

공시일 2022-04-08

기준일 2022-04-07

포커스농산물모(채권-파생형)

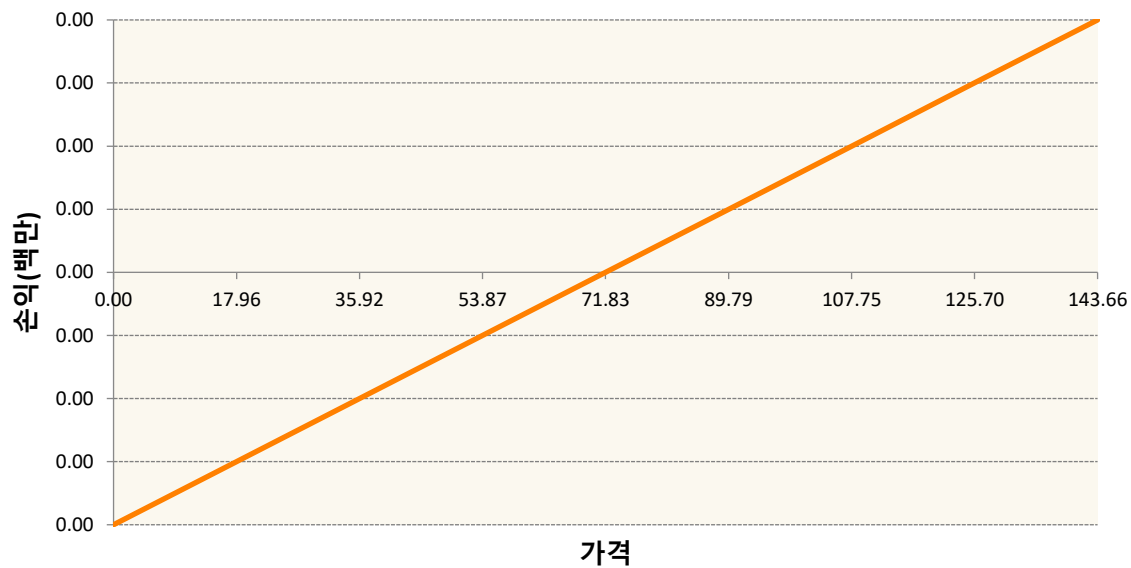
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

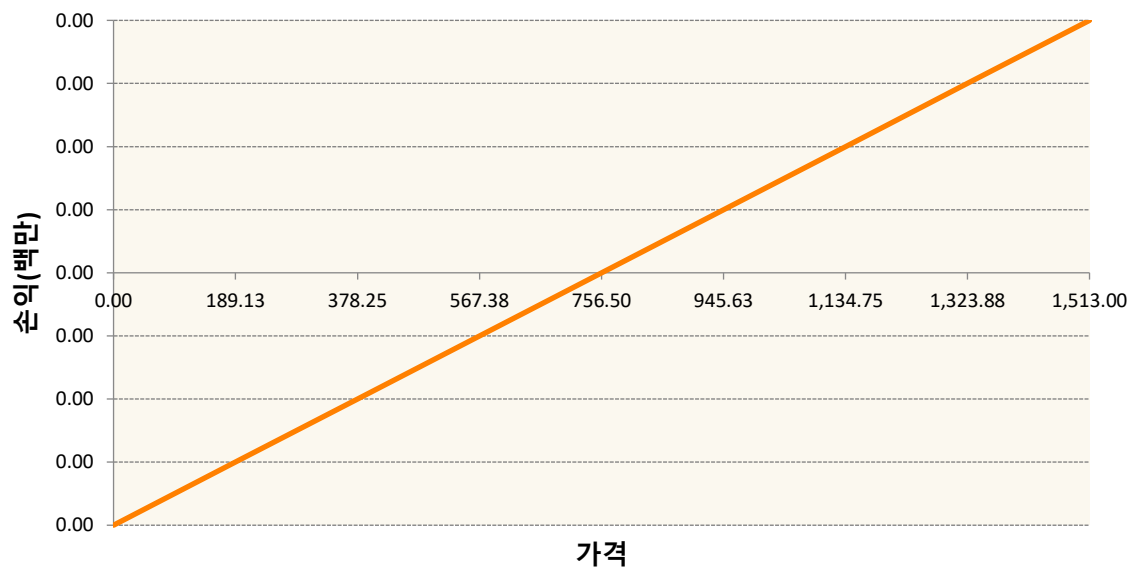
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,477	1,708	5,770	

2. 만기시점의 손익구조

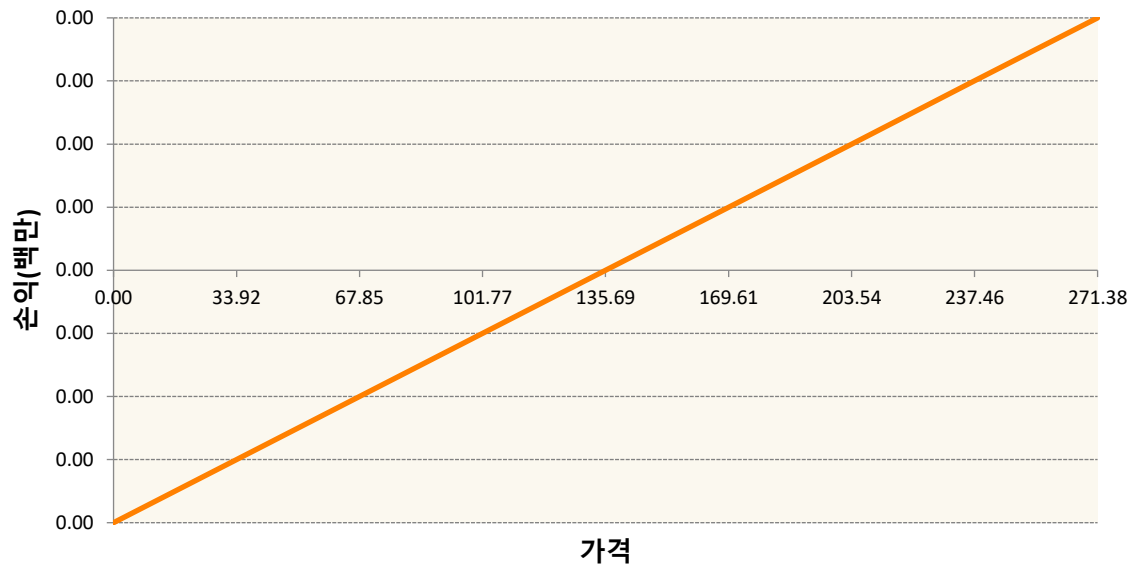
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



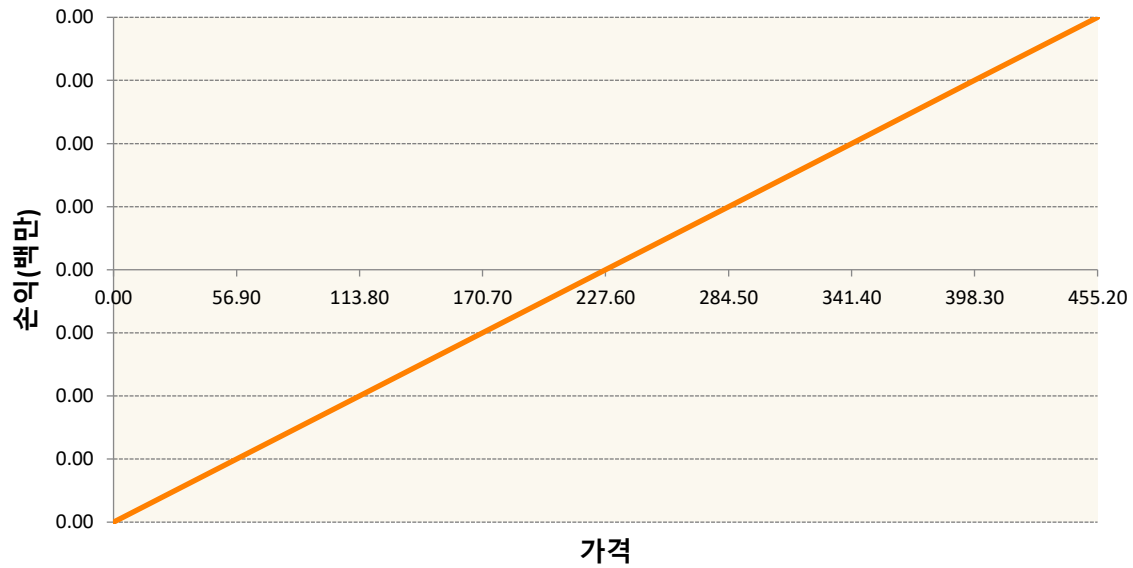
CK2-CORN FUTURE May22



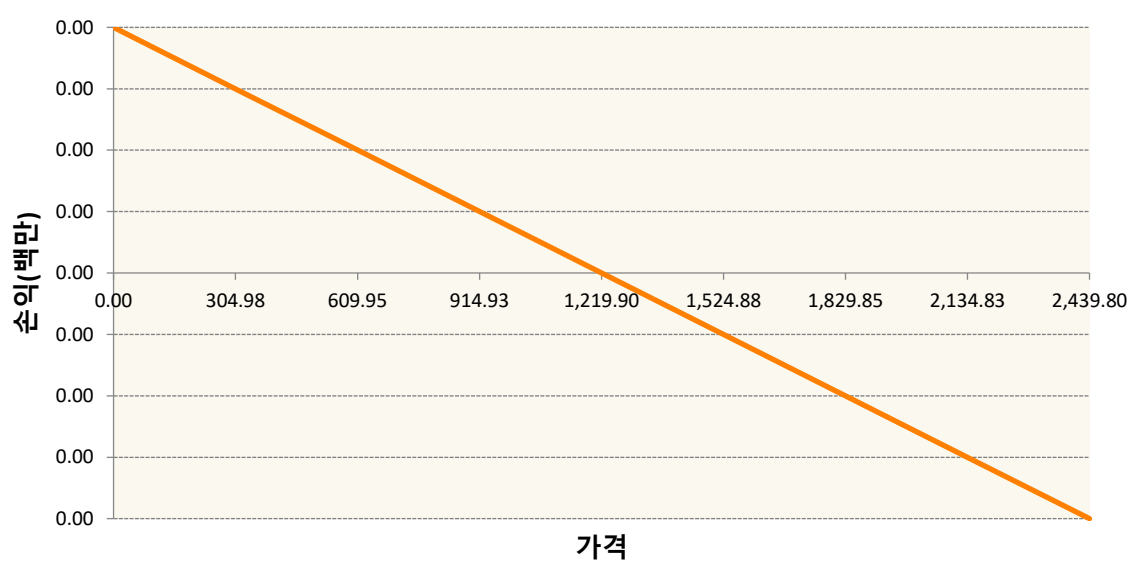
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



