

공시일 2022-03-15

기준일 2022-03-14

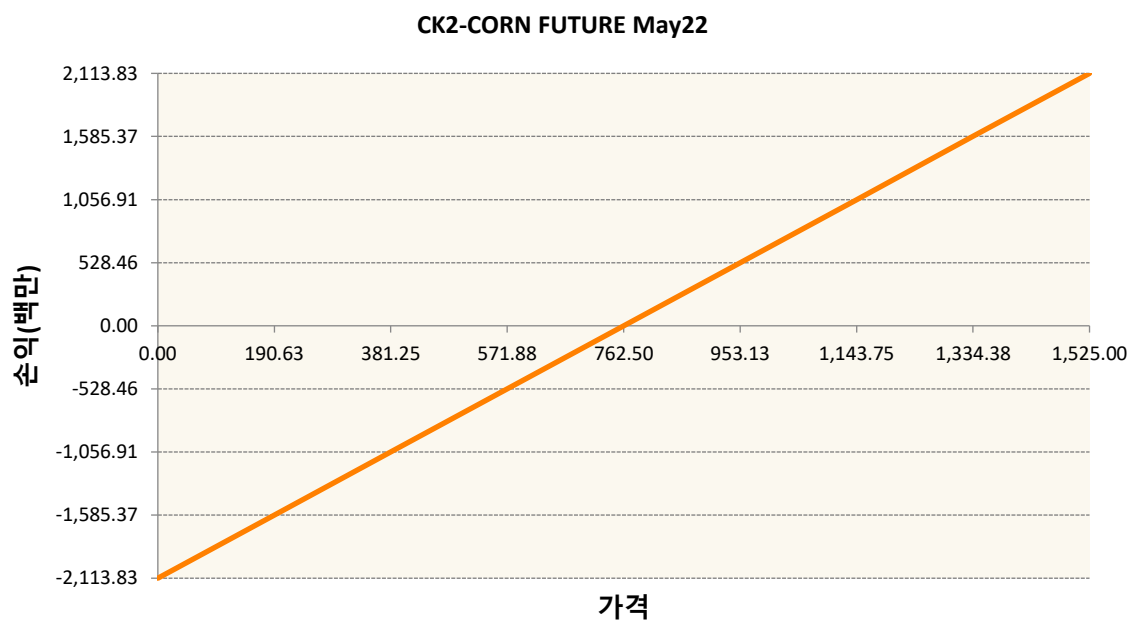
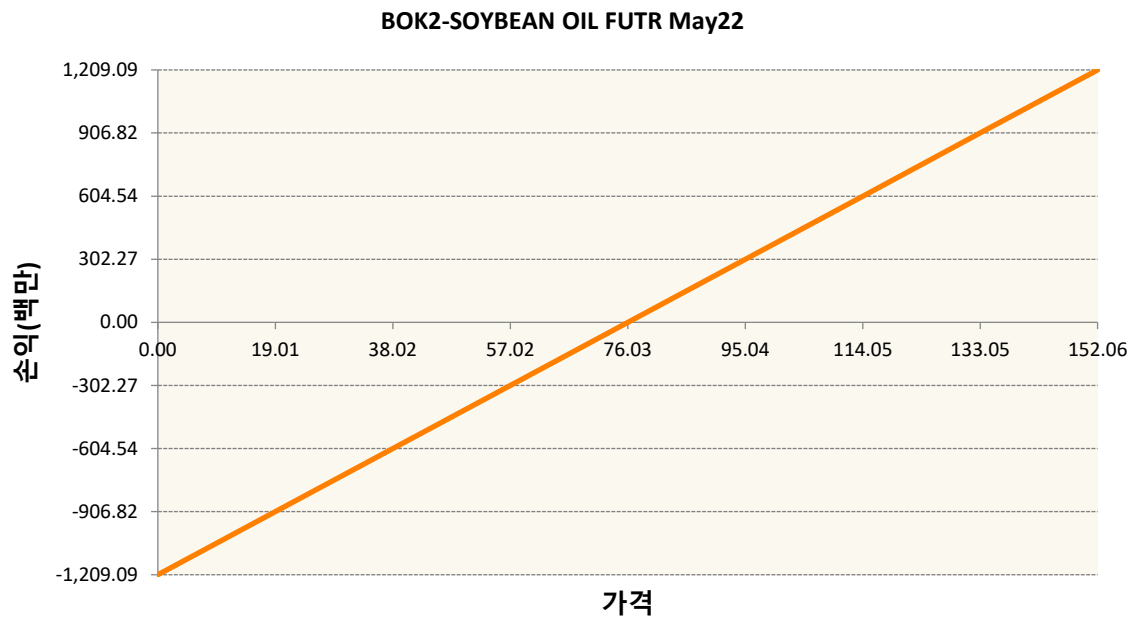
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

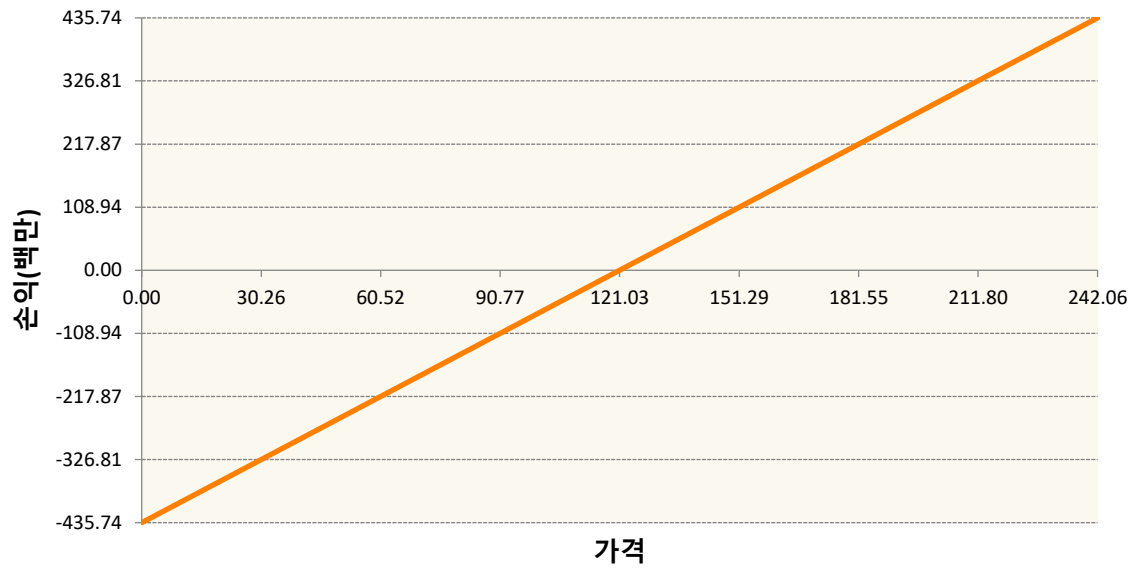
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,753	1,615	9,138	

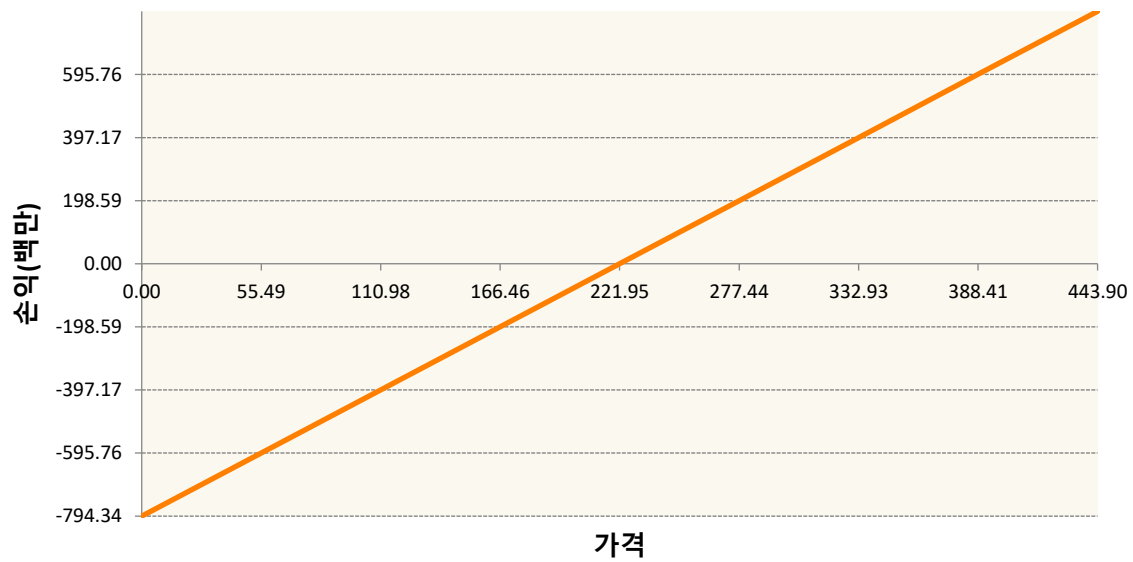
2. 만기시점의 손익구조



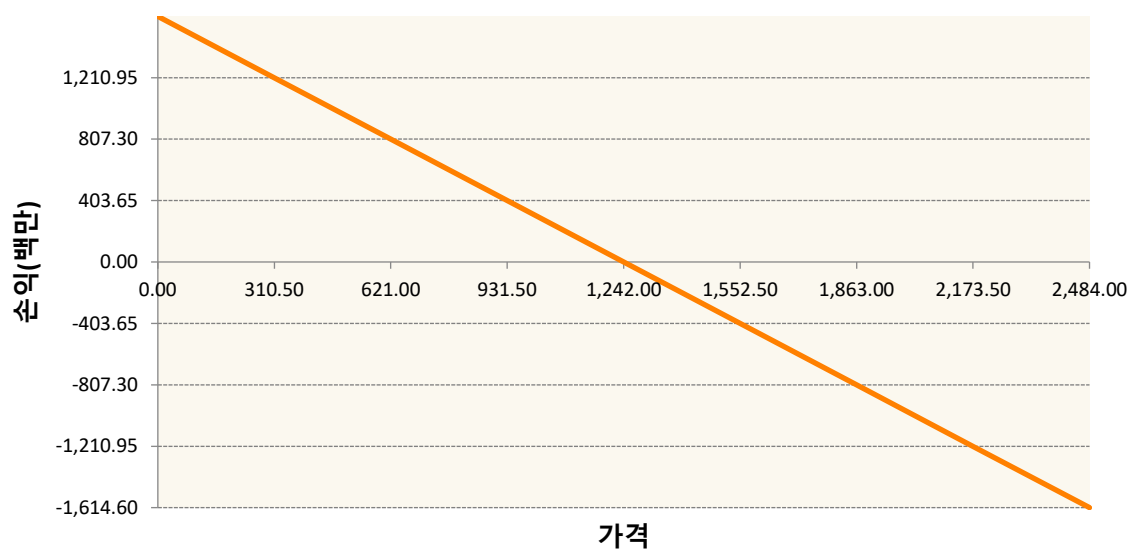
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



