

공시일 2022-03-28

기준일 2022-03-25

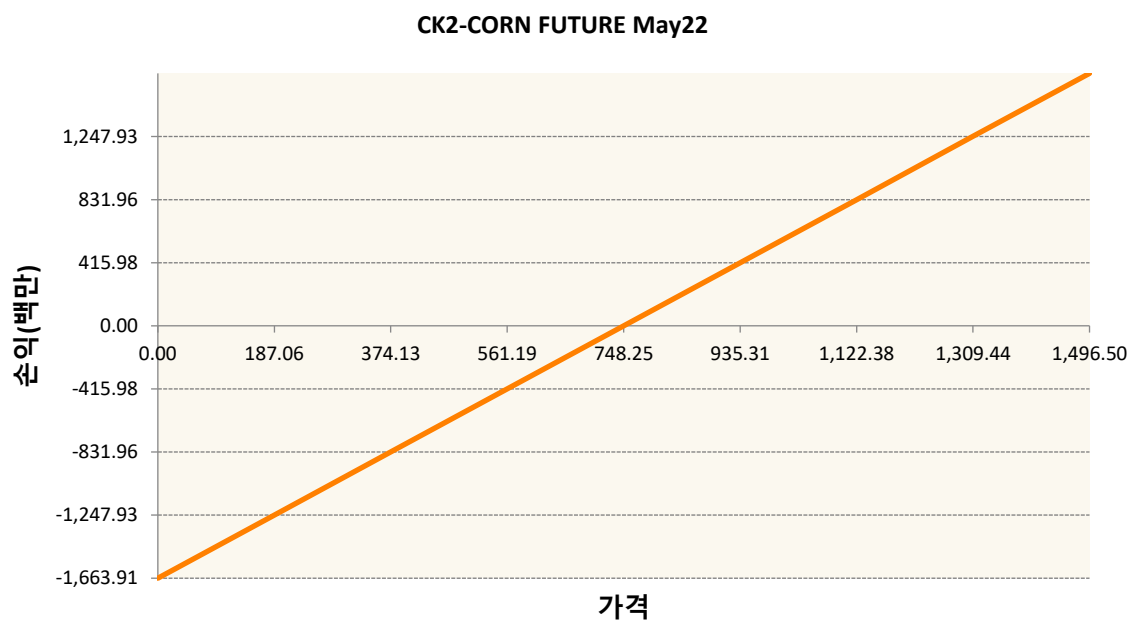
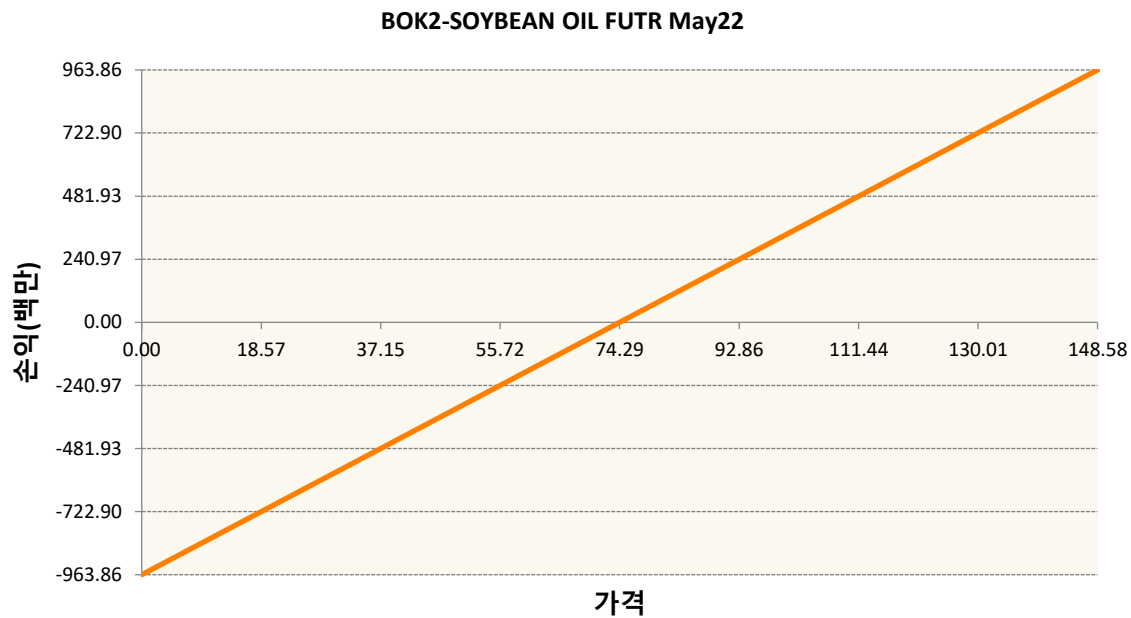
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

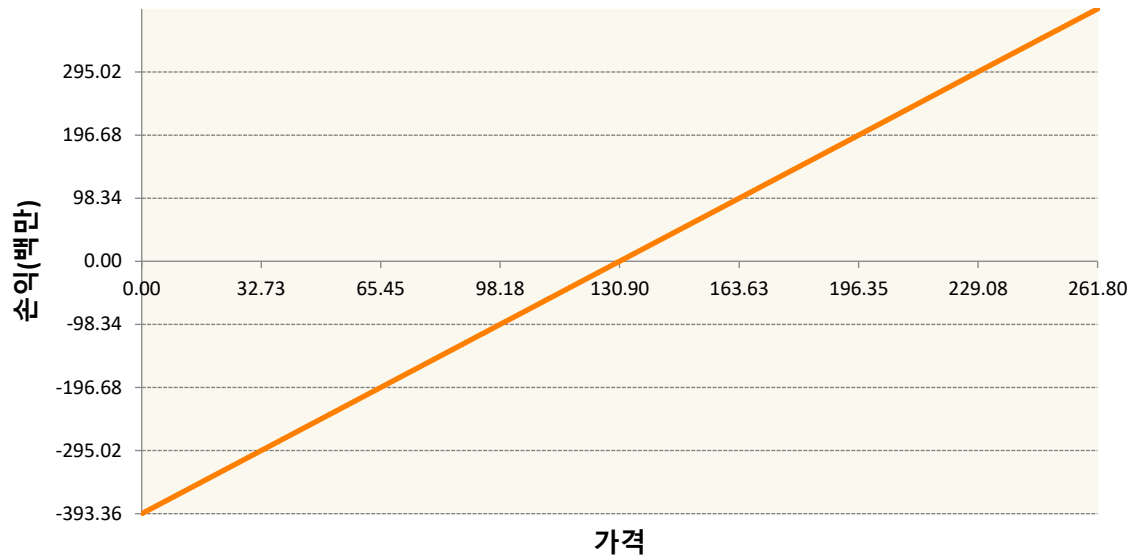
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,516	1,708	6,808	

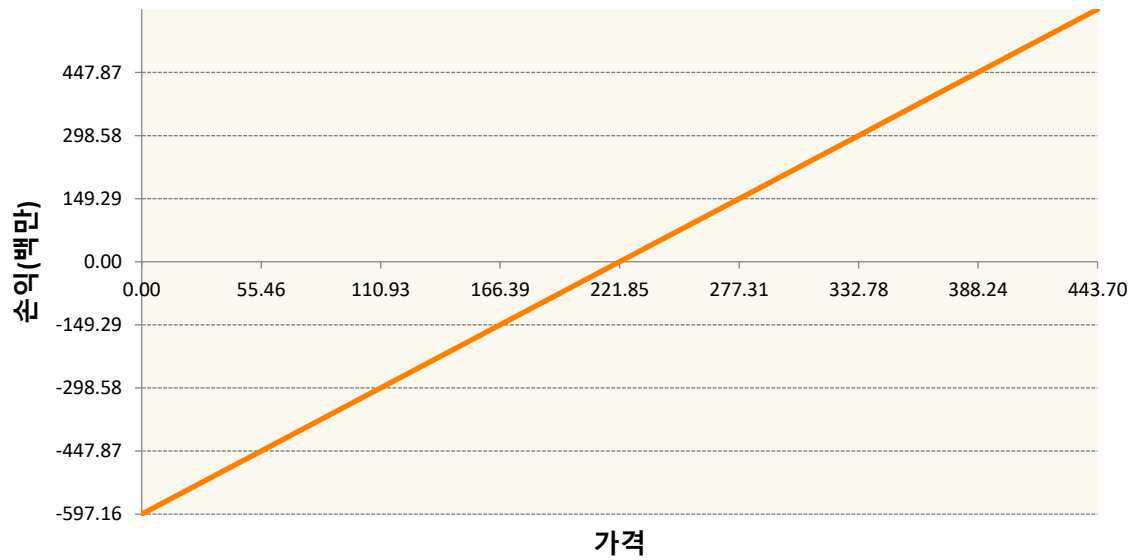
2. 만기시점의 손익구조



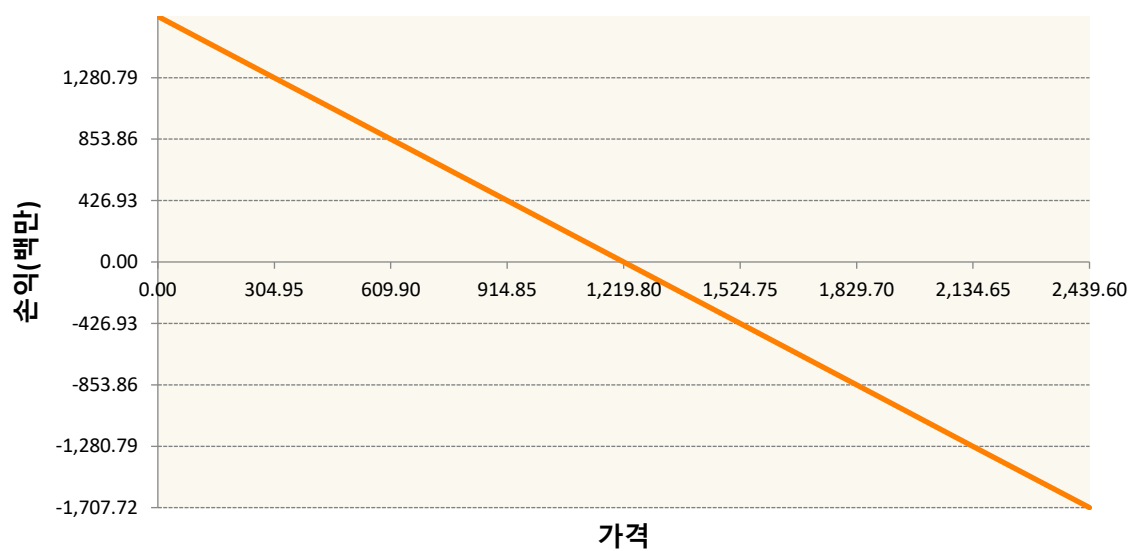
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



