

공시일 2022-03-21

기준일 2022-03-18

포커스농산물모(채권-파생형)

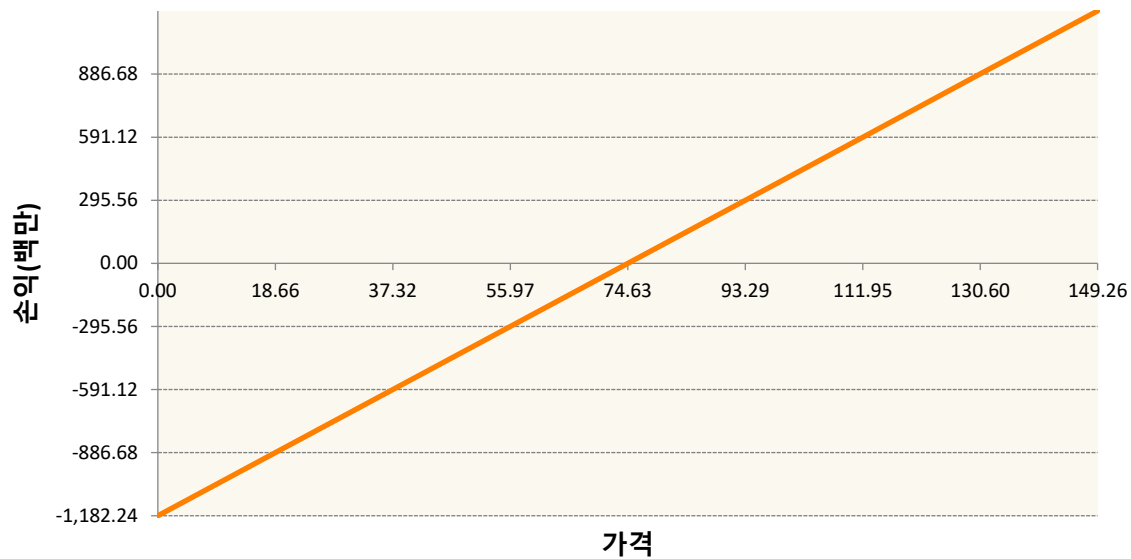
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

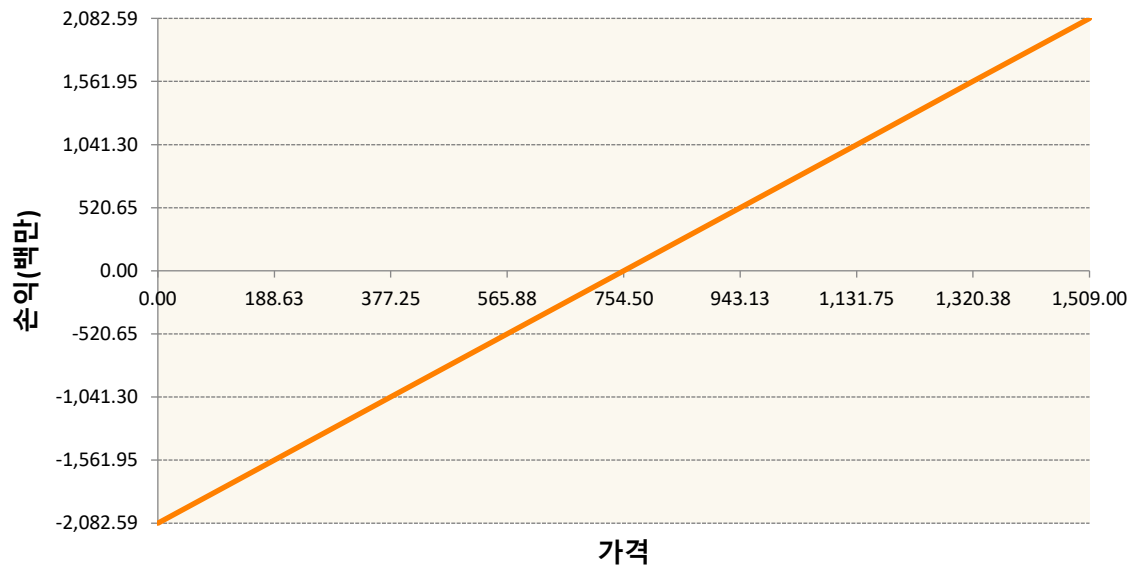
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,607	1,571	9,036	

2. 만기시점의 손익구조

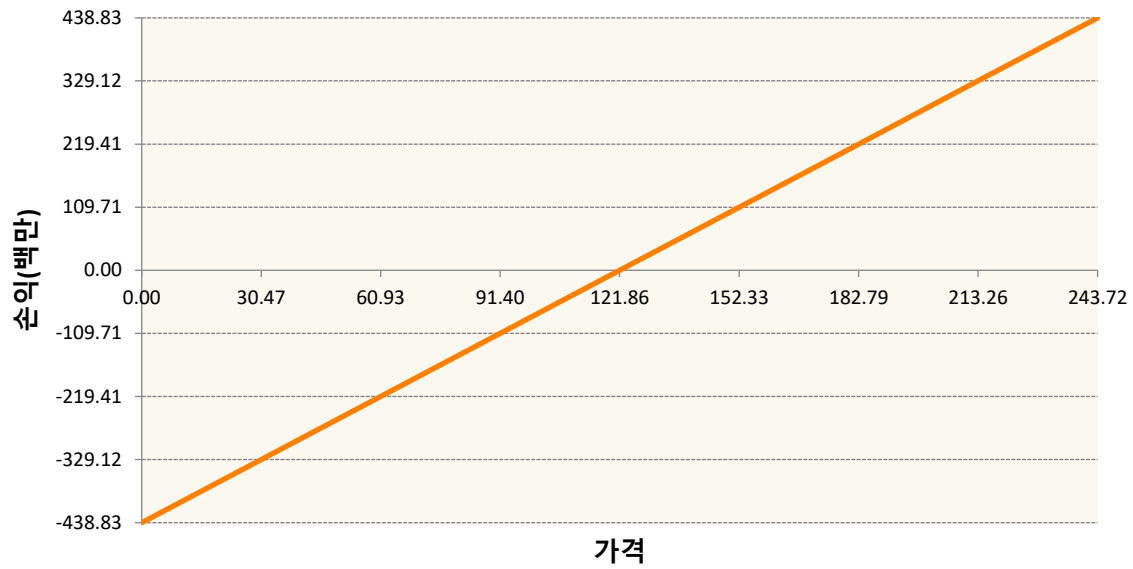
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



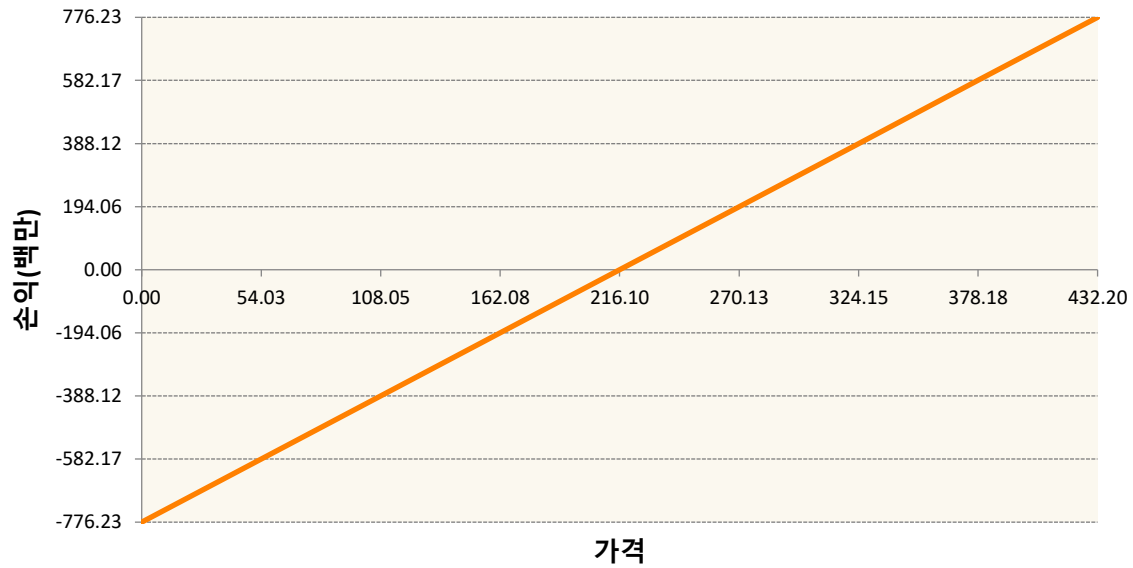
CK2-CORN FUTURE May22



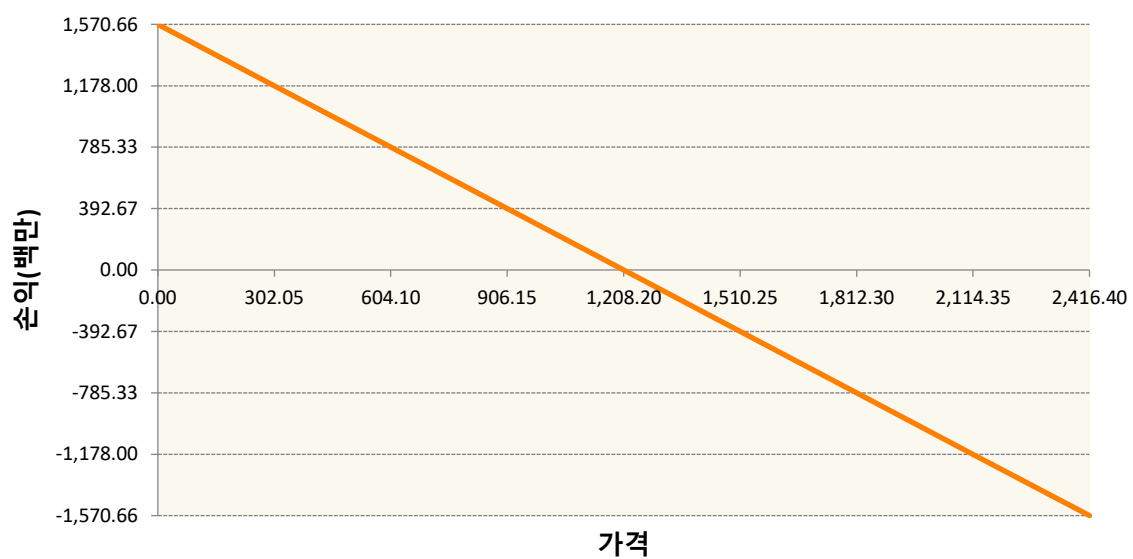
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



