

공시일 2021-12-16

기준일 2021-12-15

포커스농산물모(채권-파생형)

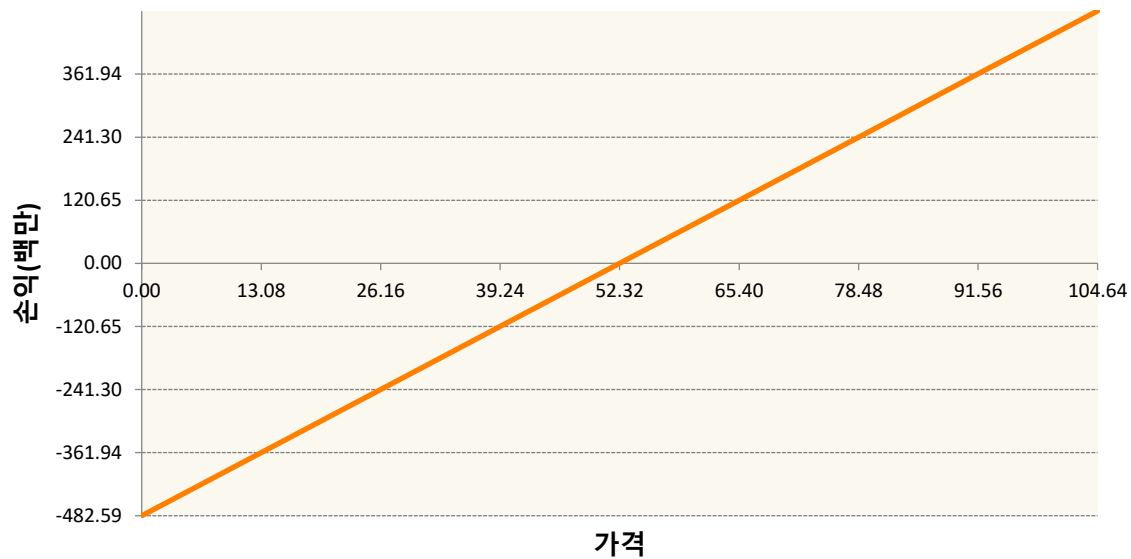
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

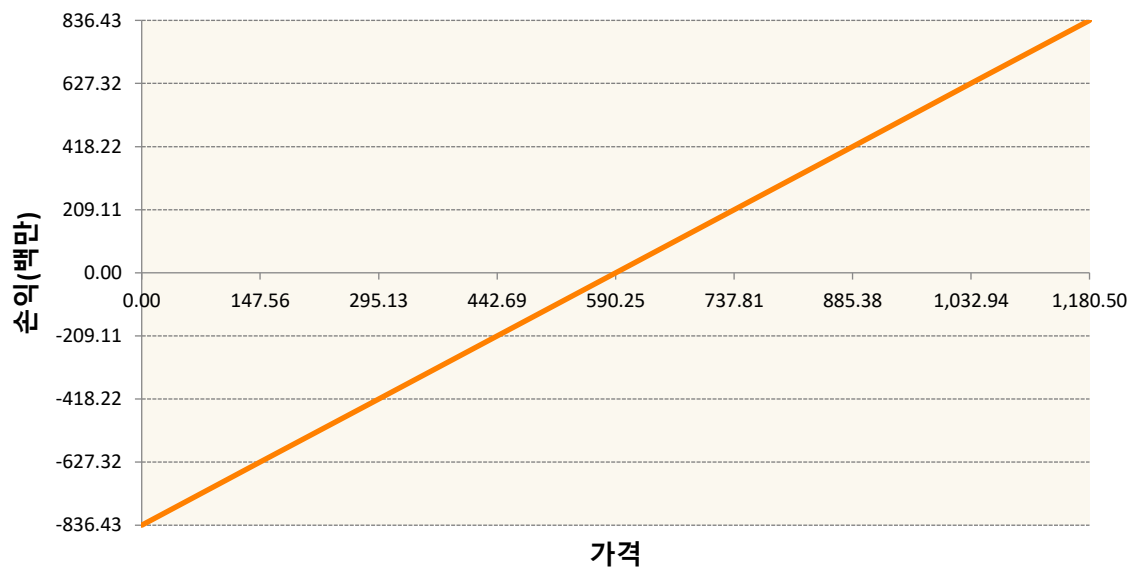
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,486	534	3,952	

2. 만기시점의 손익구조

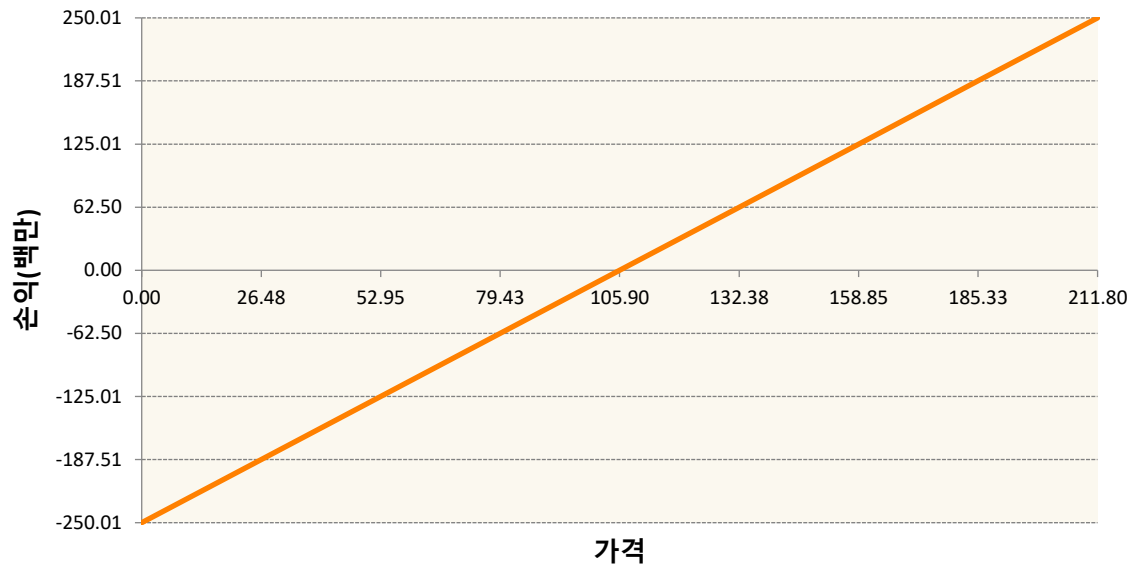
BOH2-SOYBEAN OIL FUTR Mar22



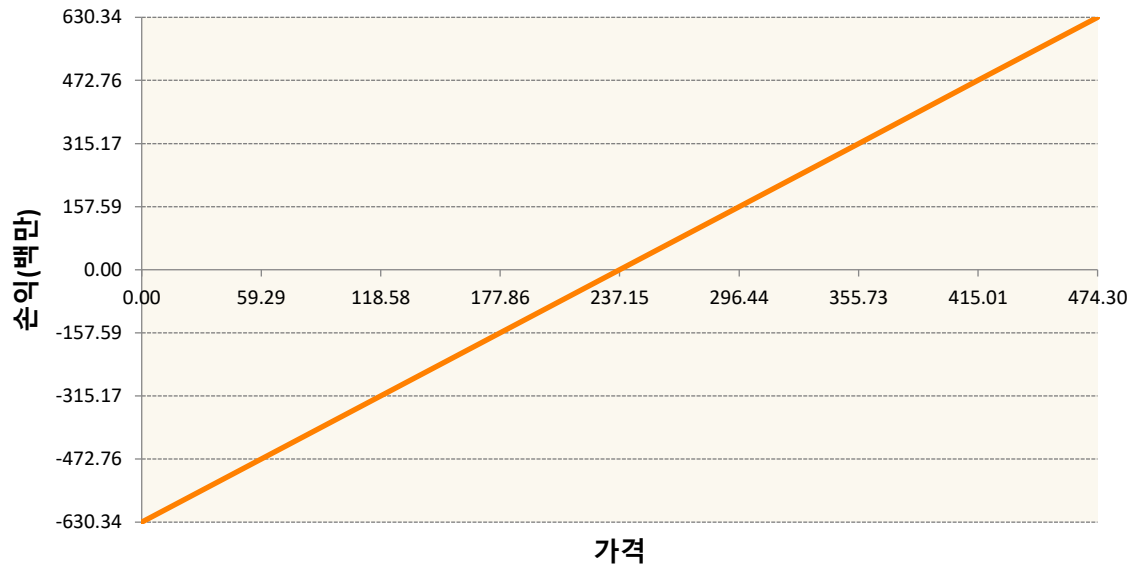
CH2-CORN FUTURE Mar22



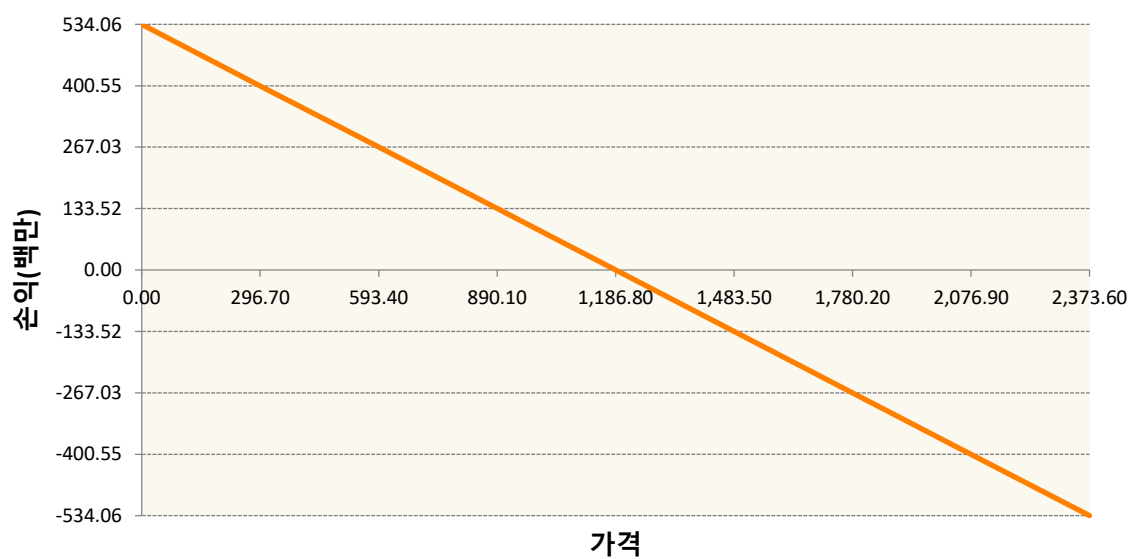
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



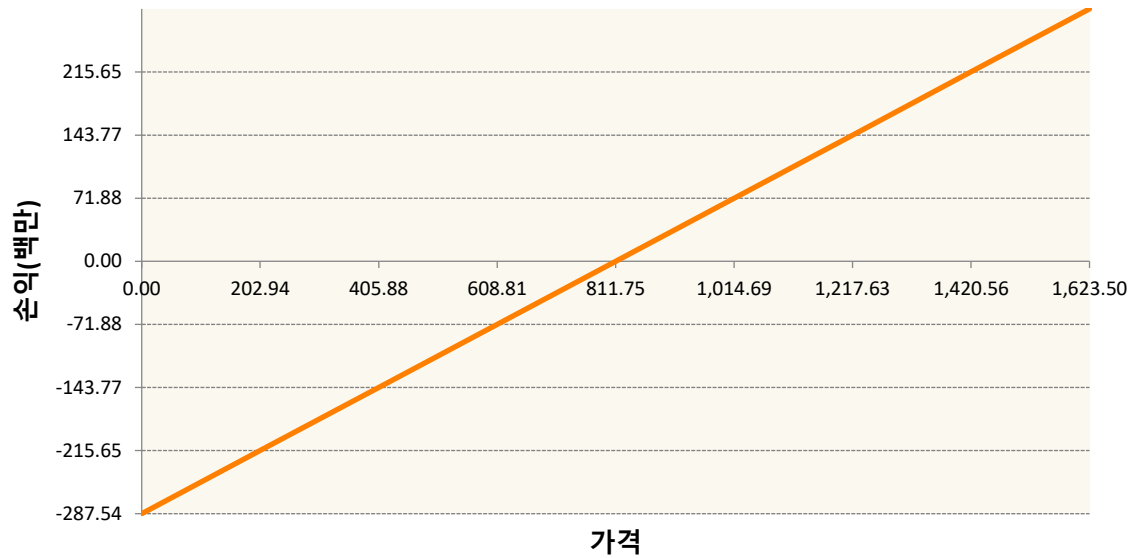
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



