

공시일 2022-04-01

기준일 2022-03-31

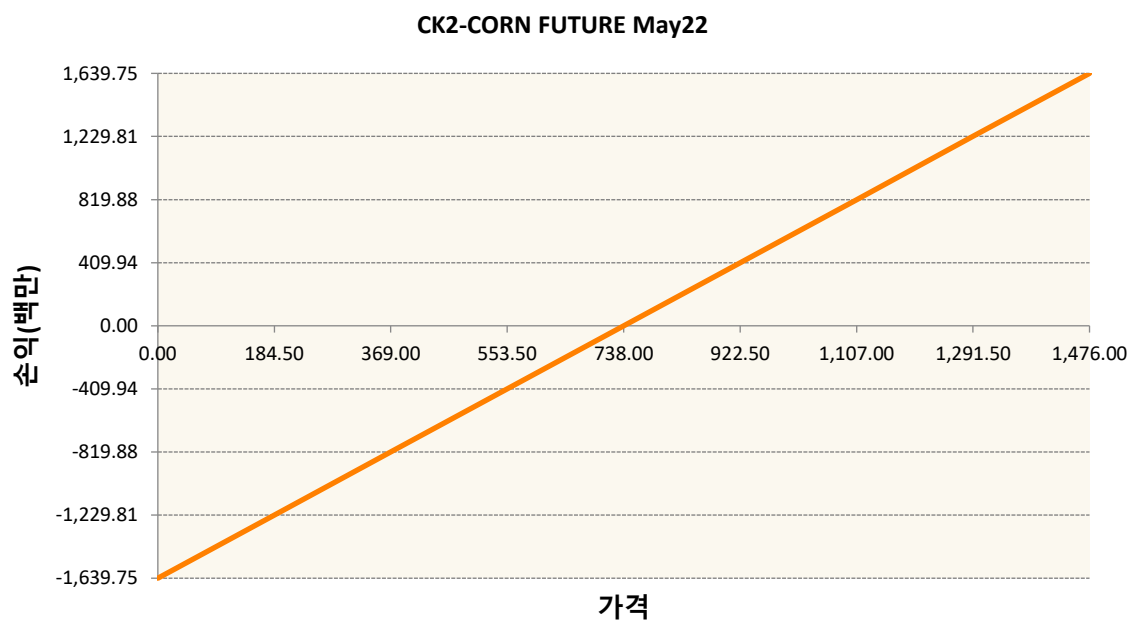
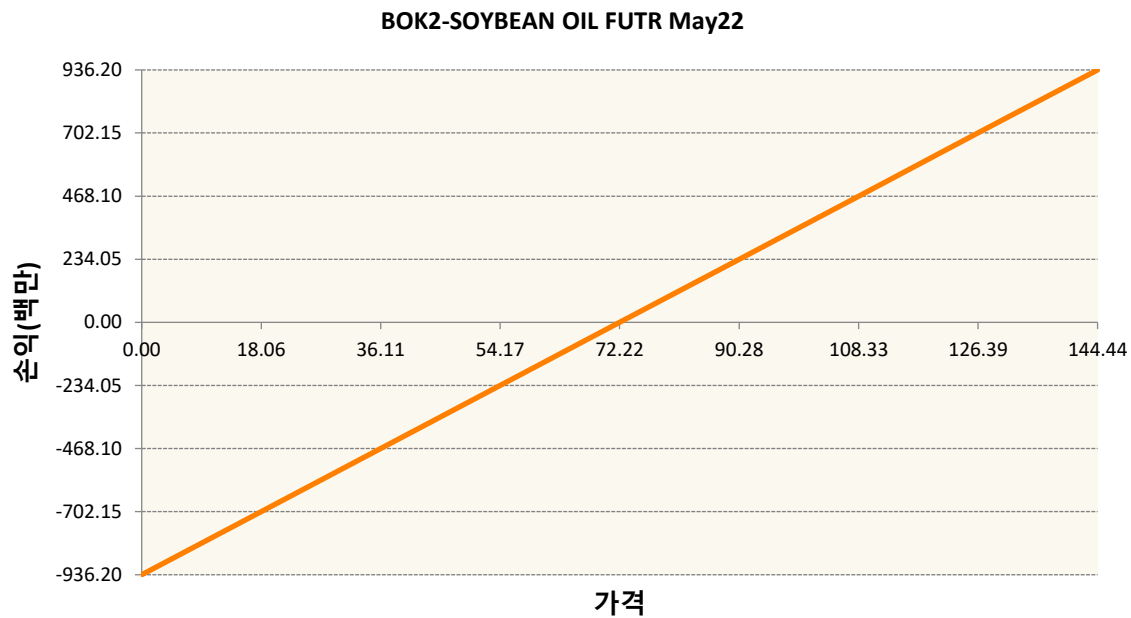
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

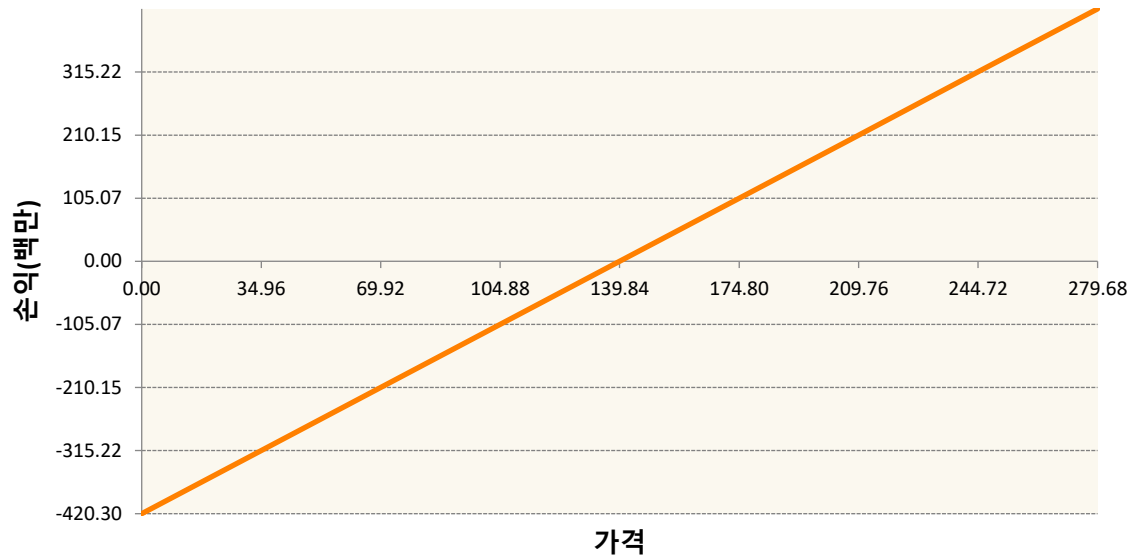
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,452	1,697	6,755	

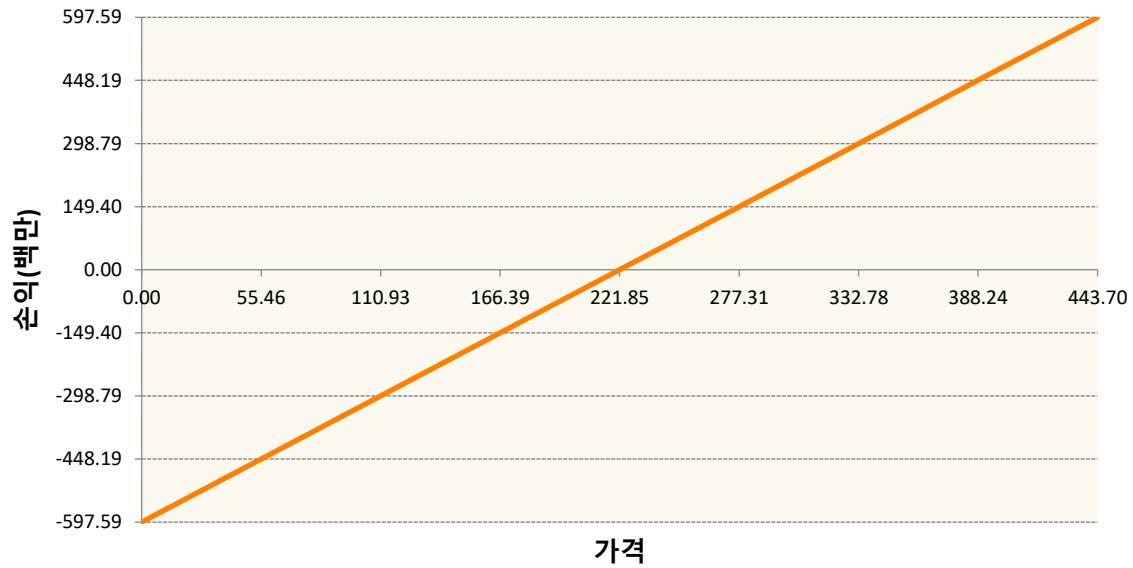
2. 만기시점의 손익구조



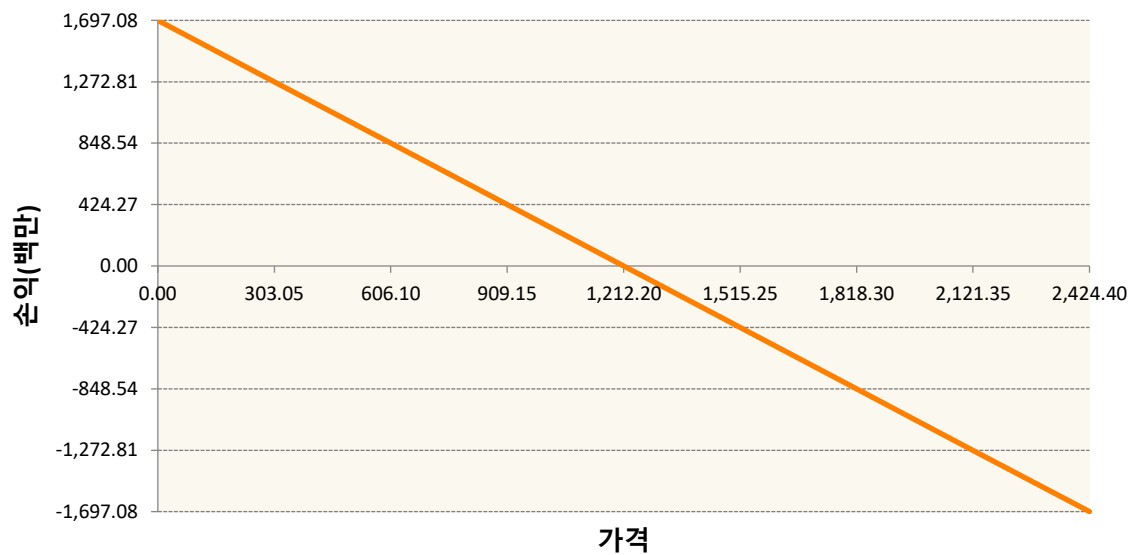
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



