

공시일 2022-03-03

기준일 2022-03-02

포커스농산물모(채권-파생형)

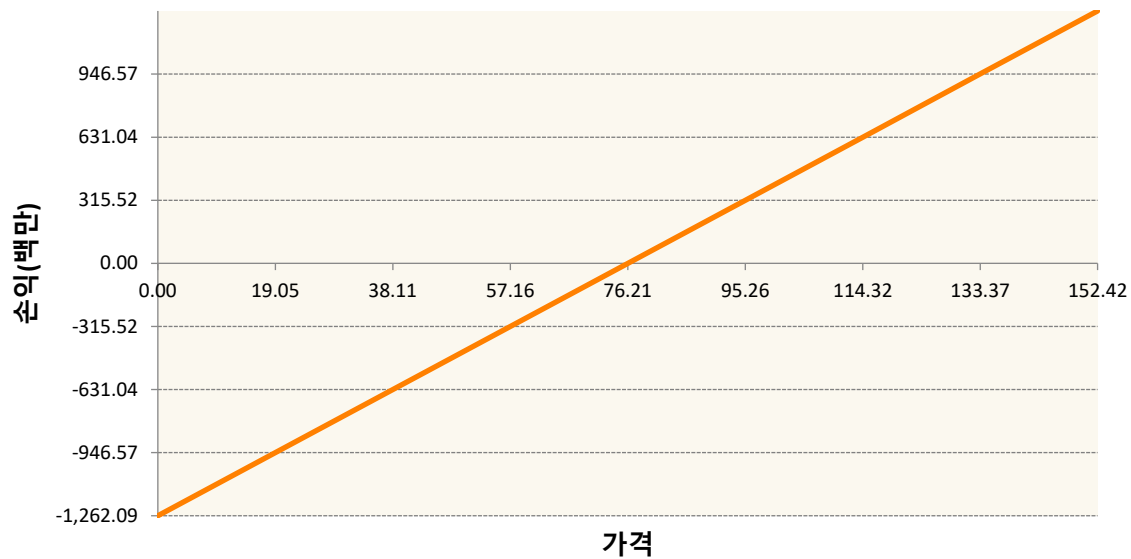
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

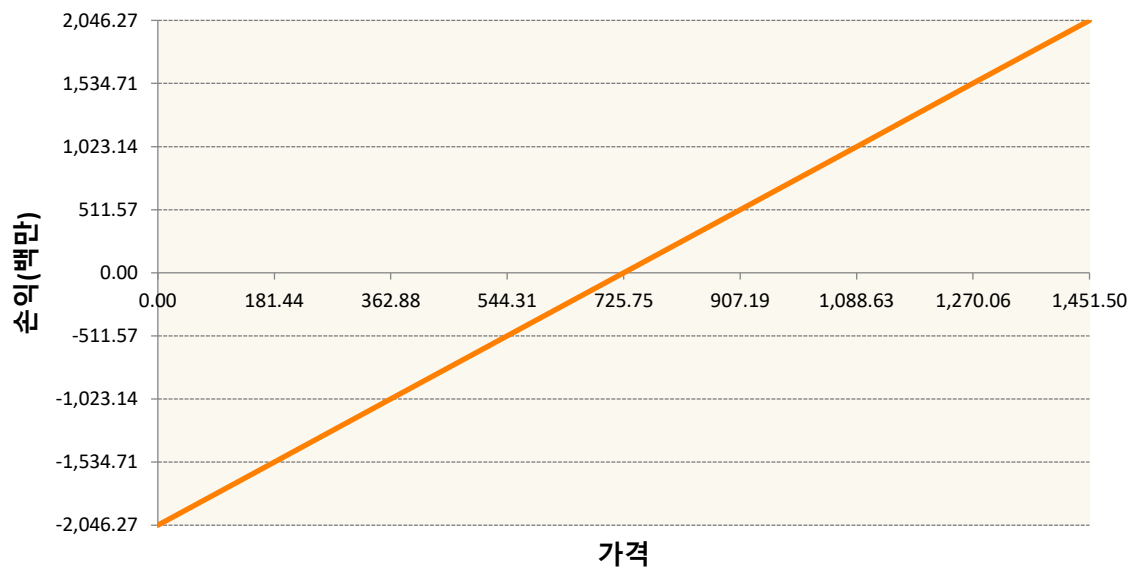
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,649	1,328	9,321	

2. 만기시점의 손익구조

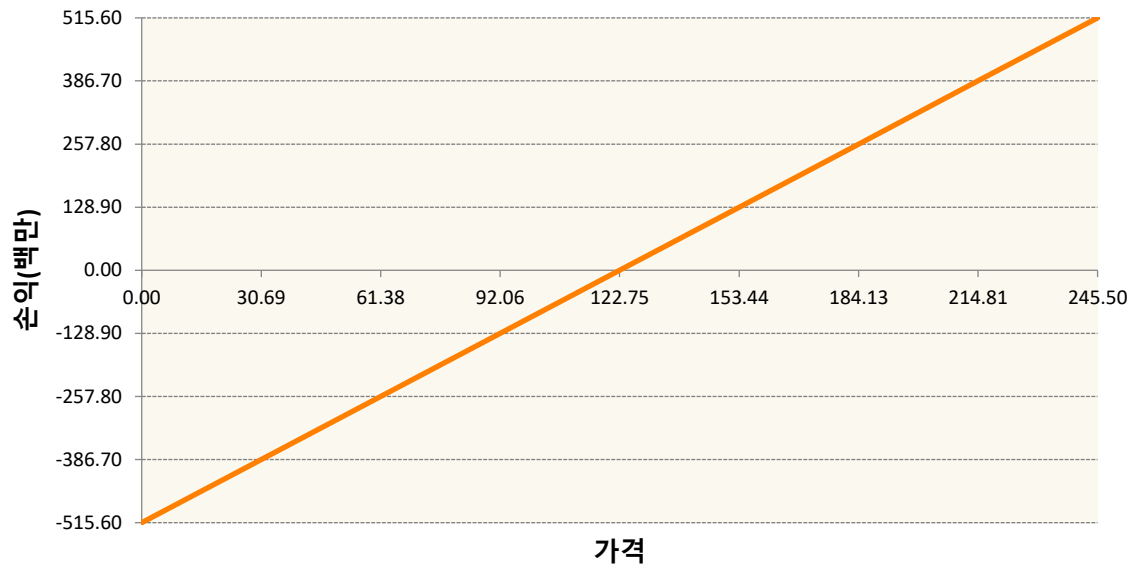
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



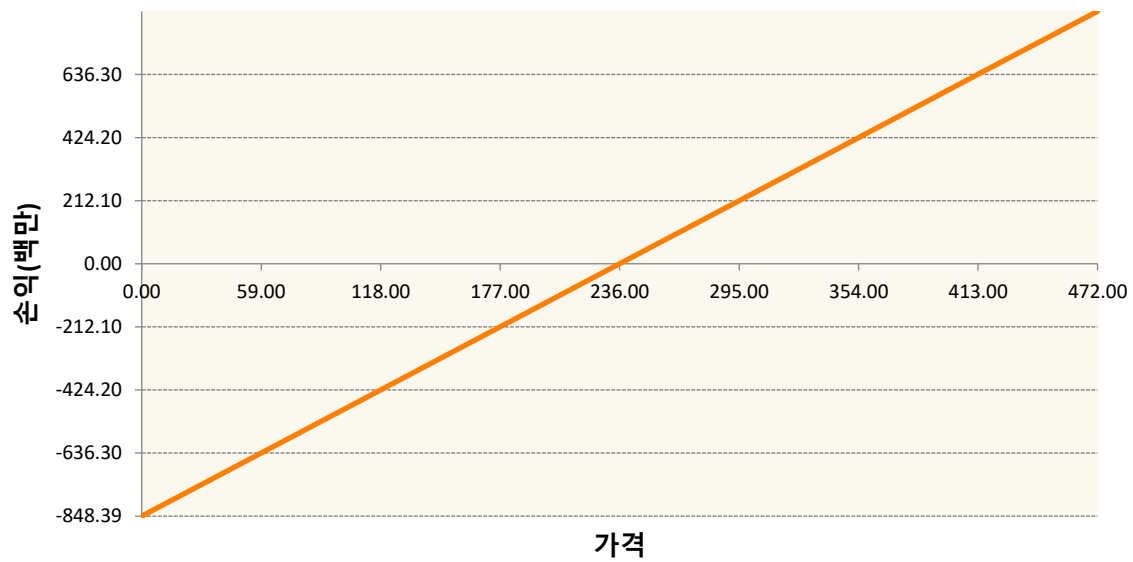
CK2-CORN FUTURE May22



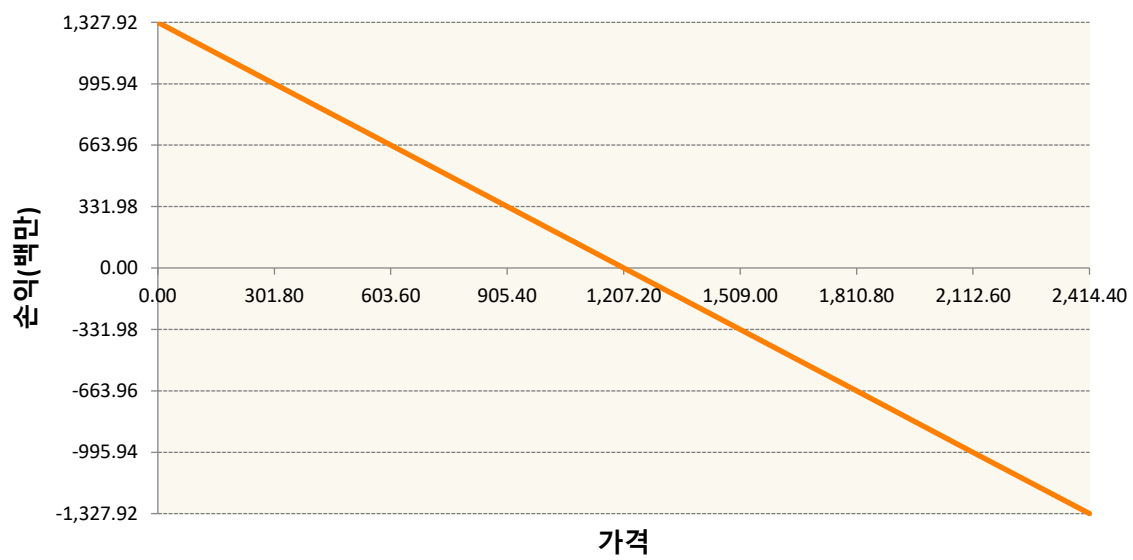
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