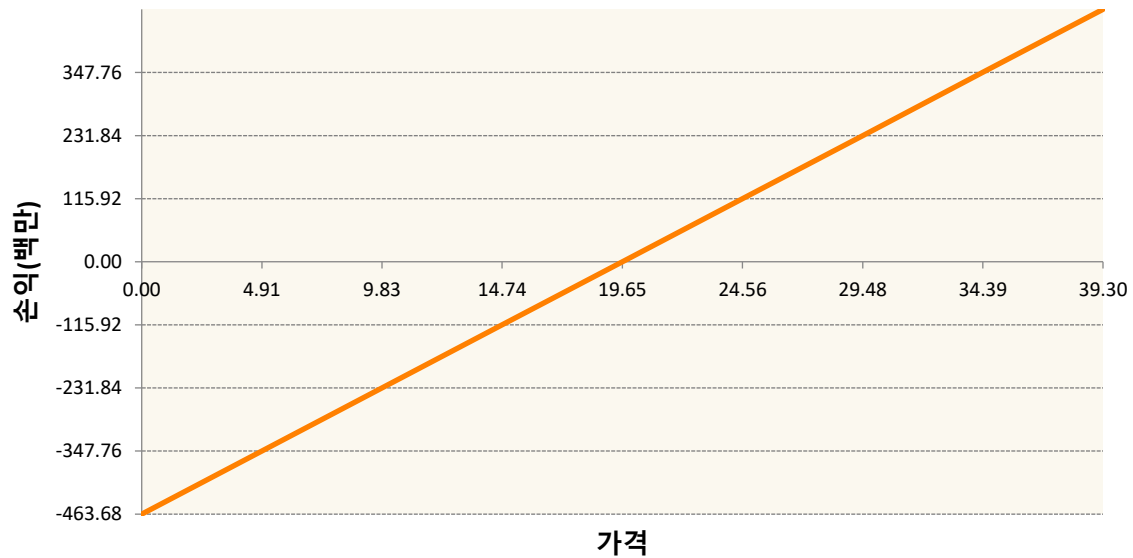
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



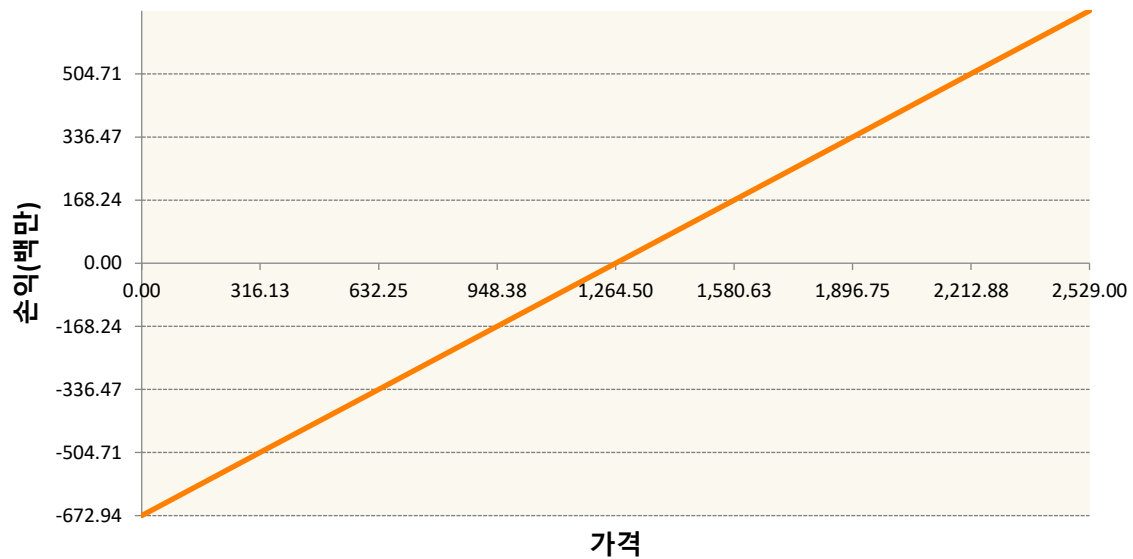
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

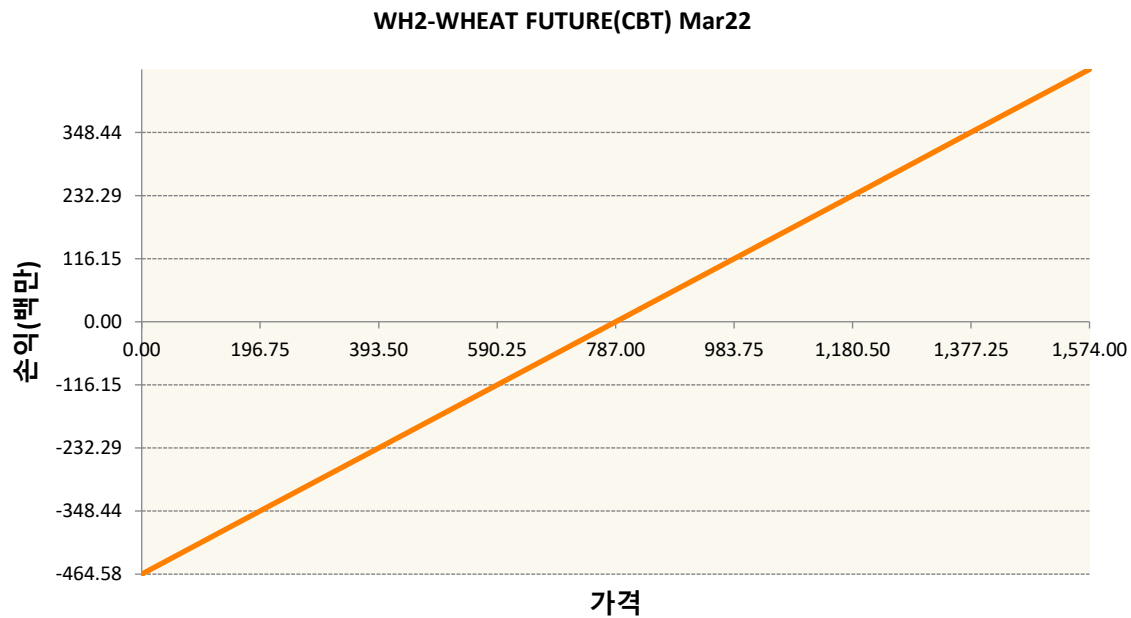
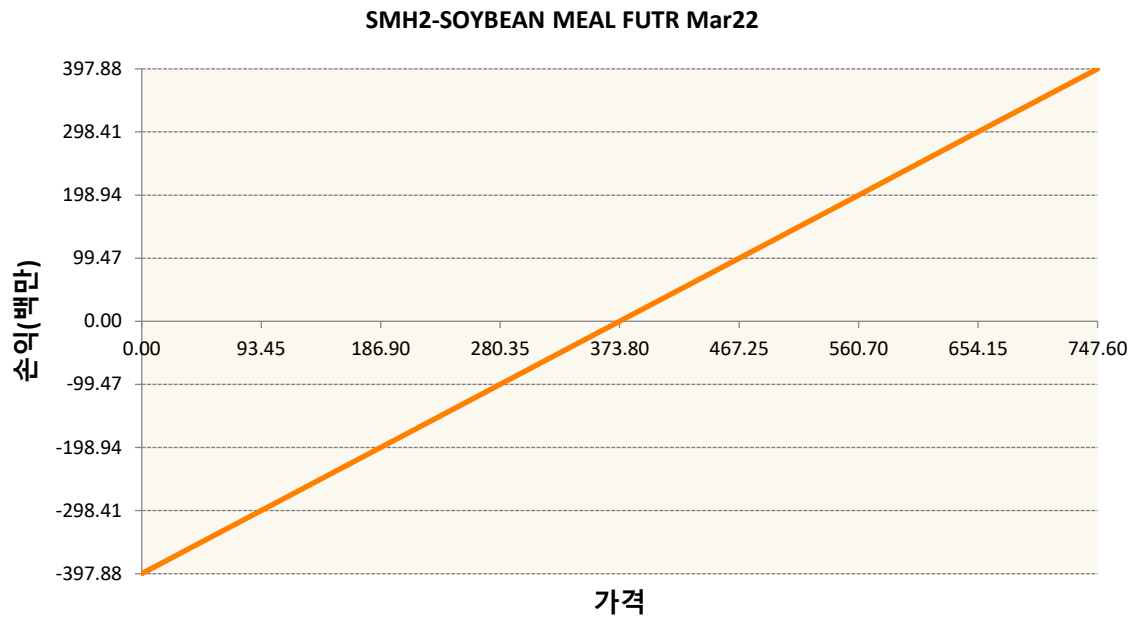


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



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	2021-12-16
기준일	2021-12-15

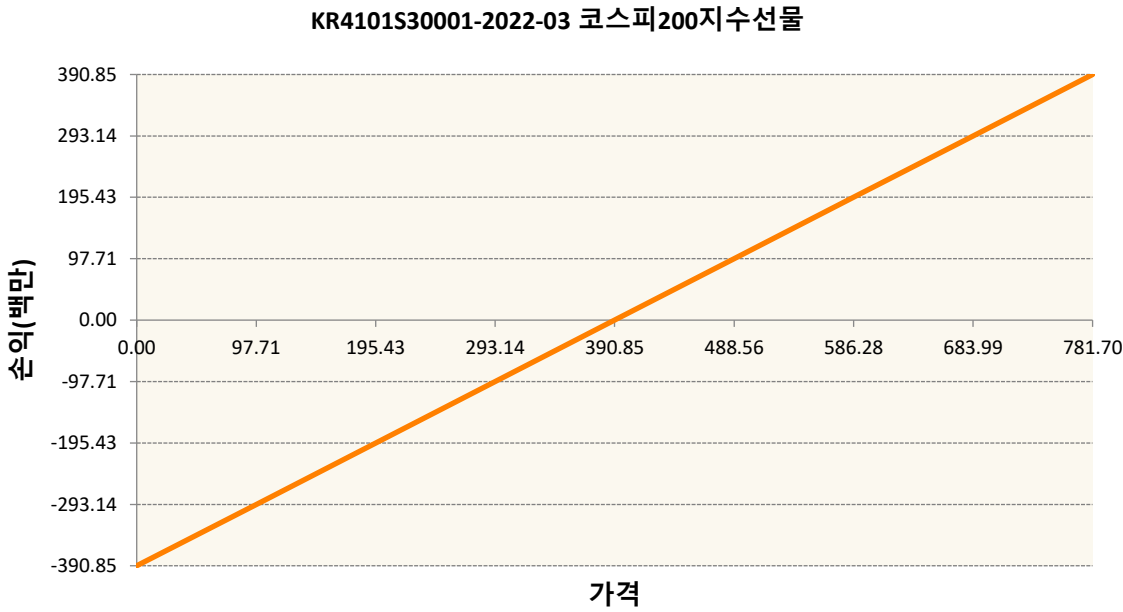
스마트인덱스모

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	391	0	391	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	2021-12-16
기준일	2021-12-15

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

901

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

539

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-16
기준일	2021-12-15

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

440

* 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	2021-12-16
기준일	2021-12-15

유로인덱스모(주식-파생형)

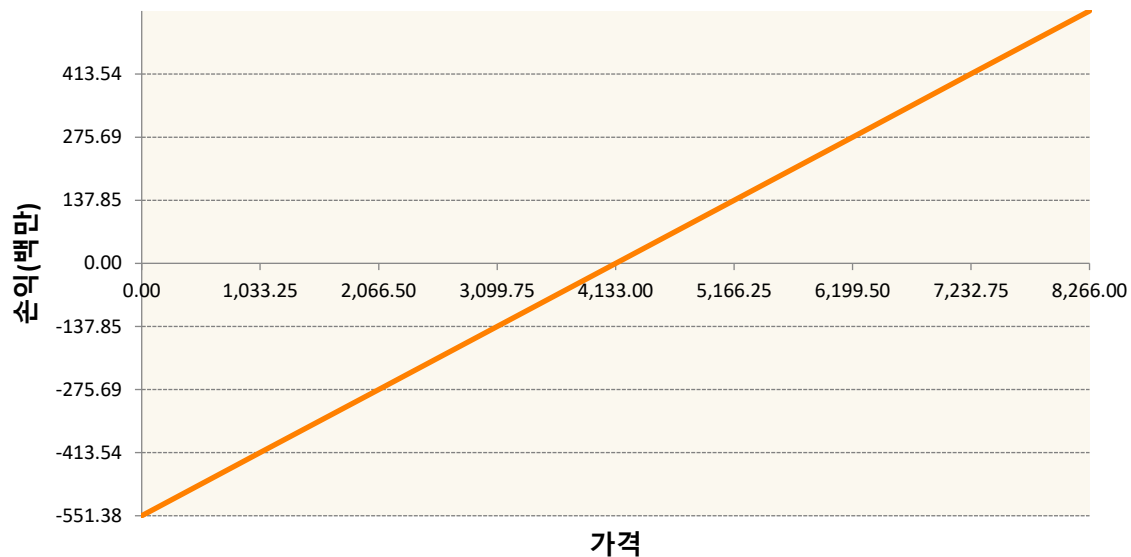
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	551	0	551	

