

공시일 2022-02-10

기준일 2022-02-09

포커스농산물모(채권-파생형)

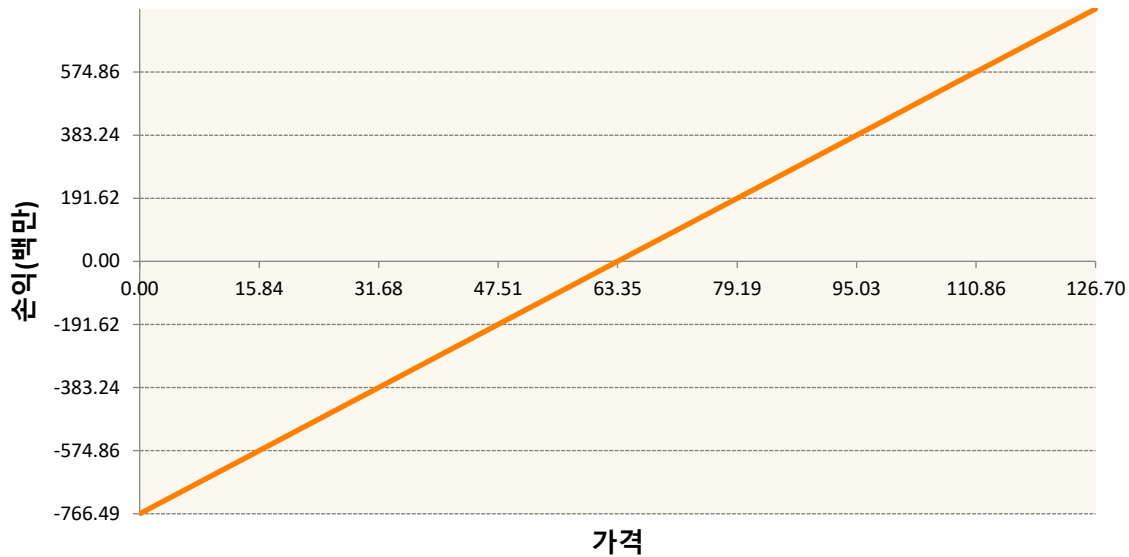
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

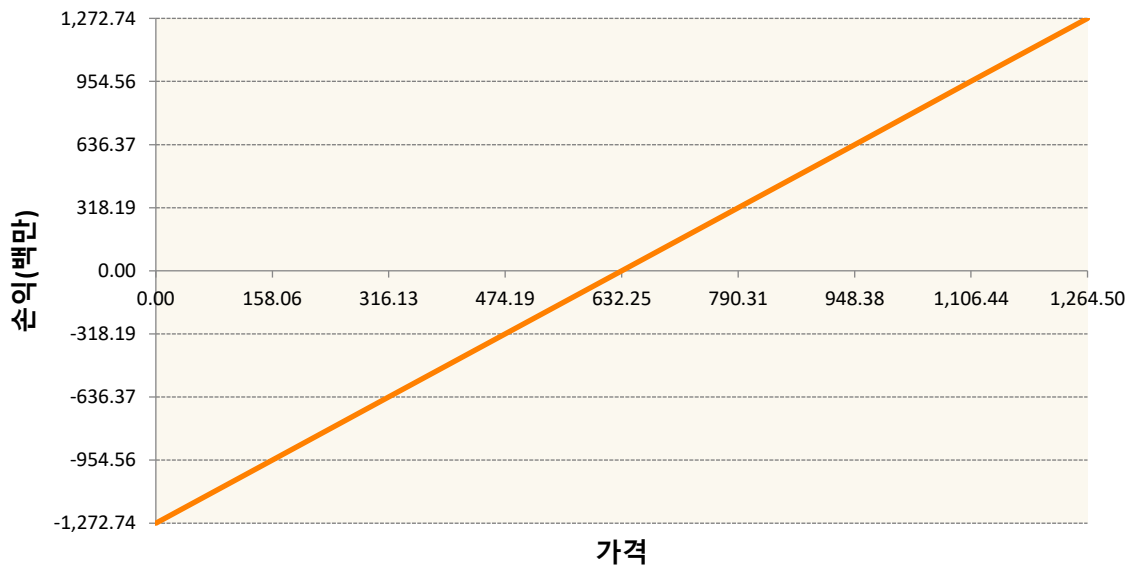
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,169	777	6,392	

2. 만기시점의 손익구조

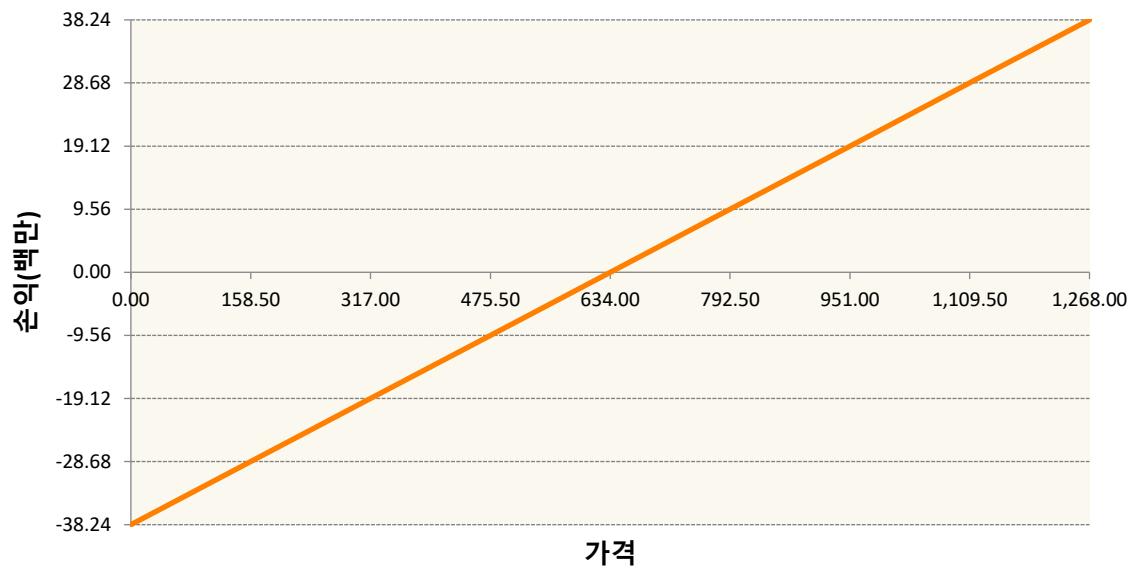
BOH2-SOYBEAN OIL FUTR Mar22



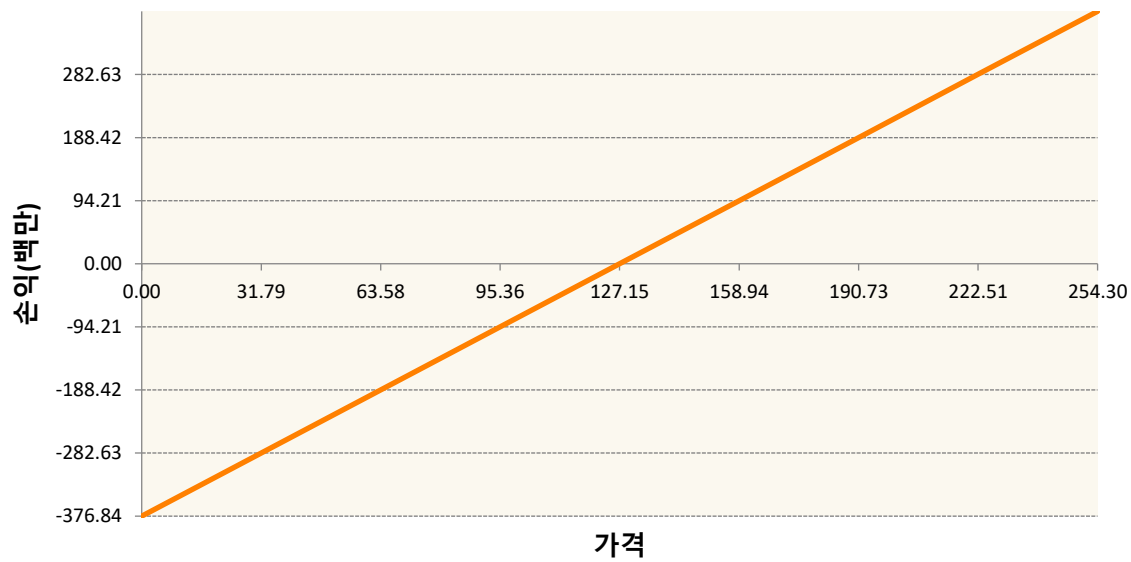
CH2-CORN FUTURE Mar22



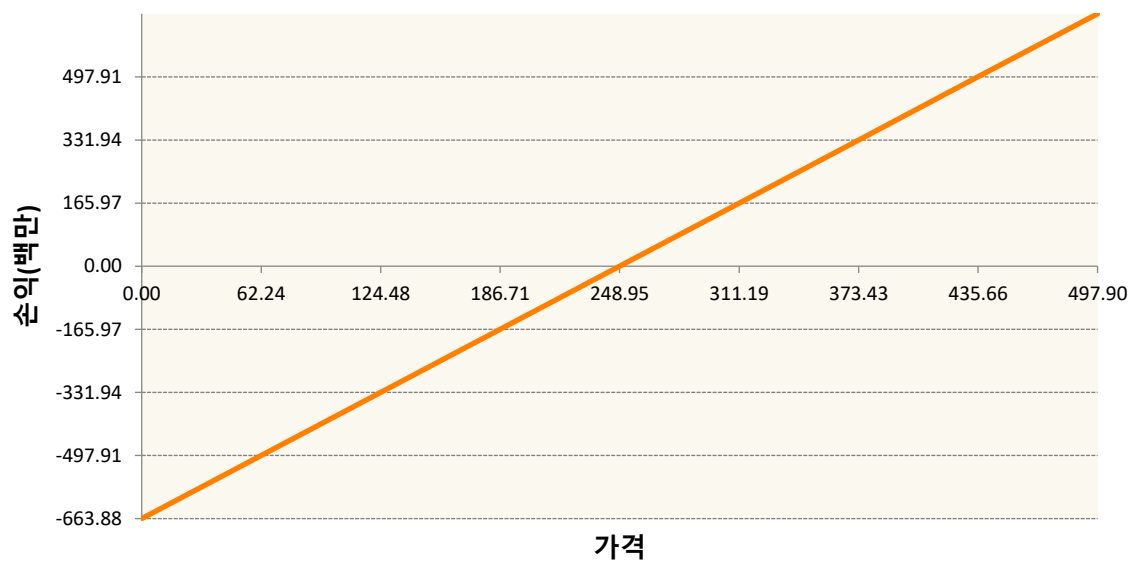
CK2-CORN FUTURE May22



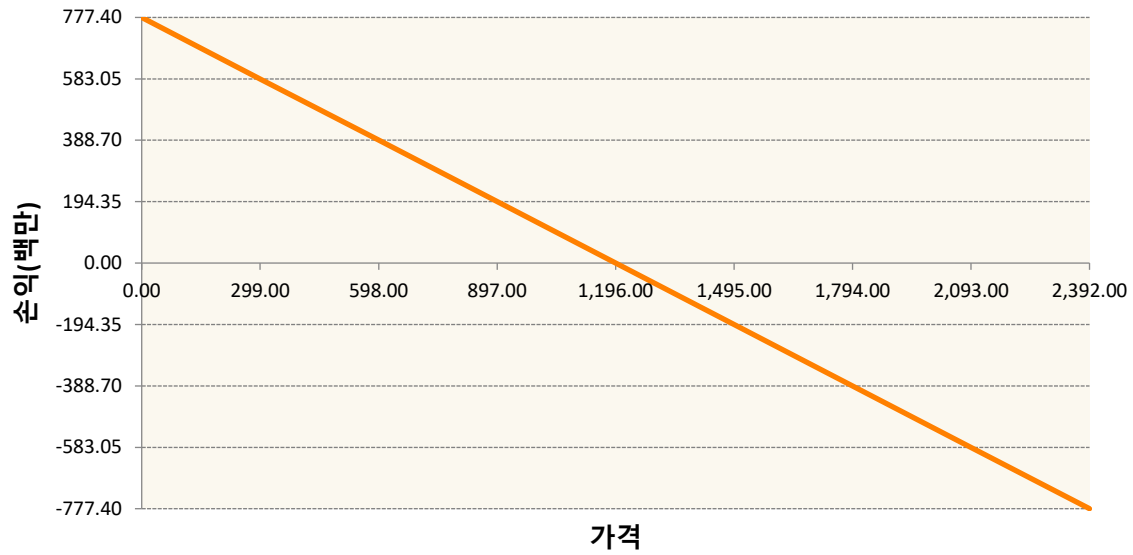
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



