

공시일 2021-12-21

기준일 2021-12-20

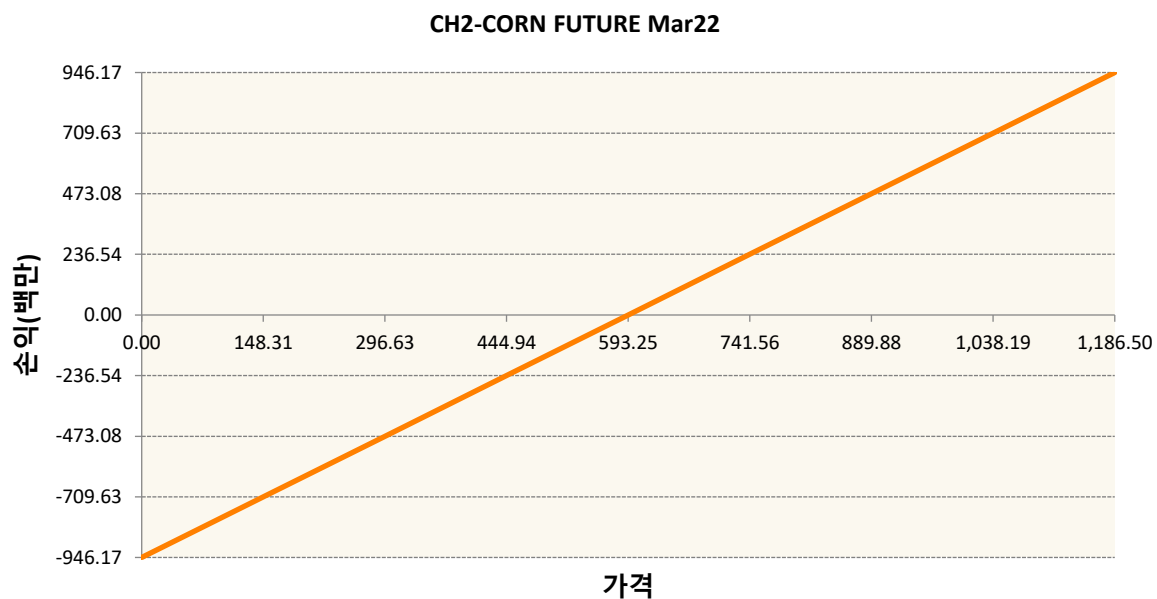
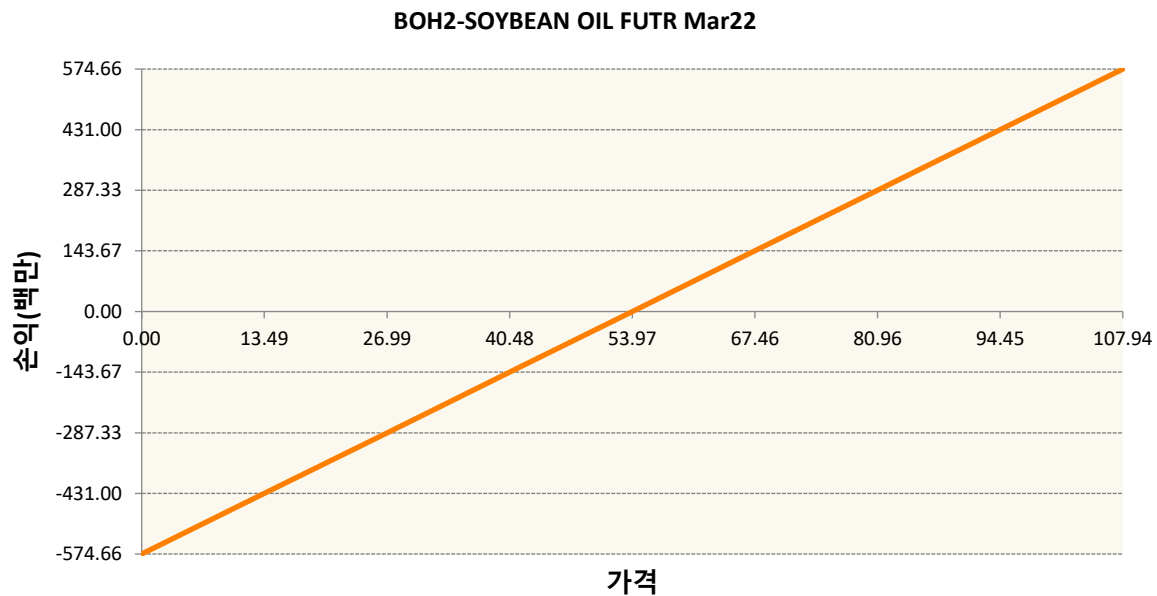
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

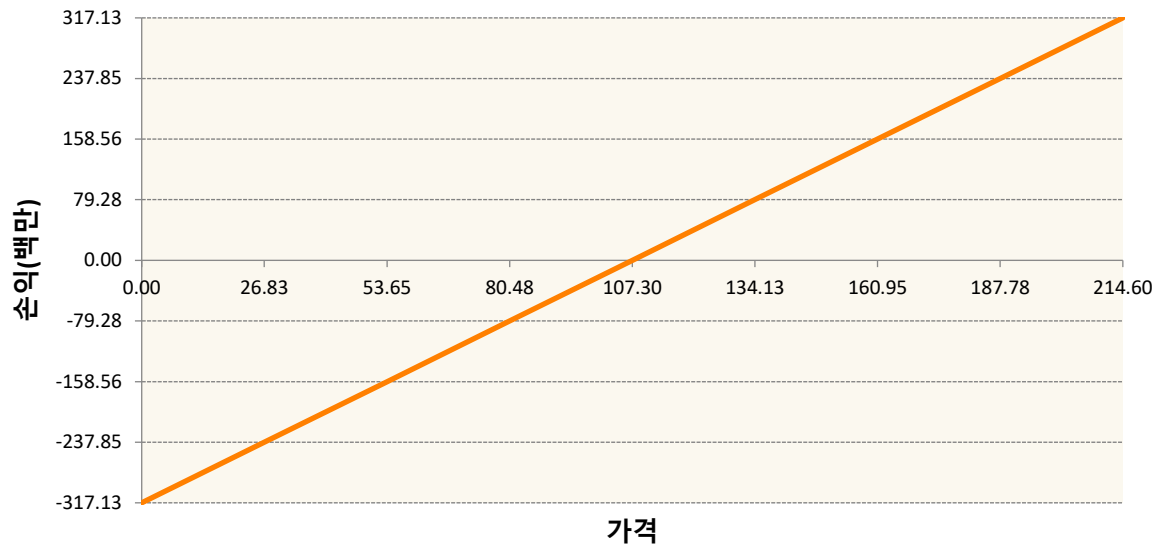
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,066	774	4,291	

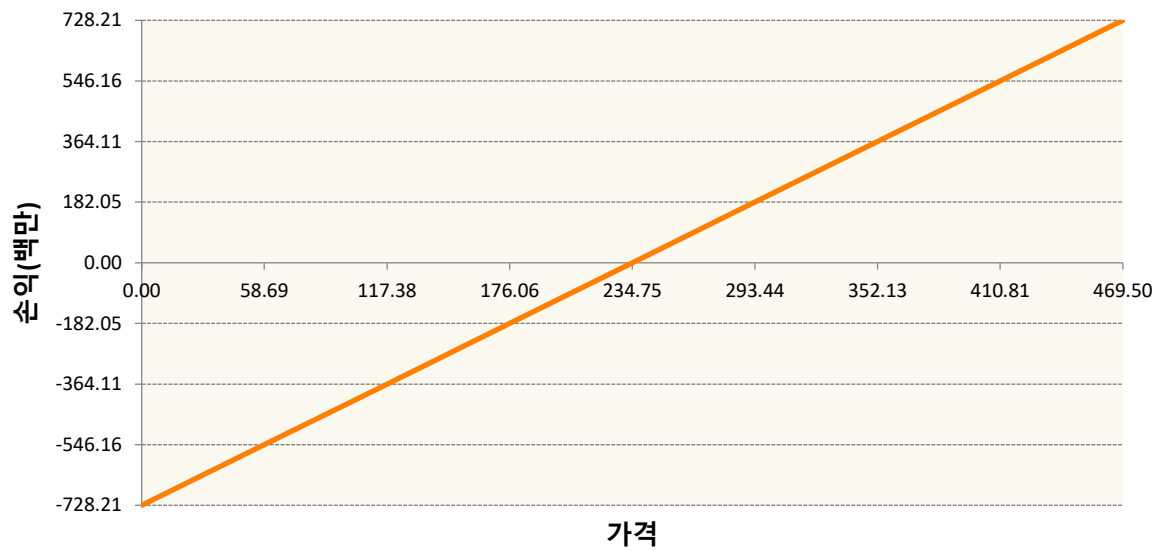
2. 만기시점의 손익구조



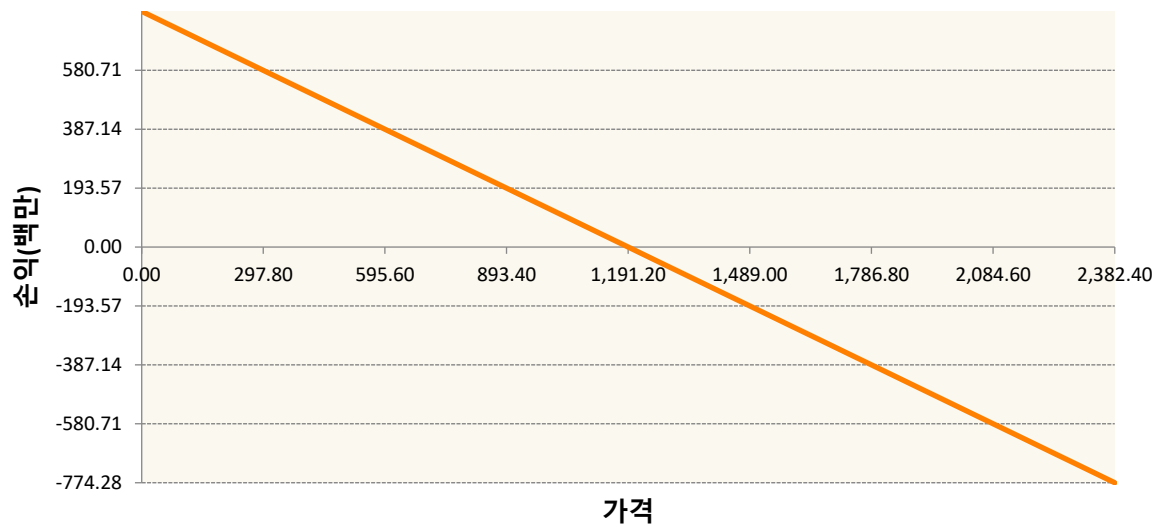
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



