

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

포커스농산물모(채권-파생형)

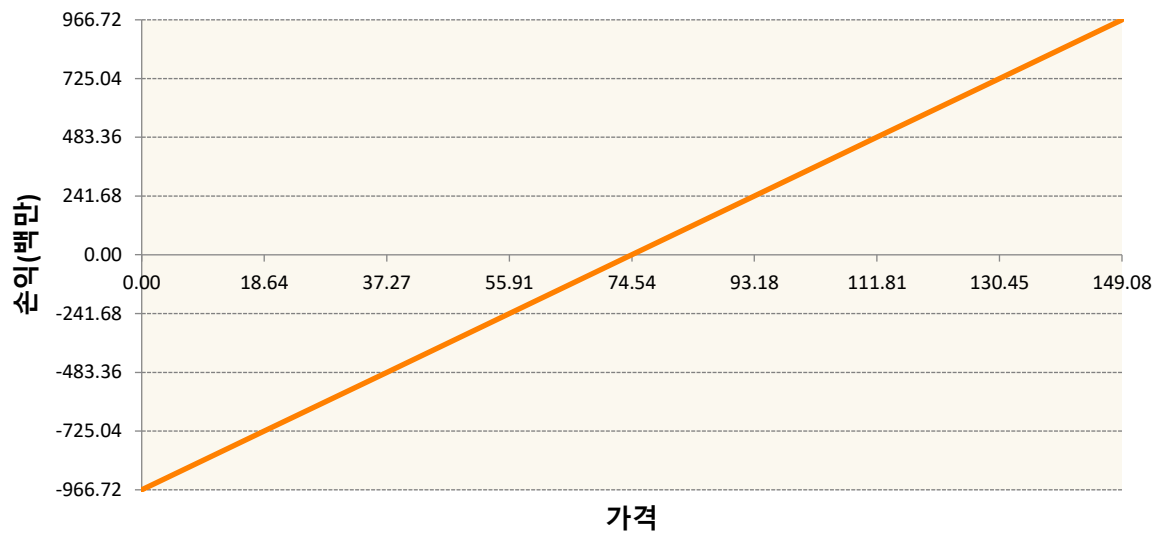
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

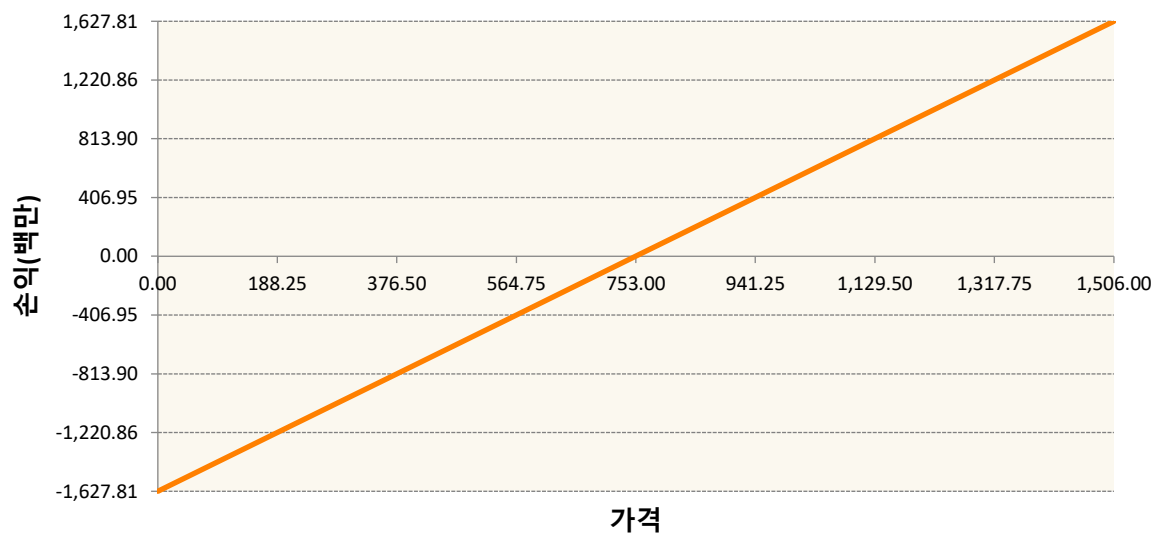
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,501	1,700	6,801	

2. 만기시점의 손익구조

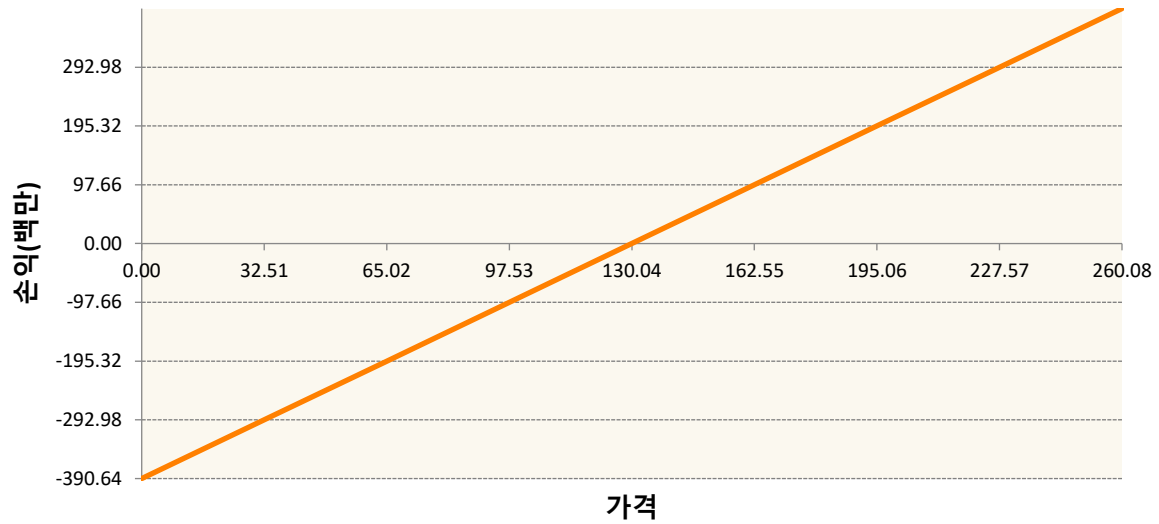
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



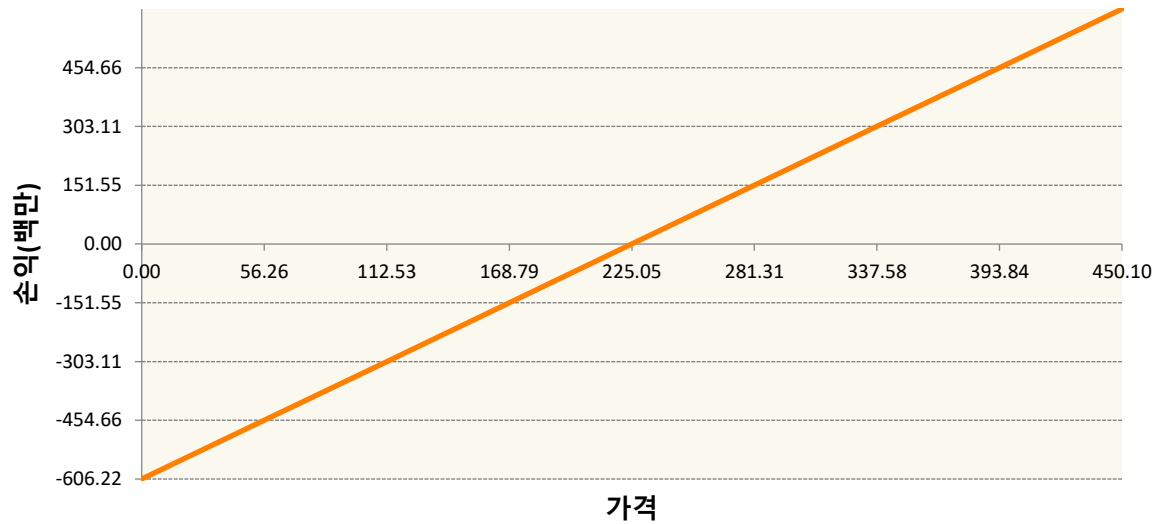
CK2-CORN FUTURE May22



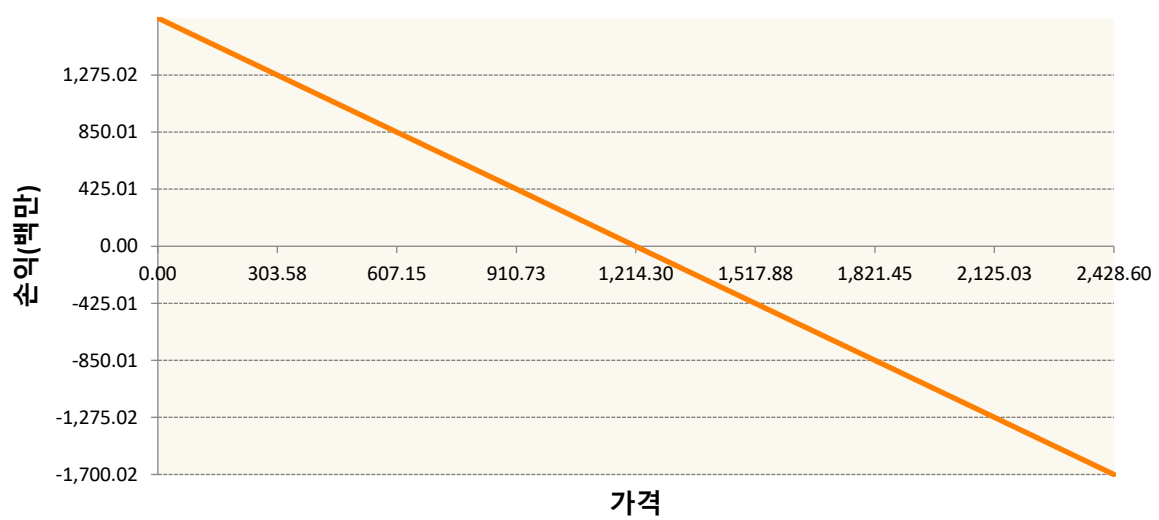
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



