

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

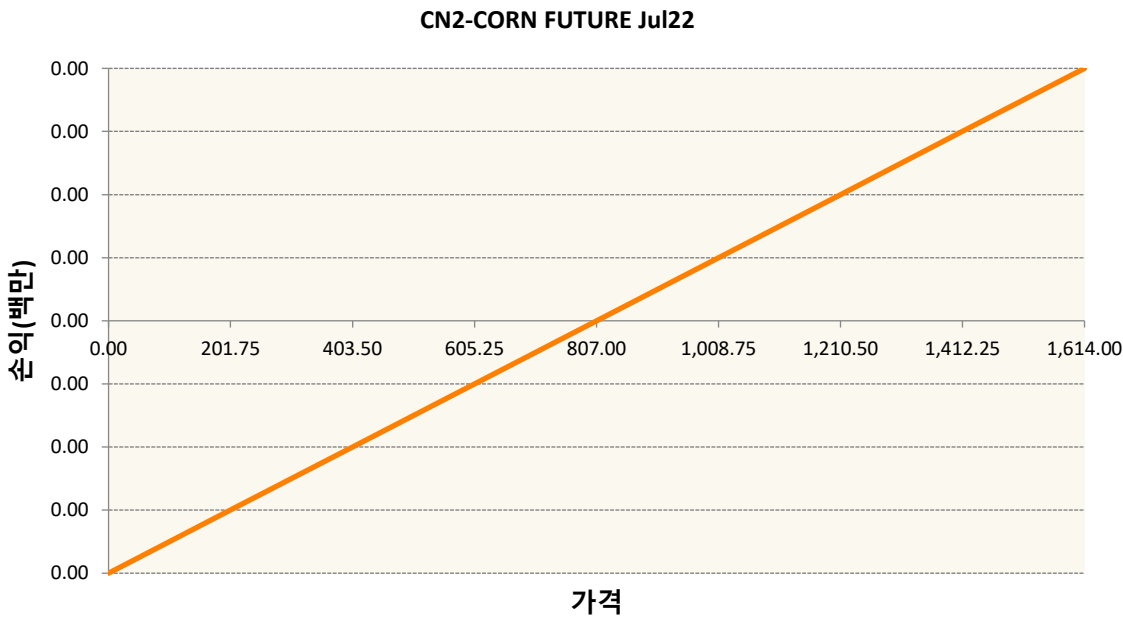
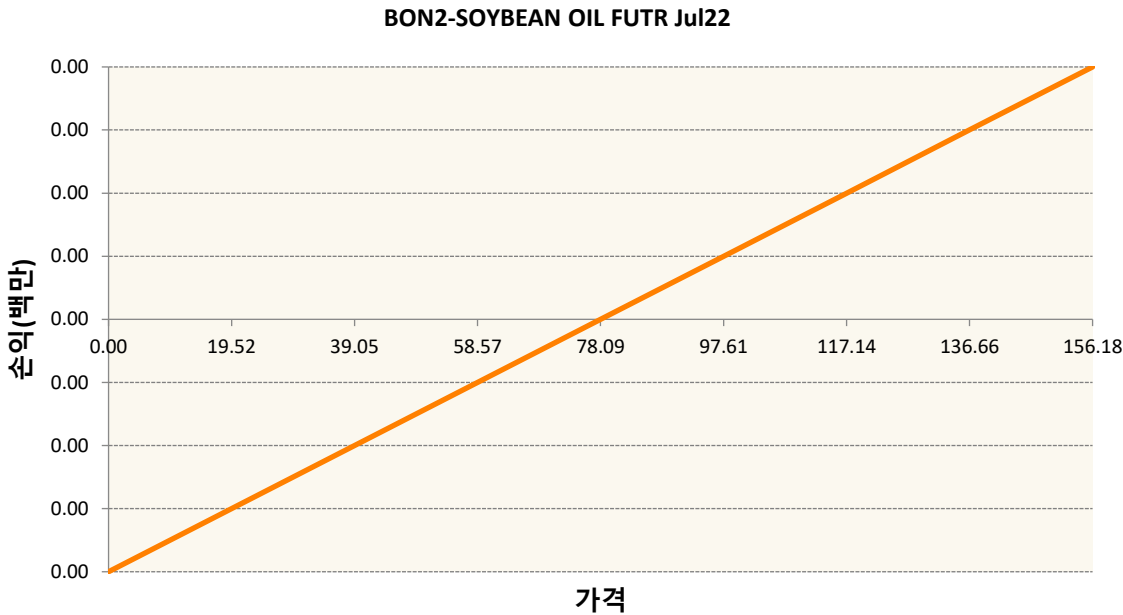
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

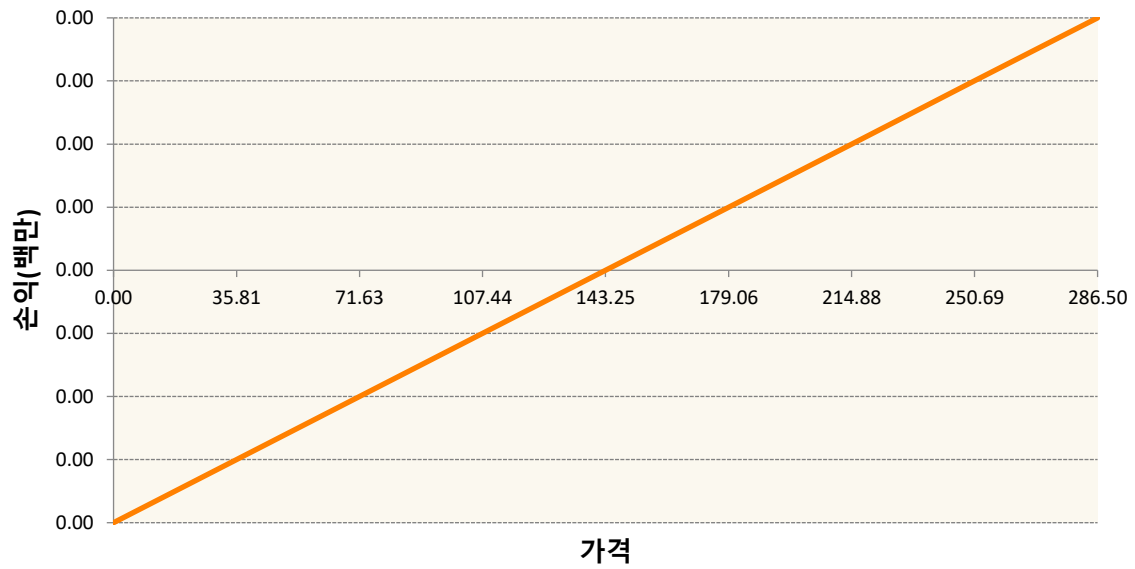
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,760	1,918	6,842	

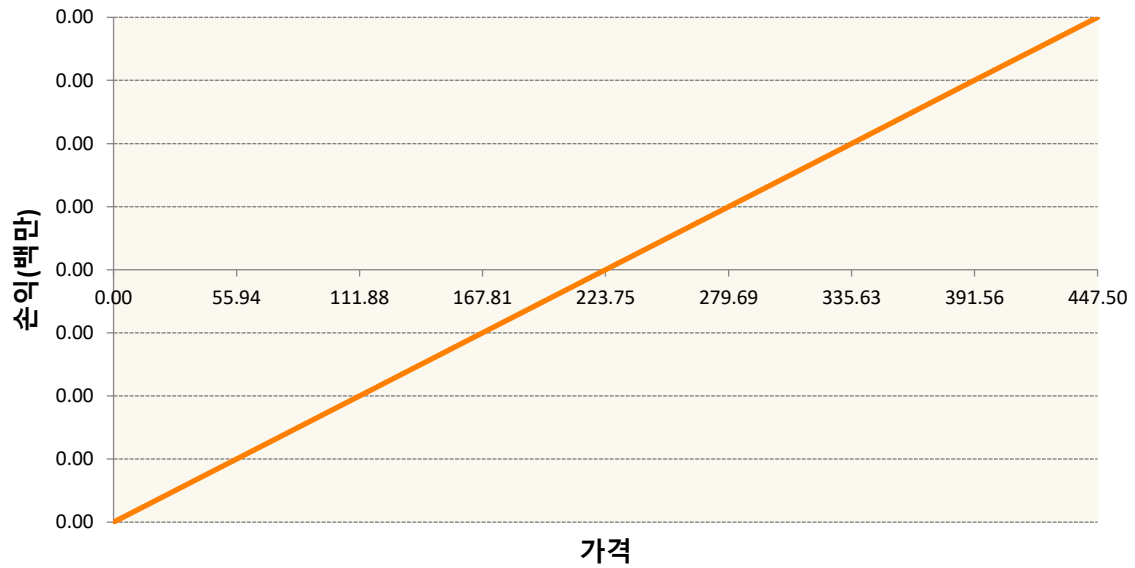
2. 만기시점의 손익구조



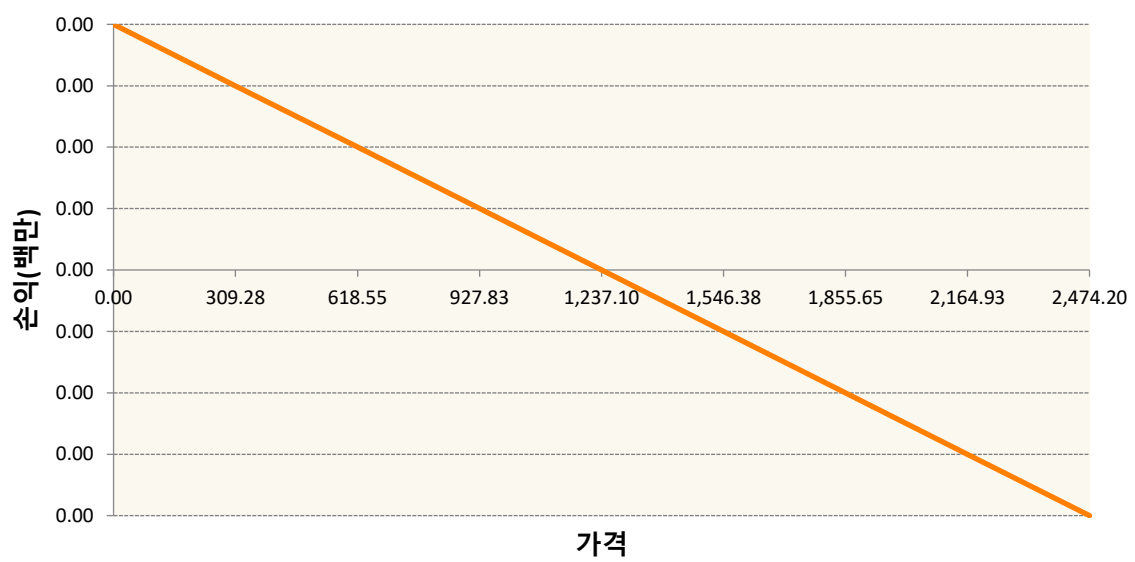
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



