

공시일 2022-03-23

기준일 2022-03-22

포커스농산물모(채권-파생형)

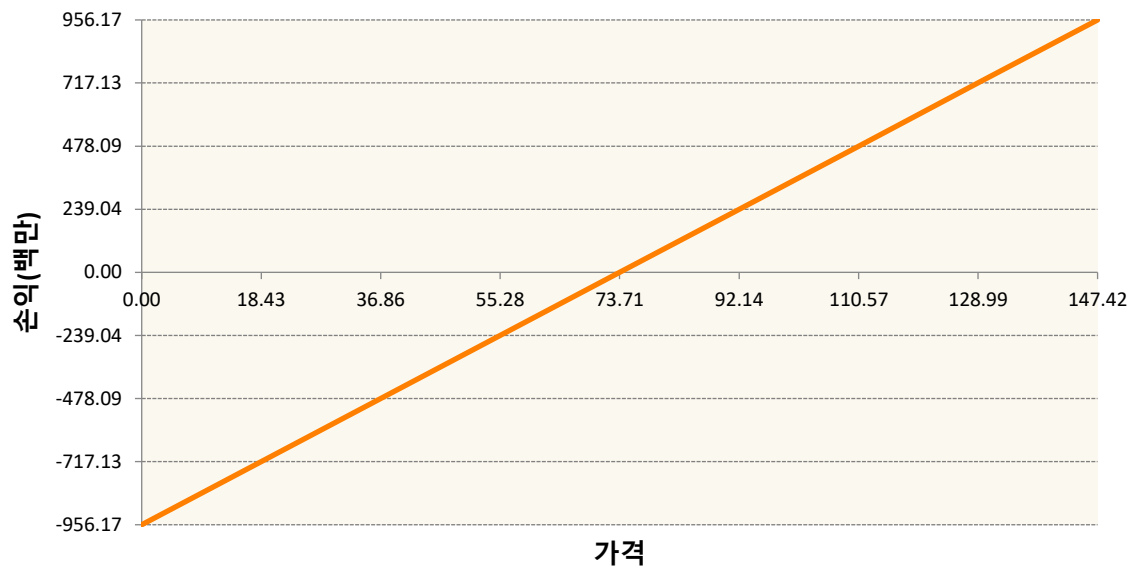
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

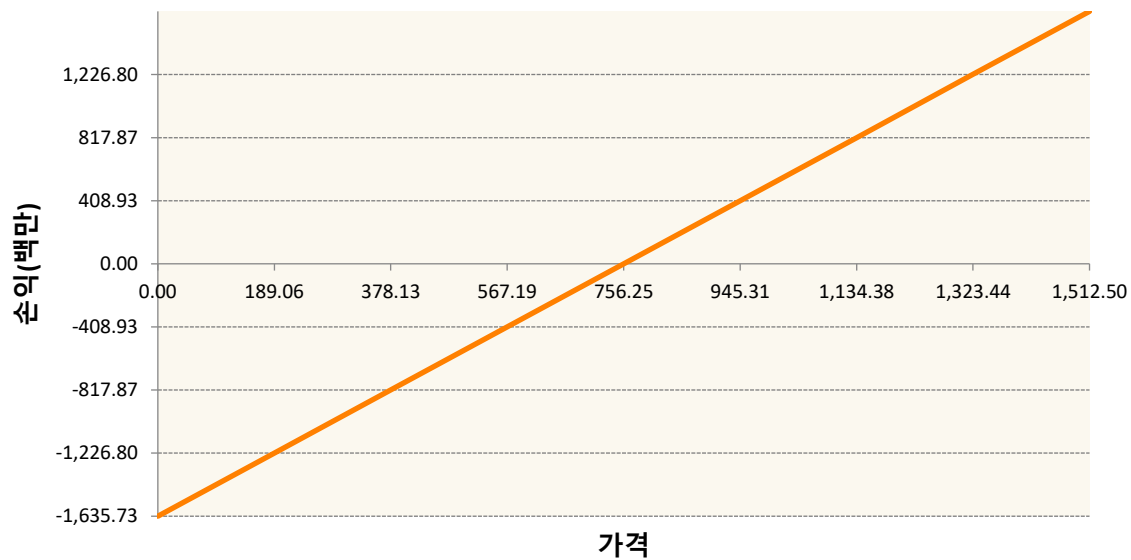
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,507	1,585	6,922	

2. 만기시점의 손익구조

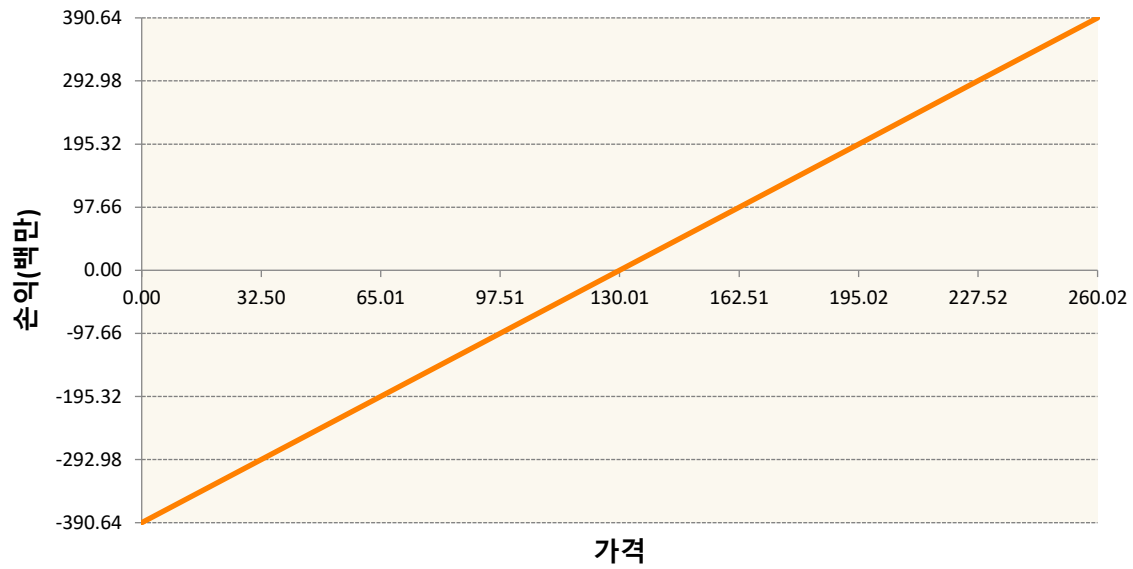
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



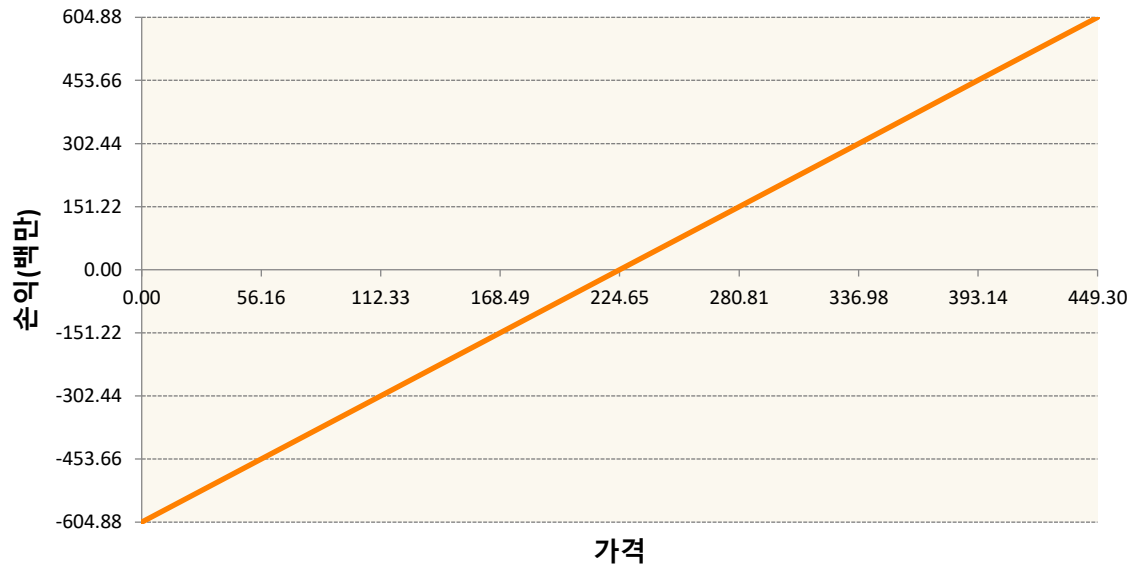
CK2-CORN FUTURE May22



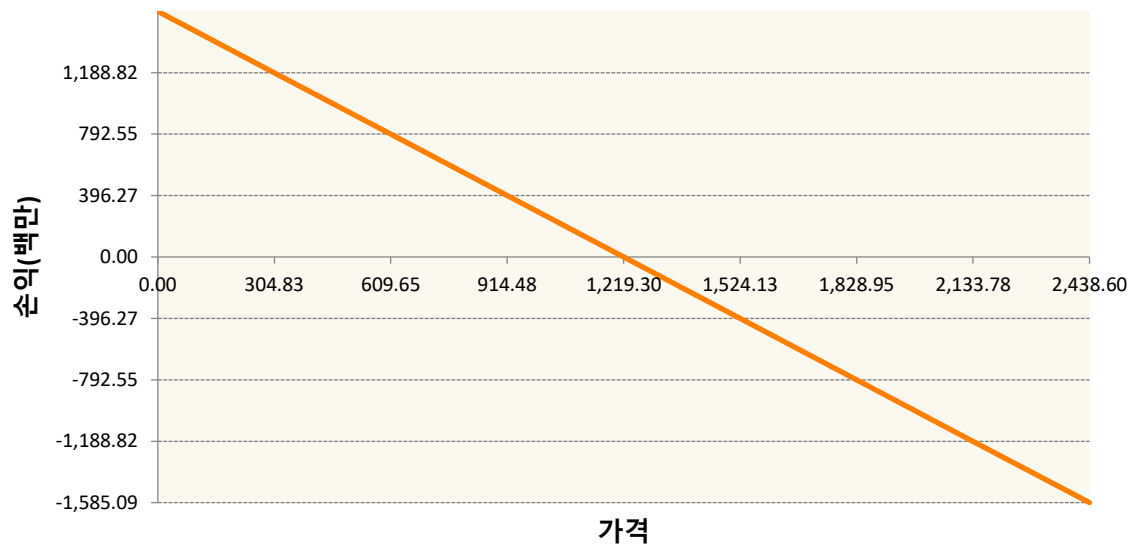
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