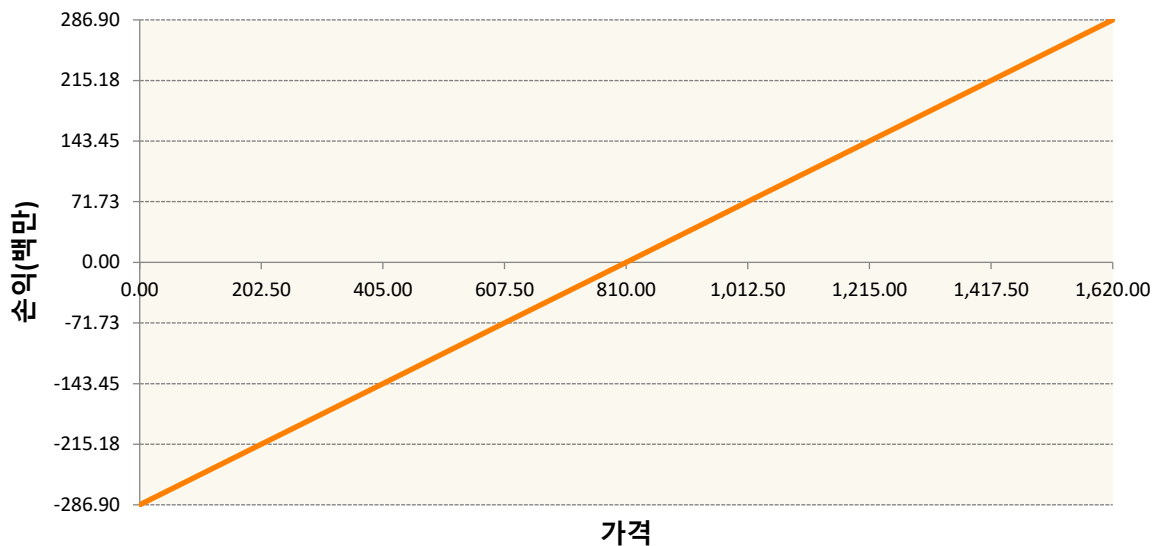
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



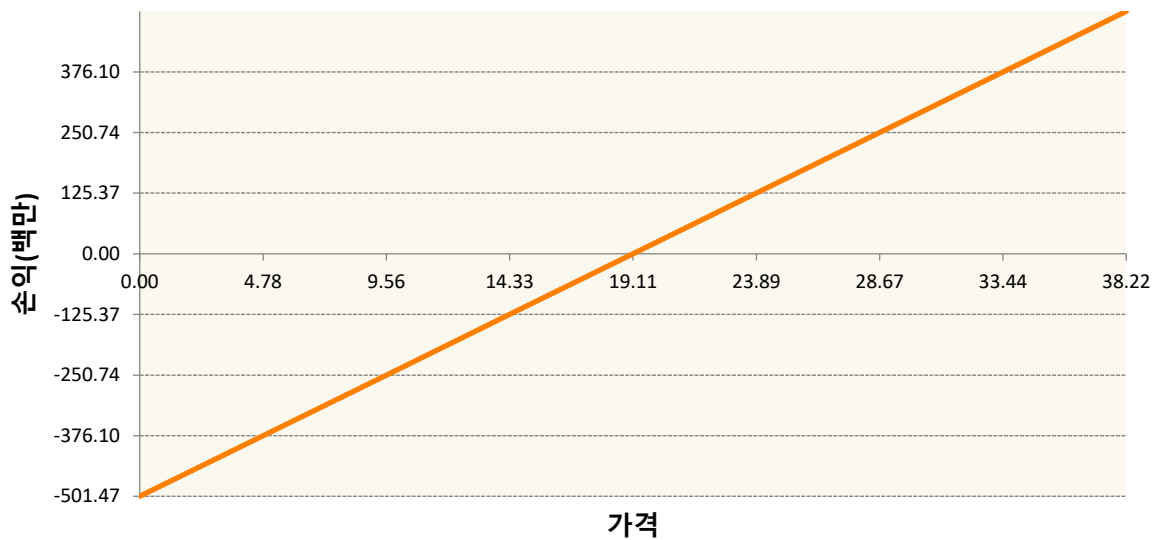
KR4175S10007-2022-01 달러선물



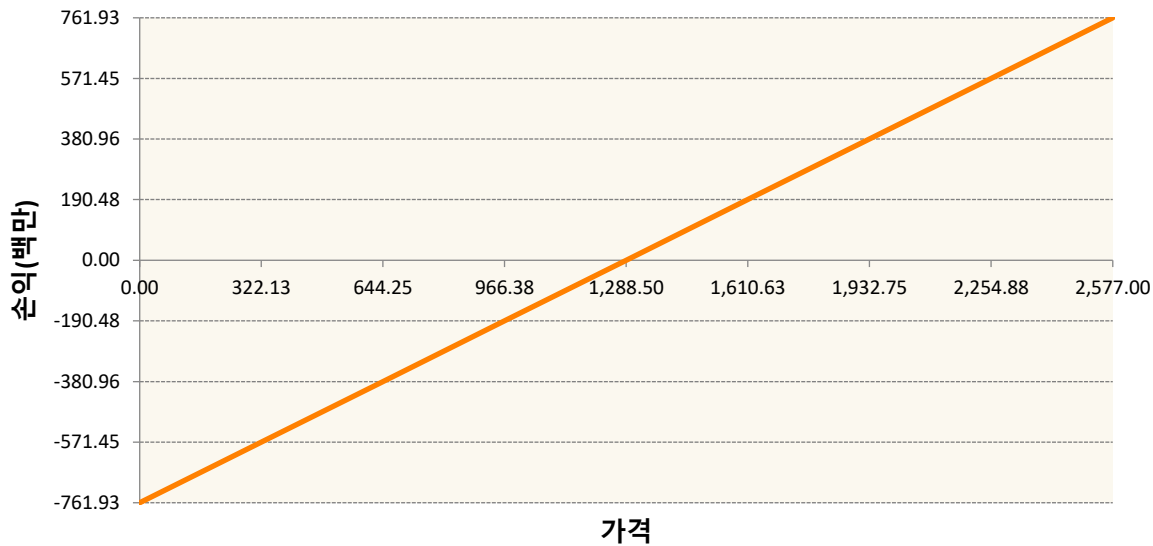
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



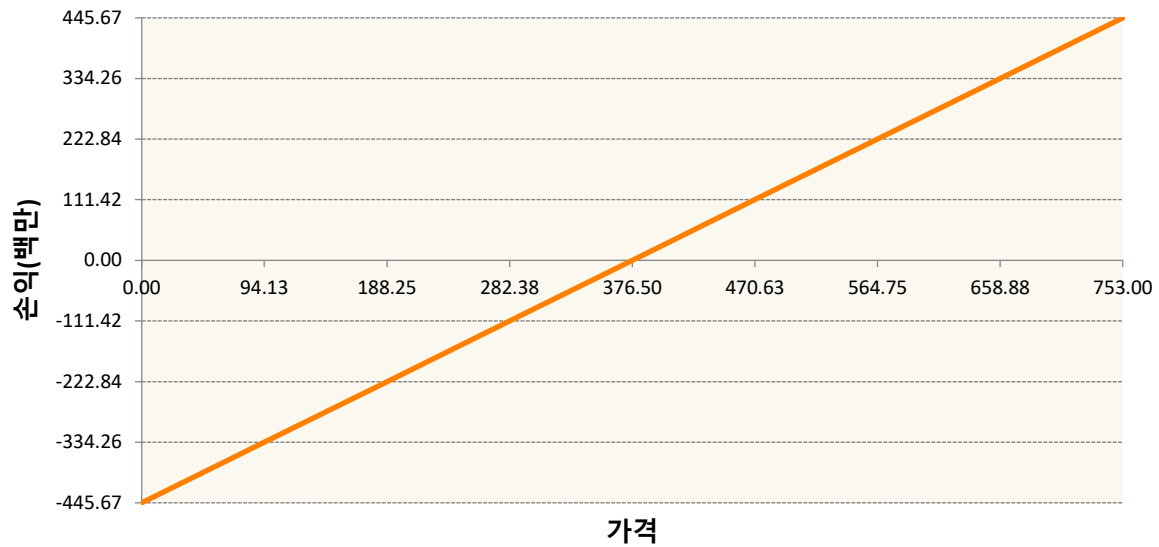
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



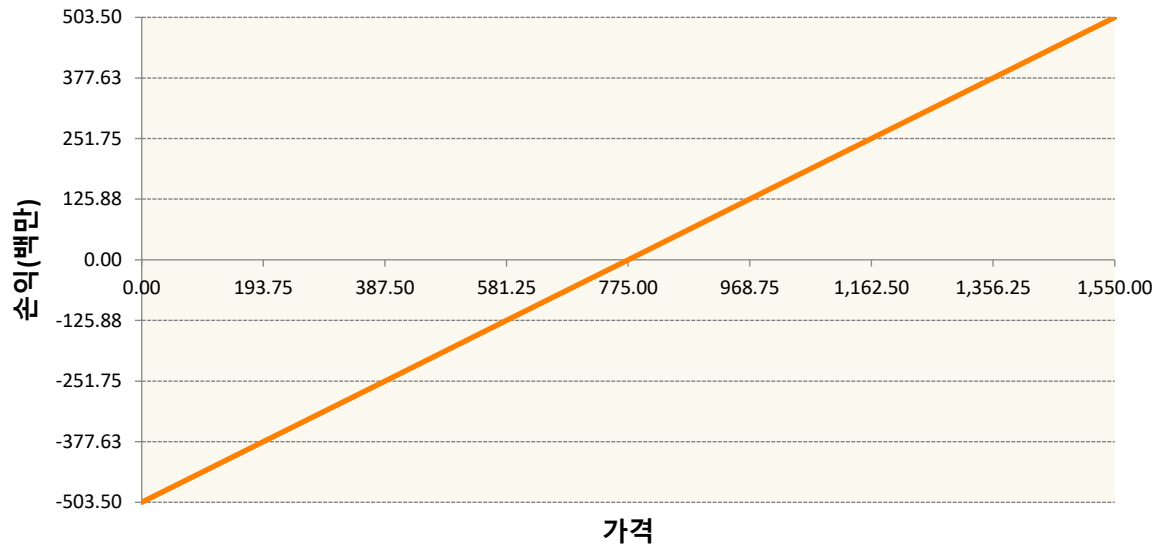
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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 2021-12-21

기준일 2021-12-20

스마트인덱스모

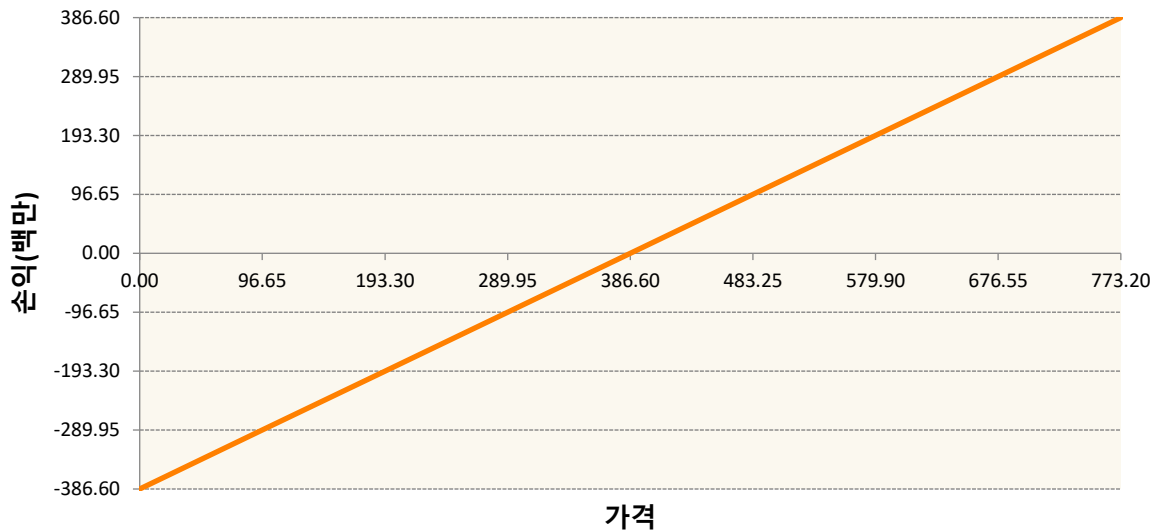
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	387	0	387	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물					31
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	
5.33%	21	21	21	21	21	21	21	
8.00%	31	31	31	31	31	31	31	

