

공시일	2021-12-17
기준일	2021-12-16

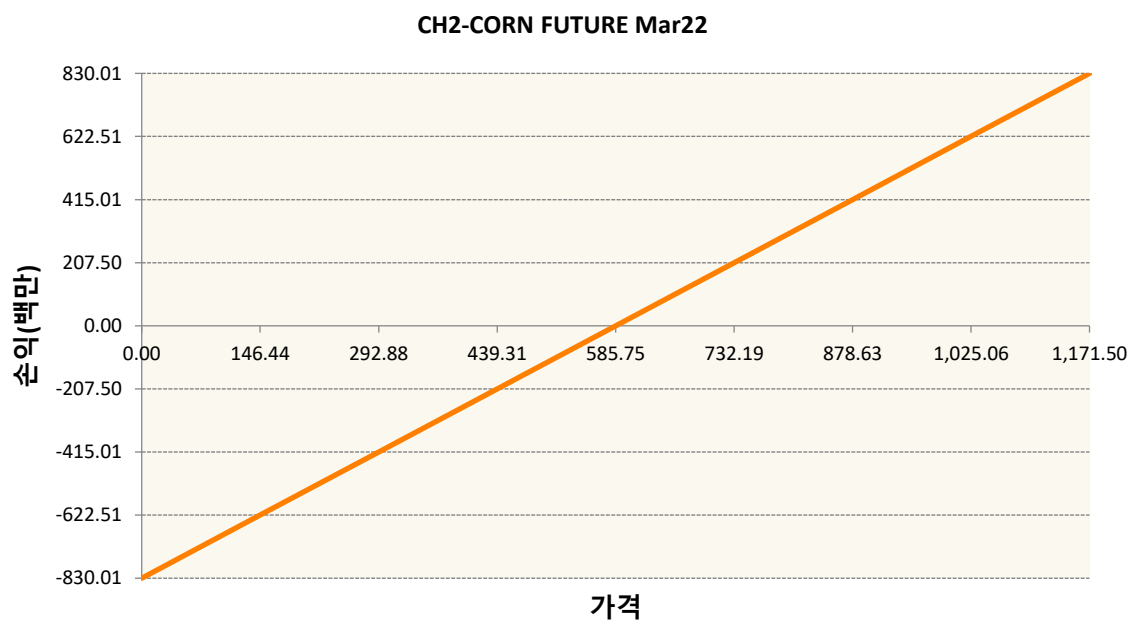
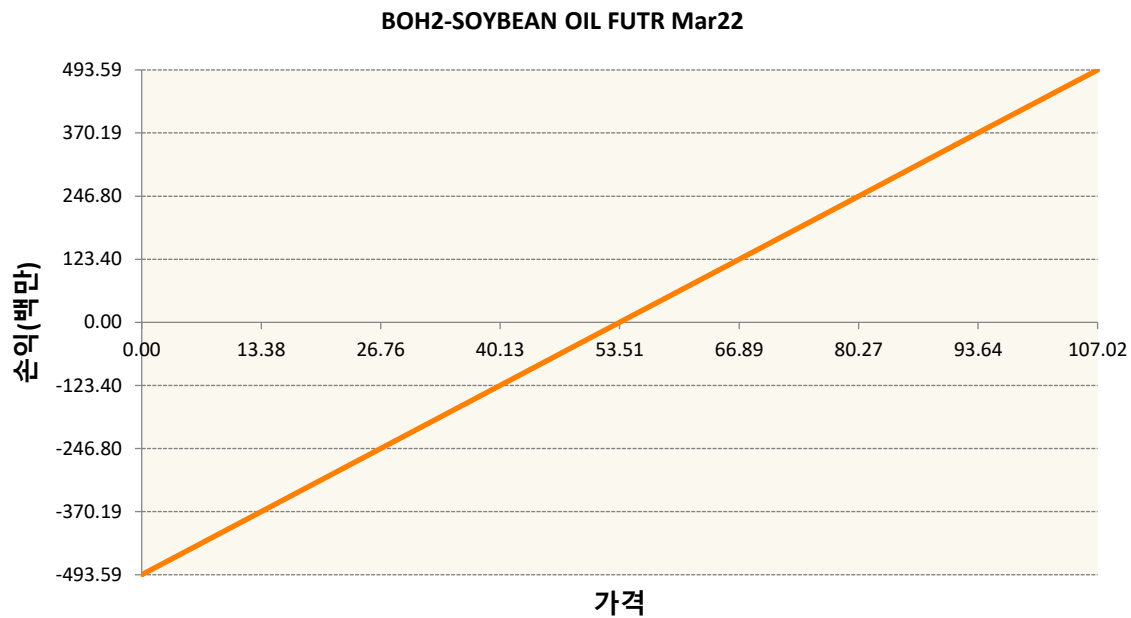
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

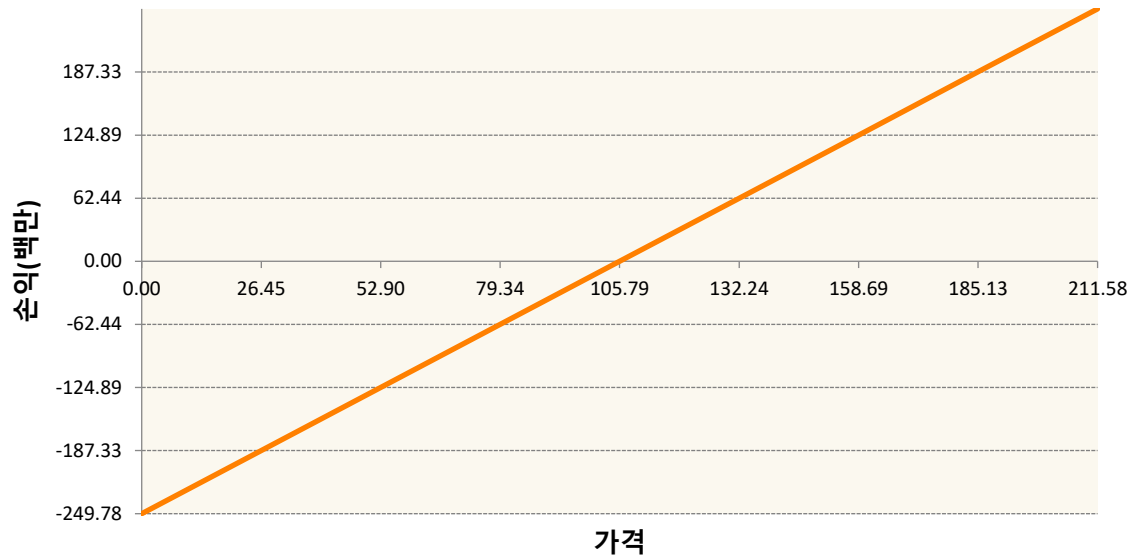
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,450	769	3,680	

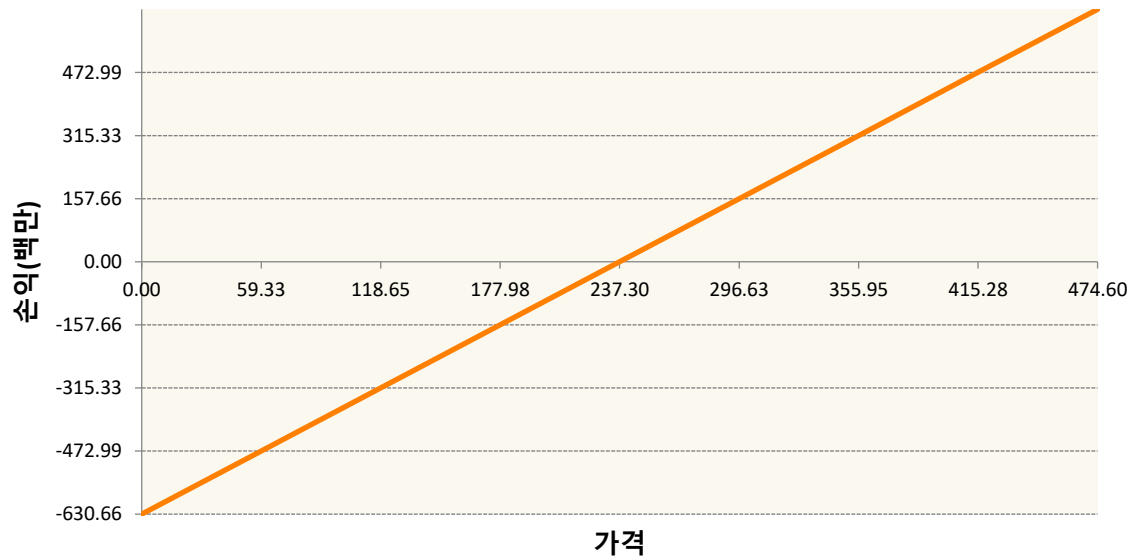
2. 만기시점의 손익구조



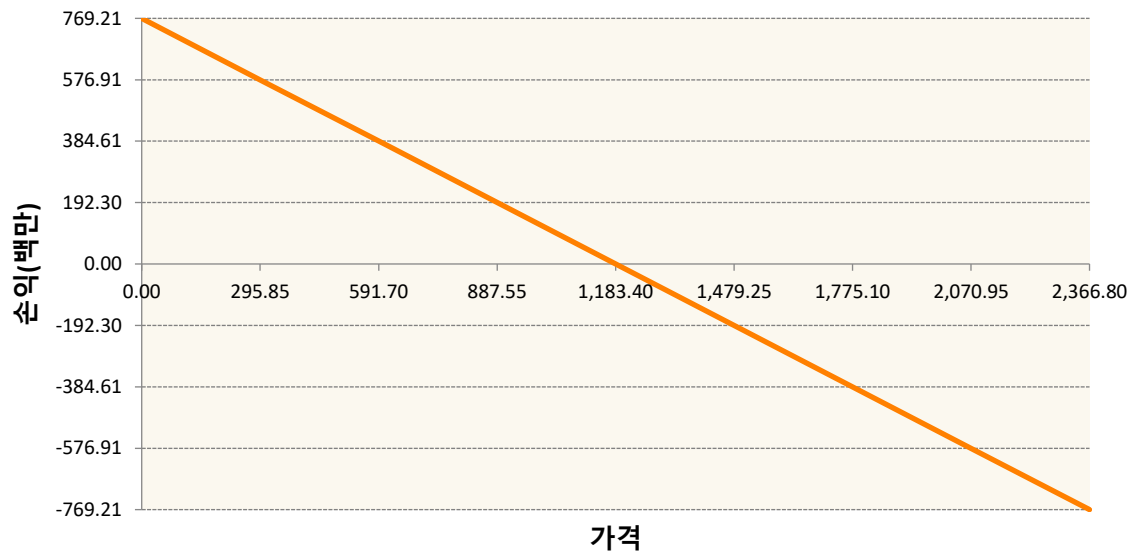
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



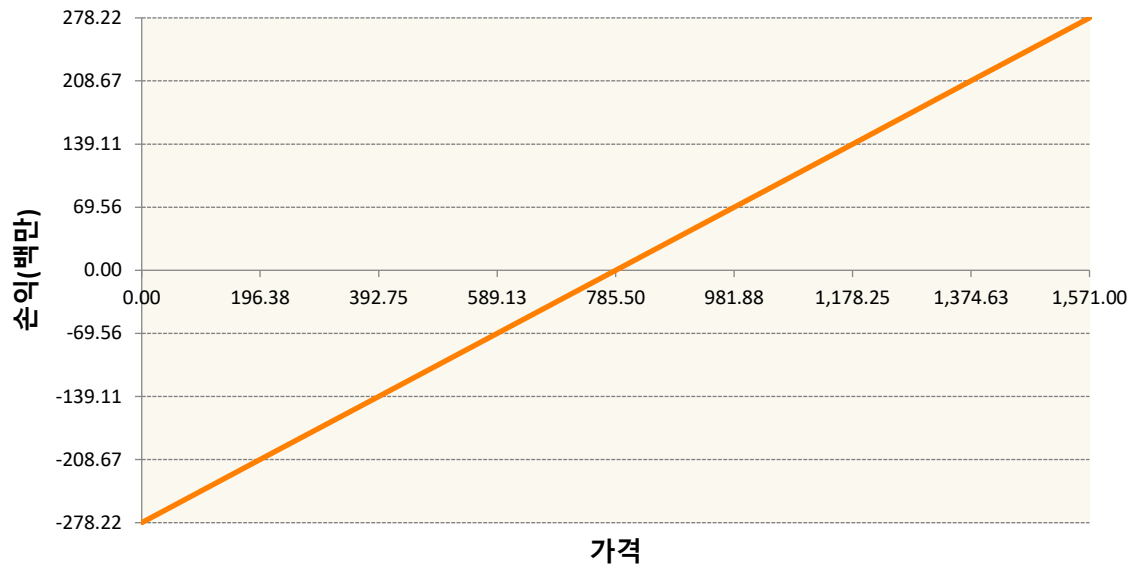
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



