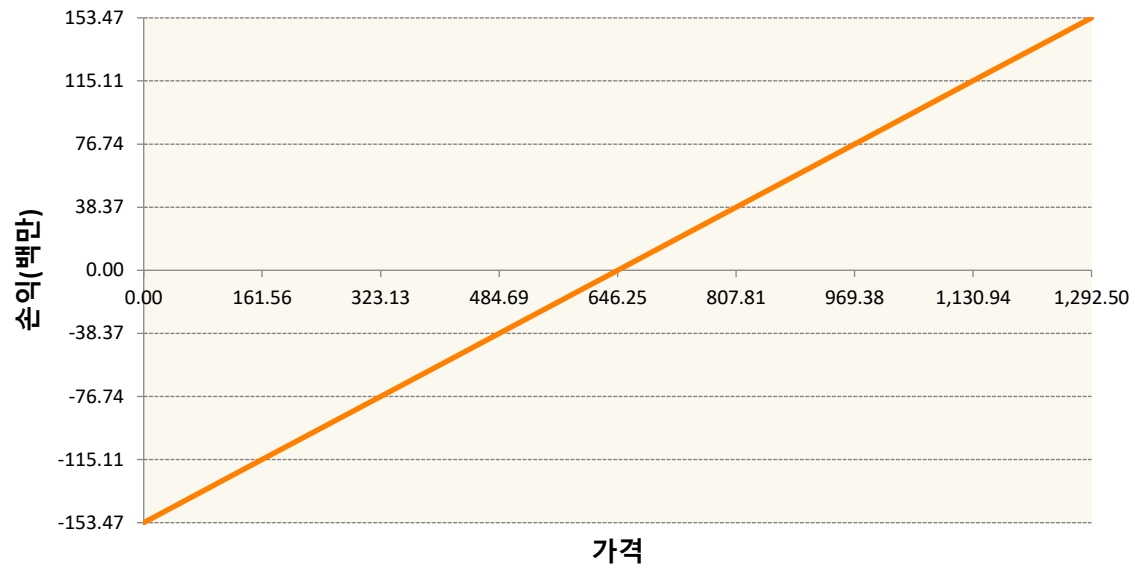
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



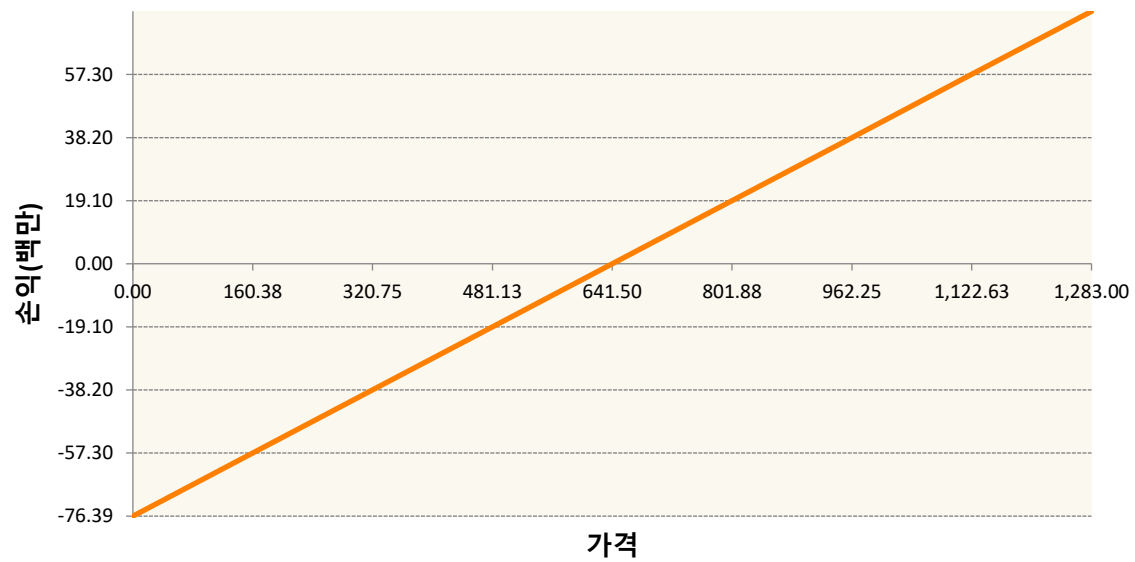
NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22



