

공시일 2021-11-25

기준일 2021-11-24

포커스농산물모(채권-파생형)

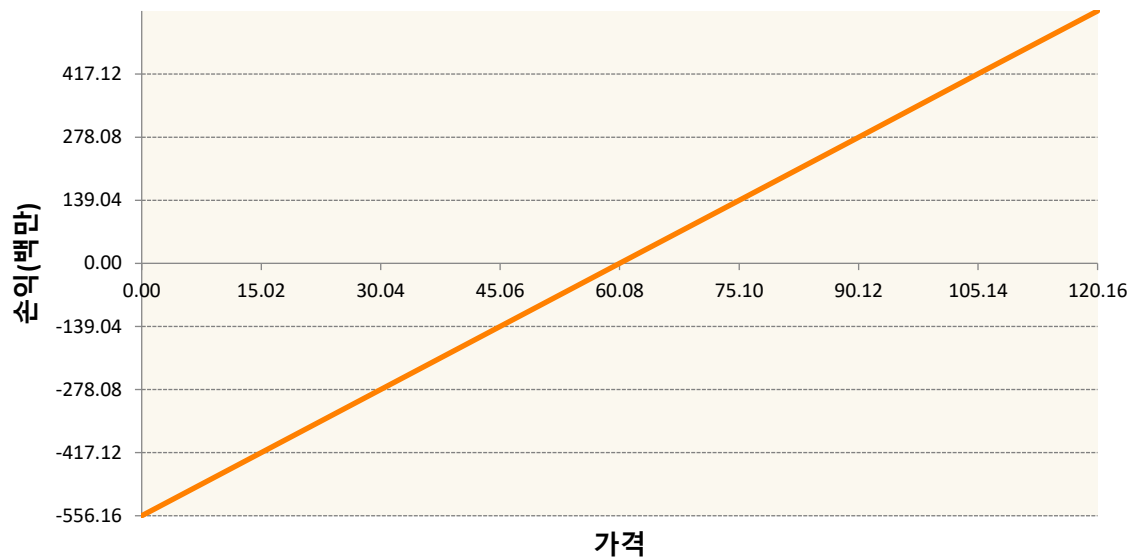
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

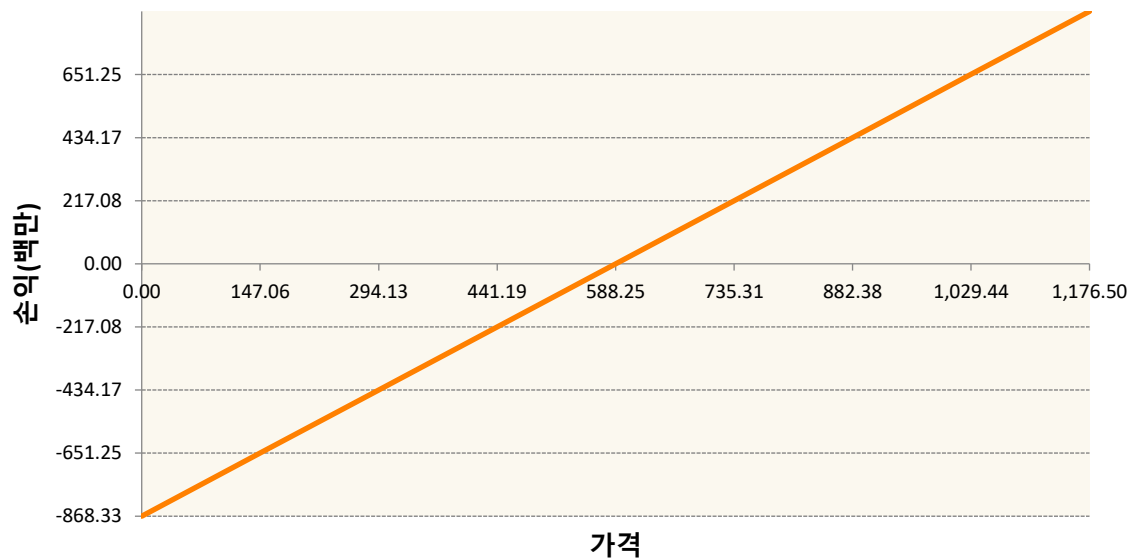
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,835	534	4,301	

2. 만기시점의 손익구조

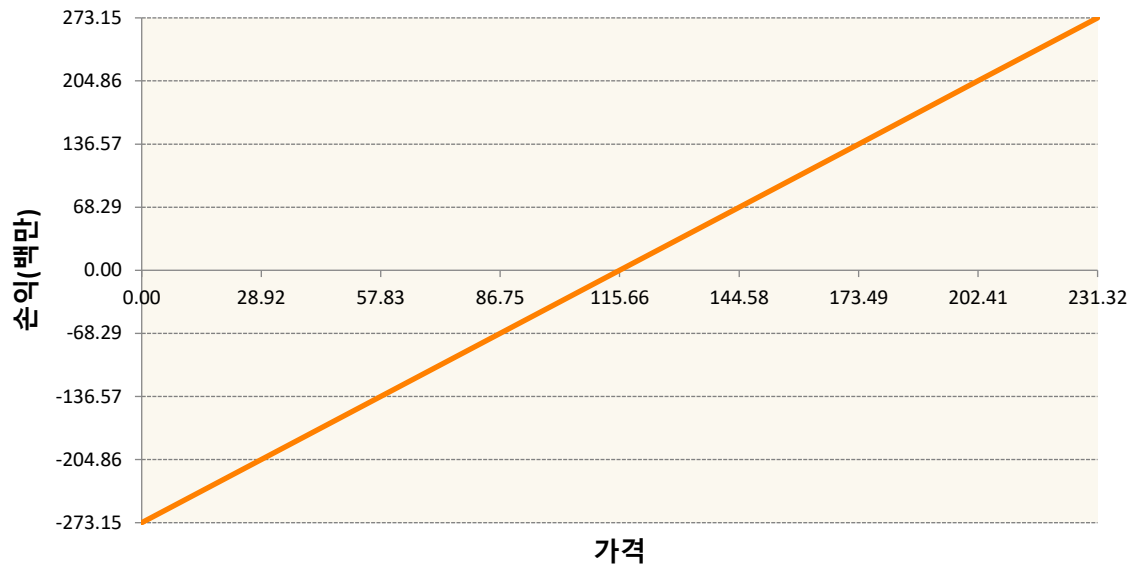
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



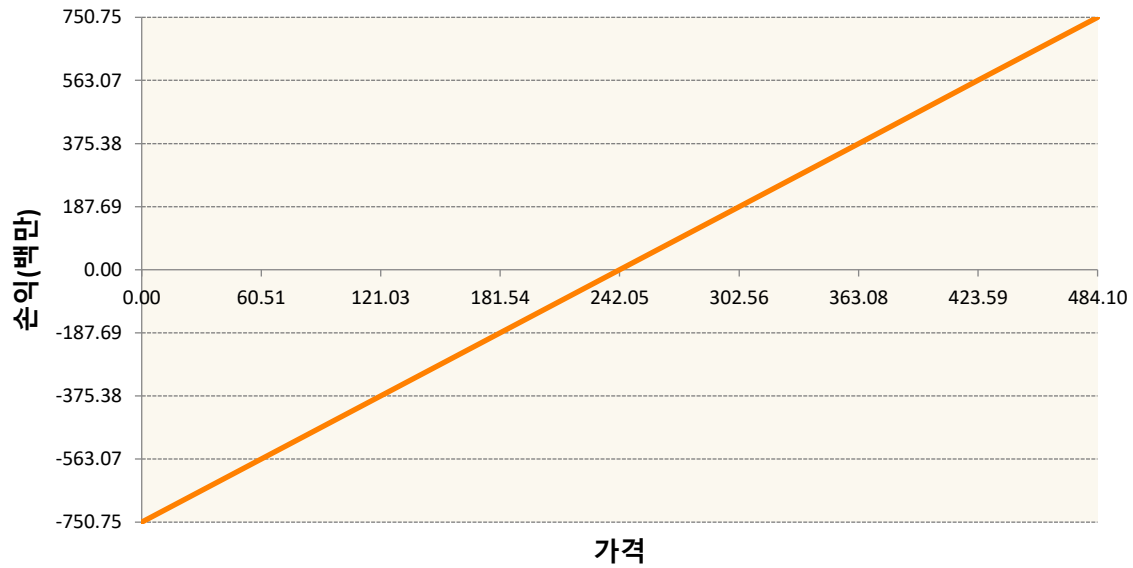
CH2-CORN FUTURE Mar22



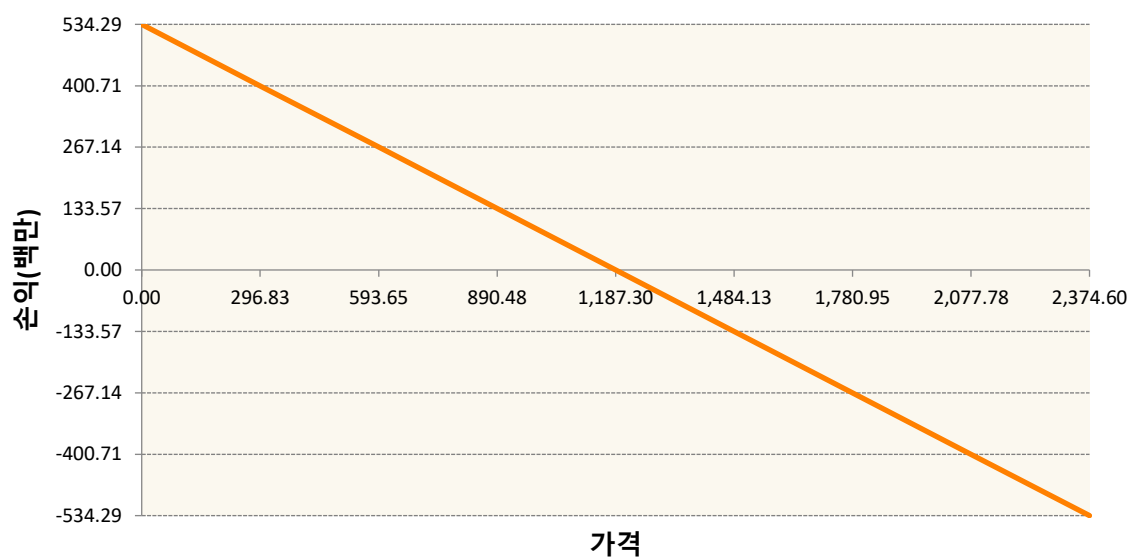
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



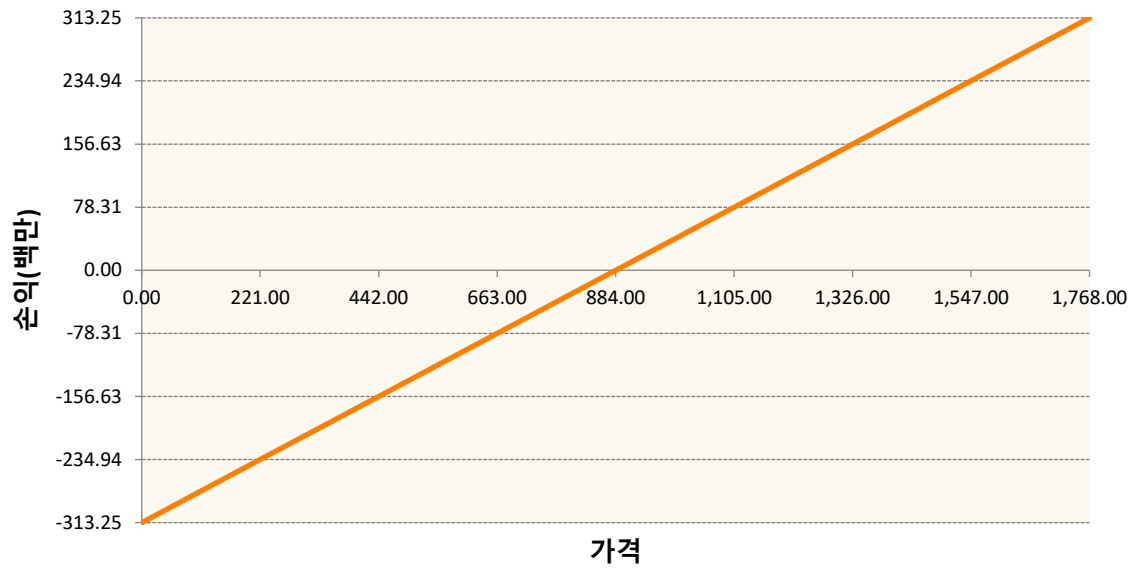
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



