

공시일 2021-11-26

기준일 2021-11-25

포커스농산물모(채권-파생형)

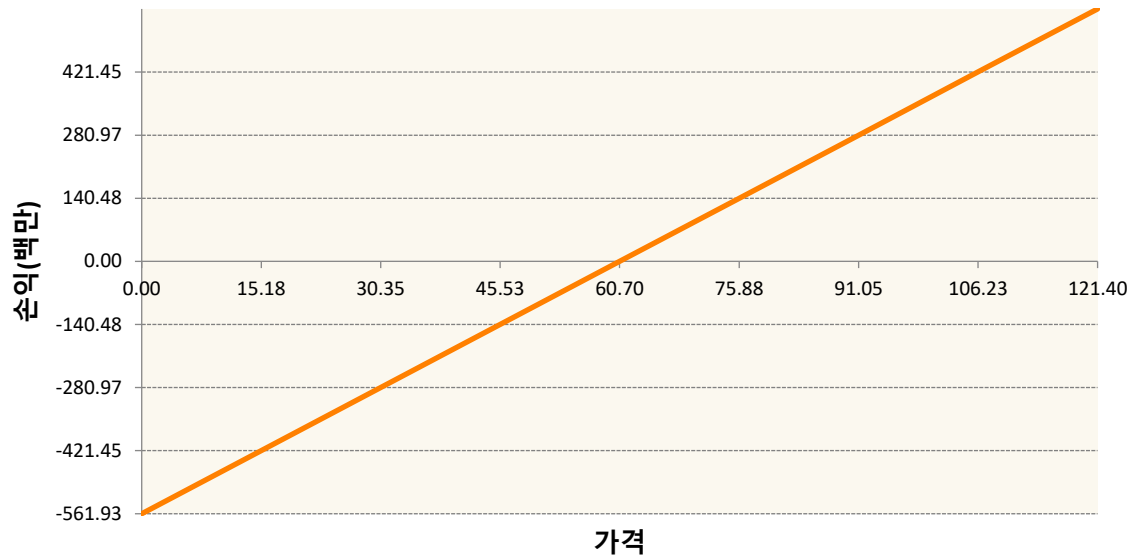
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

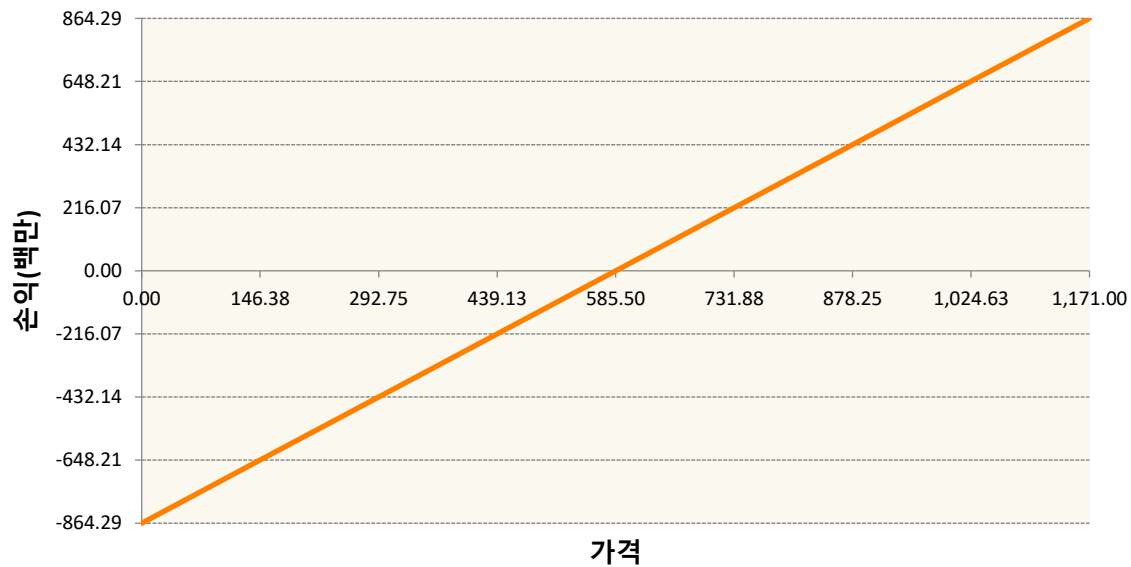
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,822	536	4,286	

2. 만기시점의 손익구조

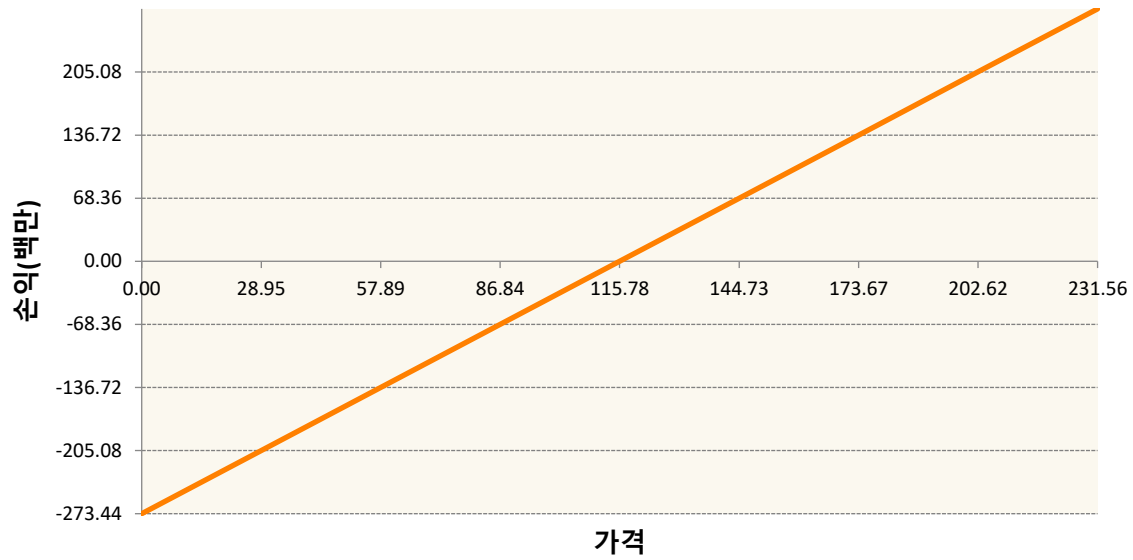
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



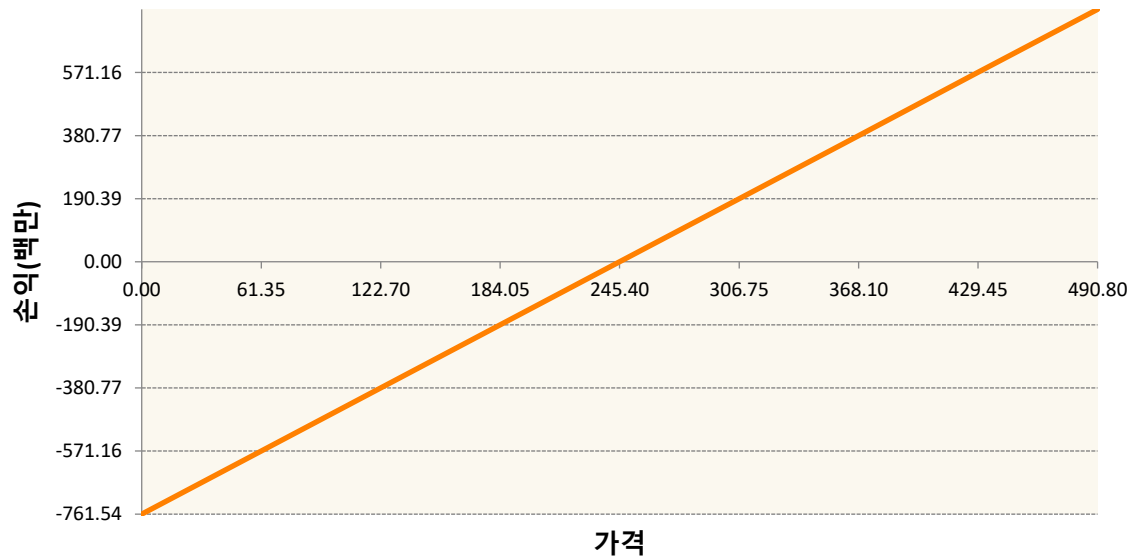
CH2-CORN FUTURE Mar22



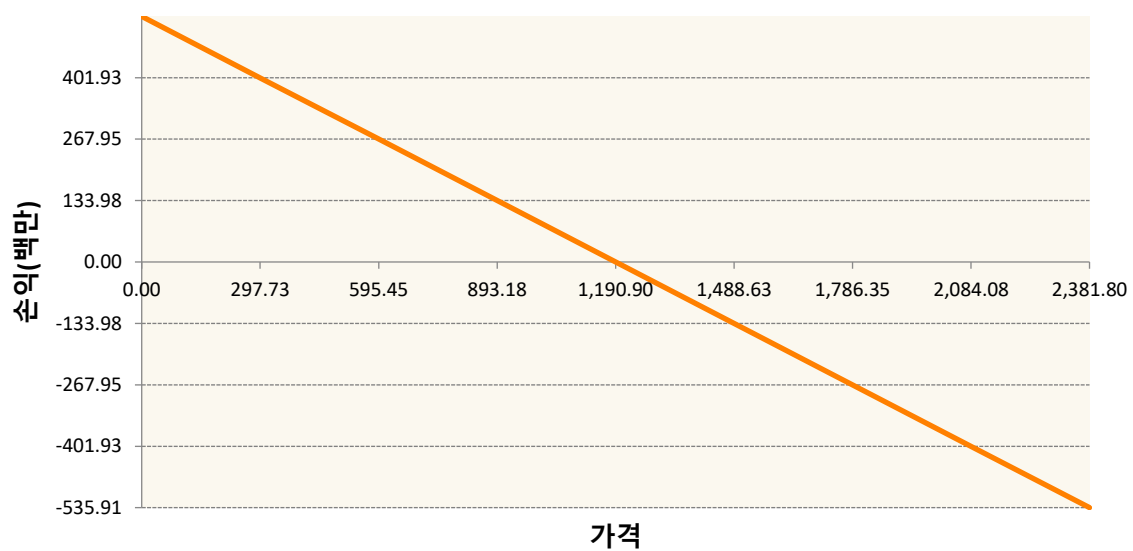
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



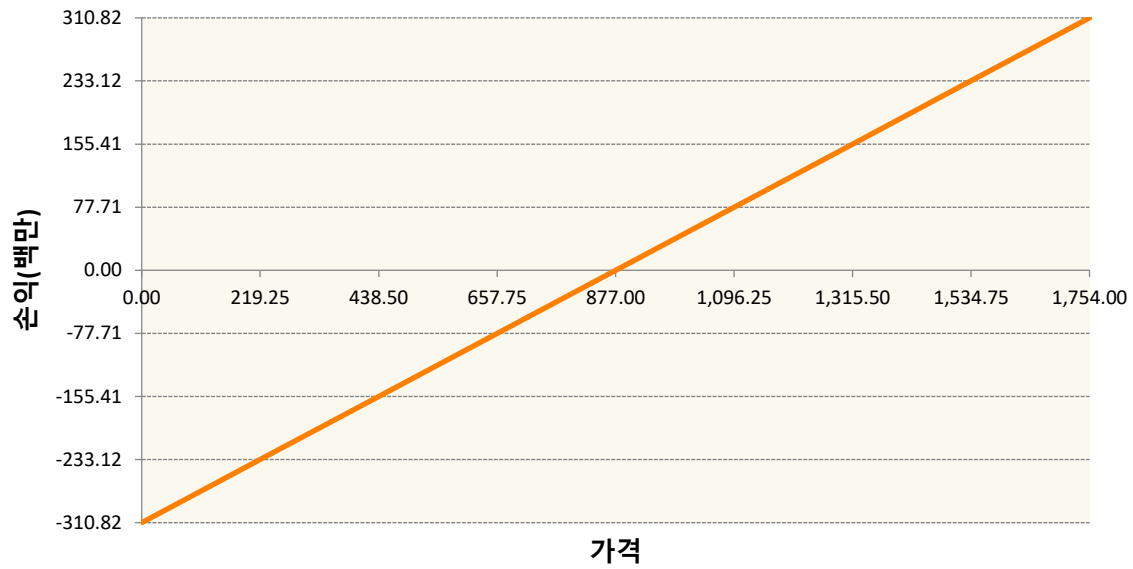
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



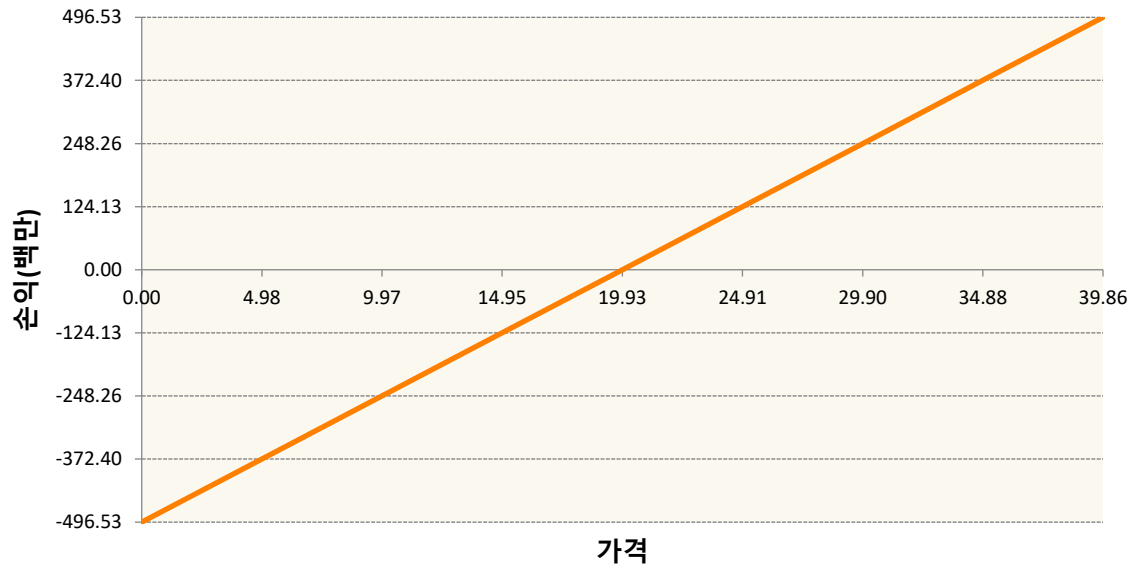
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



