

공시일 2021-12-30
기준일 2021-12-29

포커스농산물모(채권-파생형)

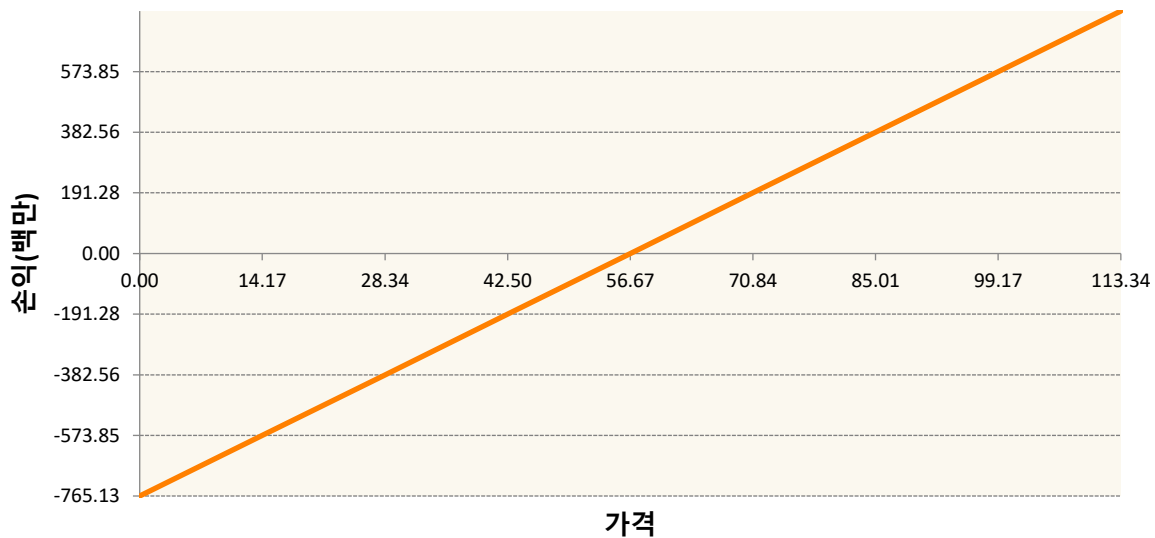
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

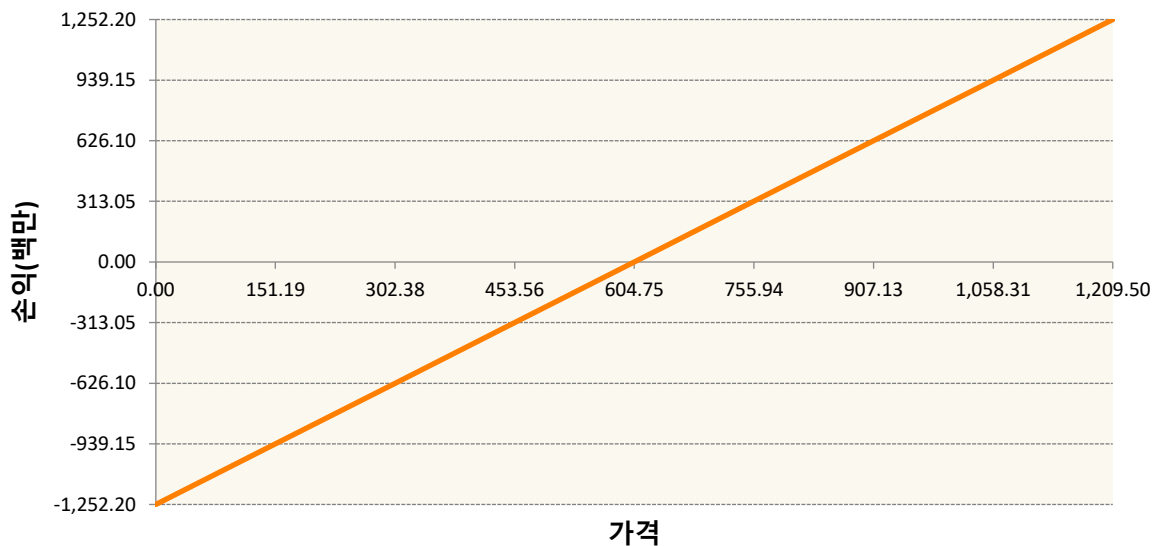
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,679	772	5,907	