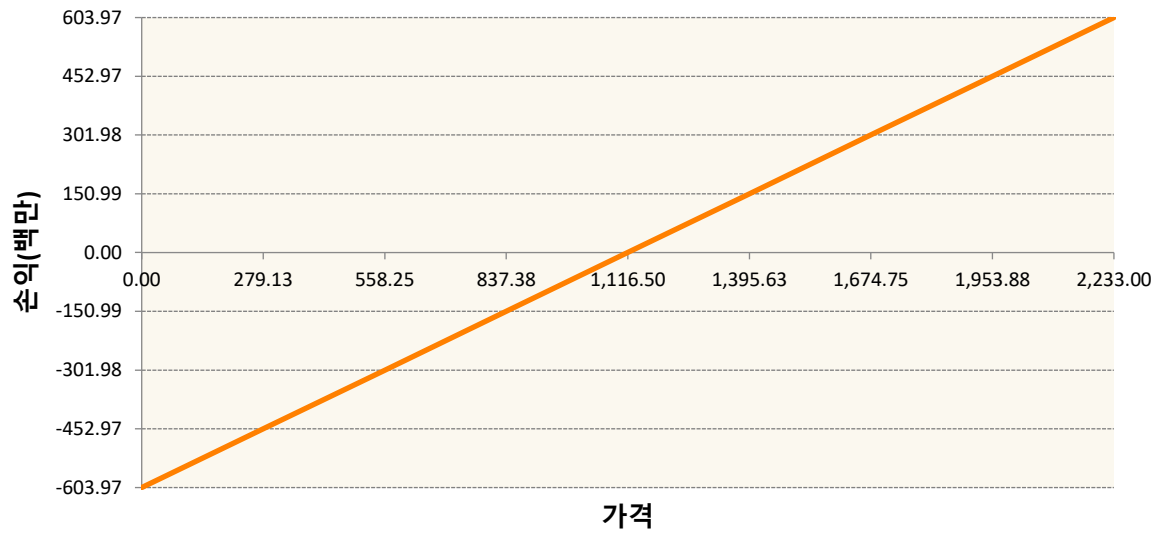
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



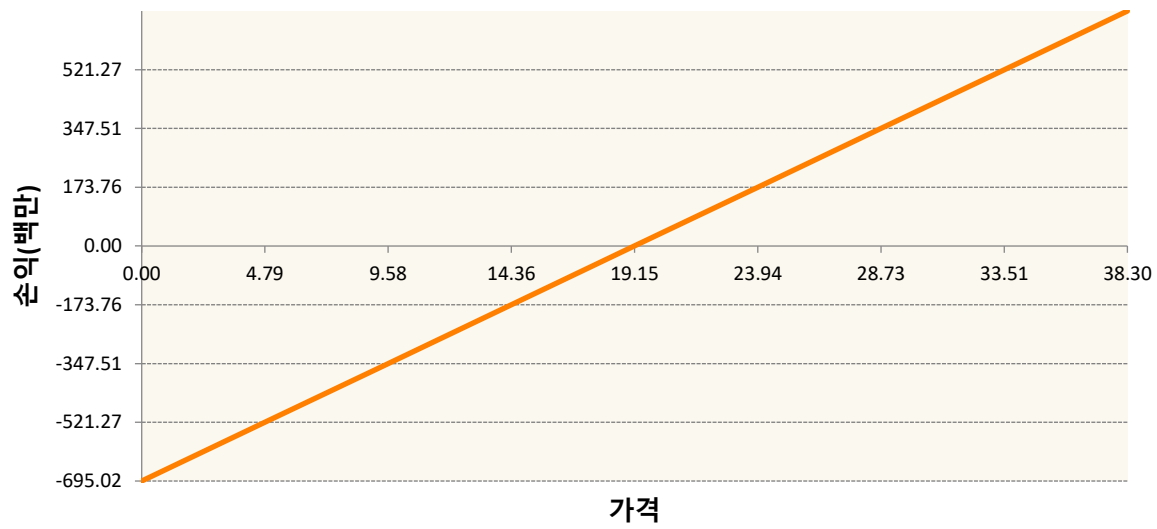
KR4175S40004-2022-04 달러선물



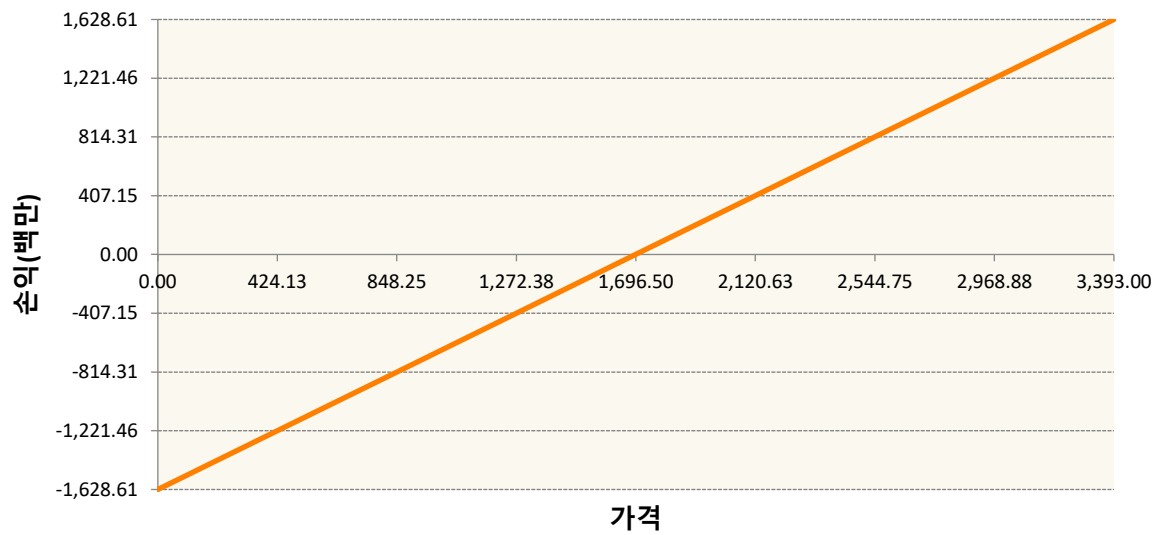
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



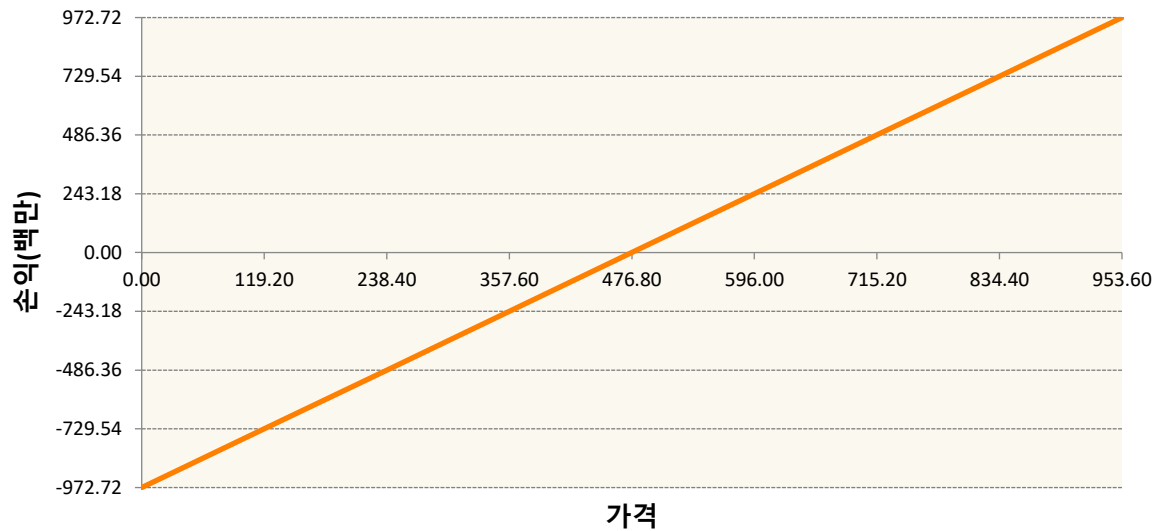
SBK2-Sugar May22



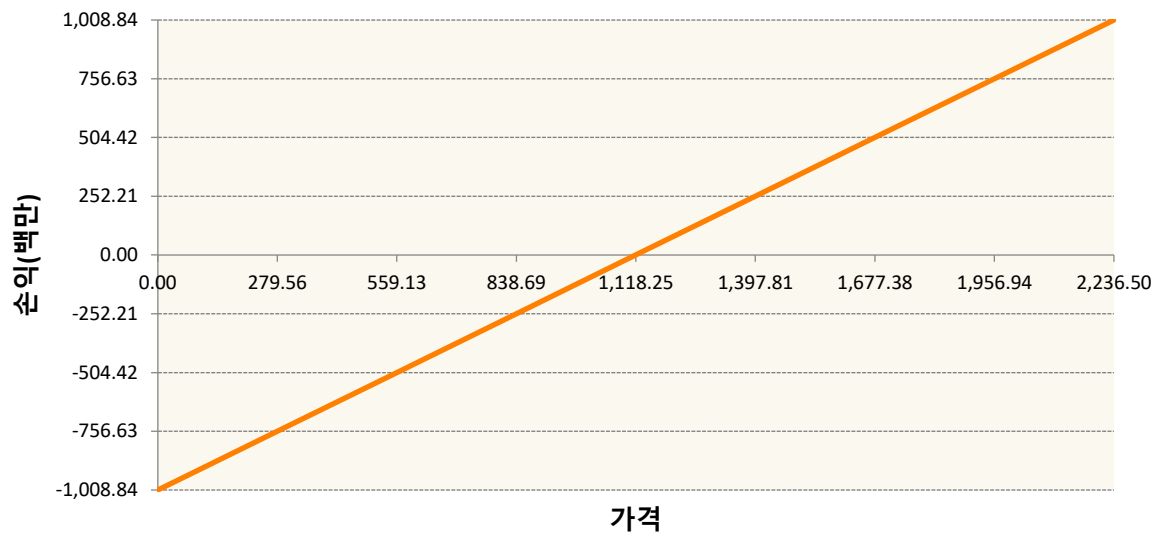
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



