

공시일 2022-02-11
기준일 2022-02-10

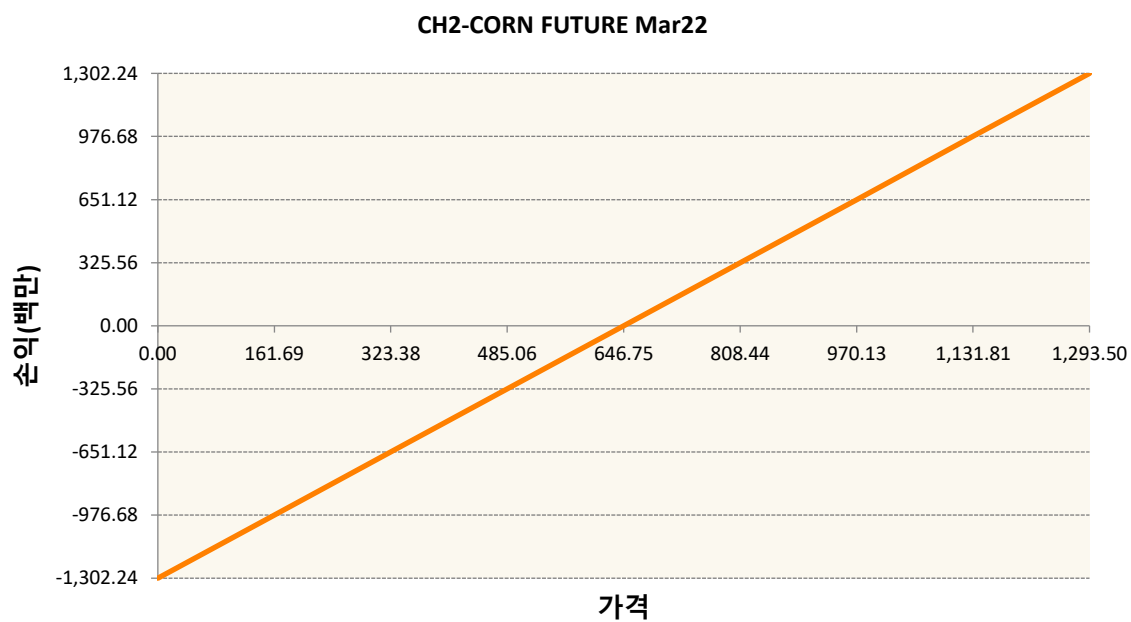
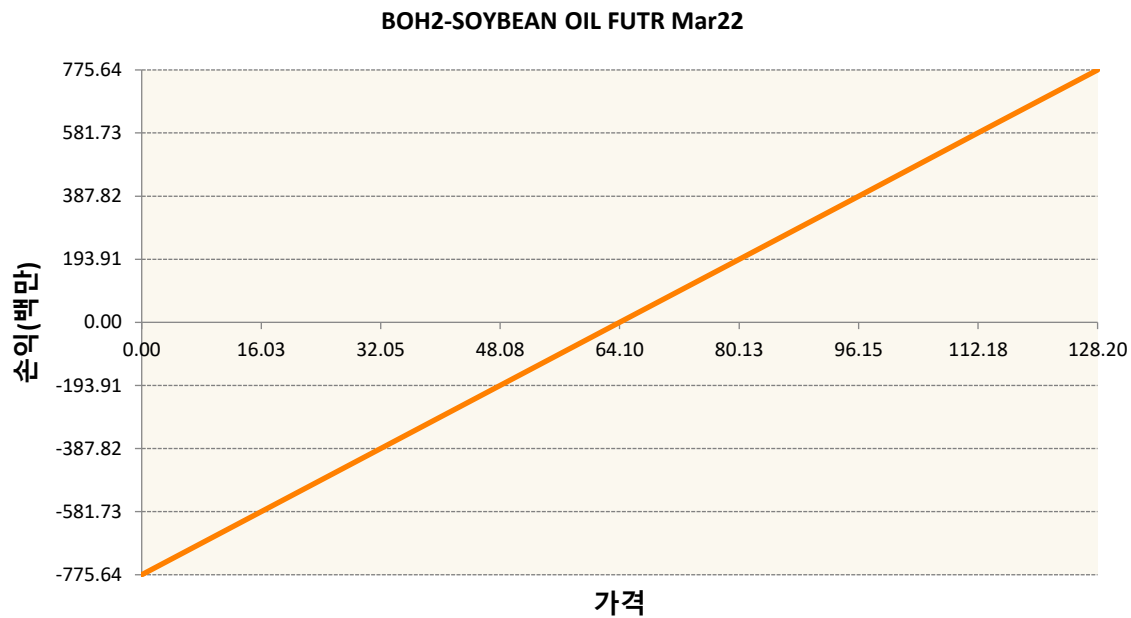
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

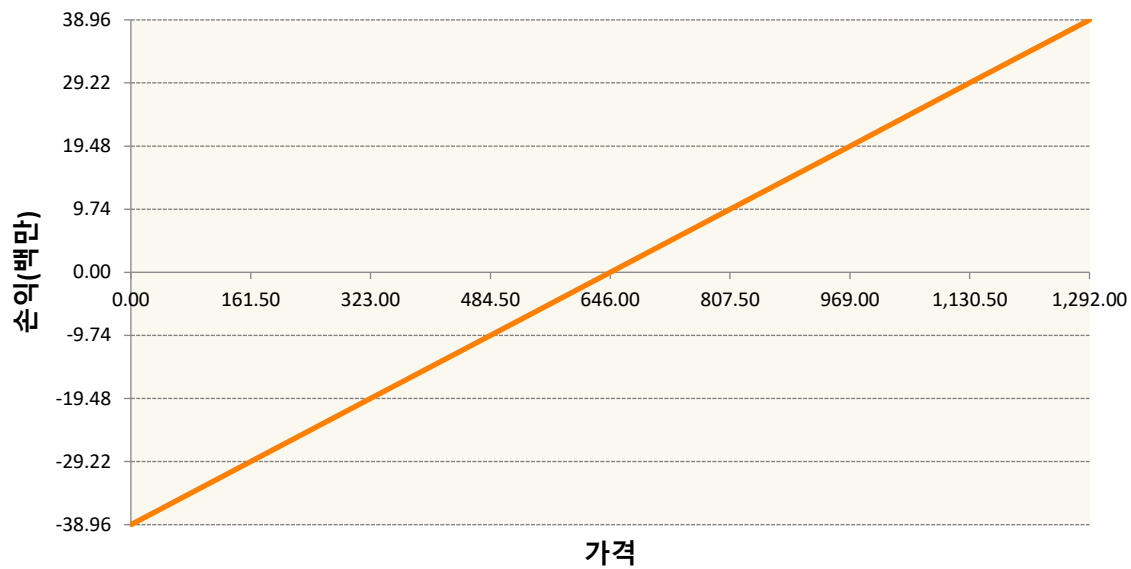
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,296	778	6,519	

