

공시일 2022-03-07

기준일 2022-03-04

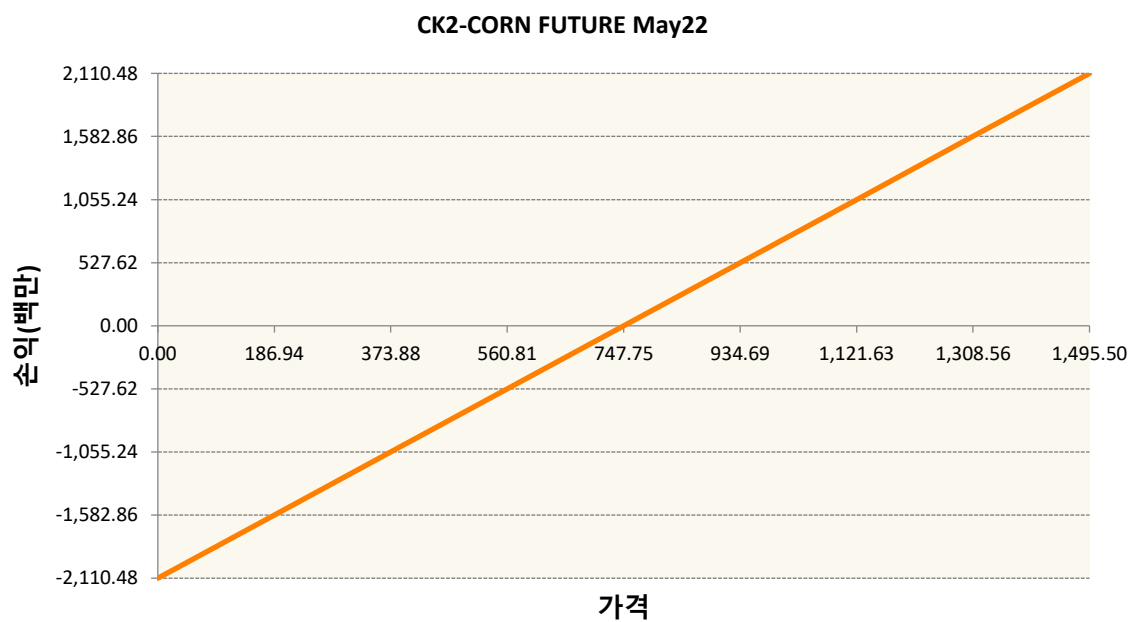
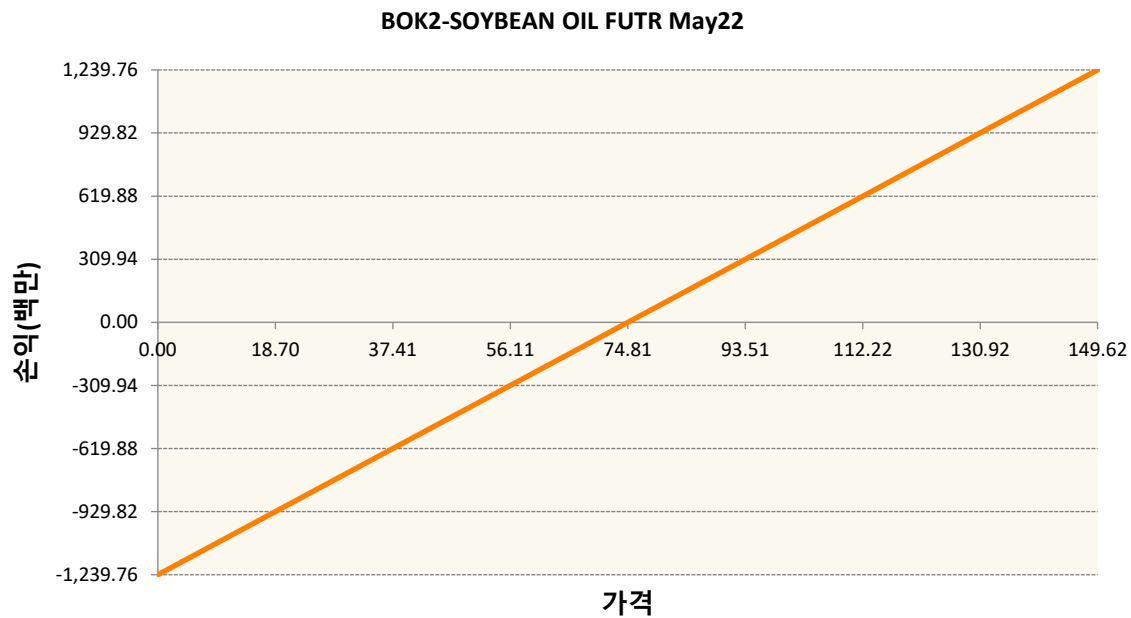
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

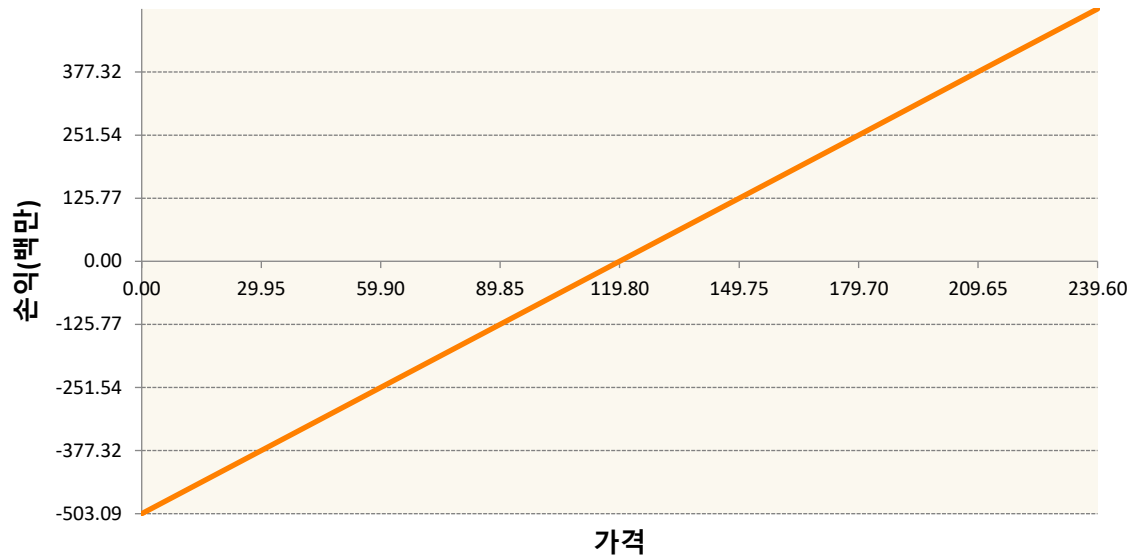
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,902	1,337	9,565	

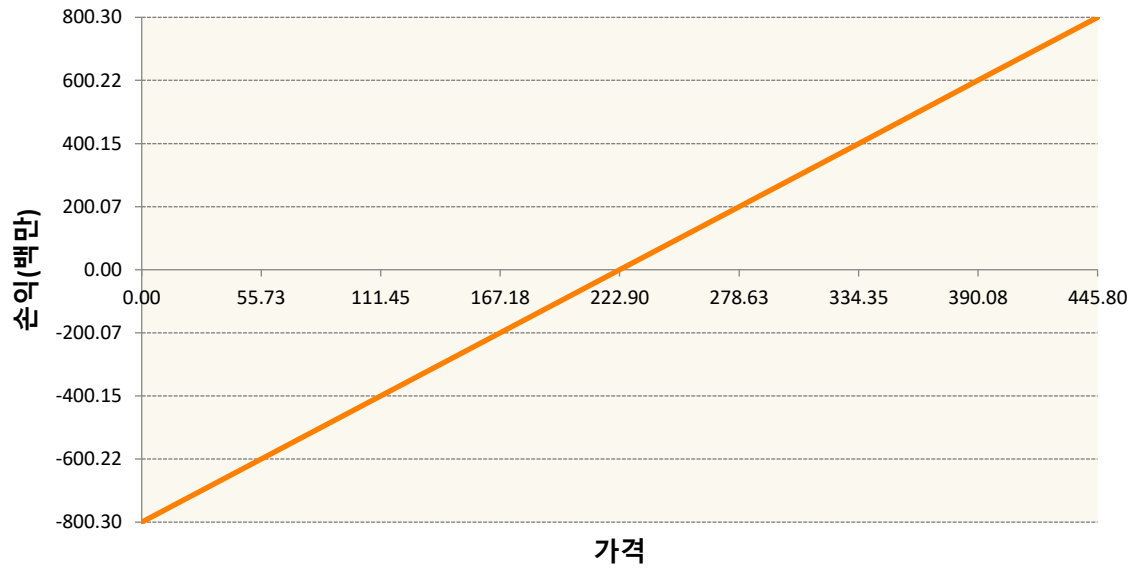
2. 만기시점의 손익구조



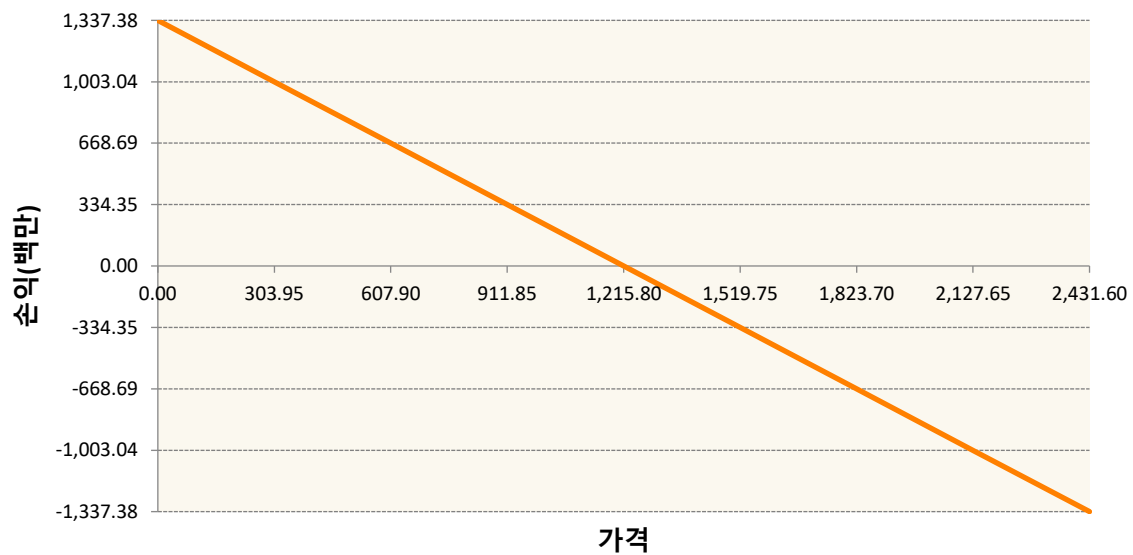
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



