

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

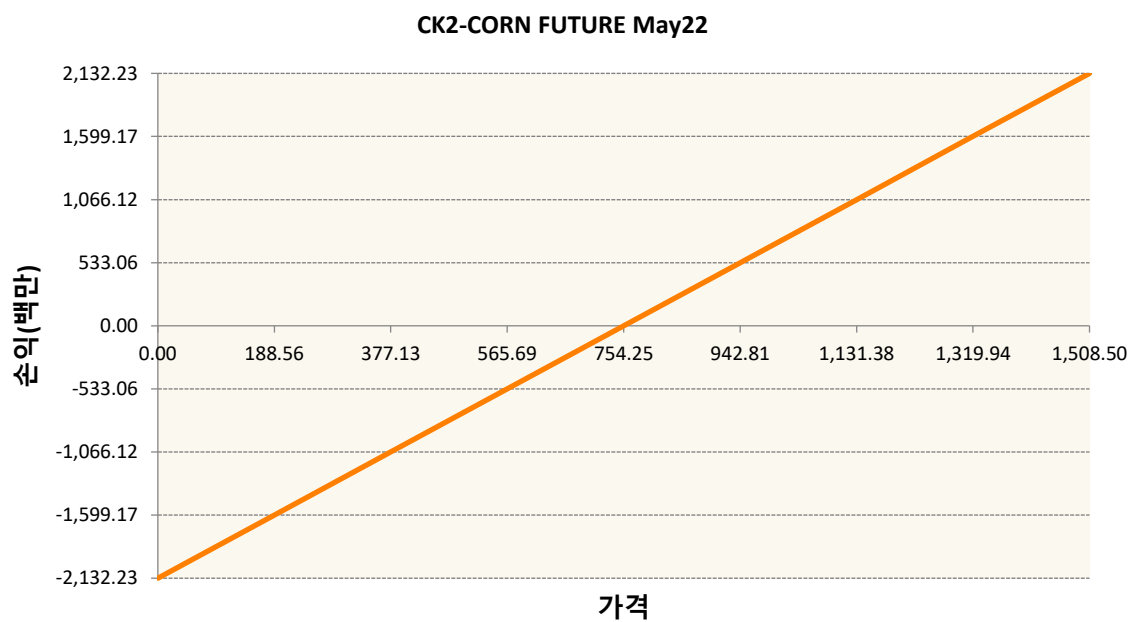
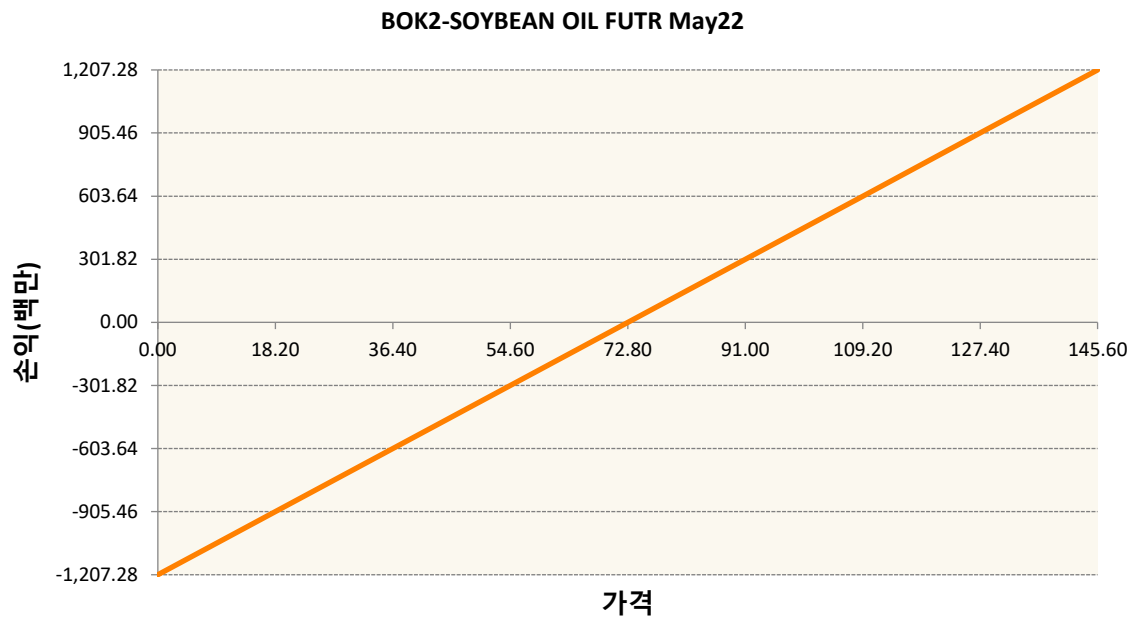
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

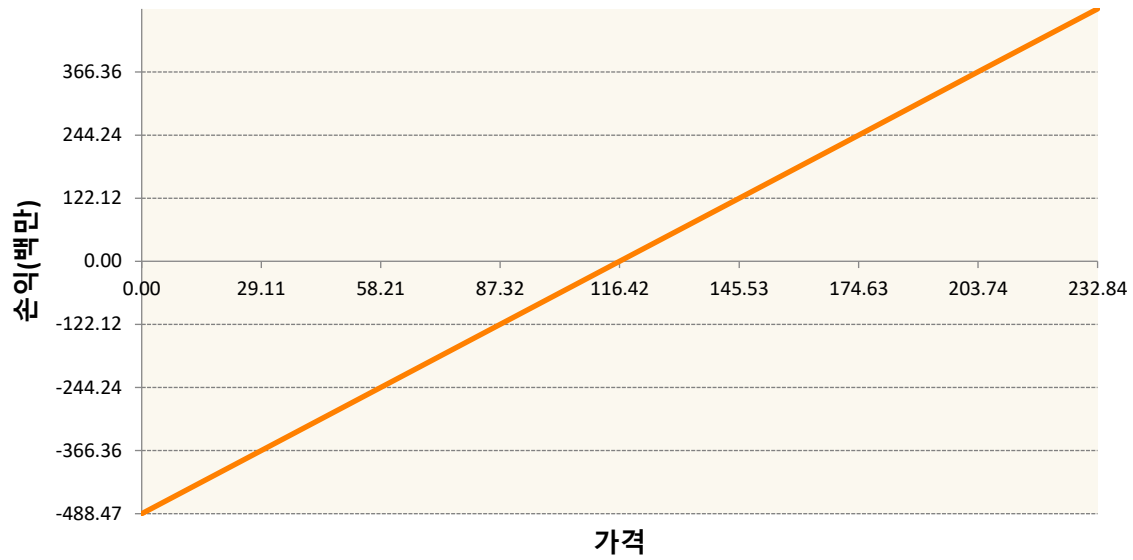
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,050	1,598	9,452	

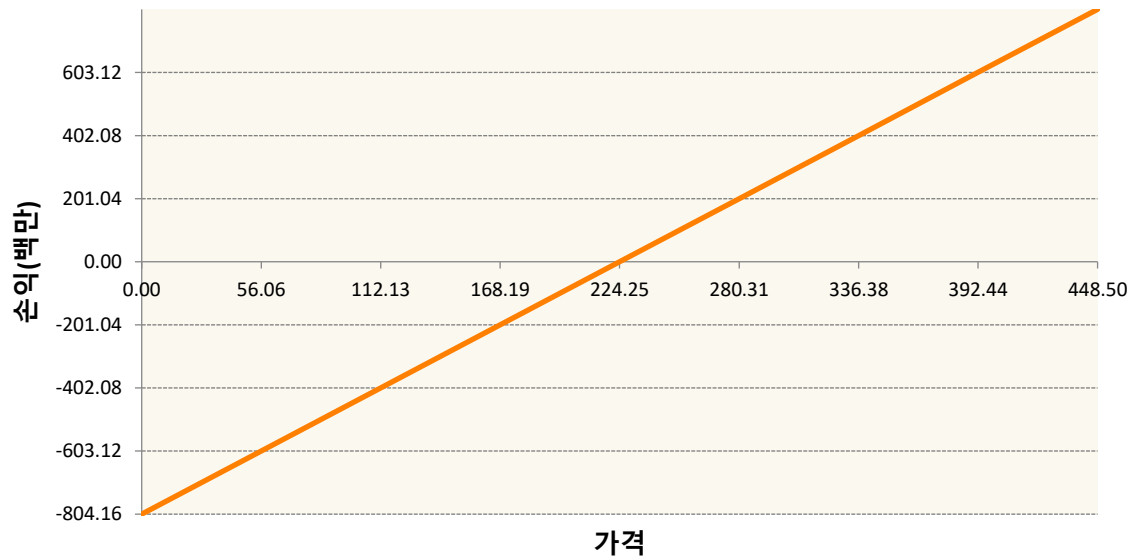
2. 만기시점의 손익구조



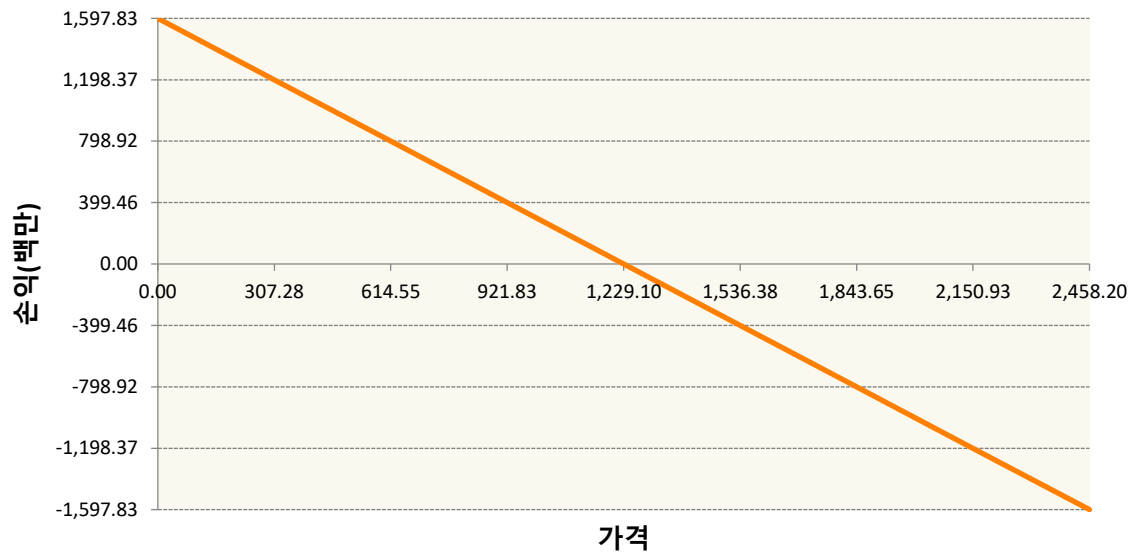
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