2. 만기시점의 손익구조

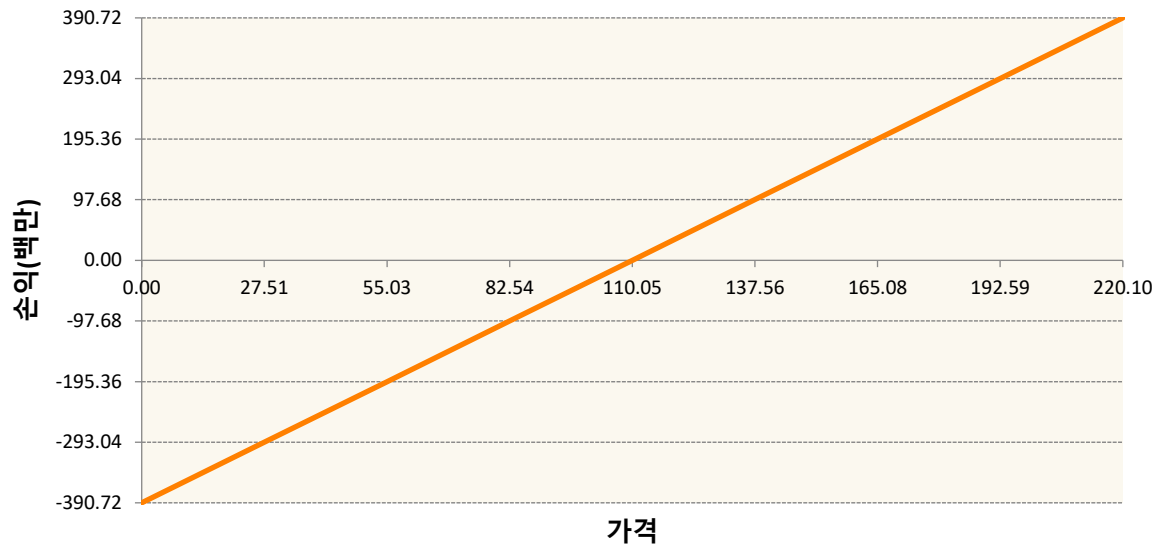
BOH2-SOYBEAN OIL FUTR Mar22



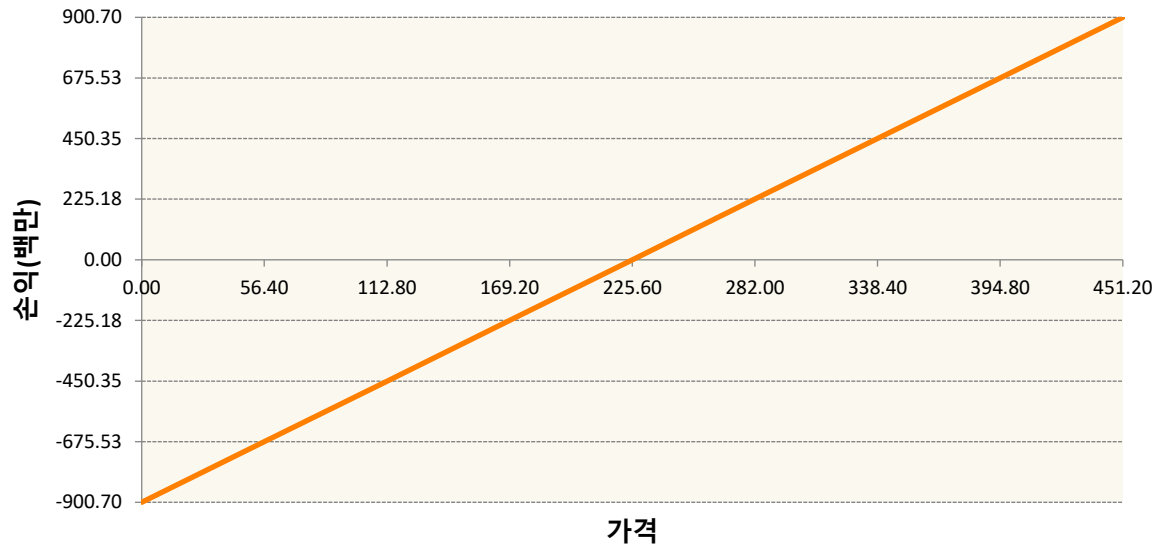
CH2-CORN FUTURE Mar22



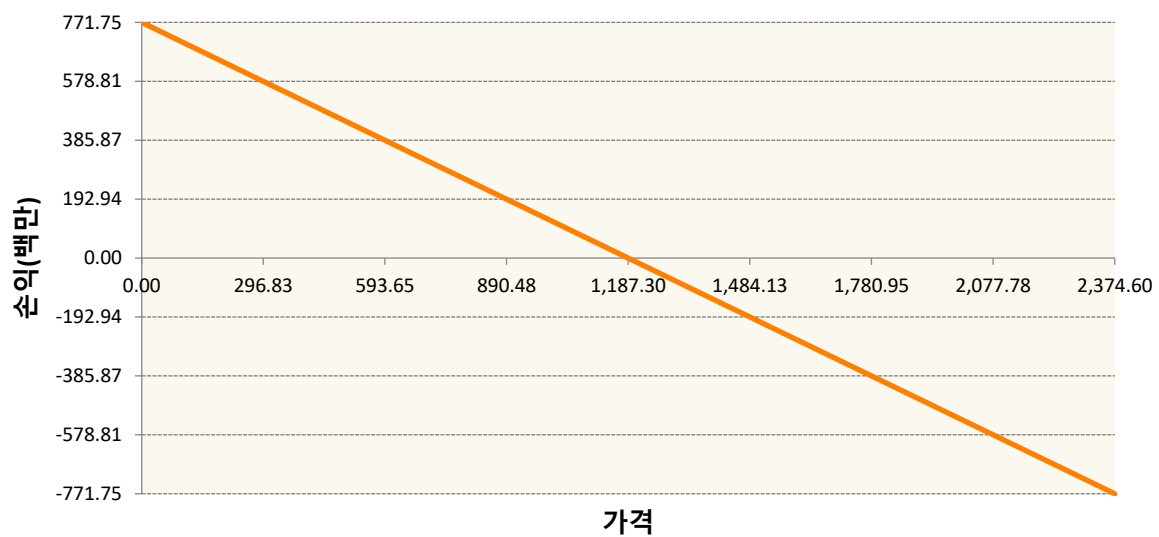
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



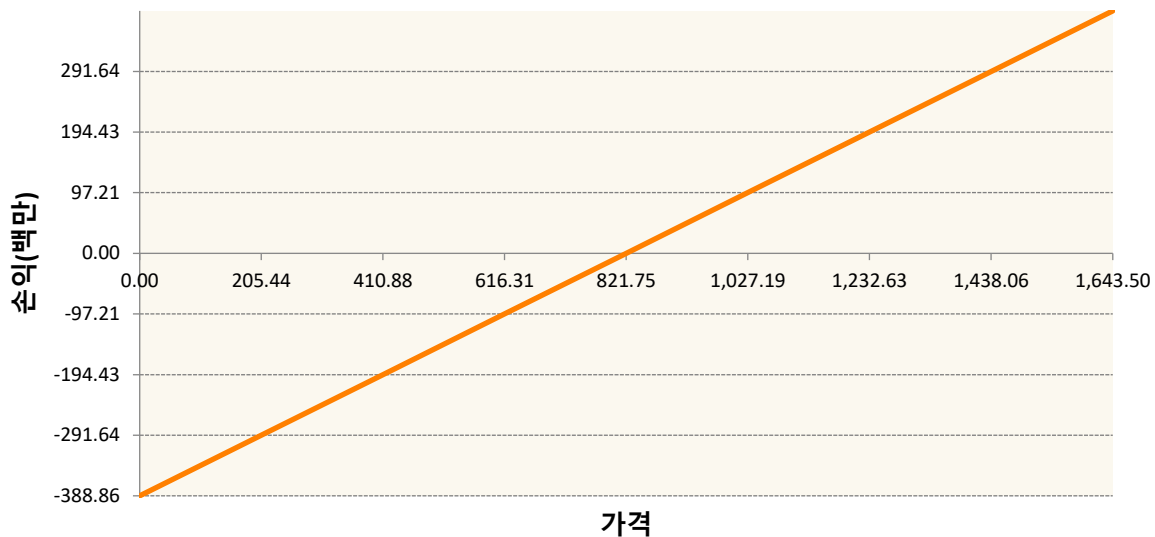
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



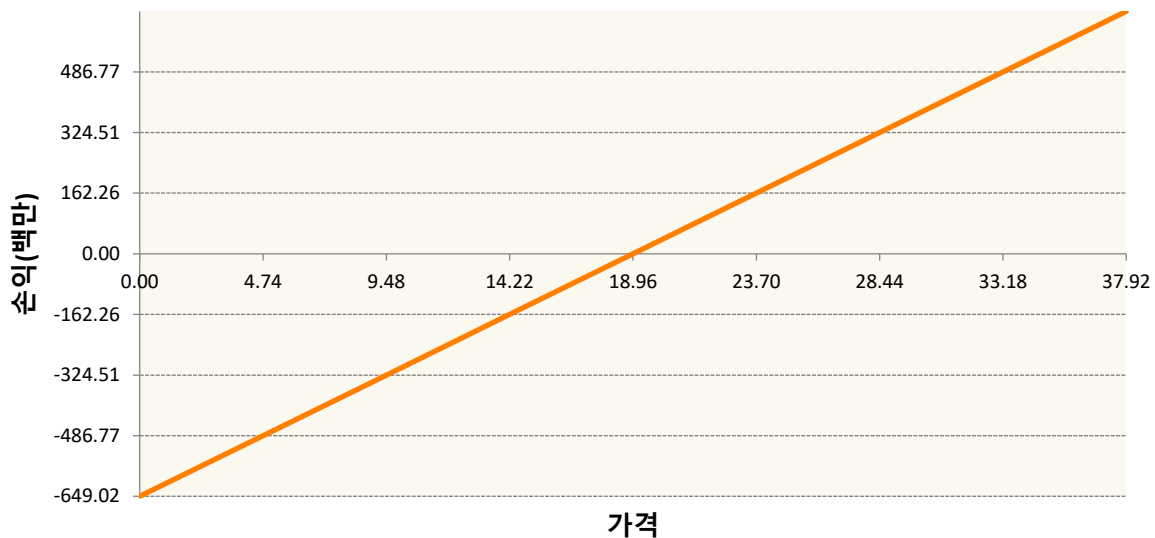
KR4175S10007-2022-01 달러선물



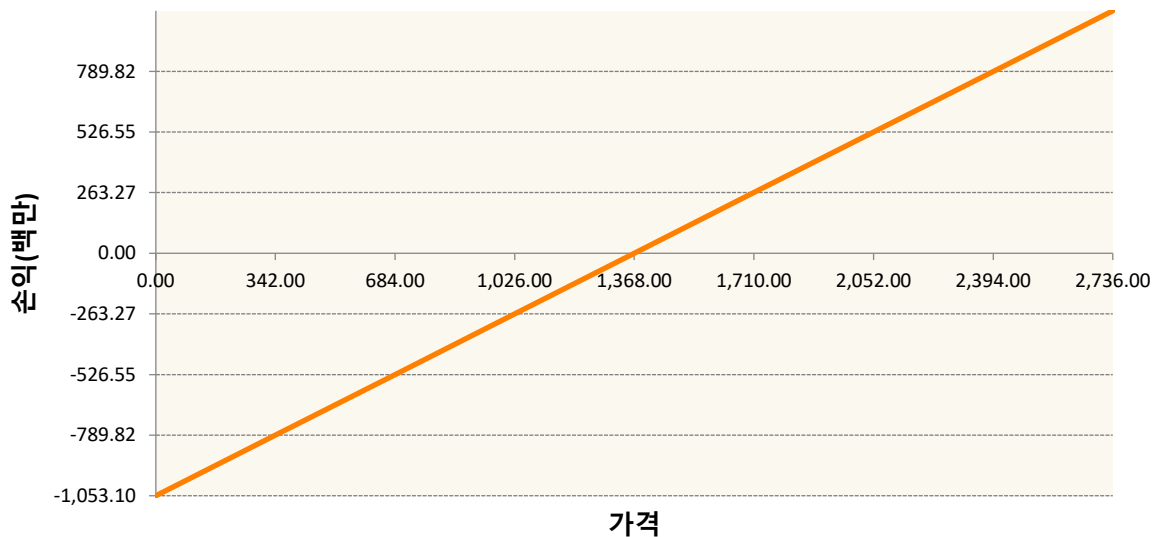
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



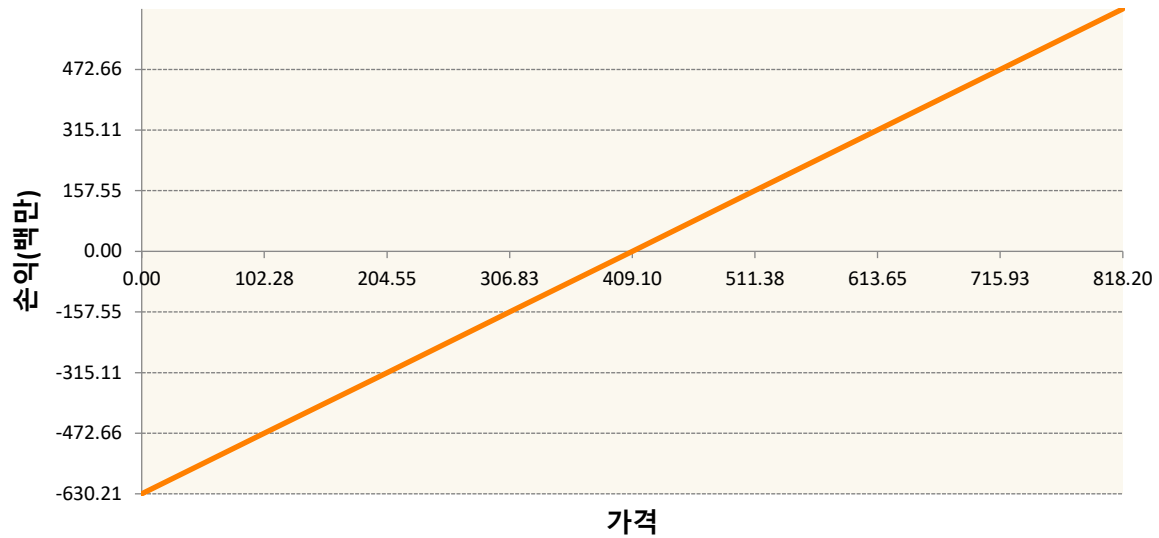
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