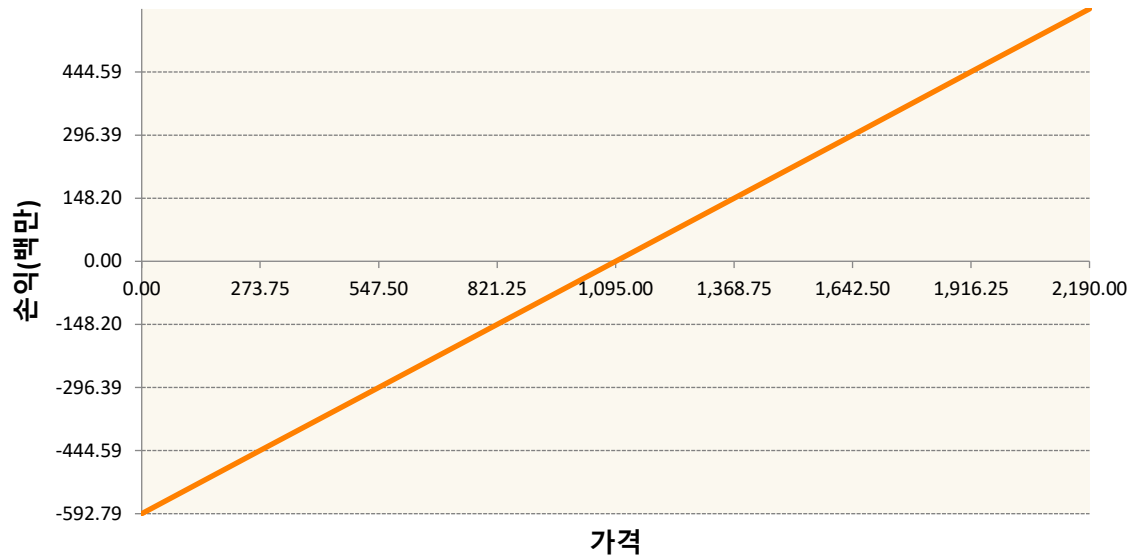
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



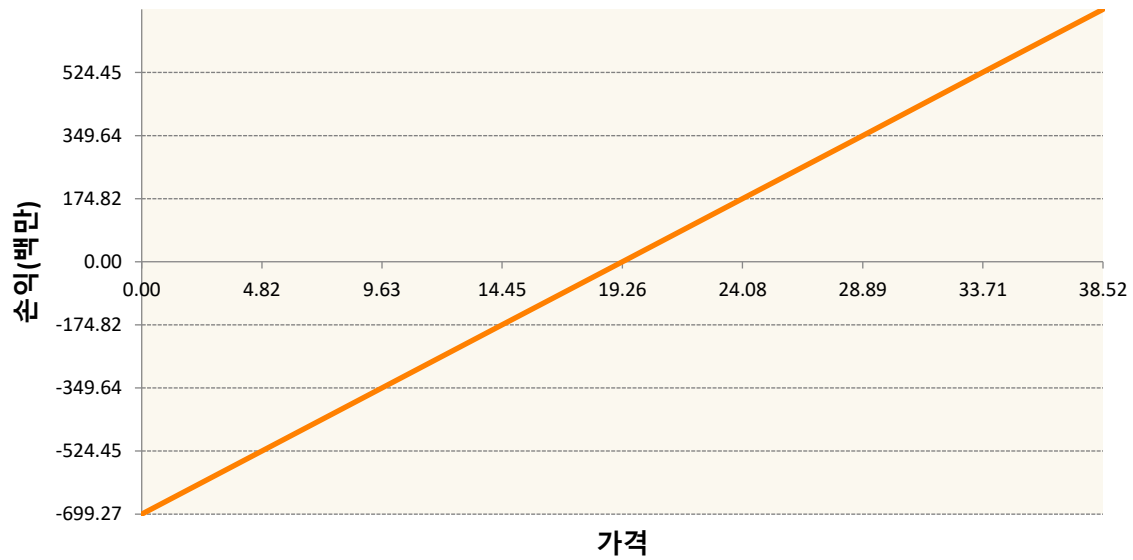
KR4175S40004-2022-04 달러선물



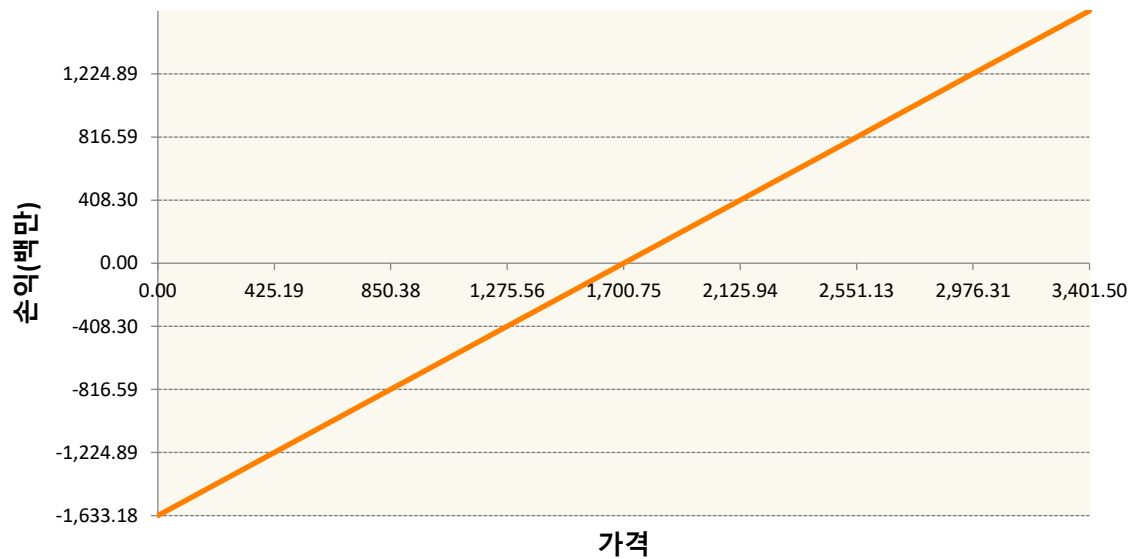
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



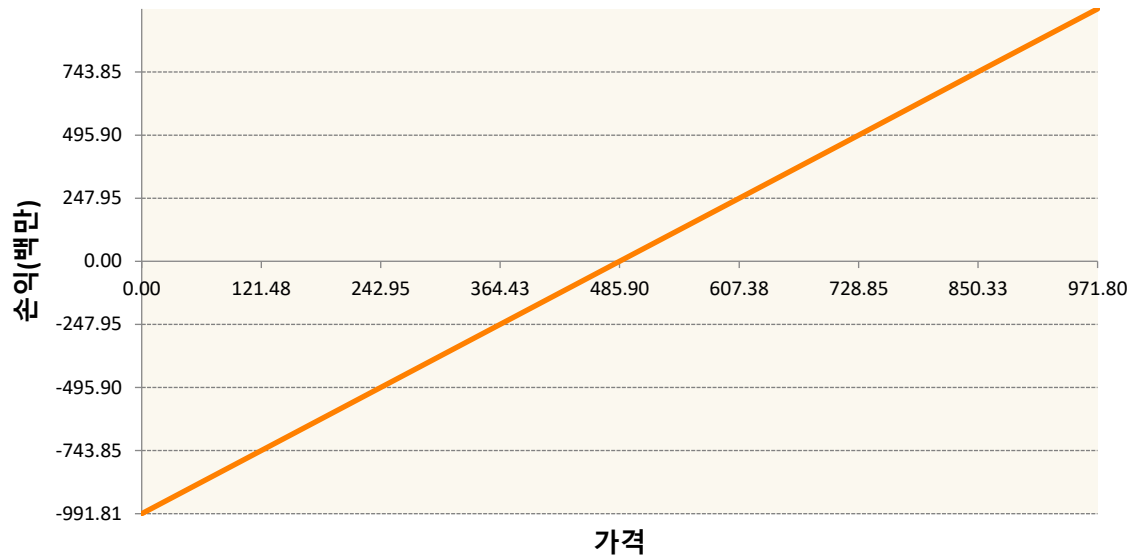
SBK2-Sugar May22



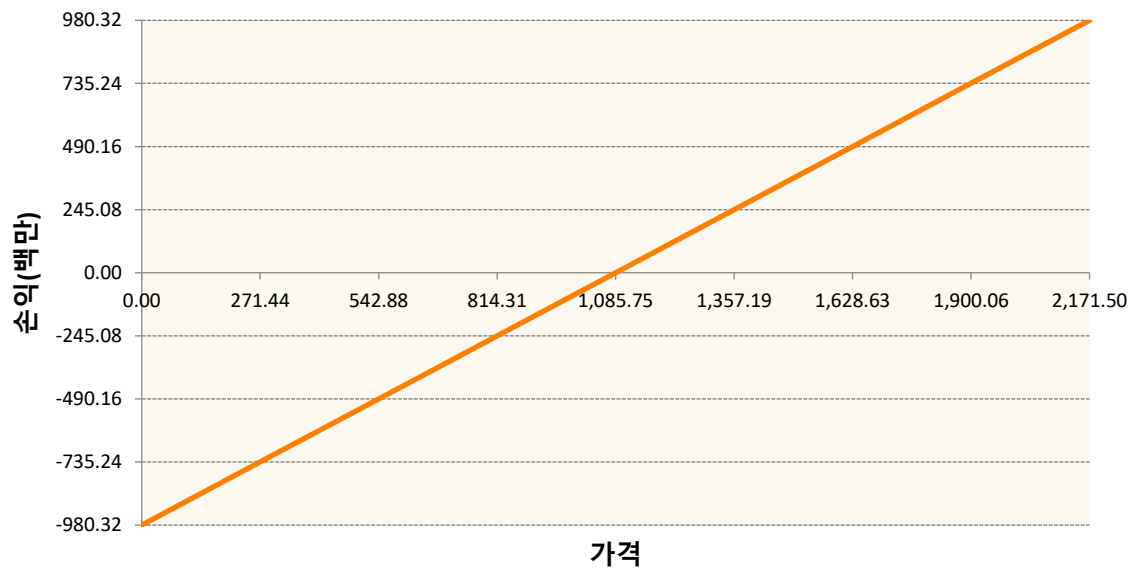
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