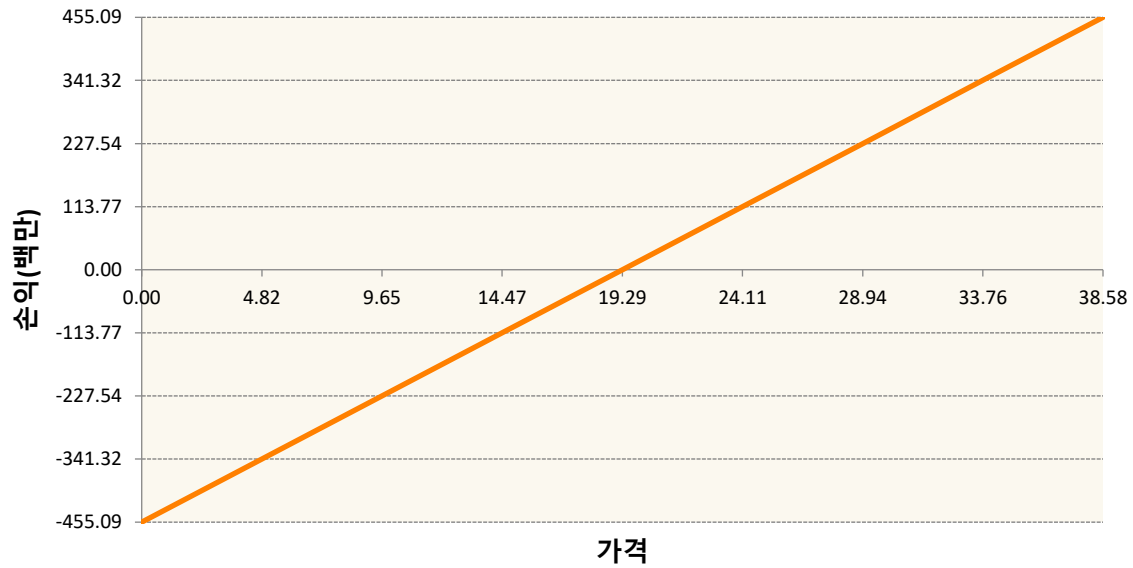
KR4175S10007-2022-01 달러선물



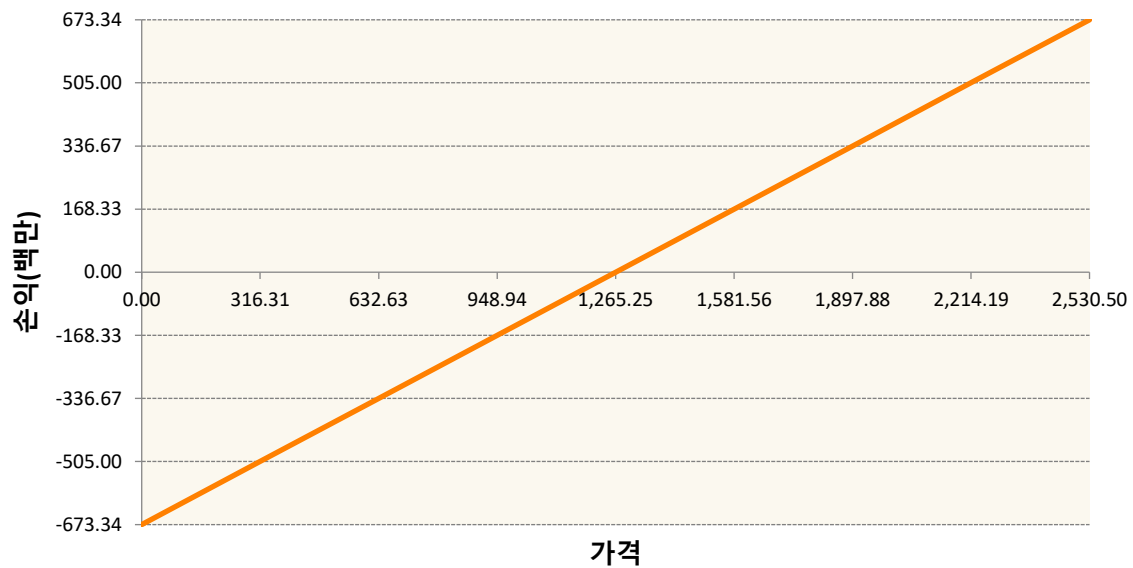
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



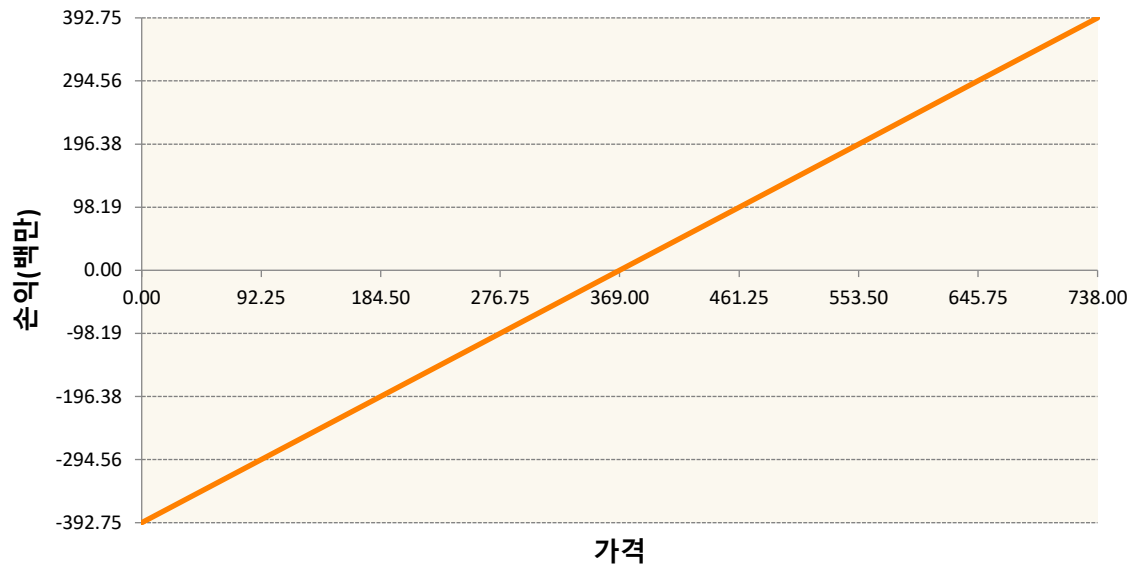
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



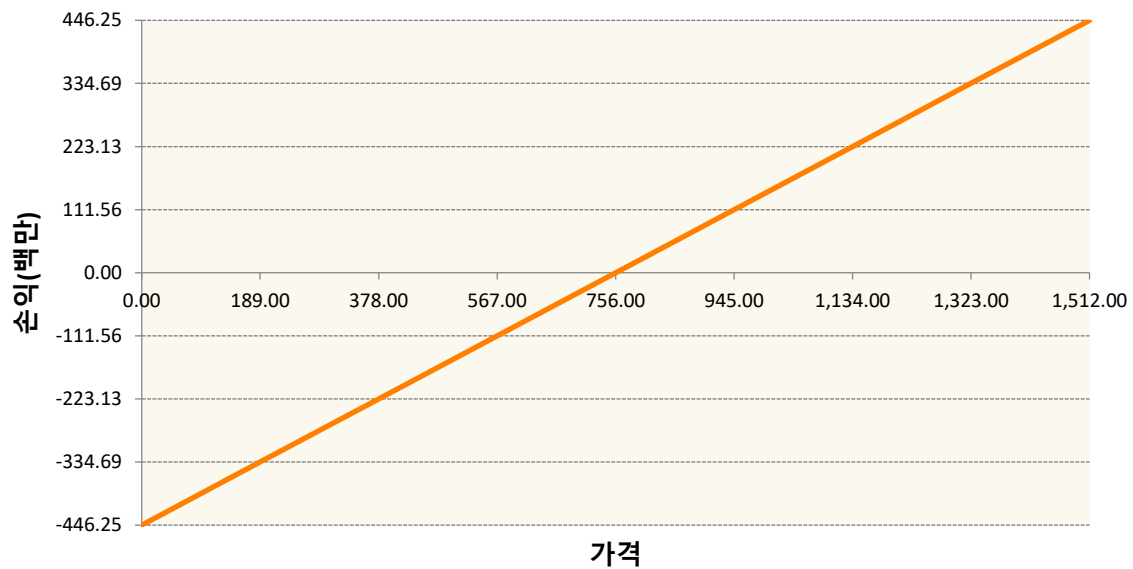
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



SMH2-SOYBEAN MEAL FUTR Mar22



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 2021-12-17

기준일 2021-12-16

스마트인덱스모

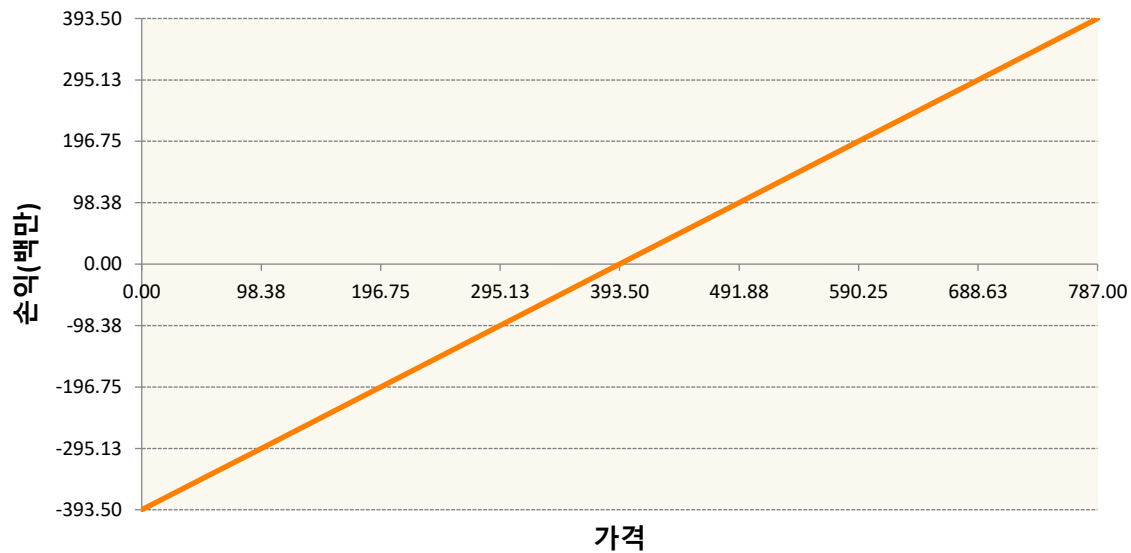
1. 계약금액

(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	2021-12-17
기준일	2021-12-16

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

912

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

546

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-17
기준일	2021-12-16

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

439

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

423

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-17
기준일	2021-12-16

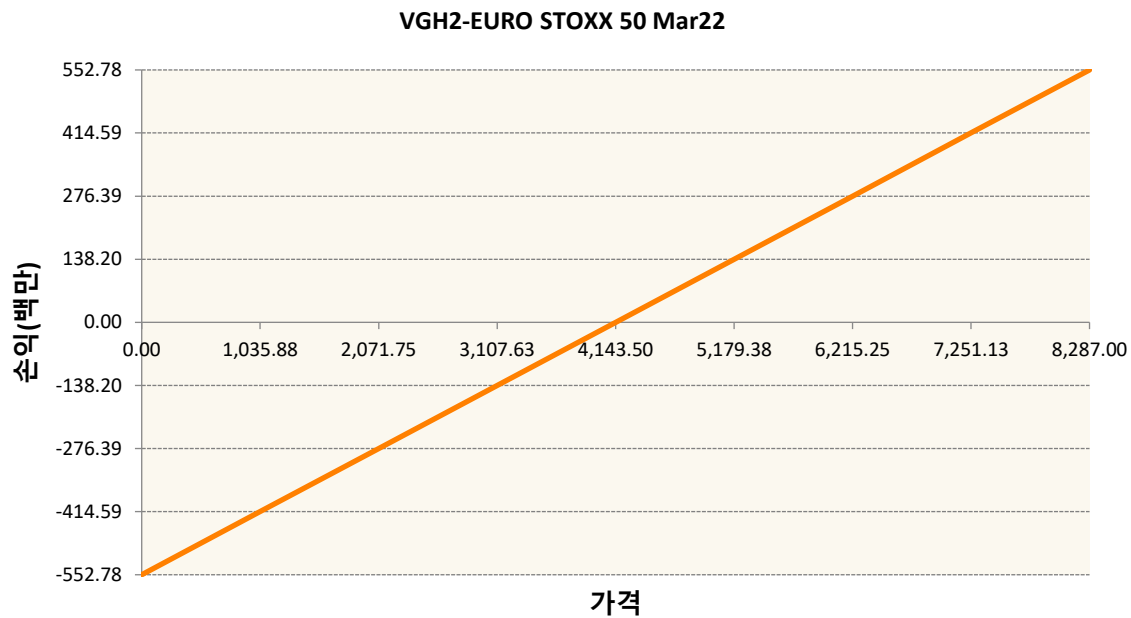
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	553	0	553	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

