

공시일 2021-11-24

기준일 2021-11-23

포커스농산물모(채권-파생형)

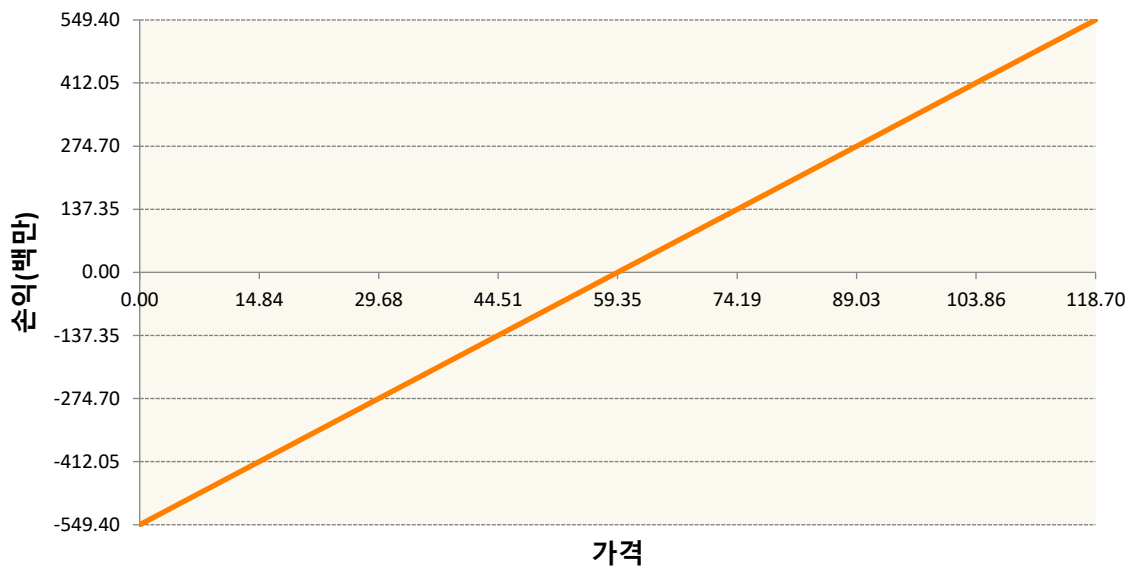
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

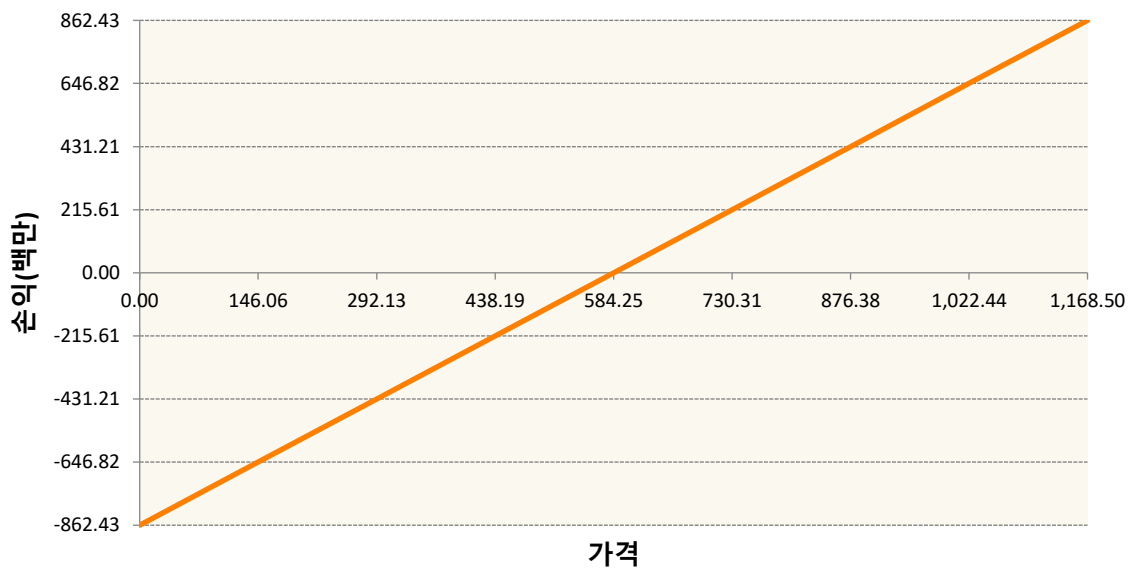
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,778	536	4,243	

2. 만기시점의 손익구조

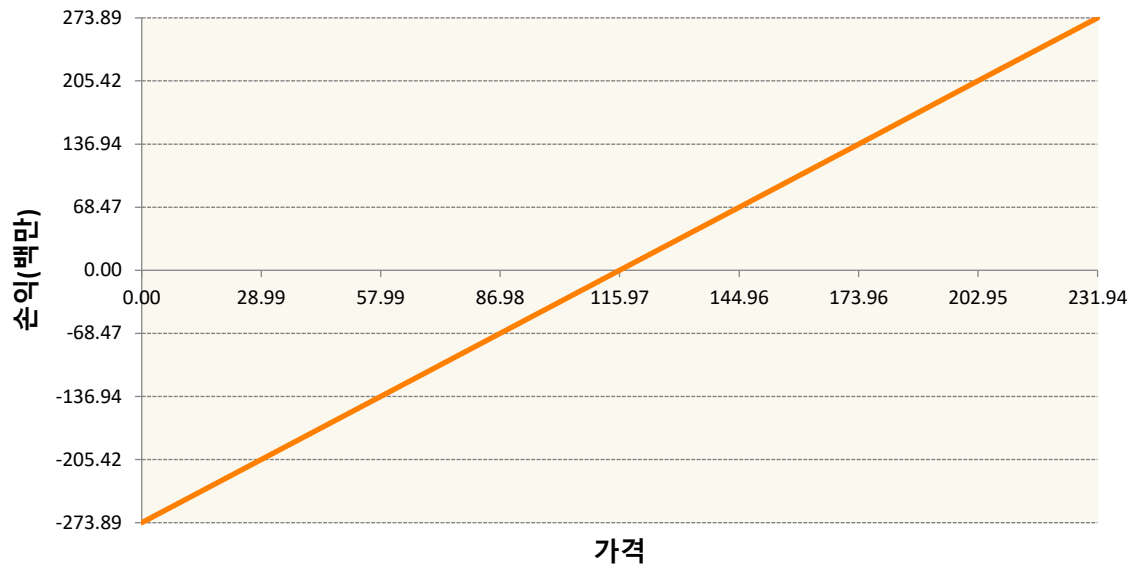
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



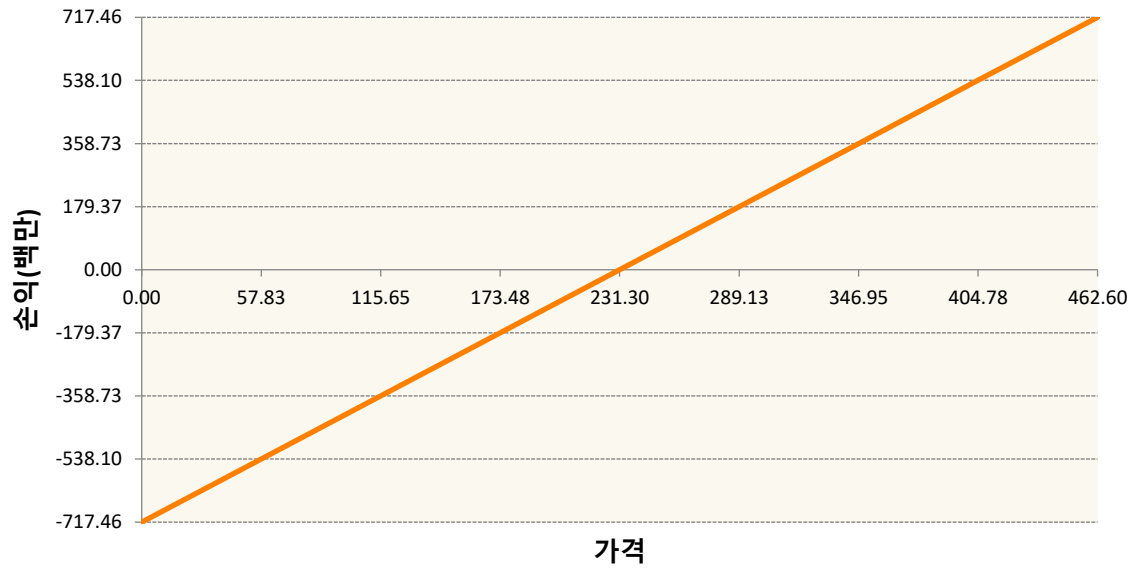
CH2-CORN FUTURE Mar22



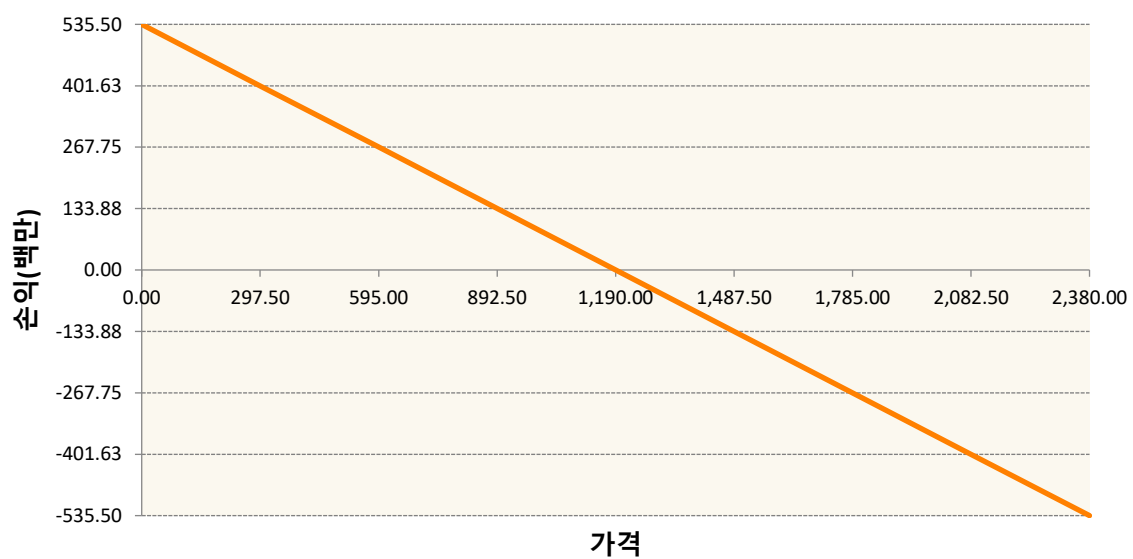
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



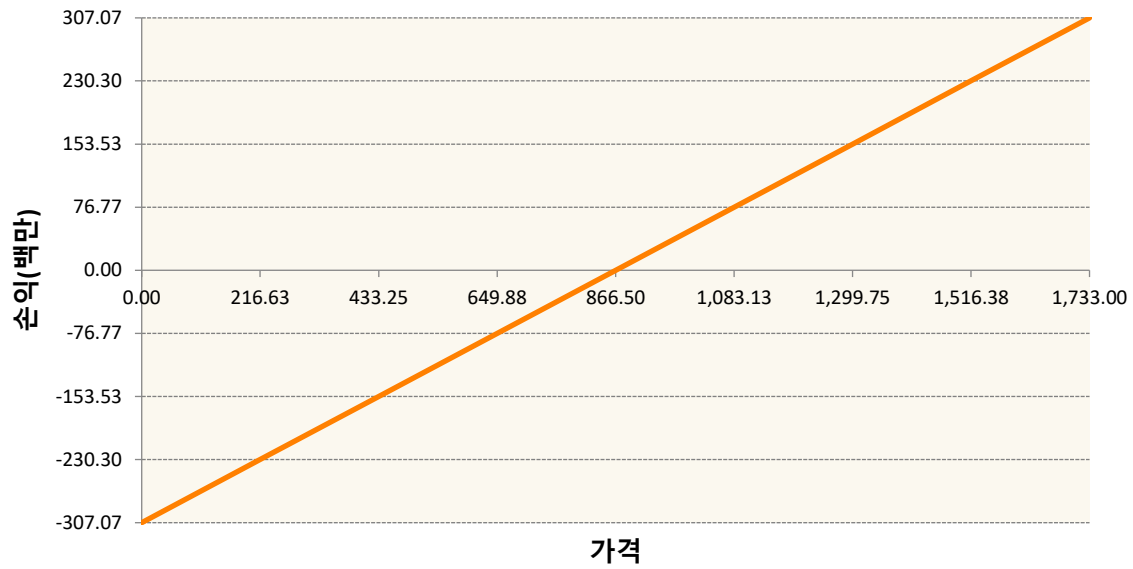
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



