

공시일 2022-01-21

기준일 2022-01-20

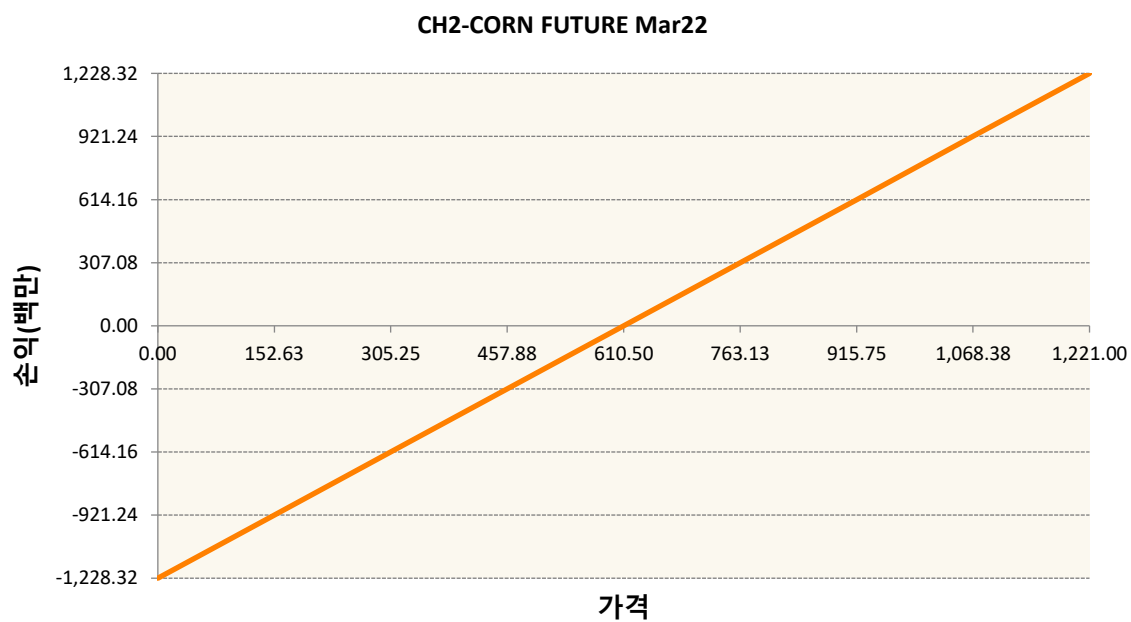
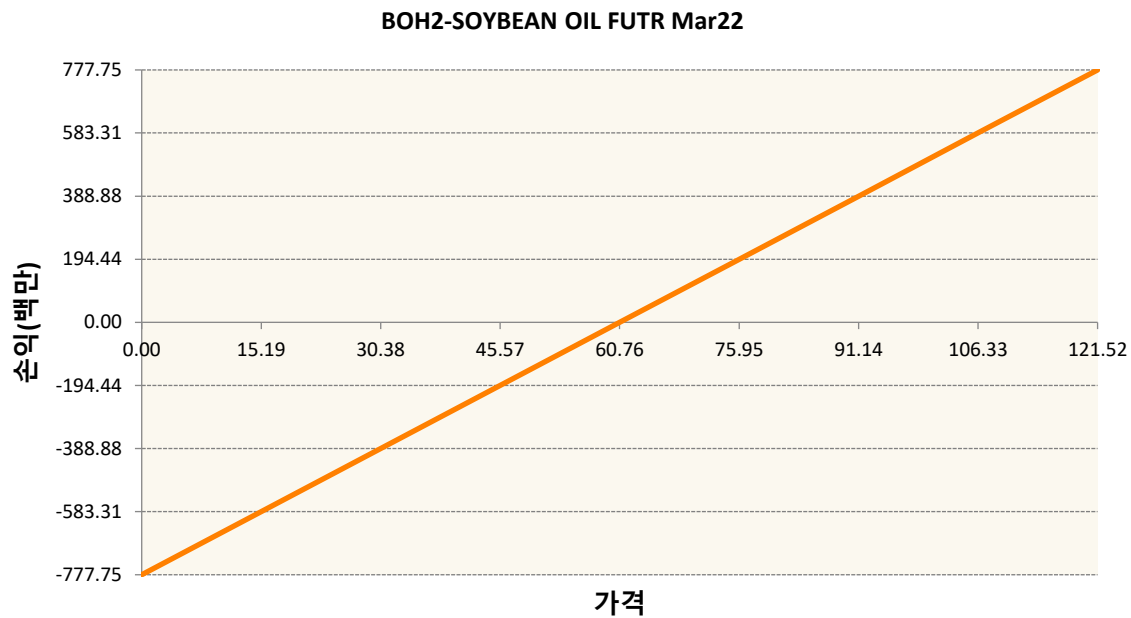
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

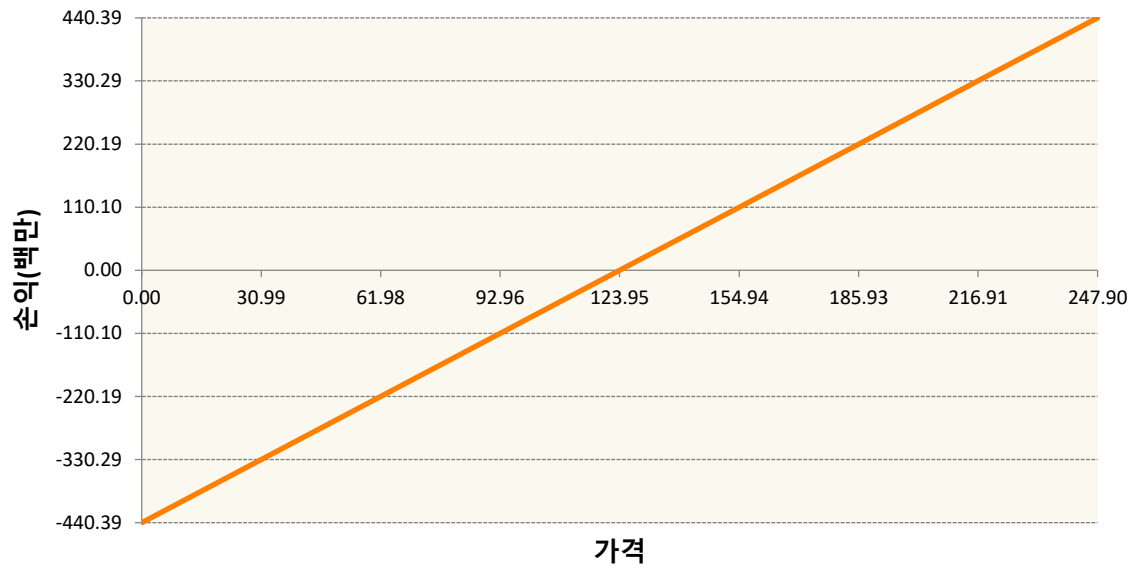
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,680	775	5,905	

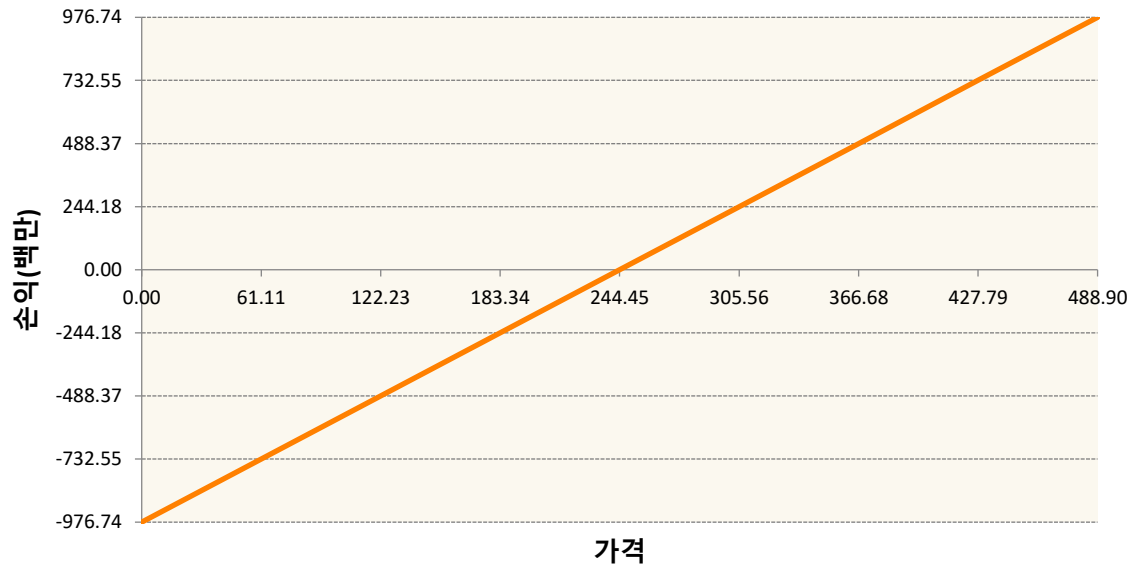
2. 만기시점의 손익구조



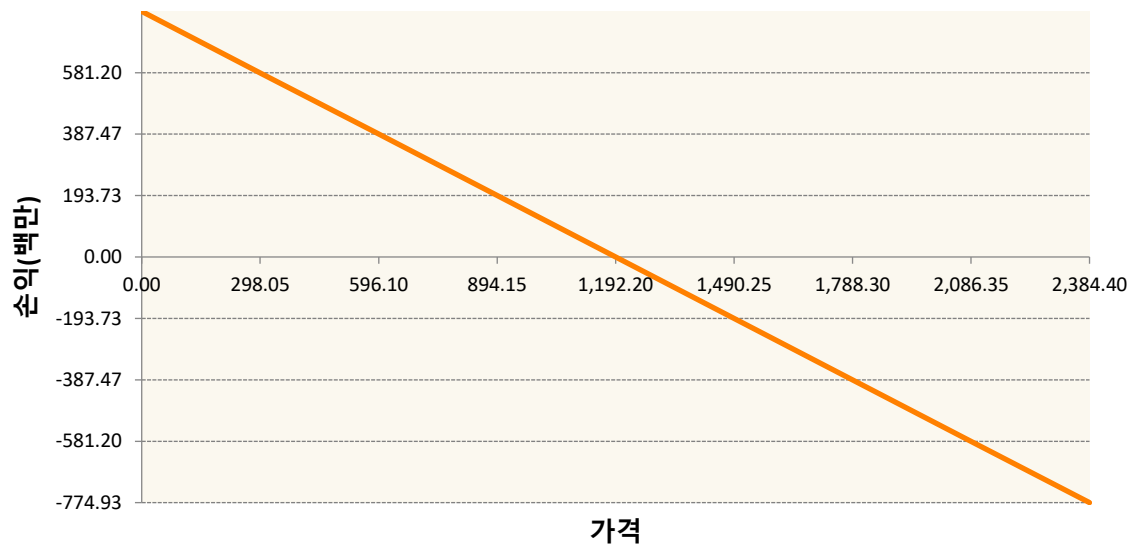
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