2. 만기시점의 손익구조

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

39

공시일	2021-12-16
기준일	2021-12-15

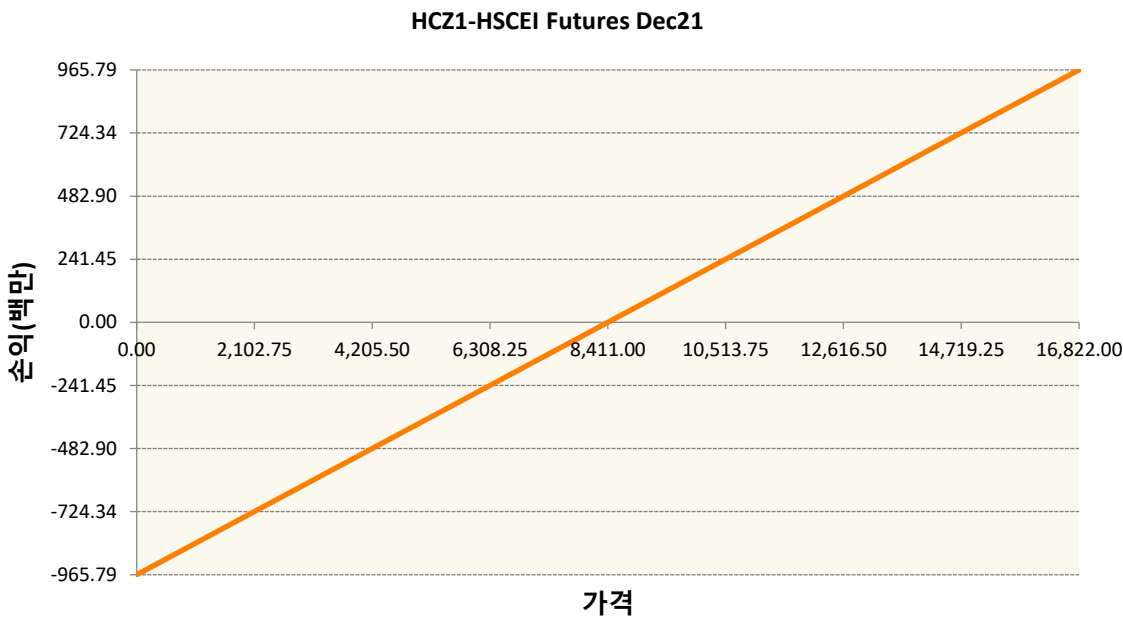
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	966	0	966	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	77
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

80

공시일 2021-12-16

기준일 2021-12-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

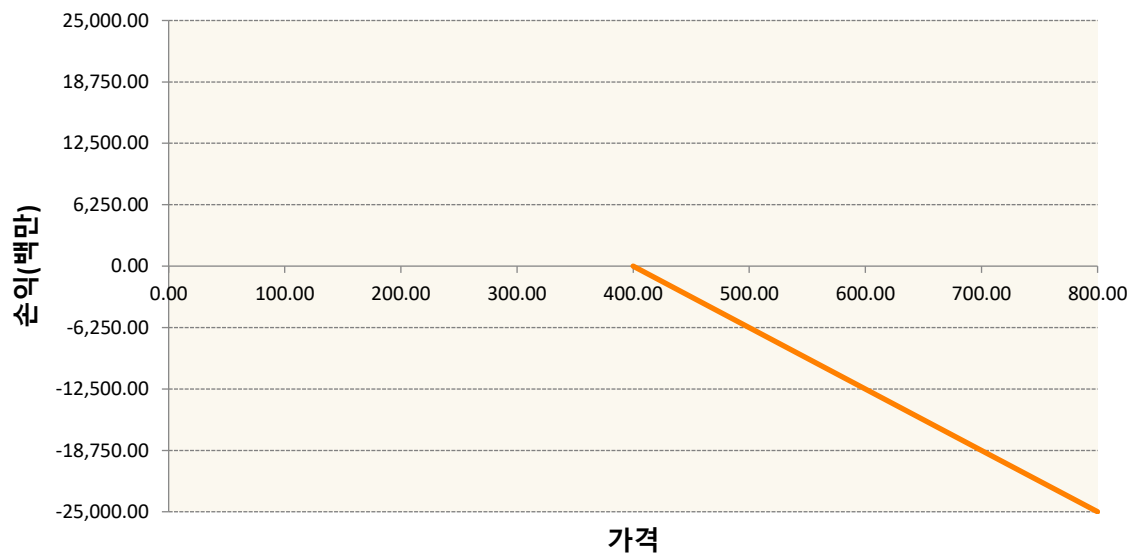
1. 계약금액

(단위:백만원)

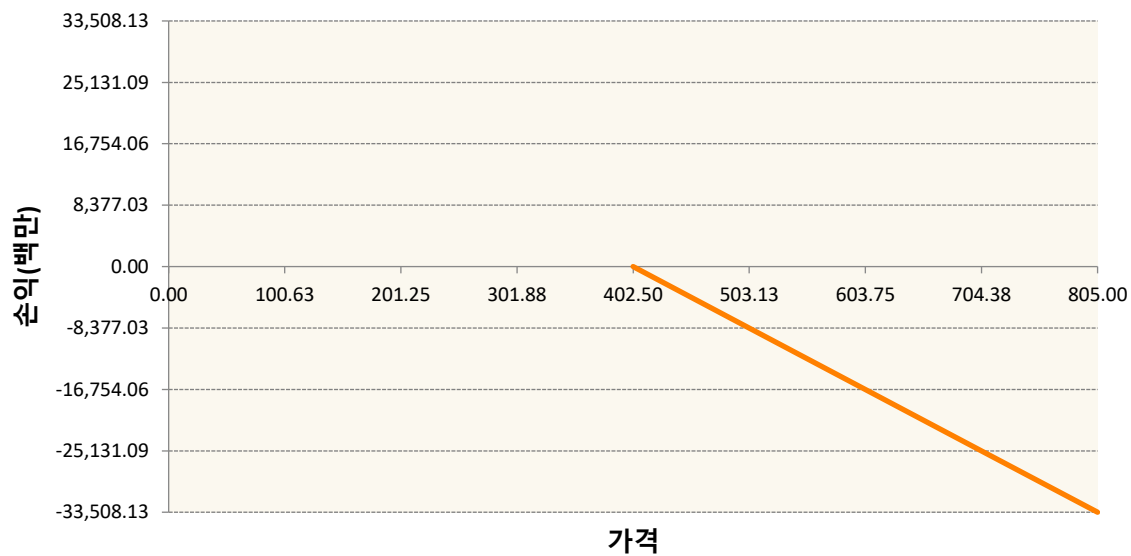
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

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 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 a linear relationship between the amount (가액) and net income (순의) in millions. The x-axis represents the amount, ranging from 0.00 to 805.00. The y-axis represents the net income, ranging from -2,012.50 to 2,012.50. The line starts at a net income of -2,012.50 when the amount is 0.00 and reaches a net income of 0.00 when the amount is 402.50.

가액 (Amount)	순의 (백만) (Net Income in millions)
0.00	-2,012.50
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003							2022-01 콜400		1,427	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	601	583	560	533	502	469	432			
-5.33%	543	508	470	428	384	338	289			
-2.67%	416	364	310	255	199	142	85			
0%	189	126	63	0	-63	-126	-190			
2.67%	-155	-218	-281	-345	-408	-472	-536			
5.33%	-610	-663	-718	-774	-832	-891	-951			
8.00%	-1,153	-1,190	-1,232	-1,277	-1,325	-1,375	-1,427			
KR4201S14029							2022-01 콜402.5		1,835	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	724	704	677	645	607	566	520
-5.33%	660	619	573	521	466	408	346
-2.67%	516	451	384	314	242	168	93
0%	247	165	83	0	-83	-167	-250
2.67%	-174	-259	-345	-431	-517	-603	-689
5.33%	-746	-821	-898	-977	-1,057	-1,138	-1,220
8.00%	-1,444	-1,499	-1,560	-1,624	-1,692	-1,762	-1,835
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,149

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,116	-1,118	-1,121	-1,126	-1,132	-1,140	-1,149
-5.33%	-665	-673	-683	-695	-709	-724	-741
-2.67%	-249	-268	-289	-311	-334	-357	-382
0%	87	58	29	0	-29	-59	-88
2.67%	307	278	249	220	191	161	132
5.33%	416	397	377	354	331	307	282
8.00%	457	448	437	424	409	392	374
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	-132	-133	-133	-134	-134	-135
-5.33%	-80	-81	-82	-83	-84	-86	-88
-2.67%	-31	-33	-35	-38	-40	-43	-45
0%	10	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	38	35	31	28	24	21	17
5.33%	53	51	48	45	42	39	36
8.00%	59	58	56	55	53	51	48

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

(단위:백만원)

4,292

공시일 2021-12-16

기준일 2021-12-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

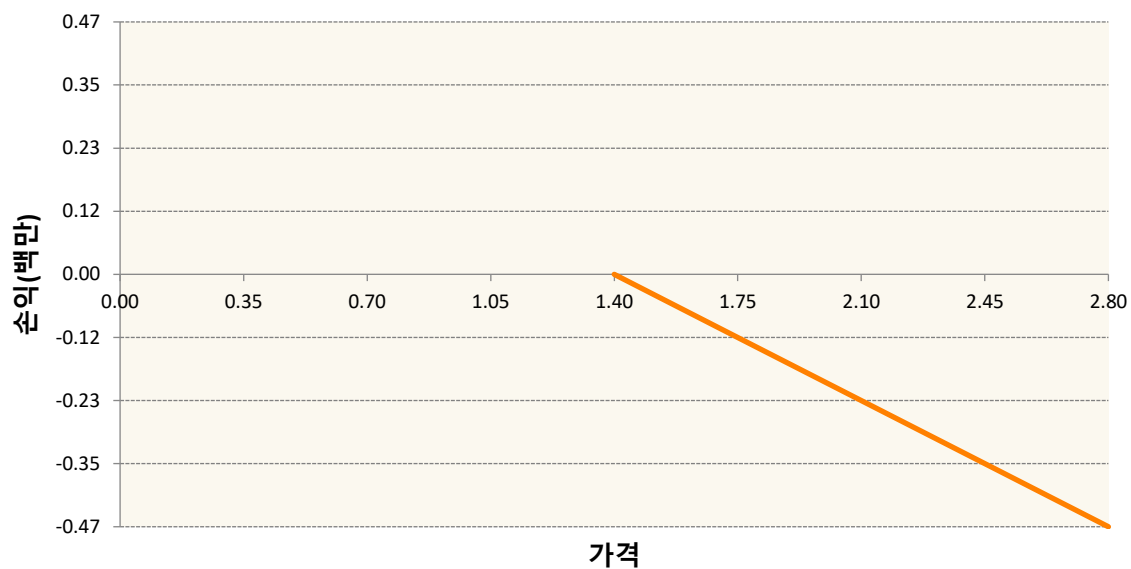
1. 계약금액

(단위:백만원)

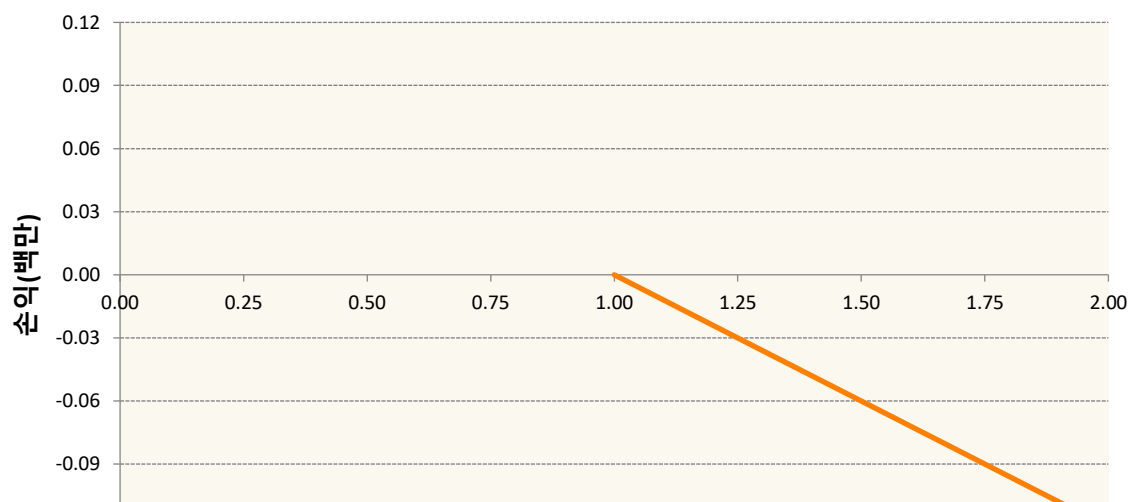
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	117	-117	장내
누계	통화	선도	0	2,004	-2,004	장외

