

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

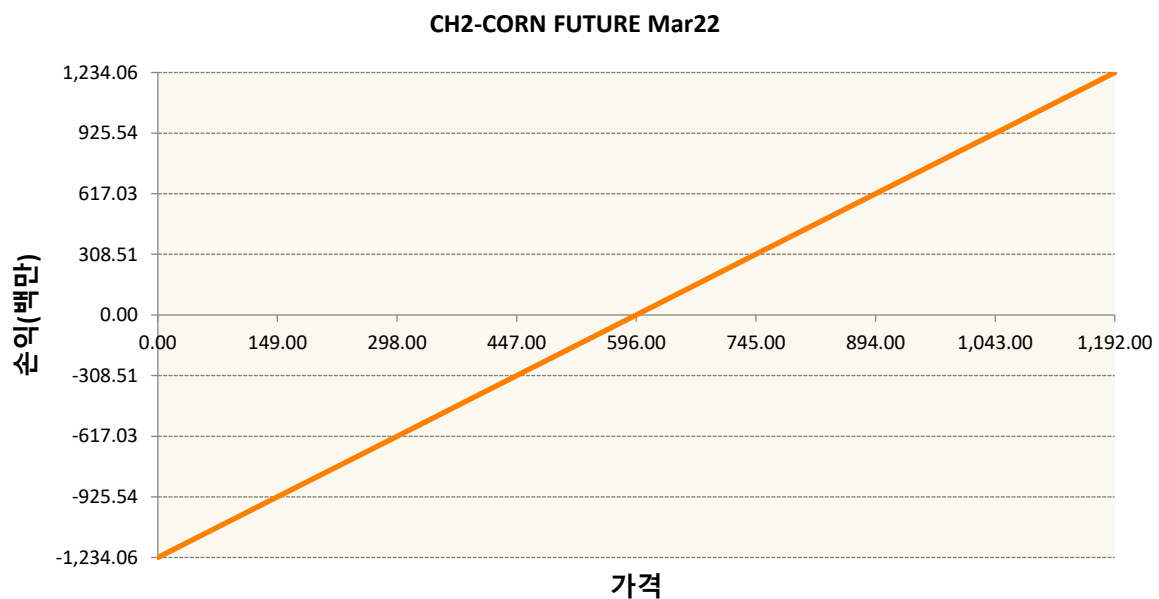
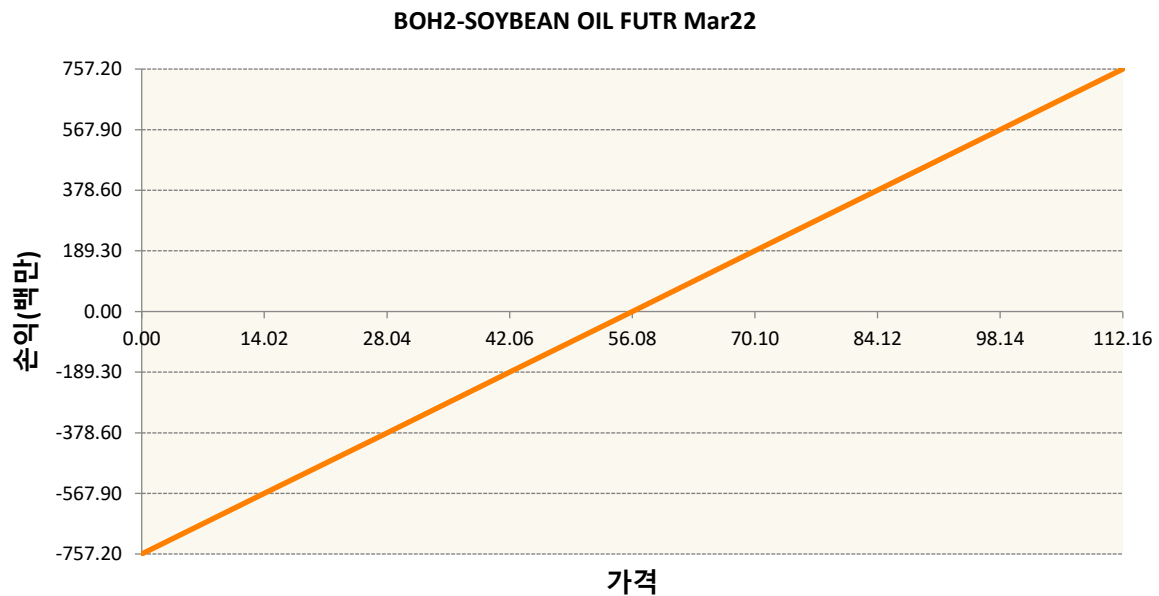
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

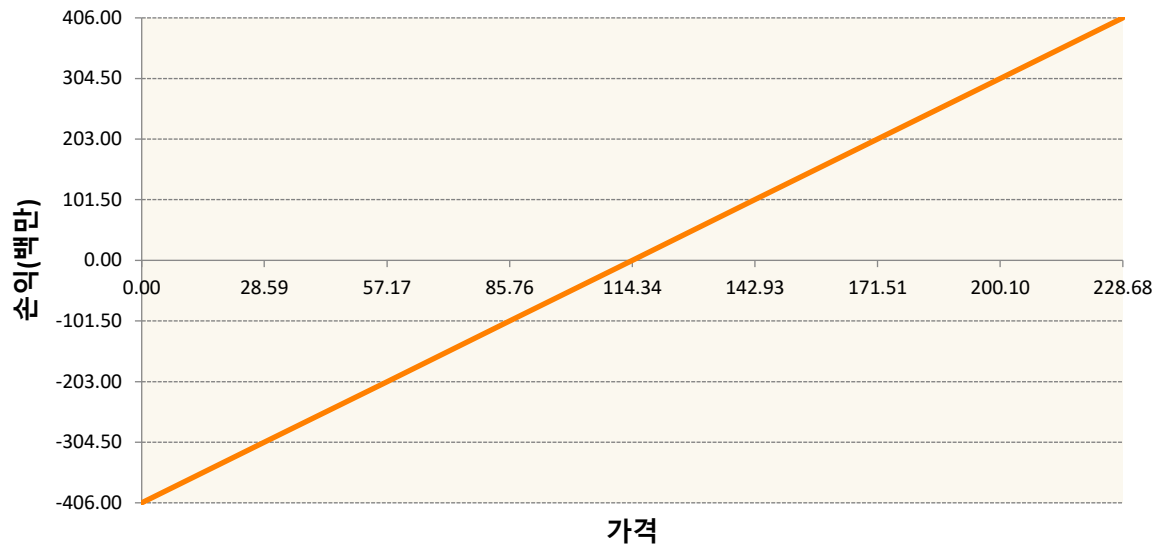
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,637	774	5,863	

