

공시일 2021-12-15

기준일 2021-12-14

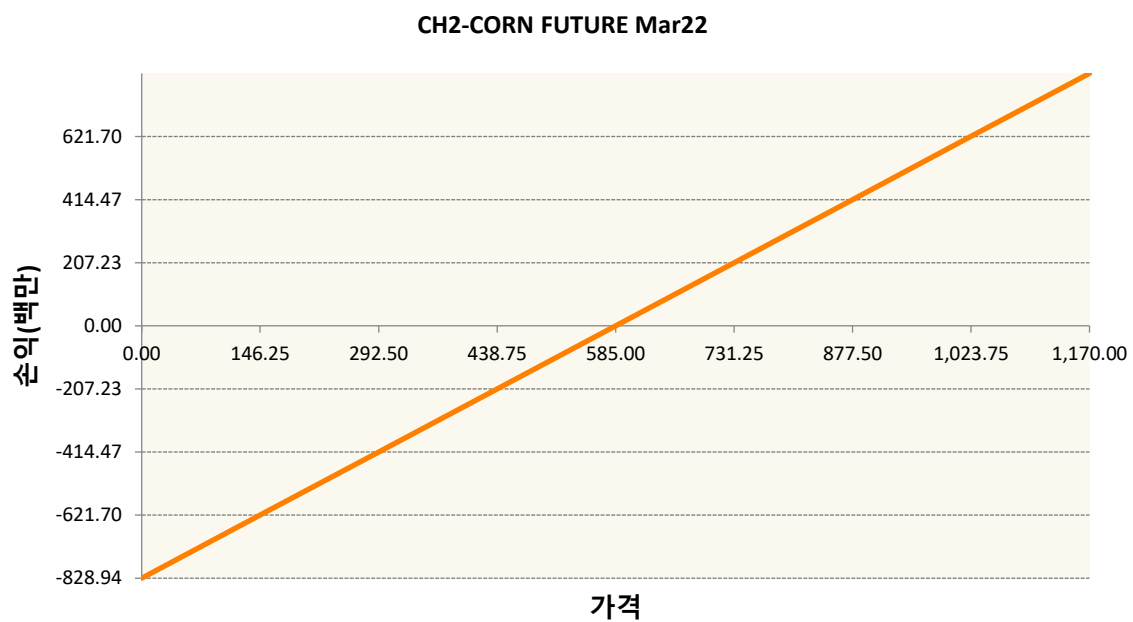
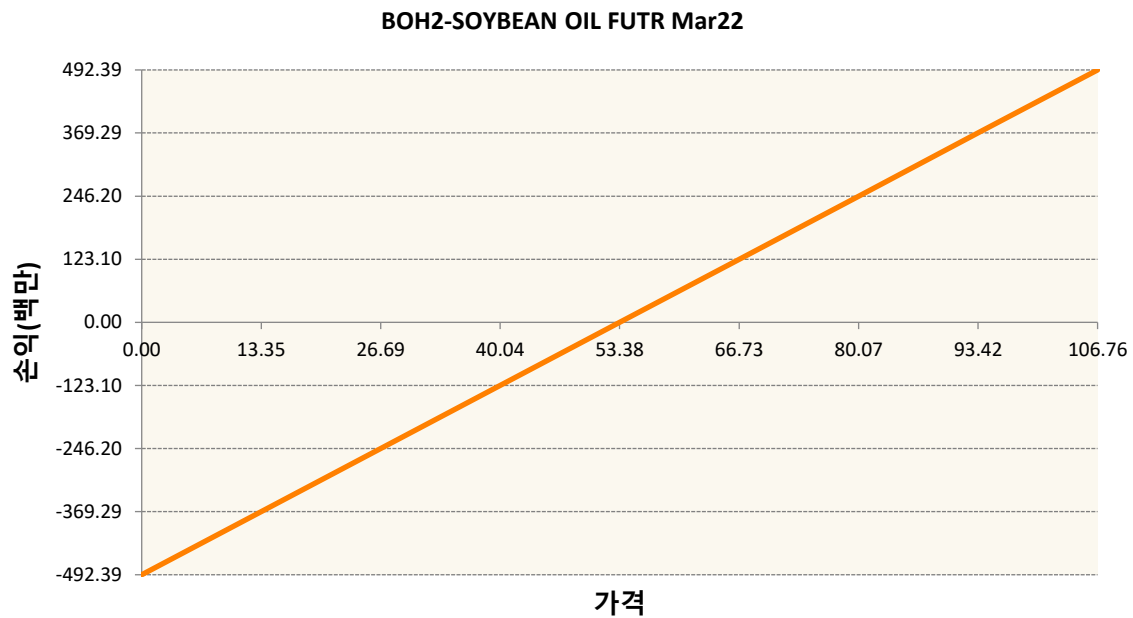
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

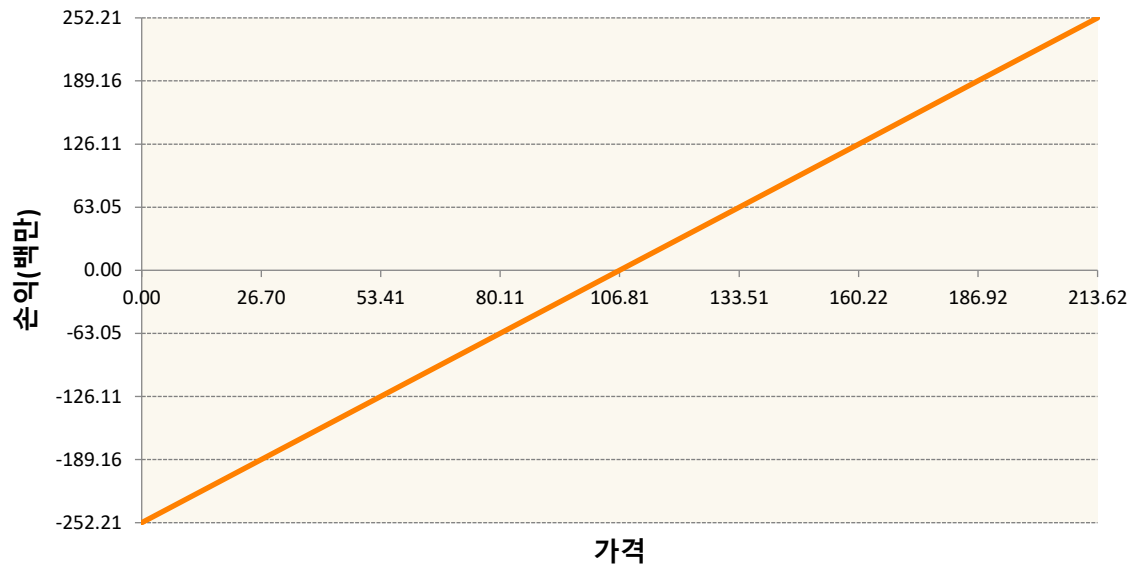
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,469	532	3,937	

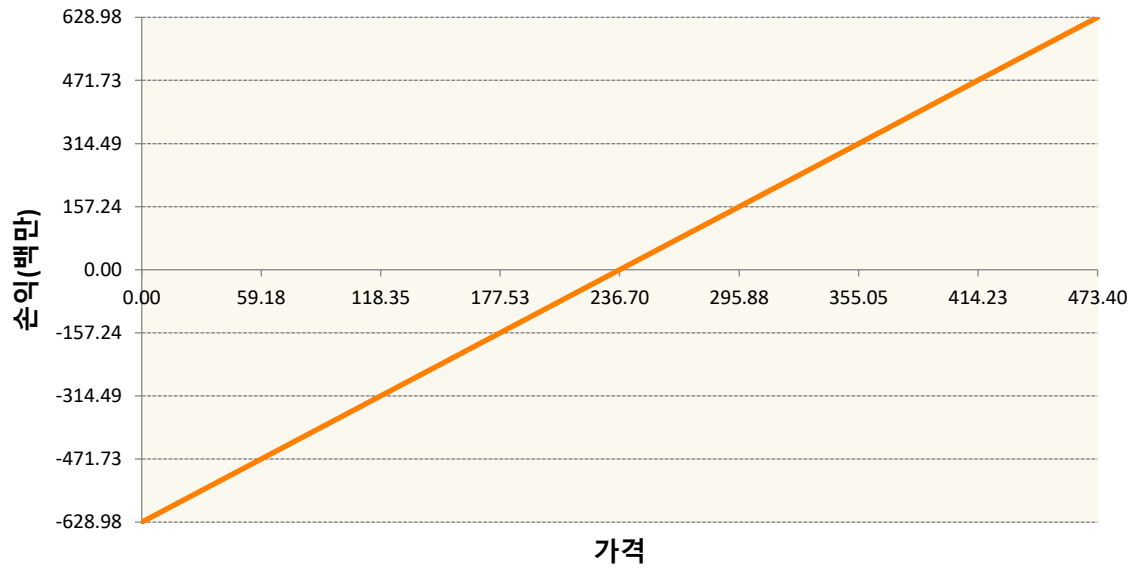
2. 만기시점의 손익구조



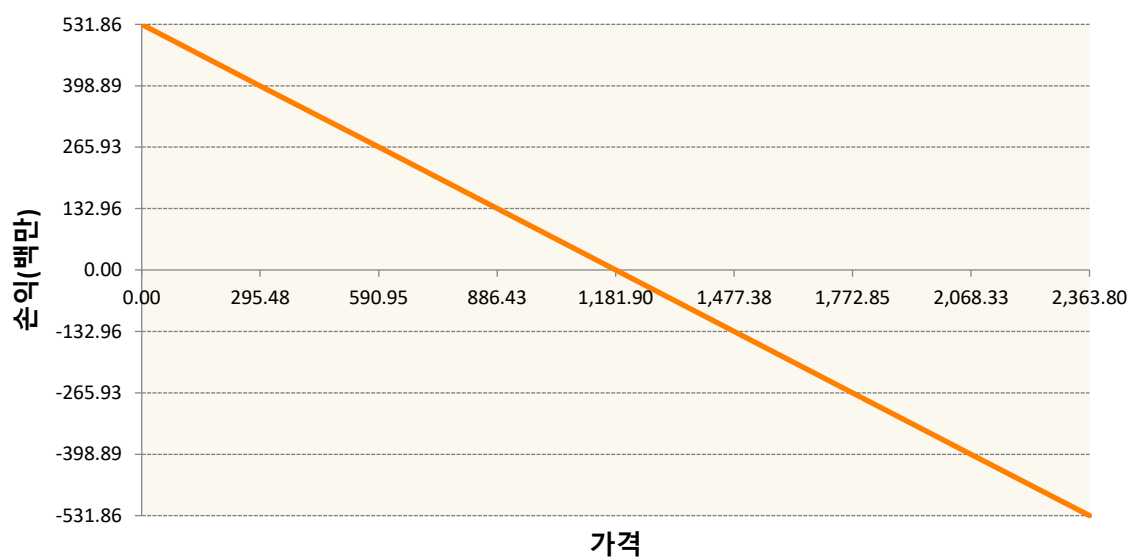
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



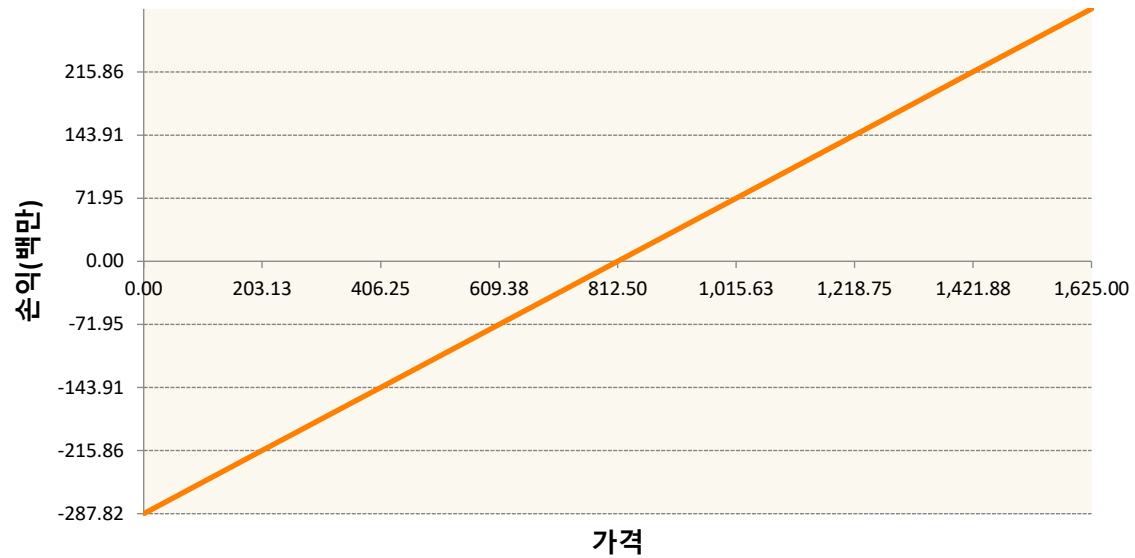
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



