

공시일 2021-11-30

기준일 2021-11-29

포커스농산물모(채권-파생형)

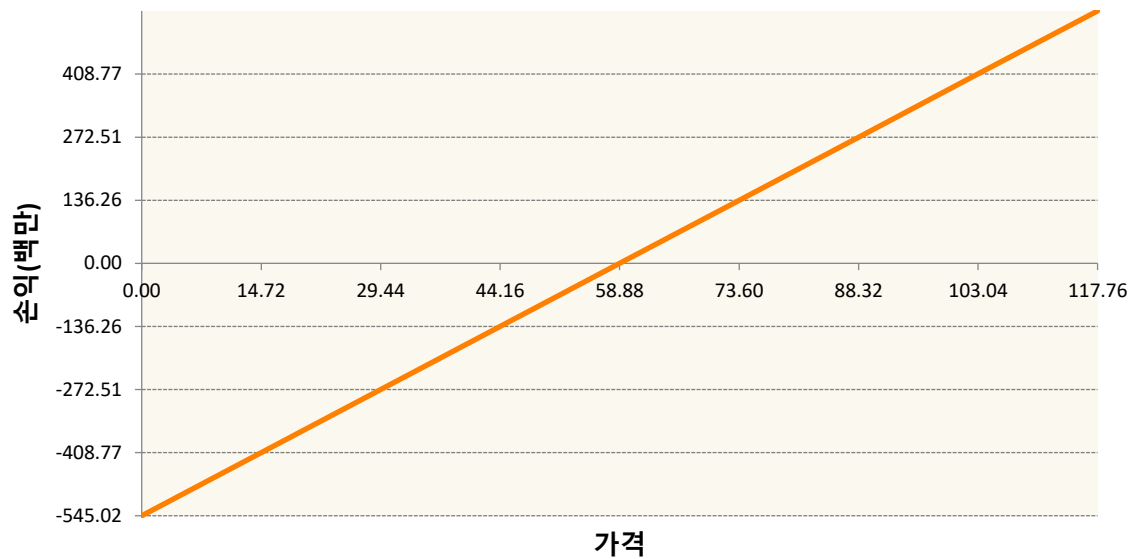
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

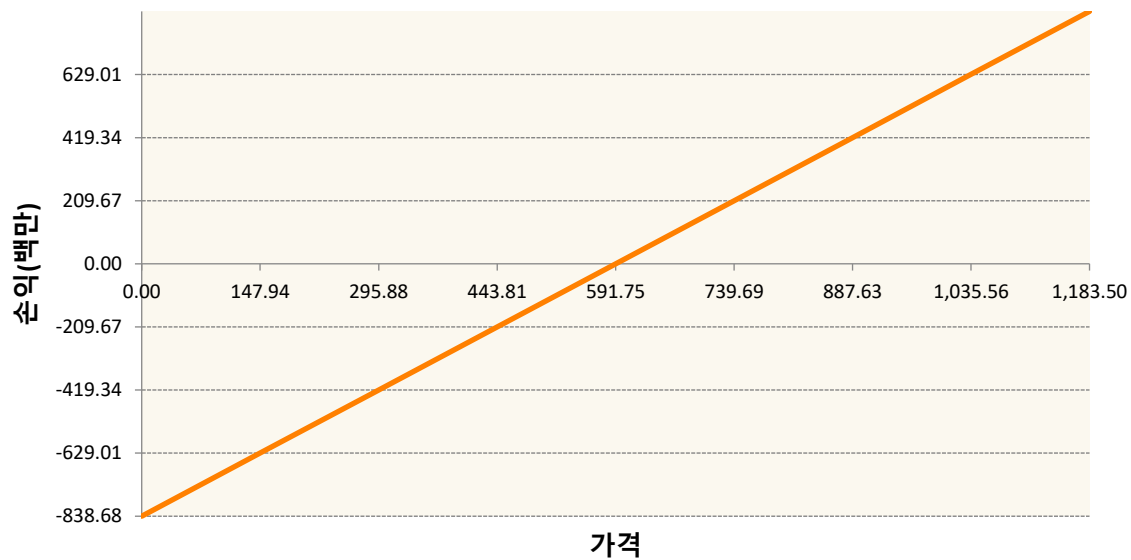
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,623	537	4,086	

2. 만기시점의 손익구조

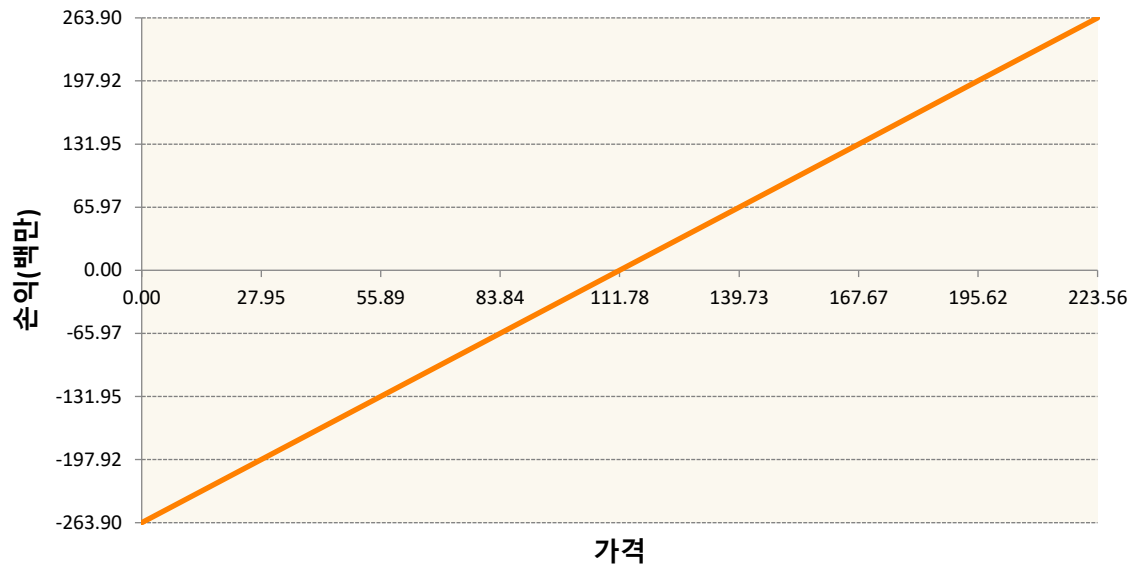
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



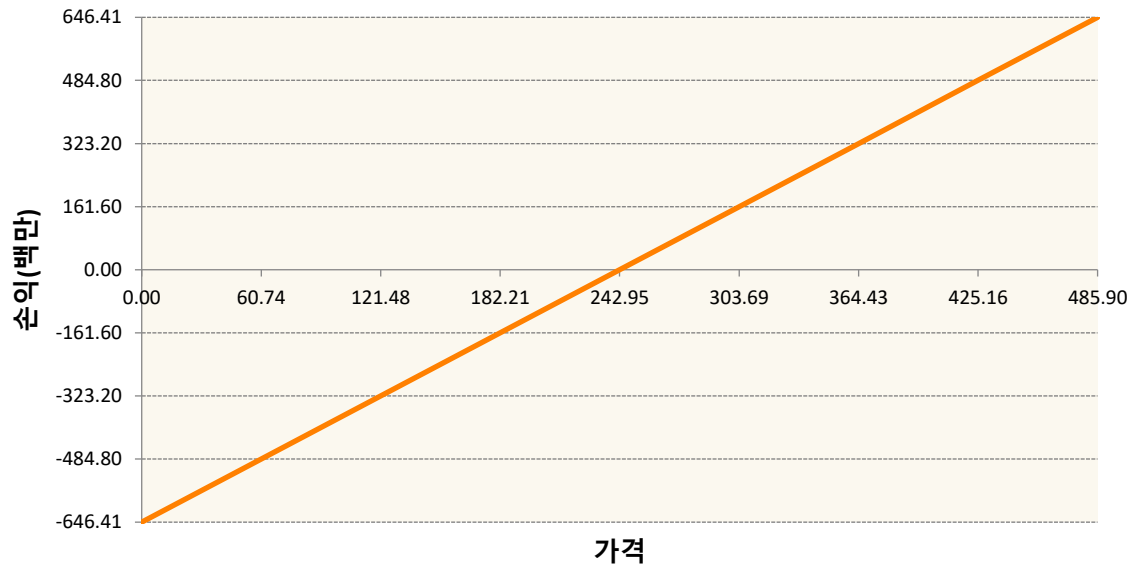
CH2-CORN FUTURE Mar22



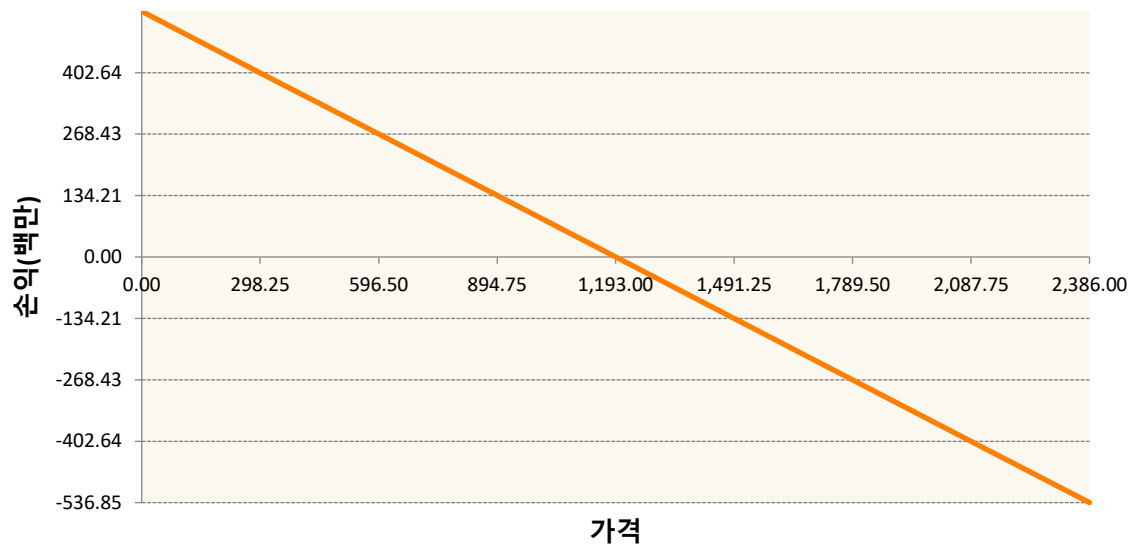
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



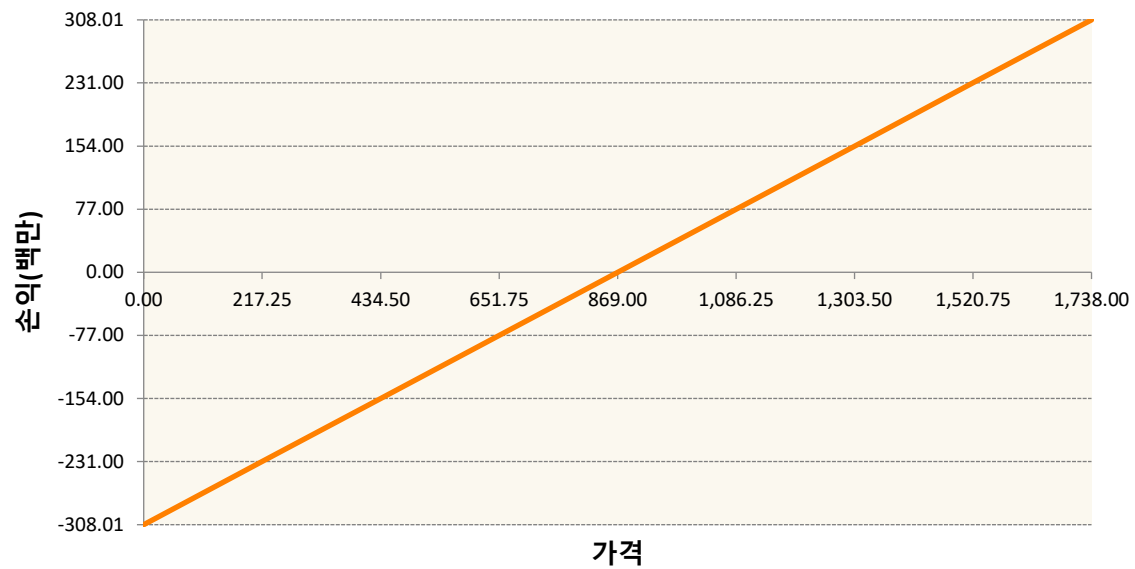
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



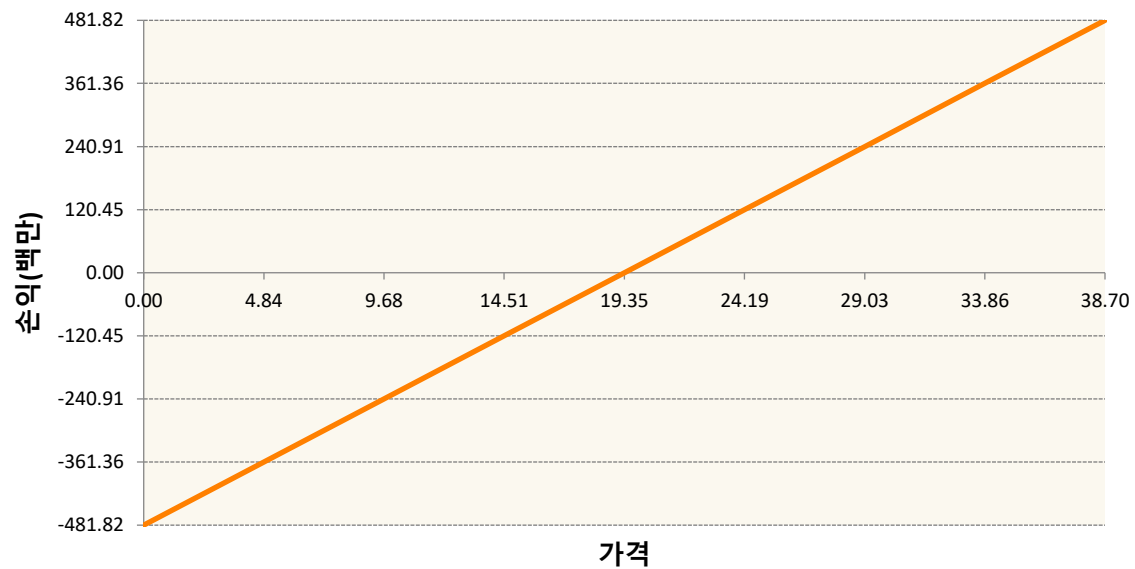
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



