

공시일 2022-01-17

기준일 2022-01-14

포커스농산물모(채권-파생형)

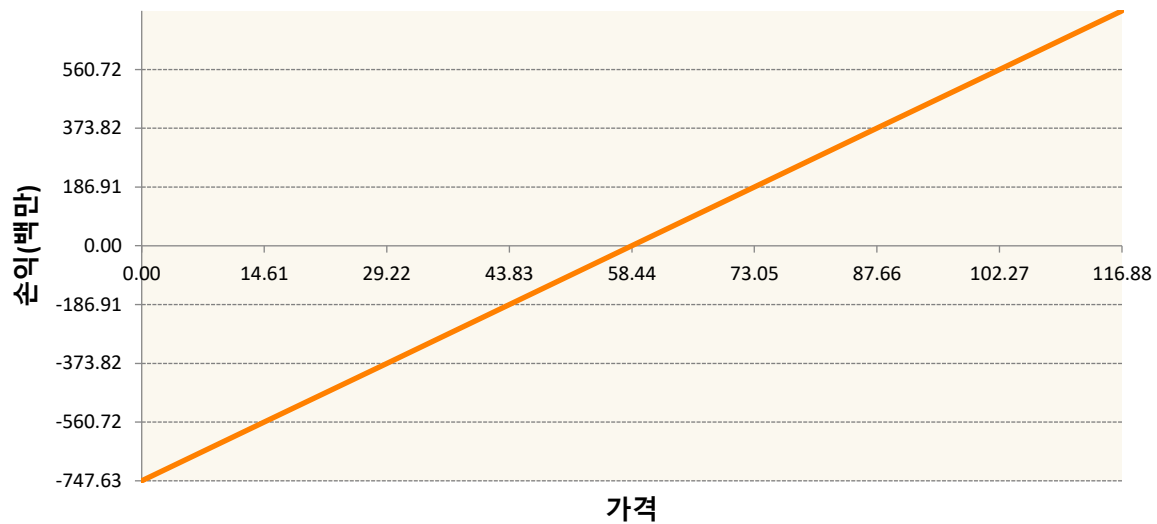
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

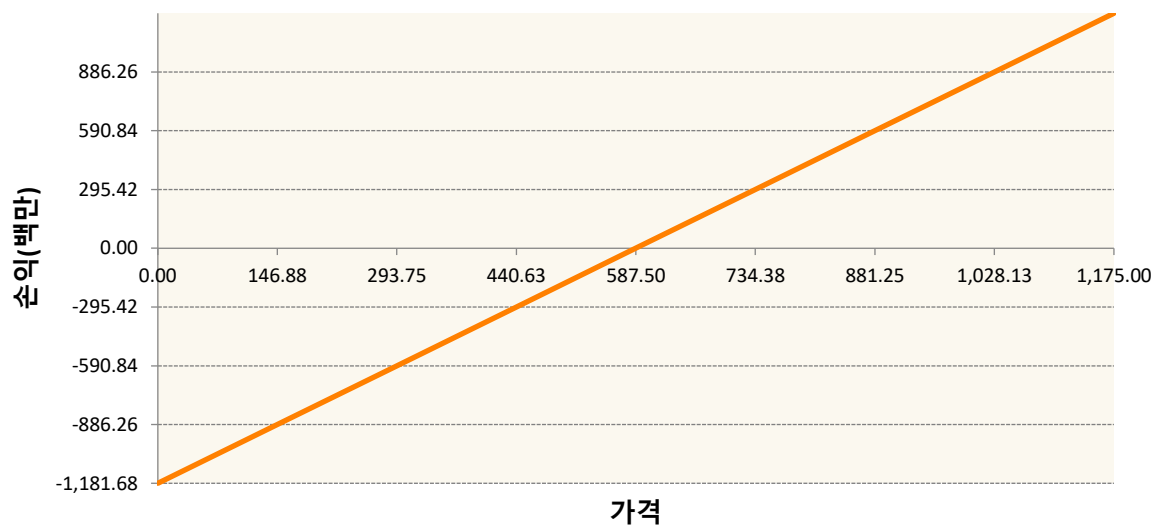
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,461	772	5,690	

2. 만기시점의 손익구조

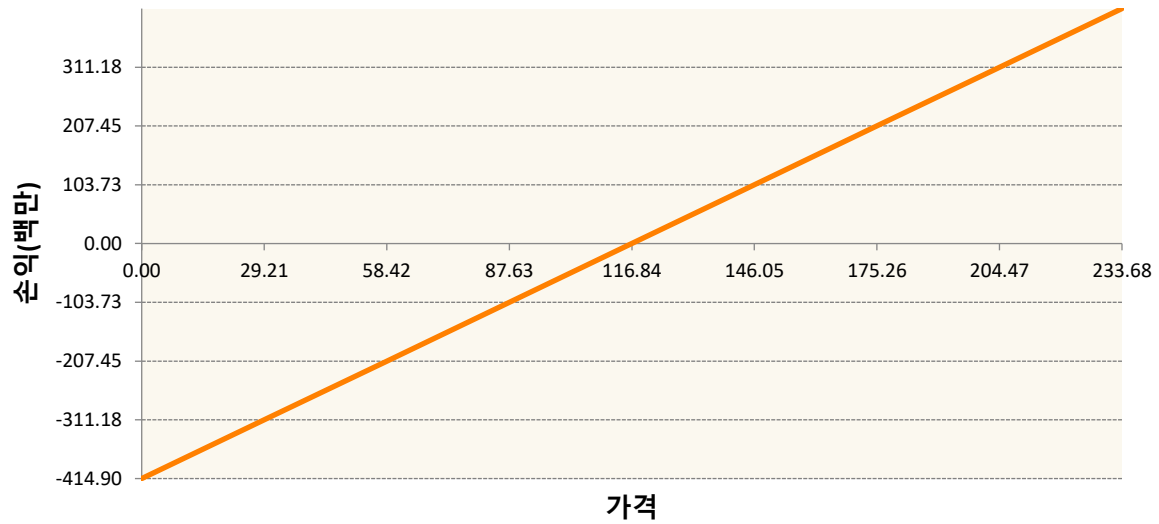
BOH2-SOYBEAN OIL FUTR Mar22



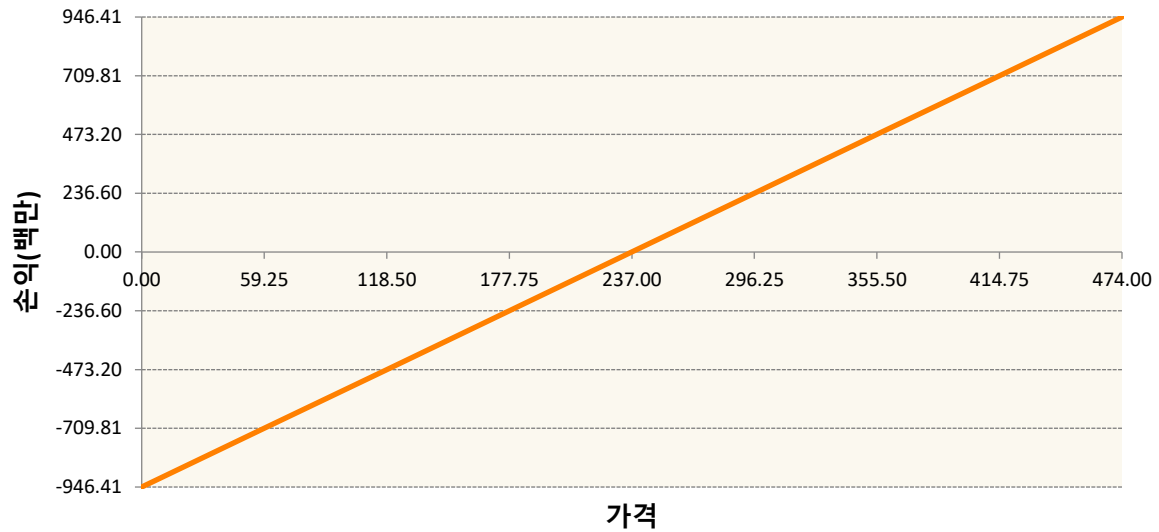
CH2-CORN FUTURE Mar22



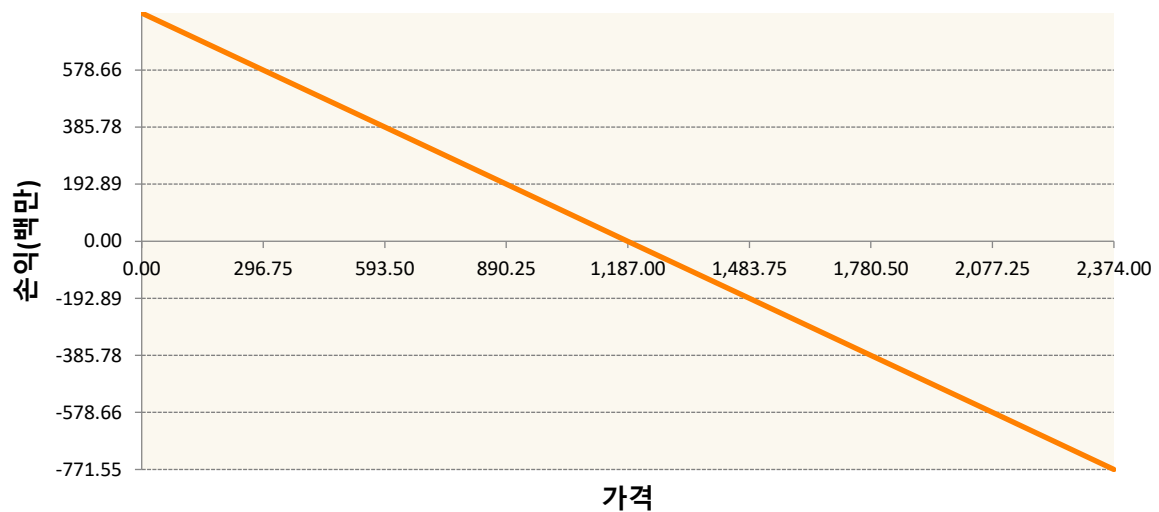
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