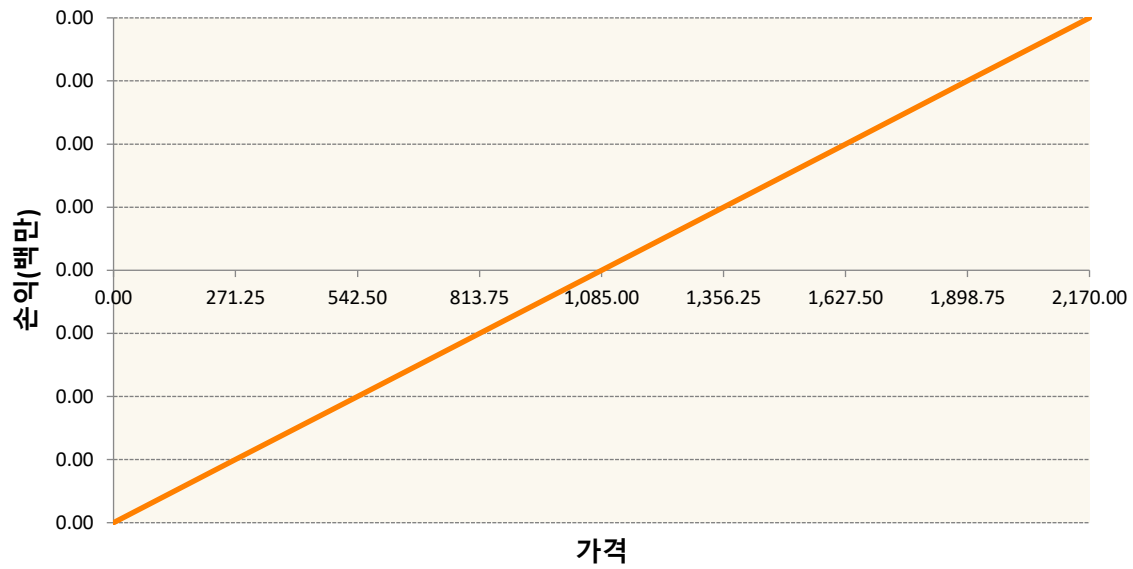
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



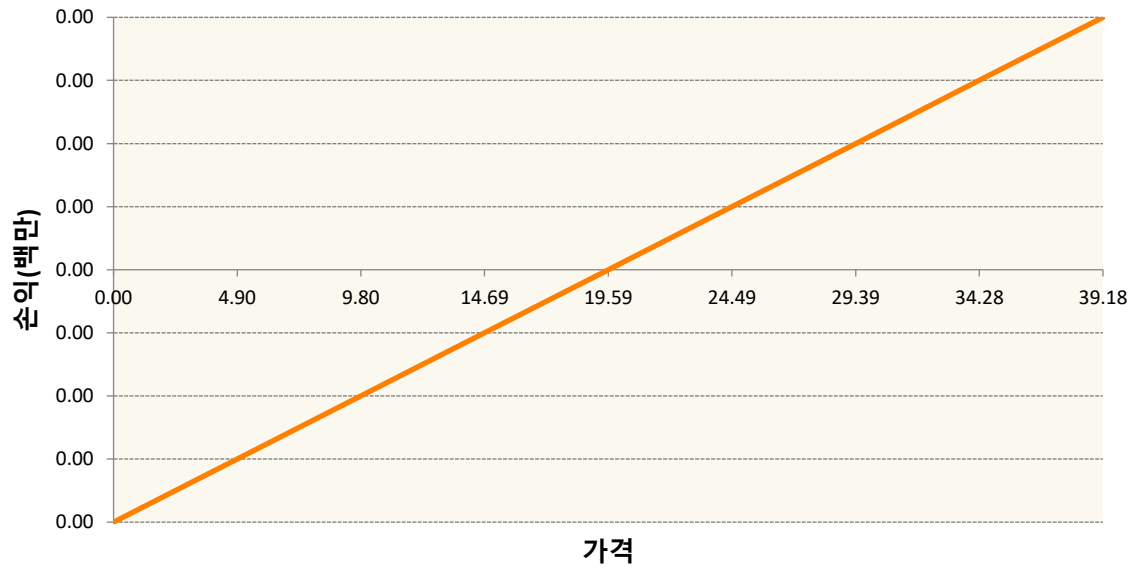
KR4175S40004-2022-04 달러선물



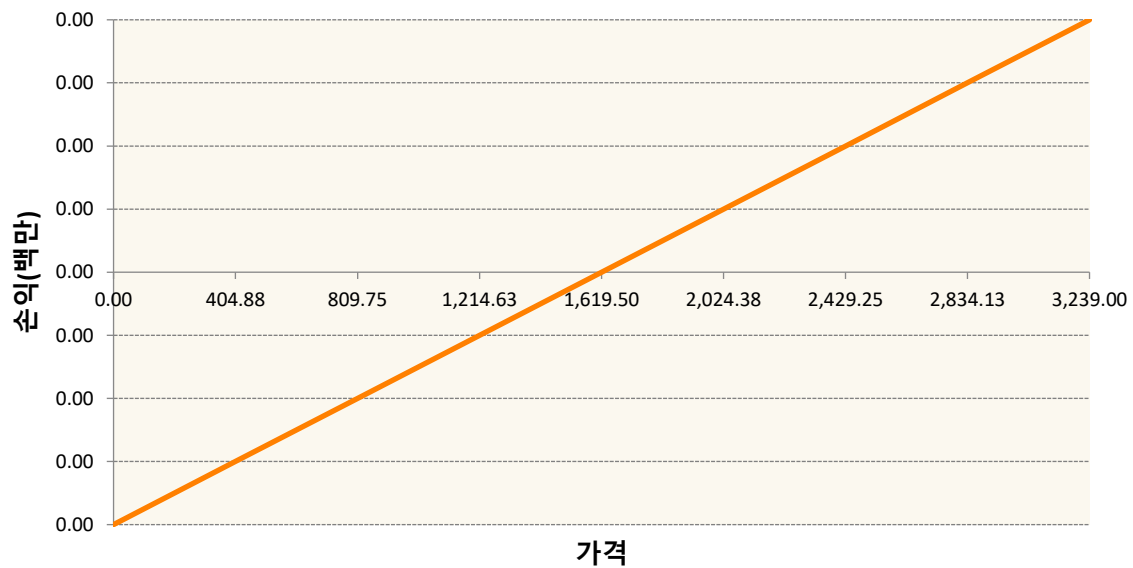
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



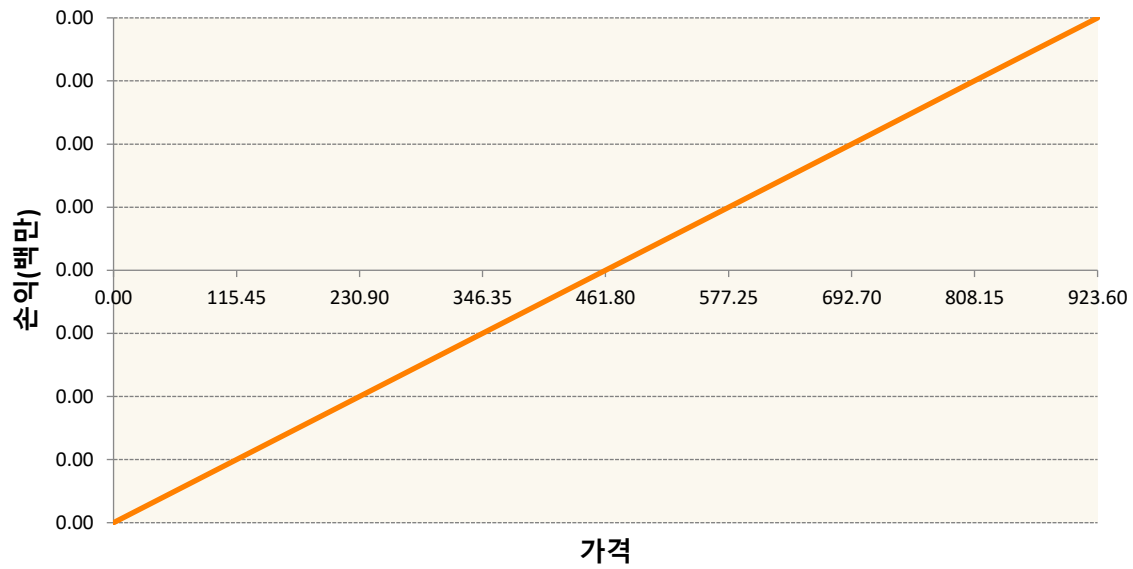
SBK2-Sugar May22



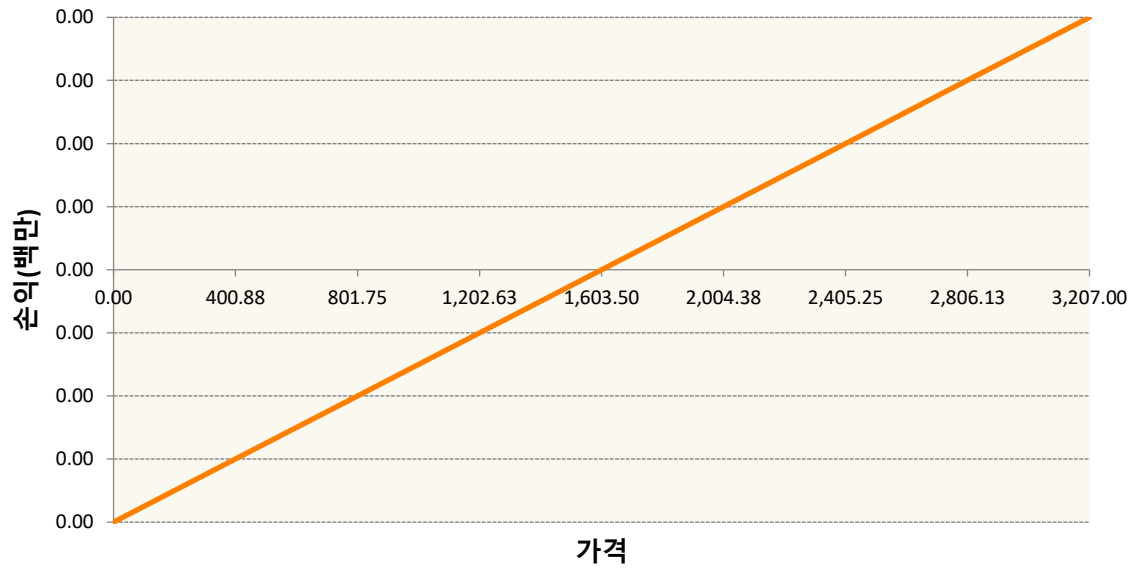
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