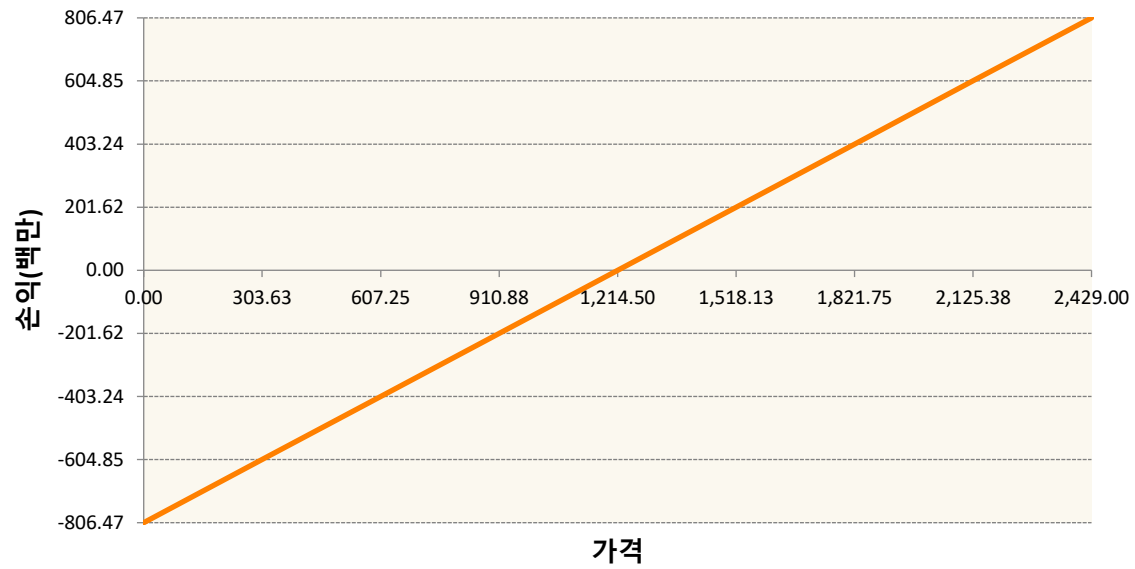
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



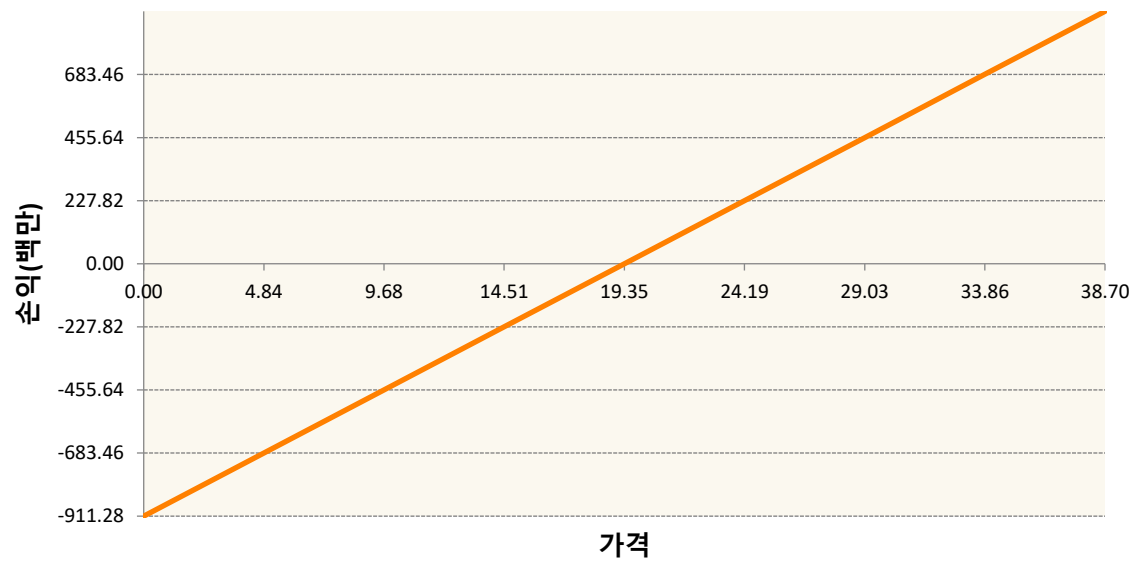
KR4175S30005-2022-03 달러선물



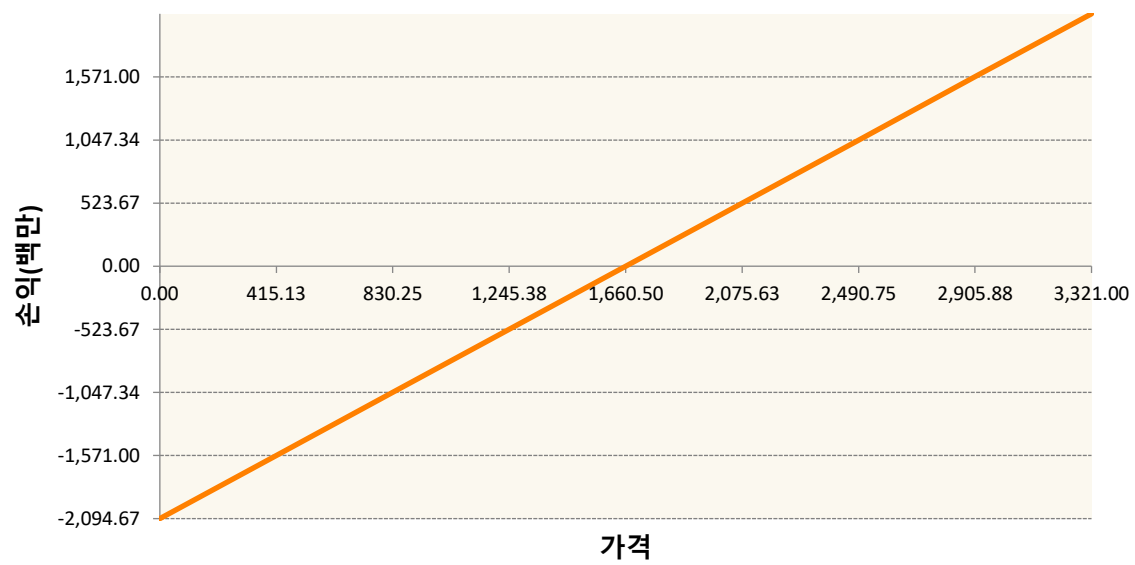
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22

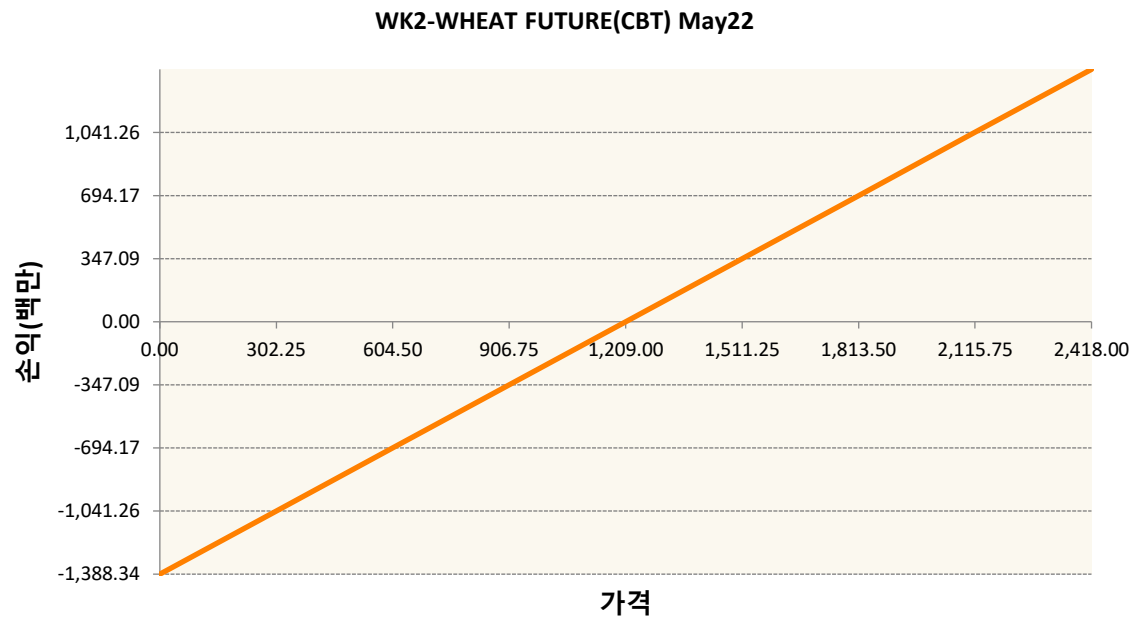
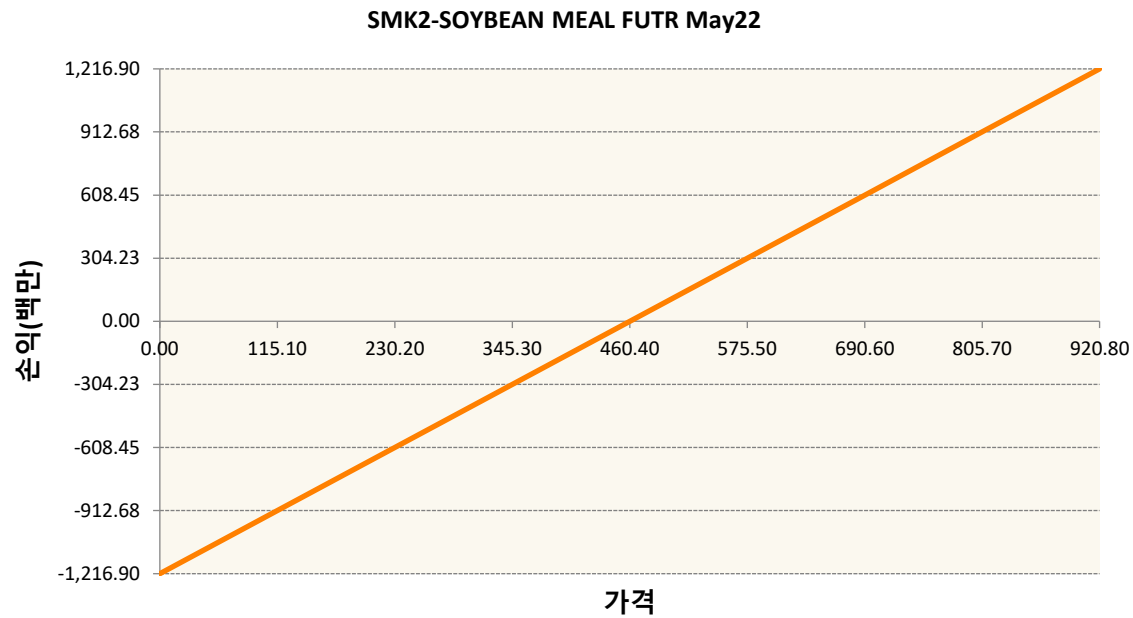


