

공시일 2022-01-05

기준일 2022-01-04

포커스농산물모(채권-파생형)

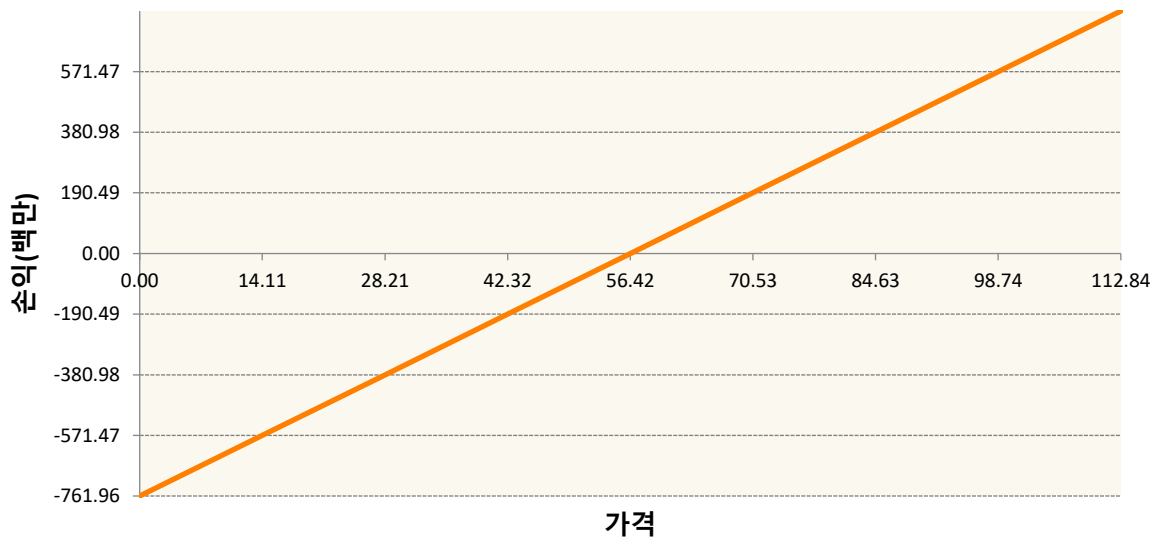
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

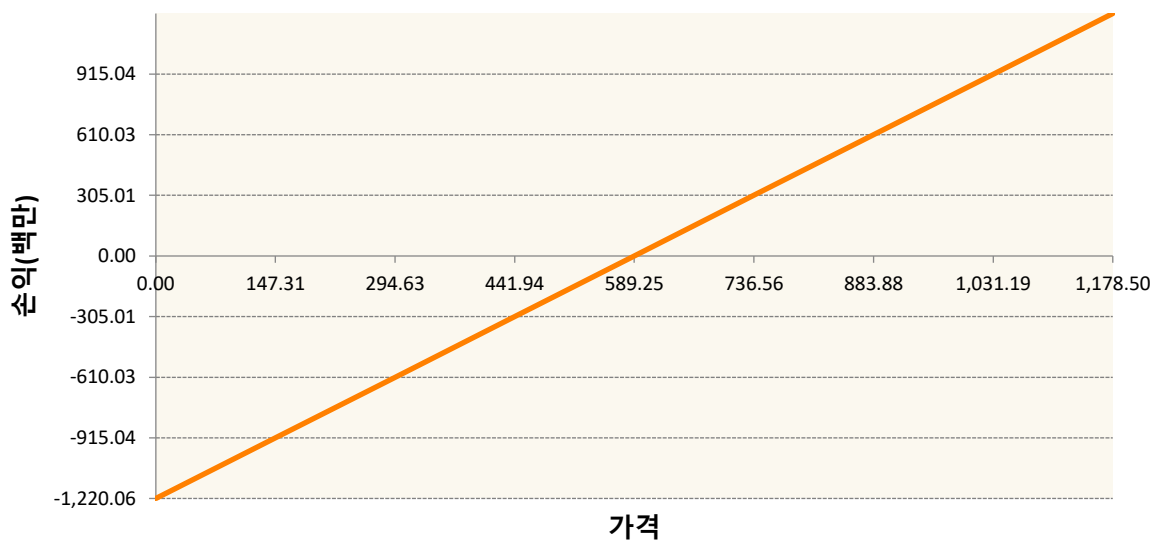
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,597	776	5,820	