공시일	2021-12-21
기준일	2021-12-20

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)

541

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-21
기준일	2021-12-20

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)

424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2021-12-21

기준일 2021-12-20

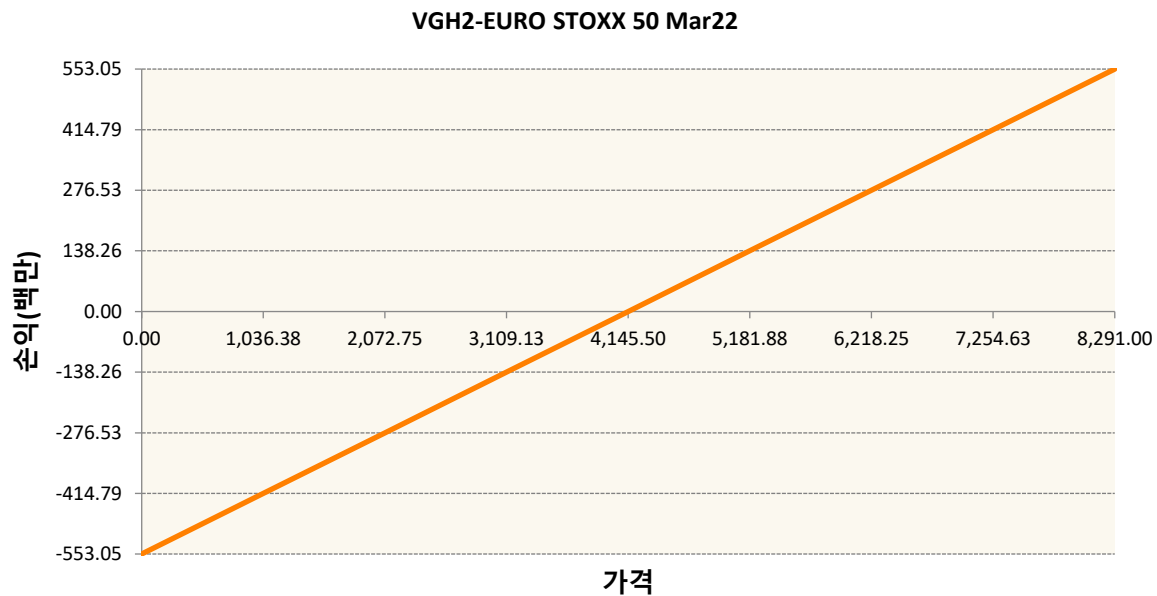
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2021-12-21
기준일	2021-12-20

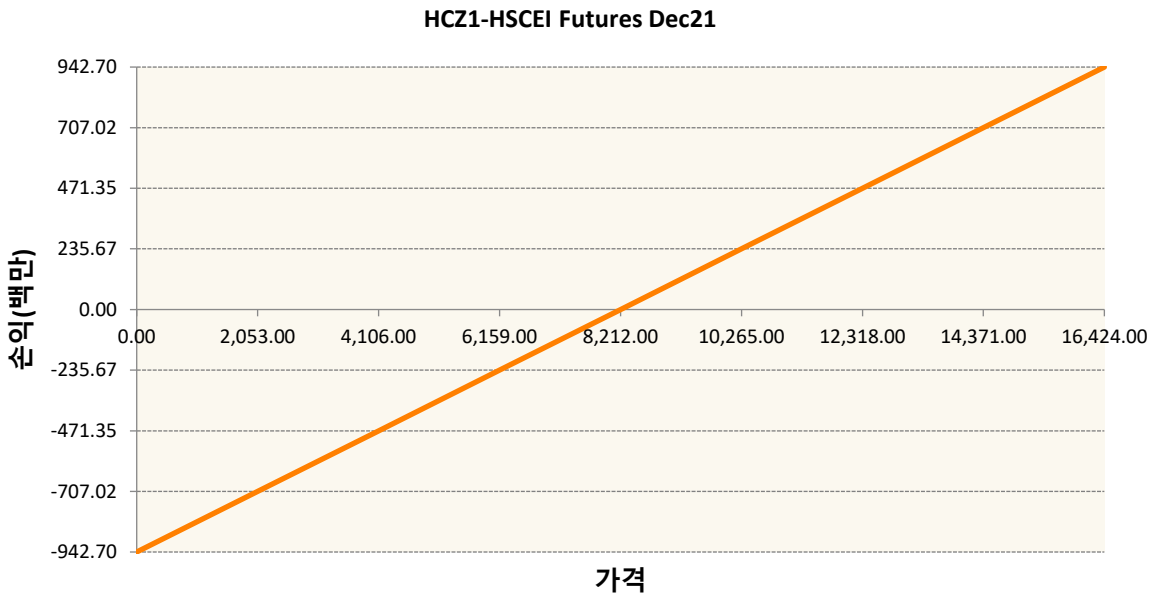
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	943	0	943	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

78

공시일 2021-12-21

기준일 2021-12-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

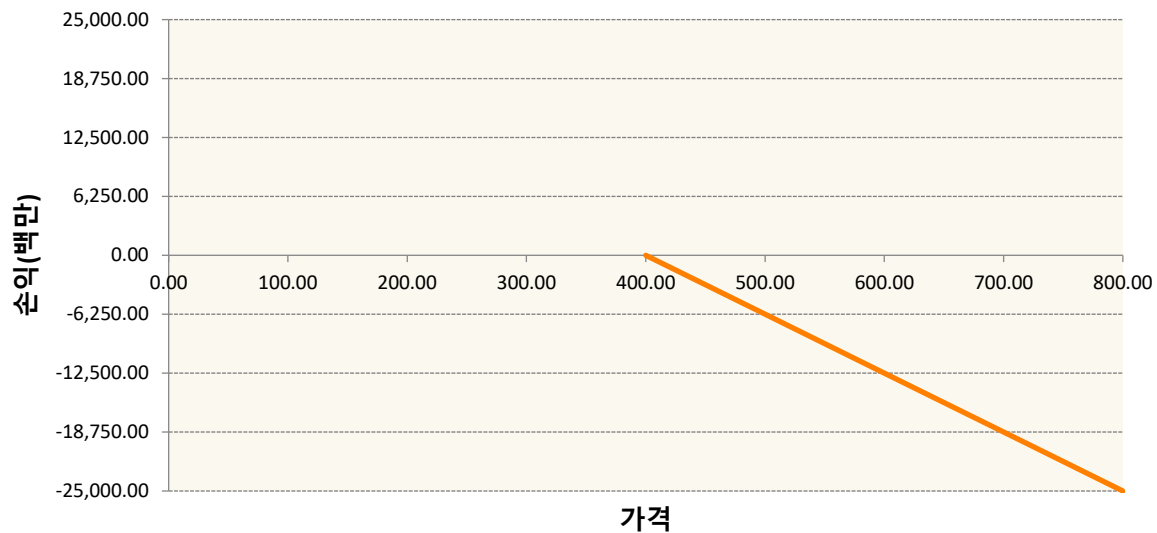
1. 계약금액

(단위:백만원)

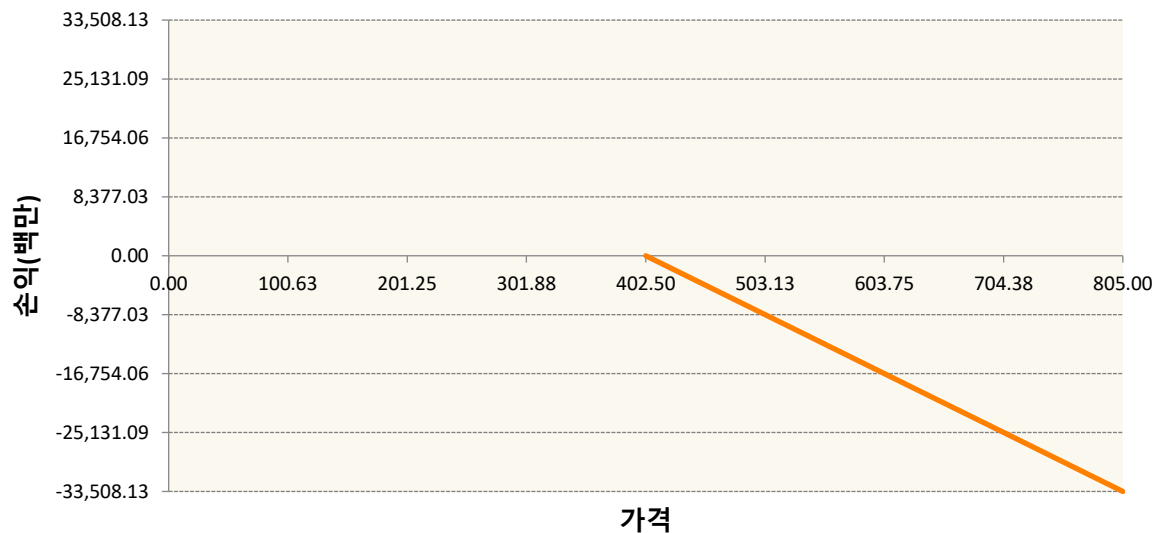
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201S14003-2022-01 콜400



KR4201S14029-2022-01 콜402.5



가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	-17,500.00
100.00	-13,125.00
200.00	-8,750.00
300.00	-4,375.00
400.00	0.00
500.00	0.00
600.00	0.00
700.00	0.00
800.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익 (백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 805.00. The y-axis represents Net Income in millions, ranging from -2,012.50 to 2,012.50. 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 (백만)
0.00	-2,012.50
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003				2022-01 콜400				1,318
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	449	439	426	409	389	365	339	
-5.33%	418	395	369	339	305	270	232	
-2.67%	335	296	254	209	163	115	66	
0%	165	110	55	0	-56	-112	-169	
2.67%	-124	-183	-242	-302	-361	-420	-479	
5.33%	-535	-588	-642	-696	-752	-808	-865	
8.00%	-1,050	-1,088	-1,129	-1,174	-1,220	-1,269	-1,318	
KR4201S14029				2022-01 콜402.5				1,682
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	530	519	504	485	461	432	400
-5.33%	497	472	441	404	364	320	272
-2.67%	407	359	308	252	194	133	71
0%	211	142	72	0	-73	-146	-220
2.67%	-134	-213	-293	-372	-451	-530	-610
5.33%	-644	-718	-793	-868	-945	-1,022	-1,099
8.00%	-1,299	-1,355	-1,416	-1,479	-1,545	-1,613	-1,682
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,200
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,181	-1,182	-1,183	-1,186	-1,189	-1,194	-1,200
-5.33%	-729	-734	-740	-747	-757	-768	-781
-2.67%	-297	-310	-326	-343	-361	-380	-401
0%	76	51	26	0	-26	-53	-80
2.67%	344	315	285	256	227	198	168
5.33%	492	469	446	421	396	370	343
8.00%	553	541	527	511	494	475	454
KR4301S14027 2022-01 풋402.5							140
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-139	-139	-139	-139	-139	-140	-140
-5.33%	-87	-87	-88	-88	-89	-90	-92
-2.67%	-37	-38	-39	-41	-43	-45	-47
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	42	38	35	32	28	25	22
5.33%	62	59	56	53	50	47	44
8.00%	71	69	67	65	63	61	58

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

(단위:백만원)