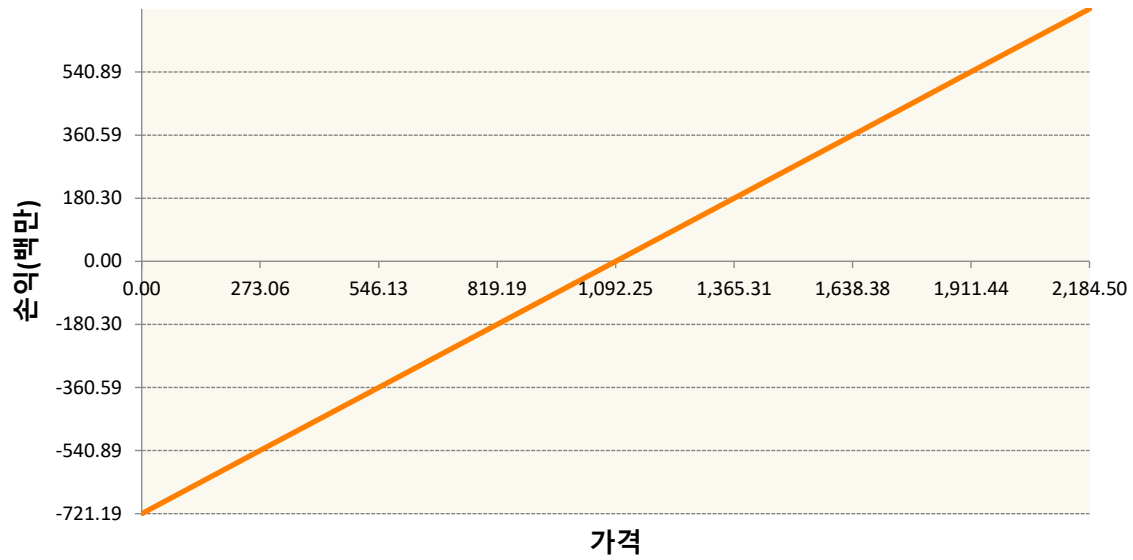
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



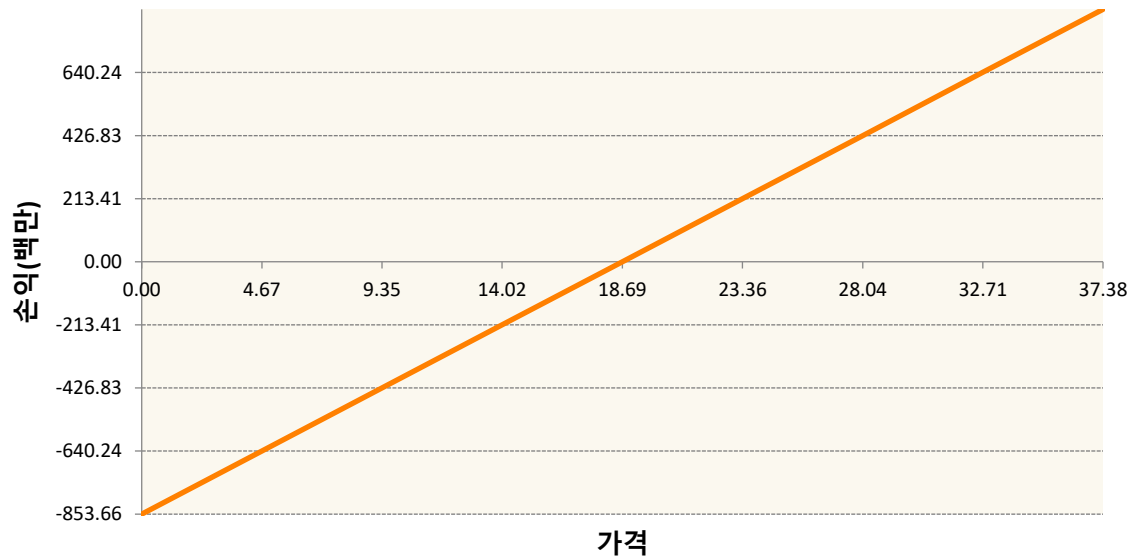
KR4175S40004-2022-04 달러선물



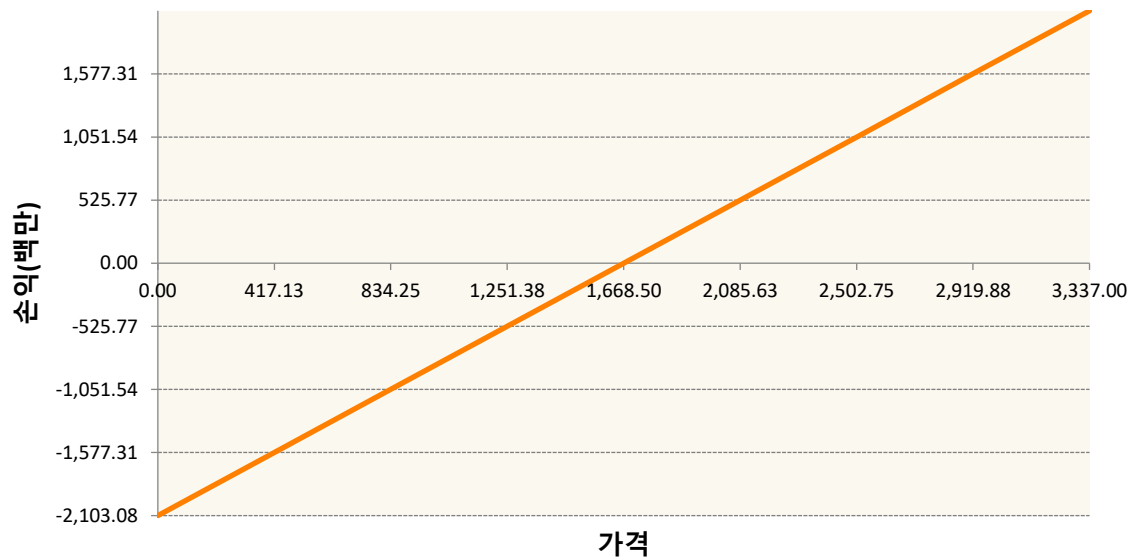
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22

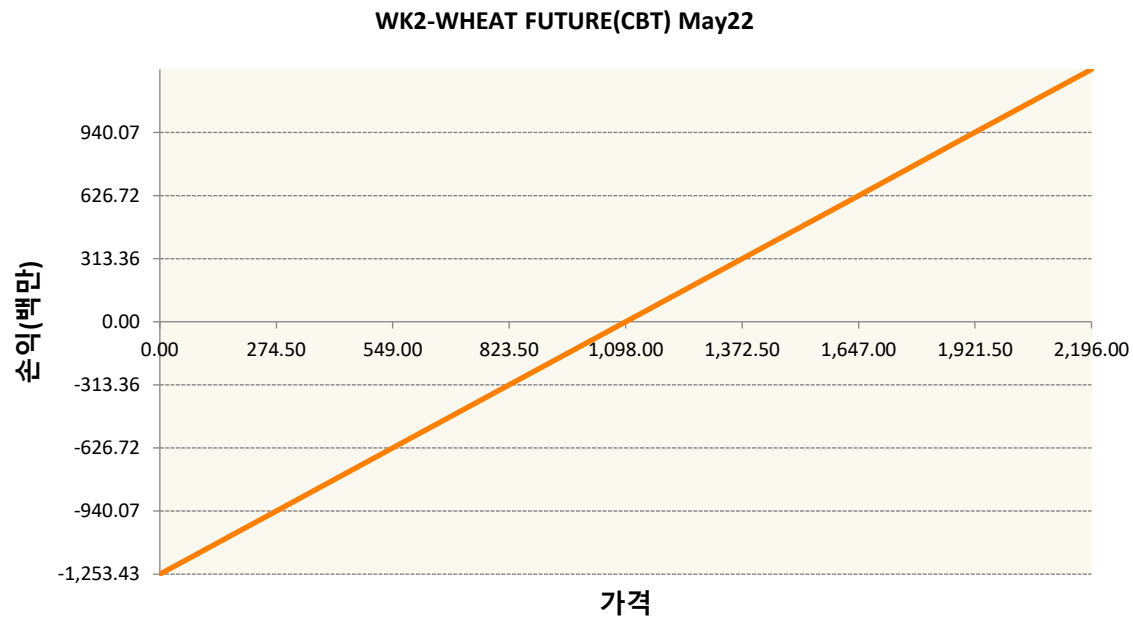
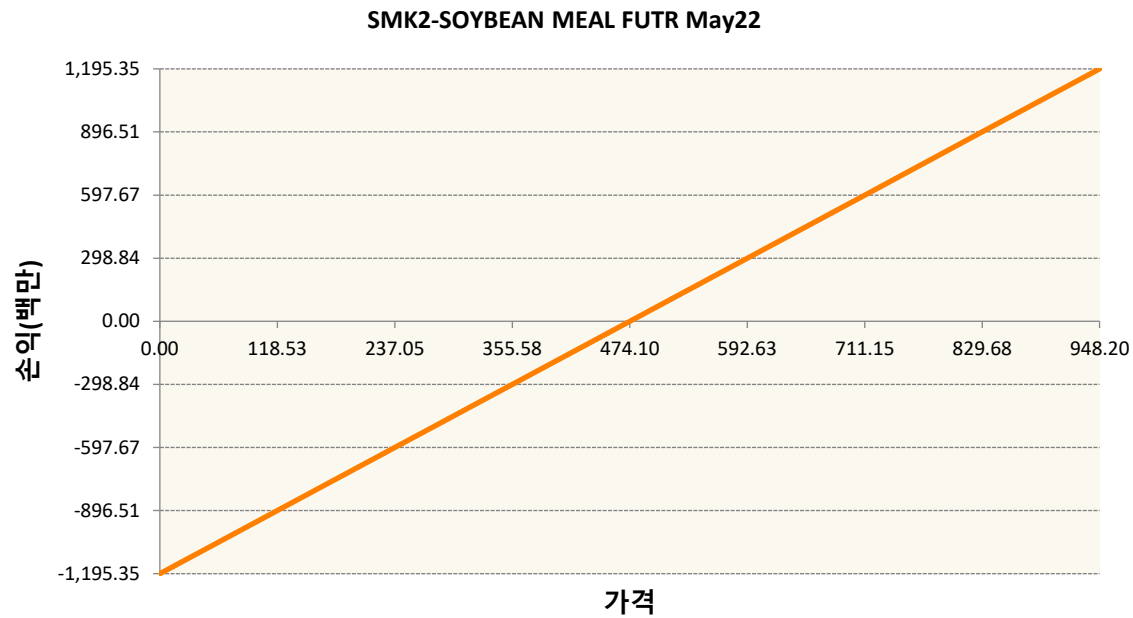


