

공시일 2021-12-20

기준일 2021-12-17

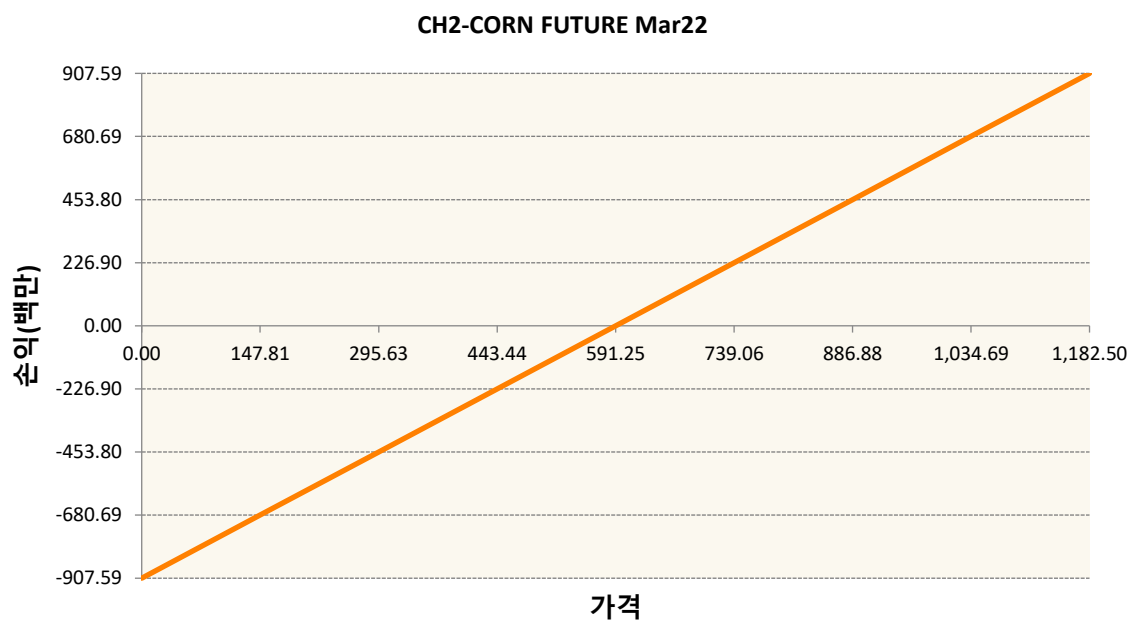
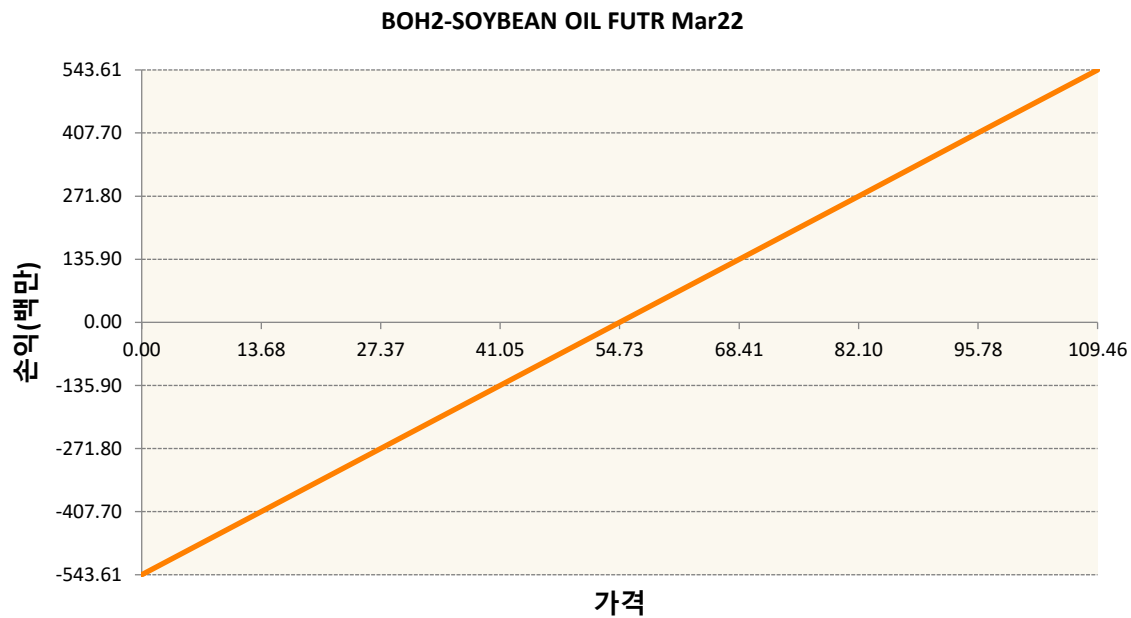
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

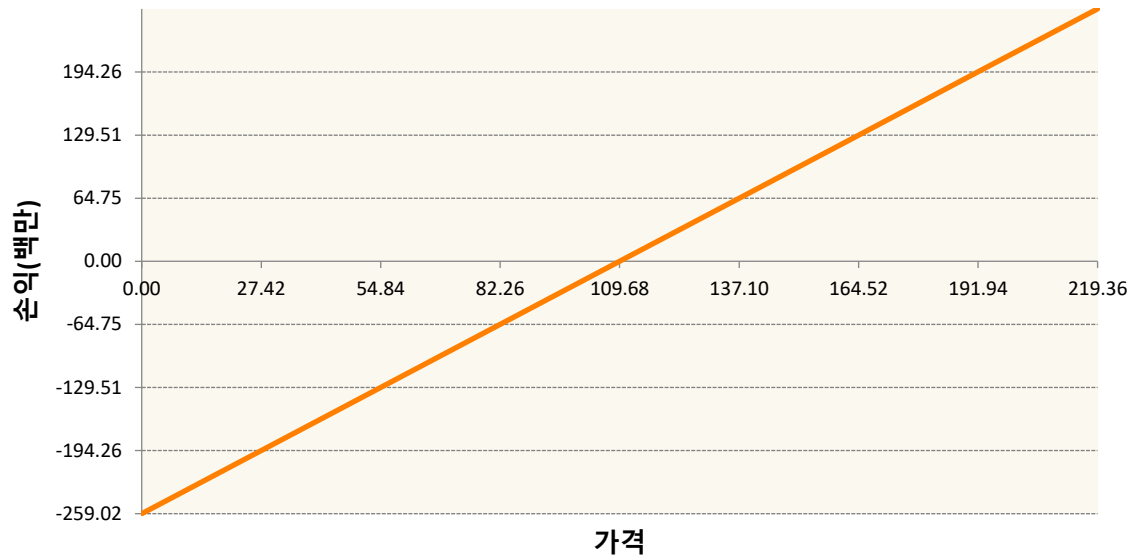
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,815	768	4,048	

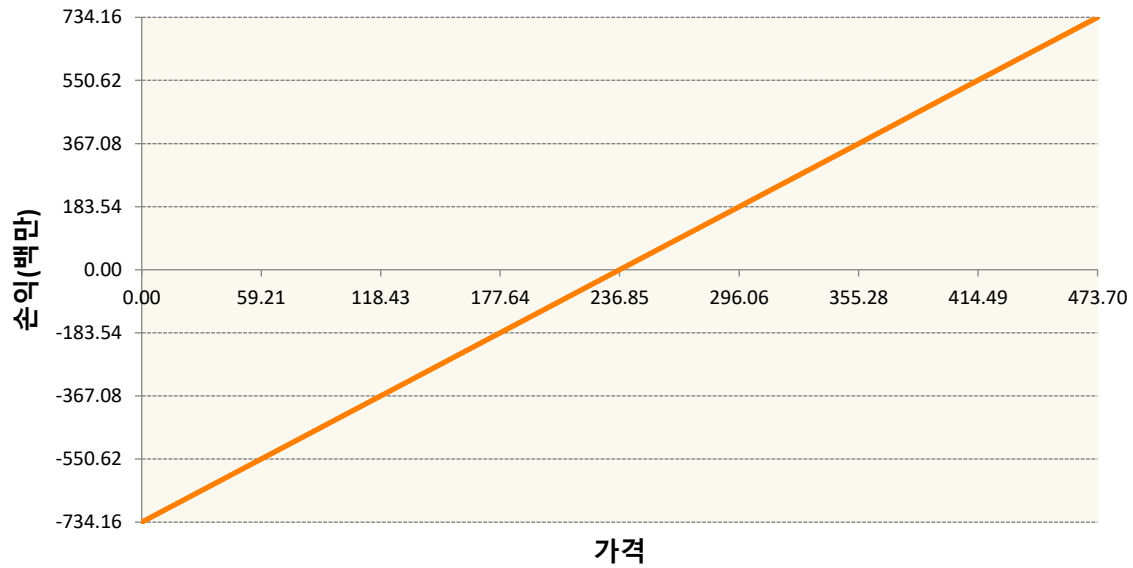
2. 만기시점의 손익구조



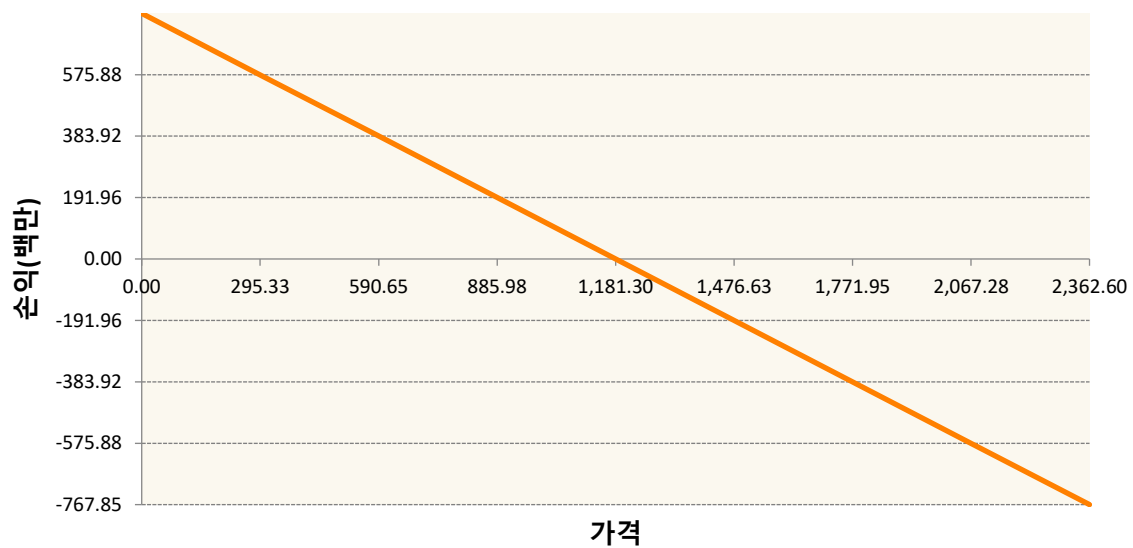
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



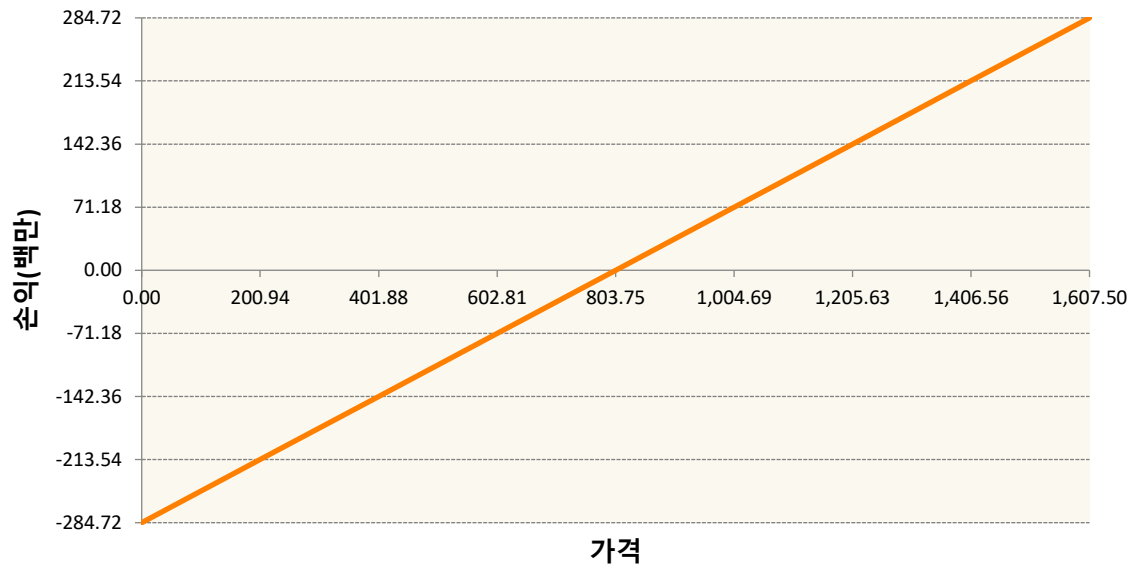
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



