

공시일 2022-01-27

기준일 2022-01-26

포커스농산물모(채권-파생형)

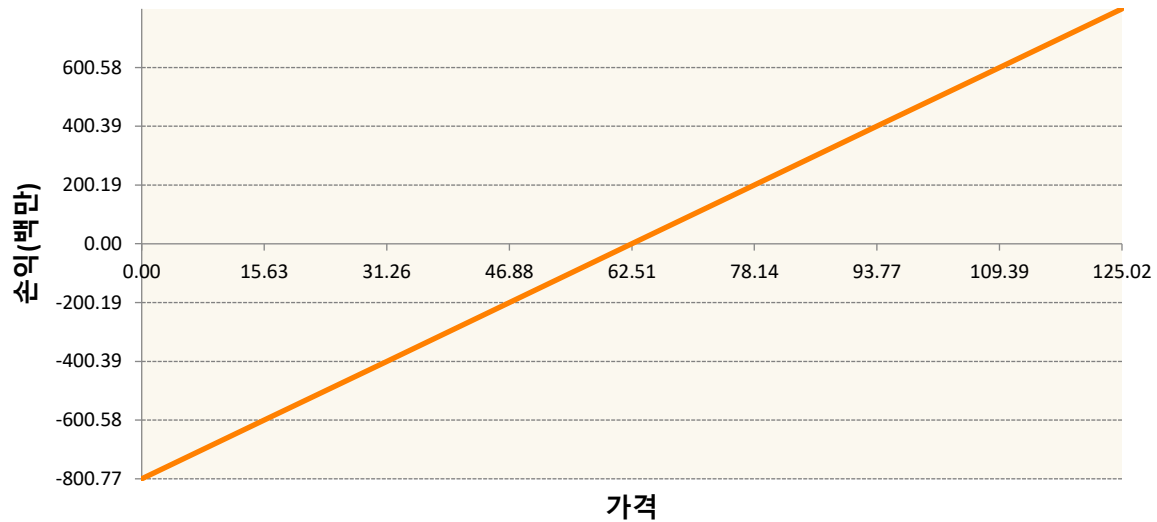
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

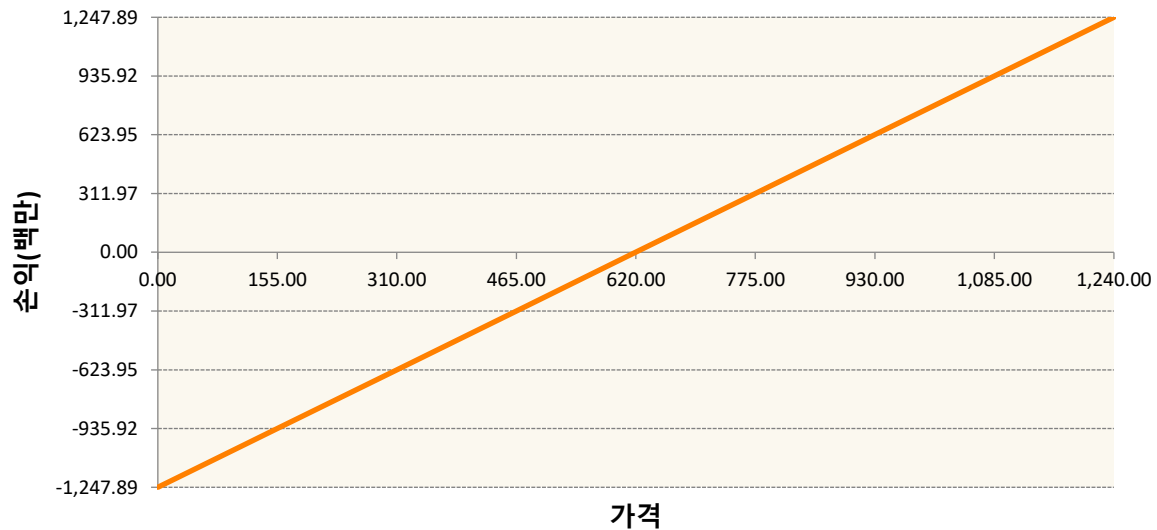
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,713	779	5,934	

2. 만기시점의 손익구조

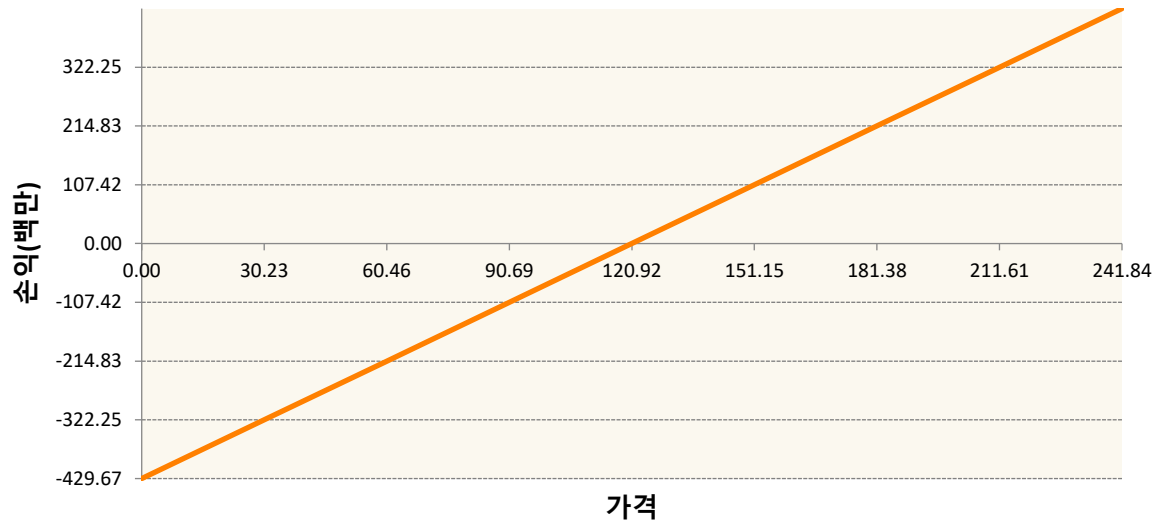
BOH2-SOYBEAN OIL FUTR Mar22



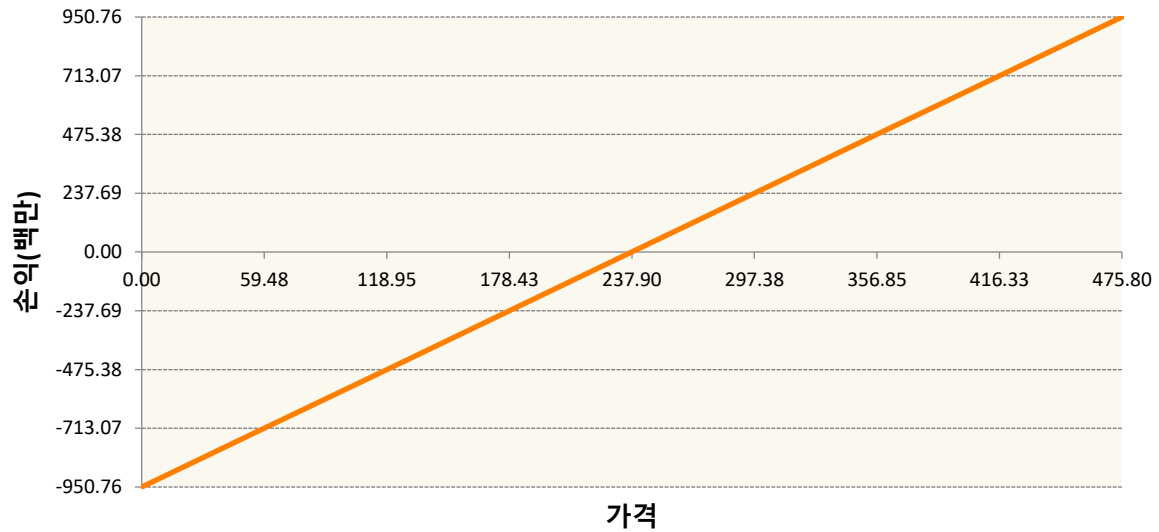
CH2-CORN FUTURE Mar22



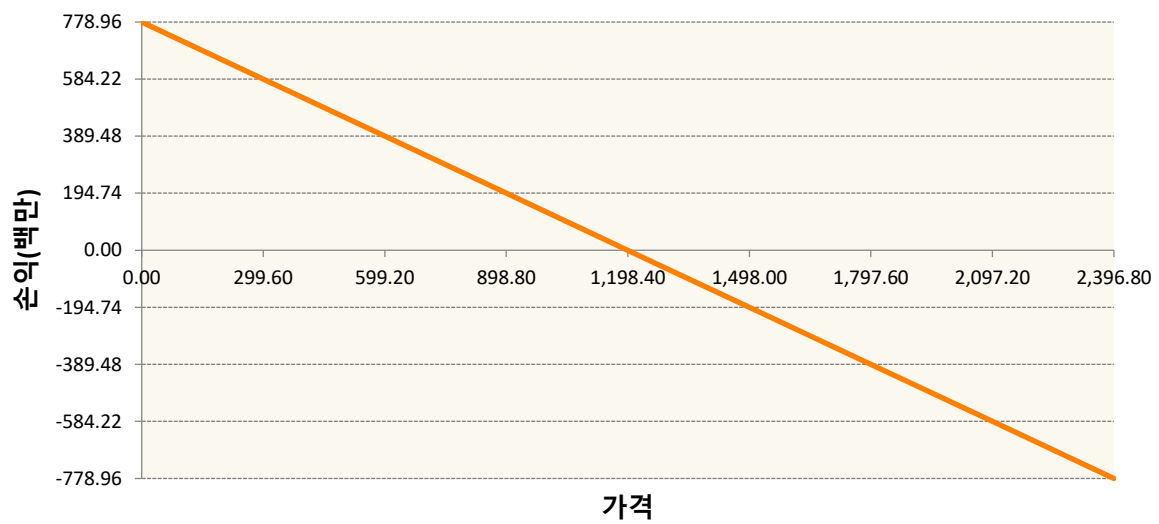
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