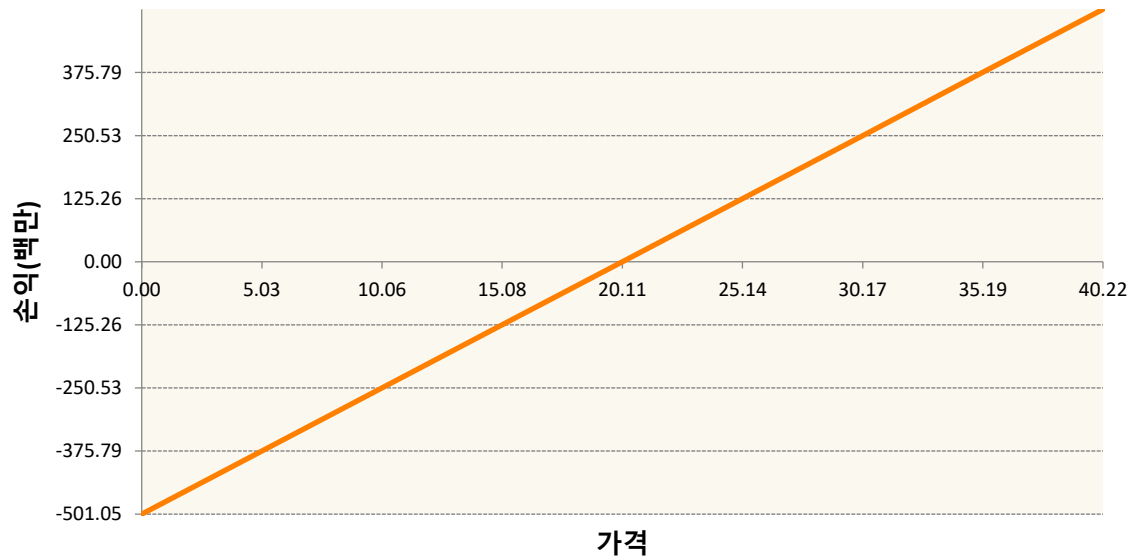
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



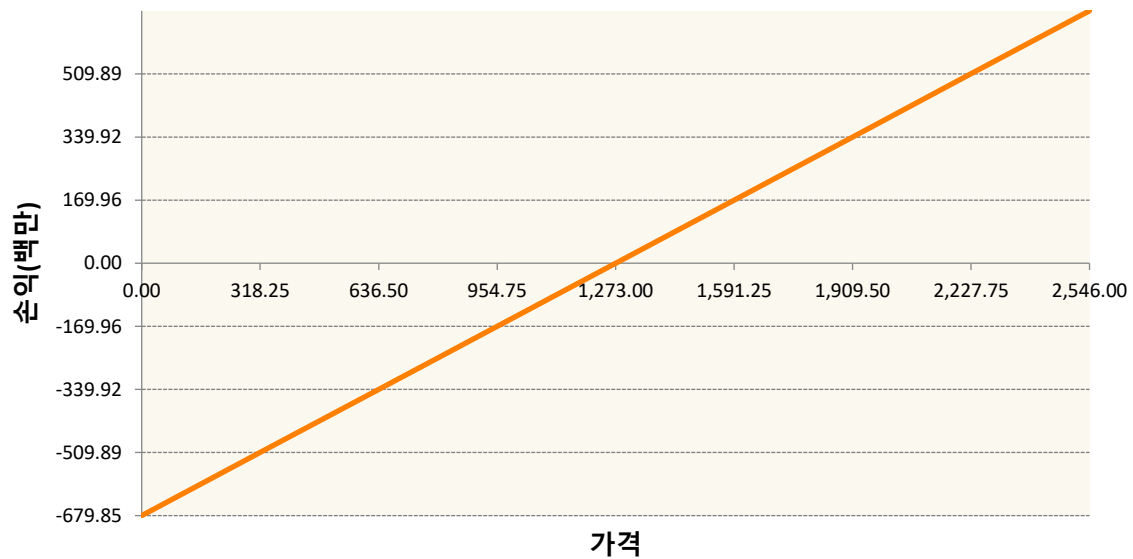
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



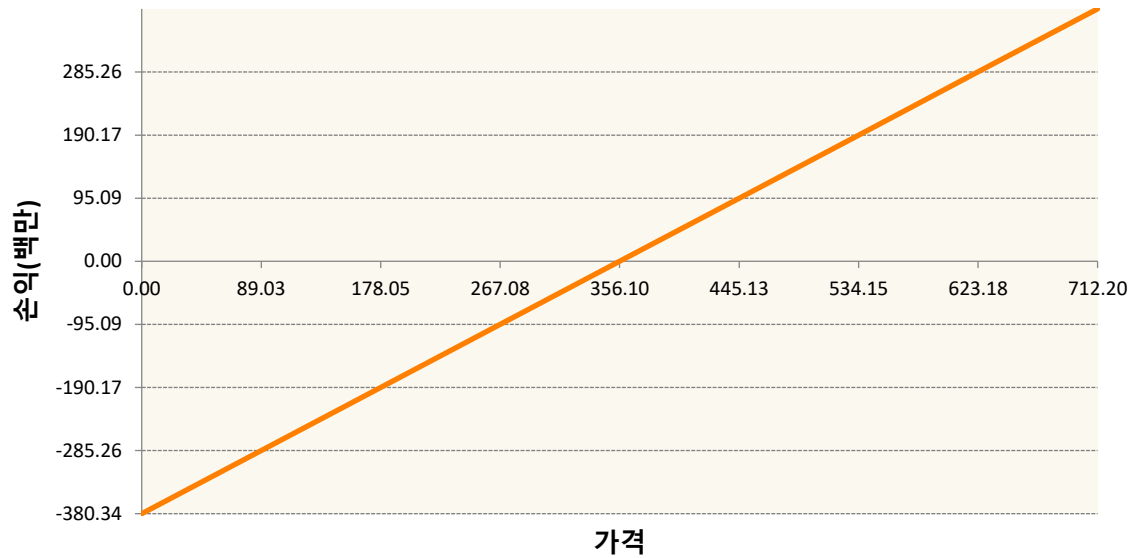
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



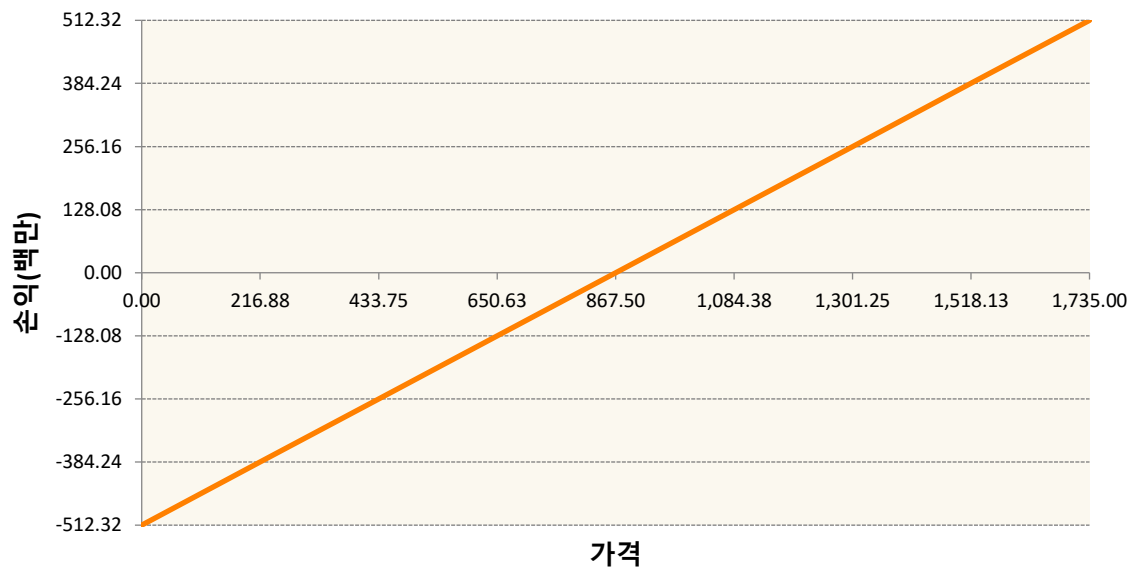
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	2021-11-25
기준일	2021-11-24

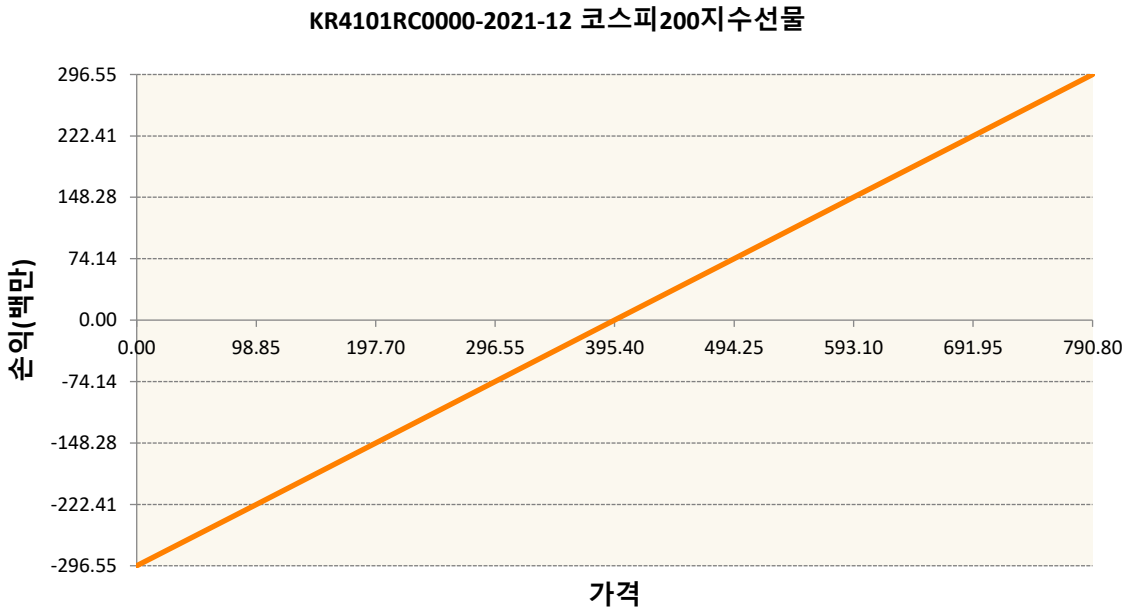
스마트인덱스모

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



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	2021-11-25
기준일	2021-11-24

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

916

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

533

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-11-25
기준일	2021-11-24

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	2021-11-25
기준일	2021-11-24

유로인덱스모(주식-파생형)

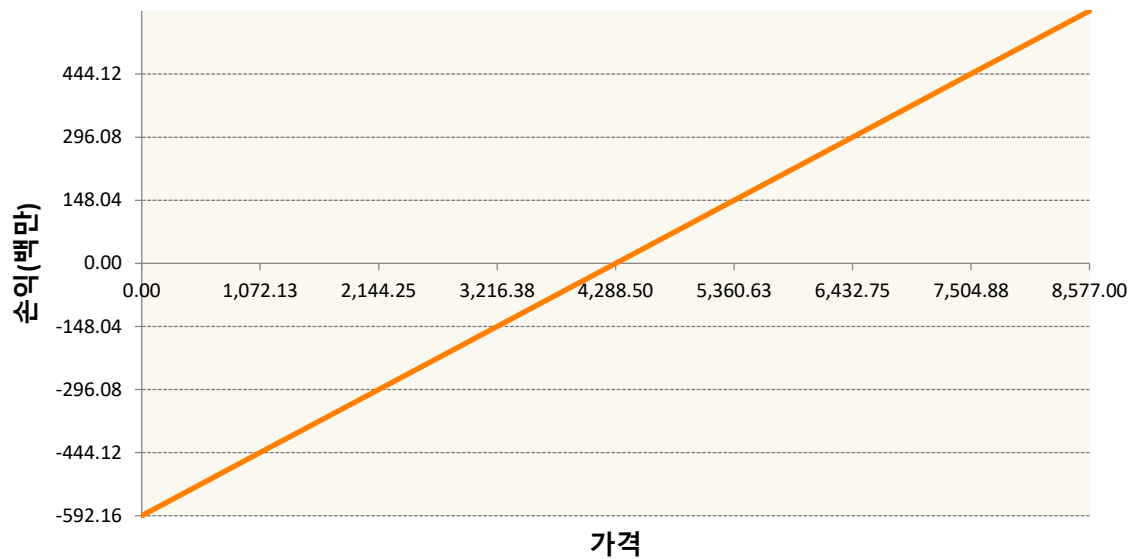
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	592	0	592	

2. 만기시점의 손익구조

VGZ1-EURO STOXX 50 Dec21



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ1	EURO STOXX 50 Dec21	47
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2021-11-25
기준일	2021-11-24