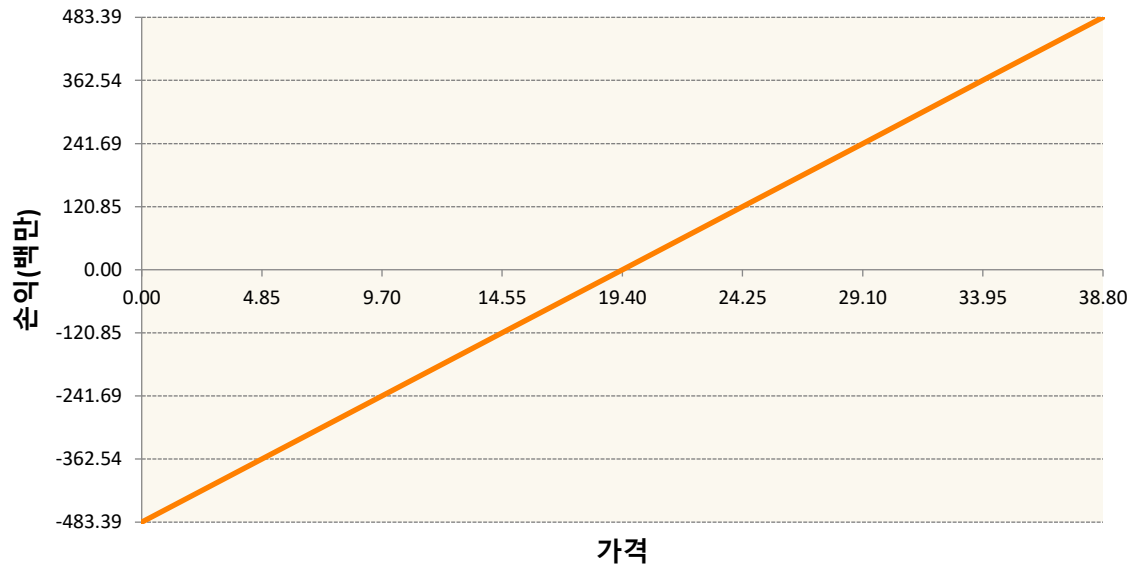
KR4175S10007-2022-01 달러선물



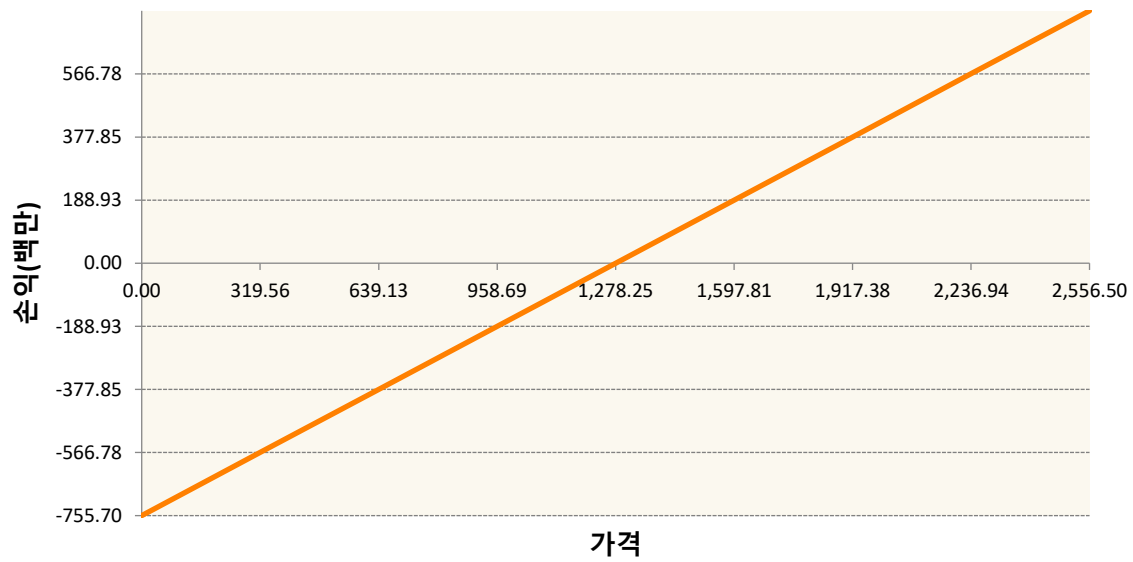
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



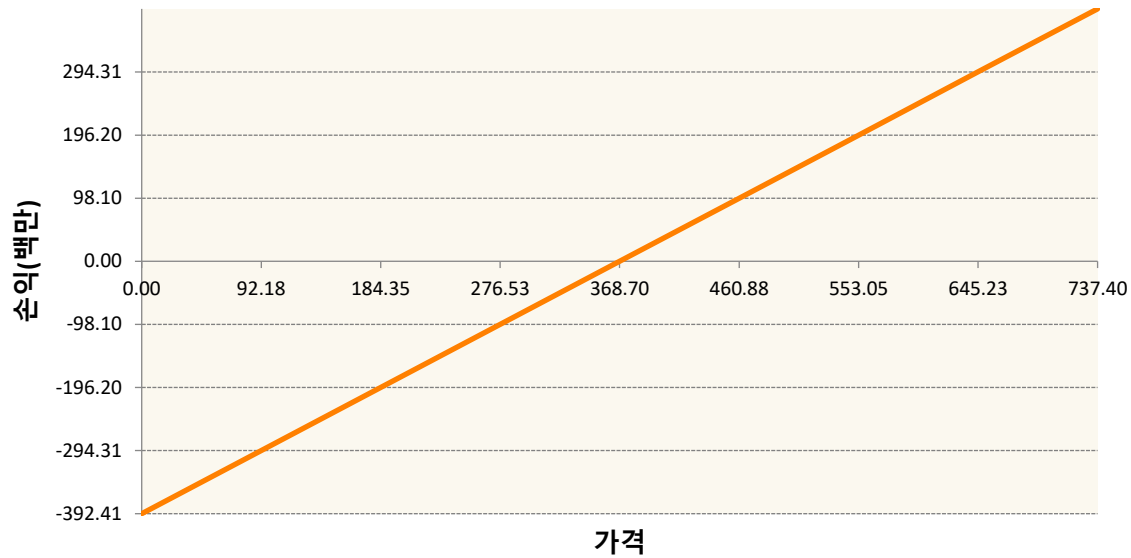
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



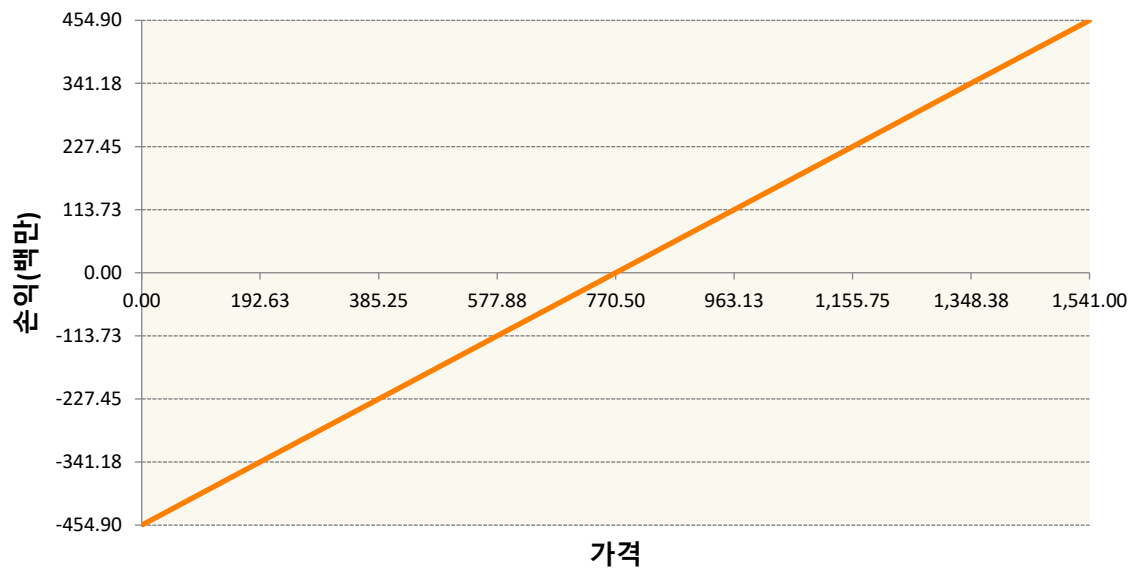
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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	2021-12-20
기준일	2021-12-17

스마트인덱스모

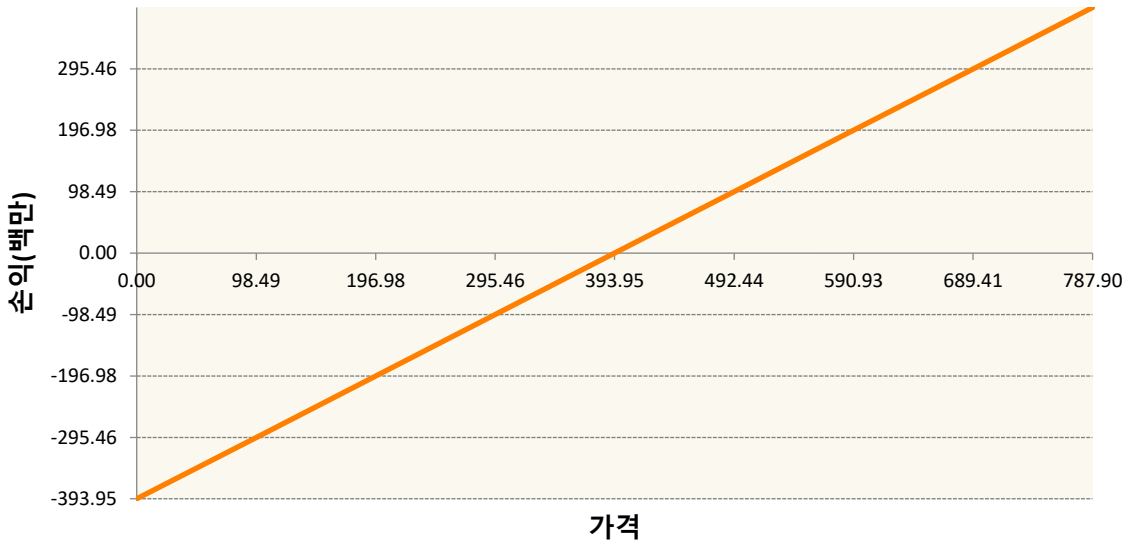
1. 계약금액

(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	2021-12-20
기준일	2021-12-17

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

909

* 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	2021-12-20
기준일	2021-12-17

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	443
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

427

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-20
기준일	2021-12-17

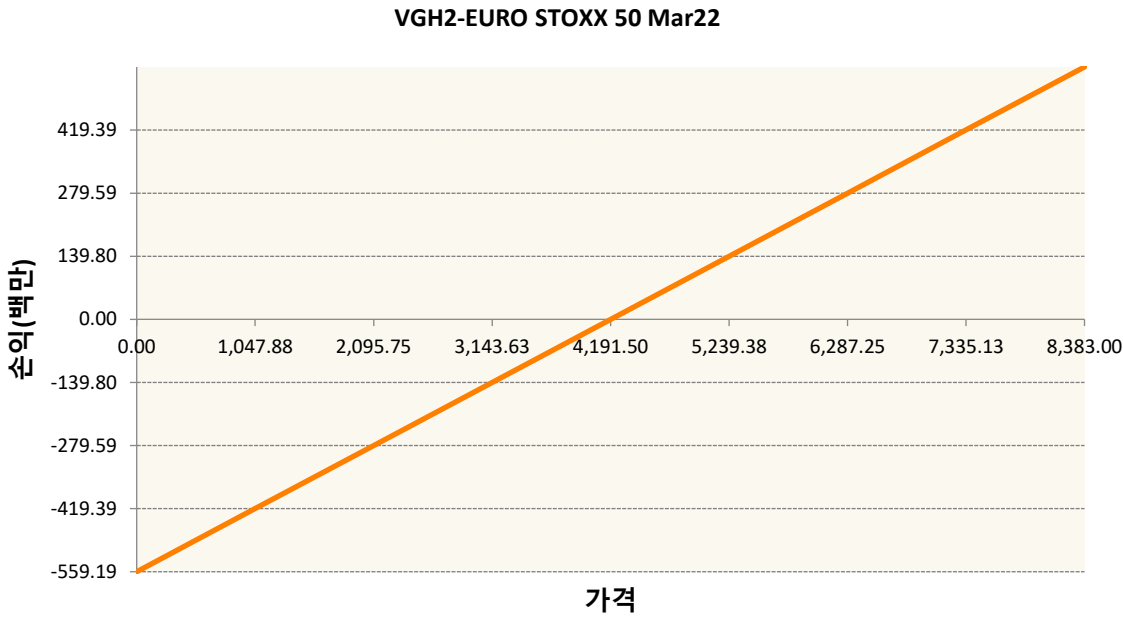
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	559	0	559	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2021-12-20
기준일	2021-12-17