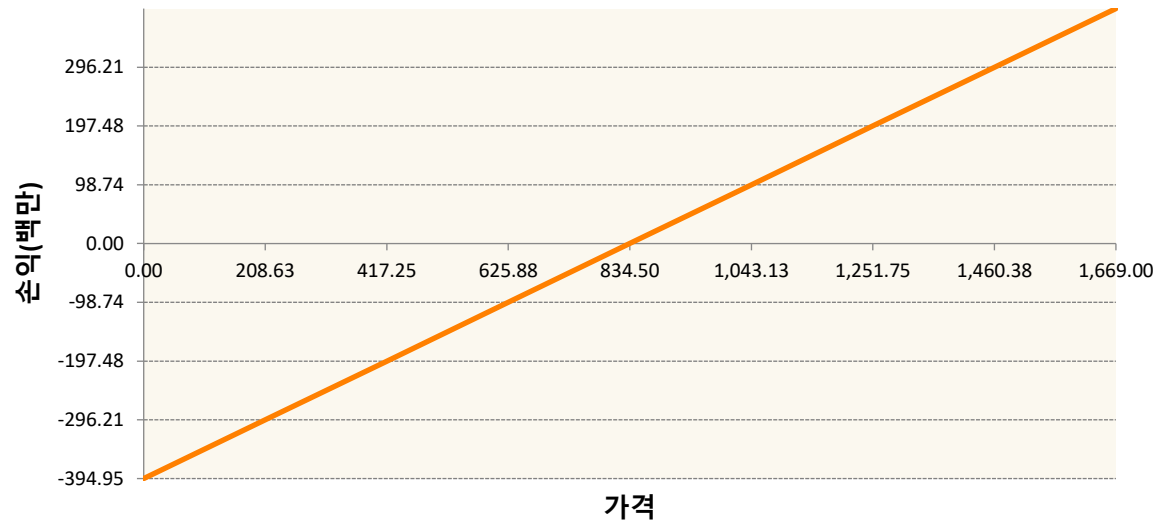
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



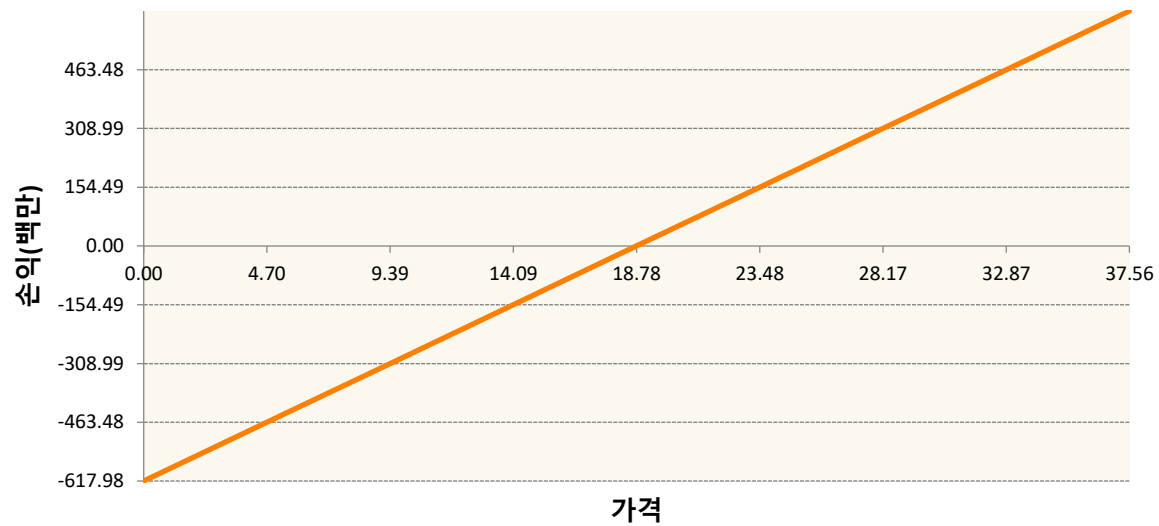
KR4175S20006-2022-02 달러선물



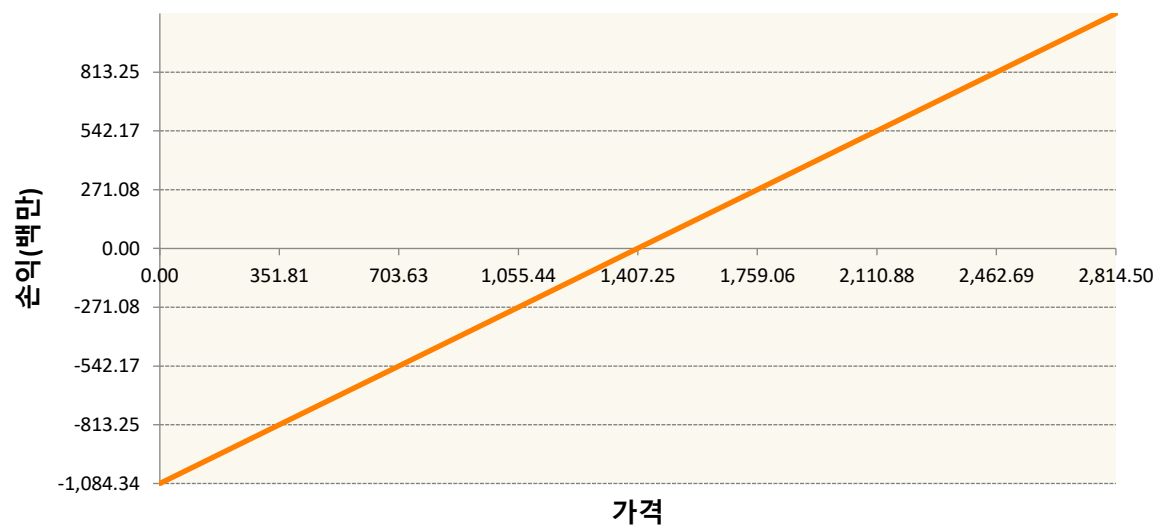
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



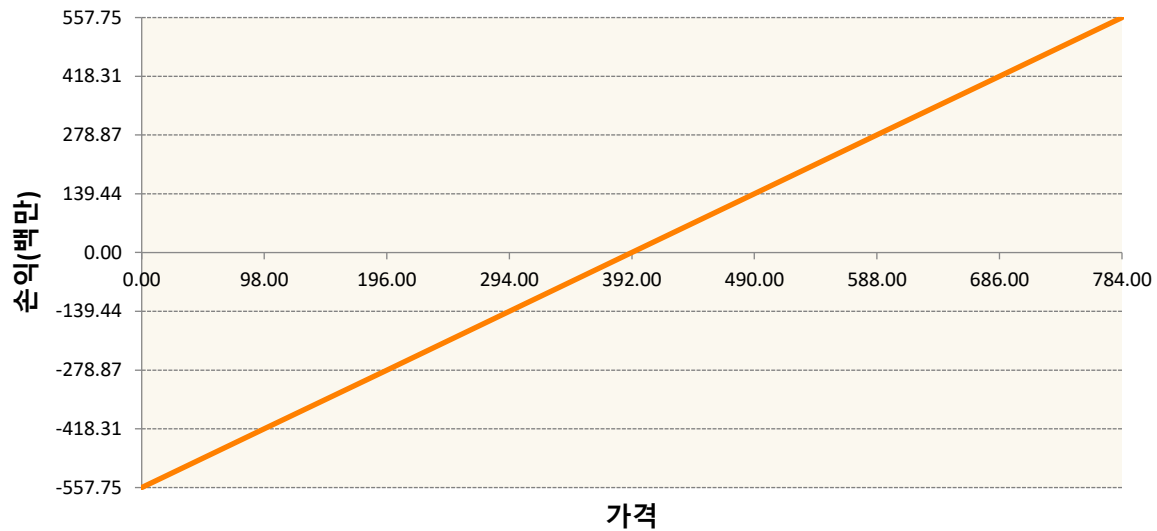
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



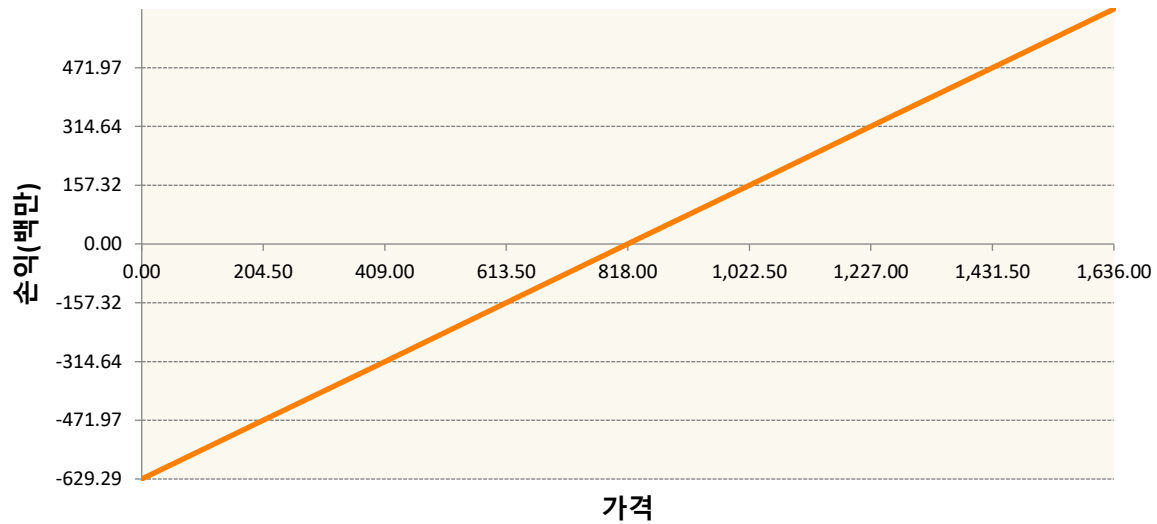
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