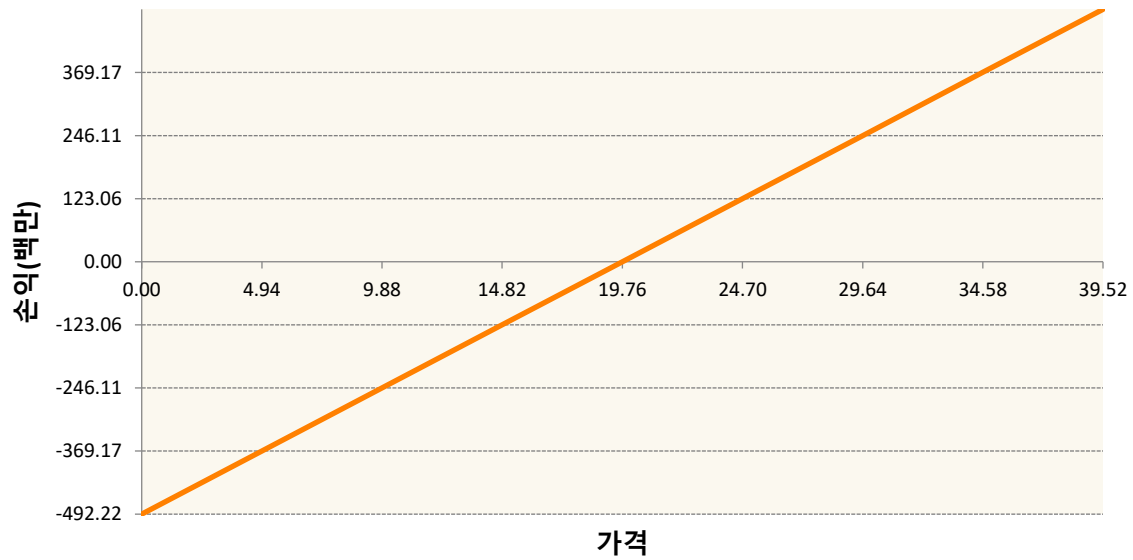
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



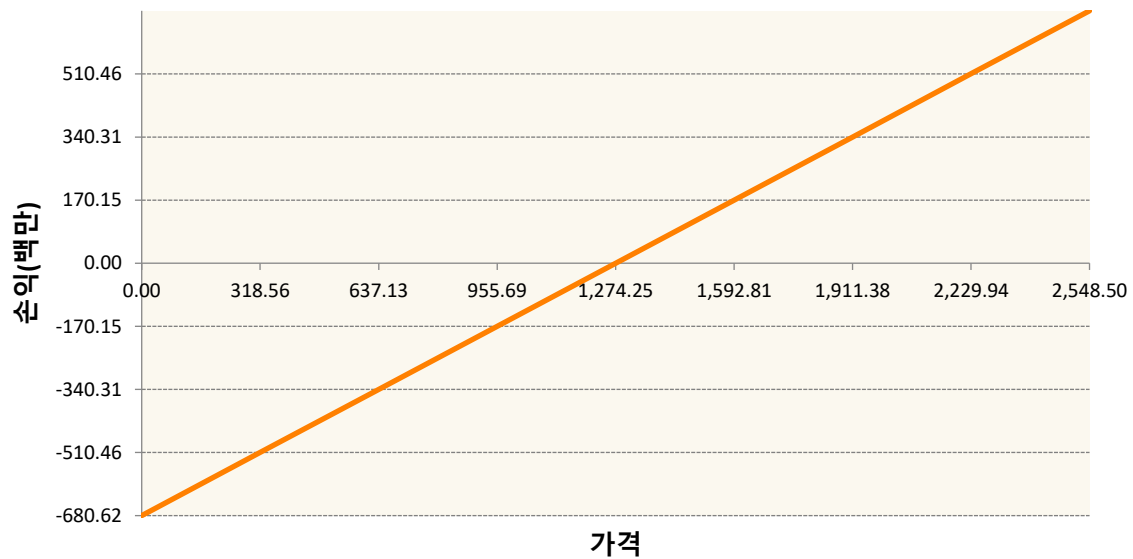
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



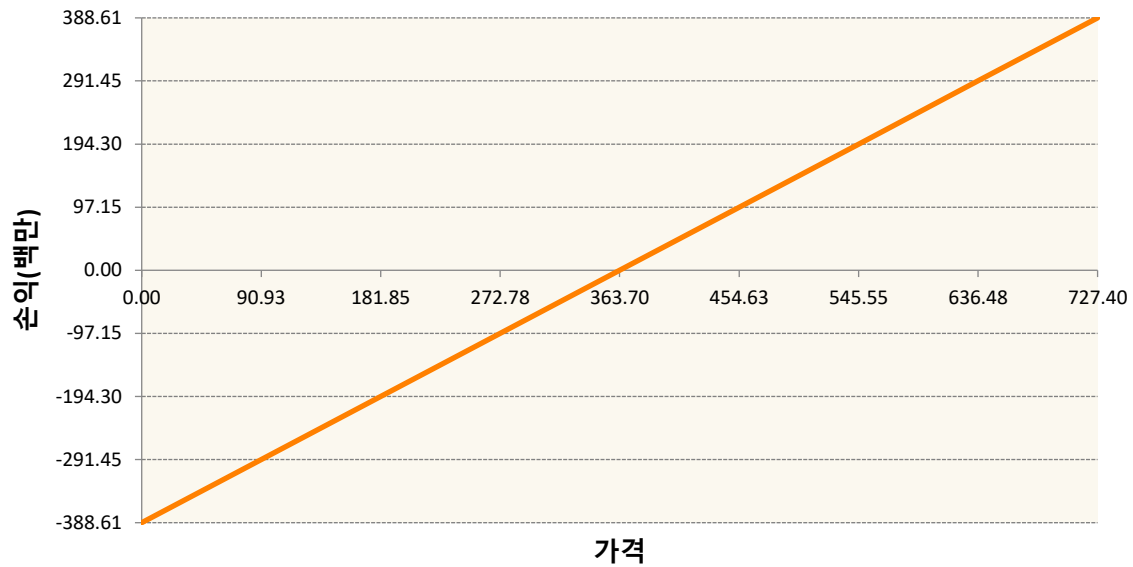
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



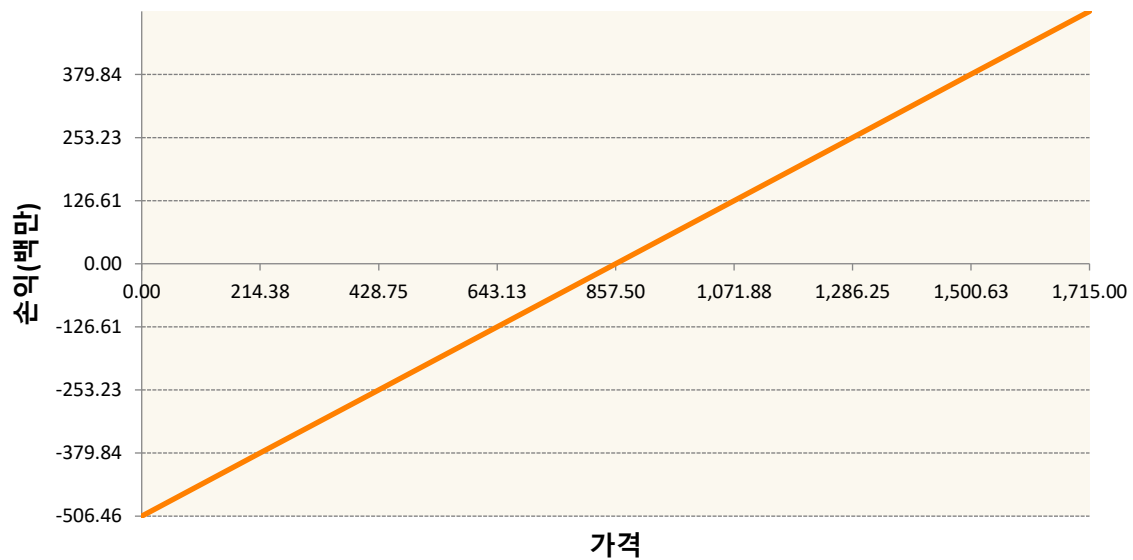
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



SMF2-SOYBEAN MEAL FUTR Jan22



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 2021-11-24

기준일 2021-11-23

스마트인덱스모

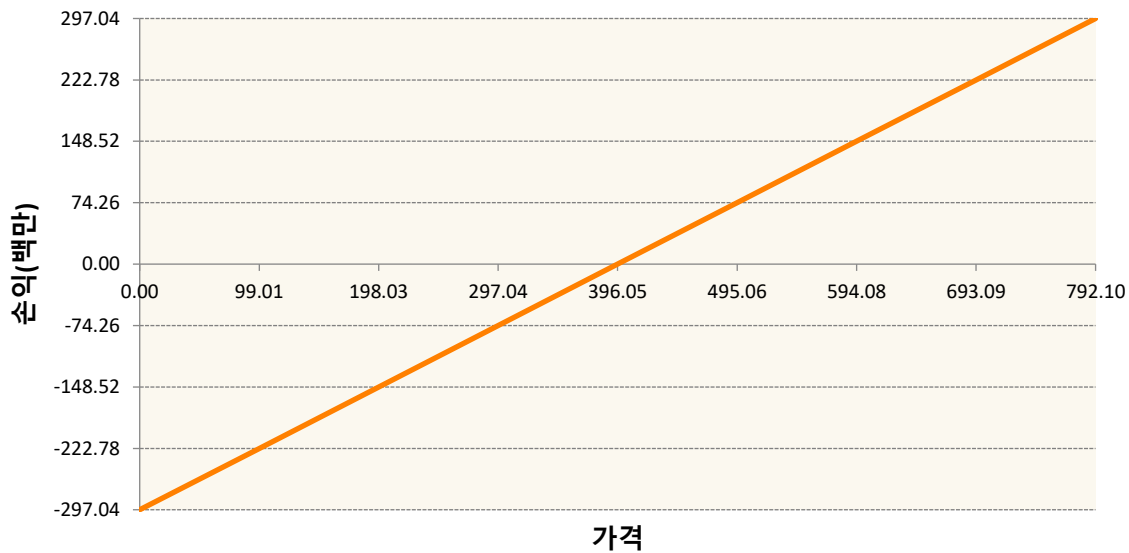
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	297	0	297	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101RC0000			2021-12 코스피200지수선물					24
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24	
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	
5.33%	16	16	16	16	16	16	16	
8.00%	24	24	24	24	24	24	24	

공시일	2021-11-24
기준일	2021-11-23

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	11,122	0	11,122	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20210825

918

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

534

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-11-24
기준일	2021-11-23

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	5,623	0	5,623	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래210913

436

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

429

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-11-24
기준일	2021-11-23

유로인덱스모(주식-파생형)

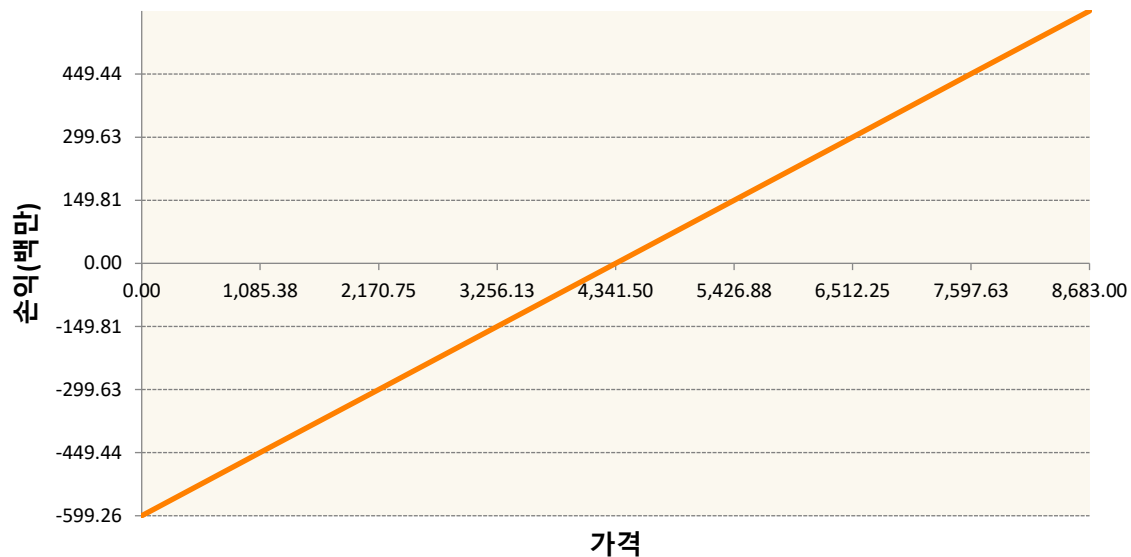
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	599	0	599	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ1-EURO STOXX 50 Dec21



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ1	EURO STOXX 50 Dec21	48
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2021-11-24
기준일	2021-11-23

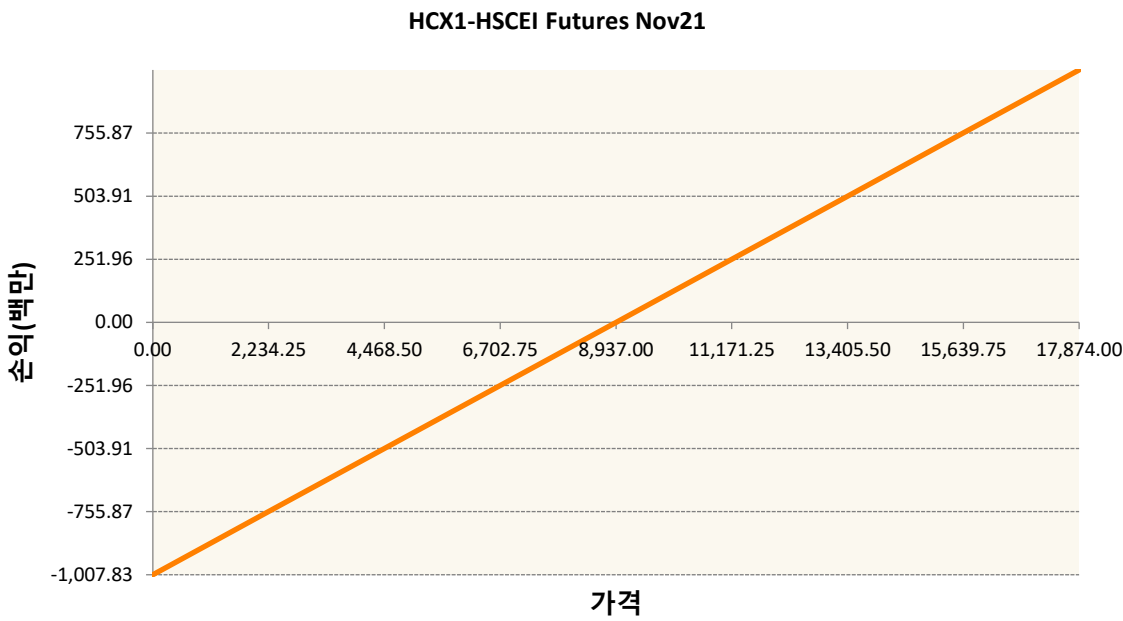
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,008	0	1,008	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX1	HSCEI Futures Nov21	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