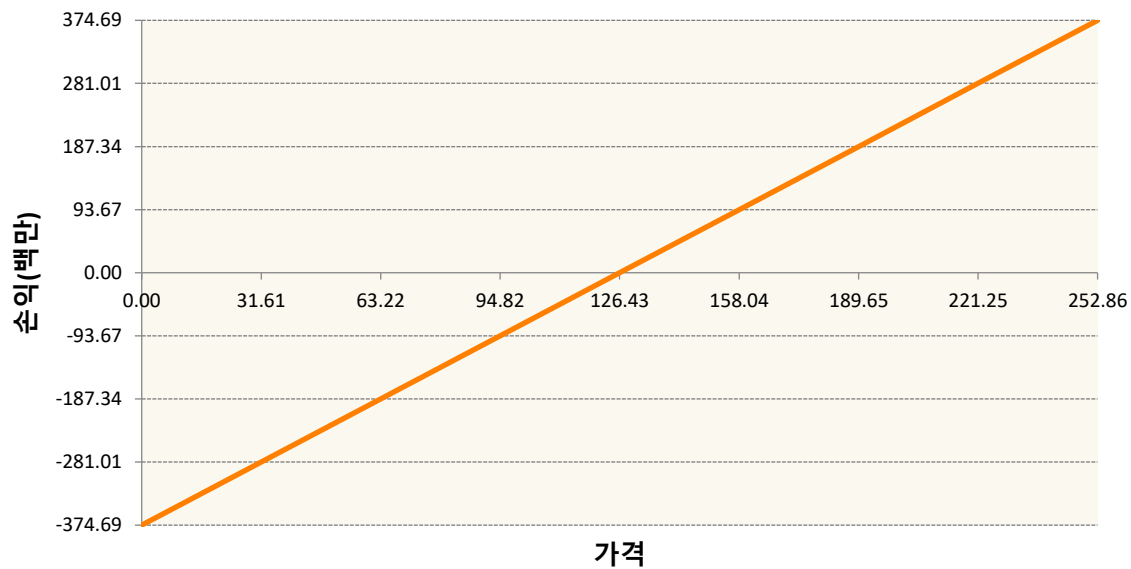
2. 만기시점의 손익구조



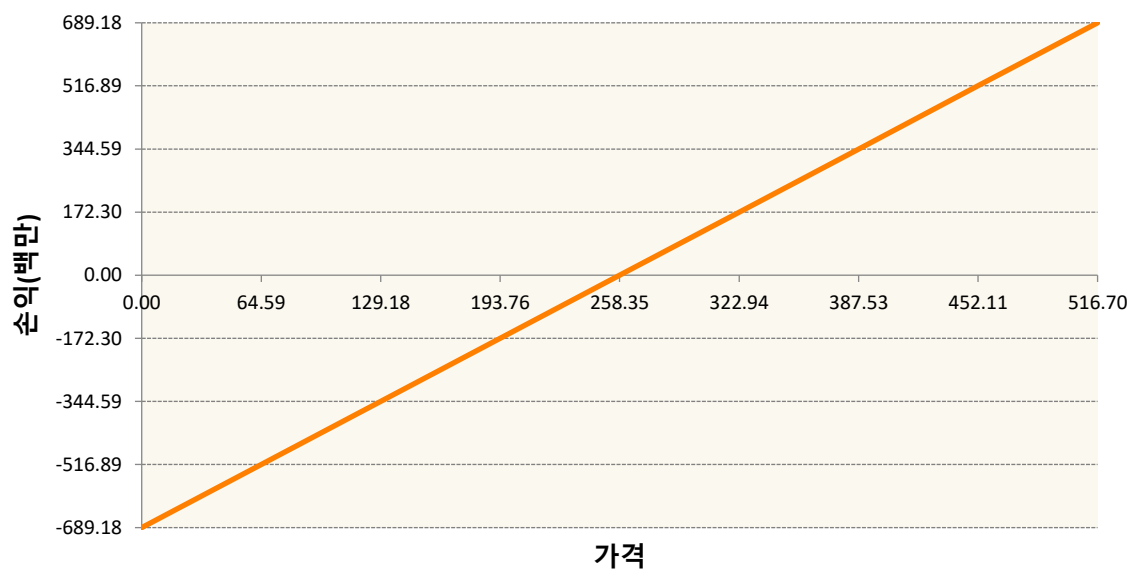
CK2-CORN FUTURE May22



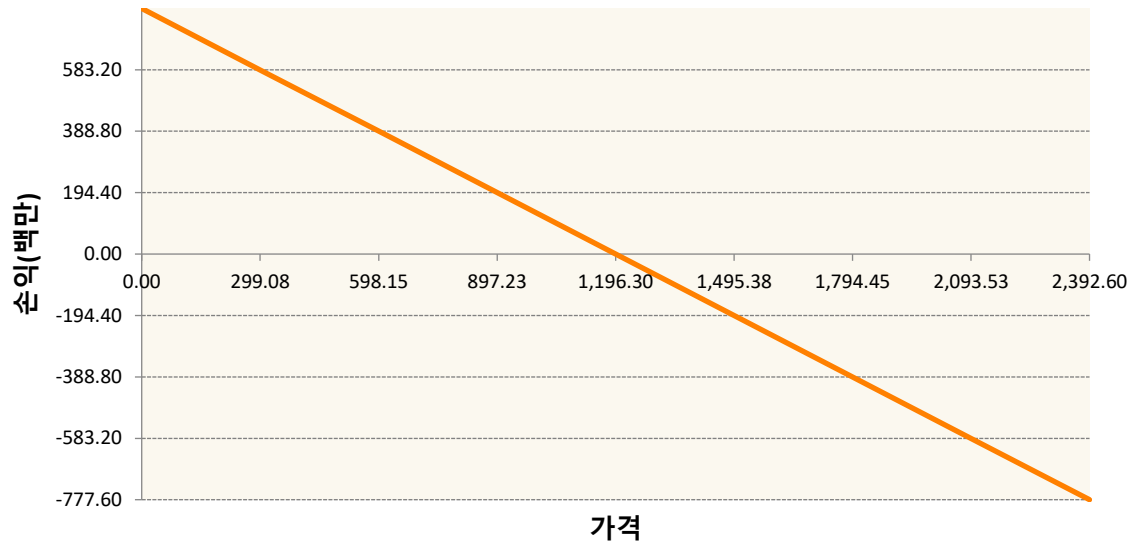
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



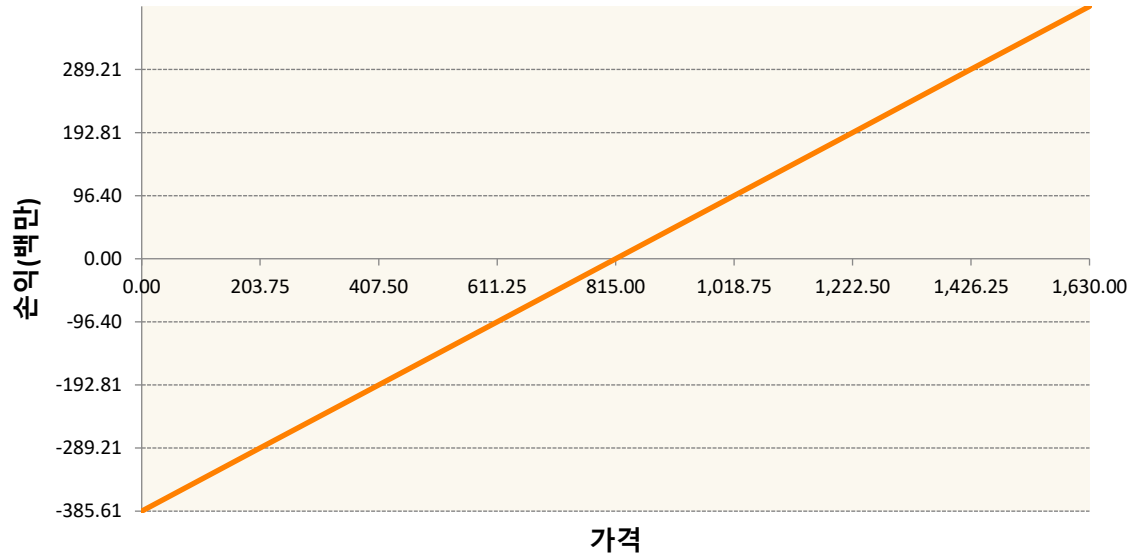
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



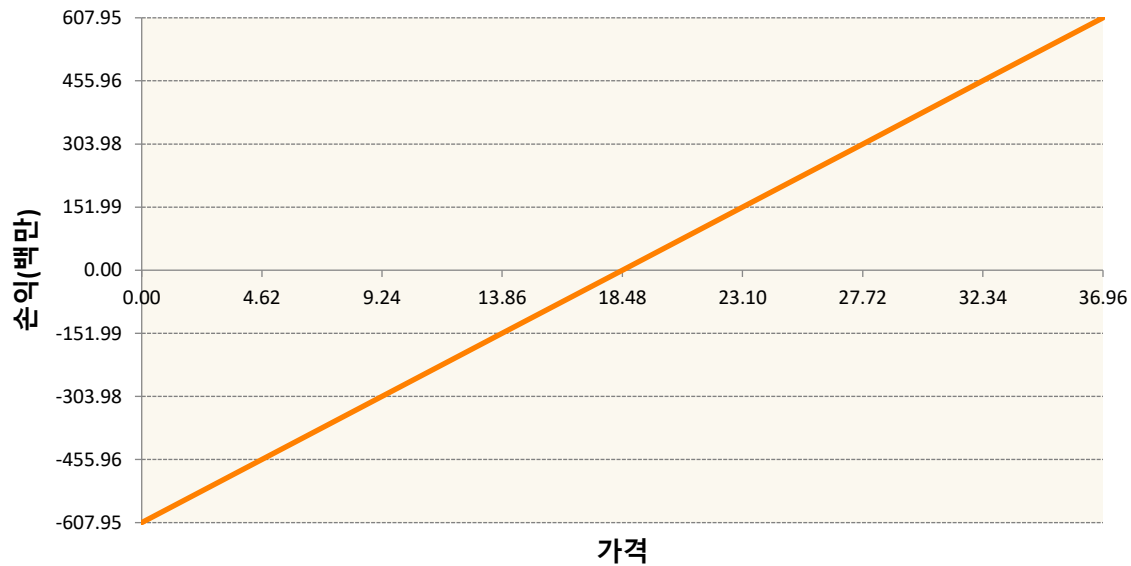
KR4175S20006-2022-02 달러선물



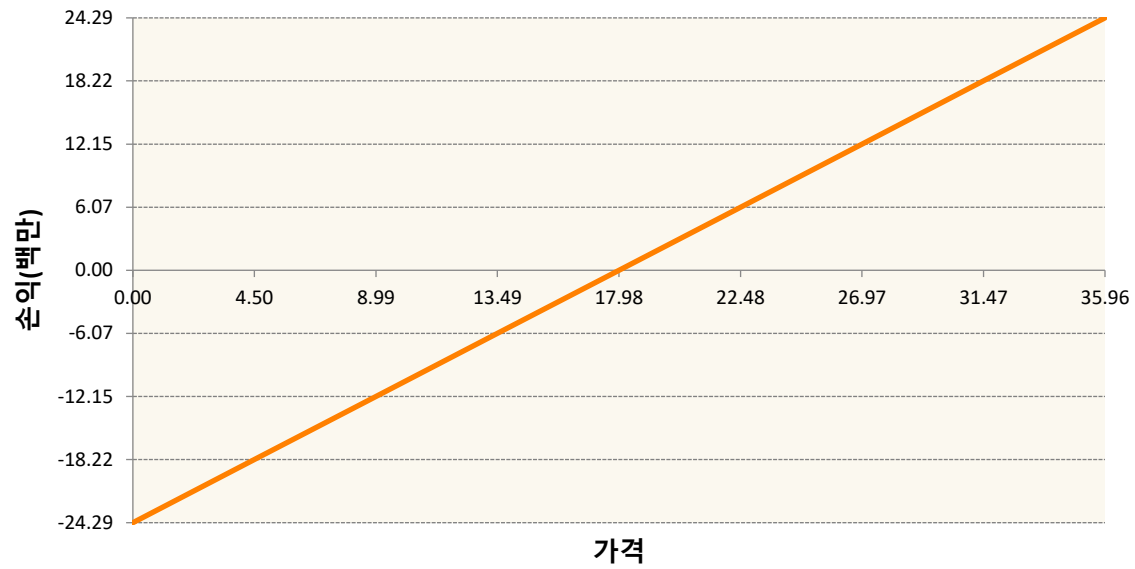
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



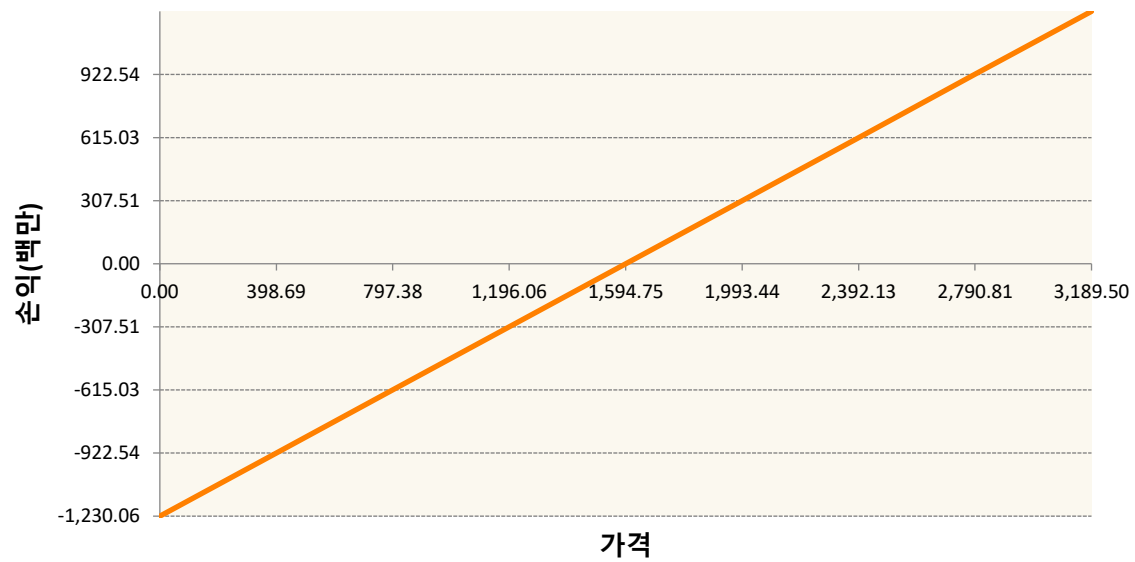
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