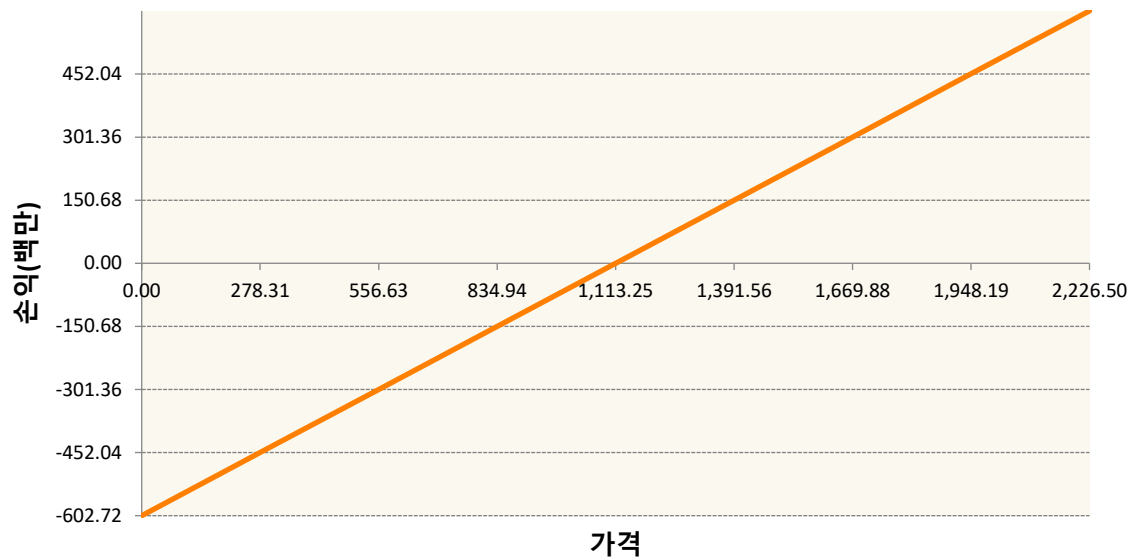
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



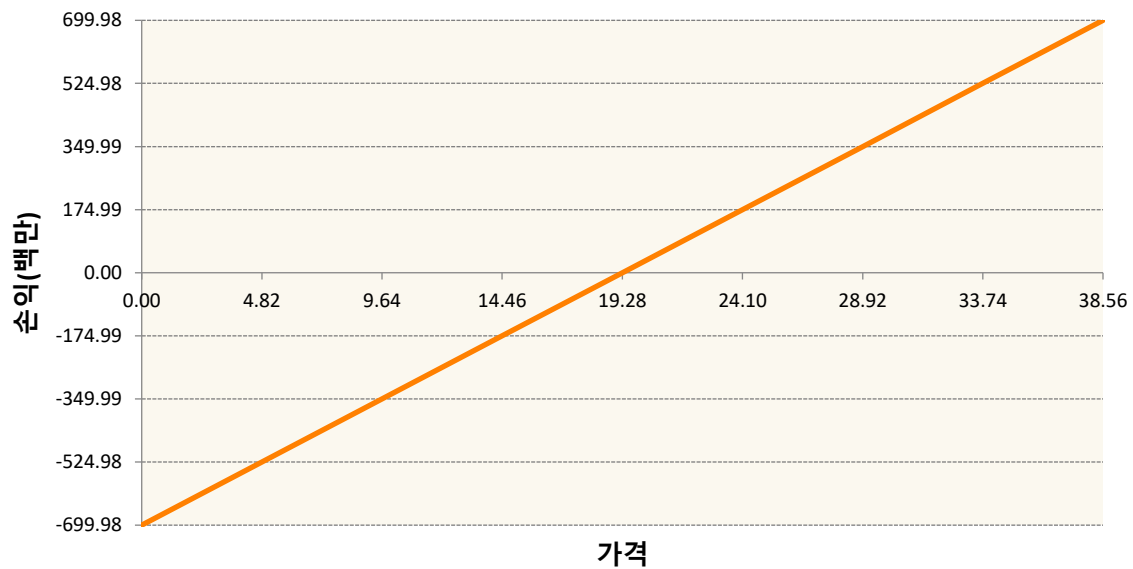
KR4175S40004-2022-04 달러선물



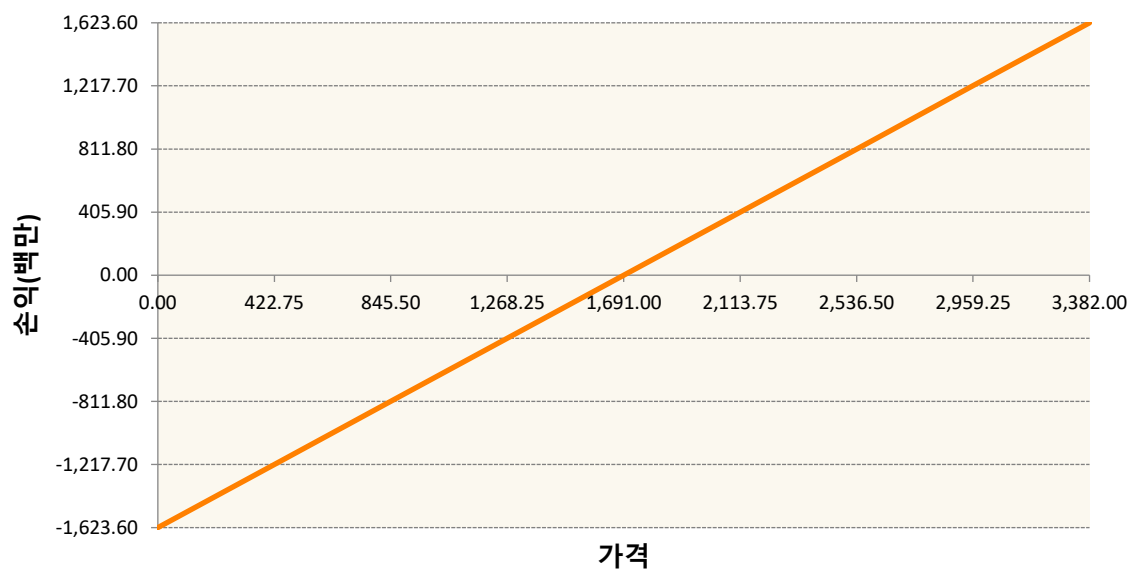
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22

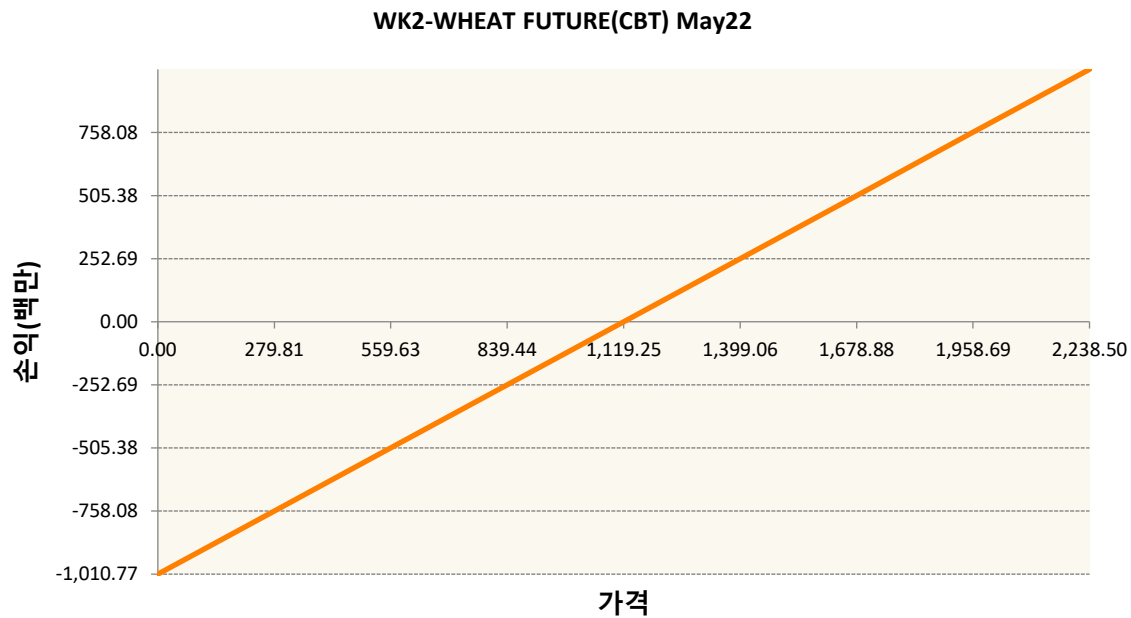
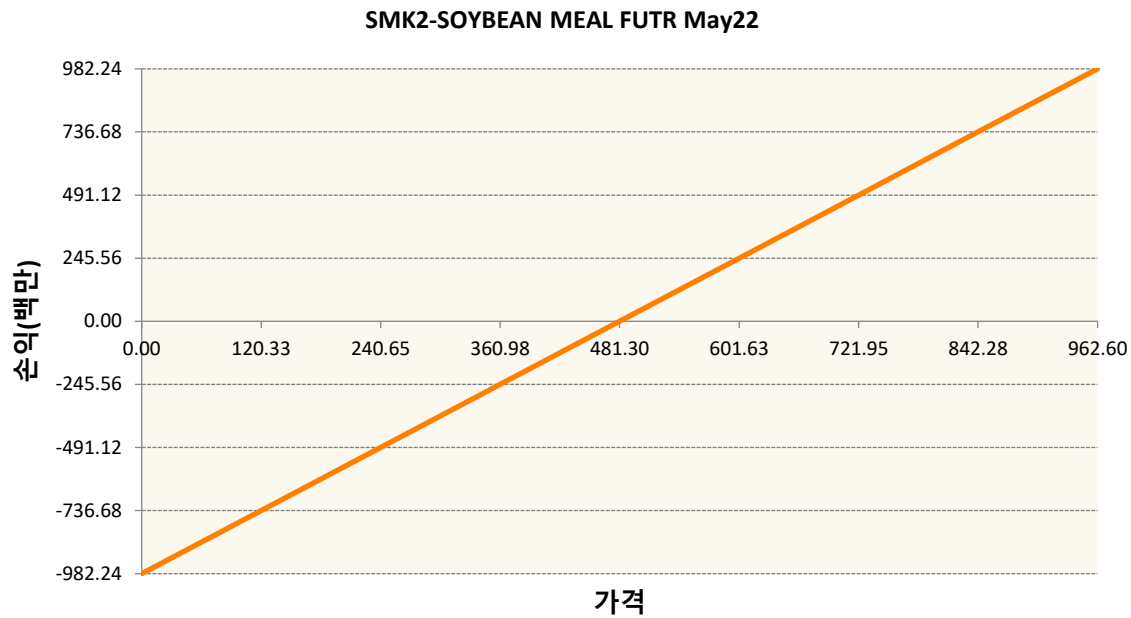


