

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

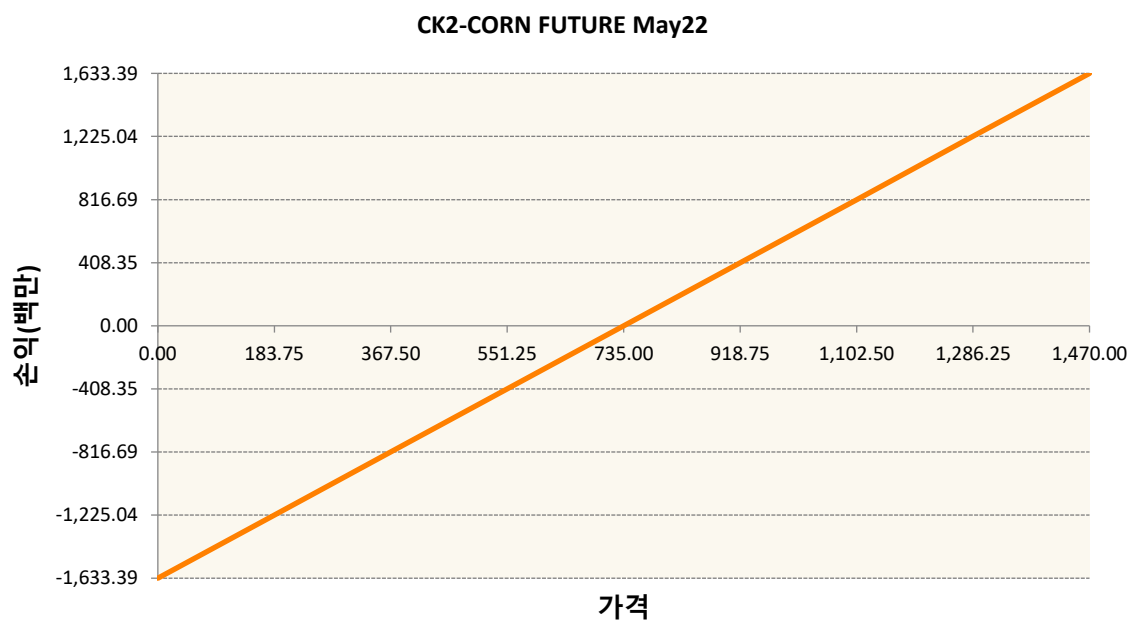
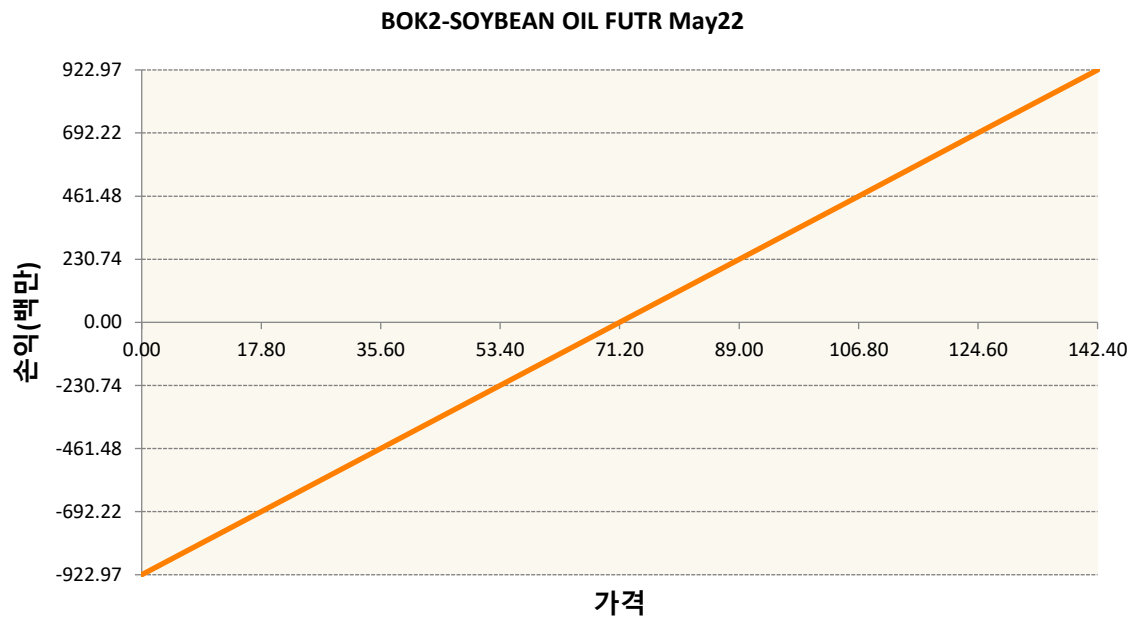
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

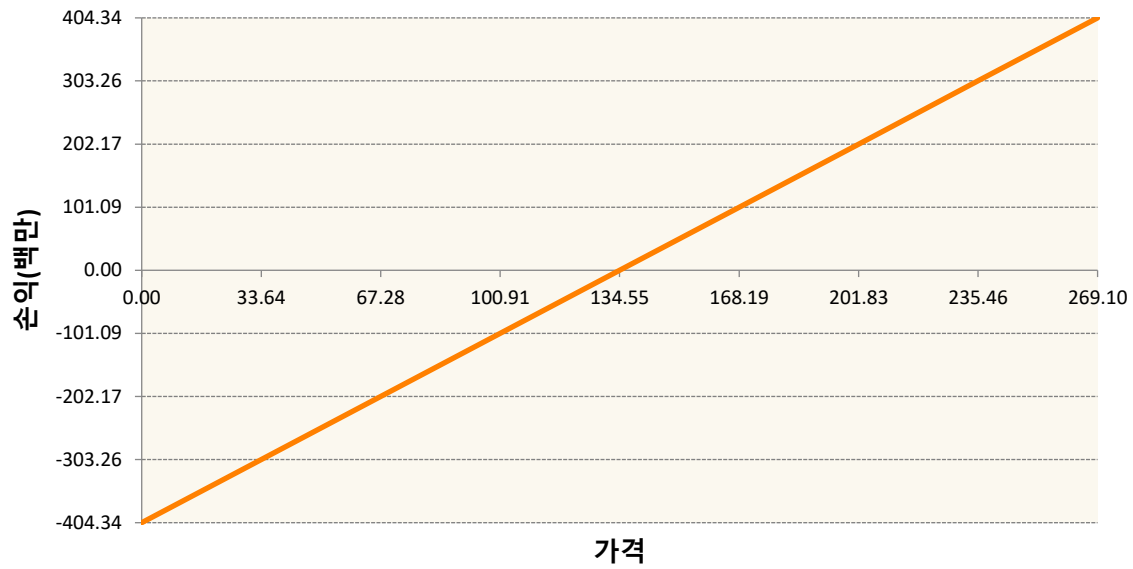
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,244	1,702	6,543	

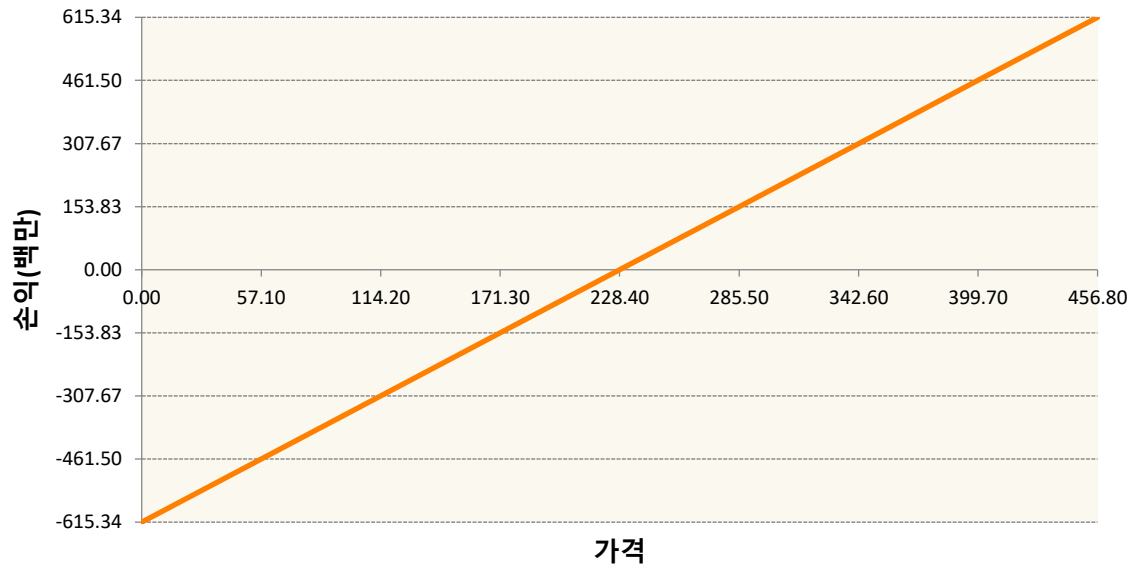
2. 만기시점의 손익구조



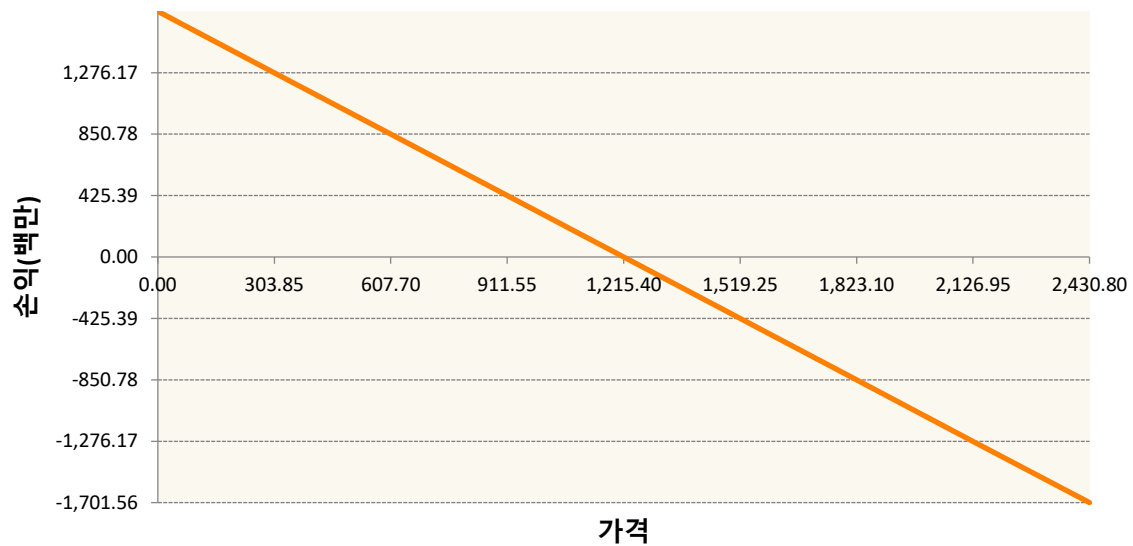
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



