

공시일 2022-01-04

기준일 2022-01-03

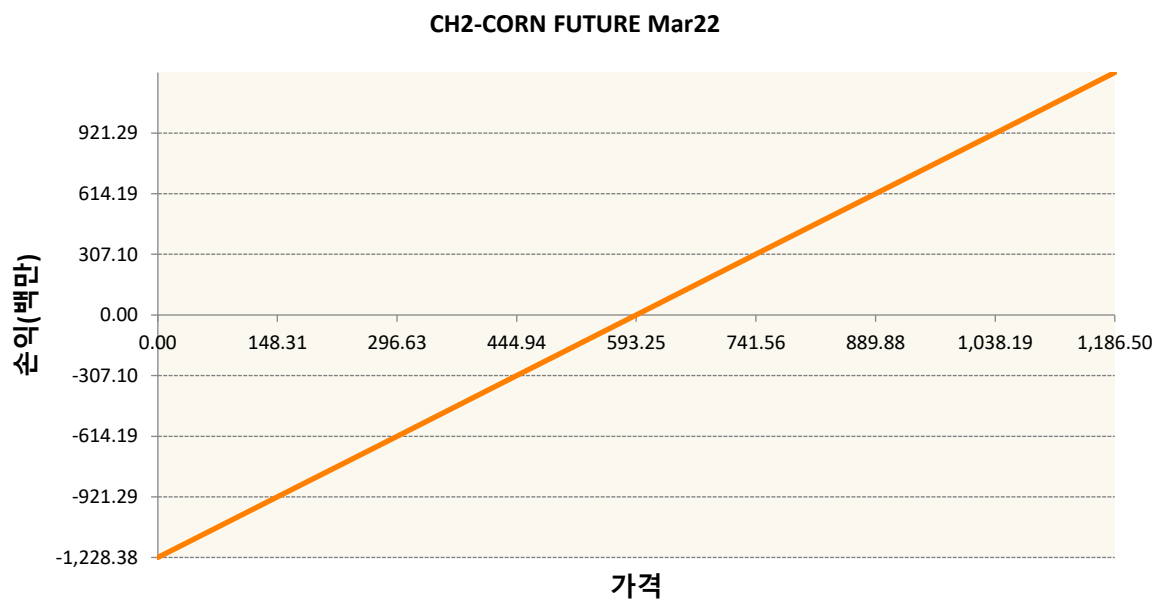
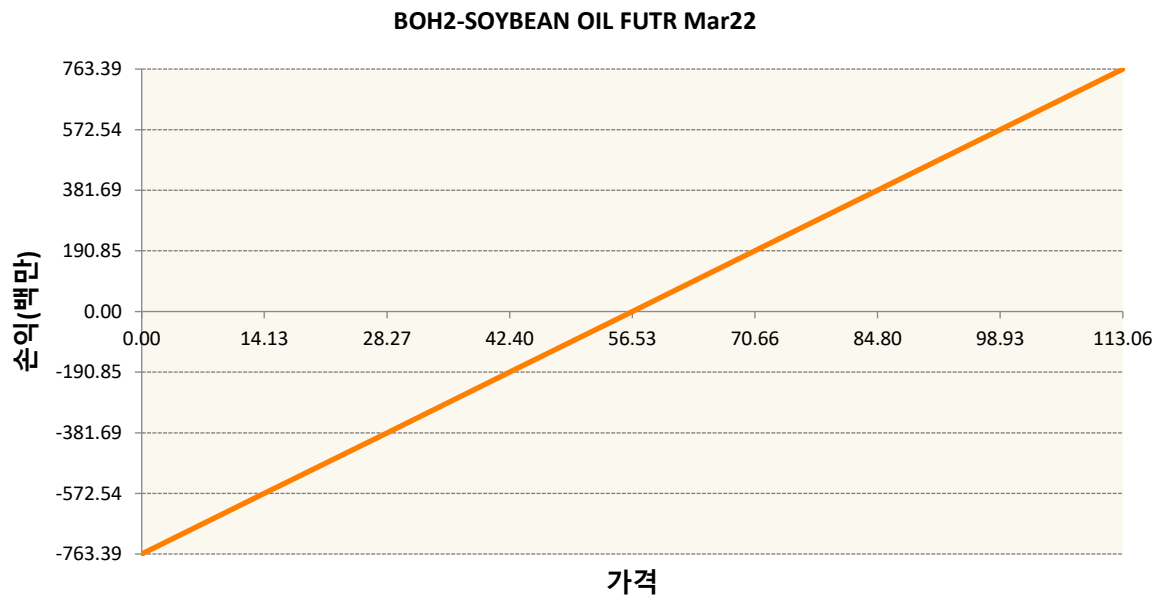
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

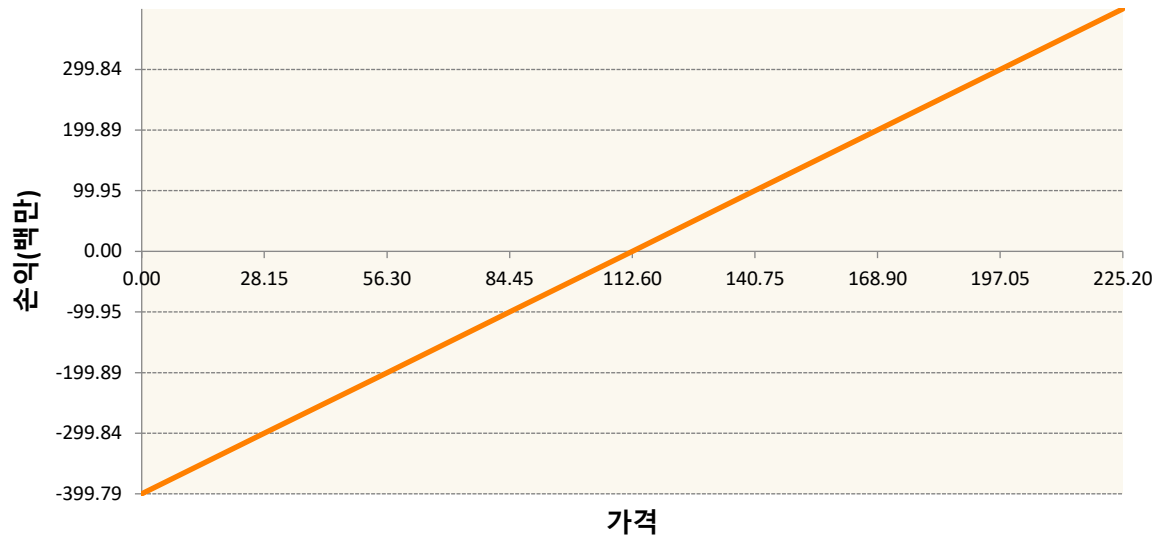
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,604	776	5,829	

