

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

포커스농산물모(채권-파생형)

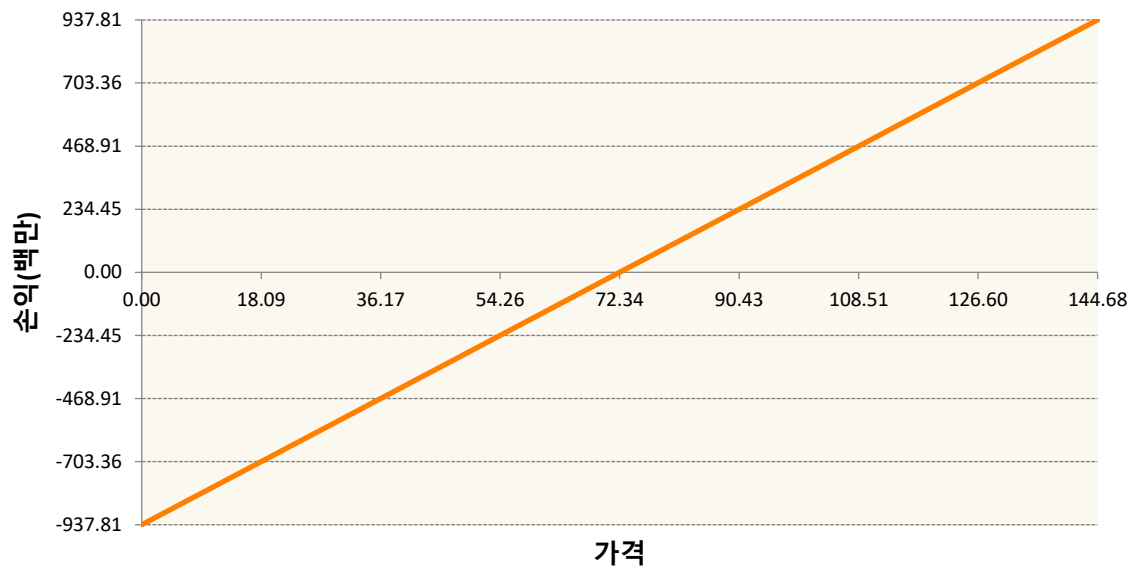
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

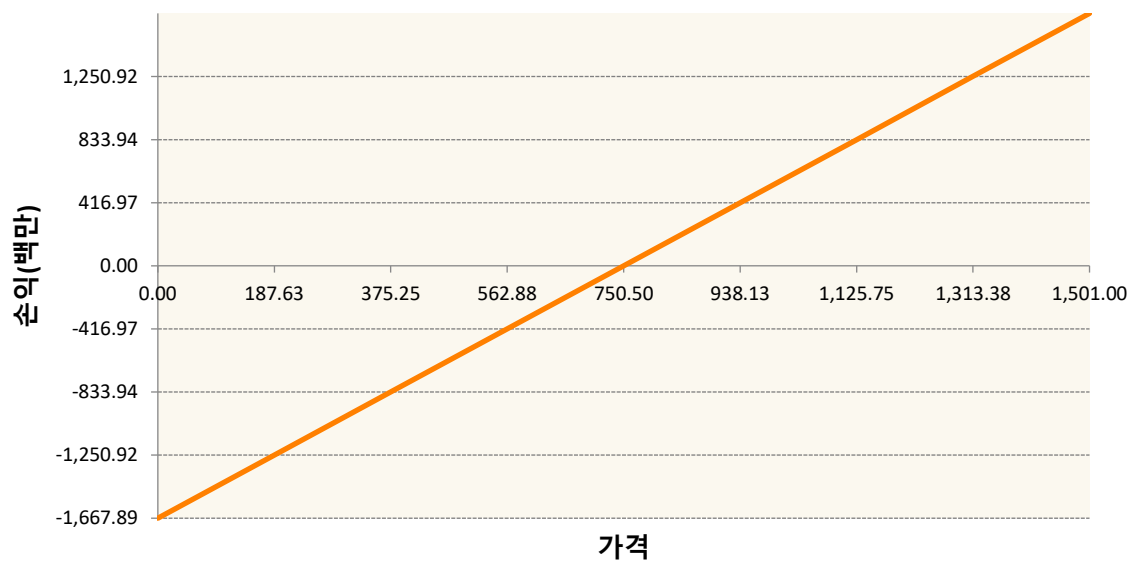
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,386	1,699	6,687	

2. 만기시점의 손익구조

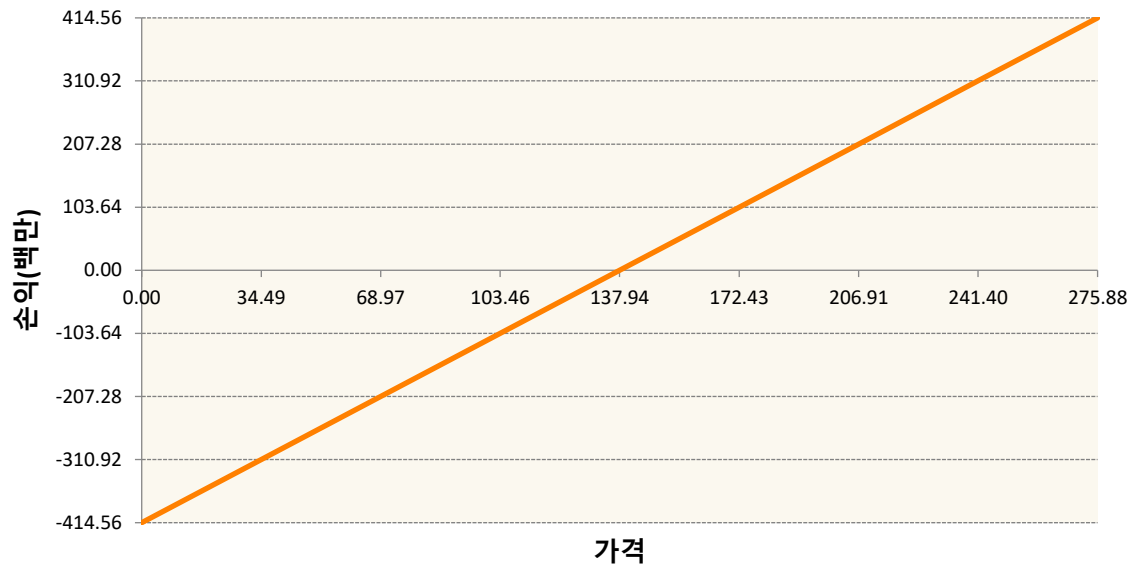
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



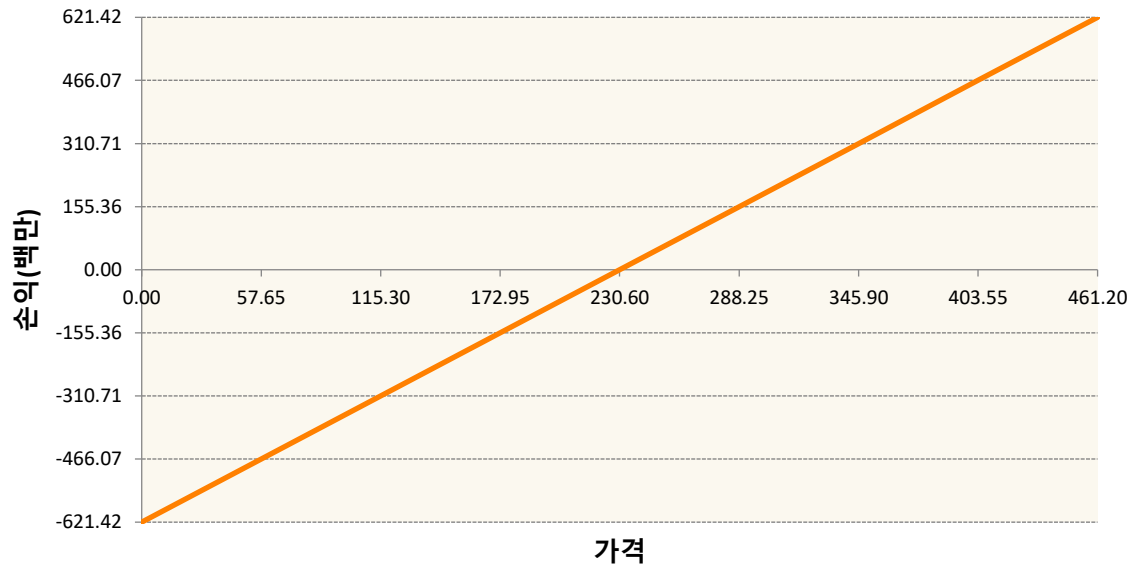
CK2-CORN FUTURE May22



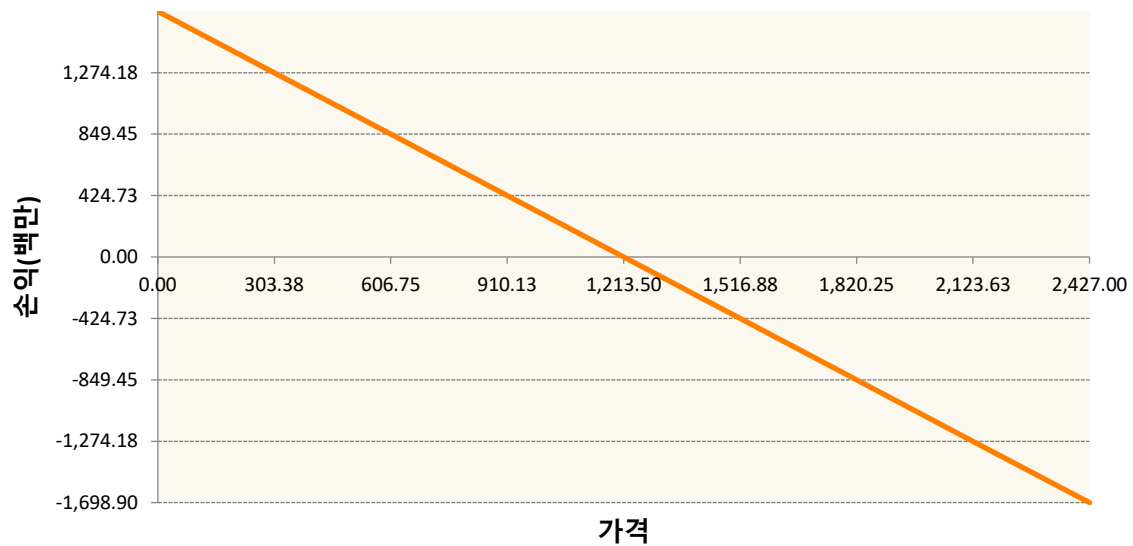
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



