

공시일 2021-11-29

기준일 2021-11-26

포커스농산물모(채권-파생형)

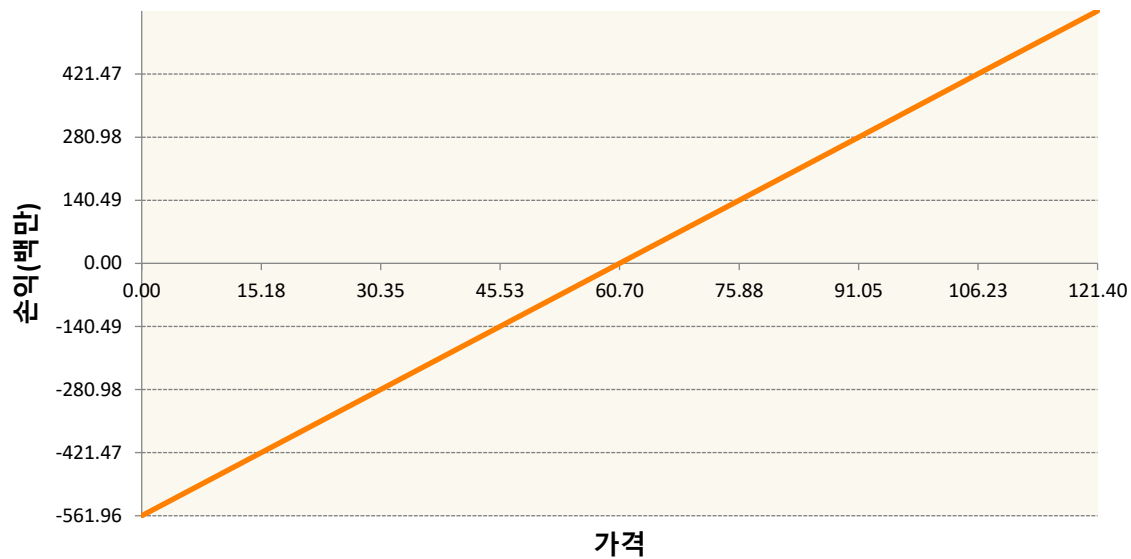
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

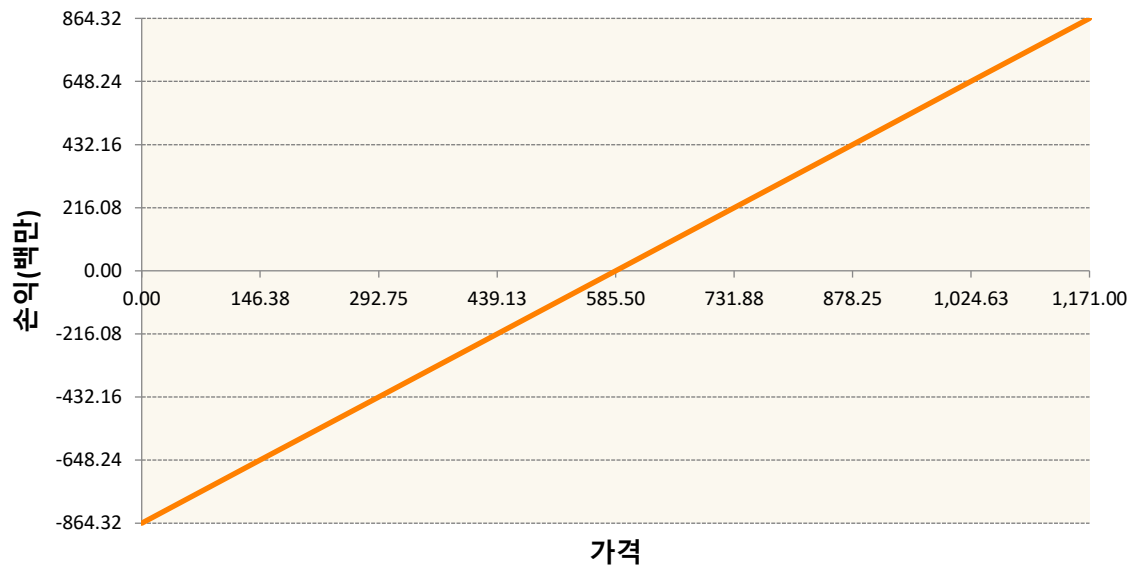
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,823	538	4,285	

2. 만기시점의 손익구조

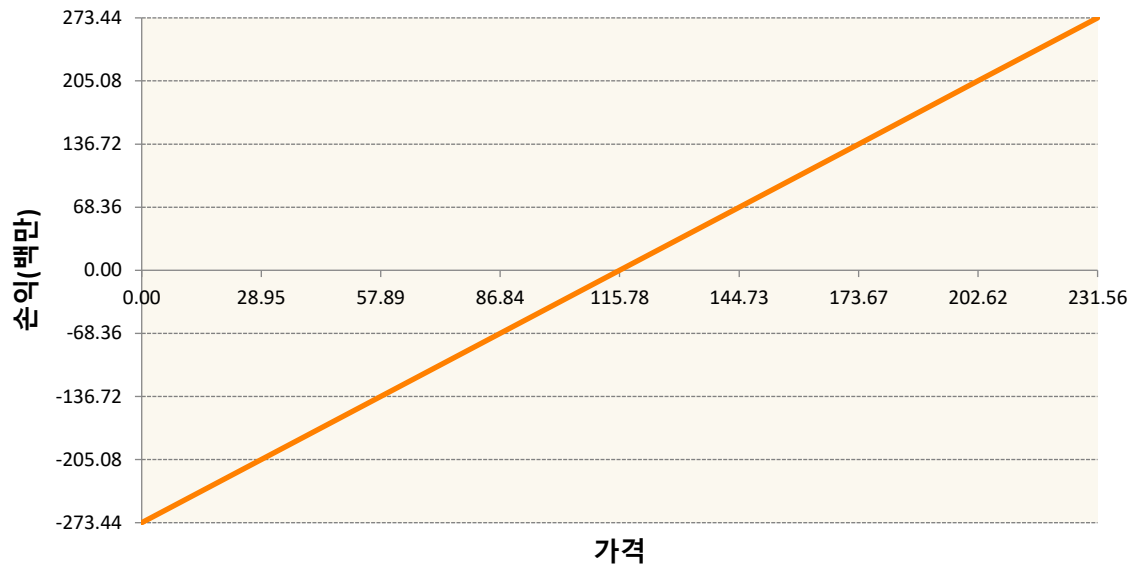
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



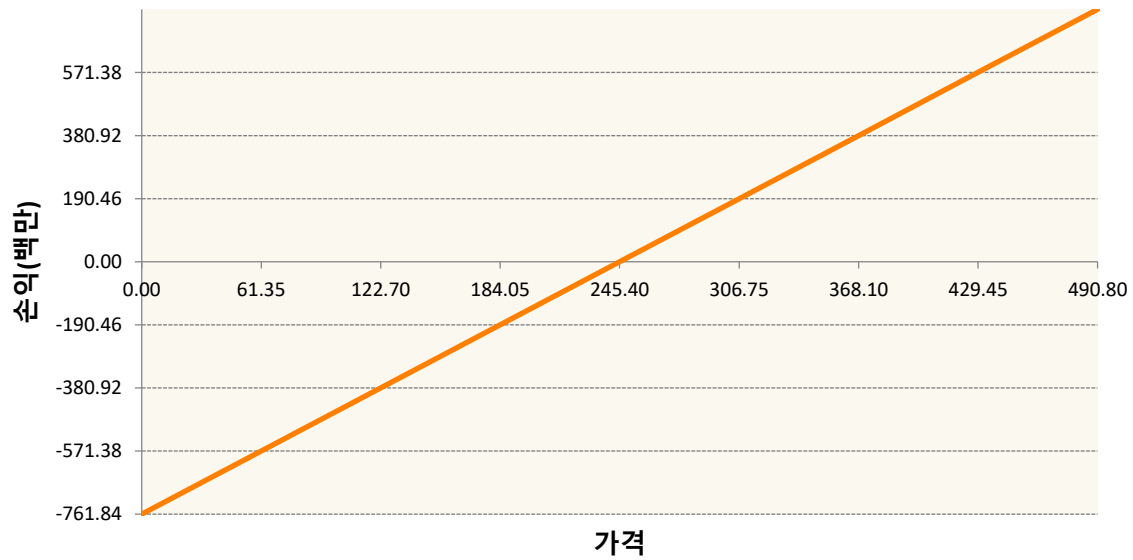
CH2-CORN FUTURE Mar22



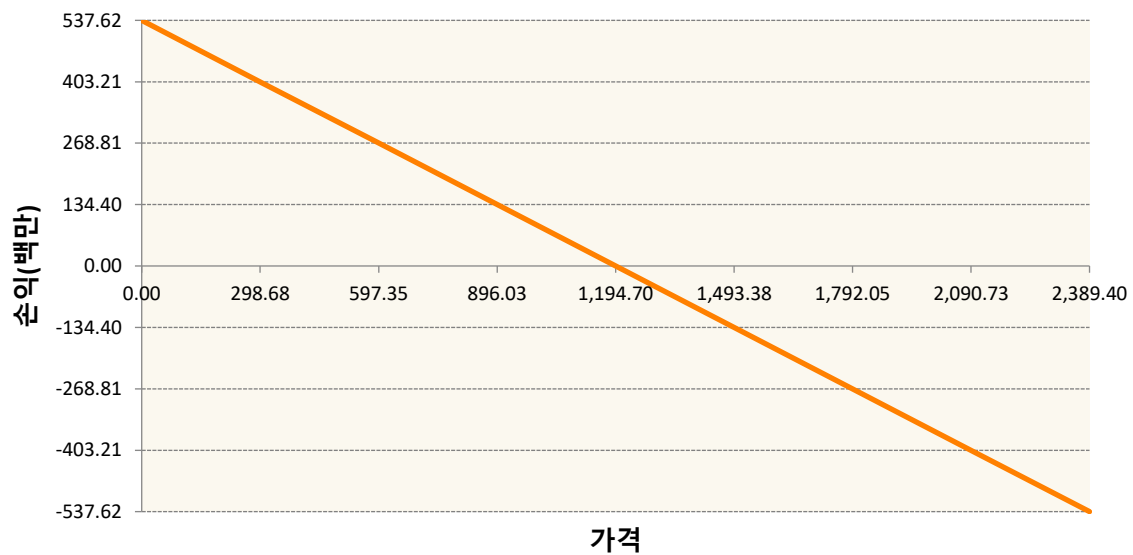
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



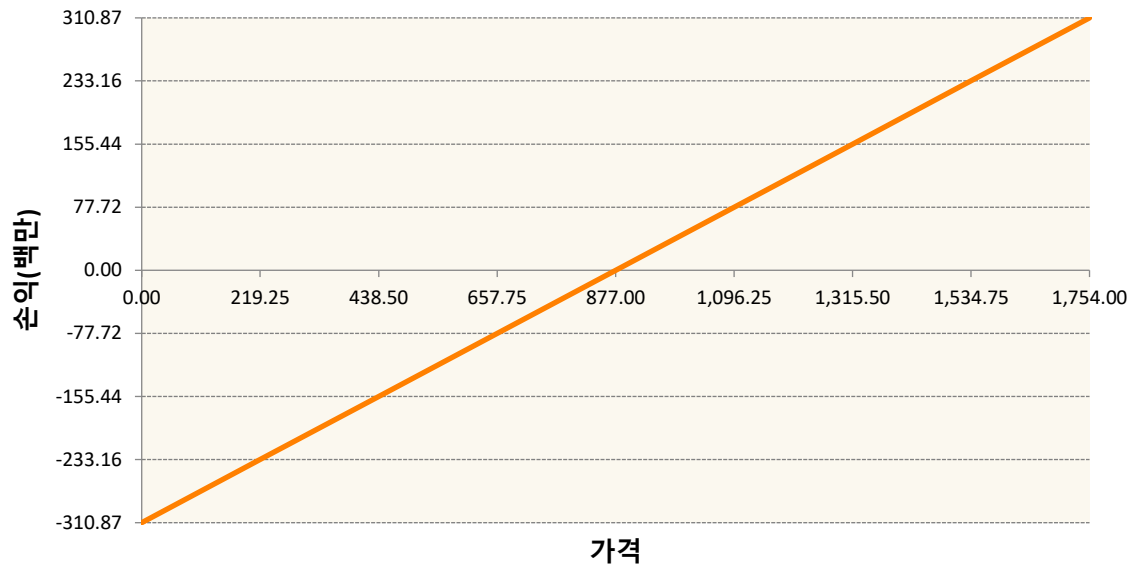
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