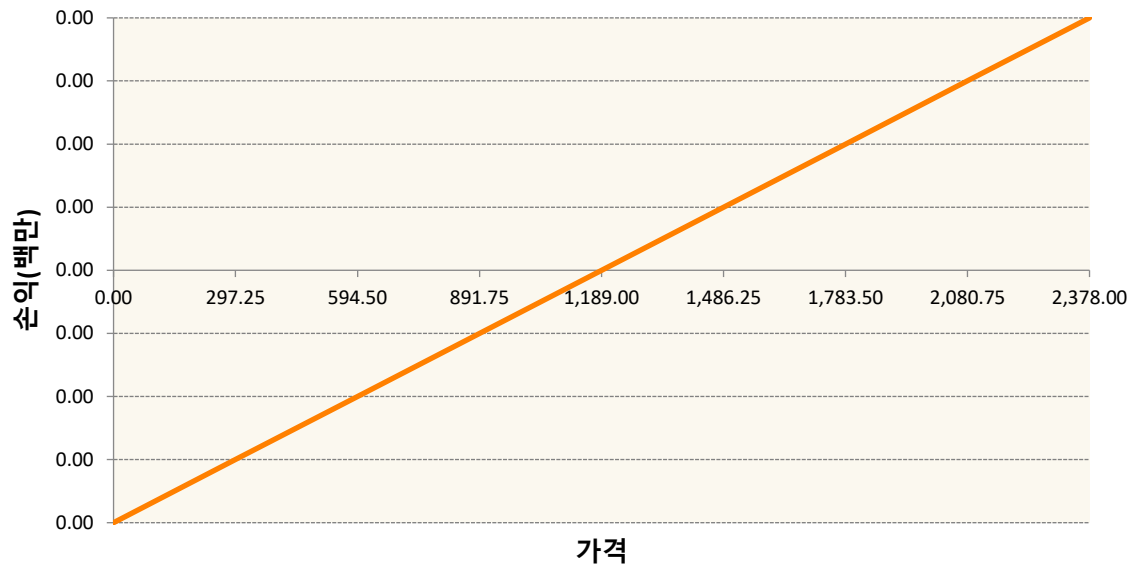
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



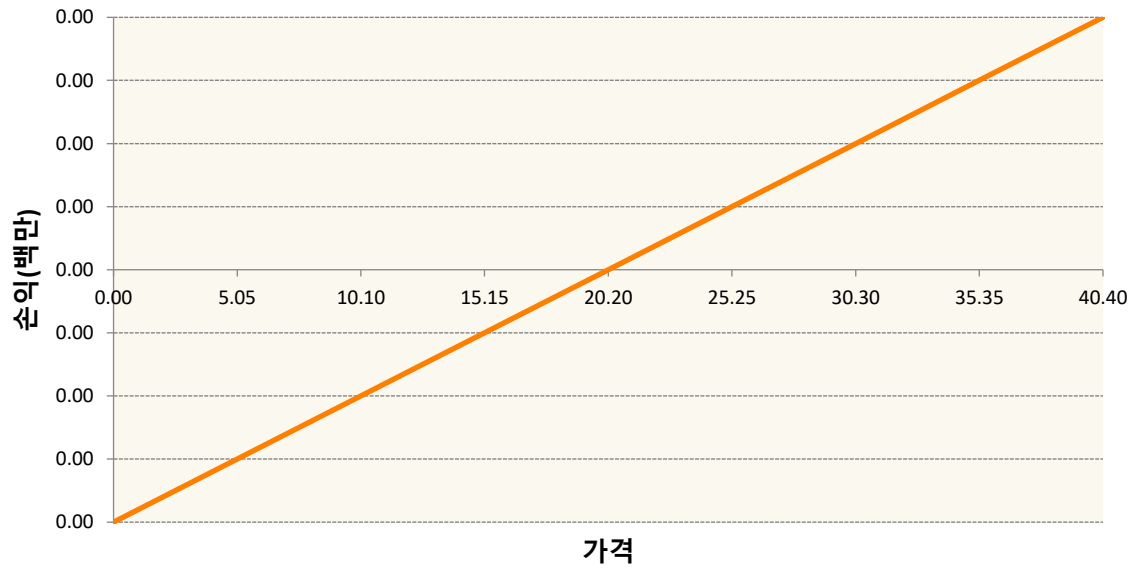
KR4175S50003-2022-05 달러선물



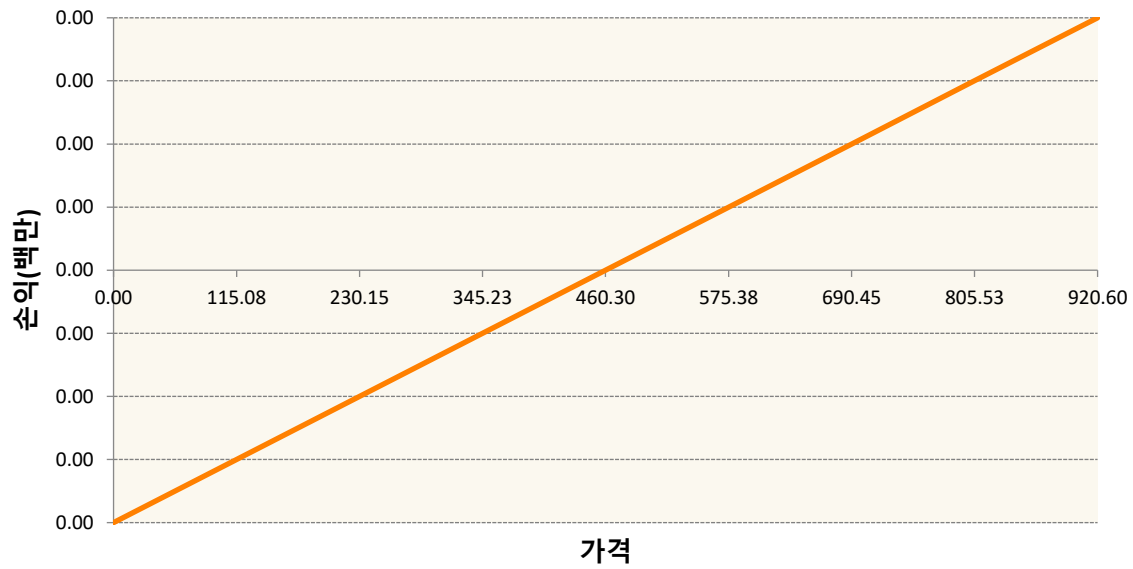
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22



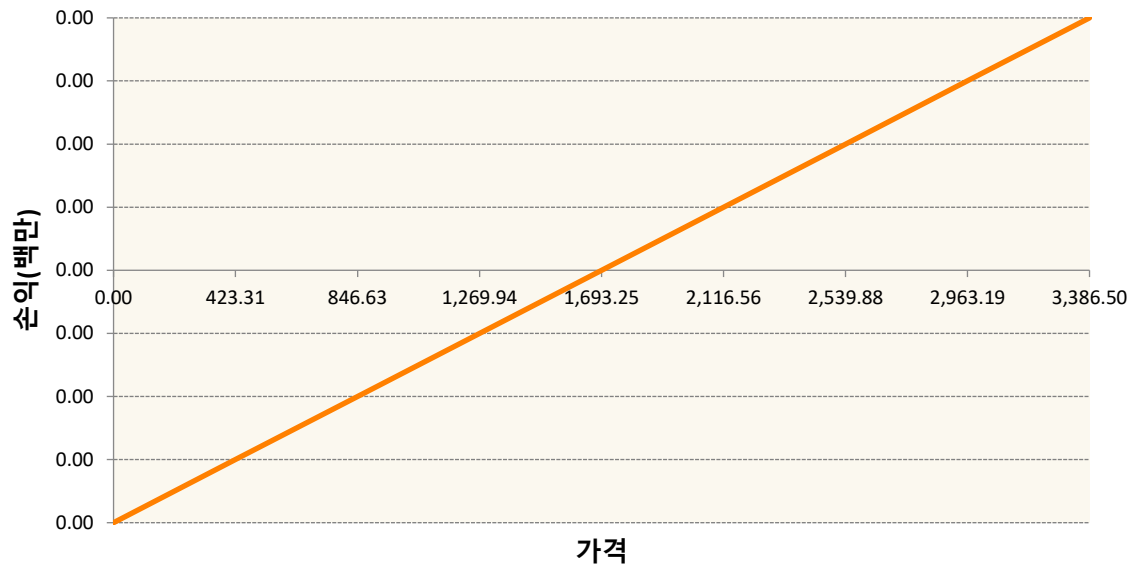
SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



