

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

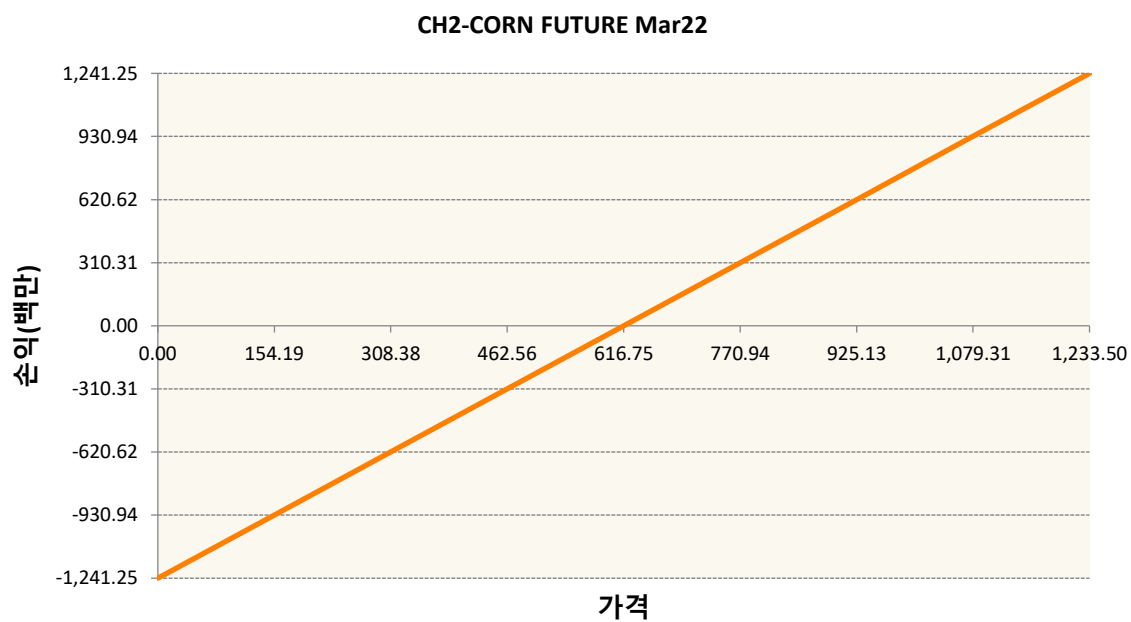
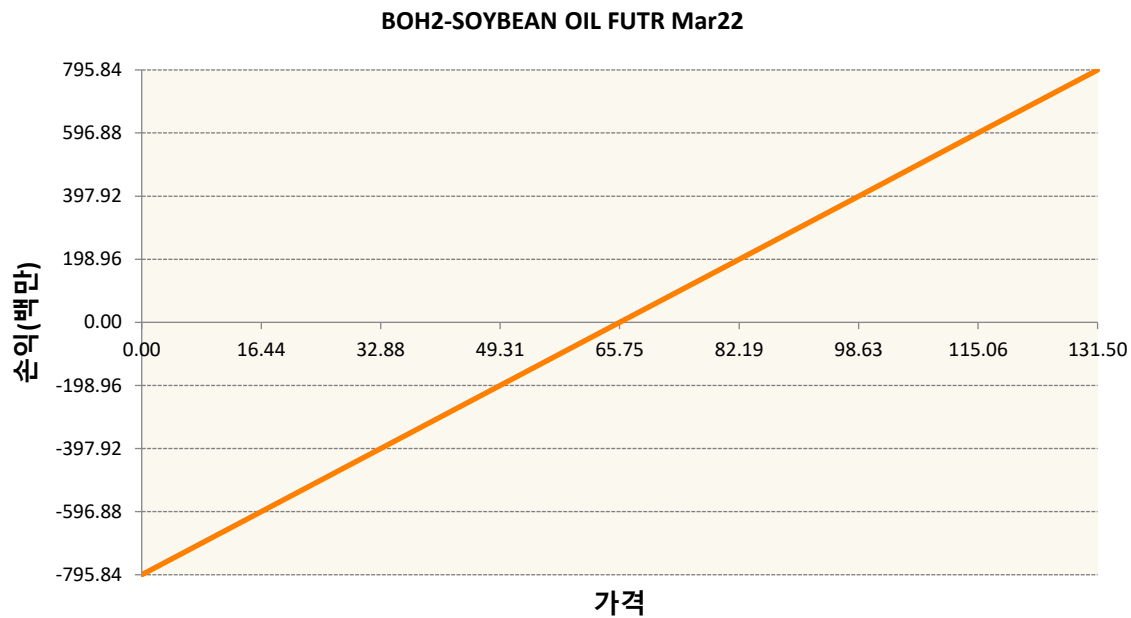
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

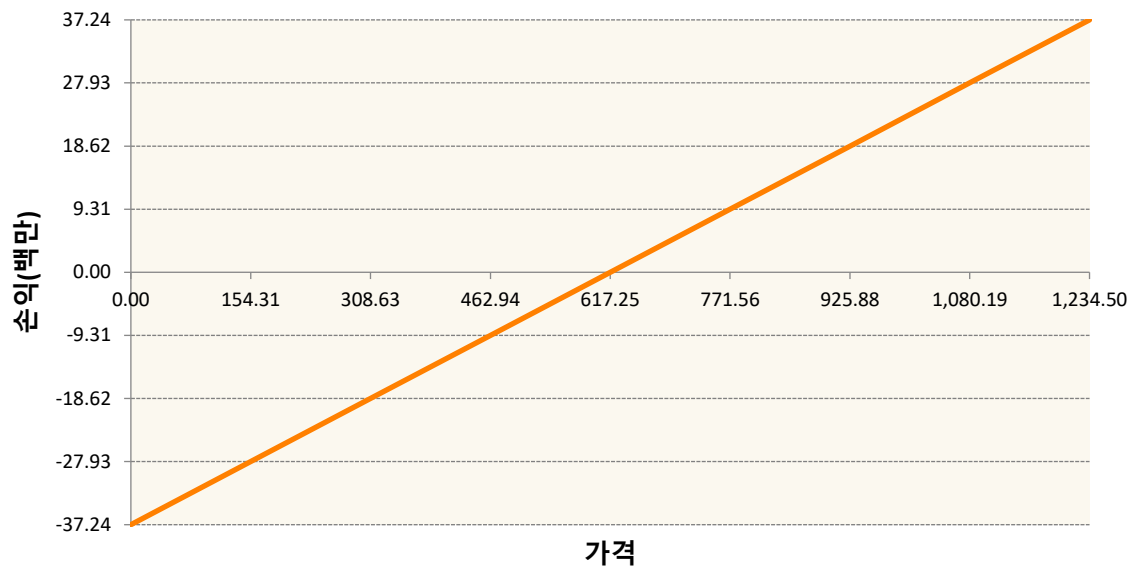
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,054	779	6,276	