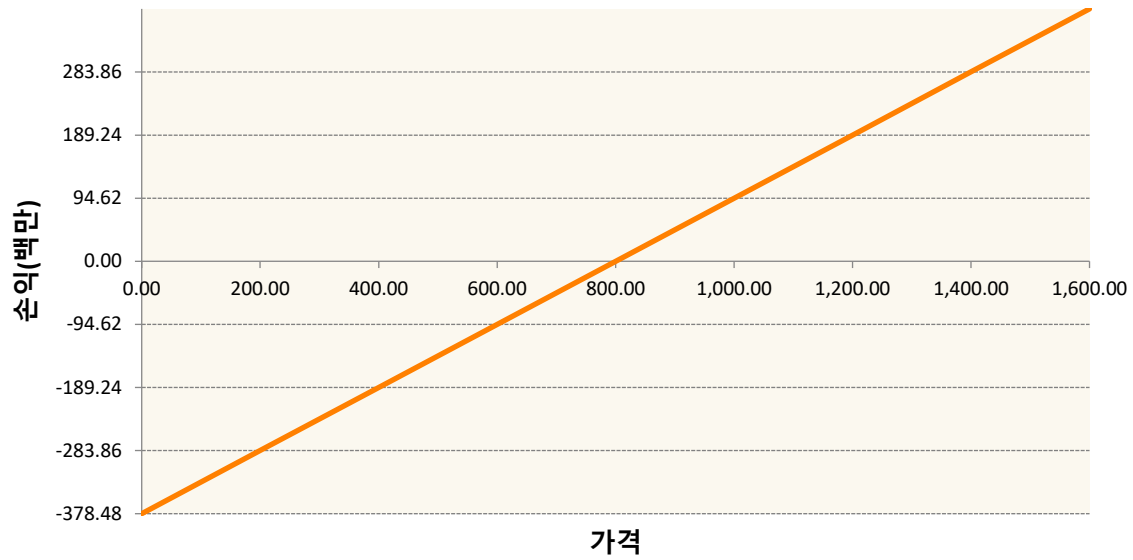
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



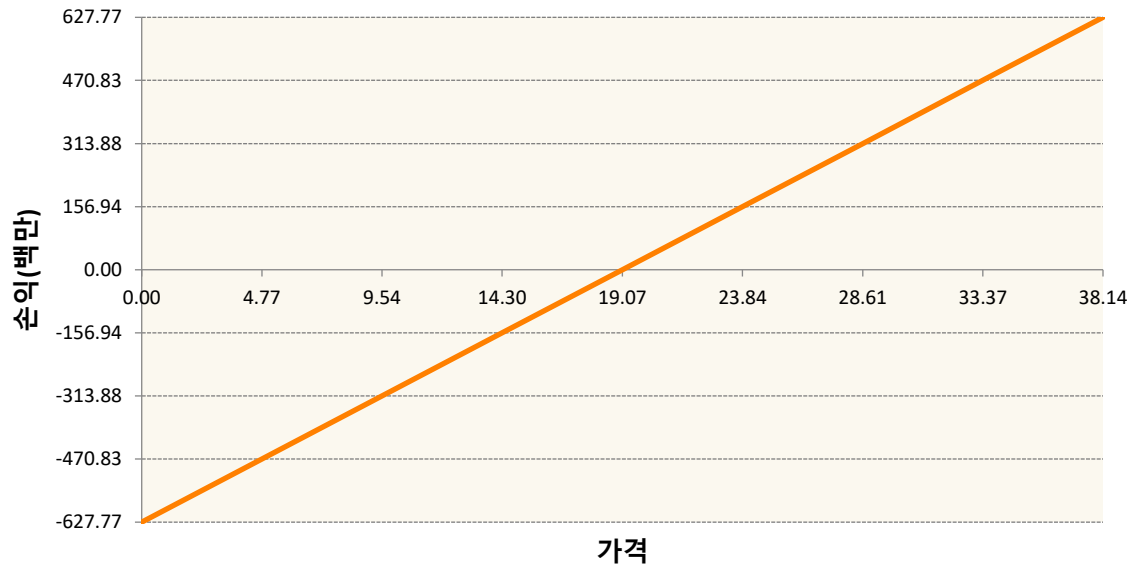
KR4175S20006-2022-02 달러선물



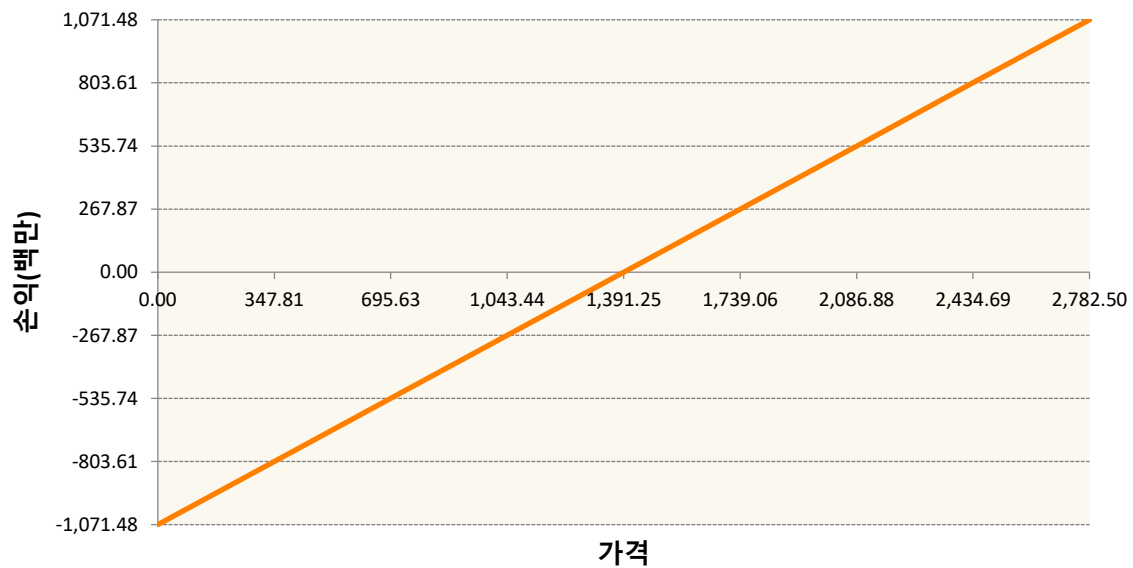
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



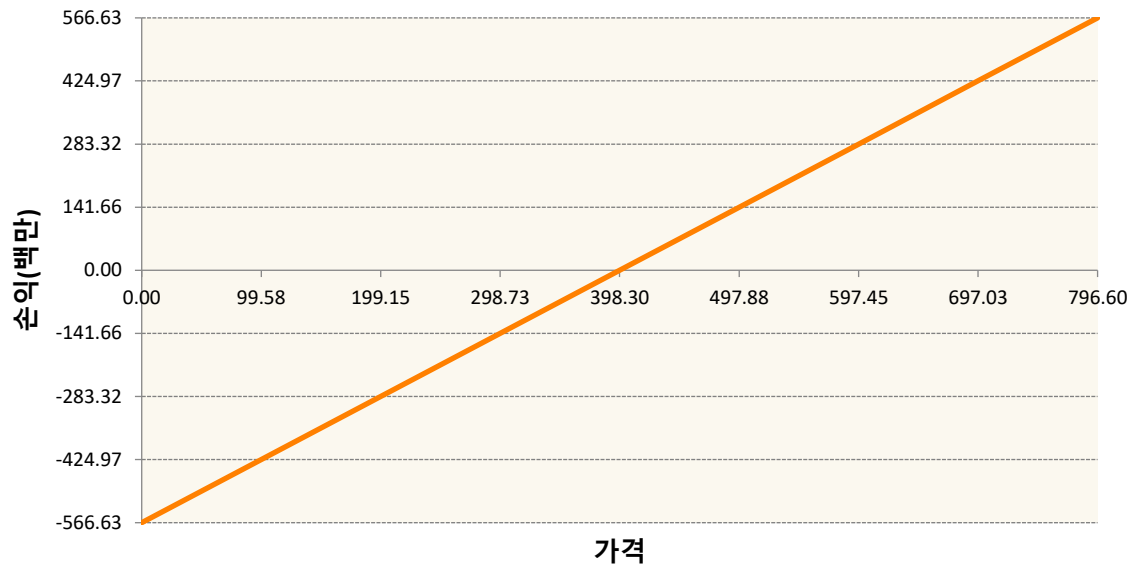
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



