

공시일 2022-02-17

기준일 2022-02-16

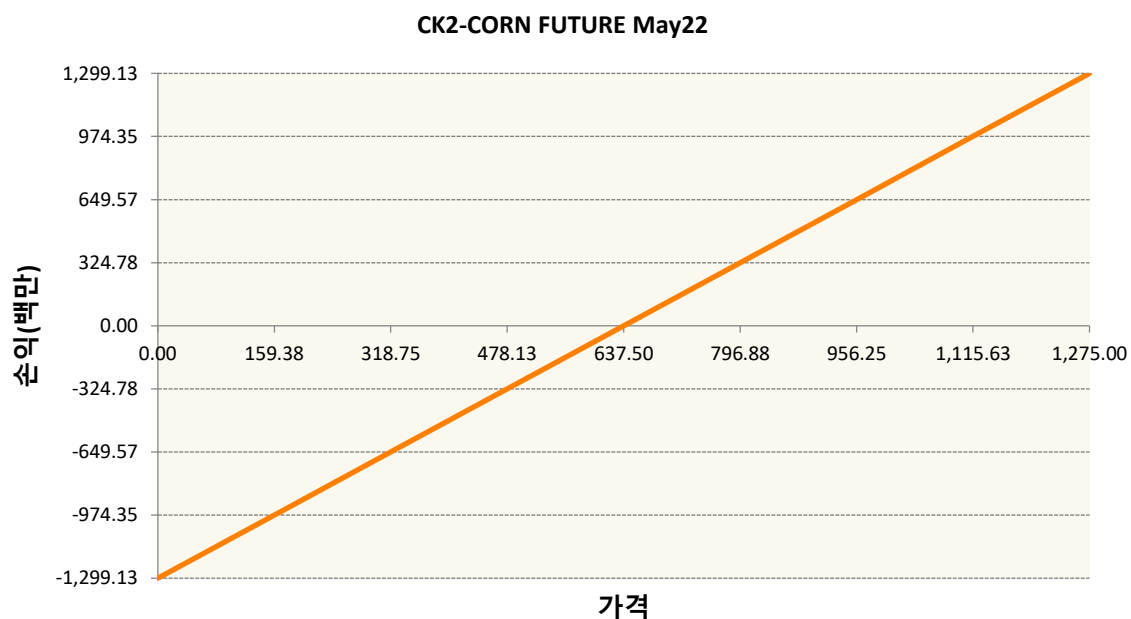
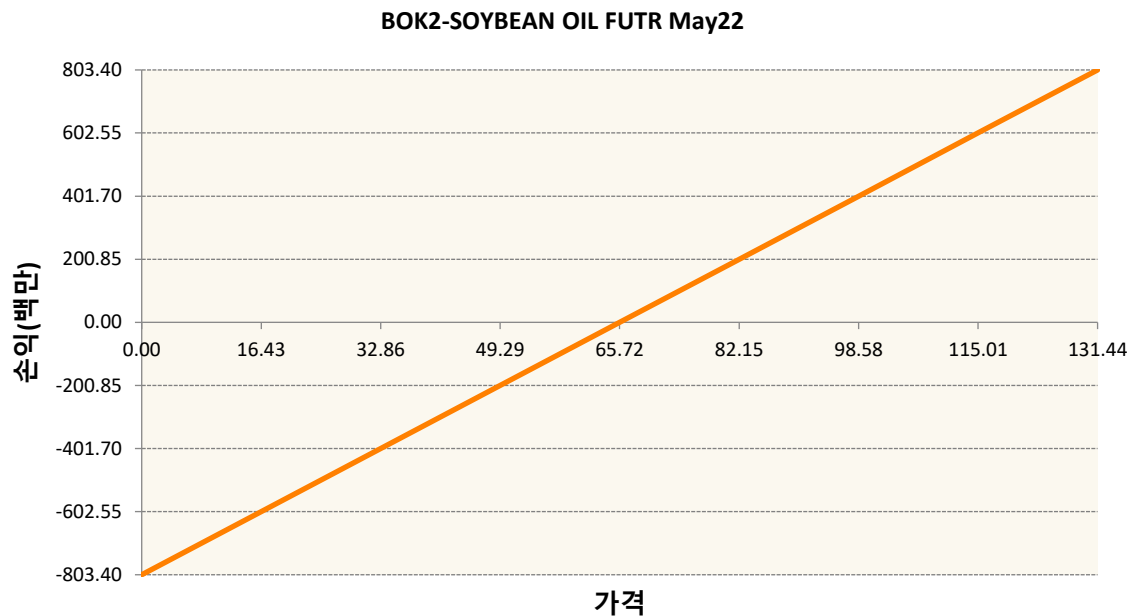
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

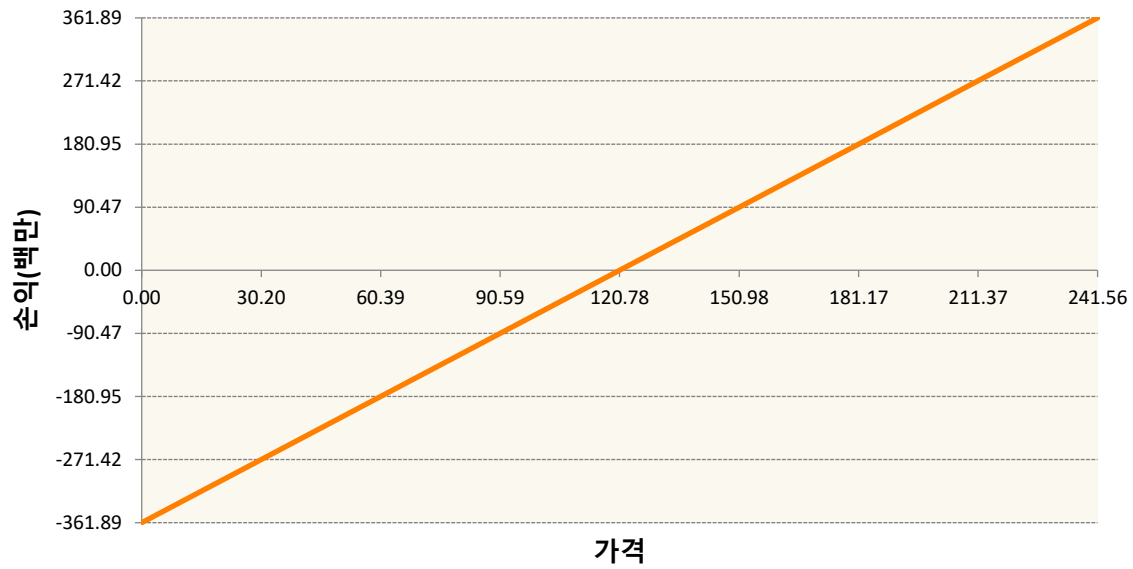
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,089	898	6,191	

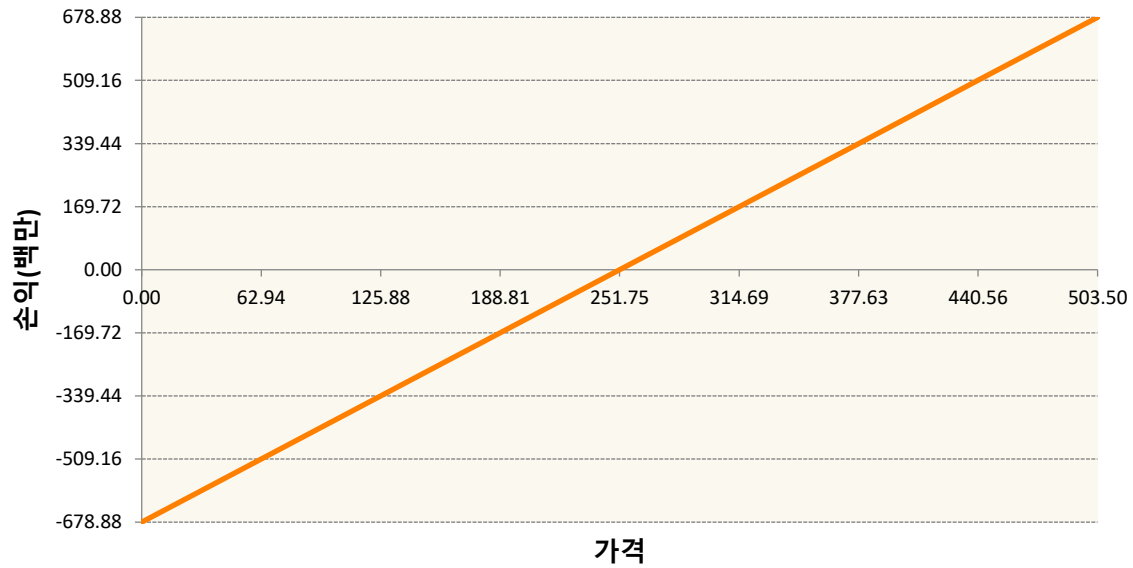
2. 만기시점의 손익구조



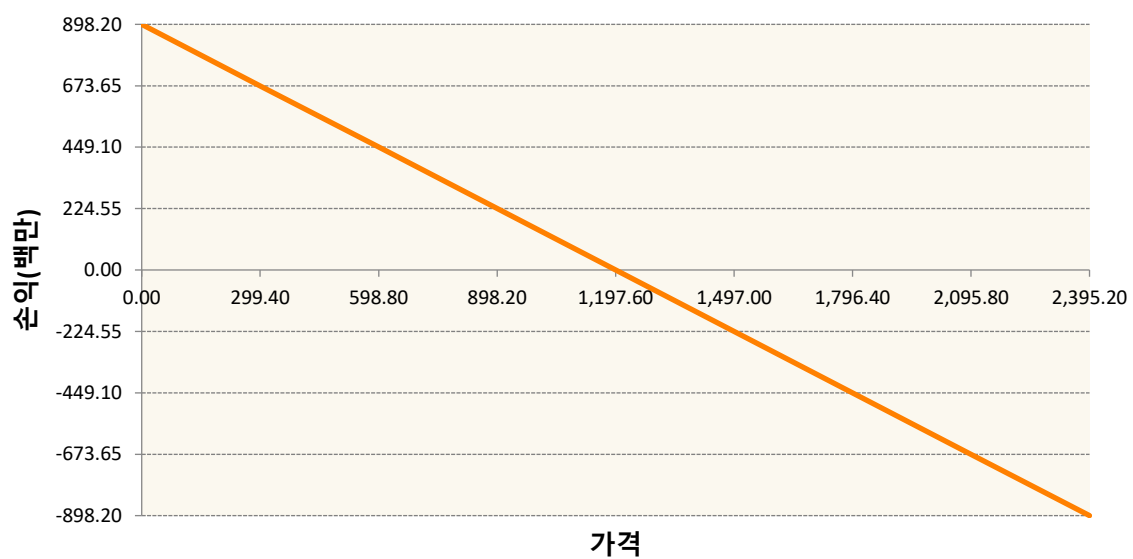
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