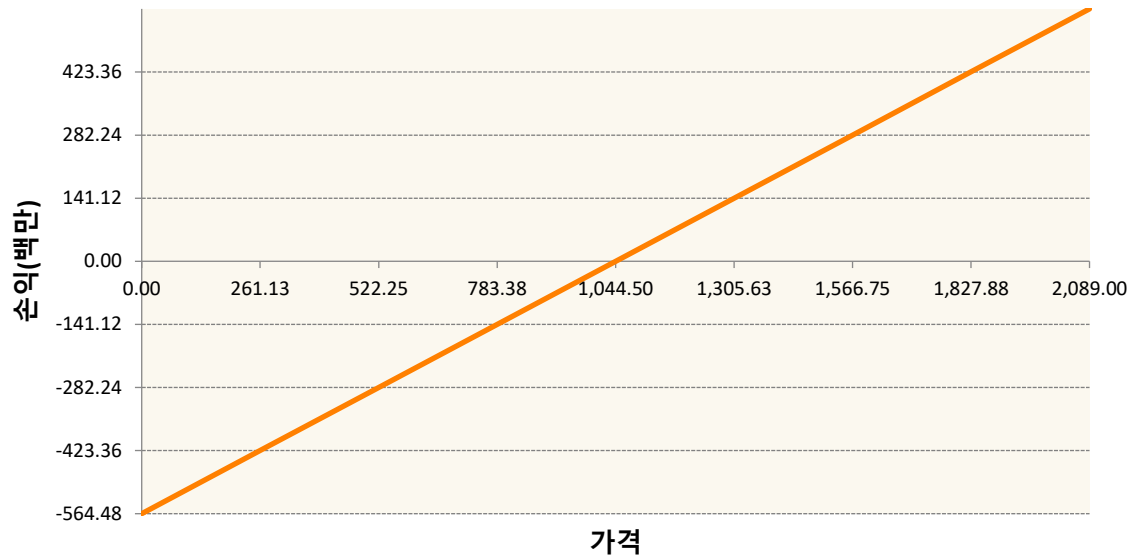
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



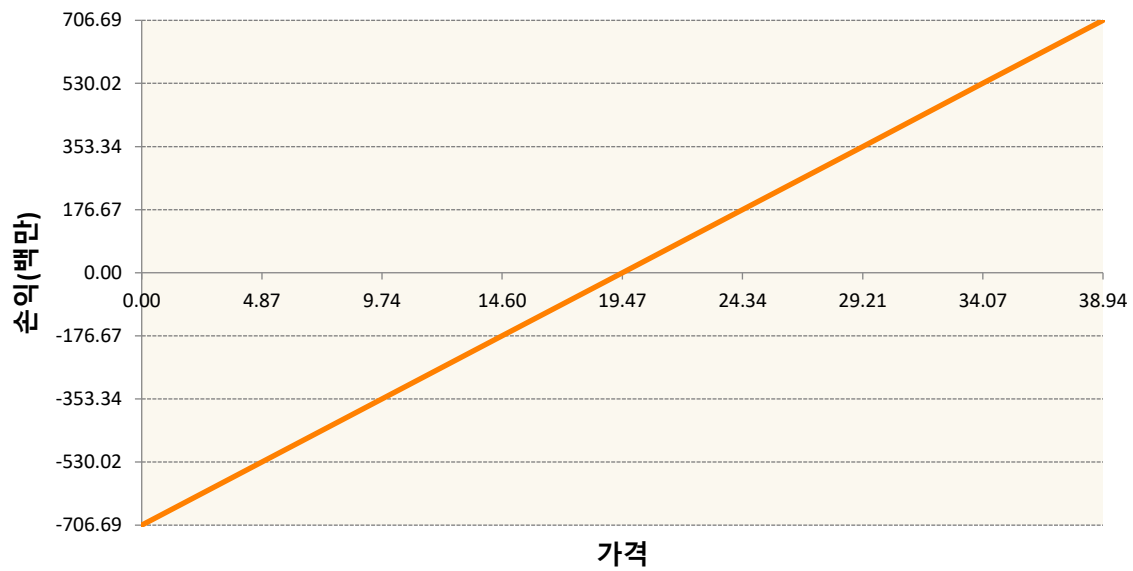
KR4175S40004-2022-04 달러선물



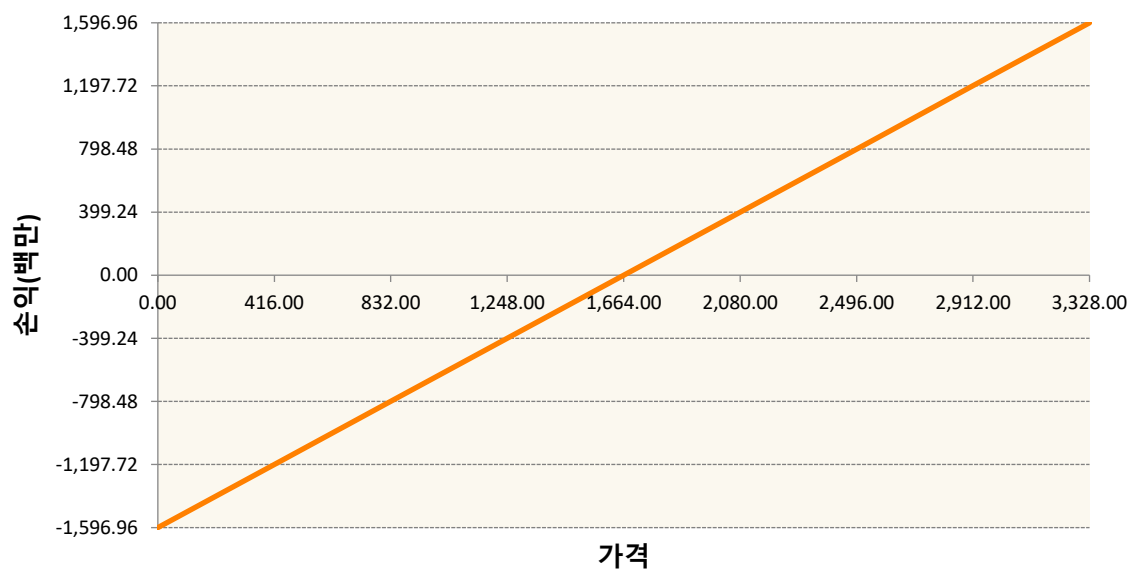
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



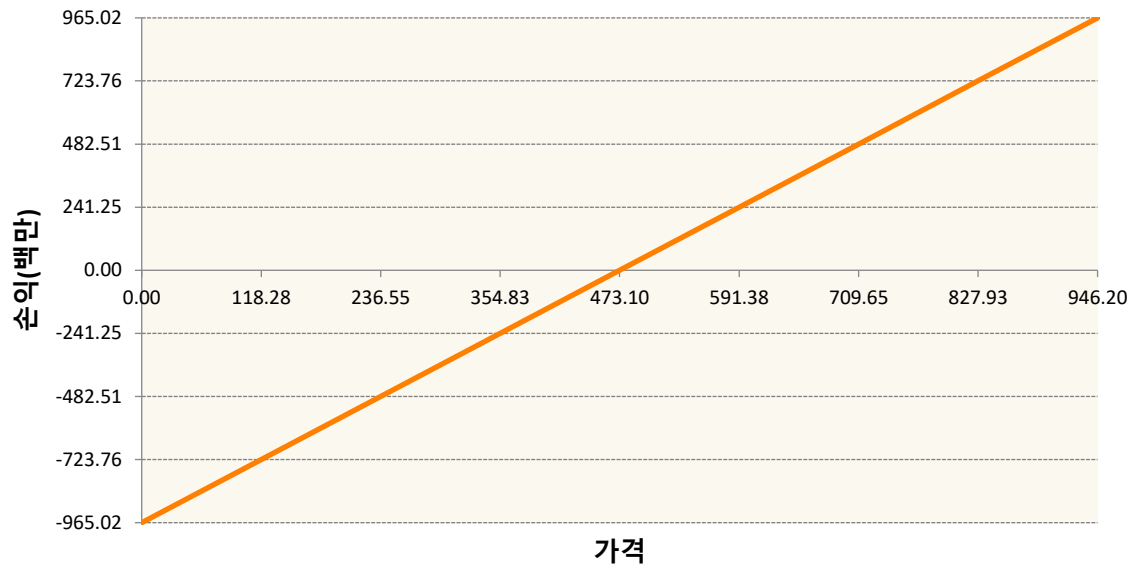
SBK2-Sugar May22



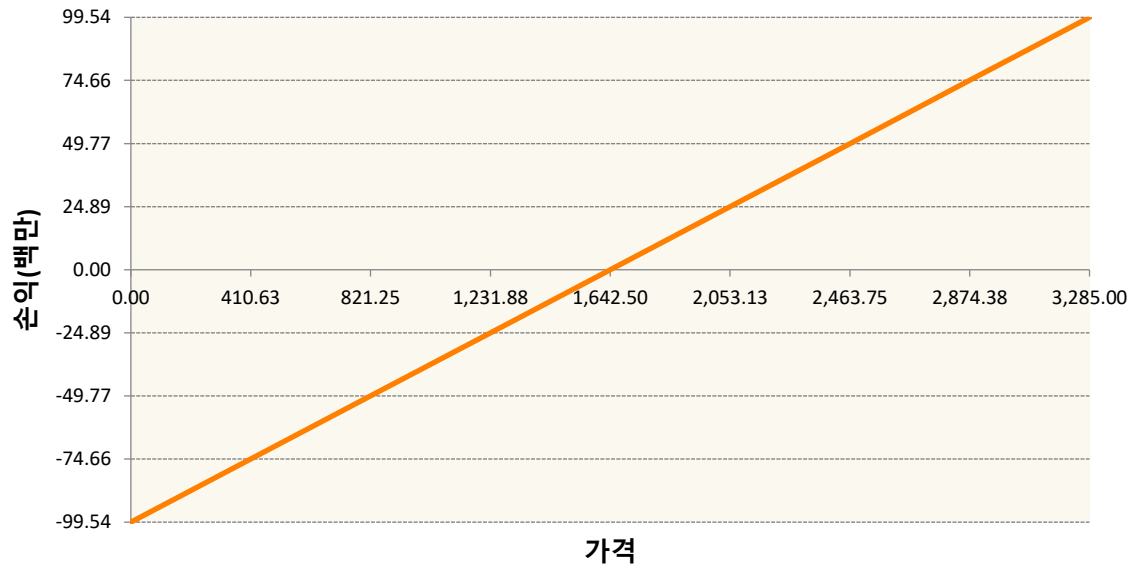
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