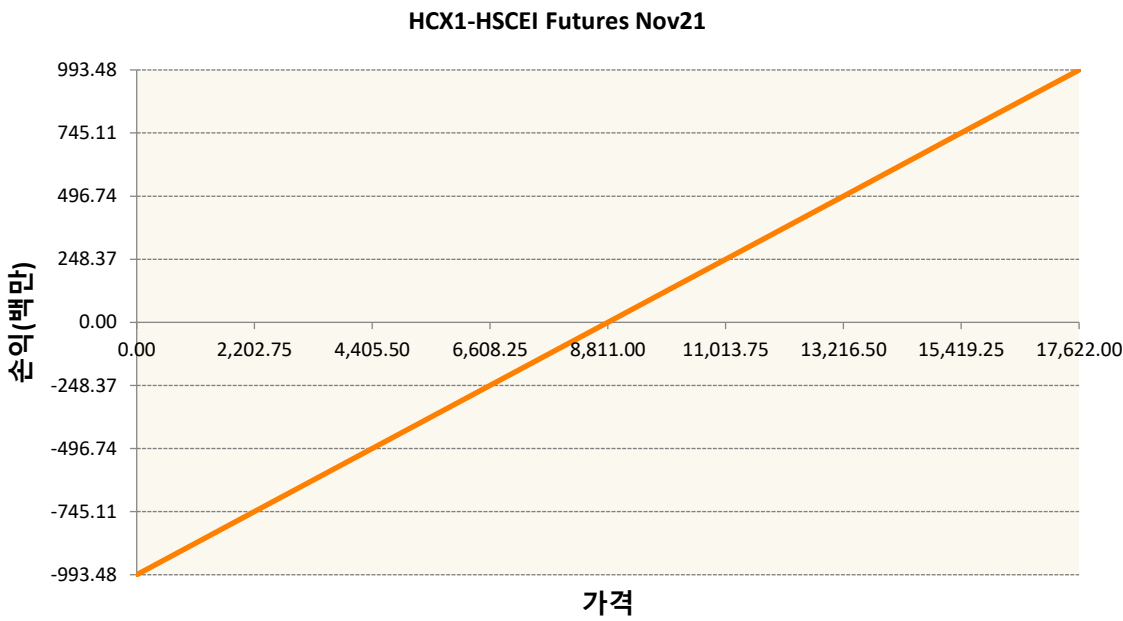
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	993	0	993	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX1	HSCEI Futures Nov21	79
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일 2021-11-25

기준일 2021-11-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

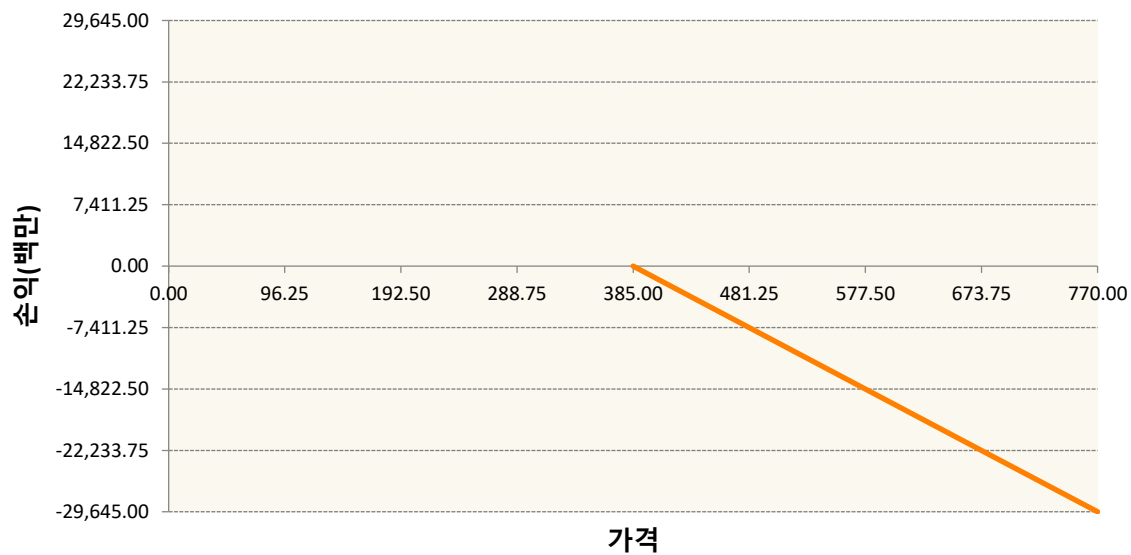
1. 계약금액

(단위:백만원)

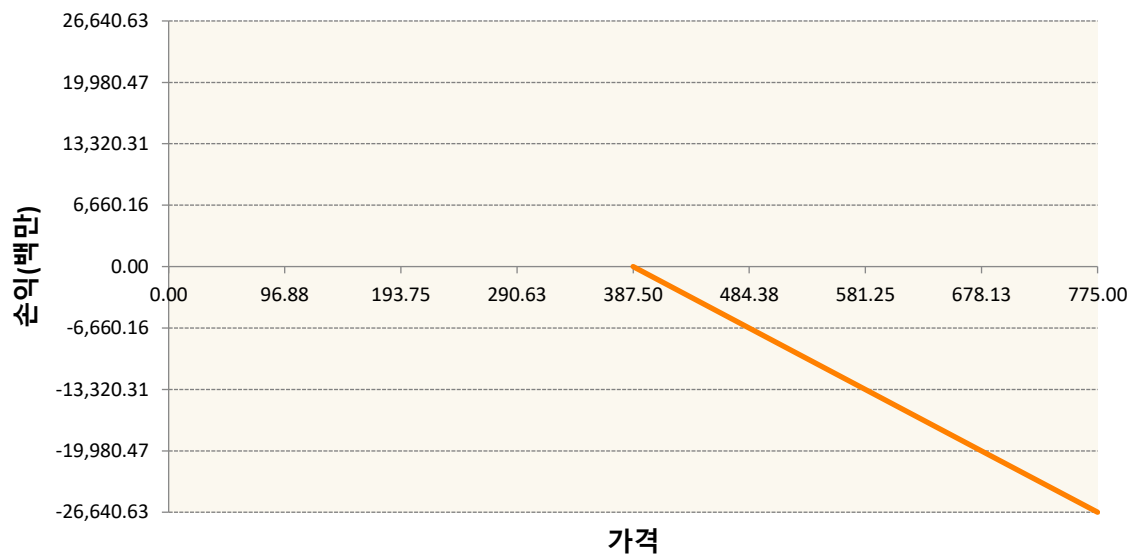
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,517	-76,517	장내

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 relationship, starting at a price of 0 with a net income of -17,325 and reaching a net income of 0 at a price of 385.

가격	순이익(백만원)
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 0.00 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			2,176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,060	1,041	1,018	993	964	933	900
-5.33%	941	902	860	817	773	729	683
-2.67%	645	594	543	492	441	390	339
0%	131	89	45	0	-46	-93	-140
2.67%	-554	-577	-604	-634	-667	-702	-739
5.33%	-1,327	-1,336	-1,348	-1,363	-1,382	-1,403	-1,428
8.00%	-2,129	-2,132	-2,136	-2,142	-2,151	-2,162	-2,176
KR4201RC3870				2021-12 콜387.5			1,896
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	843	829	812	793	770	746	719
-5.33%	762	730	696	661	624	587	548
-2.67%	540	495	450	405	359	314	268
0%	126	85	43	0	-43	-87	-131
2.67%	-455	-480	-508	-539	-571	-606	-642
5.33%	-1,131	-1,142	-1,156	-1,172	-1,192	-1,215	-1,239
8.00%	-1,844	-1,847	-1,852	-1,860	-1,869	-1,882	-1,896
KR4301RC3853 2021-12 풋385							916

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-891	-892	-895	-899	-904	-909	-916
-5.33%	-442	-452	-464	-477	-490	-504	-519
-2.67%	-107	-126	-146	-165	-184	-203	-222
0%	38	27	14	0	-15	-30	-45
2.67%	69	66	62	57	51	43	35
5.33%	71	71	70	69	68	66	63
8.00%	71	71	71	71	71	71	70

KR4301RC3879 2021-12 풋387.5							165
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-162	-163	-163	-163	-164	-165	-165
-5.33%	-86	-87	-89	-90	-92	-94	-97
-2.67%	-24	-27	-30	-33	-36	-39	-43
0%	8	5	3	0	-3	-6	-8
2.67%	16	15	14	13	11	10	8
5.33%	17	16	16	16	16	15	14
8.00%	17	17	17	17	16	16	16

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

(단위:백만원)

5,321

공시일 2021-11-25

기준일 2021-11-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

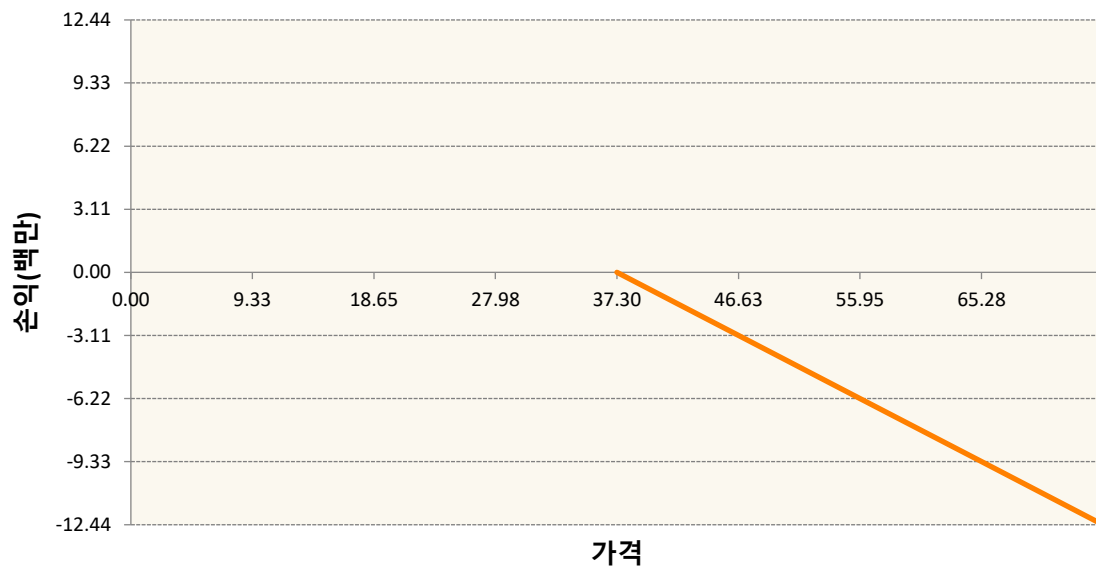
1. 계약금액

(단위:백만원)

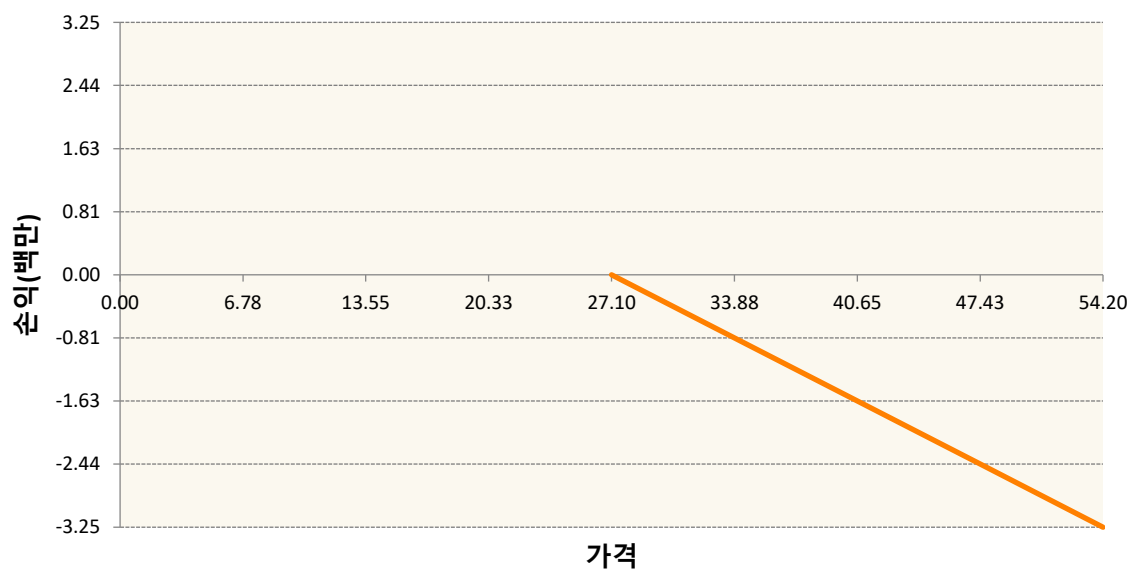
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	65	-65	장내

2. 만기시점의 손익구조

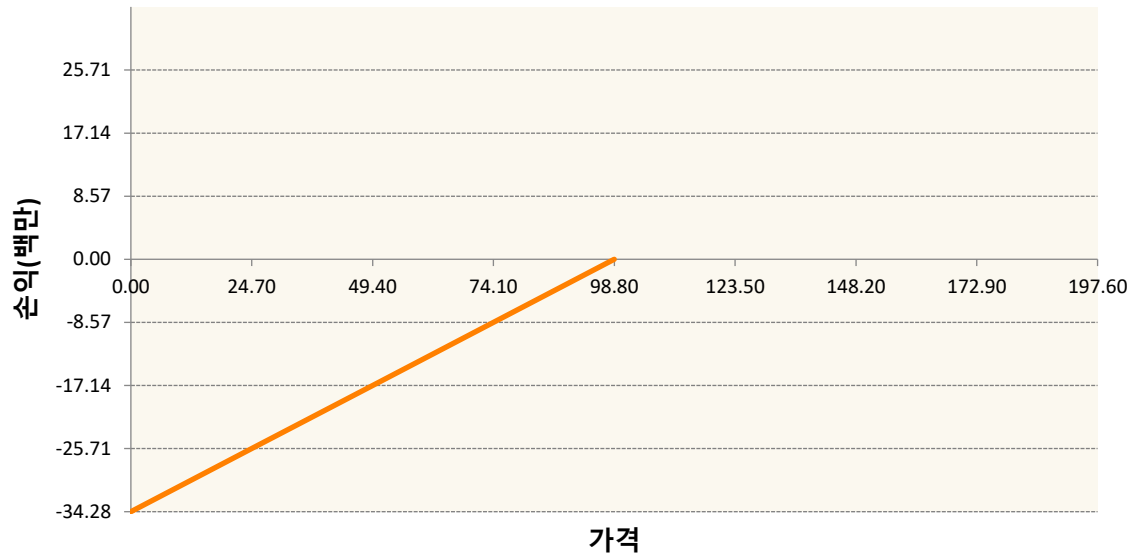
OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