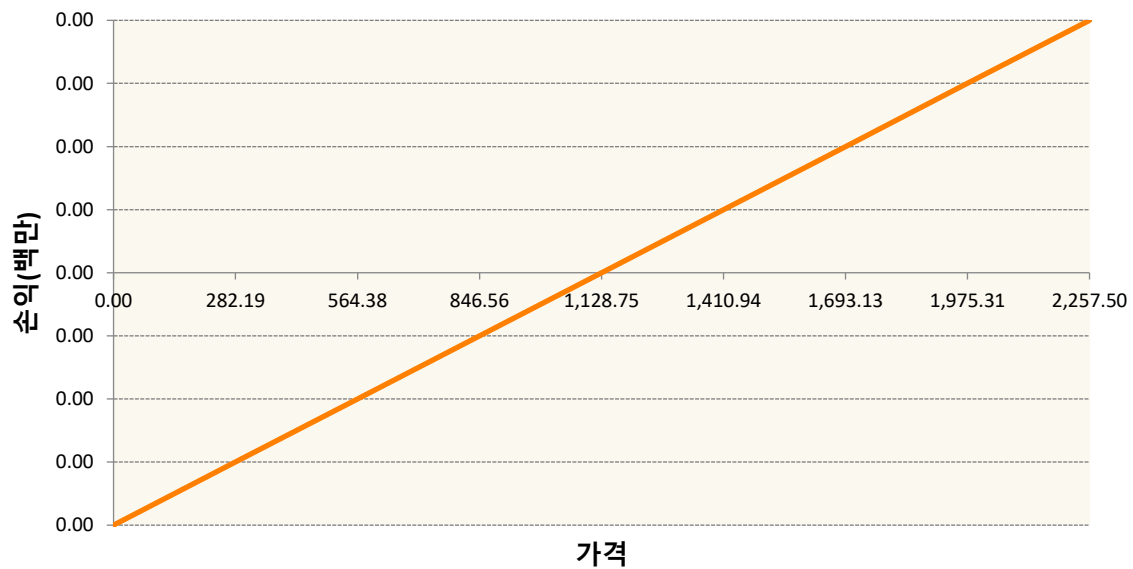
SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22



SN2-SOYBEAN FUTURE Jul22



WN2-WHEAT FUTURE(CBT) Jul22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

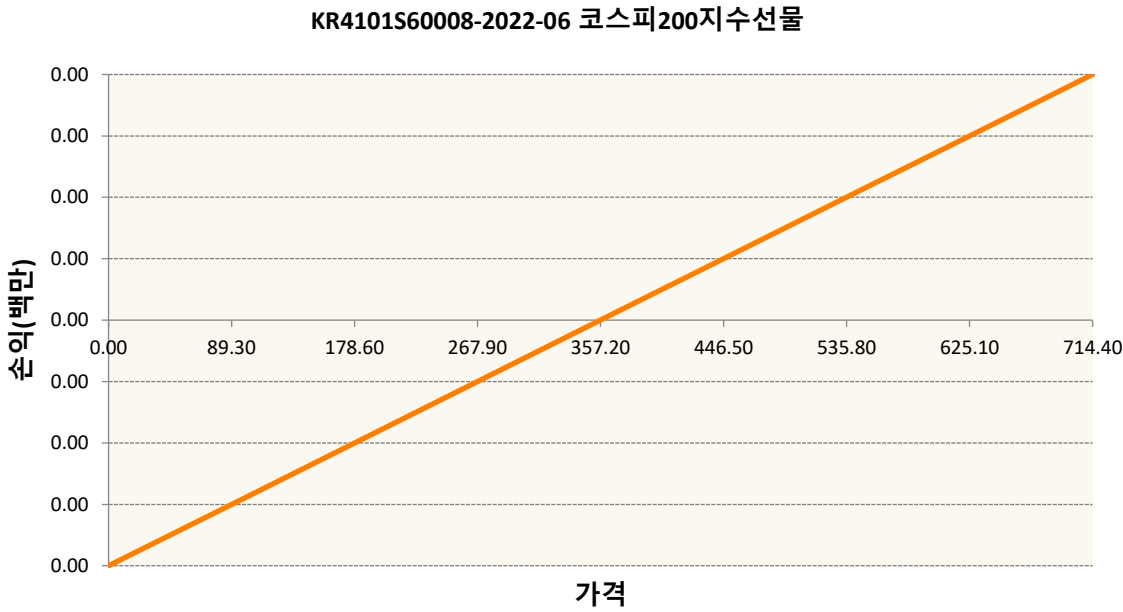
스마트인덱스모

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	1,607	0	1,607	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				129
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-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%	86	86	86	86	86	86	86
8.00%	129	129	129	129	129	129	129

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

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

375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

394

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-04-20

기준일 2022-04-19

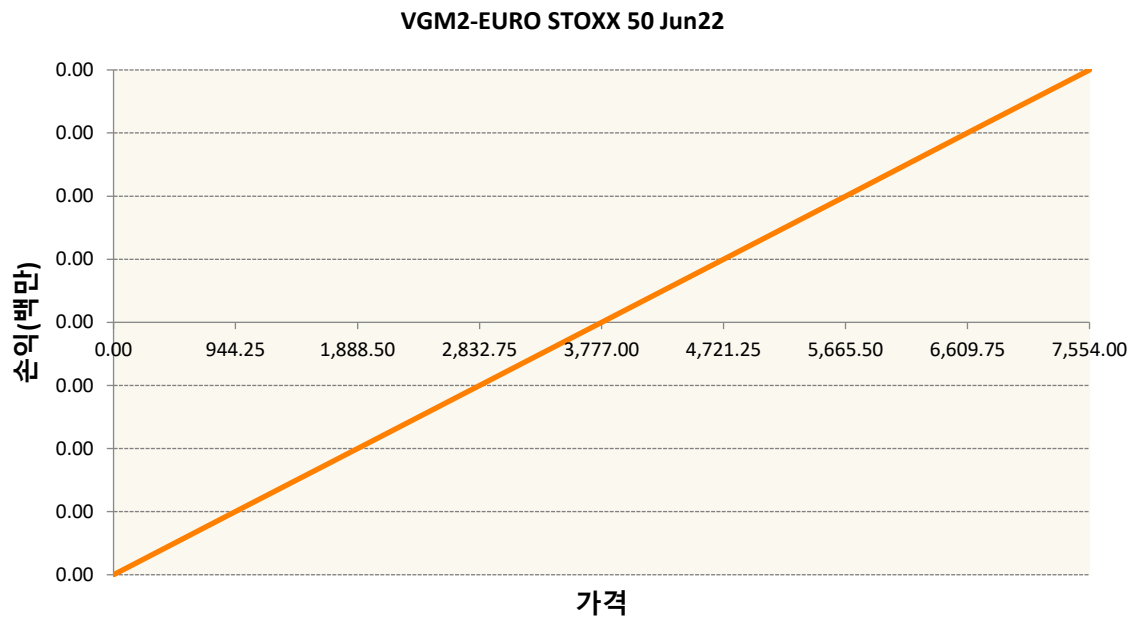
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	563	0	563	

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	2022-04-20
기준일	2022-04-19

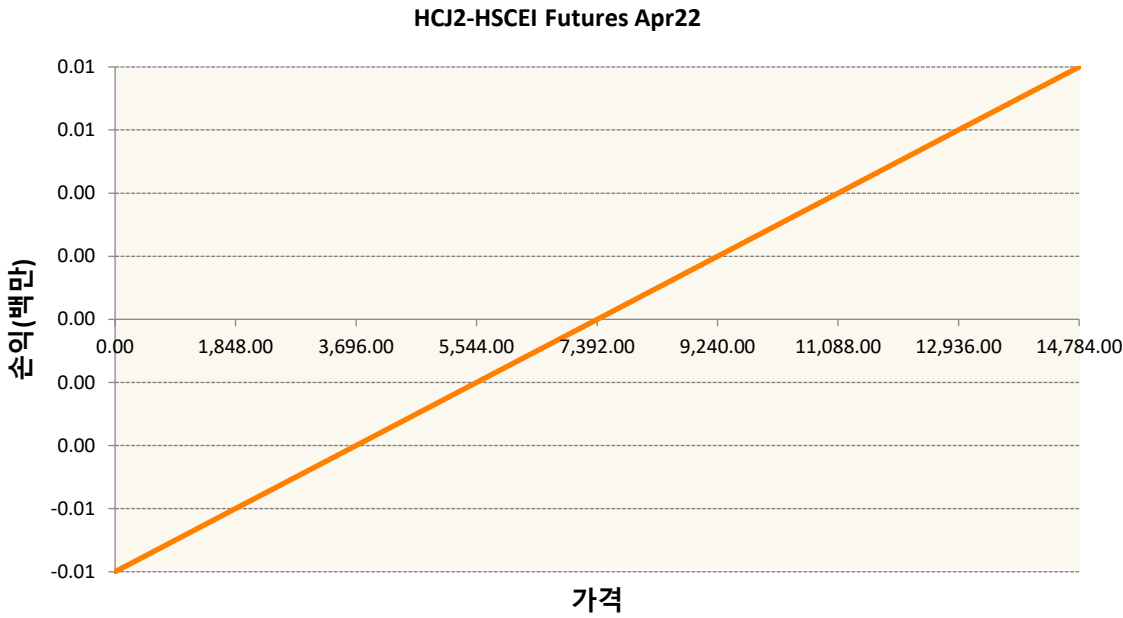
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,142	0	1,142	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI2	HSCEI Futures Apr22	91
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