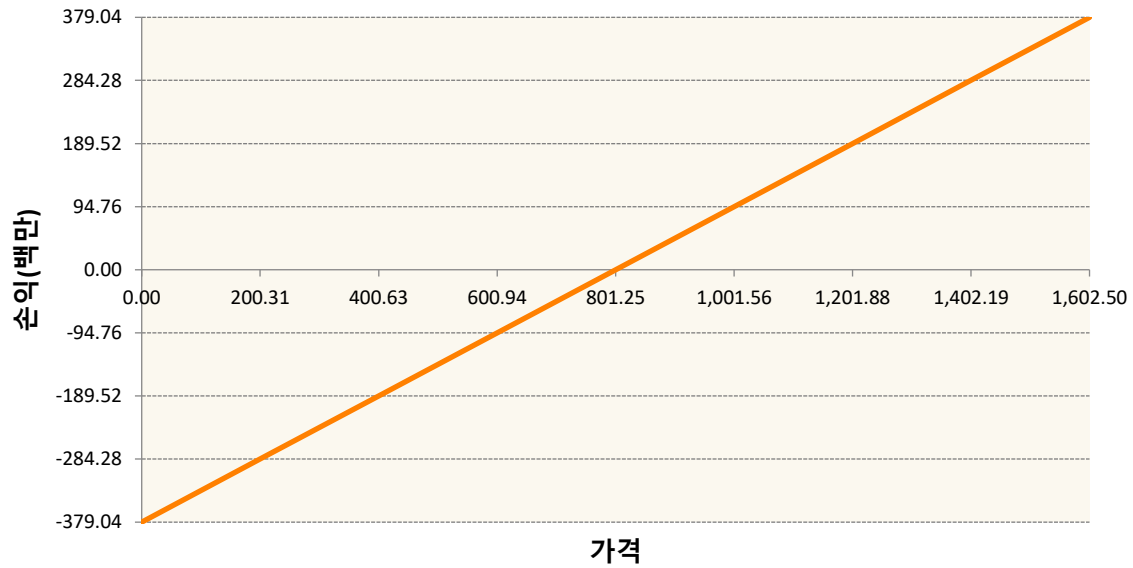
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



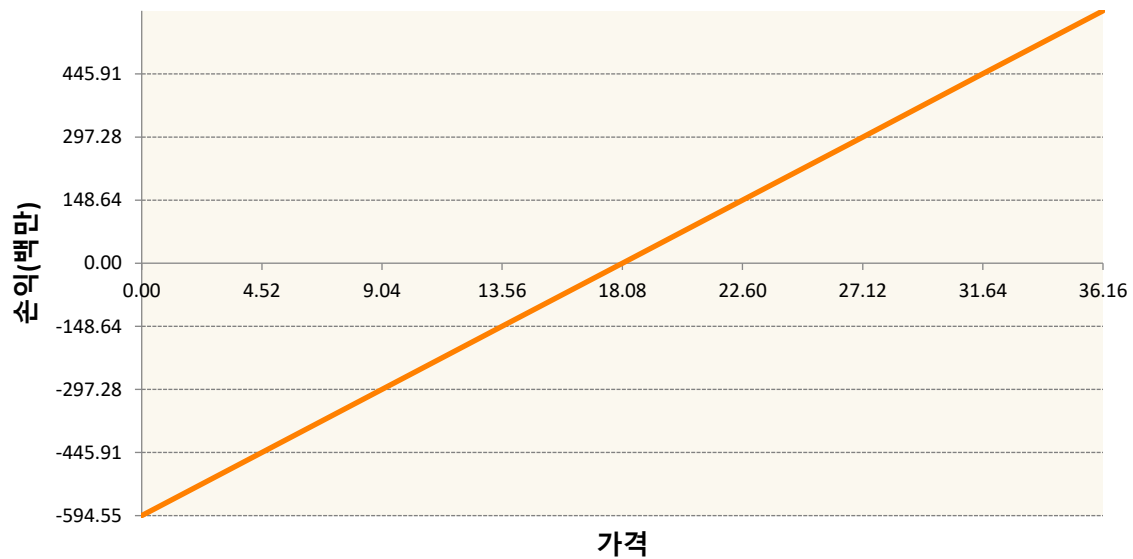
KR4175S20006-2022-02 달러선물



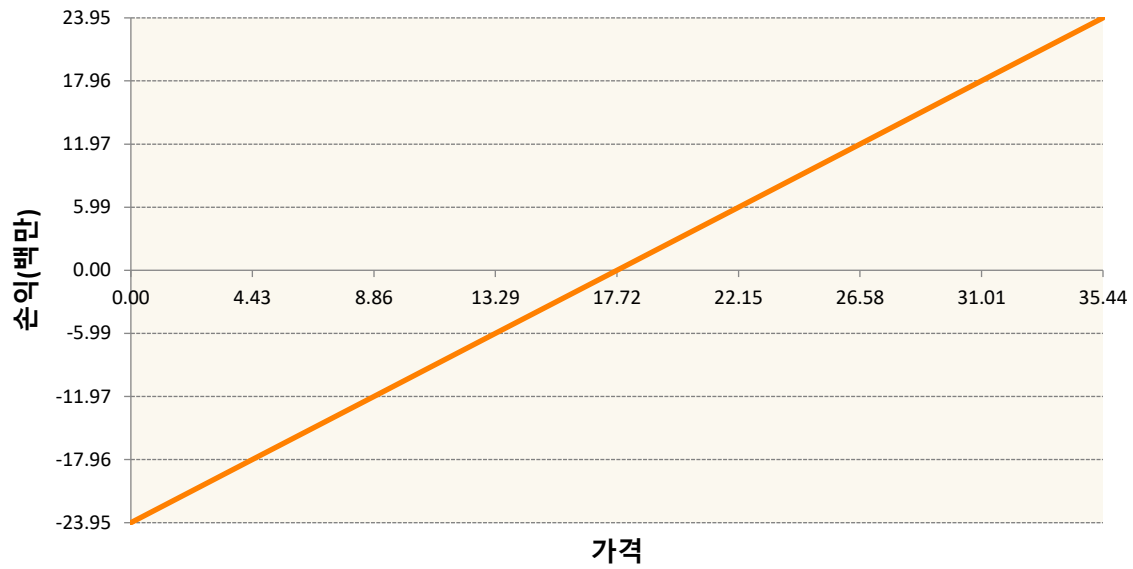
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



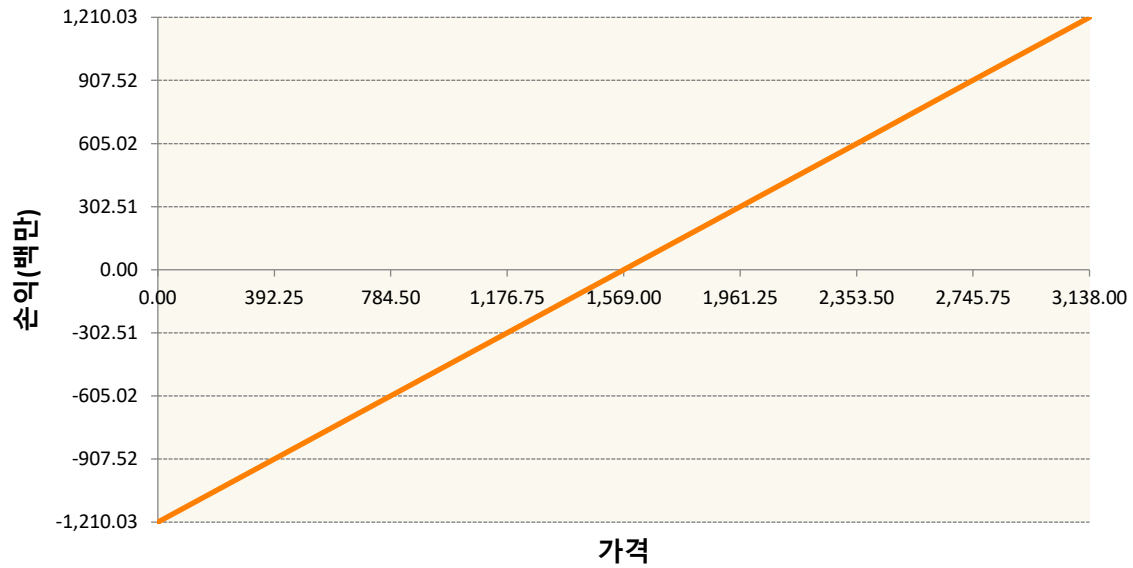
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