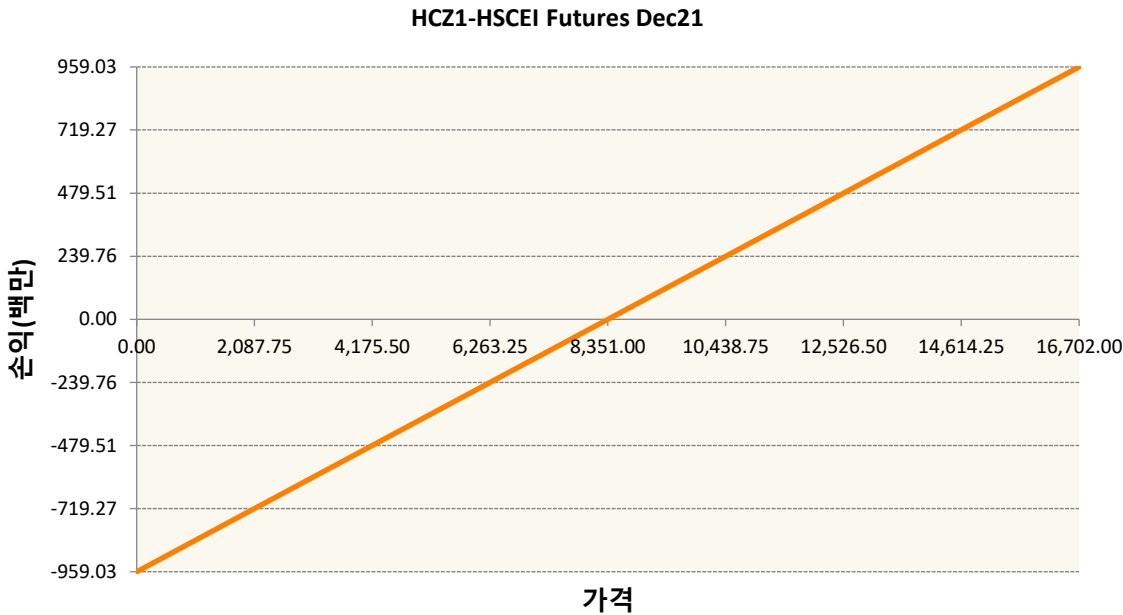
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	959	0	959	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 2021-12-20

기준일 2021-12-17

커버드콜모(주식혼합-파생형)

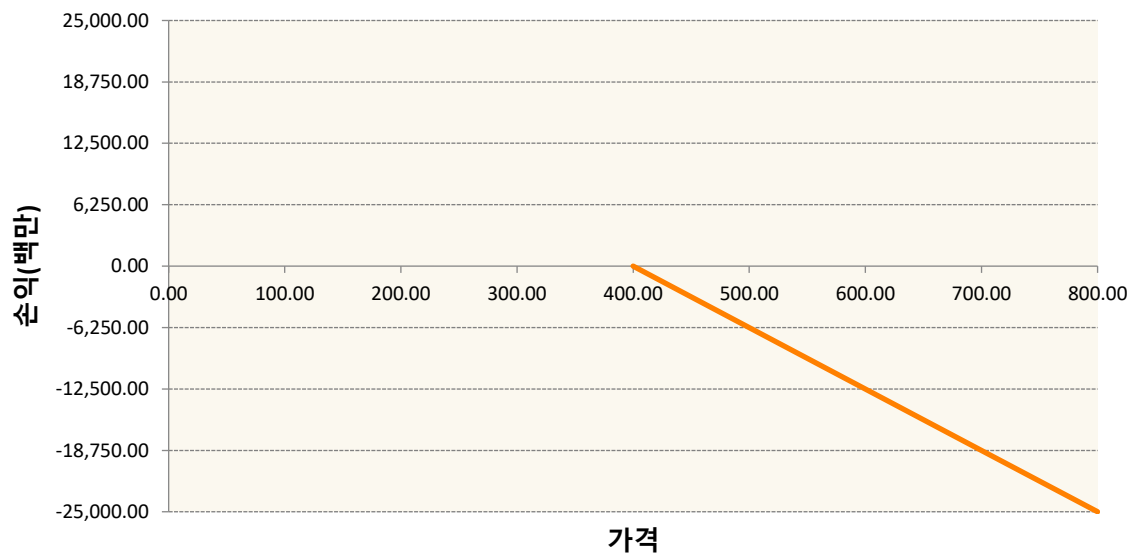
1. 계약금액

(단위:백만원)

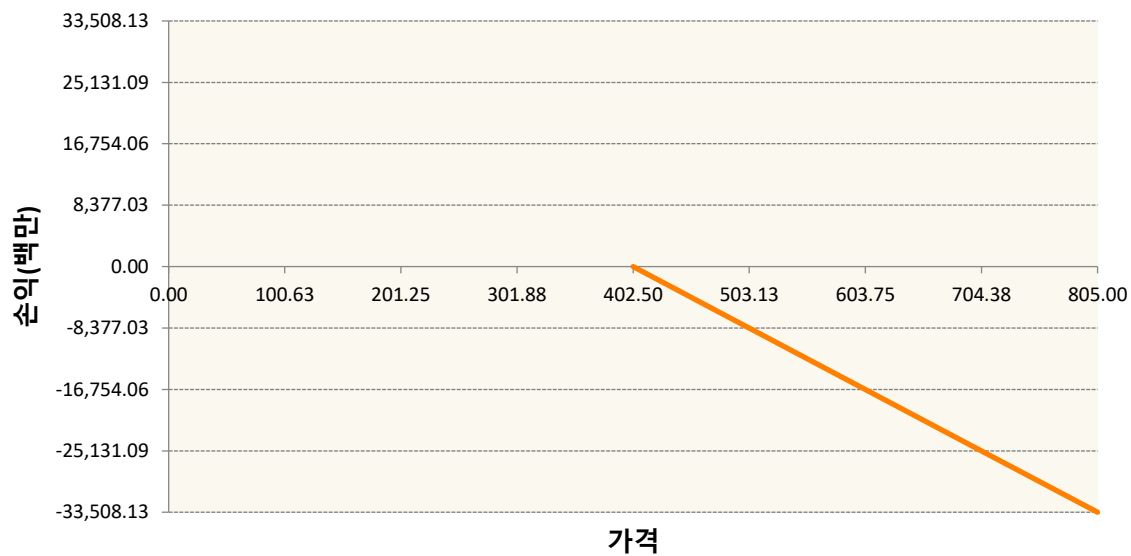
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

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 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			1,504
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	651	633	610	583	554	521	485
-5.33%	585	550	512	470	427	381	334
-2.67%	440	388	335	281	226	171	115
0%	180	120	60	0	-60	-120	-180
2.67%	-206	-262	-320	-377	-435	-494	-553
5.33%	-705	-748	-794	-843	-893	-945	-998
8.00%	-1,285	-1,312	-1,344	-1,380	-1,419	-1,460	-1,504
KR4201S14029				2022-01 콜402.5			1,938
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	784	763	736	705	668	628	584
-5.33%	712	670	623	572	518	460	401
-2.67%	546	482	414	345	275	203	130
0%	239	159	80	0	-80	-160	-240
2.67%	-237	-315	-394	-473	-552	-632	-712
5.33%	-869	-931	-997	-1,066	-1,136	-1,209	-1,282
8.00%	-1,618	-1,660	-1,708	-1,760	-1,816	-1,876	-1,938
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,128

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,101	-1,102	-1,105	-1,109	-1,114	-1,120	-1,128
-5.33%	-646	-654	-663	-674	-687	-701	-716
-2.67%	-233	-252	-272	-293	-315	-337	-360
0%	80	54	27	0	-27	-54	-80
2.67%	258	236	213	189	165	140	115
5.33%	329	318	304	289	273	255	236
8.00%	348	344	339	332	323	313	301

KR4301S14027 2022-01 풋402.5							134
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-131	-131	-132	-132	-132	-133	-134
-5.33%	-79	-79	-80	-81	-83	-84	-86
-2.67%	-30	-32	-34	-36	-38	-41	-43
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	33	30	27	24	21	19	16
5.33%	43	42	40	38	36	34	31
8.00%	47	46	45	44	43	42	40

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

(단위:백만원)

4,553

공시일 2021-12-20

기준일 2021-12-17

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

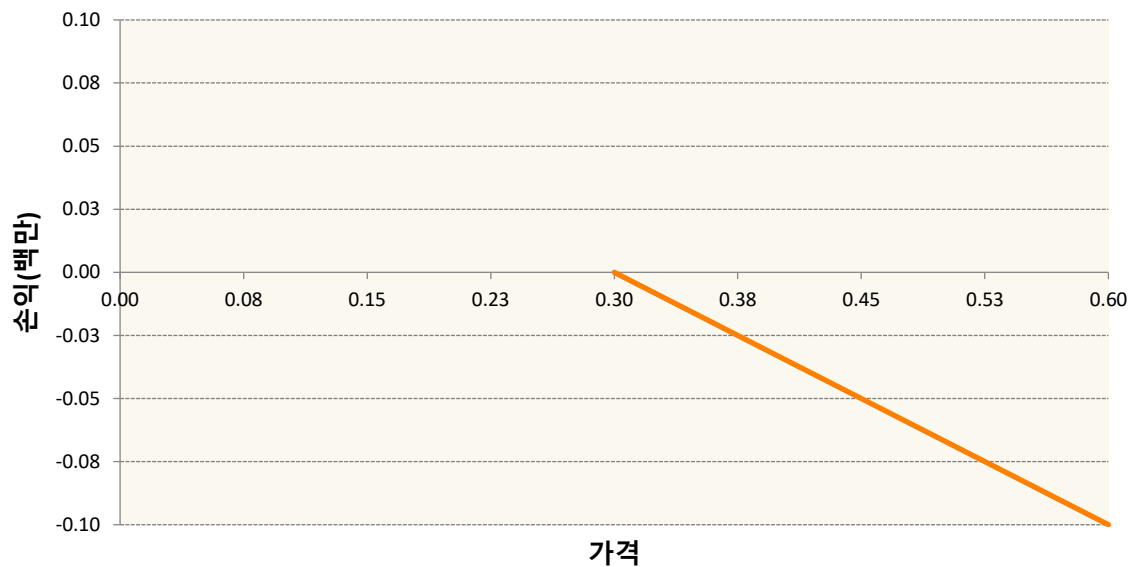
1. 계약금액

(단위:백만원)

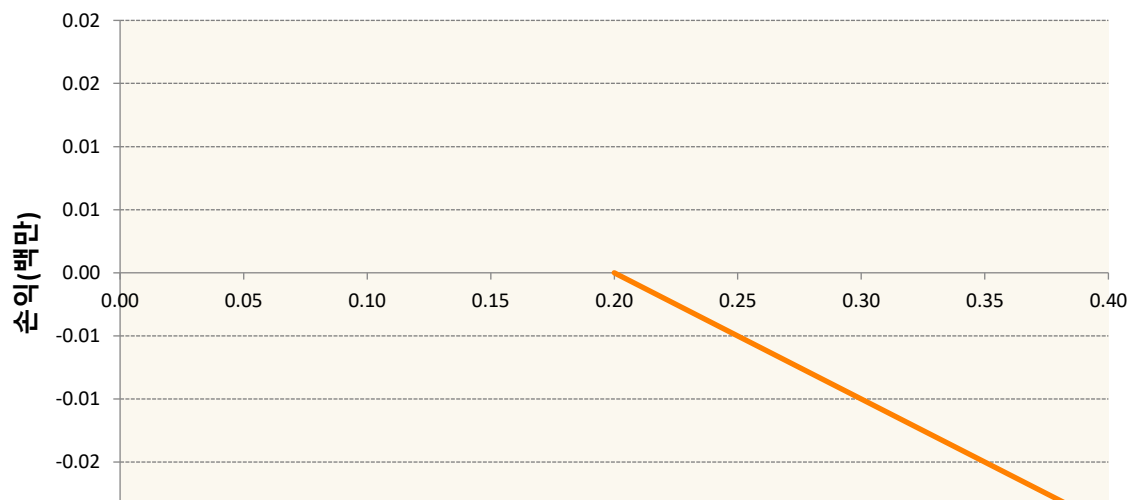
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	83	-83	장내
누계	통화	선도	0	2,008	-2,008	장외