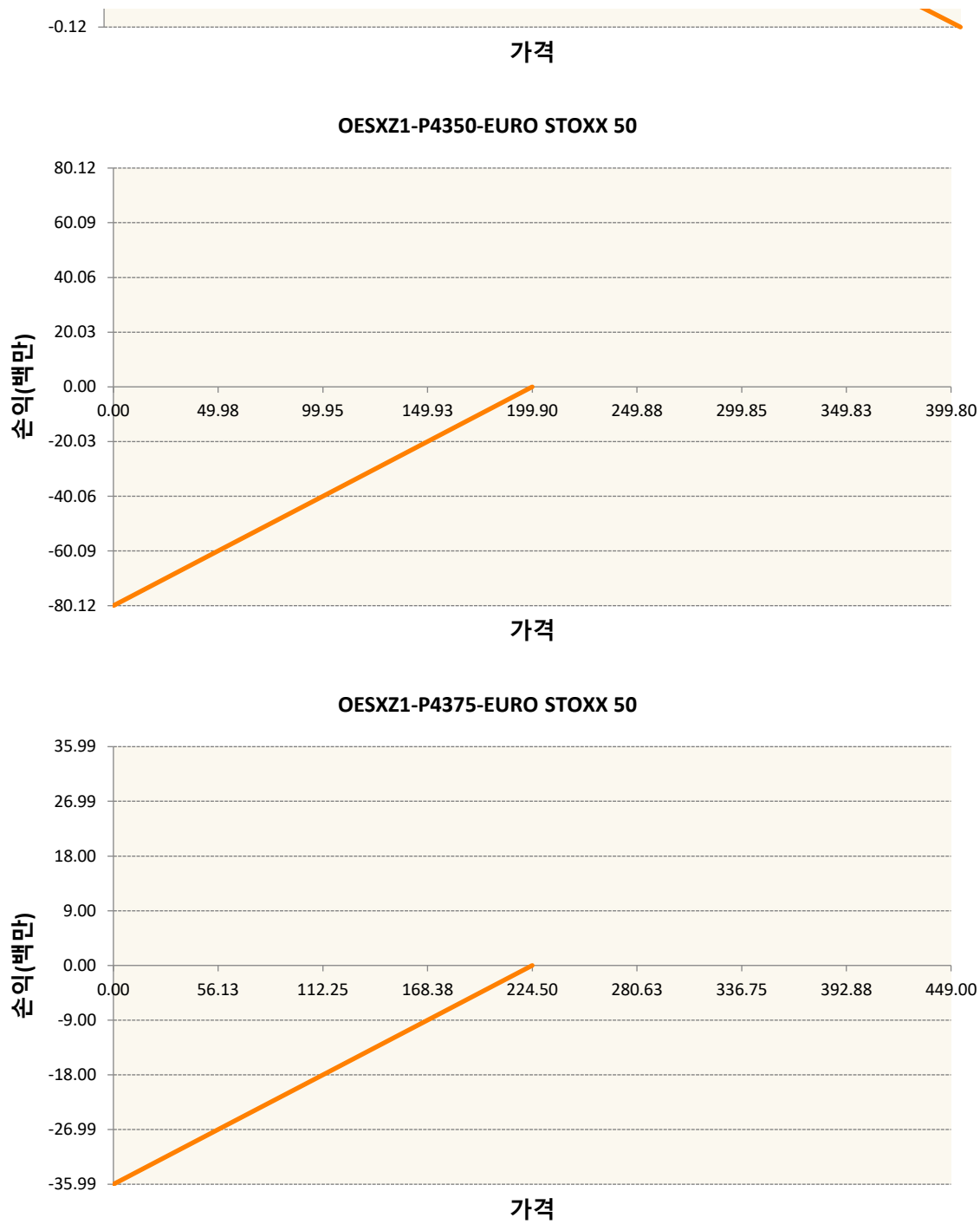
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213BCF KRW/EUR 17-03-22E
 FXW213BCF KRW/EUR 17-02-22E
 OESXZ1-C43 EURO STOXX 50
 OESXZ1-C43 EURO STOXX 50
 OESXZ1-P43 EURO STOXX 50
 OESXZ1-P43 EURO STOXX 50

15
53
107
0.04
0.01
6
3

공시일	2021-12-16
기준일	2021-12-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

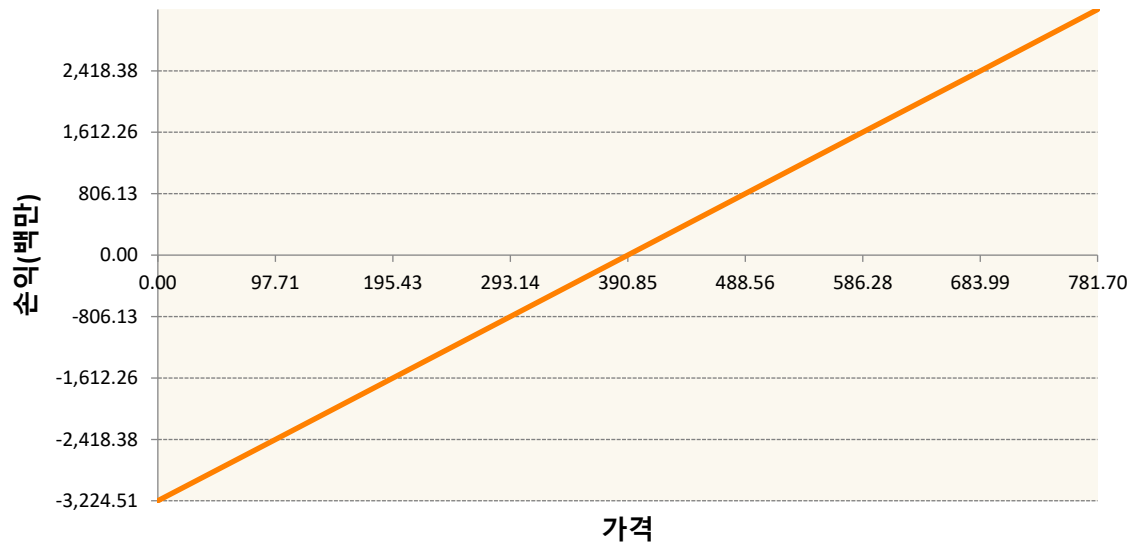
1. 계약금액

(단위:백만원)

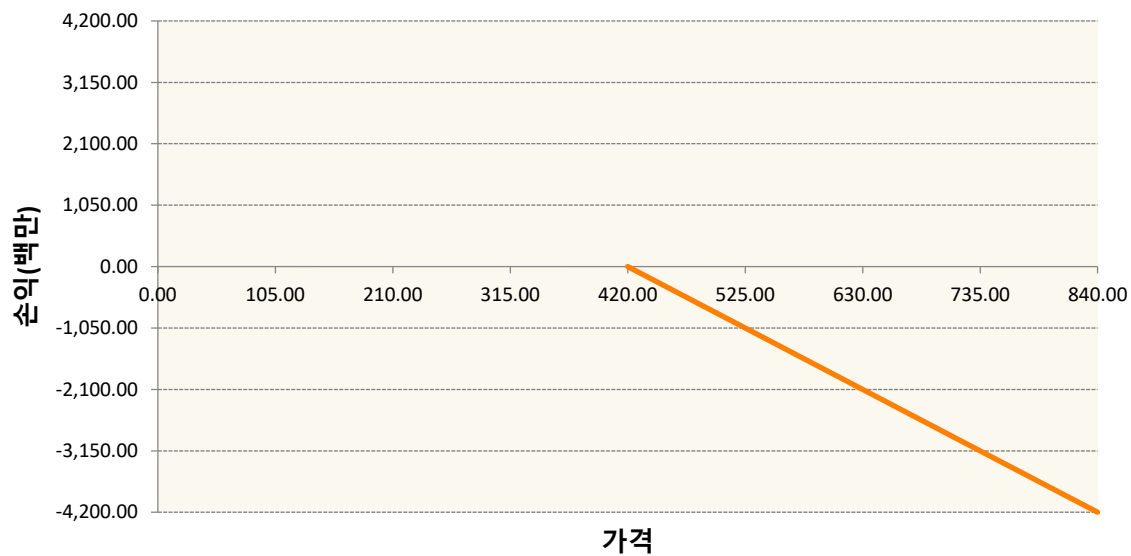
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,225	0	3,225	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S14201-2022-01 콜420



The graph illustrates the relationship between price and profit. 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 starts at the point (425.00, 0.00) and slopes downward to the point (850.00, -1,275.00).

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
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				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	35	33	31	28
-5.33%	37	35	33	30	26	22	17
-2.67%	32	29	24	19	13	7	0
0%	21	15	8	0	-8	-16	-25
2.67%	-2	-11	-20	-30	-40	-50	-59
5.33%	-41	-52	-62	-73	-84	-94	-105
8.00%	-98	-108	-119	-129	-140	-151	-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%	-24	-27	-30	-34	-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	-4	-4

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

(단위:백만원)

429

공시일	2021-12-16
기준일	2021-12-15

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	18,011	0	18,011	

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	2021-12-16
기준일	2021-12-15

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	9,704	0	9,704	

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	2021-12-16
기준일	2021-12-15

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	45,835	0	45,835	
누계	통화	선도	1,422	0	1,422	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

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

(단위:백만원)

120

공시일	2021-12-16
기준일	2021-12-15

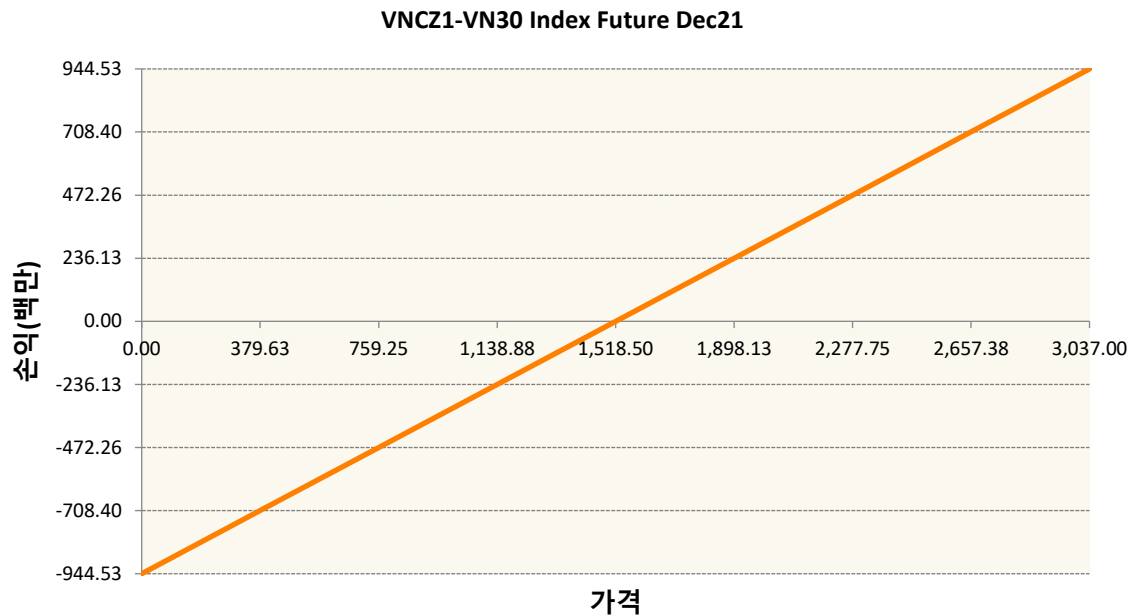
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	1,784	0	1,784	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	76

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

(단위:백만원)

255

공시일 2021-12-16

기준일 2021-12-15

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

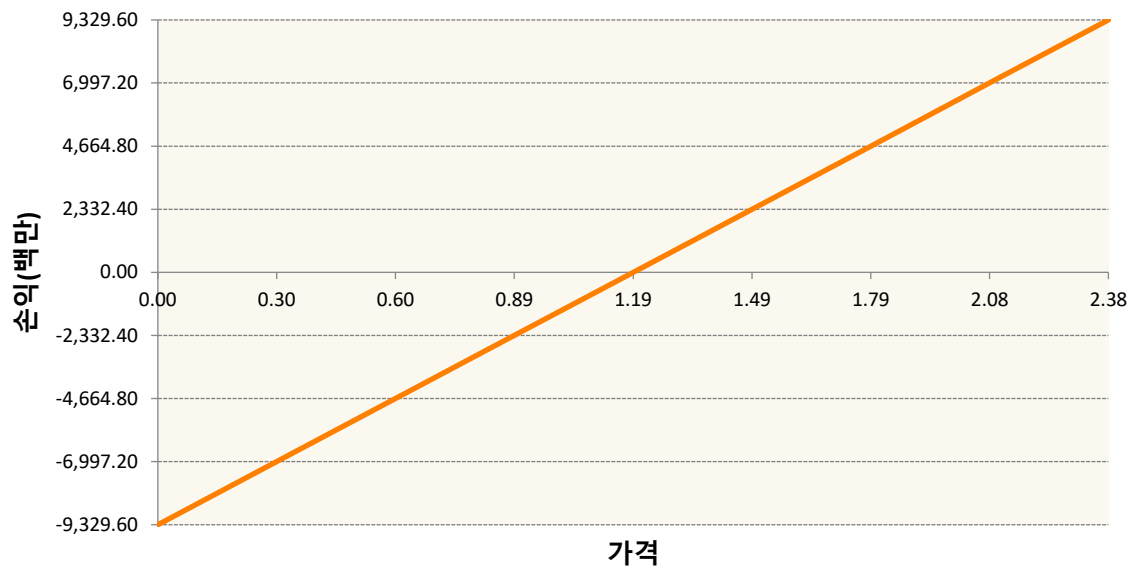
1. 계약금액

(단위:백만원)