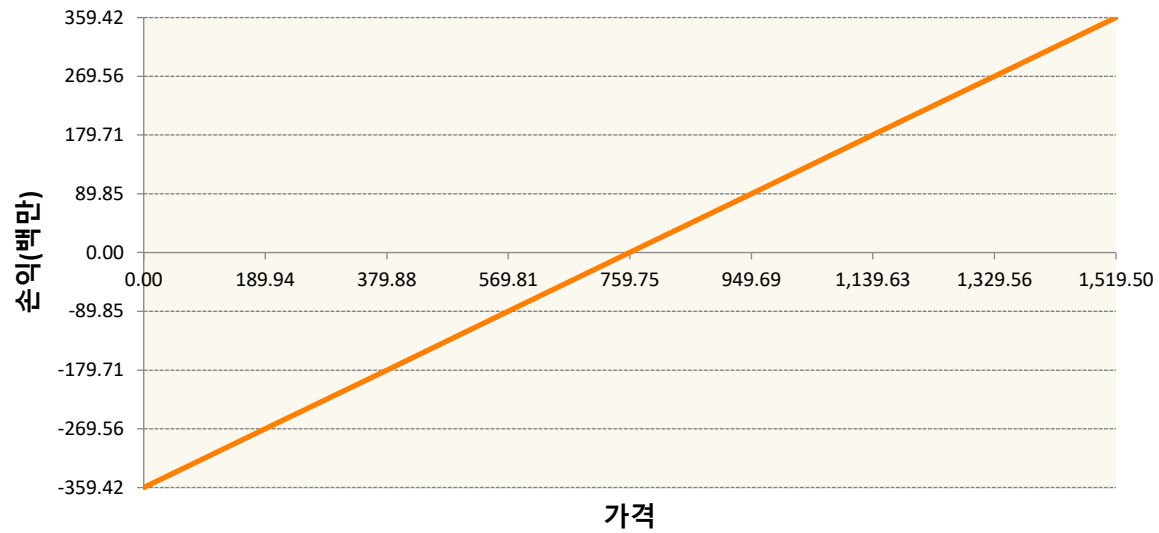
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



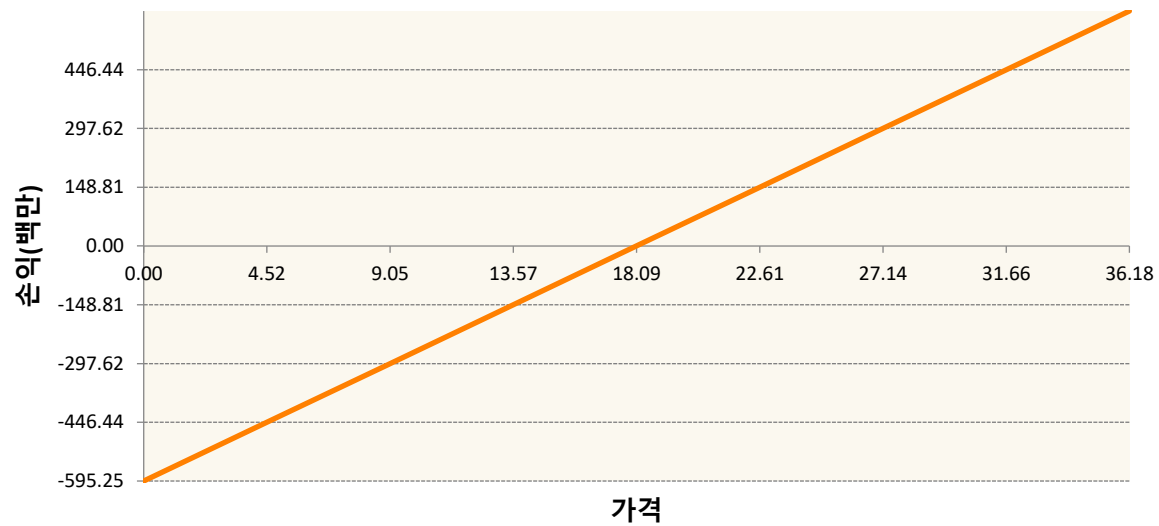
KR4175S20006-2022-02 달러선물



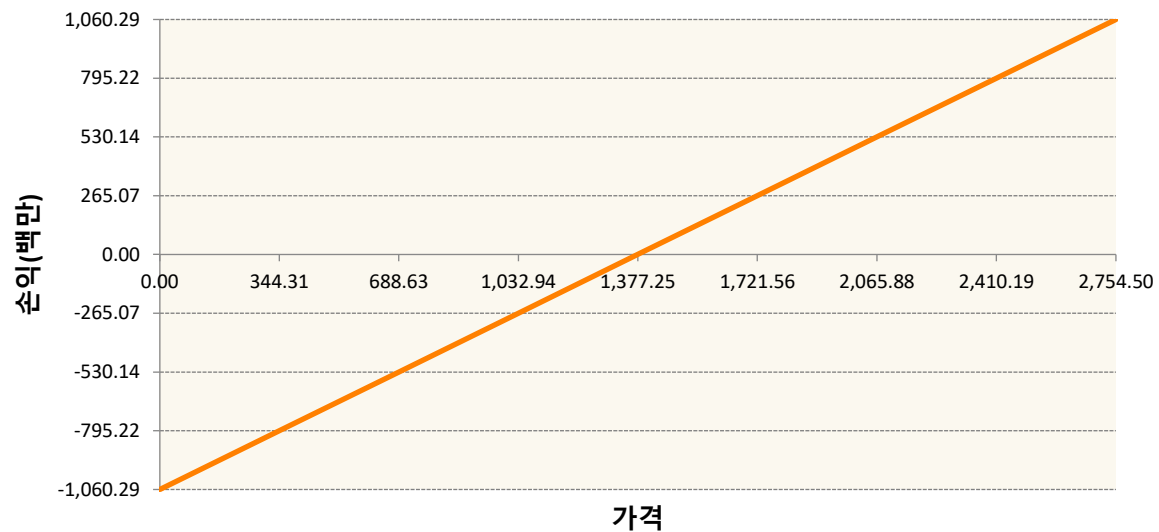
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



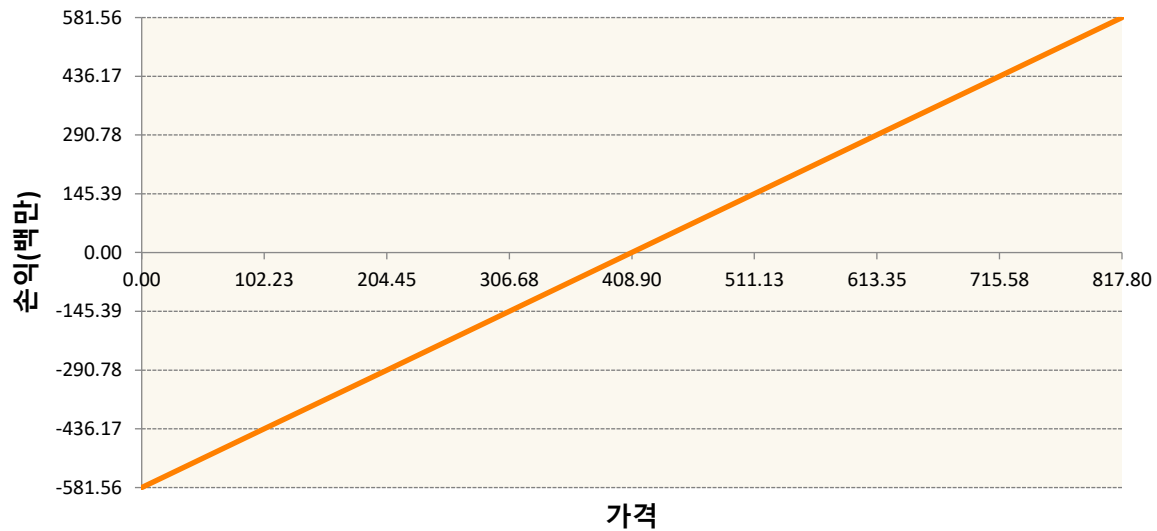
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



