

공시일 2022-03-25

기준일 2022-03-24

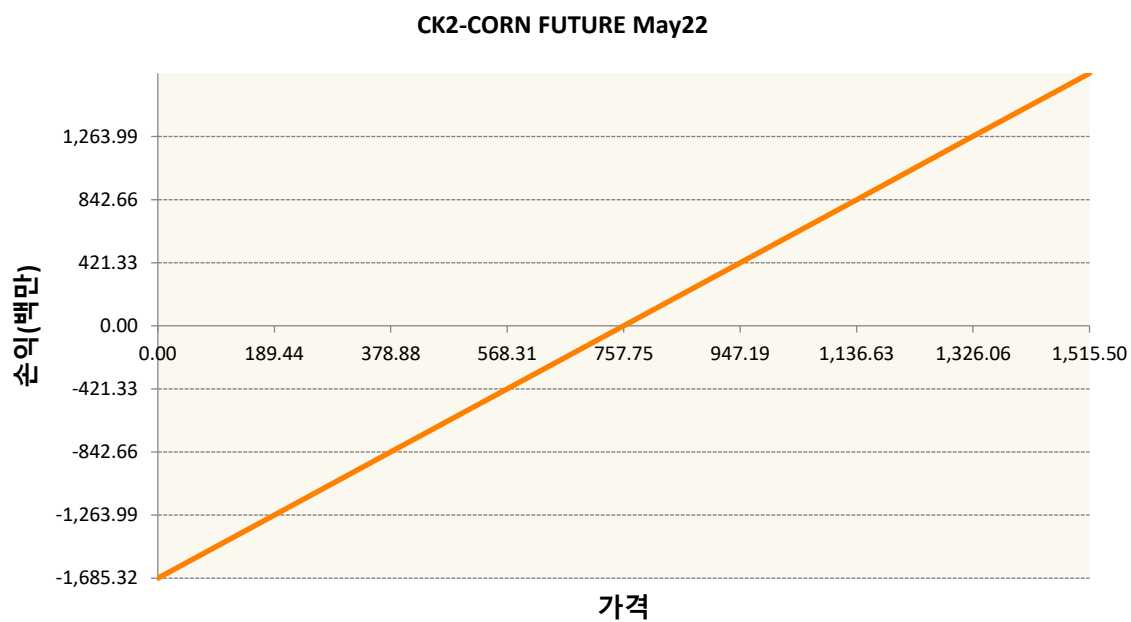
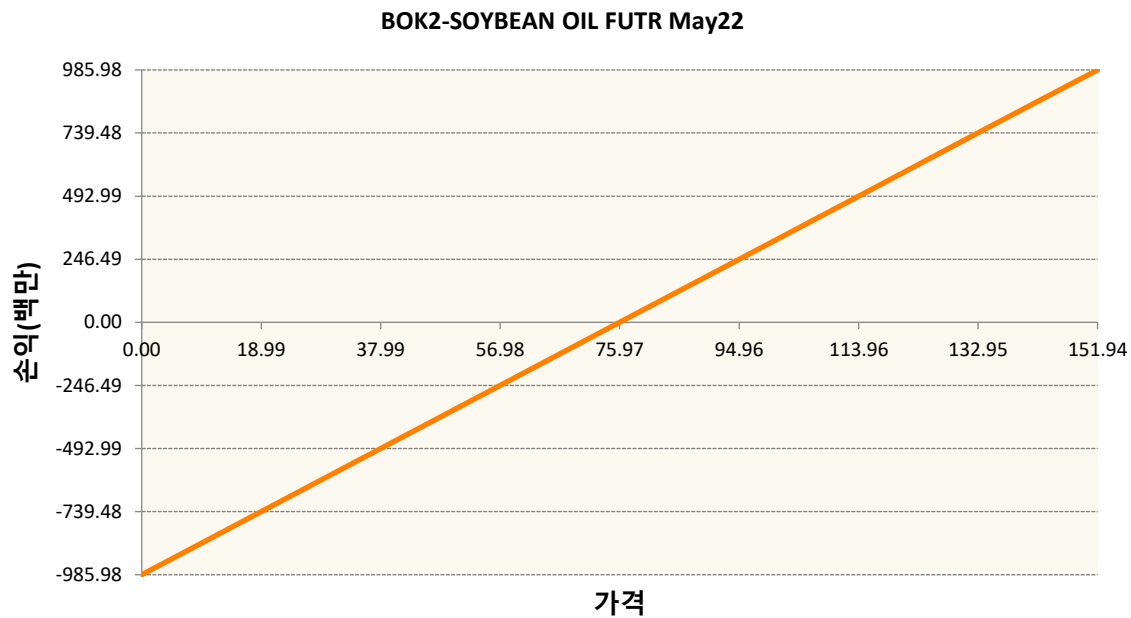
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

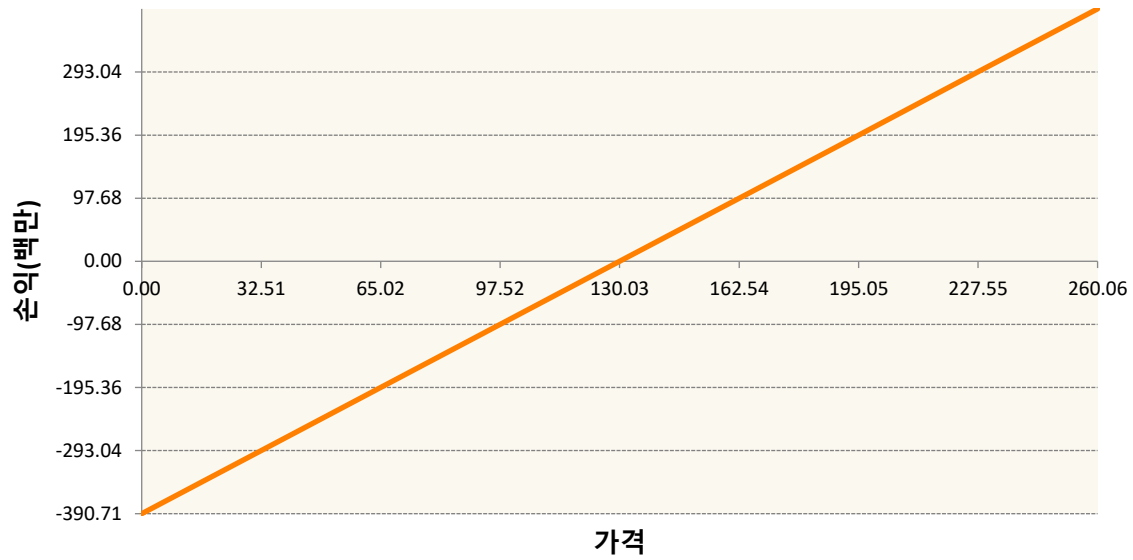
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,608	1,706	6,902	

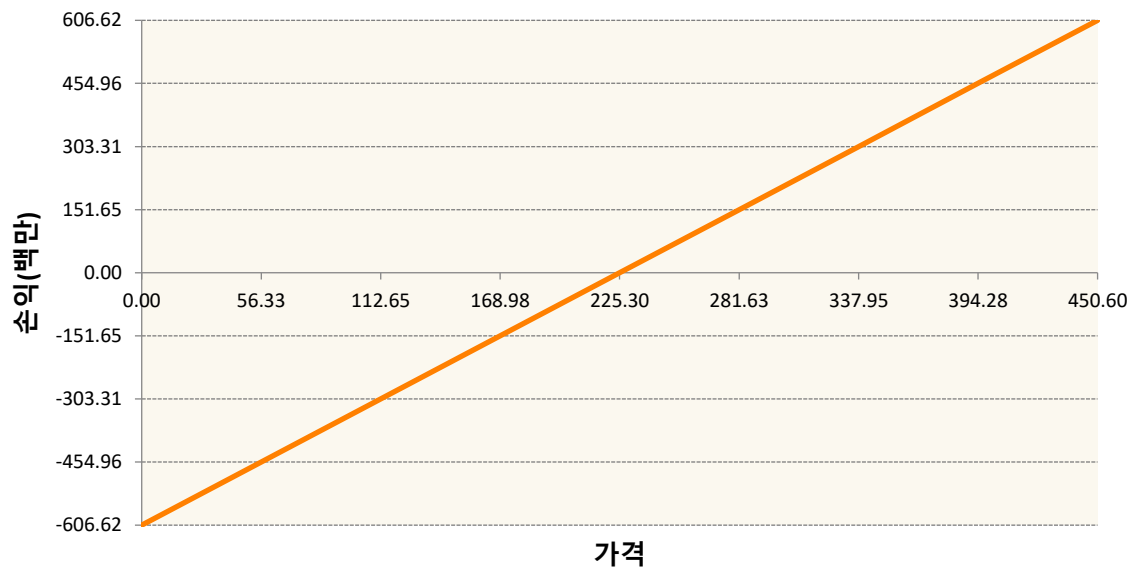
2. 만기시점의 손익구조



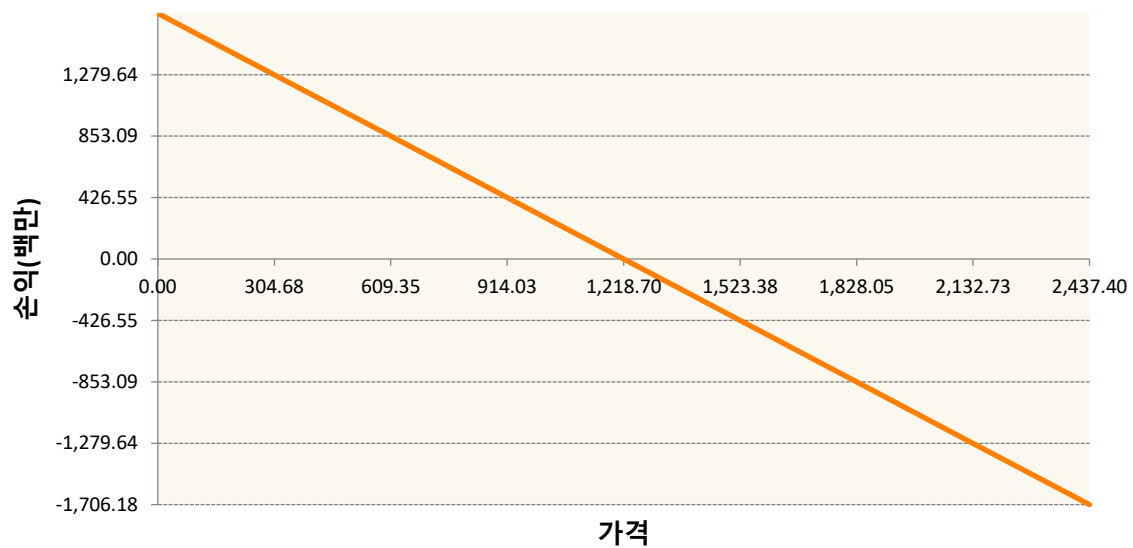
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



