

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

포커스농산물모(채권-파생형)

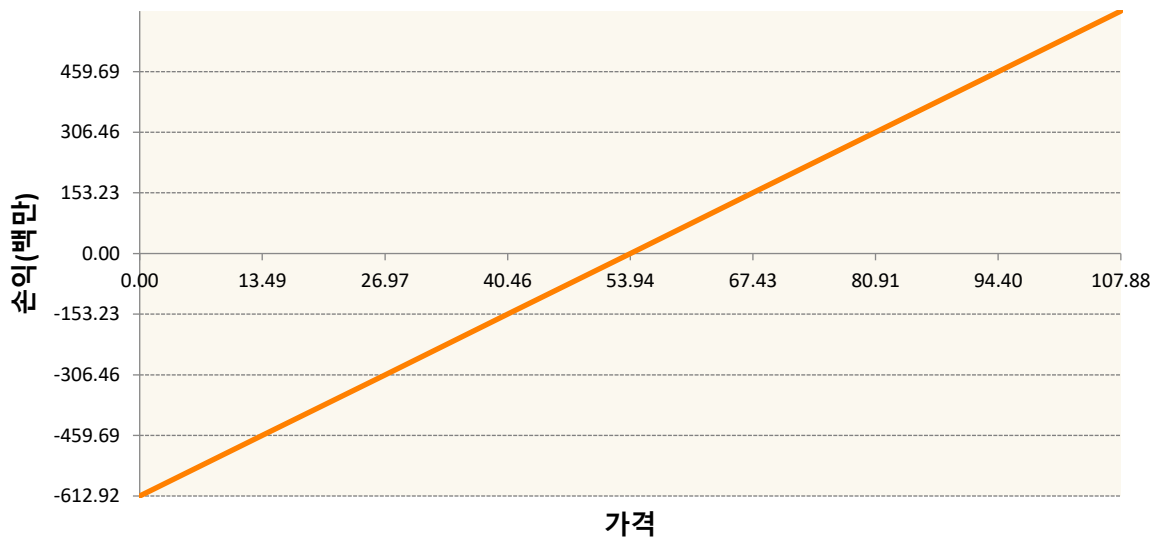
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

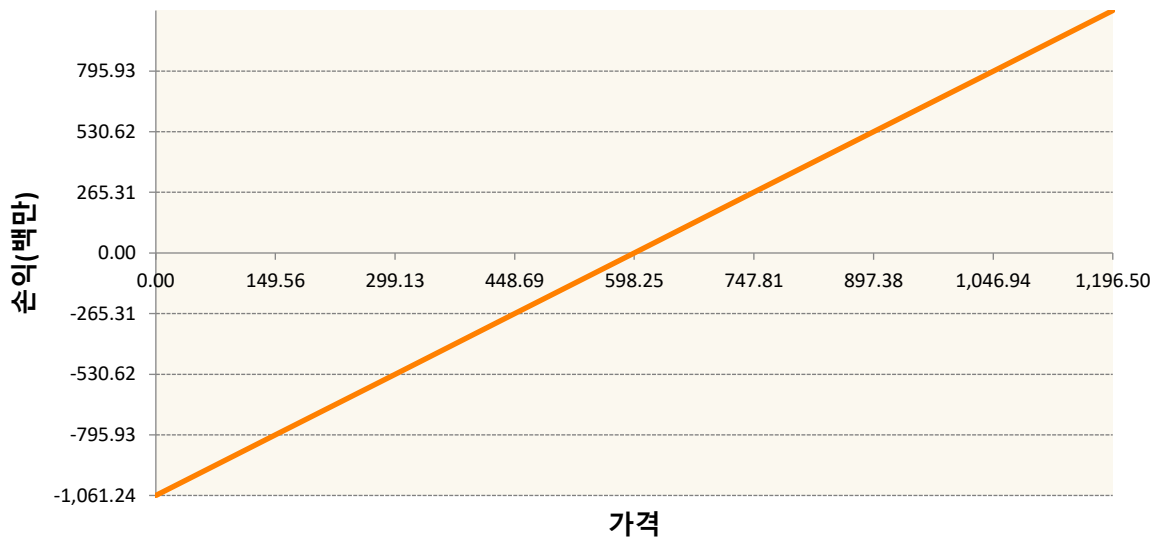
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,622	775	4,847	

2. 만기시점의 손익구조

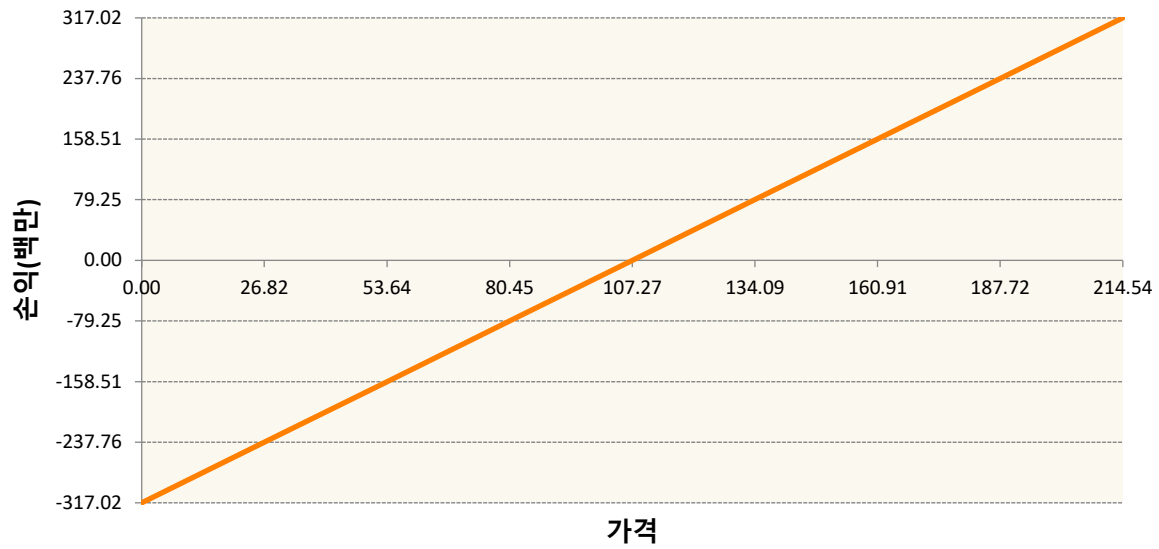
BOH2-SOYBEAN OIL FUTR Mar22



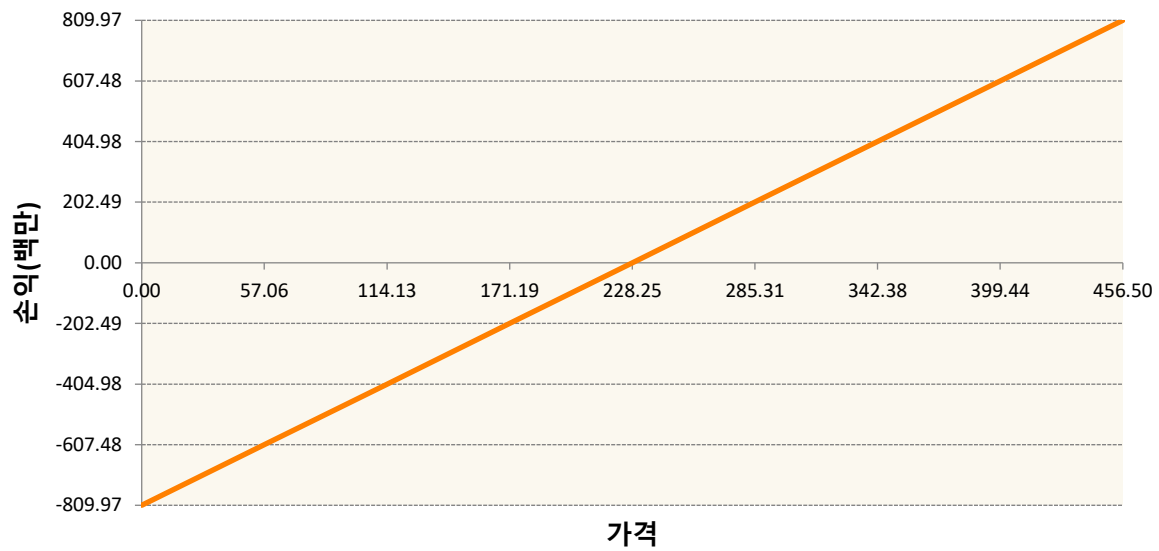
CH2-CORN FUTURE Mar22



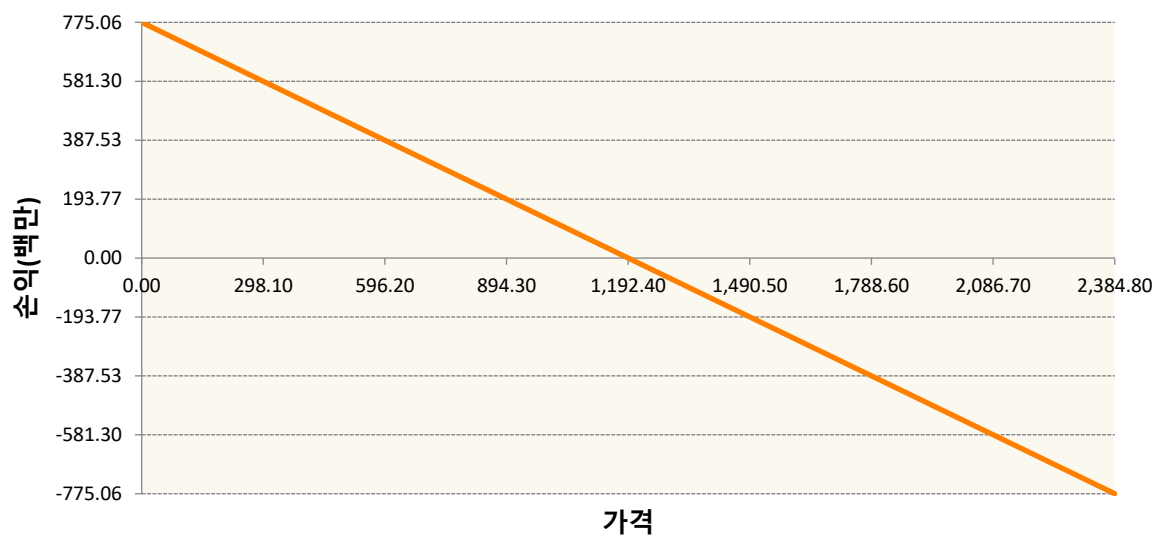
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