2. 만기시점의 손익구조

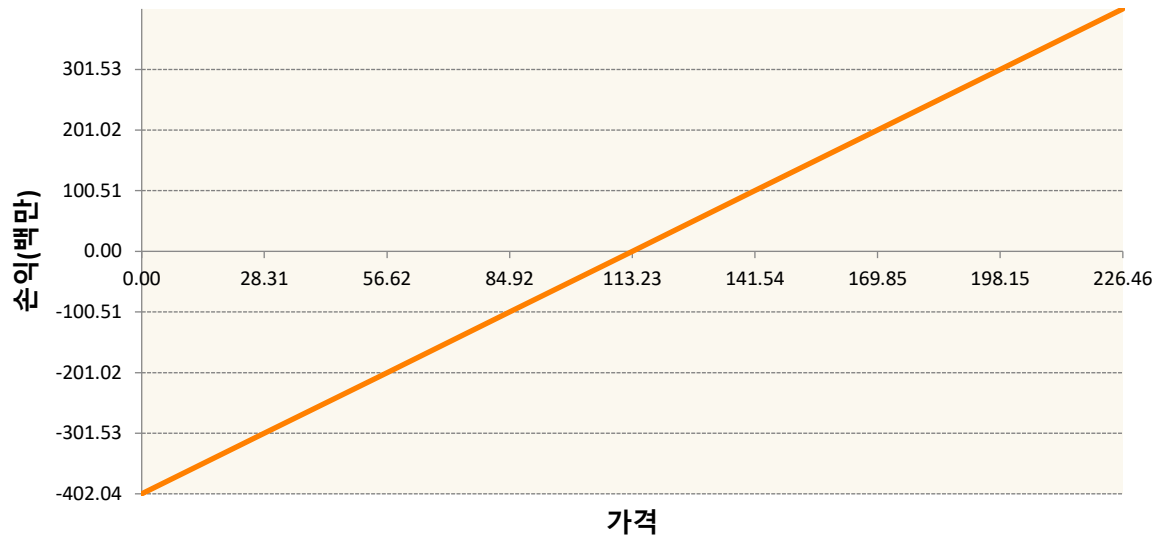
BOH2-SOYBEAN OIL FUTR Mar22



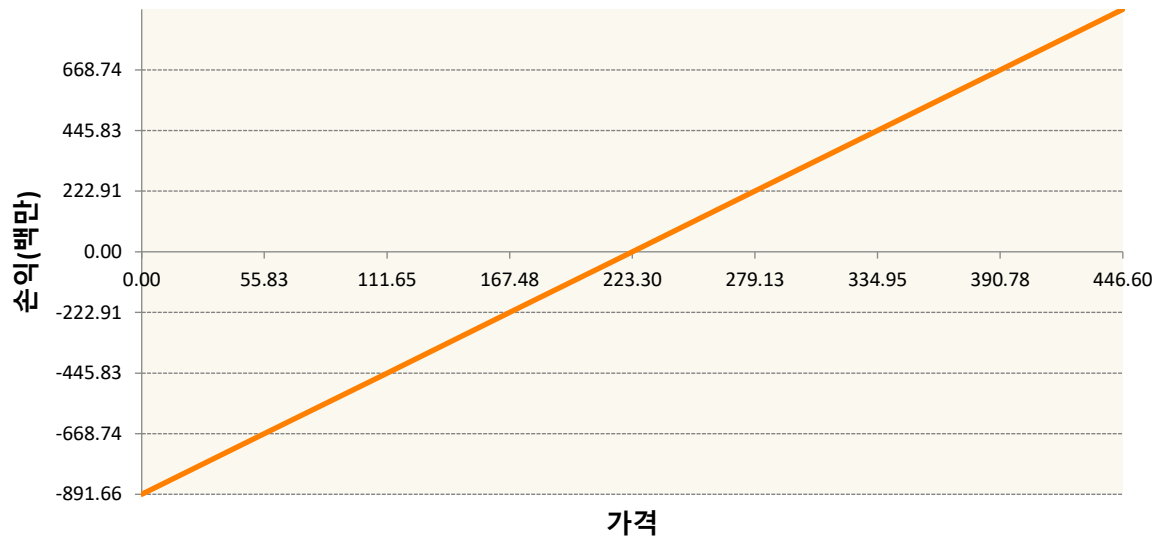
CH2-CORN FUTURE Mar22



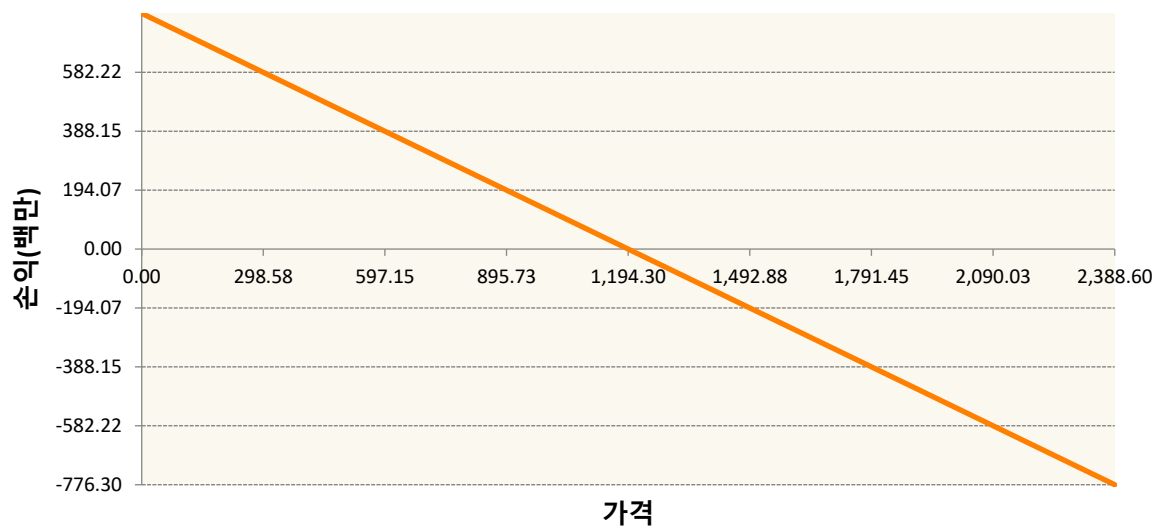
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



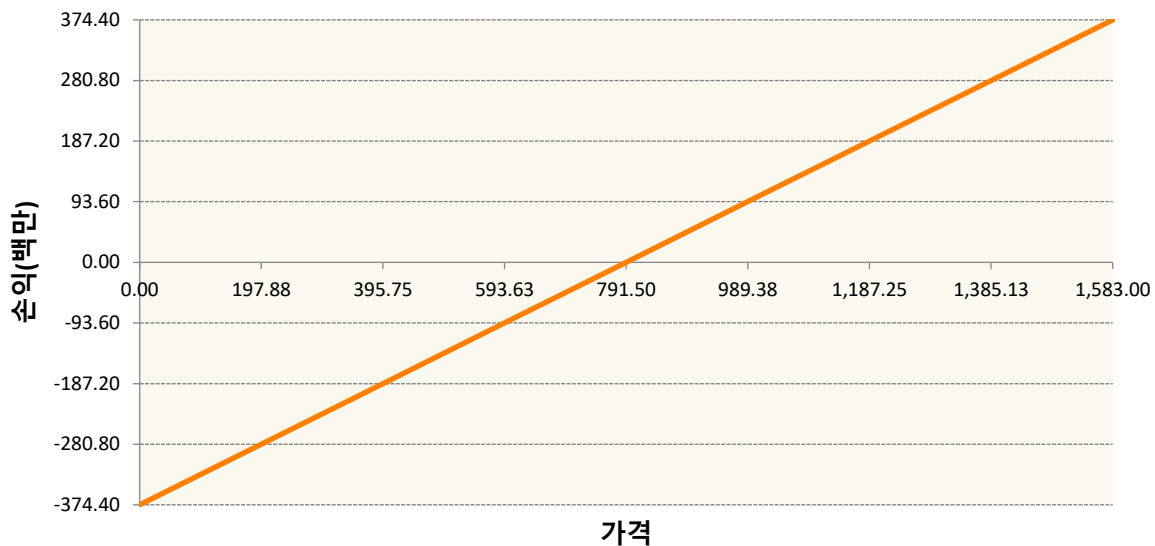
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



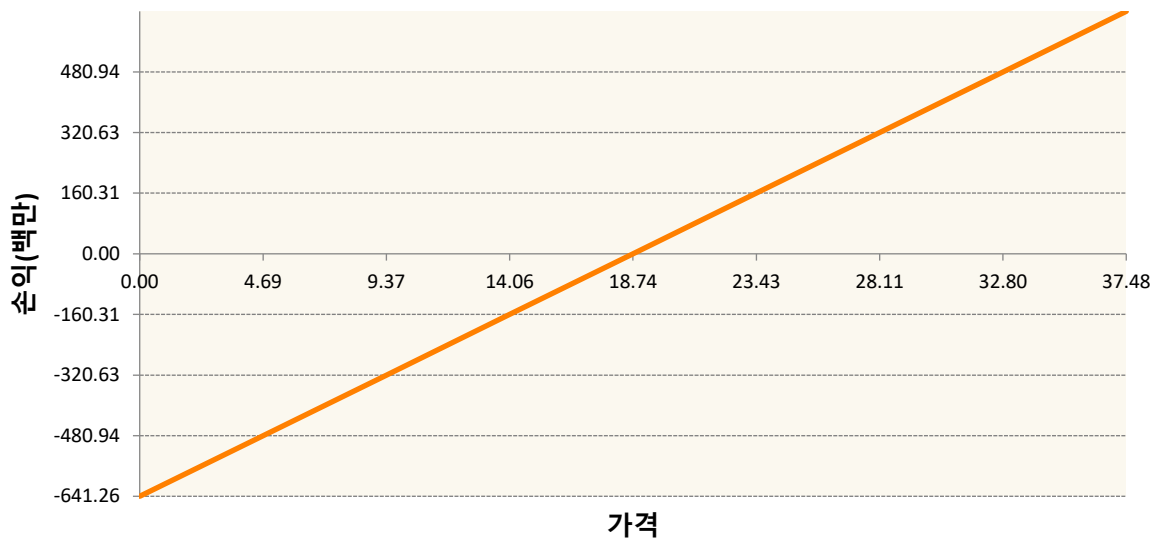
KR4175S10007-2022-01 달러선물



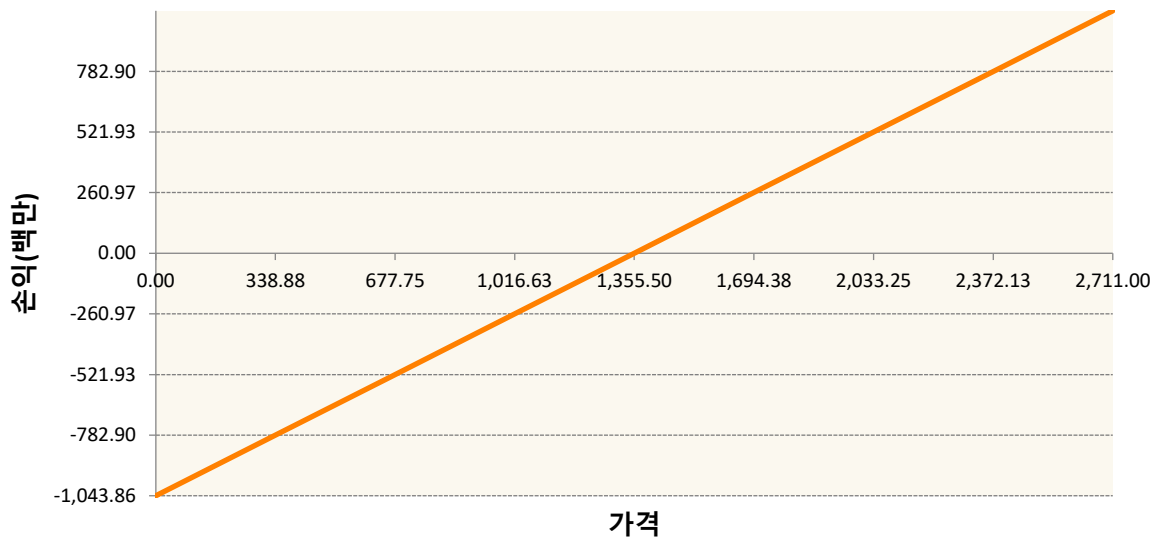
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