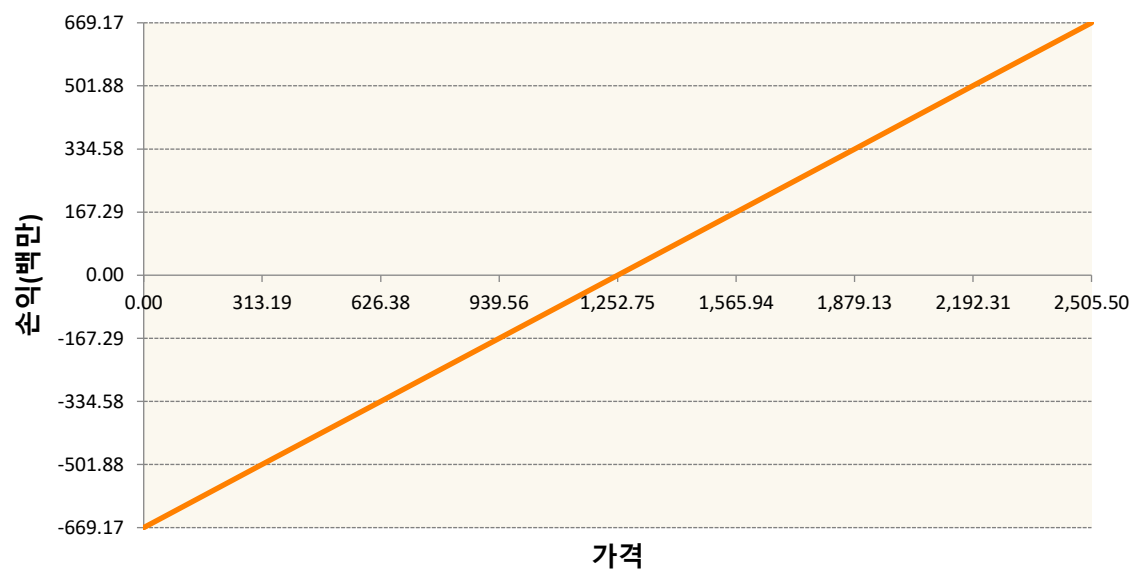
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



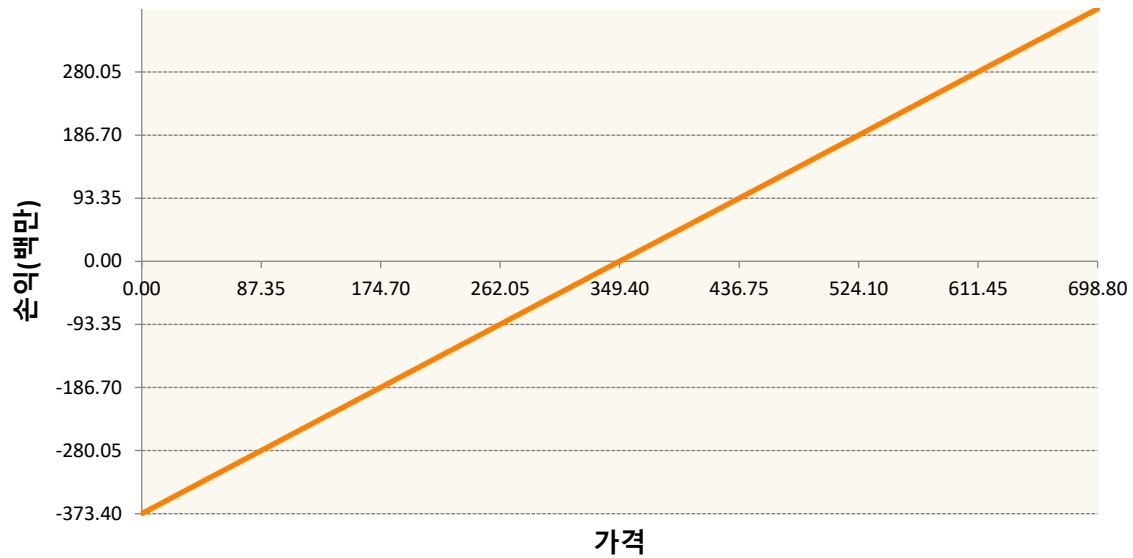
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



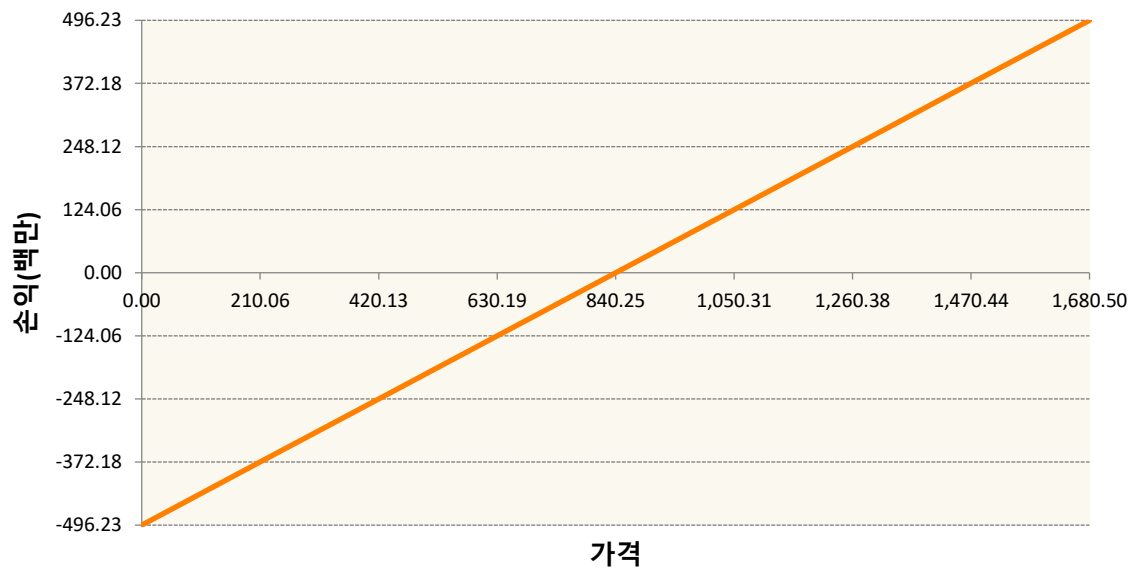
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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	2021-11-30
기준일	2021-11-29

스마트인덱스모

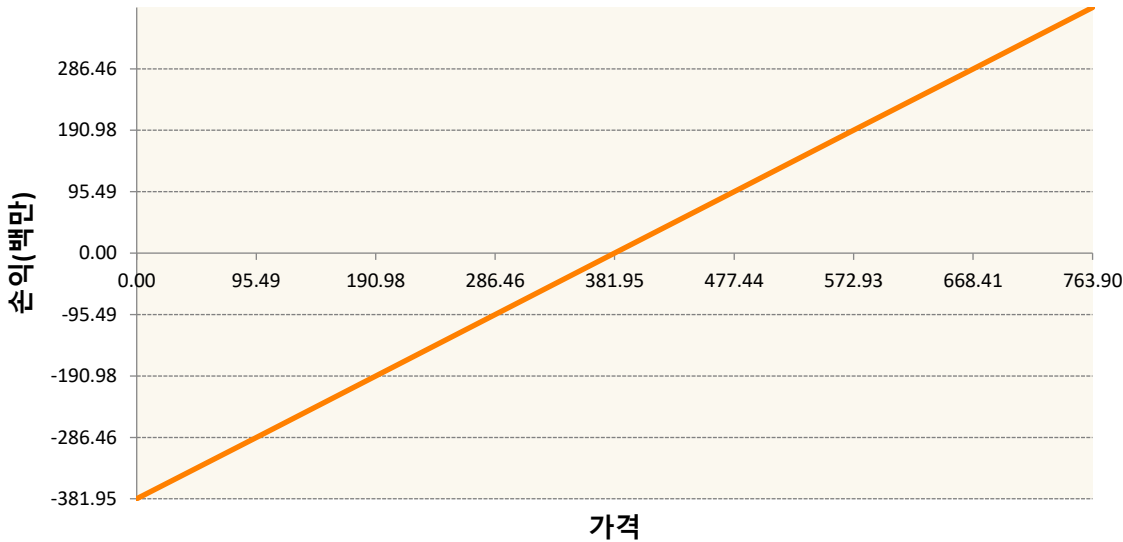
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	95	0	95	장내
누계	유가증권	선물	382	0	382	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101RC0000			2021-12 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%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-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%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

공시일	2021-11-30
기준일	2021-11-29

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

899

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

529

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-11-30
기준일	2021-11-29

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

434

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

422

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-11-30
기준일	2021-11-29

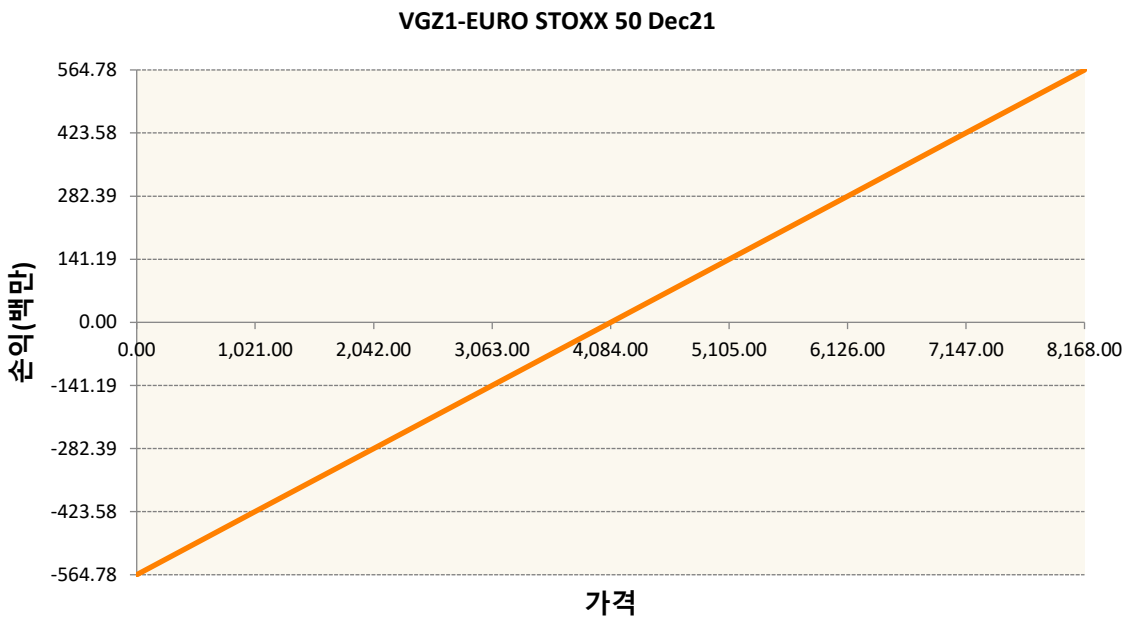
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	565	0	565	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ1	EURO STOXX 50 Dec21	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2021-11-30
기준일	2021-11-29

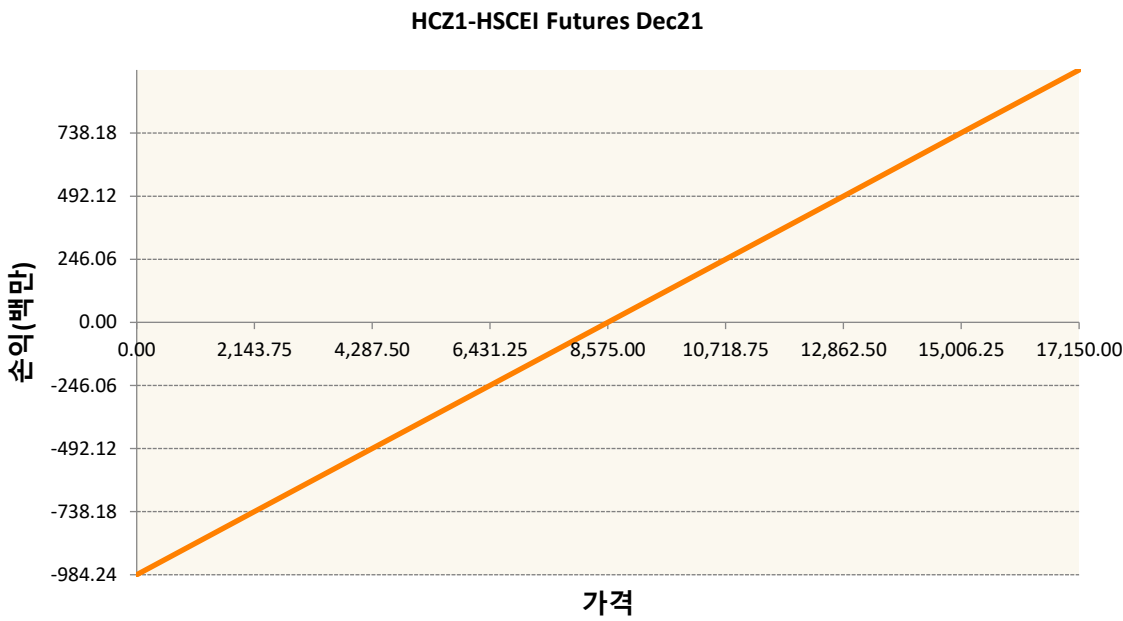
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	984	0	984	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	79
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