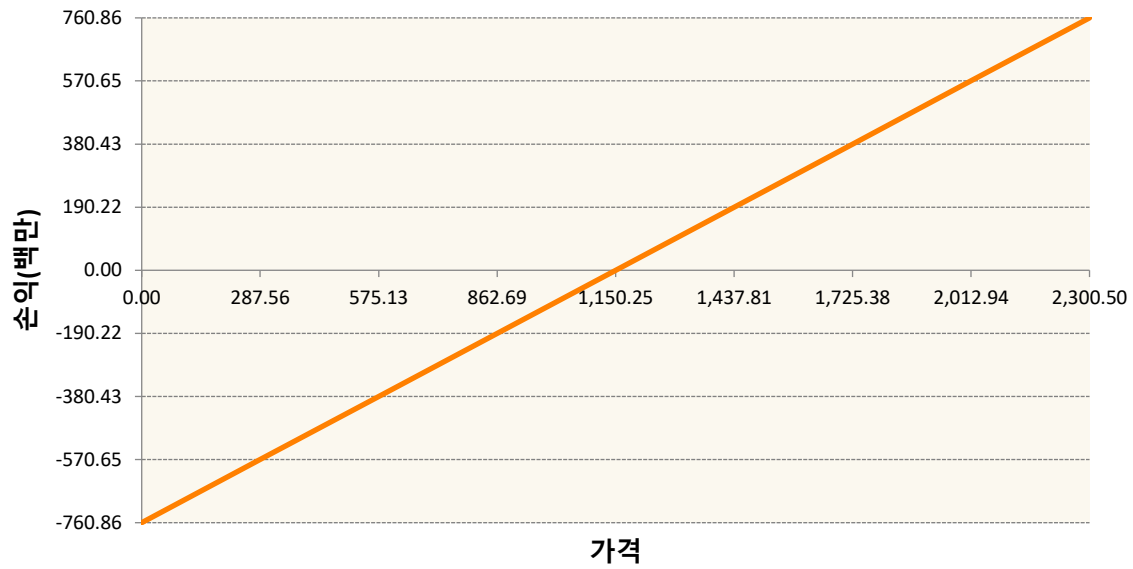
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



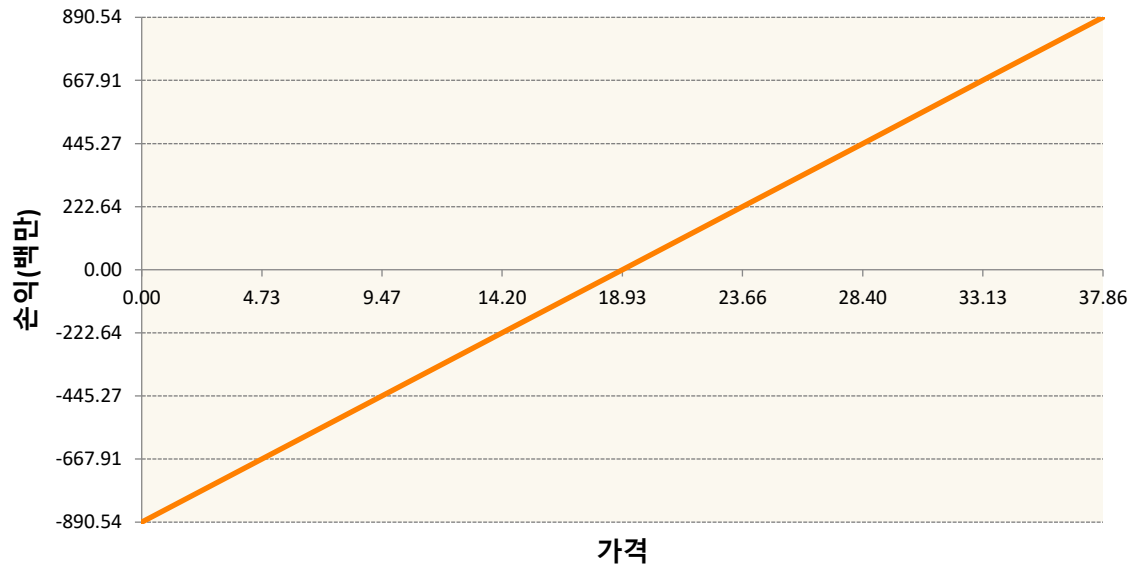
KR4175S30005-2022-03 달러선물



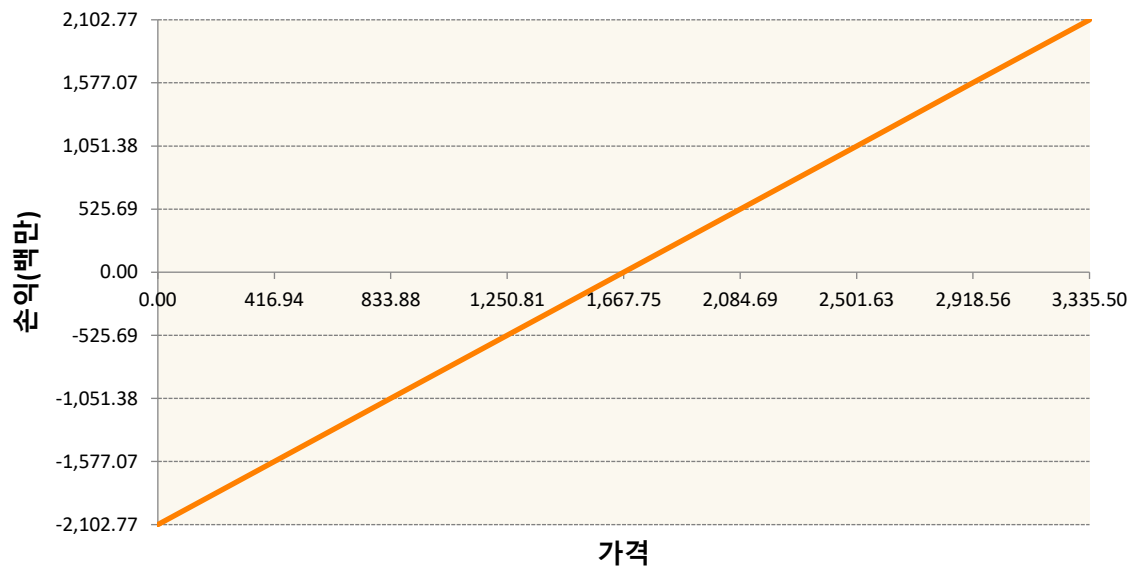
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22