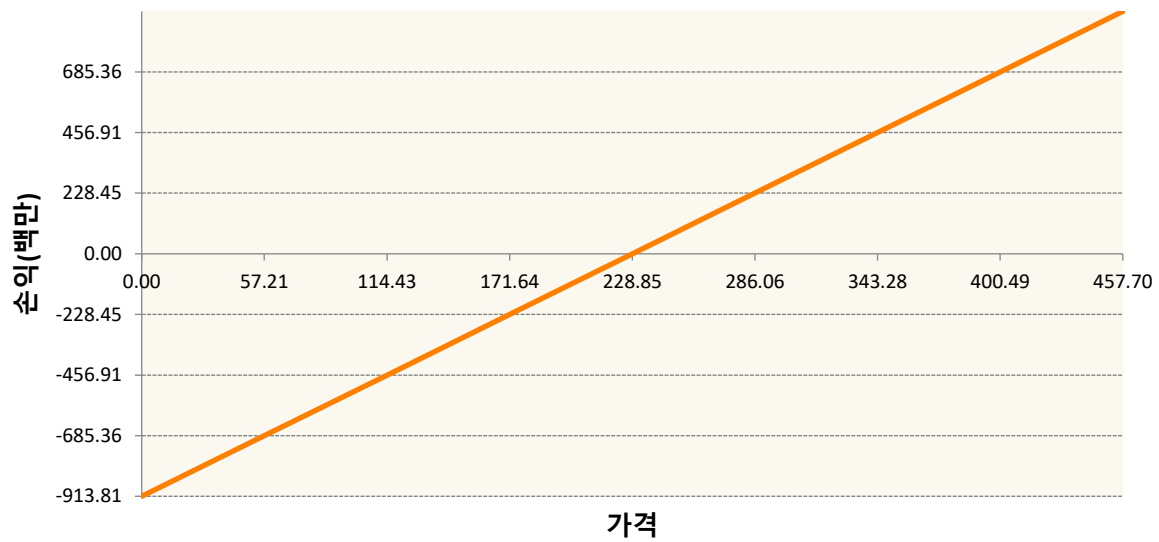
2. 만기시점의 손익구조



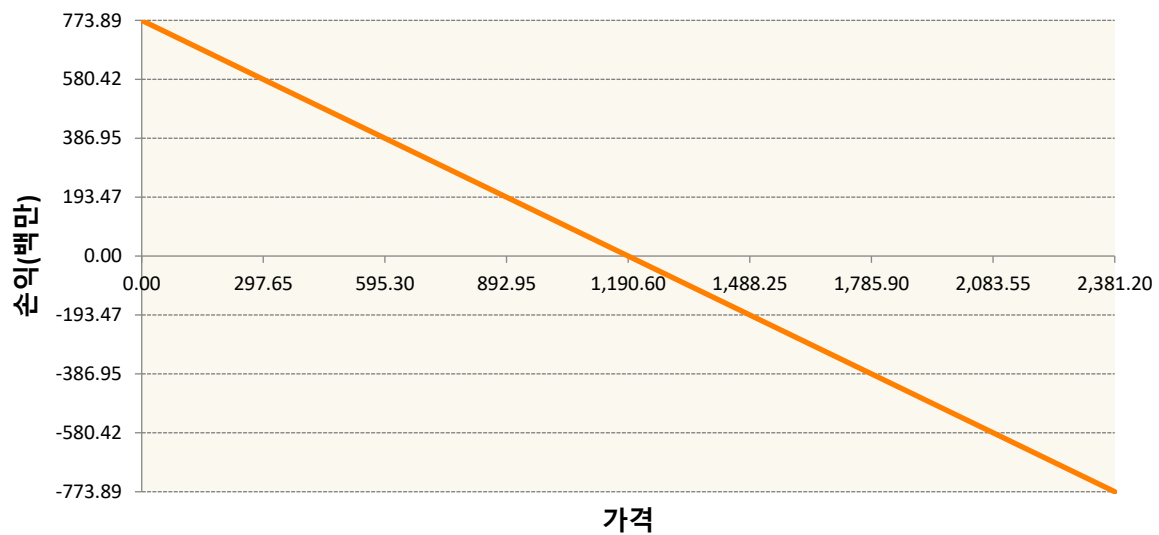
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



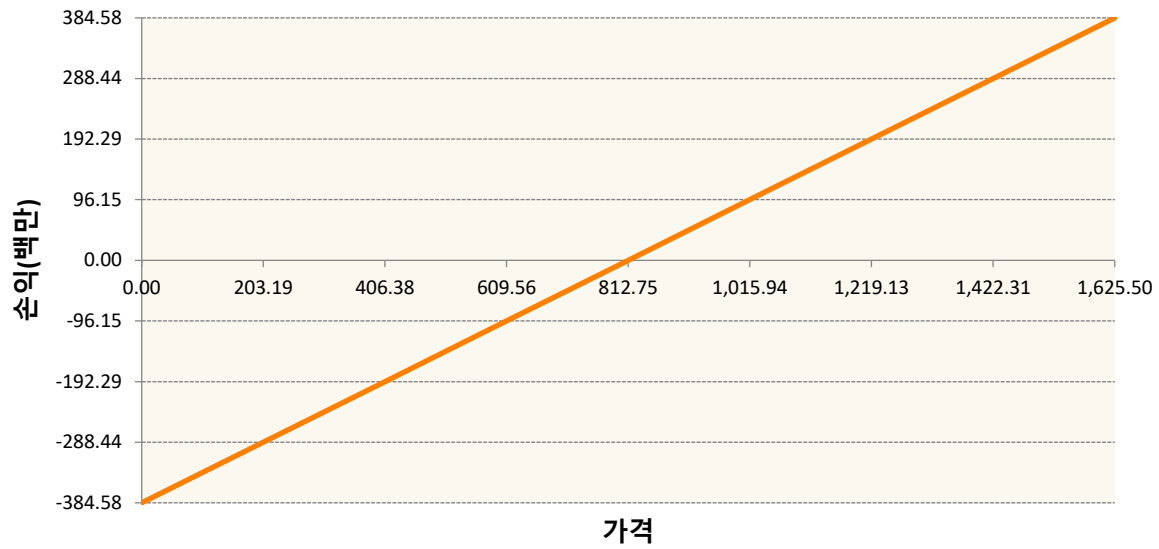
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



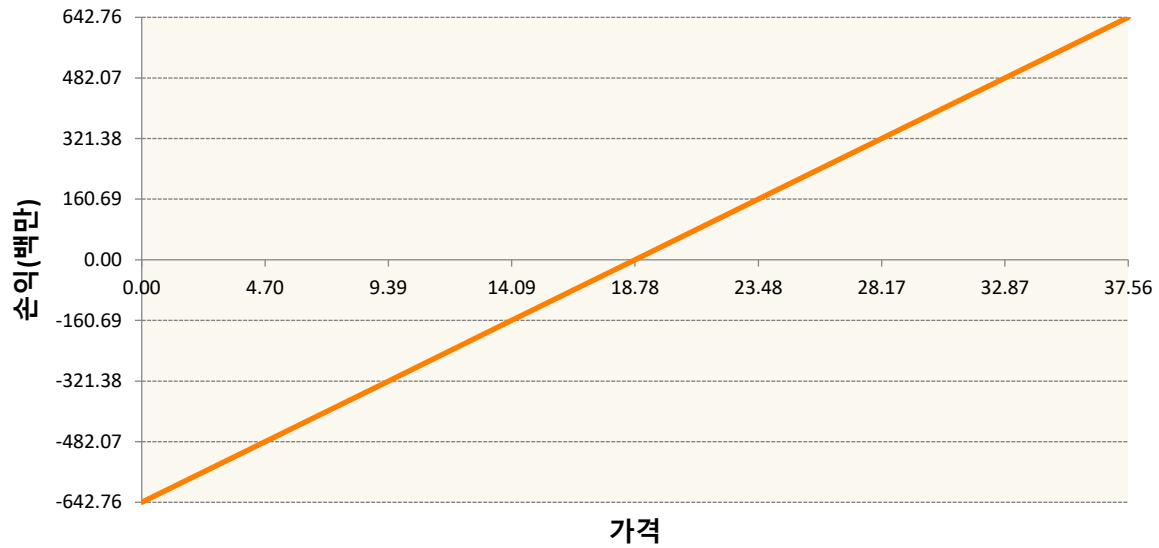
KR4175S10007-2022-01 달러선물



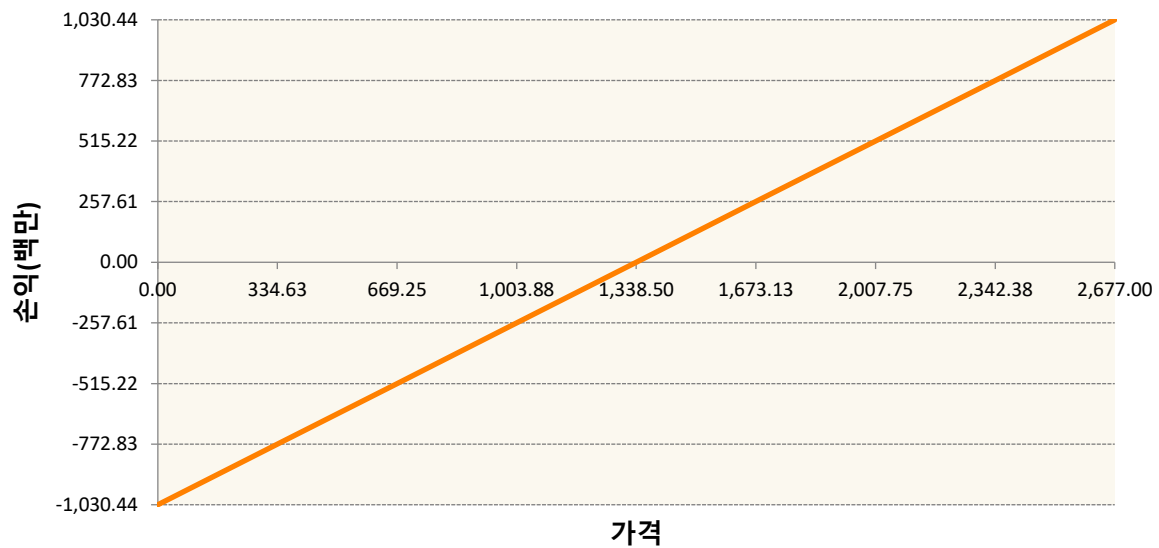
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



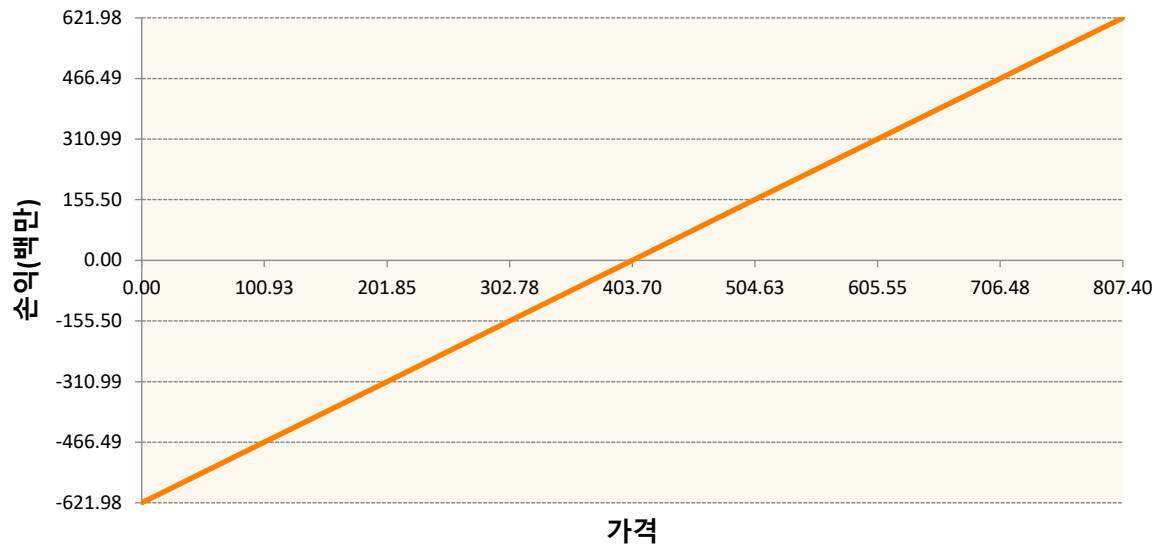
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