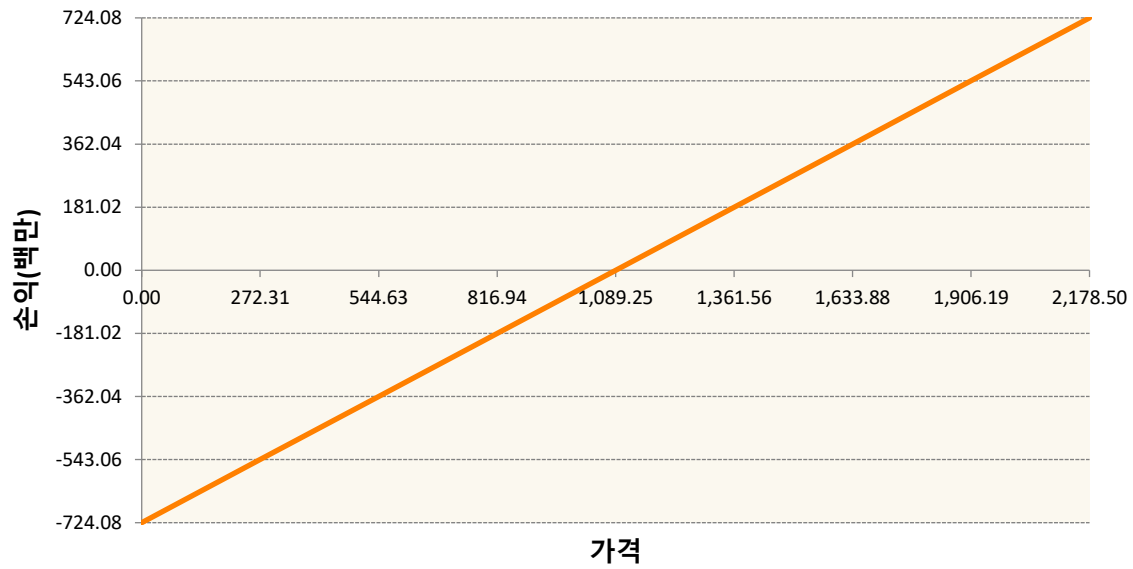
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



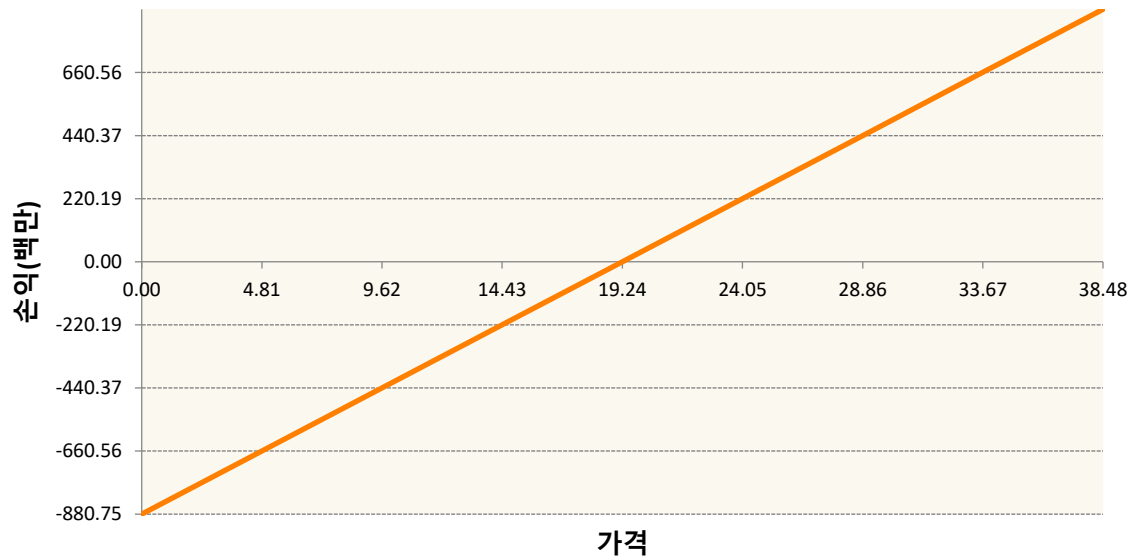
KR4175S30005-2022-03 달러선물



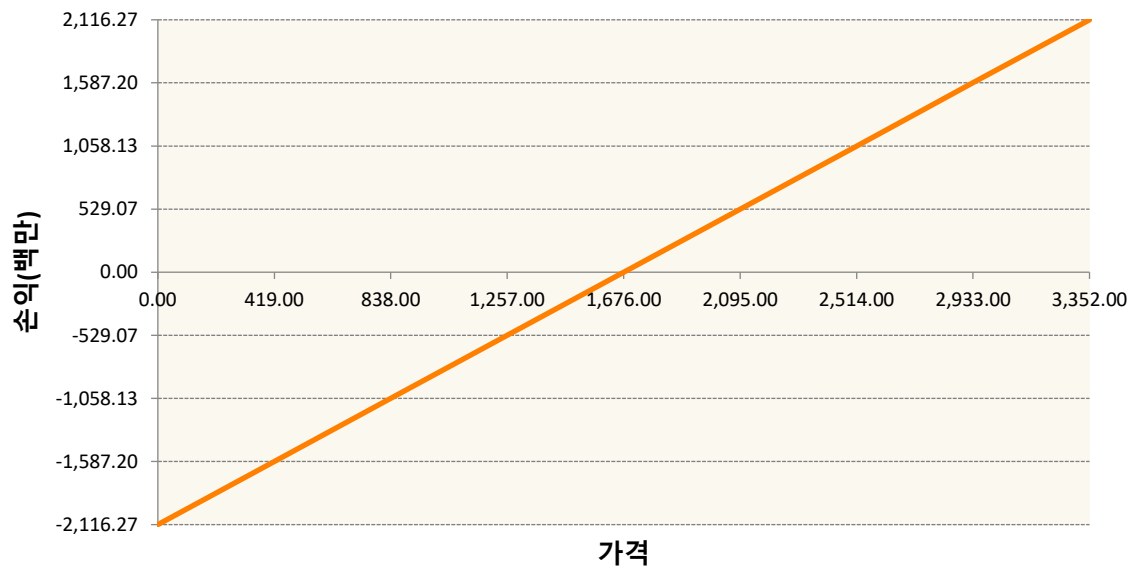
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22

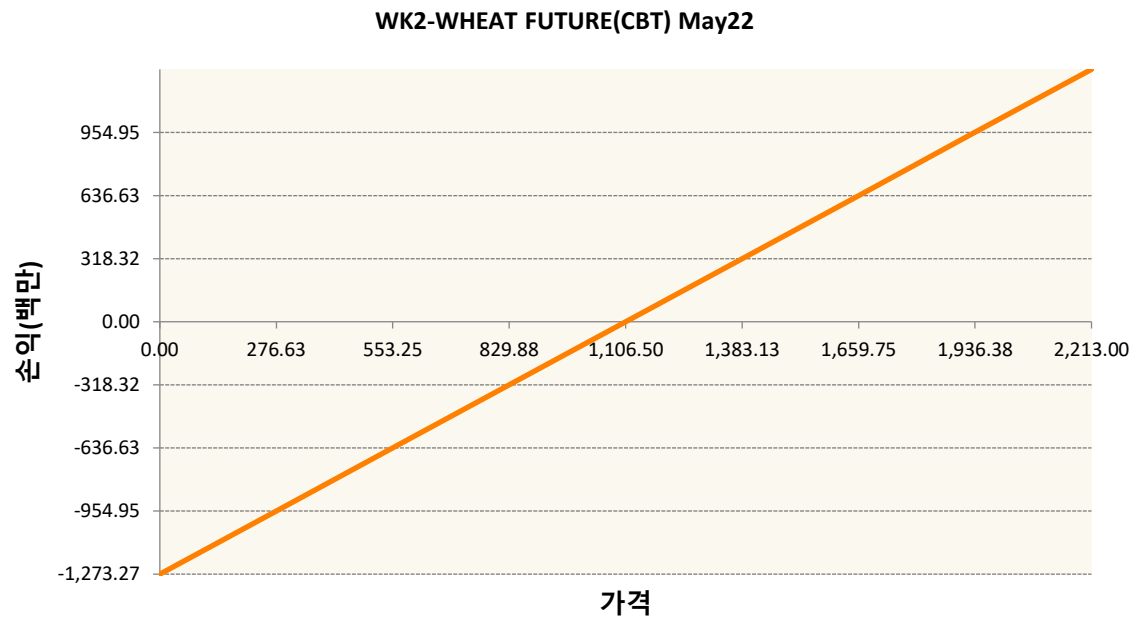
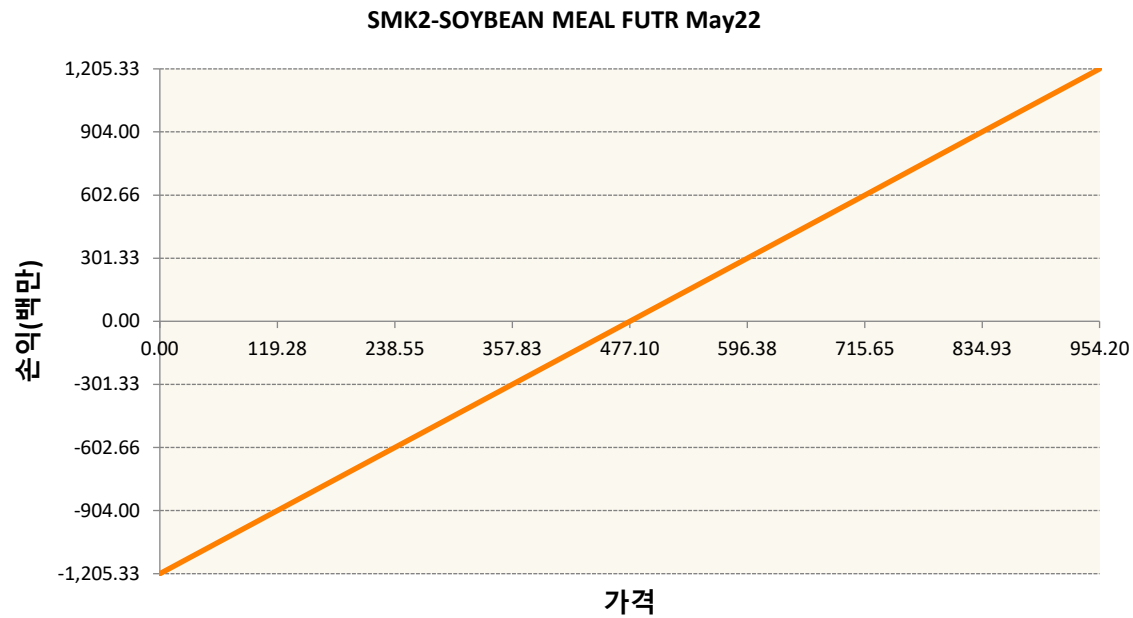