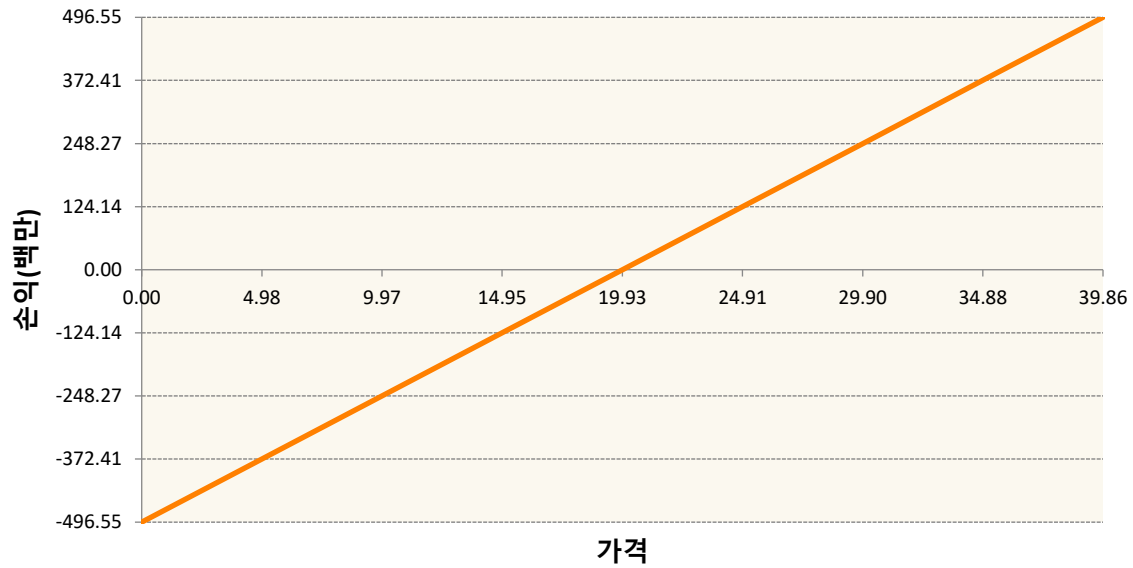
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



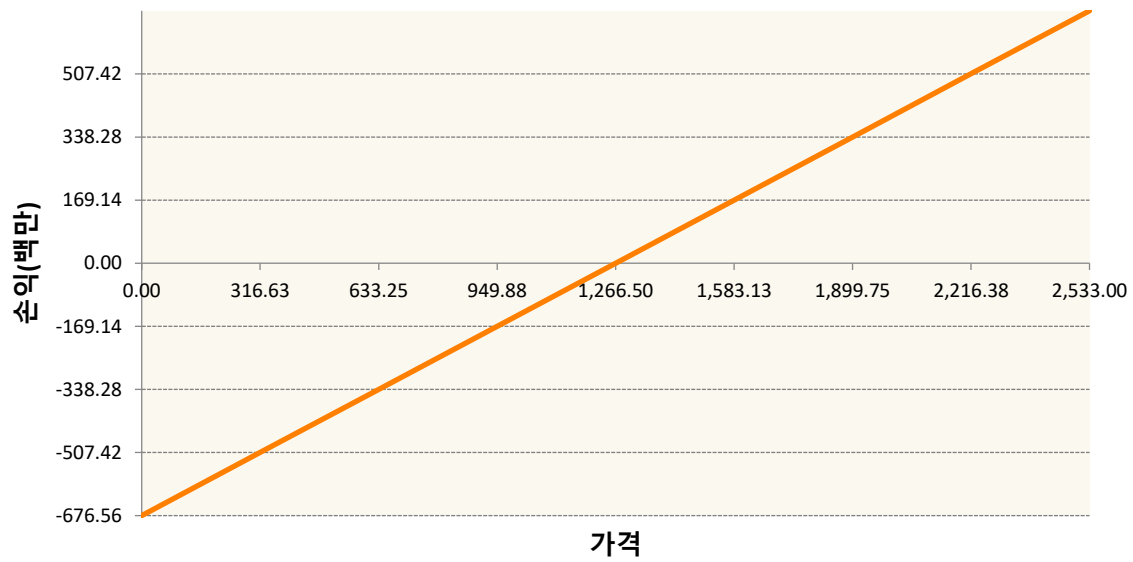
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



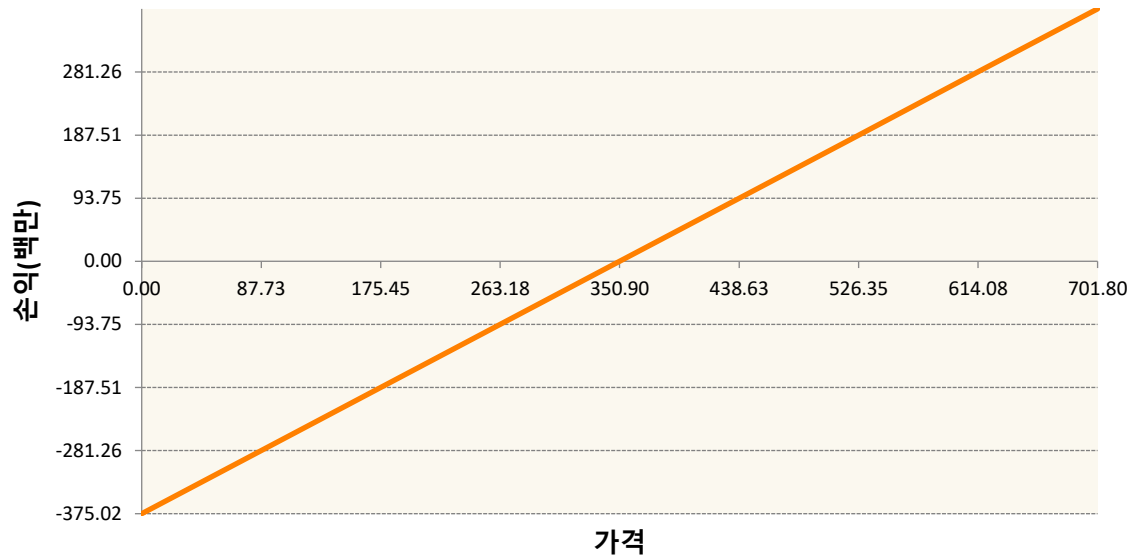
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



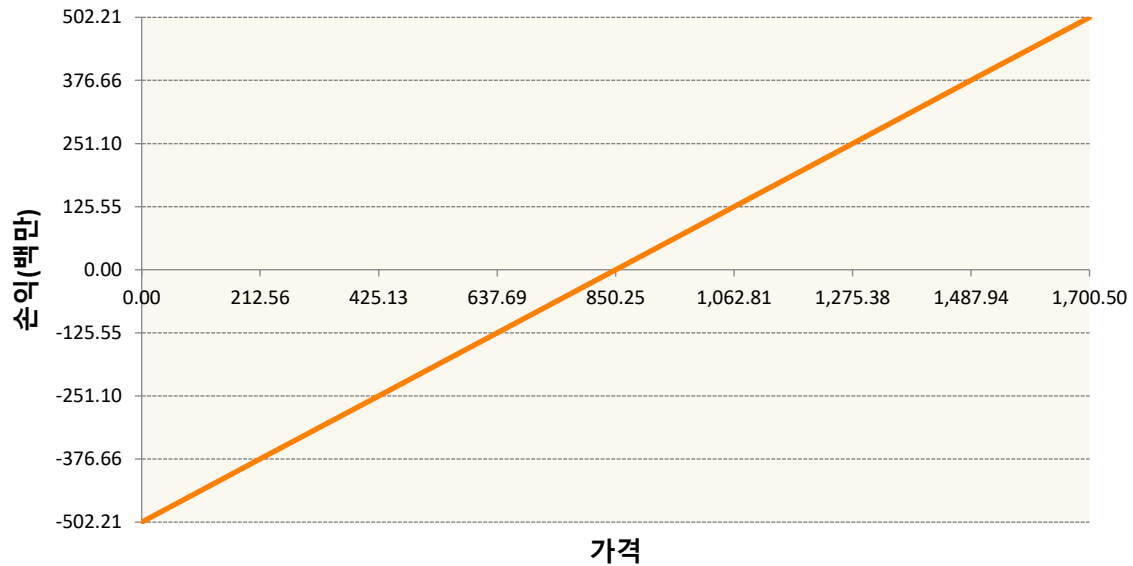
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	2021-11-29
기준일	2021-11-26

스마트인덱스모

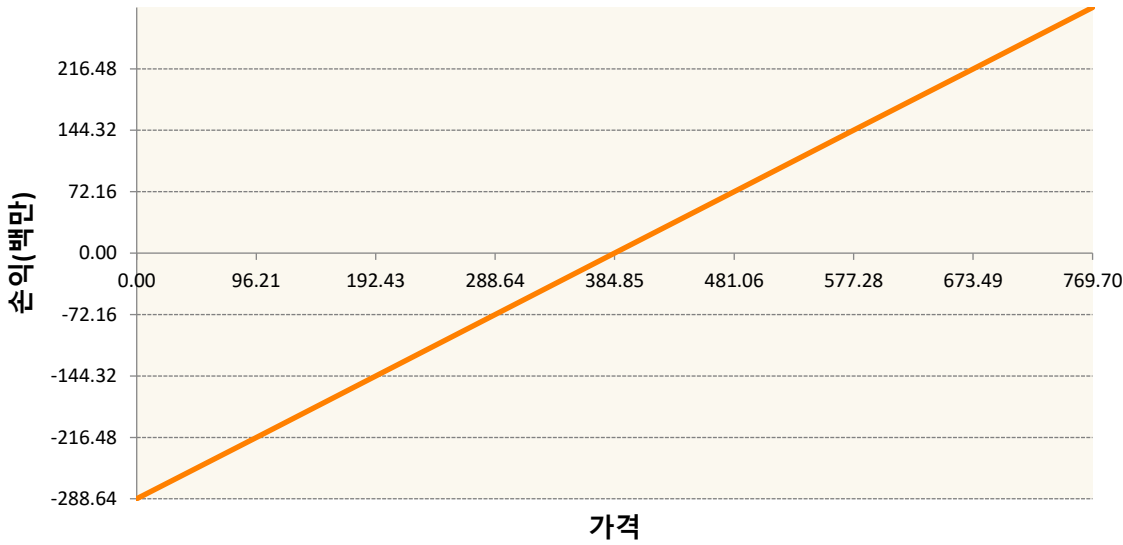
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	289	0	289	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101RC0000			2021-12 코스피200지수선물				23
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-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%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	23	23	23	23	23	23	23

공시일	2021-11-29
기준일	2021-11-26

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

919

* 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	2021-11-29
기준일	2021-11-26

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

435

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

426

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-11-29
기준일	2021-11-26

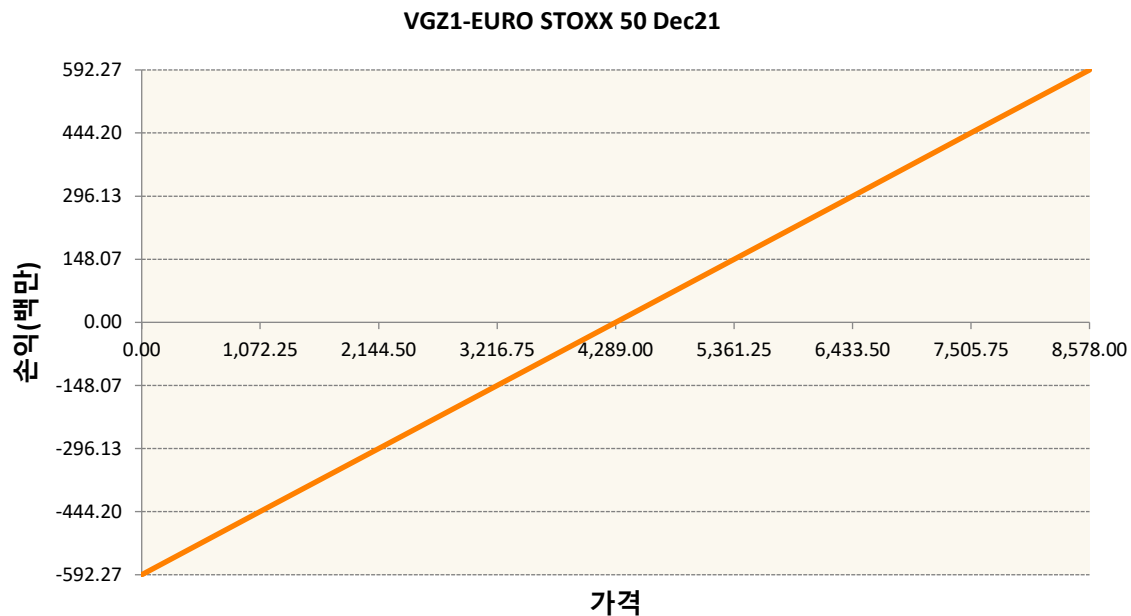
유로인덱스모(주식-파생형)

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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

41

공시일	2021-11-29
기준일	2021-11-26

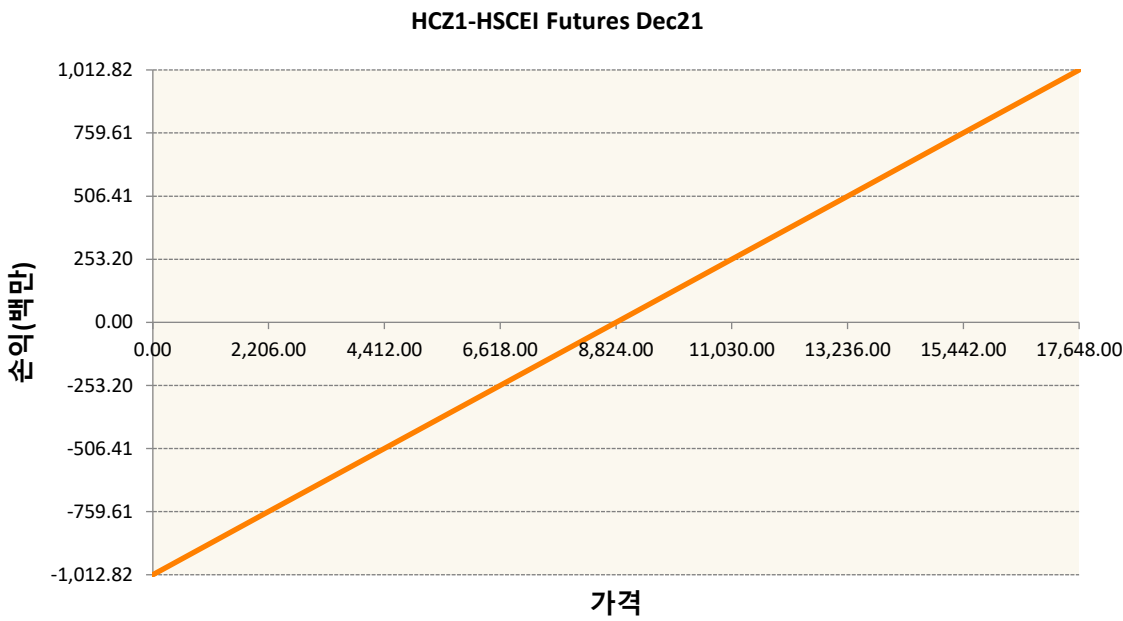
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,013	0	1,013	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