83

공시일 2021-11-30

기준일 2021-11-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

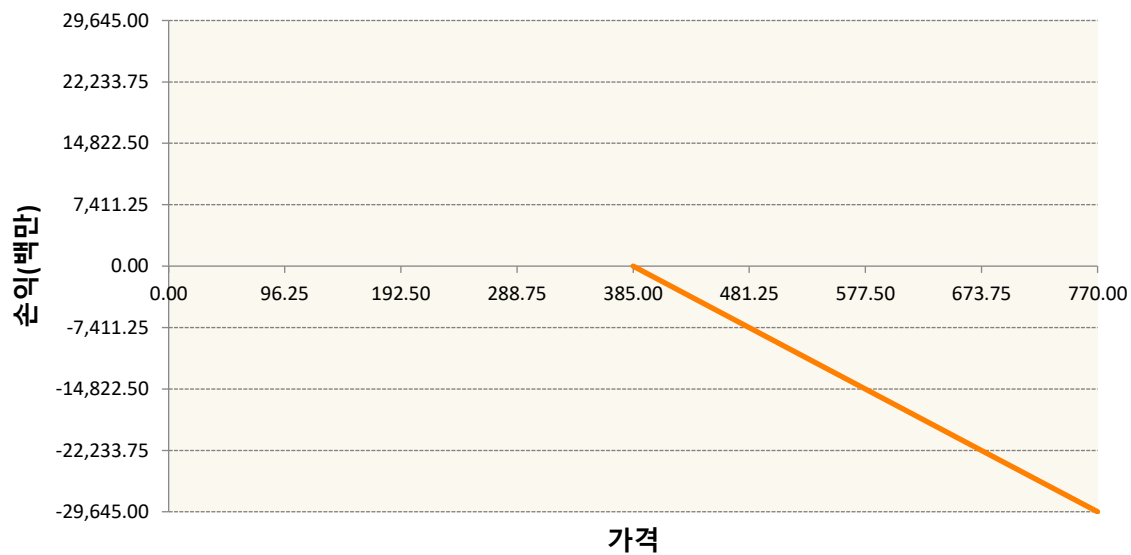
1. 계약금액

(단위:백만원)

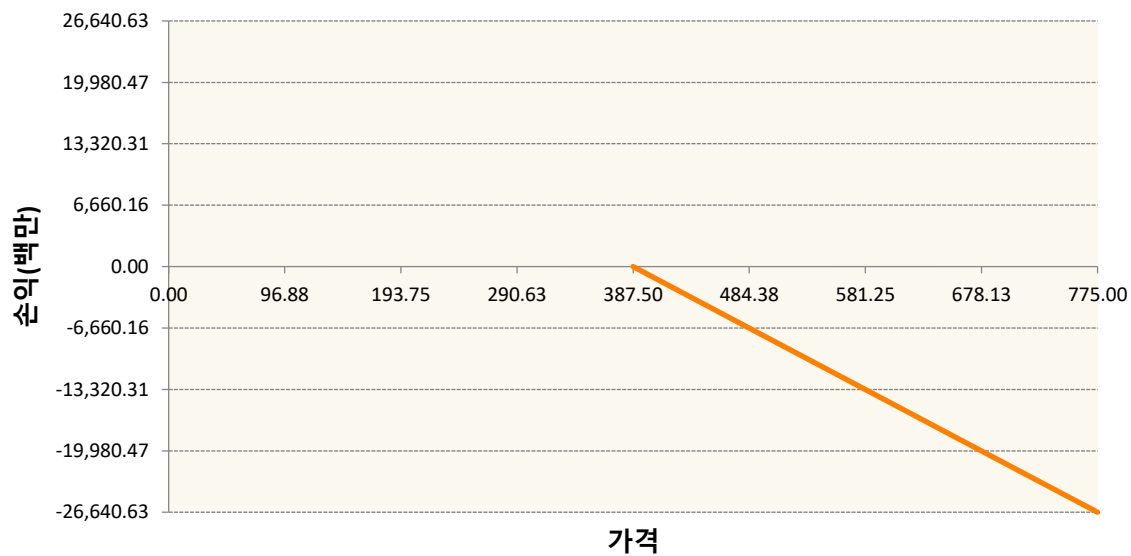
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,517	-76,517	장내

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, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 770.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), ranges from -17,325.00 to 17,325.00. A single orange line represents the net income function, 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 (Price)	순이익 (Net Income in millions)
0.00	-17,325.00
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			1,767
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	416	414	411	406	400	391	380
-5.33%	405	395	383	368	350	329	307
-2.67%	341	314	284	253	219	184	148
0%	132	88	44	0	-44	-89	-133
2.67%	-302	-343	-384	-426	-469	-512	-556
5.33%	-935	-958	-984	-1,013	-1,044	-1,076	-1,111
8.00%	-1,675	-1,683	-1,694	-1,708	-1,725	-1,745	-1,767
KR4201RC3870				2021-12 콜387.5			1,496
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	306	305	303	300	295	289	281
-5.33%	299	293	285	274	261	245	228
-2.67%	259	239	217	192	165	137	107
0%	112	75	38	0	-38	-77	-116
2.67%	-224	-263	-302	-342	-382	-422	-462
5.33%	-752	-777	-804	-833	-864	-896	-930
8.00%	-1,395	-1,405	-1,418	-1,434	-1,452	-1,473	-1,496
KR4301RC3853 2021-12 풋385							1,205

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,200	-1,200	-1,201	-1,201	-1,202	-1,203	-1,205
-5.33%	-744	-745	-748	-751	-755	-761	-767
-2.67%	-303	-312	-322	-333	-345	-358	-372
0%	58	39	20	0	-20	-39	-59
2.67%	257	240	223	205	186	168	149
5.33%	318	312	304	295	284	273	260
8.00%	328	327	325	322	318	314	308
KR4301RC3879 2021-12 풋387.5							207

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-132	-133	-133
-2.67%	-56	-57	-58	-60	-61	-63	-65
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	49	46	43	40	36	33	30
5.33%	64	62	61	59	57	54	52
8.00%	67	66	66	65	64	63	62

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

(단위:백만원)

4,889

공시일 2021-11-30

기준일 2021-11-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

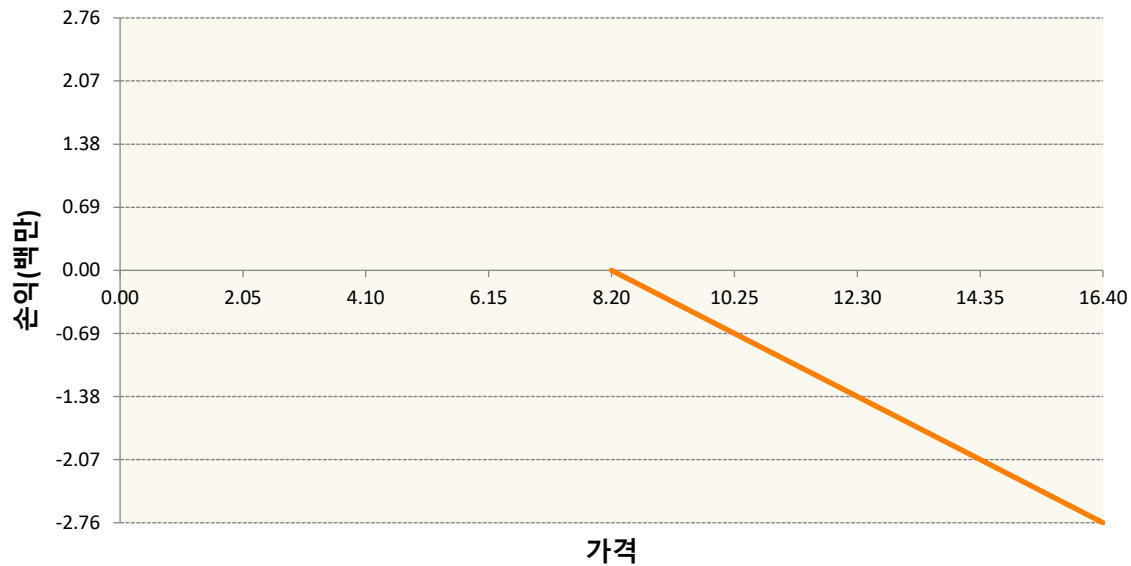
1. 계약금액

(단위:백만원)

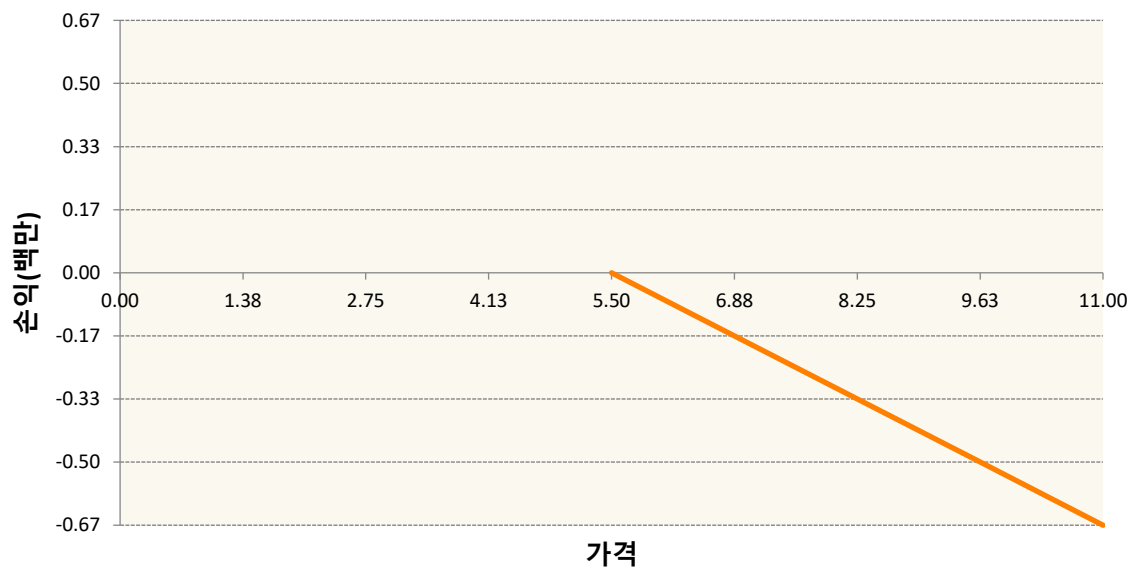
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	162	-162	장내

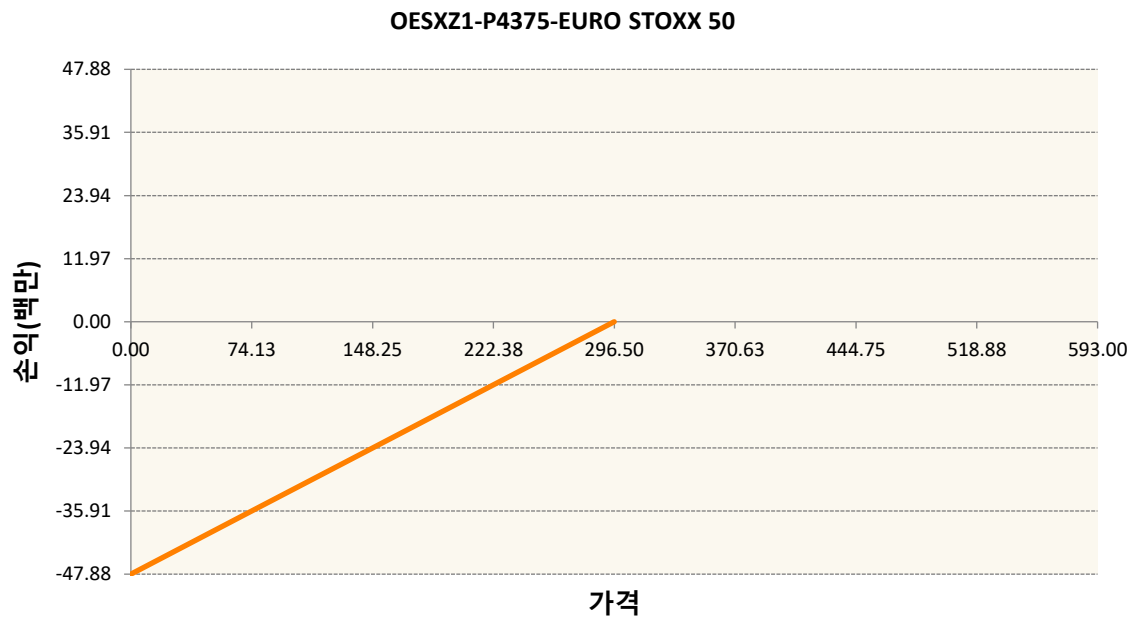
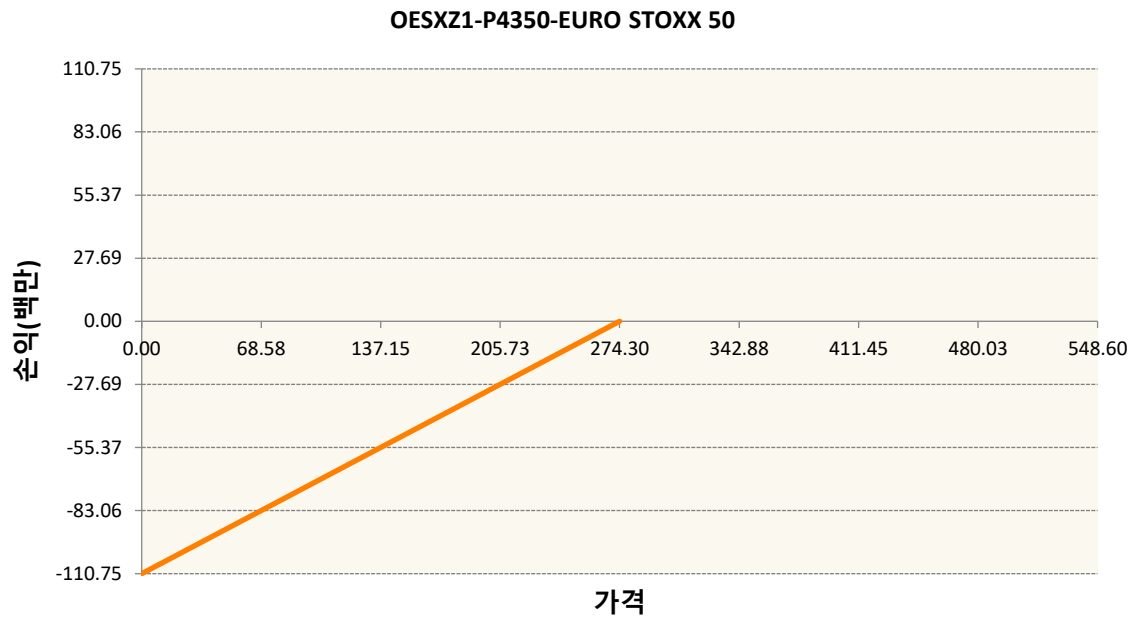
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ1-C4350-EURO STOXX 50



