

공시일 2022-01-07

기준일 2022-01-06

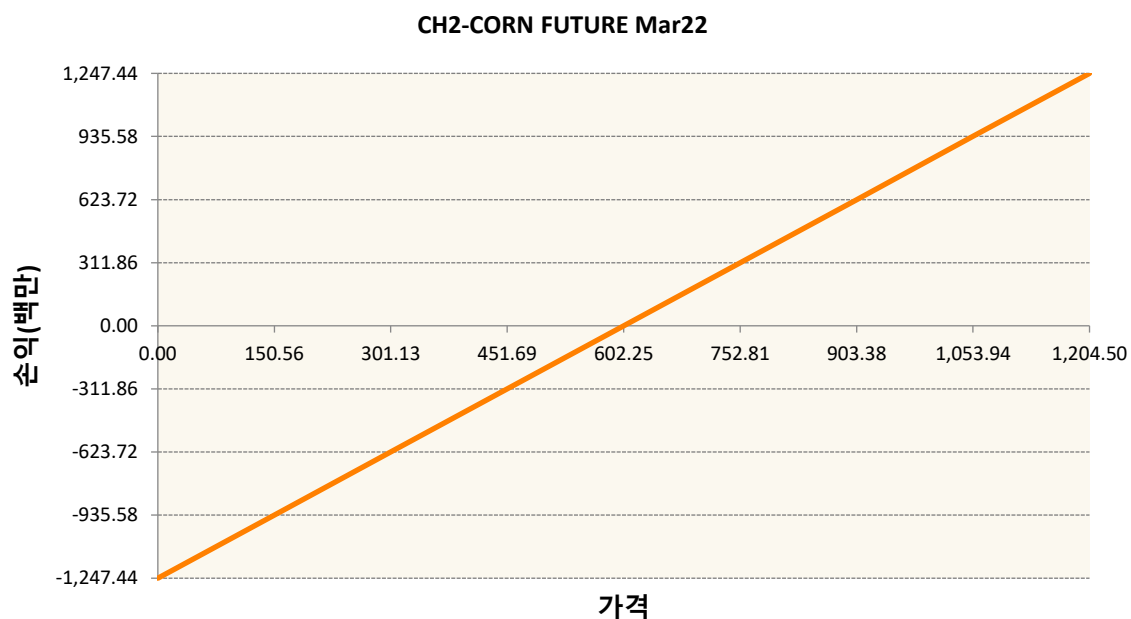
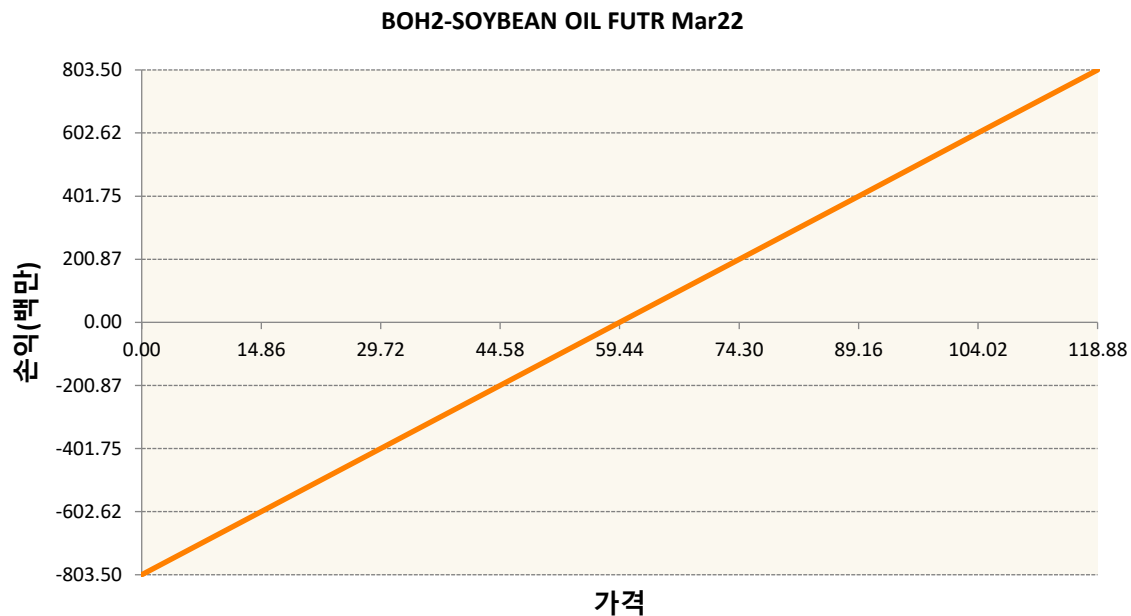
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

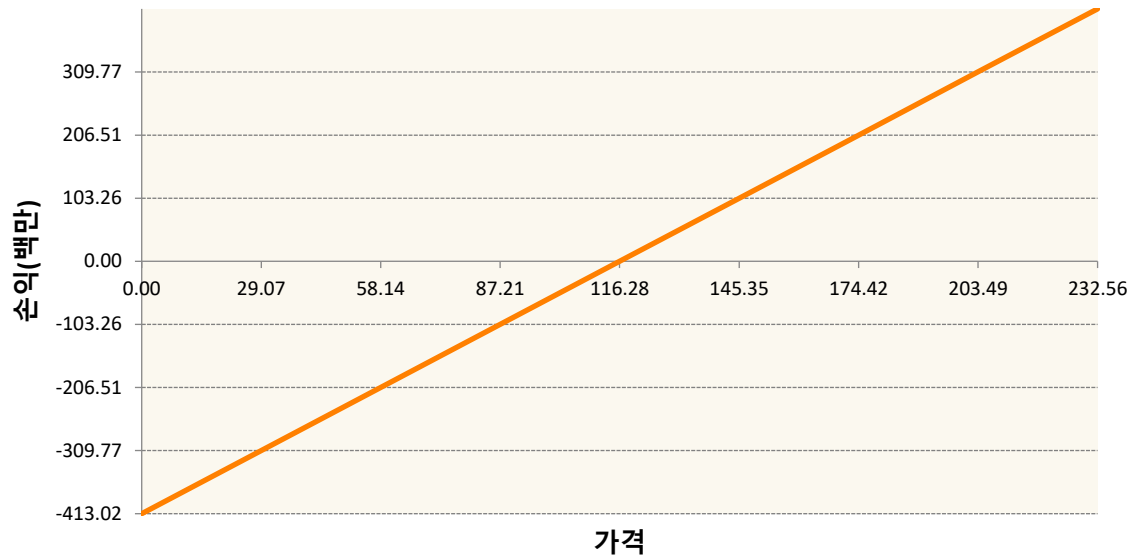
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,731	781	5,950	

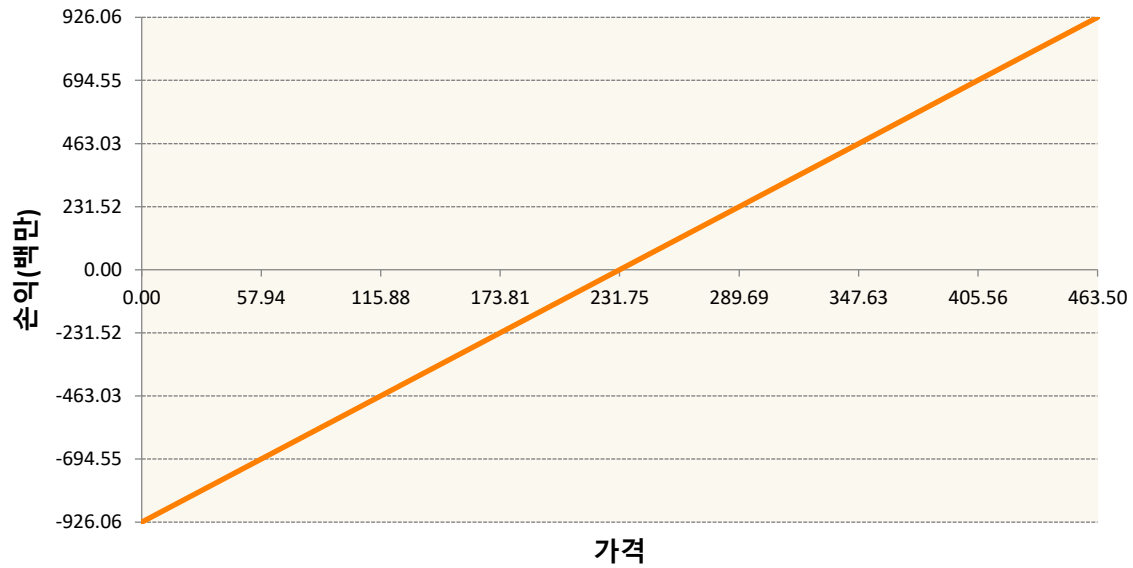
2. 만기시점의 손익구조



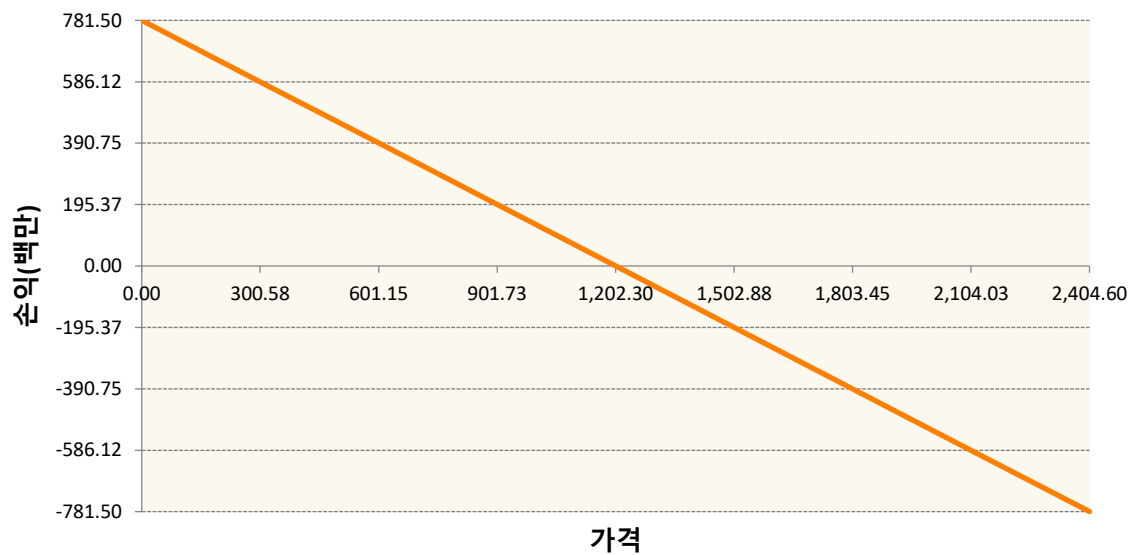
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