SBK2-Sugar May22



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	2022-03-08
기준일	2022-03-07

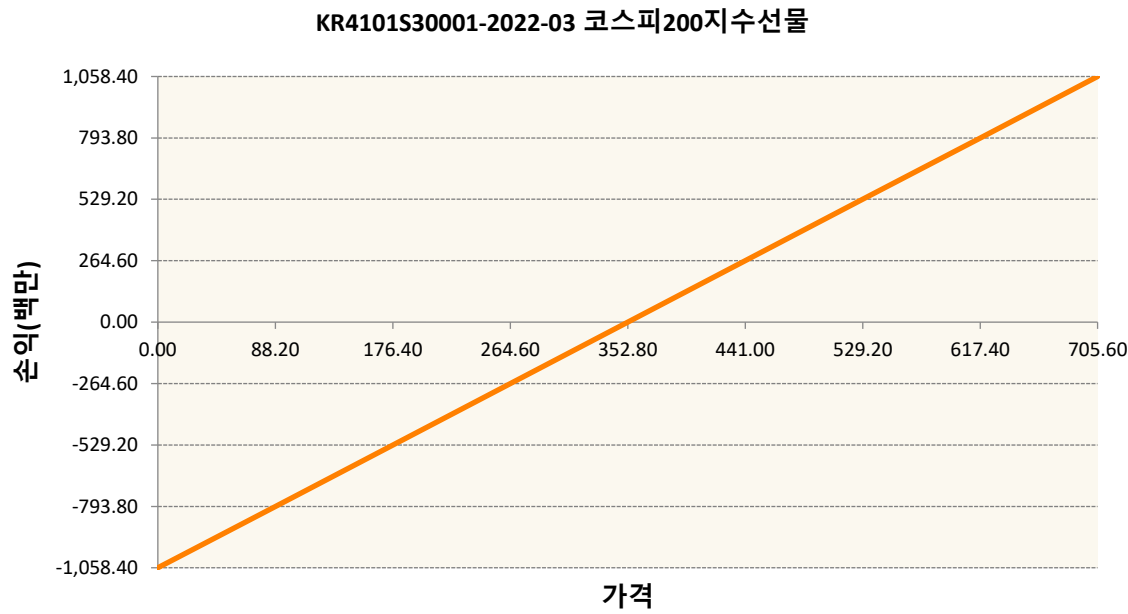
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,058	-1,058	장내
누계	유가증권	선물	1,058	0	1,058	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001			2022-03 코스피200지수선물				85
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	56	56	56	56	56	56	56
8.00%	85	85	85	85	85	85	85

공시일	2022-03-08
기준일	2022-03-07

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	138
------------------------------	-----

* 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	2022-03-08
기준일	2022-03-07

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	413
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

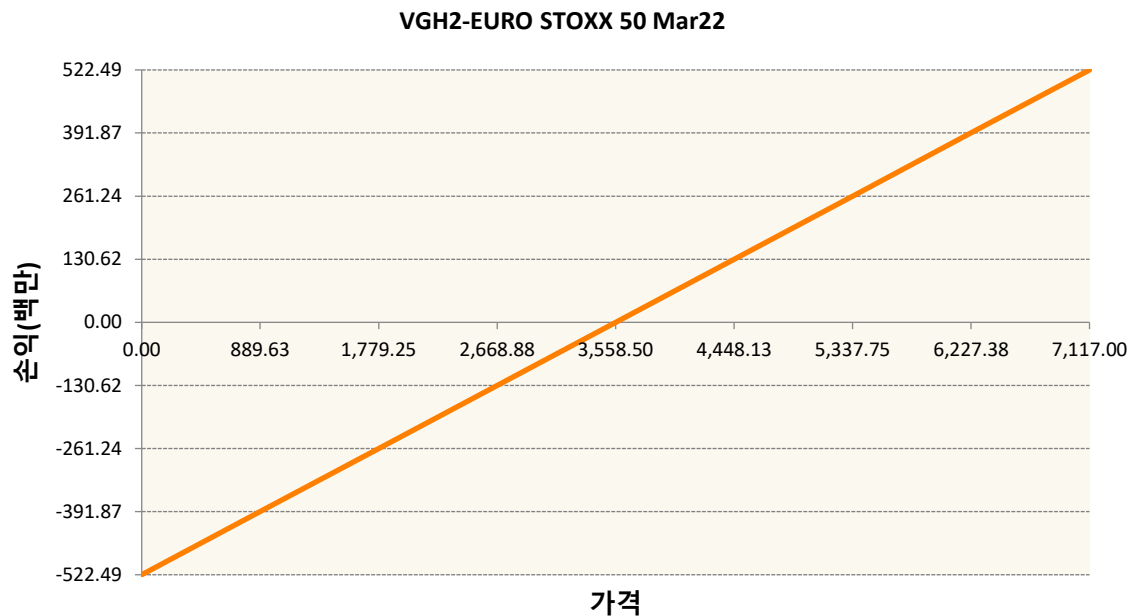
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	522	0	522	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2022-03-08
기준일	2022-03-07

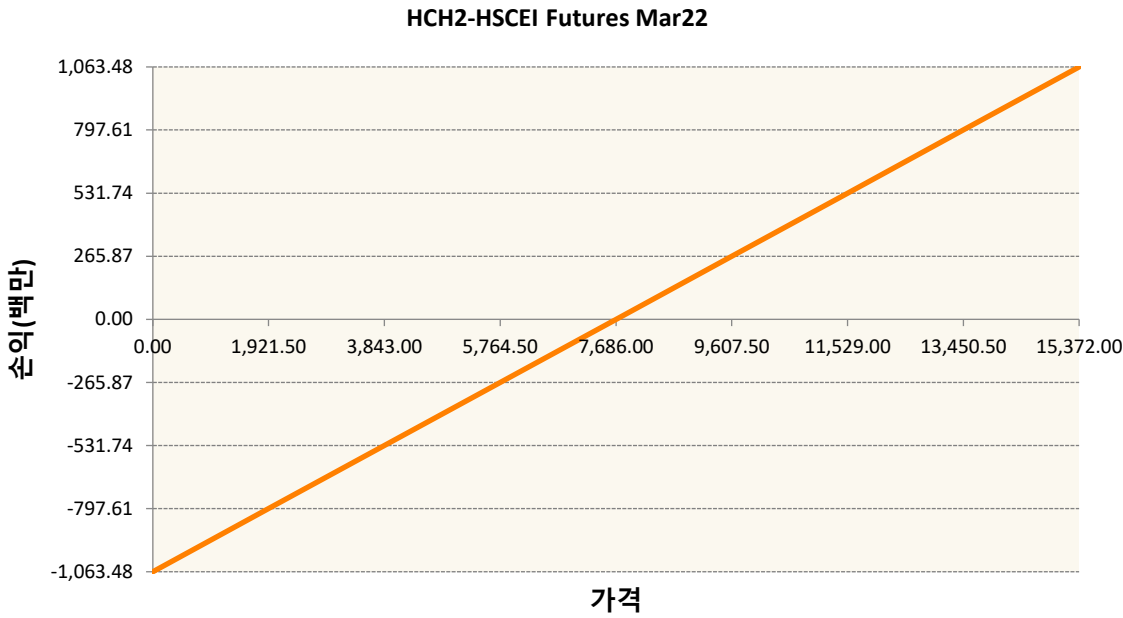
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,063	0	1,063	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2	HSCEI Futures Mar22	85
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

92

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

커버드콜모(주식혼합-파생형)

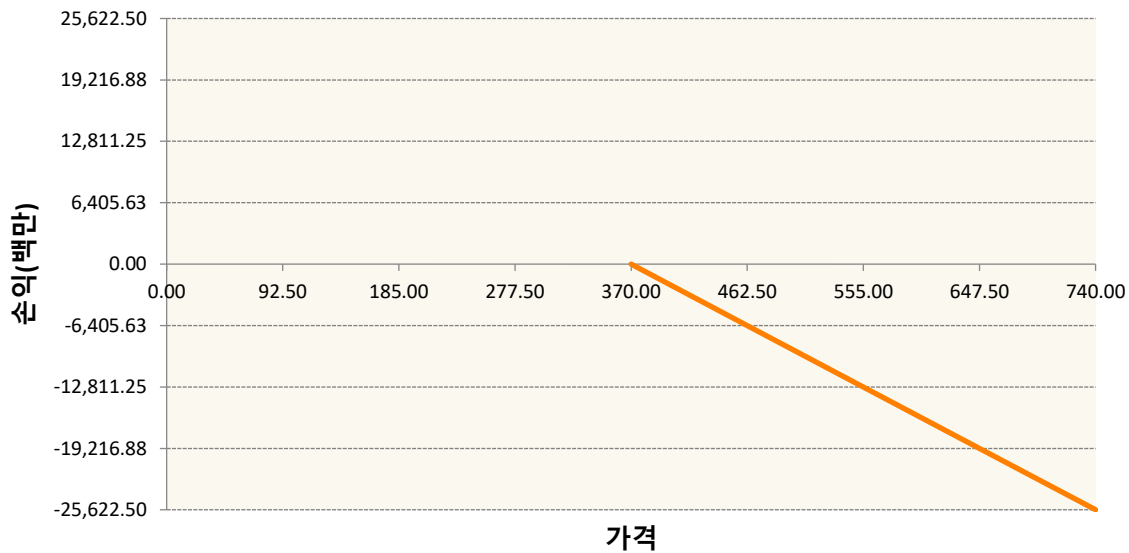
1. 계약금액

(단위:백만원)

