

공시일 2022-03-04

기준일 2022-03-03

포커스농산물모(채권-파생형)

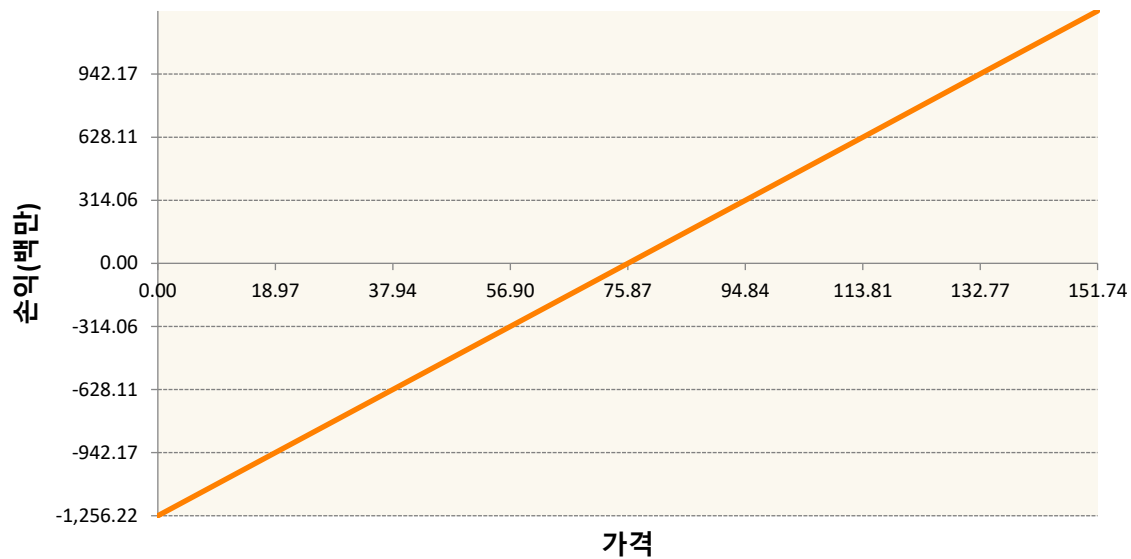
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

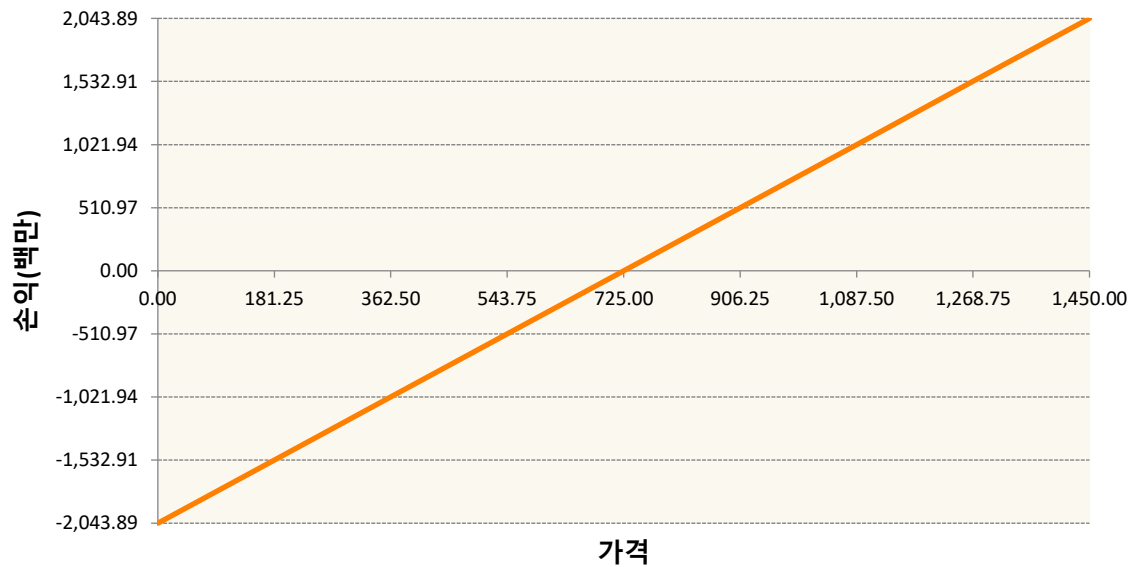
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,695	1,326	9,369	

2. 만기시점의 손익구조

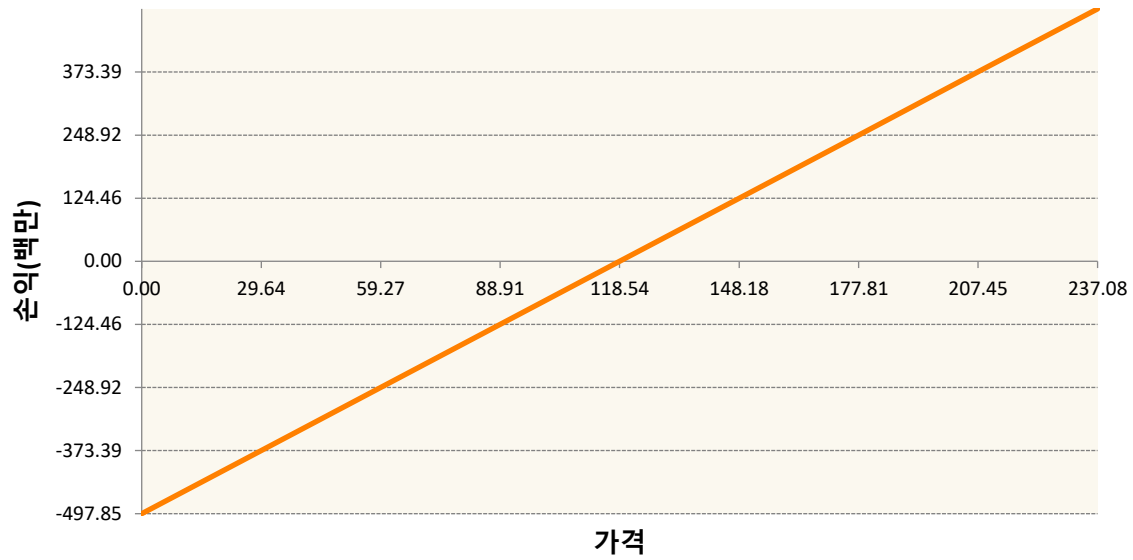
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



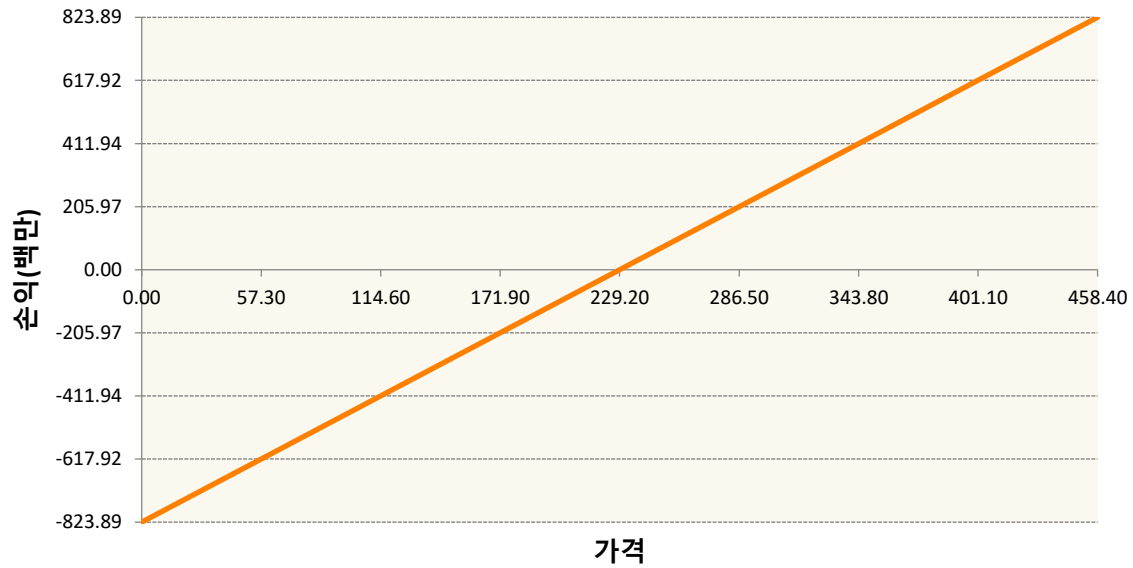
CK2-CORN FUTURE May22



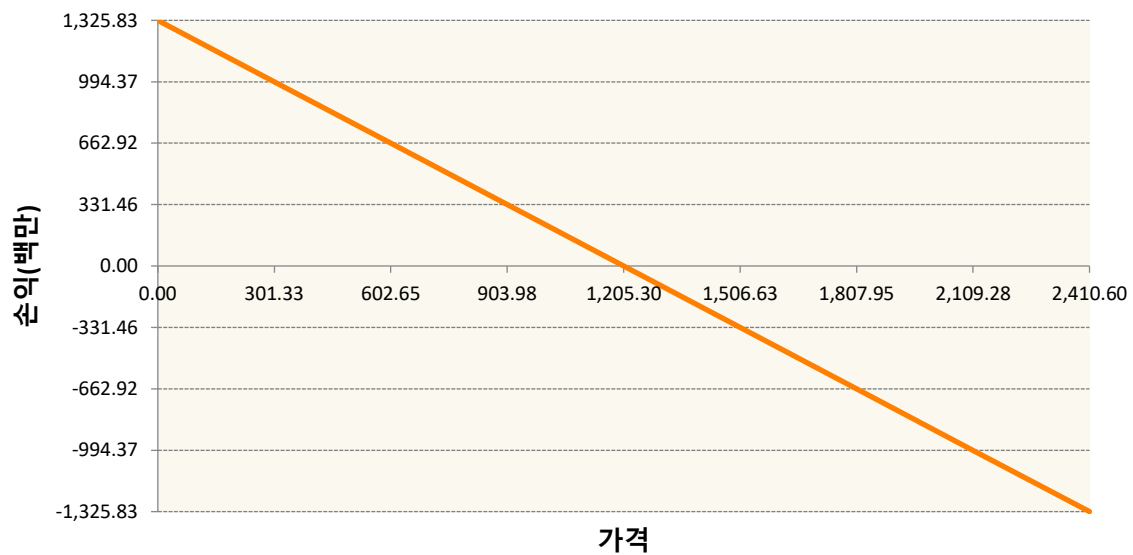
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