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	2022-03-28
기준일	2022-03-25

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	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	2022-03-28
기준일	2022-03-25

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	391
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

400

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-03-28

기준일 2022-03-25

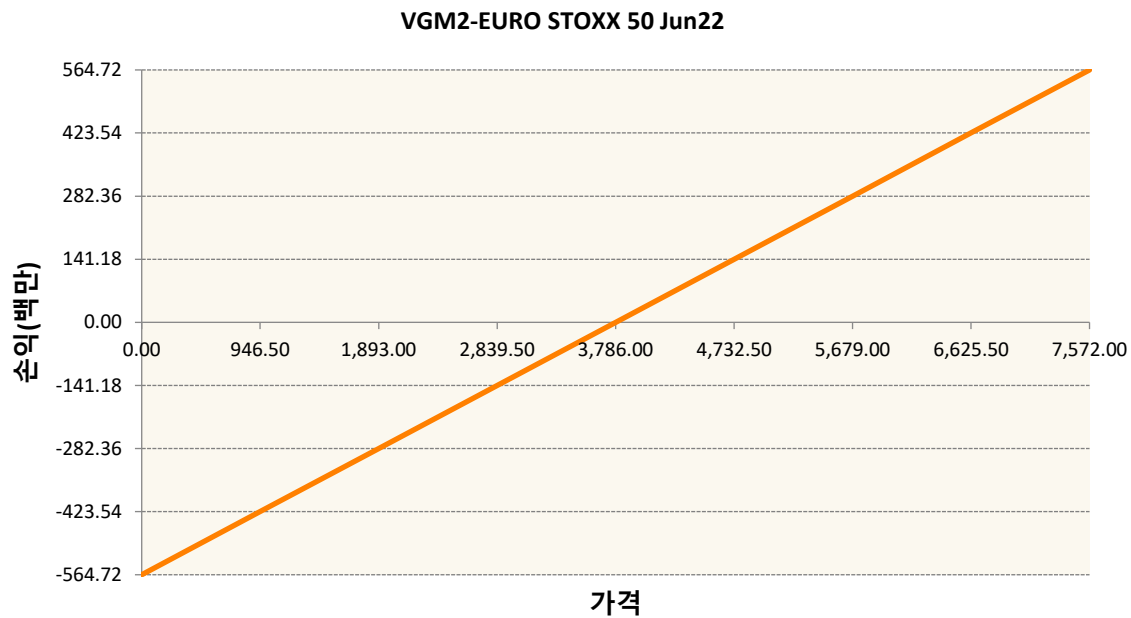
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	565	0	565	

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	2022-03-28
기준일	2022-03-25

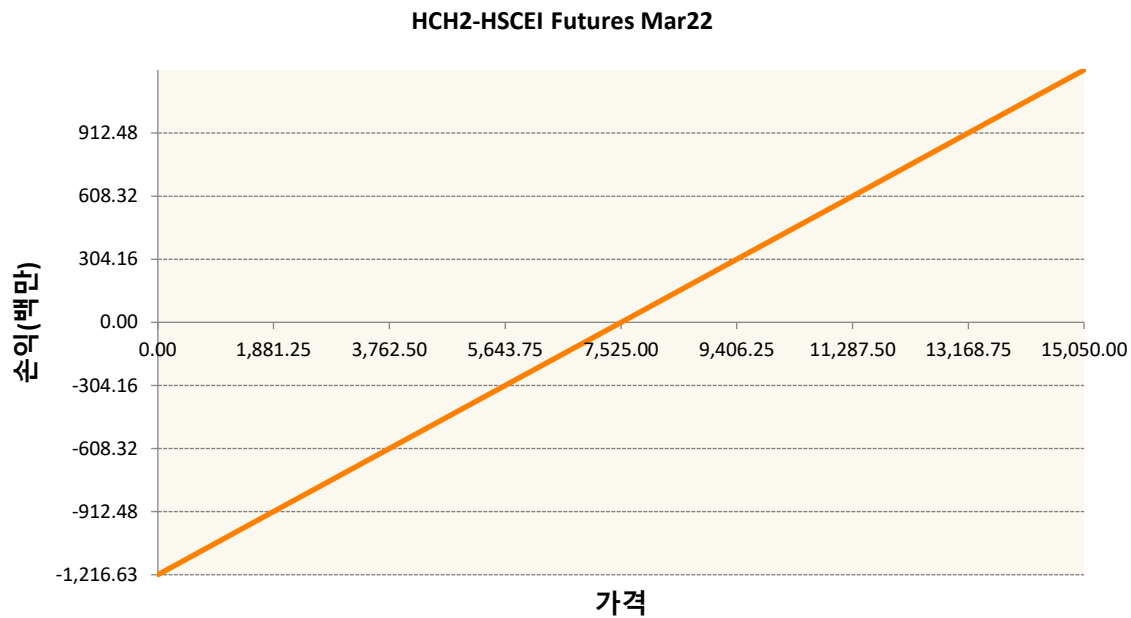
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,217	0	1,217	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2	HSCEI Futures Mar22	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

128

공시일 2022-03-28

기준일 2022-03-25

커버드콜모(주식혼합-파생형)

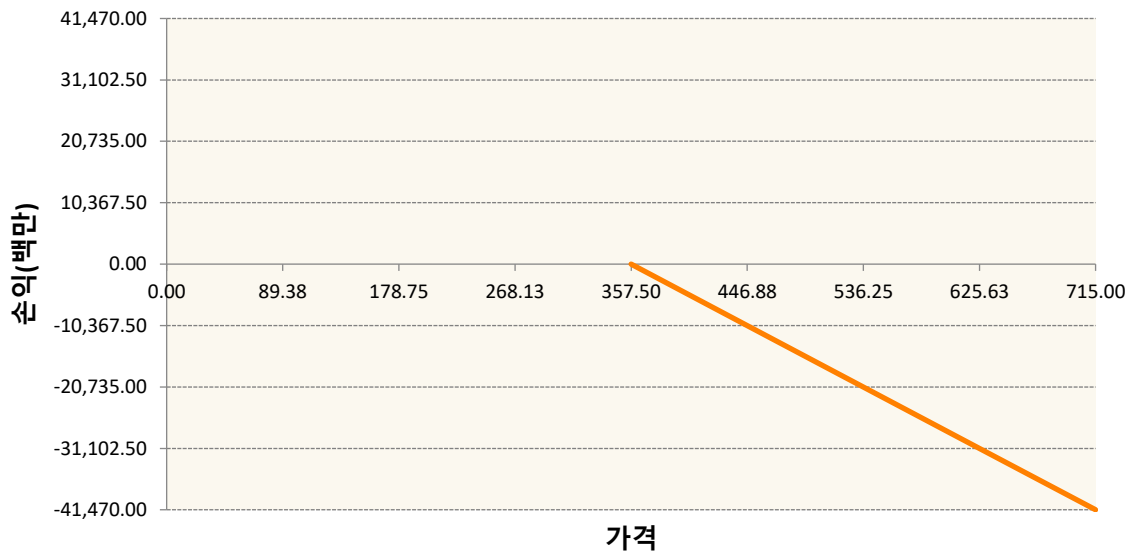
1. 계약금액

(단위:백만원)

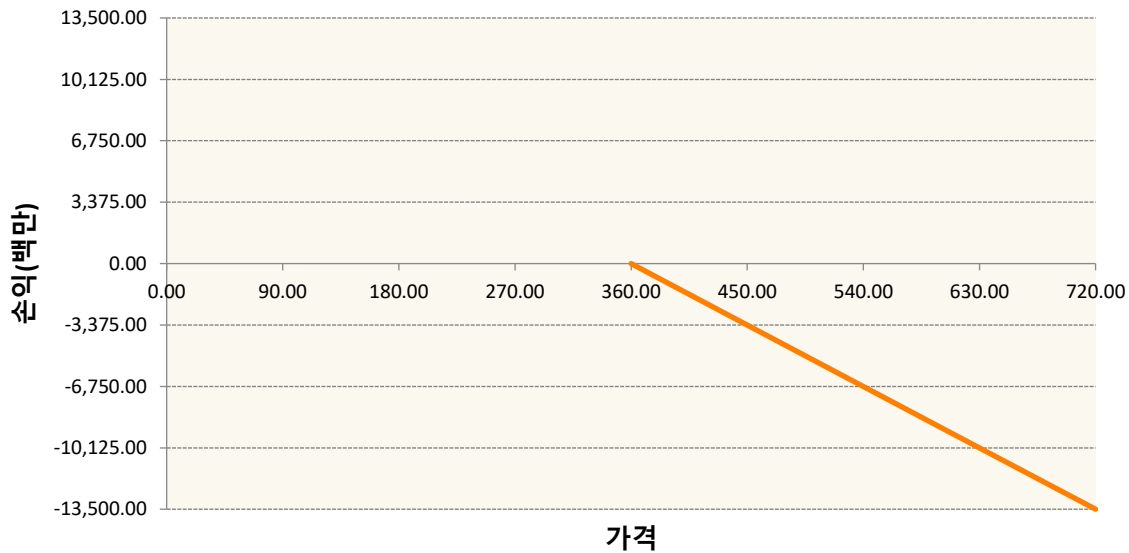
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,410	-66,410	장내