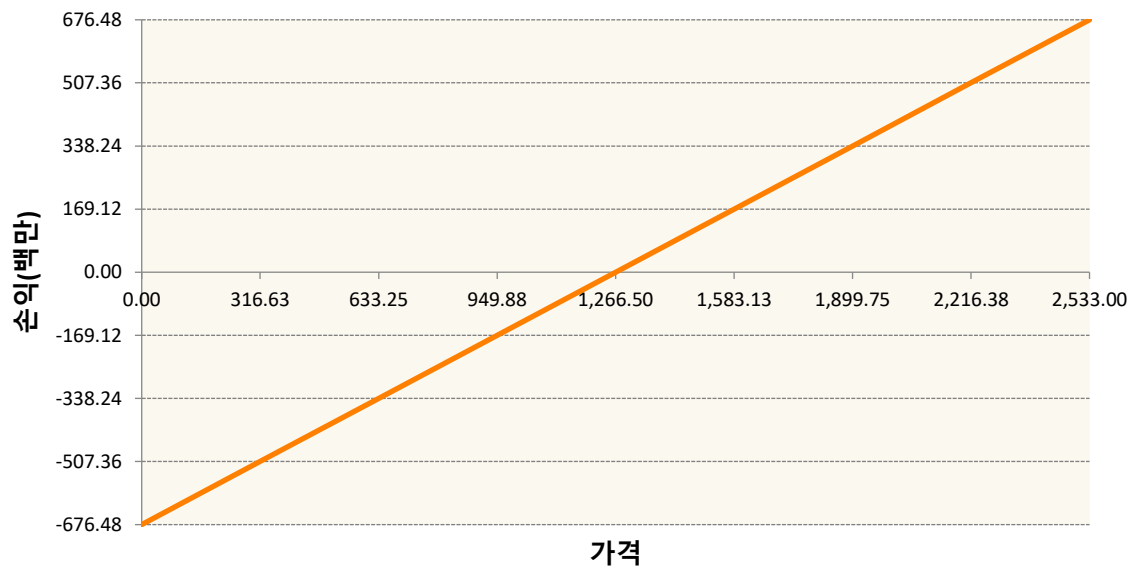
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



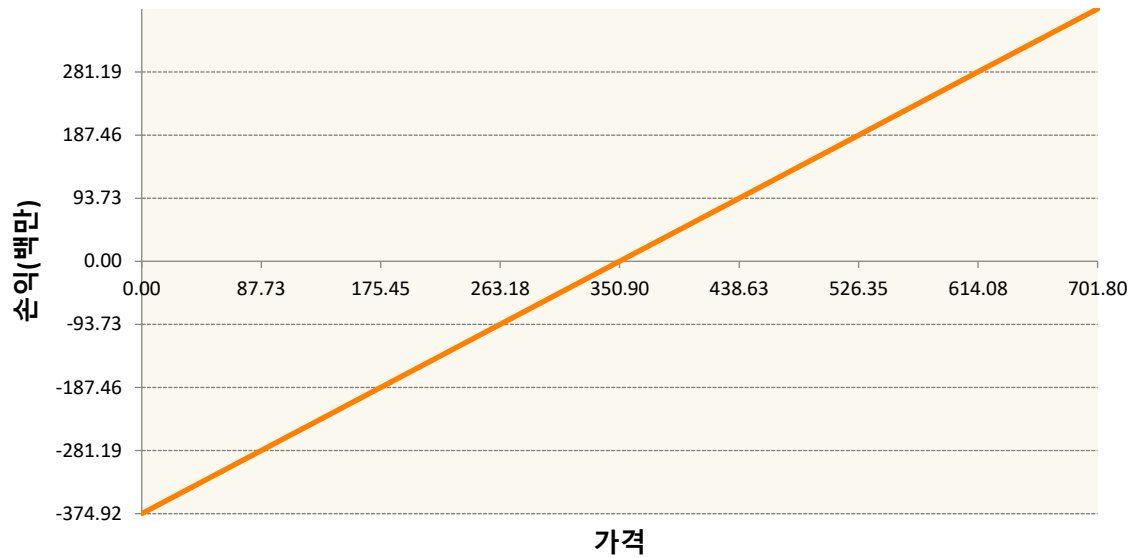
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



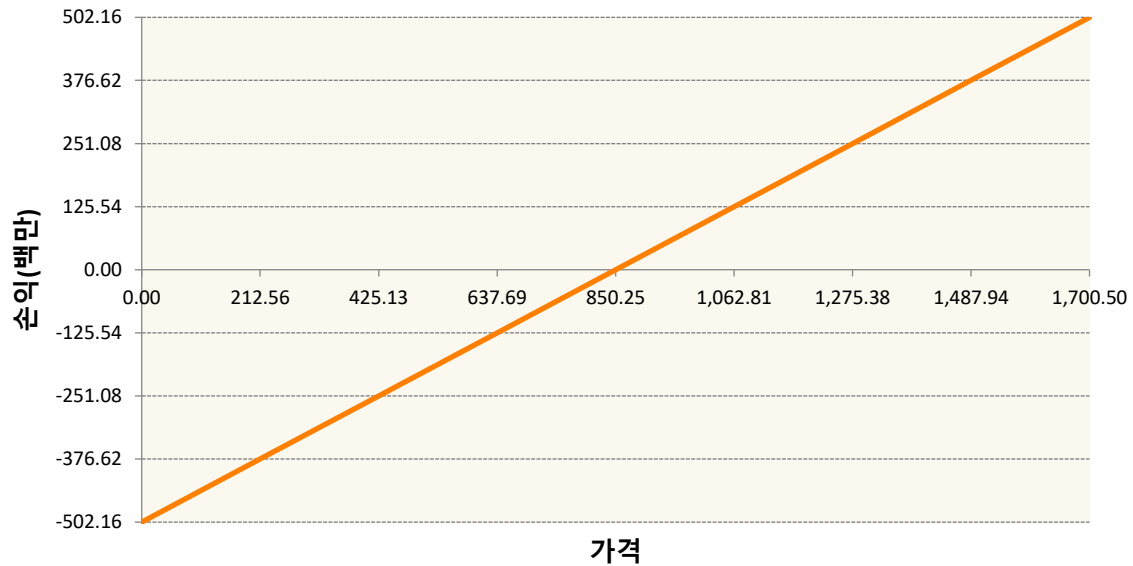
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	2021-11-26
기준일	2021-11-25

스마트인덱스모

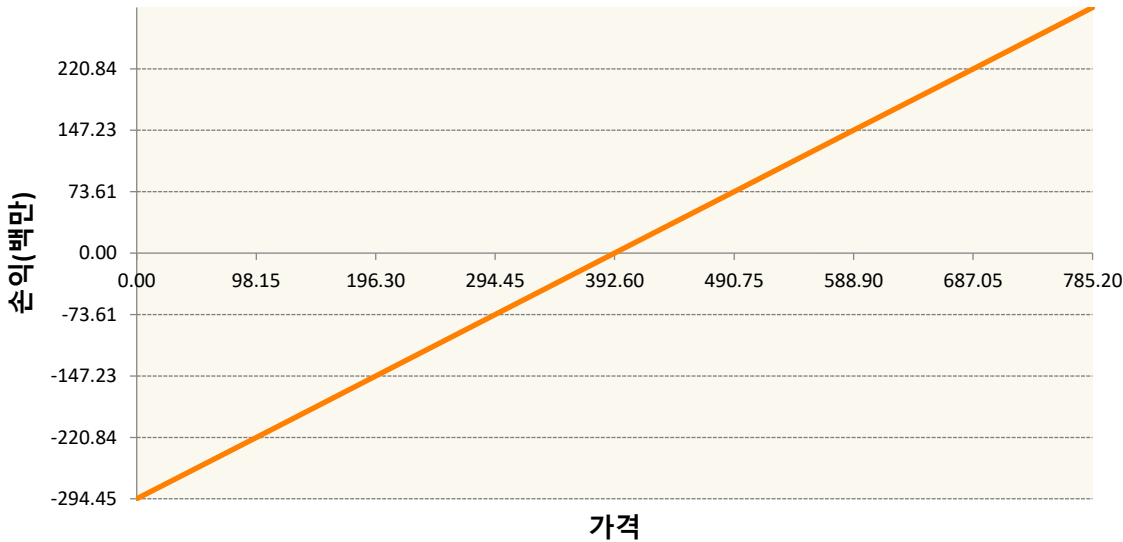
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	294	0	294	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	2021-11-26
기준일	2021-11-25

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	11,469	0	11,469	장외
누계	지수	스왑	11,469	0	11,469	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20211125

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	2021-11-26
기준일	2021-11-25

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)

428

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-11-26
기준일	2021-11-25

유로인덱스모(주식-파생형)

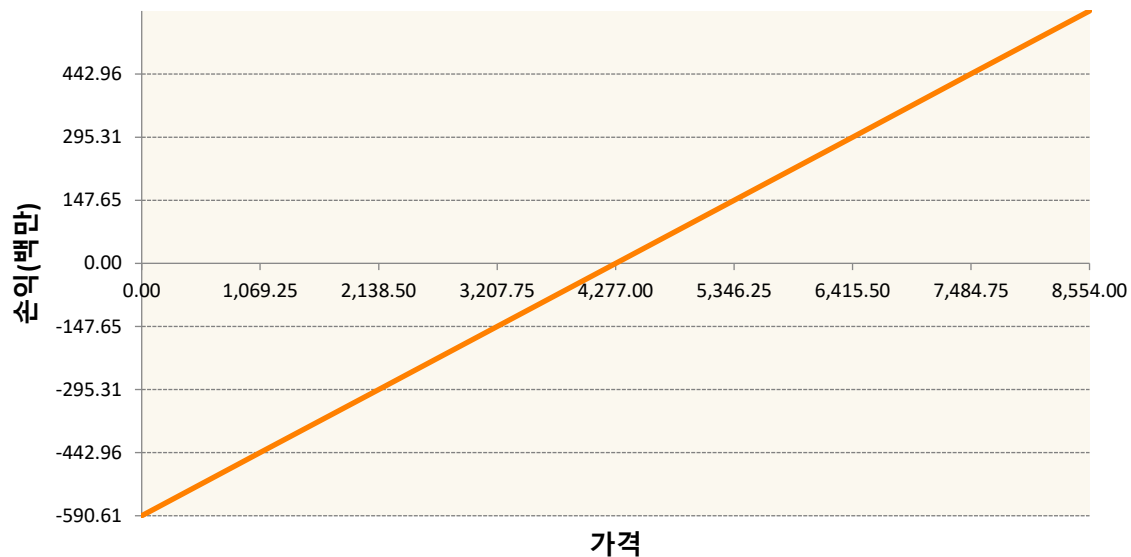
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	591	0	591	

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	2021-11-26
기준일	2021-11-25

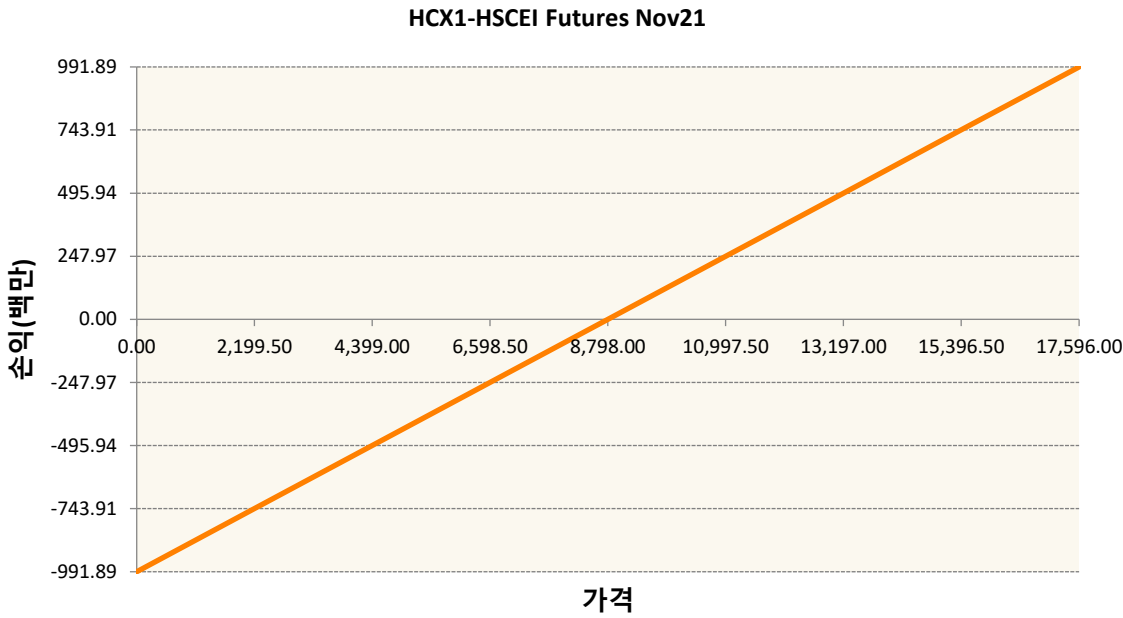
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	992	0	992	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 2021-11-26