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	2022-01-27
기준일	2022-01-26

스마트인덱스모

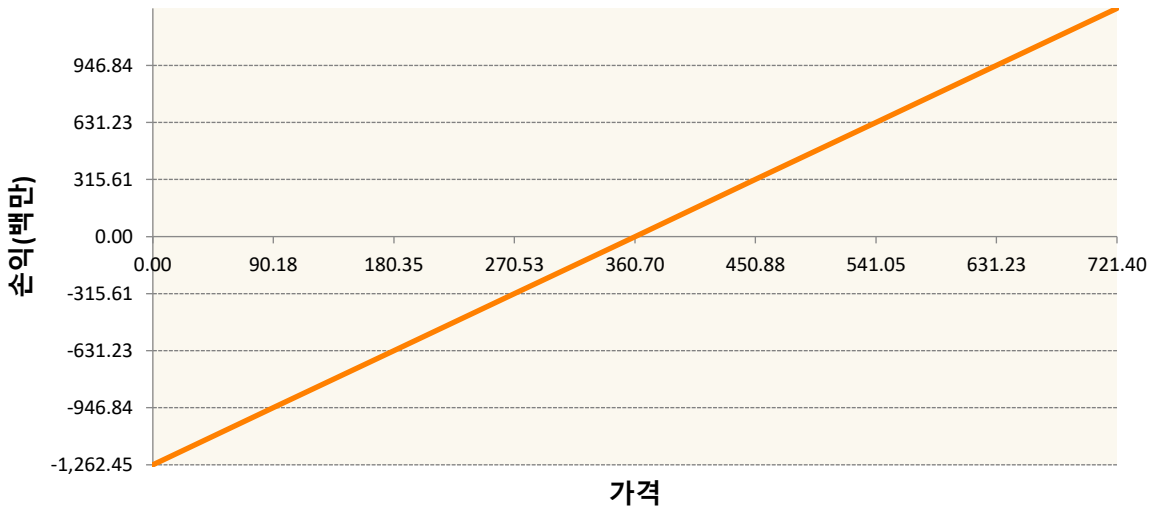
1. 계약금액

(단위:백만원)

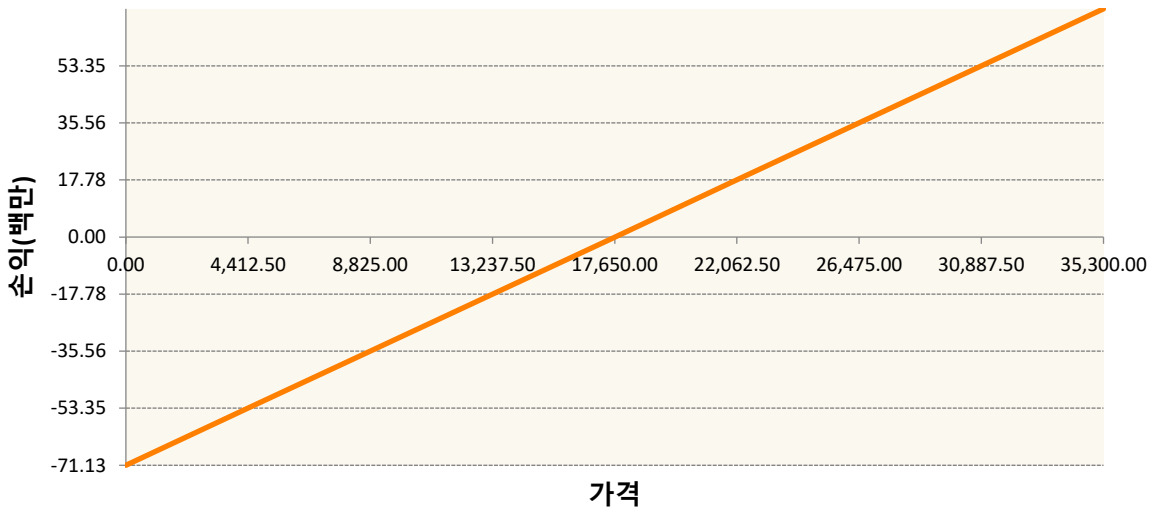
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	273	0	273	장내
누계	유가증권	선물	1,334	0	1,334	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					101
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	34	34	34	34	34	34	34
5.33%	67	67	67	67	67	67	67
8.00%	101	101	101	101	101	101	101
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)

100

공시일	2022-01-27
기준일	2022-01-26

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

854

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

510

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-01-27
기준일	2022-01-26

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

408

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

386

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-01-27

기준일 2022-01-26

유로인덱스모(주식-파생형)

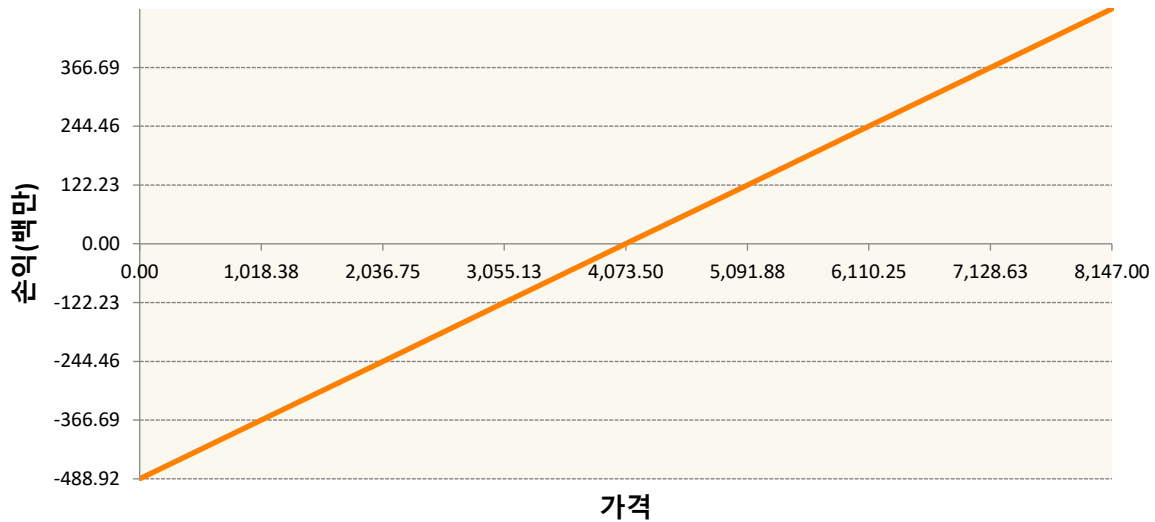
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	489	0	489	

2. 만기시점의 손익구조

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2 EURO STOXX 50 Mar22

39

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

(단위:백만원)

35

공시일 2022-01-27
기준일 2022-01-26

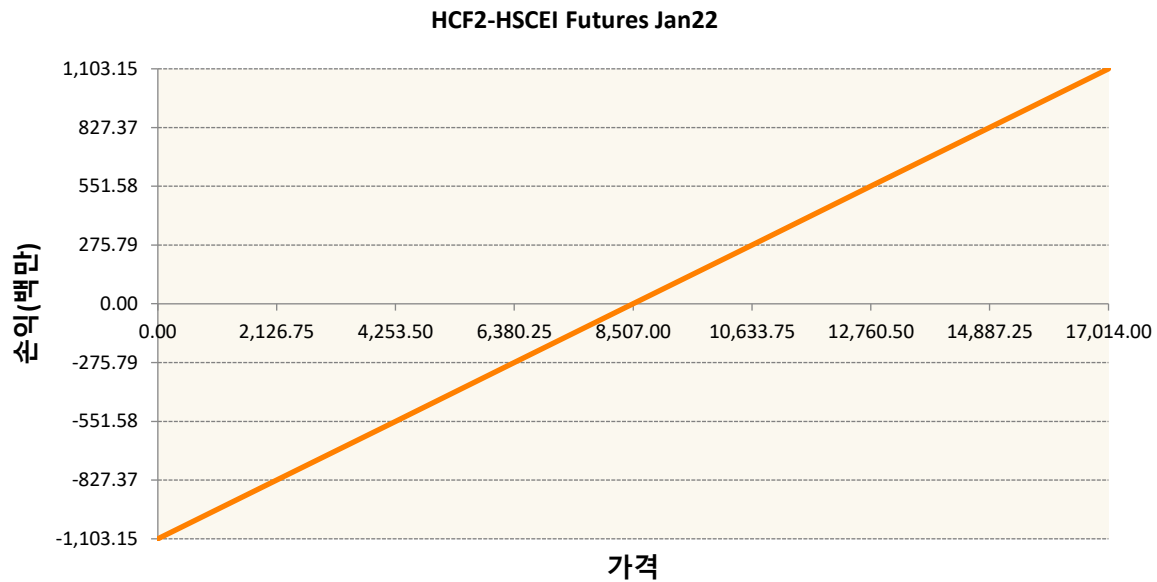
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,103	0	1,103	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF2	HSCEI Futures Jan22	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