OESXZ1-C4375-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		28
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.22
OESXZ1-C43 EURO STOXX 50		0.05
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		9
OESXZ1-P43 EURO STOXX 50		4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		40

공시일 2021-11-30

기준일 2021-11-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

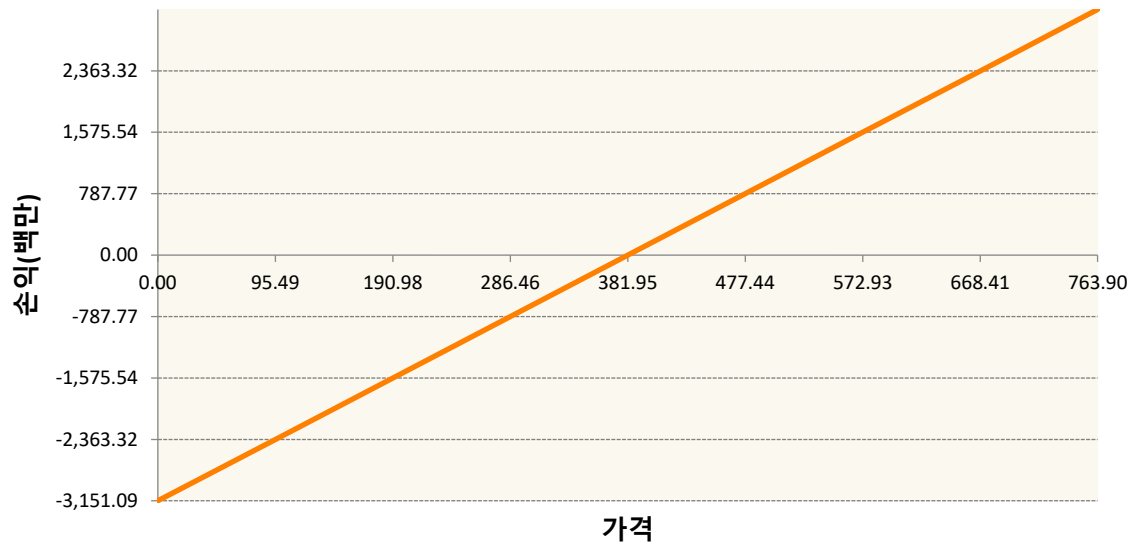
1. 계약금액

(단위:백만원)

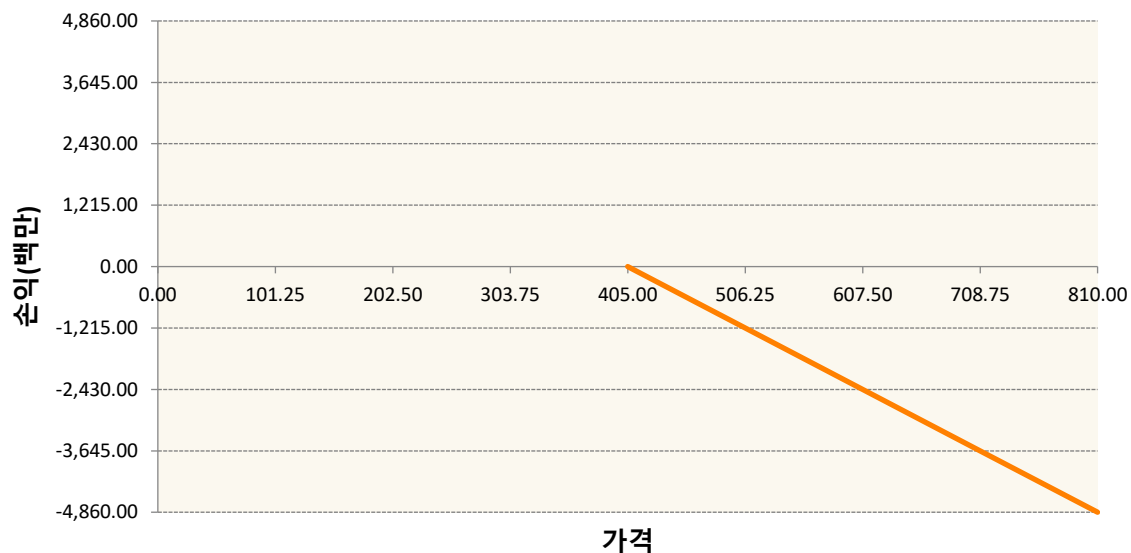
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,151	0	3,151	장내
누계	유가증권	옵션	579	5,369	-4,791	장내

2. 만기시점의 손익구조

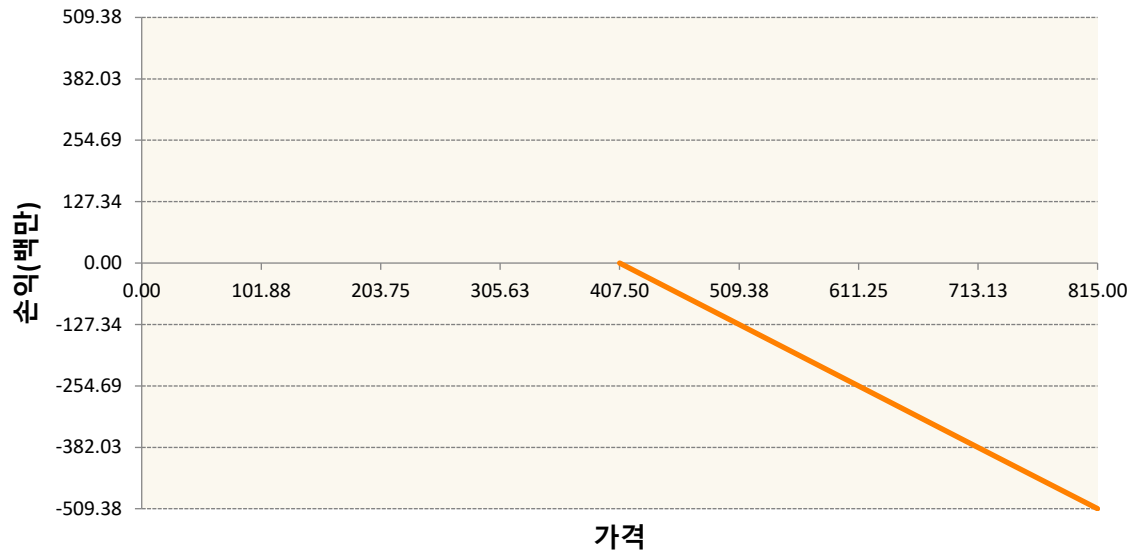
KR4101RC0000-2021-12 코스피200지수선물



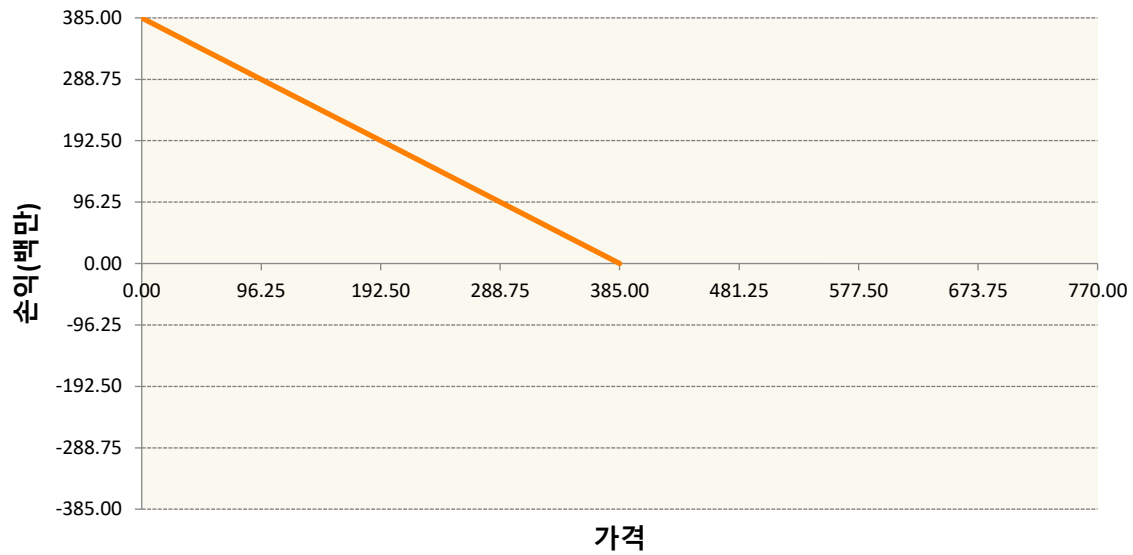
KR4201RC4050-2021-12 콜405



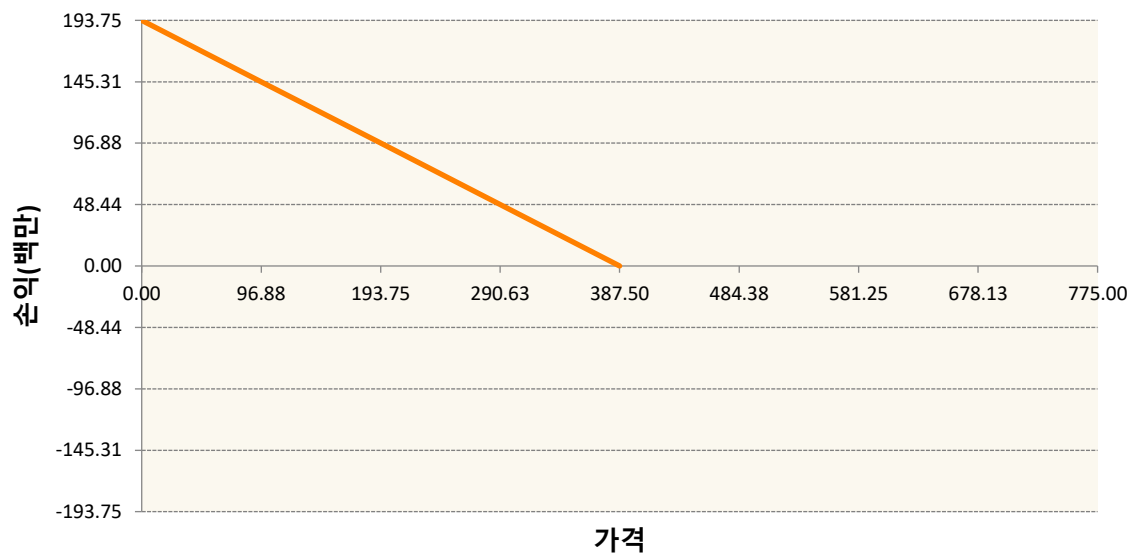
KR4201RC4076-2021-12 콜407.5



KR4301RC3853-2021-12 풋385



KR4301RC3879-2021-12 풋387.5



(단위:백만원)

KR4101RC0000							2021-12 코스피200지수선물	252
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252	
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168	
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	84	84	84	84	84	84	84	
5.33%	168	168	168	168	168	168	168	
8.00%	252	252	252	252	252	252	252	
KR4201RC4050							2021-12 콜405	150
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	10	10	10	10	10	10	9	
-5.33%	10	10	10	9	9	8	8	
-2.67%	10	9	8	7	6	4	2	
0%	7	5	3	0	-3	-7	-11	
2.67%	-5	-9	-15	-20	-26	-32	-38	
5.33%	-40	-47	-54	-61	-69	-76	-83	
8.00%	-108	-115	-122	-128	-135	-143	-150	
KR4201RC4076							2021-12 콜407.5	14
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1	
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1	
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0	
0%	1	0	0	0	0	-1	-1	
2.67%	0	-1	-1	-2	-2	-3	-3	
5.33%	-3	-4	-5	-5	-6	-7	-8	
8.00%	-9	-10	-11	-12	-12	-13	-14	
KR4301RC3853							2021-12 풋385	27
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	27	27	27	27	27	27	27	
-5.33%	17	17	17	17	17	17	17	
-2.67%	7	7	7	7	8	8	8	
0%	-1	-1	0	0	0	1	1	
2.67%	-6	-5	-5	-5	-4	-4	-3	
5.33%	-7	-7	-7	-7	-6	-6	-6	
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
KR4301RC3879							2021-12 풋387.5	14
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	14	14	14
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-2.67%	4	4	4	4	4	4	4
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