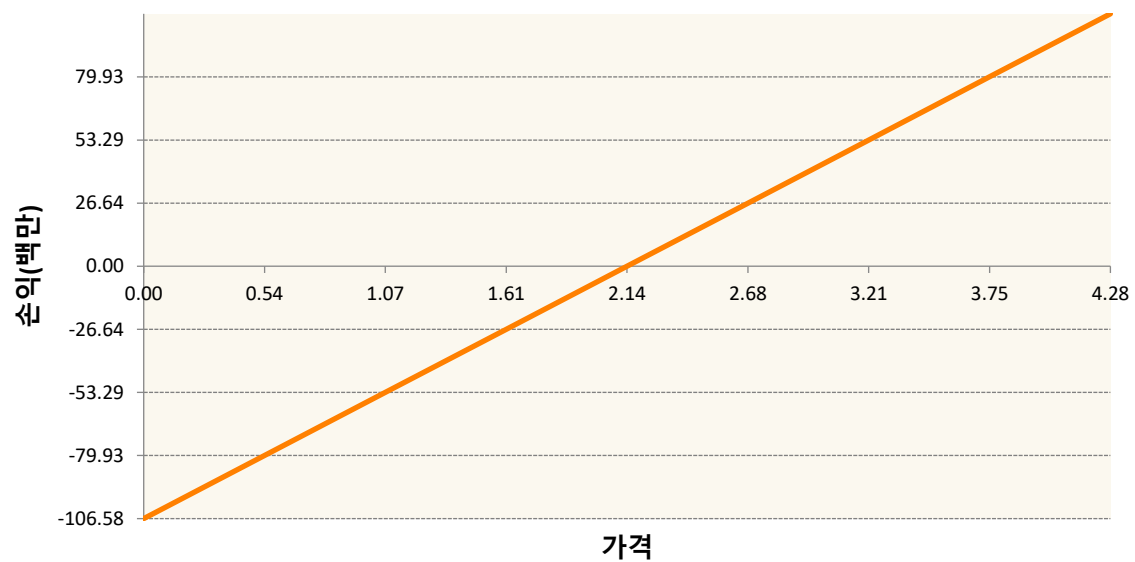
QSF2-Low Su Gasoil G Jan22



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	45
QSF2	Low Su Gasoil G Jan22	12
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	6
XBF2	GASOLINE RBOB FUT Jan22	9

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

341

공시일 2021-12-14

기준일 2021-12-13

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

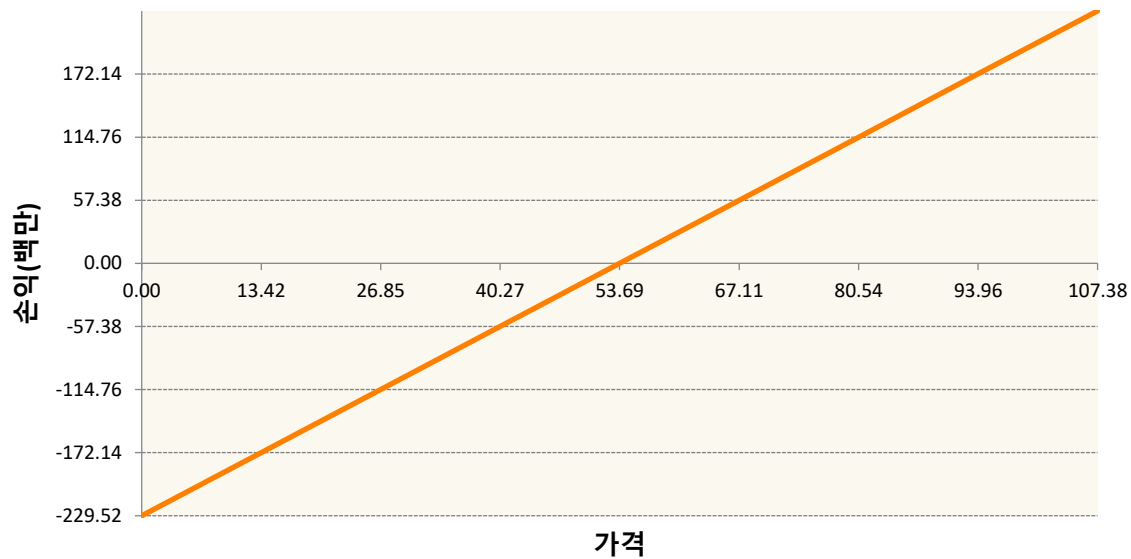
1. 계약금액

(단위:백만원)

