

공시일 2022-02-16

기준일 2022-02-15

포커스농산물모(채권-파생형)

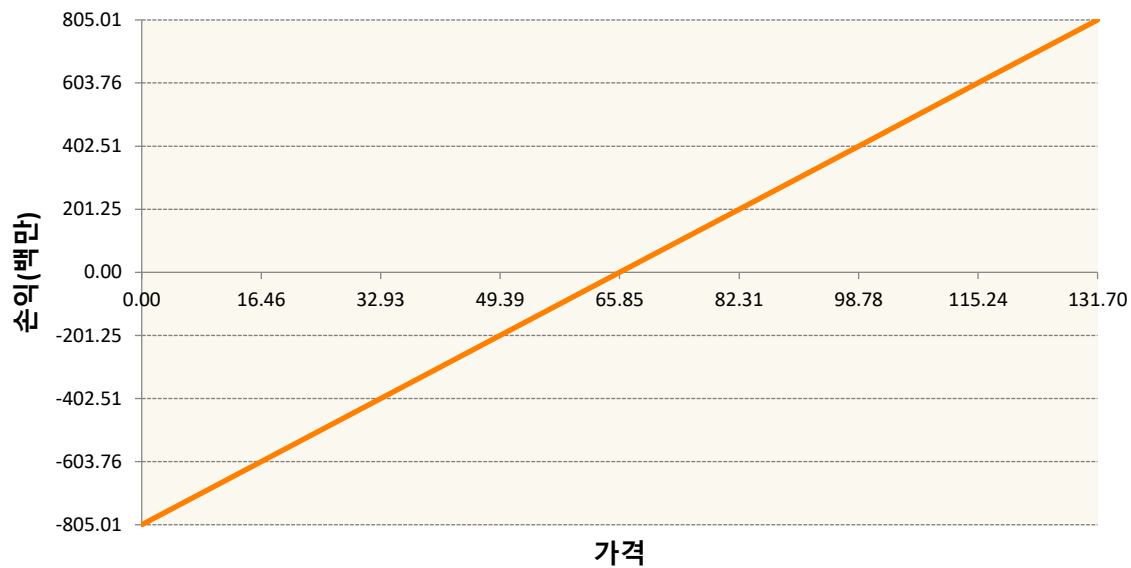
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

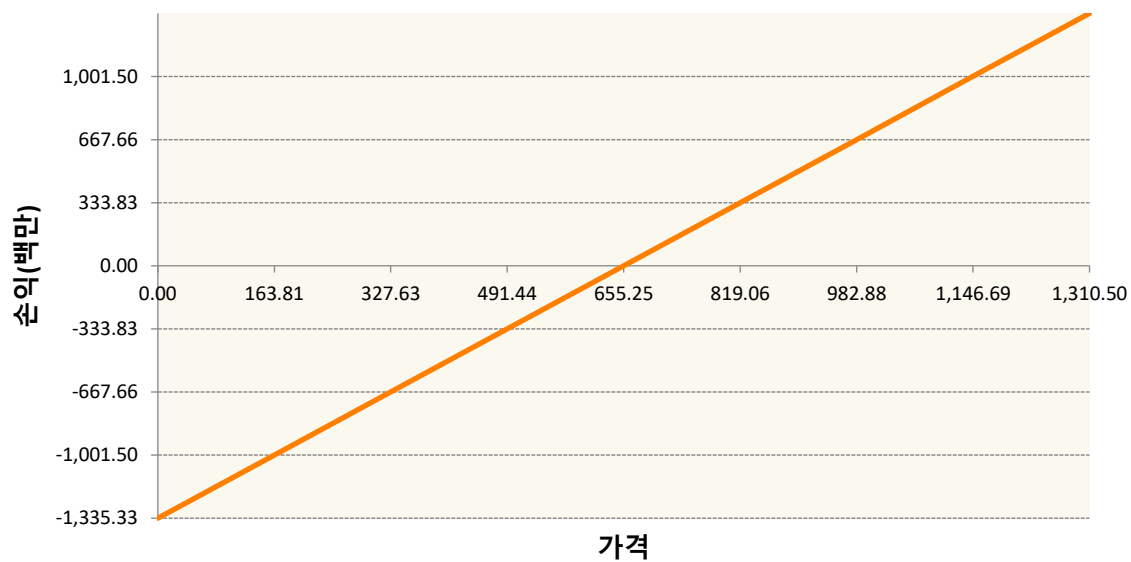
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,181	900	6,281	

2. 만기시점의 손익구조

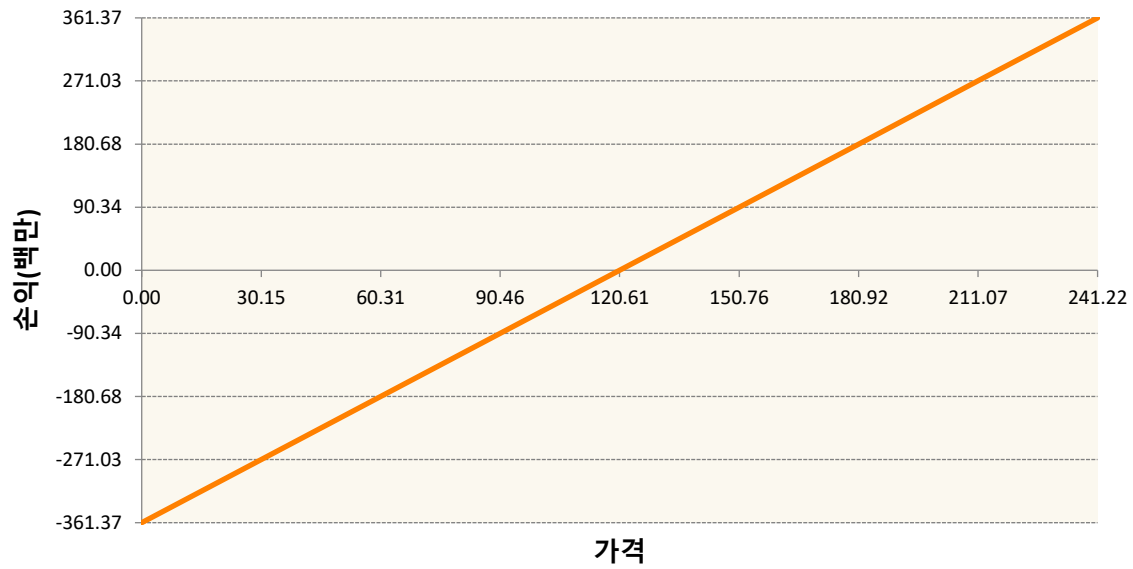
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



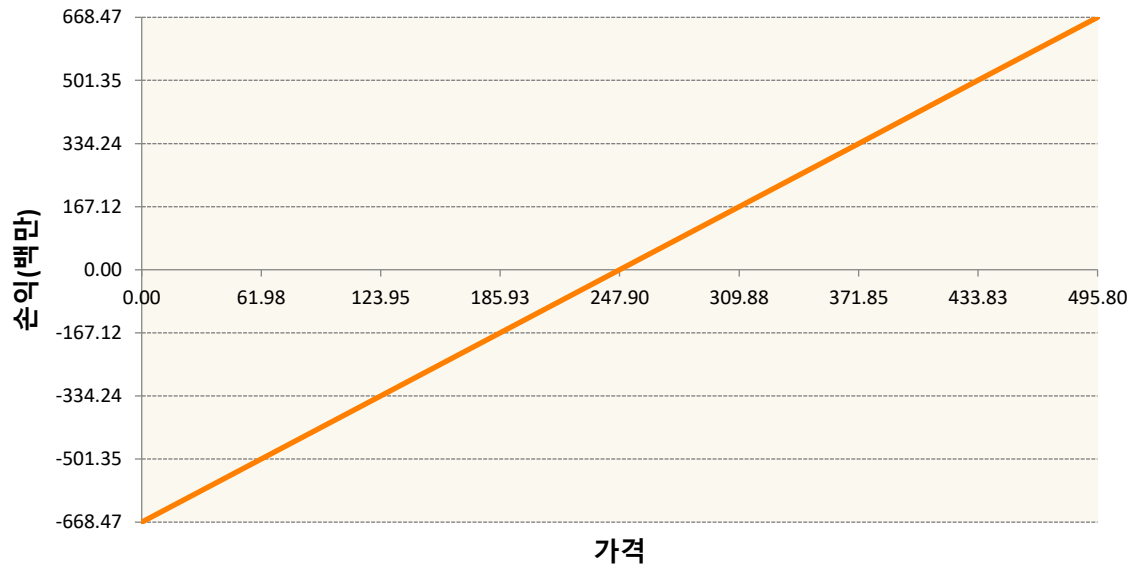
CK2-CORN FUTURE May22



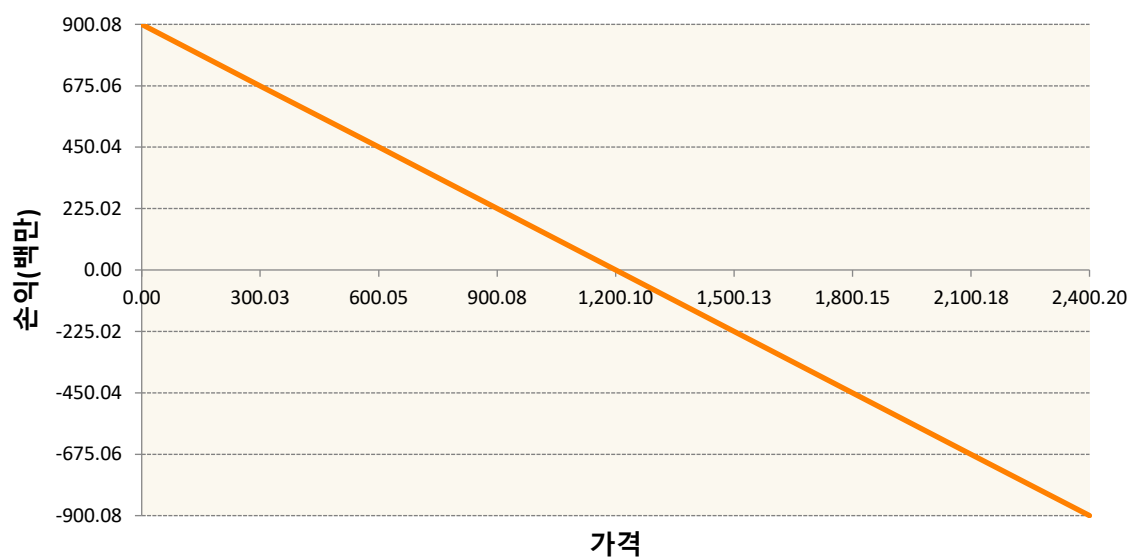
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