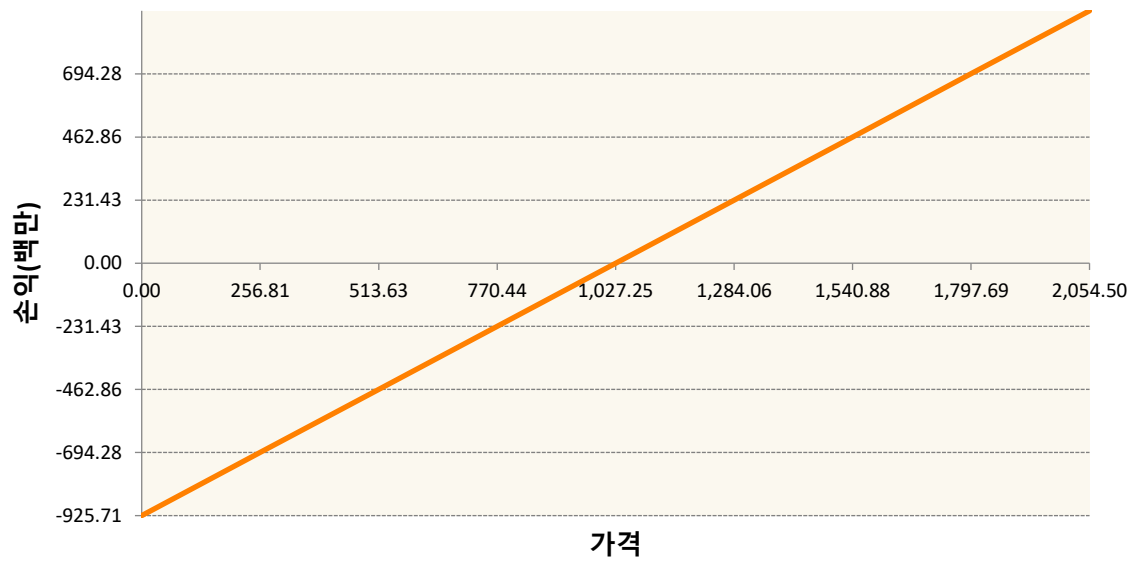
SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



SN2-SOYBEAN FUTURE Jul22



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	2022-04-01
기준일	2022-03-31

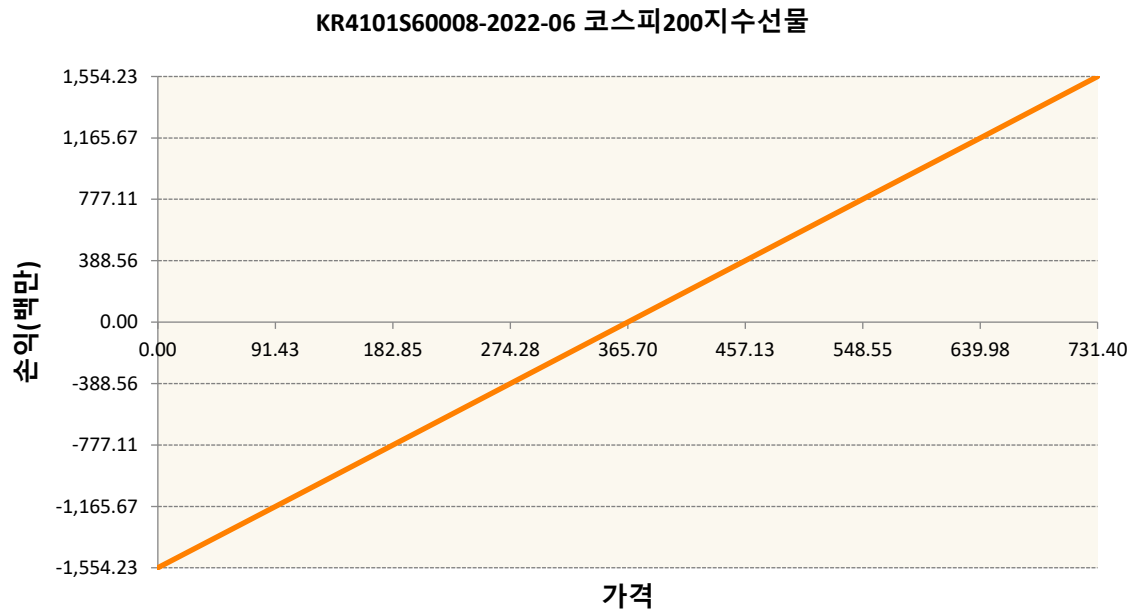
스마트인덱스모

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	1,554	0	1,554	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				124
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	83	83	83	83	83	83	83
8.00%	124	124	124	124	124	124	124

공시일	2022-04-01
기준일	2022-03-31

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

148

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

92

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-04-01
기준일	2022-03-31

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	394
-----------------------------	-----

* 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	2022-04-01
기준일	2022-03-31

유로인덱스모(주식-파생형)

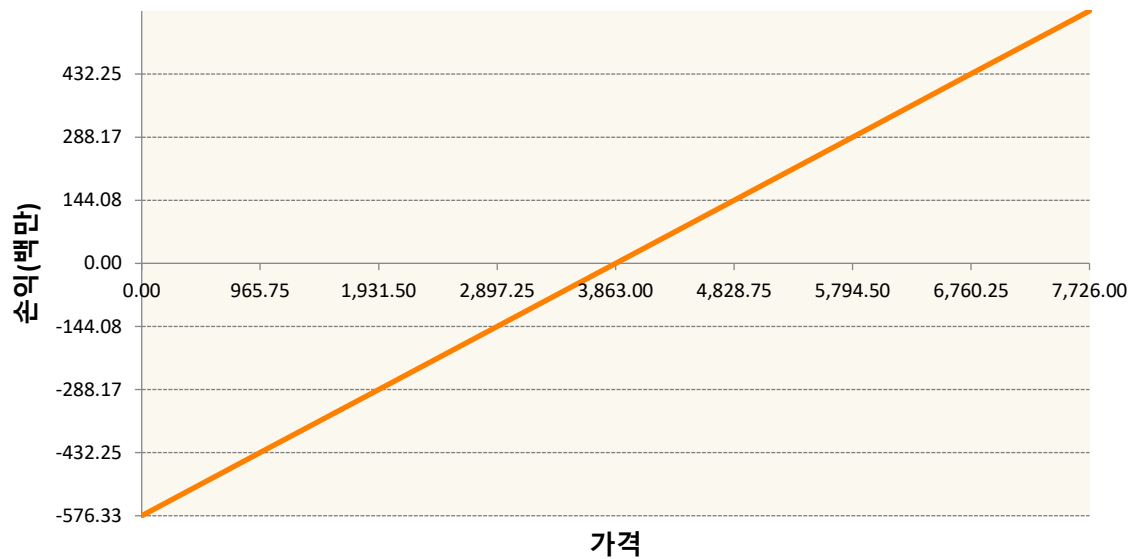
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	576	0	576	

2. 만기시점의 손익구조

VGM2-EURO STOXX 50 Jun22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2	EURO STOXX 50 Jun22	46
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

44

공시일	2022-04-01
기준일	2022-03-31

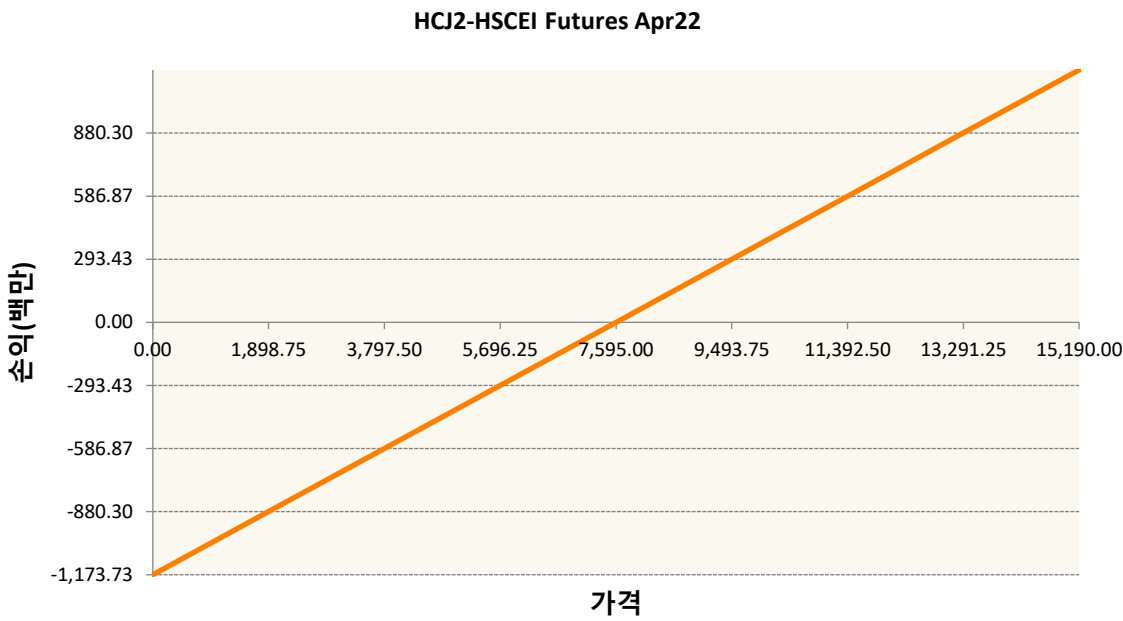
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,174	0	1,174	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI2	HSCEI Futures Apr22	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

125

공시일 2022-04-01

기준일 2022-03-31

커버드콜모(주식혼합-파생형)

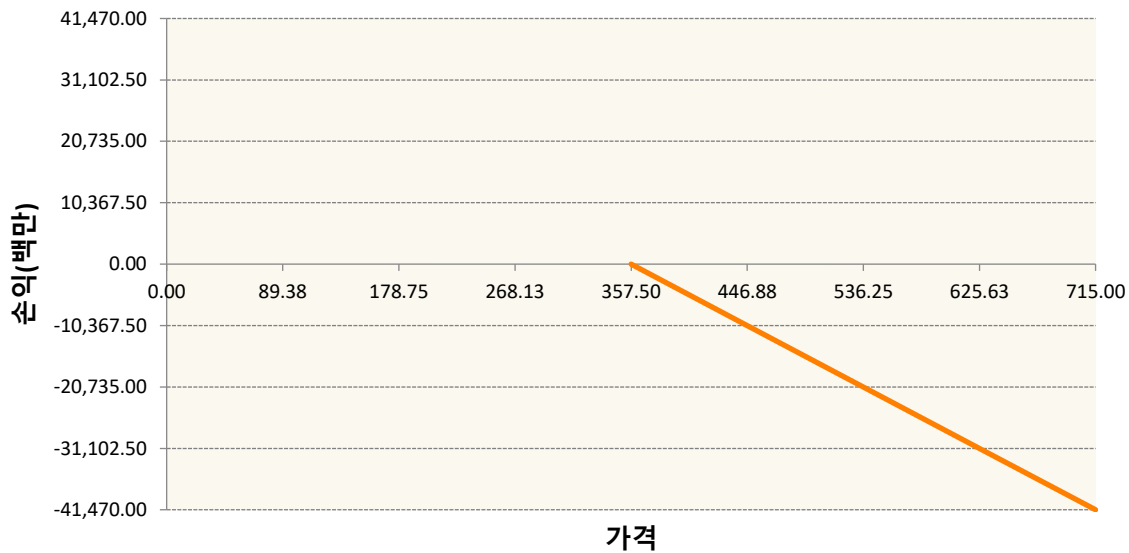
1. 계약금액

(단위:백만원)