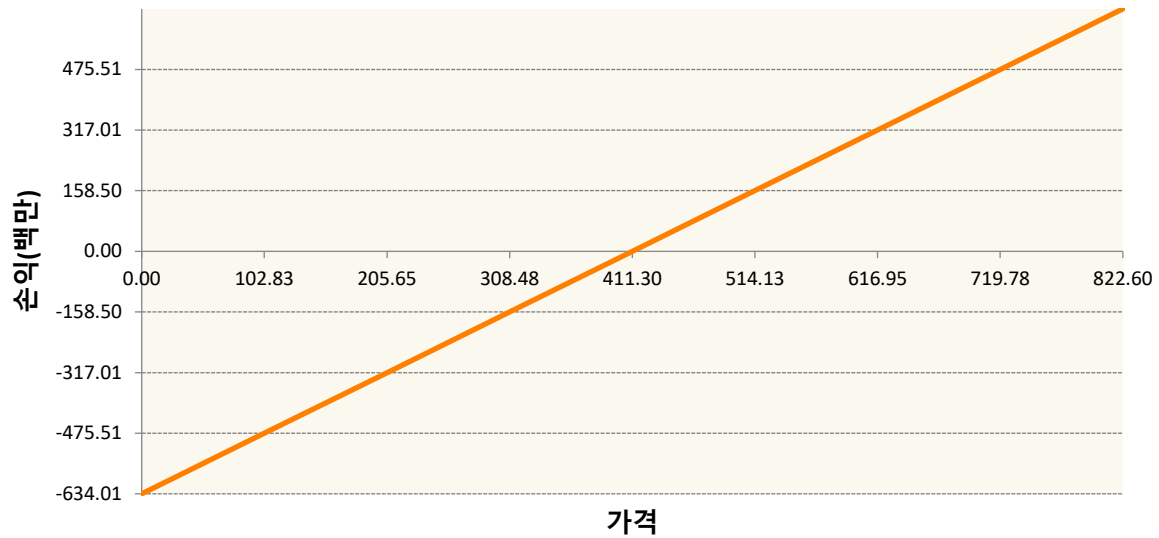
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



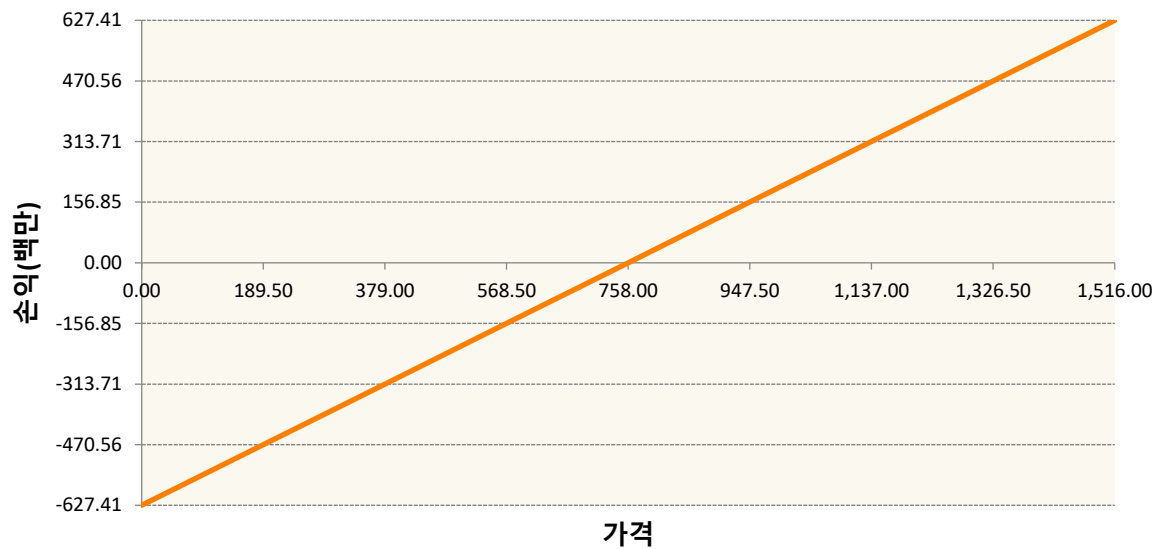
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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 2022-01-05

기준일 2022-01-04

스마트인덱스모

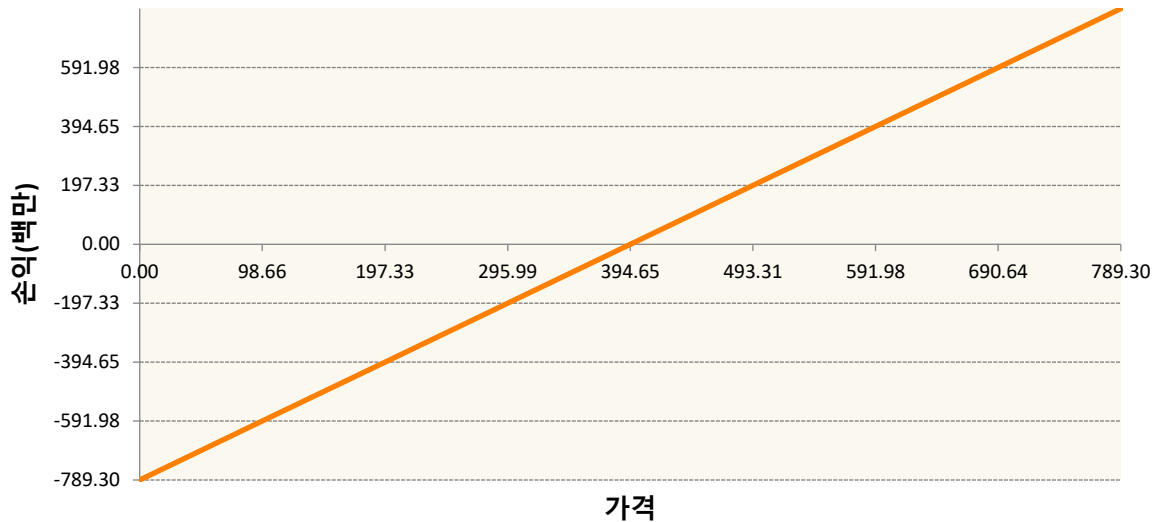
1. 계약금액

(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	2022-01-05
기준일	2022-01-04

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	2022-01-05
기준일	2022-01-04

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)

413

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-01-05

기준일 2022-01-04

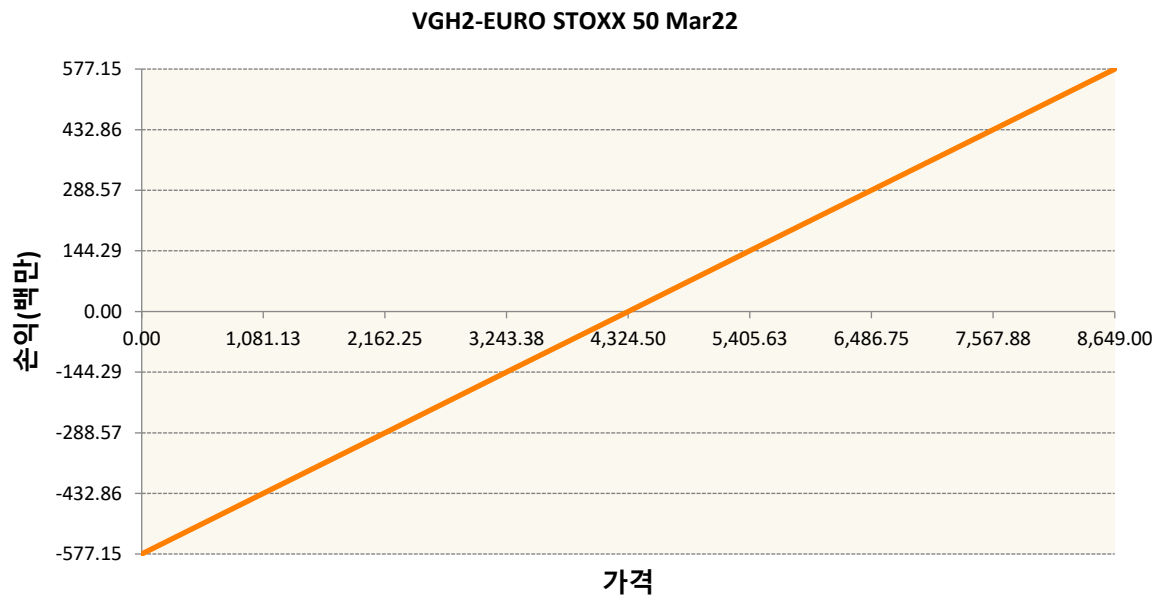
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	577	0	577	