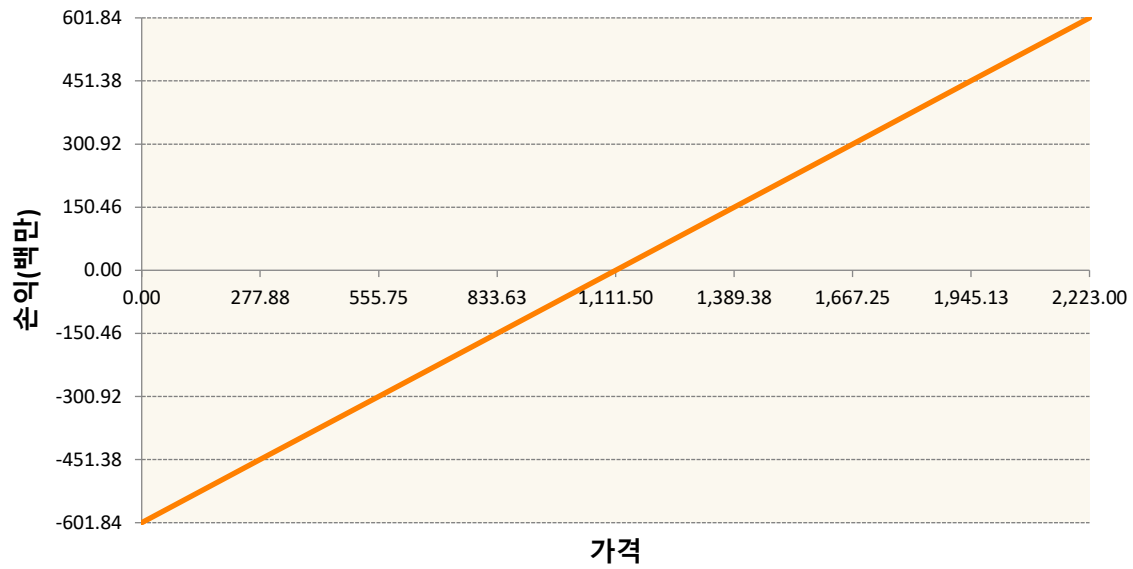
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



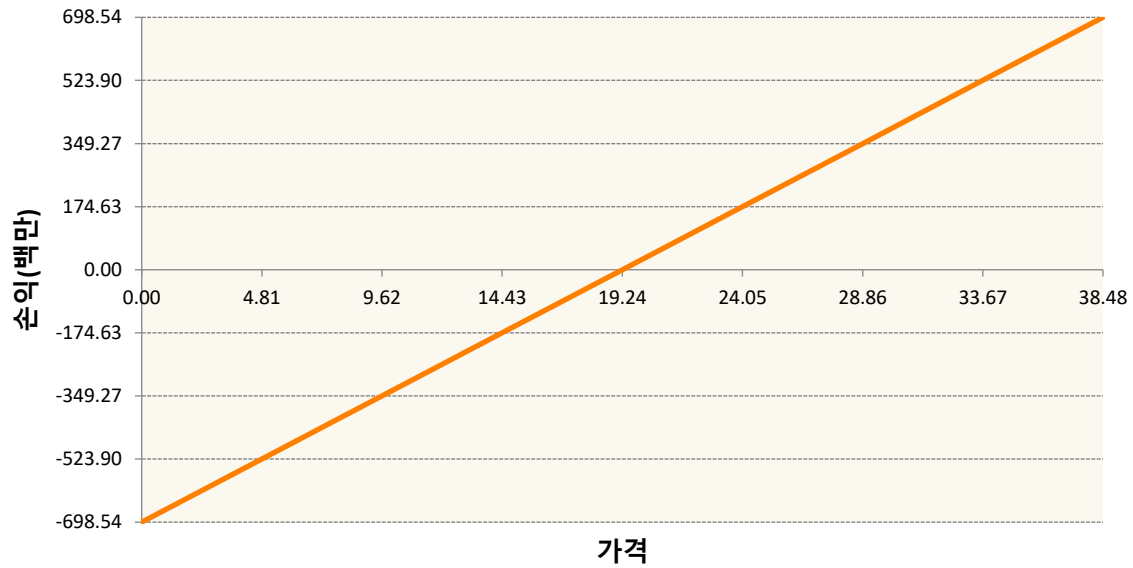
KR4175S40004-2022-04 달러선물



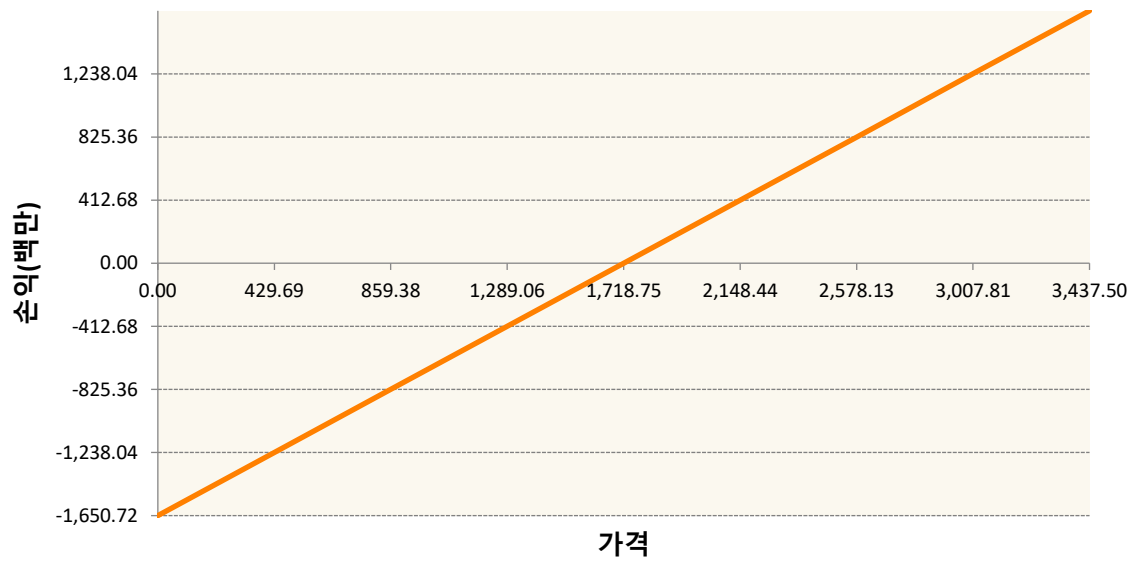
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22

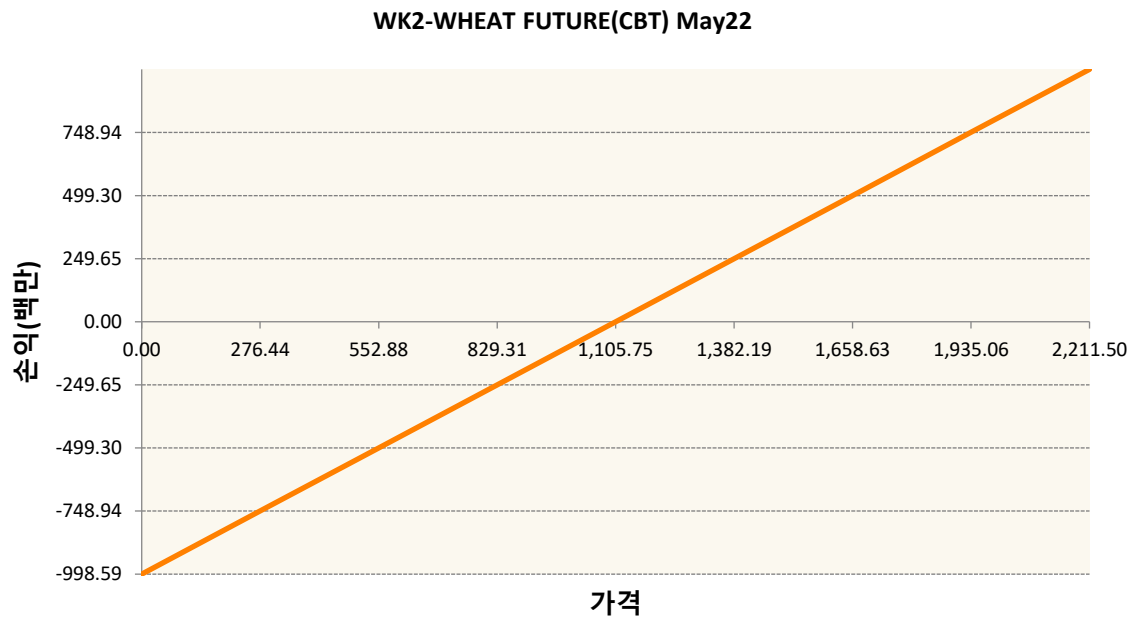
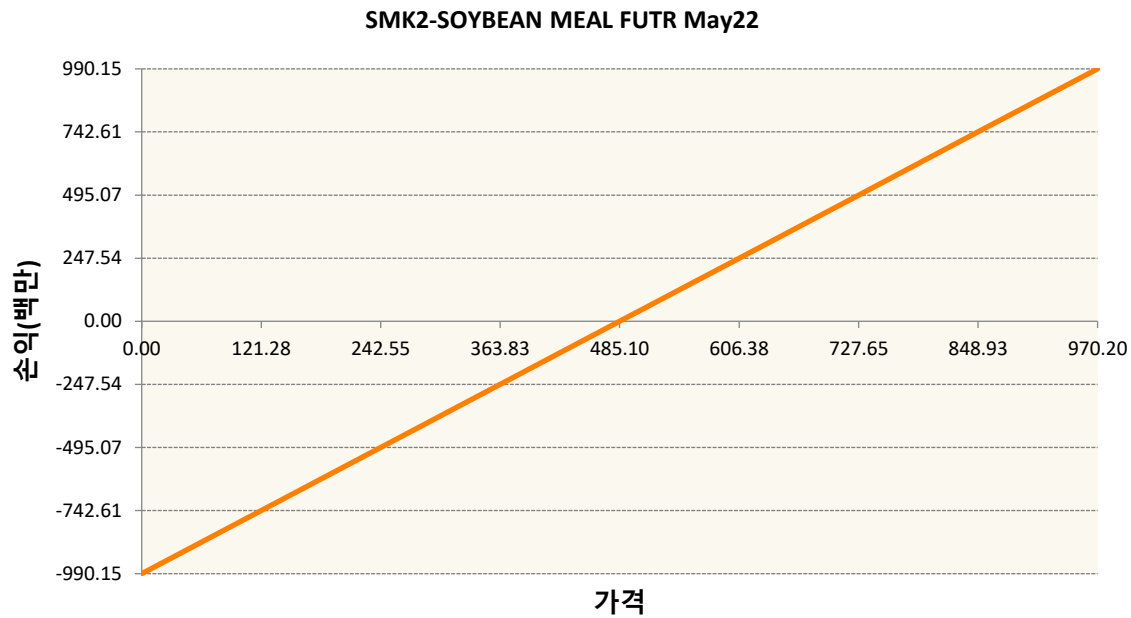