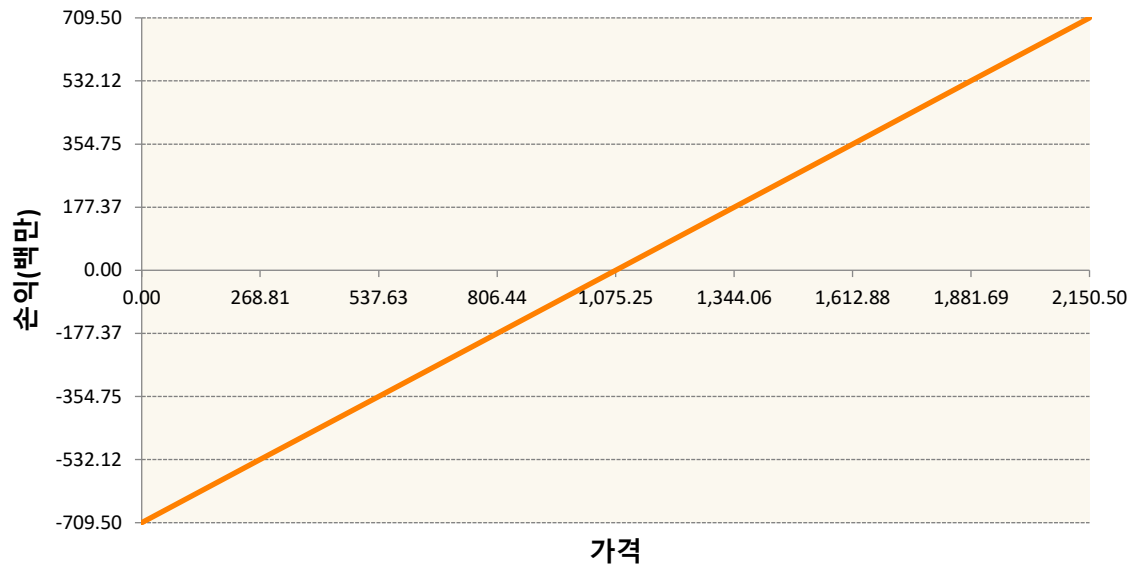
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



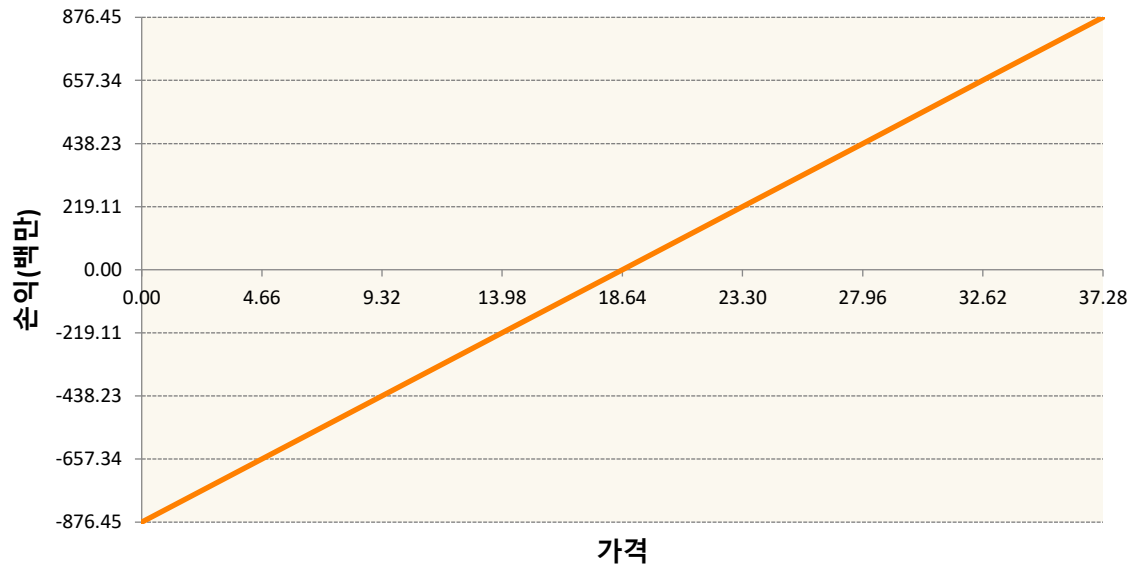
KR4175S30005-2022-03 달러선물



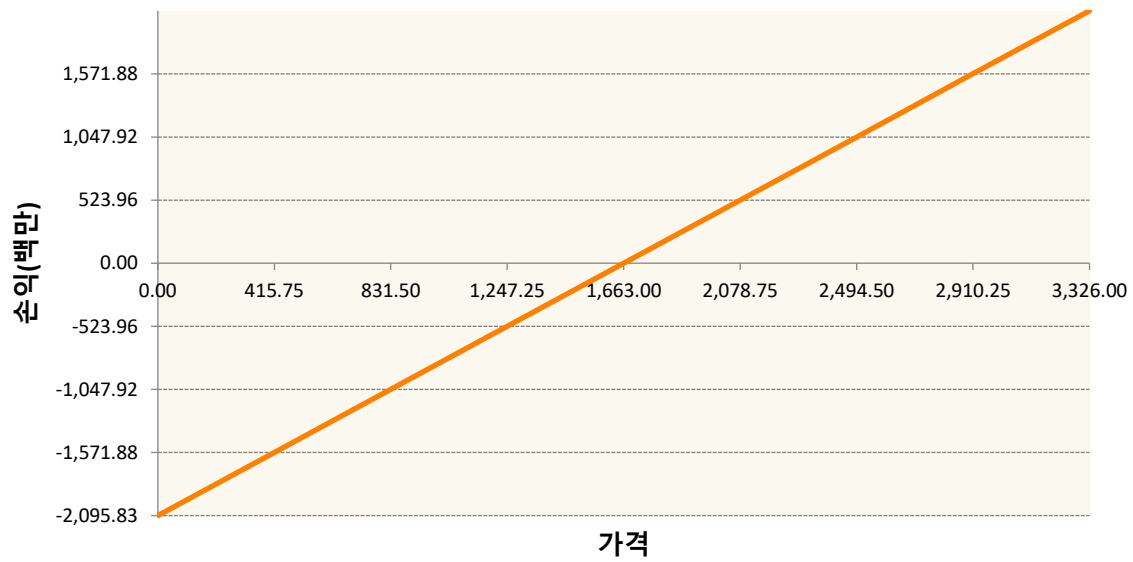
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



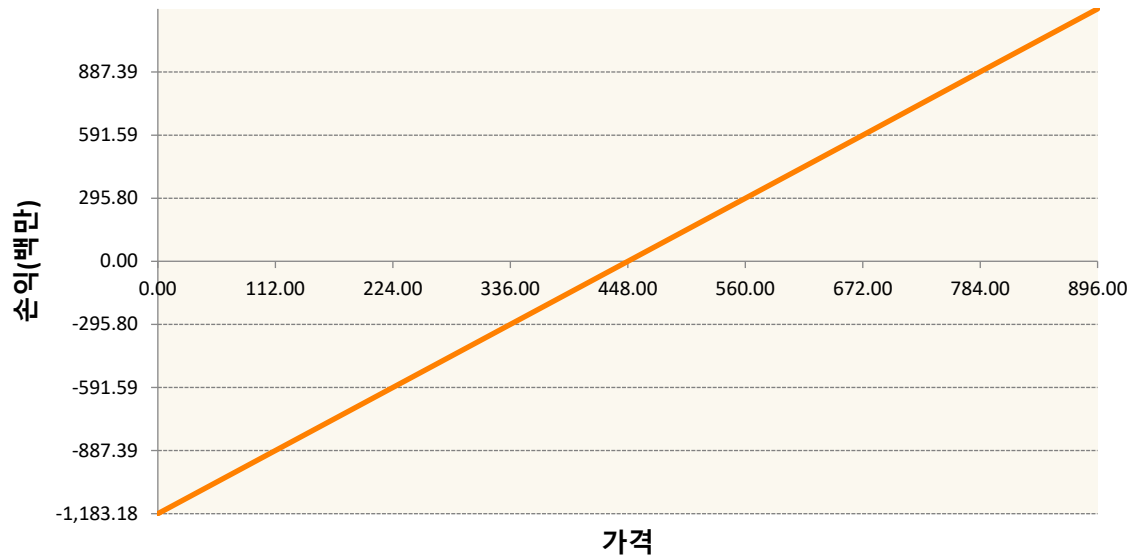
SBK2-Sugar May22



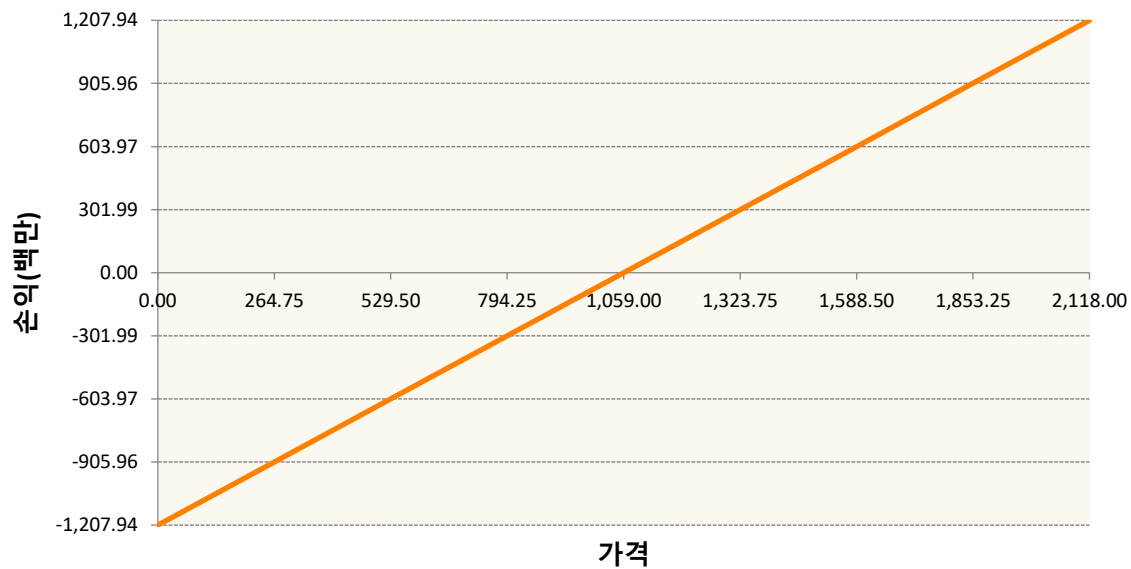
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