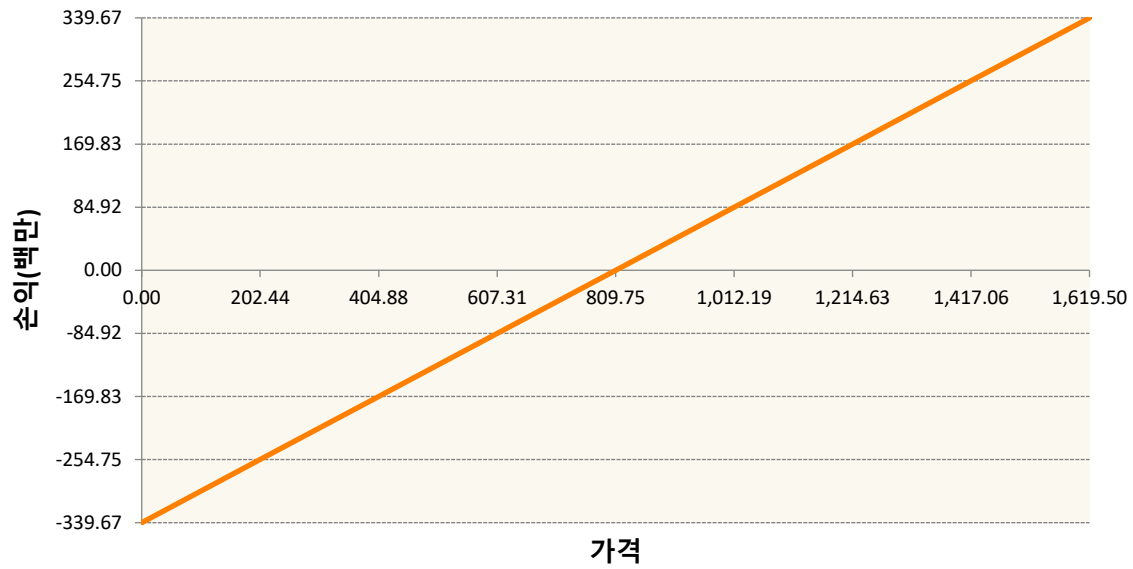
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



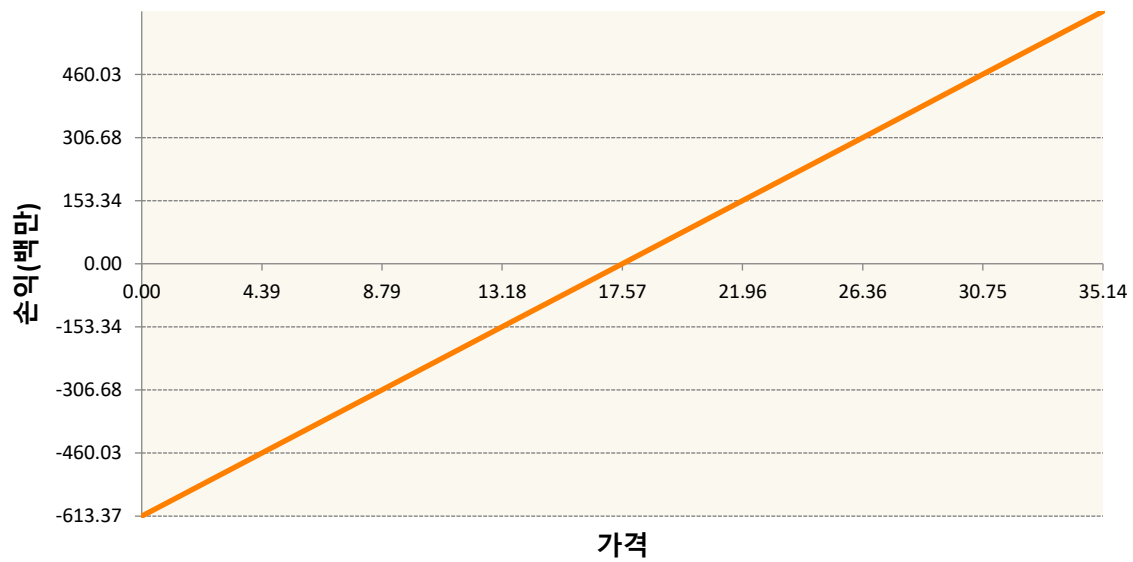
KR4175S20006-2022-02 달러선물



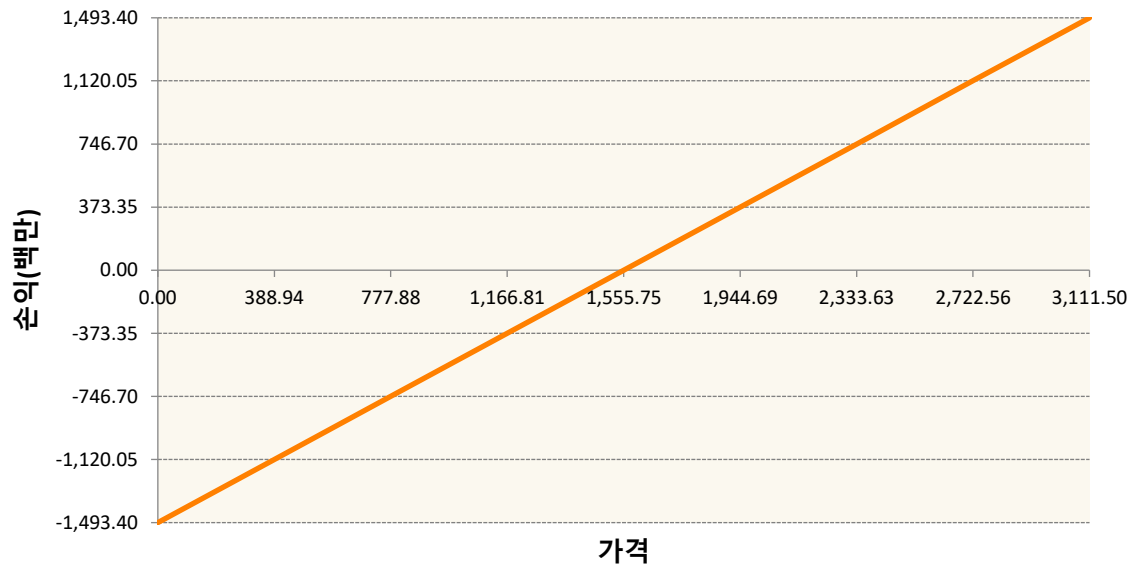
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



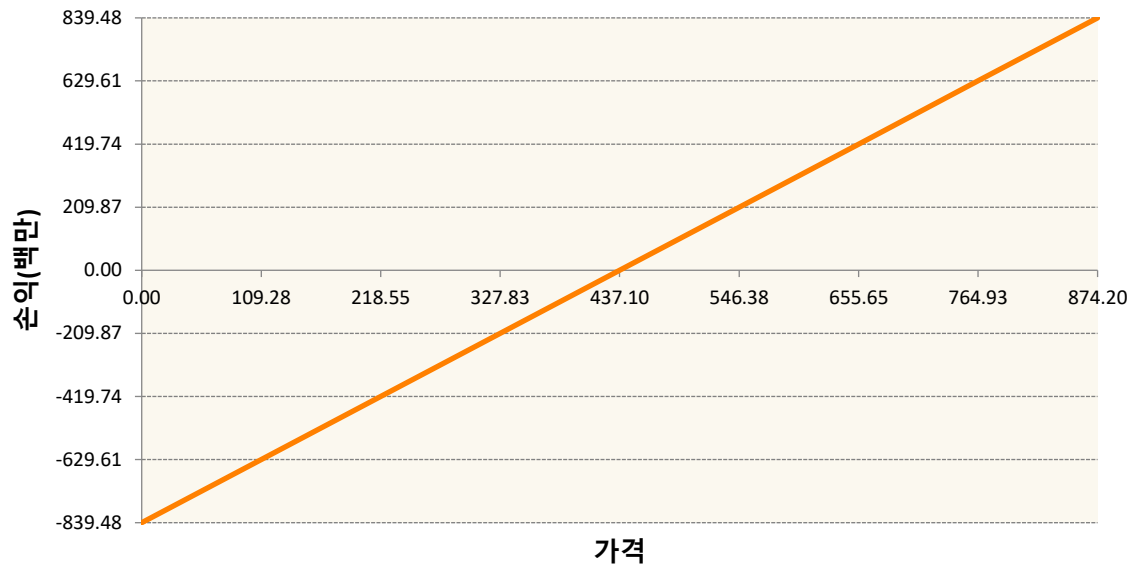
SBK2-Sugar May22



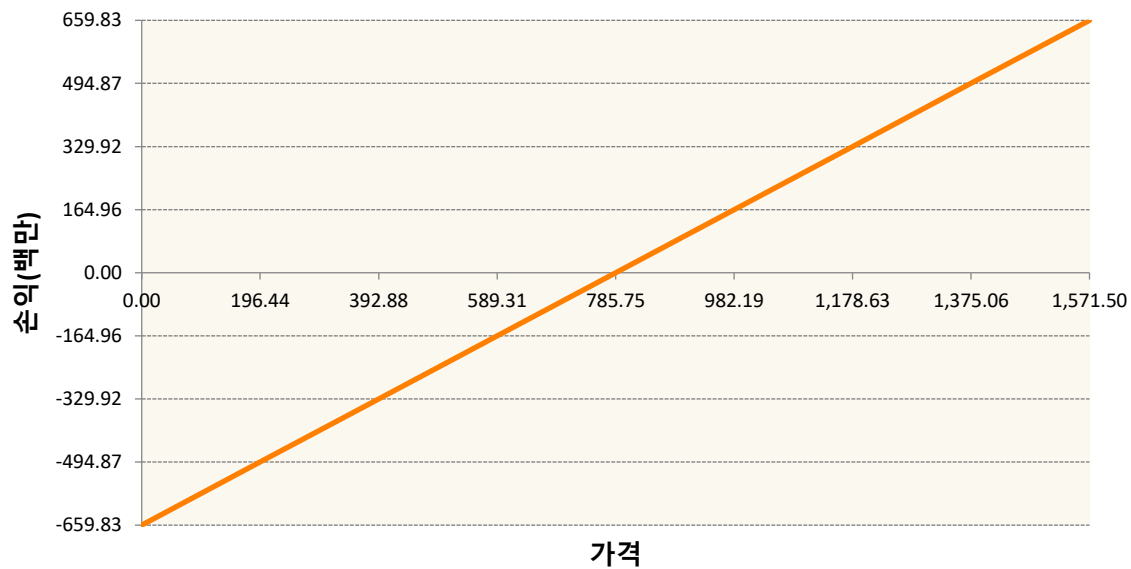
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