123

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

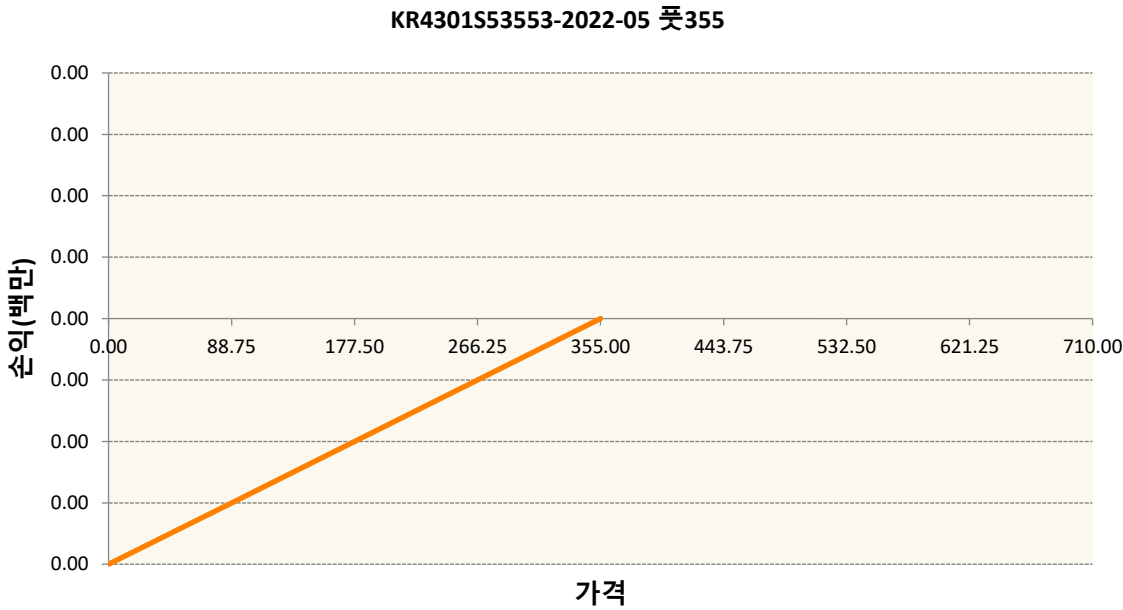
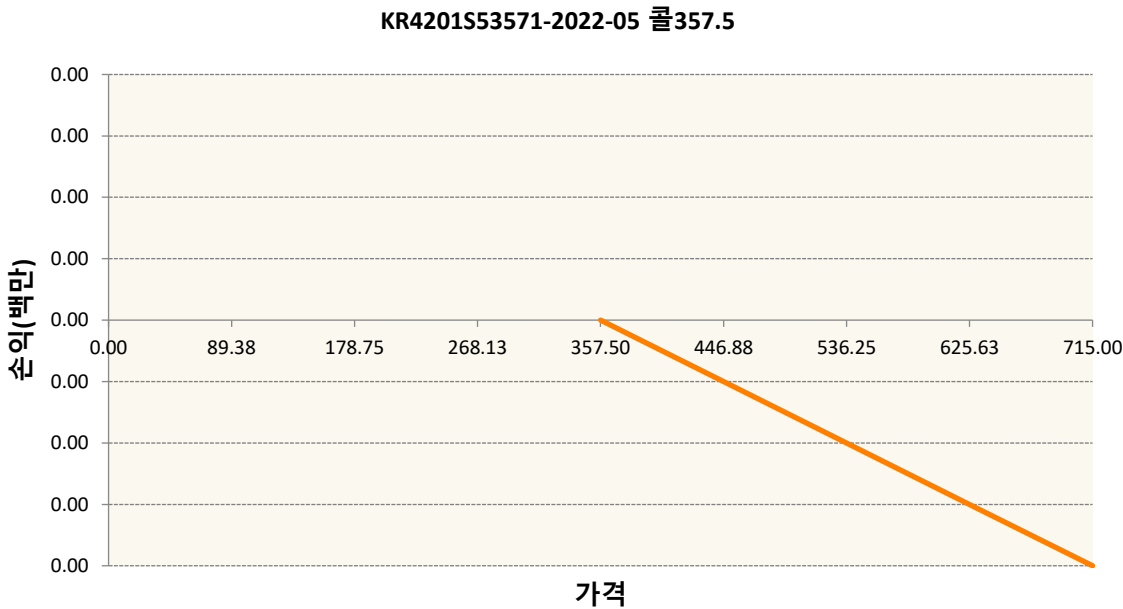
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

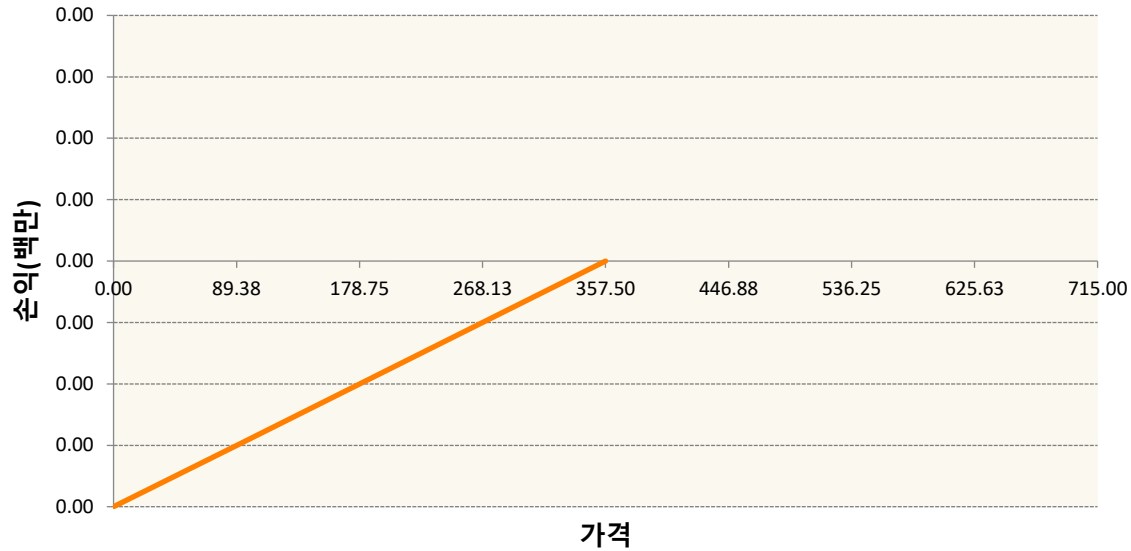
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	67,813	-67,813	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S53579-2022-05 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S53571			2022-05 콜357.5				3,402
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,550	1,503	1,445	1,379	1,306	1,227	1,142
-5.33%	1,381	1,295	1,202	1,103	1,000	892	782
-2.67%	1,024	903	779	654	527	398	269
0%	411	274	137	0	-137	-274	-411
2.67%	-479	-605	-733	-863	-994	-1,127	-1,260
5.33%	-1,610	-1,706	-1,808	-1,916	-2,029	-2,145	-2,264
8.00%	-2,911	-2,972	-3,043	-3,123	-3,210	-3,303	-3,402
KR4301S53553			2022-05 풋355				200
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-193	-194	-194	-195	-197	-198	-200
-5.33%	-109	-111	-113	-116	-118	-122	-125
-2.67%	-35	-40	-44	-48	-53	-57	-62
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	39	36	32	29	25	21	16
5.33%	47	46	44	42	40	37	34
8.00%	49	49	48	47	46	45	43
KR4301S53579			2022-05 풋357.5				568
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-554	-555	-556	-558	-561	-564	-568
-5.33%	-322	-326	-331	-337	-344	-351	-359
-2.67%	-113	-123	-134	-145	-156	-168	-179
0%	40	27	13	0	-13	-27	-40

2.67%	124	113	102	91	79	67	55
5.33%	154	149	143	137	129	121	112
8.00%	162	160	158	155	151	147	142

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

(단위:백만원)

4,018

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	2,001	-2,001	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	17
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

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

(단위:백만원)

111

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

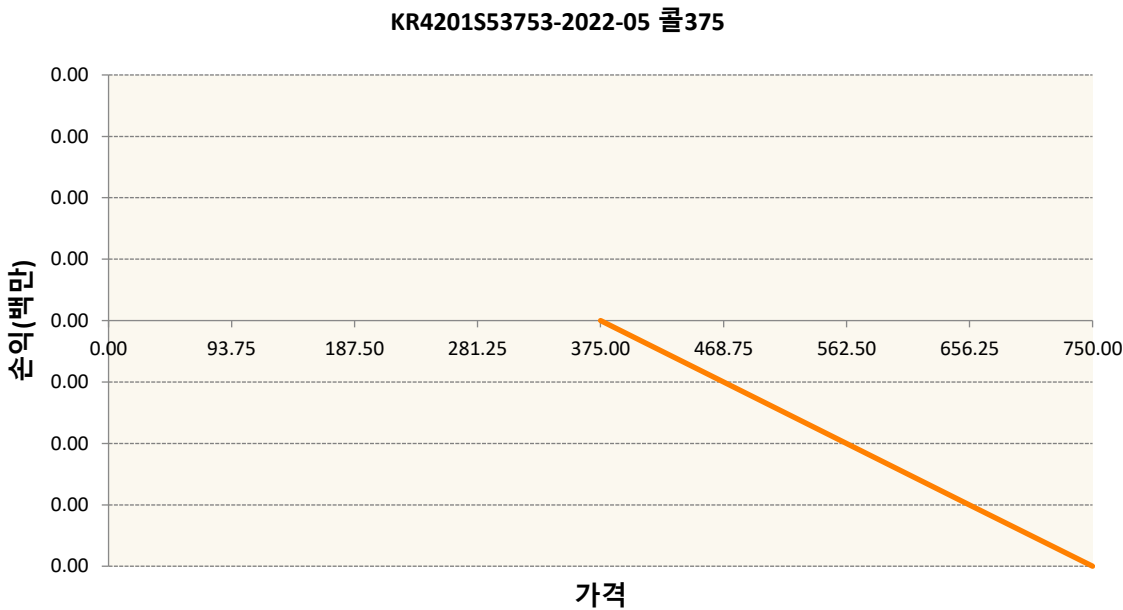
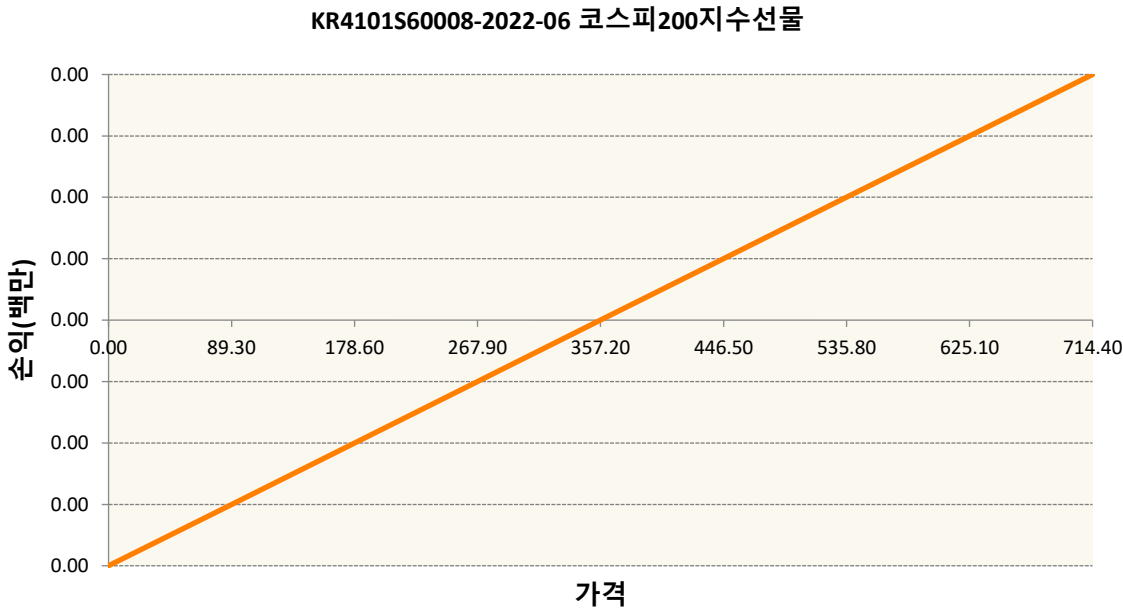
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