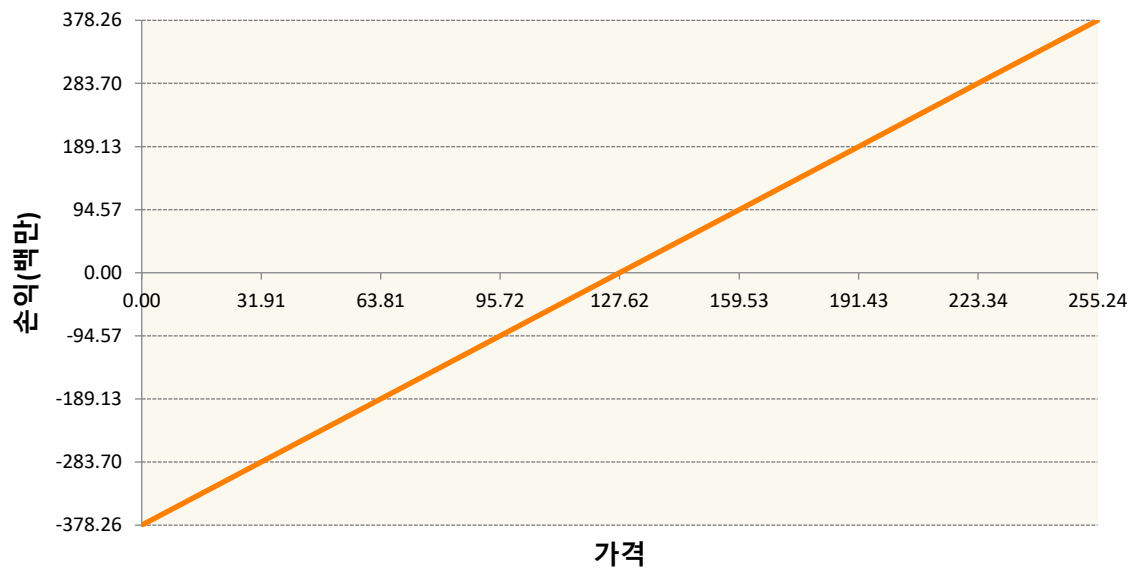
2. 만기시점의 손익구조



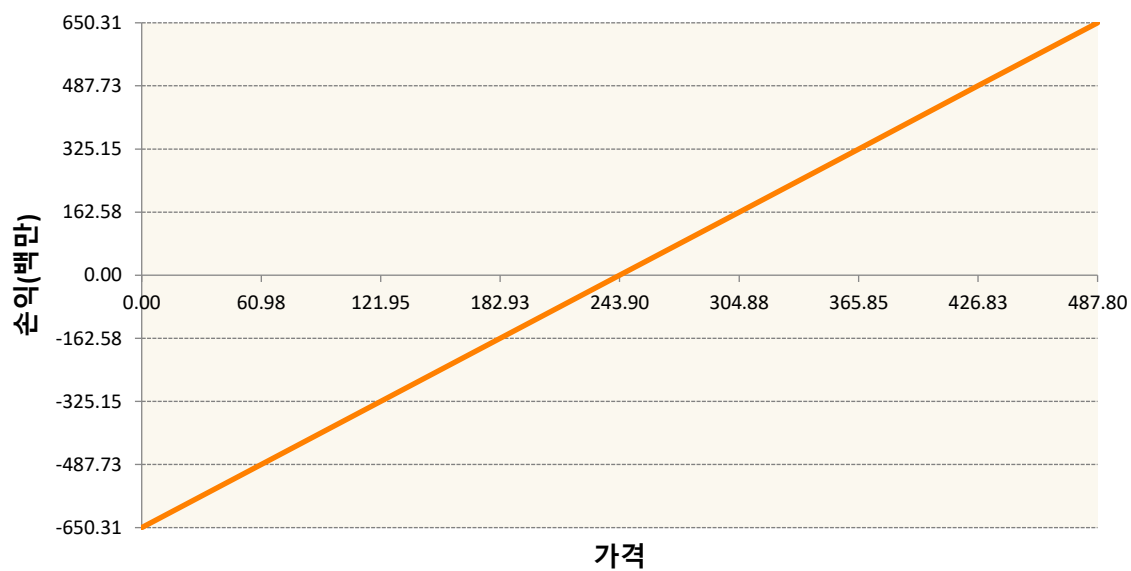
CK2-CORN FUTURE May22



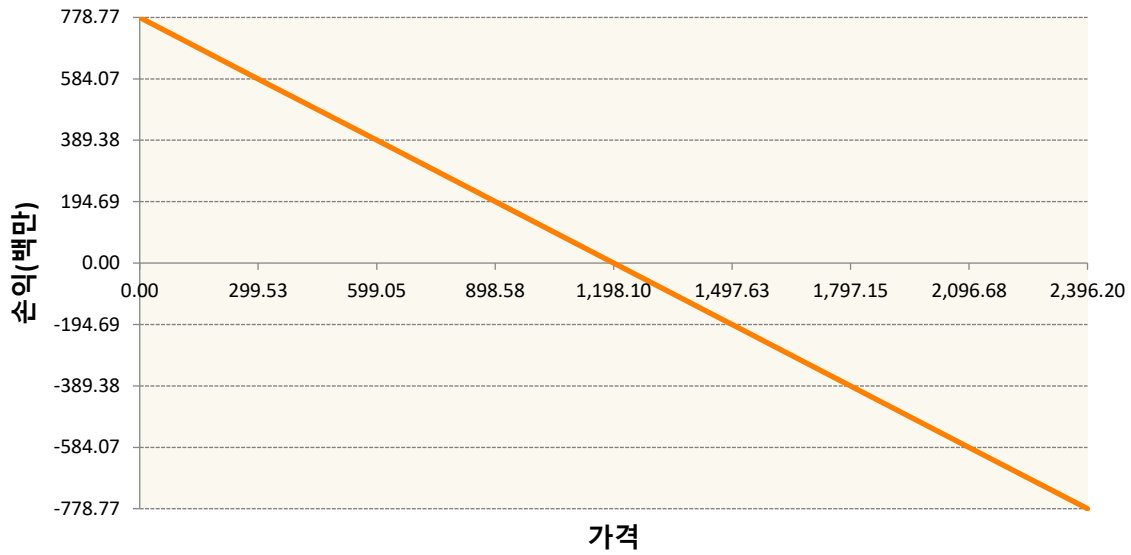
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



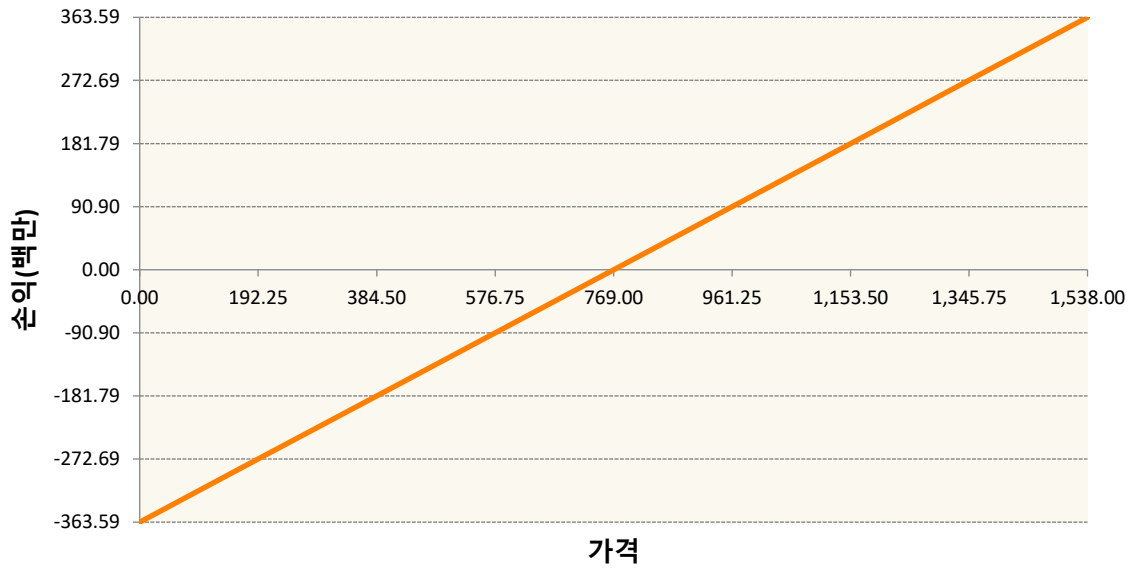
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



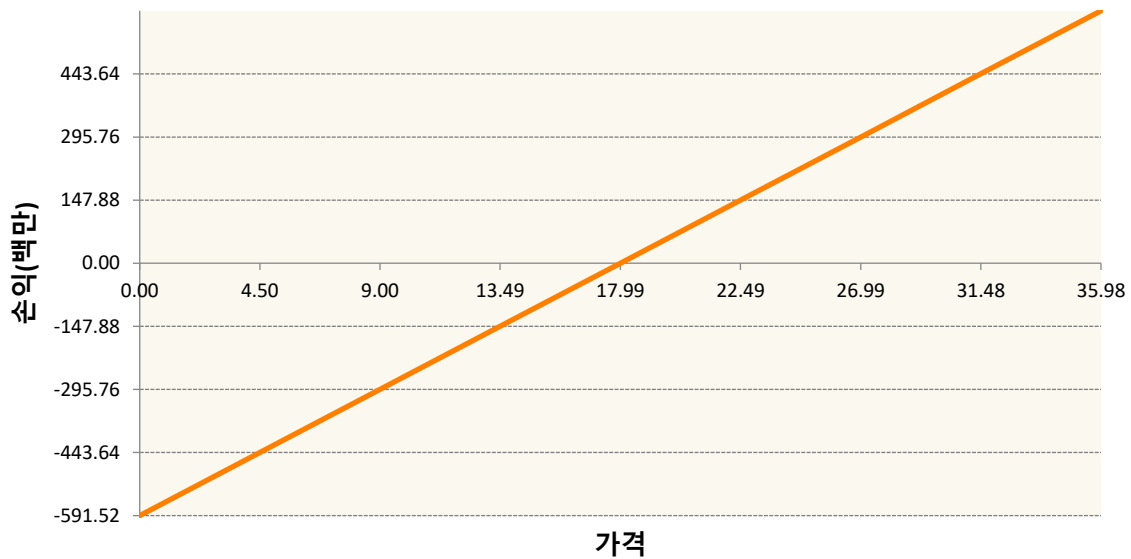
KR4175S20006-2022-02 달러선물



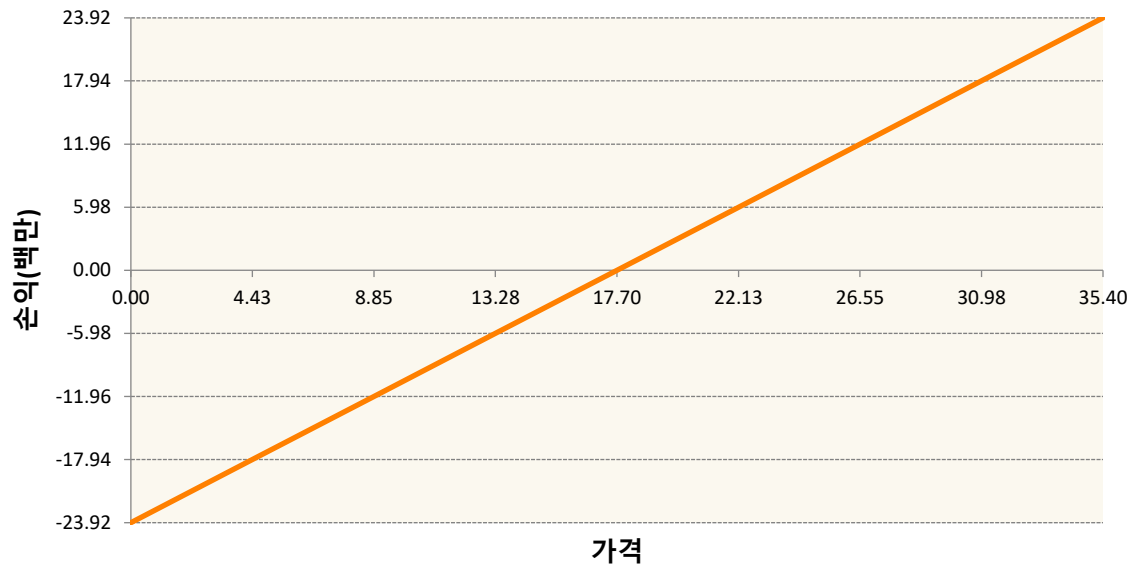
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



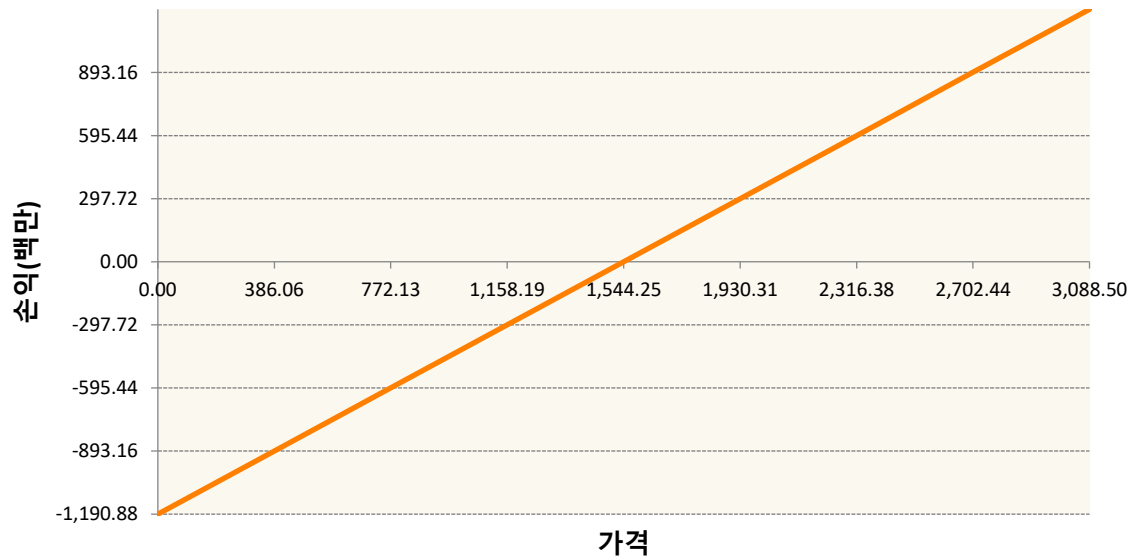
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