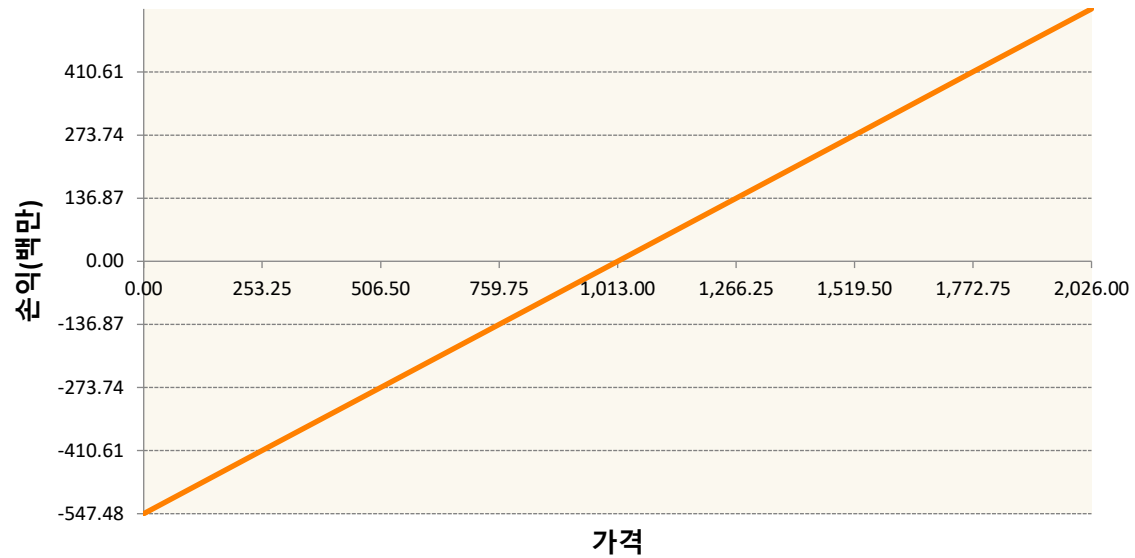
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



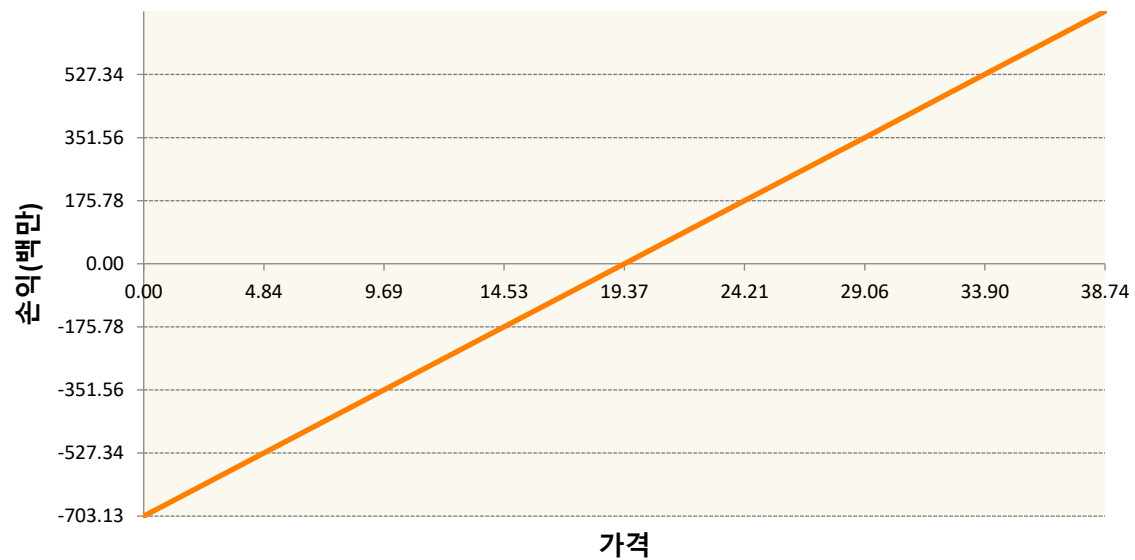
KR4175S40004-2022-04 달러선물



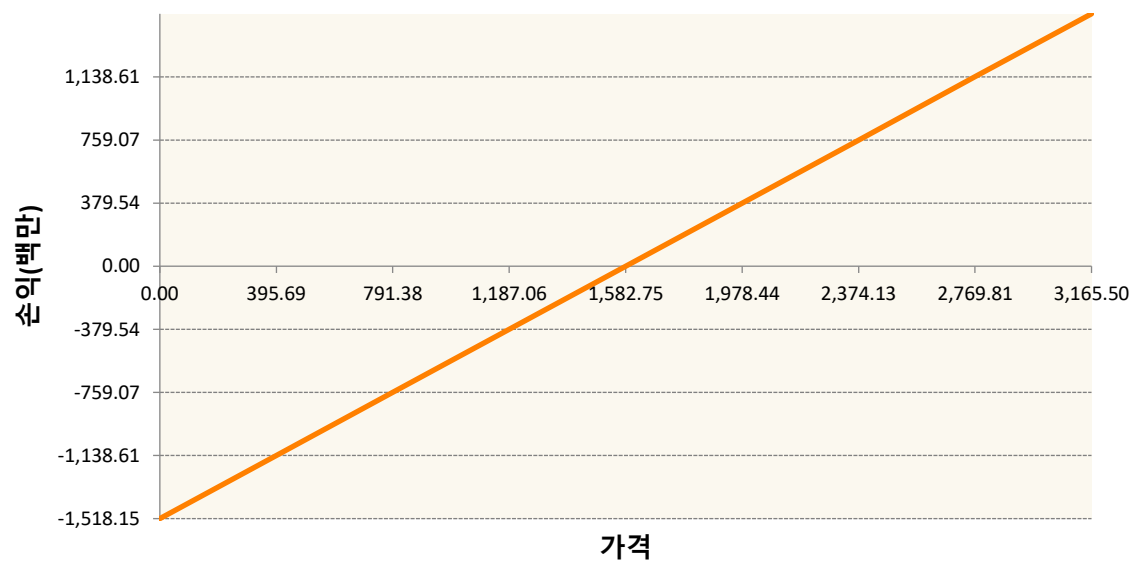
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



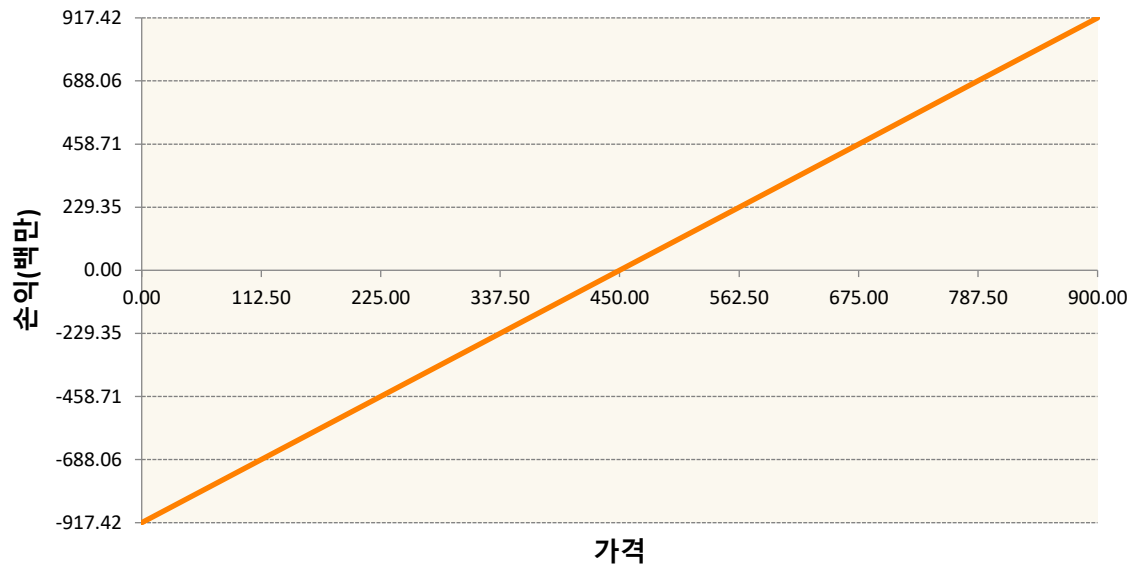
SBK2-Sugar May22



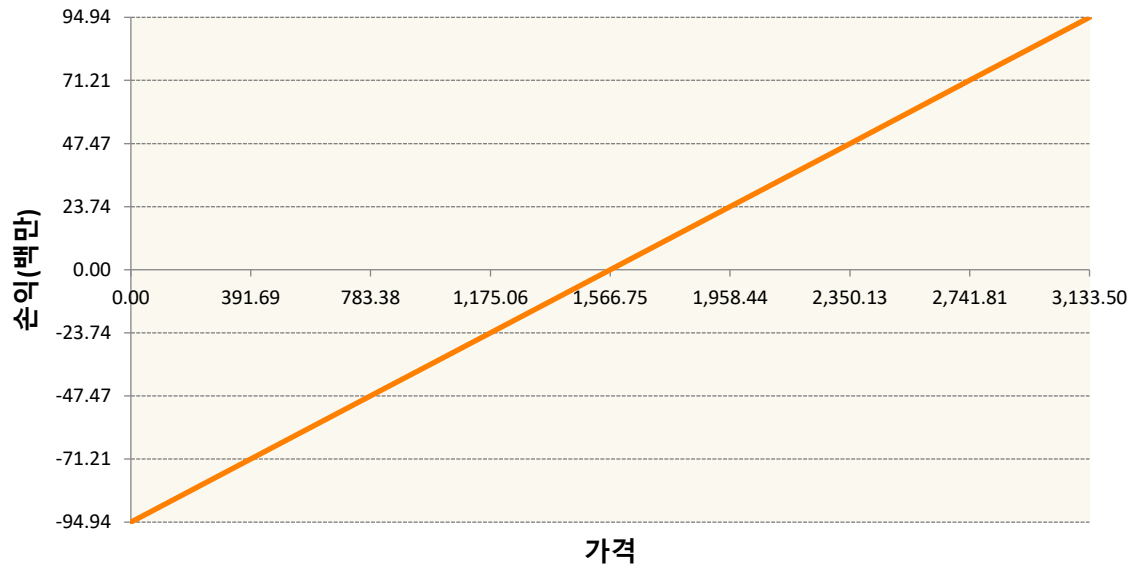
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