기준일 2021-11-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

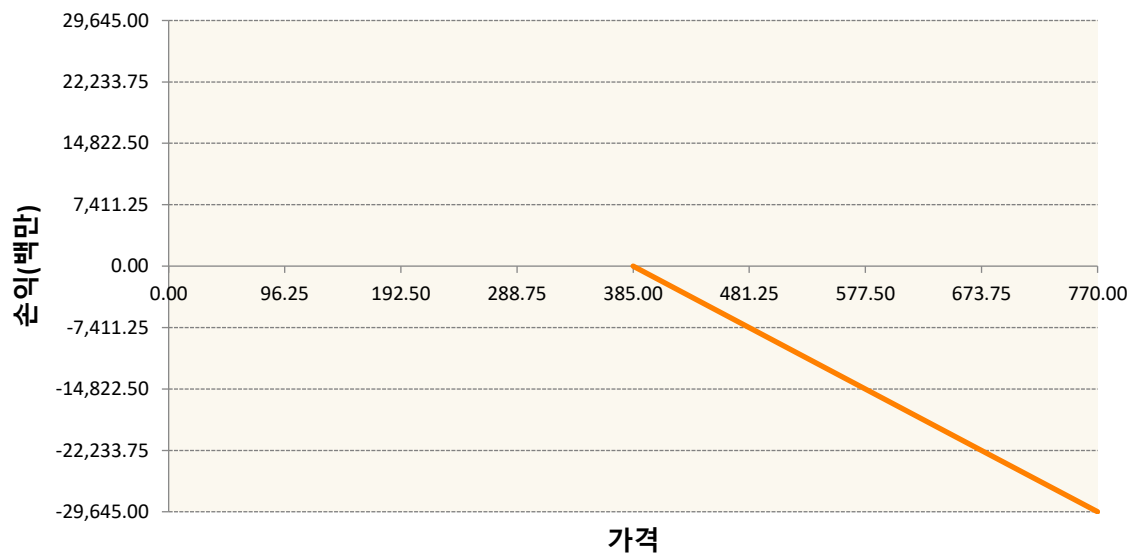
1. 계약금액

(단위:백만원)

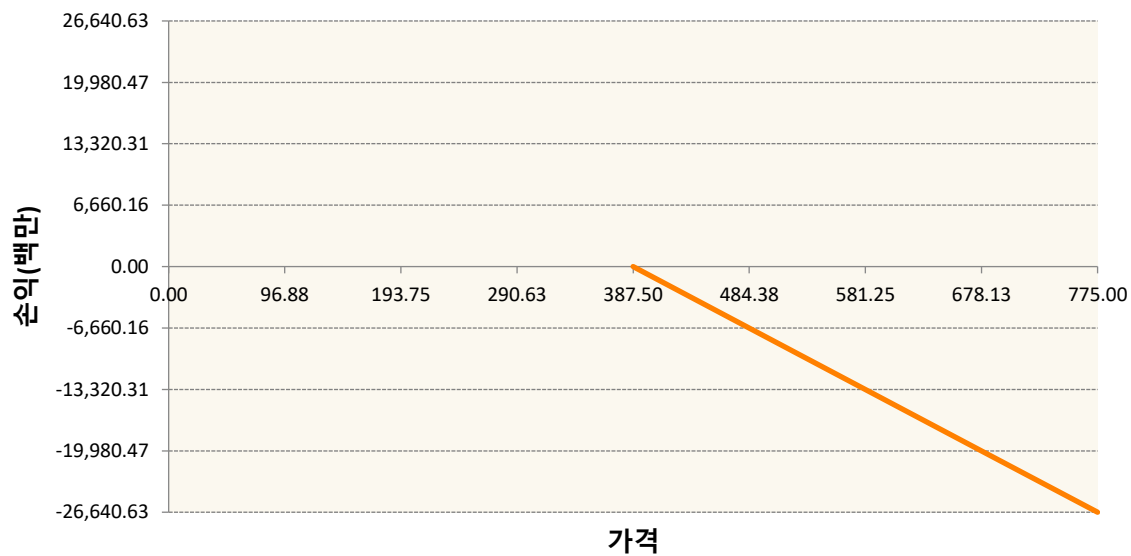
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,517	-76,517	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201RC3854-2021-12 콜385



KR4201RC3870-2021-12 콜387.5



가격	순이익(백만)
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/loss function for a product. The x-axis represents the price ('가격') and the y-axis represents the profit/loss in millions ('손익 (백만)'). The line starts at a price of 0.00 with a loss of 2,906.25 million and reaches a break-even point at a price of 387.50, where profit/loss is 0.00 million.

가격 (Price)	손익 (백만) (Profit/Loss in millions)
0.00	-2,906.25
387.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201RC3854							2021-12 콜385		2,096	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	879	867	851	832	811	787	760			
-5.33%	803	772	738	702	665	626	586			
-2.67%	580	532	484	435	387	339	290			
0%	138	93	47	0	-47	-95	-143			
2.67%	-500	-527	-558	-591	-627	-664	-703			
5.33%	-1,250	-1,261	-1,276	-1,294	-1,315	-1,339	-1,365			
8.00%	-2,041	-2,044	-2,050	-2,057	-2,067	-2,080	-2,096			
KR4201RC3870							2021-12 콜387.5		1,816	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	687	679	667	654	637	618	597
-5.33%	637	614	587	559	528	496	462
-2.67%	476	435	394	352	310	268	225
0%	130	87	44	0	-44	-88	-131
2.67%	-403	-432	-463	-497	-532	-568	-606
5.33%	-1,055	-1,068	-1,084	-1,103	-1,126	-1,150	-1,177
8.00%	-1,756	-1,760	-1,766	-1,775	-1,786	-1,800	-1,816
KR4301RC3853 2021-12 풋385							1,014

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,000	-1,001	-1,002	-1,004	-1,006	-1,010	-1,014
-5.33%	-541	-547	-555	-563	-573	-584	-596
-2.67%	-157	-174	-192	-209	-227	-245	-263
0%	46	31	16	0	-16	-33	-50
2.67%	98	94	88	81	73	64	54
5.33%	104	104	103	101	99	96	92
8.00%	104	104	104	104	104	103	102

KR4301RC3879 2021-12 풋387.5							181
--	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-179	-179	-179	-179	-180	-180	-181
-5.33%	-102	-102	-103	-104	-106	-107	-109
-2.67%	-33	-36	-38	-41	-44	-47	-49
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	22	21	19	18	16	14	12
5.33%	24	23	23	23	22	21	21
8.00%	24	24	24	24	23	23	23

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

(단위:백만원)

5,361

공시일 2021-11-26

기준일 2021-11-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

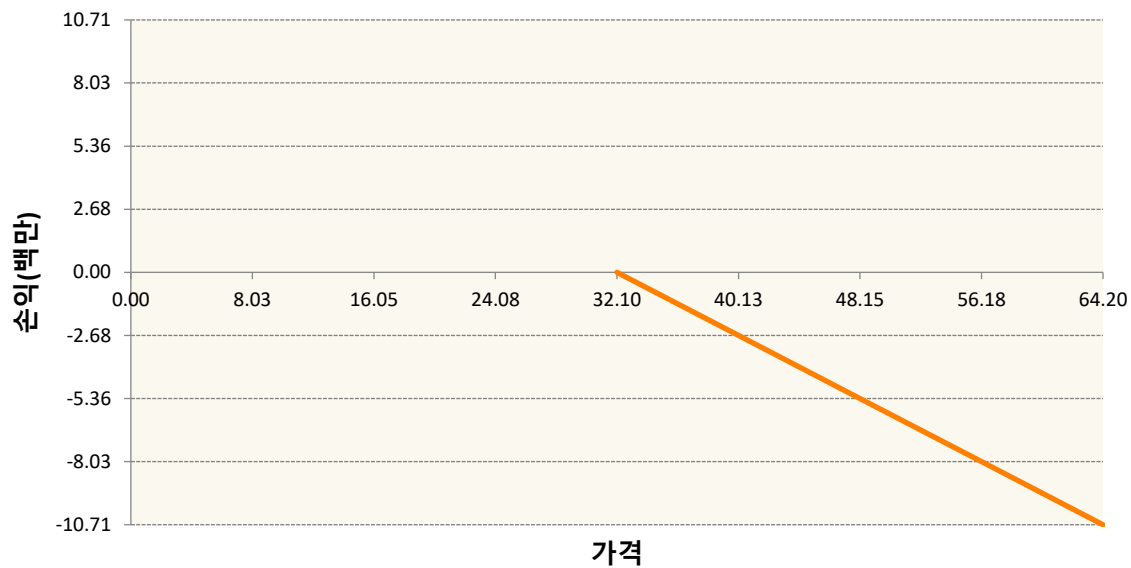
1. 계약금액

(단위:백만원)

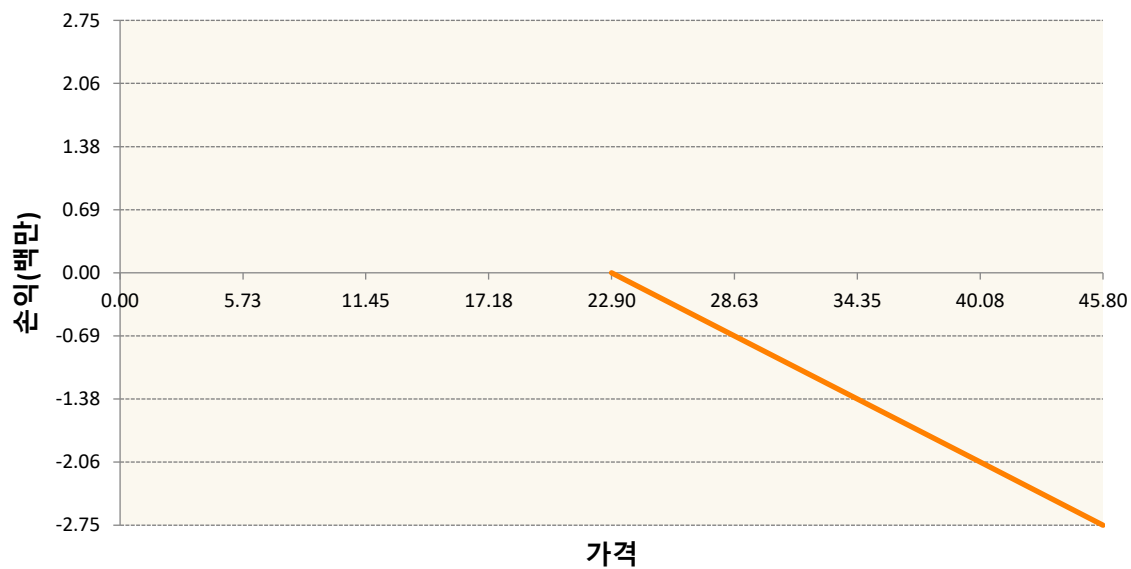
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	75	-75	장내

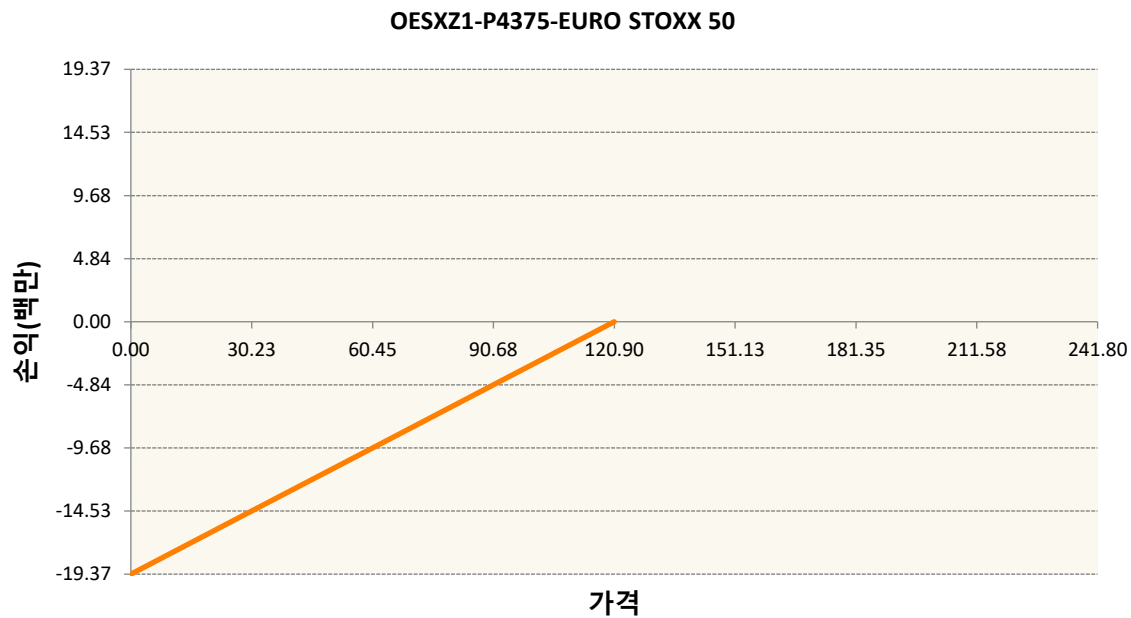
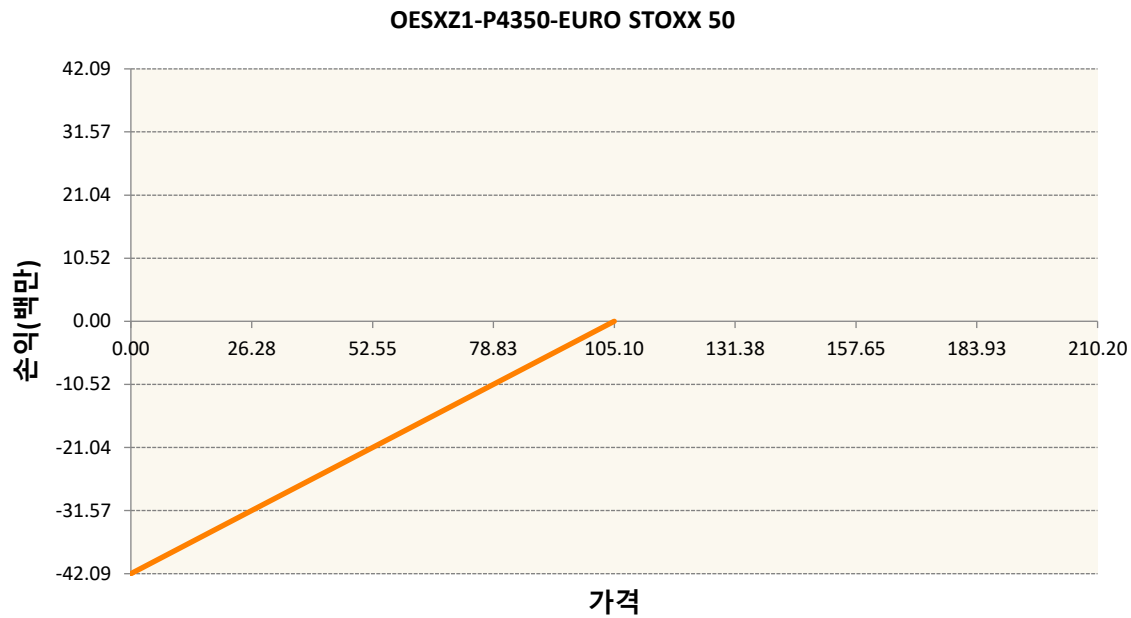
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		6
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		1
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.22
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		3
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		11