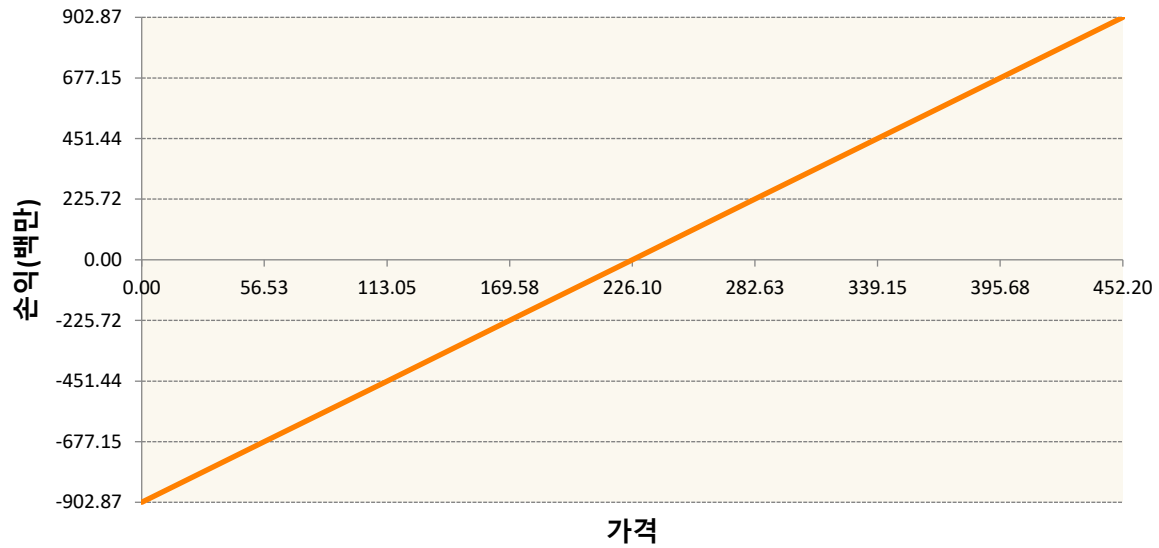
2. 만기시점의 손익구조



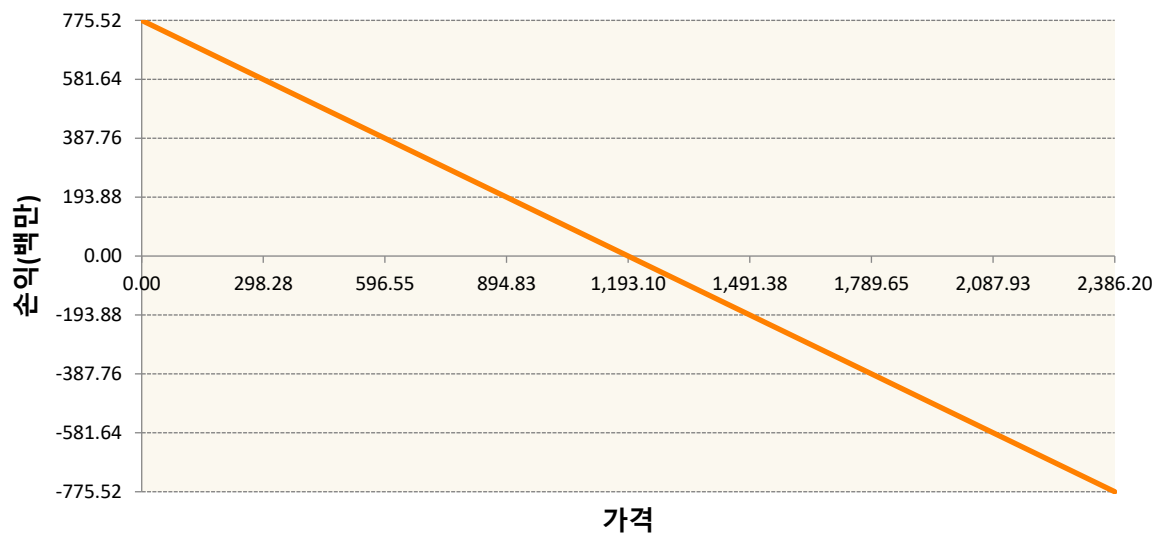
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



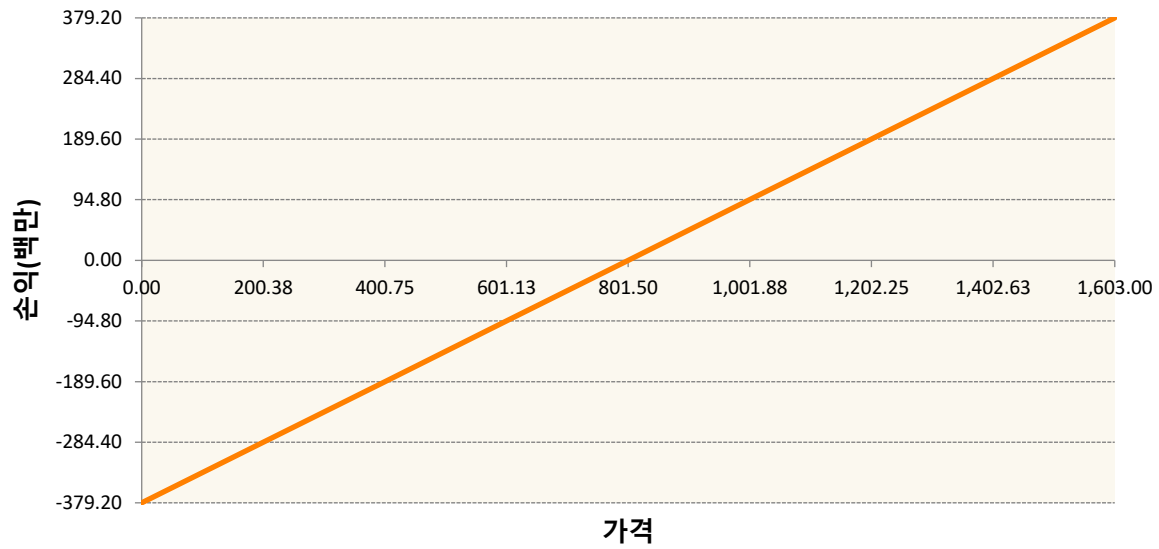
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



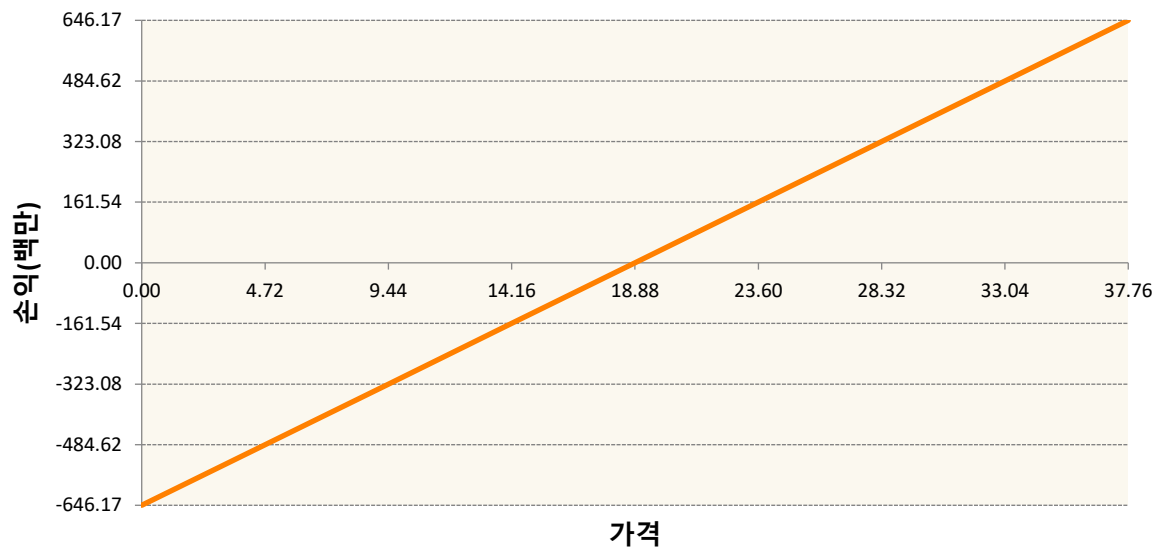
KR4175S10007-2022-01 달러선물



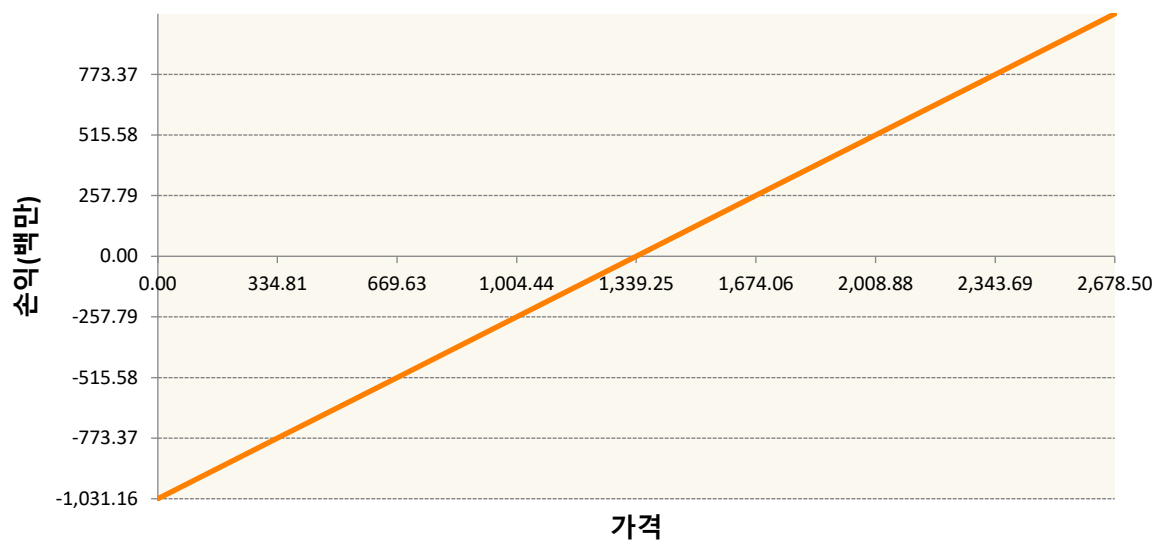
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



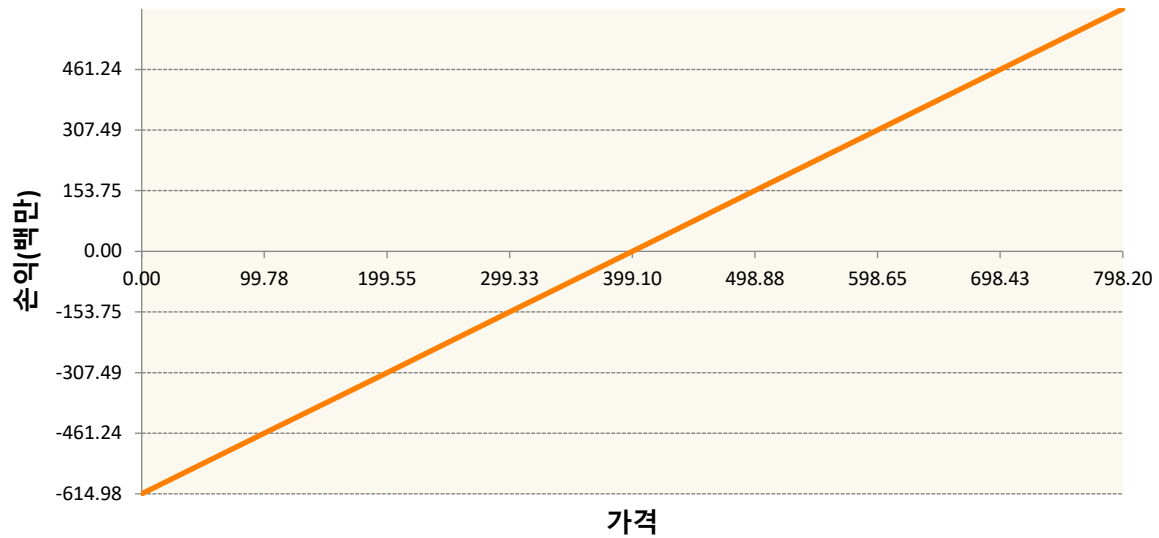
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