4,094

공시일	2021-12-21
기준일	2021-12-20

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	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,010	-2,010	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	11
FXW213BCF₩KRW/EUR 17-03-22E	54
FXW213BCF₩KRW/EUR 17-02-22E	107

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

(단위:백만원)

86

공시일 2021-12-21

기준일 2021-12-20

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

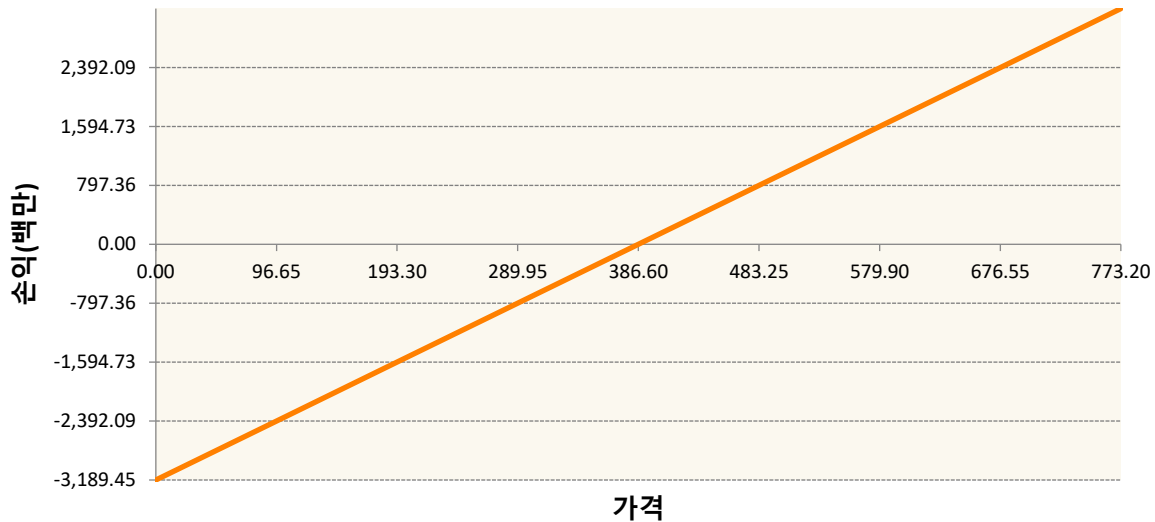
1. 계약금액

(단위:백만원)

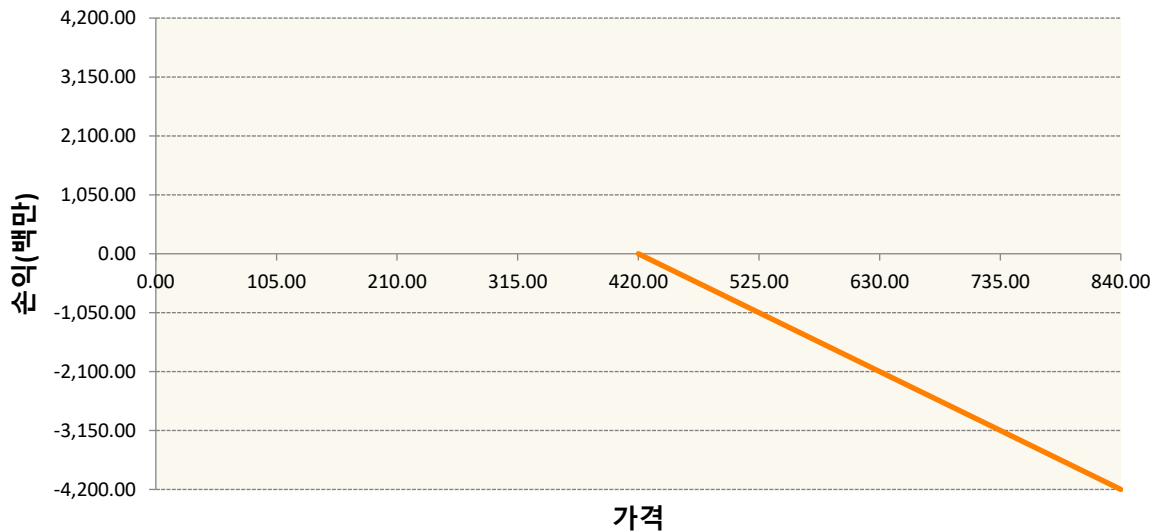
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,189	0	3,189	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

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 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. This suggests a constant marginal cost or a constant rate of profit reduction as price increases.

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					258
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-5.33%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	172	172	172	172	172	172	172
8.00%	258	258	258	258	258	258	258
KR4201S14201		2022-01 콜420					138
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	23	23	22	20	18
-5.33%	23	23	21	20	18	15	12
-2.67%	21	19	17	13	9	5	0
0%	15	11	6	0	-6	-13	-19
2.67%	0	-8	-15	-23	-31	-39	-48
5.33%	-30	-40	-49	-58	-68	-77	-87
8.00%	-78	-88	-98	-108	-118	-128	-138

KR4201S14250

2022-01 콜425

36

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	4	4
-5.33%	5	5	5	4	4	3	2
-2.67%	5	4	4	3	2	1	0
0%	4	3	1	0	-2	-3	-5
2.67%	0	-1	-3	-5	-8	-10	-12
5.33%	-6	-9	-12	-14	-17	-20	-23
8.00%	-18	-21	-24	-27	-30	-33	-36

KR4301S14001

2022-01 풋400

14

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	14	14	14	14	14	14
-5.33%	8	8	8	9	9	9	9
-2.67%	3	4	4	4	4	4	5
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-6	-5	-5	-5	-5	-4	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-5	-5

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

(단위:백만원)

397

공시일	2021-12-21
기준일	2021-12-20

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	16,897	0	16,897	

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	2021-12-21
기준일	2021-12-20

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	9,670	0	9,670	

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	2021-12-21
기준일	2021-12-20

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	45,580	0	45,580	
누계	통화	선도	1,429	0	1,429	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

FXW213BBW USD/KRW 24-12-21E

114

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

(단위:백만원)

38

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물				117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117

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

(단위:백만원)

120

공시일 2021-12-21

기준일 2021-12-20

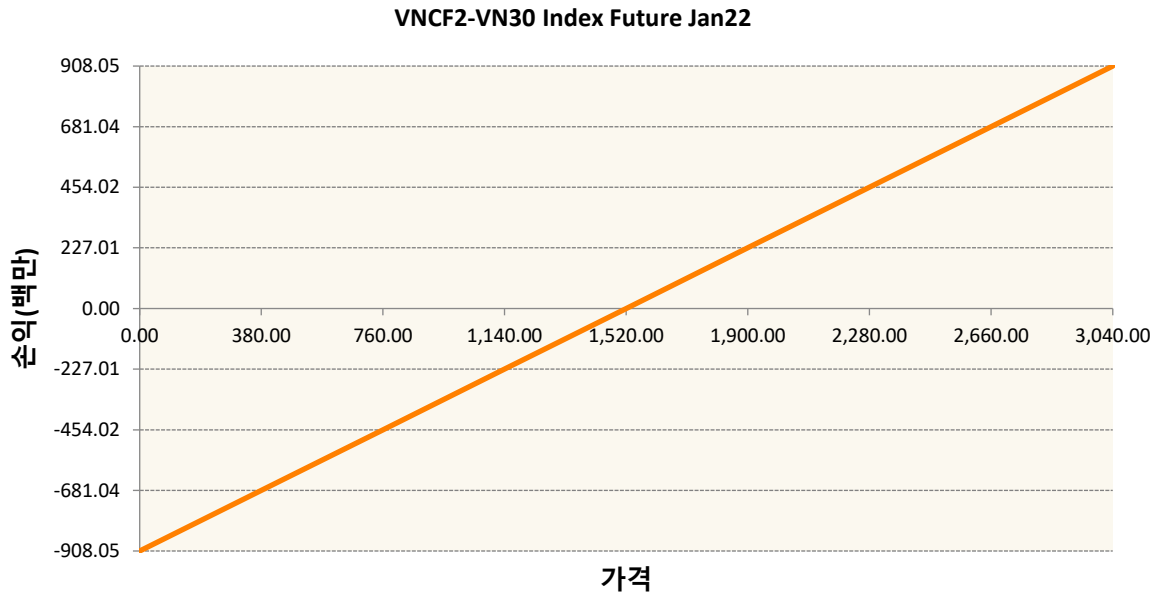
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	908	0	908	
누계	유가증권	스왑	1,789	0	1,789	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	73

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

(단위:백만원)

253

공시일 2021-12-21

기준일 2021-12-20

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

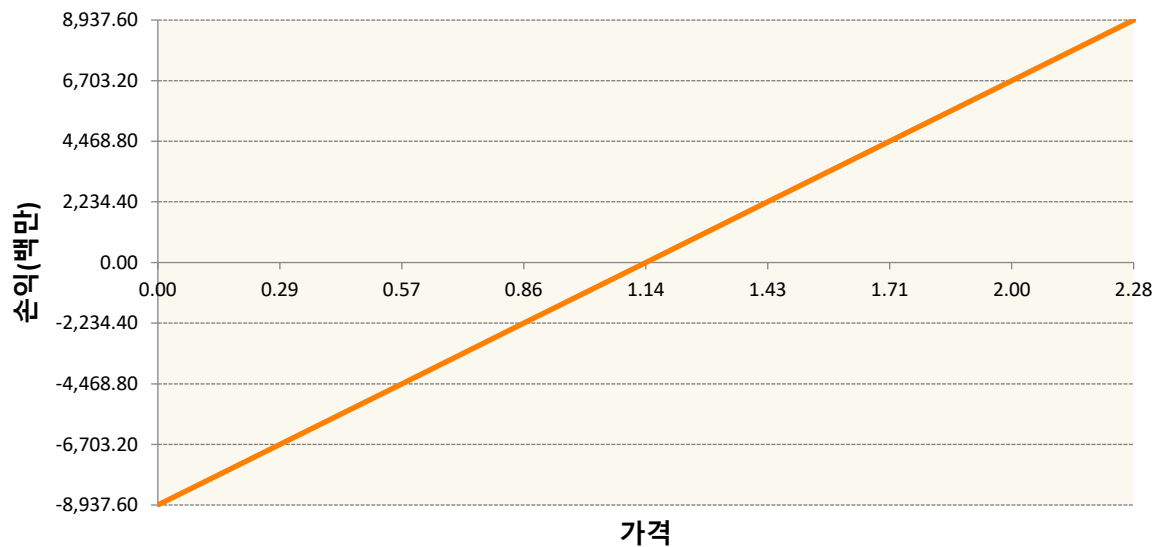
1. 계약금액

(단위:백만원)