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	2022-02-17
기준일	2022-02-16

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	145
------------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

88

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-02-17
기준일	2022-02-16

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)

384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-02-17
기준일	2022-02-16

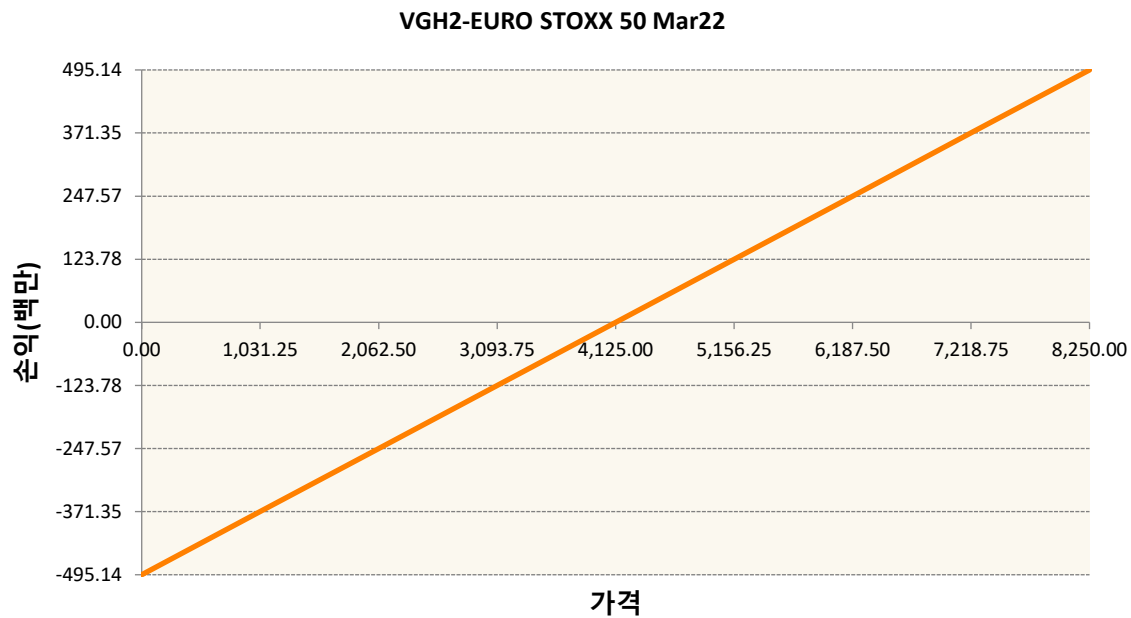
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	495	0	495	

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	2022-02-17
기준일	2022-02-16

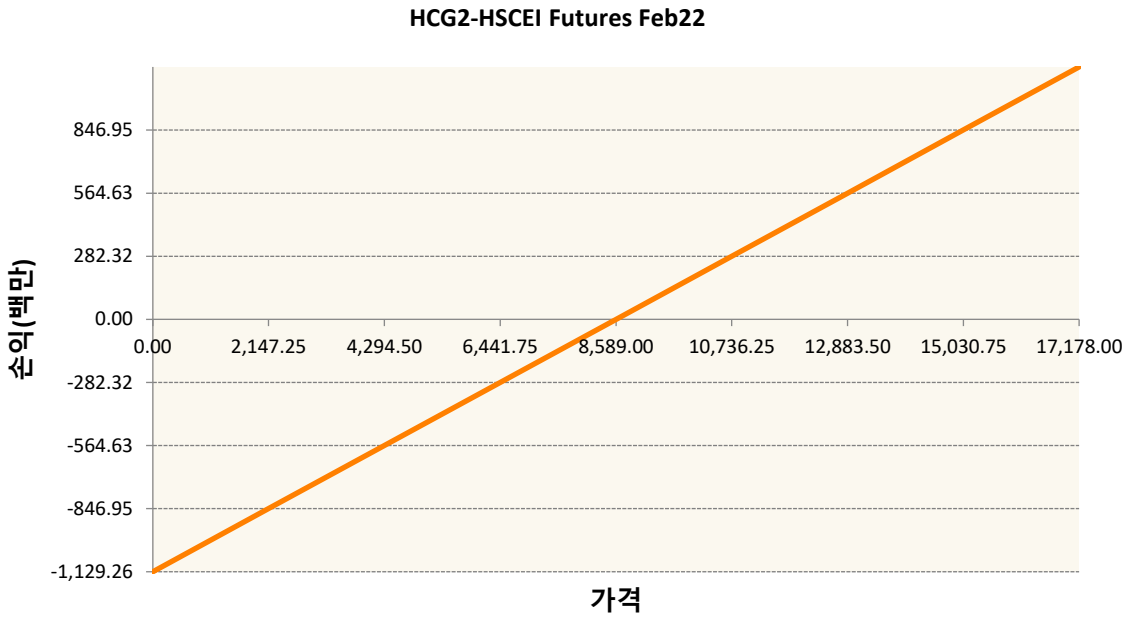
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,129	0	1,129	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 2022-02-17

기준일 2022-02-16

커버드콜모(주식혼합-파생형)

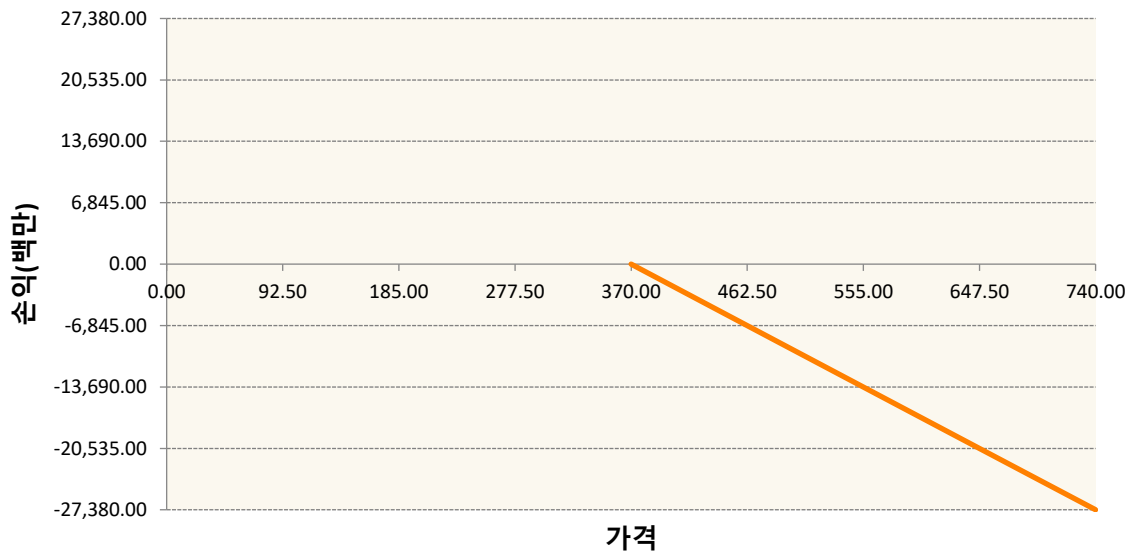
1. 계약금액

(단위:백만원)

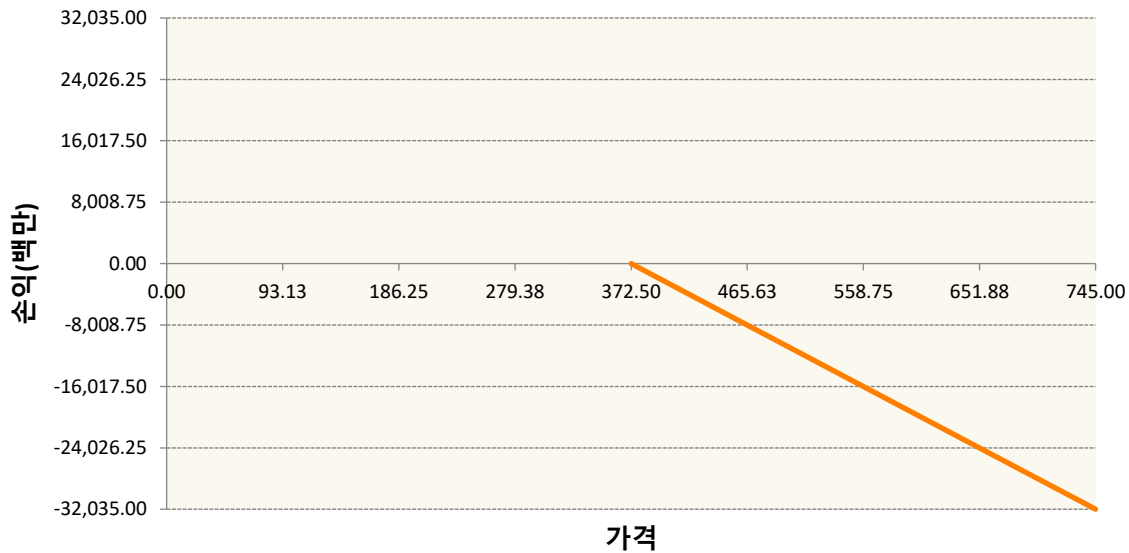
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	73,570	-73,570	장내