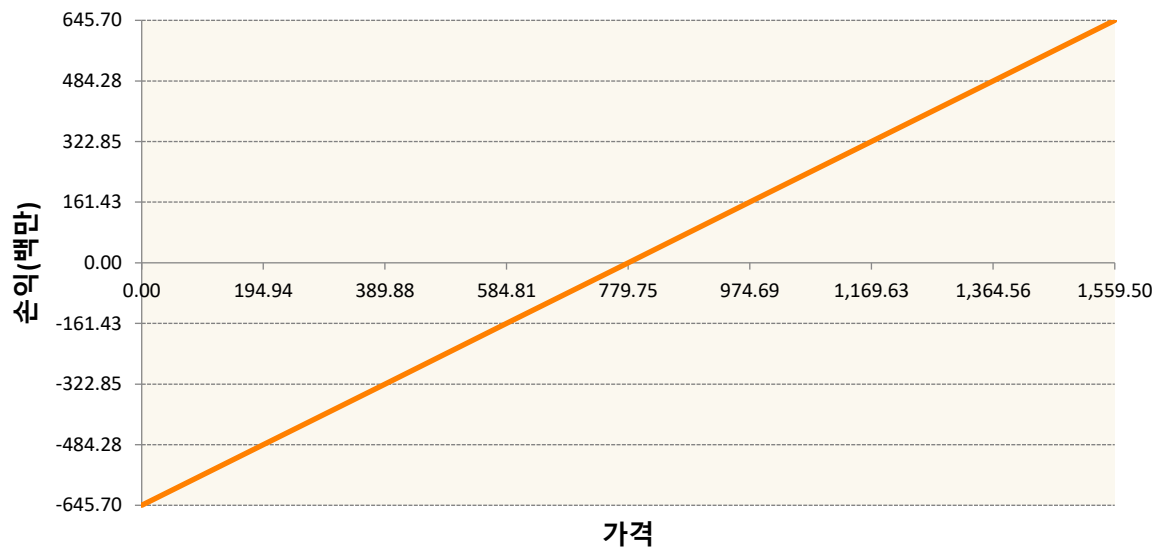
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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	2022-01-03
기준일	2021-12-31

스마트인덱스모

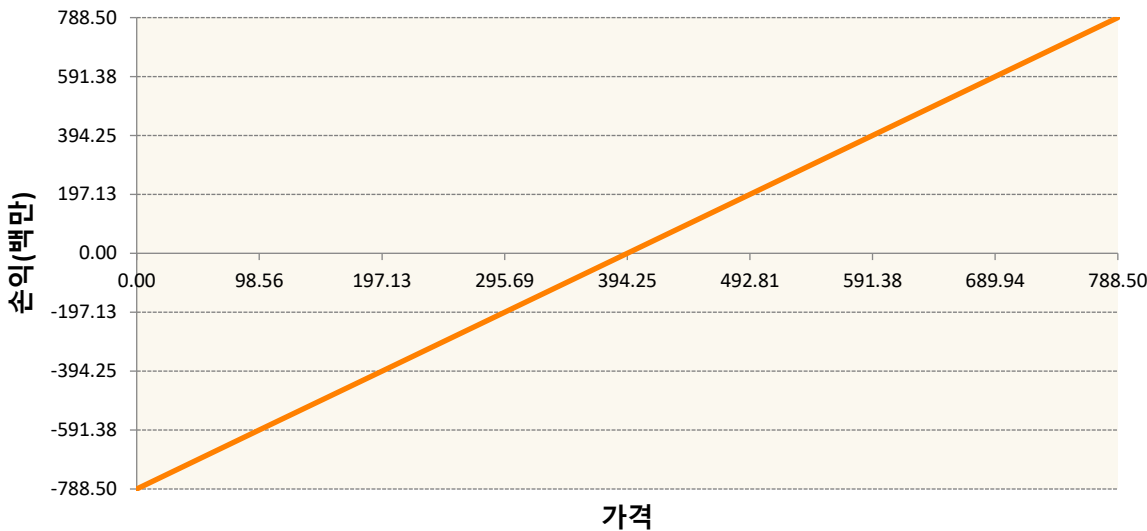
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	789	0	789	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	63	63	63	63	63	63	63

공시일	2022-01-03
기준일	2021-12-31

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

931

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

564

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-01-03
기준일	2021-12-31

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

435

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

414

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

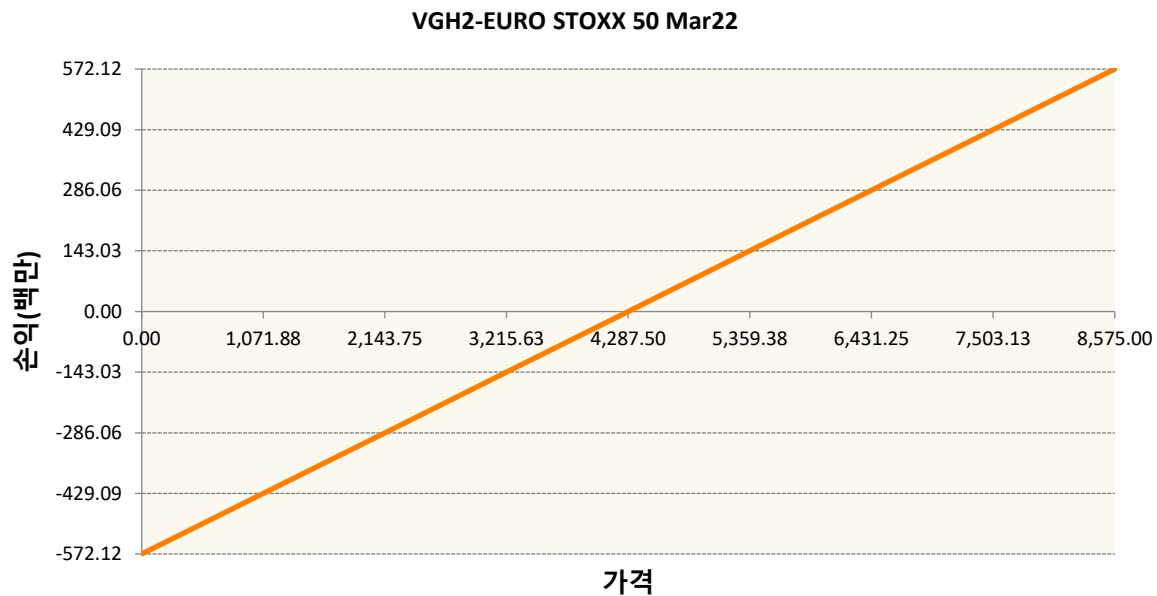
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	572	0	572	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2 EURO STOXX 50 Mar22

46

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

(단위:백만원)

41

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

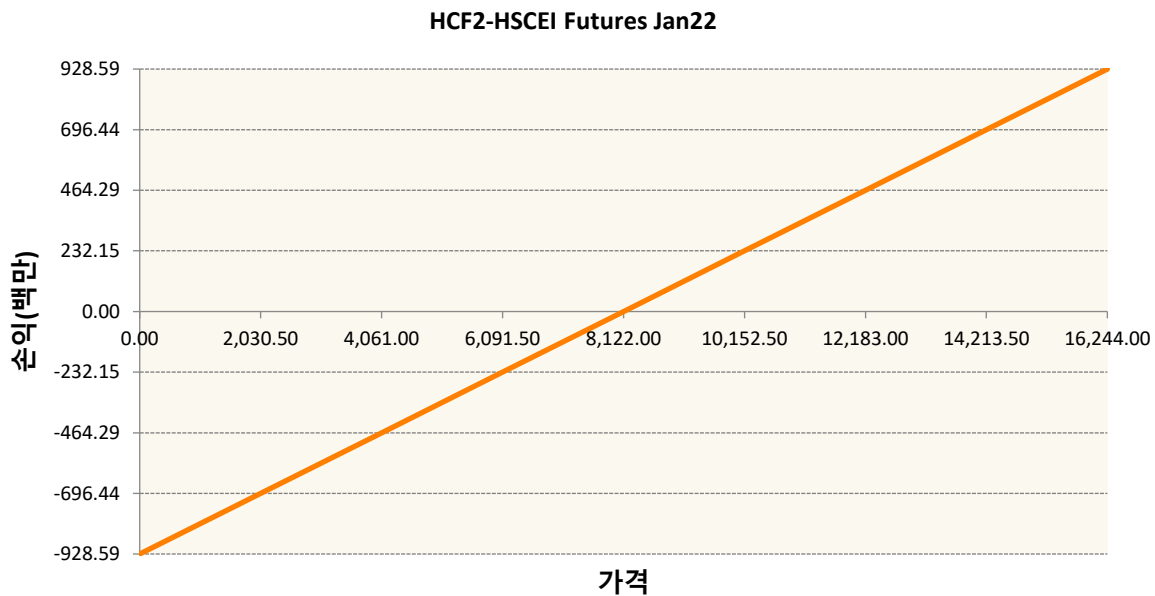
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	929	0	929	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF2	HSCEI Futures Jan22	74
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