SBK2-Sugar May22



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 2022-03-15

기준일 2022-03-14

스마트인덱스모

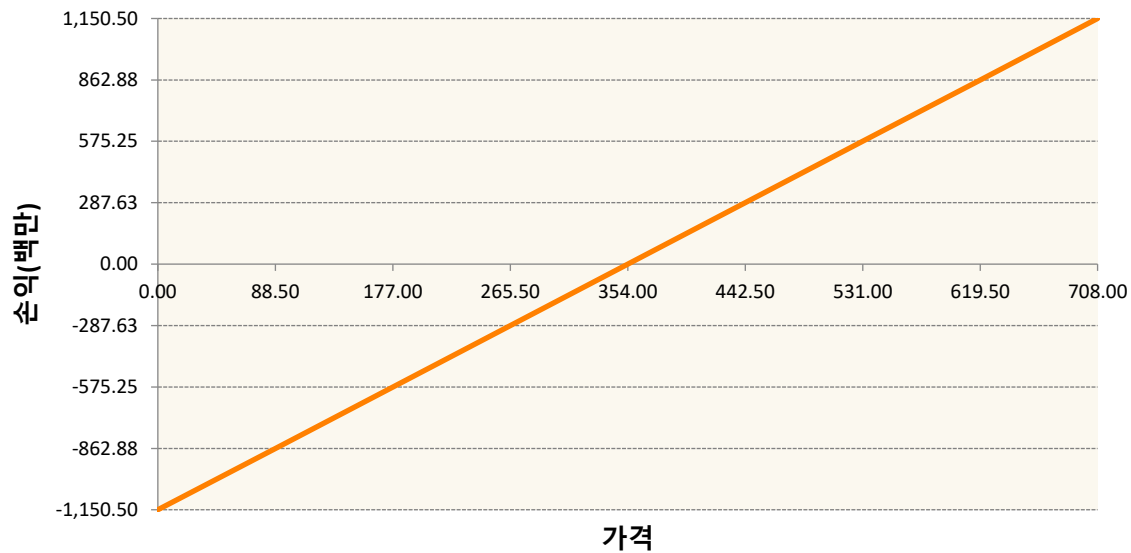
1. 계약금액

(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%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-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%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

공시일	2022-03-15
기준일	2022-03-14

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	135
------------------------------	-----

* 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	2022-03-15
기준일	2022-03-14

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	4,900	0	4,900	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래220311

402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-03-15
기준일	2022-03-14

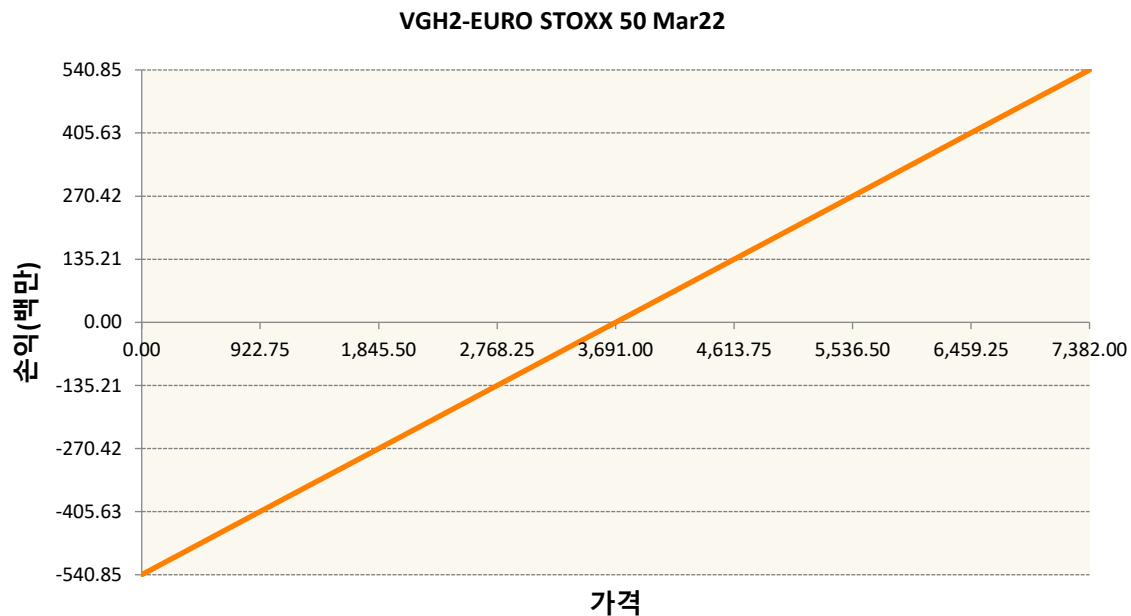
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	541	0	541	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-03-15
기준일	2022-03-14

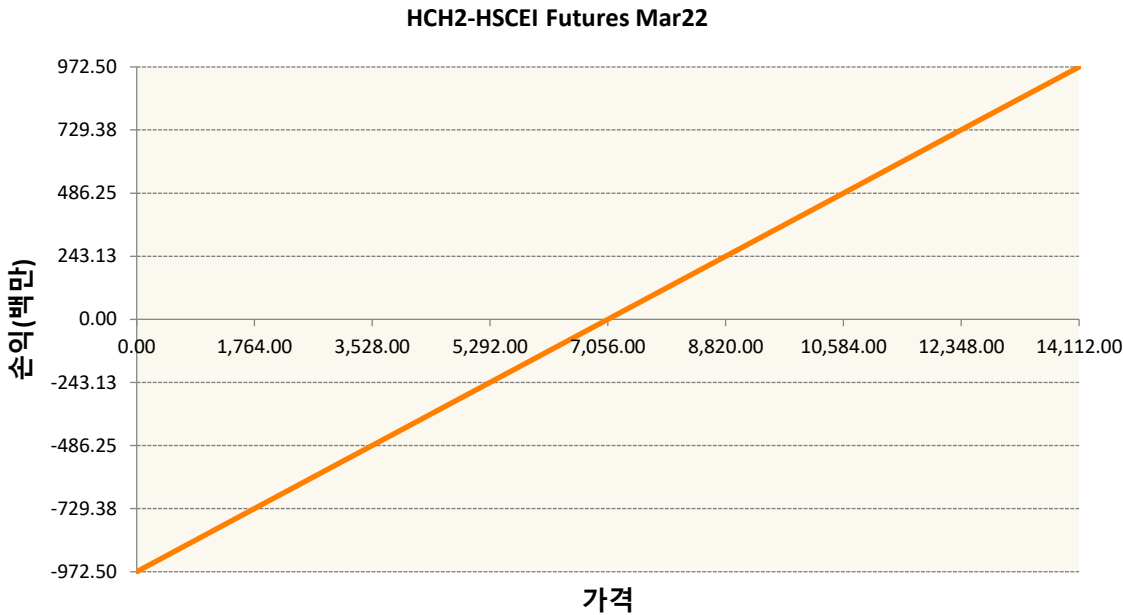
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	973	0	973	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2	HSCEI Futures Mar22	78
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

