

공시일 2021-12-24
기준일 2021-12-23

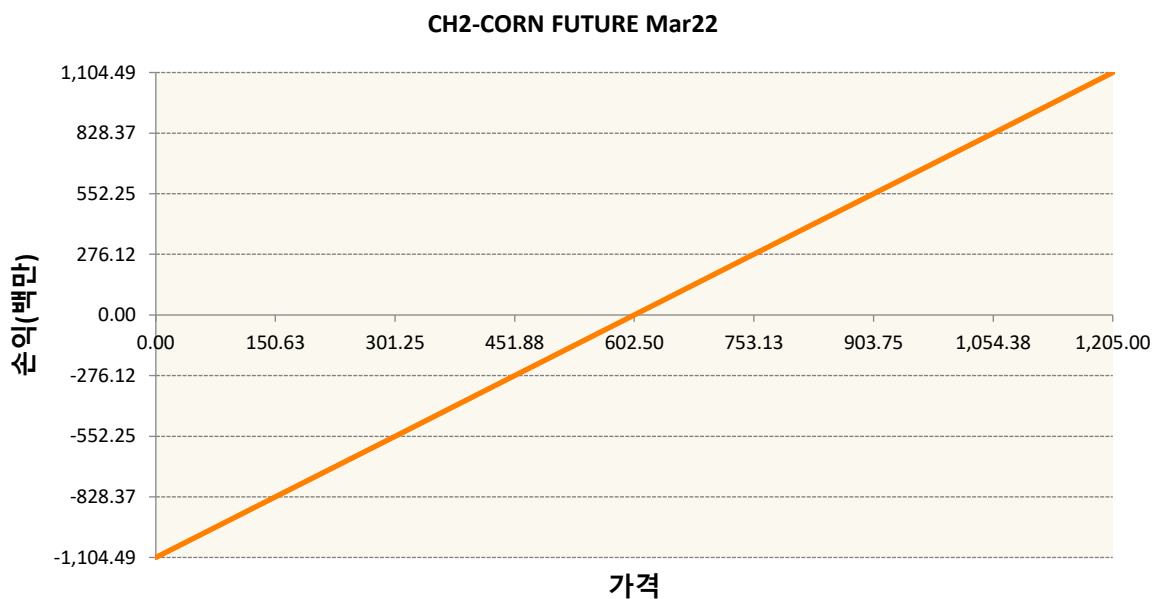
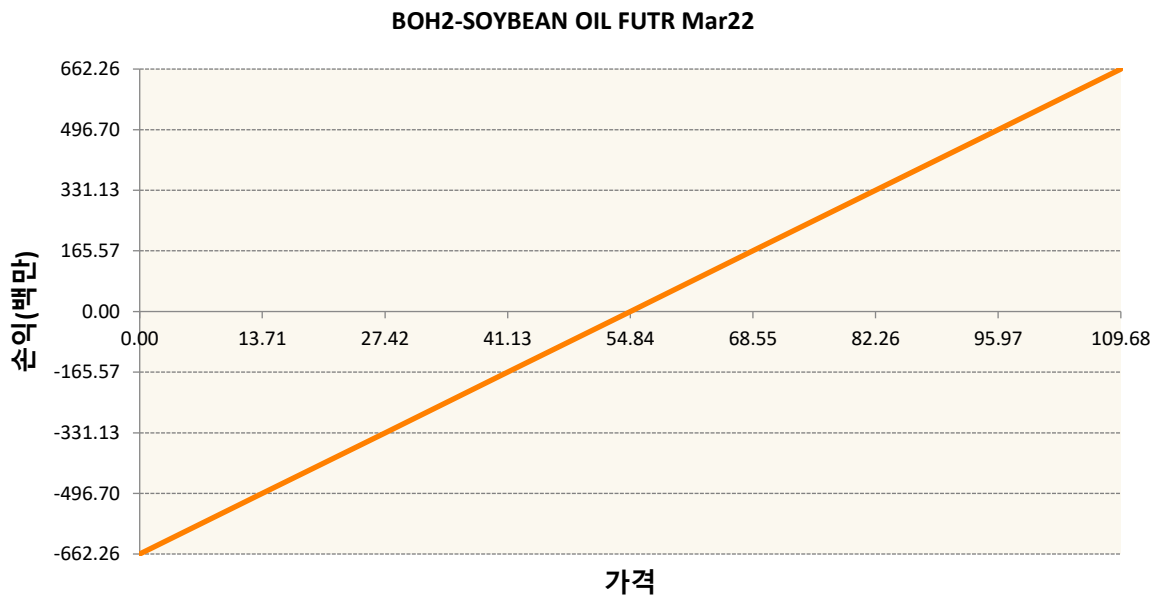
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

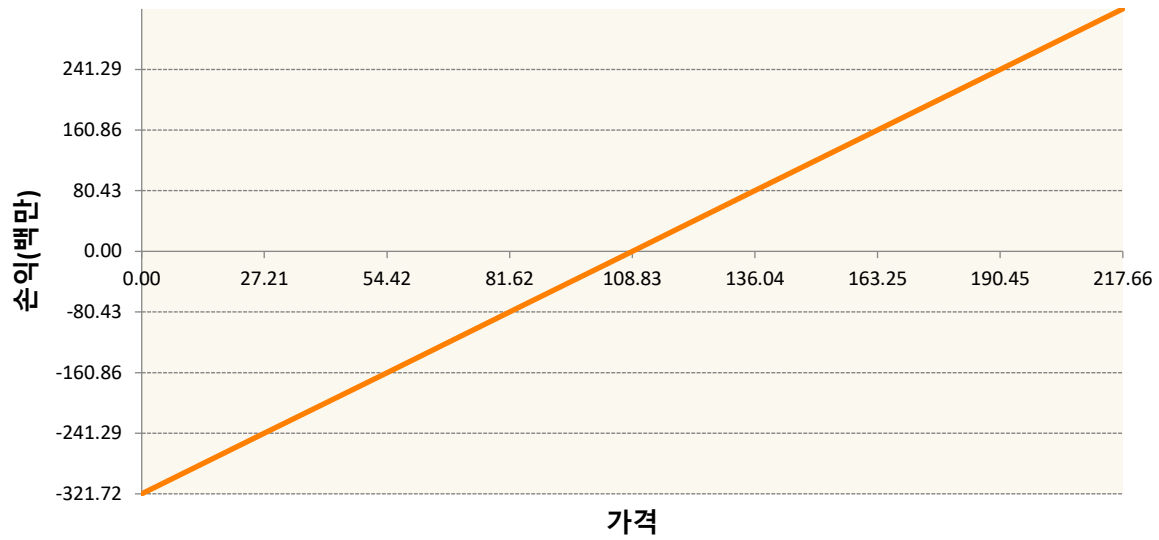
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,994	772	5,222	

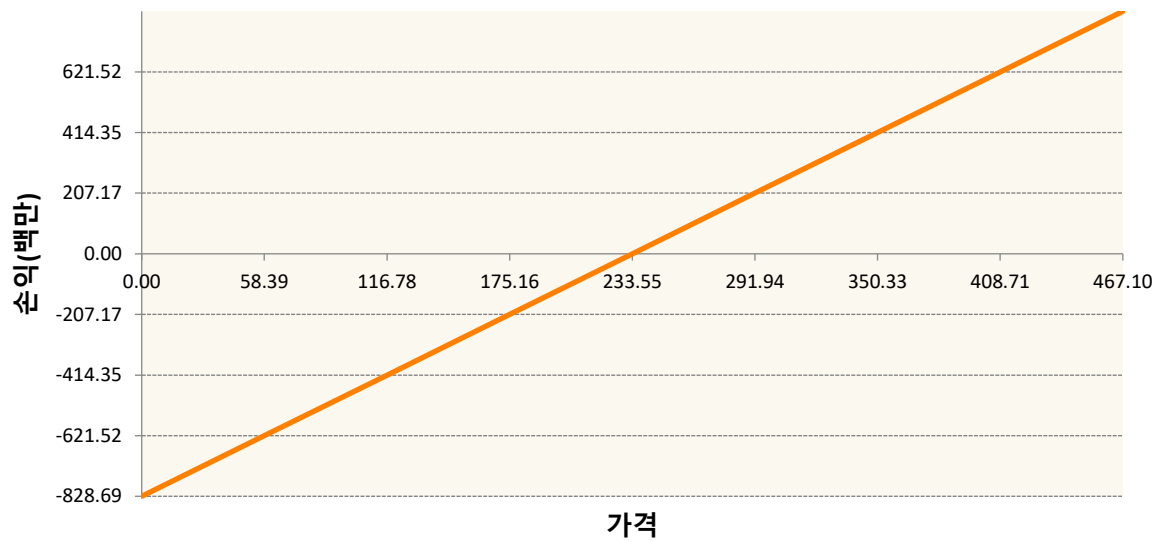
2. 만기시점의 손익구조



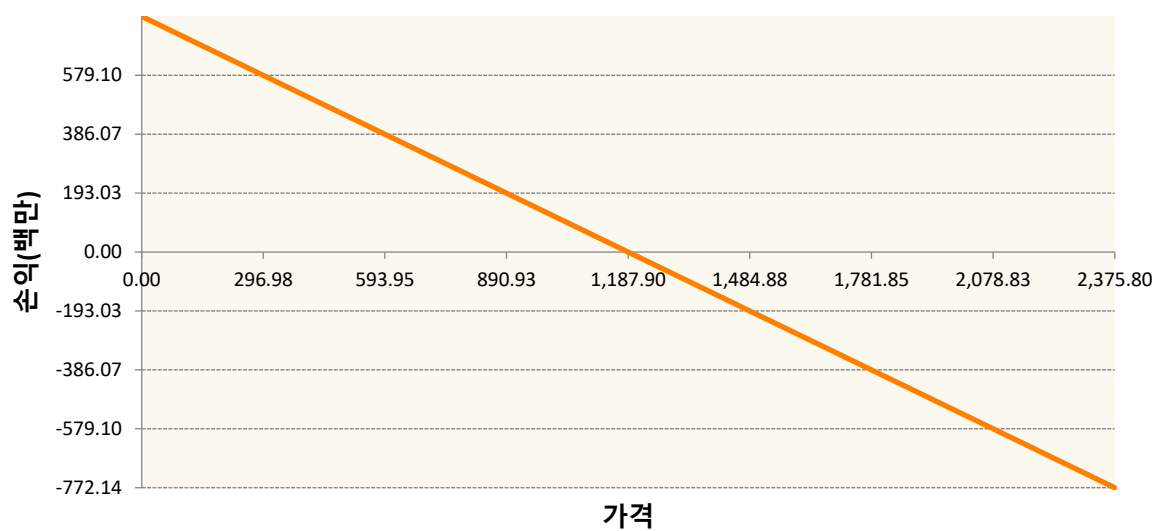
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