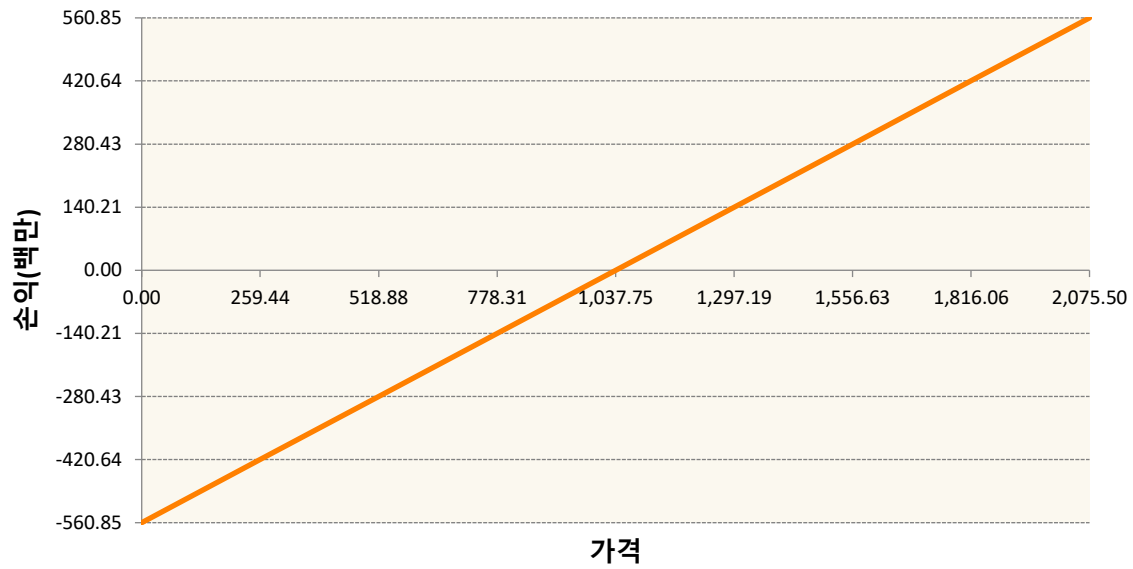
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



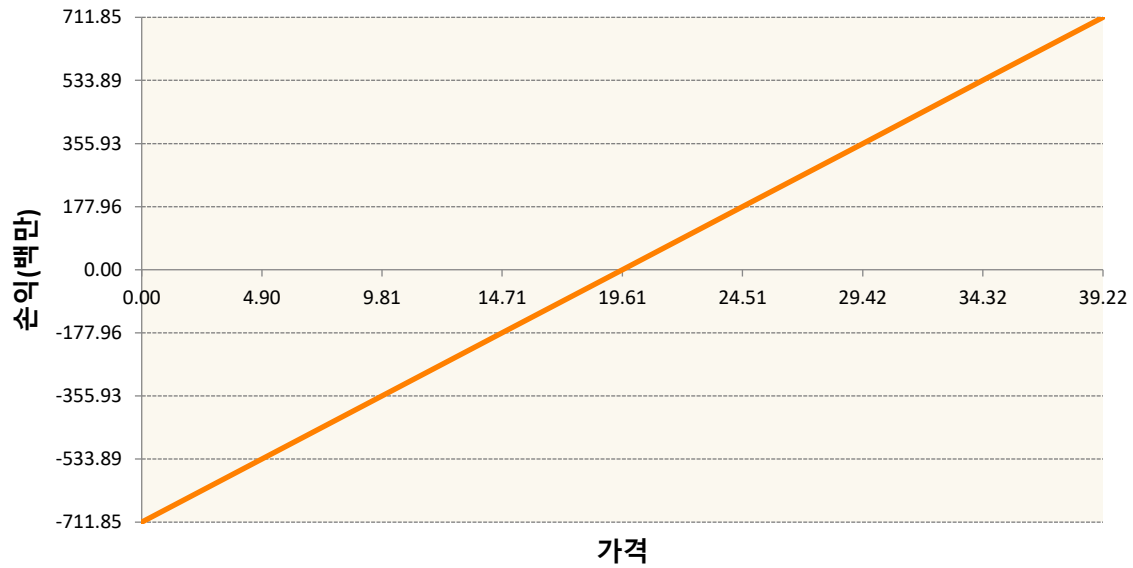
KR4175S40004-2022-04 달러선물



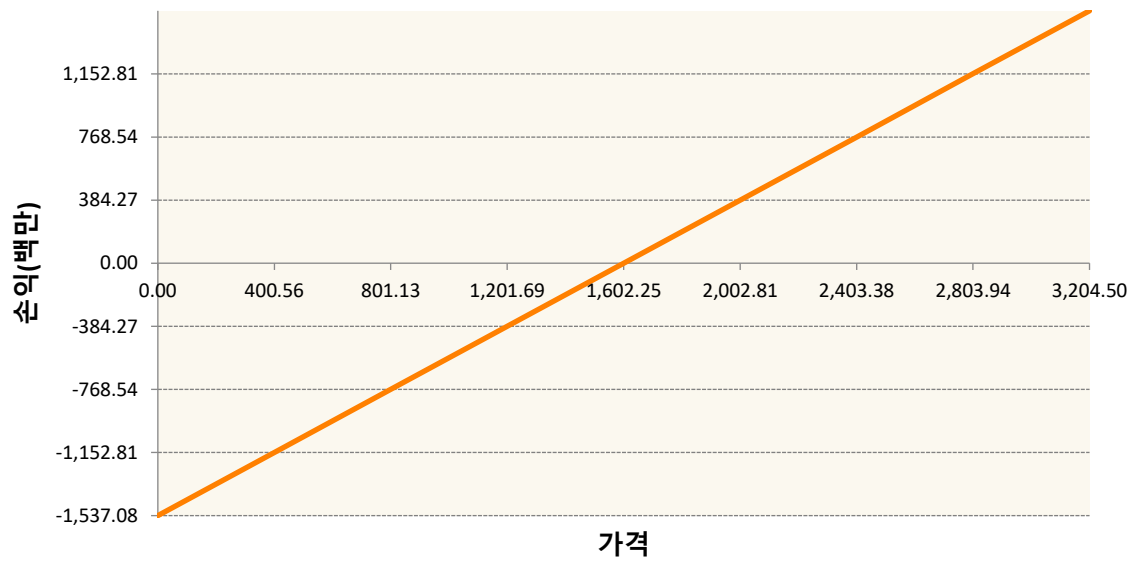
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



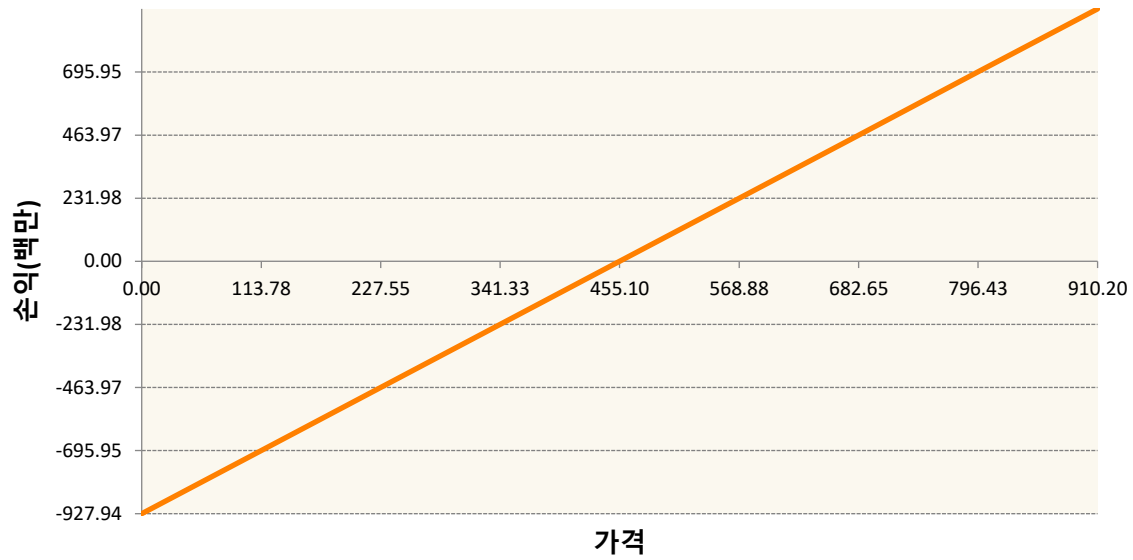
SBK2-Sugar May22



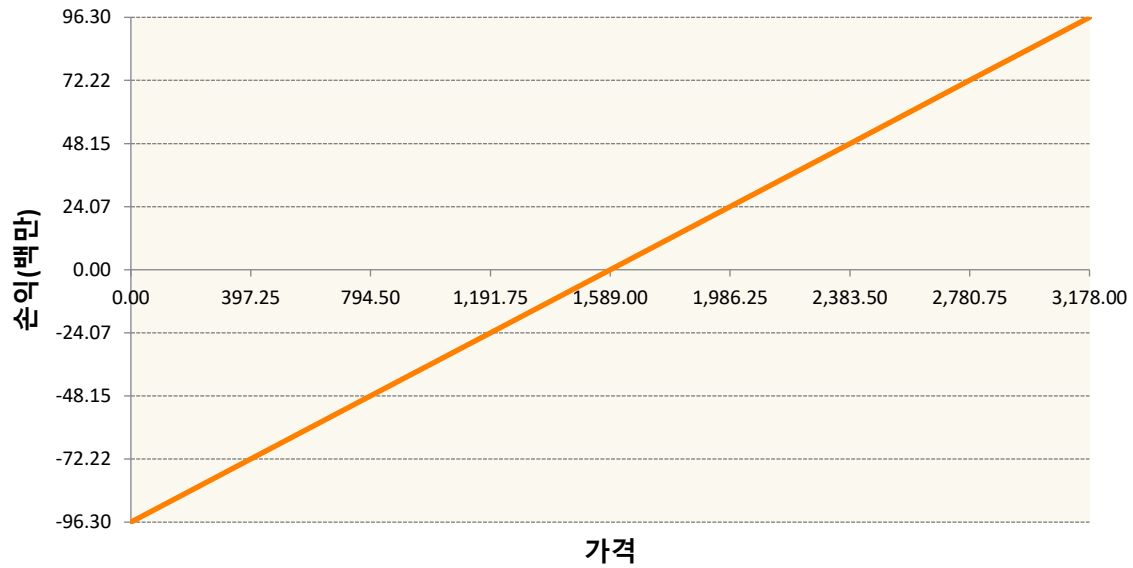
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