SBK2-Sugar May22



SK2-SOYBEAN FUTURE May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2022-03-23
기준일	2022-03-22

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)

91

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-03-23
기준일	2022-03-22

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	393
-----------------------------	-----

* 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	2022-03-23
기준일	2022-03-22

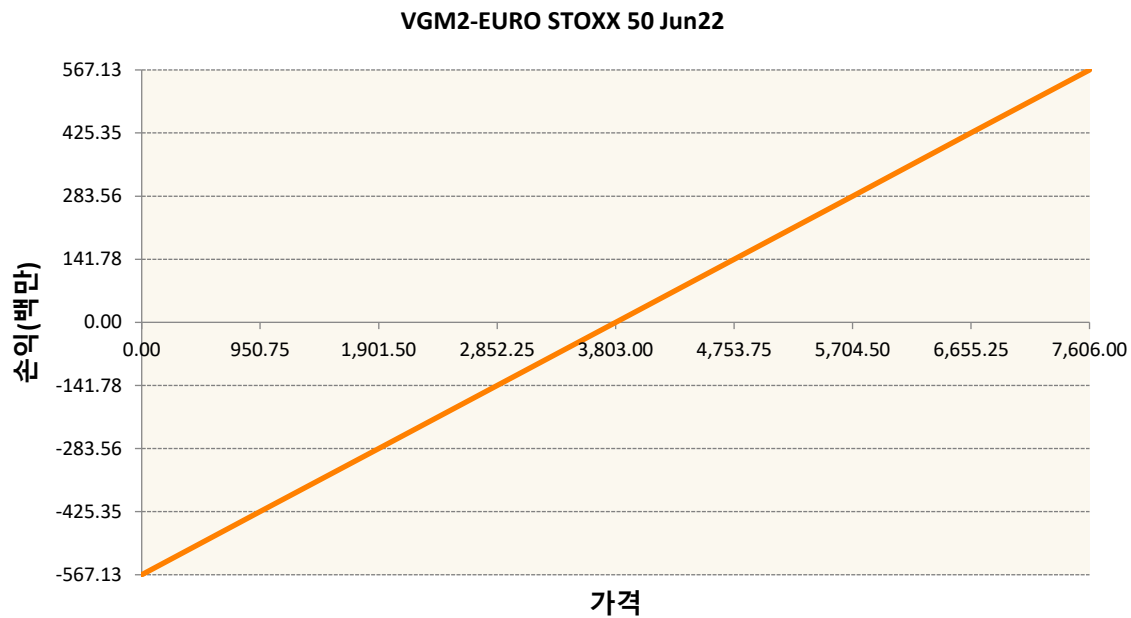
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	567	0	567	

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	2022-03-23
기준일	2022-03-22

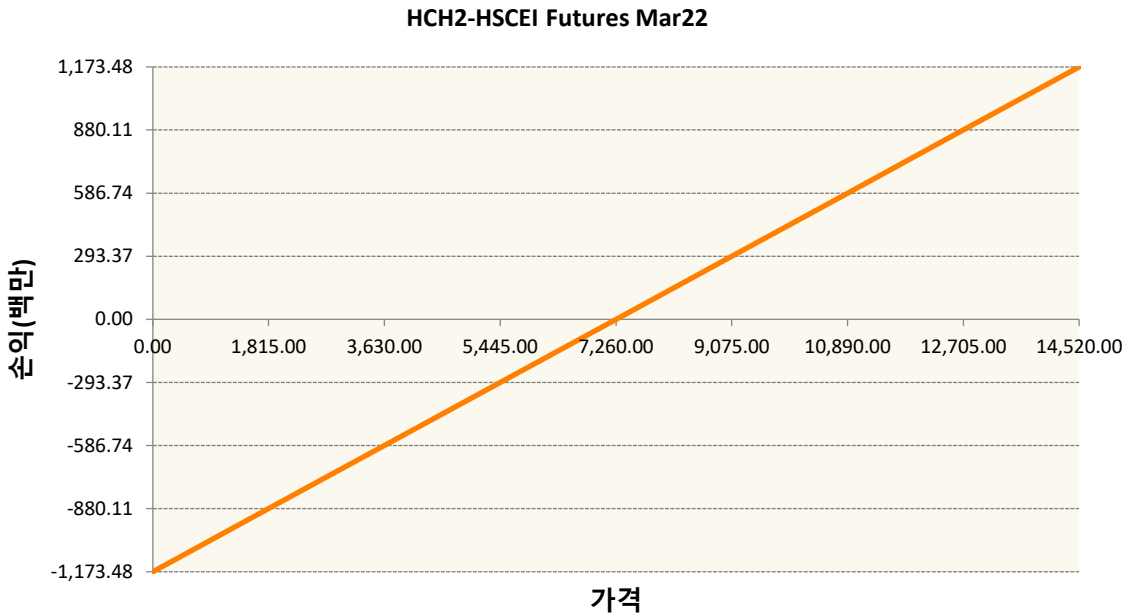
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,173	0	1,173	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH2	HSCEI Futures Mar22	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

123

공시일 2022-03-23

기준일 2022-03-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

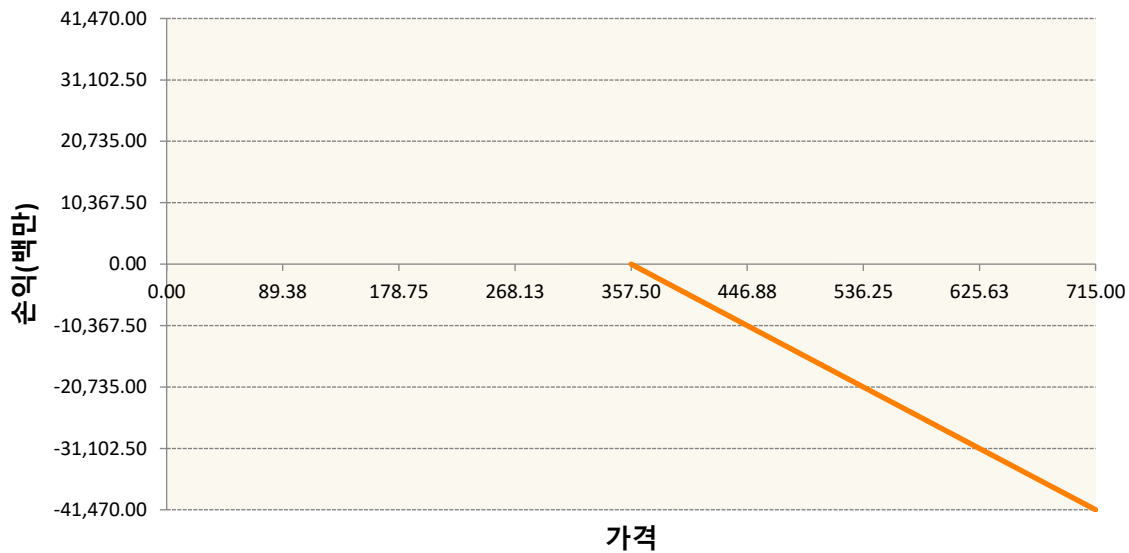
1. 계약금액

(단위:백만원)

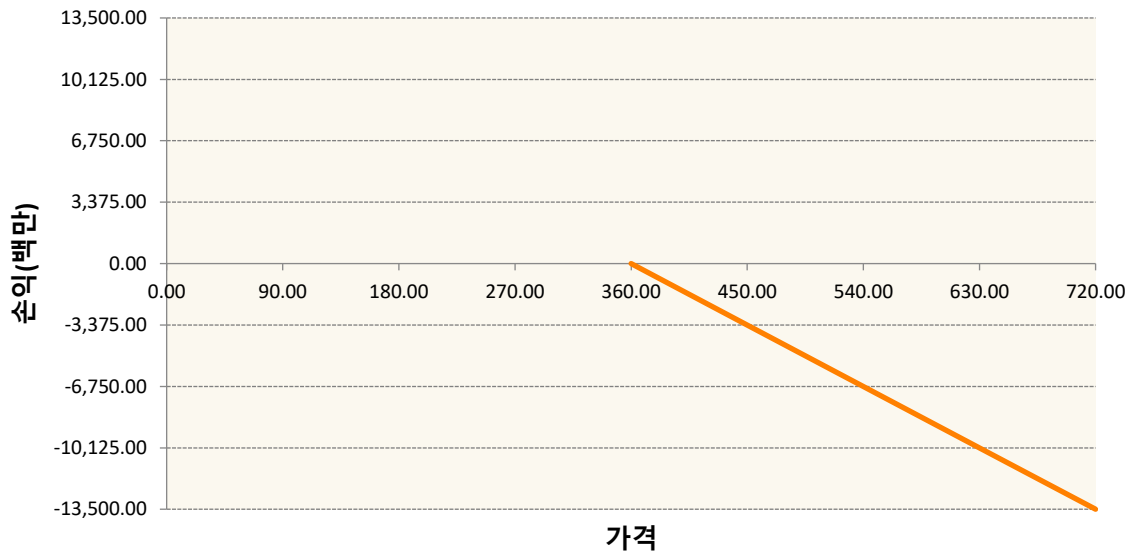
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,410	-66,410	장내