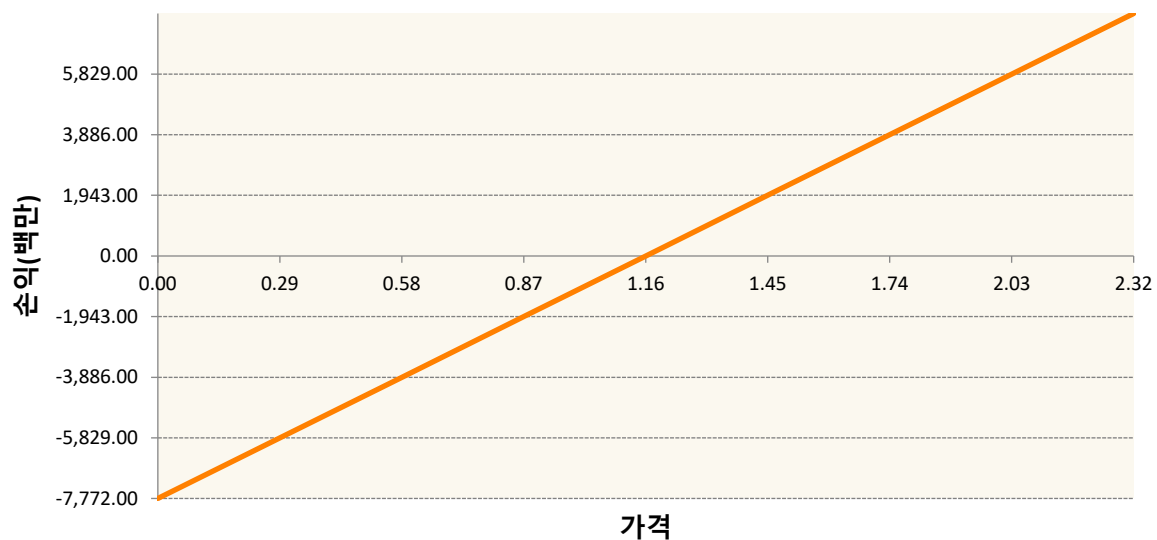
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	33,471	0	33,471	

2. 만기시점의 손익구조

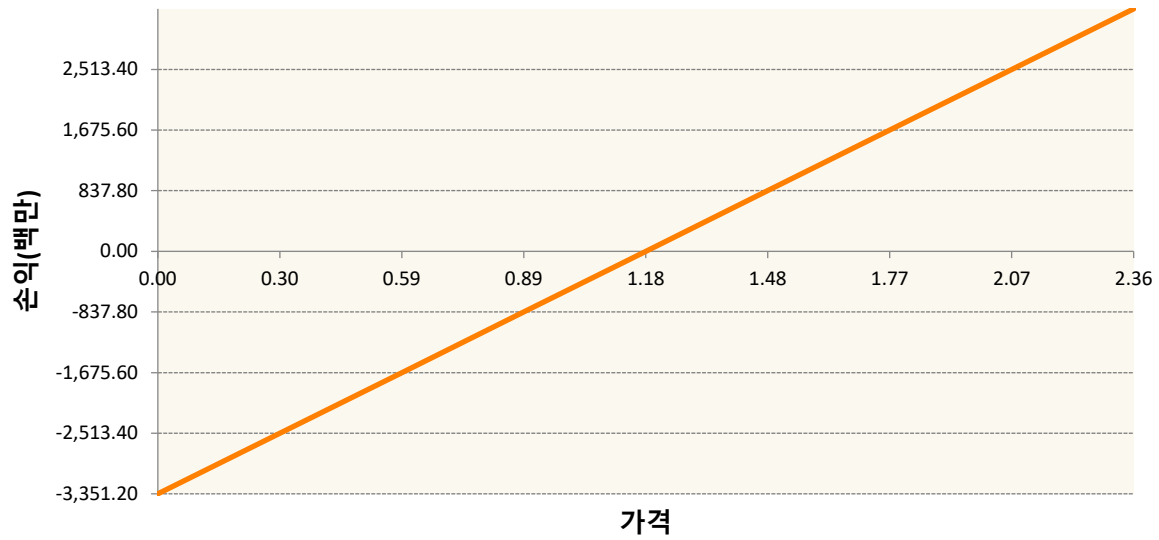
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



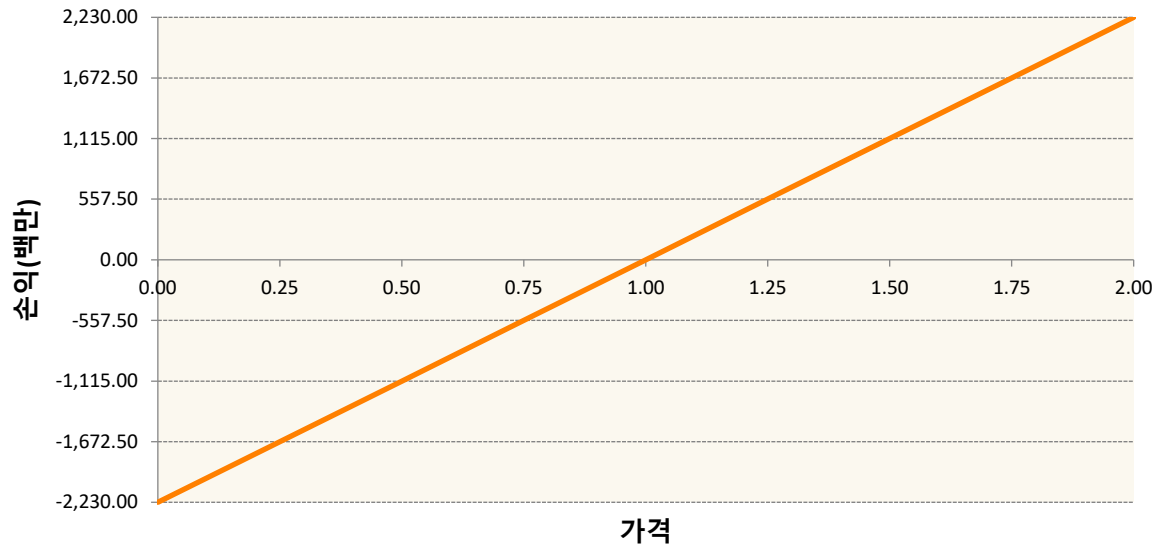
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



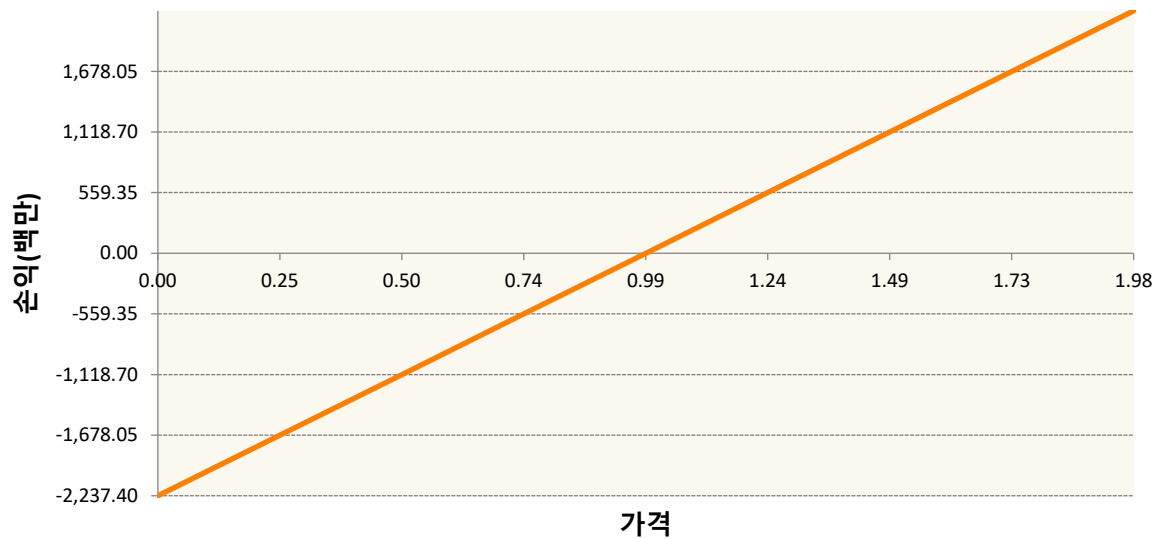
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



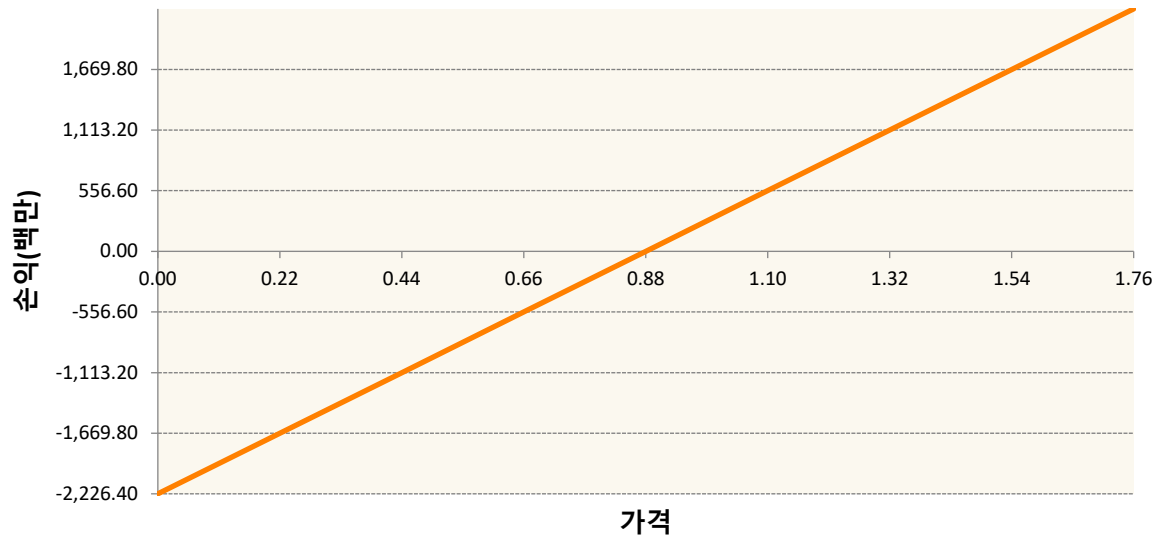
210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



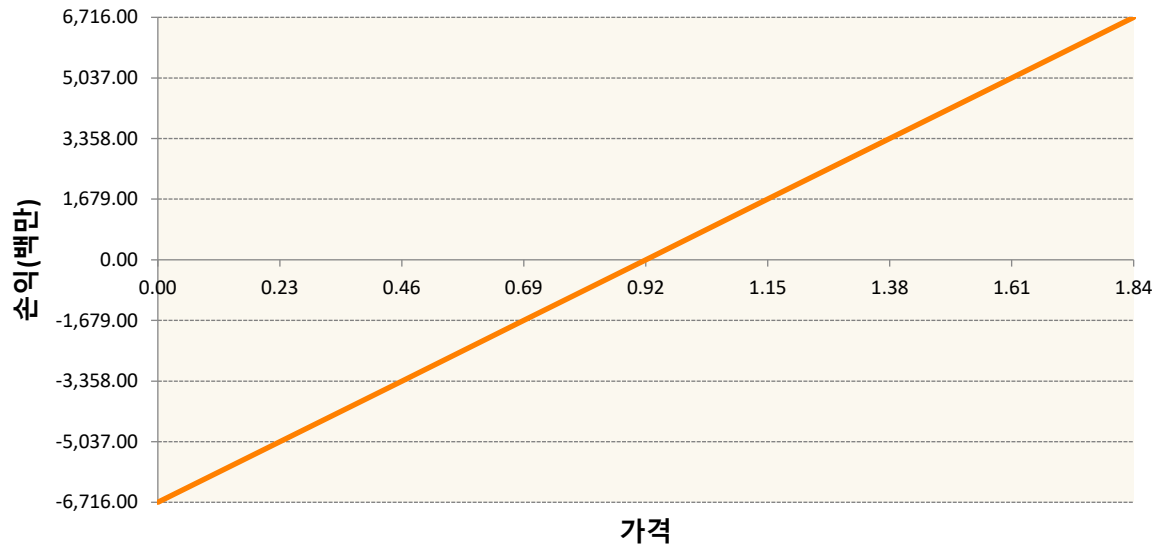
210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)		714
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		622
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		268
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		178
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		178
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		178
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		535