93

공시일 2022-01-27

기준일 2022-01-26

커버드콜모(주식혼합-파생형)

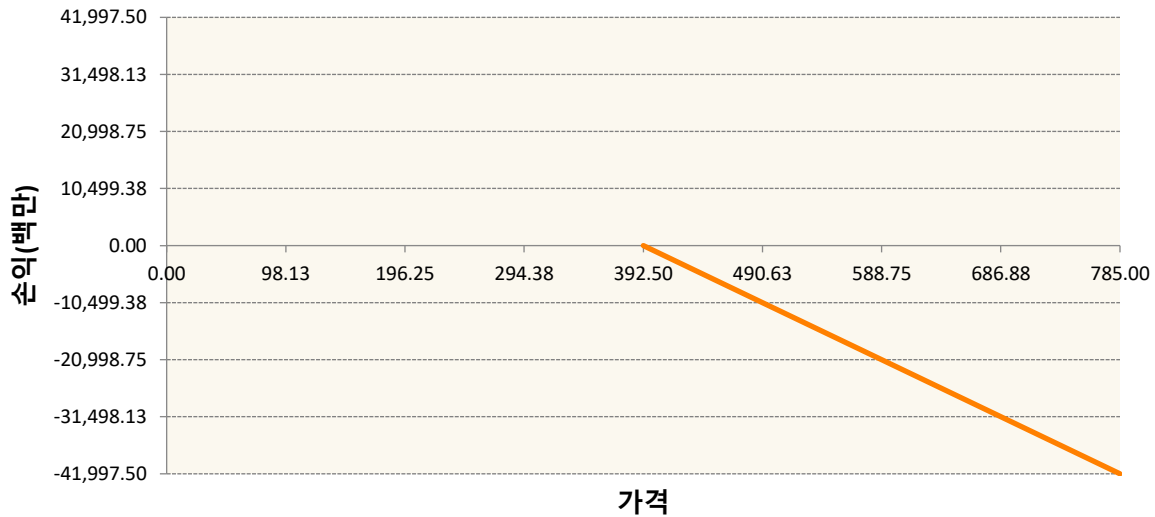
1. 계약금액

(단위:백만원)

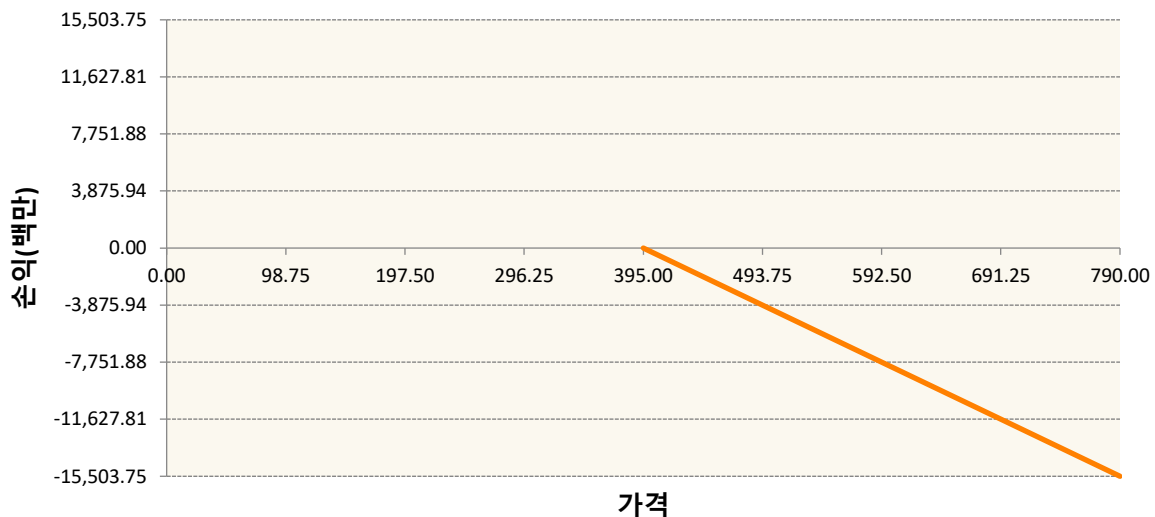
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	77,421	-77,421	장내

2. 만기시점의 손익구조

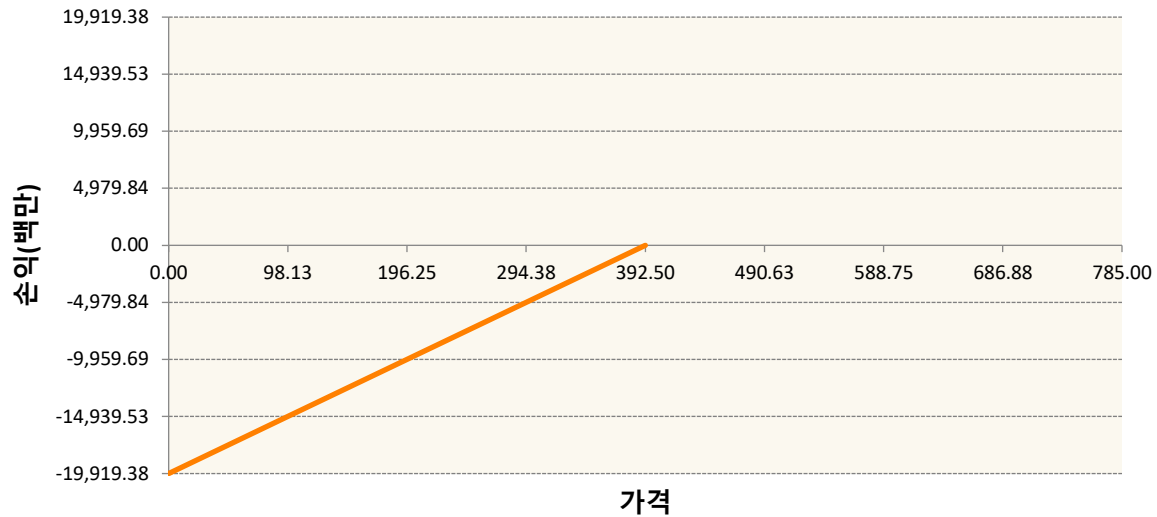
KR4201S23921-2022-02 콜392.5



KR4201S23954-2022-02 콜395



KR4301S23929-2022-02 풋392.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S23921			2022-02 콜392.5				1,063
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	107	106	104	101	96	89
-5.33%	106	104	101	95	86	74	59
-2.67%	101	94	83	68	48	24	-5
0%	78	58	32	0	-37	-79	-124
2.67%	4	-40	-89	-143	-201	-262	-326
5.33%	-182	-252	-325	-400	-476	-554	-633
8.00%	-542	-628	-715	-802	-889	-976	-1,063
KR4201S23954			2022-02 콜395				355
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	31	31	31	30	28	26
-5.33%	31	31	30	28	26	22	17
-2.67%	30	28	25	20	14	7	-3
0%	24	18	10	0	-12	-26	-41
2.67%	3	-11	-27	-44	-64	-85	-107
5.33%	-53	-76	-101	-127	-154	-181	-209
8.00%	-167	-198	-229	-260	-292	-323	-355
KR4301S23929			2022-02 풋392.5				1,444
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442	-1,442	-1,443	-1,444
-5.33%	-954	-954	-954	-955	-956	-958	-961
-2.67%	-466	-467	-469	-472	-476	-481	-488
0%	18	14	8	0	-10	-22	-35

2.67%	487	475	460	443	424	403	381
5.33%	910	885	859	831	803	774	744
8.00%	1,243	1,209	1,175	1,141	1,107	1,073	1,039

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

(단위:백만원)

2,368

공시일 2022-01-27

기준일 2022-01-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

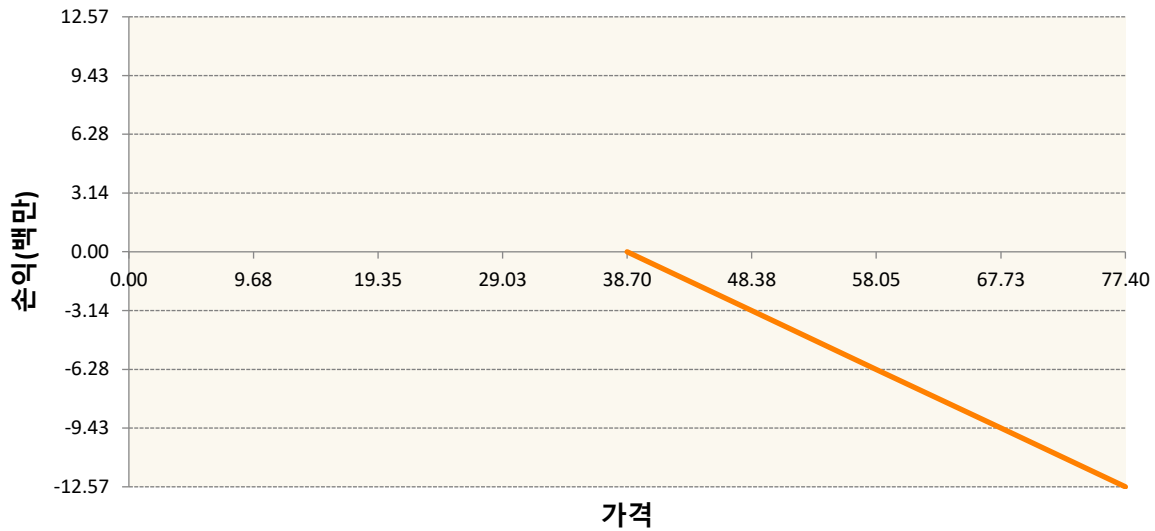
1. 계약금액

(단위:백만원)