2. 만기시점의 손익구조

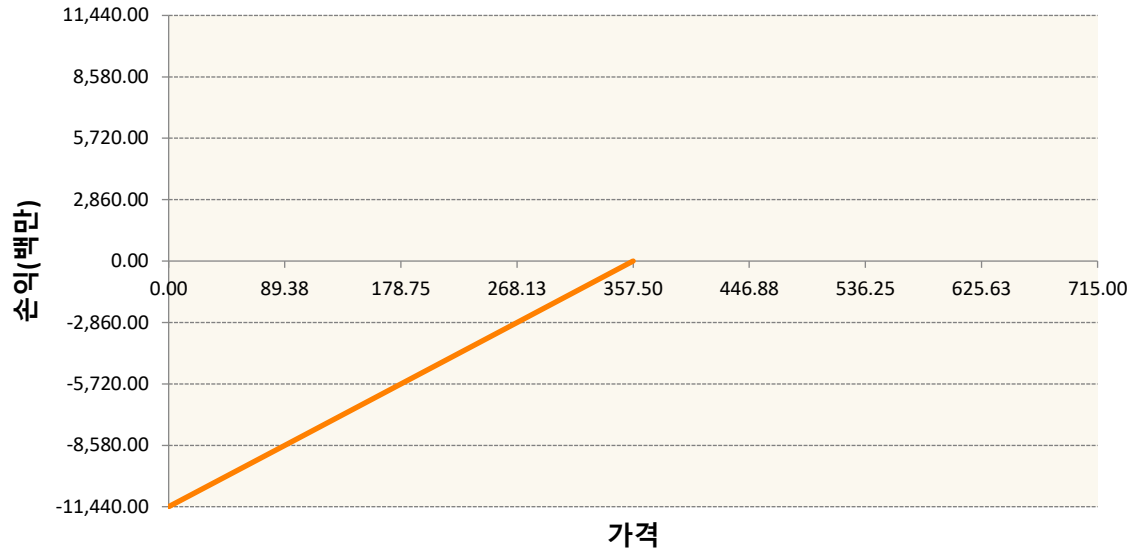
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572			2022-04 콜357.5				2,695
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,431	1,377	1,316	1,250	1,179	1,104	1,025
-5.33%	1,236	1,153	1,066	976	884	790	694
-2.67%	878	774	669	564	458	352	246
0%	323	216	108	0	-108	-216	-325
2.67%	-426	-518	-613	-711	-810	-911	-1,014
5.33%	-1,330	-1,397	-1,470	-1,549	-1,633	-1,719	-1,809
8.00%	-2,339	-2,381	-2,431	-2,488	-2,552	-2,621	-2,695
KR4201S43606			2022-04 콜360				846
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	422	407	390	370	349	326	302
-5.33%	370	345	319	291	263	233	203
-2.67%	269	236	203	170	136	102	68
0%	106	71	35	0	-35	-71	-106
2.67%	-120	-152	-185	-218	-251	-285	-319
5.33%	-401	-425	-451	-478	-507	-537	-567
8.00%	-719	-735	-753	-774	-796	-821	-846
KR4301S43570			2022-04 풋357.5				663
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-618	-623	-628	-635	-644	-653	-663
-5.33%	-335	-346	-359	-372	-386	-401	-417
-2.67%	-100	-118	-137	-156	-175	-194	-214
0%	59	39	20	0	-20	-40	-59

2.67%	141	127	112	97	81	64	47
5.33%	172	165	157	148	137	125	113
8.00%	181	178	175	170	165	158	150

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

(단위:백만원)

4,017

공시일 2022-03-23

기준일 2022-03-22

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

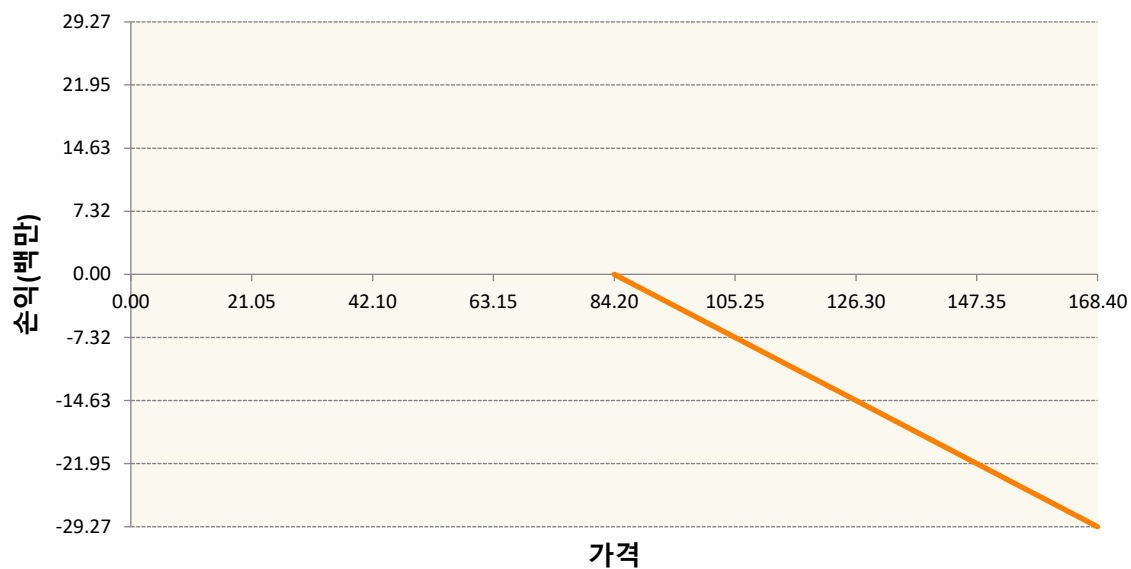
1. 계약금액

(단위:백만원)

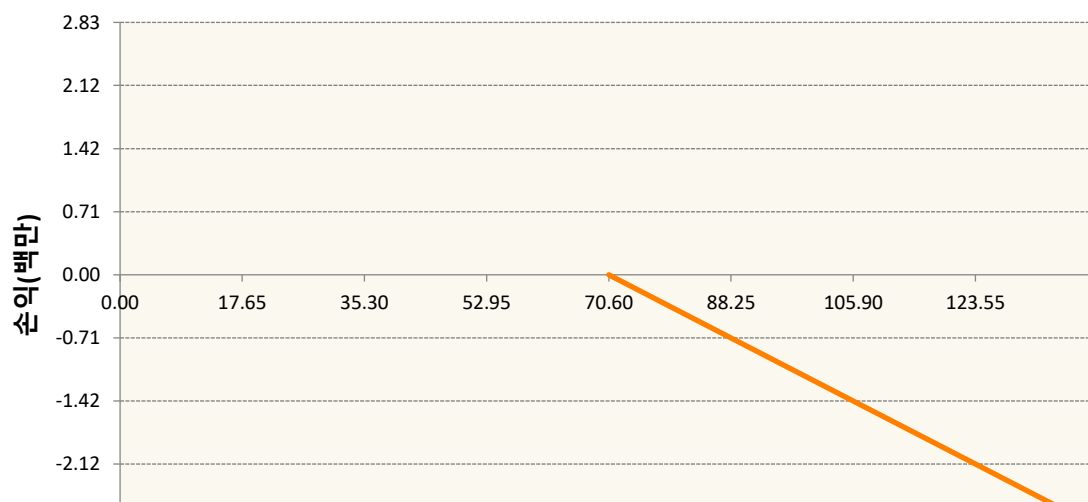
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	75	-75	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,005	-2,005	장외