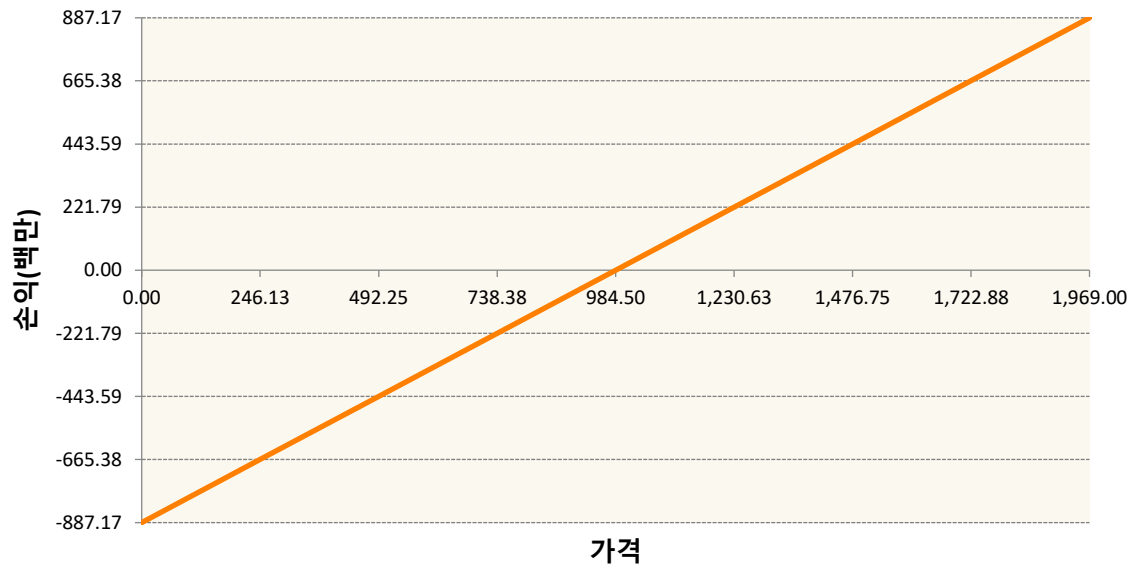
SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



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 2022-04-05

기준일 2022-04-04

스마트인덱스모

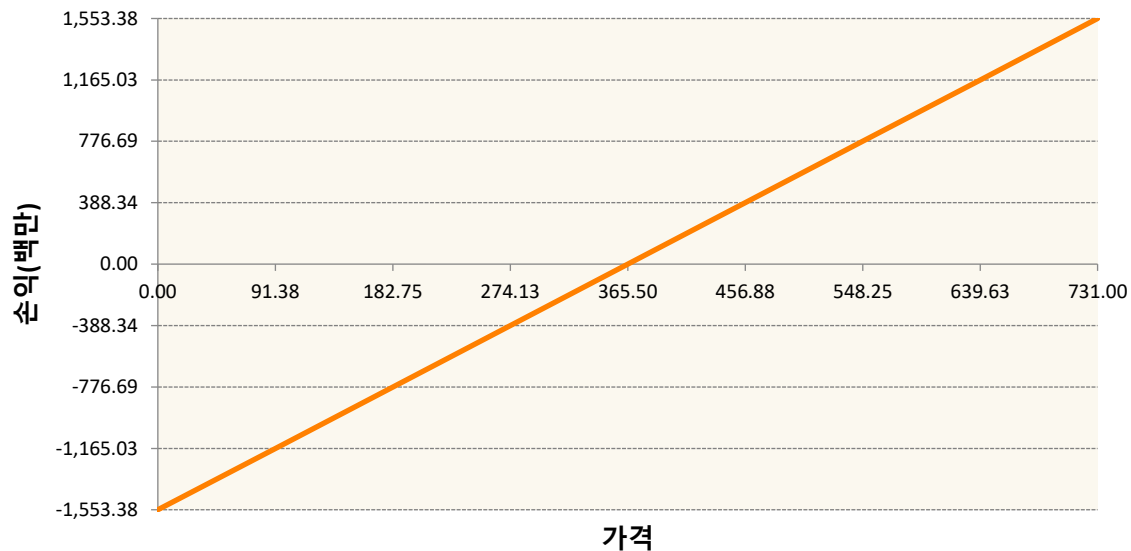
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,553	0	1,553	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



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	2022-04-05
기준일	2022-04-04

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	146
------------------------------	-----

* 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	2022-04-05
기준일	2022-04-04

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)

403

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

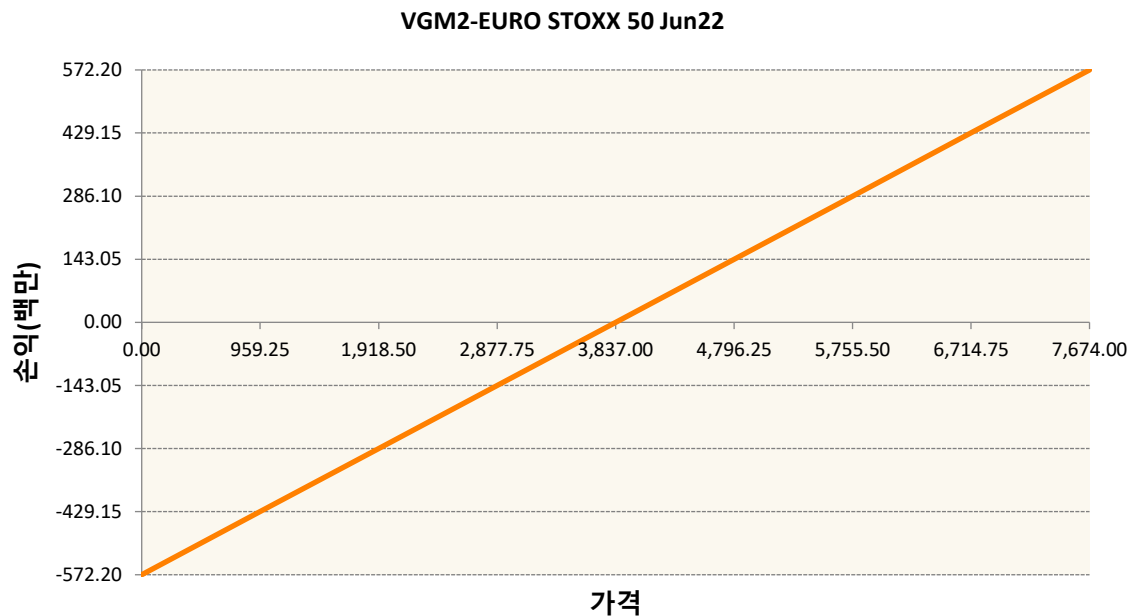
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	572	0	572	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-04-05
기준일	2022-04-04

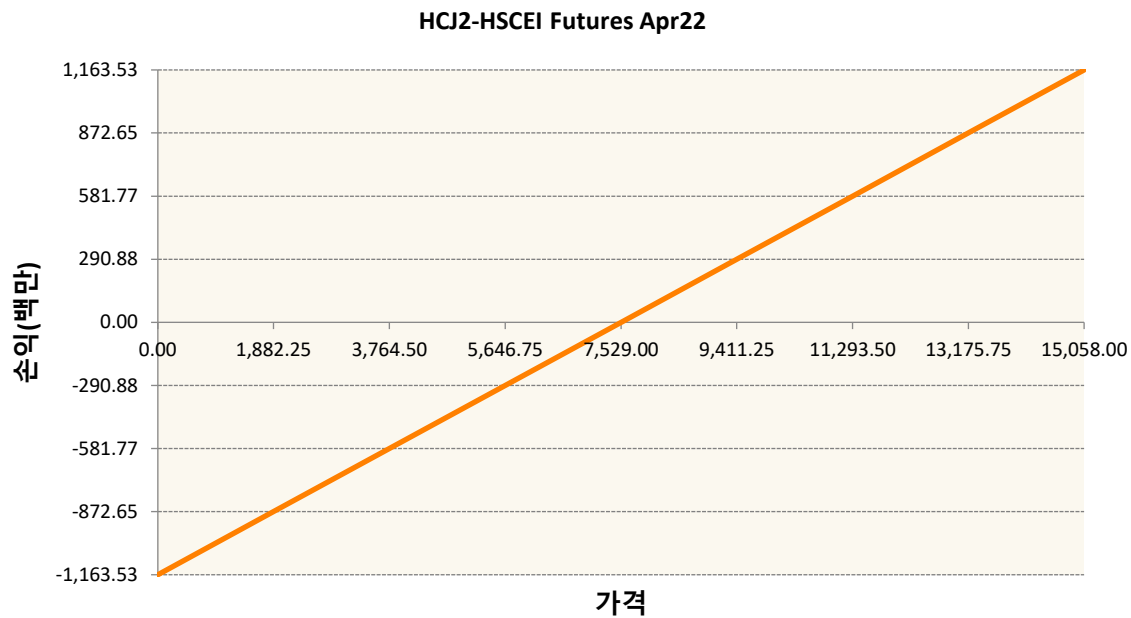
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,164	0	1,164	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI2	HSCEI Futures Apr22	93
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