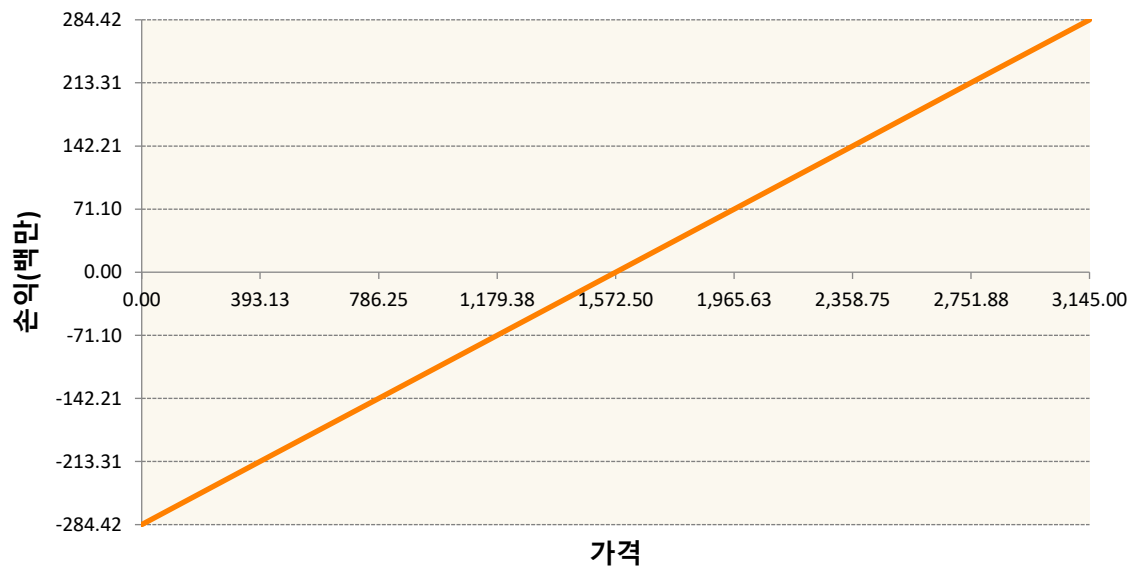
SBK2-Sugar May22



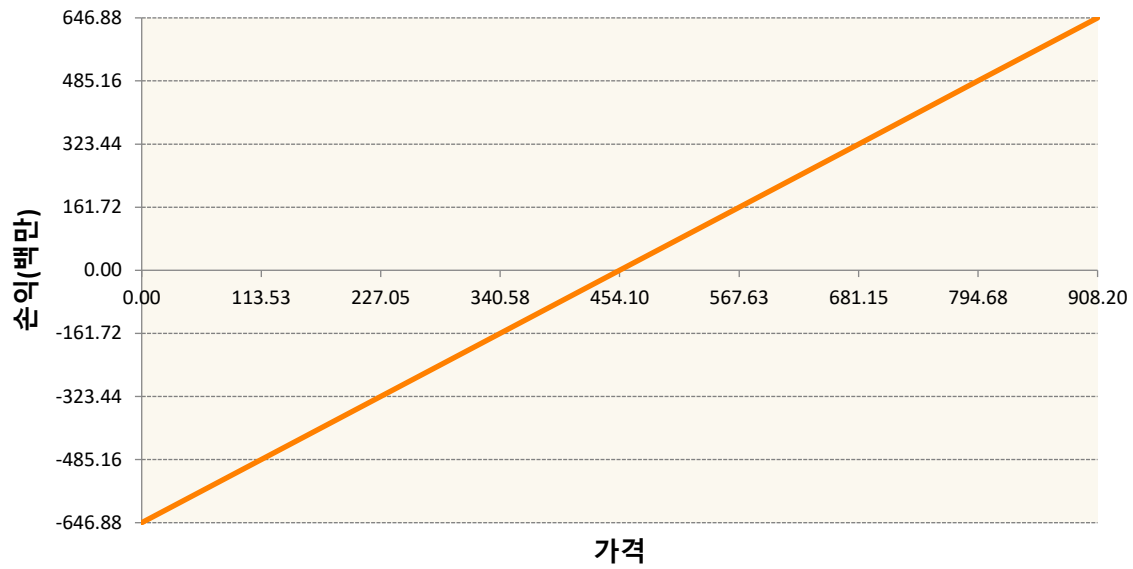
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



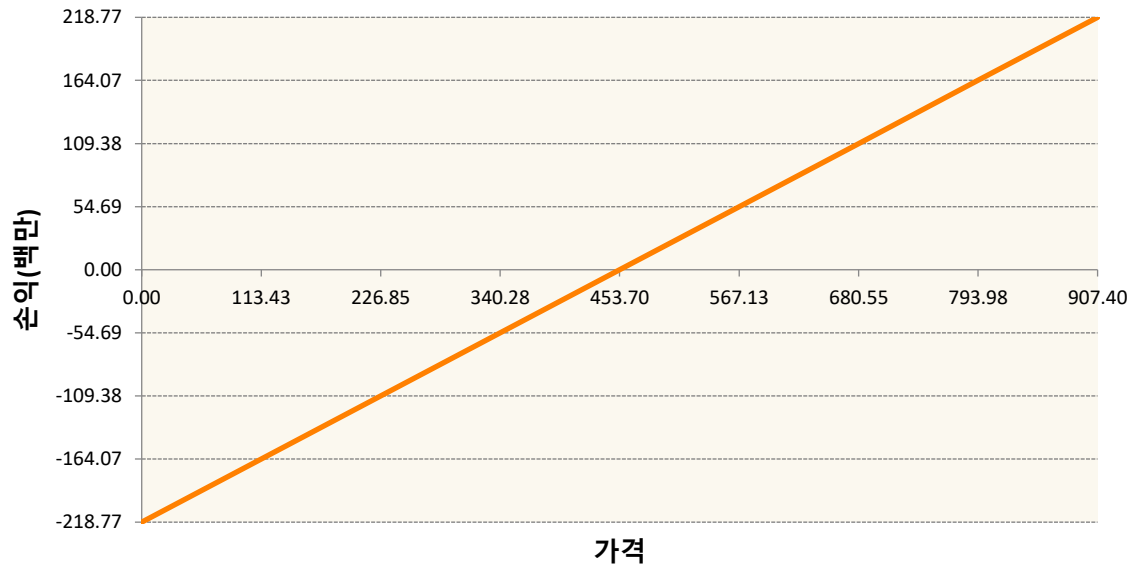
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



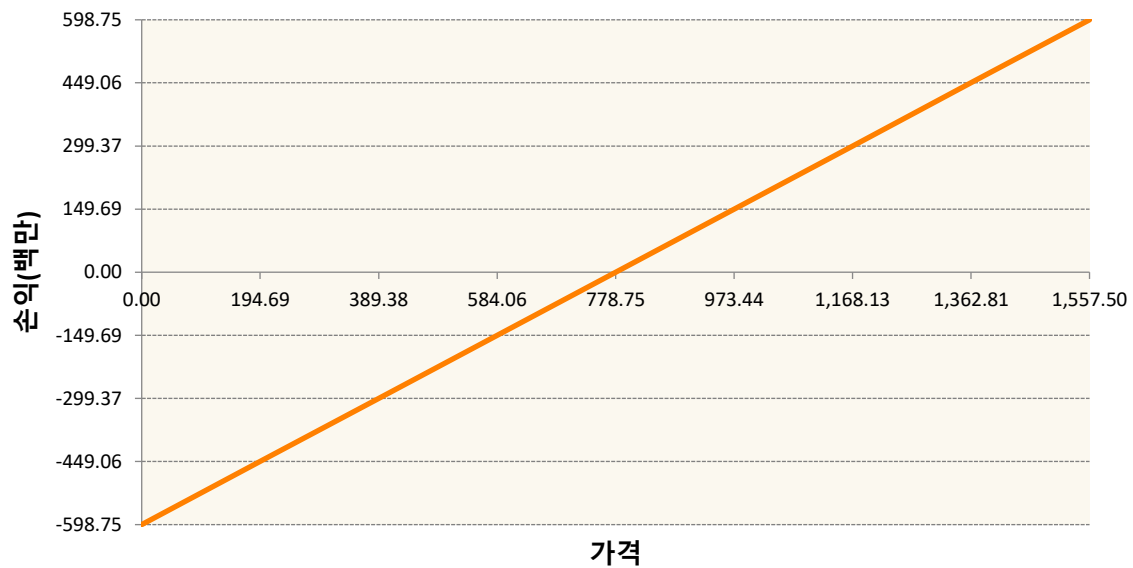
SMH2-SOYBEAN MEAL FUTR Mar22

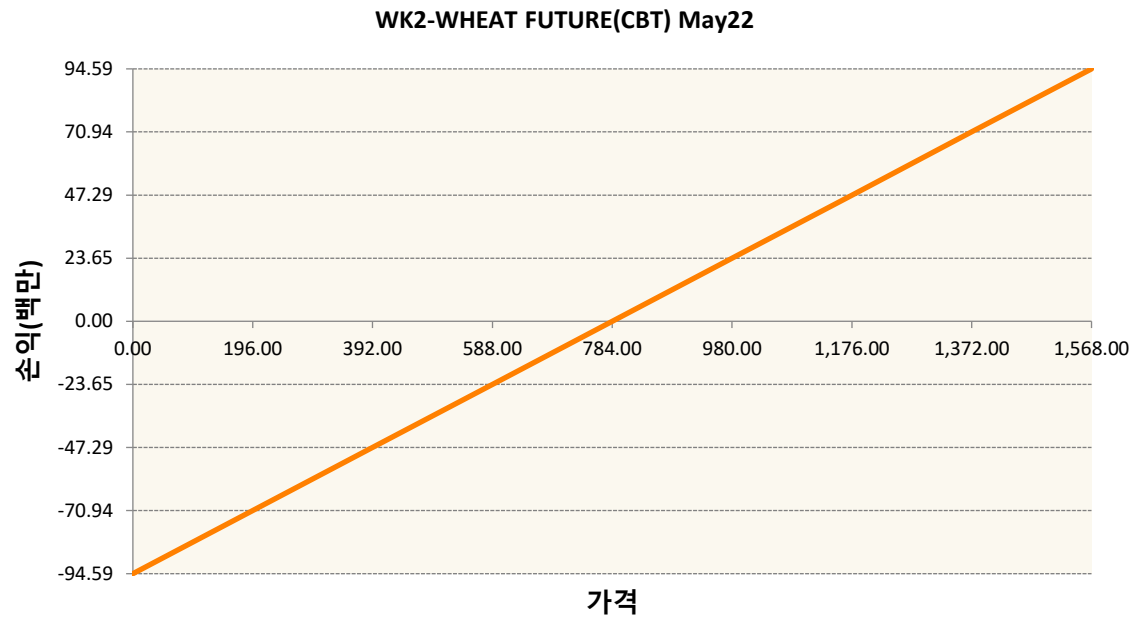


SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일 2022-02-10

기준일 2022-02-09

스마트인덱스모

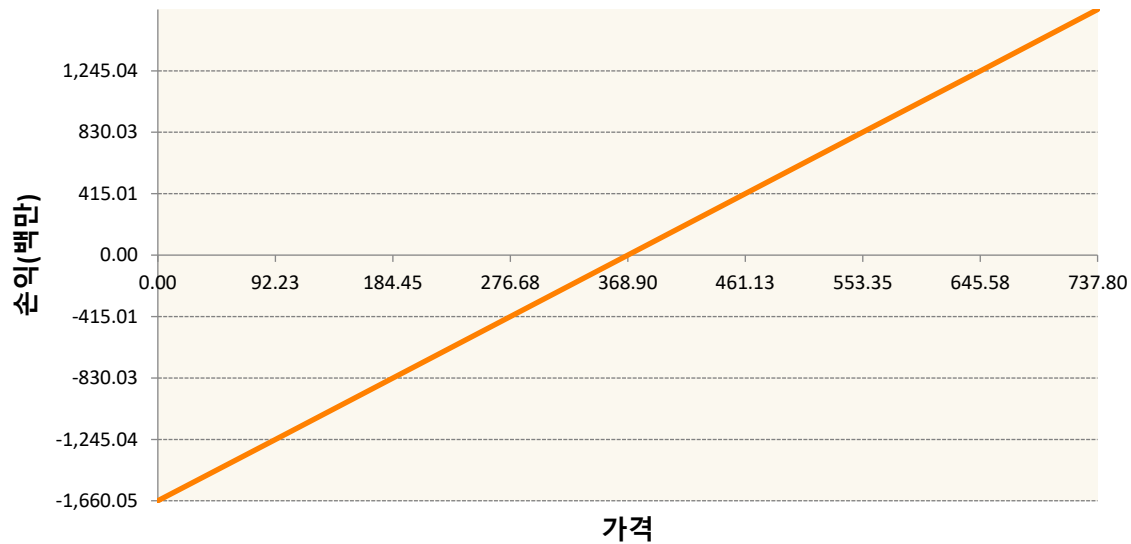
1. 계약금액

(단위:백만원)

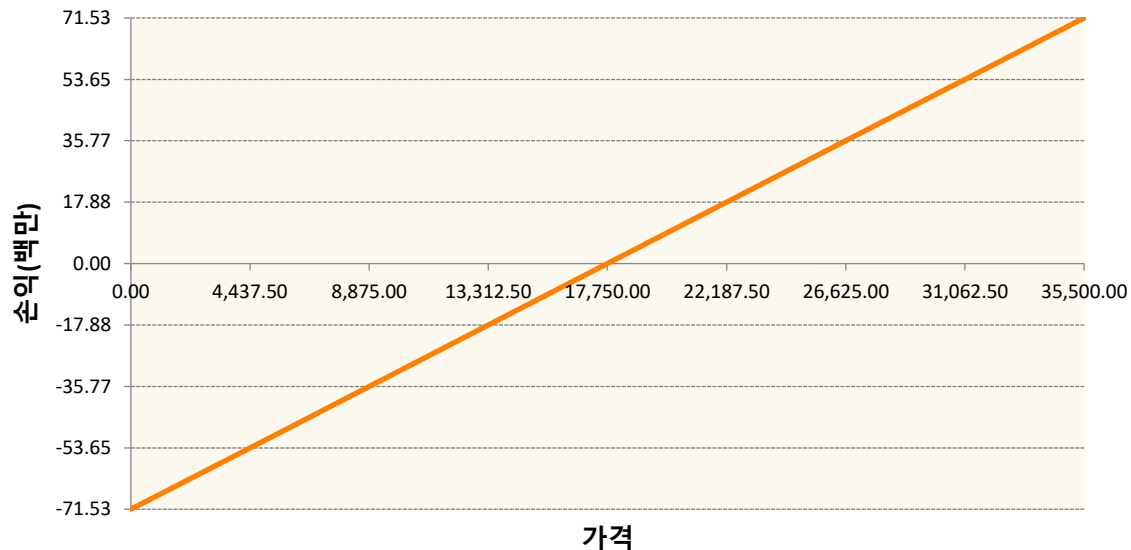
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,732	0	1,732	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133
-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%	133	133	133	133	133	133	133
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	2022-02-10
기준일	2022-02-09