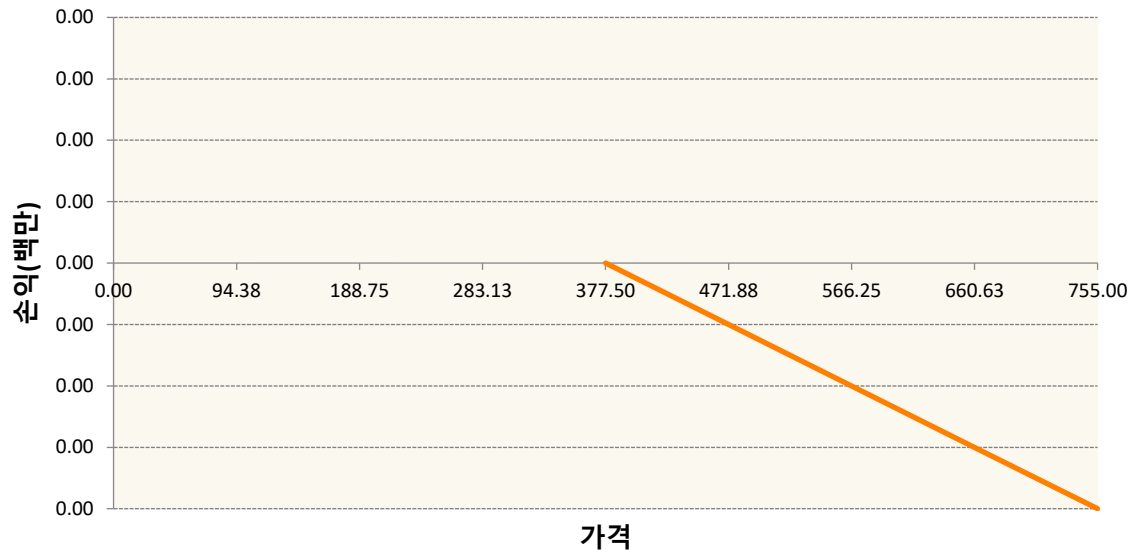
(단위:백만원)

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	625	0	625	장내
누계	유가증권	옵션	268	4,878	-4,610	장내

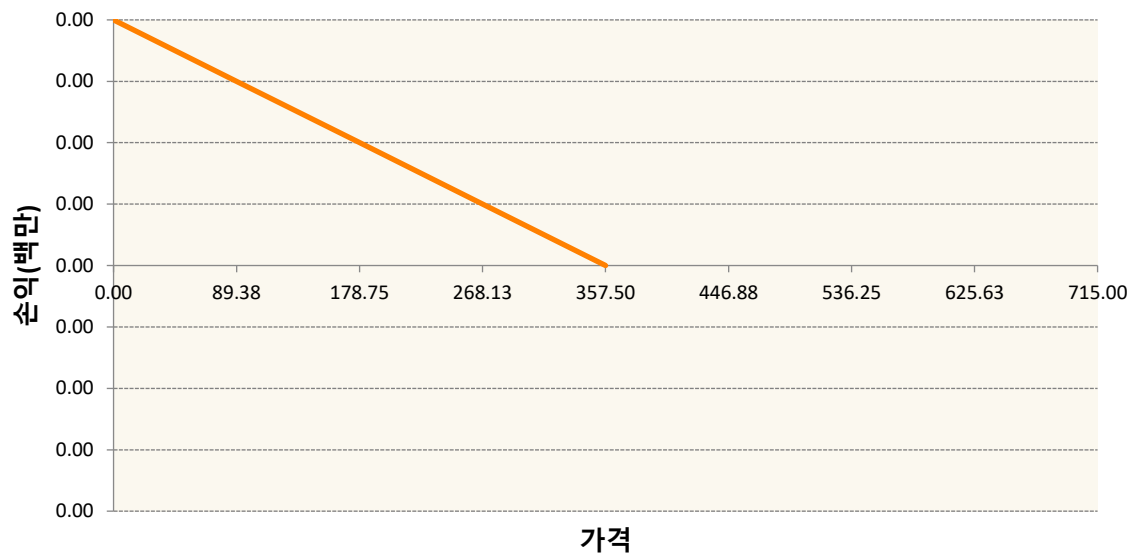
2. 만기시점의 손익구조



KR4201S53779-2022-05 콜377.5



KR4301S53579-2022-05 ㄱ357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008				2022-06 코스피200지수선물				50
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	17	17	17	17	17	17	17	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	50	50	50	50	50	50	50	
KR4201S53753				2022-05 콜375				188
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	49	48	47	45	43	40	36
-5.33%	47	45	42	38	34	29	24
-2.67%	40	35	30	24	18	11	3
0%	24	17	8	0	-9	-18	-27
2.67%	-7	-17	-27	-37	-48	-58	-68
5.33%	-57	-68	-79	-90	-100	-111	-122
8.00%	-127	-137	-147	-157	-167	-177	-188

KR4201S53779

2022-05 콜377.5

19

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	4	4	4	4	4	3
-5.33%	4	4	4	4	3	3	2
-2.67%	4	3	3	2	2	1	0
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	0	-1	-3	-4	-5	-6	-7
5.33%	-5	-6	-8	-9	-10	-11	-12
8.00%	-12	-13	-14	-15	-17	-18	-19

KR4301S53579

2022-05 풋357.5

17

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	10	10	10	10	10	11	11
-2.67%	3	4	4	4	5	5	5
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-3	-3	-3	-2	-2	-2
5.33%	-5	-4	-4	-4	-4	-4	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-4	-4

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

(단위:백만원)

223

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

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	9,499	0	9,499	

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	2022-04-20
기준일	2022-04-19

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	7,445	0	7,445	

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	2022-04-20
기준일	2022-04-19

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	24,502	0	24,502	
누계	통화	선도	3,216	28,115	-24,899	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E	2,249
FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E	40
FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E	99
FXW213C4B USD/KRW 25-04-22E	119
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

850

공시일 2022-04-20

기준일 2022-04-19

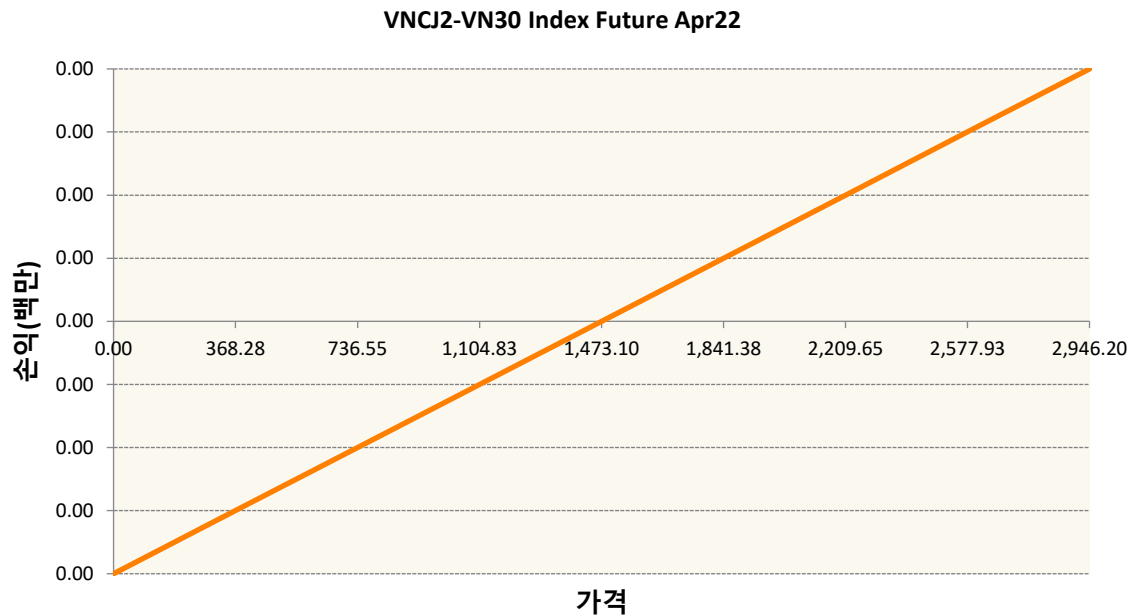
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	811	0	811	
누계	유가증권	스왑	1,823	0	1,823	장외
누계	통화	선도	0	1,174	-1,174	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	65

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

(단위:백만원)