2. 만기시점의 손익구조

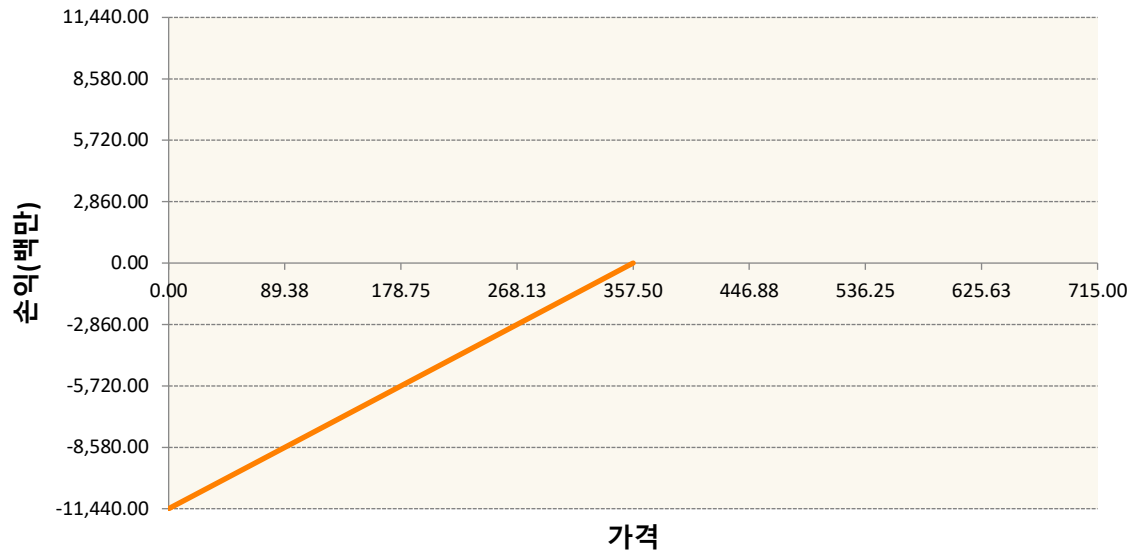
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572			2022-04 콜357.5				2,730
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,379	1,335	1,284	1,228	1,167	1,102	1,033
-5.33%	1,204	1,130	1,053	973	890	806	720
-2.67%	856	761	665	569	473	376	279
0%	293	196	98	0	-98	-197	-295
2.67%	-480	-560	-643	-729	-818	-908	-999
5.33%	-1,414	-1,468	-1,528	-1,595	-1,665	-1,740	-1,817
8.00%	-2,449	-2,479	-2,517	-2,562	-2,612	-2,669	-2,730
KR4201S43606			2022-04 콜360				856
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	403	391	376	360	342	323	302
-5.33%	357	335	312	288	262	236	210
-2.67%	260	231	200	170	140	109	78
0%	97	64	32	0	-32	-64	-97
2.67%	-136	-164	-193	-223	-253	-283	-314
5.33%	-426	-446	-468	-492	-516	-542	-569
8.00%	-754	-765	-780	-796	-814	-834	-856
KR4301S43570			2022-04 풋357.5				668
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-636	-639	-643	-648	-653	-660	-668
-5.33%	-346	-355	-365	-376	-388	-400	-413
-2.67%	-105	-121	-137	-154	-171	-188	-205
0%	51	34	17	0	-17	-34	-52

공시일 2022-03-28

기준일 2022-03-25

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

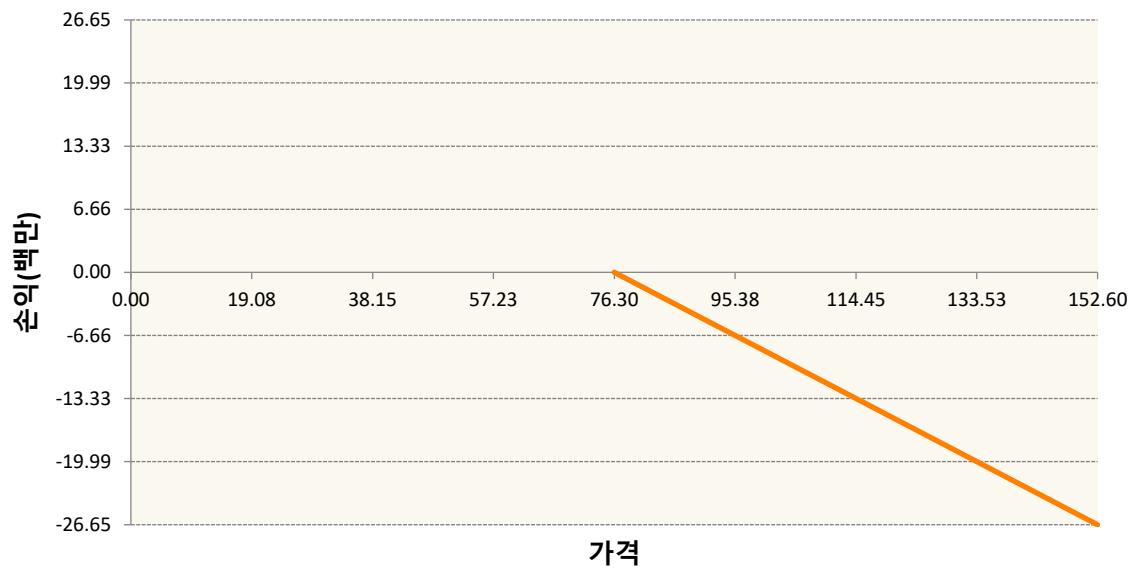
1. 계약금액

(단위:백만원)

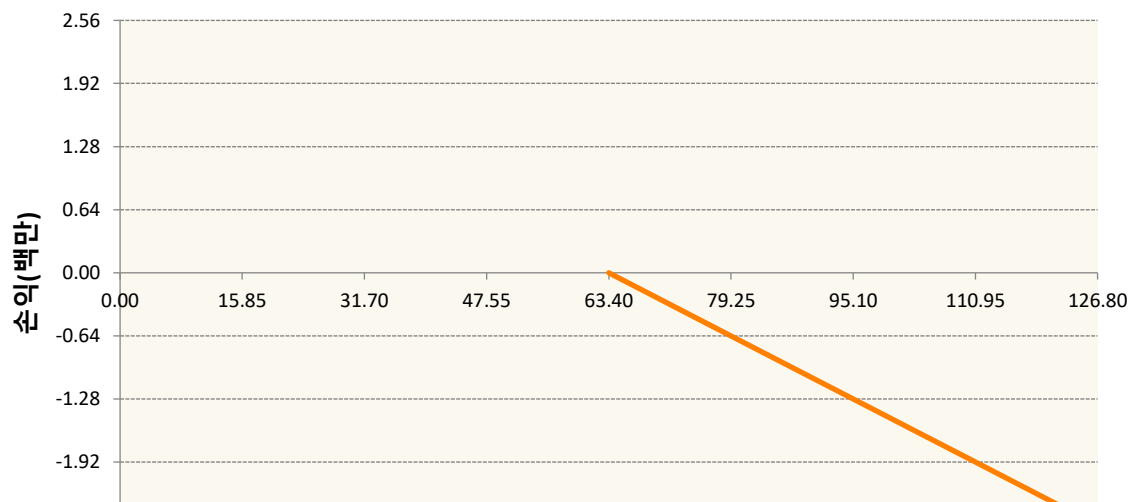
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	77	-77	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,015	-2,015	장외

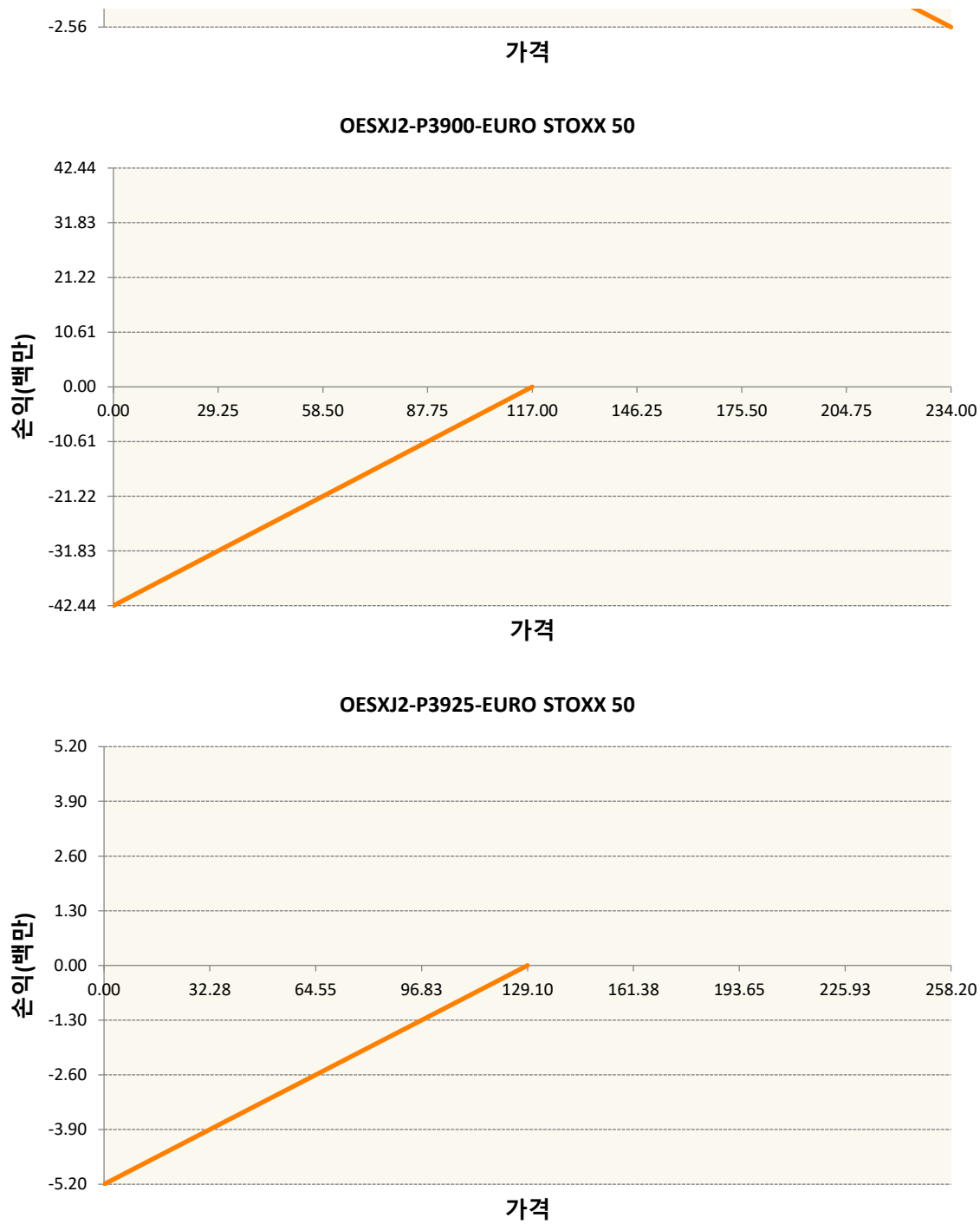
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ2-C3900-EURO STOXX 50



OESXJ2-C3925-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E
FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E
FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E
FXW213C3A KRW/EUR 22-04-22E
OESXJ2-C39(EURO STOXX 50
OESXJ2-C39(EURO STOXX 50
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50