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	884
------------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

530

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-02-10
기준일	2022-02-09

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	406
-----------------------------	-----

* 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	2022-02-10
기준일	2022-02-09

유로인덱스모(주식-파생형)

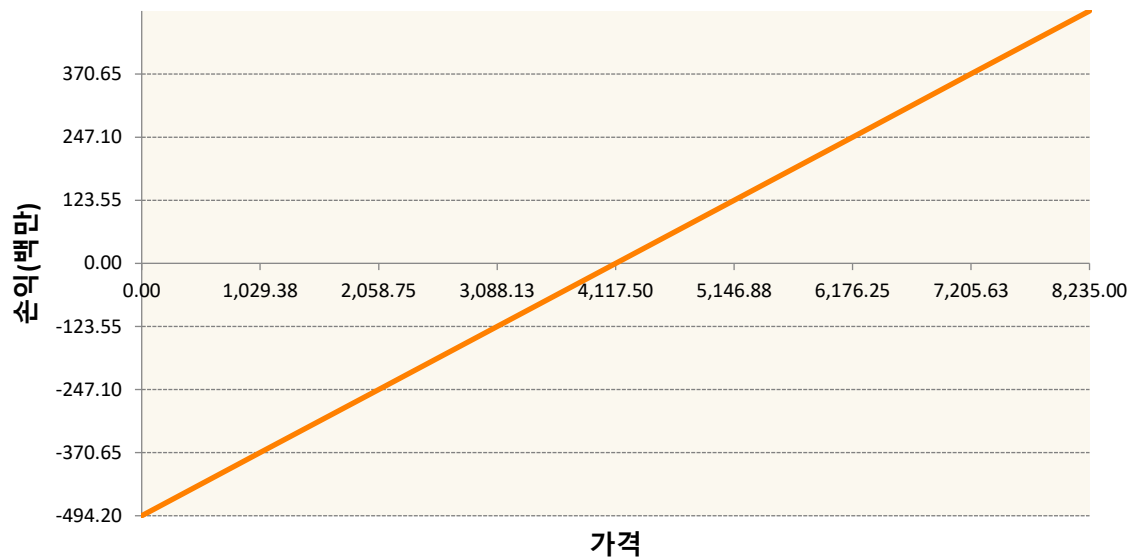
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	494	0	494	

2. 만기시점의 손익구조

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

35

공시일	2022-02-10
기준일	2022-02-09

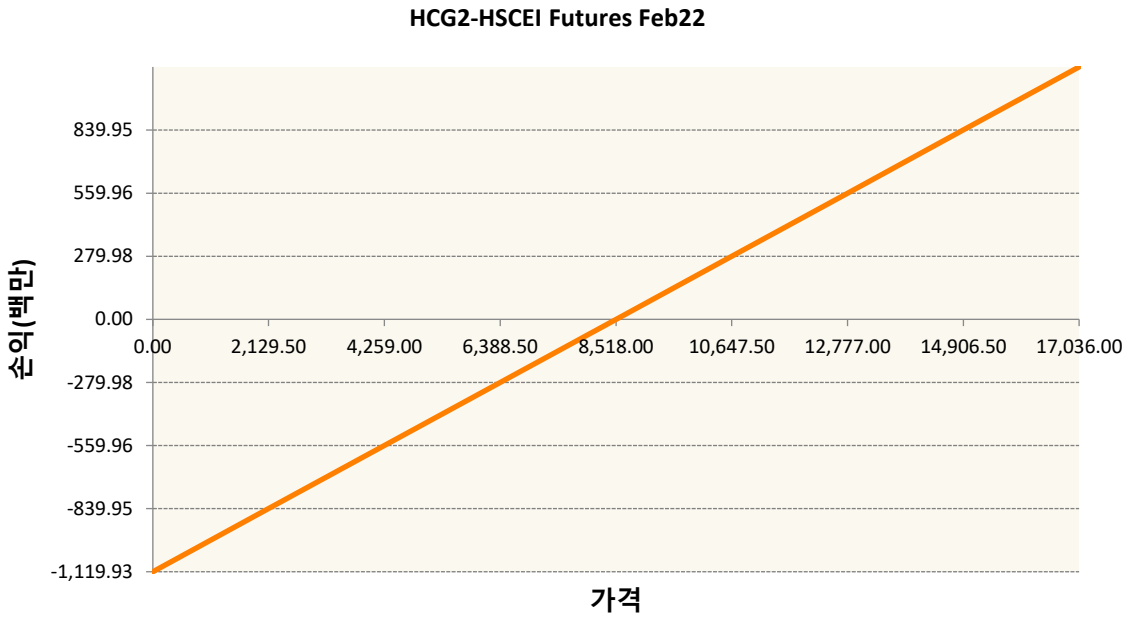
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,120	0	1,120	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG2	HSCEI Futures Feb22	90
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

95

공시일 2022-02-10

기준일 2022-02-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

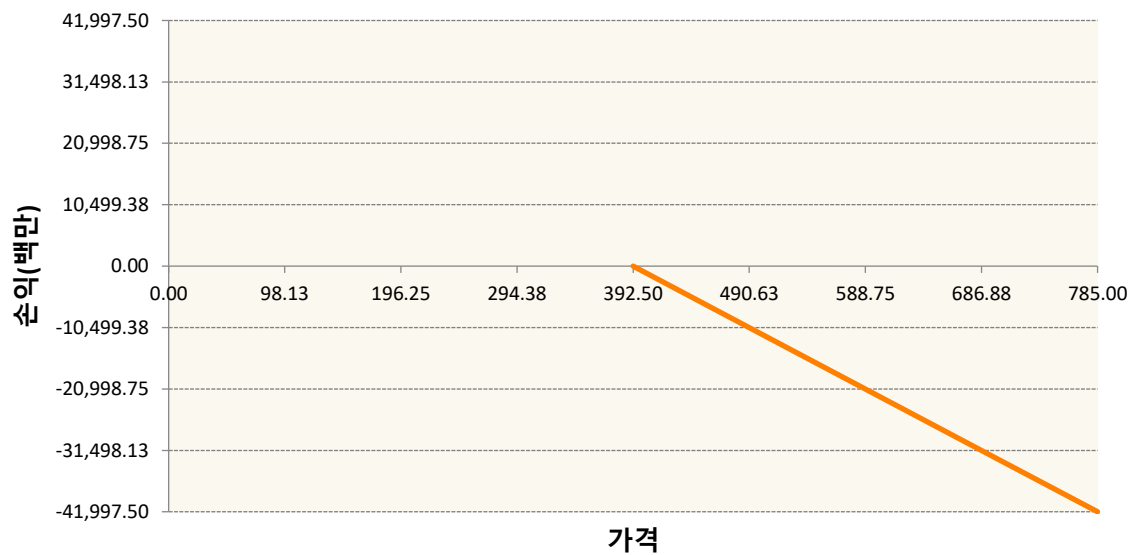
1. 계약금액

(단위:백만원)

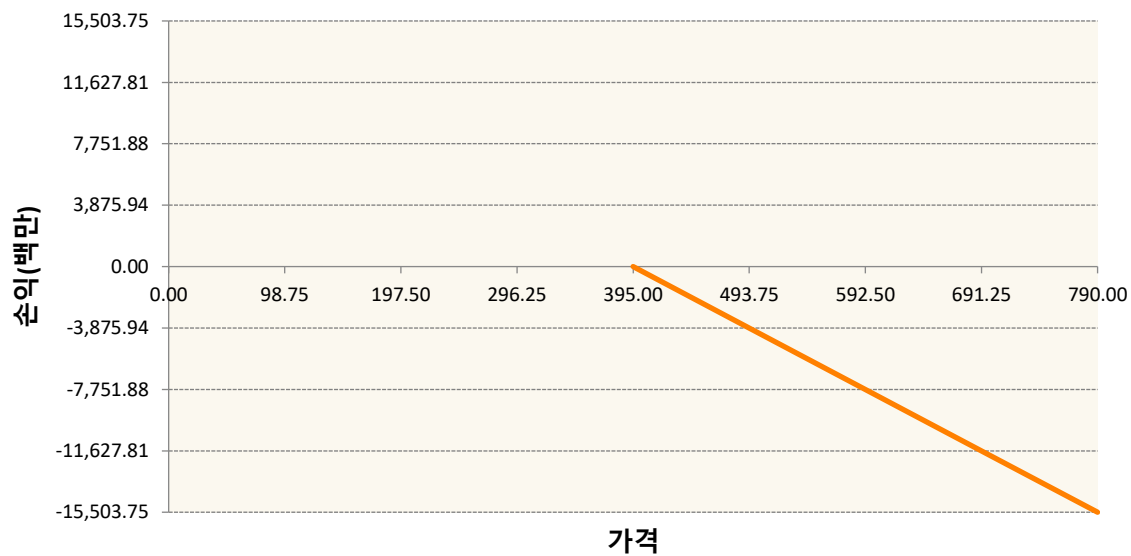
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	77,421	-77,421	장내

2. 만기시점의 손익구조

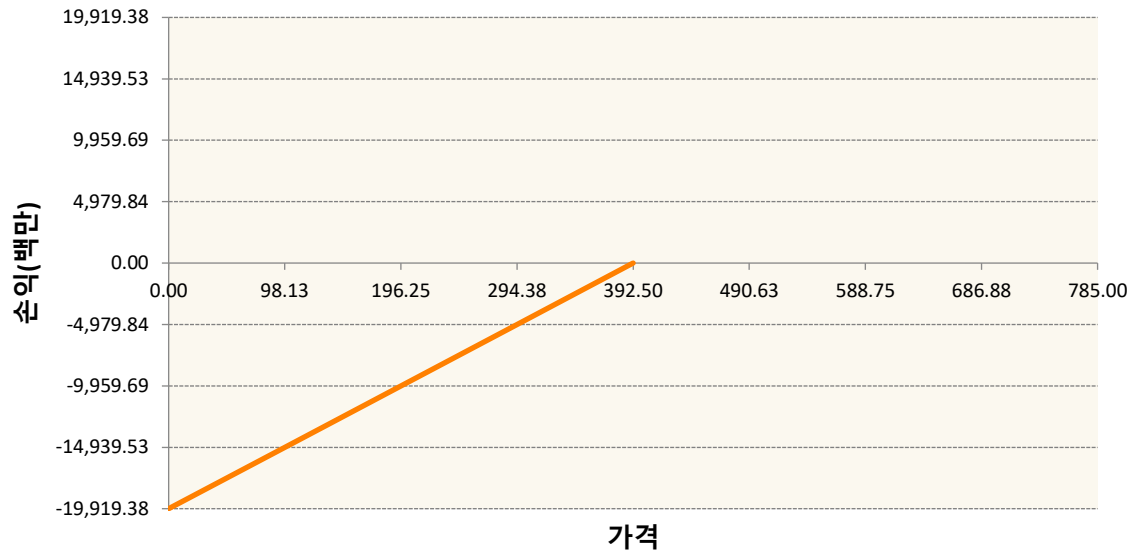
KR4201S23921-2022-02 콜392.5



KR4201S23954-2022-02 콜395



KR4301S23929-2022-02 풋392.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S23921		2022-02 콜392.5						725
		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	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	-1	-1	-3	-5	-8	-12	
5.33%	-53	-69	-85	-103	-122	-140	-160	
8.00%	-634	-647	-660	-675	-691	-708	-725	
KR4201S23954		2022-02 콜395						197
		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	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	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%	-7	-10	-14	-19	-24	-29	-35	
8.00%	-153	-160	-167	-174	-182	-189	-197	
KR4301S23929		2022-02 풋392.5						1,497
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497
-5.33%	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-998
-2.67%	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	499	499	499	499	499	499	499
5.33%	992	990	986	983	979	974	970
8.00%	1,208	1,207	1,205	1,203	1,200	1,197	1,194