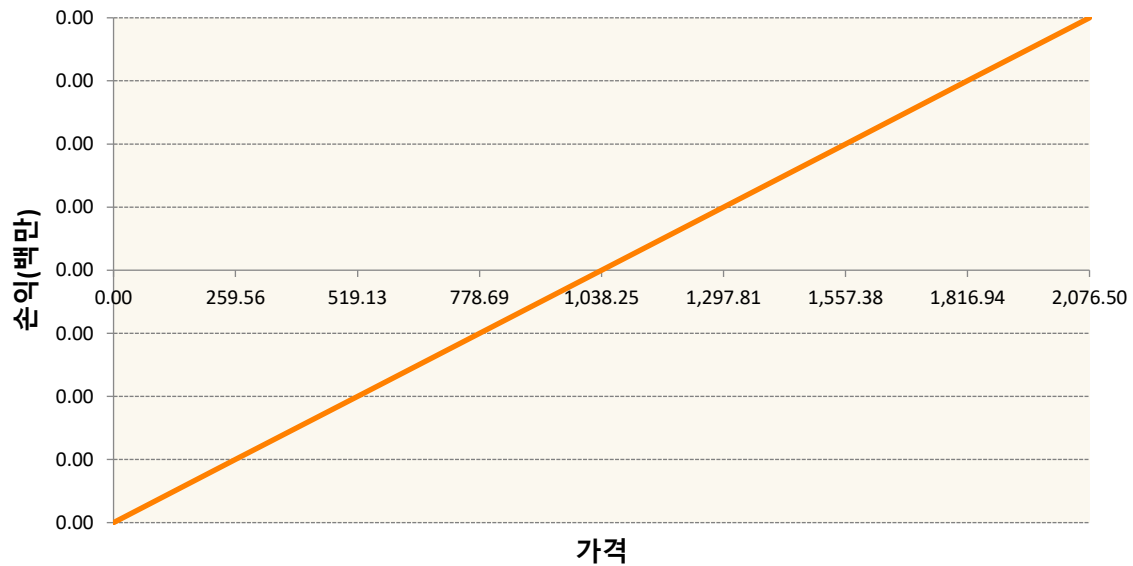
SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



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	2022-04-08
기준일	2022-04-07

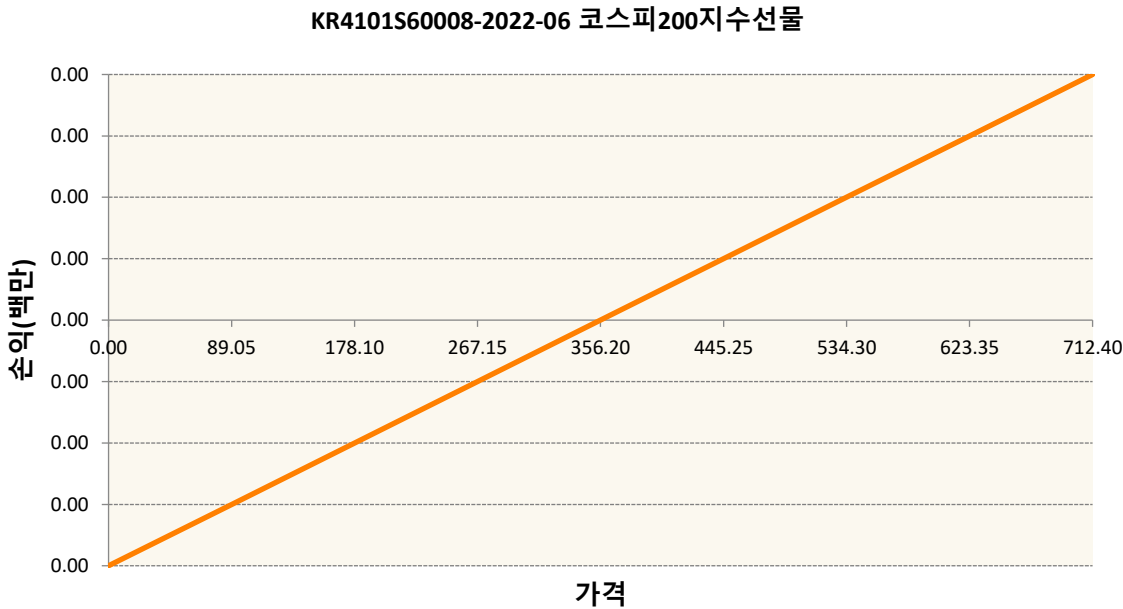
스마트인덱스모

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	1,603	0	1,603	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008		2022-06 코스피200지수선물					128
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	85	85	85	85	85	85	85
8.00%	128	128	128	128	128	128	128

공시일	2022-04-08
기준일	2022-04-07

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	2022-04-08
기준일	2022-04-07

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	392
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

402

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-04-08
기준일	2022-04-07

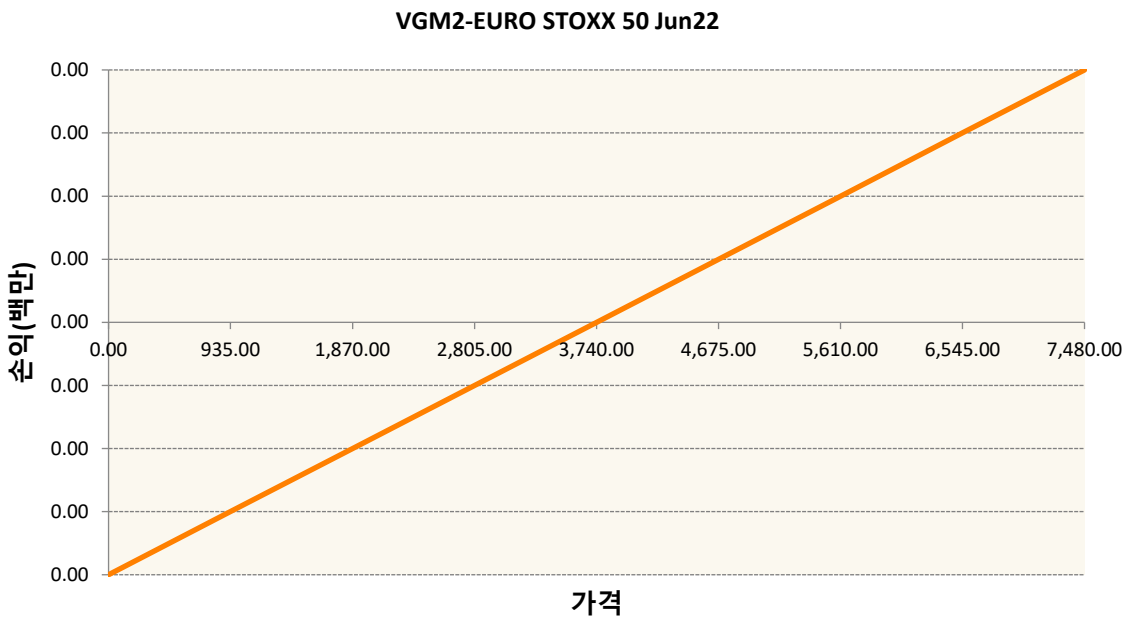
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	558	0	558	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2	EURO STOXX 50 Jun22	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-04-08
기준일	2022-04-07

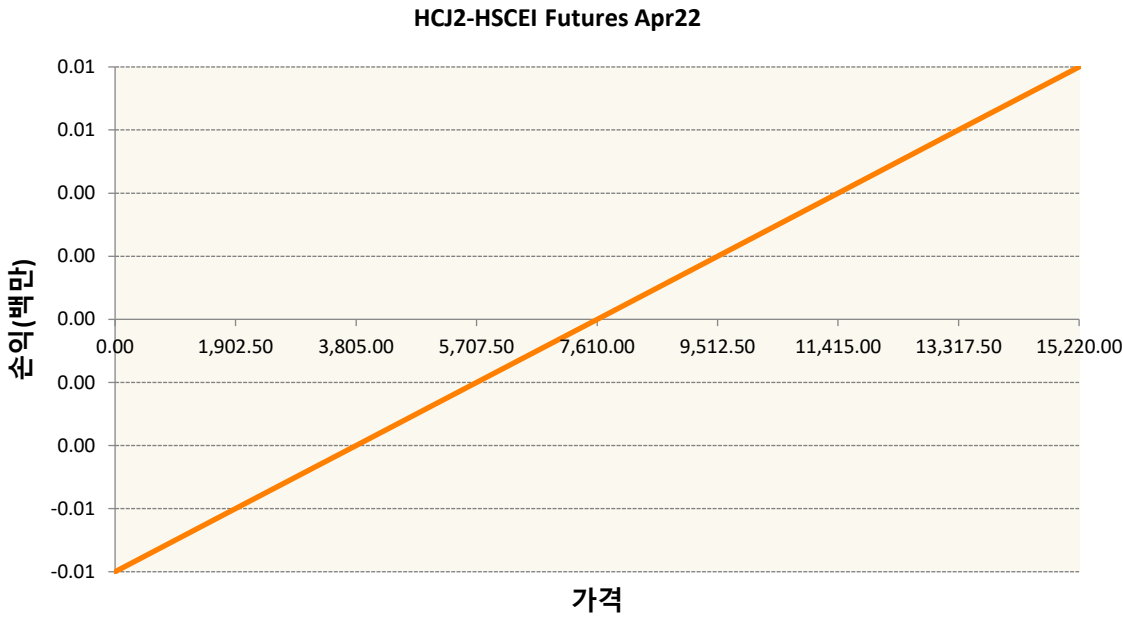
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,176	0	1,176	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