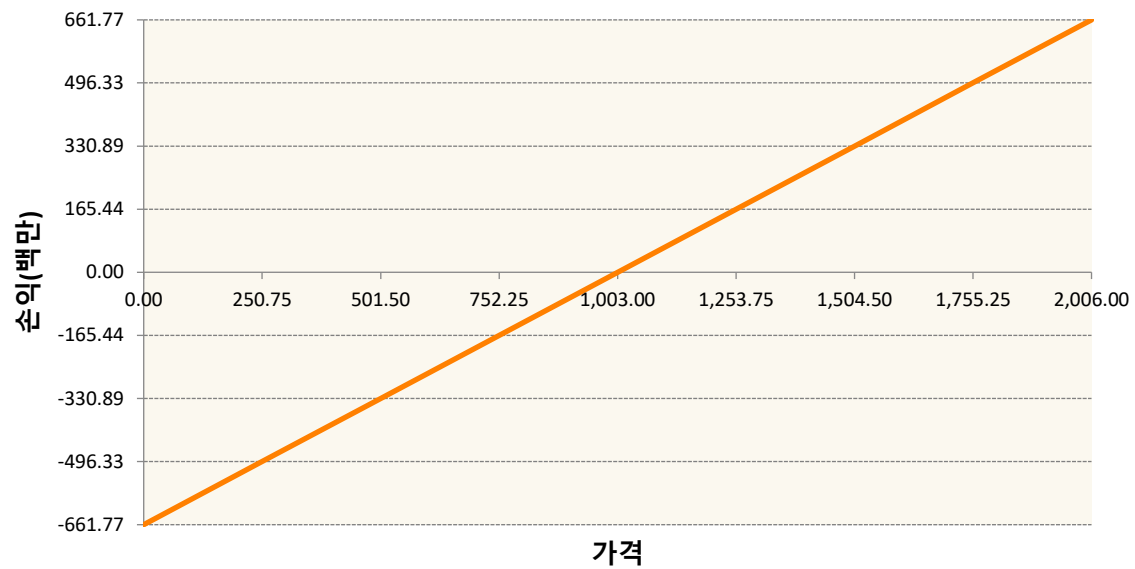
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



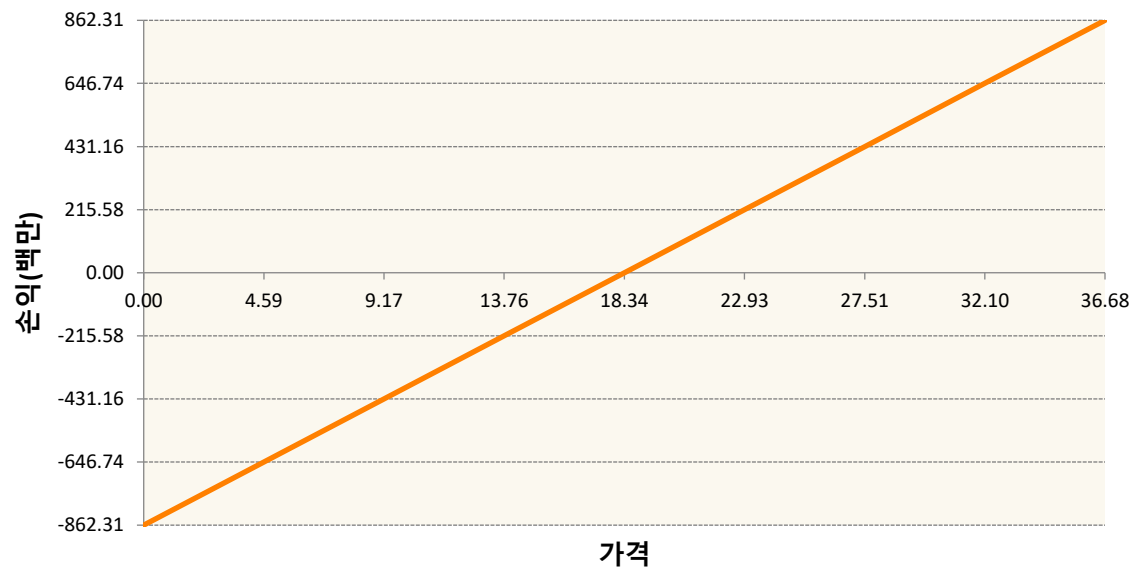
KR4175S30005-2022-03 달러선물



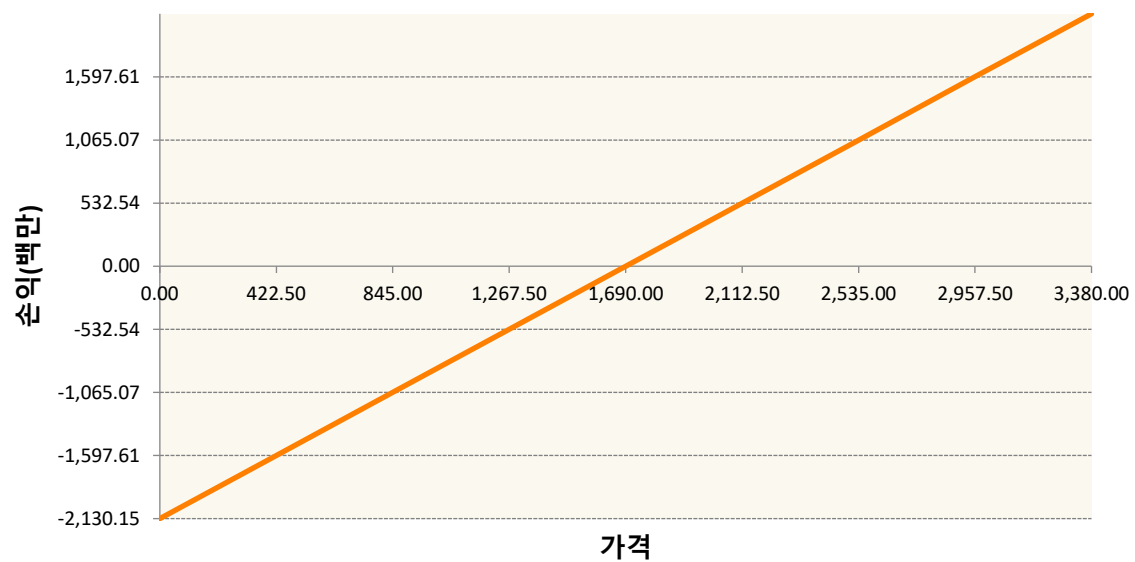
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22

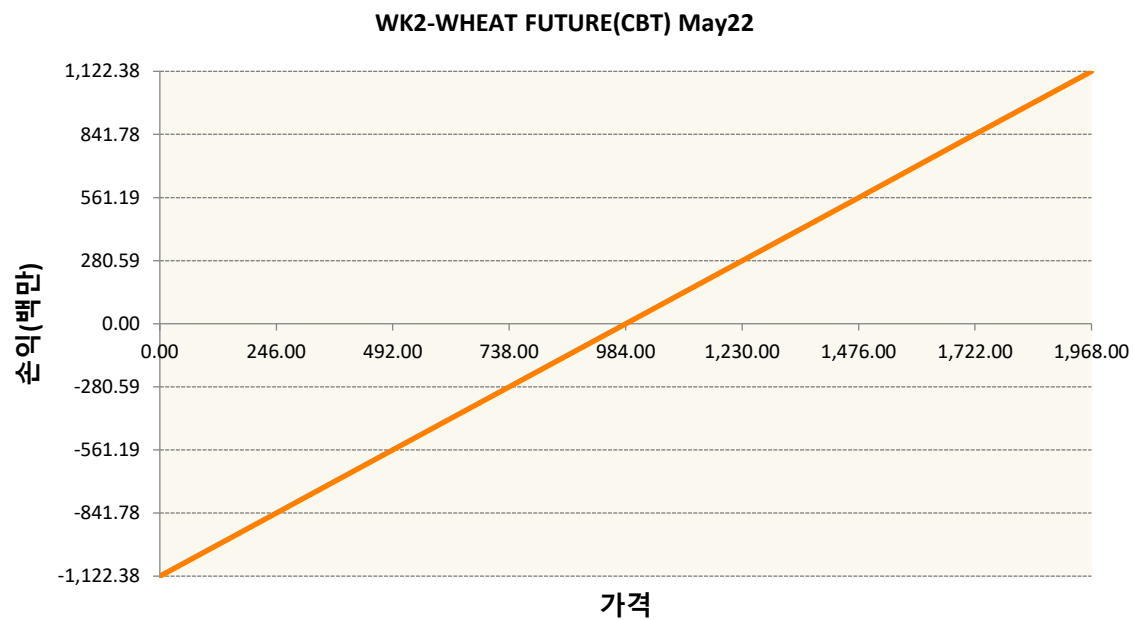
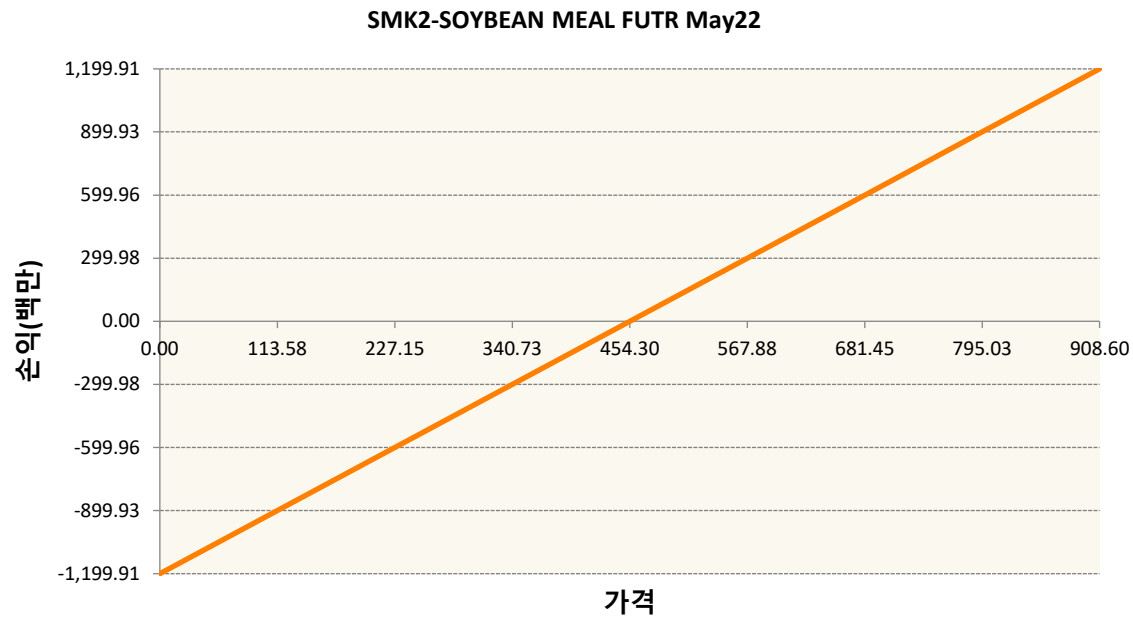