86

공시일 2022-03-15

기준일 2022-03-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

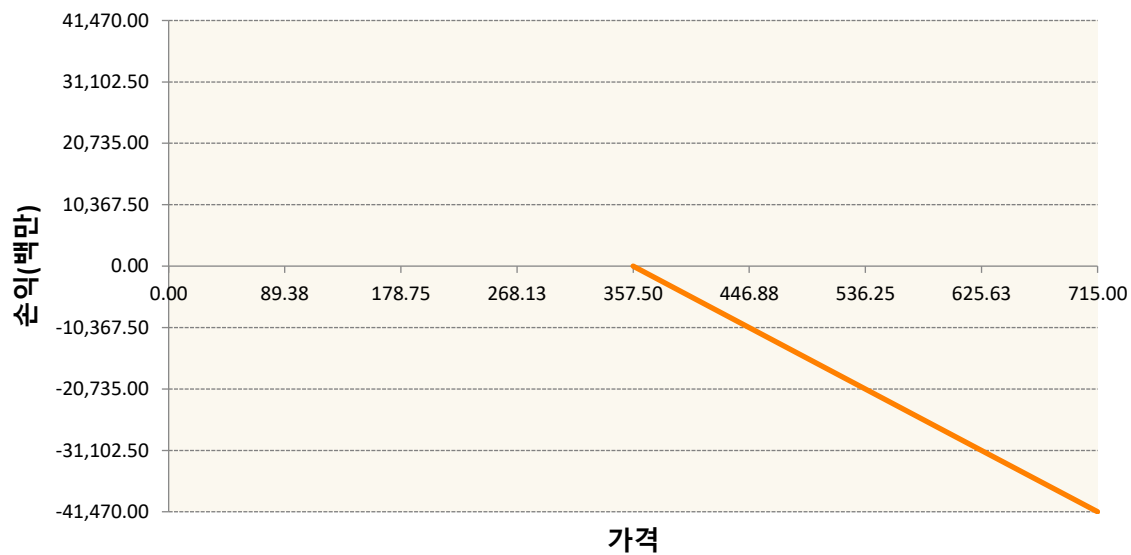
1. 계약금액

(단위:백만원)

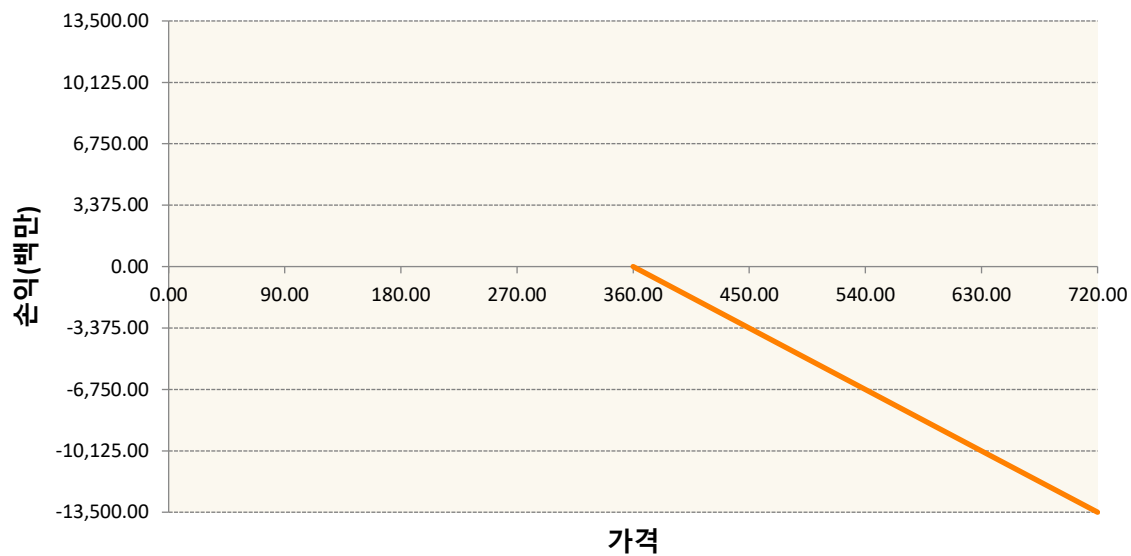
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	548	-548	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,589	-66,589	장내

2. 만기시점의 손익구조

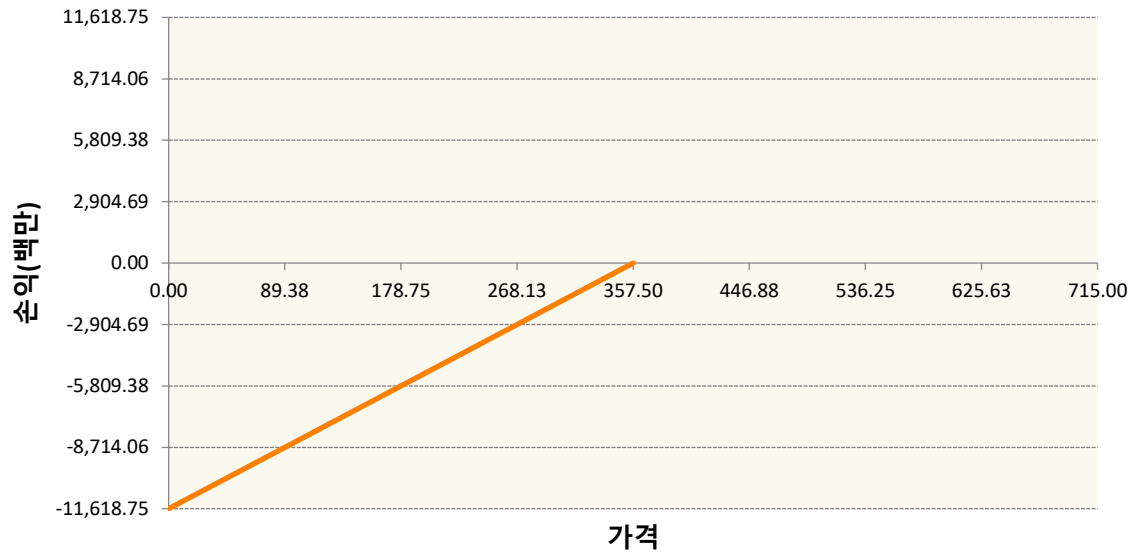
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572			2022-04 콜357.5				2,442
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,327	1,259	1,181	1,097	1,006	911	811
-5.33%	1,148	1,050	946	837	725	610	492
-2.67%	852	728	602	475	346	216	85
0%	413	276	138	0	-138	-276	-414
2.67%	-177	-314	-451	-589	-728	-866	-1,005
5.33%	-911	-1,033	-1,159	-1,288	-1,418	-1,550	-1,683
8.00%	-1,765	-1,865	-1,971	-2,083	-2,200	-2,320	-2,442
KR4201S43606			2022-04 콜360				767
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	398	378	355	329	301	272	241
-5.33%	347	318	286	252	218	181	145
-2.67%	262	224	184	144	103	62	20
0%	133	89	44	0	-44	-89	-133
2.67%	-45	-90	-136	-181	-226	-271	-317
5.33%	-271	-312	-354	-397	-441	-484	-529
8.00%	-537	-571	-608	-646	-686	-726	-767
KR4301S43570			2022-04 풋357.5				712
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-637	-645	-655	-667	-681	-696	-712
-5.33%	-357	-373	-390	-409	-429	-450	-472
-2.67%	-111	-135	-159	-184	-210	-236	-262
0%	85	57	28	0	-28	-57	-86

2.67%	225	197	169	141	113	85	56
5.33%	313	290	266	242	217	191	165
8.00%	360	345	327	309	288	267	245

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

(단위:백만원)

3,452

공시일 2022-03-15

기준일 2022-03-14

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

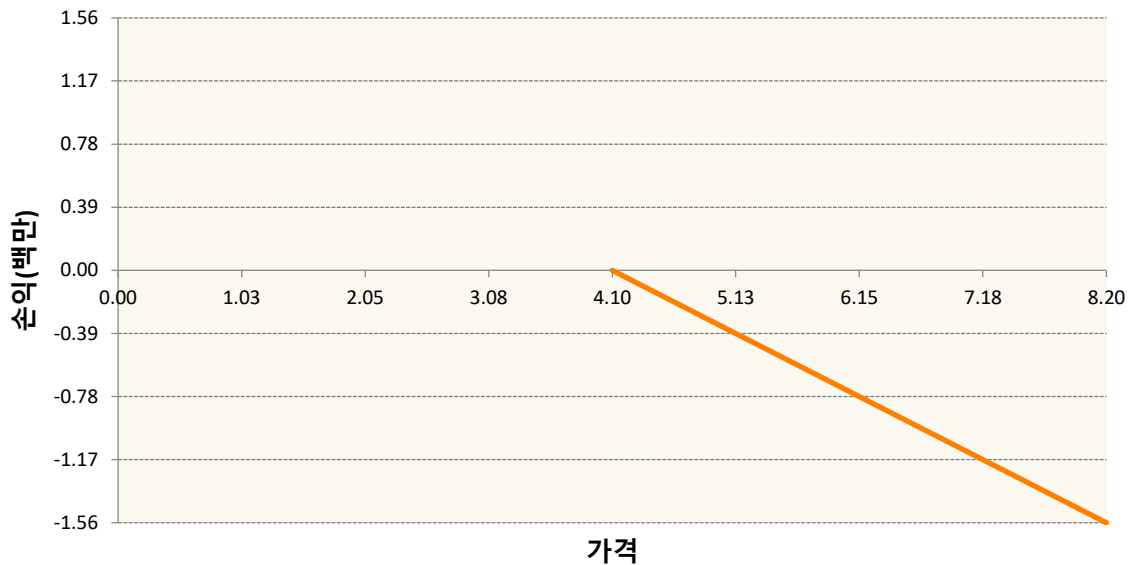
1. 계약금액

(단위:백만원)