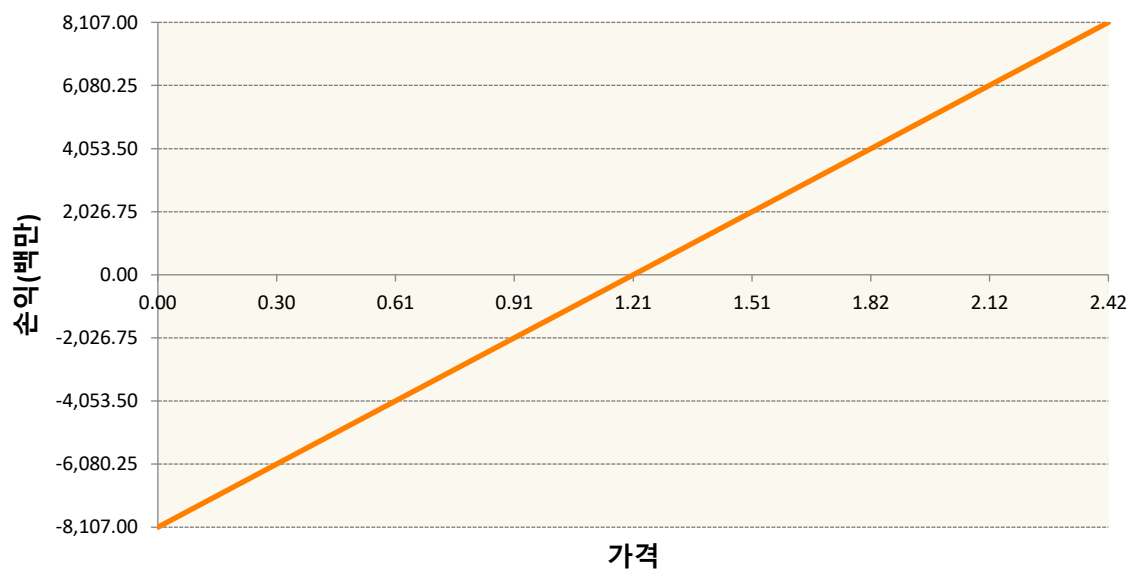
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	34,912	0	34,912	

2. 만기시점의 손익구조

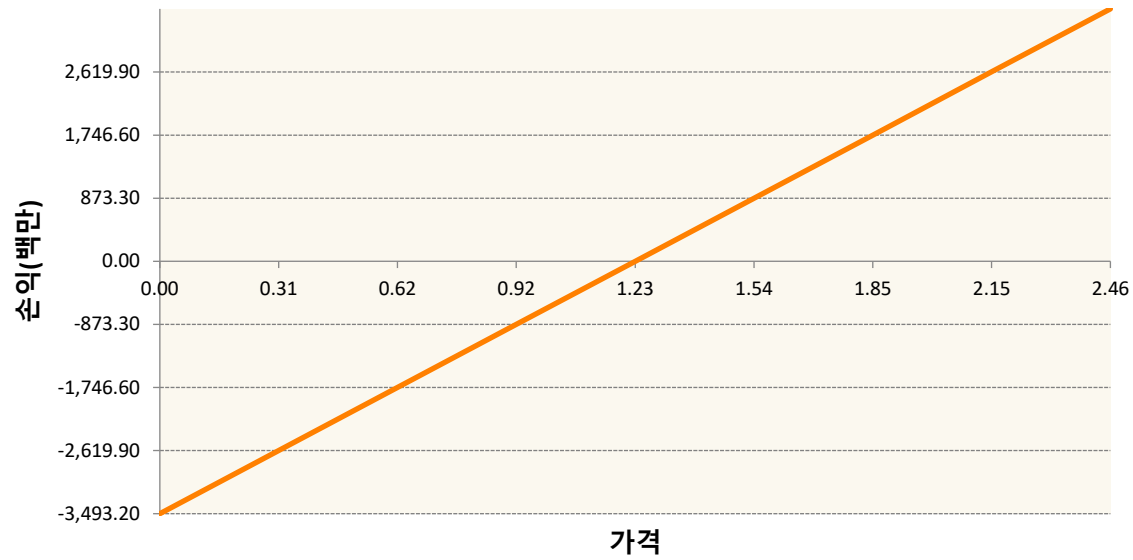
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



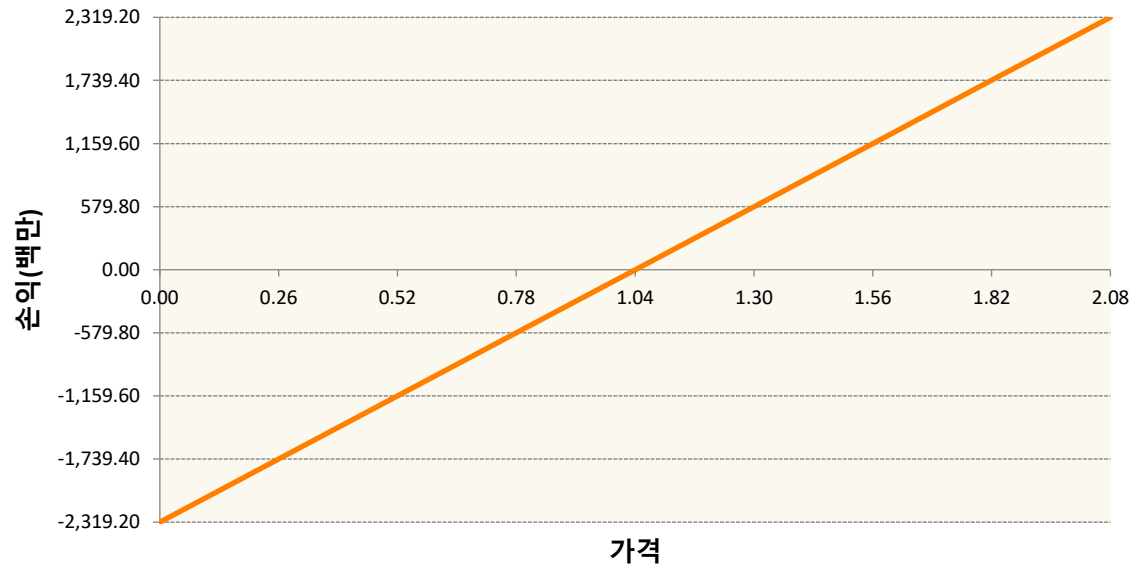
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



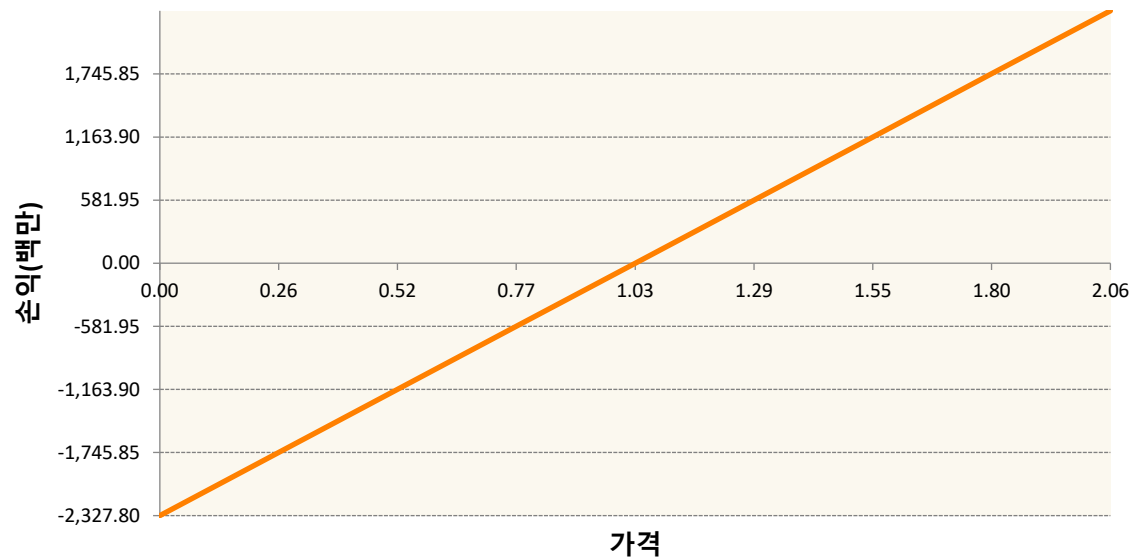
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)

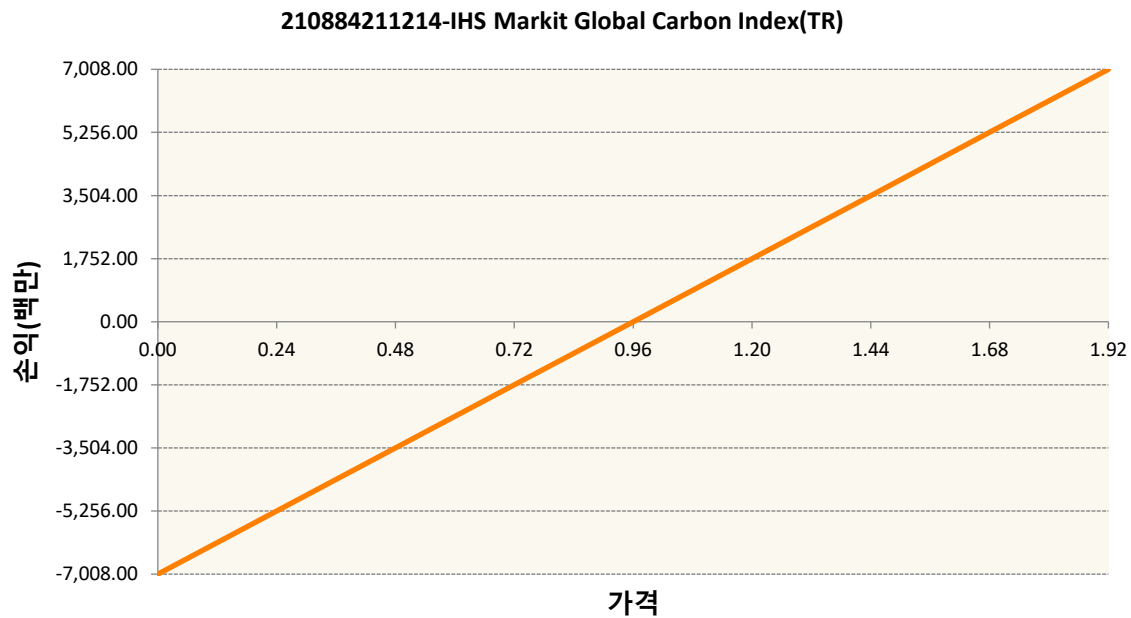
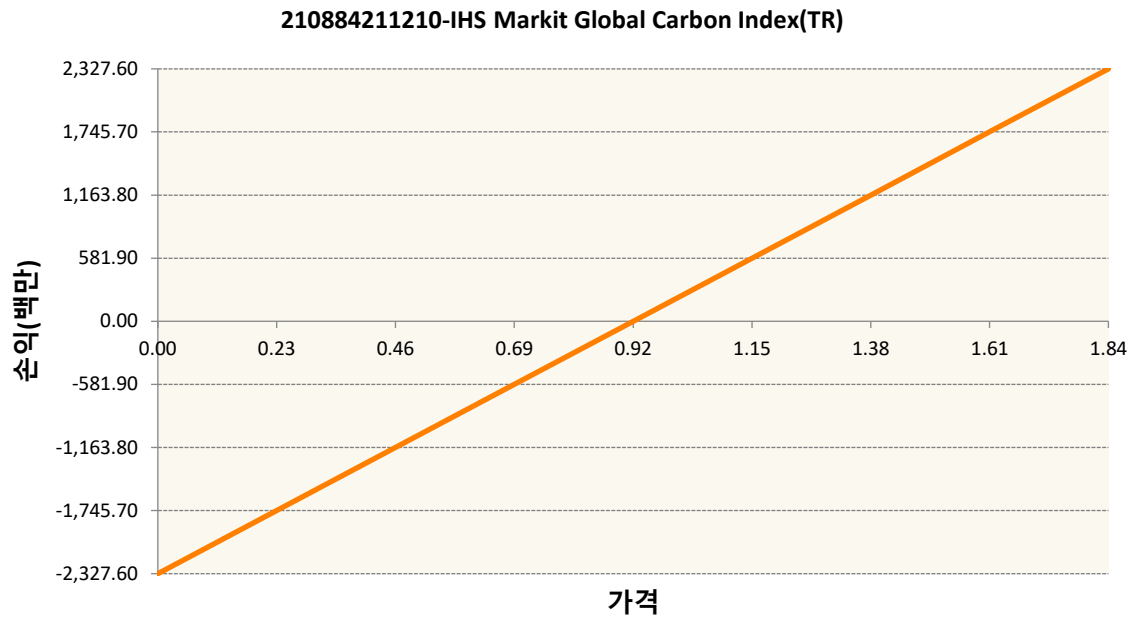