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	2022-03-04
기준일	2022-03-03

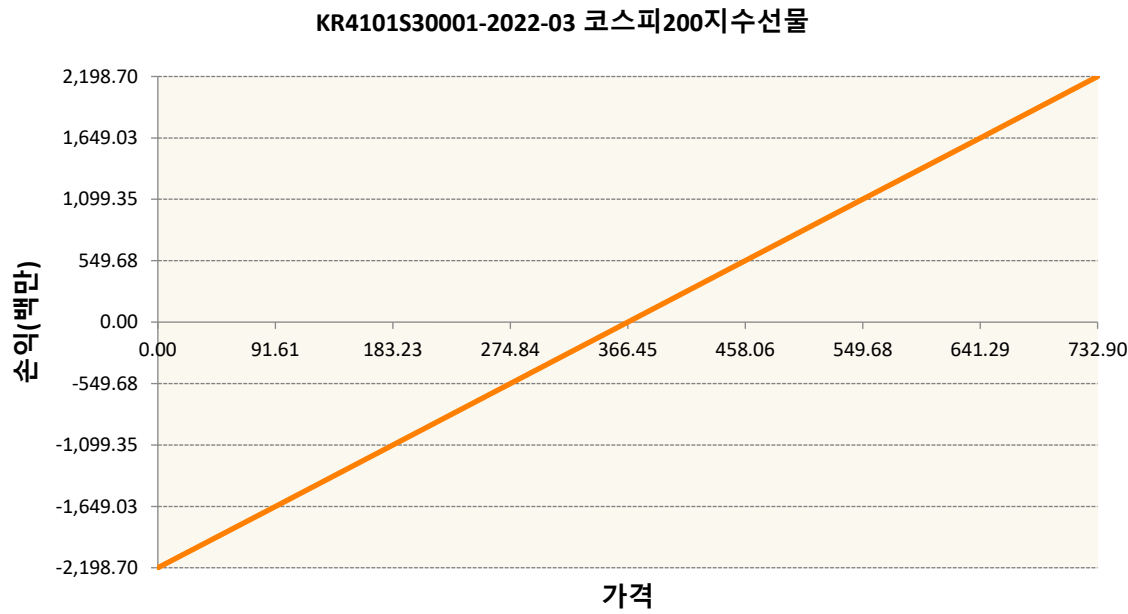
스마트인덱스모

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	2,199	0	2,199	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물				176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-5.33%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	117	117	117	117	117	117	117
8.00%	176	176	176	176	176	176	176

공시일	2022-03-04
기준일	2022-03-03

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

141

* 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	2022-03-04
기준일	2022-03-03

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	2022-03-04
기준일	2022-03-03

유로인덱스모(주식-파생형)

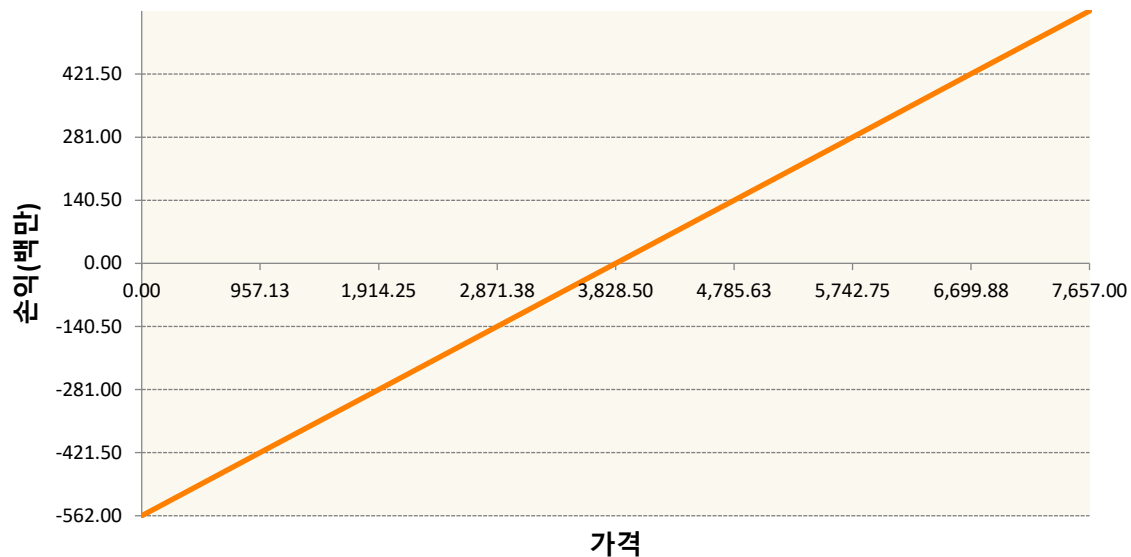
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	562	0	562	

2. 만기시점의 손익구조

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2022-03-04
기준일	2022-03-03

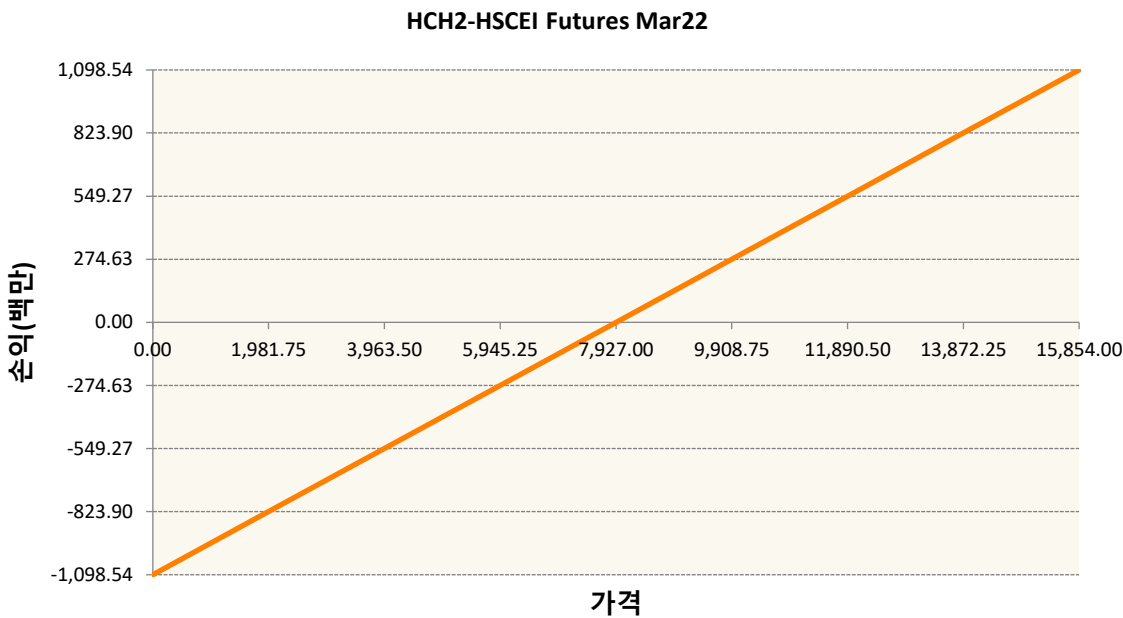
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,099	0	1,099	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2	HSCEI Futures Mar22	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

95

공시일 2022-03-04

기준일 2022-03-03

커버드콜모(주식혼합-파생형)

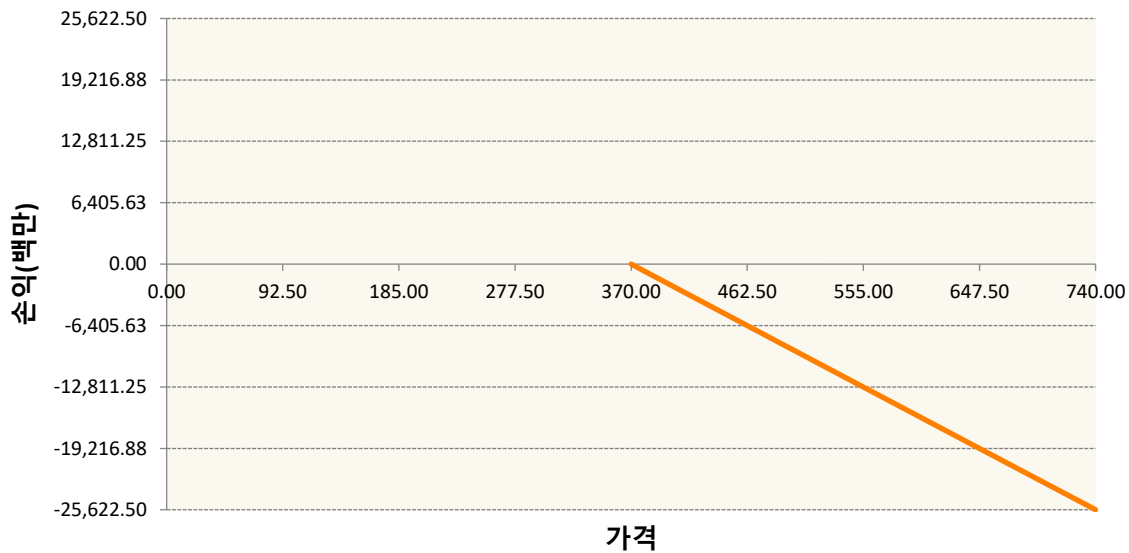
1. 계약금액

(단위:백만원)