126

공시일	2022-04-08
기준일	2022-04-07

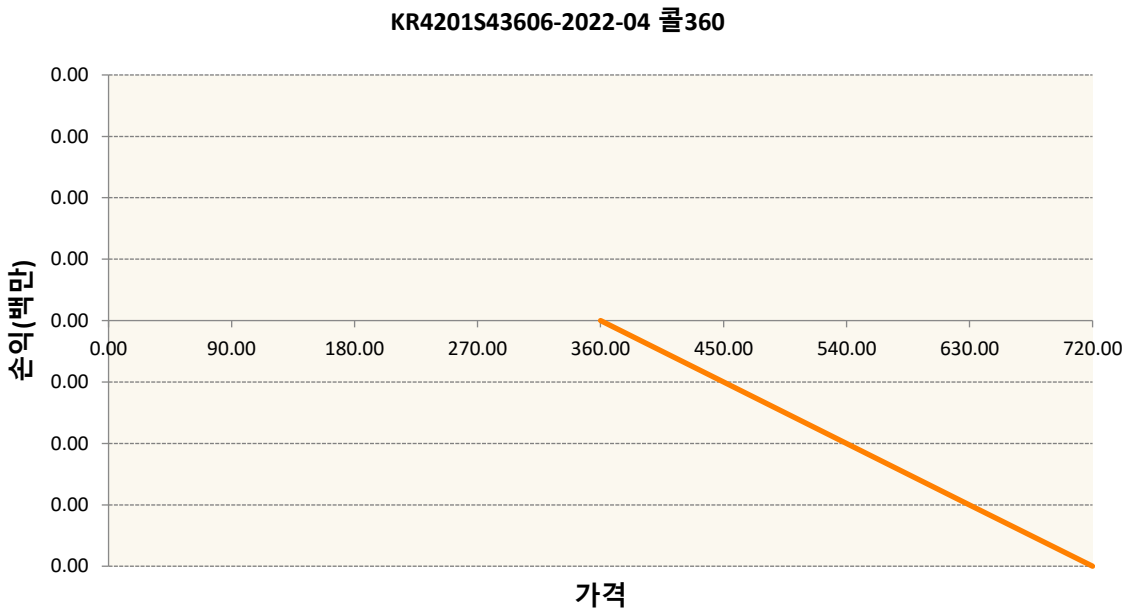
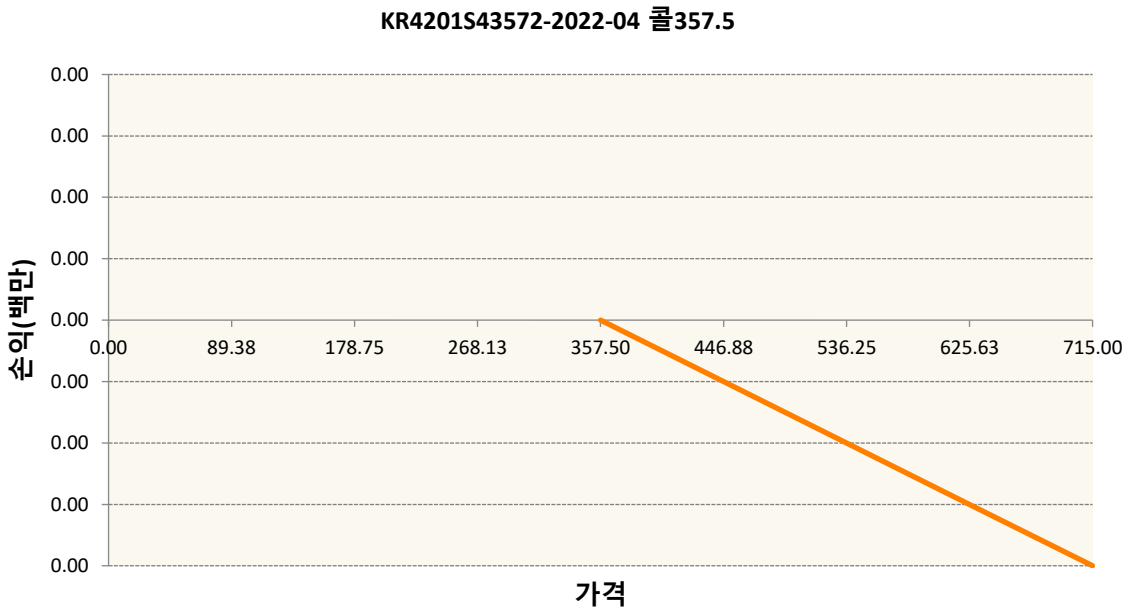
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

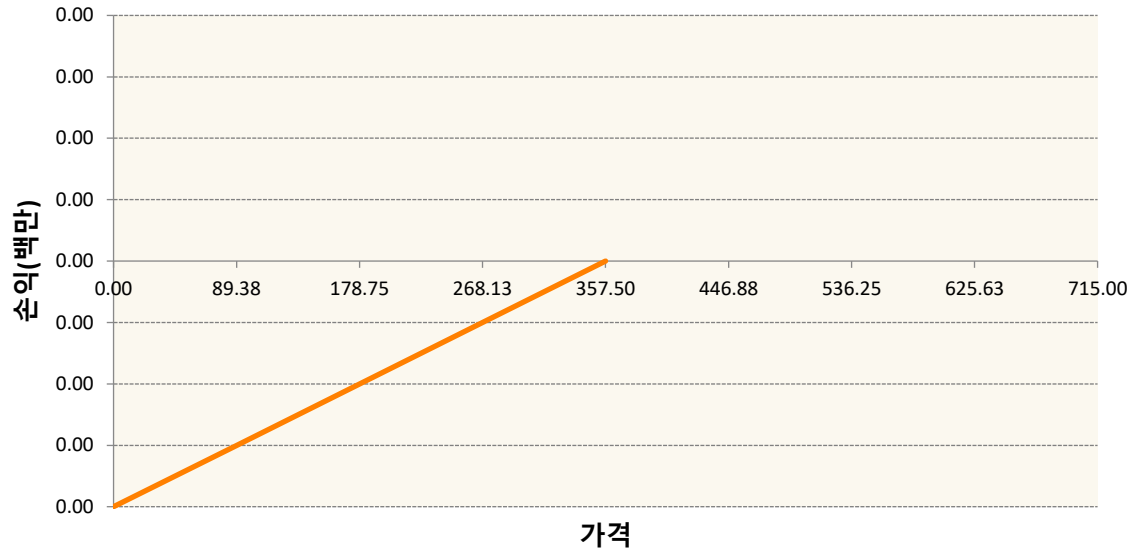
(단위:백만원)

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



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S43572			2022-04 콜357.5				2,596
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	578	577	574	570	564	555	544
-5.33%	567	557	543	526	505	481	455
-2.67%	482	448	411	371	329	285	240
0%	167	112	56	0	-56	-112	-168
2.67%	-502	-548	-596	-645	-696	-747	-799
5.33%	-1,453	-1,473	-1,497	-1,525	-1,557	-1,591	-1,628
8.00%	-2,521	-2,526	-2,534	-2,545	-2,559	-2,576	-2,596
KR4201S43606			2022-04 콜360				793
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	149	148	148	147	145	143	141
-5.33%	147	144	141	137	132	126	118
-2.67%	129	120	110	99	87	74	61
0%	52	35	17	0	-18	-35	-53
2.67%	-134	-151	-168	-185	-203	-220	-238
5.33%	-422	-431	-441	-452	-464	-477	-490
8.00%	-761	-764	-767	-772	-778	-785	-793
KR4301S43570			2022-04 풋357.5				822
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-822	-822	-822	-822	-822	-822	-822
-5.33%	-518	-519	-519	-519	-520	-521	-522
-2.67%	-219	-221	-225	-229	-233	-238	-244
0%	28	19	9	0	-9	-19	-28

2.67%	131	125	119	113	106	99	91
5.33%	144	144	143	141	139	137	134
8.00%	145	145	145	145	144	144	143

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

(단위:백만원)

4,584

공시일 2022-04-08

기준일 2022-04-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

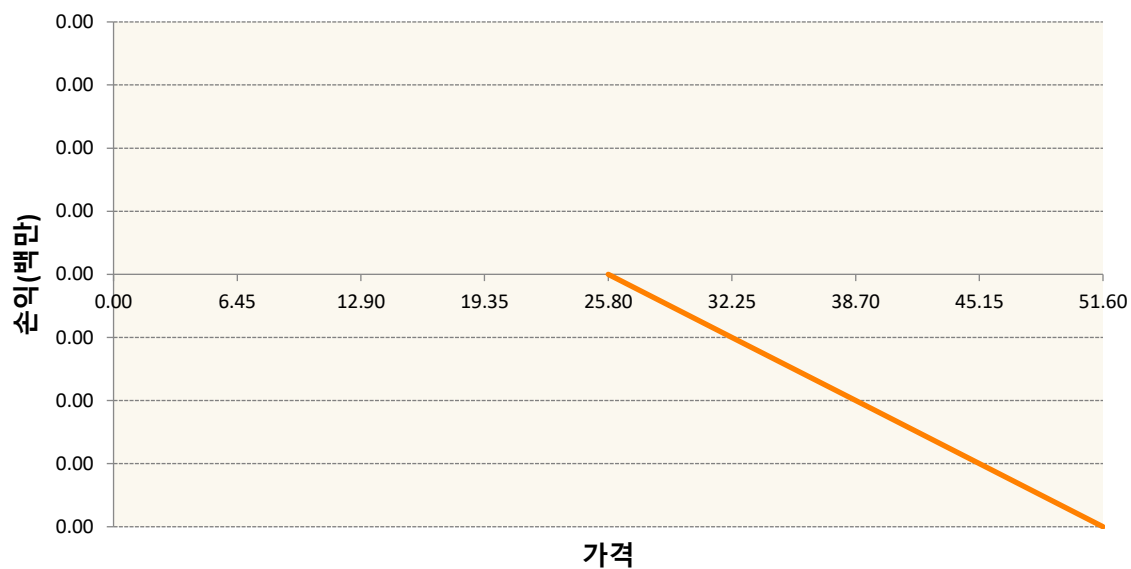
1. 계약금액

(단위:백만원)

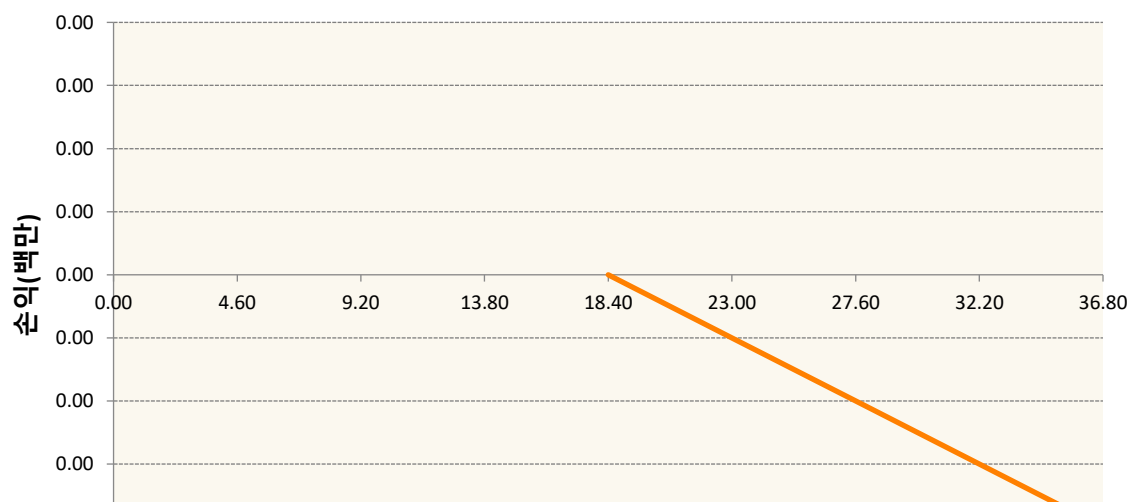
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	51	-51	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,998	-1,998	장외