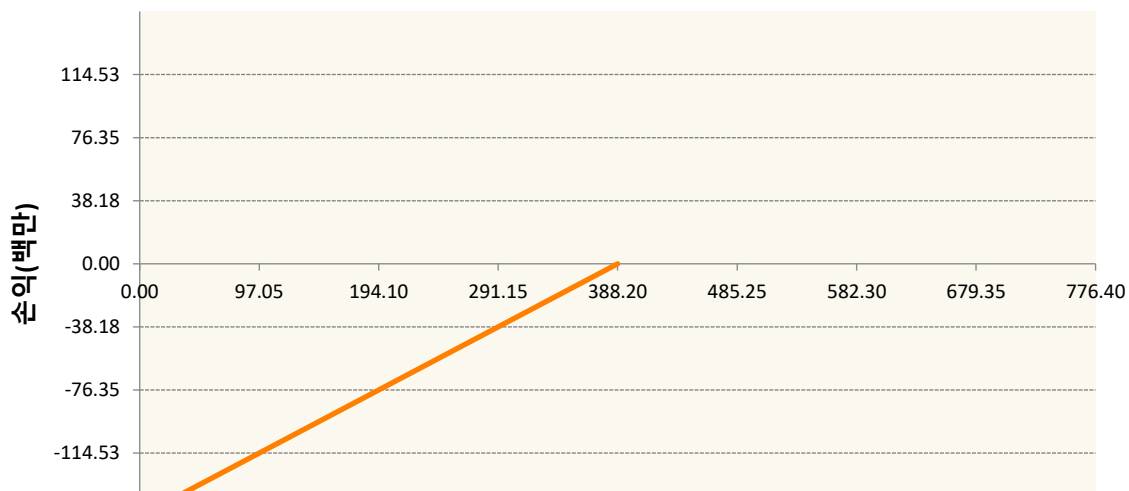
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	154	-154	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	678	2,713	-2,035	장외

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		28
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		0.12
OESXH2-P40 EURO STOXX 50		12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	193

공시일 2022-03-15

기준일 2022-03-14

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

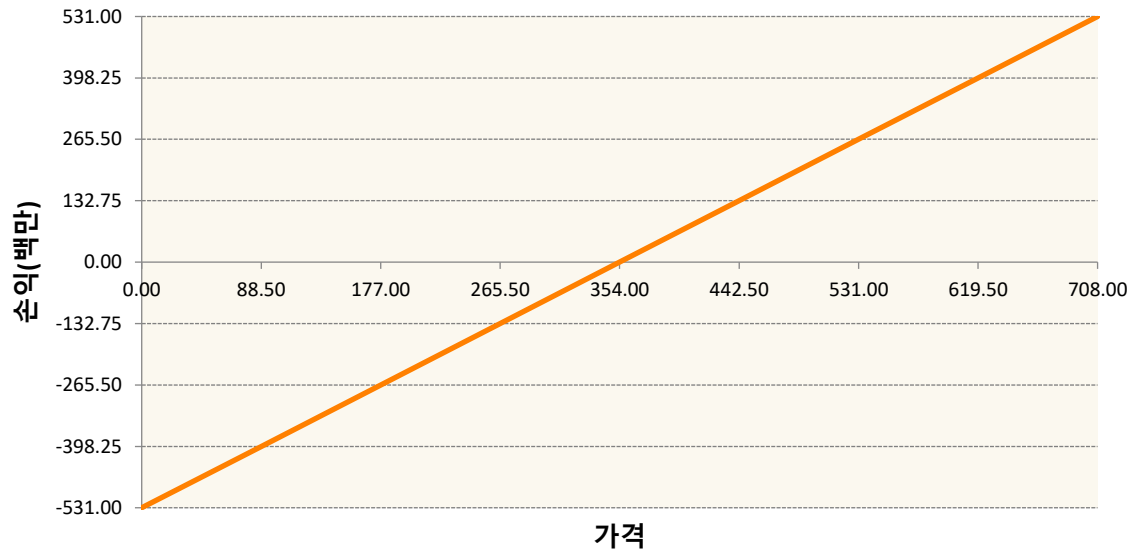
1. 계약금액

(단위:백만원)

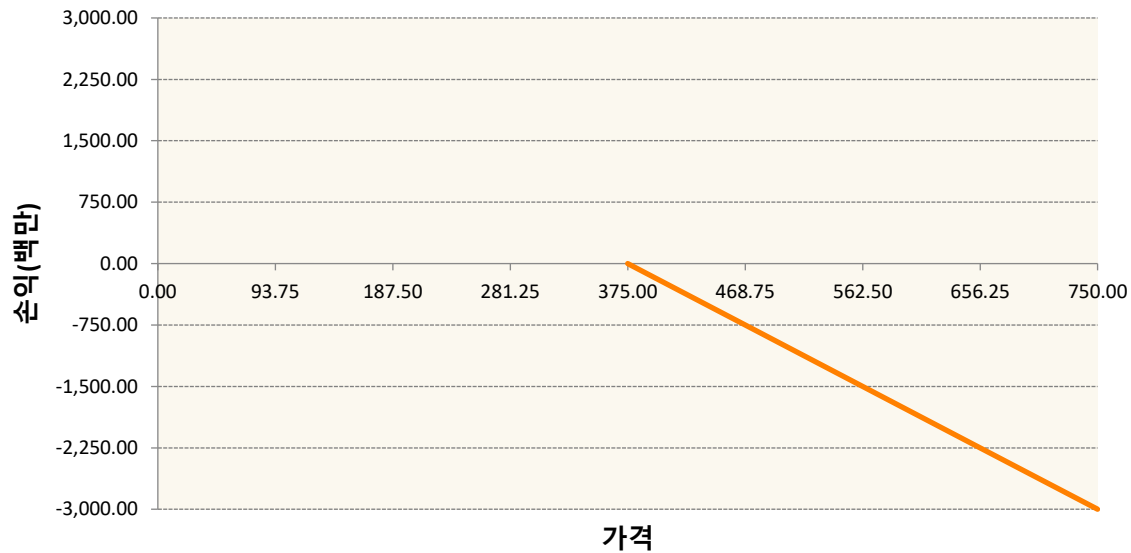
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	531	0	531	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S43754-2022-04 콜375



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The blue line shows that as the price increases beyond 377.50, the profit decreases linearly, reaching a loss of 1,698.75 million at a price of 755.00.

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

가격 (Price)	순이익 (백만원) (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					133
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	48	46	42	38	34	29
-5.33%	46	43	38	33	28	22	16
-2.67%	38	33	26	20	13	5	-2
0%	24	16	8	0	-8	-17	-26
2.67%	1	-8	-17	-27	-36	-46	-55
5.33%	-31	-41	-51	-61	-71	-81	-91
8.00%	-73	-83	-93	-103	-113	-123	-133
KR4201S43770 2022-04 콜377.5							72

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	25	23	22	20	17	15
-5.33%	24	22	20	17	14	11	8
-2.67%	20	17	14	10	6	2	-2
0%	13	9	4	0	-5	-9	-14
2.67%	1	-4	-9	-14	-19	-25	-30
5.33%	-15	-21	-26	-32	-38	-43	-49
8.00%	-37	-43	-49	-54	-60	-66	-72

KR4301S43570 2022-04 풋357.5							22
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	21	21	21	22
-5.33%	11	11	12	13	13	14	15
-2.67%	3	4	5	6	6	7	8
0%	-3	-2	-1	0	1	2	3
2.67%	-7	-6	-5	-4	-3	-3	-2
5.33%	-10	-9	-8	-7	-7	-6	-5
8.00%	-11	-11	-10	-9	-9	-8	-8

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

(단위:백만원)

208

공시일	2022-03-15
기준일	2022-03-14

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	144	-144	
누계	유가증권	수익증권	9,614	0	9,614	

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	2022-03-15
기준일	2022-03-14

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	8,047	0	8,047	

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	2022-03-15
기준일	2022-03-14

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	508	-508	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	26,728	0	26,728	
누계	통화	선도	3,727	30,722	-26,995	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	199
FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E	70
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,259
FXW213C32 USD/KRW 25-03-22E	60
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E	40
FXW213C37 USD/KRW 25-03-22E	50
FXW213C3B USD/KRW 25-03-22E	80
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

871

공시일	2022-03-15
기준일	2022-03-14

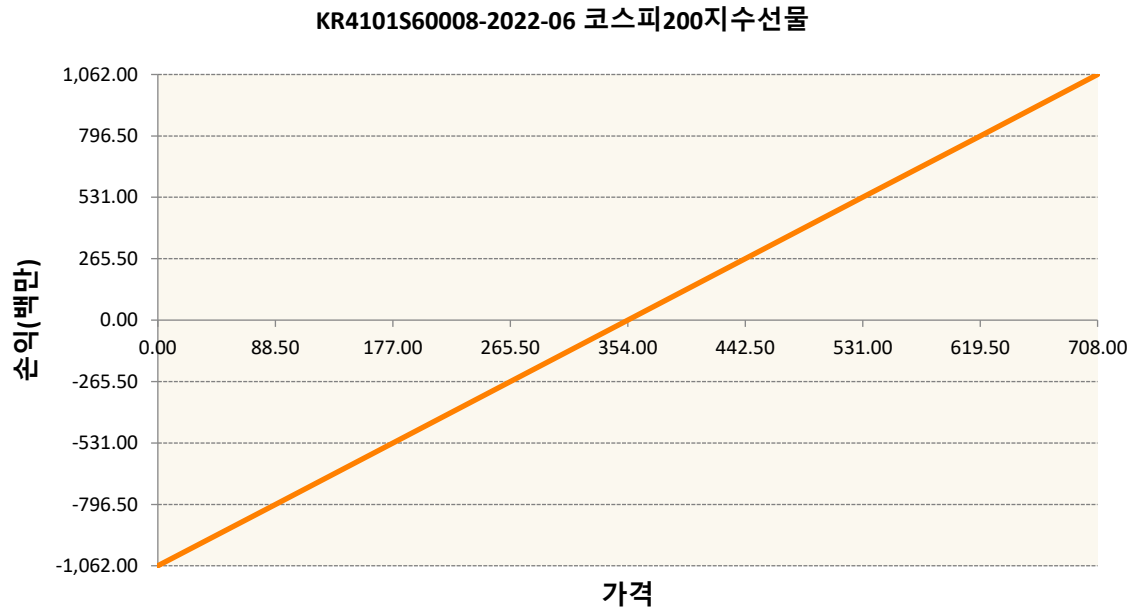
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,062	0	1,062	장내