SBK2-Sugar May22



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	2022-03-21
기준일	2022-03-18

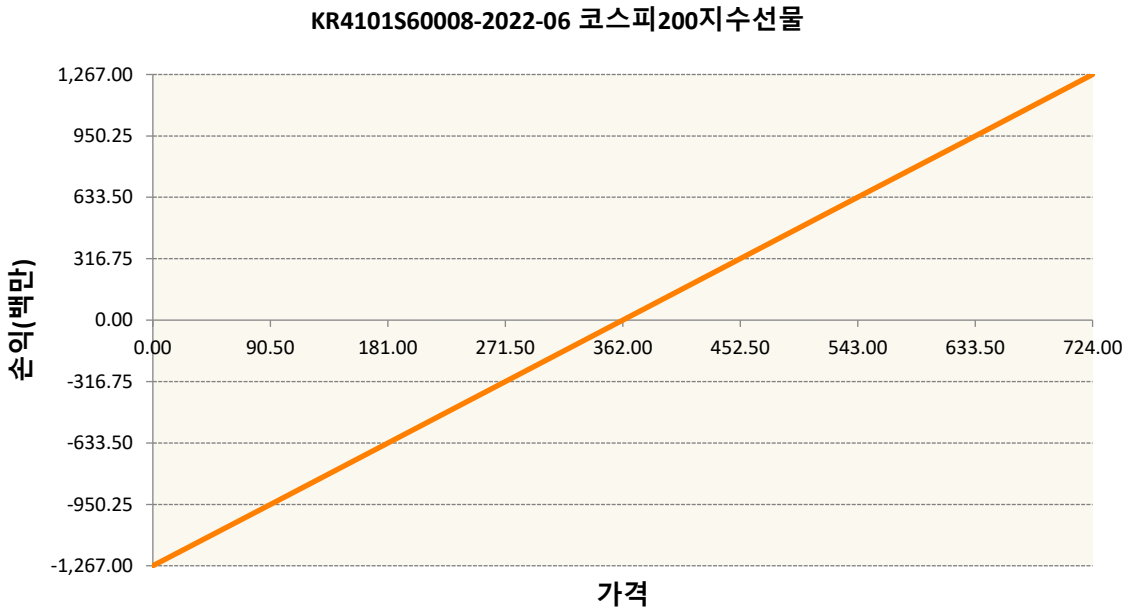
스마트인덱스모

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	1,267	0	1,267	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				101
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-5.33%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	34	34	34	34	34	34	34
5.33%	68	68	68	68	68	68	68
8.00%	101	101	101	101	101	101	101

공시일	2022-03-21
기준일	2022-03-18

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

142

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

91

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-03-21
기준일	2022-03-18

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	388
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

399

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-03-21
기준일	2022-03-18

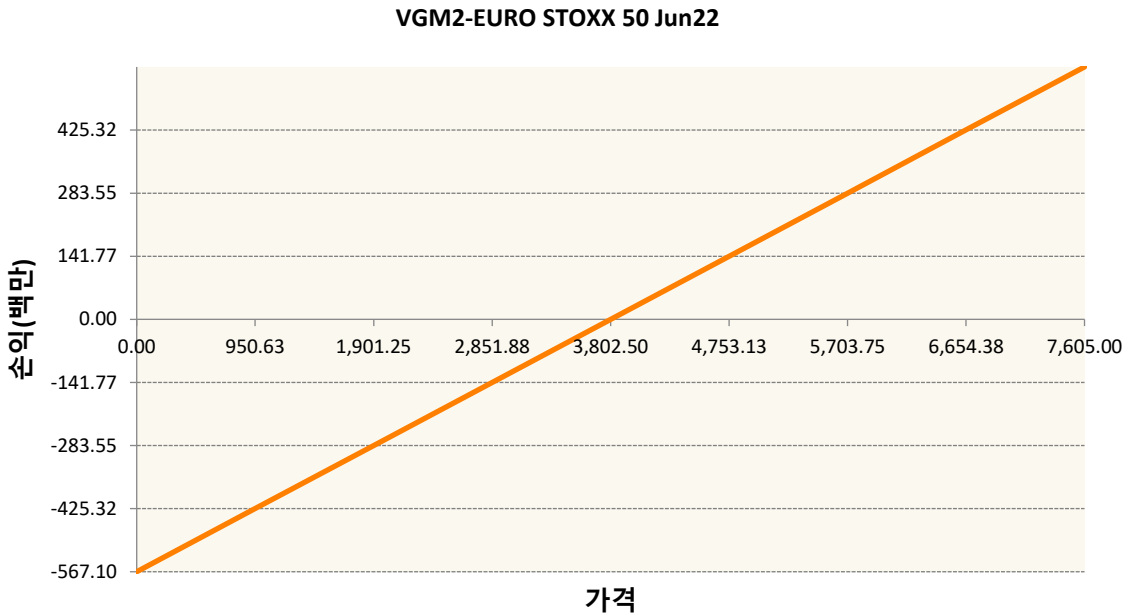
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	567	0	567	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2	EURO STOXX 50 Jun22	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

44

공시일 2022-03-21

기준일 2022-03-18

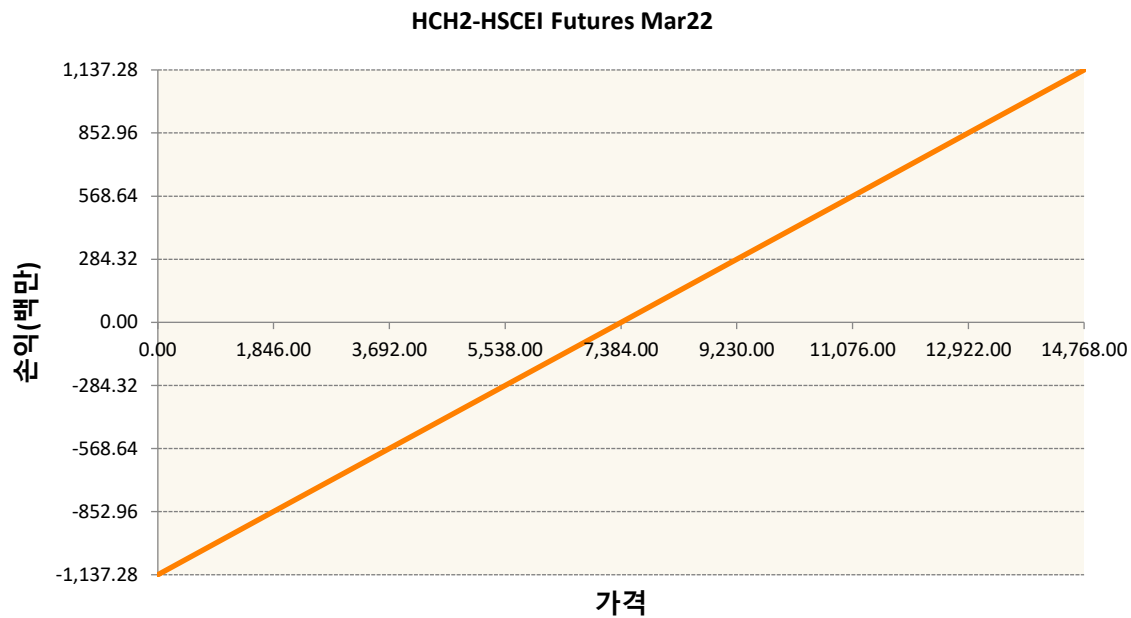
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,137	0	1,137	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2

HSCEI Futures Mar22

91

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

(단위:백만원)

119

공시일 2022-03-21

기준일 2022-03-18

커버드콜모(주식혼합-파생형)