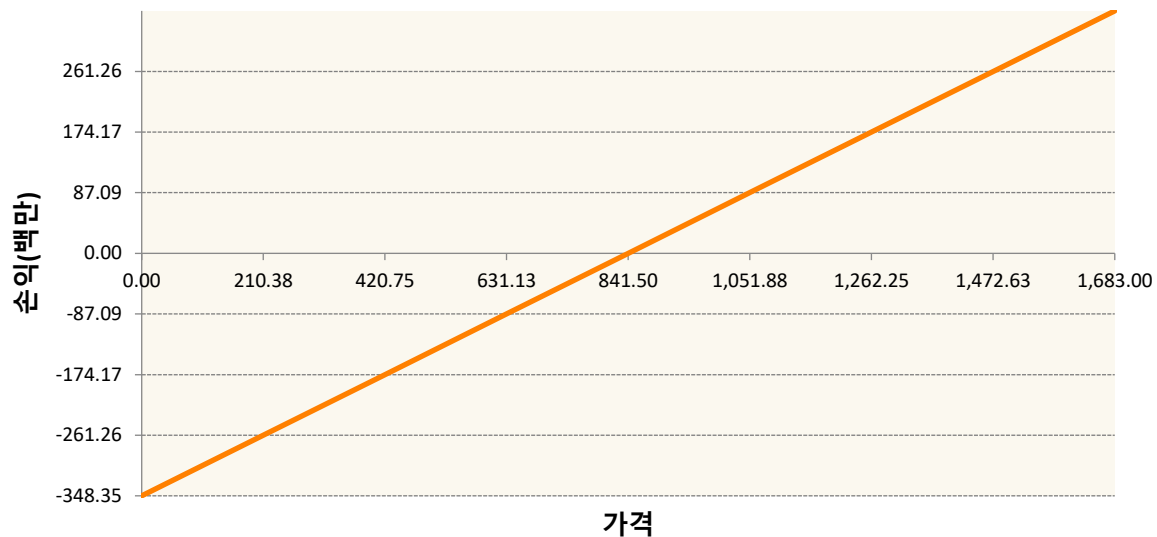
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



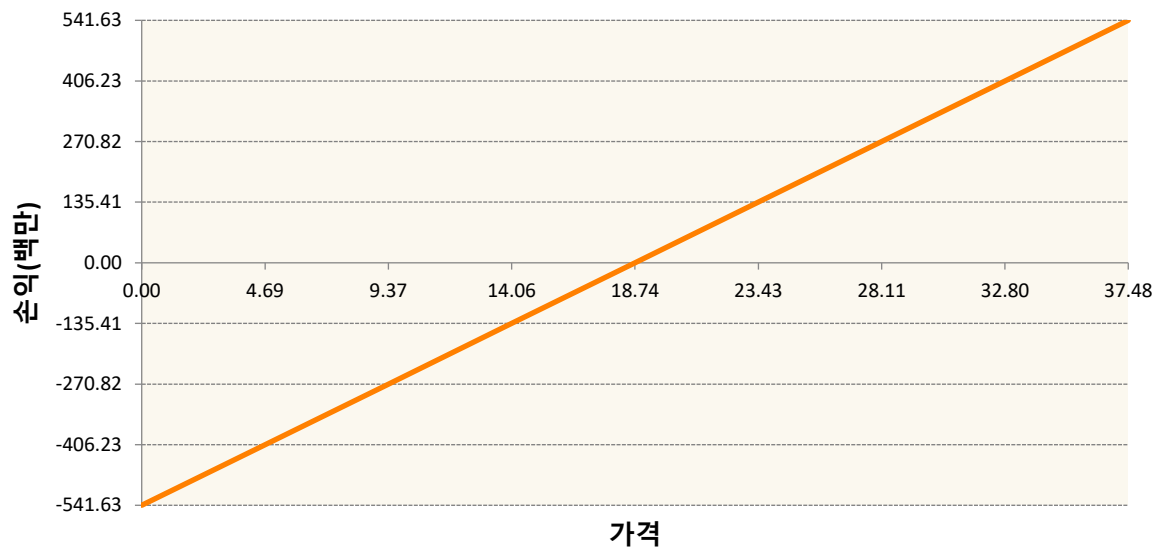
KR4175S10007-2022-01 달러선물



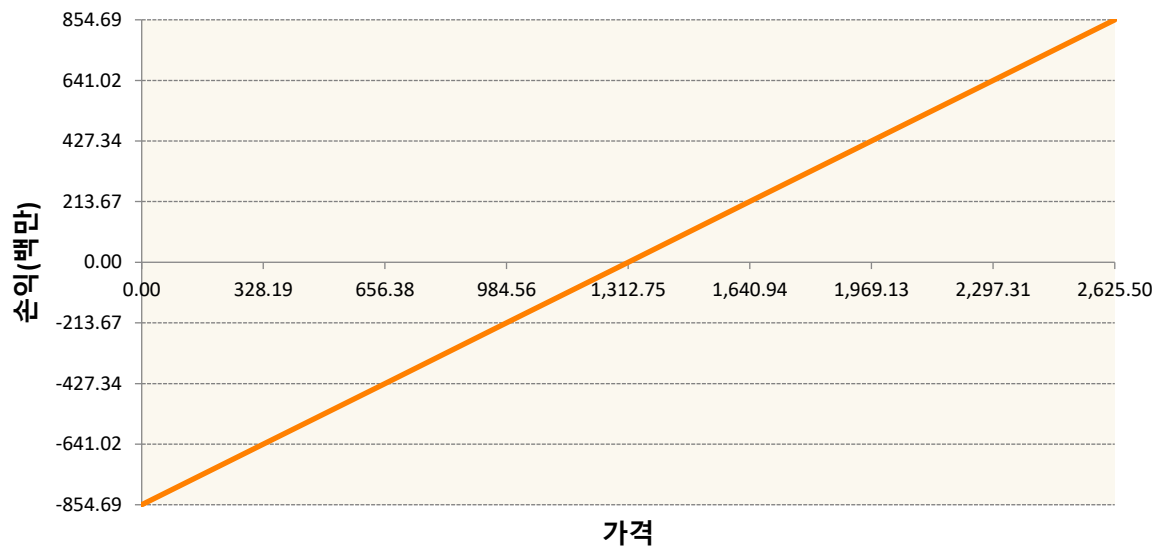
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



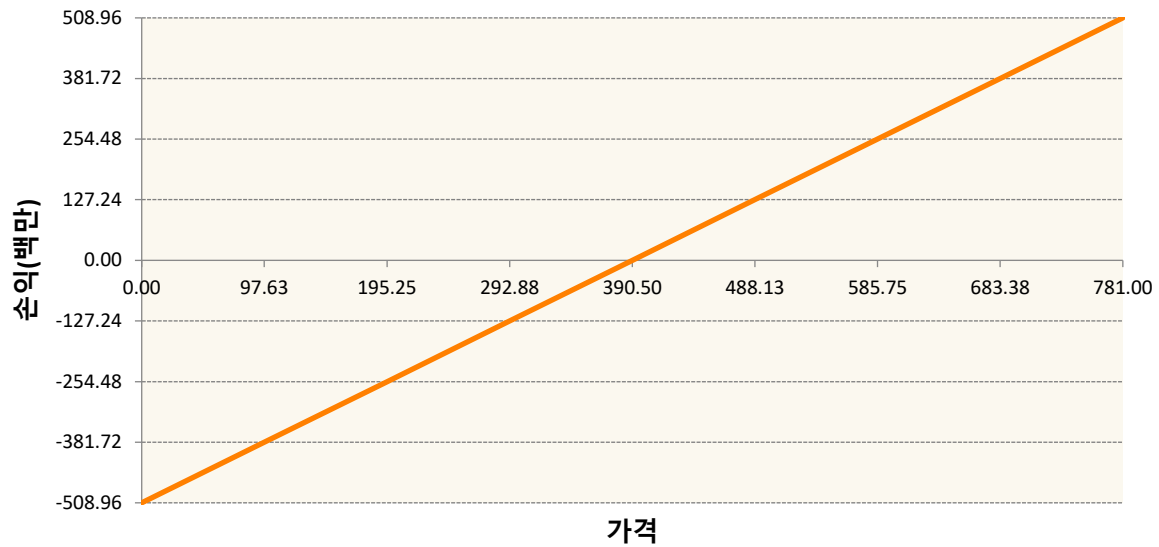
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



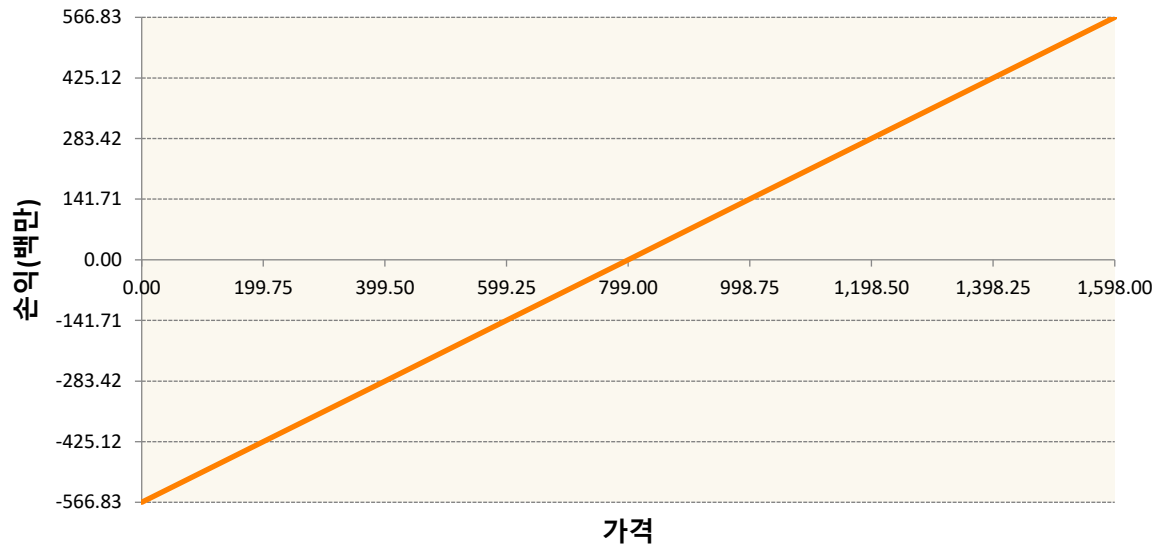
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