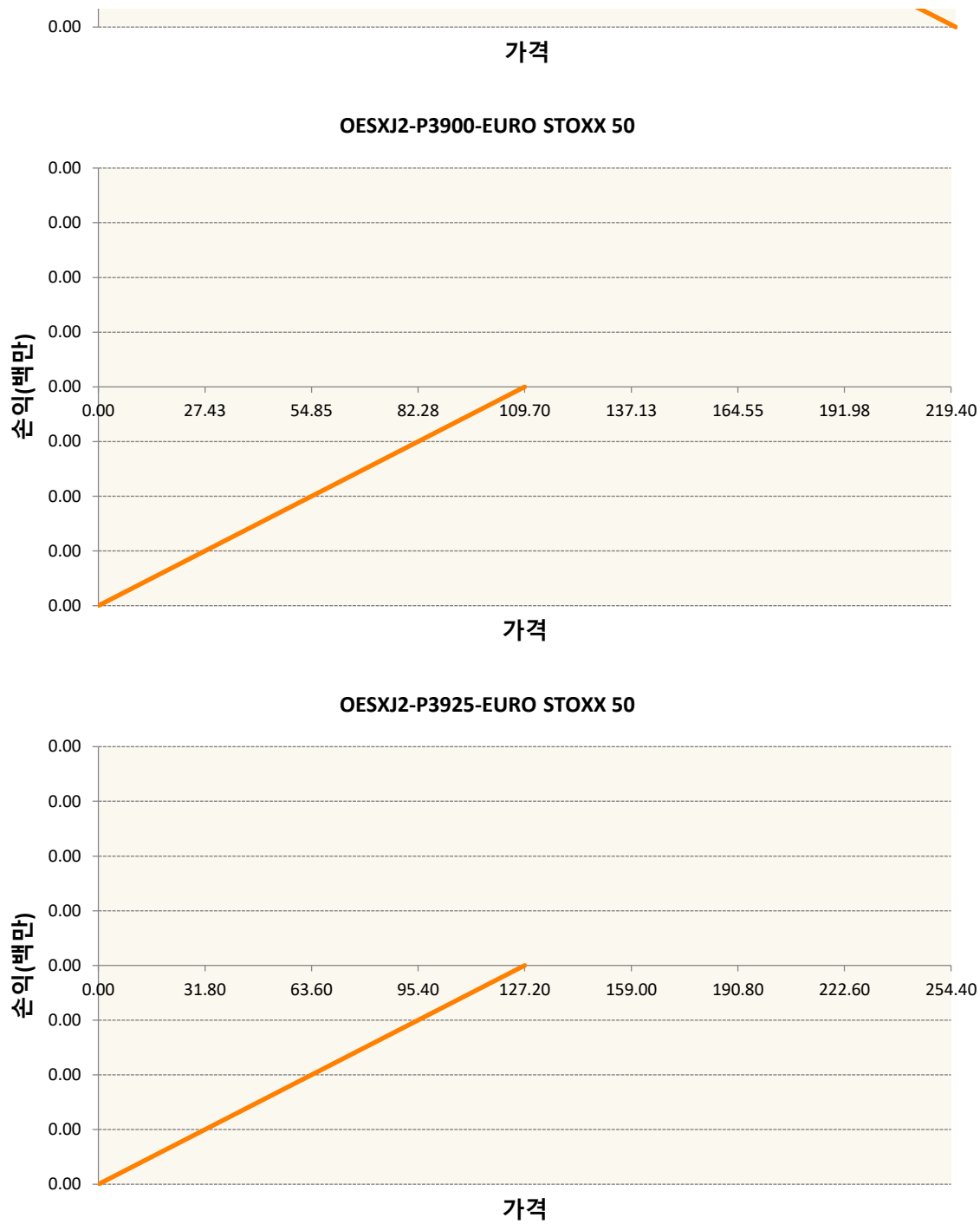
2. 만기시점의 손익구조

OESXJ2-C3900-EURO STOXX 50



OESXJ2-C3925-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY

4

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

1

OESXJ2-C39(EURO STOXX 50

0.06

OESXJ2-P39(EURO STOXX 50

3

OESXJ2-P39(EURO STOXX 50

0.41

공시일 2022-04-08

기준일 2022-04-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

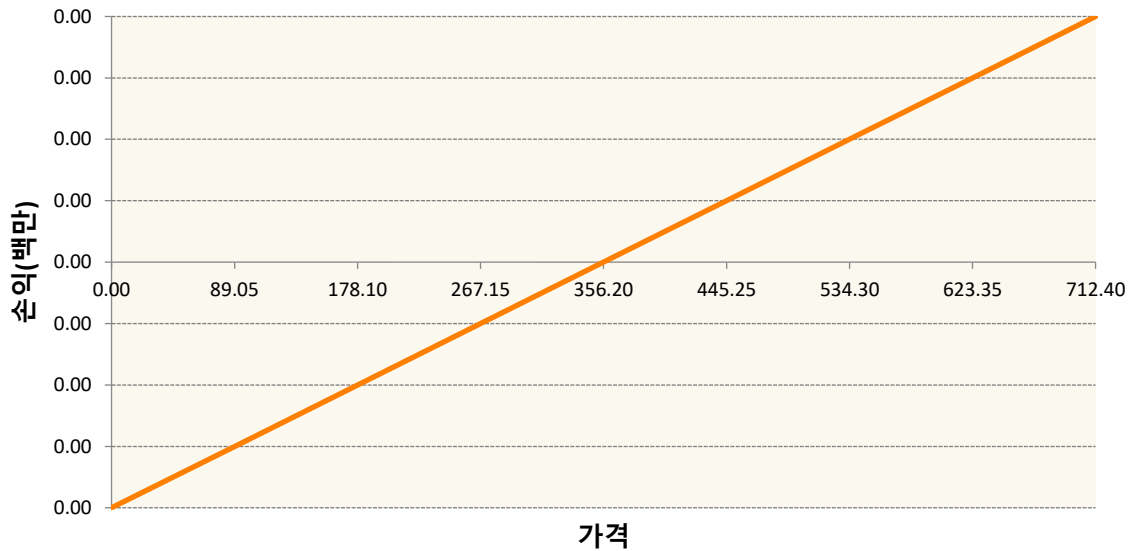
1. 계약금액

(단위:백만원)

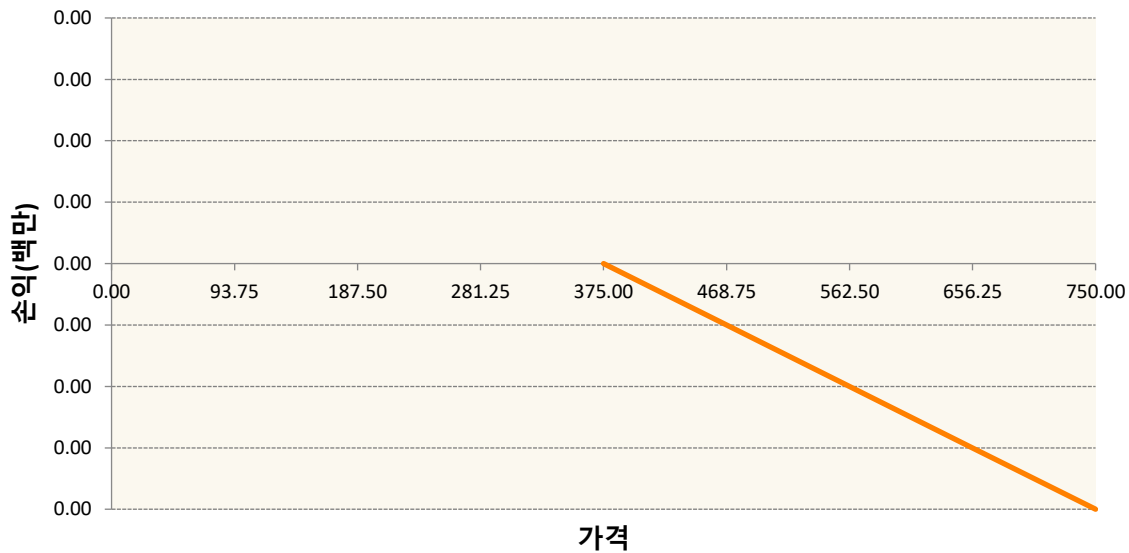
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	89	-89	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	445	0	445	장내
누계	유가증권	옵션	358	4,699	-4,341	장내

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 0.00 to 0.00. A blue line represents the relationship, starting at a price of 377.50 with a profit/loss of 0.00, and ending at a price of 755.00 with a profit/loss of 0.00.

가격	손익(백만)
377.50	0.00
755.00	0.00

가격	순익 (백만)
0.00	0.00
357.50	0.00

(단위:백만원)

KR4101S60008		2022-06 코스피200지수선물					36
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	36	36	36	36	36	36	36
KR4201S43754		2022-04 콜375					100
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	5
-5.33%	6	6	6	5	5	5	5
-2.67%	5	5	5	4	4	3	2
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-4	-7	-10	-13	-17	-20	-24
5.33%	-30	-34	-38	-42	-46	-50	-55
8.00%	-79	-83	-86	-89	-93	-96	-100
KR4201S43770 2022-04 콜377.5							50

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	2	1	1
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-1	-3	-4	-6	-8	-9	-11
5.33%	-13	-15	-17	-20	-22	-24	-26
8.00%	-37	-39	-41	-43	-46	-48	-50

KR4301S43570 2022-04 풋357.5							26
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	26	26	26	26	26	26
-5.33%	16	16	16	16	16	16	16
-2.67%	7	7	7	7	7	7	8
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3
5.33%	-5	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-4

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

(단위:백만원)

147

공시일	2022-04-08
기준일	2022-04-07

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	50	-50	
누계	유가증권	수익증권	9,525	0	9,525	

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	2022-04-08
기준일	2022-04-07

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	7,459	0	7,459	

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	2022-04-08
기준일	2022-04-07

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	216	-216	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	25,922	0	25,922	
누계	통화	선도	1,707	27,719	-26,012	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,218
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E	39
FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E	98
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

796

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

(단위:백만원)

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the profit/loss (손익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 712.40 with major ticks every 89.05. The y-axis represents the profit/loss, ranging from -0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid orange line starts at the origin (0, 0) and extends linearly to the point (712.40, 0.00).

가액 (Price)	손익 (백만) (Profit/Loss in millions)
0.00	-0.00
89.05	-0.00
178.10	-0.00
267.15	-0.00
356.20	-0.00
445.25	-0.00
534.30	-0.00
623.35	-0.00
712.40	0.00

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				100
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	66	66	66	66	66	66	66
8.00%	100	100	100	100	100	100	100

공시일 2022-04-08

기준일 2022-04-07

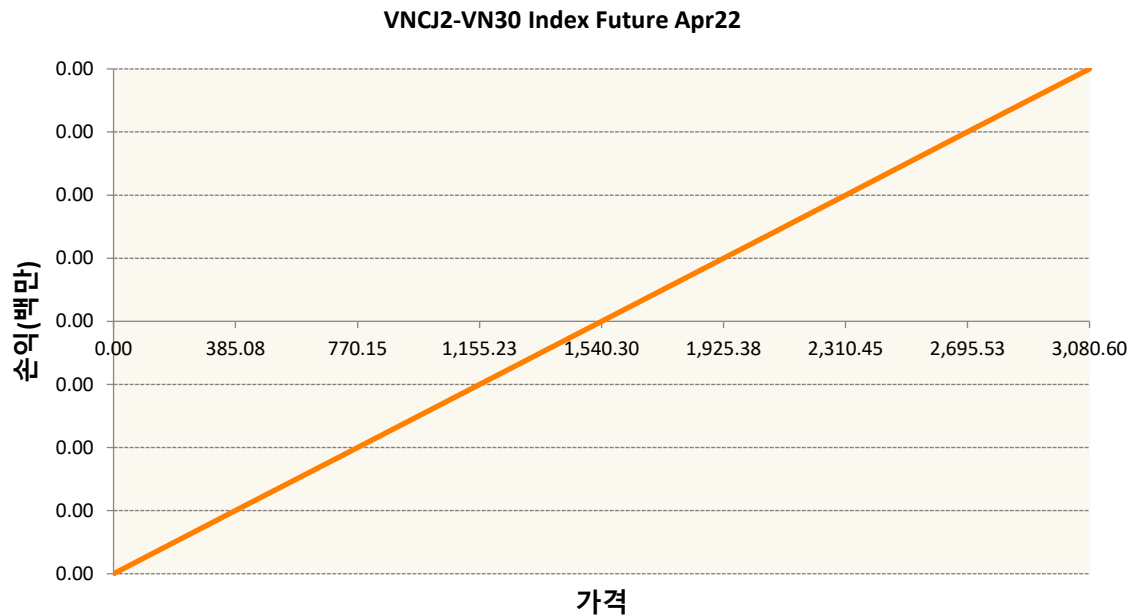
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	855	0	855	
누계	유가증권	스왑	1,820	0	1,820	장외
누계	통화	선도	0	1,172	-1,172	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	68