124

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

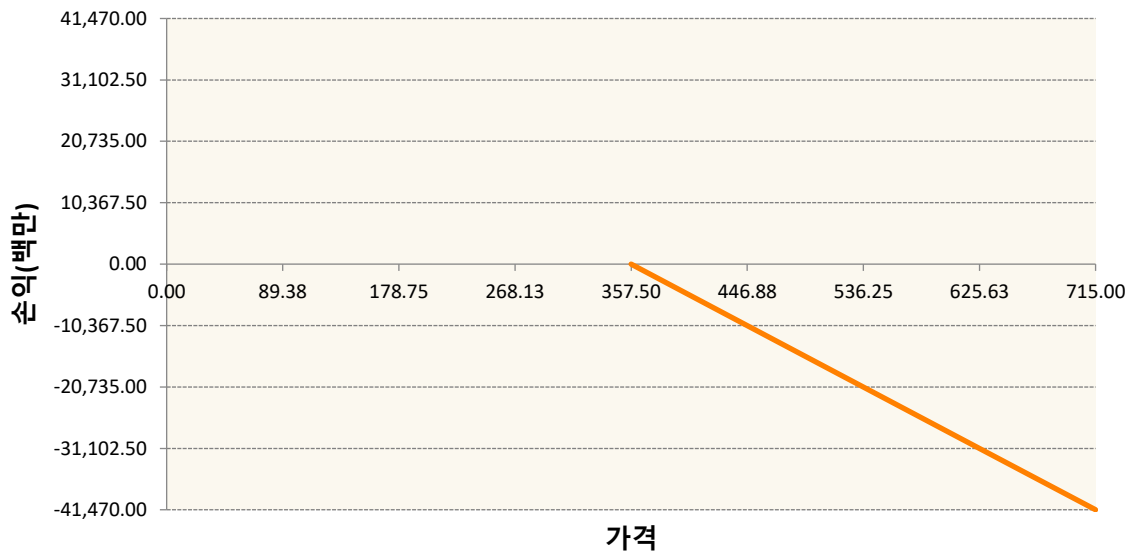
1. 계약금액

(단위:백만원)

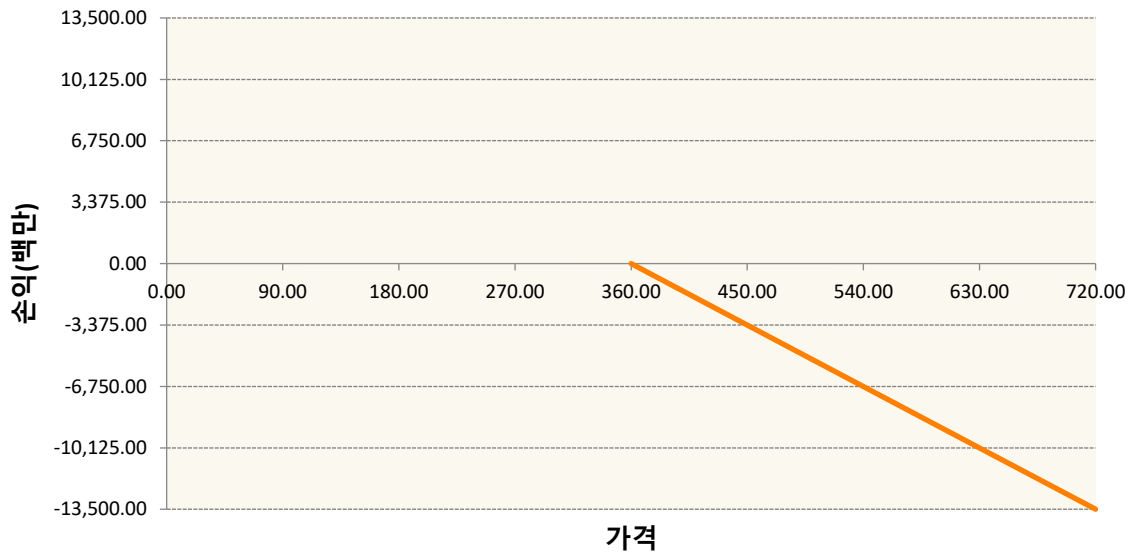
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,410	-66,410	장내

2. 만기시점의 손익구조

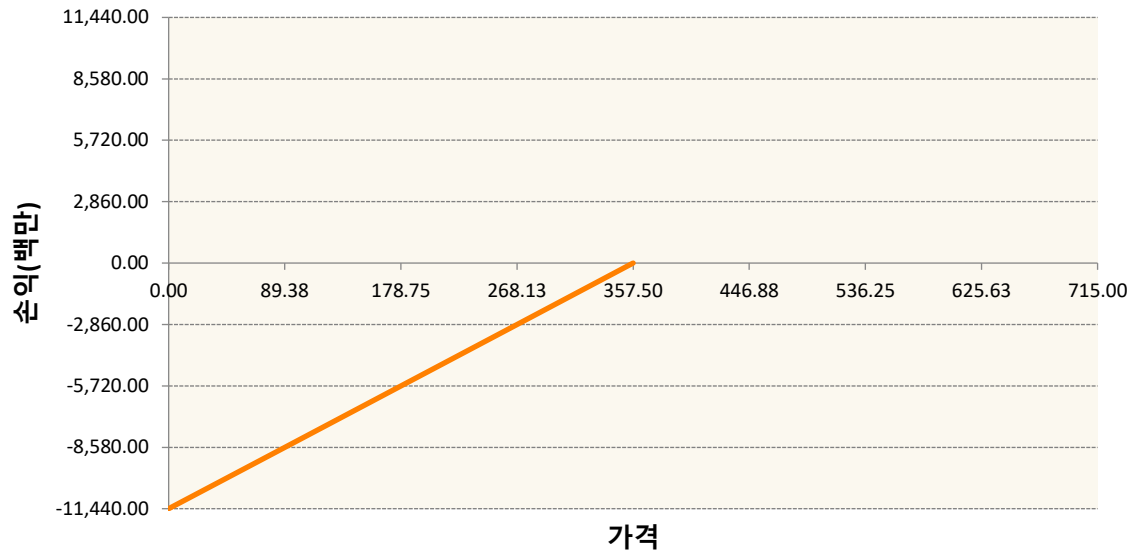
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572		2022-04 콜357.5					2,996
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,286	1,269	1,248	1,222	1,192	1,159	1,123
-5.33%	1,174	1,130	1,083	1,033	981	928	873
-2.67%	837	771	706	640	574	509	443
0%	179	121	61	0	-62	-124	-187
2.67%	-751	-783	-820	-861	-905	-952	-1,001
5.33%	-1,822	-1,833	-1,849	-1,869	-1,894	-1,922	-1,954
8.00%	-2,939	-2,942	-2,946	-2,954	-2,965	-2,979	-2,996
KR4201S43606		2022-04 콜360					940
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	360	356	350	344	336	327	316
-5.33%	334	322	309	295	280	264	247
-2.67%	248	227	207	186	166	145	124
0%	62	42	21	0	-21	-42	-63
2.67%	-219	-232	-246	-261	-278	-294	-312
5.33%	-557	-562	-569	-577	-587	-597	-609
8.00%	-916	-917	-919	-923	-927	-933	-940
KR4301S43570		2022-04 풋357.5					657
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-651	-651	-651	-652	-653	-655	-657
-5.33%	-345	-348	-352	-357	-363	-369	-375
-2.67%	-93	-103	-114	-124	-135	-145	-156
0%	23	16	8	0	-9	-18	-27

2.67%	44	43	41	38	35	31	27
5.33%	45	45	45	45	44	43	42
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

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

(단위:백만원)

4,874

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

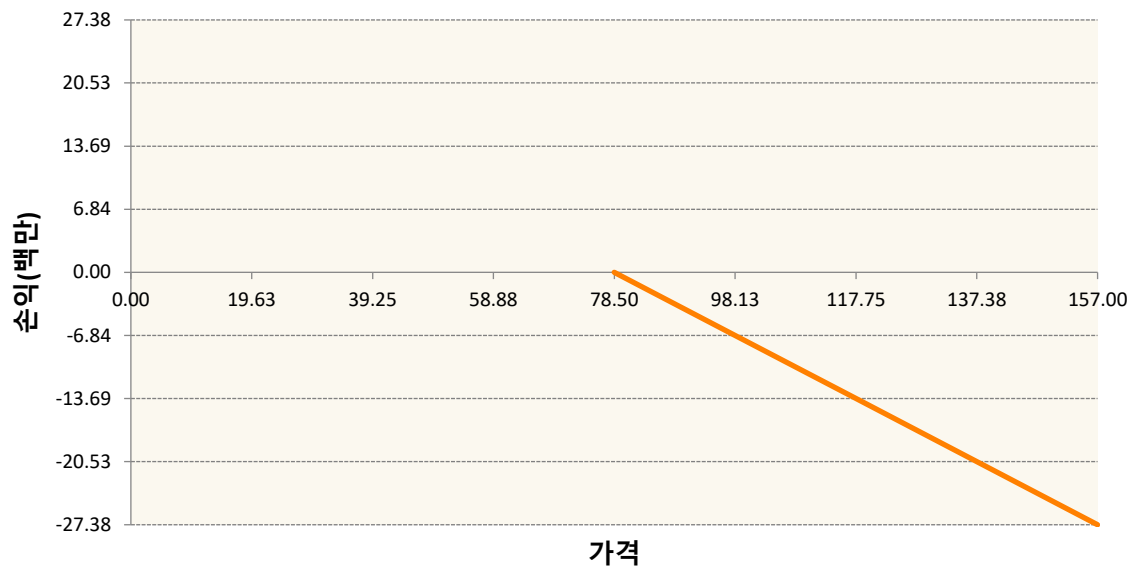
1. 계약금액

(단위:백만원)

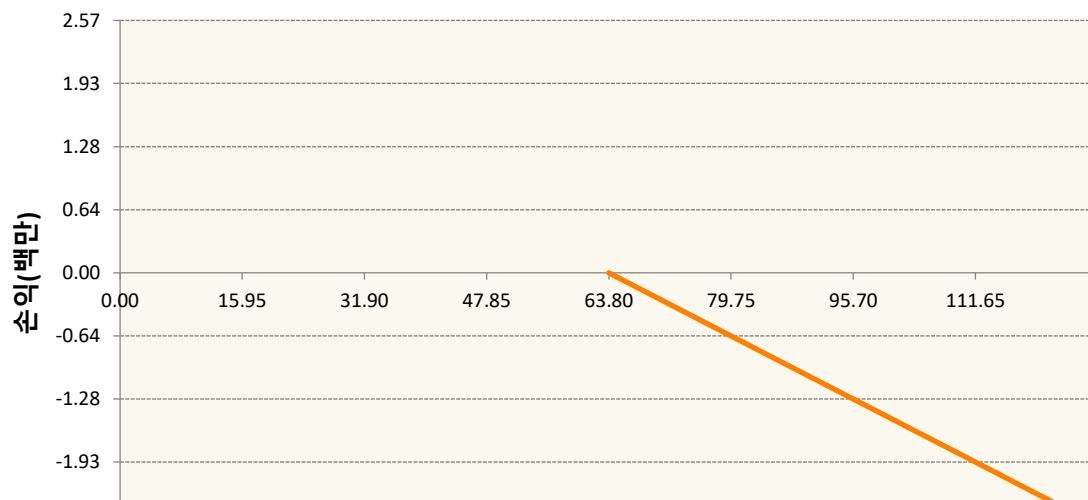
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	55	-55	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,012	-2,012	장외