SBK2-Sugar May22



SK2-SOYBEAN FUTURE 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	2022-03-03
기준일	2022-03-02

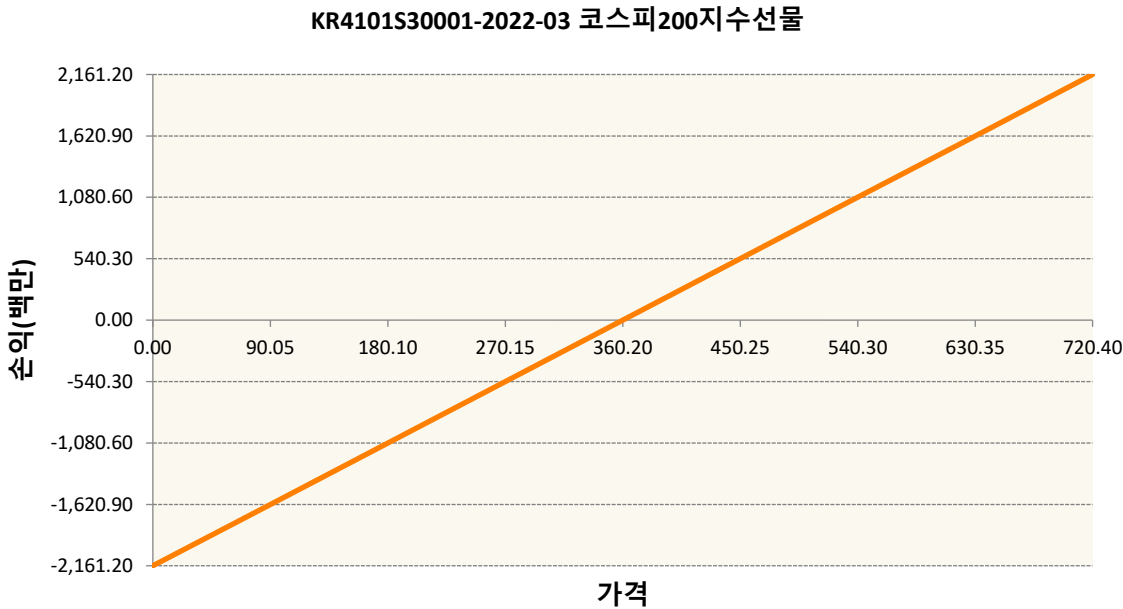
스마트인덱스모

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	2,161	0	2,161	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물				173
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
-5.33%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
-2.67%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	58	58	58	58	58	58	58
5.33%	115	115	115	115	115	115	115
8.00%	173	173	173	173	173	173	173

공시일	2022-03-03
기준일	2022-03-02

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	1,733	0	1,733	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20220225

140

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

86

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-03-03
기준일	2022-03-02

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	418
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

392

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-03-03
기준일	2022-03-02

유로인덱스모(주식-파생형)

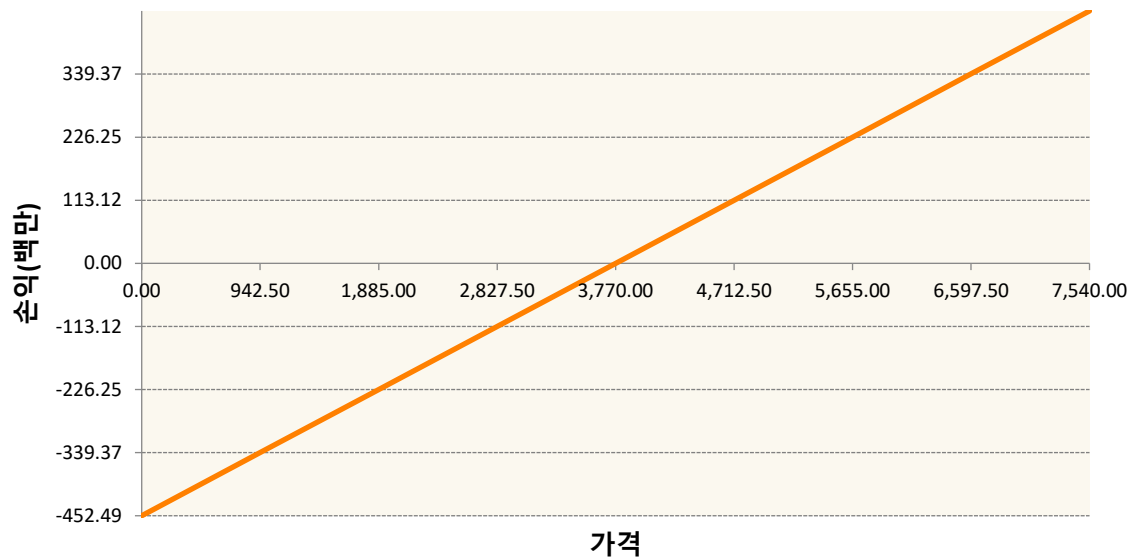
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	452	0	452	

2. 만기시점의 손익구조

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	36
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

33

공시일 2022-03-03

기준일 2022-03-02

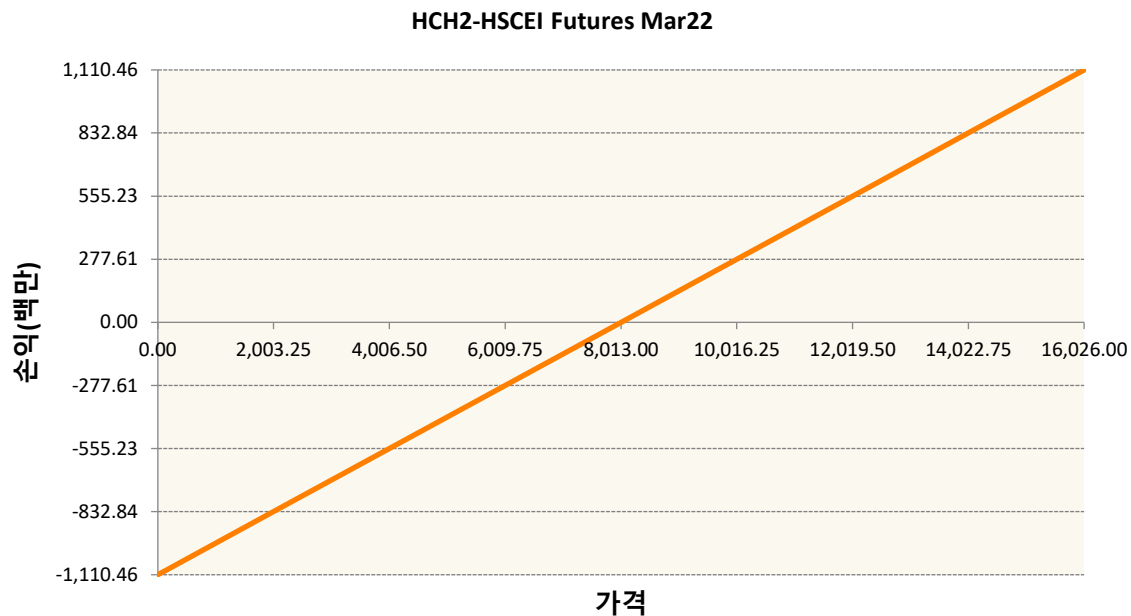
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,110	0	1,110	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2

HSCEI Futures Mar22

89

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

(단위:백만원)

96

공시일 2022-03-03

기준일 2022-03-02

커버드콜모(주식혼합-파생형)

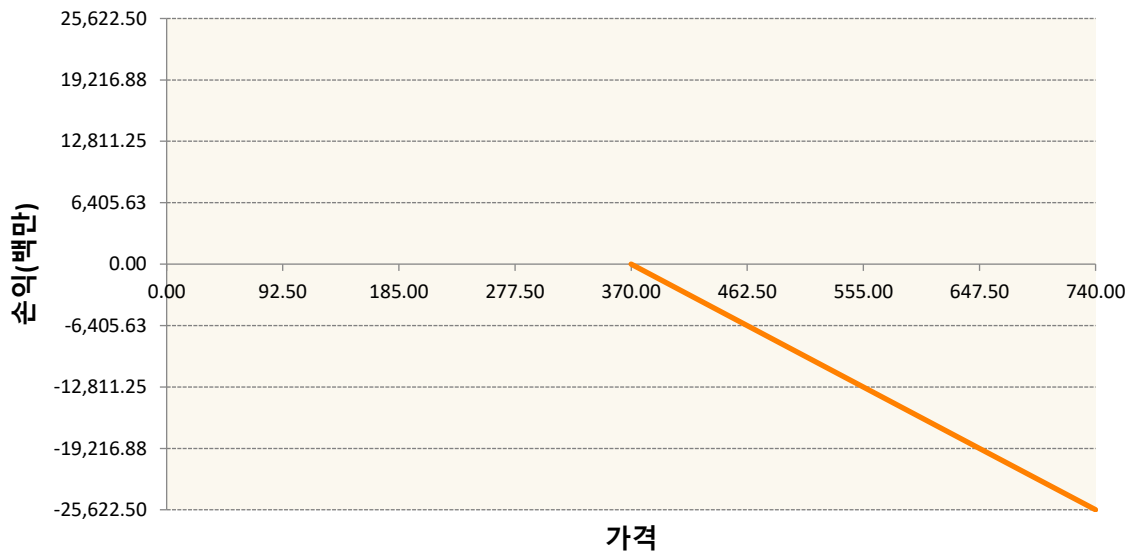
1. 계약금액

(단위:백만원)