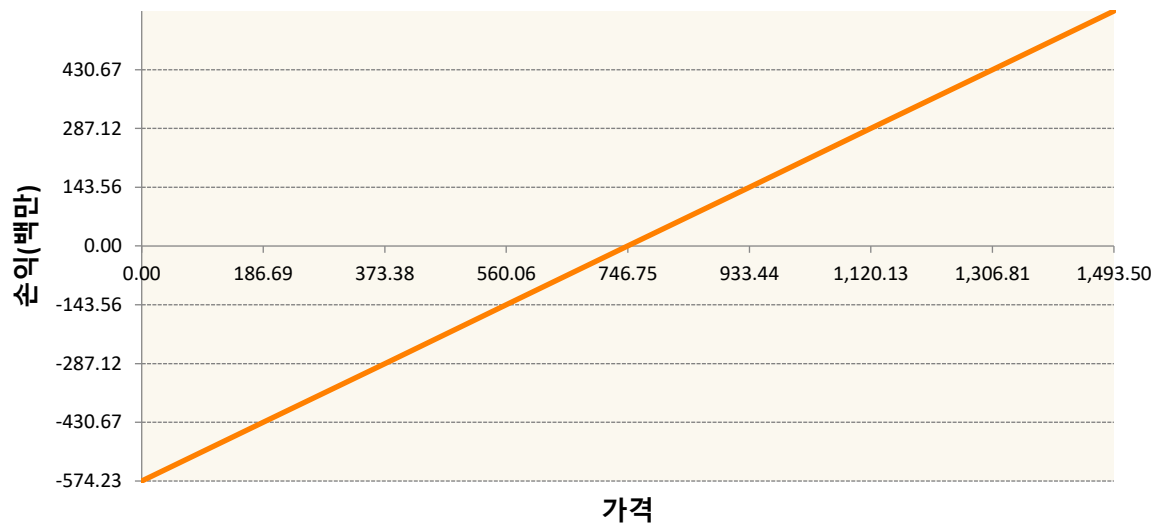
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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 2022-01-17

기준일 2022-01-14

스마트인덱스모

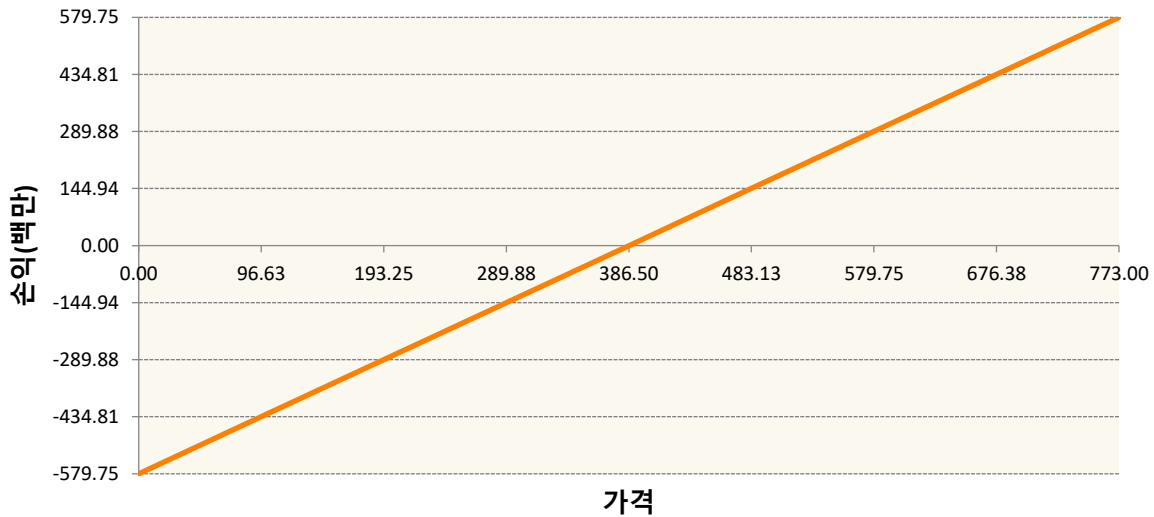
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	580	0	580	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					46
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	46	46	46	46	46	46	46

공시일	2022-01-17
기준일	2022-01-14

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)

SWMXWO00 신한MSCI선진국미래20211125

914

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

557

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-01-17
기준일	2022-01-14

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

427

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

398

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-01-17
기준일 2022-01-14

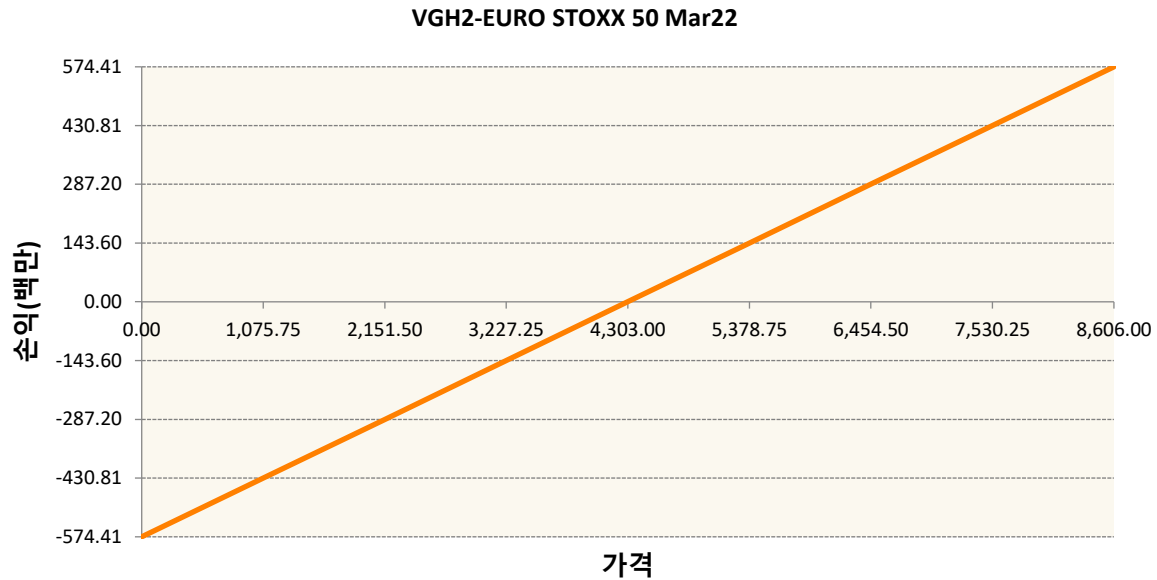
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

VGH2 EURO STOXX 50 Mar22

46

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

(단위:백만원)

40

공시일 2022-01-17
기준일 2022-01-14

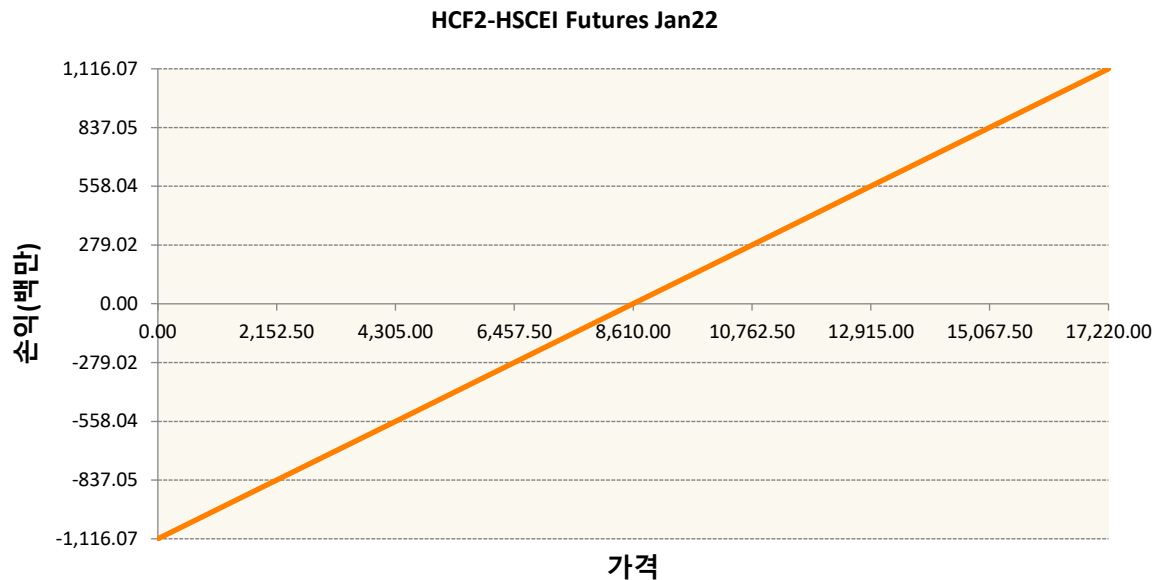
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,116	0	1,116	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF2	HSCEI Futures Jan22	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

