

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

포커스농산물모(채권-파생형)

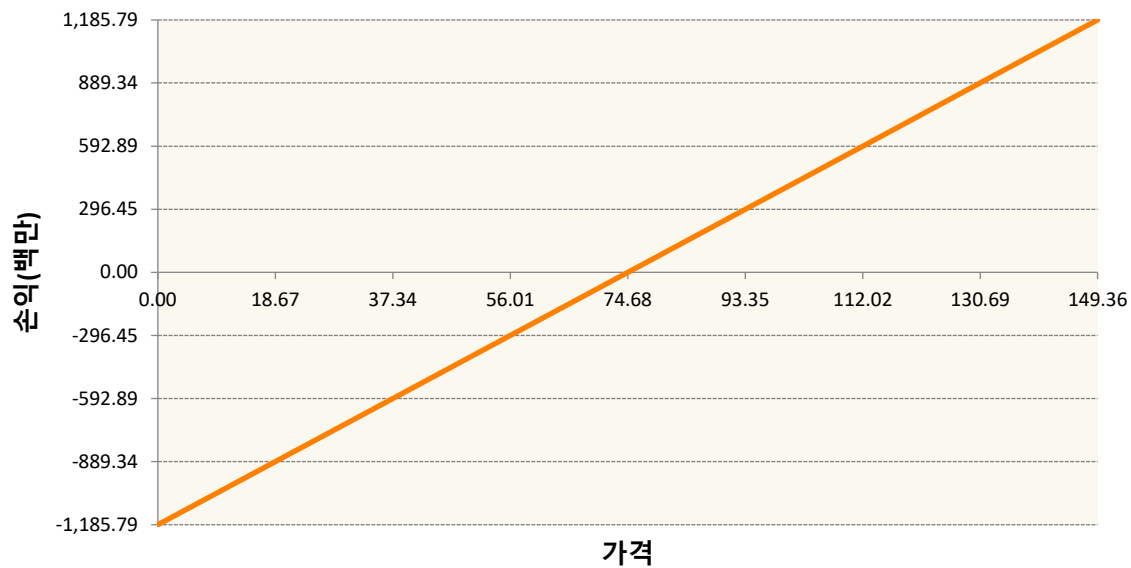
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

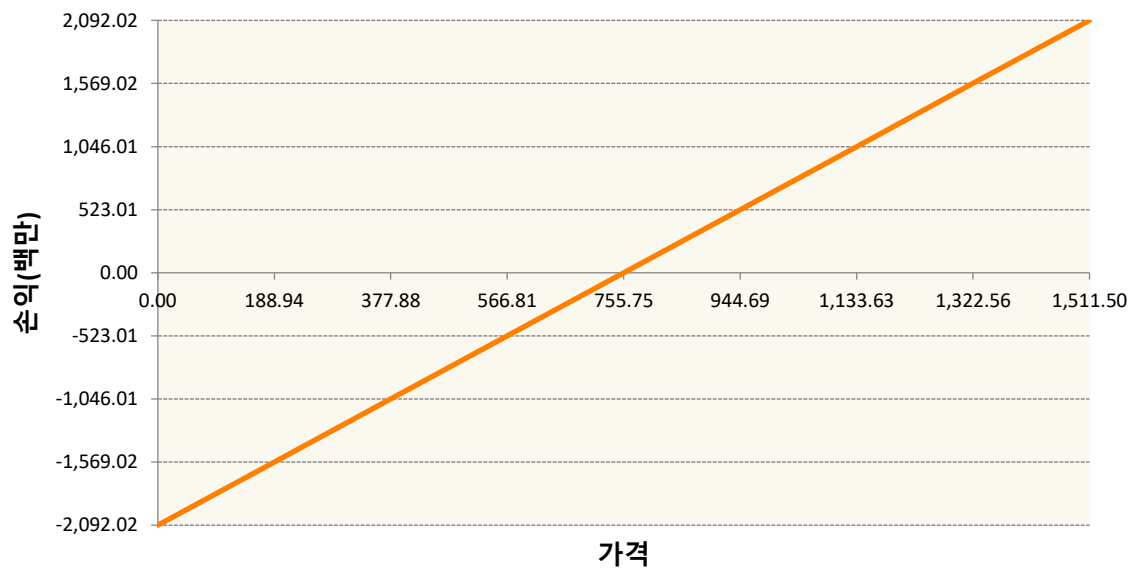
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,680	1,602	9,078	

2. 만기시점의 손익구조

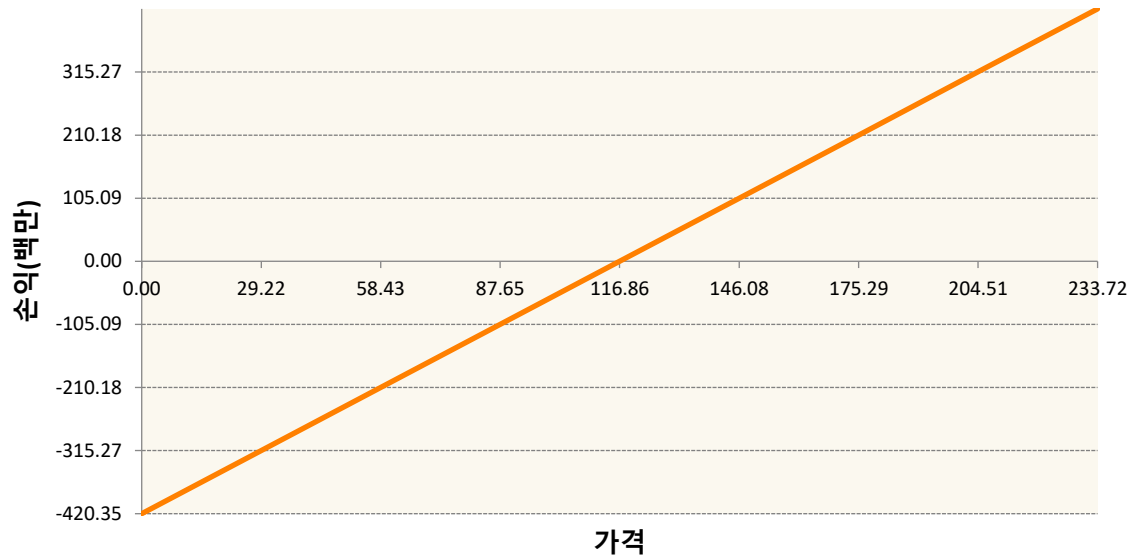
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



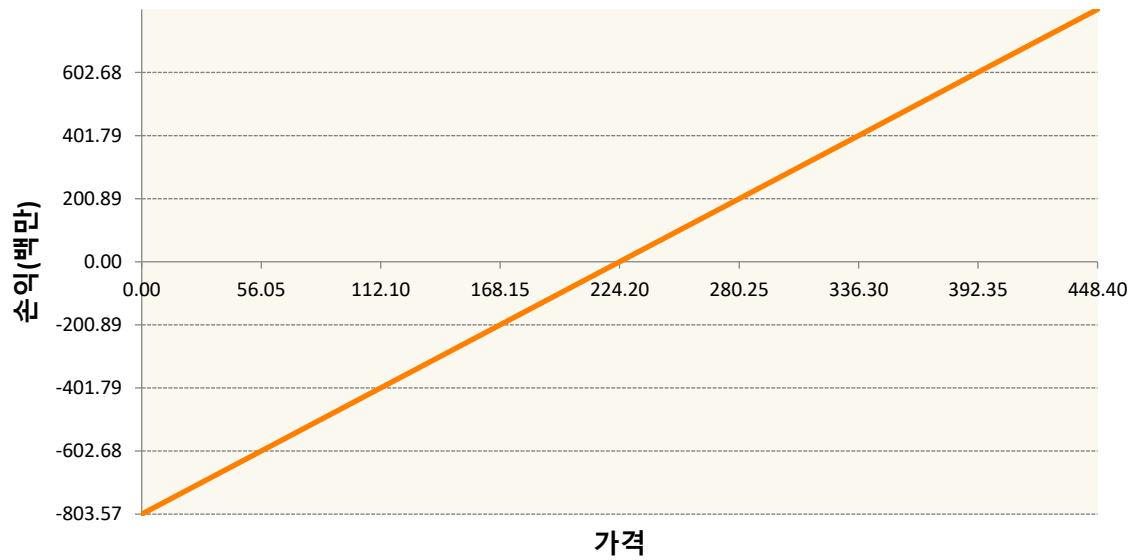
CK2-CORN FUTURE May22



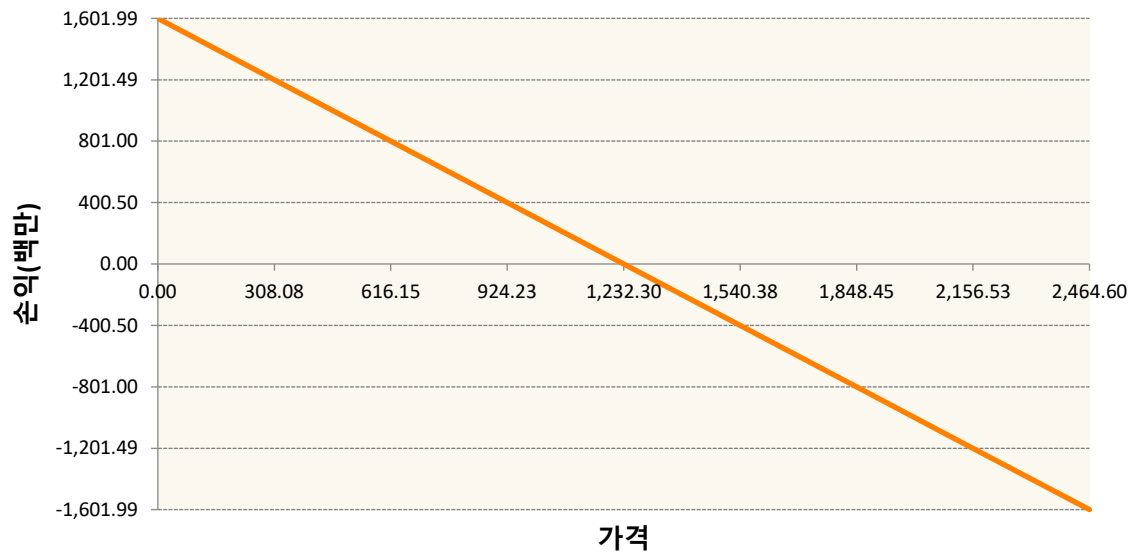
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