SBK2-Sugar May22



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	2022-03-25
기준일	2022-03-24

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

144

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

90

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-03-25
기준일	2022-03-24

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	395
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

404

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-03-25
기준일	2022-03-24

유로인덱스모(주식-파생형)

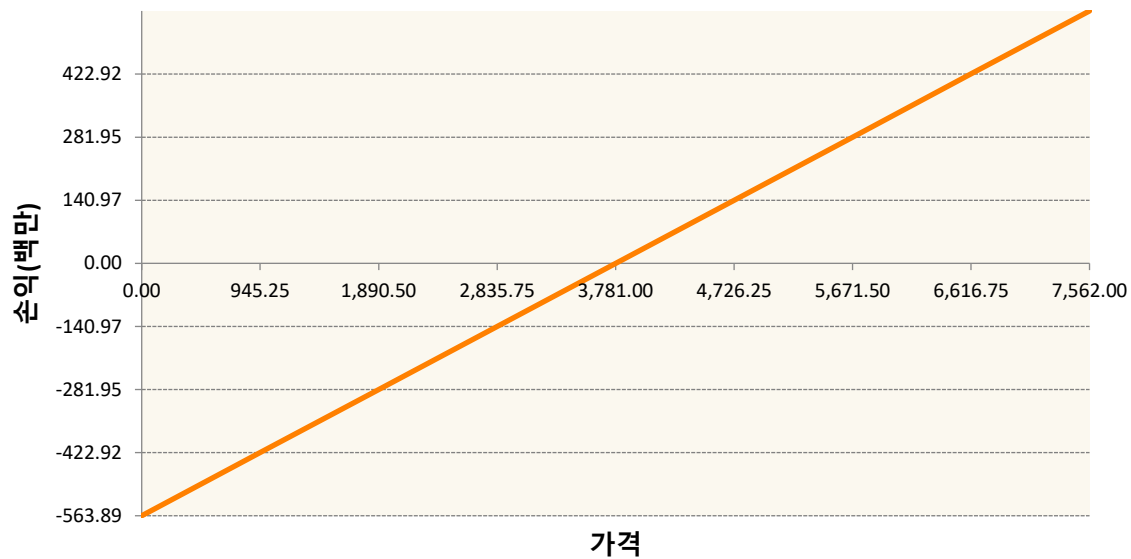
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	564	0	564	

2. 만기시점의 손익구조

VGM2-EURO STOXX 50 Jun22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

44

공시일	2022-03-25
기준일	2022-03-24

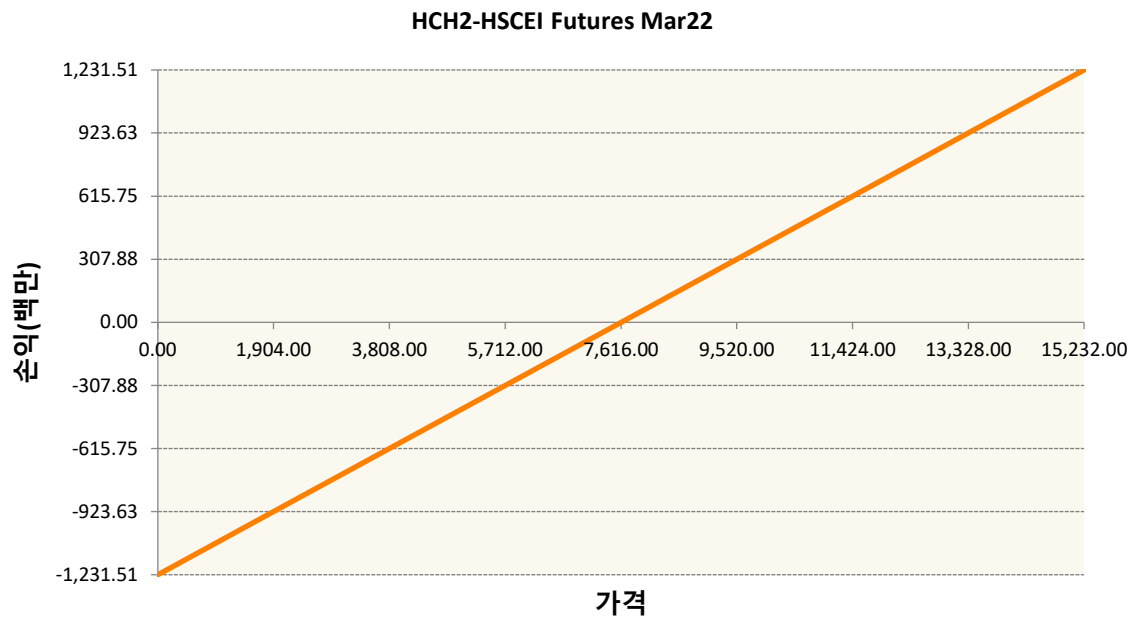
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,232	0	1,232	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2	HSCEI Futures Mar22	99
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

130

공시일 2022-03-25

기준일 2022-03-24

커버드콜모(주식혼합-파생형)

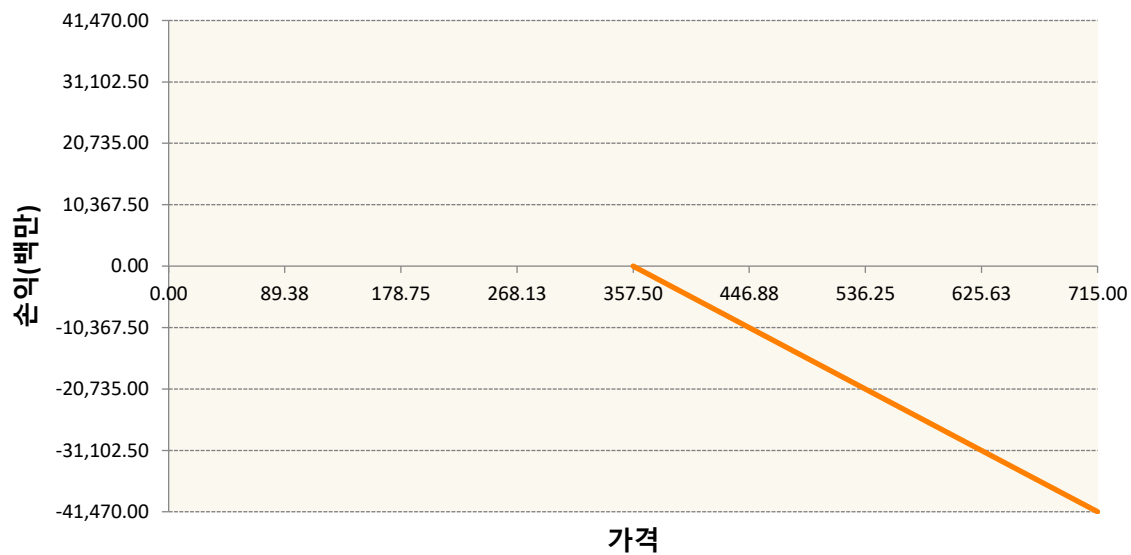
1. 계약금액

(단위:백만원)

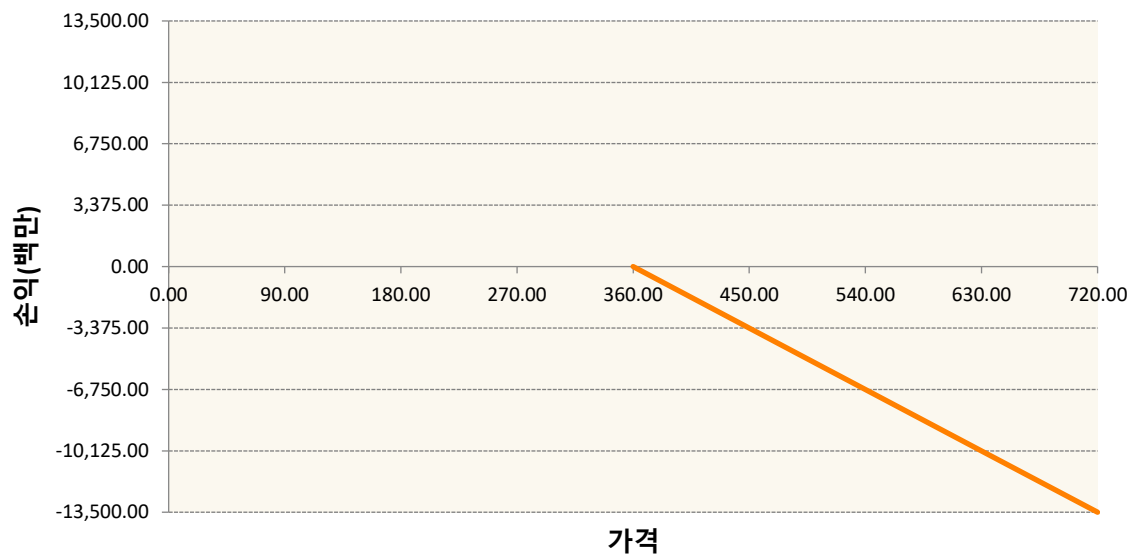
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,410	-66,410	장내