2. 만기시점의 손익구조



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 2022-03-15

기준일 2022-03-14

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

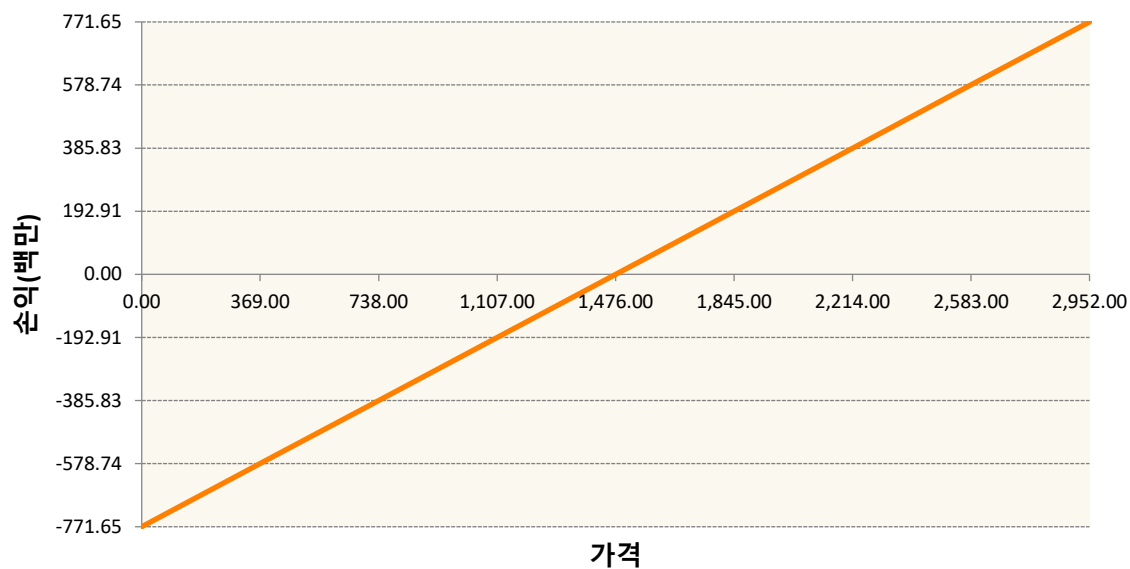
1. 계약금액

(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	772	0	772	
누계	유가증권	스왑	1,854	0	1,854	장외
누계	통화	선도	0	1,329	-1,329	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	62

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

(단위:백만원)

271

공시일 2022-03-15

기준일 2022-03-14

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

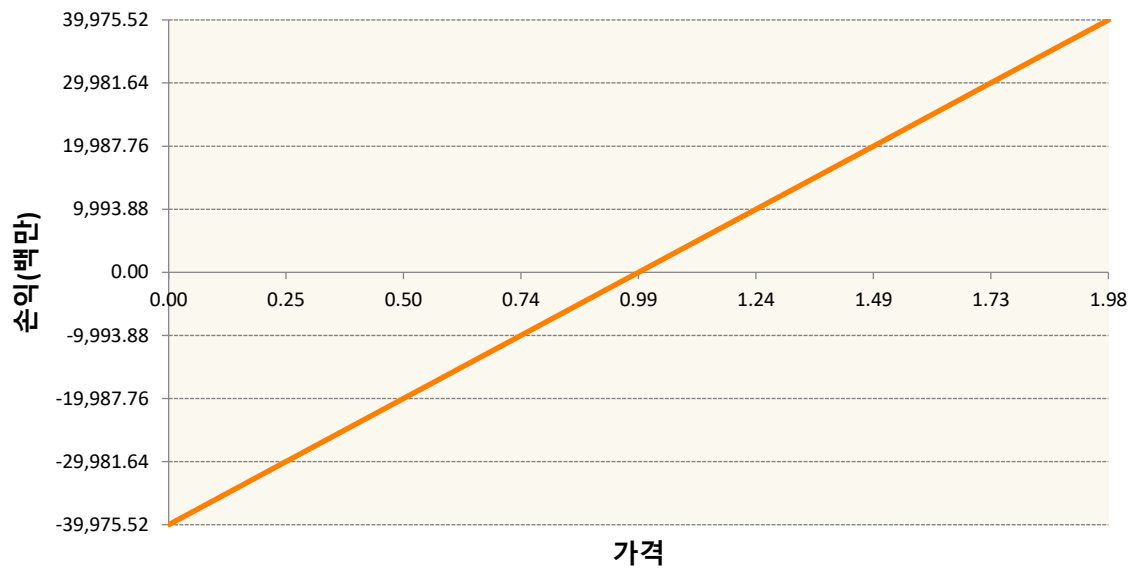
1. 계약금액

(단위:백만원)

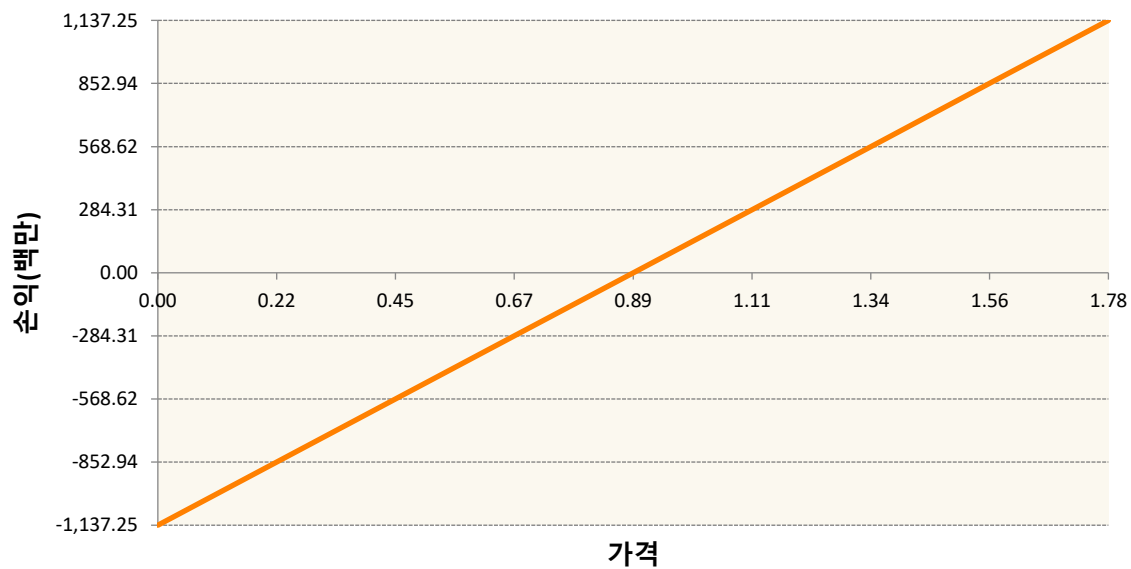
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	43,387	0	43,387	

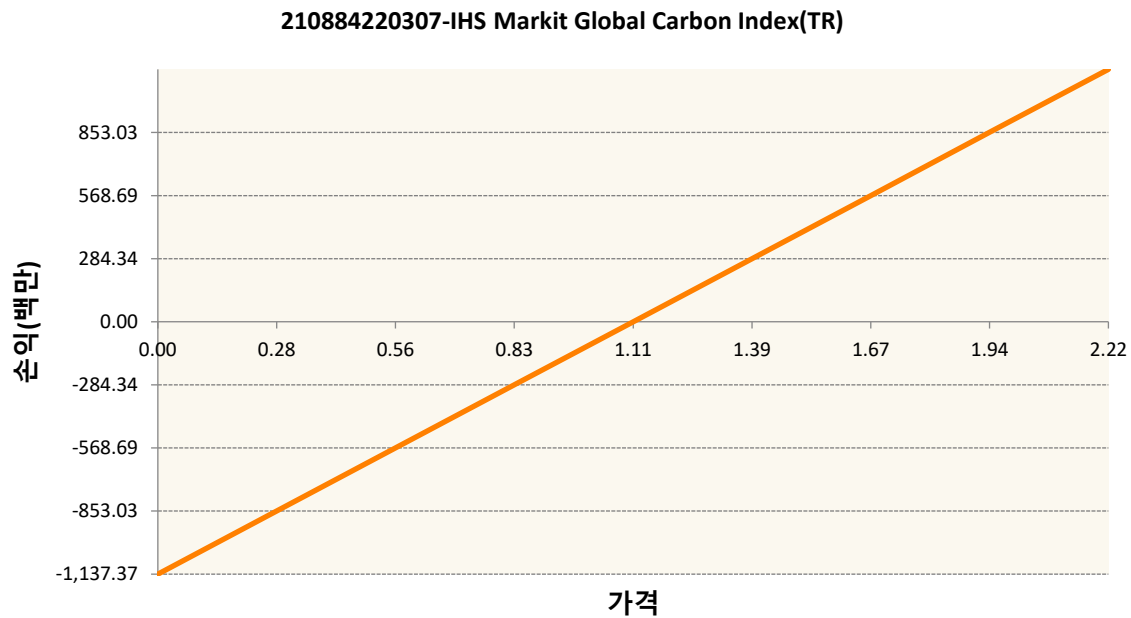
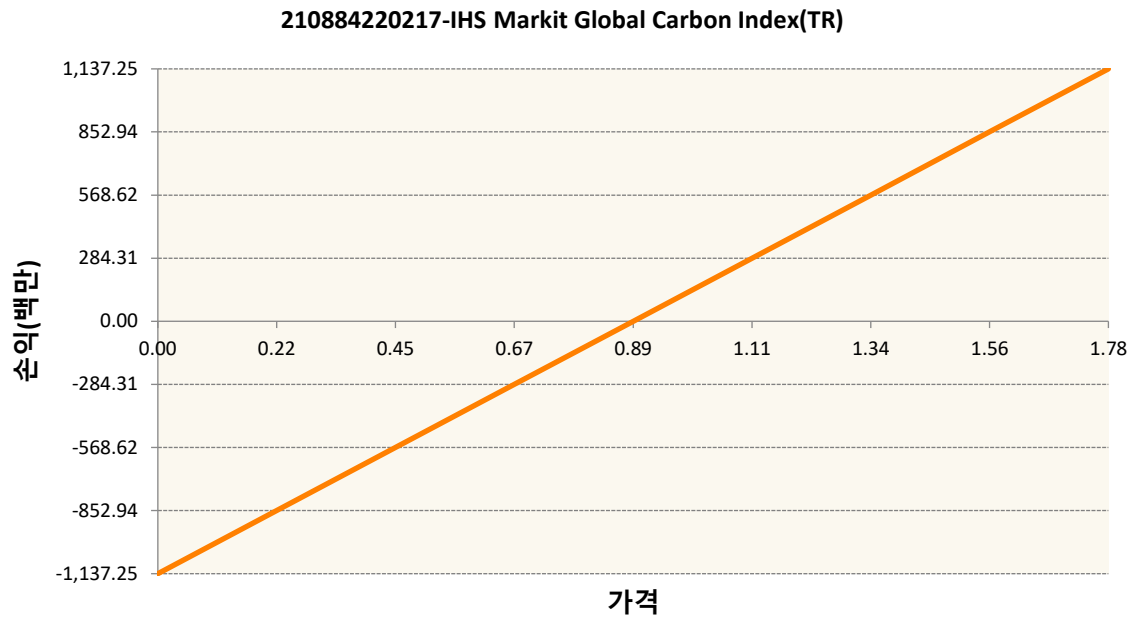
2. 만기시점의 손익구조