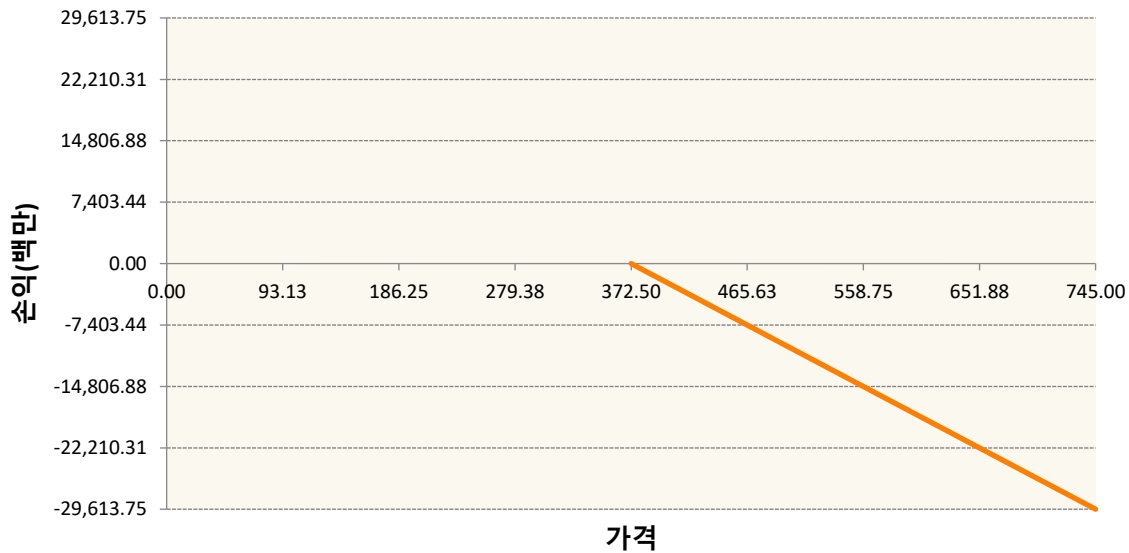
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	68,739	-68,739	장내

2. 만기시점의 손익구조

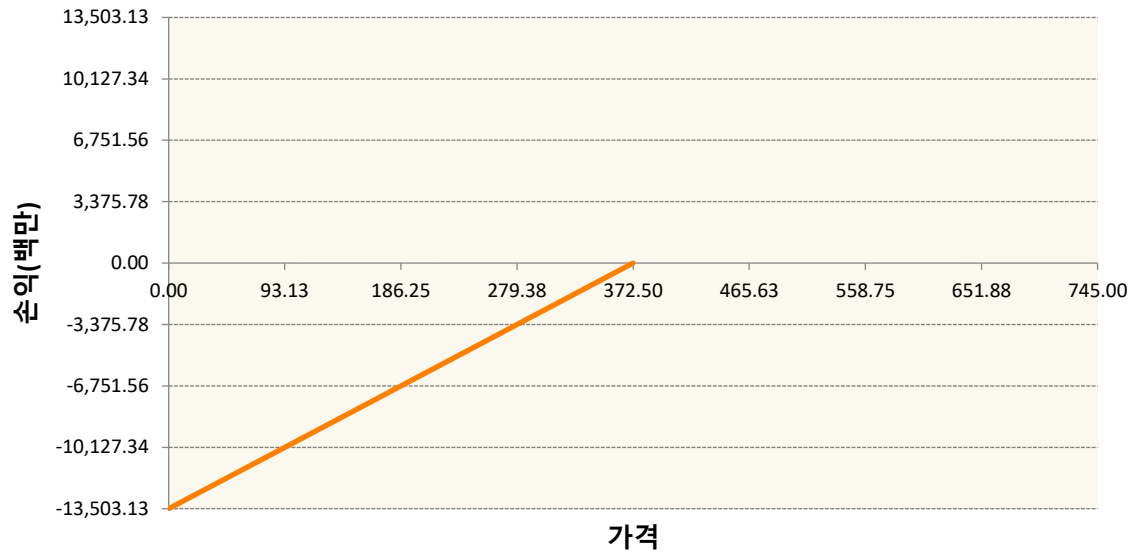
KR4201S33706-2022-03 콜370



KR4201S33722-2022-03 콜372.5



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S33706			2022-03 콜370				1,545
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	361	359	357	353	348	340	332
-5.33%	351	344	333	321	306	289	270
-2.67%	296	273	248	221	193	163	133
0%	112	75	37	0	-37	-75	-113
2.67%	-272	-306	-340	-375	-411	-447	-484
5.33%	-828	-847	-867	-891	-916	-942	-970
8.00%	-1,473	-1,479	-1,487	-1,498	-1,512	-1,527	-1,545
KR4201S33722			2022-03 콜372.5				1,678
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	337	336	334	331	326	320	312
-5.33%	330	324	315	304	290	273	254
-2.67%	287	265	241	214	185	154	122
0%	122	82	41	0	-42	-84	-126
2.67%	-258	-300	-342	-385	-428	-471	-515
5.33%	-853	-879	-908	-939	-972	-1,006	-1,042
8.00%	-1,575	-1,585	-1,598	-1,614	-1,633	-1,654	-1,678
KR4301S33720			2022-03 풋372.5				976
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-975	-975	-975	-975	-975	-975	-976
-5.33%	-620	-620	-621	-622	-624	-626	-628
-2.67%	-270	-274	-279	-284	-290	-297	-305
0%	37	25	13	0	-13	-26	-39

2.67%	221	208	195	182	168	155	141
5.33%	279	274	268	261	253	245	236
8.00%	287	286	285	283	281	277	273

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

(단위:백만원)

4,404

공시일 2022-03-04

기준일 2022-03-03

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

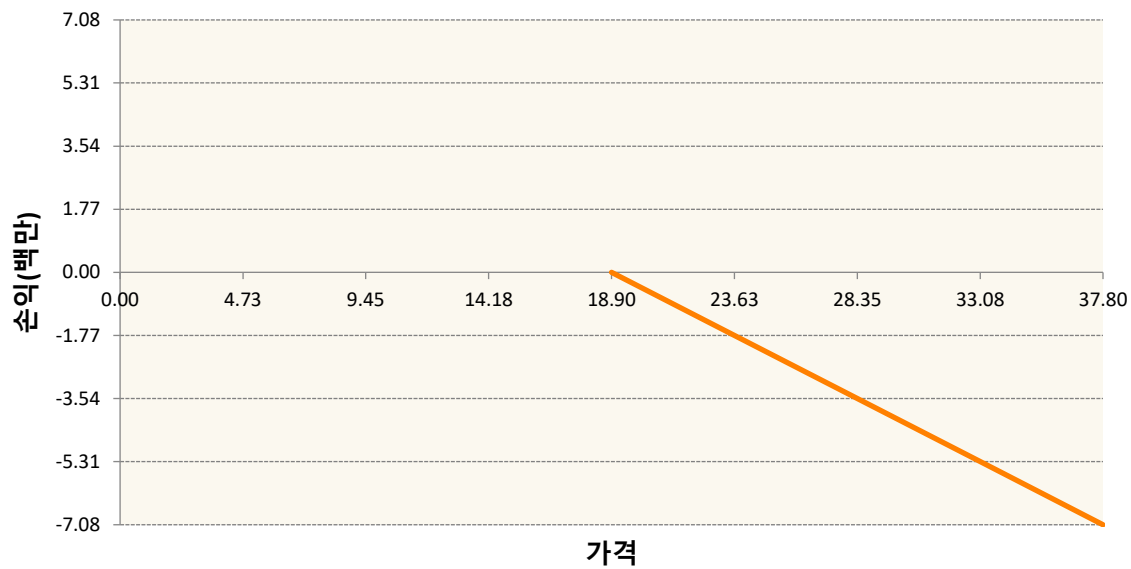
1. 계약금액

(단위:백만원)

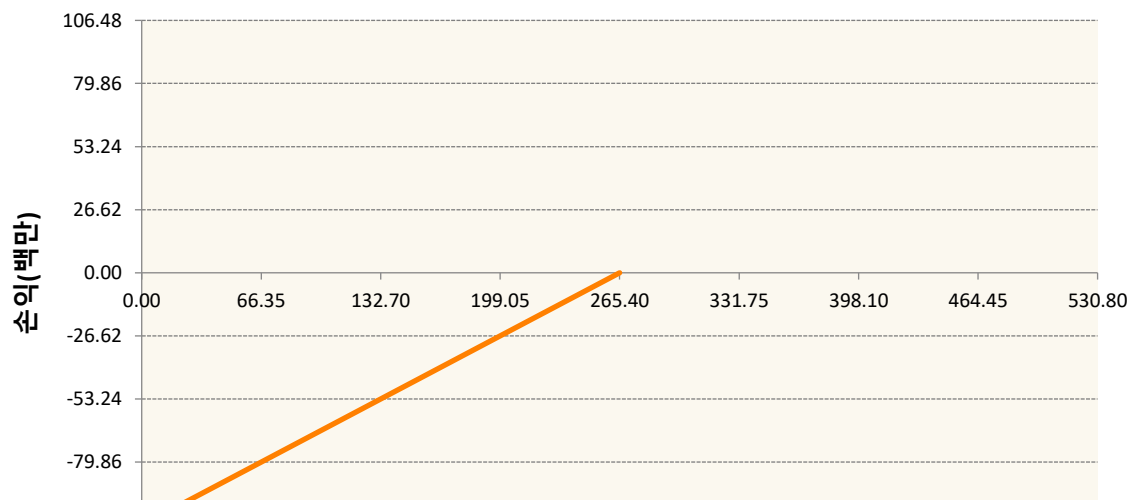
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	114	-114	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	267	1,337	-1,070	장외

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		45
FXW213BCF KRW/EUR 17-03-22E		53
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		1
OESXH2-P40 EURO STOXX 50		9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	128

공시일 2022-03-04

기준일 2022-03-03

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

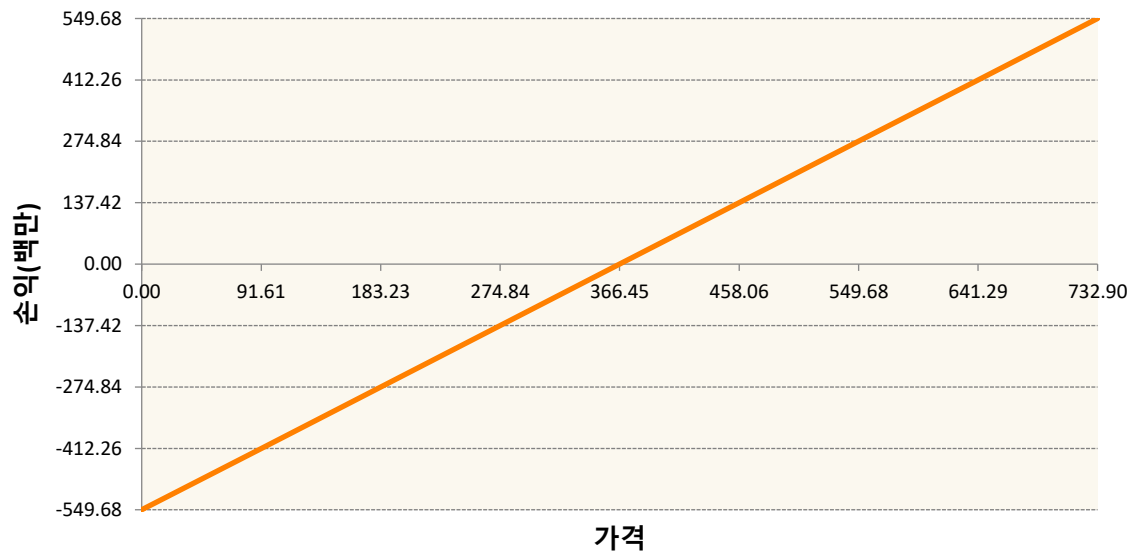
1. 계약금액

(단위:백만원)