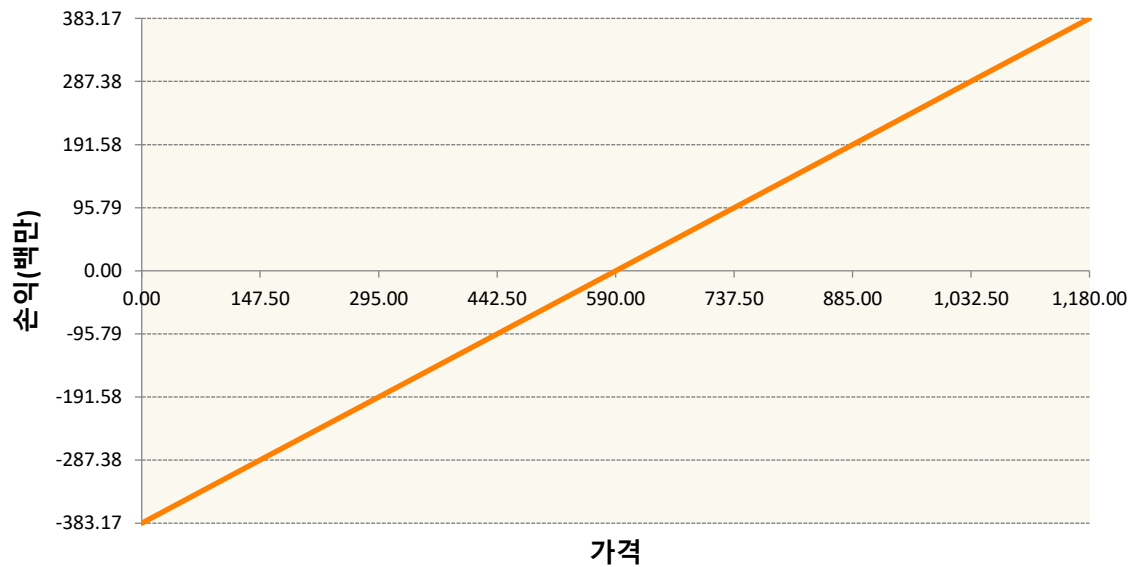
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,009	591	1,418	

2. 만기시점의 손익구조

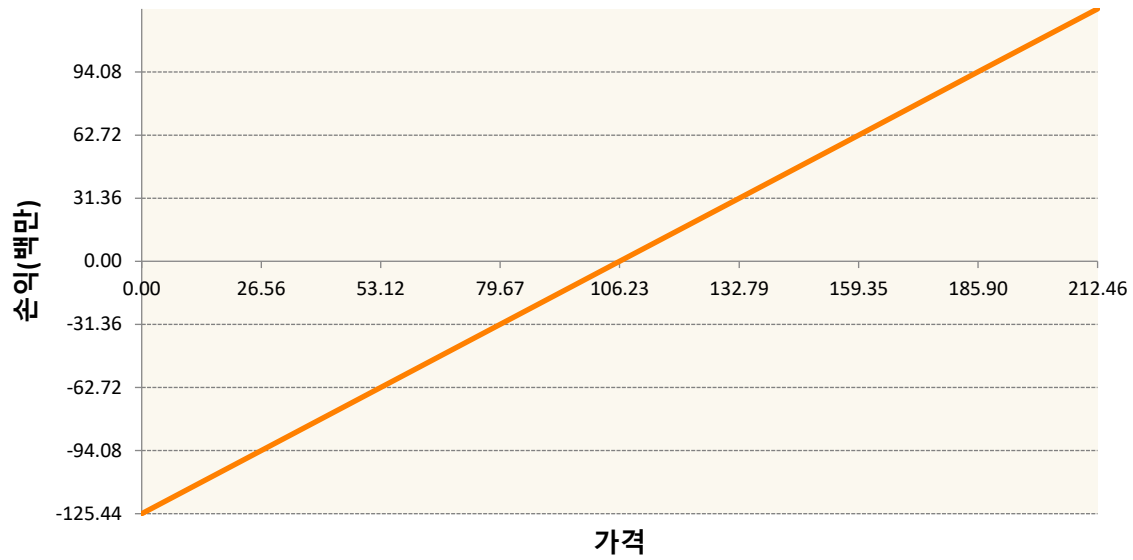
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