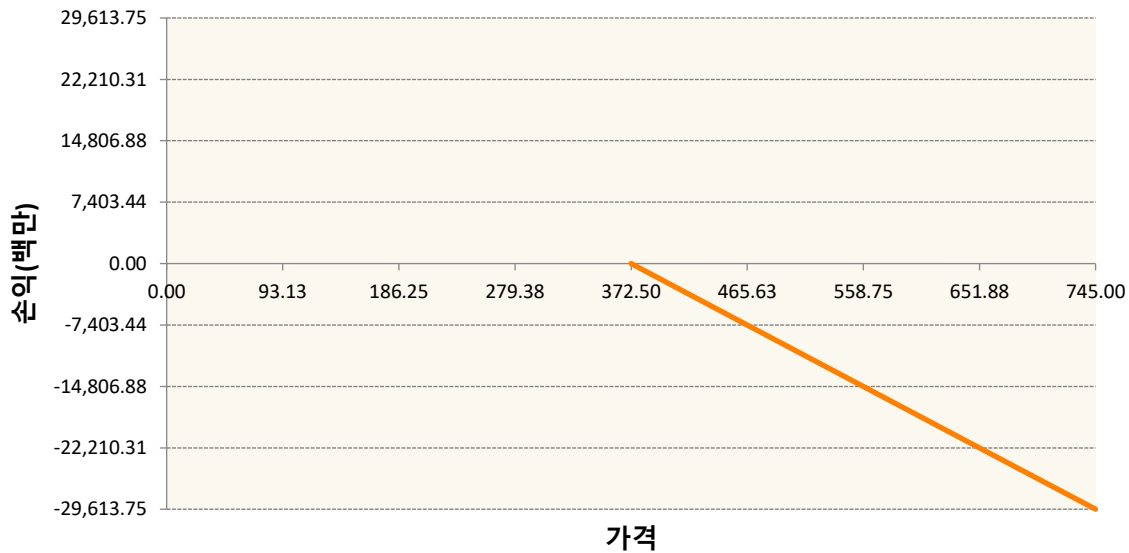
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	68,739	-68,739	장내

2. 만기시점의 손익구조

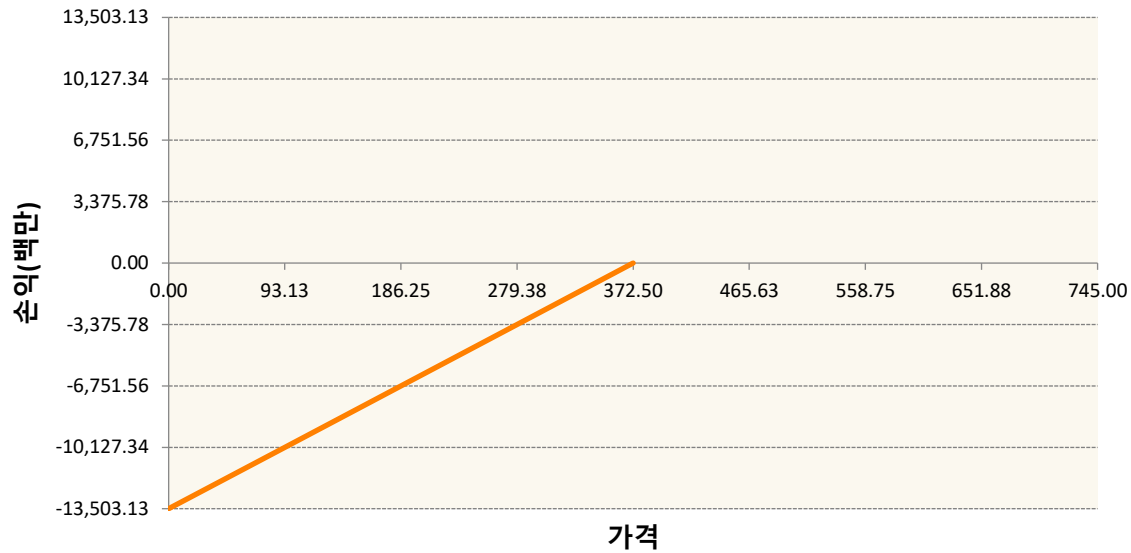
KR4201S33706-2022-03 콜370



KR4201S33722-2022-03 콜372.5



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S33706		2022-03 콜370						1,291
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	236	236	234	231	227	221	214	
-5.33%	232	227	220	211	199	185	169	
-2.67%	205	189	170	148	124	98	71	
0%	103	70	36	0	-36	-74	-111	
2.67%	-147	-189	-231	-273	-314	-356	-398	
5.33%	-576	-610	-645	-682	-719	-757	-796	
8.00%	-1,143	-1,162	-1,183	-1,207	-1,233	-1,261	-1,291	
KR4201S33722		2022-03 콜372.5						1,382
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	218	218	216	214	211	206	199	
-5.33%	215	212	206	197	186	173	157	
-2.67%	195	180	162	141	117	91	62	
0%	107	73	38	0	-39	-79	-120	
2.67%	-130	-178	-226	-273	-321	-369	-417	
5.33%	-571	-614	-658	-703	-749	-795	-841	
8.00%	-1,188	-1,213	-1,242	-1,274	-1,308	-1,344	-1,382	
KR4301S33720		2022-03 풋372.5						999
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-999	-999
-5.33%	-650	-650	-650	-651	-652	-653	-655	
-2.67%	-303	-305	-307	-311	-315	-320	-326	
0%	27	19	10	0	-11	-22	-34	

2.67%	289	274	258	242	226	211	195
5.33%	429	416	403	389	375	360	346
8.00%	472	467	461	454	446	437	427

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

(단위:백만원)

3,547

공시일 2022-03-03

기준일 2022-03-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

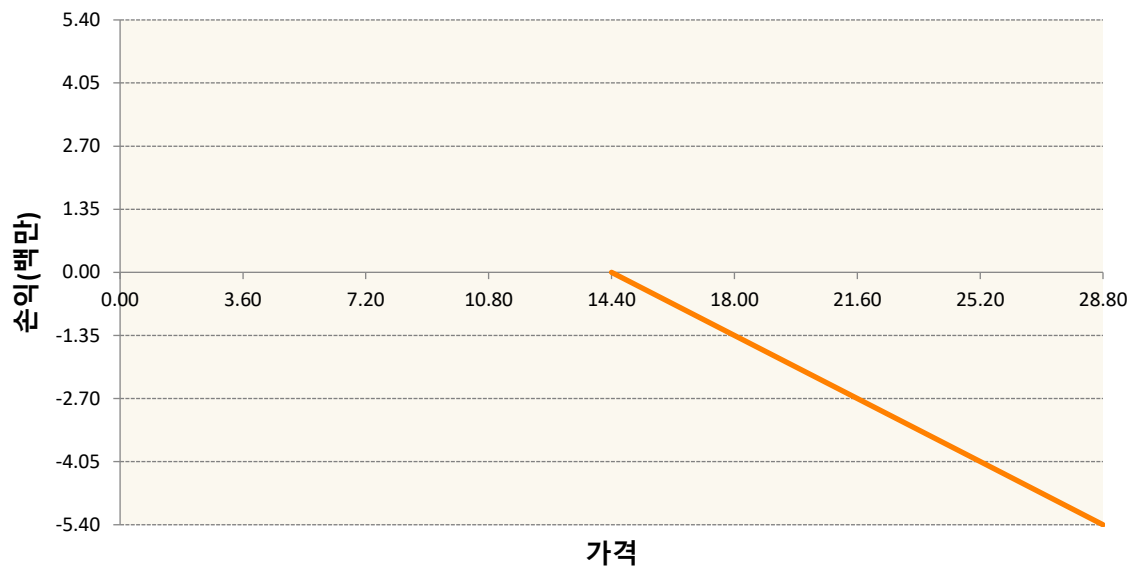
1. 계약금액

(단위:백만원)

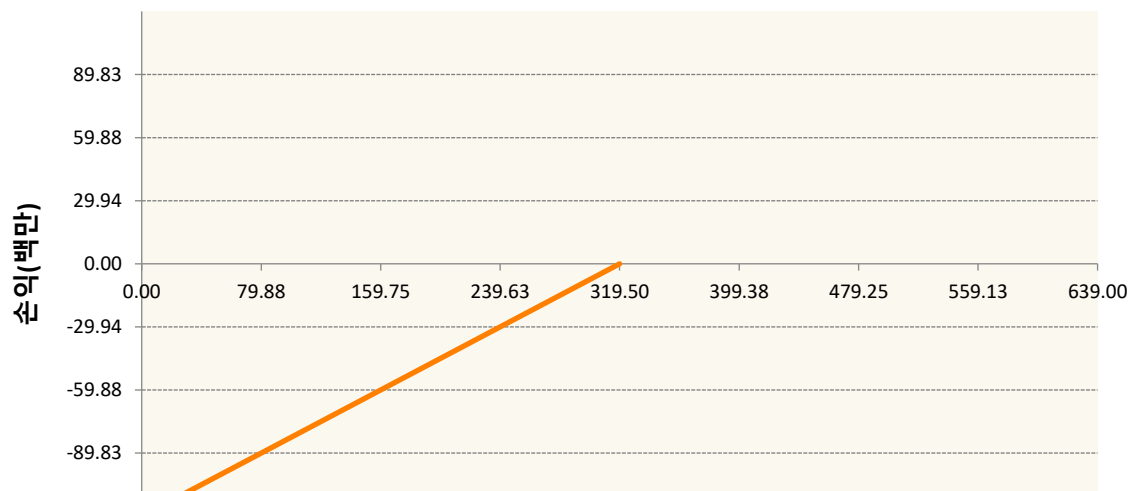
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	125	-125	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	268	1,339	-1,071	장외

2. 만기시점의 손익구조

OESXH2-C4075-EURO STOXX 50



OESXH2-P4075-EURO STOXX 50



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	56
FXW213BCF KRW/EUR 17-03-22E	54
FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E	21
FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E	32
FXW213C32 EUR/KRW 17-03-22E	21
OESXH2-C4C EURO STOXX 50	0.43
OESXH2-P40 EURO STOXX 50	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	143