SMH2-SOYBEAN MEAL FUTR Mar22



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	2021-12-23
기준일	2021-12-22

스마트인덱스모

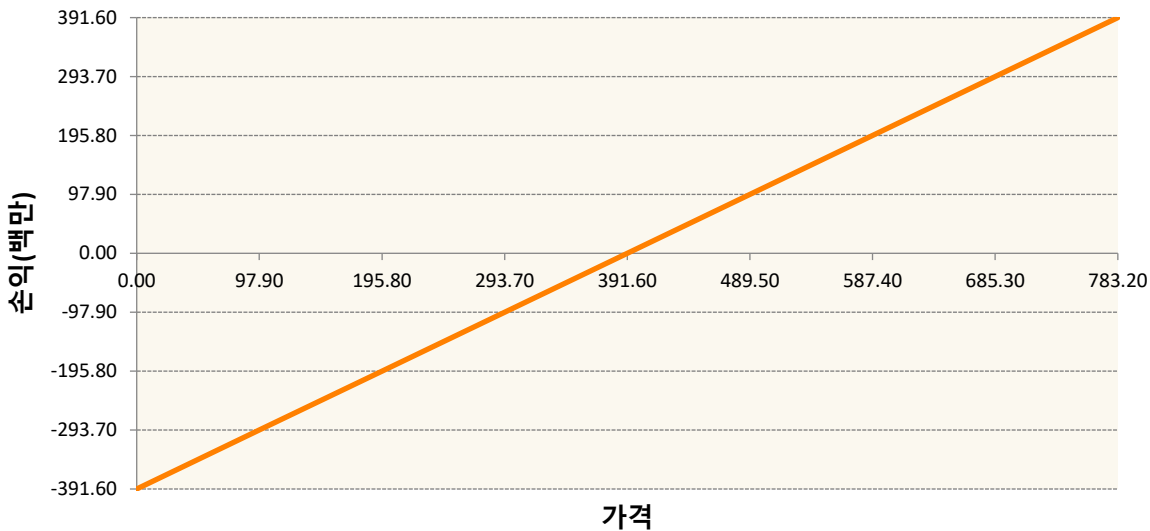
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	392	0	392	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물				32
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	32	32	32	32	32	32	32

공시일	2021-12-23
기준일	2021-12-22

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

905

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-23
기준일	2021-12-22

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	5,505	0	5,505	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래211213

436

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

424

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

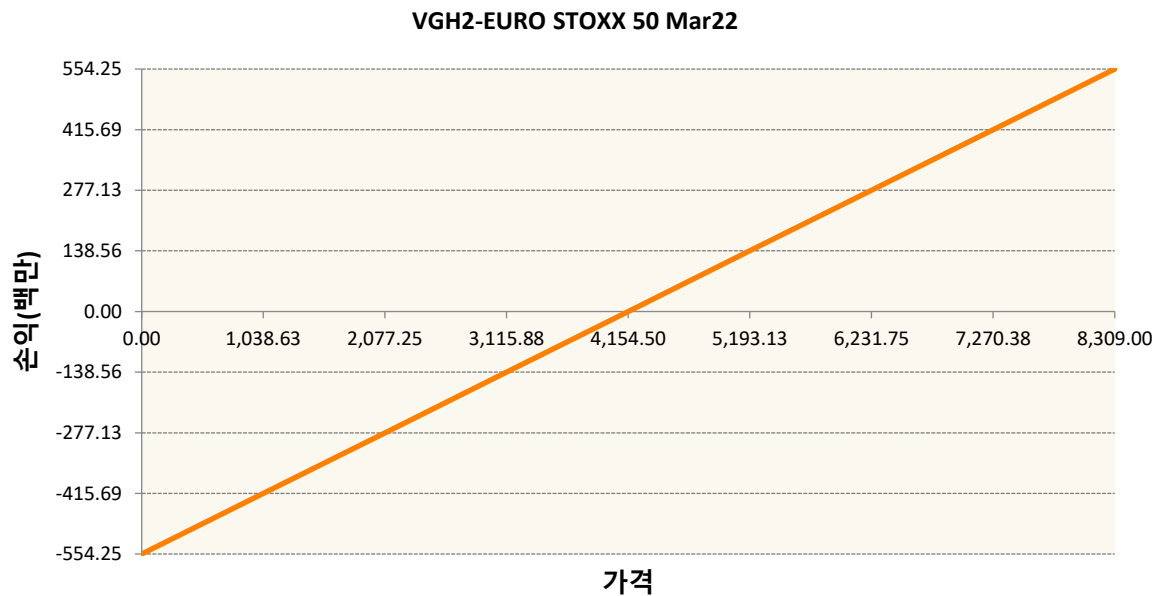
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	554	0	554	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VG2 EURO STOXX 50 Mar22

44

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

(단위:백만원)

39

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

차이나인덱스모(주식-파생형)

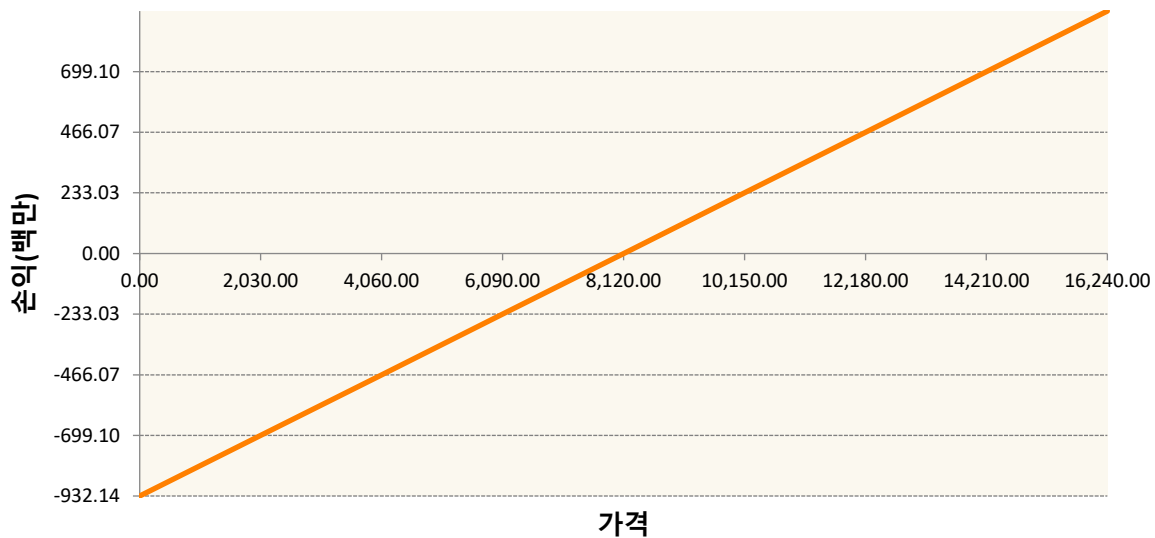
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	932	0	932	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCZ1-HSCEI Futures Dec21



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

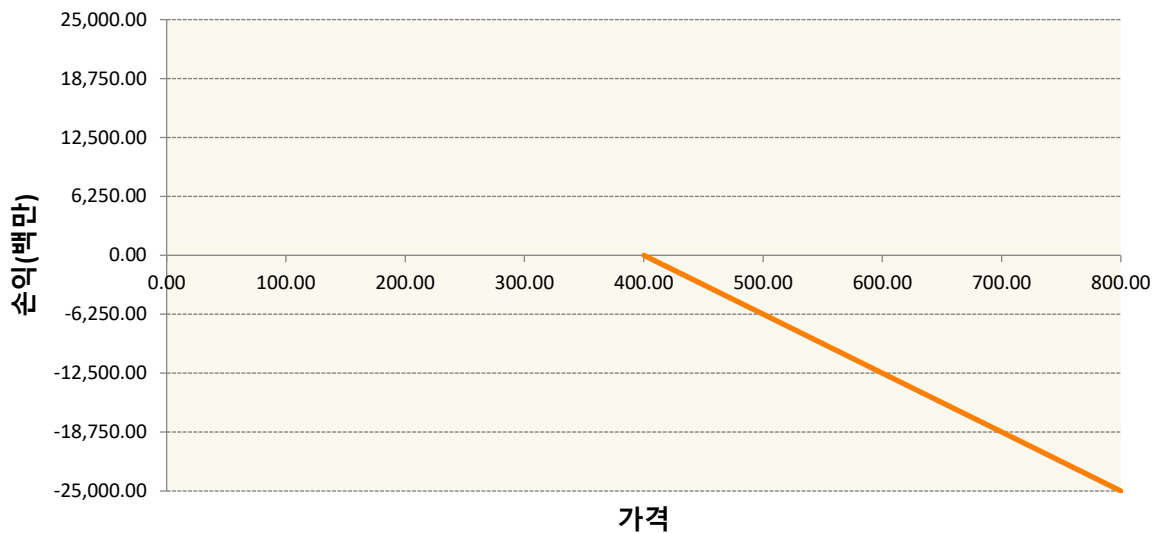
1. 계약금액

(단위:백만원)

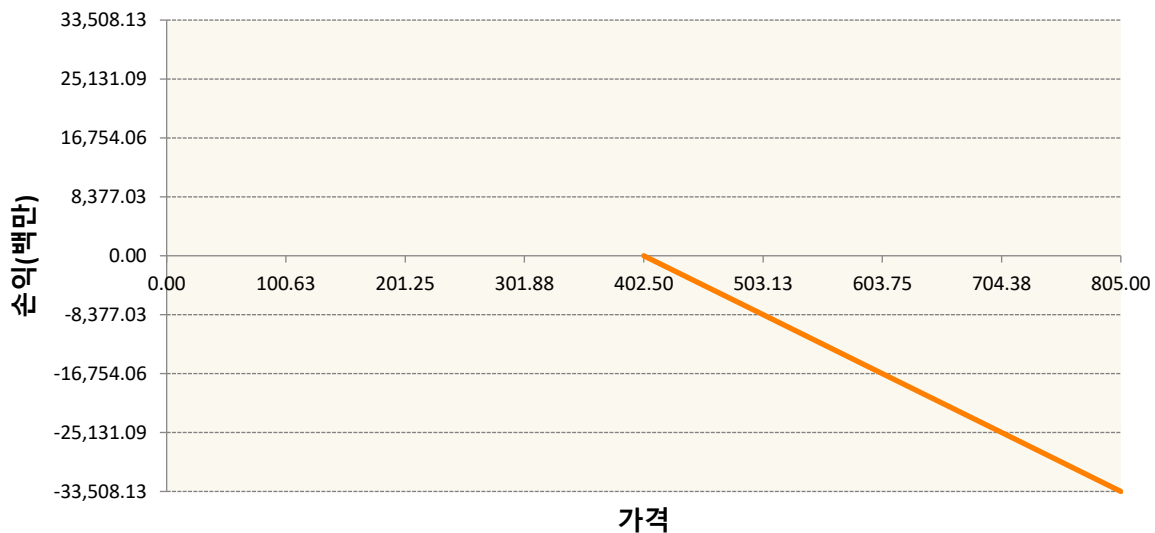
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201S14003-2022-01 콜400



KR4201S14029-2022-01 콜402.5



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 800.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -17,500.00 to 17,500.00. A solid orange line represents the profit function, starting at a price of 0 with a loss of 17,500 million and reaching a break-even point at a price of 400 with zero profit.