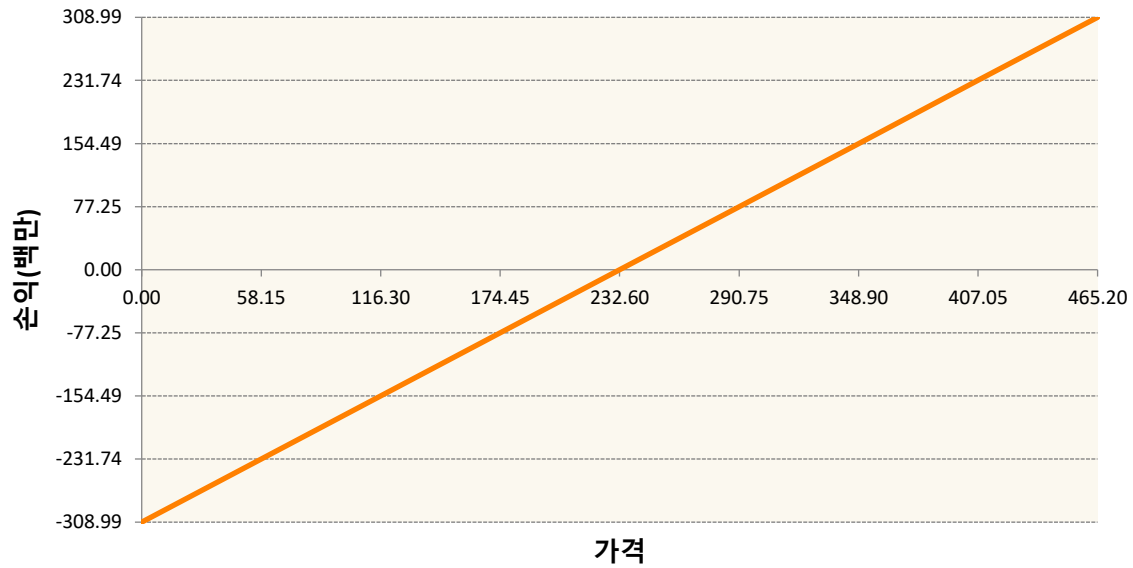
CH2-CORN FUTURE Mar22



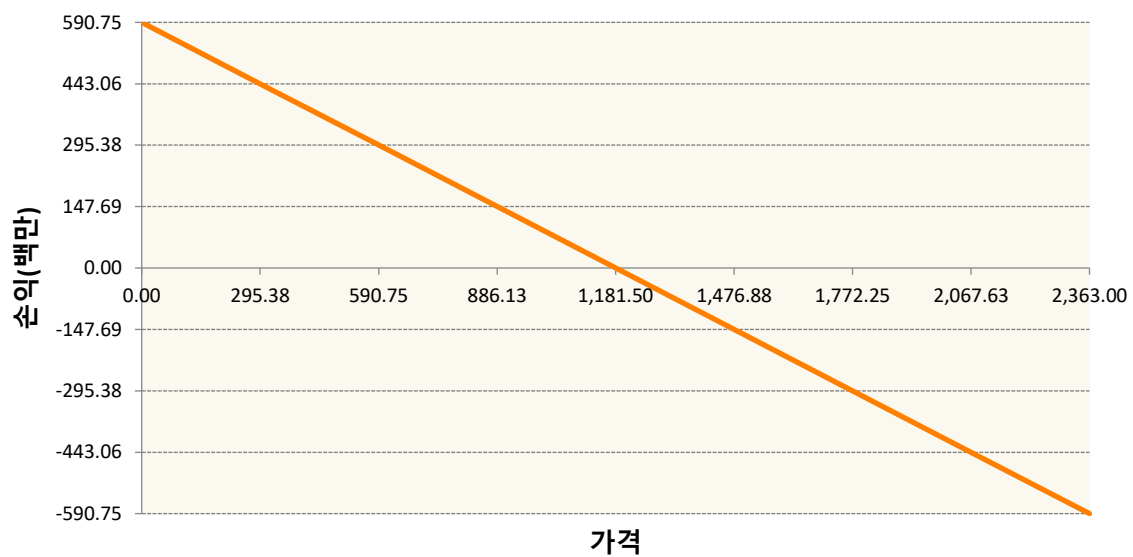
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