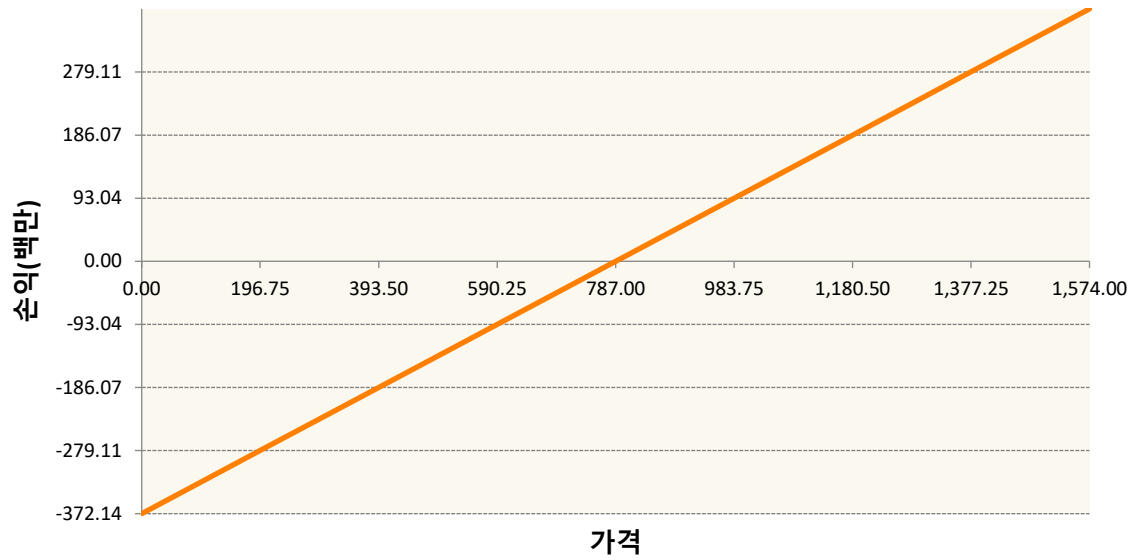
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



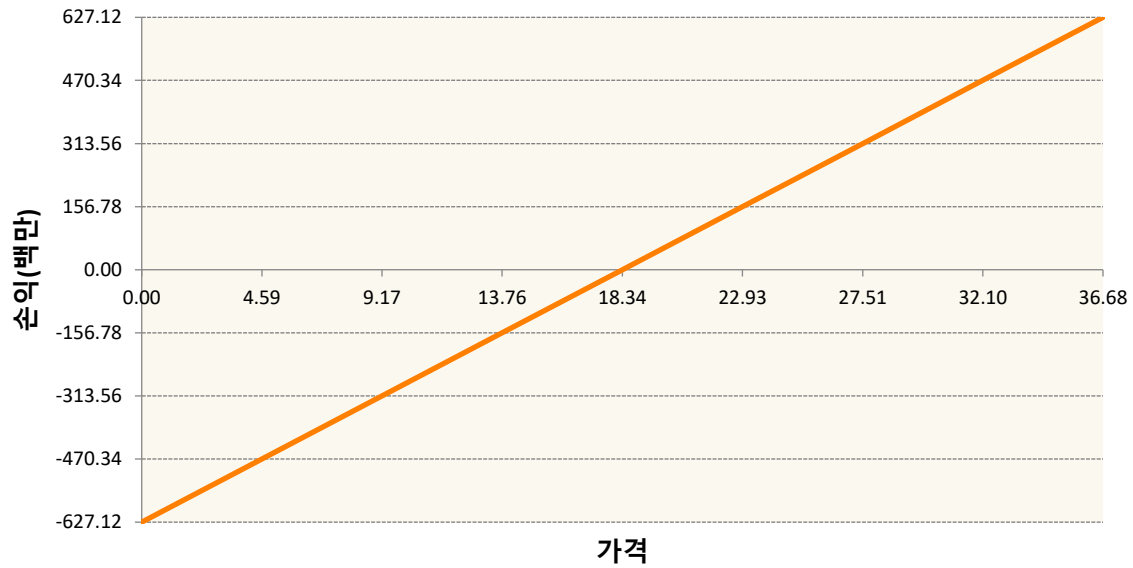
KR4175S10007-2022-01 달러선물



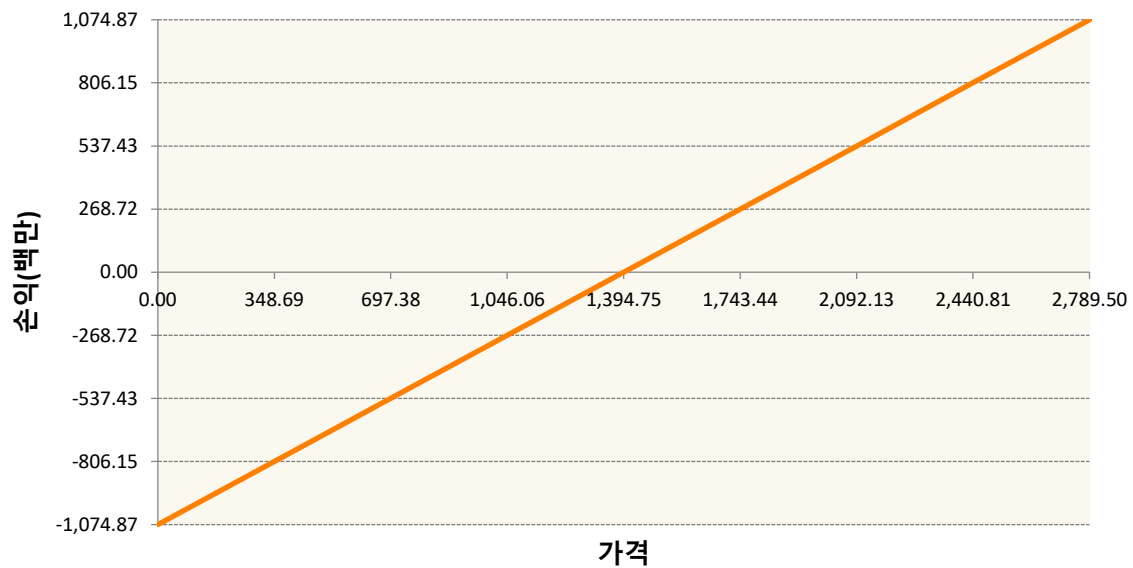
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



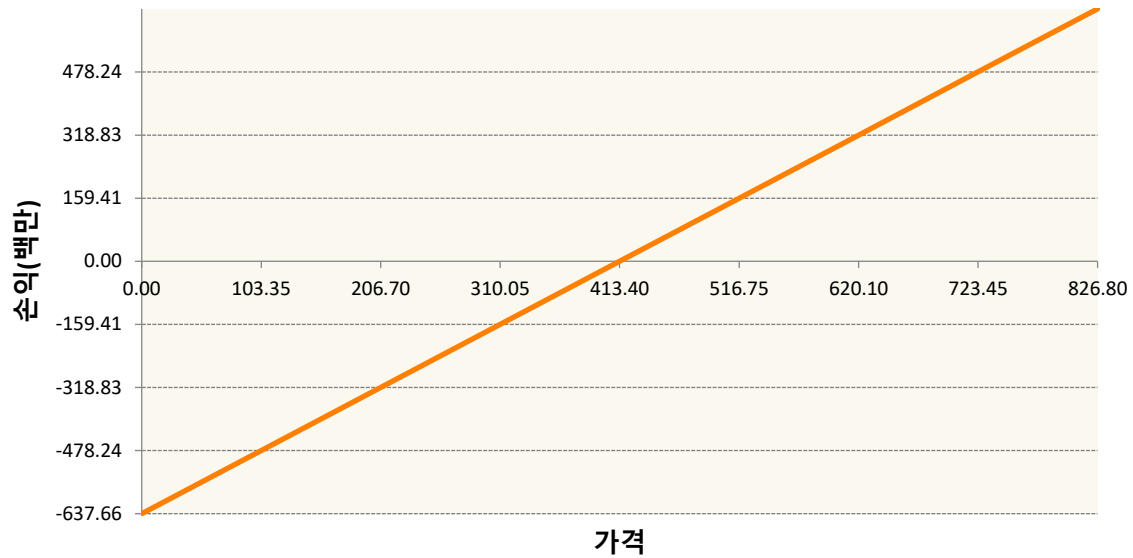
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