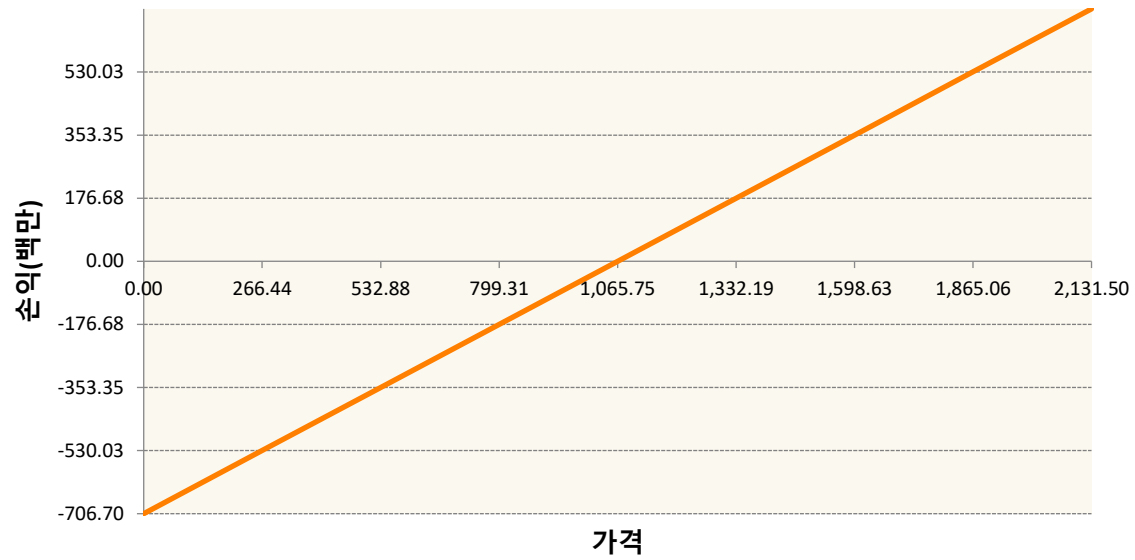
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



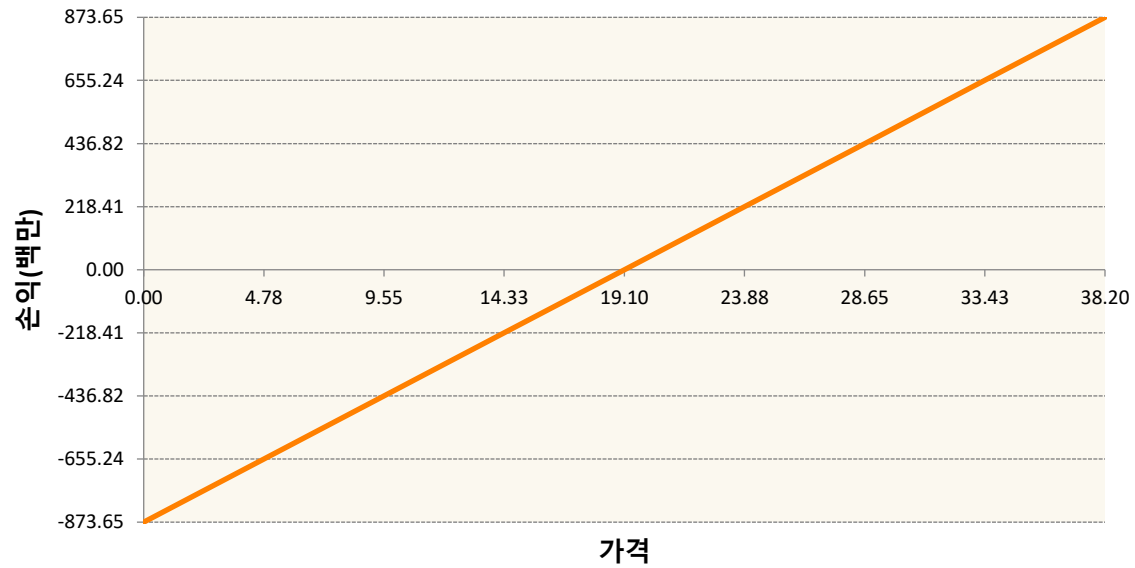
KR4175S30005-2022-03 달러선물



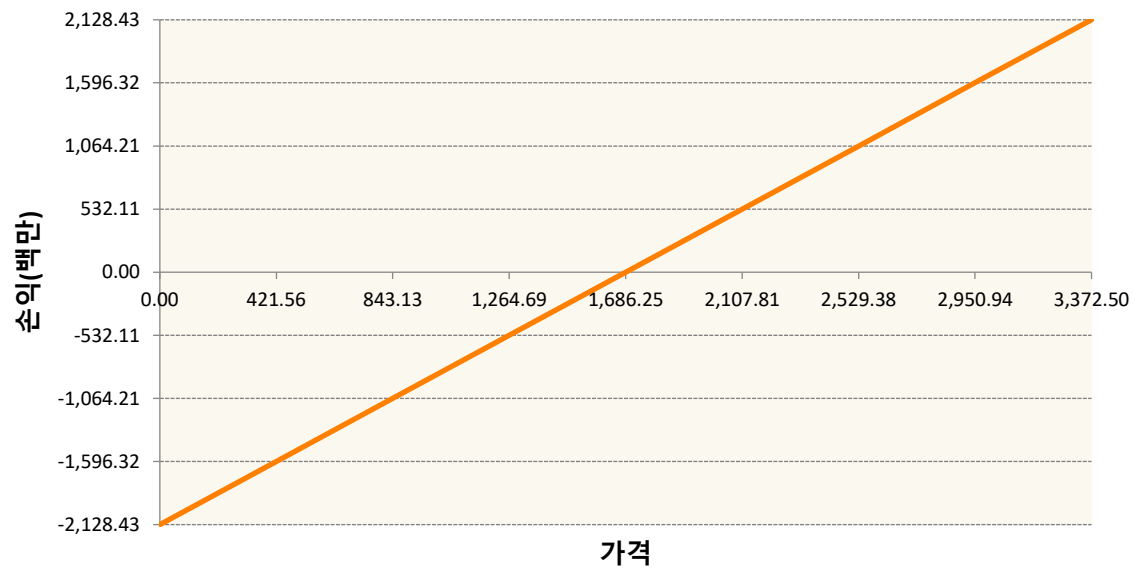
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