공시일 2022-03-03

기준일 2022-03-02

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

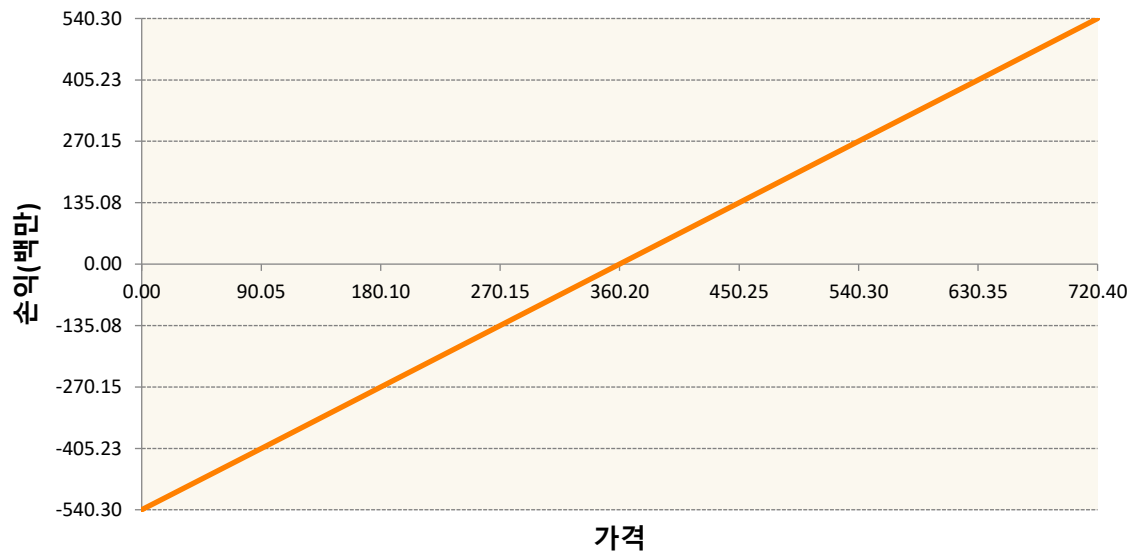
1. 계약금액

(단위:백만원)

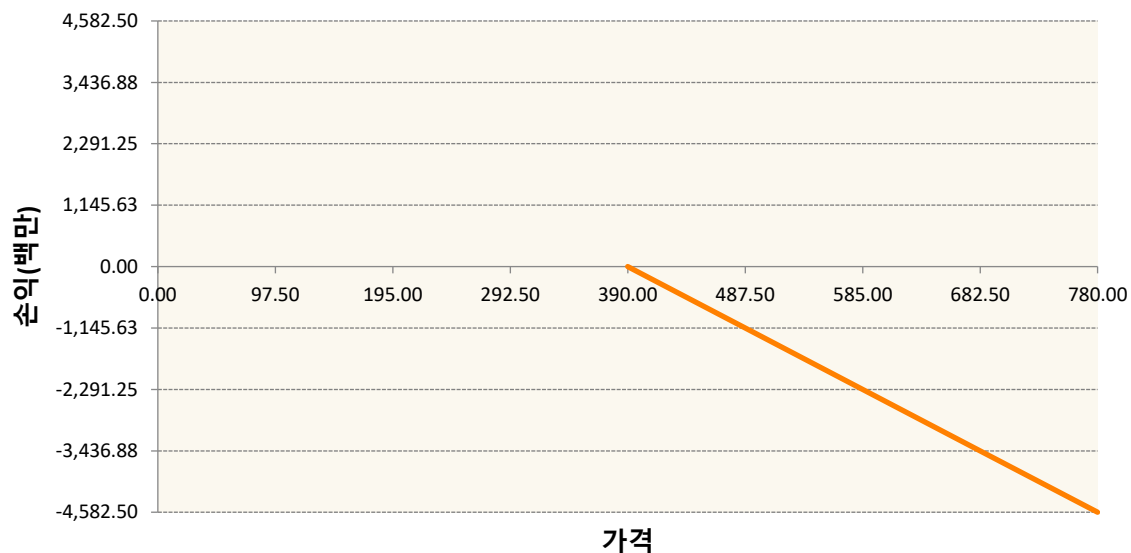
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	540	0	540	장내
누계	유가증권	옵션	372	4,877	-4,505	장내

2. 만기시점의 손익구조

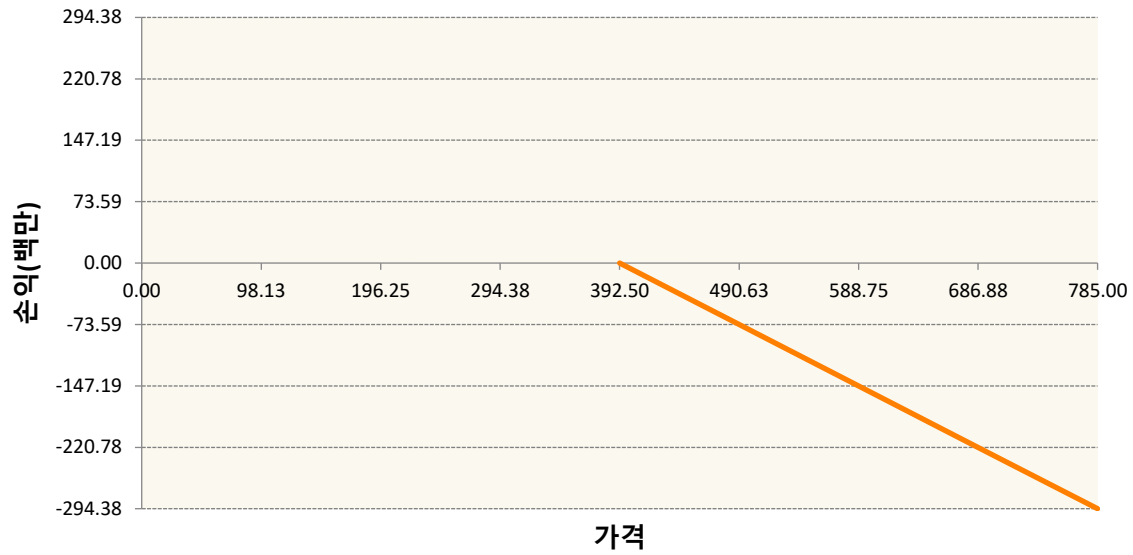
KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



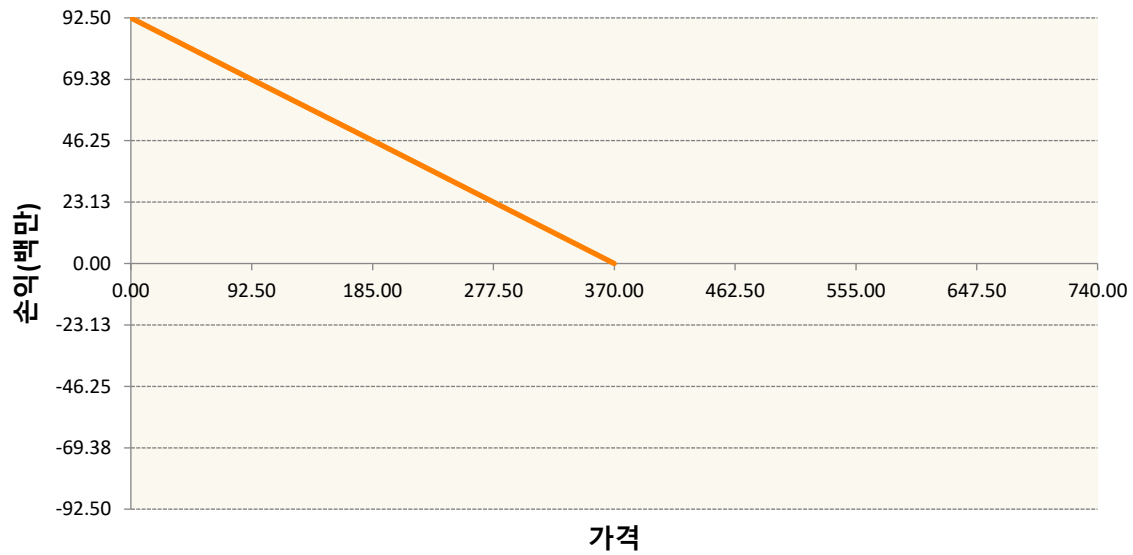
KR4201S33904-2022-03 콜390



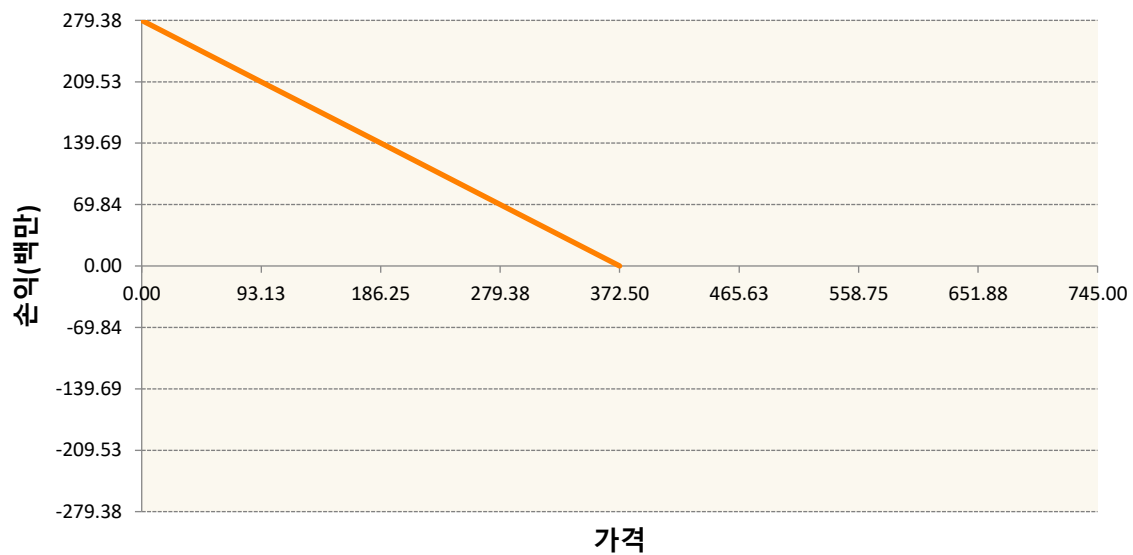
KR4201S33920-2022-03 콜392.5



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					104
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	5	5	5	5	5	4	4
-2.67%	5	5	4	4	3	2	0
0%	4	3	2	0	-2	-5	-8
2.67%	-1	-4	-7	-11	-16	-20	-25
5.33%	-18	-24	-30	-36	-43	-49	-56
8.00%	-59	-66	-74	-81	-89	-96	-104
KR4201S33920		2022-03 콜392.5					6
	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	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-2	-2	-2	-3	-3
8.00%	-3	-3	-4	-4	-5	-5	-6
KR4301S33704		2022-03 풋370					7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-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	-1	-1	-1
5.33%	-3	-3	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
KR4301S33720		2022-03 풋372.5					21
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	13	13	13	13	13	14	14
-2.67%	6	6	6	6	7	7	7
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-6	-6	-5	-5	-5	-4	-4
5.33%	-9	-9	-8	-8	-8	-7	-7
8.00%	-10	-10	-10	-9	-9	-9	-9