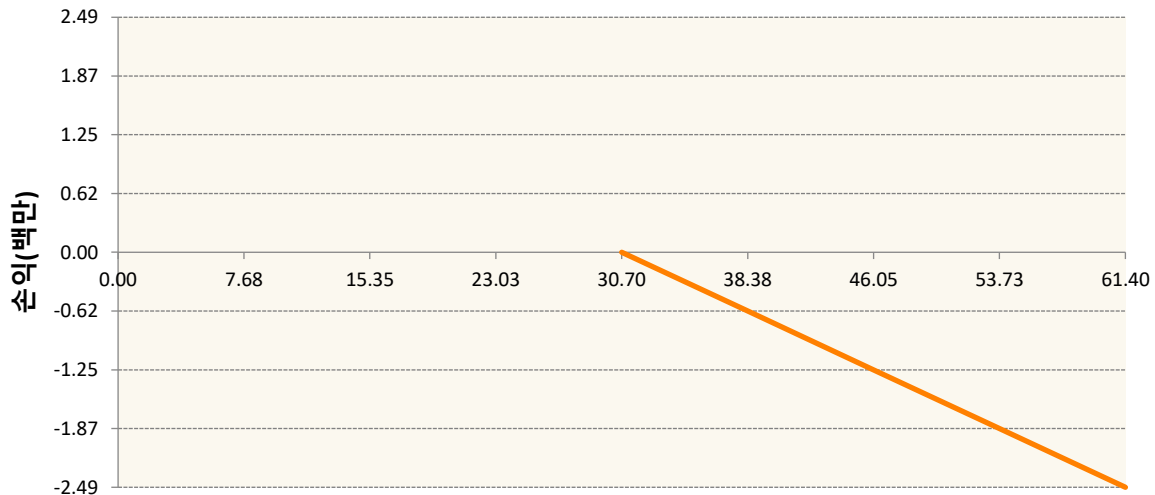
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	92	-92	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,030	-2,030	장외

2. 만기시점의 손익구조

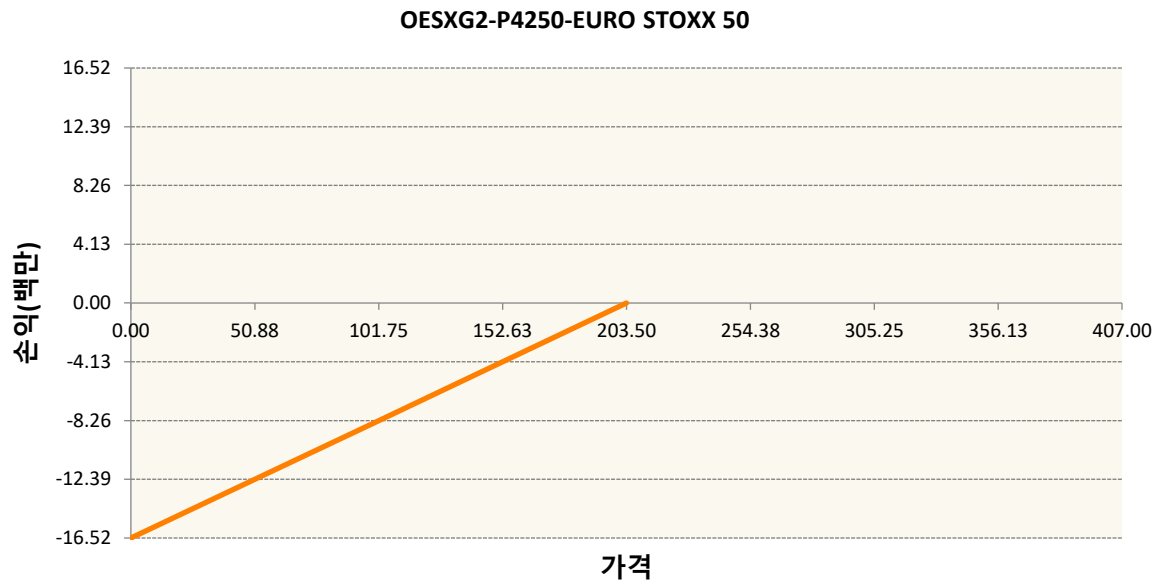
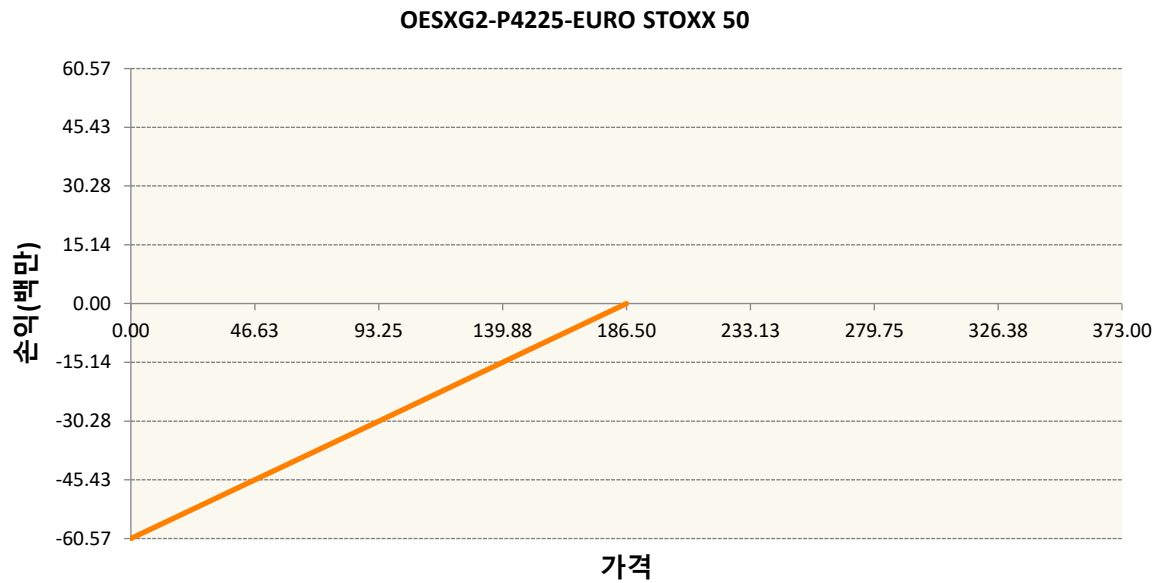
OESXG1-C4225-EURO STOXX 50



OESXG2-C4250-EURO STOXX 50



가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
FXW213BCF² KRW/EUR 17-03-22E
FXW213BCF² KRW/EUR 17-02-22E
OESXG1-C42 EURO STOXX 50
OESXG2-C42 EURO STOXX 50
OESXG2-P42 EURO STOXX 50
OESXG2-P42 EURO STOXX 50

19
54
108
1
0.2
5
1

공시일 2022-01-27

기준일 2022-01-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

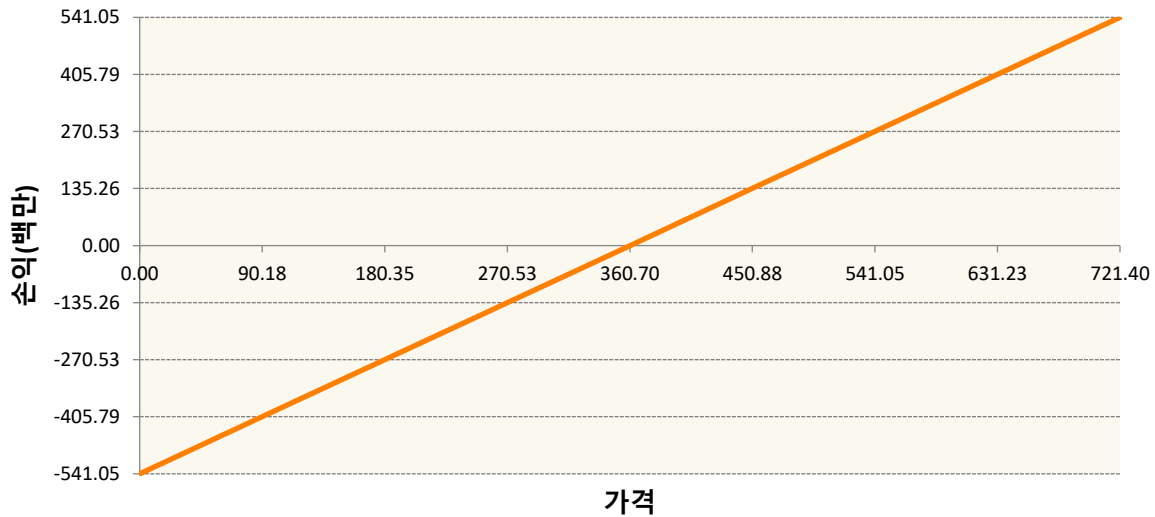
1. 계약금액

(단위:백만원)

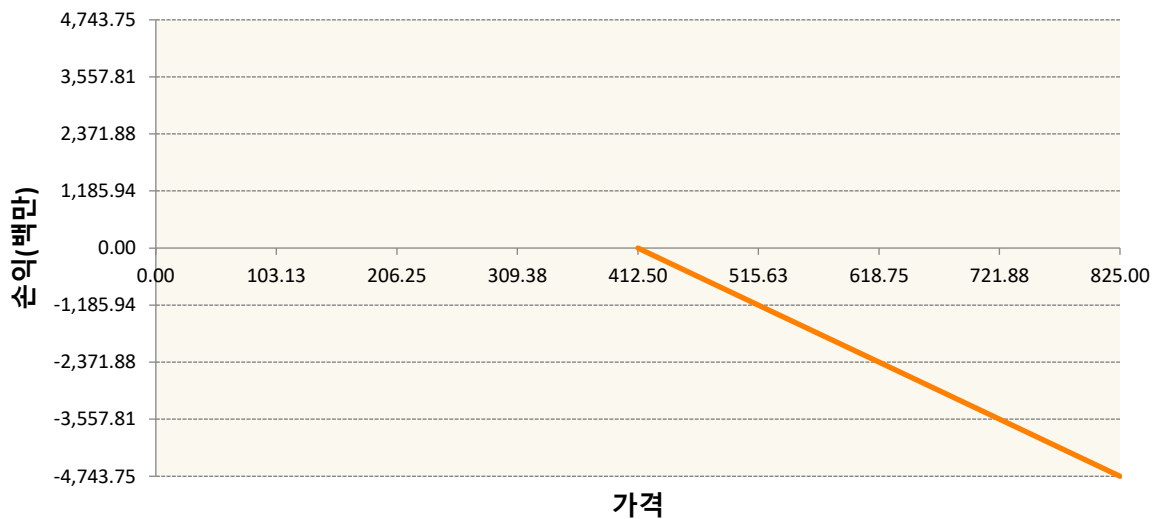
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	541	0	541	장내
누계	유가증권	옵션	294	5,055	-4,761	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S24127-2022-02 콜412.5



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 830.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -311.25 to 311.25. A blue line starts at the point (415.00, 0.00) and slopes downward to the point (830.00, -311.25).