93

공시일 2022-01-17

기준일 2022-01-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

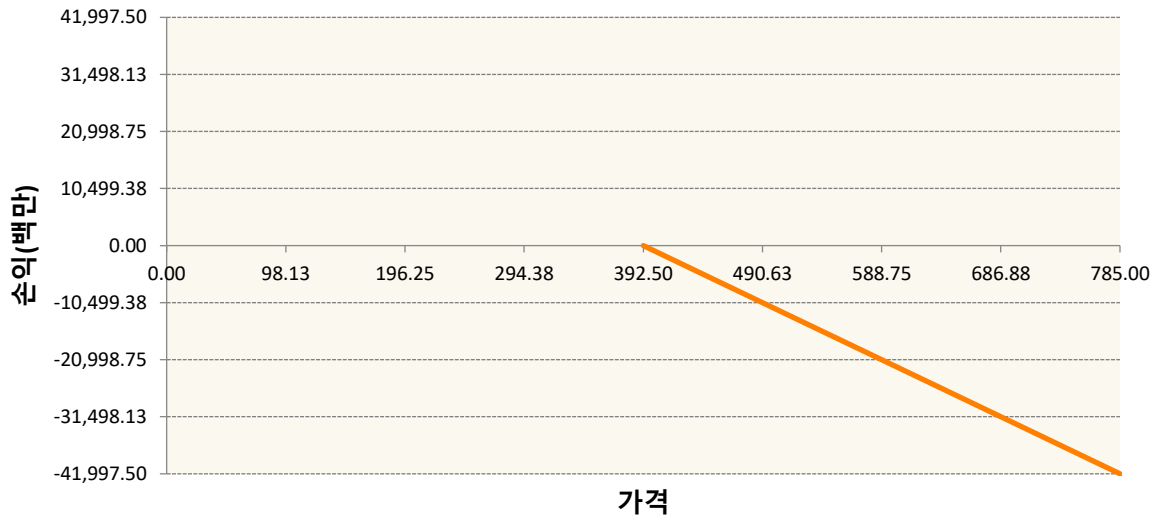
1. 계약금액

(단위:백만원)

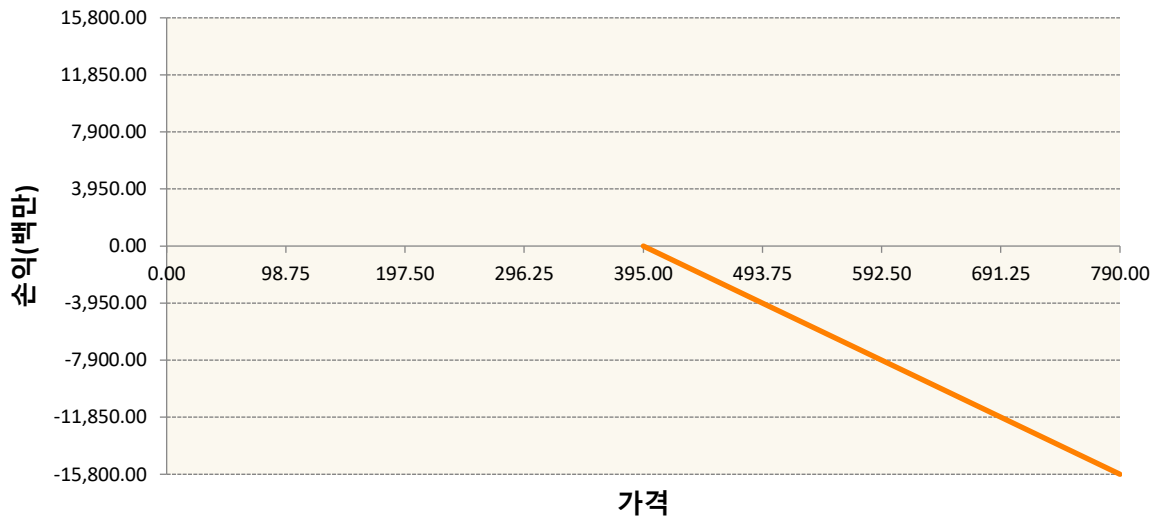
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	8,818	48,351	-39,533	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,932	-76,932	장내

2. 만기시점의 손익구조

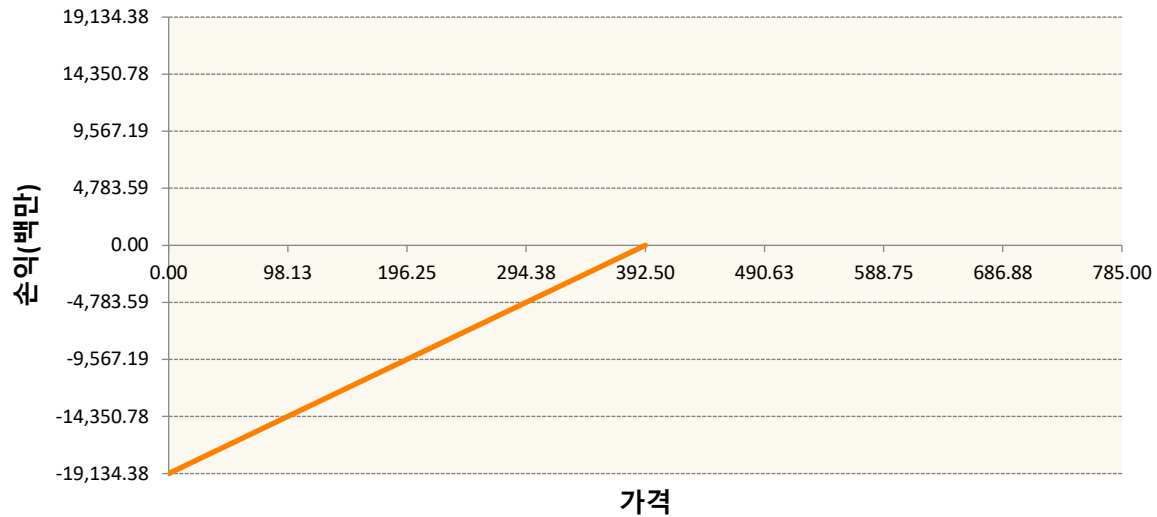
KR4201S23921-2022-02 콜392.5



KR4201S23954-2022-02 콜395



KR4301S23929-2022-02 풋392.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S23921			2022-02 콜392.5				2,377
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	919	896	866	830	787	740	688
-5.33%	840	792	738	678	613	544	473
-2.67%	653	575	495	411	326	239	150
0%	293	196	98	0	-98	-197	-295
2.67%	-275	-373	-472	-571	-671	-770	-870
5.33%	-1,044	-1,125	-1,209	-1,296	-1,385	-1,476	-1,569
8.00%	-1,967	-2,022	-2,084	-2,151	-2,223	-2,298	-2,377
KR4201S23954			2022-02 콜395				855
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	307	300	290	278	264	248	230
-5.33%	283	268	249	229	207	183	157
-2.67%	225	198	170	140	110	78	46
0%	107	72	36	0	-36	-73	-109
2.67%	-86	-124	-161	-199	-237	-275	-312
5.33%	-356	-389	-422	-457	-491	-527	-562
8.00%	-689	-712	-738	-765	-794	-824	-855
KR4301S23929			2022-02 풋392.5				1,291
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,272	-1,273	-1,274	-1,277	-1,280	-1,285	-1,291
-5.33%	-774	-779	-786	-794	-804	-816	-829
-2.67%	-304	-319	-337	-355	-375	-396	-418
0%	82	55	28	0	-28	-56	-84

2.67%	327	300	273	245	217	189	160
5.33%	438	421	403	384	363	341	318
8.00%	472	465	457	447	435	421	406

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

(단위:백만원)

4,363

공시일 2022-01-17

기준일 2022-01-14

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

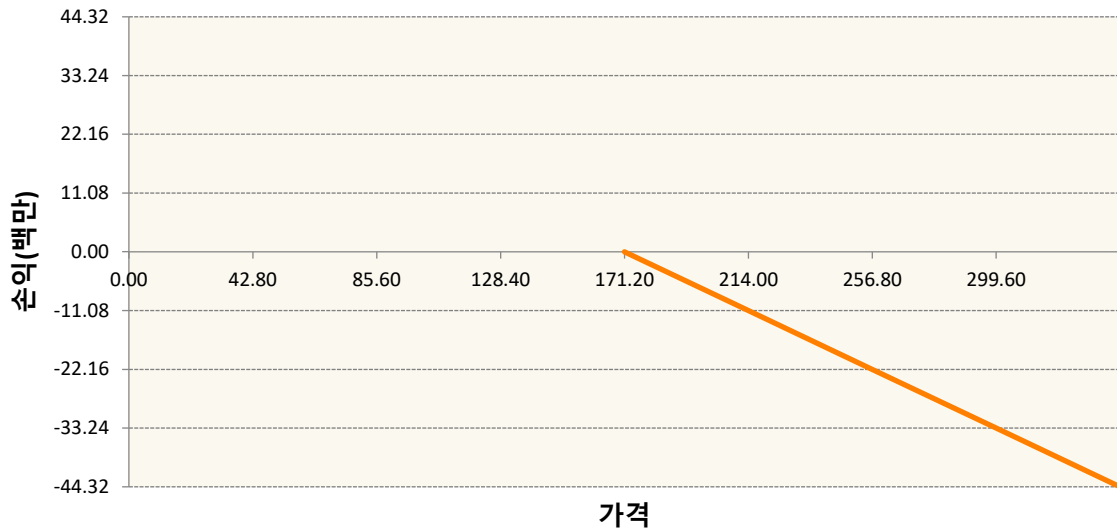
1. 계약금액

(단위:백만원)