85

공시일 2021-11-24

기준일 2021-11-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

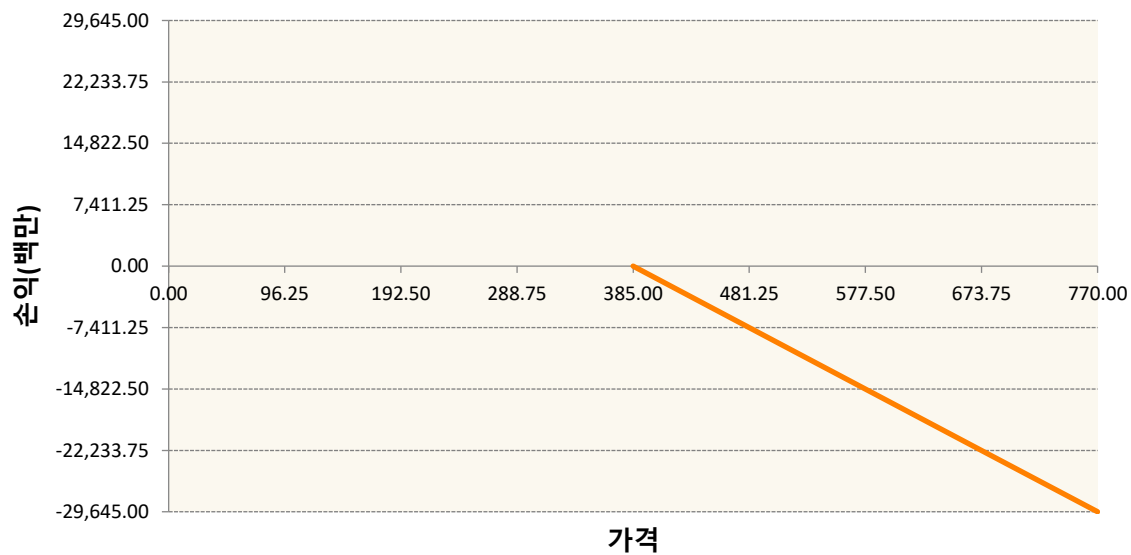
1. 계약금액

(단위:백만원)

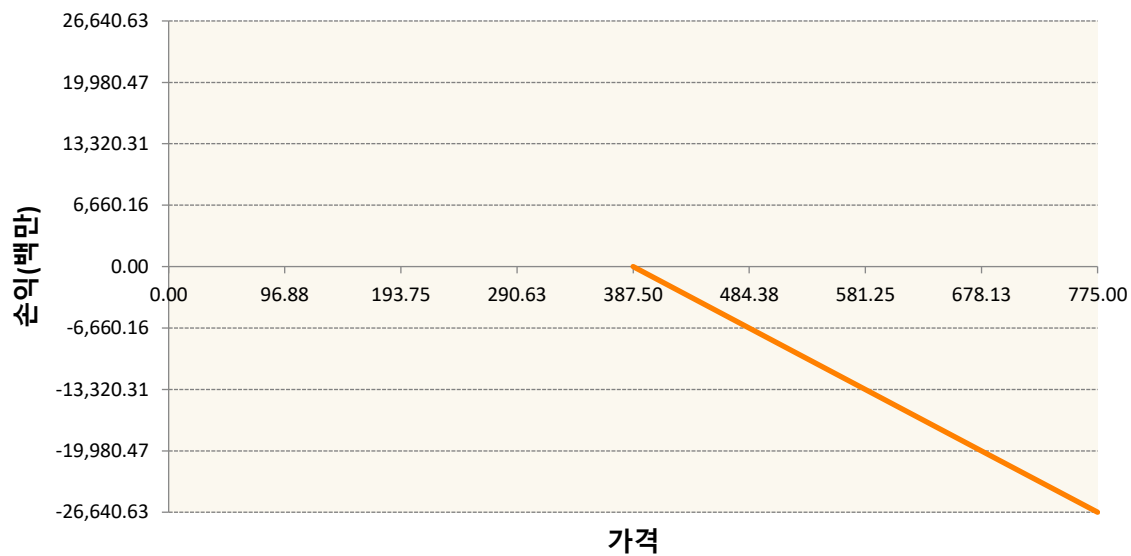
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,517	-76,517	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201RC3854-2021-12 콜385



KR4201RC3870-2021-12 콜387.5



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). A solid orange line shows a linear increase in net income as price increases, starting from a negative value at zero price and reaching zero net income at a price of 385.00.

가격 (Price)	순이익(백만원) (Net Income)
0.00	-17,325.00
96.25	-12,993.75
192.50	-8,662.50
288.75	-4,331.25
385.00	0.00

The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions). The line starts at a price of 0.00 with a profit of -2,906.25 and increases linearly to a profit of 0 at a price of 387.50. This point represents the break-even price.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-2,906.25
387.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201RC3854						2021-12 콜385		2,192
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,122	1,099	1,073	1,044	1,012	978	942	
-5.33%	984	941	896	850	804	756	708	
-2.67%	665	612	559	506	454	401	348	
0%	132	90	46	0	-47	-94	-143	
2.67%	-562	-585	-612	-642	-675	-711	-749	
5.33%	-1,338	-1,347	-1,359	-1,375	-1,394	-1,416	-1,441	
8.00%	-2,142	-2,145	-2,149	-2,156	-2,165	-2,177	-2,192	
KR4201RC3870						2021-12 콜387.5		1,912
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	898	882	862	839	814	786	757
-5.33%	802	767	731	692	653	613	571
-2.67%	560	513	466	419	371	324	277
0%	128	86	44	0	-44	-89	-134
2.67%	-463	-488	-516	-547	-580	-615	-652
5.33%	-1,143	-1,154	-1,168	-1,185	-1,205	-1,228	-1,253
8.00%	-1,858	-1,861	-1,866	-1,874	-1,884	-1,897	-1,912
KR4301RC3853 2021-12 풋385							886

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-853	-856	-859	-864	-870	-877	-886
-5.33%	-411	-424	-437	-452	-467	-482	-498
-2.67%	-95	-115	-134	-154	-174	-194	-213
0%	38	26	14	0	-14	-30	-45
2.67%	65	62	58	53	47	40	31
5.33%	67	67	66	65	64	61	58
8.00%	67	67	67	67	67	66	65
KR4301RC3879 2021-12 풋387.5							160

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-156	-157	-157	-158	-158	-159	-160
-5.33%	-81	-82	-84	-86	-88	-90	-93
-2.67%	-21	-25	-28	-31	-34	-38	-41
0%	8	5	3	0	-3	-6	-8
2.67%	15	14	13	12	11	9	7
5.33%	16	15	15	15	15	14	13
8.00%	16	16	16	15	15	15	15

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

(단위:백만원)

5,274

공시일 2021-11-24

기준일 2021-11-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

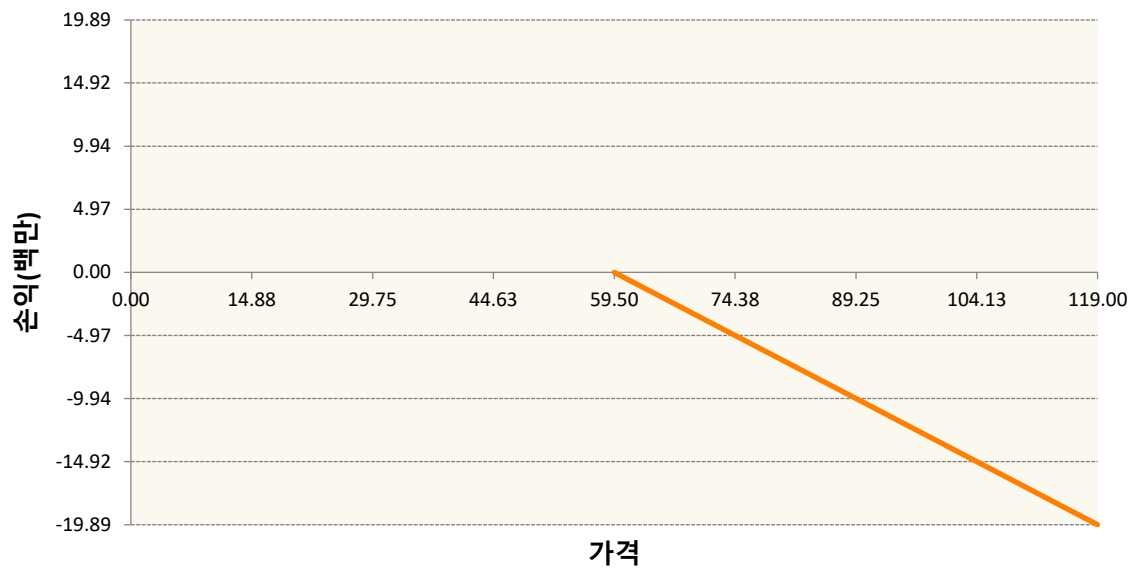
1. 계약금액

(단위:백만원)

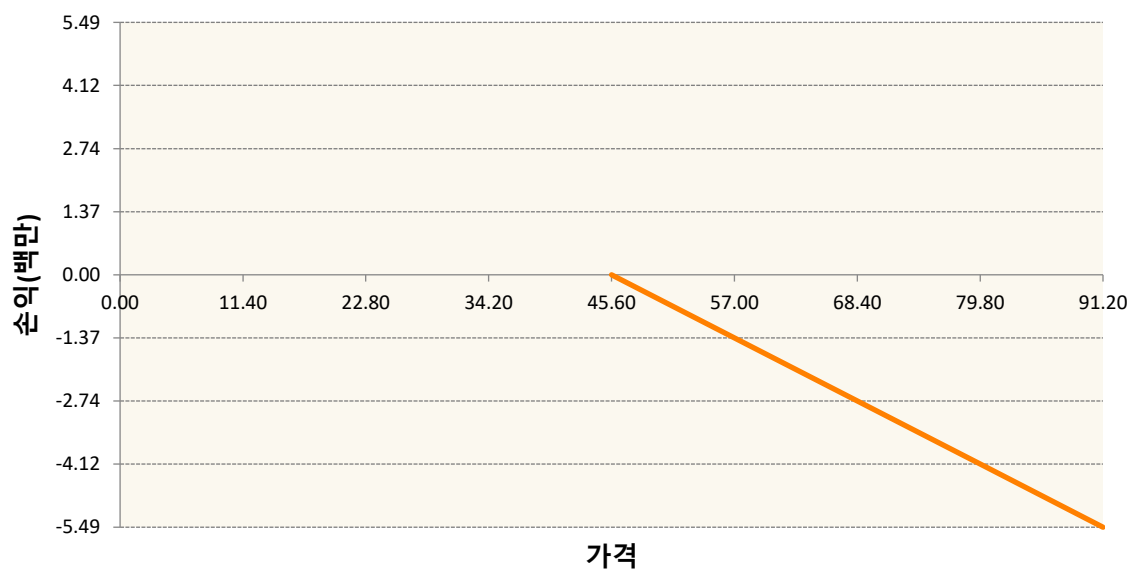
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	60	-60	장내