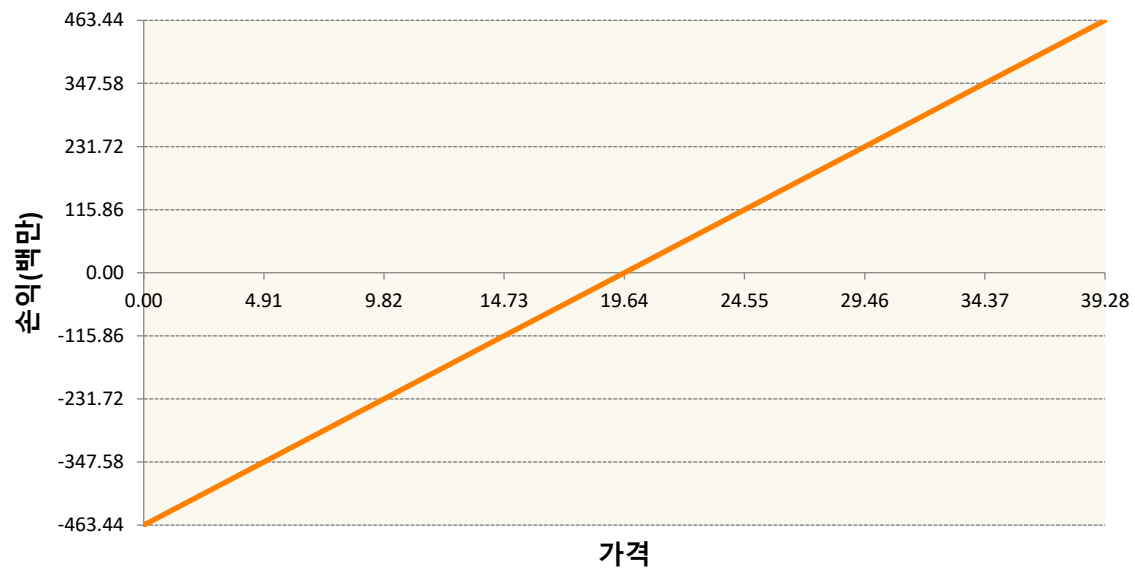
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



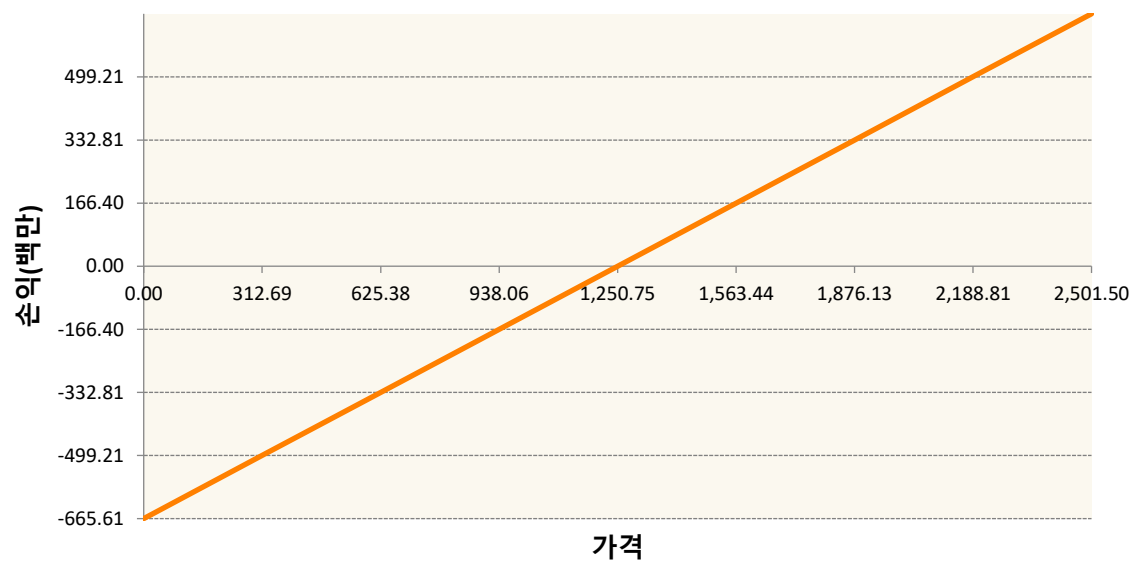
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

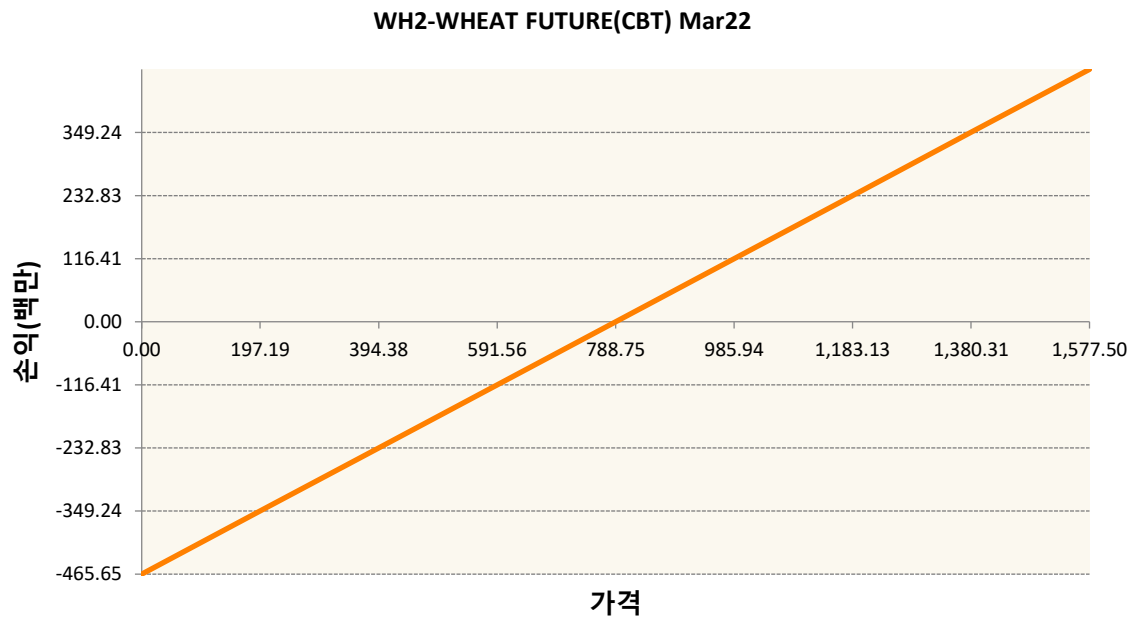
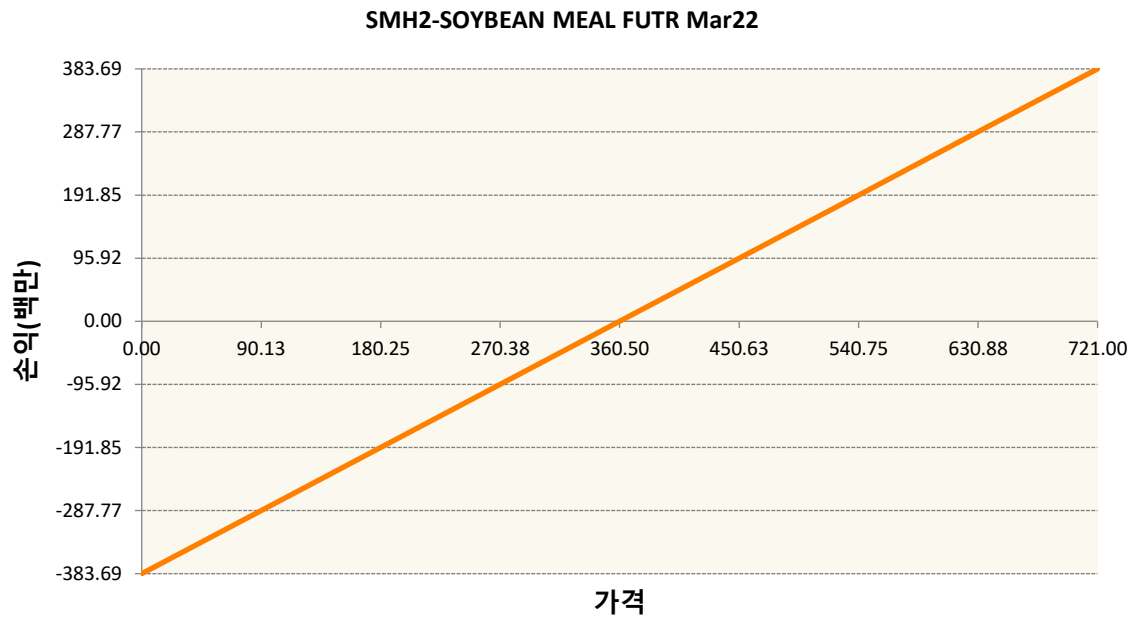


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



SH2-SOYBEAN FUTURE 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	2021-12-15
기준일	2021-12-14

스마트인덱스모

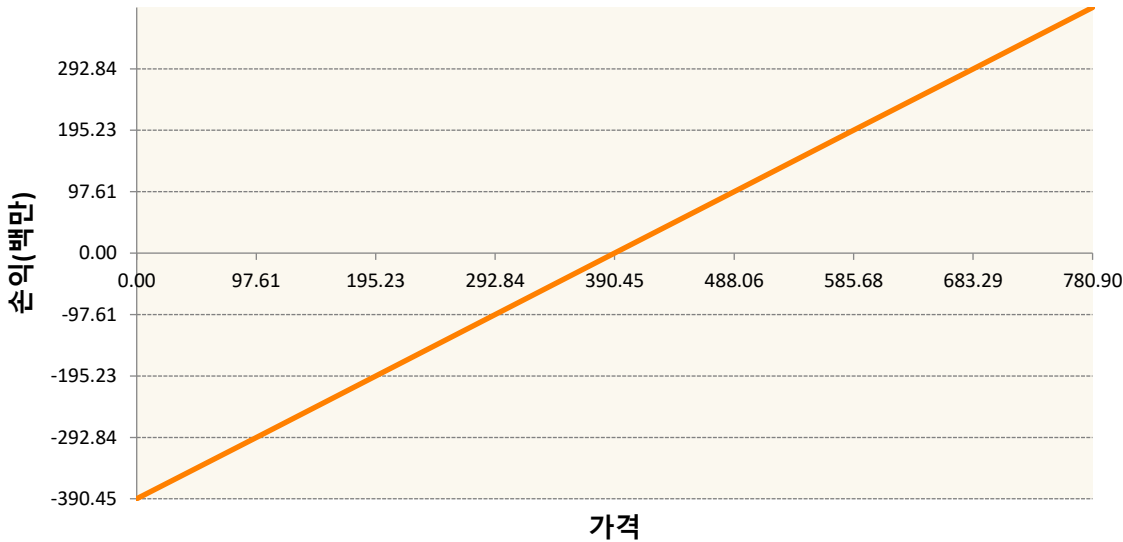
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	390	0	390	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	2021-12-15
기준일	2021-12-14

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

908

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

543

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-15
기준일	2021-12-14

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	5,505	0	5,505	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래211213

441

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

428

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-15
기준일	2021-12-14

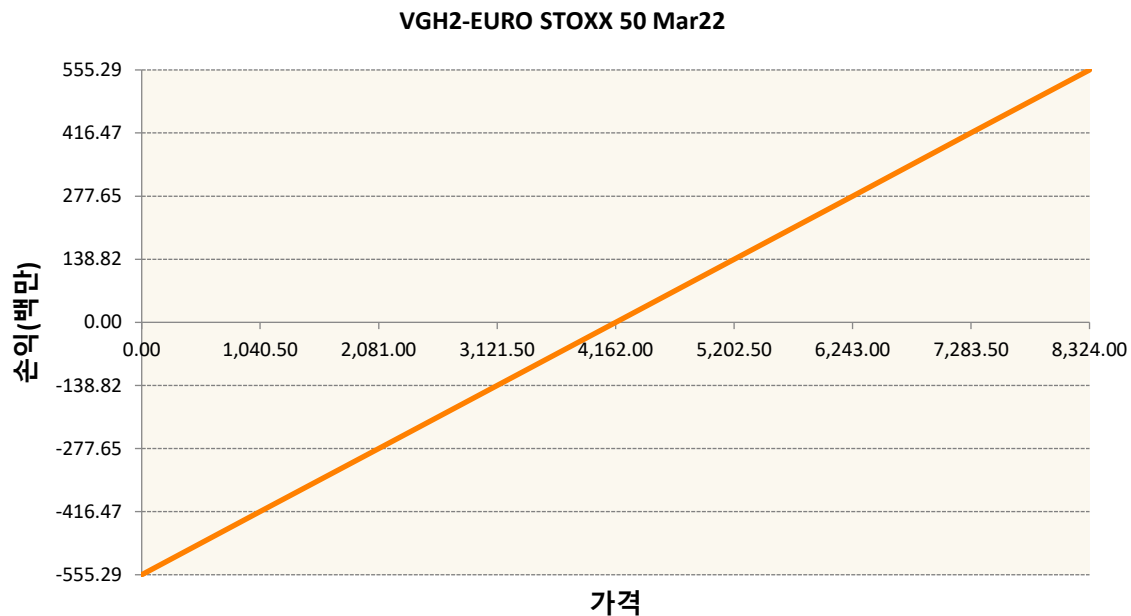
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	555	0	555	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2021-12-15
기준일	2021-12-14