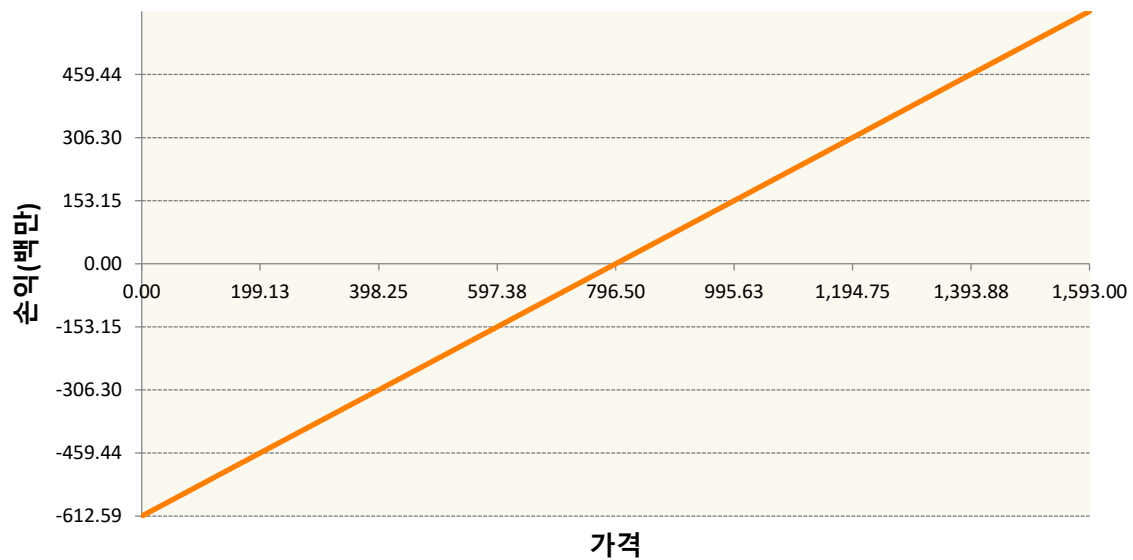
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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	2022-01-21
기준일	2022-01-20

스마트인덱스모

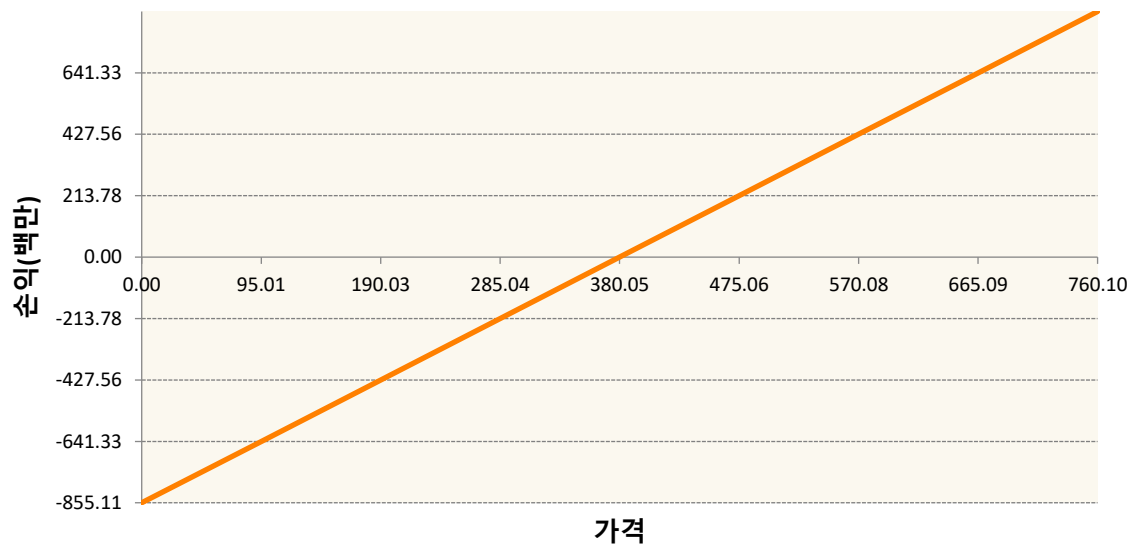
1. 계약금액

(단위:백만원)

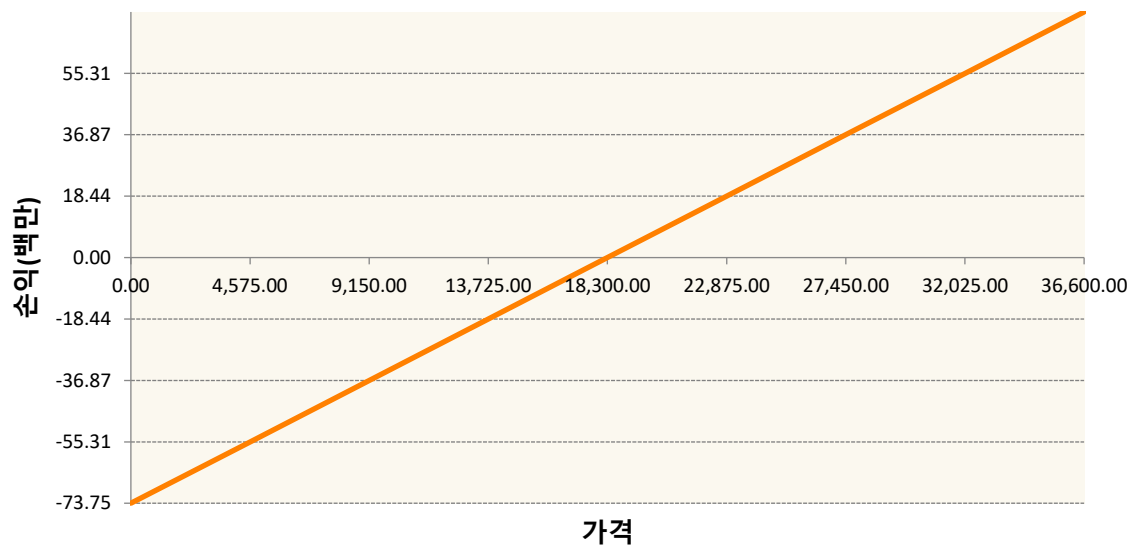
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	94	0	94	장내
누계	유가증권	선물	929	0	929	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					68
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	46	46	46	46	46	46	46
8.00%	68	68	68	68	68	68	68
KR41B9S20003		2022-02 두산중공업개별선물					6
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

71

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

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

890

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

535

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

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	429
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

399

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

유로인덱스모(주식-파생형)

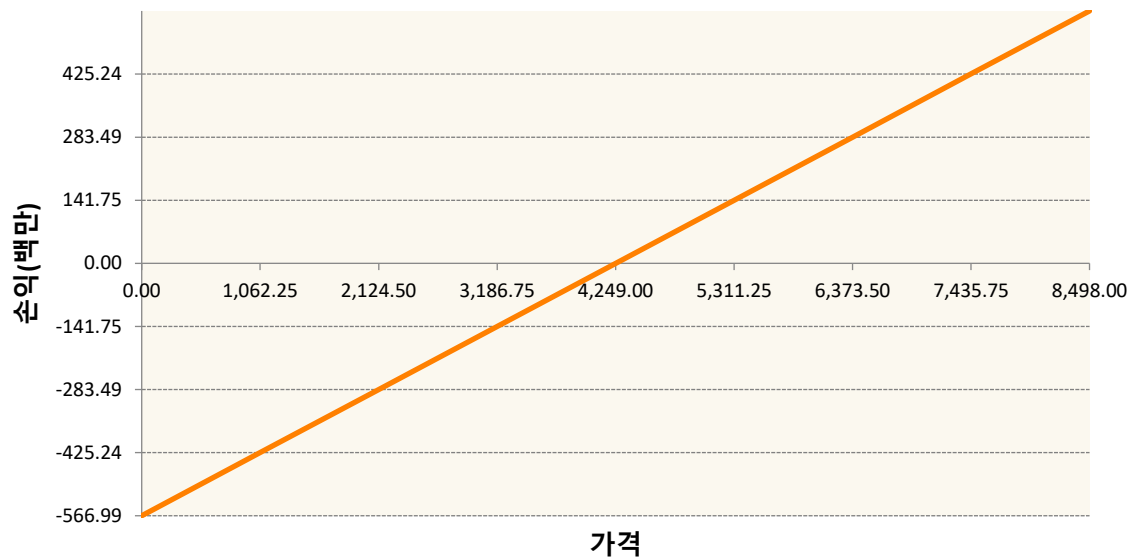
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	567	0	567	

2. 만기시점의 손익구조

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

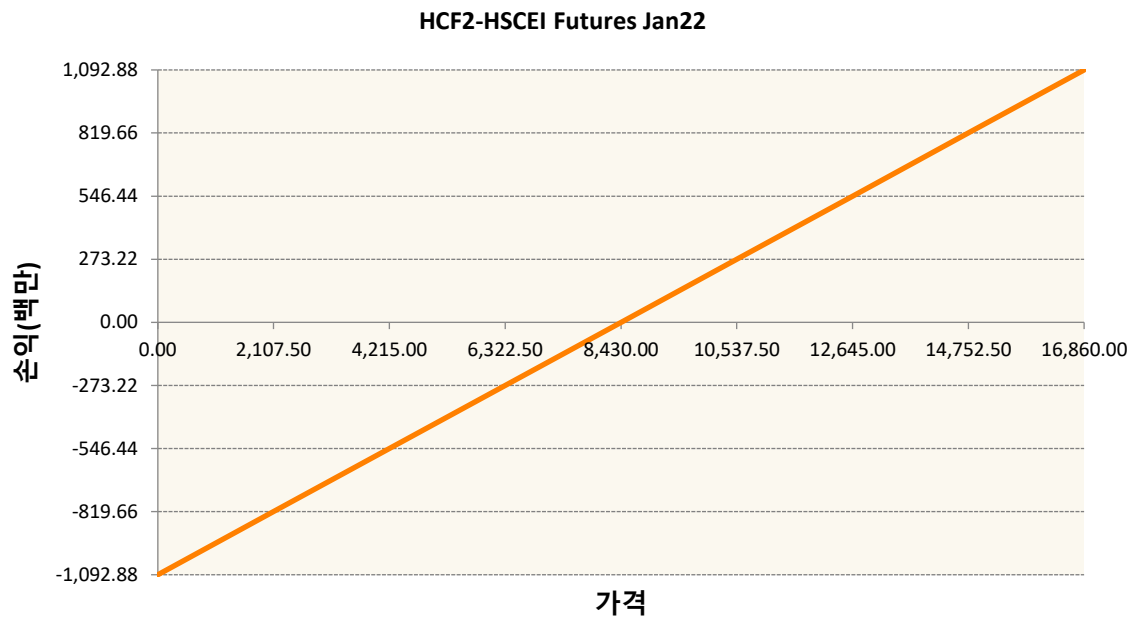
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,093	0	1,093	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF2	HSCEI Futures Jan22	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