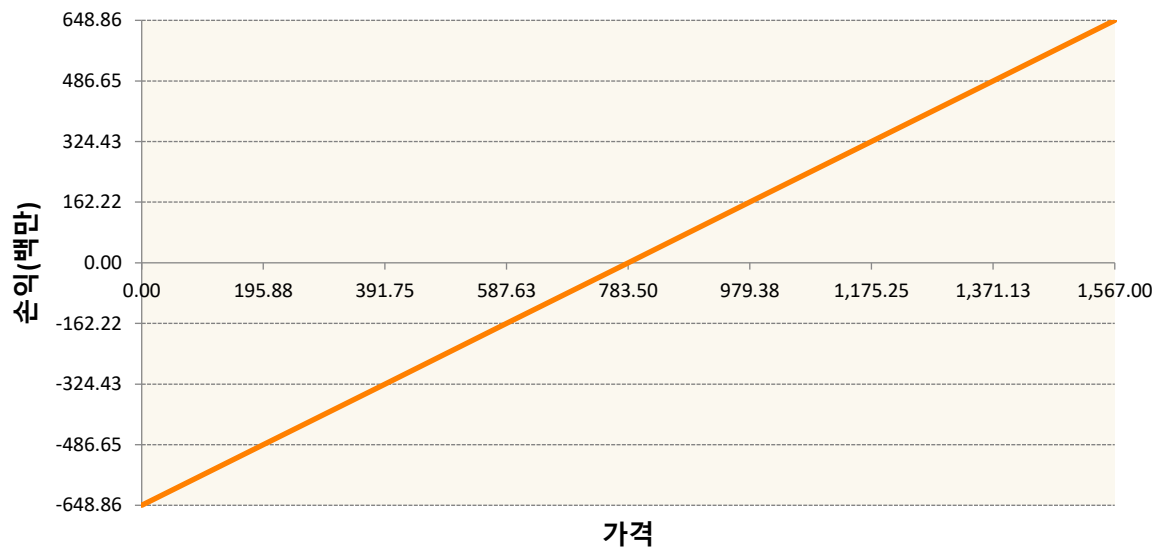
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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	2021-12-30
기준일	2021-12-29

스마트인덱스모

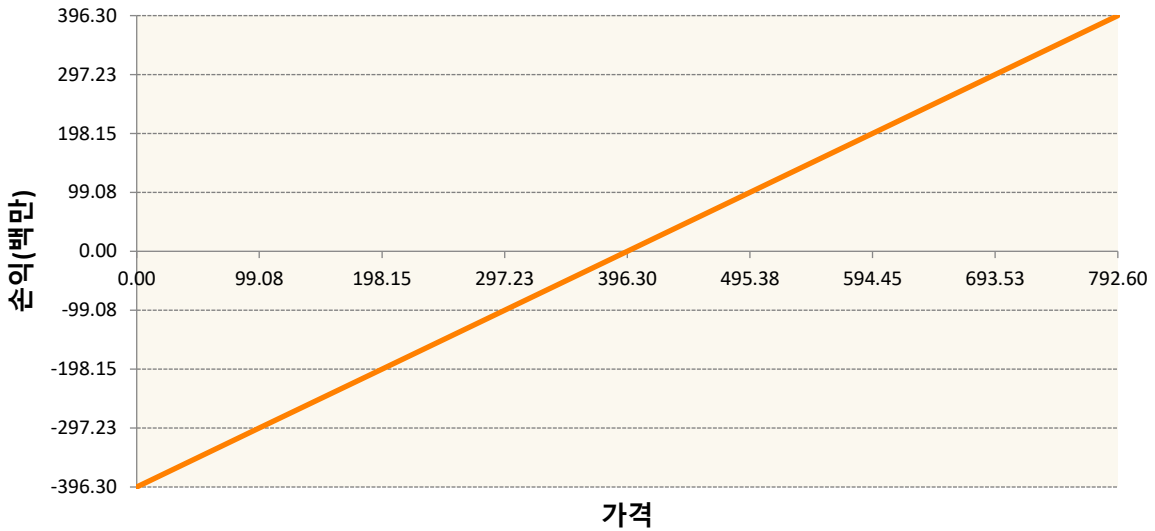
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	396	0	396	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	2021-12-30
기준일	2021-12-29

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

930

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

563

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-30
기준일	2021-12-29

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	5,505	0	5,505	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래211213

437

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

417

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2021-12-30
기준일	2021-12-29

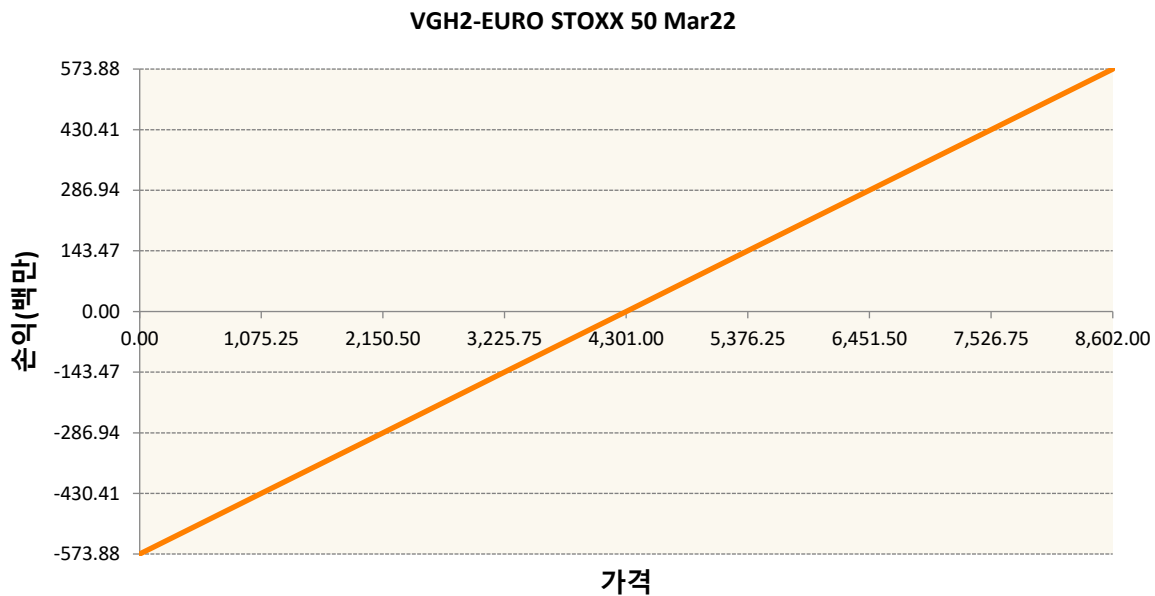
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	574	0	574	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VG2 EURO STOXX 50 Mar22

46

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

(단위:백만원)

41

공시일	2021-12-30
기준일	2021-12-29

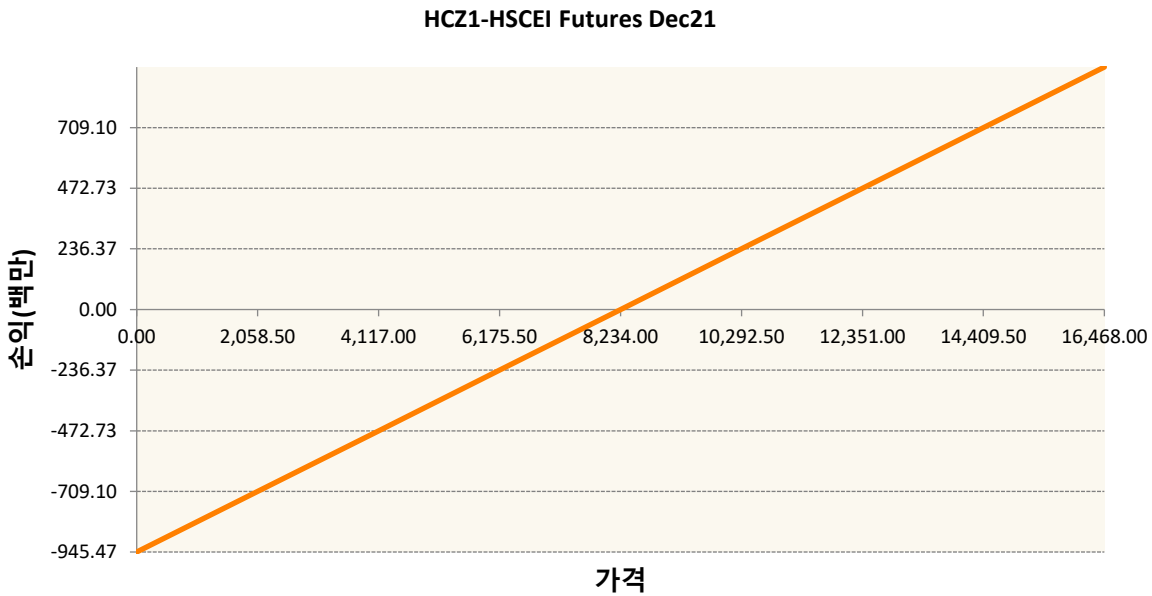
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	945	0	945	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ1	HSCEI Futures Dec21	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