85

공시일 2021-11-29

기준일 2021-11-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

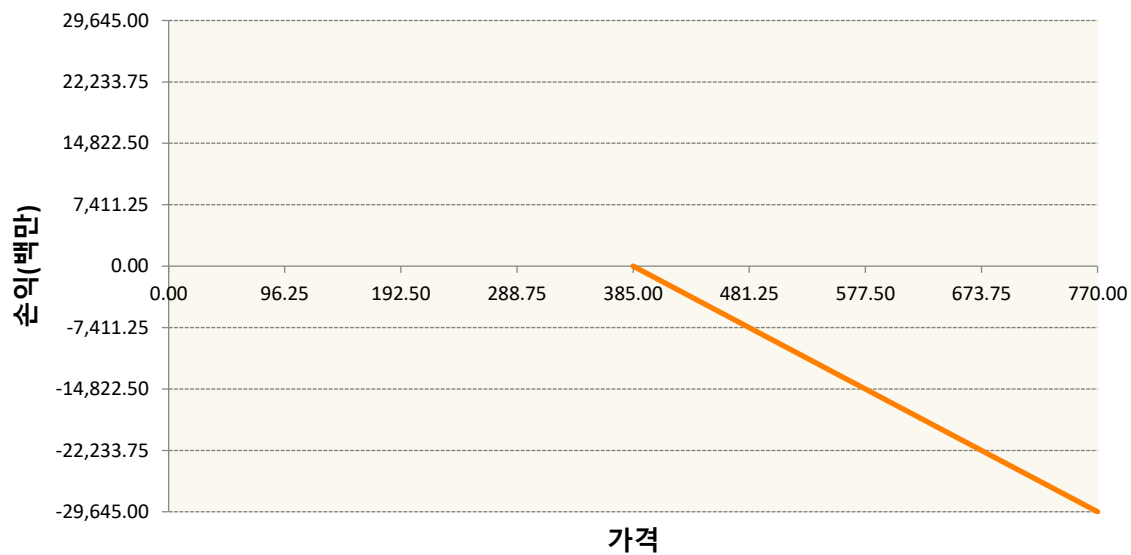
1. 계약금액

(단위:백만원)

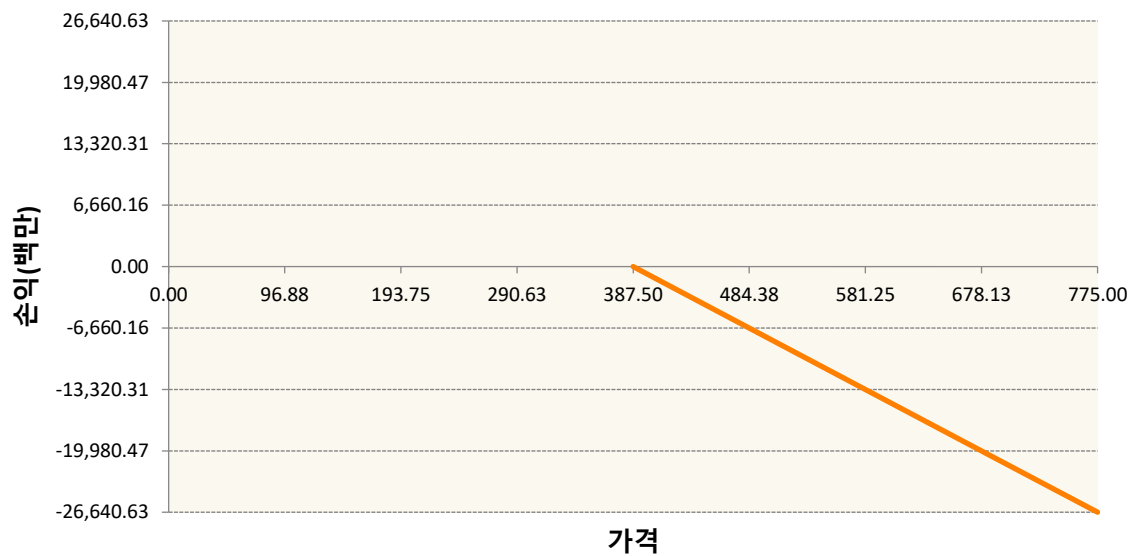
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,517	-76,517	장내

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					1,879
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	584	579	571	561	548	532	514
-5.33%	554	536	514	490	462	432	401
-2.67%	438	400	360	319	276	233	189
0%	148	98	49	0	-49	-98	-148
2.67%	-358	-398	-440	-483	-527	-572	-617
5.33%	-1,031	-1,052	-1,077	-1,105	-1,136	-1,169	-1,204
8.00%	-1,786	-1,793	-1,804	-1,819	-1,836	-1,856	-1,879
KR4201RC3870		2021-12 콜387.5					1,607
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	443	440	435	428	418	407	393
-5.33%	425	412	397	378	356	333	307
-2.67%	347	317	284	250	215	179	141
0%	131	87	44	0	-44	-87	-131
2.67%	-275	-315	-355	-396	-438	-480	-522
5.33%	-845	-869	-895	-924	-955	-988	-1,022
8.00%	-1,507	-1,516	-1,529	-1,544	-1,563	-1,584	-1,607
KR4301RC3853 2021-12 풋385							1,152

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,144	-1,144	-1,144	-1,145	-1,147	-1,149	-1,152
-5.33%	-685	-688	-692	-697	-703	-711	-719
-2.67%	-255	-268	-281	-296	-311	-327	-343
0%	61	40	20	0	-20	-40	-61
2.67%	205	192	178	162	147	130	113
5.33%	240	236	231	225	217	208	198
8.00%	244	244	243	241	239	235	231
KR4301RC3879 2021-12 풋387.5							200

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-199	-199	-199	-199	-199	-200	-200
-5.33%	-122	-123	-123	-124	-125	-126	-127
-2.67%	-49	-50	-52	-54	-56	-59	-61
0%	10	7	3	0	-3	-7	-10
2.67%	41	38	35	32	29	26	23
5.33%	50	49	47	46	44	43	41
8.00%	51	51	50	50	49	49	48

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

(단위:백만원)

5,071

공시일 2021-11-29

기준일 2021-11-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

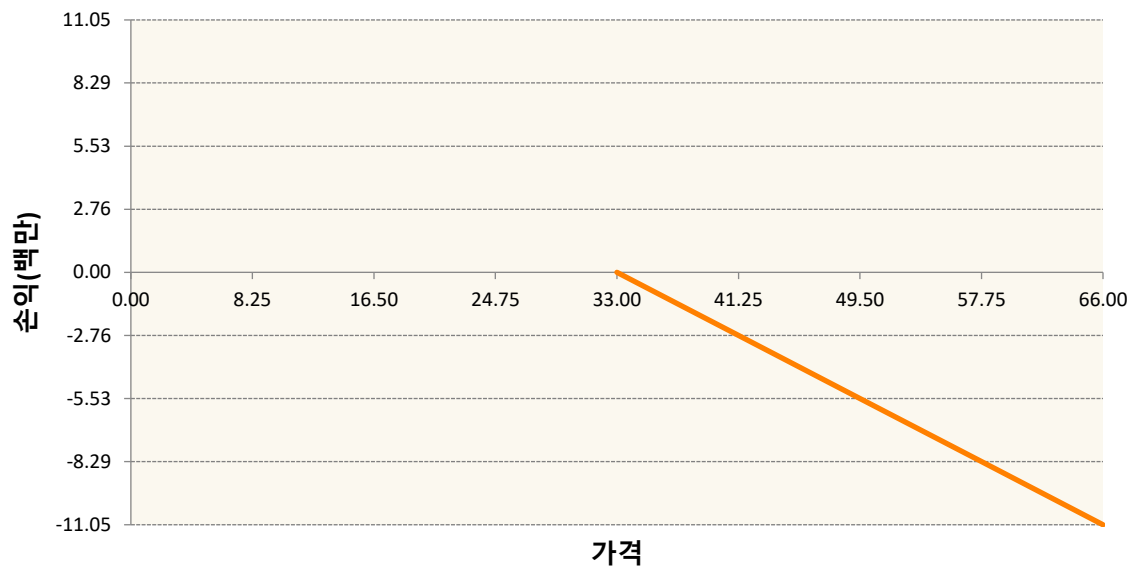
1. 계약금액

(단위:백만원)

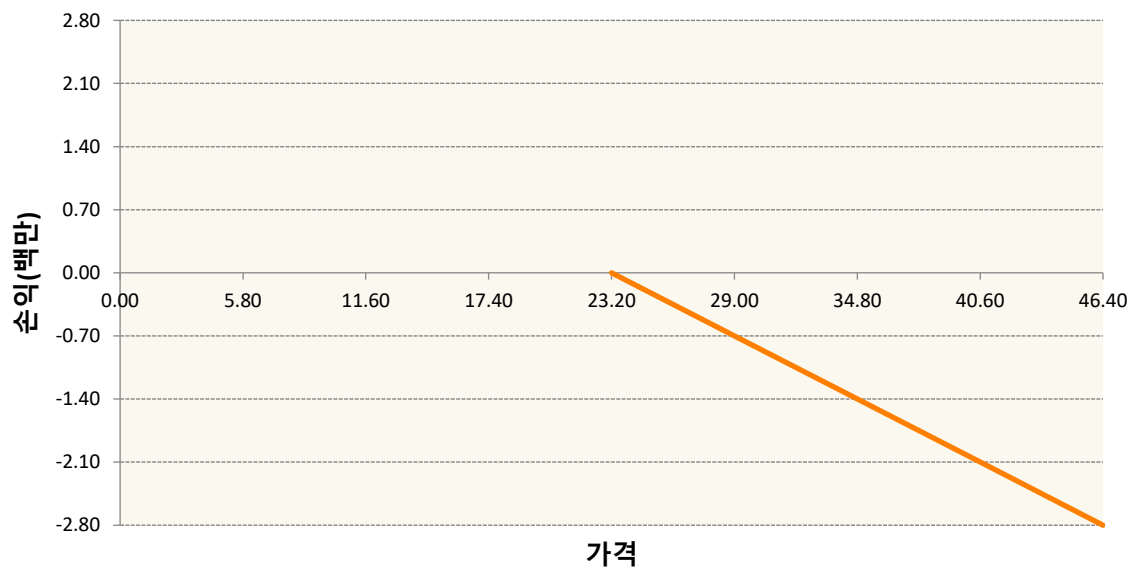
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	69	-69	장내

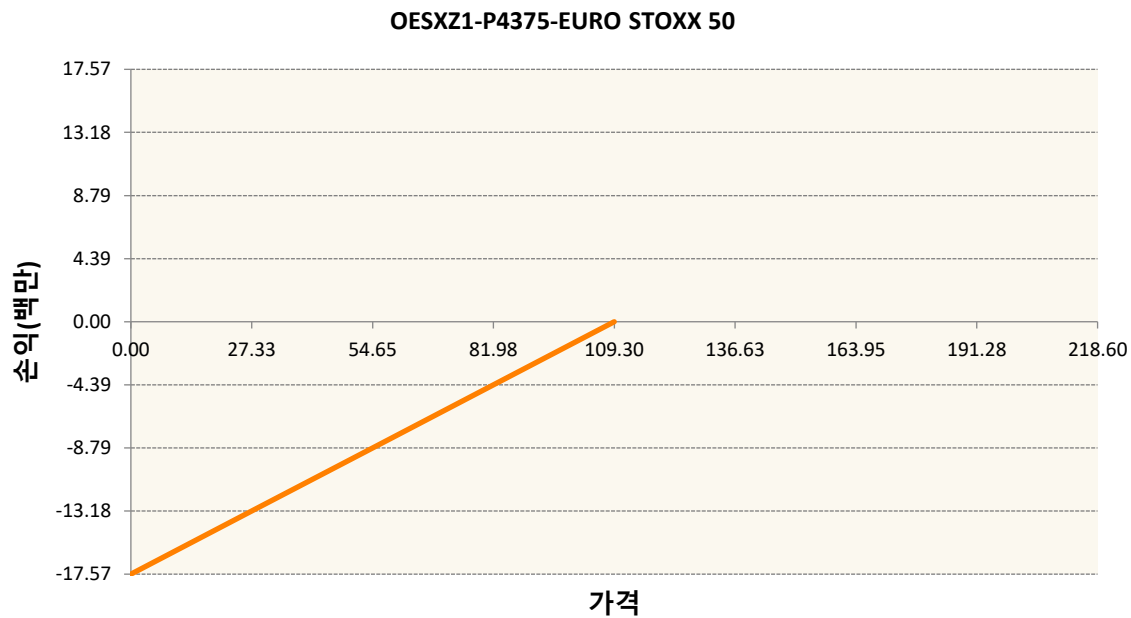
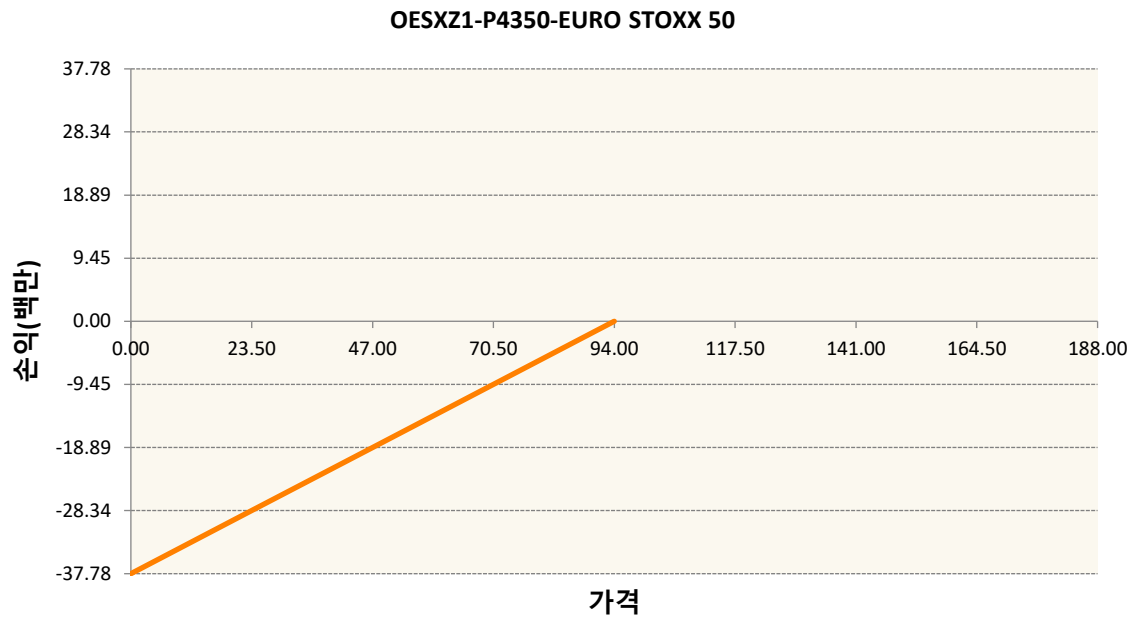
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		9
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		1
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.22
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		3
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13