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

(단위:백만원)

120

공시일	2022-03-03
기준일	2022-03-02

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	9,786	0	9,786	

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	2022-03-03
기준일	2022-03-02

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	8,070	0	8,070	

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	2022-03-03
기준일	2022-03-02

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	180	-180	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	27,626	0	27,626	
누계	통화	선도	1,568	29,827	-28,259	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	193
FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E	68
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,193
FXW213C32' USD/KRW 25-03-22E	58
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

790

공시일 2022-03-03

기준일 2022-03-02

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

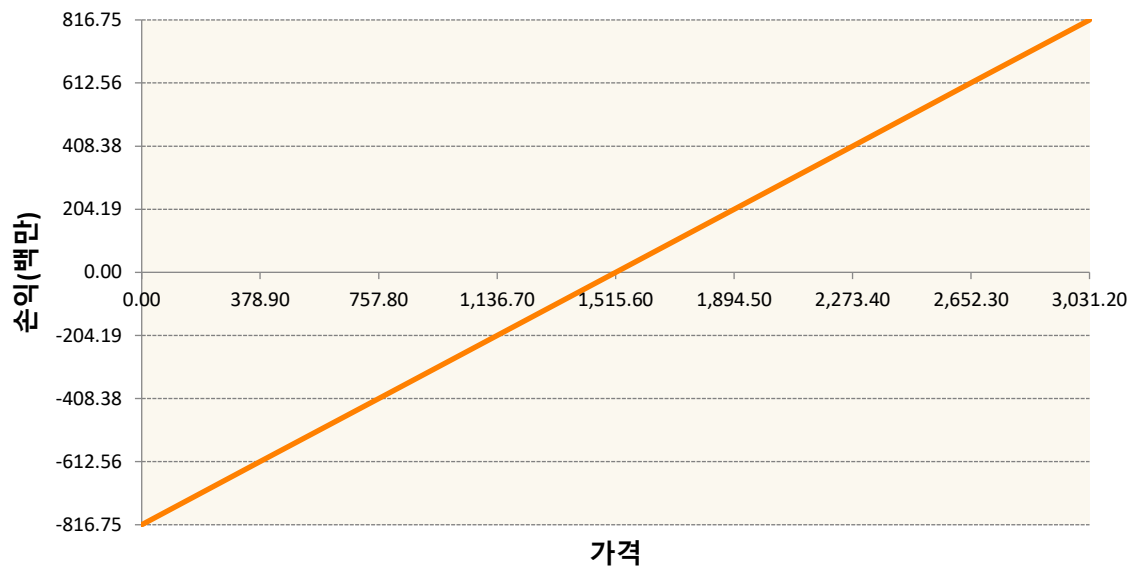
1. 계약금액

(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	817	0	817	
누계	유가증권	스왑	1,830	0	1,830	장외
누계	통화	선도	0	1,312	-1,312	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCH2-VN30 Index Future Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	146
FXW213BCN KRW/EUR 18-03-22E	43
FXW213C1K KRW/EUR 22-04-22E	16
FXW213C2P KRW/EUR 20-05-22E	46
VNCH2 VN30 Index Future Mar22	65

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

(단위:백만원)

268

공시일 2022-03-03

기준일 2022-03-02

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

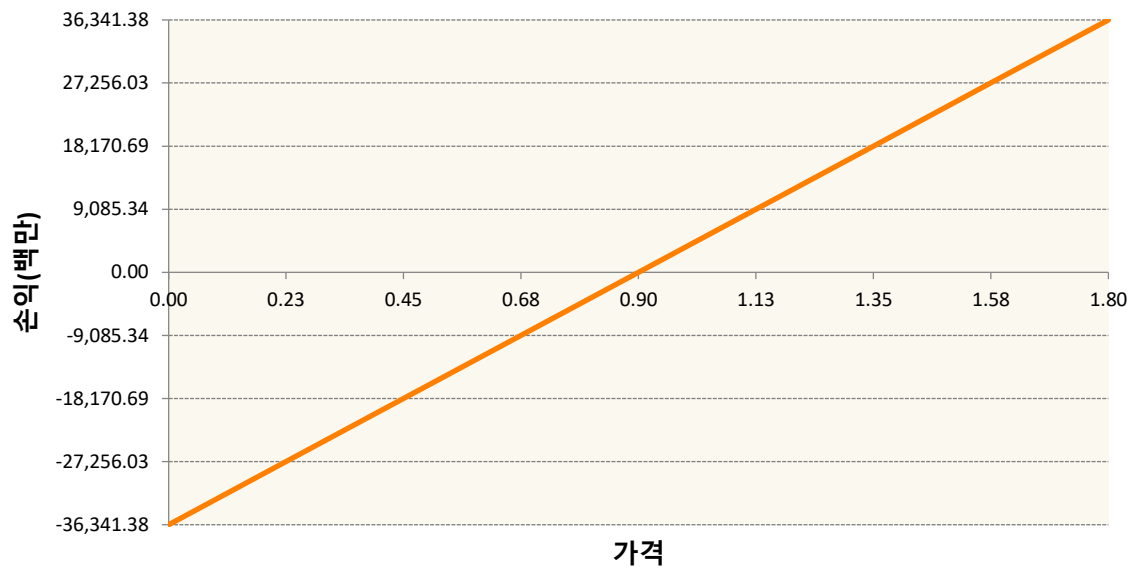
1. 계약금액

(단위:백만원)

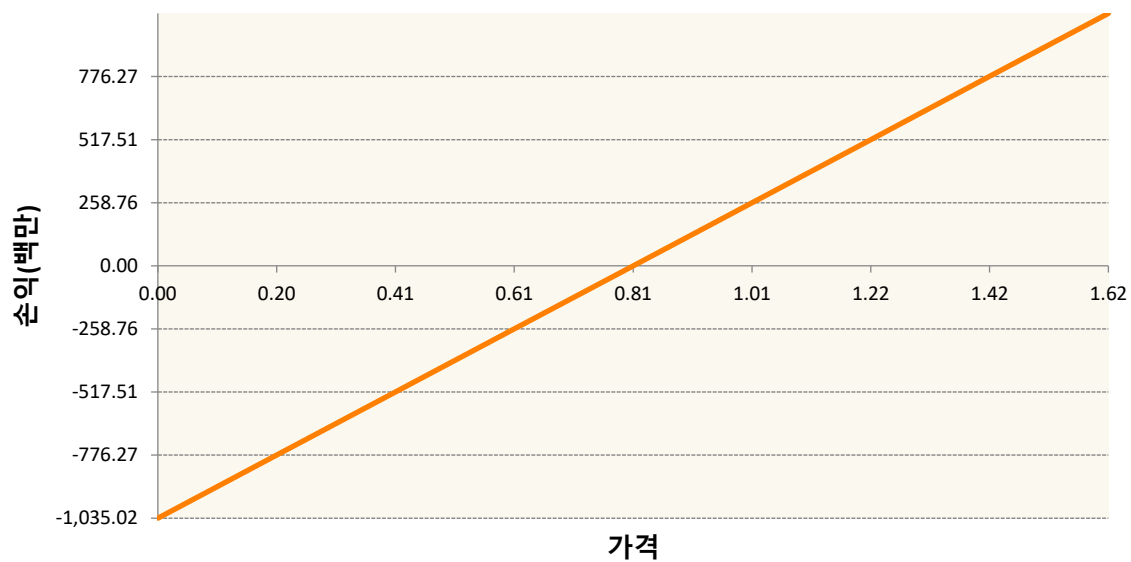
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	38,411	0	38,411	

2. 만기시점의 손익구조

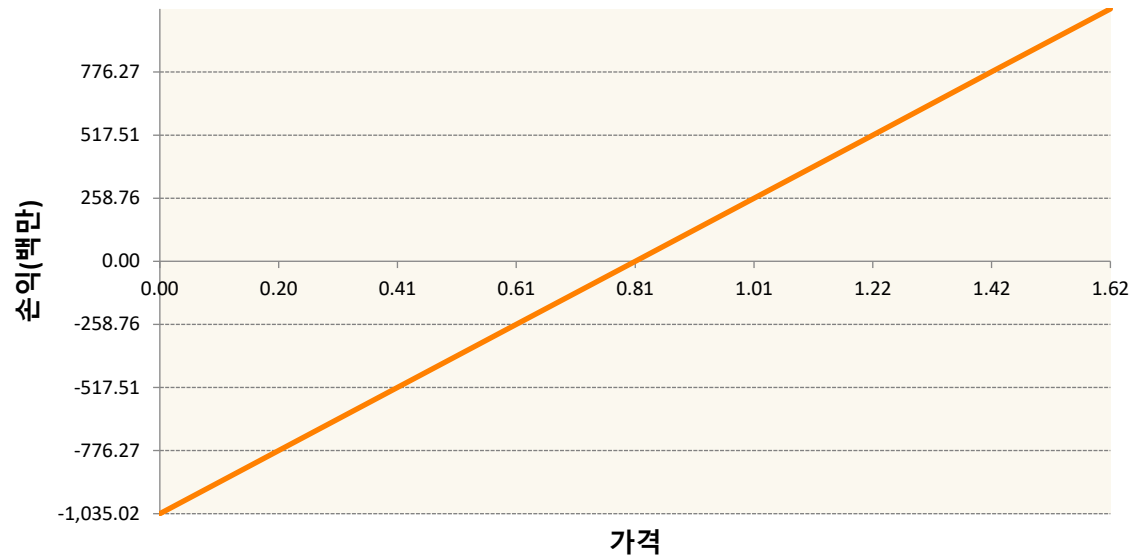
210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