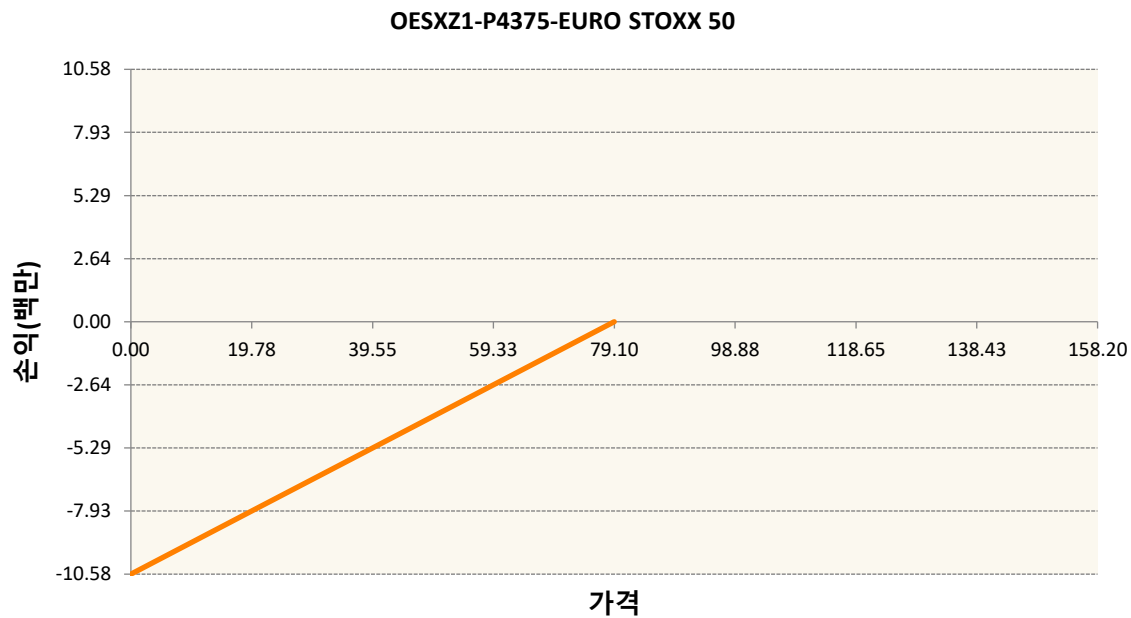
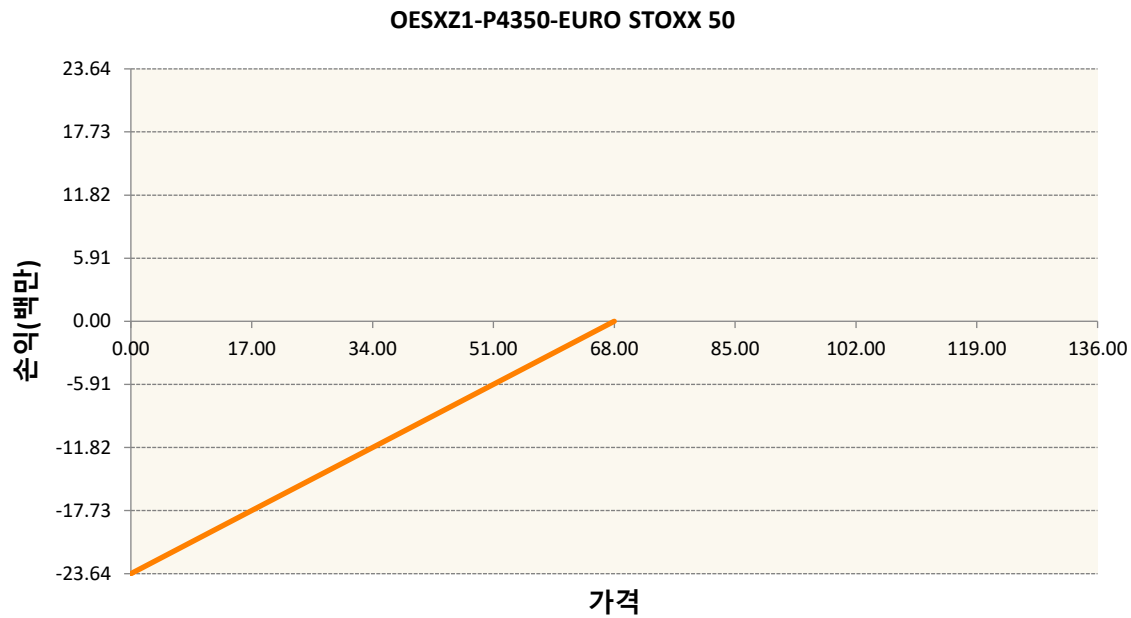
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		13
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		2
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.44
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		2
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		1

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

공시일 2021-11-24

기준일 2021-11-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

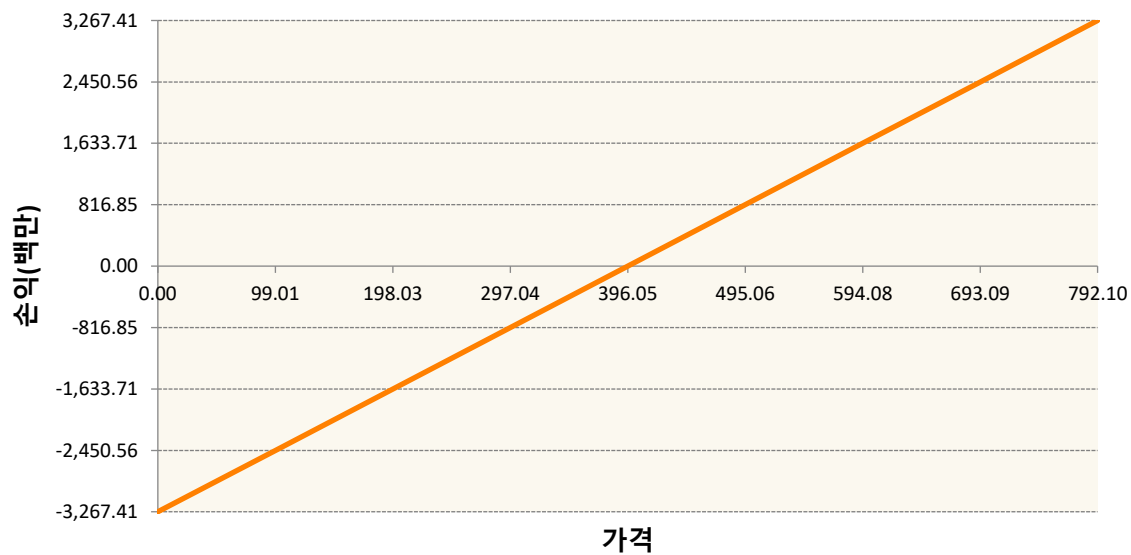
1. 계약금액

(단위:백만원)

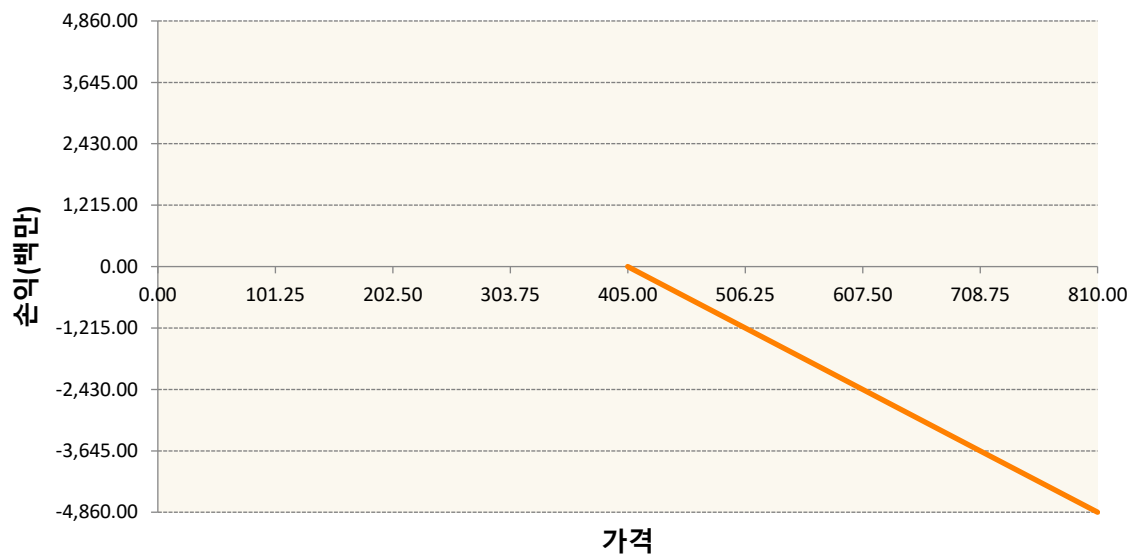
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,267	0	3,267	장내
누계	유가증권	옵션	579	5,369	-4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조

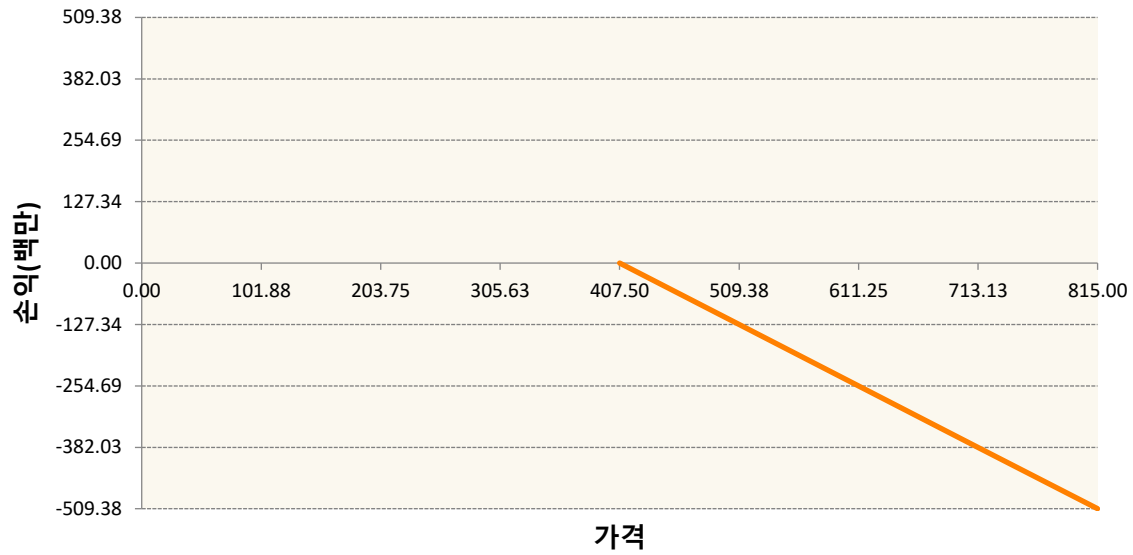
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



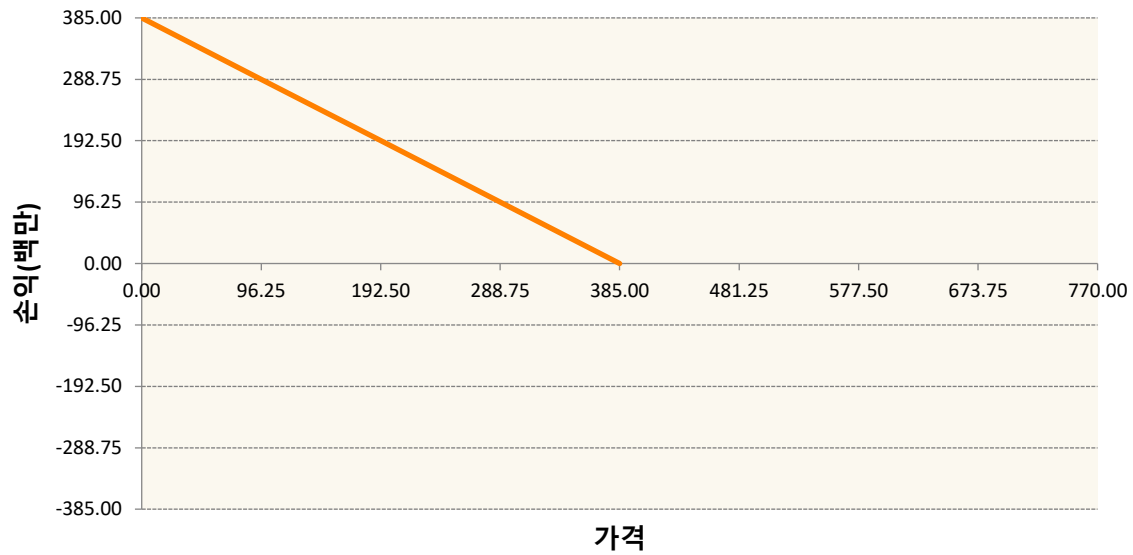
KR4201RC4050-2021-12 콜405



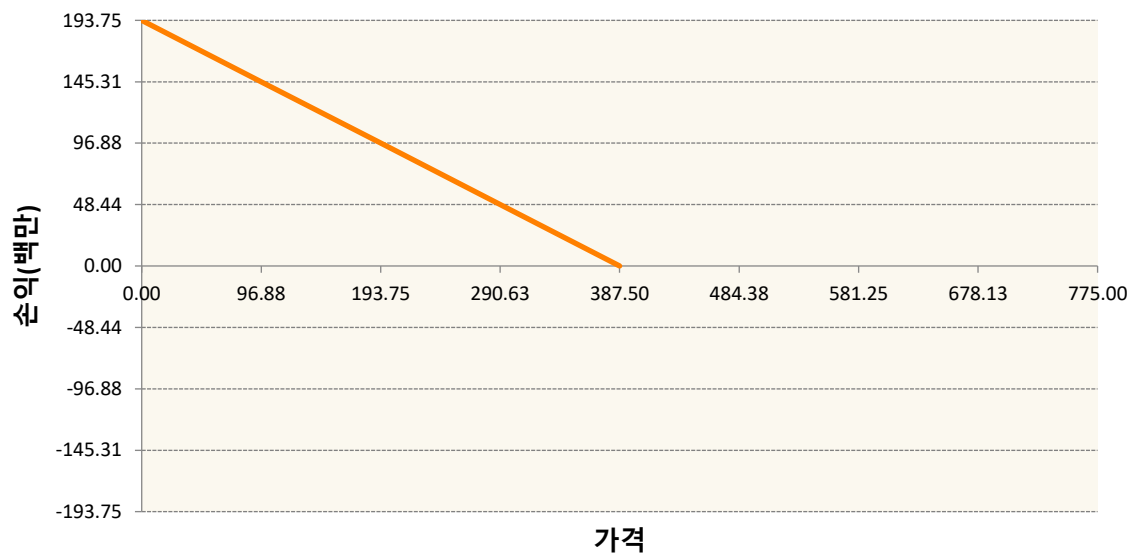
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



KR4301RC3853-2021-12 풋385



KR4301RC3879-2021-12 풋387.5



(단위:백만원)