공시일	2021-11-29
기준일	2021-11-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

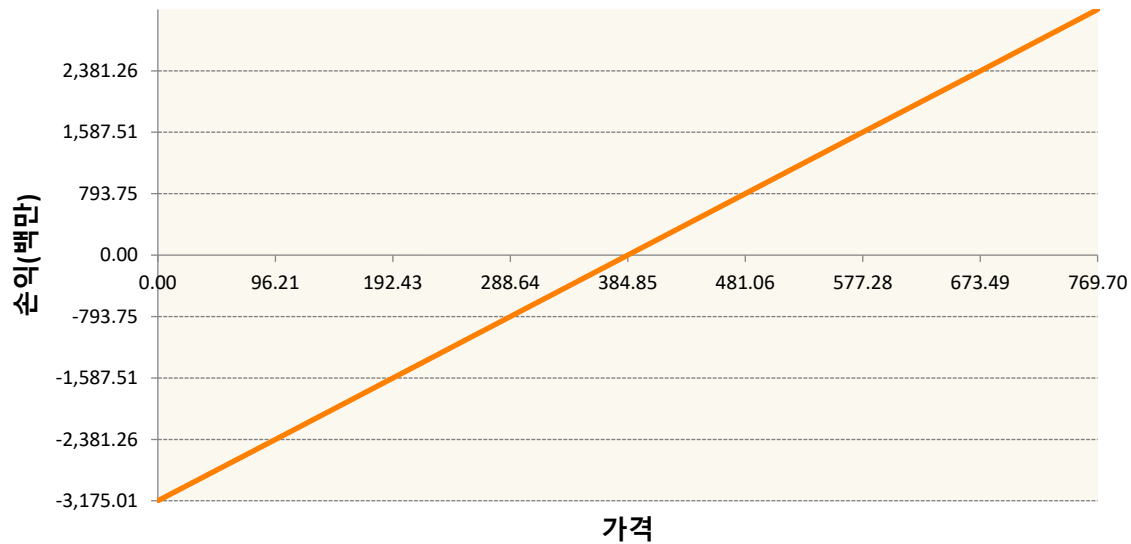
1. 계약금액

(단위:백만원)

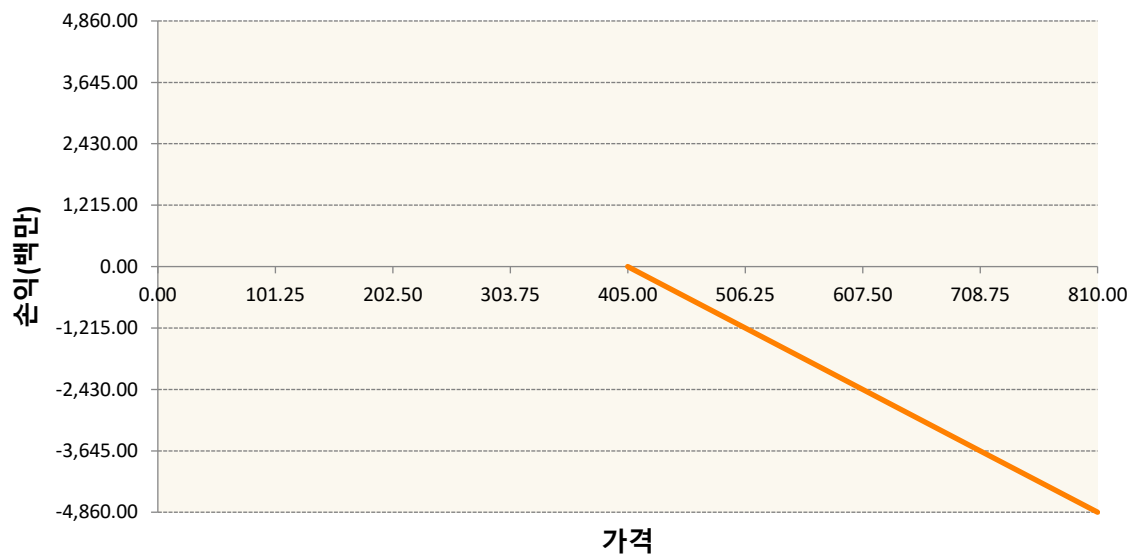
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,175	0	3,175	장내
누계	유가증권	옵션	579	5,369	-4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조

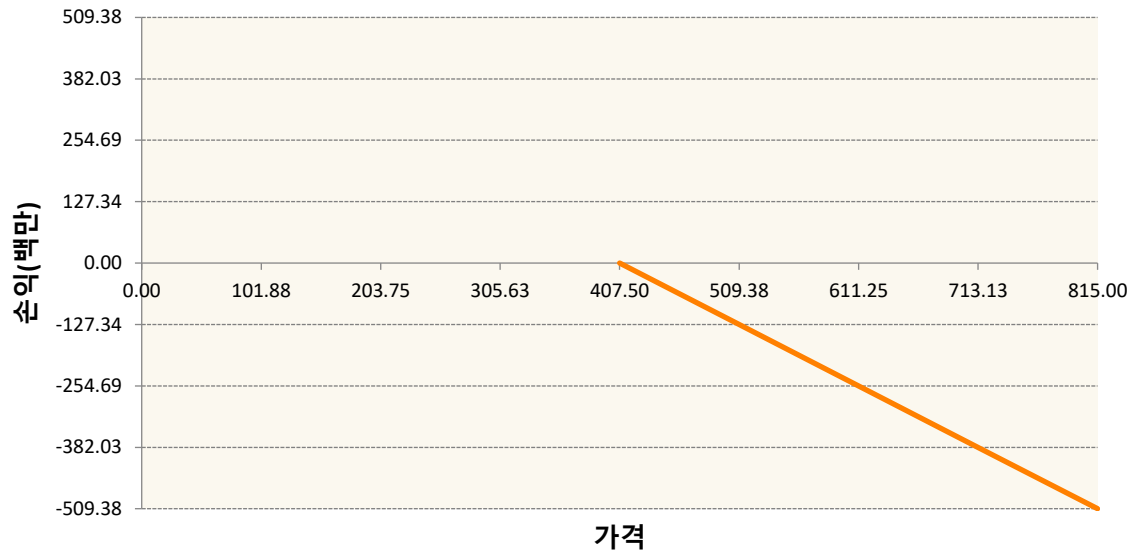
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



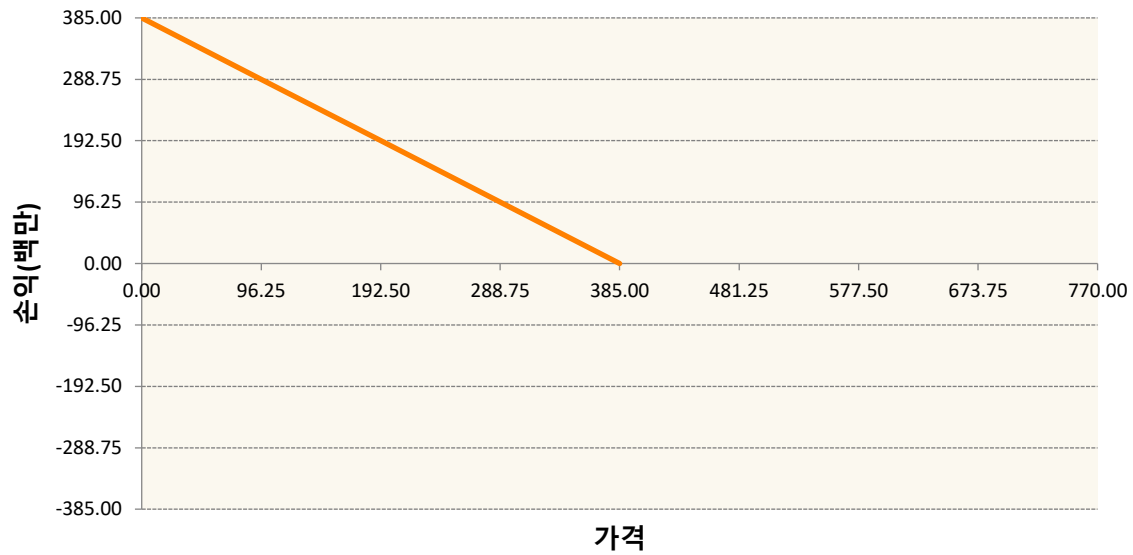
KR4201RC4050-2021-12 콜405



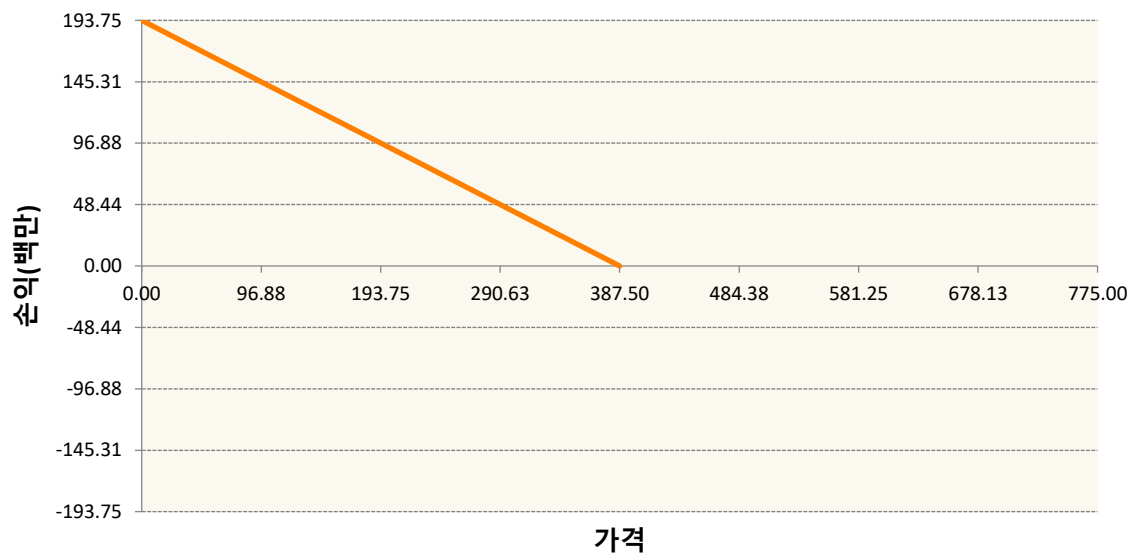
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



KR4301RC3853-2021-12 풋385



KR4301RC3879-2021-12 풋387.5



(단위:백만원)

KR4101RC0000							2021-12 코스피200지수선물		254		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254				
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169				
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	85	85	85	85	85	85	85				
5.33%	169	169	169	169	169	169	169				
8.00%	254	254	254	254	254	254	254				
KR4201RC4050							2021-12 콜405		179		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	19	19	19	19	19	18	18				
-5.33%	19	19	18	18	17	15	14				
-2.67%	18	17	15	13	11	8	4				
0%	12	8	4	0	-5	-10	-16				
2.67%	-9	-15	-22	-29	-36	-43	-51				
5.33%	-56	-65	-73	-81	-89	-97	-105				
8.00%	-136	-143	-150	-157	-164	-171	-179				
KR4201RC4076							2021-12 콜407.5		17		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	2	2	2	2	2	1	1				
-5.33%	2	2	2	1	1	1	1				
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0				
0%	1	1	0	0	0	-1	-1				
2.67%	-1	-1	-2	-3	-3	-4	-5				
5.33%	-5	-6	-7	-7	-8	-9	-10				
8.00%	-12	-13	-14	-15	-15	-16	-17				
KR4301RC3853							2021-12 풋385		26		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	25	25	25	25	25	26	26				
-5.33%	15	15	15	15	16	16	16				
-2.67%	6	6	6	7	7	7	8				
0%	-1	-1	0	0	0	1	1				
2.67%	-5	-4	-4	-4	-3	-3	-3				
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4				
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5				
KR4301RC3879							2021-12 풋387.5		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%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	3	3	3	4	4	4	4
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-3	-3	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