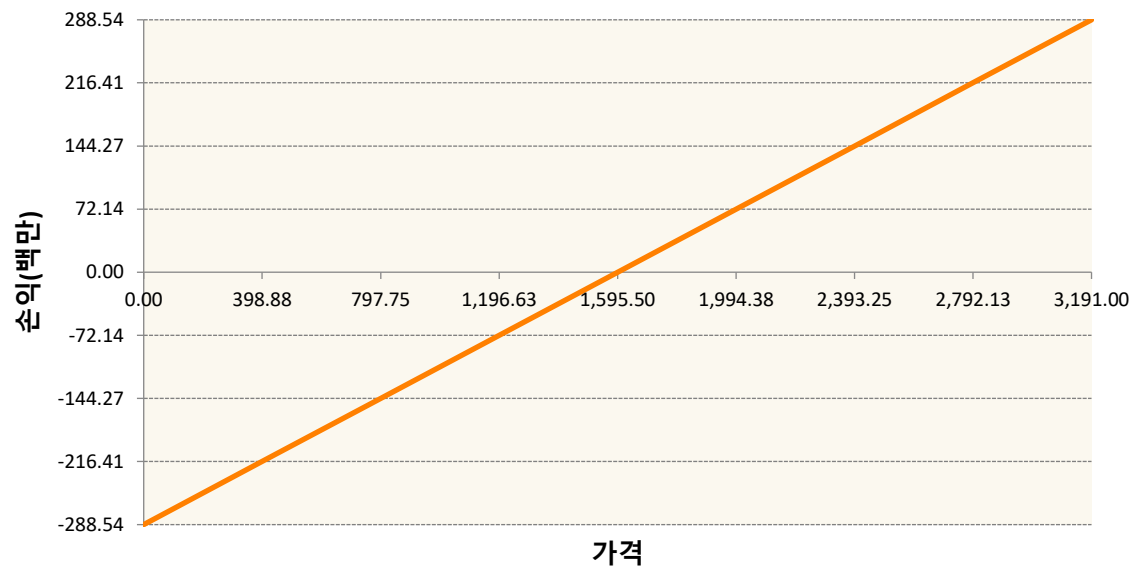
SBK2-Sugar May22



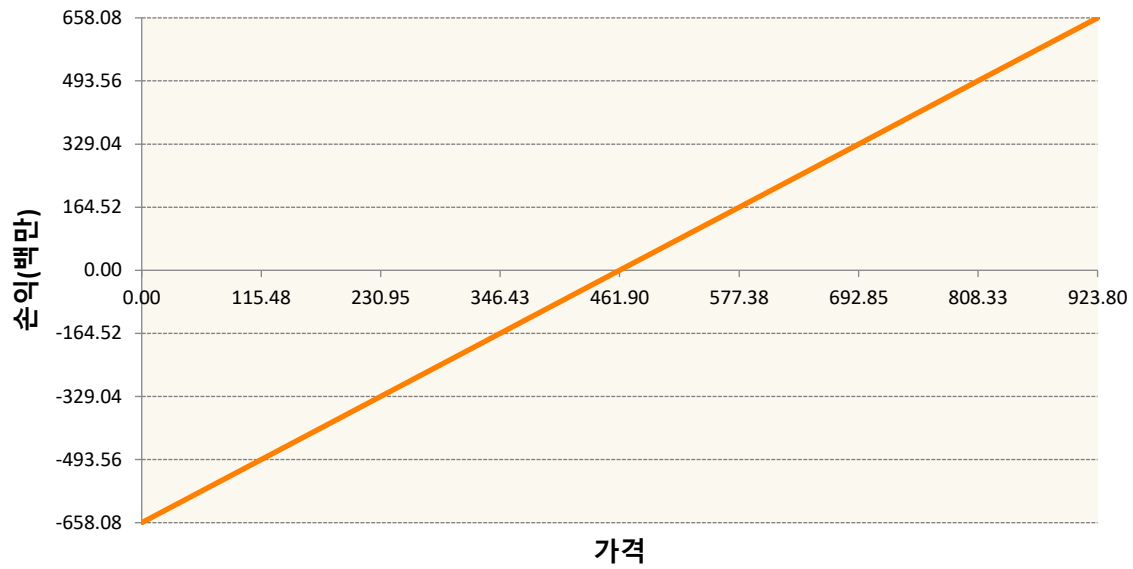
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



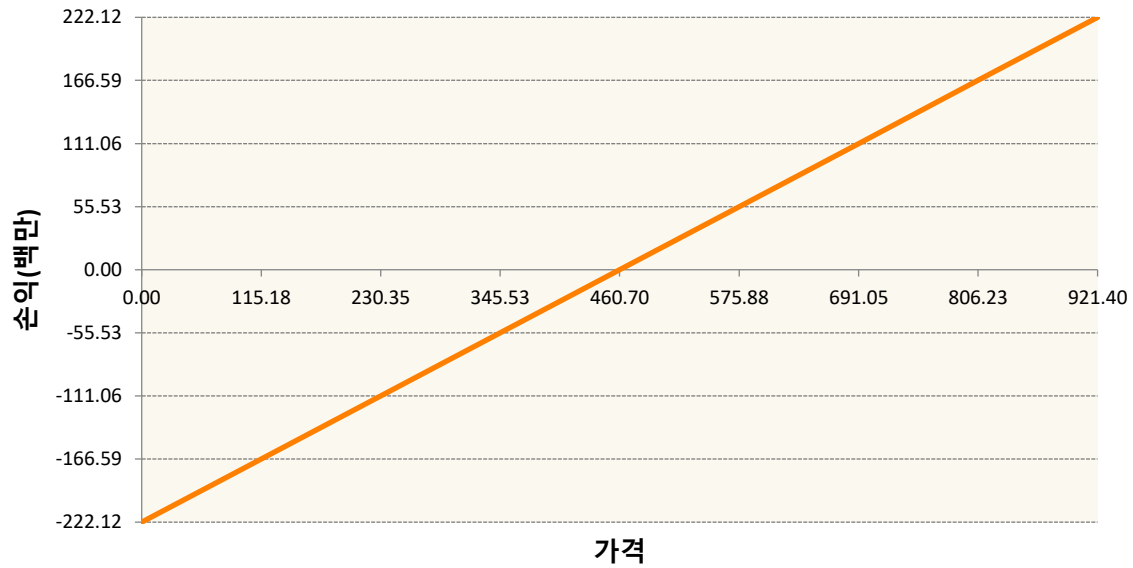
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



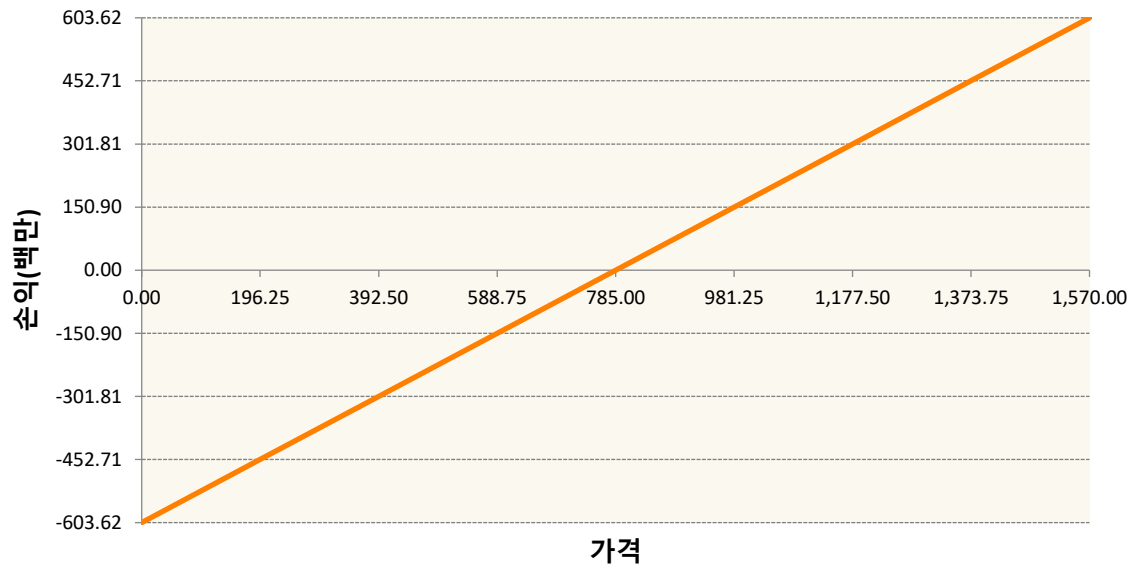
SMH2-SOYBEAN MEAL FUTR Mar22



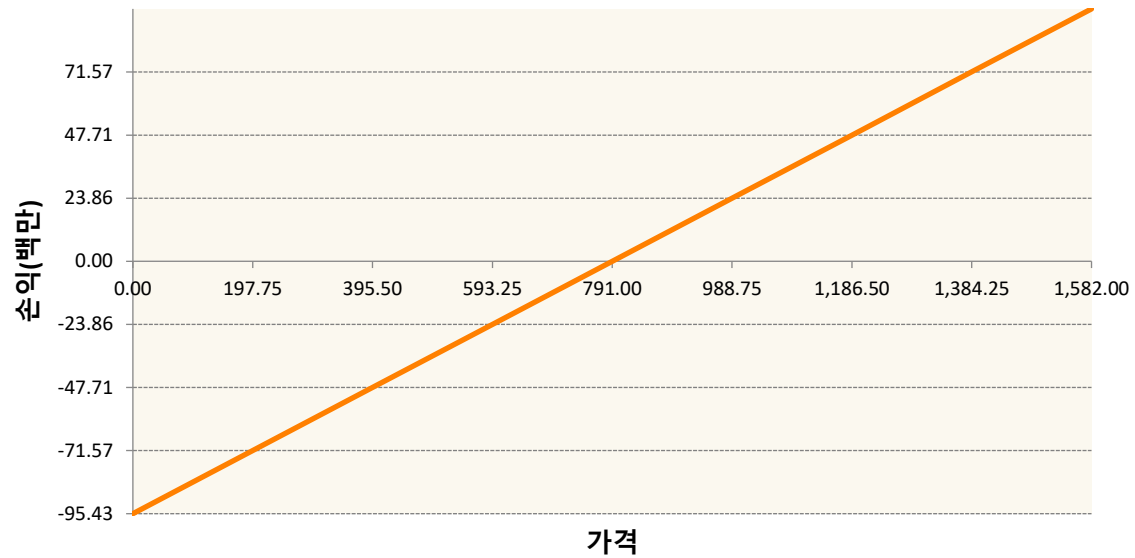
SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



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	2022-02-11
기준일	2022-02-10

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	9,567	-9,567	장외
누계	지수	스왑	1,902	0	1,902	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20211125

149

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

90

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-02-11
기준일	2022-02-10

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	412
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

391

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-02-11
기준일	2022-02-10

유로인덱스모(주식-파생형)