KR4101RC0000							2021-12 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%	-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%	262	262	262	262	262	262	262	
KR4201RC4050							2021-12 콜405	255
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	58	57	56	55	53	51	
-5.33%	57	55	53	50	47	43	39	
-2.67%	48	44	39	34	28	22	16	
0%	23	15	8	0	-8	-16	-24	
2.67%	-31	-40	-48	-57	-65	-74	-83	
5.33%	-116	-123	-130	-137	-145	-153	-161	
8.00%	-225	-229	-233	-238	-243	-249	-255	
KR4201RC4076							2021-12 콜407.5	25
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5	
-5.33%	5	5	5	4	4	4	3	
-2.67%	4	4	4	3	3	2	1	
0%	2	2	1	0	-1	-2	-2	
2.67%	-3	-4	-4	-5	-6	-7	-8	
5.33%	-11	-12	-12	-13	-14	-15	-16	
8.00%	-22	-22	-23	-23	-24	-24	-25	
KR4301RC3853							2021-12 풋385	20
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	19	19	19	19	20	
-5.33%	9	9	10	10	10	11	11	
-2.67%	2	3	3	3	4	4	5	
0%	-1	-1	0	0	0	1	1	
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
KR4301RC3879							2021-12 풋387.5	11
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	11	11	11	11
-5.33%	5	5	6	6	6	6	6
-2.67%	1	2	2	2	2	3	3
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

542

공시일	2021-11-24
기준일	2021-11-23

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	18,704	0	18,704	

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	2021-11-24
기준일	2021-11-23

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	9,757	0	9,757	

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	2021-11-24
기준일	2021-11-23

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	
누계	유가증권	수익증권	46,082	0	46,082	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

0

공시일 2021-11-24

기준일 2021-11-23

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

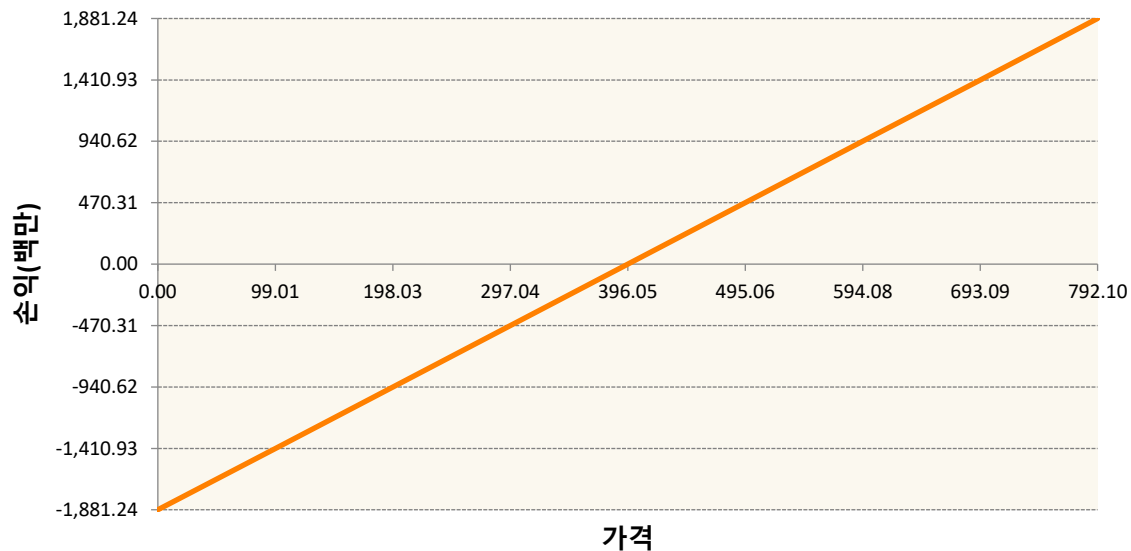
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,881	0	1,881	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



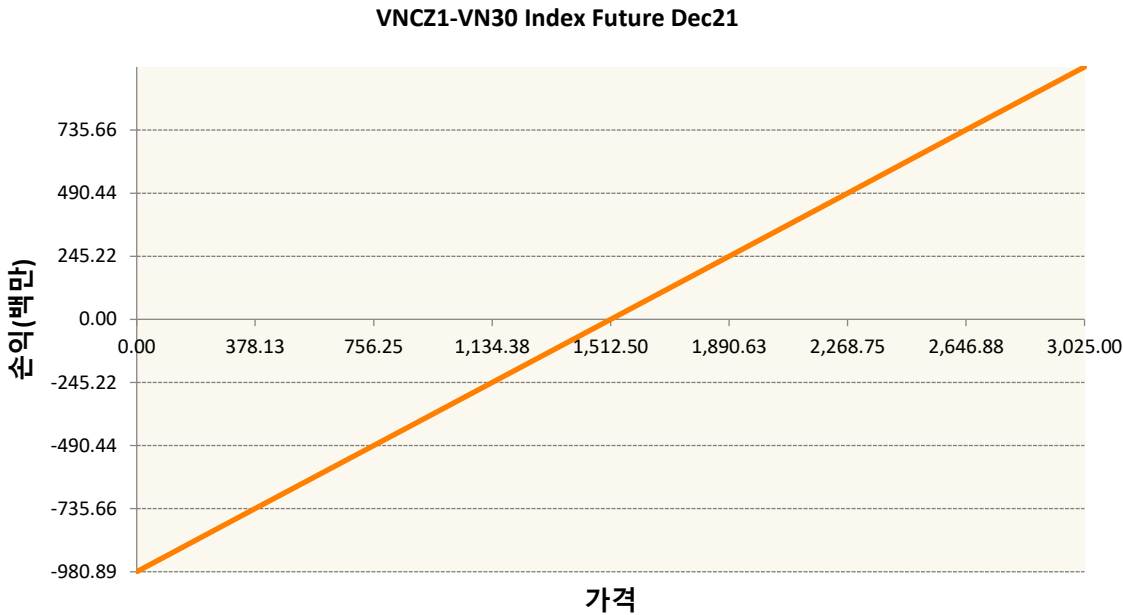
공시일	2021-11-24
기준일	2021-11-23

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
누계	유가증권	선물	981	0	981	
누계	유가증권	스왑	1,785	0	1,785	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)		
2.5504E+11	VN30TR Index(EUR)	143
VNCZ1	VN30 Index Future Dec21	78

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)	
	238

공시일 2021-11-24

기준일 2021-11-23

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

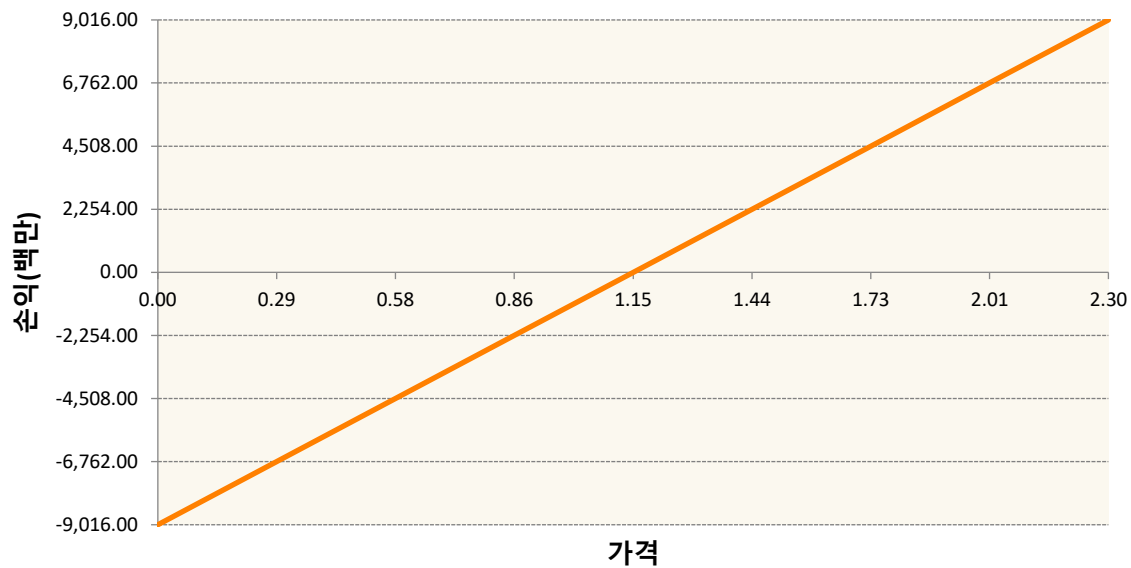
1. 계약금액

(단위:백만원)

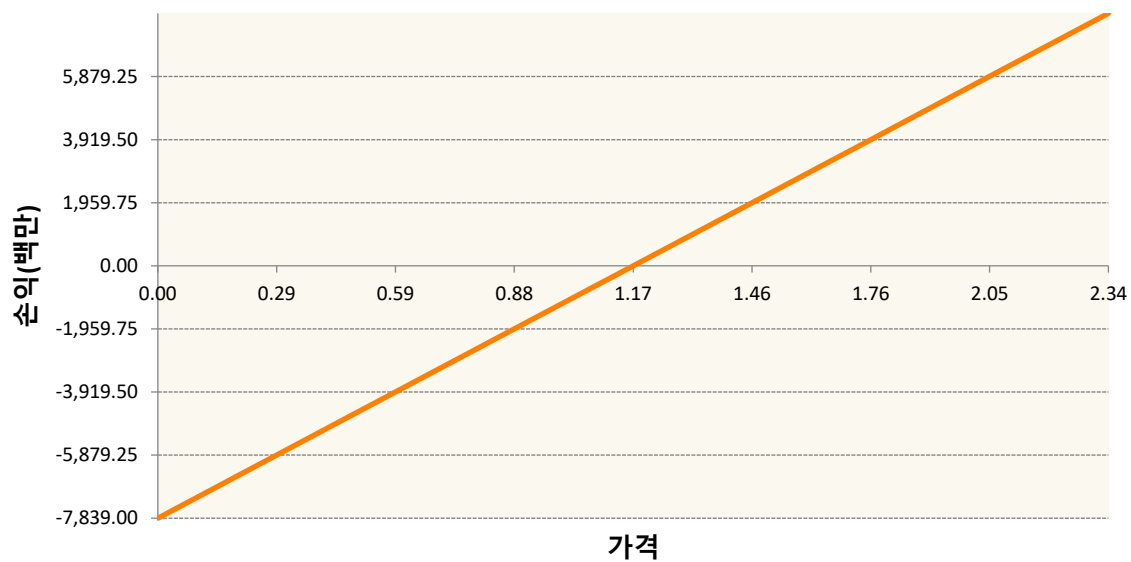
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	22,465	0	22,465	

2. 만기시점의 손익구조

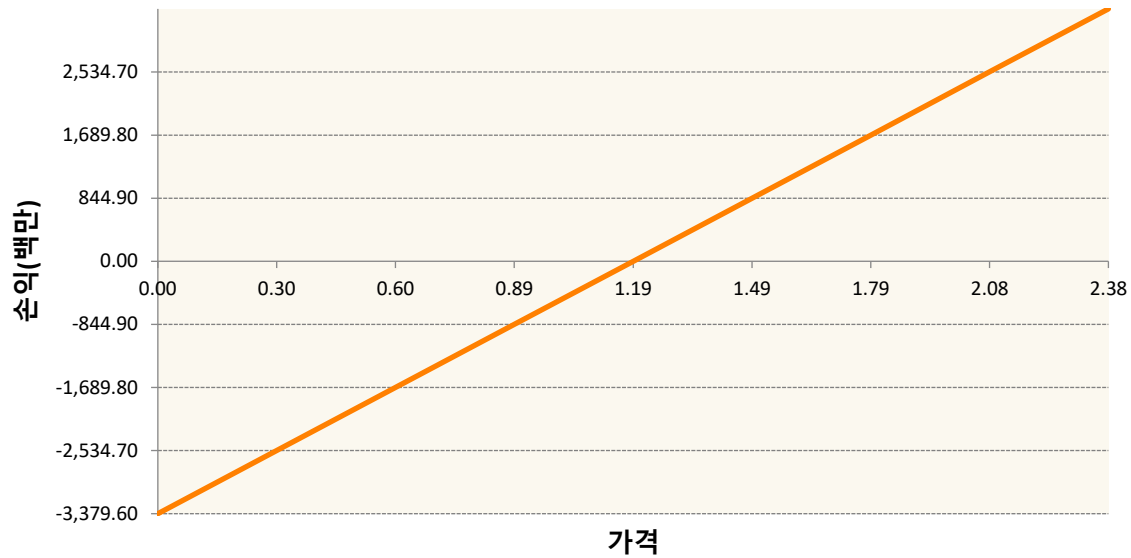
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