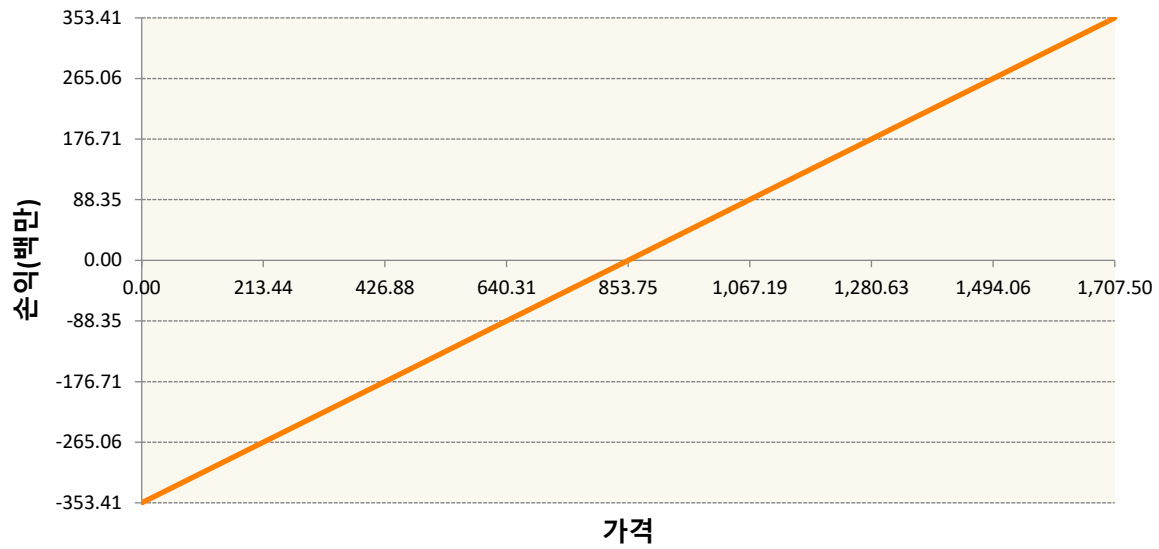
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



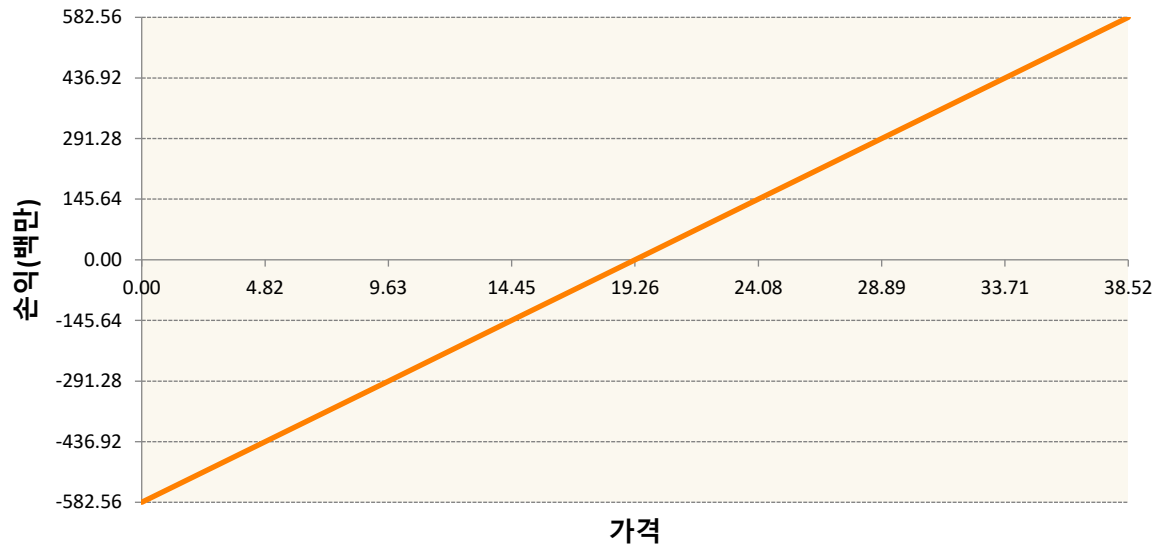
KR4175S10007-2022-01 달러선물



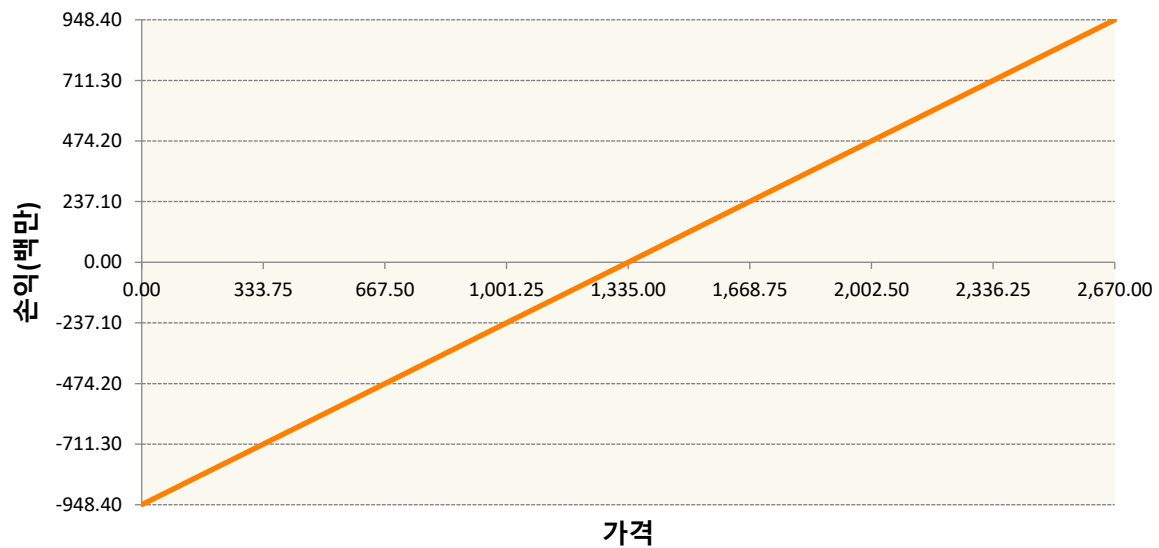
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



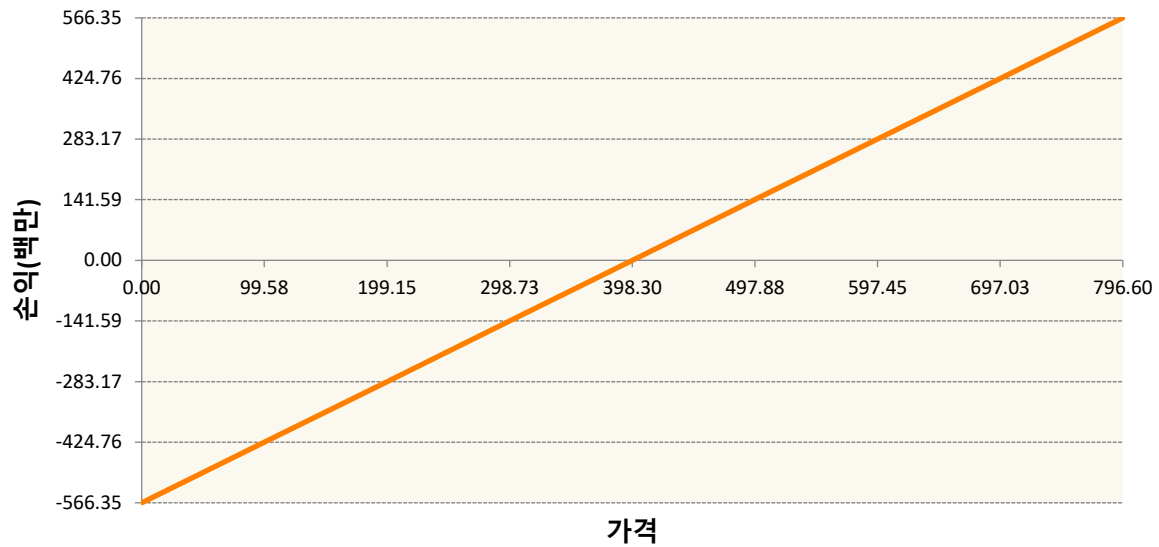
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



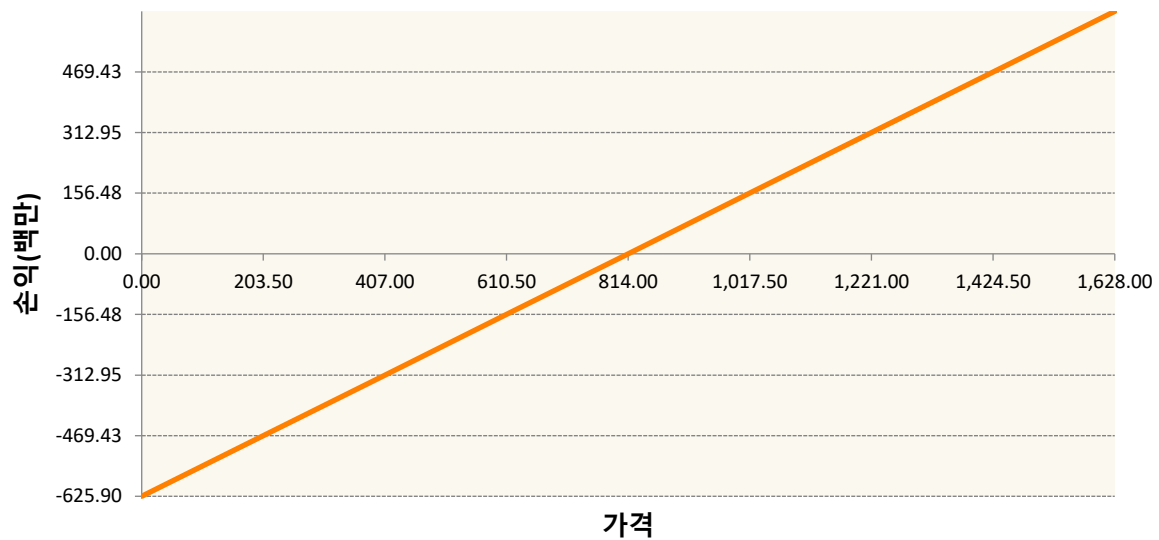
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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 2021-12-24