78

공시일 2021-12-30
기준일 2021-12-29

커버드콜모(주식혼합-파생형)

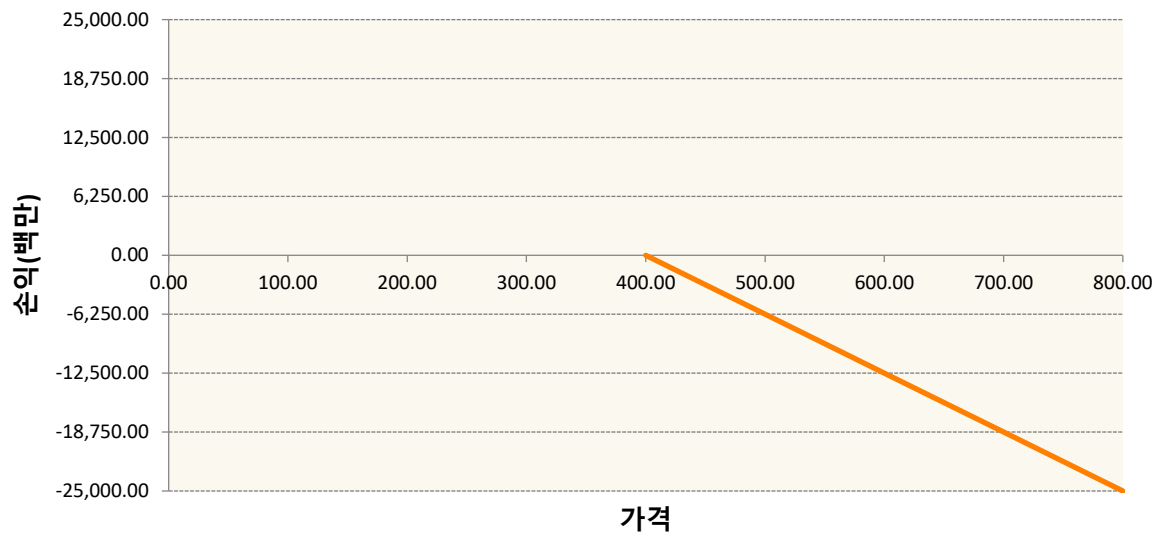
1. 계약금액

(단위:백만원)

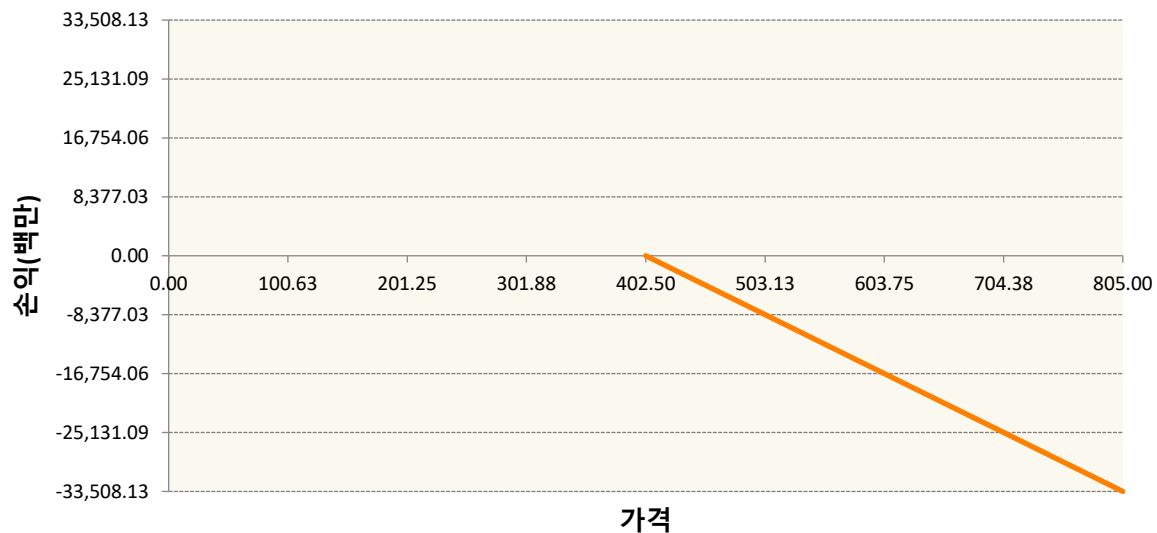
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

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 ranges from 0.00 to 800.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from -17,500.00 to 17,500.00. A blue line represents the profit function, starting at (0, -17,500) and ending at (400, 0). This indicates that the profit is zero when the price is 400.

가격 (Price)	이익 (Profit 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 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				1,474
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	435	430	424	415	403	389	373	
-5.33%	413	399	381	360	337	311	284	
-2.67%	334	302	269	234	197	160	122	
0%	132	88	44	0	-44	-89	-133	
2.67%	-232	-274	-317	-360	-403	-447	-490	
5.33%	-745	-773	-803	-836	-870	-906	-943	
8.00%	-1,350	-1,363	-1,379	-1,399	-1,422	-1,446	-1,474	
KR4201S14029				2022-01 콜402.5				1,876
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	497	493	486	476	464	448	429
-5.33%	477	461	441	417	390	360	326
-2.67%	395	358	318	275	230	183	135
0%	171	115	58	0	-58	-116	-175
2.67%	-262	-321	-380	-439	-499	-558	-618
5.33%	-903	-946	-991	-1,039	-1,088	-1,140	-1,192
8.00%	-1,686	-1,708	-1,734	-1,765	-1,799	-1,836	-1,876

KR4301S14001

2022-01 풋400

1,212

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,206	-1,207	-1,207	-1,207	-1,208	-1,210	-1,212
-5.33%	-745	-747	-750	-753	-758	-764	-771
-2.67%	-301	-311	-321	-333	-346	-360	-374
0%	60	40	20	0	-20	-40	-61
2.67%	258	241	223	205	186	167	148
5.33%	320	313	305	295	285	273	260
8.00%	330	328	326	323	319	314	308

KR4301S14027

2022-01 풋402.5

143

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-142	-142	-142	-142	-143	-143	-143
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-91	-91	-92
-2.67%	-38	-39	-40	-41	-42	-44	-45
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	34	31	29	27	25	22	20
5.33%	44	43	41	40	39	37	35
8.00%	45	45	45	44	44	43	42

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

(단위:백만원)

4,806

공시일 2021-12-30

기준일 2021-12-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

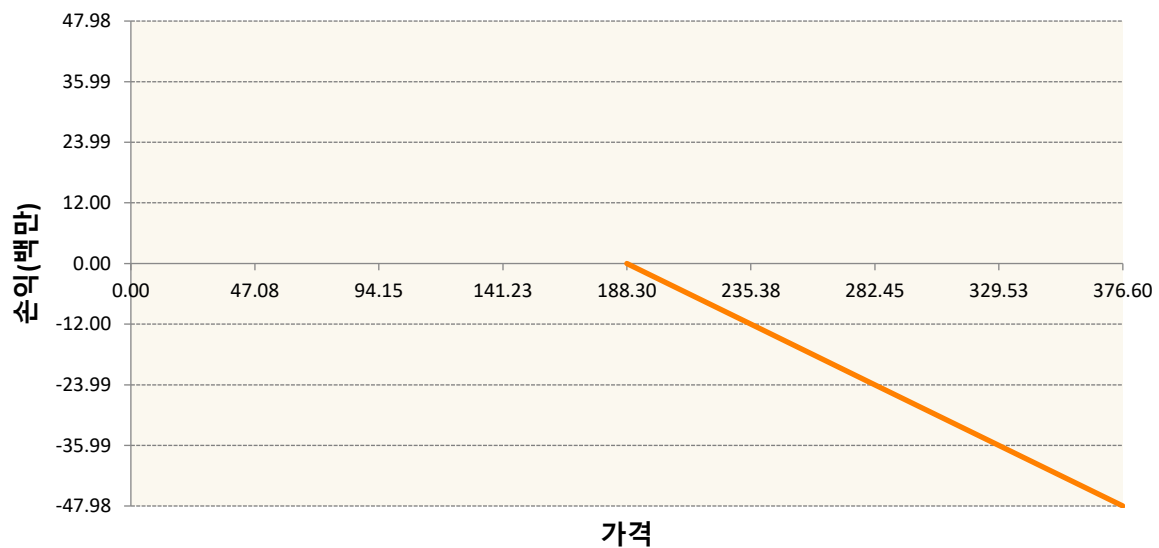
1. 계약금액

(단위:백만원)