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

(단위:백만원)

271

공시일	2022-04-08
기준일	2022-04-07

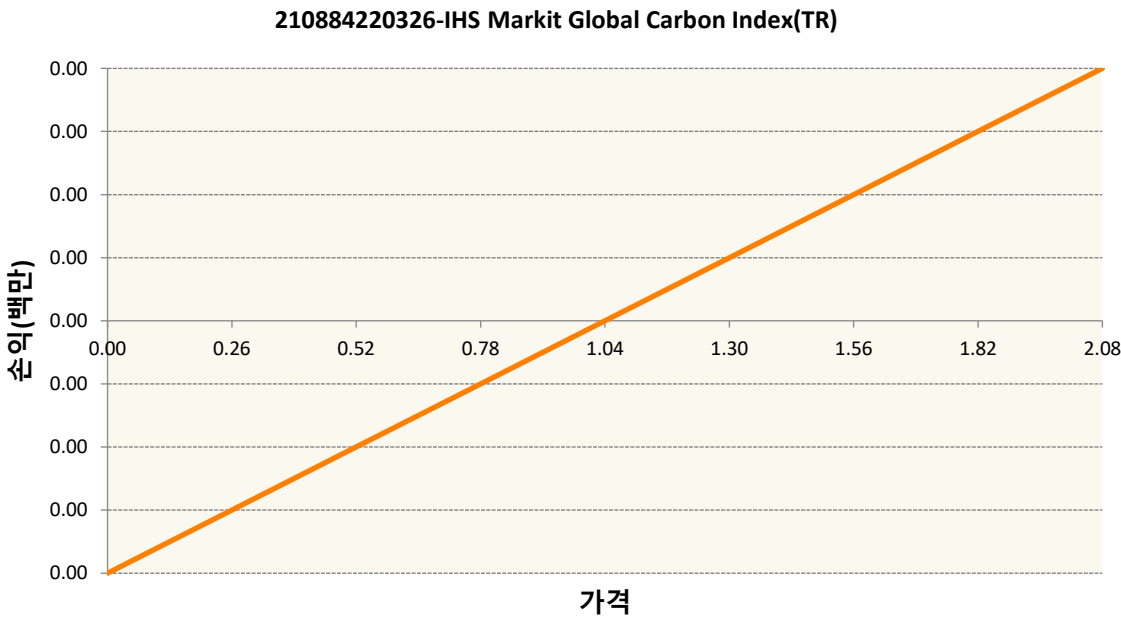
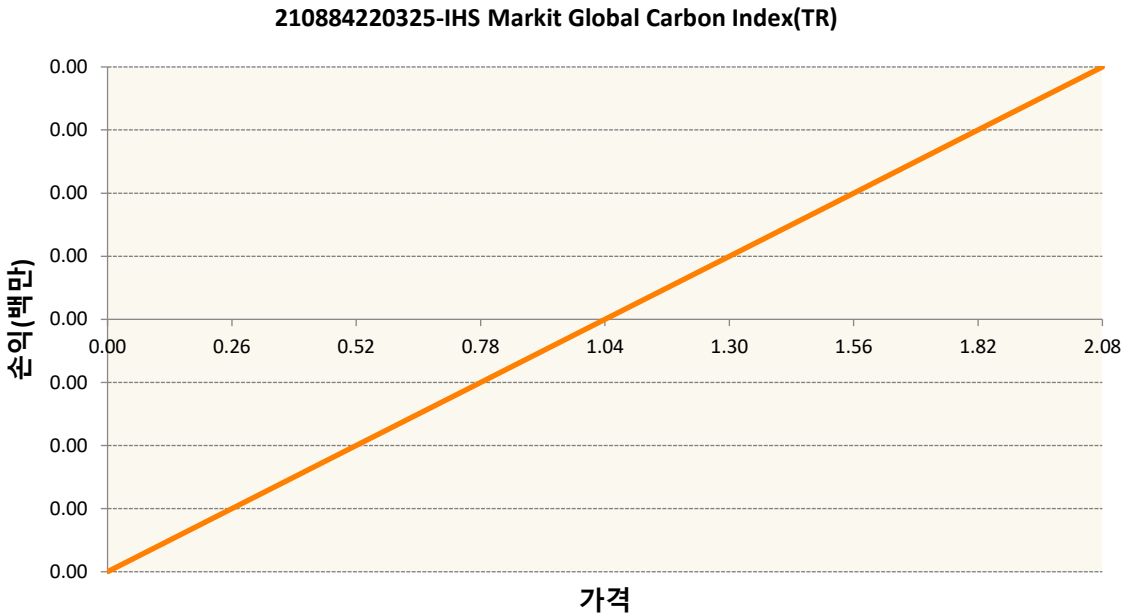
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

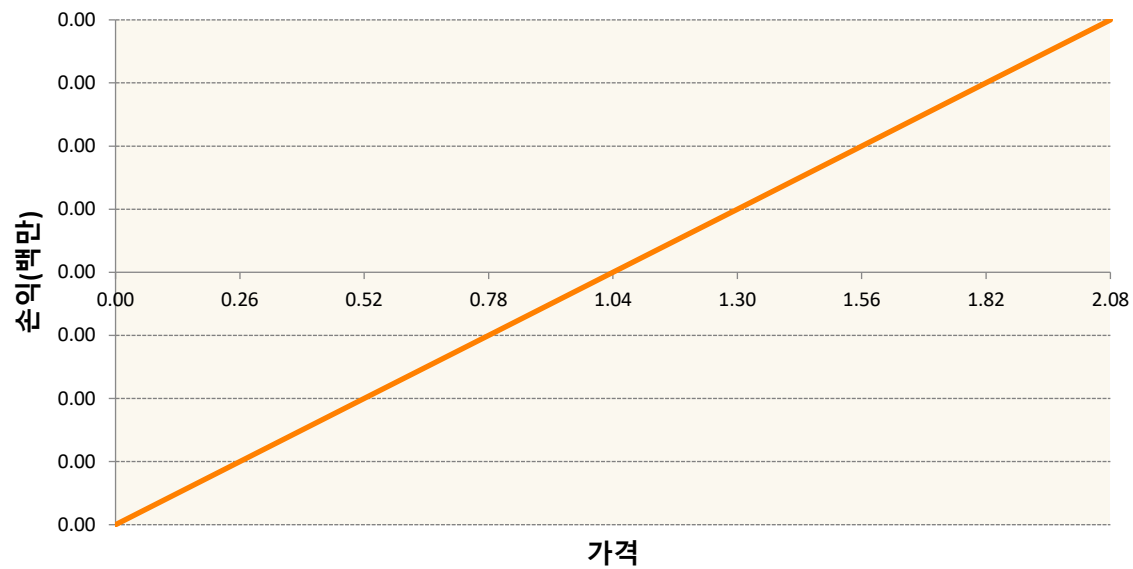
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	44,164	0	44,164	

2. 만기시점의 손익구조



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

186

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

3,239

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

93

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

(단위:백만원)

6,414

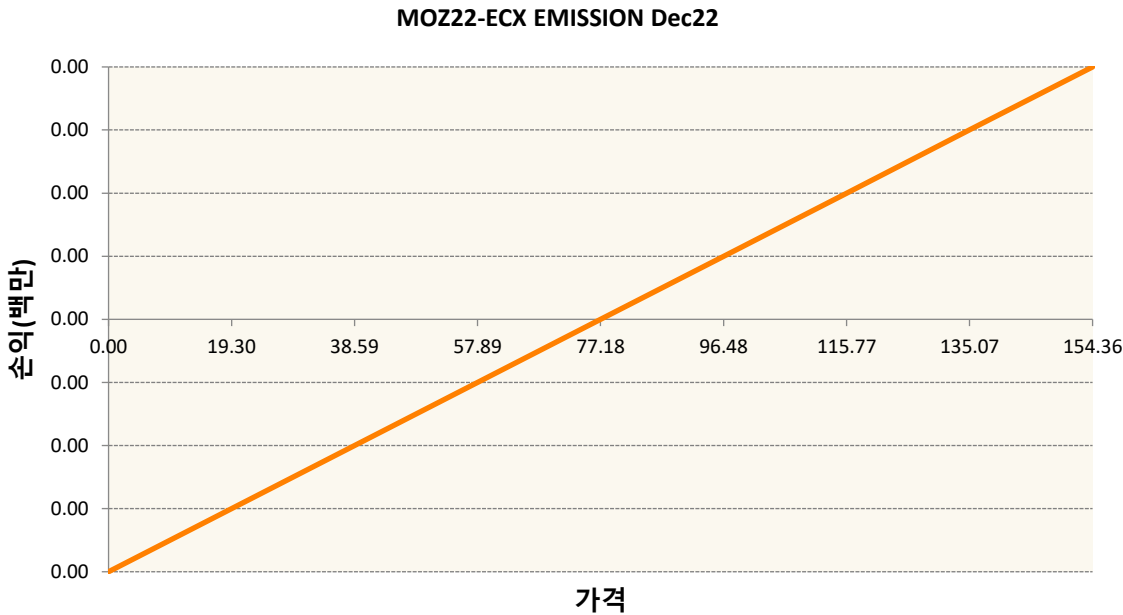
공시일	2022-04-08
기준일	2022-04-07

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	15,624	0	15,624	
누계	통화	선도	0	7,429	-7,429	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213C3V·KRW/EUR 25-04-22E			594
MOZ22	ECX EMISSION Dec22		1,250

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,293

공시일	2022-04-08
기준일	2022-04-07

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)	24
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	24
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	24
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	24

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

(단위:백만원)

180

공시일	2022-04-08
기준일	2022-04-07

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)	34
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	40
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	34
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	34

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

(단위:백만원)