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 2022-03-24

기준일 2022-03-23

스마트인덱스모

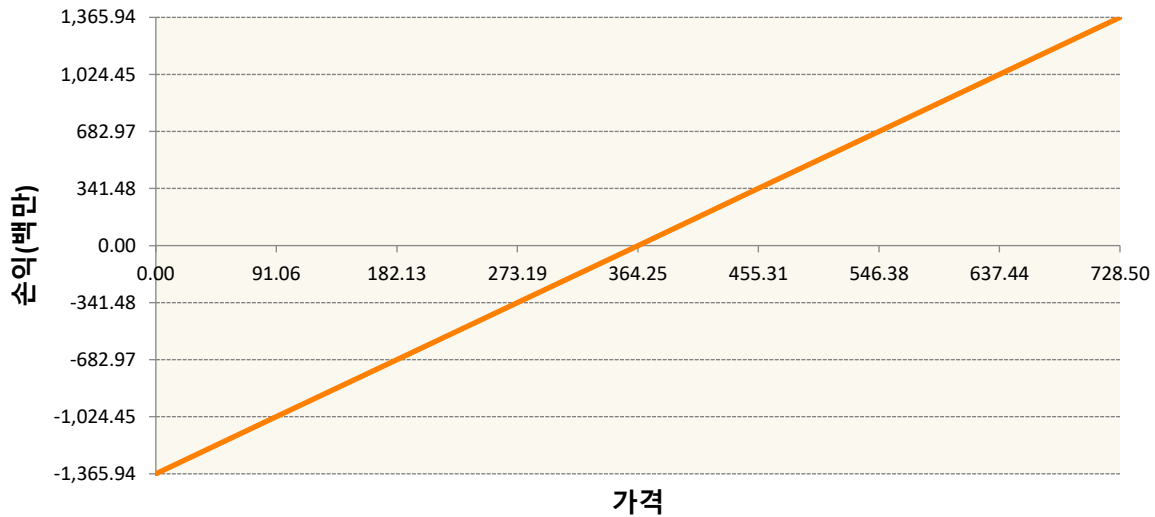
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,366	0	1,366	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109
-5.33%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	73	73	73	73	73	73	73
8.00%	109	109	109	109	109	109	109

공시일	2022-03-24
기준일	2022-03-23

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)

SWMXWO00 신한MSCI선진국미래20220225

145

* 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	2022-03-24
기준일	2022-03-23

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

393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

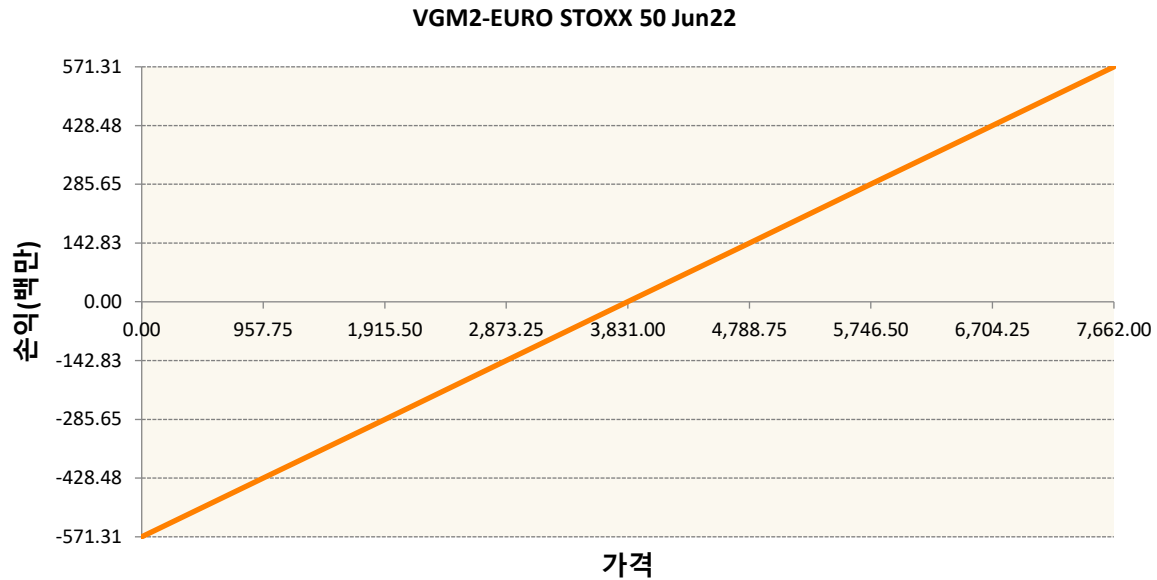
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	571	0	571	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2 EURO STOXX 50 Jun22

46

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

(단위:백만원)

44

공시일	2022-03-24
기준일	2022-03-23

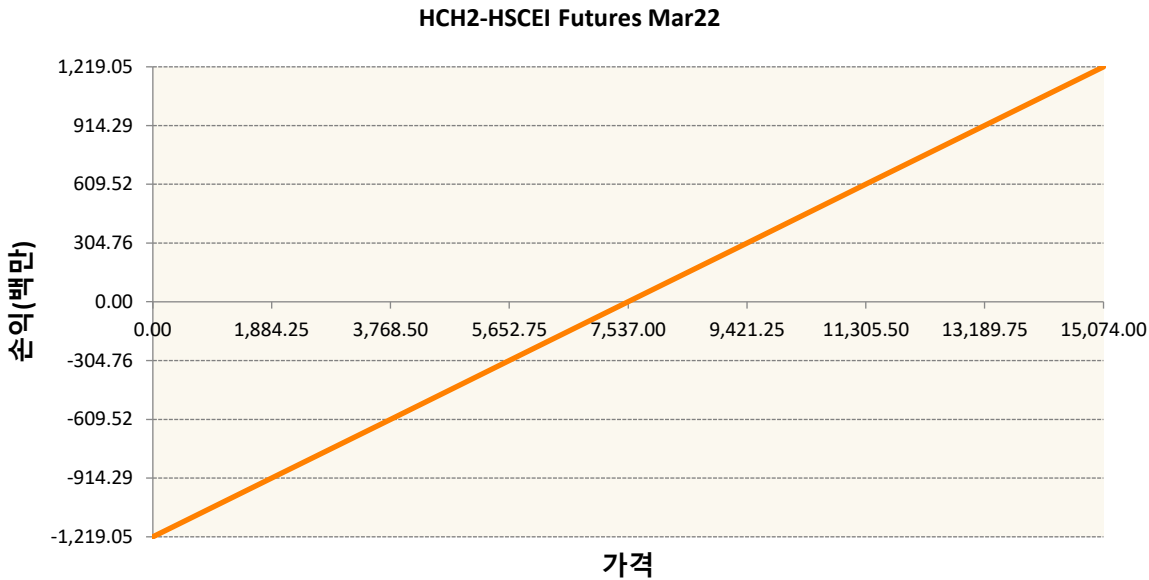
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,219	0	1,219	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCH2 HSCEI Futures Mar22	98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	129

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

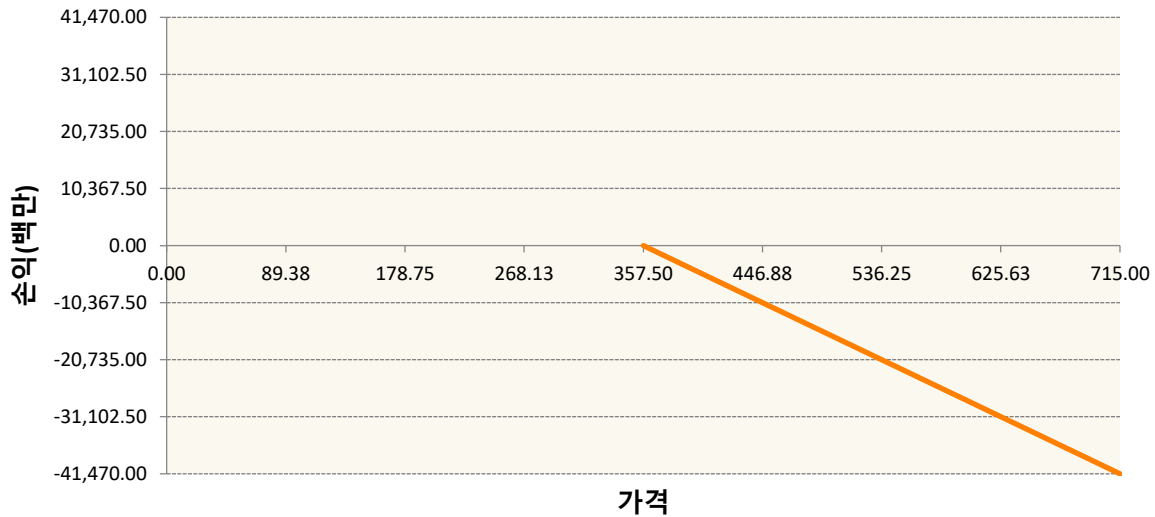
1. 계약금액

(단위:백만원)