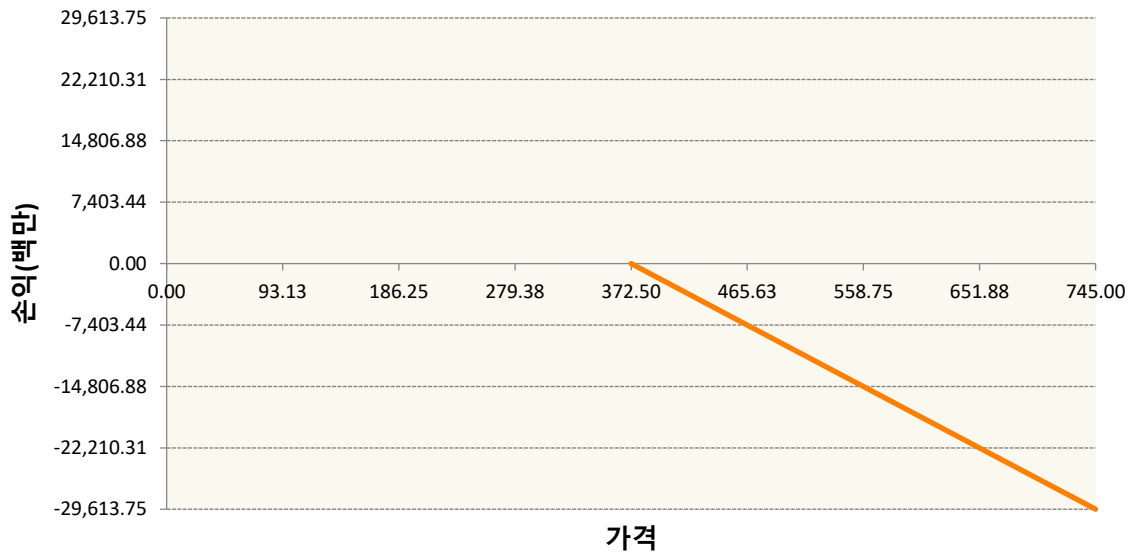
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	68,739	-68,739	장내

2. 만기시점의 손익구조

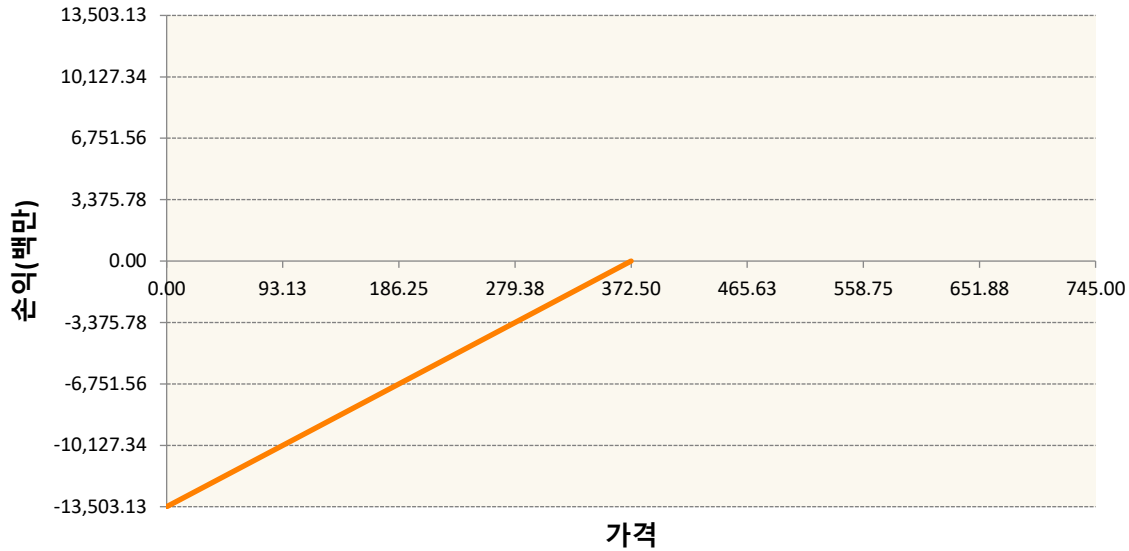
KR4201S33706-2022-03 콜370



KR4201S33722-2022-03 콜372.5



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S33706		2022-03 콜370						892
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		26	26	26	26	26	26	26
-5.33%		26	26	26	26	25	25	24
-2.67%		26	25	24	23	21	17	13
0%		20	15	8	0	-10	-22	-34
2.67%		-41	-60	-81	-103	-125	-148	-172
5.33%		-290	-317	-344	-372	-399	-426	-453
8.00%		-786	-800	-816	-833	-852	-871	-892
KR4201S33722		2022-03 콜372.5						889
		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%		18	18	18	18	18	18	17
-2.67%		18	18	17	16	15	12	9
0%		15	12	7	0	-9	-19	-31
2.67%		-27	-44	-64	-85	-107	-131	-155
5.33%		-241	-273	-304	-336	-368	-399	-431
8.00%		-742	-764	-786	-810	-836	-862	-889
KR4301S33720		2022-03 풋372.5						1,021
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021	-1,021
-5.33%		-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680
-2.67%		-339	-339	-339	-339	-339	-339	-340
0%		2	2	1	0	-2	-4	-6

2.67%	334	330	324	318	311	304	296
5.33%	592	580	569	557	546	534	523
8.00%	694	687	681	673	665	656	648

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

(단위:백만원)

2,117

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

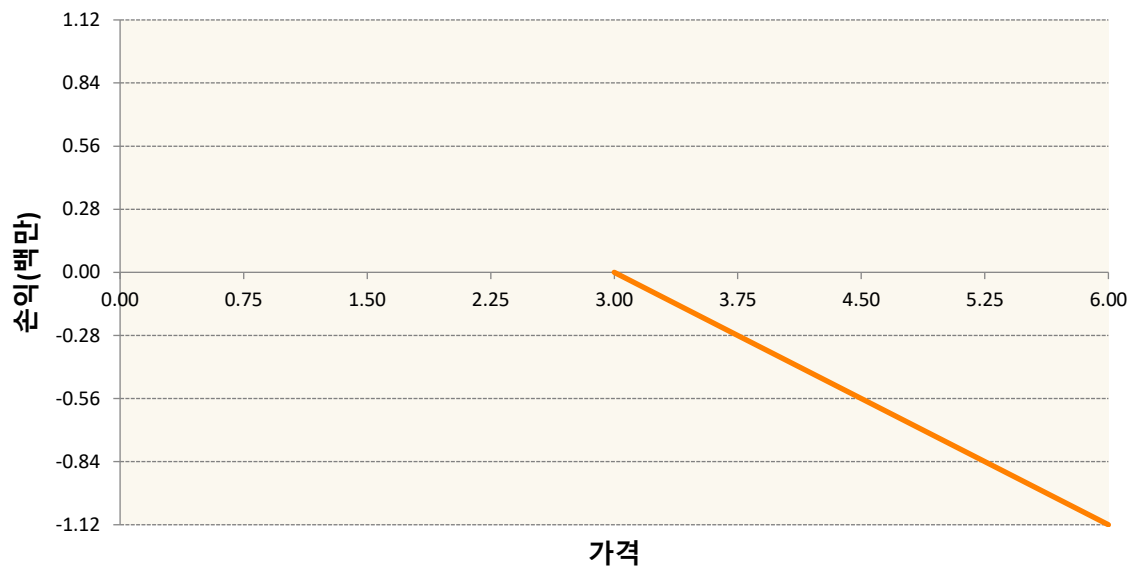
1. 계약금액

(단위:백만원)

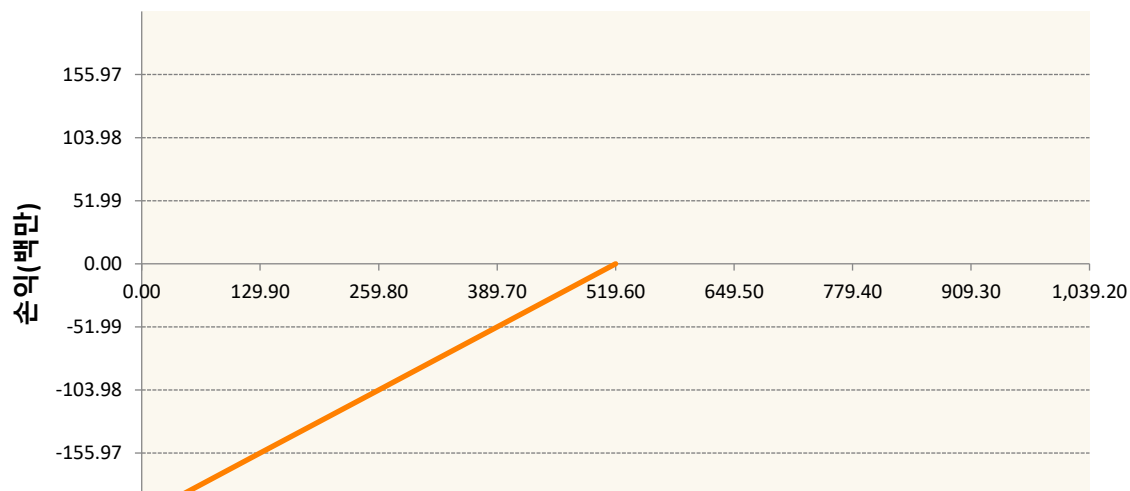
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	209	-209	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	667	1,334	-667	장외

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		97
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
FXW213C37 EUR/KRW 17-03-22E		32
OESXH2-C4C EURO STOXX 50		0.09
OESXH2-P40 EURO STOXX 50		17

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		224

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

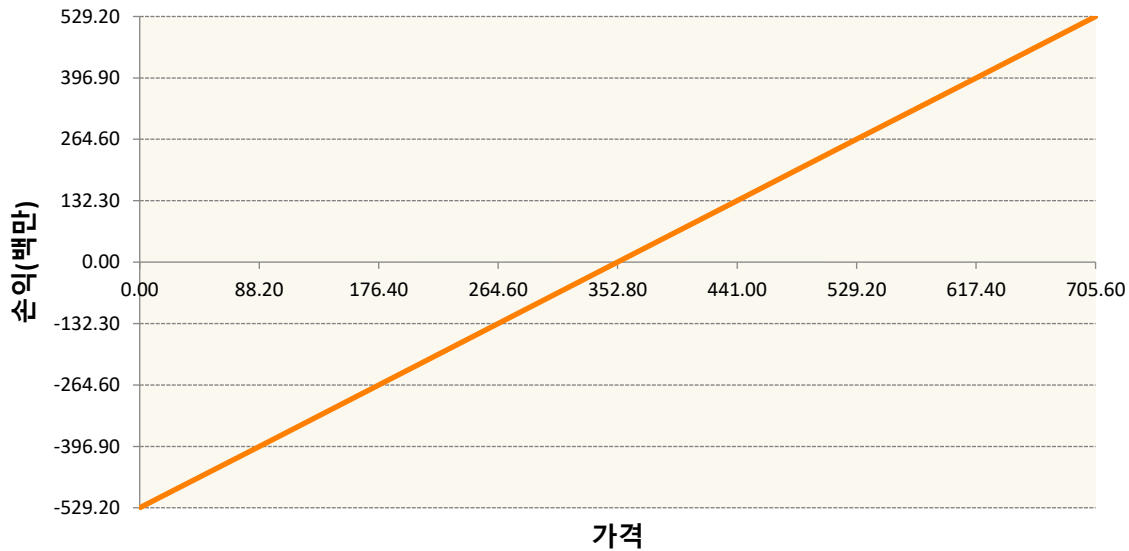
1. 계약금액

(단위:백만원)