2
21
32
64
43
2
0.2
3
0.42

공시일 2022-03-28

기준일 2022-03-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

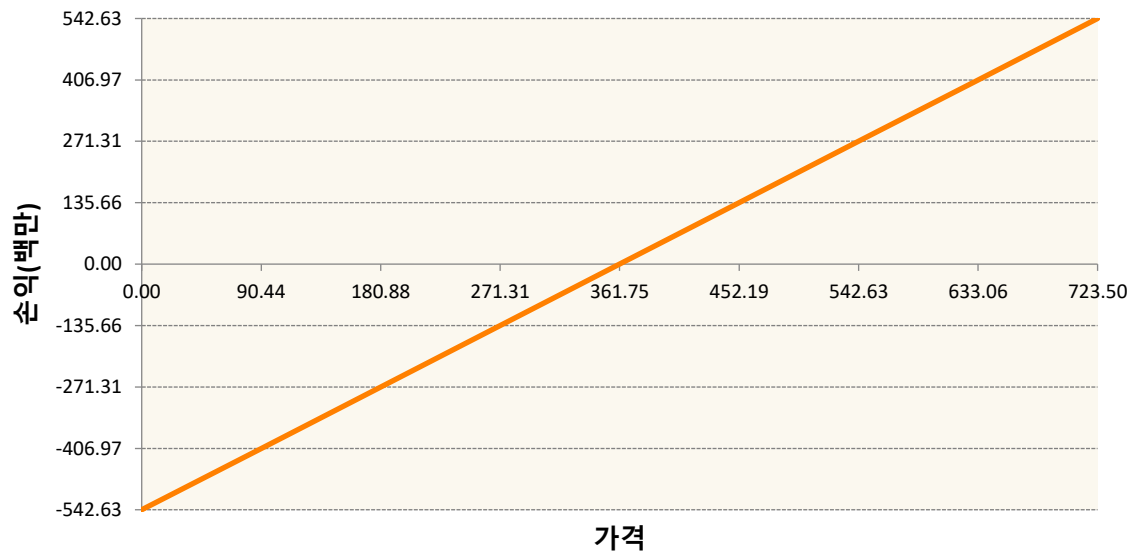
1. 계약금액

(단위:백만원)

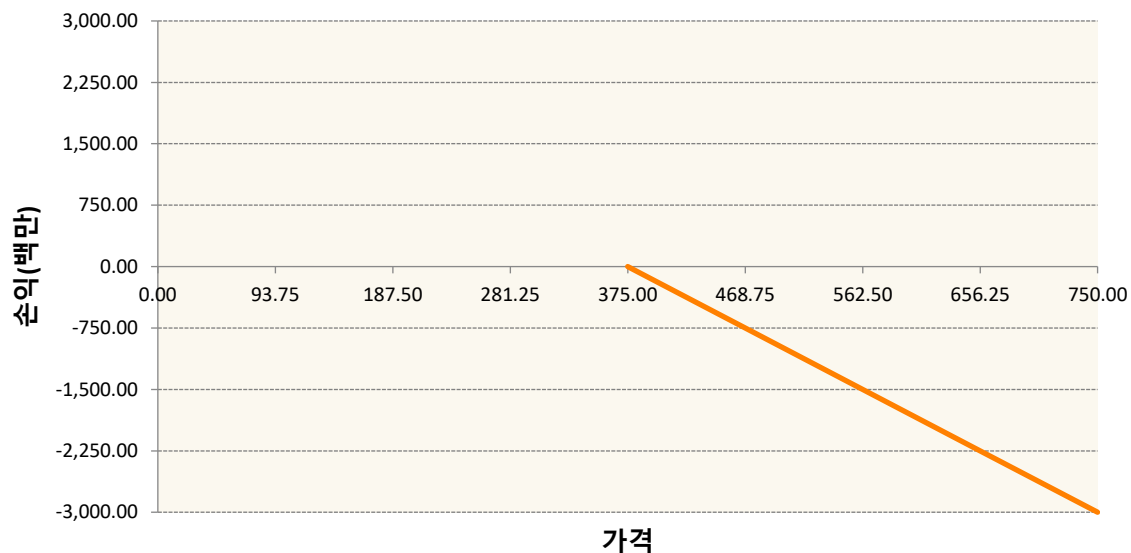
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	543	0	543	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

2. 만기시점의 손익구조

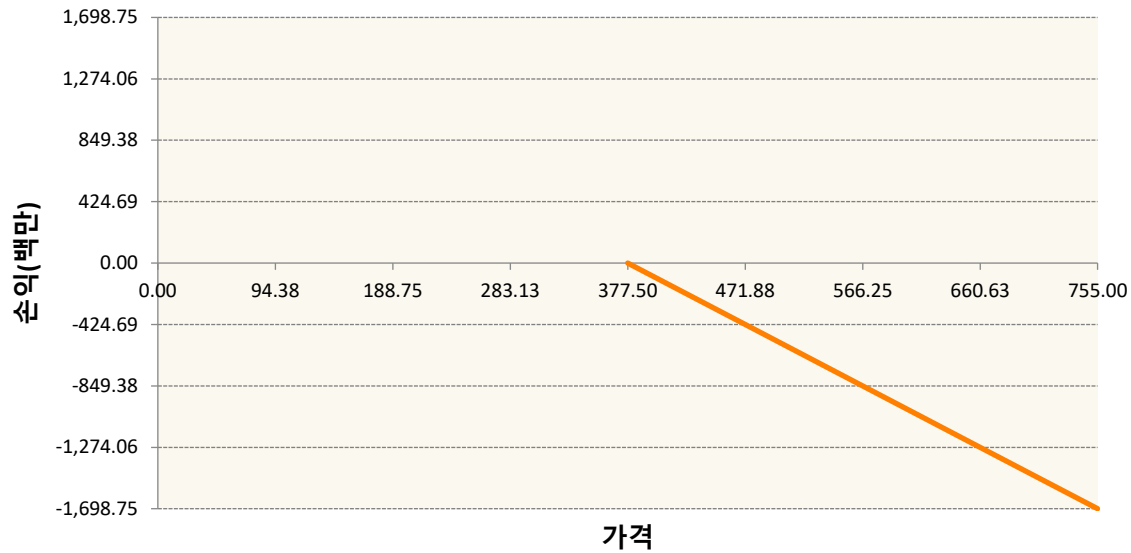
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



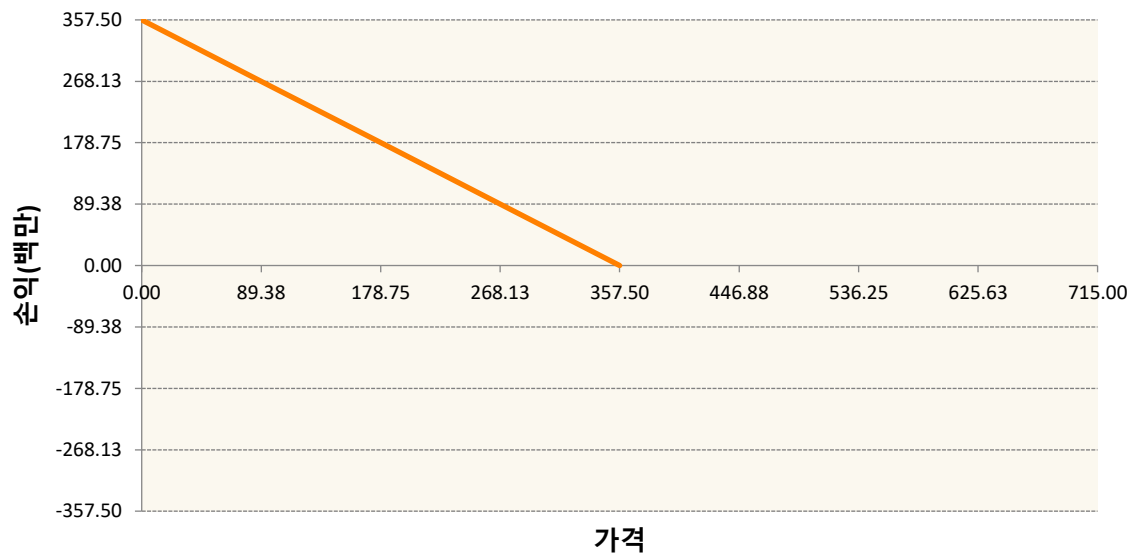
KR4201S43754-2022-04 콜375



KR4201S43770-2022-04 콜377.5



KR4301S43570-2022-04 ㄸ357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(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				143
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	42	41	40	38	36	34	31
-5.33%	39	37	35	32	29	25	21
-2.67%	33	29	25	20	15	10	5
0%	18	12	6	0	-6	-13	-19
2.67%	-9	-16	-23	-30	-37	-45	-52
5.33%	-51	-58	-65	-72	-79	-86	-93
8.00%	-106	-111	-117	-123	-130	-136	-143
KR4201S43770 2022-04 콜377.5							76

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	19	18	17	15
-5.33%	19	19	17	16	14	12	10
-2.67%	16	15	12	10	8	5	2
0%	10	6	3	0	-3	-7	-10
2.67%	-4	-8	-12	-16	-20	-23	-27
5.33%	-25	-29	-33	-37	-41	-45	-49
8.00%	-54	-58	-61	-65	-69	-72	-76
KR4301S43570 2022-04 풋357.5							21

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	20	20	20	20	21	21
-5.33%	11	11	11	12	12	13	13
-2.67%	3	4	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	-4	-4	-3
8.00%	-5	-5	-5	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

236

공시일	2022-03-28
기준일	2022-03-25

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	9,457	0	9,457	

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	2022-03-28
기준일	2022-03-25

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	7,690	0	7,690	

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	2022-03-28
기준일	2022-03-25

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	25,816	0	25,816	
누계	통화	선도	1,706	27,703	-25,997	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E		2,216
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E		39
FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E		98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	781

공시일 2022-03-28

기준일 2022-03-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

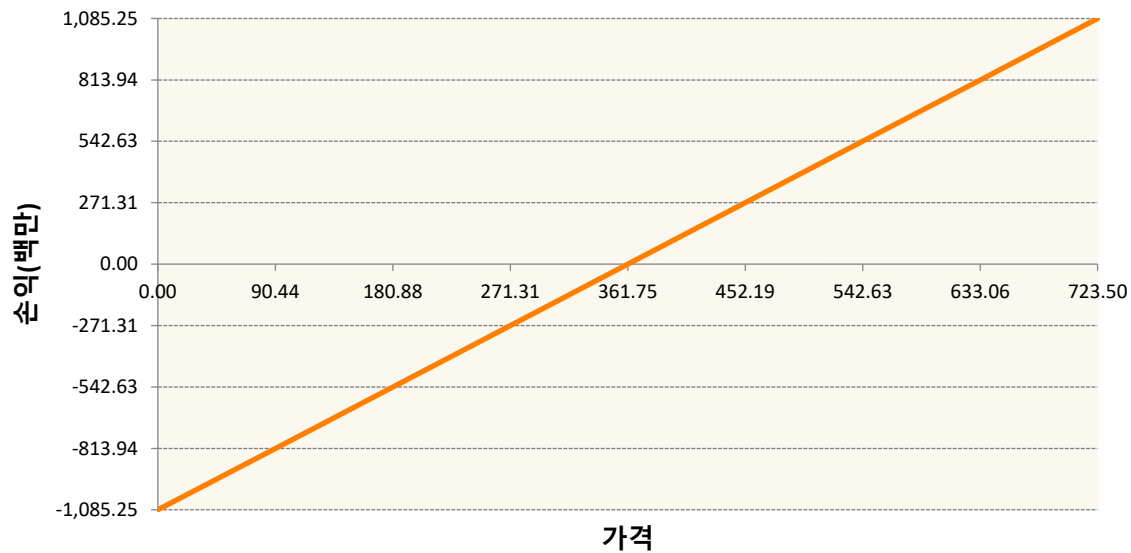
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,085	0	1,085	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 2022-03-28