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)		3,186
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		91
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		91
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		91

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6,334

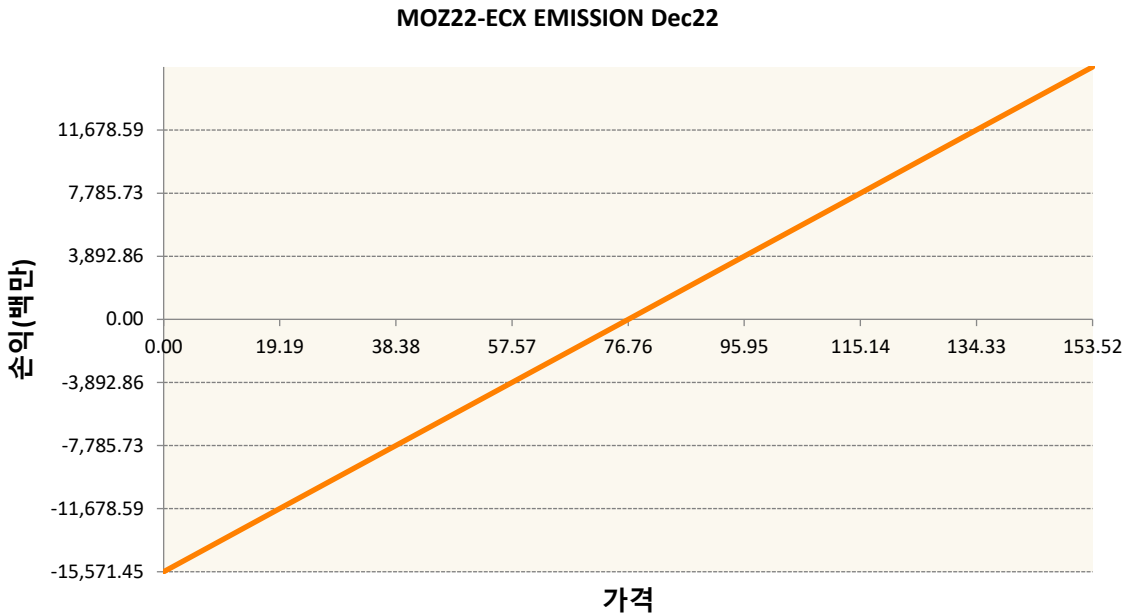
공시일	2022-03-15
기준일	2022-03-14

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	15,571	0	15,571	
누계	통화	선도	0	8,297	-8,297	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213C2R	KRW/EUR 28-03-22E		664
MOZ22	ECX EMISSION Dec22		1,246

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,344

공시일	2022-03-15
기준일	2022-03-14

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)

43

공시일	2022-03-15
기준일	2022-03-14

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)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	13

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

(단위:백만원)

69

공시일 2022-03-15

기준일 2022-03-14

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

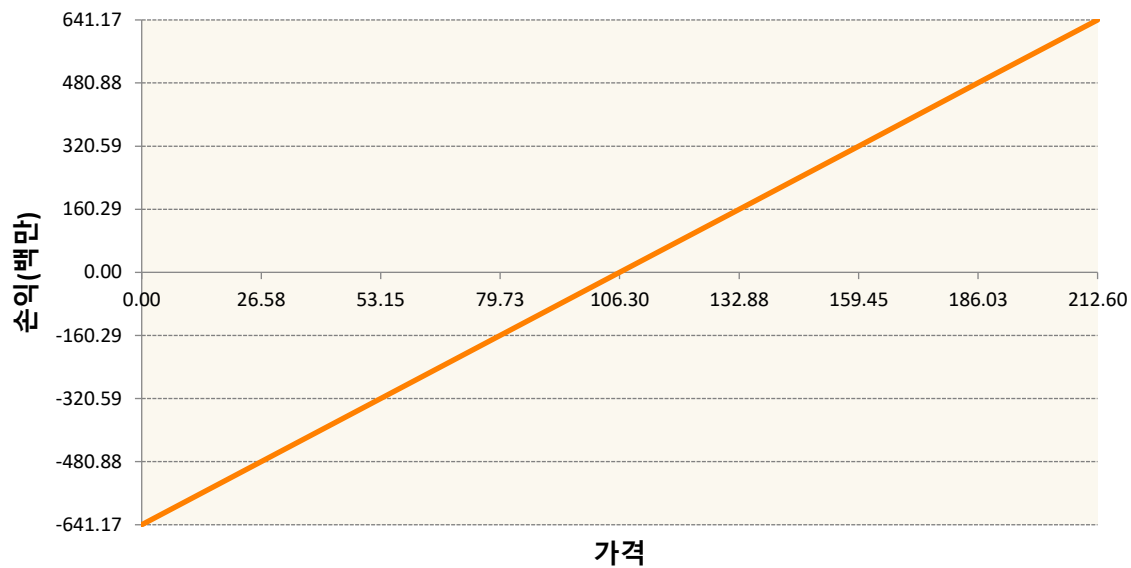
1. 계약금액

(단위:백만원)

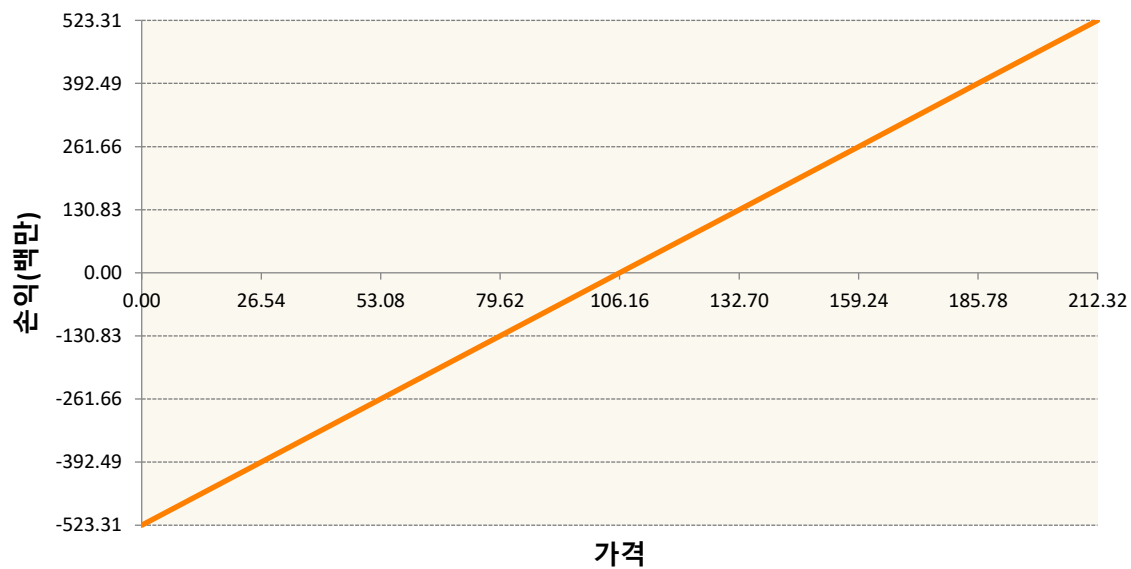
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,423	559	1,864	

2. 만기시점의 손익구조

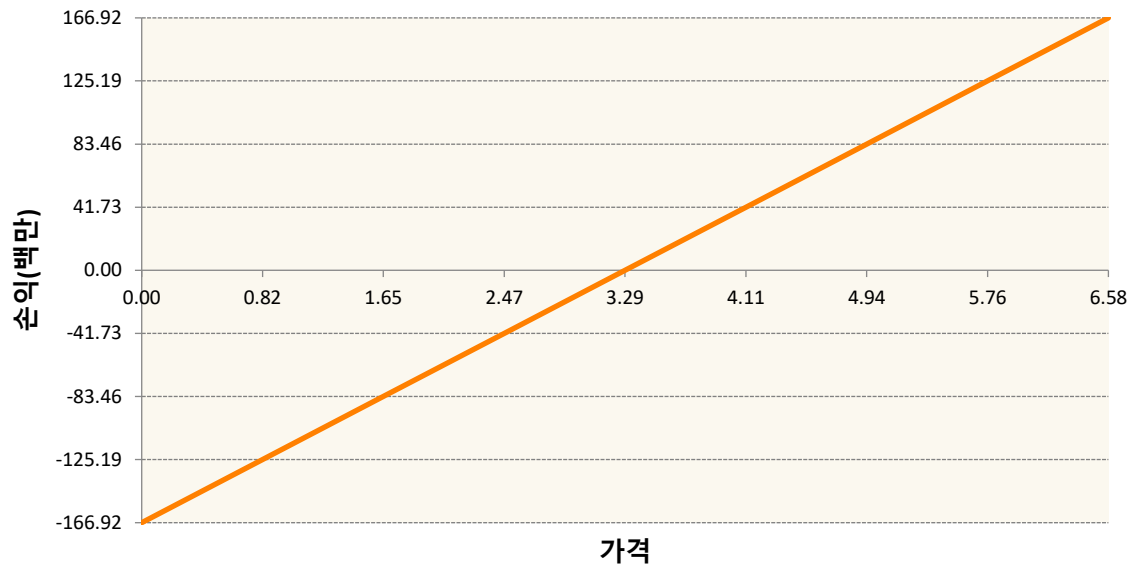
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