39

공시일	2021-12-17
기준일	2021-12-16

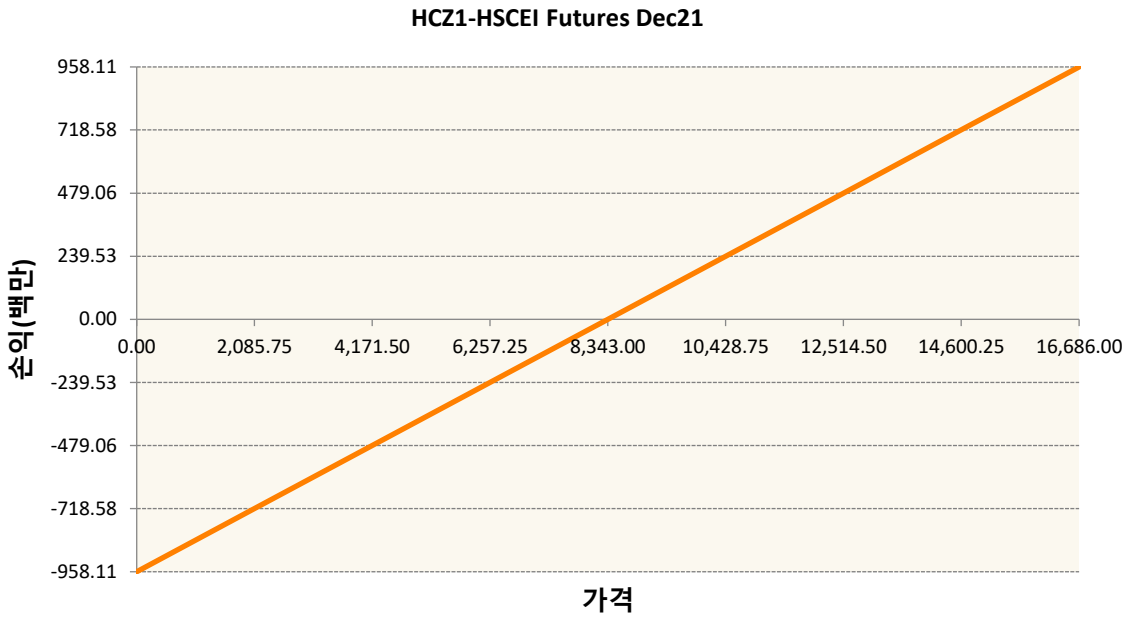
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	958	0	958	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

79

공시일	2021-12-17
기준일	2021-12-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

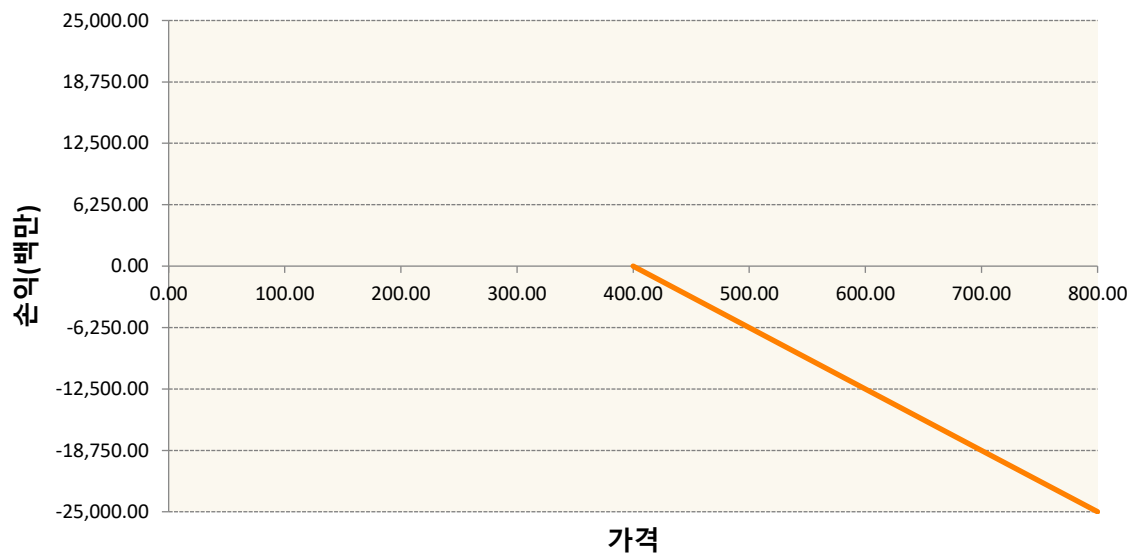
1. 계약금액

(단위:백만원)

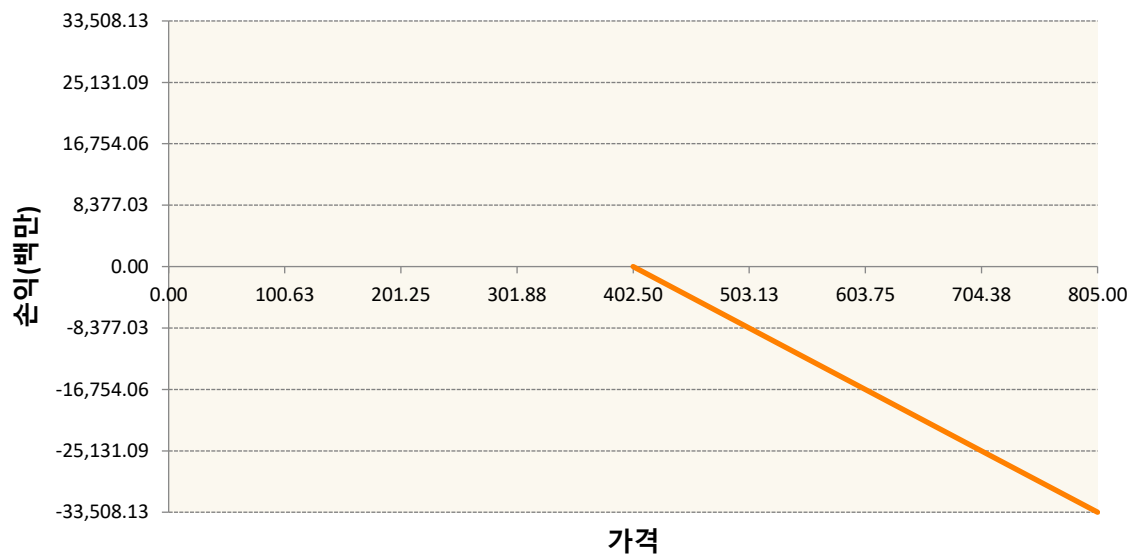
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

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 '순익(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 0.00 with a net income of -17,500.00, and reaching a net income of 0.00 at a price of 400.00.

가격 (Price)	순익 (백만) (Net Income)
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				1,474
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	628	610	587	561	531	498	463	
-5.33%	566	531	493	452	409	363	316	
-2.67%	429	377	324	270	215	160	103	
0%	183	122	61	0	-61	-122	-183	
2.67%	-186	-245	-304	-364	-424	-485	-545	
5.33%	-669	-715	-765	-816	-869	-923	-978	
8.00%	-1,235	-1,266	-1,301	-1,340	-1,382	-1,427	-1,474	
KR4201S14029				2022-01 콜402.5				1,897
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	756	735	709	677	641	601	557
-5.33%	688	647	601	550	496	438	378
-2.67%	532	468	401	332	261	189	116
0%	241	161	81	0	-81	-162	-243
2.67%	-212	-293	-374	-456	-537	-619	-701
5.33%	-821	-888	-958	-1,031	-1,105	-1,180	-1,256
8.00%	-1,552	-1,598	-1,651	-1,707	-1,767	-1,831	-1,897
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,142

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,115	-1,117	-1,119	-1,123	-1,128	-1,134	-1,142
-5.33%	-661	-668	-677	-688	-700	-714	-729
-2.67%	-244	-262	-282	-302	-324	-346	-369
0%	81	54	27	0	-27	-54	-82
2.67%	276	252	227	202	176	150	124
5.33%	359	346	330	313	295	275	255
8.00%	384	379	372	364	353	341	328

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	-134	-135
-5.33%	-80	-81	-82	-83	-84	-85	-87
-2.67%	-31	-33	-35	-37	-39	-42	-44
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	35	32	29	26	23	20	17
5.33%	47	45	43	41	38	36	33
8.00%	51	50	49	48	47	45	43

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

(단위:백만원)

4,465

공시일	2021-12-17
기준일	2021-12-16

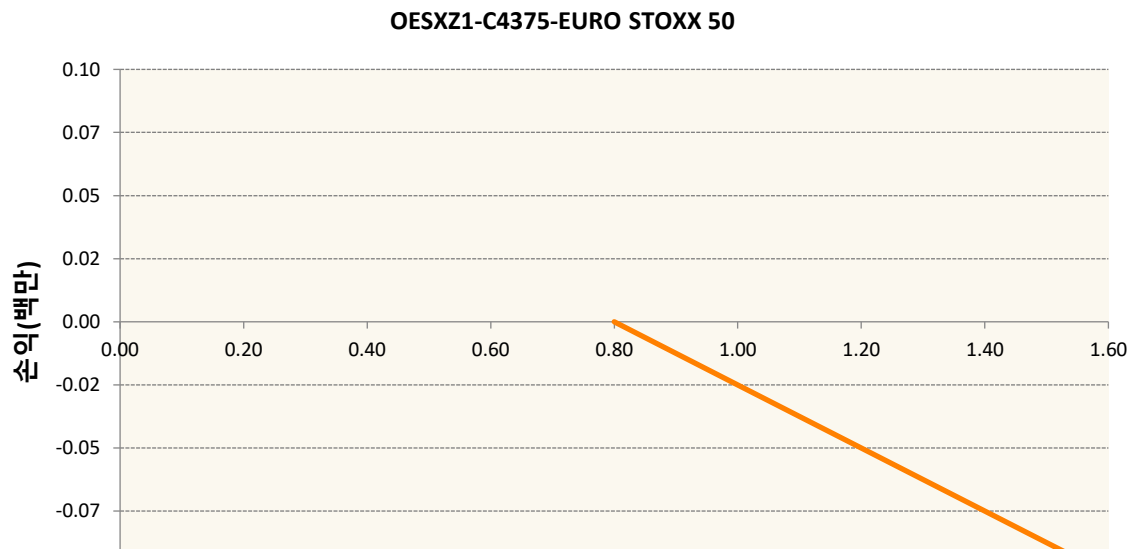
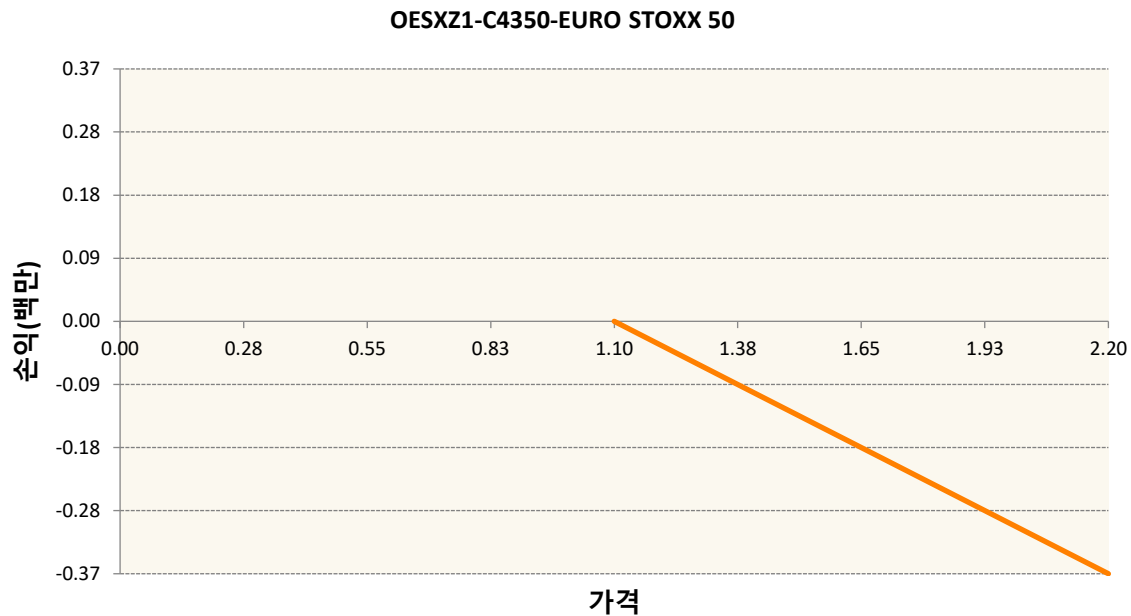
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