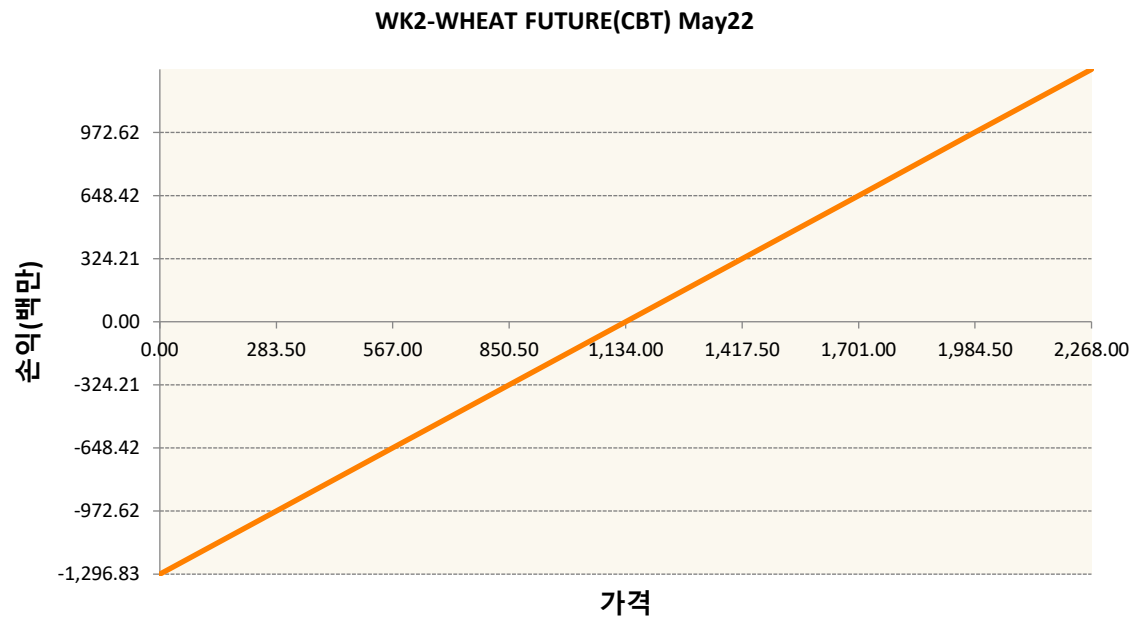
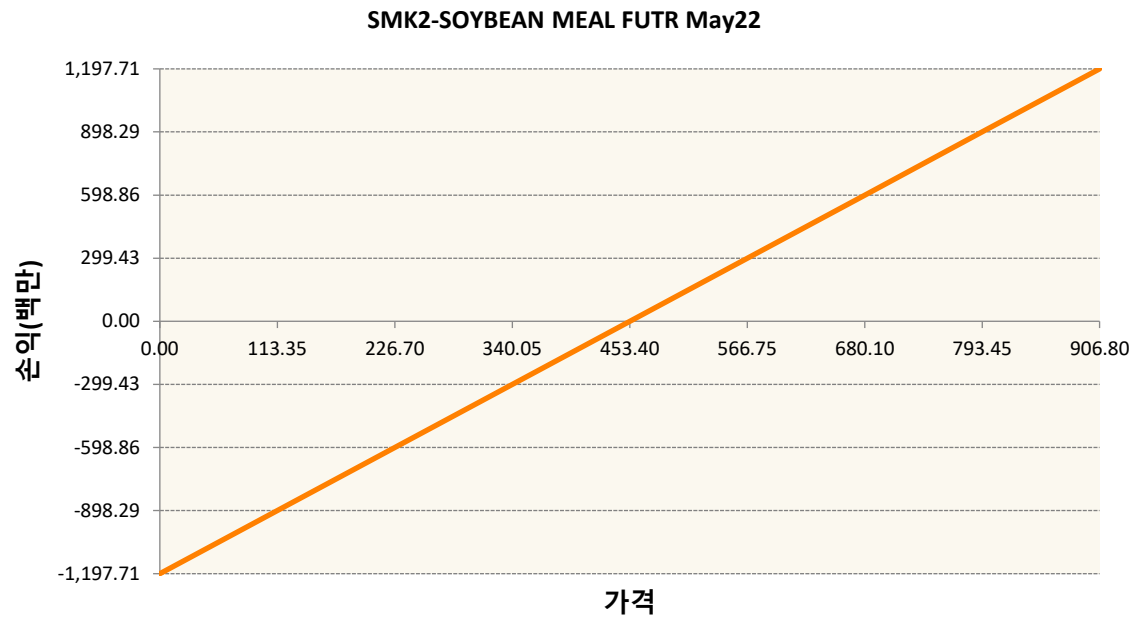


SBK2-Sugar May22



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	2022-03-07
기준일	2022-03-04

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)

87

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-03-07
기준일	2022-03-04

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	417
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

389

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-03-07
기준일 2022-03-04

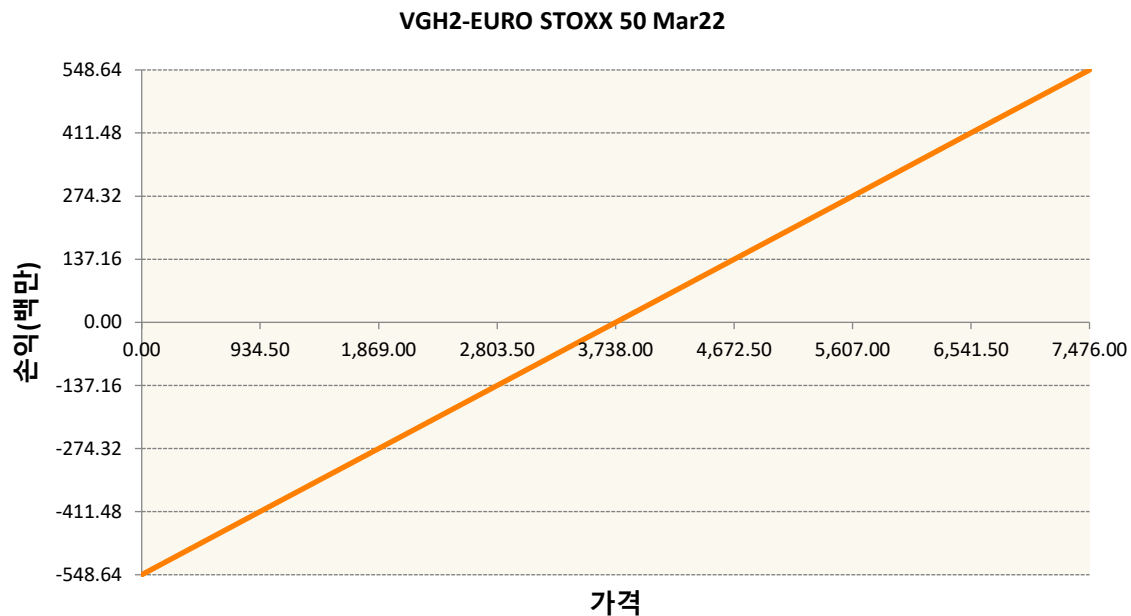
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	549	0	549	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2022-03-07
기준일	2022-03-04

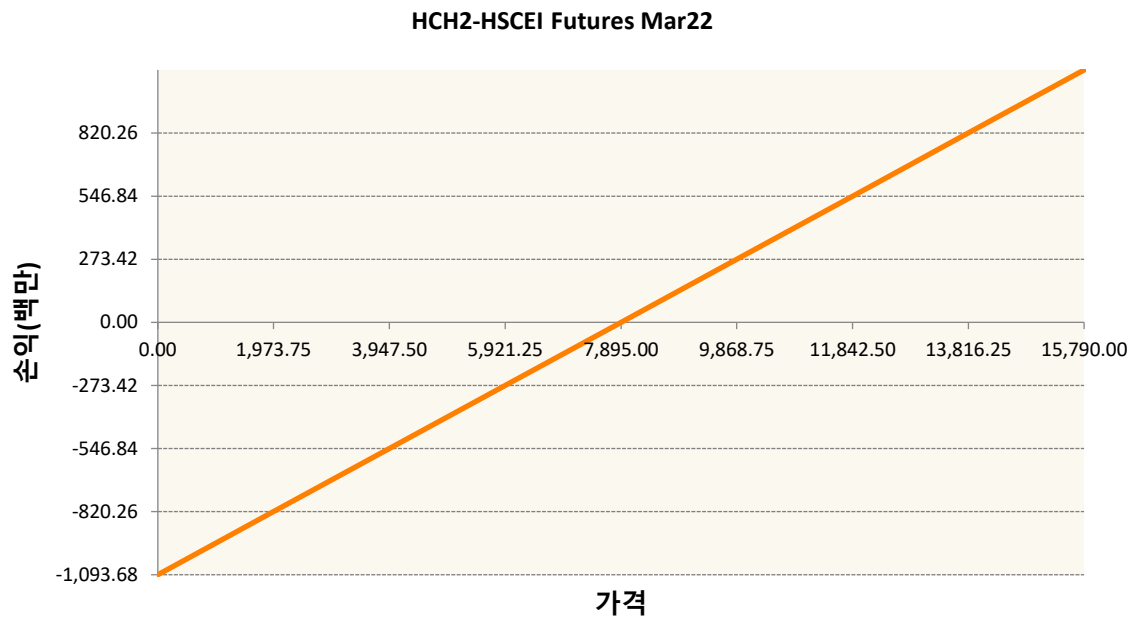
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,094	0	1,094	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2	HSCEI Futures Mar22	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

94

공시일 2022-03-07

기준일 2022-03-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

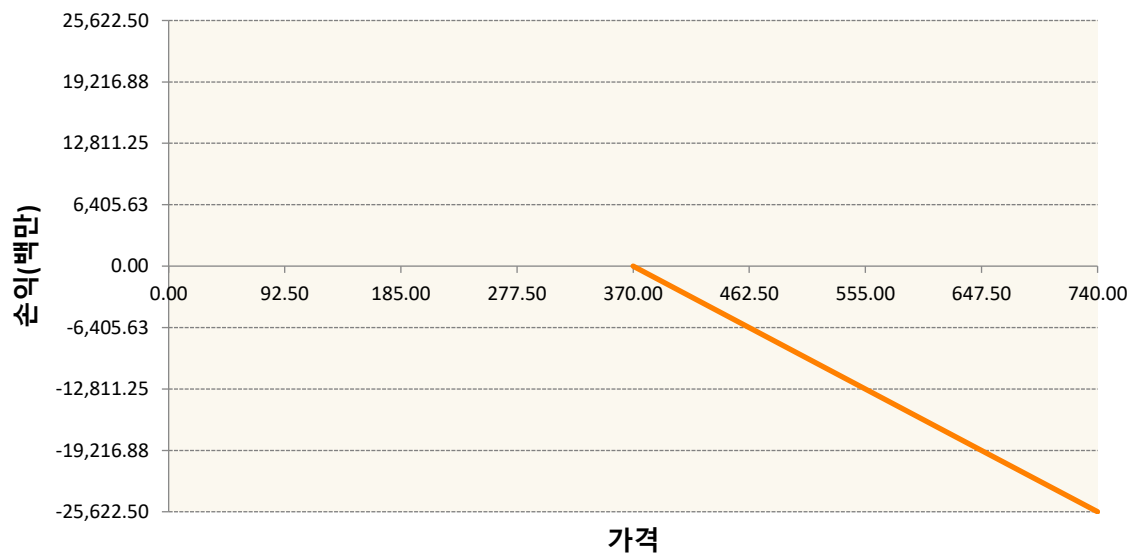
1. 계약금액

(단위:백만원)