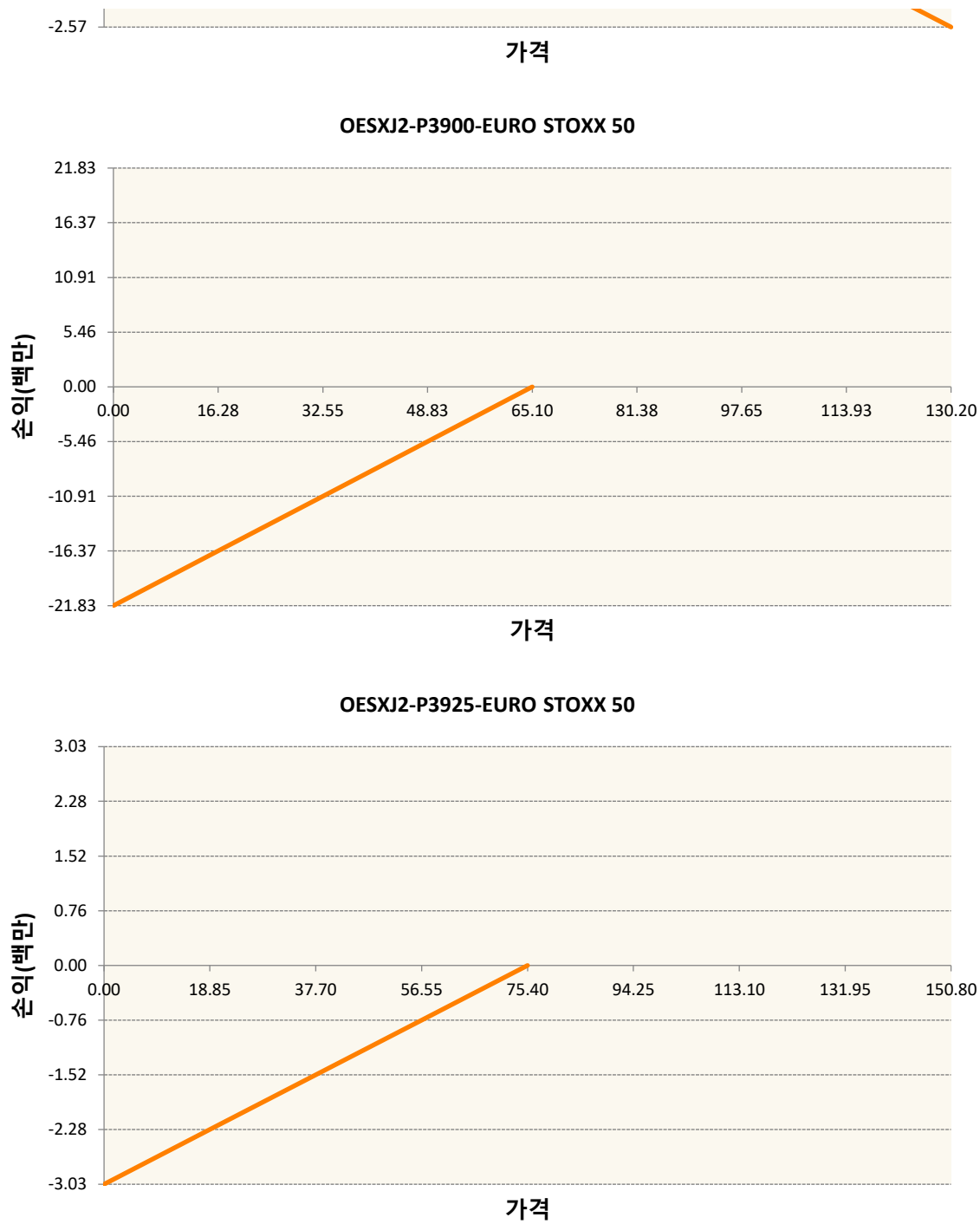
2. 만기시점의 손익구조

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

13
21
32
64
43
2
0.21
2
0.24

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

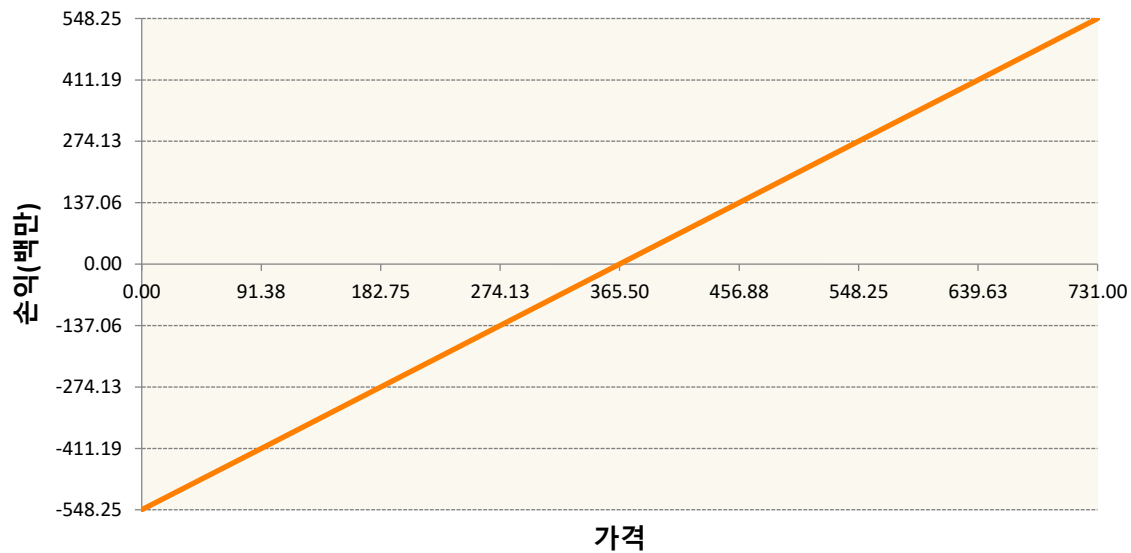
1. 계약금액

(단위:백만원)

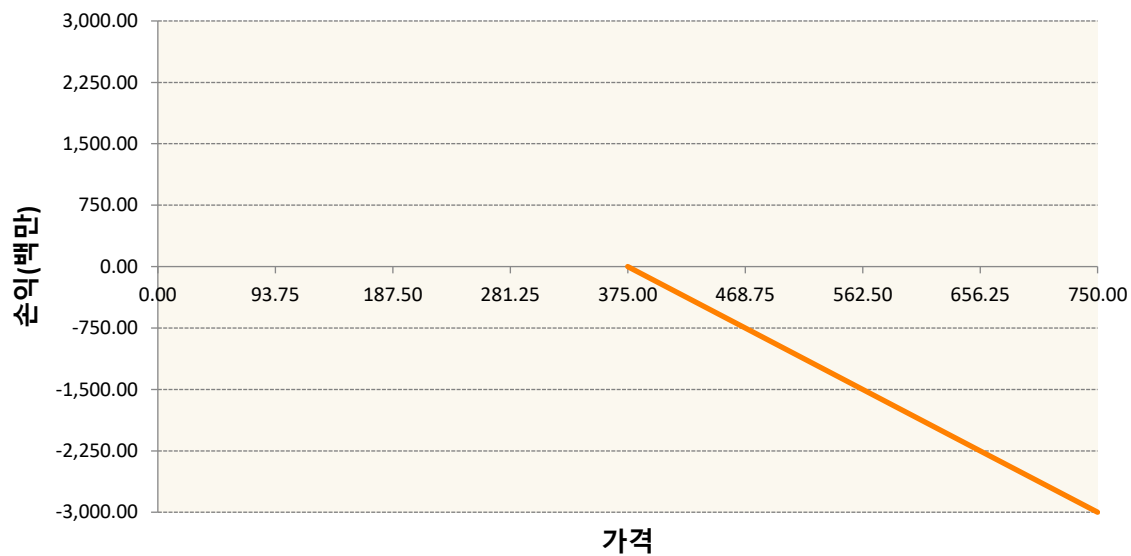
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	548	0	548	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S43754-2022-04 콜375



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The blue line shows that as the price increases beyond the break-even point of 377.50, the profit decreases linearly, reaching a loss of 1,698.75 million at a price of 755.00.

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 '가격' (Price), ranges from 0.00 to 715.00. The y-axis, labeled '순이익 (백만원)' (Net Income in 100 million won), ranges from -357.50 to 357.50. A solid orange line represents the function, starting at (0, 357.50) and ending at (357.50, 0). The area under the line is shaded light orange.