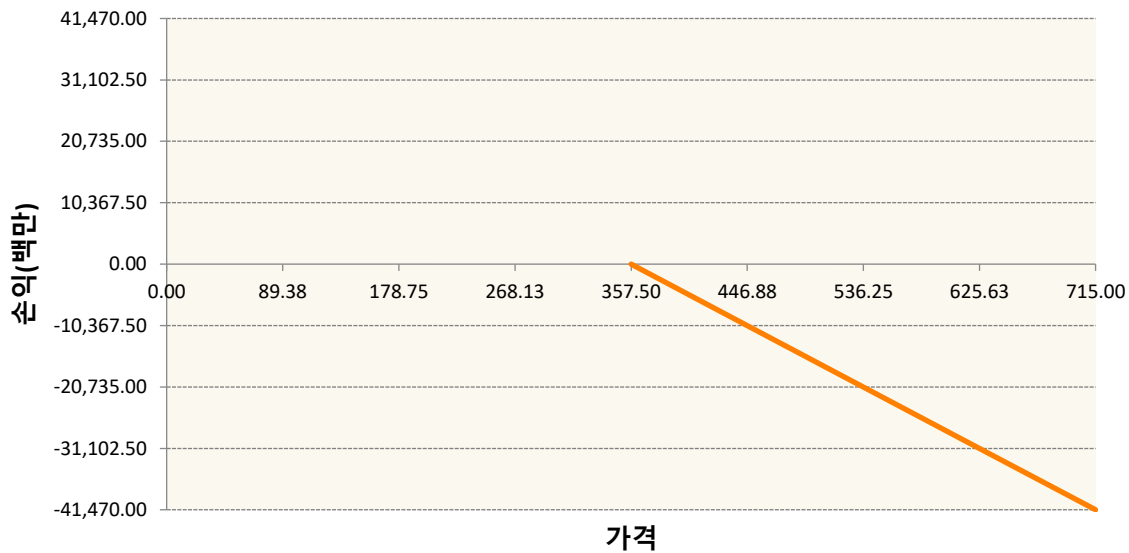
1. 계약금액

(단위:백만원)

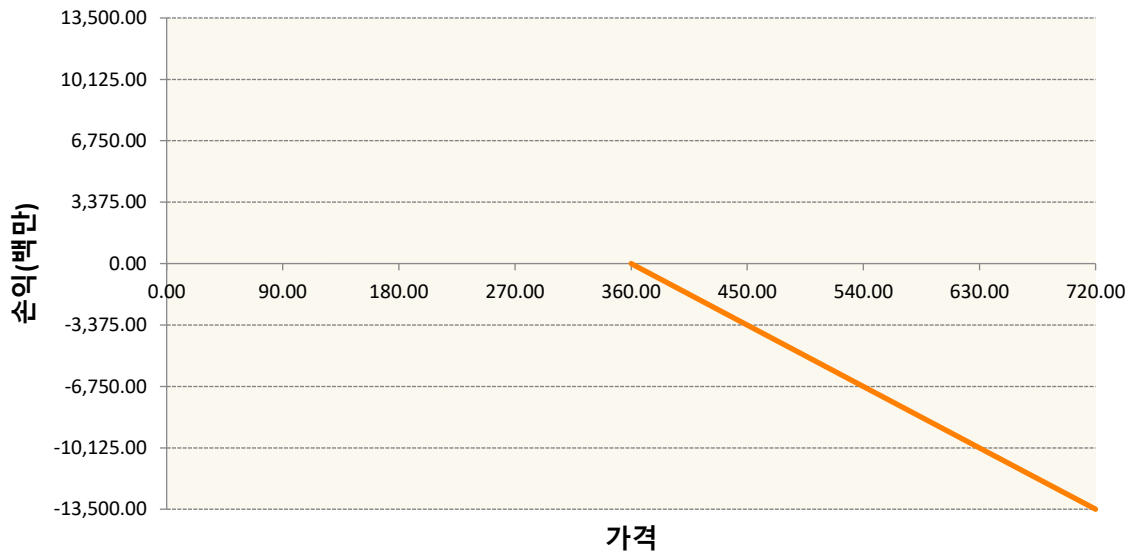
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	176	0	176	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,410	-66,410	장내

2. 만기시점의 손익구조

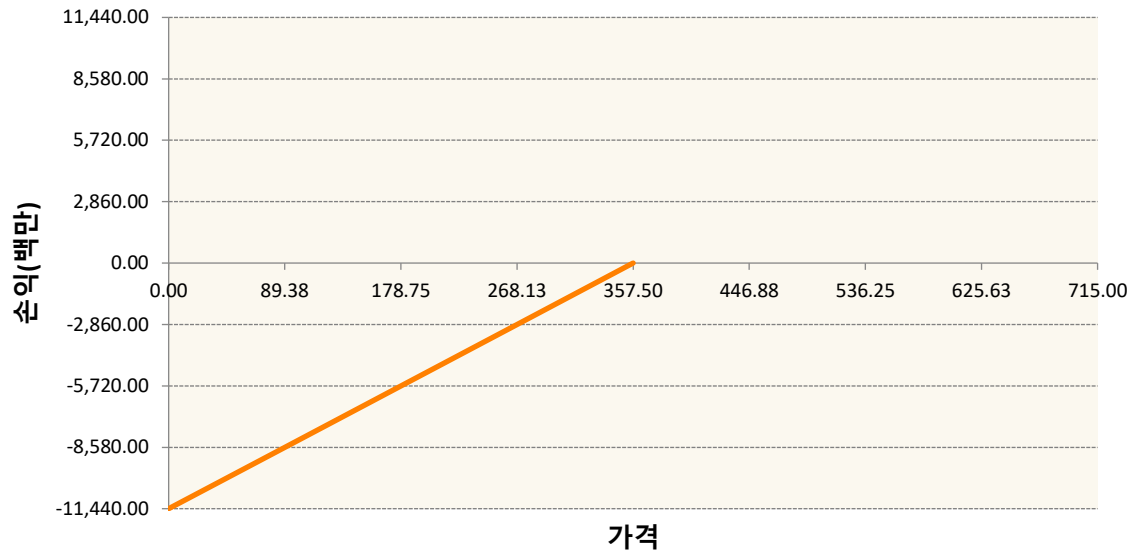
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572			2022-04 콜357.5				2,705
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,545	1,477	1,402	1,321	1,236	1,147	1,056
-5.33%	1,315	1,218	1,117	1,014	909	803	695
-2.67%	926	810	693	577	459	342	225
0%	355	237	119	0	-119	-238	-357
2.67%	-392	-495	-601	-710	-821	-933	-1,047
5.33%	-1,283	-1,362	-1,447	-1,538	-1,633	-1,732	-1,834
8.00%	-2,277	-2,330	-2,391	-2,461	-2,537	-2,619	-2,705
KR4201S43606			2022-04 콜360				852
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	462	442	420	395	369	342	314
-5.33%	398	368	337	305	273	239	205
-2.67%	286	249	212	175	137	100	62
0%	117	78	39	0	-39	-78	-117
2.67%	-111	-146	-182	-219	-256	-293	-331
5.33%	-387	-415	-445	-477	-509	-543	-577
8.00%	-701	-720	-743	-767	-794	-822	-852
KR4301S43570			2022-04 풋357.5				648
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-584	-591	-600	-610	-622	-634	-648
-5.33%	-310	-325	-341	-358	-375	-394	-412
-2.67%	-87	-108	-130	-152	-173	-195	-217
0%	66	44	22	0	-22	-45	-67

2.67%	150	134	117	99	80	61	41
5.33%	187	178	168	156	142	128	112
8.00%	200	196	191	184	176	166	156

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

(단위:백만원)

3,934

공시일 2022-03-21

기준일 2022-03-18

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

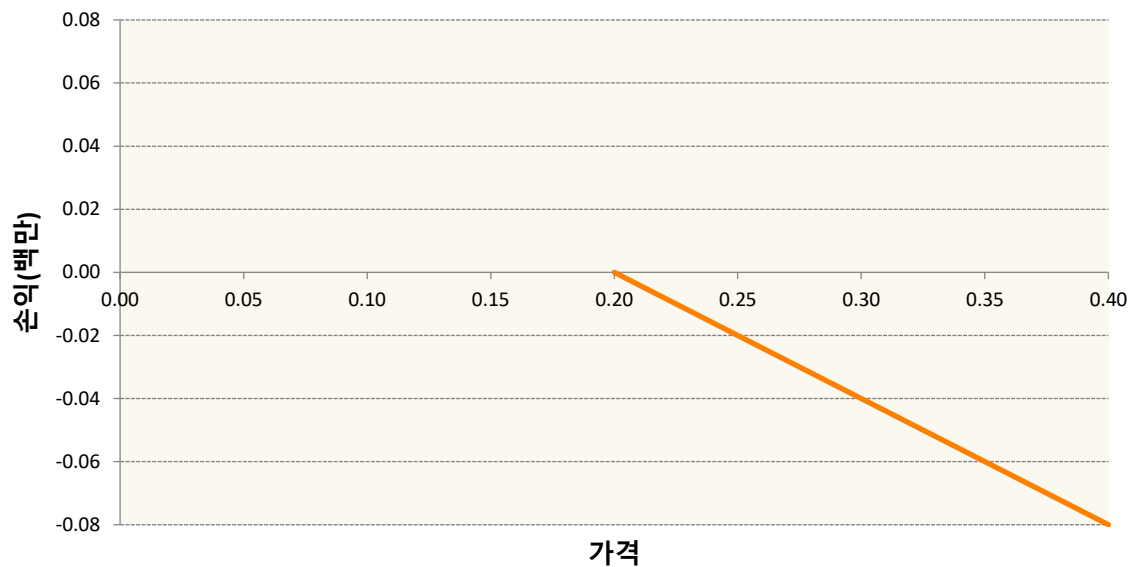
1. 계약금액

(단위:백만원)