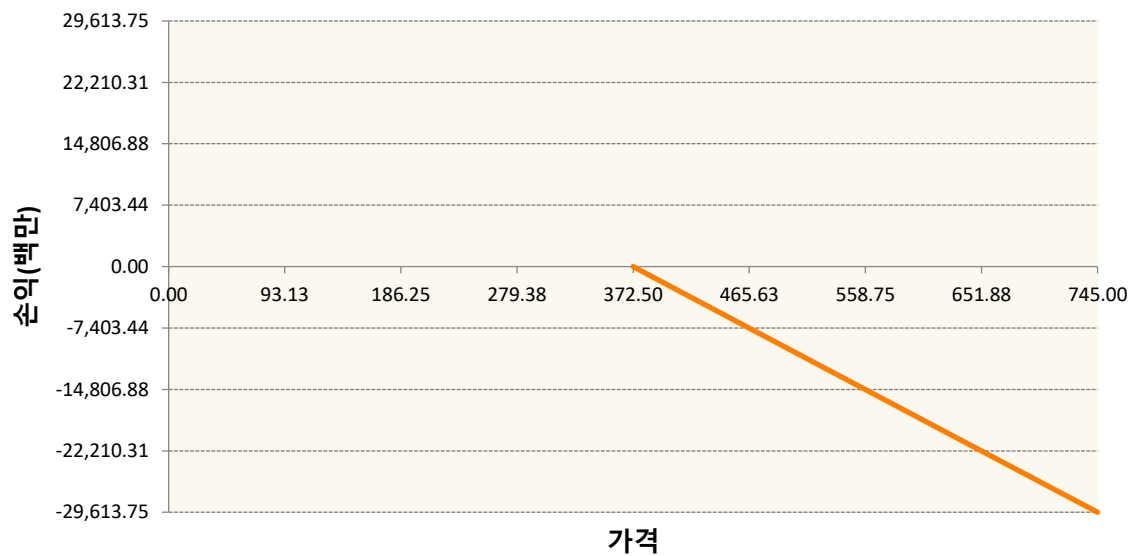
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	68,739	-68,739	장내

2. 만기시점의 손익구조

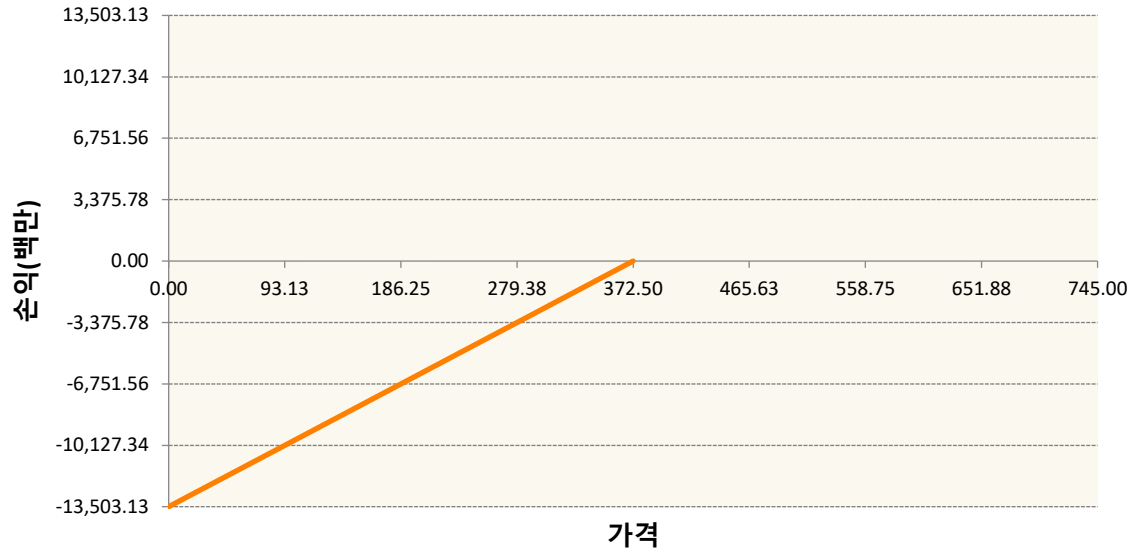
KR4201S33706-2022-03 콜370



KR4201S33722-2022-03 콜372.5



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S33706			2022-03 콜370				1,337
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	206	206	205	204	202	199	194
-5.33%	204	201	197	191	183	173	162
-2.67%	185	172	158	140	121	100	77
0%	90	61	31	0	-32	-64	-97
2.67%	-172	-208	-245	-282	-318	-355	-392
5.33%	-636	-662	-689	-718	-749	-780	-811
8.00%	-1,236	-1,247	-1,260	-1,276	-1,295	-1,315	-1,337
KR4201S33722			2022-03 콜372.5				1,424
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	184	184	183	182	181	178	174
-5.33%	183	181	178	172	166	157	146
-2.67%	169	159	145	129	111	90	67
0%	92	63	32	0	-34	-68	-104
2.67%	-151	-194	-236	-278	-320	-362	-405
5.33%	-627	-662	-698	-735	-773	-811	-850
8.00%	-1,285	-1,302	-1,321	-1,344	-1,369	-1,395	-1,424
KR4301S33720			2022-03 풋372.5				1,007
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007
-5.33%	-658	-658	-658	-658	-659	-660	-661
-2.67%	-309	-310	-312	-315	-318	-322	-327
0%	24	17	9	0	-10	-20	-30

2.67%	282	268	253	239	225	210	196
5.33%	403	393	382	371	360	348	335
8.00%	431	428	425	420	415	409	402

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

(단위:백만원)

3,719

공시일 2022-03-07

기준일 2022-03-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

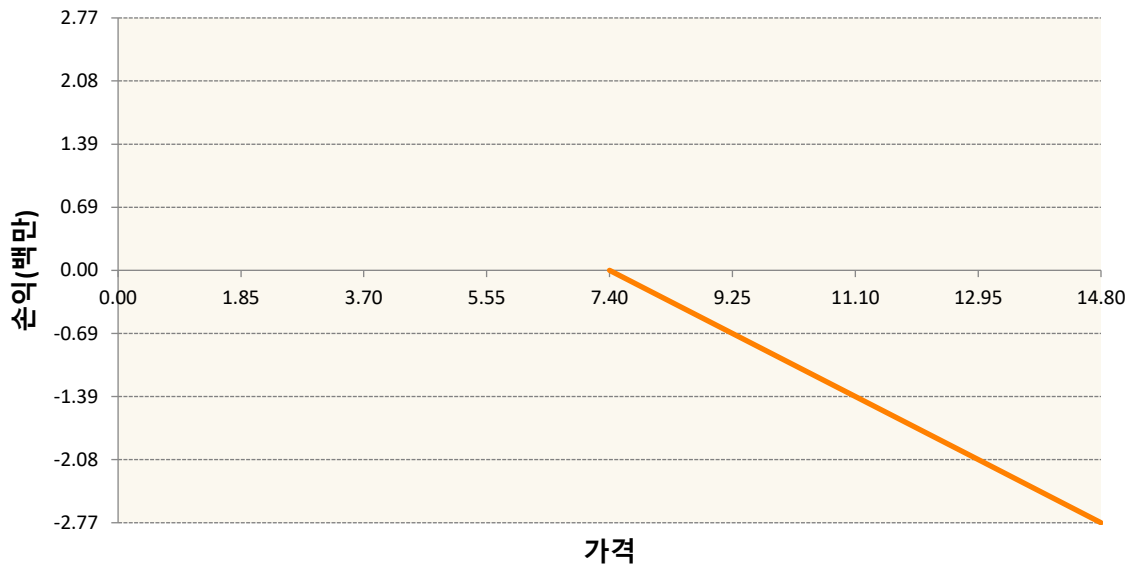
1. 계약금액

(단위:백만원)

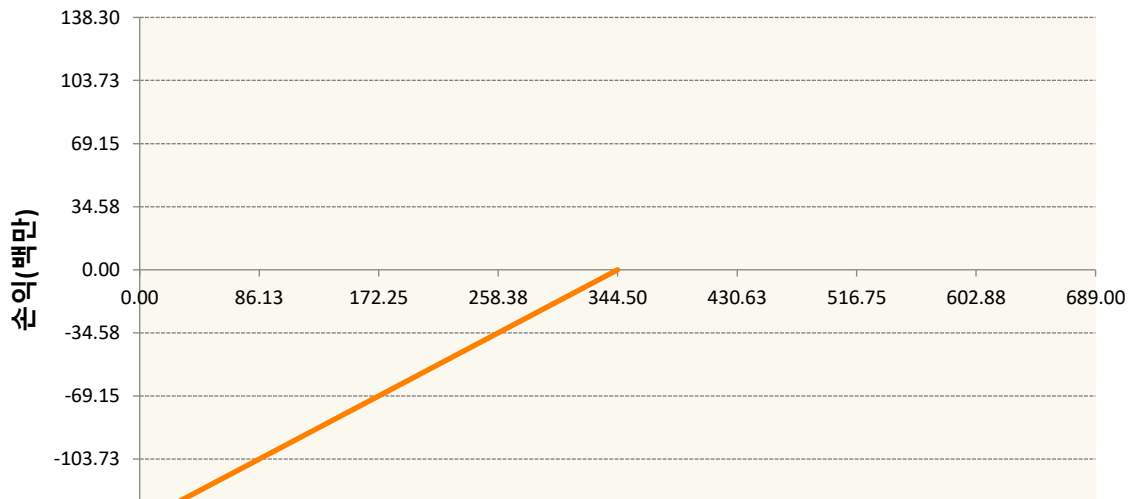
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	141	-141	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	268	1,338	-1,071	장외