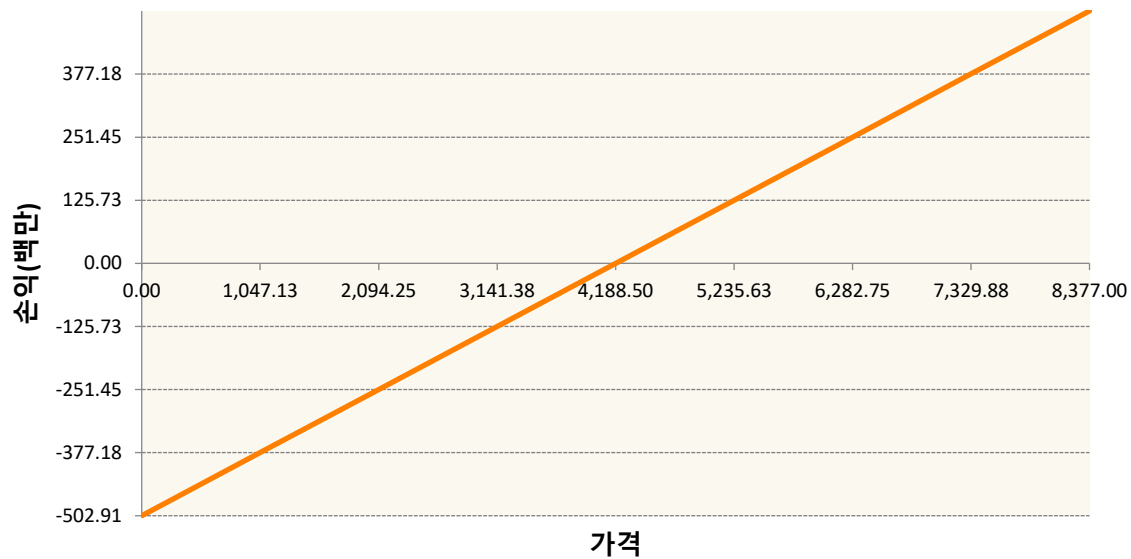
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	503	0	503	

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)

36

공시일	2022-02-11
기준일	2022-02-10

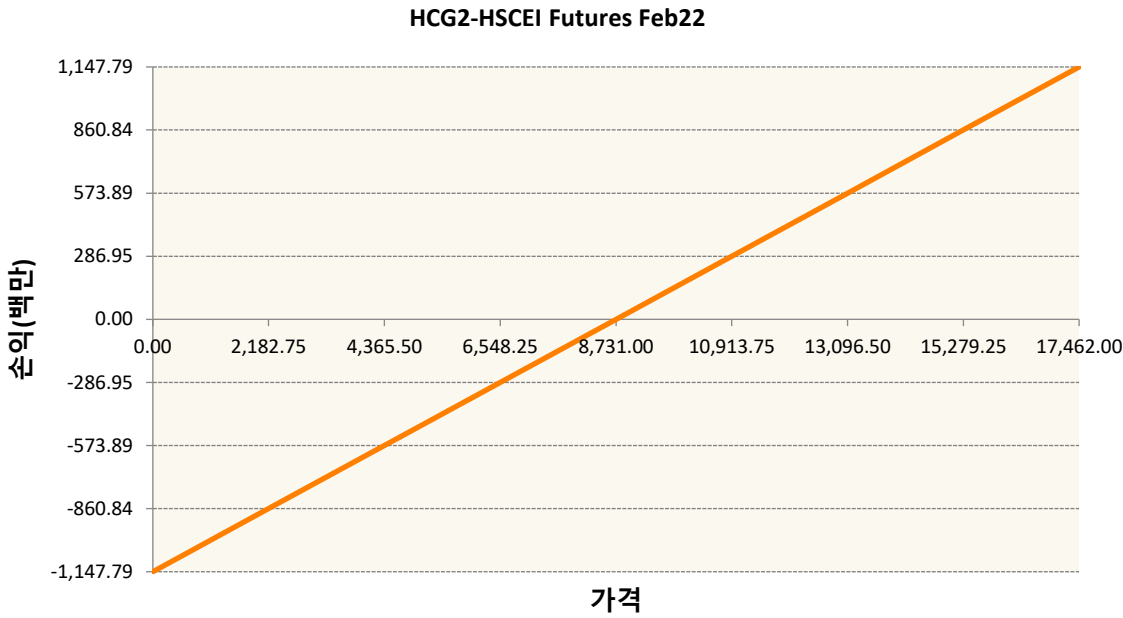
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,148	0	1,148	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG2	HSCEI Futures Feb22	92
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

98

공시일	2022-02-11
기준일	2022-02-10

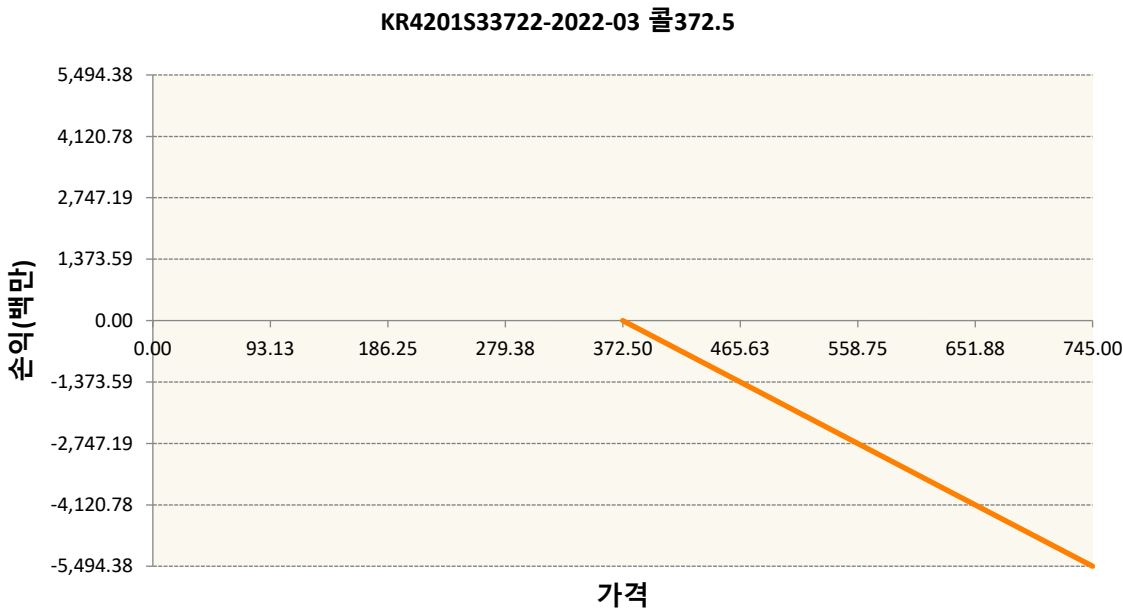
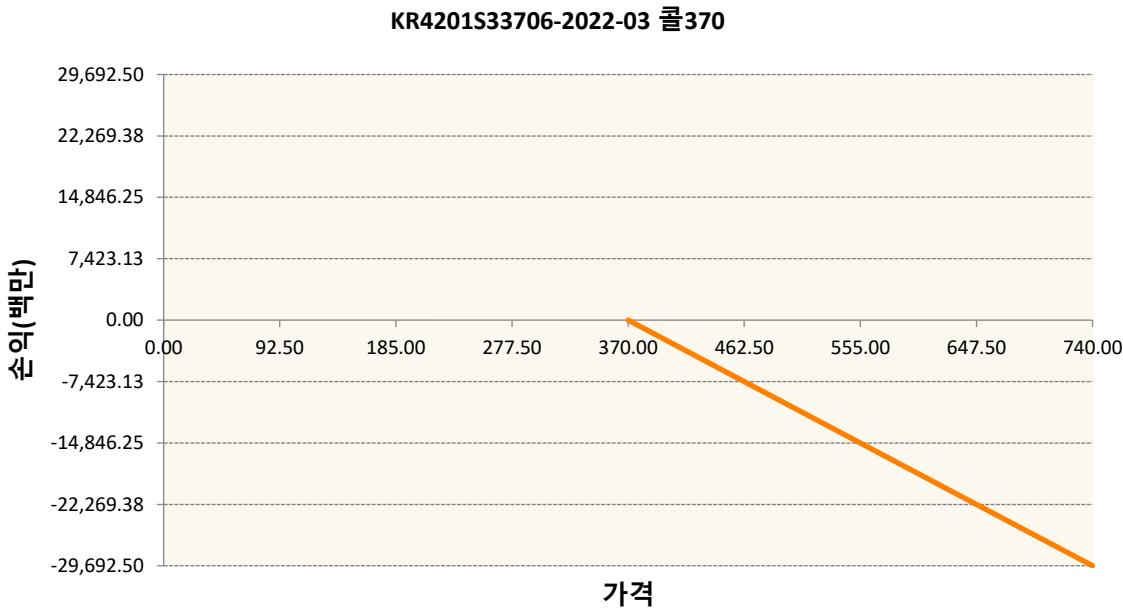
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	35,930	-35,930	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,187	-35,187	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S33706						2022-03 콜370		1,857
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	980	939	893	843	789	732	672	
-5.33%	849	787	722	654	585	514	441	
-2.67%	614	535	456	376	296	216	135	
0%	252	168	84	0	-84	-168	-252	
2.67%	-240	-317	-395	-475	-555	-636	-717	
5.33%	-844	-905	-970	-1,038	-1,108	-1,181	-1,255	
8.00%	-1,531	-1,573	-1,621	-1,674	-1,732	-1,793	-1,857	
KR4201S33722						2022-03 콜372.5		332
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	166	159	151	143	133	123	113	
-5.33%	145	135	123	112	99	87	74	
-2.67%	107	93	79	65	50	36	21	
0%	46	31	15	0	-15	-31	-46	
2.67%	-38	-53	-68	-83	-98	-113	-128	
5.33%	-144	-156	-169	-182	-196	-210	-224	
8.00%	-267	-276	-285	-296	-307	-319	-332	