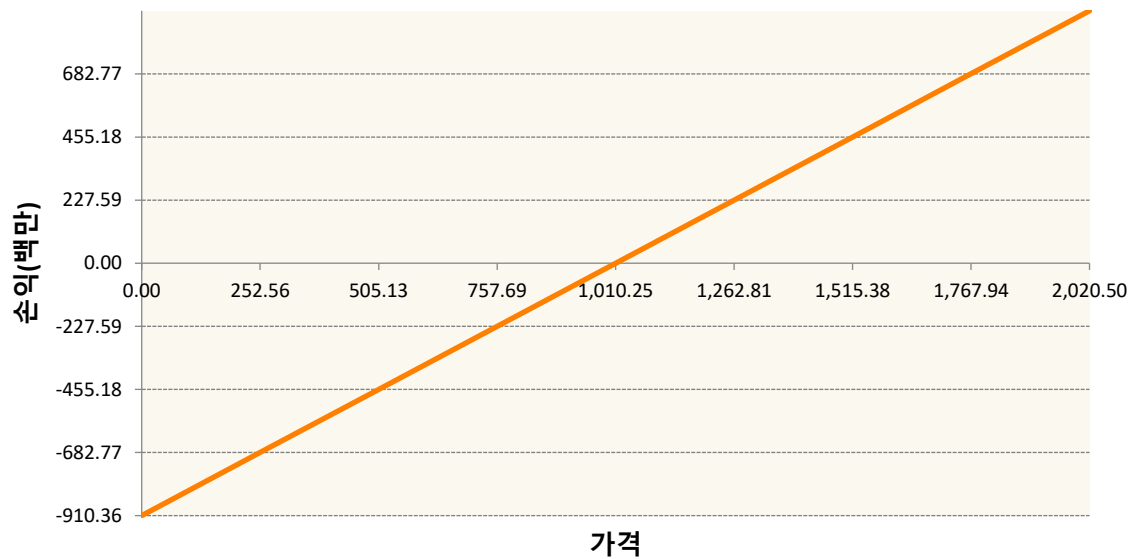
SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



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	2022-04-06
기준일	2022-04-05

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	147
------------------------------	-----

* 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	2022-04-06
기준일	2022-04-05

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 2022-04-06

기준일 2022-04-05

유로인덱스모(주식-파생형)

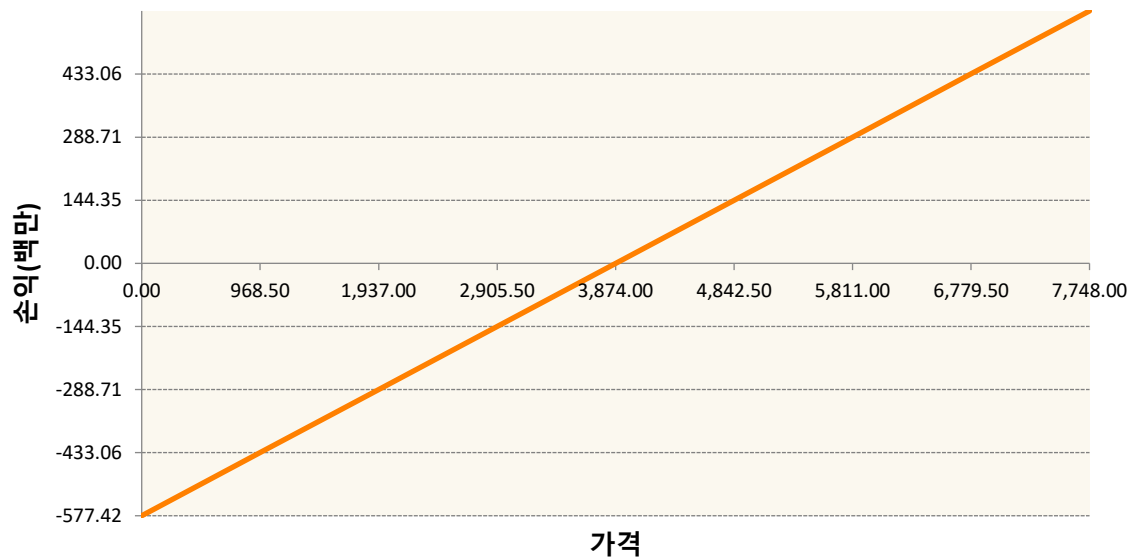
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	577	0	577	

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)

43

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

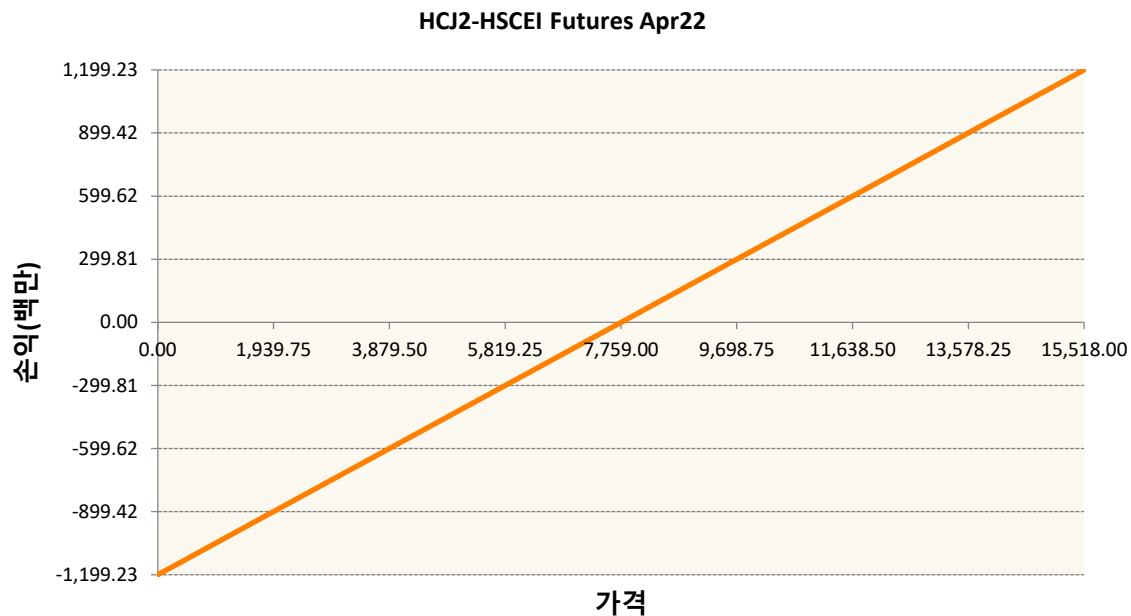
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,199	0	1,199	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI2	HSCEI Futures Apr22	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

128

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

커버드콜모(주식혼합-파생형)

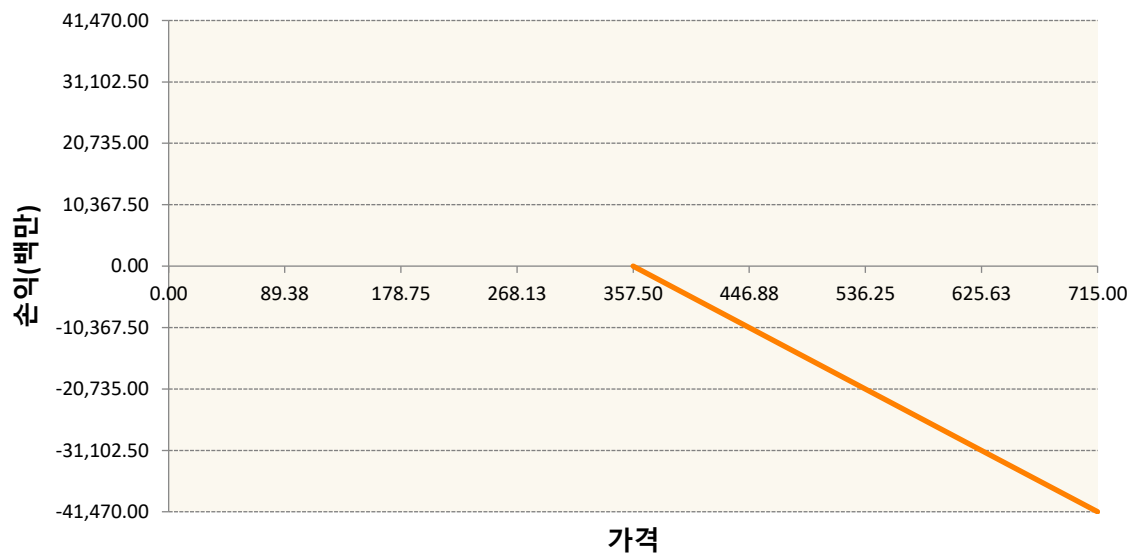
1. 계약금액

(단위:백만원)