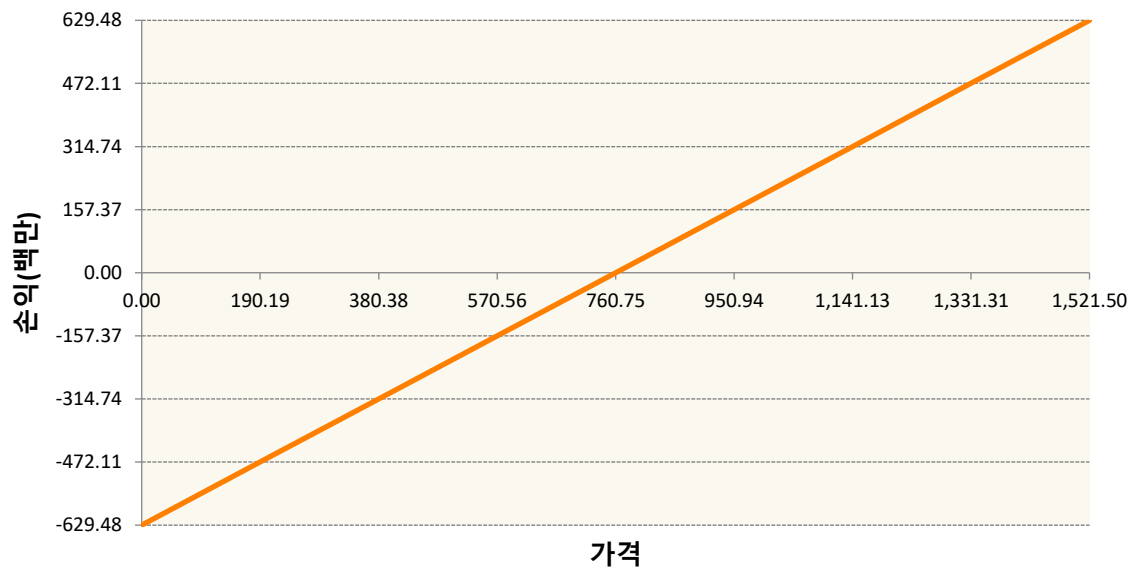
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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 2022-01-07

기준일 2022-01-06

스마트인덱스모

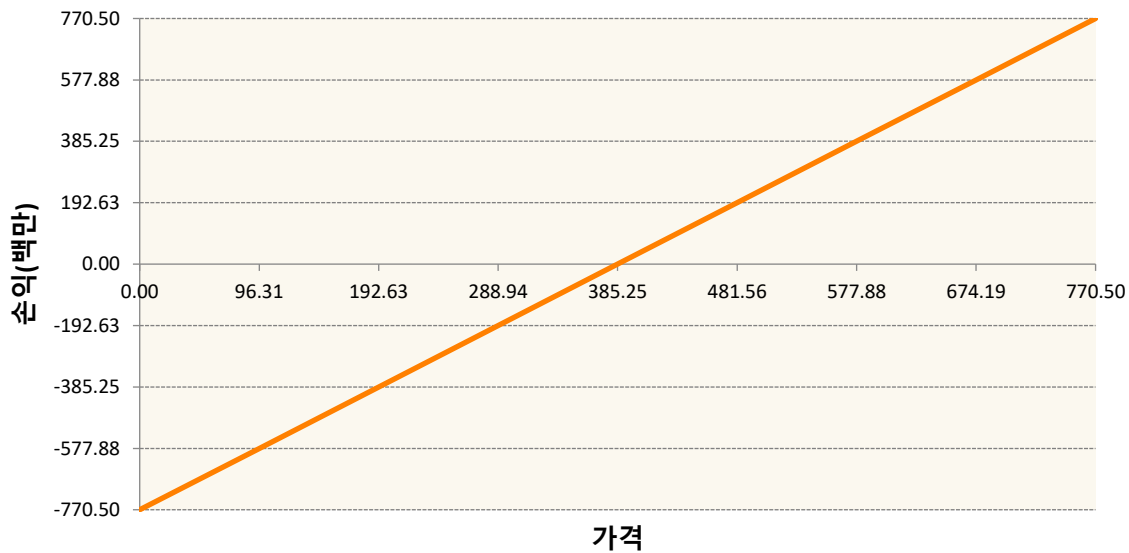
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	771	0	771	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					62
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-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%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

공시일	2022-01-07
기준일	2022-01-06

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

920

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

560

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-01-07
기준일	2022-01-06

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	434
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

407

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-01-07
기준일	2022-01-06

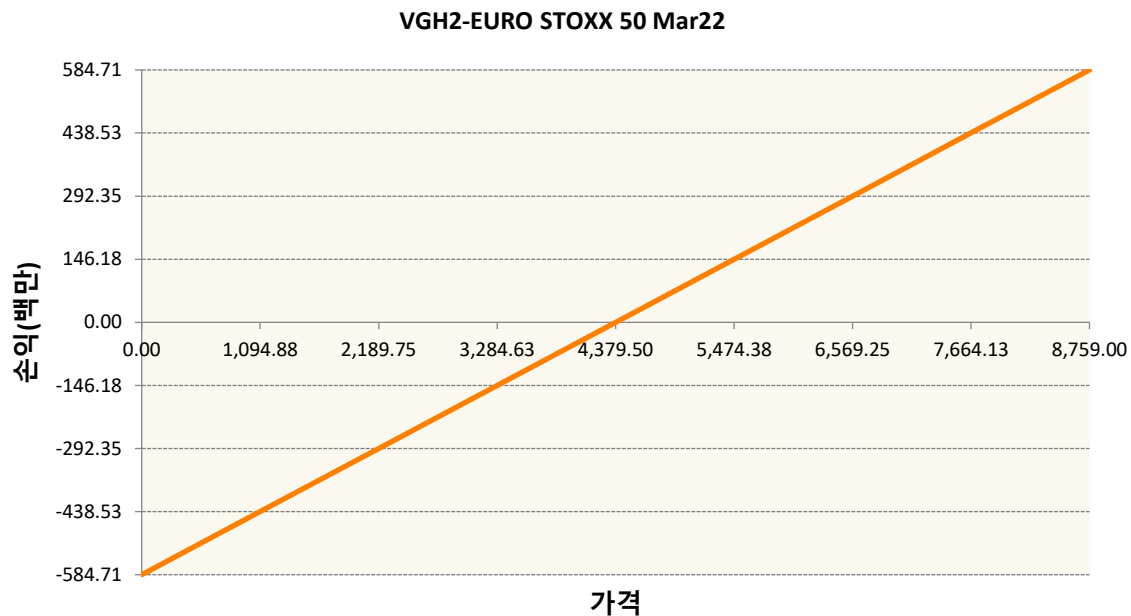
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	585	0	585	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	47
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2022-01-07
기준일	2022-01-06

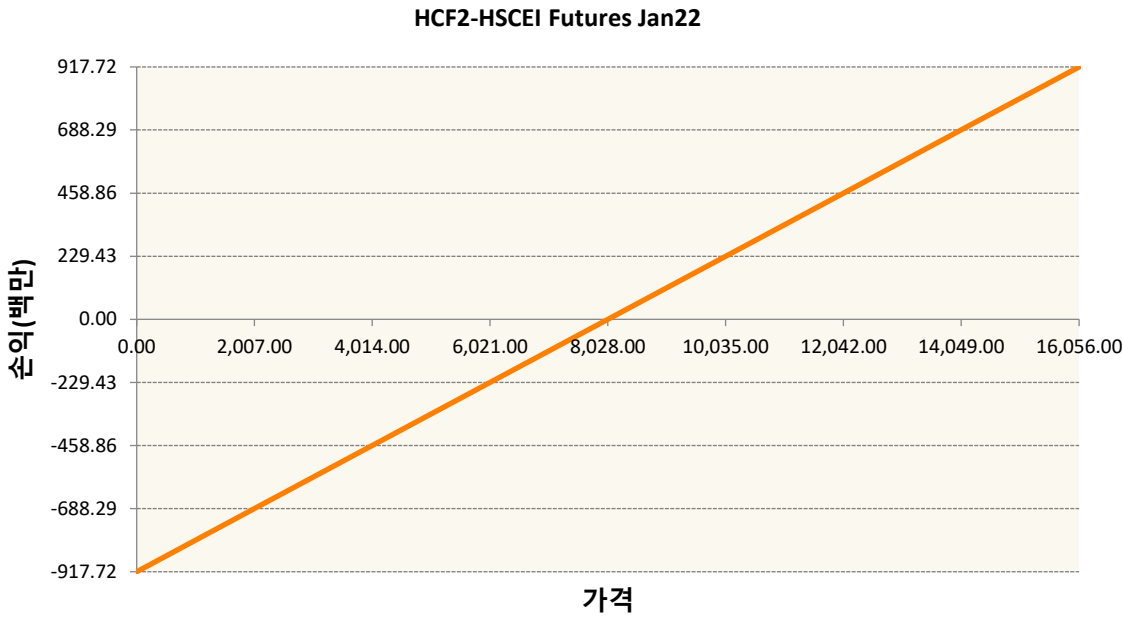
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	918	0	918	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF2	HSCEI Futures Jan22	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

76

공시일 2022-01-07

기준일 2022-01-06

커버드콜모(주식혼합-파생형)