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,524

공시일 2022-02-10

기준일 2022-02-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

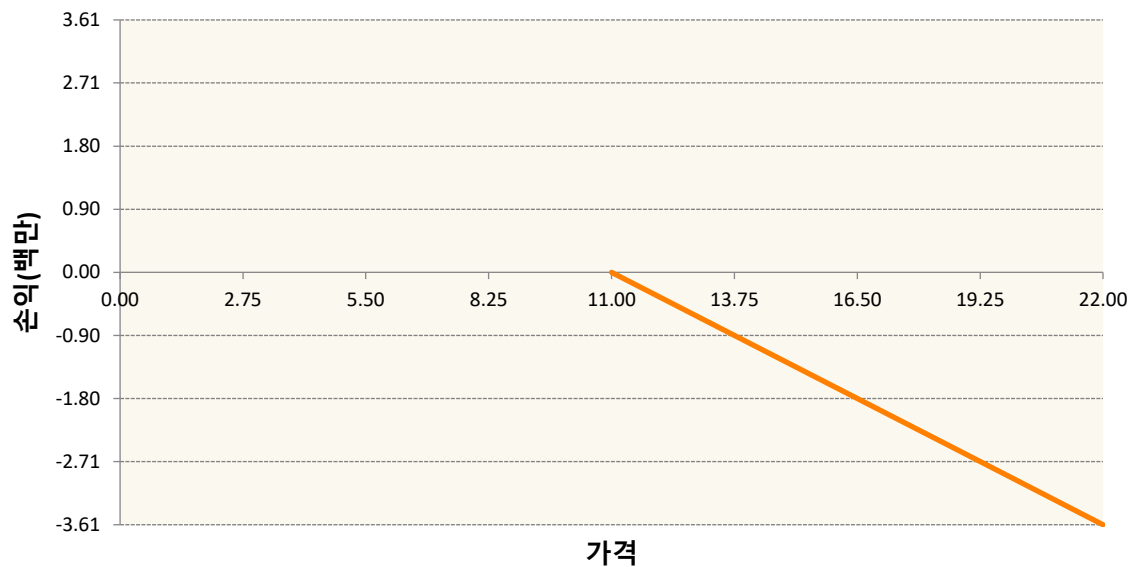
1. 계약금액

(단위:백만원)

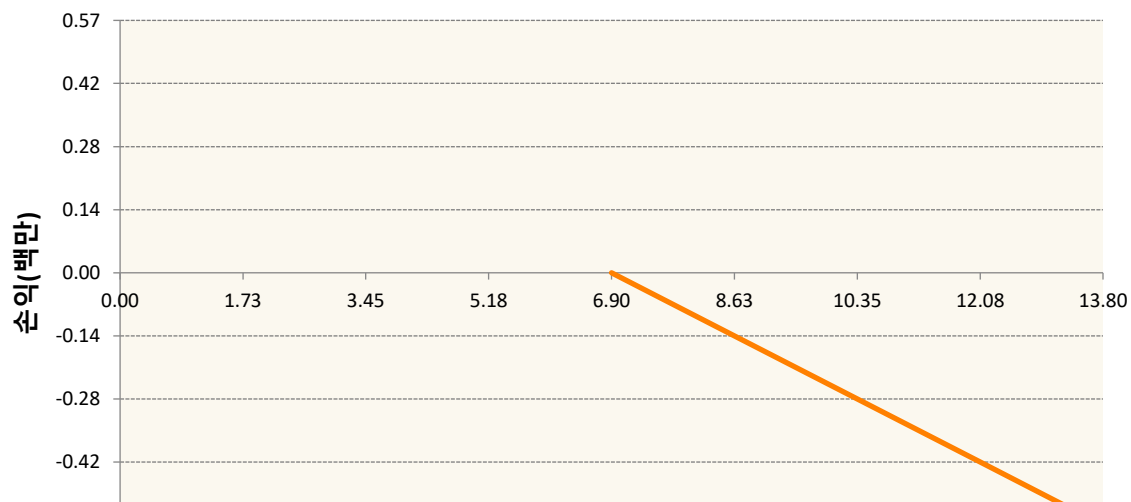
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	49	-49	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,050	-2,050	장외

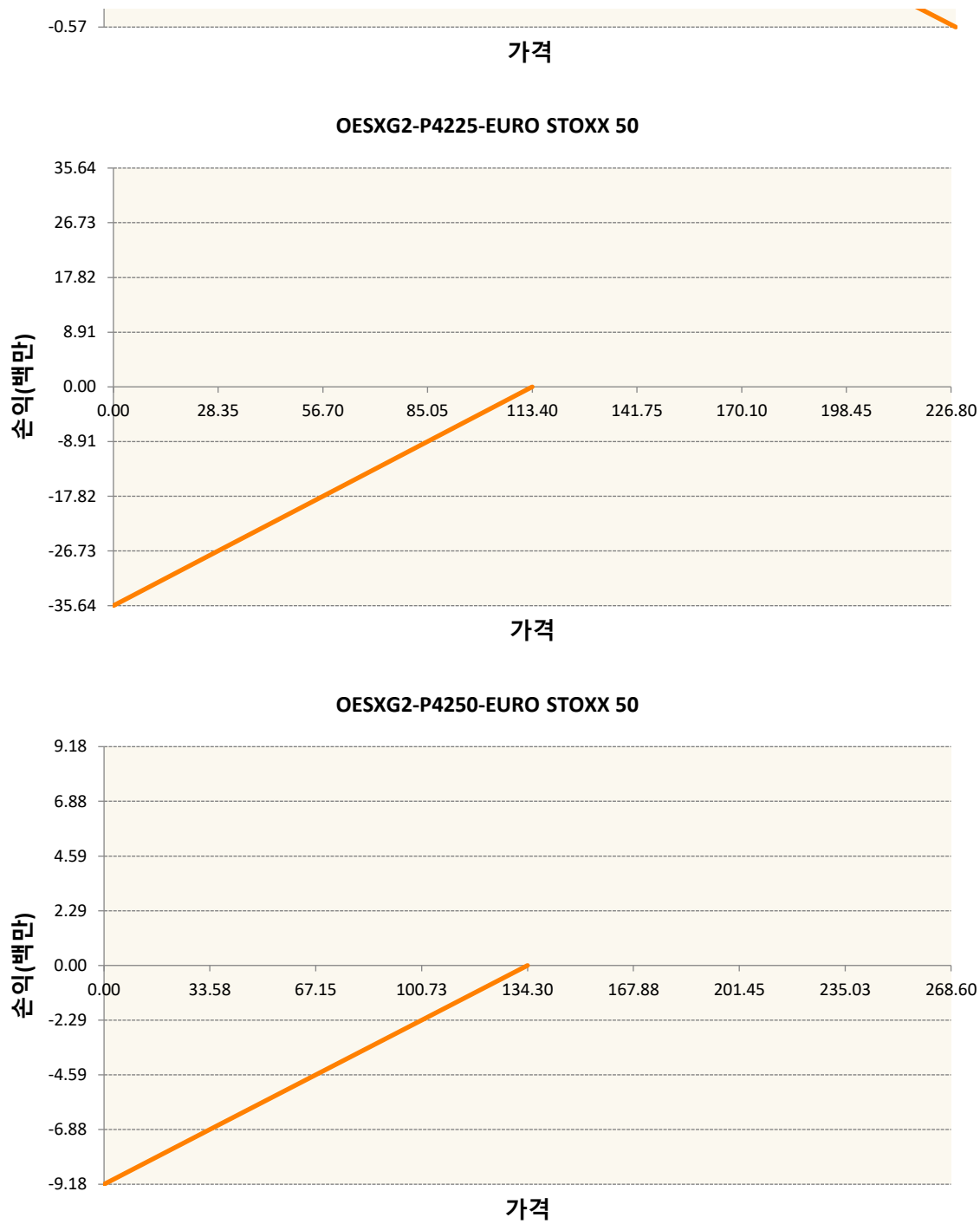
2. 만기시점의 손익구조

OESXG1-C4225-EURO STOXX 50



OESXG2-C4250-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
 OESXG1-C42 EURO STOXX 50
 OESXG2-C42 EURO STOXX 50
 OESXG2-P42 EURO STOXX 50
 OESXG2-P42 EURO STOXX 50

3
55
109
0.29
0.05
3
1

공시일 2022-02-10

기준일 2022-02-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

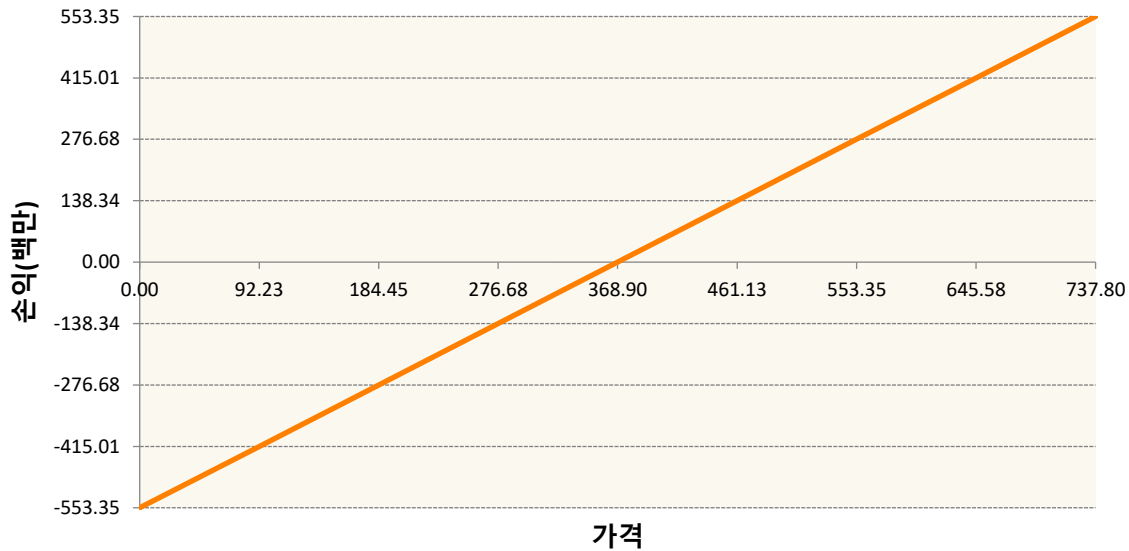
1. 계약금액

(단위:백만원)