268

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

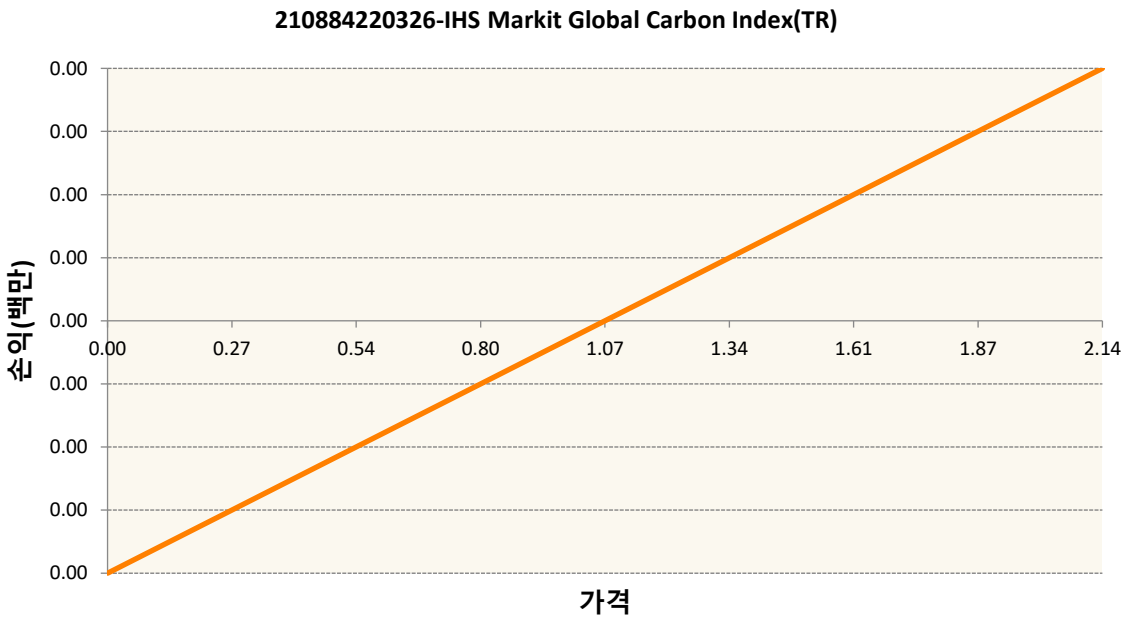
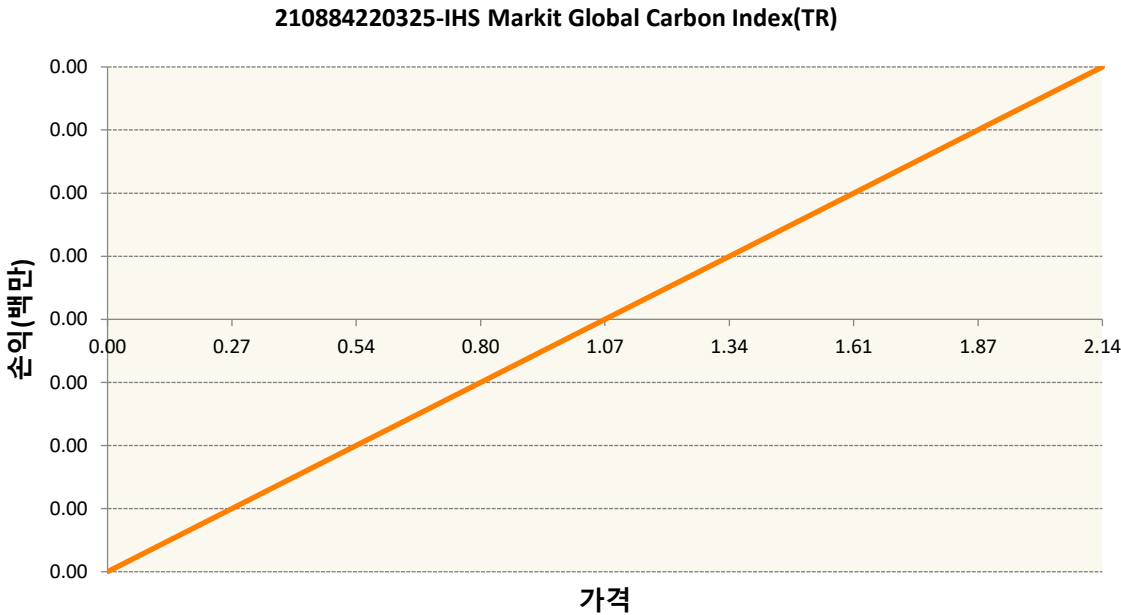
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

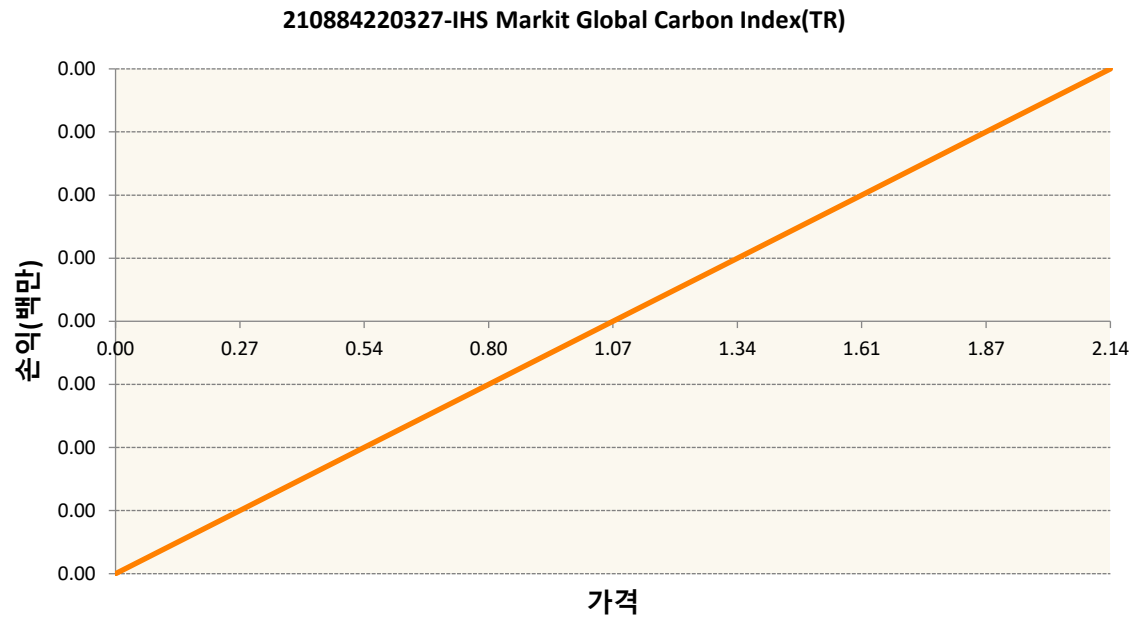
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	45,438	0	45,438	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		192
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		3,358
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		96

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		6,638

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

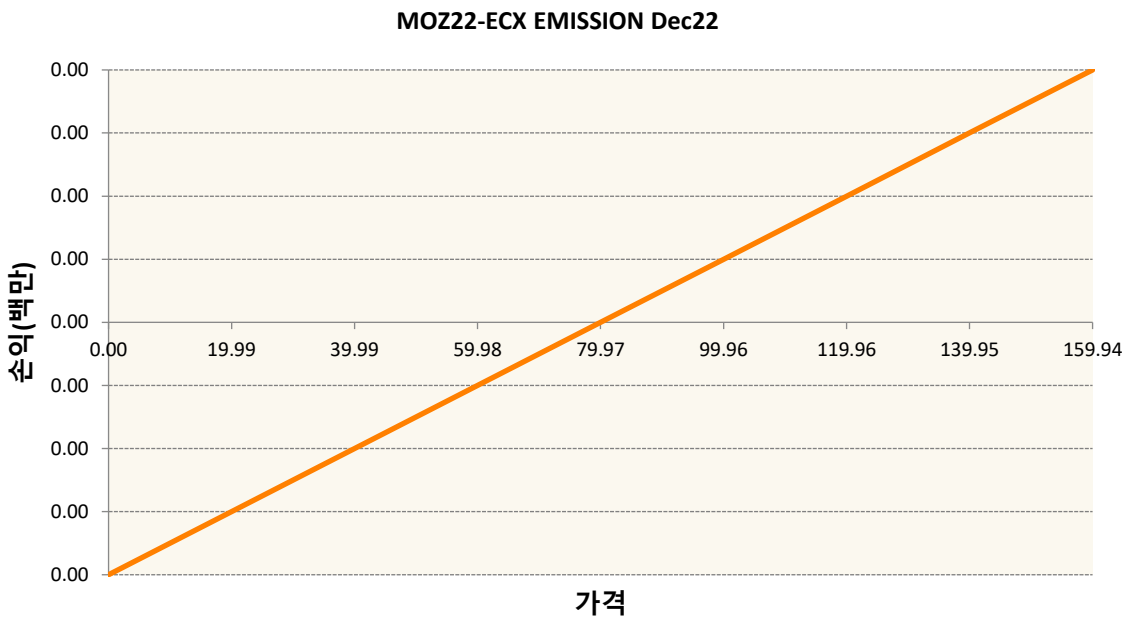
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	16,185	0	16,185	
누계	통화	선도	0	7,442	-7,442	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C3V·KRW/EUR 25-04-22E	595
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,295

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

(단위:백만원)

3,397

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

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)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	32

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

(단위:백만원)

240

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

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	8,439	0	8,439	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	3

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

(단위:백만원)

14

공시일 2022-04-20

기준일 2022-04-19

에쿼티알파일반사모혼합자산

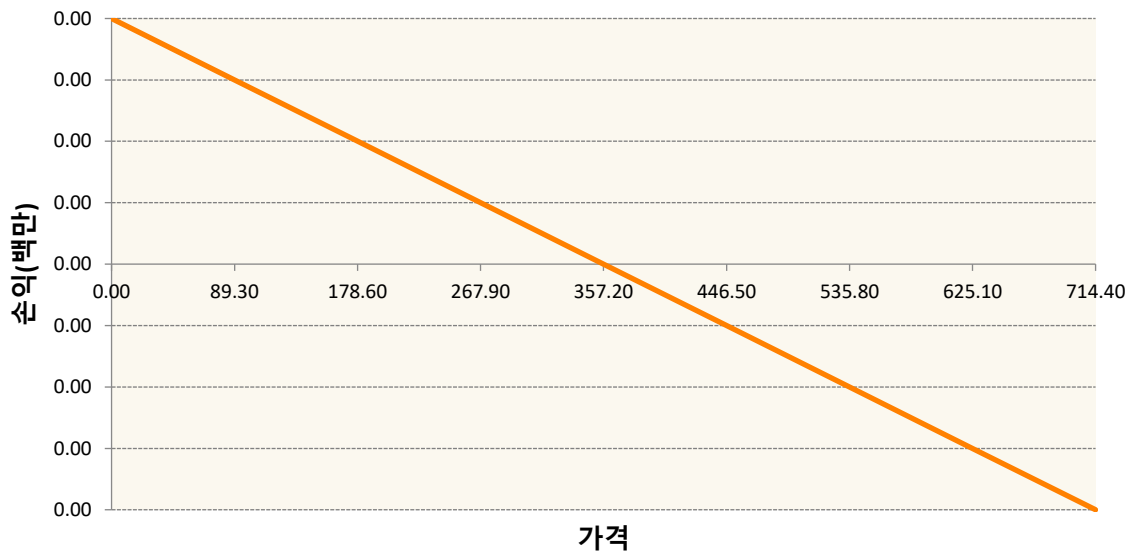
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	894	-894	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,786	-1,786	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물	143
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322	0
KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322	0
KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	0
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331	0
KRS0003070 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0407	0
KRS0003070 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0407	0
KRS0003086 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0412	0