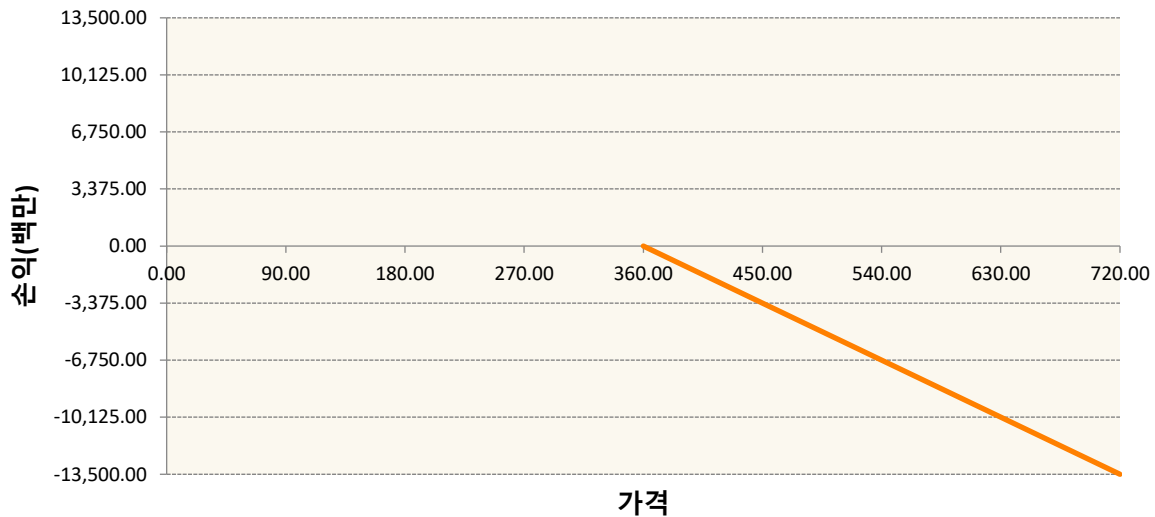
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,410	-66,410	장내

2. 만기시점의 손익구조

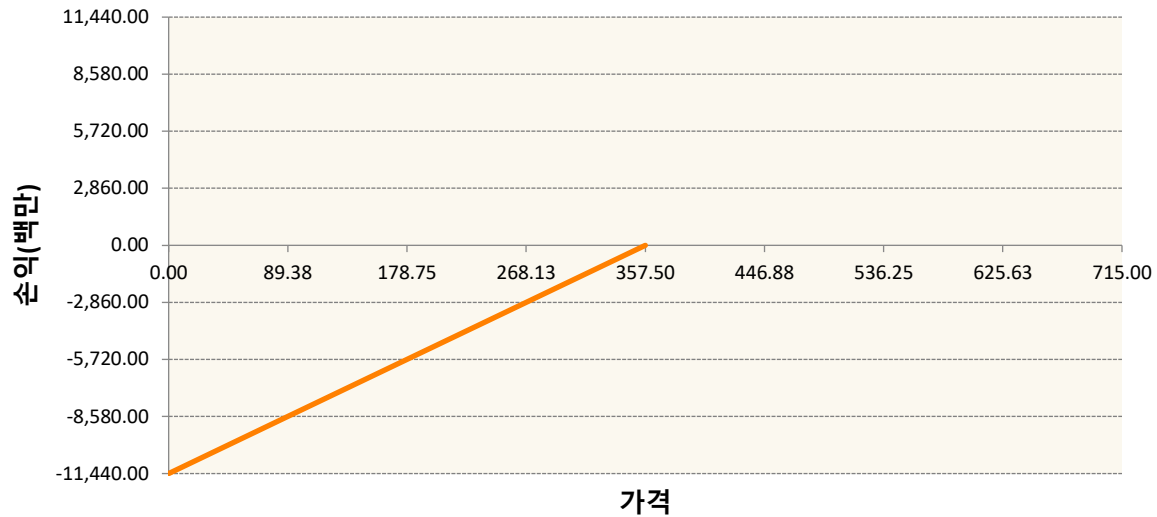
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572		2022-04 콜357.5					2,821
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,571	1,514	1,451	1,383	1,310	1,234	1,156
-5.33%	1,342	1,256	1,168	1,077	985	891	797
-2.67%	927	825	722	619	517	414	311
0%	299	200	101	0	-101	-203	-305
2.67%	-523	-602	-684	-770	-859	-950	-1,043
5.33%	-1,490	-1,541	-1,600	-1,666	-1,736	-1,811	-1,889
8.00%	-2,544	-2,573	-2,609	-2,653	-2,704	-2,760	-2,821
KR4201S43606		2022-04 콜360					888
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	465	449	430	410	388	365	341
-5.33%	403	377	350	322	293	264	234
-2.67%	285	252	220	187	154	121	88
0%	100	67	33	0	-33	-67	-101
2.67%	-151	-178	-207	-237	-267	-298	-329
5.33%	-453	-472	-493	-516	-541	-567	-594
8.00%	-787	-798	-812	-828	-847	-867	-888
KR4301S43570		2022-04 풋357.5					627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-582	-587	-593	-600	-608	-617	-627
-5.33%	-302	-313	-326	-340	-354	-369	-384
-2.67%	-82	-100	-118	-136	-154	-172	-190
0%	50	33	17	0	-17	-34	-52

2.67%	105	96	86	75	63	50	36
5.33%	122	119	114	108	102	94	85
8.00%	125	124	123	121	118	114	109

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

(단위:백만원)

4,215

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

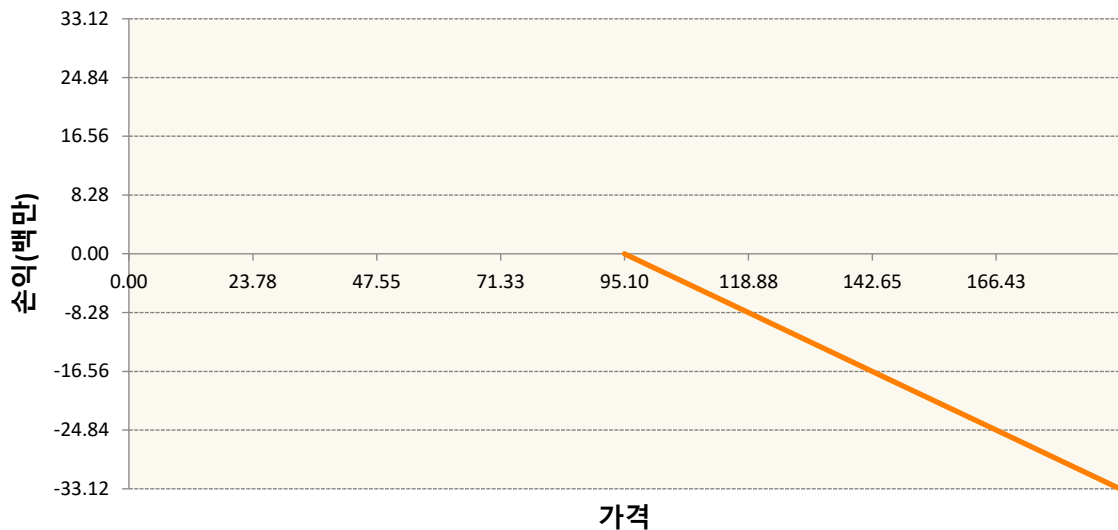
1. 계약금액

(단위:백만원)

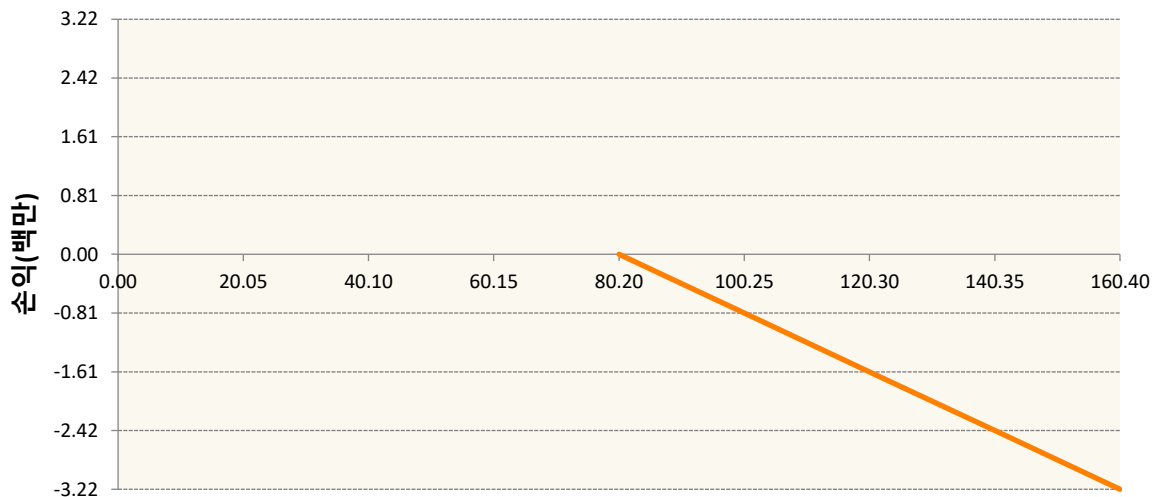
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	72	-72	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,009	-2,009	장외