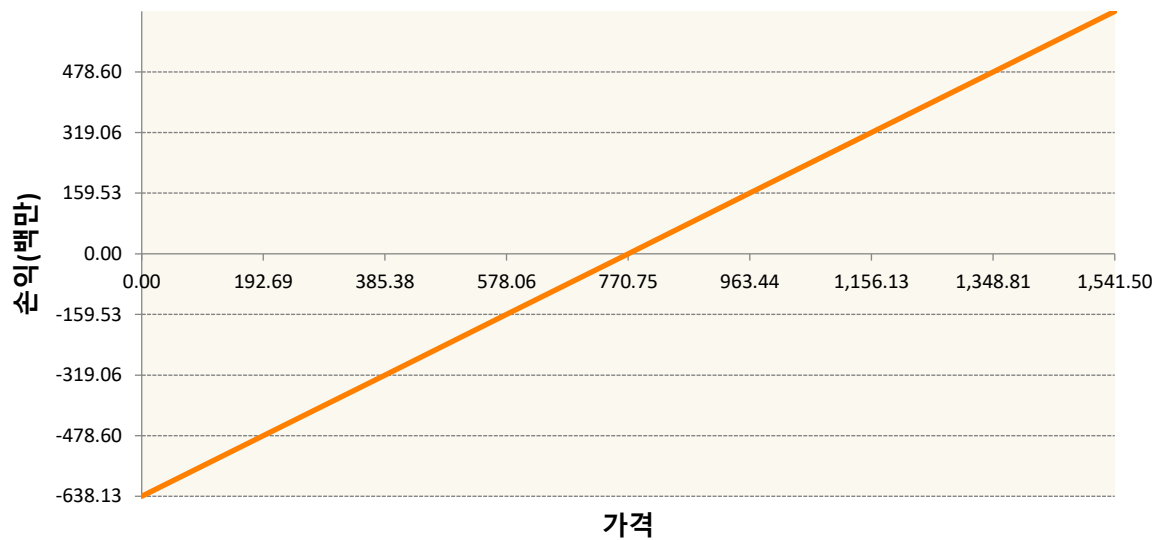
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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 2022-01-04

기준일 2022-01-03

스마트인덱스모

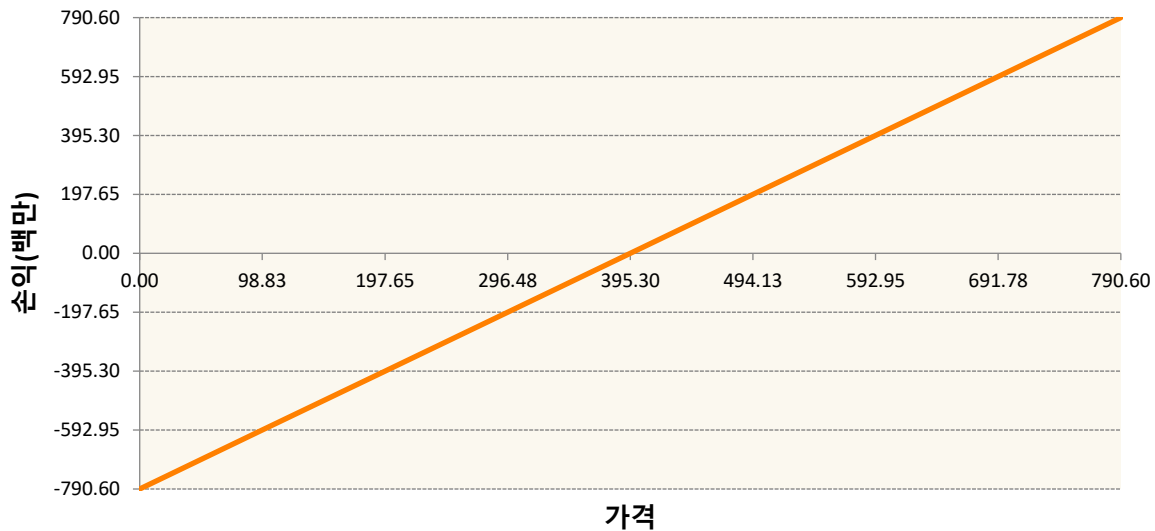
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	791	0	791	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	2022-01-04
기준일	2022-01-03

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

928

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

562

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-01-04
기준일	2022-01-03

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	442
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

419

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-01-04
기준일 2022-01-03

유로인덱스모(주식-파생형)

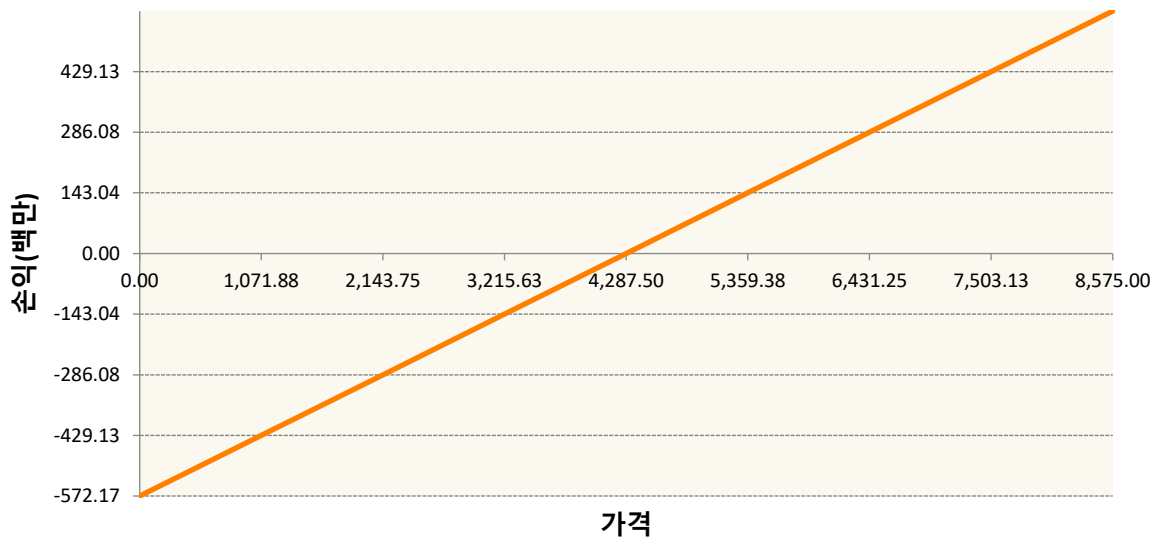
1. 계약금액

(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

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	46
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2022-01-04
기준일	2022-01-03

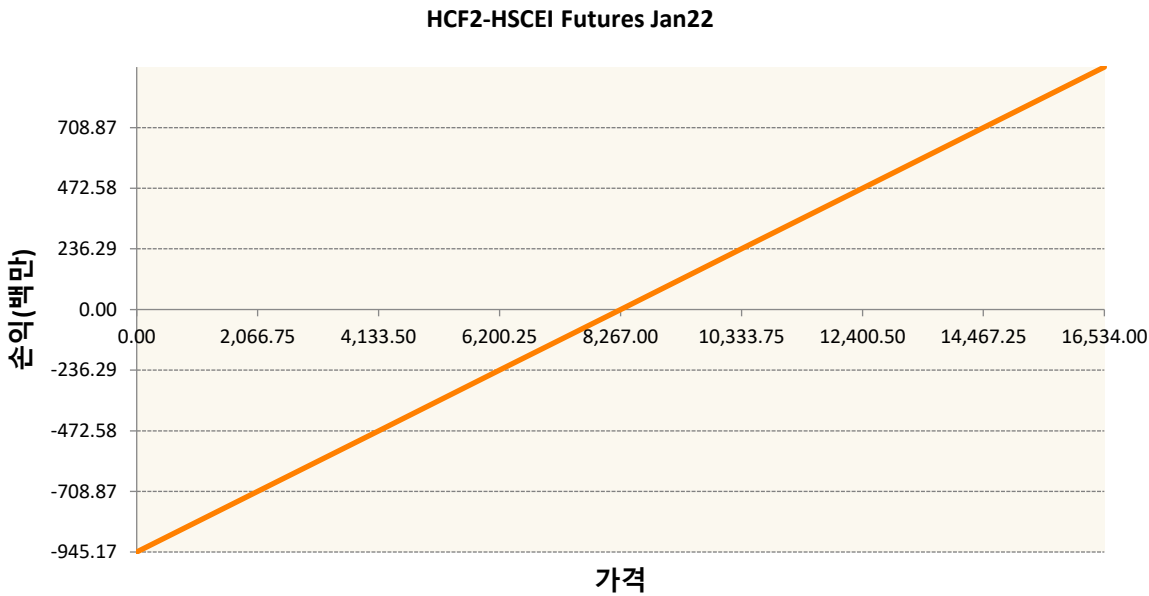
차이나인덱스모(주식-파생형)