175

공시일 2022-04-08

기준일 2022-04-07

에퀴티알파일반사모혼합자산

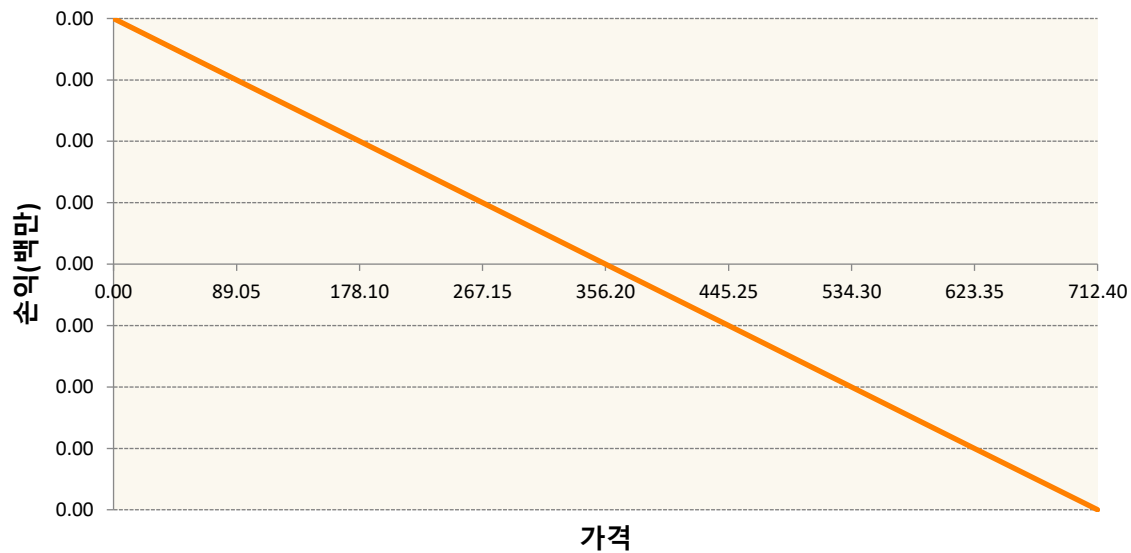
1. 계약금액

(단위:백만원)

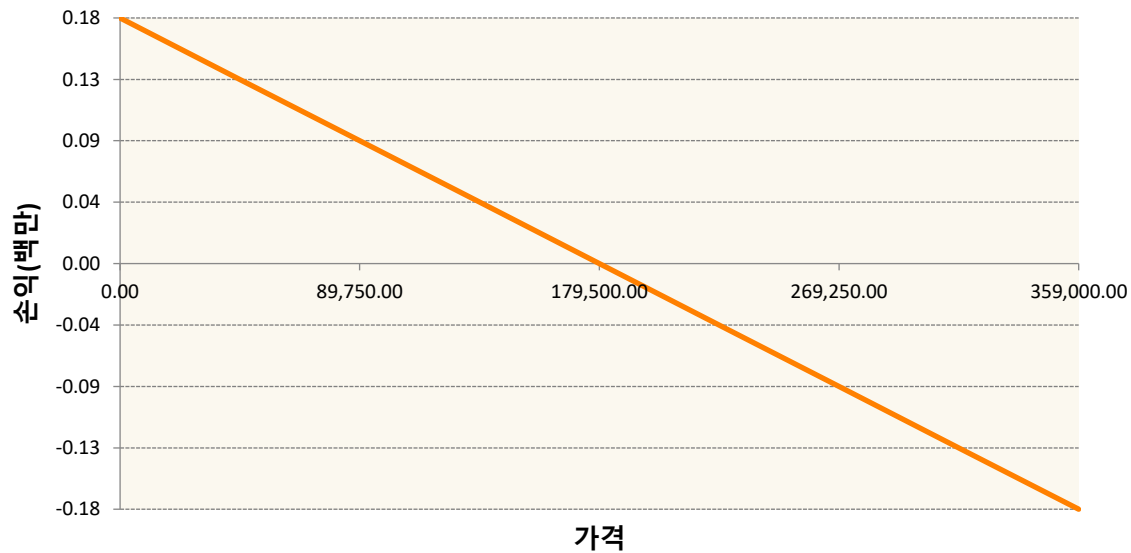
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,597	-1,597	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

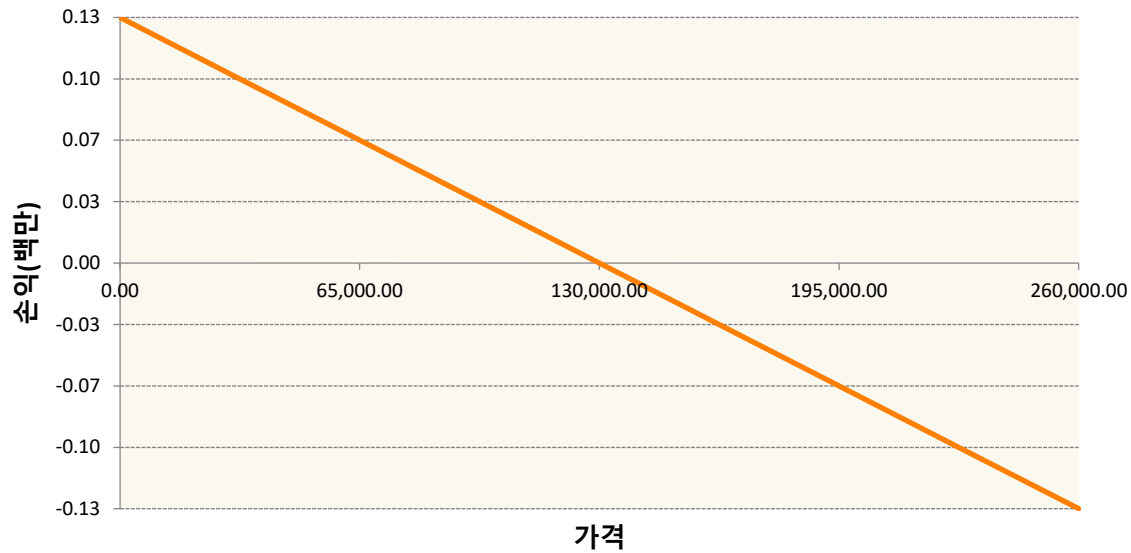
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4116S40008-2022-04 현대차개별선물



KR41ERS40006-2022-04 DL이앤씨개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물	107
KR4116S400 2022-04 현대차개별선물	9
KR41ERS400 2022-04 DL이앤씨개별선물	12
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322	1
KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322	1
KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	0.2
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331	2
KRS0003070 SWAP_SAMSUNG_0407	0.32
KRS0003070 SWAP_SAMSUNG_0407	0.02

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

(단위:백만원)

138

공시일 2022-04-08

기준일 2022-04-07

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

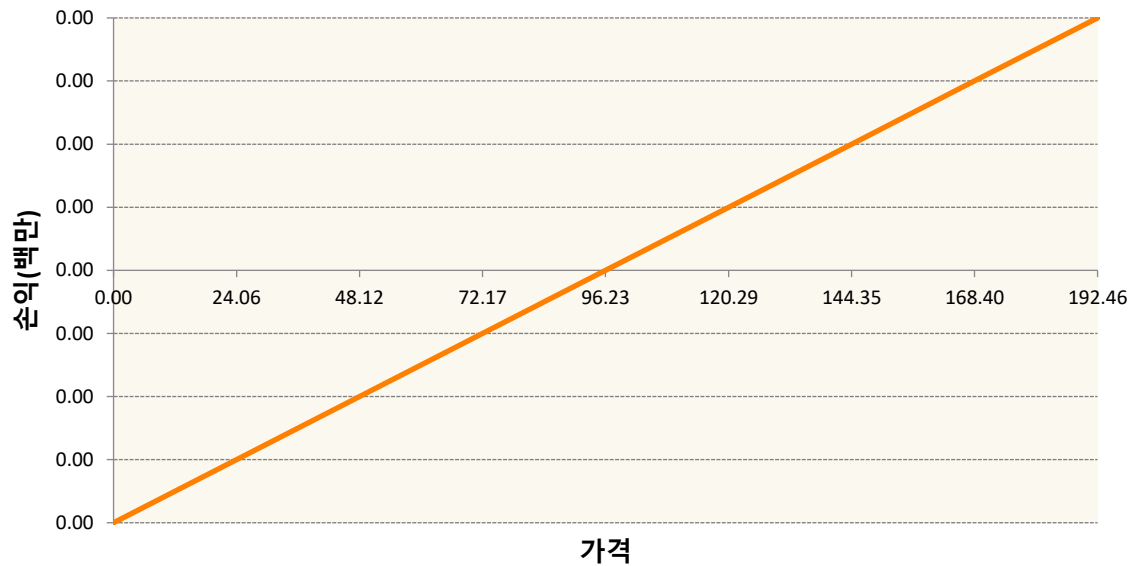
1. 계약금액

(단위:백만원)

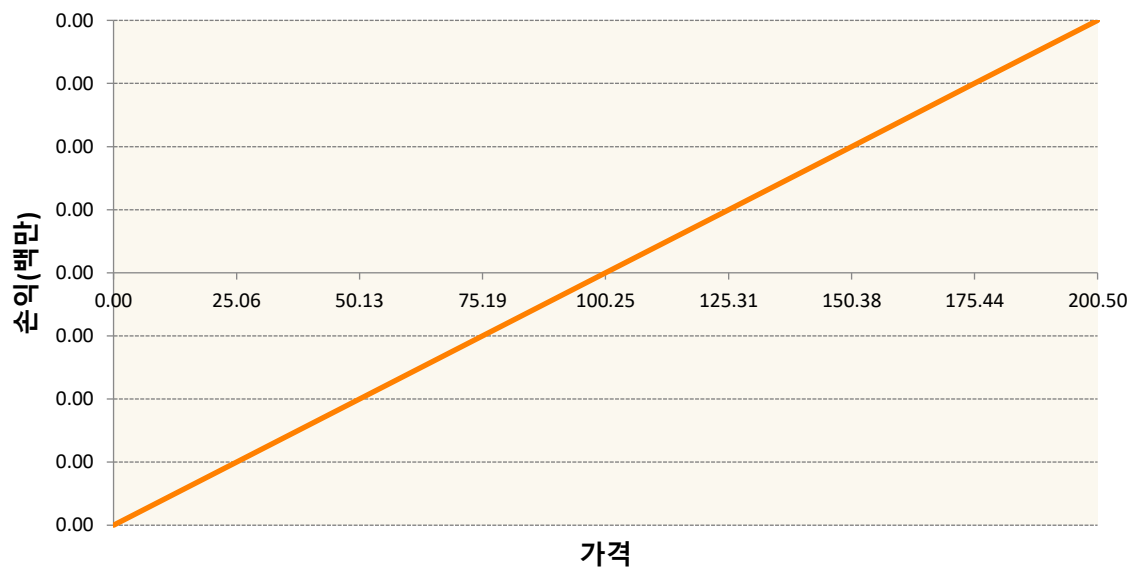
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,251	549	1,702	