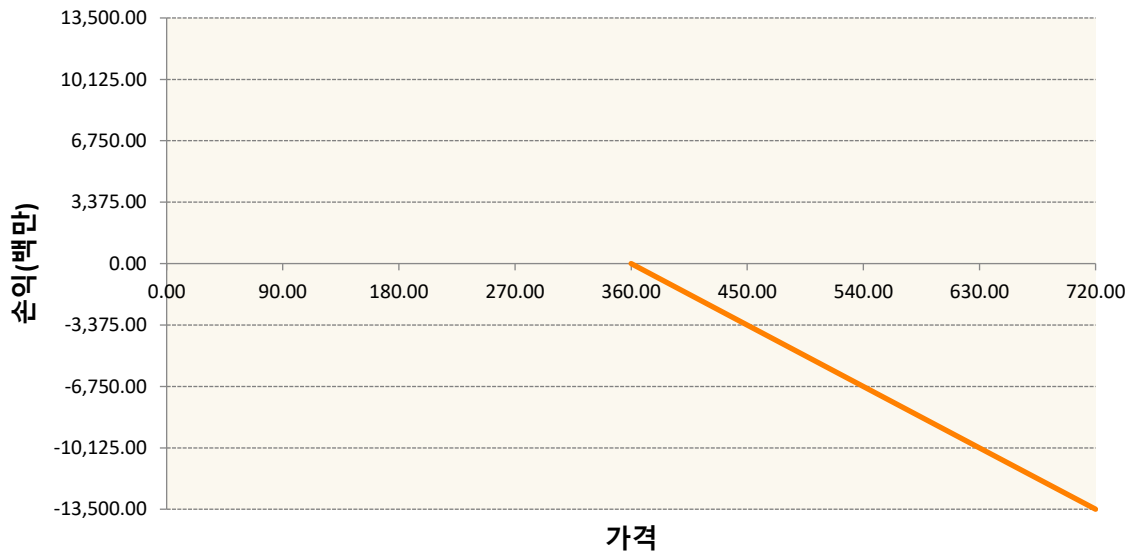
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,410	-66,410	장내

2. 만기시점의 손익구조

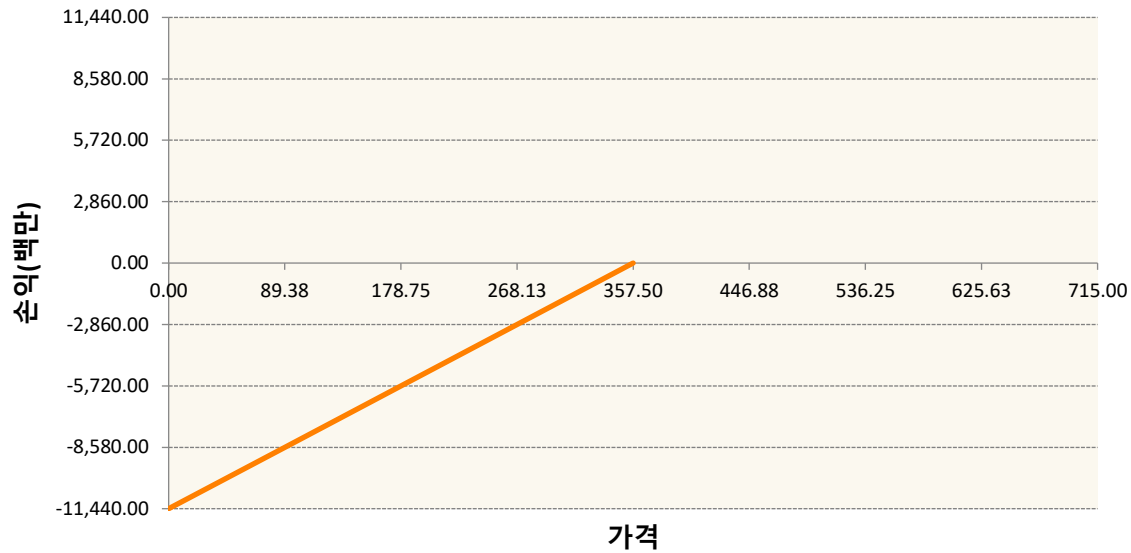
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S43572			2022-04 콜357.5				2,950
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,435	1,404	1,368	1,328	1,283	1,235	1,183
-5.33%	1,269	1,210	1,147	1,082	1,016	948	879
-2.67%	881	803	725	648	570	492	413
0%	215	145	73	0	-74	-148	-224
2.67%	-690	-734	-784	-838	-895	-956	-1,018
5.33%	-1,736	-1,756	-1,783	-1,815	-1,852	-1,894	-1,939
8.00%	-2,842	-2,849	-2,860	-2,876	-2,896	-2,921	-2,950
KR4201S43606			2022-04 콜360				927
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	412	404	394	383	370	356	341
-5.33%	370	353	335	316	296	275	254
-2.67%	266	241	217	192	167	142	117
0%	73	49	25	0	-25	-50	-75
2.67%	-201	-218	-237	-256	-276	-297	-319
5.33%	-530	-539	-549	-562	-575	-591	-607
8.00%	-884	-887	-892	-899	-907	-916	-927
KR4301S43570			2022-04 풋357.5				634
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-621	-622	-623	-625	-628	-631	-634
-5.33%	-321	-327	-333	-340	-348	-356	-365
-2.67%	-85	-97	-109	-121	-134	-146	-158
0%	28	19	10	0	-10	-21	-31

2.67%	53	51	48	44	39	34	28
5.33%	56	55	55	54	53	51	49
8.00%	56	56	56	55	55	55	54

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

(단위:백만원)

4,638

공시일 2022-04-01

기준일 2022-03-31

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

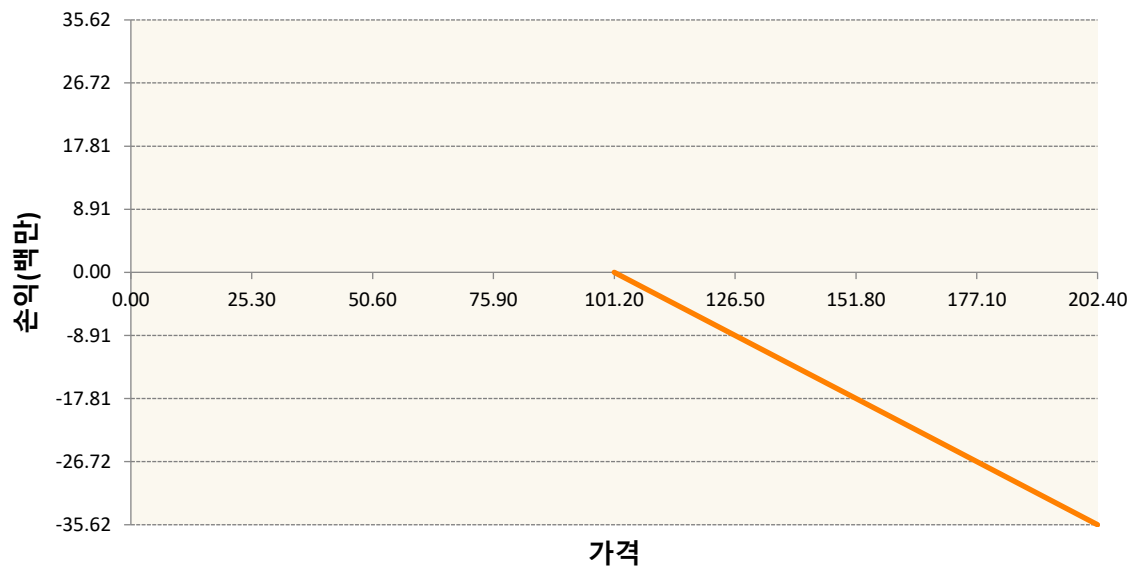
1. 계약금액

(단위:백만원)

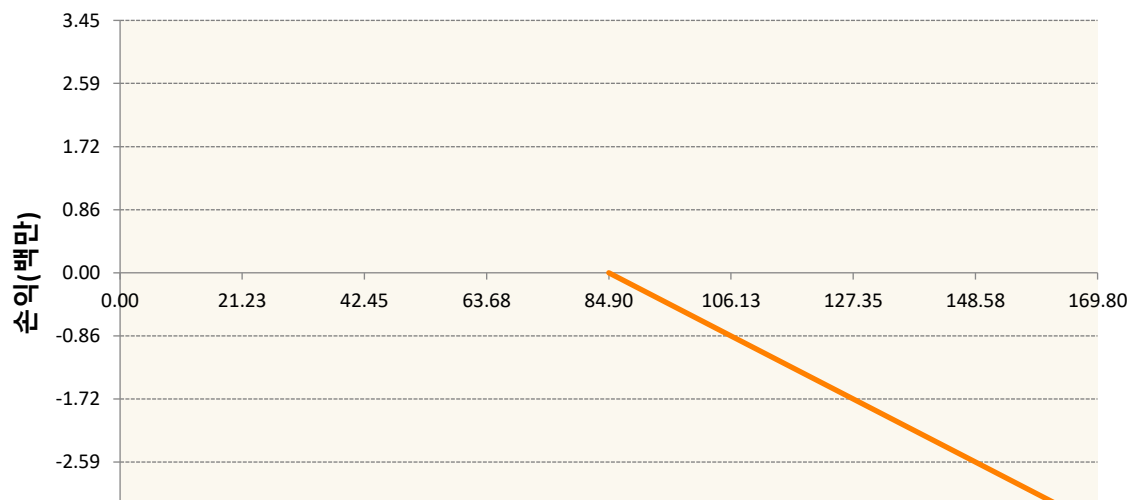
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	63	-63	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,031	-2,031	장외