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,314

공시일 2021-12-21

기준일 2021-12-20

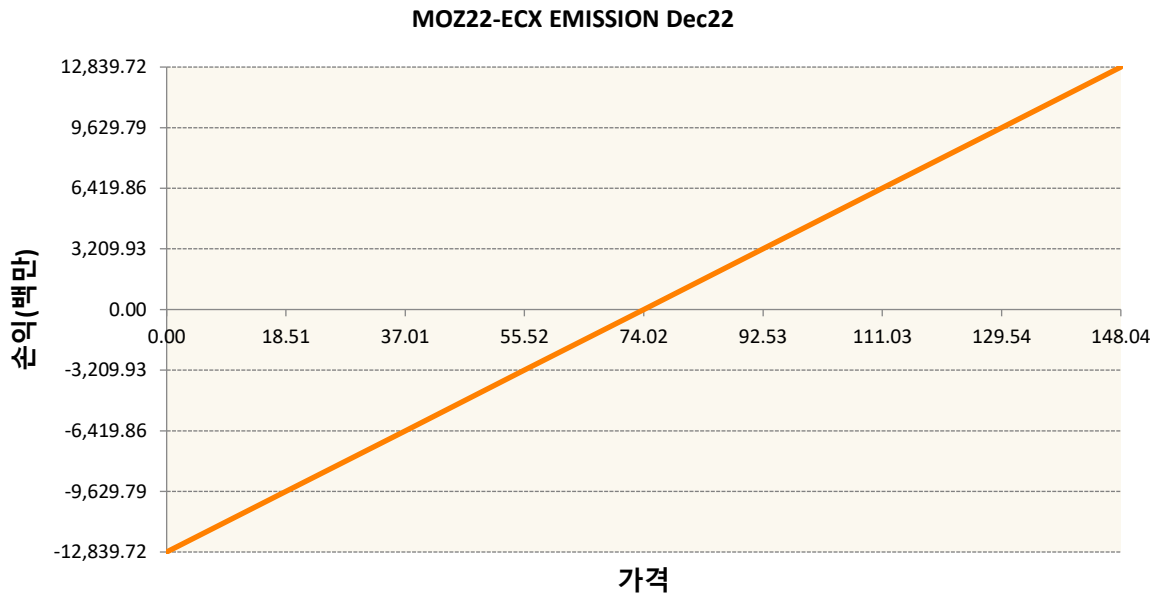
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,840	0	12,840	
누계	통화	선도	0	6,726	-6,726	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX-KRW/EUR 28-12-21E

383

FXW213BCA-KRW/EUR 28-12-21E

155

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,027

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

(단위:백만원)

2,418

공시일 2021-12-21

기준일 2021-12-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

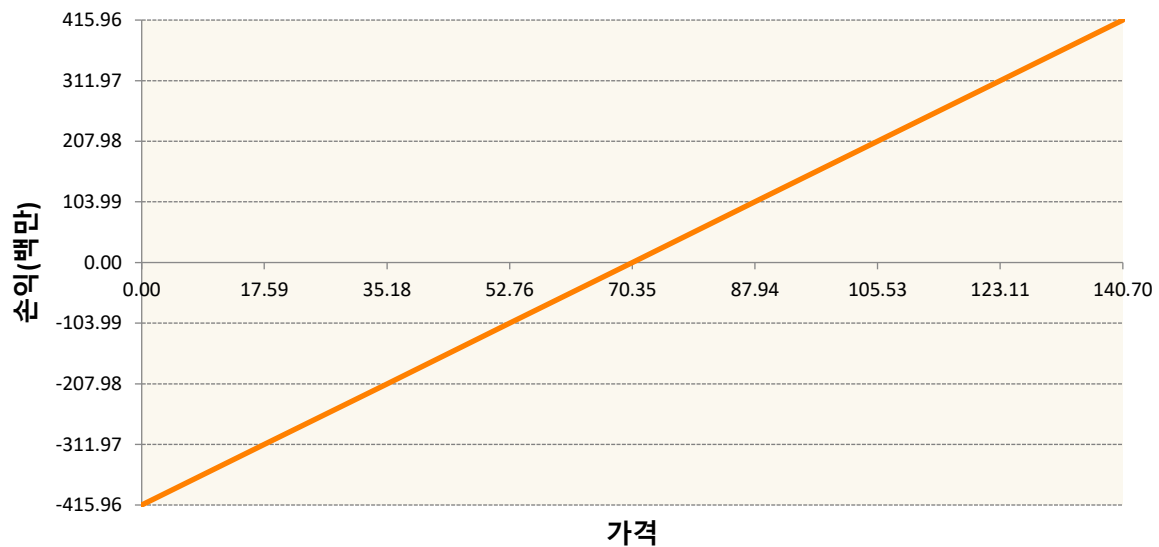
1. 계약금액

(단위:백만원)

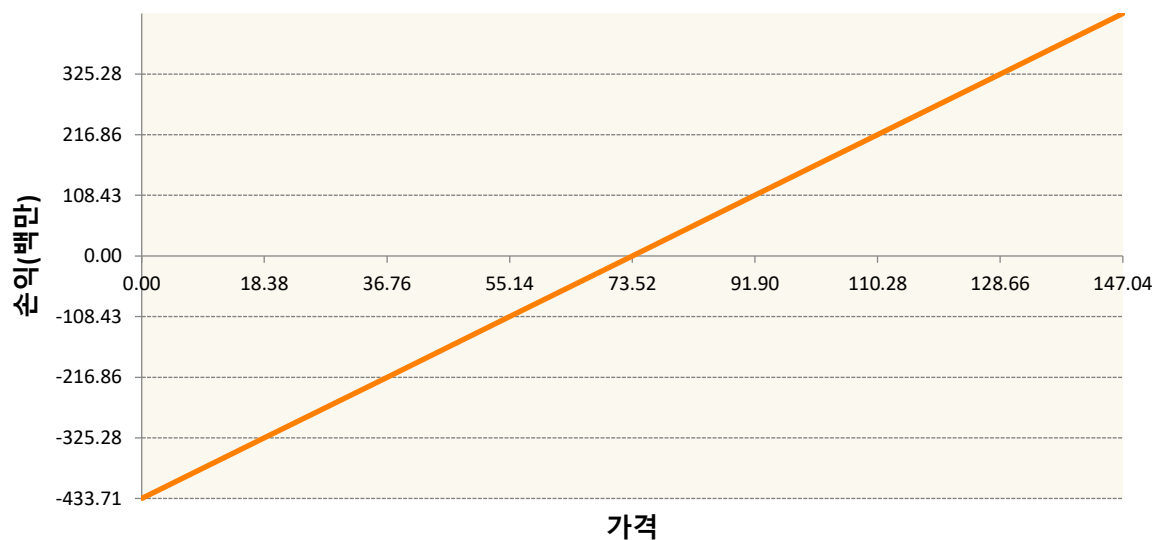
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,792	357	1,435	

2. 만기시점의 손익구조

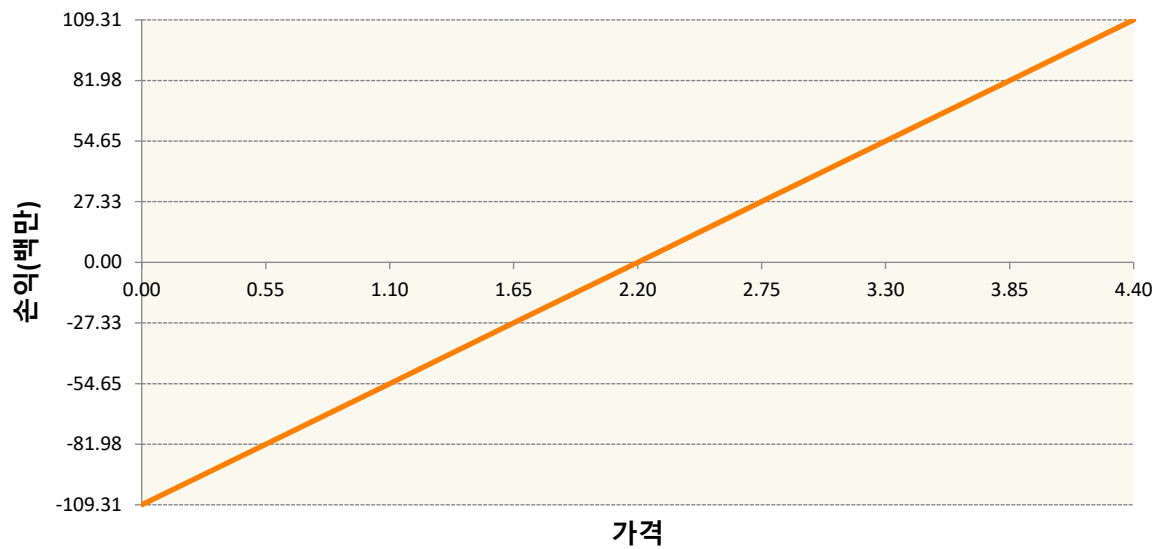
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



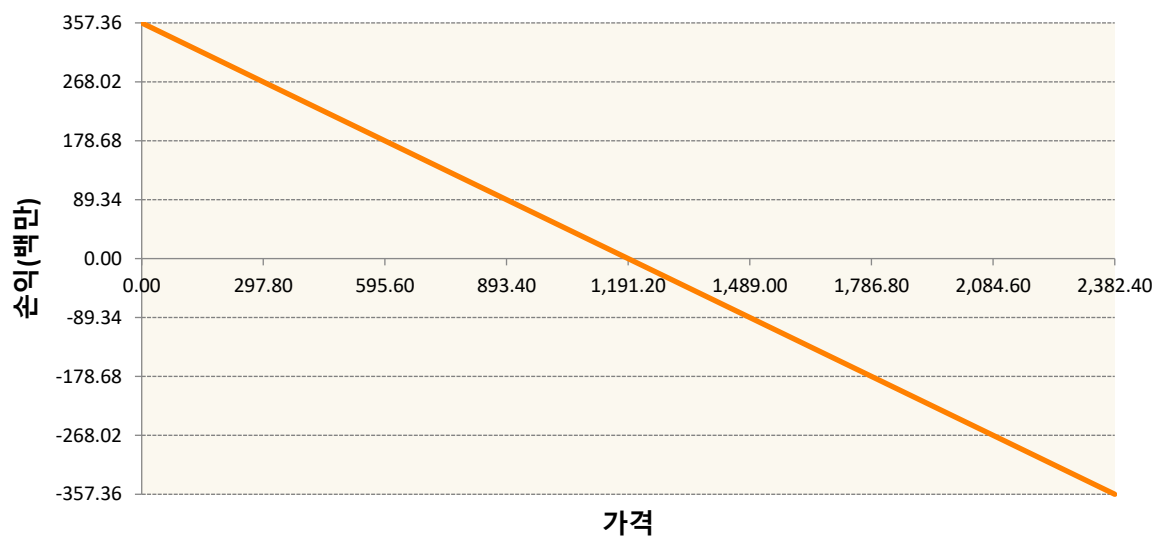
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