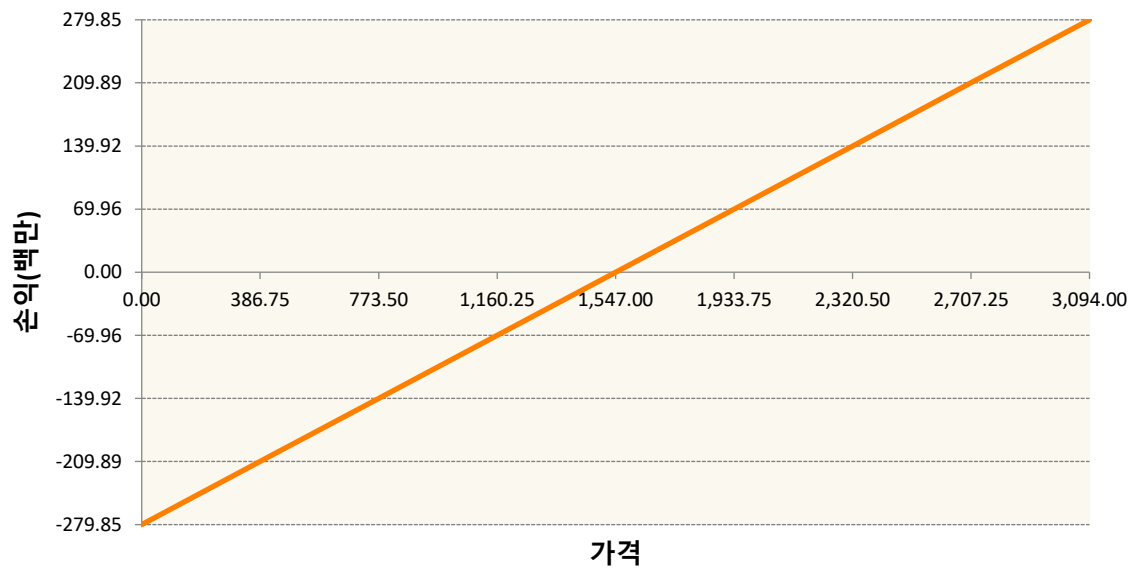
SBK2-Sugar May22



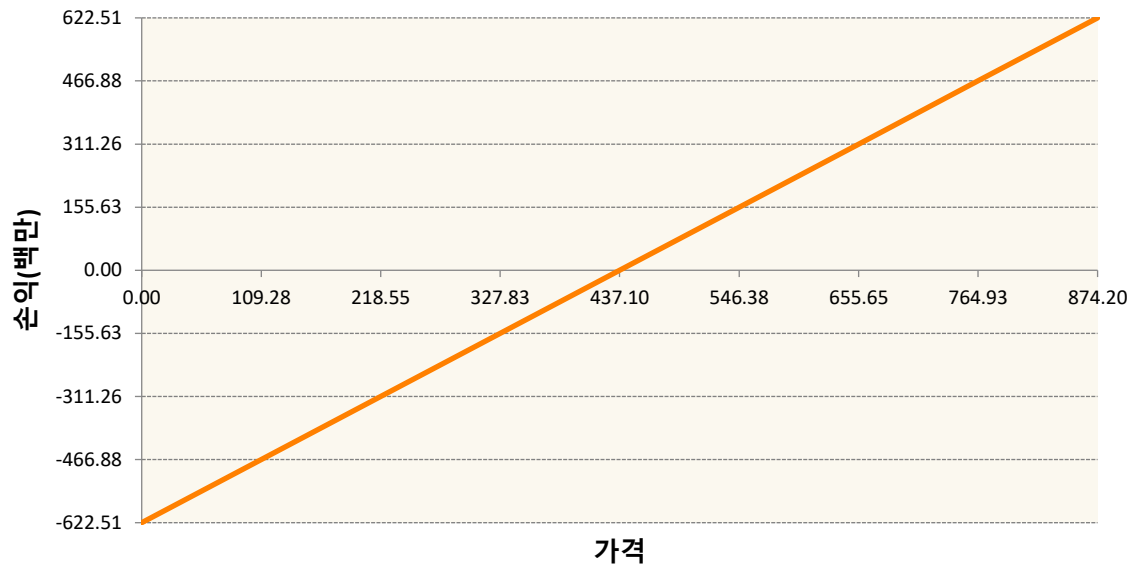
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



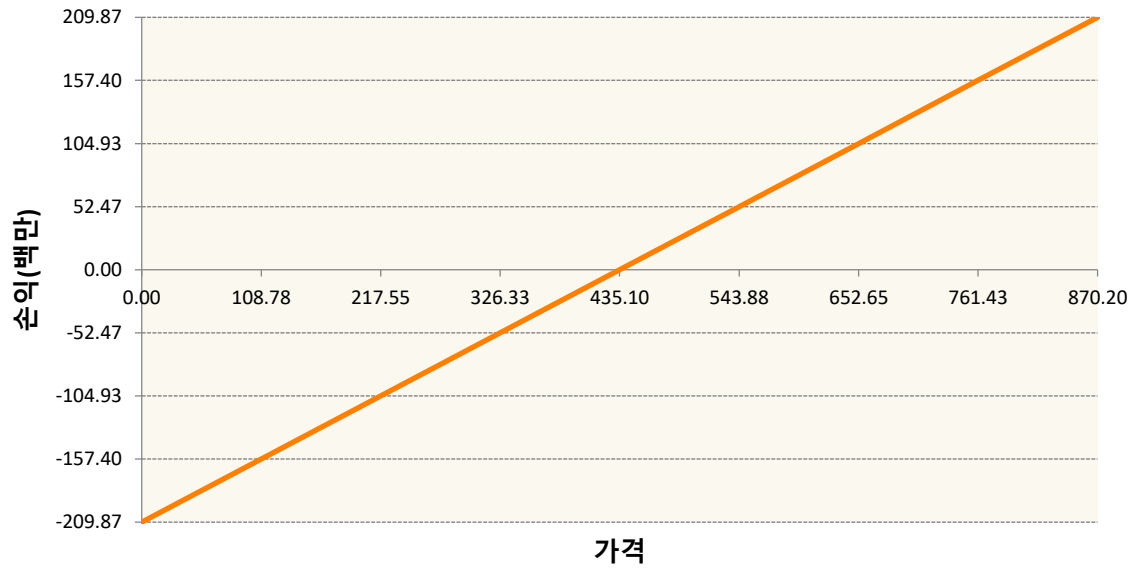
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



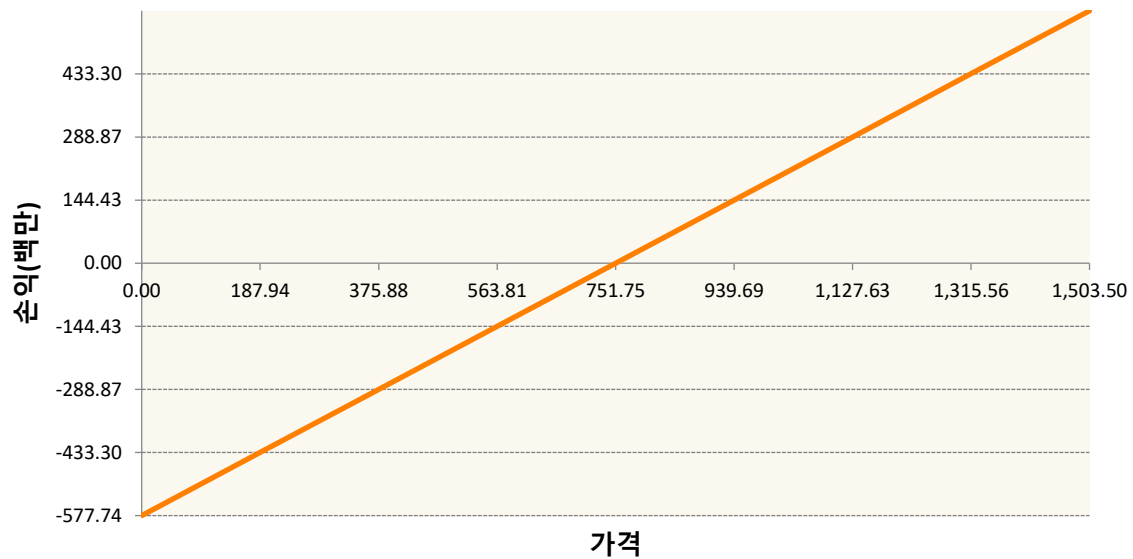
SMH2-SOYBEAN MEAL FUTR Mar22



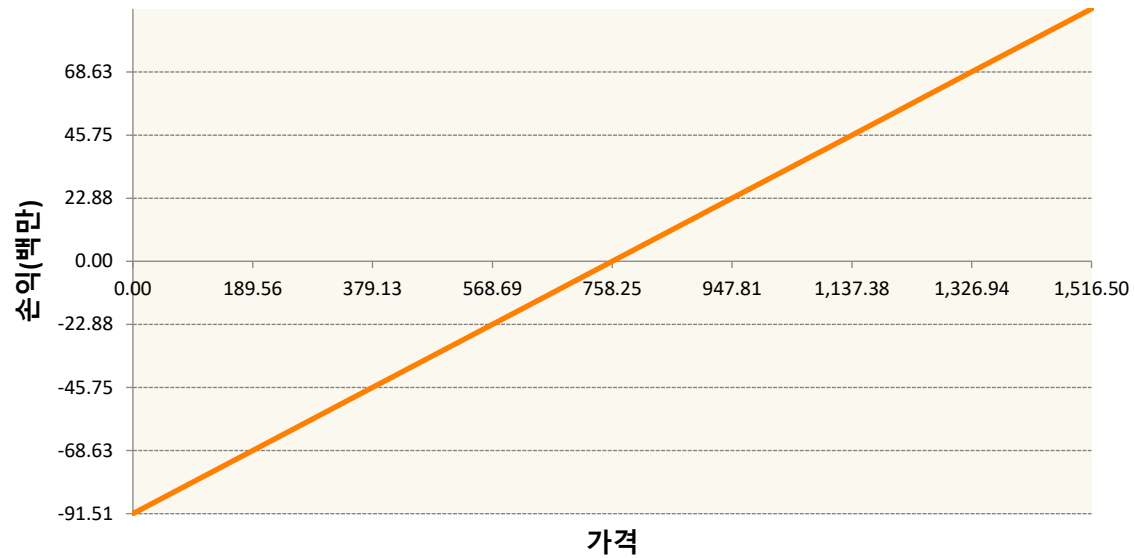
SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22



WK2-WHEAT FUTURE(CBT) May22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

스마트인덱스모

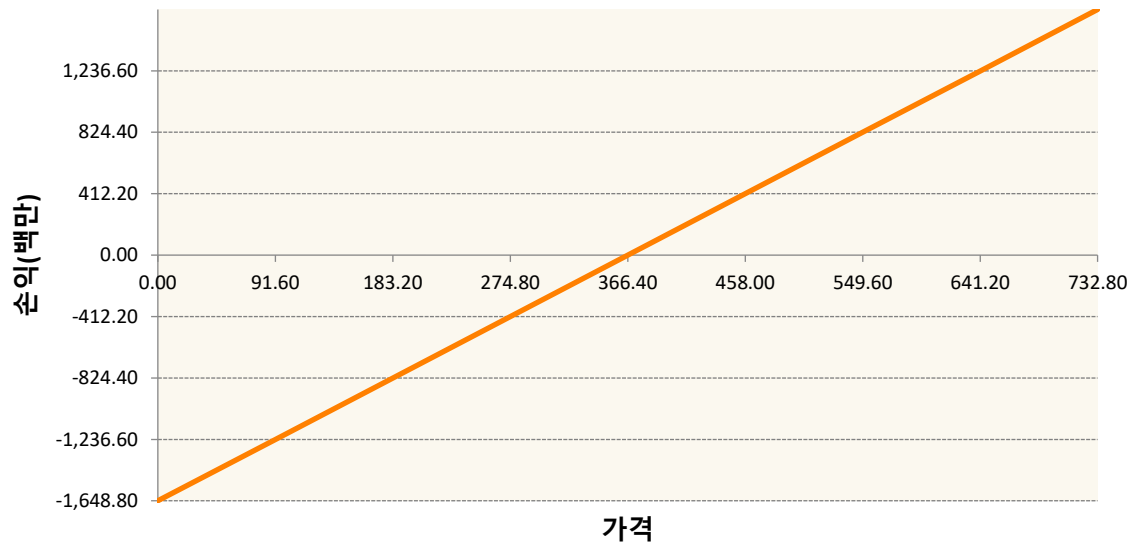
1. 계약금액

(단위:백만원)