2. 만기시점의 손익구조

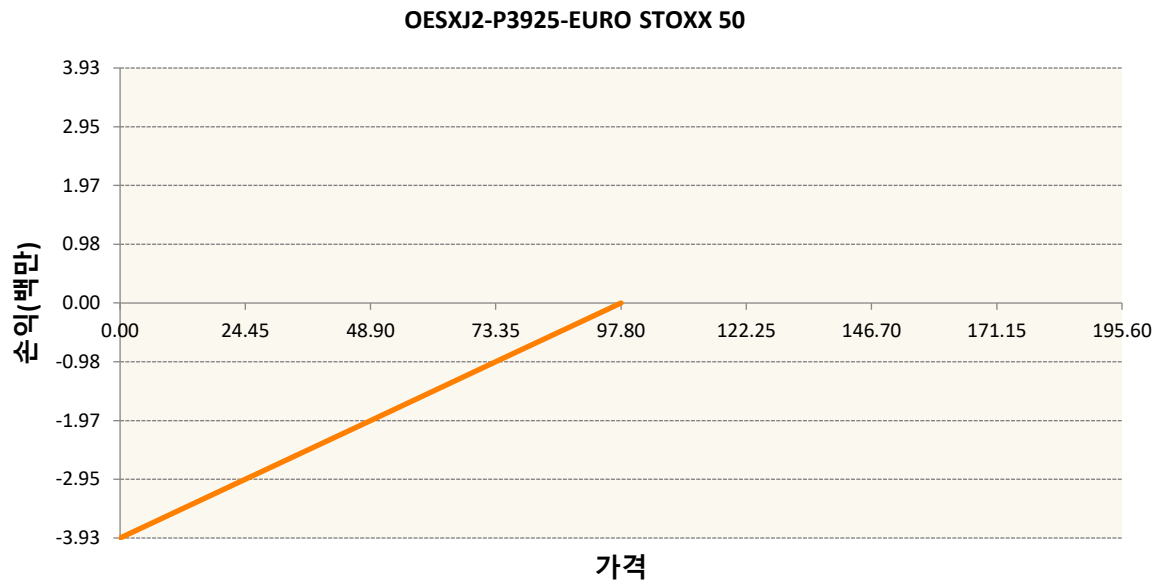
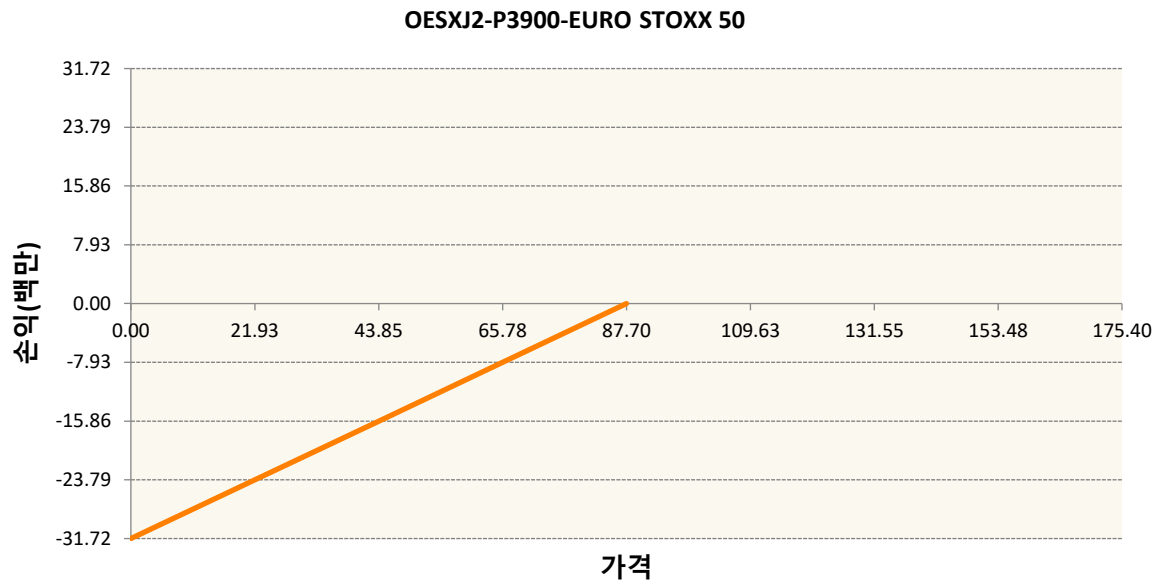
OESXJ2-C3900-EURO STOXX 50



OESXJ2-C3925-EURO STOXX 50



가격



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	9
FXW213C2F4 KRW/EUR 27-05-22E	21
FXW213C2F4 KRW/EUR 22-04-22E	32
FXW213C384 KRW/EUR 27-05-22E	64
FXW213C3A4 KRW/EUR 22-04-22E	43
OESXJ2-C390 EURO STOXX 50	3
OESXJ2-C392 EURO STOXX 50	0.26
OESXJ2-P390 EURO STOXX 50	3
OESXJ2-P392 EURO STOXX 50	0.31

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

(단위:백만원)

101

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

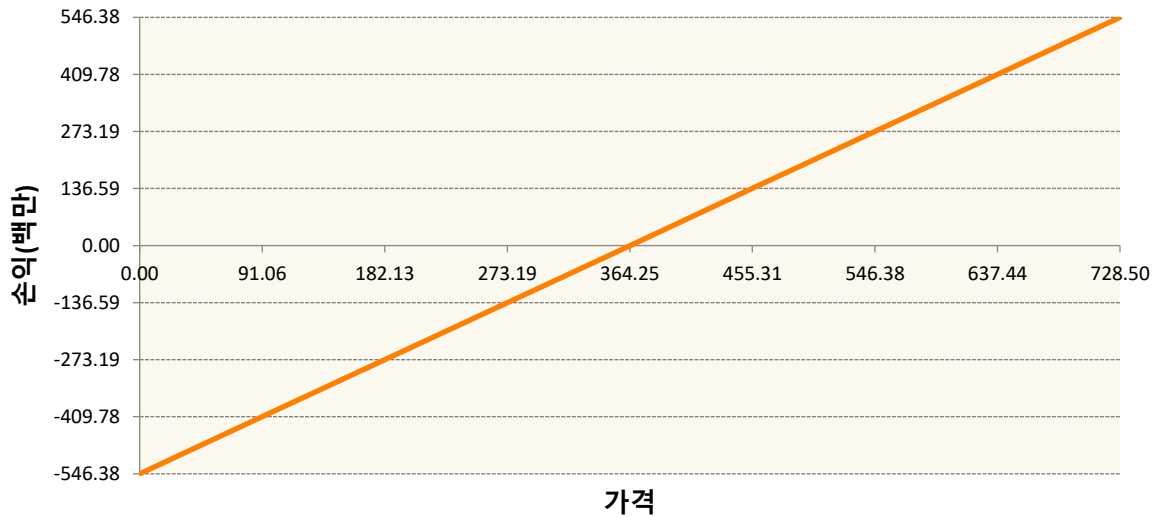
1. 계약금액

(단위:백만원)

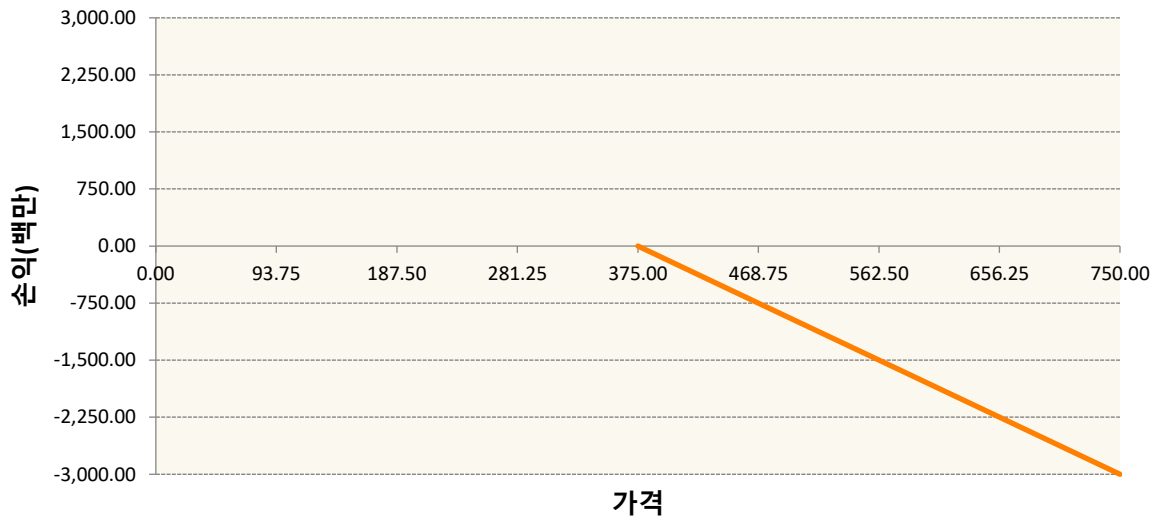
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	546	0	546	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S43754-2022-04 콜375



가격	이익 (백만)
377.50	0.00
471.88	-424.69
566.25	-849.38
660.63	-1,274.06
755.00	-1,698.75

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 715.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from -357.50 to 357.50. A blue line starts at (0, 357.50) and ends at (357.50, 0), indicating that profit is zero when the price is 357.50.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	357.50
357.50	0.00

(단위:백만원)

KR4101S60008				2022-06 코스피200지수선물				44
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	
5.33%	29	29	29	29	29	29	29	
8.00%	44	44	44	44	44	44	44	
KR4201S43754				2022-04 콜375				153
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	52	51	49	47	44	41	38
-5.33%	48	46	42	39	35	30	25
-2.67%	39	34	29	24	18	12	6
0%	20	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-12	-19	-27	-34	-42	-49	-57
5.33%	-58	-65	-72	-79	-86	-93	-101
8.00%	-116	-121	-127	-133	-139	-146	-153

KR4201S43770

2022-04 콜377.5

82

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	25	25	23	22	21	19
-5.33%	24	23	21	19	17	15	13
-2.67%	20	18	15	12	9	6	3
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-5	-9	-13	-18	-22	-26	-30
5.33%	-29	-33	-37	-41	-45	-50	-54
8.00%	-60	-63	-67	-71	-74	-78	-82

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	19	20
-5.33%	9	10	10	11	11	12	12
-2.67%	3	3	4	4	5	5	6
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-1
5.33%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-3

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

(단위:백만원)

253

공시일	2022-03-24
기준일	2022-03-23

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	9,392	0	9,392	

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	2022-03-24
기준일	2022-03-23

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	7,762	0	7,762	

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	2022-03-24
기준일	2022-03-23

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	25,639	0	25,639	
누계	통화	선도	5,462	30,017	-24,555	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	2,207
FXW213C32 USD/KRW 25-03-22E	58
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E	39
FXW213C37 USD/KRW 25-03-22E	49
FXW213C3B USD/KRW 25-03-22E	78
FXW213C3F4 USD/KRW 25-03-22E	49
FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E	97