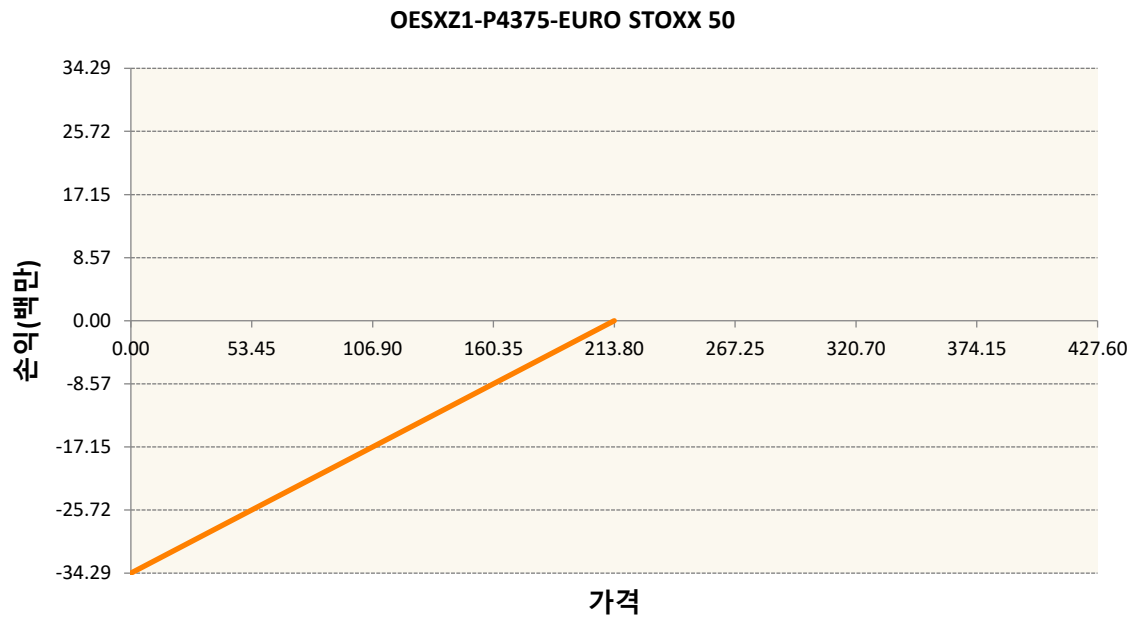
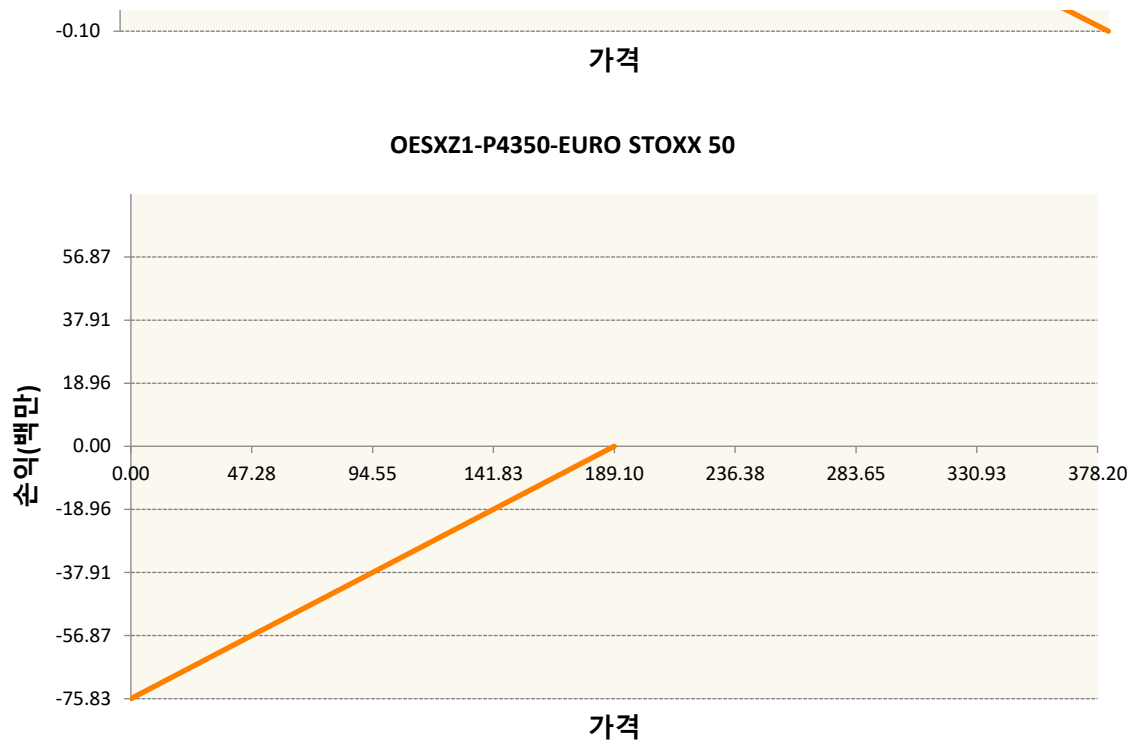
1. 계약금액

(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	111	-111	장내
누계	통화	선도	0	2,005	-2,005	장외

2. 만기시점의 손익구조





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

12
53
107
0.03
0.01
6
3

공시일 2021-12-17

기준일 2021-12-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

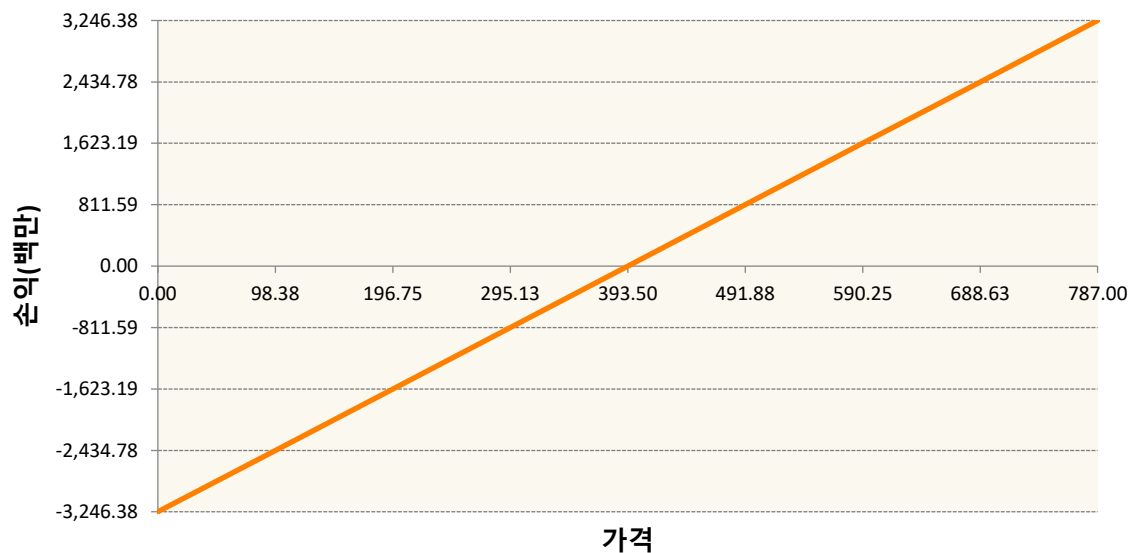
1. 계약금액

(단위:백만원)

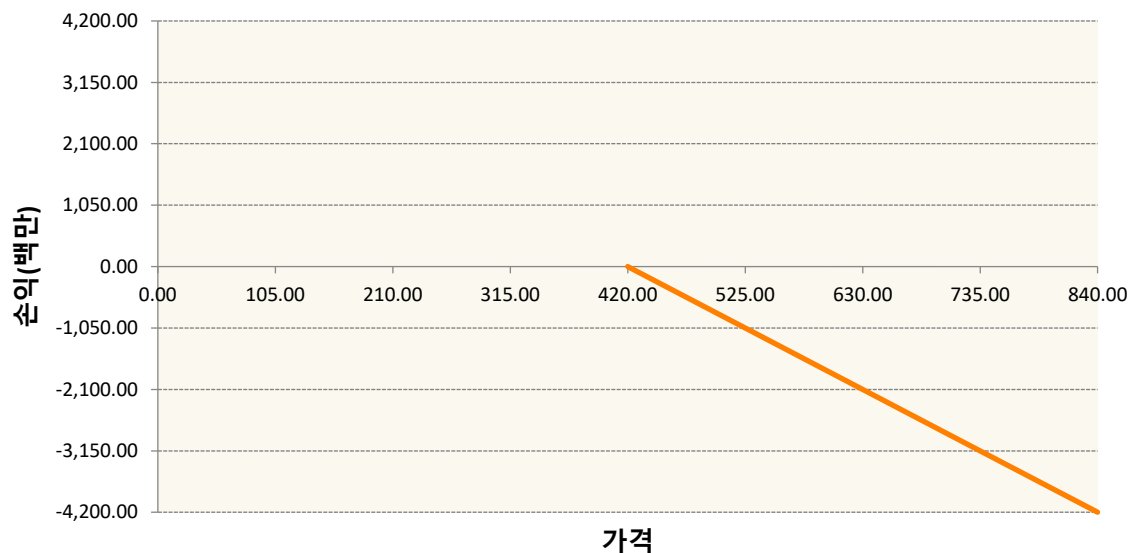
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,246	0	3,246	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

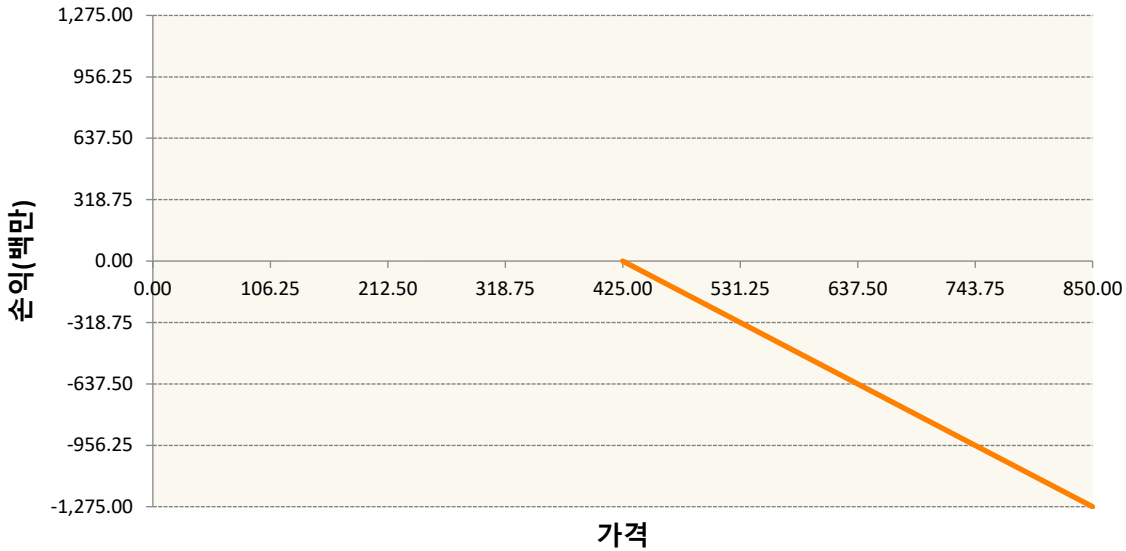
2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물

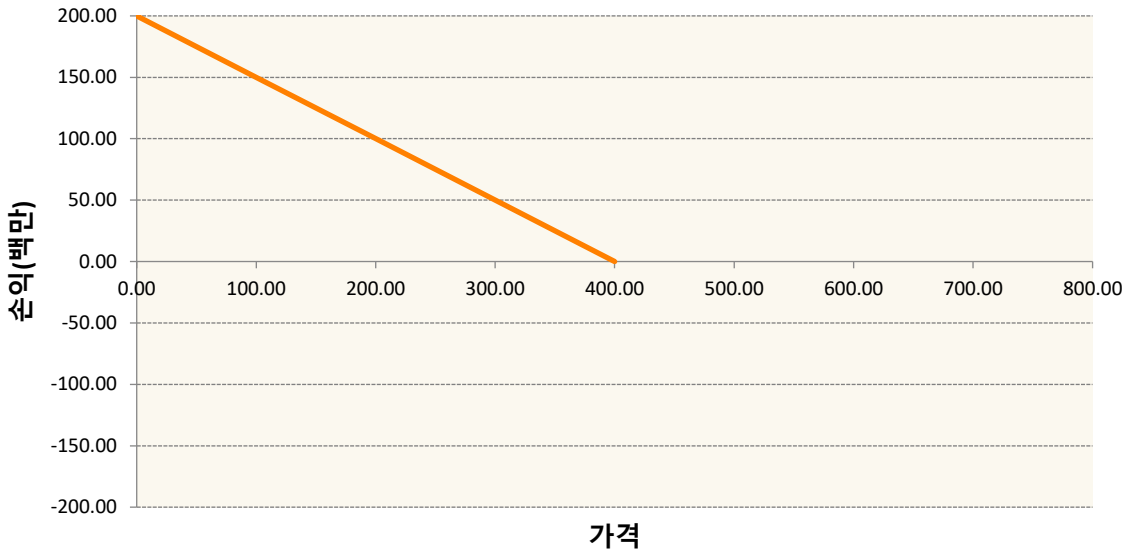


KR4201S14201-2022-01 콜420



KR4201S14250-2022-01 **콜**425

KR4301S14001-2022-01 쪽400



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				167
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	39	38	36	35	32	29
-5.33%	38	36	34	31	27	23	19
-2.67%	33	29	25	20	14	8	2
0%	21	14	7	0	-8	-16	-24
2.67%	-4	-13	-22	-32	-41	-51	-60
5.33%	-46	-56	-67	-77	-87	-98	-108
8.00%	-107	-117	-127	-137	-147	-157	-167
KR4201S14250 2022-01 콜425							45

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	8	8	7	7
-5.33%	9	8	8	7	6	5	4
-2.67%	8	7	6	5	3	2	0
0%	5	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	0	-3	-5	-8	-10	-13	-16
5.33%	-10	-13	-16	-19	-23	-26	-29
8.00%	-26	-29	-32	-35	-39	-42	-45
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	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%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

439

공시일	2021-12-17
기준일	2021-12-16

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	1,119	-1,119	
누계	유가증권	수익증권	16,810	0	16,810	

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	2021-12-17
기준일	2021-12-16

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	9,660	0	9,660	

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	2021-12-17
기준일	2021-12-16

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	45,626	0	45,626	
누계	통화	선도	1,421	0	1,421	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	2021-12-17
기준일	2021-12-16