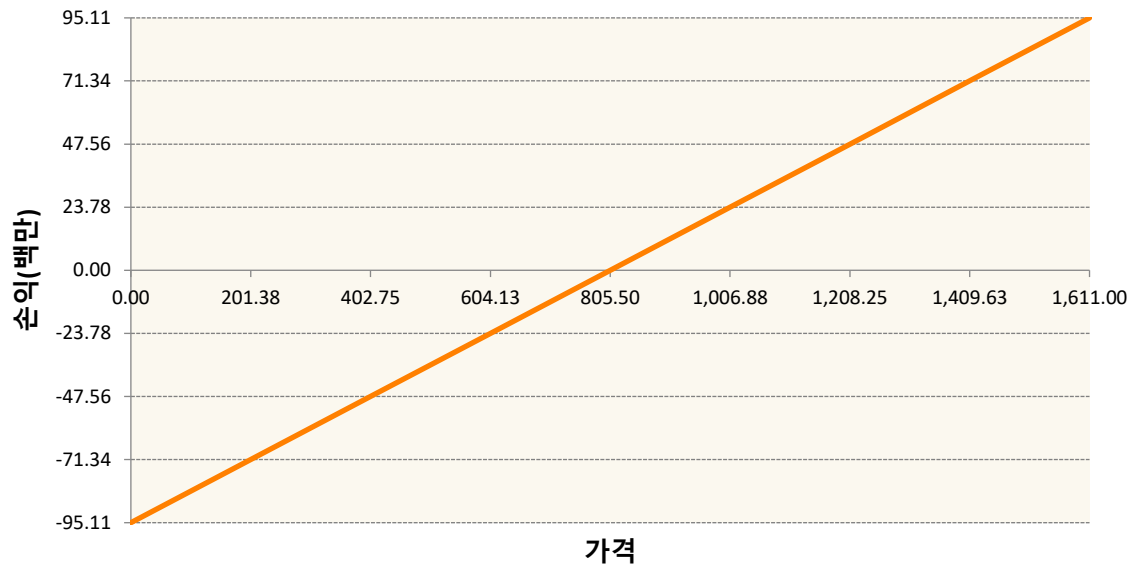
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