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

2,021

공시일 2022-02-11

기준일 2022-02-10

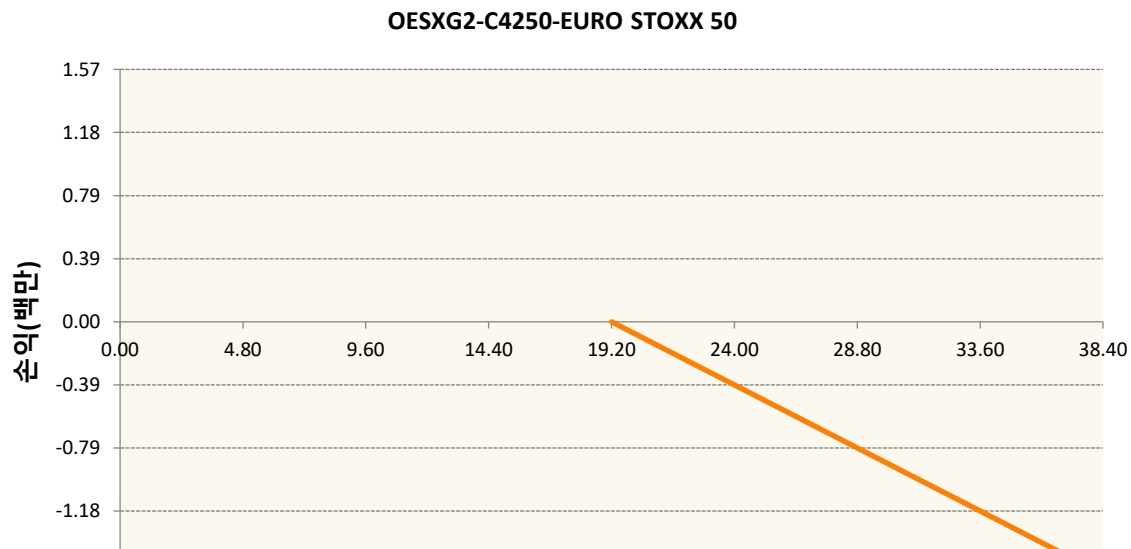
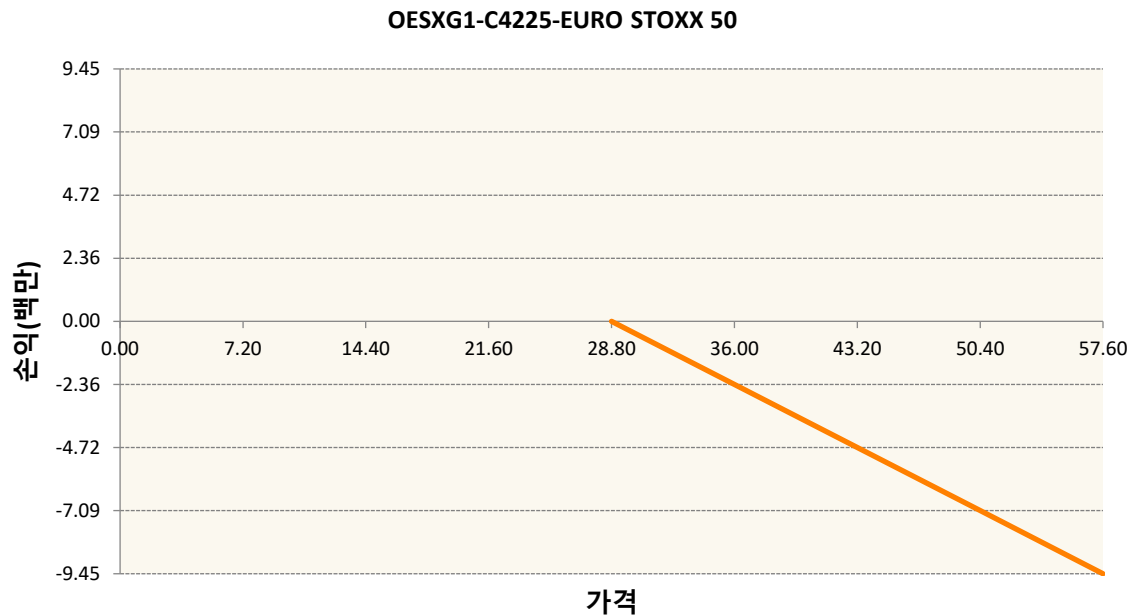
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

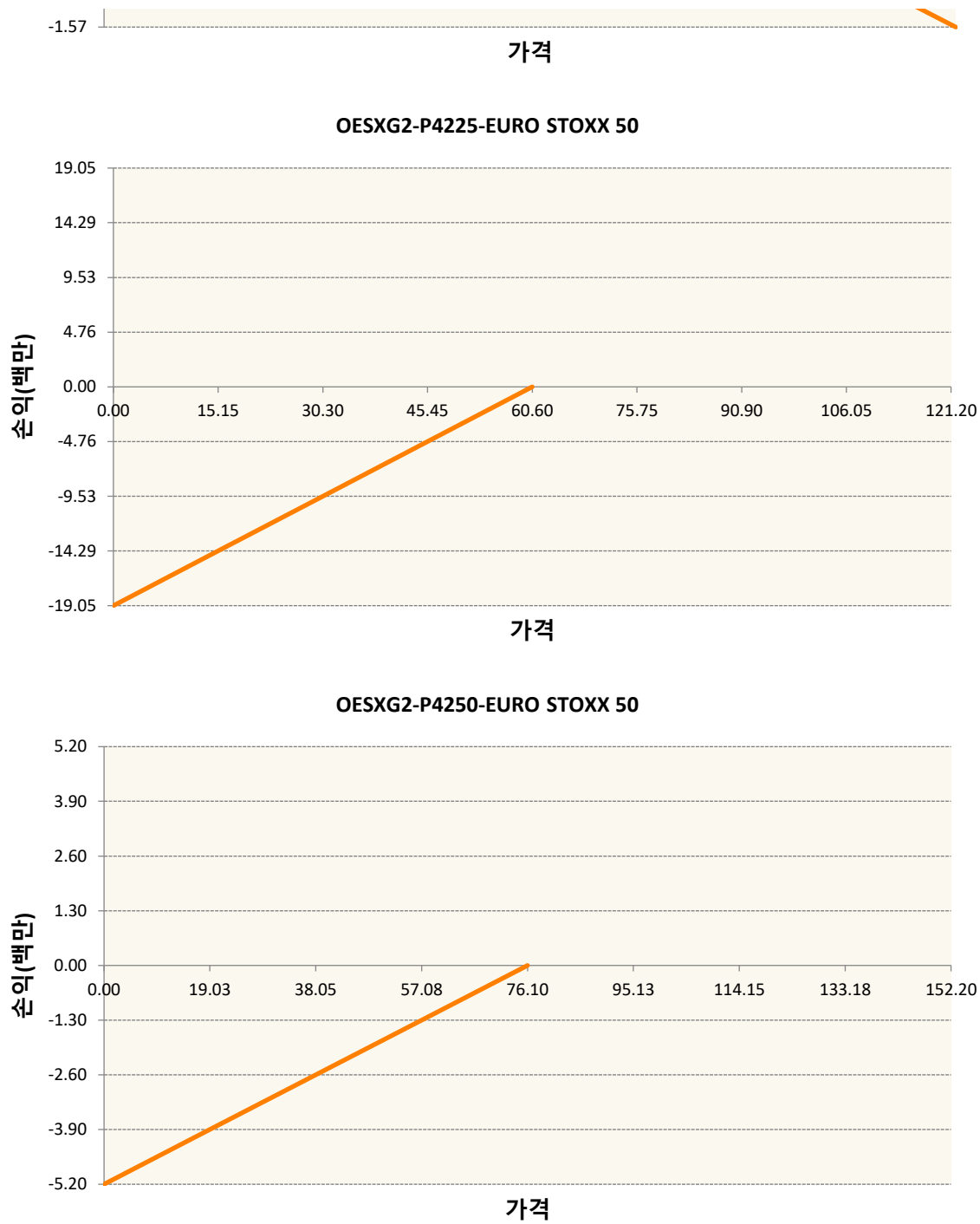
1. 계약금액

(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	35	-35	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,050	-2,050	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

8
55
109
1
0.13
2
0.42

공시일	2022-02-11
기준일	2022-02-10

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

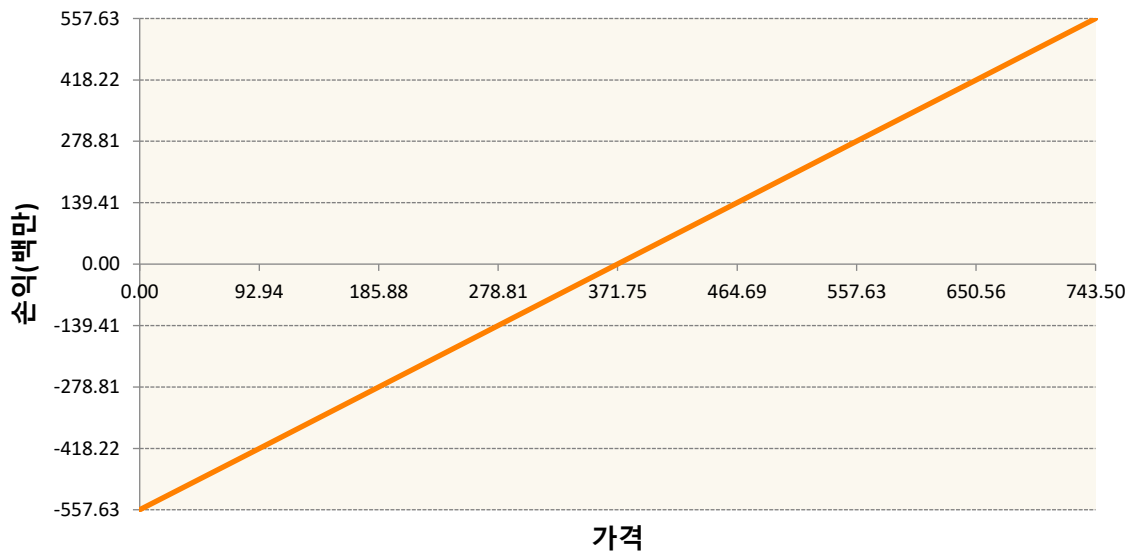
1. 계약금액

(단위:백만원)

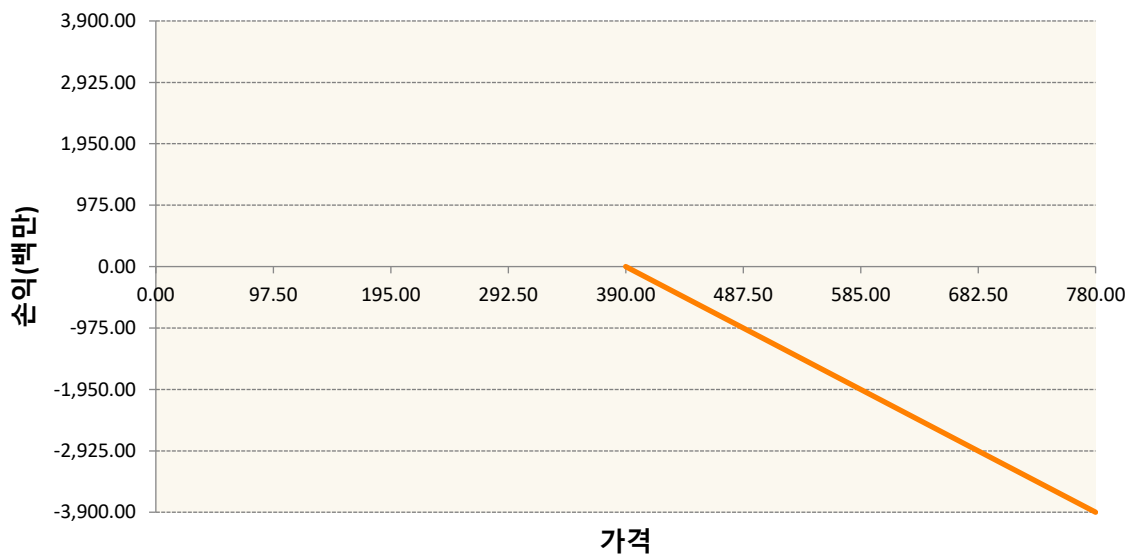
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	364	4,894	-4,529	장내
누계	유가증권	선물	558	0	558	장내
누계	유가증권	옵션	372	4,881	-4,509	장내