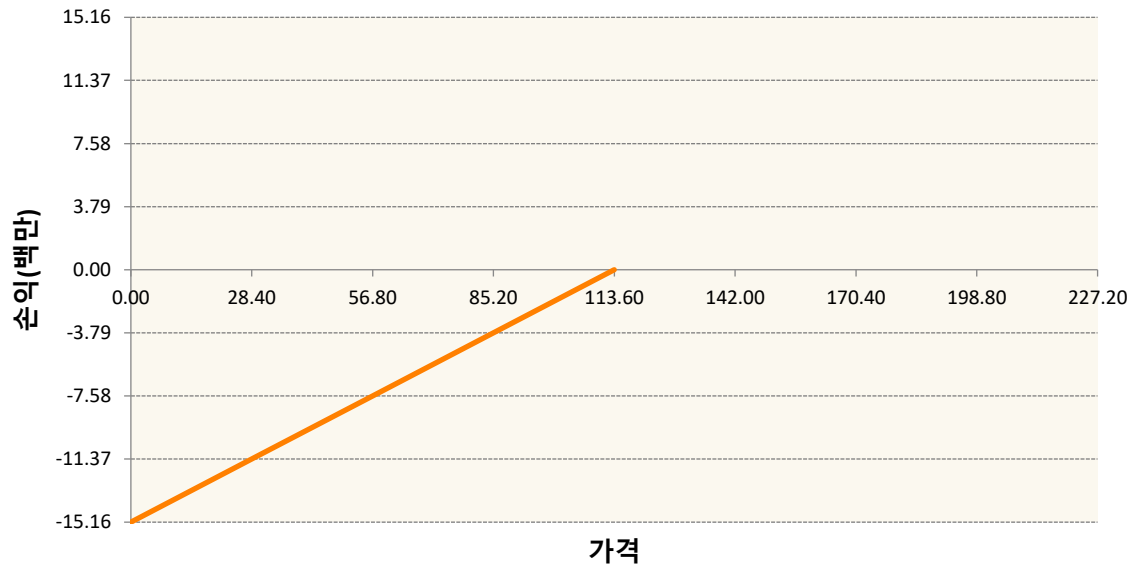
OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50



OESXZ1-P4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-P4375-EURO STOXX 50



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 OESXZ1-C43 EURO STOXX 50
 OESXZ1-C43 EURO STOXX 50
 OESXZ1-P43 EURO STOXX 50
 OESXZ1-P43 EURO STOXX 50

7
1
0.26
3
1

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

(단위:백만원)

10

공시일 2021-11-25

기준일 2021-11-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

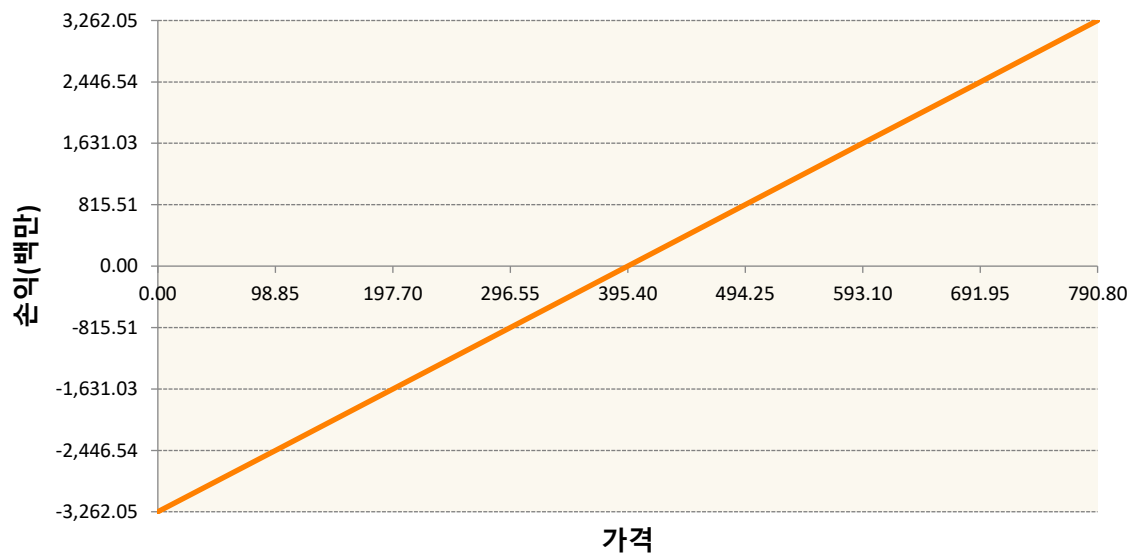
1. 계약금액

(단위:백만원)

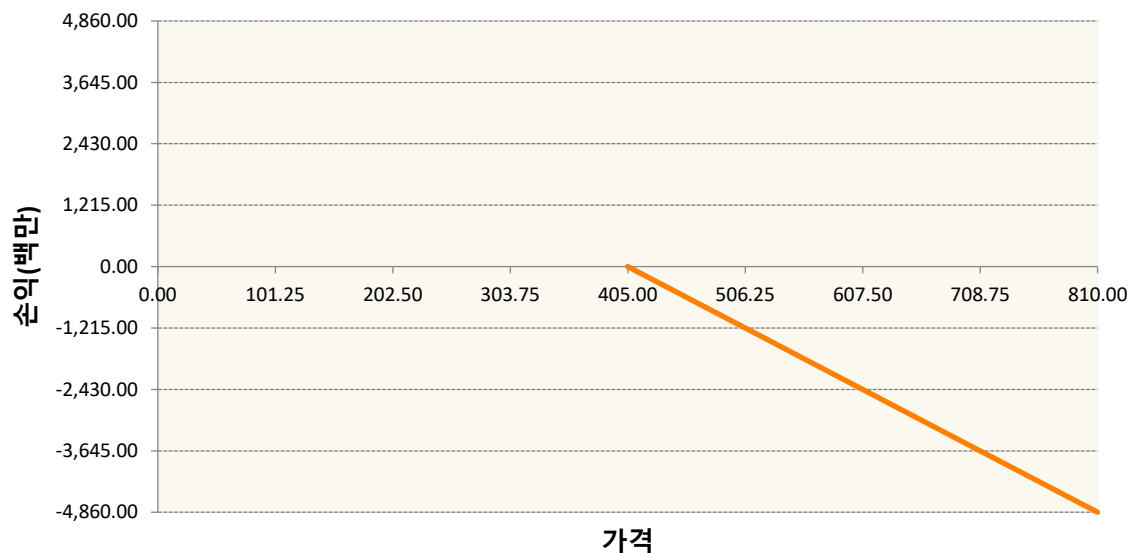
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,262	0	3,262	장내
누계	유가증권	옵션	579	5,369	-4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조

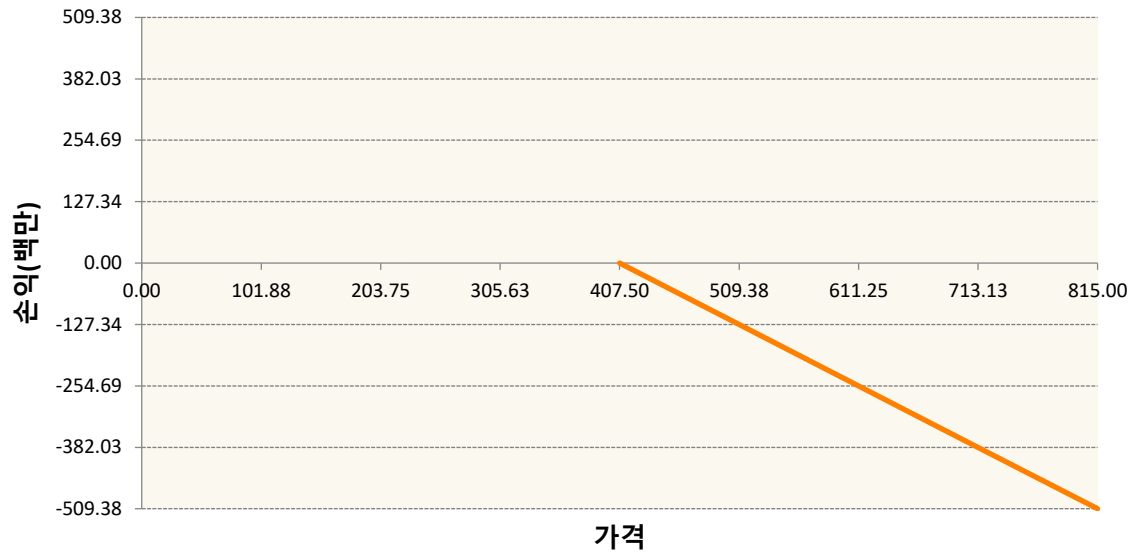
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



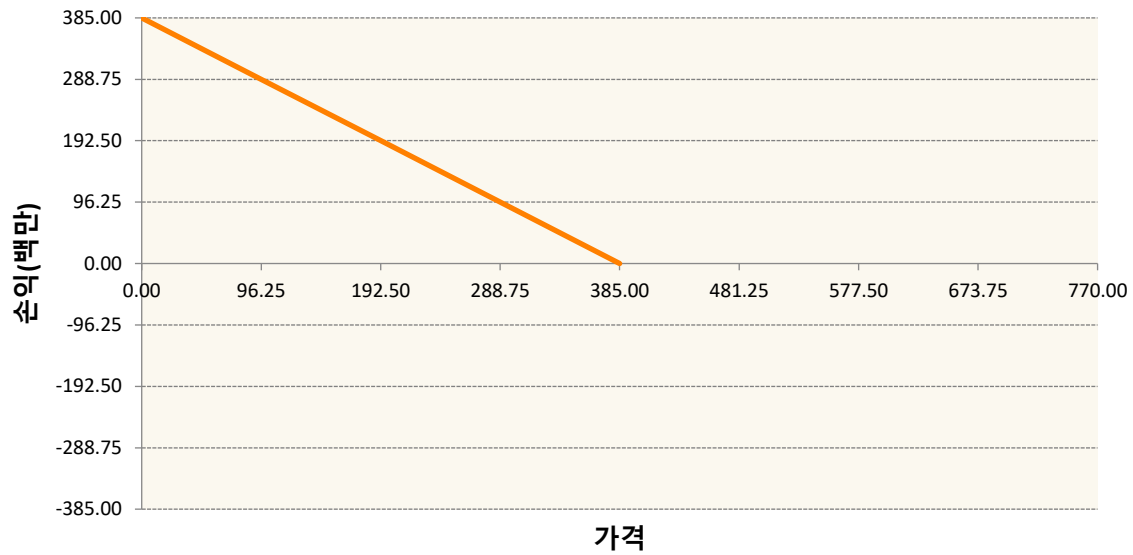
KR4201RC4050-2021-12 콜405



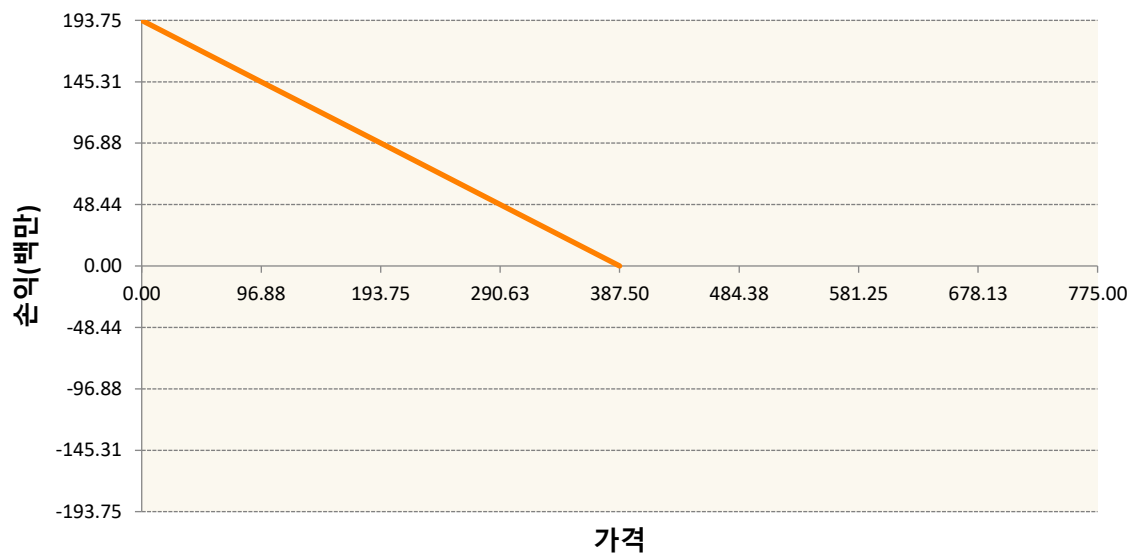
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



KR4301RC3853-2021-12 풋385



KR4301RC3879-2021-12 풋387.5



(단위:백만원)

KR4101RC0000							2021-12 코스피200지수선물		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				
KR4201RC4050							2021-12 콜405		249		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	52	51	51	50	49	48	46				
-5.33%	50	49	47	45	42	39	35				
-2.67%	44	40	36	31	26	20	14				
0%	21	15	7	0	-7	-15	-23				
2.67%	-29	-37	-46	-54	-62	-71	-79				
5.33%	-111	-118	-125	-132	-140	-148	-155				
8.00%	-219	-222	-227	-232	-237	-243	-249				
KR4201RC4076							2021-12 콜407.5		24		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	4	4	4	4	4	4	4				
-5.33%	4	4	4	4	4	3	3				
-2.67%	4	4	3	3	2	2	1				
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2				
2.67%	-2	-3	-4	-5	-6	-7	-8				
5.33%	-10	-11	-12	-13	-13	-14	-15				
8.00%	-21	-21	-22	-22	-23	-24	-24				
KR4301RC3853							2021-12 풋385		20		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	20	20	20	20	20	20	20				
-5.33%	10	10	10	11	11	11	12				
-2.67%	2	3	3	4	4	5	5				
0%	-1	-1	0	0	0	1	1				
2.67%	-2	-1	-1	-1	-1	-1	-1				
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1				
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2				
KR4301RC3879							2021-12 풋387.5		11		
기초자산의 변동성											

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

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

(단위:백만원)

533

공시일	2021-11-25
기준일	2021-11-24

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	18,598	0	18,598	

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	2021-11-25
기준일	2021-11-24

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	9,701	0	9,701	

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	2021-11-25
기준일	2021-11-24

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	45,821	0	45,821	

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

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Profit/Loss (손익(백만)). The line starts at a negative profit for low prices and crosses the x-axis at approximately 395.40, indicating the break-even point. For prices above this point, the profit increases linearly.