2. 만기시점의 손익구조

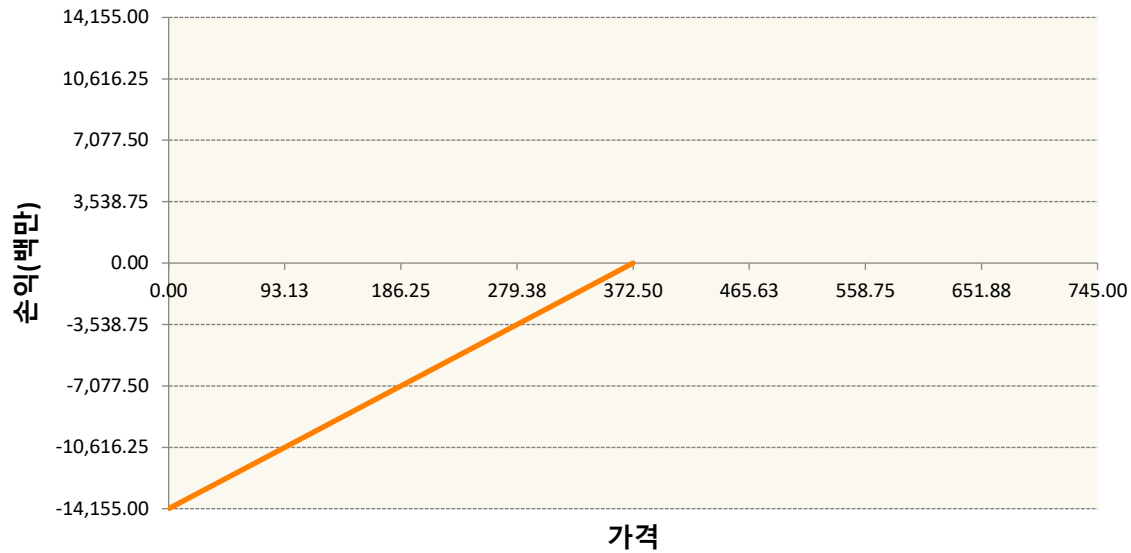
KR4201S33706-2022-03 콜370



KR4201S33722-2022-03 콜372.5



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S33706			2022-03 콜370				1,605
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	712	689	661	628	592	552	509
-5.33%	637	596	550	501	450	396	341
-2.67%	481	421	360	297	233	168	103
0%	211	141	70	0	-71	-141	-212
2.67%	-187	-256	-325	-394	-464	-534	-605
5.33%	-704	-761	-819	-880	-943	-1,007	-1,072
8.00%	-1,313	-1,352	-1,396	-1,443	-1,495	-1,548	-1,605
KR4201S33722			2022-03 콜372.5				1,799
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	746	724	695	661	622	580	533
-5.33%	675	632	584	531	475	416	355
-2.67%	521	455	387	317	246	173	99
0%	242	162	81	0	-81	-163	-244
2.67%	-183	-265	-347	-430	-512	-595	-678
5.33%	-750	-820	-893	-968	-1,044	-1,121	-1,199
8.00%	-1,432	-1,483	-1,540	-1,600	-1,664	-1,730	-1,799
KR4301S33720			2022-03 풋372.5				933
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-905	-906	-909	-913	-919	-925	-933
-5.33%	-541	-548	-556	-566	-578	-590	-604
-2.67%	-204	-220	-237	-255	-274	-293	-313
0%	72	48	24	0	-24	-49	-73

2.67%	258	234	209	185	160	135	110
5.33%	357	339	321	301	280	259	238
8.00%	396	387	377	364	350	335	319

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

(단위:백만원)

4,076

공시일 2022-02-17

기준일 2022-02-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

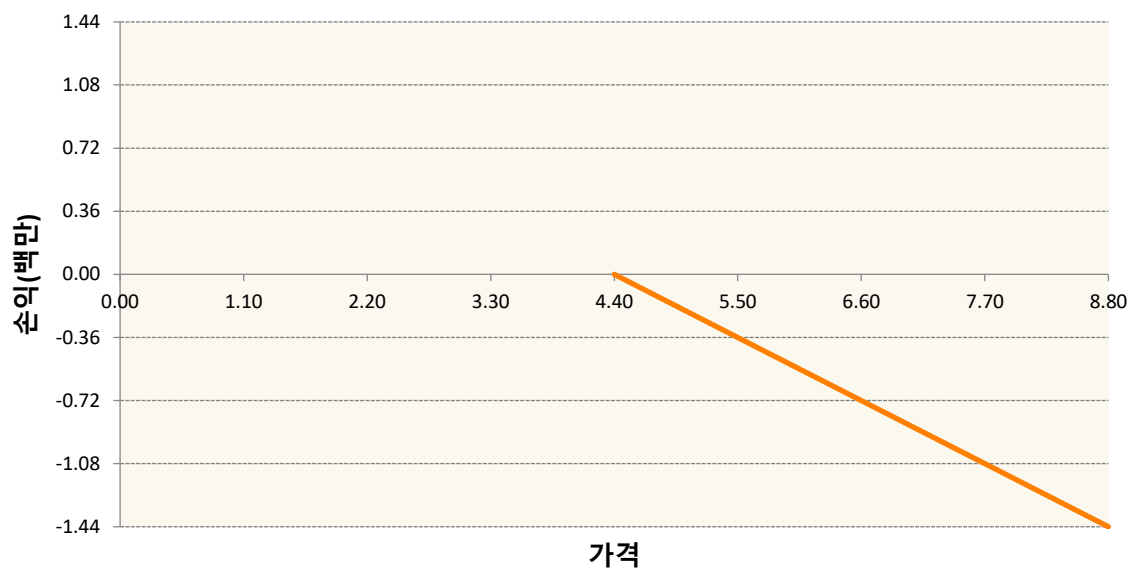
1. 계약금액

(단위:백만원)

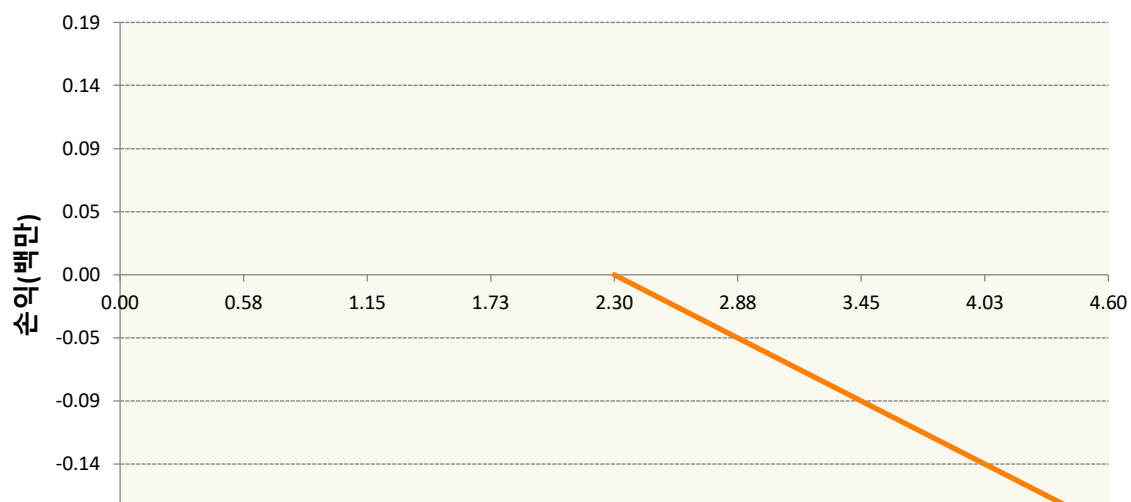
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	41	-41	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,721	-2,721	장외