2. 만기시점의 손익구조

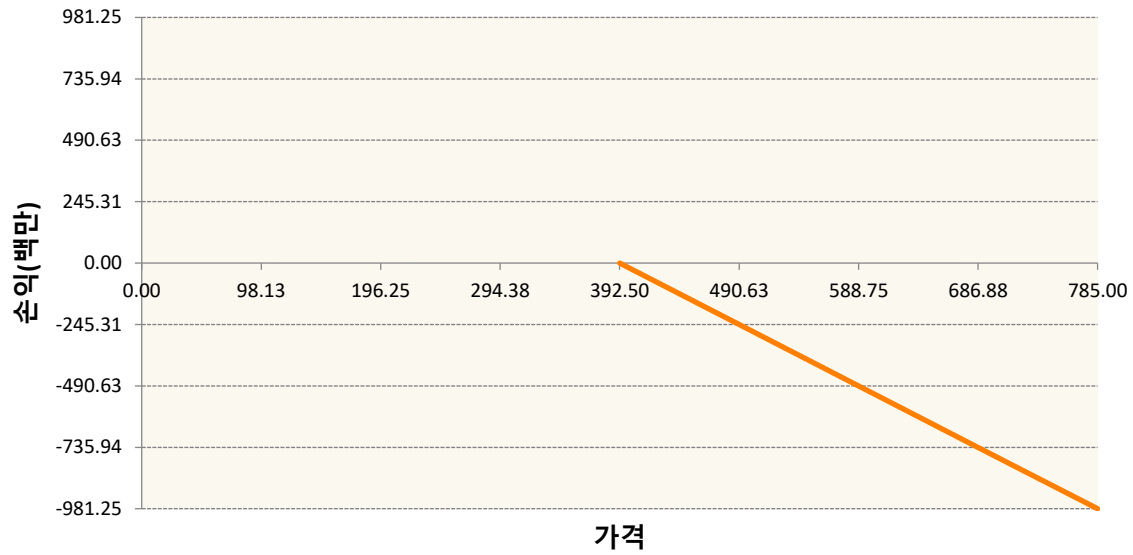
KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



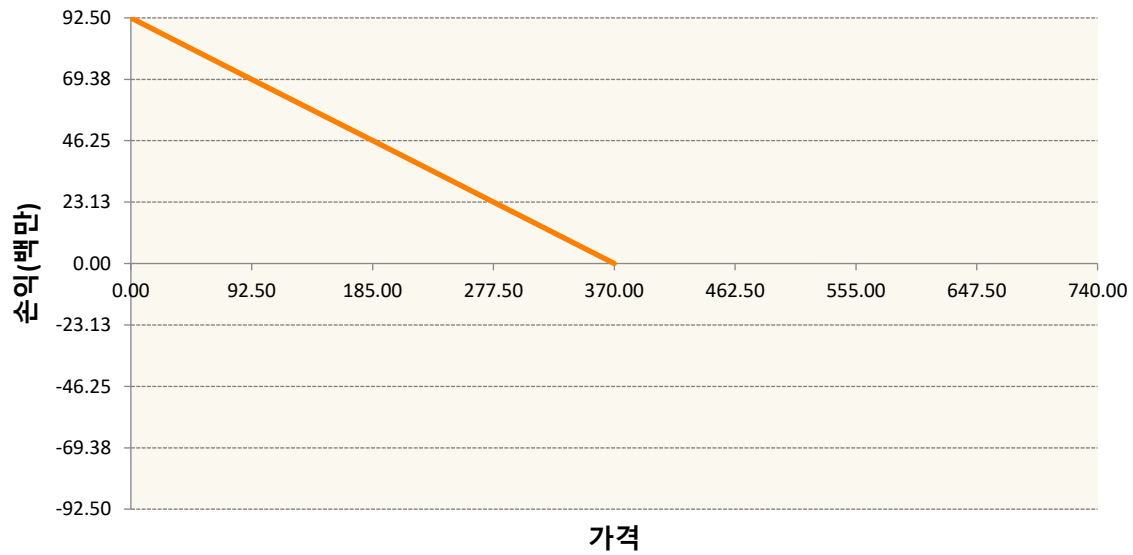
KR4201S33904-2022-03 콜390



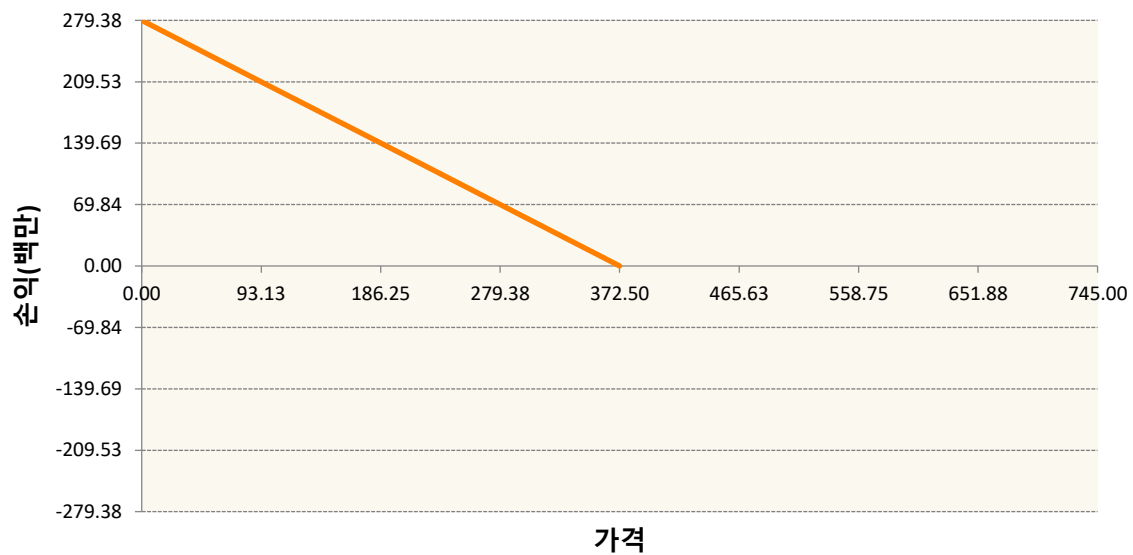
KR4201S33920-2022-03 콜392.5



KR4301S33704-2022-03 풋370



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



(단위:백만원)

KR4101S30001				2022-03 코스피200지수선물				45
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-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%	45	45	45	45	45	45	45	45
KR4201S33904				2022-03 콜390				173
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	56	54	52	49	46	42	37	
-5.33%	52	49	45	40	35	29	23	
-2.67%	43	38	31	25	17	9	1	
0%	26	18	9	0	-9	-19	-28	
2.67%	-4	-14	-25	-35	-46	-56	-67	
5.33%	-49	-60	-71	-82	-93	-104	-115	
8.00%	-110	-120	-130	-141	-151	-162	-173	
KR4201S33920				2022-03 콜392.5				41
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	12	12	12	11	10	9	8	
-5.33%	12	11	10	9	8	6	5	
-2.67%	10	9	7	6	4	2	0	
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7	
2.67%	-1	-3	-6	-8	-11	-13	-16	
5.33%	-11	-14	-16	-19	-22	-25	-27	
8.00%	-25	-28	-30	-33	-36	-38	-41	
KR4301S33704				2022-03 풋370				6
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5	5	5	5	5	6	6	
-5.33%	3	3	3	3	3	3	4	
-2.67%	1	1	1	1	2	2	2	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	0	
5.33%	-2	-2	-1	-1	-1	-1	-1	
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1	
KR4301S33720				2022-03 풋372.5				18
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	18
-5.33%	10	10	10	10	11	11	11
-2.67%	3	4	4	5	5	5	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-3	-3	-3	-2	-2
5.33%	-6	-5	-5	-5	-4	-4	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

226

공시일	2022-02-11
기준일	2022-02-10

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	10,372	0	10,372	

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	2022-02-11
기준일	2022-02-10

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	8,792	0	8,792	

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	2022-02-11
기준일	2022-02-10

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	440	-440	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	29,222	0	29,222	
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	2022-02-11
기준일	2022-02-10

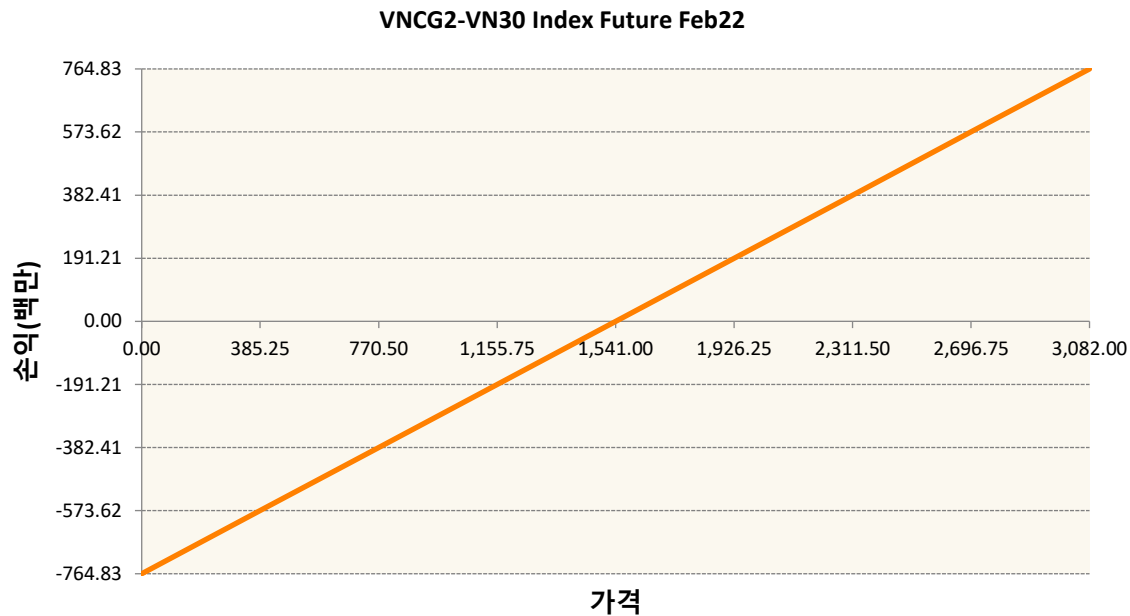
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	765	0	765	
누계	유가증권	스왑	1,869	0	1,869	장외
누계	통화	선도	0	1,340	-1,340	장외