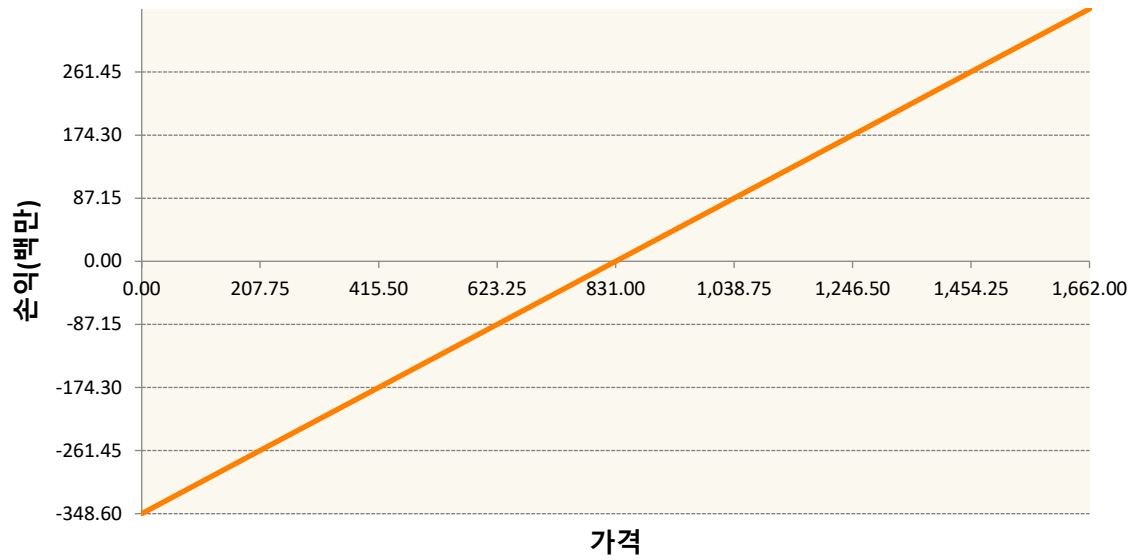
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



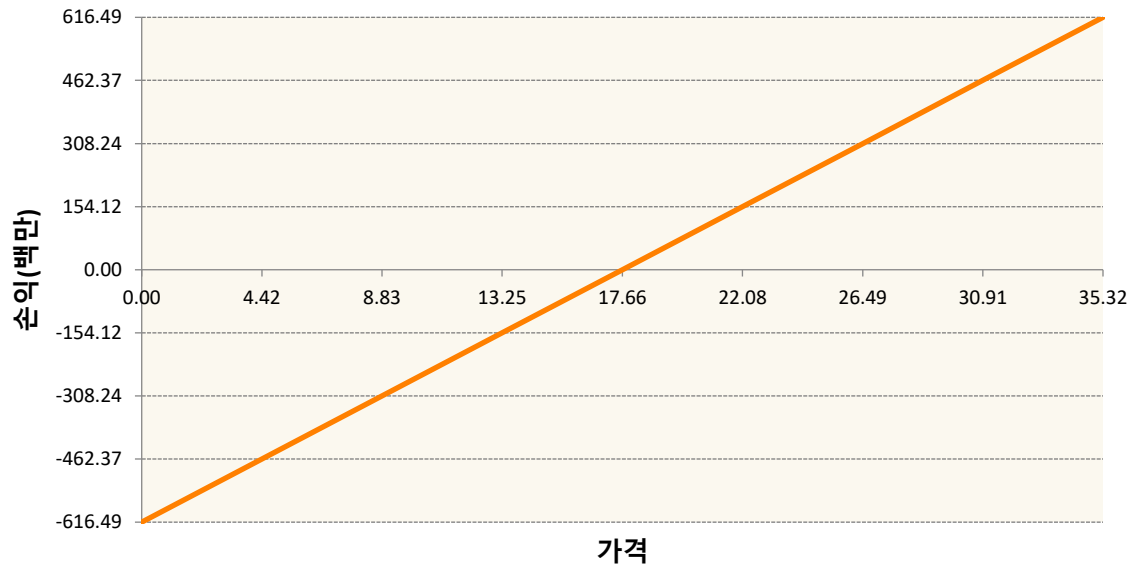
KR4175S20006-2022-02 달러선물



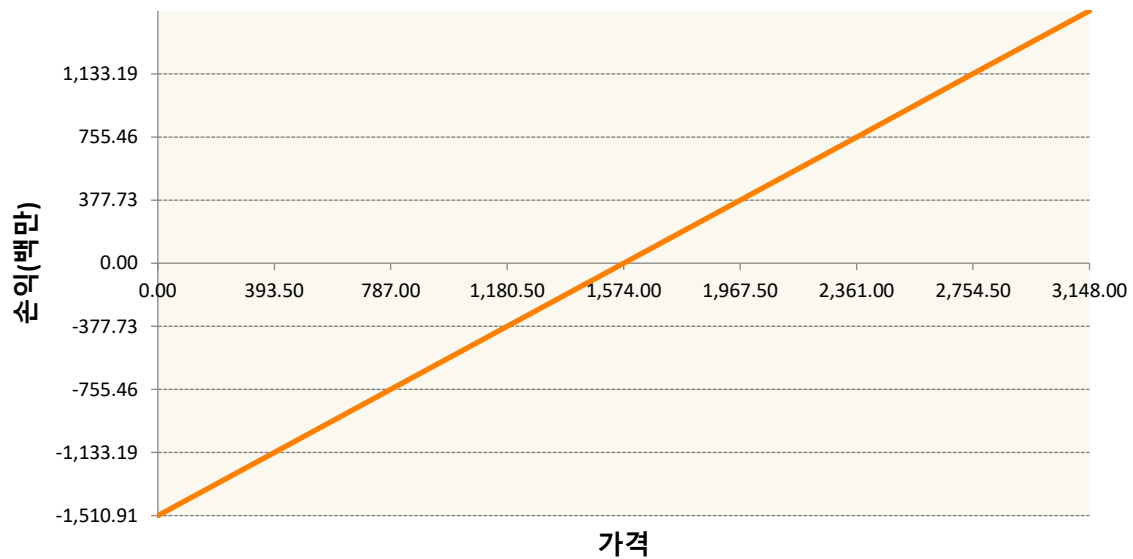
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



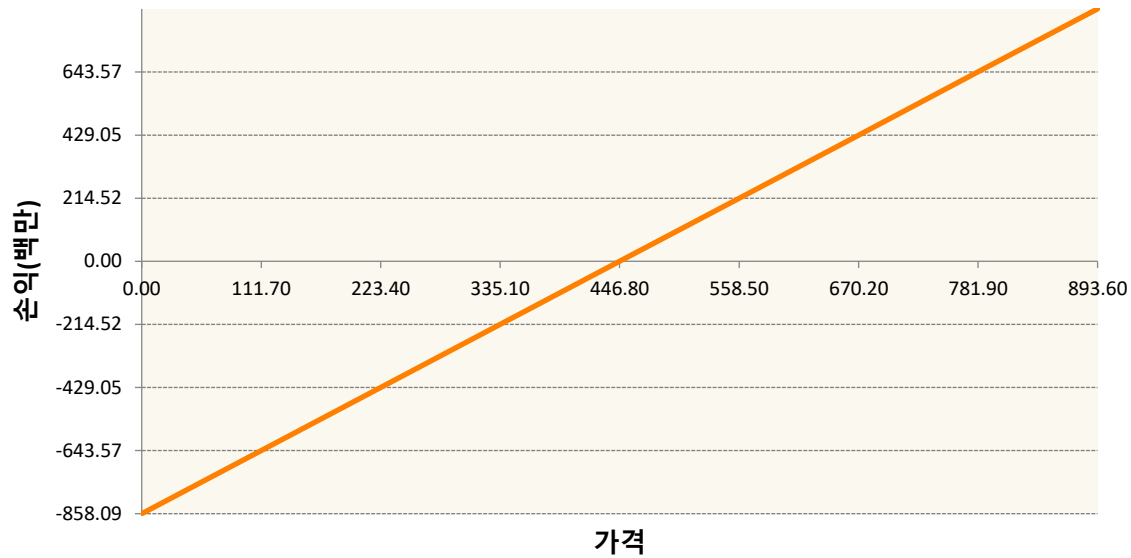
SBK2-Sugar May22



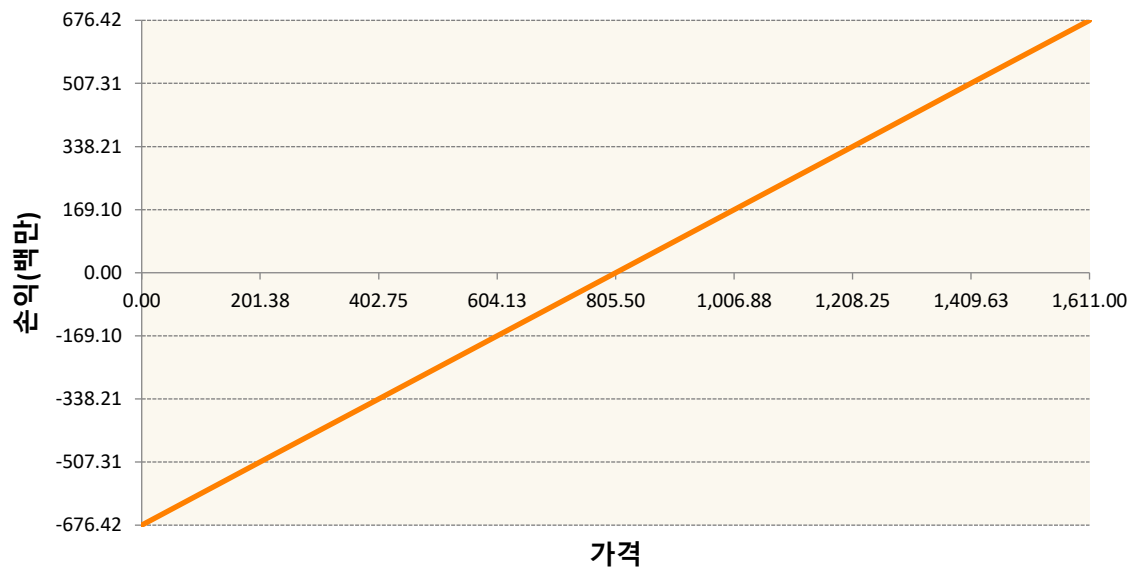
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