76

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

커버드콜모(주식혼합-파생형)

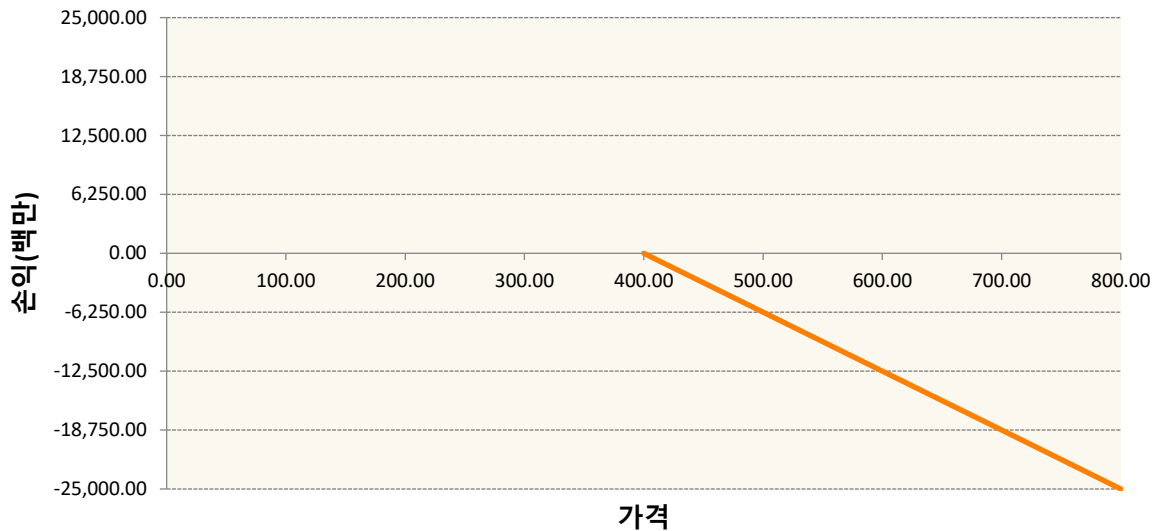
1. 계약금액

(단위:백만원)

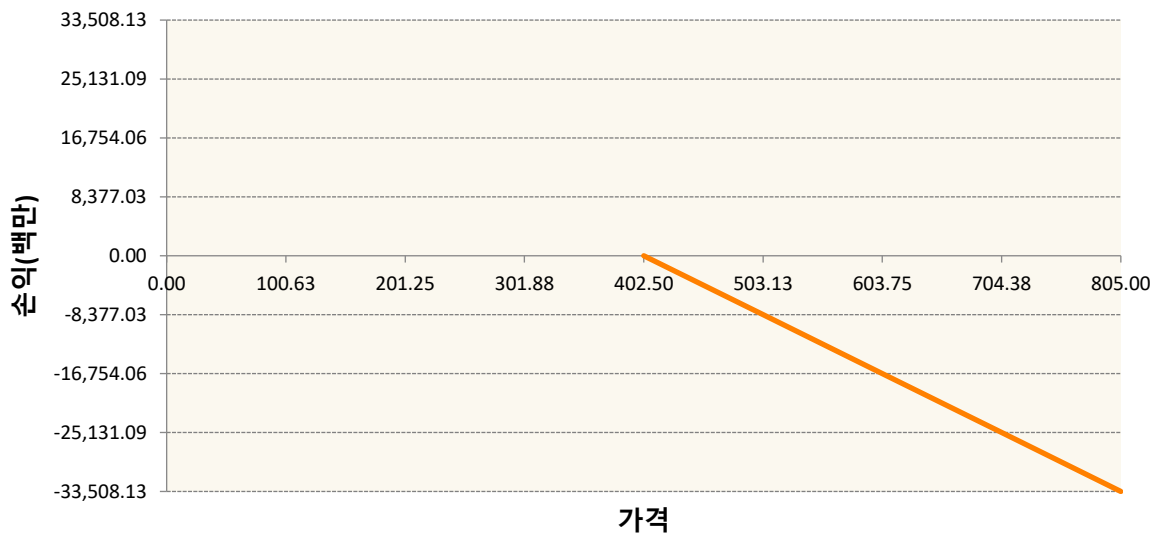
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201S14003-2022-01 콜400



KR4201S14029-2022-01 콜402.5



The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순익). The x-axis represents the price in millions of won, ranging from 0.00 to 800.00. The y-axis represents the net income in millions of won, ranging from -17,500.00 to 17,500.00. The line starts at a price of 0.00 with a net income of -17,500.00 and reaches a net income of 0.00 at a price of 400.00.

가액 (Price)	순익 (Net Income)
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 relationship between the price (가액) and the net income (순익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 805.00. The y-axis represents the net income, ranging from -2,012.50 to 2,012.50. The orange line shows that the net income is negative for prices below 402.50 and becomes zero at a price of 402.50.

가액 (Price)	순익 (백만) (Net Income)
0.00	-2,012.50
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003						2022-01 콜400		1,407
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	338	336	333	328	321	311	300	
-5.33%	328	319	307	292	275	256	235	
-2.67%	276	252	226	197	167	136	103	
0%	118	79	40	0	-40	-80	-121	
2.67%	-206	-246	-287	-328	-369	-410	-452	
5.33%	-694	-722	-752	-783	-817	-851	-886	
8.00%	-1,289	-1,301	-1,317	-1,336	-1,358	-1,381	-1,407	
KR4201S14029						2022-01 콜402.5		1,778
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	378	376	373	367	360	350	337
-5.33%	368	359	347	331	311	289	264
-2.67%	318	291	260	227	190	152	112
0%	149	101	51	0	-51	-103	-156
2.67%	-226	-282	-338	-394	-450	-506	-563
5.33%	-829	-871	-916	-962	-1,010	-1,060	-1,110
8.00%	-1,595	-1,616	-1,642	-1,672	-1,704	-1,740	-1,778
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,257

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,255	-1,255	-1,255	-1,256	-1,256	-1,257	-1,257
-5.33%	-796	-797	-798	-799	-802	-805	-809
-2.67%	-344	-349	-356	-364	-373	-383	-394
0%	50	34	17	0	-17	-35	-53
2.67%	288	270	252	234	216	198	179
5.33%	365	358	349	339	329	317	304
8.00%	376	375	373	370	367	362	356

KR4301S14027 2022-01 풋402.5							147
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-96
-2.67%	-43	-43	-43	-44	-45	-46	-47
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	37	35	33	31	28	26	24
5.33%	49	48	47	46	44	43	41
8.00%	52	52	51	51	50	49	49

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

(단위:백만원)

4,702

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

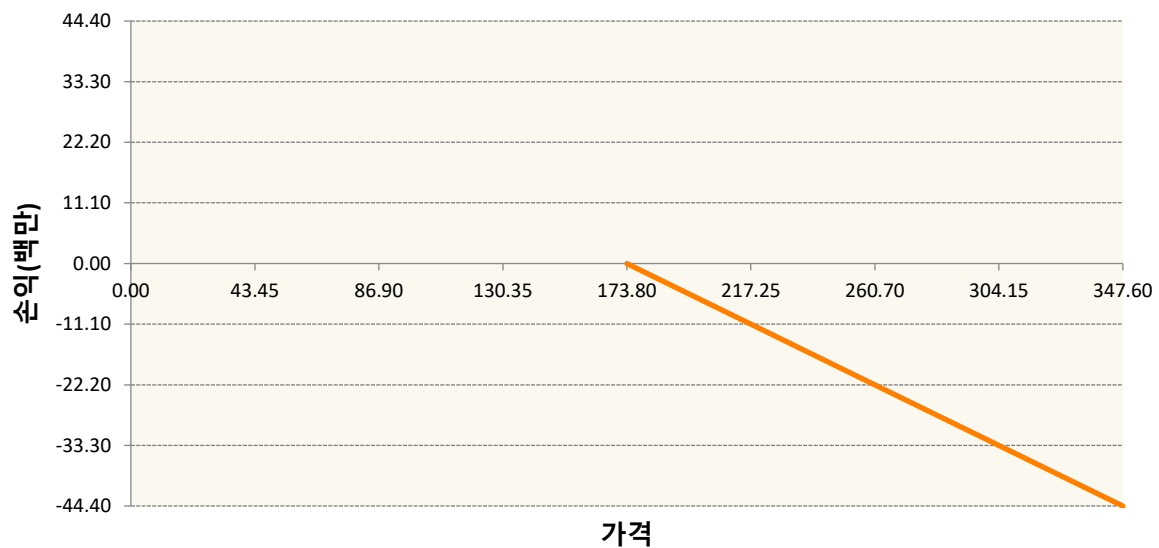
1. 계약금액

(단위:백만원)