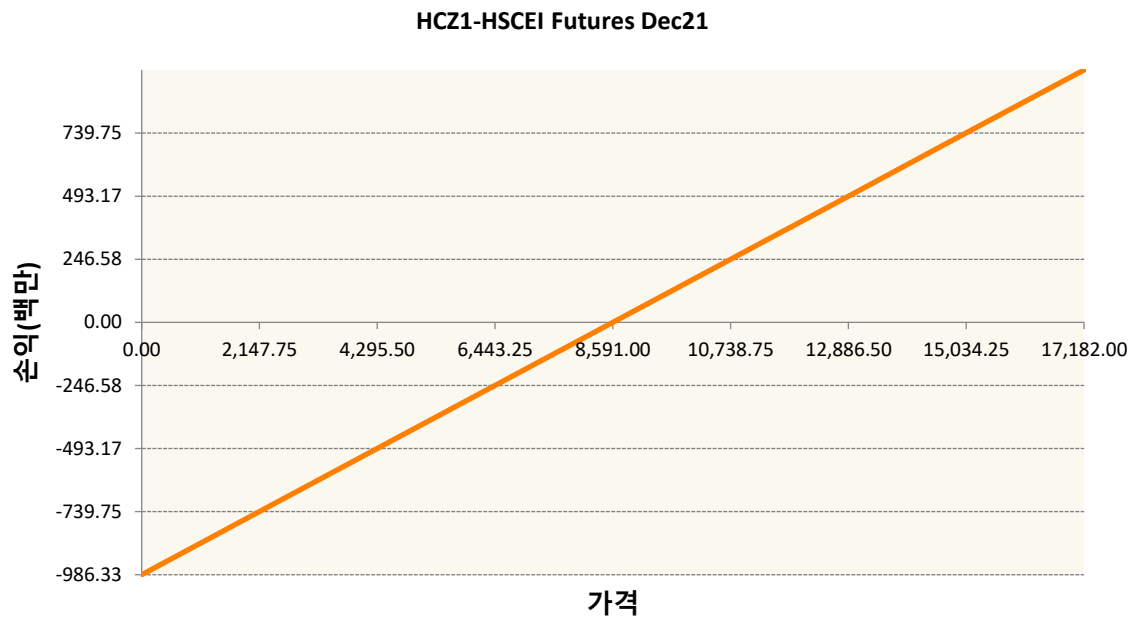
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	986	0	986	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

82

공시일 2021-12-15

기준일 2021-12-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

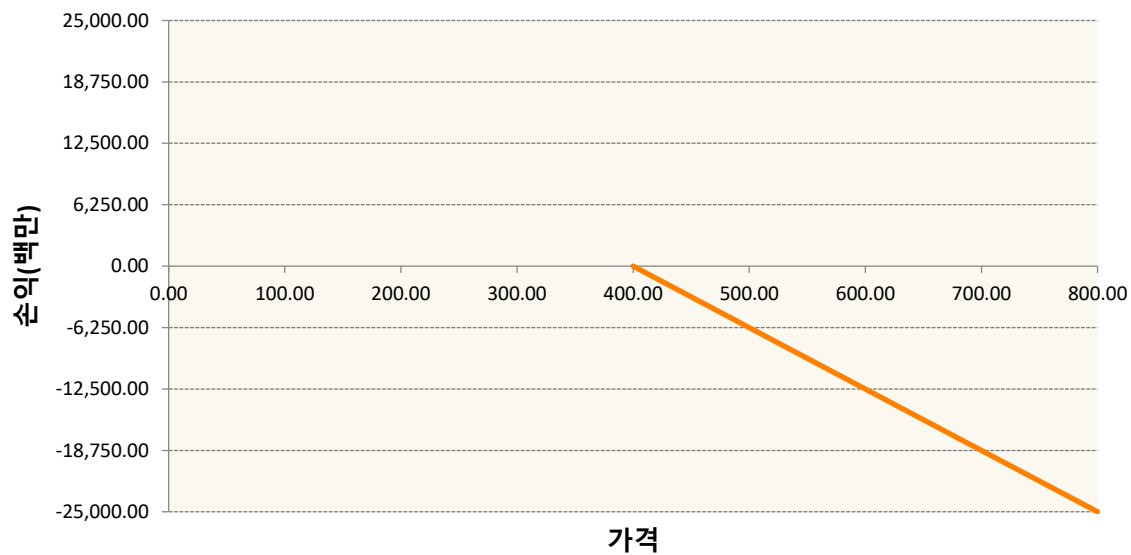
1. 계약금액

(단위:백만원)

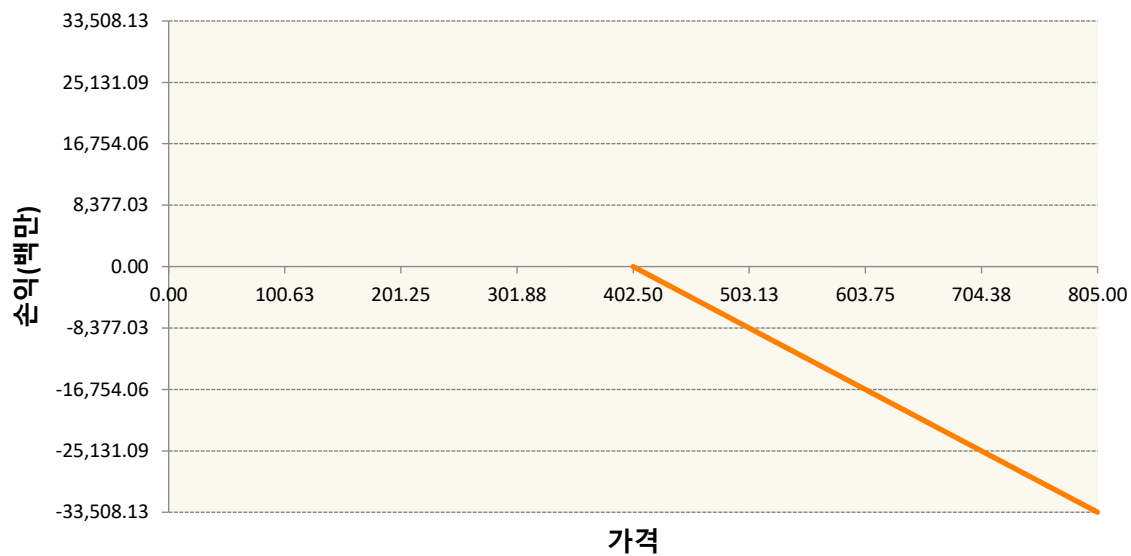
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201S14003-2022-01 콜400



KR4201S14029-2022-01 콜402.5



The graph illustrates 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 data, 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	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 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 loss of 2,012.50 million and reaches a profit of 0 million at a price of 402.50.

가격	손익 (백만)
0.00	-2,012.50
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003				2022-01 콜400			1,421
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	602	583	560	532	501	467	430
-5.33%	543	508	469	427	382	335	286
-2.67%	416	364	310	254	198	140	82
0%	191	127	64	0	-64	-128	-192
2.67%	-150	-214	-278	-342	-407	-471	-536
5.33%	-601	-655	-711	-769	-828	-887	-948
8.00%	-1,140	-1,179	-1,222	-1,268	-1,317	-1,368	-1,421
KR4201S14029				2022-01 콜402.5			1,828
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	726	705	677	644	606	564	518
-5.33%	661	620	572	520	464	405	343
-2.67%	516	451	383	312	240	165	90
0%	249	167	84	0	-84	-168	-253
2.67%	-168	-254	-341	-428	-515	-602	-689
5.33%	-735	-811	-890	-970	-1,052	-1,134	-1,217
8.00%	-1,427	-1,485	-1,547	-1,613	-1,682	-1,754	-1,828
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,151

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,118	-1,120	-1,123	-1,128	-1,134	-1,142	-1,151
-5.33%	-668	-676	-686	-697	-711	-726	-743
-2.67%	-251	-270	-290	-312	-335	-359	-383
0%	87	58	29	0	-29	-59	-88
2.67%	310	281	252	222	193	163	133
5.33%	422	402	381	359	335	310	285
8.00%	464	455	443	430	414	397	379

KR4301S14027 2022-01 풋402.5							135
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-133	-133	-133	-134	-135	-135
-5.33%	-81	-81	-82	-83	-85	-86	-88
-2.67%	-32	-34	-36	-38	-40	-43	-45
0%	10	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	38	35	31	28	24	21	17
5.33%	54	51	49	46	43	40	37
8.00%	60	59	57	55	53	51	49

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

(단위:백만원)

4,272

공시일 2021-12-15

기준일 2021-12-14

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

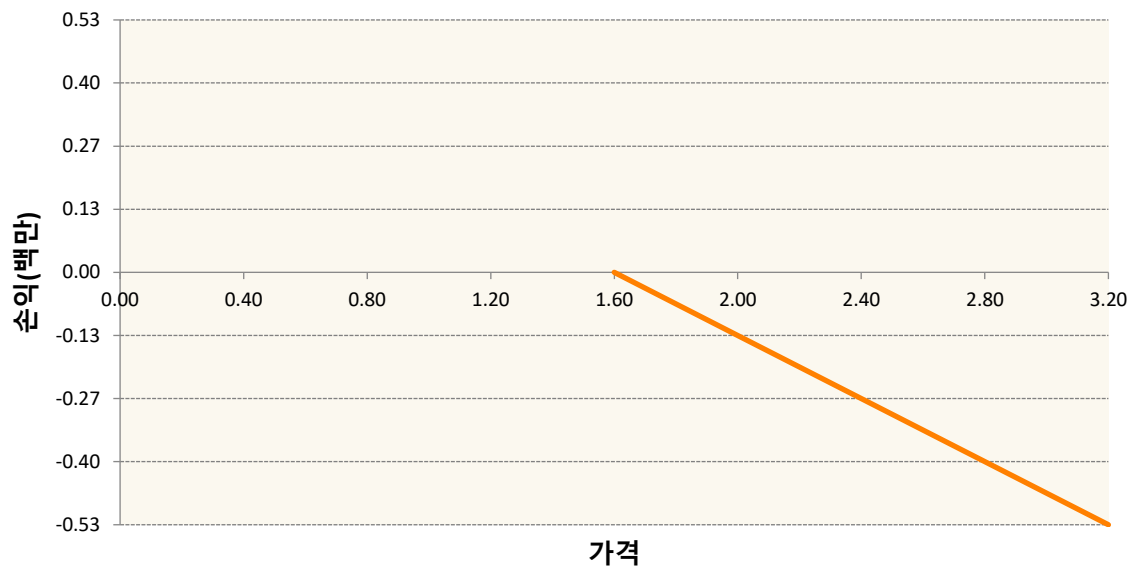
1. 계약금액

(단위:백만원)

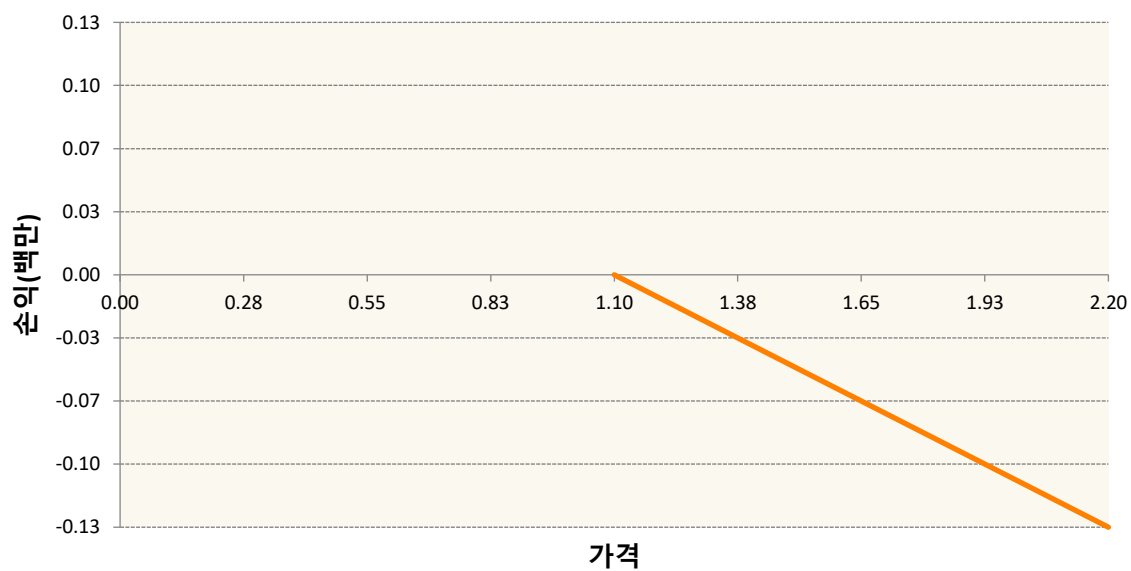
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	100	-100	장내