2. 만기시점의 손익구조

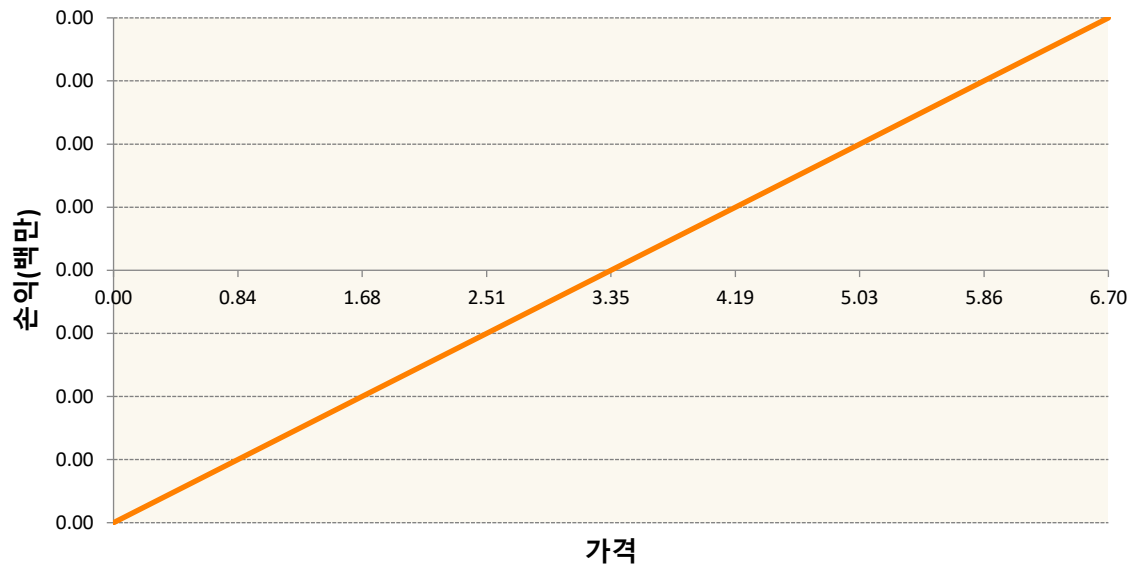
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



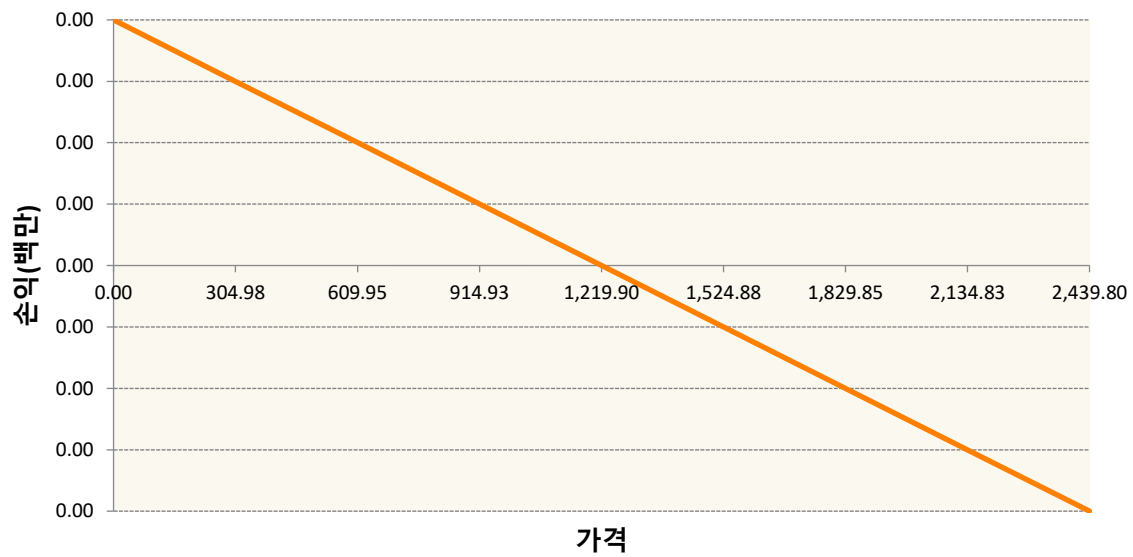
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



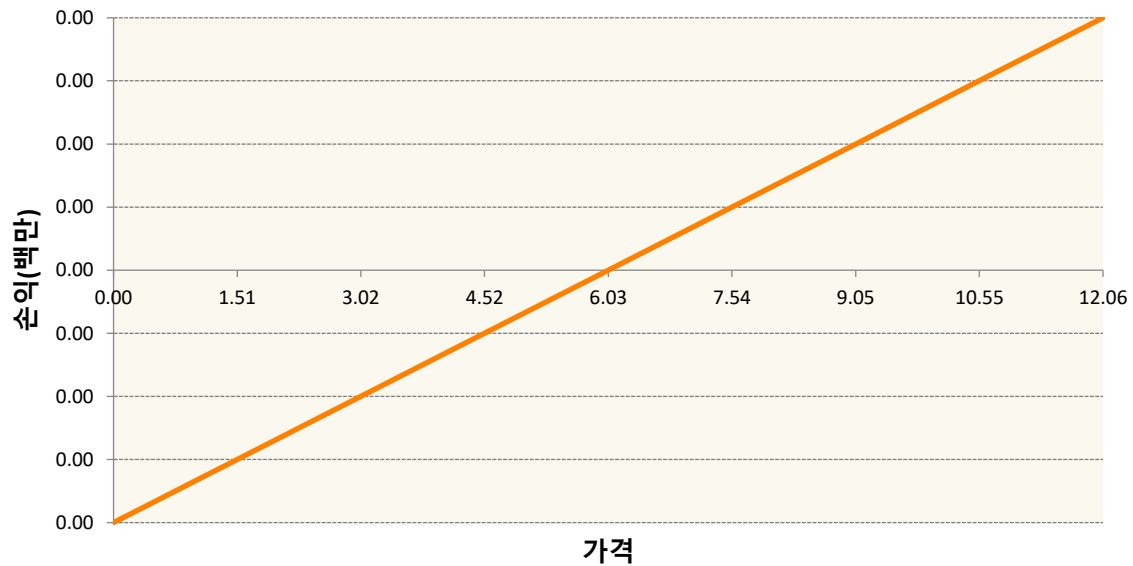
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

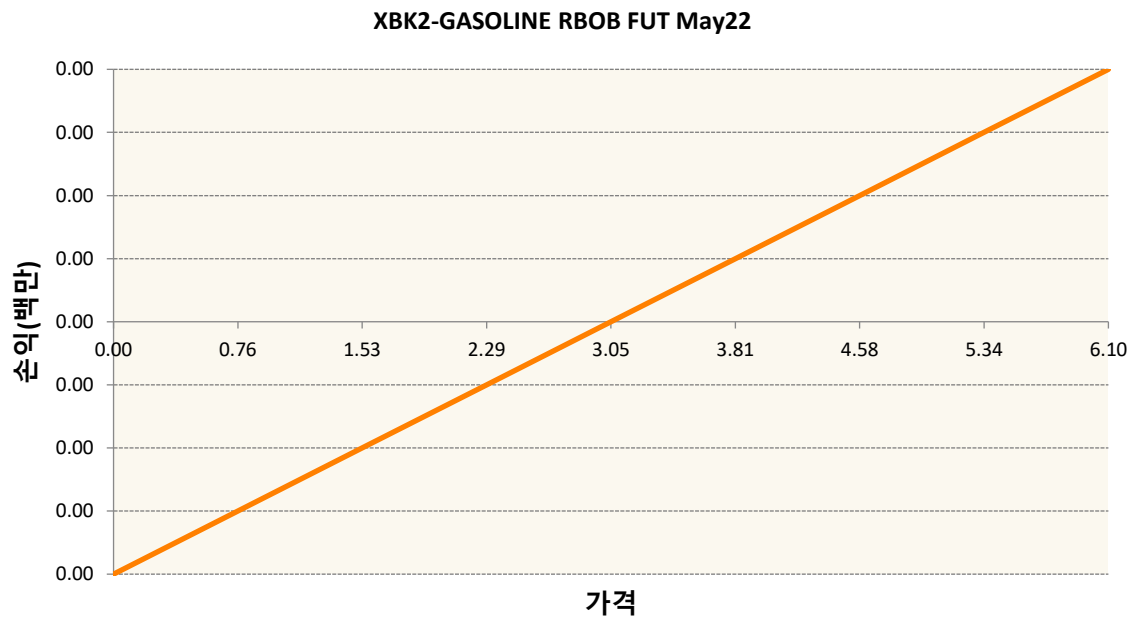
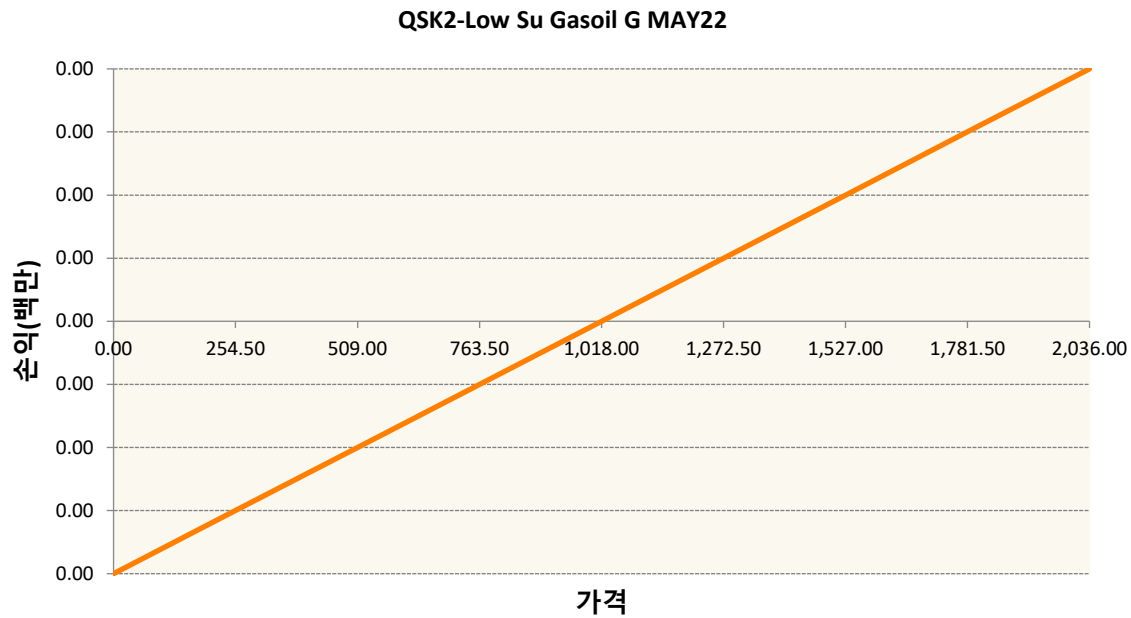


KR4175S40004-2022-04 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK2	WTI CRUDE FUTURE May22		37
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		40
HOK2	NY Harb ULSD Fut May22		14
KR4175S400 2022-04 달러선물			44
NGK22	NATURAL GAS FUTR May22		58
QSK2	Low Su Gasoil G MAY22		20
XBK2	GASOLINE RBOB FUT May22		12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		506