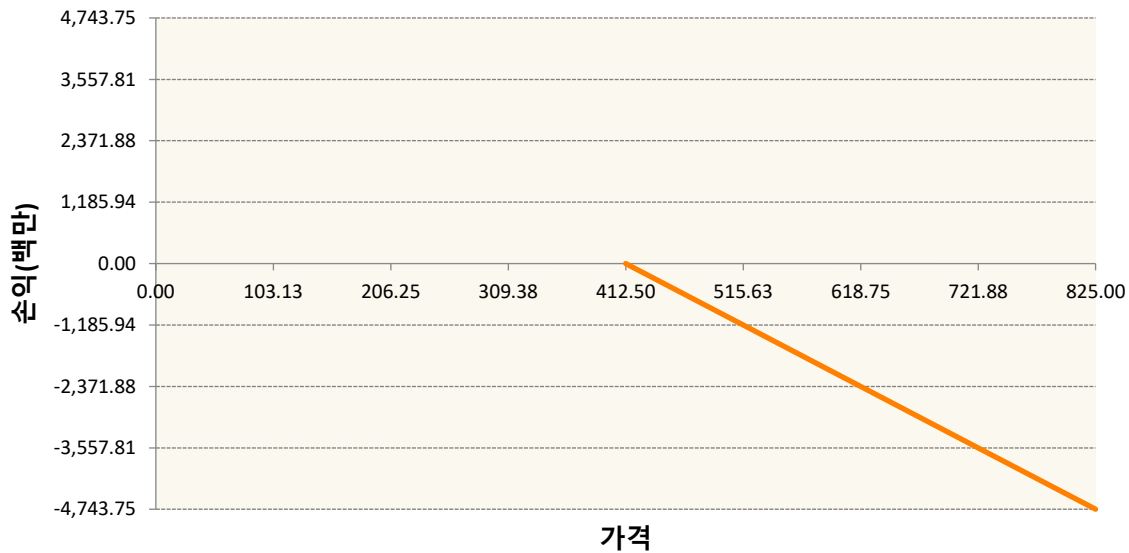
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	553	0	553	장내
누계	유가증권	옵션	294	5,055	-4,761	장내

2. 만기시점의 손익구조

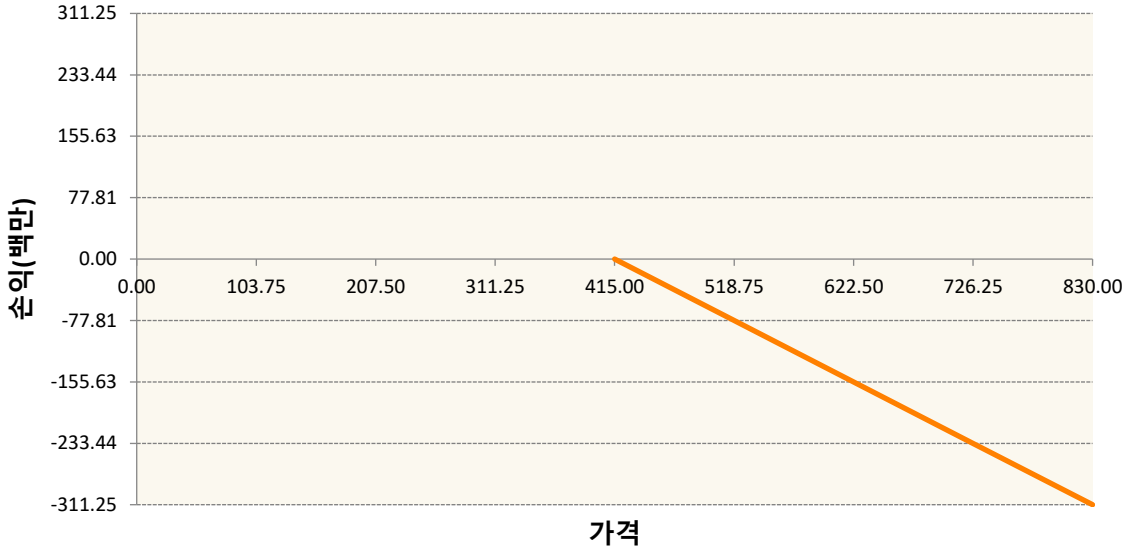
KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



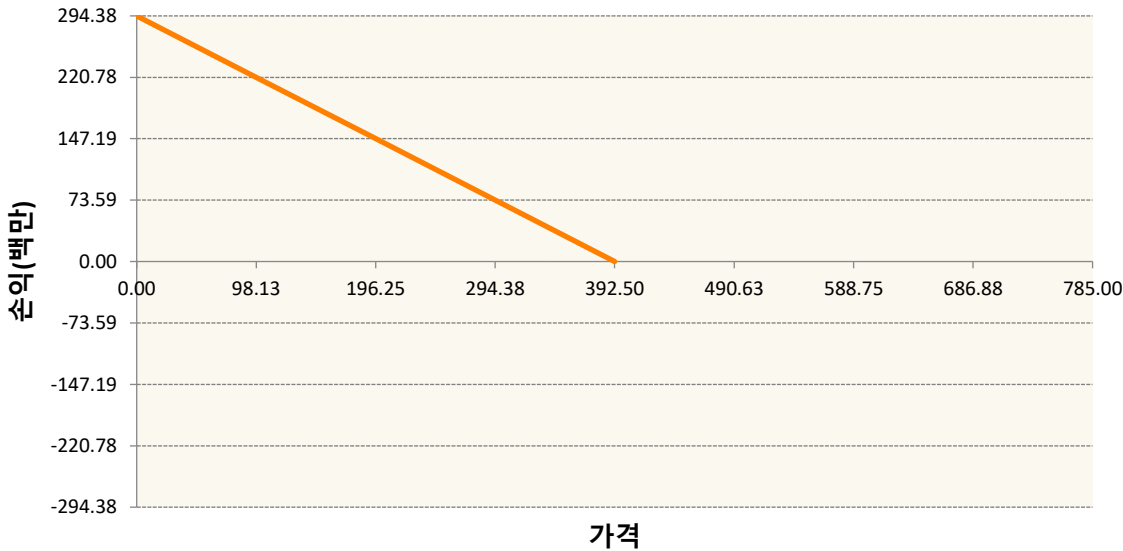
KR4201S24127-2022-02 콜412.5



KR4201S24150-2022-02 쿨415



KR4301S23929-2022-02 ₩392.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(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		2	
	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	0	-1	-1	-2

KR4201S24150

2022-02 콜415

0

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	0	0	0	0

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%	-15	-15	-15	-15	-14	-14	-14
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18

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

(단위:백만원)

63

공시일	2022-02-10
기준일	2022-02-09

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	10,377	0	10,377	

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	2022-02-10
기준일	2022-02-09

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	8,796	0	8,796	

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	2022-02-10
기준일	2022-02-09

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	29,676	0	29,676	
누계	통화	선도	921	30,511	-29,589	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E	2,249
FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	191
FXW213C23 USD/KRW 24-02-22E	74
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

813

공시일 2022-02-10

기준일 2022-02-09

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

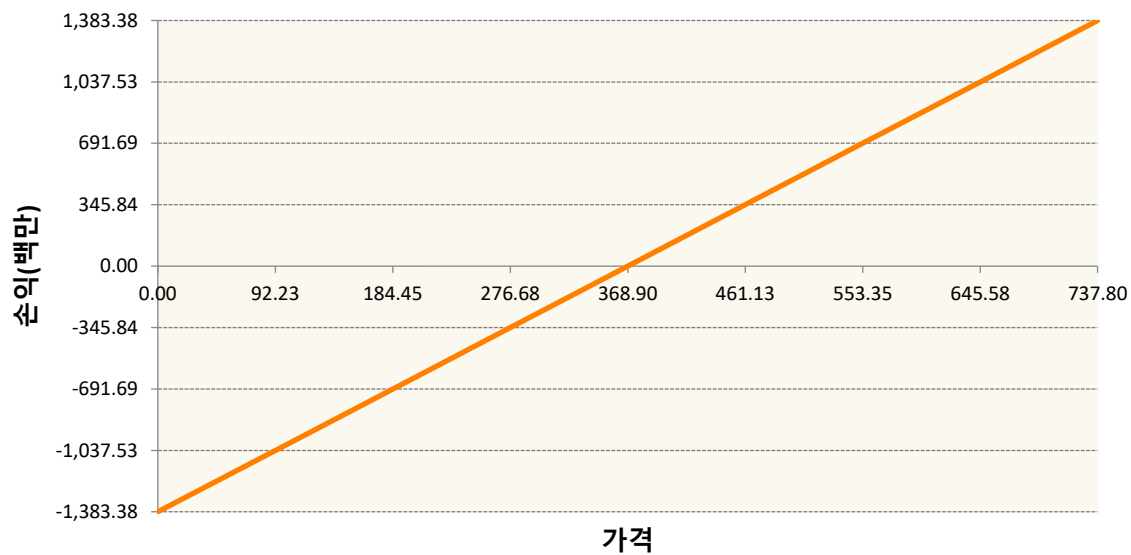
1. 계약금액

(단위:백만원)

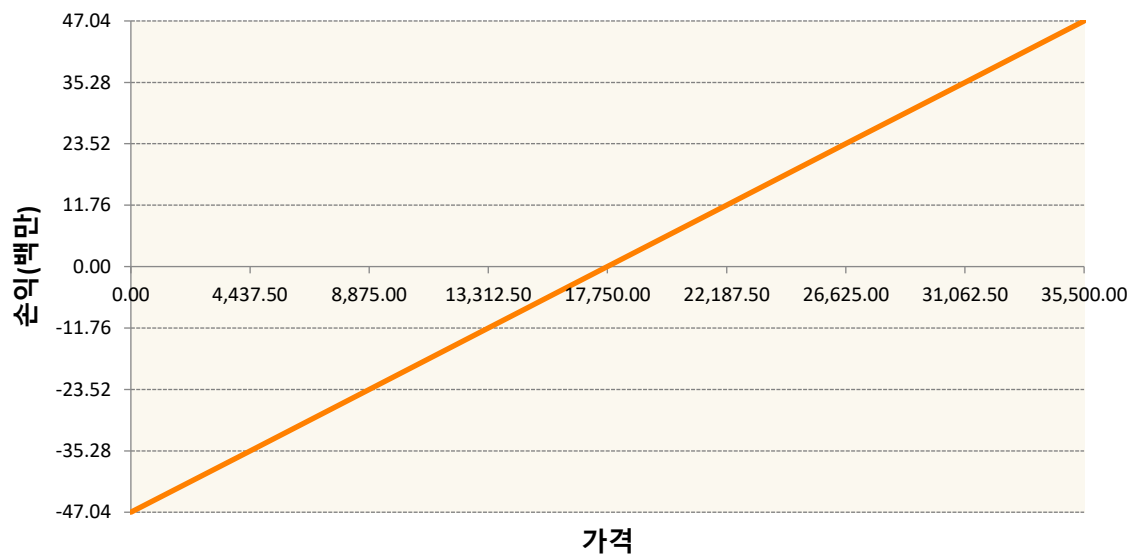
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,430	0	1,430	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	111	111	111	111	111	111	111
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)

106

공시일	2022-02-10
기준일	2022-02-09

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

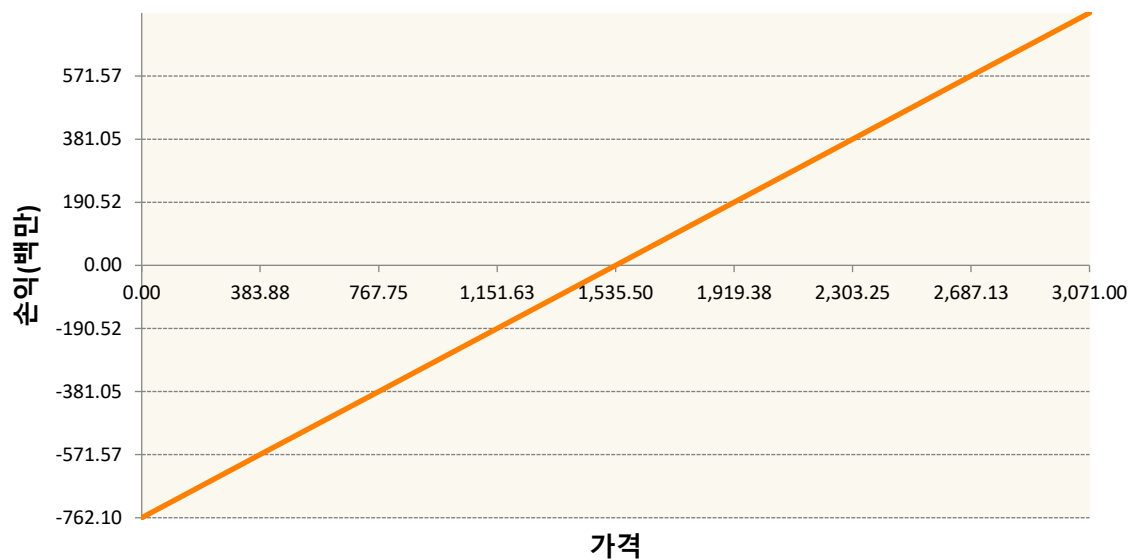
1. 계약금액

(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	762	0	762	
누계	유가증권	스왑	1,868	0	1,868	장외
누계	통화	선도	0	1,339	-1,339	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCG2-VN30 Index Future Feb22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	149
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	61