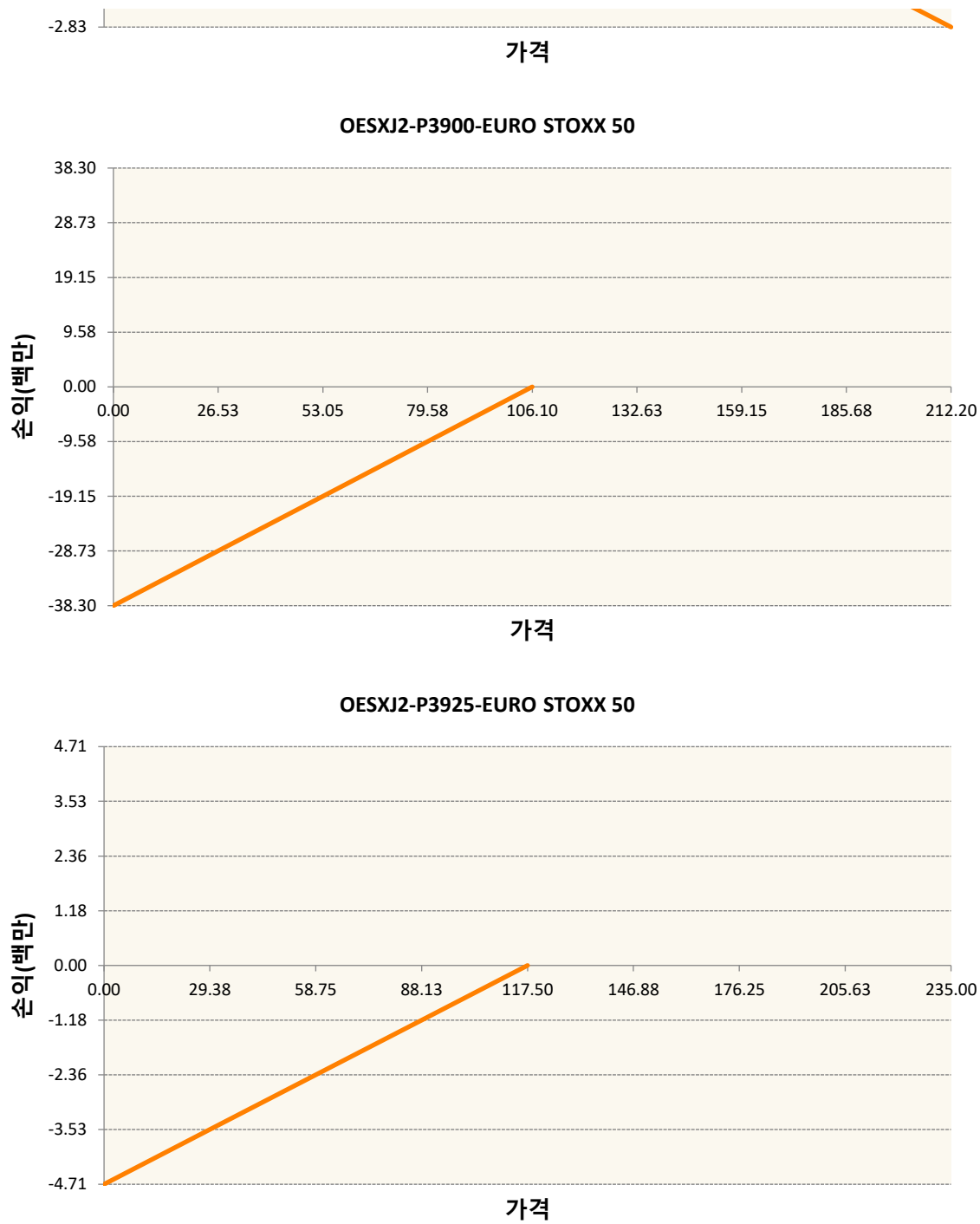
2. 만기시점의 손익구조

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

4
21
32
64
43
2
0.23
3
0.38

공시일 2022-03-23

기준일 2022-03-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

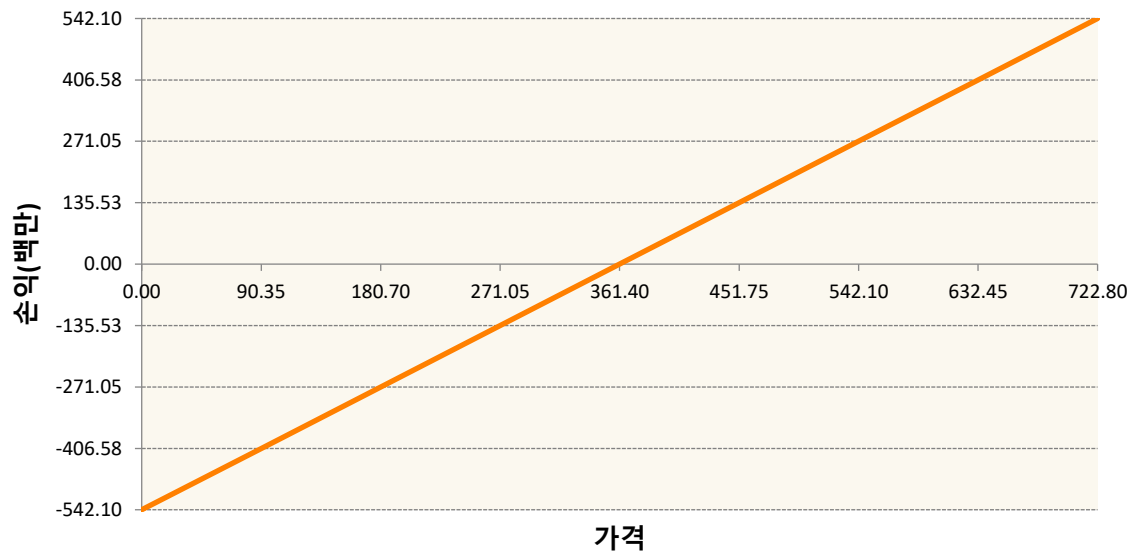
1. 계약금액

(단위:백만원)

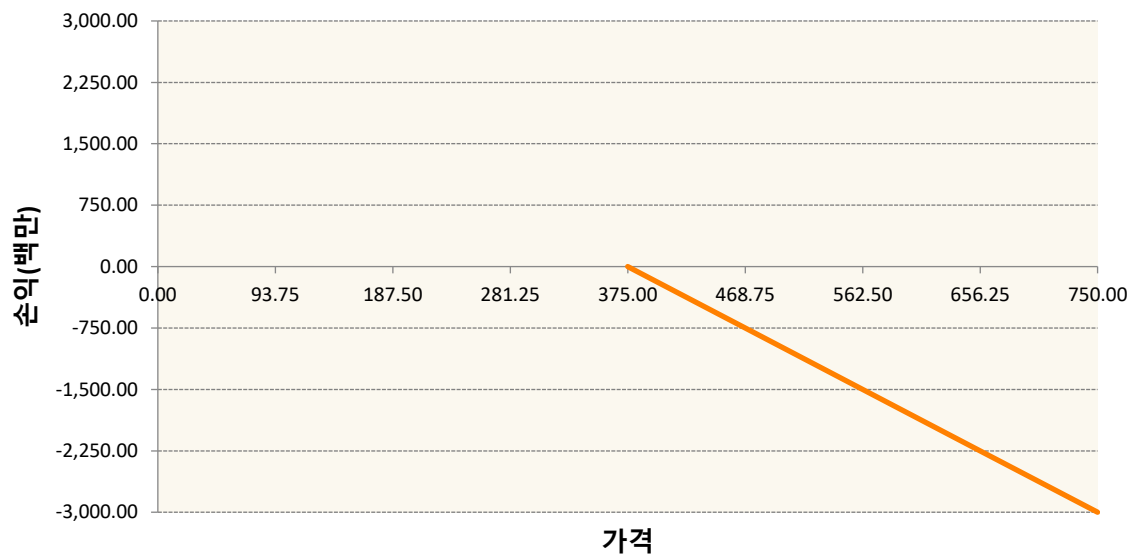
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	542	0	542	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

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 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 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				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%	47	46	44	42	40	37	33
-5.33%	44	42	38	35	31	26	22
-2.67%	36	32	27	21	16	10	4
0%	20	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-8	-15	-23	-31	-39	-46	-54
5.33%	-48	-56	-64	-72	-79	-87	-95
8.00%	-102	-108	-115	-122	-129	-136	-143
KR4201S43770 2022-04 콜377.5							77

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	23	23	22	21	20	18	17
-5.33%	22	21	19	17	15	13	11
-2.67%	18	16	14	11	8	5	1
0%	11	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-3	-7	-12	-16	-20	-25	-29
5.33%	-24	-29	-33	-37	-42	-46	-51
8.00%	-52	-56	-60	-64	-68	-73	-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%	19	19	20	20	20	20	21
-5.33%	10	11	11	12	12	13	13
-2.67%	3	4	4	5	5	6	7
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-4	-4	-3	-3	-2	-1
5.33%	-5	-5	-5	-5	-4	-4	-4
8.00%	-6	-6	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

235

공시일	2022-03-23
기준일	2022-03-22

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	9,282	0	9,282	

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	2022-03-23
기준일	2022-03-22

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	119	-119	
누계	유가증권	수익증권	7,670	0	7,670	

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	2022-03-23
기준일	2022-03-22

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	25,339	0	25,339	
누계	통화	선도	4,263	30,124	-25,860	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		2,215
FXW213C32 USD/KRW 25-03-22E		58
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

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

(단위:백만원)

911

공시일	2022-03-23
기준일	2022-03-22

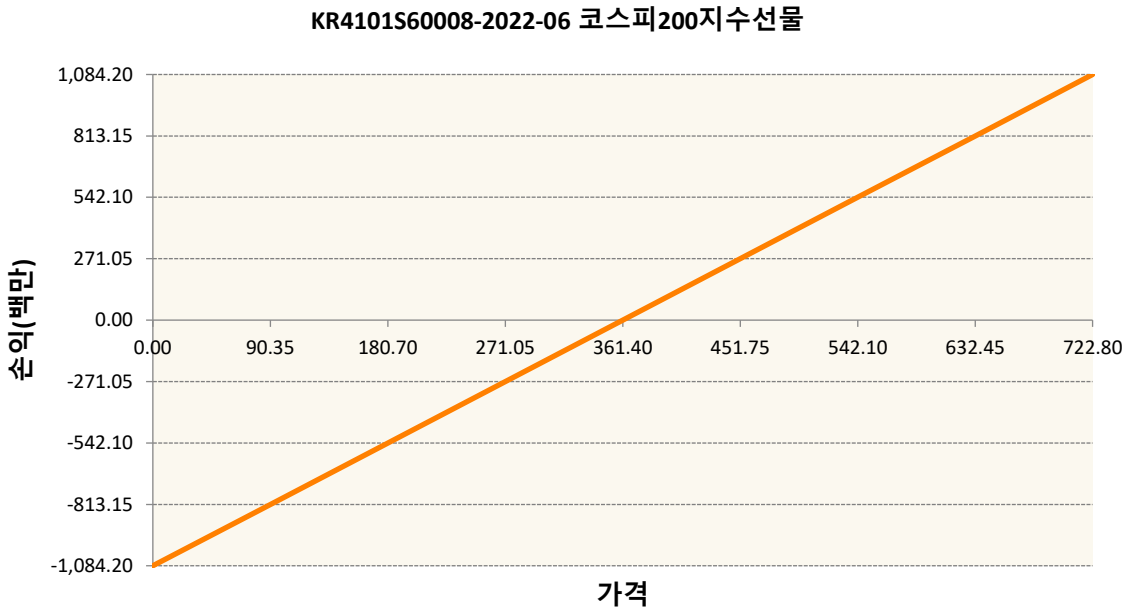
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,084	0	1,084	장내