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	2022-01-05
기준일	2022-01-04

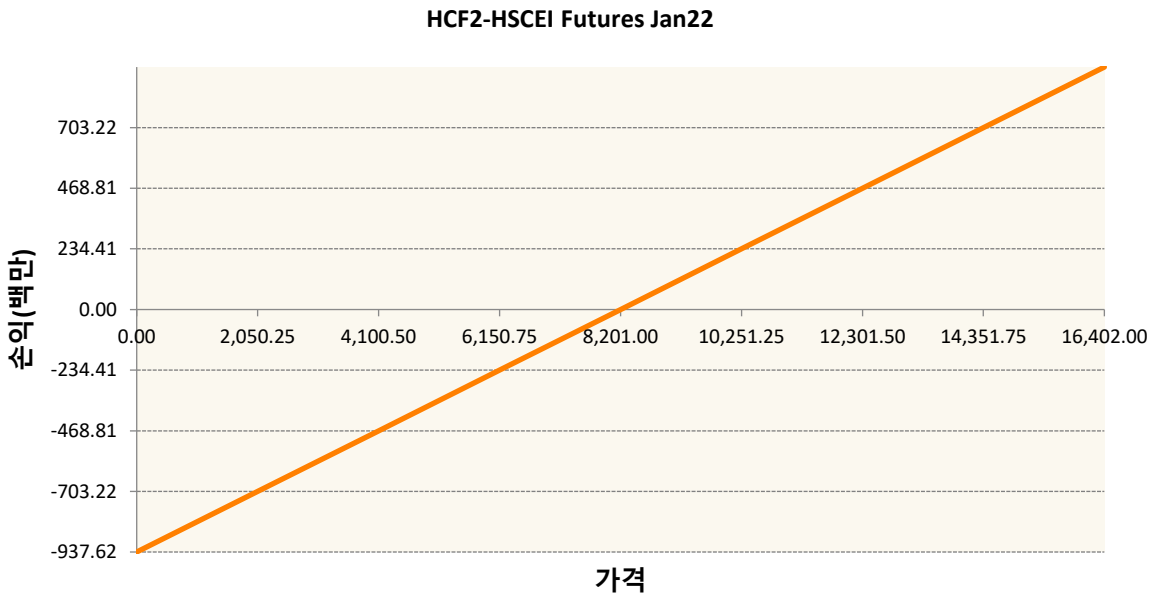
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	938	0	938	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF2	HSCEI Futures Jan22	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일 2022-01-05

기준일 2022-01-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

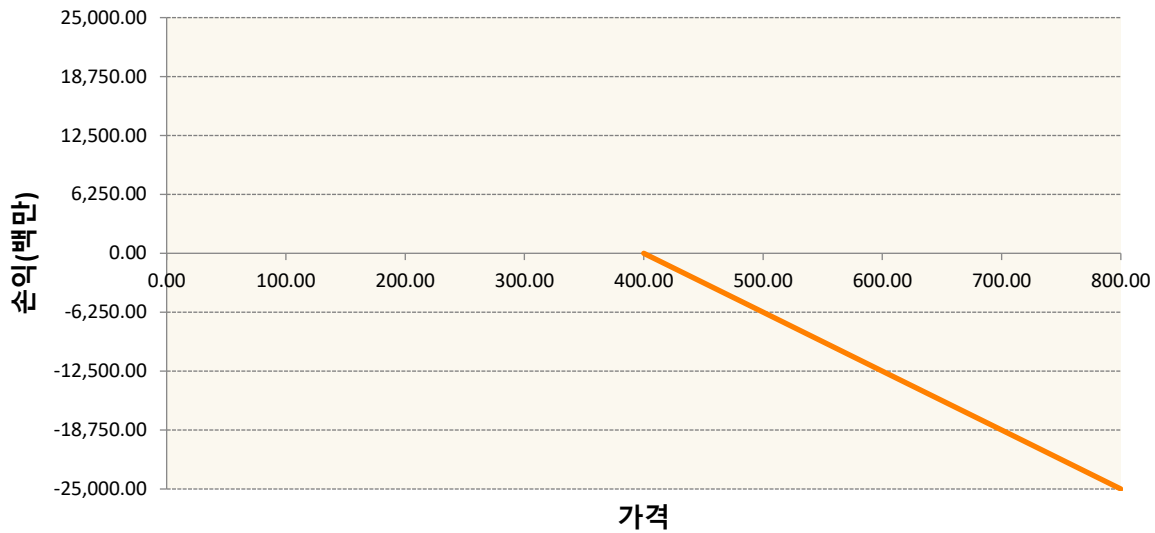
1. 계약금액

(단위:백만원)

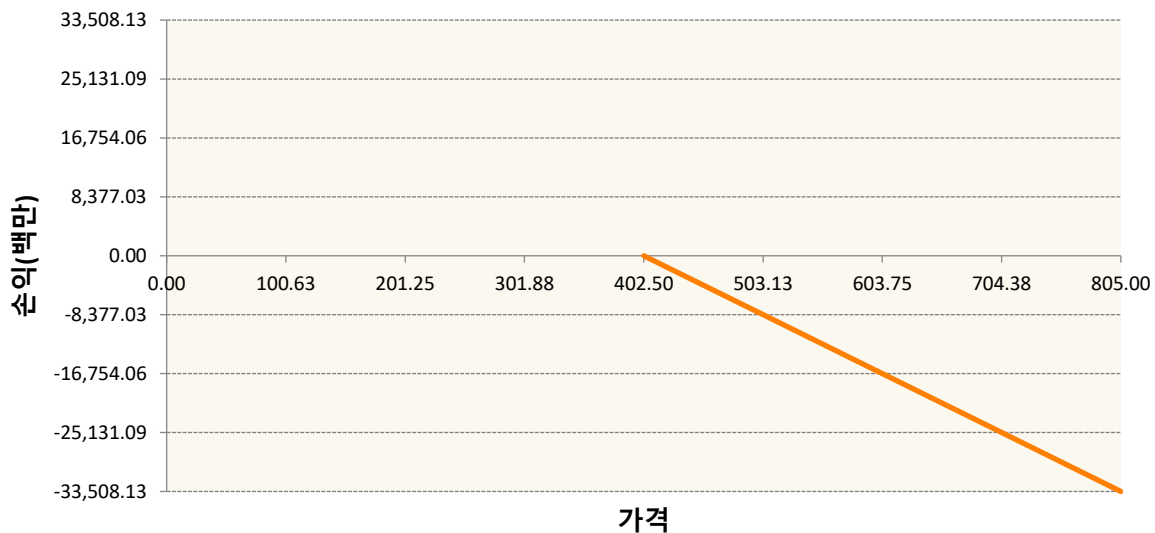
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

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
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%	280	279	278	276	273	270	264	
-5.33%	276	271	265	258	248	236	222	
-2.67%	242	225	206	186	163	140	115	
0%	96	65	32	0	-33	-66	-99	
2.67%	-251	-282	-314	-346	-378	-410	-443	
5.33%	-787	-803	-821	-842	-864	-888	-913	
8.00%	-1,416	-1,420	-1,427	-1,436	-1,447	-1,460	-1,474	
KR4201S14029				2022-01 콜402.5				1,854
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	299	299	298	296	293	290	284
-5.33%	296	292	287	279	268	255	240
-2.67%	266	249	229	205	179	151	122
0%	120	81	41	0	-42	-84	-126
2.67%	-274	-319	-363	-408	-453	-498	-543
5.33%	-938	-964	-994	-1,026	-1,059	-1,095	-1,131
8.00%	-1,756	-1,765	-1,777	-1,792	-1,810	-1,831	-1,854

KR4301S14001

2022-01 풋400

1,289

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,289	-1,289	-1,289	-1,289	-1,289	-1,289	-1,289
-5.33%	-828	-828	-828	-828	-829	-830	-832
-2.67%	-369	-372	-375	-379	-384	-390	-397
0%	39	26	13	0	-13	-27	-41
2.67%	252	241	229	216	204	191	177
5.33%	292	290	287	284	279	273	267
8.00%	294	294	294	294	293	292	290

KR4301S14027

2022-01 풋402.5

151

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
-5.33%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-47	-47	-48
0%	4	3	1	0	-1	-3	-4
2.67%	34	33	31	30	28	26	25
5.33%	42	42	41	40	40	39	38
8.00%	43	43	43	42	42	42	42

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

(단위:백만원)

5,138

공시일 2022-01-05

기준일 2022-01-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

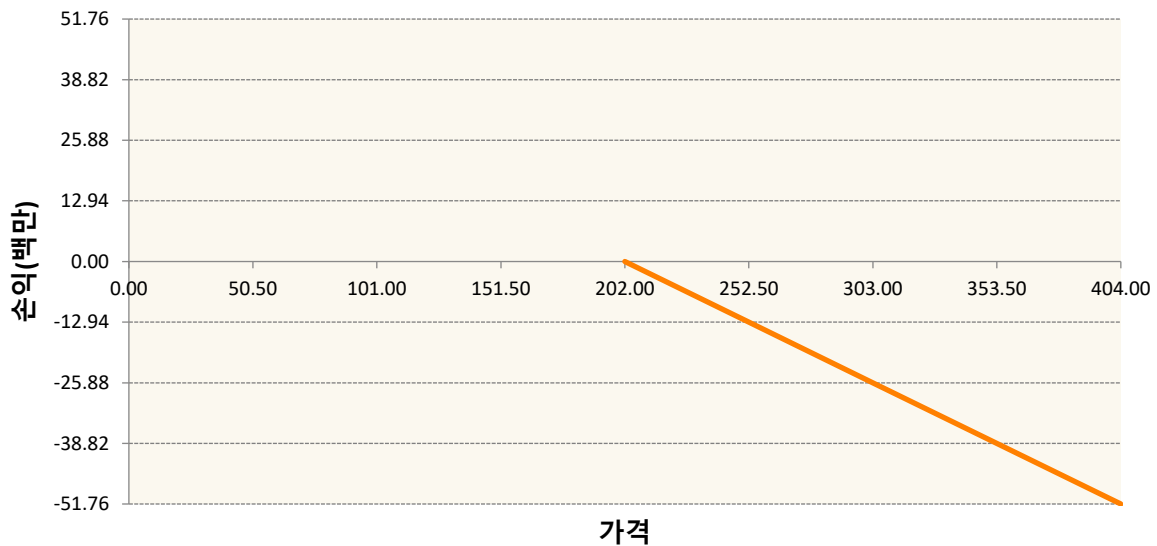
1. 계약금액

(단위:백만원)