210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		745
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		649
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		279
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		186
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		186
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		186
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		558

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,295

공시일 2021-12-16

기준일 2021-12-15

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

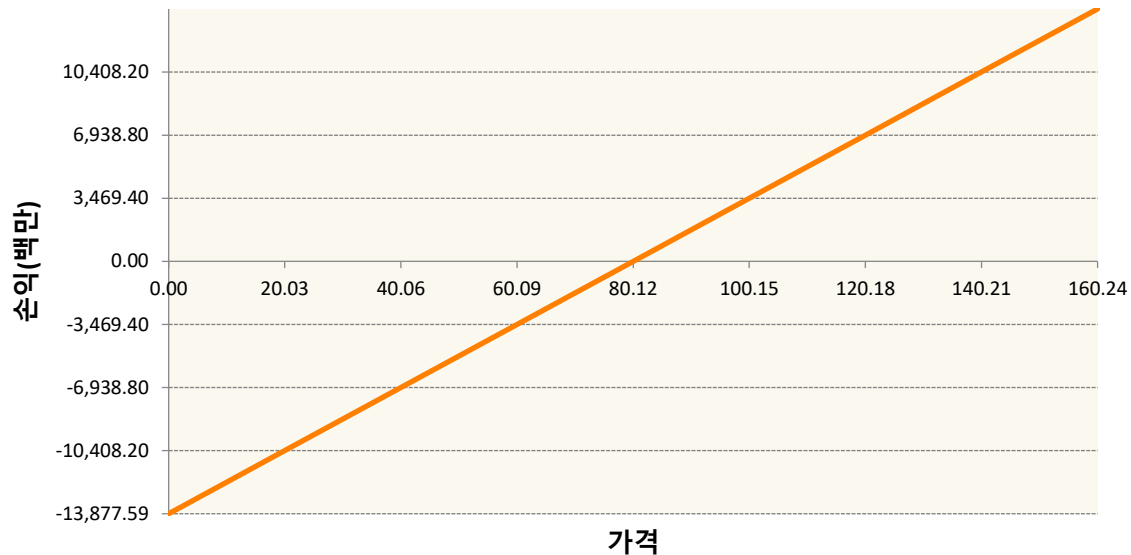
1. 계약금액

(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	13,878	0	13,878	
누계	통화	선도	0	6,705	-6,705	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	1,110

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

(단위:백만원)

2,504

공시일 2021-12-16

기준일 2021-12-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

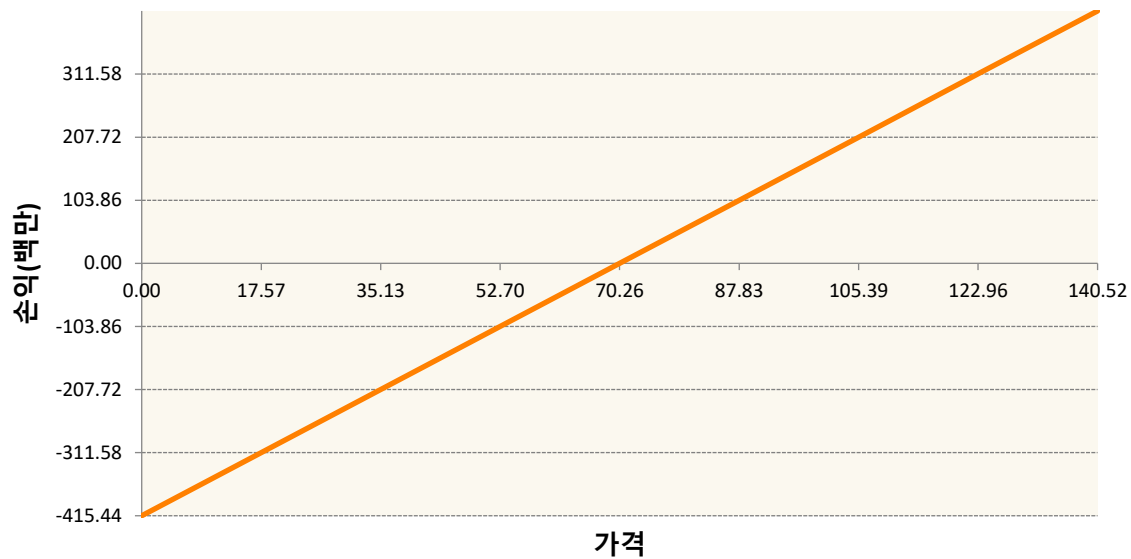
1. 계약금액

(단위:백만원)

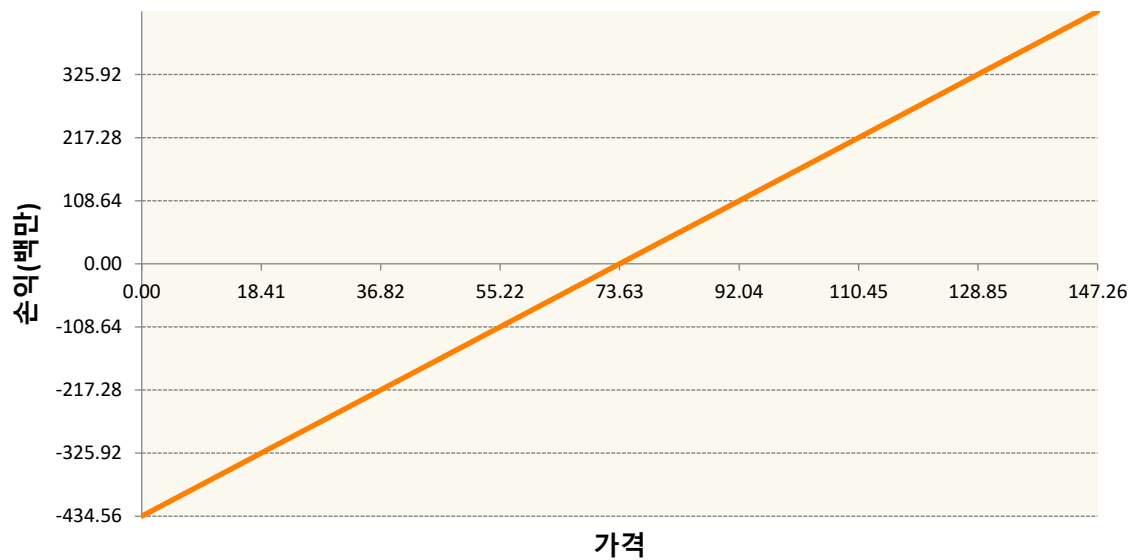
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,804	356	1,448	

2. 만기시점의 손익구조

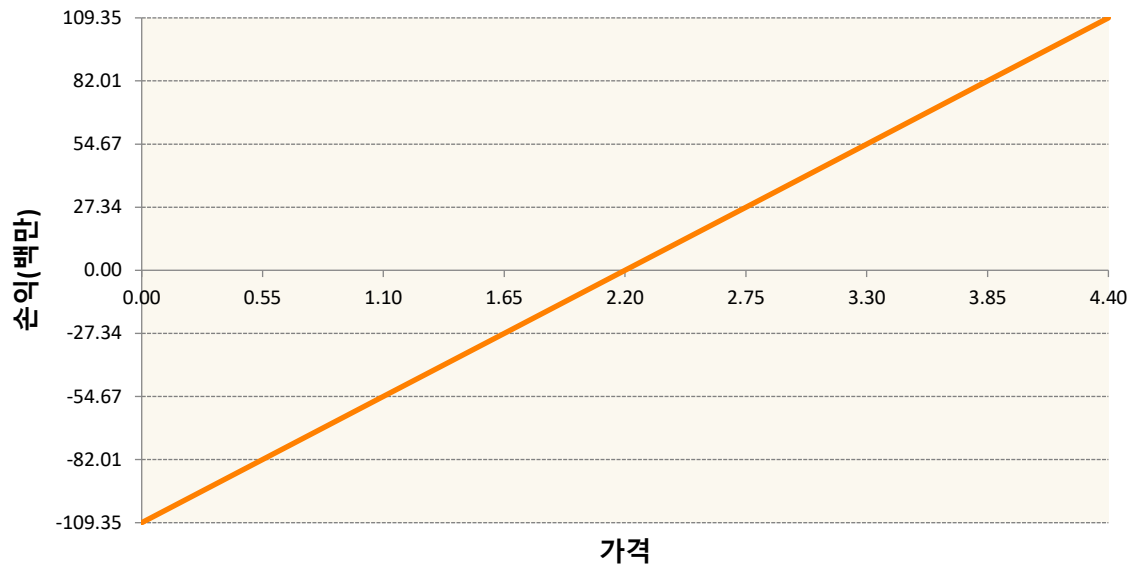
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



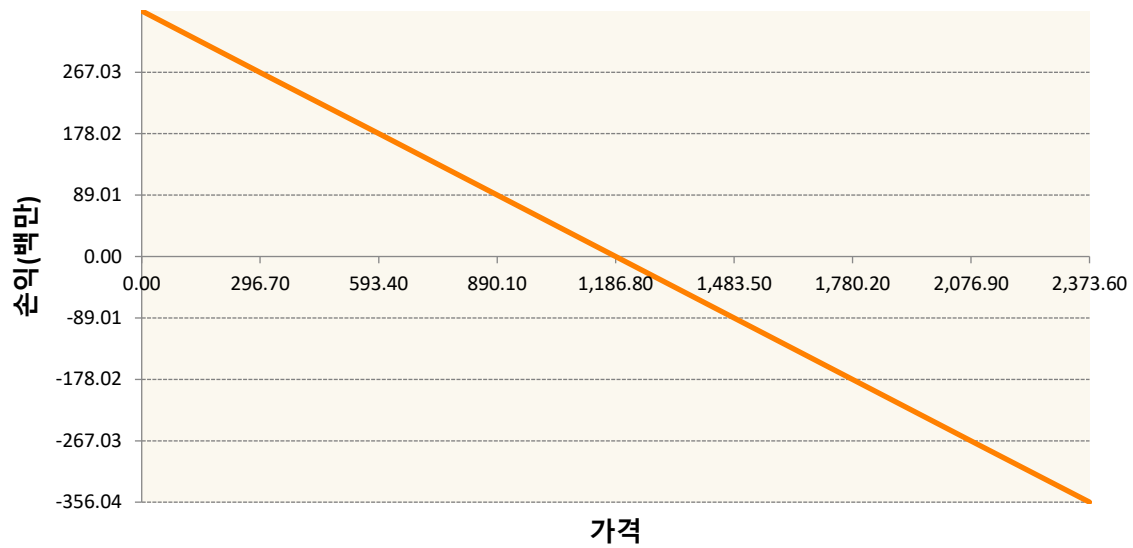
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



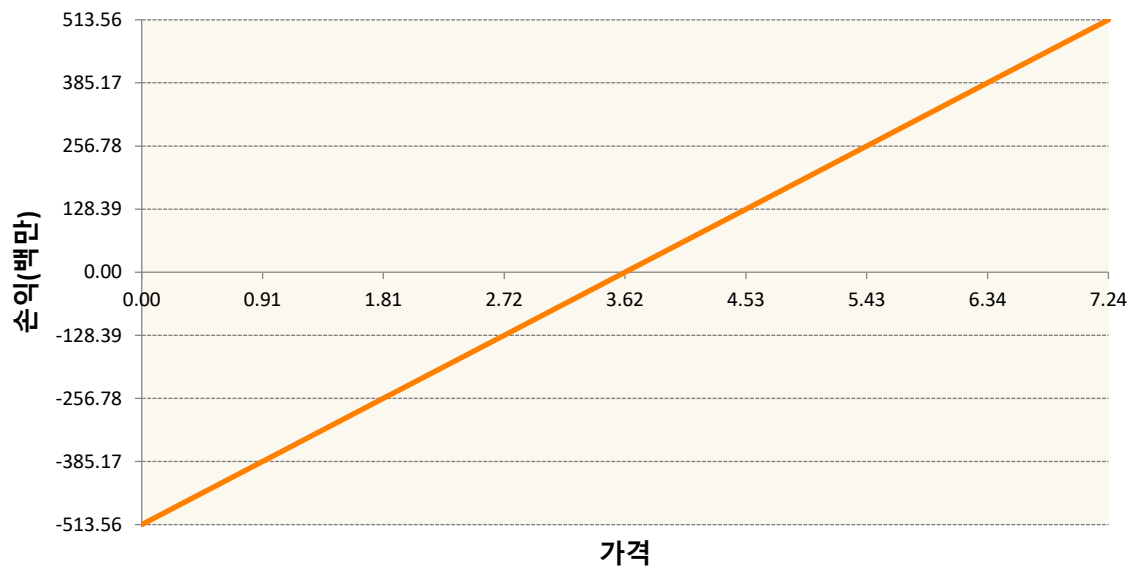
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