기준일 2022-03-25

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

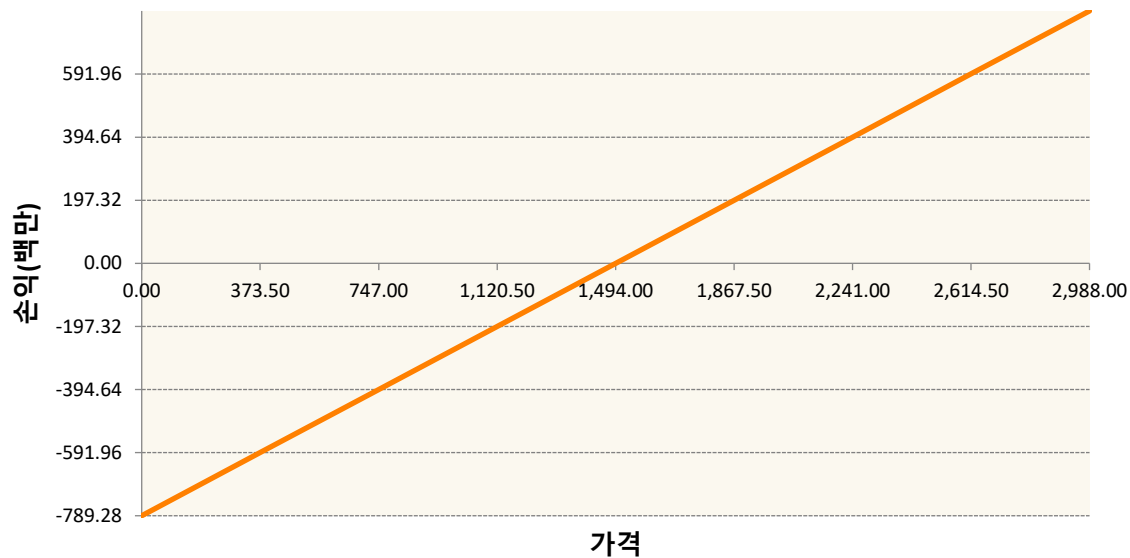
1. 계약금액

(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	789	0	789	
누계	유가증권	스왑	1,837	0	1,837	장외
누계	통화	선도	0	1,182	-1,182	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCJ2-VN30 Index Future Apr22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	147
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)

267

공시일 2022-03-28

기준일 2022-03-25

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

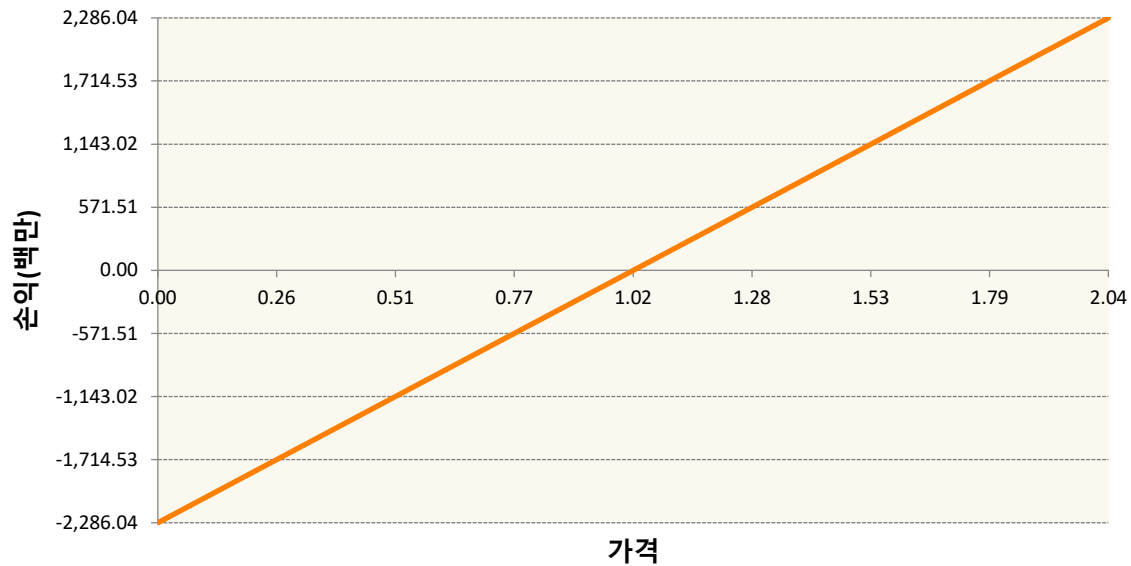
1. 계약금액

(단위:백만원)

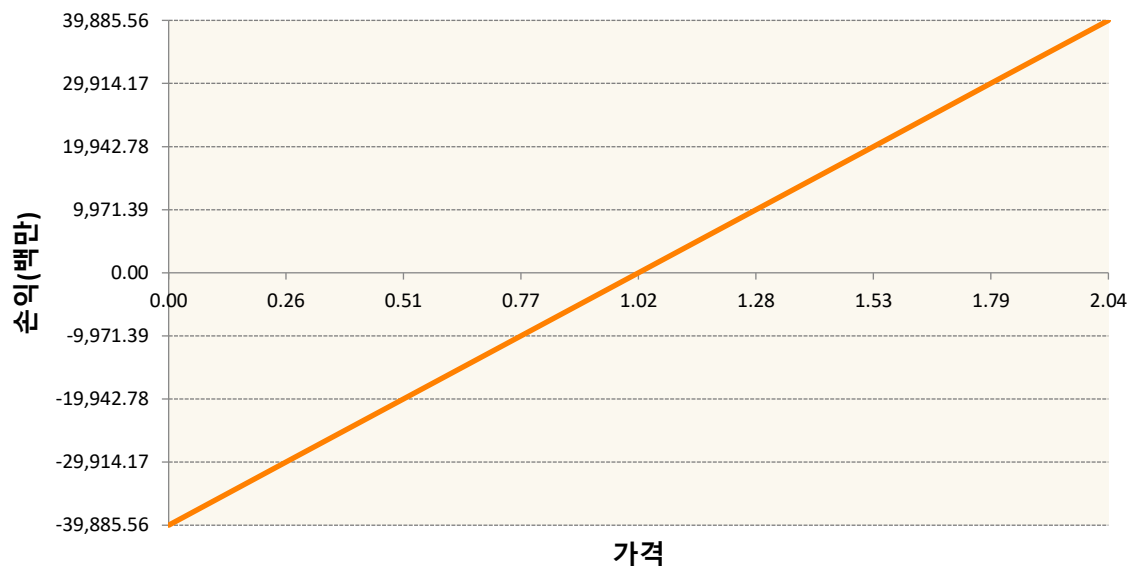
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	42,466	0	42,466	
누계	유가증권	선물	43,315	0	43,315	

2. 만기시점의 손익구조

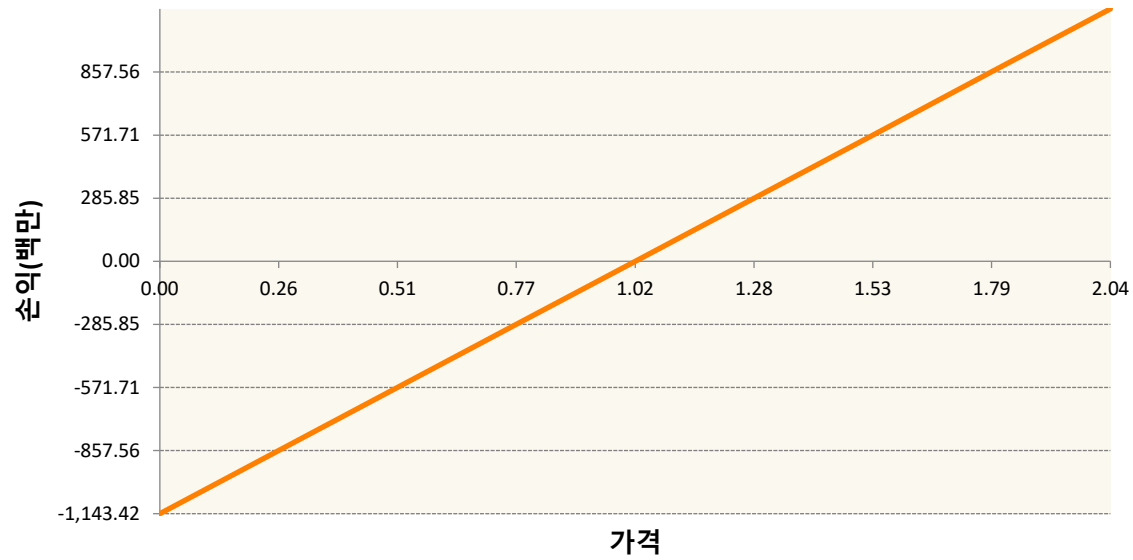
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220326-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)
 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)
 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)

182
3,183
91

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

(단위:백만원)