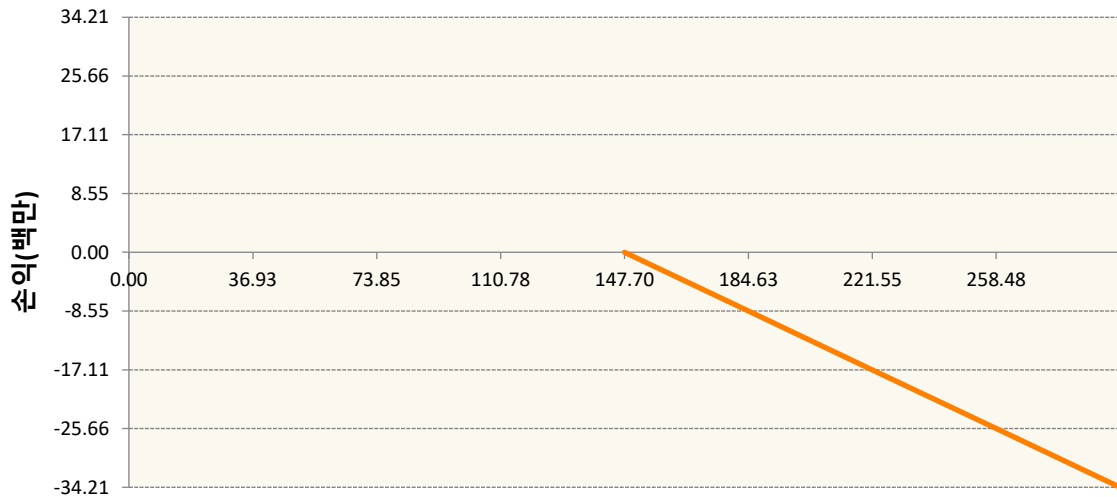
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	81	-81	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,044	-2,044	장외

2. 만기시점의 손익구조

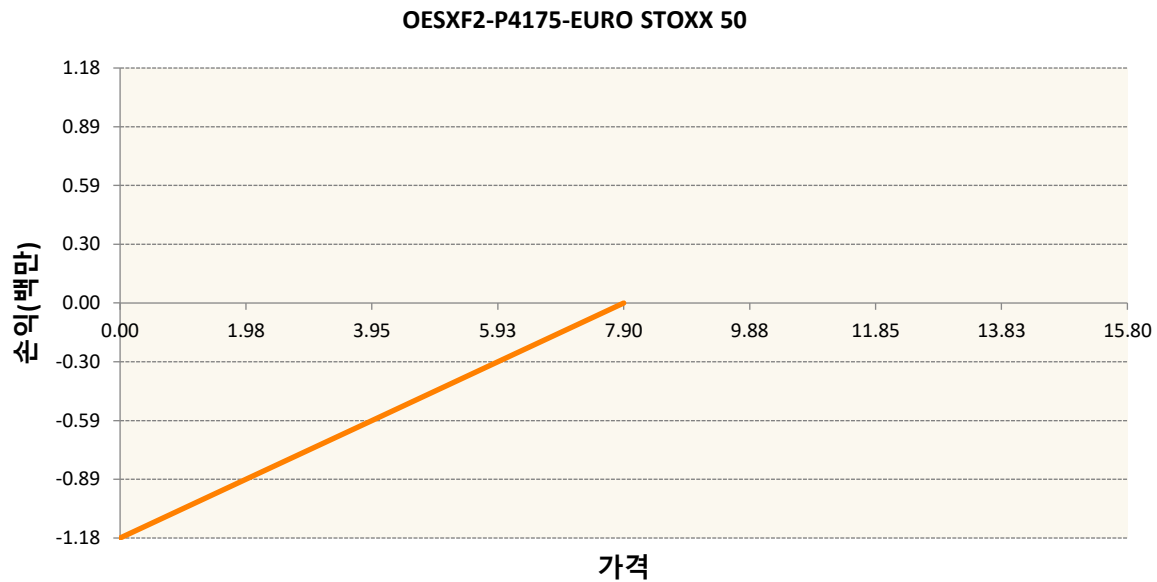
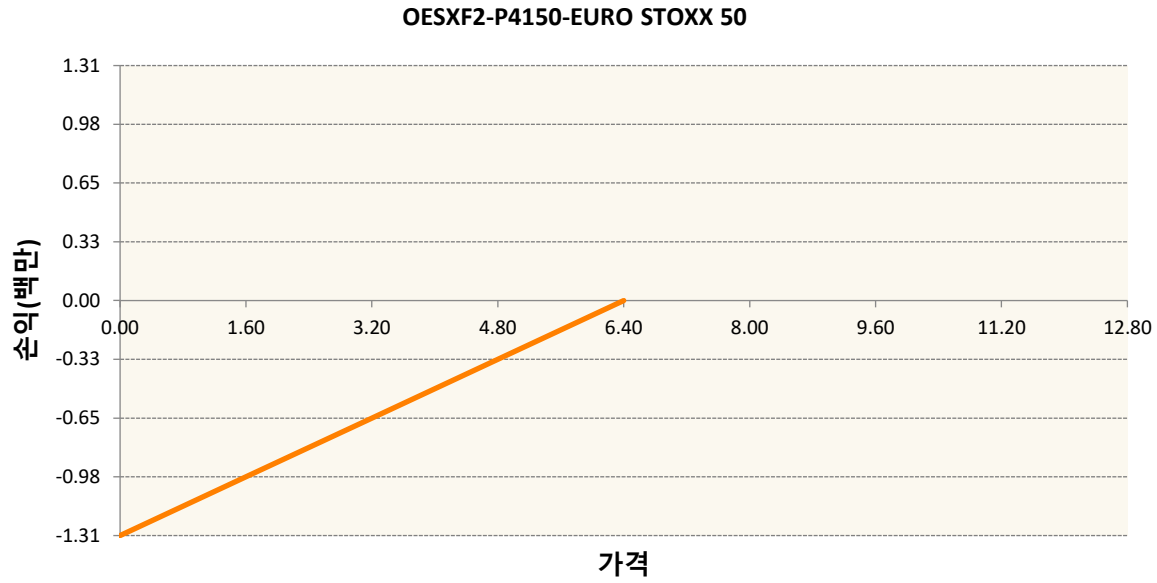
OESXF2-C4150-EURO STOXX 50



OESXF2-C4175-EURO STOXX 50



가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213BCF4 KRW/EUR 17-03-22E
 FXW213BCF4 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
4
3
0.1
0.09

공시일 2022-01-17
기준일 2022-01-14

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

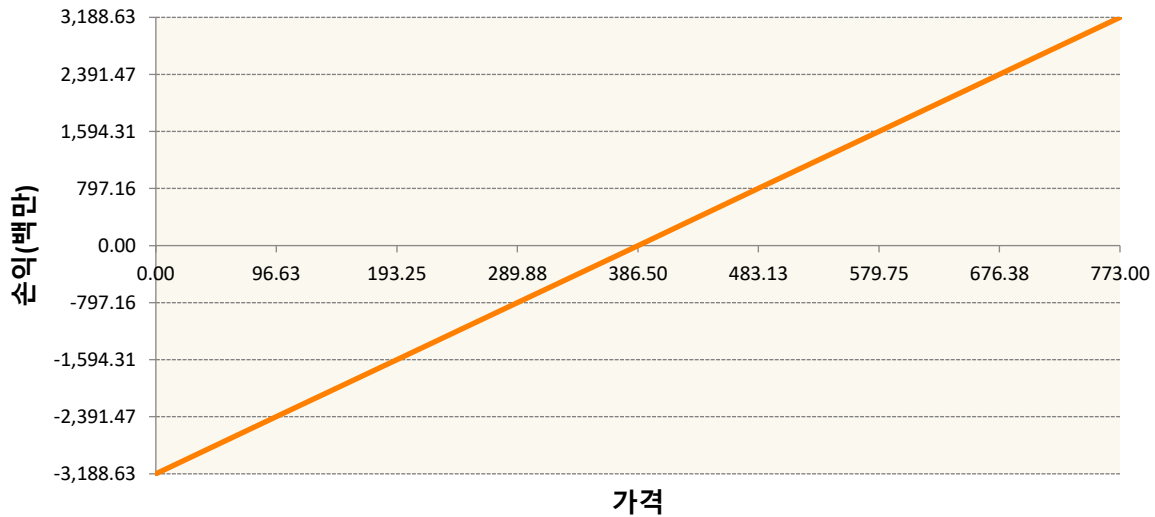
1. 계약금액

(단위:백만원)