394

공시일	2021-11-30
기준일	2021-11-29

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	593	-593	
누계	유가증권	수익증권	17,998	0	17,998	

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	2021-11-30
기준일	2021-11-29

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	9,698	0	9,698	

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	2021-11-30
기준일	2021-11-29

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	45,804	0	45,804	
누계	통화	선도	1,432	0	1,432	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBW USD/KRW 24-12-21E	115
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

39

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

가격	순이익(백만)
0.00	-1,814.26
95.49	-1,360.70
190.98	-907.13
286.46	-453.57
381.95	0.00
477.44	453.57
572.93	907.13
668.41	1,360.70
763.90	1,814.26

(단위:백만원)

KR4101RC0000			2021-12 코스피200지수선물				145
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	48	48	48	48	48	48	48
5.33%	97	97	97	97	97	97	97
8.00%	145	145	145	145	145	145	145

공시일 2021-11-30

기준일 2021-11-29

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

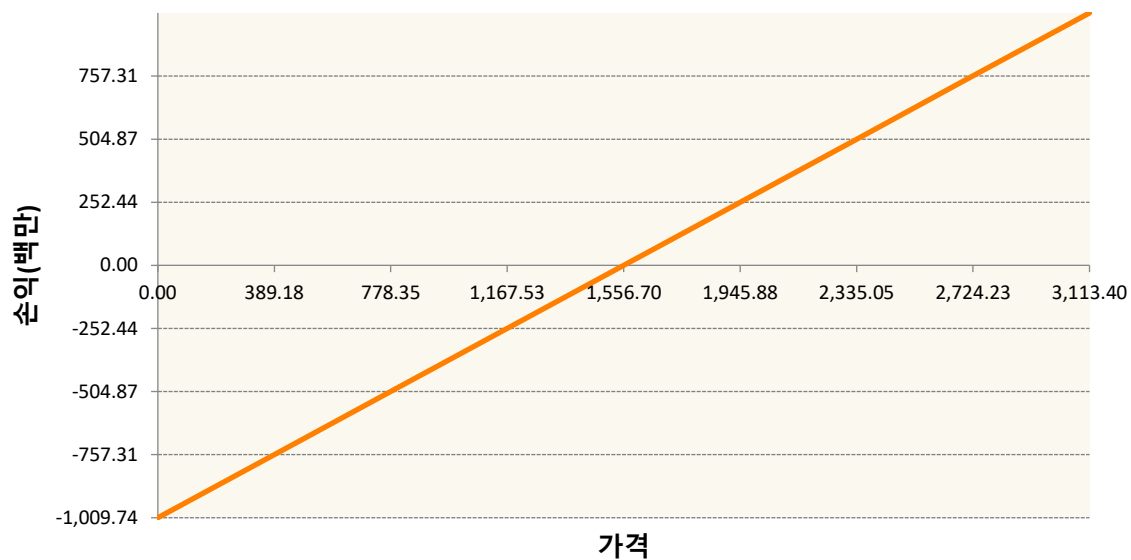
1. 계약금액

(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	1,010	0	1,010	
누계	유가증권	스왑	1,797	0	1,797	장외
누계	통화	선도	0	579	-579	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCZ1-VN30 Index Future Dec21



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)
 FXW213BBQ KRW/EUR 25-02-22E
 FXW213BBS KRW/EUR 25-02-22E
 VNCZ1 VN30 Index Future Dec21

144
 36
 11
 81

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

(단위:백만원)

262

공시일 2021-11-30

기준일 2021-11-29

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

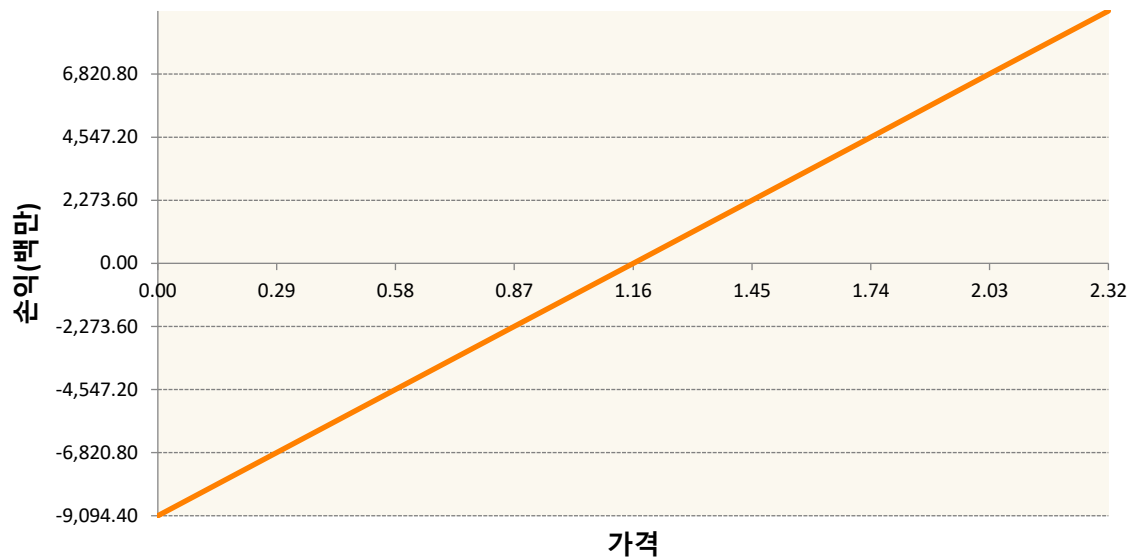
1. 계약금액

(단위:백만원)

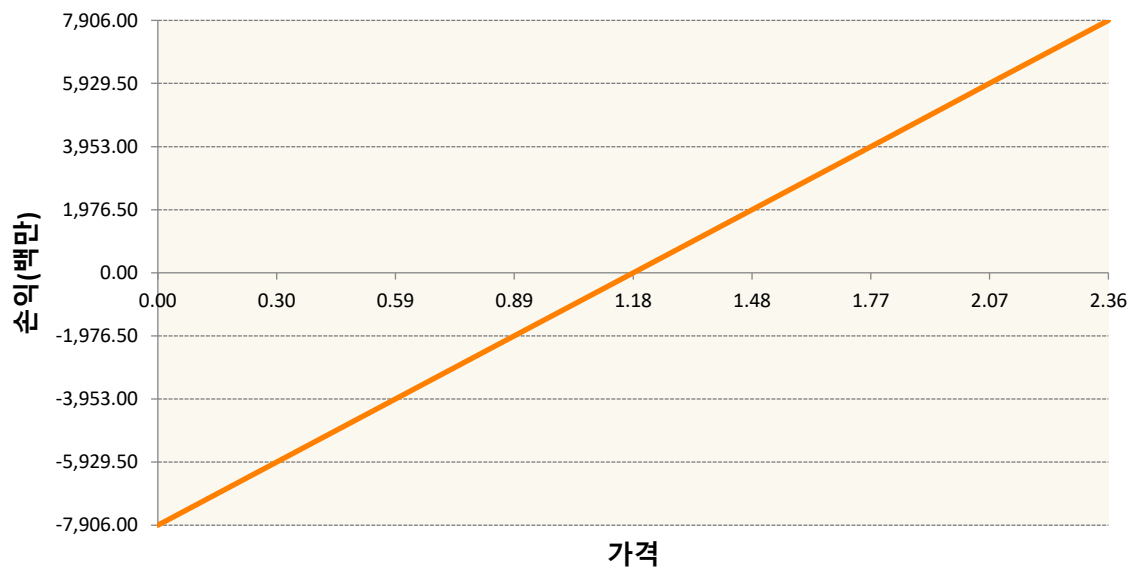
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,260	0	2,260	
누계	유가증권	선물	24,966	0	24,966	

2. 만기시점의 손익구조

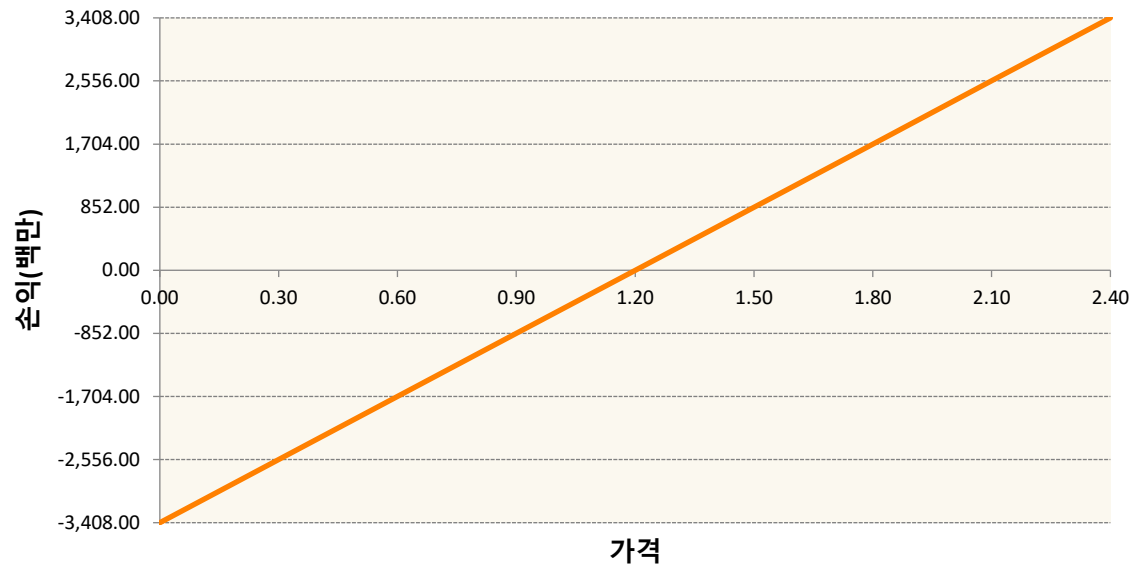
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



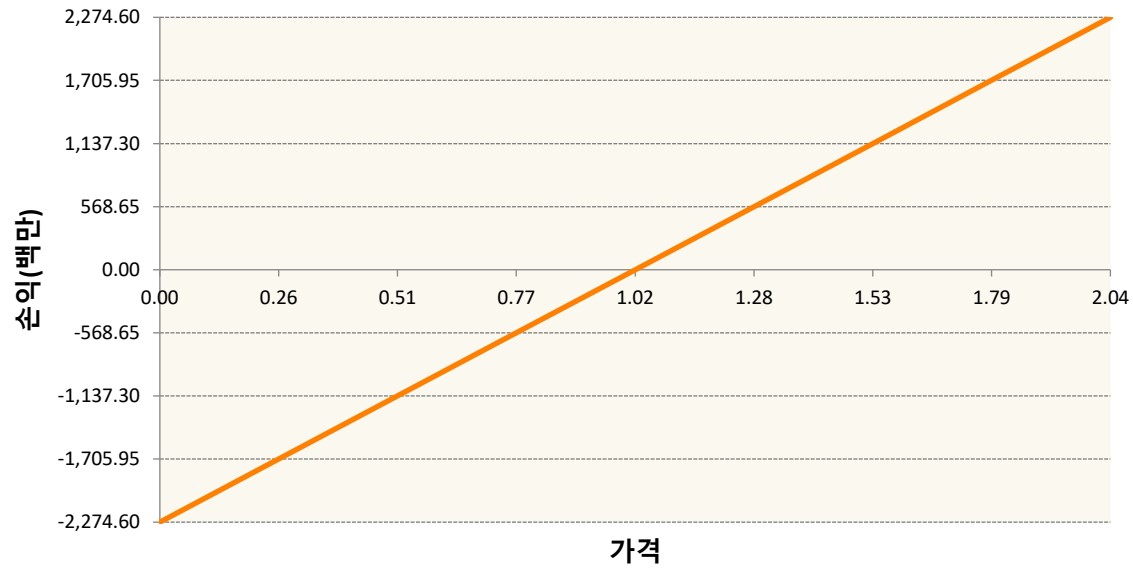
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



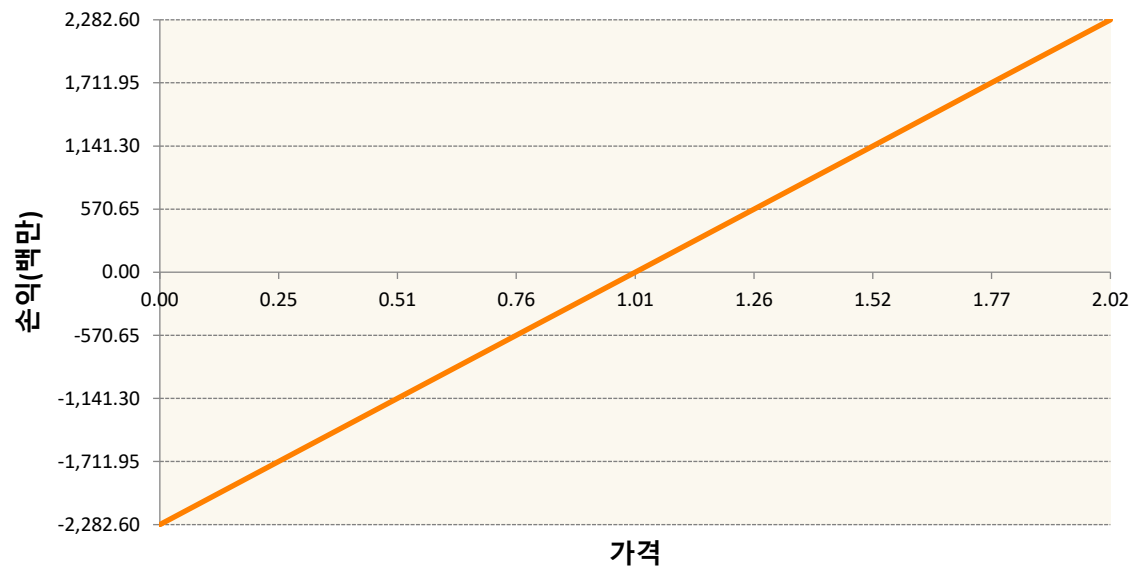
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		729
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		634
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		273
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		182
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		182