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

(단위:백만원)

공시일	2022-02-10
기준일	2022-02-09

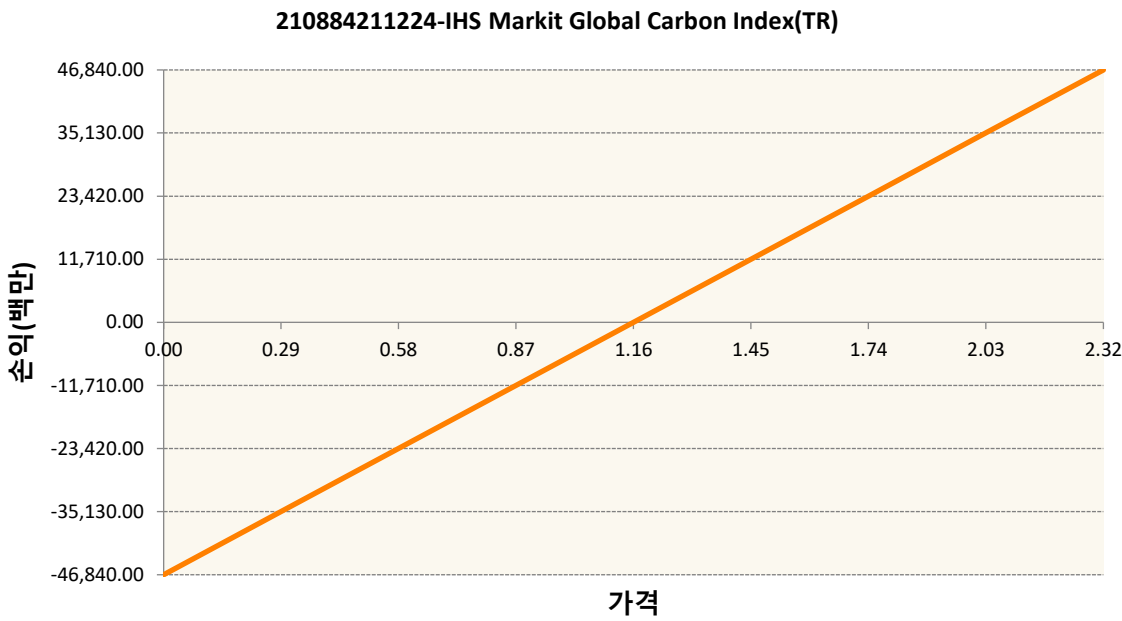
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	46,840	0	46,840	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,749

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

(단위:백만원)

6,007

공시일 2022-02-10

기준일 2022-02-09

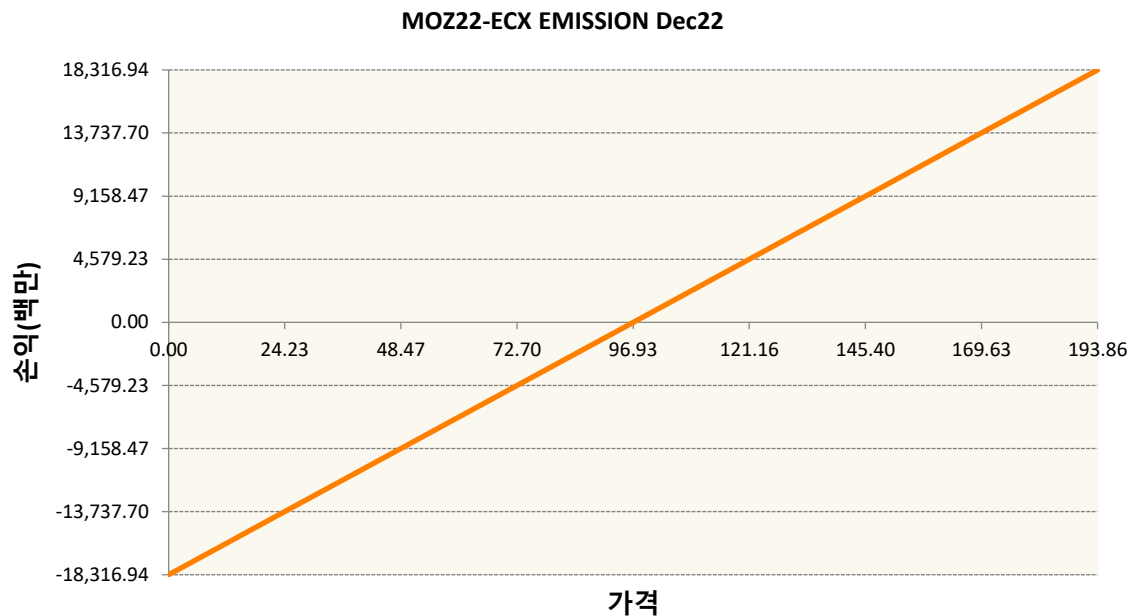
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	18,317	0	18,317	
누계	통화	선도	0	8,824	-8,824	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1V·KRW/EUR 25-02-22E

706

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,465

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

(단위:백만원)

3,414

공시일	2022-02-10
기준일	2022-02-09

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)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	32

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

(단위:백만원)

243

공시일	2022-02-10
기준일	2022-02-09

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)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)
70

공시일 2022-02-10

기준일 2022-02-09

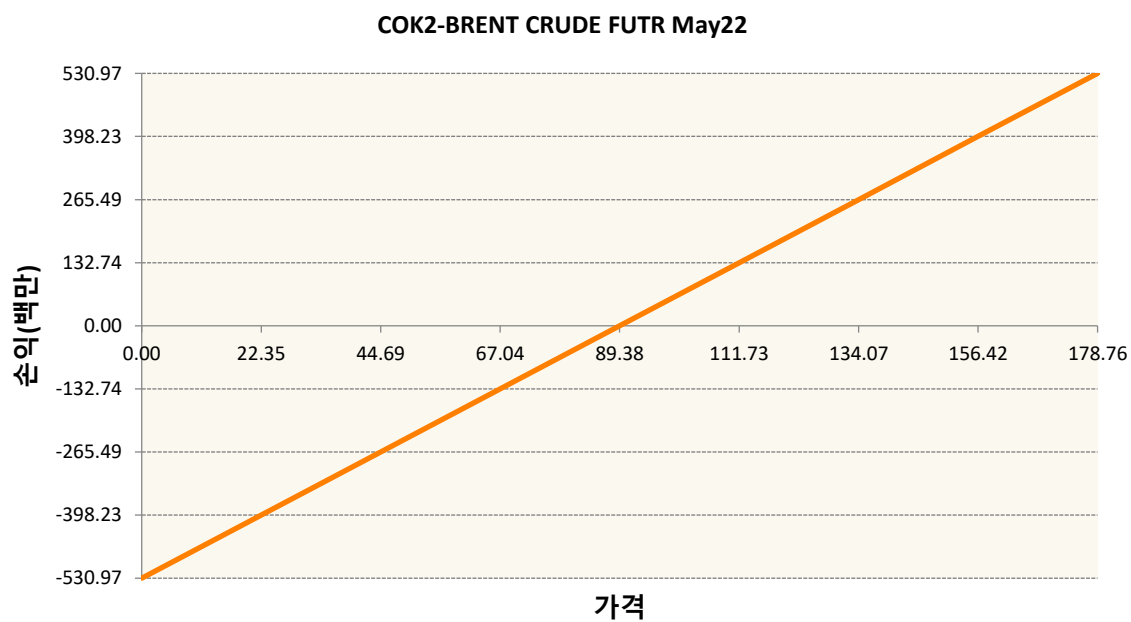
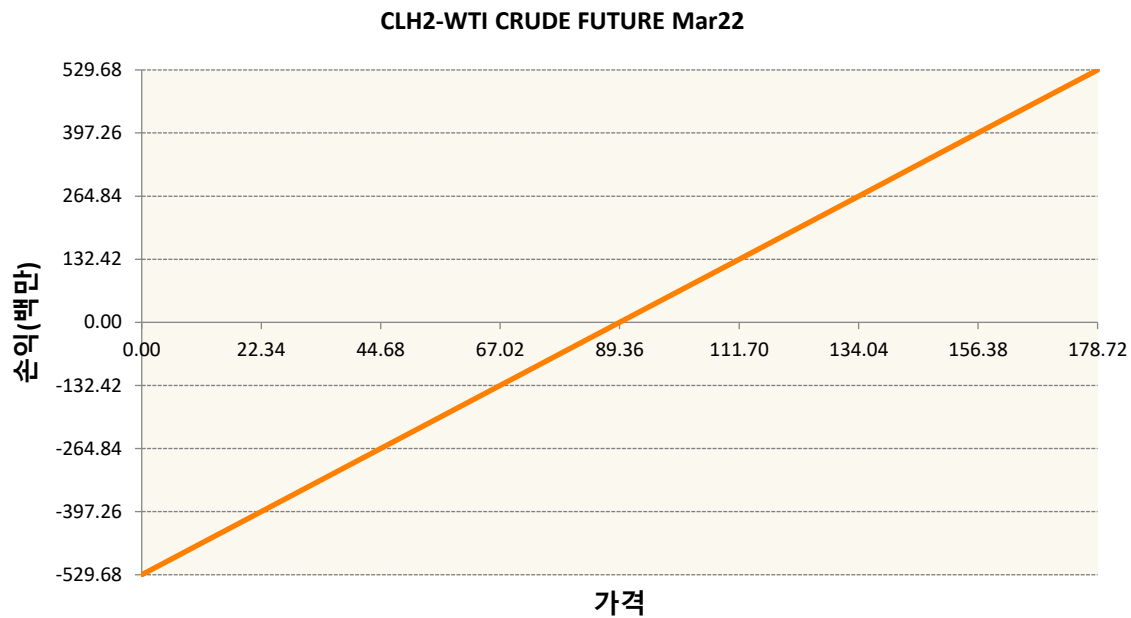
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