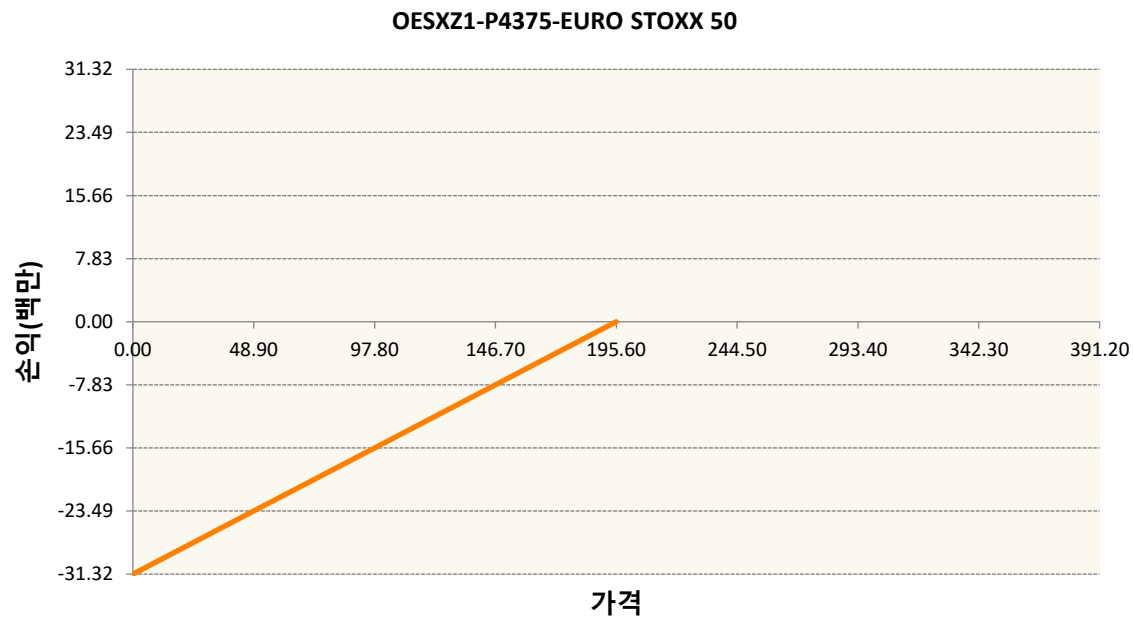
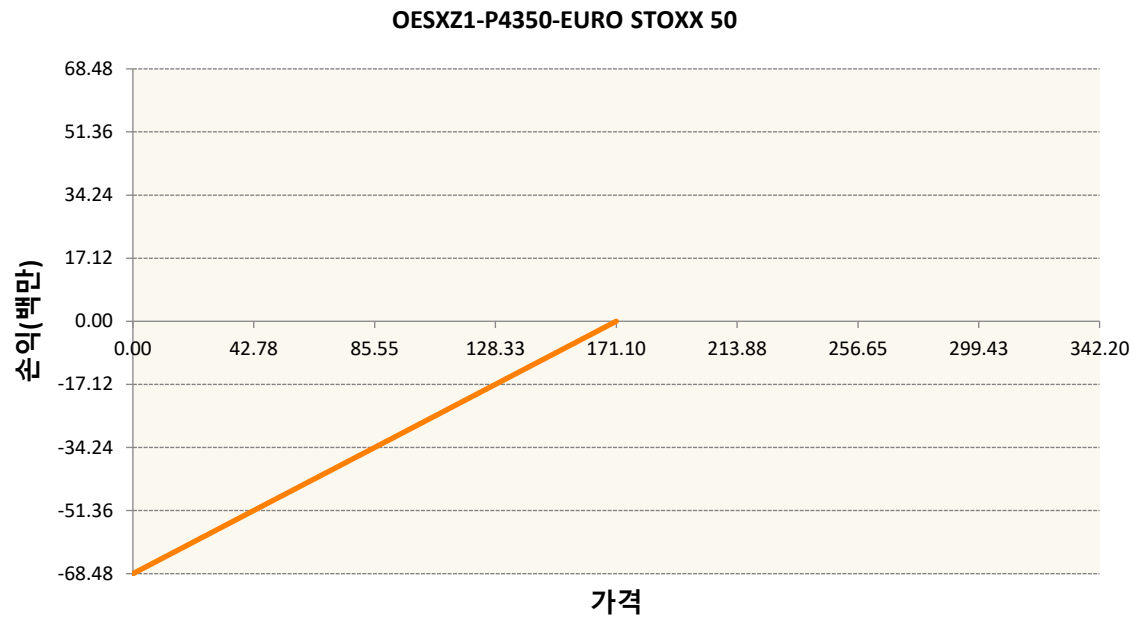
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		7
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.04
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.01
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		5
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	16

공시일	2021-12-15
기준일	2021-12-14

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

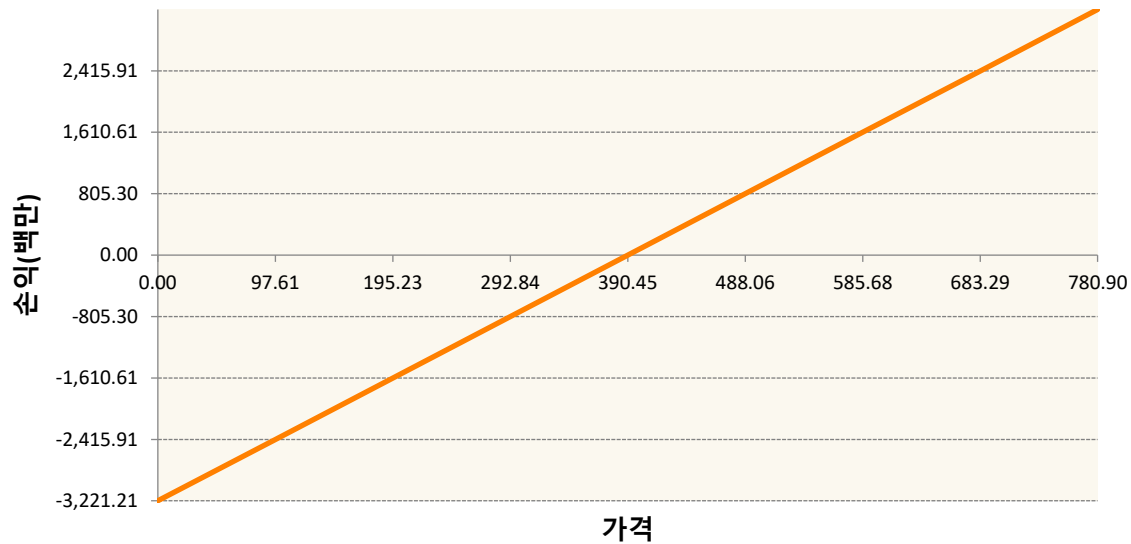
1. 계약금액

(단위:백만원)

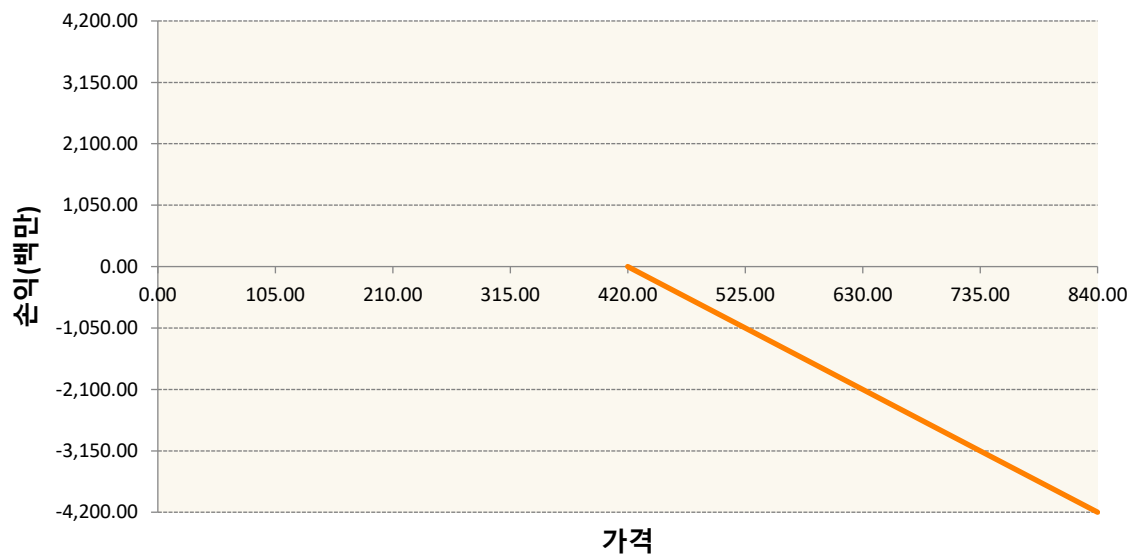
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,221	0	3,221	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S14201-2022-01 콜420



The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 850.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from -1,275.00 to 1,275.00. A blue line represents the profit function, starting at a price of 425.00 with zero profit and decreasing linearly to a price of 850.00 with a profit of -1,275.00.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
425.00	0.00
850.00	-1,275.00

The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 800.00. The y-axis, labeled '이익 (백만)' (Profit in millions), ranges from -200.00 to 200.00. A blue line starts at a profit of 200.00 when the price is 0.00 and decreases linearly to a profit of 0.00 when the price is 400.00. Beyond a price of 400.00, the profit would become negative, but the line is not plotted in that region.

가격 (Price)	이익 (백만) (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			261
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-261	-261	-261	-261	-261	-261	-261
-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%	261	261	261	261	261	261	261
KR4201S14201				2022-01 콜420			161
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	38	37	36	34	31	28
-5.33%	38	36	33	30	26	22	17
-2.67%	33	29	24	19	13	7	0
0%	21	15	8	0	-8	-16	-25
2.67%	-2	-11	-20	-30	-40	-50	-60
5.33%	-40	-51	-62	-73	-83	-94	-105
8.00%	-97	-107	-118	-129	-139	-150	-161
KR4201S14250 2022-01 콜425							43

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	8	8	7	6
-5.33%	9	8	8	7	6	5	4
-2.67%	8	7	6	5	3	1	0
0%	5	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	0	-2	-5	-7	-10	-13	-16
5.33%	-9	-12	-15	-18	-22	-25	-28
8.00%	-23	-27	-30	-33	-37	-40	-43
KR4301S14001 2022-01 풋400							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%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	3	3	3	4	4	4	4
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-5	-5	-4	-4	-4	-4	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4

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

(단위:백만원)

428

공시일	2021-12-15
기준일	2021-12-14

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	17,975	0	17,975	

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	2021-12-15
기준일	2021-12-14

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	9,685	0	9,685	

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	2021-12-15
기준일	2021-12-14

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	45,745	0	45,745	
누계	통화	선도	1,419	0	1,419	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)

38

공시일	2021-12-15
기준일	2021-12-14

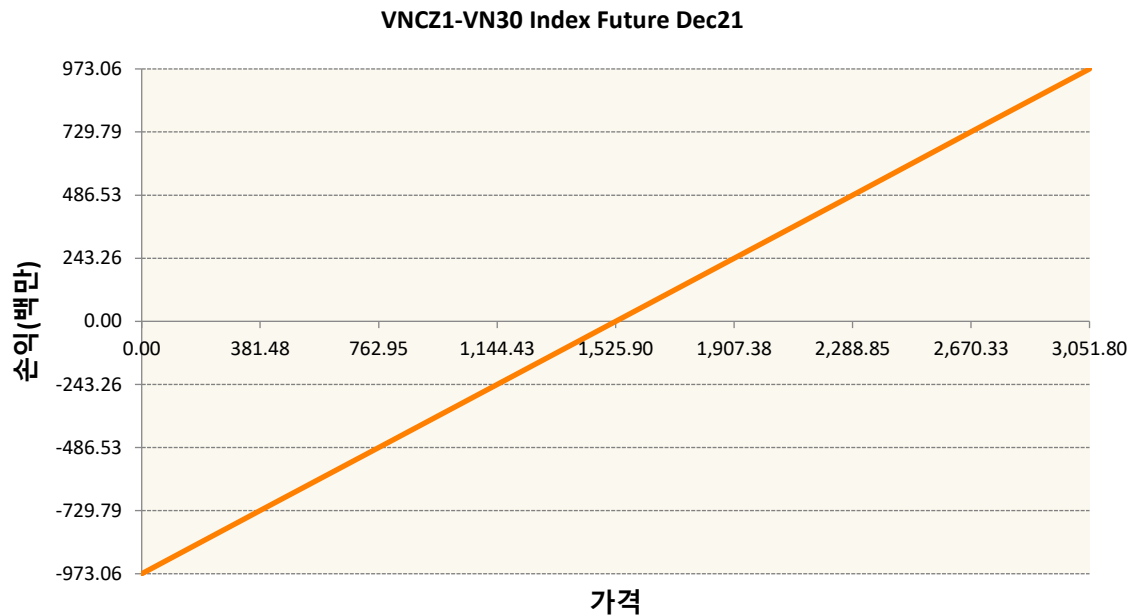
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	973	0	973	
누계	유가증권	스왑	1,782	0	1,782	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	78

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

(단위:백만원)