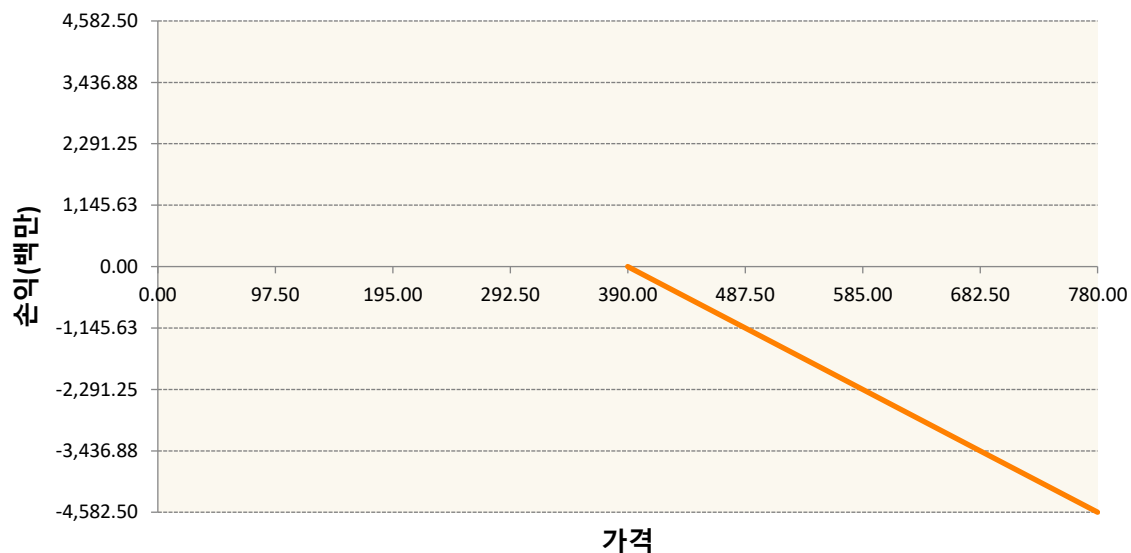
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	550	0	550	장내
누계	유가증권	옵션	372	4,877	-4,505	장내

2. 만기시점의 손익구조

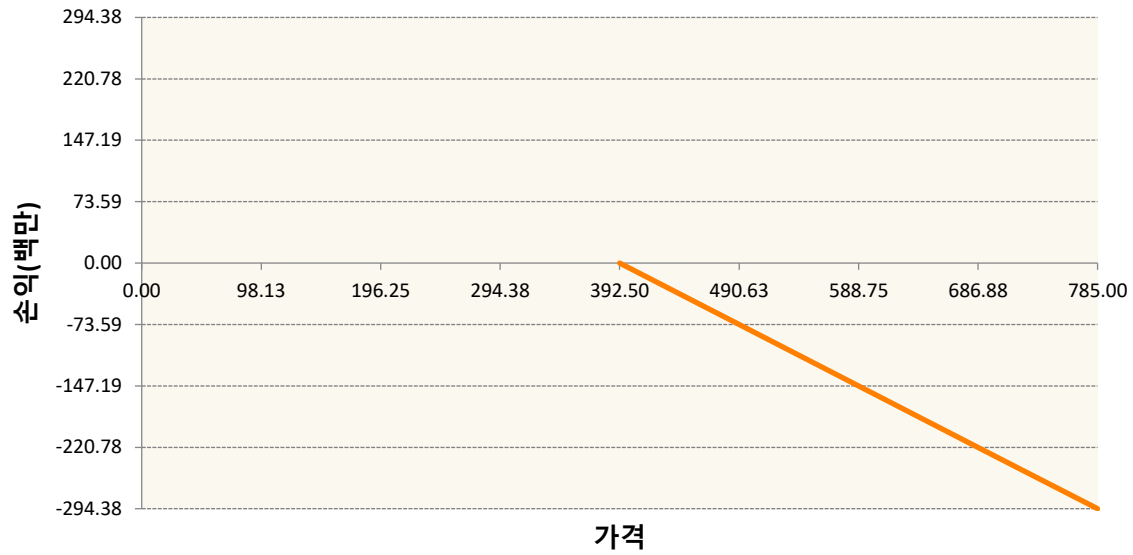
KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



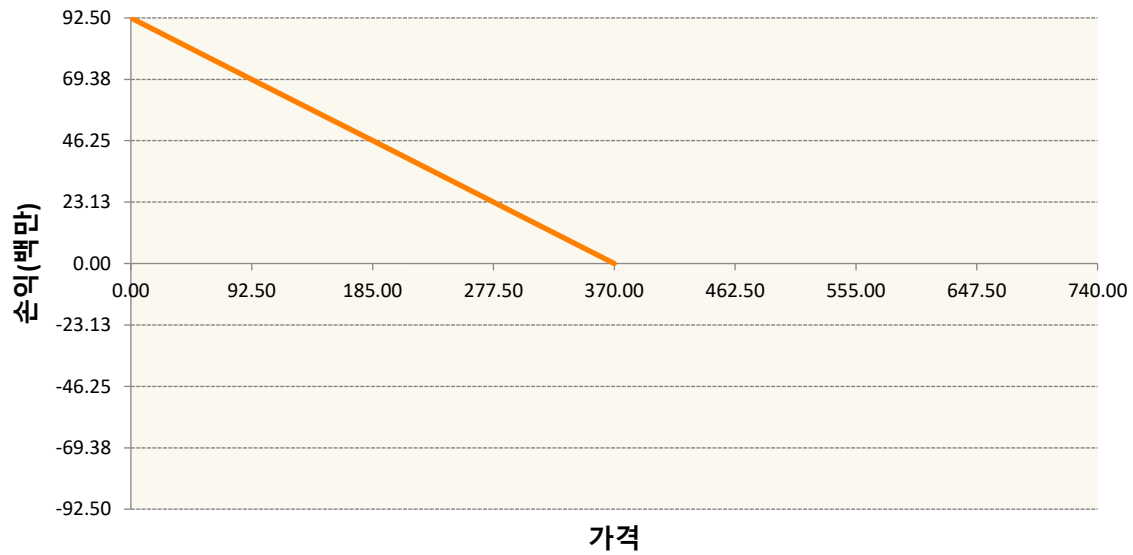
KR4201S33904-2022-03 콜390



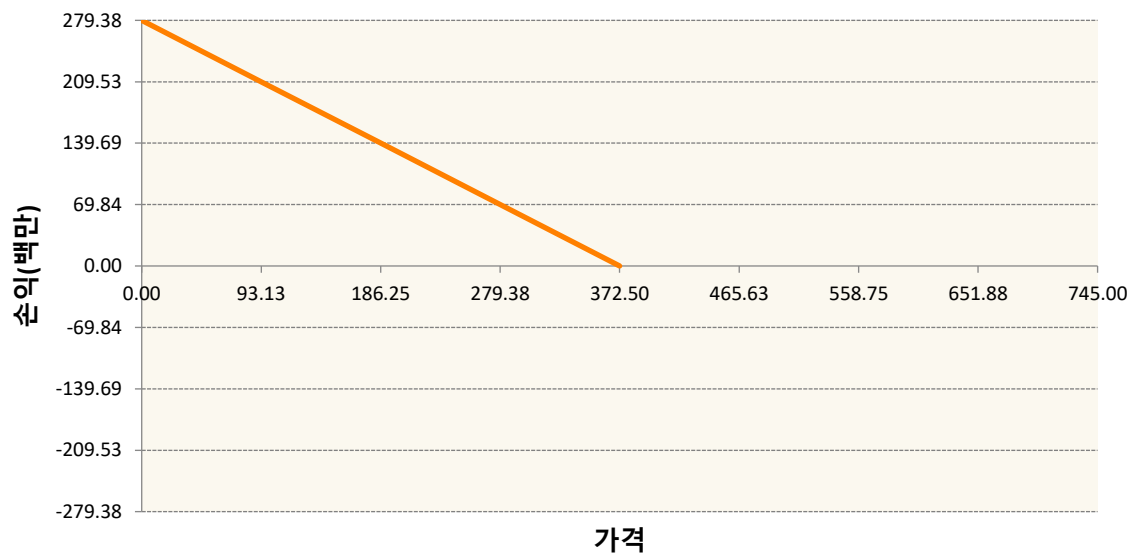
KR4201S33920-2022-03 콜392.5



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				
-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				
KR4201S33904							2022-03 콜390		137		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8				
-5.33%	8	8	8	8	7	7	6				
-2.67%	8	8	7	6	5	4	2				
0%	6	4	2	0	-3	-6	-10				
2.67%	-4	-8	-13	-18	-23	-28	-34				
5.33%	-35	-42	-49	-55	-62	-69	-75				
8.00%	-99	-105	-111	-118	-124	-131	-137				
KR4201S33920							2022-03 콜392.5		8		
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	-1				
2.67%	0	0	-1	-1	-1	-2	-2				
5.33%	-2	-2	-3	-3	-3	-4	-4				
8.00%	-5	-6	-6	-7	-7	-7	-8				
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%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1				
5.33%	-2	-2	-1	-1	-1	-1	-1				
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2				
KR4301S33720							2022-03 풋372.5		20		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	20	20	20	20
-5.33%	13	13	13	13	13	13	13
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-5	-4	-4	-4	-3	-3	-3
5.33%	-6	-6	-6	-5	-5	-5	-5
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

151

공시일	2022-03-04
기준일	2022-03-03

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	9,726	0	9,726	

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	2022-03-04
기준일	2022-03-03

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	8,021	0	8,021	

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	2022-03-04
기준일	2022-03-03

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	27,458	0	27,458	
누계	통화	선도	2,048	29,790	-27,742	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	193
FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E	67
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,190
FXW213C32' USD/KRW 25-03-22E	58
FXW213C33' USD/KRW 25-04-22E	39
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