가격 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
0.00	-17,500.00
100.00	-13,125.00
200.00	-8,750.00
300.00	-4,375.00
400.00	0.00

The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 805.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from -2,012.50 to 2,012.50. A blue line represents the profit function, starting at (0, -2012.5) and ending at (402.5, 0). The line is linear, indicating a constant marginal contribution margin.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-2,012.50
100.63	-1,509.38
201.25	-1,006.25
301.88	-503.13
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003						2022-01 콜400		1,439
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	518	508	494	477	456	433	407	
-5.33%	479	455	427	396	363	327	289	
-2.67%	375	333	290	245	199	152	104	
0%	160	107	54	0	-54	-107	-161	
2.67%	-190	-243	-296	-349	-403	-457	-511	
5.33%	-669	-710	-753	-798	-844	-892	-940	
8.00%	-1,240	-1,265	-1,294	-1,326	-1,362	-1,399	-1,439	
KR4201S14029						2022-01 콜402.5		1,842
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	610	599	584	564	540	512	481
-5.33%	570	543	510	473	432	388	341
-2.67%	456	406	352	296	237	177	115
0%	209	140	70	0	-70	-141	-212
2.67%	-215	-287	-360	-432	-505	-578	-651
5.33%	-815	-874	-936	-999	-1,064	-1,131	-1,198
8.00%	-1,550	-1,589	-1,632	-1,680	-1,731	-1,785	-1,842
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,184

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,170	-1,170	-1,171	-1,173	-1,176	-1,179	-1,184
-5.33%	-712	-716	-721	-728	-736	-746	-757
-2.67%	-280	-293	-308	-324	-341	-359	-377
0%	71	48	24	0	-24	-48	-72
2.67%	284	261	238	215	191	168	144
5.33%	370	358	344	329	313	295	277
8.00%	392	388	383	376	368	358	347

KR4301S14027 2022-01 풋402.5							139
--	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-138	-138	-138	-139	-139	-139	-139
-5.33%	-86	-86	-87	-87	-88	-89	-90
-2.67%	-35	-37	-38	-40	-41	-43	-45
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	36	33	30	28	25	22	19
5.33%	49	47	45	43	41	39	36
8.00%	52	52	51	50	49	47	46

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

(단위:백만원)

4,515

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

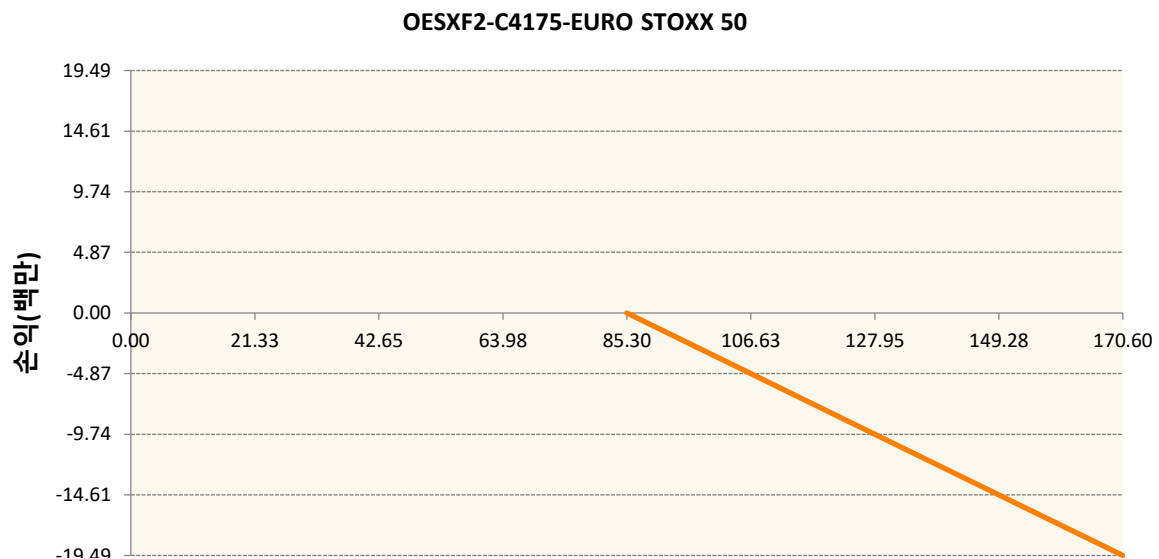
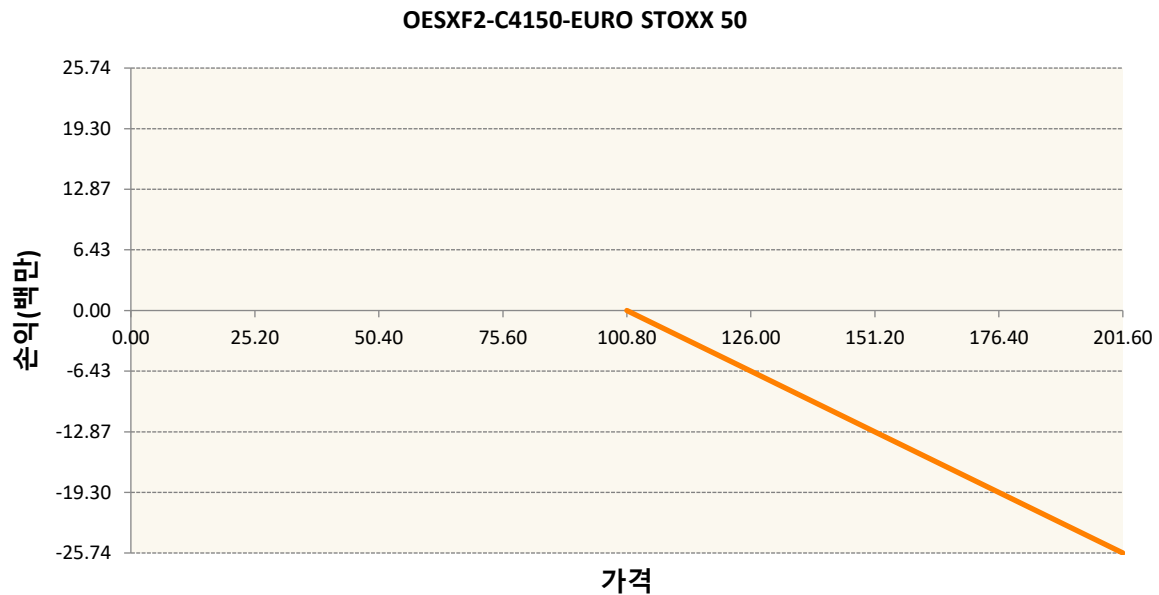
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

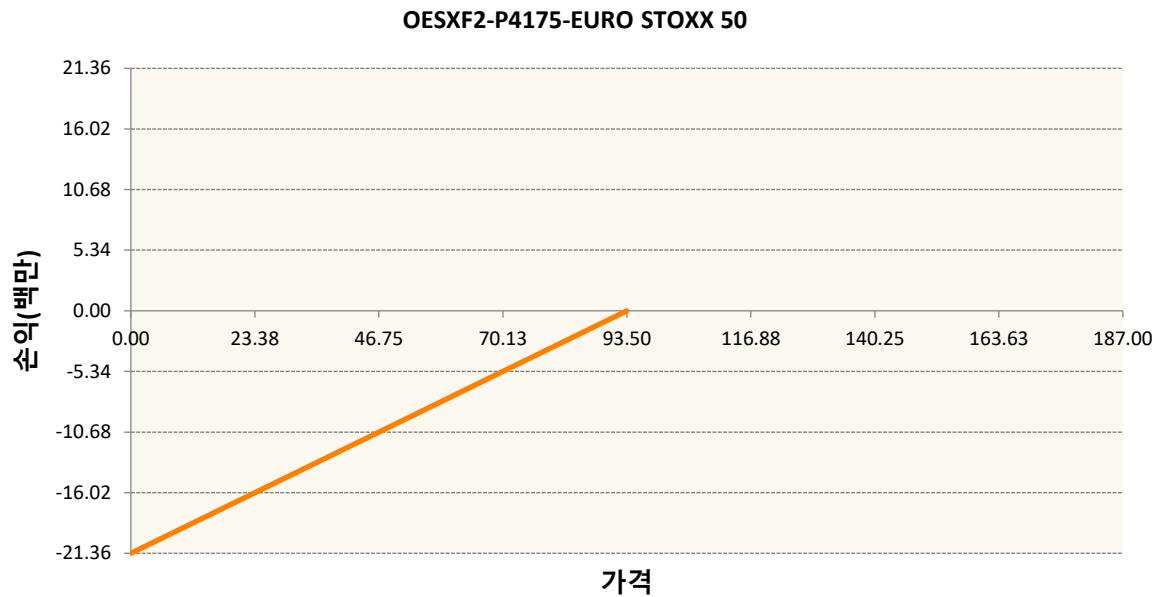
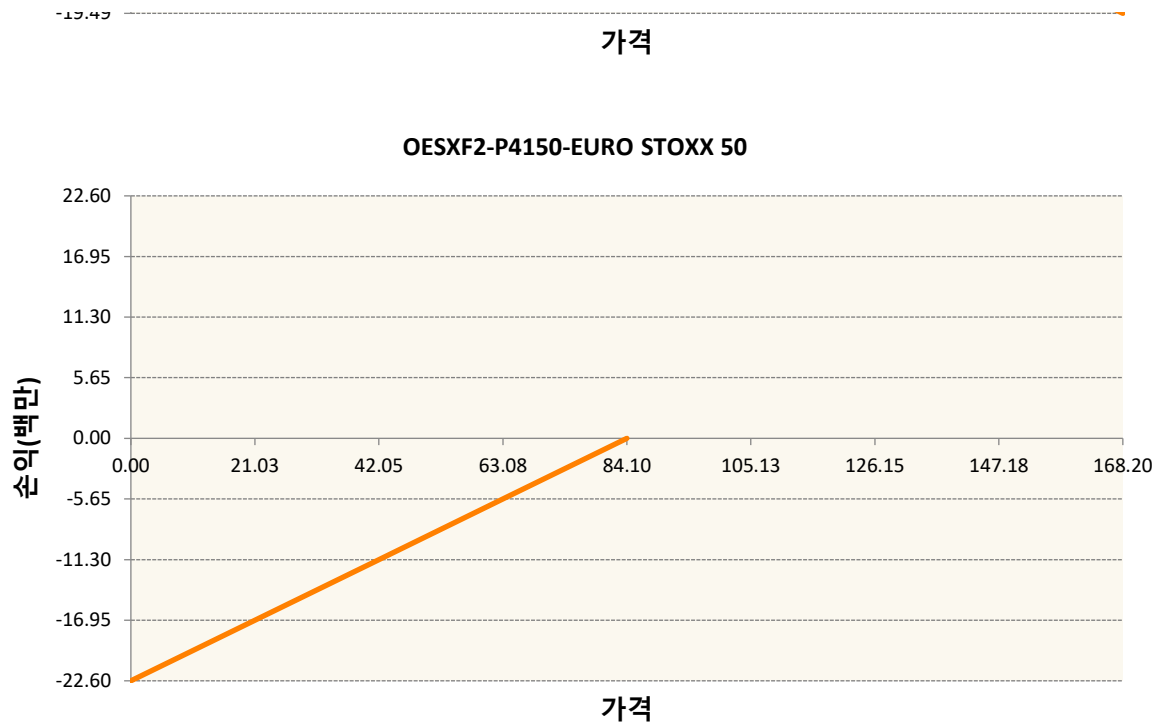
1. 계약금액