가격 (Price)	손익(백만) (Profit/Loss in millions)
0.00	-1,878.15
98.85	-1,408.61
197.70	-939.08
296.55	-469.54
395.40	0.00
494.25	469.54
593.10	939.08
691.95	1,408.61
790.80	1,878.15

(단위:백만원)

KR4101RC0000	2021-12 코스피200지수선물						150
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150
-5.33%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	50	50	50	50	50	50	50
5.33%	100	100	100	100	100	100	100
8.00%	150	150	150	150	150	150	150

공시일 2021-11-25

기준일 2021-11-24

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

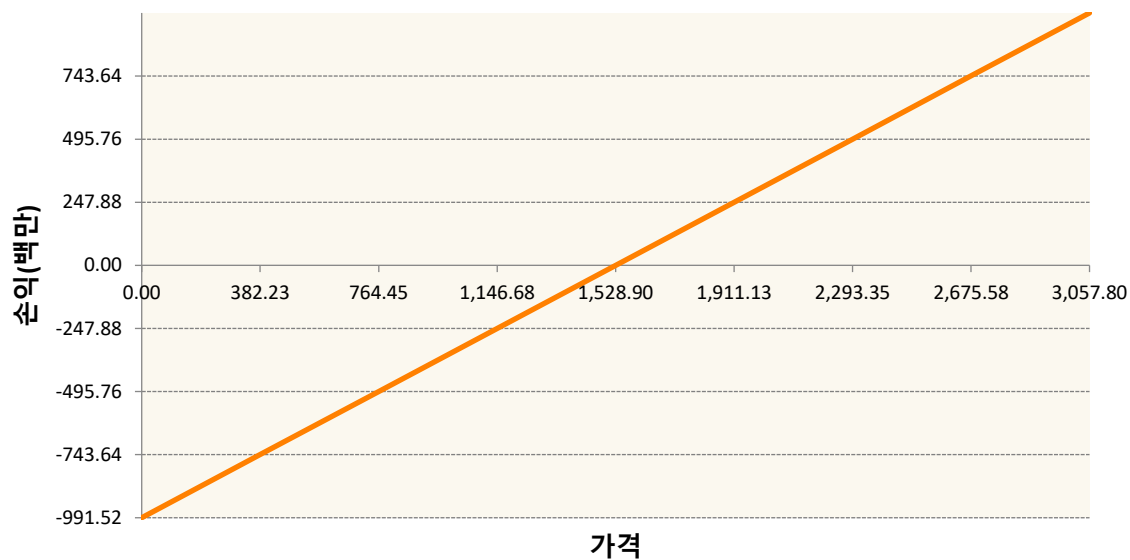
1. 계약금액

(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	992	0	992	
누계	유가증권	스왑	1,782	0	1,782	장외
누계	통화	선도	0	440	-440	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCZ1-VN30 Index Future Dec21



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)

143

FXW213BBQ KRW/EUR 25-02-22E

35

VNCZ1 VN30 Index Future Dec21

79

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

(단위:백만원)

254

공시일 2021-11-25

기준일 2021-11-24

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

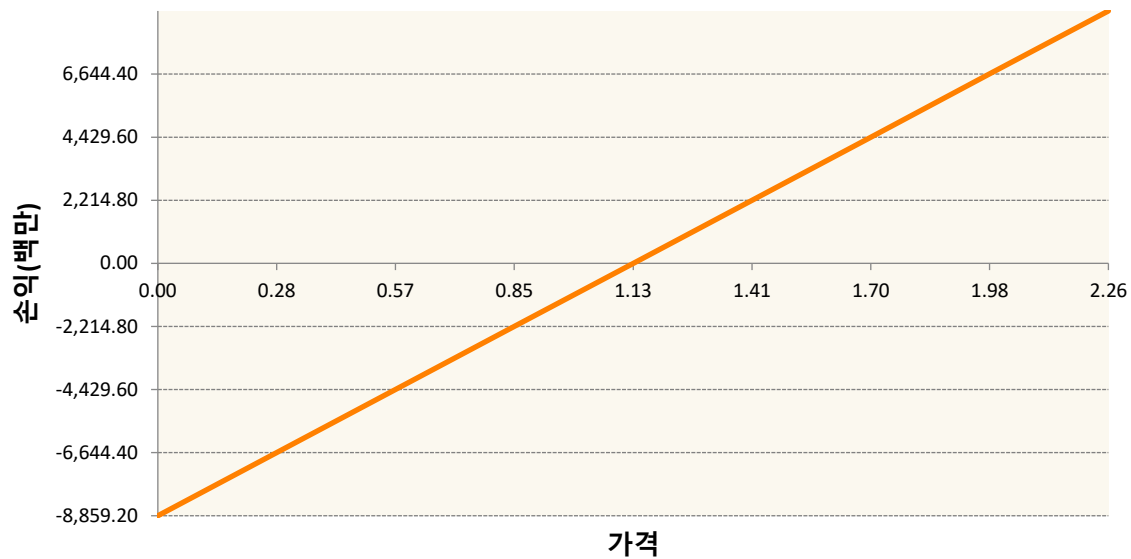
1. 계약금액

(단위:백만원)

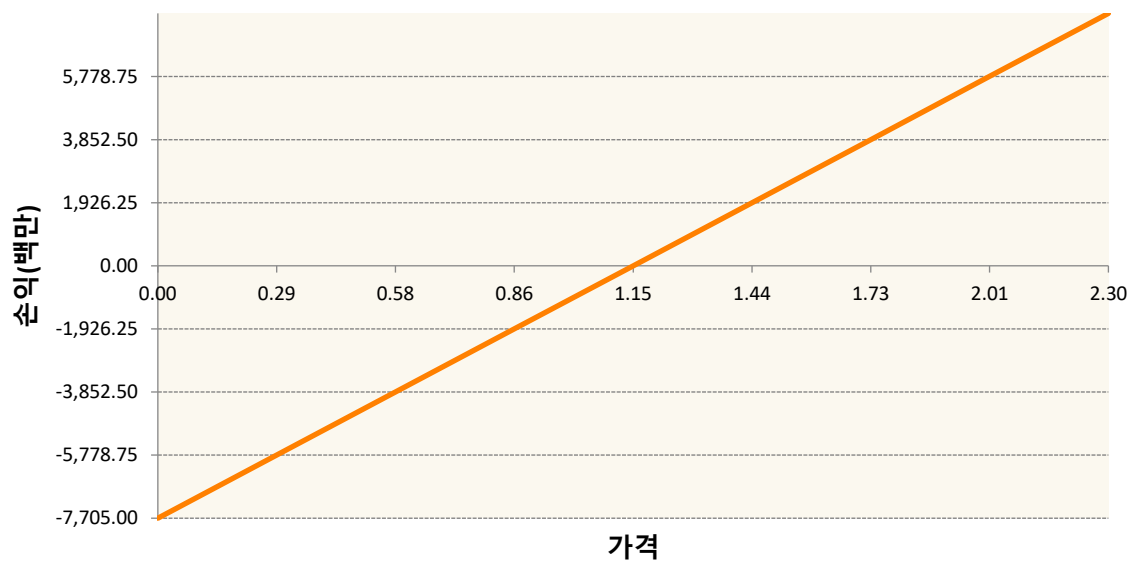
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	22,095	0	22,095	

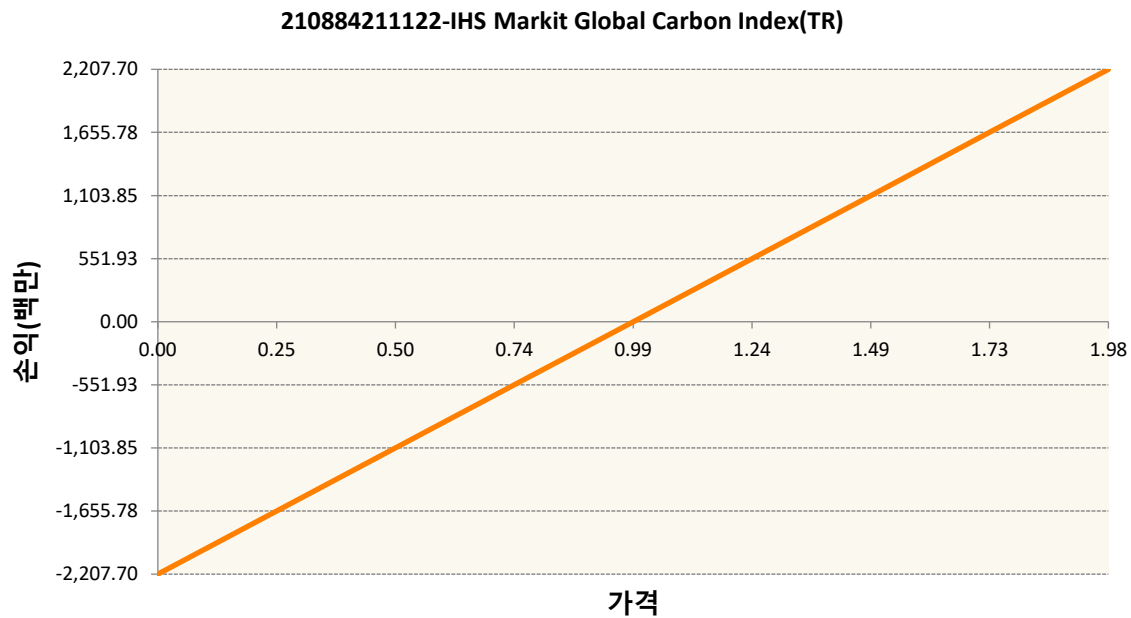
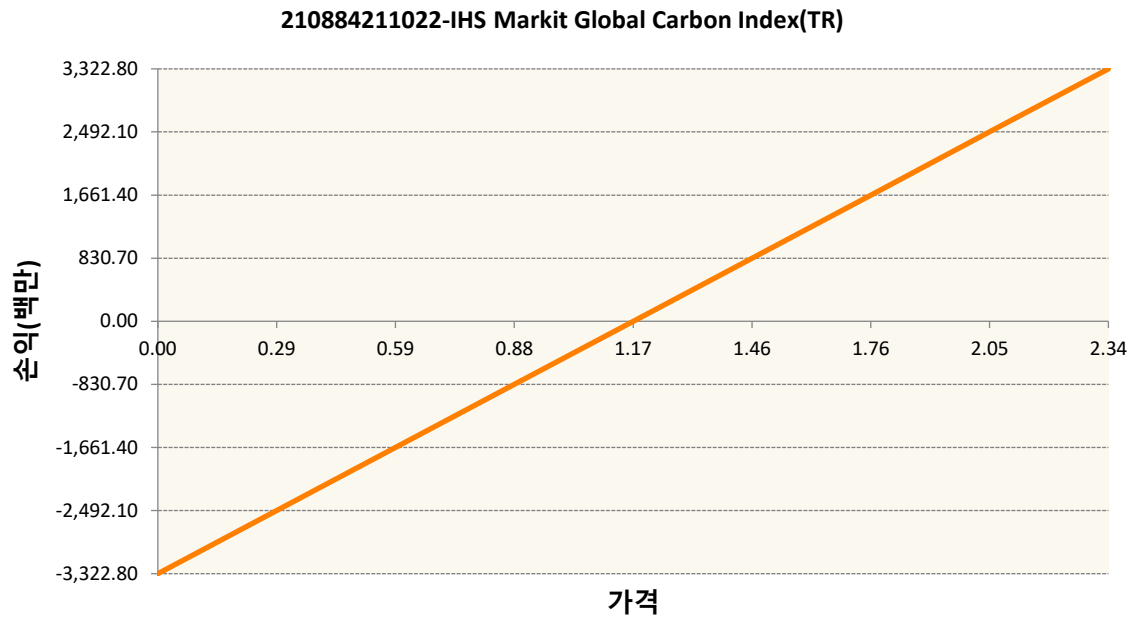
2. 만기시점의 손익구조