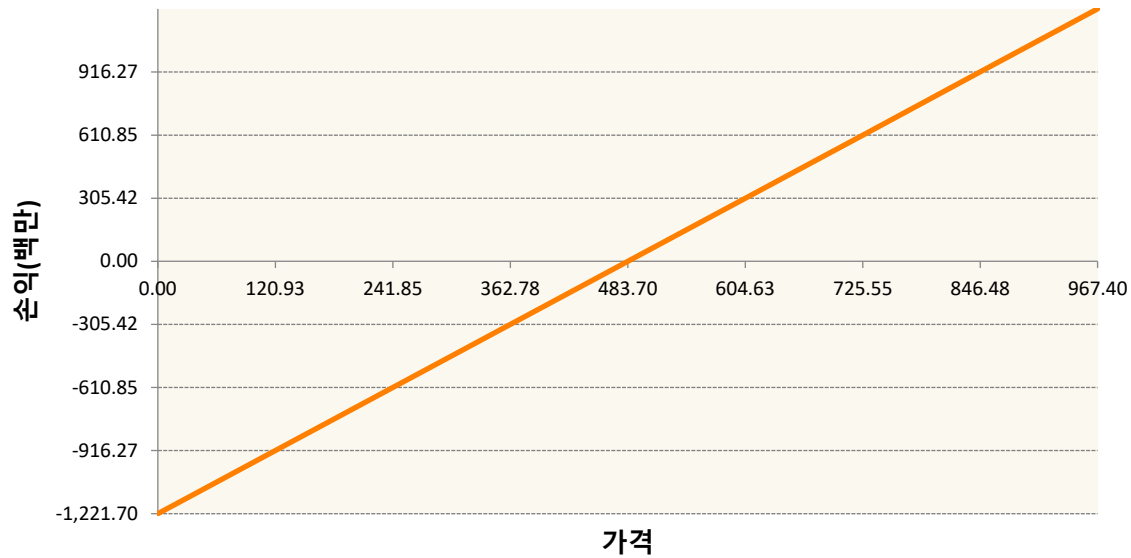
SBK2-Sugar May22



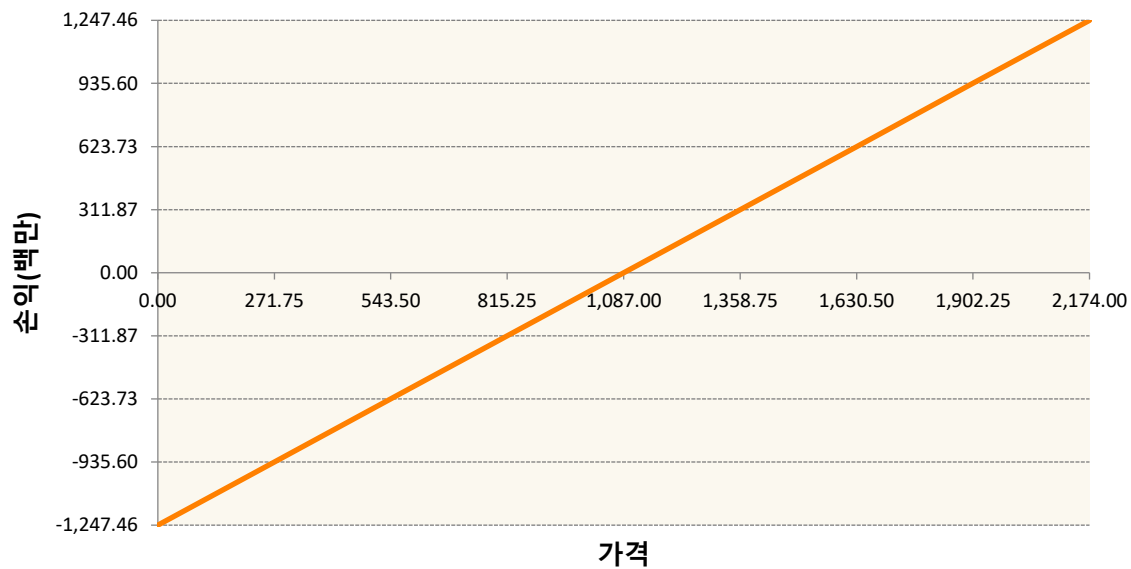
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



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	2022-03-14
기준일	2022-03-11

스마트인덱스모

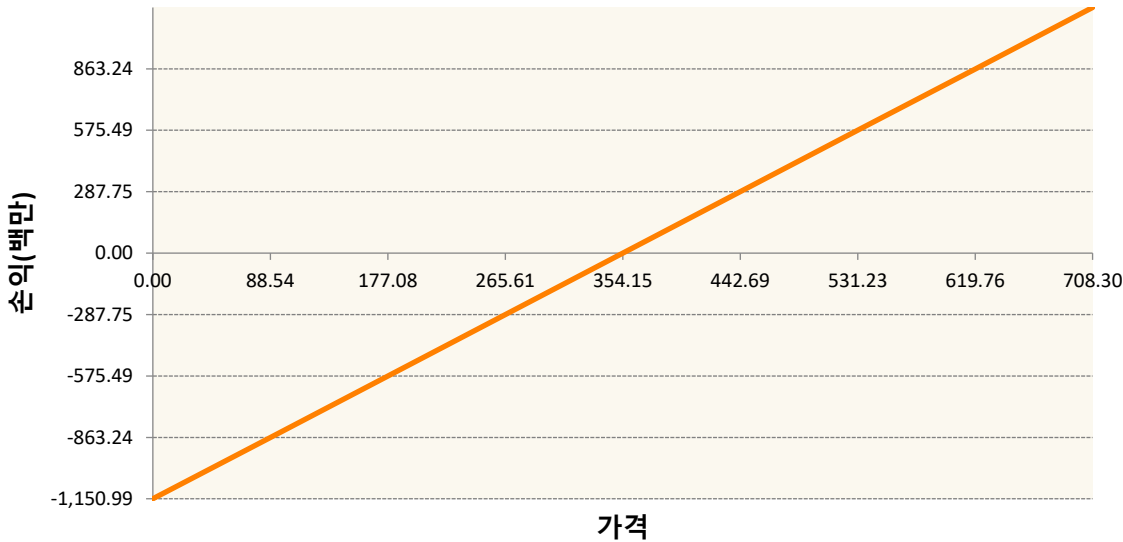
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,151	0	1,151	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				92
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

공시일	2022-03-14
기준일	2022-03-11

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

137

* 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	2022-03-14
기준일	2022-03-11

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	4,900	0	4,900	장외
누계	지수	스왑	4,900	0	4,900	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래220311

399

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

371

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

유로인덱스모(주식-파생형)

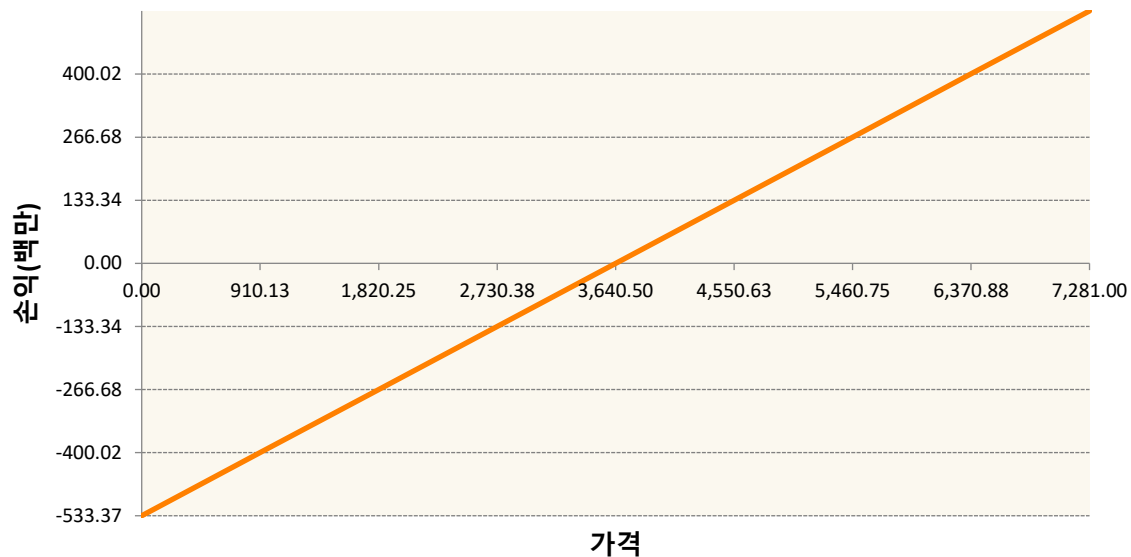
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	533	0	533	

2. 만기시점의 손익구조

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2	EURO STOXX 50 Mar22	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-03-14
기준일	2022-03-11

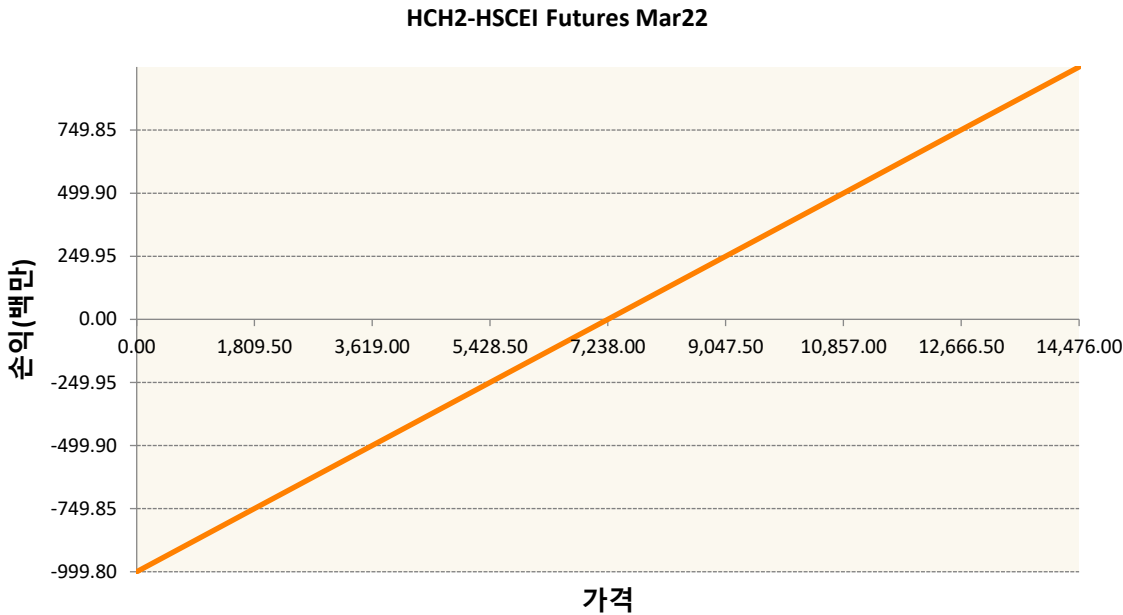
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,000	0	1,000	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2	HSCEI Futures Mar22	80
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

88

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

커버드콜모(주식혼합-파생형)

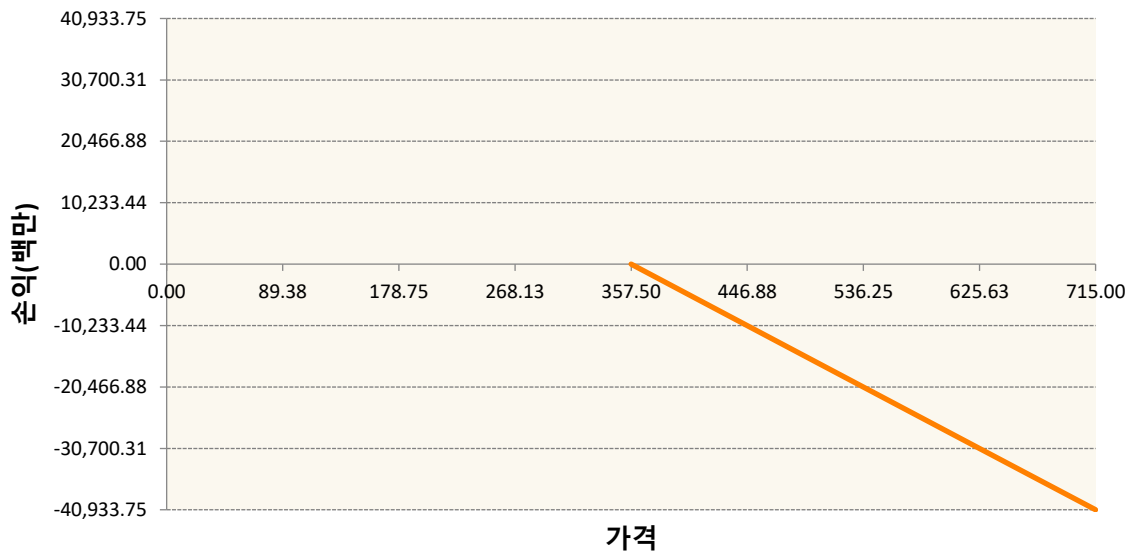
1. 계약금액

(단위:백만원)