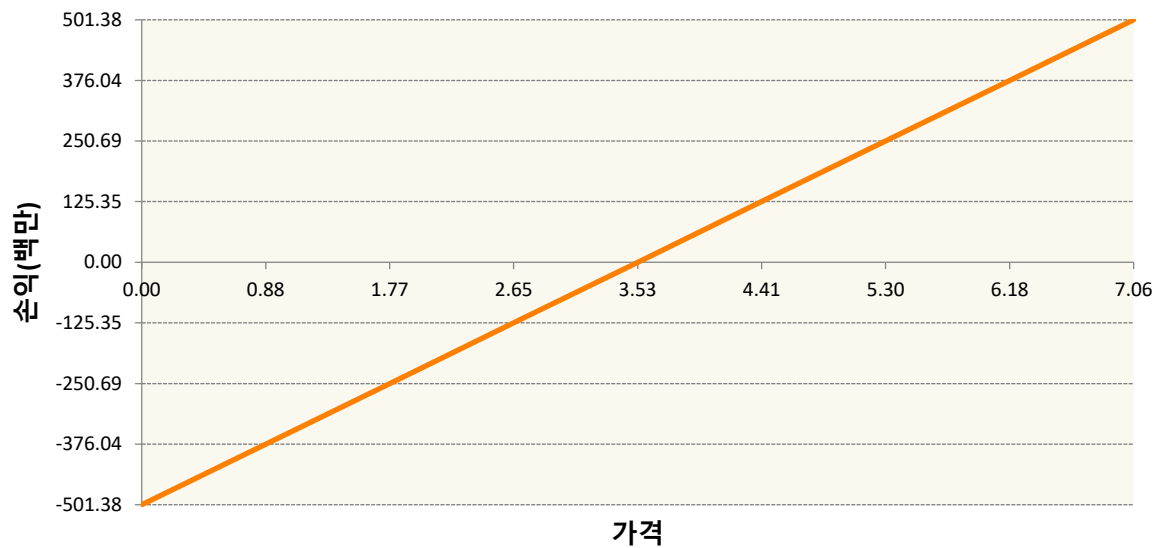
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22



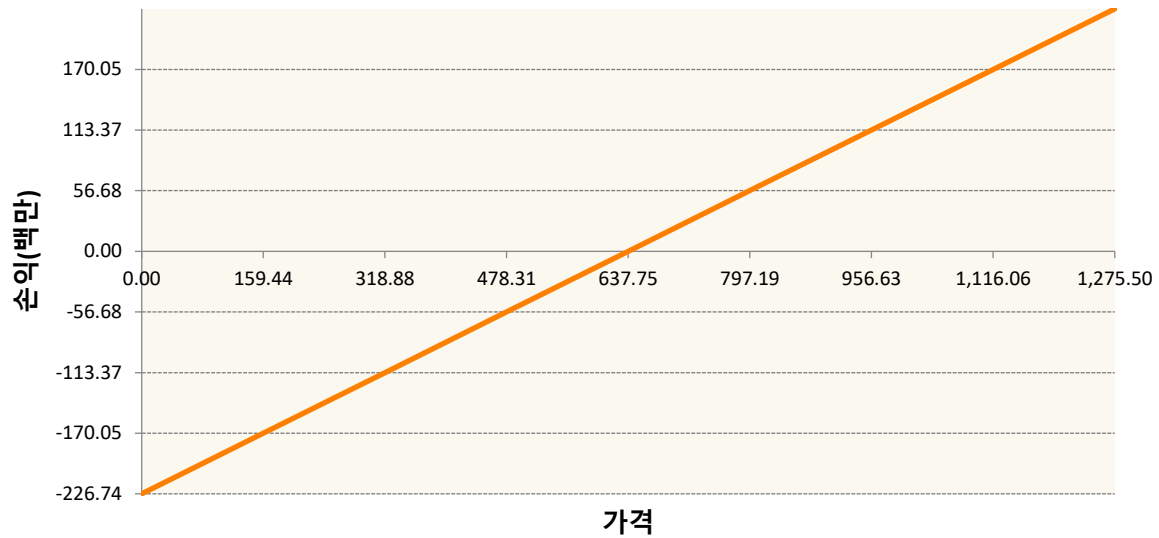
KR4175S10007-2022-01 달러선물



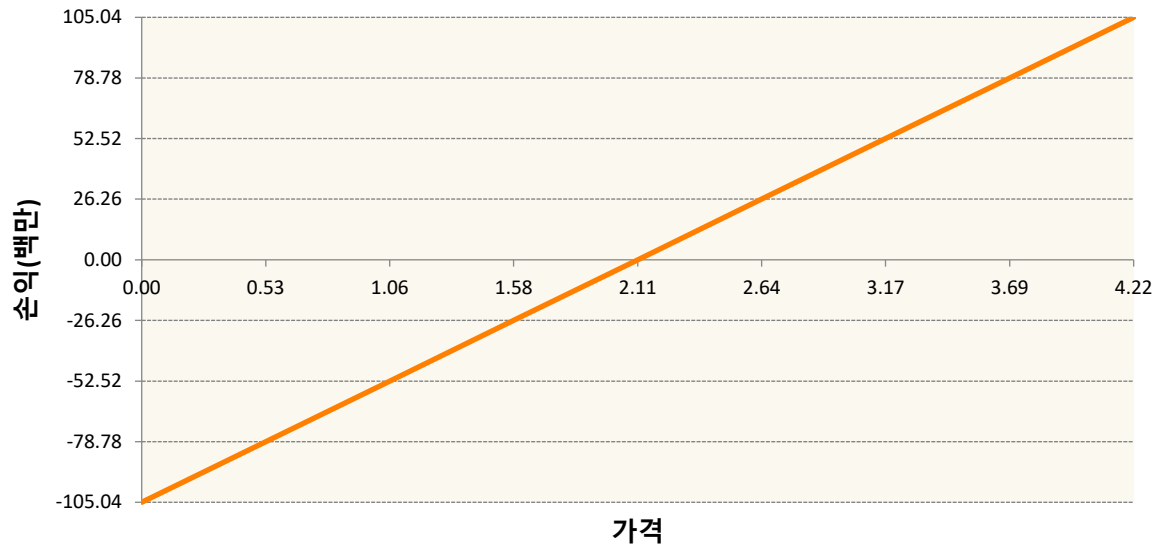
NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBH2-GASOLINE RBOB FUT 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	29
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22	40
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	18
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22	8

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

(단위:백만원)

322

공시일 2021-12-21

기준일 2021-12-20

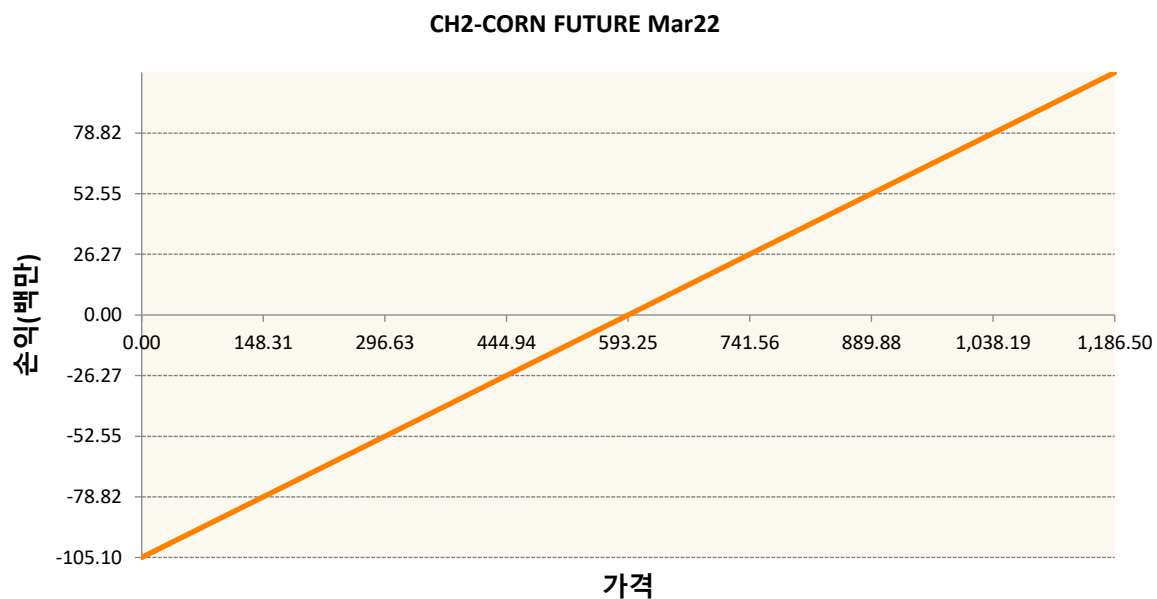
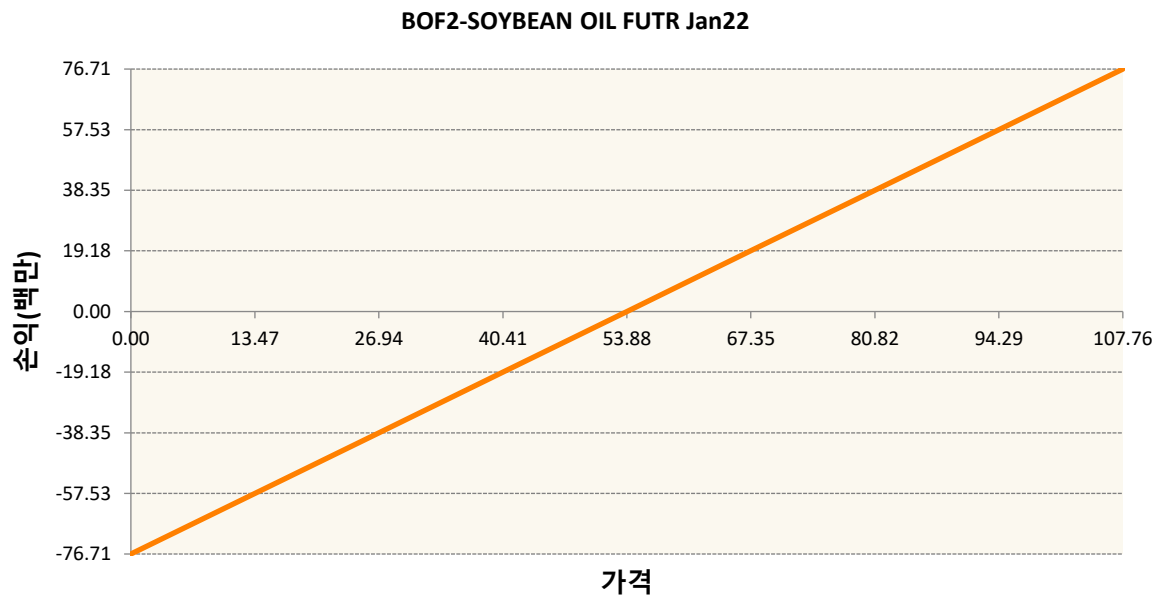
애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