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,020

공시일 2021-11-30

기준일 2021-11-29

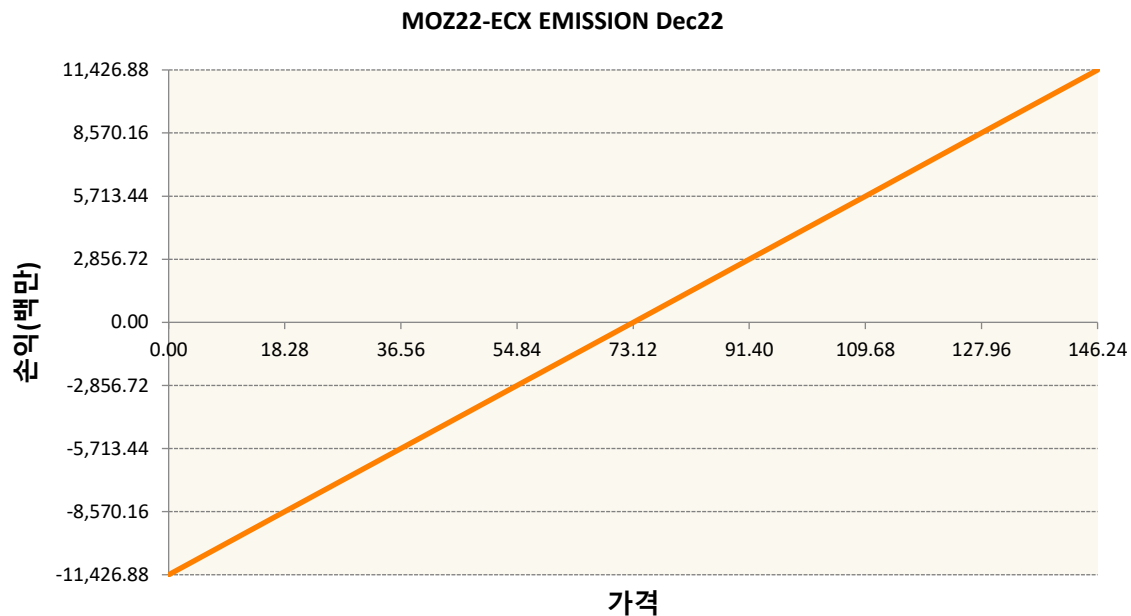
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,427	0	11,427	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

914

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

(단위:백만원)

1,842

공시일 2021-11-30

기준일 2021-11-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

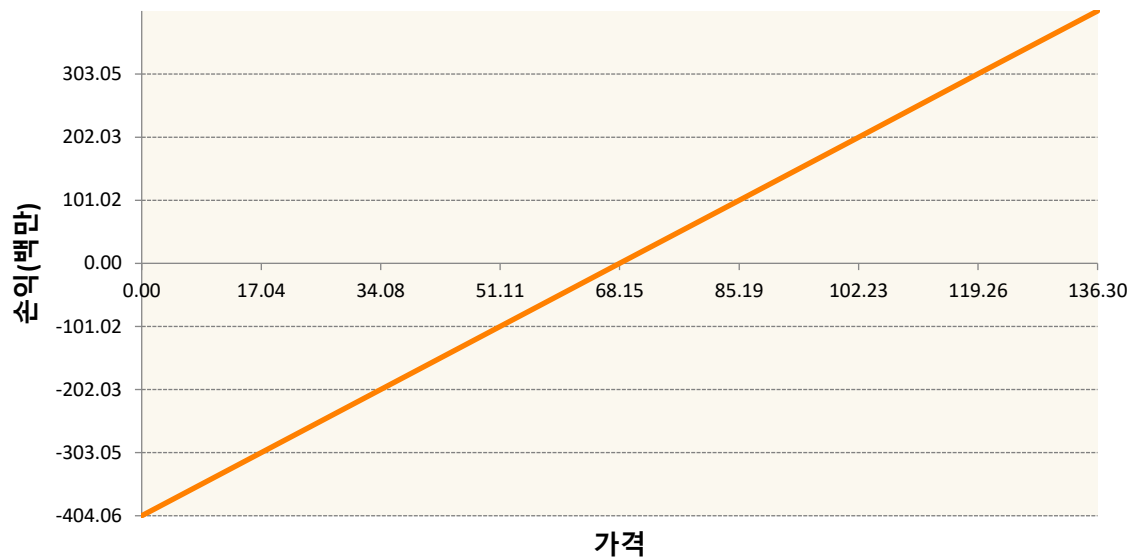
1. 계약금액

(단위:백만원)

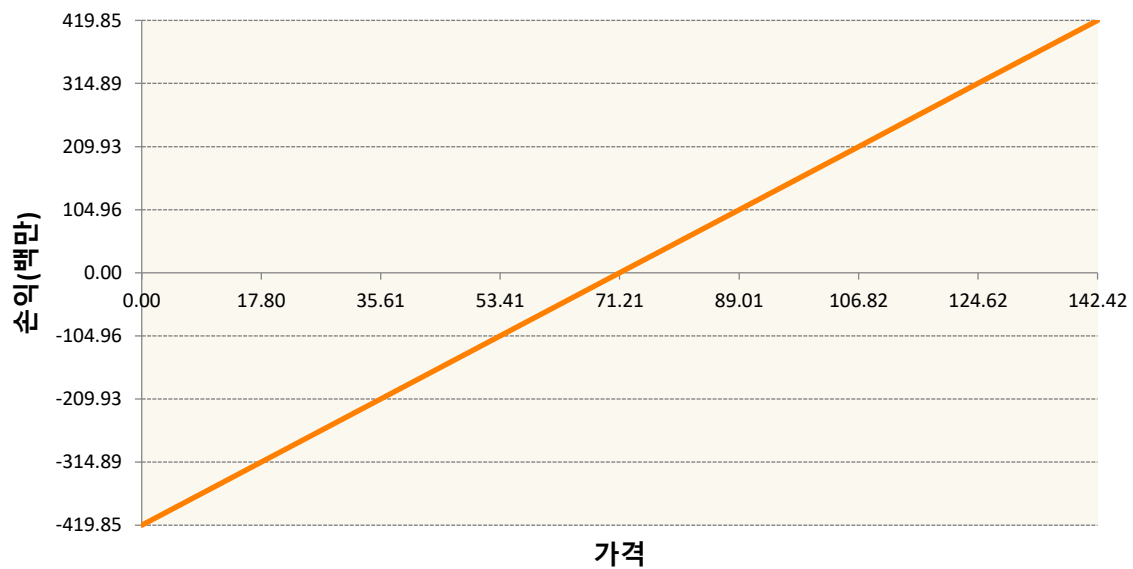
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,021	537	1,485	

2. 만기시점의 손익구조

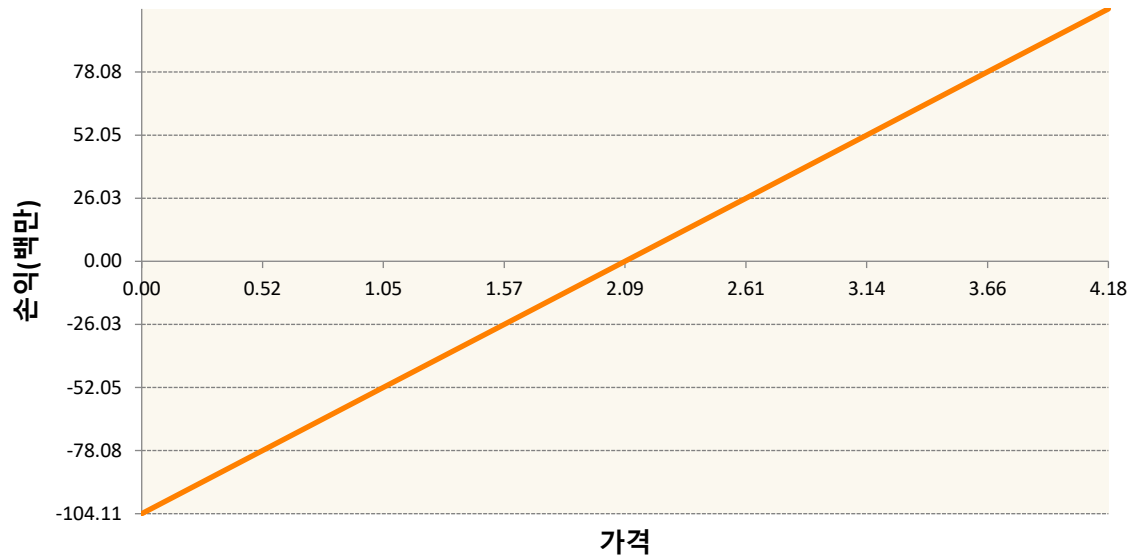
CLF2-WTI CRUDE FUTURE Jan22



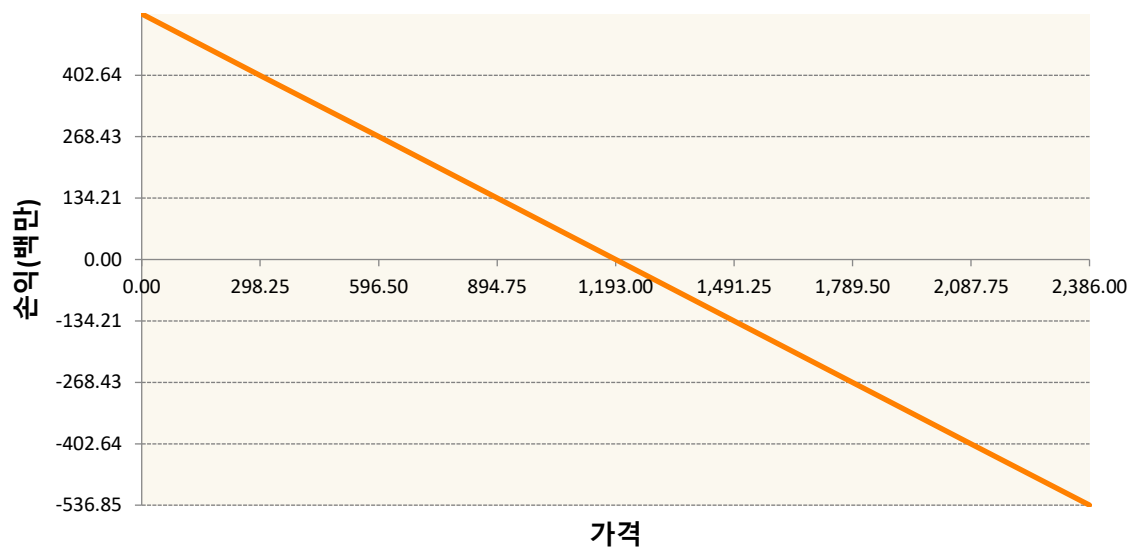
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



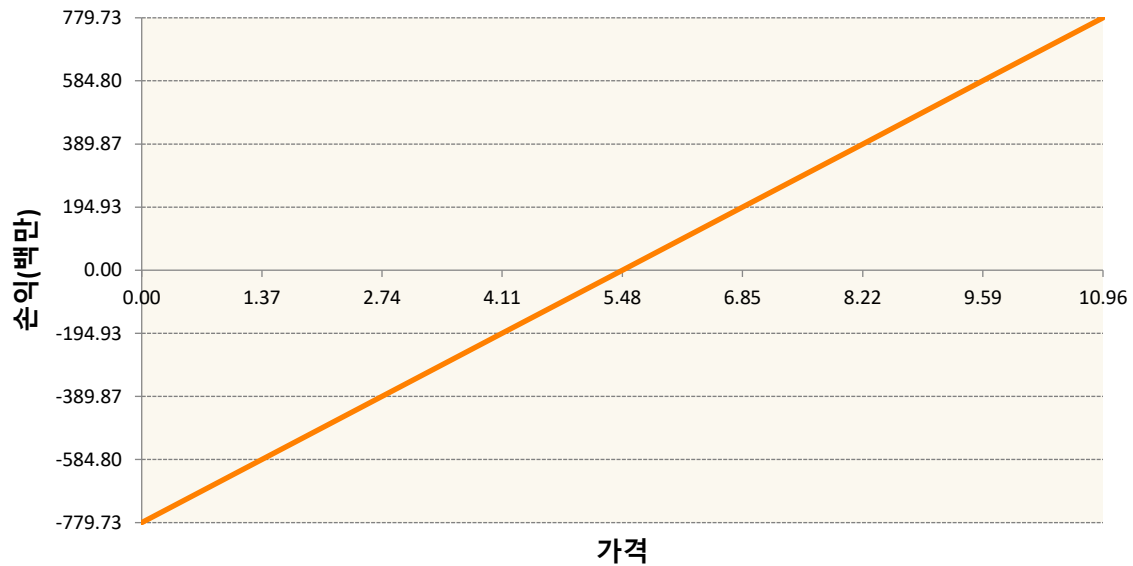
HOF2-NY Harb ULSD Fut Jan22



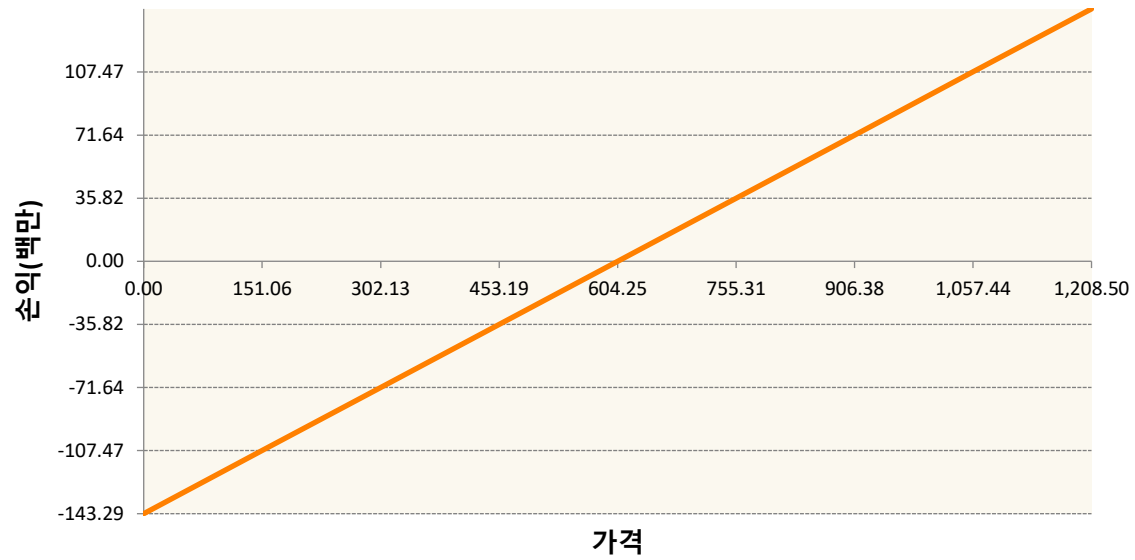
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