782

공시일	2022-03-04
기준일	2022-03-03

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

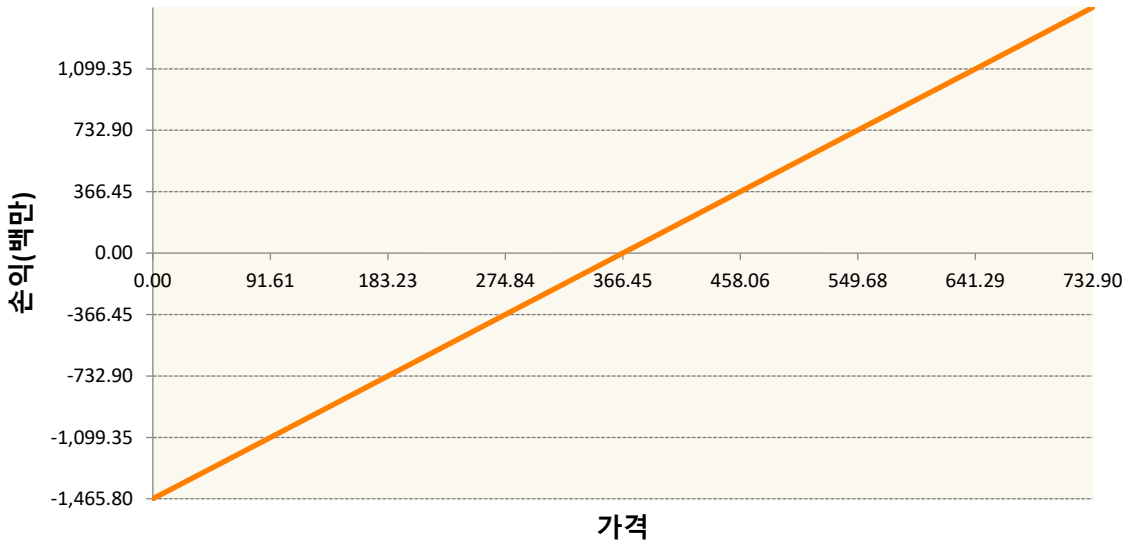
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물				117
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117

공시일 2022-03-04

기준일 2022-03-03

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

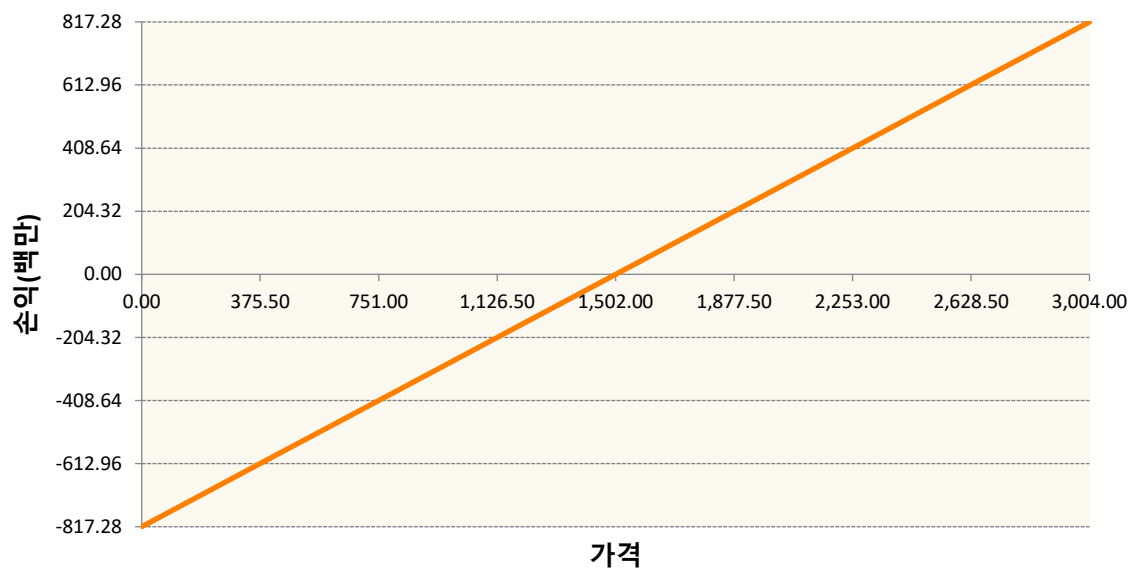
1. 계약금액

(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	1,828	0	1,828	장외
누계	통화	선도	0	1,311	-1,311	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 2022-03-04

기준일 2022-03-03

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

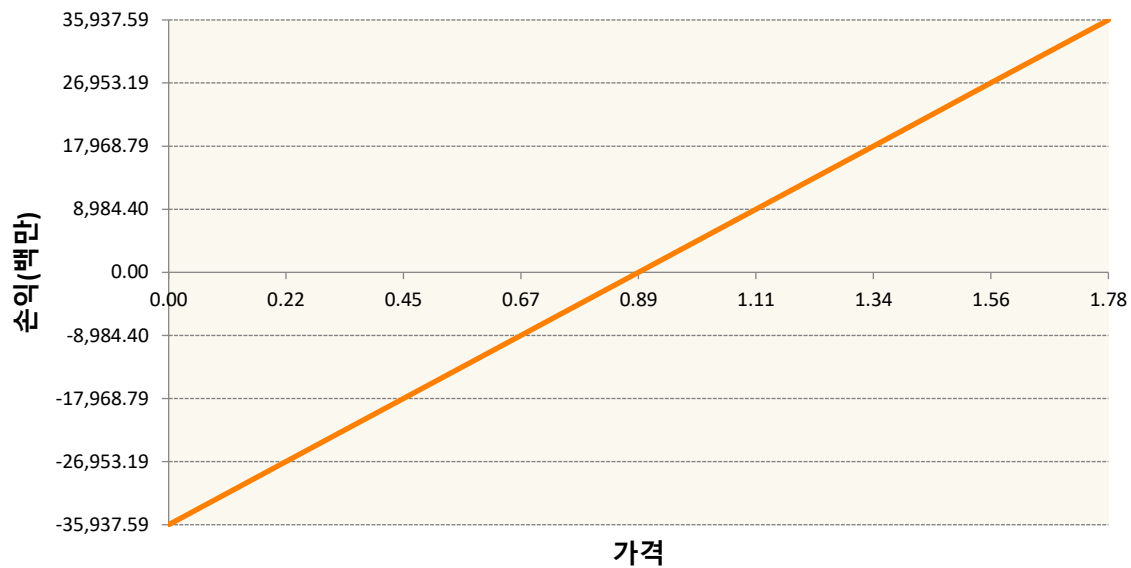
1. 계약금액

(단위:백만원)

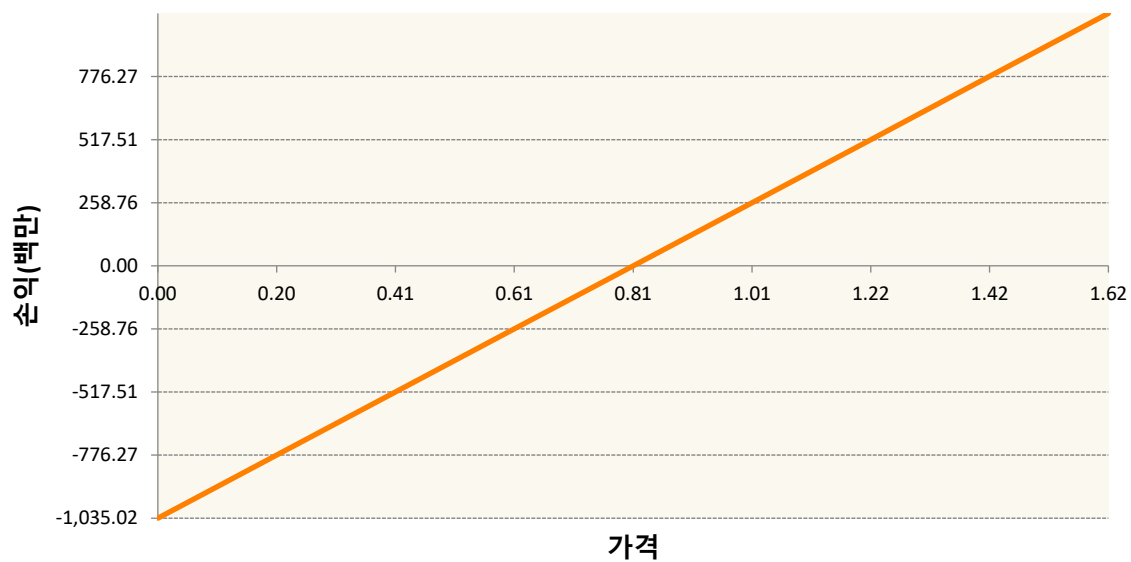
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	38,008	0	38,008	

2. 만기시점의 손익구조

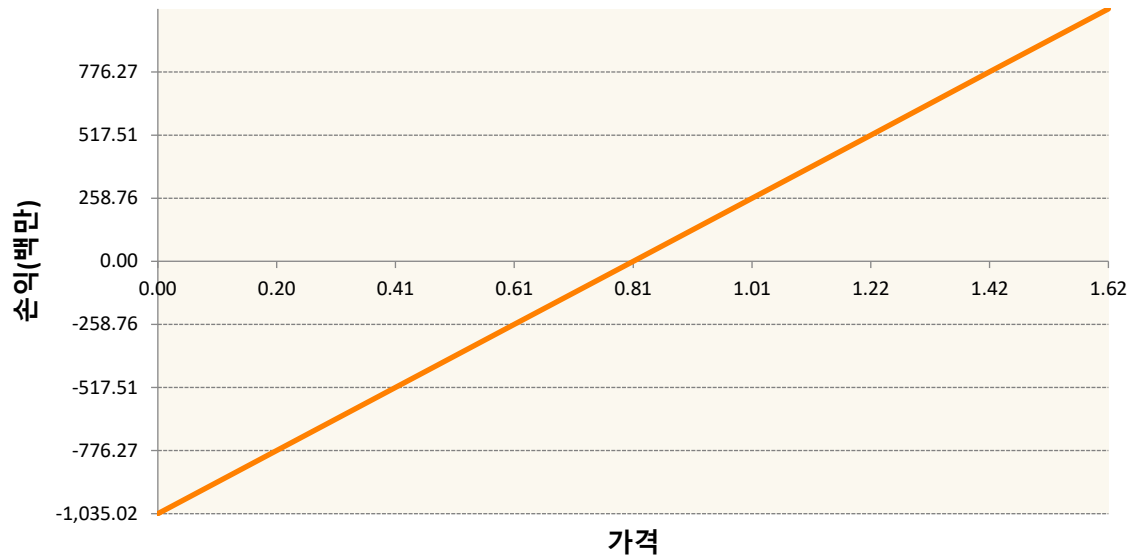
210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