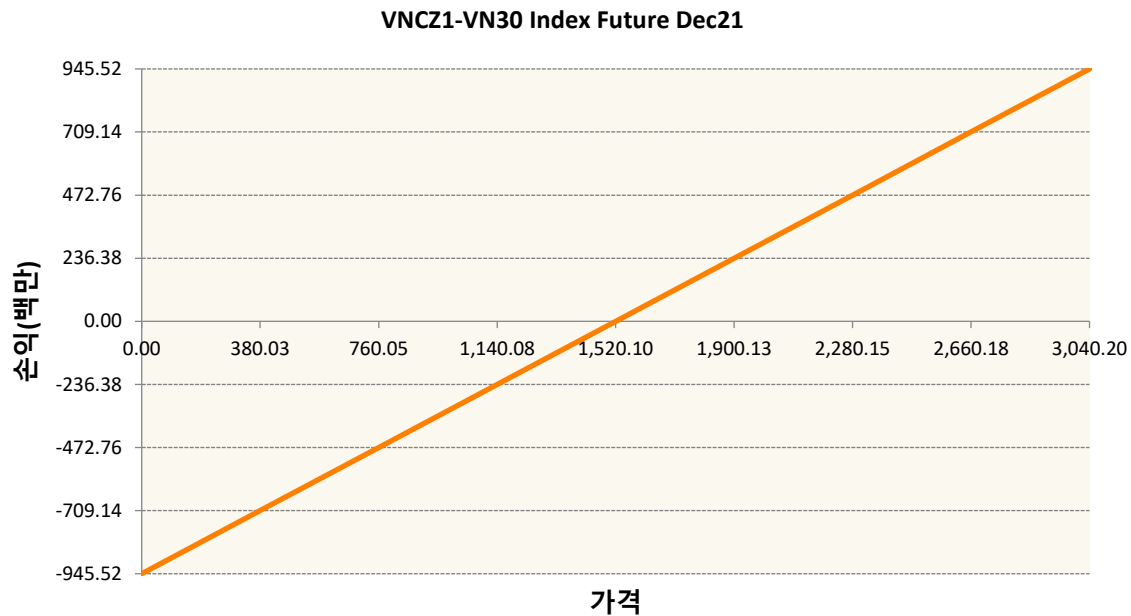
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	946	0	946	
누계	유가증권	스왑	1,785	0	1,785	장외
누계	통화	선도	0	575	-575	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 2021-12-17

기준일 2021-12-16

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

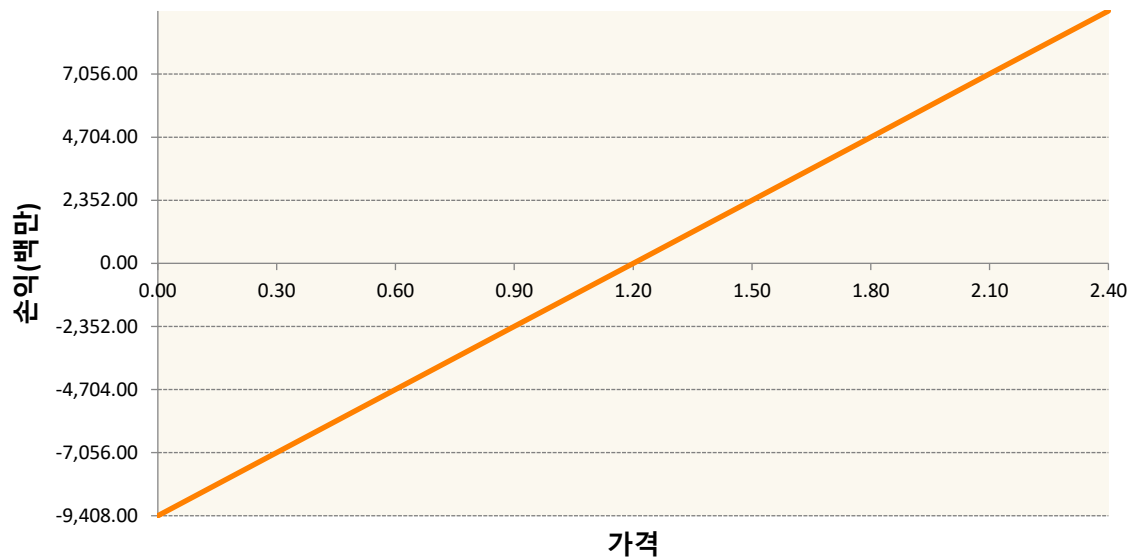
1. 계약금액

(단위:백만원)

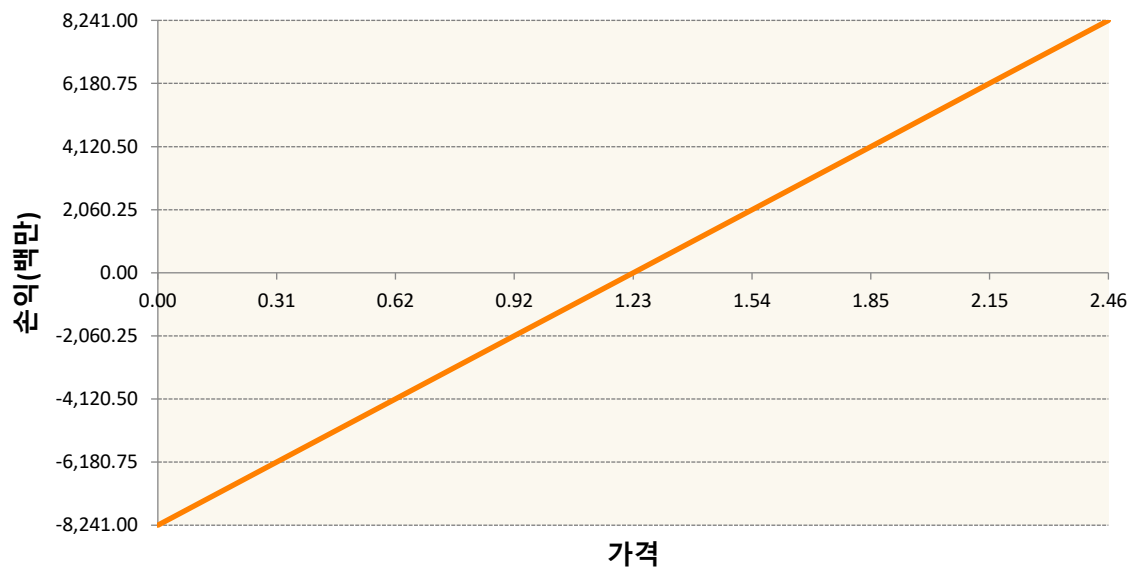
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	35,347	0	35,347	

2. 만기시점의 손익구조

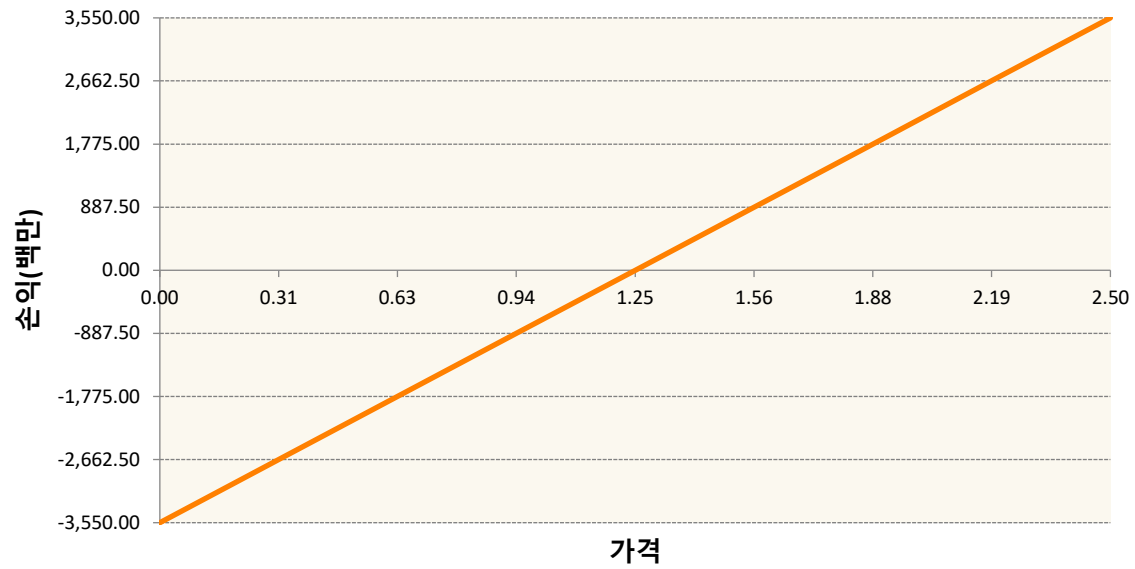
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



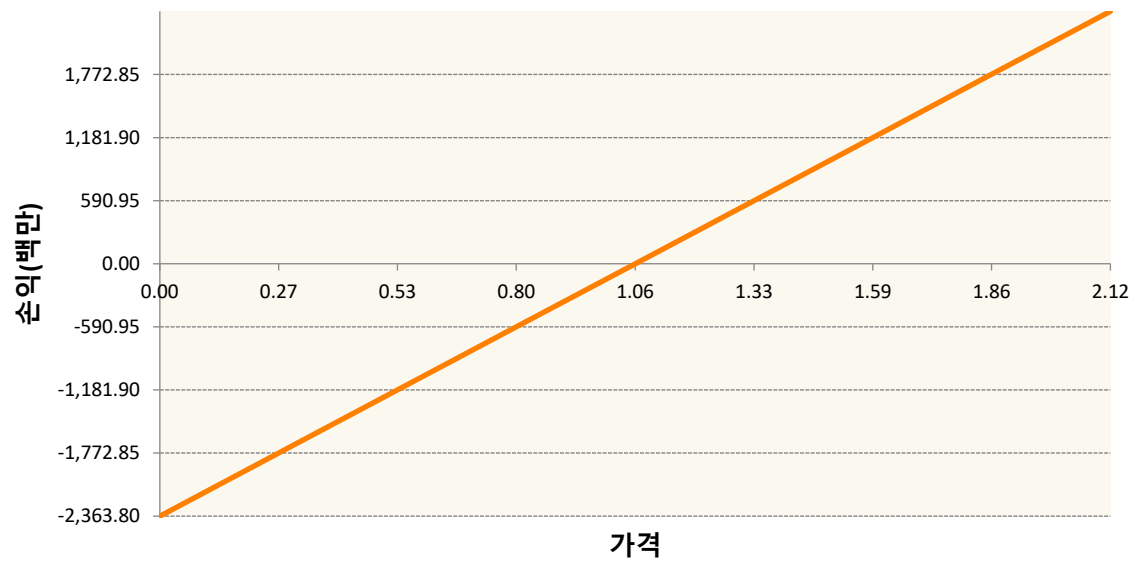
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



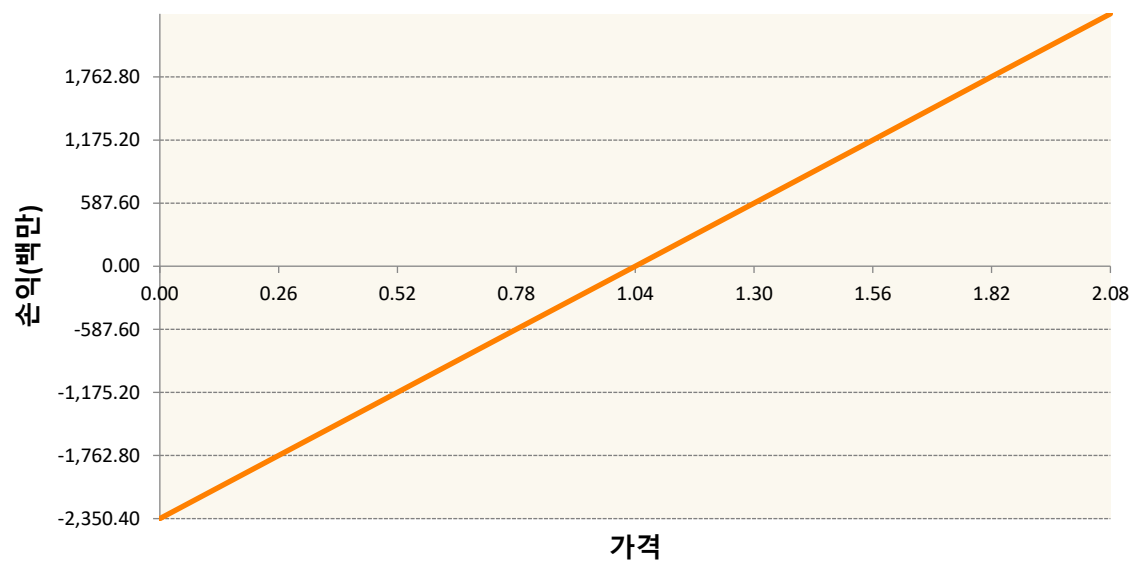
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