공시일 2021-11-26

기준일 2021-11-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

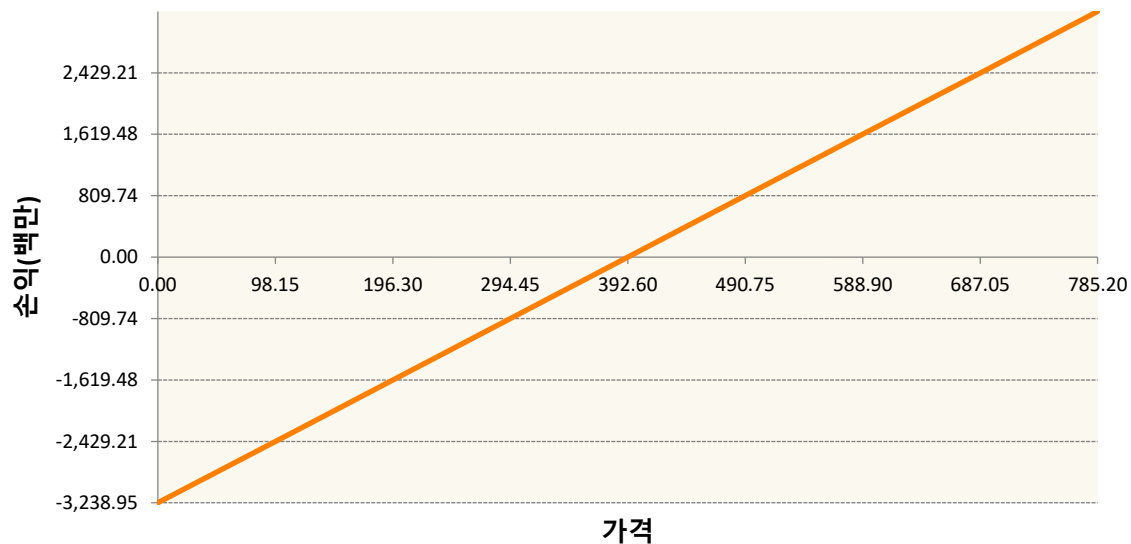
1. 계약금액

(단위:백만원)

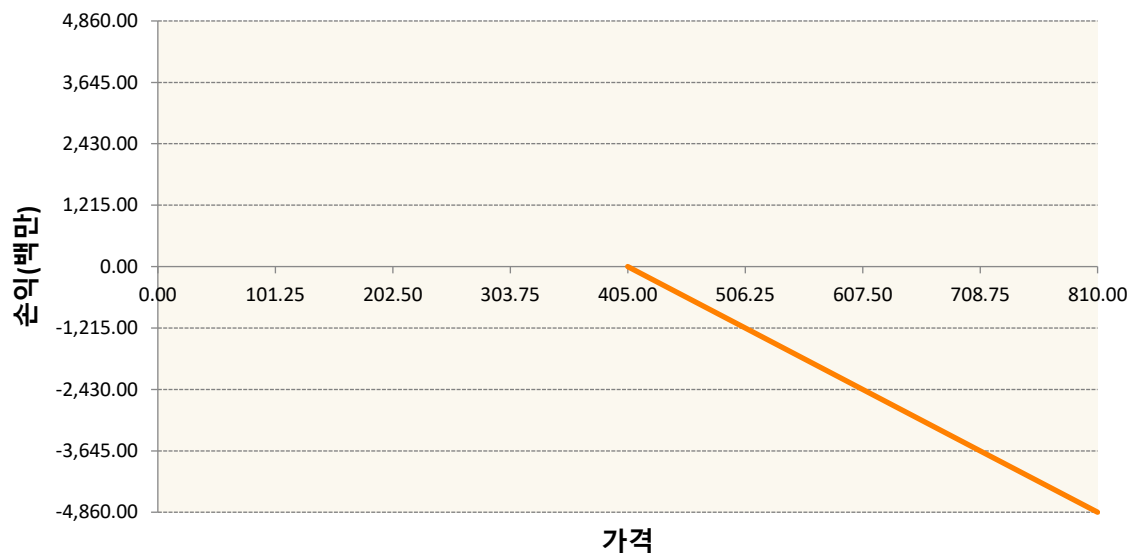
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,239	0	3,239	장내
누계	유가증권	옵션	579	5,369	-4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조

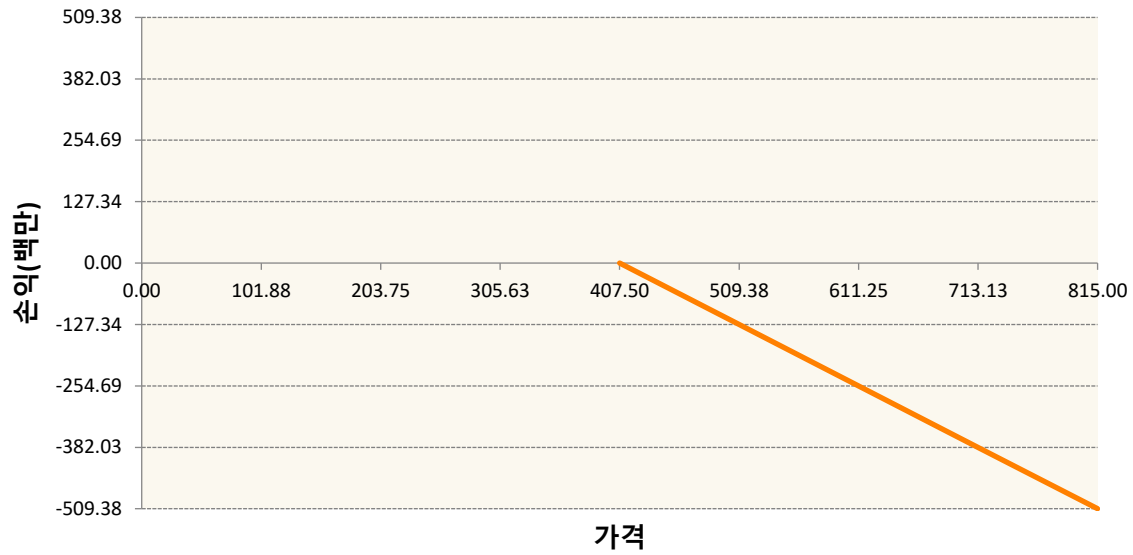
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



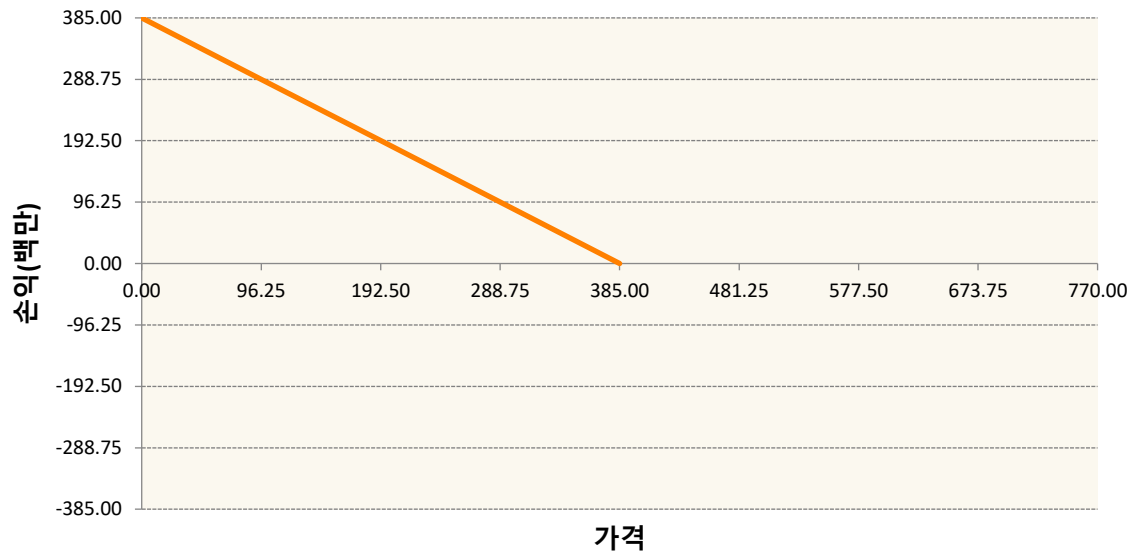
KR4201RC4050-2021-12 콜405



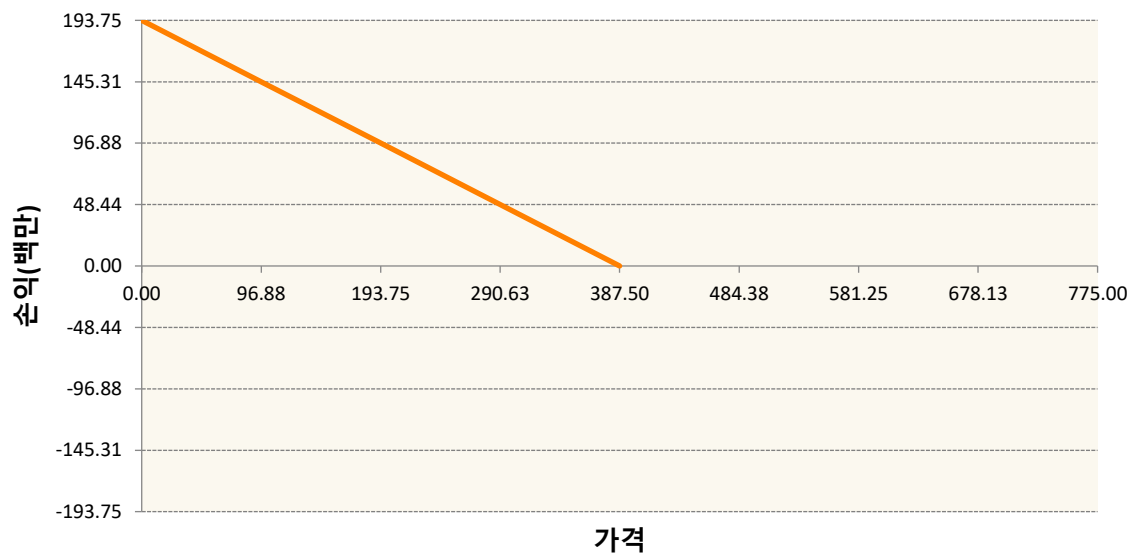
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



KR4301RC3853-2021-12 풋385



KR4301RC3879-2021-12 풋387.5



(단위:백만원)

KR4101RC0000							2021-12 코스피200지수선물		259		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259				
-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%	259	259	259	259	259	259	259				
KR4201RC4050							2021-12 콜405		226		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	37	36	36	36	35	34	33				
-5.33%	36	35	34	33	31	29	26				
-2.67%	33	30	27	23	19	15	10				
0%	18	12	6	0	-7	-13	-20				
2.67%	-21	-29	-37	-45	-53	-61	-69				
5.33%	-92	-99	-107	-115	-122	-130	-138				
8.00%	-192	-197	-202	-207	-213	-219	-226				
KR4201RC4076							2021-12 콜407.5		22		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3				
-5.33%	3	3	3	3	3	2	2				
-2.67%	3	3	2	2	2	1	1				
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2				
2.67%	-2	-2	-3	-4	-5	-6	-7				
5.33%	-8	-9	-10	-11	-12	-12	-13				
8.00%	-18	-19	-19	-20	-21	-21	-22				
KR4301RC3853							2021-12 풋385		23		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	22	22	22	22	22	22	23				
-5.33%	12	12	12	13	13	13	13				
-2.67%	3	4	4	5	5	5	6				
0%	-1	-1	0	0	0	1	1				
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1				
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2				
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2				
KR4301RC3879							2021-12 풋387.5		12		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7
-2.67%	2	2	3	3	3	3	3
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