가격 (Price)	순이익 (백만원) (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				149
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	25	25	25	25	24	23
-5.33%	25	25	24	23	22	20	19
-2.67%	22	21	19	16	14	11	8
0%	12	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-16	-21	-26	-31	-36	-40	-45
5.33%	-66	-70	-74	-78	-82	-87	-91
8.00%	-132	-134	-136	-139	-142	-145	-149

KR4201S43770

2022-04 콜377.5

78

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-5.33%	11	11	11	10	10	9	8
-2.67%	10	10	9	8	6	5	3
0%	6	4	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-7	-10	-12	-15	-18	-20	-23
5.33%	-32	-34	-37	-39	-42	-44	-47
8.00%	-67	-68	-70	-72	-74	-76	-78

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	20	21
-5.33%	11	11	11	11	11	12	12
-2.67%	3	3	4	4	4	5	5
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

252

공시일	2022-04-05
기준일	2022-04-04

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	9,683	0	9,683	

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	2022-04-05
기준일	2022-04-04

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	7,651	0	7,651	

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	2022-04-05
기준일	2022-04-04

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	26,435	0	26,435	
누계	통화	선도	1,700	27,603	-25,903	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,208
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E	39
FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E	97
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

790

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

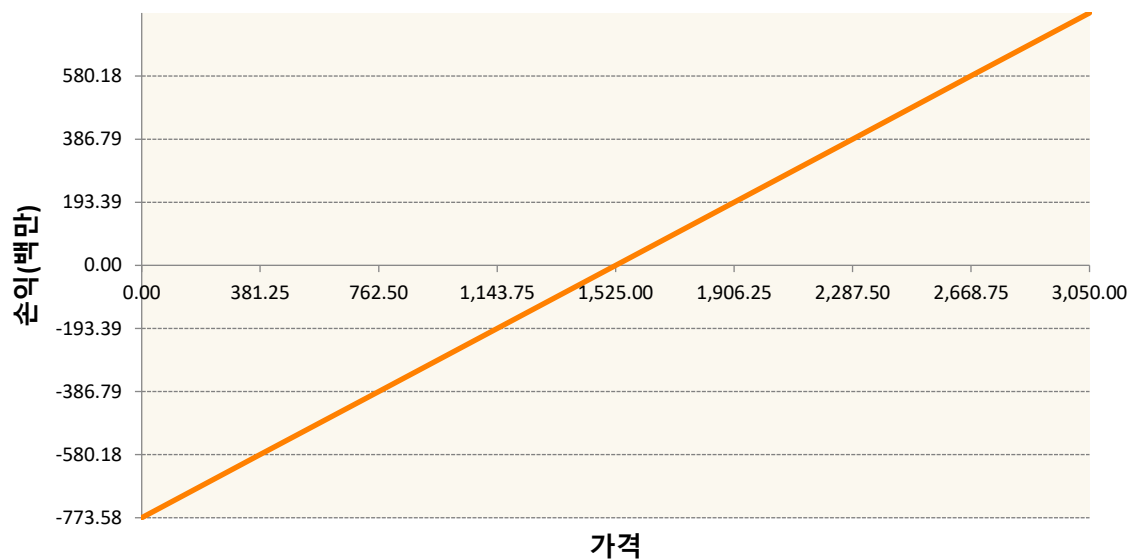
1. 계약금액

(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	774	0	774	
누계	유가증권	스왑	1,834	0	1,834	장외
누계	통화	선도	0	1,180	-1,180	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	62

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

(단위:백만원)

266

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

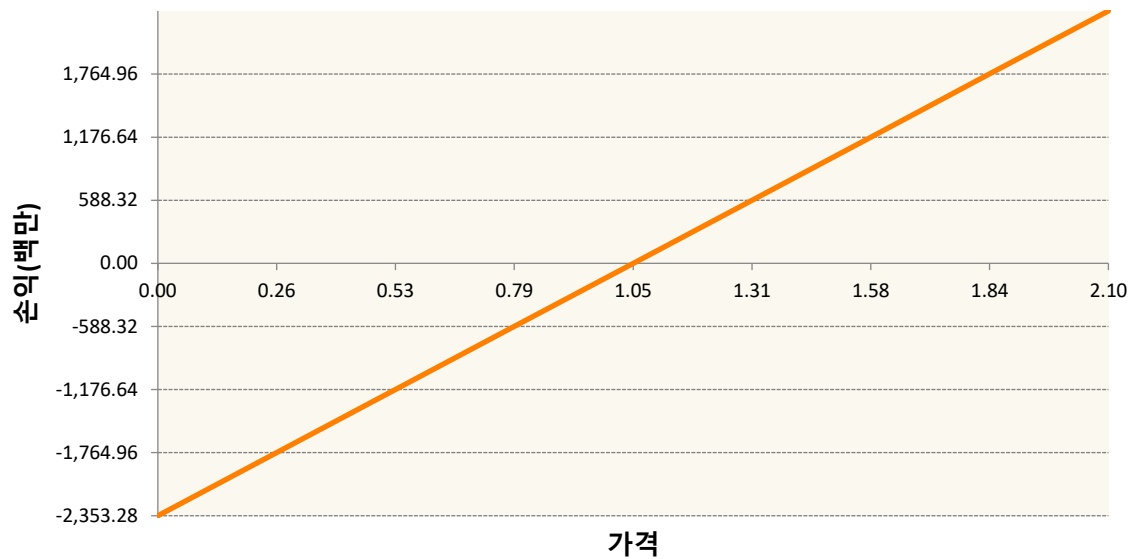
1. 계약금액

(단위:백만원)

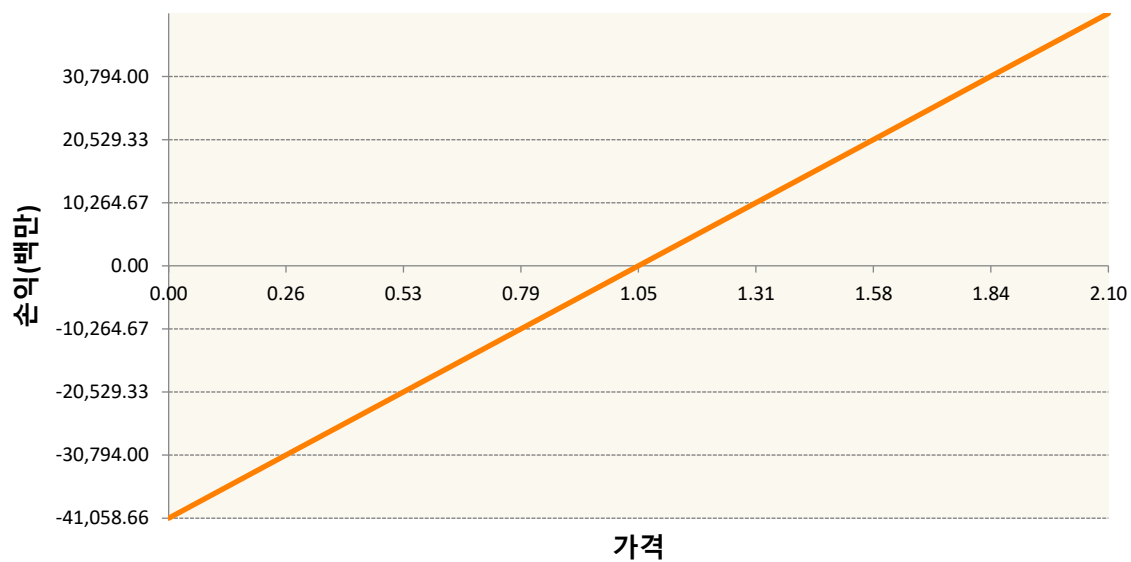
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	44,589	0	44,589	

2. 만기시점의 손익구조

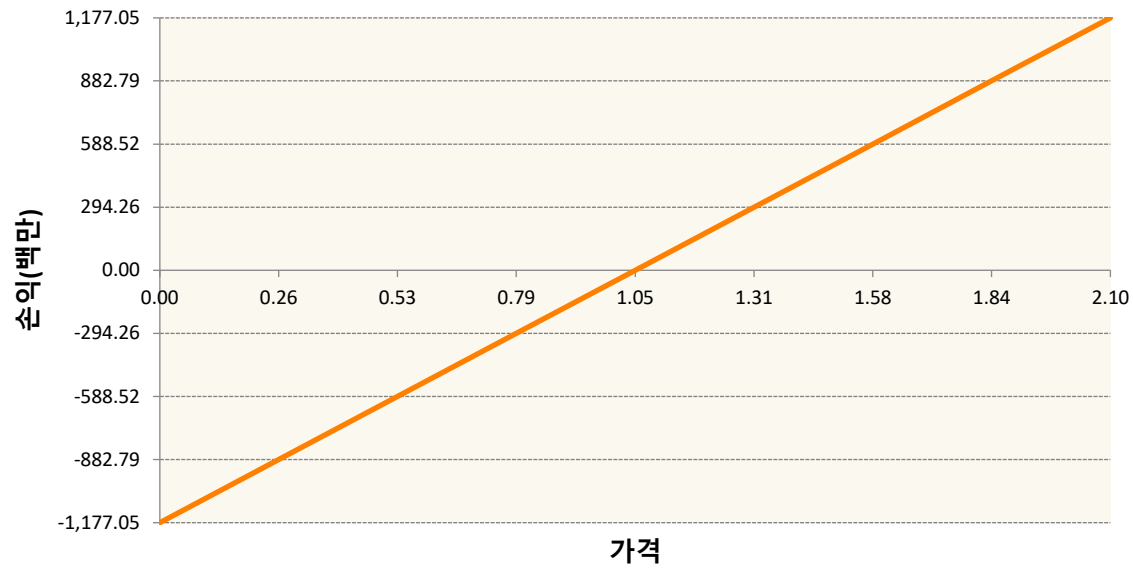
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

188
3,280
94

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

(단위:백만원)

6,516

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

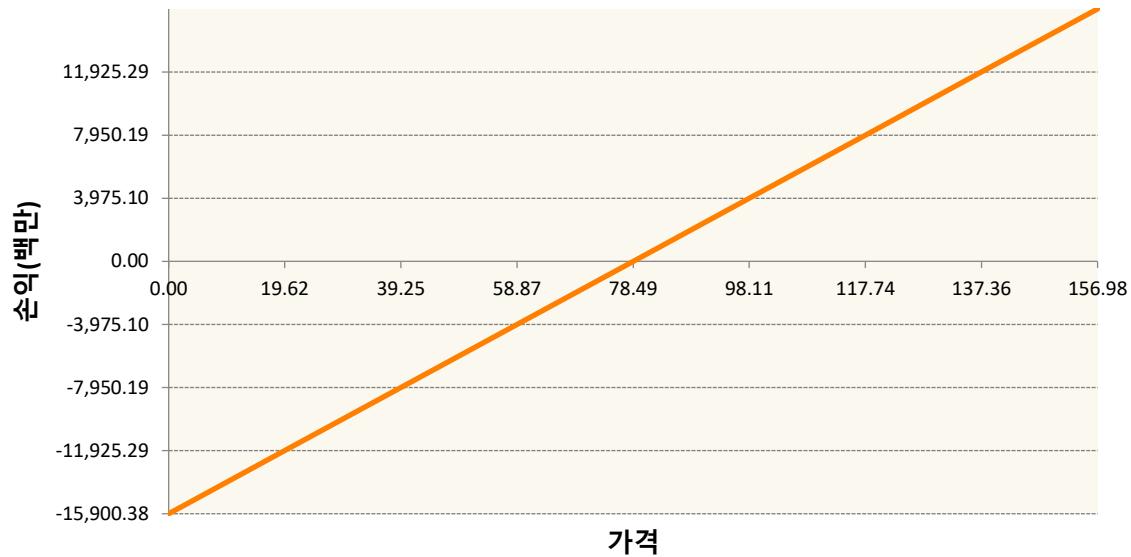
1. 계약금액

(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	15,900	0	15,900	
누계	통화	선도	0	7,483	-7,483	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C3V·KRW/EUR 25-04-22E