기준일 2021-12-23

스마트인덱스모

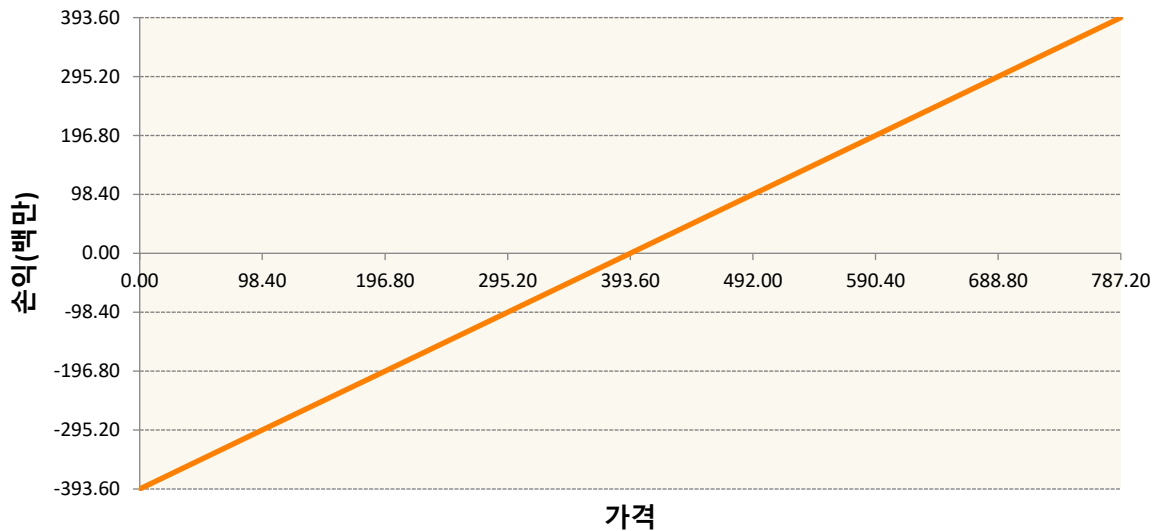
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	394	0	394	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	2021-12-24
기준일	2021-12-23

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

914

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

554

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-24
기준일	2021-12-23

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

438

* 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	2021-12-24
기준일	2021-12-23

유로인덱스모(주식-파생형)

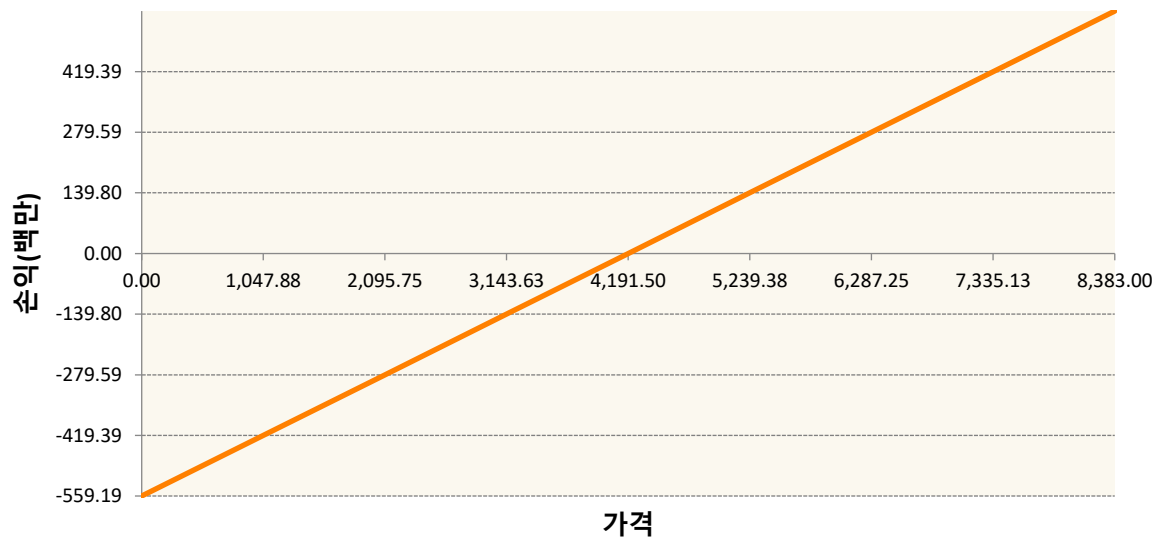
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	559	0	559	

2. 만기시점의 손익구조

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2021-12-24
기준일	2021-12-23

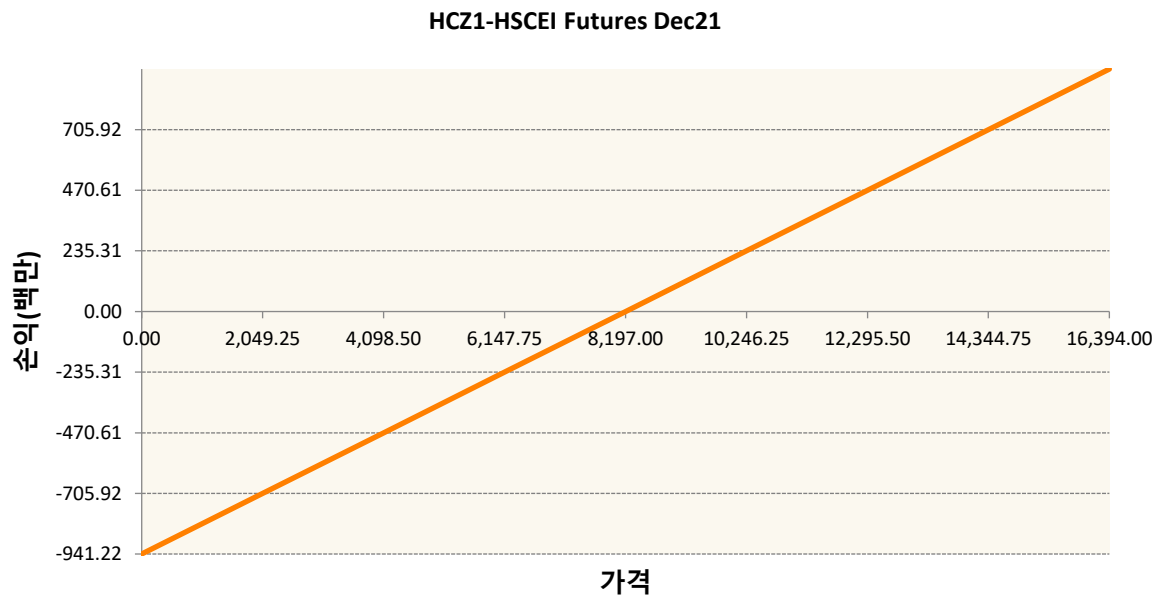
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	941	0	941	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

78

공시일 2021-12-24

기준일 2021-12-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

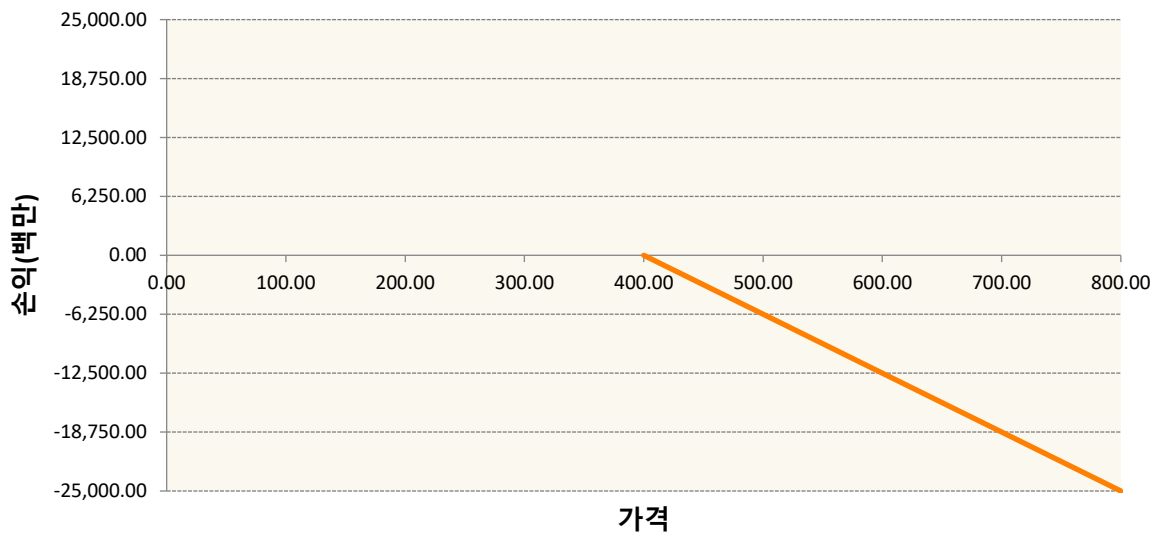
1. 계약금액

(단위:백만원)

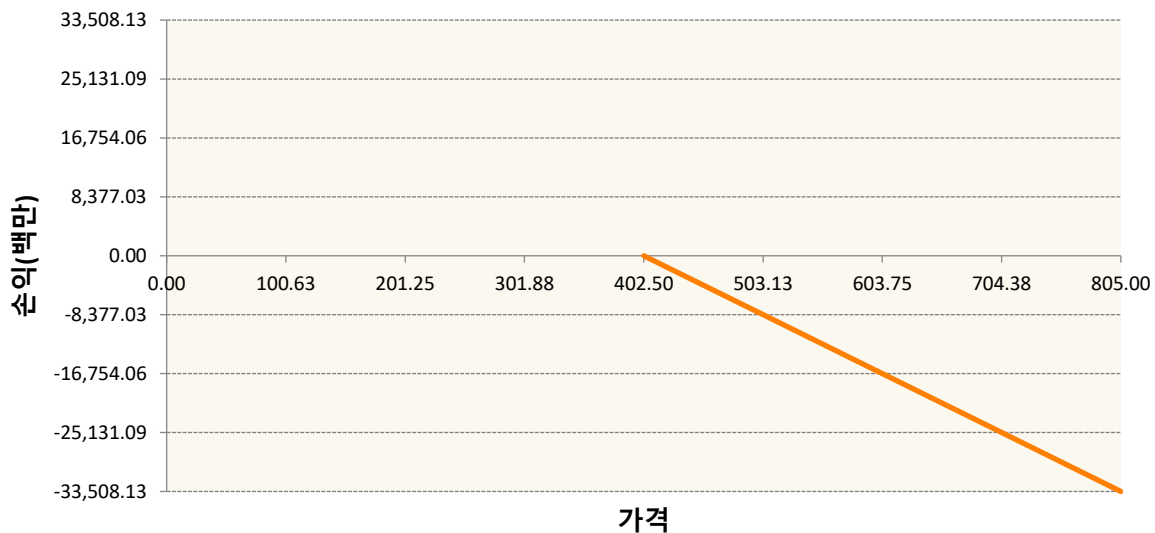
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201S14003-2022-01 콜400



KR4201S14029-2022-01 콜402.5



The graph illustrates 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 shows that the profit is negative for prices below 400,000 won and becomes zero at 400,000 won.