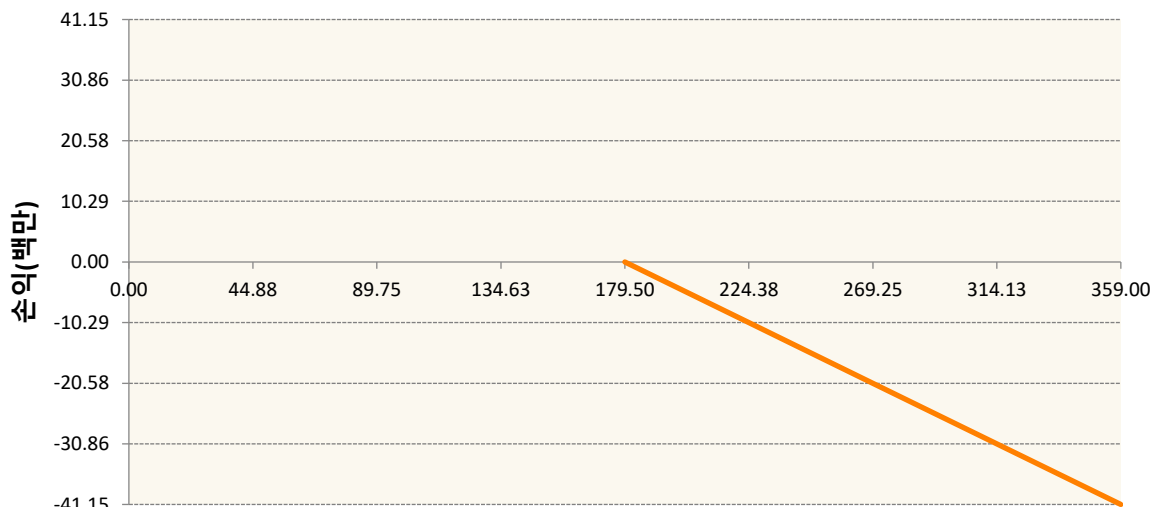
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	101	-101	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,023	-2,023	장외

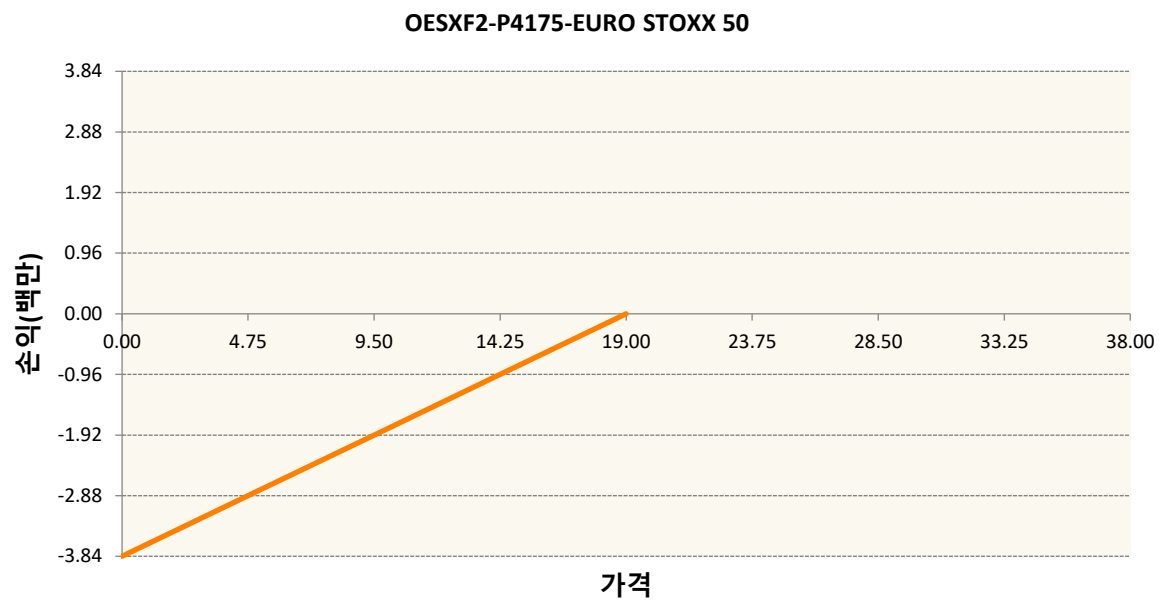
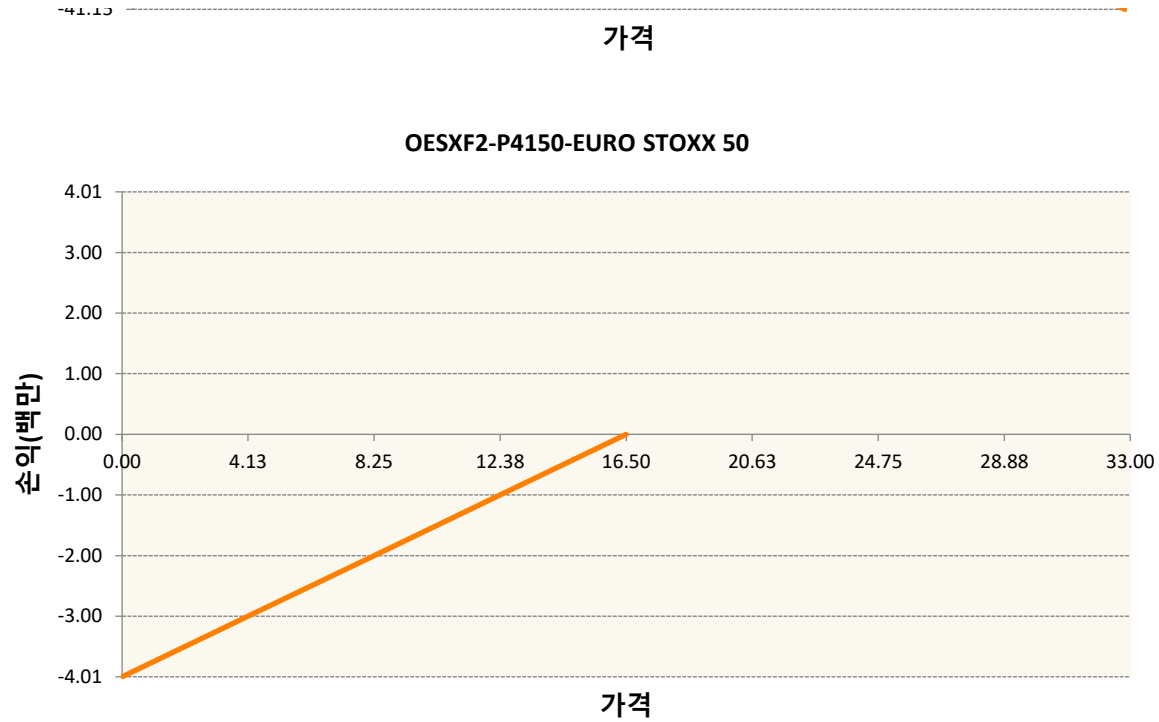
2. 만기시점의 손익구조

OESXF2-C4150-EURO STOXX 50



OESXF2-C4175-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY	4
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	0.32
OESXF2-P41 EURO STOXX 50	0.31