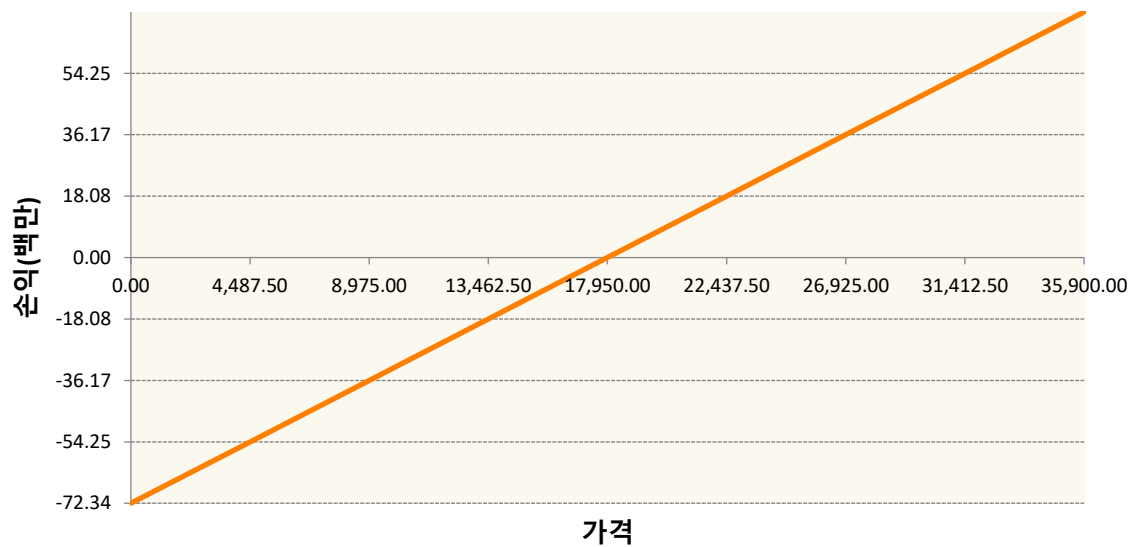
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	92	0	92	장내
누계	유가증권	선물	1,721	0	1,721	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132
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)

129

공시일	2022-02-07
기준일	2022-02-04

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

876

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

532

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-02-07
기준일	2022-02-04

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	396
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

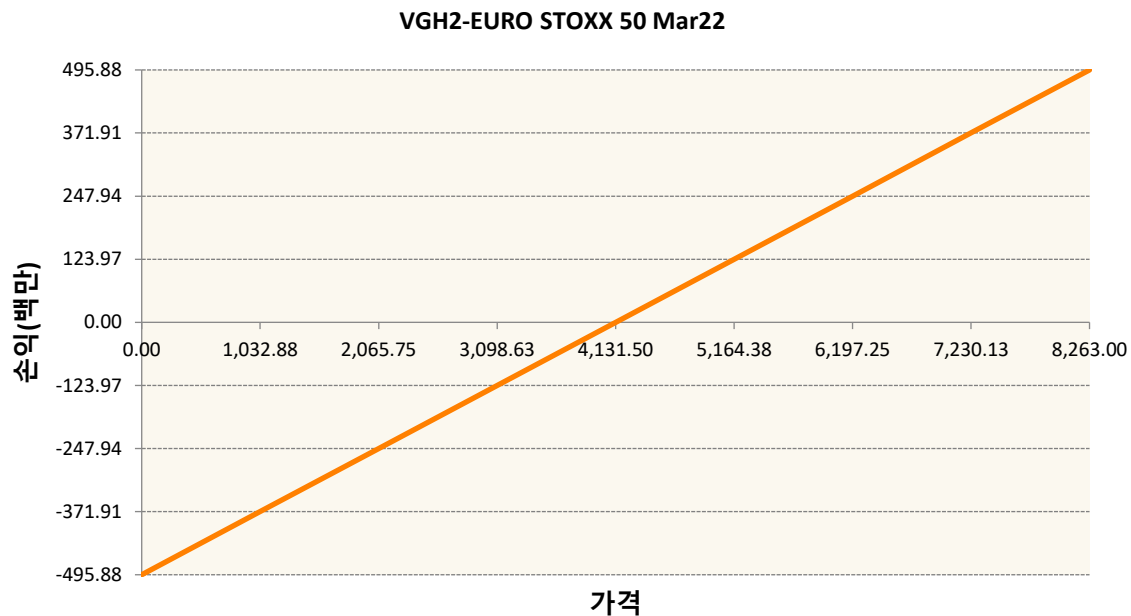
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	496	0	496	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	40
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

35

공시일	2022-02-07
기준일	2022-02-04

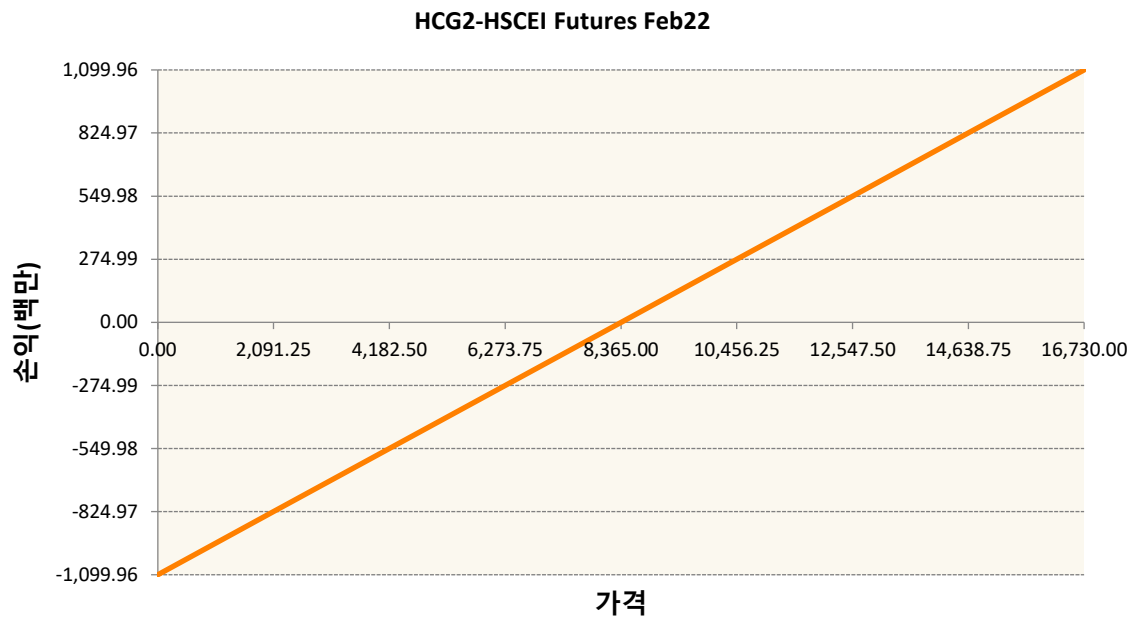
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,100	0	1,100	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG2	HSCEI Futures Feb22	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

93

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

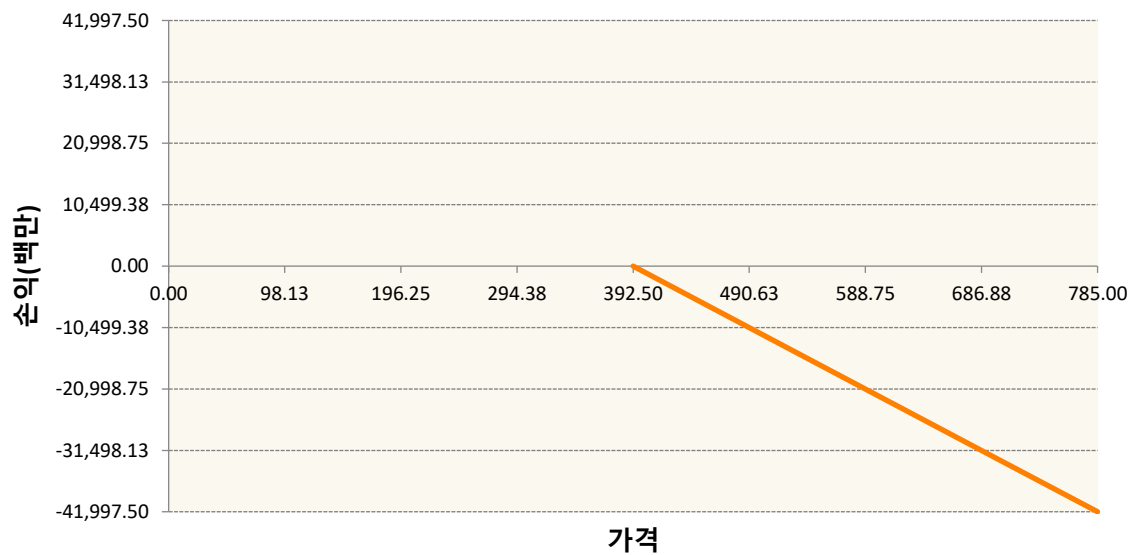
1. 계약금액

(단위:백만원)

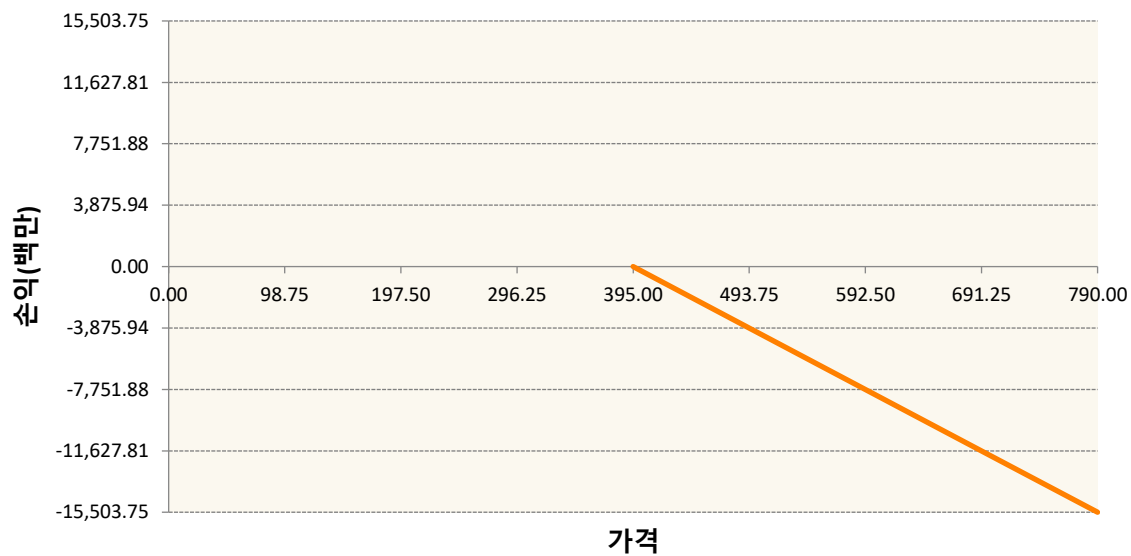
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	77,421	-77,421	장내