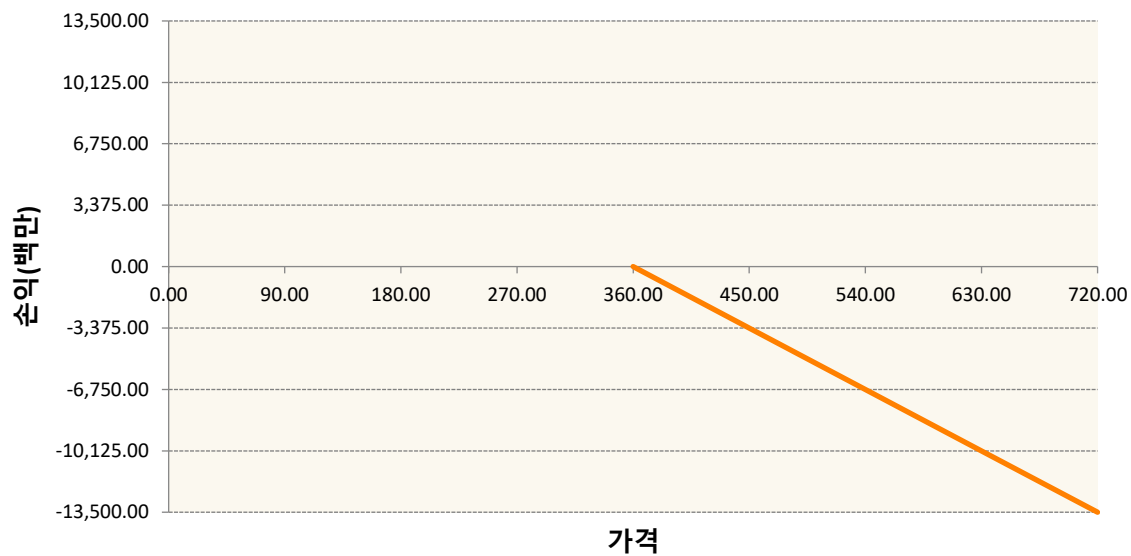
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,410	-66,410	장내

2. 만기시점의 손익구조

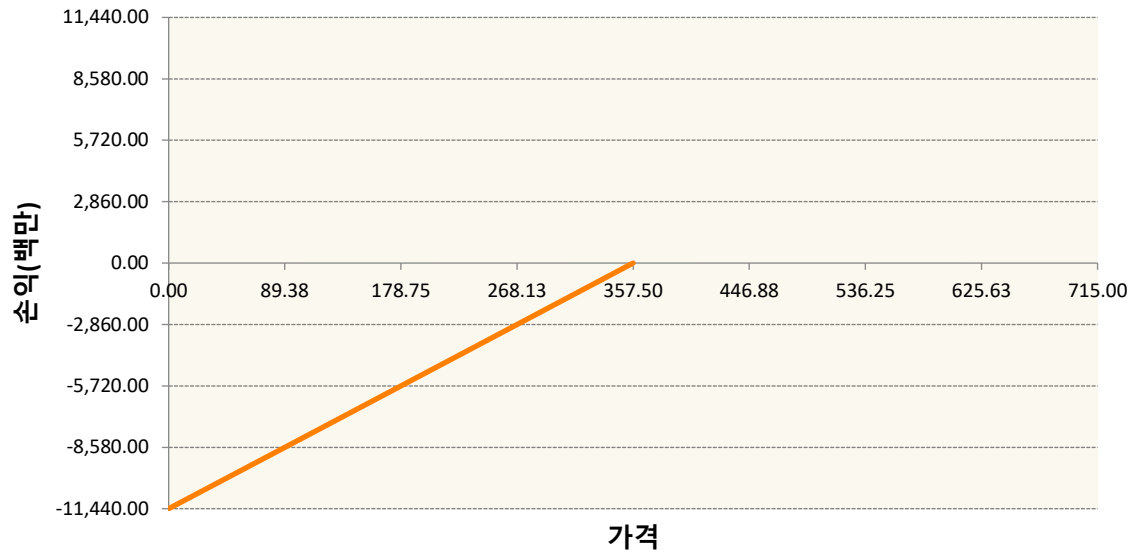
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S43572			2022-04 콜357.5				3,017
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,233	1,220	1,203	1,182	1,158	1,130	1,099
-5.33%	1,139	1,101	1,059	1,015	968	919	869
-2.67%	822	761	700	638	577	515	453
0%	166	112	57	0	-58	-116	-175
2.67%	-775	-803	-835	-871	-910	-953	-997
5.33%	-1,855	-1,863	-1,876	-1,892	-1,912	-1,936	-1,963
8.00%	-2,975	-2,976	-2,980	-2,985	-2,993	-3,004	-3,017
KR4201S43606			2022-04 콜360				946
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	341	339	334	329	323	315	307
-5.33%	321	311	299	287	273	259	244
-2.67%	241	223	204	184	165	146	126
0%	58	39	20	0	-20	-39	-59
2.67%	-226	-238	-250	-264	-279	-294	-310
5.33%	-567	-572	-577	-584	-592	-601	-612
8.00%	-928	-929	-930	-933	-936	-941	-946
KR4301S43570			2022-04 풋357.5				667
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-664	-664	-664	-665	-665	-666	-667
-5.33%	-356	-358	-361	-365	-369	-374	-379
-2.67%	-96	-105	-115	-124	-134	-143	-153
0%	20	14	7	0	-8	-15	-24

2.67%	37	36	35	33	31	28	25
5.33%	38	38	38	37	37	37	36
8.00%	38	38	38	38	38	38	38

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

(단위:백만원)

4,976

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

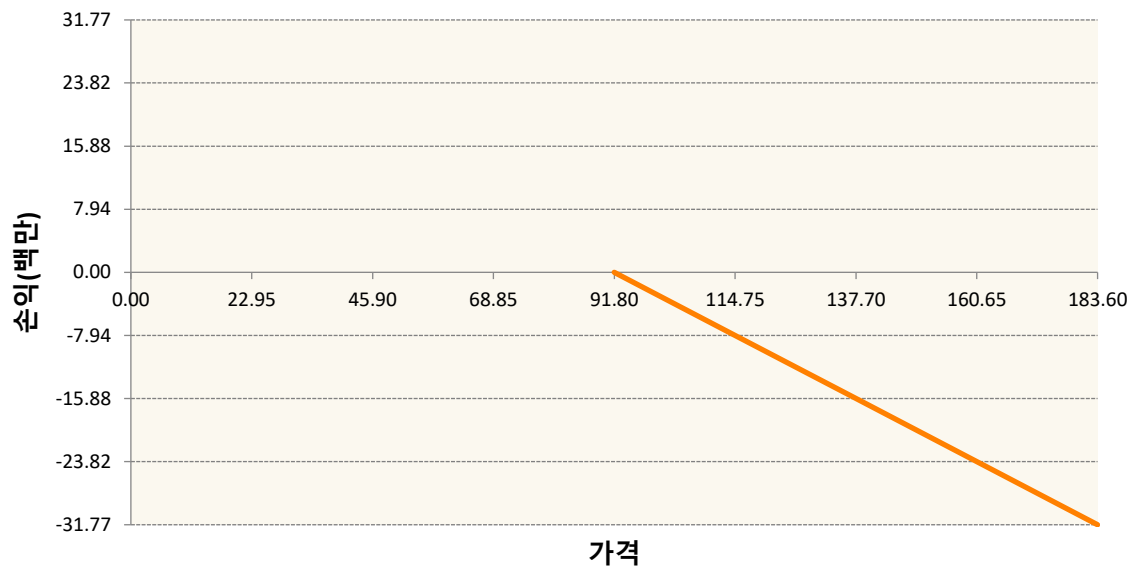
1. 계약금액

(단위:백만원)

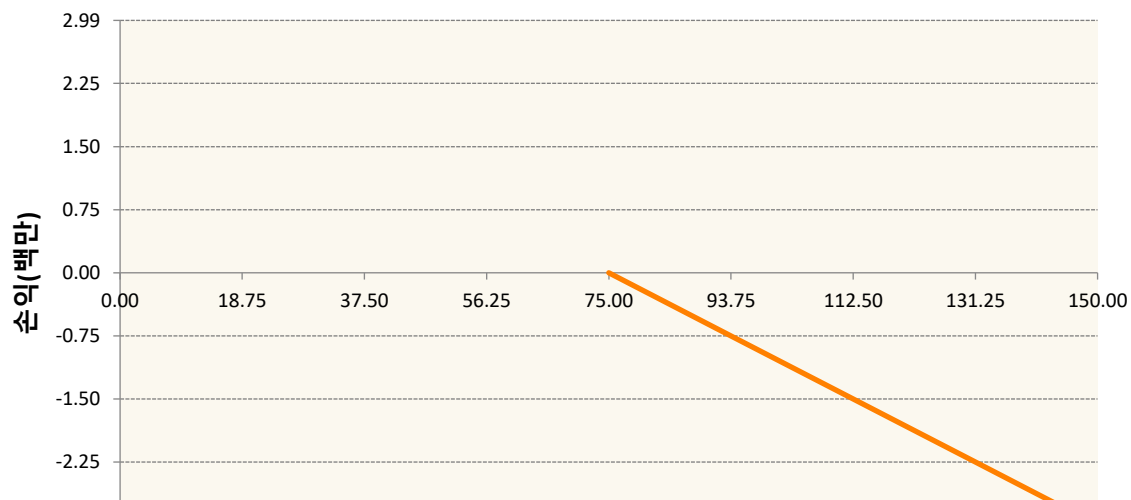
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	51	-51	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,996	-1,996	장외