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
415.00	0.00
830.00	-311.25

The graph illustrates the relationship between the price of a product and the profit it generates. The x-axis represents the price (가격) in Korean Won, ranging from 0.00 to 785.00. The y-axis represents the profit (이익) in millions of Korean Won, ranging from -294.38 to 294.38. A blue line shows that profit is maximized at a price of 0.00 and decreases linearly as the price increases, reaching zero profit at a price of 392.50.

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

(단위:백만원)

KR4101S30001				2022-03 코스피200지수선물				43
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	14	14	14	14	14	14	14	
5.33%	29	29	29	29	29	29	29	
8.00%	43	43	43	43	43	43	43	
KR4201S24127				2022-02 콜412.5				48
	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	-1
0%	2	1	1	0	-1	-3	-5
2.67%	1	0	-1	-3	-6	-9	-12
5.33%	-2	-4	-8	-11	-16	-21	-26
8.00%	-10	-15	-21	-27	-34	-41	-48

KR4201S24150

2022-02 콜415

3

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	0	0	-1
5.33%	0	0	0	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-2	-2	-2	-3

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%	14	14	14	14	14	14	14
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-7	-7	-7	-7	-6	-6	-6
5.33%	-13	-13	-13	-12	-12	-11	-11
8.00%	-18	-18	-17	-17	-16	-16	-15

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

(단위:백만원)

78

공시일	2022-01-27
기준일	2022-01-26

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	10,534	0	10,534	

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	2022-01-27
기준일	2022-01-26

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	76	-76	
누계	유가증권	수익증권	8,999	0	8,999	

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	2022-01-27
기준일	2022-01-26

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	322	-322	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	30,349	0	30,349	
누계	통화	선도	0	30,541	-30,541	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E	2,252
FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	192
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

796

공시일 2022-01-27

기준일 2022-01-26

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

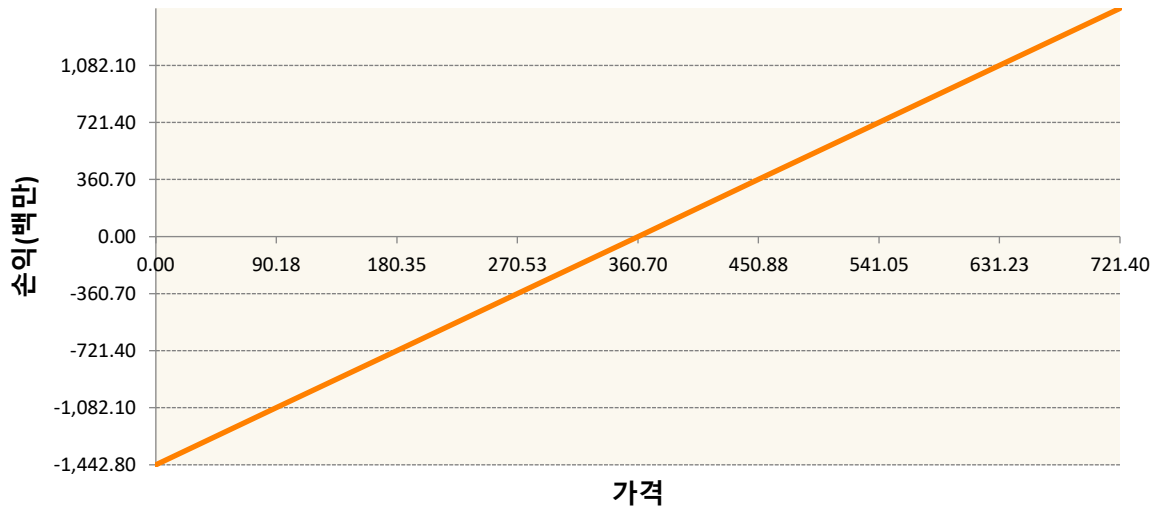
1. 계약금액

(단위:백만원)

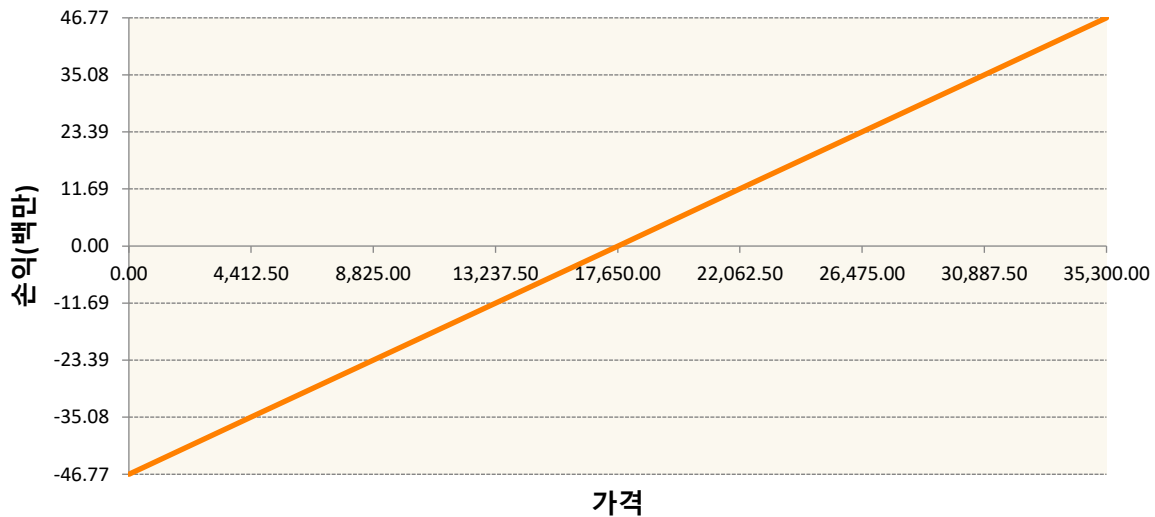
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	91	0	91	장내
누계	유가증권	선물	1,490	0	1,490	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					115
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	115	115	115	115	115	115	115
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)

111

공시일 2022-01-27

기준일 2022-01-26

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

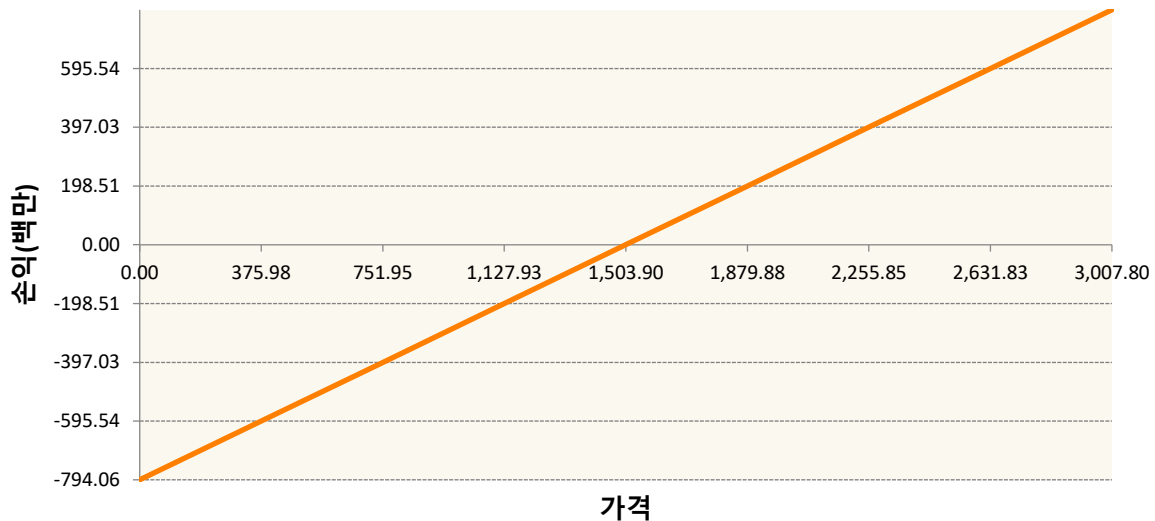
1. 계약금액

(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	794	0	794	
누계	유가증권	스왑	1,850	0	1,850	장외
누계	통화	선도	0	1,326	-1,326	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCG2-VN30 Index Future Feb22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	148
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
VNCG2 VN30 Index Future Feb22	64

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

(단위:백만원)