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

937

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

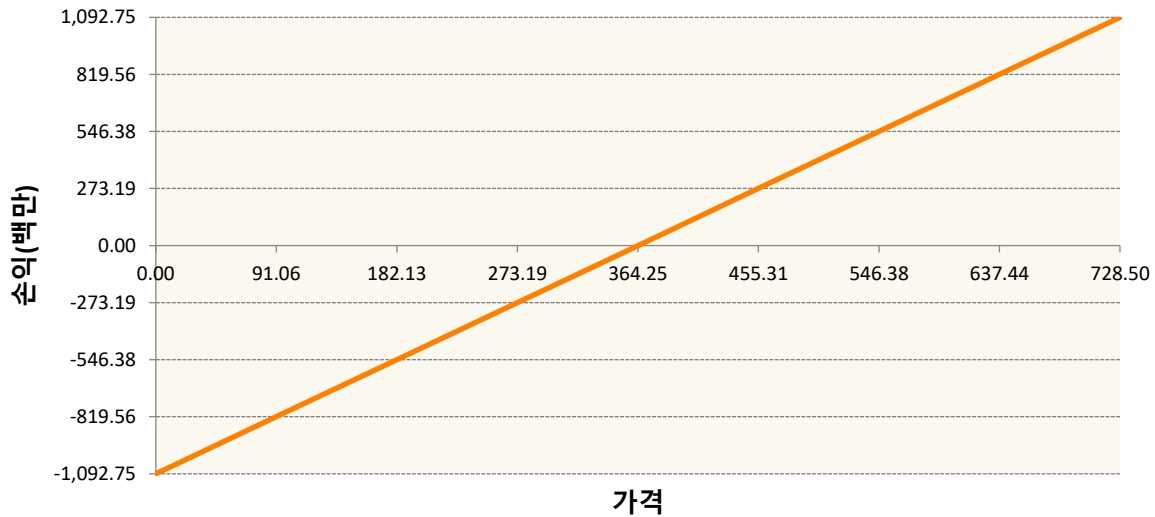
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,093	0	1,093	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				88
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

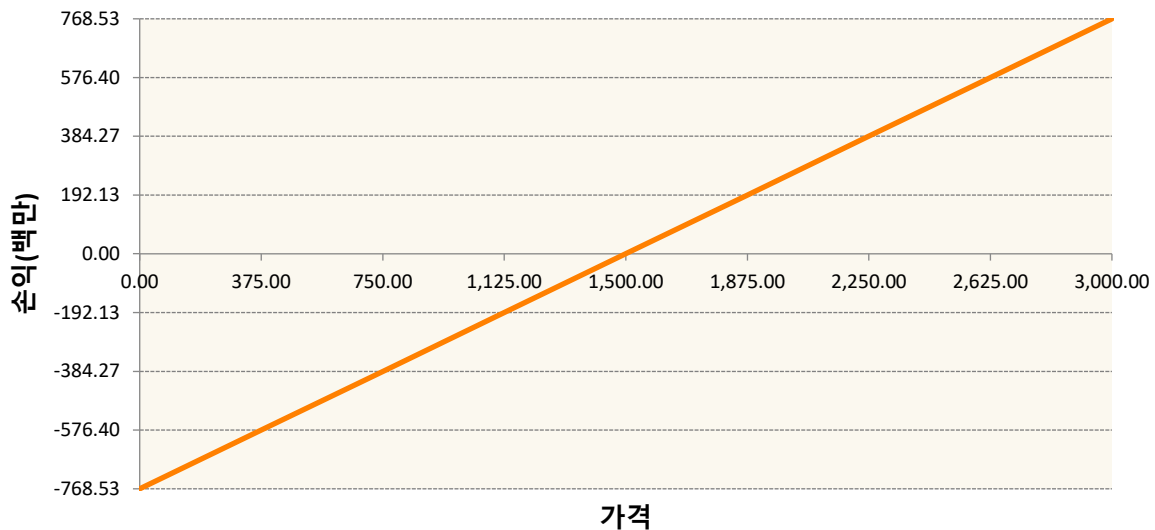
1. 계약금액

(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	769	0	769	
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	61

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

(단위:백만원)

264

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

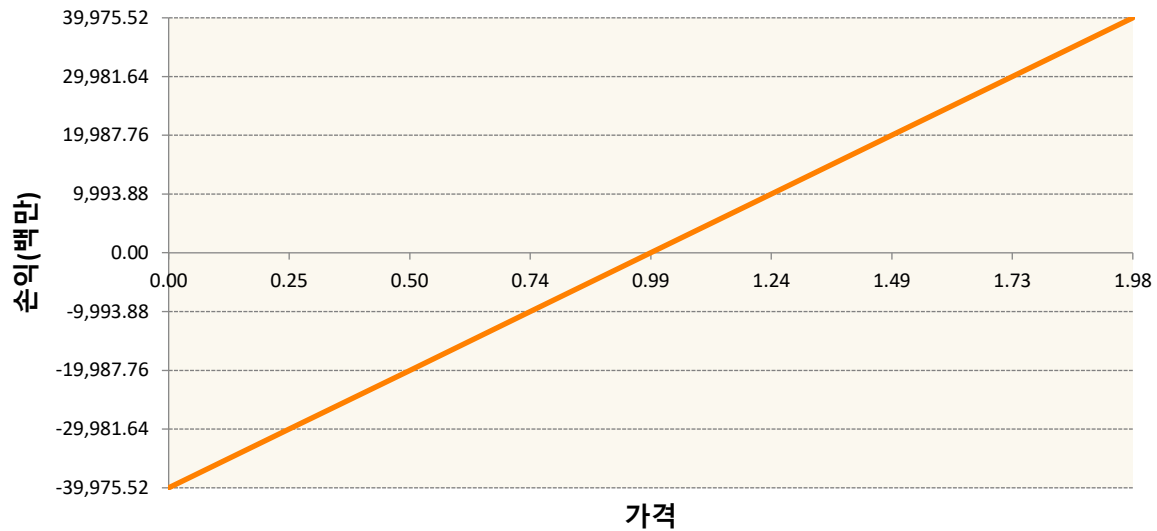
1. 계약금액

(단위:백만원)

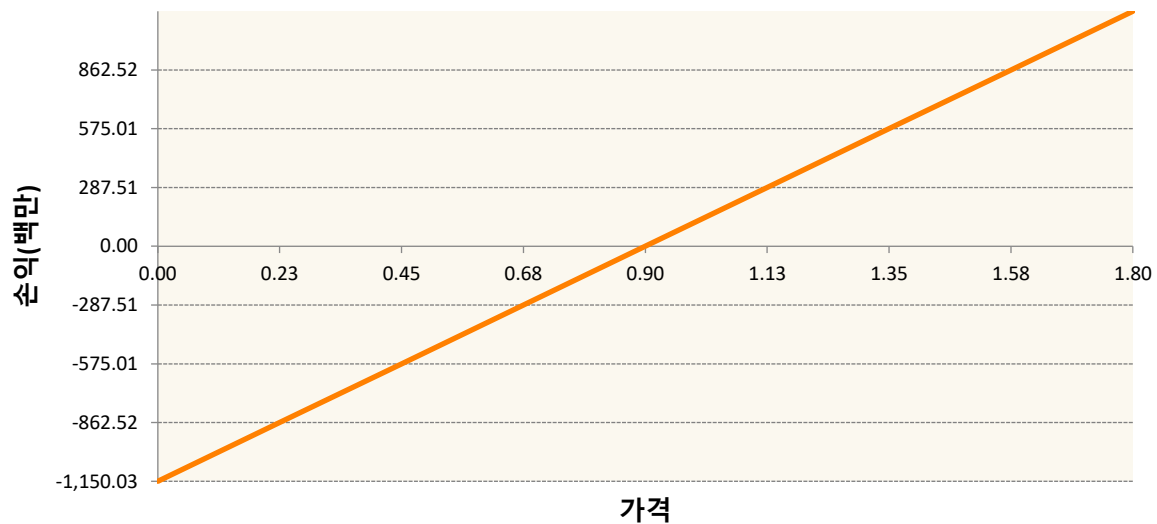
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	43,423	0	43,423	

2. 만기시점의 손익구조

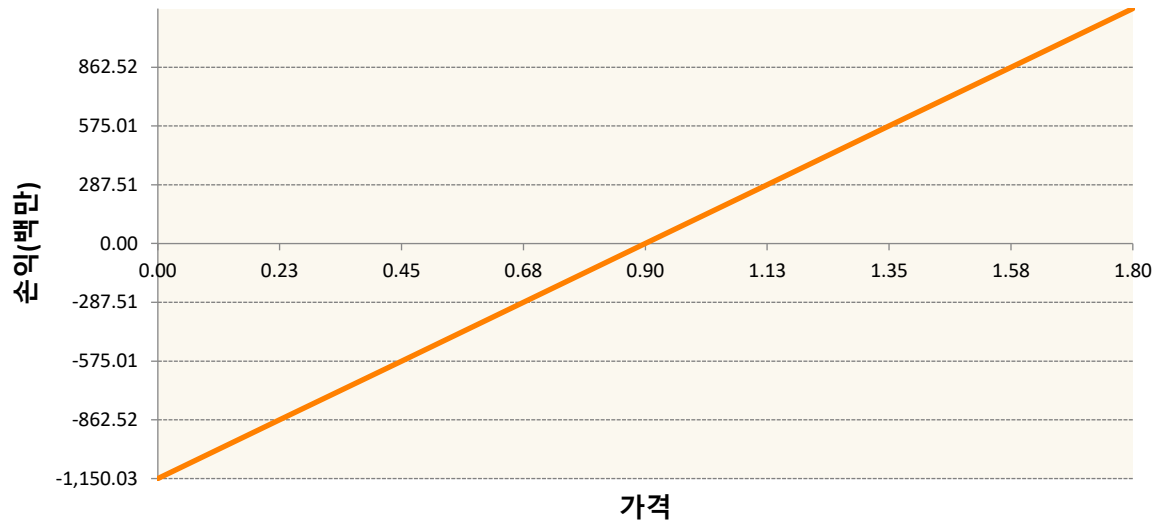
210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