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	2022-02-16
기준일	2022-02-15

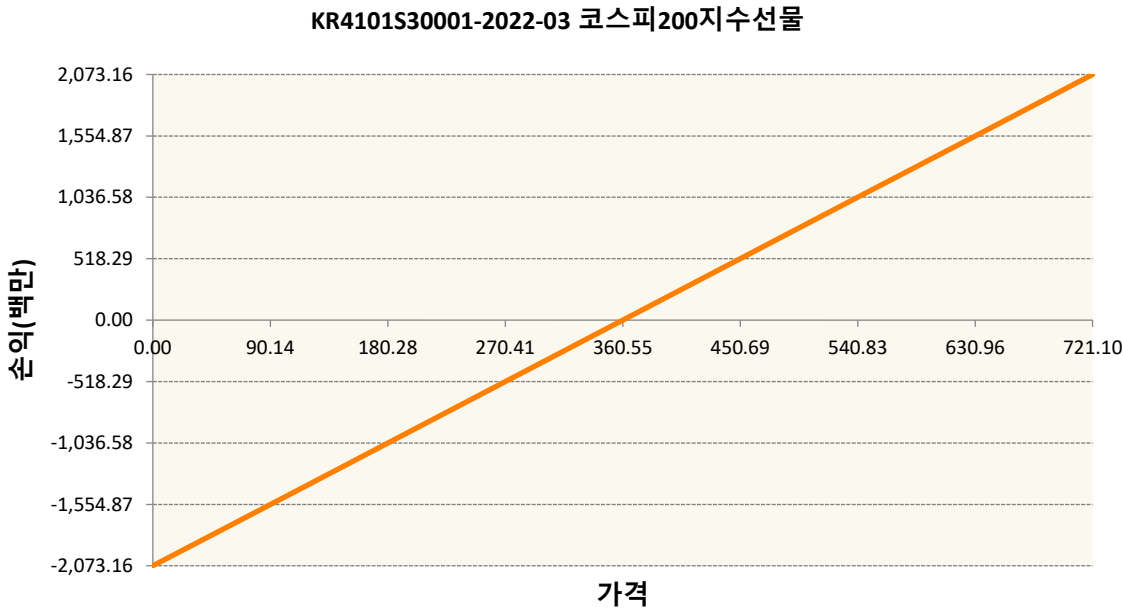
스마트인덱스모

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	2,073	0	2,073	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물				166
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-5.33%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	111	111	111	111	111	111	111
8.00%	166	166	166	166	166	166	166

공시일	2022-02-16
기준일	2022-02-15

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	1,902	0	1,902	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20211125	143
------------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

87

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-02-16
기준일	2022-02-15

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	403
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-02-16
기준일	2022-02-15

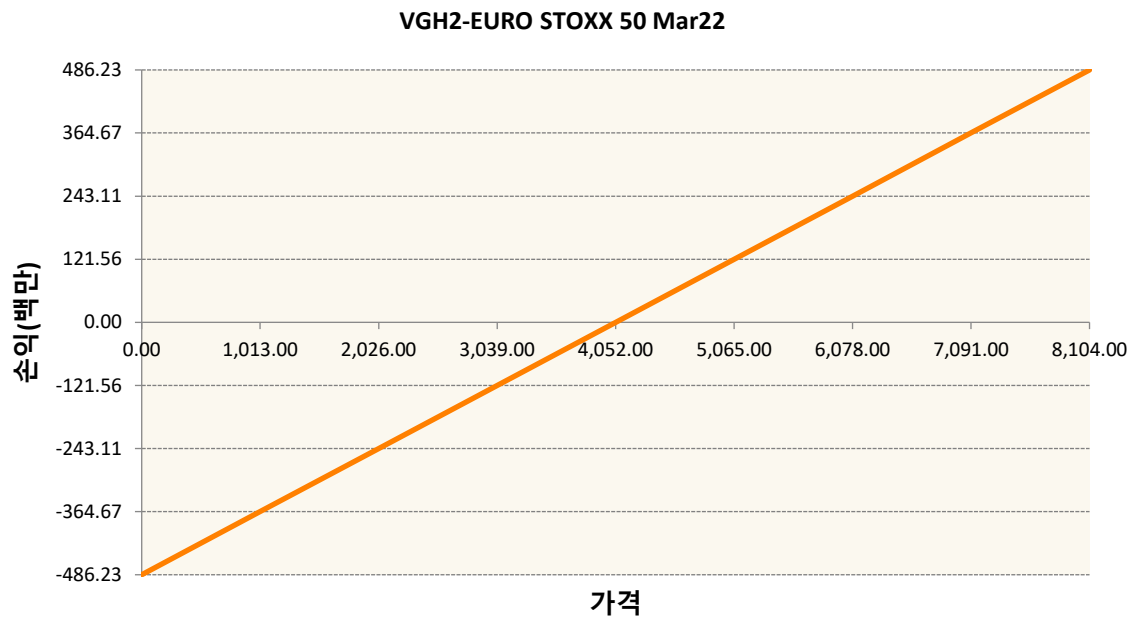
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	486	0	486	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	39
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

34

공시일	2022-02-16
기준일	2022-02-15

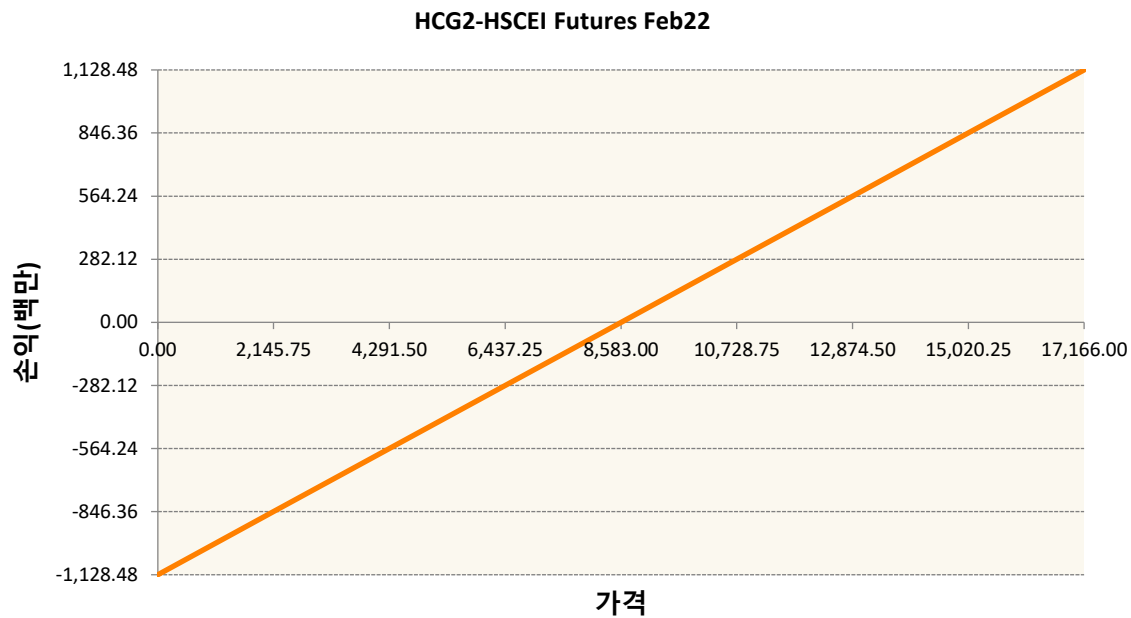
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,128	0	1,128	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

96

공시일 2022-02-16

기준일 2022-02-15

커버드콜모(주식혼합-파생형)

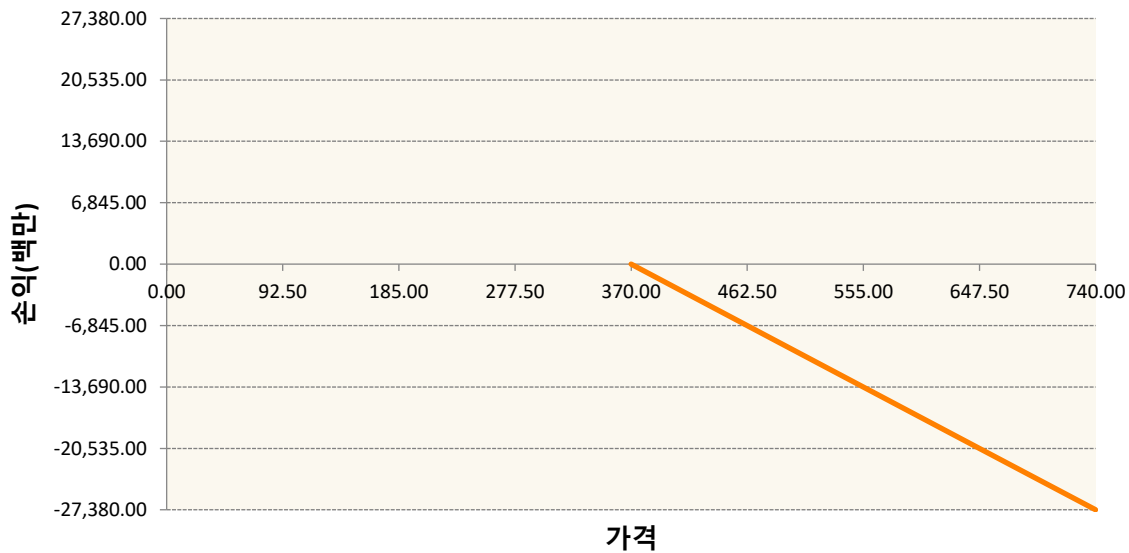
1. 계약금액

(단위:백만원)