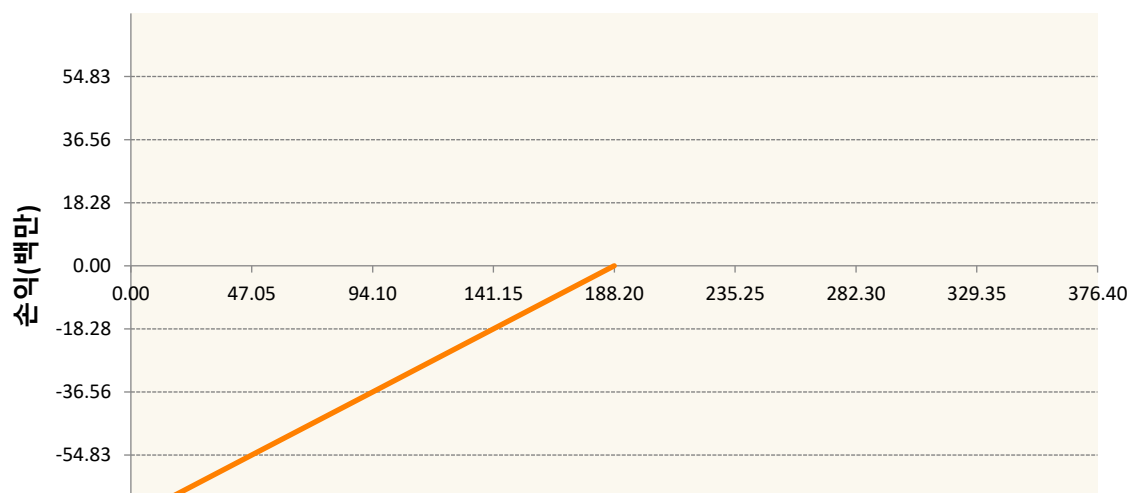
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	73	-73	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,009	-2,009	장외

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		0.26
FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E		21
FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E		32
FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E		64
FXW213C3A KRW/EUR 22-04-22E		43
OESXH2-C4C EURO STOXX 50		0.01
OESXH2-P40 EURO STOXX 50		6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	84

공시일 2022-03-21

기준일 2022-03-18

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

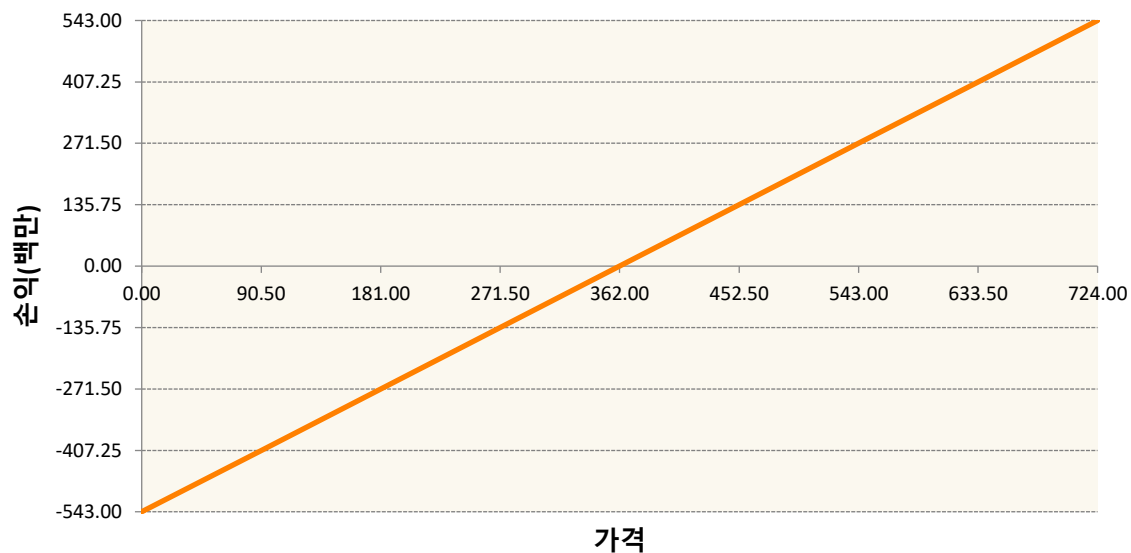
1. 계약금액

(단위:백만원)

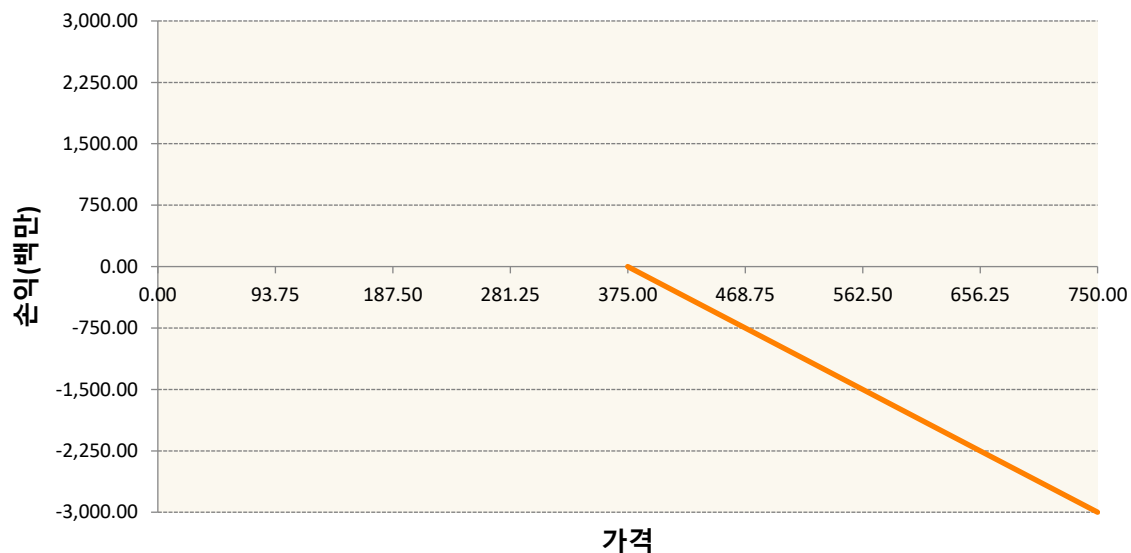
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	543	0	543	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

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%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-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%	29	29	29	29	29	29	29	
8.00%	43	43	43	43	43	43	43	
KR4201S43754				2022-04 콜375				148
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	56	54	52	49	46	42	37
-5.33%	52	48	44	39	34	29	23
-2.67%	41	36	30	24	17	10	3
0%	23	15	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-7	-15	-24	-32	-41	-49	-58
5.33%	-48	-57	-65	-74	-82	-91	-100
8.00%	-101	-109	-116	-124	-132	-140	-148

KR4201S43770

2022-04 콜377.5

80

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	26	25	23	21	19
-5.33%	26	25	22	20	17	15	12
-2.67%	21	19	15	12	9	5	1
0%	12	8	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-3	-7	-12	-17	-22	-26	-31
5.33%	-24	-29	-34	-39	-44	-49	-54
8.00%	-53	-57	-61	-66	-70	-75	-80

KR4301S43570

2022-04 풋357.5

20

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	19	19	19	20	20
-5.33%	10	10	11	11	12	12	13
-2.67%	3	3	4	5	5	6	7
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-5	-4	-4	-3	-3	-2	-1
5.33%	-6	-6	-5	-5	-4	-4	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

240

공시일	2022-03-21
기준일	2022-03-18

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	9,111	0	9,111	

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	2022-03-21
기준일	2022-03-18

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	7,647	0	7,647	

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	2022-03-21
기준일	2022-03-18

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	24,873	0	24,873	
누계	통화	선도	4,227	29,864	-25,637	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E	193
FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E	68
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,196
FXW213C32 USD/KRW 25-03-22E	58
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E	39
FXW213C37 USD/KRW 25-03-22E	48
FXW213C3B USD/KRW 25-03-22E	77
FXW213C3F USD/KRW 25-03-22E	48
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

895

공시일	2022-03-21
기준일	2022-03-18

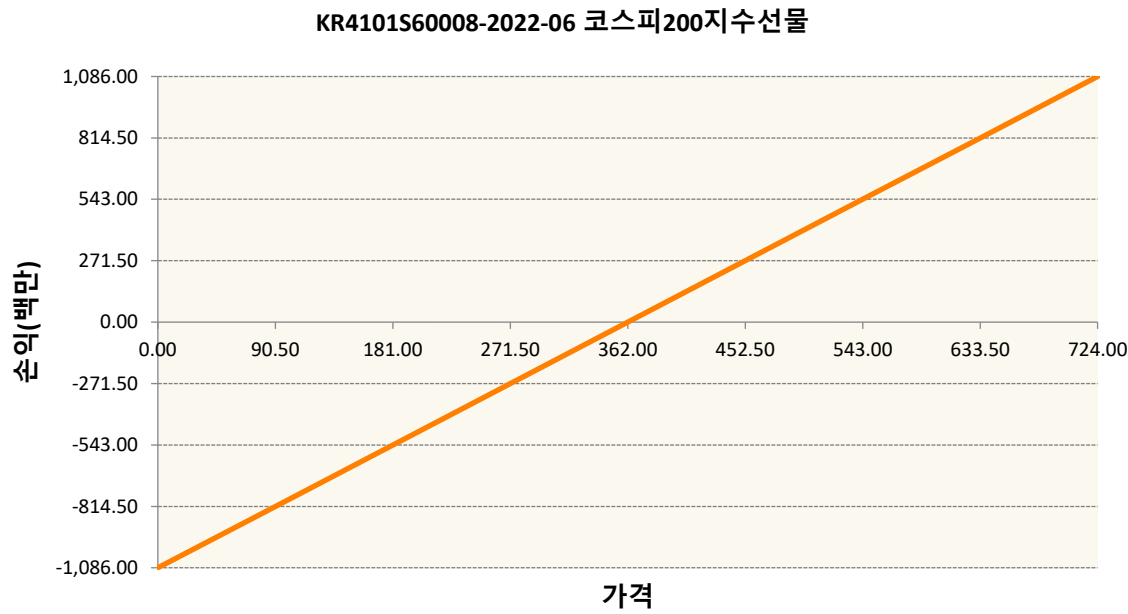
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,086	0	1,086	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