6,353

공시일 2022-03-28

기준일 2022-03-25

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

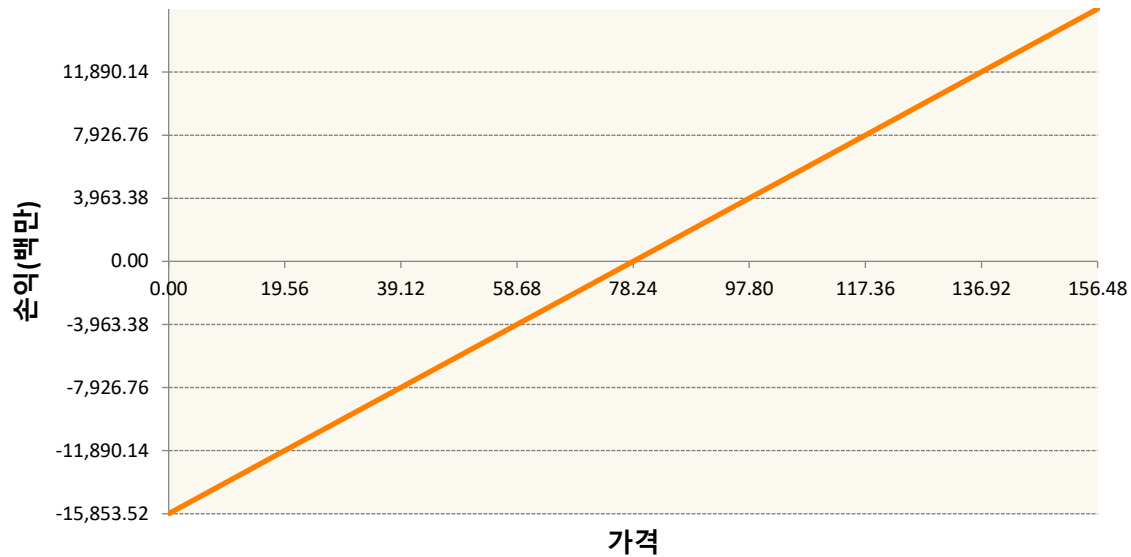
1. 계약금액

(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	15,854	0	15,854	
누계	통화	선도	0	8,219	-8,219	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2R KRW/EUR 28-03-22E

658

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,268

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

(단위:백만원)

3,369

공시일	2022-03-28
기준일	2022-03-25

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)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	8

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

(단위:백만원)

59

공시일	2022-03-28
기준일	2022-03-25

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 2022-03-28

기준일 2022-03-25

에쿼티알파일반사모혼합자산

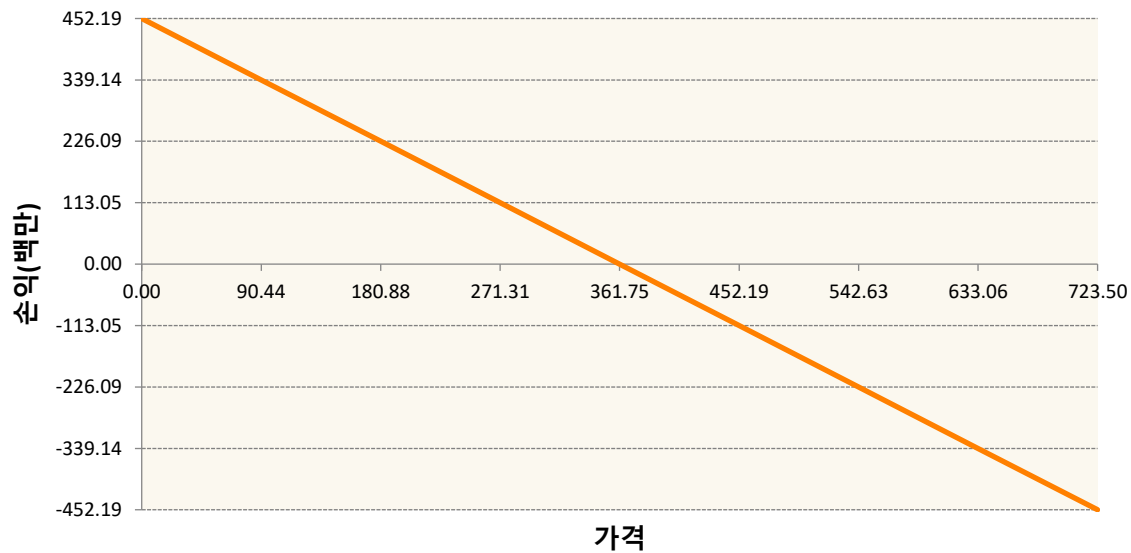
1. 계약금액

(단위:백만원)

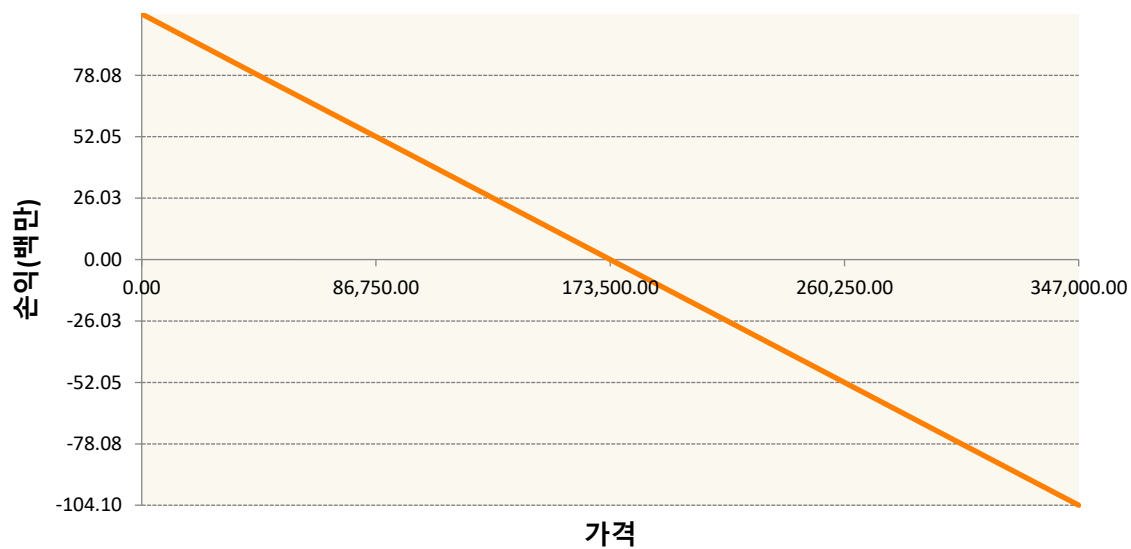
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	104	-104	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	556	-556	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4116S40008-2022-04 현대차개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322		1
KRS0003014 SWAP_APPLE INC_0322		2
KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322		1
KRS0003014 SWAP_TESLA INC_0322		2
KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322		0.44
KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물		36
KR4116S400 2022-04 현대차개별선물		8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	55

공시일 2022-03-28

기준일 2022-03-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

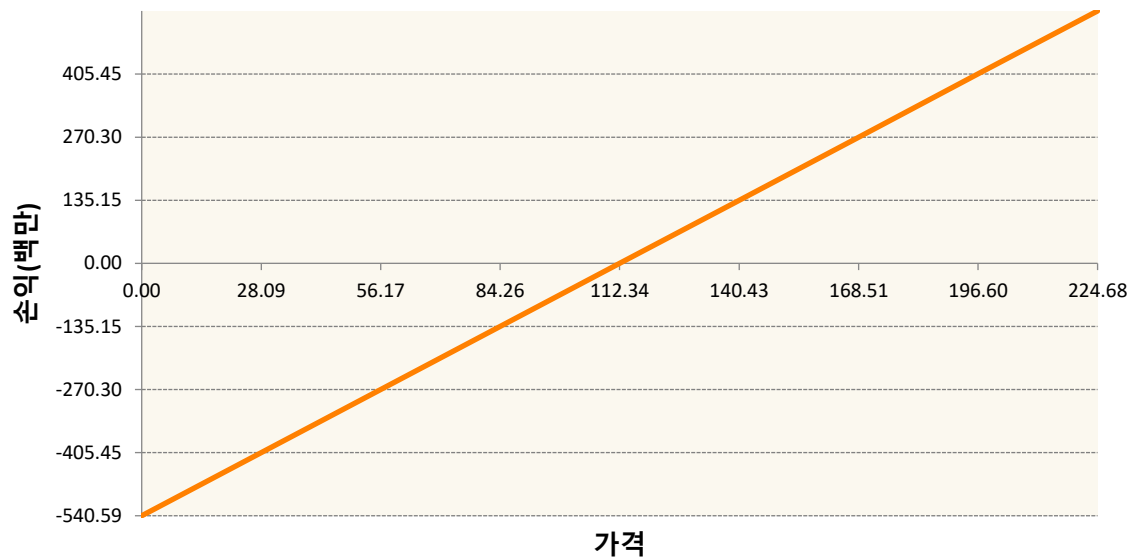
1. 계약금액

(단위:백만원)

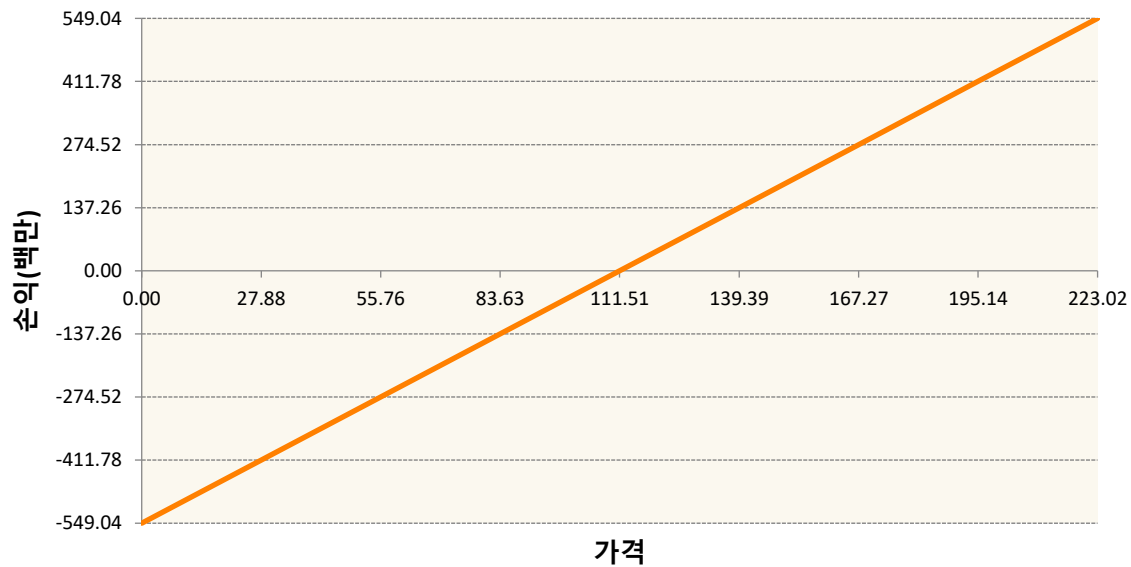
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,447	549	1,898	