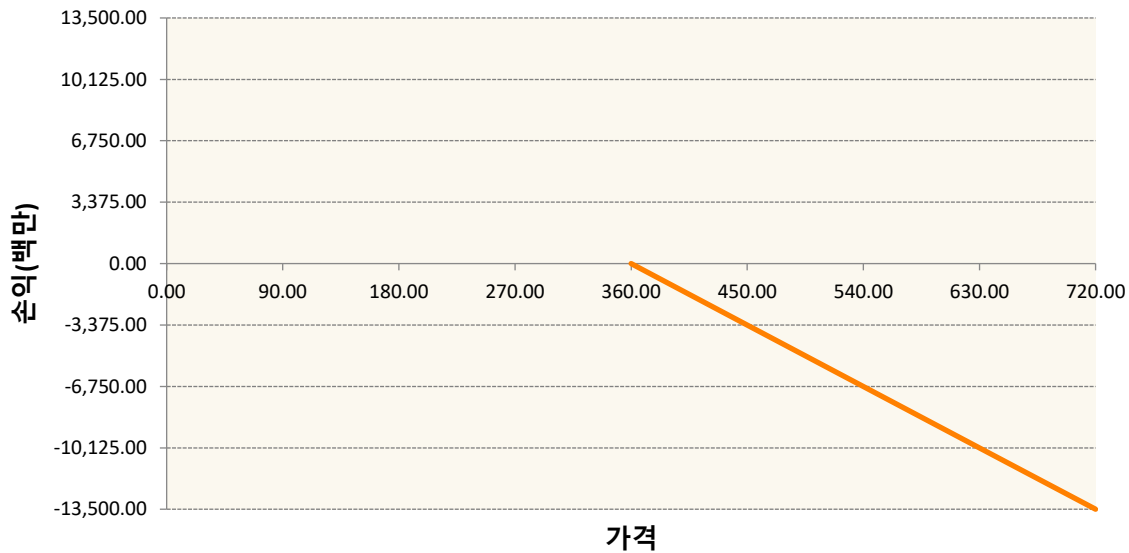
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	52,964	-52,964	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,053	-66,053	장내

2. 만기시점의 손익구조

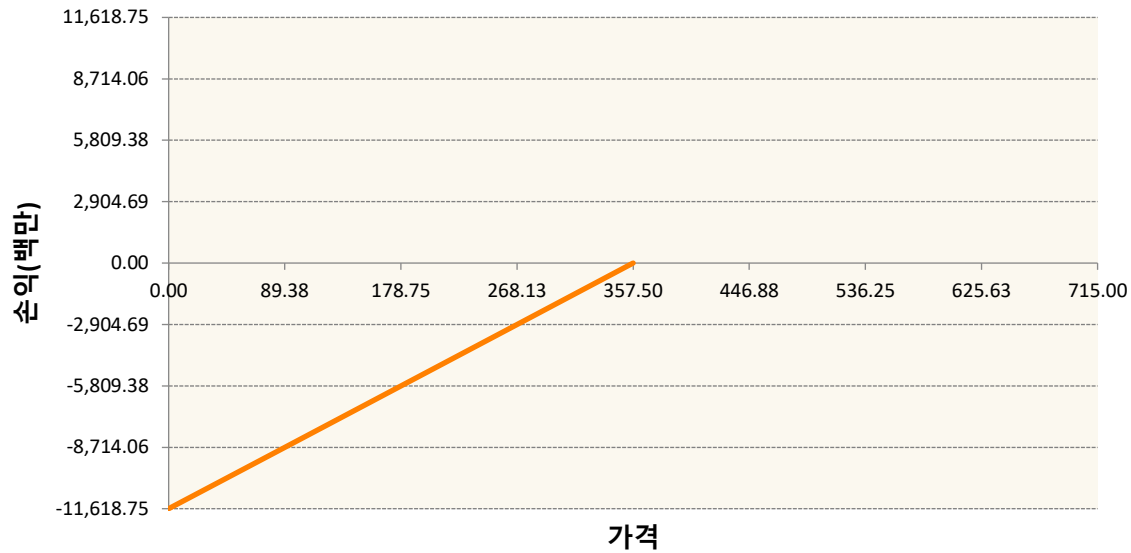
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572			2022-04 콜357.5				2,441
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,378	1,302	1,218	1,128	1,031	930	824
-5.33%	1,184	1,079	969	855	737	617	494
-2.67%	873	744	614	482	348	214	79
0%	424	283	141	0	-141	-283	-424
2.67%	-170	-310	-450	-591	-732	-874	-1,015
5.33%	-900	-1,026	-1,154	-1,285	-1,419	-1,554	-1,690
8.00%	-1,745	-1,848	-1,957	-2,073	-2,192	-2,315	-2,441
KR4201S43606			2022-04 콜360				778
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	420	398	372	344	314	282	249
-5.33%	364	332	298	262	225	187	148
-2.67%	273	232	191	148	106	62	19
0%	138	92	46	0	-46	-92	-139
2.67%	-44	-91	-137	-184	-231	-278	-325
5.33%	-272	-315	-358	-403	-448	-493	-539
8.00%	-539	-575	-613	-653	-693	-735	-778
KR4301S43570			2022-04 풋357.5				705
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-622	-632	-643	-656	-671	-687	-705
-5.33%	-346	-363	-382	-402	-423	-445	-468
-2.67%	-104	-129	-155	-181	-207	-234	-261
0%	88	58	29	0	-29	-59	-88

2.67%	224	196	167	139	110	81	52
5.33%	309	286	262	238	212	186	159
8.00%	356	340	323	303	283	261	238

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

3,435

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

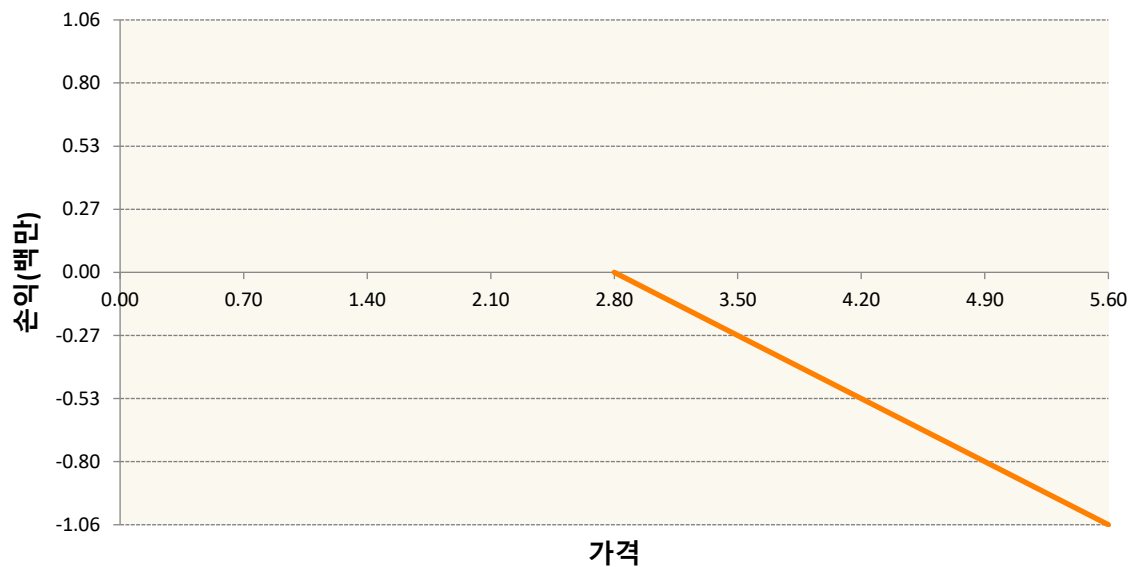
1. 계약금액

(단위:백만원)

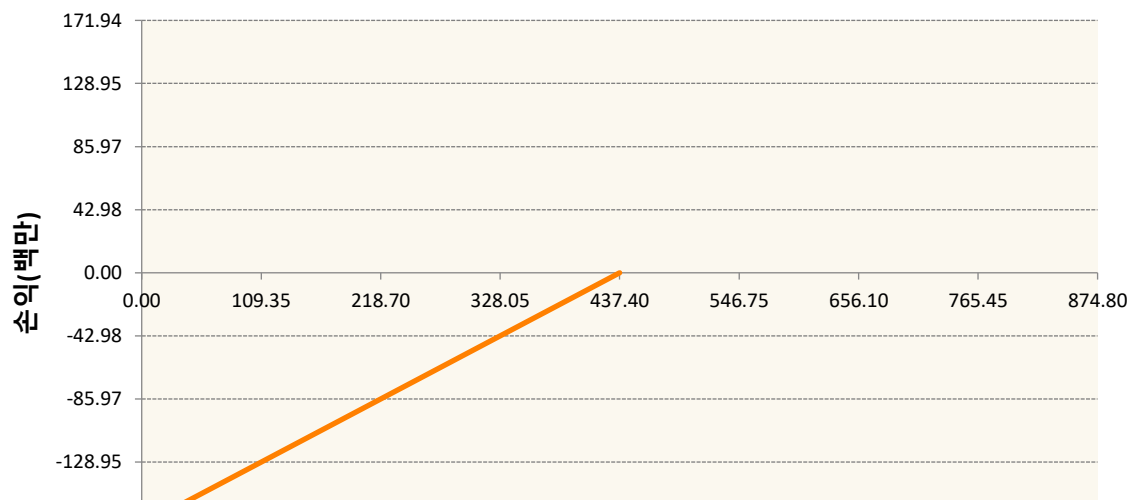
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	173	-173	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	678	2,711	-2,033	장외