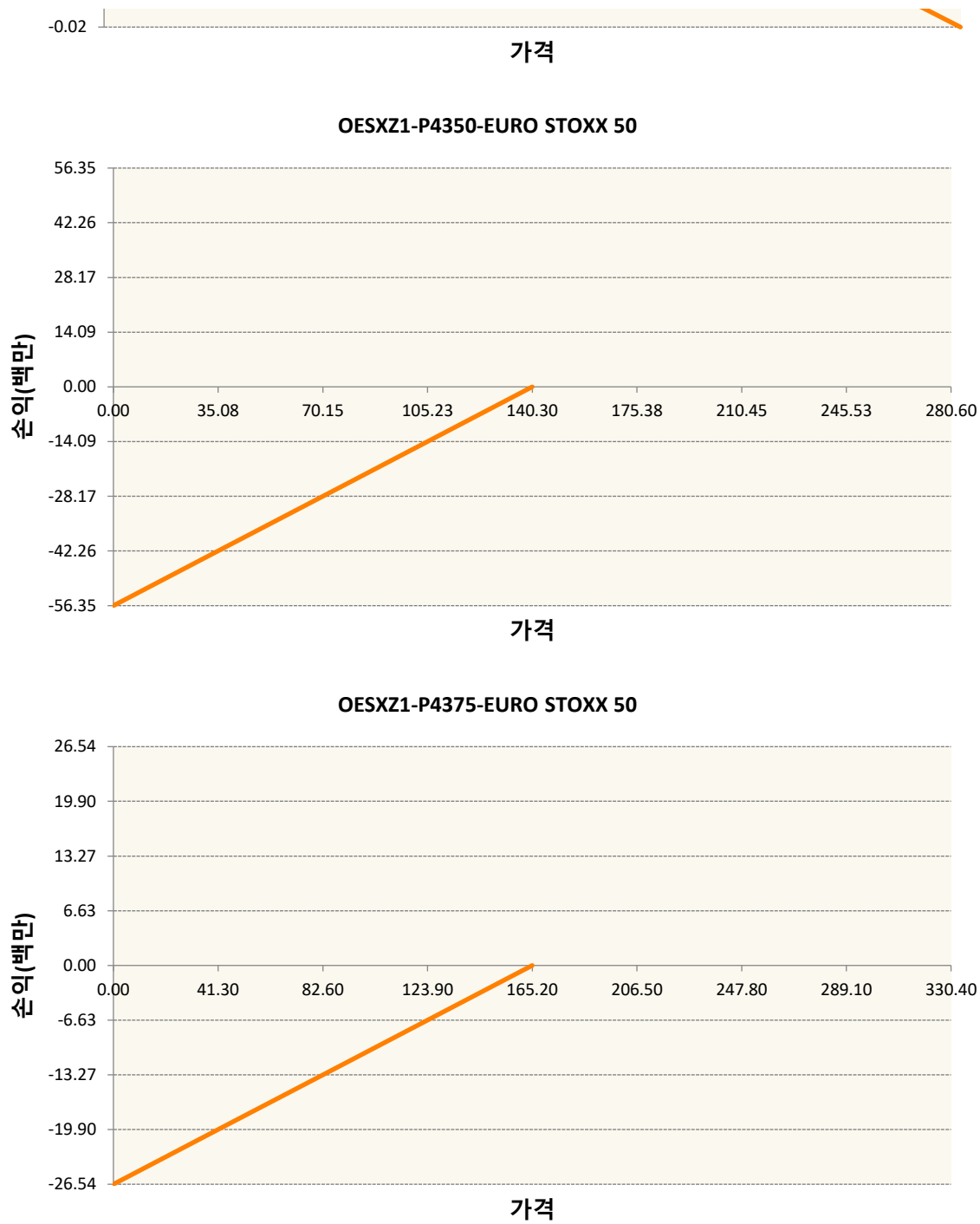
2. 만기시점의 손익구조

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

3
54
107
0.01
0
5
2

공시일 2021-12-20

기준일 2021-12-17

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

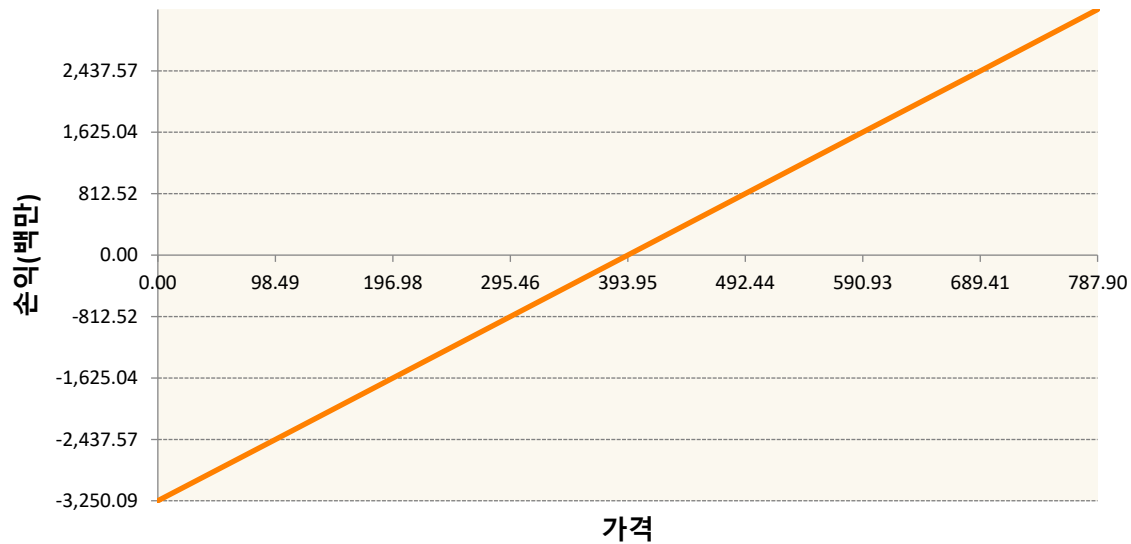
1. 계약금액

(단위:백만원)

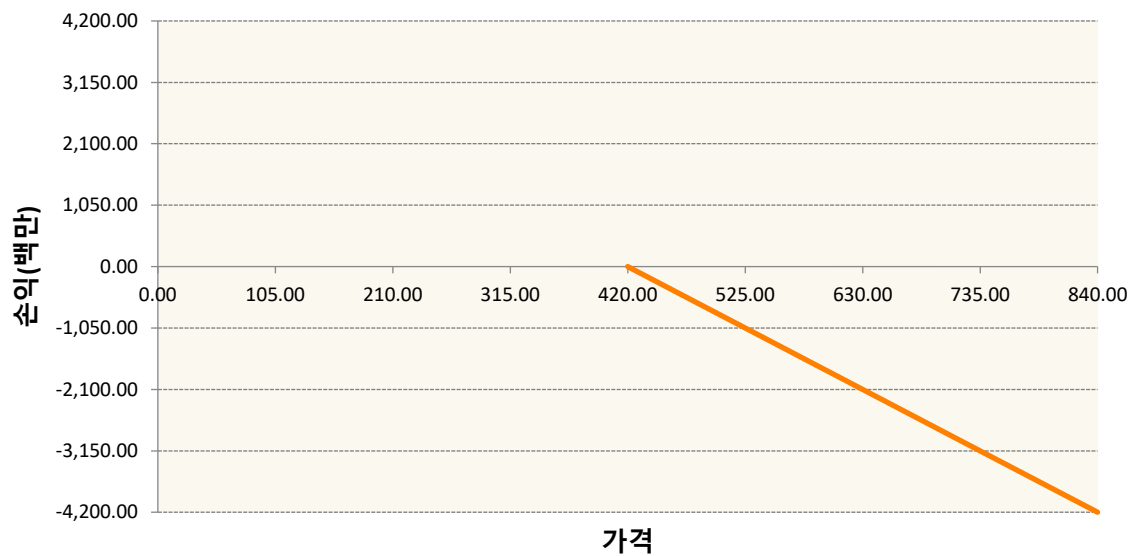
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,250	0	3,250	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

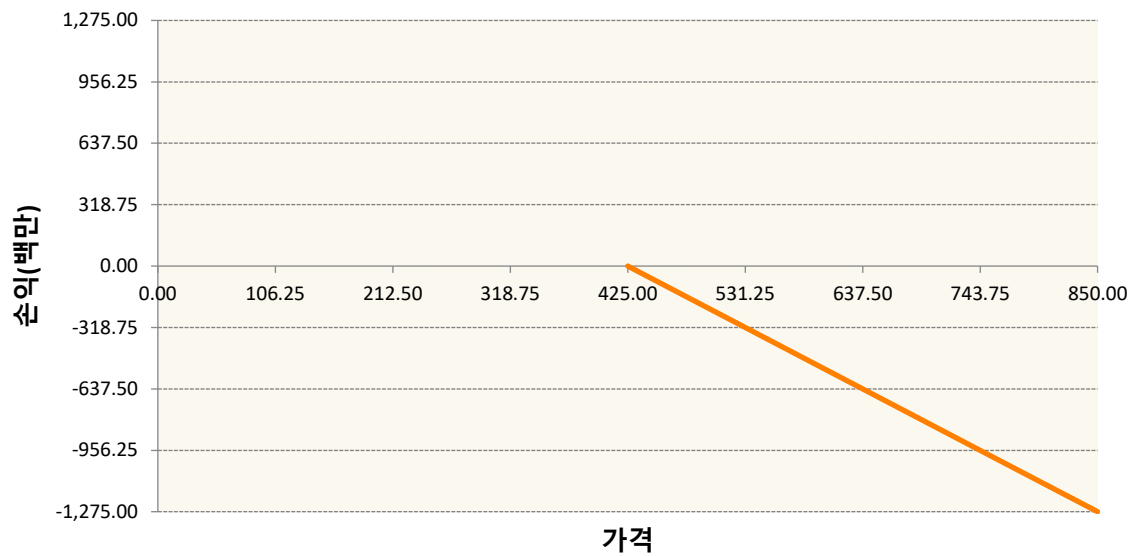
2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물

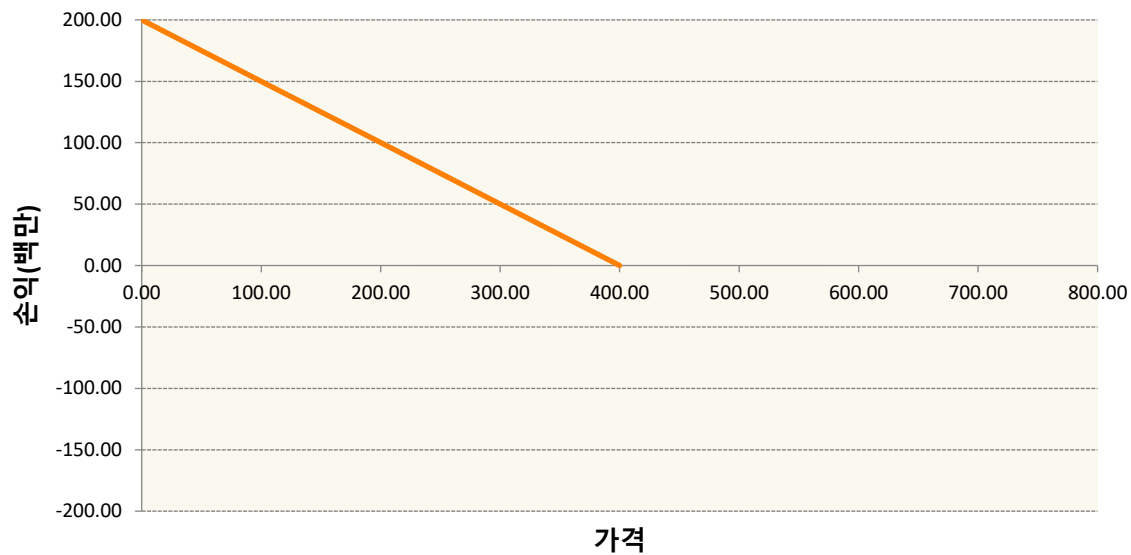


KR4201S14201-2022-01 콜420



KR4201S14250-2022-01 **콜**425

KR4301S14001-2022-01 ㄱ400



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001				2022-03 코스피200지수선물				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%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176	
-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%	176	176	176	176	176	176	176	
8.00%	263	263	263	263	263	263	263	
KR4201S14201				2022-01 콜420				171
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	40	39	38	36	33	31
-5.33%	39	37	35	32	29	25	20
-2.67%	34	30	26	21	15	9	2
0%	21	15	7	0	-8	-16	-24
2.67%	-5	-14	-24	-33	-42	-52	-61
5.33%	-50	-60	-70	-80	-90	-100	-110
8.00%	-113	-123	-132	-142	-152	-161	-171
KR4201S14250 2022-01 콜425							46

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	9	9	9	9	8	8	7
-5.33%	9	9	8	7	7	6	4
-2.67%	8	7	6	5	3	2	0
0%	5	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-1	-3	-6	-8	-11	-14	-16
5.33%	-11	-14	-17	-20	-23	-26	-29
8.00%	-28	-31	-34	-37	-40	-43	-46
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%	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	-2	-2	-2	-2	-1
5.33%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3

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

(단위:백만원)

446

공시일	2021-12-20
기준일	2021-12-17

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	16,725	0	16,725	

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	2021-12-20
기준일	2021-12-17

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	40	-40	
누계	유가증권	수익증권	9,572	0	9,572	

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	2021-12-20
기준일	2021-12-17

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	282	-282	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	45,116	0	45,116	
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 2021-12-20

기준일 2021-12-17

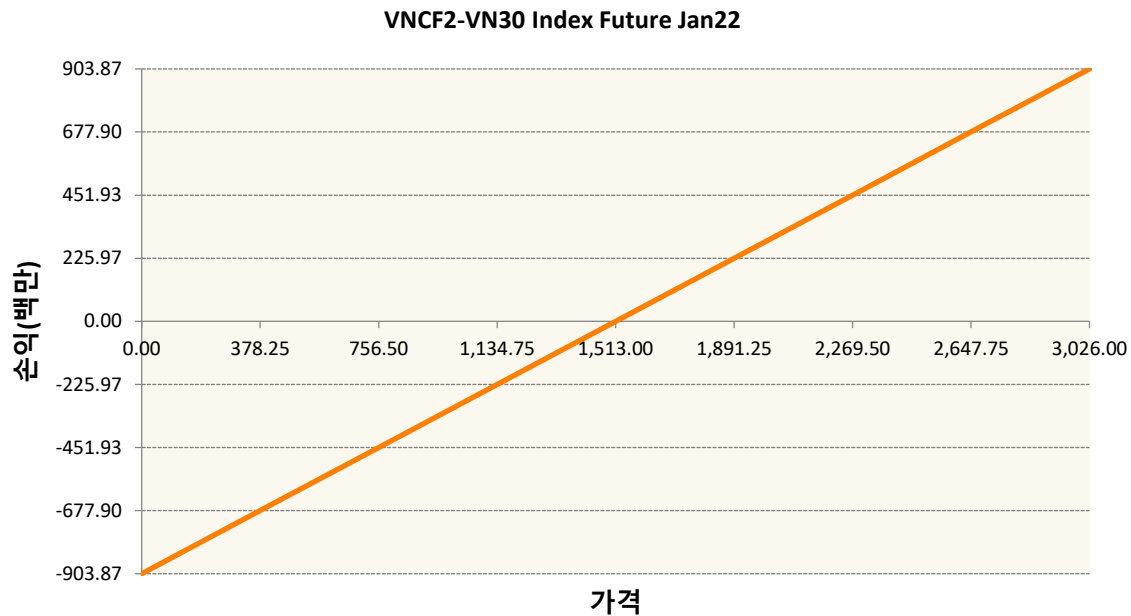
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	904	0	904	
누계	유가증권	스왑	1,788	0	1,788	장외
누계	통화	선도	0	576	-576	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
VNCF2 VN30 Index Future Jan22	72