공시일 2022-03-21

기준일 2022-03-18

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

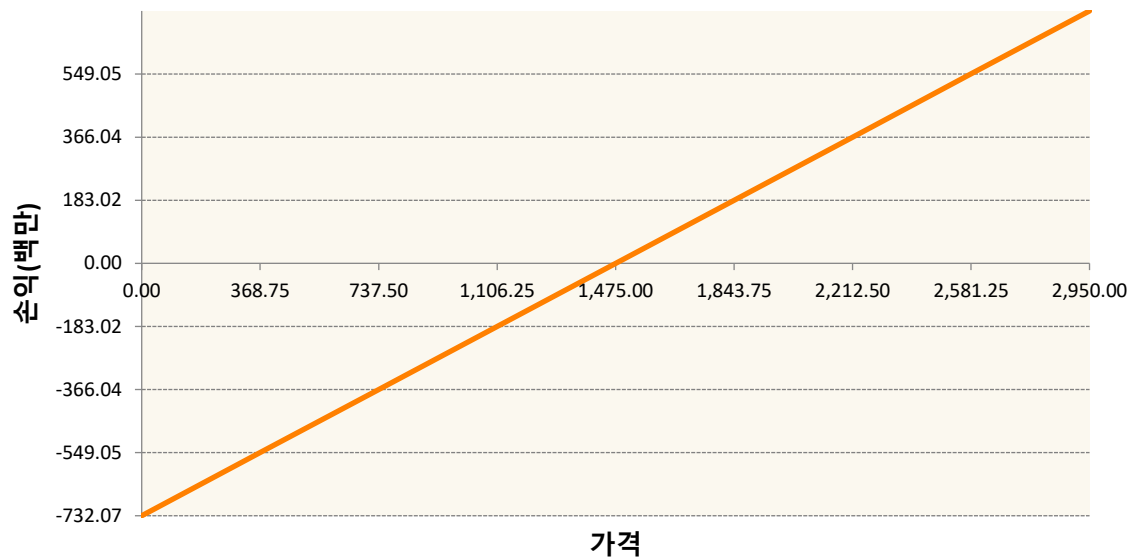
1. 계약금액

(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	732	0	732	
누계	유가증권	스왑	1,831	0	1,831	장외
누계	통화	선도	0	1,179	-1,179	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCJ2-VN30 Index Future Apr22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	146
FXW213C1K·KRW/EUR 22-04-22E	16
FXW213C2P·KRW/EUR 20-05-22E	46
FXW213C3G·KRW/EUR 24-06-22E	32
VNCJ2 VN30 Index Future Apr22	59

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

(단위:백만원)

261

공시일 2022-03-21

기준일 2022-03-18

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

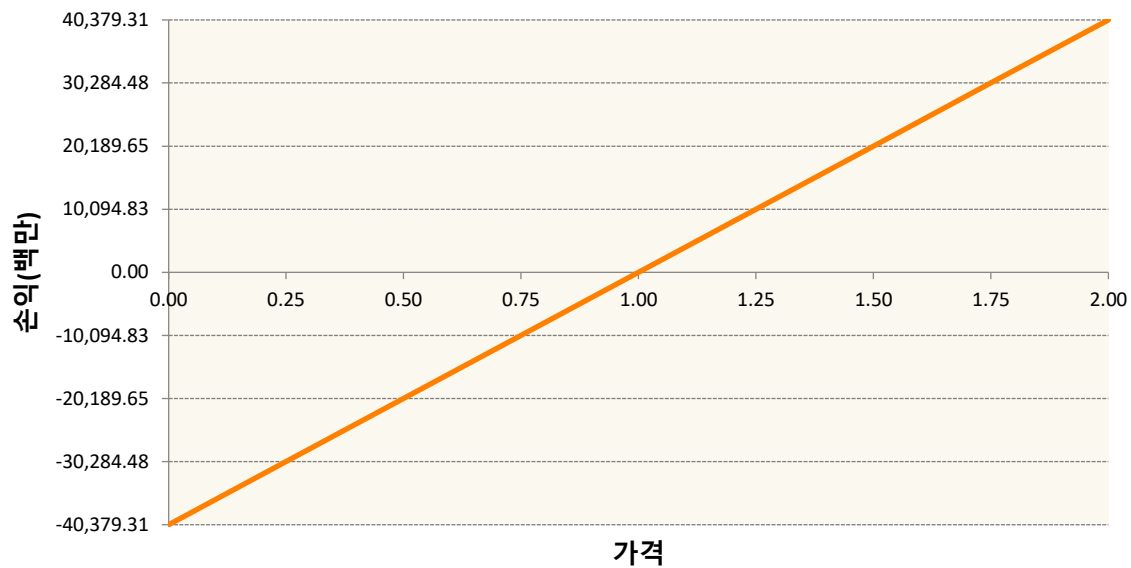
1. 계약금액

(단위:백만원)

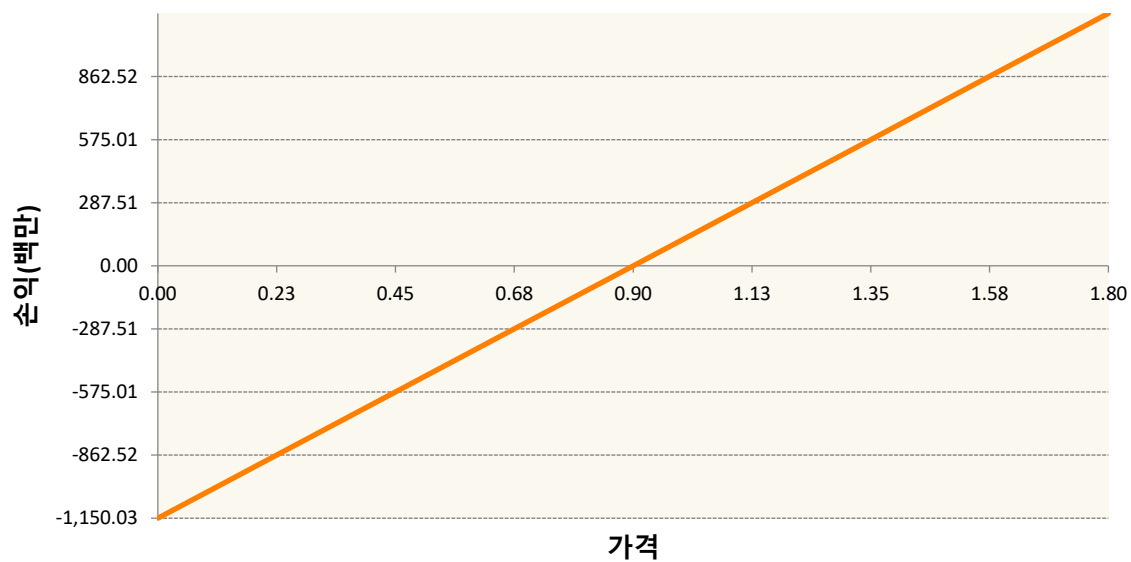
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	43,827	0	43,827	

2. 만기시점의 손익구조

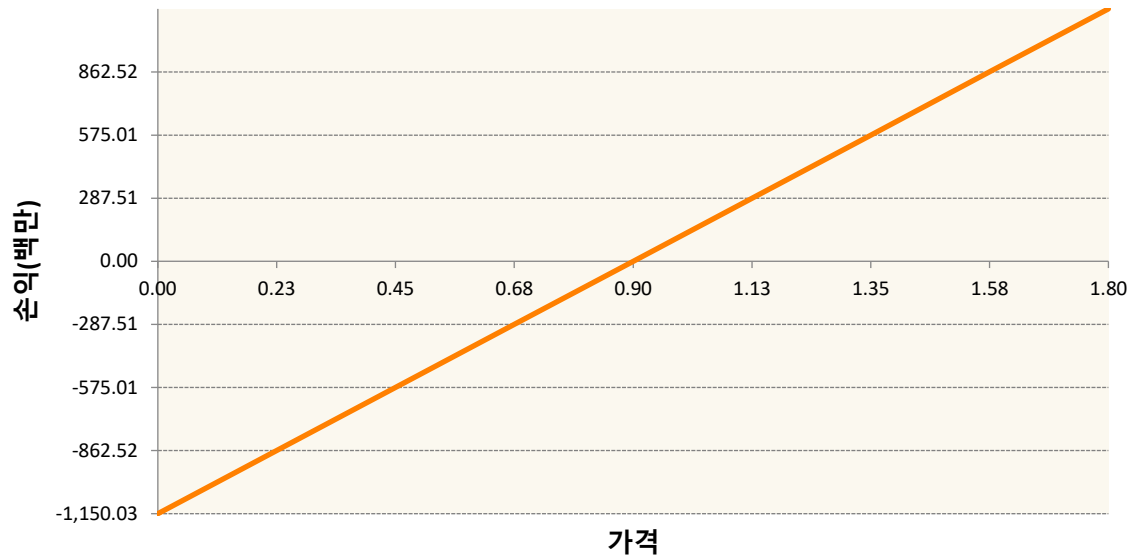
210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