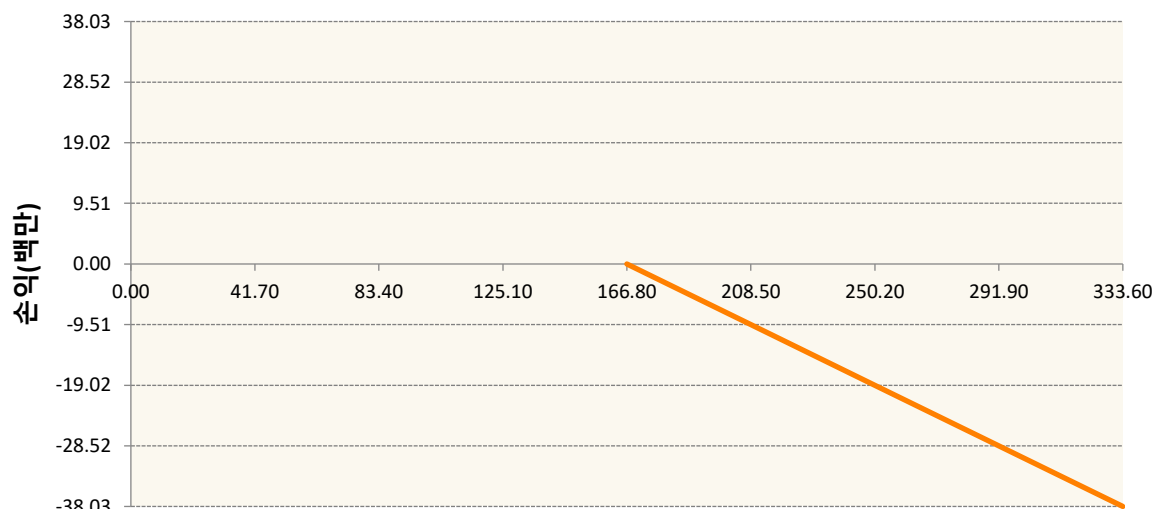
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	99	-99	장내
누계	통화	선도	0	2,012	-2,012	장외

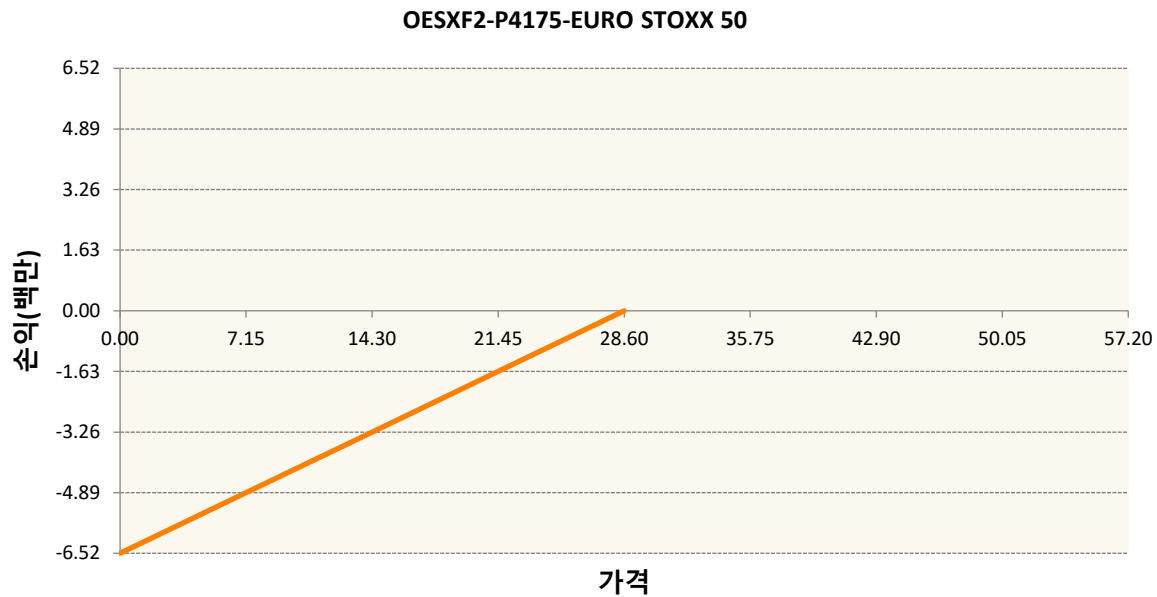
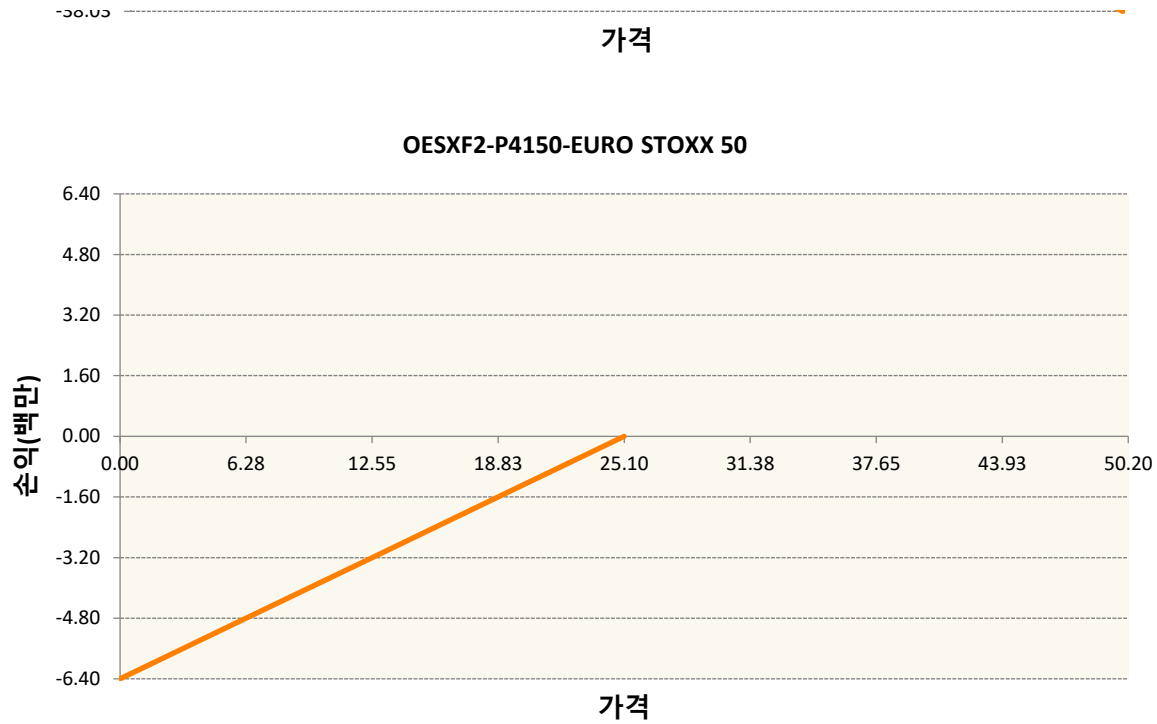
2. 만기시점의 손익구조

OESXF2-C4150-EURO STOXX 50



OESXF2-C4175-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213BCF-KRW/EUR 17-03-22E
 FXW213BCF-KRW/EUR 17-02-22E
 OESXF2-C41 EURO STOXX 50
 OESXF2-C41 EURO STOXX 50
 OESXF2-P41 EURO STOXX 50
 OESXF2-P41 EURO STOXX 50