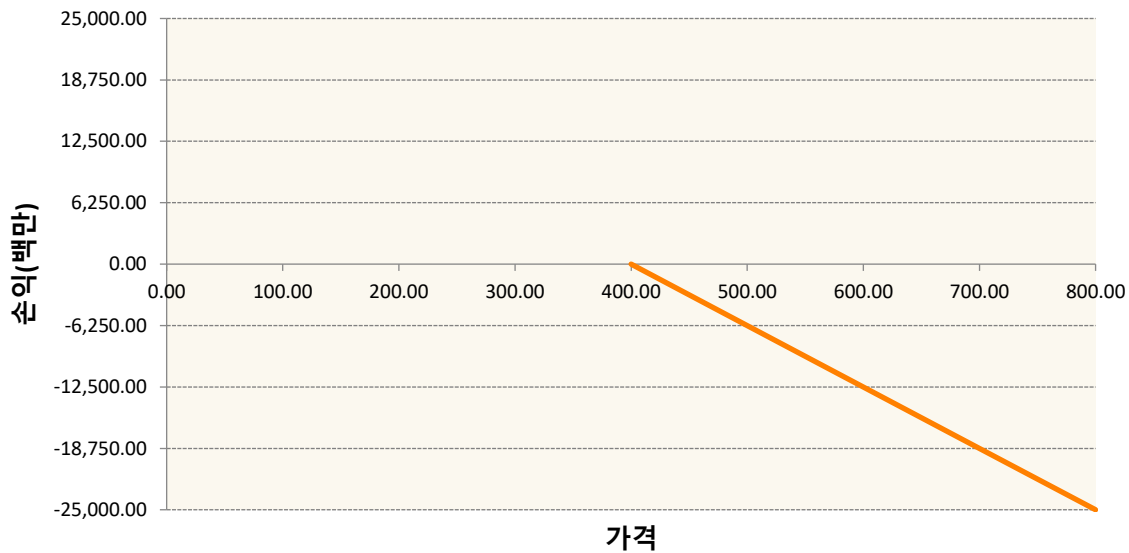
1. 계약금액

(단위:백만원)

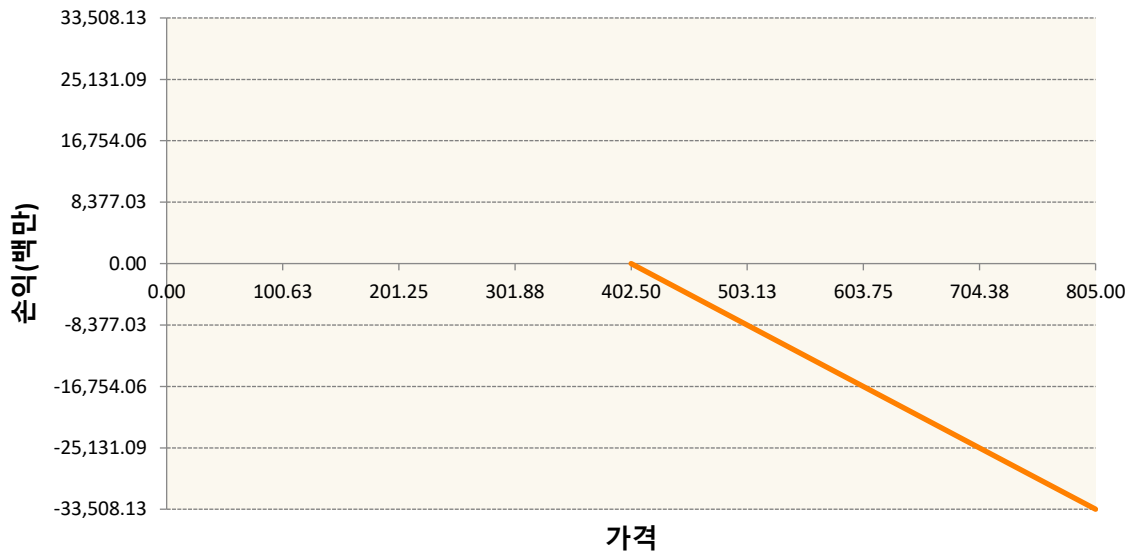
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	78,021	-78,021	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201S14003-2022-01 콜400



KR4201S14029-2022-01 콜402.5



The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 800.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), ranges from -17,500.00 to 17,500.00. A solid orange line represents the net income function, starting at a price of 0 with a net income of -17,500 and reaching a net income of 0 at a price of 400.

가격 (Price)	순이익 (Net Income 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 the relationship between price and profit/loss. The x-axis represents '가격' (Price) and the y-axis represents '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions). A solid orange line shows a linear relationship, starting at a price of 0.00 with a loss of 2,012.50 million and reaching a profit of 0.00 million at a price of 402.50 million.

가격	손익 (백만)
0.00	-2,012.50
402.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201S14003				2022-01 콜400				1,104
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	82	82	82	82	82	81	80	
-5.33%	82	82	81	80	78	75	72	
-2.67%	79	76	72	65	57	48	37	
0%	49	35	18	0	-20	-41	-63	
2.67%	-97	-126	-155	-185	-214	-244	-274	
5.33%	-460	-486	-512	-540	-568	-596	-624	
8.00%	-1,009	-1,020	-1,033	-1,048	-1,065	-1,084	-1,104	
KR4201S14029				2022-01 콜402.5				1,335
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	79	79	79	79	79	78	78
-5.33%	79	79	78	77	76	73	69
-2.67%	77	75	70	64	56	46	34
0%	52	38	20	0	-22	-47	-73
2.67%	-91	-126	-163	-200	-237	-275	-314
5.33%	-500	-538	-577	-616	-656	-695	-735
8.00%	-1,183	-1,202	-1,225	-1,249	-1,276	-1,305	-1,335
KR4301S14001 2022-01 풋400							1,339

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,339	-1,339	-1,339	-1,339	-1,339	-1,339	-1,339
-5.33%	-888	-888	-888	-888	-888	-888	-888
-2.67%	-438	-438	-438	-438	-439	-440	-441
0%	10	8	4	0	-5	-11	-17
2.67%	400	388	375	363	350	337	323
5.33%	586	576	566	556	545	533	522
8.00%	614	612	610	608	604	600	595

KR4301S14027 2022-01 풋402.5							154
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
-5.33%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	48	47	46	45	43	42	41
5.33%	76	75	73	72	70	69	67
8.00%	82	81	81	81	80	79	79

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

(단위:백만원)

3,643

공시일 2022-01-07

기준일 2022-01-06

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

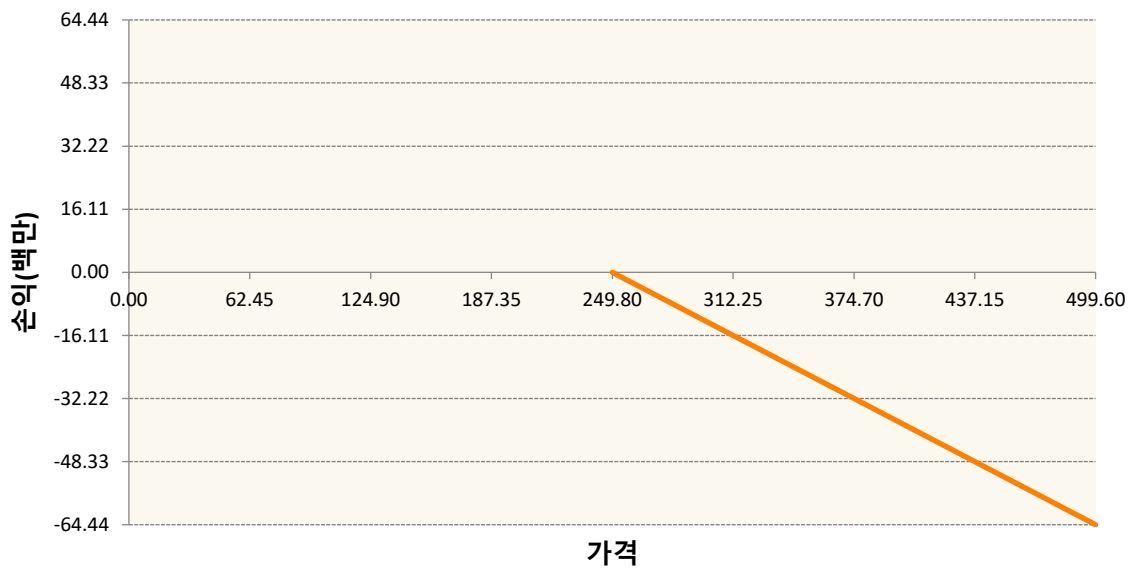
1. 계약금액

(단위:백만원)