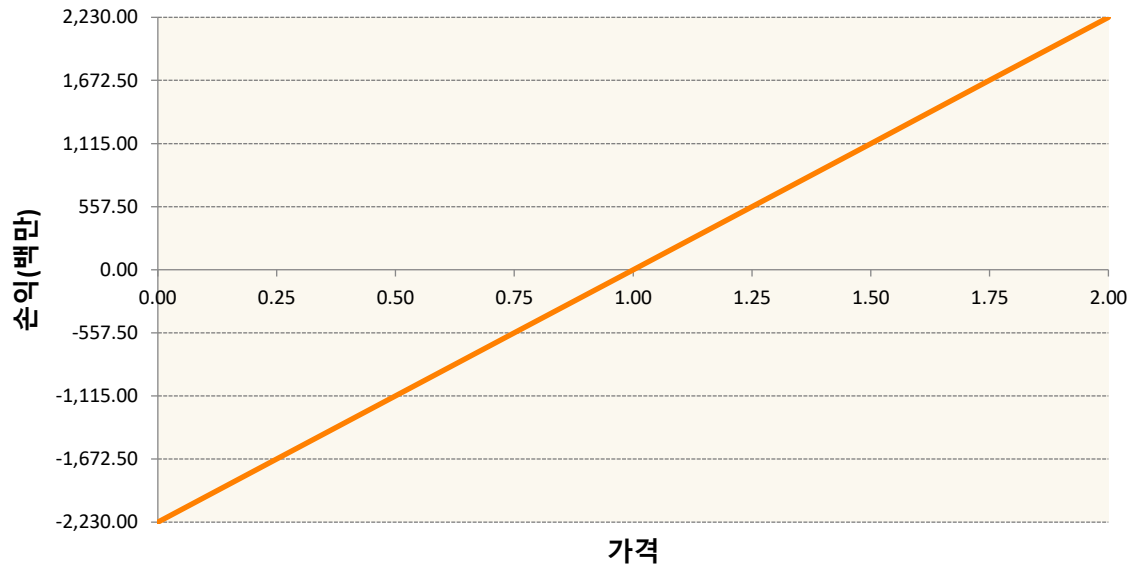
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	719
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	626
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	269
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	179

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

(단위:백만원)

2,715

공시일 2021-11-24

기준일 2021-11-23

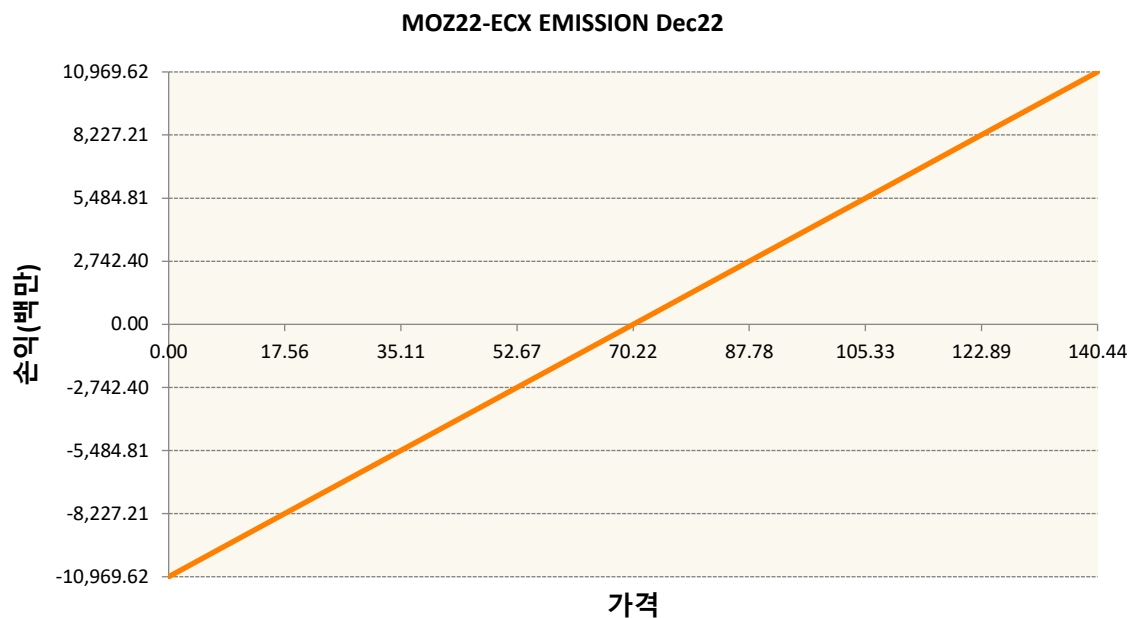
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,970	0	10,970	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

878

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

(단위:백만원)

1,770

공시일 2021-11-24

기준일 2021-11-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

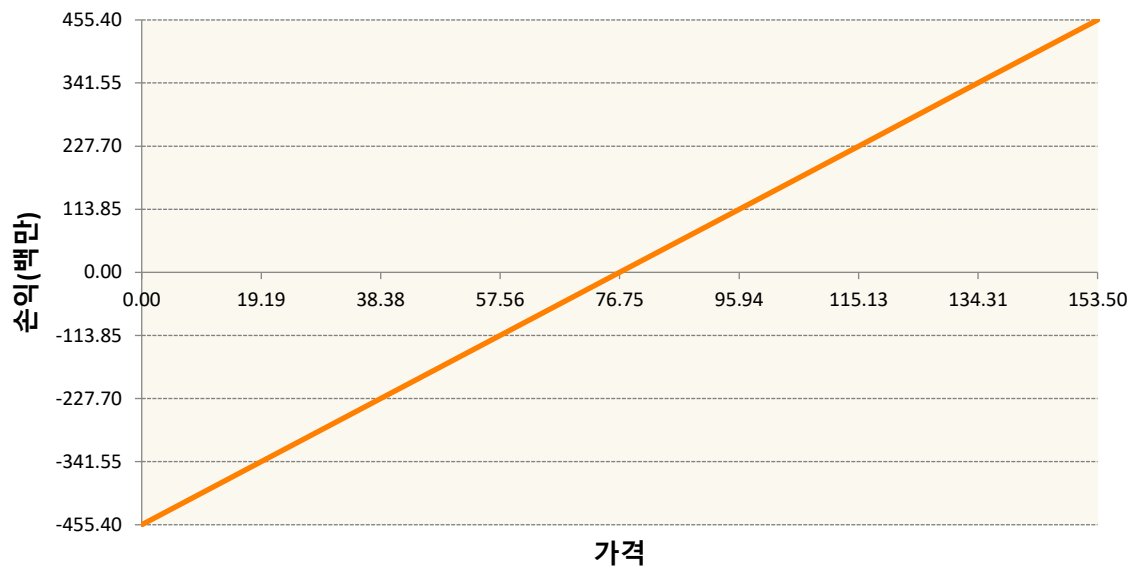
1. 계약금액

(단위:백만원)

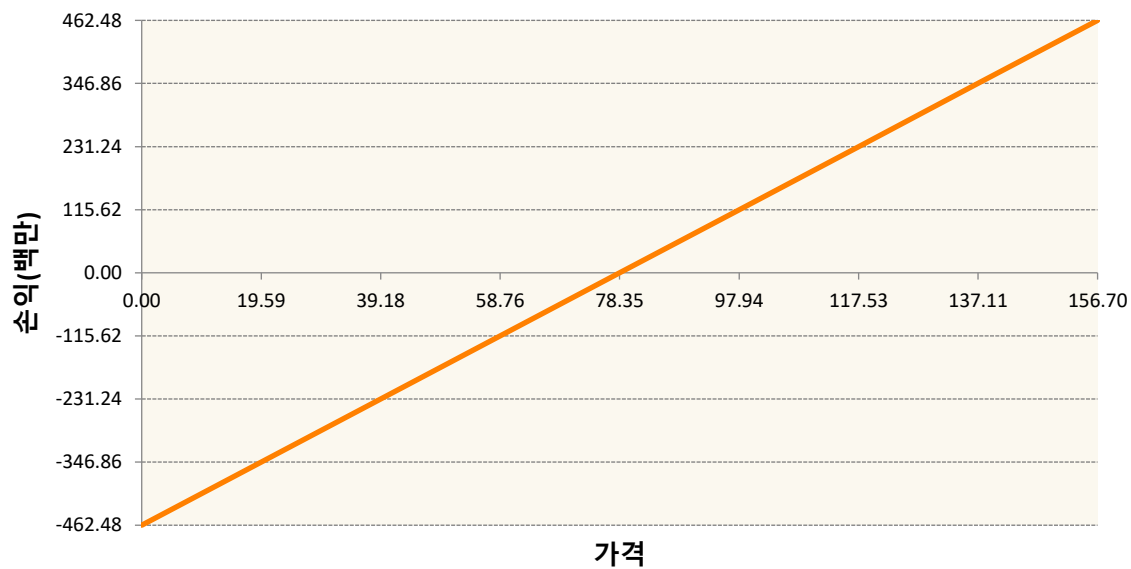
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,105	536	1,569	

2. 만기시점의 손익구조

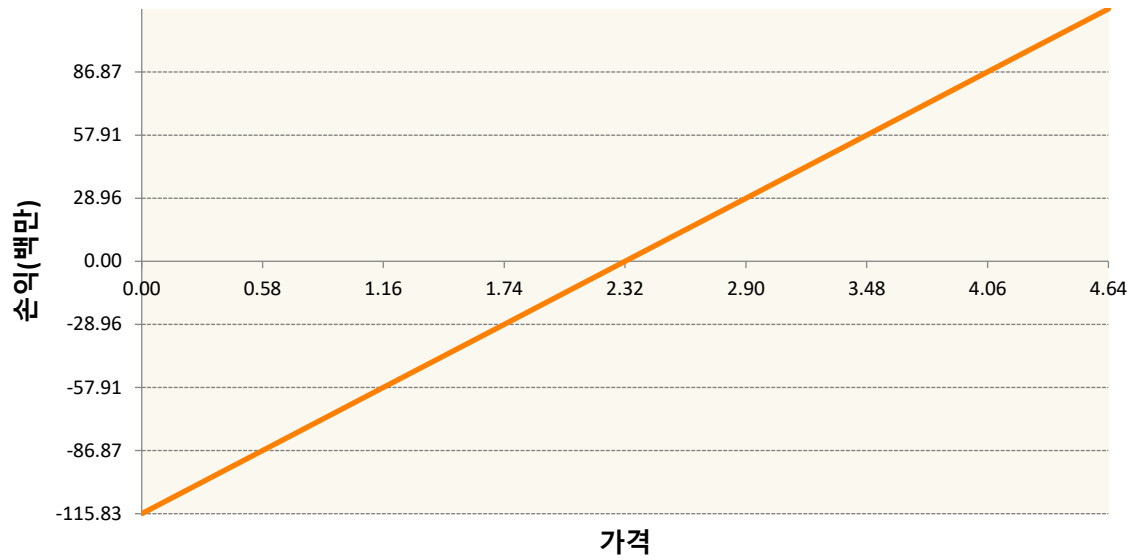
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



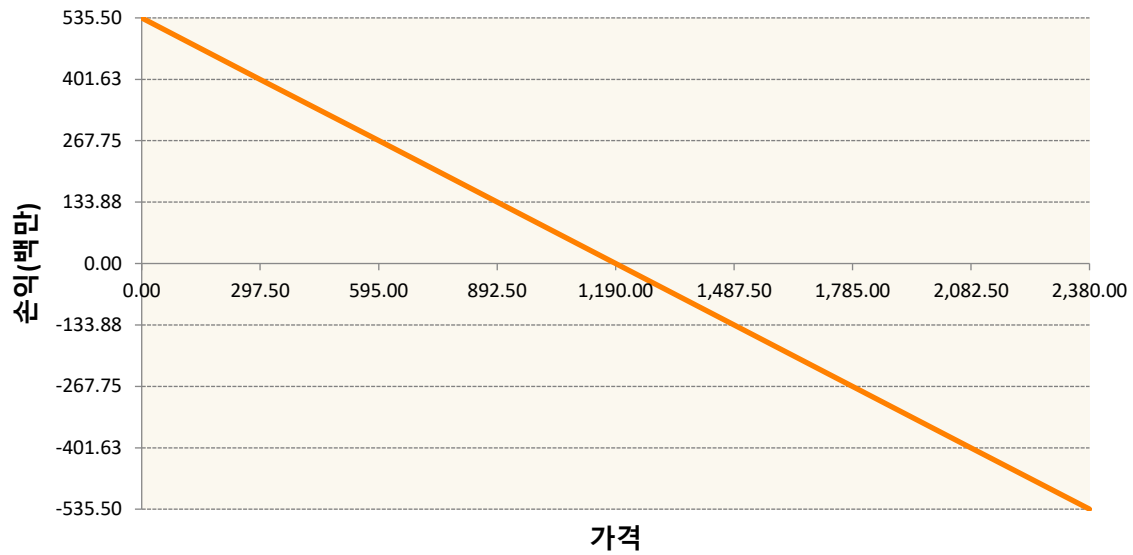
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



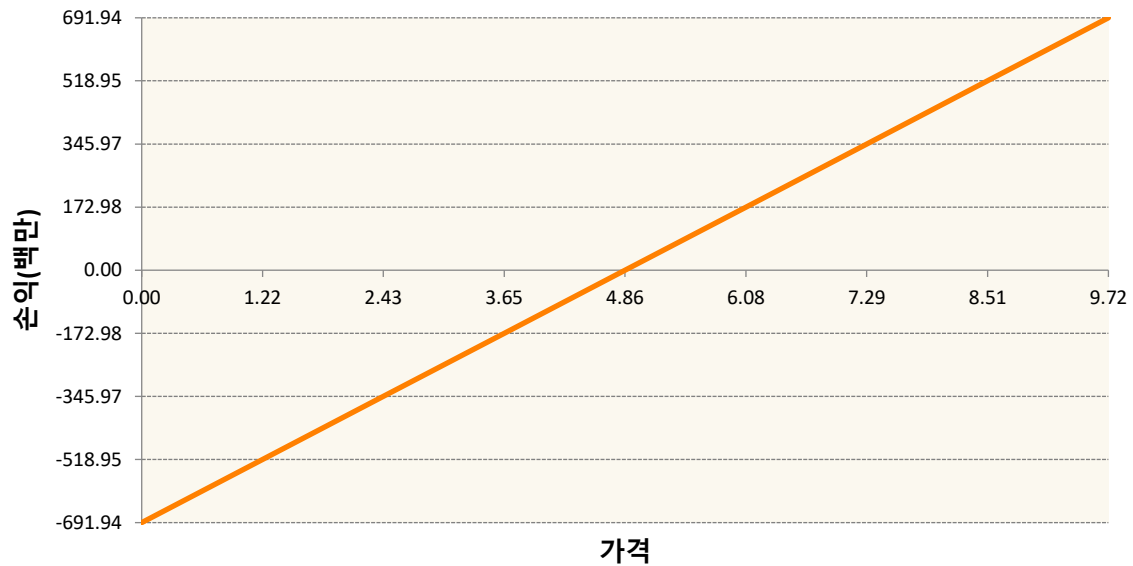
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22