3
54
107
4
3
1
1

공시일 2021-12-30

기준일 2021-12-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

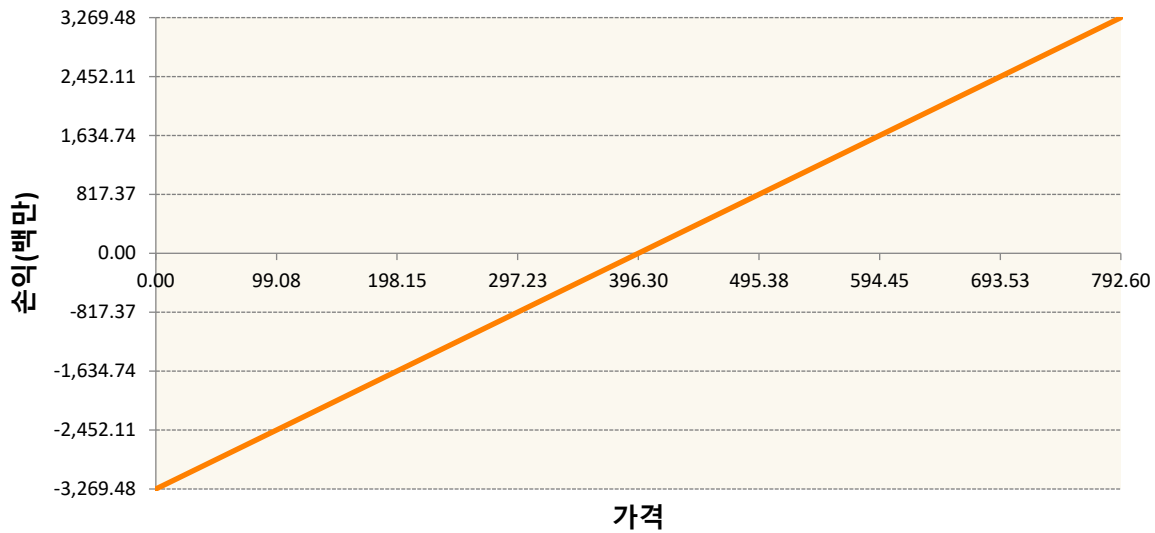
1. 계약금액

(단위:백만원)

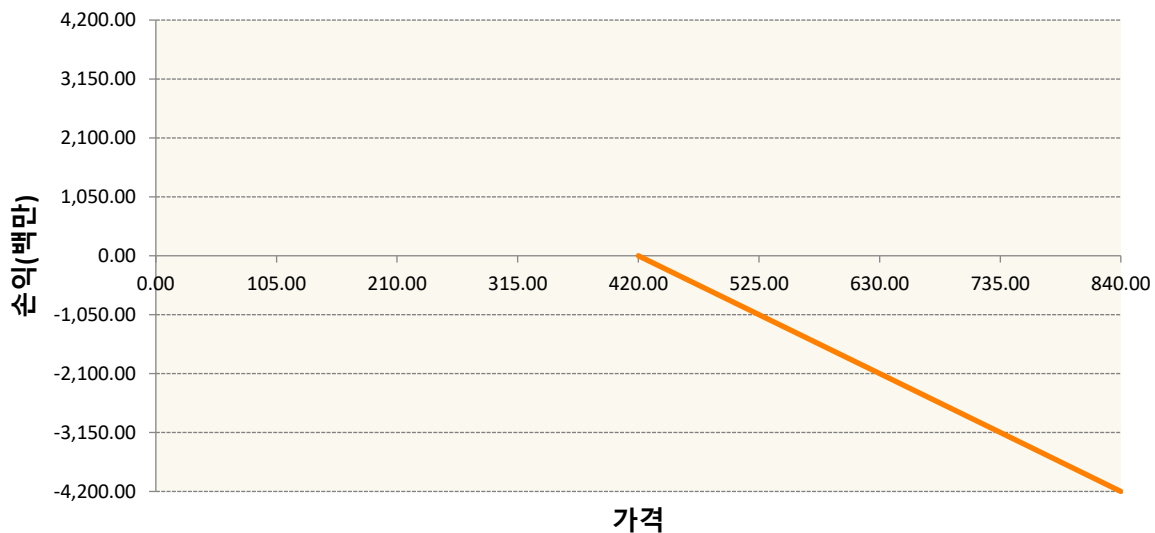
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,269	0	3,269	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

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					262
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-262	-262	-262	-262	-262	-262	-262
-5.33%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175
-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%	175	175	175	175	175	175	175
8.00%	262	262	262	262	262	262	262
KR4201S14201		2022-01 콜420					144
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	16	16	16	15	15
-5.33%	16	16	16	15	14	13	11
-2.67%	15	14	13	11	9	6	3
0%	11	8	4	0	-4	-9	-14
2.67%	-5	-11	-17	-23	-29	-36	-43
5.33%	-41	-48	-56	-63	-71	-78	-86
8.00%	-102	-109	-116	-123	-130	-137	-144

KR4201S14250

2022-01 콜425

37

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	3	2	2	1	0
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-1	-2	-3	-5	-7	-9	-10
5.33%	-8	-10	-12	-15	-17	-19	-21
8.00%	-23	-25	-27	-30	-32	-34	-37

KR4301S14001

2022-01 풋400

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

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

(단위:백만원)

405

공시일	2021-12-30
기준일	2021-12-29

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	16,889	0	16,889	

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	2021-12-30
기준일	2021-12-29

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	9,614	0	9,614	

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	2021-12-30
기준일	2021-12-29

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	45,128	0	45,128	
누계	통화	선도	0	27,883	-27,883	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E

2,231

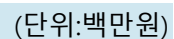
4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

740

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

KR4101S30001-2022-03 코스피|200지수선물

KR410IS30001			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 2021-12-30

기준일 2021-12-29

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

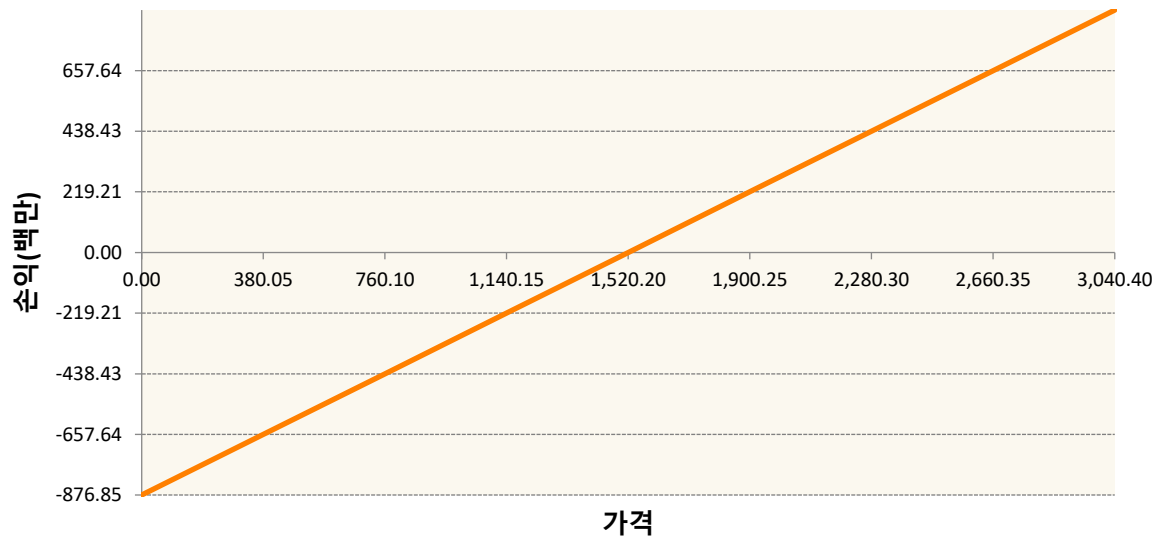
1. 계약금액

(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	877	0	877	
누계	유가증권	스왑	1,791	0	1,791	장외
누계	통화	선도	0	1,113	-1,113	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCF2-VN30 Index Future Jan22



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
FXW213BCN KRW/EUR 18-03-22E	43
VNCF2 VN30 Index Future Jan22	70

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

(단위:백만원)

262

공시일 2021-12-30
기준일 2021-12-29

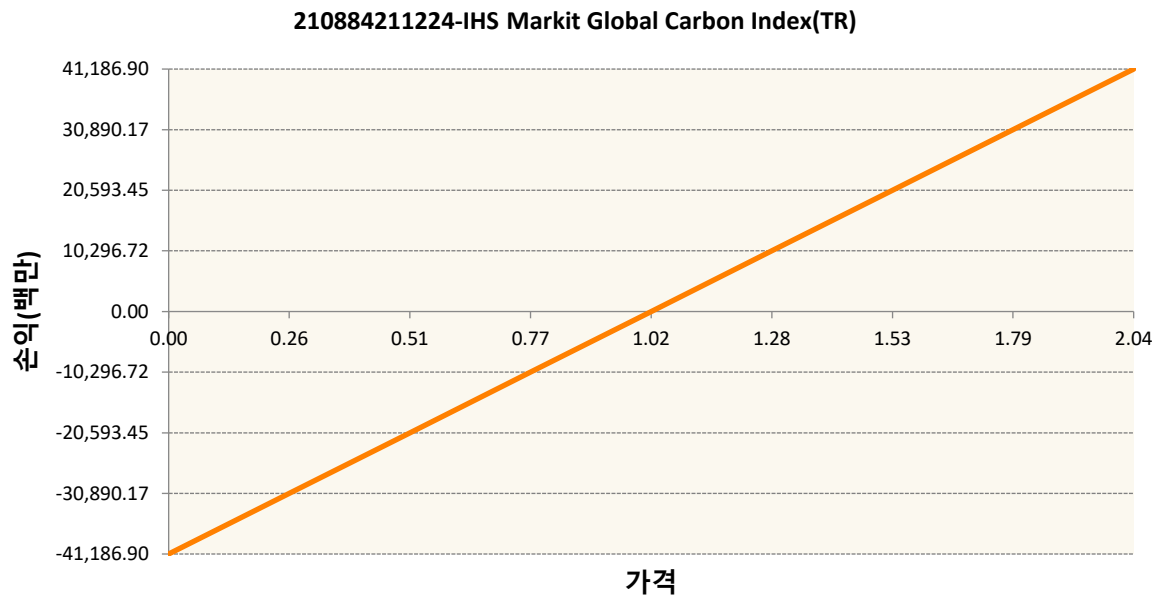
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	41,187	0	41,187	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)