2. 만기시점의 손익구조

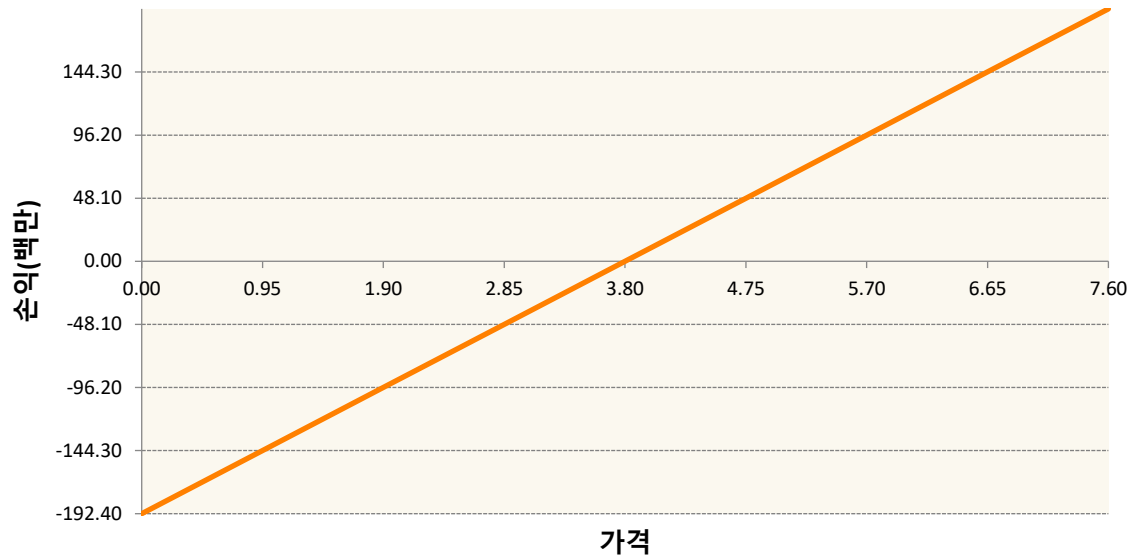
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



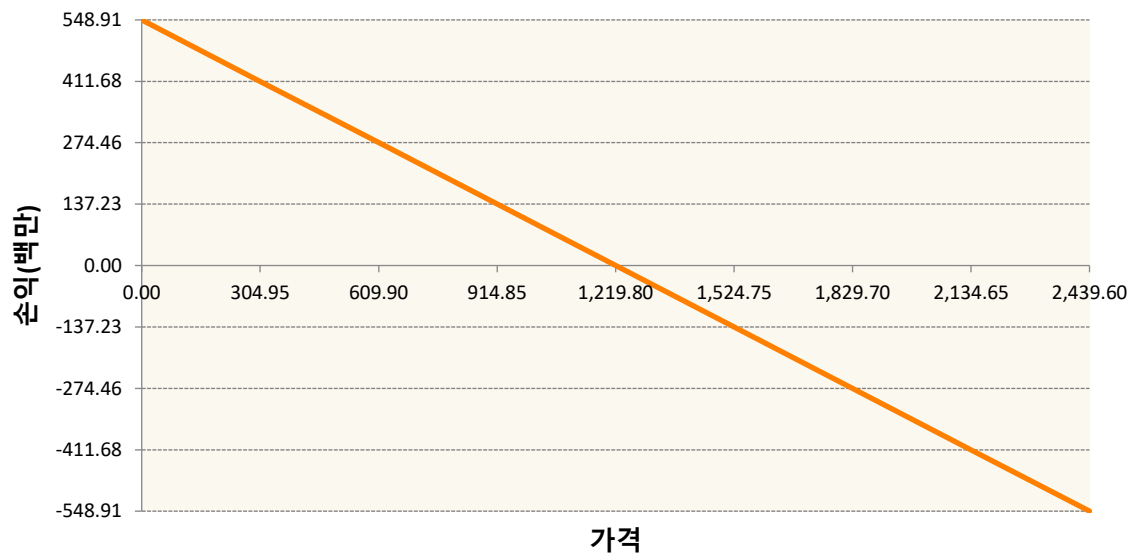
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



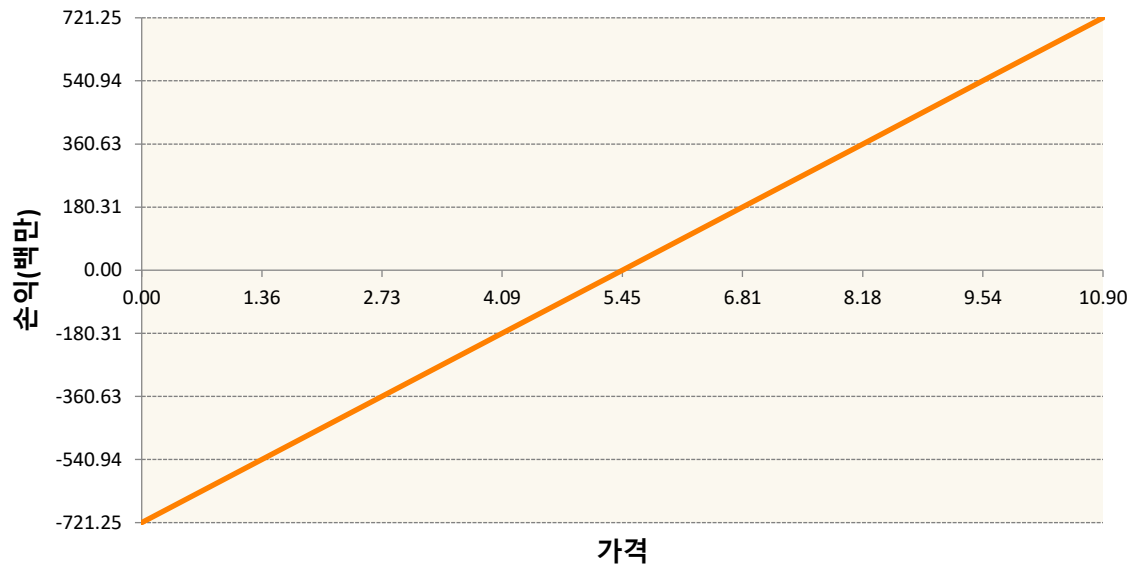
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22



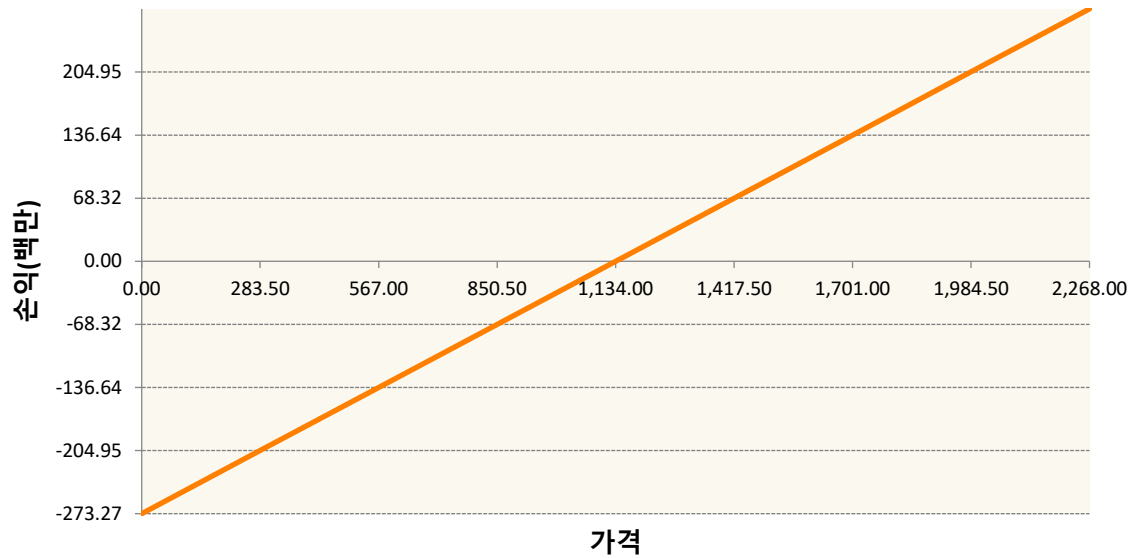
KR4175S40004-2022-04 달러선물



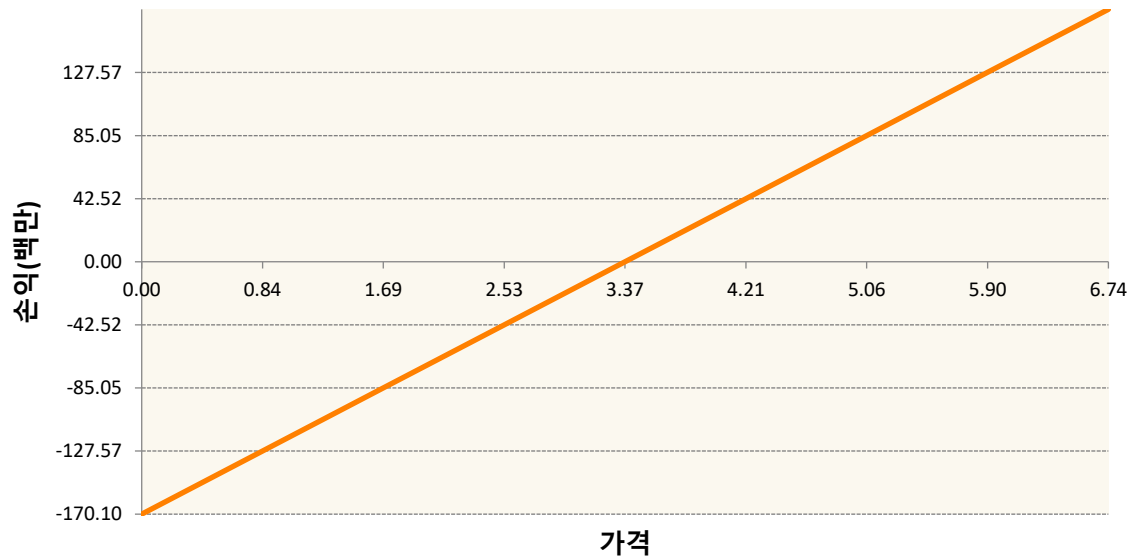
NGK22-NATURAL GAS FUTR May22



QSK2-Low Su Gasoil G MAY22



XBK2-GASOLINE RBOB FUT May22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22	43
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22	44
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22	15
KR4175S400	2022-04 달러선물	44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22	58
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22	22
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22	14

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

(단위:백만원)

537