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		21
FXW213BCF KRW/EUR 17-03-22E		54
FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E		22
FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E		33
FXW213C32 EUR/KRW 17-03-22E		22
FXW213C37 EUR/KRW 17-03-22E		33
FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E		65
FXW213C3A KRW/EUR 22-04-22E		43
OESXH2-C4C EURO STOXX 50		0.09
OESXH2-P40 EURO STOXX 50		14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	182

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

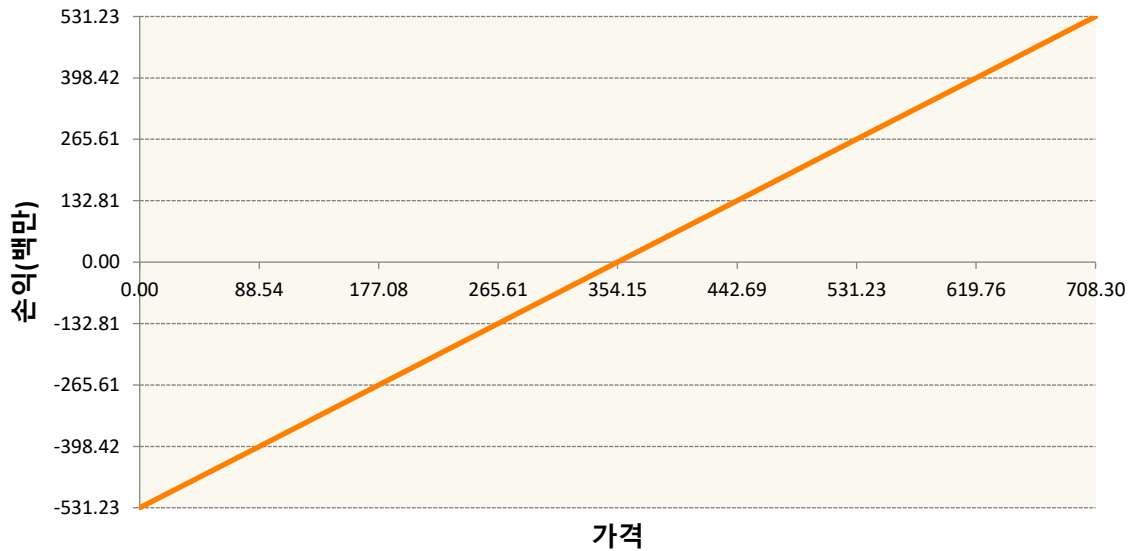
1. 계약금액

(단위:백만원)

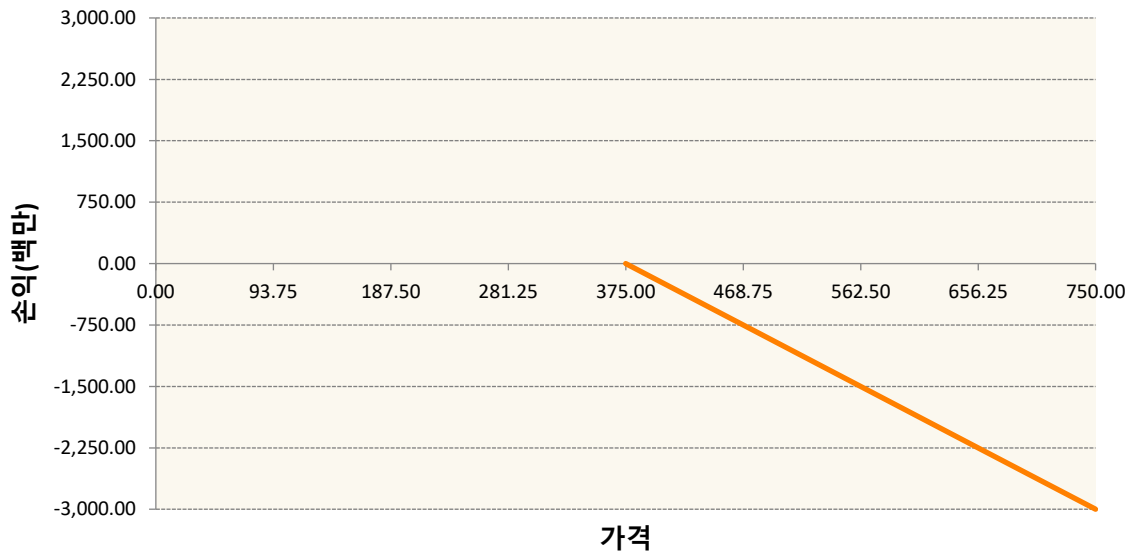
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	346	2,648	-2,302	장내
누계	유가증권	선물	531	0	531	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S43754-2022-04 콜375



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 755.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -1,698.75 to 1,698.75. A blue line starts at the point (377.50, 0.00) and slopes downward to the point (755.00, -1,698.75).

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
377.50	0.00
755.00	-1,698.75

The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가액' (Price), ranges from 0.00 to 715.00. The y-axis, labeled '순익 (백만)' (Net Income in millions), ranges from -357.50 to 357.50. A solid orange line represents the function, starting at (0.00, 357.50) and ending at (357.50, 0.00).

가액 (Price)	순익 (백만) (Net Income)
0.00	357.50
89.38	268.13
178.75	178.75
268.13	89.38
357.50	0.00

(단위:백만원)

KR4101S60008				2022-06 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%	-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%	43	43	43	43	43	43	43	
KR4201S43754				2022-04 콜375				136
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	53	49	46	41	36	31
-5.33%	50	46	41	36	30	23	17
-2.67%	41	35	28	21	13	5	-3
0%	25	17	9	0	-9	-18	-27
2.67%	2	-8	-18	-28	-38	-48	-58
5.33%	-32	-42	-52	-63	-73	-84	-94
8.00%	-74	-85	-95	-105	-115	-126	-136
KR4201S43770 2022-04 콜377.5							74

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	27	25	24	21	19	16
-5.33%	26	24	21	18	15	12	8
-2.67%	21	18	15	11	7	3	-2
0%	14	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	2	-4	-9	-15	-20	-26	-31
5.33%	-16	-22	-27	-33	-39	-45	-51
8.00%	-38	-44	-50	-56	-62	-68	-74

KR4301S43570 2022-04 풋357.5							22
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	20	20	21	21	22
-5.33%	11	11	12	12	13	14	14
-2.67%	3	4	5	6	6	7	8
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-6	-5	-4	-3	-2	-2
5.33%	-10	-9	-8	-7	-7	-6	-5
8.00%	-11	-10	-10	-9	-9	-8	-7

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

(단위:백만원)

213

공시일	2022-03-14
기준일	2022-03-11

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	9,732	0	9,732	

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	2022-03-14
기준일	2022-03-11

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	8,026	0	8,026	

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	2022-03-14
기준일	2022-03-11

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	27,164	0	27,164	
누계	통화	선도	3,696	30,467	-26,771	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	197
FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E	69
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,240
FXW213C32 USD/KRW 25-03-22E	59
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E	39
FXW213C37 USD/KRW 25-03-22E	49
FXW213C3B USD/KRW 25-03-22E	79
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

873

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

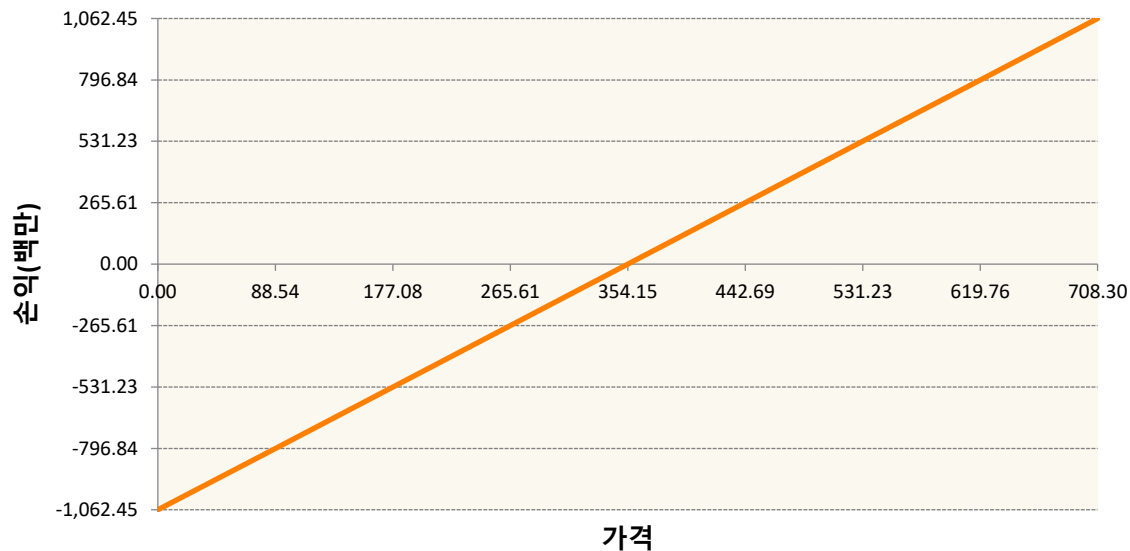
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	354	0	354	장내
누계	유가증권	선물	1,062	0	1,062	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008				2022-06 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%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57	
-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%	57	57	57	57	57	57	57	
8.00%	85	85	85	85	85	85	85	