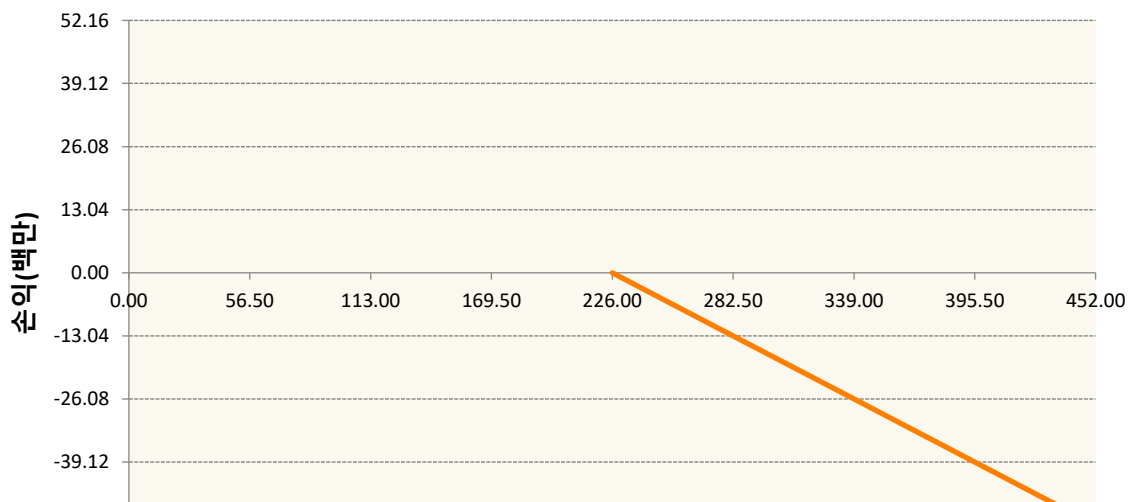
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	120	-120	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,037	-2,037	장외

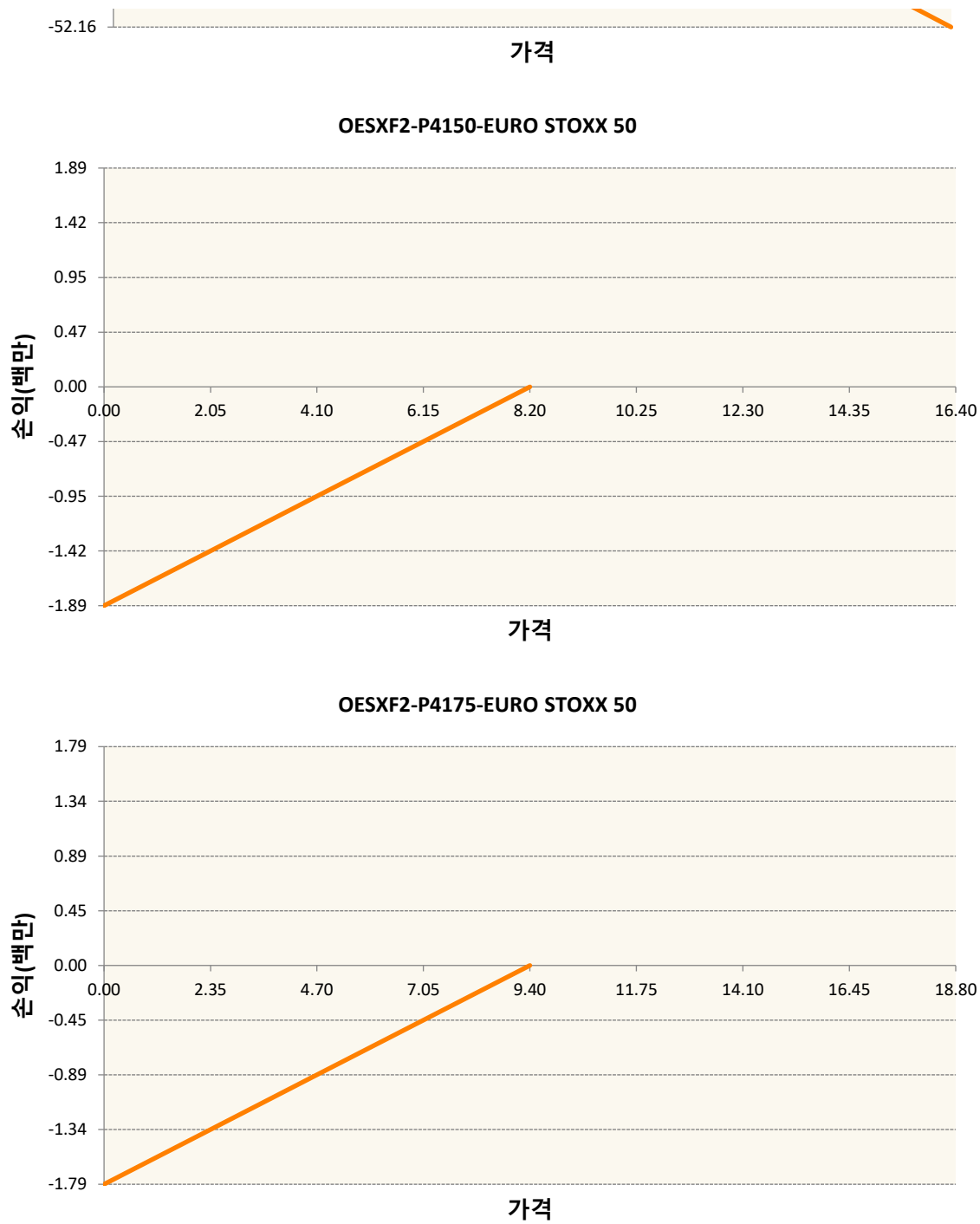
2. 만기시점의 손익구조

OESXF2-C4150-EURO STOXX 50



OESXF2-C4175-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG 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

6
54
109
5
4
0.15
0.14

공시일 2022-01-07

기준일 2022-01-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

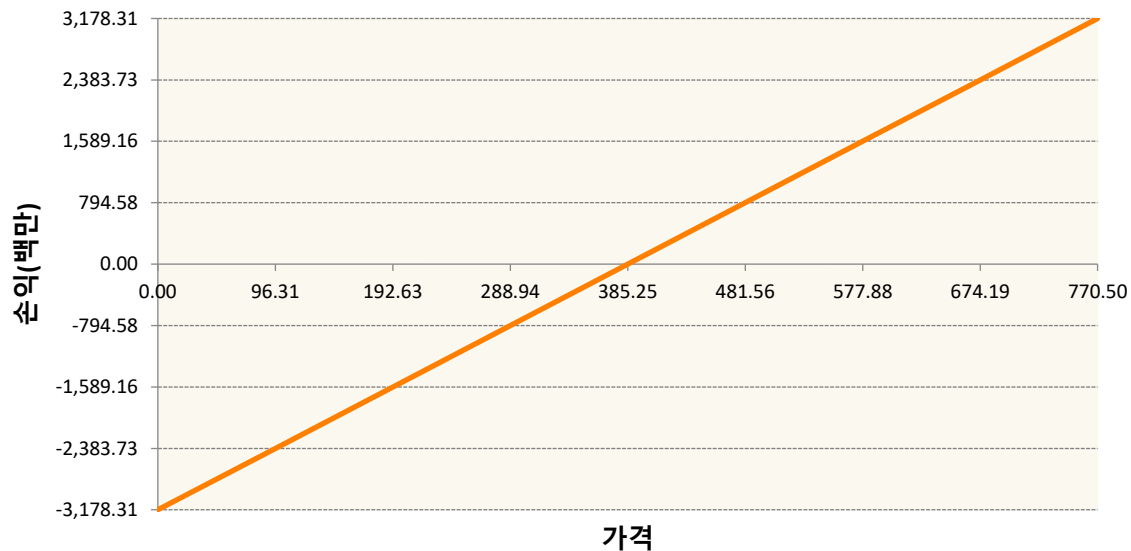
1. 계약금액

(단위:백만원)

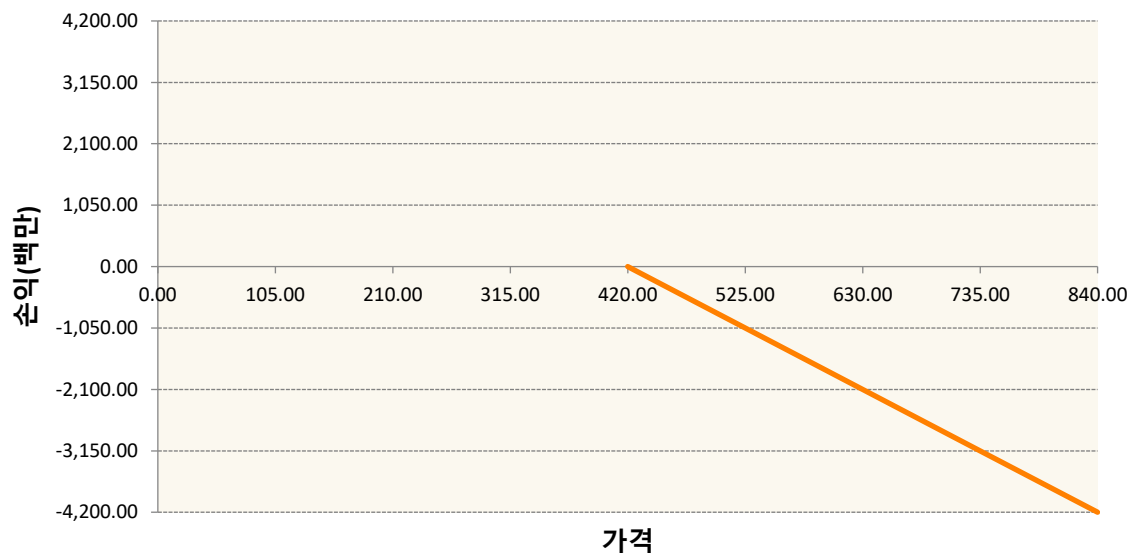
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,178	0	3,178	장내
누계	유가증권	옵션	200	5,475	-5,275	장내