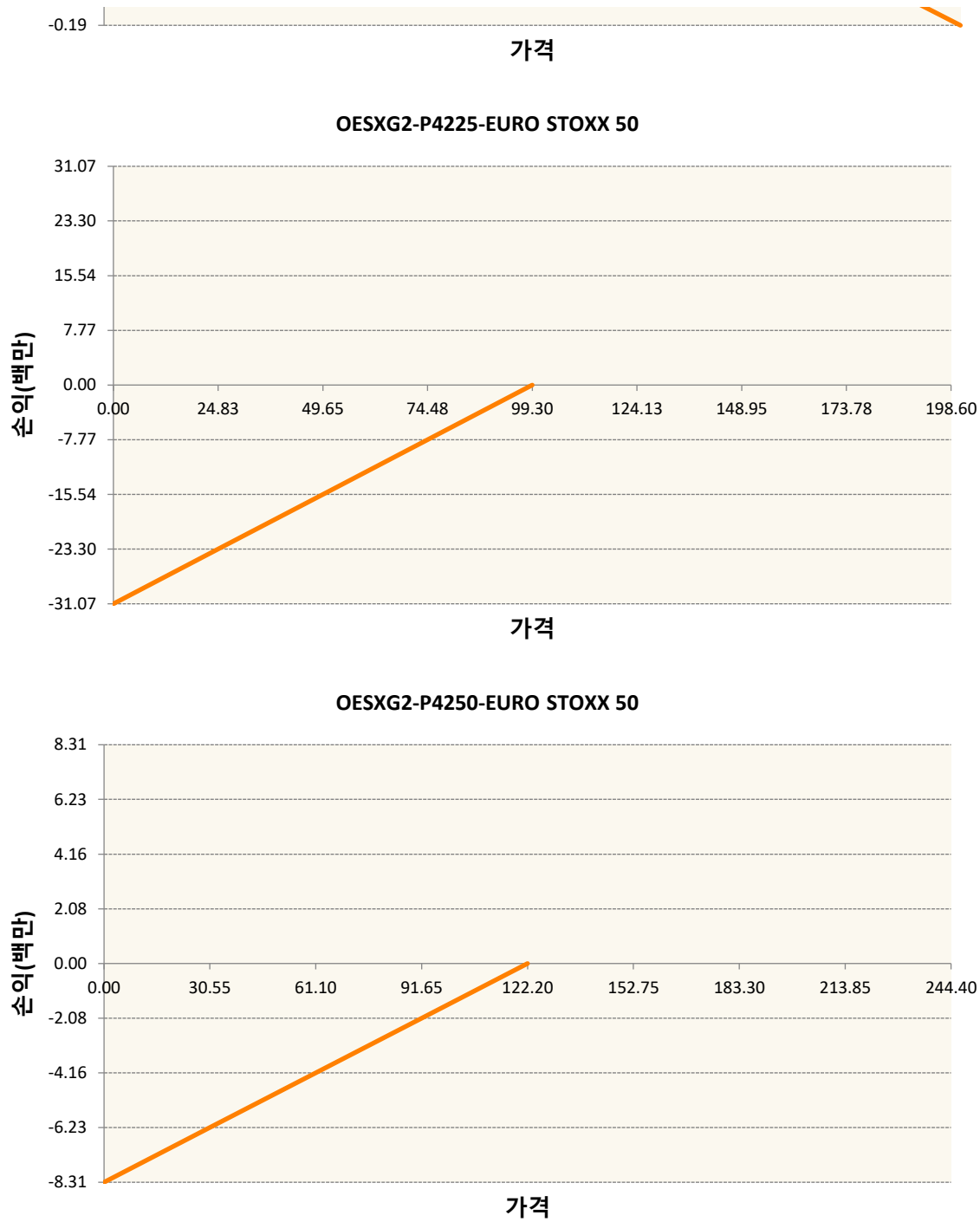
2. 만기시점의 손익구조

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
 FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E
 FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E
 OESXG1-C42 EURO STOXX 50
 OESXG2-C42 EURO STOXX 50
 OESXG2-P42 EURO STOXX 50
 OESXG2-P42 EURO STOXX 50

1
54
109
22
33
0.11
0.02
2
1

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

(단위:백만원)

102

공시일	2022-02-17
기준일	2022-02-16

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

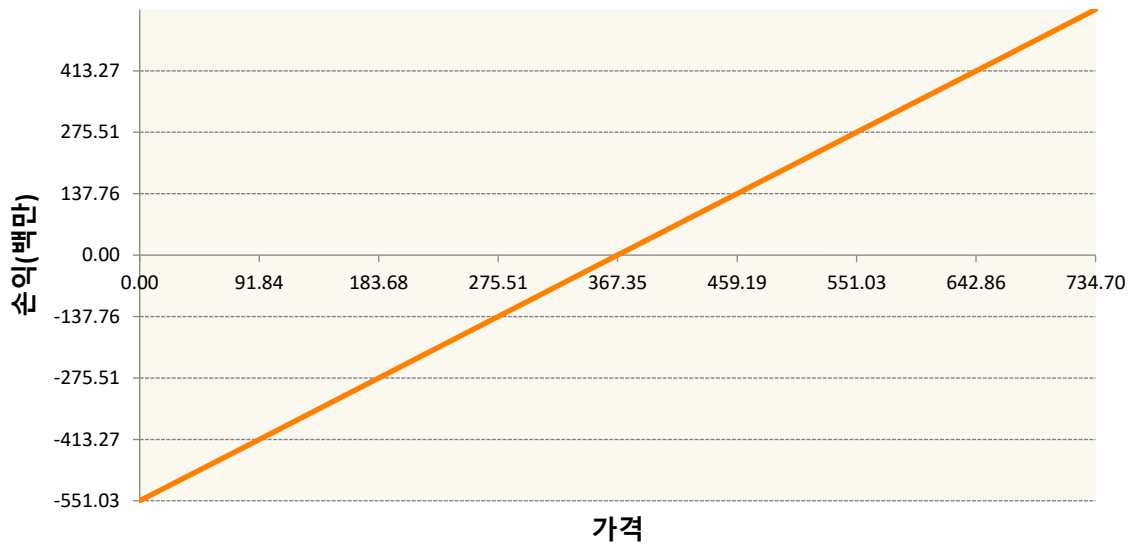
1. 계약금액

(단위:백만원)

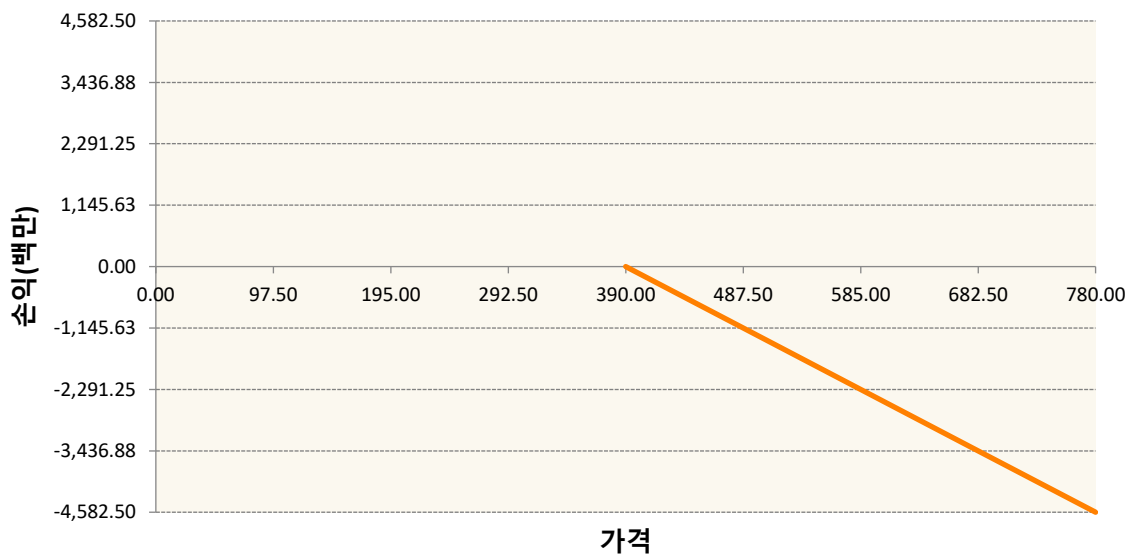
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	551	0	551	장내
누계	유가증권	옵션	372	4,877	-4,505	장내

2. 만기시점의 손익구조

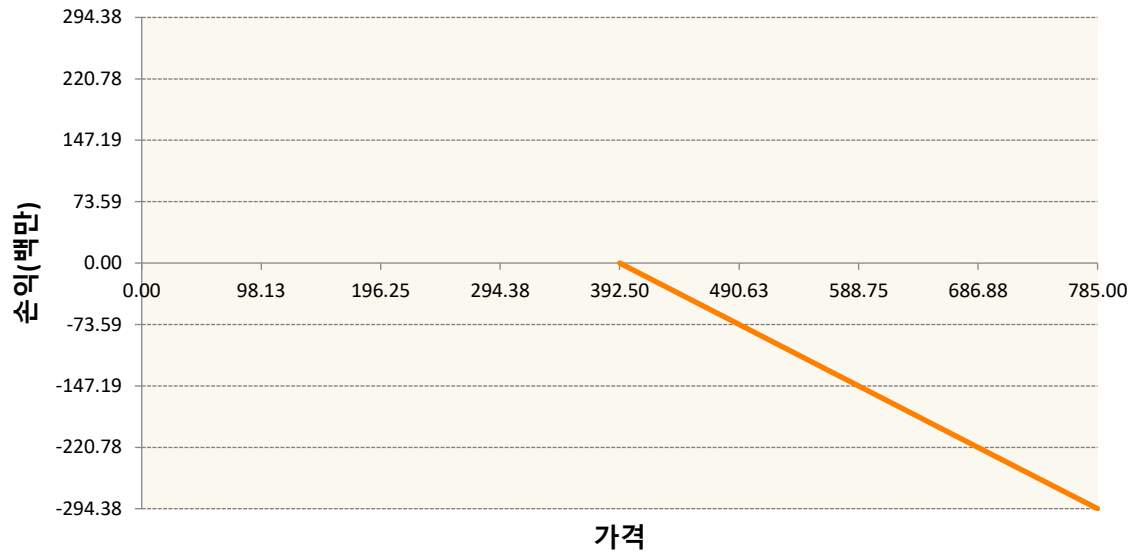
KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