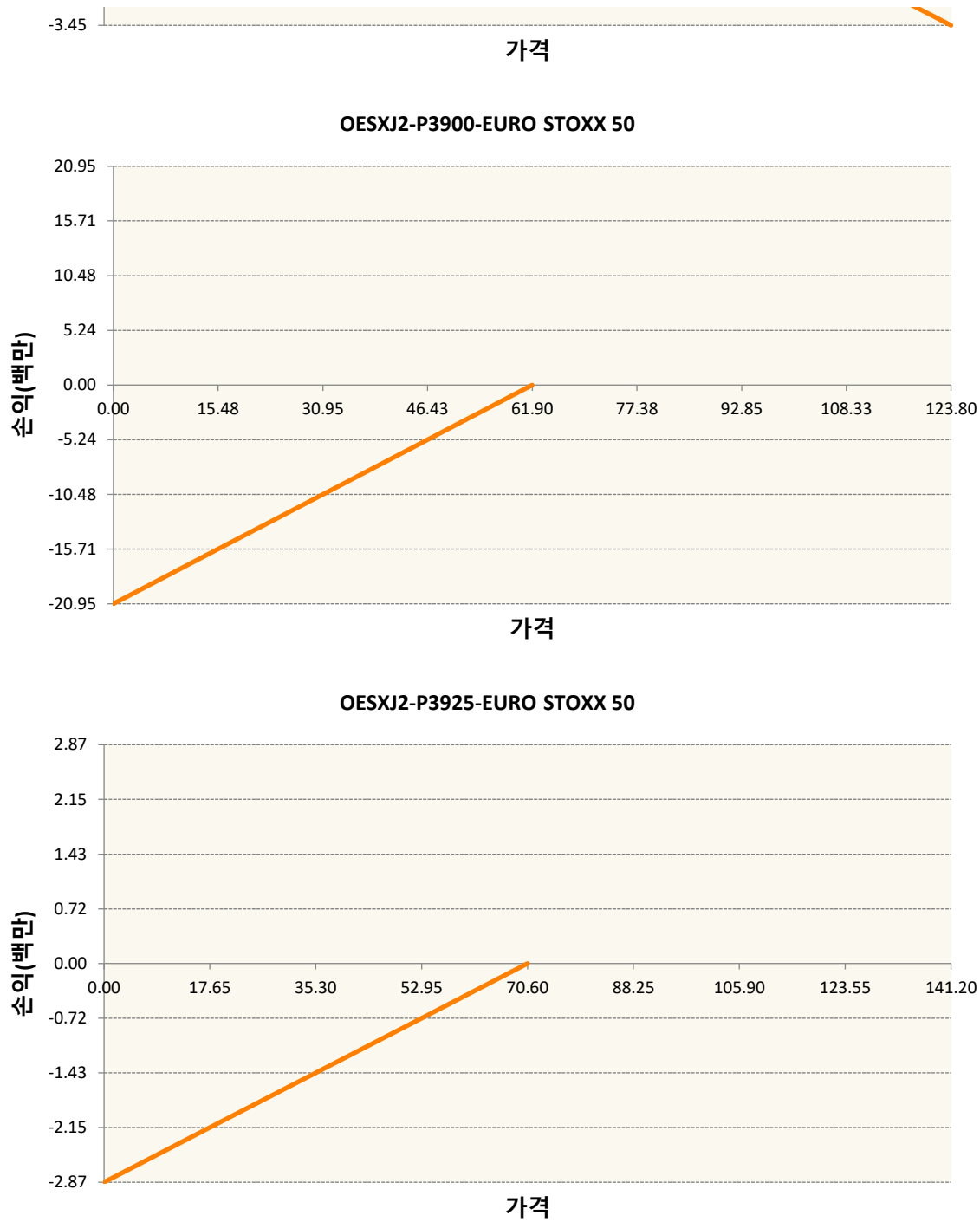
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ2-C3900-EURO STOXX 50



OESXJ2-C3925-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	16
FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E	22
FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E	32
FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E	65
FXW213C3A KRW/EUR 22-04-22E	43
OESXJ2-C39(EURO STOXX 50	3
OESXJ2-C39(EURO STOXX 50	0.28
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50	2
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50	0.23

공시일 2022-04-01

기준일 2022-03-31

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

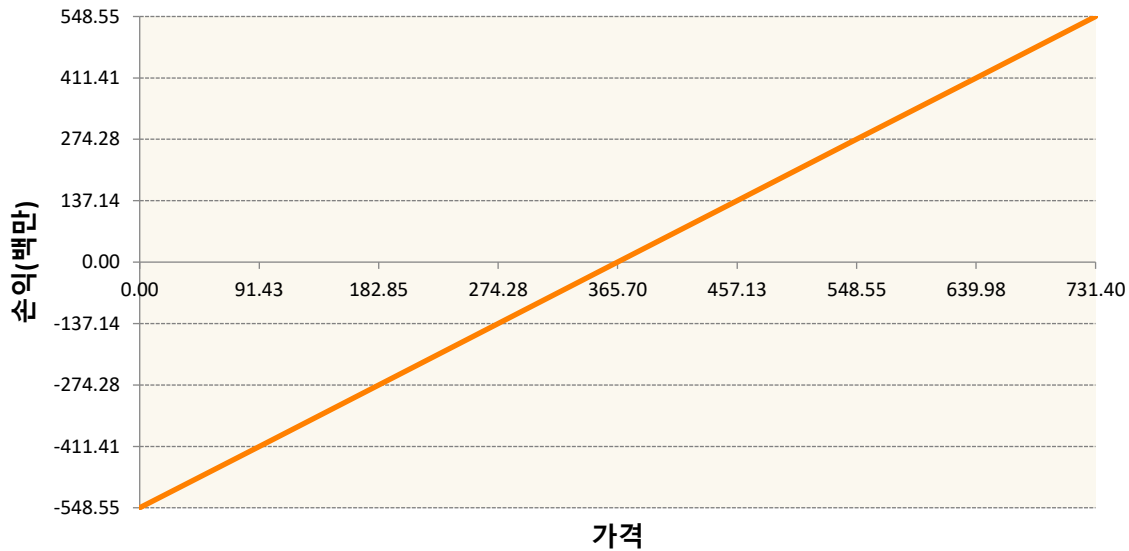
1. 계약금액

(단위:백만원)

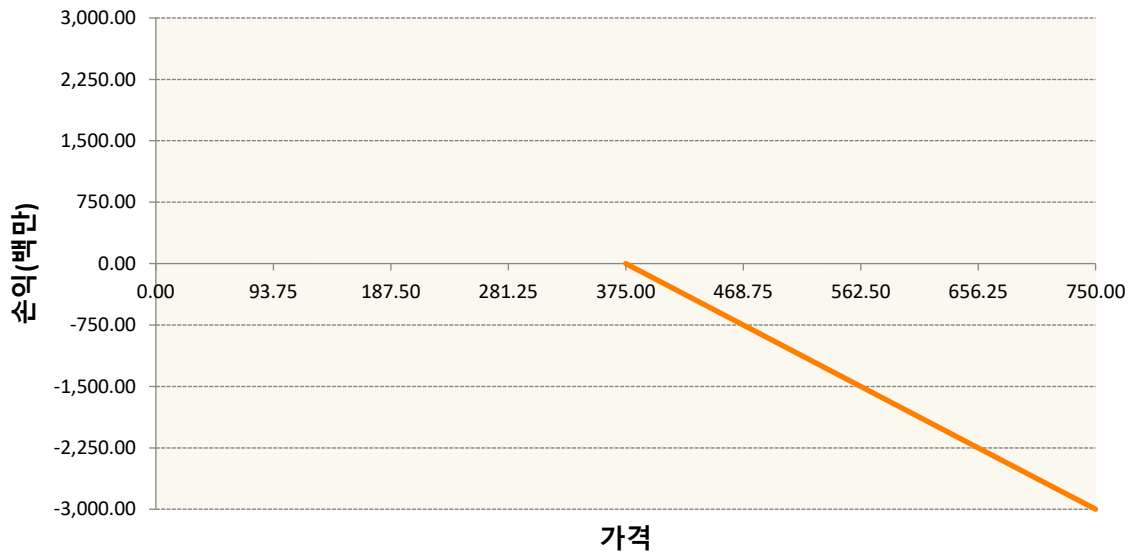
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	549	0	549	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S43754-2022-04 콜375



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 755.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -1,698.75 to 1,698.75. A single orange line represents the relationship, starting at a price of 377.50 with zero profit/loss, and decreasing linearly to a price of 755.00 with a profit/loss of -1,698.75.

가격 (Price)	손익 (백만) (Profit/Loss in millions)
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 the y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions). The blue line shows that as the price increases, the profit decreases linearly, starting at 357.50 million when the price is 0 and reaching 0 profit 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				152
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	36	35	34	33	32	31
-5.33%	35	34	32	30	28	26	23
-2.67%	30	27	24	20	16	12	8
0%	15	10	5	0	-5	-10	-16
2.67%	-16	-22	-28	-33	-39	-45	-50
5.33%	-66	-70	-75	-81	-86	-91	-96
8.00%	-130	-133	-136	-140	-144	-148	-152

KR4201S43770

2022-04 콜377.5

81

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	16	16	15	15
-5.33%	16	16	15	14	13	12	11
-2.67%	14	13	11	10	8	6	4
0%	8	5	3	0	-3	-6	-8
2.67%	-7	-10	-14	-17	-20	-23	-26
5.33%	-32	-35	-38	-41	-44	-48	-51
8.00%	-67	-69	-71	-73	-76	-78	-81

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	10	10	11	11	11	11
-2.67%	3	3	3	4	4	5	5
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2

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

(단위:백만원)

258

공시일	2022-04-01
기준일	2022-03-31

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	9,482	0	9,482	

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	2022-04-01
기준일	2022-03-31

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	7,653	0	7,653	

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	2022-04-01
기준일	2022-03-31

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	25,884	0	25,884	
누계	통화	선도	1,697	27,551	-25,854	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E		2,204
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E		39
FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E		97

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

(단위:백만원)

787

공시일 2022-04-01

기준일 2022-03-31

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

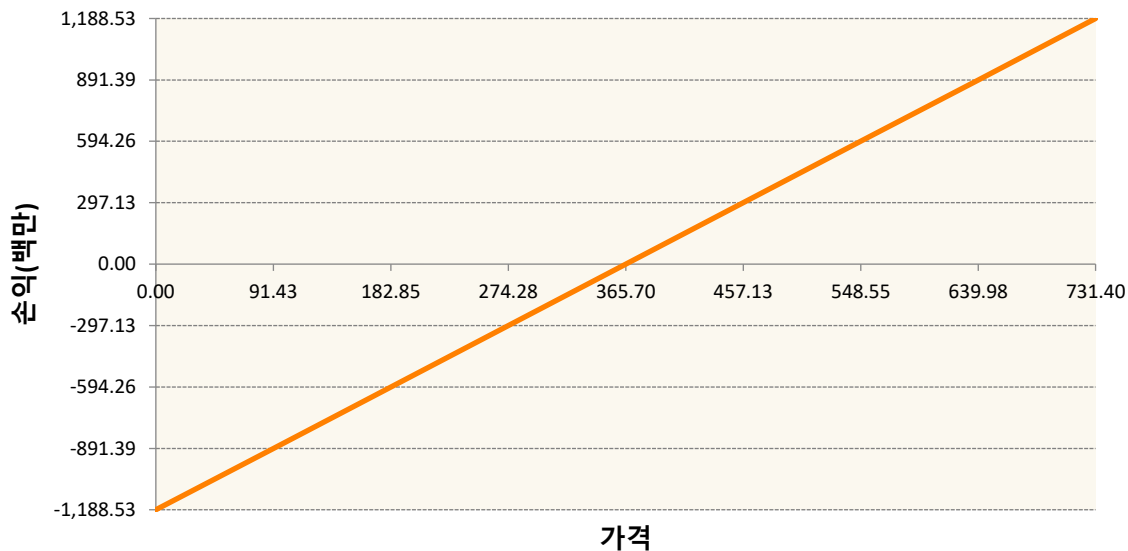
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,189	0	1,189	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				95
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	63	63	63	63	63	63	63
8.00%	95	95	95	95	95	95	95