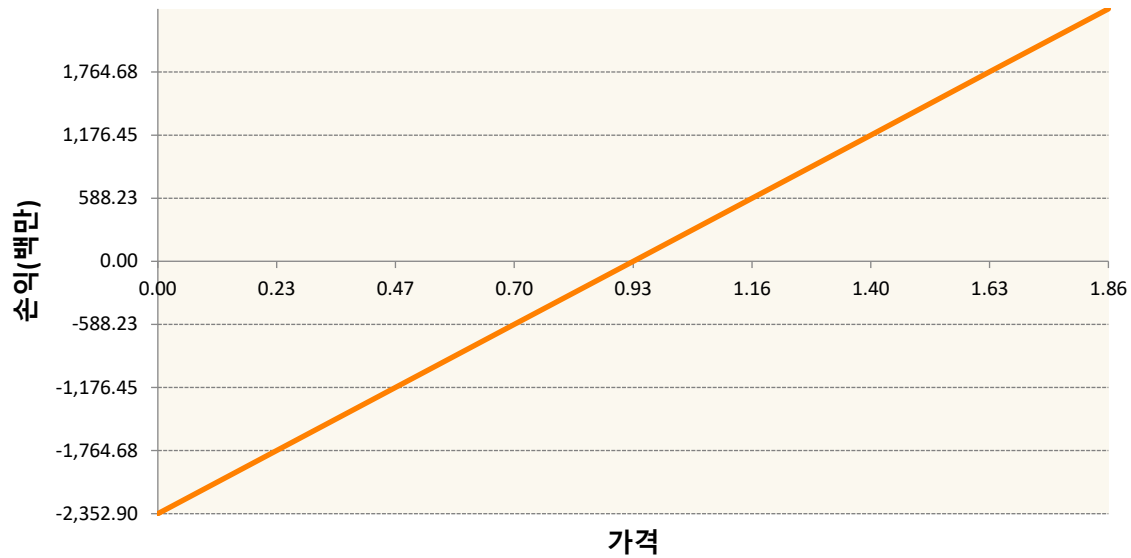
210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



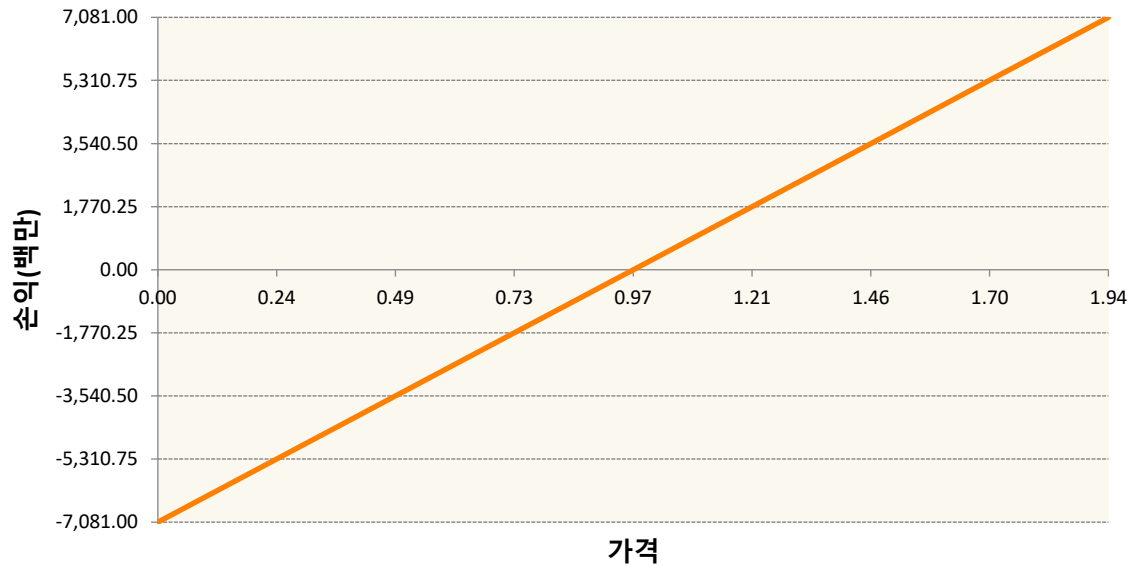
210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211210-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211214-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	755
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	658
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	283
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	188
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	189
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	188
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	566

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

(단위:백만원)

4,356

공시일	2021-12-17
기준일	2021-12-16

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

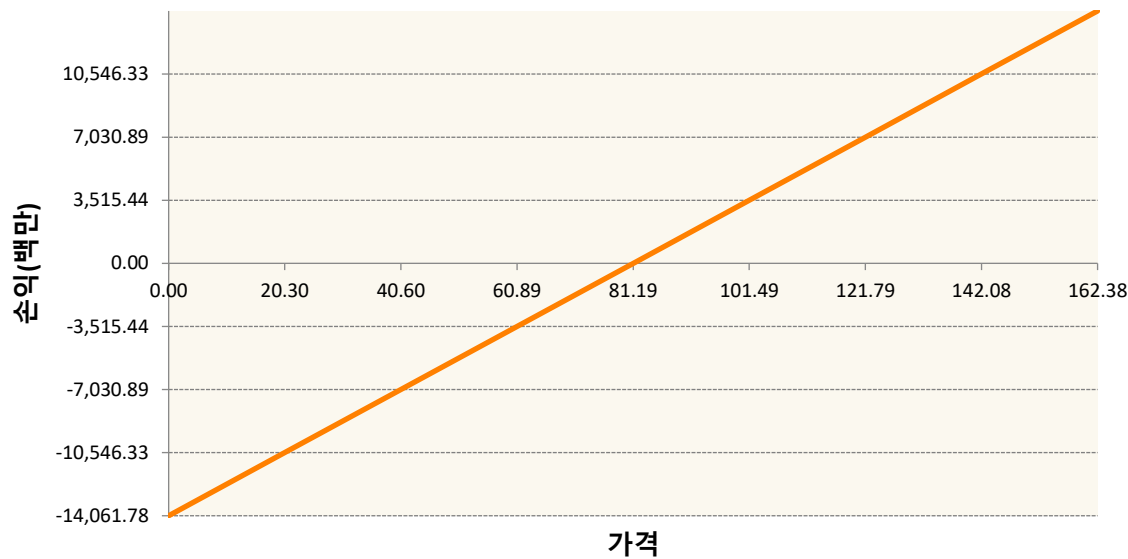
1. 계약금액

(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	14,062	0	14,062	
누계	통화	선도	0	6,708	-6,708	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX·KRW/EUR 28-12-21E	382
FXW213BCA·KRW/EUR 28-12-21E	155
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,125

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

(단위:백만원)

2,528

공시일	2021-12-17
기준일	2021-12-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

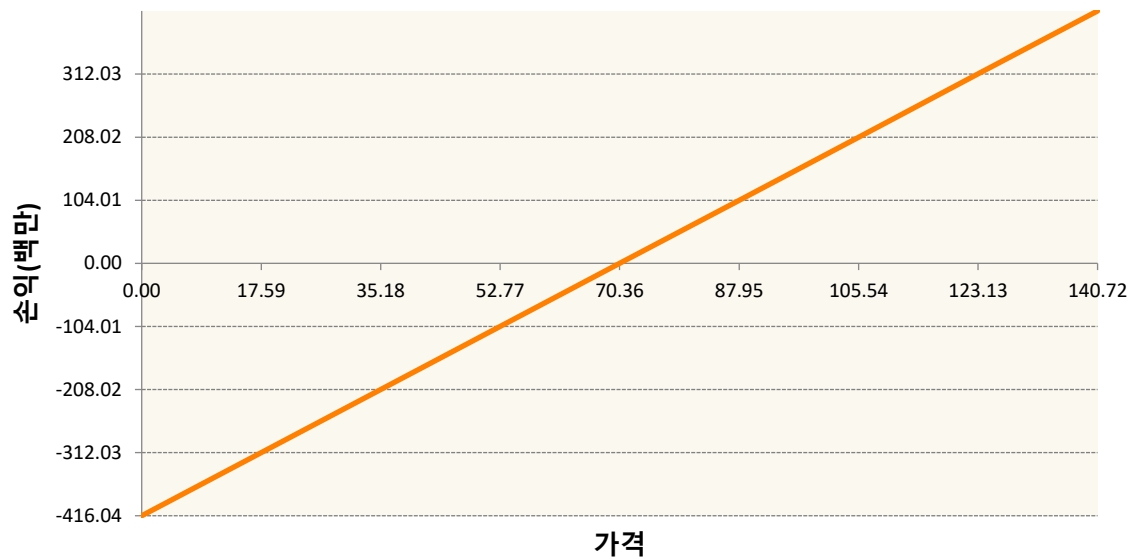
1. 계약금액

(단위:백만원)

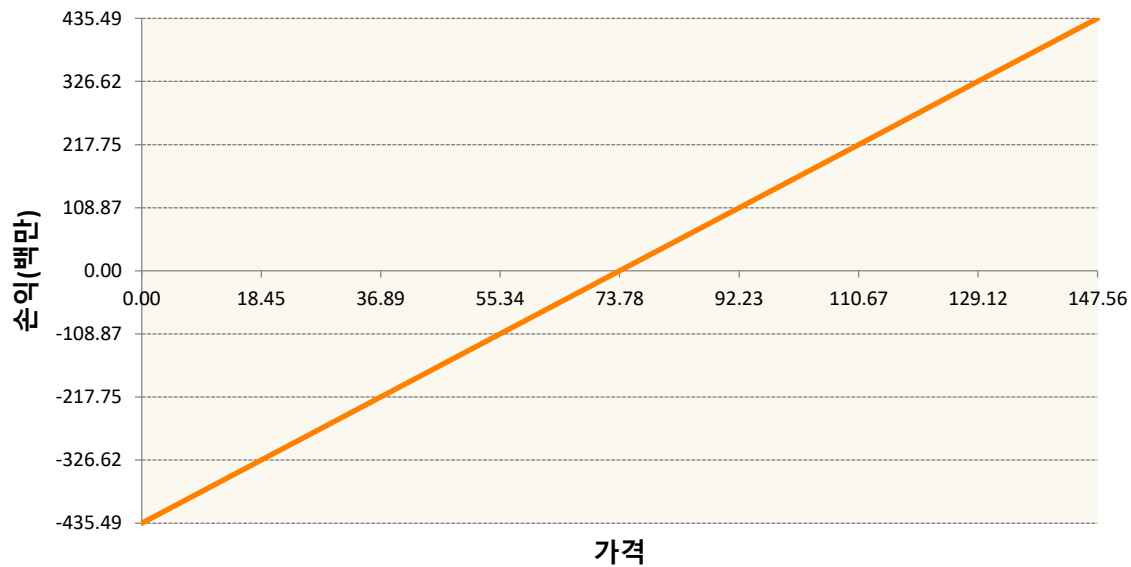
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,811	355	1,456	

2. 만기시점의 손익구조

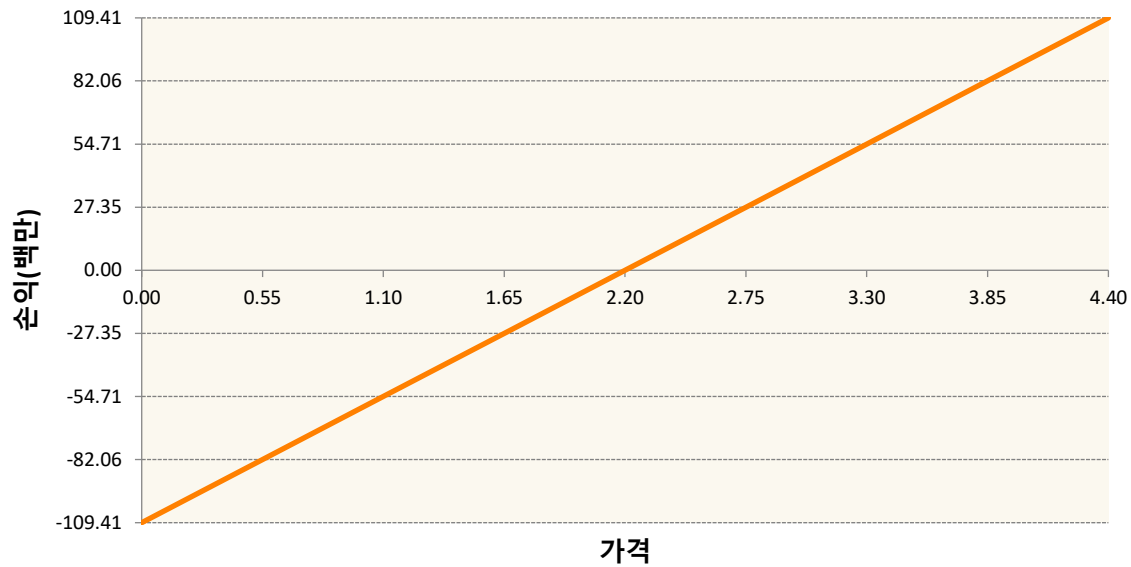
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



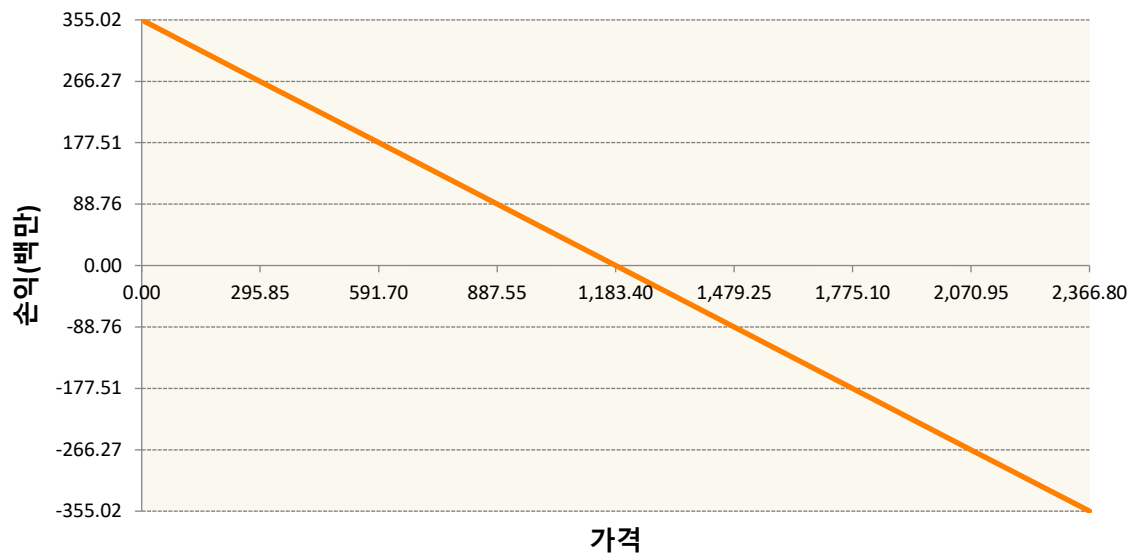
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