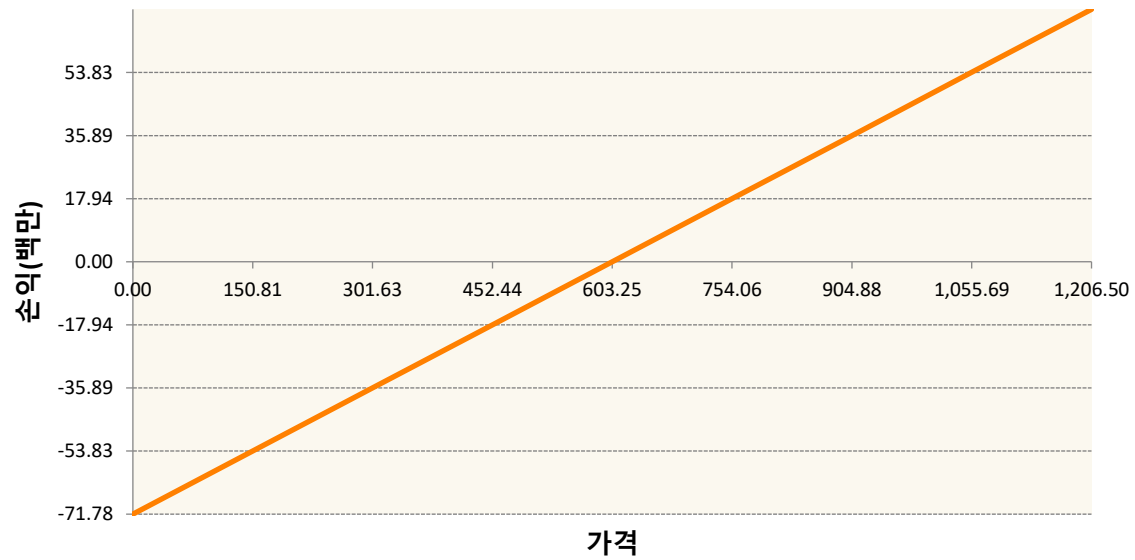
NGF22-NATURAL GAS FUTR Jan22



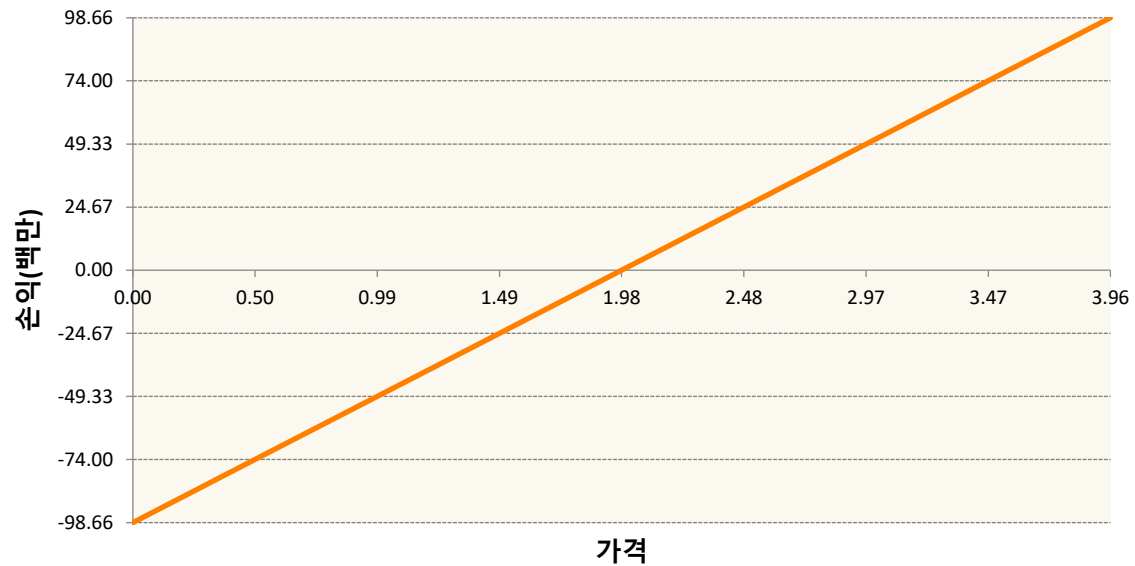
QSF2-Low Su Gasoil G Jan22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBF2-GASOLINE RBOB FUT Jan22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF2	WTI CRUDE FUTURE Jan22	32
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22	34
HOF2	NY Harb ULSD Fut Jan22	8
KR4175RC00 2021-12 달러선물		43
NGF22	NATURAL GAS FUTR Jan22	62
QSF2	Low Su Gasoil G Jan22	11
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	6
XBF2	GASOLINE RBOB FUT Jan22	8

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

381

공시일 2021-11-30

기준일 2021-11-29

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

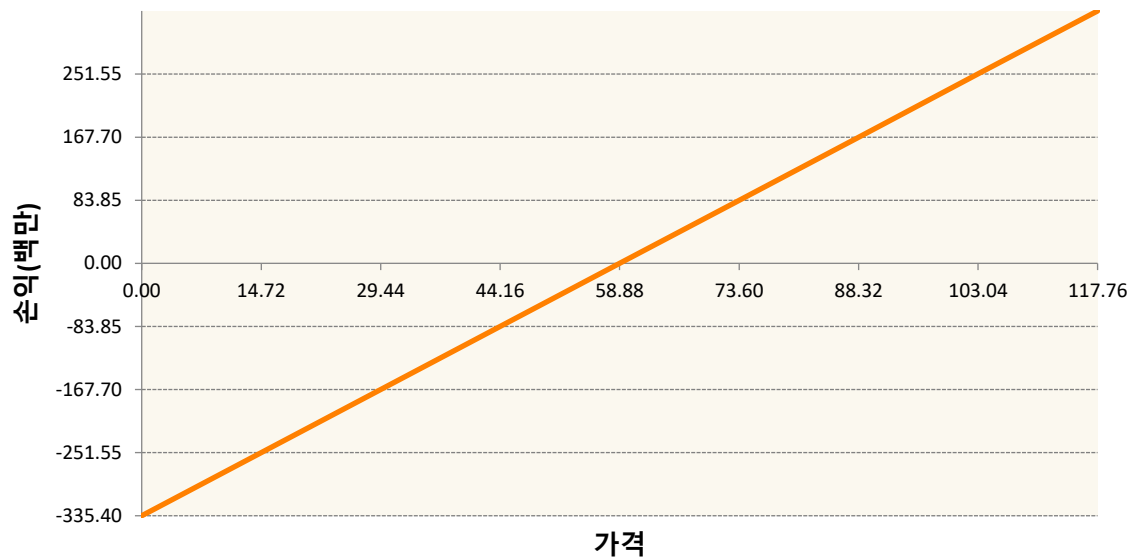
1. 계약금액

(단위:백만원)

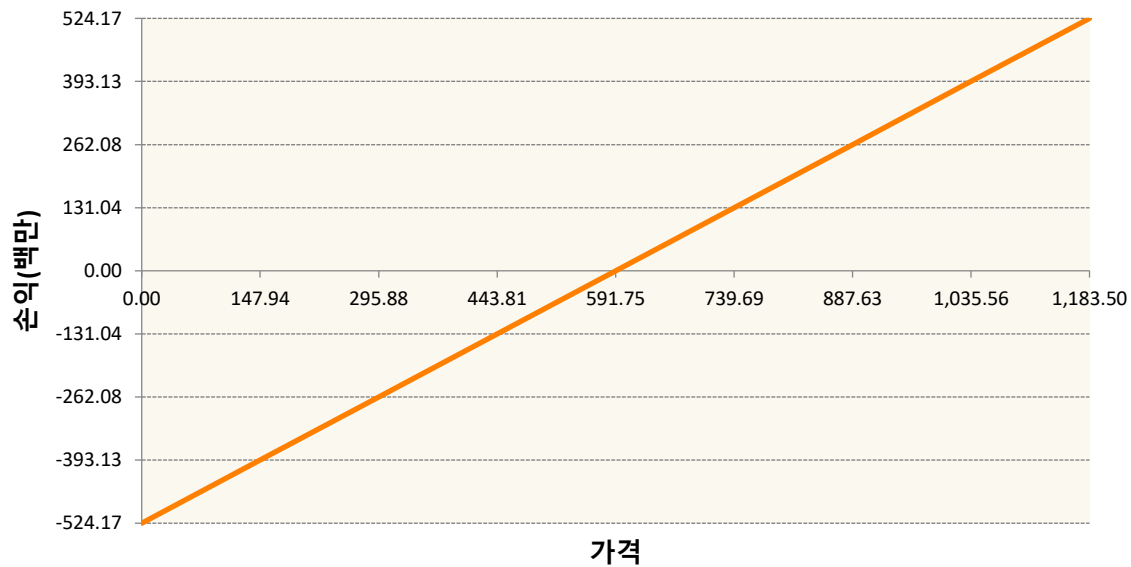
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,732	597	2,136	