433

공시일	2021-11-29
기준일	2021-11-26

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	18,589	0	18,589	

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	2021-11-29
기준일	2021-11-26

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	9,697	0	9,697	

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	2021-11-29
기준일	2021-11-26

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	45,798	0	45,798	

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 2021-11-29

기준일 2021-11-26

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

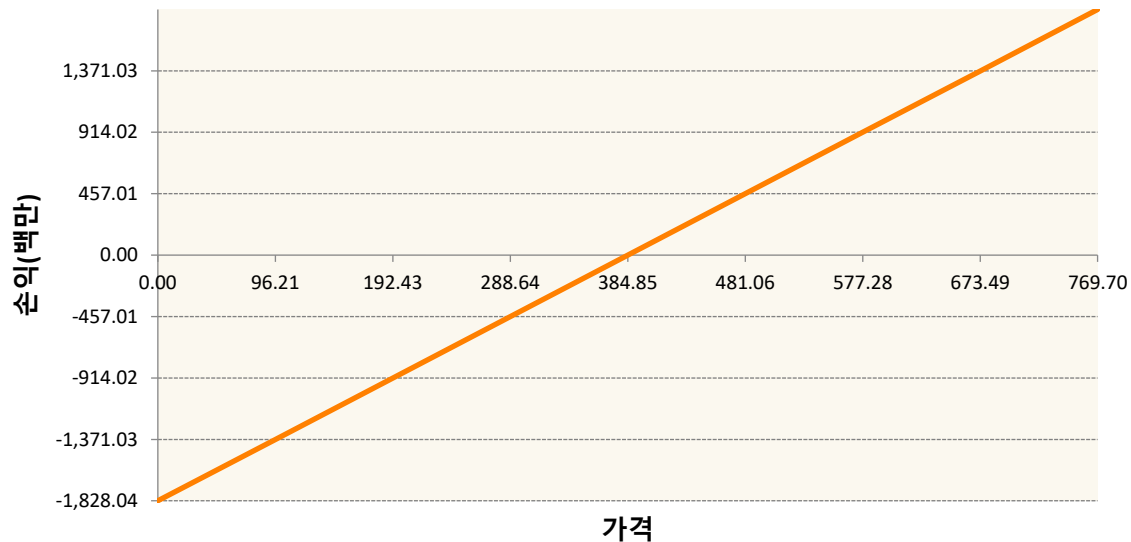
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,828	0	1,828	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101RC0000

2021-12 코스피200지수선물

146

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-5.33%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	49	49	49	49	49	49	49
5.33%	98	98	98	98	98	98	98
8.00%	146	146	146	146	146	146	146

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

(단위:백만원)

150

공시일	2021-11-29
기준일	2021-11-26

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

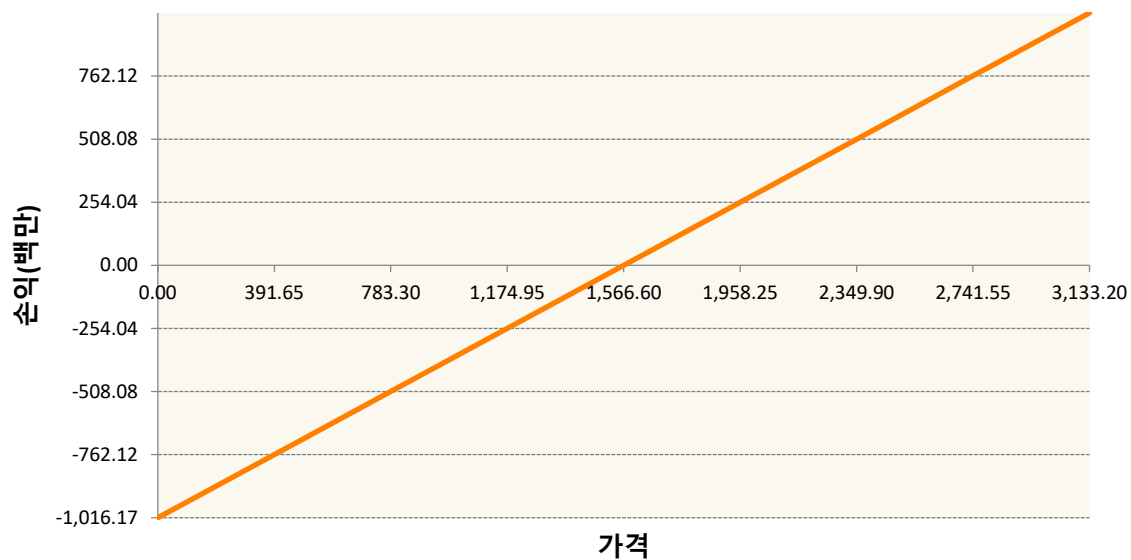
1. 계약금액

(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	1,016	0	1,016	
누계	유가증권	스왑	1,789	0	1,789	장외
누계	통화	선도	0	576	-576	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
FXW213BBS KRW/EUR 25-02-22E	11
VNCZ1 VN30 Index Future Dec21	81

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

(단위:백만원)

262

공시일 2021-11-29

기준일 2021-11-26

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

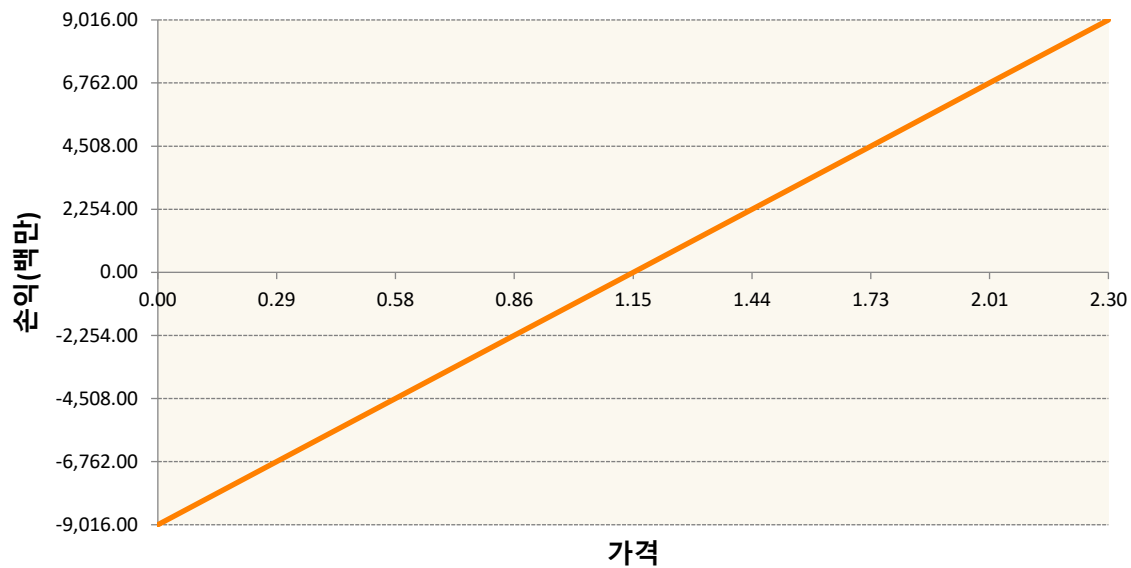
1. 계약금액

(단위:백만원)

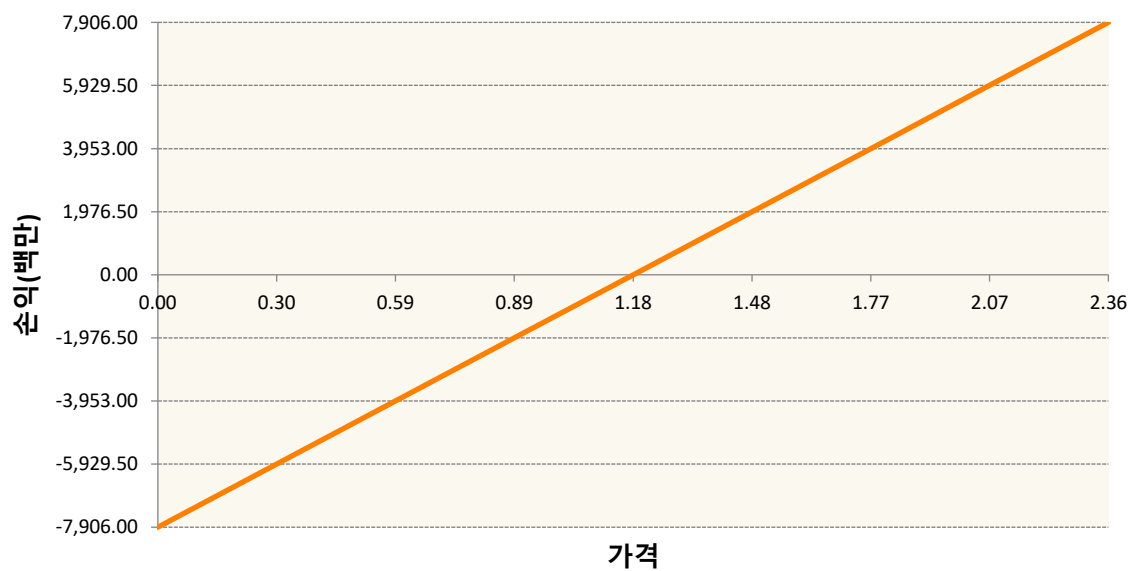
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	22,582	0	22,582	

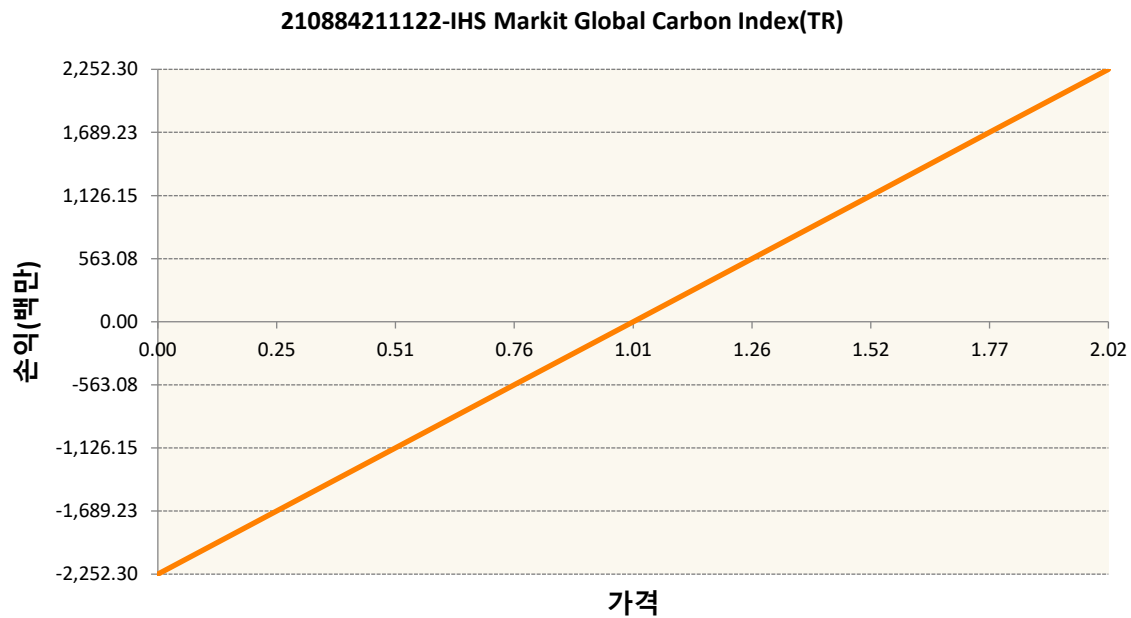
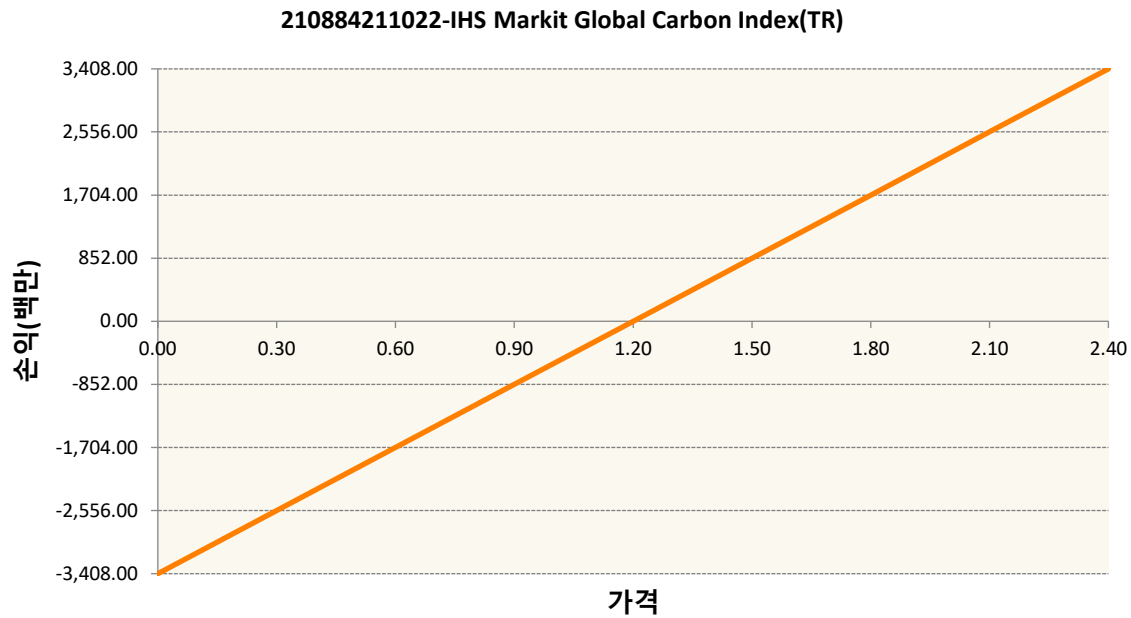
2. 만기시점의 손익구조