공시일	2022-04-01
기준일	2022-03-31

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

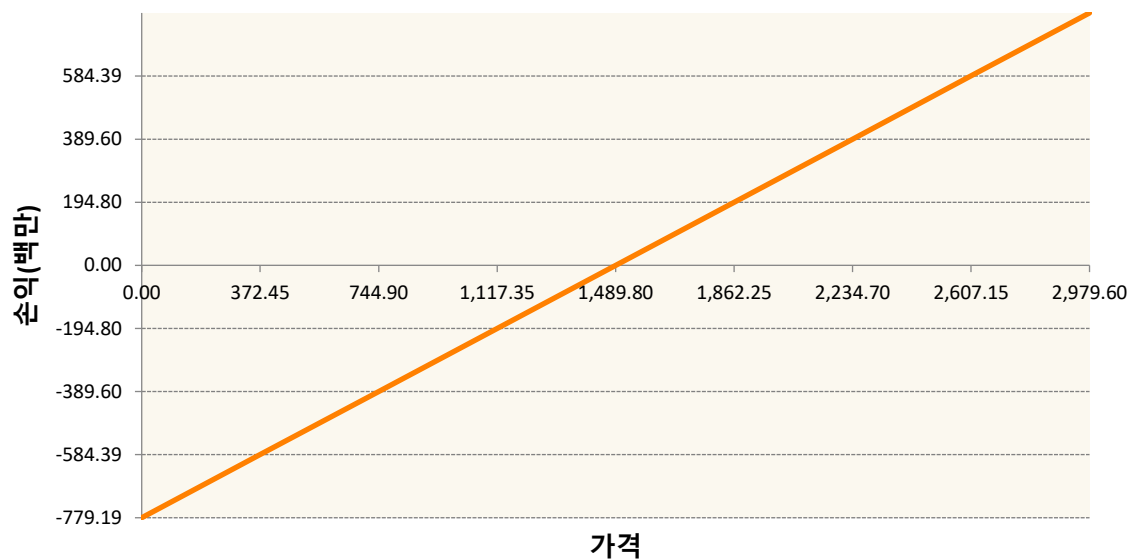
1. 계약금액

(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	779	0	779	
누계	유가증권	스왑	1,851	0	1,851	장외
누계	통화	선도	0	1,191	-1,191	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCJ2-VN30 Index Future Apr22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	148
FXW213C1K·KRW/EUR 22-04-22E	16
FXW213C2P·KRW/EUR 20-05-22E	47
FXW213C3G·KRW/EUR 24-06-22E	32
VNCJ2 VN30 Index Future Apr22	62

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

(단위:백만원)

268

공시일 2022-04-01

기준일 2022-03-31

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

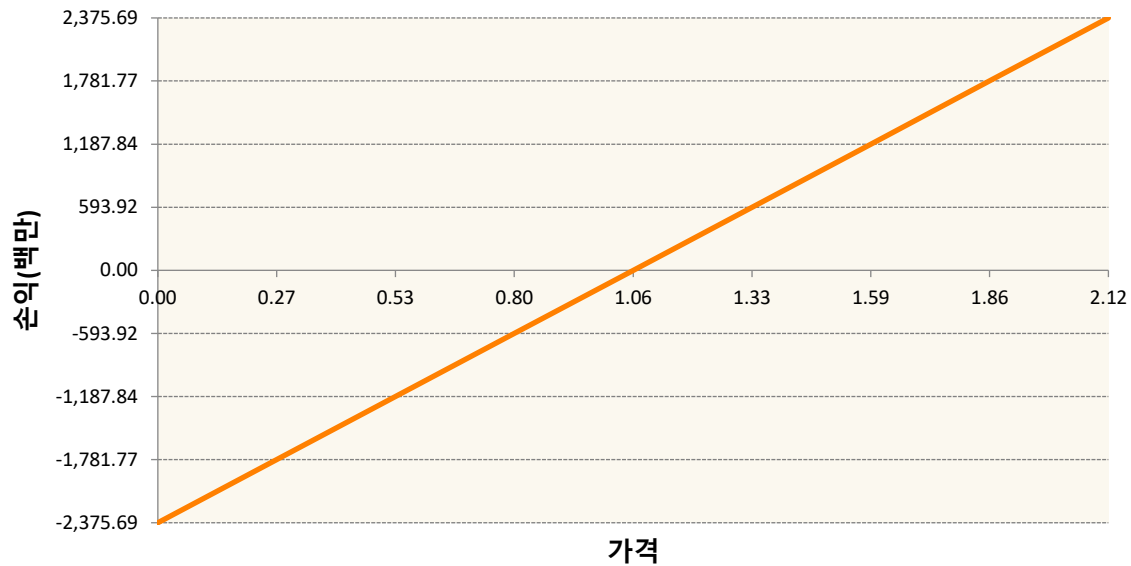
1. 계약금액

(단위:백만원)

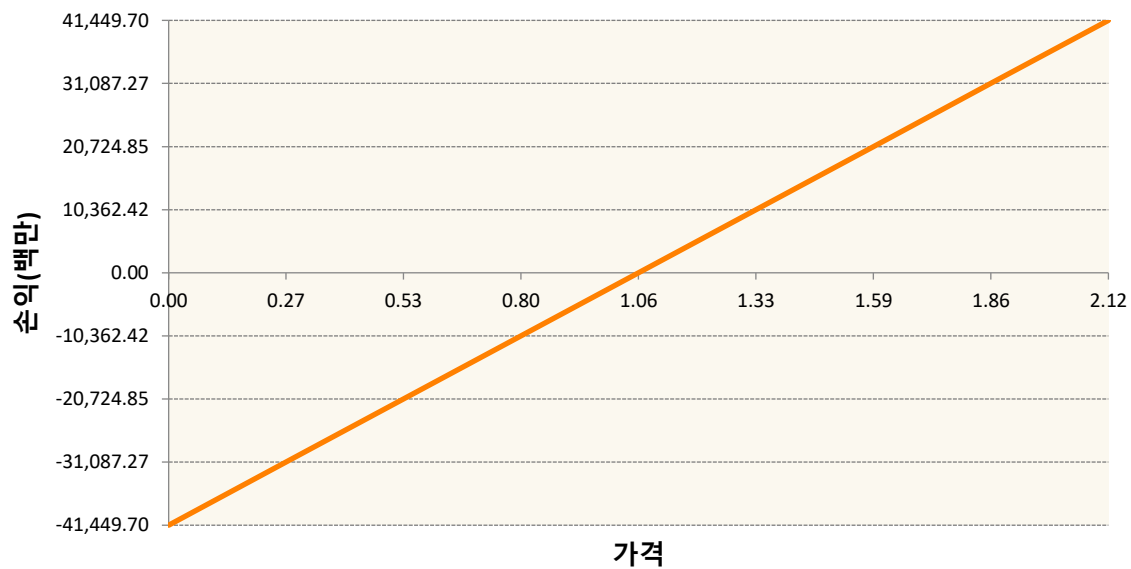
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	45,014	0	45,014	

2. 만기시점의 손익구조

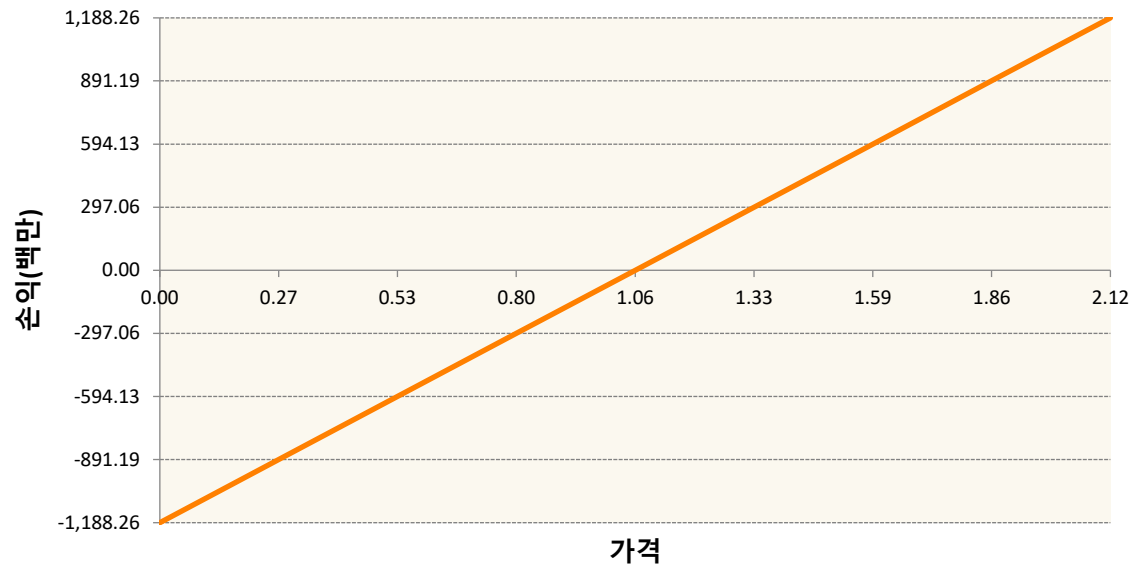
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

189
3,303
95

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

(단위:백만원)