210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11	IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	711
2.1088E+11	IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	619
2.1088E+11	IHS Markit Global Carbon Index(TR)	266
2.1088E+11	IHS Markit Global Carbon Index(TR)	177

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,683

공시일 2021-11-25

기준일 2021-11-24

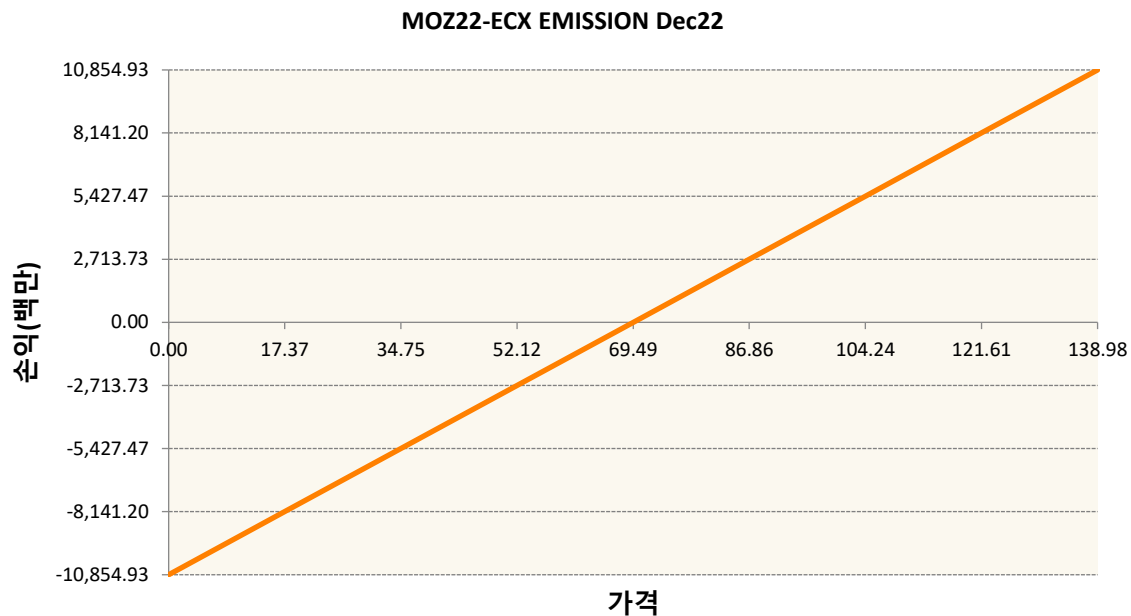
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,855	0	10,855	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

MOZ22	ECX EMISSION Dec22	868
-------	--------------------	-----

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

(단위:백만원)

1,752

공시일 2021-11-25

기준일 2021-11-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

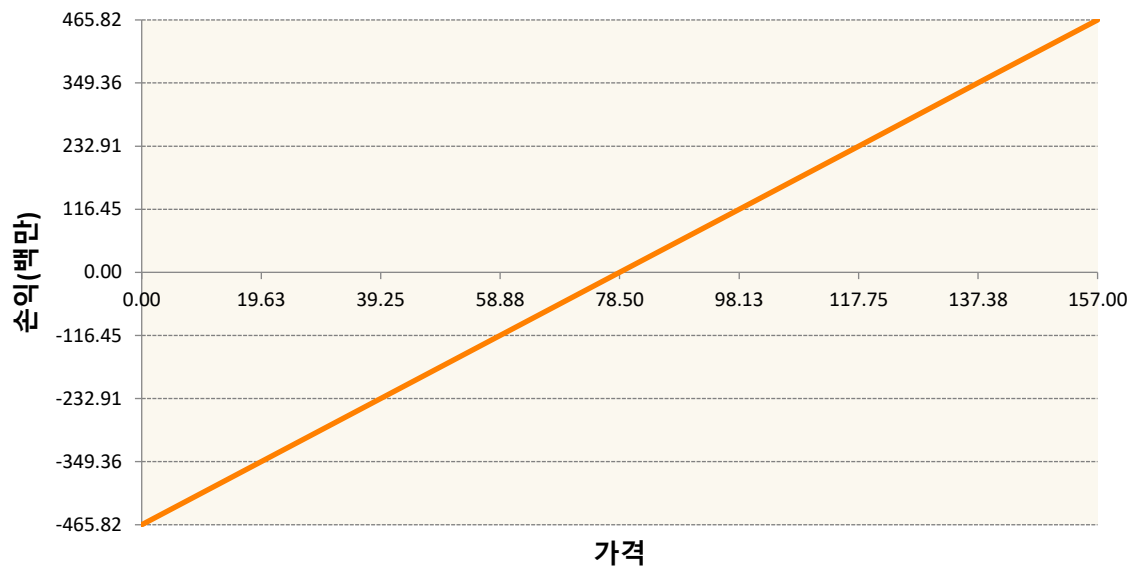
1. 계약금액

(단위:백만원)

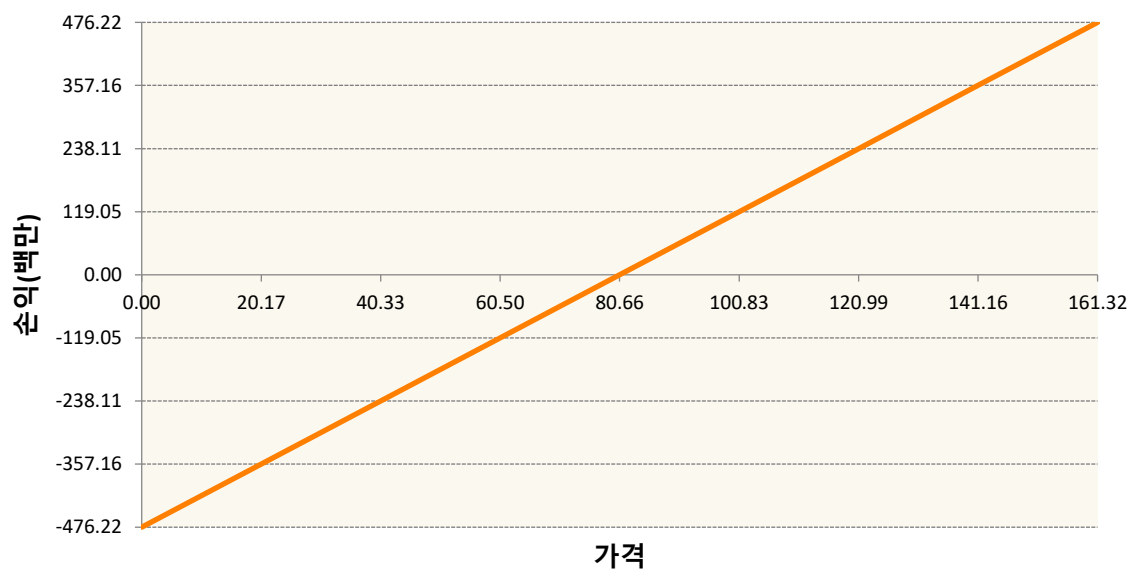
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,167	534	1,633	

2. 만기시점의 손익구조

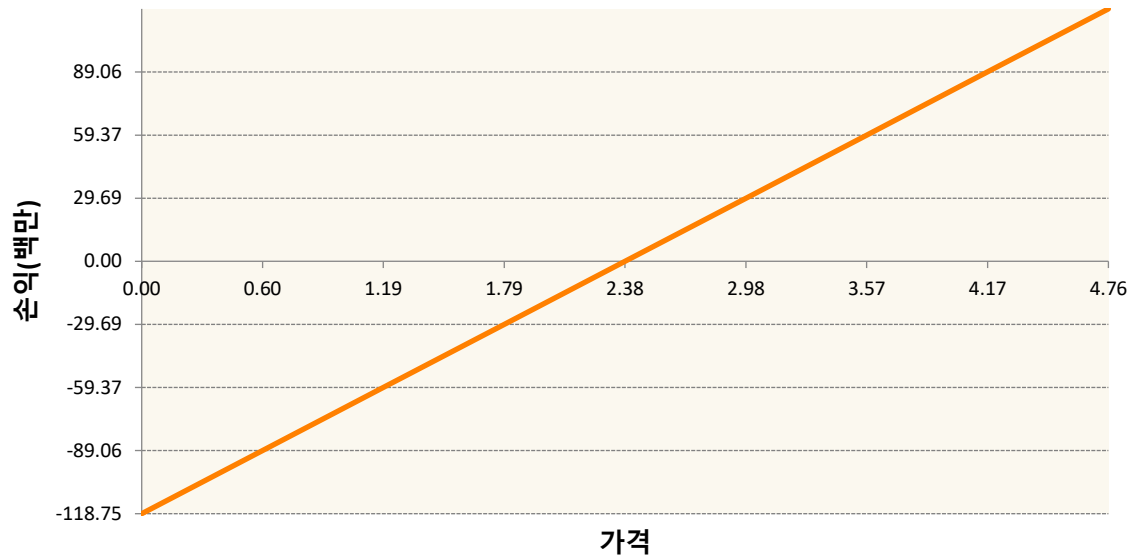
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



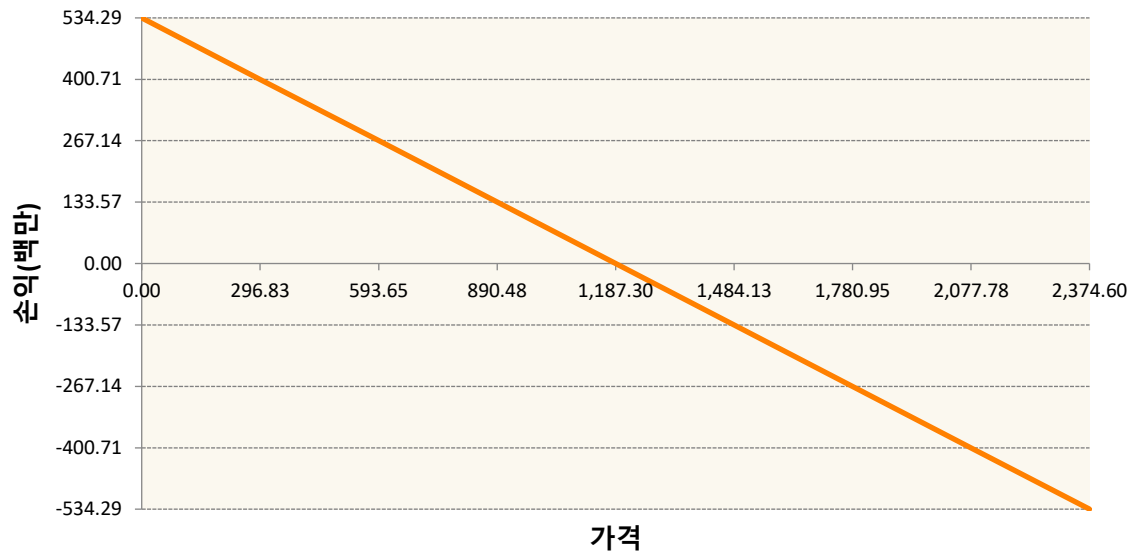
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



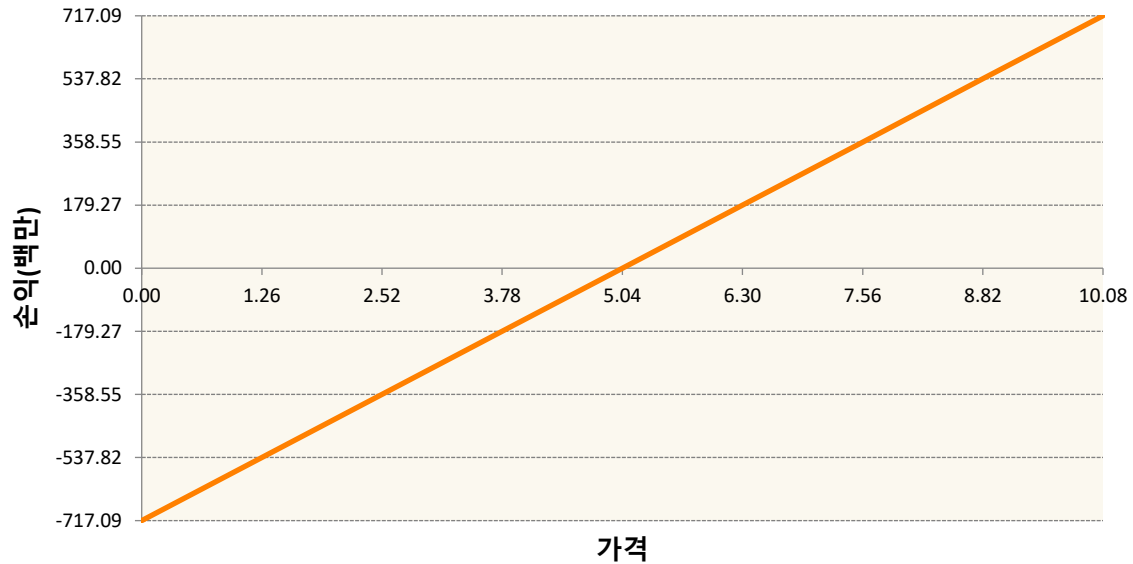
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22