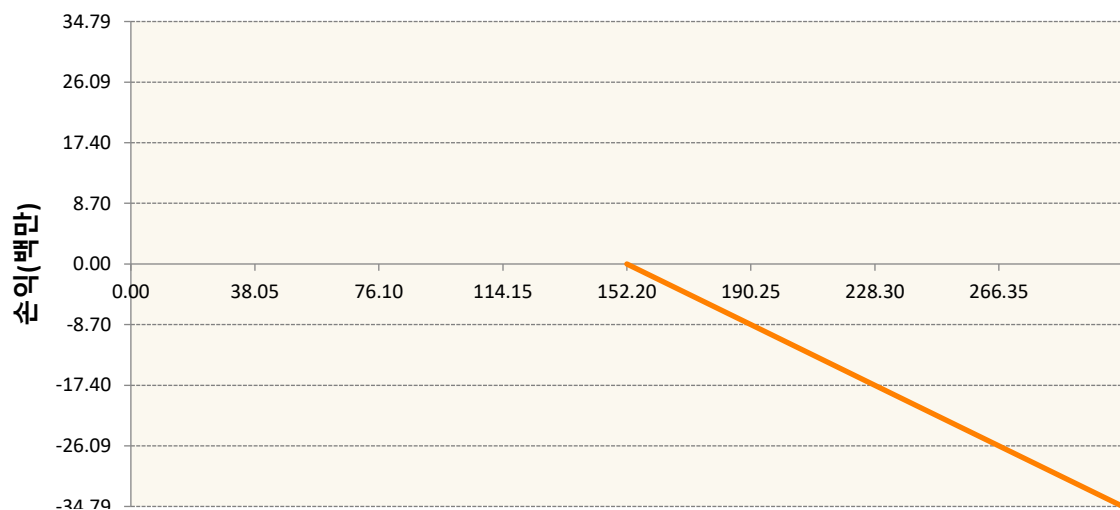
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	92	-92	장내
누계	통화	선도	0	2,017	-2,017	장외

2. 만기시점의 손익구조

OESXF2-C4150-EURO STOXX 50

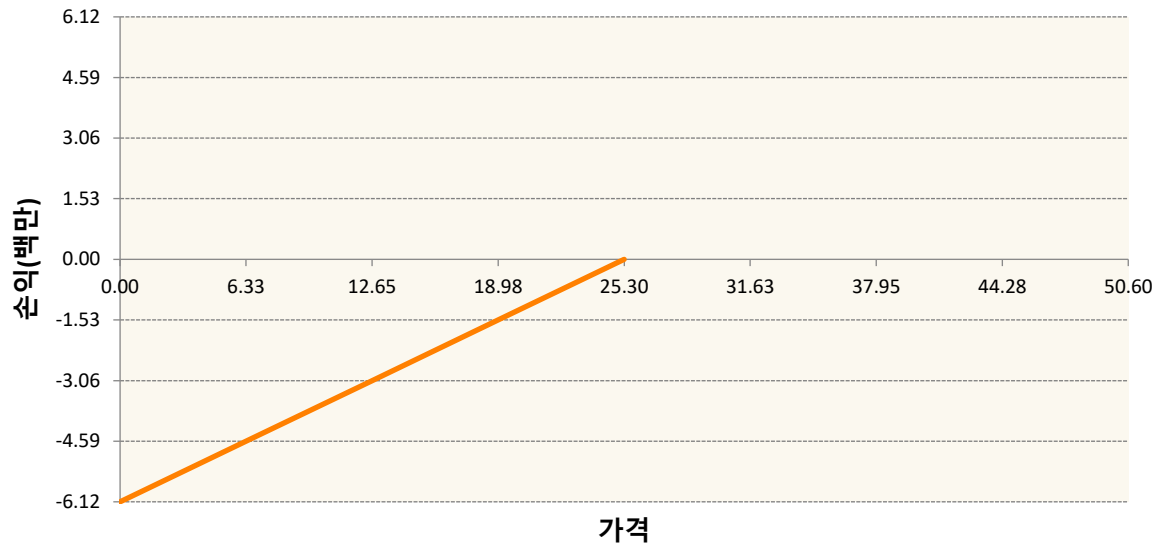


OESXF2-C4175-EURO STOXX 50

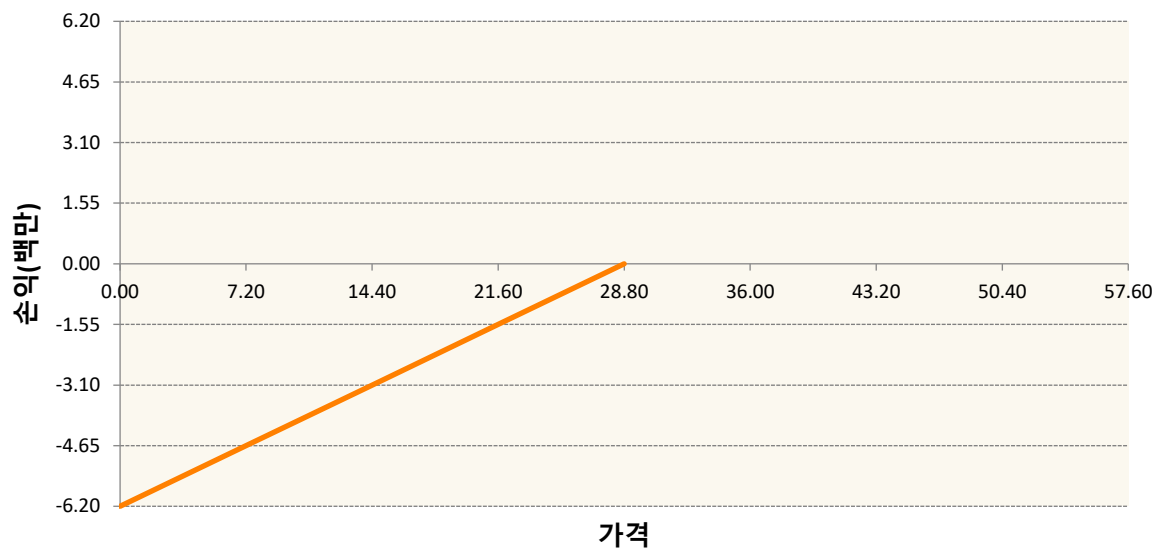


가격

OESXF2-P4150-EURO STOXX 50



OESXF2-P4175-EURO STOXX 50



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY

3

FXW213BCF-KRW/EUR 17-03-22E

54

FXW213BCF-KRW/EUR 17-02-22E

108

OESXF2-C41 EURO STOXX 50

4

OESXF2-C41 EURO STOXX 50

3

OESXF2-P41 EURO STOXX 50

0.49

OESXF2-P41 EURO STOXX 50

0.5

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

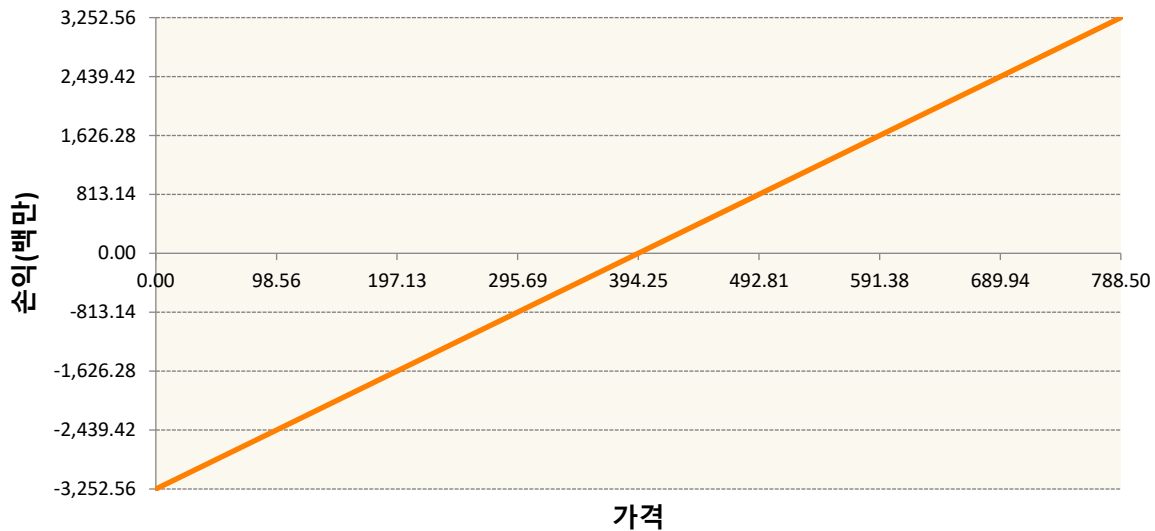
1. 계약금액

(단위:백만원)