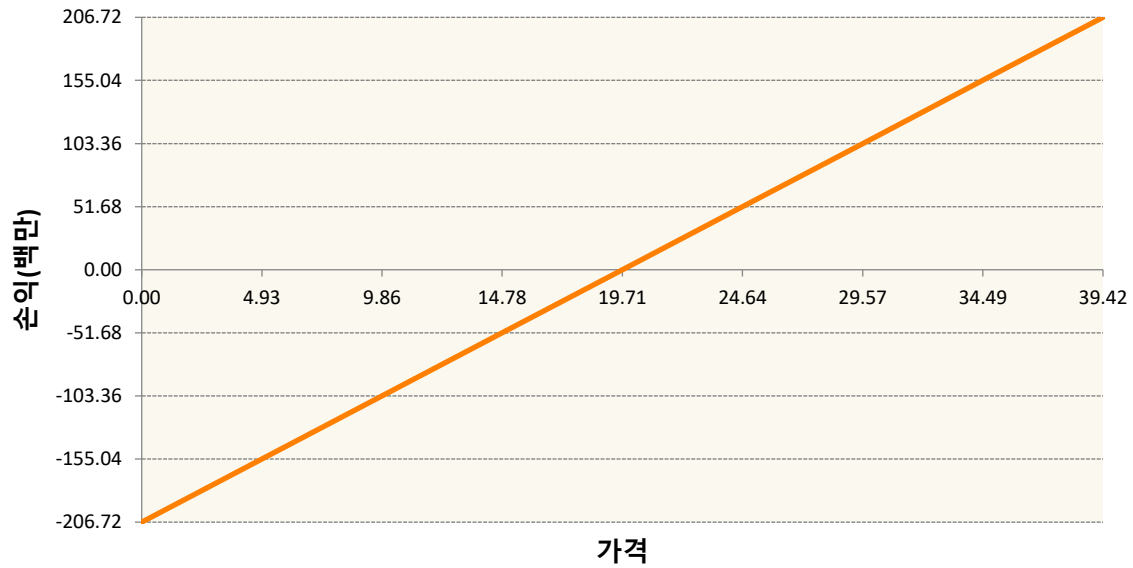
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



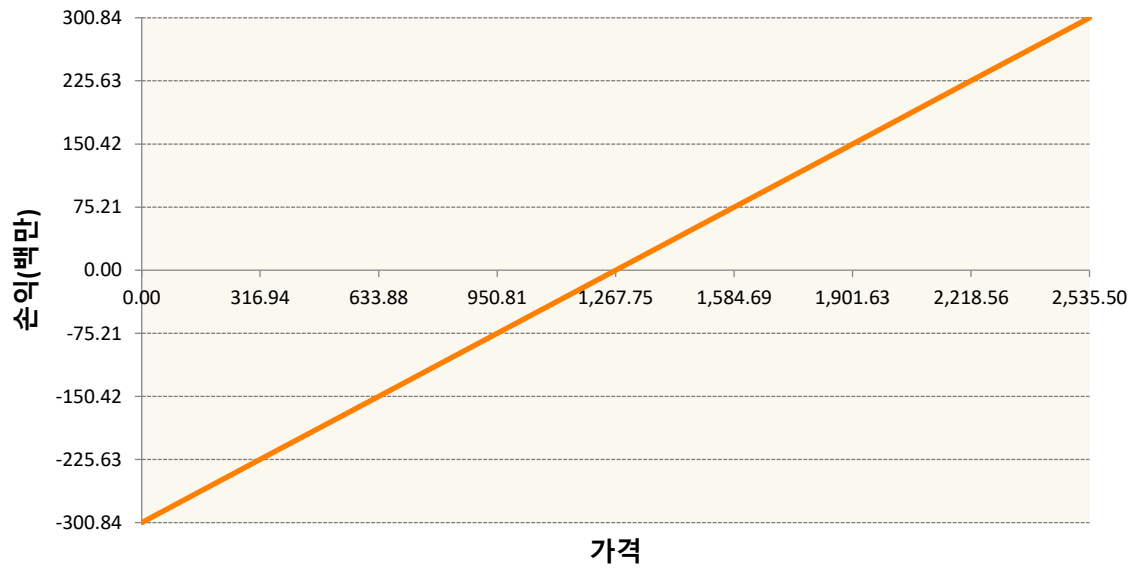
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