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		59
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		0.22
OESXH2-P40 EURO STOXX 50		11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	151

공시일 2022-03-07

기준일 2022-03-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

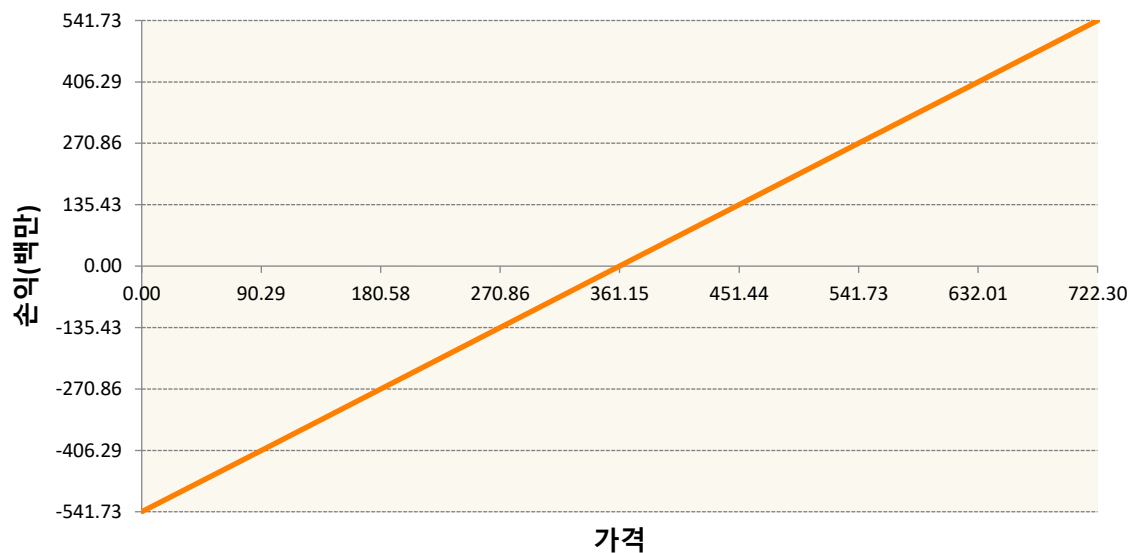
1. 계약금액

(단위:백만원)

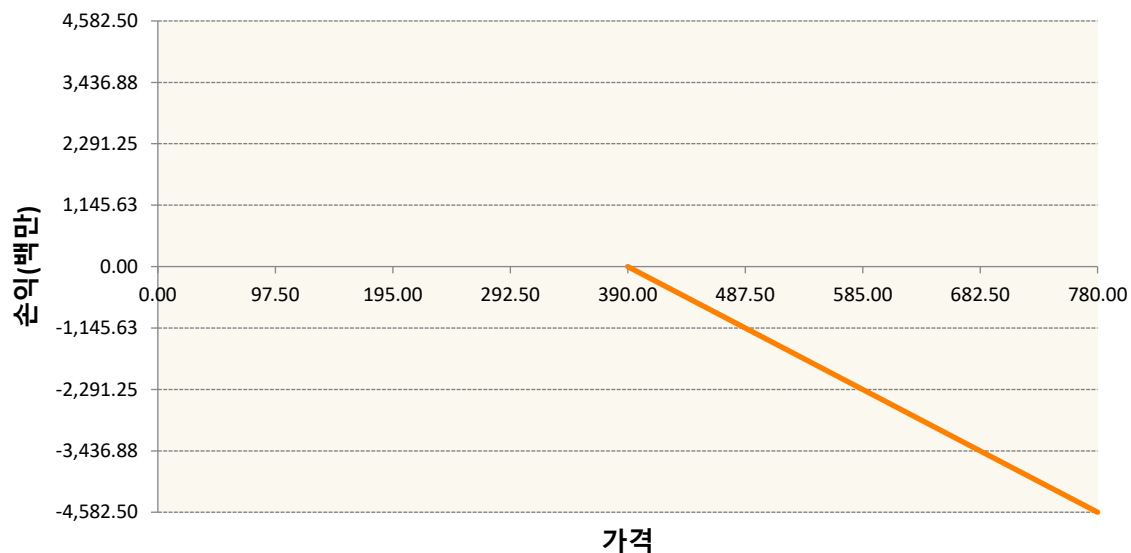
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	542	0	542	장내
누계	유가증권	옵션	372	4,877	-4,505	장내

2. 만기시점의 손익구조

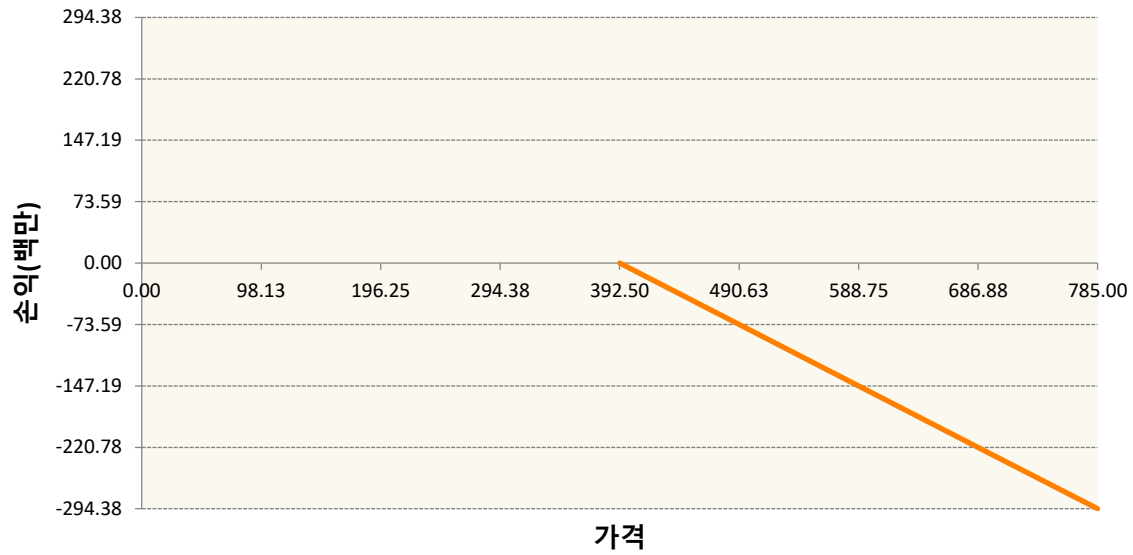
KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