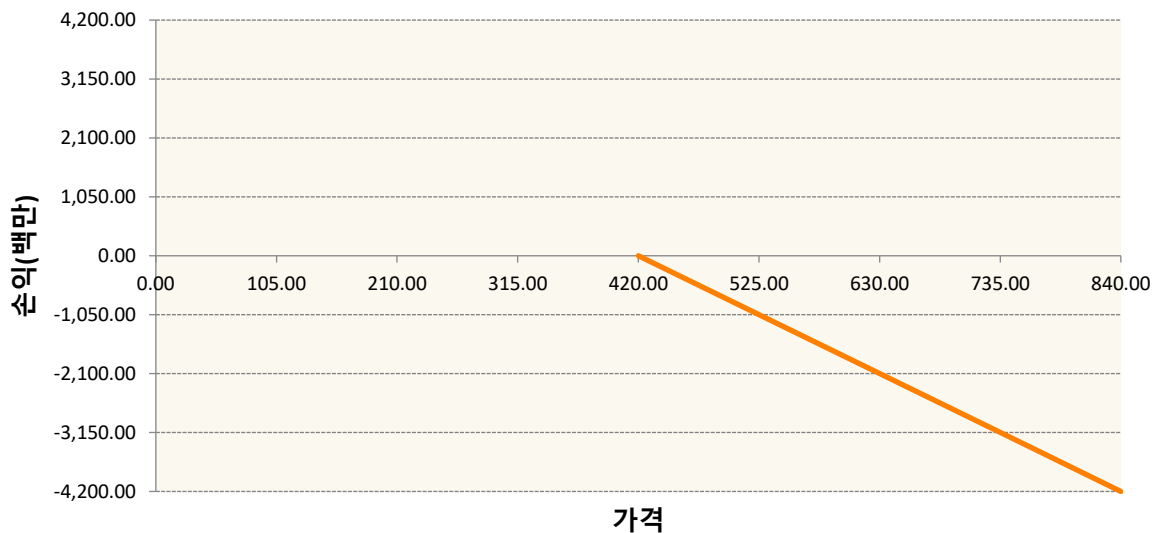
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,253	0	3,253	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S14201-2022-01 콜420



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 blue line represents the profit function, which starts at a price of 425.00 (where profit is 0) and decreases linearly as the price increases, reaching a profit of -1,275.00 at a price of 850.00.

가격 (Price)	이익 (Profit)
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					260
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
-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%	173	173	173	173	173	173	173
8.00%	260	260	260	260	260	260	260
KR4201S14201		2022-01 콜420					127
	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	10	9	8	7
-2.67%	10	9	9	7	6	4	2
0%	7	5	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-3	-8	-13	-18	-23	-29	-35
5.33%	-32	-39	-45	-52	-59	-66	-73
8.00%	-86	-93	-100	-107	-113	-120	-127
KR4201S14250 2022-01 콜425							31

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	1
-2.67%	2	2	2	1	1	1	0
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	-1	-2	-4	-5	-6	-8
5.33%	-6	-8	-10	-12	-13	-15	-17
8.00%	-19	-21	-23	-25	-27	-29	-31
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%	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)

376

공시일	2022-01-03
기준일	2021-12-31

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	6,434	-6,434	
누계	유가증권	수익증권	10,477	0	10,477	

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	2022-01-03
기준일	2021-12-31

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	59	-59	
누계	유가증권	수익증권	9,568	0	9,568	

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	2022-01-03
기준일	2021-12-31

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	45,188	0	45,188	
누계	통화	선도	0	27,937	-27,937	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E

2,235

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

736

기준일 2021-12-31

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

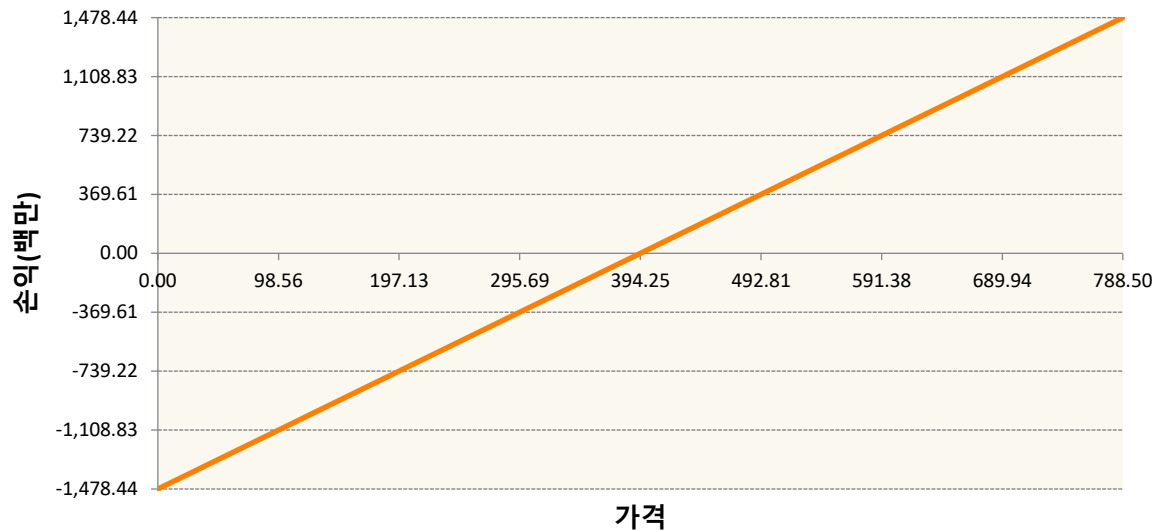
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,478	0	1,478	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001 2022-03 코스피200지수선물							118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	79	79	79	79	79	79	79
8.00%	118	118	118	118	118	118	118

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

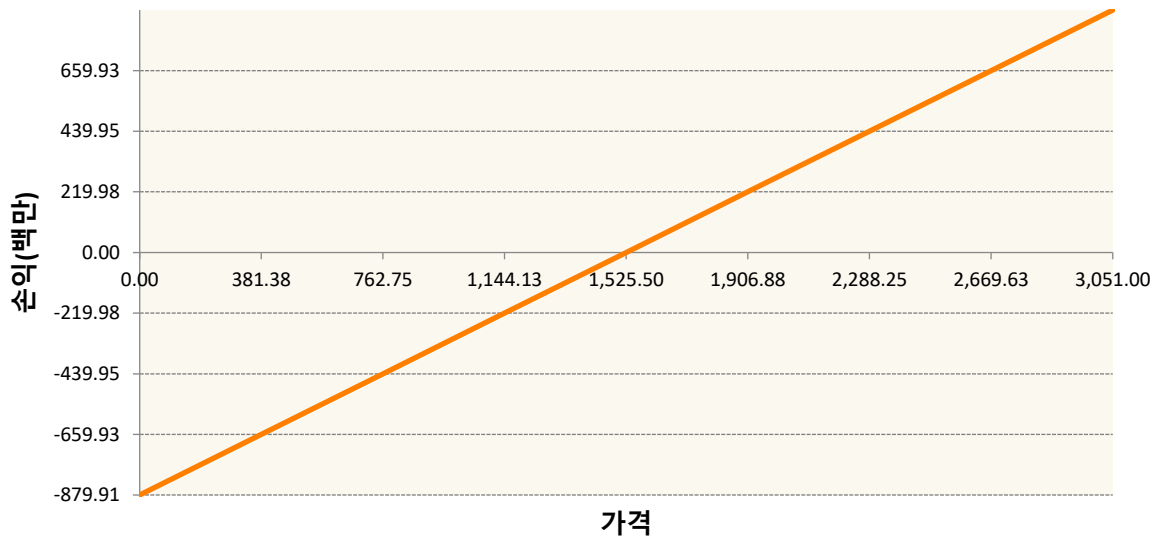
1. 계약금액

(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	880	0	880	
누계	유가증권	스왑	1,796	0	1,796	장외
누계	통화	선도	0	1,116	-1,116	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	70

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

(단위:백만원)

259

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

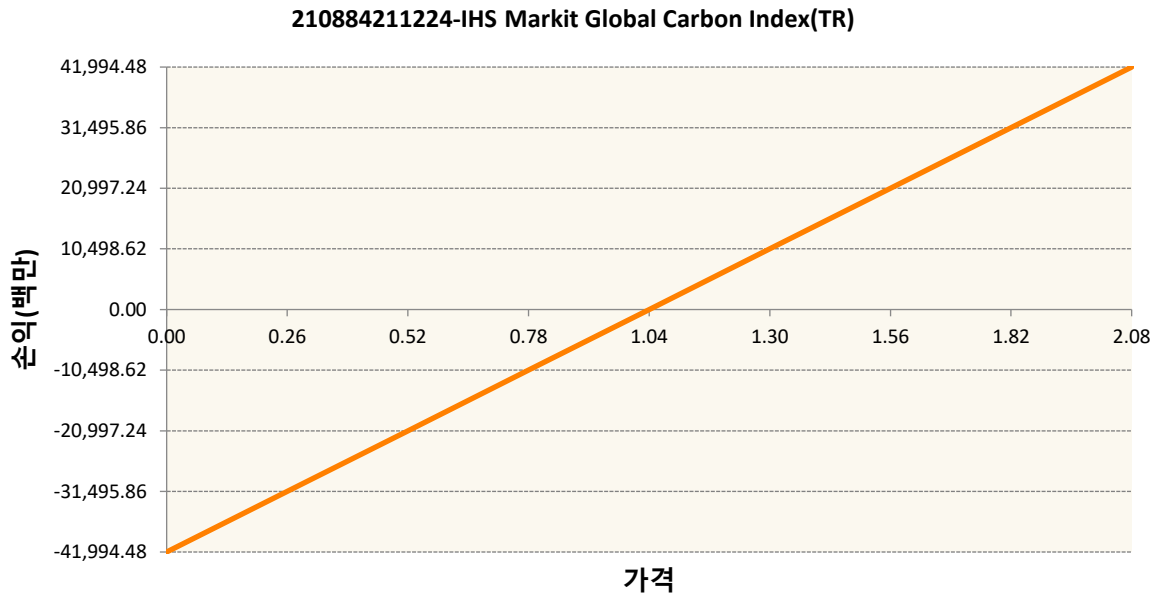
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	41,994	0	41,994	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,370