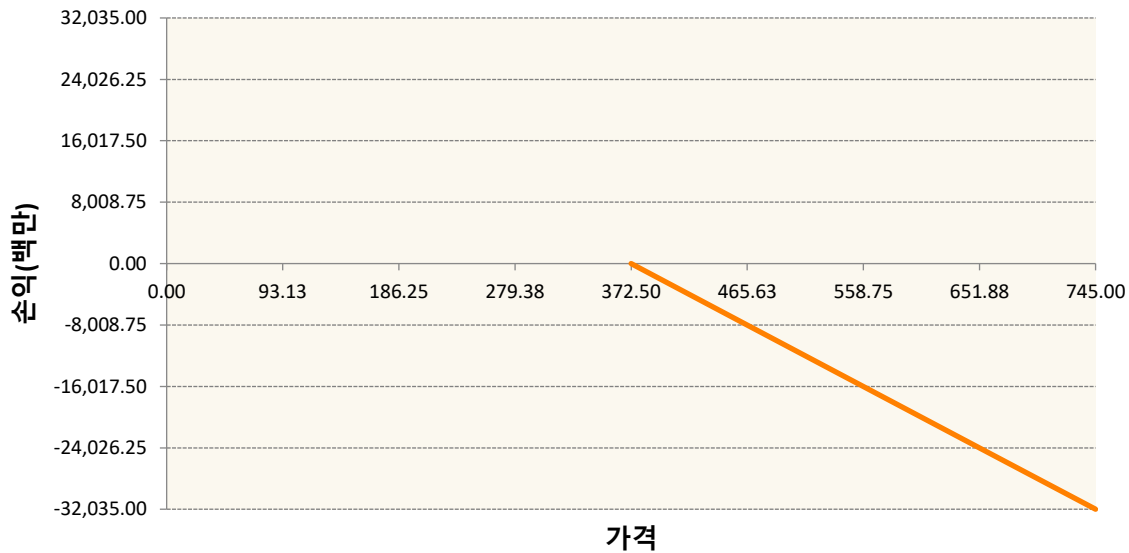
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	73,570	-73,570	장내

2. 만기시점의 손익구조

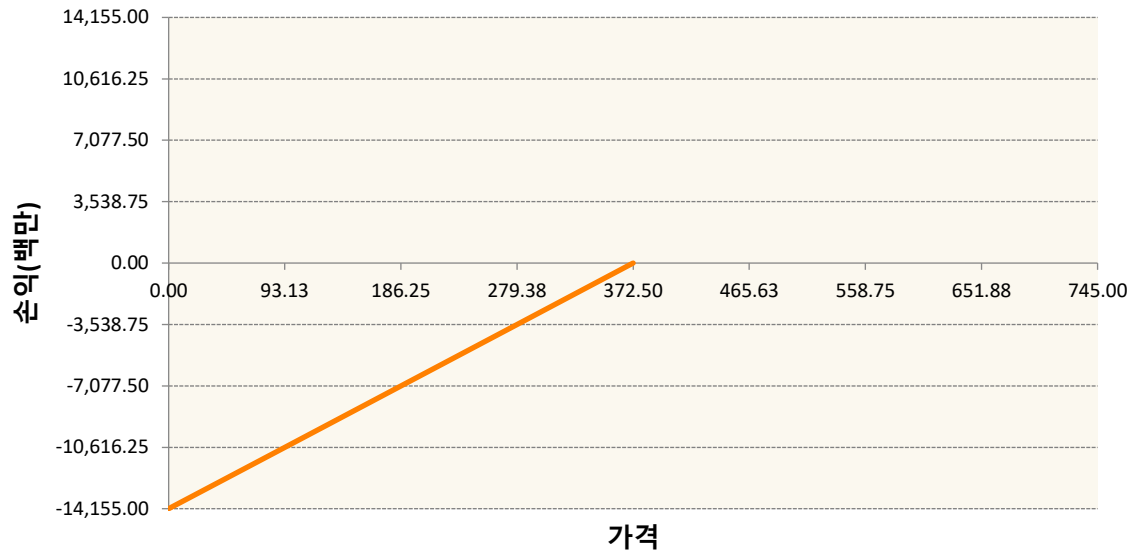
KR4201S33706-2022-03 콜370



KR4201S33722-2022-03 콜372.5



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S33706			2022-03 콜370				1,428
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	576	556	531	502	468	430	388
-5.33%	523	487	446	401	352	301	246
-2.67%	413	358	300	239	176	112	46
0%	215	144	72	0	-73	-147	-220
2.67%	-92	-169	-246	-324	-401	-478	-556
5.33%	-512	-585	-659	-733	-808	-884	-960
8.00%	-1,034	-1,093	-1,156	-1,222	-1,289	-1,358	-1,428
KR4201S33722			2022-03 콜372.5				1,595
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	602	583	558	527	491	450	405
-5.33%	552	515	472	424	371	314	254
-2.67%	443	385	321	254	184	112	38
0%	242	163	82	0	-83	-167	-251
2.67%	-81	-171	-261	-351	-441	-530	-620
5.33%	-536	-623	-712	-801	-890	-980	-1,070
8.00%	-1,112	-1,187	-1,265	-1,345	-1,427	-1,510	-1,595
KR4301S33720			2022-03 풋372.5				961
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-931	-933	-936	-940	-946	-953	-961
-5.33%	-572	-578	-586	-596	-607	-620	-634
-2.67%	-231	-244	-260	-277	-296	-316	-337
0%	72	49	25	0	-25	-51	-78

2.67%	310	281	252	223	194	165	136
5.33%	471	443	415	387	359	330	301
8.00%	561	541	519	496	472	447	422

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

(단위:백만원)

3,565

공시일 2022-02-16

기준일 2022-02-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

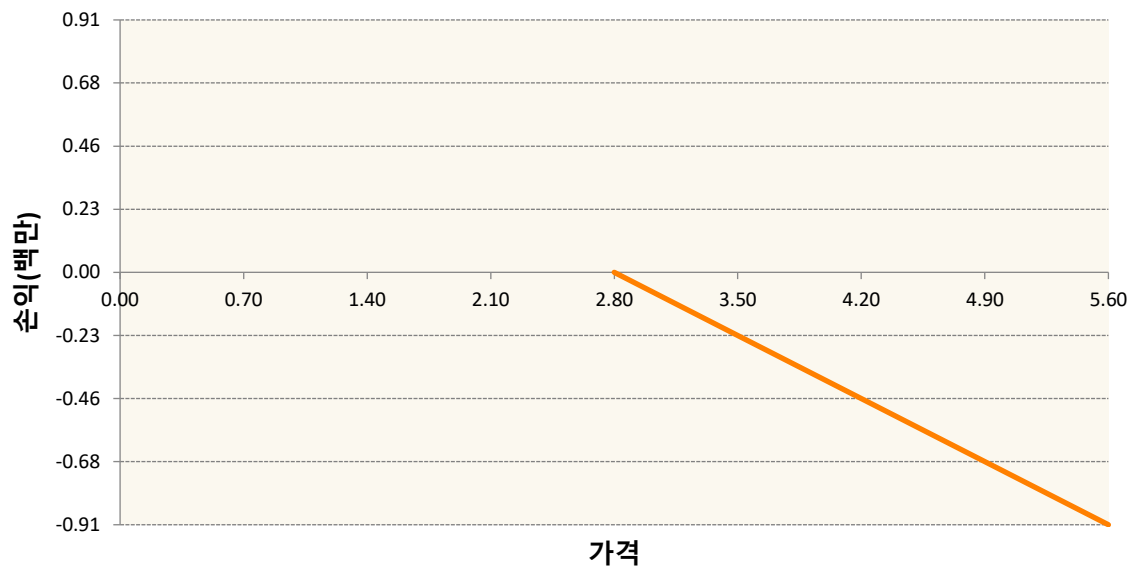
1. 계약금액

(단위:백만원)

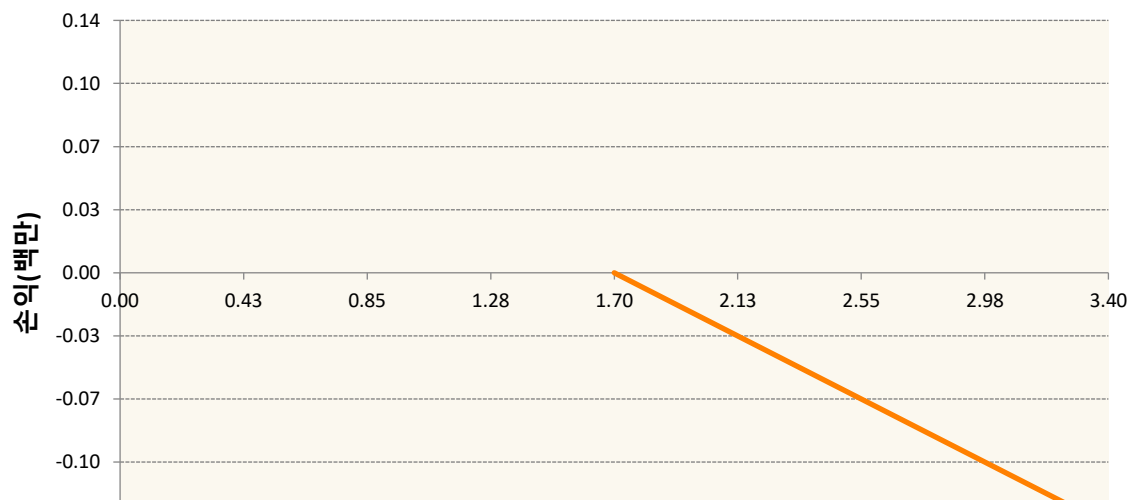
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	68	-68	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,716	-2,716	장외