2,884
82
82

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

(단위:백만원)

5,258

공시일 2022-03-04

기준일 2022-03-03

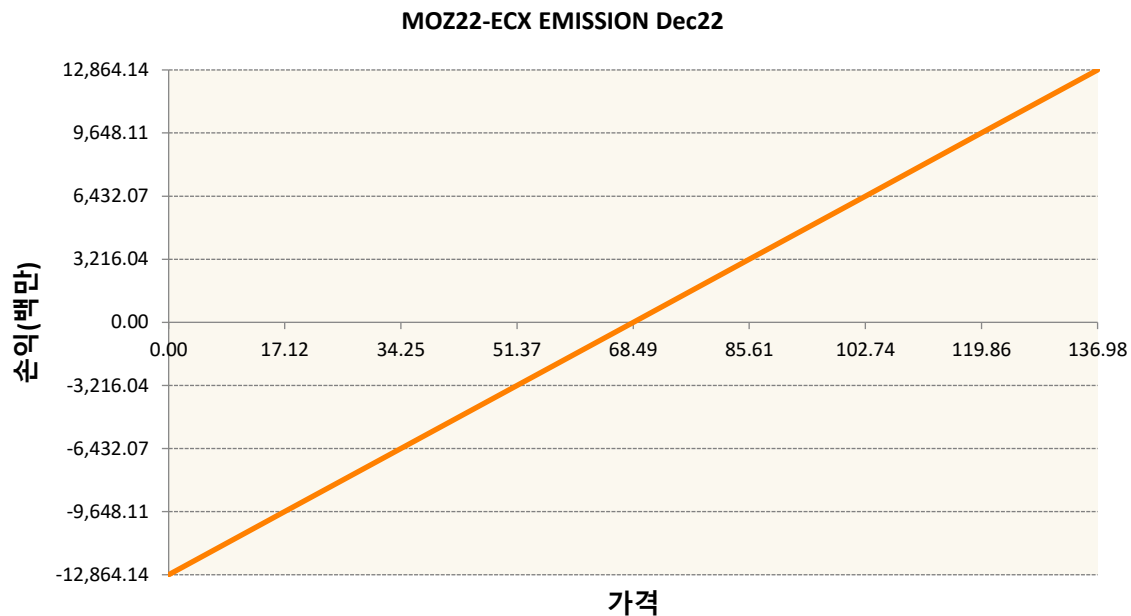
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,864	0	12,864	
누계	통화	선도	0	8,180	-8,180	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2R KRW/EUR 28-03-22E
MOZ22 ECX EMISSION Dec22

654
1,029

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

(단위:백만원)

2,631

공시일	2022-03-04
기준일	2022-03-03

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)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	6

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

(단위:백만원)

46

공시일	2022-03-04
기준일	2022-03-03

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)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	7

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

(단위:백만원)

36

공시일	2022-03-04
기준일	2022-03-03

에쿼티알파일반사모혼합자산

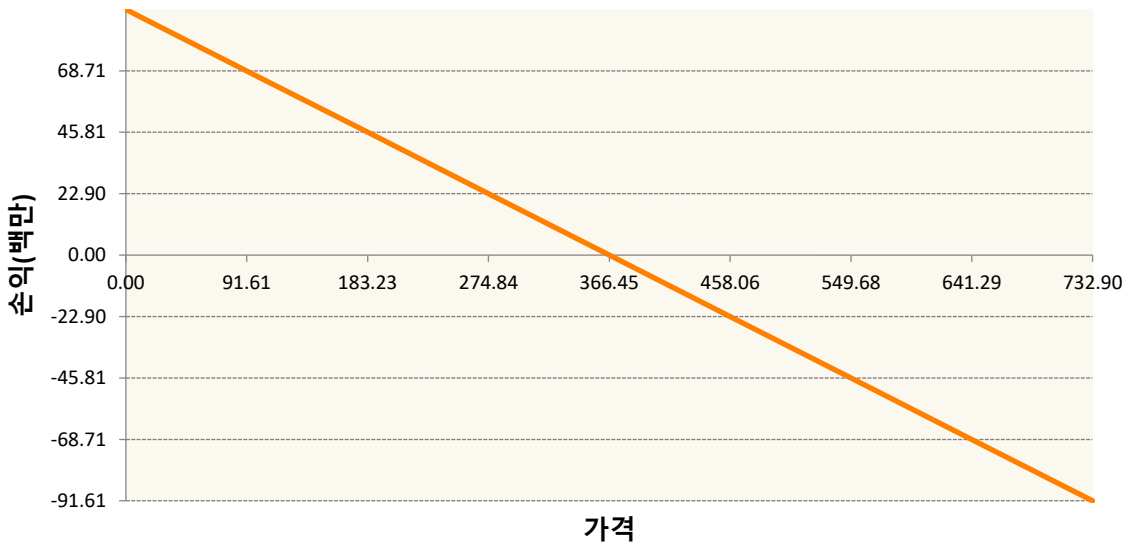
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	92	-92	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 2022-03-04

기준일 2022-03-03

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

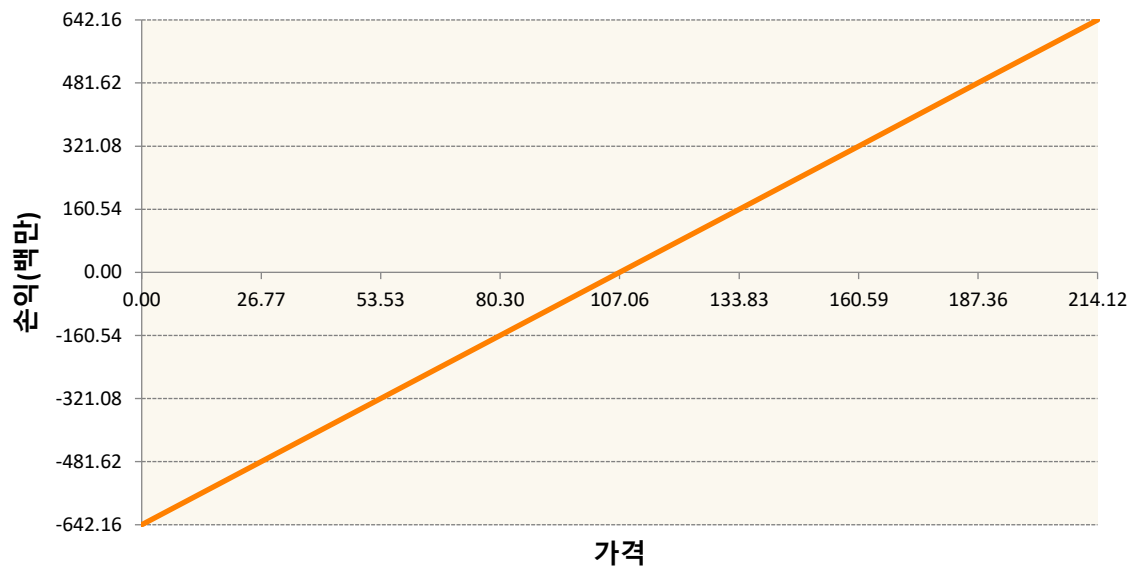
1. 계약금액

(단위:백만원)

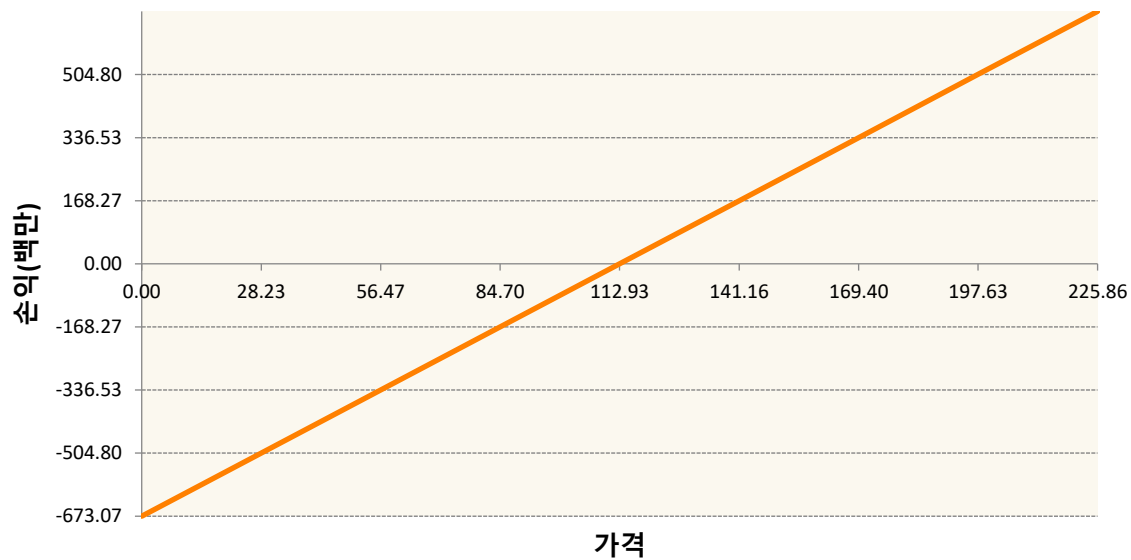
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,624	542	2,081	