(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
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	89	-89	장내
누계	통화	선도	0	2,016	-2,016	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		9
FXW213BCF-KRW/EUR 17-03-22E		54
FXW213BCF-KRW/EUR 17-02-22E		108
OESXF2-C41 EURO STOXX 50		2
OESXF2-C41 EURO STOXX 50		2
OESXF2-P41 EURO STOXX 50		2
OESXF2-P41 EURO STOXX 50		2

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

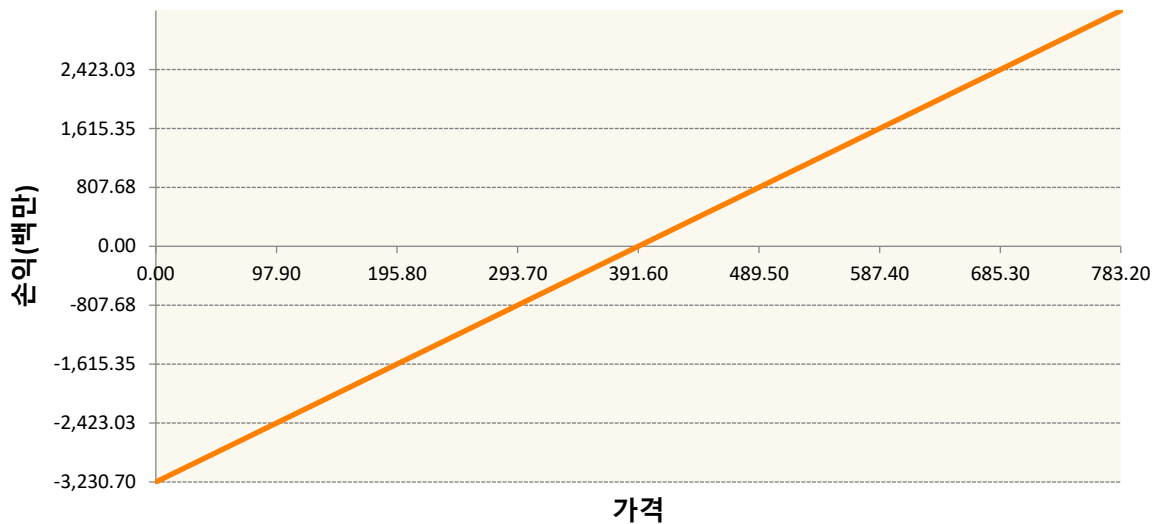
1. 계약금액

(단위:백만원)

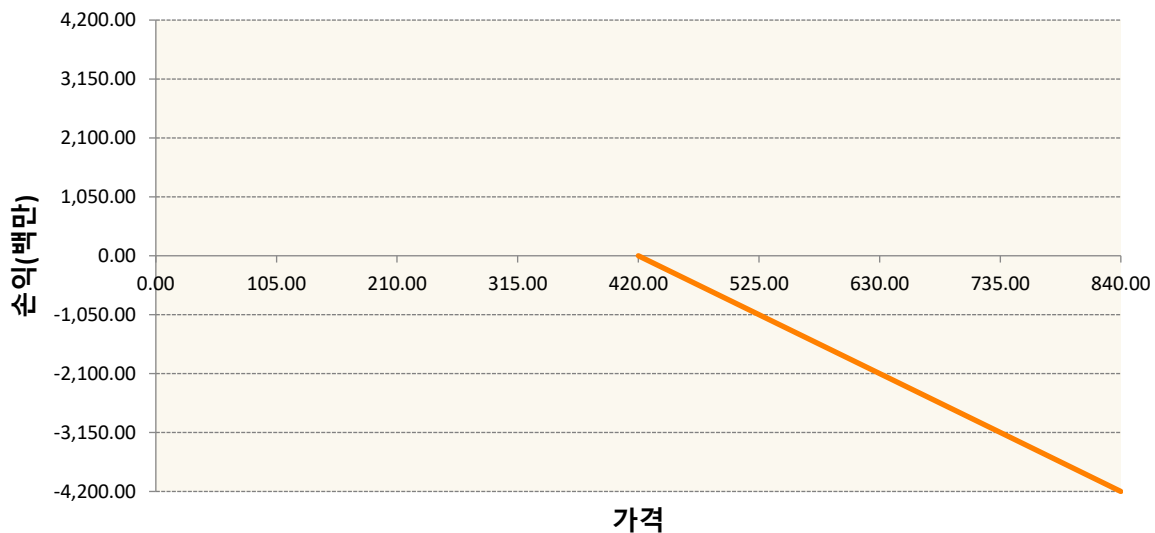
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,231	0	3,231	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S14201-2022-01 콜420



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 850.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -1,275.00 to 1,275.00. A single orange line represents the relationship, starting at a price of 425.00 with zero profit/loss, and decreasing linearly to a price of 850.00 with a profit/loss of -1,275.00.

가격	손익(백만)
425.00	0.00
850.00	-1,275.00

The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The profit starts at 200.00 when the price is 0.00 and decreases linearly to 0.00 as the price reaches 400.00. Beyond this point, the profit would become negative, but the graph only shows the segment where profit is non-negative.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	200.00
100.00	150.00
200.00	100.00
300.00	50.00
400.00	0.00

(단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 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
KR4201S14201		2022-01 콜420					153
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	26	26	25	23	22
-5.33%	26	25	24	23	20	18	15
-2.67%	24	21	19	15	11	7	2
0%	16	11	6	0	-6	-13	-19
2.67%	-4	-11	-19	-27	-35	-43	-51
5.33%	-41	-50	-59	-68	-77	-87	-96
8.00%	-99	-108	-117	-126	-135	-144	-153

KR4201S14250

2022-01 콜425

40

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	5	5	5
-5.33%	6	6	5	5	4	4	3
-2.67%	5	5	4	3	2	1	0
0%	4	3	1	0	-2	-3	-5
2.67%	0	-2	-4	-6	-9	-11	-13
5.33%	-9	-11	-14	-17	-19	-22	-25
8.00%	-23	-26	-29	-32	-34	-37	-40

KR4301S14001

2022-01 풋400

14

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	13	13	14
-5.33%	8	8	8	8	8	9	9
-2.67%	3	3	4	4	4	4	4
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

421

공시일	2021-12-23
기준일	2021-12-22

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	16,861	0	16,861	

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	2021-12-23
기준일	2021-12-22

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	9,649	0	9,649	

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	2021-12-23
기준일	2021-12-22

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	45,481	0	45,481	
누계	통화	선도	1,430	28,012	-26,582	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213BBW USD/KRW 24-12-21E		114
FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E		2,241

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

(단위:백만원)

789

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,469	0	1,469	장내

KR4101S30001				2022-03 코스피200지수선물			119
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	40	40	40	40	40	40	40
5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	119	119	119	119	119	119	119

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

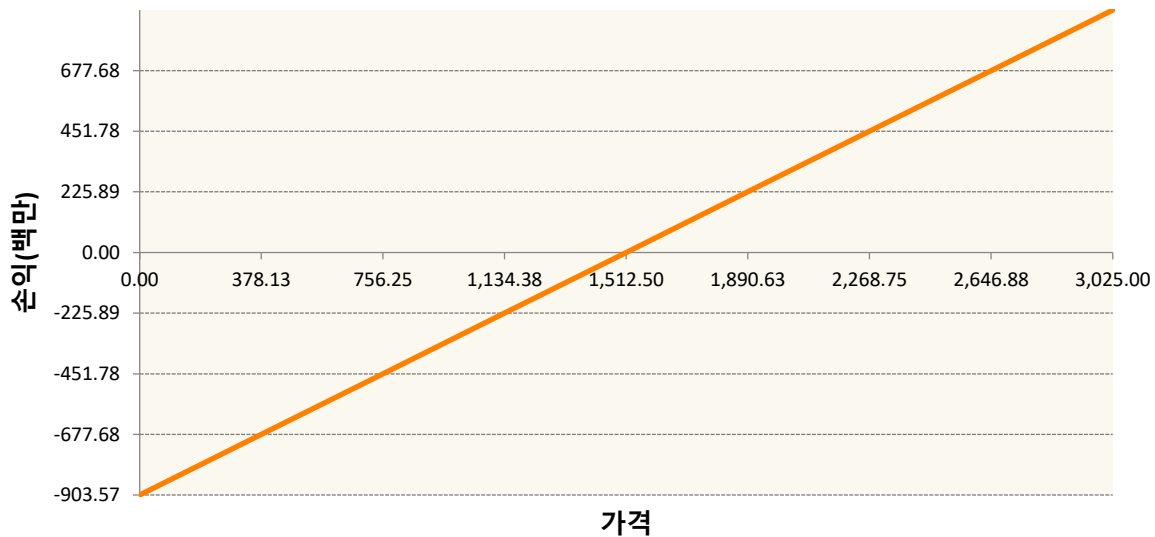
1. 계약금액

(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	904	0	904	
누계	유가증권	스왑	1,794	0	1,794	장외
누계	통화	선도	0	1,115	-1,115	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCF2-VN30 Index Future Jan22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	144
FXW213BBQ KRW/EUR 25-02-22E	35
FXW213BBS KRW/EUR 25-02-22E	11
FXW213BCN KRW/EUR 18-03-22E	43
VNCF2 VN30 Index Future Jan22	72

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

(단위:백만원)