258

공시일 2021-12-15

기준일 2021-12-14

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

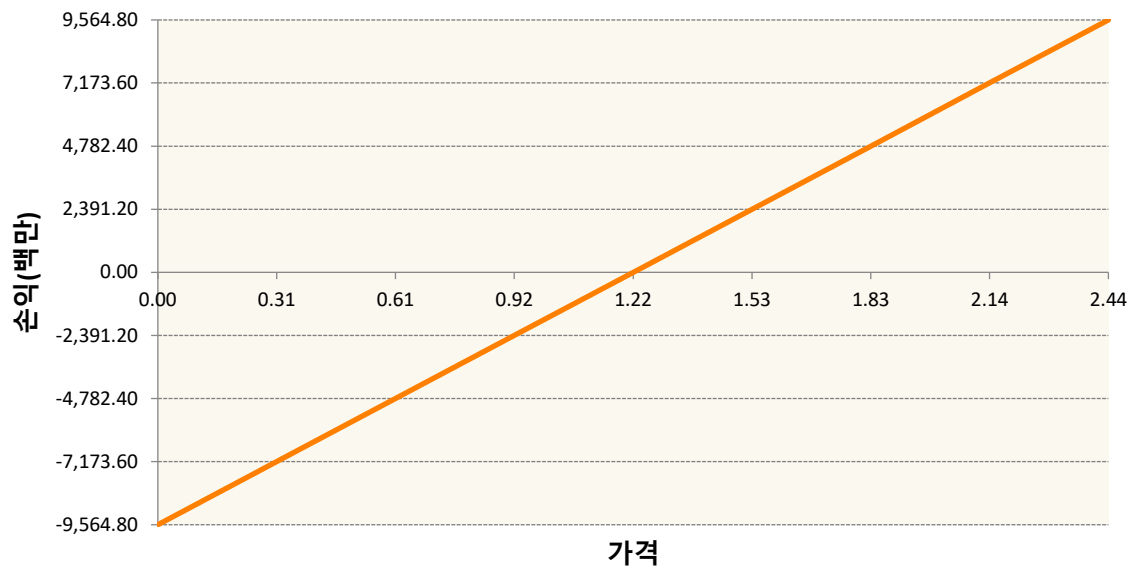
1. 계약금액

(단위:백만원)

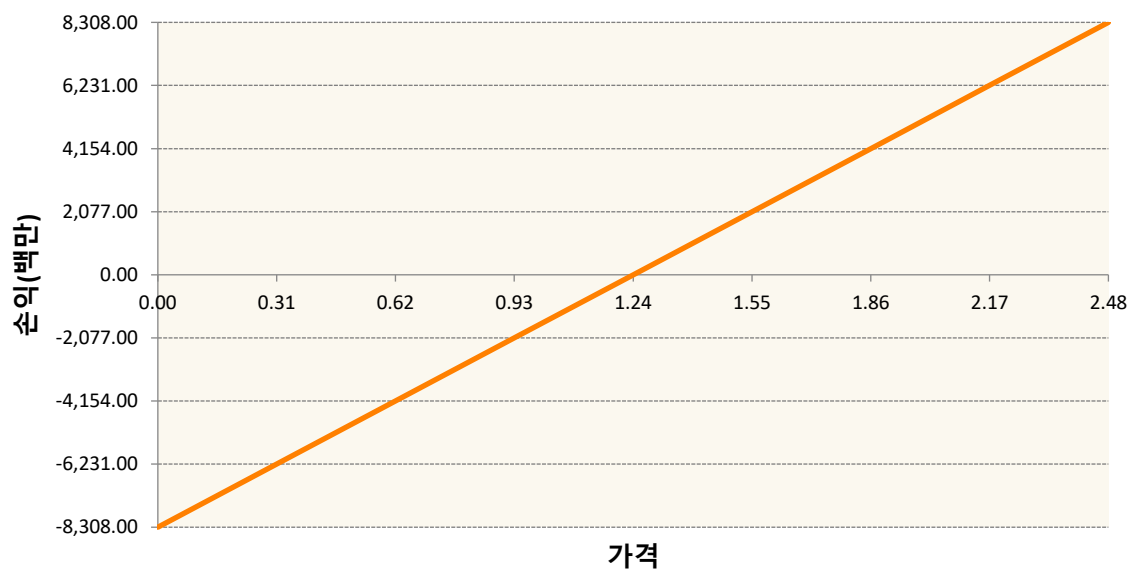
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,300	0	7,300	
누계	유가증권	선물	35,765	0	35,765	

2. 만기시점의 손익구조

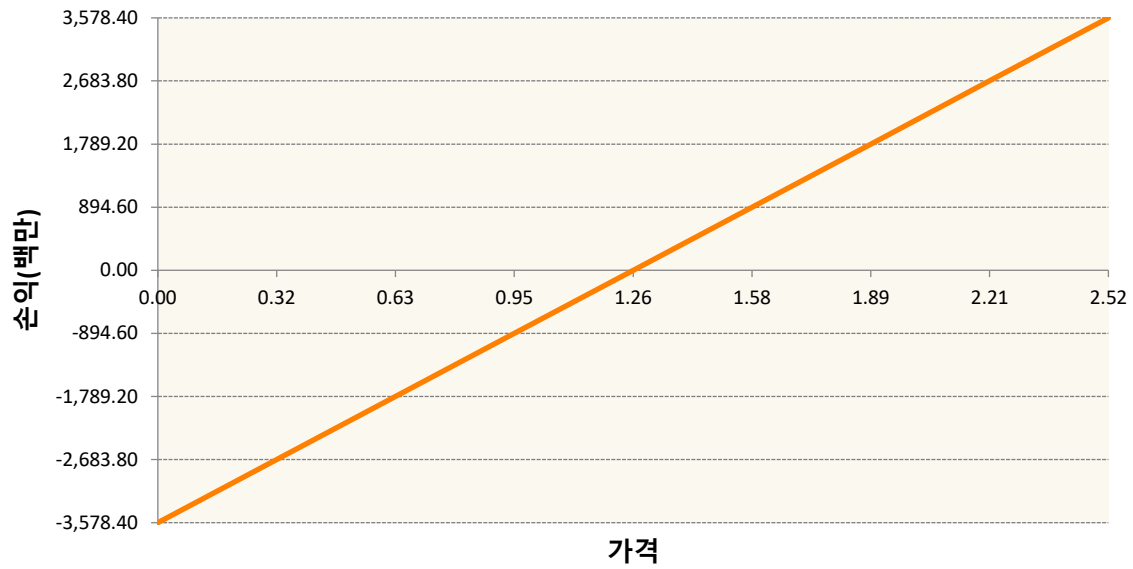
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



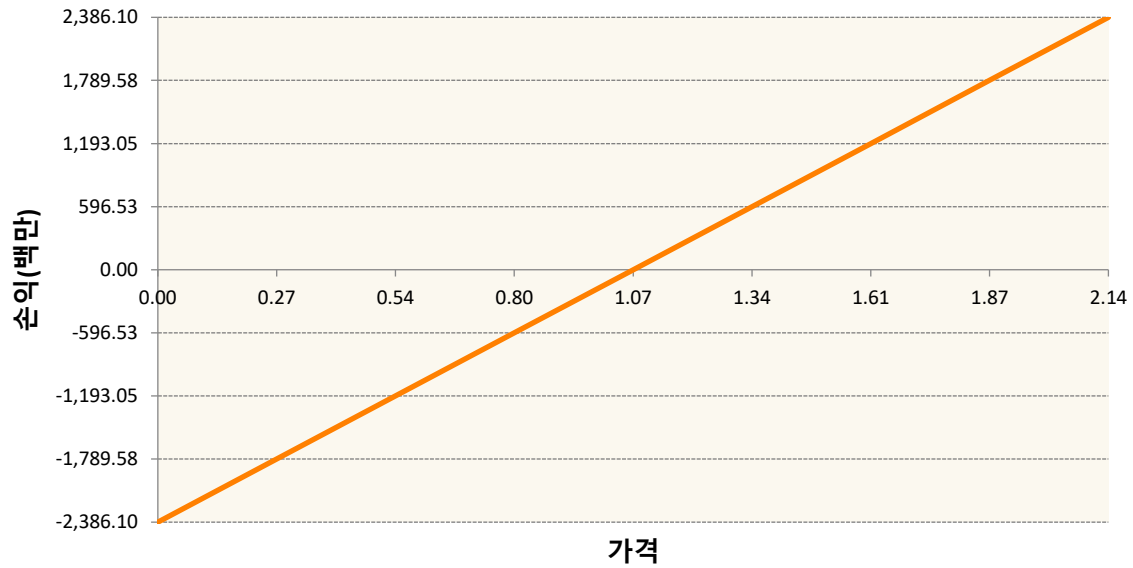
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



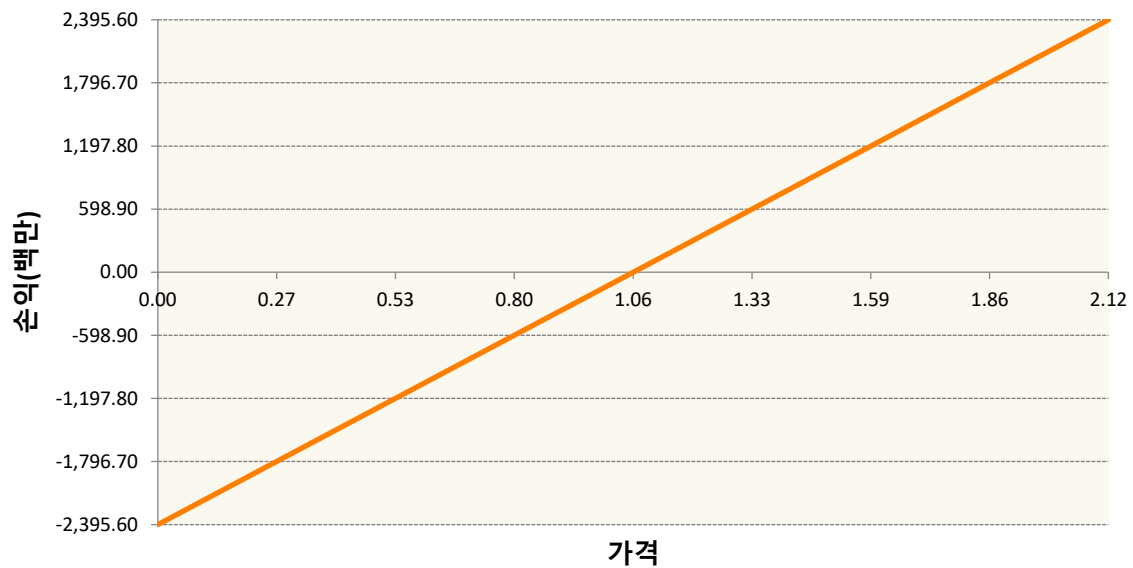
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)

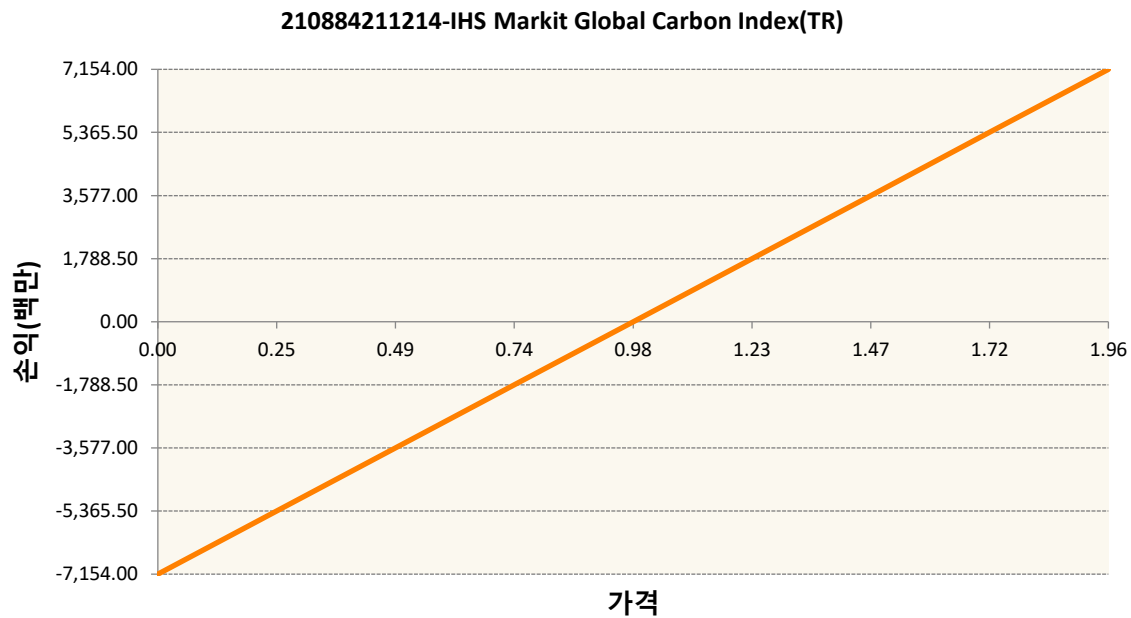
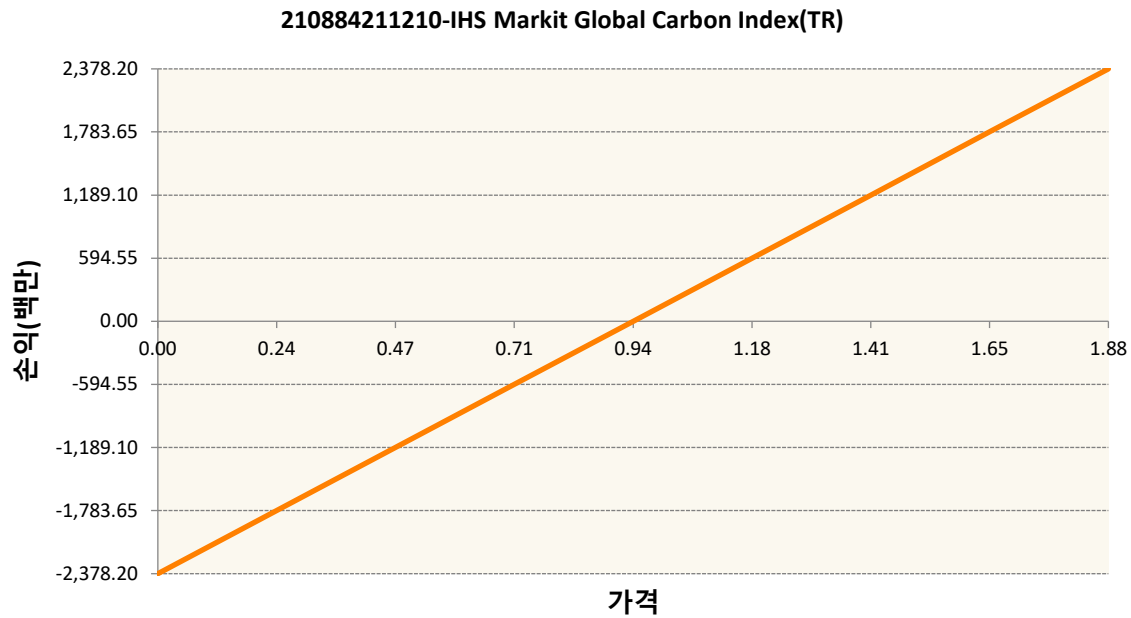