91

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

커버드콜모(주식혼합-파생형)

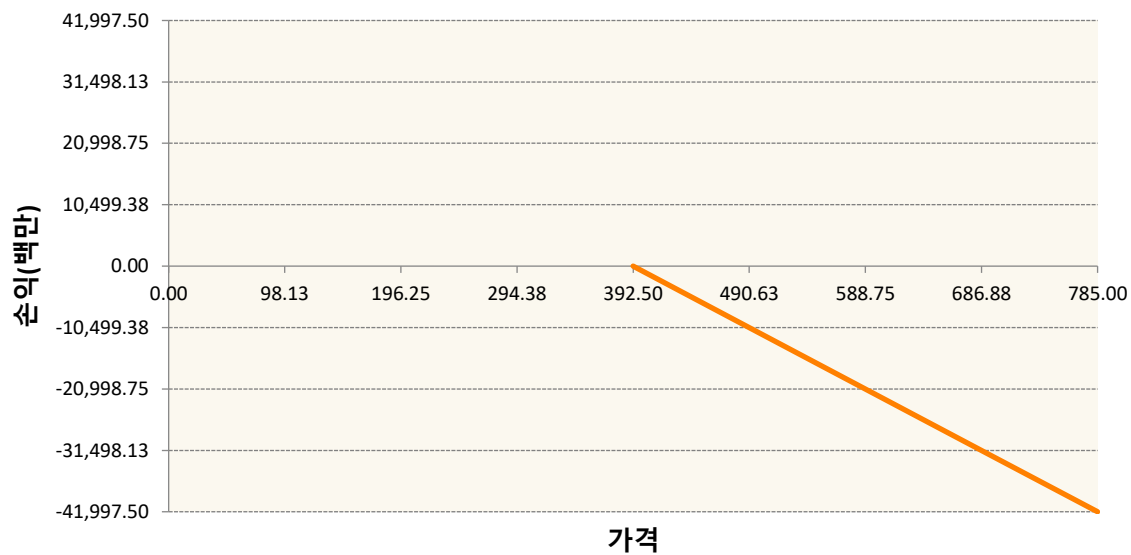
1. 계약금액

(단위:백만원)

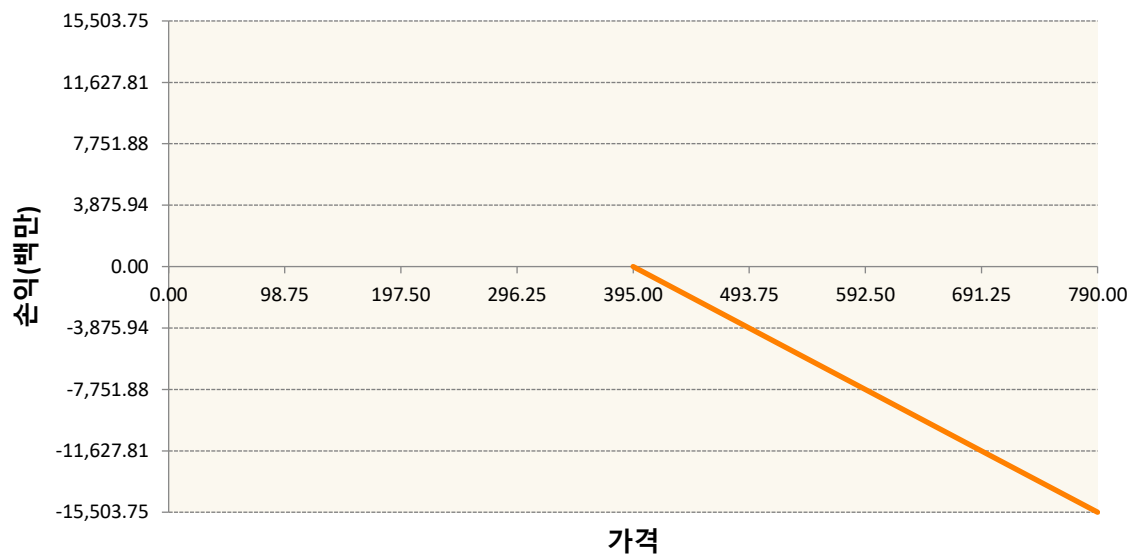
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	296	305	-10	장내
누계	유가증권	옵션	0	77,224	-77,224	장내

2. 만기시점의 손익구조

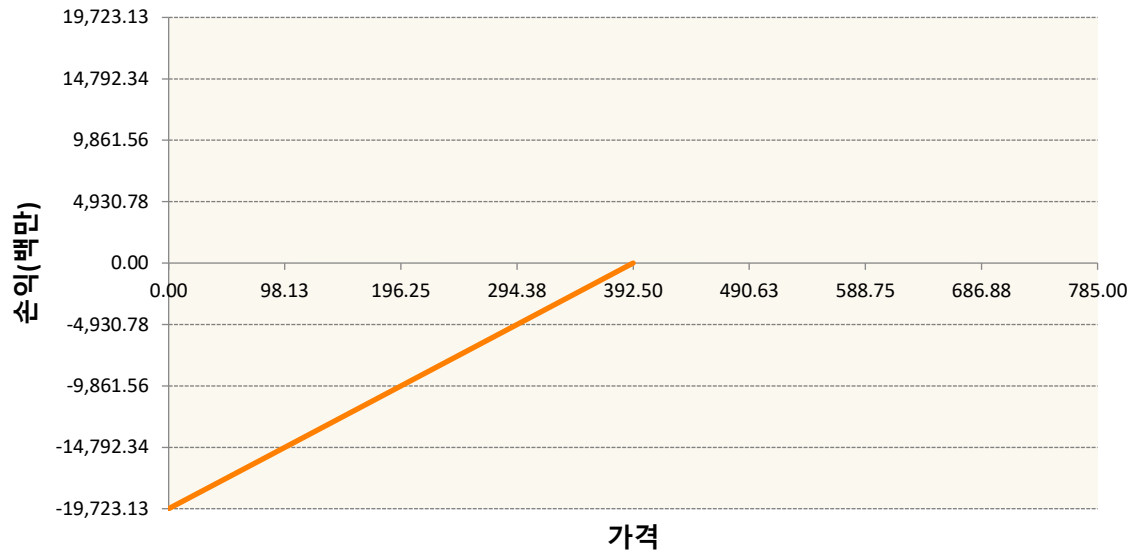
KR4201S23921-2022-02 콜392.5



KR4201S23954-2022-02 콜395



KR4301S23929-2022-02 풋392.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S23921 2022-02 콜392.5								2,044
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	547	540	528	512	491	466	436	
-5.33%	522	500	472	438	399	355	306	
-2.67%	438	392	339	281	220	155	88	
0%	231	157	79	0	-81	-163	-246	
2.67%	-168	-258	-349	-440	-530	-621	-711	
5.33%	-791	-876	-962	-1,049	-1,137	-1,225	-1,314	
8.00%	-1,613	-1,675	-1,743	-1,814	-1,888	-1,965	-2,044	
KR4201S23954 2022-02 콜395								711
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	173	171	168	163	156	148	138	
-5.33%	166	160	151	140	128	113	97	
-2.67%	142	128	110	91	70	48	25	
0%	80	54	28	0	-28	-57	-87	
2.67%	-48	-81	-114	-147	-180	-213	-246	
5.33%	-256	-289	-322	-355	-388	-421	-454	
8.00%	-541	-567	-594	-622	-651	-681	-711	
KR4301S23929 2022-02 풋392.5								1,418
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,411	-1,411	-1,412	-1,412	-1,413	-1,415	-1,418	
-5.33%	-903	-904	-906	-909	-914	-920	-927	
-2.67%	-402	-408	-417	-427	-439	-453	-468	
0%	60	41	21	0	-22	-45	-68	

2.67%	415	387	359	331	303	275	246
5.33%	618	594	570	544	519	492	466
8.00%	697	685	671	655	638	619	599

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

(단위:백만원)

3,968

공시일 2022-01-21

기준일 2022-01-20

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

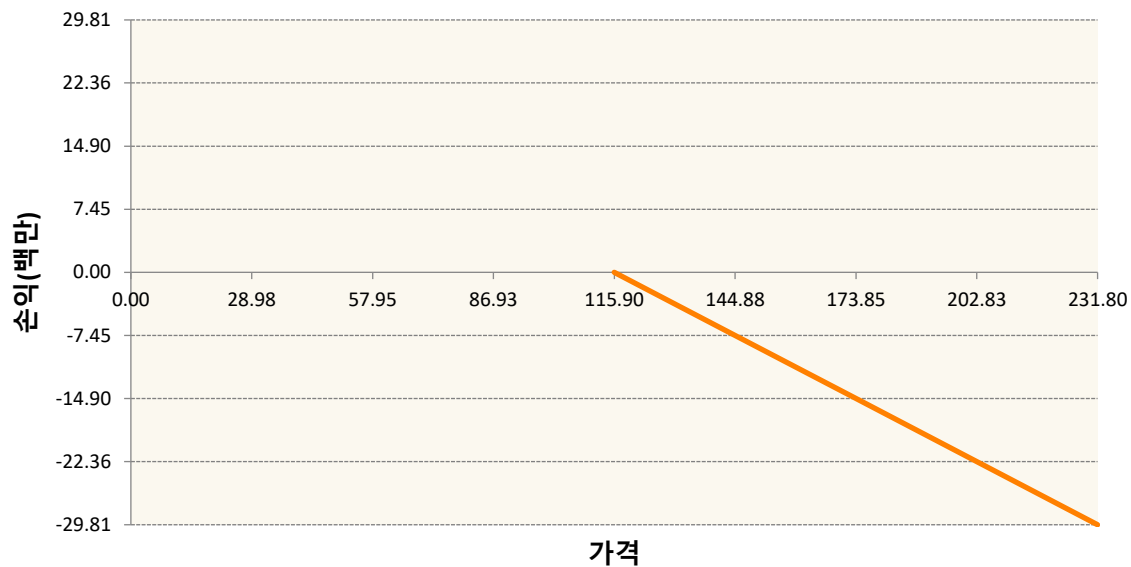
1. 계약금액

(단위:백만원)