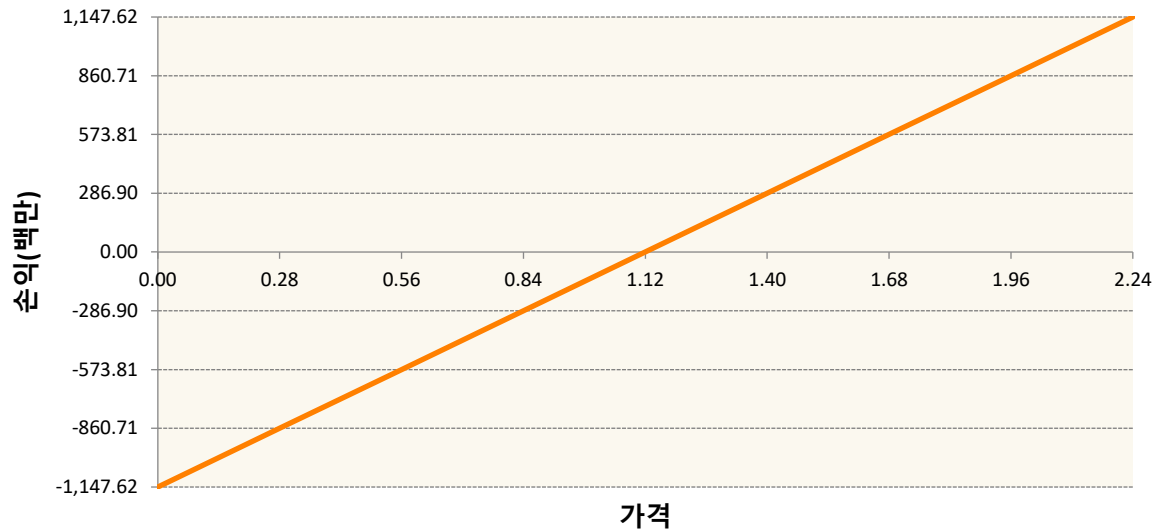
210884220216-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)	3,205
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)

6,372

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

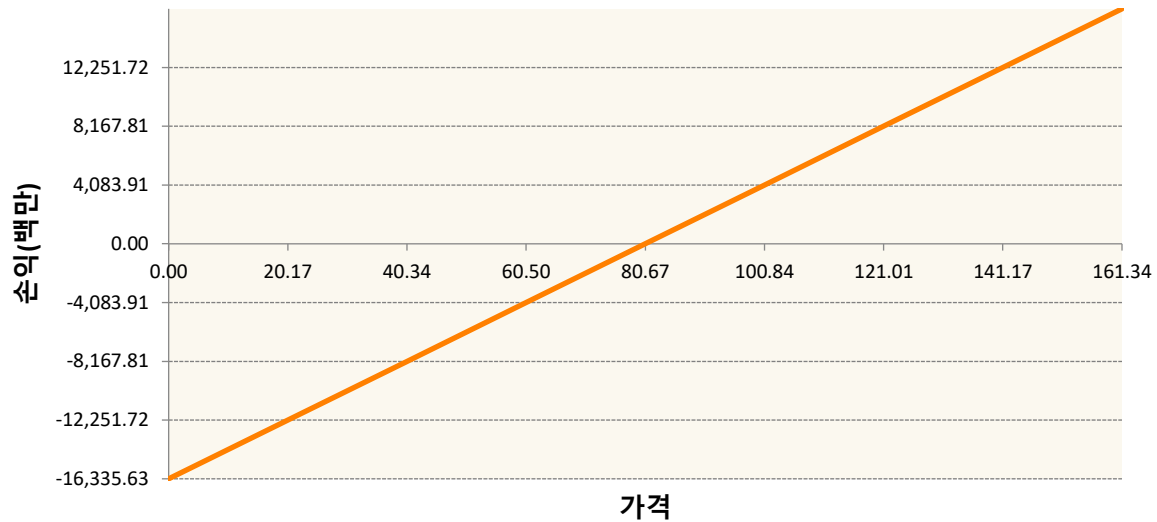
1. 계약금액

(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	16,336	0	16,336	
누계	통화	선도	0	8,194	-8,194	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2R KRW/EUR 28-03-22E

656

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,307

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

(단위:백만원)

3,442

공시일	2022-03-24
기준일	2022-03-23

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	11,035	0	11,035	장외
누계	지수	스왑	11,035	0	11,035	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	6

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

(단위:백만원)

47

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

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)	23
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	27
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	23
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	23

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

(단위:백만원)

118

공시일	2022-03-24
기준일	2022-03-23

에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0003014; SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322	0.12
KRS0003014; SWAP_APPLE INC_0322	1
KRS0003014; SWAP_NVIDIA CORP_0322	0
KRS0003014; SWAP_TESLA INC_0322	1
KRS0003014; SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	0.32

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

(단위:백만원)

6

공시일 2022-03-24

기준일 2022-03-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

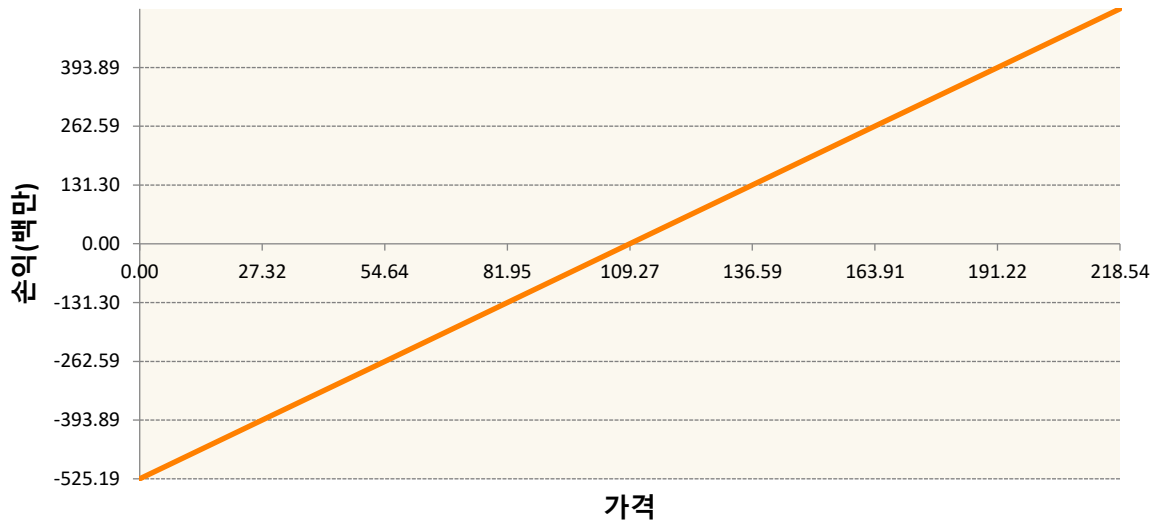
1. 계약금액

(단위:백만원)

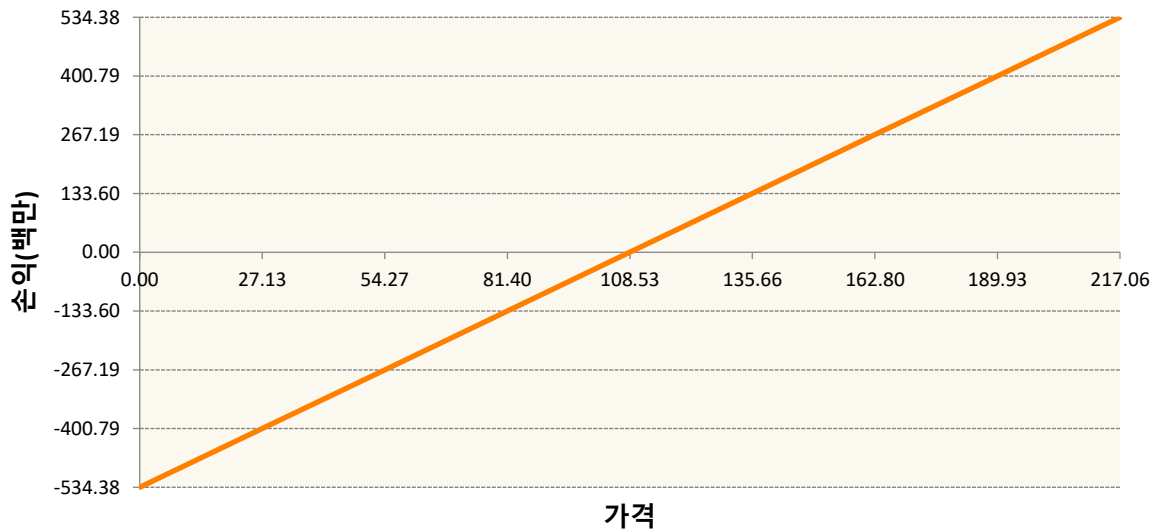
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,358	546	1,812	