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

(단위:백만원)

5,377

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

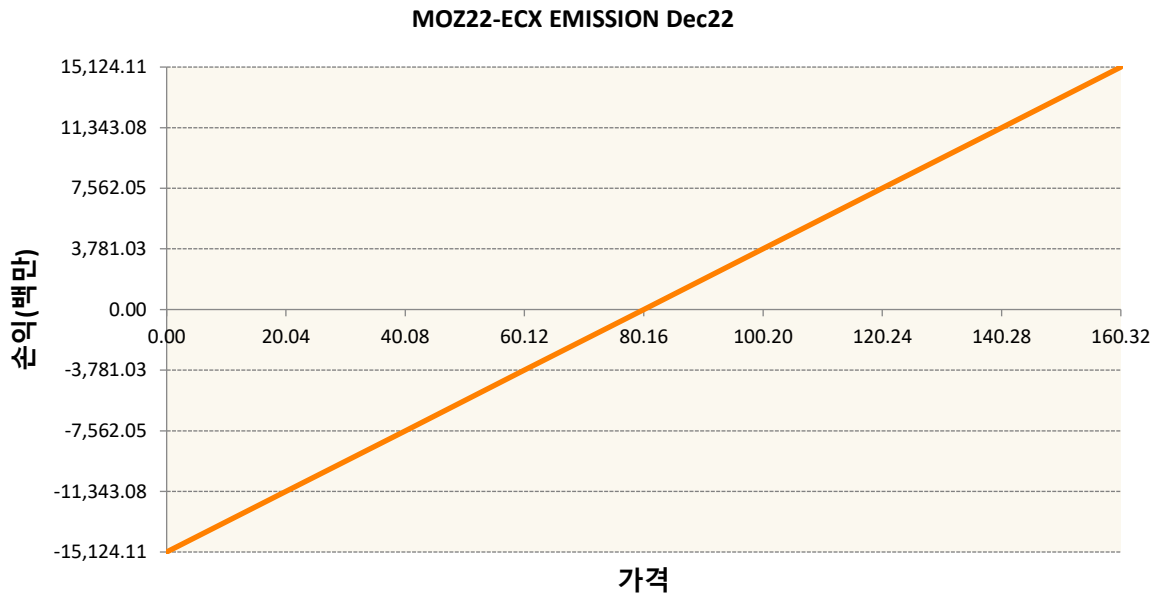
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,124	0	15,124	
누계	통화	선도	0	6,076	-6,076	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCV·KRW/EUR 28-01-22E

486

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,210

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

(단위:백만원)

2,826

공시일	2022-01-03
기준일	2021-12-31

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)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	2

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

(단위:백만원)

17

공시일 2022-01-03

기준일 2021-12-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

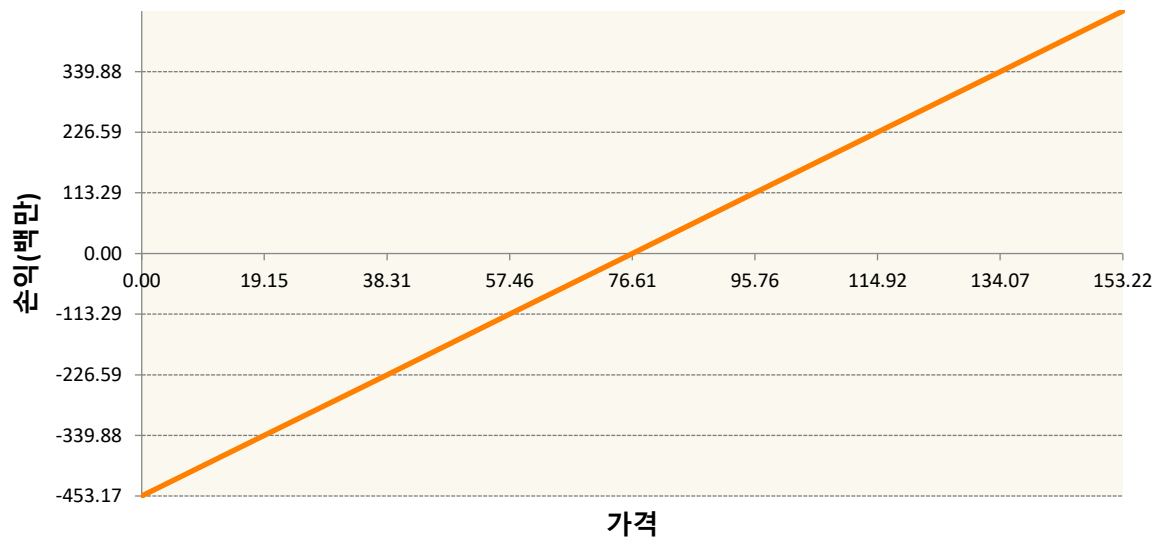
1. 계약금액

(단위:백만원)

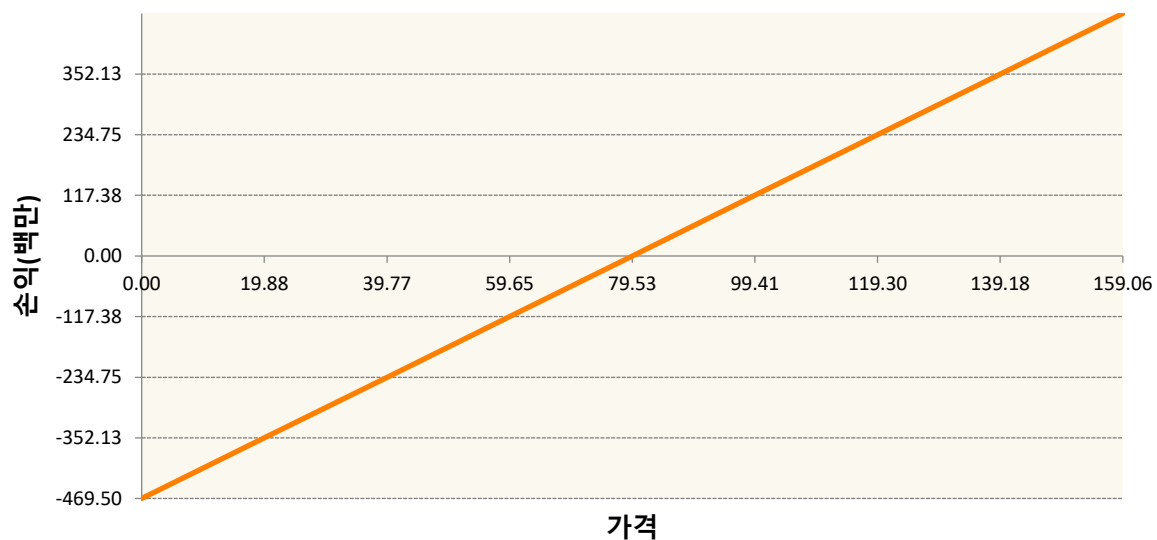
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,915	357	1,558	

2. 만기시점의 손익구조

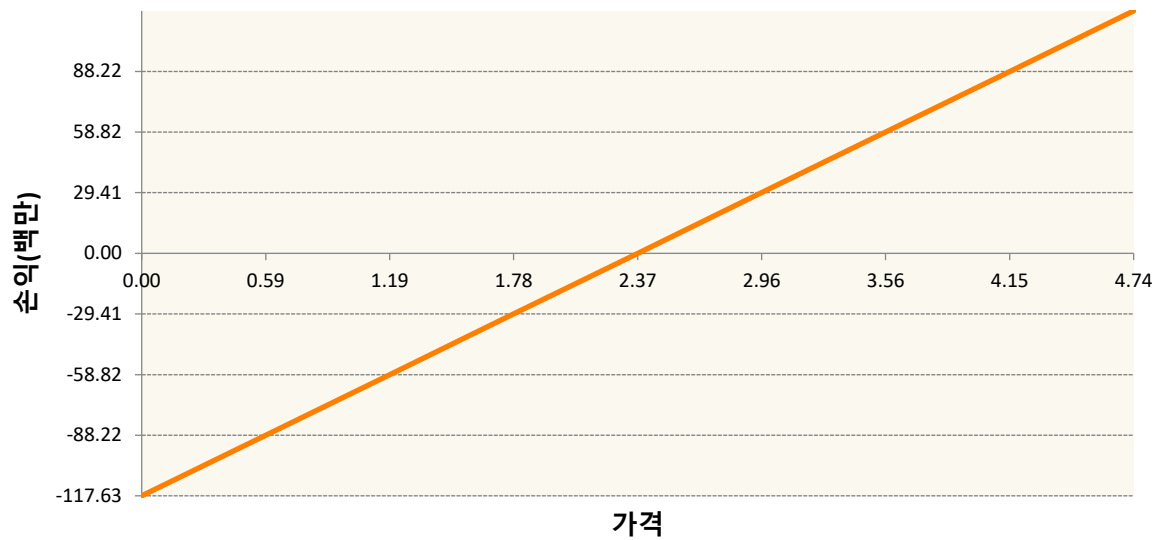
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