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)		724
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		631
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		272
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		181

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,735

공시일	2021-11-29
기준일	2021-11-26

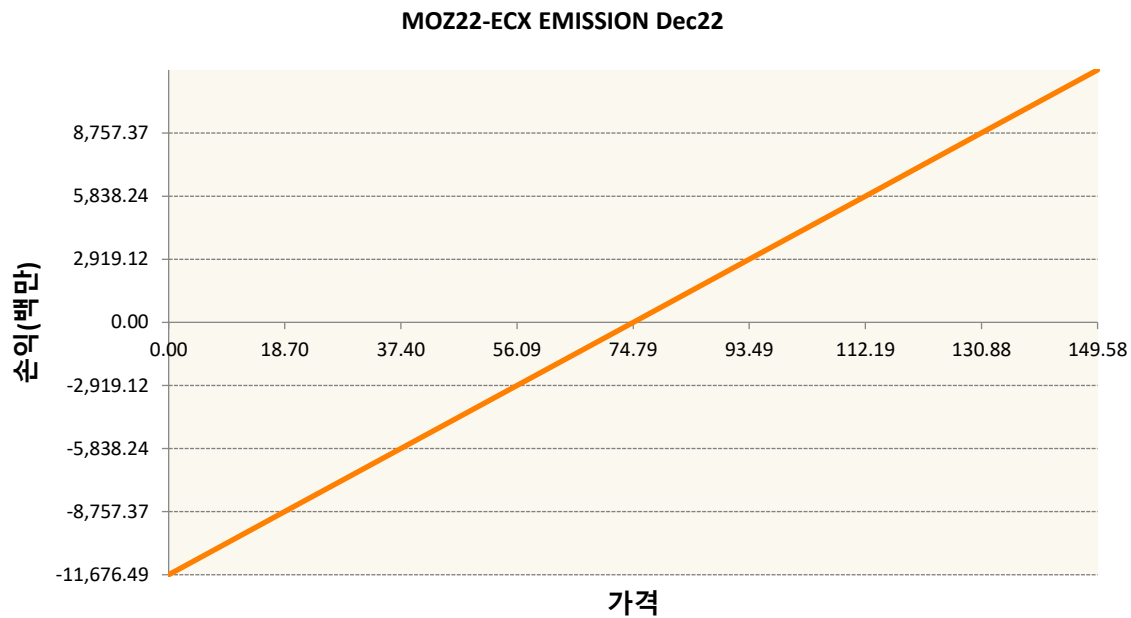
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,676	0	11,676	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

934

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

(단위:백만원)

1,880

공시일 2021-11-29

기준일 2021-11-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

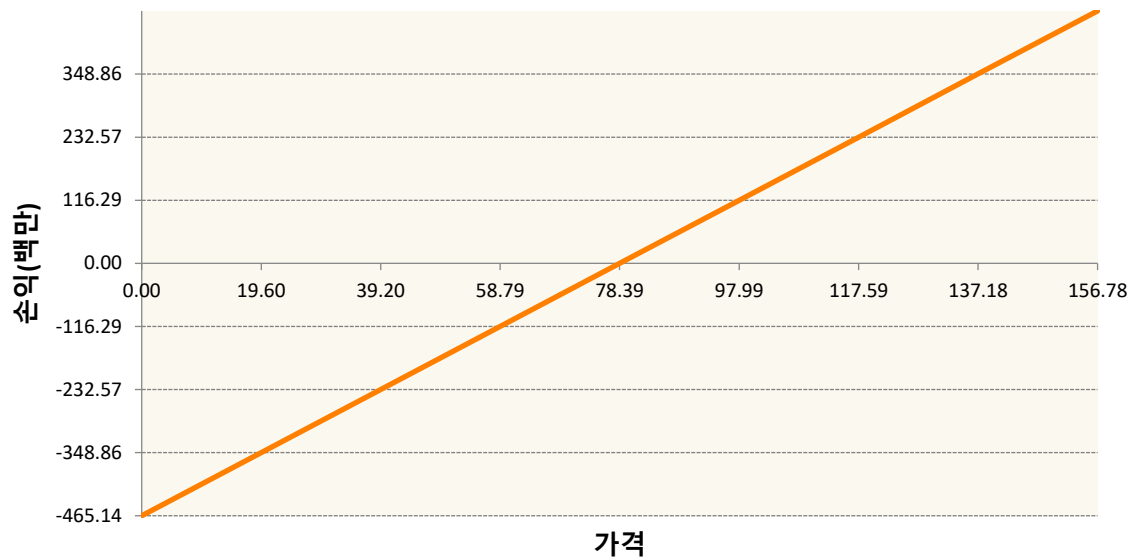
1. 계약금액

(단위:백만원)

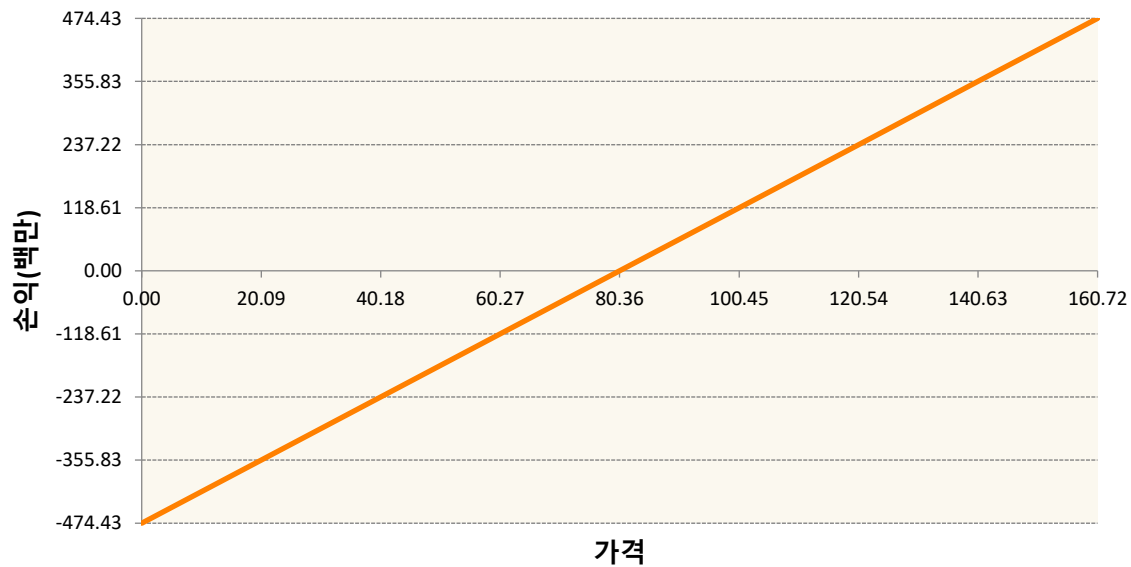
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,143	538	1,606	

2. 만기시점의 손익구조

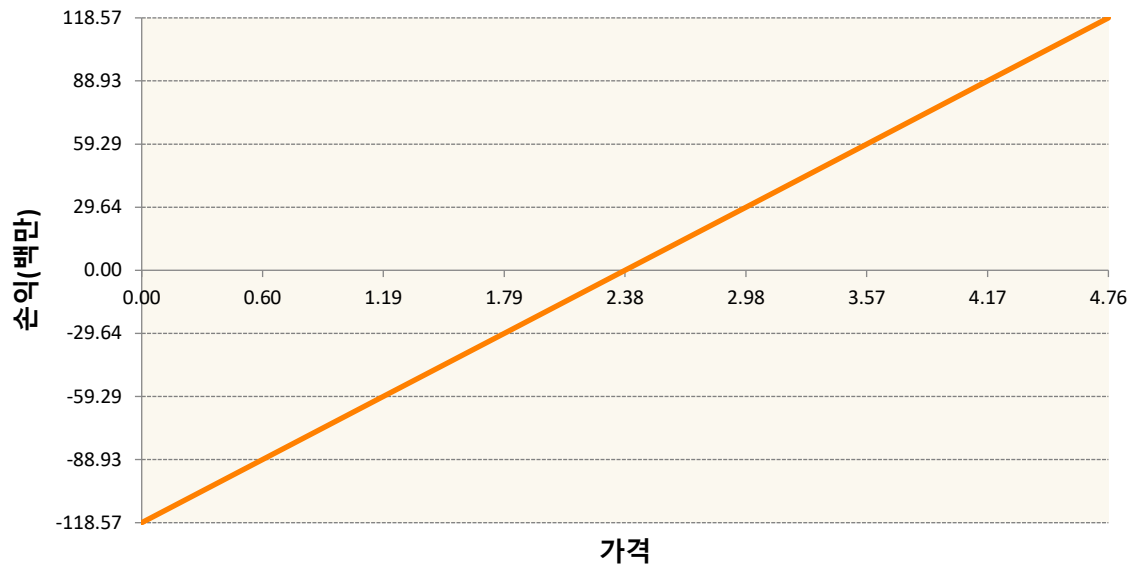
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



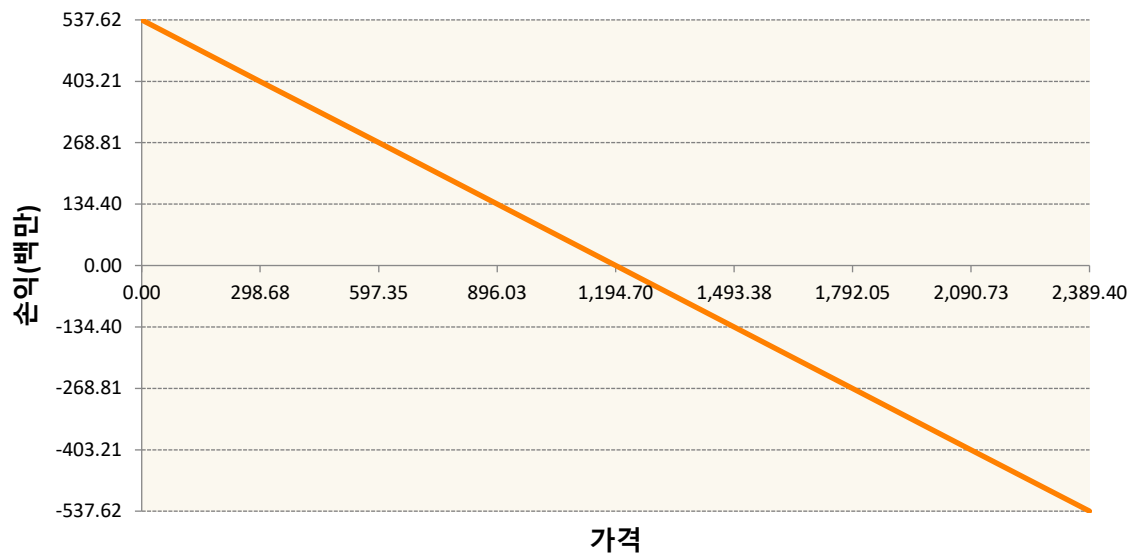
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



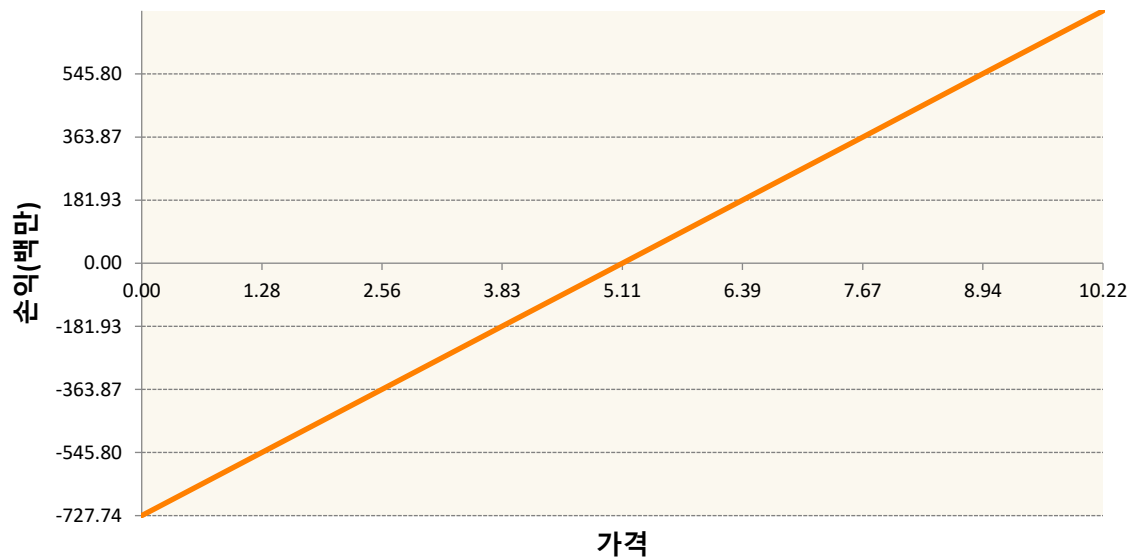
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22