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

(단위:백만원)

공시일 2022-04-20

기준일 2022-04-19

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

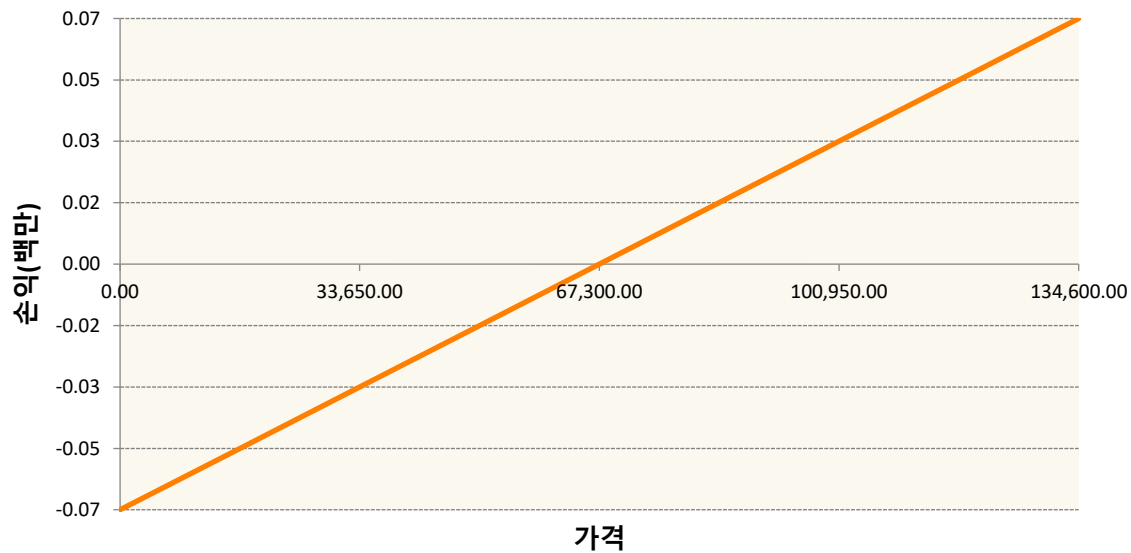
1. 계약금액

(단위:백만원)

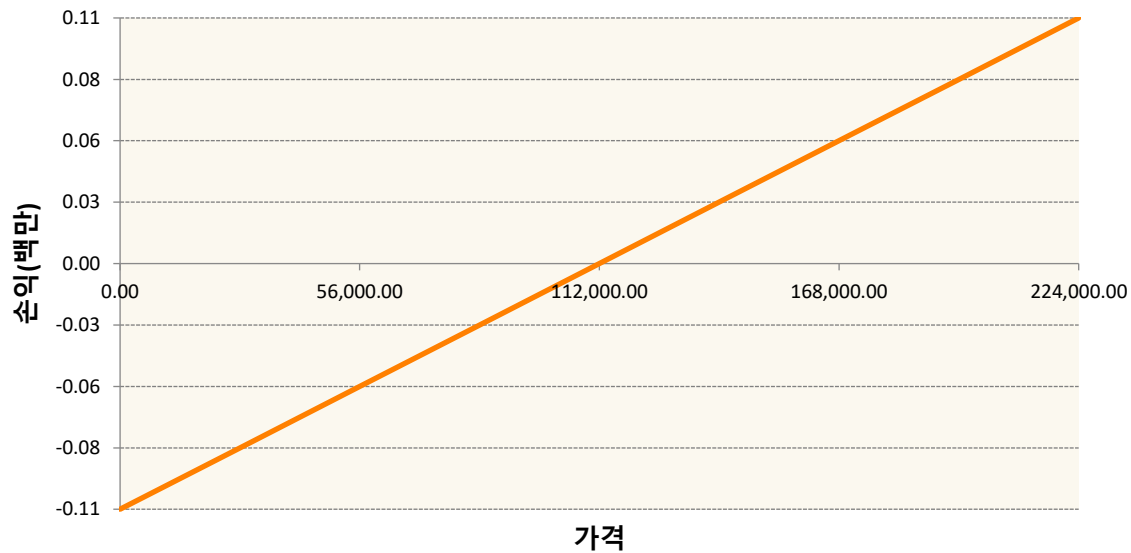
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	891	0	891	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S50008-2022-05 삼성전자개별선물



KR4150S50006-2022-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S50008		2022-05 삼성전자개별선물					35
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-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%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	35	35	35	35	35	35	35
KR4150S50006		2022-05 SK하이닉스개별선물					37
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-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%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

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

77

공시일	2022-04-20
기준일	2022-04-19

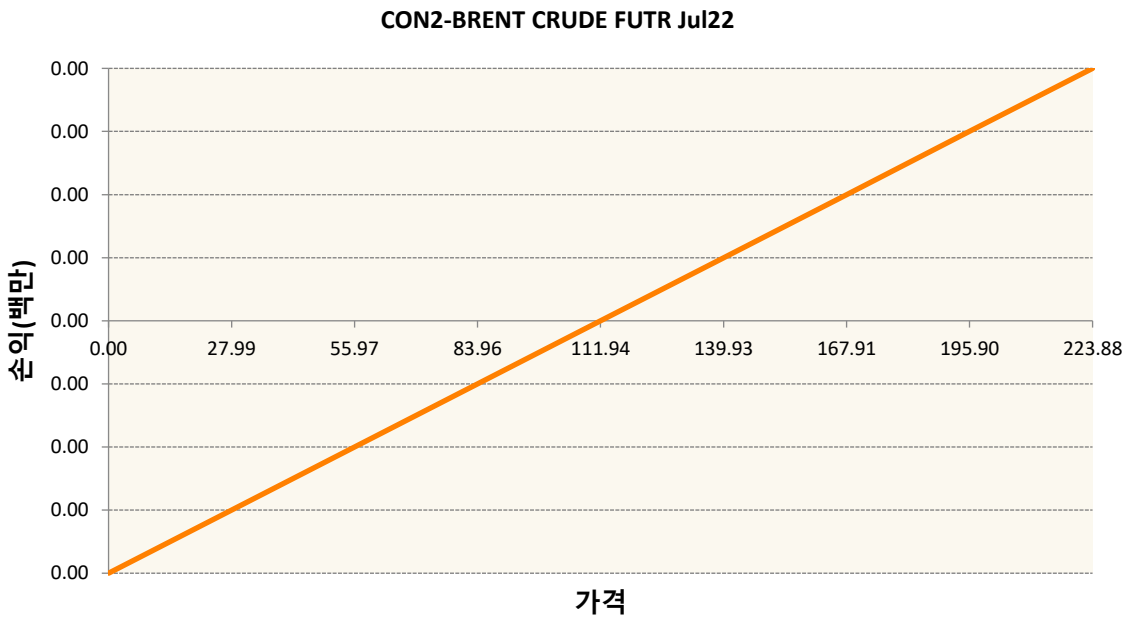
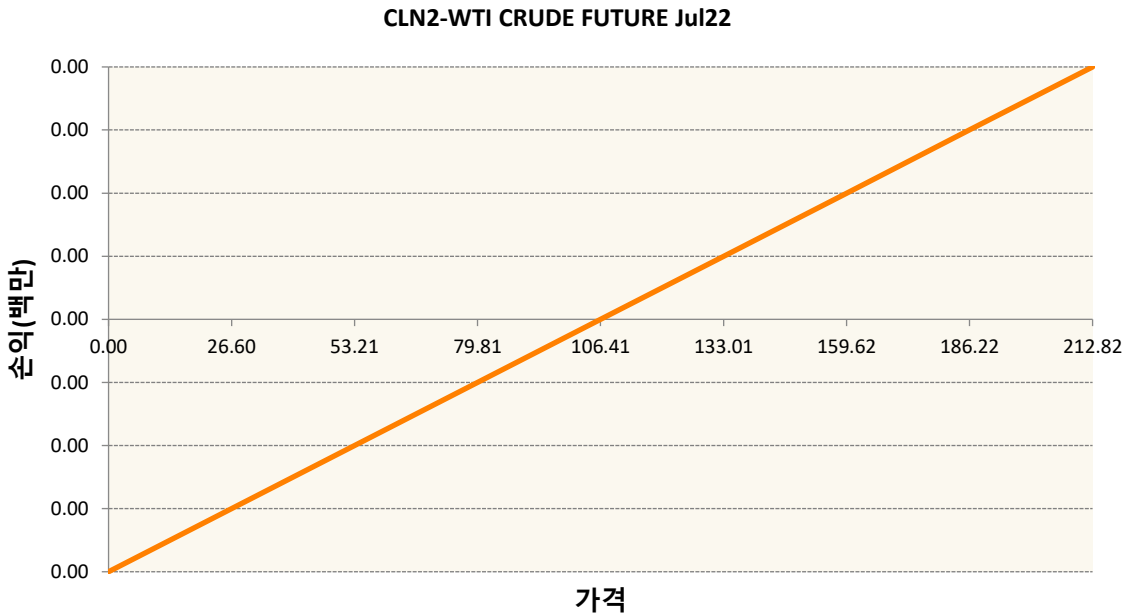
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

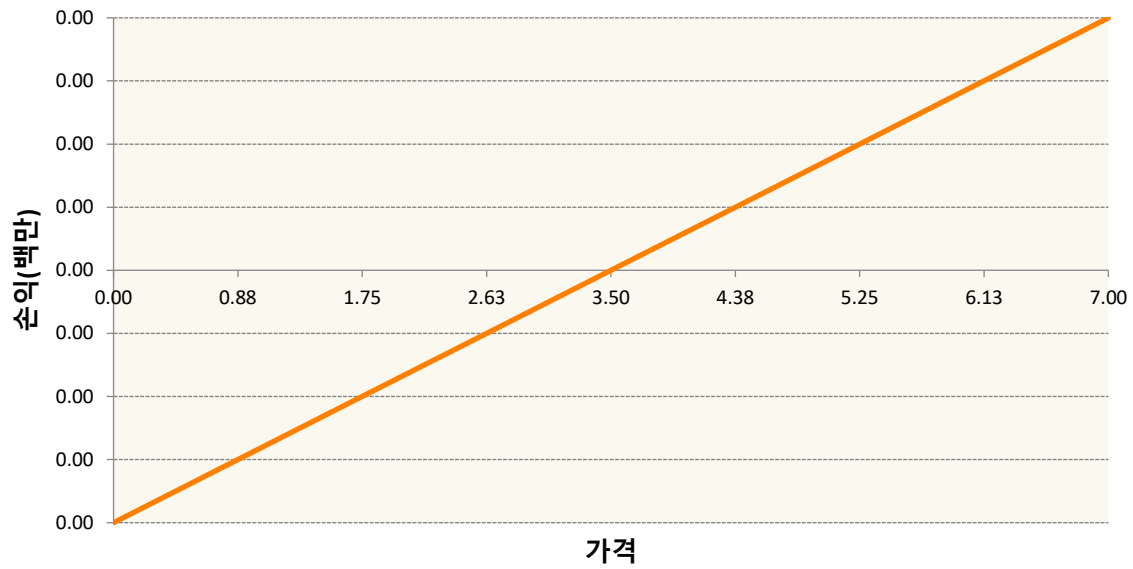
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,776	619	2,157	