2. 만기시점의 손익구조



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 2022-03-23

기준일 2022-03-22

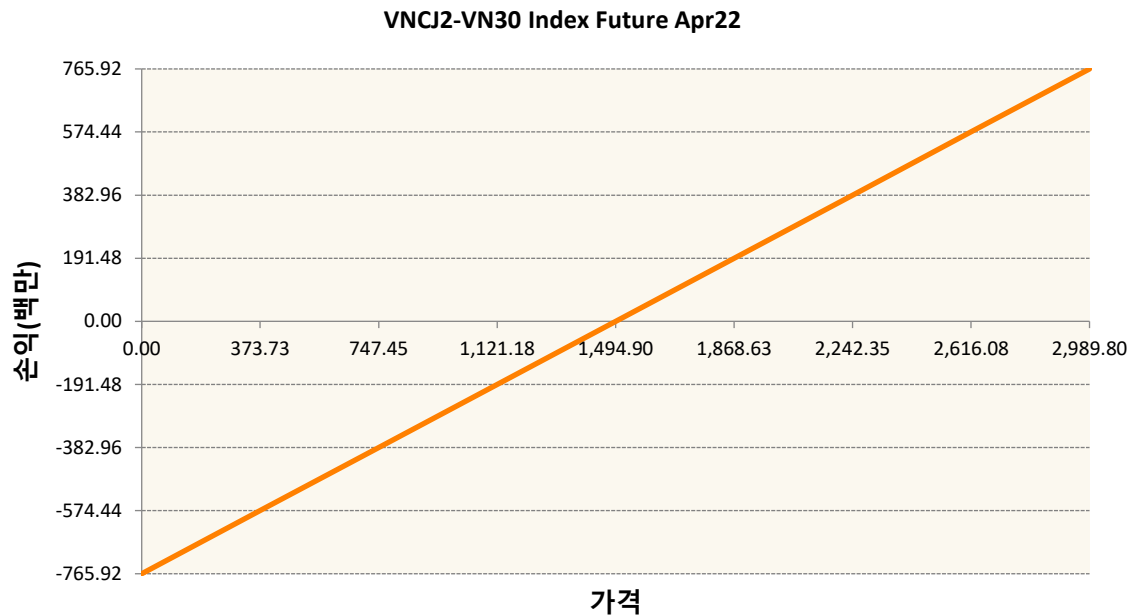
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	766	0	766	
누계	유가증권	스왑	1,828	0	1,828	장외
누계	통화	선도	0	1,177	-1,177	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	61

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

(단위:백만원)

264

공시일 2022-03-23

기준일 2022-03-22

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

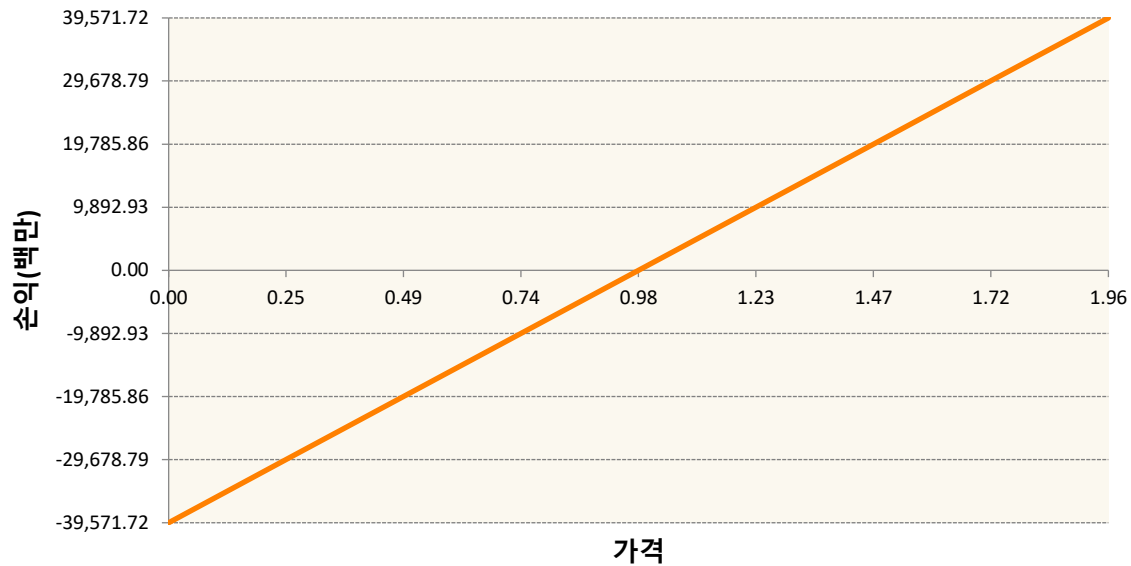
1. 계약금액

(단위:백만원)

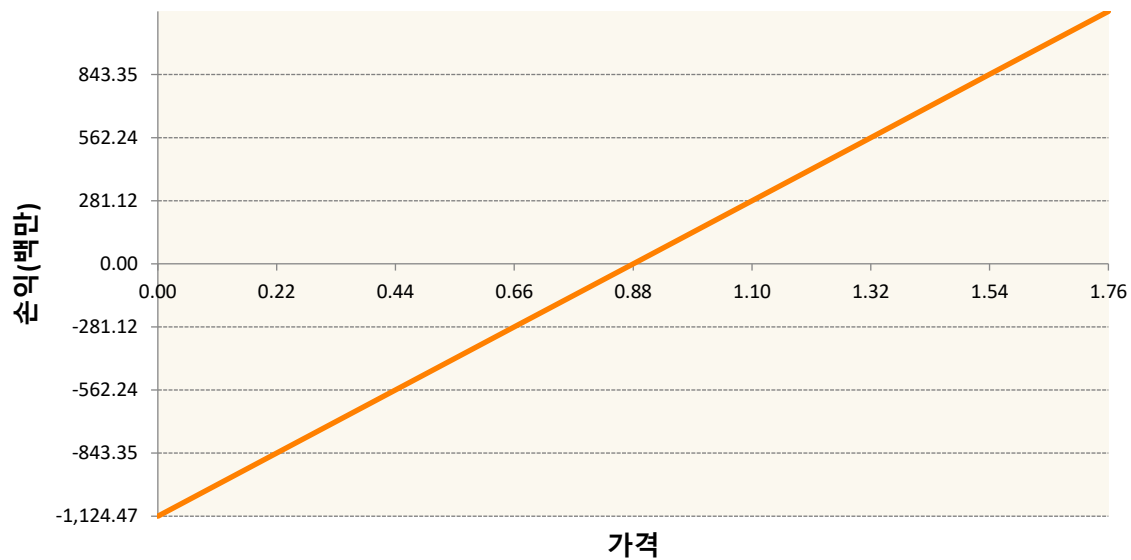
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	42,948	0	42,948	

2. 만기시점의 손익구조

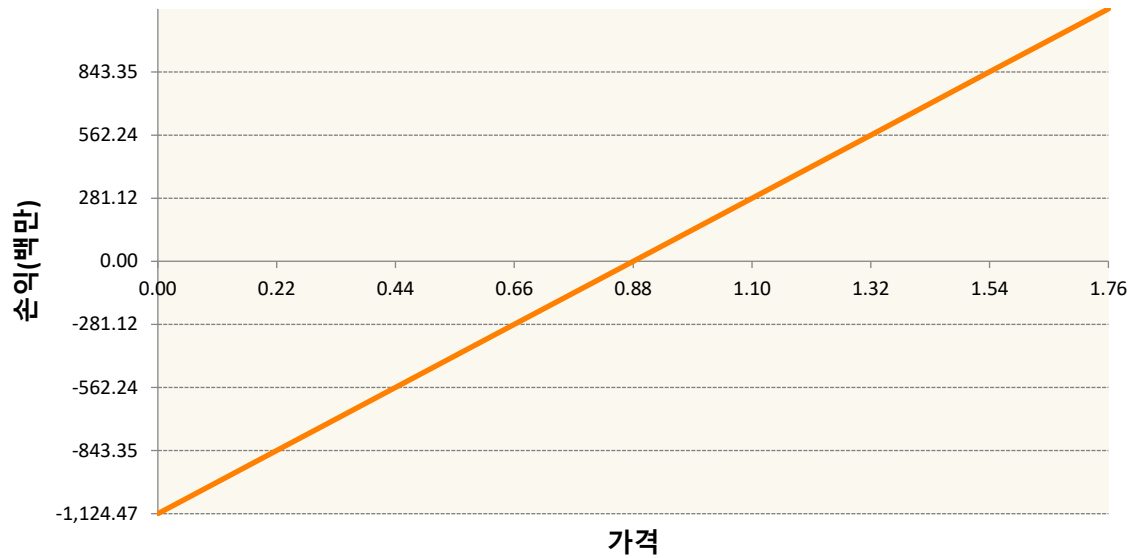
210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



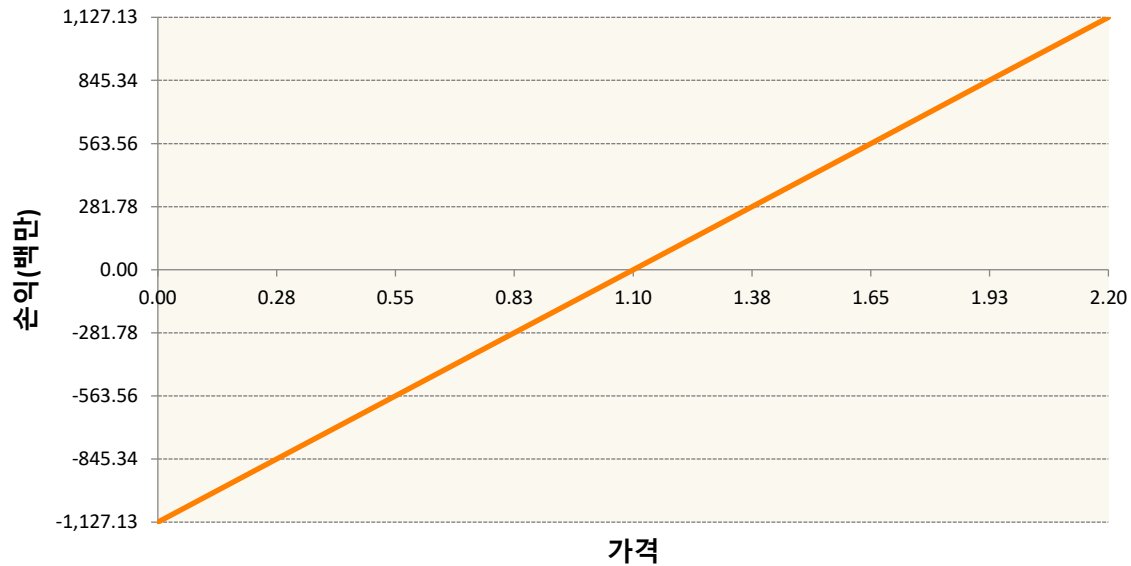
210884220216-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220217-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220307-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	3,159
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	90
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	90
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)	90