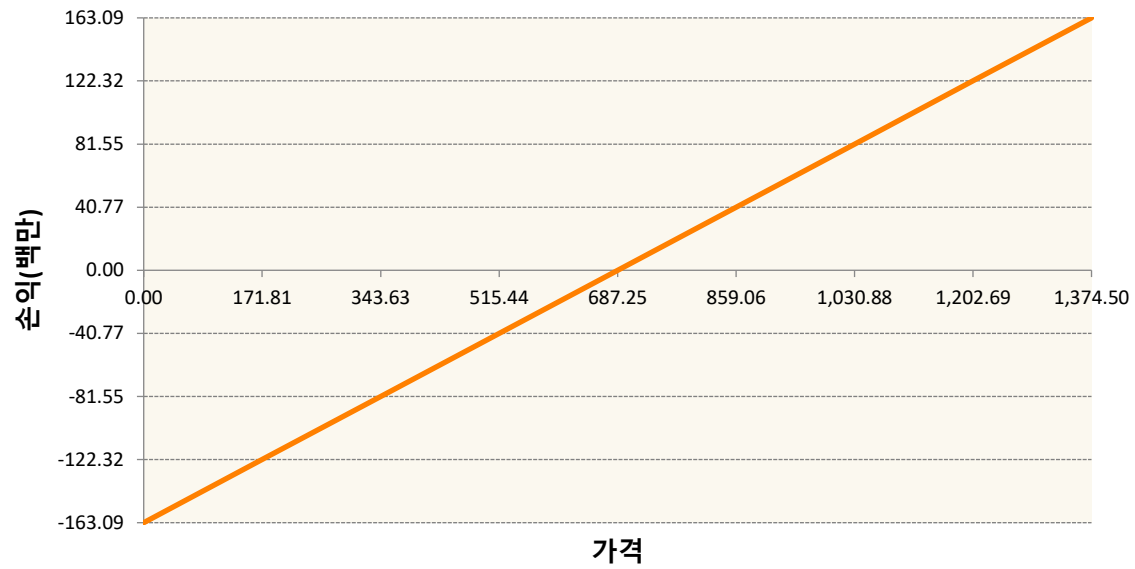
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



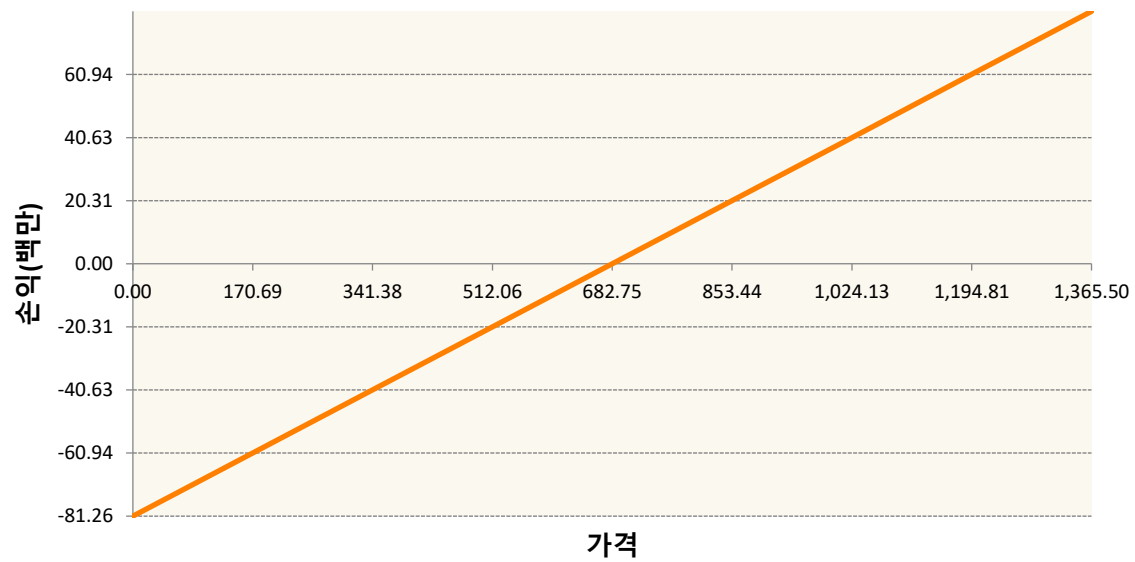
NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22



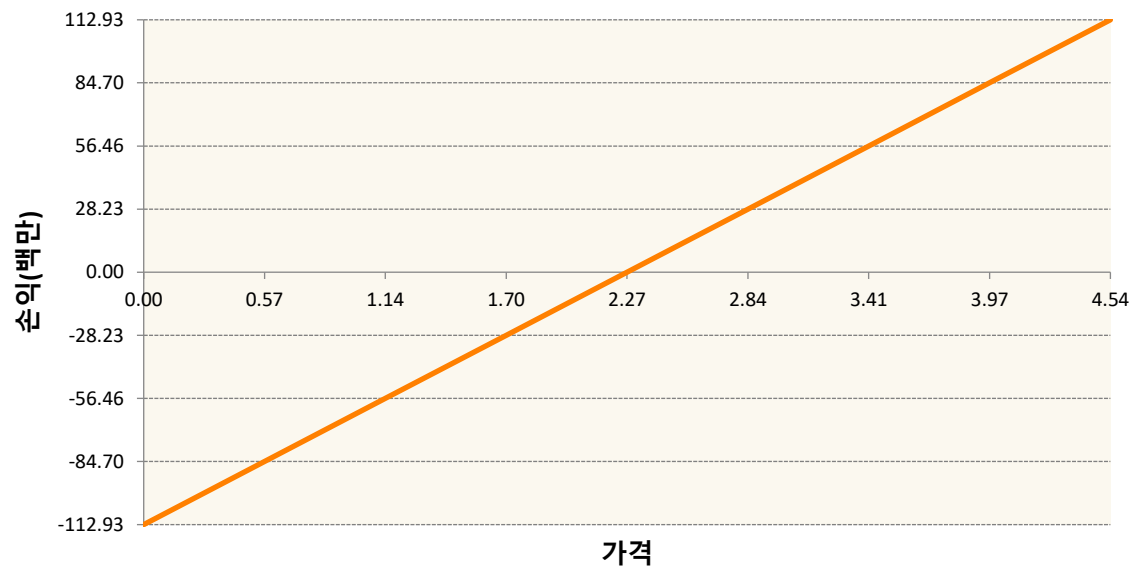
QSF2-Low Su Gasoil G Jan22



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)

378

공시일 2021-11-29

기준일 2021-11-26

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

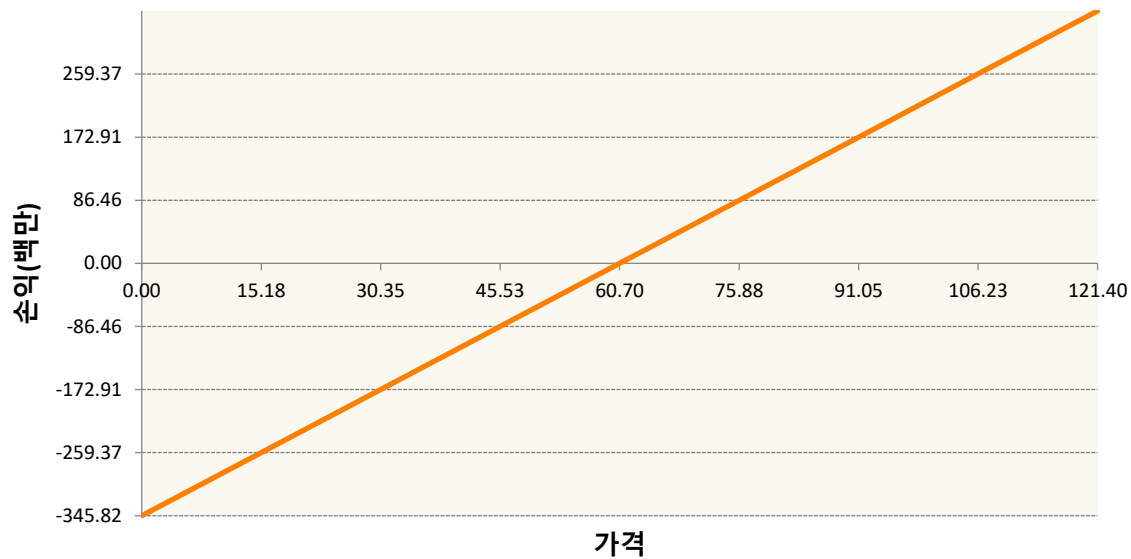
1. 계약금액

(단위:백만원)

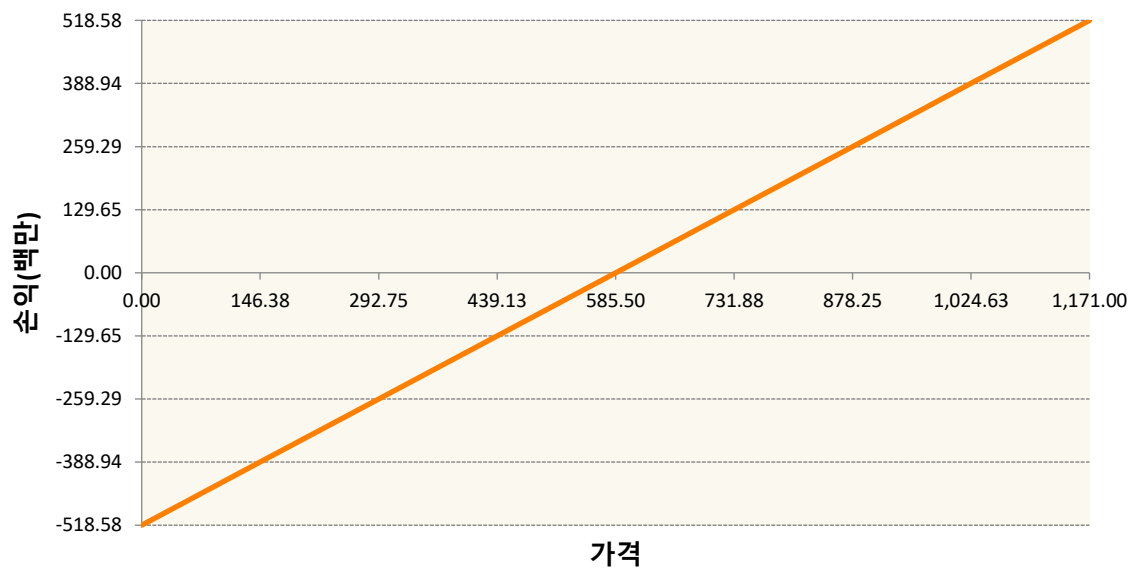
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,840	597	2,243	

2. 만기시점의 손익구조

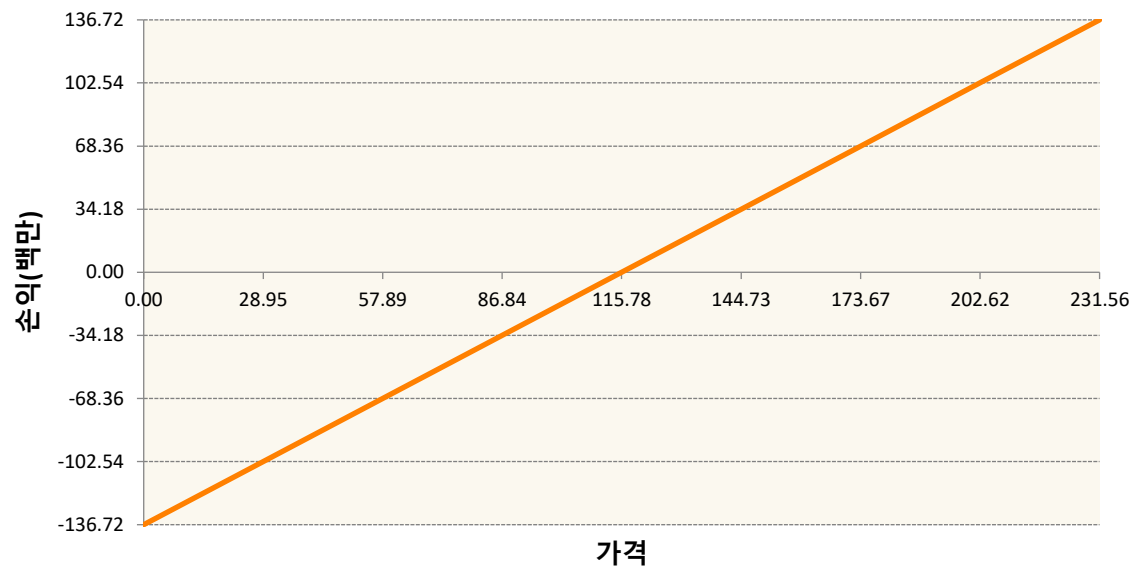
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