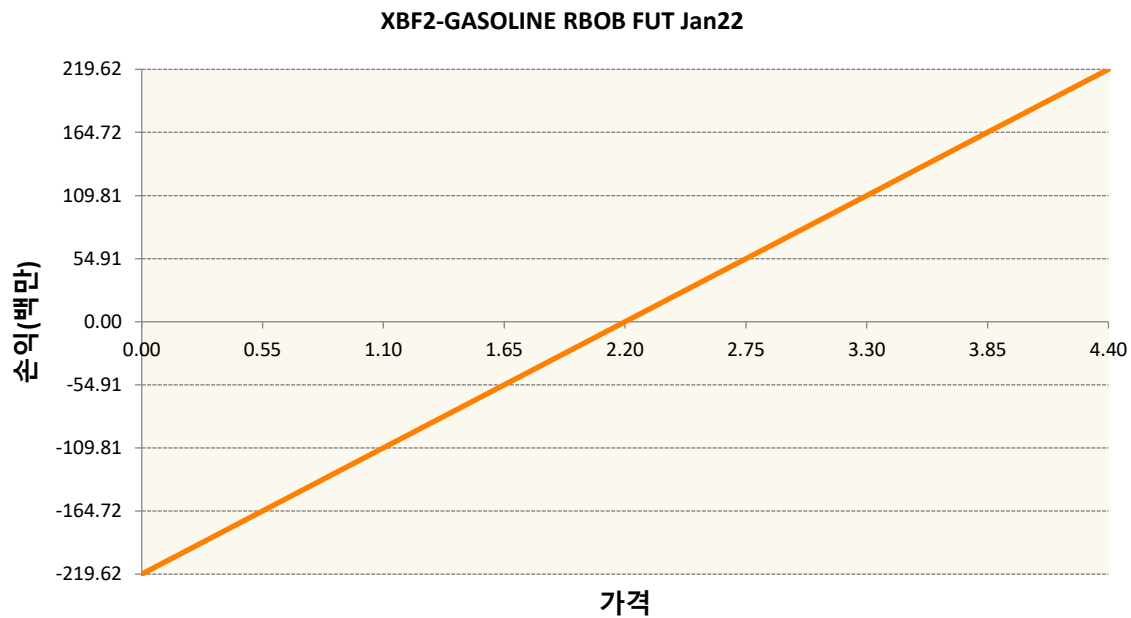
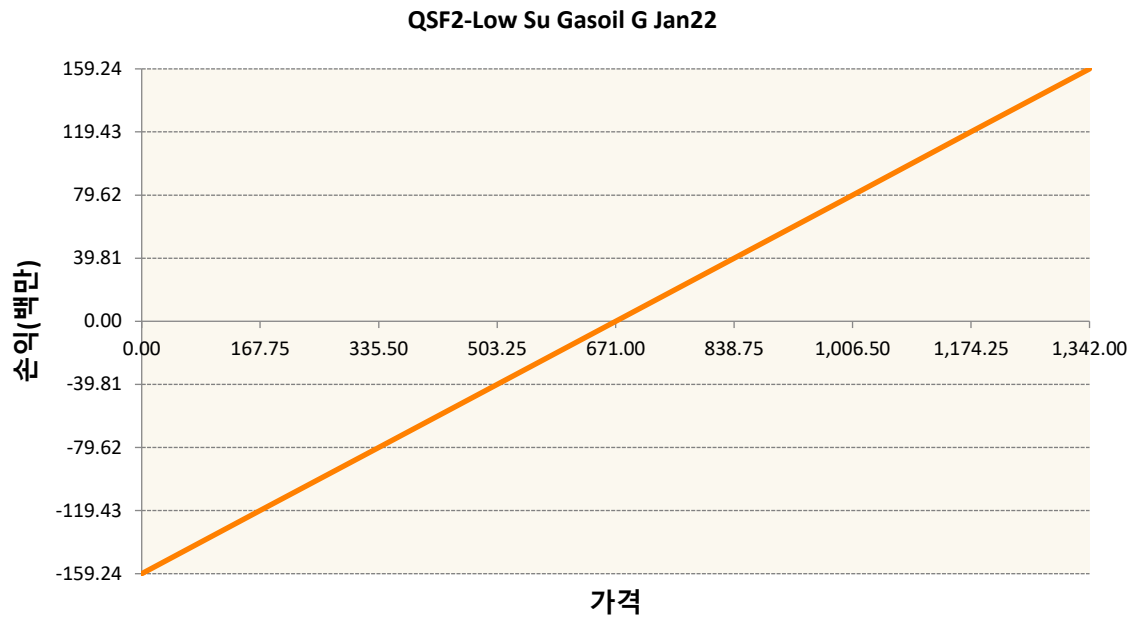


KR4175RC0001-2021-12 달러선물



NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLF2	WTI CRUDE FUTURE Jan22		36
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22		37
HOF2	NY Harb ULSD Fut Jan22		9
KR4175RC00 2021-12 달러선물			43
NGF22	NATURAL GAS FUTR Jan22		55
QSF2	Low Su Gasoil G Jan22		13
XBF2	GASOLINE RBOB FUT Jan22		18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		373

공시일 2021-11-24

기준일 2021-11-23

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

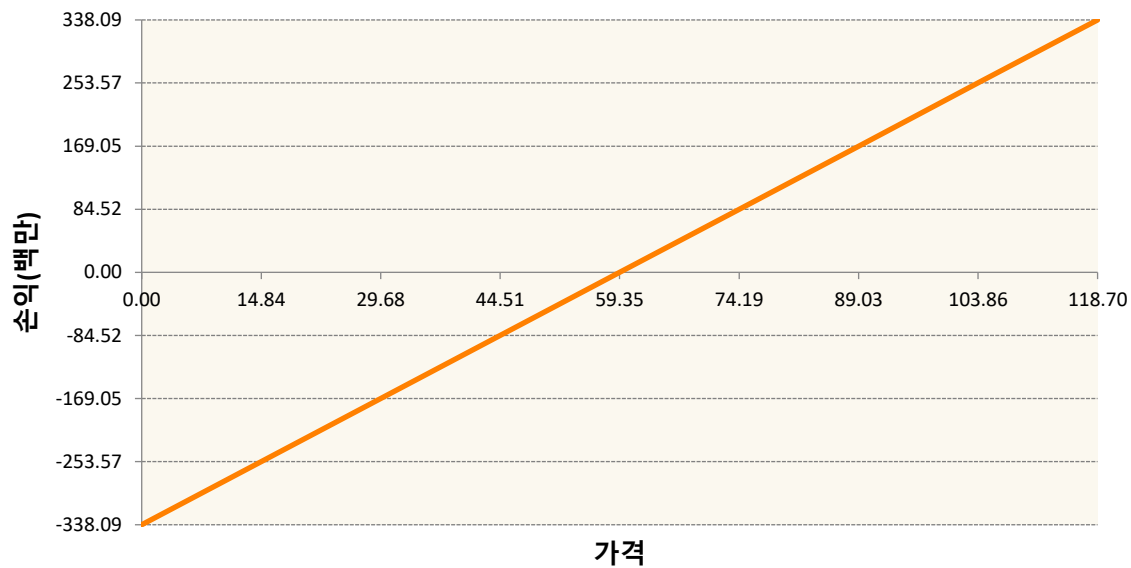
1. 계약금액

(단위:백만원)

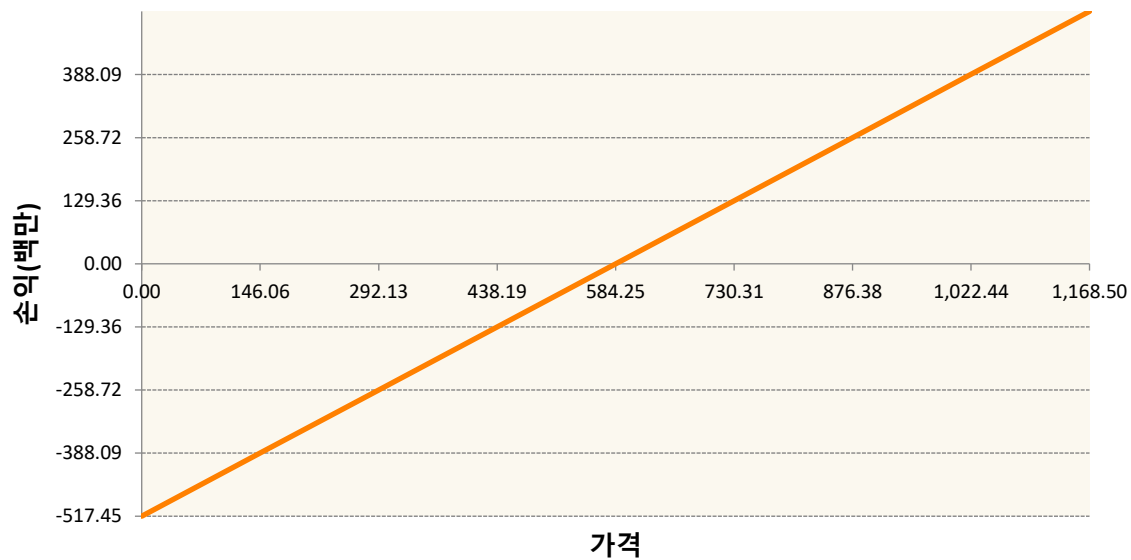
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,815	595	2,220	

2. 만기시점의 손익구조

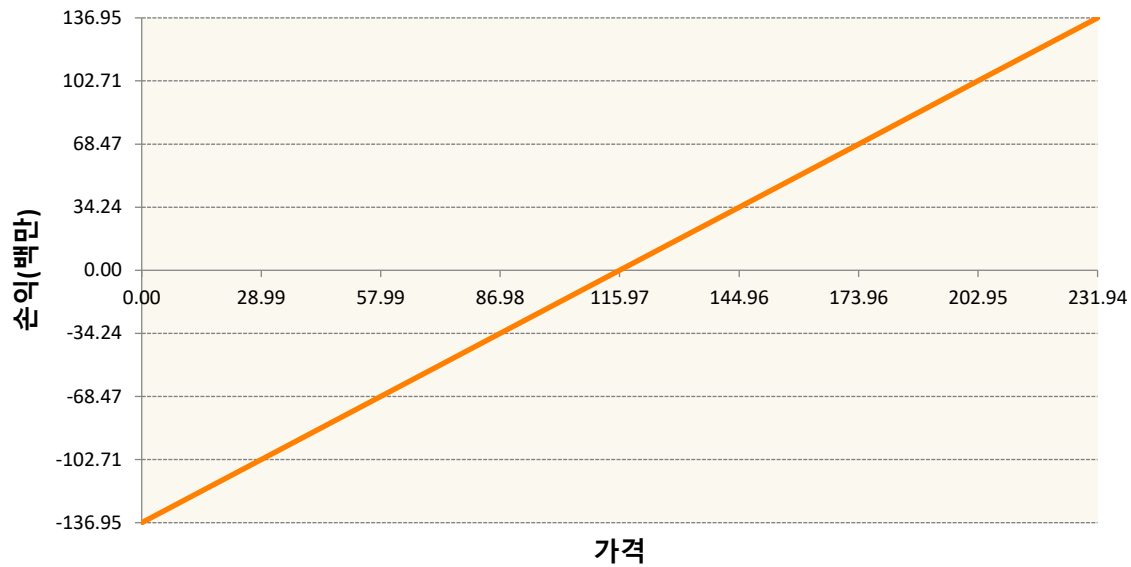
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