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)

HCF2	HSCEI Futures Jan22	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

78

공시일 2022-01-04

기준일 2022-01-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

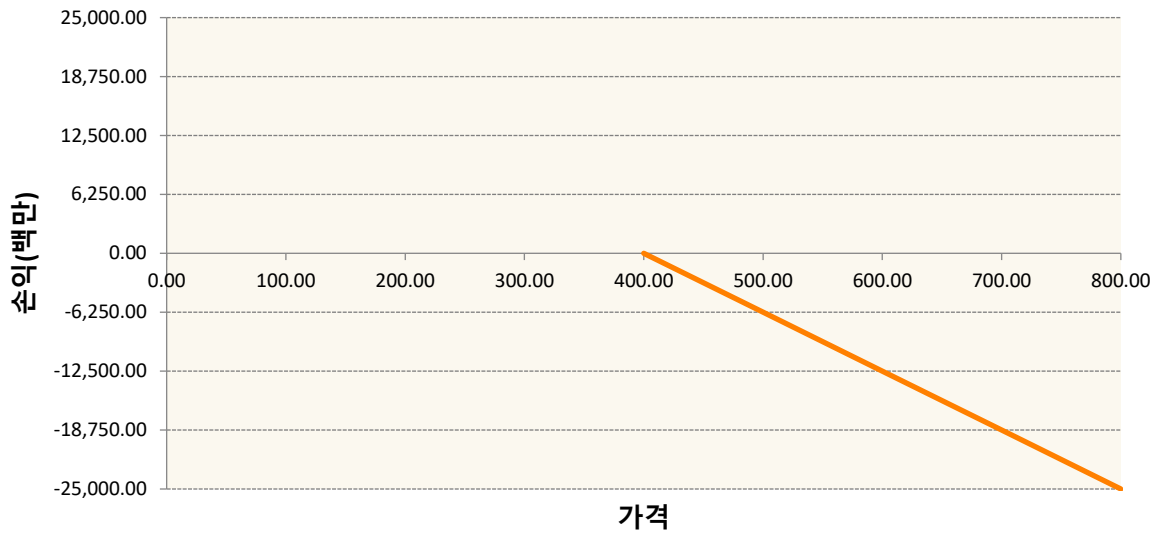
1. 계약금액

(단위:백만원)

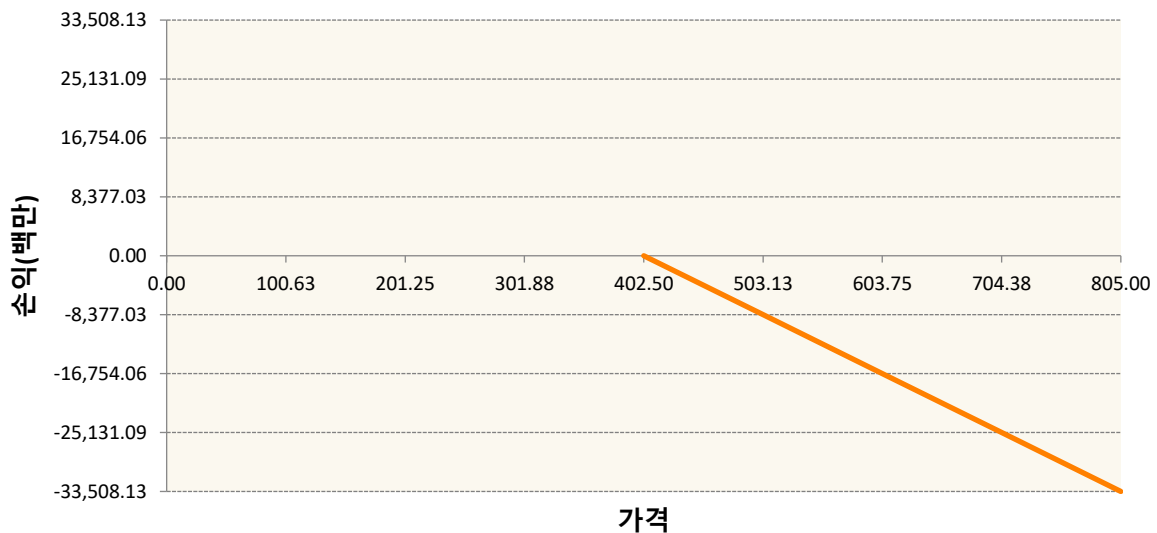
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

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 the relationship between price and profit/loss. The x-axis represents price (가격) and the y-axis represents profit/loss in millions (손익 (백만)). The line starts at a price of 0.00 with a loss of 2,012.50 million and reaches a profit of 0 million at a price of 402.50.

가격	손익 (백만)
0.00	-2,012.50
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003				2022-01 콜400			1,467
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	312	311	309	306	302	296	289
-5.33%	305	299	291	281	268	253	237
-2.67%	262	243	220	197	171	144	117
0%	105	70	35	0	-35	-71	-107
2.67%	-244	-278	-312	-347	-382	-417	-453
5.33%	-771	-790	-811	-835	-860	-887	-915
8.00%	-1,393	-1,399	-1,408	-1,419	-1,433	-1,449	-1,467
KR4201S14029				2022-01 콜402.5			1,849
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	340	339	337	335	330	324	317
-5.33%	334	329	321	310	296	279	260
-2.67%	295	274	249	221	191	159	125
0%	132	89	45	0	-45	-91	-137
2.67%	-269	-317	-365	-413	-462	-510	-559
5.33%	-922	-952	-986	-1,022	-1,060	-1,099	-1,140
8.00%	-1,729	-1,741	-1,756	-1,775	-1,797	-1,822	-1,849

KR4301S14001

2022-01 풋400

1,268

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,267	-1,267	-1,267	-1,267	-1,267	-1,267	-1,268
-5.33%	-806	-806	-807	-807	-809	-811	-814
-2.67%	-350	-354	-359	-365	-373	-381	-390
0%	45	30	15	0	-16	-31	-47
2.67%	258	245	231	216	201	186	171
5.33%	308	305	300	295	288	280	271
8.00%	313	312	312	311	309	307	304

KR4301S14027

2022-01 풋402.5

149

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
-2.67%	-43	-44	-44	-45	-45	-46	-47
0%	4	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	35	33	31	29	27	25	23
5.33%	43	43	42	41	40	39	38
8.00%	44	44	44	44	44	43	43

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

(단위:백만원)

5,012

공시일 2022-01-04

기준일 2022-01-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

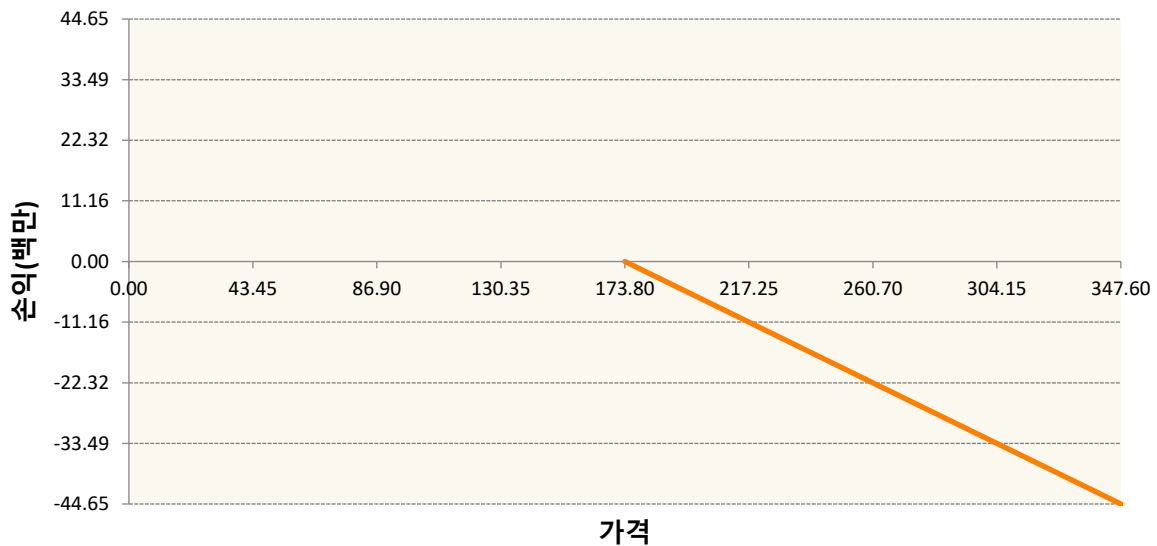
1. 계약금액

(단위:백만원)