3,308

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

(단위:백만원)

5,299

공시일 2021-12-30

기준일 2021-12-29

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

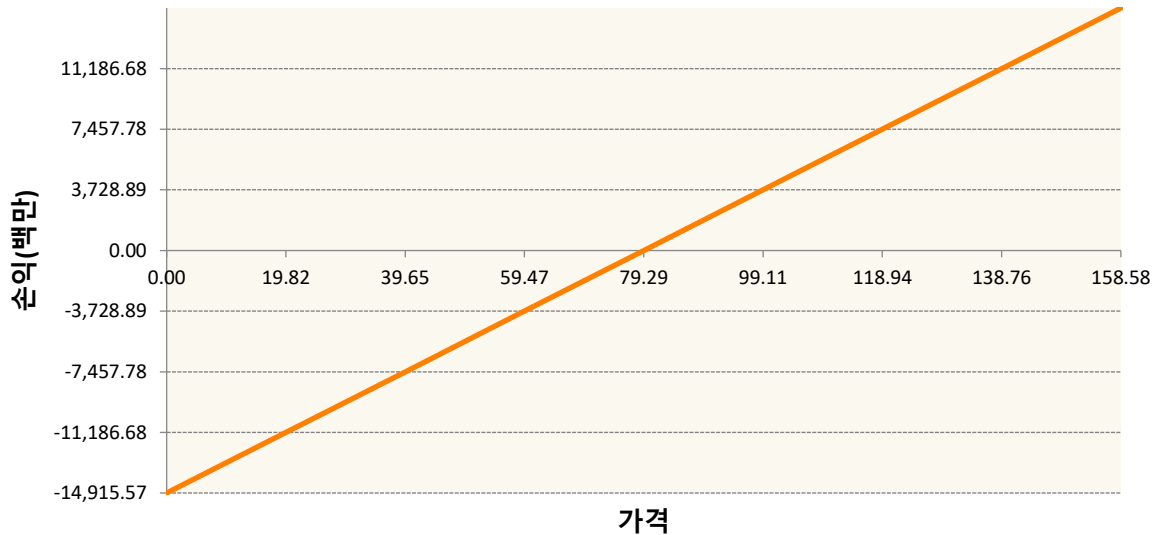
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	14,916	0	14,916	
누계	통화	선도	0	6,060	-6,060	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCV·KRW/EUR 28-01-22E

485

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,193

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

(단위:백만원)

2,789

공시일	2021-12-30
기준일	2021-12-29

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)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	3

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

(단위:백만원)

24

공시일 2021-12-30

기준일 2021-12-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

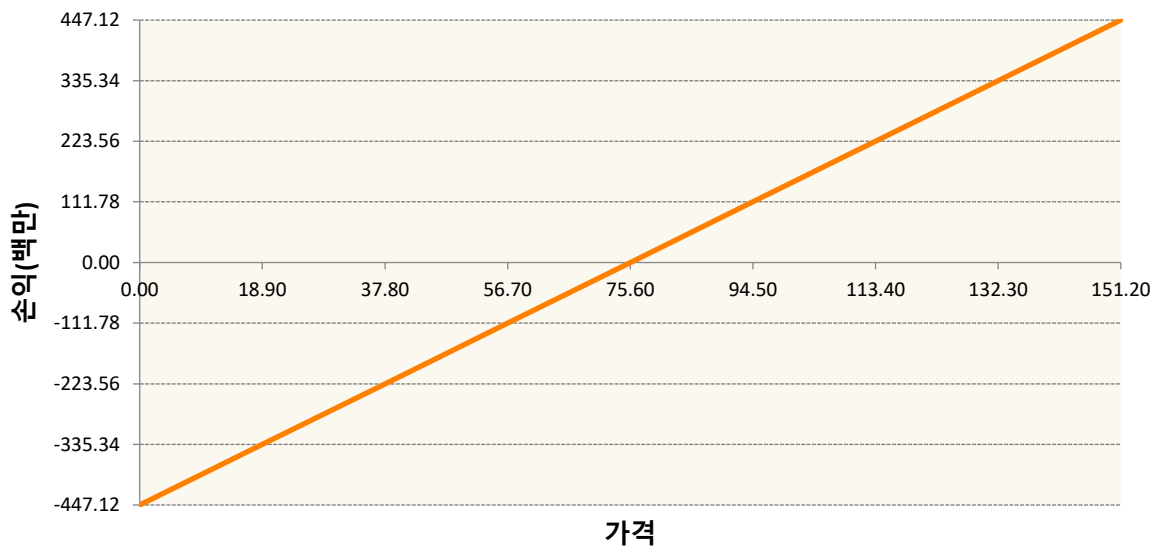
1. 계약금액

(단위:백만원)

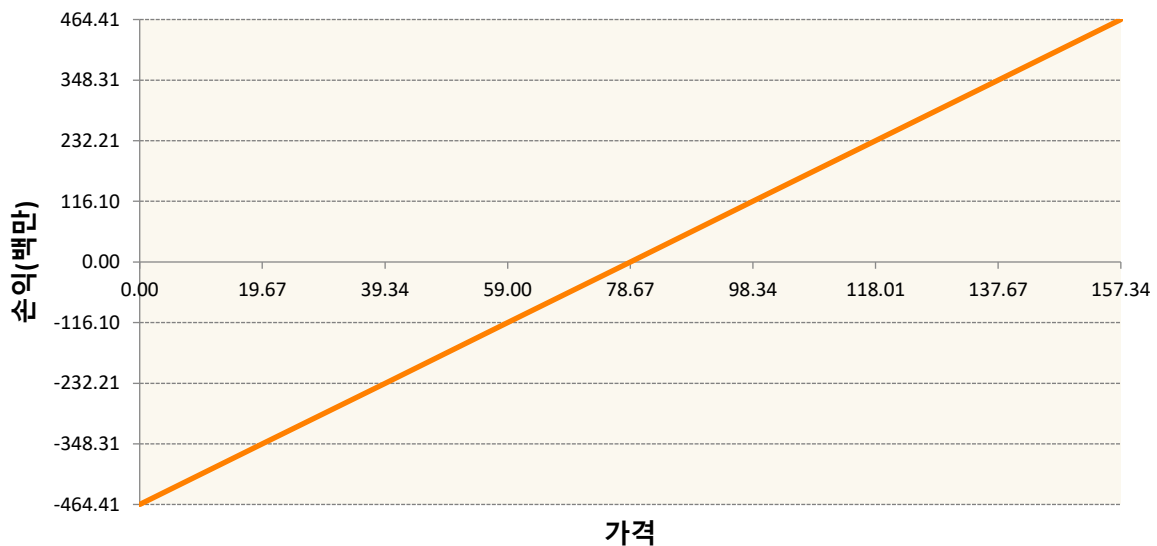
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,942	356	1,586	

2. 만기시점의 손익구조

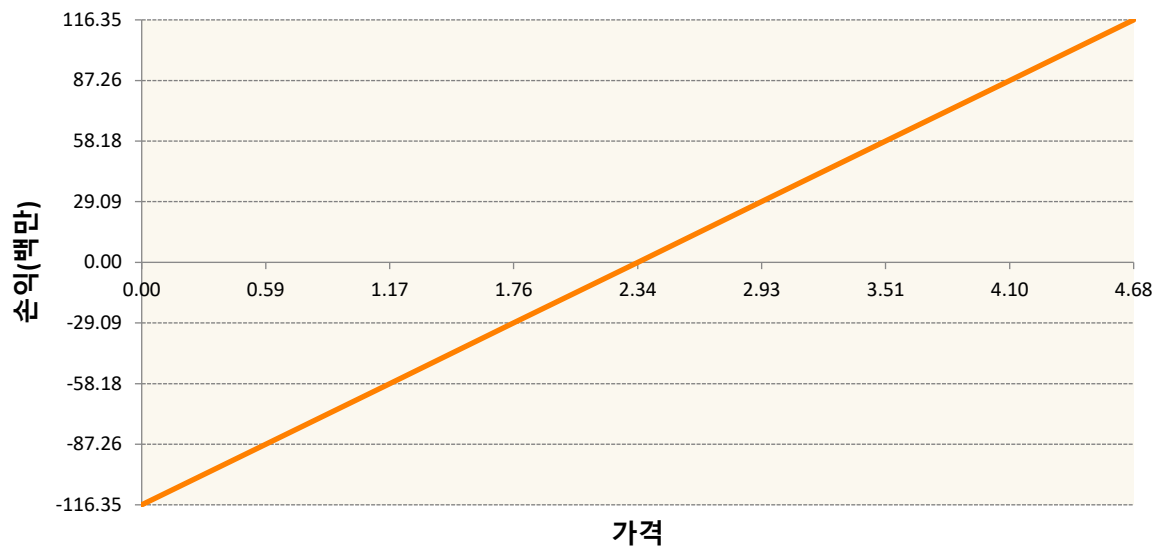
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