6,586

공시일	2022-04-01
기준일	2022-03-31

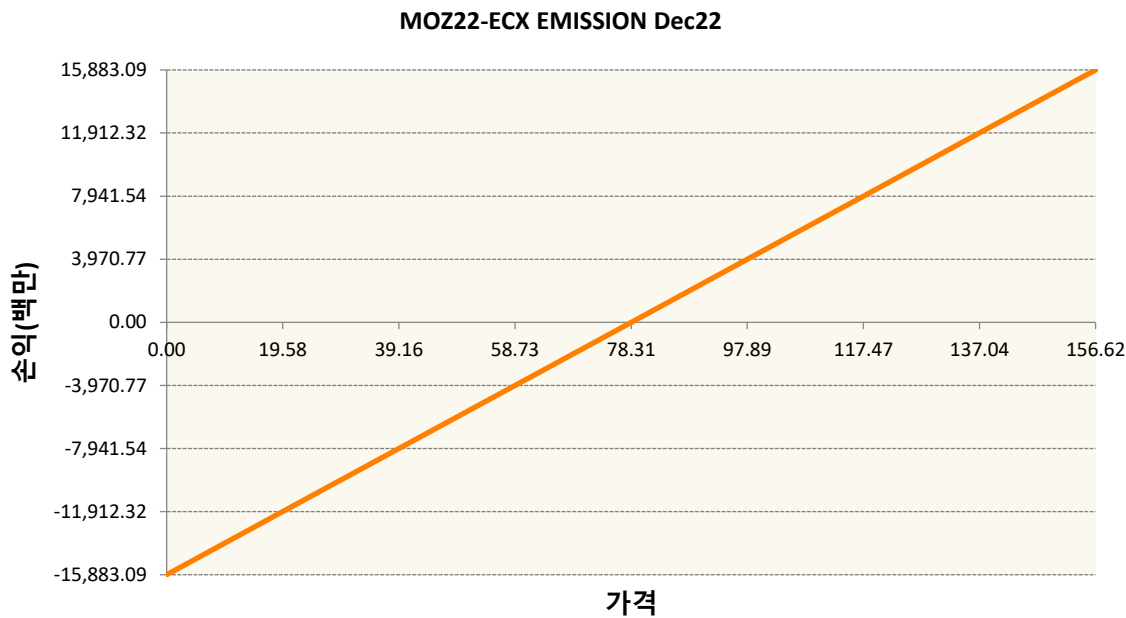
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,883	0	15,883	
누계	통화	선도	0	7,554	-7,554	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C3V·KRW/EUR 25-04-22E	604
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,271

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

(단위:백만원)

3,347

공시일	2022-04-01
기준일	2022-03-31

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)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	11

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

(단위:백만원)

78

공시일	2022-04-01
기준일	2022-03-31

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)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	30
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	26

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

(단위:백만원)

132

공시일 2022-04-01

기준일 2022-03-31

에쿼티알파일반사모혼합자산

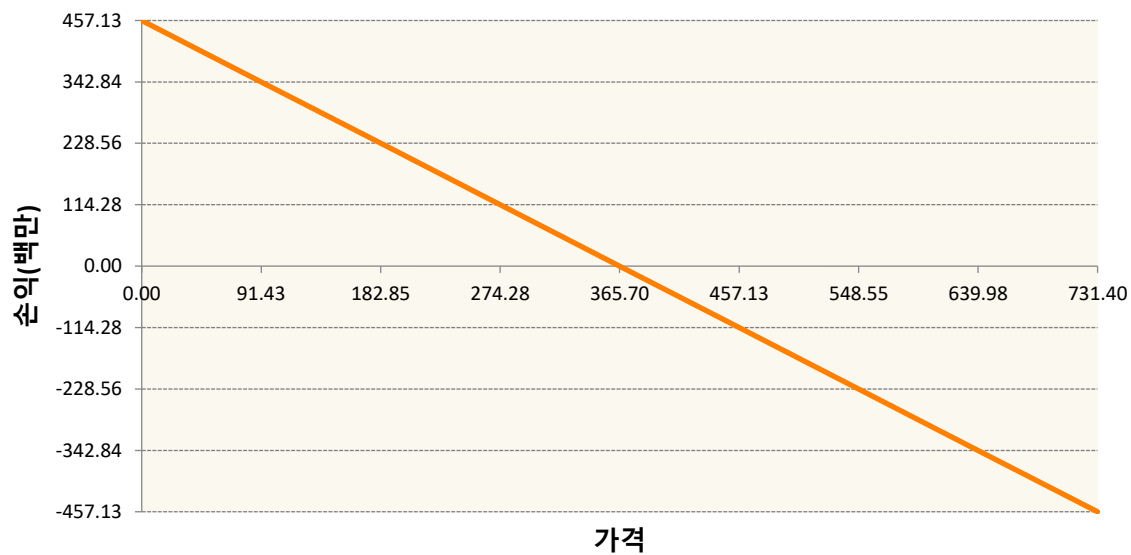
1. 계약금액

(단위:백만원)

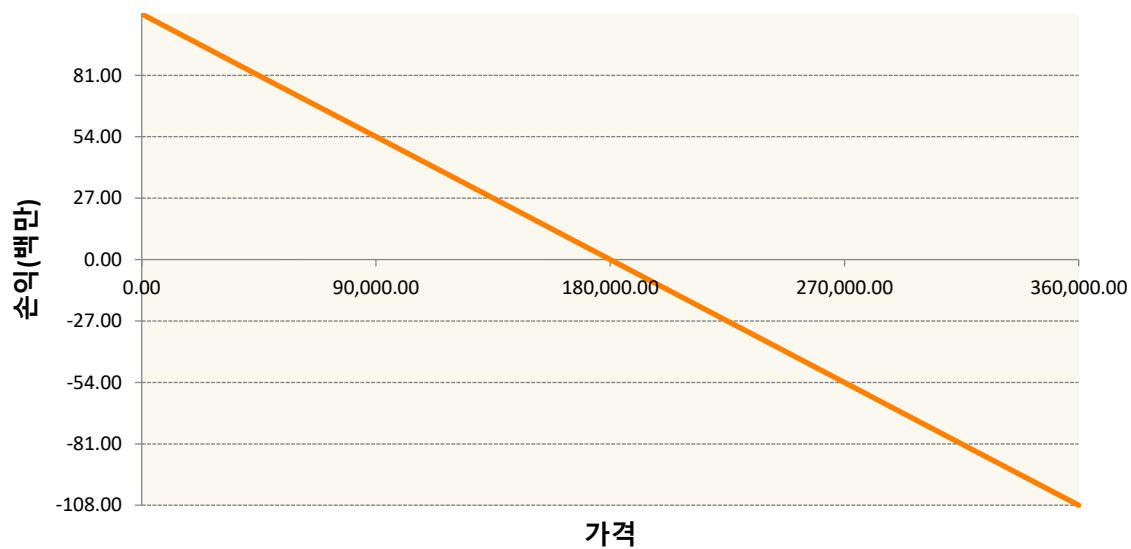
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	565	-565	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

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		3
KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322		0.47
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331		1
KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물		37
KR4116S400 2022-04 현대차개별선물		9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	62

공시일 2022-04-01

기준일 2022-03-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

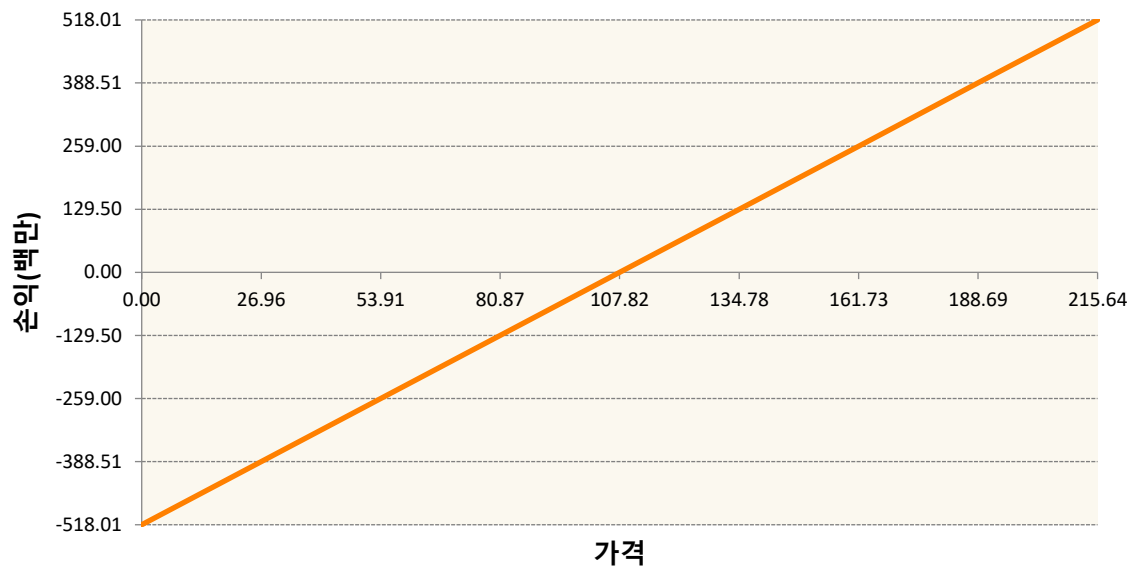
1. 계약금액

(단위:백만원)

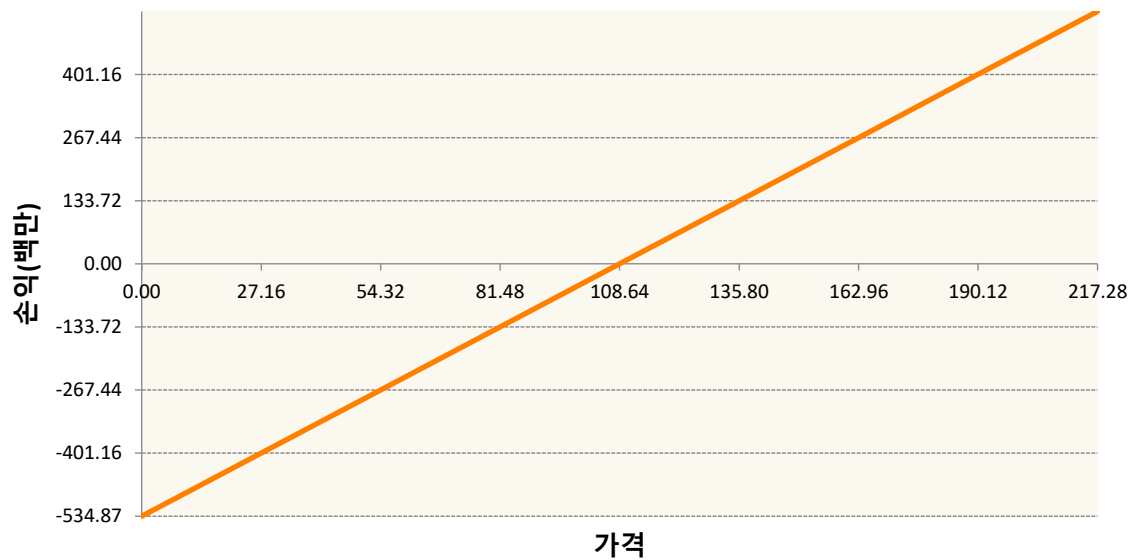
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,384	545	1,838	