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

(단위:백만원)

6,289

공시일 2022-03-23

기준일 2022-03-22

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

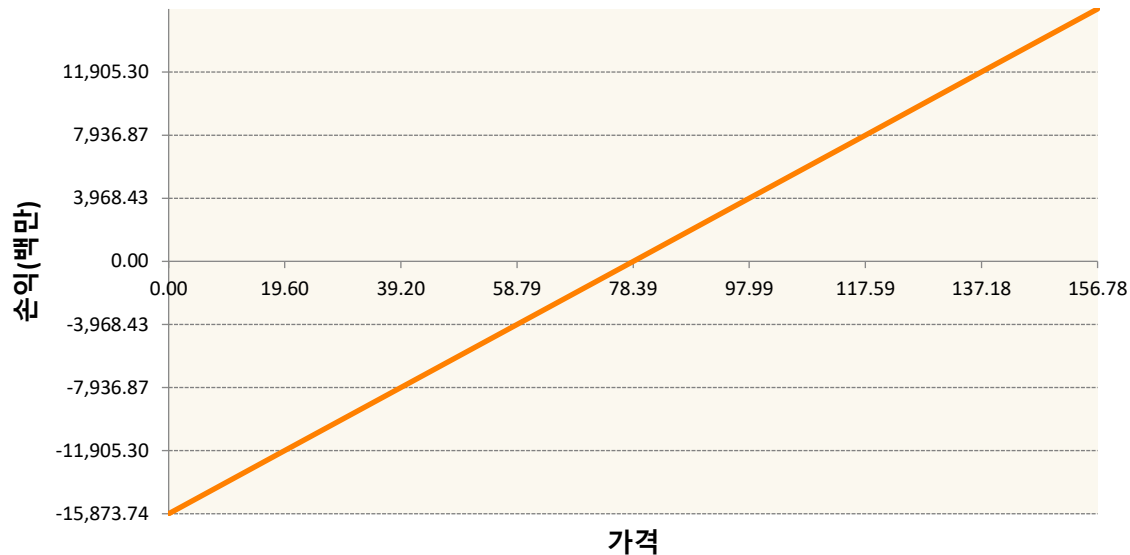
1. 계약금액

(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	15,874	0	15,874	
누계	통화	선도	0	8,179	-8,179	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2R KRW/EUR 28-03-22E

654

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,270

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

(단위:백만원)

3,356

공시일	2022-03-23
기준일	2022-03-22

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	11,760	0	11,760	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (NH)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠)	16

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

(단위:백만원)

122

공시일	2022-03-23
기준일	2022-03-22

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)		19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)		22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)		19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)		19

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

공시일 2022-03-23

기준일 2022-03-22

에퀴티알파일반사모혼합자산

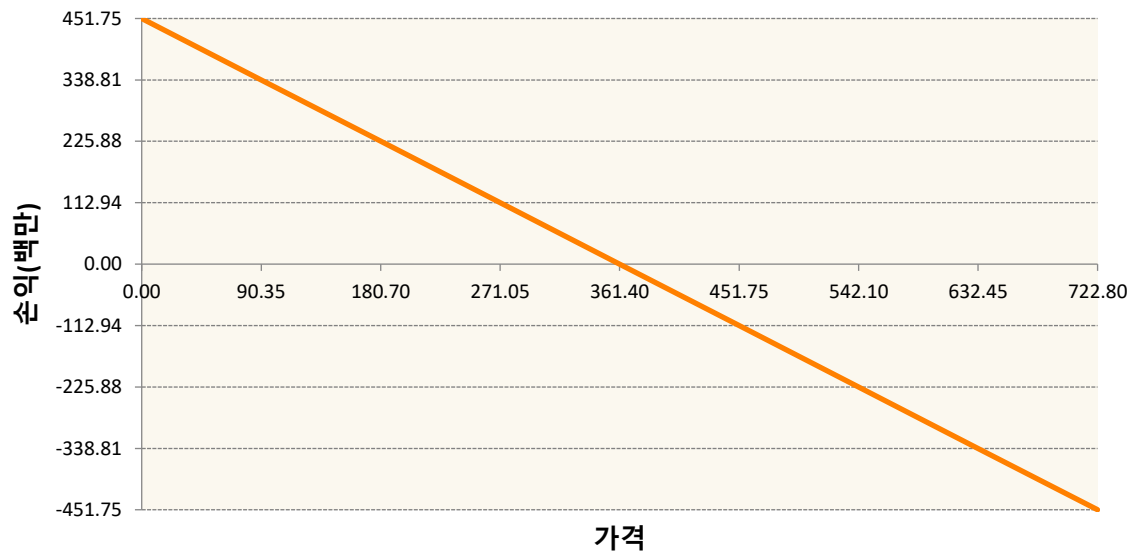
1. 계약금액

(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	452	-452	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	0.03
KRS0003014. SWAP_APPLE INC_0322	0.12
KRS0003014. SWAP_NVIDIA CORP_0322	0.1
KRS0003014. SWAP_TESLA INC_0322	0.03
KRS0003014. SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	0.06
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물	36

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

(단위:백만원)

33

공시일 2022-03-23

기준일 2022-03-22

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

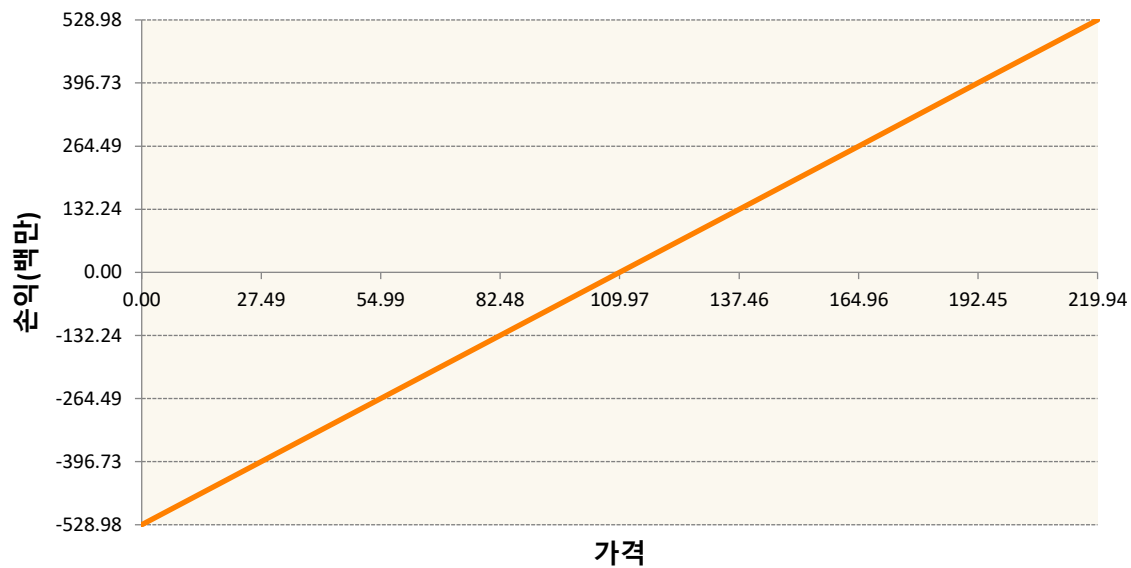
1. 계약금액

(단위:백만원)

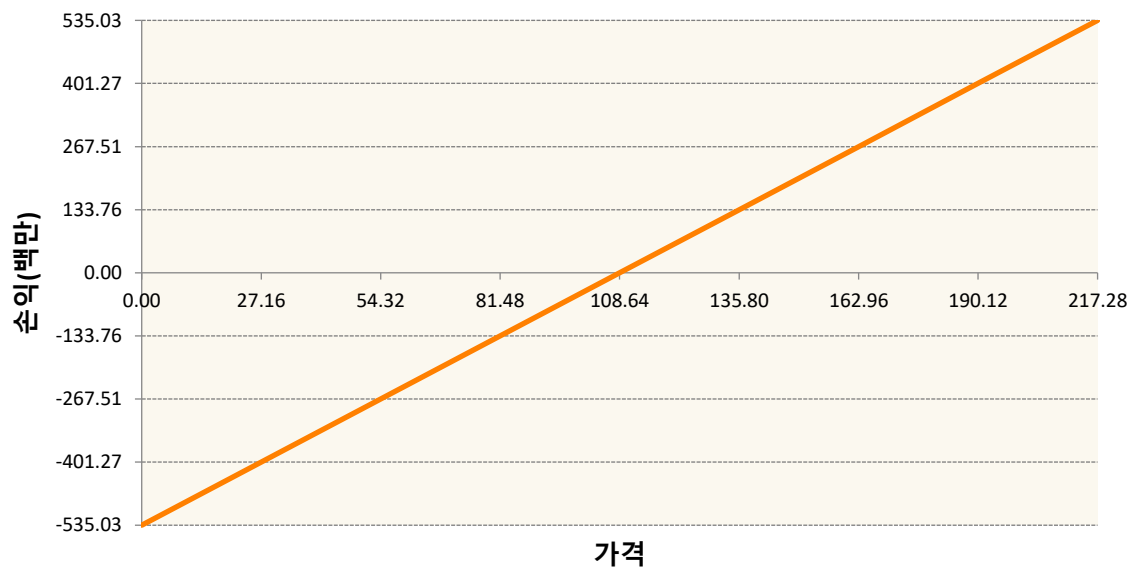
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,322	488	1,834	