497

공시일	2021-11-26
기준일	2021-11-25

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	18,504	0	18,504	

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	2021-11-26
기준일	2021-11-25

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	9,653	0	9,653	

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	2021-11-26
기준일	2021-11-25

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	45,590	0	45,590	

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 2021-11-26

기준일 2021-11-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

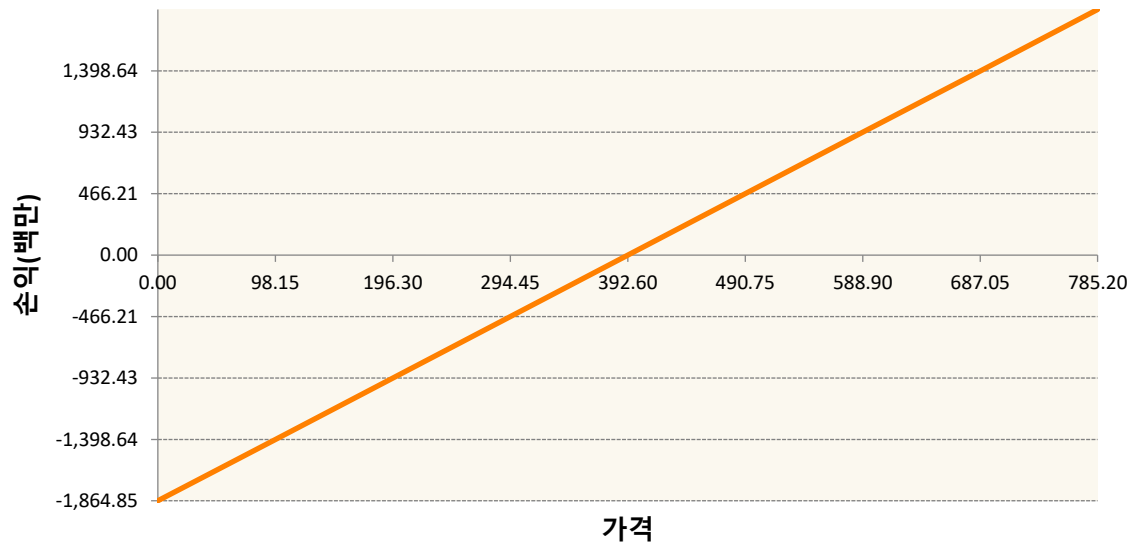
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,865	0	1,865	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101RC0000

2021-12 코스피200지수선물

149

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
-5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-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%	99	99	99	99	99	99	99
8.00%	149	149	149	149	149	149	149

공시일	2021-11-26
기준일	2021-11-25

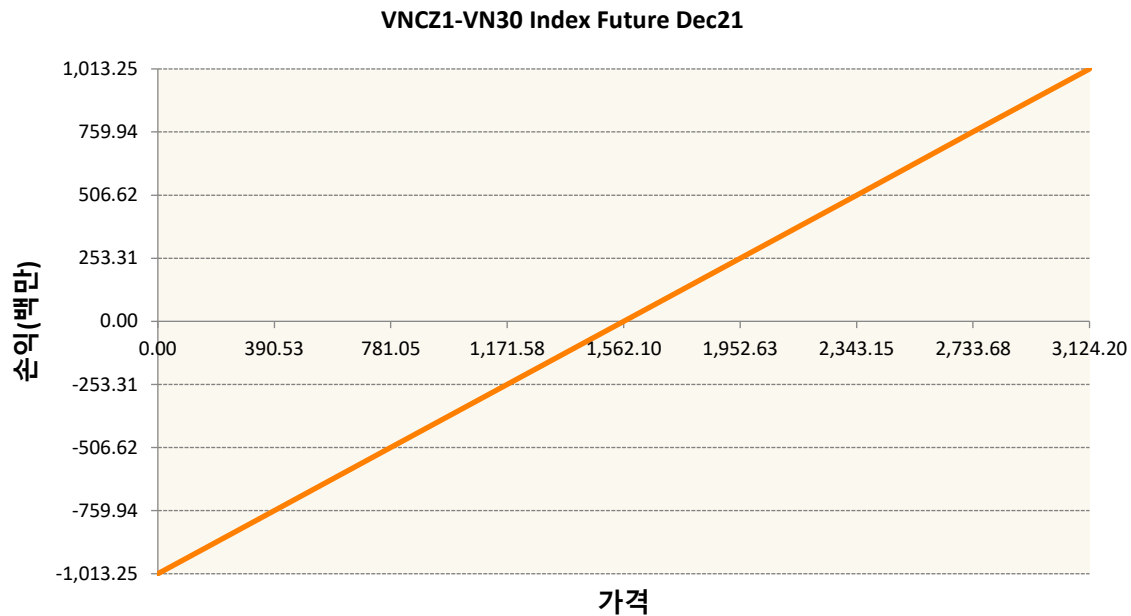
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	1,013	0	1,013	
누계	유가증권	스왑	1,783	0	1,783	장외
누계	통화	선도	0	441	-441	장외

2. 만기시점의 손익구조



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	81

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

(단위:백만원)

257

공시일 2021-11-26

기준일 2021-11-25

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

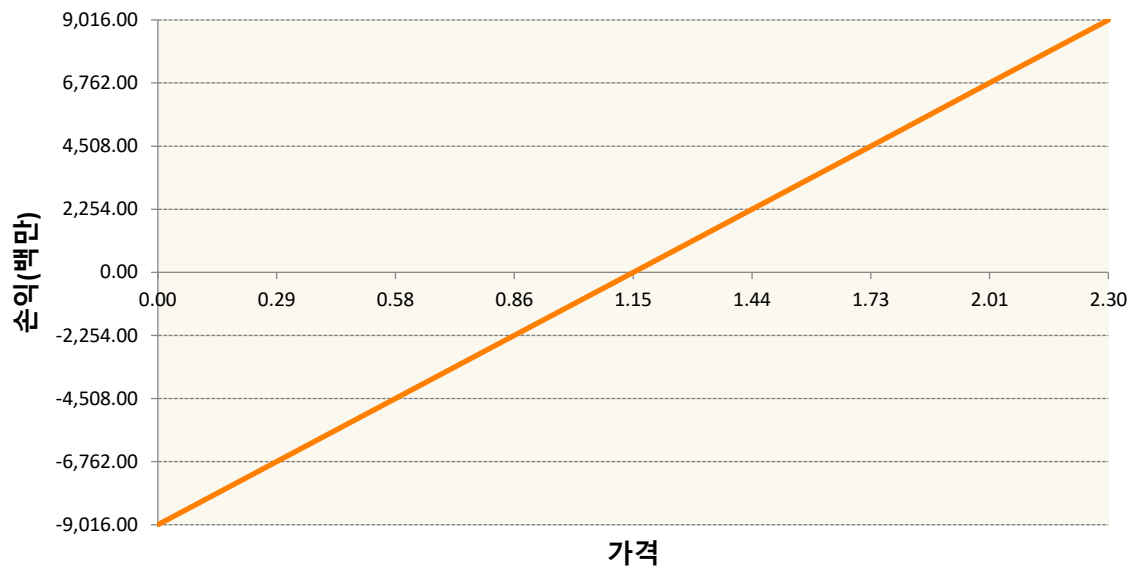
1. 계약금액

(단위:백만원)

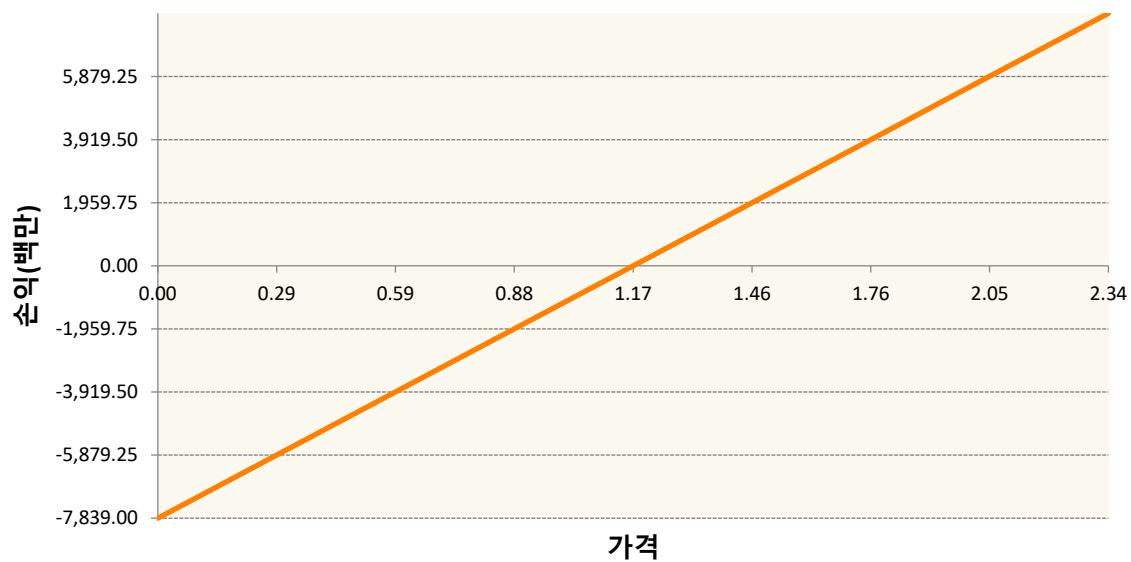
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	22,487	0	22,487	

2. 만기시점의 손익구조

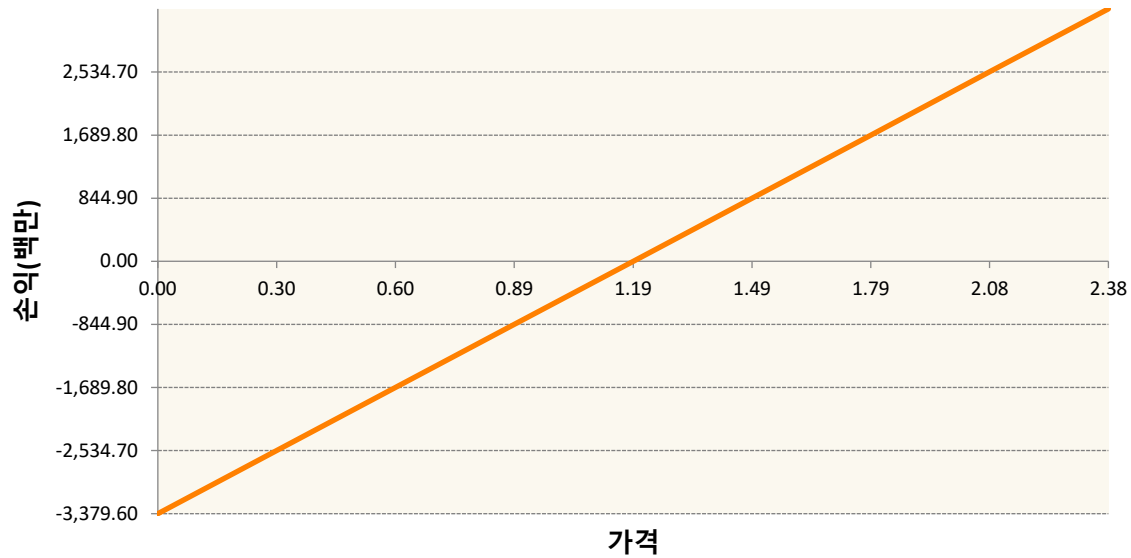
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



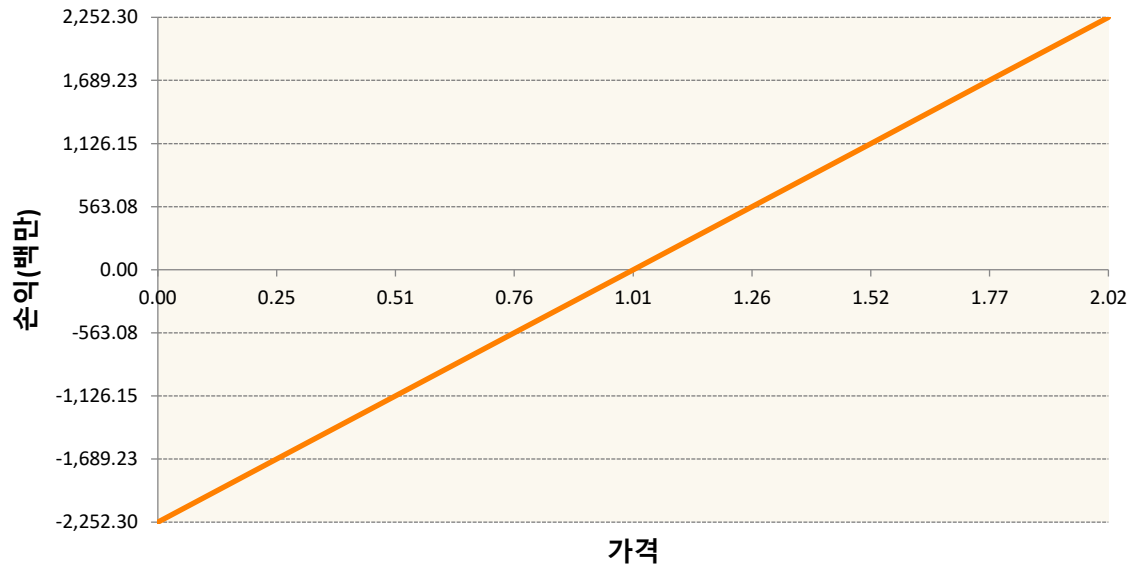
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



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)	723
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	629
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	271
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	180

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

(단위:백만원)