210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		765
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		666
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		287
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		191
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		191
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		191
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		573

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,395

공시일	2021-12-15
기준일	2021-12-14

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

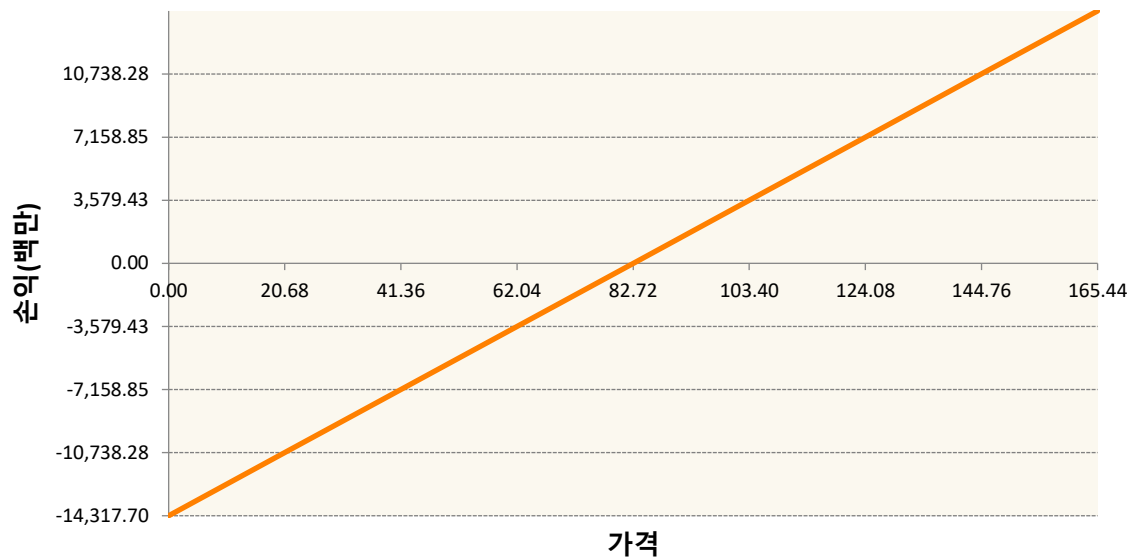
1. 계약금액

(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	14,318	0	14,318	
누계	통화	선도	0	6,696	-6,696	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	1,145

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

(단위:백만원)

2,574

공시일 2021-12-15

기준일 2021-12-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

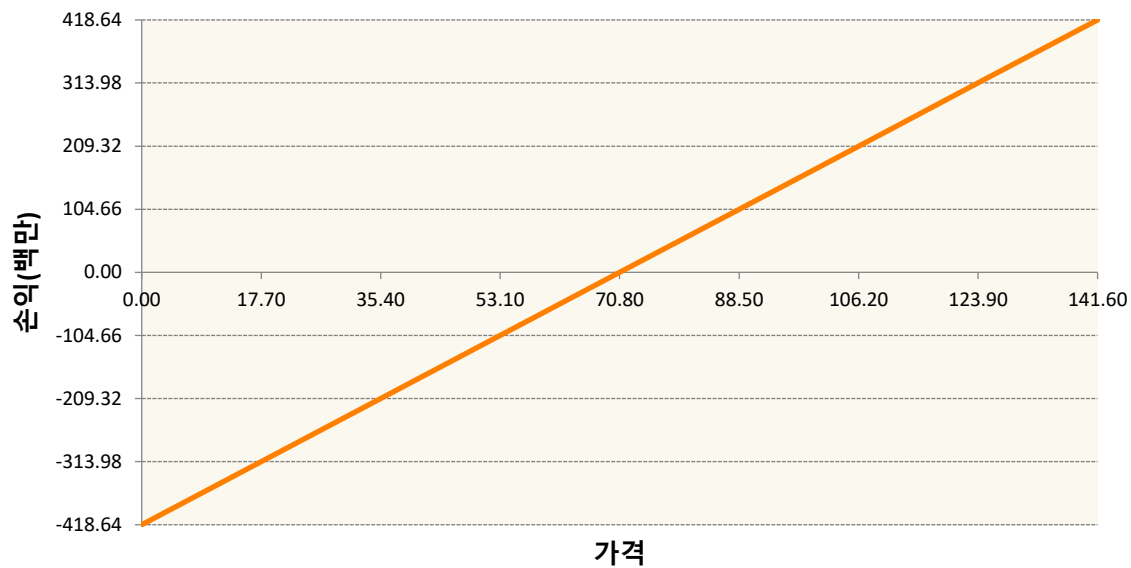
1. 계약금액

(단위:백만원)

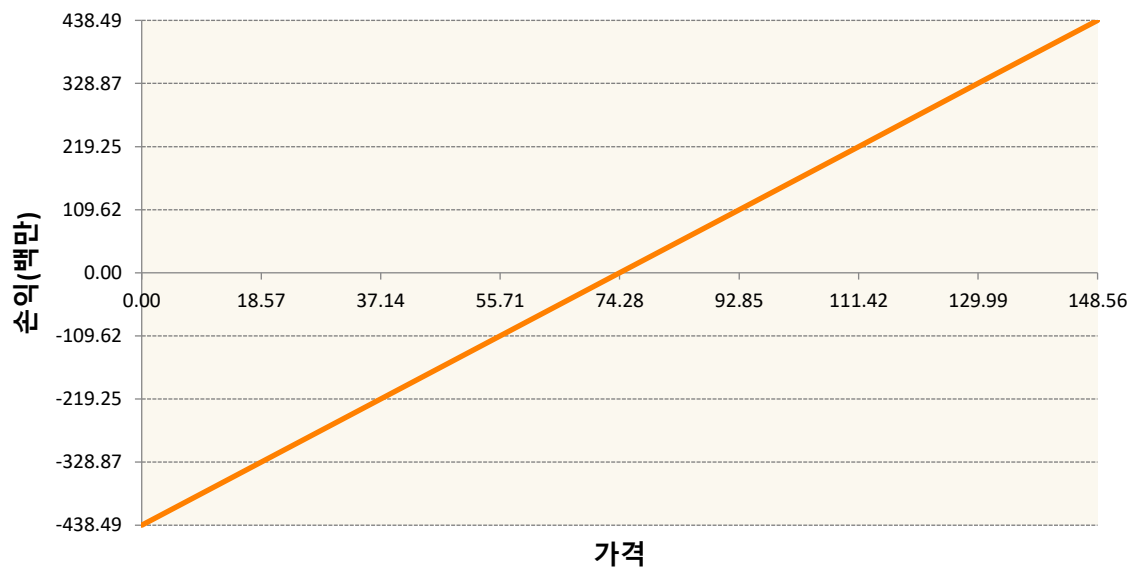
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,822	355	1,468	

2. 만기시점의 손익구조

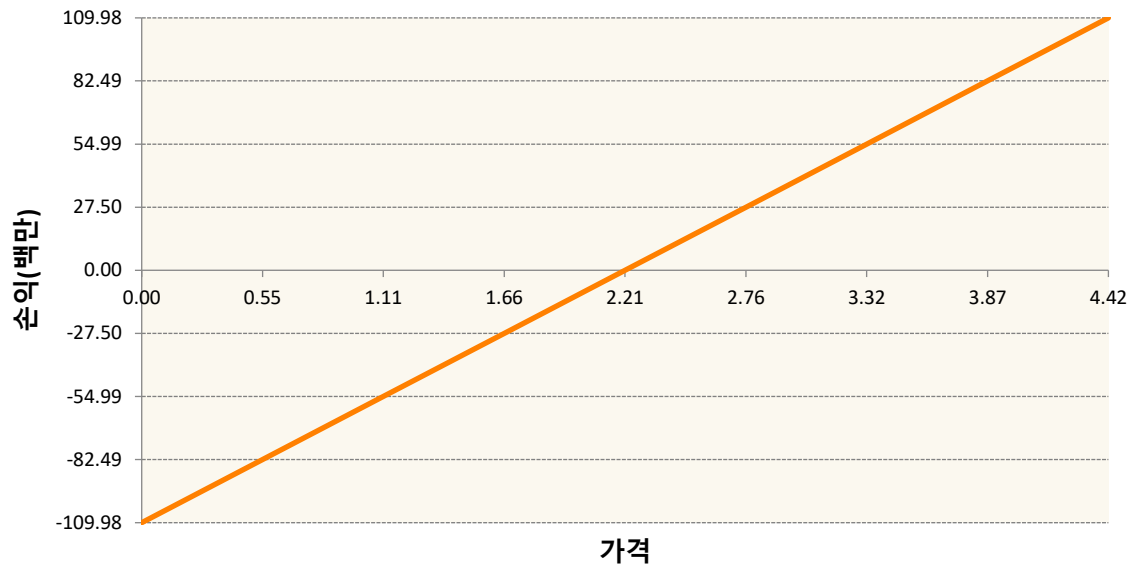
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



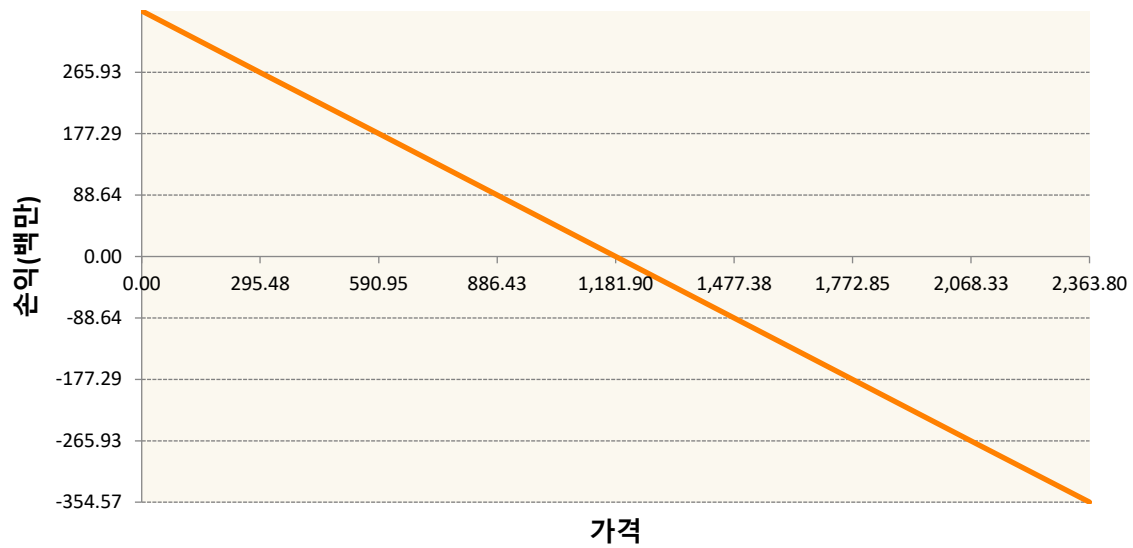
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



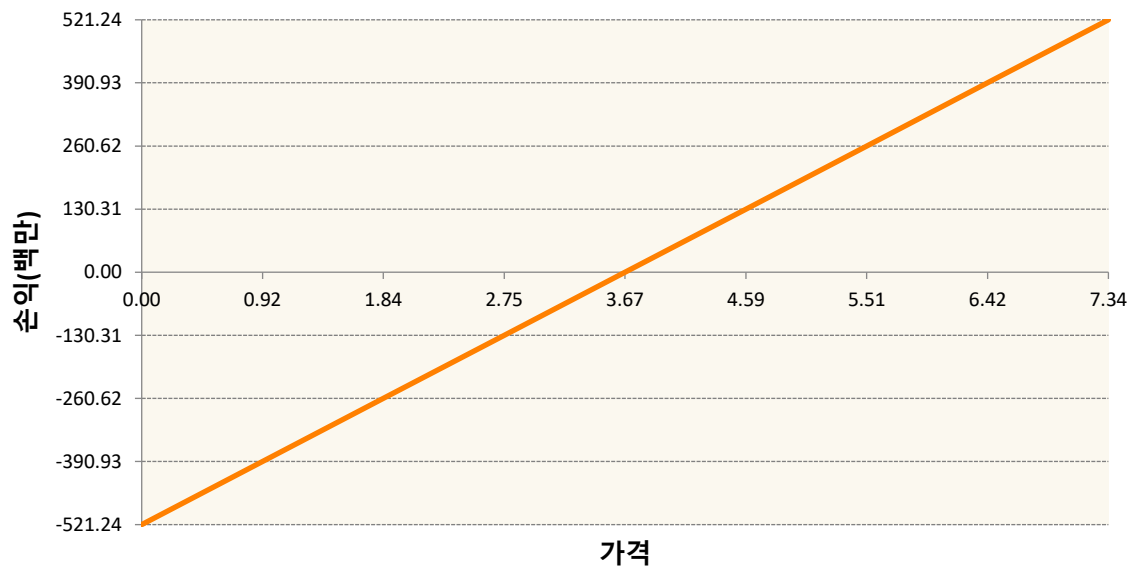
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