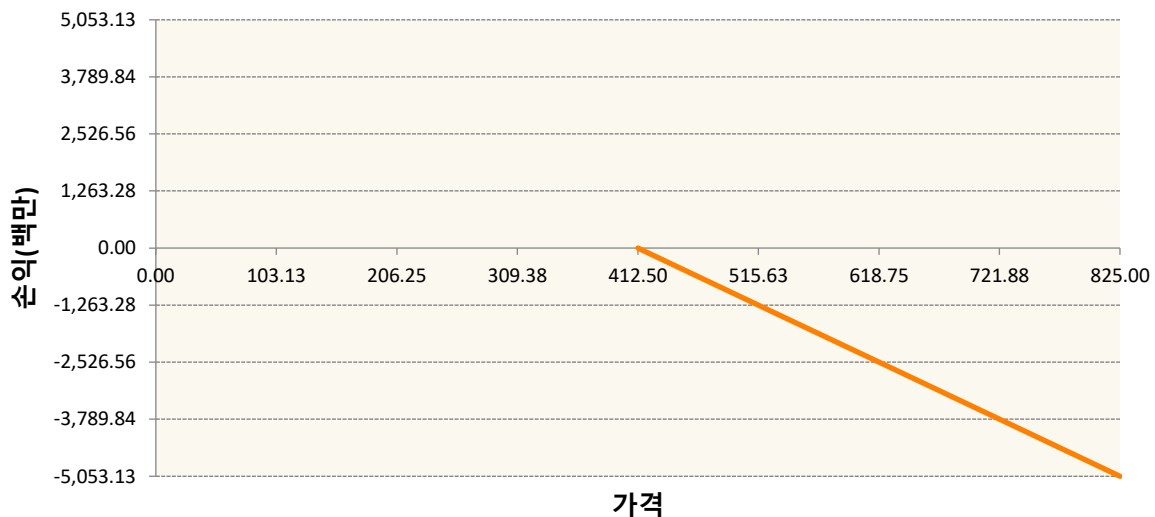
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	1,859	1,755	104	장내
누계	유가증권	선물	3,189	0	3,189	장내
누계	유가증권	옵션	393	5,364	-4,972	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S24127-2022-02 콜412.5



The graph illustrates the relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 830.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -311.25 to 311.25. A solid orange line represents the profit function, starting at a price of 415.00 (where profit is 0) and decreasing linearly to a price of 830.00 (where profit is -311.25).

가격 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
415.00	0.00
518.75	-77.81
622.50	-155.63
726.25	-233.44
830.00	-311.25

가격 (Price)	이익 (백만 원) (Profit in 100,000 Won)
0.00	392.50
98.13	294.38
196.25	196.25
294.38	98.13
392.50	0.00

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물				256
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256
-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%	256	256	256	256	256	256	256
KR4201S24127			2022-02 콜412.5				184
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	37	37	36	35	33	31	28
-5.33%	36	35	33	30	27	23	18
-2.67%	32	29	25	20	14	8	1
0%	21	15	8	0	-8	-17	-26
2.67%	-3	-12	-23	-33	-43	-54	-65
5.33%	-46	-58	-70	-82	-94	-106	-118
8.00%	-113	-125	-137	-148	-160	-172	-184
KR4201S24150 2022-02 콜415							11

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	1
-5.33%	2	2	2	2	1	1	1
-2.67%	2	2	1	1	1	0	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-2
2.67%	0	-1	-1	-2	-2	-3	-4
5.33%	-2	-3	-4	-5	-5	-6	-7
8.00%	-6	-7	-8	-8	-9	-10	-11

KR4301S23929 2022-02 풋392.5							26
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	26	26	26	26	26	26
-5.33%	16	16	16	16	16	17	17
-2.67%	6	7	7	7	8	8	9
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-7	-6	-6	-5	-4	-4	-3
5.33%	-9	-9	-8	-8	-7	-7	-7
8.00%	-10	-10	-9	-9	-9	-9	-8

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

(단위:백만원)

410

공시일	2022-01-17
기준일	2022-01-14

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	10,514	0	10,514	

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	2022-01-17
기준일	2022-01-14

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	120	-120	
누계	유가증권	수익증권	9,307	0	9,307	

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	2022-01-17
기준일	2022-01-14

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	31,195	0	31,195	
누계	통화	선도	13,179	27,902	-14,723	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E	2,232
FXW213C17 USD/KRW 26-01-22E	1,054
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

1,076

공시일 2022-01-17

기준일 2022-01-14

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

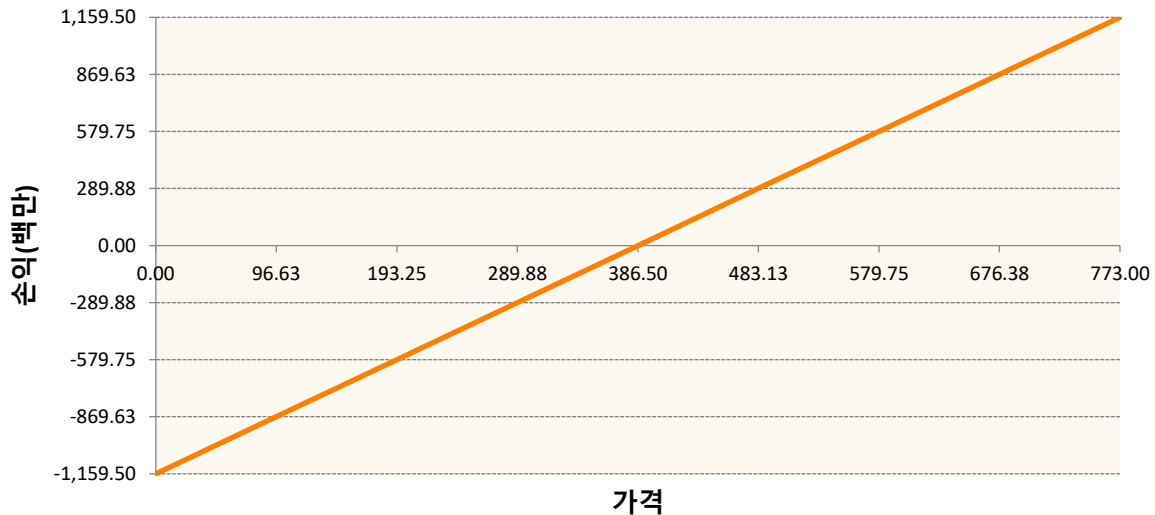
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,160	0	1,160	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	93	93	93	93	93	93	93

공시일 2022-01-17

기준일 2022-01-14

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

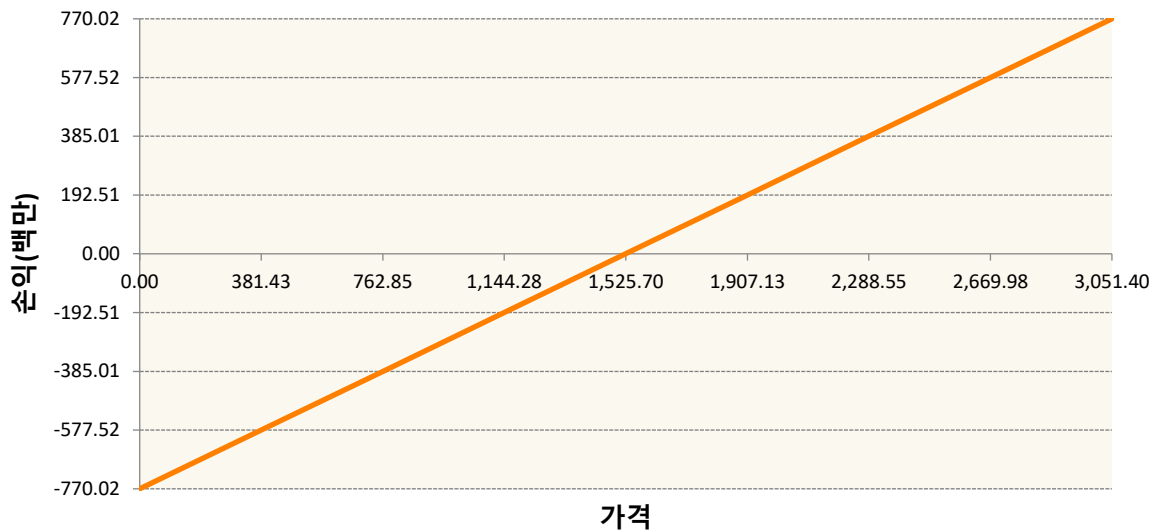
1. 계약금액

(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	770	0	770	
누계	유가증권	스왑	1,819	0	1,819	장외
누계	통화	선도	0	1,131	-1,131	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCF2-VN30 Index Future Jan22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	146
FXW213BBQ: KRW/EUR 25-02-22E	36
FXW213BBS: KRW/EUR 25-02-22E	11
FXW213BCN: KRW/EUR 18-03-22E	44
VNCF2 VN30 Index Future Jan22	62

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

(단위:백만원)