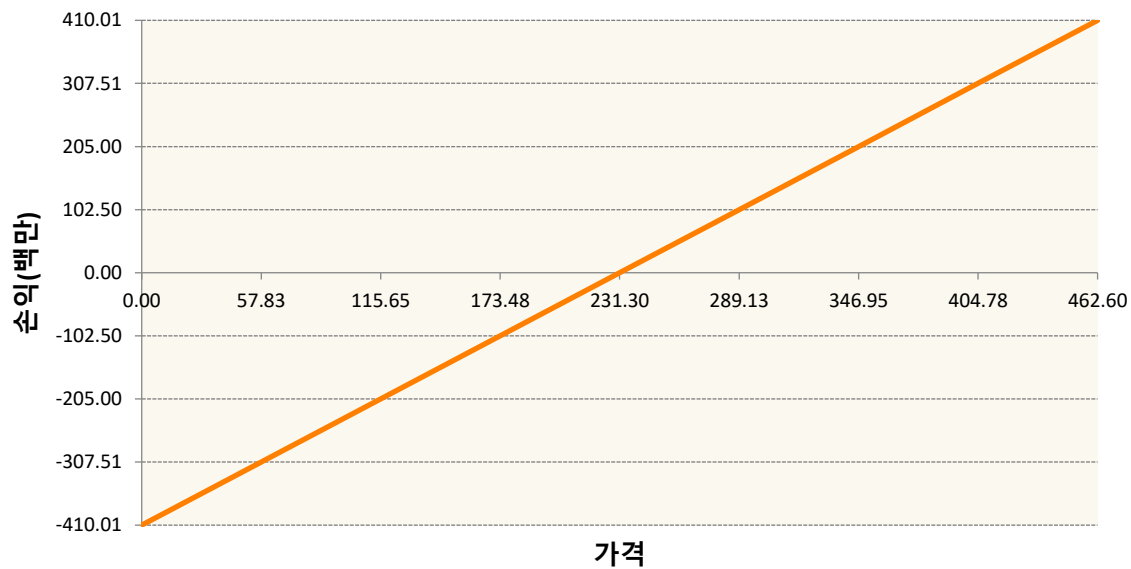
CH2-CORN FUTURE Mar22



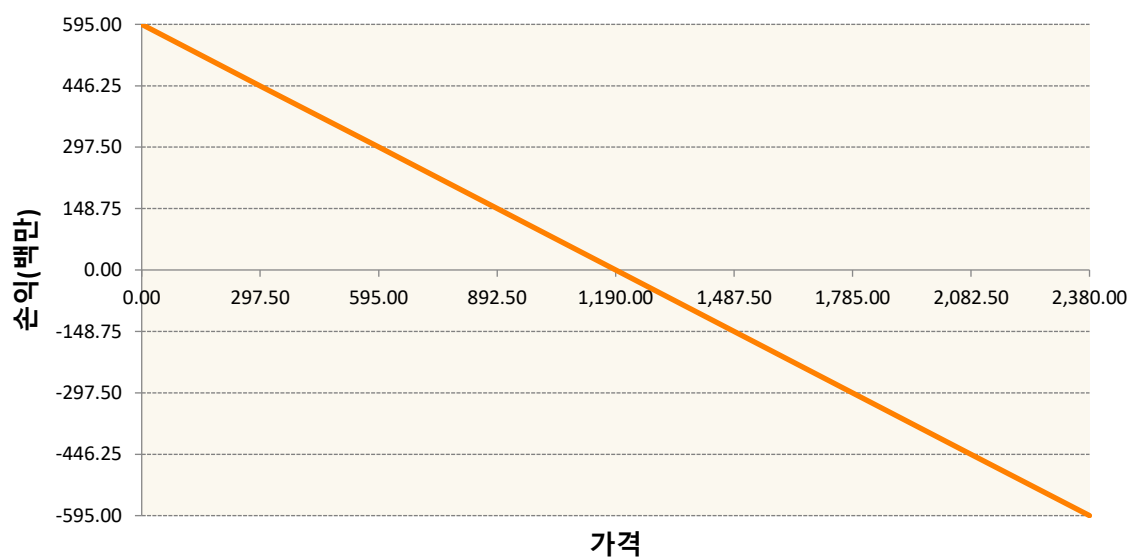
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



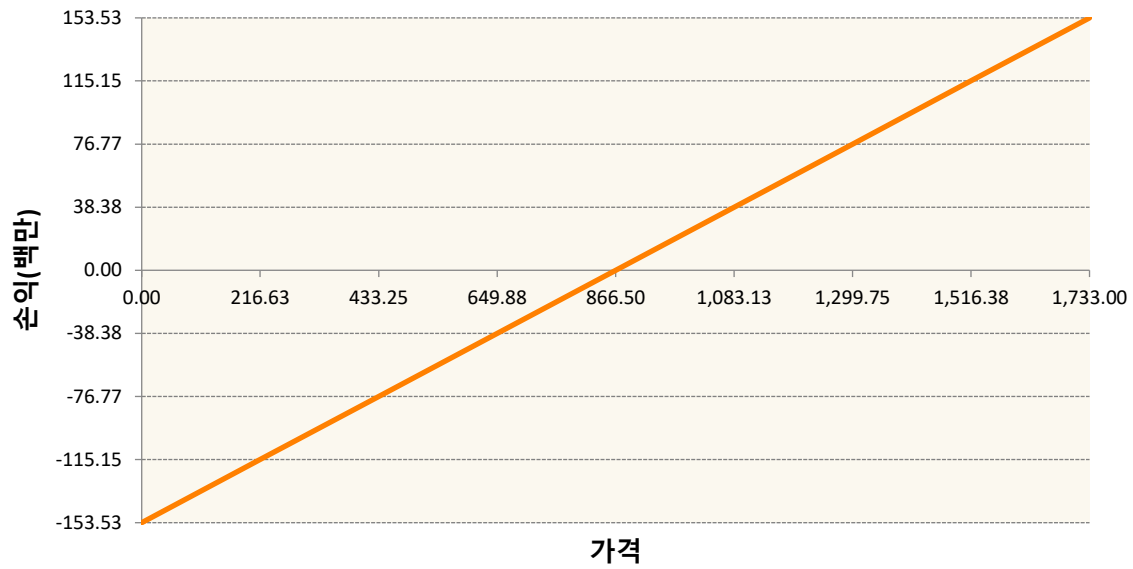
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



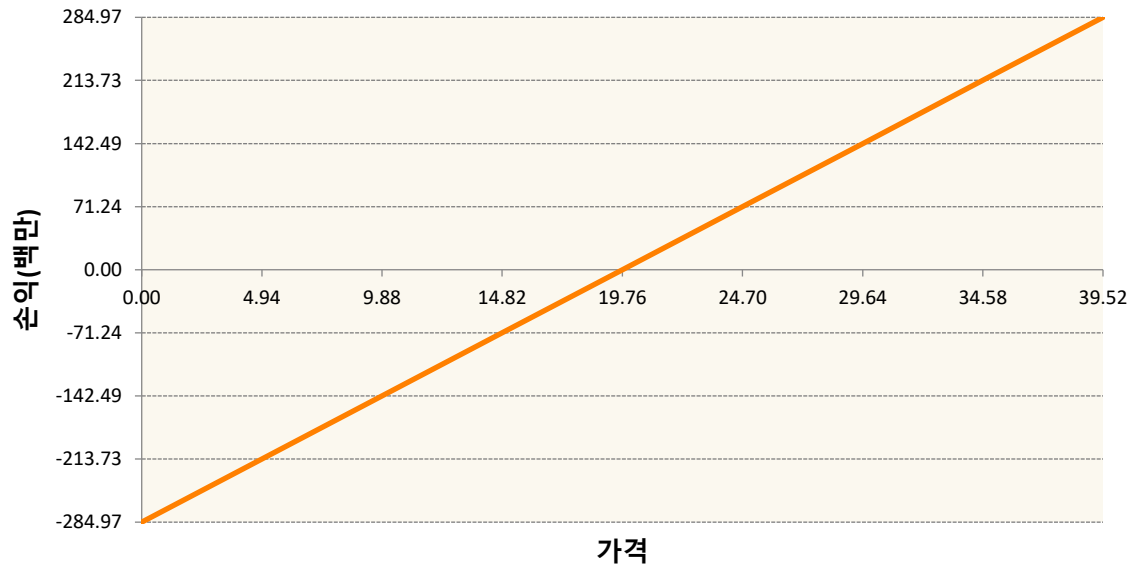
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



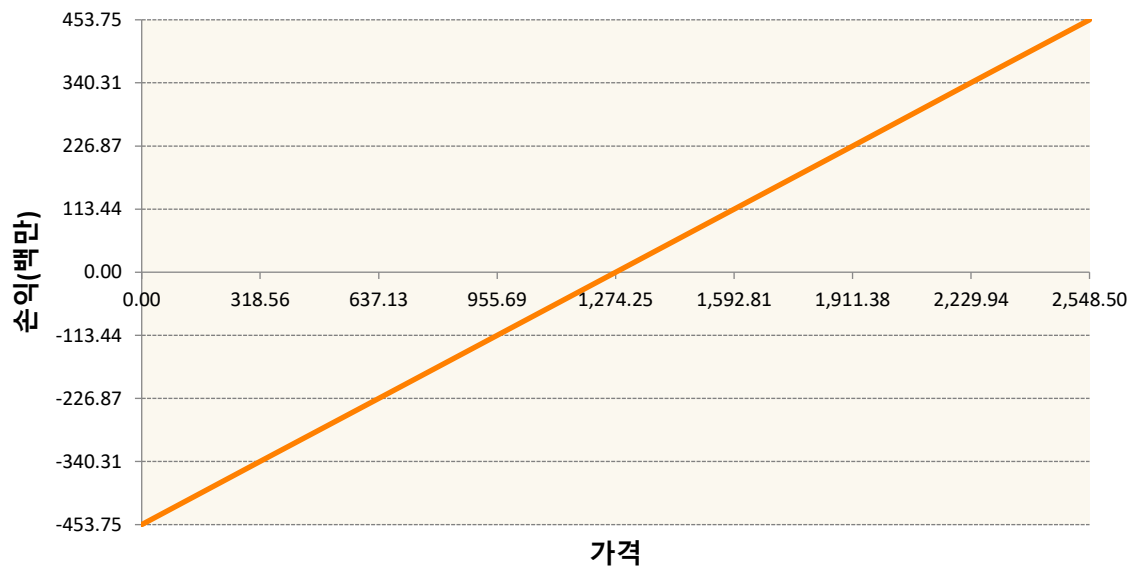
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



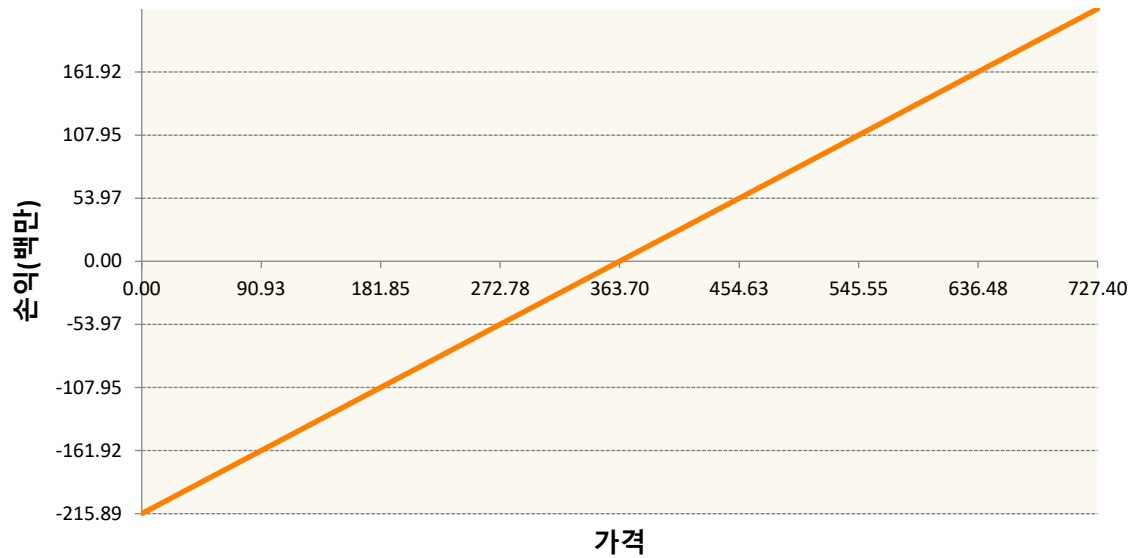
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



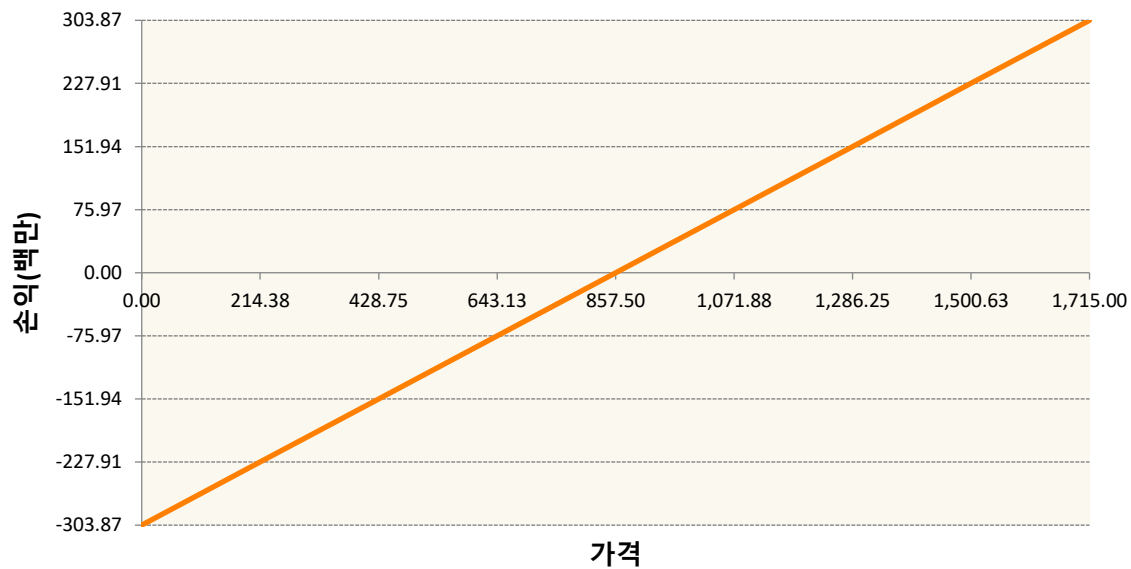
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



SMF2-SOYBEAN MEAL FUTR Jan22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22	27
CH2	CORN FUTURE Mar22	41
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22	11
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22	33
KR4175RC00 2021-12 달러선물		48
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22	12
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22	23
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22	36
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22	17
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22	24

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

(단위:백만원)

330