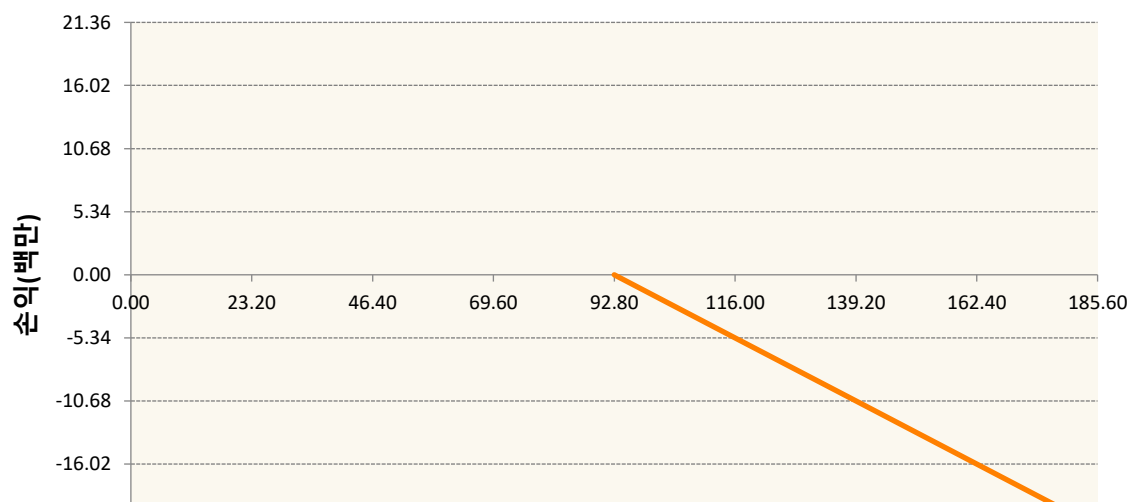
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	53	-53	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,031	-2,031	장외

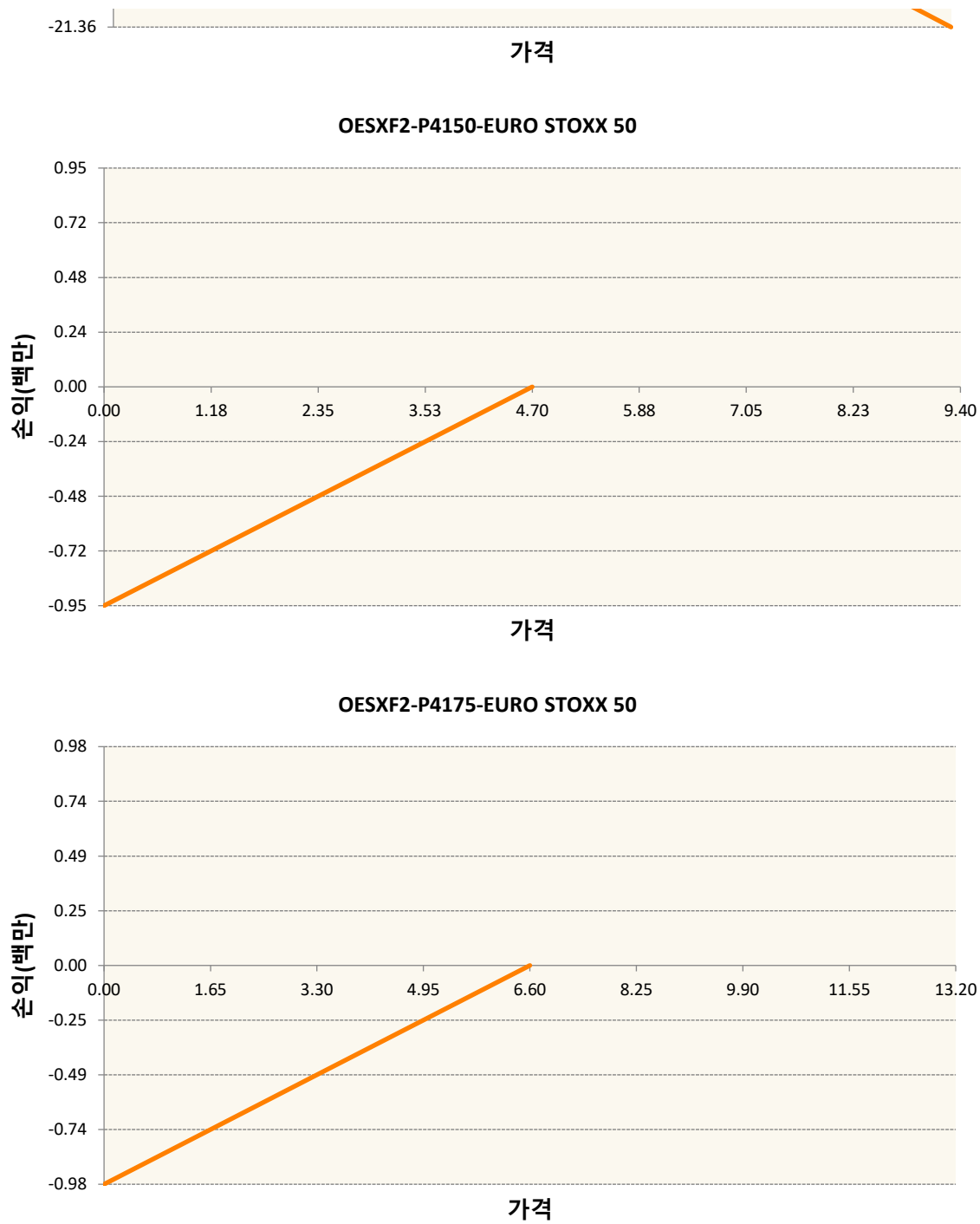
2. 만기시점의 손익구조

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

0.09
54
108
2
2
0.08
0.08

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

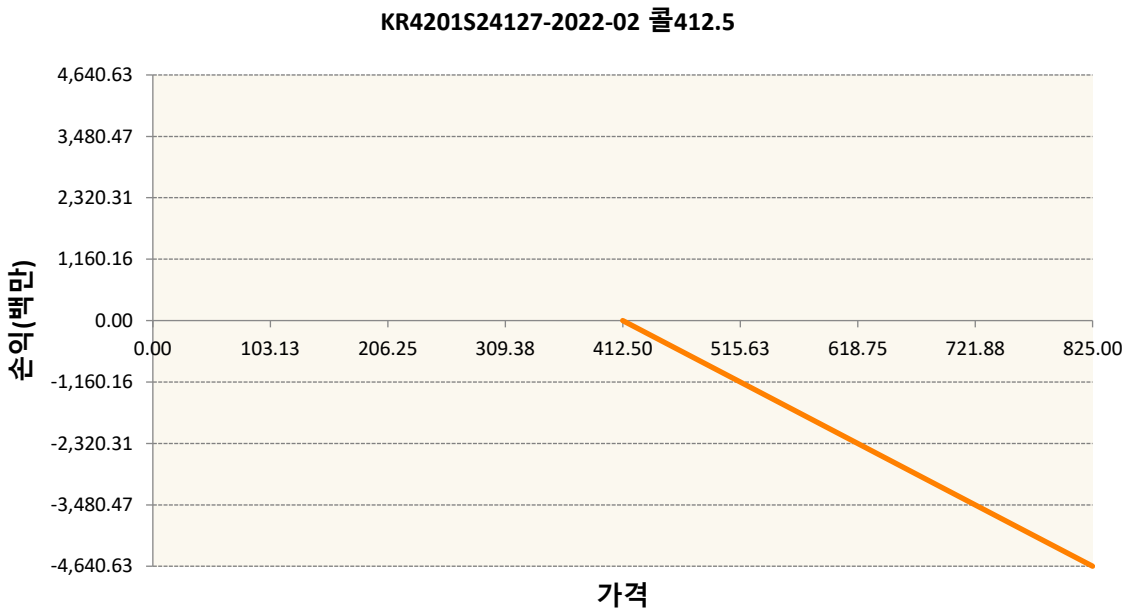
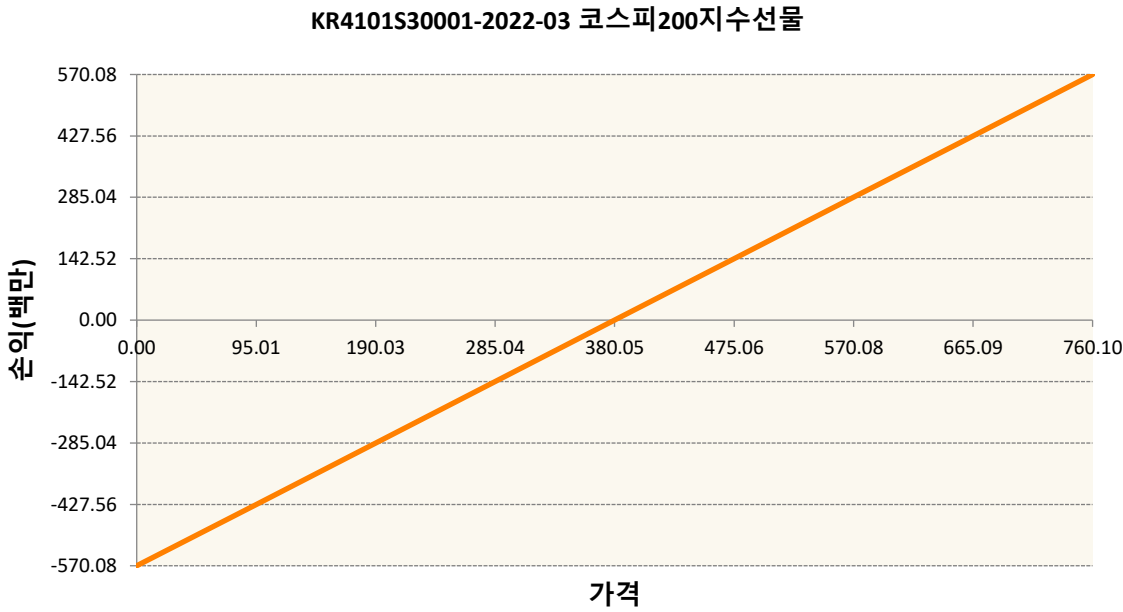
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	206	-206	장내
누계	유가증권	선물	570	0	570	장내
누계	유가증권	옵션	294	4,952	-4,658	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격	이익(백만)
415.00	0.00
518.75	-77.81
622.50	-155.63
726.25	-233.44
830.00	-311.25