252

공시일	2022-01-17
기준일	2022-01-14

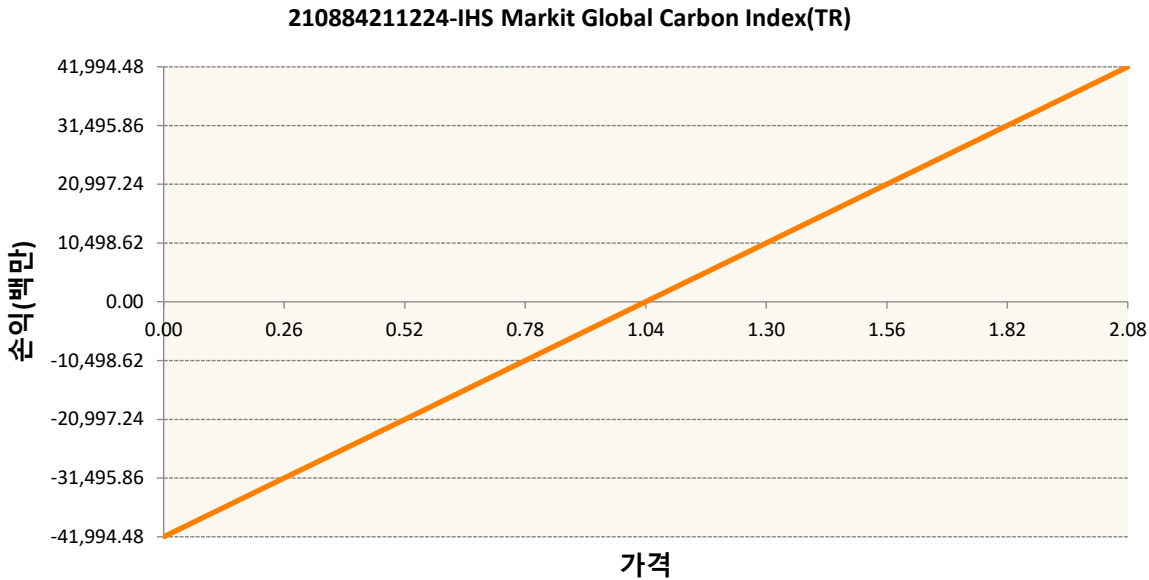
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)

3,363

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

(단위:백만원)

5,425

공시일 2022-01-17

기준일 2022-01-14

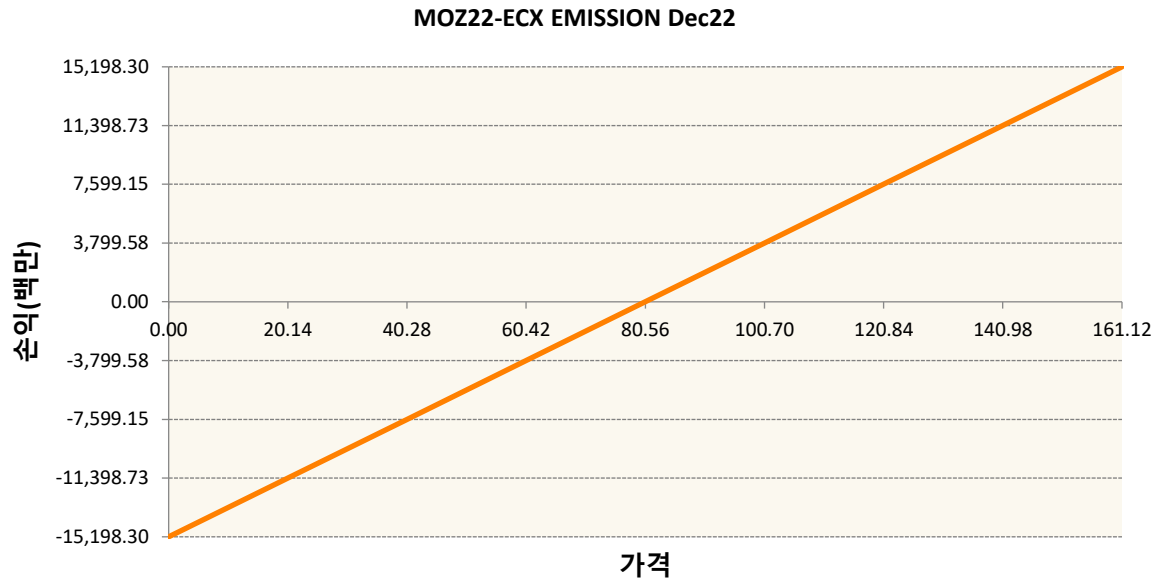
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,198	0	15,198	
누계	통화	선도	0	6,156	-6,156	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCV·KRW/EUR 28-01-22E

493

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,216

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

(단위:백만원)

2,844

공시일	2022-01-17
기준일	2022-01-14

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)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	20

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

(단위:백만원)

155

공시일	2022-01-17
기준일	2022-01-14

SOL차이나육성산업액티브상장지

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	10,650	0	10,650	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	0.07
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	0.08
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	0.07
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	0.07

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

(단위:백만원)

0

공시일 2022-01-17

기준일 2022-01-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

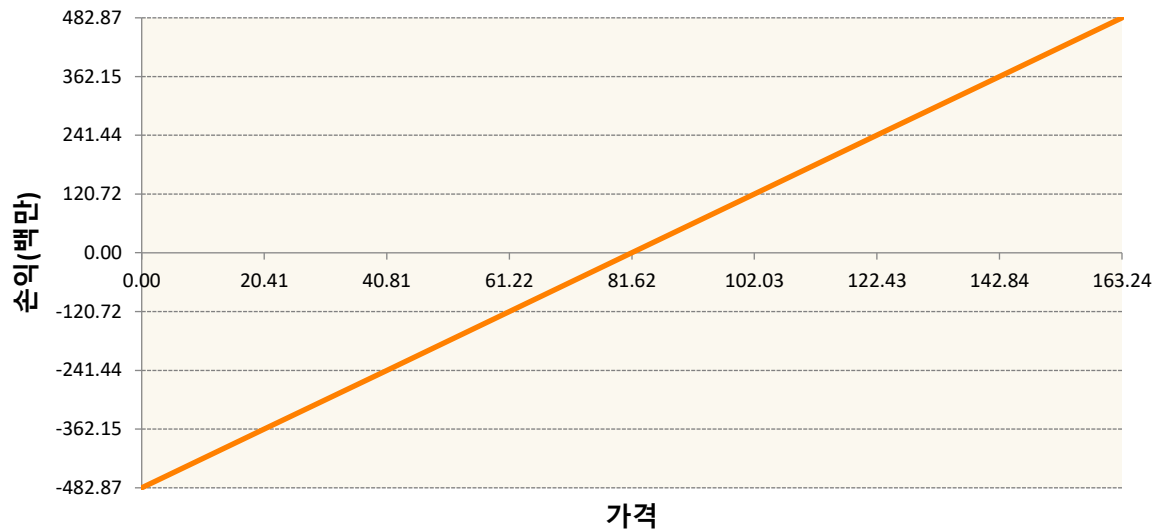
1. 계약금액

(단위:백만원)

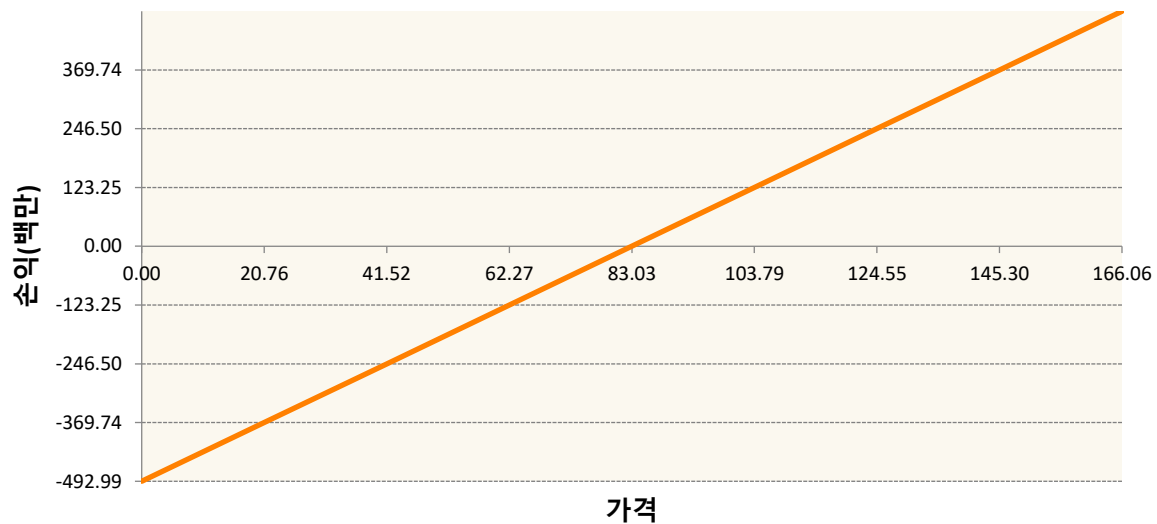
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,129	356	1,773	

2. 만기시점의 손익구조

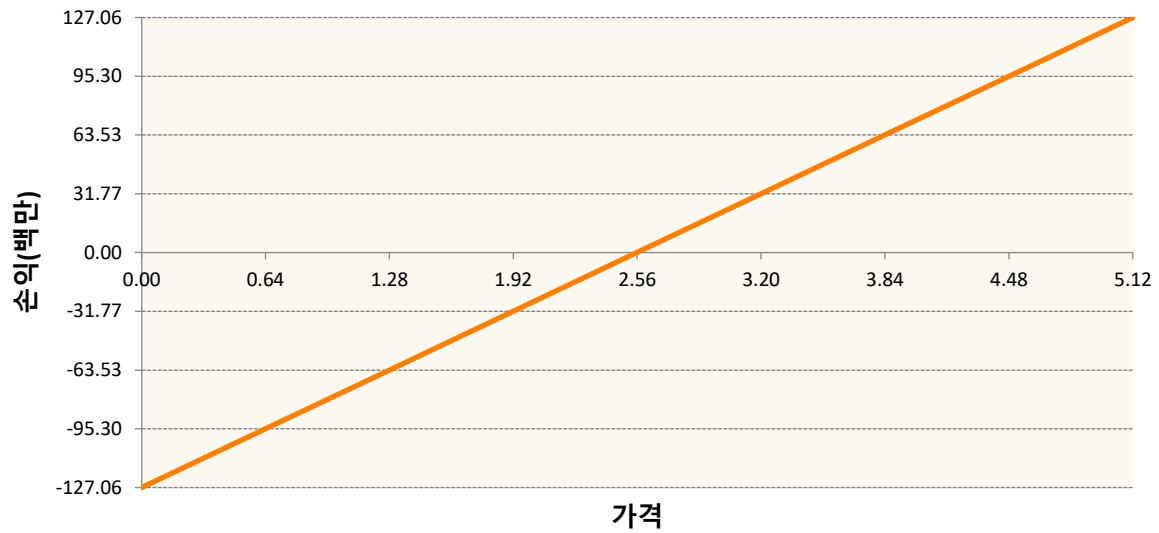
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