2. 만기시점의 손익구조

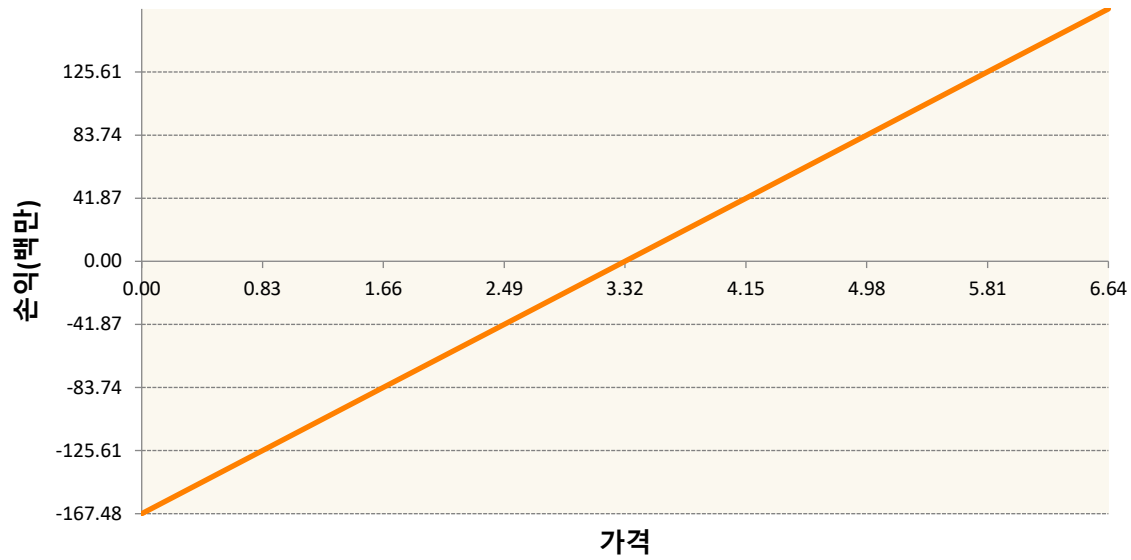
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



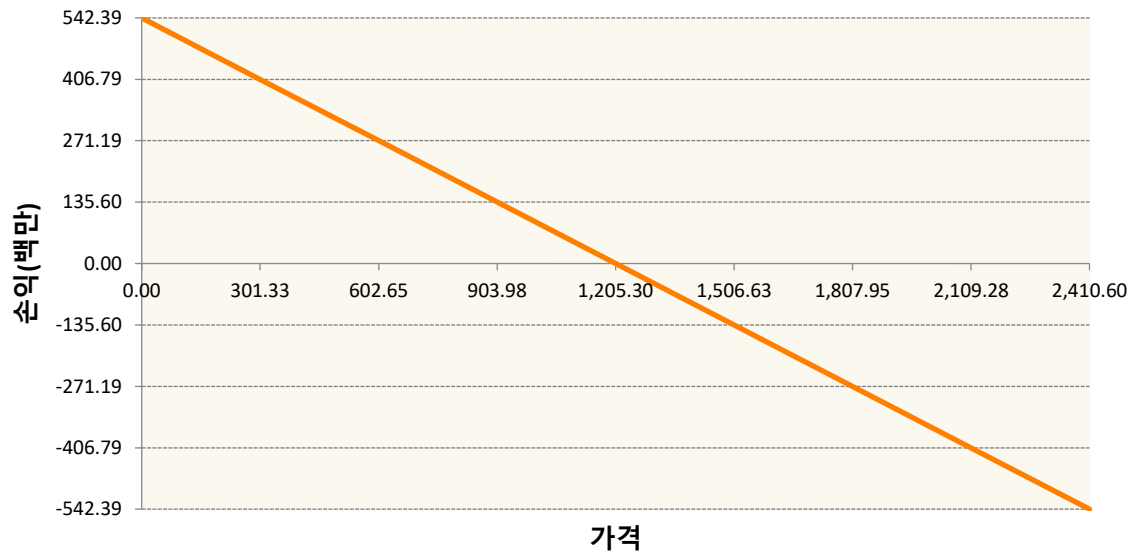
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



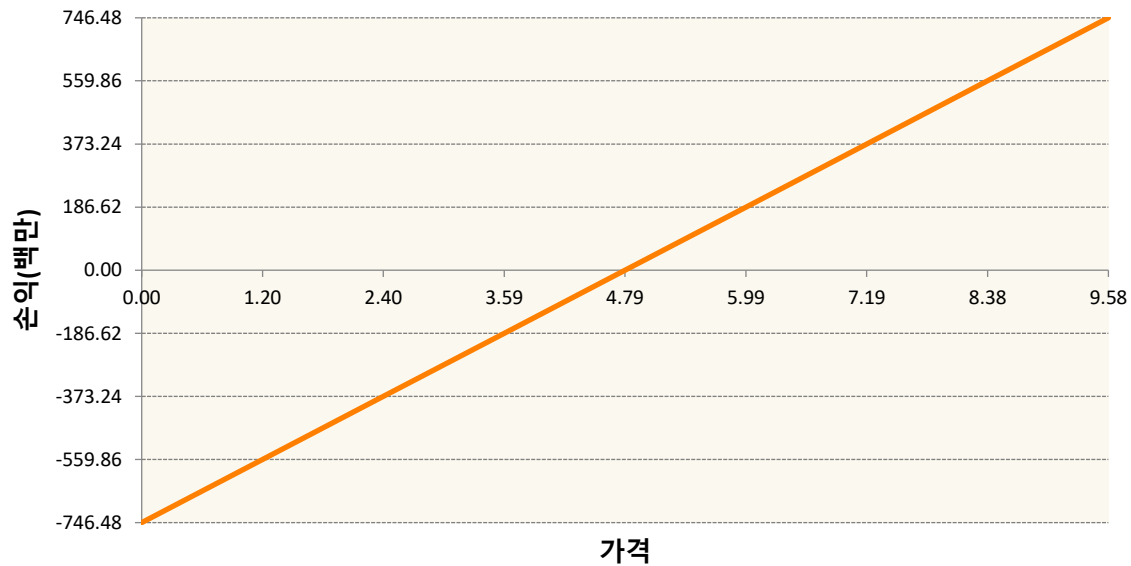
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

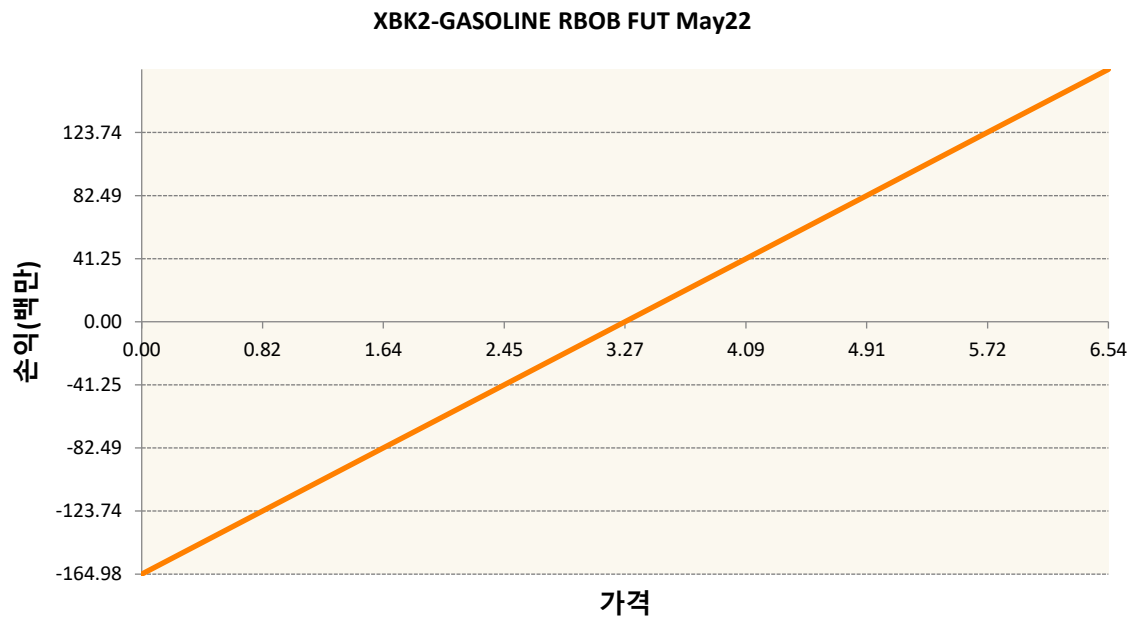
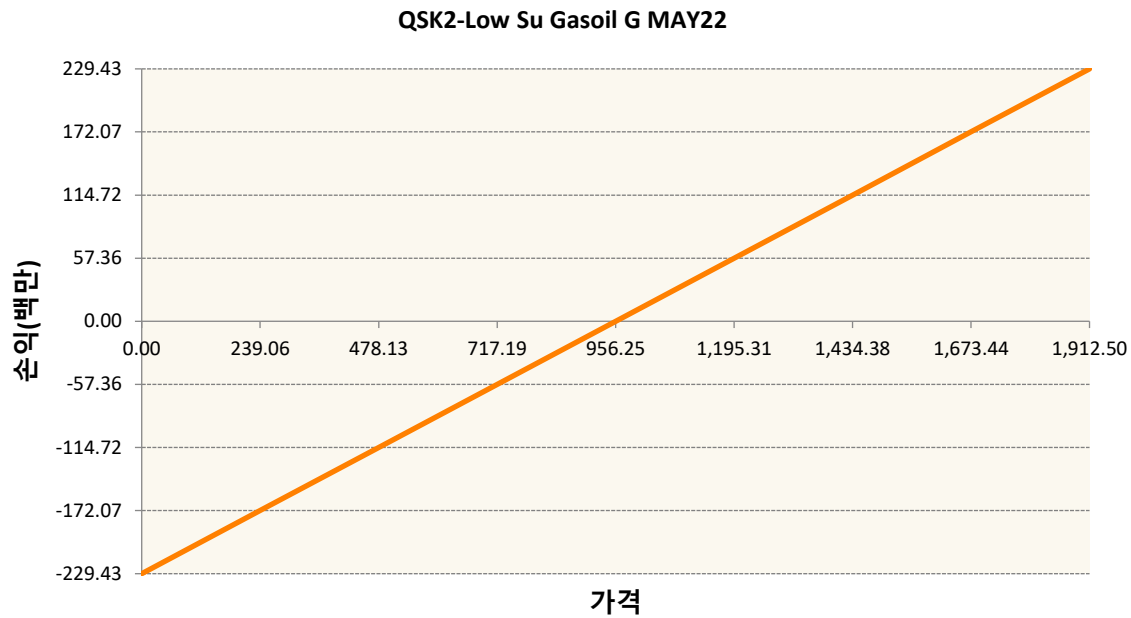


KR4175S30005-2022-03 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		51
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22		54
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		13
KR4175S300	2022-03 달러선물		43
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		60
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		18
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		530