272

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

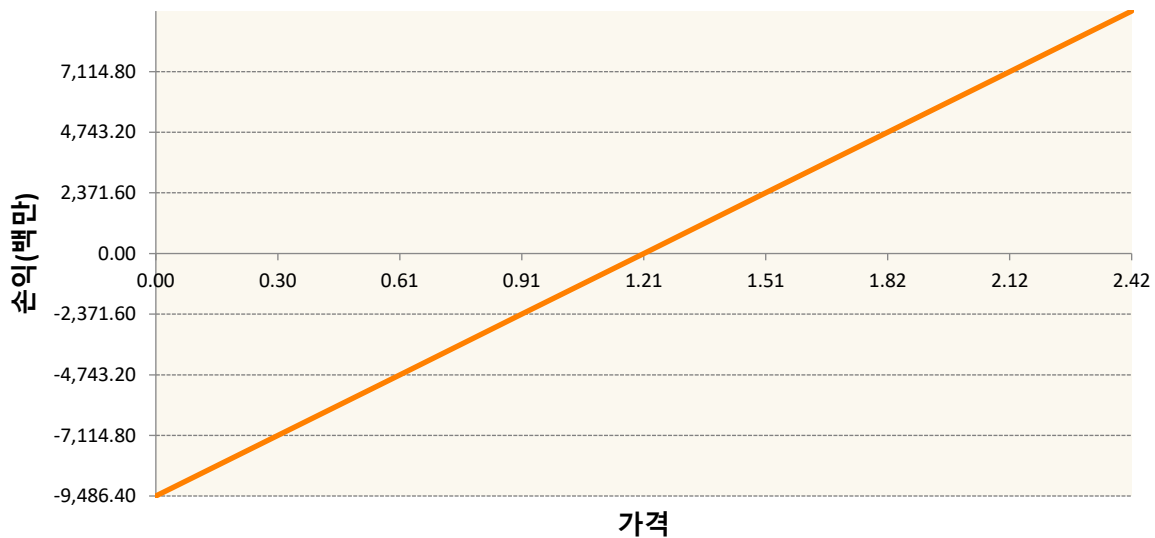
1. 계약금액

(단위:백만원)

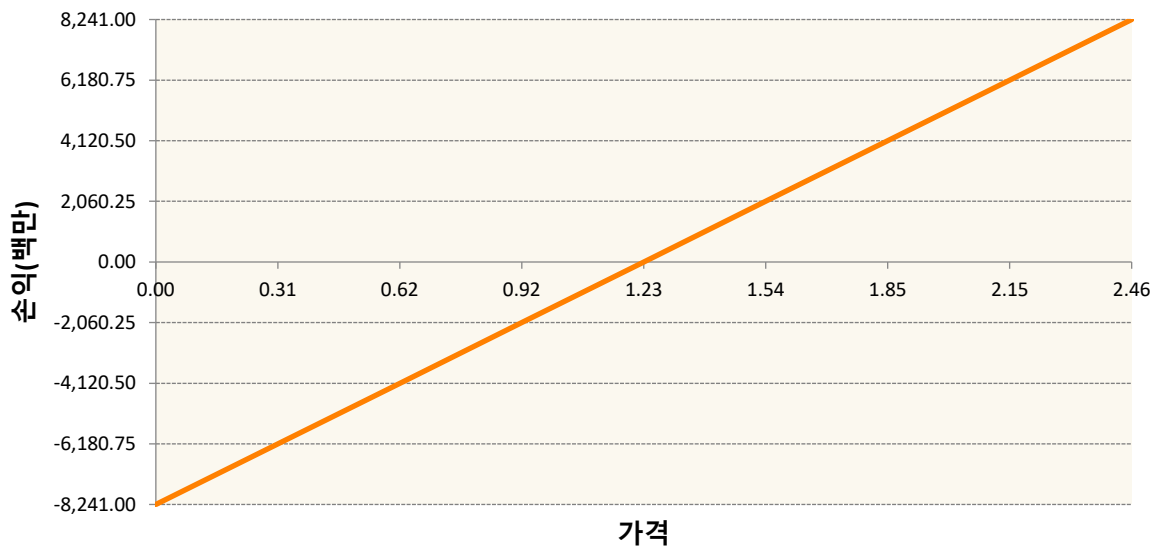
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	35,473	0	35,473	

2. 만기시점의 손익구조

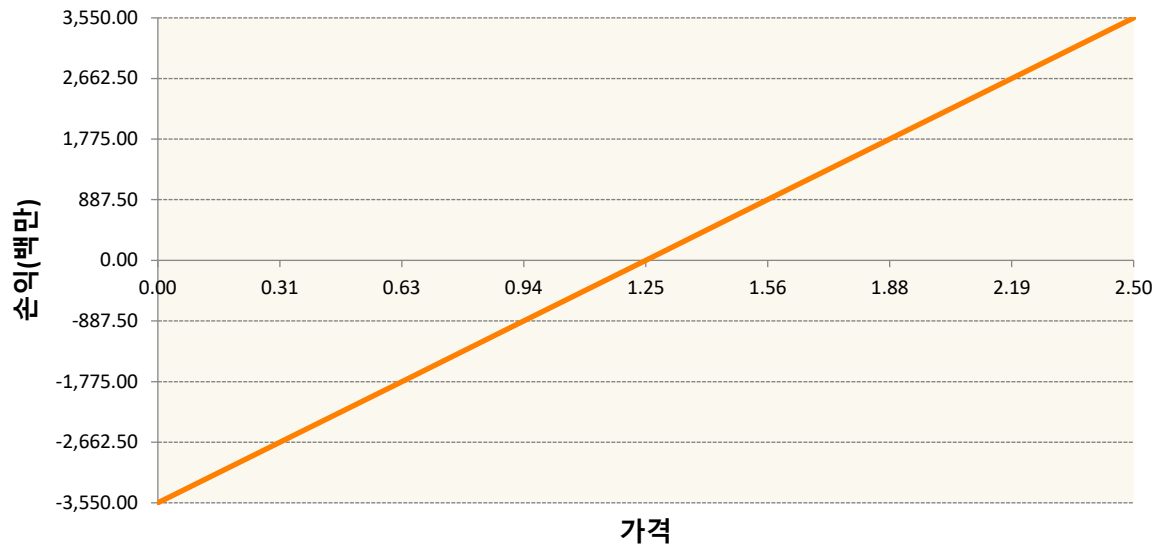
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



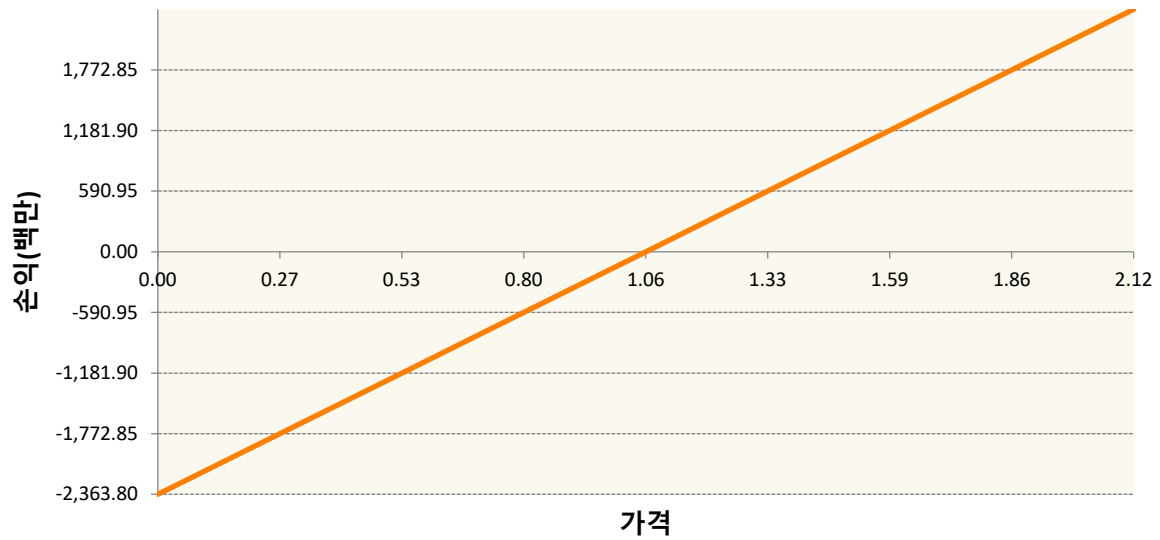
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



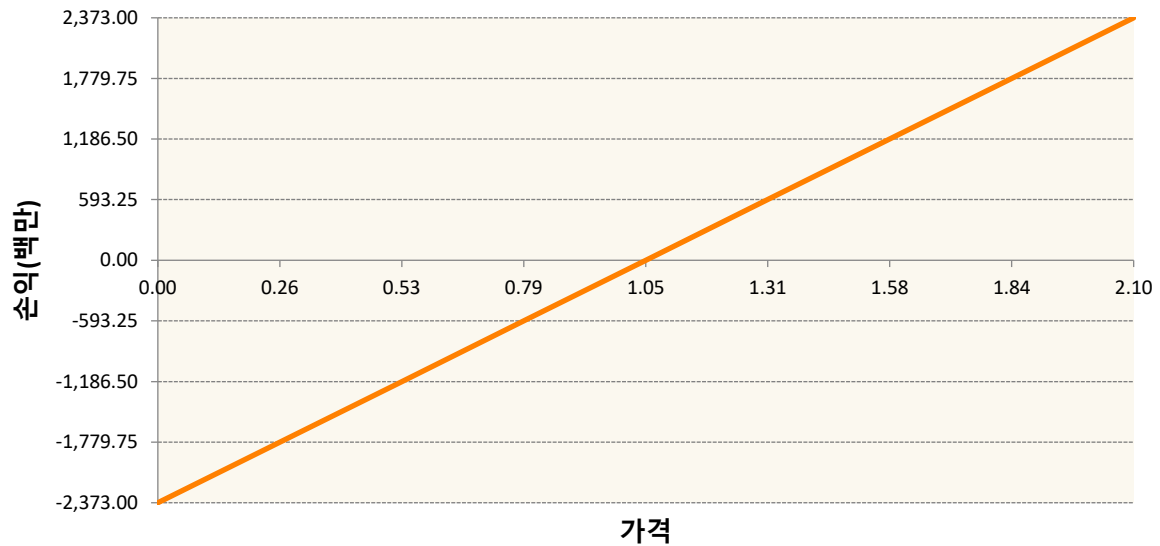
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)