2. 만기시점의 손익구조

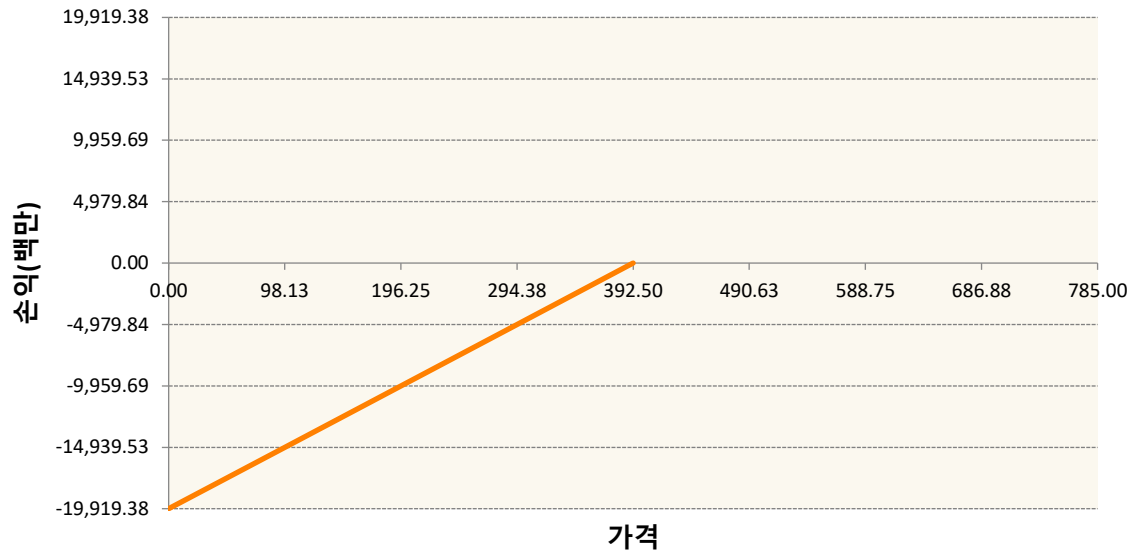
KR4201S23921-2022-02 콜392.5



KR4201S23954-2022-02 콜395



KR4301S23929-2022-02 풋392.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S23921			2022-02 콜392.5				970
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24	24	24	24	23	23	23
-5.33%	24	24	23	23	23	22	20
-2.67%	23	23	22	20	17	13	6
0%	20	16	9	0	-12	-27	-45
2.67%	-14	-34	-58	-85	-116	-148	-183
5.33%	-185	-231	-279	-327	-376	-425	-476
8.00%	-652	-704	-757	-810	-863	-917	-970
KR4201S23954			2022-02 콜395				307
	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%	6	6	6	6	6	5	5
-2.67%	6	6	5	5	4	3	1
0%	5	4	2	0	-3	-8	-13
2.67%	-3	-8	-15	-23	-32	-43	-54
5.33%	-47	-62	-78	-94	-111	-128	-145
8.00%	-187	-207	-227	-247	-267	-287	-307
KR4301S23929			2022-02 풋392.5				1,486
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486
-5.33%	-990	-990	-990	-990	-990	-990	-990
-2.67%	-495	-495	-495	-495	-495	-495	-495
0%	1	1	1	0	-1	-2	-4

2.67%	494	491	488	483	477	470	463
5.33%	946	933	919	904	889	874	858
8.00%	1,232	1,215	1,198	1,181	1,163	1,146	1,128

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

(단위:백만원)

2,114

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

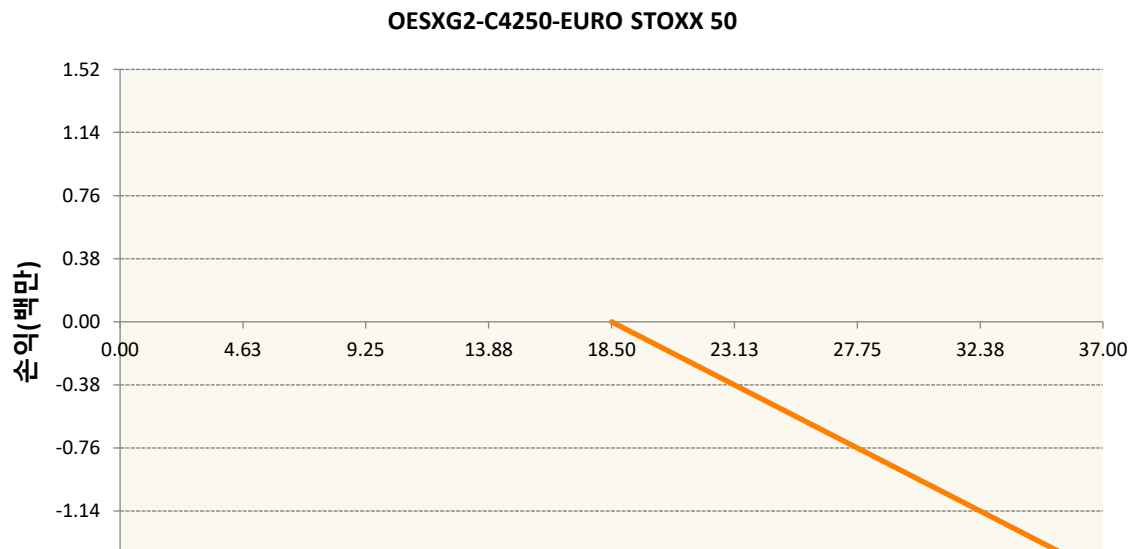
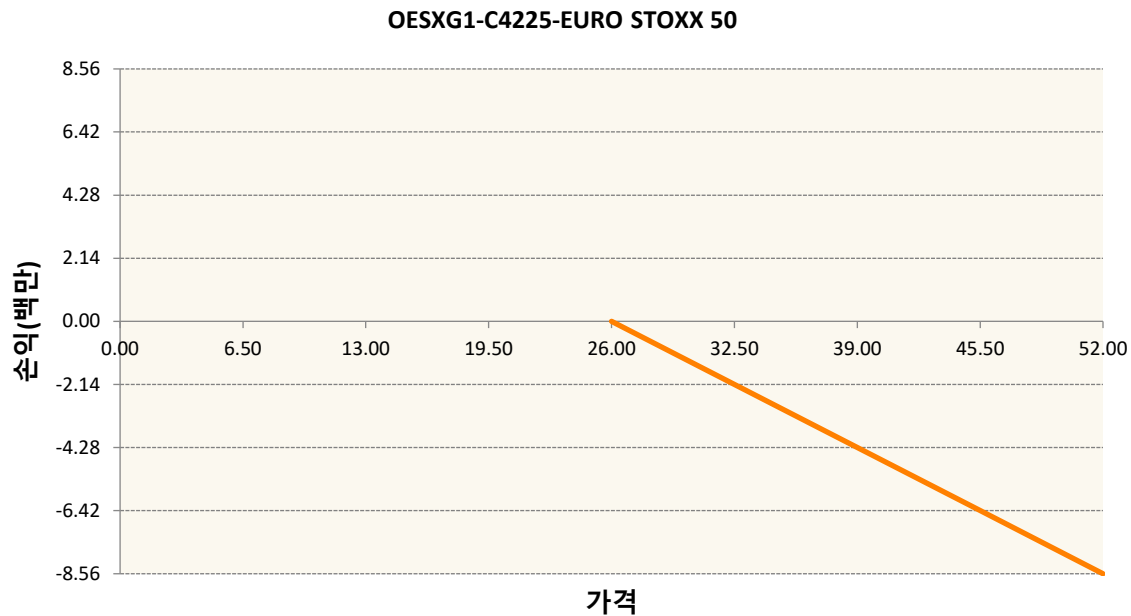
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

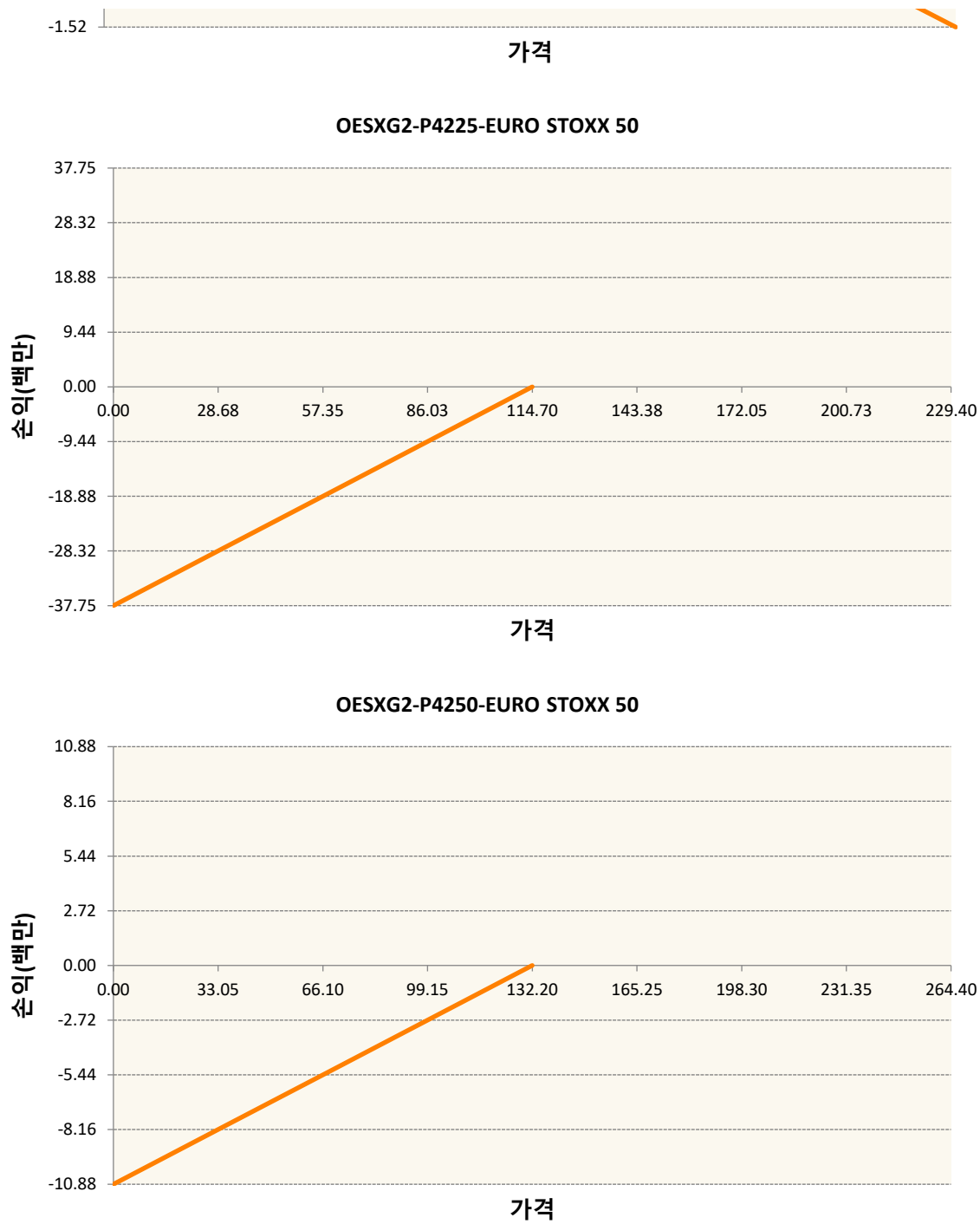
1. 계약금액

(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	59	-59	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,057	-2,057	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213BCF KRW/EUR 17-03-22E
 FXW213BCF 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