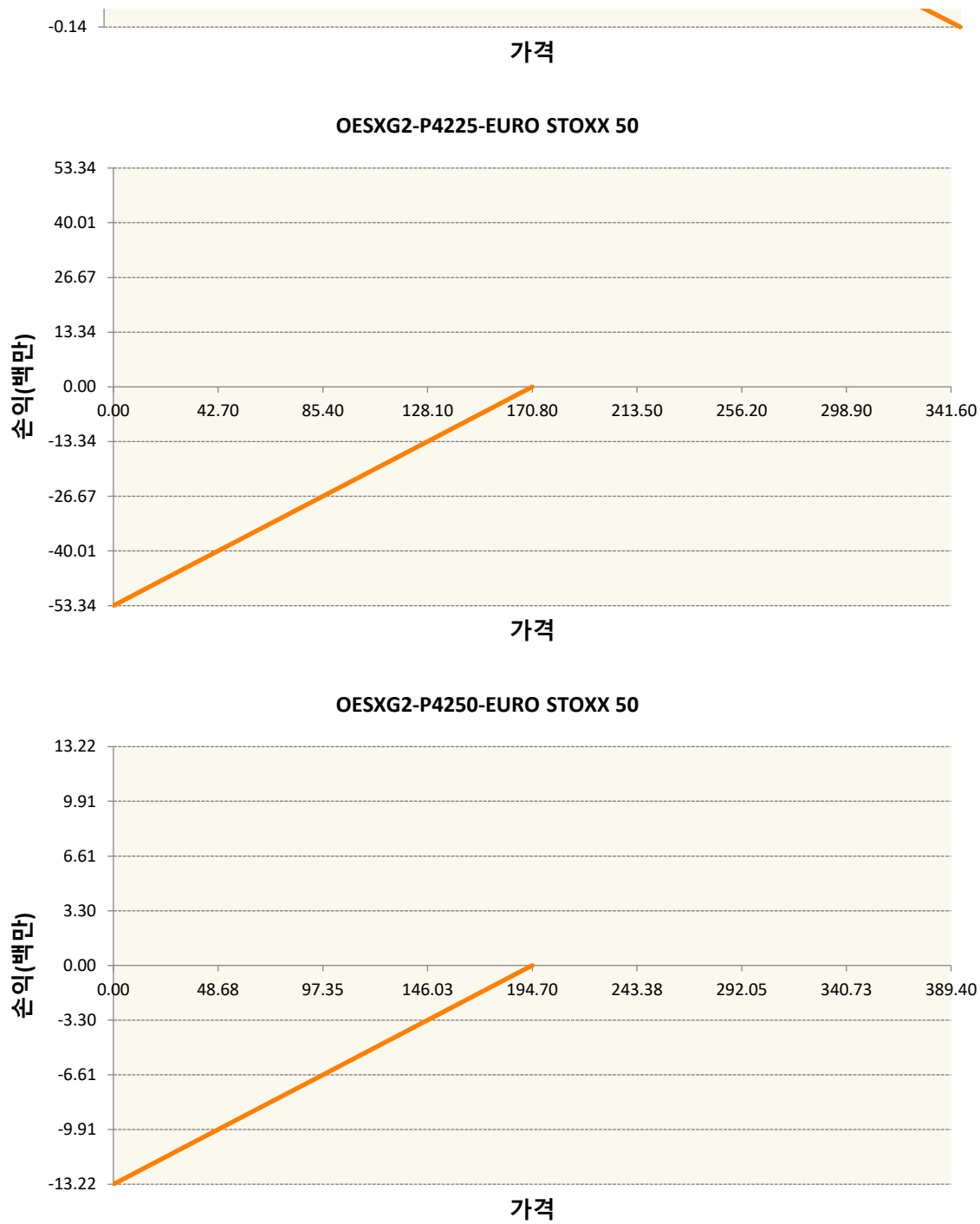
2. 만기시점의 손익구조

OESXG1-C4225-EURO STOXX 50



OESXG2-C4250-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	15
FXW213BCF KRW/EUR 17-03-22E	54
FXW213BCF KRW/EUR 17-02-22E	109
FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E	22
FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E	33
OESXG1-C42 EURO STOXX 50	0.07
OESXG2-C42 EURO STOXX 50	0.01
OESXG2-P42 EURO STOXX 50	4
OESXG2-P42 EURO STOXX 50	1

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

(단위:백만원)

121

공시일 2022-02-16

기준일 2022-02-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

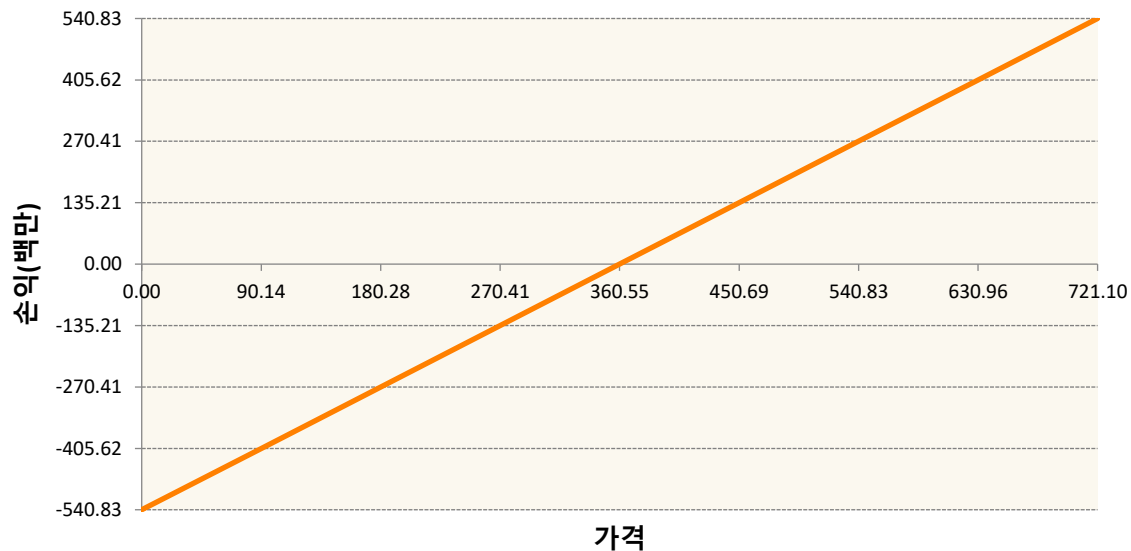
1. 계약금액

(단위:백만원)

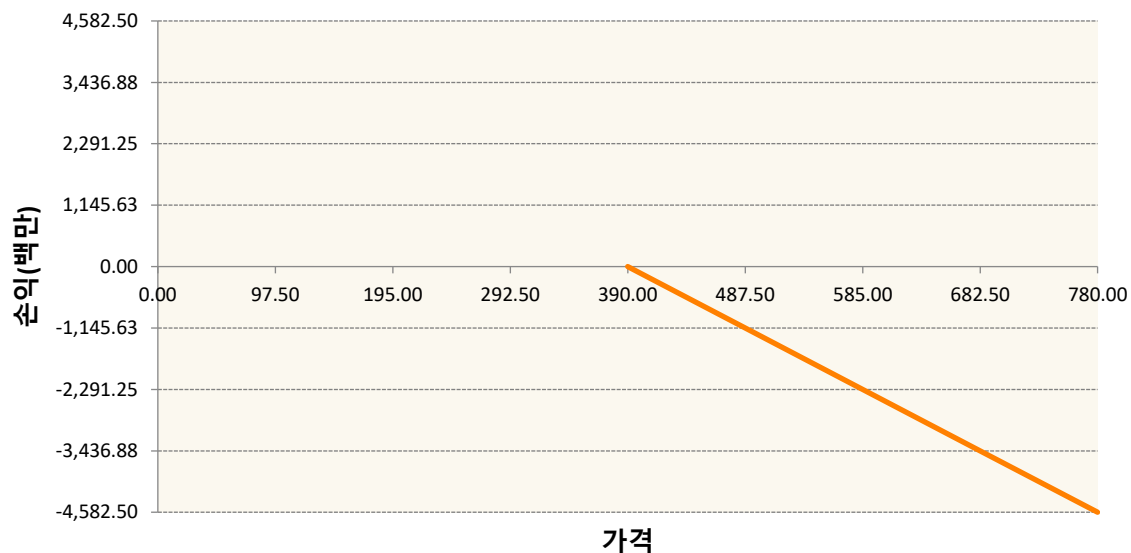
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	541	0	541	장내
누계	유가증권	옵션	372	4,877	-4,505	장내

2. 만기시점의 손익구조

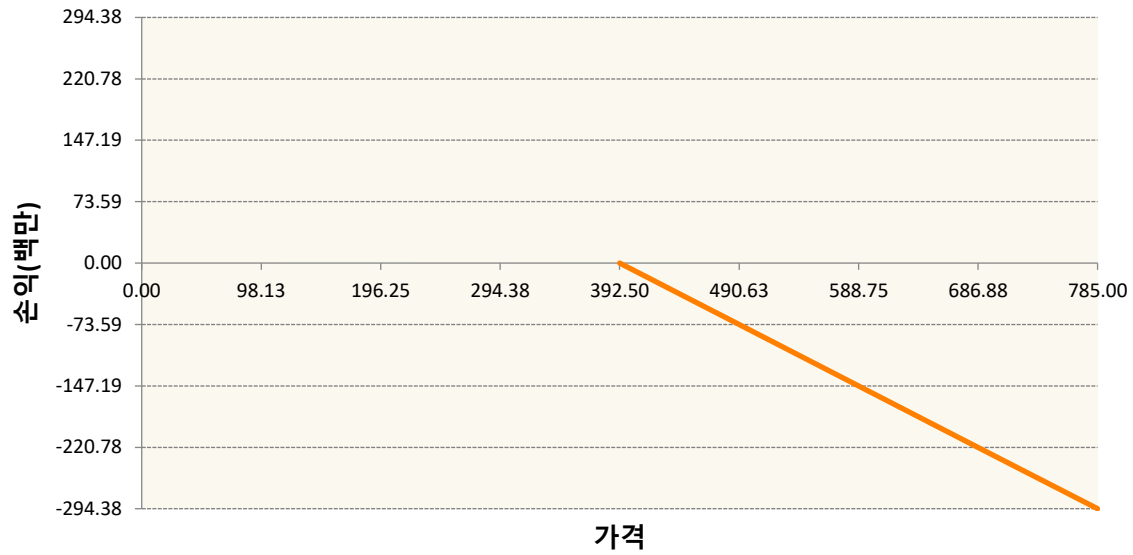
KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