가격 (Price)	이익 (Profit)
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 a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익 (백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 805.00. The y-axis represents Net Income in millions, ranging from -2,012.50 to 2,012.50. The line starts at a price of 0.00 with a net income of -2,012.50 and reaches a net income of 0.00 at a price of 402.50.

가격	순이익 (백만)
0.00	-2,012.50
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003				2022-01 콜400			1,495
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	562	551	536	518	497	473	446
-5.33%	517	491	462	430	395	358	320
-2.67%	398	355	311	265	218	170	122
0%	159	106	53	0	-53	-106	-159
2.67%	-222	-272	-322	-373	-424	-476	-528
5.33%	-729	-765	-803	-844	-887	-931	-977
8.00%	-1,321	-1,341	-1,365	-1,394	-1,425	-1,458	-1,495
KR4201S14029				2022-01 콜402.5			1,917
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	664	652	635	614	589	560	528
-5.33%	617	588	553	514	472	426	378
-2.67%	487	434	378	320	261	200	138
0%	209	140	70	0	-70	-140	-211
2.67%	-254	-323	-393	-463	-533	-604	-674
5.33%	-893	-946	-1,002	-1,061	-1,122	-1,184	-1,248
8.00%	-1,659	-1,691	-1,728	-1,770	-1,816	-1,865	-1,917
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,161

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,146	-1,147	-1,148	-1,150	-1,153	-1,156	-1,161
-5.33%	-687	-692	-698	-705	-714	-724	-736
-2.67%	-260	-274	-290	-307	-325	-344	-363
0%	71	48	24	0	-24	-48	-72
2.67%	254	235	214	193	171	149	127
5.33%	319	310	300	287	274	259	243
8.00%	333	331	328	323	317	309	300

KR4301S14027 2022-01 풋402.5							137
--	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-137	-137	-137
-5.33%	-83	-84	-84	-85	-86	-87	-88
-2.67%	-33	-35	-36	-38	-40	-42	-44
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	33	30	28	25	23	20	17
5.33%	43	41	40	38	36	35	33
8.00%	45	45	44	44	43	42	40

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

(단위:백만원)

4,670

공시일 2021-12-24

기준일 2021-12-23

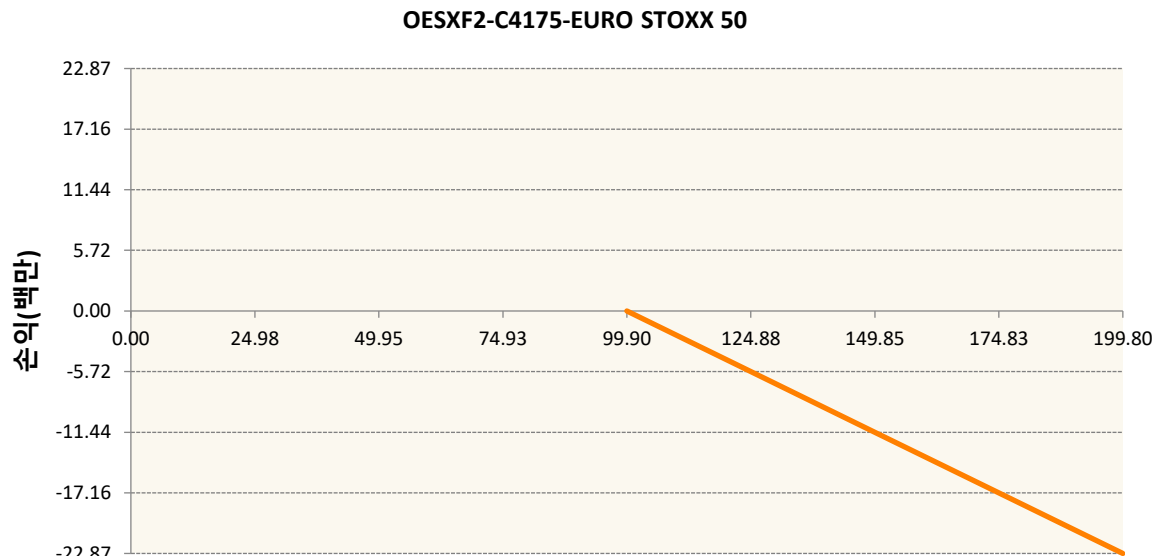
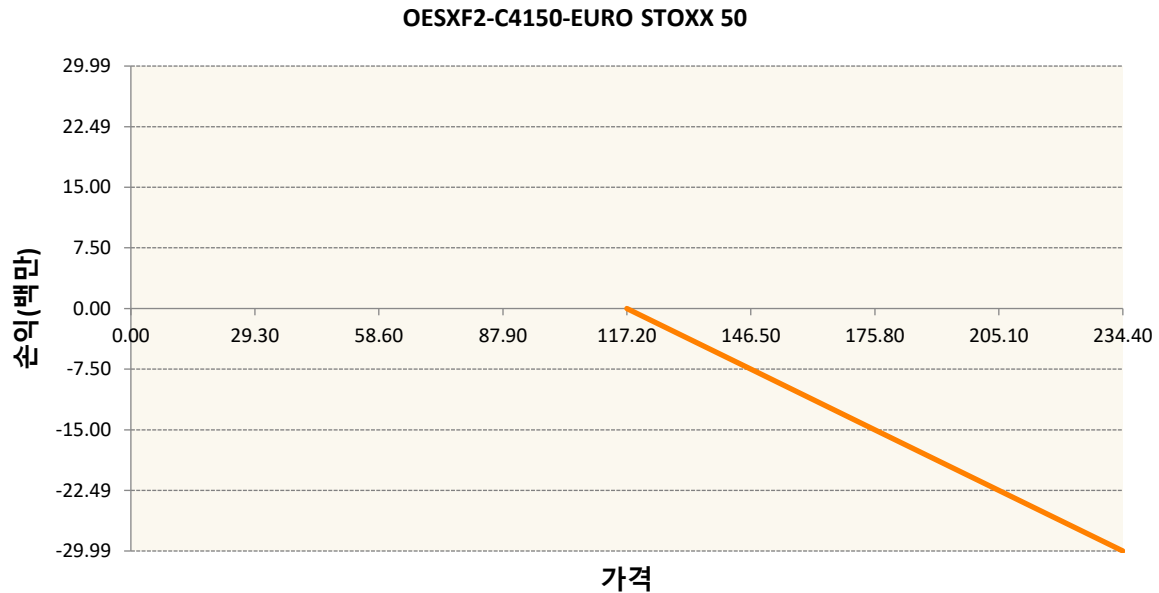
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

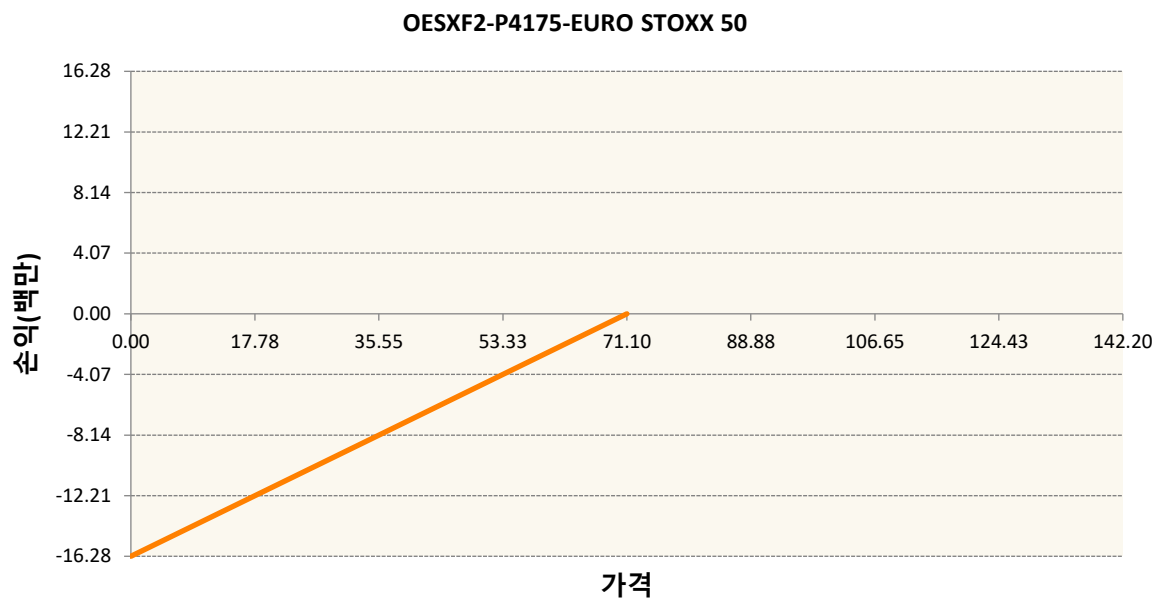
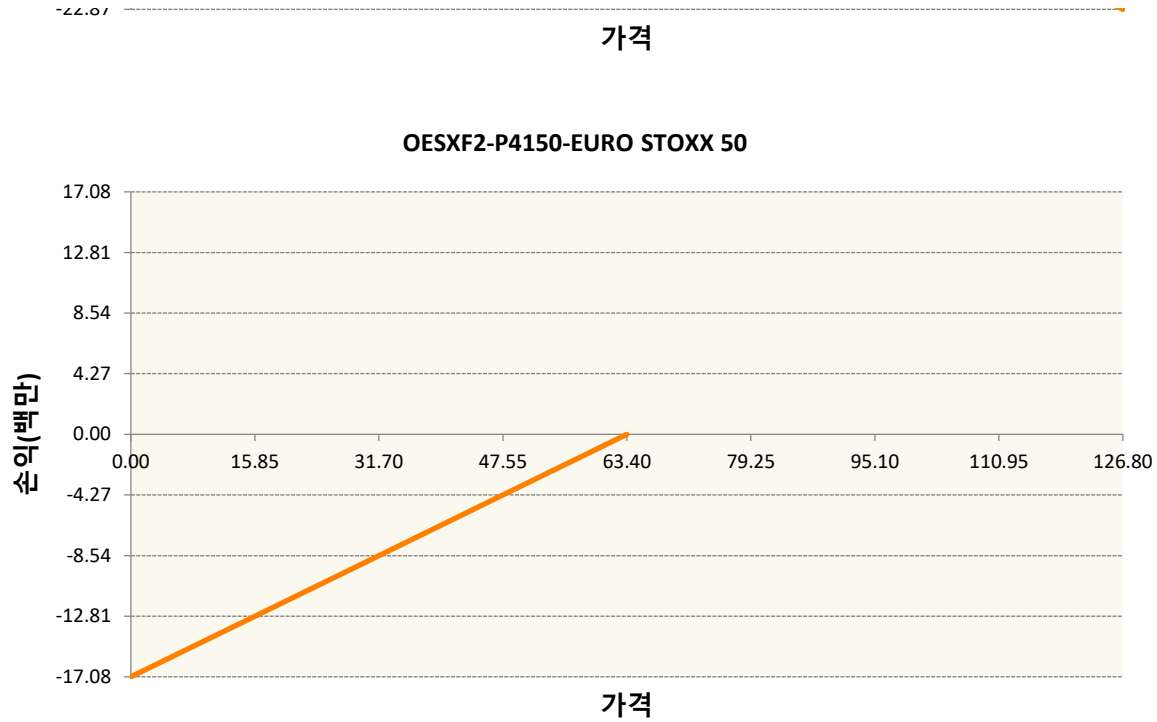
1. 계약금액