2. 만기시점의 손익구조

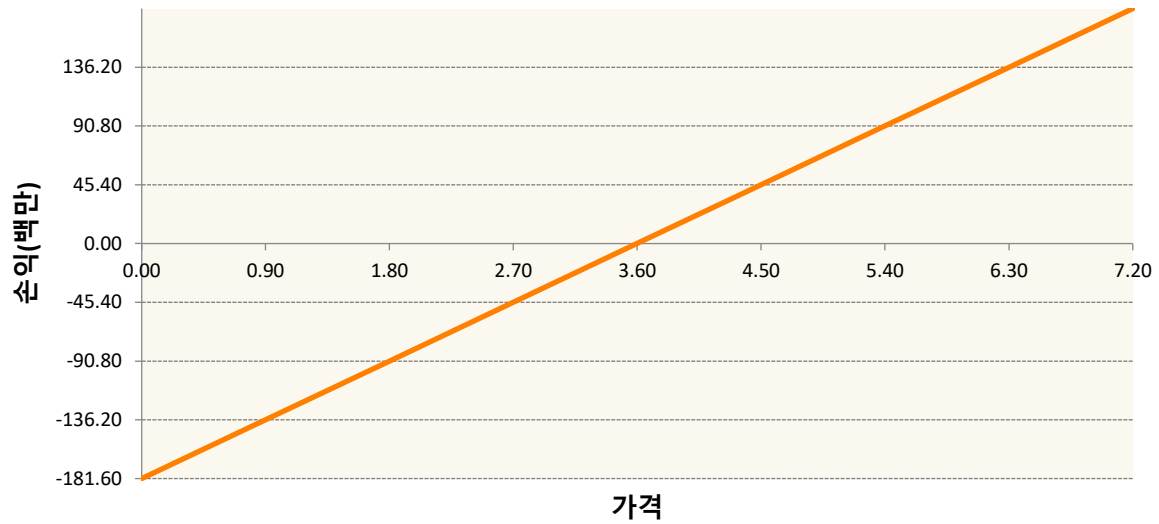
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



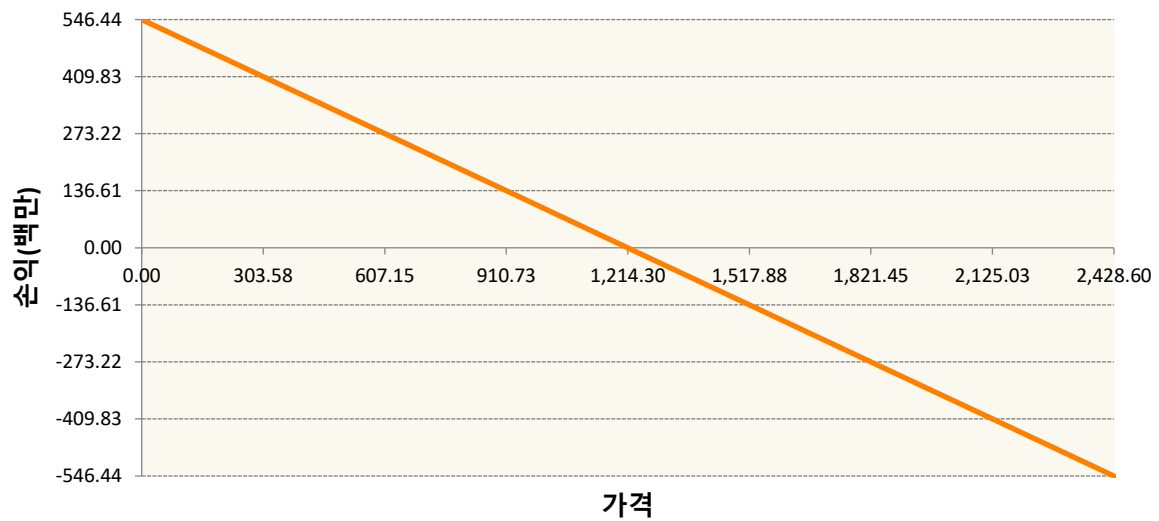
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



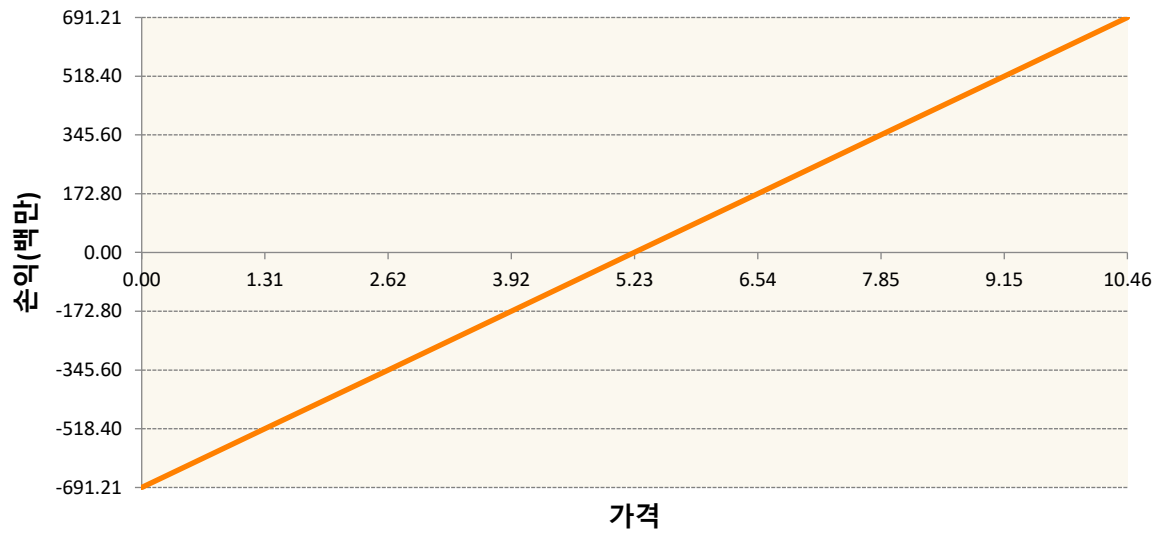
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

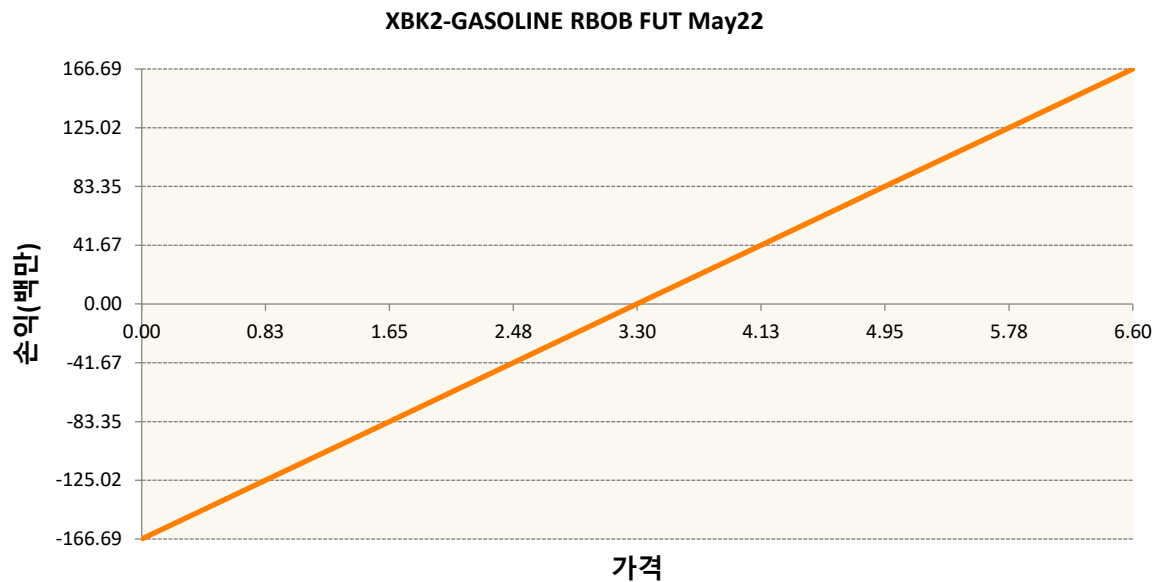
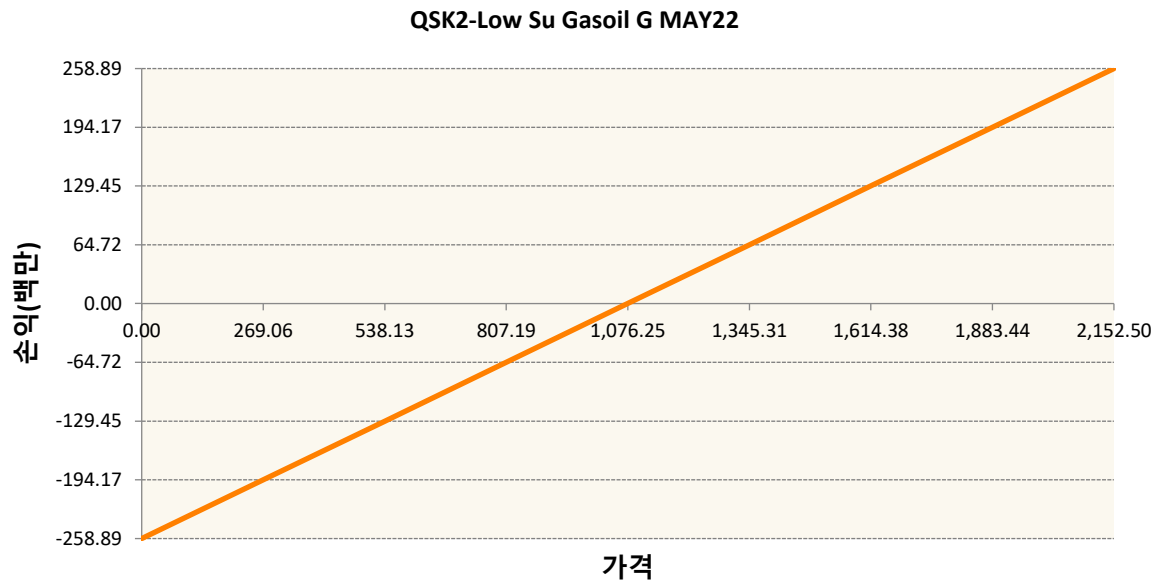


KR4175S40004-2022-04 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		42
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		43
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		15
KR4175S400	2022-04 달러선물		44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		55
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		21
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		519