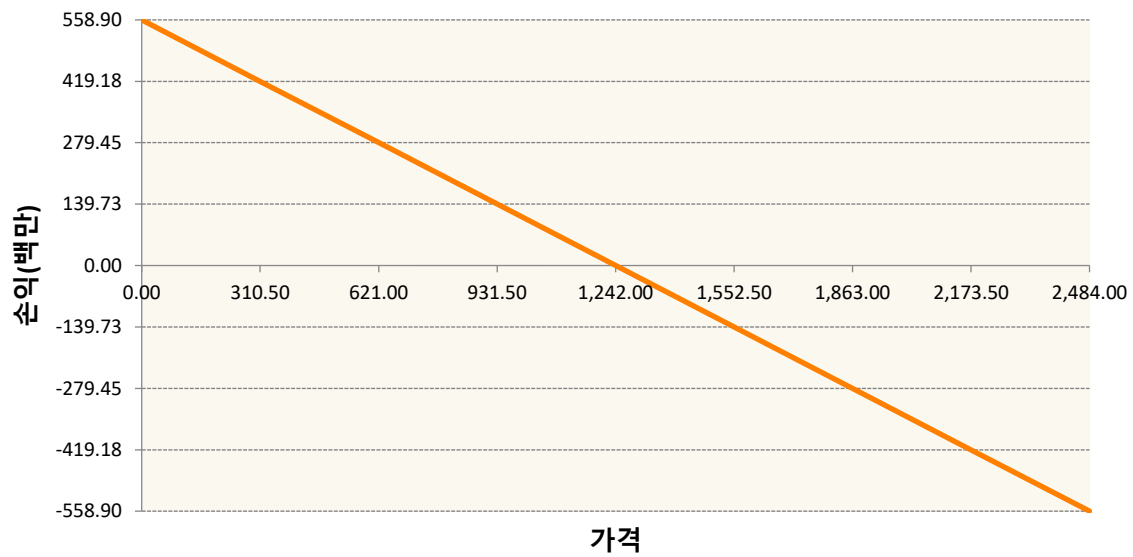
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



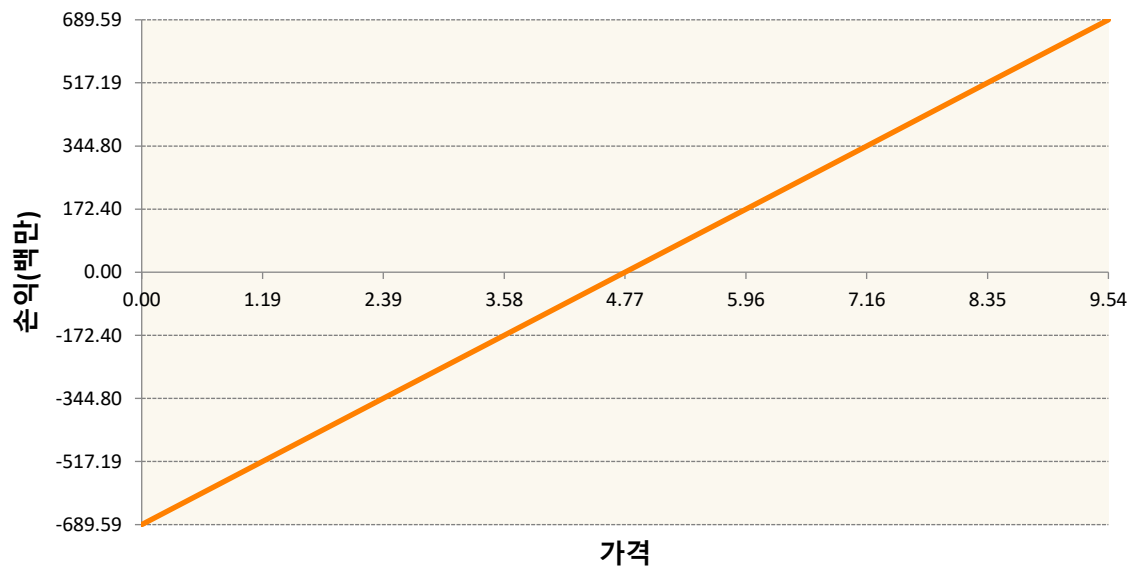
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

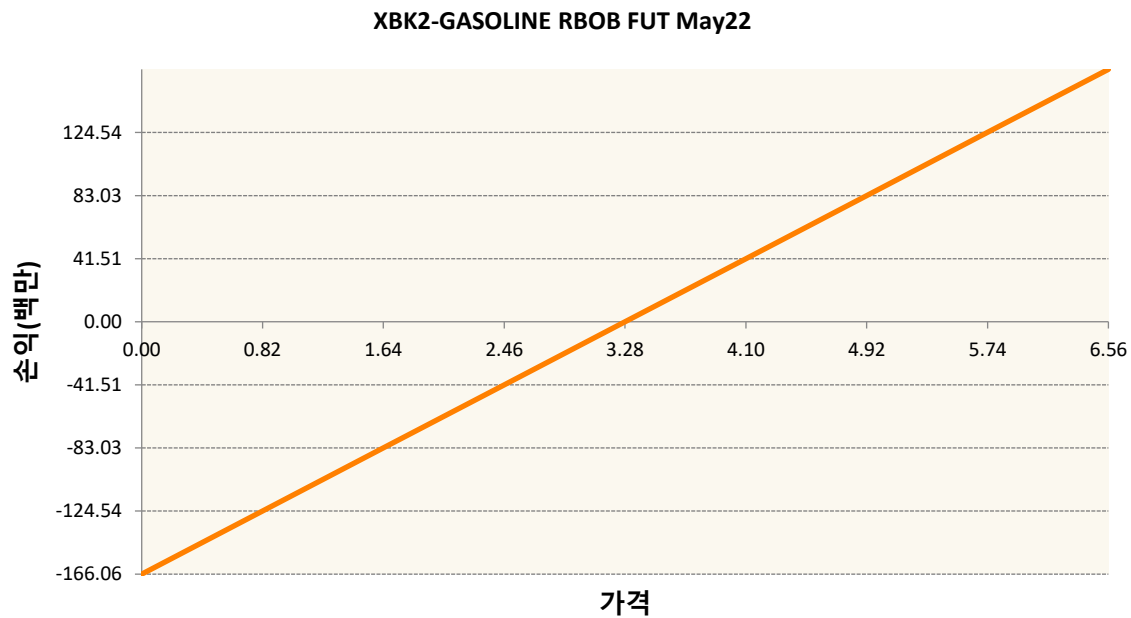
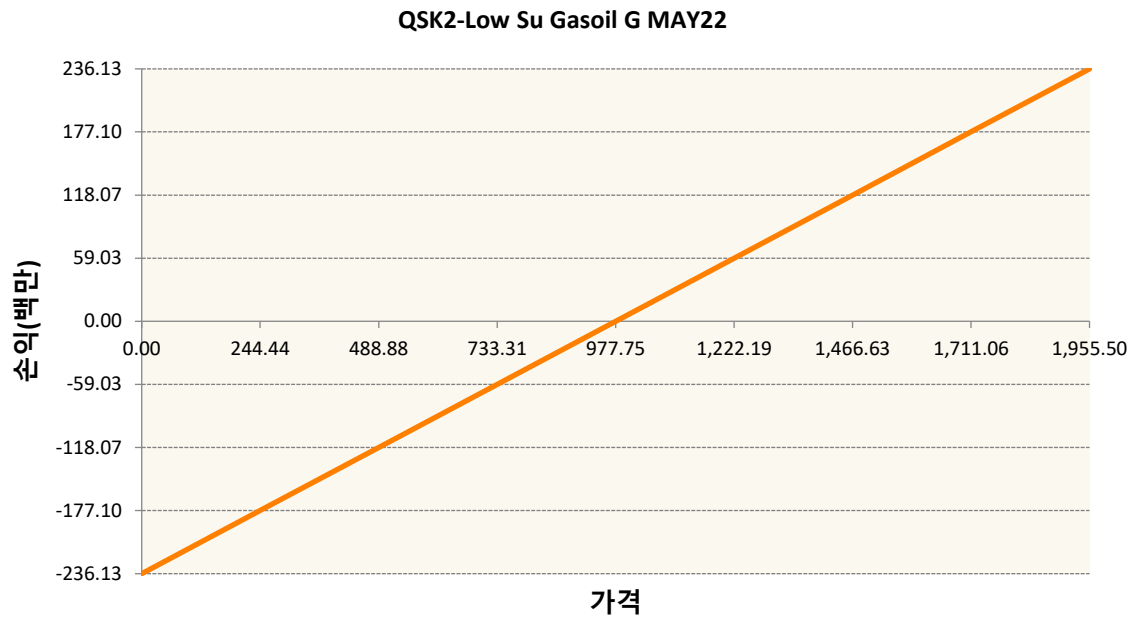


KR4175S30005-2022-03 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		51
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		42
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		13
KR4175S300 2022-03 달러선물			45
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		55
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		19
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		523