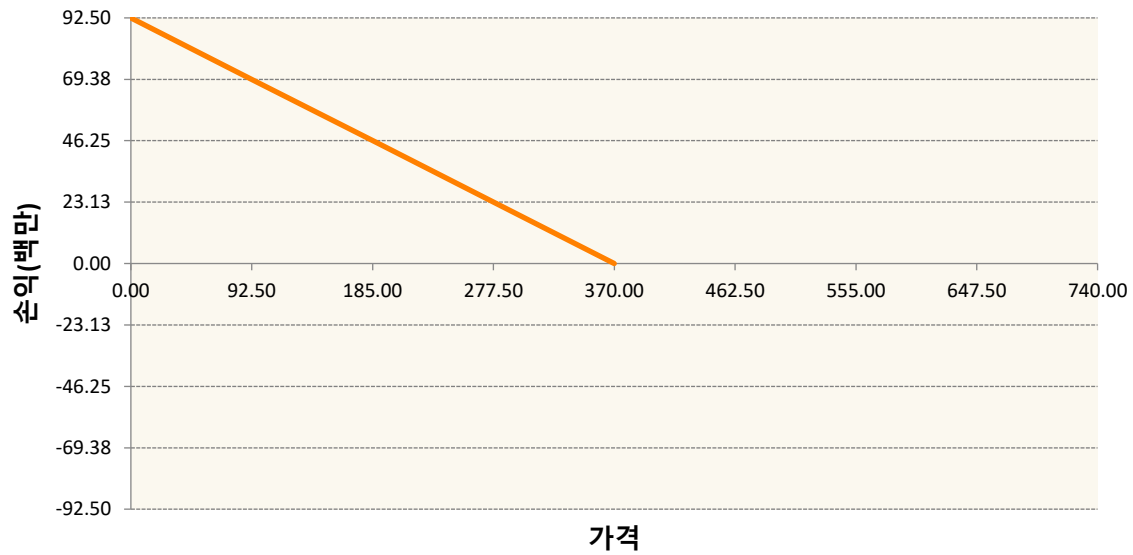
KR4201S33904-2022-03 콜390



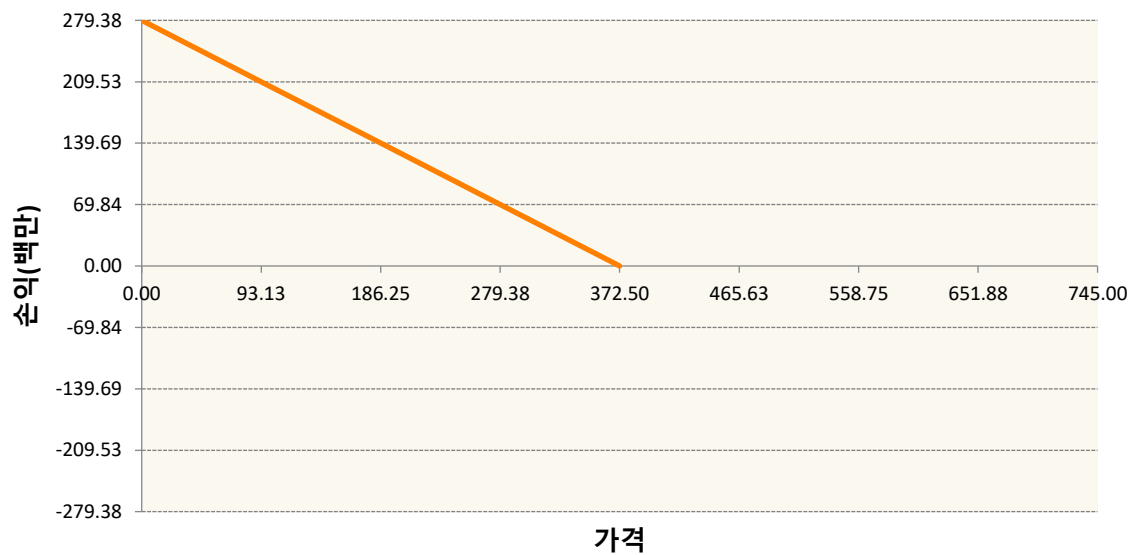
KR4201S33920-2022-03 콜392.5



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	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	29	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43	43
KR4201S33904						2022-03 콜390		99
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3	2
-2.67%	3	3	3	3	2	1		0
0%	3	2	1	0	-2	-3		-6
2.67%	-1	-3	-6	-9	-13	-16		-21
5.33%	-17	-22	-27	-33	-39	-44		-50
8.00%	-60	-66	-73	-79	-86	-92		-99
KR4201S33920						2022-03 콜392.5		5
	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	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	-1	-1		-1
5.33%	-1	-1	-1	-2	-2	-2		-3
8.00%	-3	-3	-4	-4	-5	-5		-5
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	7
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-2	-2	-1	-1	-1		-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2		-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2		-2
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%	14	14	14	14	14	14	14
-2.67%	6	6	6	7	7	7	7
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-6	-6	-5	-5	-5	-4	-4
5.33%	-8	-8	-8	-8	-7	-7	-7
8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-8	-8

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

(단위:백만원)

112

공시일	2022-03-07
기준일	2022-03-04

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	9,646	0	9,646	

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	2022-03-07
기준일	2022-03-04

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	7,955	0	7,955	

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	2022-03-07
기준일	2022-03-04

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	27,232	0	27,232	
누계	통화	선도	2,064	30,027	-27,963	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	194
FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E	68
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,208
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)

789

공시일 2022-03-07

기준일 2022-03-04

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

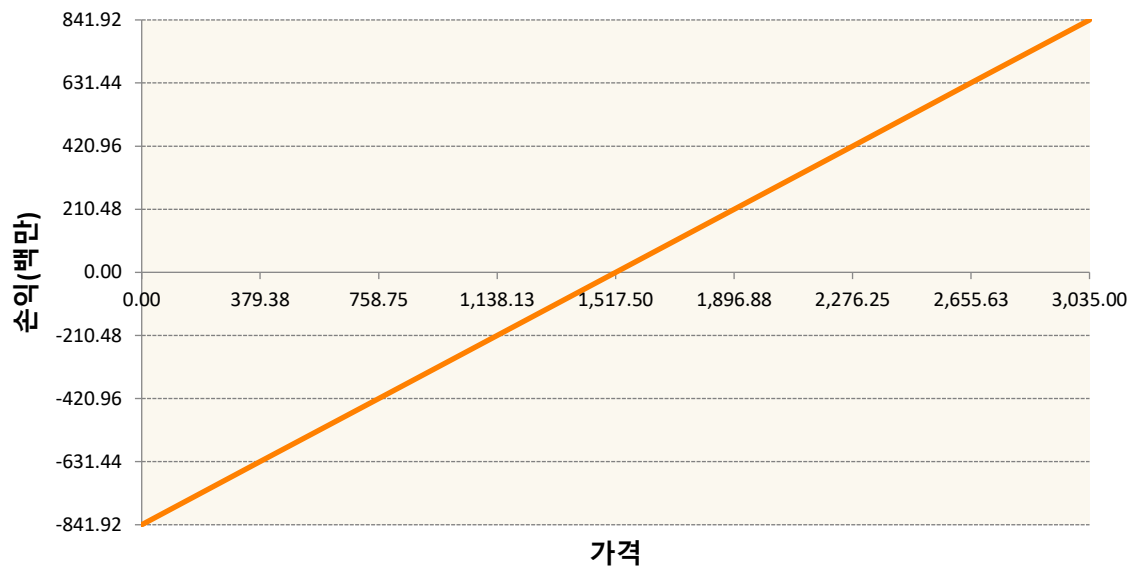
1. 계약금액

(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	842	0	842	
누계	유가증권	스왑	1,829	0	1,829	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	67

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

(단위:백만원)

271

공시일 2022-03-07

기준일 2022-03-04

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

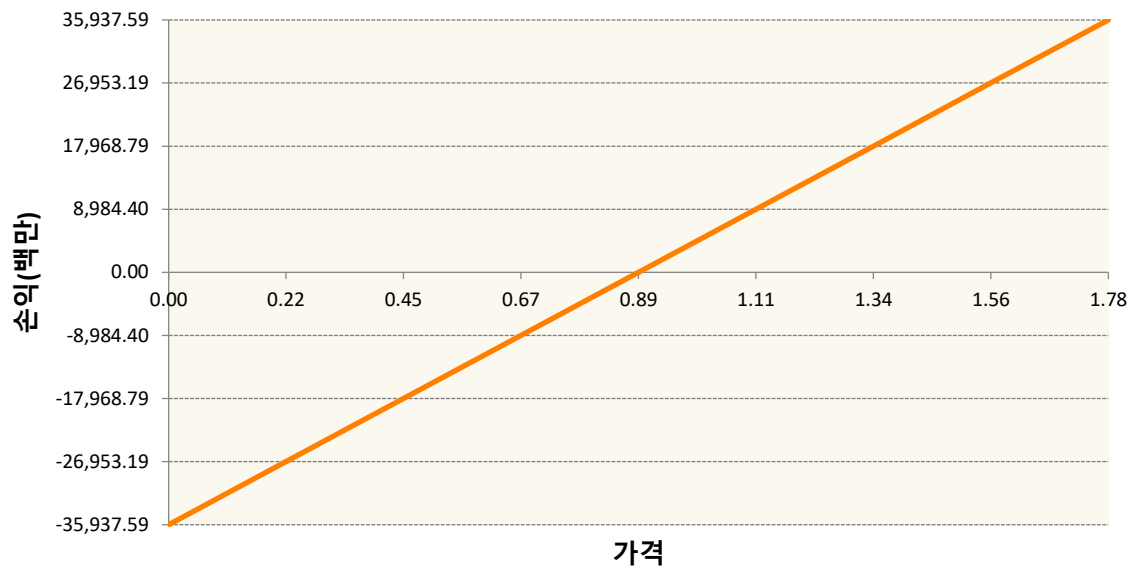
1. 계약금액

(단위:백만원)

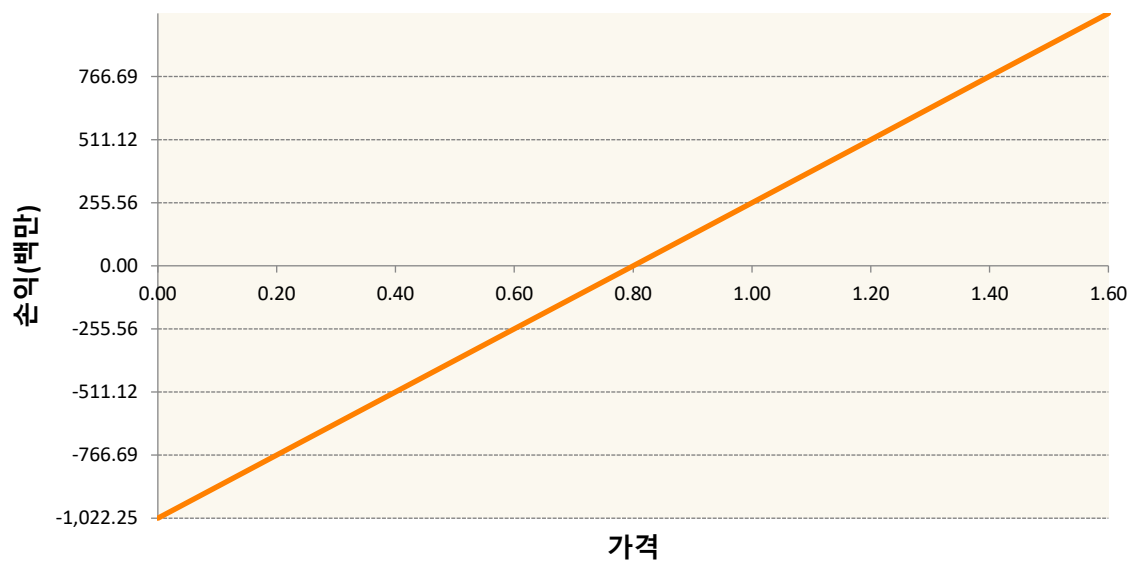
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	37,982	0	37,982	