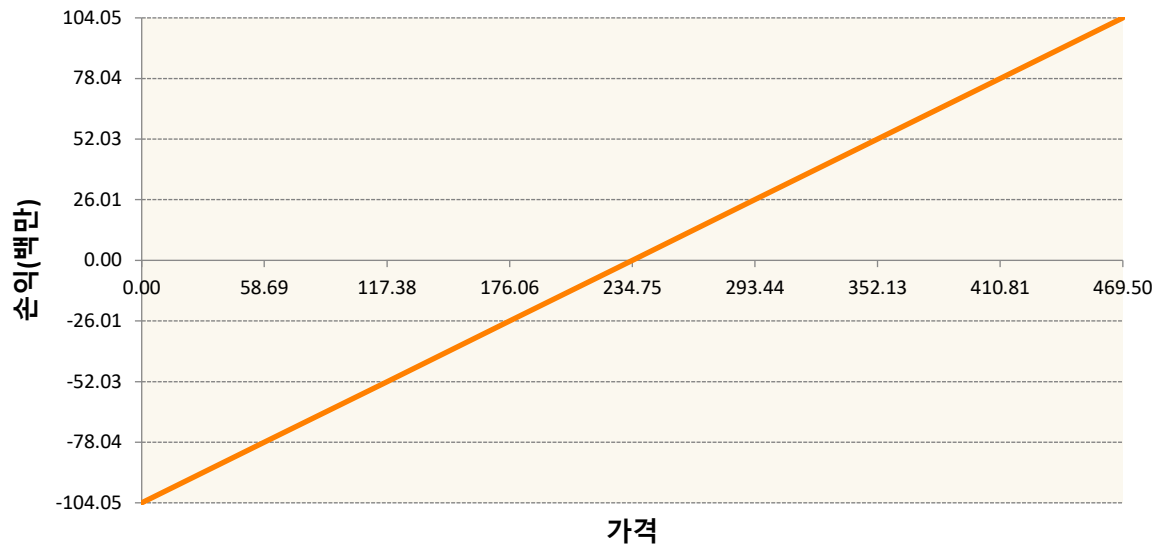
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	576	0	576	

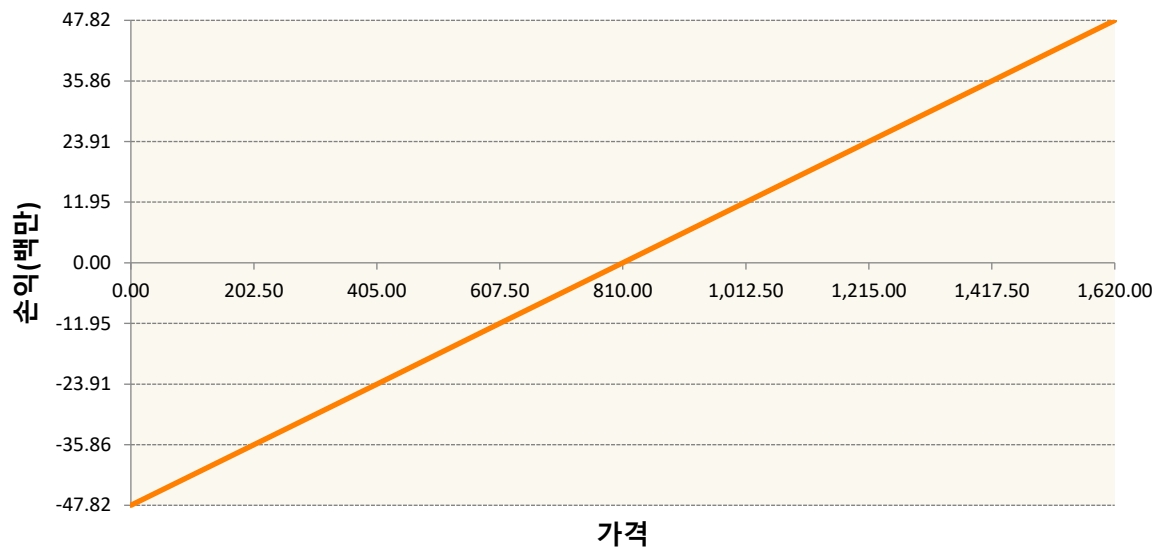
2. 만기시점의 손익구조



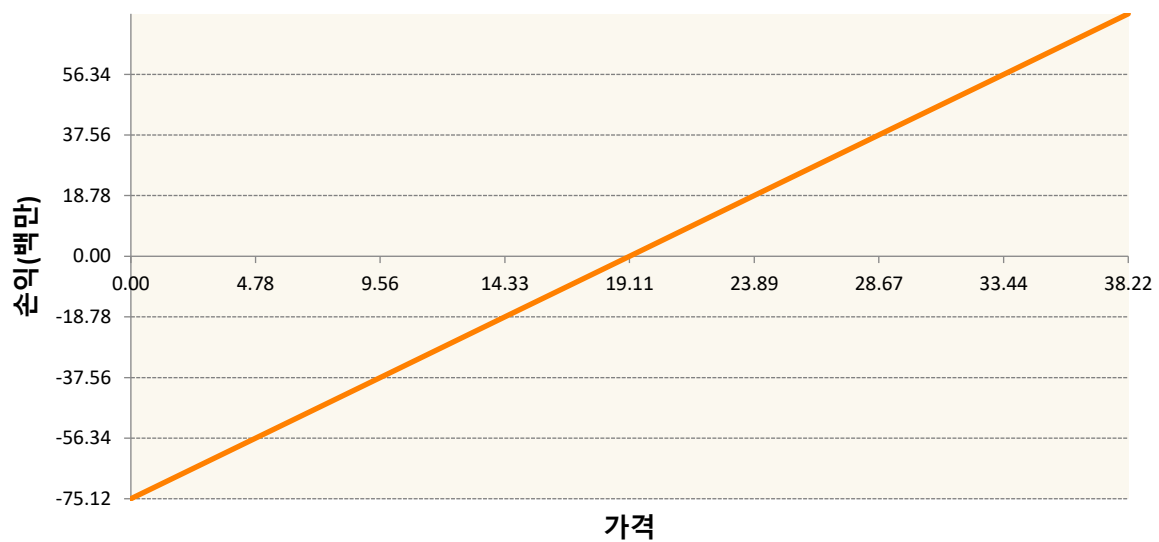
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



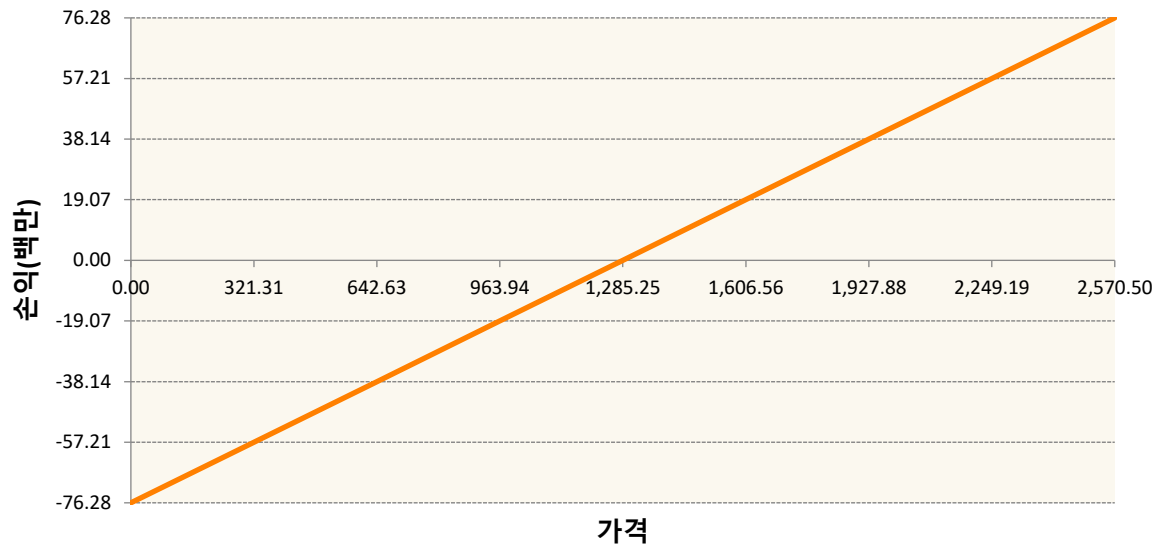
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



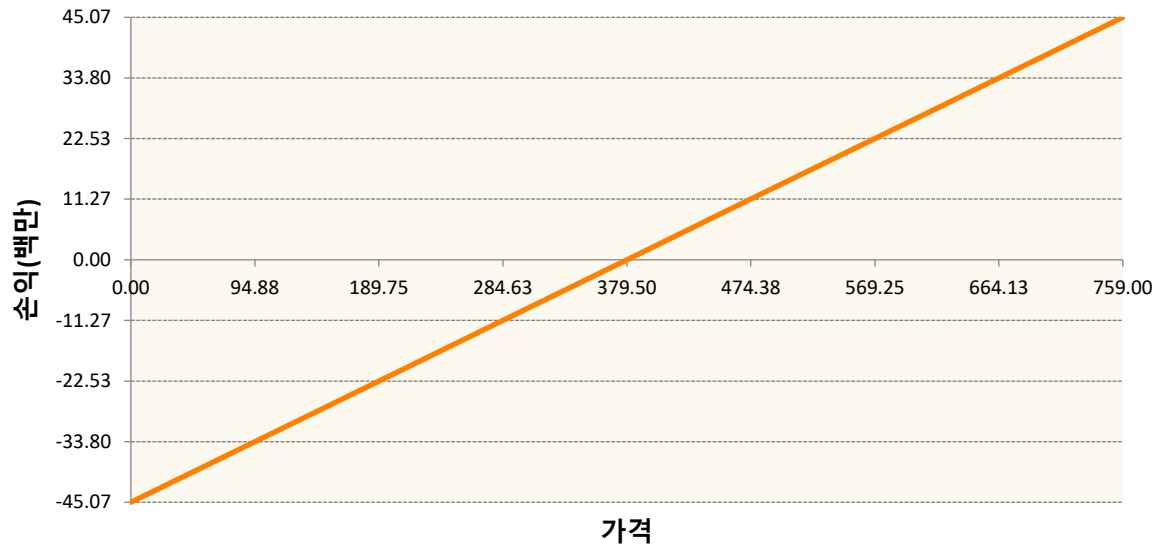
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



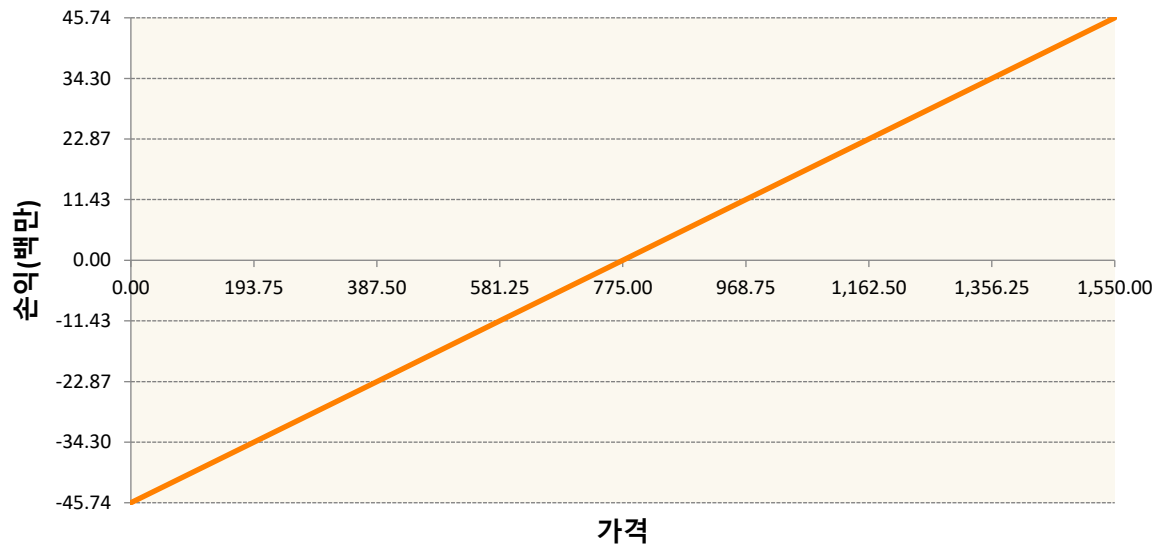
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	8
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22	8
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22	4
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22	6
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22	6
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22	4
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22	4

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

66