공시일 2022-01-05

기준일 2022-01-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

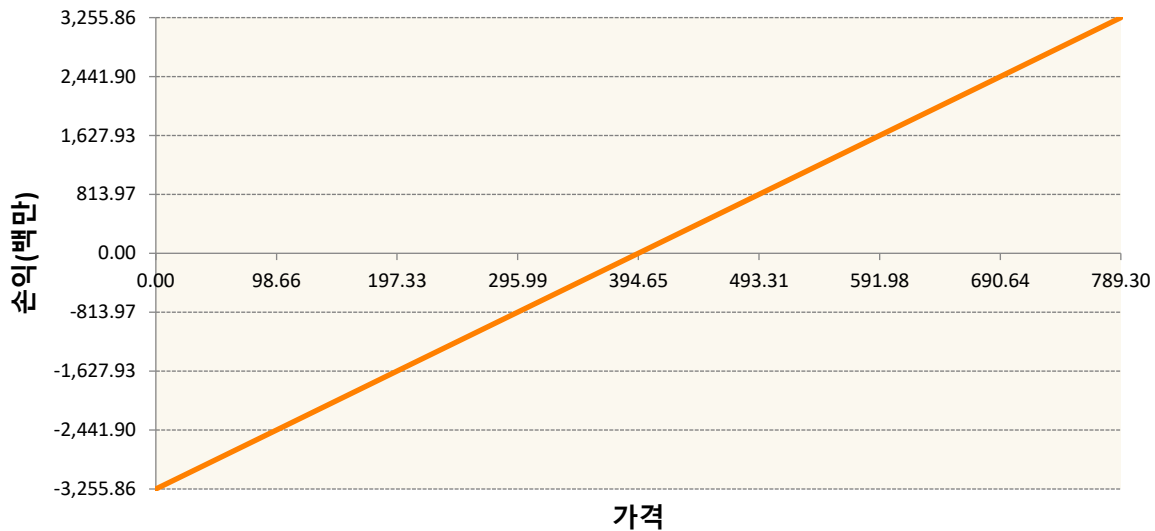
1. 계약금액

(단위:백만원)

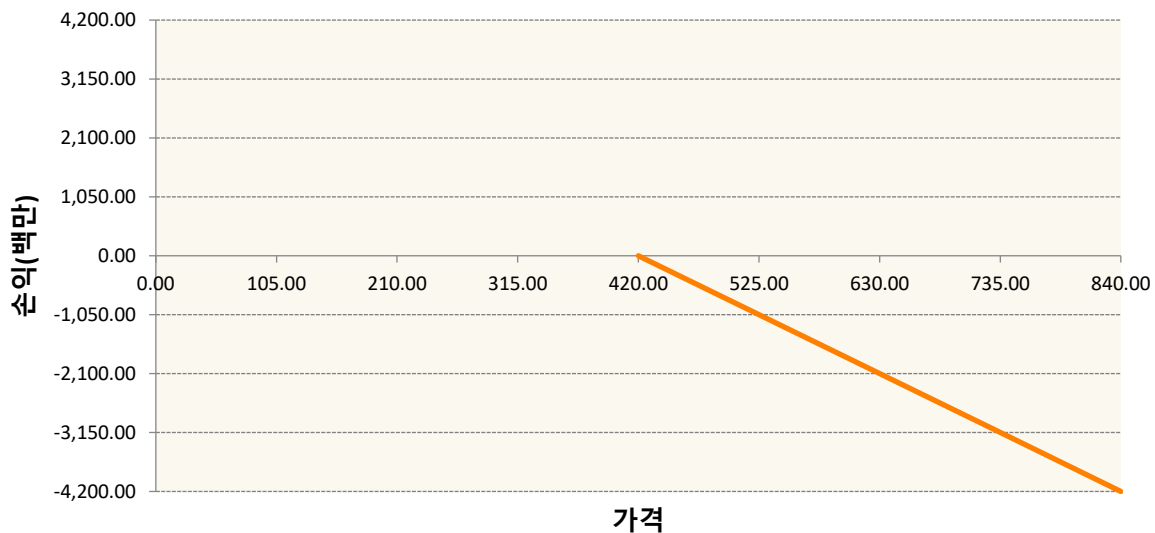
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,256	0	3,256	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

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).

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		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		121
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	5	5	5	5	5	5	4
-2.67%	5	5	5	4	4	3	2
0%	4	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-3	-7	-10	-14	-18	-23	-27
5.33%	-31	-36	-42	-47	-53	-58	-64
8.00%	-89	-95	-100	-105	-110	-116	-121
KR4201S14250 2022-01 콜425							29

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	0	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-5	-6
5.33%	-5	-7	-8	-10	-11	-13	-14
8.00%	-18	-20	-22	-23	-25	-27	-29
KR4301S14001 2022-01 풋400							15

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	15	15	15
-5.33%	9	9	9	9	9	9	10
-2.67%	4	4	4	4	4	4	5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

357

공시일	2022-01-05
기준일	2022-01-04

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	10,532	0	10,532	

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	2022-01-05
기준일	2022-01-04

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	9,618	0	9,618	

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	2022-01-05
기준일	2022-01-04

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	45,186	0	45,186	
누계	통화	선도	0	28,061	-28,061	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E

2,245

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

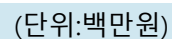
4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

738

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물

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 2022-01-05

기준일 2022-01-04

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

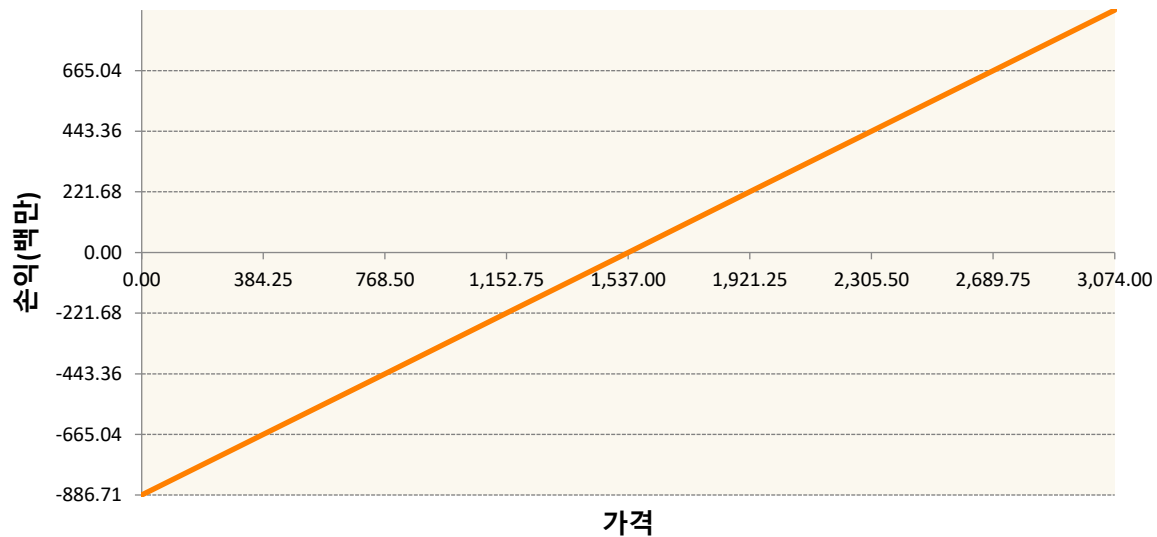
1. 계약금액

(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	1,801	0	1,801	장외
누계	통화	선도	0	1,119	-1,119	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 2022-01-05

기준일 2022-01-04

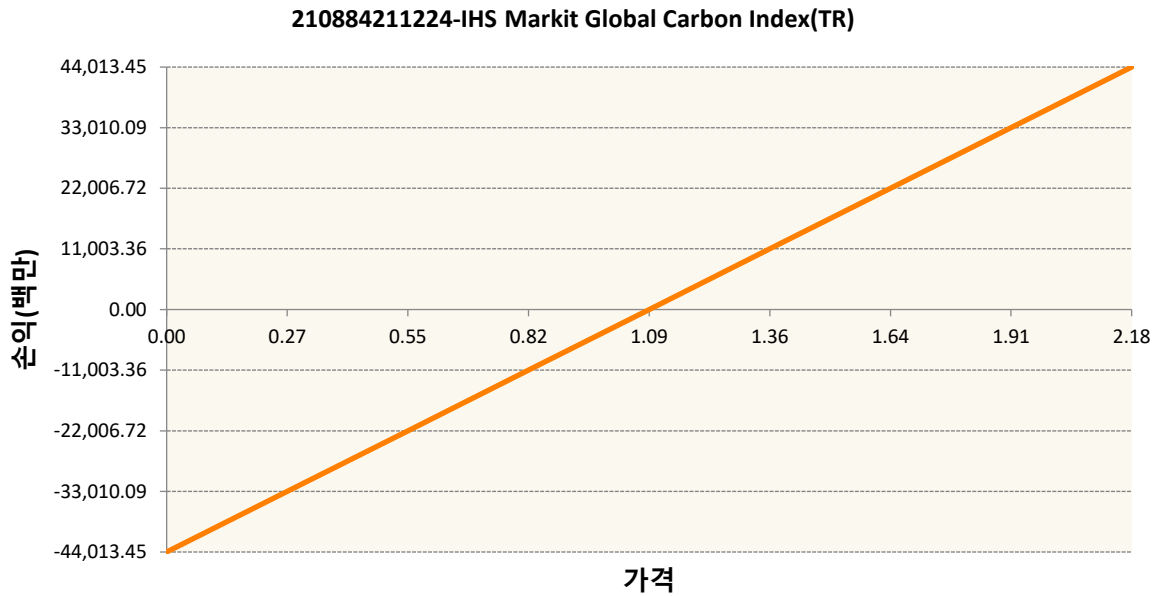
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	44,013	0	44,013	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,507