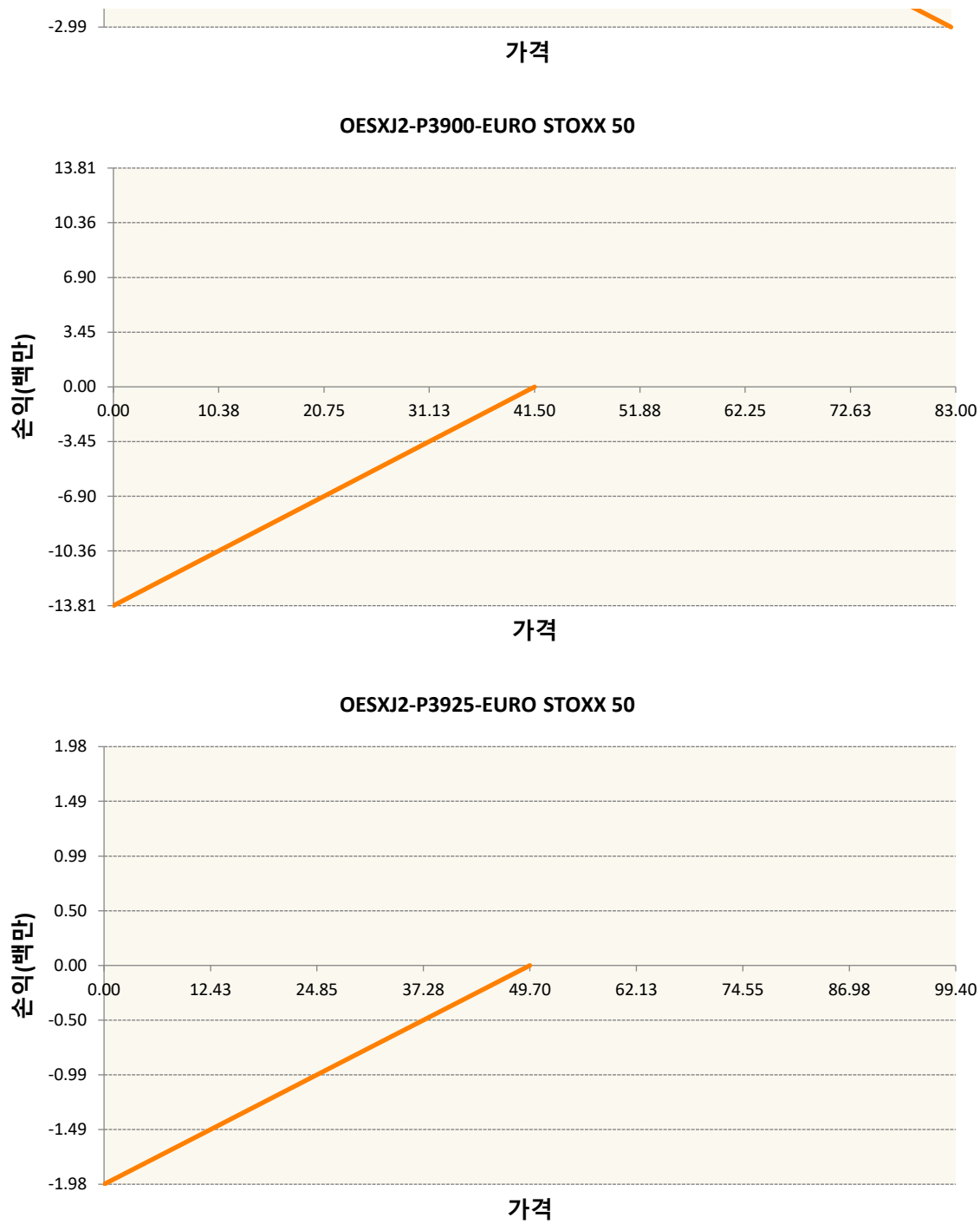
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ2-C3900-EURO STOXX 50



OESXJ2-C3925-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	18
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	3
OESXJ2-C39(EURO STOXX 50	0.24
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50	1
OESXJ2-P39(EURO STOXX 50	0.16

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

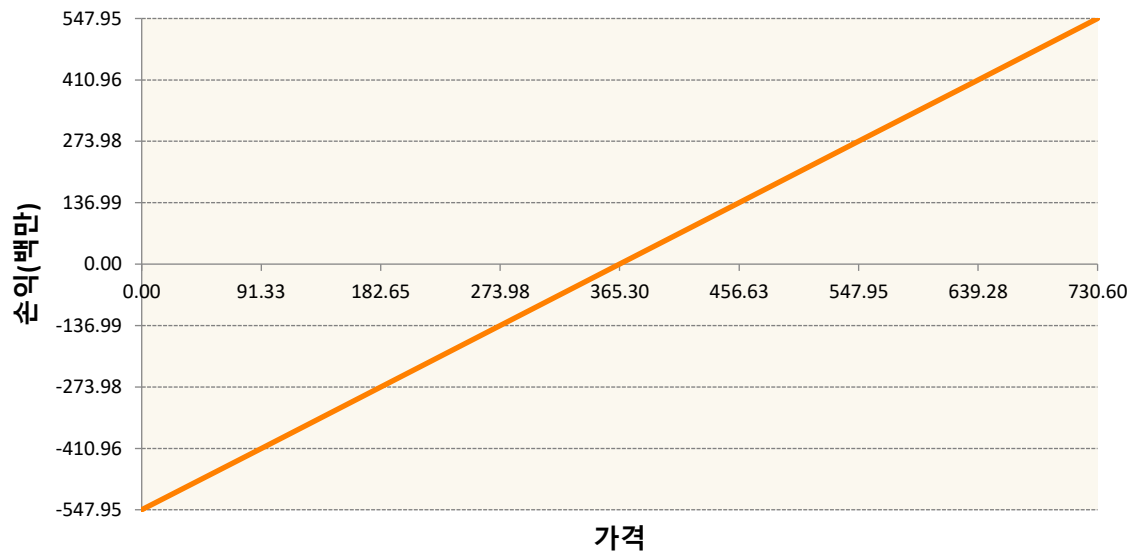
1. 계약금액

(단위:백만원)

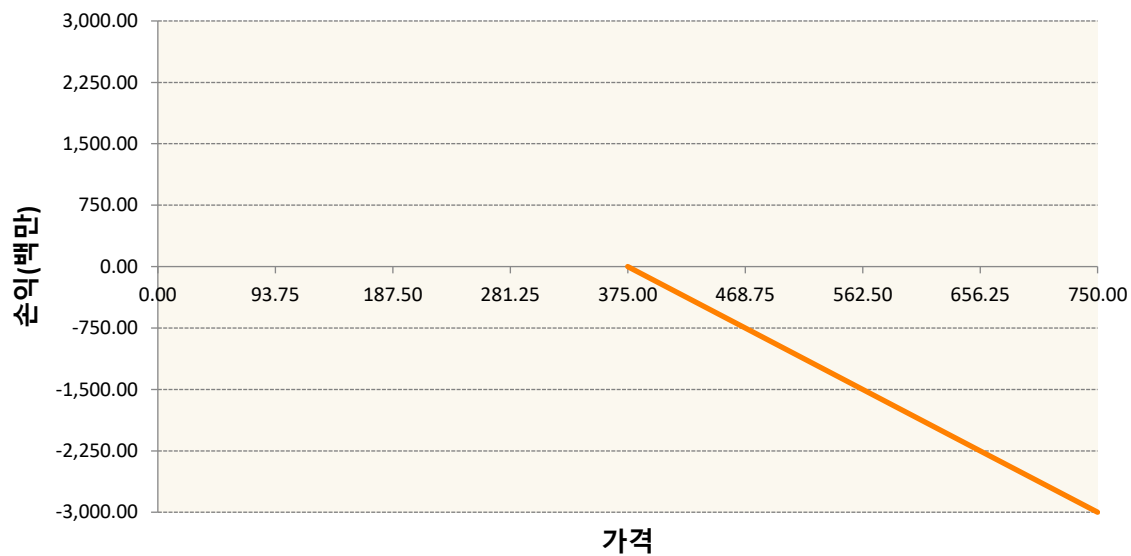
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	548	0	548	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S43754-2022-04 콜375



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis, 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 '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 data, starting at (0.00, 357.50) and ending at (357.50, 0.00).

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				148
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	21	21
-5.33%	22	22	21	20	19	18	17
-2.67%	20	19	17	15	13	10	8
0%	10	7	4	0	-4	-8	-11
2.67%	-16	-21	-25	-30	-34	-39	-43
5.33%	-66	-69	-73	-77	-81	-85	-89
8.00%	-133	-134	-137	-139	-142	-145	-148

KR4201S43770

2022-04 콜377.5

77

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	9	9
-5.33%	10	10	9	9	9	8	7
-2.67%	9	8	8	7	6	4	3
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-7	-9	-12	-14	-17	-19	-22
5.33%	-32	-34	-36	-39	-41	-43	-46
8.00%	-67	-68	-70	-71	-73	-75	-77

KR4301S43570

2022-04 풋357.5

21

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	11	11	11	11	12	12	12
-2.67%	3	3	4	4	4	4	5
0%	-1	0	0	0	0	0	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)

249

공시일	2022-04-06
기준일	2022-04-05

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	9,612	0	9,612	

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	2022-04-06
기준일	2022-04-05

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	107	-107	
누계	유가증권	수익증권	7,487	0	7,487	

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	2022-04-06
기준일	2022-04-05

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	26,239	0	26,239	
누계	통화	선도	1,698	27,565	-25,867	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,205
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)