(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	86	-86	장내
누계	통화	선도	0	2,020	-2,020	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	5
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	1
OESXF2-P41 EURO STOXX 50	1

공시일 2021-12-24

기준일 2021-12-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

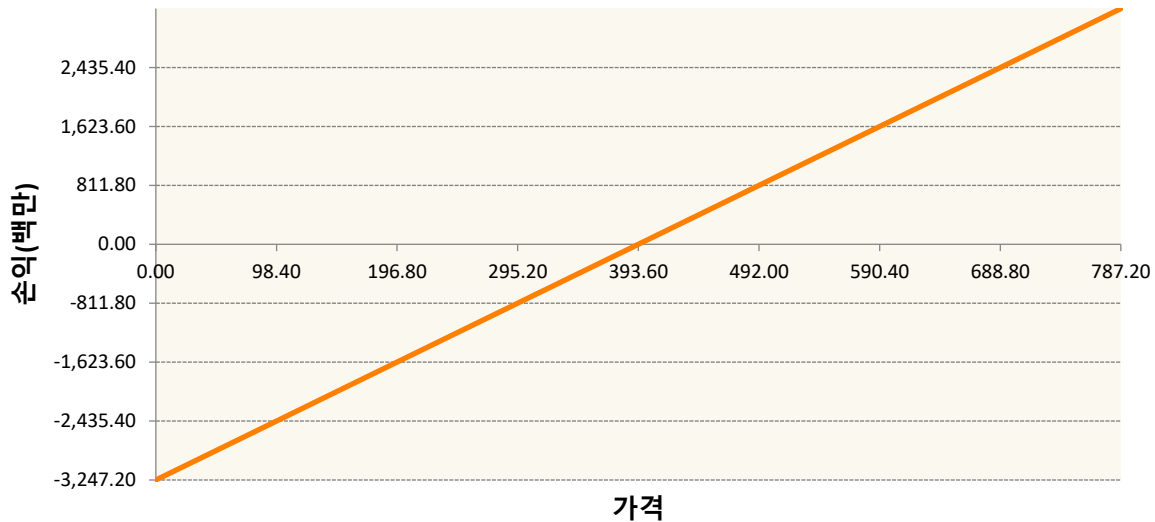
1. 계약금액

(단위:백만원)

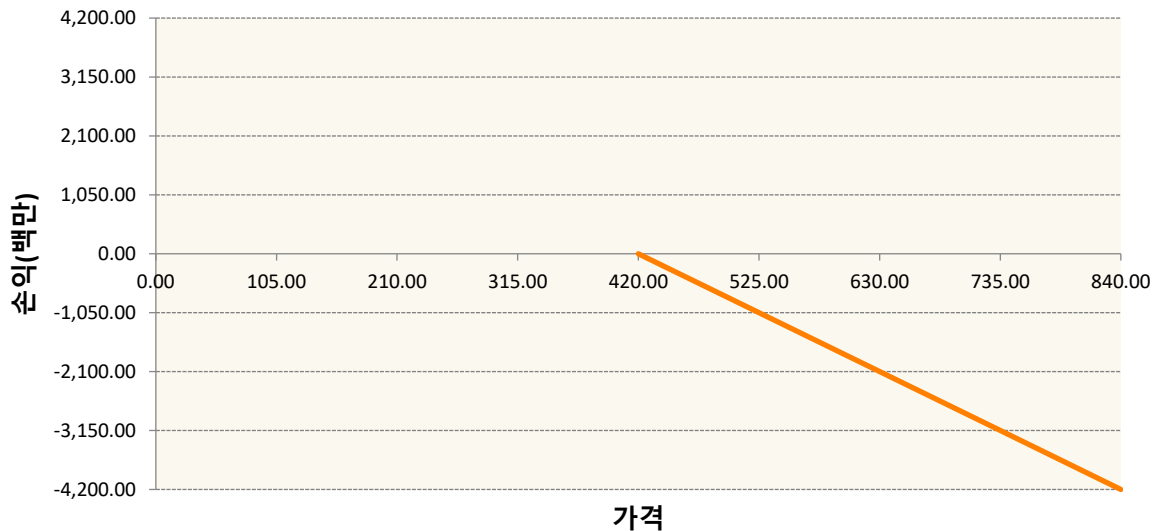
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,247	0	3,247	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S14201-2022-01 콜420



The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 850.00 with major ticks every 106.25. The y-axis represents the net income, ranging from -1,275.00 to 1,275.00 with major ticks every 318.75. A single orange line is plotted, starting at the point (425.00, 0.00) and extending downwards to the point (850.00, -1,275.00). This indicates that as the price increases beyond 425.00, the net income decreases linearly.

가액	순익(백만)
425.00	0.00
850.00	-1,275.00

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 800.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from -200.00 to 200.00. A blue line starts at (0, 200) and ends at (400, 0), showing that profit is zero at a price of 400.00.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
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					263
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263
-5.33%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175
-2.67%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	88	88	88	88	88	88	88
5.33%	175	175	175	175	175	175	175
8.00%	263	263	263	263	263	263	263
KR4201S14201		2022-01 콜420					161
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	28	27	26	24
-5.33%	29	28	27	25	22	20	17
-2.67%	26	23	20	17	12	8	3
0%	16	11	6	0	-6	-13	-20
2.67%	-6	-13	-21	-29	-37	-46	-54
5.33%	-47	-56	-65	-74	-83	-92	-101
8.00%	-110	-118	-127	-135	-144	-152	-161

KR4201S14250

2022-01 콜425

42

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	5
-5.33%	6	6	6	5	5	4	4
-2.67%	6	5	5	4	3	2	0
0%	4	3	1	0	-2	-3	-5
2.67%	-1	-3	-5	-7	-9	-11	-14
5.33%	-10	-13	-16	-18	-21	-23	-26
8.00%	-26	-29	-32	-34	-37	-40	-42

KR4301S14001

2022-01 풋400

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	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-3	-2	-2	-2	-2	-1
5.33%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3

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

(단위:백만원)

434

공시일	2021-12-24
기준일	2021-12-23

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	16,860	0	16,860	

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	2021-12-24
기준일	2021-12-23

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	51	-51	
누계	유가증권	수익증권	9,598	0	9,598	

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	2021-12-24
기준일	2021-12-23

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	428	-428	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	45,052	0	45,052	
누계	통화	선도	1,425	27,916	-26,490	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		2,233

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

(단위:백만원)

784

공시일 2021-12-24

기준일 2021-12-23

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

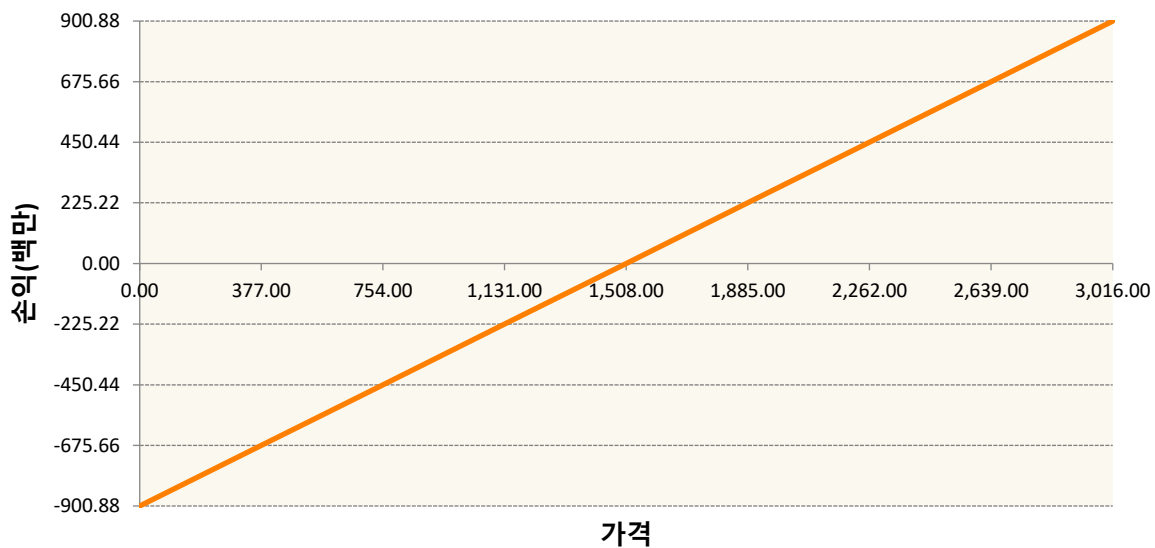
1. 계약금액

(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	901	0	901	
누계	유가증권	스왑	1,799	0	1,799	장외
누계	통화	선도	0	1,118	-1,118	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	36
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 2021-12-24