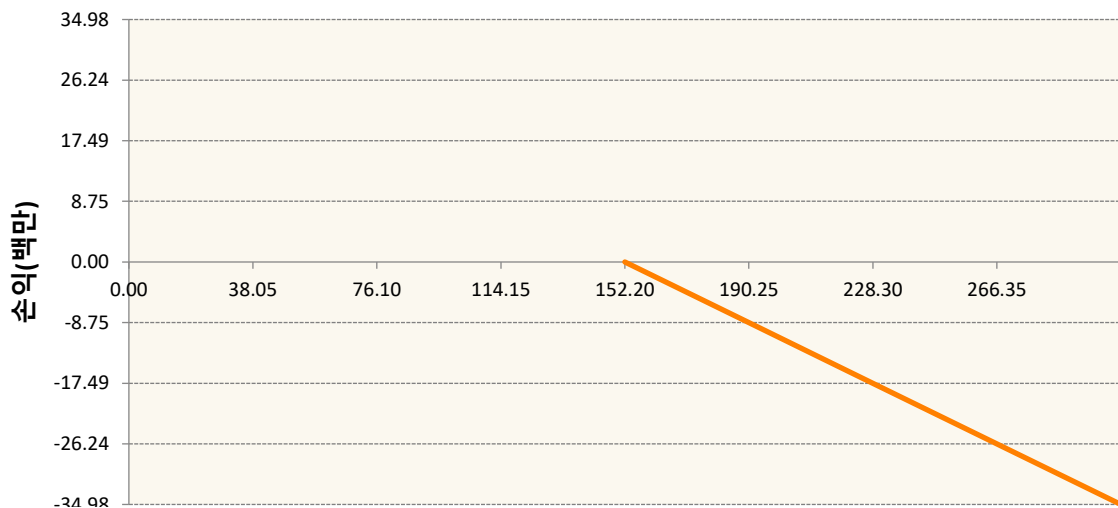
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	10	0	10	장외
누계	유가증권	옵션	0	92	-92	장내
누계	통화	선도	0	2,028	-2,028	장외

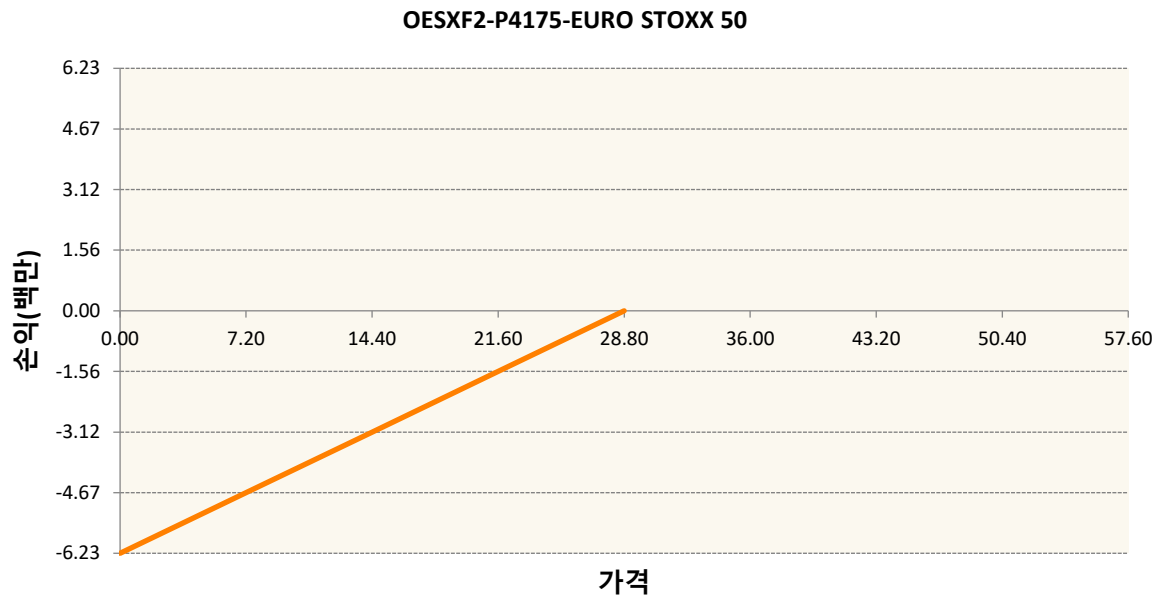
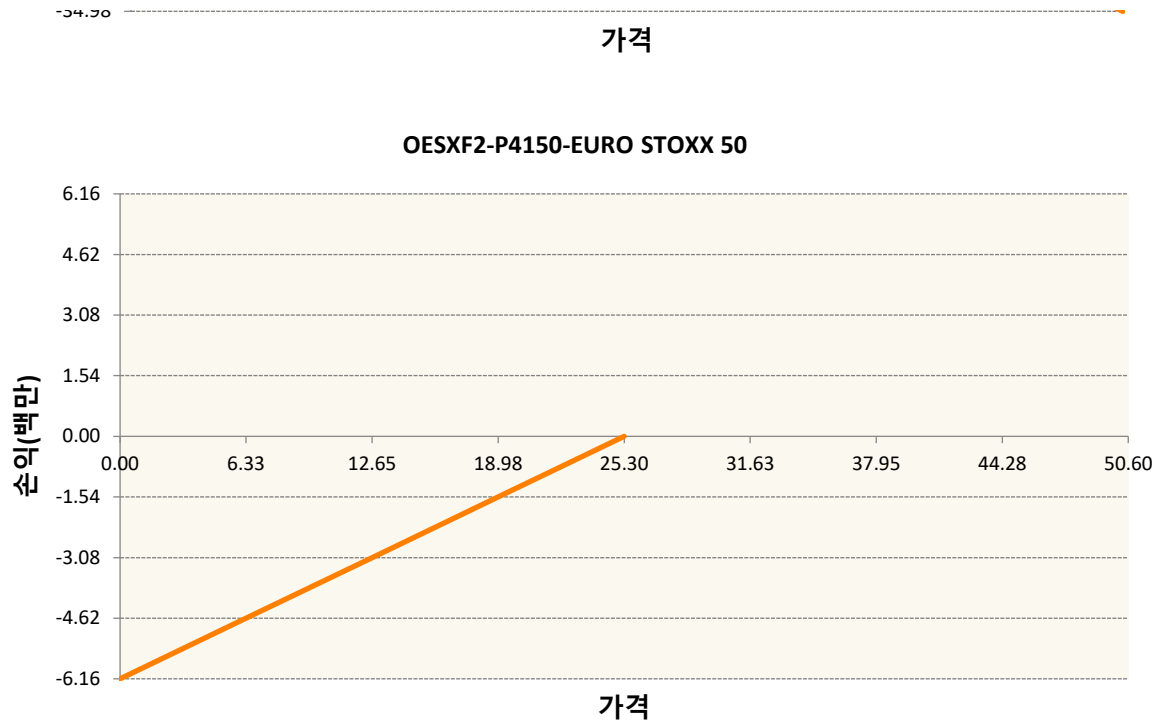
2. 만기시점의 손익구조

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
108
4
3
0.49
0.5

공시일 2022-01-04

기준일 2022-01-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

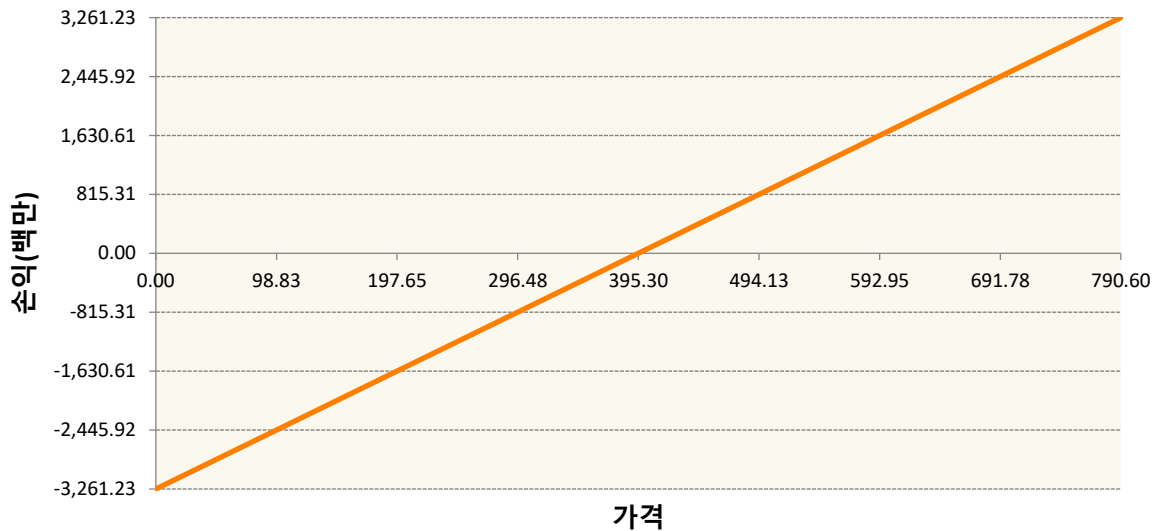
1. 계약금액

(단위:백만원)