789

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

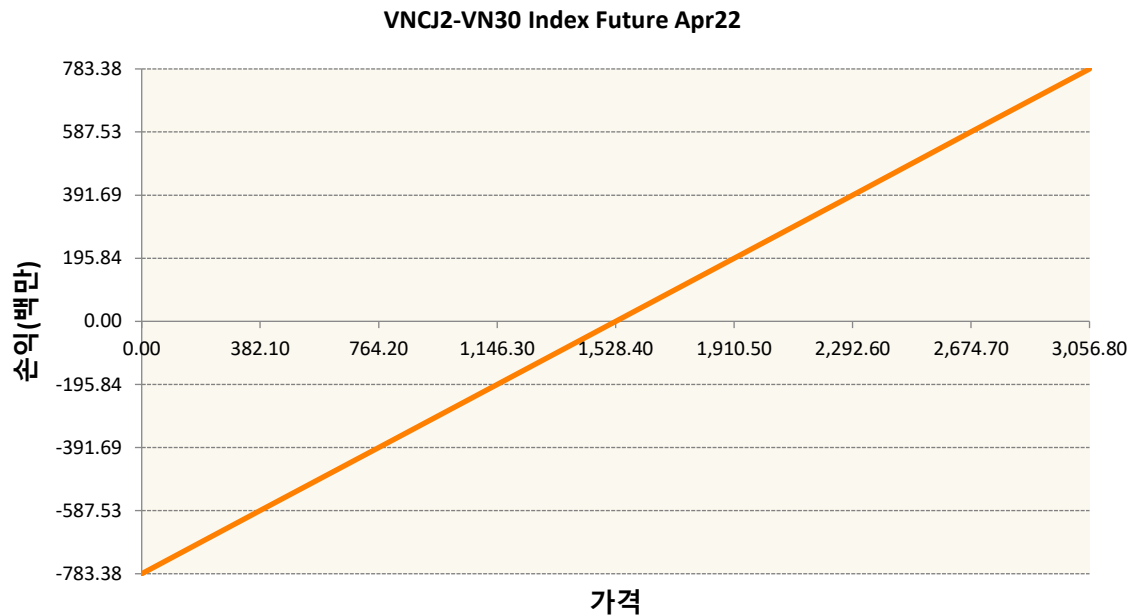
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	783	0	783	
누계	유가증권	스왑	1,819	0	1,819	장외
누계	통화	선도	0	1,171	-1,171	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)

265

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

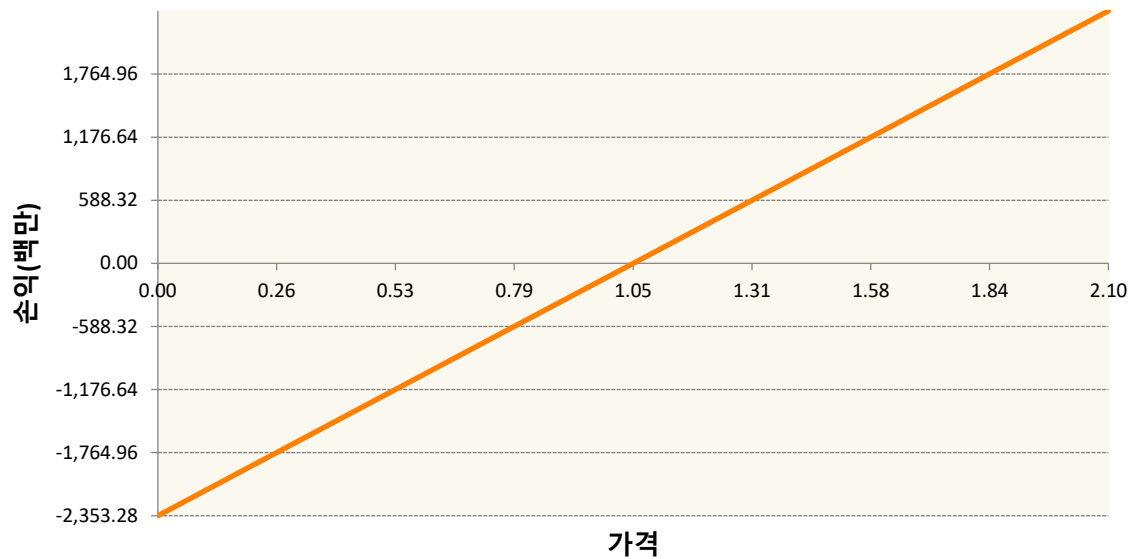
1. 계약금액

(단위:백만원)

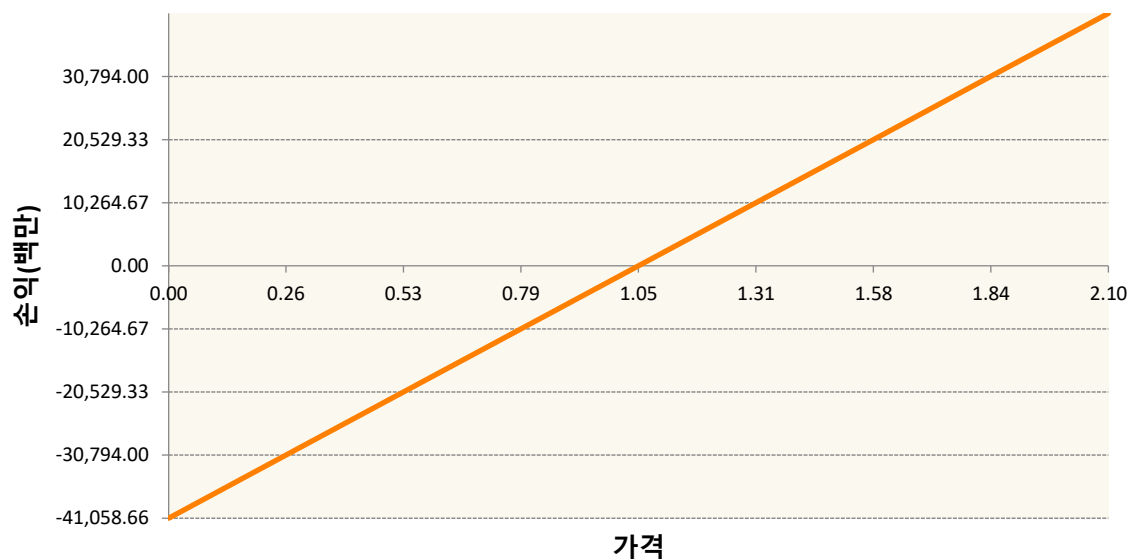
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	44,589	0	44,589	

2. 만기시점의 손익구조

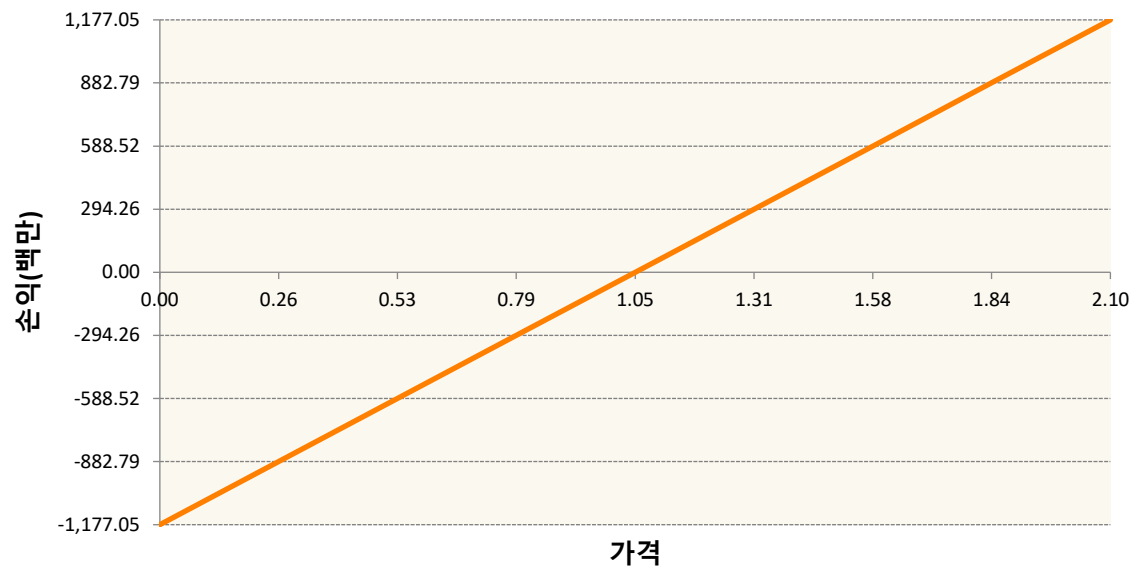
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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
3,274
94

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

(단위:백만원)

6,482

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

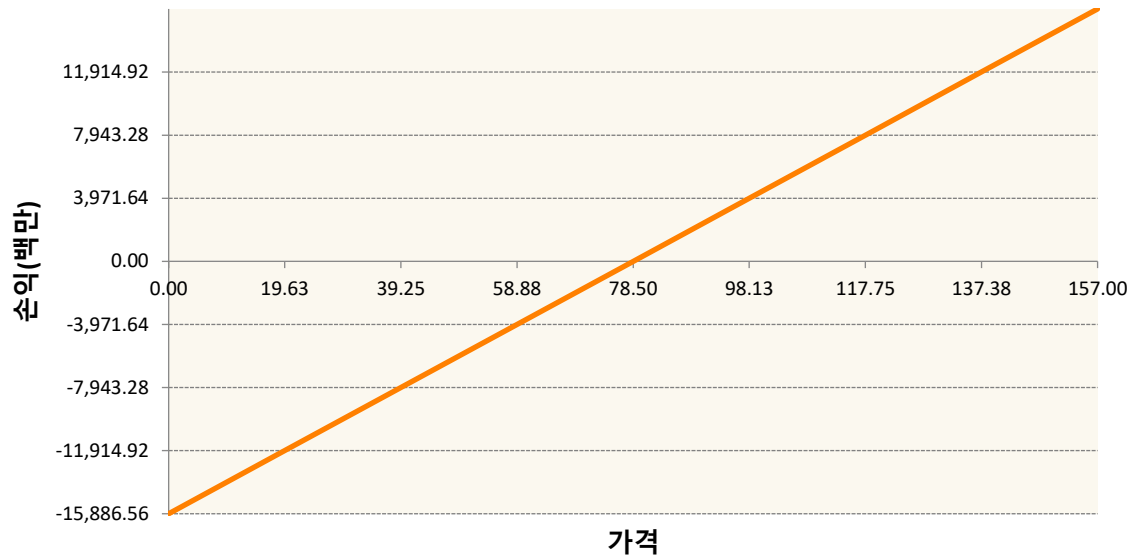
1. 계약금액

(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	15,887	0	15,887	
누계	통화	선도	0	7,425	-7,425	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C3V·KRW/EUR 25-04-22E