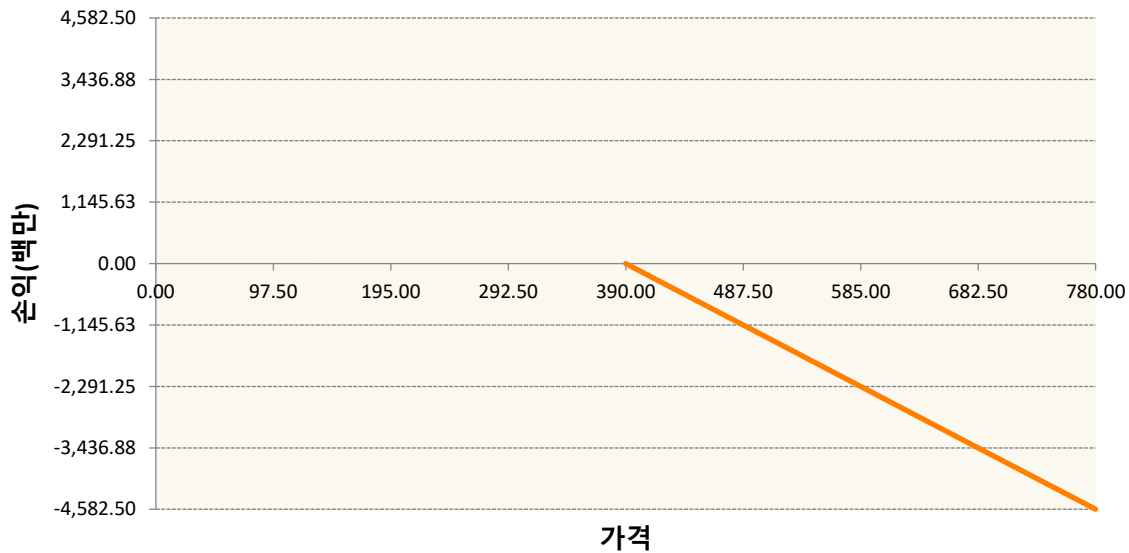
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	529	0	529	장내
누계	유가증권	옵션	372	4,877	-4,505	장내

2. 만기시점의 손익구조

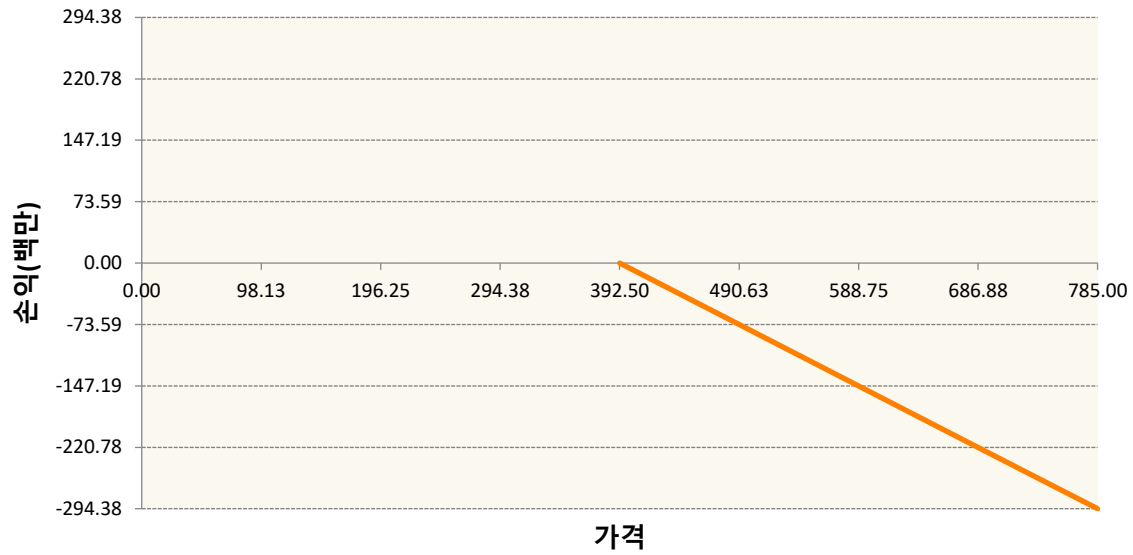
KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



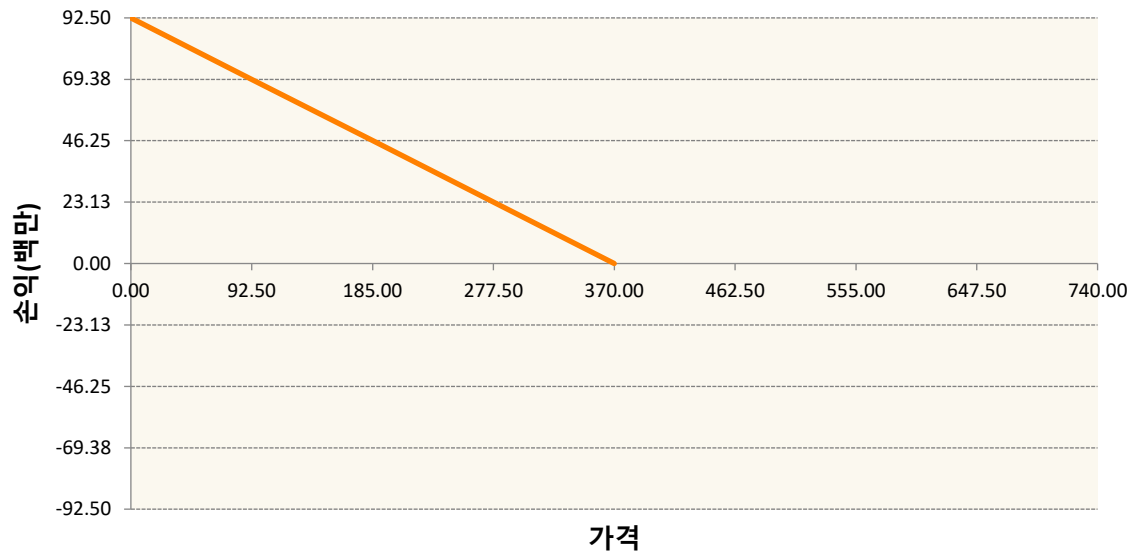
KR4201S33904-2022-03 콜390



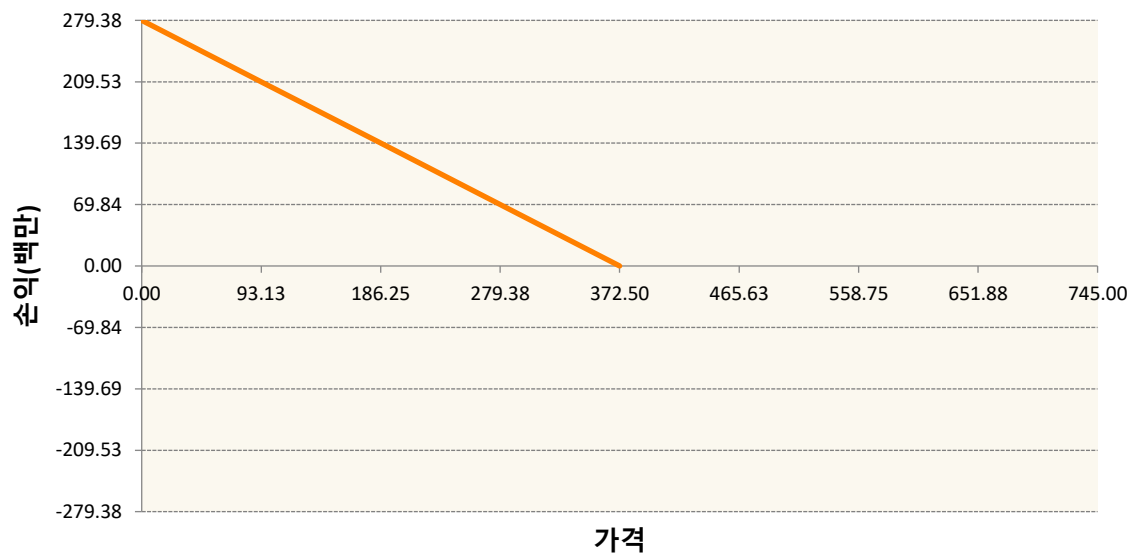
KR4201S33920-2022-03 콜392.5



KR4301S33704-2022-03 풋370



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



(단위:백만원)

KR4101S30001							2022-03 코스피200지수선물		42		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42				
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28				
-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%	28	28	28	28	28	28	28				
8.00%	42	42	42	42	42	42	42				
KR4201S33904							2022-03 콜390		33		
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	-2	-2				
5.33%	-1	-2	-3	-4	-6	-8	-10				
8.00%	-10	-13	-17	-21	-24	-28	-33				
KR4201S33920							2022-03 콜392.5		2		
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	0	0	0	0				
5.33%	0	0	0	0	0	0	0				
8.00%	0	-1	-1	-1	-1	-1	-2				
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%	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%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3				
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4				
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%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-7	-7	-6	-6	-6
5.33%	-12	-12	-12	-12	-11	-11	-11
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-13

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

(단위:백만원)

68

공시일	2022-03-08
기준일	2022-03-07

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	9,803	0	9,803	

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	2022-03-08
기준일	2022-03-07

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	8,084	0	8,084	

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	2022-03-08
기준일	2022-03-07

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	27,675	0	27,675	
누계	통화	선도	2,700	30,346	-27,647	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	196
FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E	69
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,231
FXW213C32 USD/KRW 25-03-22E	59
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E	39
FXW213C37 USD/KRW 25-03-22E	49
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