599

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,272

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

(단위:백만원)

3,346

공시일	2022-04-05
기준일	2022-04-04

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)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	18

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

(단위:백만원)

135

공시일	2022-04-05
기준일	2022-04-04

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)	30
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	35
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	30
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	30

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

(단위:백만원)

153

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

에쿼티알파일반사모혼합자산

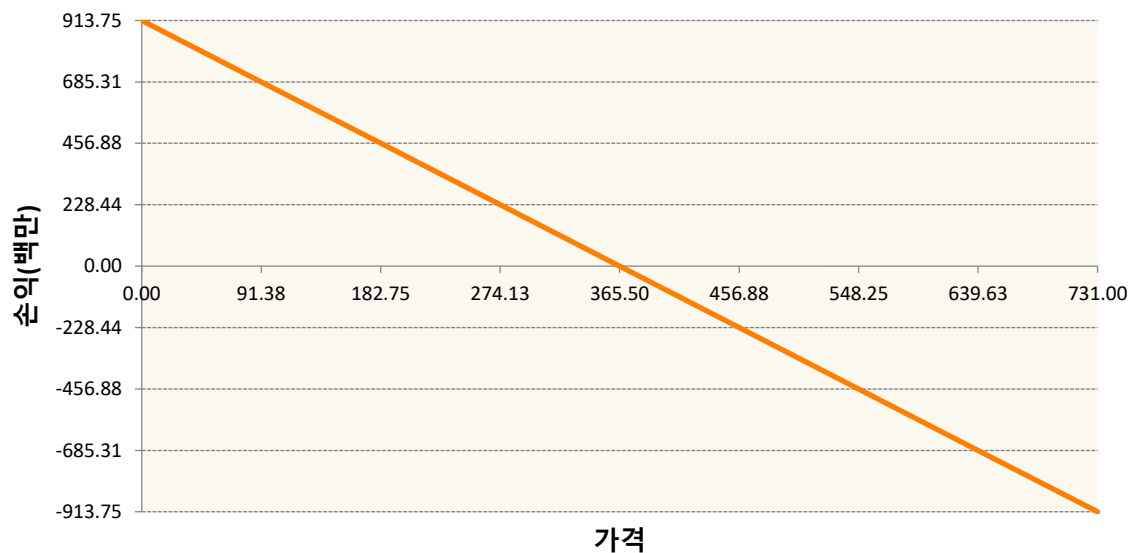
1. 계약금액

(단위:백만원)

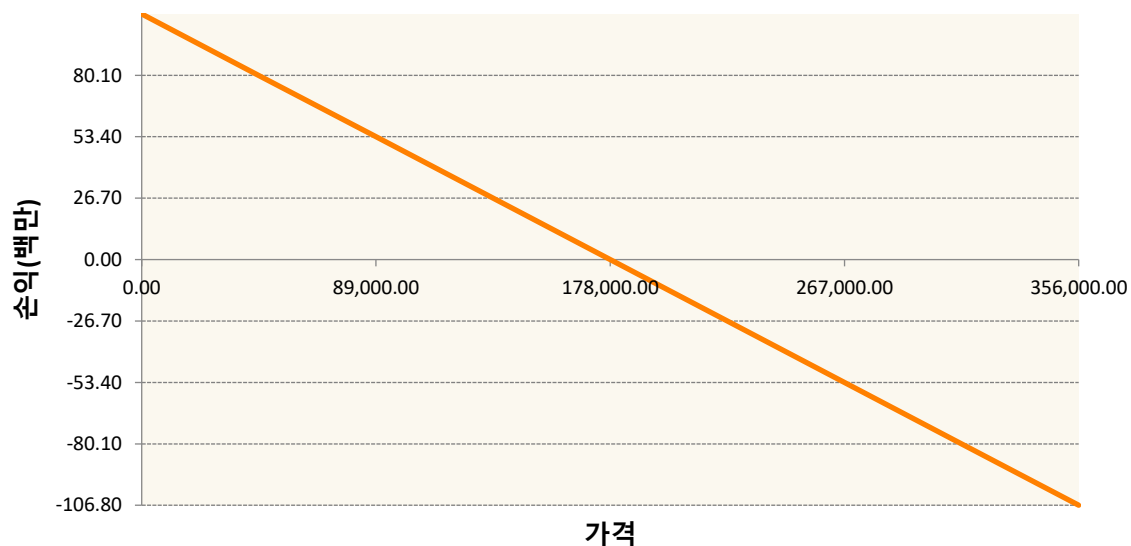
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,021	-1,021	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4116S40008-2022-04 현대차개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물	73
KR4116S400 2022-04 현대차개별선물	9
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322	2
KRS0003014 SWAP_APPLE INC_0322	2
KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322	0.08
KRS0003014 SWAP_TESLA INC_0322	3
KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	1
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331	1

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

96

공시일 2022-04-05

기준일 2022-04-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

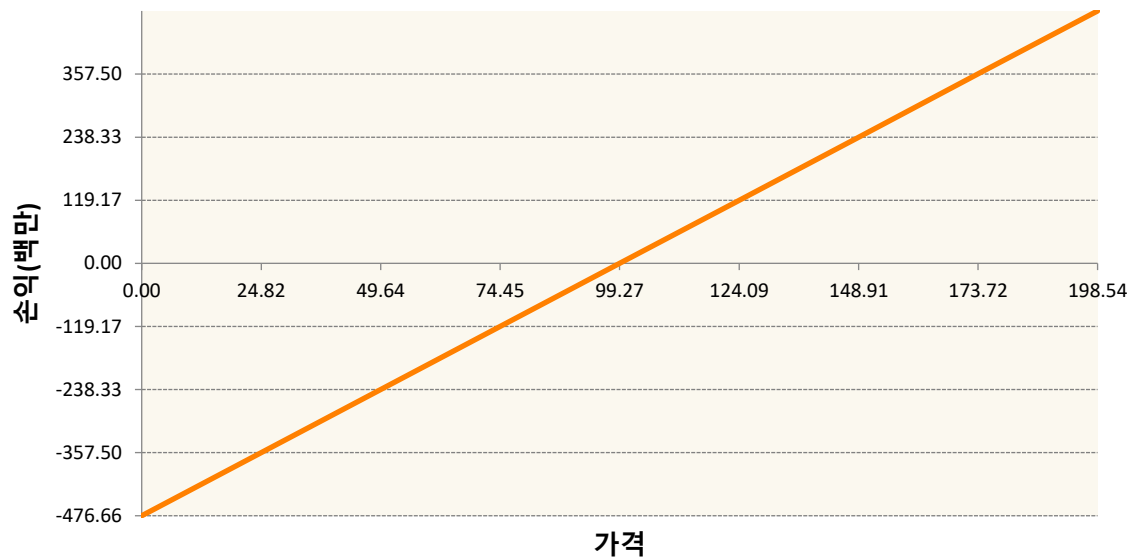
1. 계약금액

(단위:백만원)

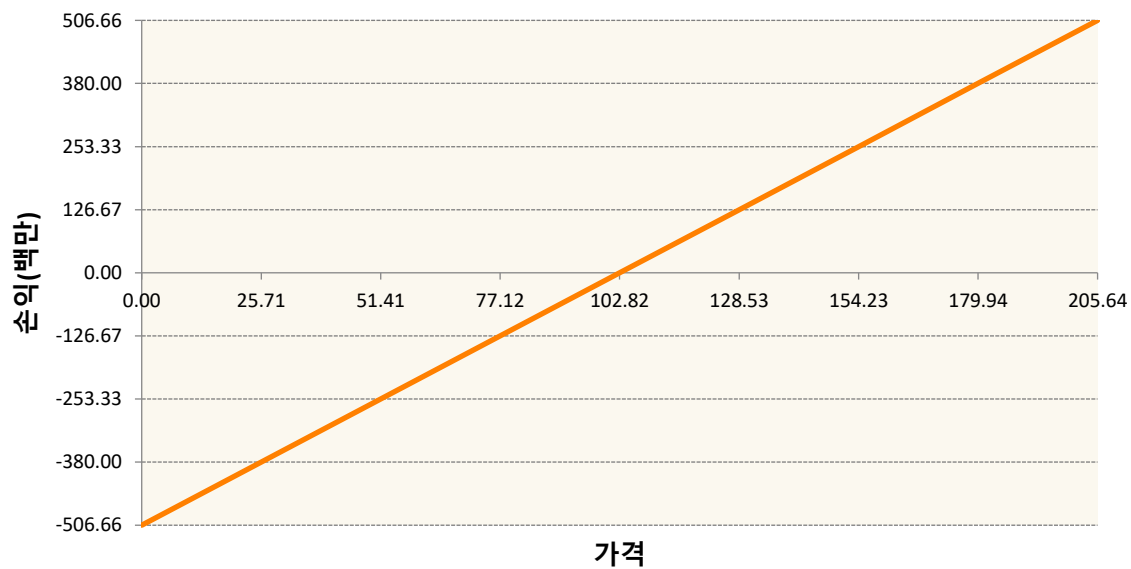
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,319	547	1,772	