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 785.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from -294.38 to 294.38. A blue line represents the profit function, starting at (0, 294.38) and ending at (392.50, 0). The line is linear, indicating a constant marginal cost.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	294.38
392.50	0.00

(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	-46
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	46	46	46	46	46	46	46	46
KR4201S24127				2022-02 콜412.5				127
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	14	13	12
-5.33%	15	15	14	13	12	10	8
-2.67%	14	13	11	9	6	3	-1
0%	11	8	4	0	-5	-10	-16
2.67%	0	-5	-12	-18	-25	-33	-40
5.33%	-23	-32	-41	-49	-59	-68	-77
8.00%	-67	-77	-87	-97	-107	-117	-127

KR4201S24150

2022-02 콜415

8

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	0
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0
0%	1	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2
5.33%	-1	-2	-2	-3	-3	-4	-5
8.00%	-4	-4	-5	-6	-6	-7	-8

KR4301S23929

2022-02 풋392.5

21

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	13	13	14	14	14	14	14
-2.67%	6	6	6	6	7	7	7
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-6	-6	-5	-5	-5	-4	-4
5.33%	-9	-9	-9	-8	-8	-7	-7
8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-9	-9

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

(단위:백만원)

147

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

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	10,504	0	10,504	

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	2022-01-21
기준일	2022-01-20

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	9,050	0	9,050	

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	2022-01-21
기준일	2022-01-20

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	580	-580	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	30,583	0	30,583	
누계	통화	선도	13,236	28,021	-14,786	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E		2,242
FXW213C17 USD/KRW 26-01-22E		1,059
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,074

공시일 2022-01-21

기준일 2022-01-20

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

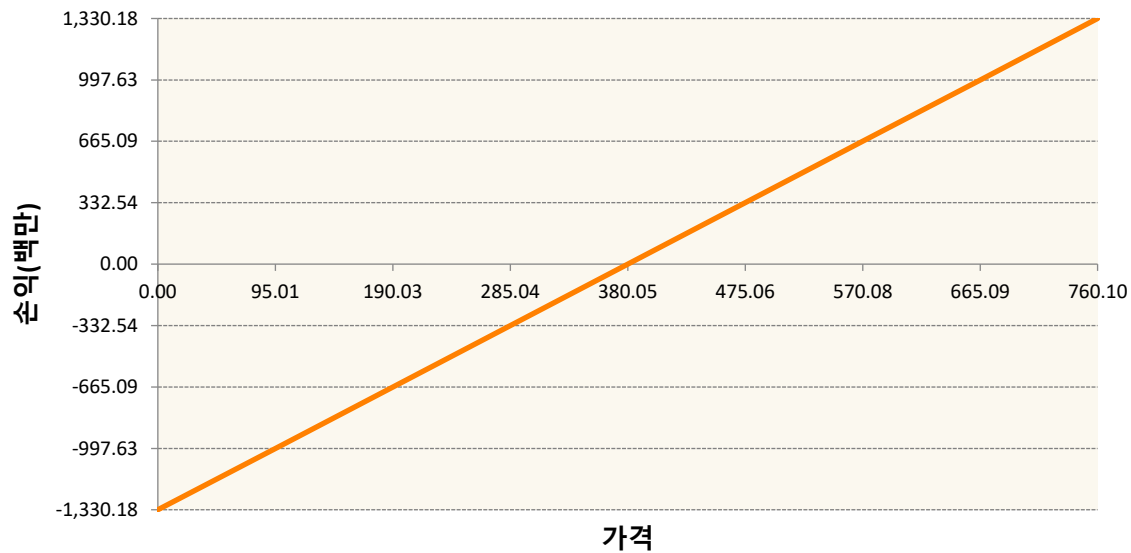
1. 계약금액

(단위:백만원)

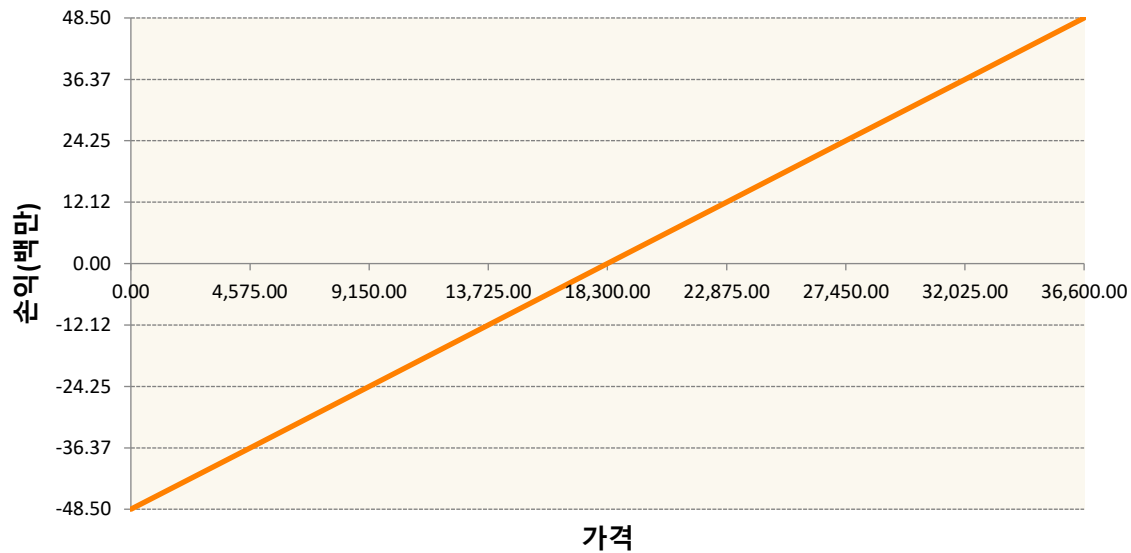
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	14	0	14	장내
누계	유가증권	선물	1,379	0	1,379	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-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%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	107	107	107	107	107	107	107
KR41B9S20003		2022-02 두산중공업개별선물					4
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

104

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

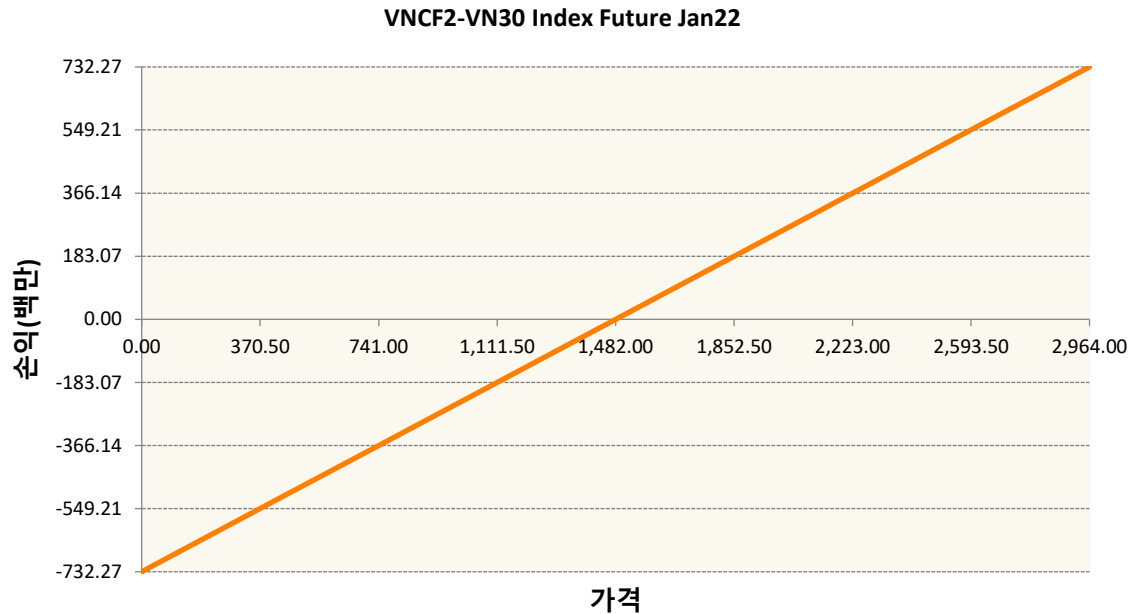
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	732	0	732	
누계	유가증권	스왑	1,808	0	1,808	장외
누계	통화	선도	0	1,327	-1,327	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
FXW213C1K KRW/EUR 22-04-22E	16
VNCF2 VN30 Index Future Jan22	59

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

(단위:백만원)