2,914
83
83

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

(단위:백만원)

5,311

공시일 2022-03-03

기준일 2022-03-02

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

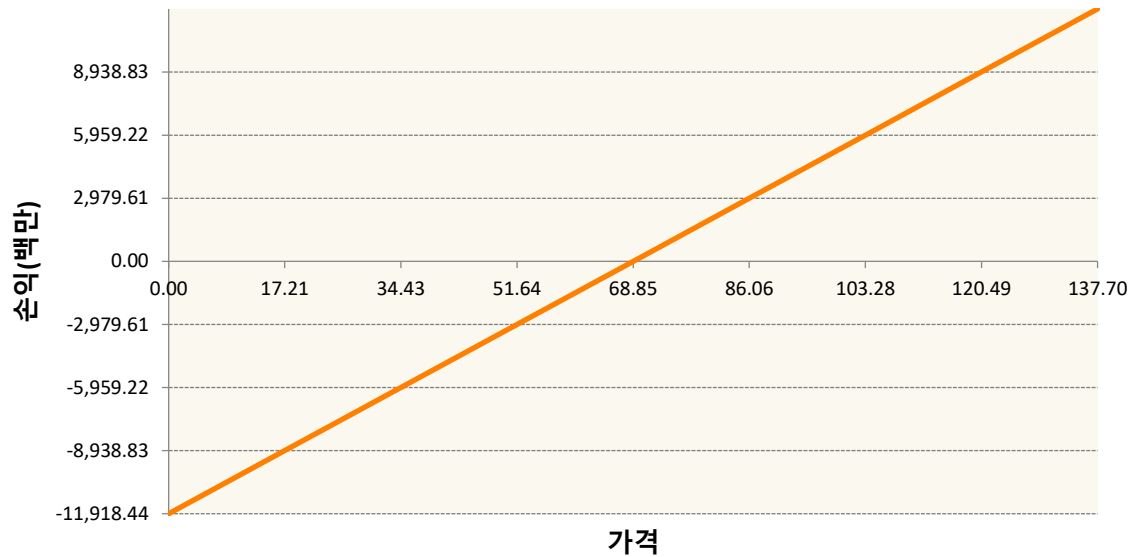
1. 계약금액

(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	11,918	0	11,918	
누계	통화	선도	0	8,190	-8,190	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2R KRW/EUR 28-03-22E

655

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

953

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

(단위:백만원)

2,462

공시일	2022-03-03
기준일	2022-03-02

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)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	7

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

(단위:백만원)

52

공시일	2022-03-03
기준일	2022-03-02

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	5

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

(단위:백만원)

26

공시일	2022-03-03
기준일	2022-03-02

에쿼티알파일반사모혼합자산

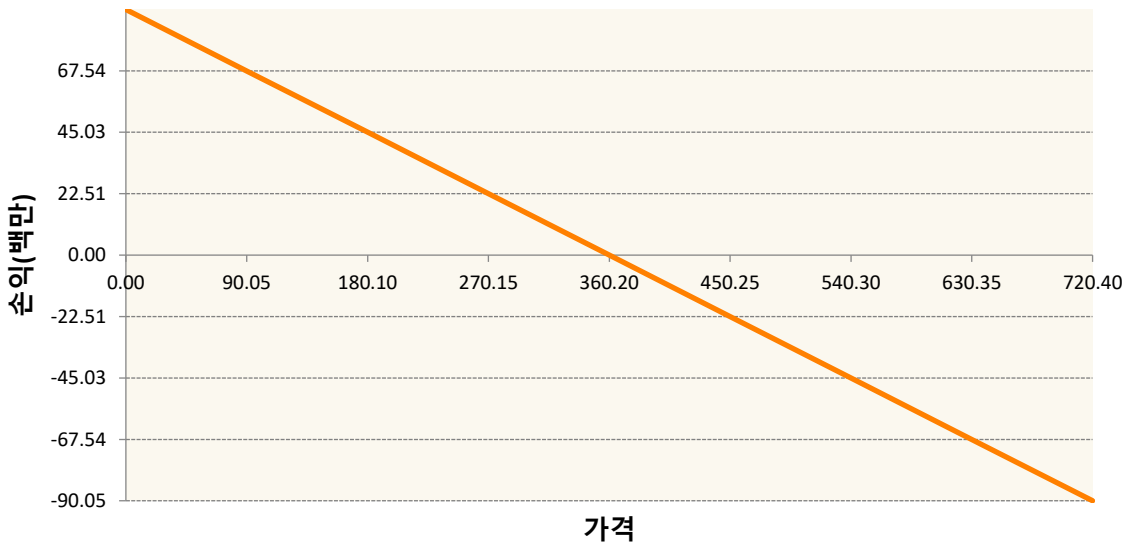
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	90	-90	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001		2022-03 코스피200지수선물					7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-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%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

6

공시일 2022-03-03

기준일 2022-03-02

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

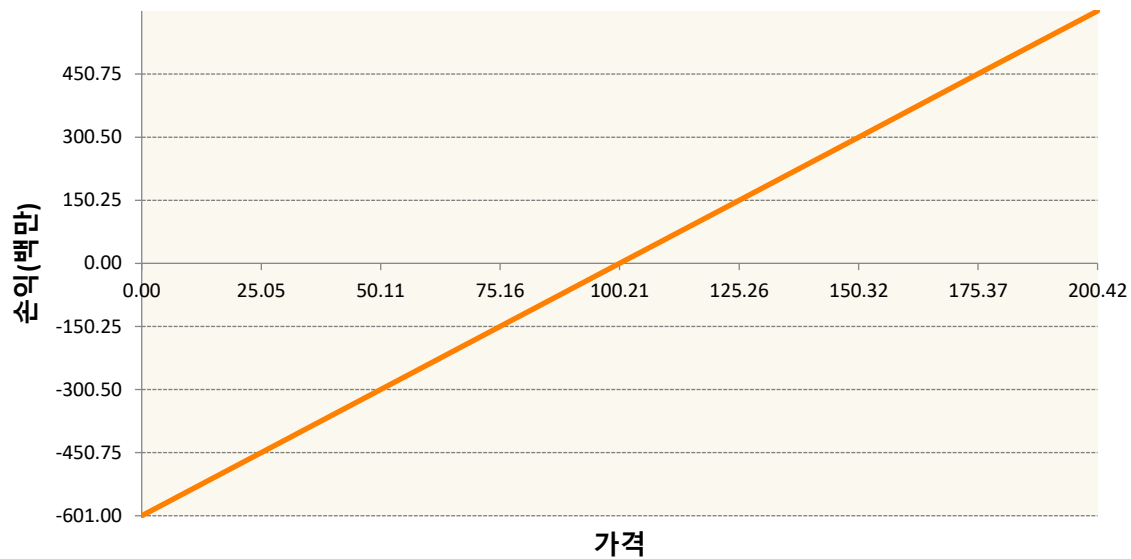
1. 계약금액

(단위:백만원)

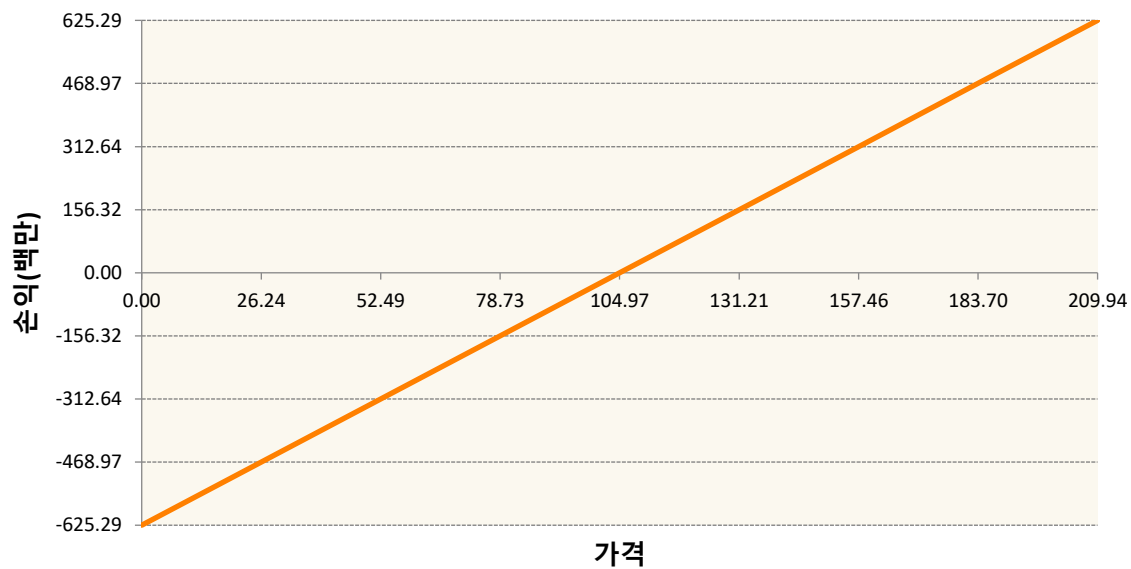
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,466	423	2,043	