4
55
110
1
0.12
3
1

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

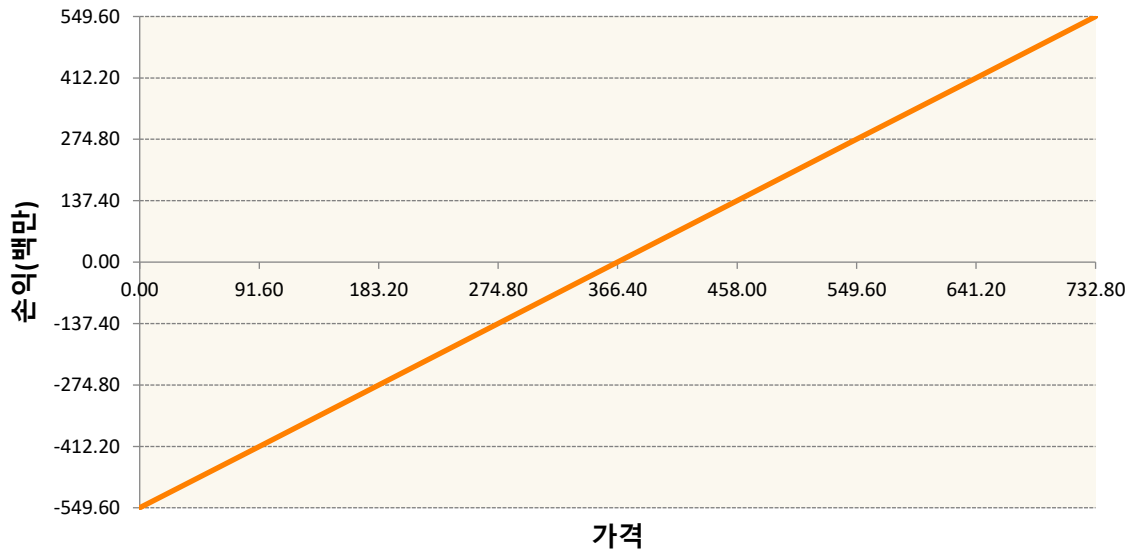
1. 계약금액

(단위:백만원)

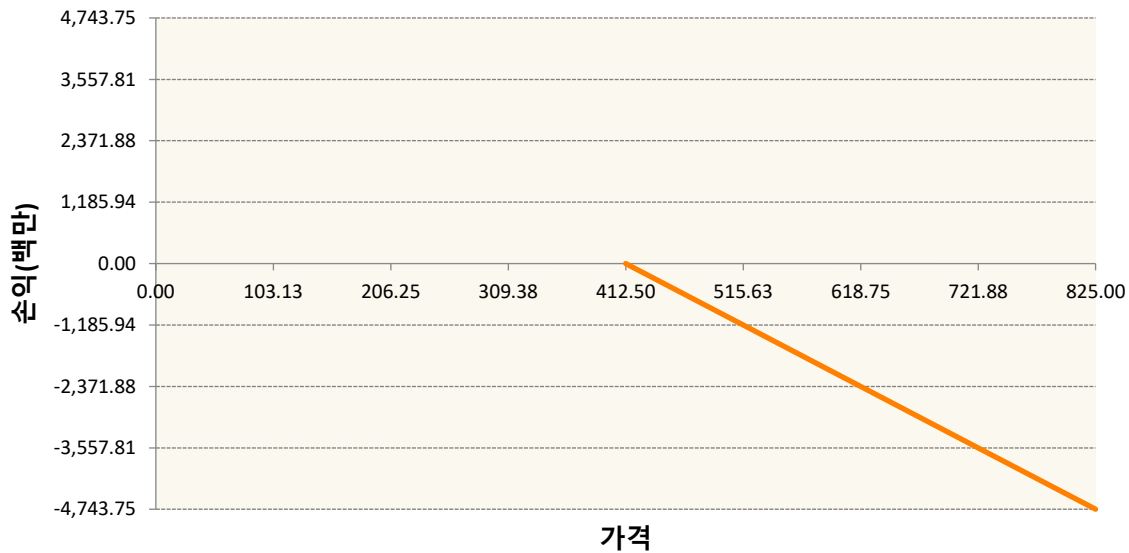
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	550	0	550	장내
누계	유가증권	옵션	294	5,055	-4,761	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S24127-2022-02 콜412.5



The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The line starts at a price of 415.00 with zero profit and shows that as the price increases beyond this point, the profit decreases linearly, reaching a loss of 311.25 million at a price of 830.00.

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

The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The profit starts at 294.38 million won when the price is 0.00 and decreases linearly to 0 million won when the price reaches 392.50. Beyond this point, the profit would be negative, but the line is only plotted up to the break-even point.

가격 (Price)	이익 (백만 원) (Profit in 100,000 Won)
0.00	294.38
98.13	220.78
196.25	147.19
294.38	73.59
392.50	0.00

(단위:백만원)

KR4101S30001				2022-03 코스피200지수선물				44
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-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%	29	29	29	29	29	29	29	
8.00%	44	44	44	44	44	44	44	
KR4201S24127				2022-02 콜412.5				24
	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%	0	-1	-2	-3	-5	-6	-8
8.00%	-5	-7	-10	-13	-16	-20	-24

KR4201S24150

2022-02 콜415

1

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	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	-1	-1	-1	-1

KR4301S23929

2022-02 풋392.5

22

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22
-5.33%	15	15	15	15	15	15	15
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
5.33%	-14	-14	-14	-13	-13	-13	-13
8.00%	-18	-18	-18	-17	-17	-17	-17

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

(단위:백만원)

65

공시일	2022-02-07
기준일	2022-02-04

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	10,597	0	10,597	

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	2022-02-07
기준일	2022-02-04

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	9,053	0	9,053	

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	2022-02-07
기준일	2022-02-04

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	30,531	0	30,531	
누계	통화	선도	922	30,524	-29,602	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E	2,250
FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	192
FXW213C23 USD/KRW 24-02-22E	74
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

811

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

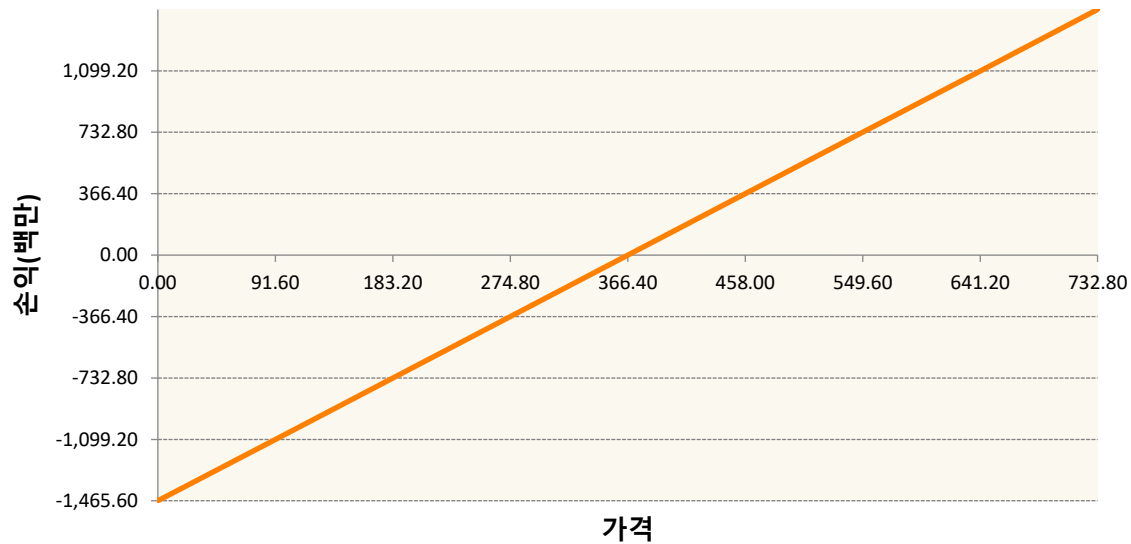
1. 계약금액

(단위:백만원)

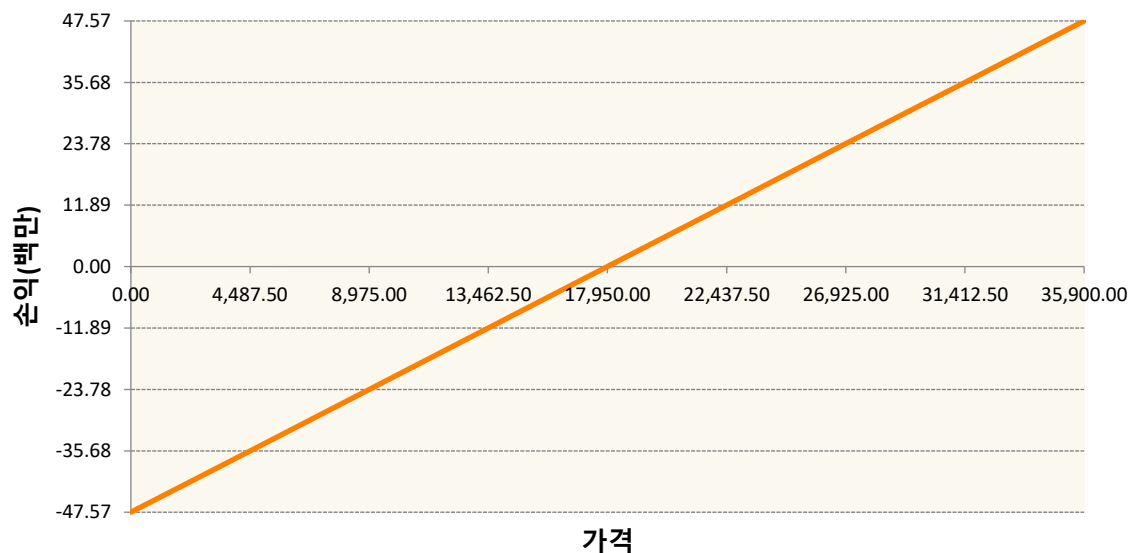
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,513	0	1,513	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117
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)

113

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

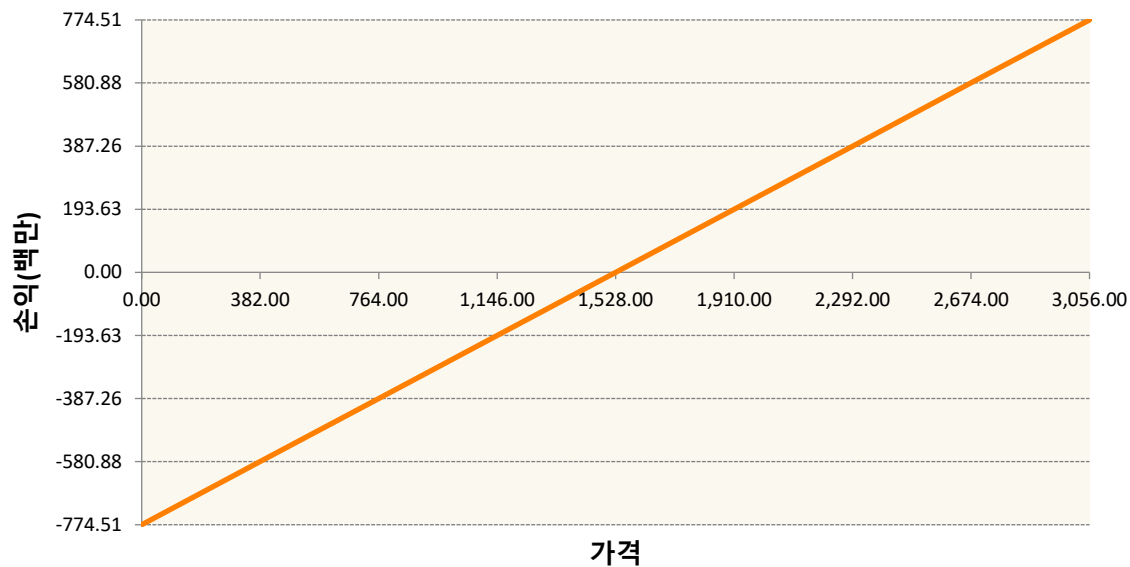
1. 계약금액

(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	775	0	775	
누계	유가증권	스왑	1,875	0	1,875	장외
누계	통화	선도	0	1,344	-1,344	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCG2-VN30 Index Future Feb22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	150
FXW213BBQ KRW/EUR 25-02-22E	36
FXW213BBS KRW/EUR 25-02-22E	11
FXW213BCN KRW/EUR 18-03-22E	44
FXW213C1K KRW/EUR 22-04-22E	16
VNCG2 VN30 Index Future Feb22	62