2,728

공시일	2021-11-26
기준일	2021-11-25

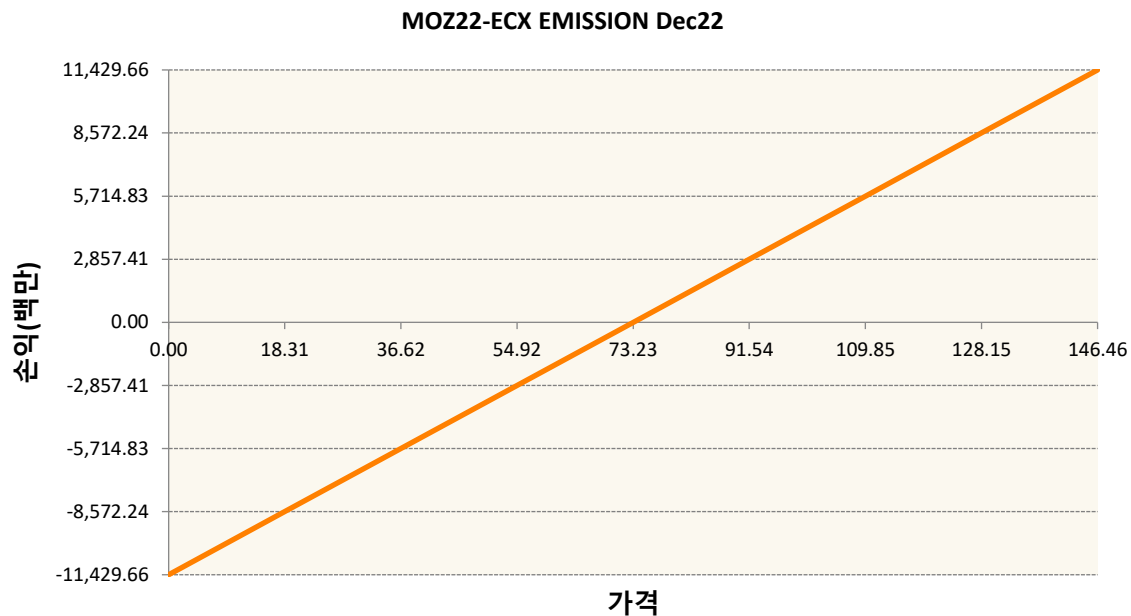
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,430	0	11,430	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

MOZ22	ECX EMISSION Dec22	914
-------	--------------------	-----

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

(단위:백만원)

1,853

공시일 2021-11-26

기준일 2021-11-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

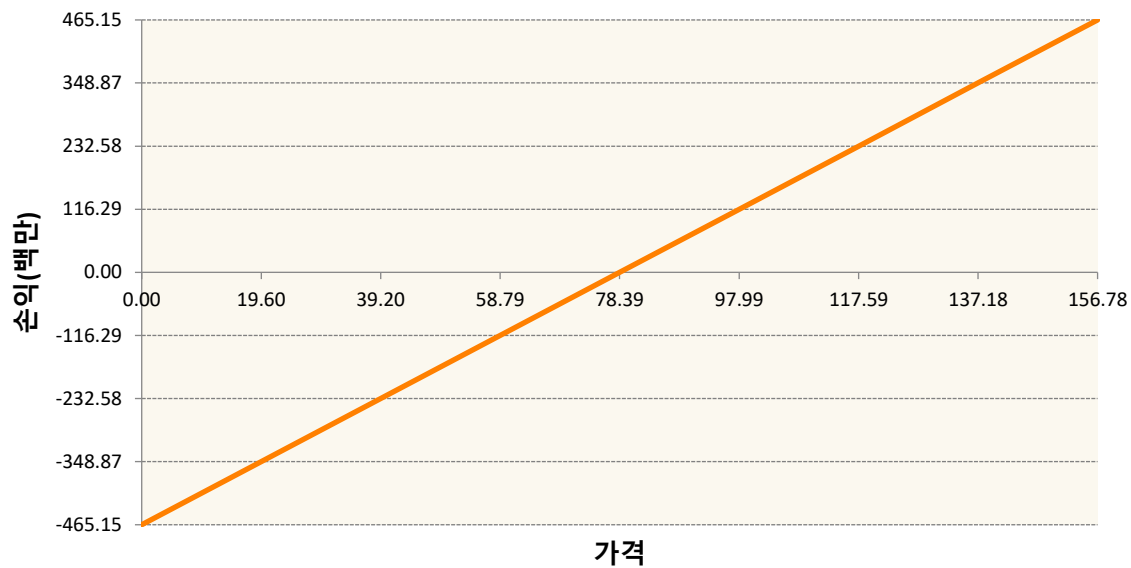
1. 계약금액

(단위:백만원)

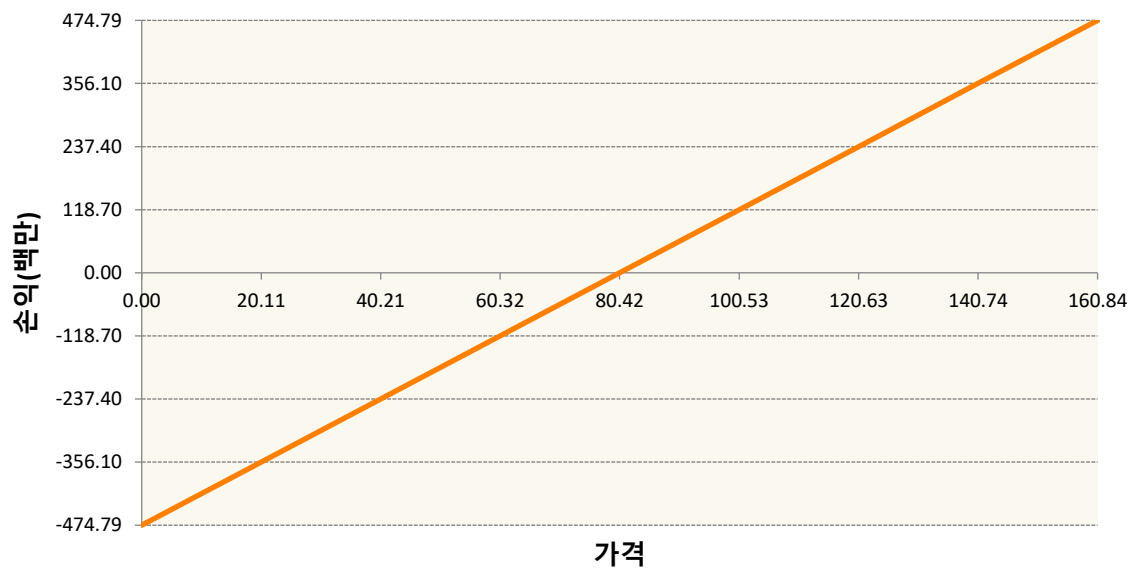
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,146	536	1,610	

2. 만기시점의 손익구조

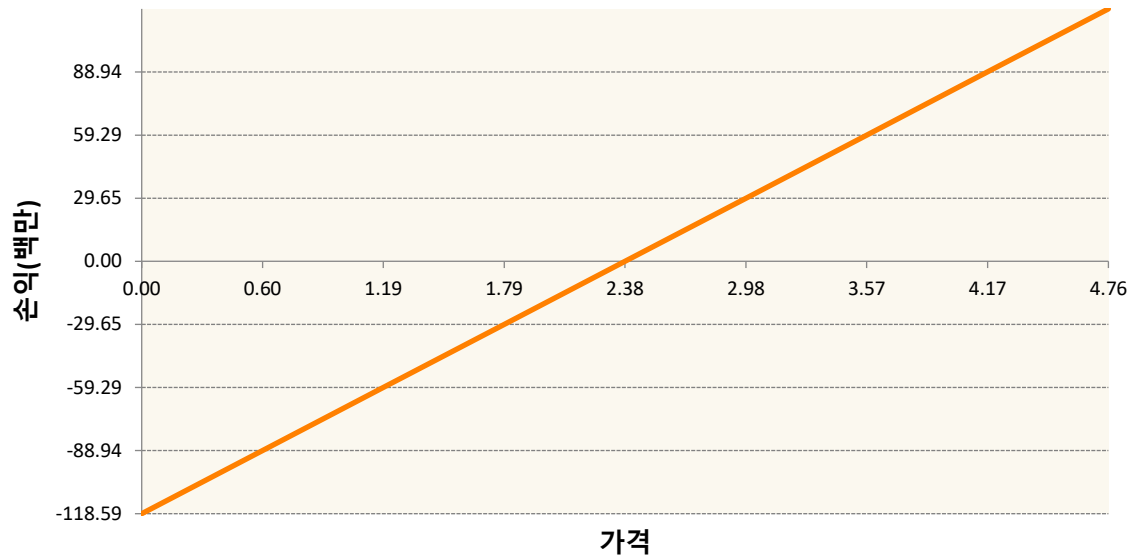
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



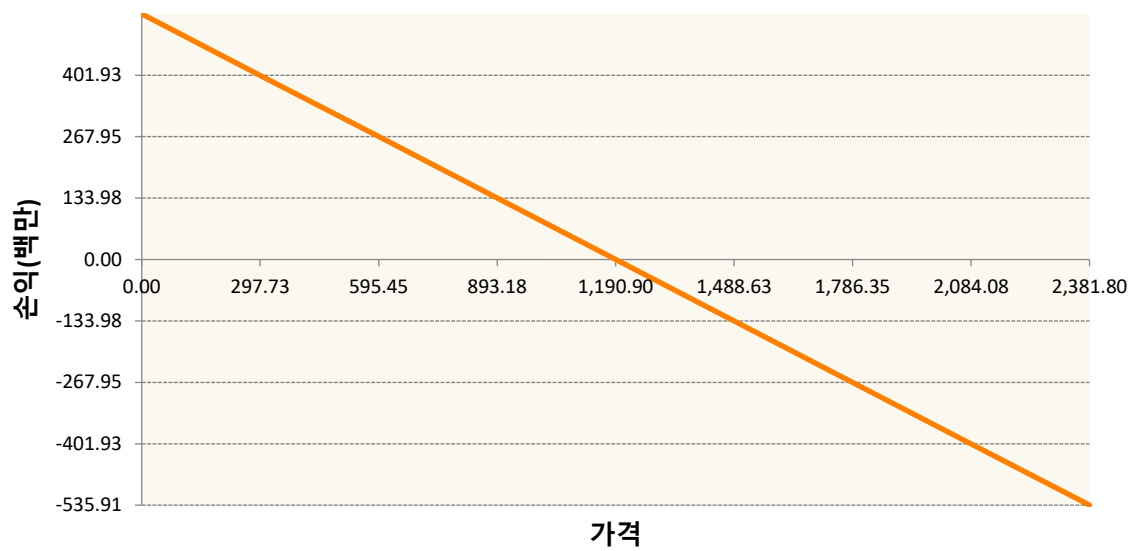
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



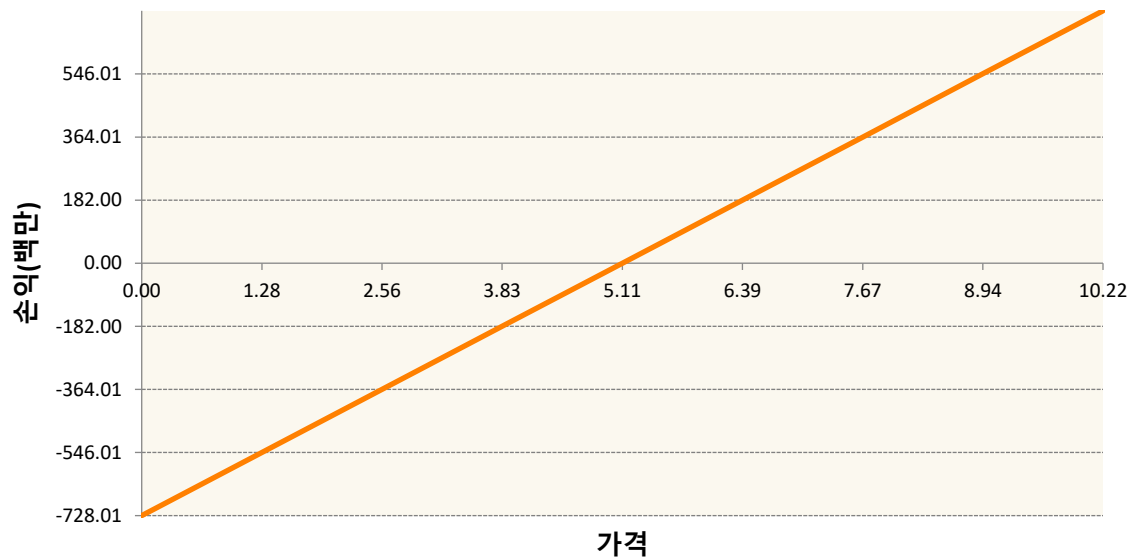
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22