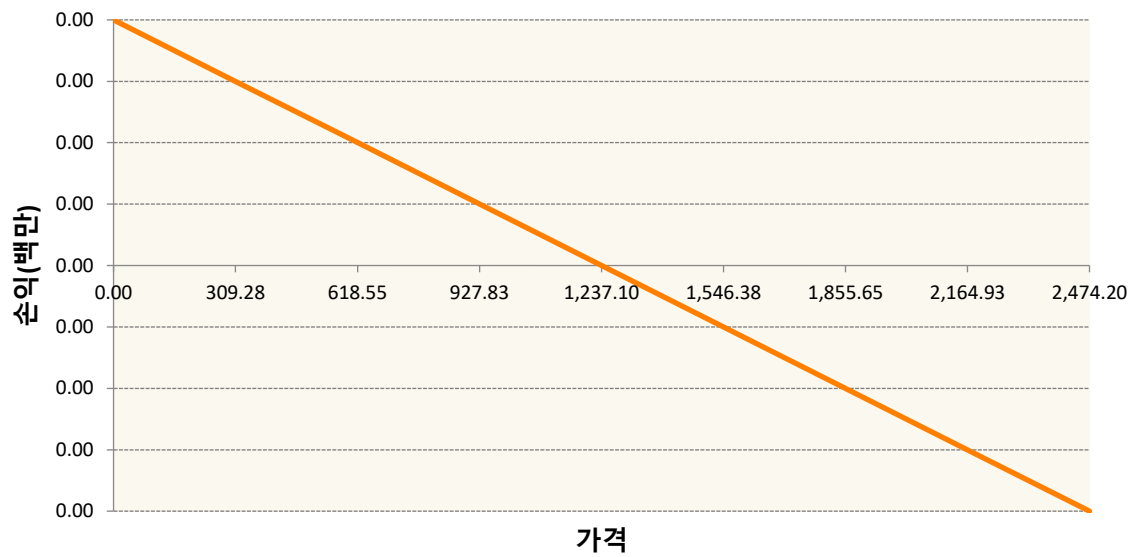
2. 만기시점의 손익구조



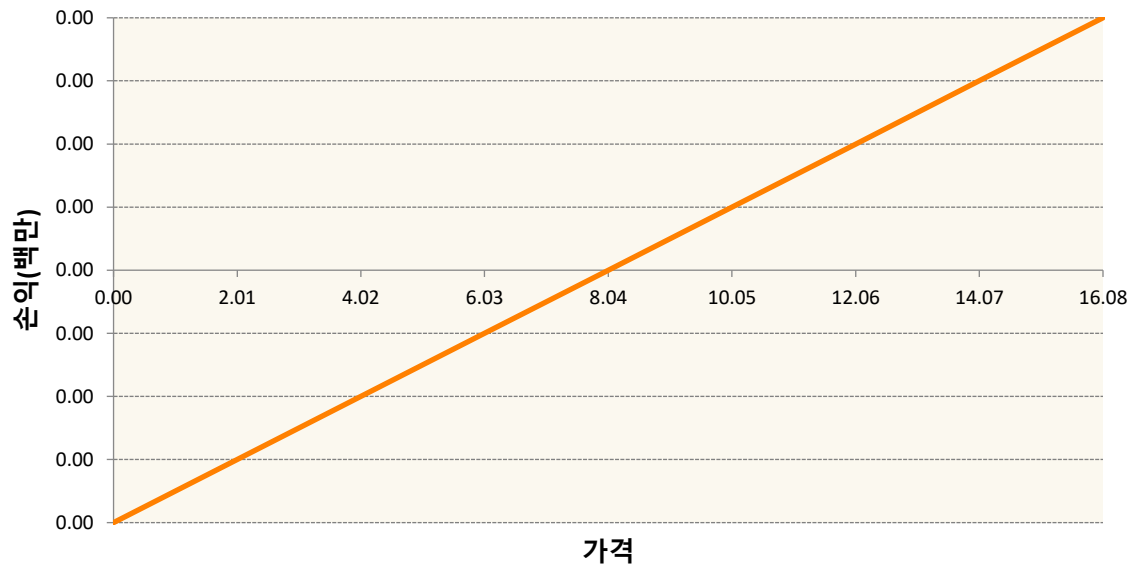
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

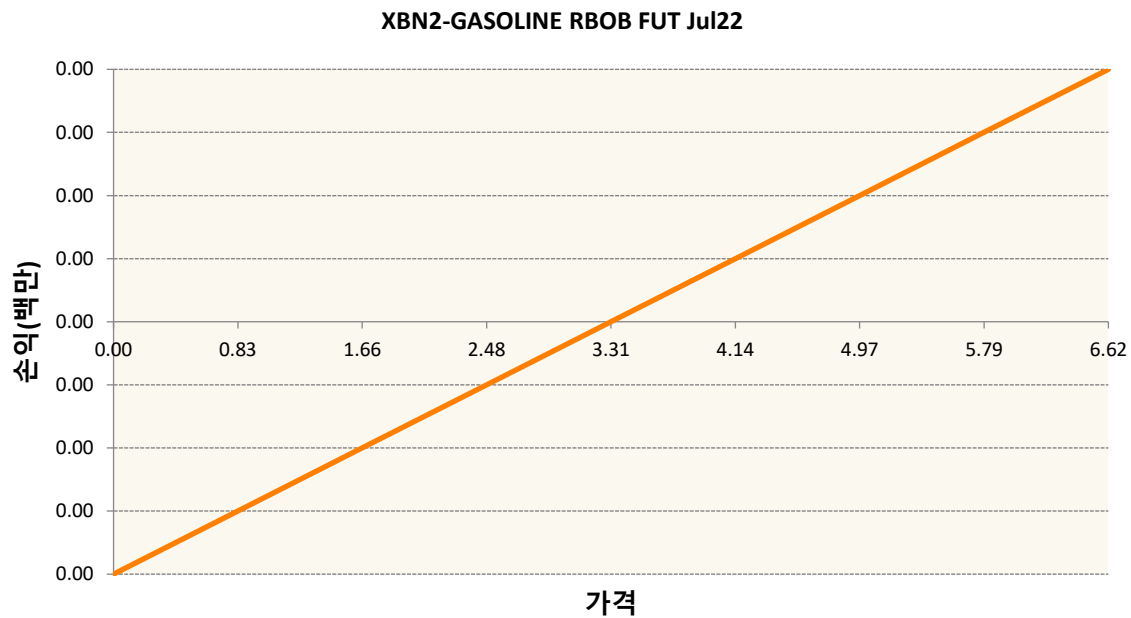
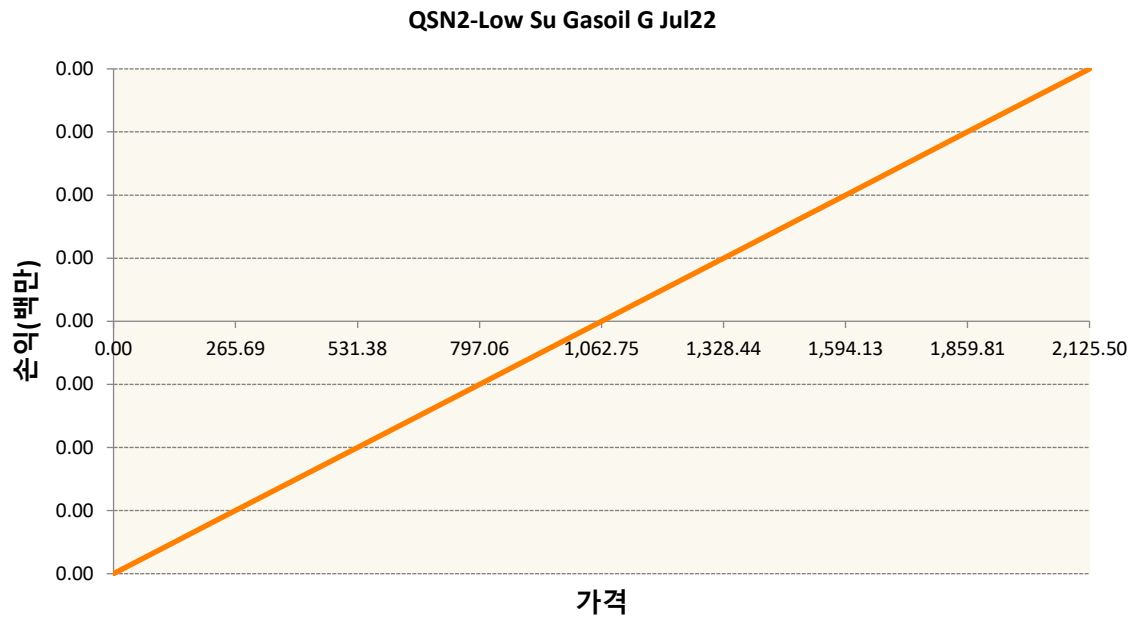


KR4175S50003-2022-05 달러선물



NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLN2	WTI CRUDE FUTURE Jul22		42
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		44
HON2	NY Harb ULSD Fut Jul22		14
KR4175S500 2022-05 달러선물			49
NGN22	NATURAL GAS FUTR Jul22		87
QSN2	Low Su Gasoil G Jul22		21
XBN2	GASOLINE RBOB FUT Jul22		14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		650