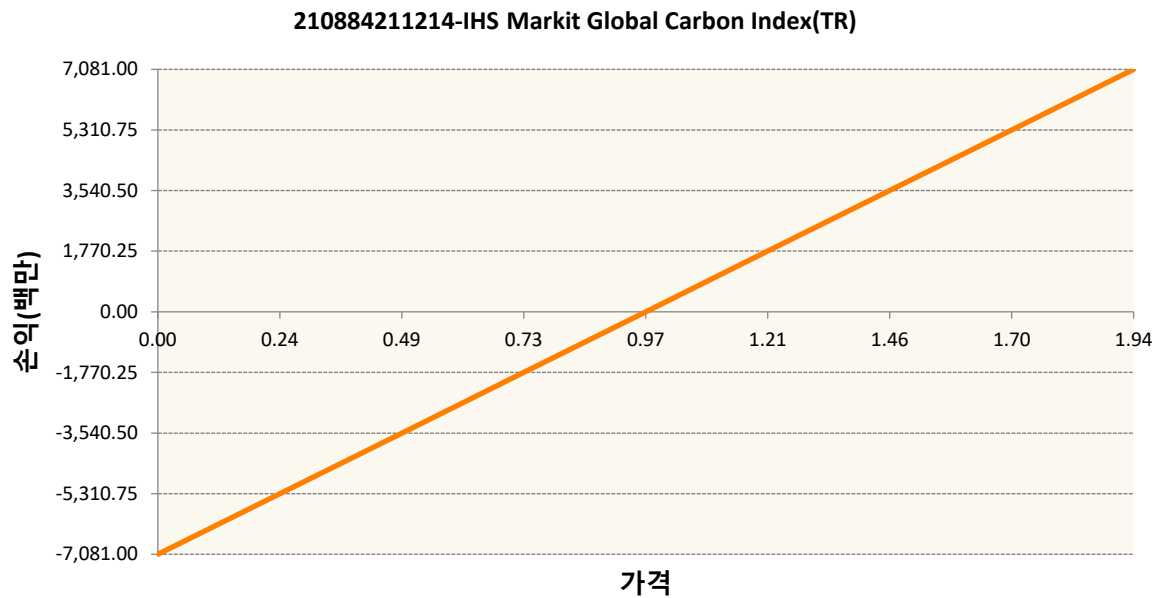
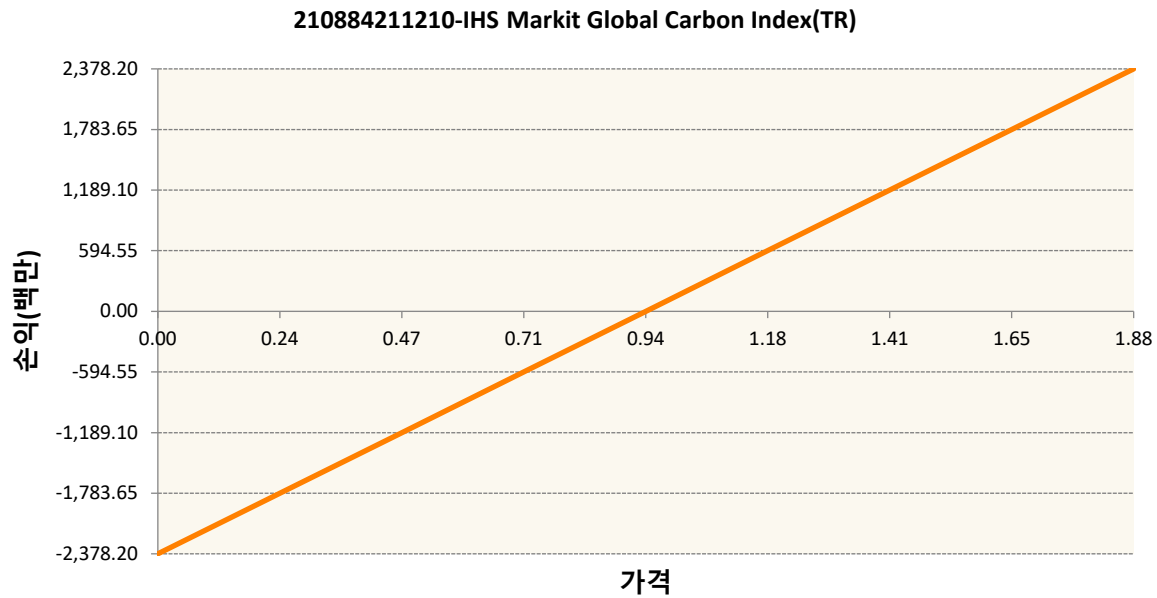


210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		759
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)		661
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		285
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		189
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		190
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		189
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		569

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,560

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

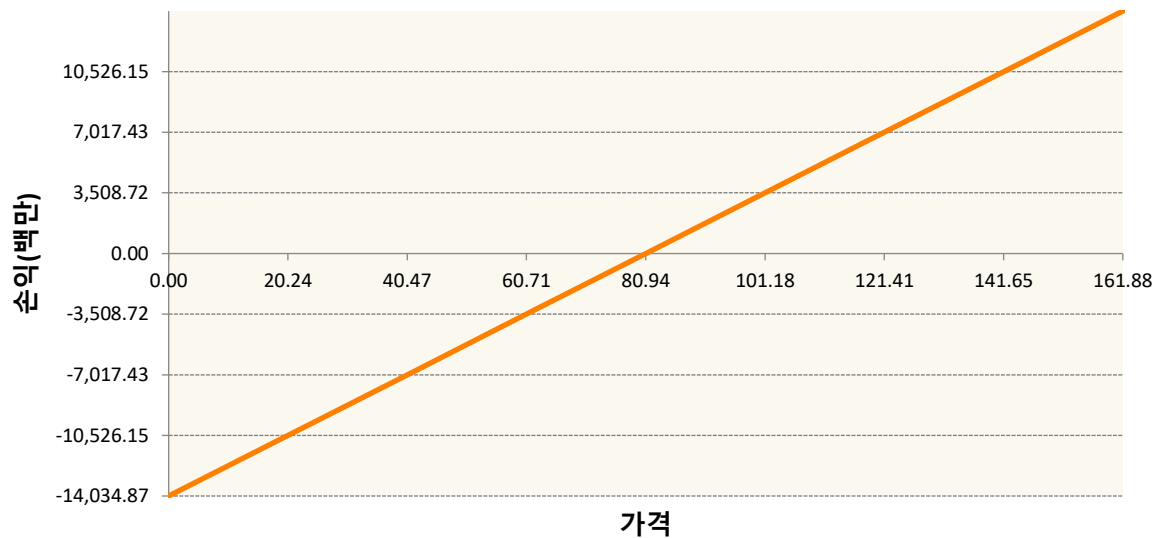
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	14,035	0	14,035	
누계	통화	선도	0	6,745	-6,745	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX-KRW/EUR 28-12-21E	384
FXW213BCA-KRW/EUR 28-12-21E	156
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,123

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

(단위:백만원)

2,645

공시일	2021-12-23
기준일	2021-12-22

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	11,760	0	11,760	장외
누계	지수	스왑	11,760	0	11,760	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (NH)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	1

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

(단위:백만원)

7

공시일 2021-12-23

기준일 2021-12-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

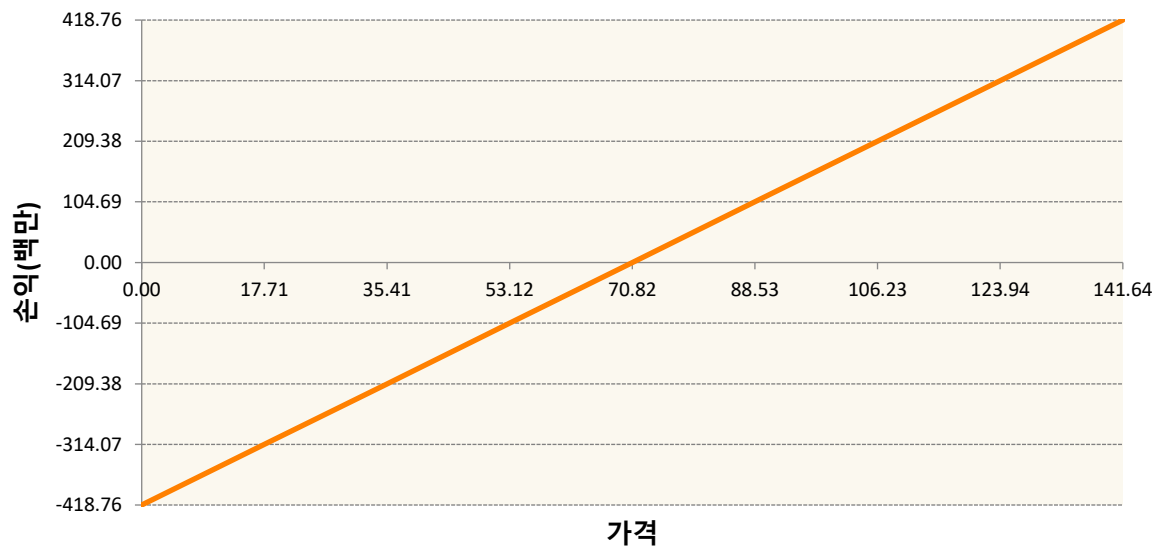
1. 계약금액

(단위:백만원)

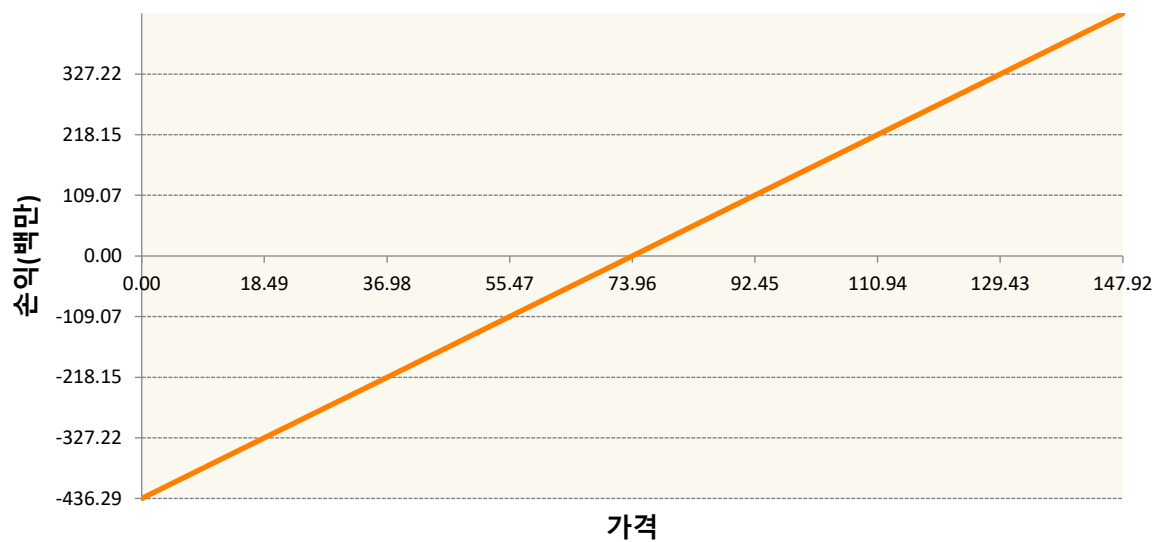
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,816	358	1,458	