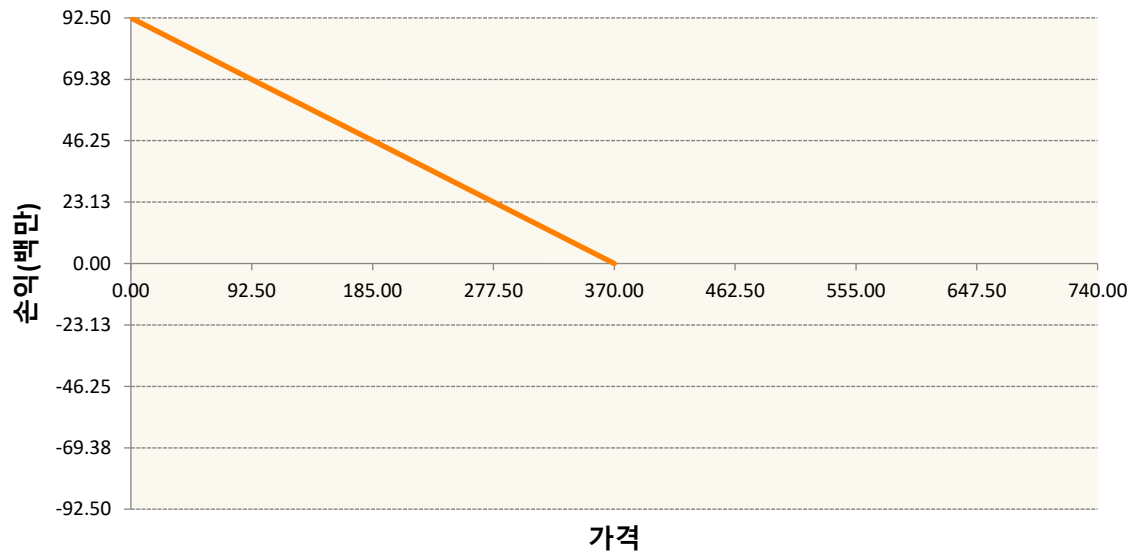
KR4201S33904-2022-03 콜390



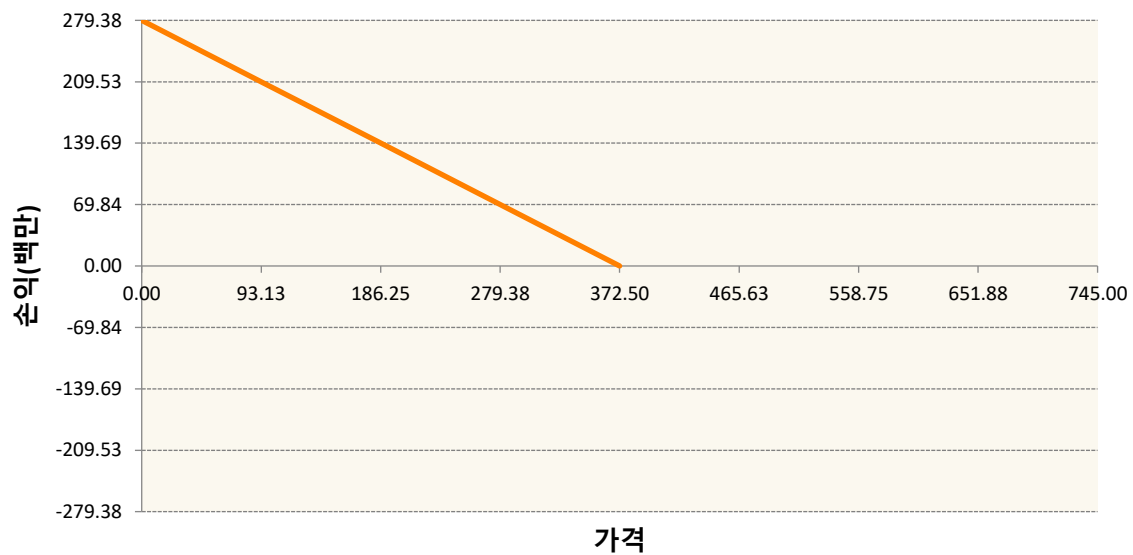
KR4201S33920-2022-03 콜392.5



KR4301S33704-2022-03 풋370



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



(단위:백만원)

KR4101S30001				2022-03 코스피200지수선물				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	-44
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-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%	29	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	44	44	44	44	44	44	44	44
KR4201S33904				2022-03 콜390				177
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	44	43	42	40	37	34	31	31
-5.33%	42	40	37	34	29	25	19	19
-2.67%	36	32	27	21	15	8	0	0
0%	23	16	8	0	-9	-18	-27	-27
2.67%	-2	-12	-23	-33	-44	-55	-66	-66
5.33%	-45	-57	-69	-80	-92	-104	-116	-116
8.00%	-107	-119	-130	-142	-154	-166	-177	-177
KR4201S33920				2022-03 콜392.5				11
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	1	1	1
-2.67%	2	2	2	1	1	0	0	0
0%	1	1	0	0	-1	-1	-2	-2
2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-3	-4	-4
5.33%	-2	-3	-4	-5	-5	-6	-7	-7
8.00%	-6	-7	-8	-8	-9	-10	-11	-11
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	6
-5.33%	3	3	3	4	4	4	4	4
-2.67%	1	1	1	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301S33720				2022-03 풋372.5				18
	기초자산의 변동성							

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

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

(단위:백만원)

201

공시일 2022-02-17

기준일 2022-02-16

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	10,120	0	10,120	

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	2022-02-17
기준일	2022-02-16

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	8,763	0	8,763	

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	2022-02-17
기준일	2022-02-16

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	29,124	0	29,124	
누계	통화	선도	922	30,539	-29,617	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E	2,251
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)

801

공시일 2022-02-17

기준일 2022-02-16

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

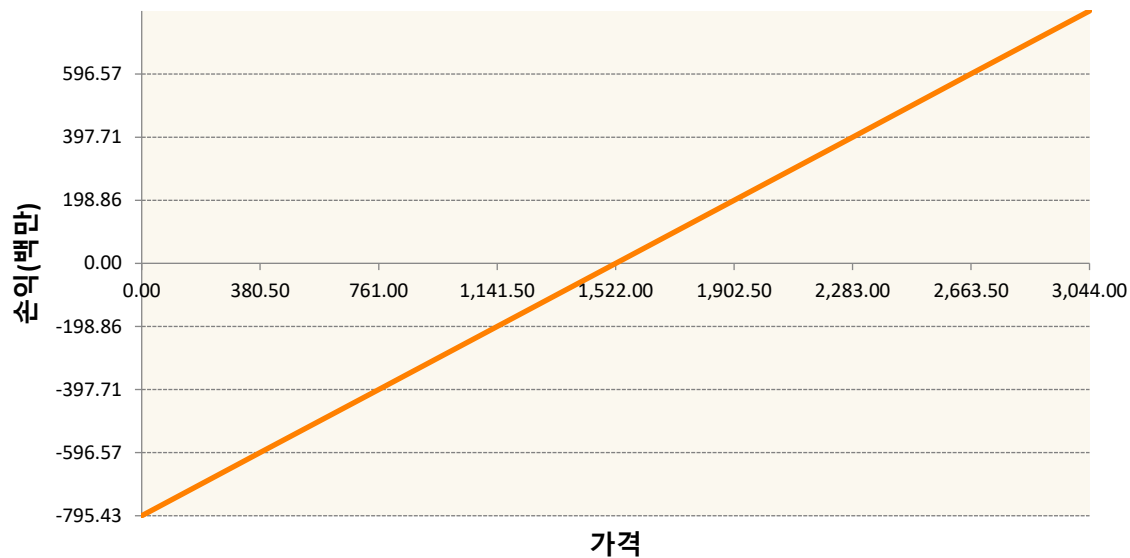
1. 계약금액

(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	795	0	795	
누계	유가증권	스왑	1,860	0	1,860	장외
누계	통화	선도	0	1,333	-1,333	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	64

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

(단위:백만원)

공시일 2022-02-17

기준일 2022-02-16

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

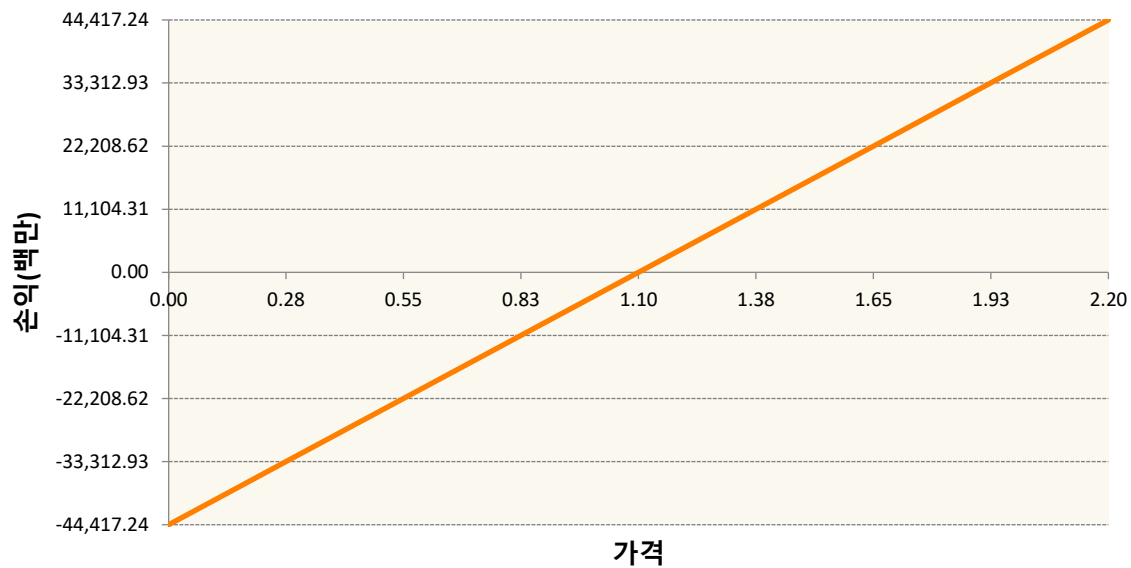
1. 계약금액

(단위:백만원)

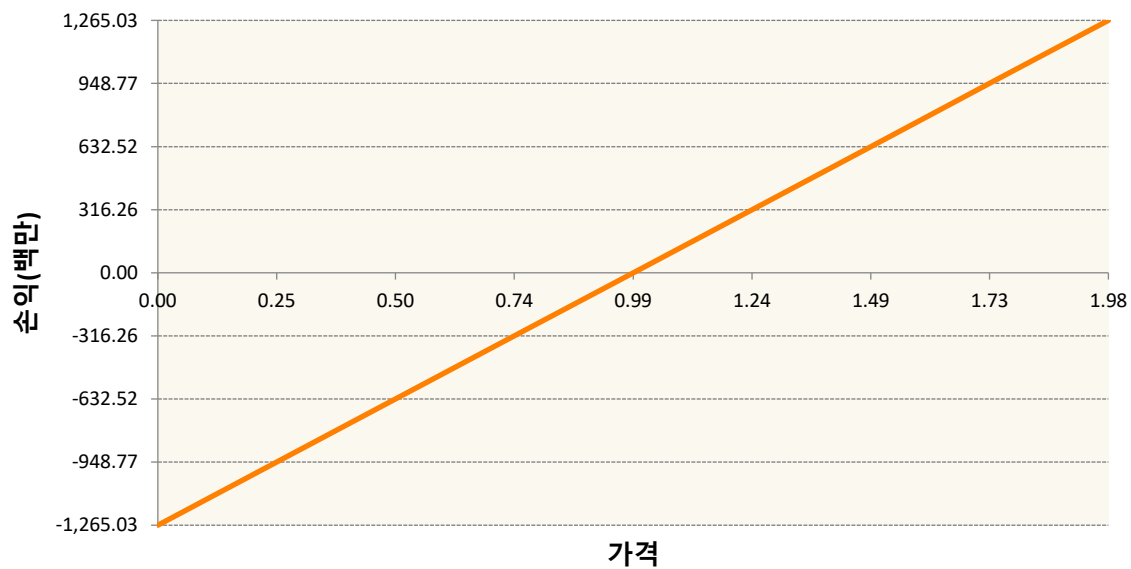
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,556	0	2,556	
누계	유가증권	선물	46,947	0	46,947	