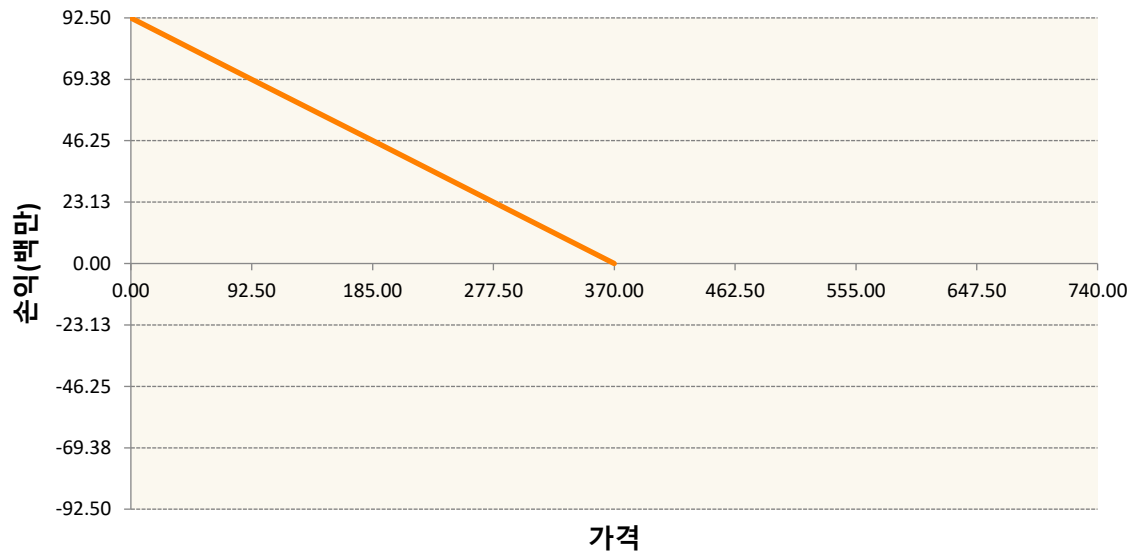
KR4201S33904-2022-03 콜390



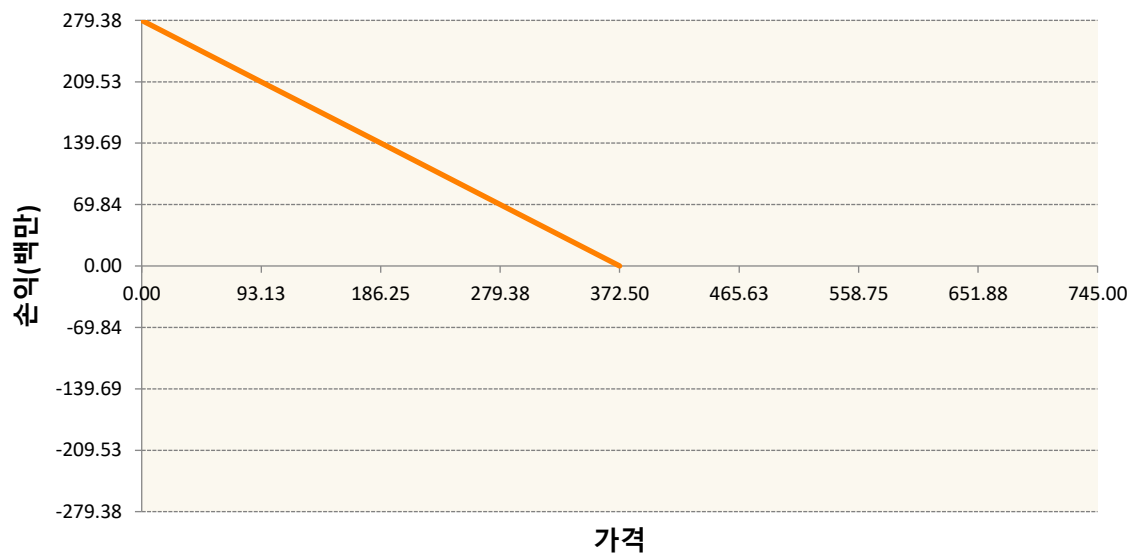
KR4201S33920-2022-03 콜392.5



KR4301S33704-2022-03 풋370



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물				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
KR4201S33904			2022-03 콜390				154
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	33	32	30	27	23
-5.33%	34	32	30	27	23	18	13
-2.67%	30	27	22	17	11	4	-3
0%	21	15	8	0	-8	-17	-26
2.67%	3	-6	-16	-26	-37	-48	-59
5.33%	-28	-40	-52	-64	-76	-89	-101
8.00%	-76	-89	-102	-115	-128	-141	-154
KR4201S33920			2022-03 콜392.5				9
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	1	1
-5.33%	2	2	2	2	1	1	1
-2.67%	2	2	1	1	1	0	0
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2
2.67%	0	0	-1	-2	-2	-3	-4
5.33%	-2	-2	-3	-4	-5	-5	-6
8.00%	-4	-5	-6	-7	-8	-8	-9
KR4301S33704			2022-03 풋370				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%	1	1	2	2	2	2	2
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-2	-2	-2	-1	-1	-1	-1
5.33%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-2
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301S33720			2022-03 풋372.5				19
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	19	19	19	19
-5.33%	11	11	12	12	12	12	13
-2.67%	5	5	5	5	6	6	7
0%	-1	-1	0	0	1	1	2
2.67%	-6	-6	-5	-4	-4	-3	-3
5.33%	-9	-9	-8	-8	-7	-7	-6
8.00%	-11	-11	-10	-10	-9	-9	-8

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

(단위:백만원)

174

공시일	2022-02-16
기준일	2022-02-15

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	10,202	0	10,202	

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	2022-02-16
기준일	2022-02-15

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	8,834	0	8,834	

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	2022-02-16
기준일	2022-02-15

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	29,361	0	29,361	
누계	통화	선도	924	30,595	-29,671	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E	2,256
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)

807

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Profit/Loss (손익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 721.10. The y-axis represents Profit/Loss in millions, ranging from -1,352.06 to 1,352.06. The line starts at a price of 0.00 with a loss of 1,352.06 million and ends at a price of 721.10 with a profit of 1,352.06 million.

가격	손익(백만)
0.00	-1,352.06
90.14	-1,014.05
180.28	-676.03
270.41	-338.02
360.55	0.00
450.69	338.02
540.83	676.03
630.96	1,014.05
721.10	1,352.06

(단위:백만원)

KR4101S30001				2022-03 코스피200지수선물			108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-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%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	108	108	108	108	108	108	108

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

(단위:백만원)

100

공시일 2022-02-16

기준일 2022-02-15

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

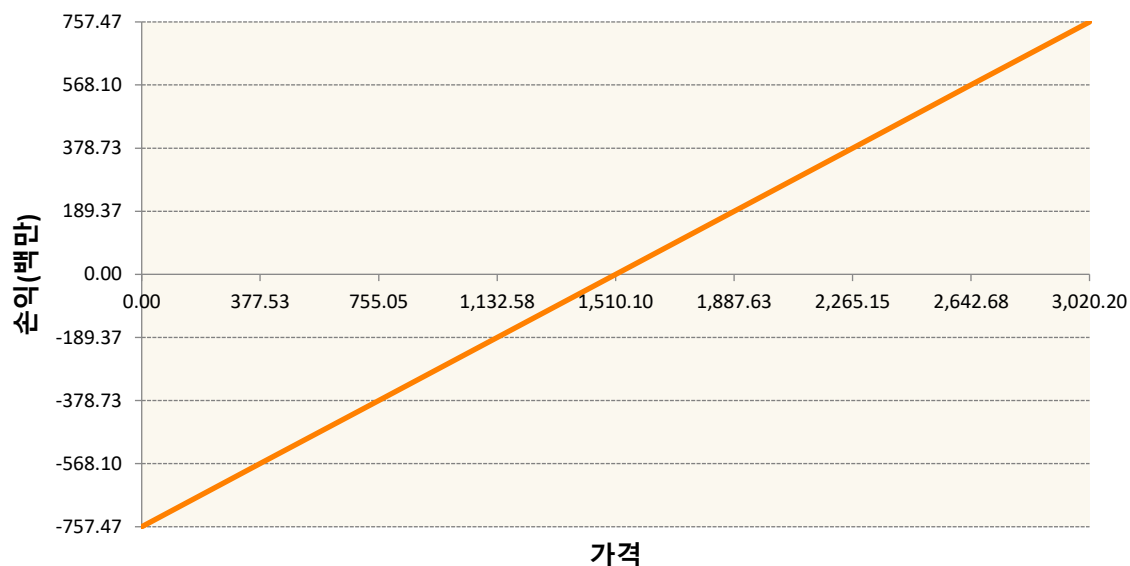
1. 계약금액

(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	757	0	757	
누계	유가증권	스왑	1,856	0	1,856	장외
누계	통화	선도	0	1,331	-1,331	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	43
FXW213C1K KRW/EUR 22-04-22E	16
VNCG2 VN30 Index Future Feb22	61

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

(단위:백만원)