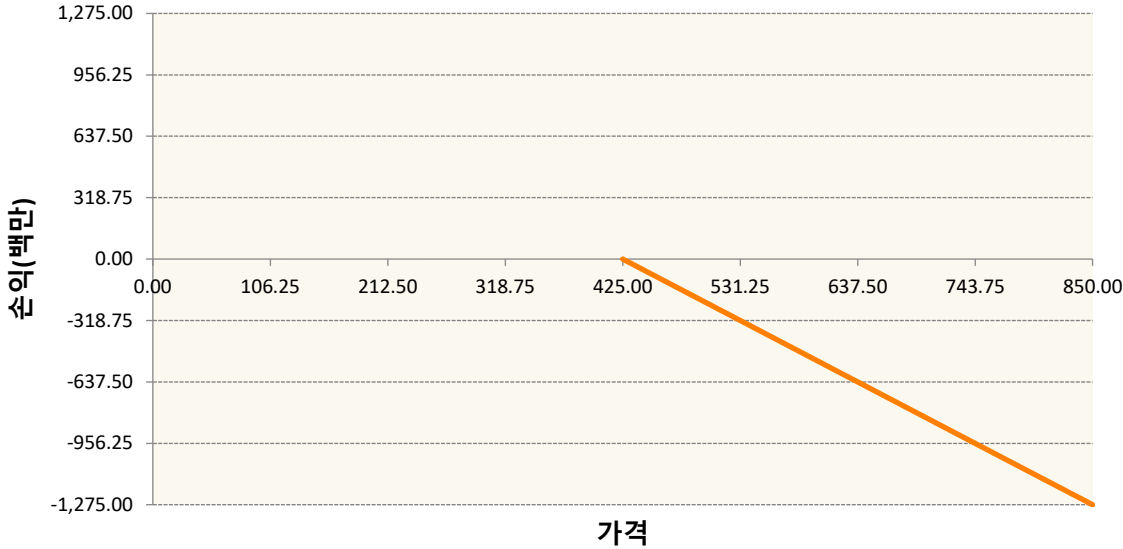
2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물

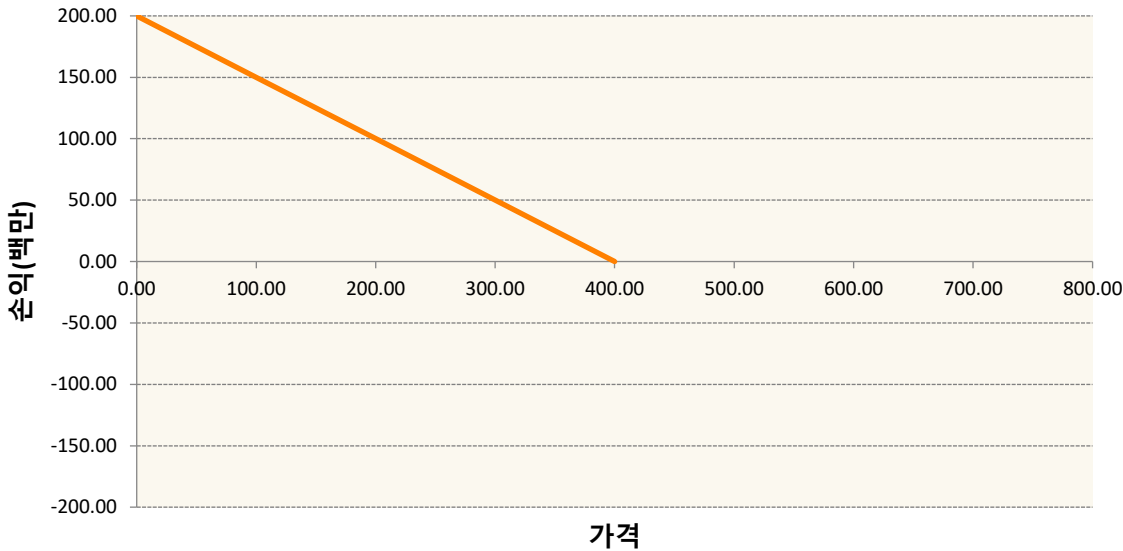


KR4201S14201-2022-01 콜420



KR4201S14250-2022-01 **콜**425

KR4301S14001-2022-01 ㄱ400



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001				2022-03 코스피200지수선물				255
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255	
-5.33%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170	
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	85	85	85	85	85	85	85	
5.33%	170	170	170	170	170	170	170	
8.00%	255	255	255	255	255	255	255	
KR4201S14201				2022-01 콜420				63
	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	0	0	0
0%	1	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	0	-1	-2	-3	-5	-7	-9
5.33%	-6	-9	-12	-16	-19	-23	-27
8.00%	-33	-38	-43	-48	-53	-58	-63
KR4201S14250 2022-01 콜425							13

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	-1	-1	-2
5.33%	-1	-1	-2	-3	-3	-4	-5
8.00%	-5	-6	-8	-9	-10	-12	-13

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%	10	10	10	10	10	10	10
-2.67%	5	5	5	5	5	5	5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-5	-4	-4	-4	-4	-4	-4
5.33%	-7	-7	-6	-6	-6	-6	-6
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

288

공시일	2022-01-07
기준일	2022-01-06

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	10,527	0	10,527	

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	2022-01-07
기준일	2022-01-06

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	100	-100	
누계	유가증권	수익증권	9,513	0	9,513	

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	2022-01-07
기준일	2022-01-06

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	13,427	-13,427	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	31,736	0	31,736	
누계	통화	선도	0	28,224	-28,224	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

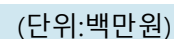
FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E	2,258
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

740

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물

KR4101S30001							2022-03 코스피200지수선물		108	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108			
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72			
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	36	36	36	36	36	36	36			
5.33%	72	72	72	72	72	72	72			
8.00%	108	108	108	108	108	108	108			

공시일 2022-01-07

기준일 2022-01-06

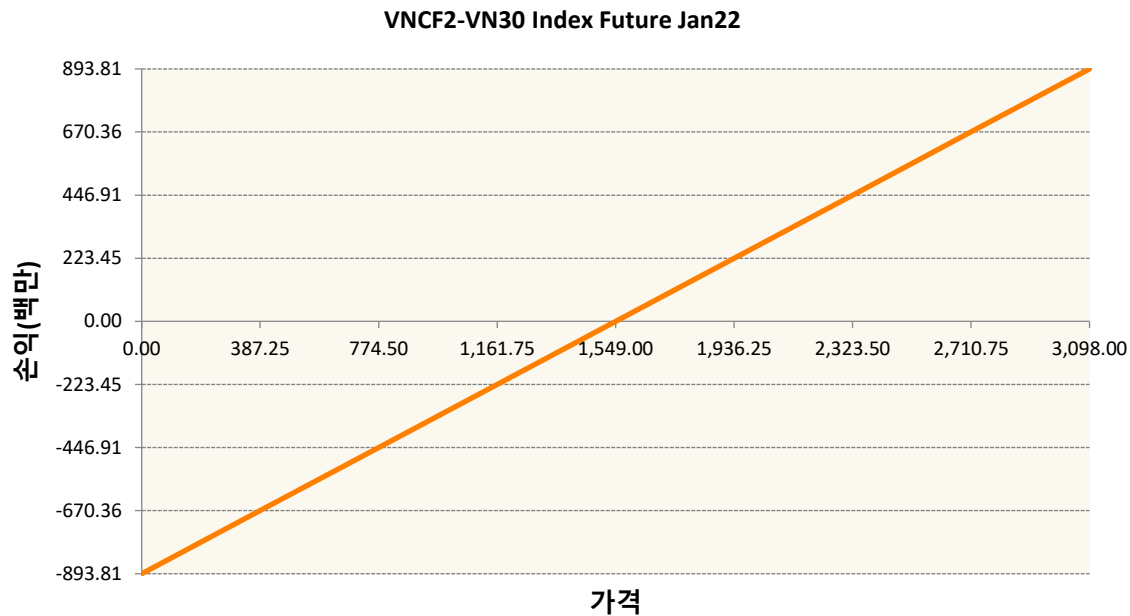
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	894	0	894	
누계	유가증권	스왑	1,813	0	1,813	장외
누계	통화	선도	0	1,127	-1,127	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	145
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)

261

공시일 2022-01-07
기준일 2022-01-06

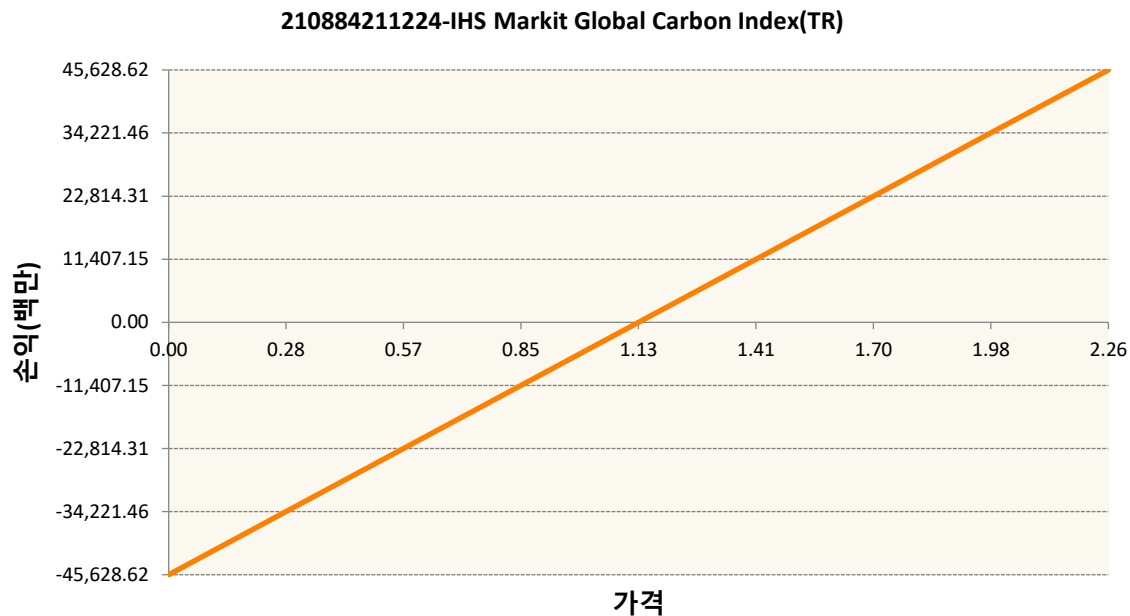
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	45,629	0	45,629	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,638