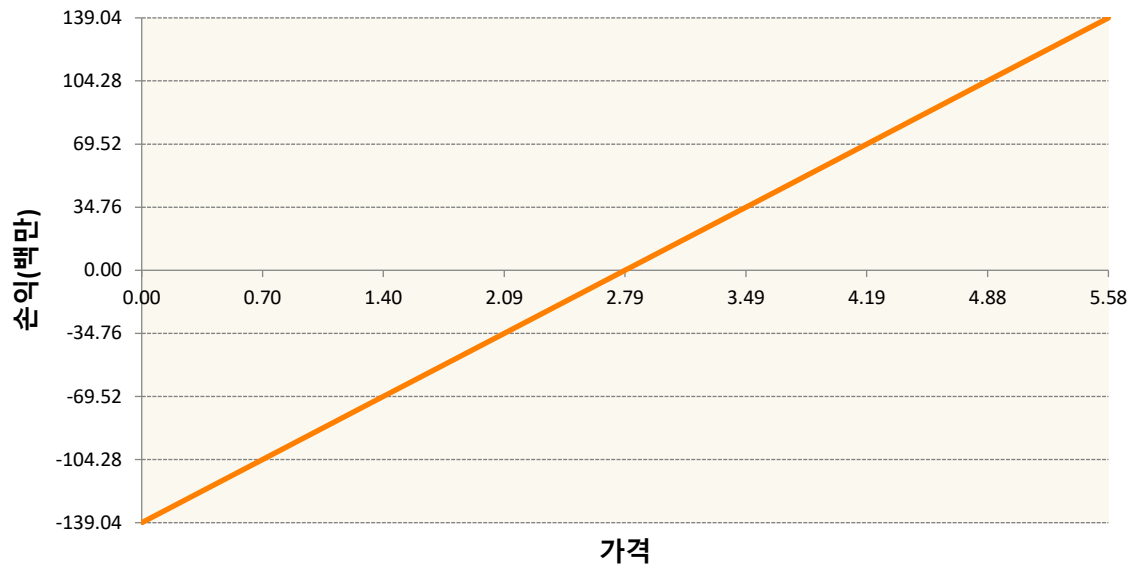
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,266	419	1,847	

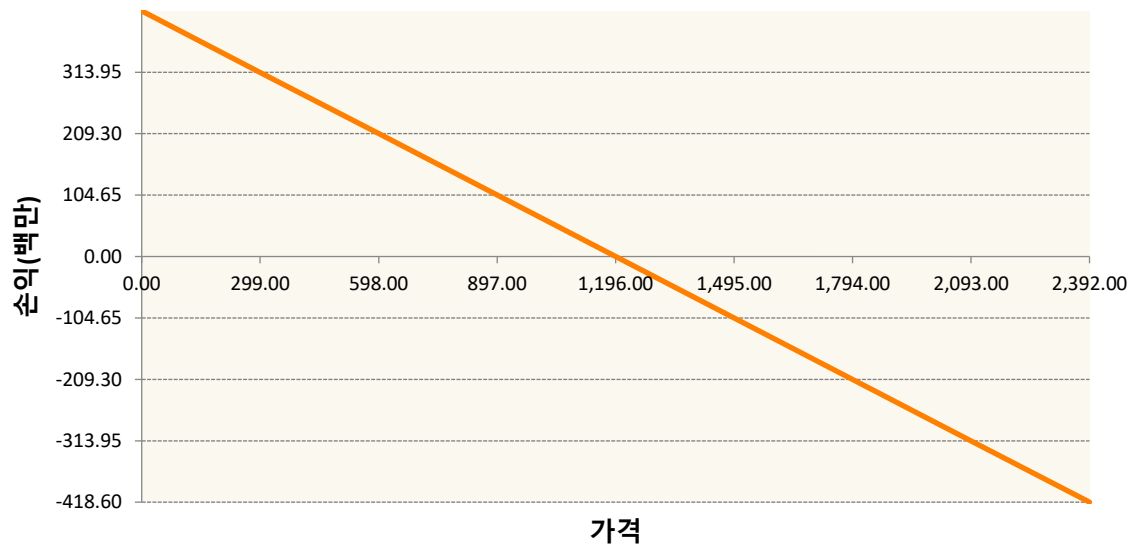
2. 만기시점의 손익구조



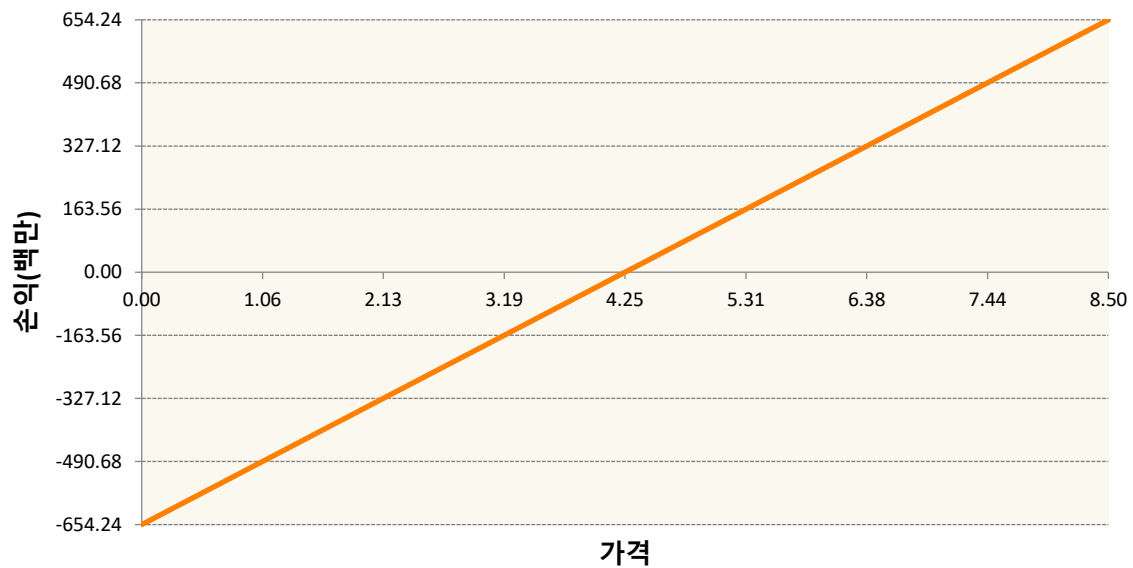
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22



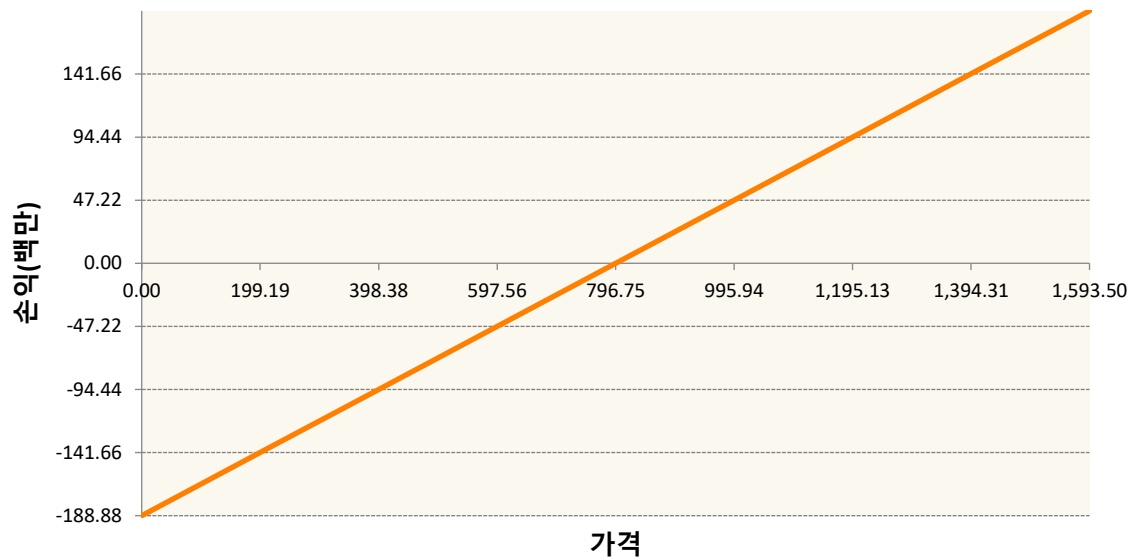
KR4175S20006-2022-02 달러선물



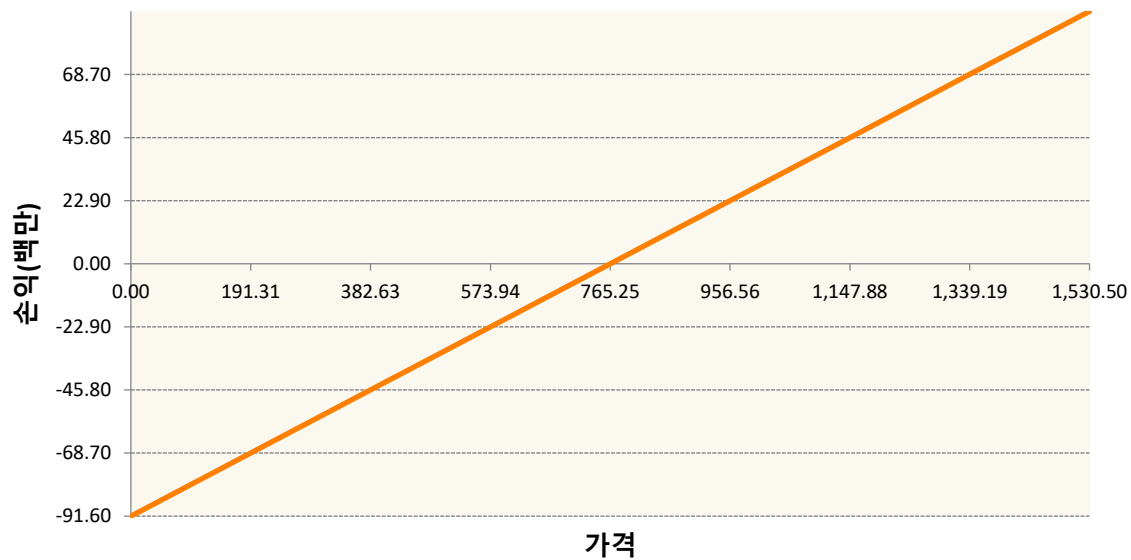
NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22



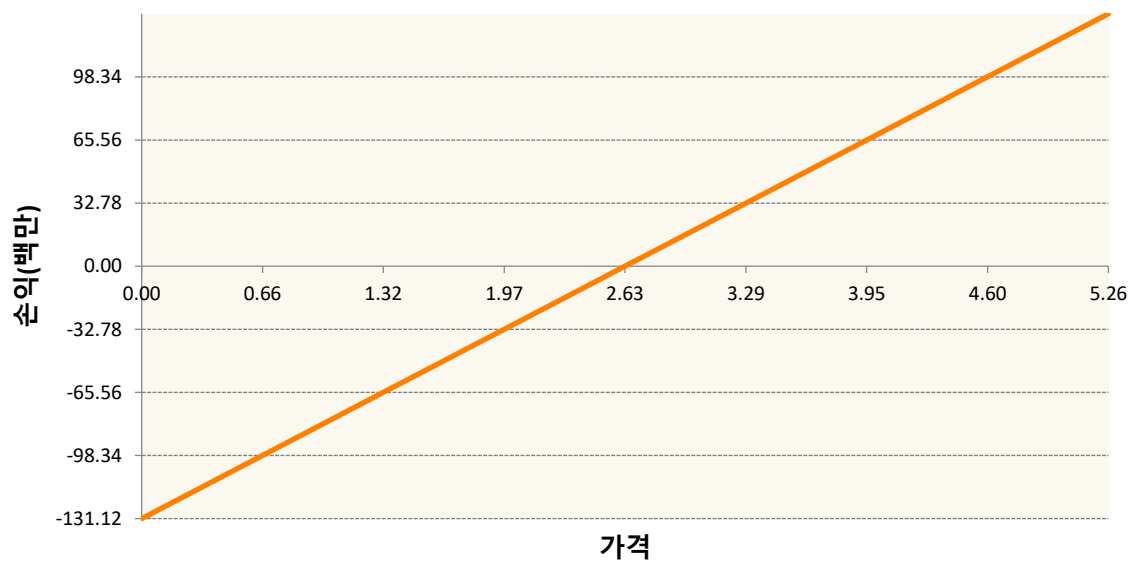
QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



QSK2-Low Su Gasoil G MAY22



XBH2-GASOLINE RBOB FUT Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22	42
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22	42
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22	11
KR4175S200	2022-02 달러선물	33
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22	52
QSH2	Low Su Gasoil G Mar22	15
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22	7
XBH2	GASOLINE RBOB FUT Mar22	10

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

449