공시일 2022-01-21
기준일 2022-01-20

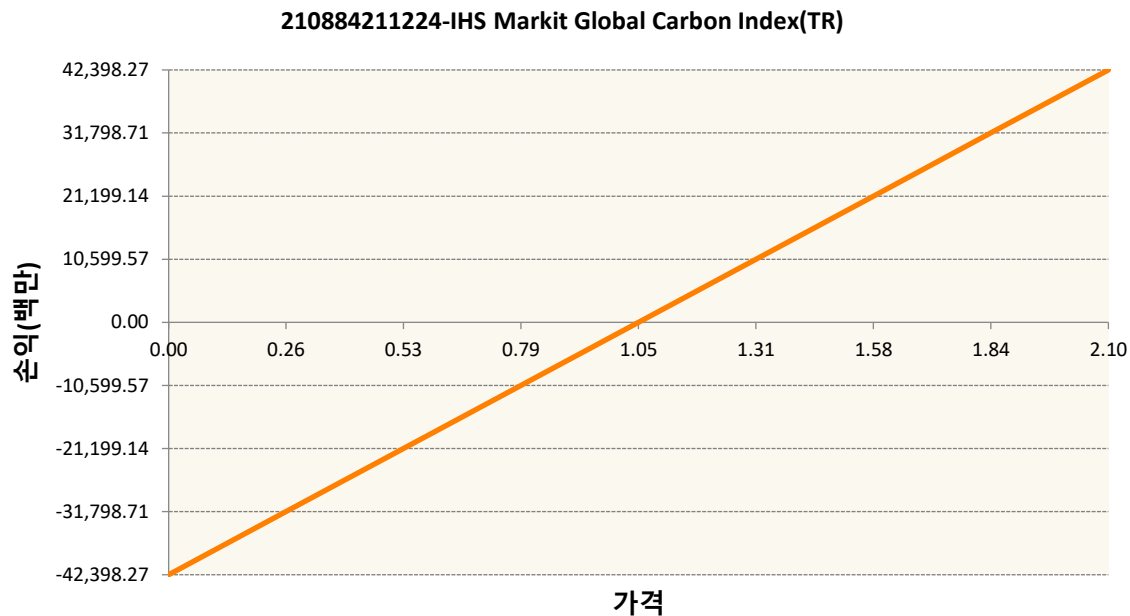
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)

3,379

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

(단위:백만원)

5,445

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

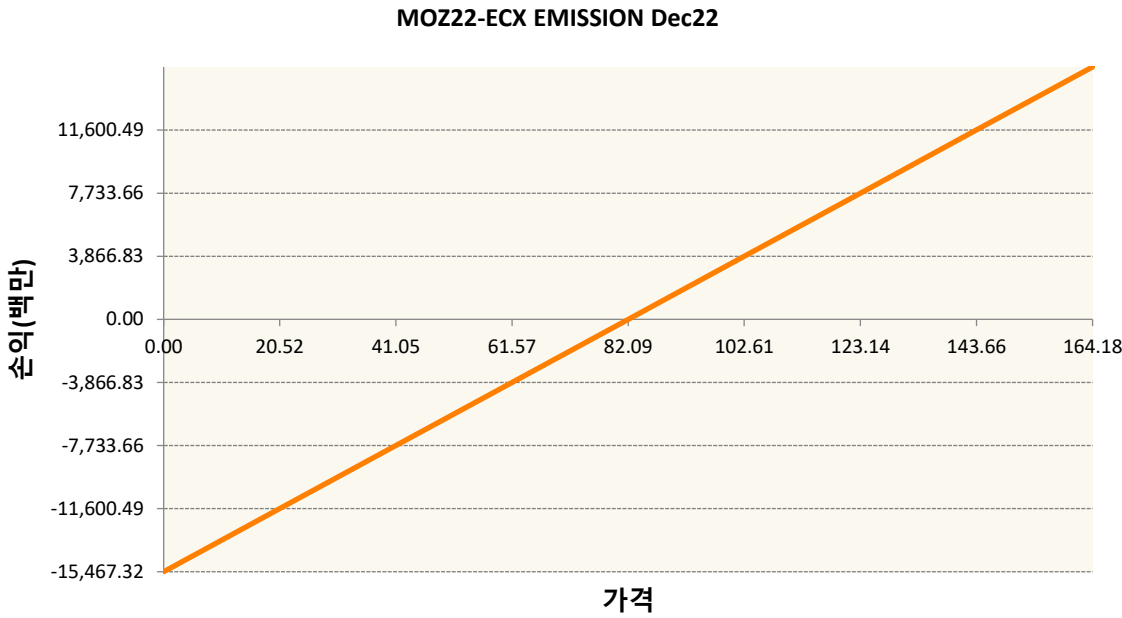
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,467	0	15,467	
누계	통화	선도	0	6,117	-6,117	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCV·KRW/EUR 28-01-22E	489
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,237

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

(단위:백만원)

2,882

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

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)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	19

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

(단위:백만원)

145

공시일	2022-01-21
기준일	2022-01-20

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)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	6

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

(단위:백만원)

30

공시일 2022-01-21

기준일 2022-01-20

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

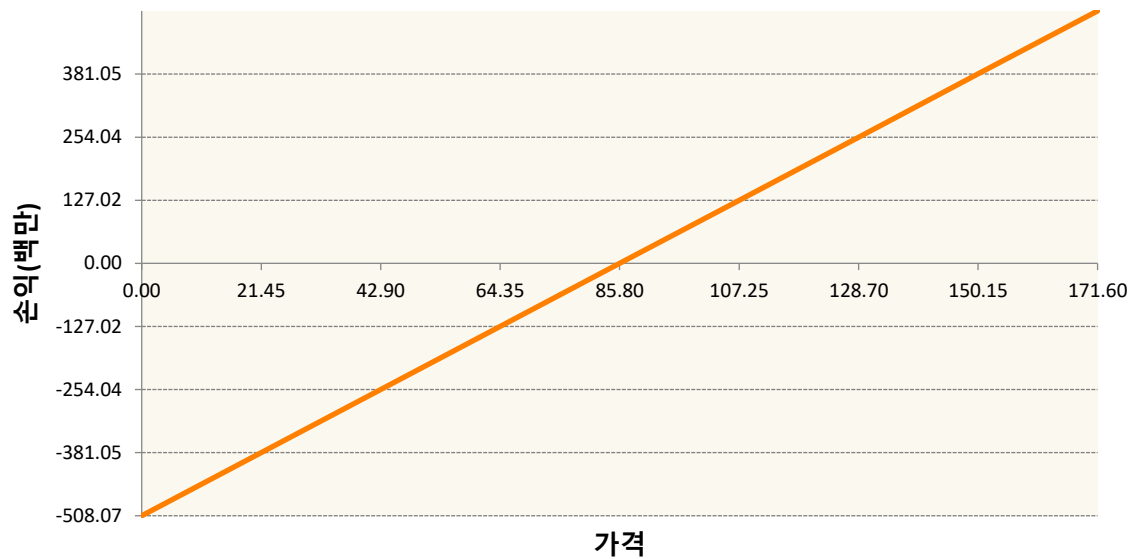
1. 계약금액

(단위:백만원)

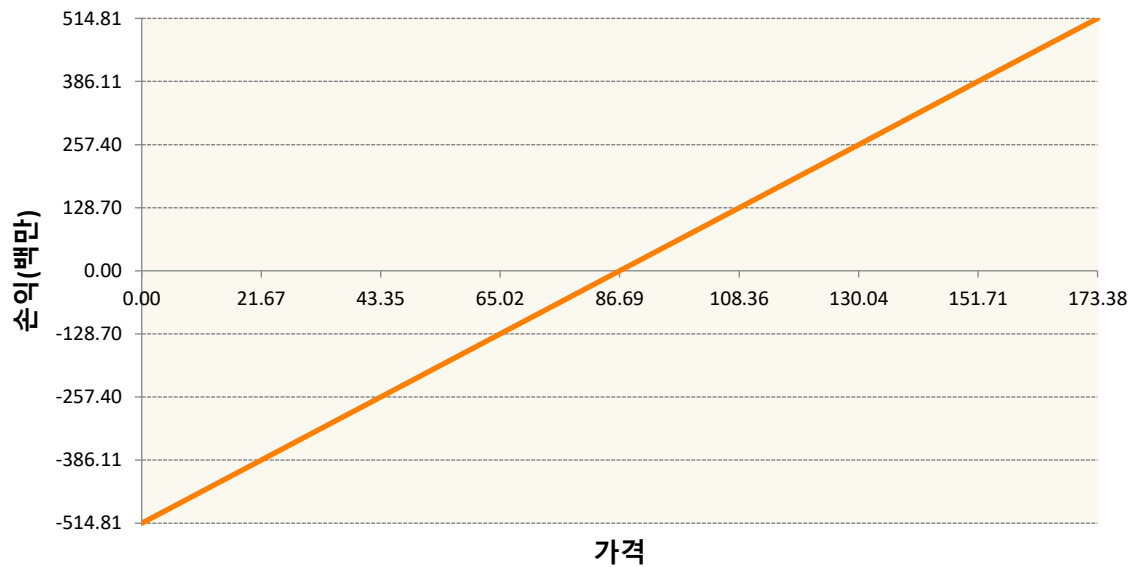
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,172	358	1,814	

2. 만기시점의 손익구조

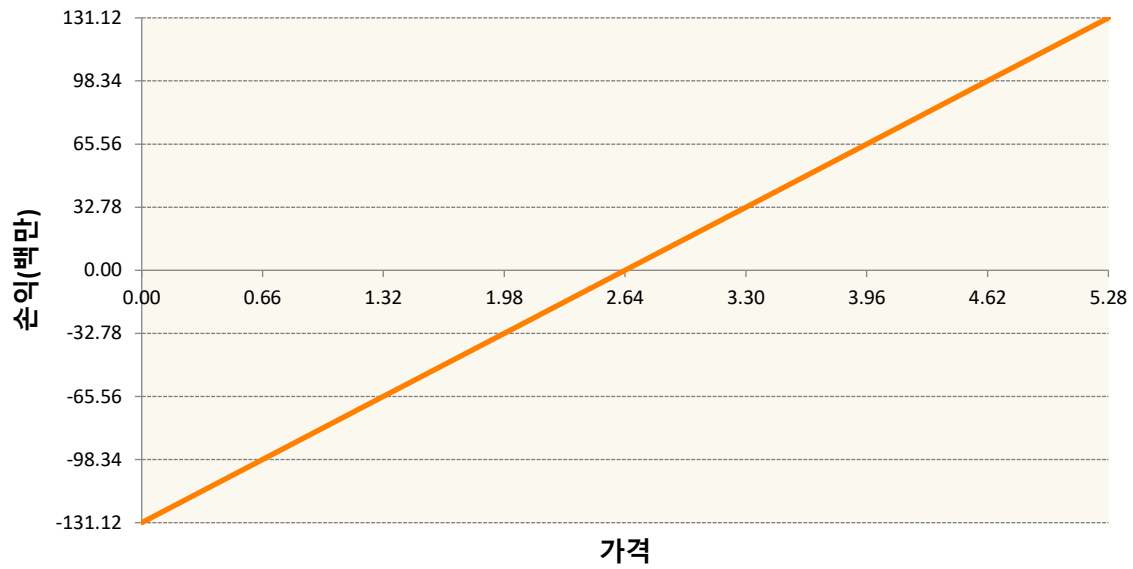
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