2. 만기시점의 손익구조

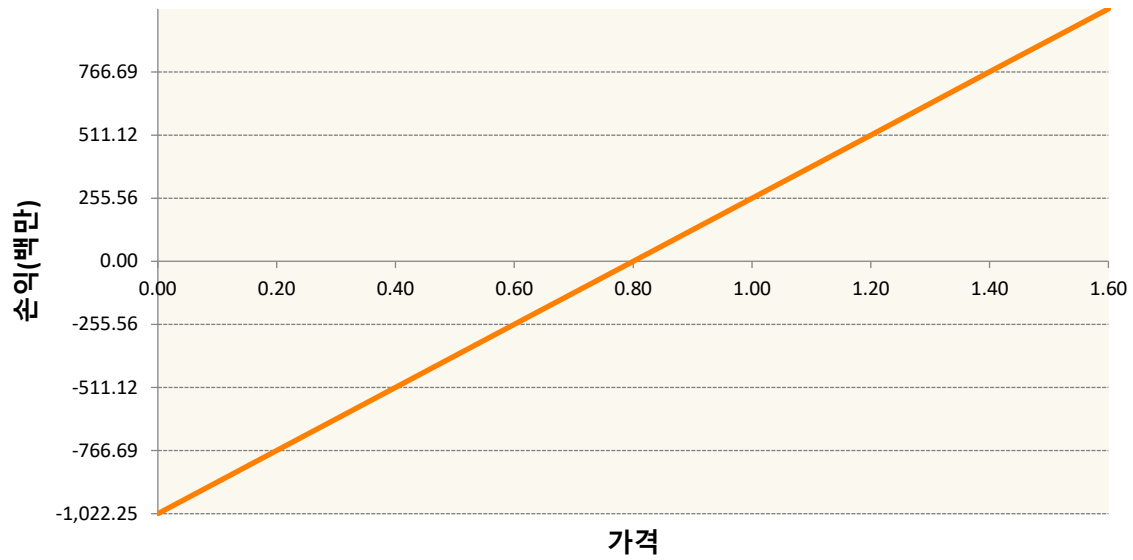
210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

2,872
82
82

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

(단위:백만원)

5,236

공시일 2022-03-07

기준일 2022-03-04

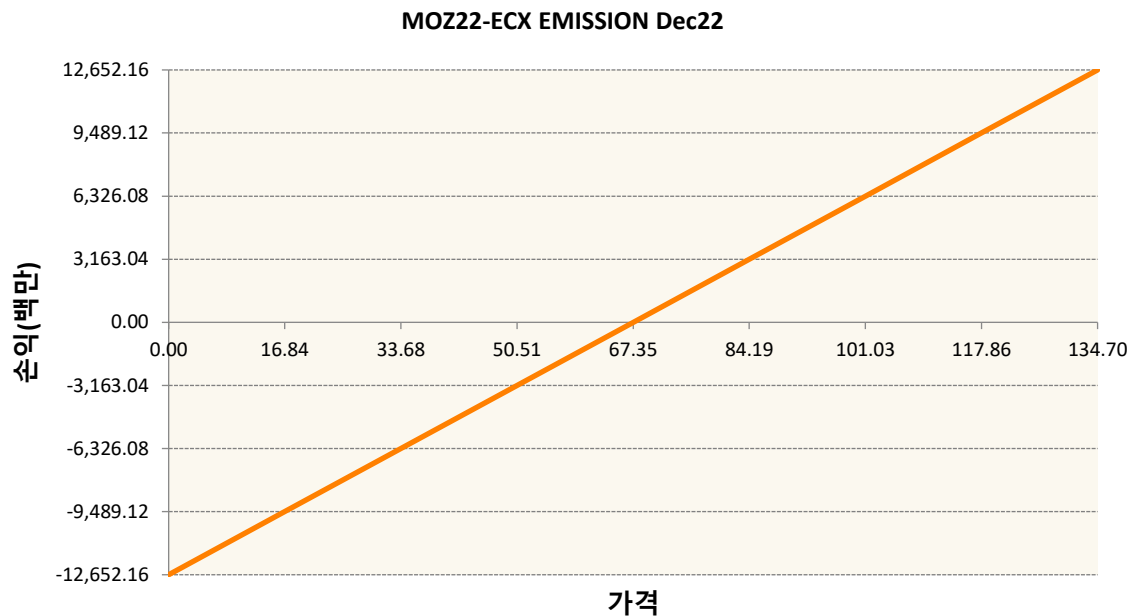
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,652	0	12,652	
누계	통화	선도	0	8,186	-8,186	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

655
1,012

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

(단위:백만원)

2,595

공시일	2022-03-07
기준일	2022-03-04

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)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	9

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

(단위:백만원)

68

공시일	2022-03-07
기준일	2022-03-04

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	9

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

(단위:백만원)

45

공시일 2022-03-07

기준일 2022-03-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

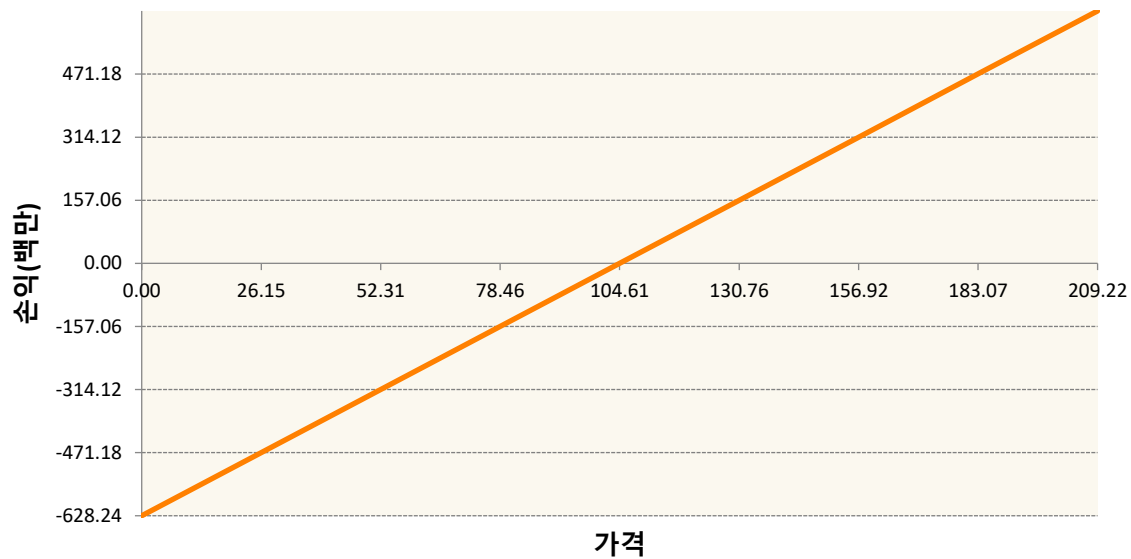
1. 계약금액

(단위:백만원)

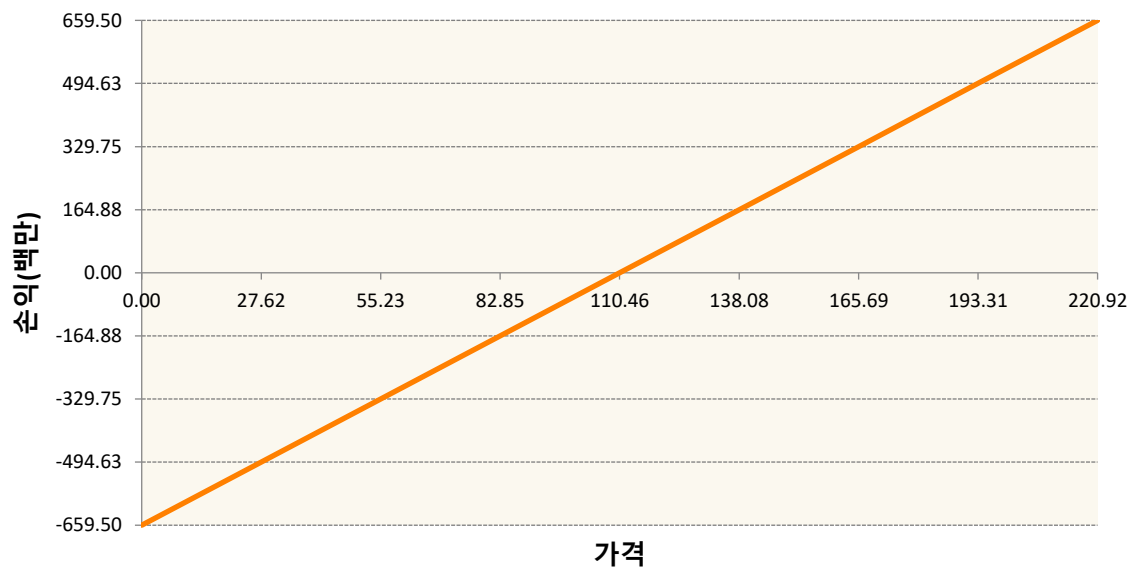
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,598	547	2,051	

2. 만기시점의 손익구조

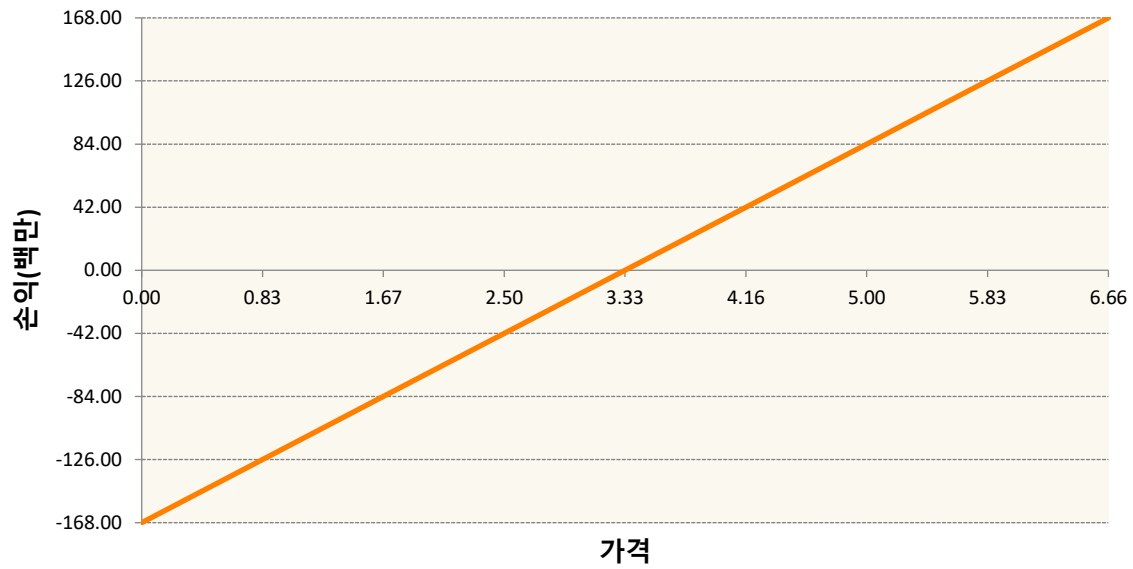
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