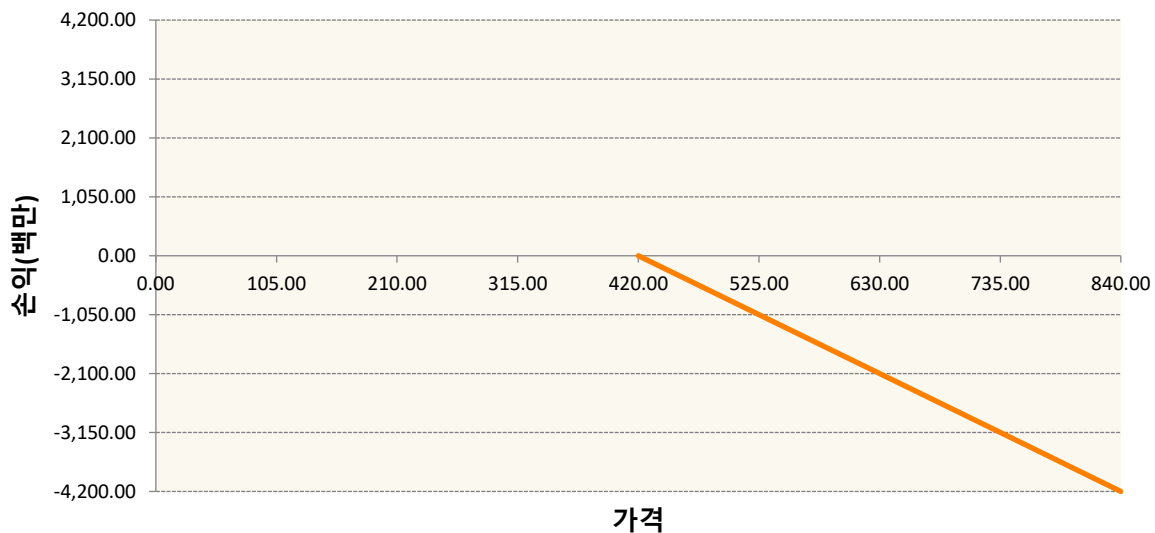
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,261	0	3,261	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S14201-2022-01 콜420



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 850.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from -1,275.00 to 1,275.00. A blue line starts at the point (425.00, 0.00) and slopes downward to the point (850.00, -1,275.00).

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
425.00	0.00
850.00	-1,275.00

가격	순익(백만)
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				126
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	7	7	7	7	7	6	6
-2.67%	7	7	6	6	5	3	2
0%	5	4	2	0	-3	-5	-9
2.67%	-4	-8	-12	-16	-21	-26	-31
5.33%	-33	-39	-45	-51	-57	-63	-69
8.00%	-92	-97	-103	-109	-114	-120	-126

KR4201S14250

2022-01 콜425

30

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	1	1	0
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-5	-7
5.33%	-6	-7	-9	-11	-12	-14	-16
8.00%	-19	-21	-23	-25	-27	-28	-30

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	-2	-2	-2	-2
5.33%	-4	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3

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

(단위:백만원)

370

공시일	2022-01-04
기준일	2022-01-03

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	10,512	0	10,512	

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	2022-01-04
기준일	2022-01-03

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	9,599	0	9,599	

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	2022-01-04
기준일	2022-01-03

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	239	-239	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	45,099	0	45,099	
누계	통화	선도	0	28,007	-28,007	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E

2,241

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

735

기준일 2022-01-03

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

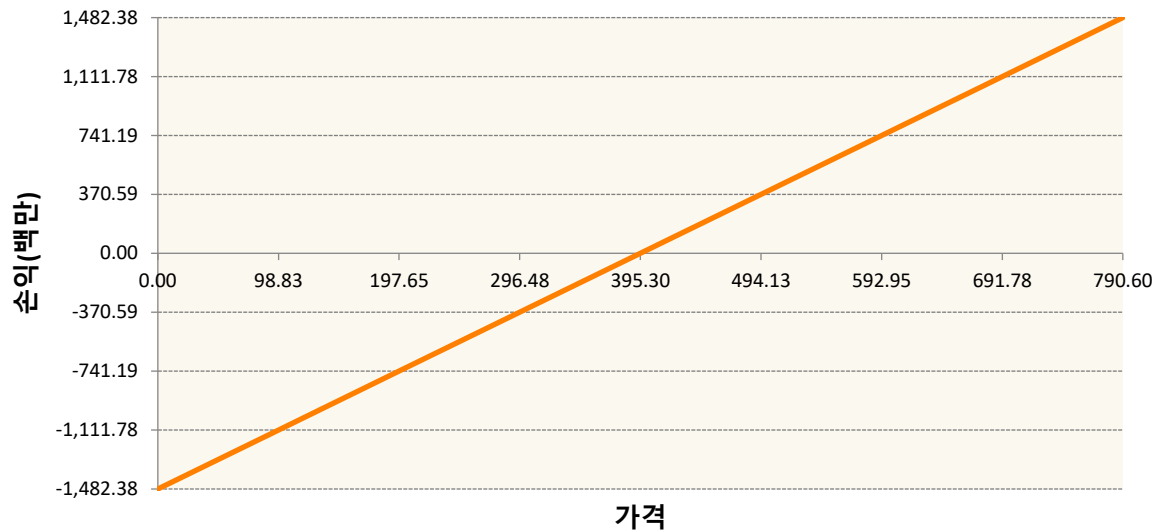
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,482	0	1,482	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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 2022-01-04

기준일 2022-01-03

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

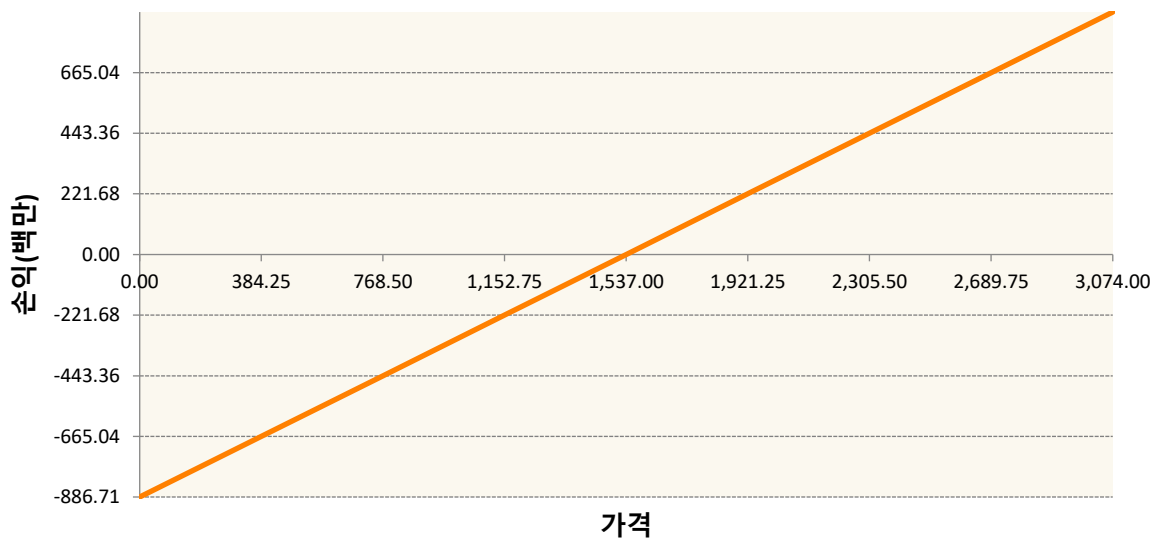
1. 계약금액

(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	887	0	887	
누계	유가증권	스왑	1,806	0	1,806	장외
누계	통화	선도	0	1,122	-1,122	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	71

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

(단위:백만원)

260

공시일 2022-01-04

기준일 2022-01-03

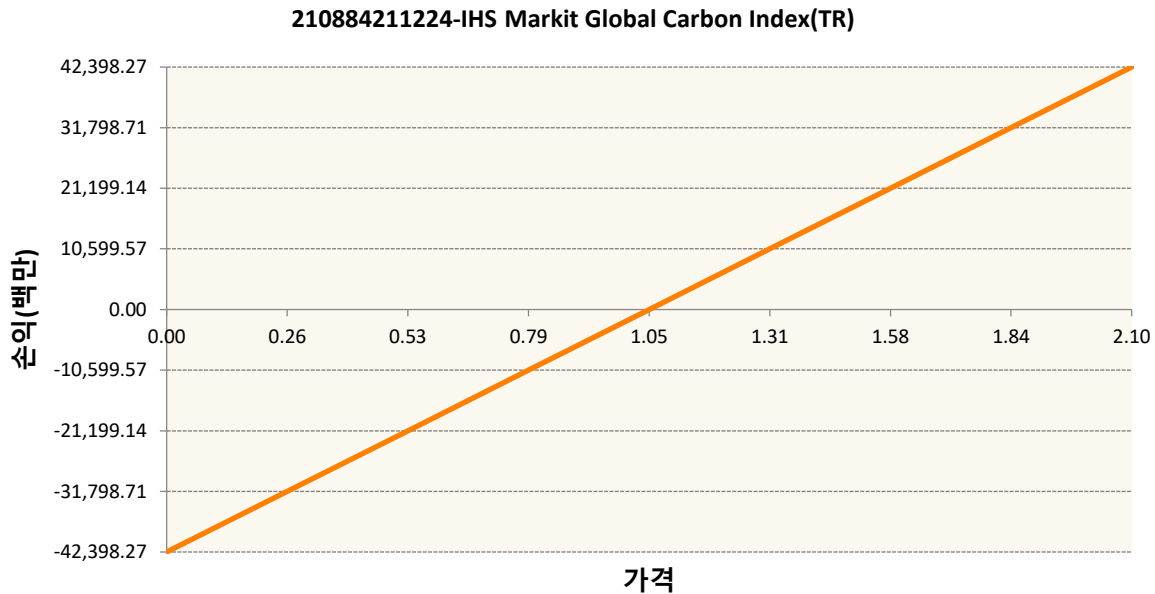
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	42,398	0	42,398	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,394