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

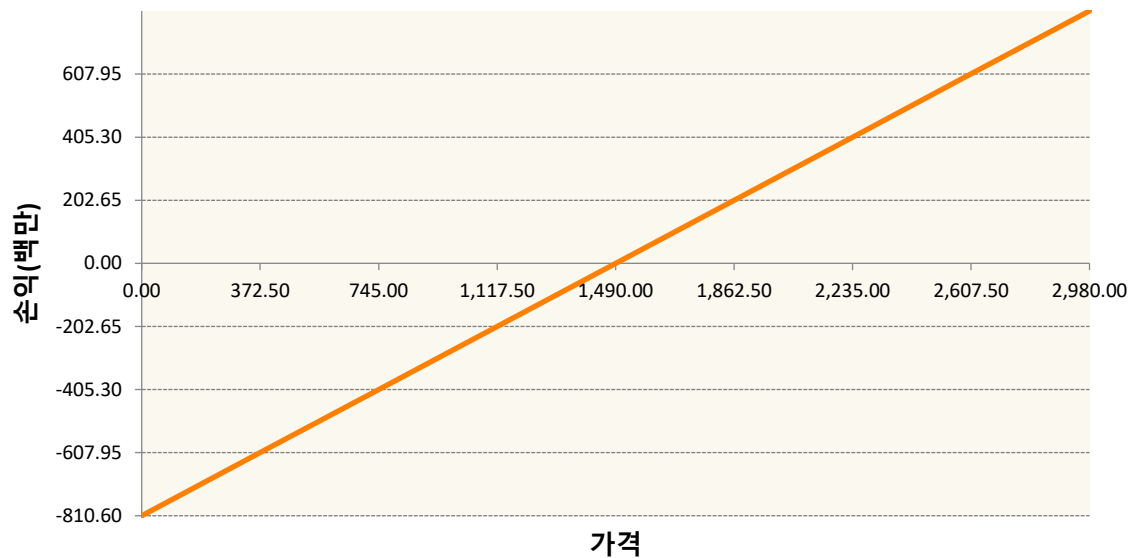
1. 계약금액

(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	811	0	811	
누계	유가증권	스왑	1,853	0	1,853	장외
누계	통화	선도	0	1,328	-1,328	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCH2-VN30 Index Future Mar22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	148
FXW213BCN KRW/EUR 18-03-22E	43
FXW213C1K KRW/EUR 22-04-22E	16
FXW213C2P KRW/EUR 20-05-22E	47
VNCH2 VN30 Index Future Mar22	65

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

(단위:백만원)

275

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

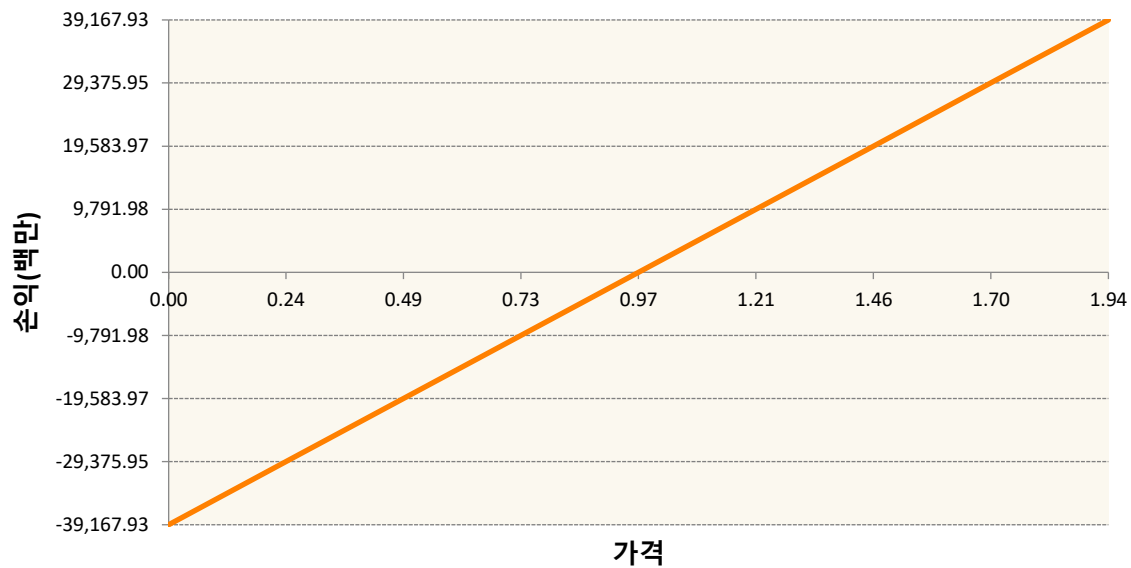
1. 계약금액

(단위:백만원)

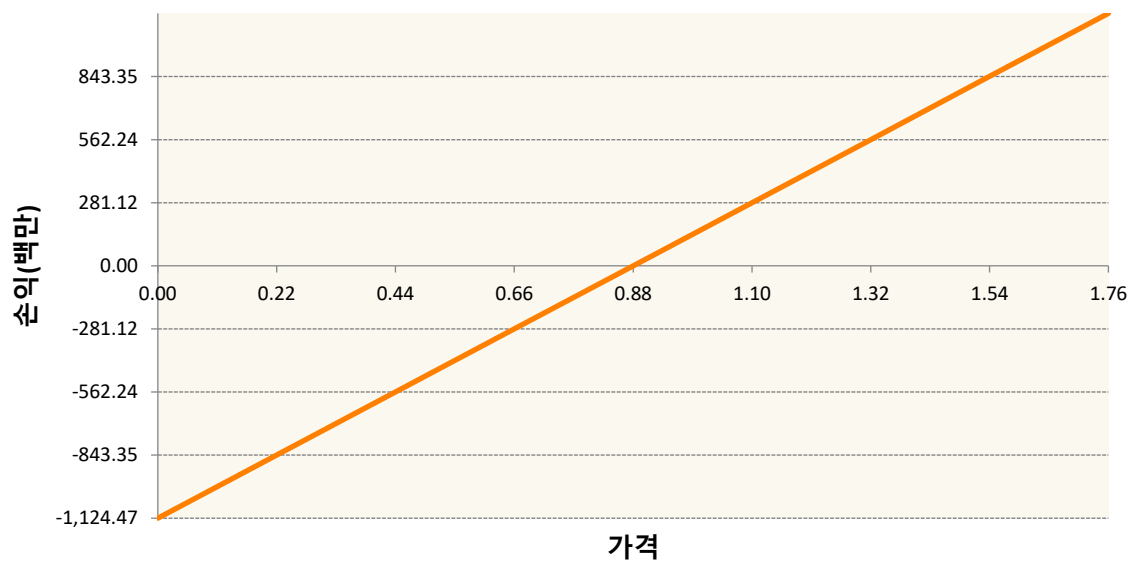
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	42,534	0	42,534	

2. 만기시점의 손익구조

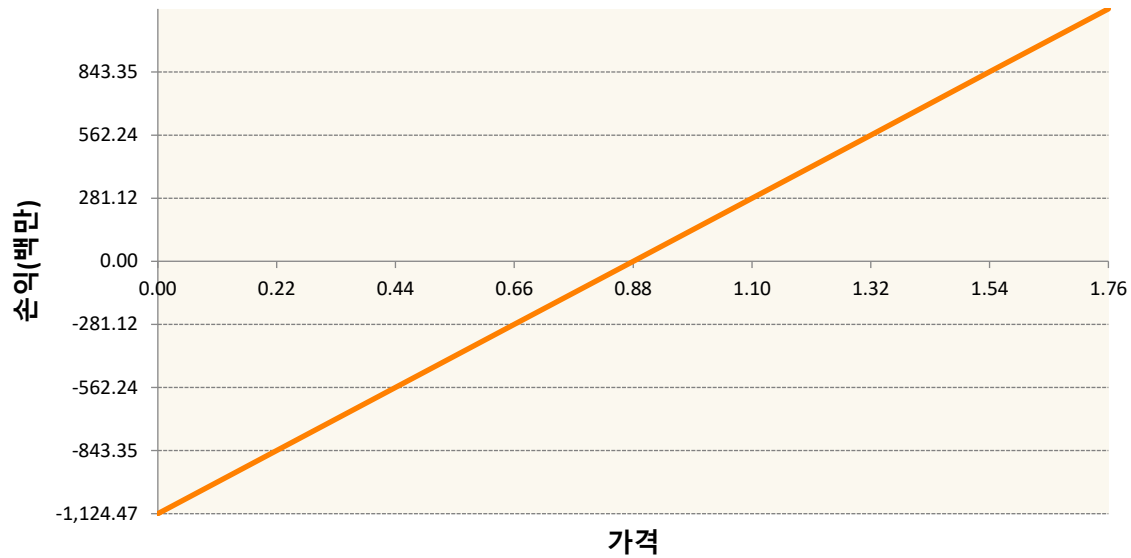
210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