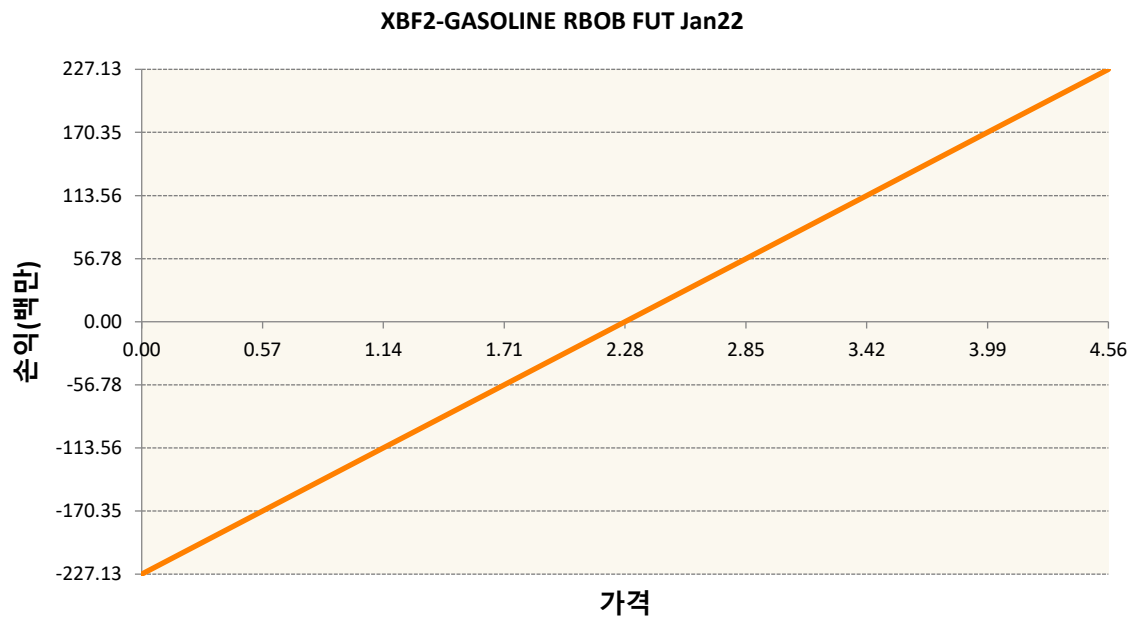
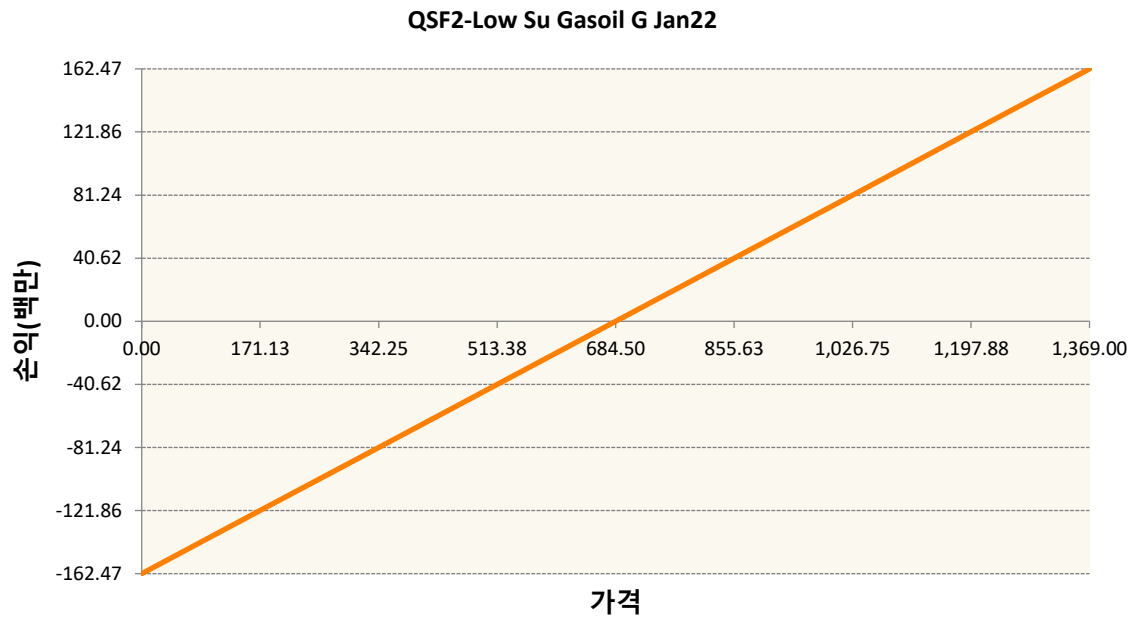


KR4175RC0001-2021-12 달러선물



NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLF2	WTI CRUDE FUTURE Jan22		37
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22		38
HOF2	NY Harb ULSD Fut Jan22		9
KR4175RC00 2021-12 달러선물			43
NGF22	NATURAL GAS FUTR Jan22		57
QSF2	Low Su Gasoil G Jan22		13
XBF2	GASOLINE RBOB FUT Jan22		18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		384

공시일 2021-11-25

기준일 2021-11-24

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

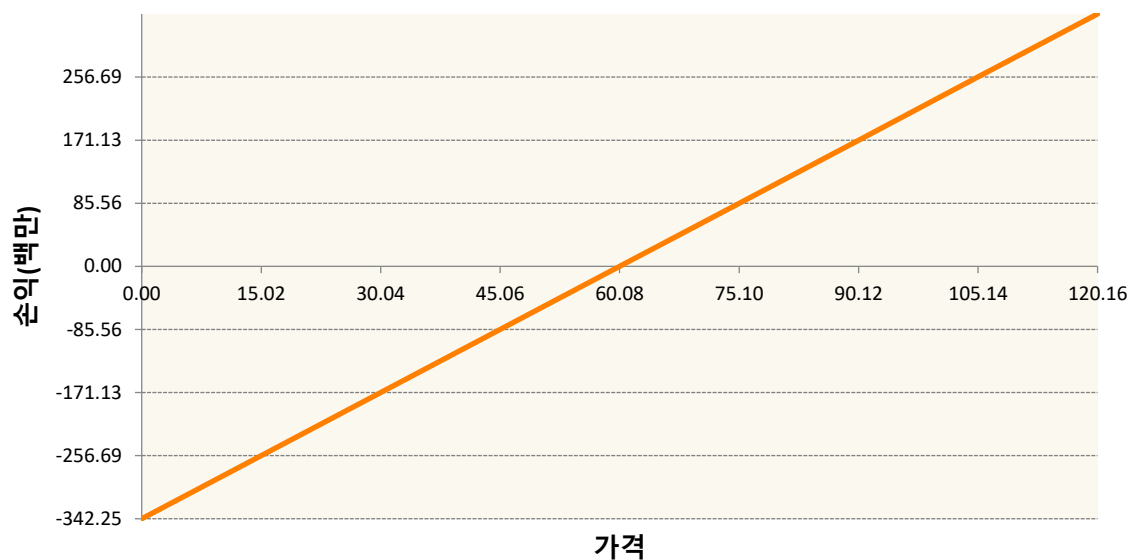
1. 계약금액

(단위:백만원)

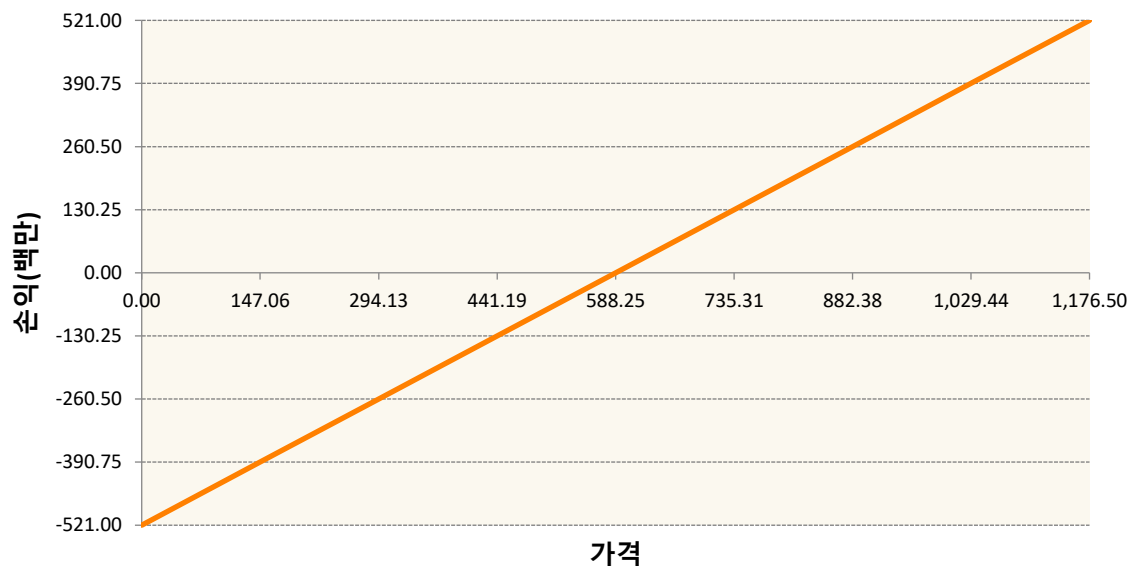
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,847	594	2,254	

2. 만기시점의 손익구조

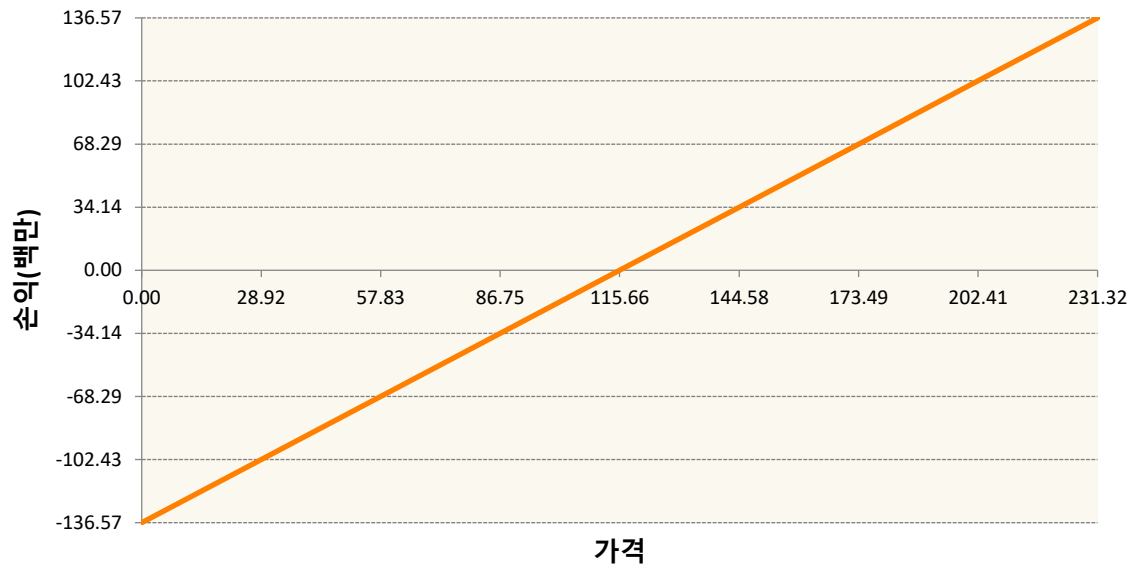
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