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

(단위:백만원)

5,602

공시일 2022-01-05

기준일 2022-01-04

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

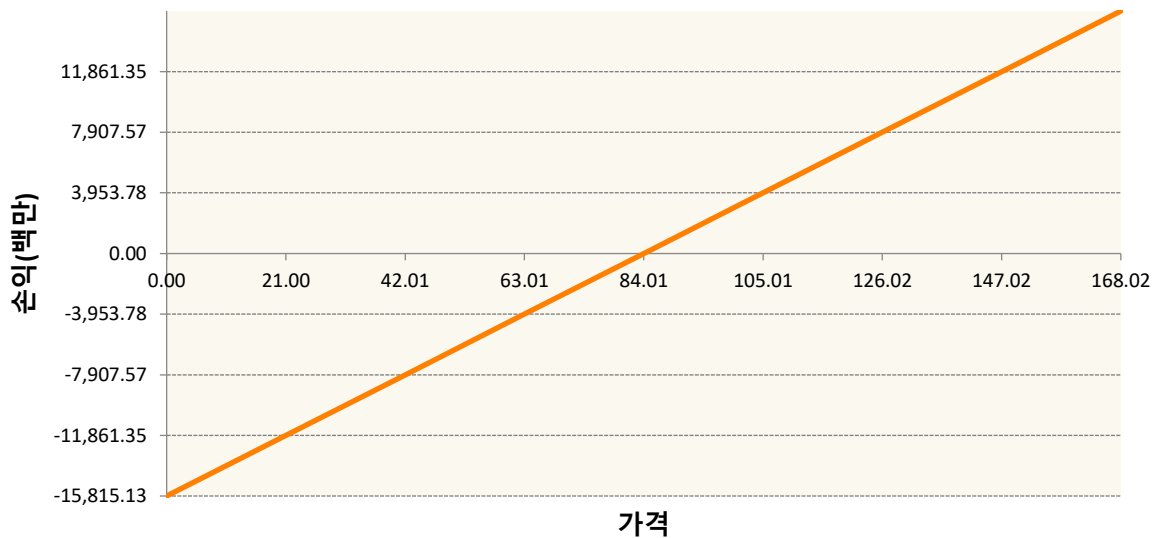
1. 계약금액

(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	15,815	0	15,815	
누계	통화	선도	0	6,094	-6,094	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCV·KRW/EUR 28-01-22E

487

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,265

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

(단위:백만원)

2,950

공시일	2022-01-05
기준일	2022-01-04

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)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	7

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

(단위:백만원)

56

공시일 2022-01-05

기준일 2022-01-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

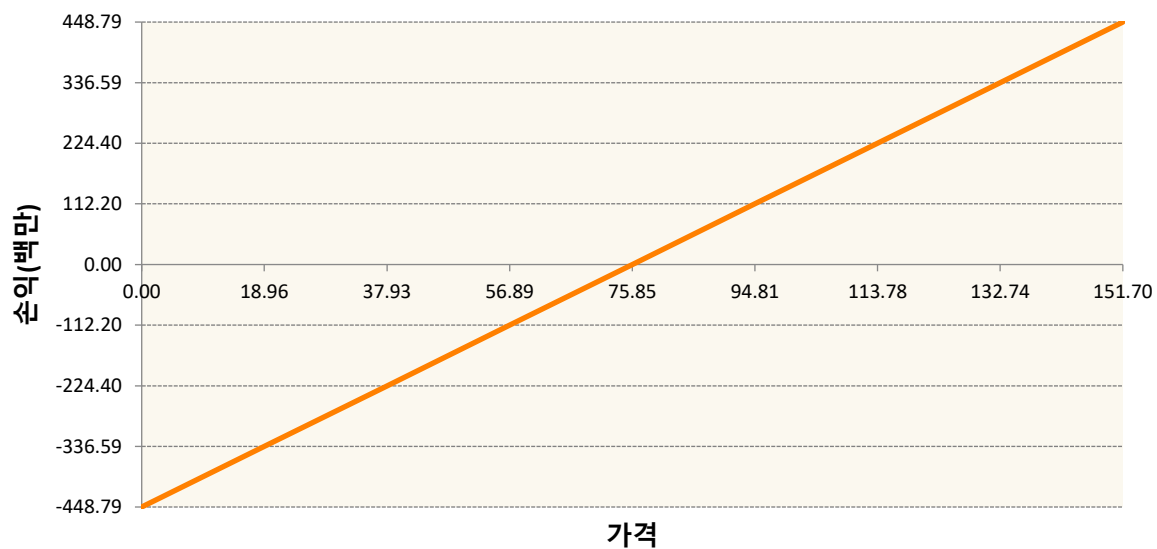
1. 계약금액

(단위:백만원)

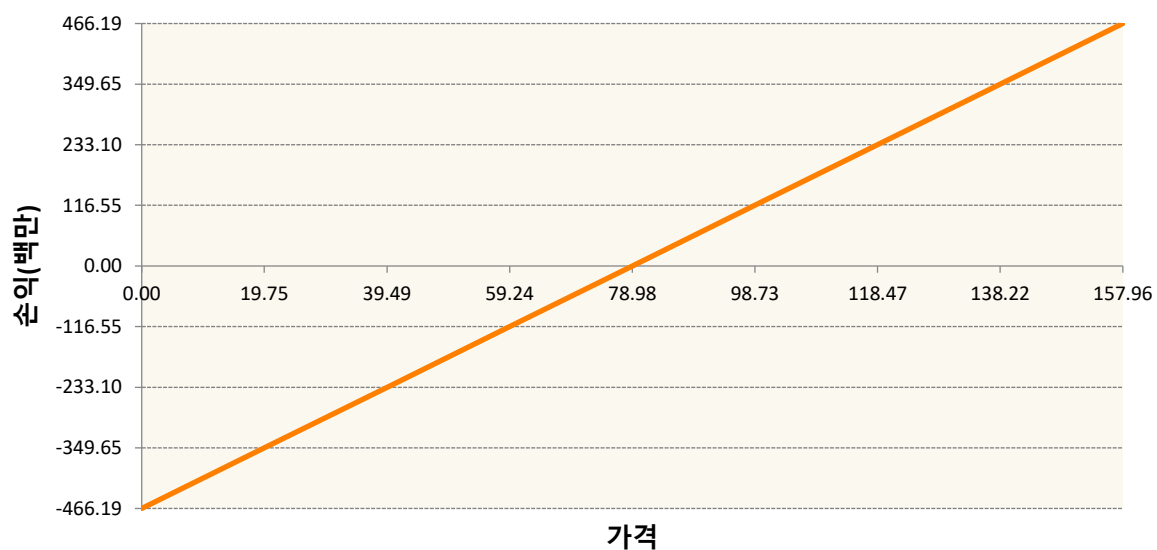
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,937	358	1,579	

2. 만기시점의 손익구조

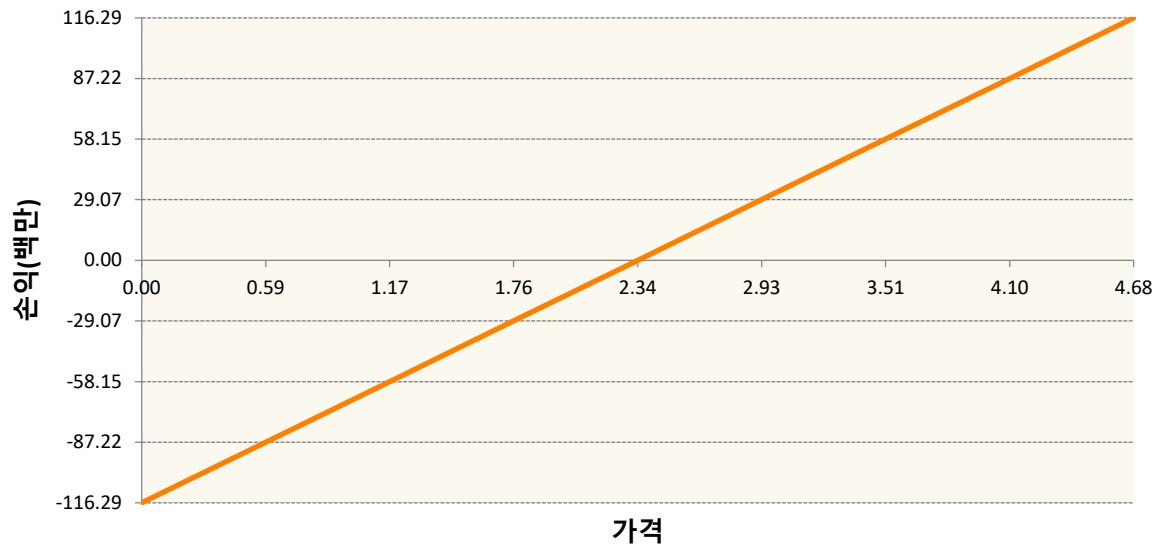
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