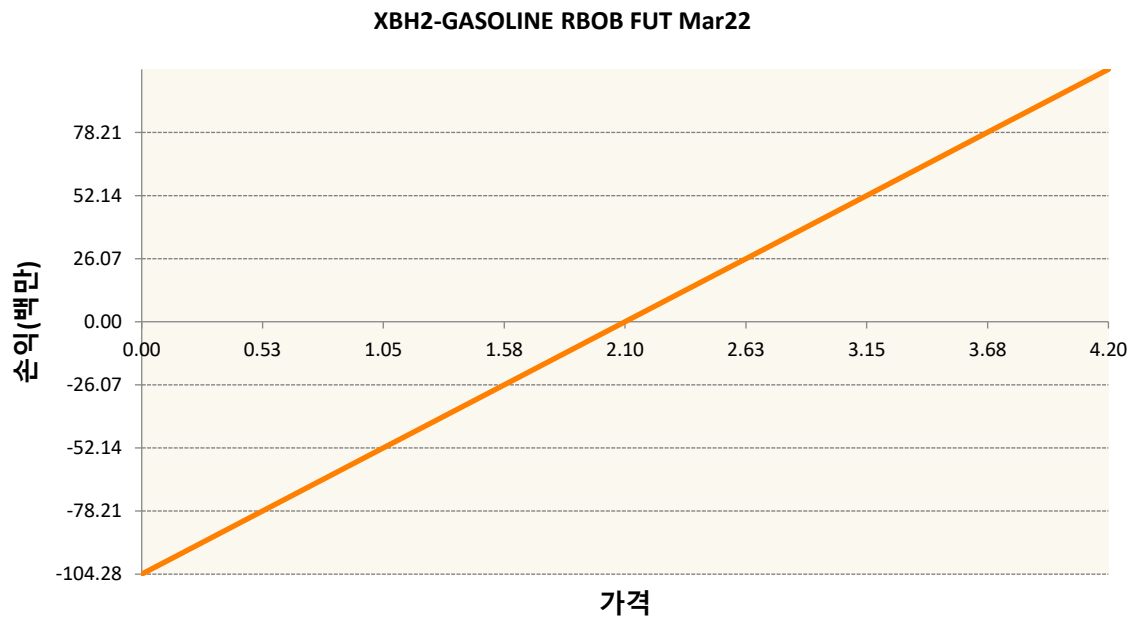
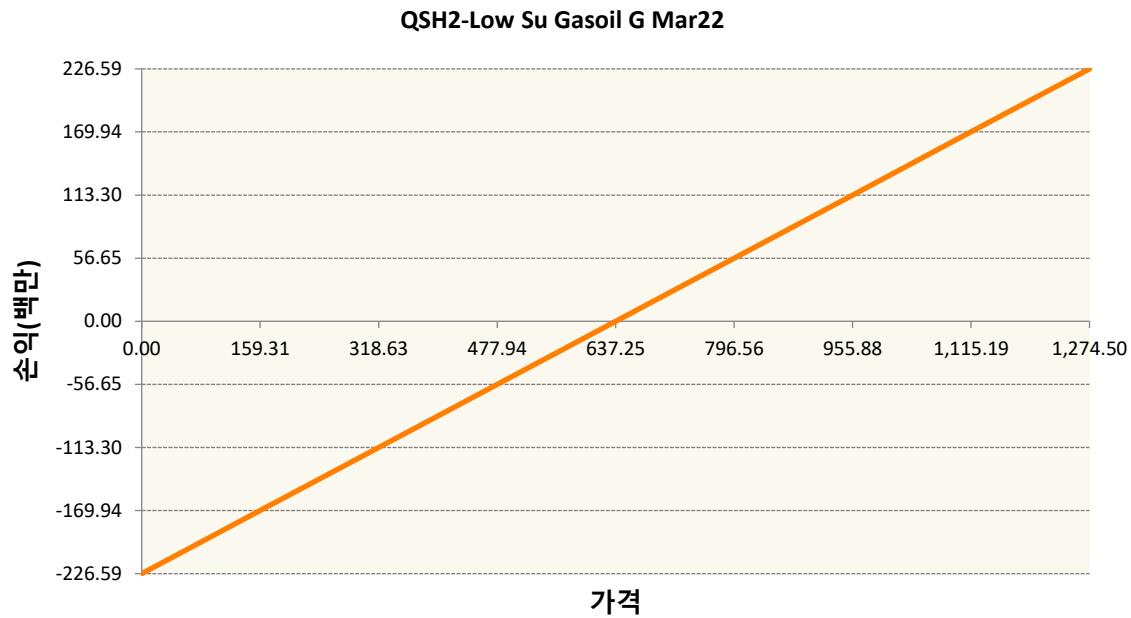


KR4175RC0001-2021-12 달러선물



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		41
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22		18
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22		8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		325

공시일 2021-12-16

기준일 2021-12-15

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

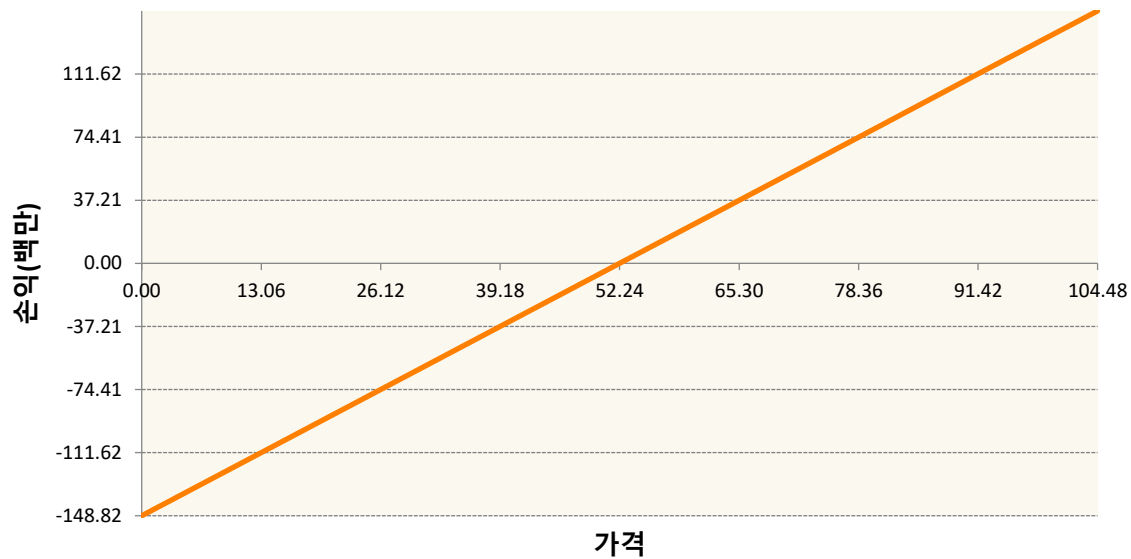
1. 계약금액

(단위:백만원)

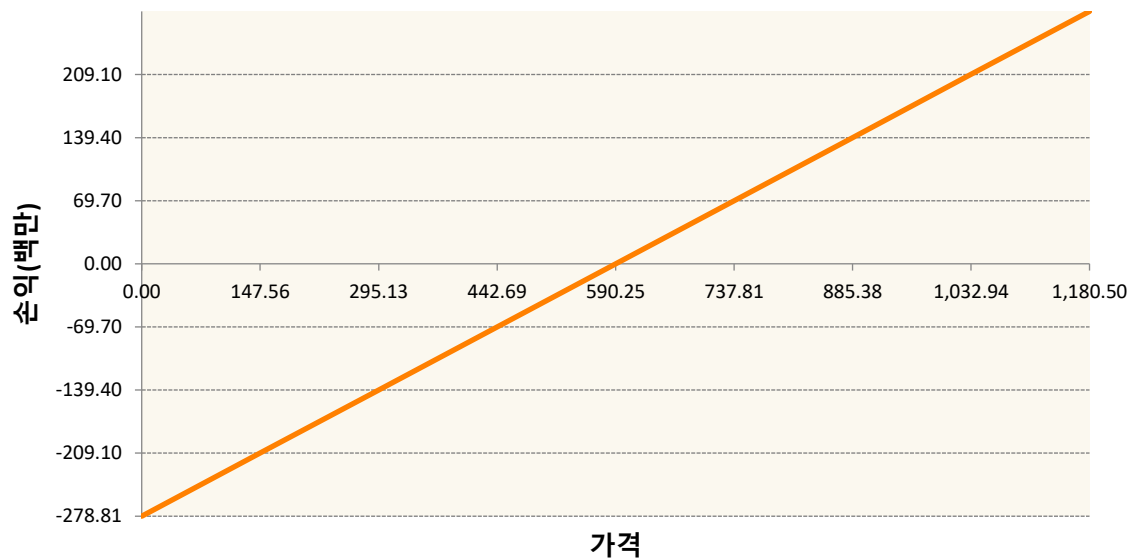
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,448	593	855	

2. 만기시점의 손익구조

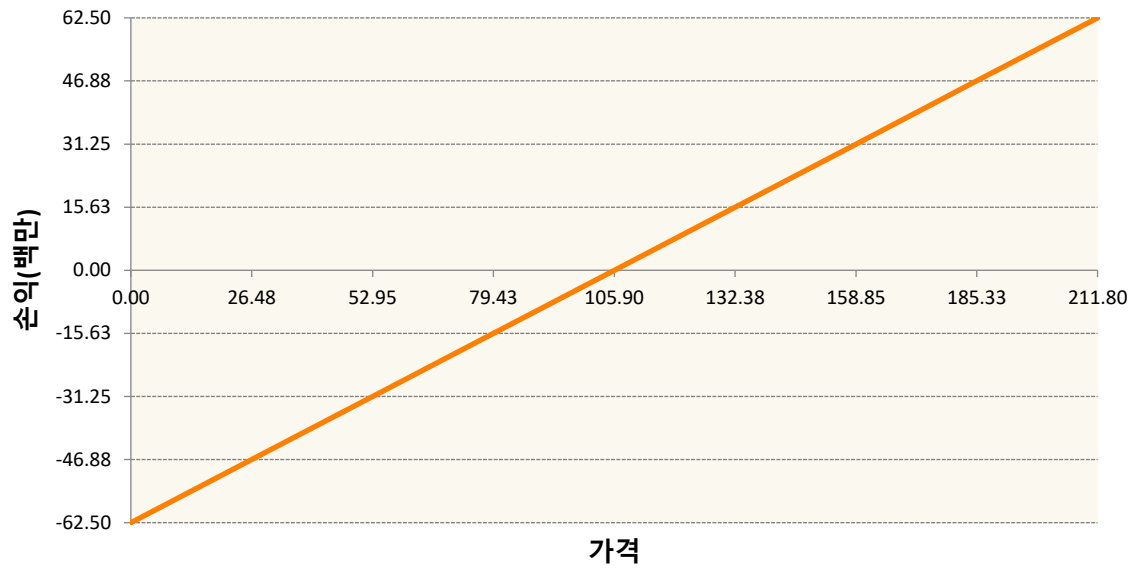
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