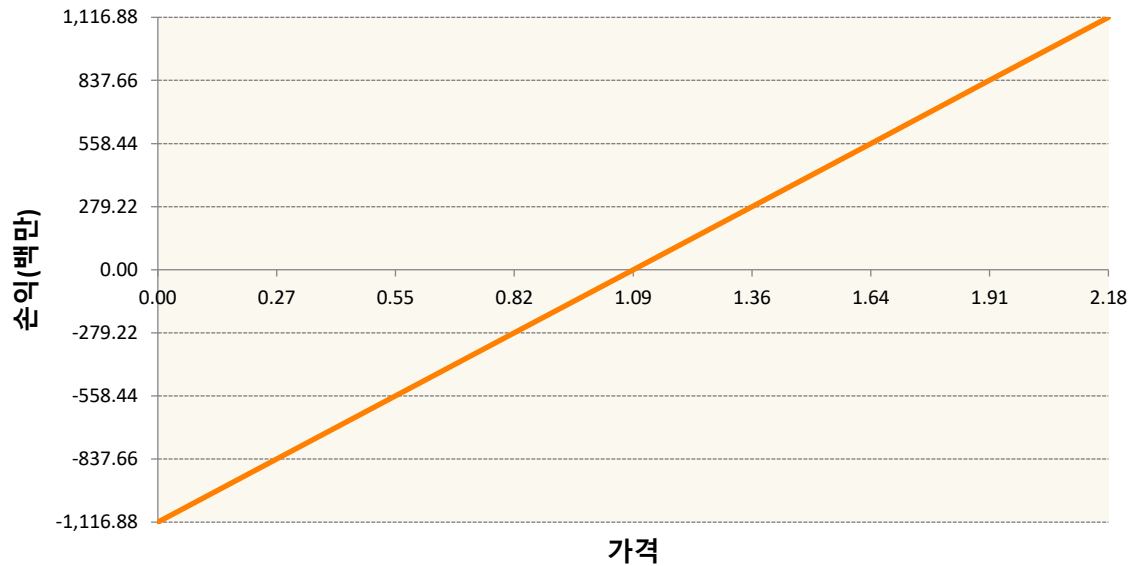
210884220216-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220217-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220307-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	3,134
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	90
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	90
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	90

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

(단위:백만원)

6,231

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

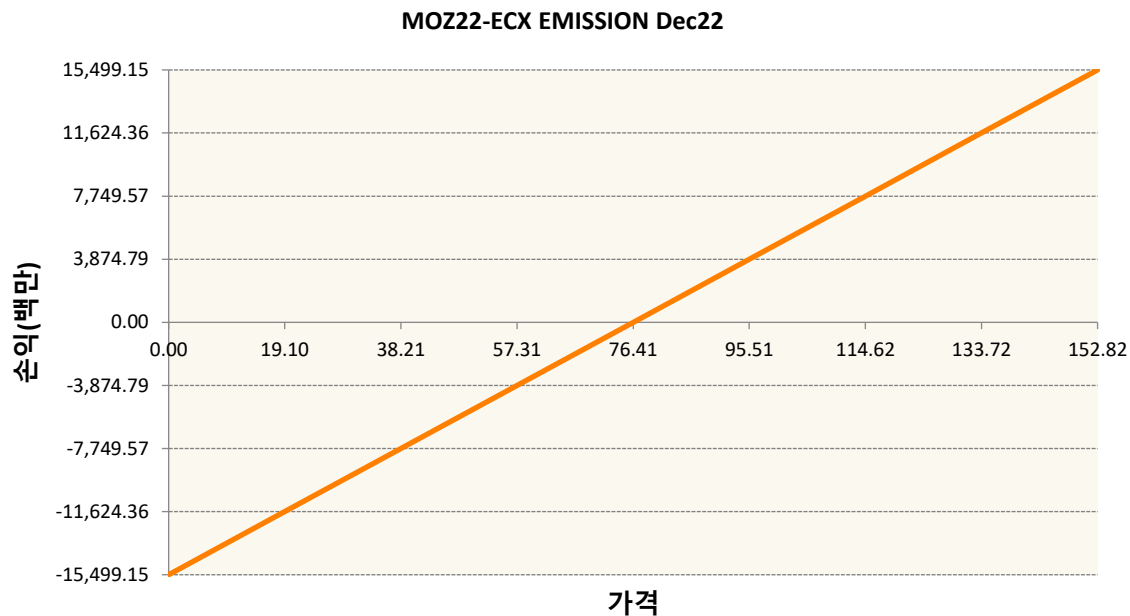
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,499	0	15,499	
누계	통화	선도	0	8,292	-8,292	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2R KRW/EUR 28-03-22E

663

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,240

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

(단위:백만원)

3,337

공시일	2022-03-14
기준일	2022-03-11

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)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	4

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

(단위:백만원)

31

공시일	2022-03-14
기준일	2022-03-11

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)		15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)		18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)		15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)		15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	79

공시일 2022-03-14

기준일 2022-03-11

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

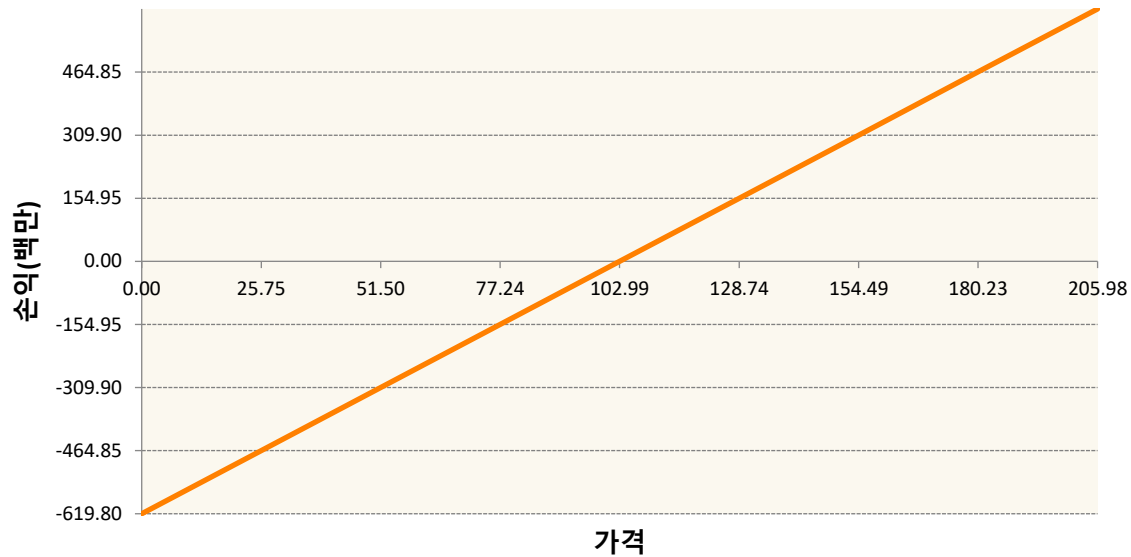
1. 계약금액

(단위:백만원)

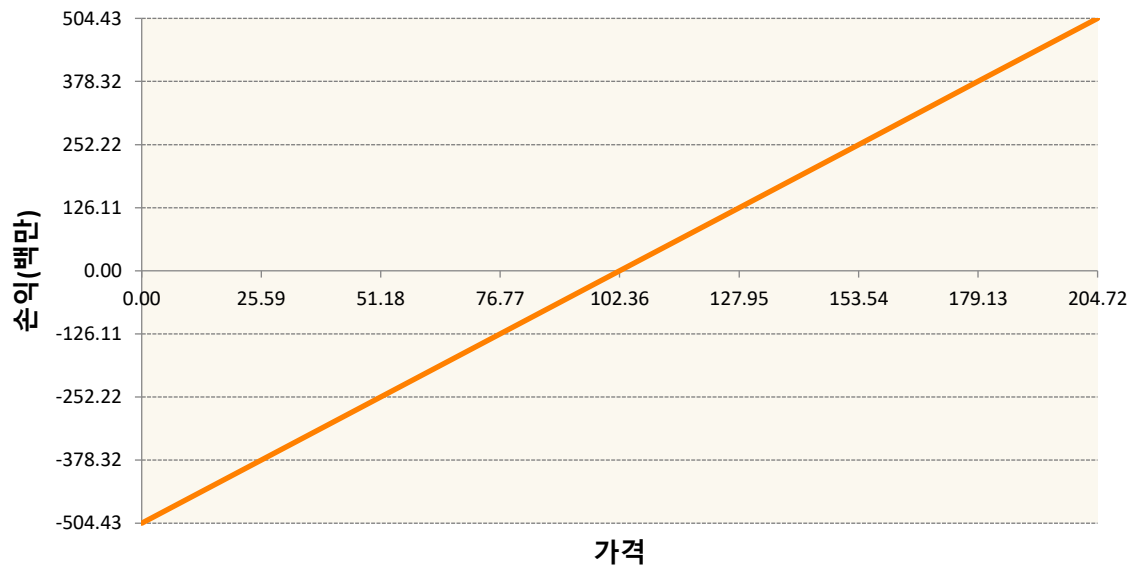
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,353	555	1,799	

2. 만기시점의 손익구조

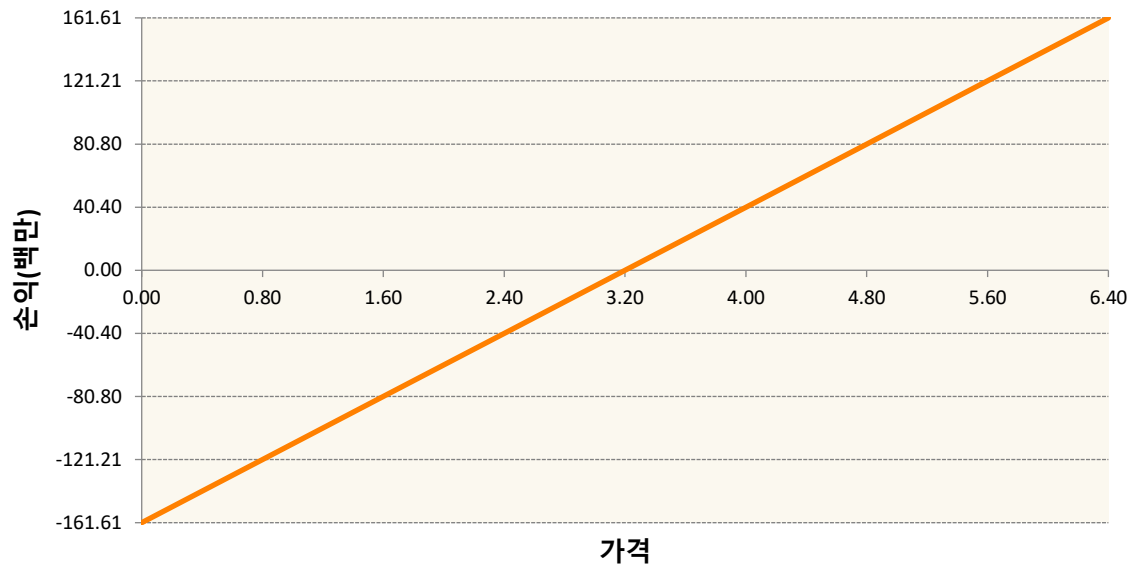
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