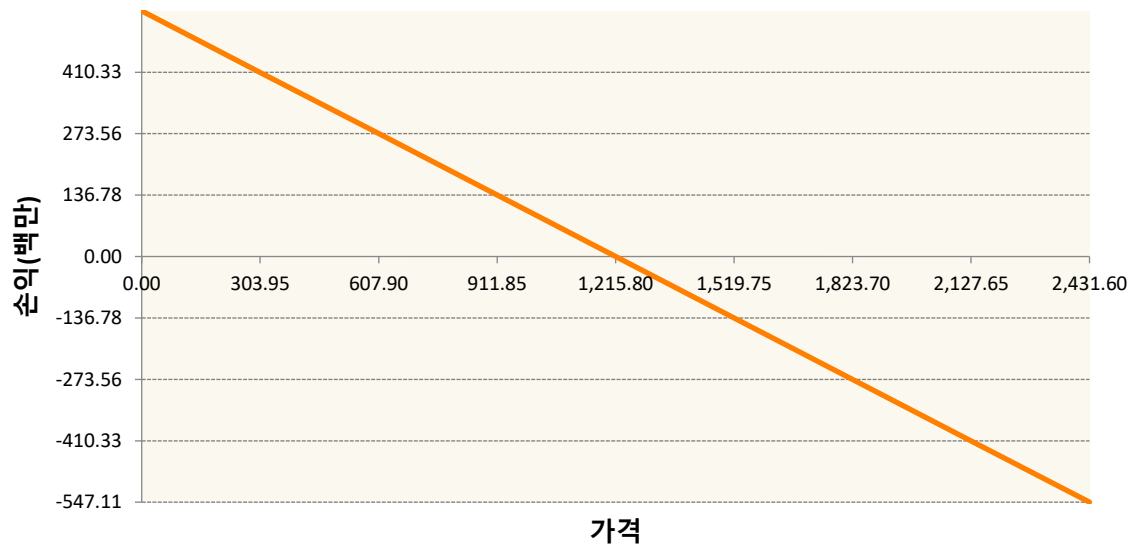
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



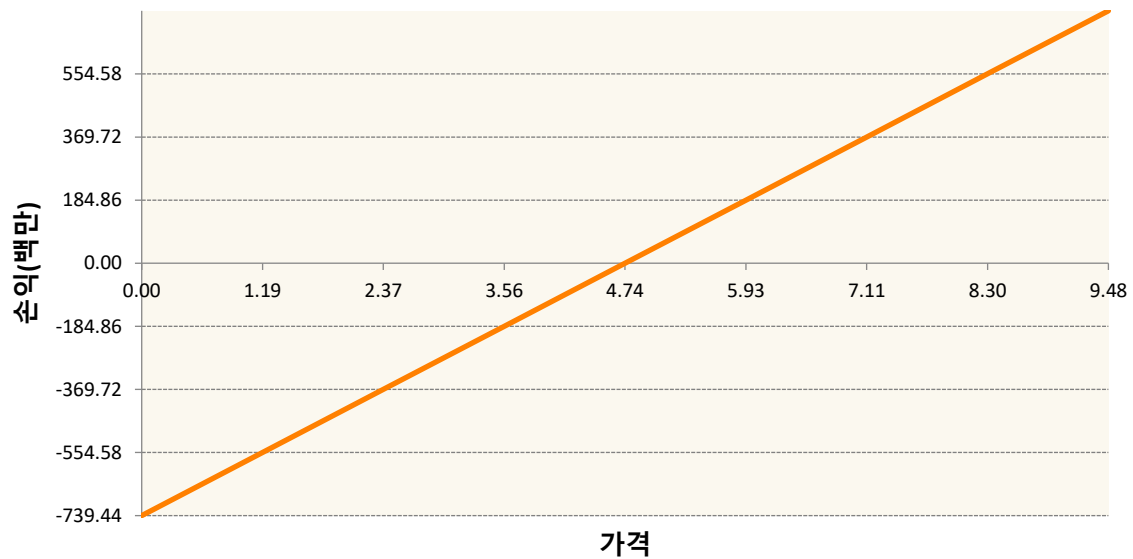
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22



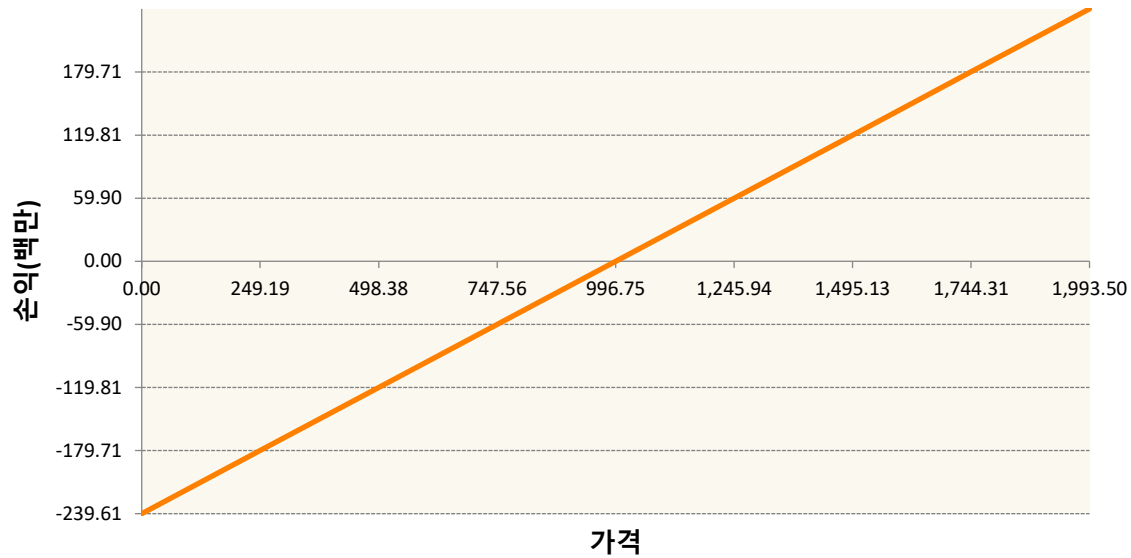
KR4175S30005-2022-03 달러선물



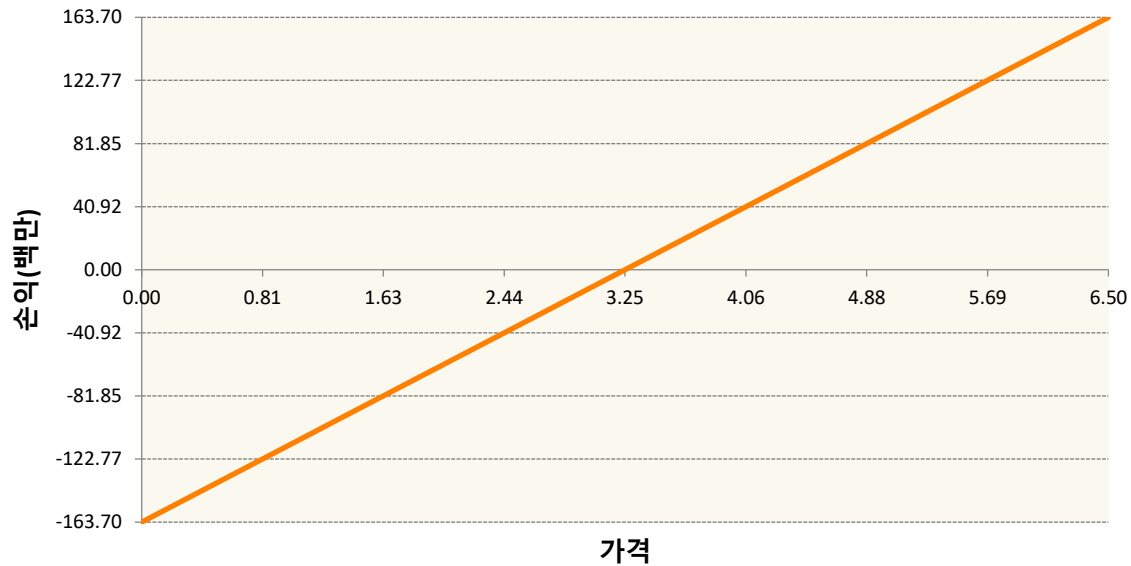
NGK22-NATURAL GAS FUTR May22



QSK2-Low Su Gasoil G MAY22



XBK2-GASOLINE RBOB FUT May22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22	50
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22	53
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22	13
KR4175S300	2022-03 달러선물	44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22	59
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22	19
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22	13

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

(단위:백만원)

525