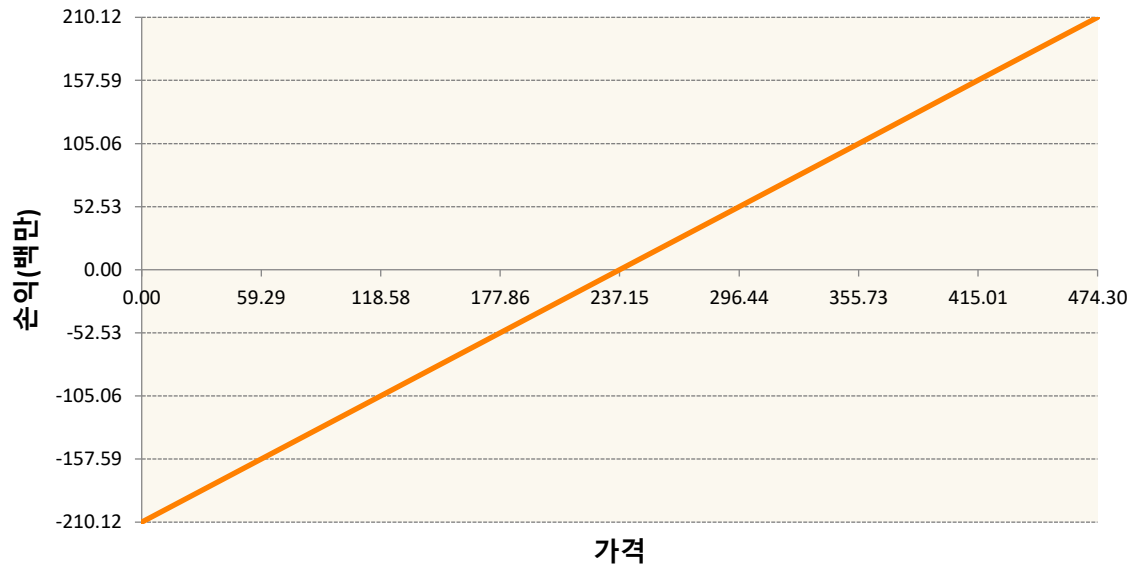
CH2-CORN FUTURE Mar22



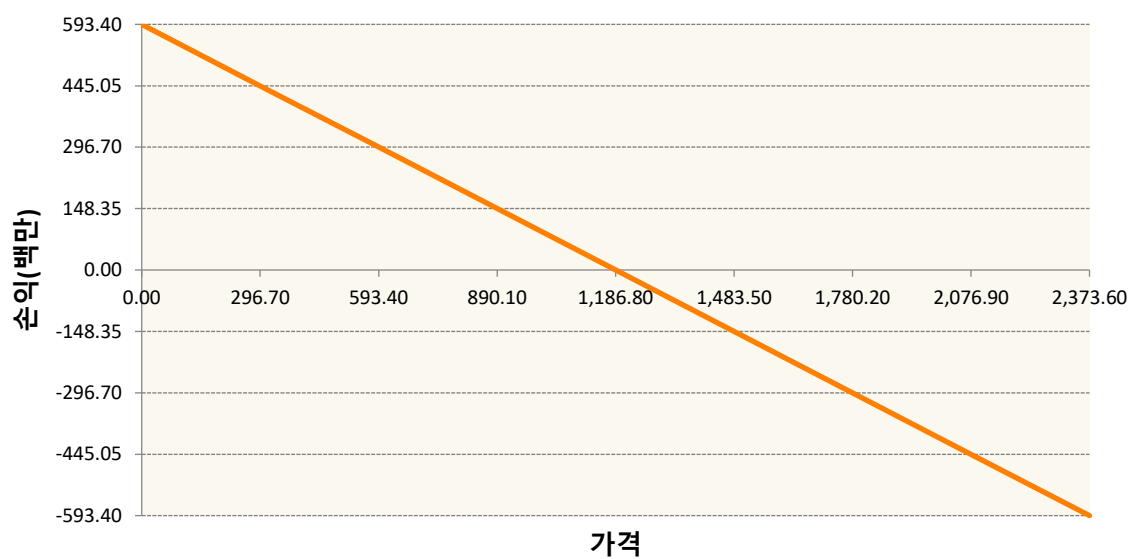
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



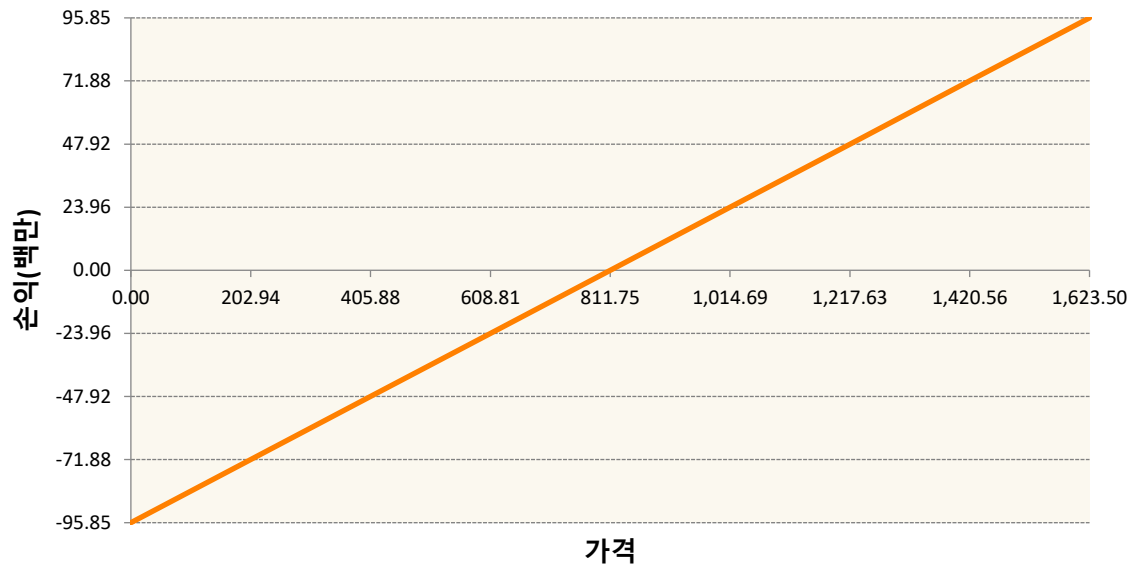
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



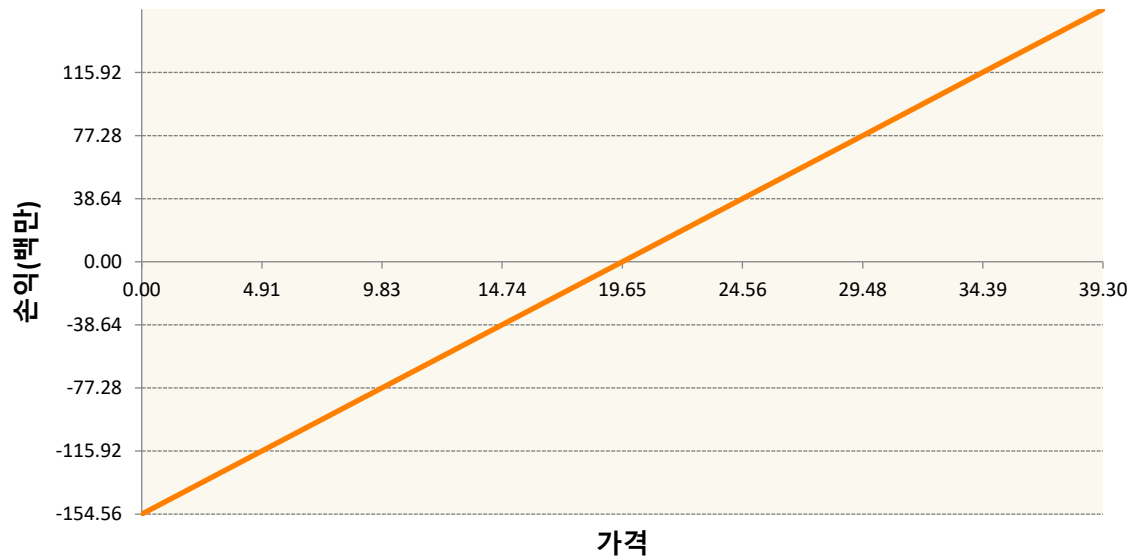
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



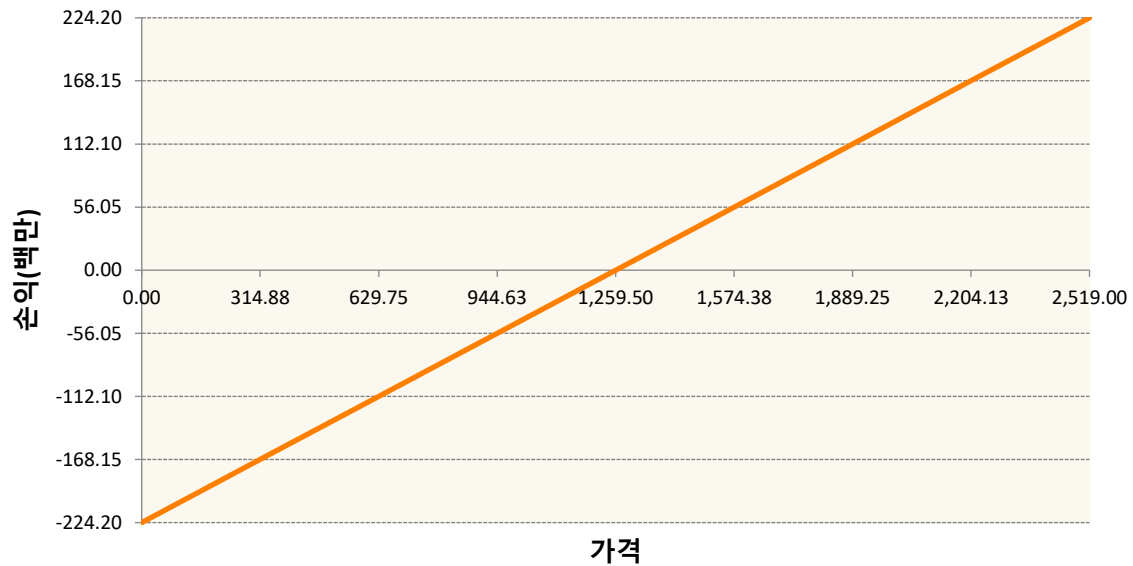
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

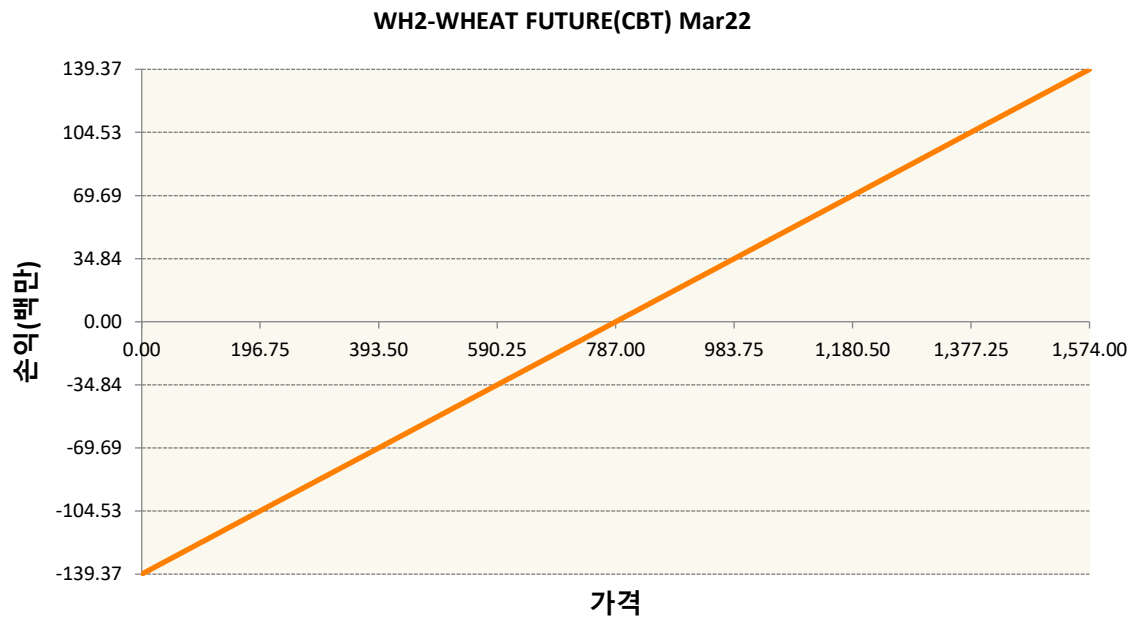
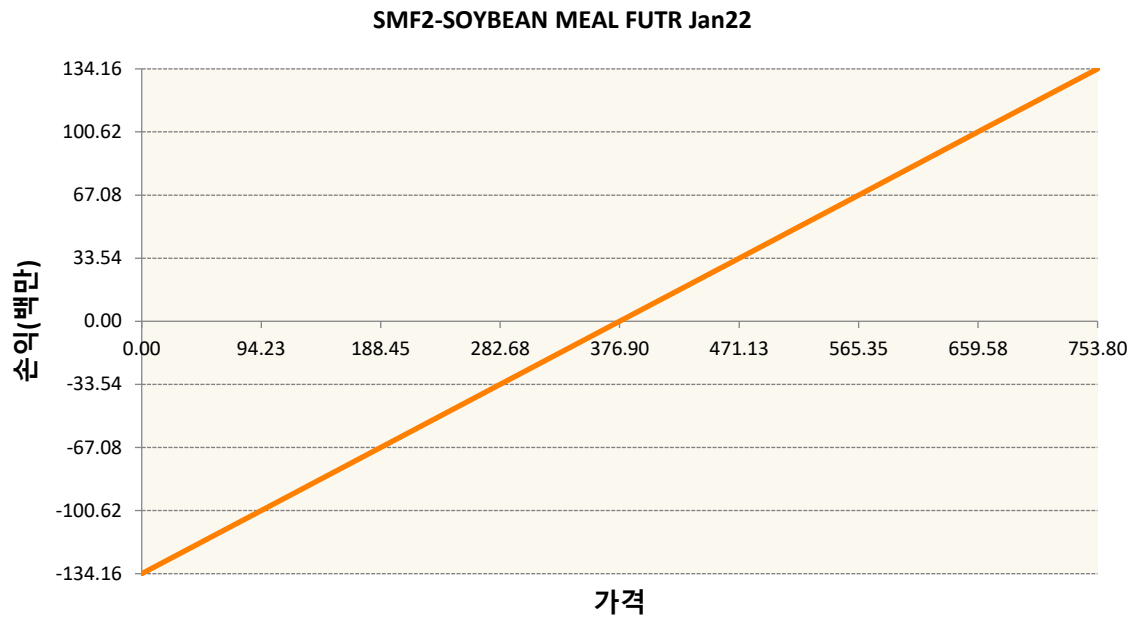


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22		12
CH2	CORN FUTURE Mar22		22
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22		5
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22		17
KR4175RC00 2021-12 달러선물			47
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22		8
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22		12
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22		18
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22		11
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22		11