2. 만기시점의 손익구조

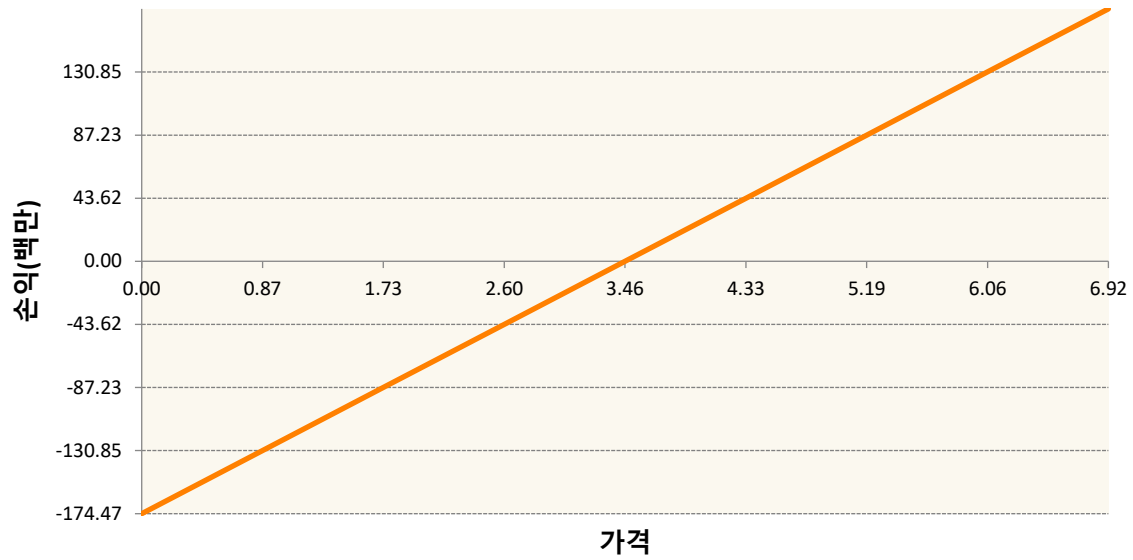
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



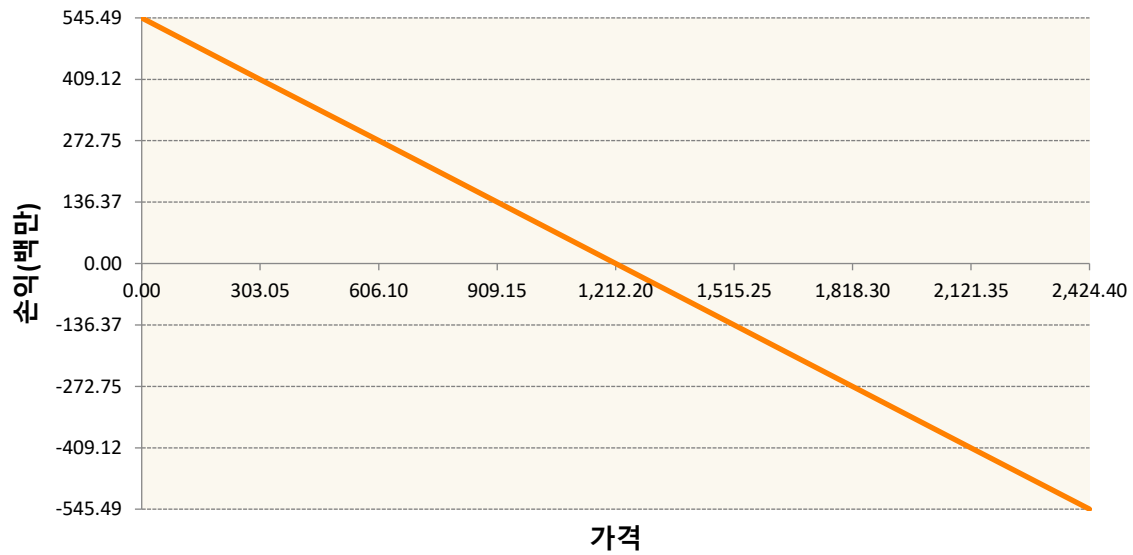
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



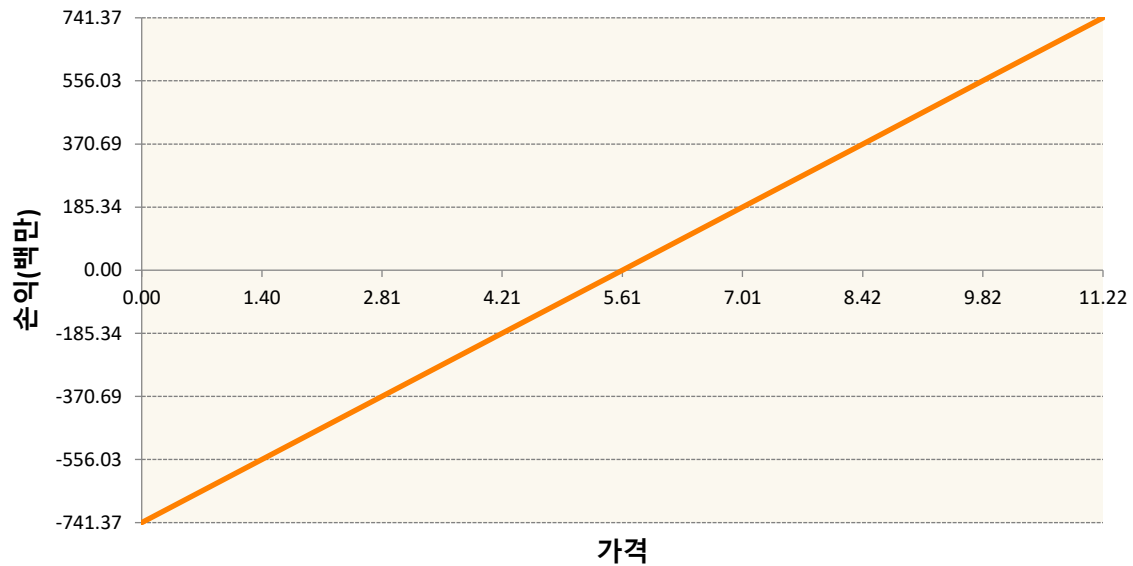
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

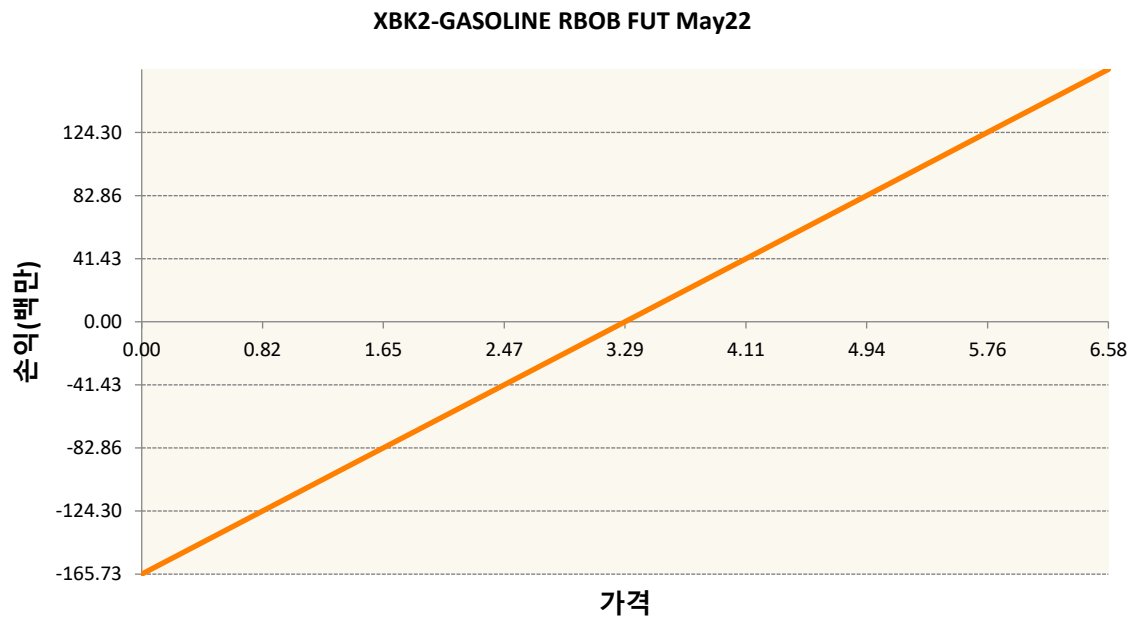
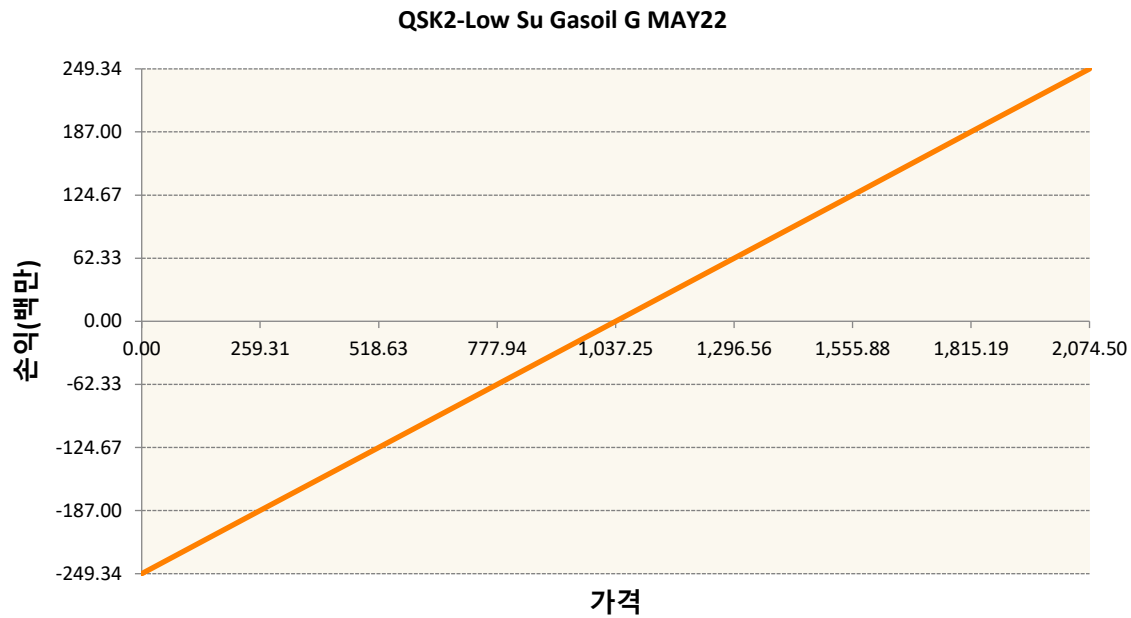


KR4175S40004-2022-04 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		41
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		43
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		14
KR4175S400 2022-04 달러선물			44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		59
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		20
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		530