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

(단위:백만원)

5,804

공시일 2022-01-07

기준일 2022-01-06

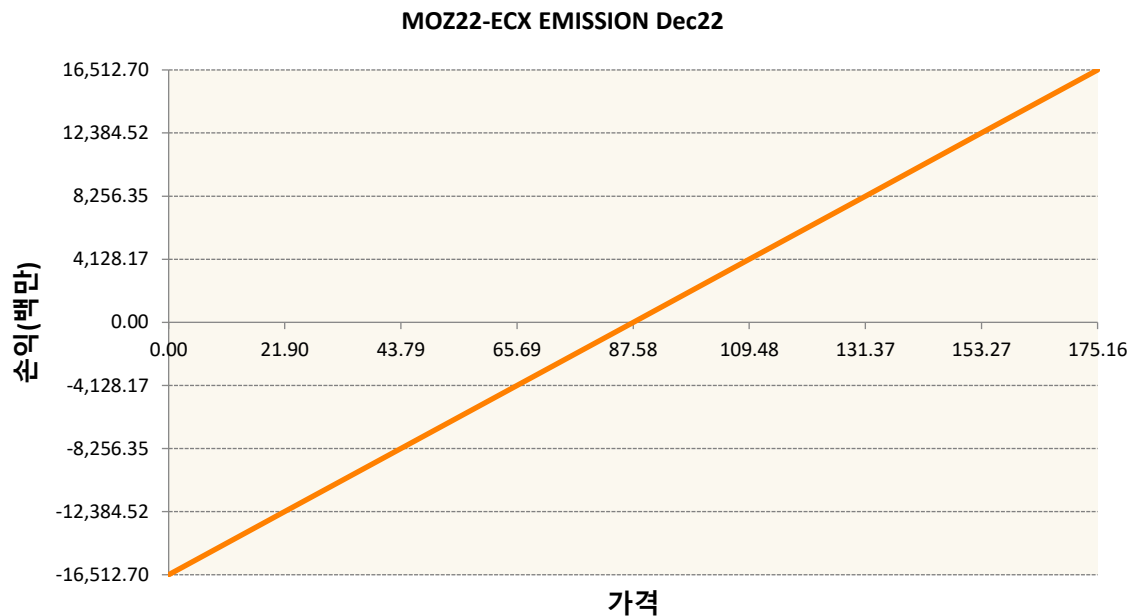
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	16,513	0	16,513	
누계	통화	선도	0	6,135	-6,135	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCV·KRW/EUR 28-01-22E

491

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,321

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

(단위:백만원)

3,073

공시일	2022-01-07
기준일	2022-01-06

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)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	11

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

(단위:백만원)

87

공시일 2022-01-07

기준일 2022-01-06

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

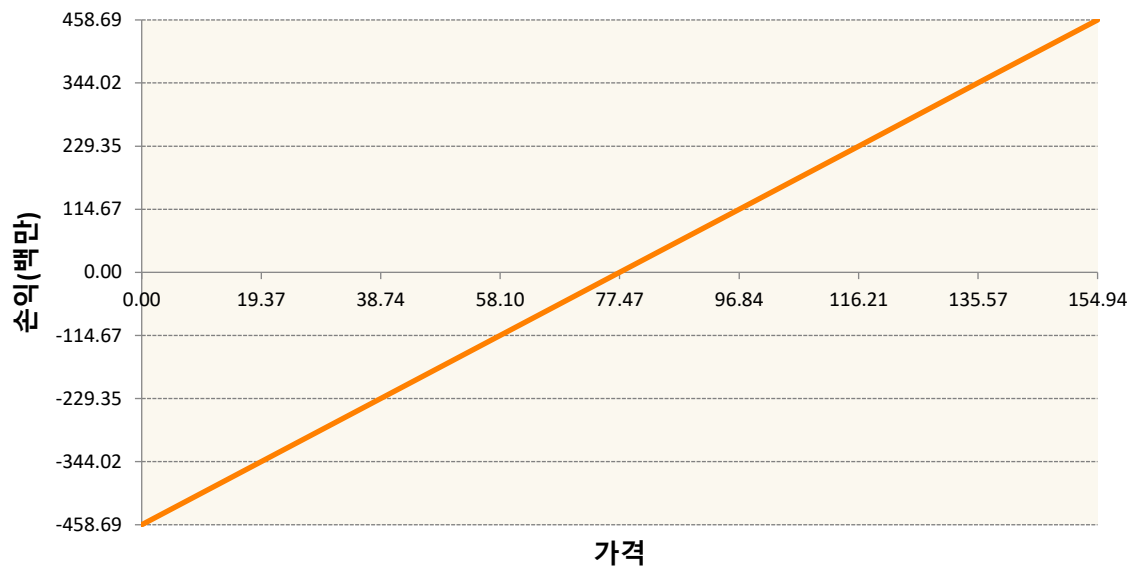
1. 계약금액

(단위:백만원)

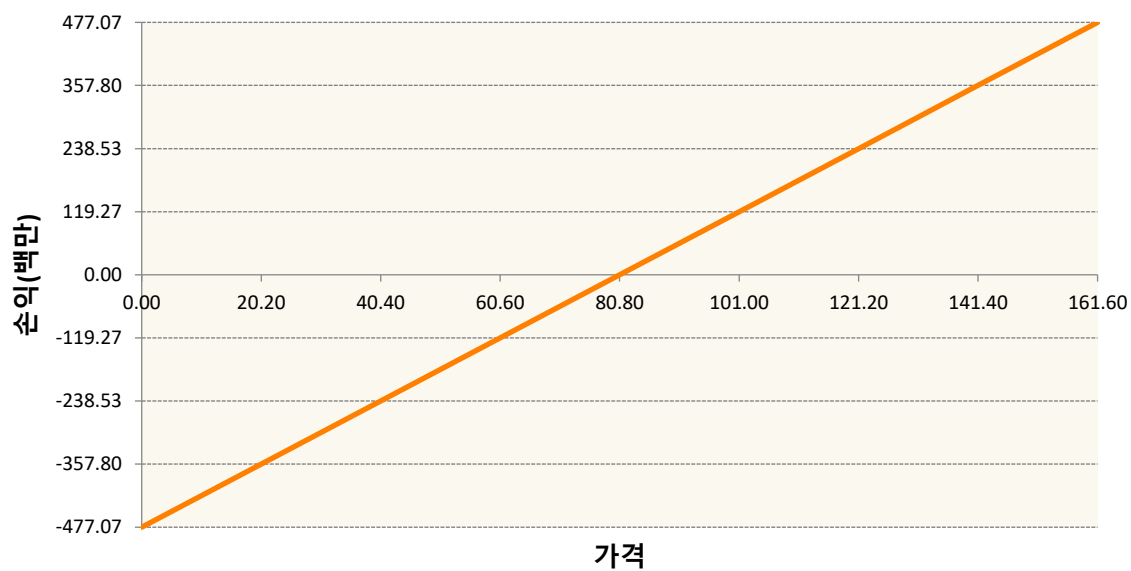
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,976	361	1,615	

2. 만기시점의 손익구조

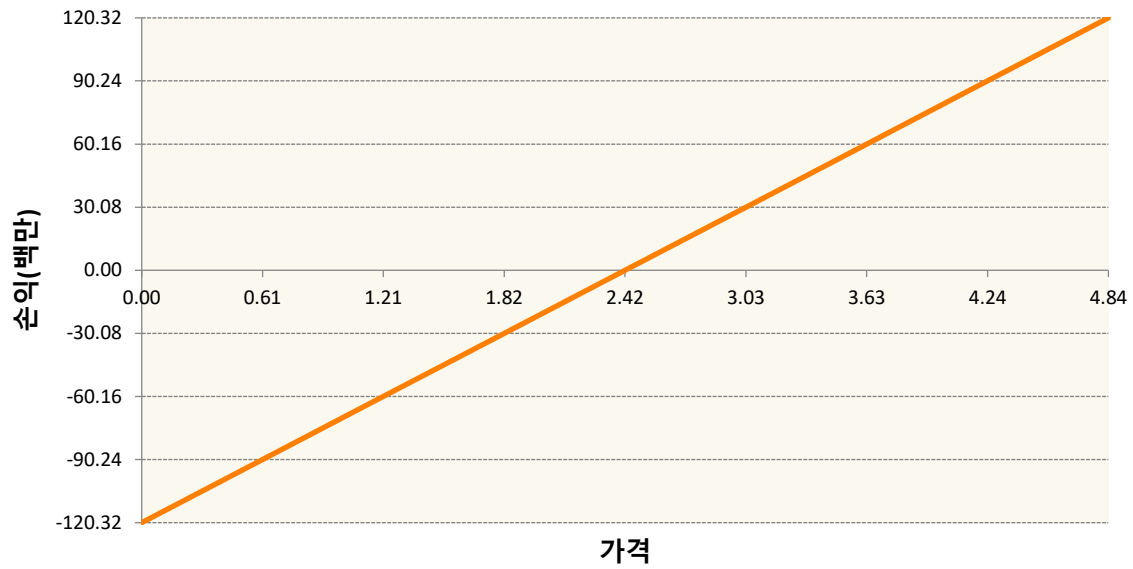
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