2. 만기시점의 손익구조

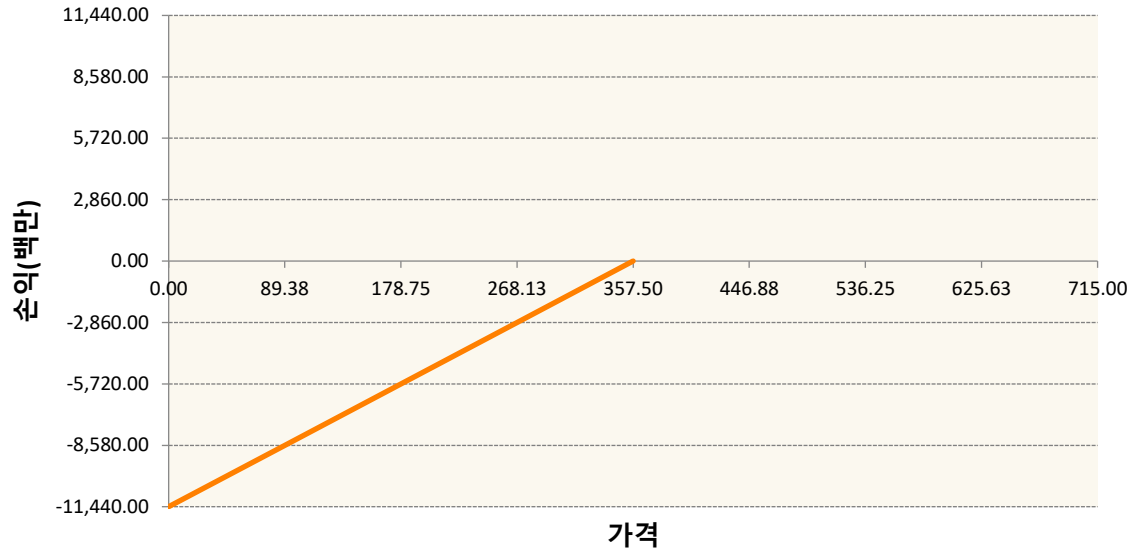
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572			2022-04 콜357.5				2,774
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,470	1,420	1,363	1,301	1,235	1,165	1,092
-5.33%	1,270	1,191	1,108	1,023	936	847	757
-2.67%	891	792	693	593	494	394	295
0%	296	198	99	0	-100	-200	-300
2.67%	-501	-580	-663	-749	-838	-928	-1,021
5.33%	-1,451	-1,504	-1,564	-1,629	-1,700	-1,774	-1,852
8.00%	-2,496	-2,525	-2,562	-2,606	-2,657	-2,713	-2,774
KR4201S43606			2022-04 콜360				872
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	432	418	402	384	364	343	320
-5.33%	379	355	330	304	277	250	221
-2.67%	272	241	210	178	146	115	83
0%	98	66	33	0	-33	-66	-99
2.67%	-143	-171	-200	-230	-260	-290	-321
5.33%	-439	-459	-480	-504	-528	-554	-581
8.00%	-770	-782	-796	-812	-830	-850	-872
KR4301S43570			2022-04 풋357.5				649
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-613	-616	-621	-626	-633	-641	-649
-5.33%	-326	-336	-347	-359	-372	-385	-399
-2.67%	-94	-111	-128	-145	-163	-180	-197
0%	50	33	17	0	-17	-34	-51

2.67%	113	103	93	81	68	55	42
5.33%	131	128	123	117	110	102	93
8.00%	135	134	133	130	127	123	119

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

(단위:백만원)

4,187

공시일 2022-03-25

기준일 2022-03-24

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

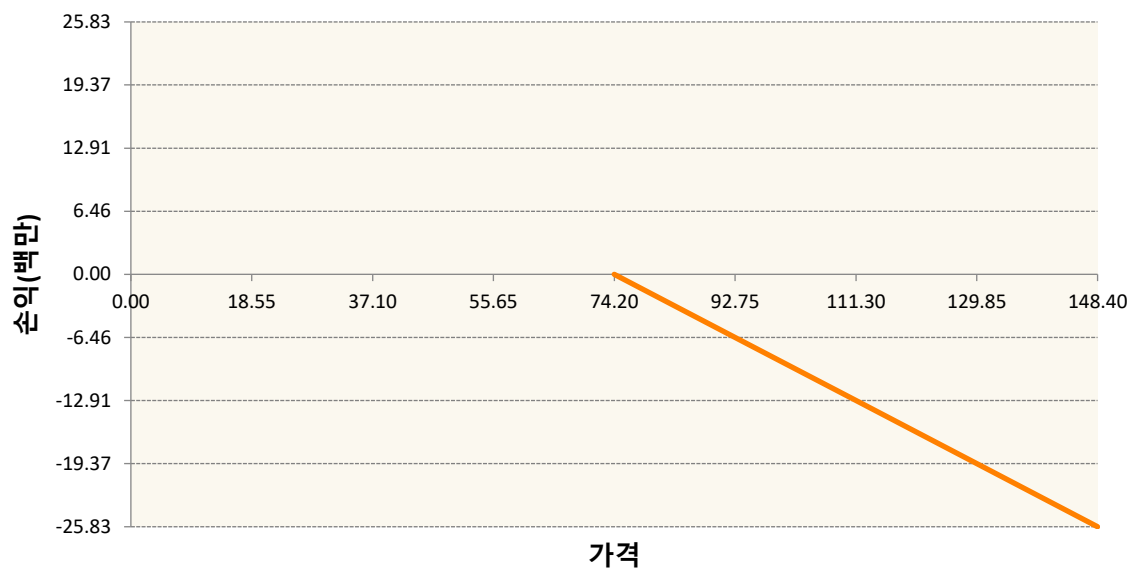
1. 계약금액

(단위:백만원)

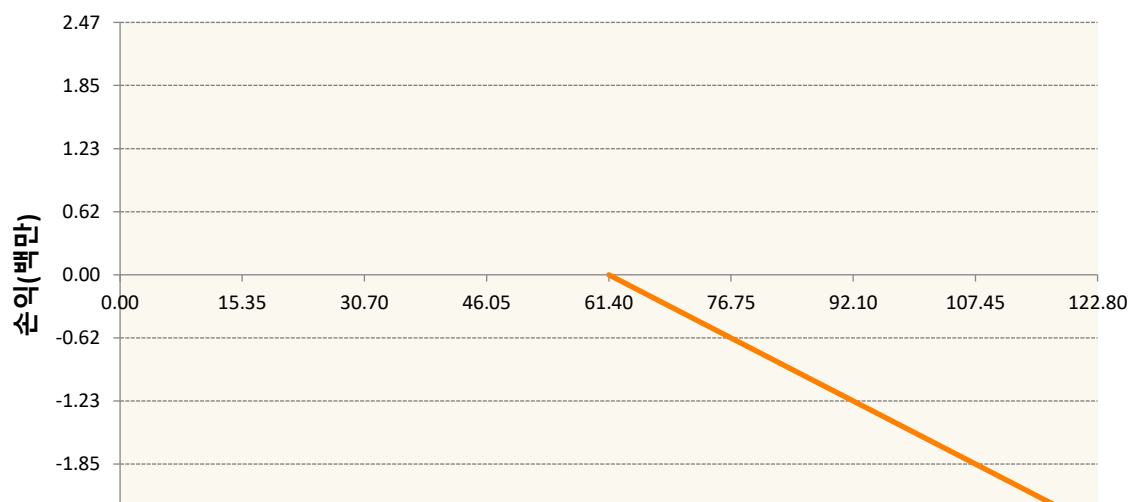
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	76	-76	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,008	-2,008	장외

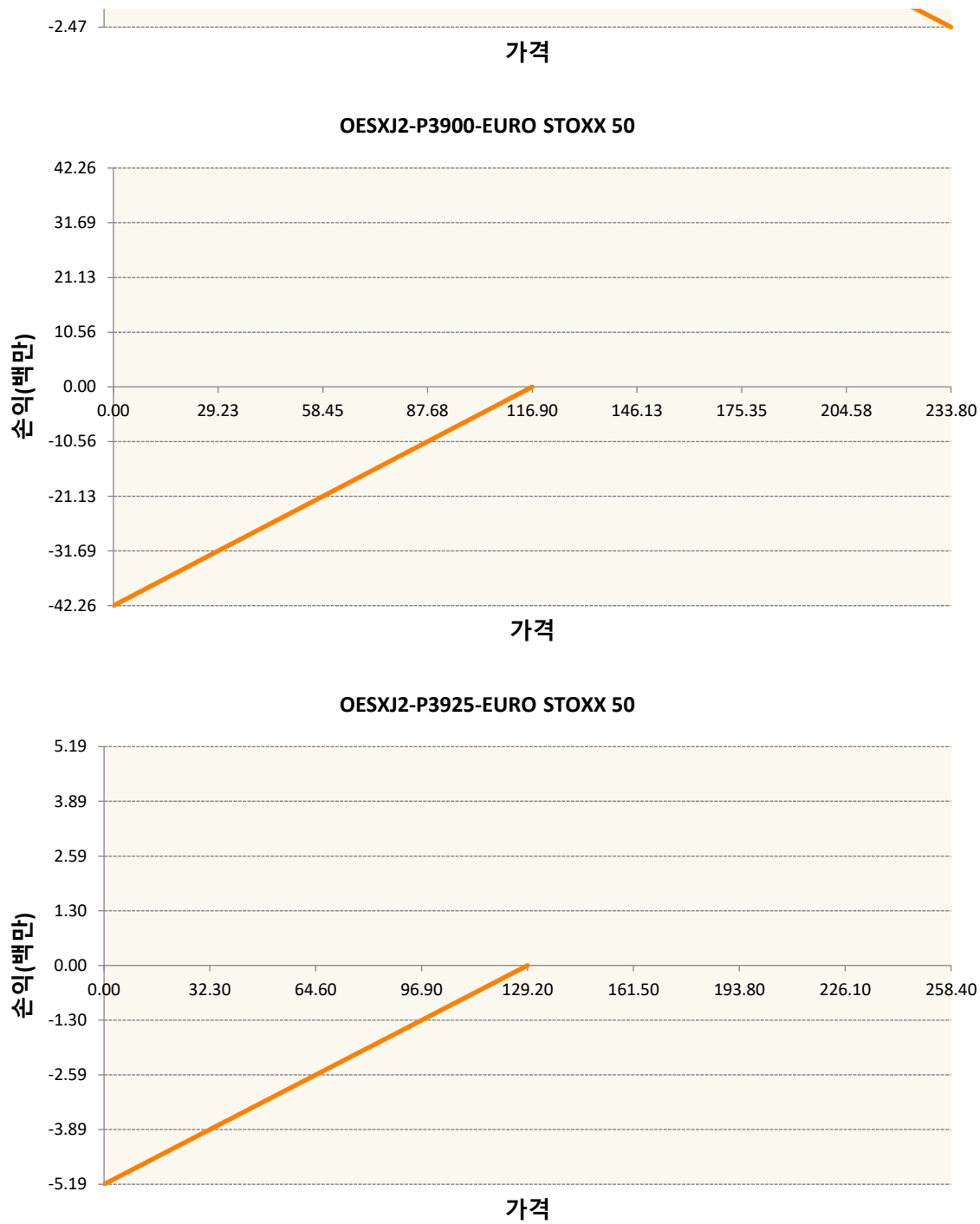
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ2-C3900-EURO STOXX 50