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

(단위:백만원)

252

공시일 2021-12-20

기준일 2021-12-17

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

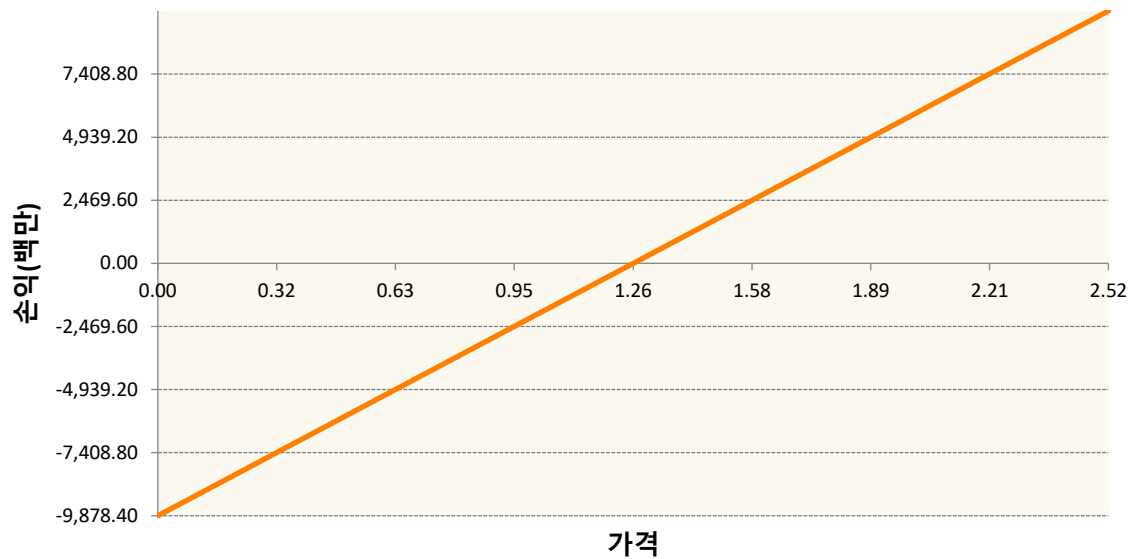
1. 계약금액

(단위:백만원)

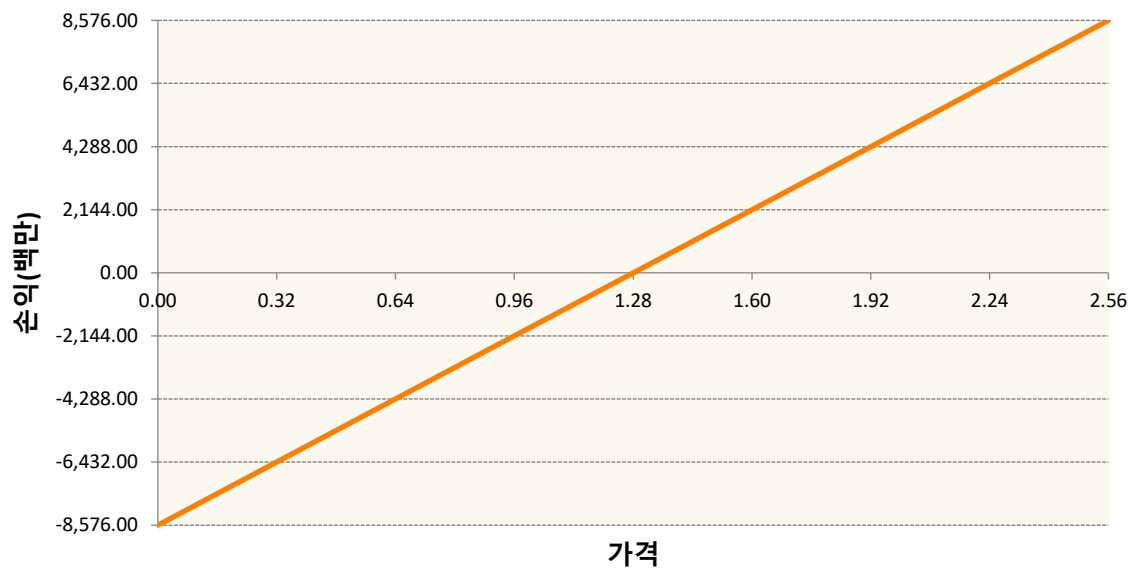
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	36,890	0	36,890	

2. 만기시점의 손익구조

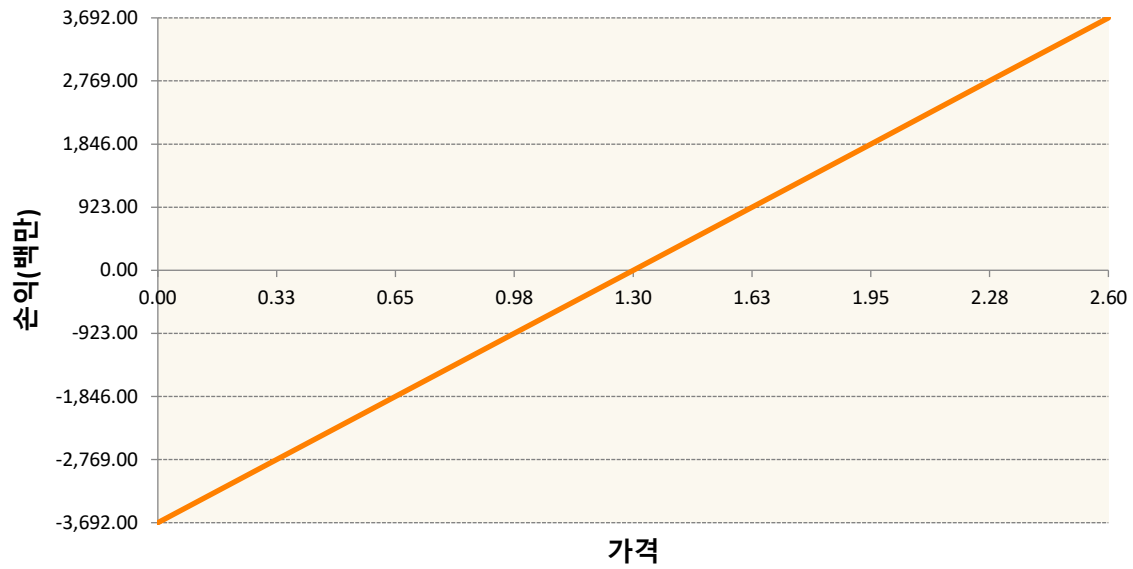
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



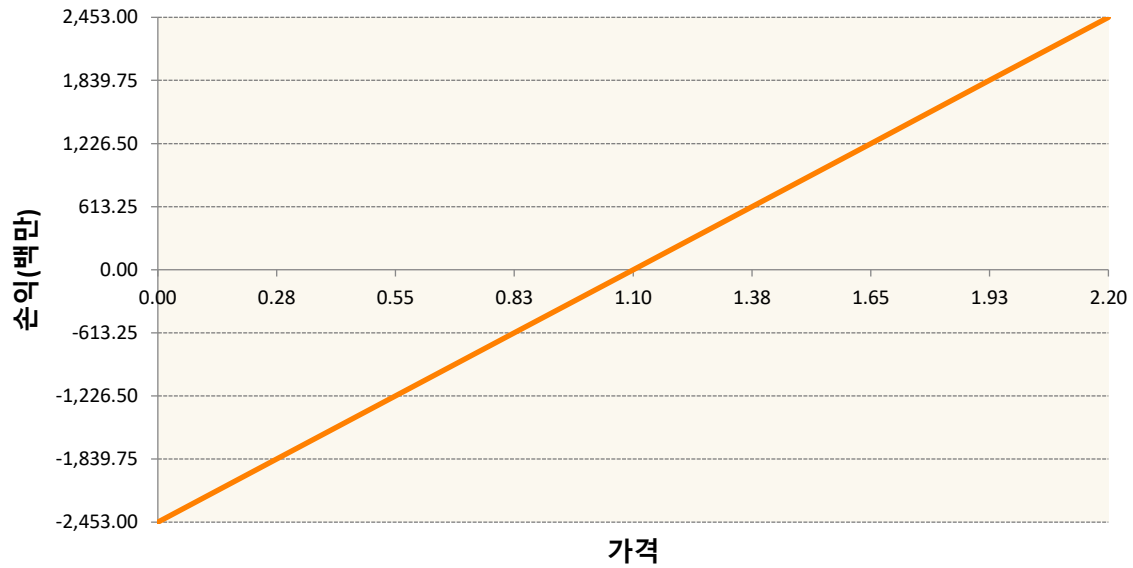
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



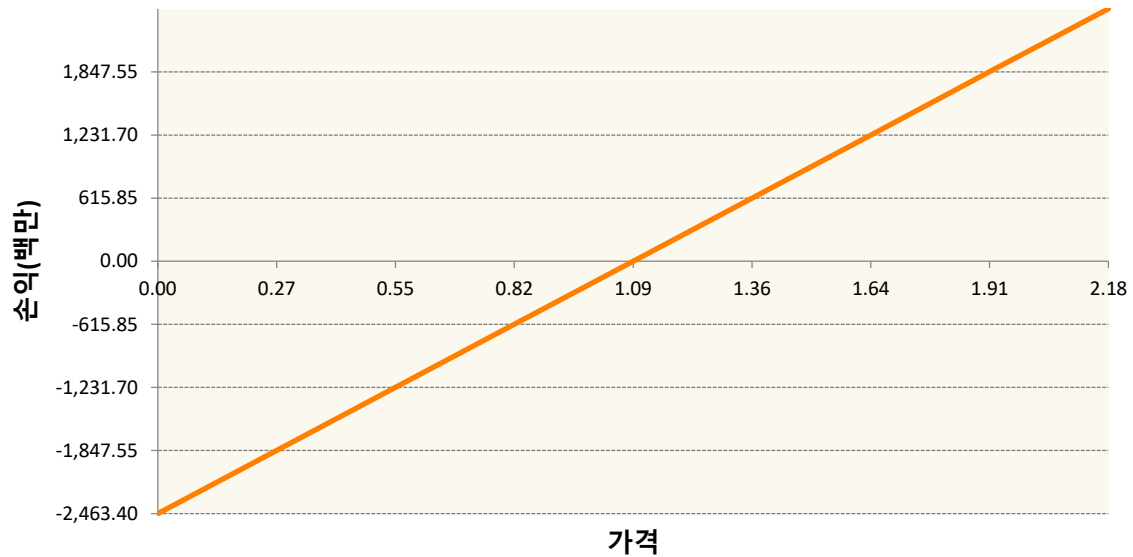
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



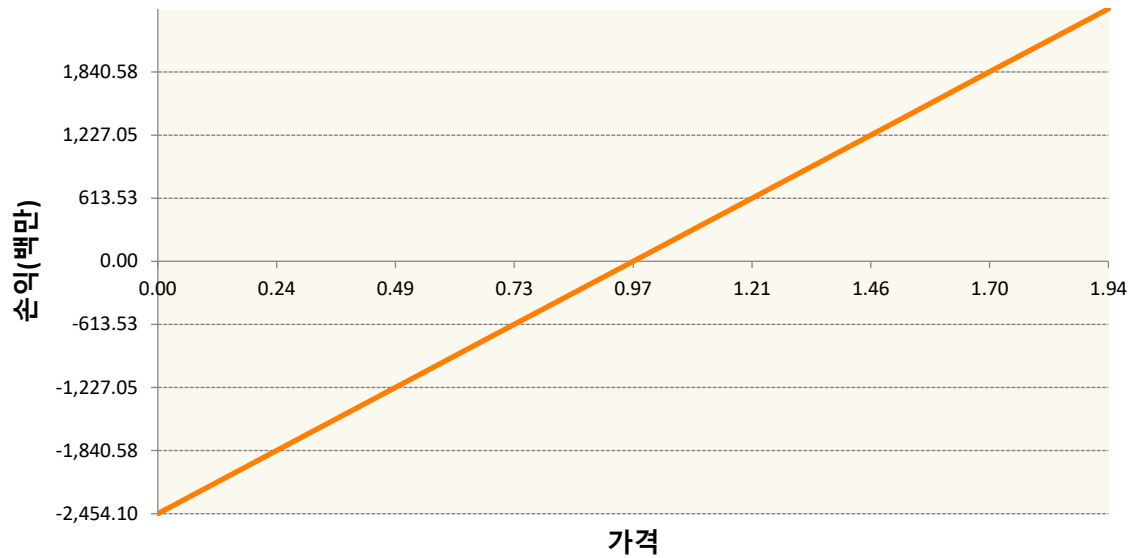
210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