기준일 2021-12-23

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

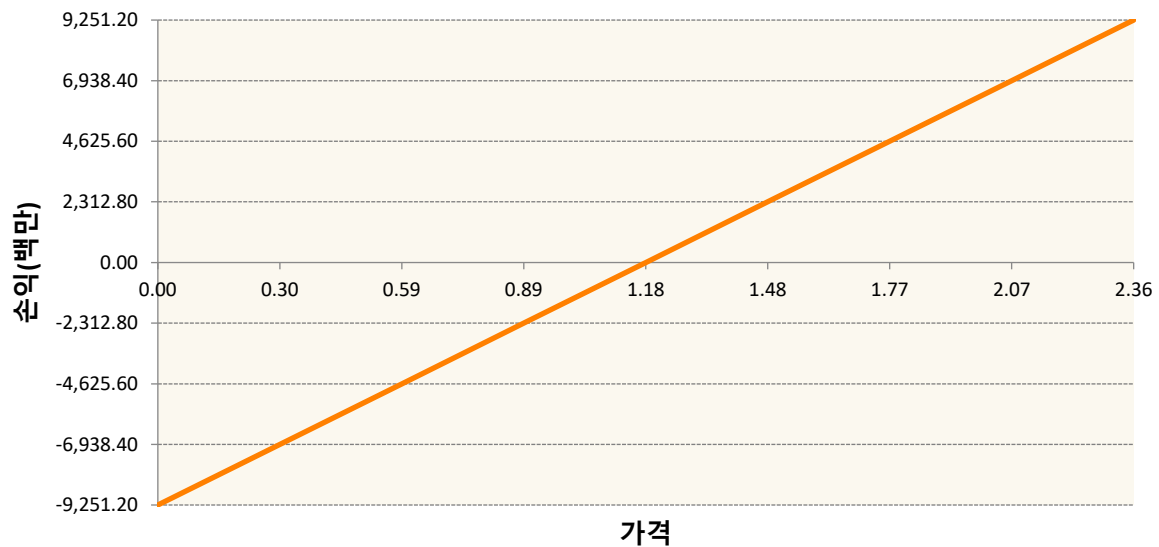
1. 계약금액

(단위:백만원)

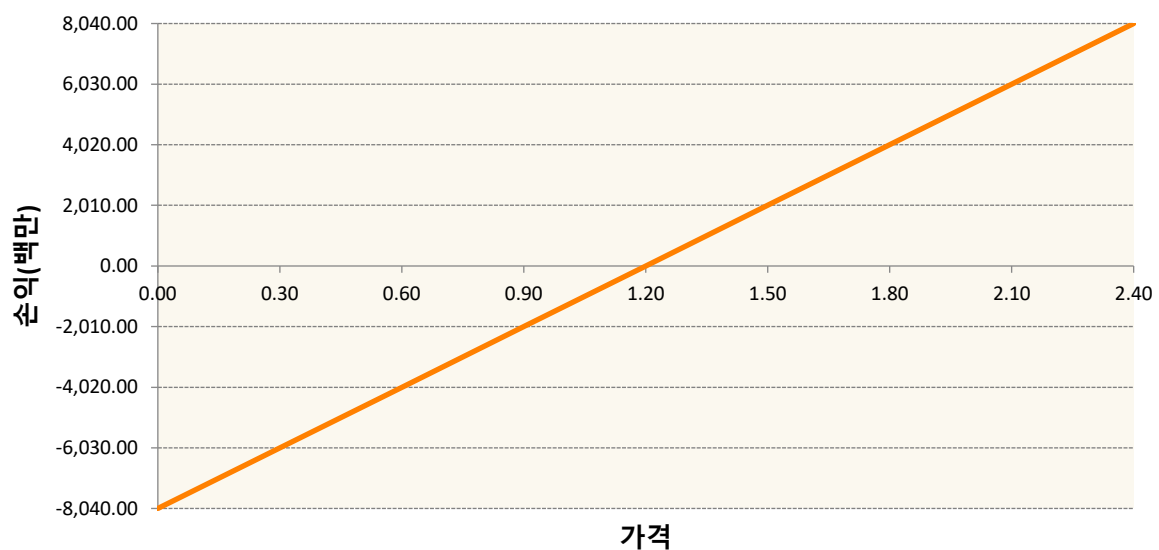
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	34,595	0	34,595	

2. 만기시점의 손익구조

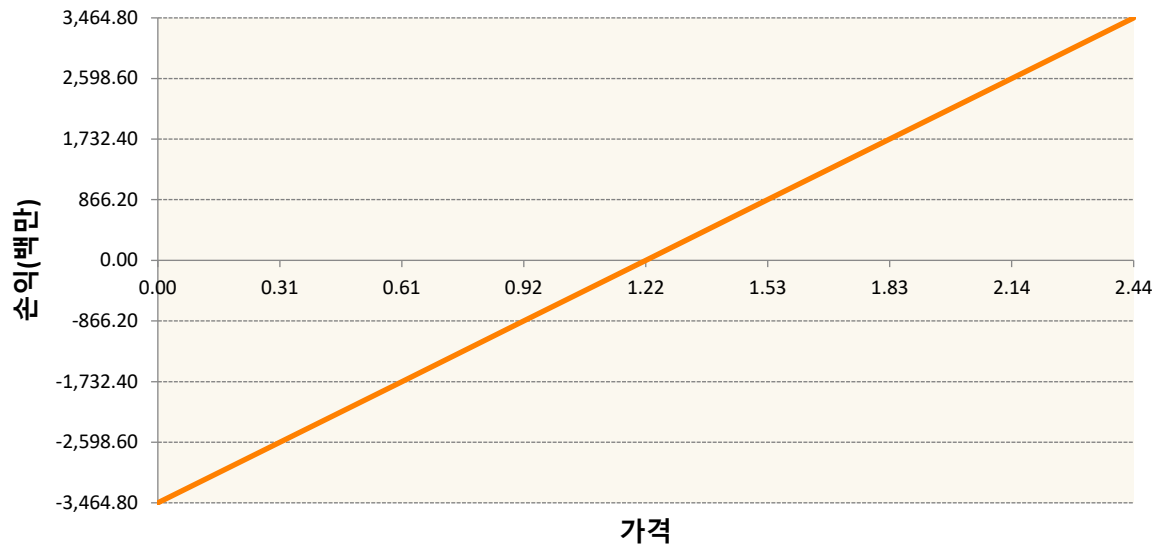
210884210930-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



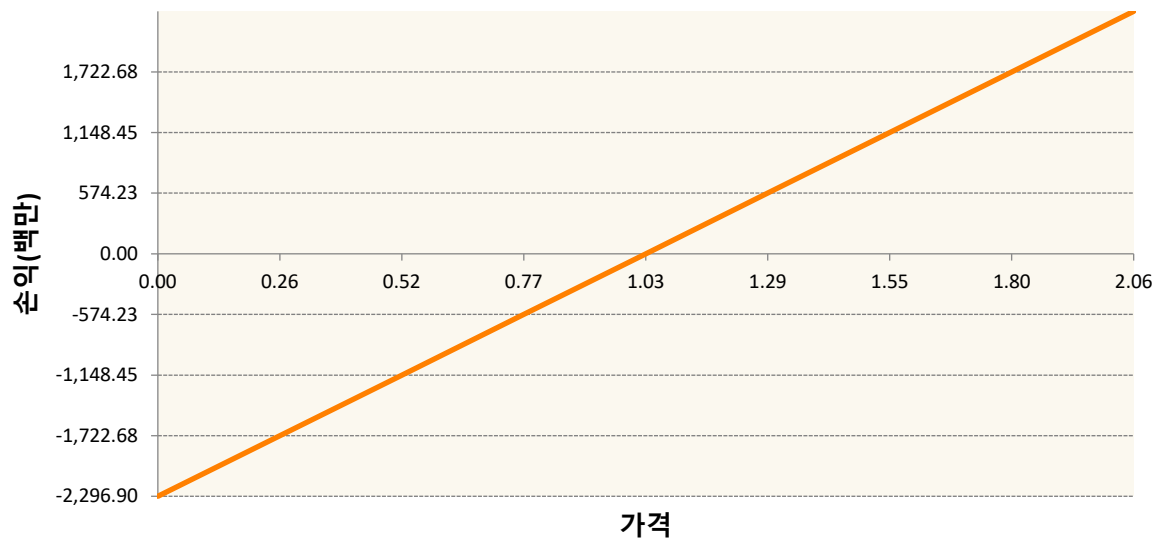
210884211008-IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)



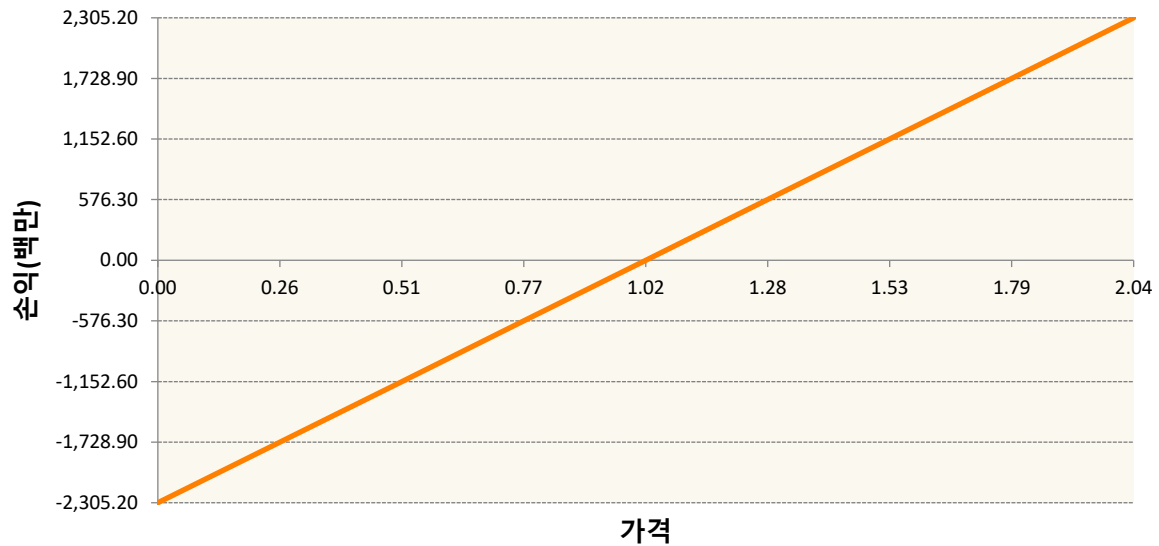
210884211022-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