2. 만기시점의 손익구조

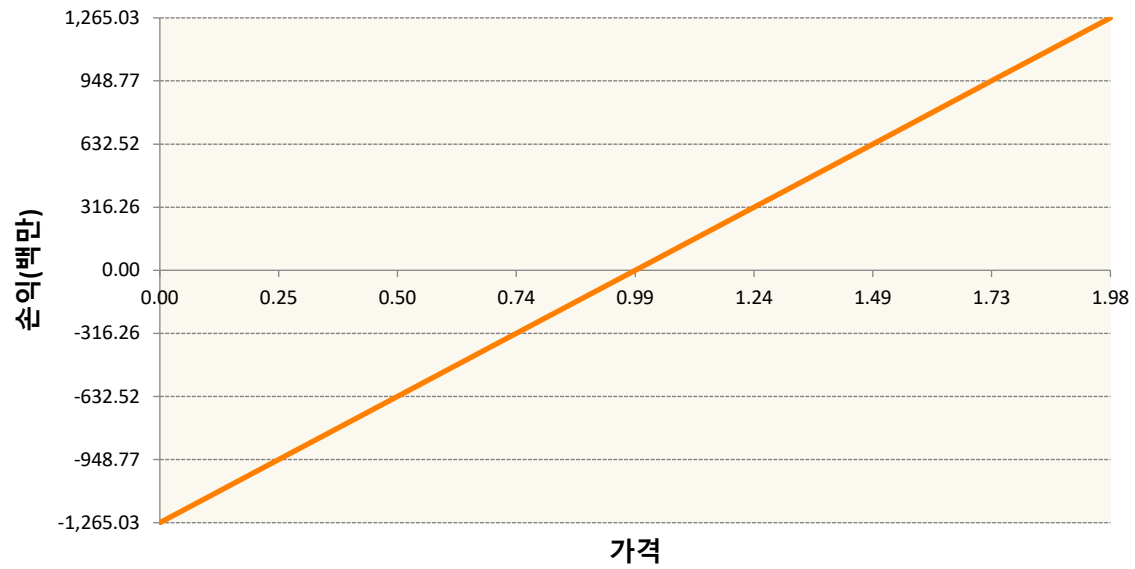
210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220216-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220217-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,560
102
102

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

(단위:백만원)

6,033

공시일 2022-02-17

기준일 2022-02-16

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

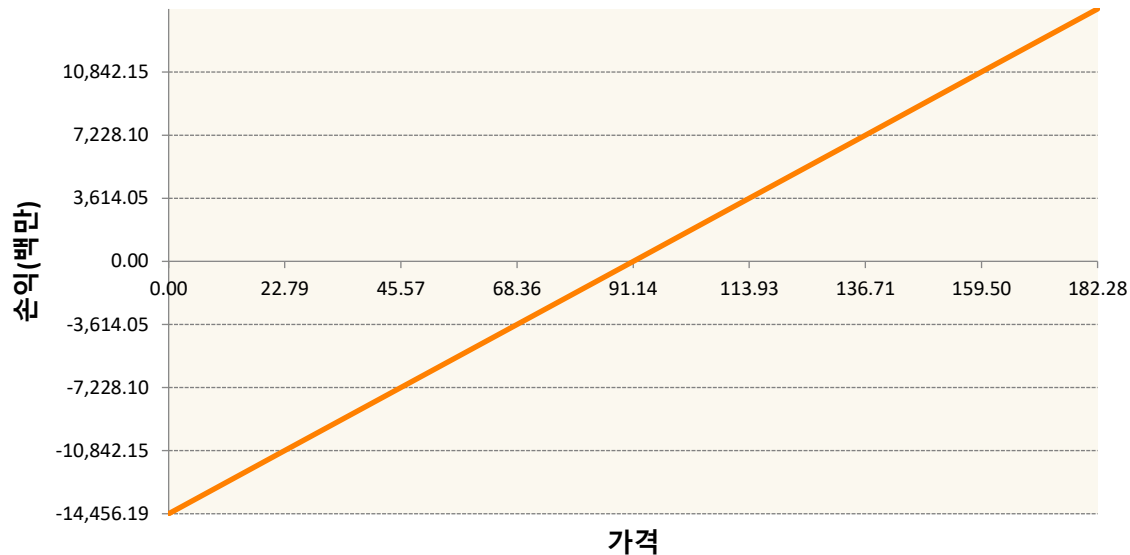
1. 계약금액

(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	14,456	0	14,456	
누계	통화	선도	0	8,784	-8,784	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1V·KRW/EUR 25-02-22E

703

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,156

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

(단위:백만원)

2,737

공시일	2022-02-17
기준일	2022-02-16

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)	35
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	35
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	35
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	35

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

(단위:백만원)

271

공시일	2022-02-17
기준일	2022-02-16

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)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	13

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

(단위:백만원)

66

공시일 2022-02-17

기준일 2022-02-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

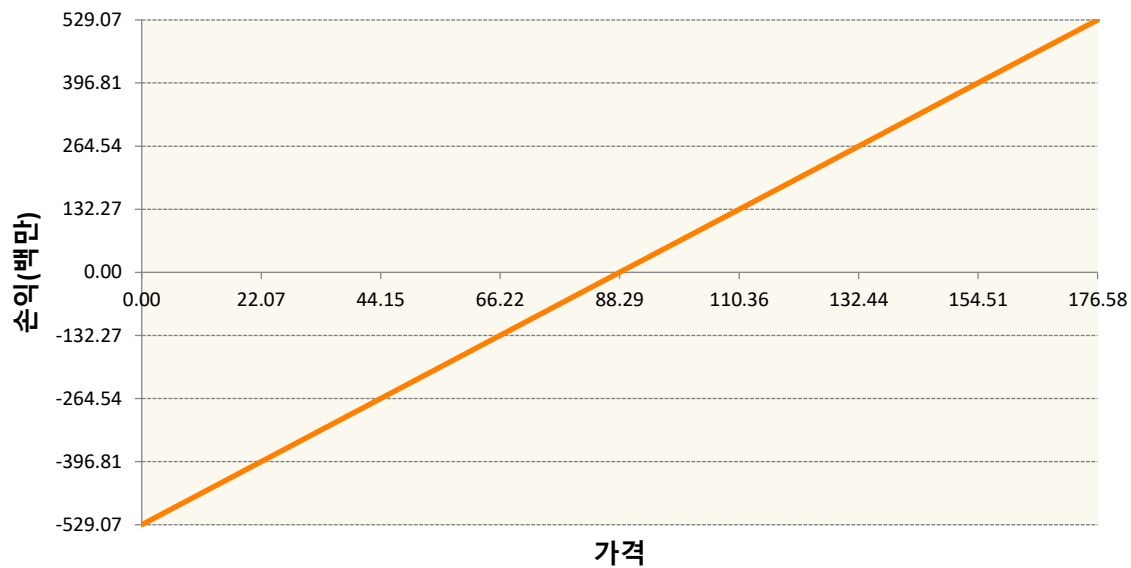
1. 계약금액

(단위:백만원)

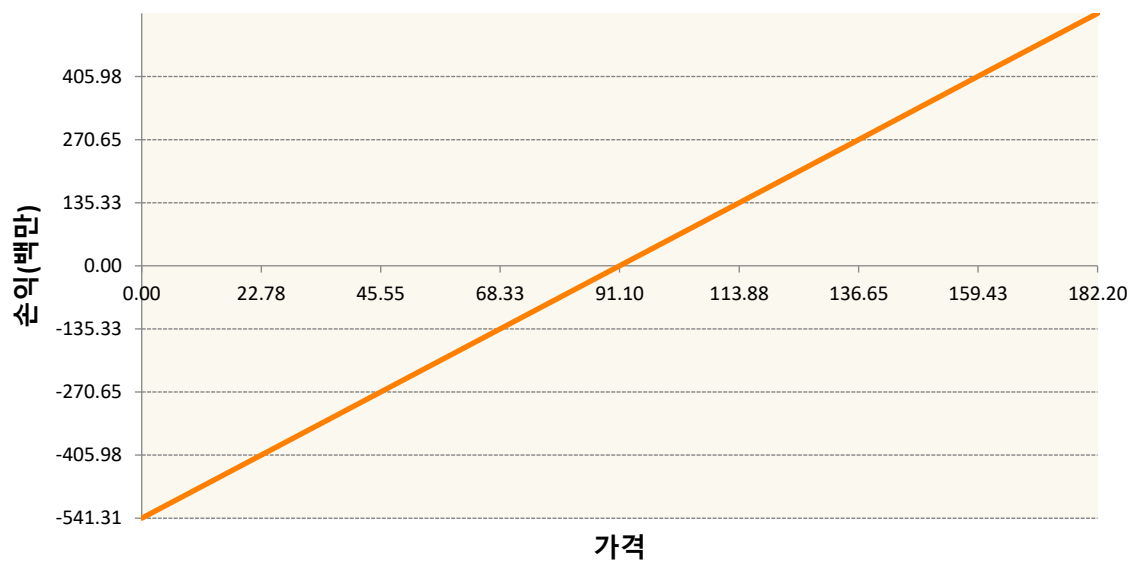
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,290	419	1,871	