2. 만기시점의 손익구조

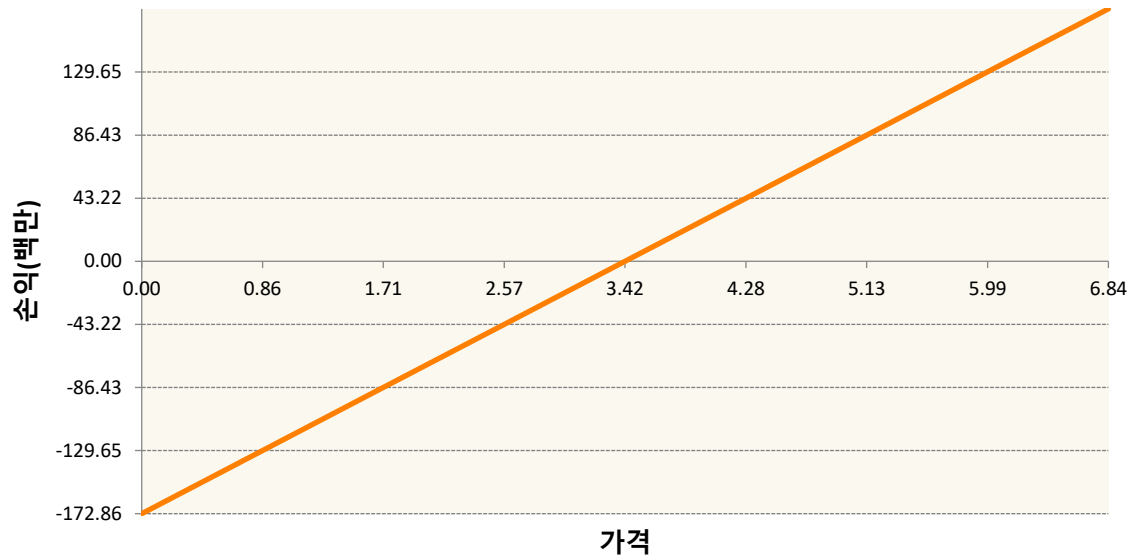
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



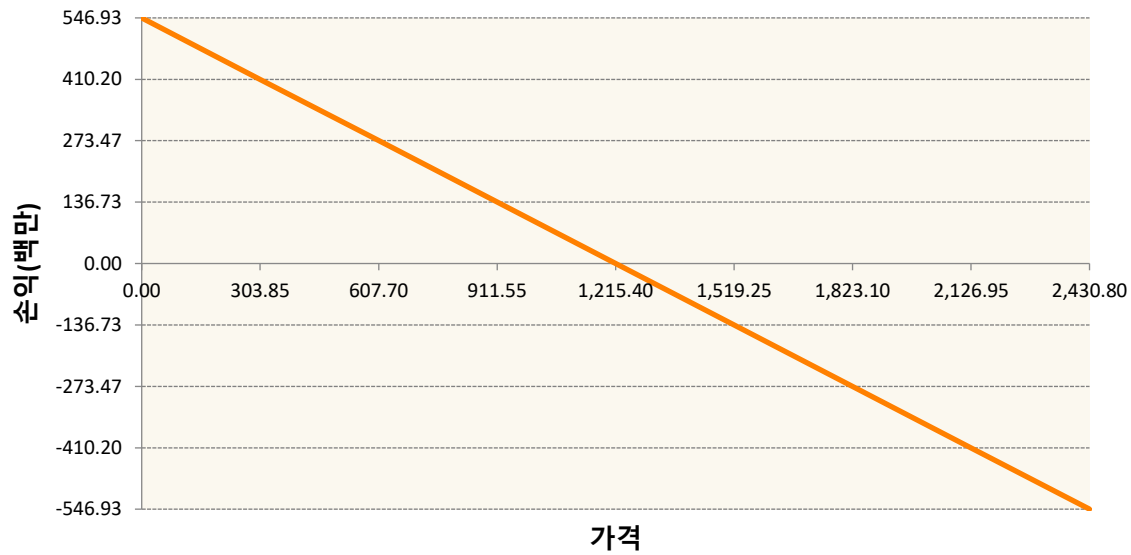
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



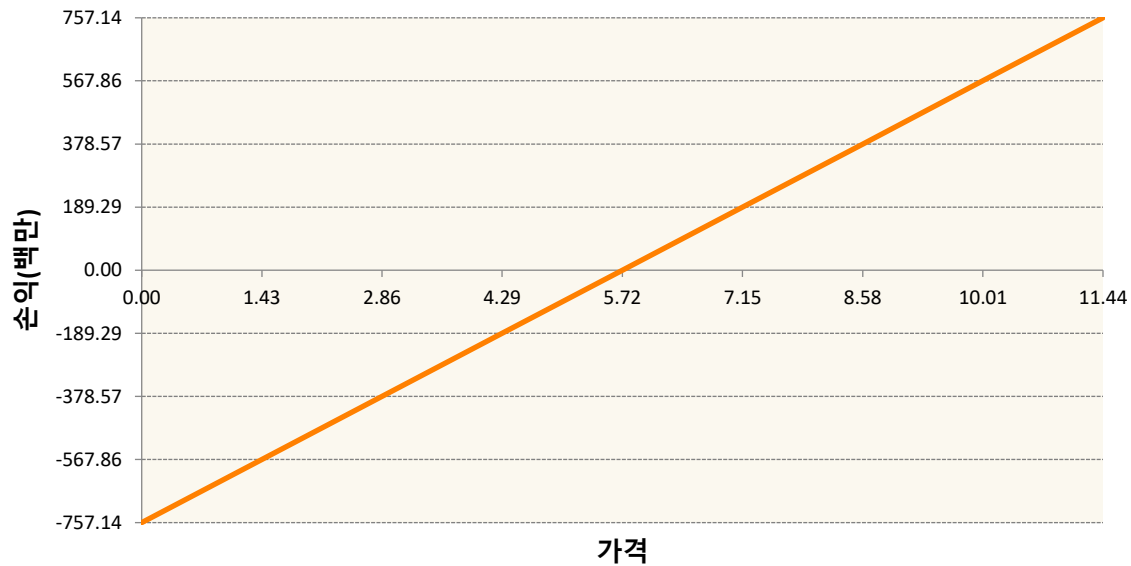
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

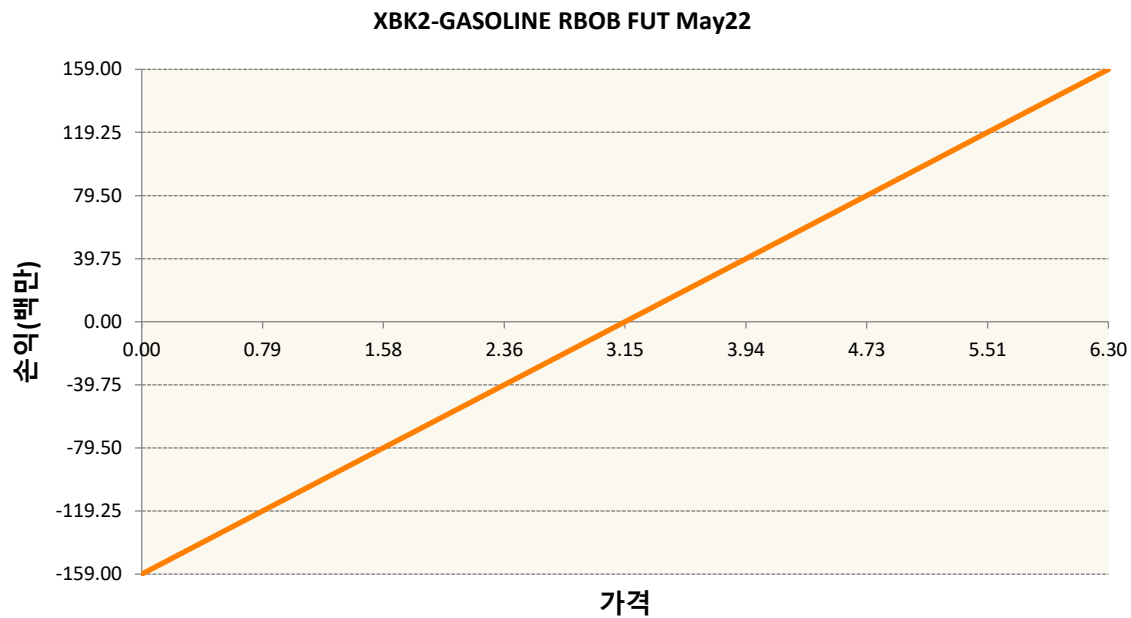
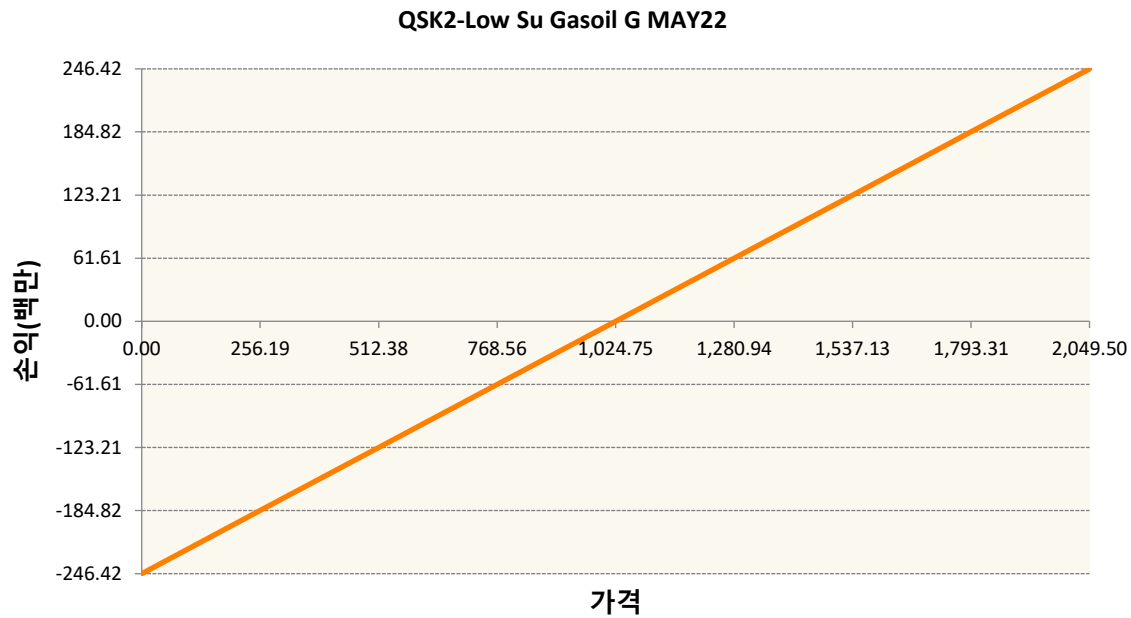


KR4175S40004-2022-04 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		38
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		41
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		14
KR4175S400 2022-04 달러선물			44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		61
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		20
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	521