594

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,271

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

(단위:백만원)

3,341

공시일	2022-04-06
기준일	2022-04-05

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)

137

공시일	2022-04-06
기준일	2022-04-05

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)

154

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

에쿼티알파일반사모혼합자산

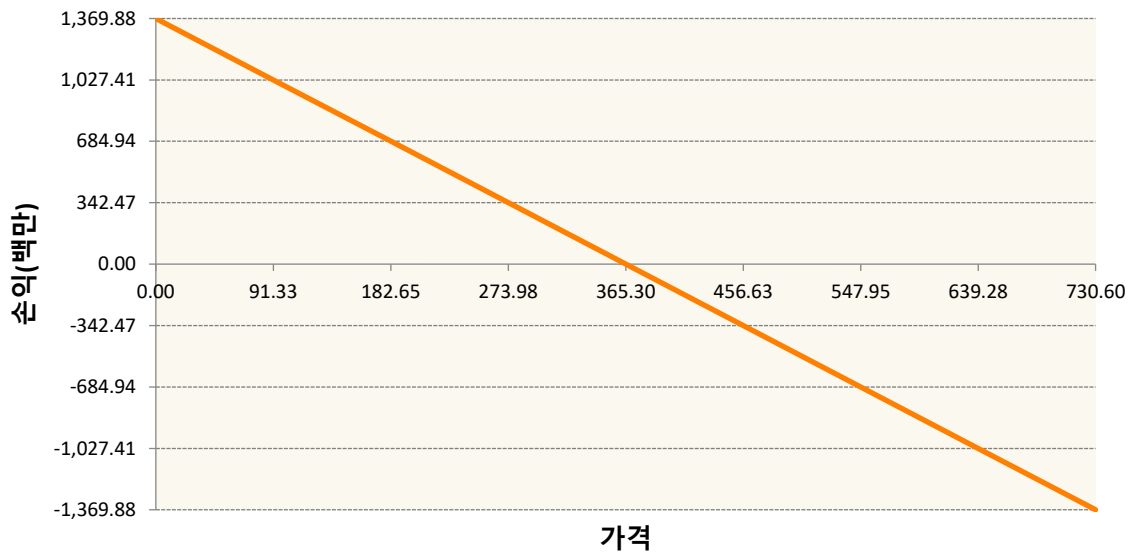
1. 계약금액

(단위:백만원)

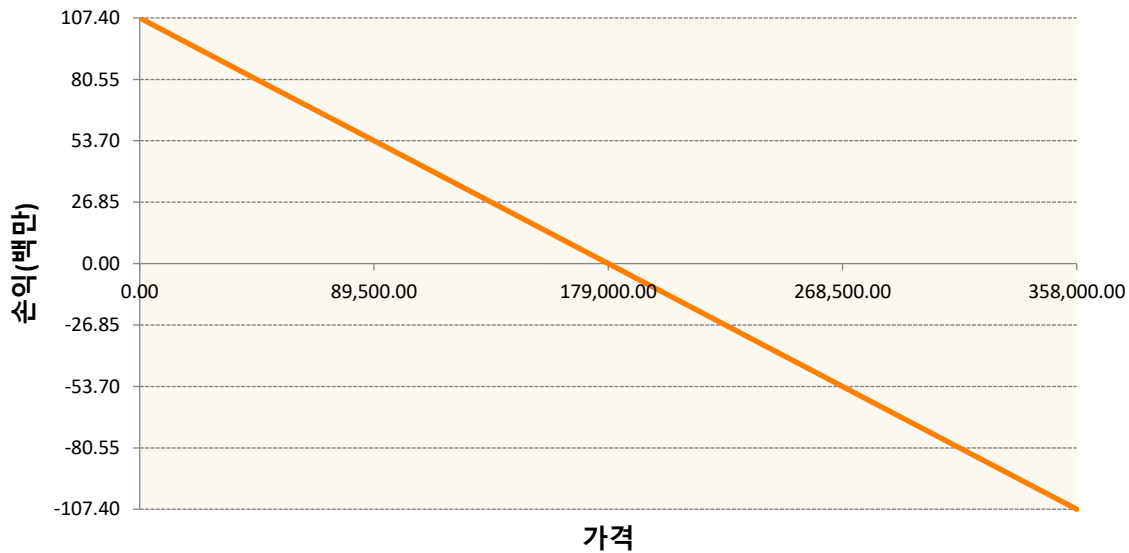
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	456	-456	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,477	-1,477	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4116S40008-2022-04 현대차개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물	110
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	0.38
KRS0003014 SWAP_TESLA INC_0322	4
KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	1
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331	1

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

133

공시일 2022-04-06

기준일 2022-04-05

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

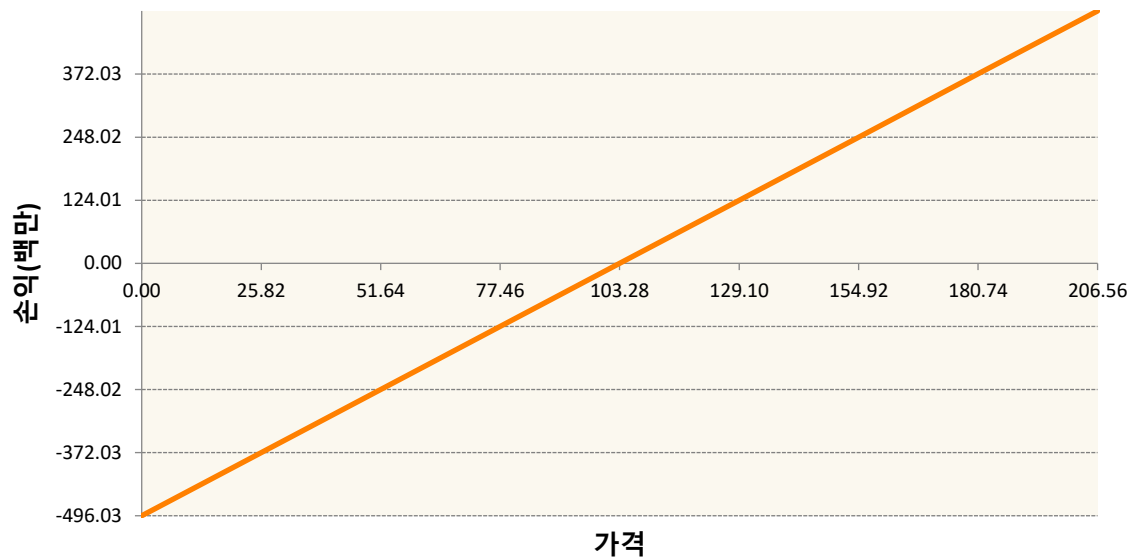
1. 계약금액

(단위:백만원)

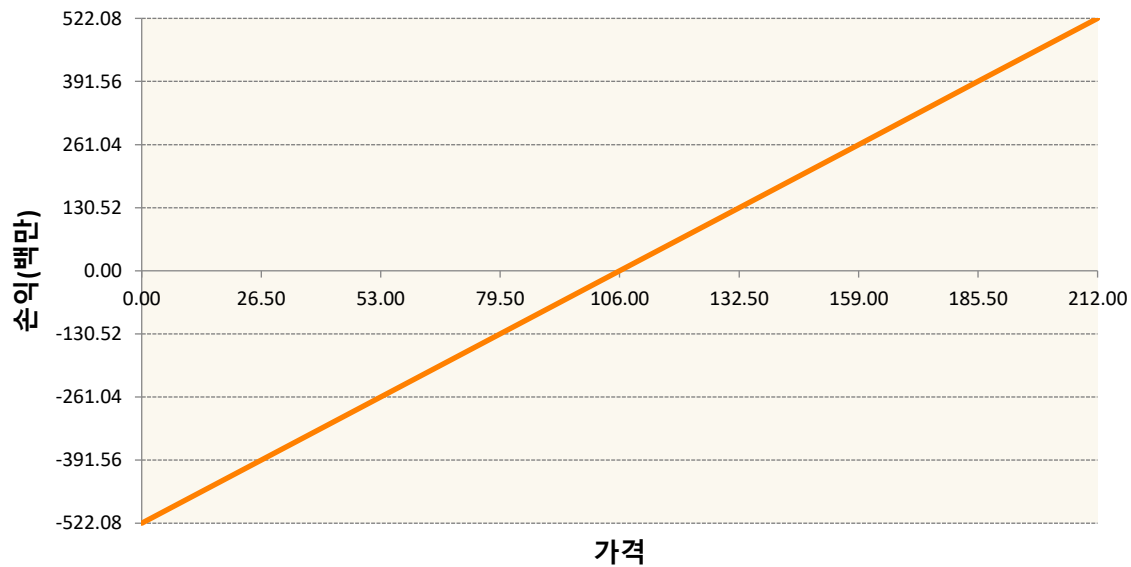
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,303	546	1,757	