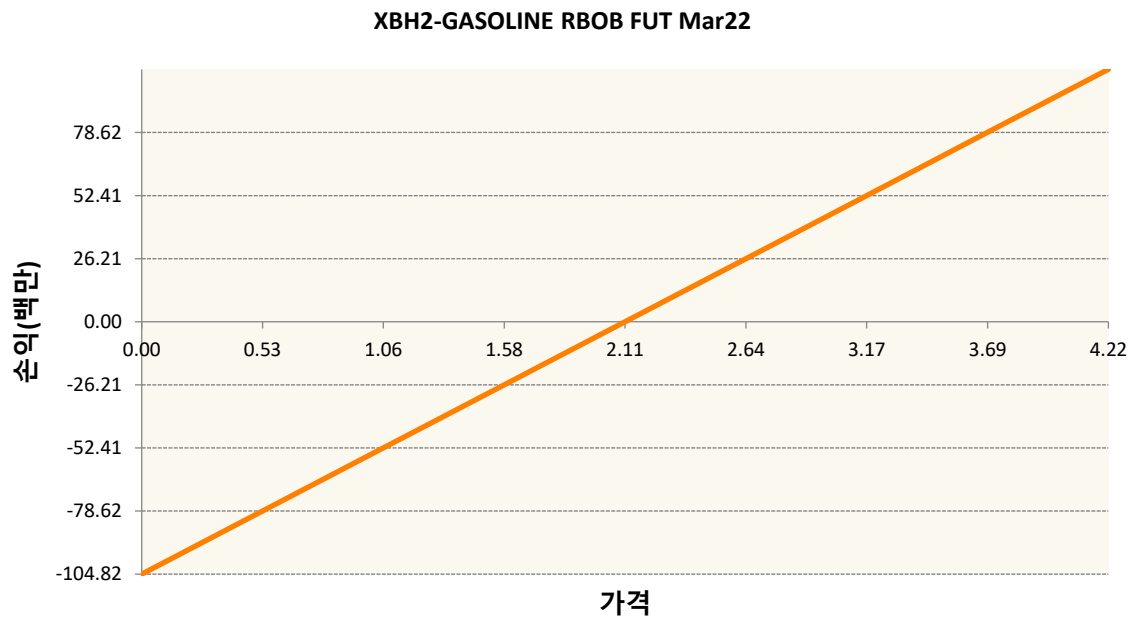
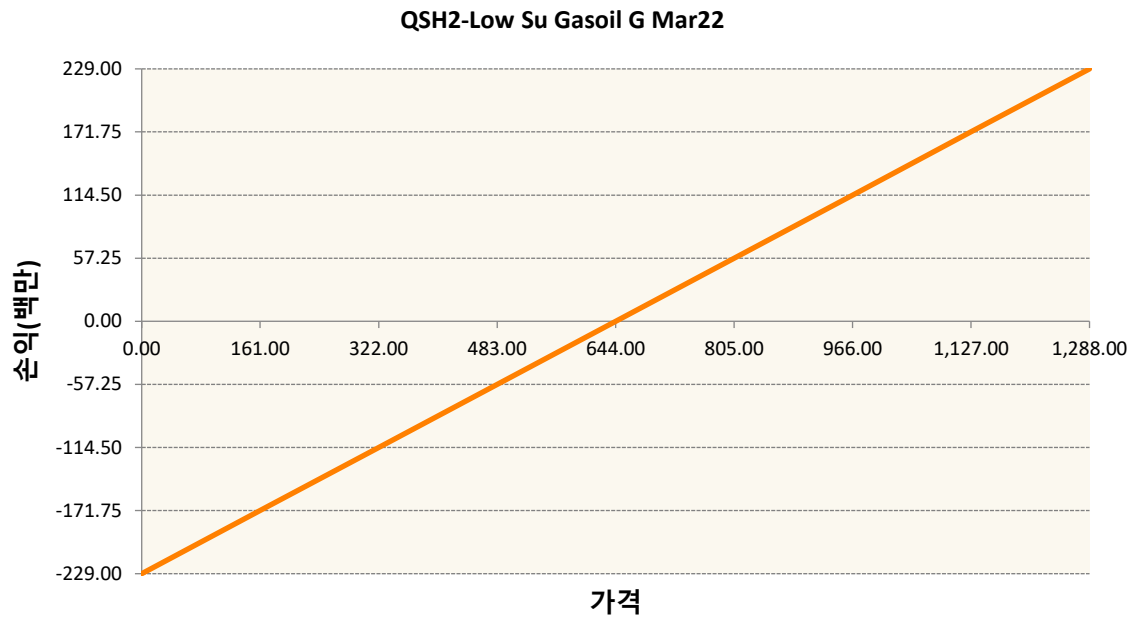


KR4175RC0001-2021-12 달러선물



NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22		33
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22		35
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22		9
KR4175RC00 2021-12 달러선물			28
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22		42
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22		18
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22		8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		328

공시일 2021-12-15

기준일 2021-12-14

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

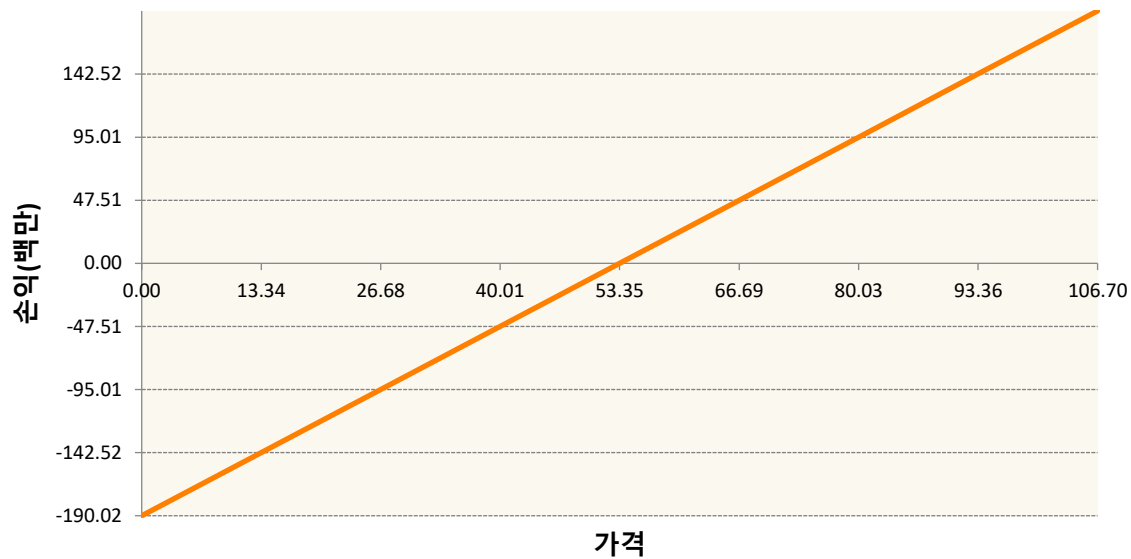
1. 계약금액

(단위:백만원)

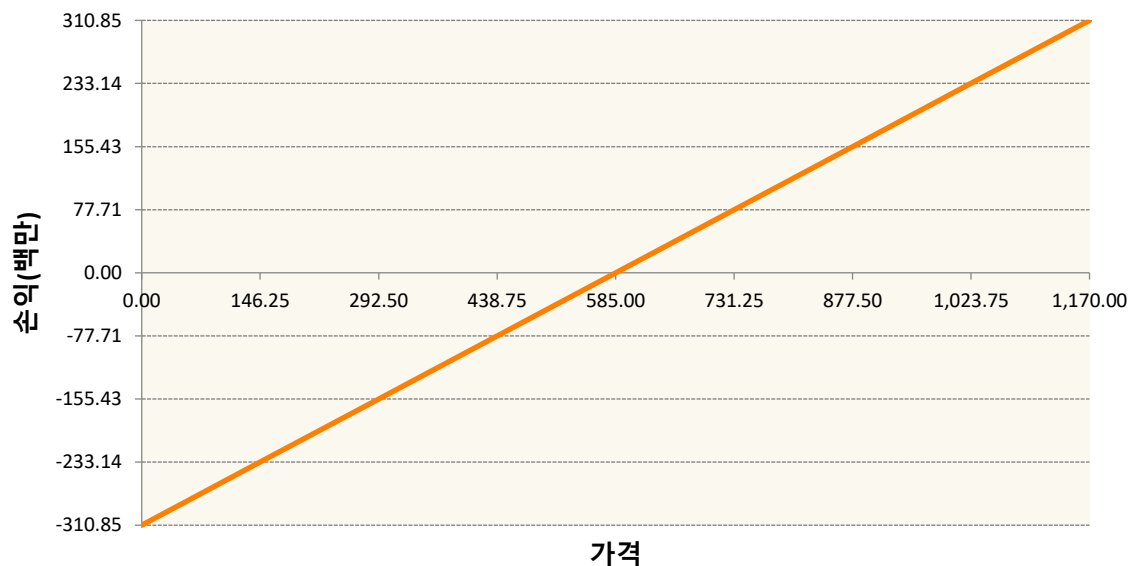
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,723	591	1,132	

2. 만기시점의 손익구조

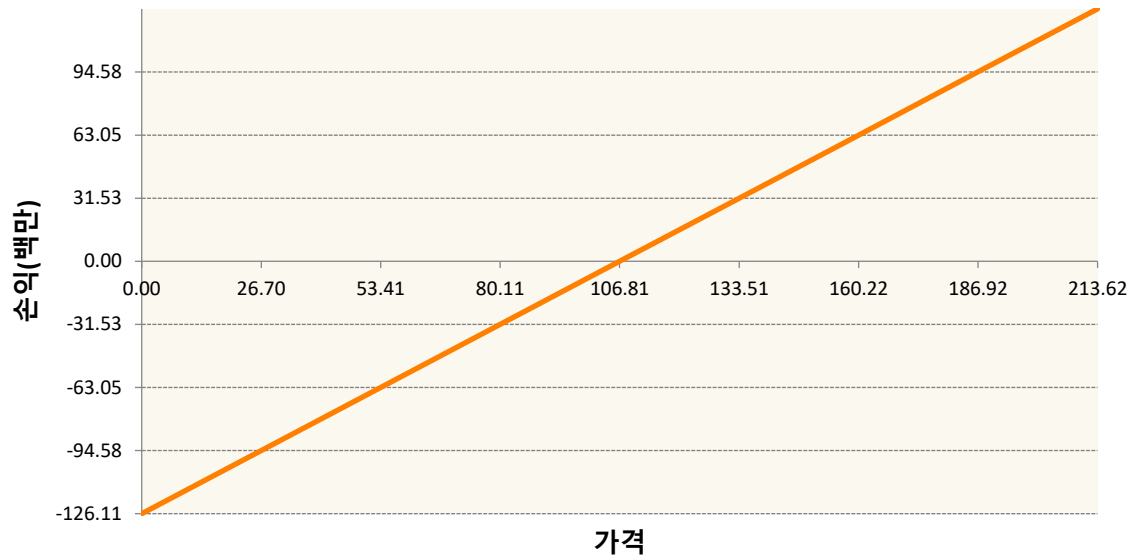
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