818

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

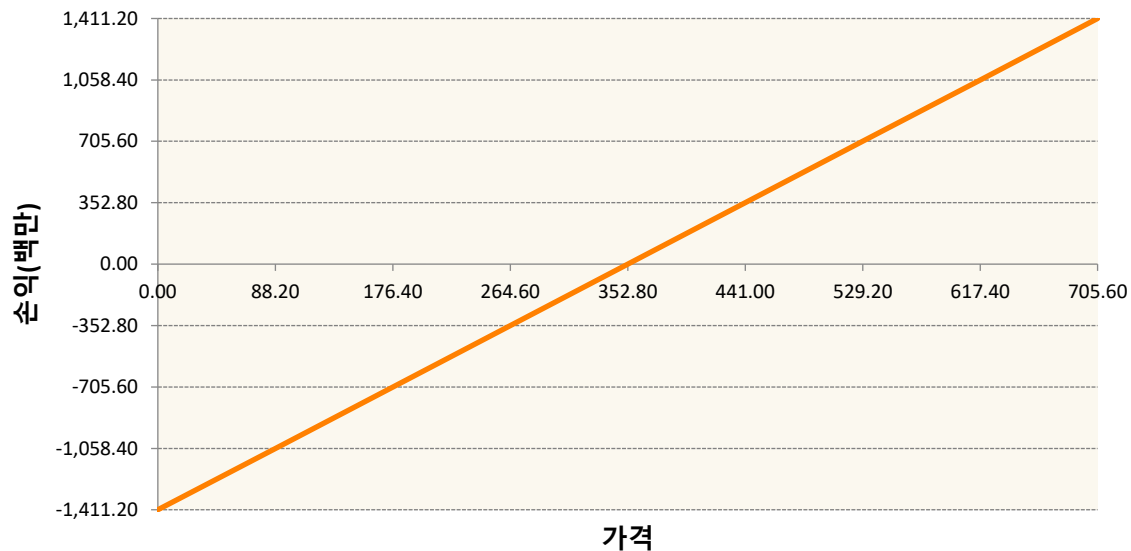
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001

2022-03 코스피200지수선물

113

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

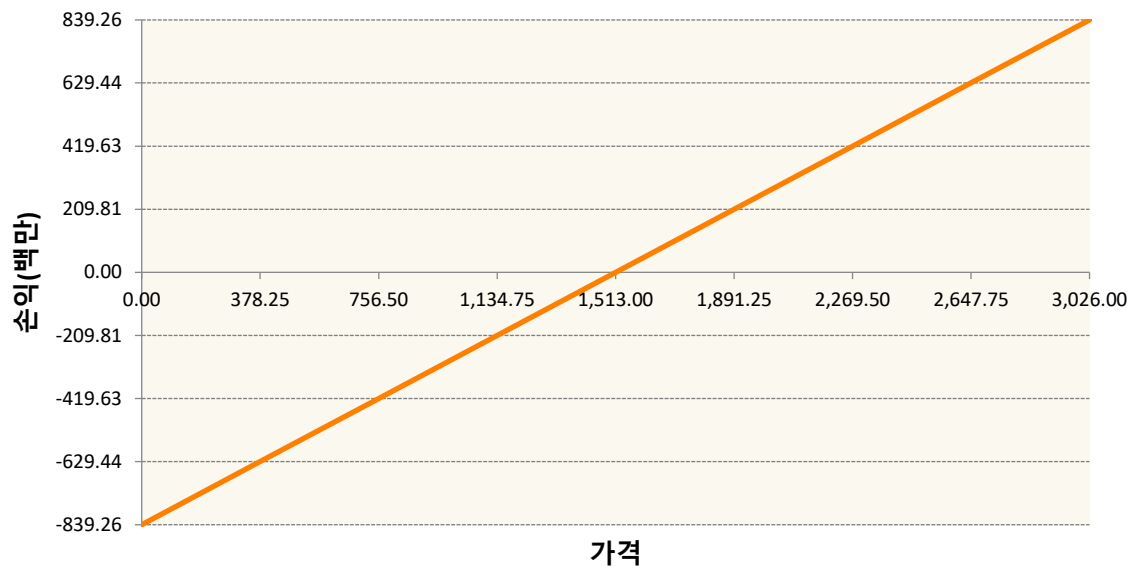
1. 계약금액

(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	839	0	839	
누계	유가증권	스왑	1,824	0	1,824	장외
누계	통화	선도	0	1,307	-1,307	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)

270

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

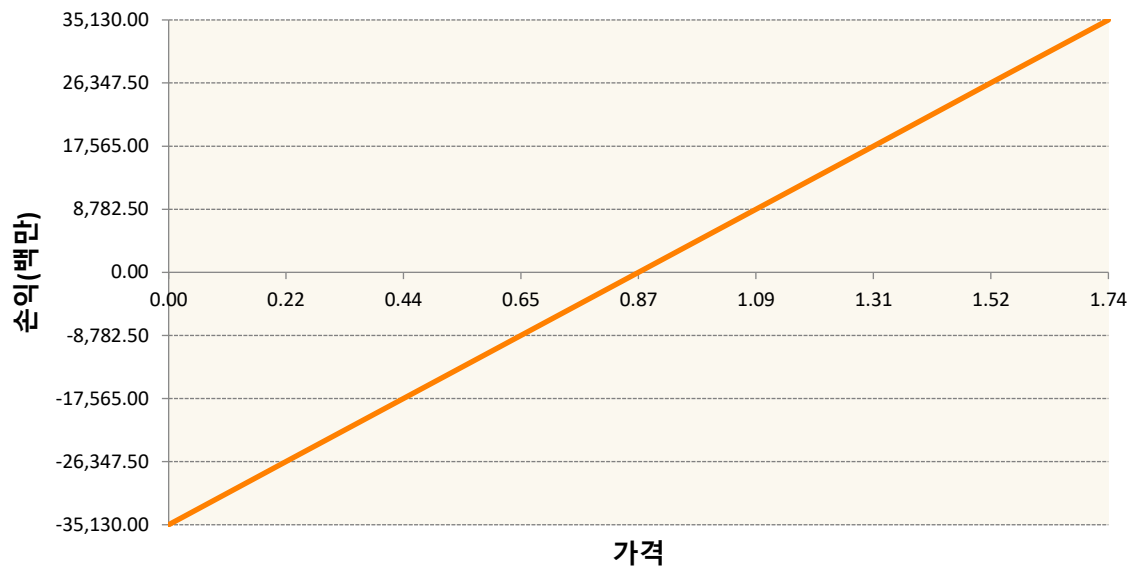
1. 계약금액

(단위:백만원)

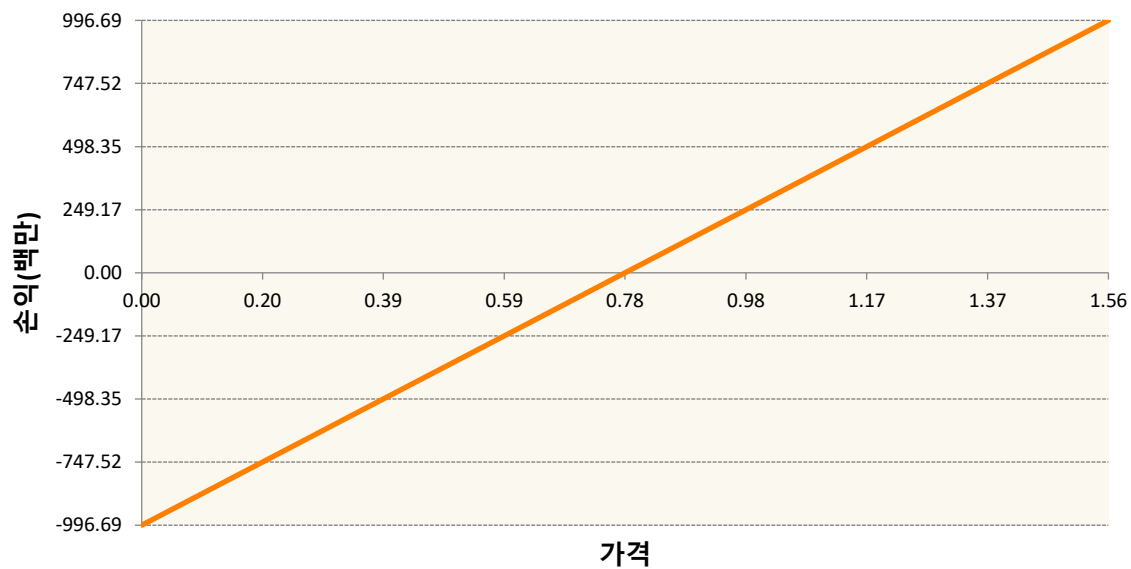
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,025	0	1,025	
누계	유가증권	선물	38,128	0	38,128	