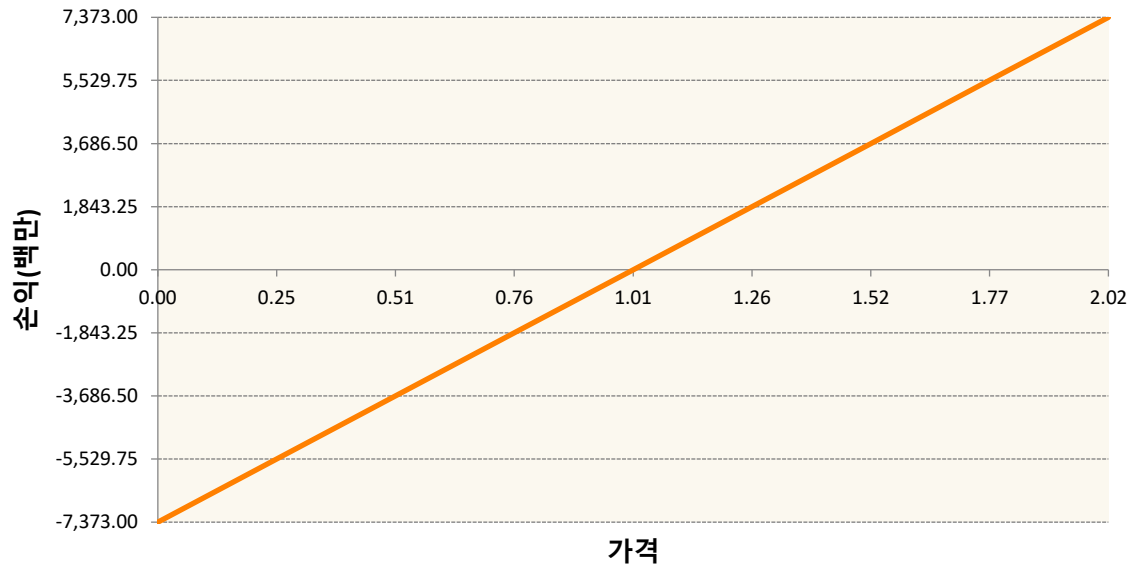
210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)	788
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	686
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	295
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	196
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	197
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	197
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	590

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

(단위:백만원)

4,571

공시일	2021-12-20
기준일	2021-12-17

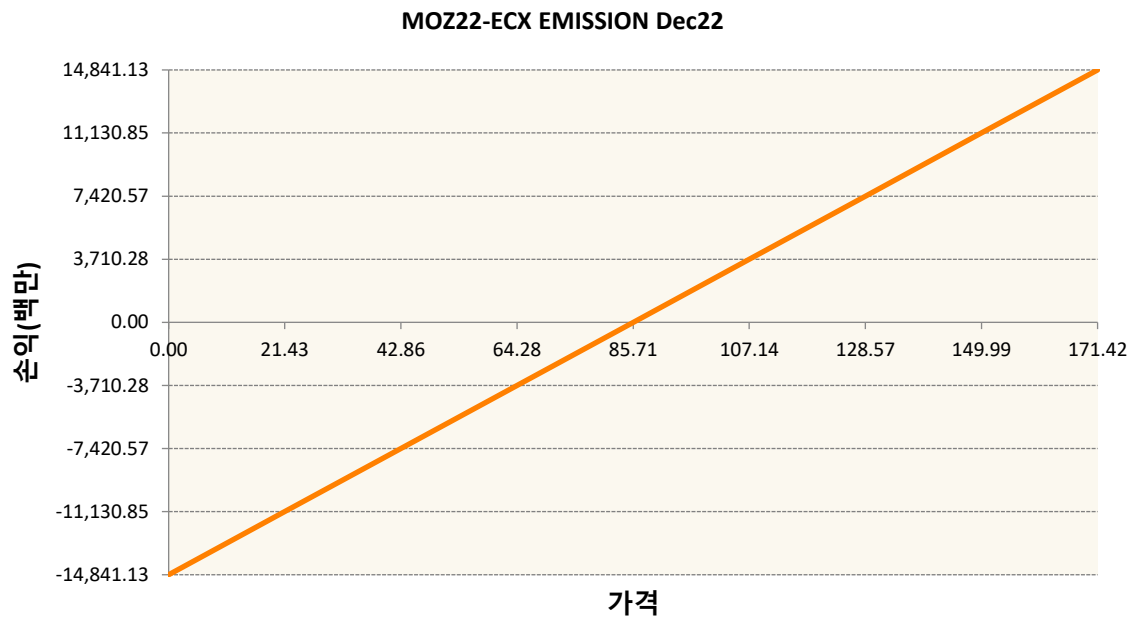
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	14,841	0	14,841	
누계	통화	선도	0	6,719	-6,719	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX·KRW/EUR 28-12-21E	382
FXW213BCA·KRW/EUR 28-12-21E	155
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,187

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

(단위:백만원)

2,652

공시일 2021-12-20

기준일 2021-12-17

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

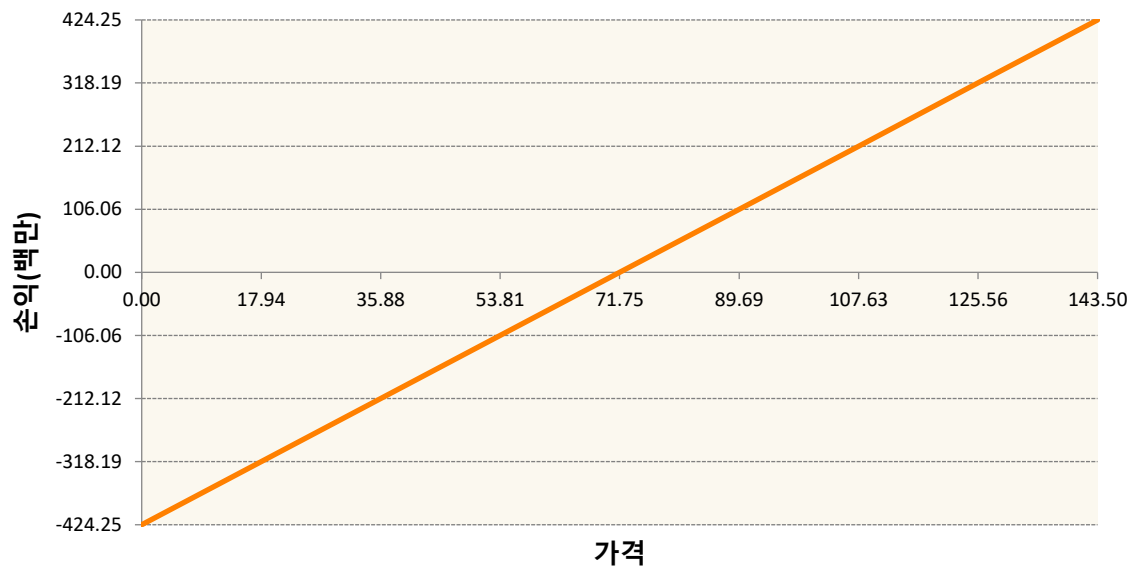
1. 계약금액

(단위:백만원)

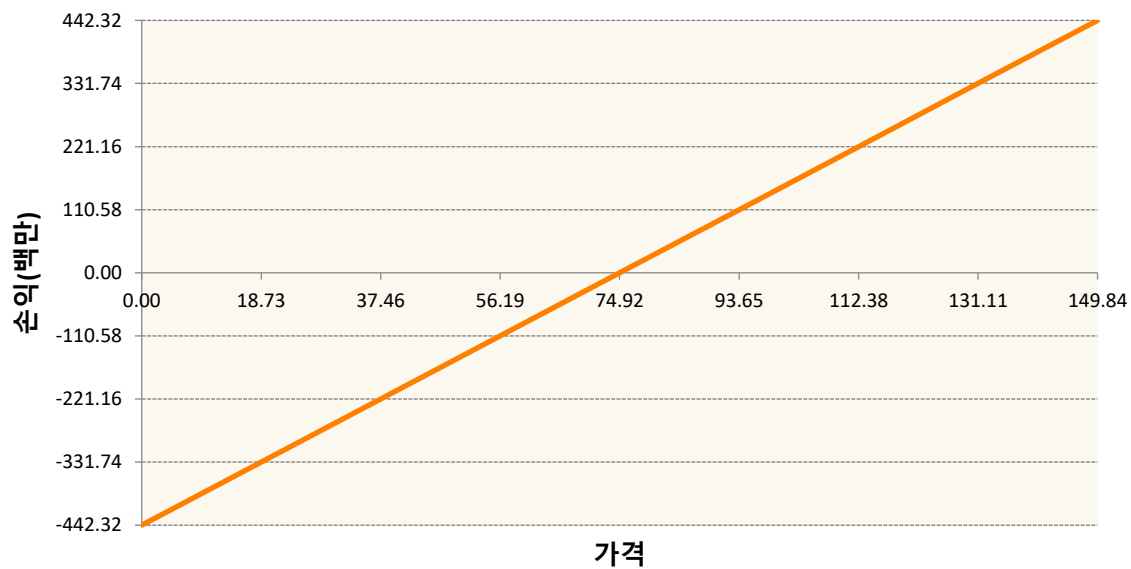
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,830	354	1,475	

2. 만기시점의 손익구조

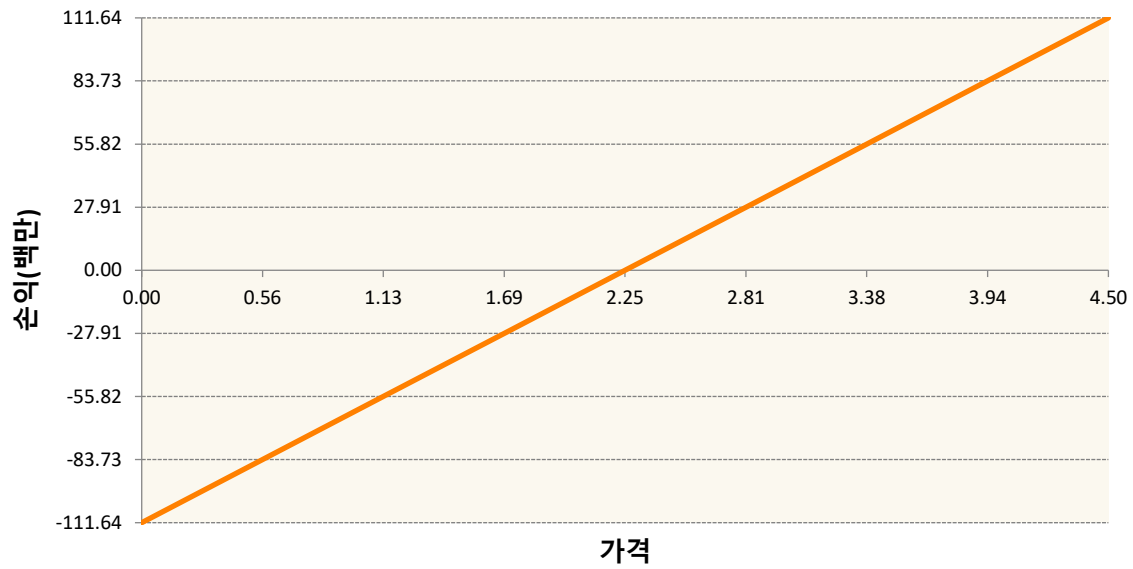
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



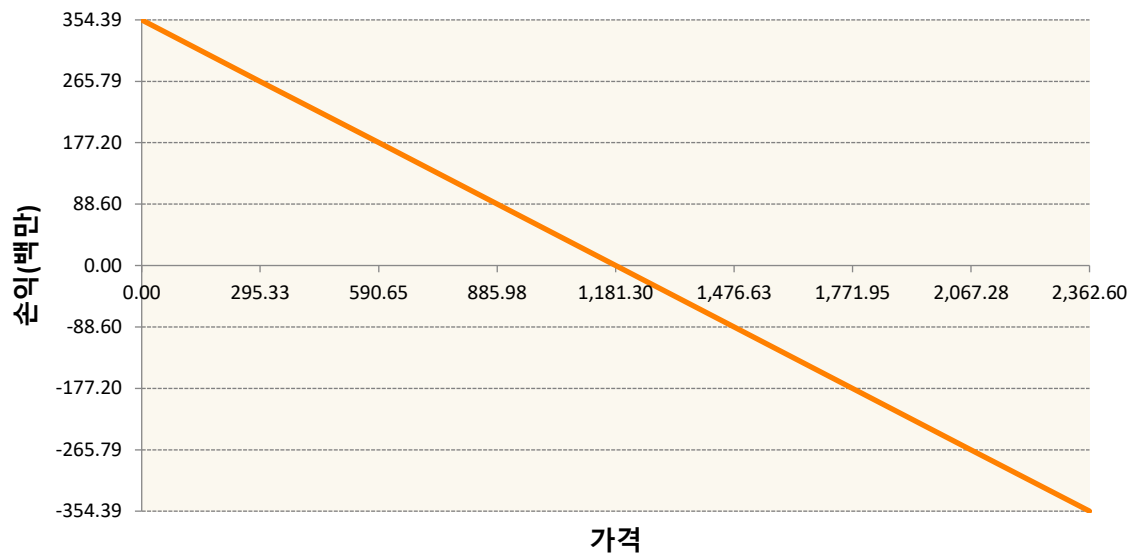
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