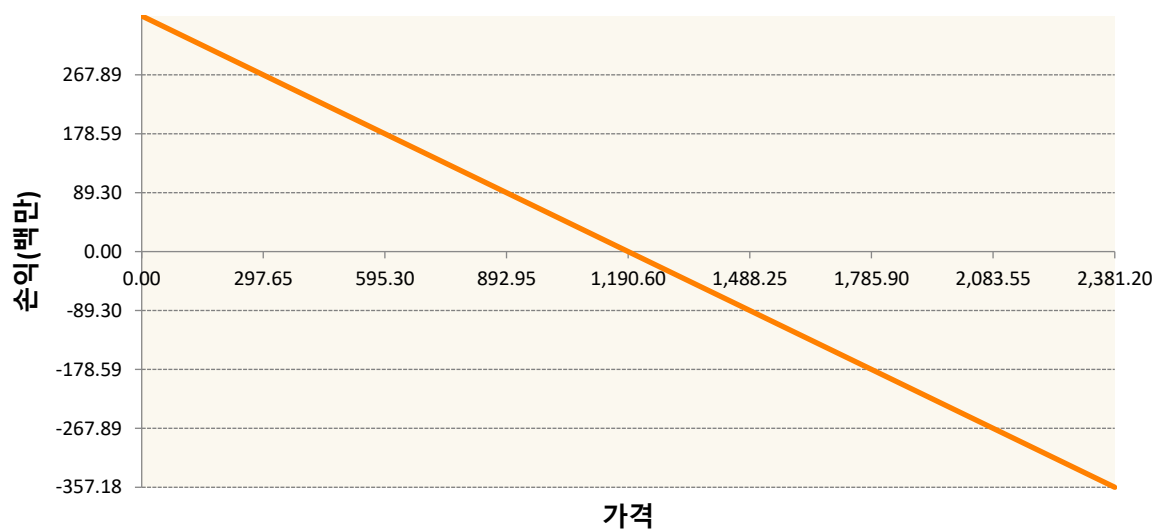
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



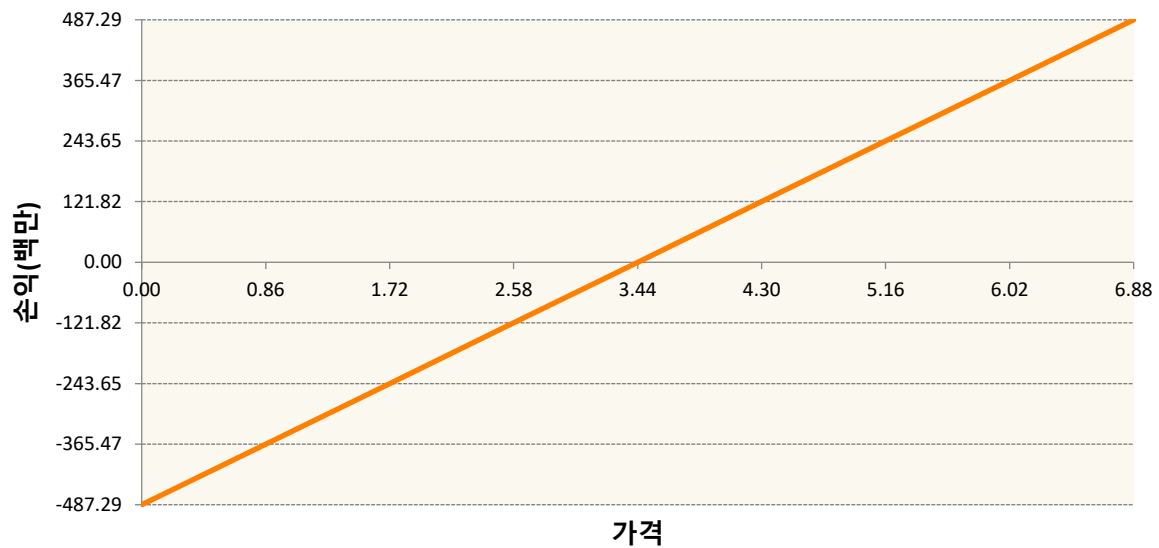
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

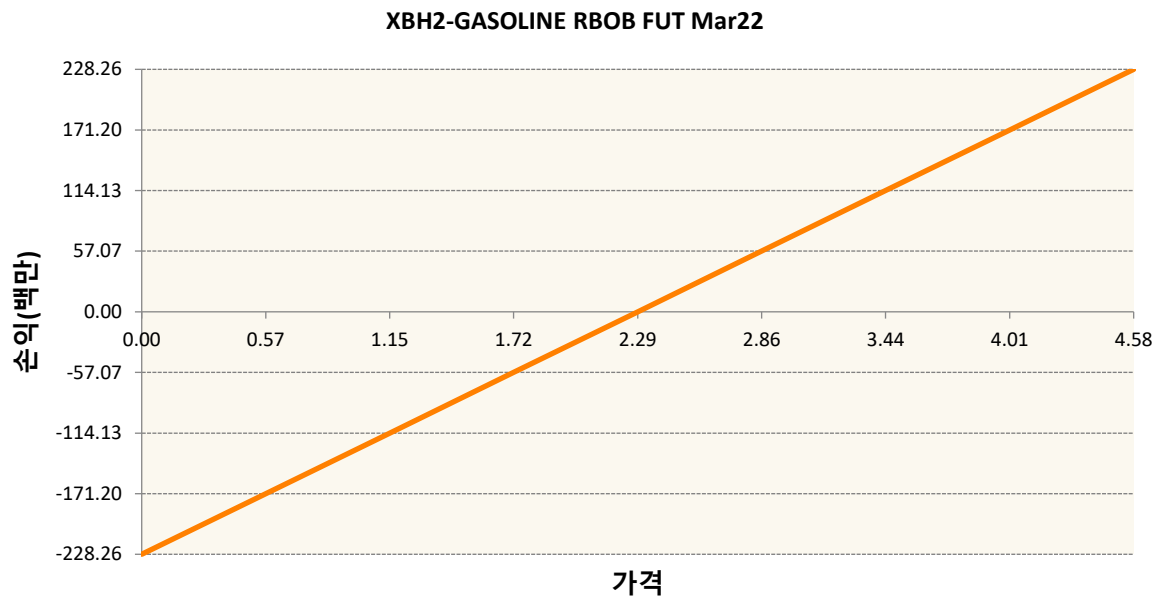
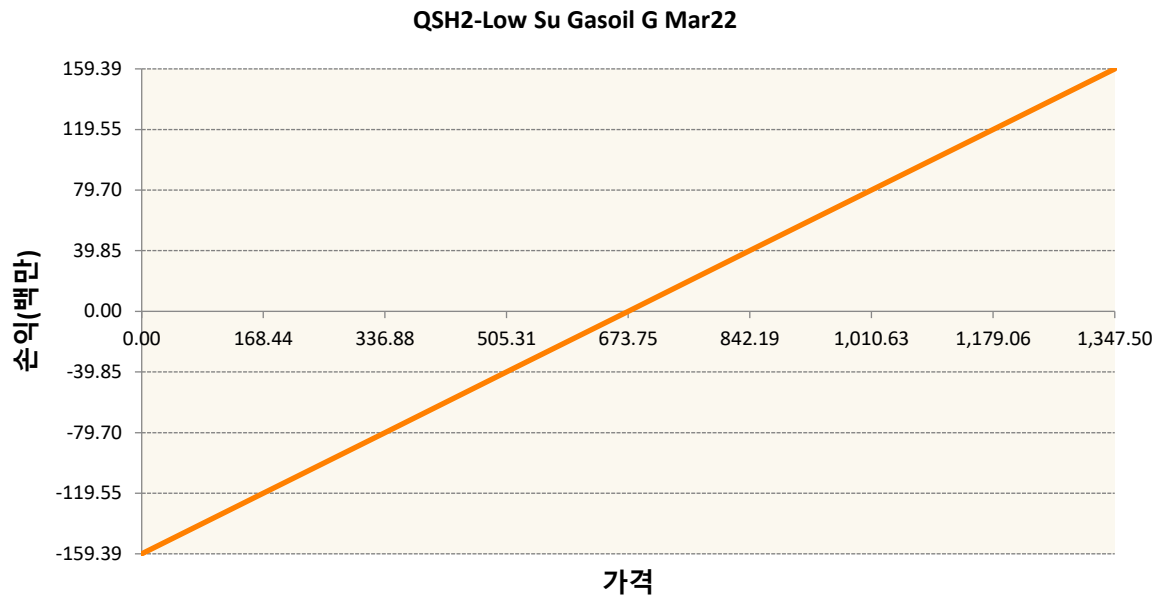


KR4175S10007-2022-01 달러선물



NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22		36
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22		38
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22		9
KR4175S100	2022-01 달러선물		29
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22		39
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22		13
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22		18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		344