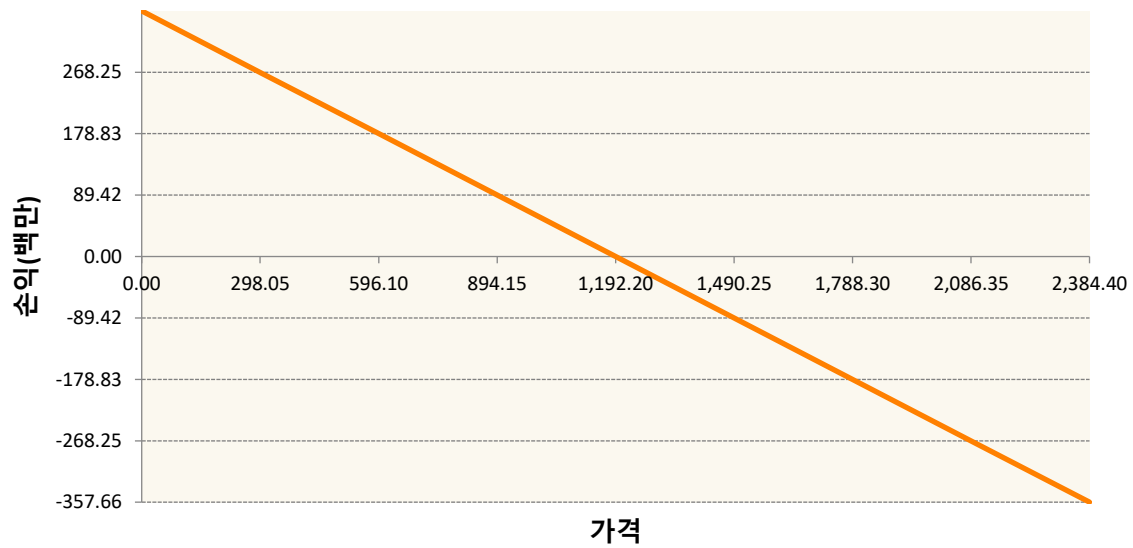
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



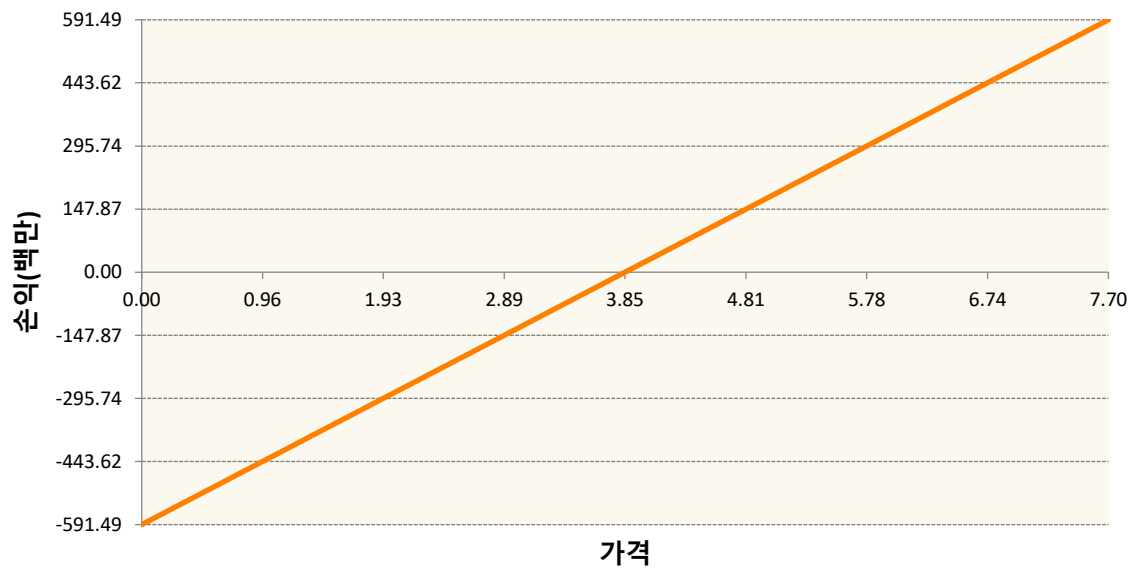
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22

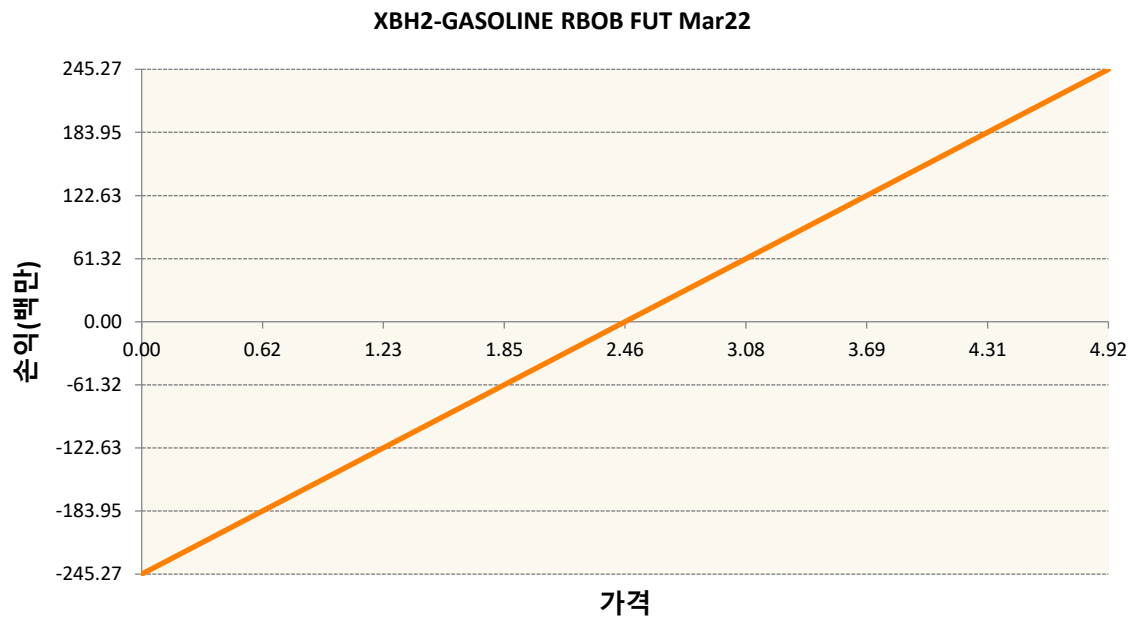
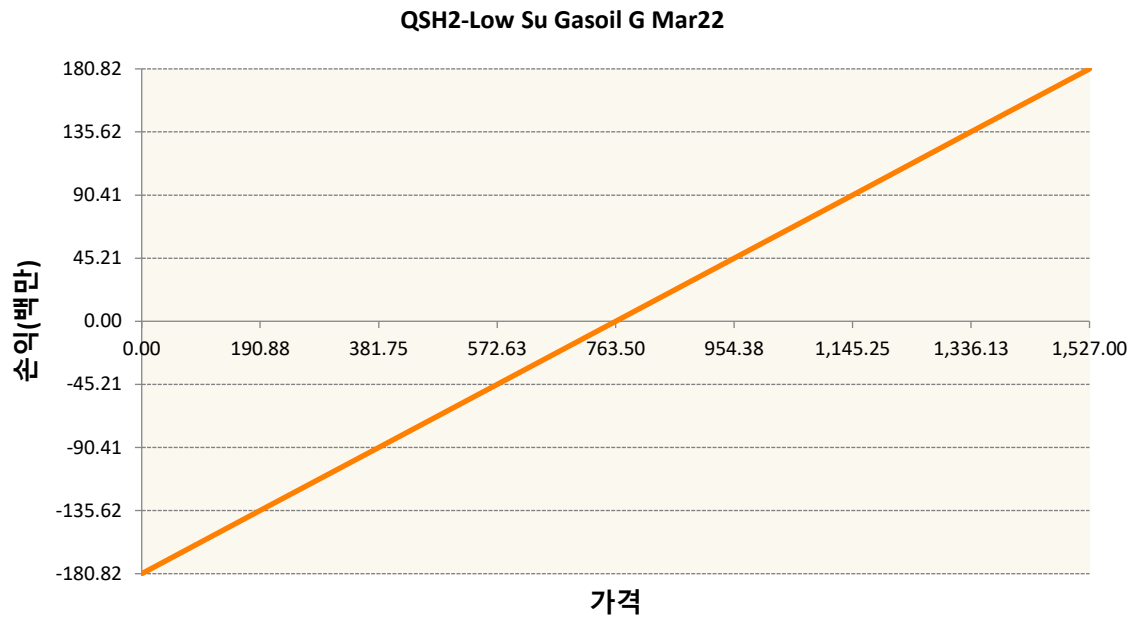


KR4175S20006-2022-02 달러선물



NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22		41
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22		41
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22		10
KR4175S200 2022-02 달러선물			29
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22		47
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22		14
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22		20

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	393