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

(단위:백만원)

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

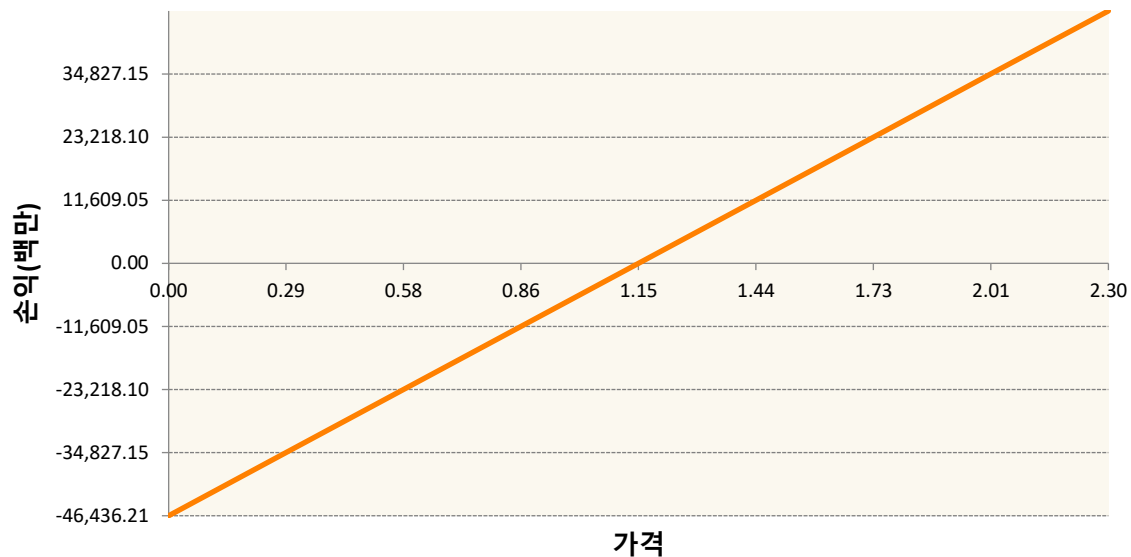
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	46,436	0	46,436	

2. 만기시점의 손익구조

210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,705

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

(단위:백만원)

5,955

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

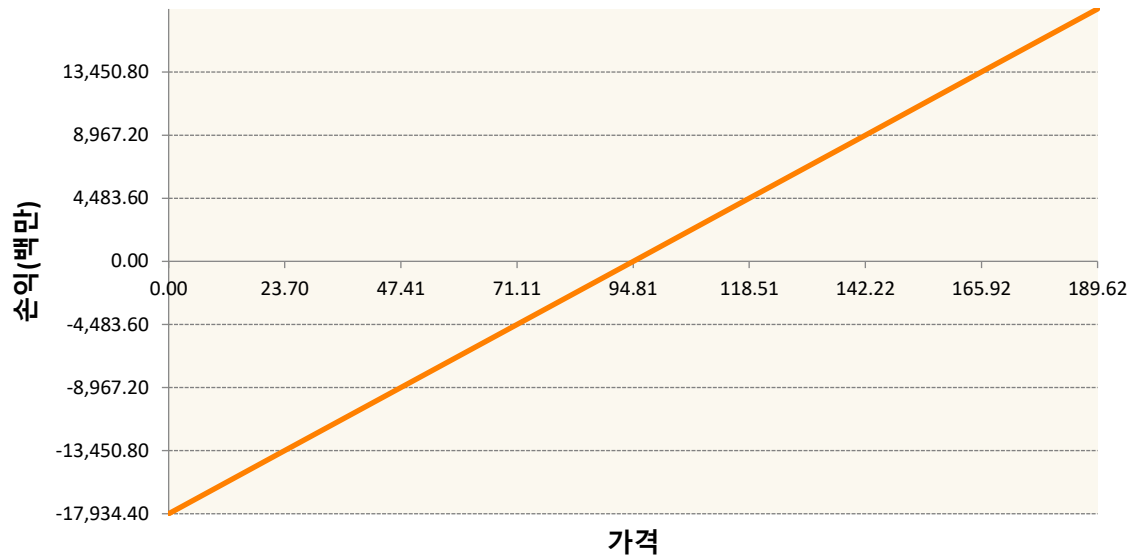
1. 계약금액

(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	17,934	0	17,934	
누계	통화	선도	0	8,856	-8,856	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1V·KRW/EUR 25-02-22E

708

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,435

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

(단위:백만원)

3,372

공시일	2022-02-07
기준일	2022-02-04

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)	29
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	29
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	29
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	29

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

(단위:백만원)

218

공시일	2022-02-07
기준일	2022-02-04

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	9

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

(단위:백만원)

49

공시일 2022-02-07

기준일 2022-02-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

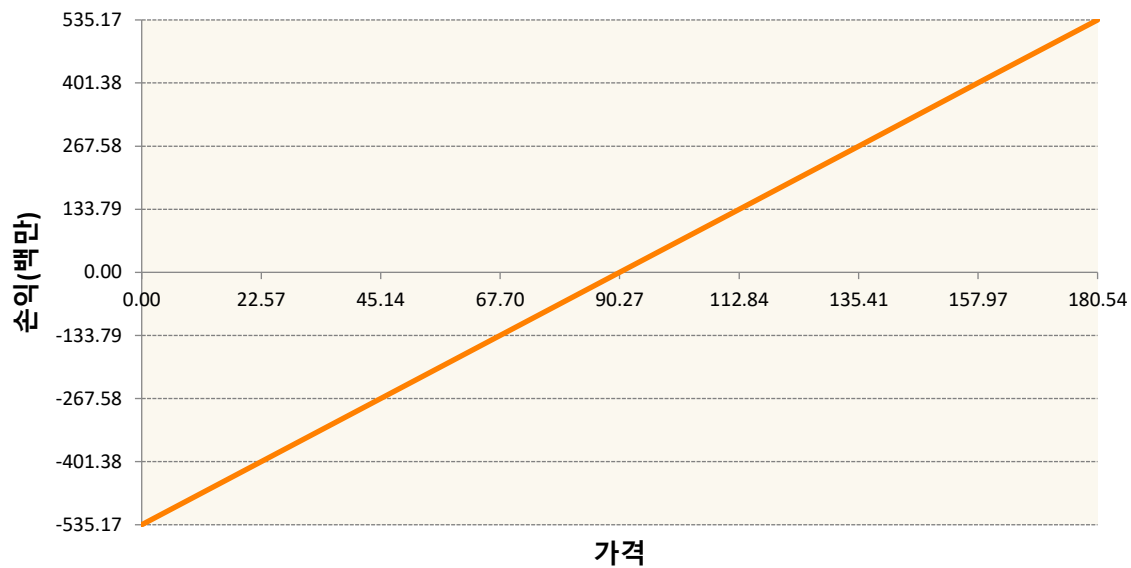
1. 계약금액

(단위:백만원)

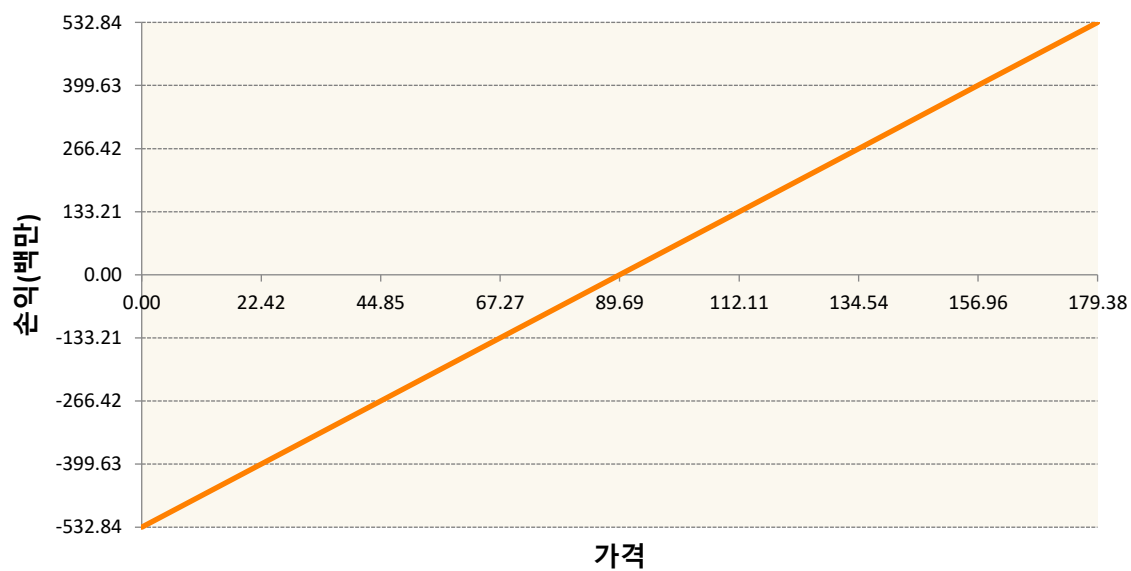
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,377	419	1,957	