OESXJ2-C3925-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	3
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
OESXJ2-C39(EURO STOXX 50	2
OESXJ2-C39(EURO STOXX 50	0.2
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50	3
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50	0.42

공시일 2022-03-25

기준일 2022-03-24

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

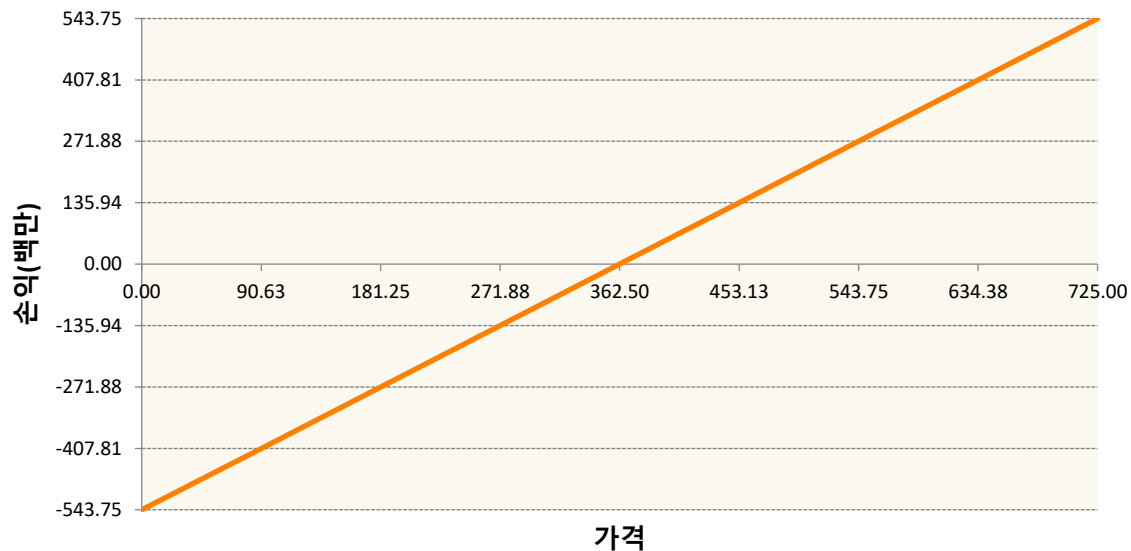
1. 계약금액

(단위:백만원)

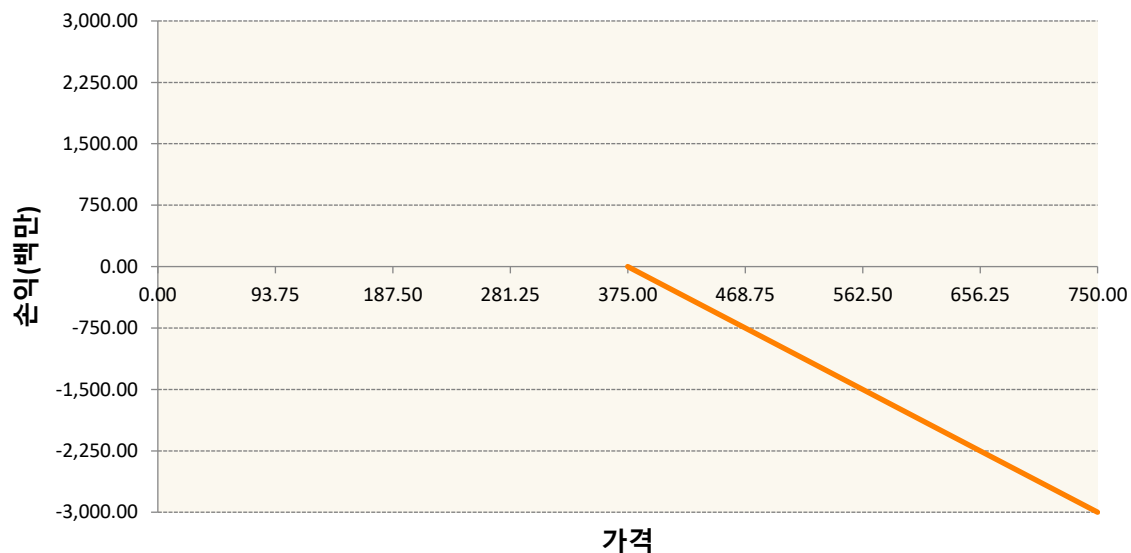
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	544	0	544	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

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				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				147
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	46	44	42	40	38	35
-5.33%	44	41	38	35	32	27	23
-2.67%	36	32	27	22	17	11	5
0%	19	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	-10	-18	-25	-32	-39	-47	-54
5.33%	-54	-61	-68	-75	-82	-89	-97
8.00%	-111	-116	-122	-128	-134	-141	-147
KR4201S43770 2022-04 콜377.5							79

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23	22	22	21	20	19	17
-5.33%	22	21	19	18	16	14	11
-2.67%	18	16	14	11	8	5	2
0%	10	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	-4	-8	-13	-17	-21	-25	-29
5.33%	-27	-31	-35	-39	-43	-47	-52
8.00%	-57	-60	-64	-68	-71	-75	-79

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

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

(단위:백만원)

244

공시일	2022-03-25
기준일	2022-03-24

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	9,372	0	9,372	

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	2022-03-25
기준일	2022-03-24

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	124	-124	
누계	유가증권	수익증권	7,621	0	7,621	

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	2022-03-25
기준일	2022-03-24

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	25,586	0	25,586	
누계	통화	선도	5,485	30,141	-24,656	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E		195
FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E		68
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E		2,216
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		78
FXW213C3F USD/KRW 25-03-22E		49
FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E		98

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

(단위:백만원)

942

공시일 2022-03-25

기준일 2022-03-24

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

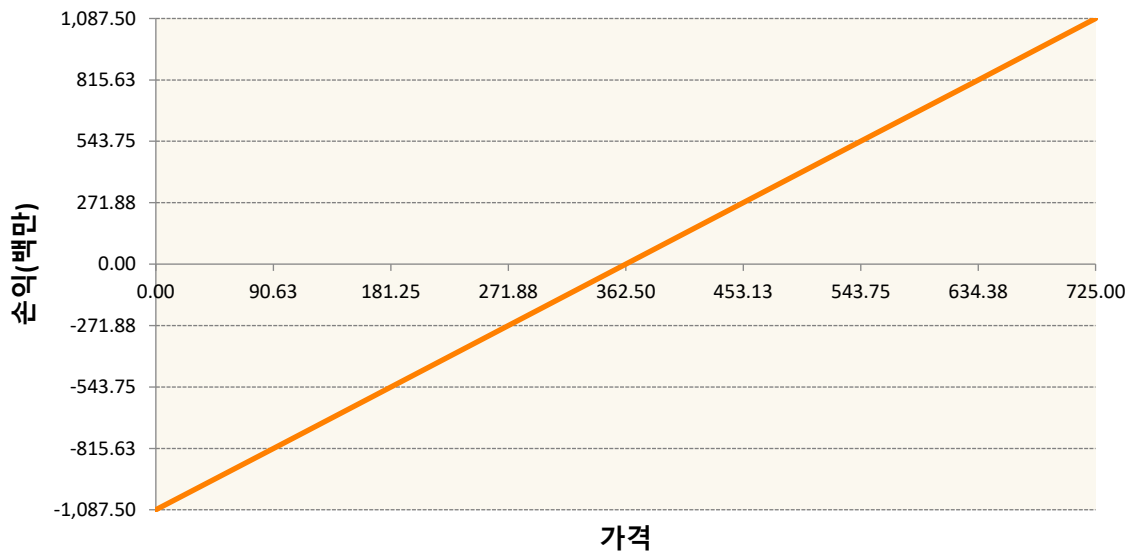
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,088	0	1,088	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