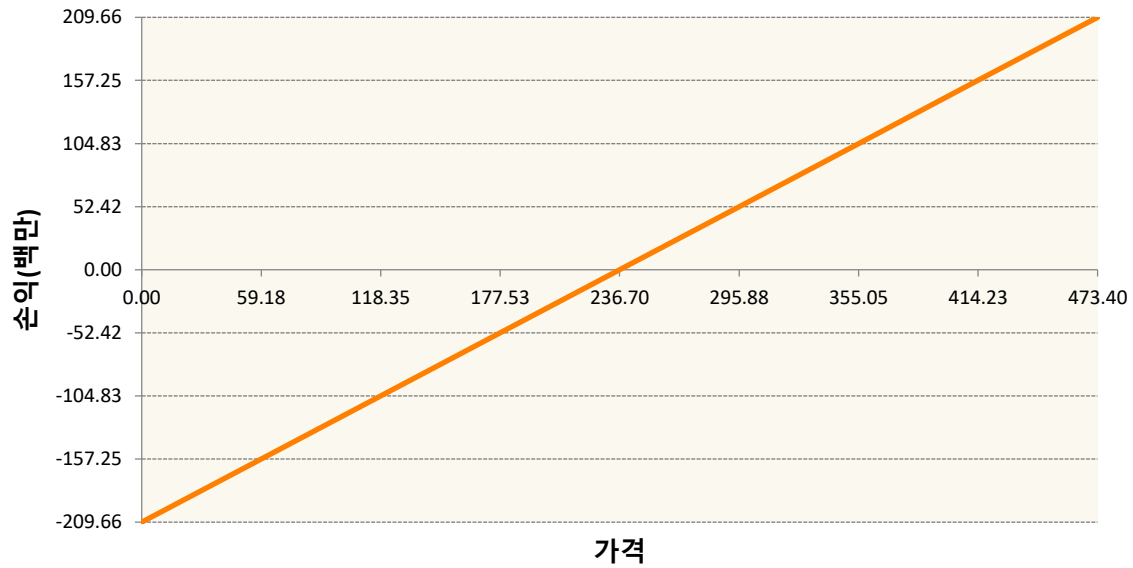
CH2-CORN FUTURE Mar22



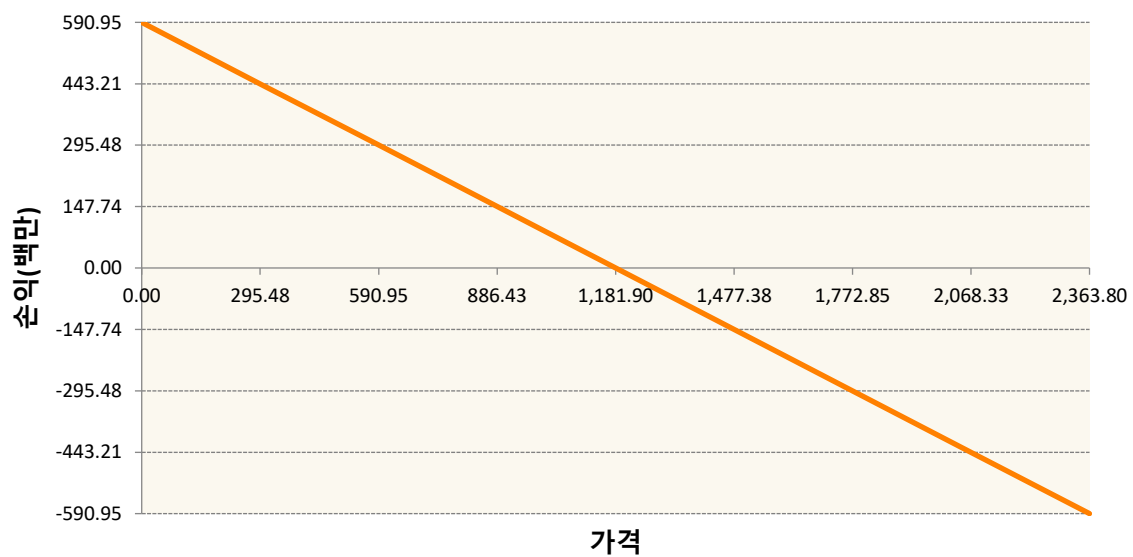
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



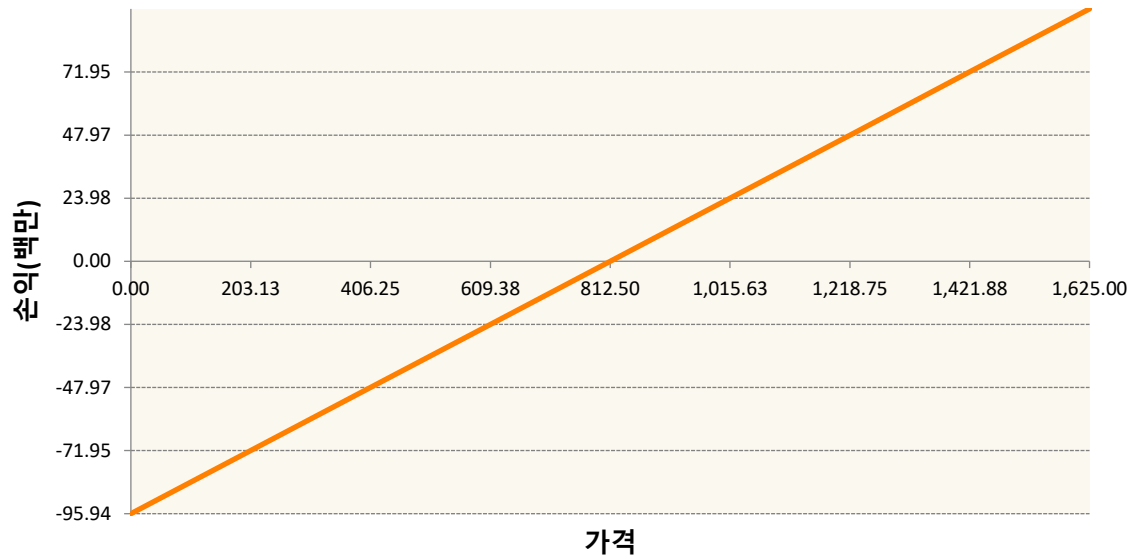
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



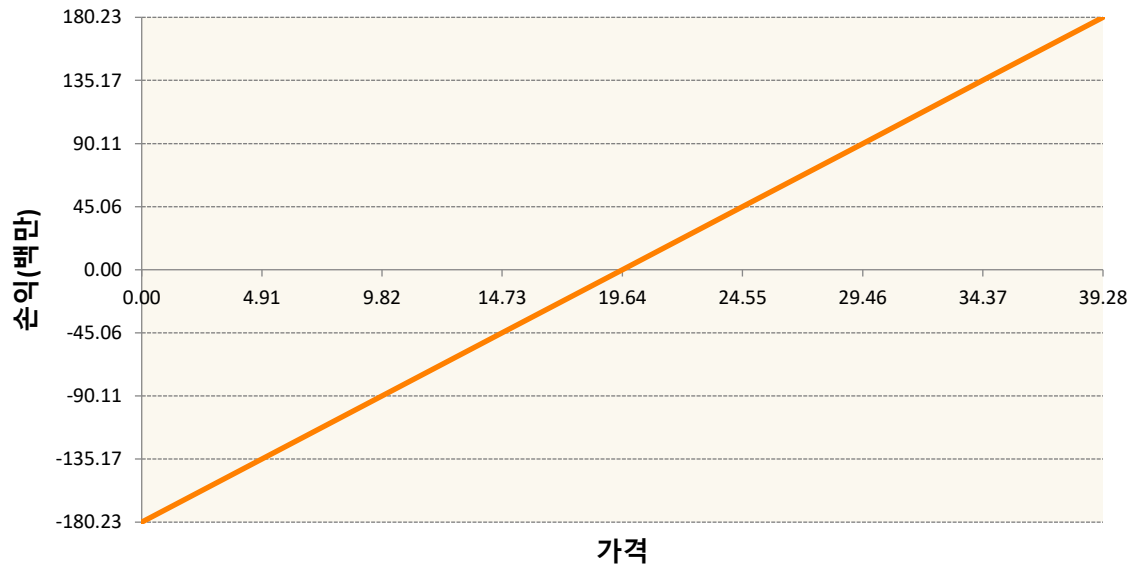
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



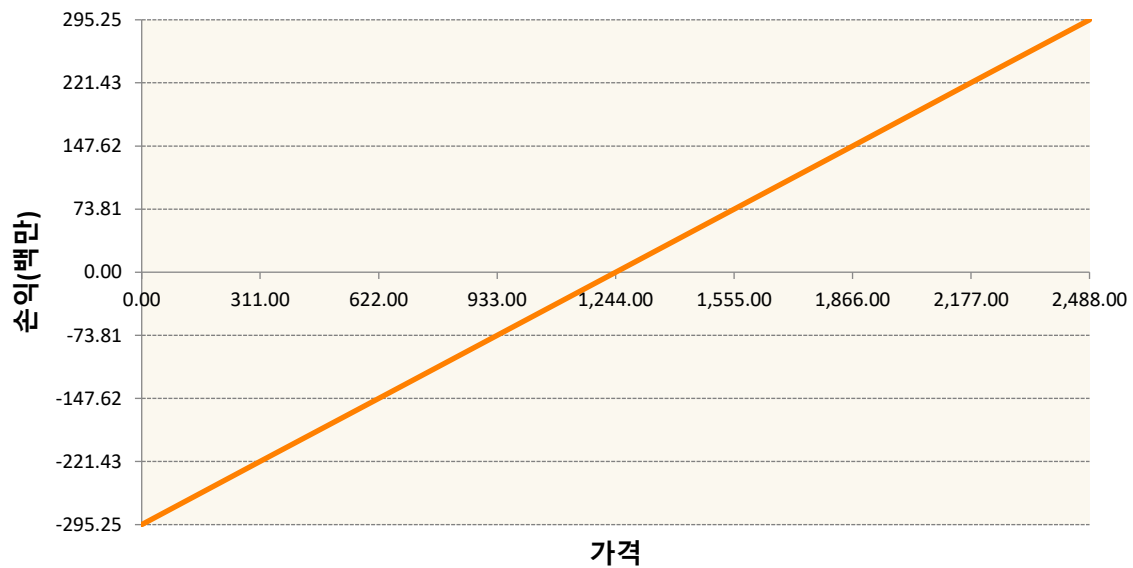
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

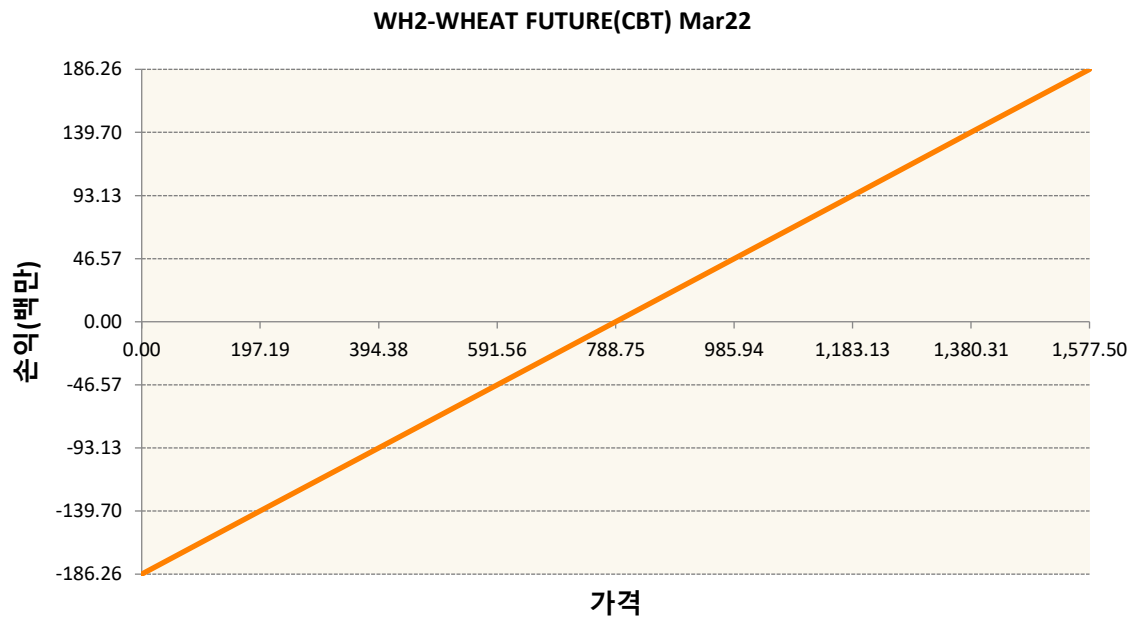
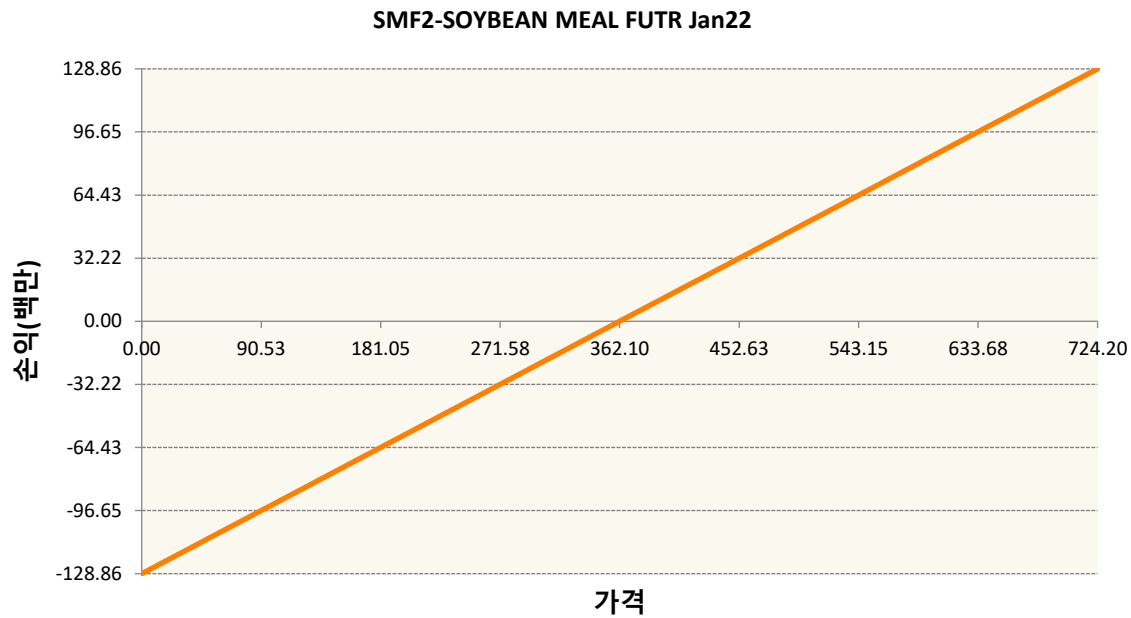


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22





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