2. 만기시점의 손익구조

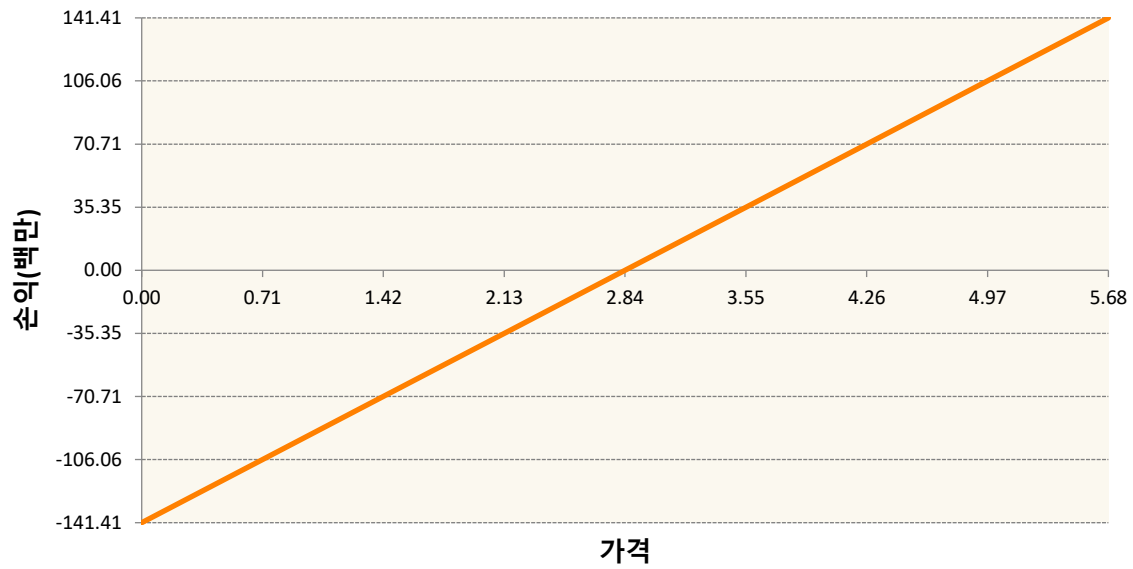
CLH2-WTI CRUDE FUTURE Mar22



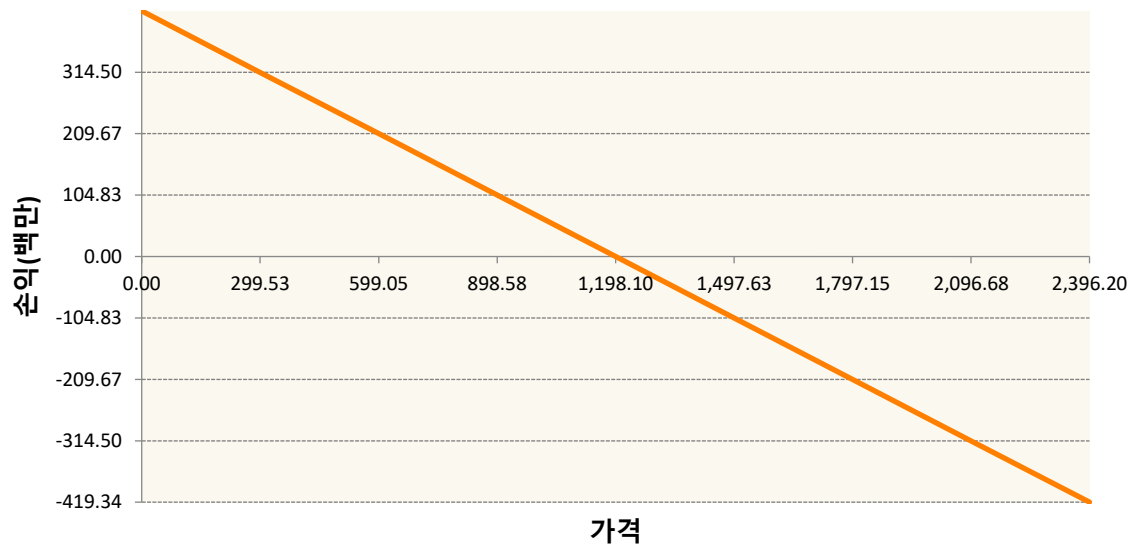
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



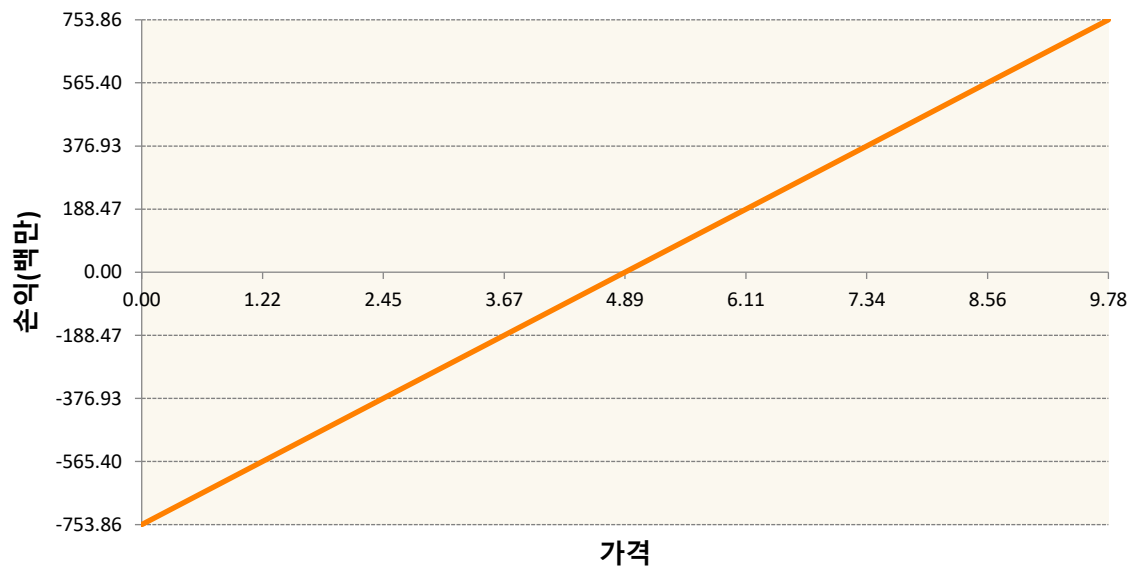
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22



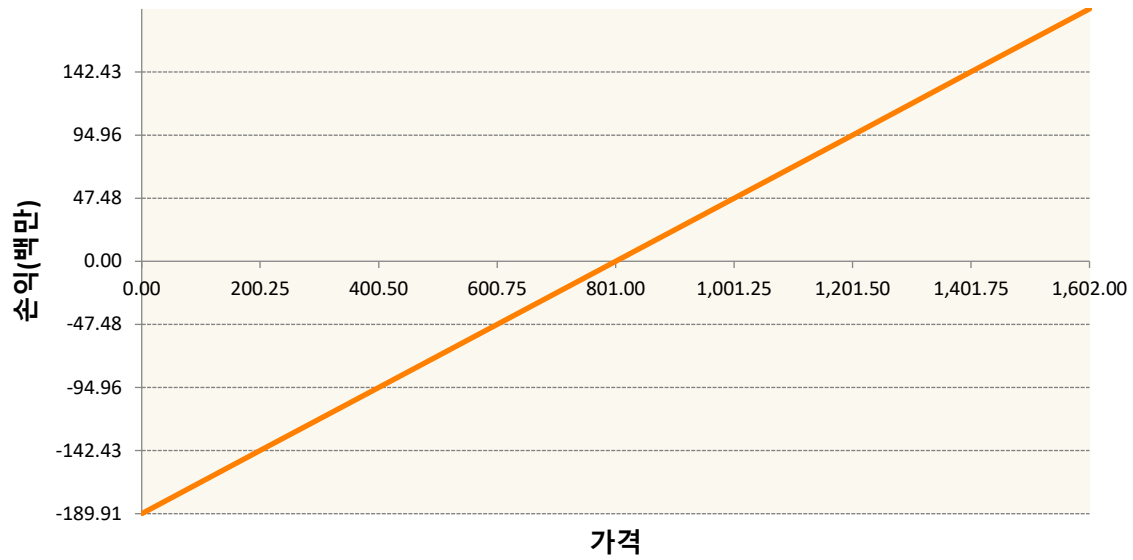
KR4175S20006-2022-02 달러선물



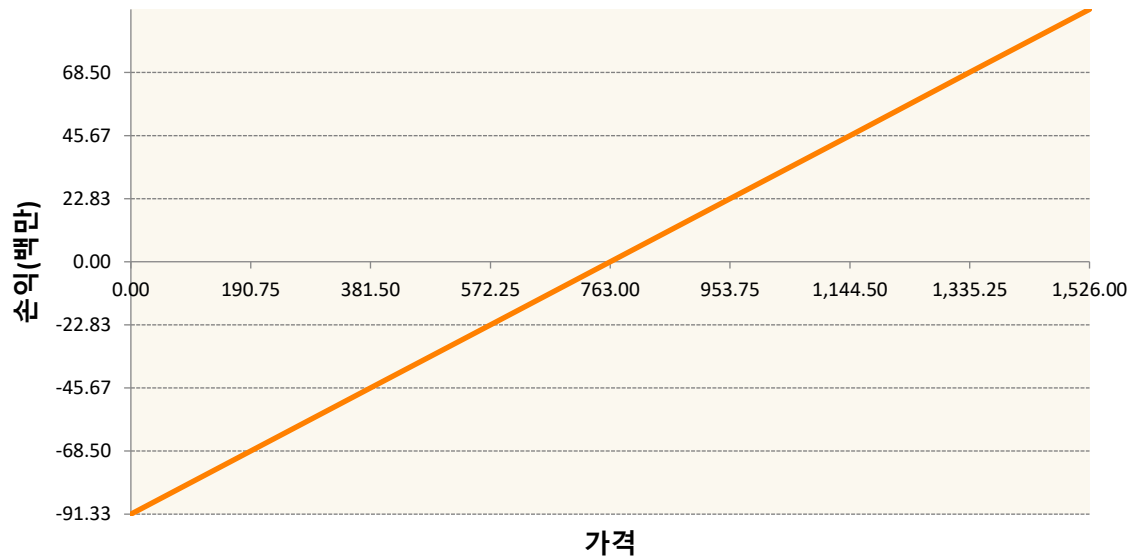
NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22



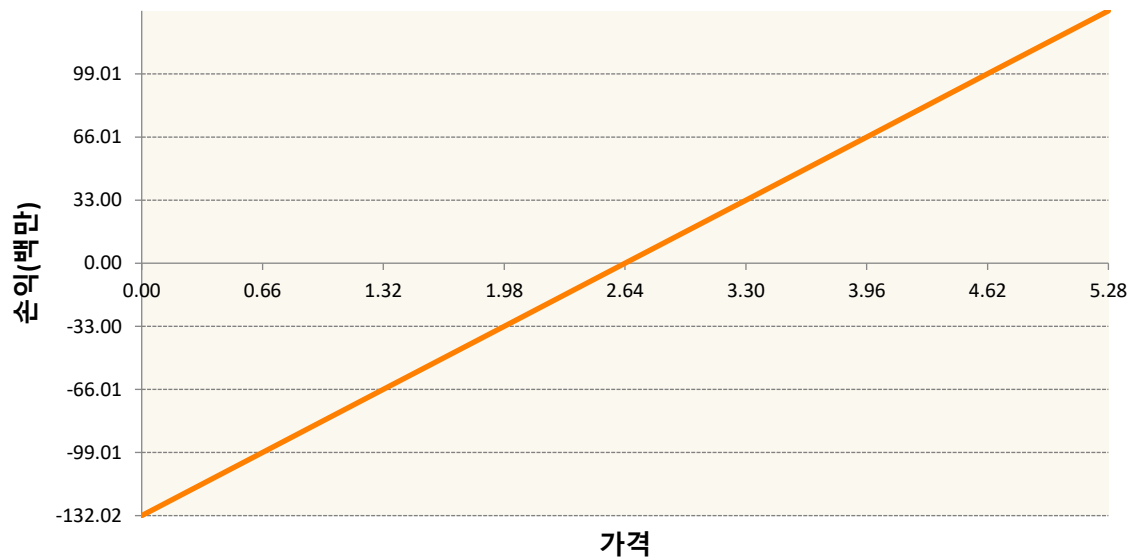
QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



QSK2-Low Su Gasoil G MAY22



XBH2-GASOLINE RBOB FUT Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22	43
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22	43
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22	11
KR4175S200	2022-02 달러선물	34
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22	60
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	15
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22	7
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22	11

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

481