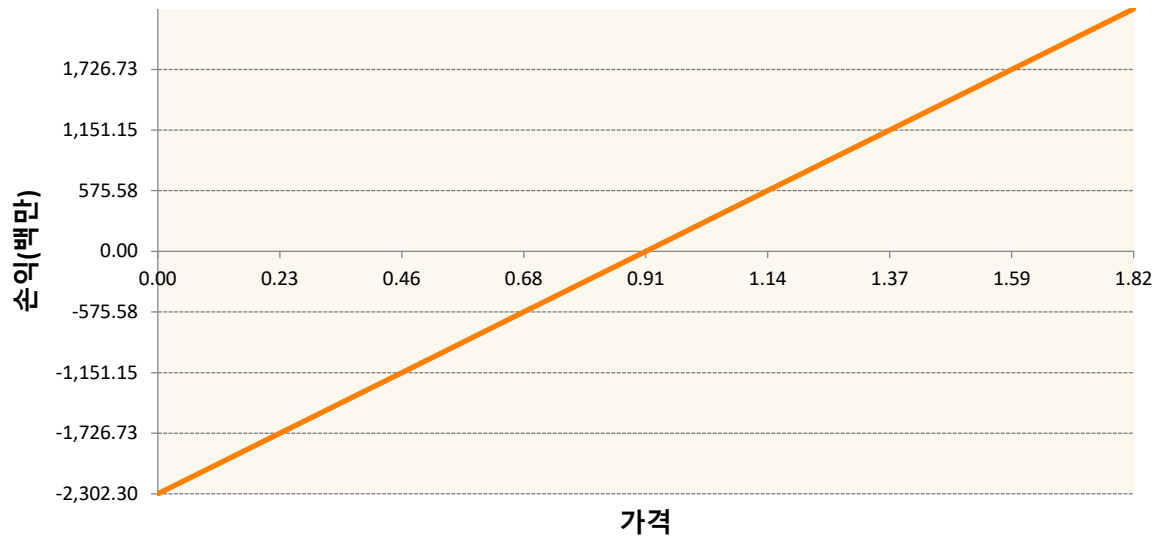
210884211122-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



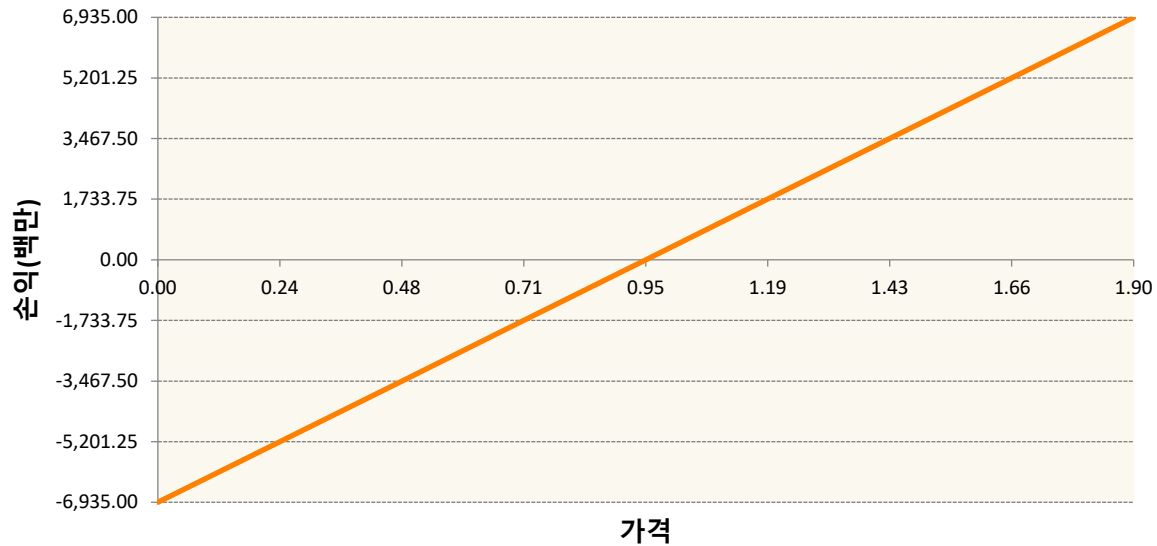
210884211129-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211210-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884211214-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	739
2.1088E+11 IHS MARKIT GLOBAL CARBON INDEX(TR)	644
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	277
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	184
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	184
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	184
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	554

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

(단위:백만원)

4,421

공시일 2021-12-24

기준일 2021-12-23

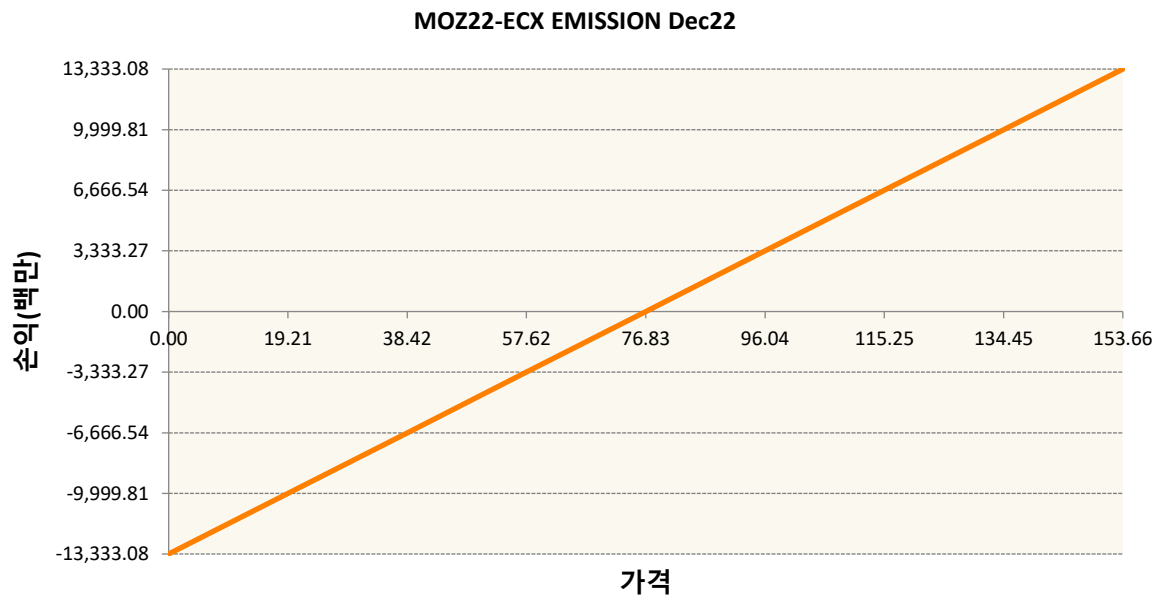
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,333	0	13,333	
누계	통화	선도	0	6,760	-6,760	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BBX-KRW/EUR 28-12-21E	385
FXW213BCA-KRW/EUR 28-12-21E	156
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,067

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

(단위:백만원)

2,536

공시일	2021-12-24
기준일	2021-12-23

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	11,760	0	11,760	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (NH)	0.31
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	0.31
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	0.31
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	0.31

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

(단위:백만원)

2

공시일 2021-12-24

기준일 2021-12-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

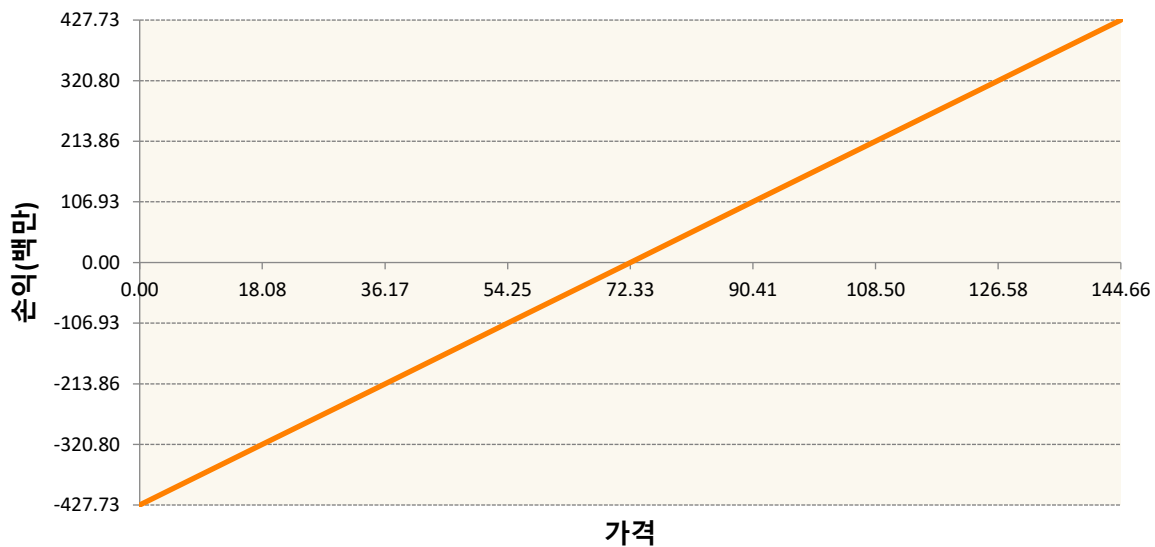
1. 계약금액

(단위:백만원)

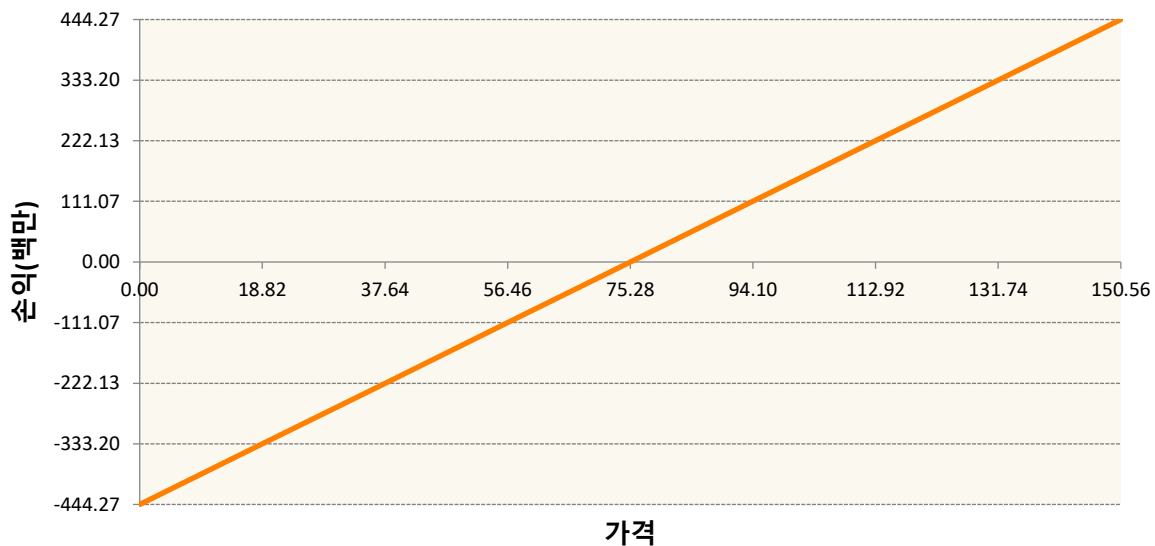
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,849	356	1,493	