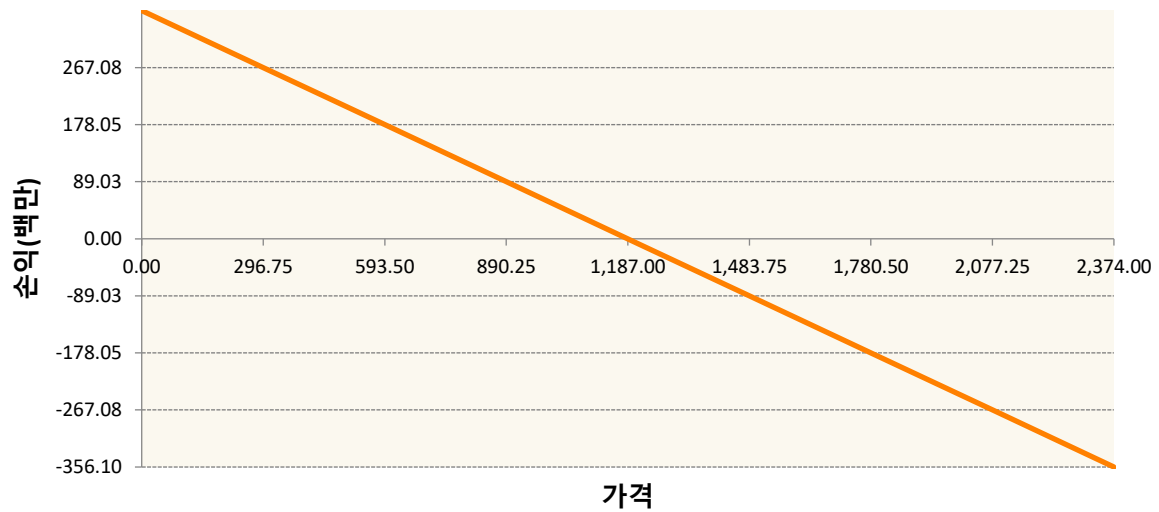
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



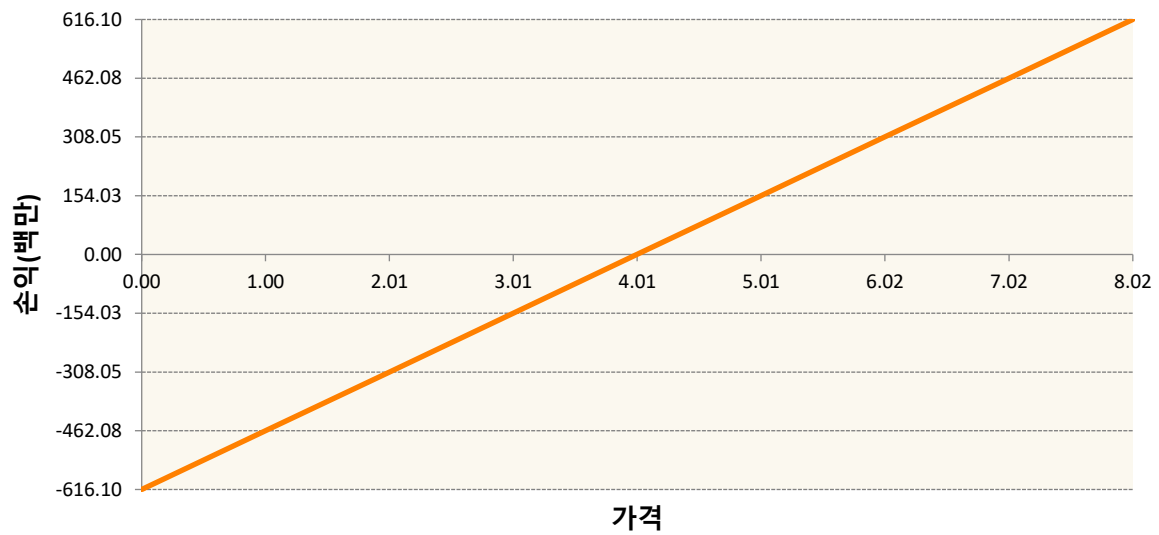
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22



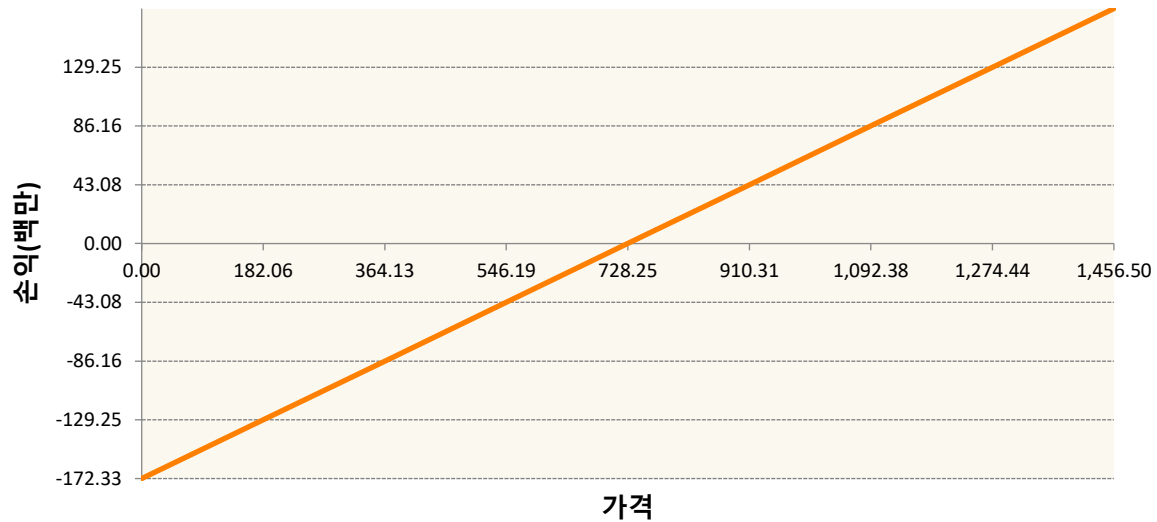
KR4175S20006-2022-02 달러선물



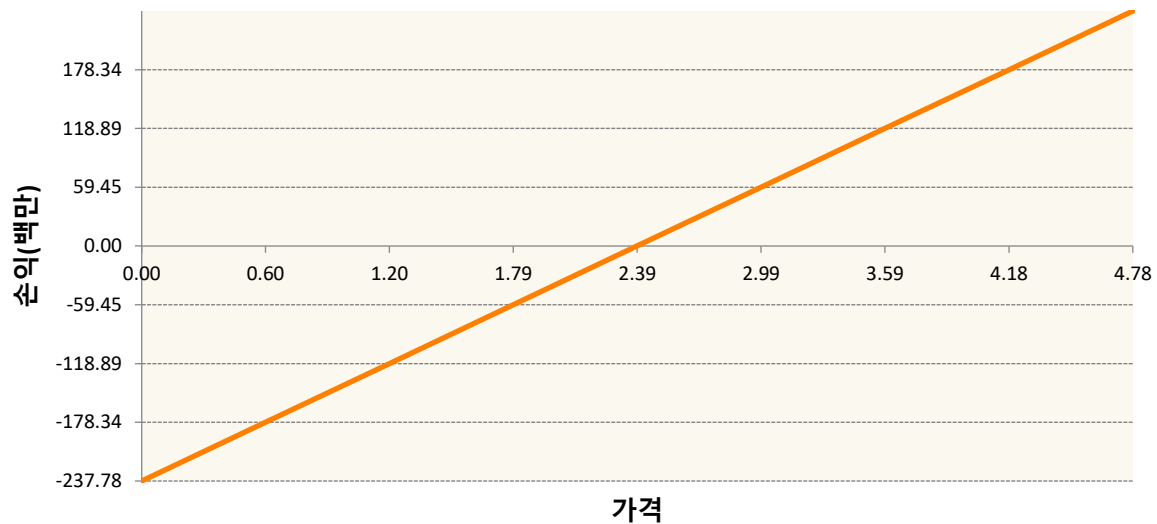
NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBH2-GASOLINE RBOB FUT Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22	39
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22	39
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22	10
KR4175S200	2022-02 달러선물	28
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22	49
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	14
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22	19

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

(단위:백만원)

390