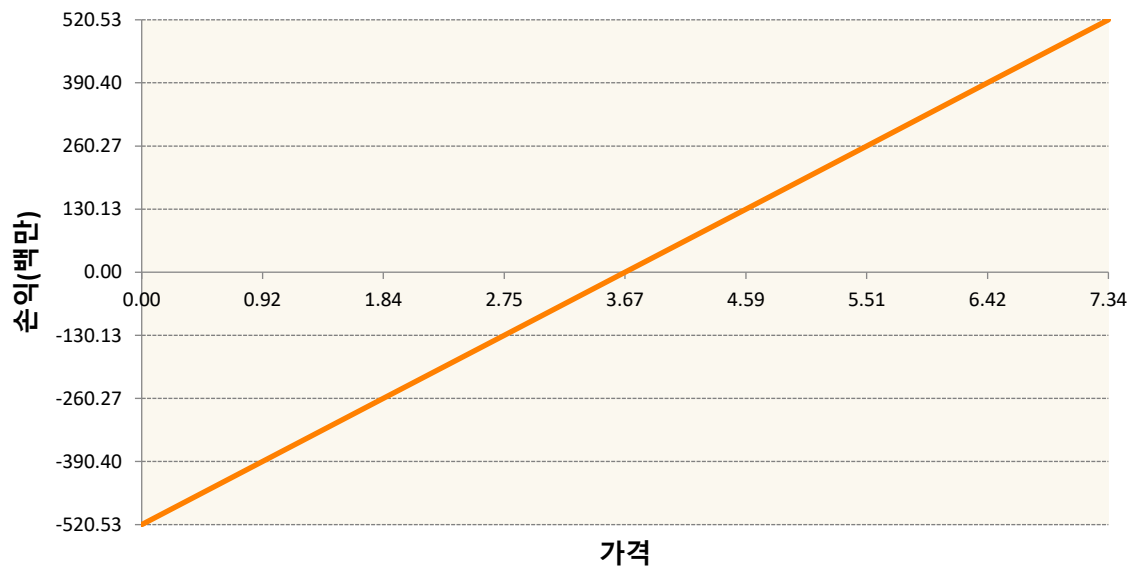
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

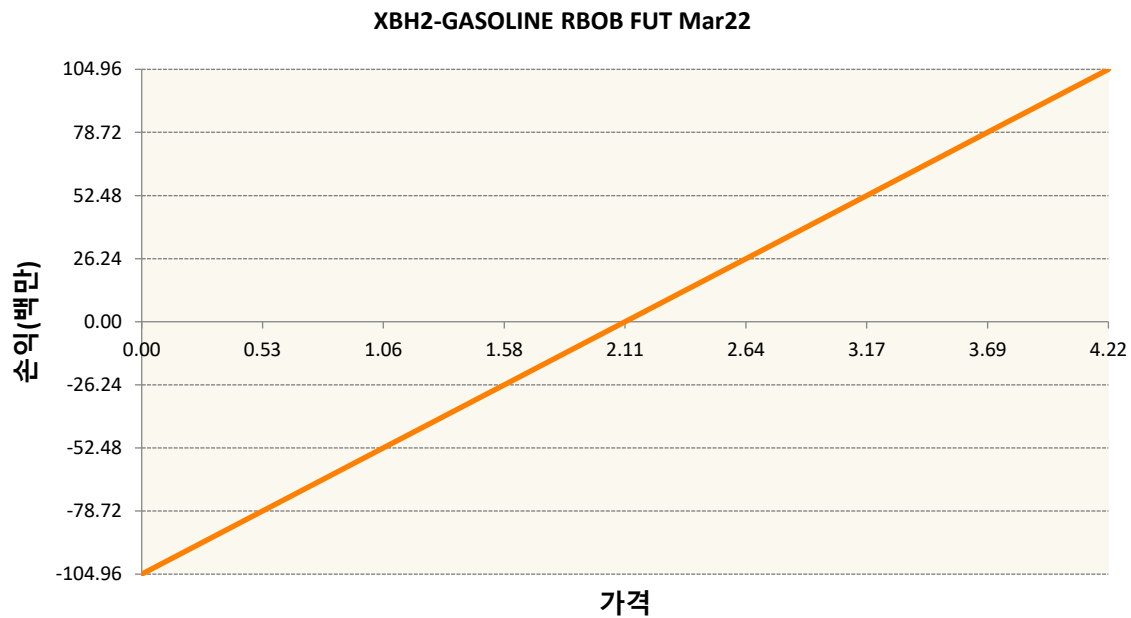
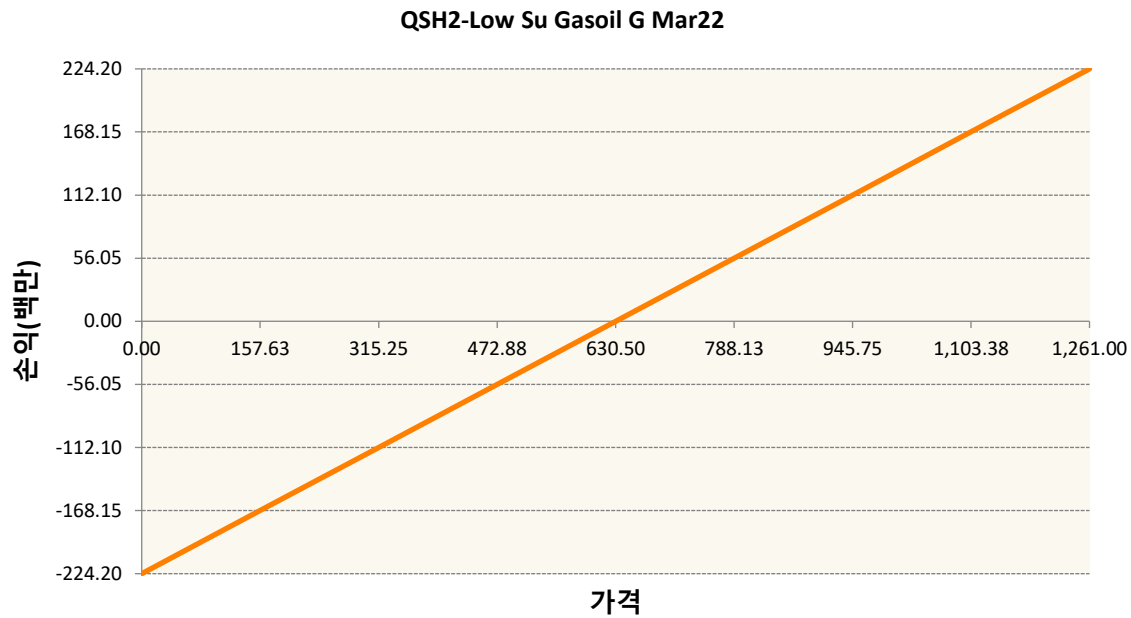


KR4175S10007-2022-01 달러선물



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
KR4175S100 2022-01 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)
		327

공시일 2021-12-17

기준일 2021-12-16

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

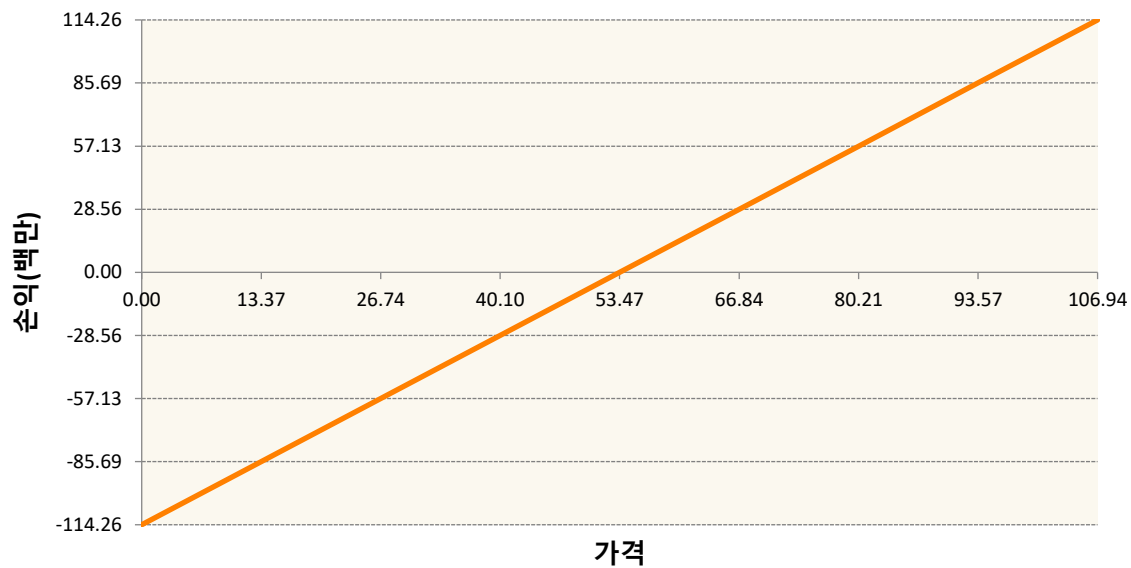
1. 계약금액

(단위:백만원)

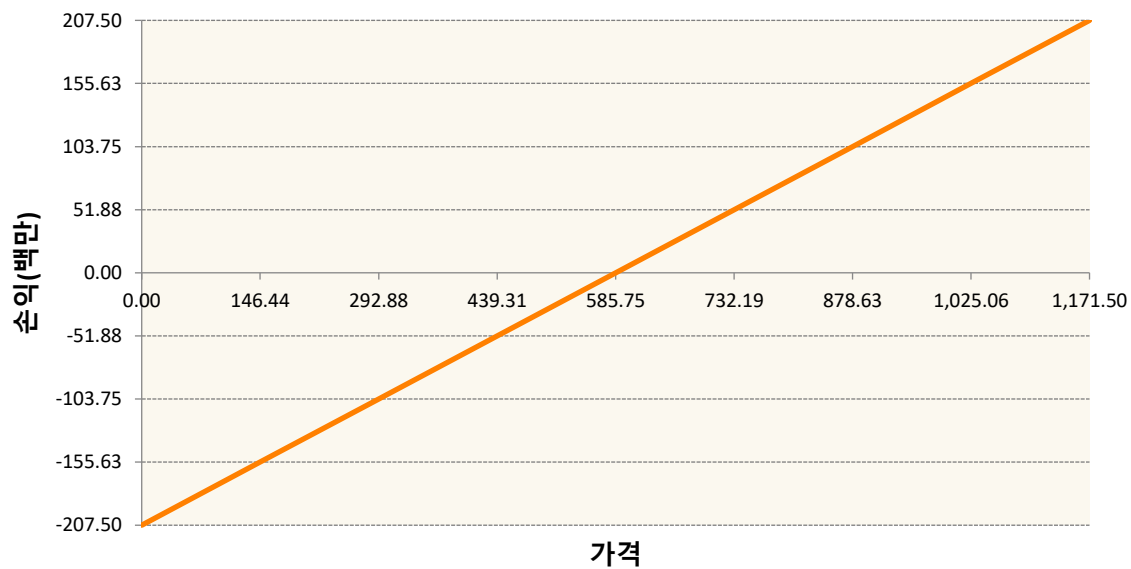
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,139	0	1,139	

2. 만기시점의 손익구조

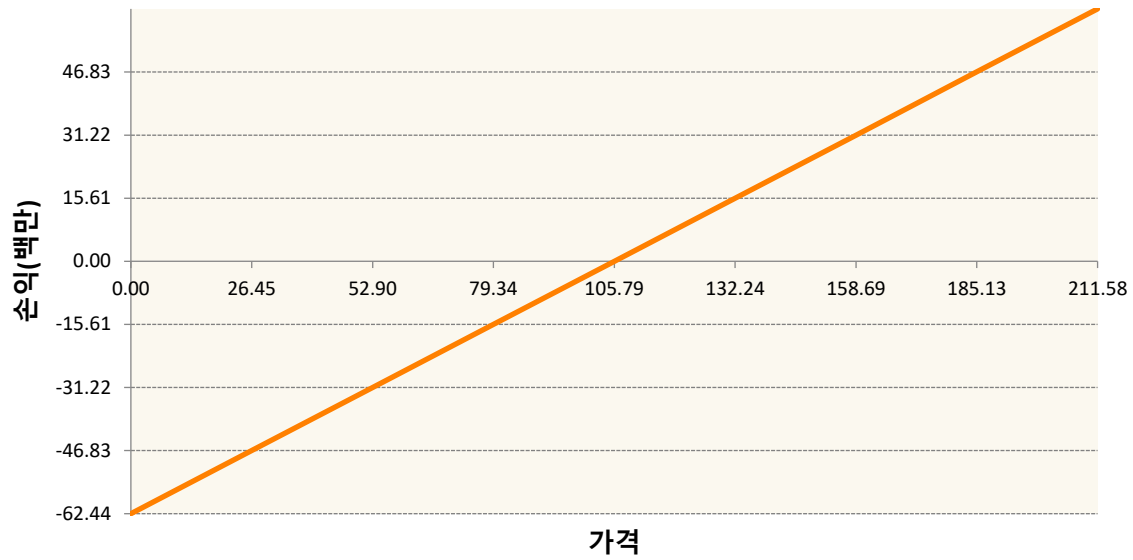
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