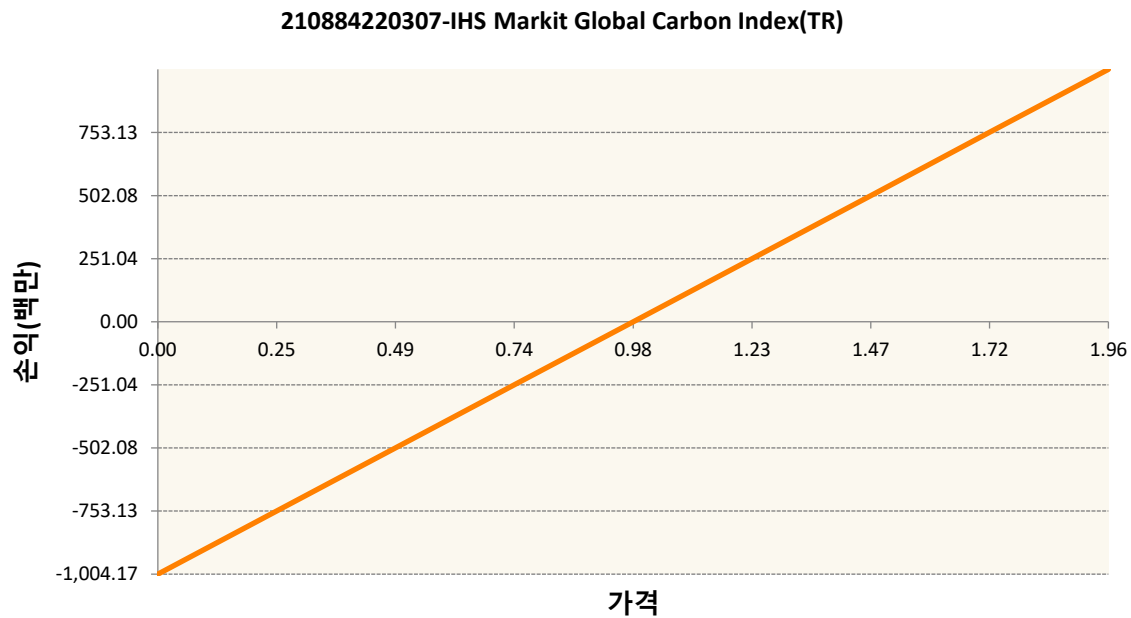
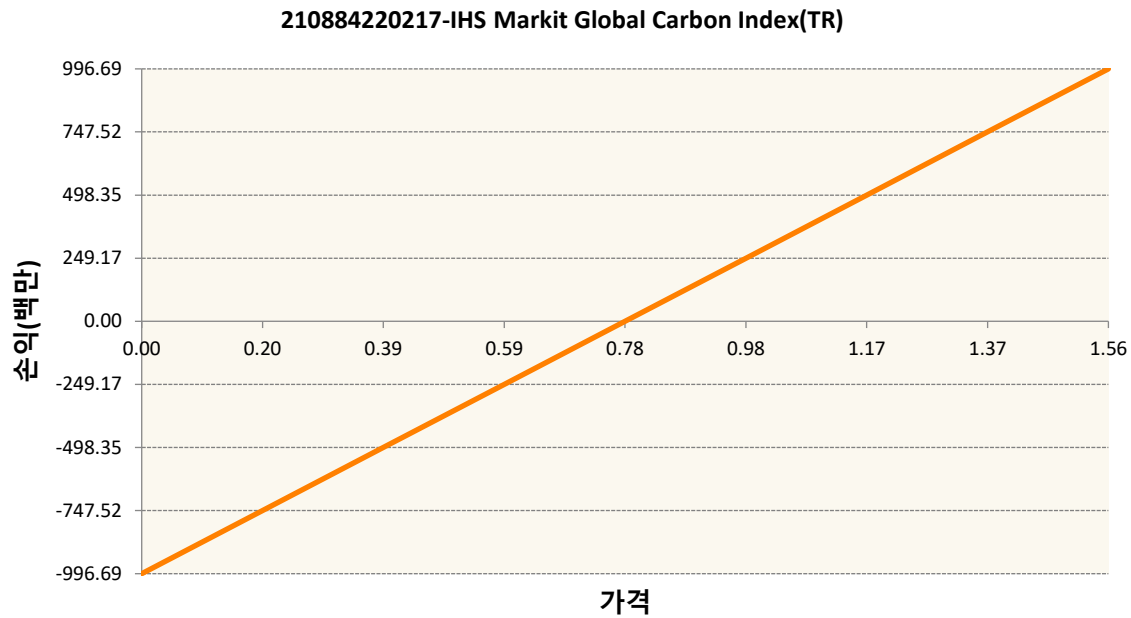
2. 만기시점의 손익구조

210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220216-IHS Markit Global Carbon Index(TR)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11	IHS Markit Global Carbon Index(TR)	2,798
2.1088E+11	IHS Markit Global Carbon Index(TR)	80
2.1088E+11	IHS Markit Global Carbon Index(TR)	80
2.1088E+11	IHS Markit Global Carbon Index(TR)	80

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,238

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

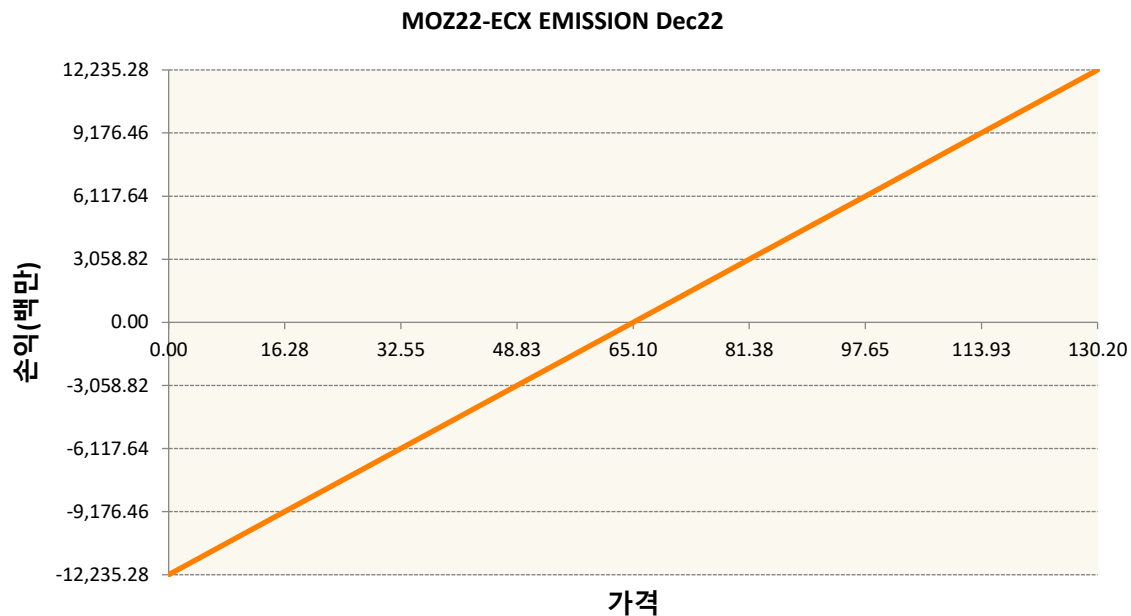
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,235	0	12,235	
누계	통화	선도	0	8,161	-8,161	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

653
979

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

(단위:백만원)

2,523

공시일	2022-03-08
기준일	2022-03-07

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)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	8

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

(단위:백만원)

63

공시일	2022-03-08
기준일	2022-03-07

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)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	8

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

(단위:백만원)

40

공시일 2022-03-08

기준일 2022-03-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

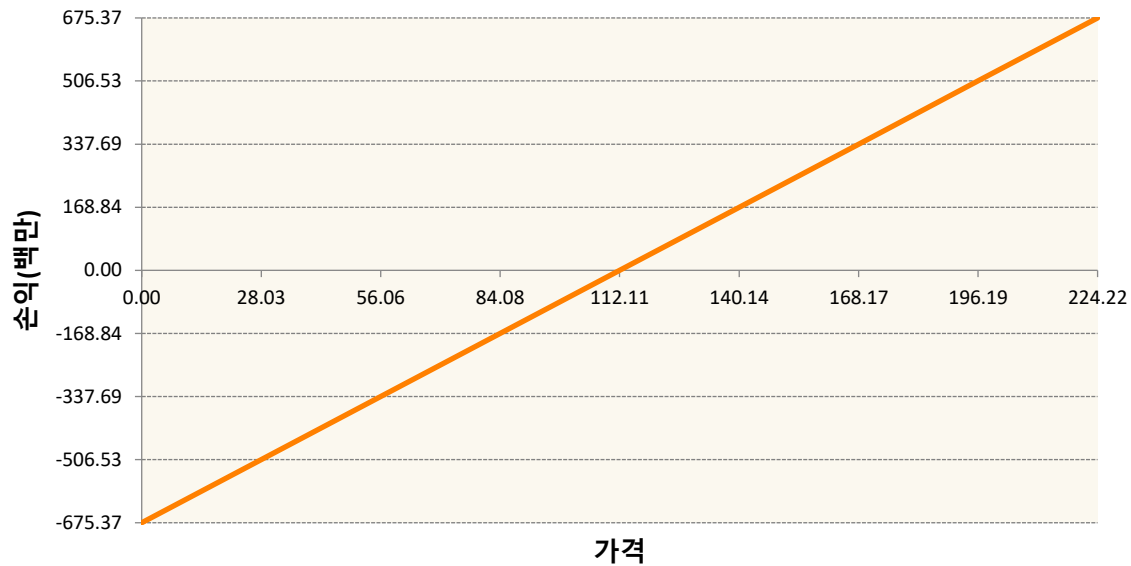
1. 계약금액

(단위:백만원)

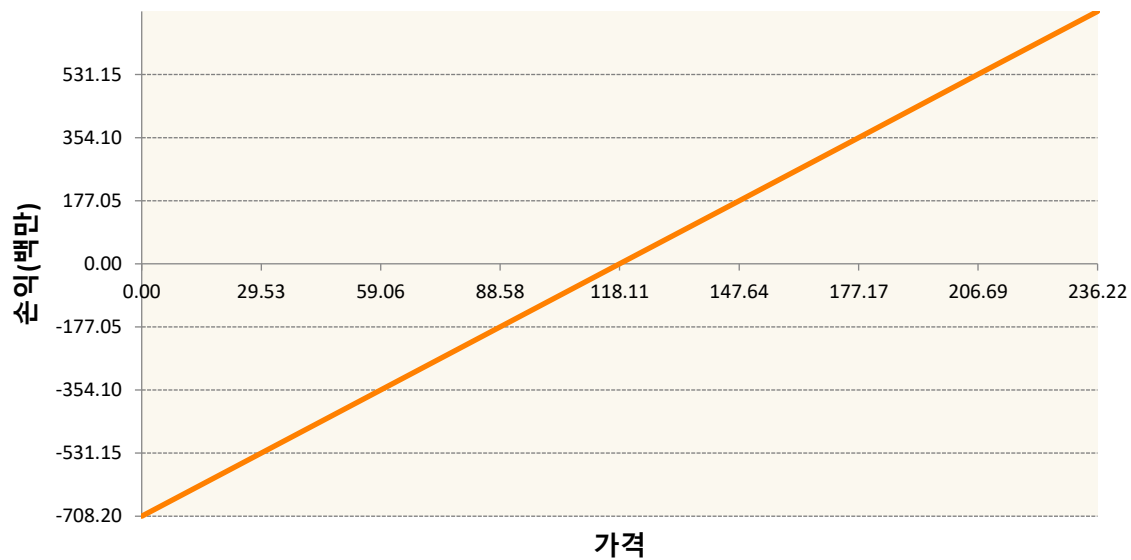
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,778	553	2,225	