2. 만기시점의 손익구조

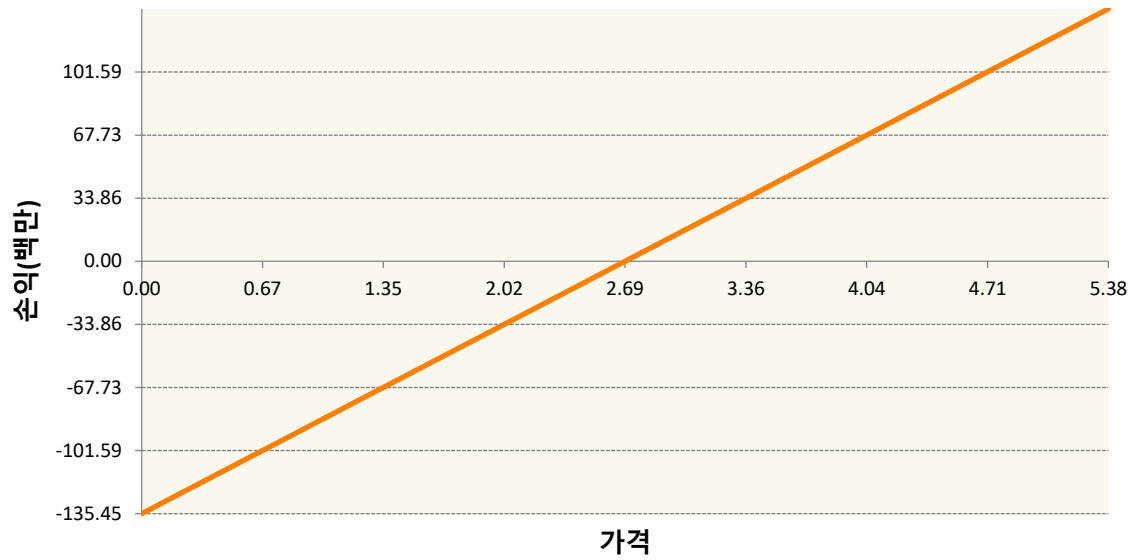
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



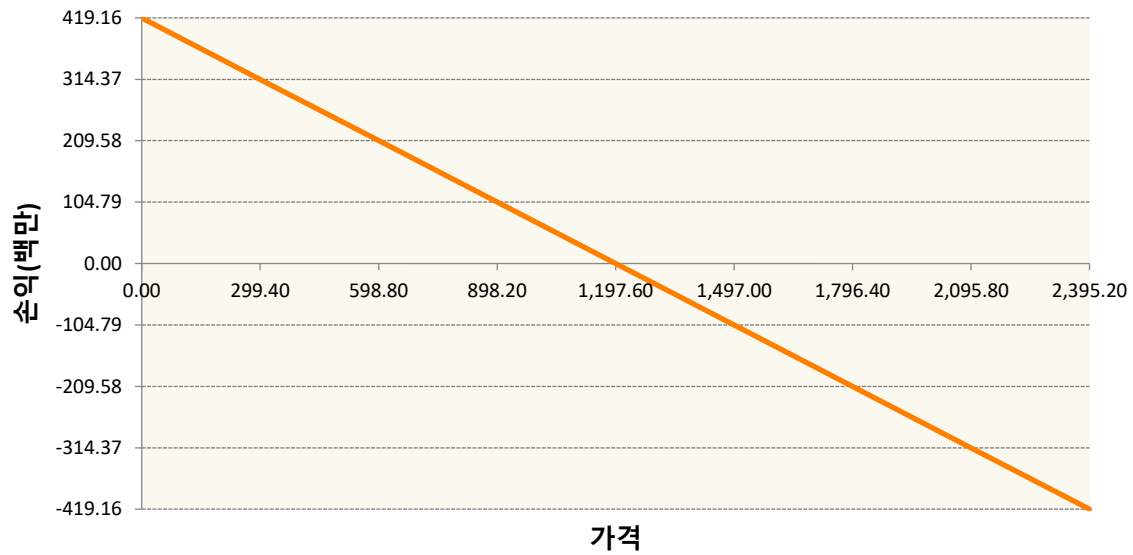
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



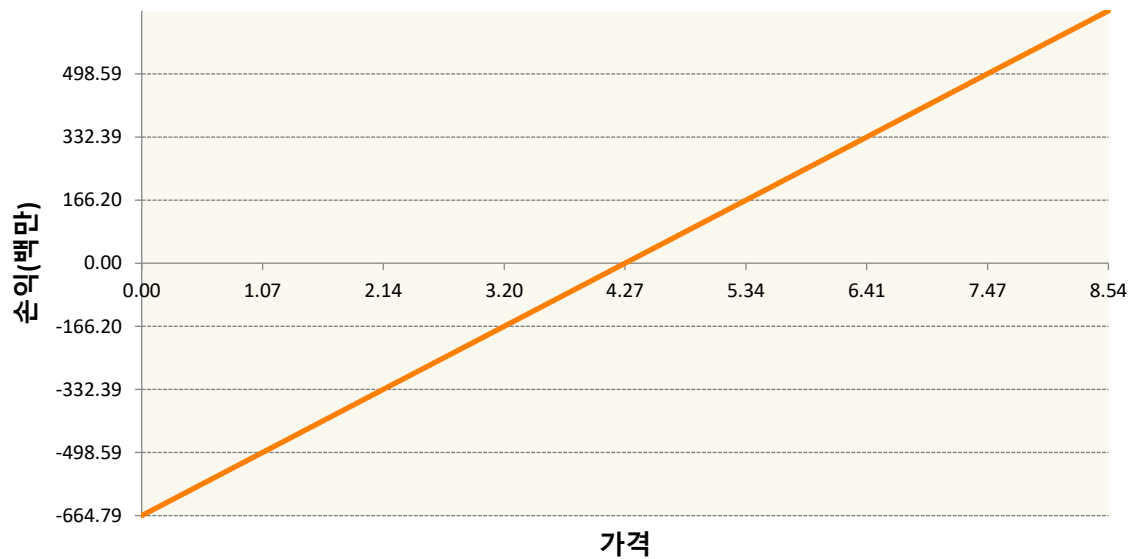
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

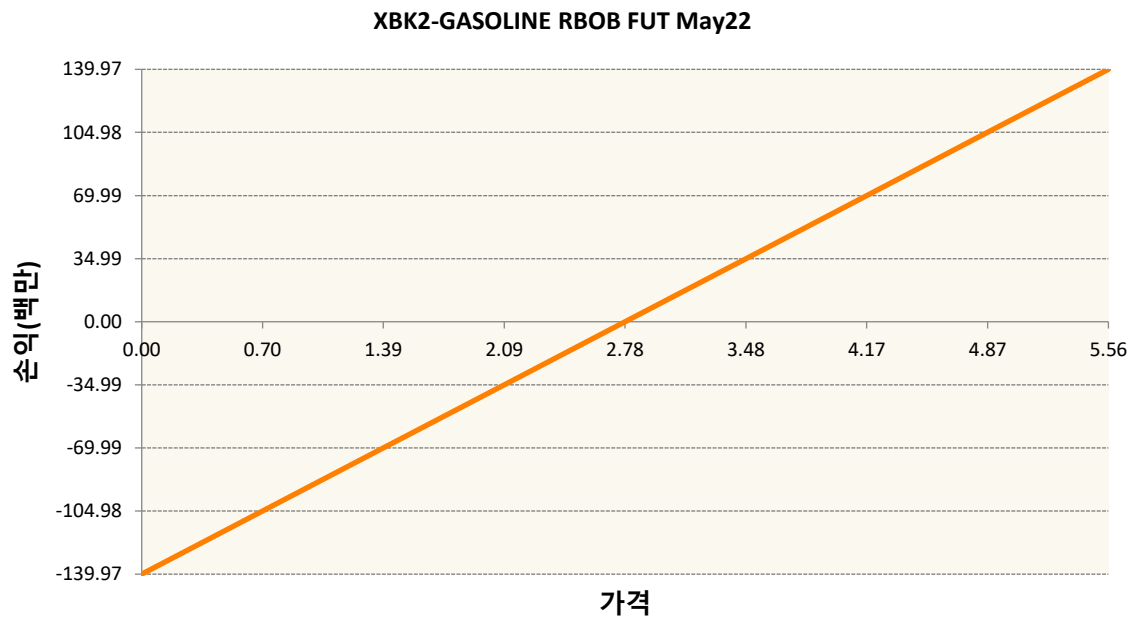
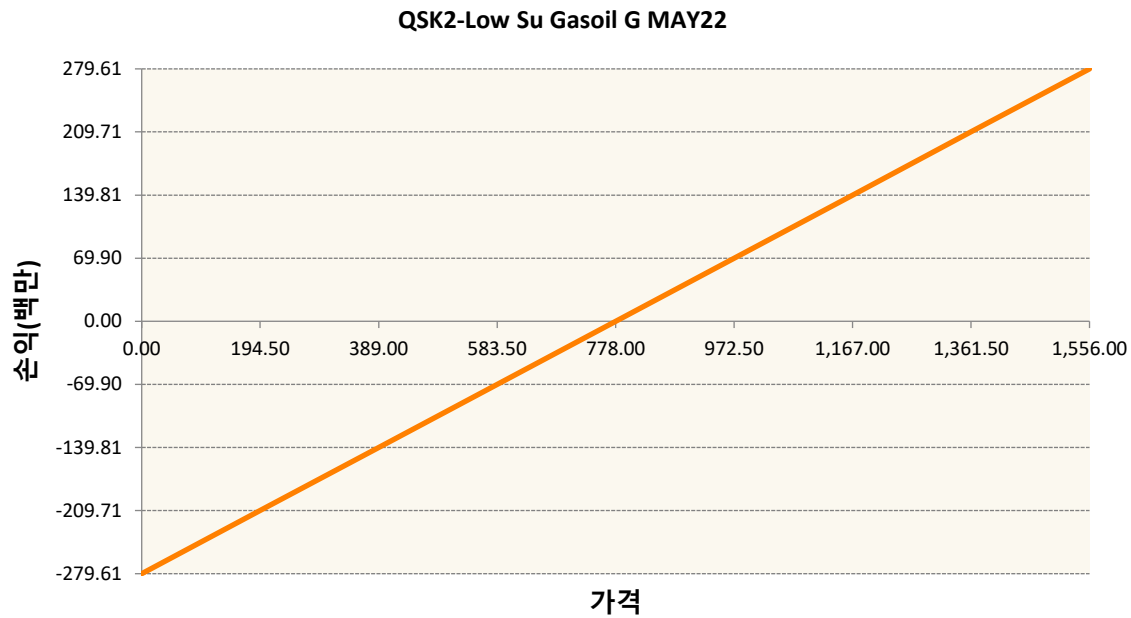


KR4175S20006-2022-02 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		42
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22		43
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		11
KR4175S200	2022-02 달러선물		34
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		53
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		22
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		457