2. 만기시점의 손익구조



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 2022-02-11
기준일 2022-02-10

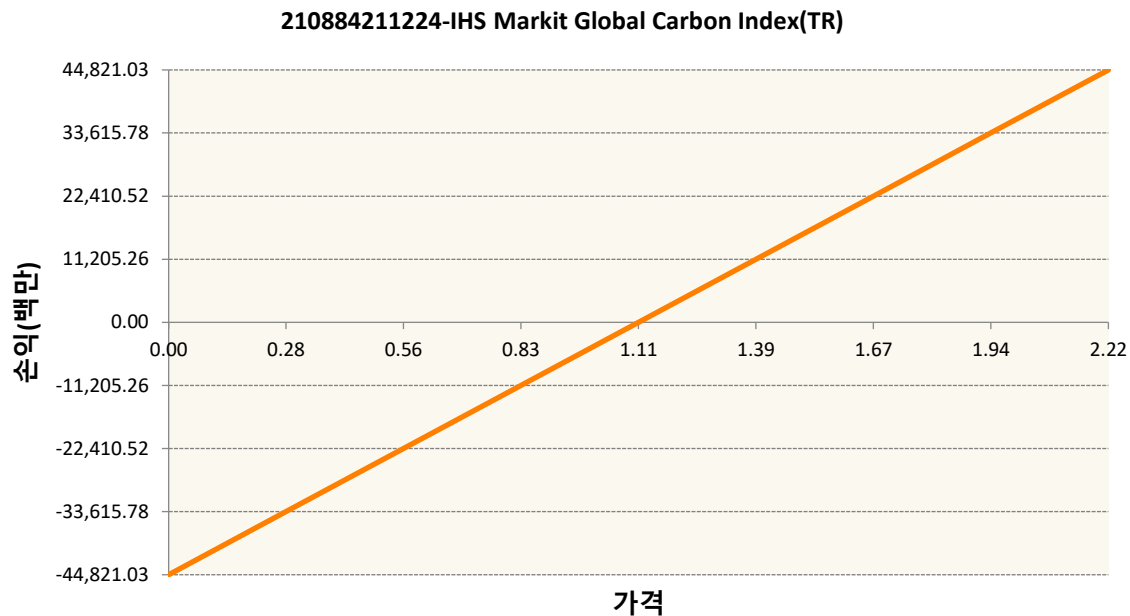
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	44,821	0	44,821	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,572

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

(단위:백만원)

5,771

공시일	2022-02-11
기준일	2022-02-10

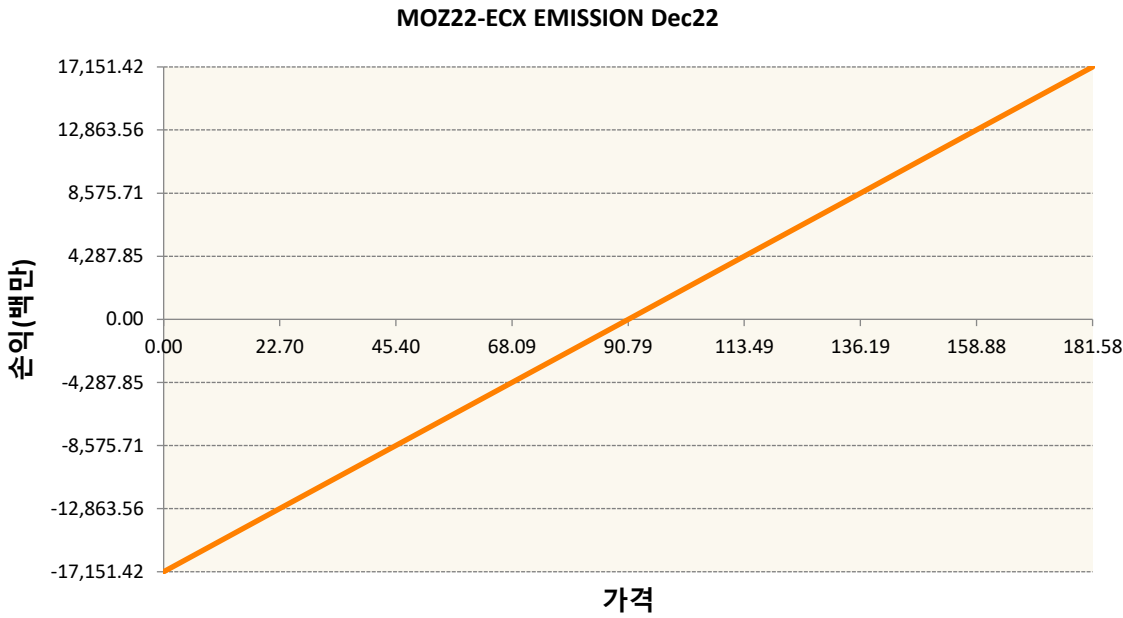
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	17,151	0	17,151	
누계	통화	선도	0	8,826	-8,826	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1V·KRW/EUR 25-02-22E	706
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,372

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

(단위:백만원)

3,241

공시일	2022-02-11
기준일	2022-02-10

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)	31
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	31
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	31
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	31

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

(단위:백만원)

237

공시일	2022-02-11
기준일	2022-02-10

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)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	12

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

(단위:백만원)

64

공시일 2022-02-11
기준일 2022-02-10

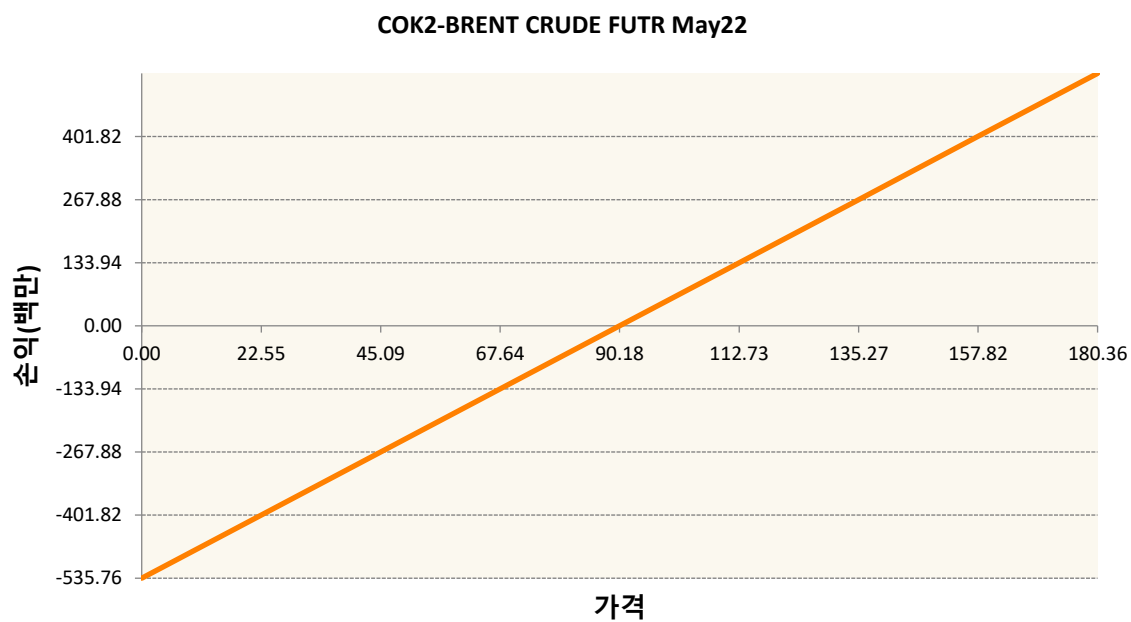
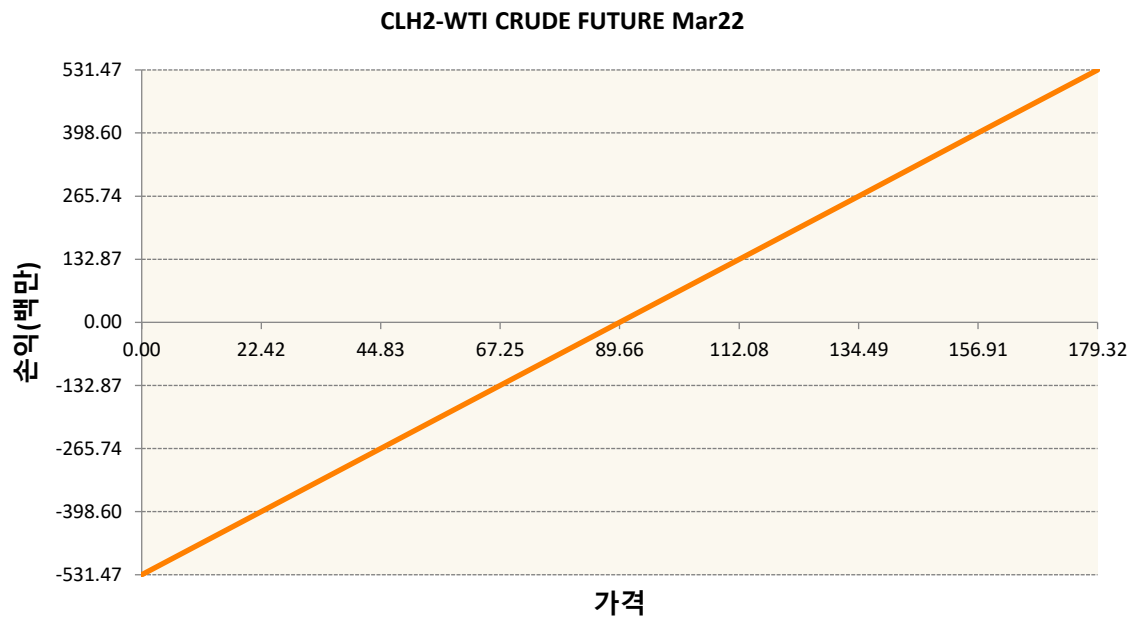
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

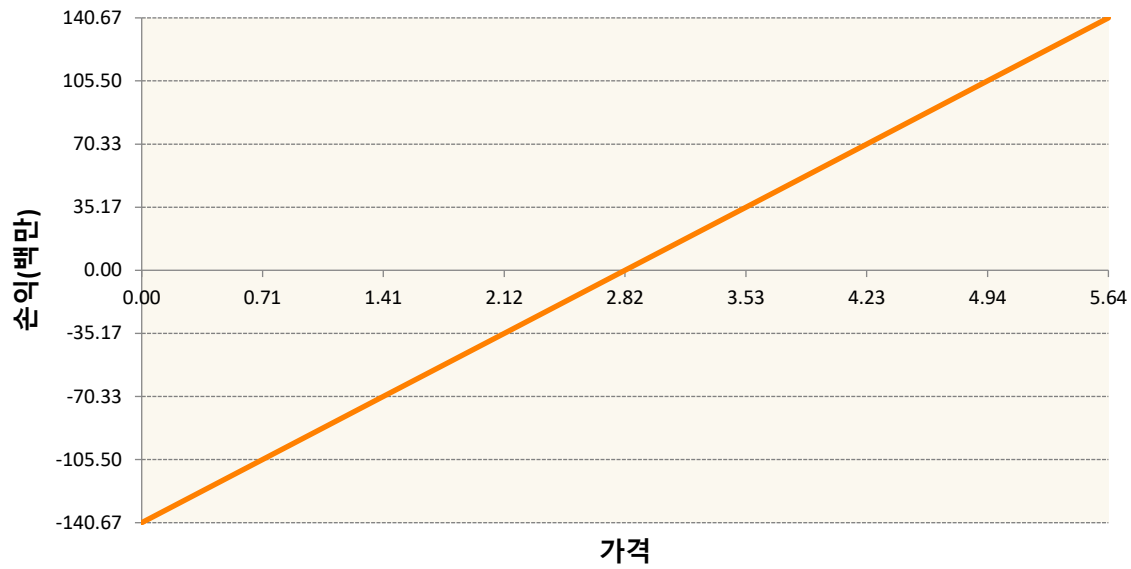
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,243	419	1,824	