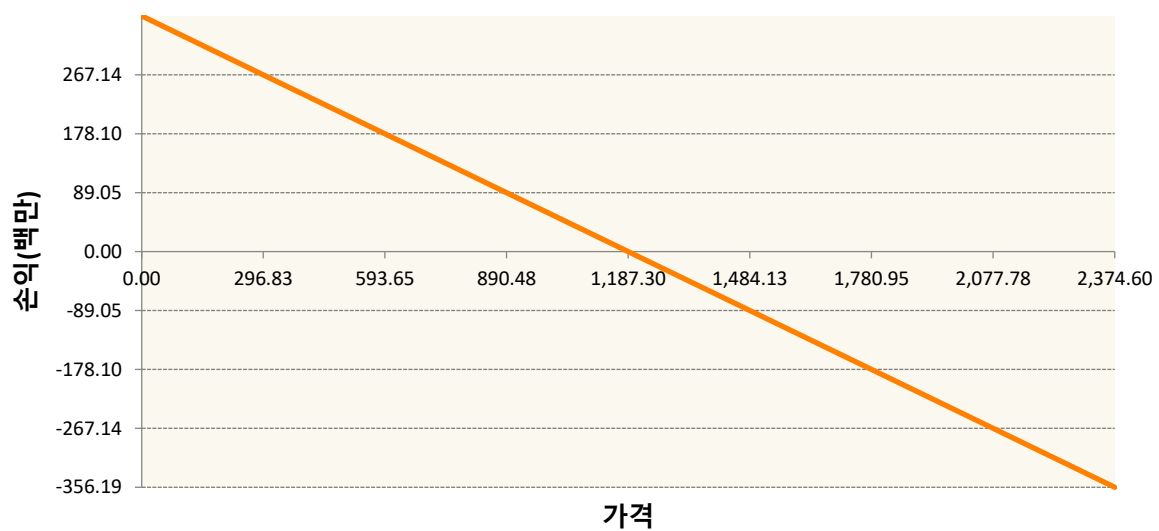
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



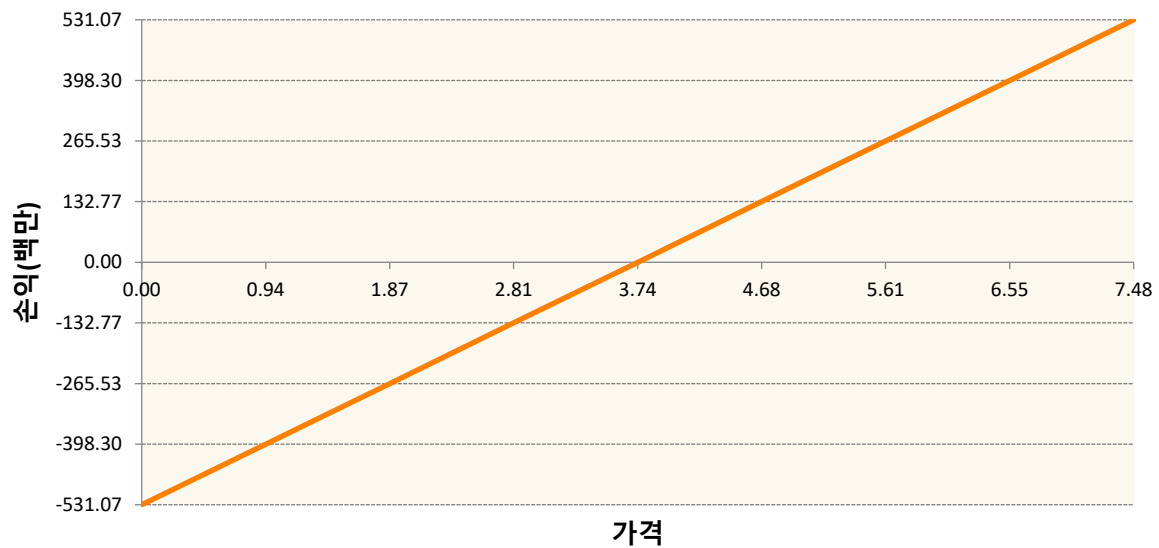
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

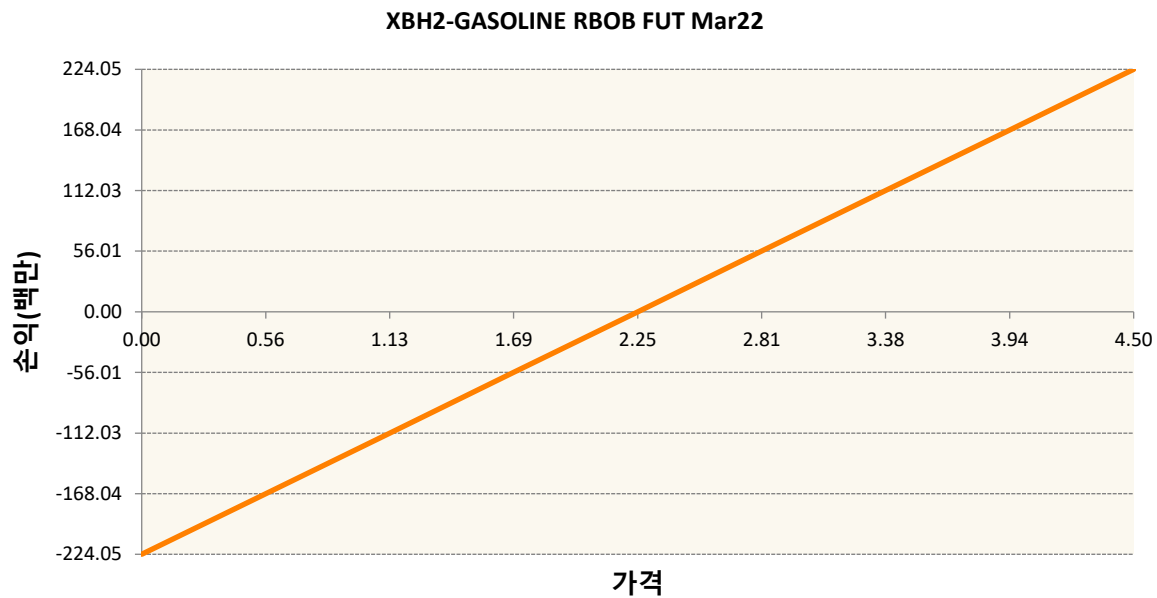
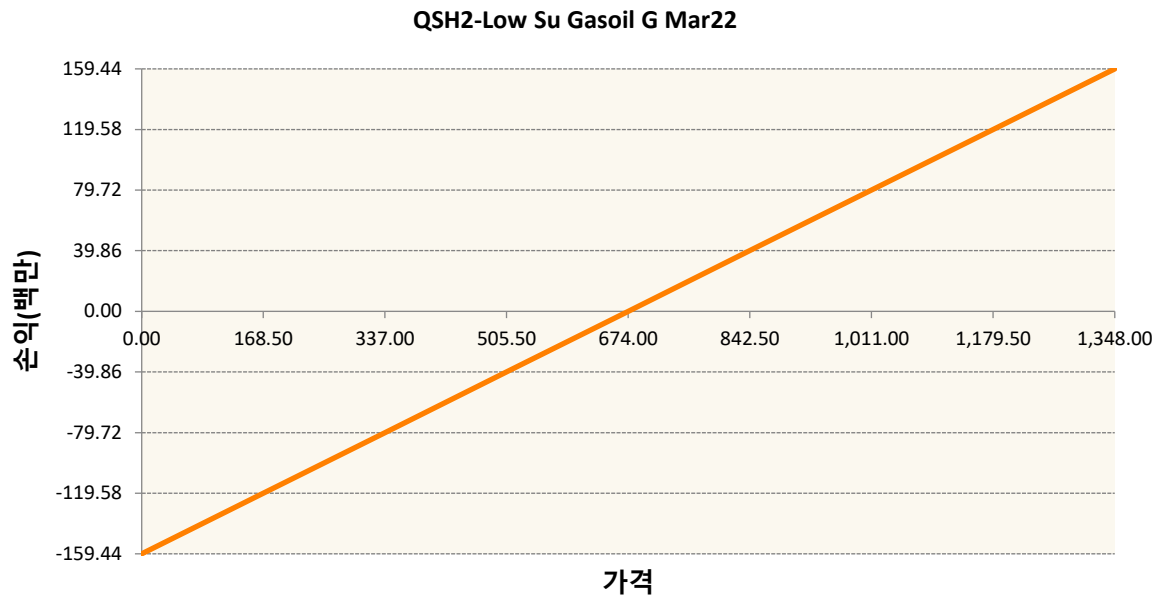


KR4175S10007-2022-01 달러선물



NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22		36
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22		37
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22		9
KR4175S100	2022-01 달러선물		28
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22		42
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22		13
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22		18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		351