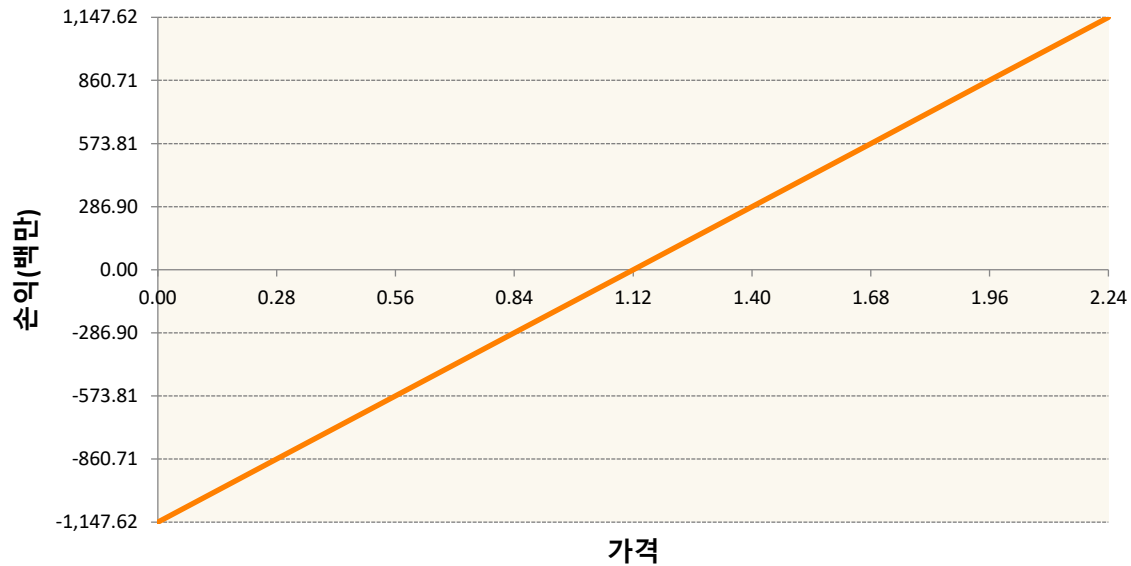
210884220216-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)	3,217
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	92
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	92
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	92

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

(단위:백만원)

6,403

공시일	2022-03-21
기준일	2022-03-18

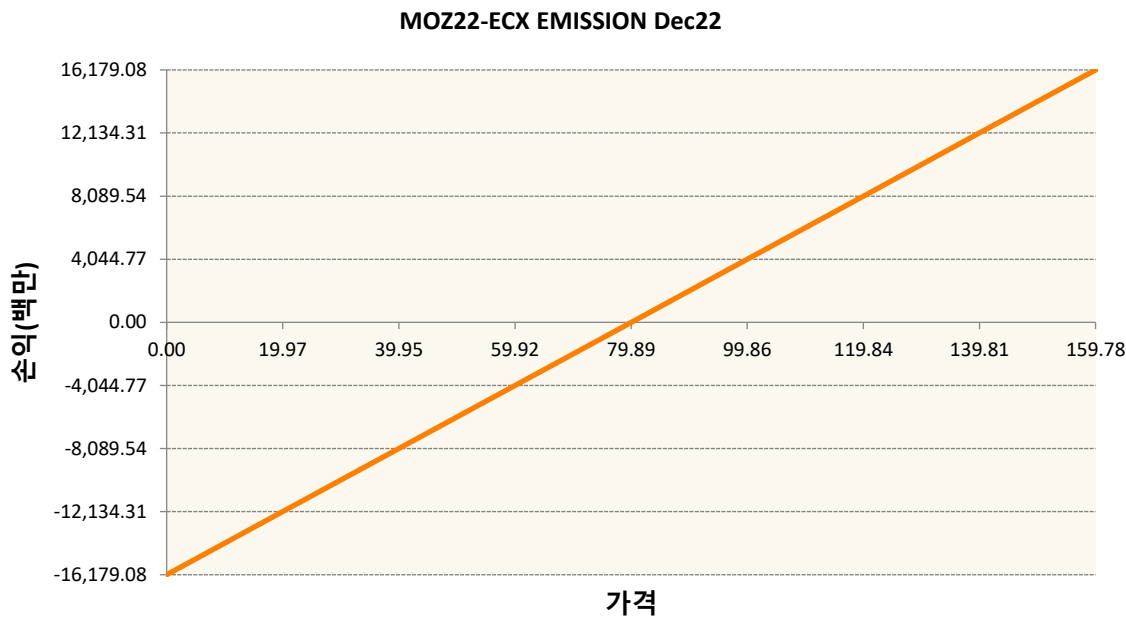
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	16,179	0	16,179	
누계	통화	선도	0	8,195	-8,195	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2R₩ KRW/EUR 28-03-22E	656
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,294

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

(단위:백만원)

3,422

공시일	2022-03-21
기준일	2022-03-18

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)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	18

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

(단위:백만원)

135

공시일	2022-03-21
기준일	2022-03-18

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)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	25
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	22

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

(단위:백만원)

113

공시일 2022-03-21

기준일 2022-03-18

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

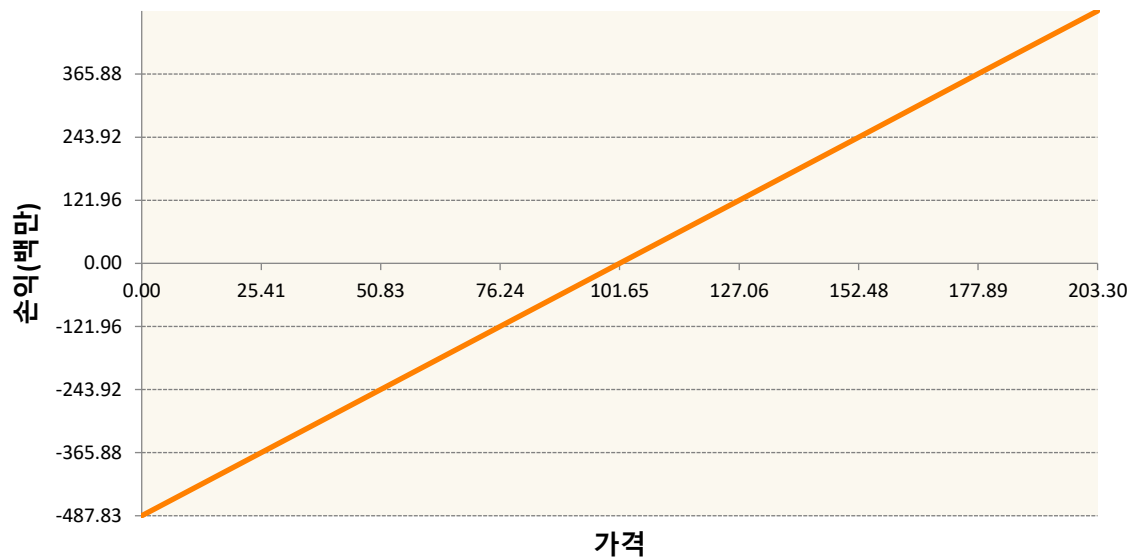
1. 계약금액

(단위:백만원)

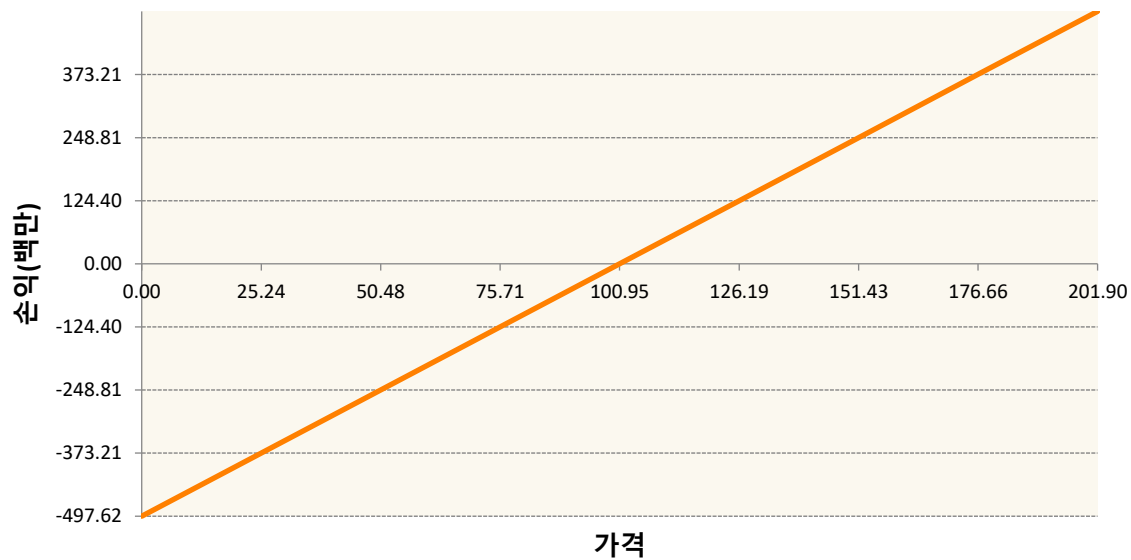
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,214	423	1,791	