2. 만기시점의 손익구조

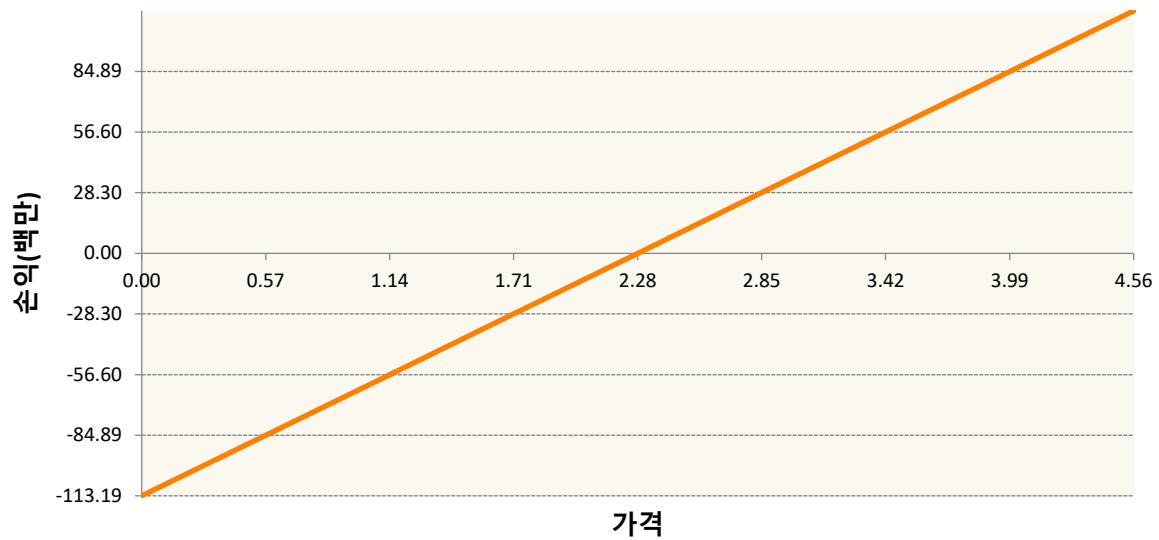
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



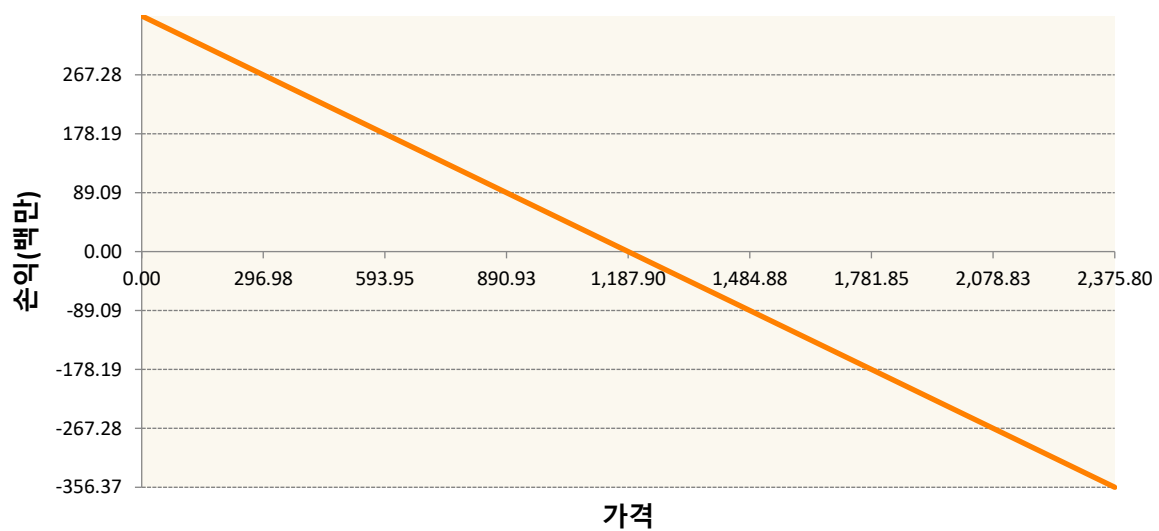
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



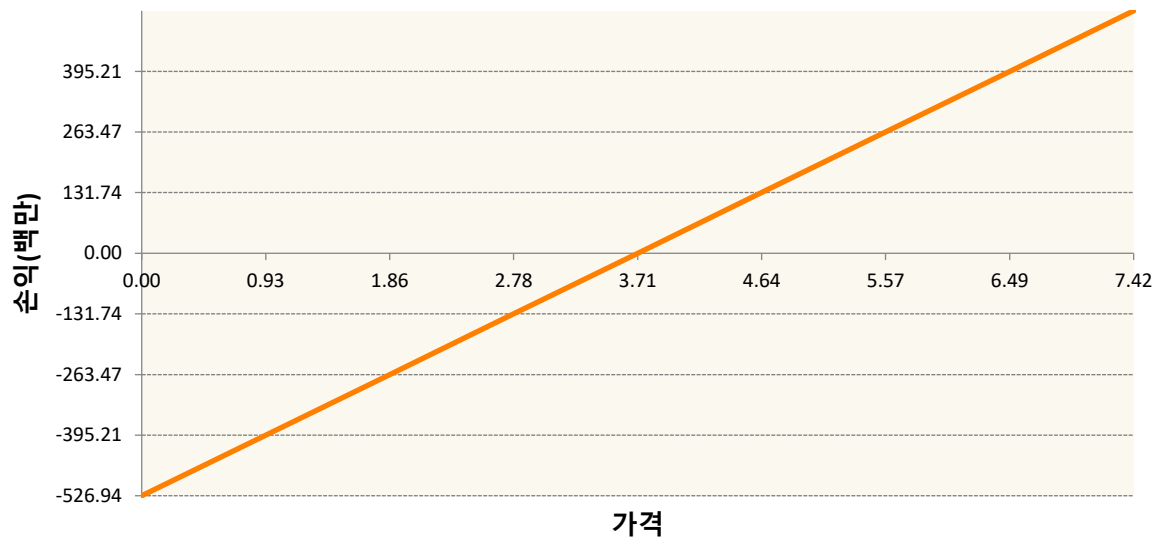
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

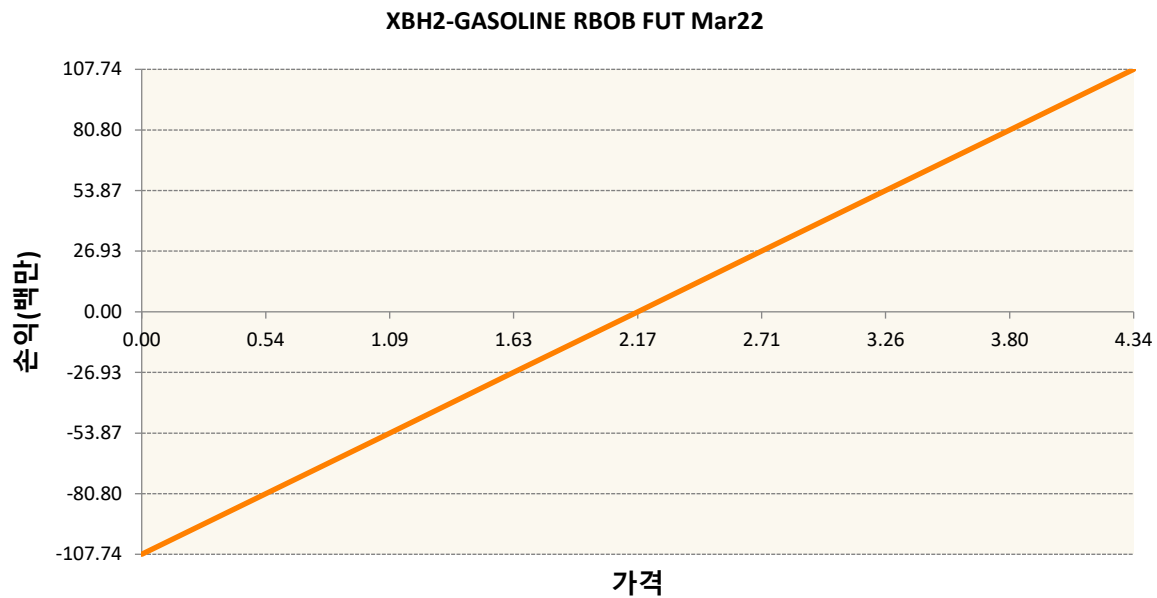
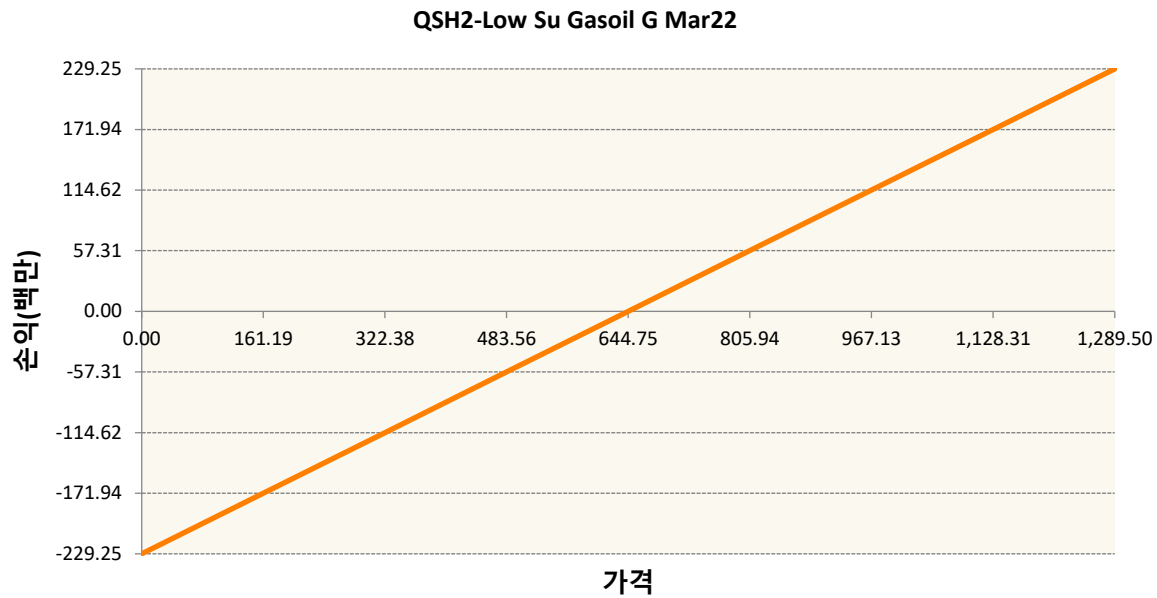


KR4175S10007-2022-01 달러선물



NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22		34
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22		36
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22		9
KR4175S100	2022-01 달러선물		29
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22		42
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22		18
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22		9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	335