2. 만기시점의 손익구조

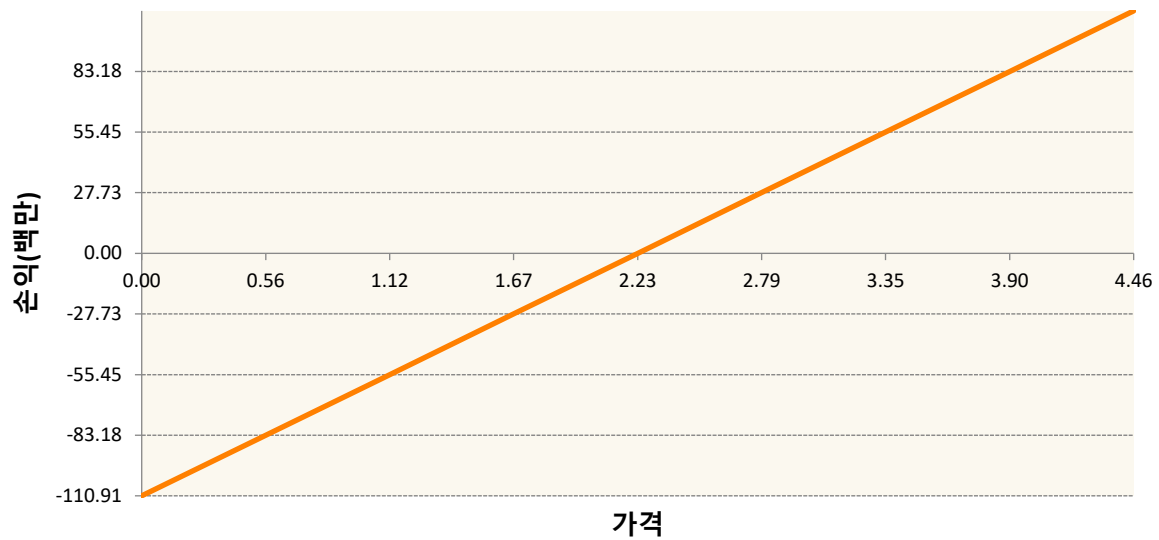
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



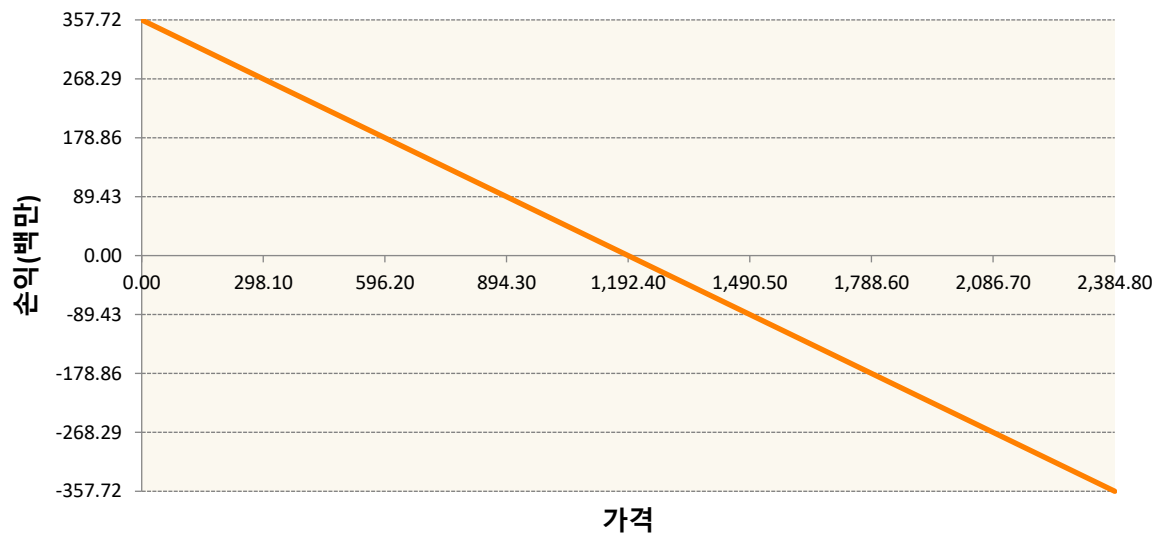
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



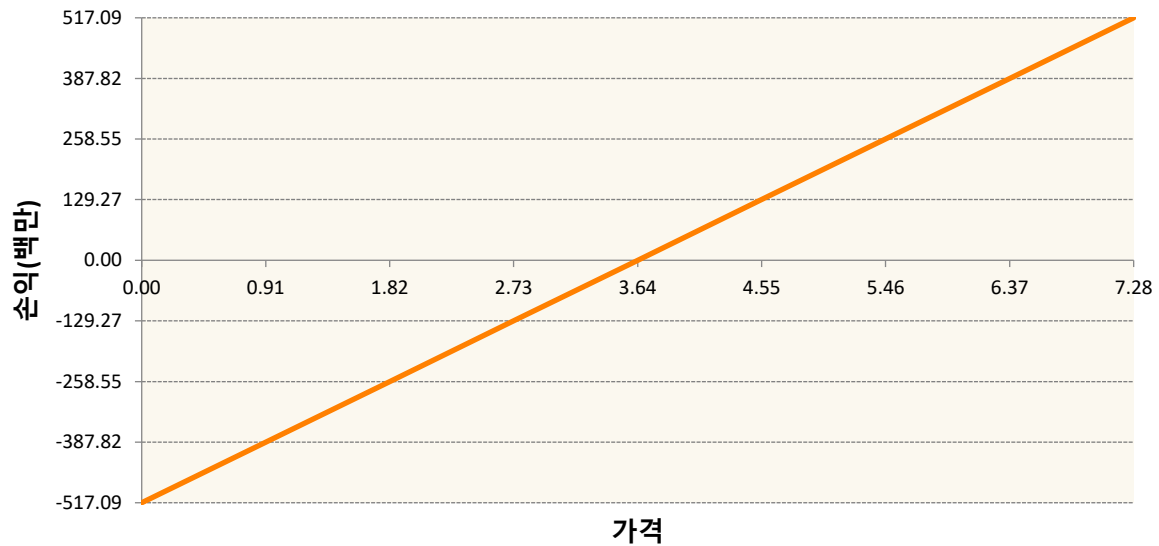
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22



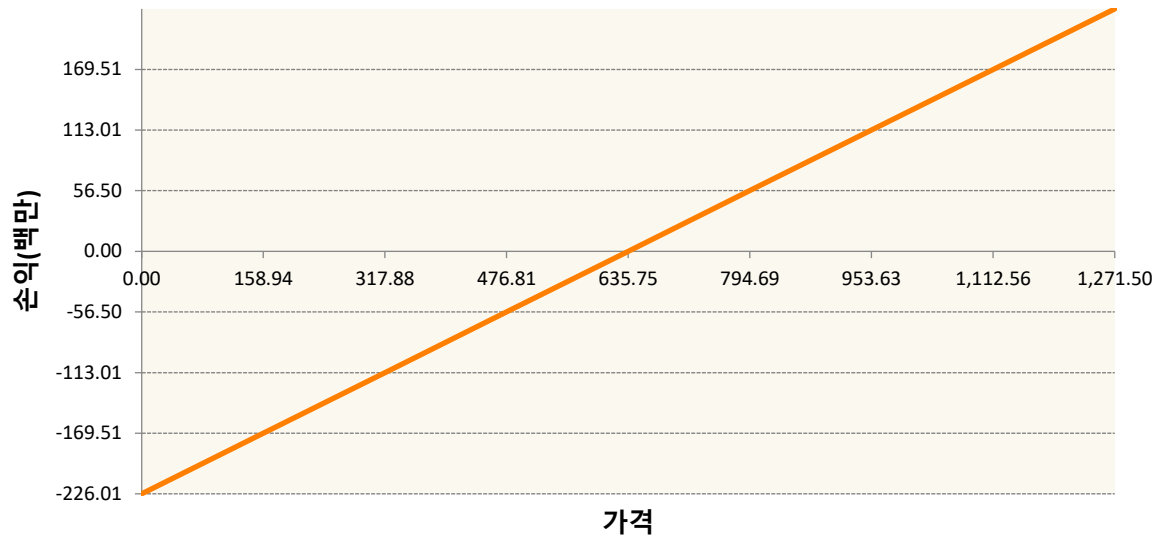
KR4175S10007-2022-01 달러선물



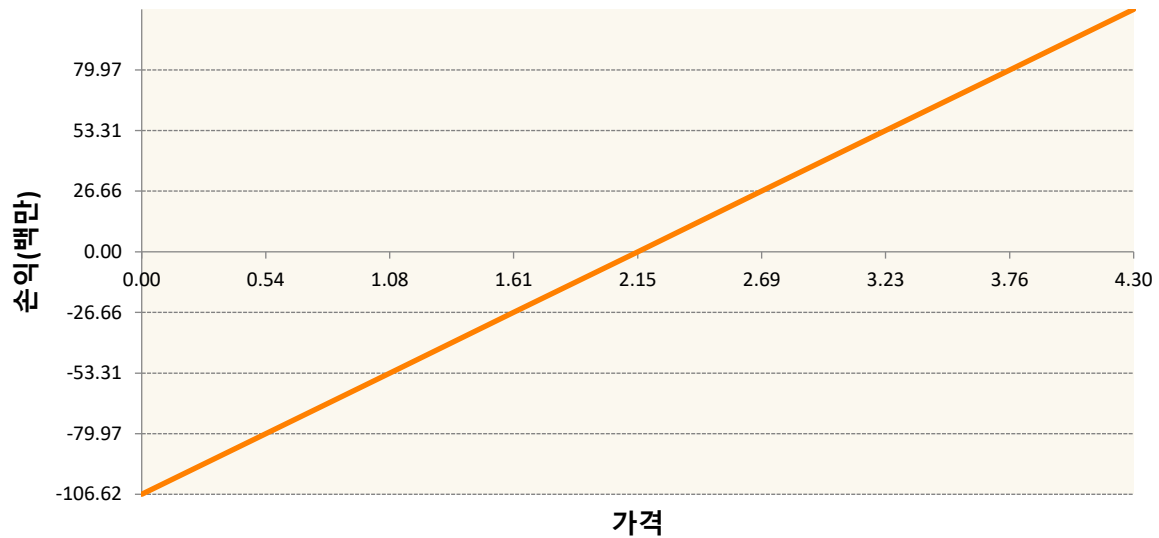
NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBH2-GASOLINE RBOB FUT Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22	34
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22	35
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22	9
KR4175S100	2022-01 달러선물	29
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22	41
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	18
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22	9

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

(단위:백만원)

329