2. 만기시점의 손익구조

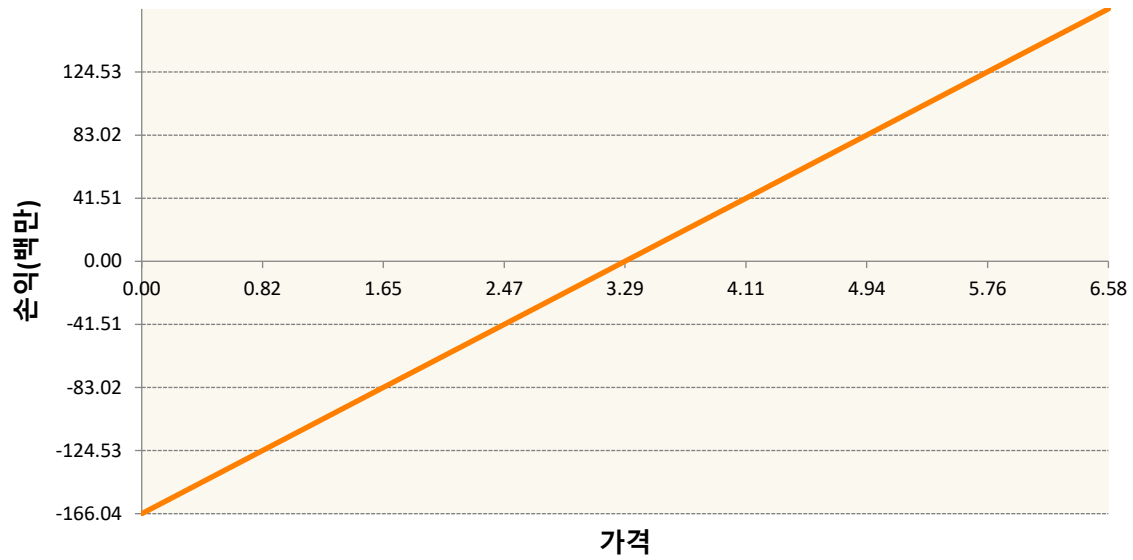
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



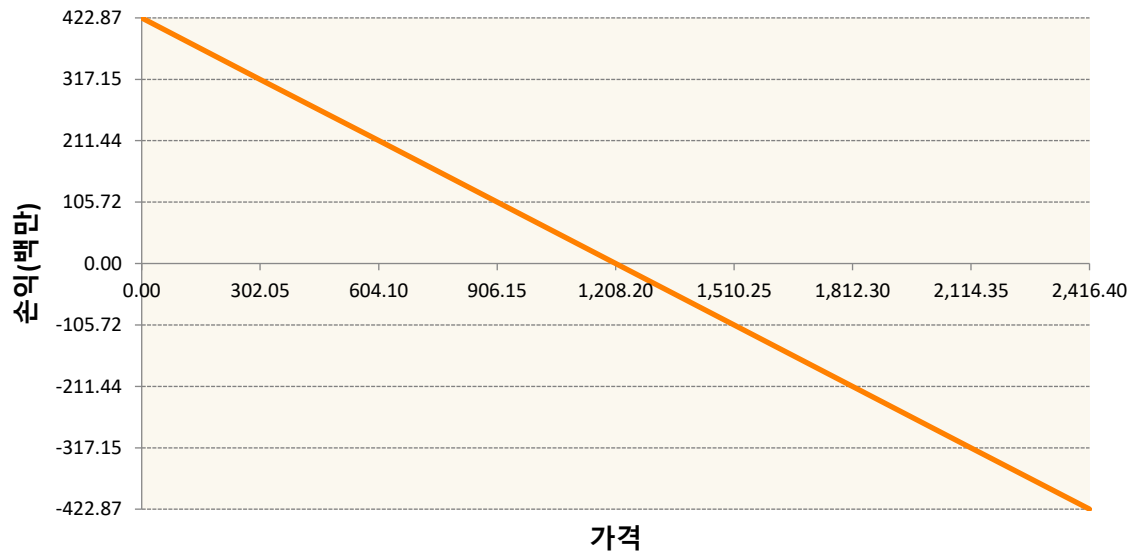
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



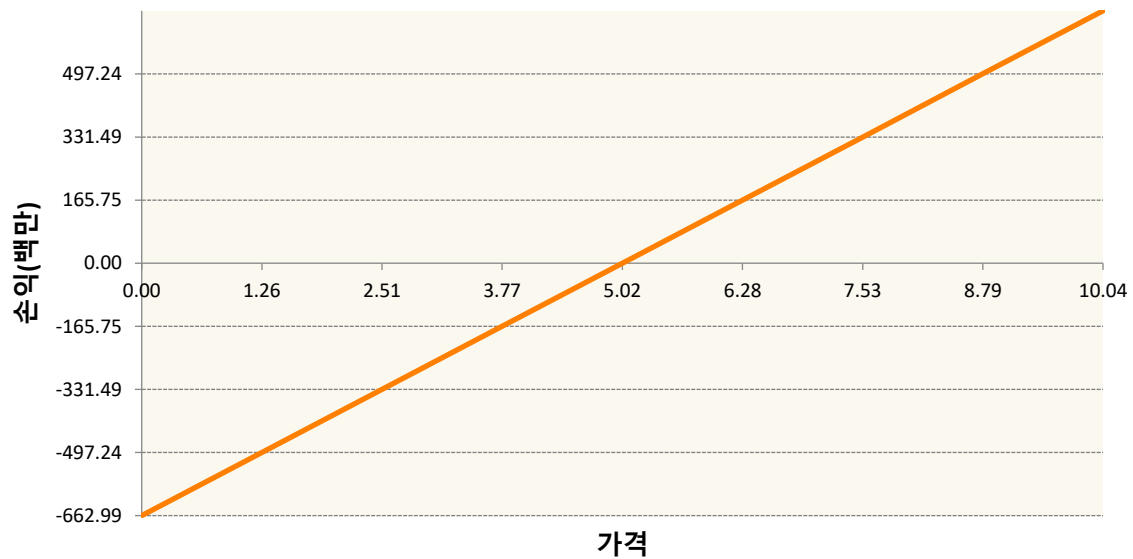
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22



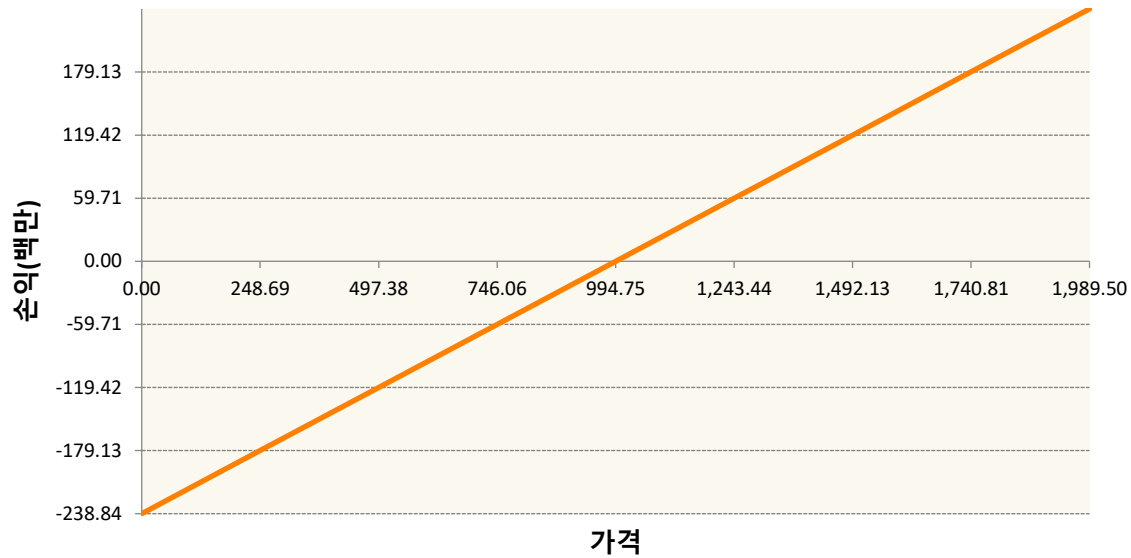
KR4175S40004-2022-04 달러선물



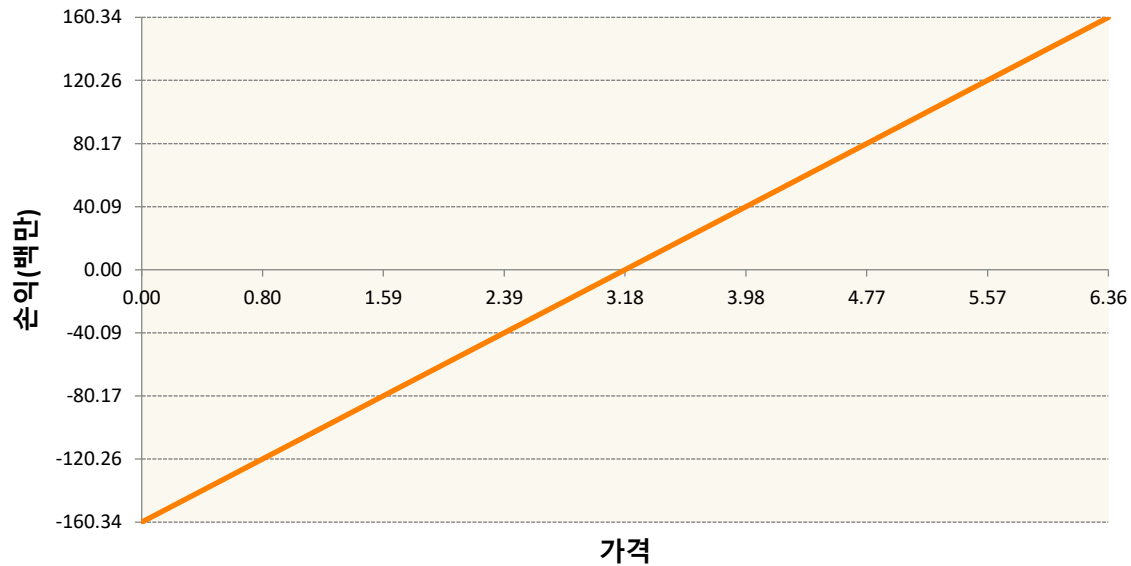
NGK22-NATURAL GAS FUTR May22



QSK2-Low Su Gasoil G MAY22



XBK2-GASOLINE RBOB FUT May22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22	39
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22	40
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22	13
KR4175S400	2022-04 달러선물	34
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22	53
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22	19
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22	13

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

(단위:백만원)

487