2. 만기시점의 손익구조

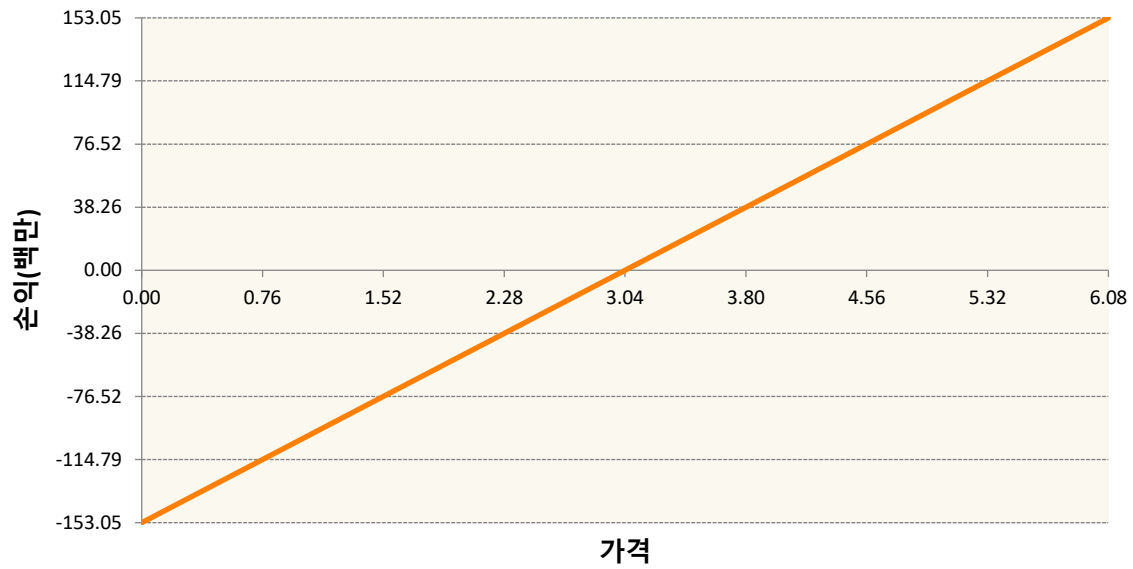
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



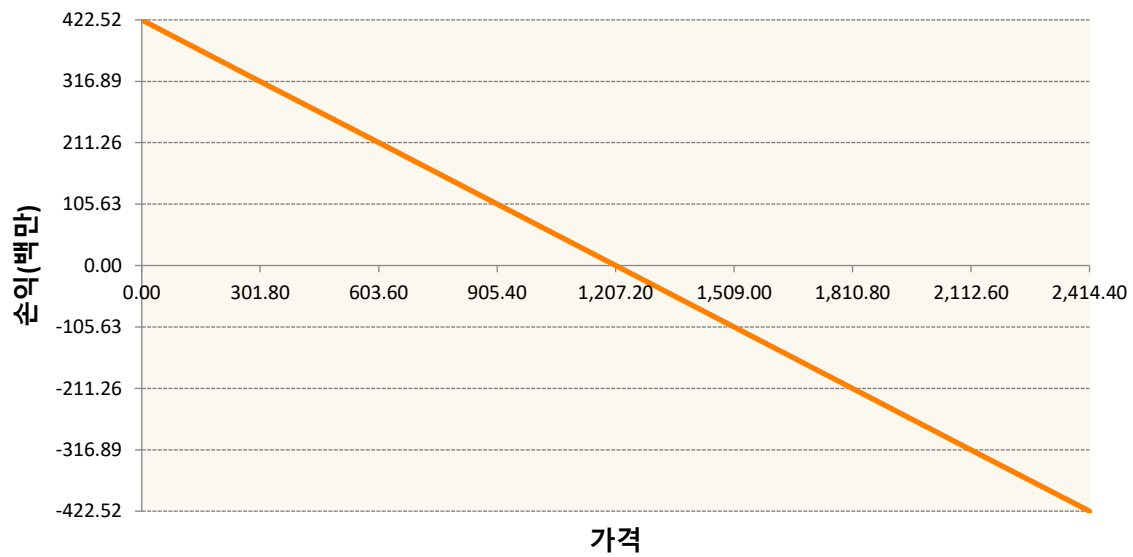
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



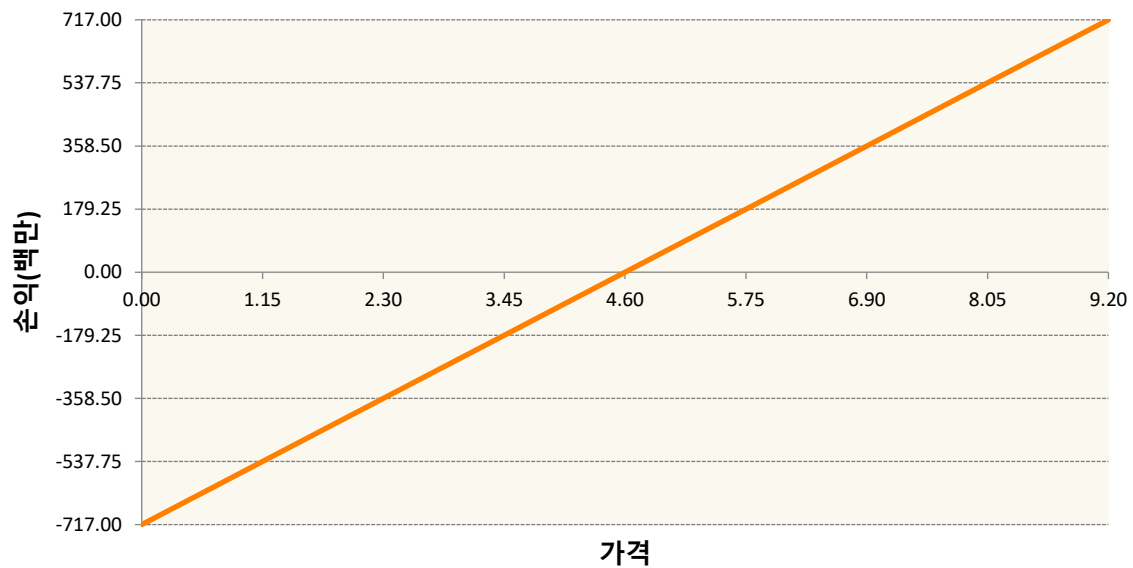
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

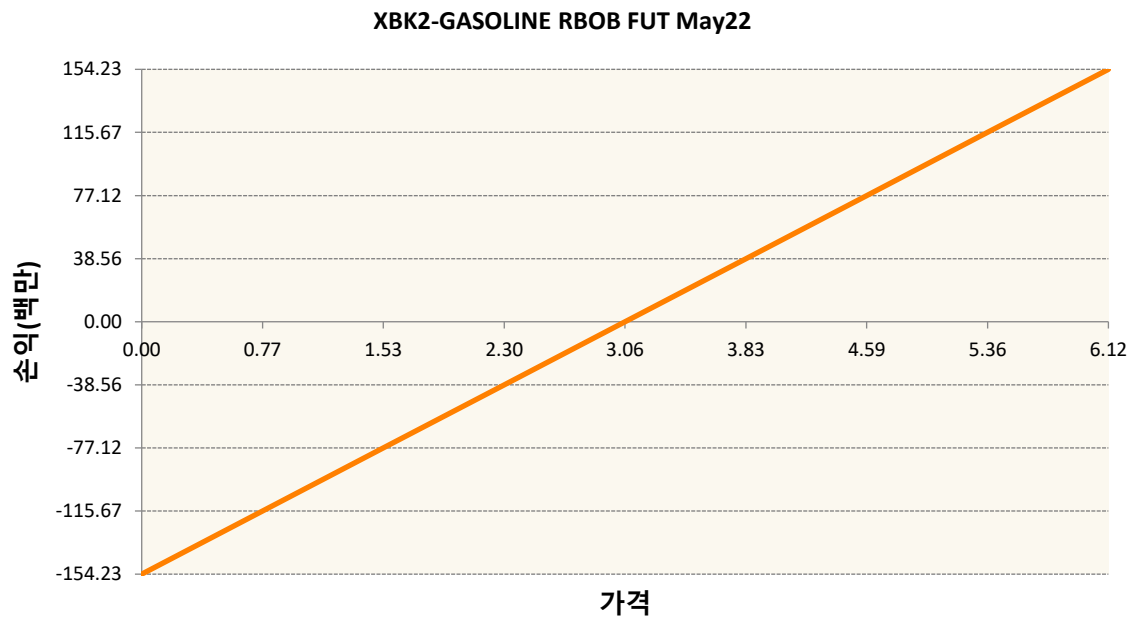
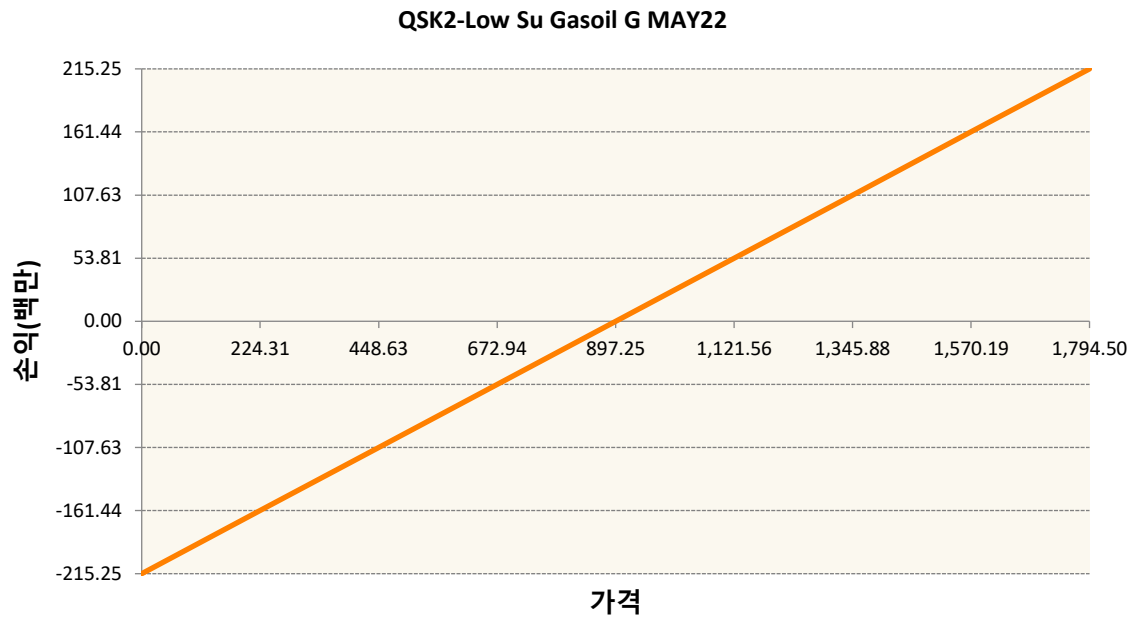


KR4175S30005-2022-03 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		48
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22		50
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		12
KR4175S300	2022-03 달러선물		34
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		57
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		17
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		491