공시일	2022-01-27
기준일	2022-01-26

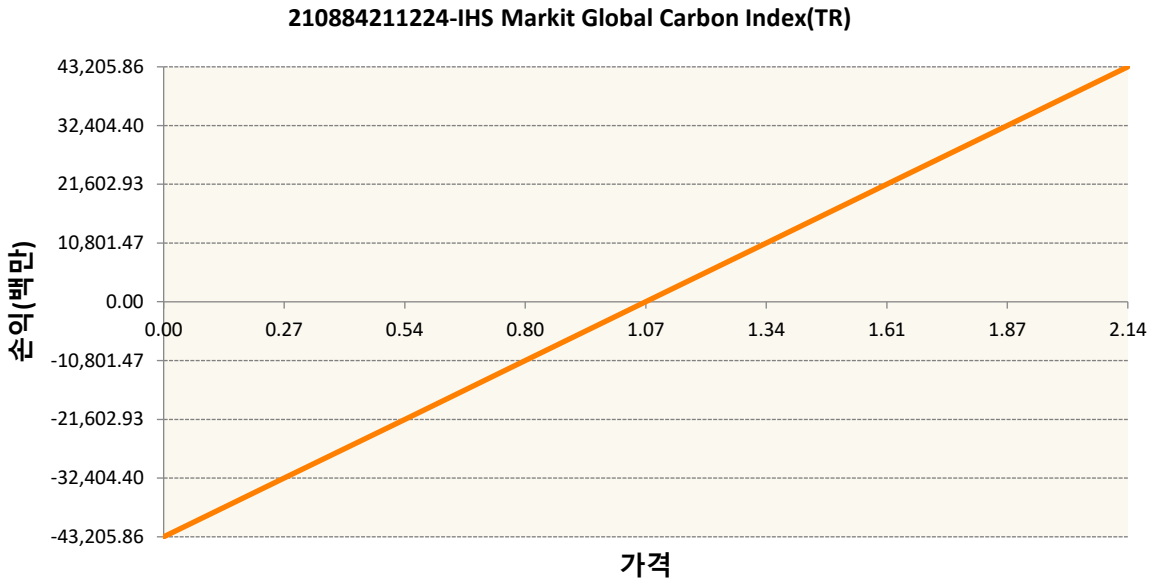
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	43,206	0	43,206	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,454

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

(단위:백만원)

5,591

공시일 2022-01-27
기준일 2022-01-26

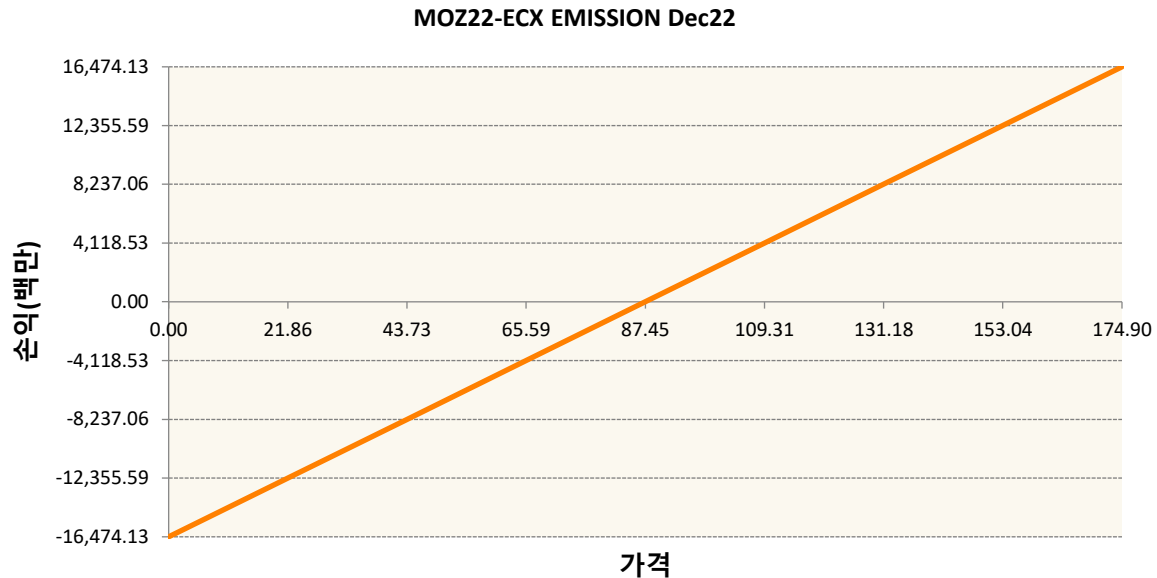
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	16,474	0	16,474	
누계	통화	선도	0	6,114	-6,114	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCV·KRW/EUR 28-01-22E

489

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,318

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

(단위:백만원)

3,058

공시일	2022-01-27
기준일	2022-01-26

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)

150

공시일	2022-01-27
기준일	2022-01-26

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)	0.29
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	0.34
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	0.29
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	0.29

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

(단위:백만원)

2

공시일 2022-01-27

기준일 2022-01-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

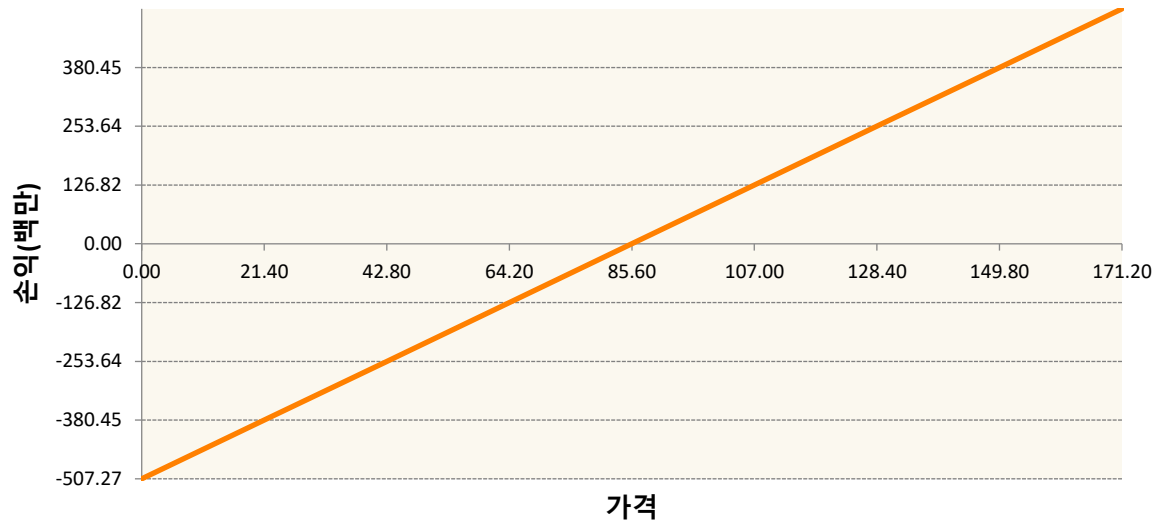
1. 계약금액

(단위:백만원)

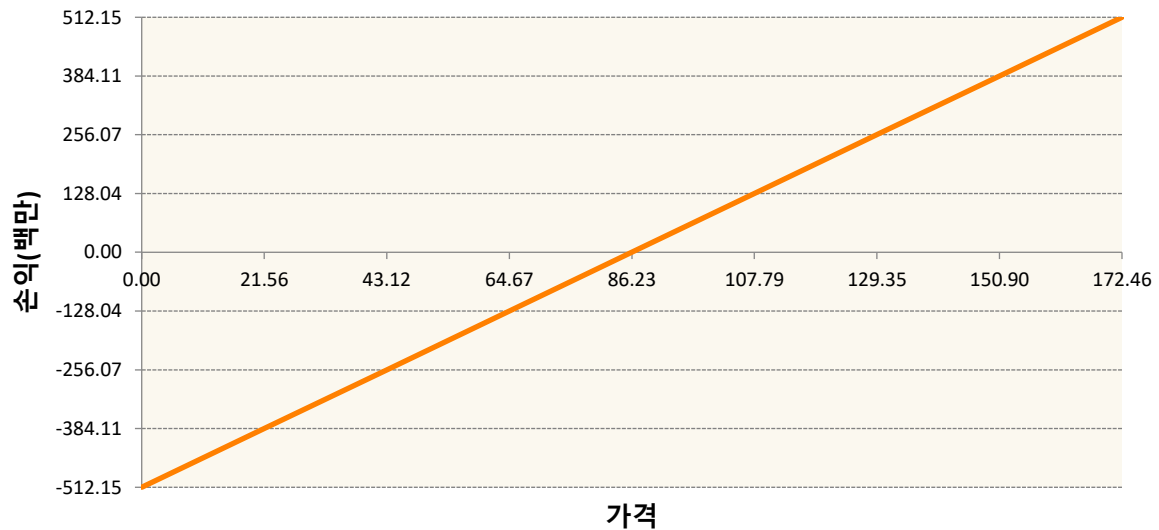
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,173	360	1,814	