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

(단위:백만원)

5,410

공시일 2022-01-04

기준일 2022-01-03

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

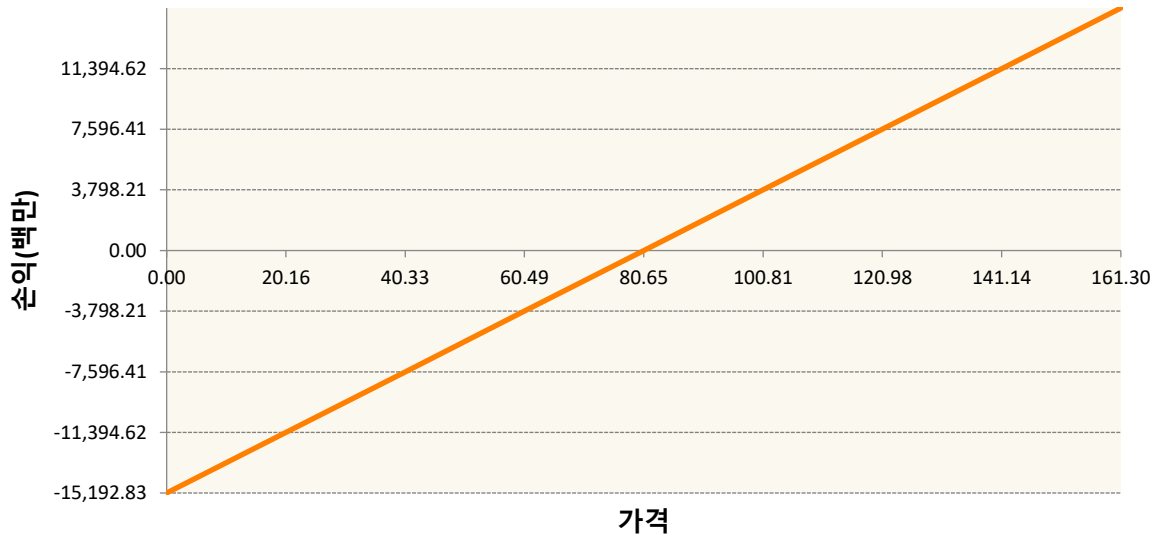
1. 계약금액

(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	15,193	0	15,193	
누계	통화	선도	0	6,109	-6,109	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCV·KRW/EUR 28-01-22E

489

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,215

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

(단위:백만원)

2,837

공시일	2022-01-04
기준일	2022-01-03

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)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	8

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

(단위:백만원)

58

공시일 2022-01-04

기준일 2022-01-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

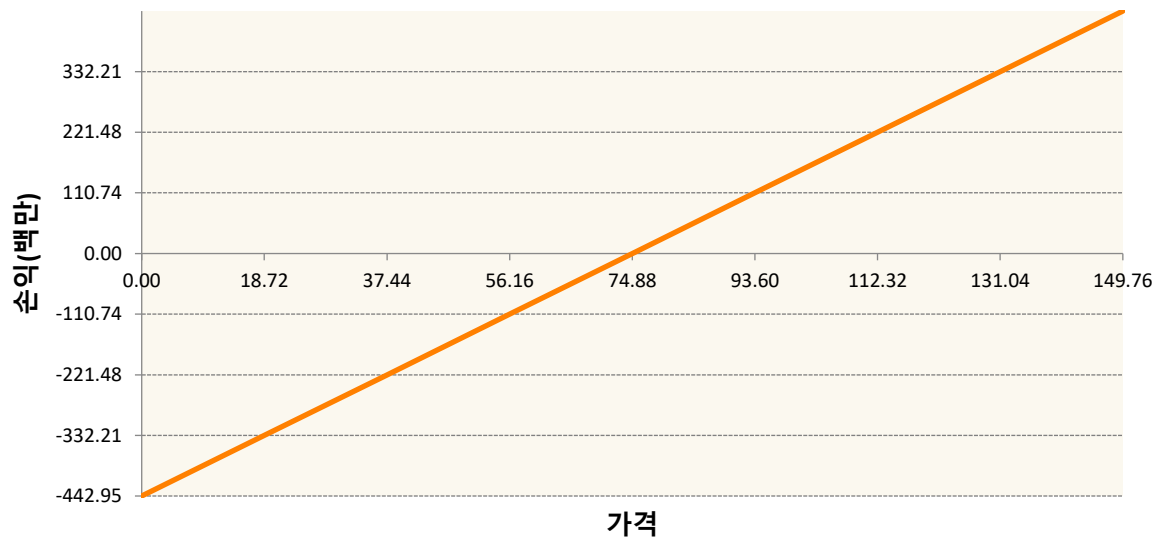
1. 계약금액

(단위:백만원)

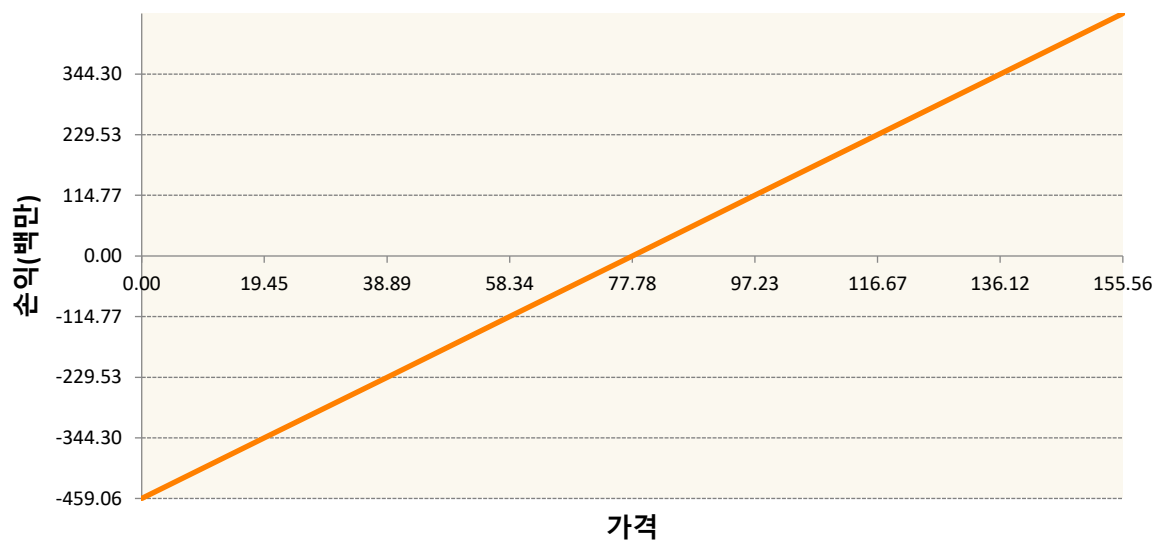
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,900	358	1,542	

2. 만기시점의 손익구조

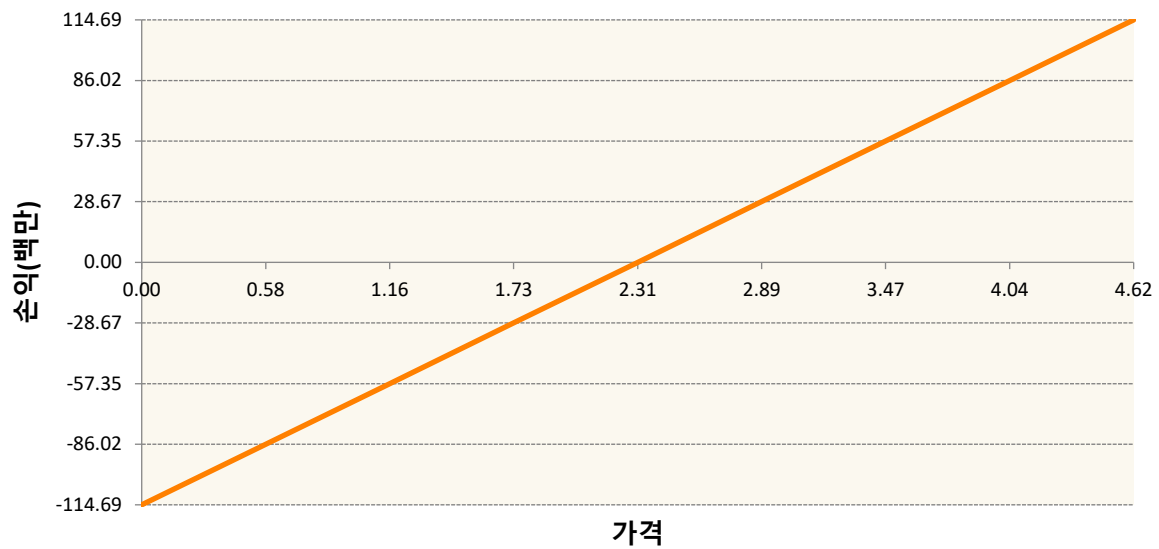
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