공시일	2022-02-16
기준일	2022-02-15

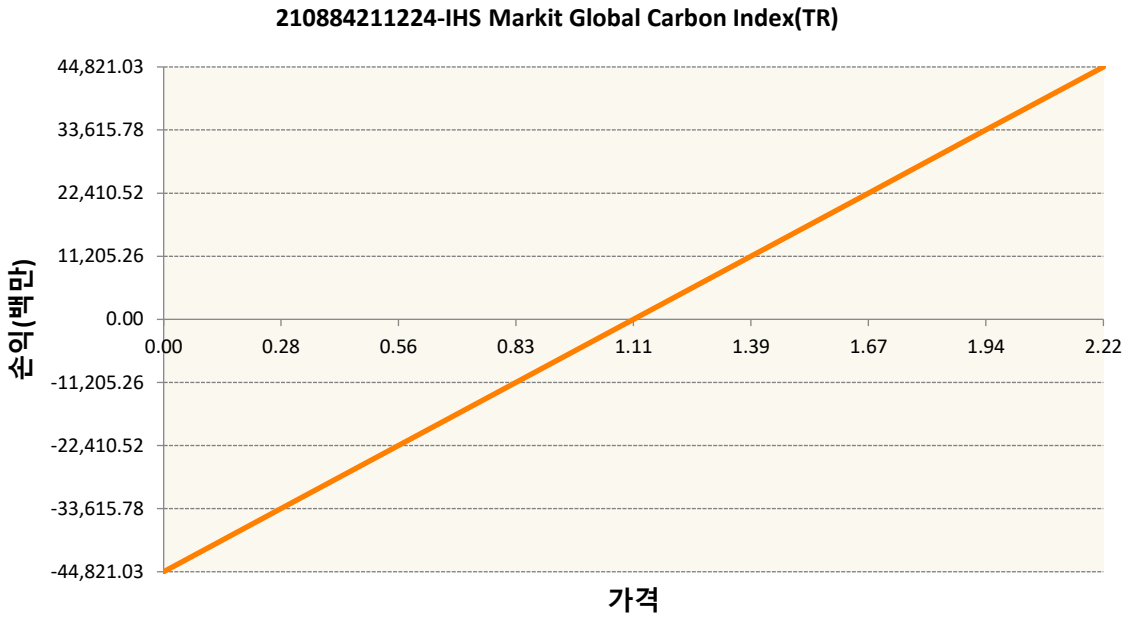
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)

3,578

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

(단위:백만원)

5,756

공시일	2022-02-16
기준일	2022-02-15

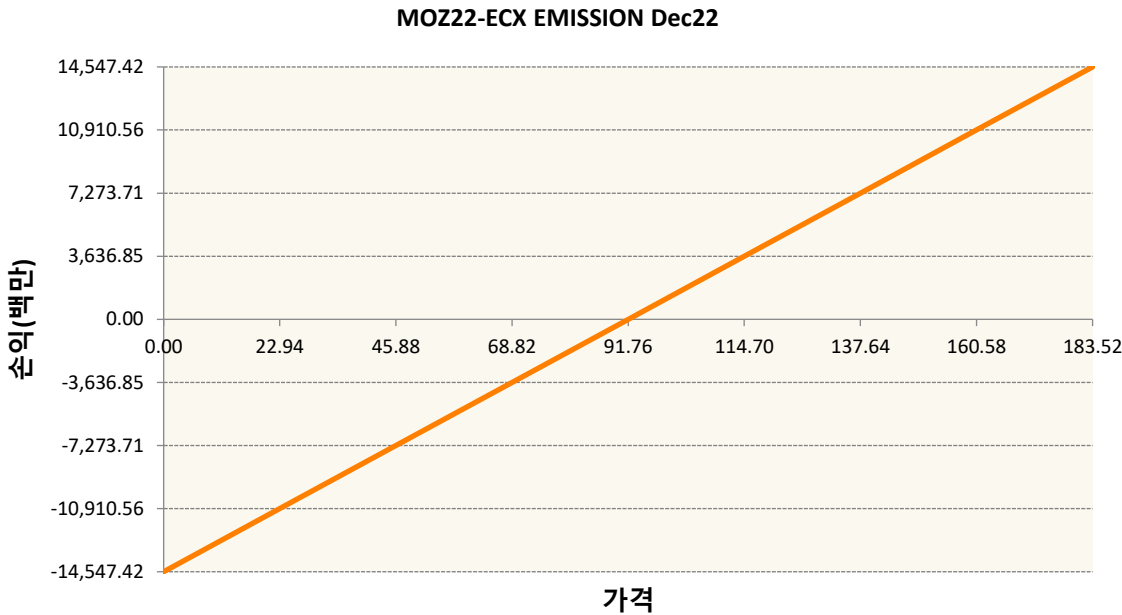
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	14,547	0	14,547	
누계	통화	선도	0	8,768	-8,768	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1V·KRW/EUR 25-02-22E	701
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,164

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

(단위:백만원)

2,752

공시일	2022-02-16
기준일	2022-02-15

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)	43
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	43
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	43
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	43

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

(단위:백만원)

330

공시일	2022-02-16
기준일	2022-02-15

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)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	21
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	18

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

(단위:백만원)

95

공시일 2022-02-16

기준일 2022-02-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

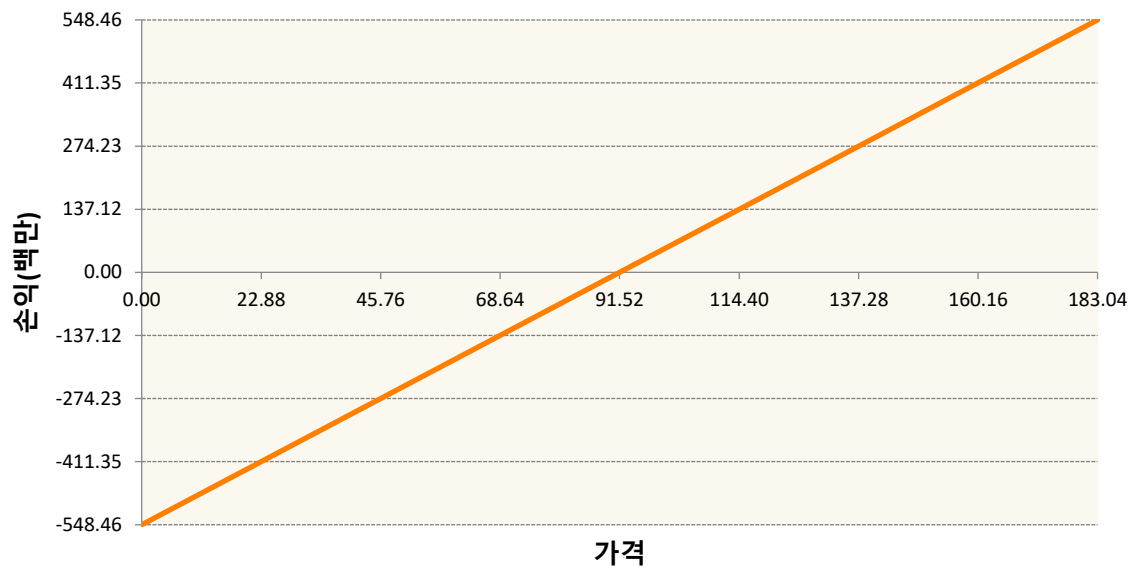
1. 계약금액

(단위:백만원)

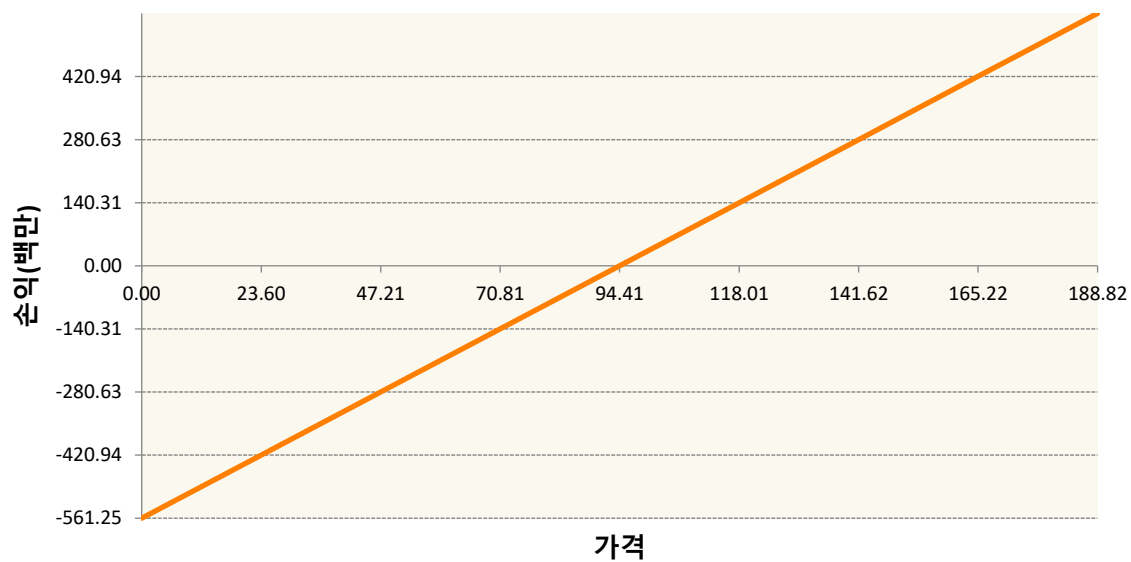
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,333	420	1,913	