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 2022-03-25

기준일 2022-03-24

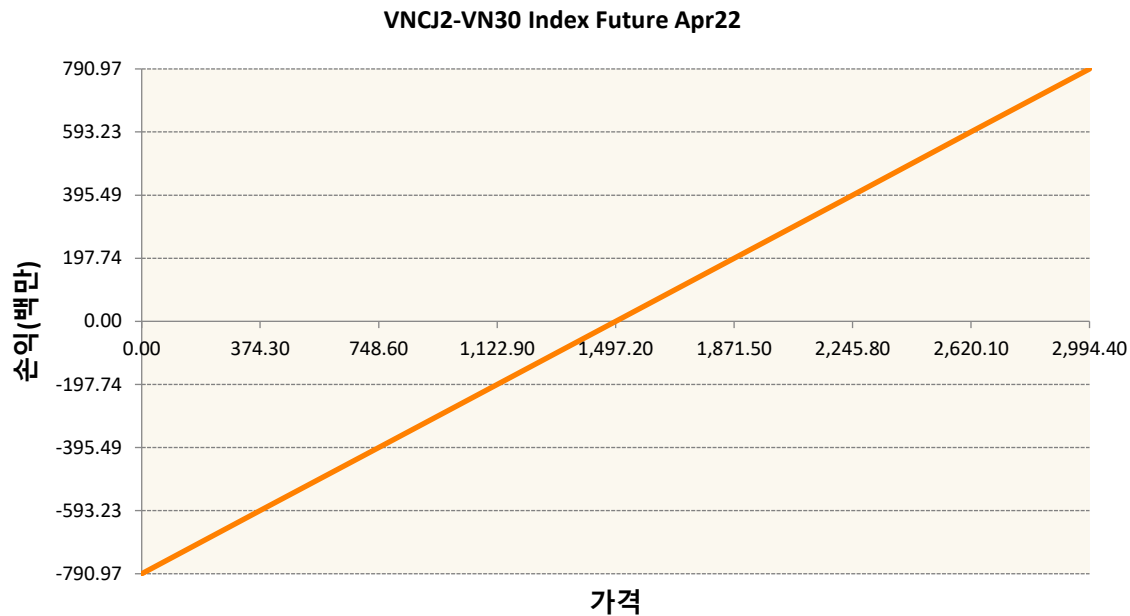
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	791	0	791	
누계	유가증권	스왑	1,830	0	1,830	장외
누계	통화	선도	0	1,178	-1,178	장외

2. 만기시점의 손익구조



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	63

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

(단위:백만원)

266

공시일 2022-03-25

기준일 2022-03-24

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

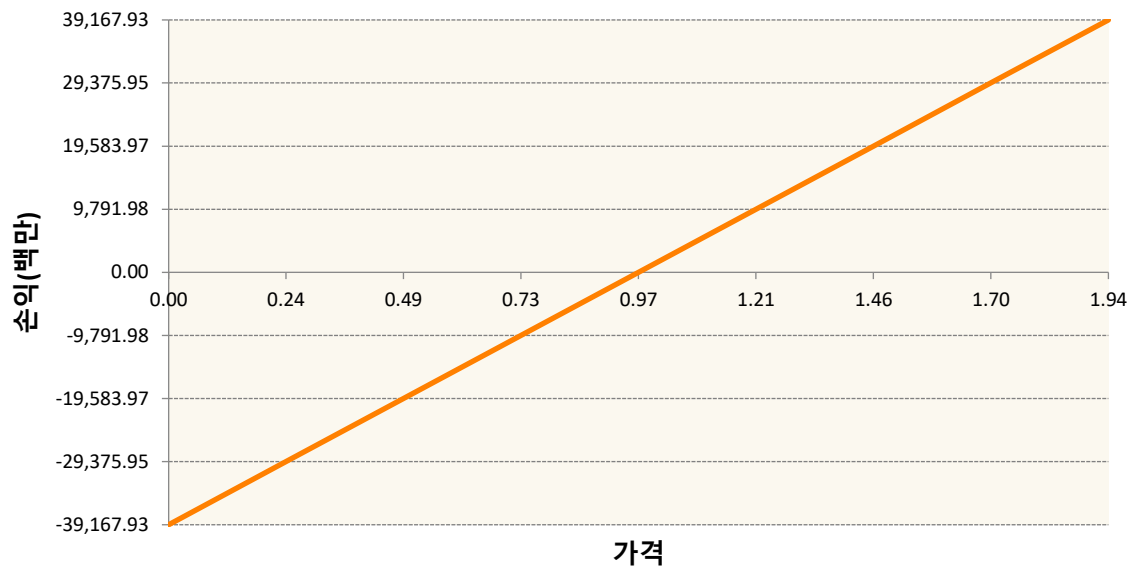
1. 계약금액

(단위:백만원)

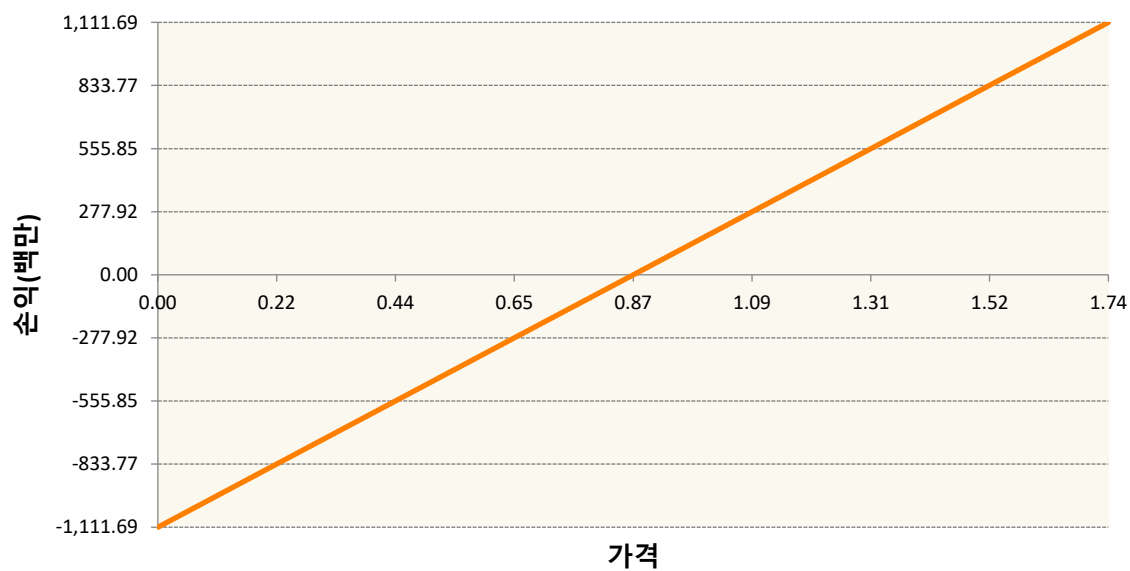
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	42,508	0	42,508	

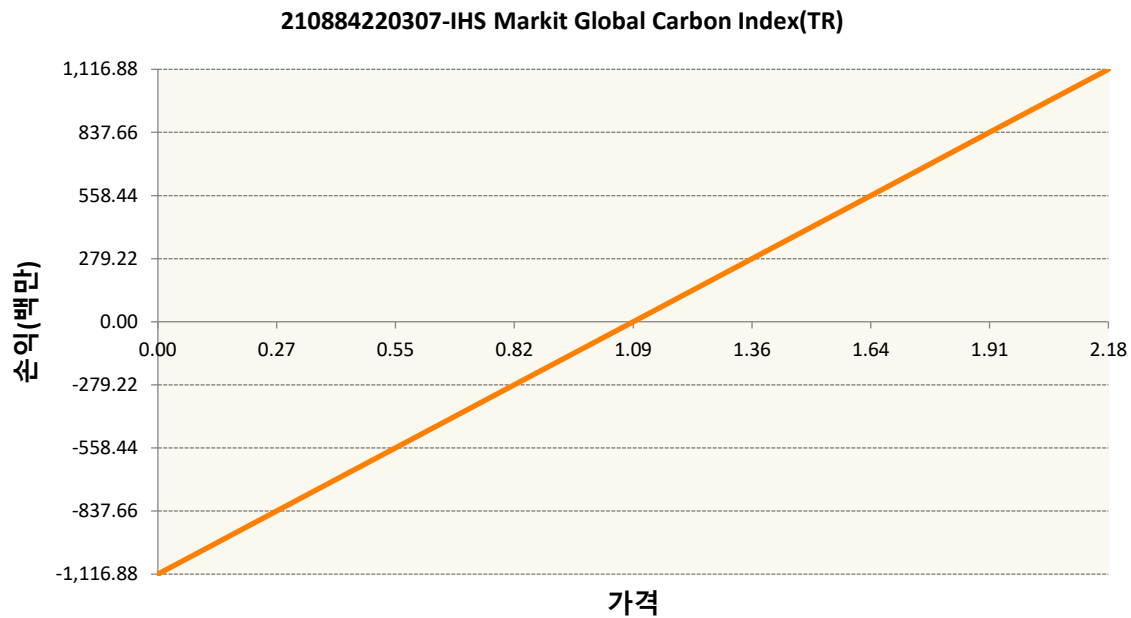
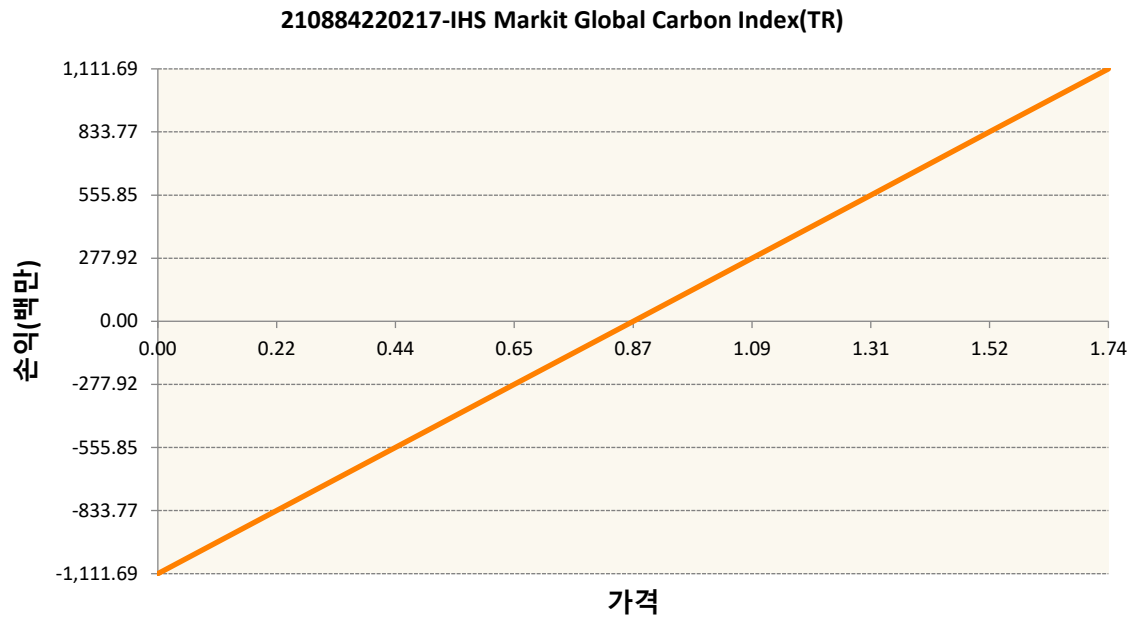
2. 만기시점의 손익구조