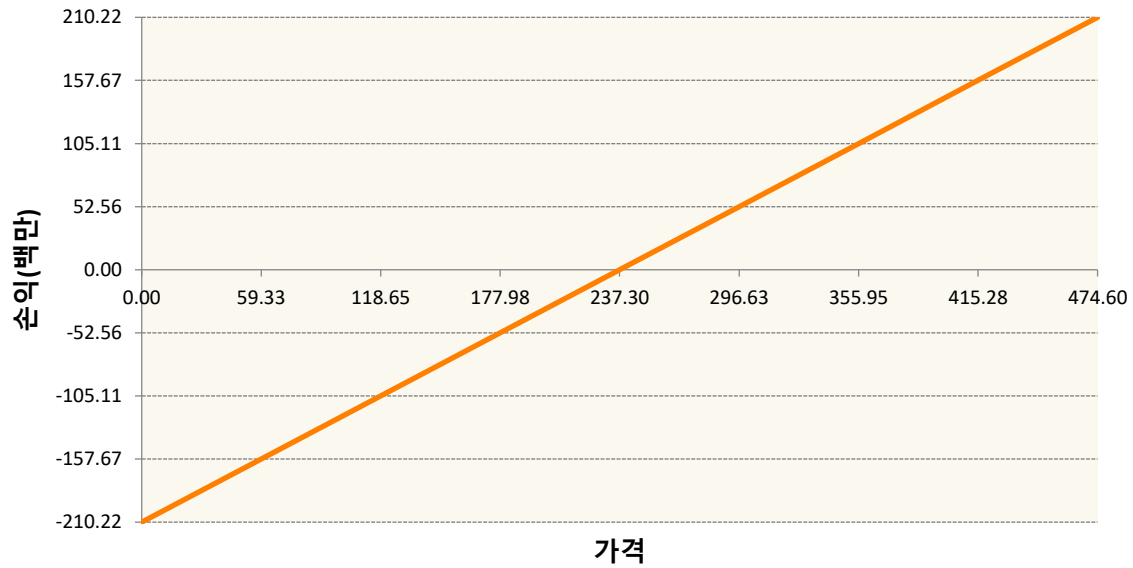
CH2-CORN FUTURE Mar22



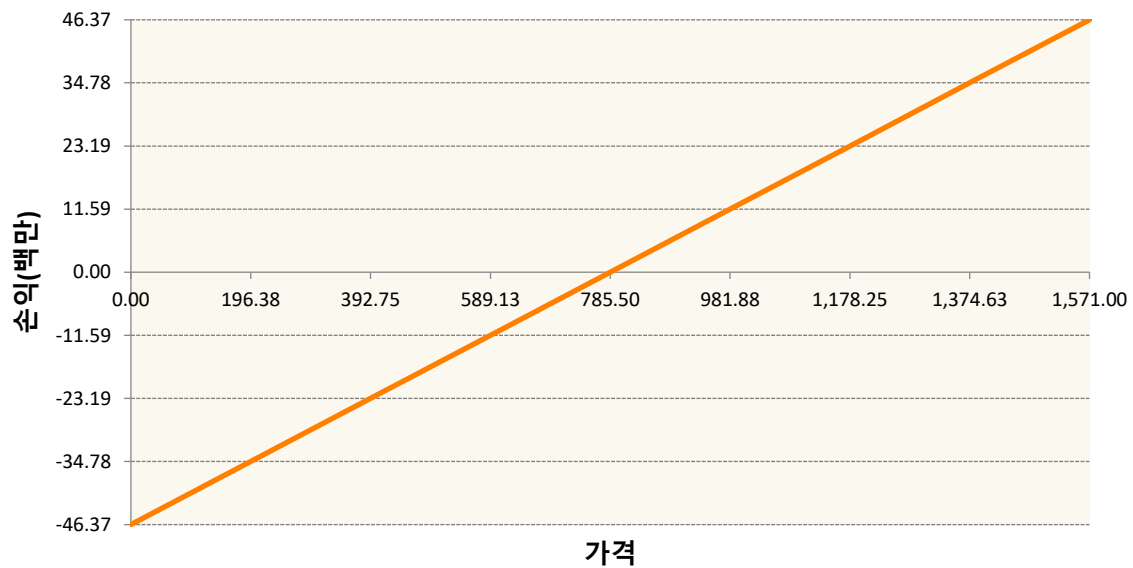
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



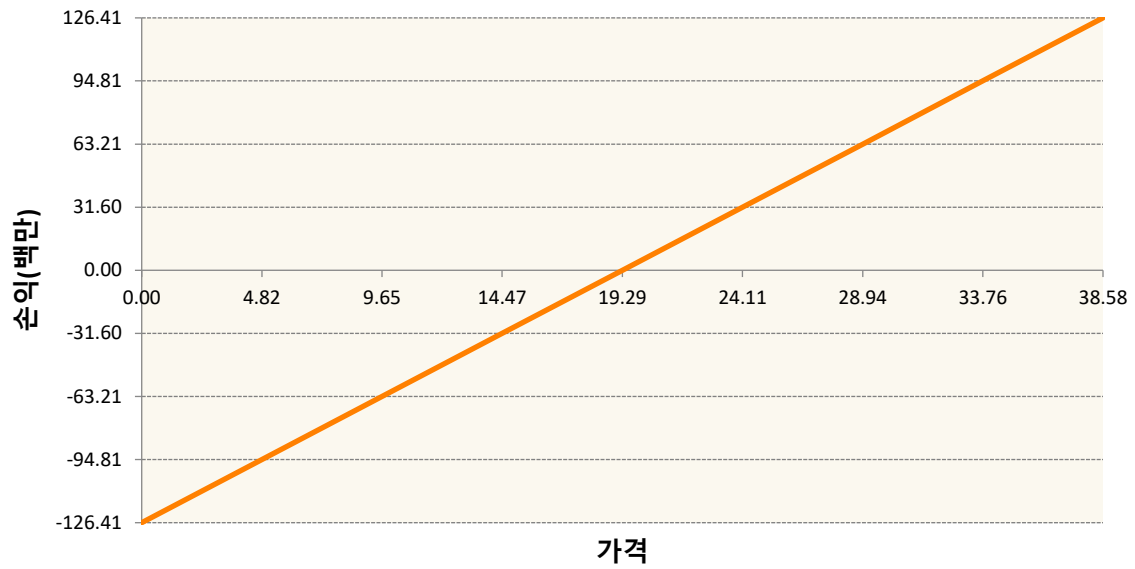
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



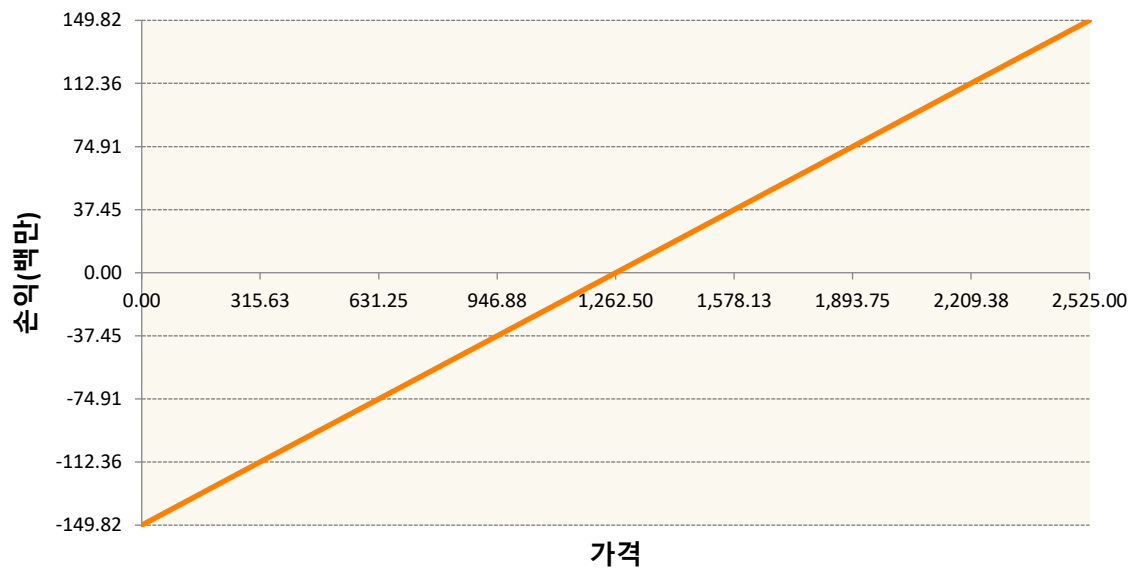
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



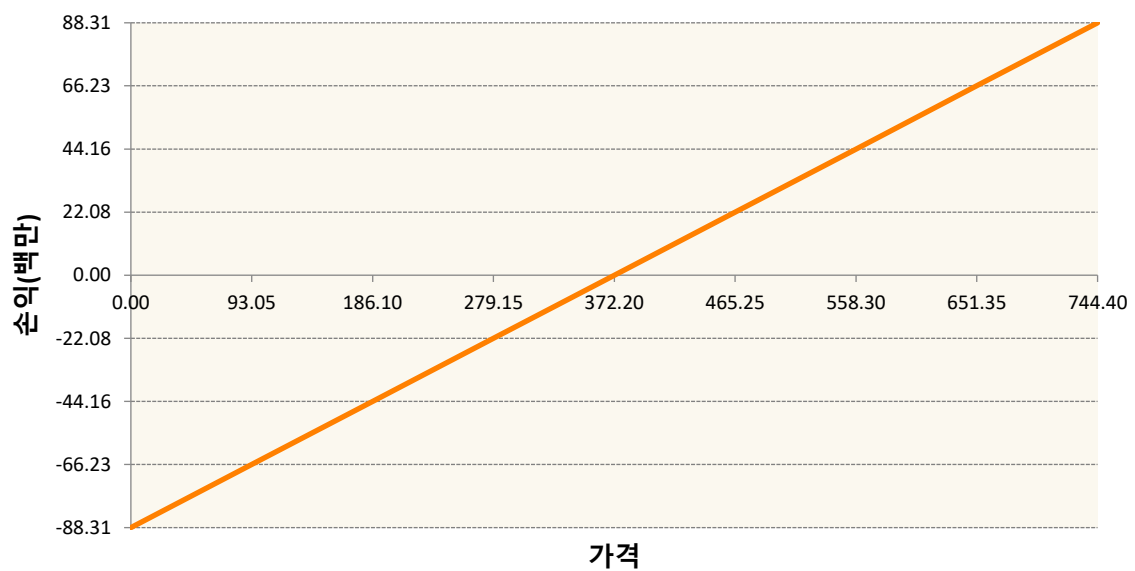
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



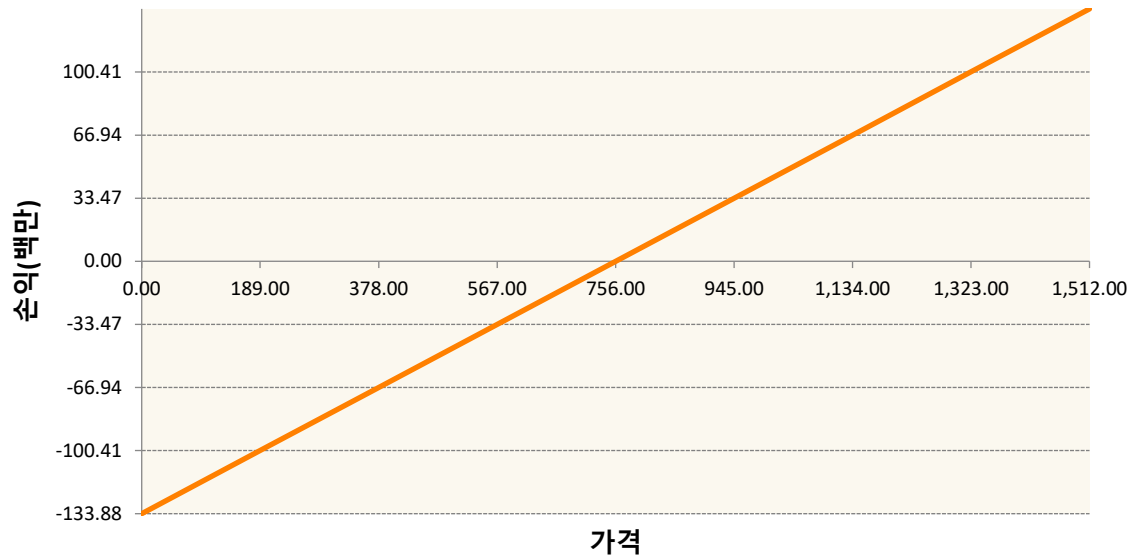
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



SMF2-SOYBEAN MEAL FUTR Jan22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22	9
CH2	CORN FUTURE Mar22	17
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22	5
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22	17
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22	4
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22	10
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22	12
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22	7
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22	11

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

(단위:백만원)

129