2. 만기시점의 손익구조

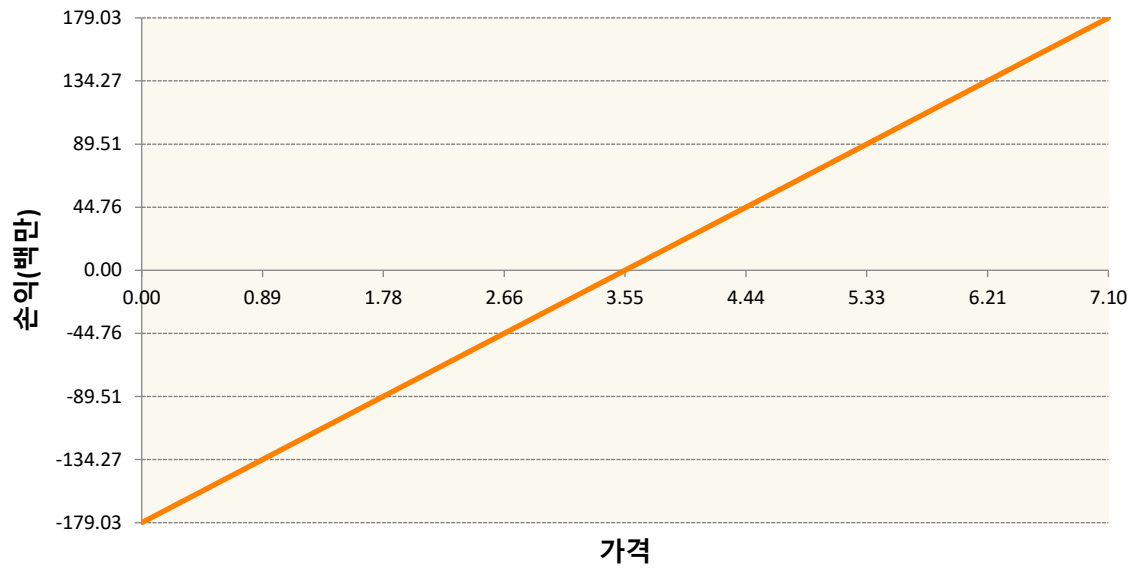
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



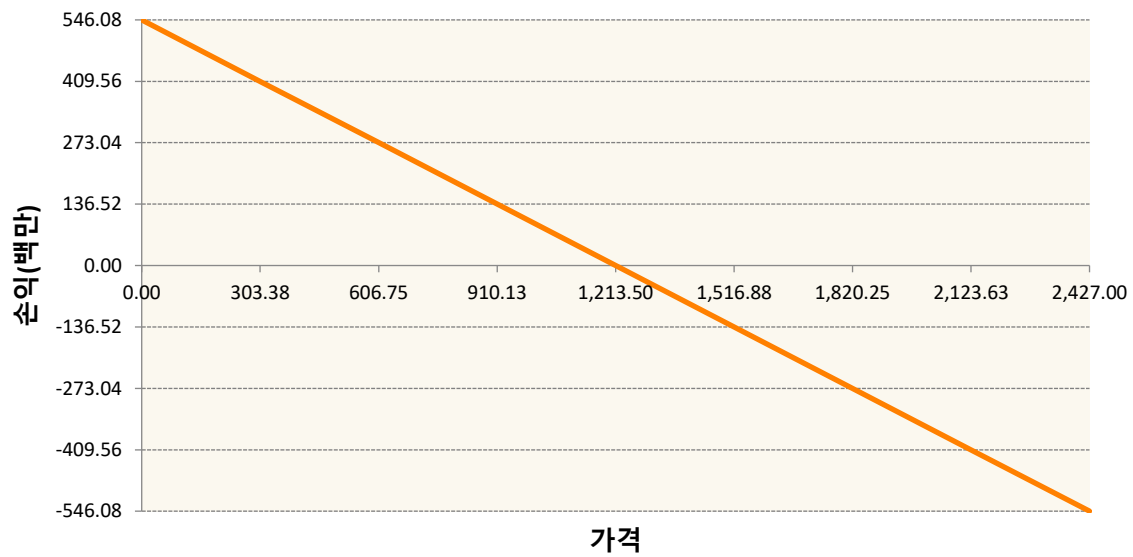
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



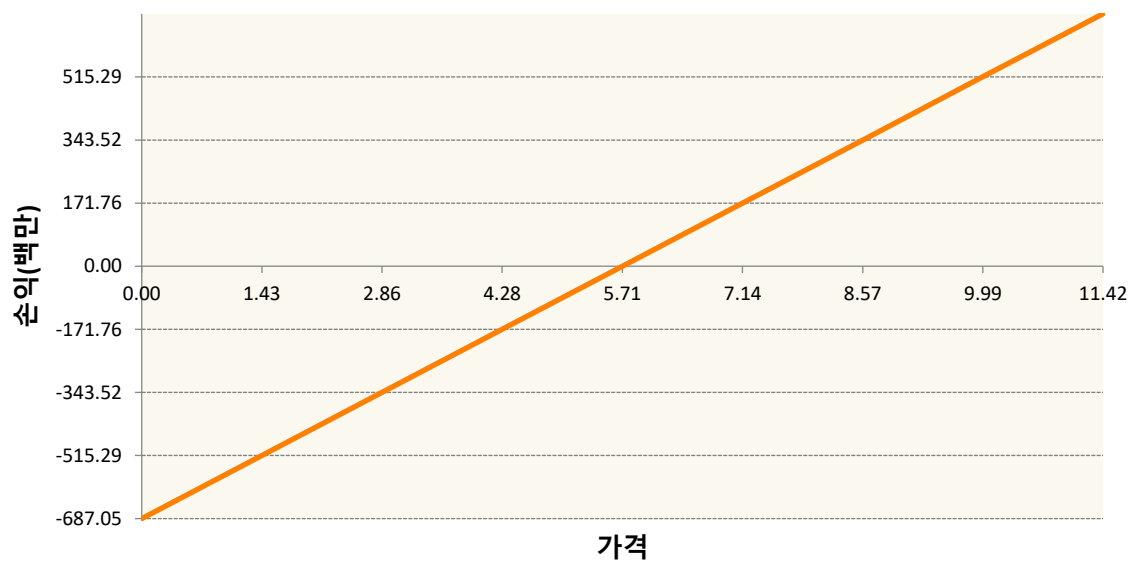
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

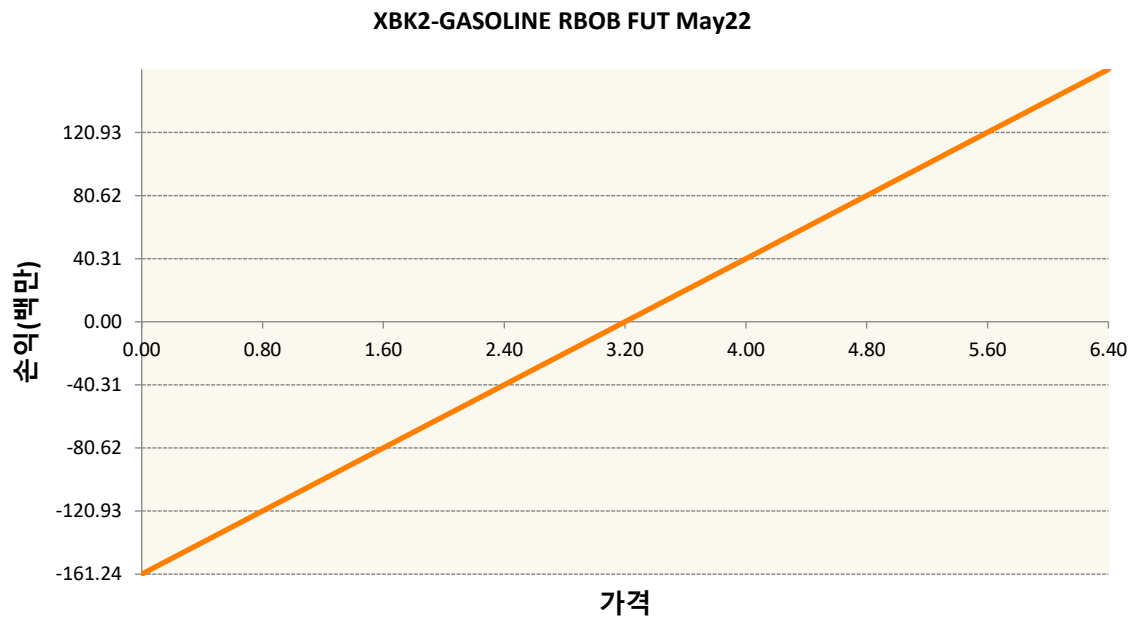
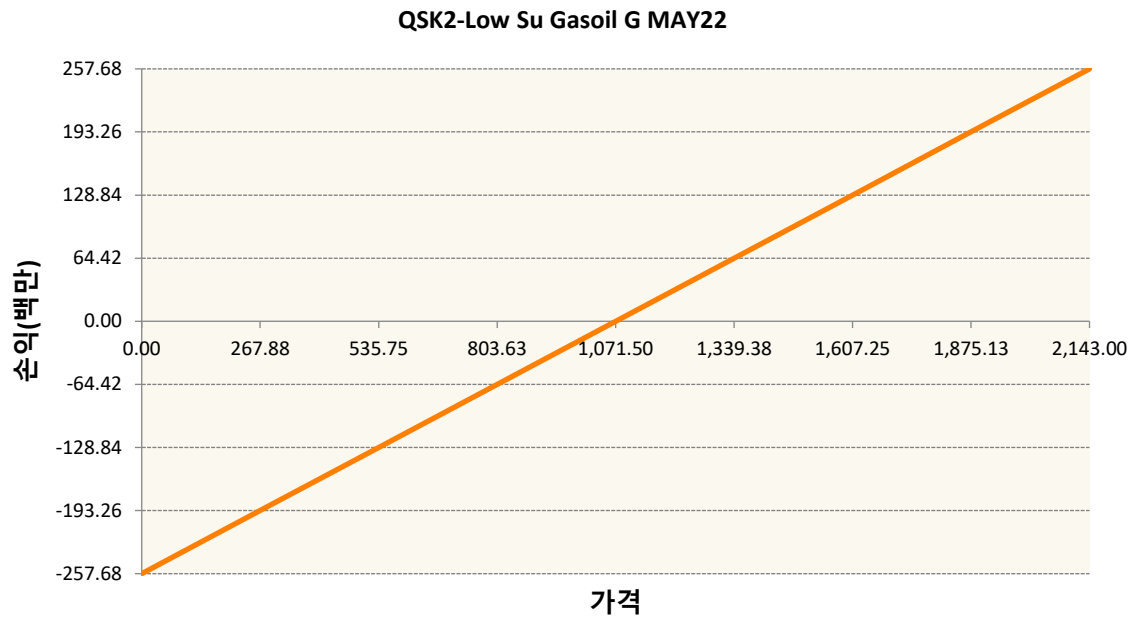


KR4175S40004-2022-04 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		40
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		42
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		14
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)
		511