2. 만기시점의 손익구조

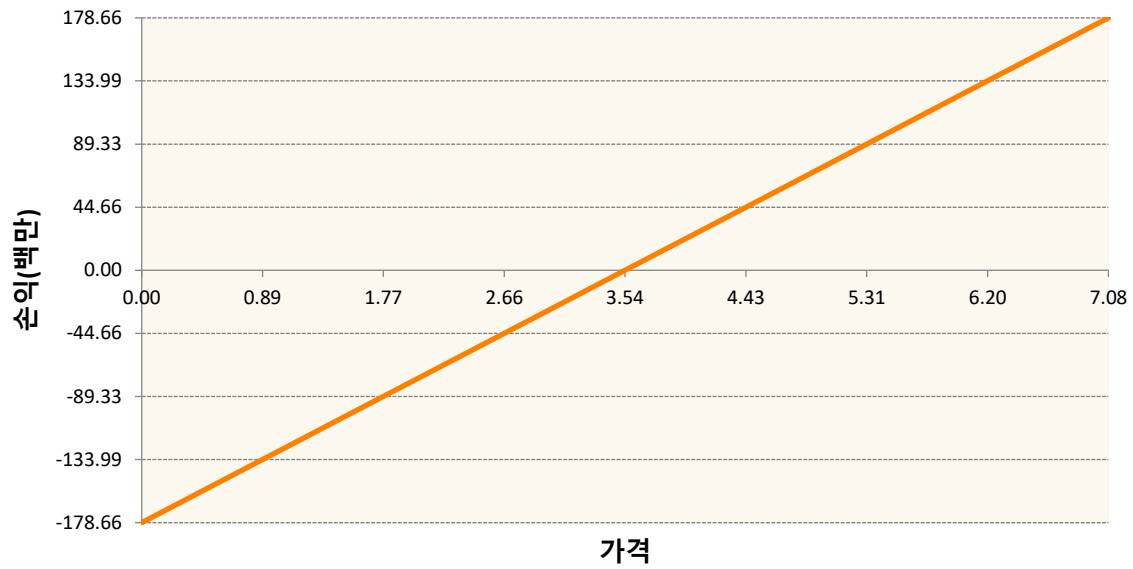
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



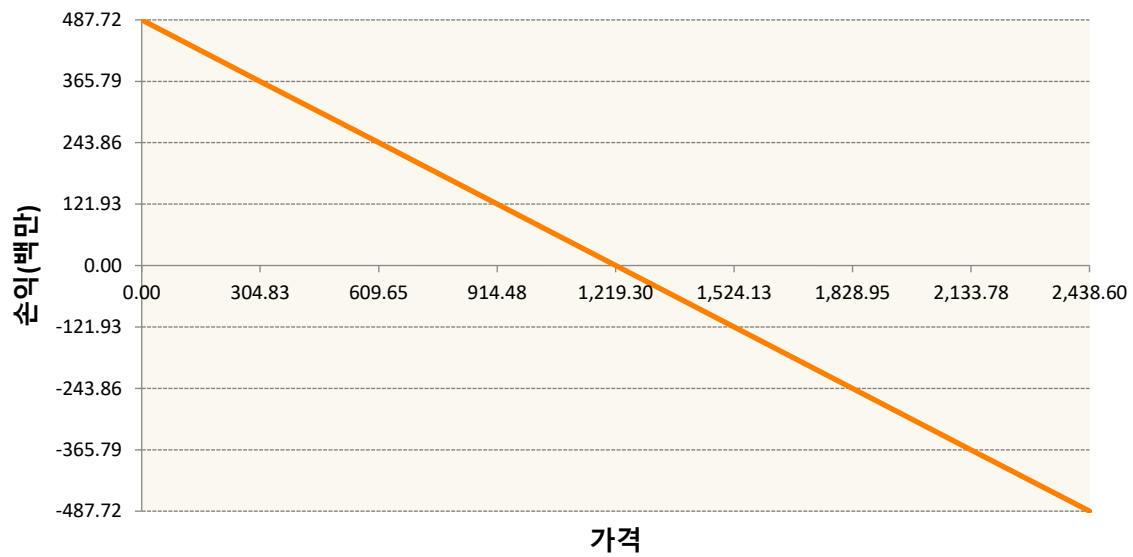
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



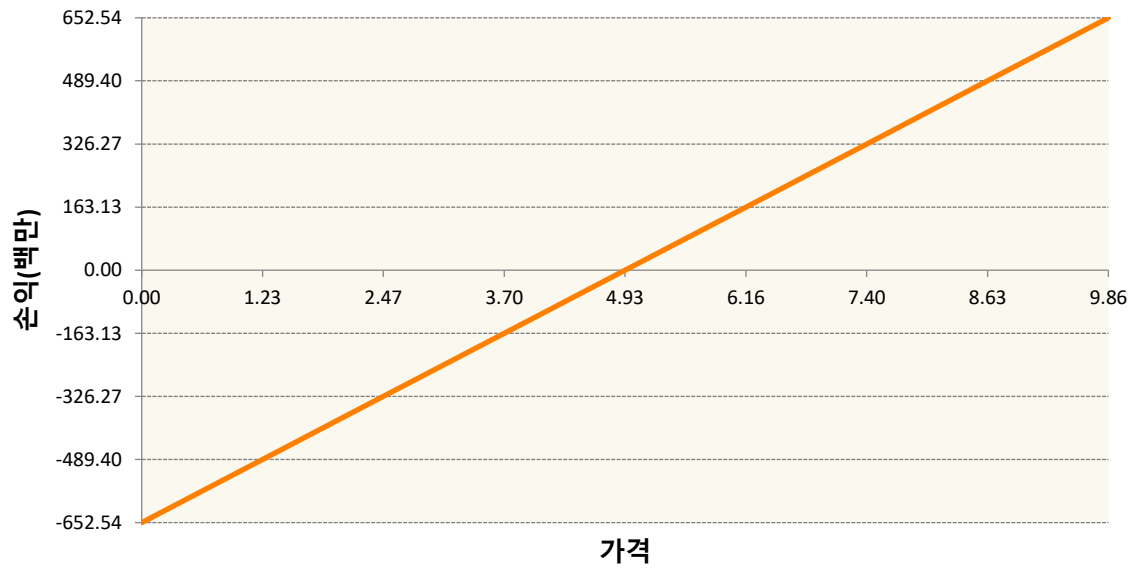
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22



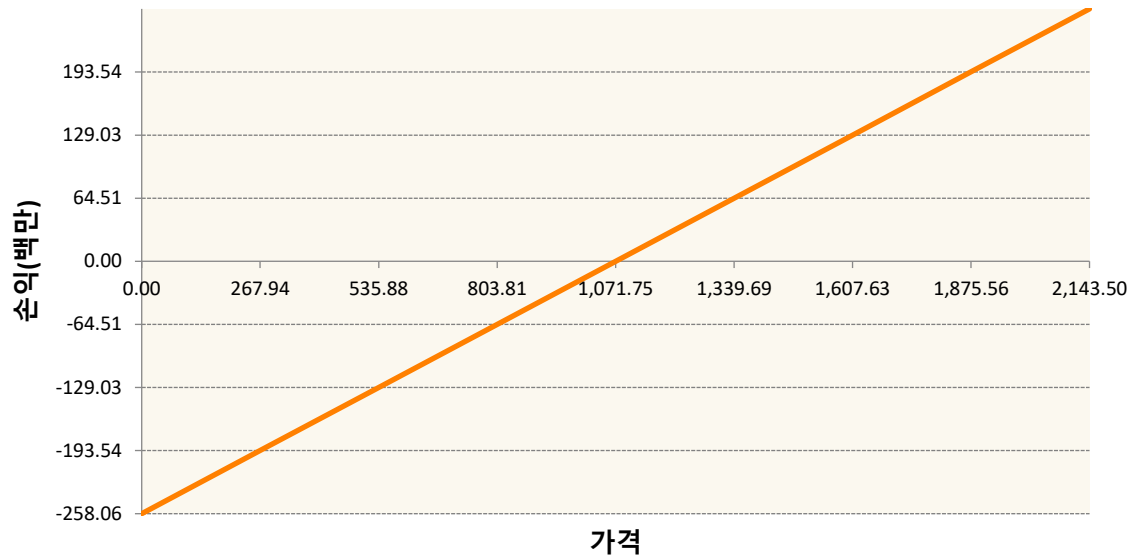
KR4175S40004-2022-04 달러선물



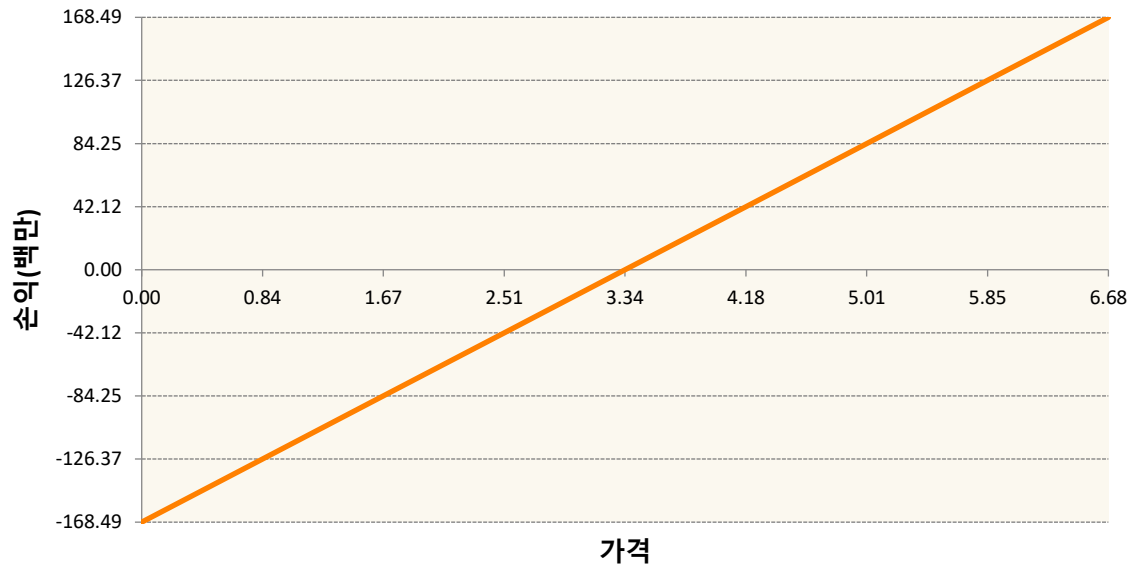
NGK22-NATURAL GAS FUTR May22



QSK2-Low Su Gasoil G MAY22



XBK2-GASOLINE RBOB FUT May22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22	42
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22	43
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22	14
KR4175S400	2022-04 달러선물	39
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22	52
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22	21
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22	13

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

(단위:백만원)

507