2. 만기시점의 손익구조

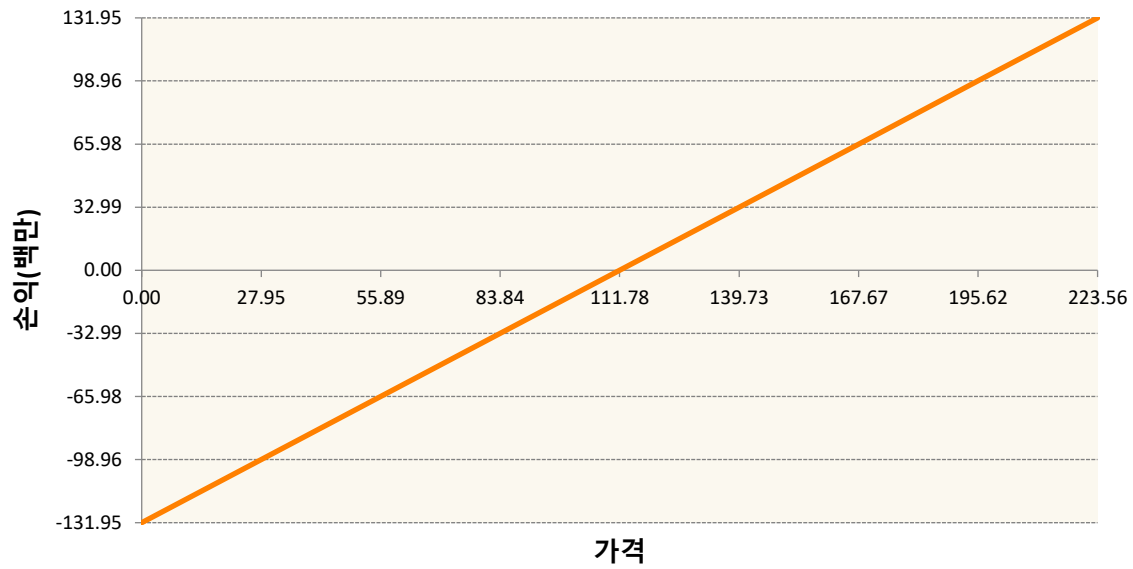
BOF2-SOYBEAN OIL FUTR Jan22



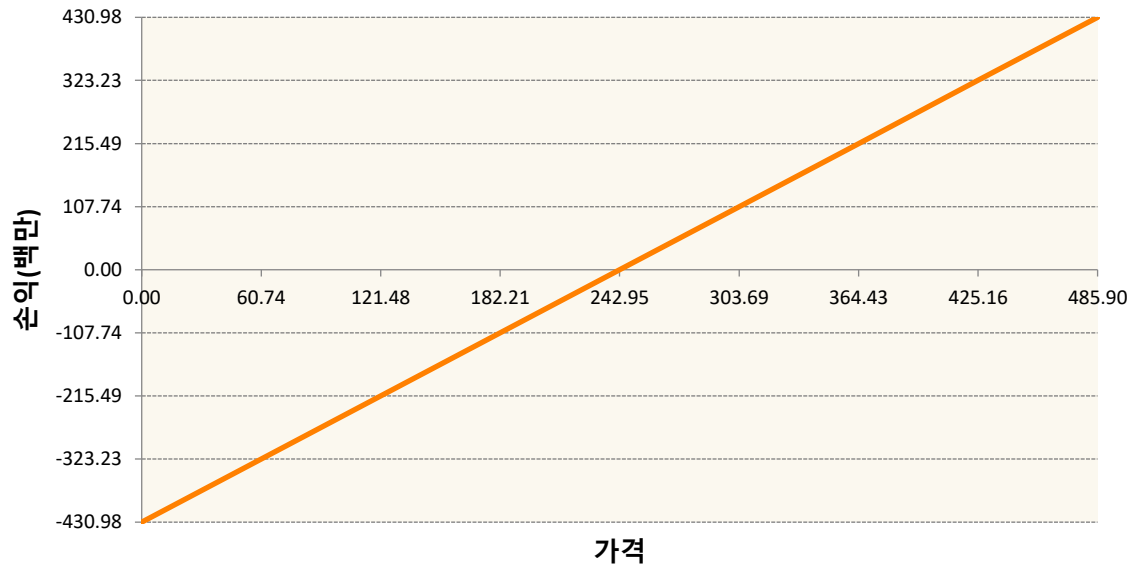
CH2-CORN FUTURE Mar22



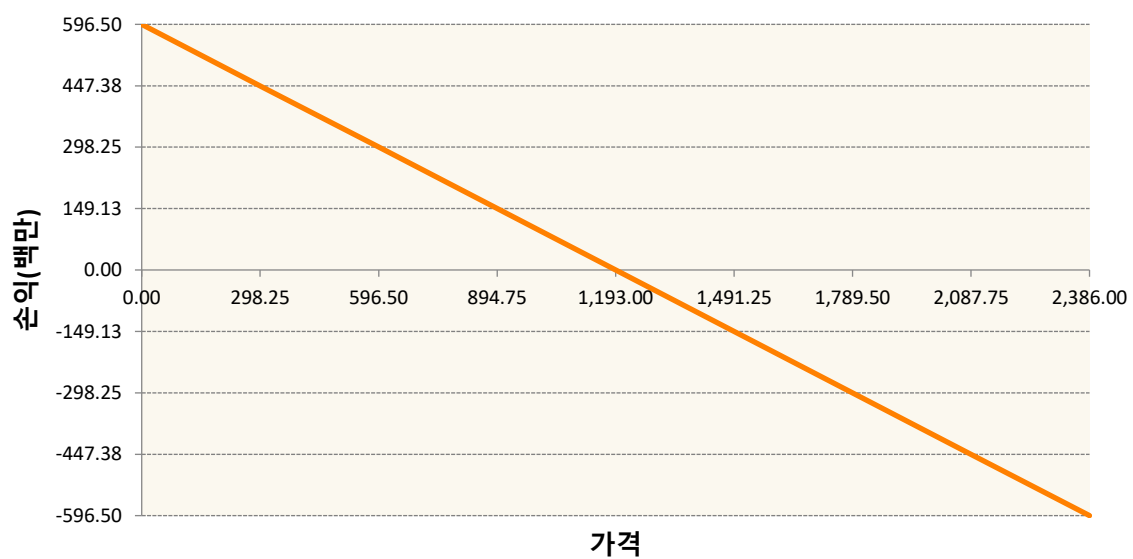
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



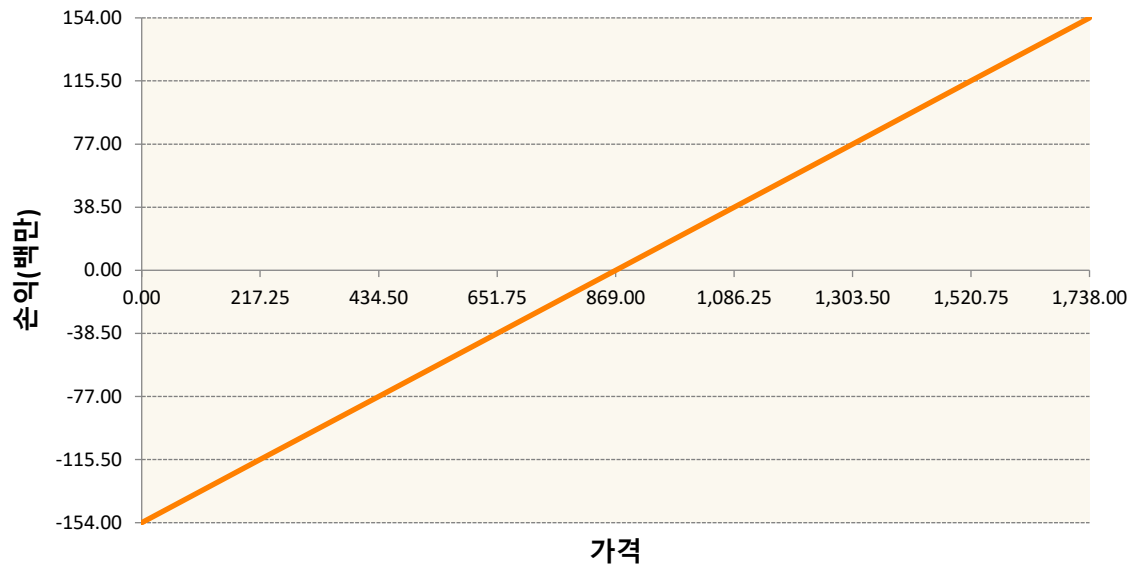
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



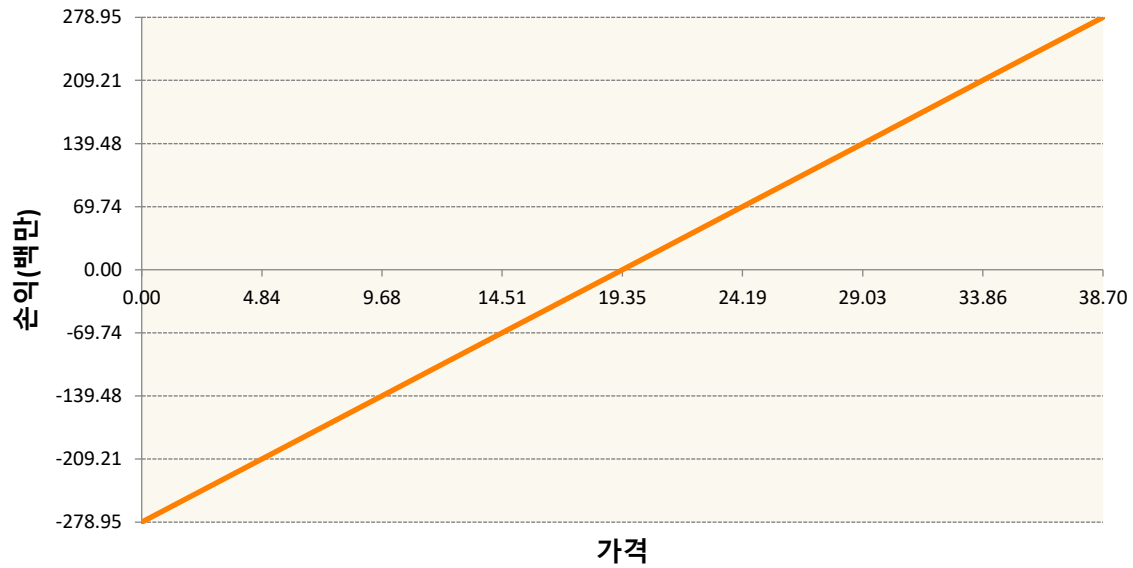
KR4175RC0001-2021-12 달러선물



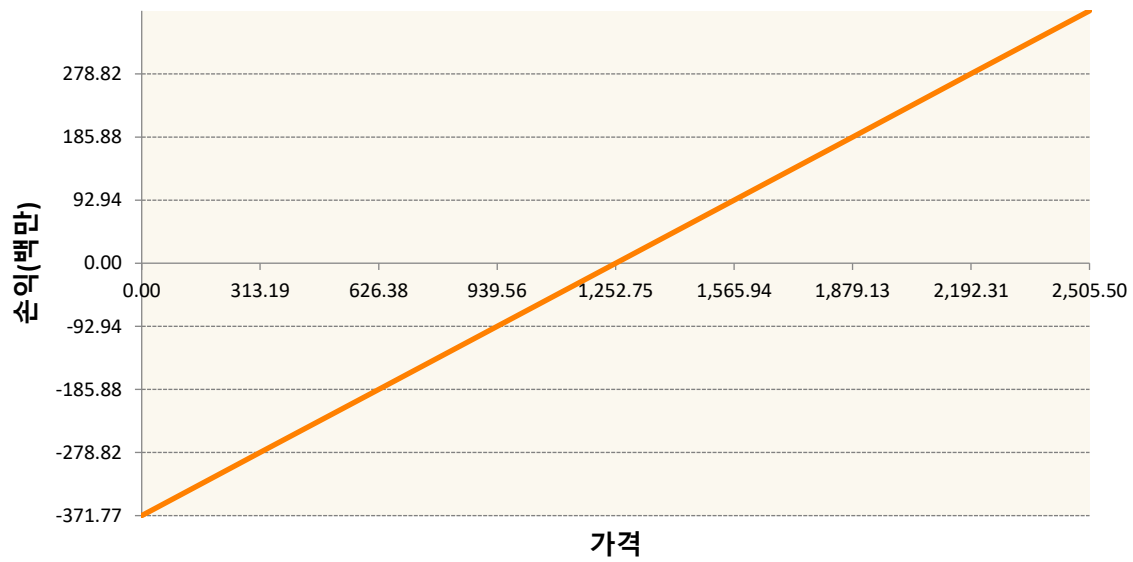
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



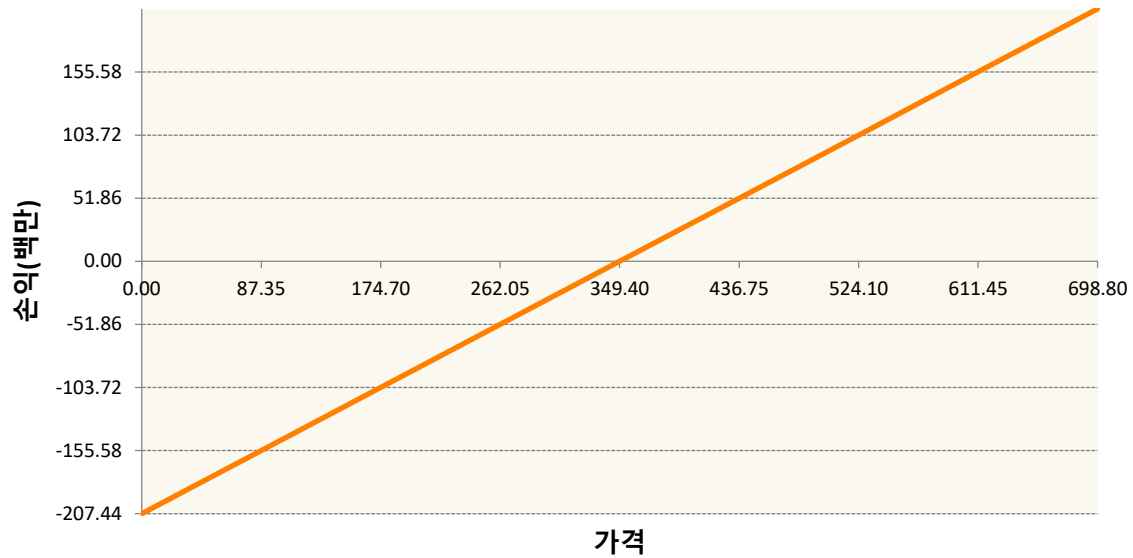
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



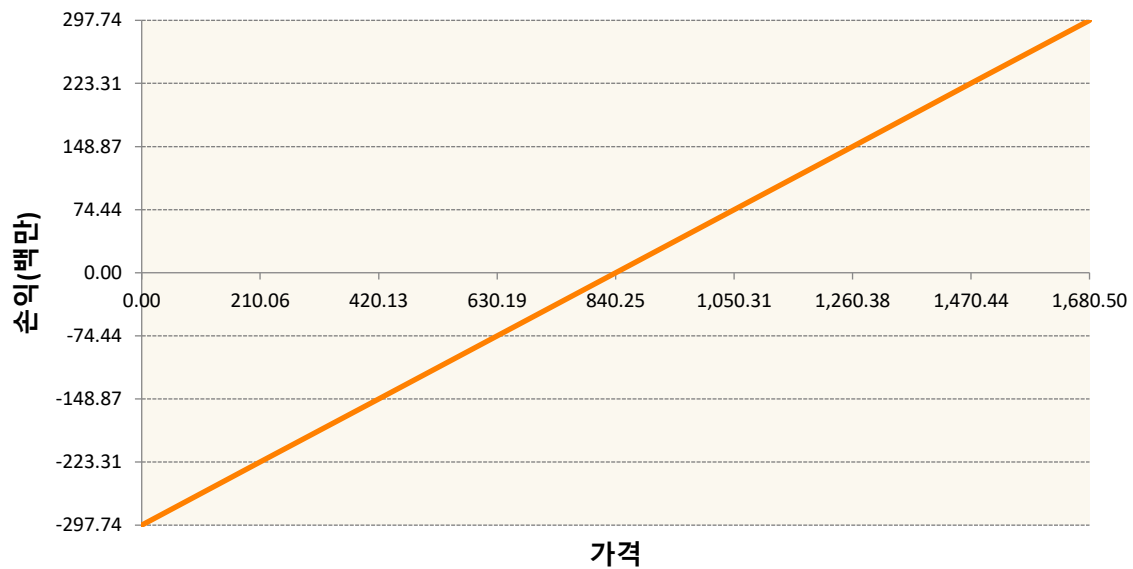
SF2-SOYBEAN FUTURE Jan22



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		48
KWH2	KC HRW WHEAT FUT Mar22	12
SBH2	Sugar #11 (WORLD) Mar22	22
SF2	SOYBEAN FUTURE Jan22	30
SMF2	SOYBEAN MEAL FUTR Jan22	17
WH2	WHEAT FUTURE(CBT) Mar22	24

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

(단위:백만원)

324