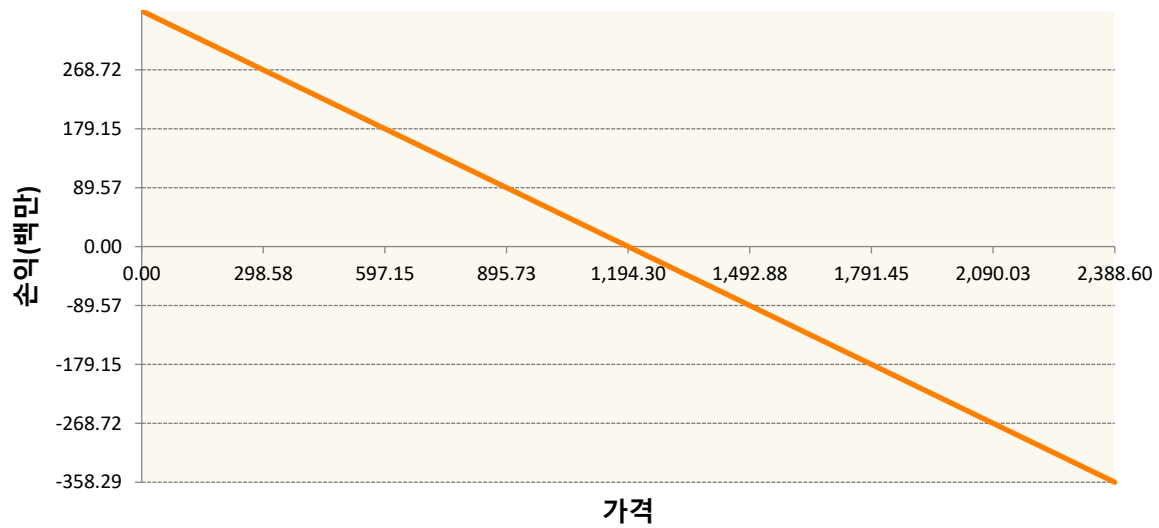
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



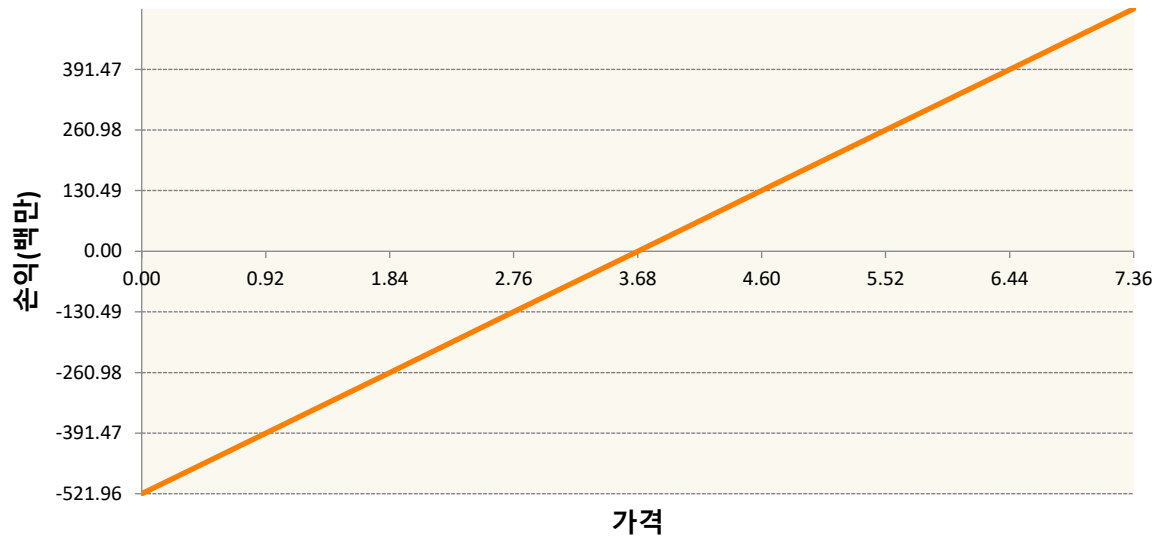
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

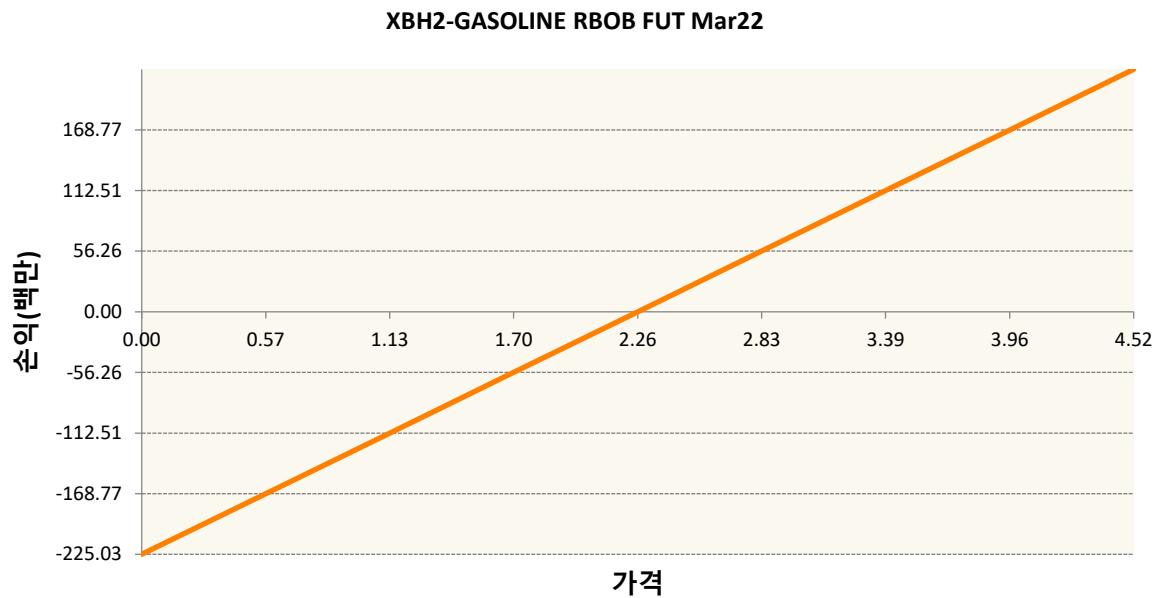
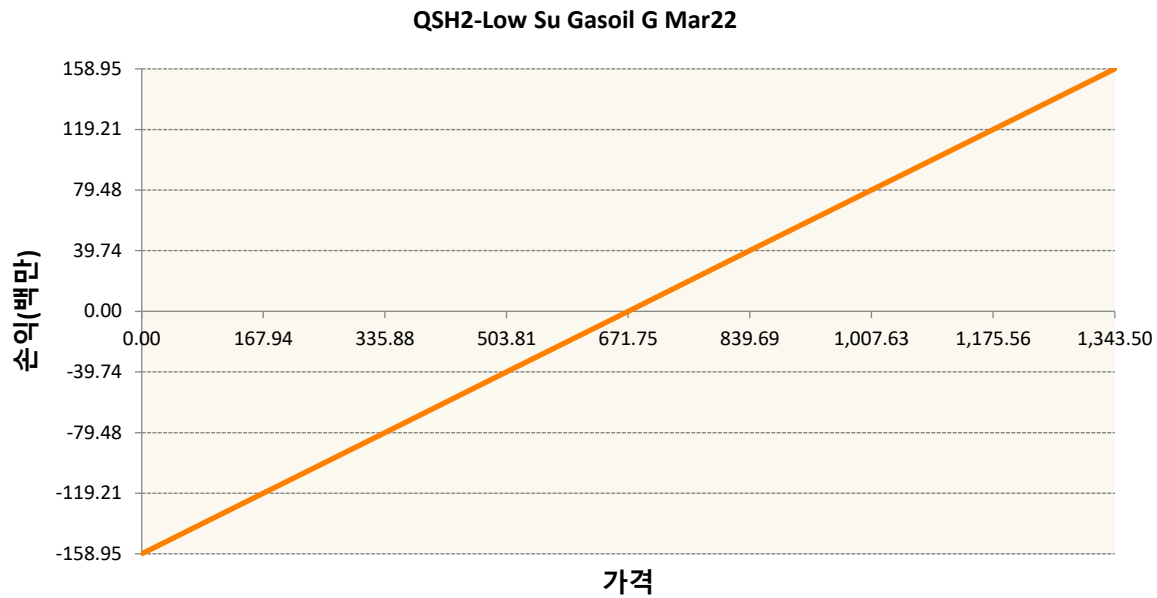


KR4175S10007-2022-01 달러선물



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		29
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)
		348