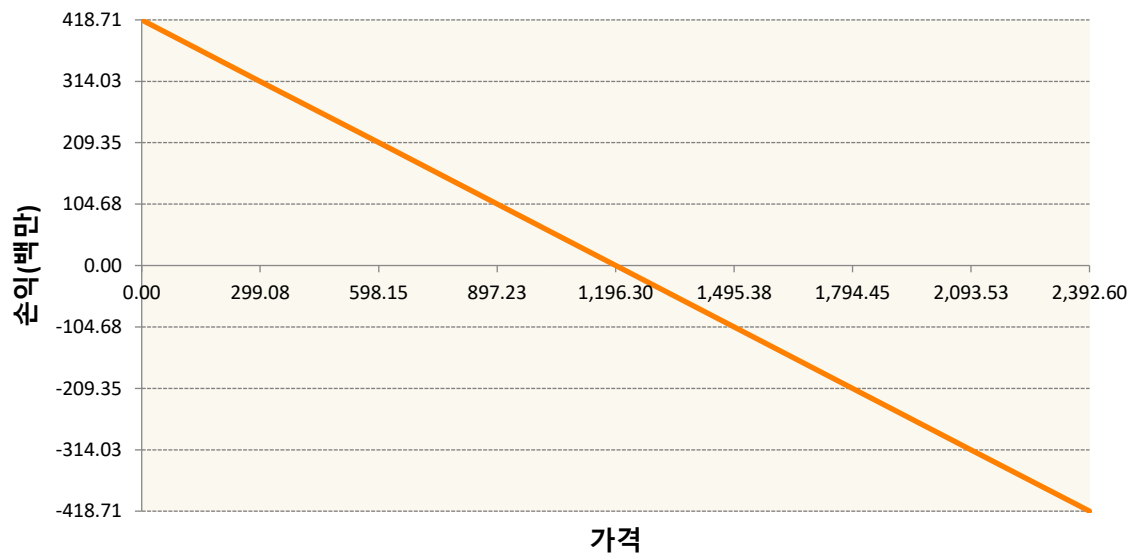
2. 만기시점의 손익구조



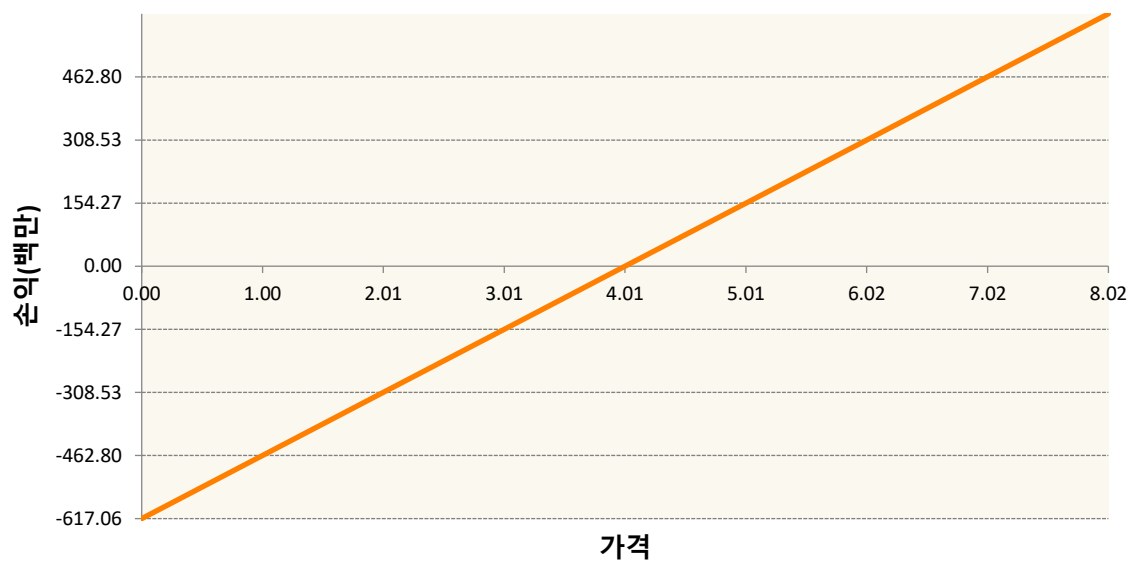
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22



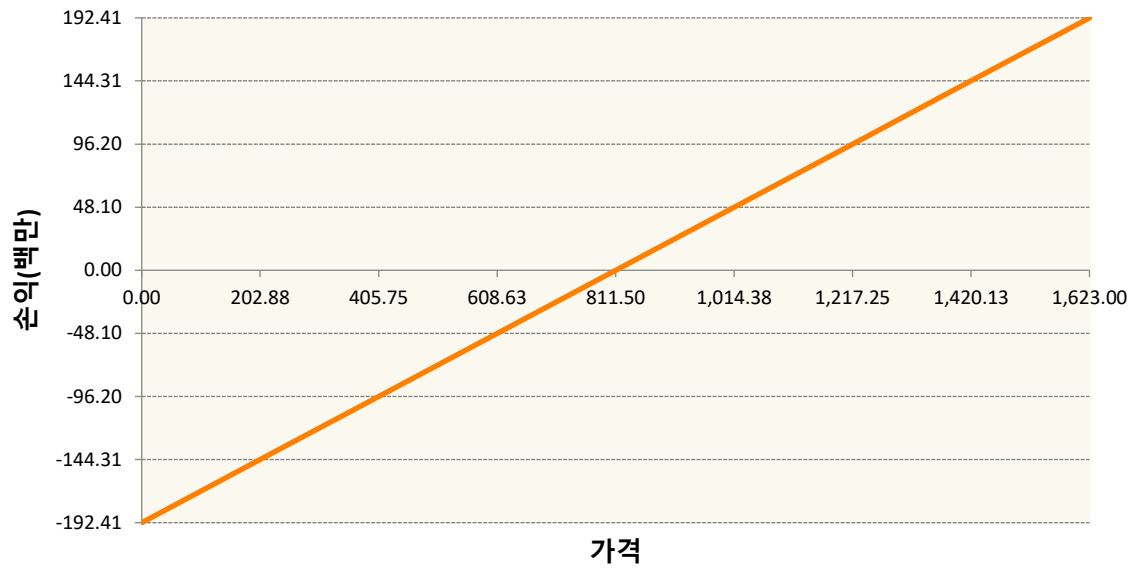
KR4175S20006-2022-02 달러선물



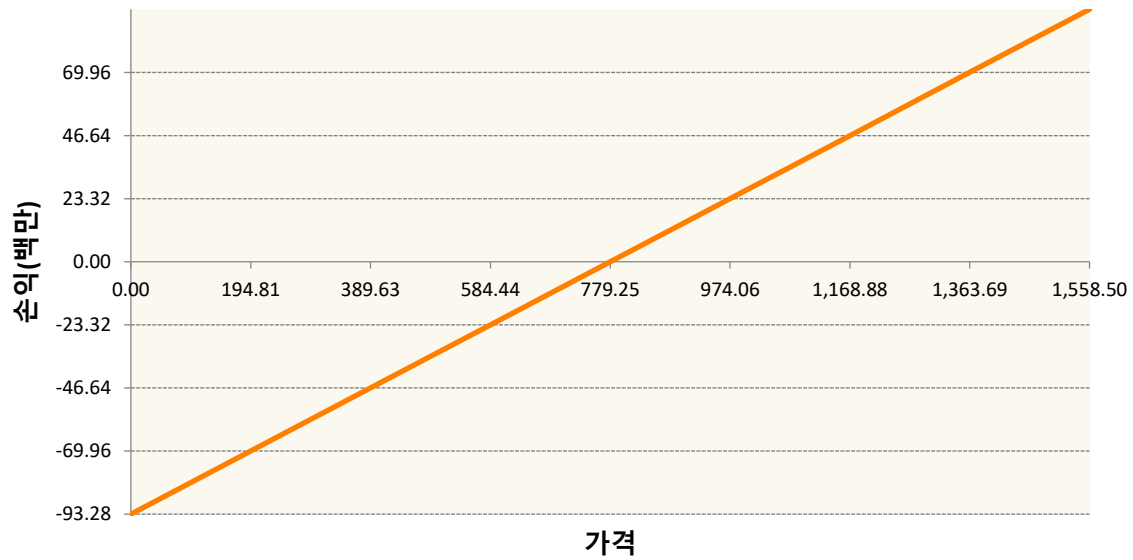
NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22



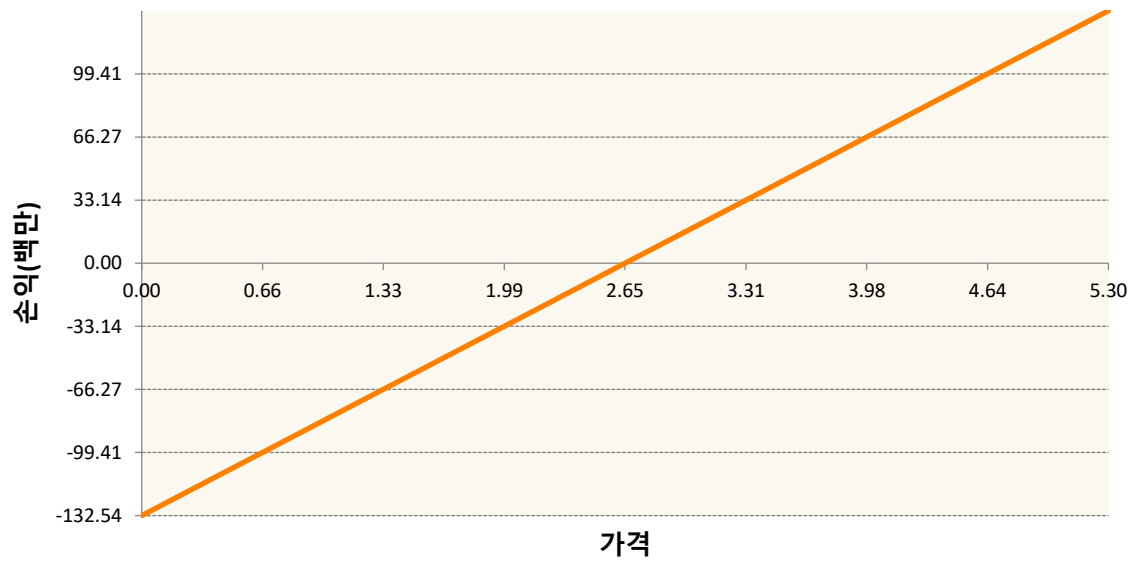
QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



QSK2-Low Su Gasoil G MAY22



XBH2-GASOLINE RBOB FUT Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH2	WTI CRUDE FUTURE Mar22	43
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22	43
HOH2	NY Harb ULSD Fut Mar22	11
KR4175S200	2022-02 달러선물	33
NGH22	NATURAL GAS FUTR Mar22	49
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)

440