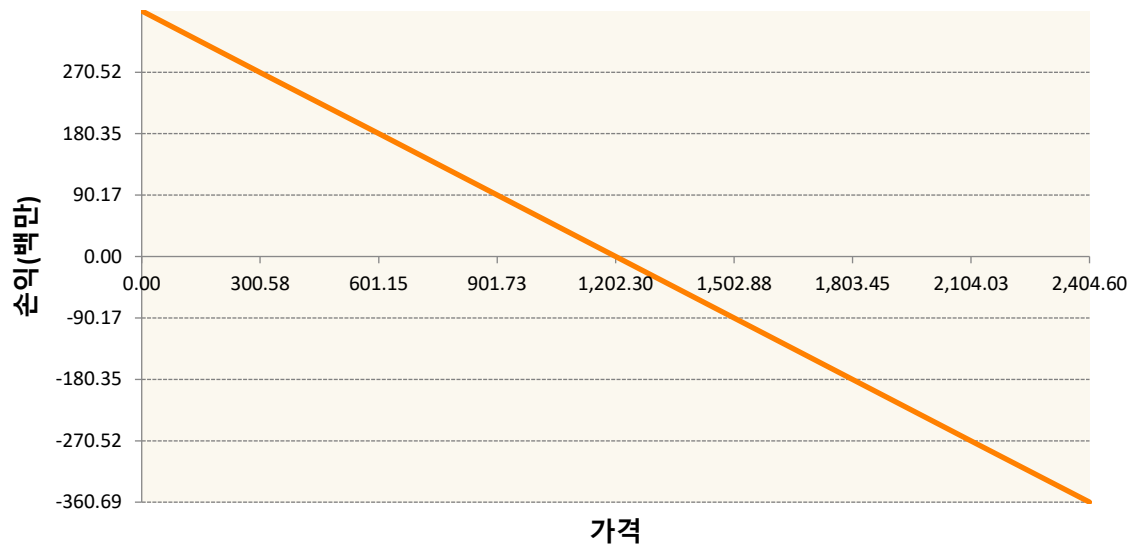
COH2-BRENT CRUDE FUTR Mar22



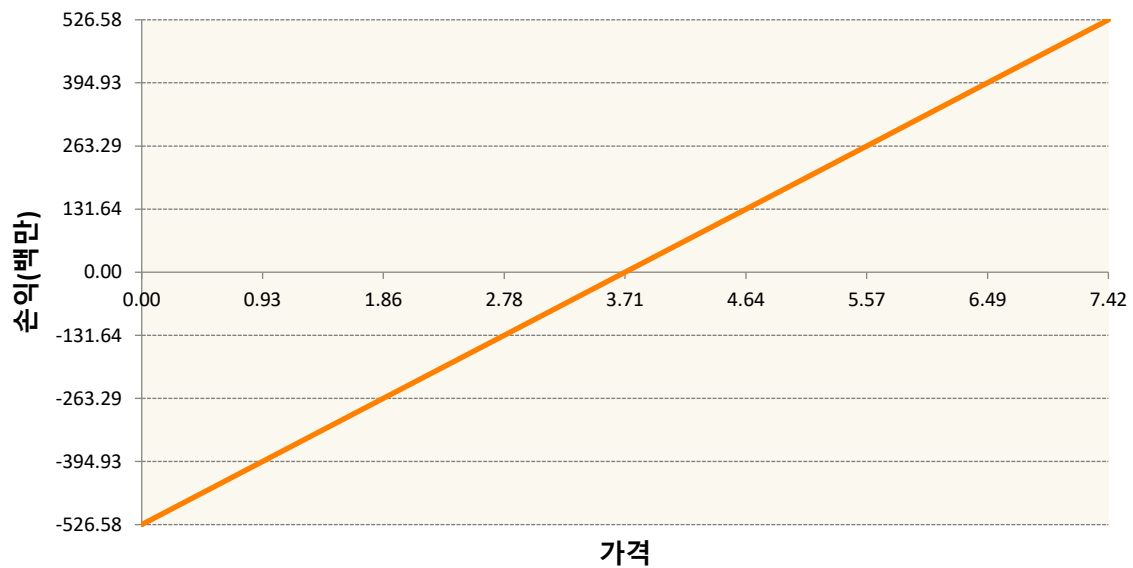
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

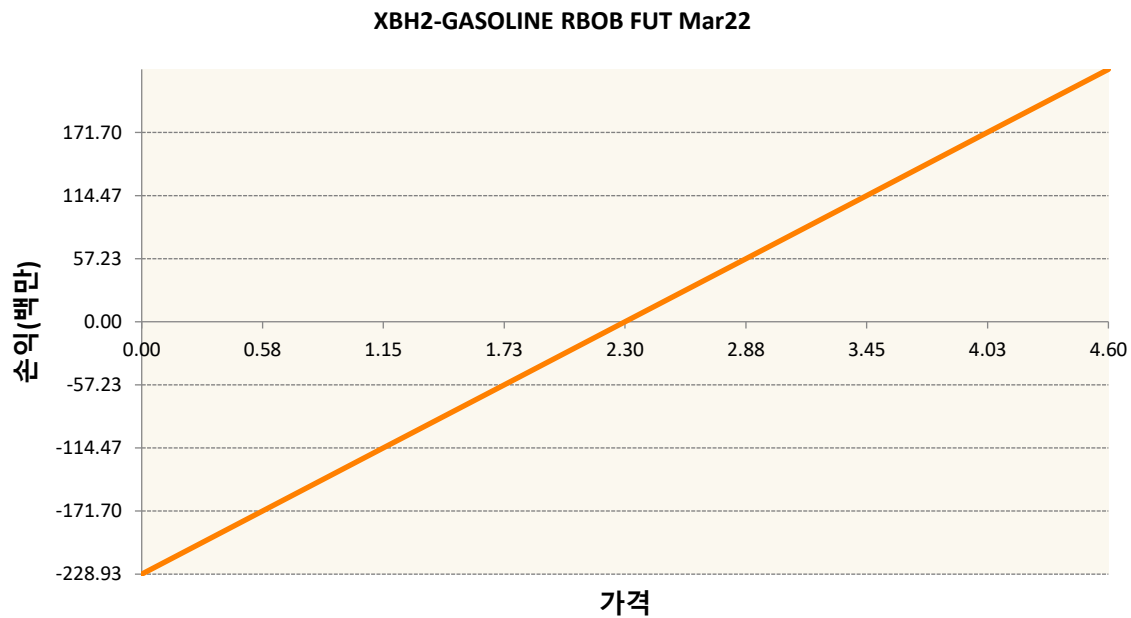
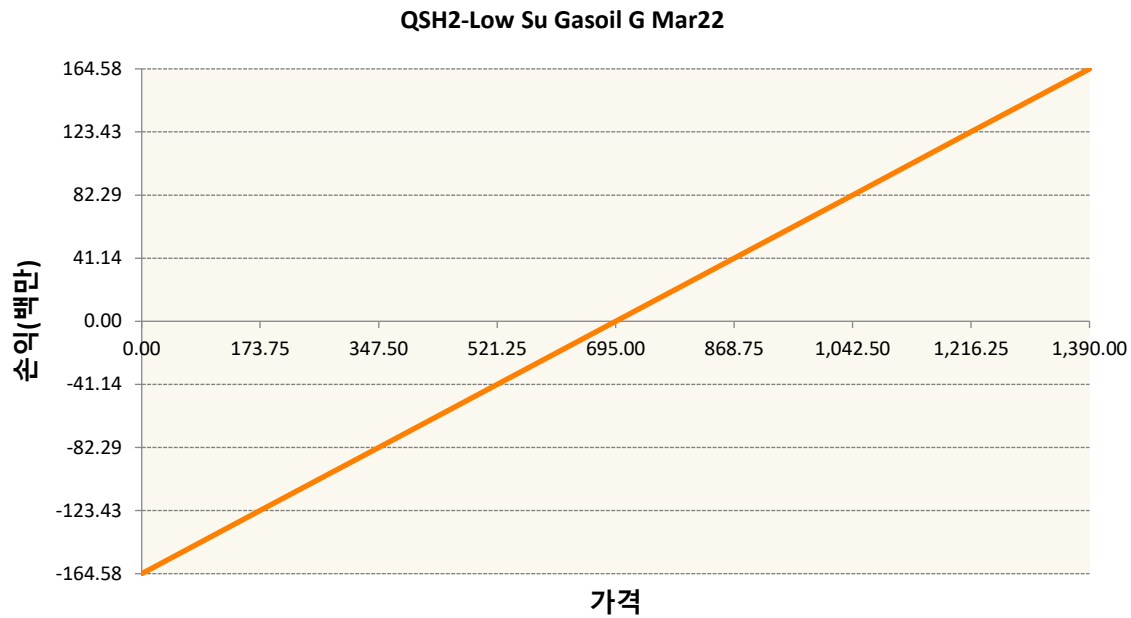


KR4175S10007-2022-01 달러선물



NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22		37
COH2	BRENT CRUDE FUTR Mar22		38
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22		10
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)
		353