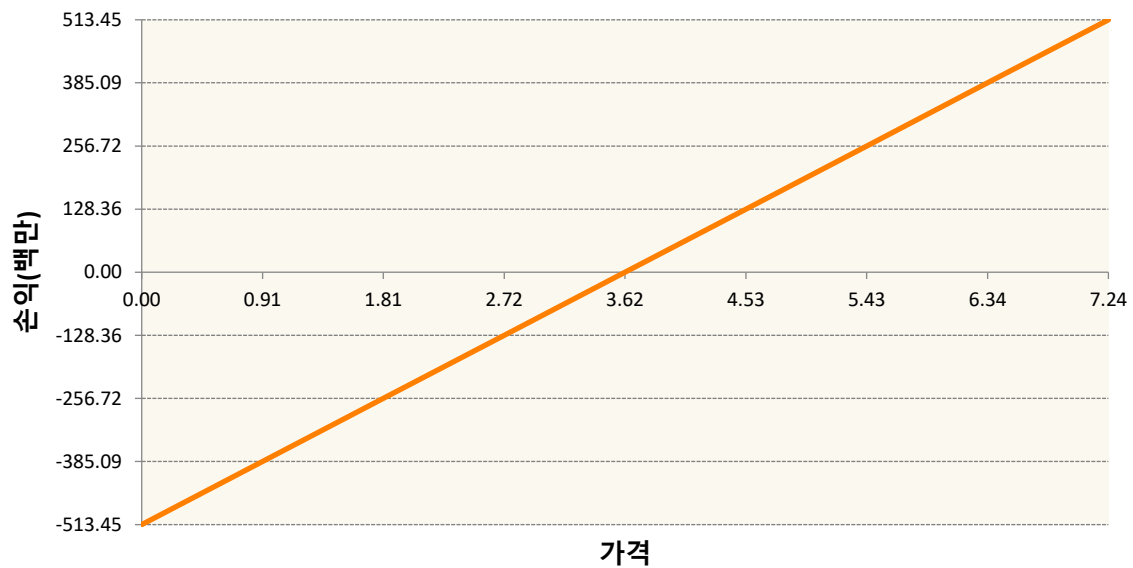
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

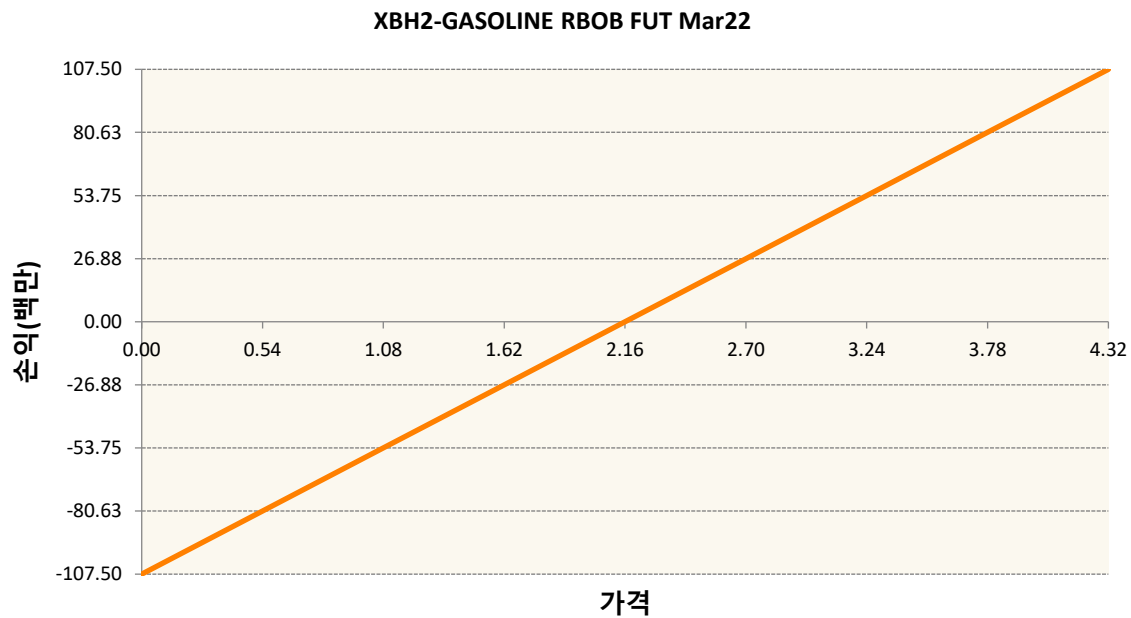
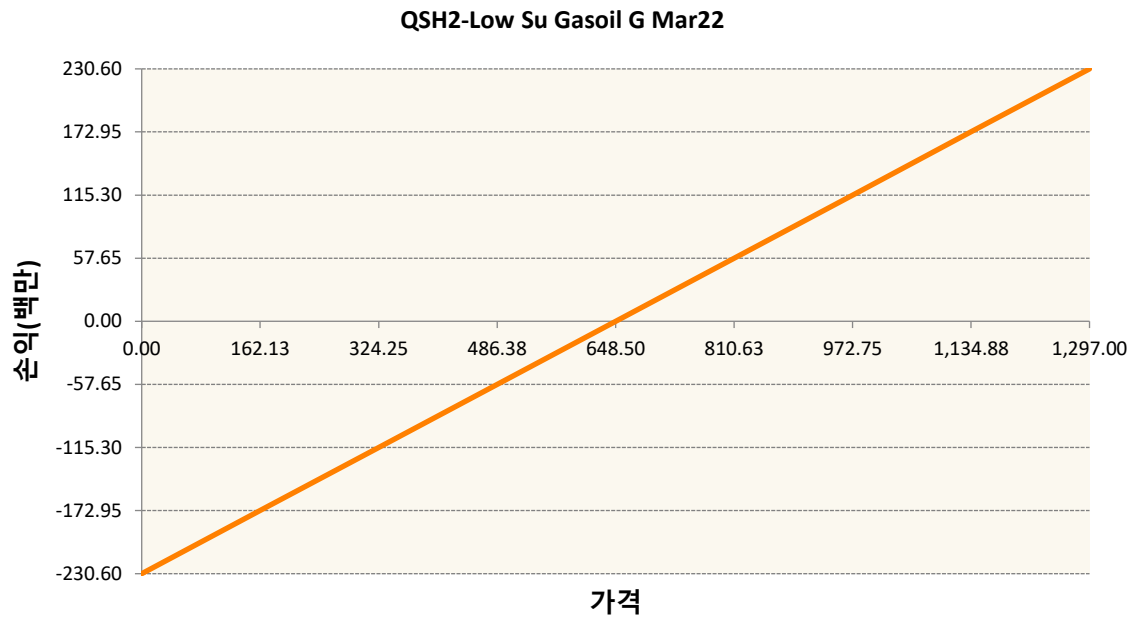


KR4175S10007-2022-01 달러선물



NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22		34
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22		35
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22		9
KR4175S100 2022-01 달러선물			28
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22		41
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22		18
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22		9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	329

공시일 2021-12-20

기준일 2021-12-17

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

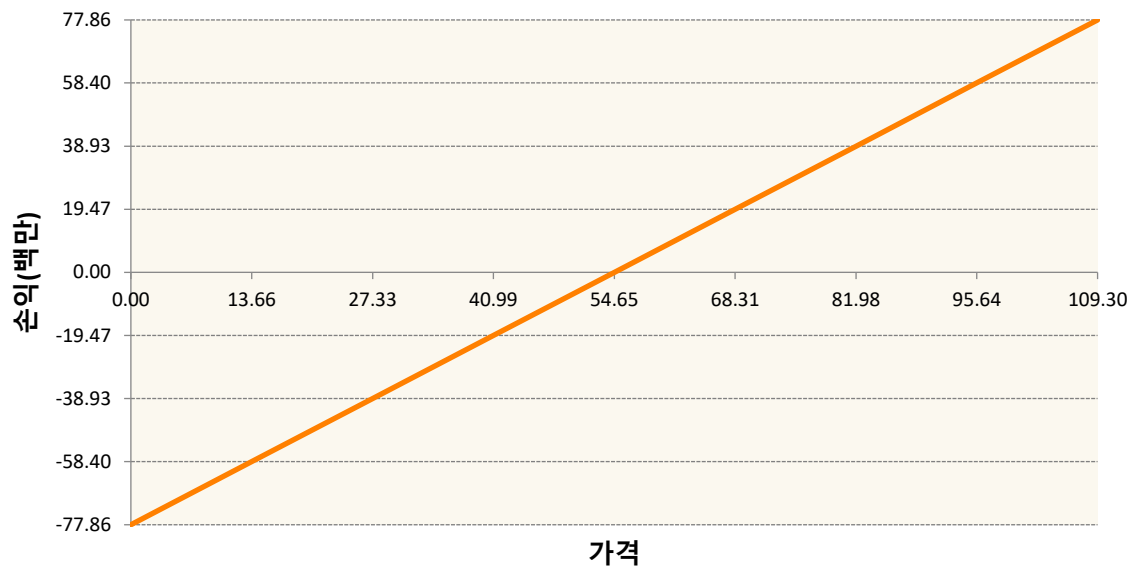
1. 계약금액

(단위:백만원)

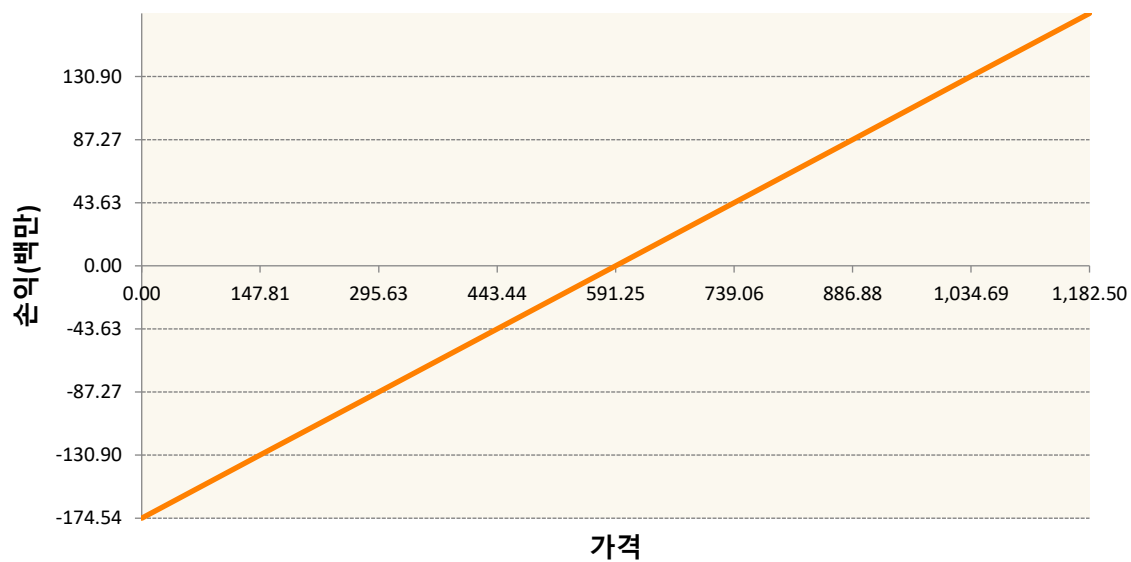
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	877	0	877	

2. 만기시점의 손익구조

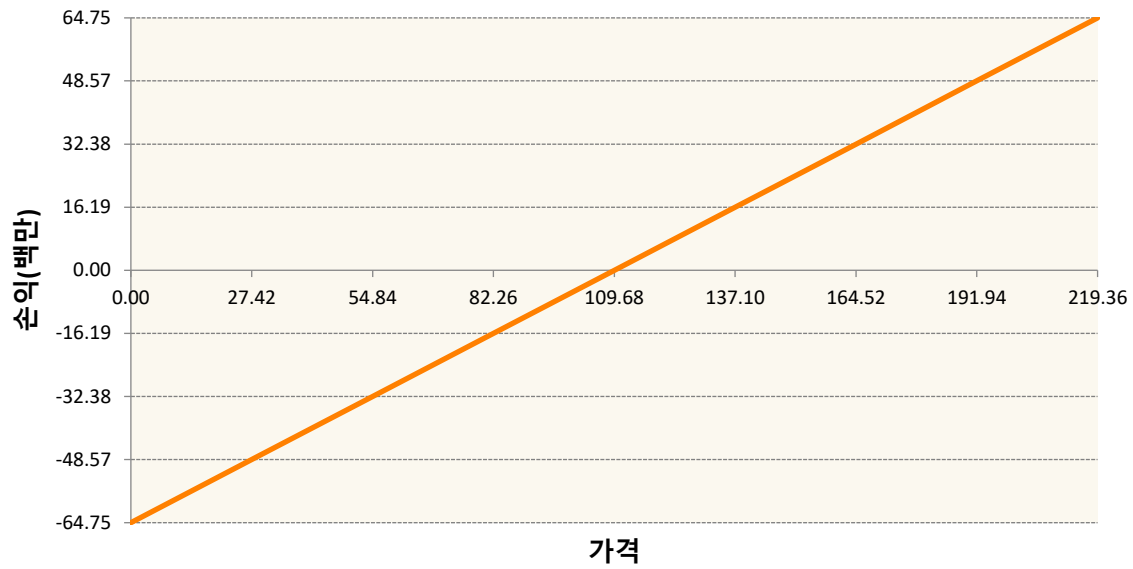
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