2. 만기시점의 손익구조

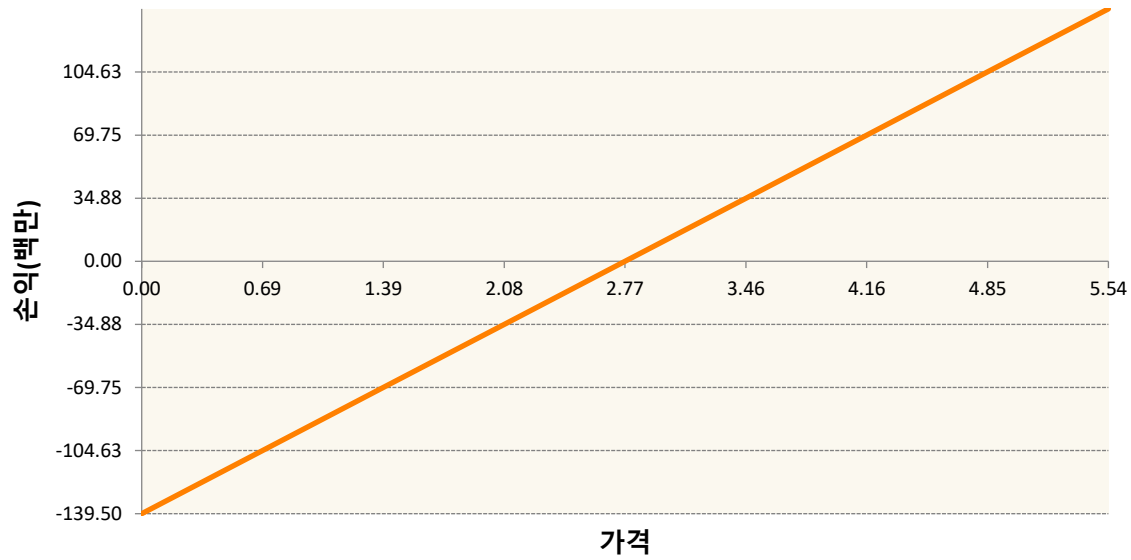
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



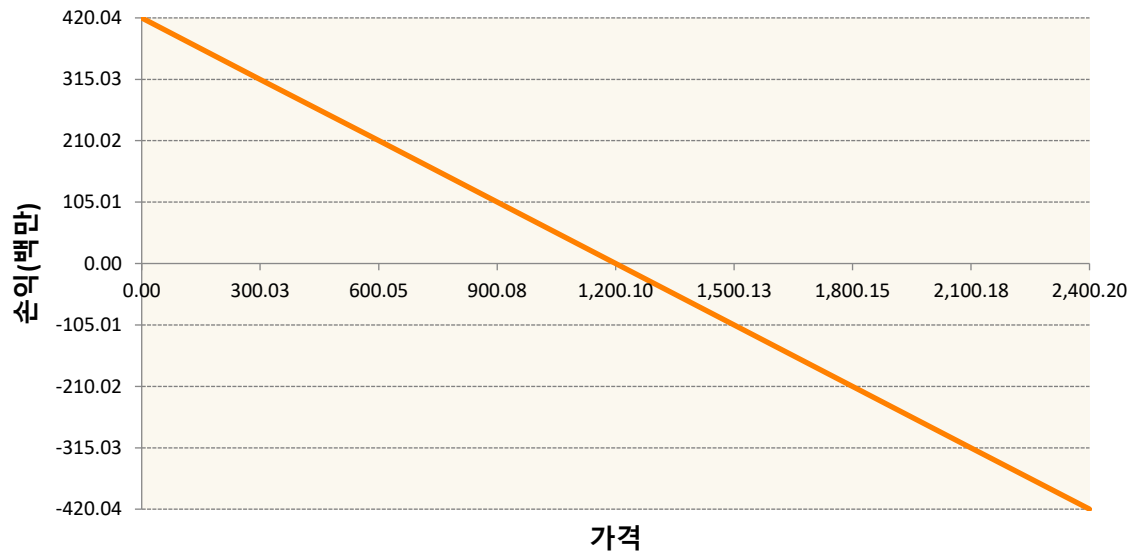
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



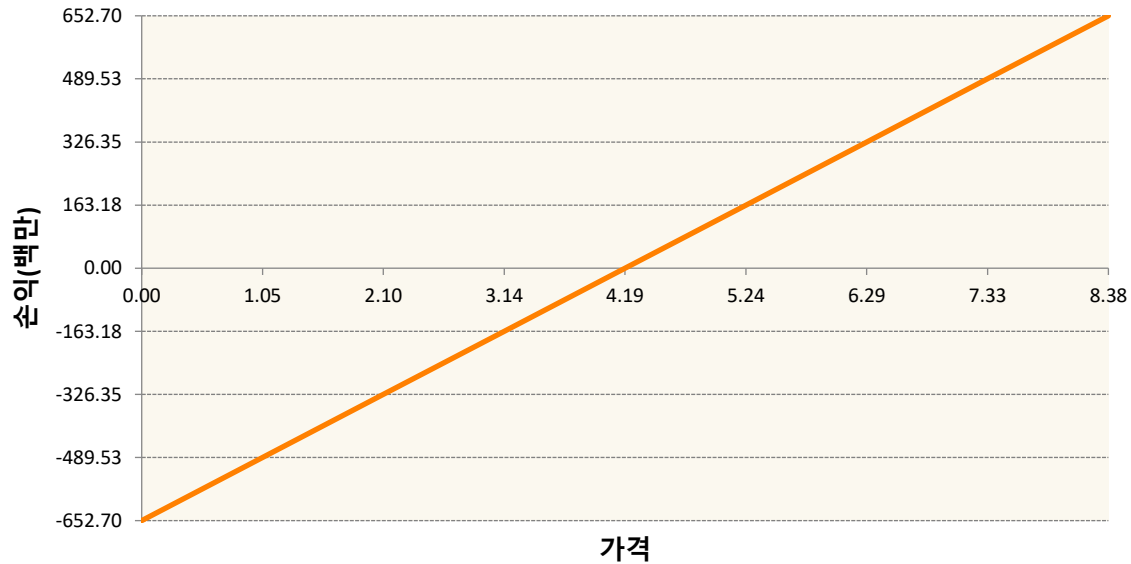
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

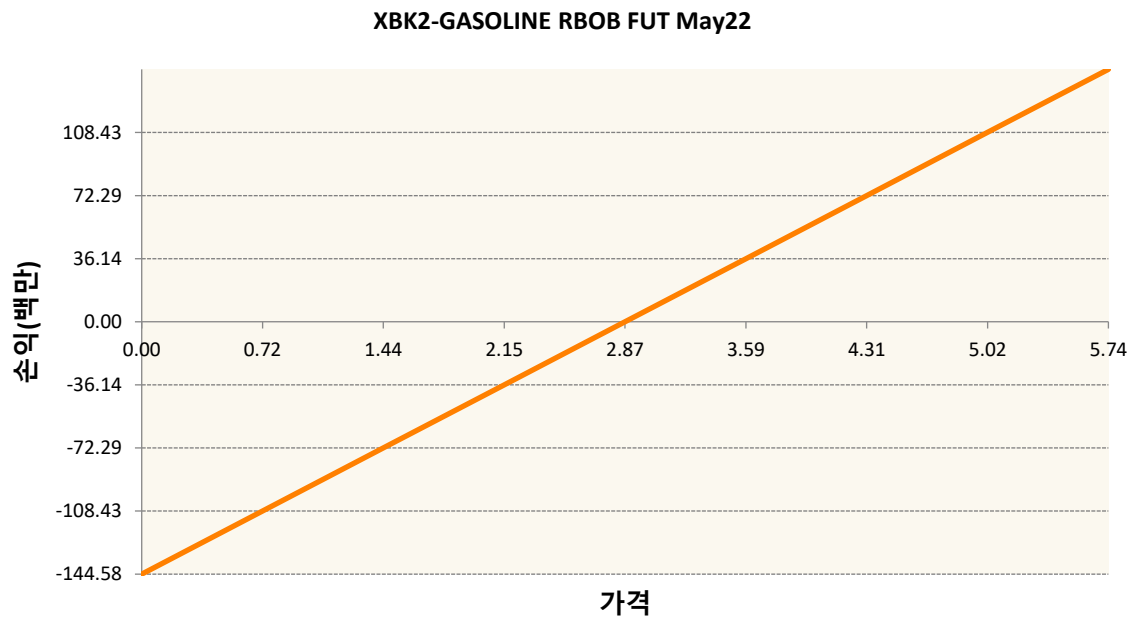
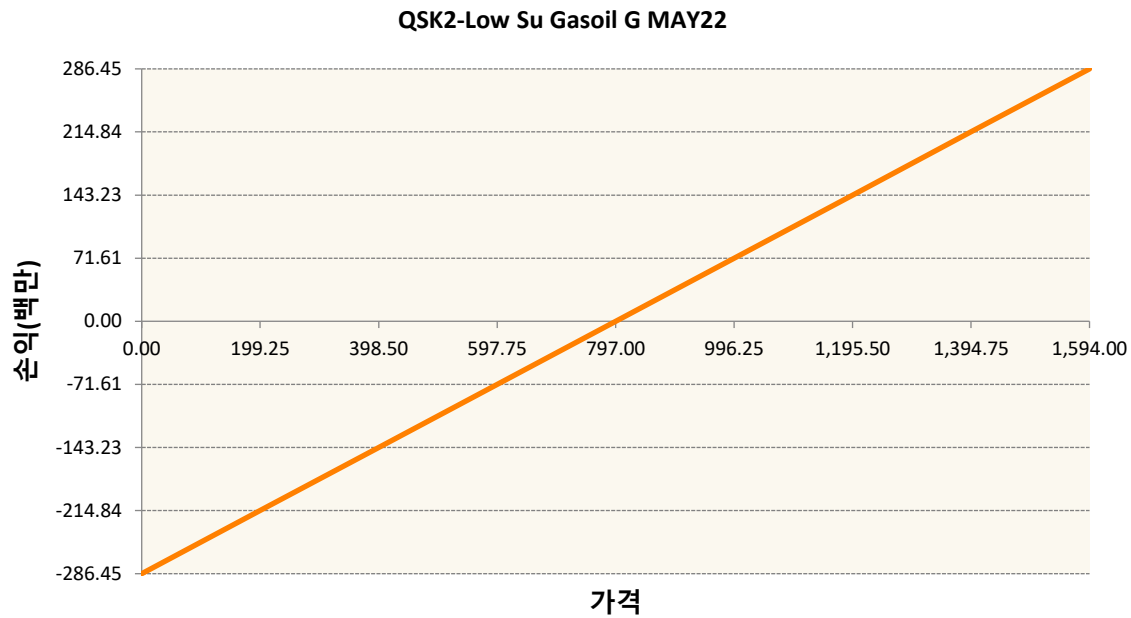


KR4175S20006-2022-02 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		44
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22		45
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		11
KR4175S200 2022-02 달러선물			34
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		52
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		23
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		460