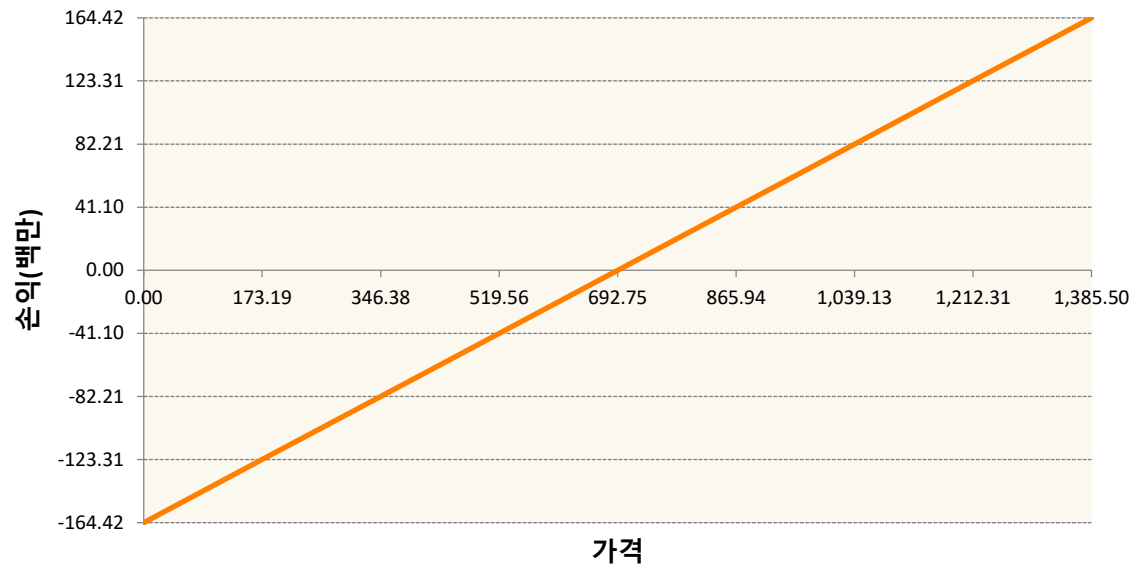
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



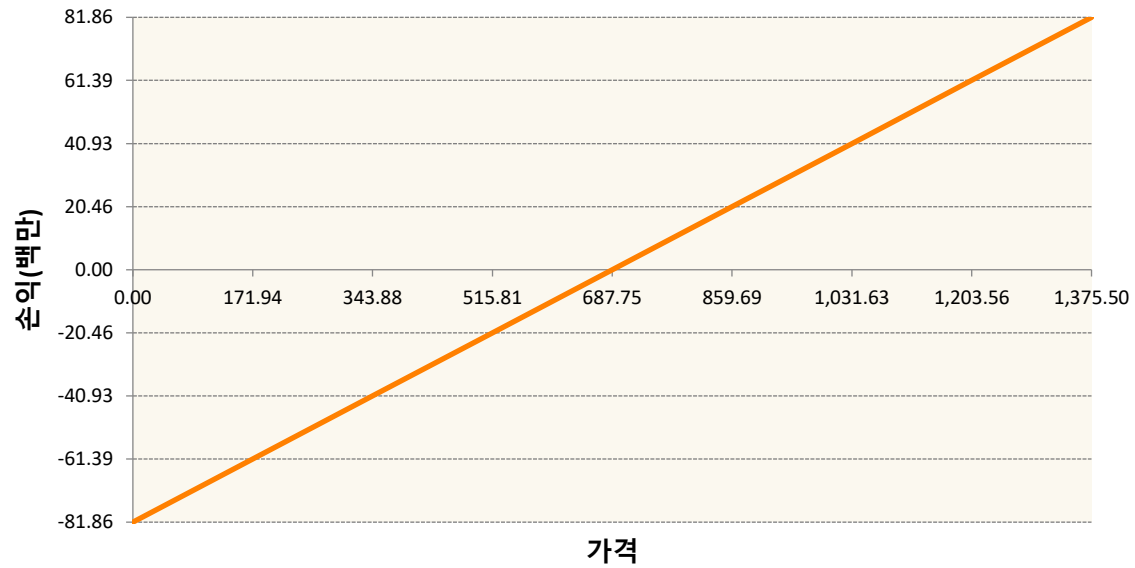
NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22



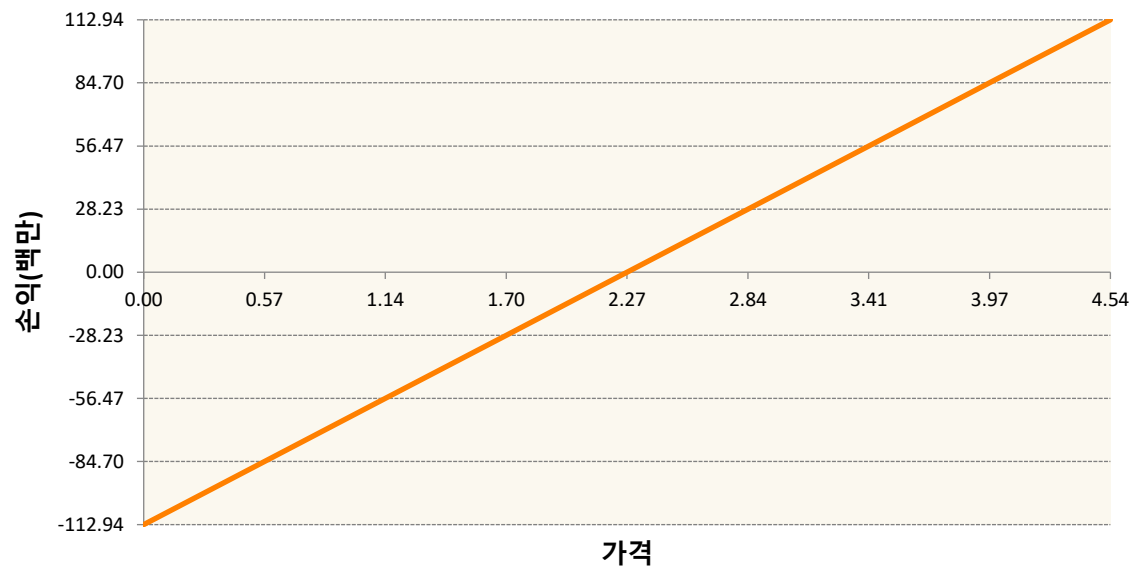
QSF2-Low Su Gasoil G Jan22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBF2-GASOLINE RBOB FUT 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	58
QSF2	Low Su Gasoil G Jan22	13
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	7
XBF2	GASOLINE RBOB FUT Jan22	9

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

380

공시일 2021-11-26

기준일 2021-11-25

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

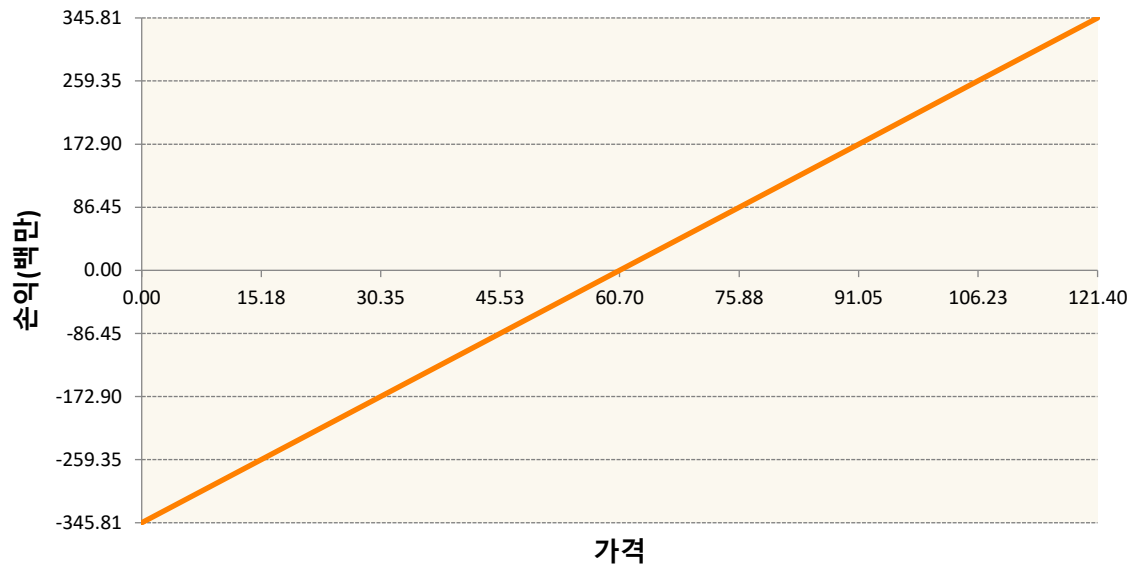
1. 계약금액

(단위:백만원)

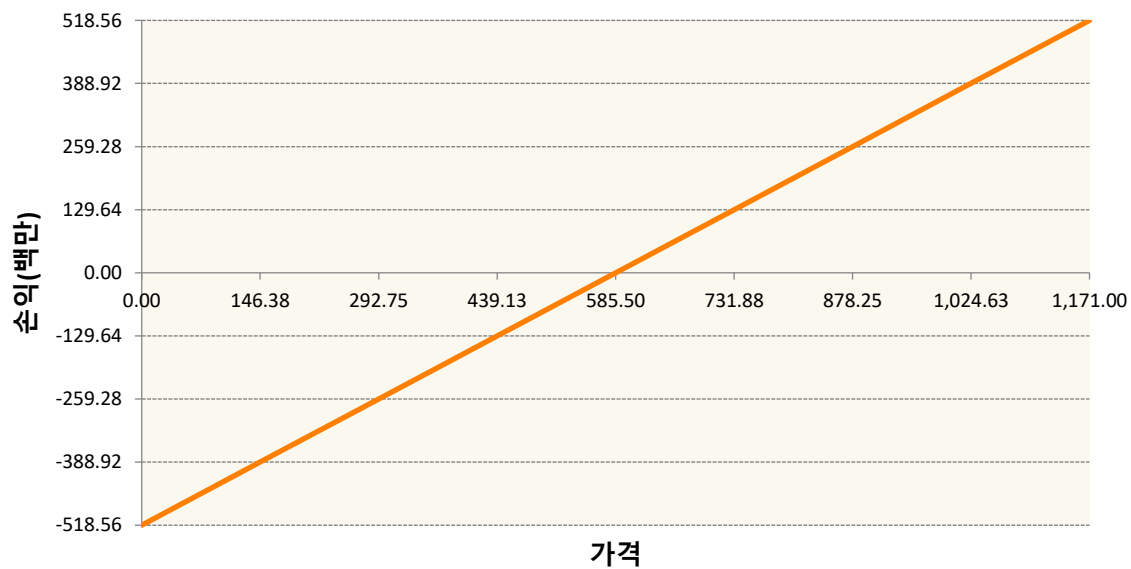
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,840	595	2,244	

2. 만기시점의 손익구조

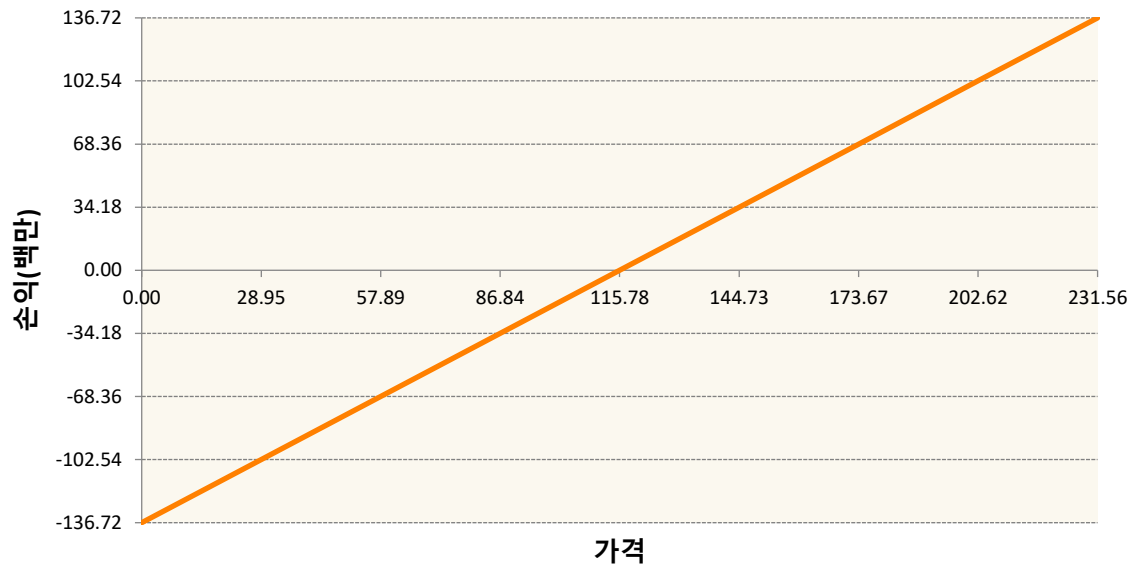
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