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)		3,119
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		89
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		89
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		89

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		6,219

공시일 2022-03-25

기준일 2022-03-24

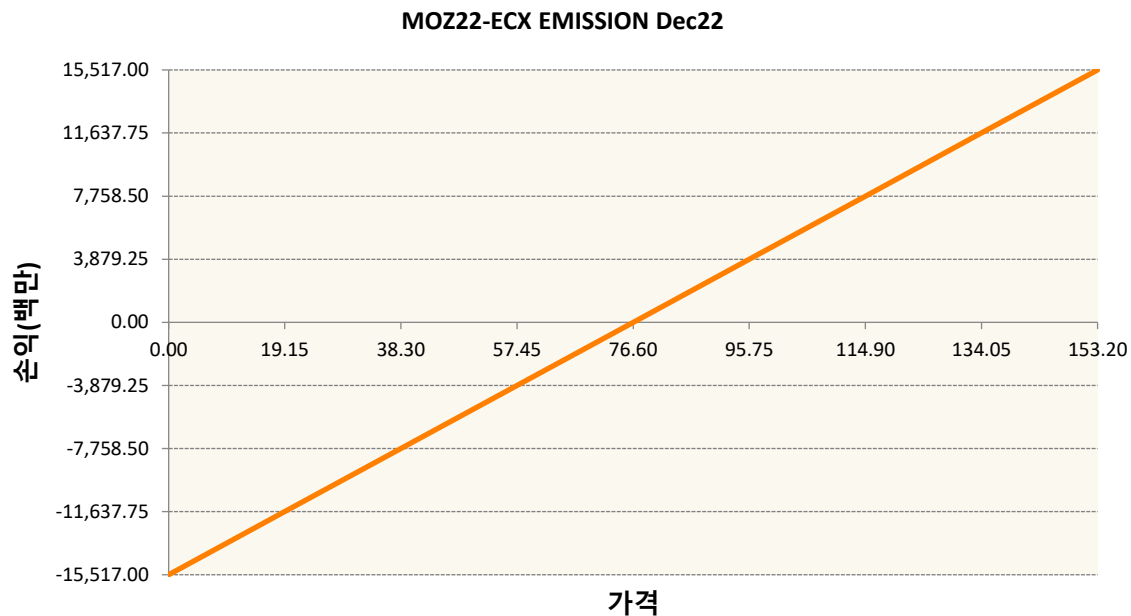
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,517	0	15,517	
누계	통화	선도	0	8,190	-8,190	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2R KRW/EUR 28-03-22E

655

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,241

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

(단위:백만원)

3,300

공시일	2022-03-25
기준일	2022-03-24

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	11,035	0	11,035	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	3

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

(단위:백만원)

26

공시일	2022-03-25
기준일	2022-03-24

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)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	24
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	20

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

(단위:백만원)

106

공시일 2022-03-25

기준일 2022-03-24

에퀴티알파일반사모혼합자산

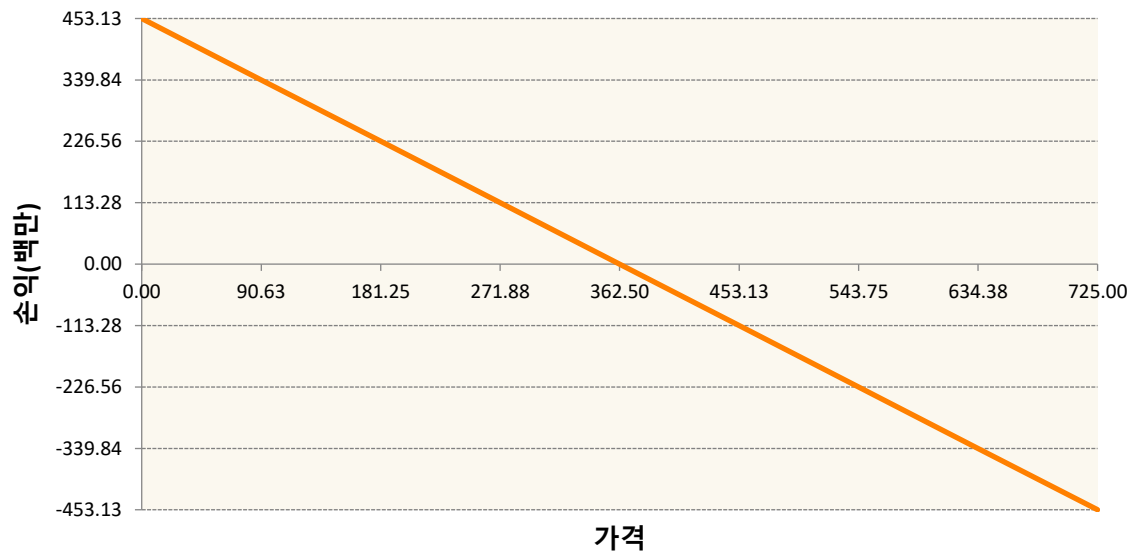
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	453	-453	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0003014. SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322	0.4
KRS0003014. SWAP_APPLE INC_0322	1
KRS0003014. SWAP_NVIDIA CORP_0322	0.4
KRS0003014. SWAP_TESLA INC_0322	1
KRS0003014. SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	0.36
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물	36

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

(단위:백만원)

41

공시일 2022-03-25

기준일 2022-03-24

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

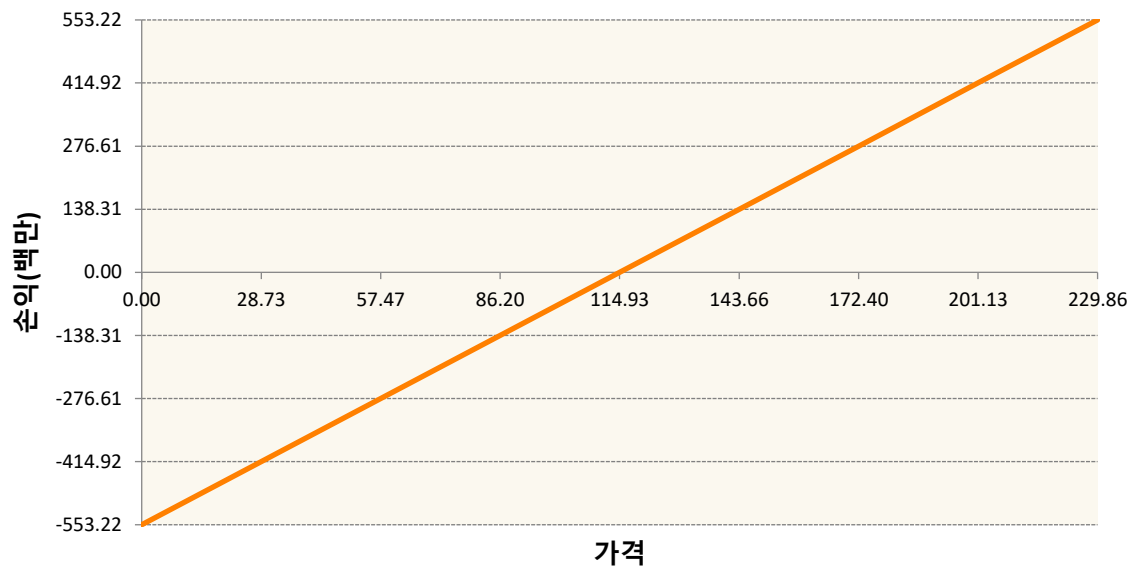
1. 계약금액

(단위:백만원)

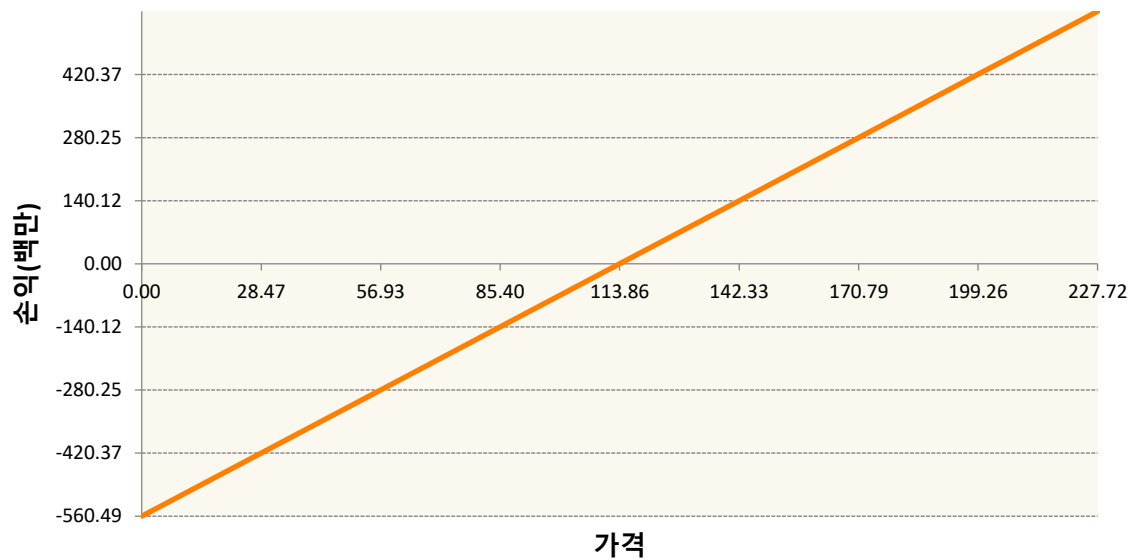
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,452	548	1,904	