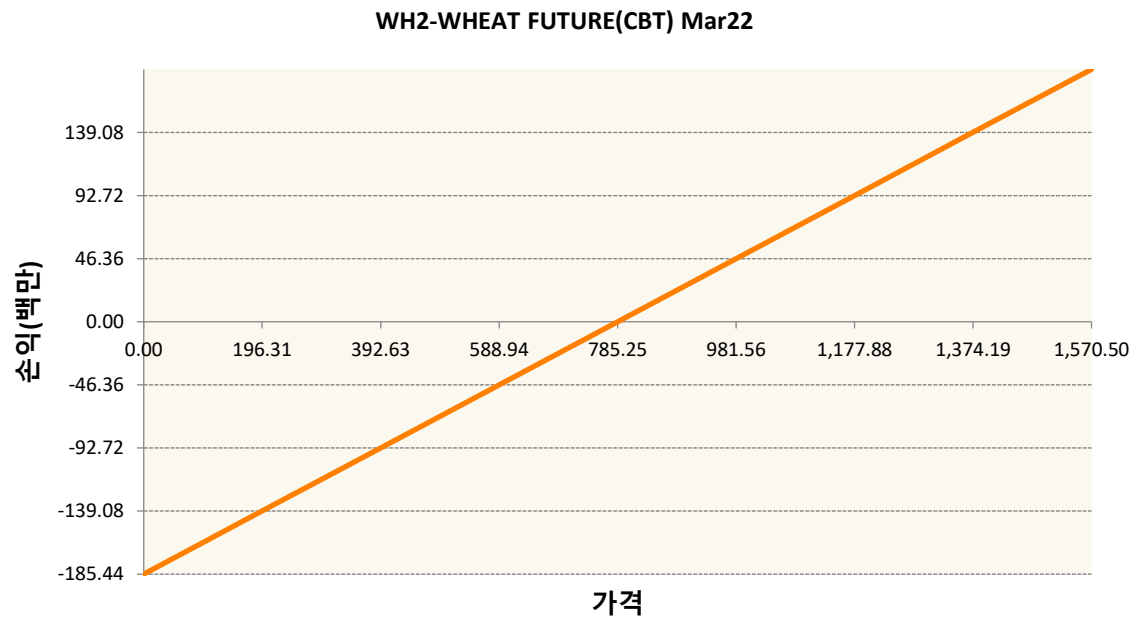
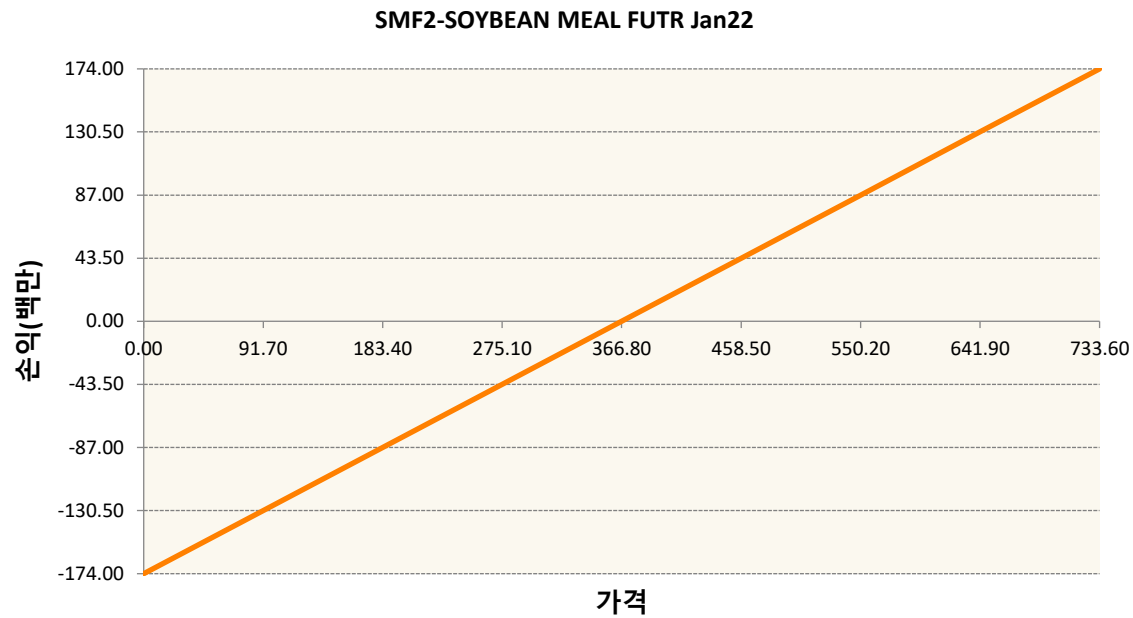


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22		18
CH2	CORN FUTURE Mar22		31
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22		10
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22		25
KR4175RC00 2021-12 달러선물			47
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22		8
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22		17
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22		24
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22		14
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22		15