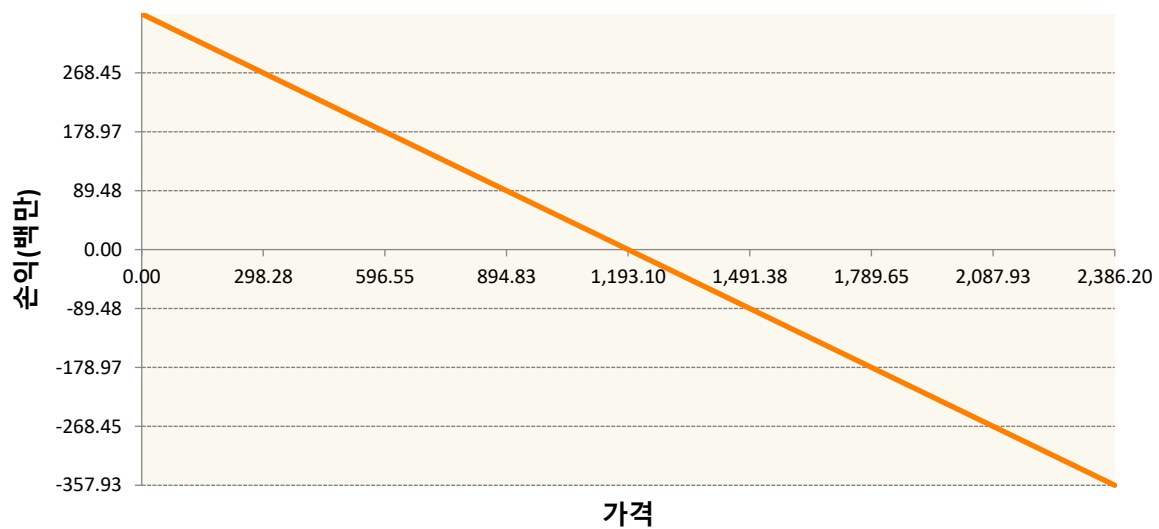
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



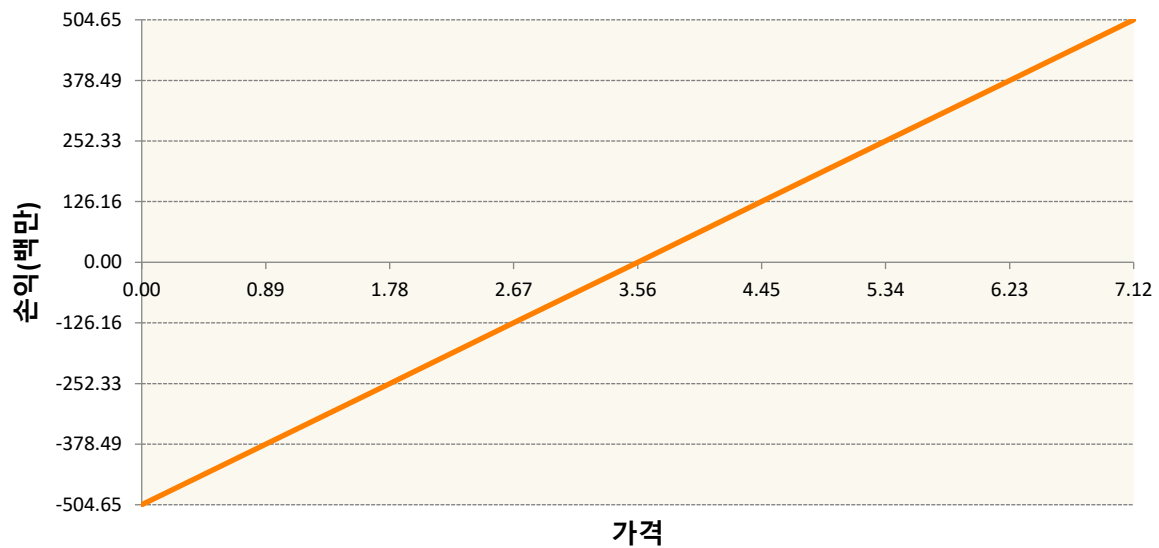
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

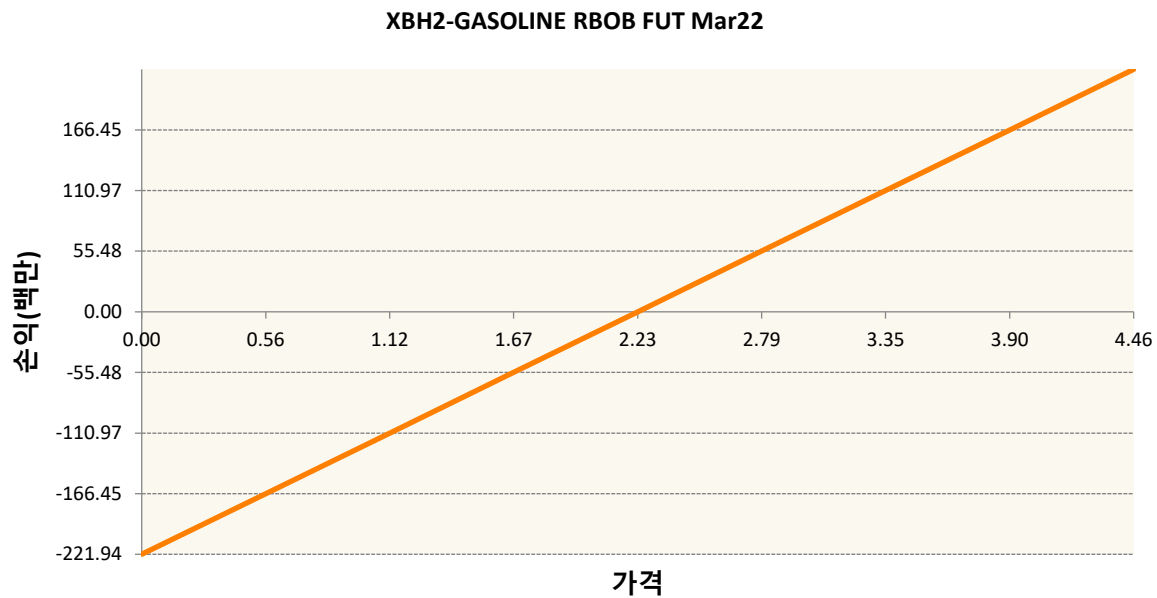
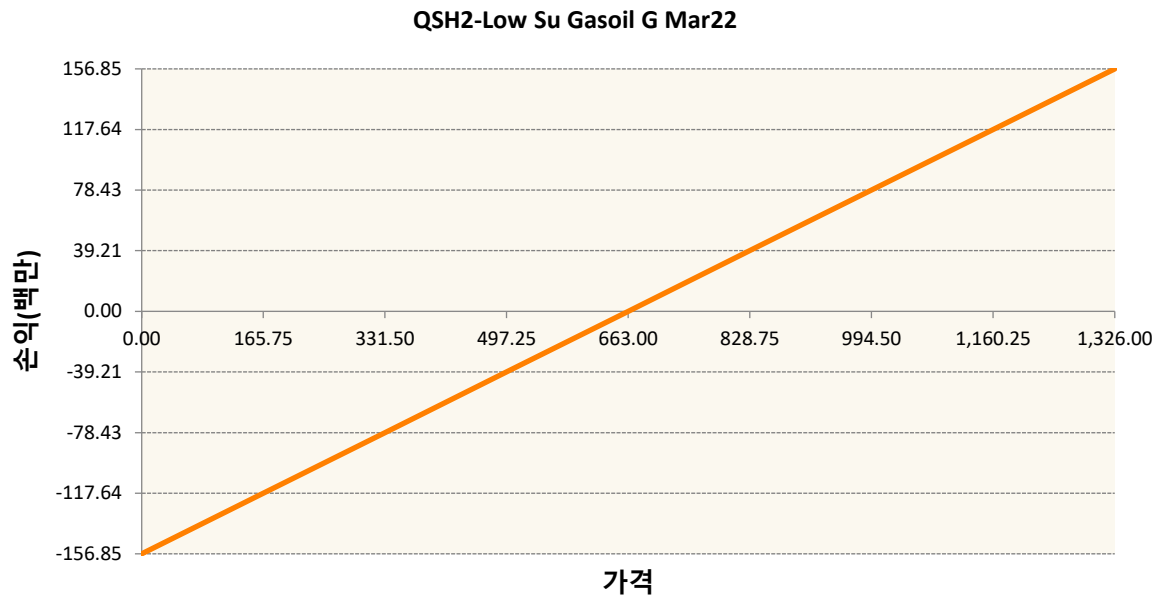


KR4175S10007-2022-01 달러선물



NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22		35
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22		37
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22		9
KR4175S100	2022-01 달러선물		29
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22		40
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22		13
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22		18

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