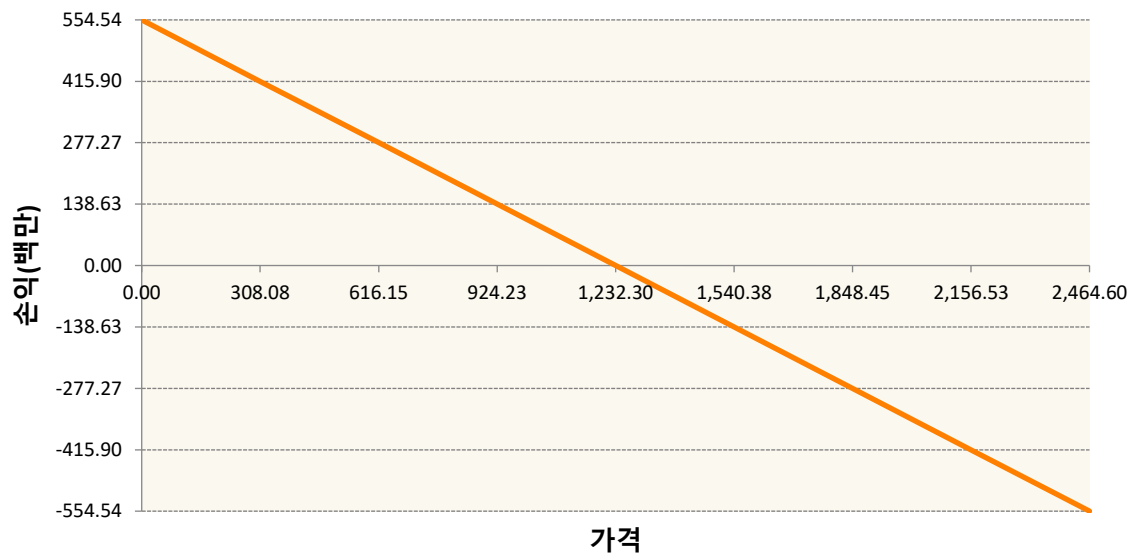
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



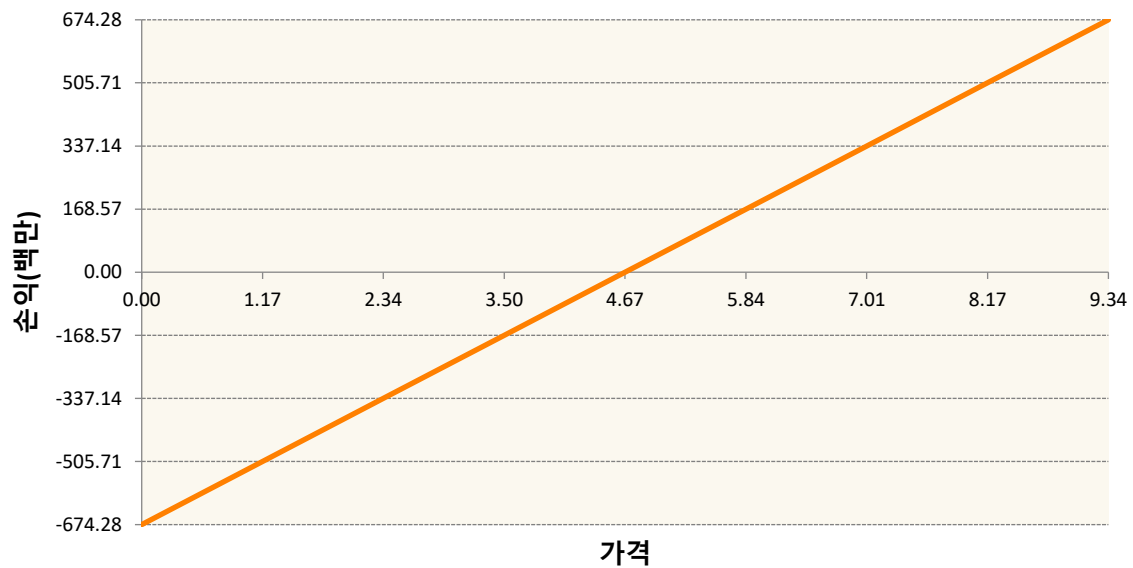
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

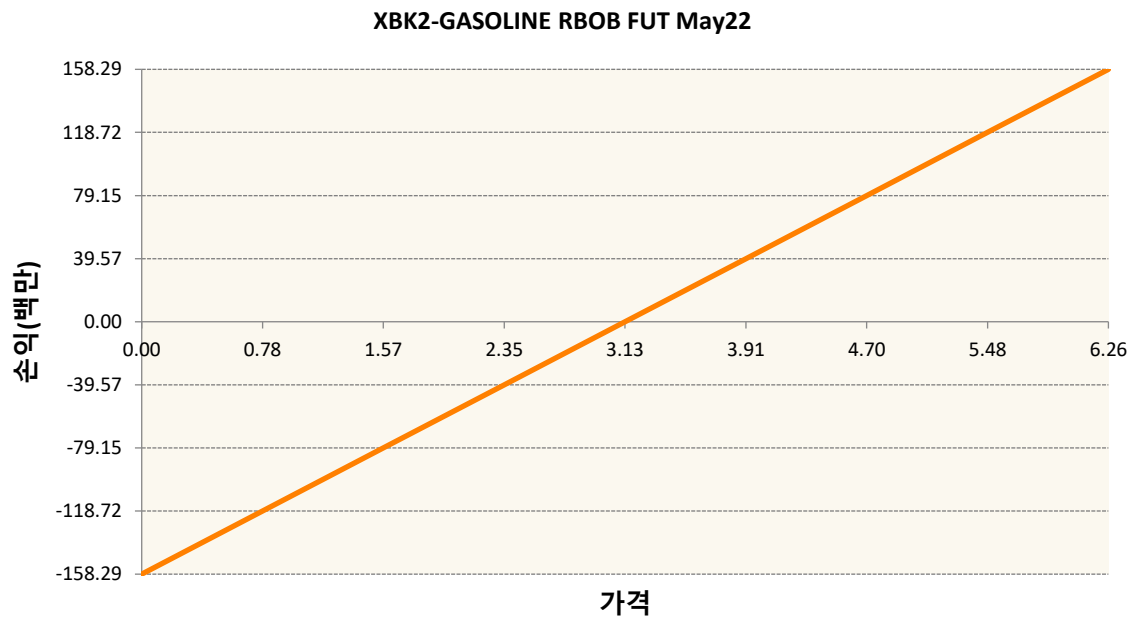
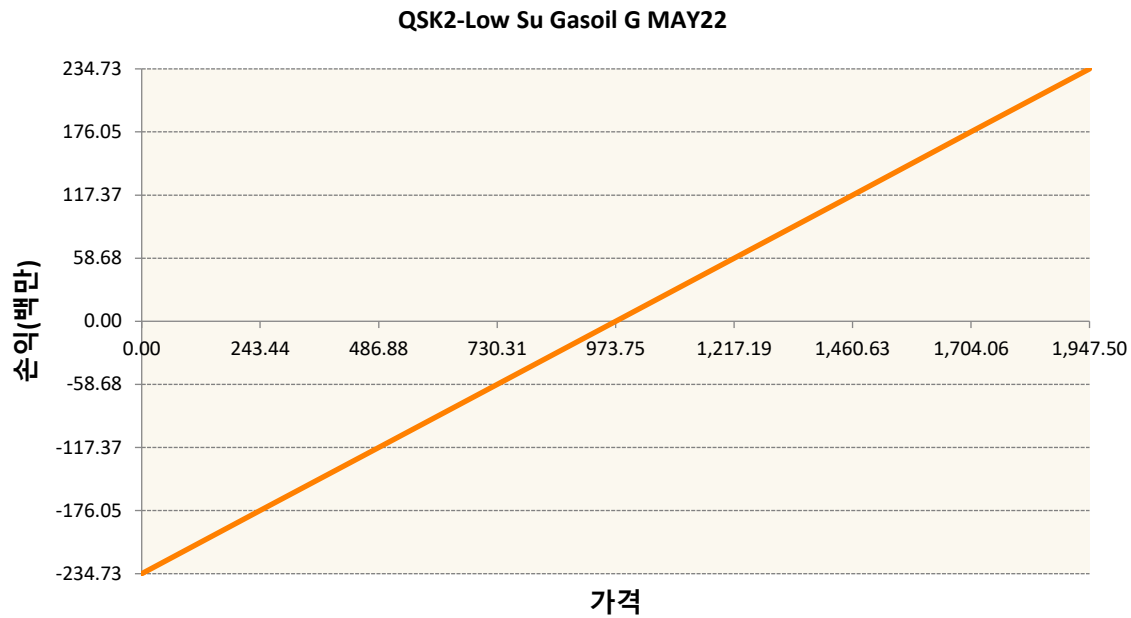


KR4175S30005-2022-03 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		50
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		40
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		13
KR4175S300 2022-03 달러선물			44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		54
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		19
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	508