2. 만기시점의 손익구조

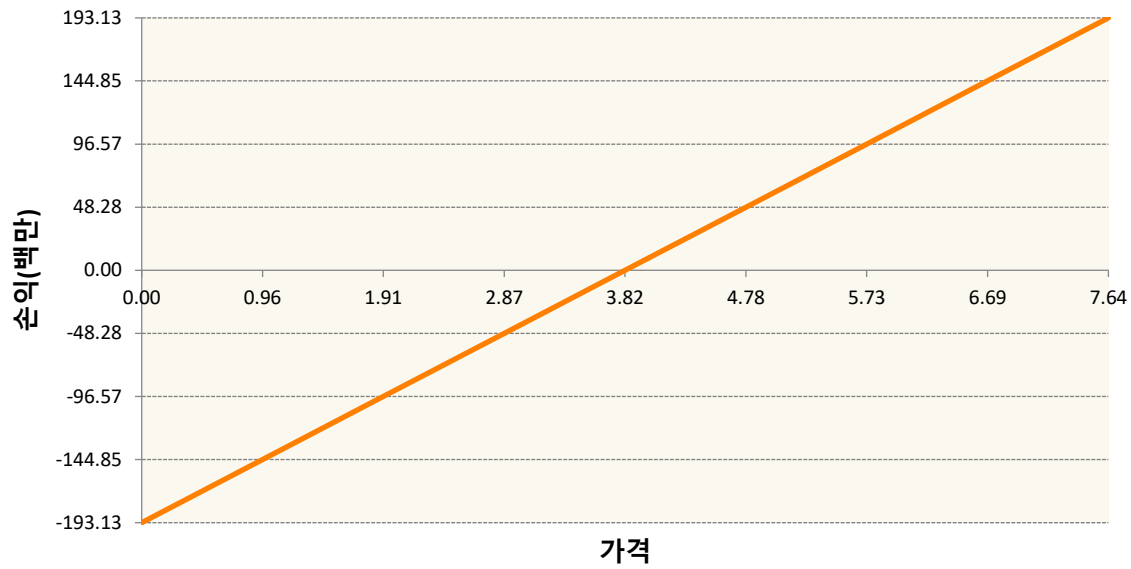
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



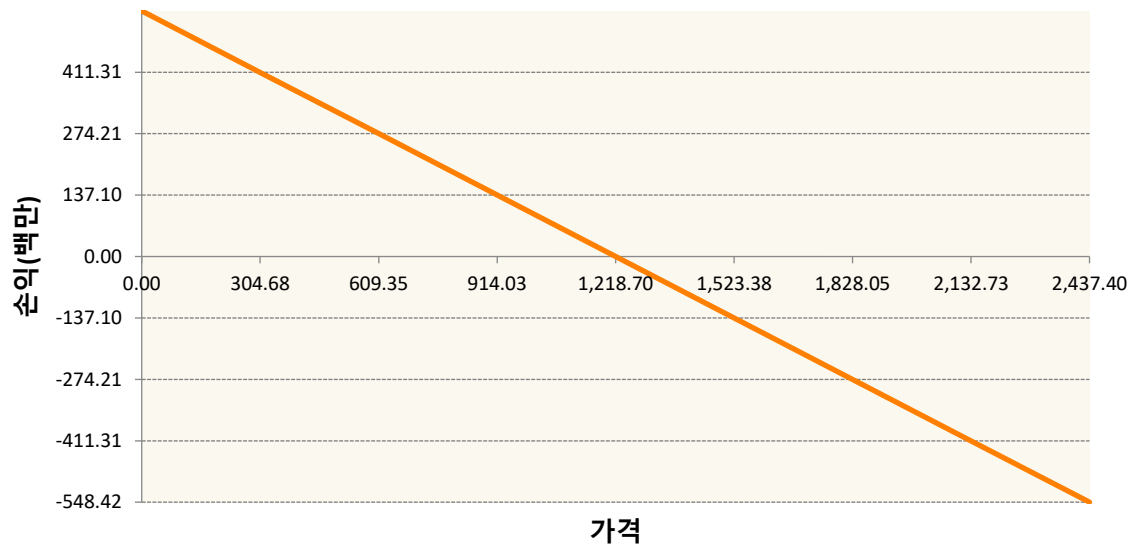
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



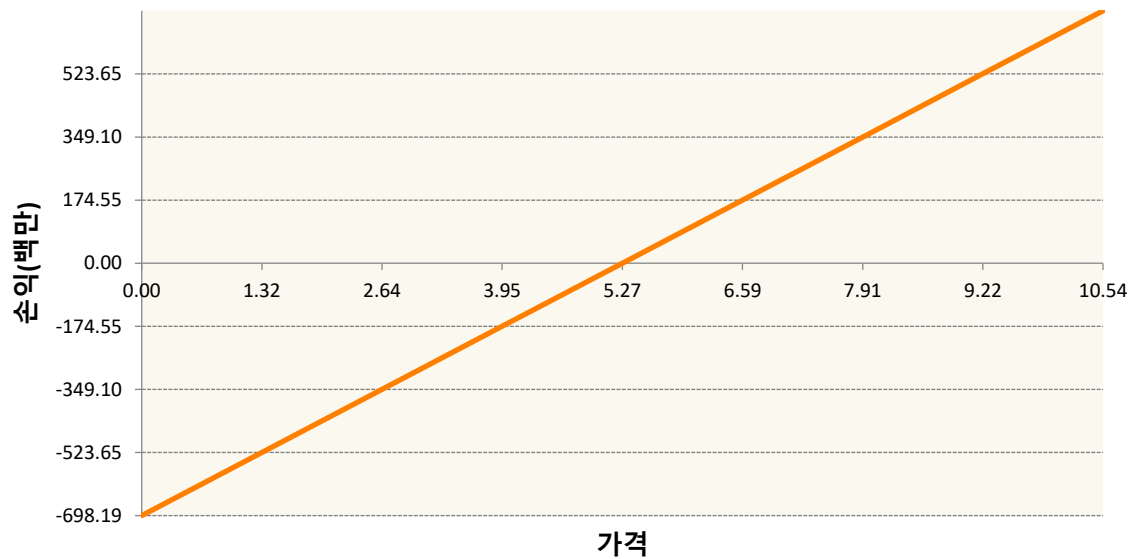
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

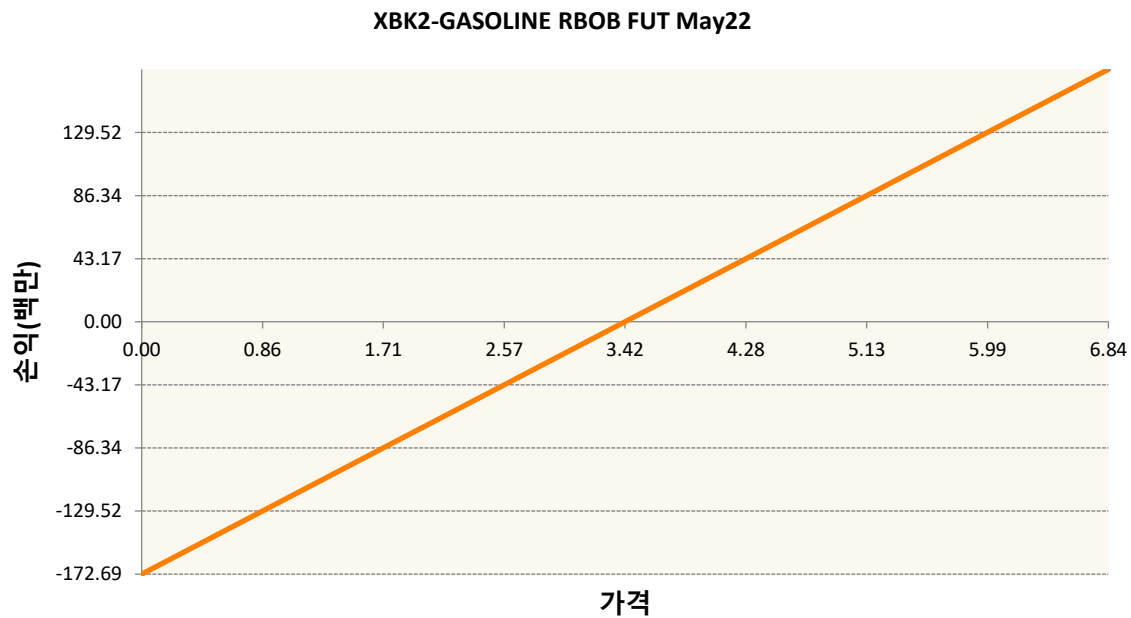
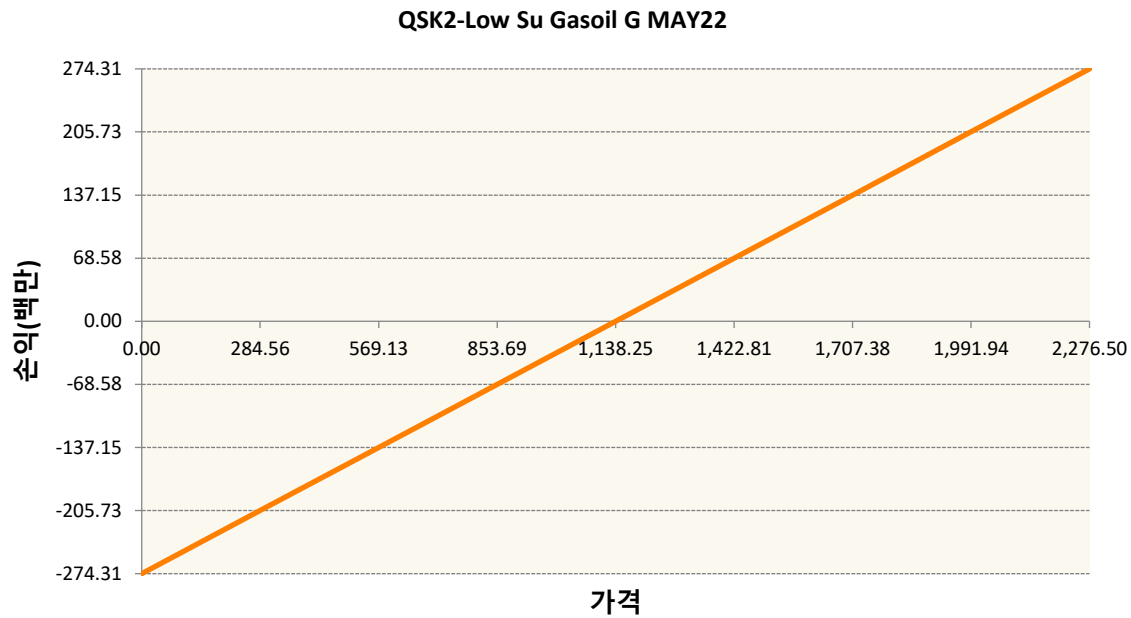


KR4175S40004-2022-04 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		44
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		45
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		15
KR4175S400 2022-04 달러선물			44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		56
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		22
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	539