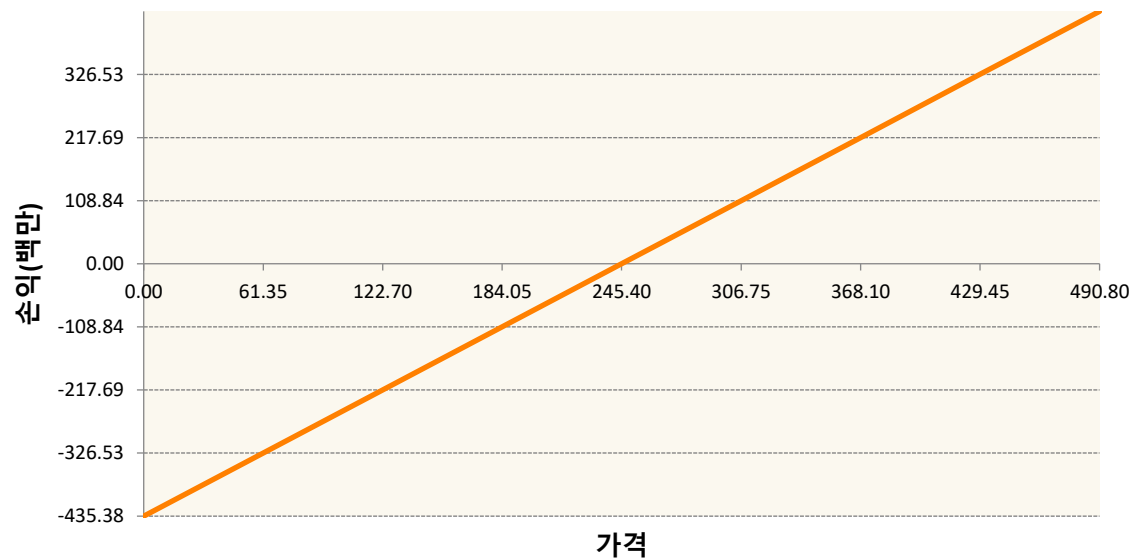
CH2-CORN FUTURE Mar22



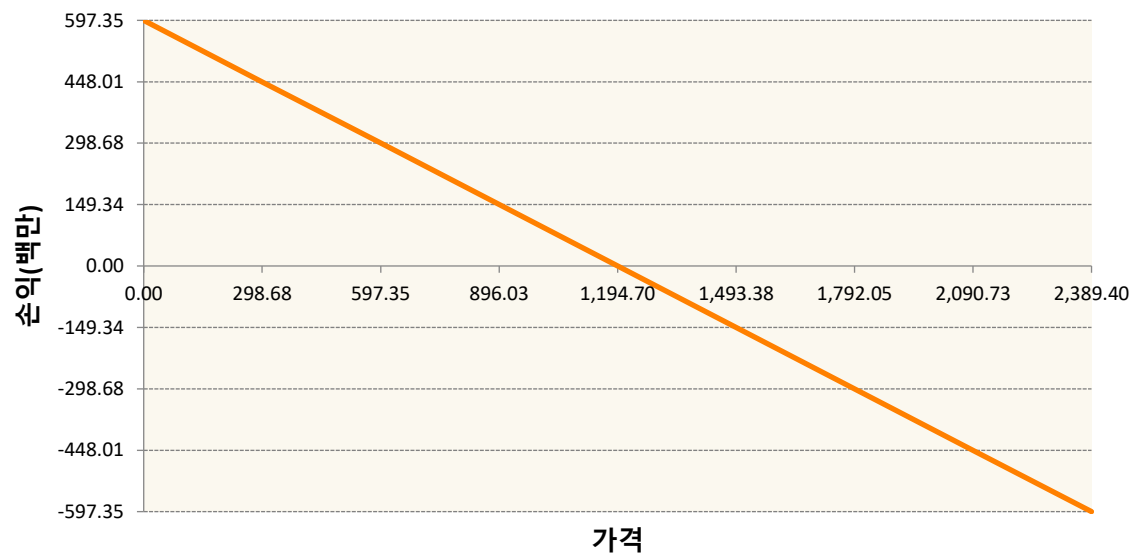
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



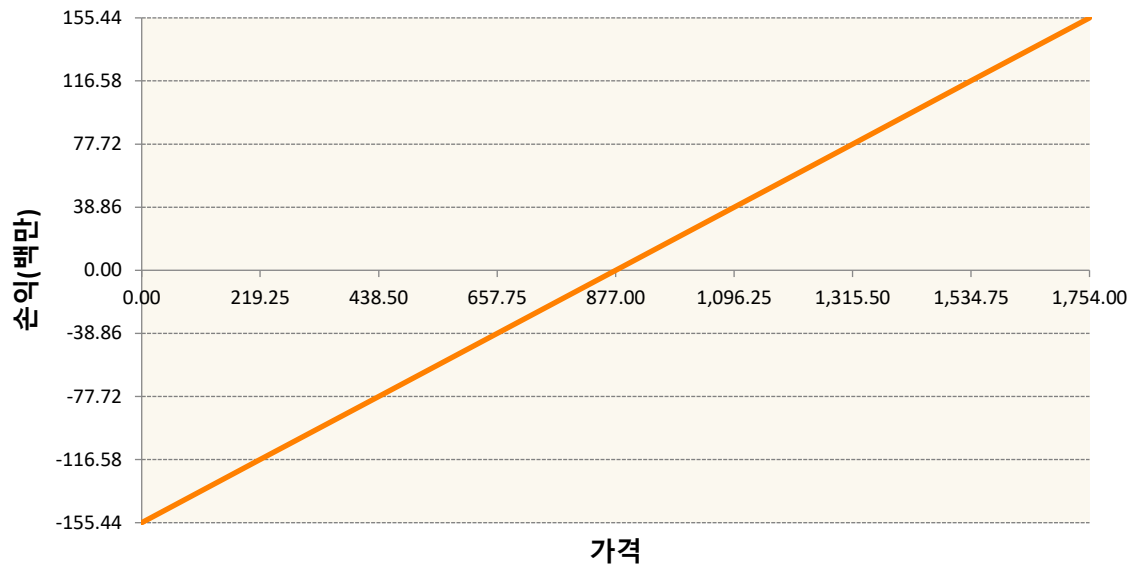
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



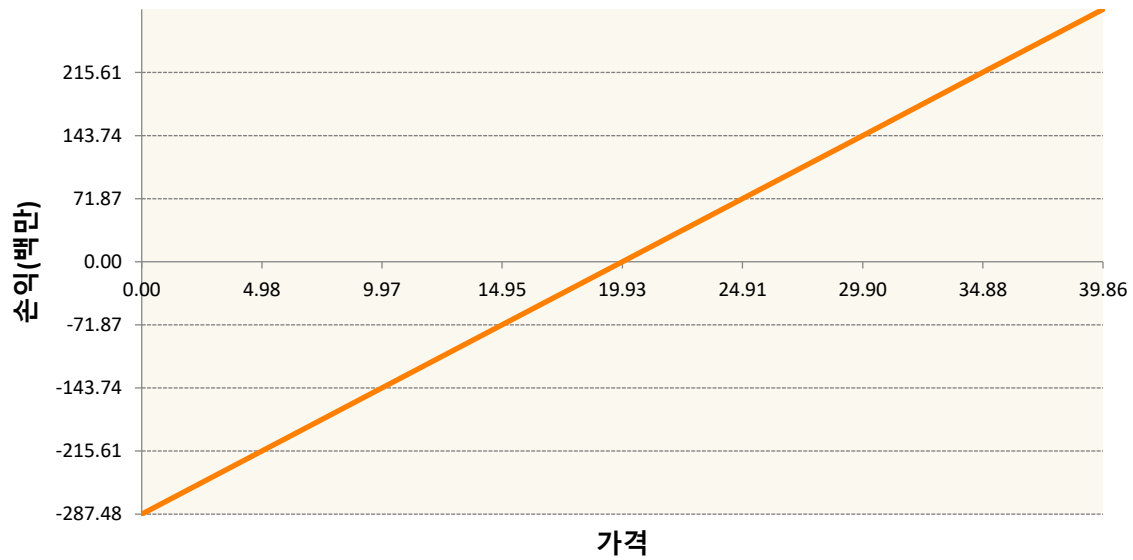
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



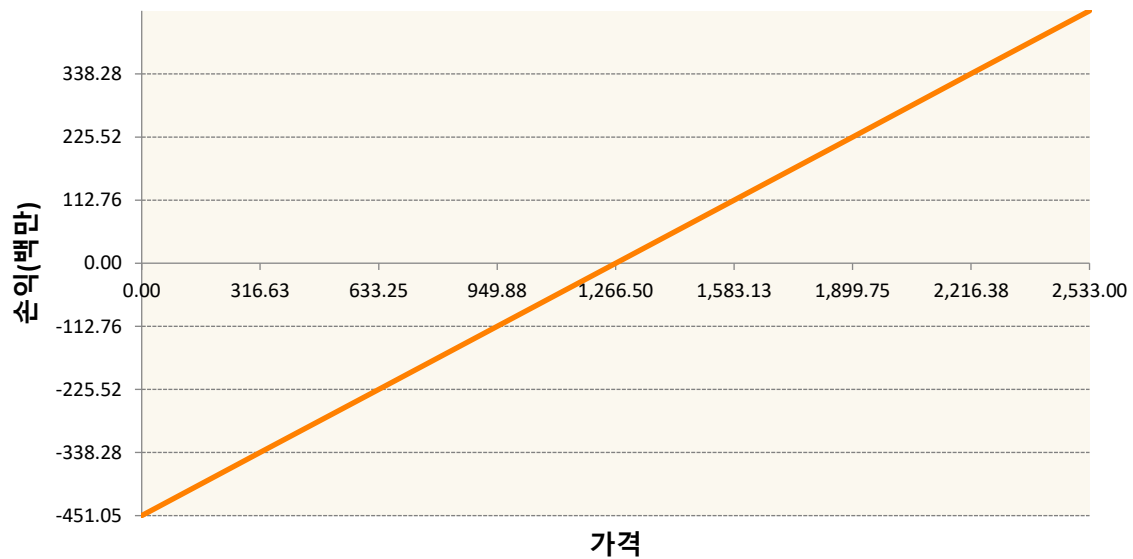
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



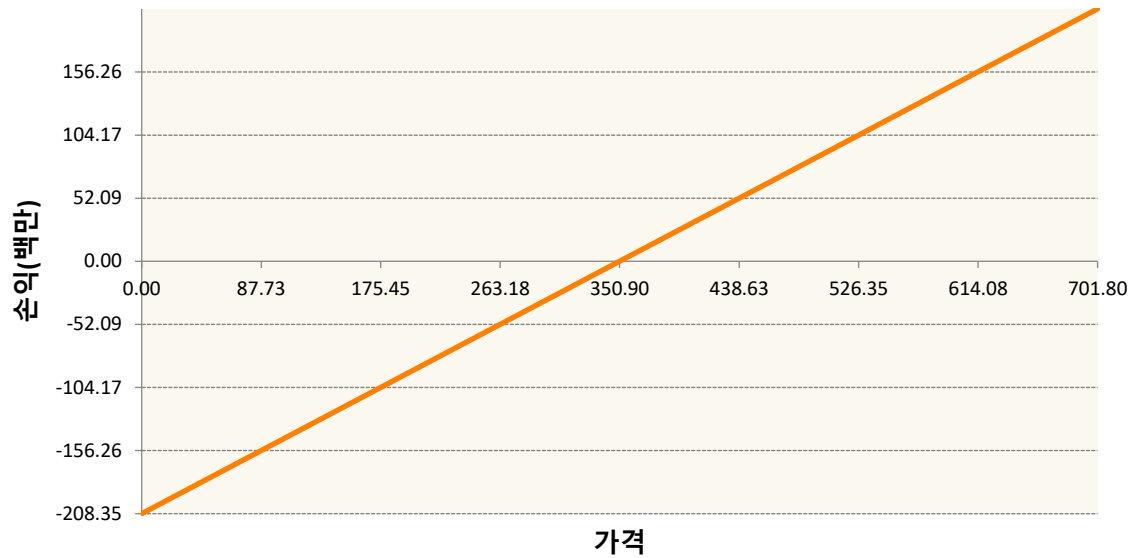
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



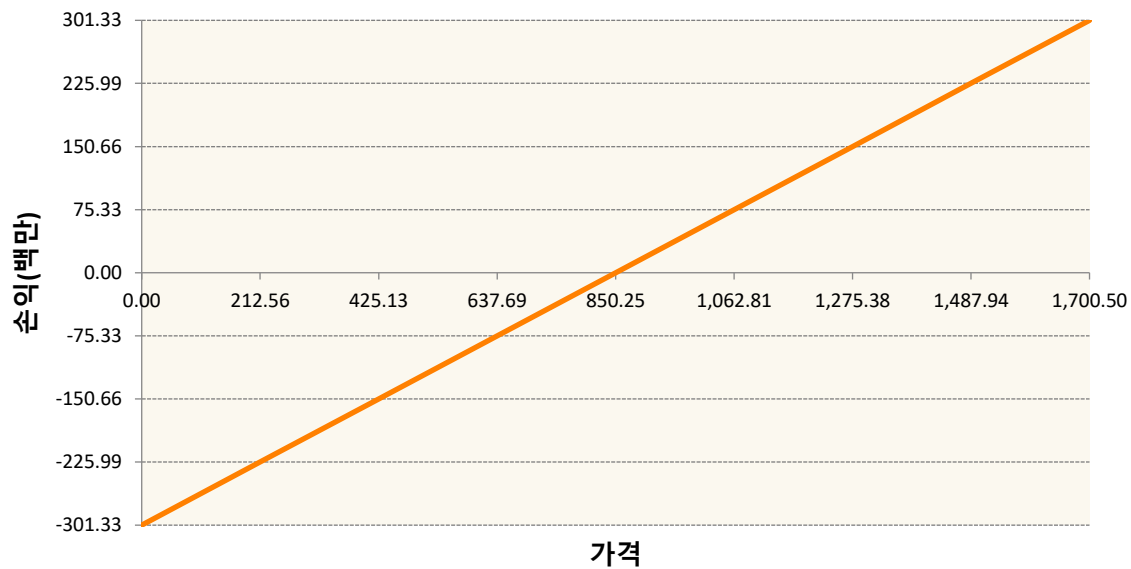
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



SMF2-SOYBEAN MEAL FUTR Jan22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(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