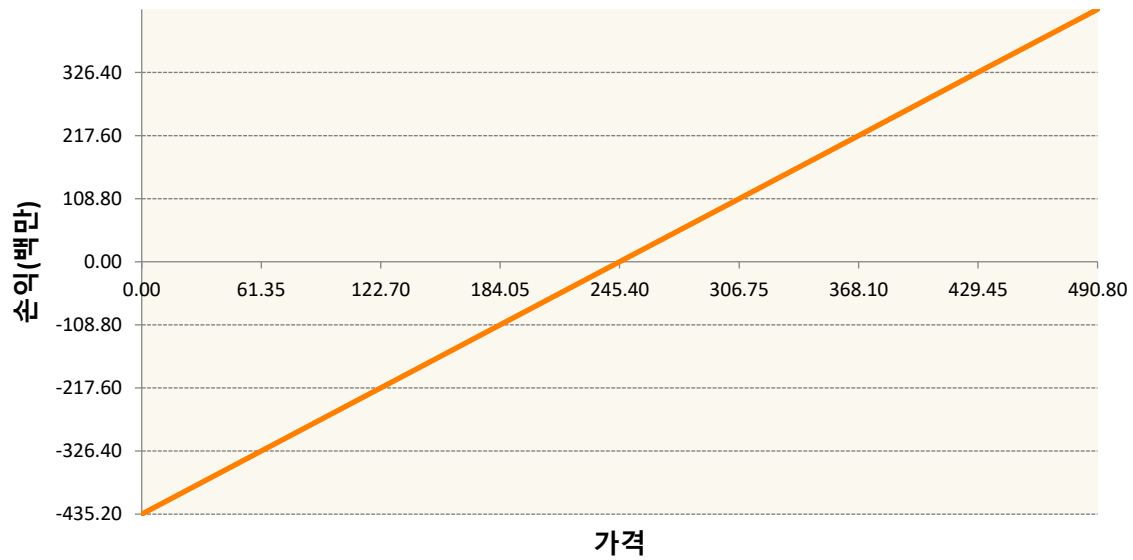
CH2-CORN FUTURE Mar22



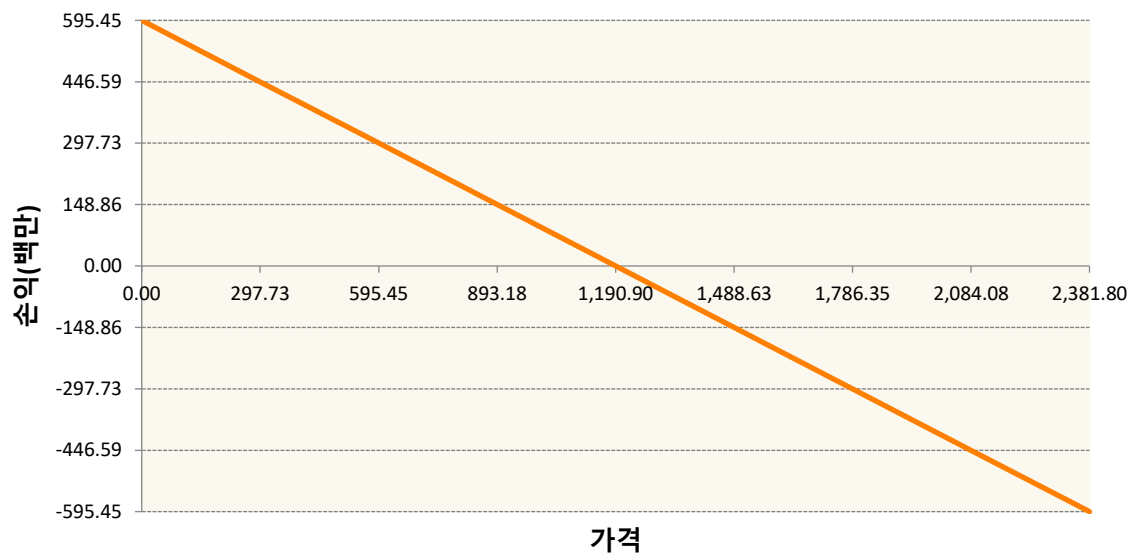
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



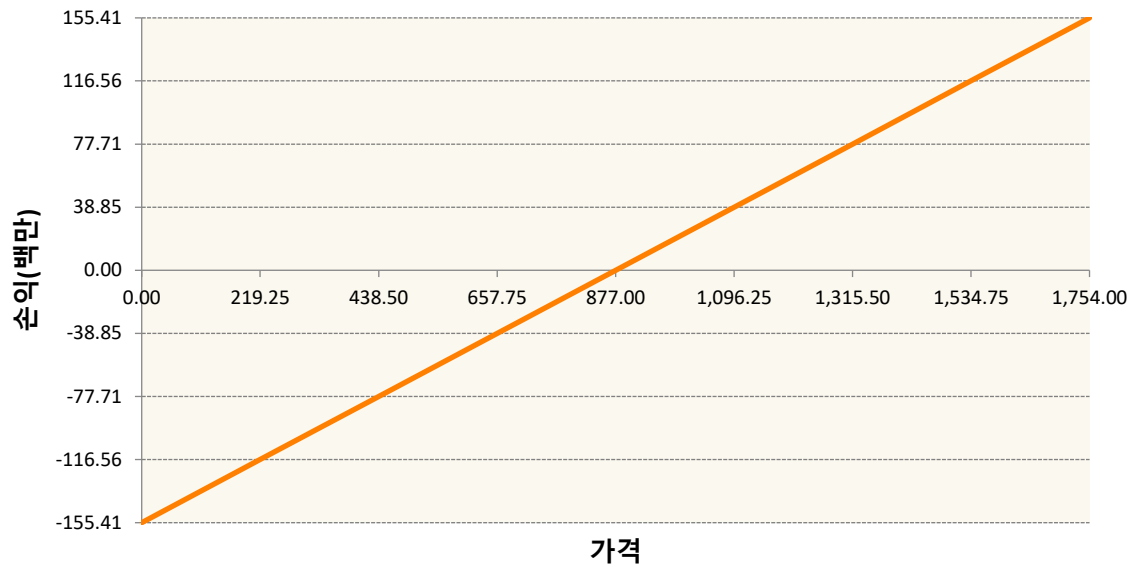
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



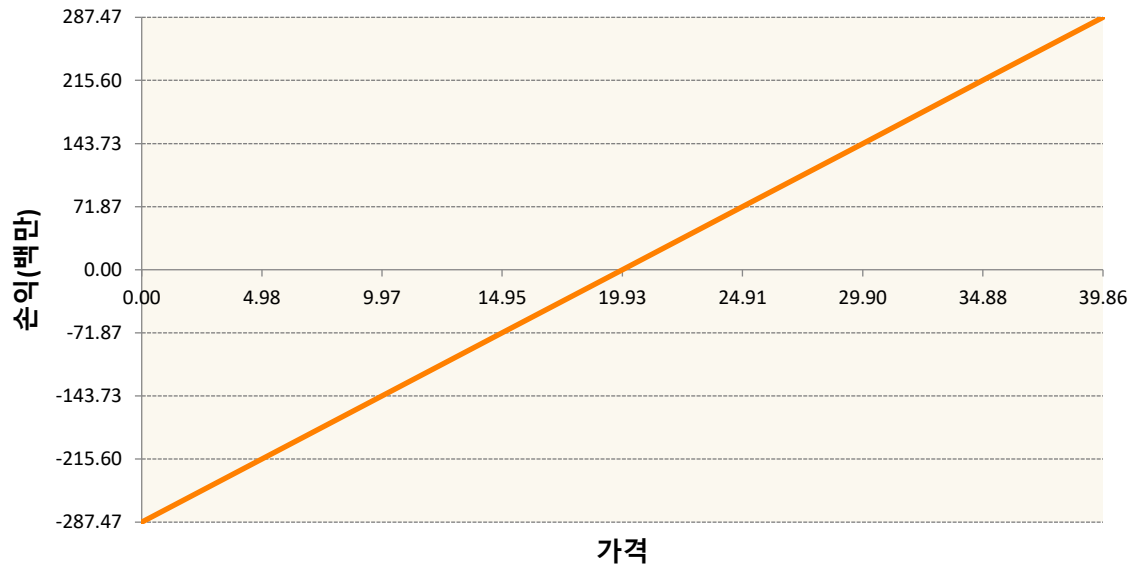
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



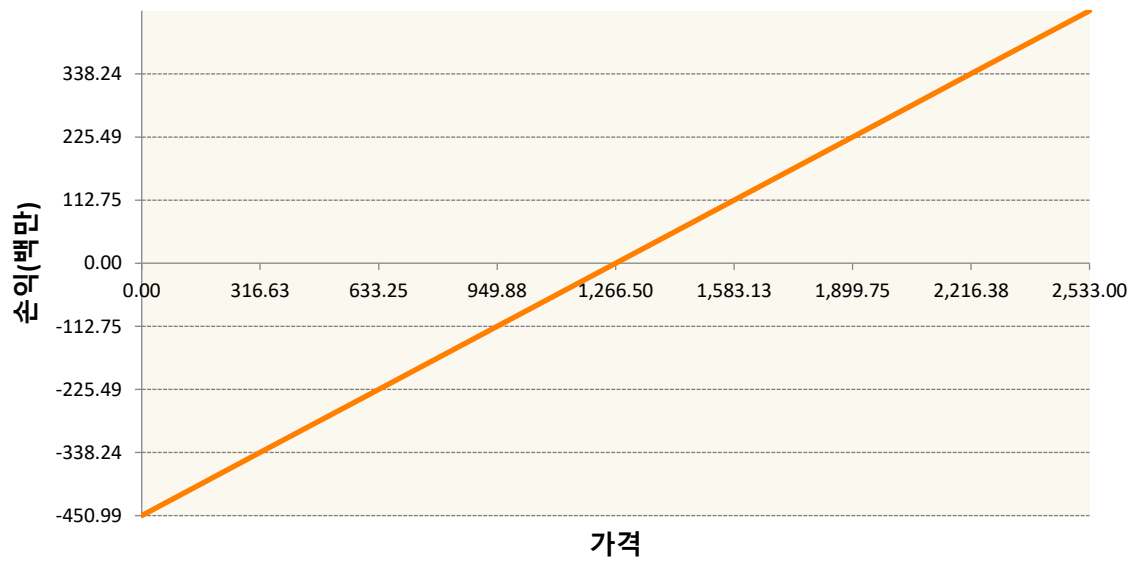
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22

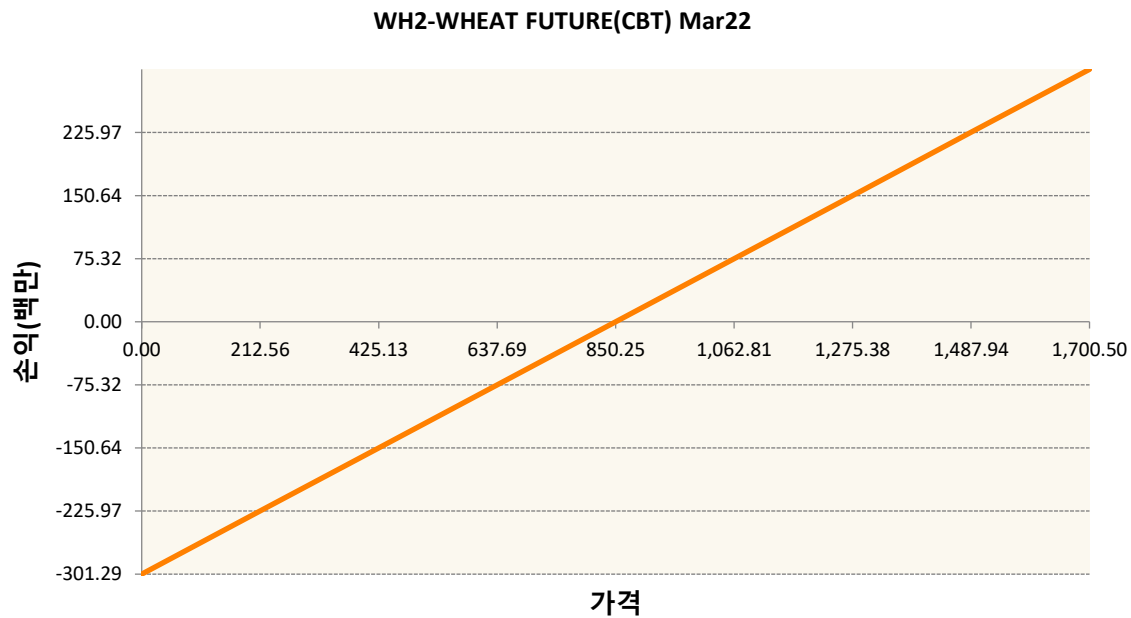
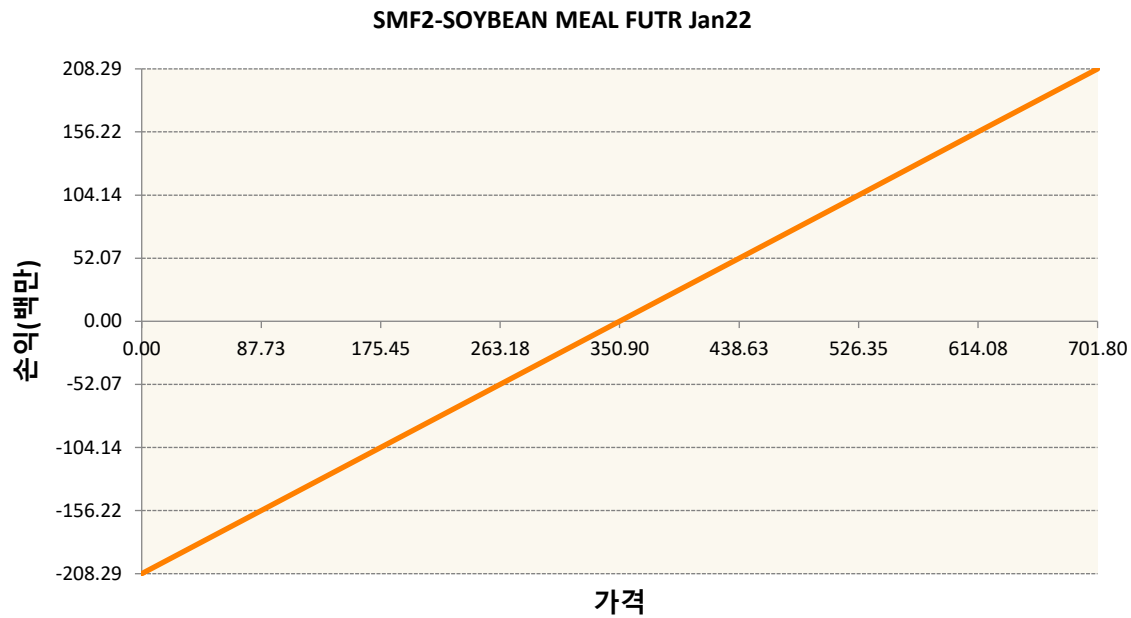


SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
BOF2	SOYBEAN OIL FUTR Jan22		28
CH2	CORN FUTURE Mar22		41
CTH2	COTTON NO.2 FUTR Mar22		11
KCH2	COFFEE 'C' FUTURE Mar22		35
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