2. 만기시점의 손익구조

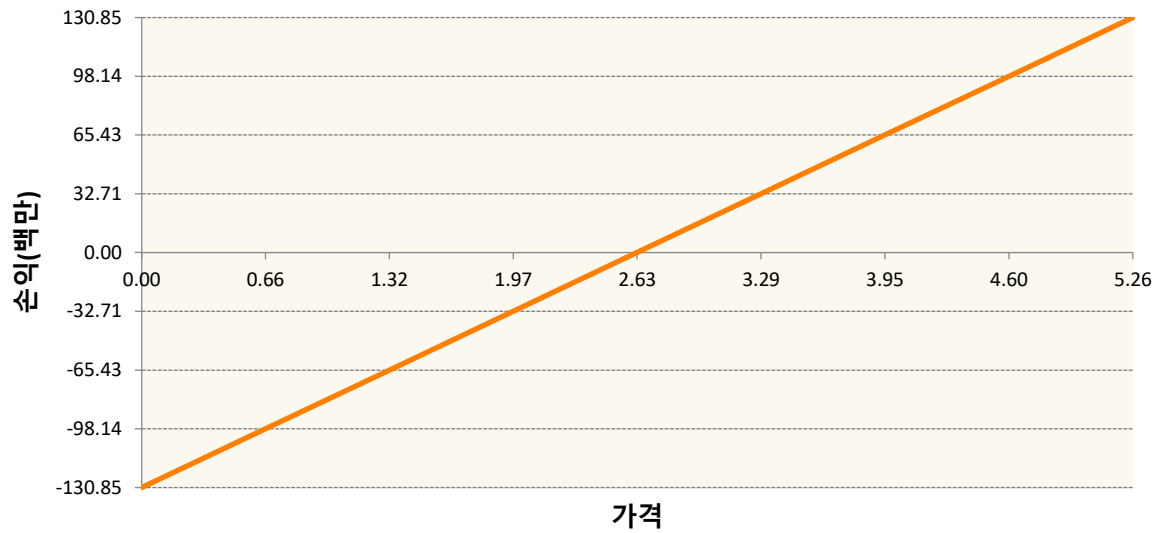
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



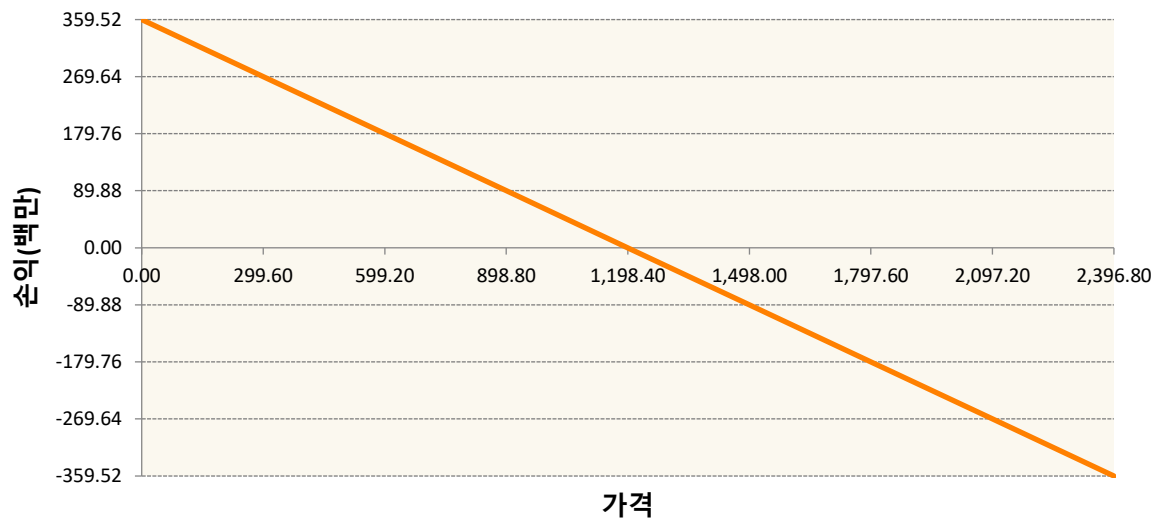
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



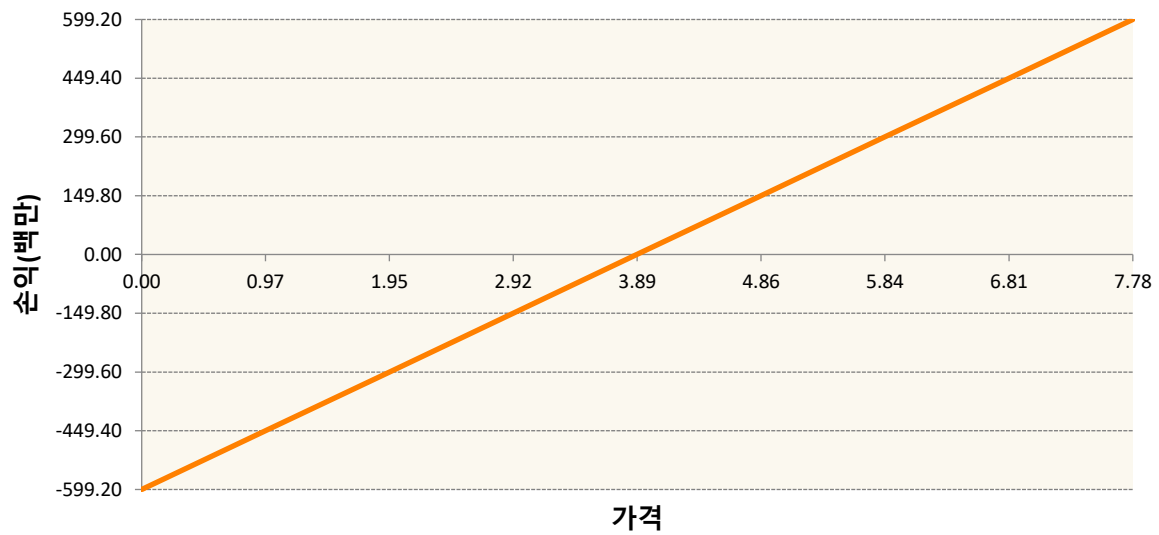
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22



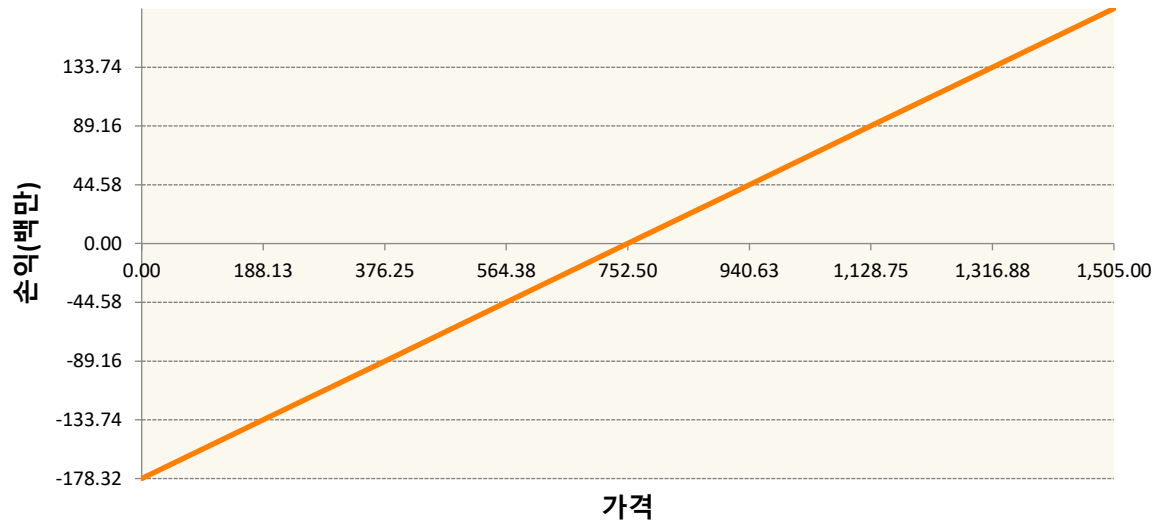
KR4175S20006-2022-02 달러선물



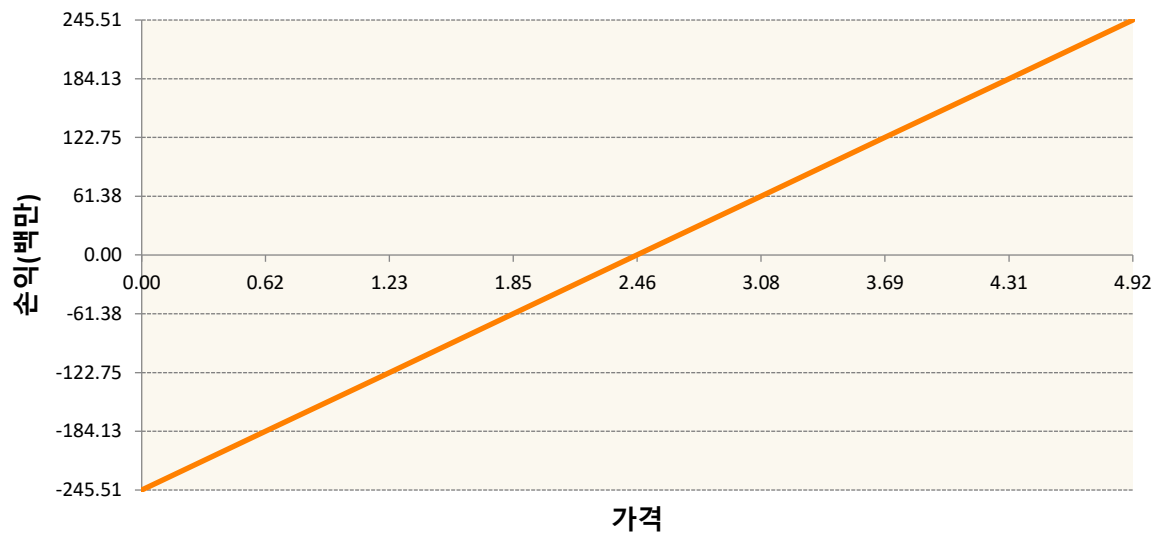
NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBH2-GASOLINE RBOB FUT 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	48
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	14
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22	20

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

(단위:백만원)

395