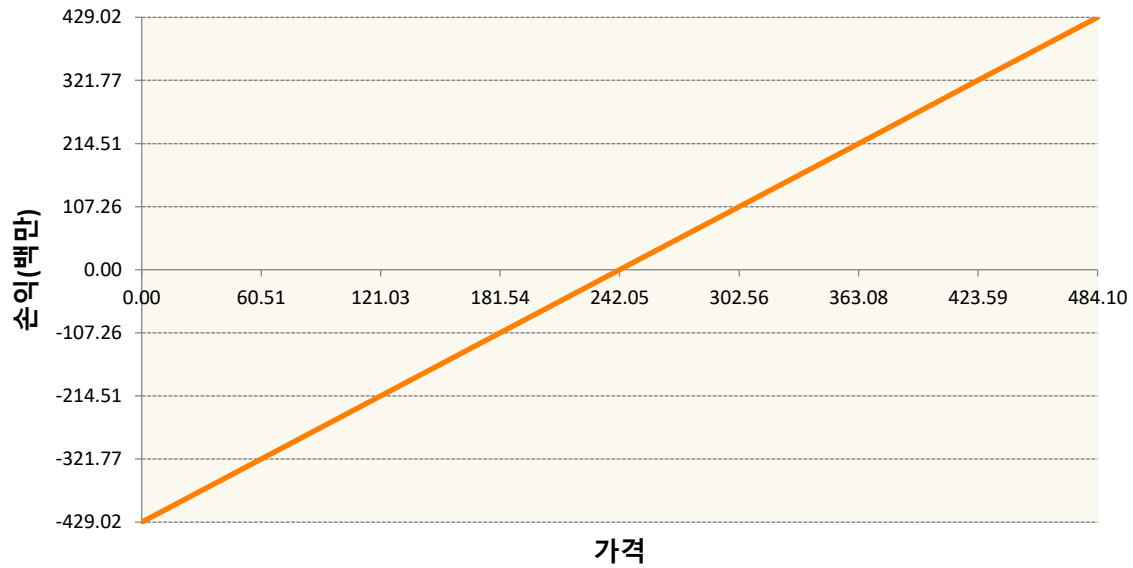
CH2-CORN FUTURE Mar22



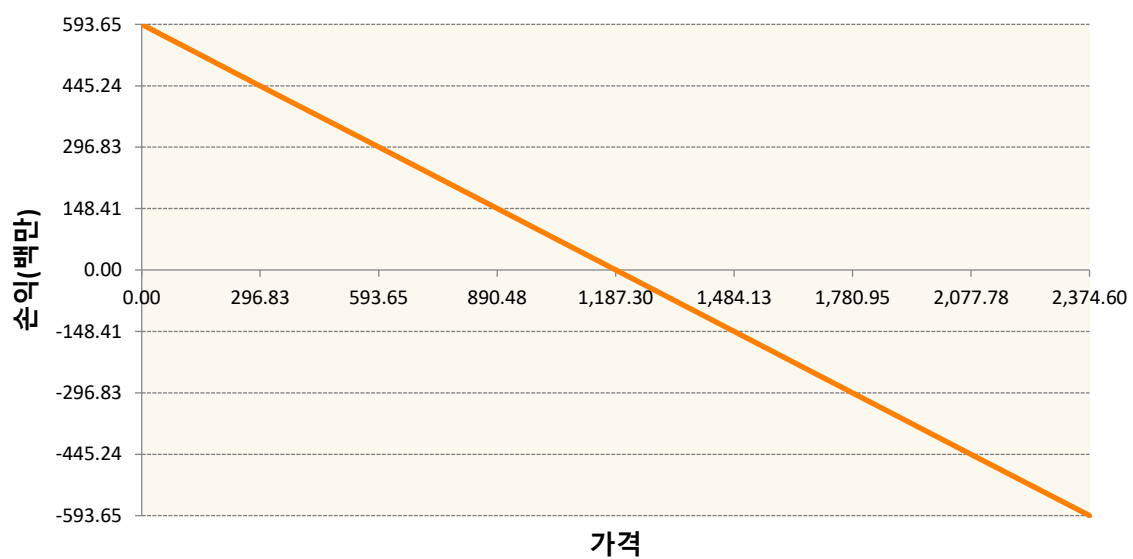
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



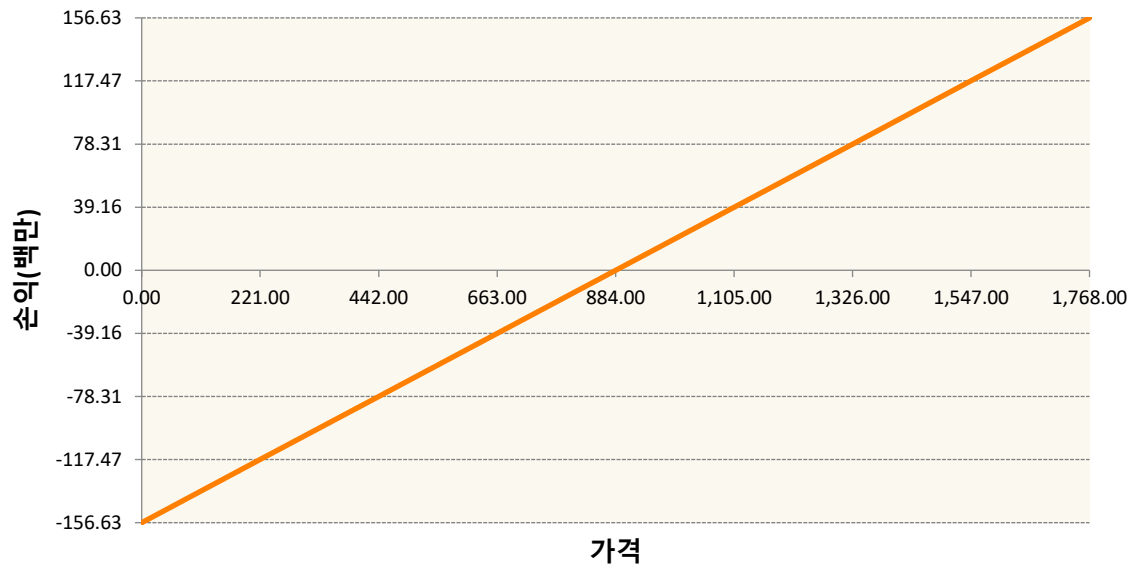
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



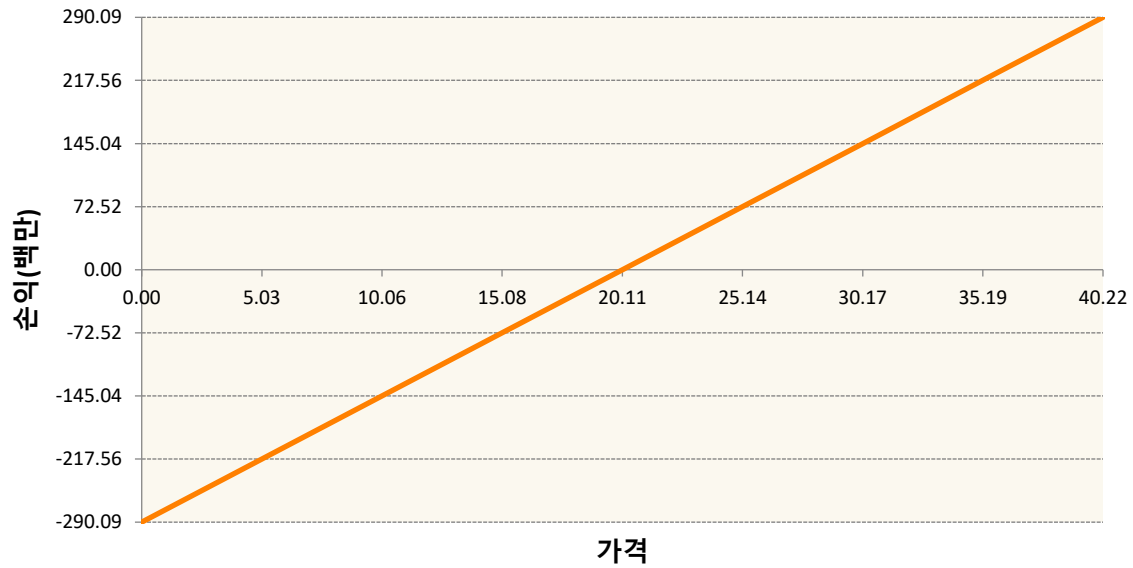
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



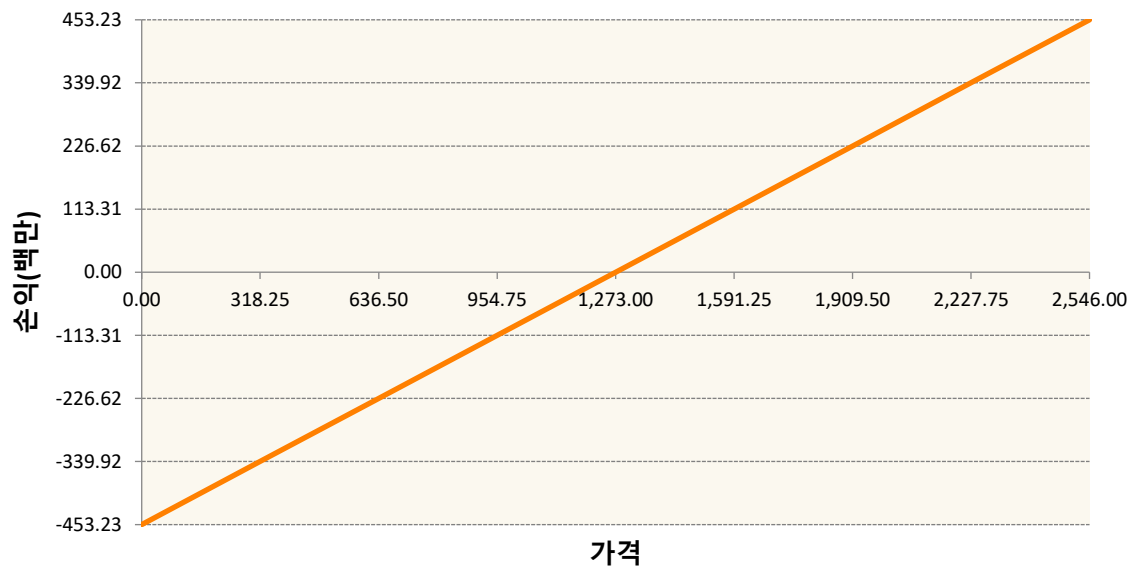
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



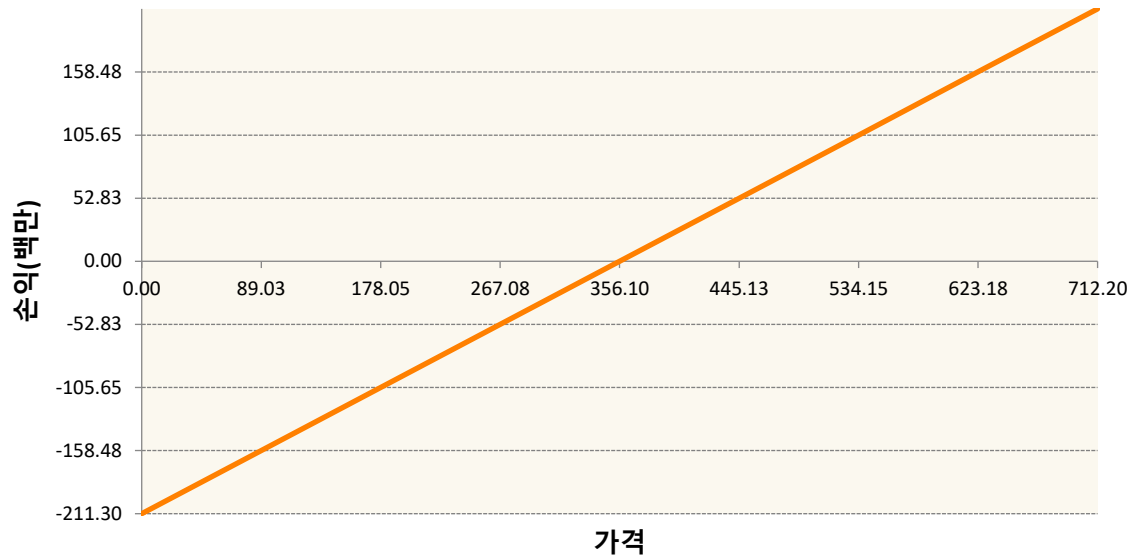
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



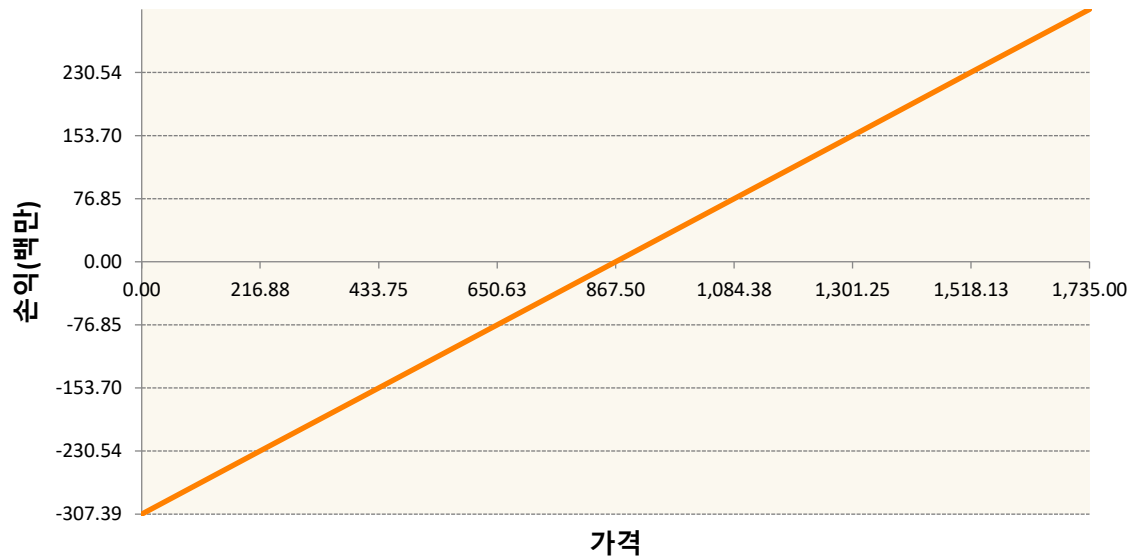
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	42
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22	11
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22	34
KR4175RC00 2021-12 달러선물		47
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22	13
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22	23
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22	36
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22	17
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22	25