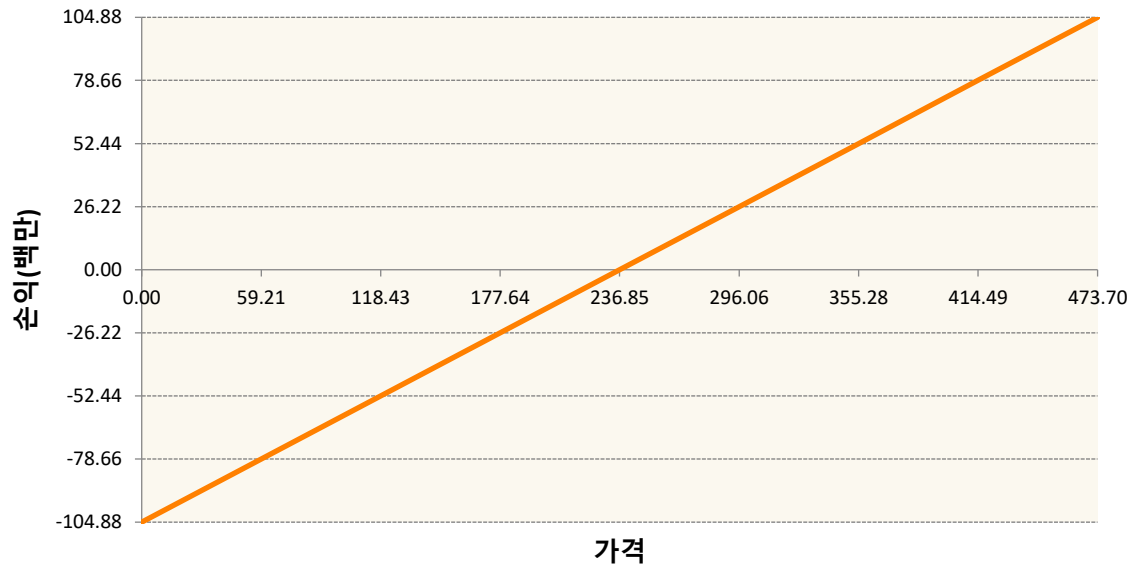
CH2-CORN FUTURE Mar22



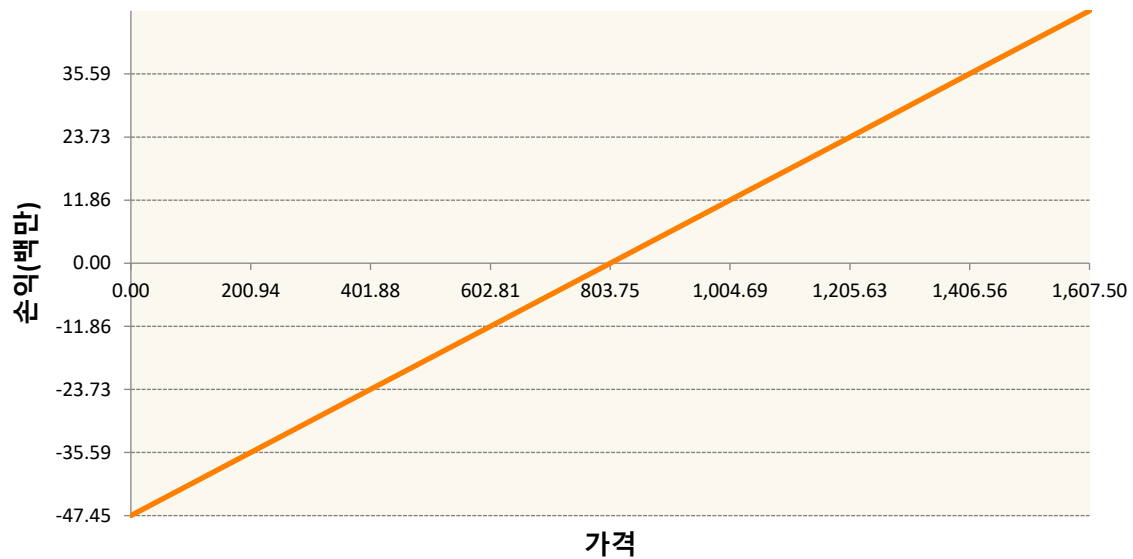
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



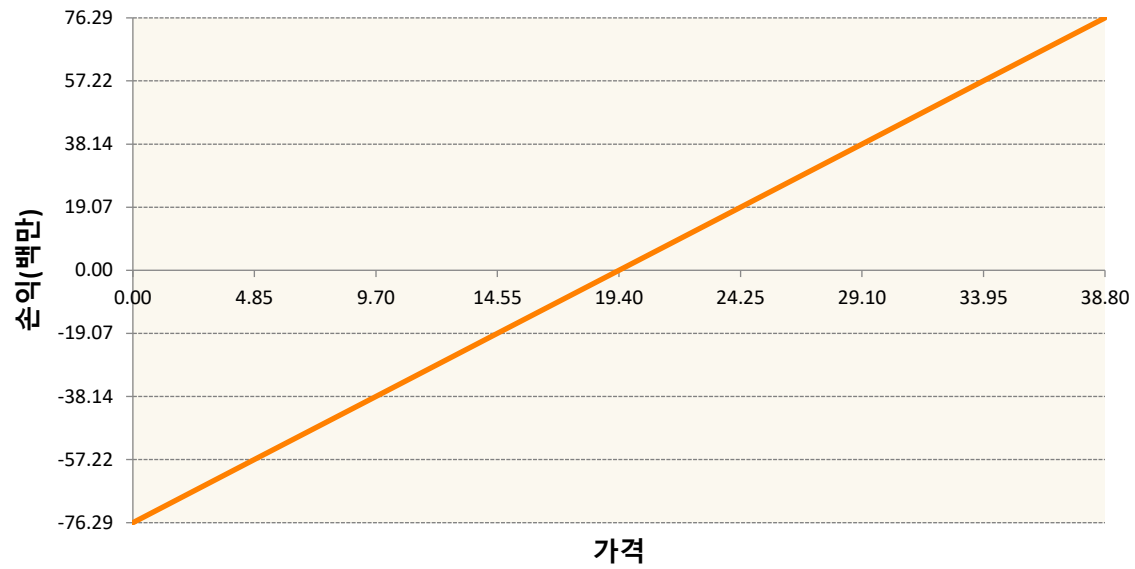
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



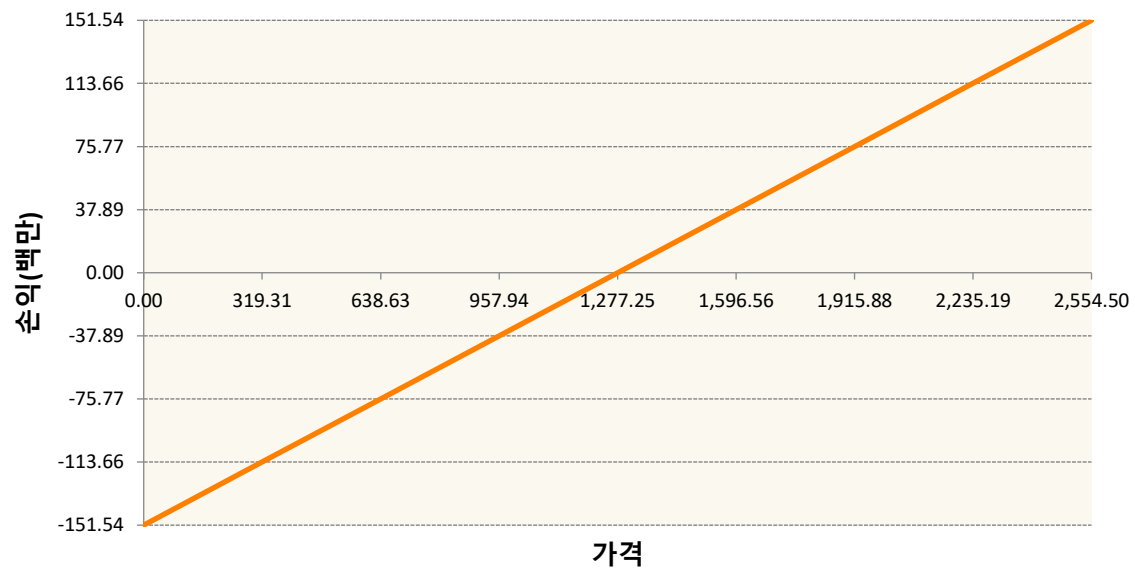
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



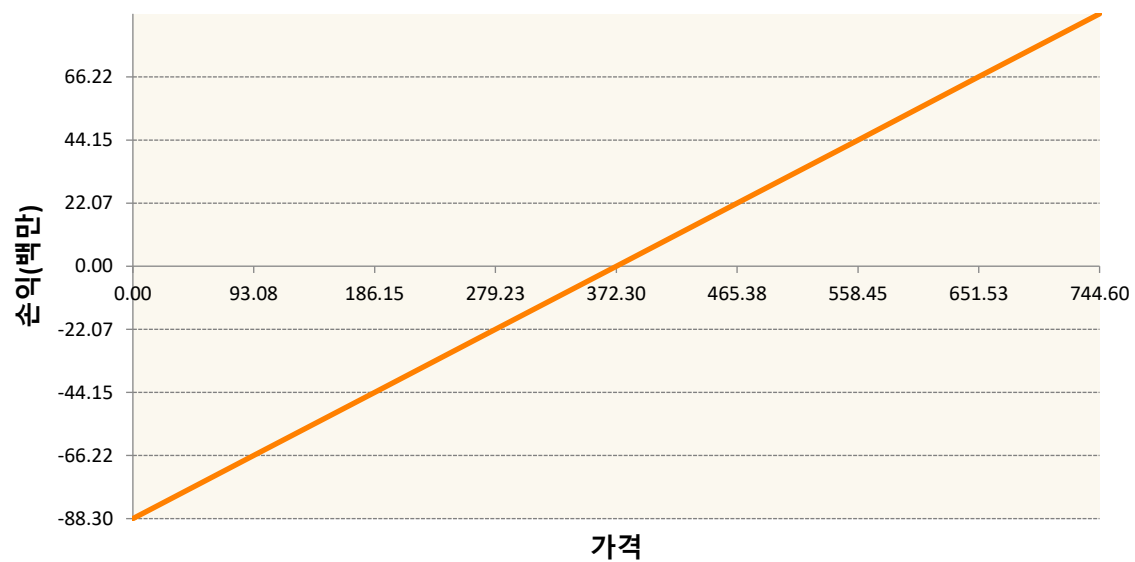
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



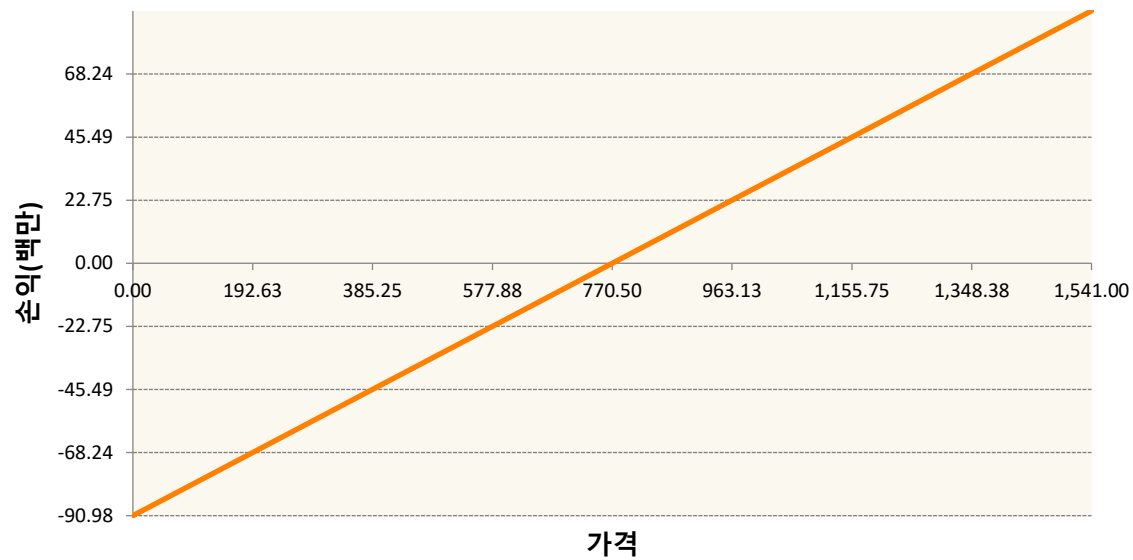
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



SMF2-SOYBEAN MEAL FUTR Jan22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22	6
CH2	CORN FUTURE Mar22	14
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22	5
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22	8
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22	4
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22	6
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22	12
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22	7
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22	7

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

(단위:백만원)

96