2. 만기시점의 손익구조

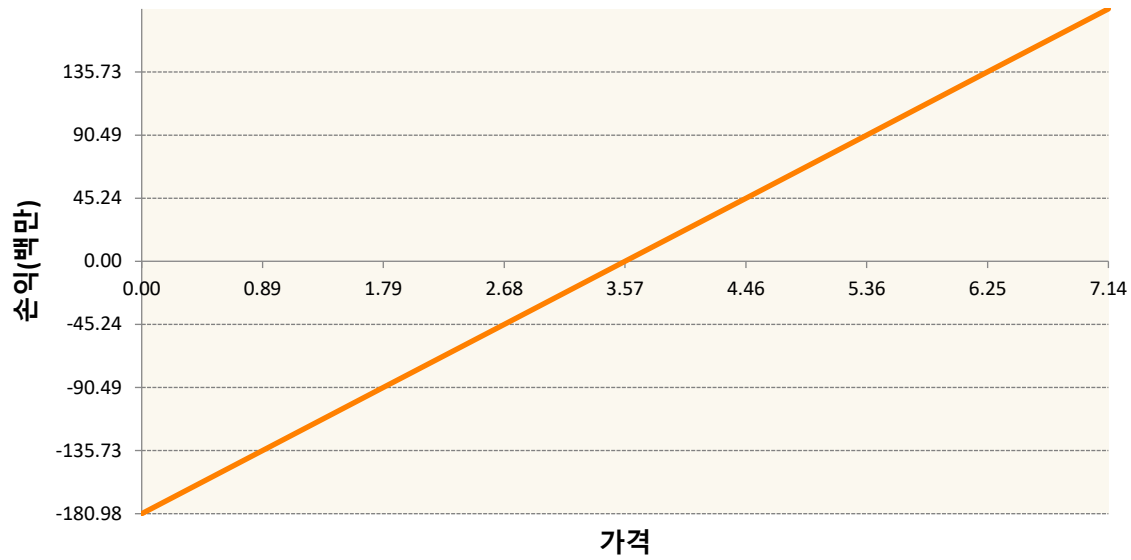
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



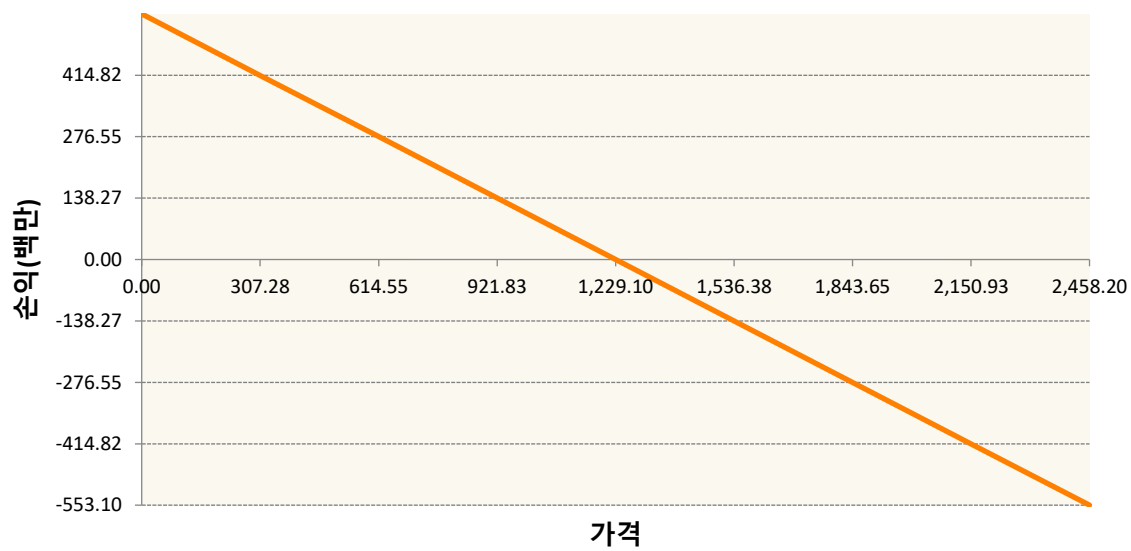
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



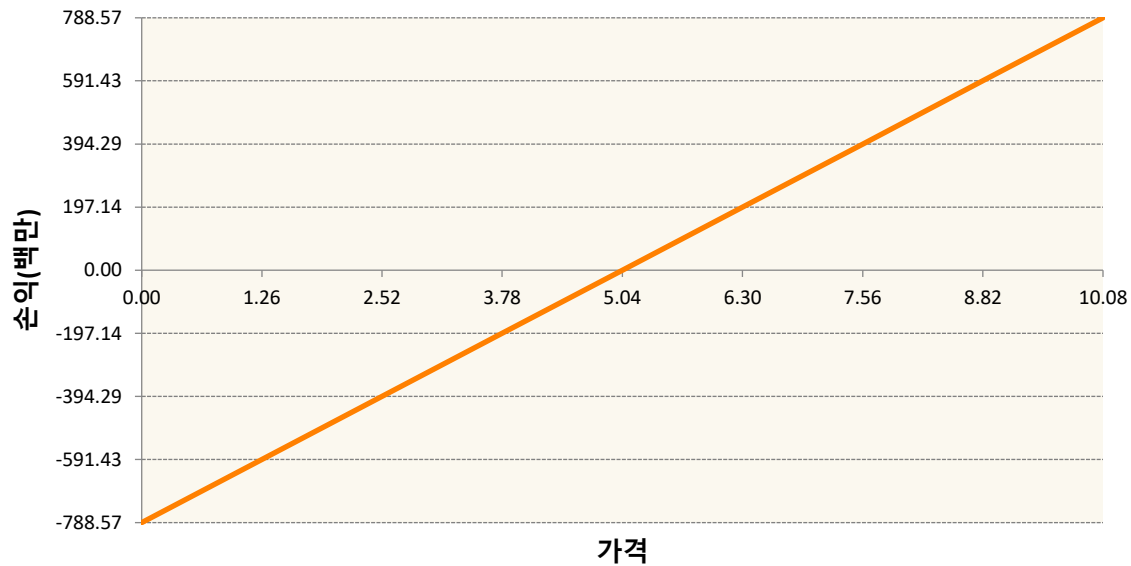
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

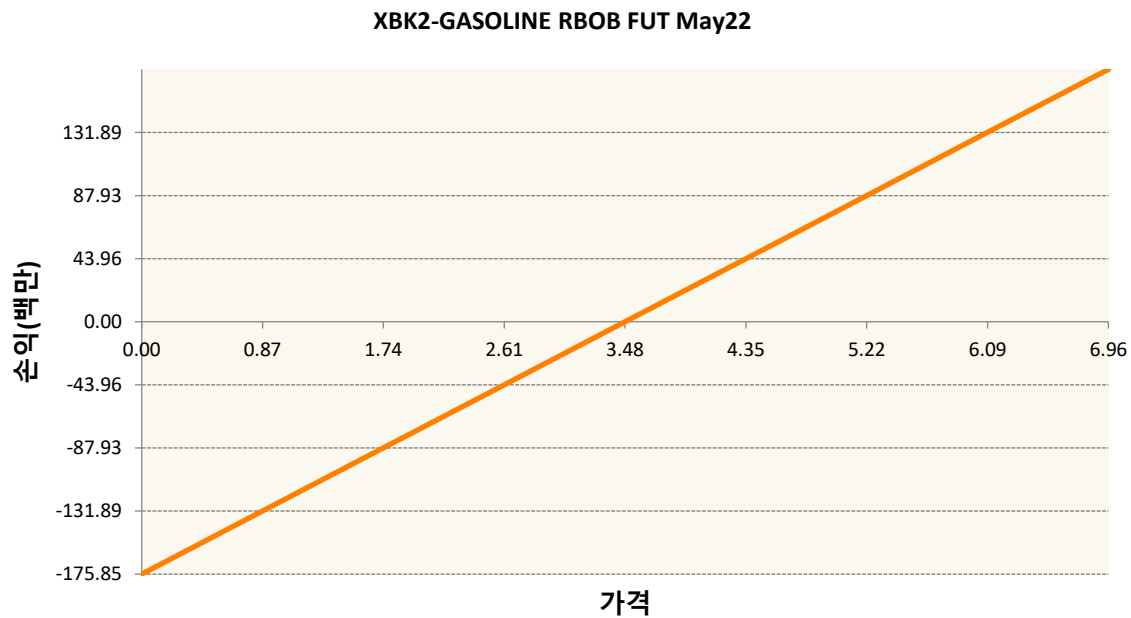
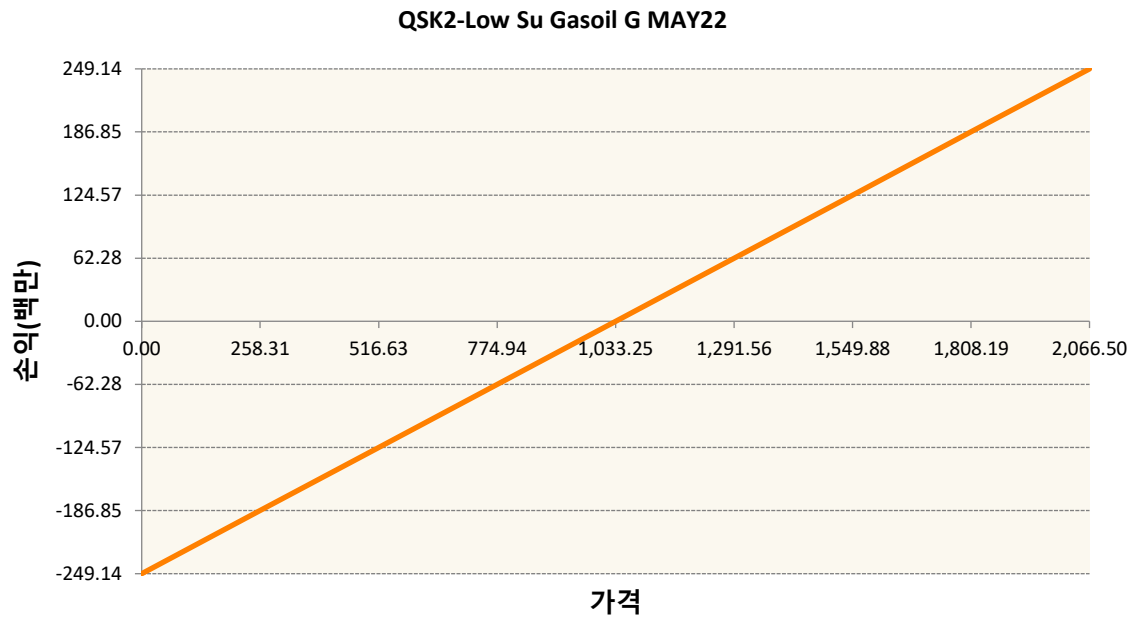


KR4175S30005-2022-03 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		54
COK2	BRENT CRUDE FUTR May22		57
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		14
KR4175S300 2022-03 달러선물			44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		63
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		20
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		564