

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

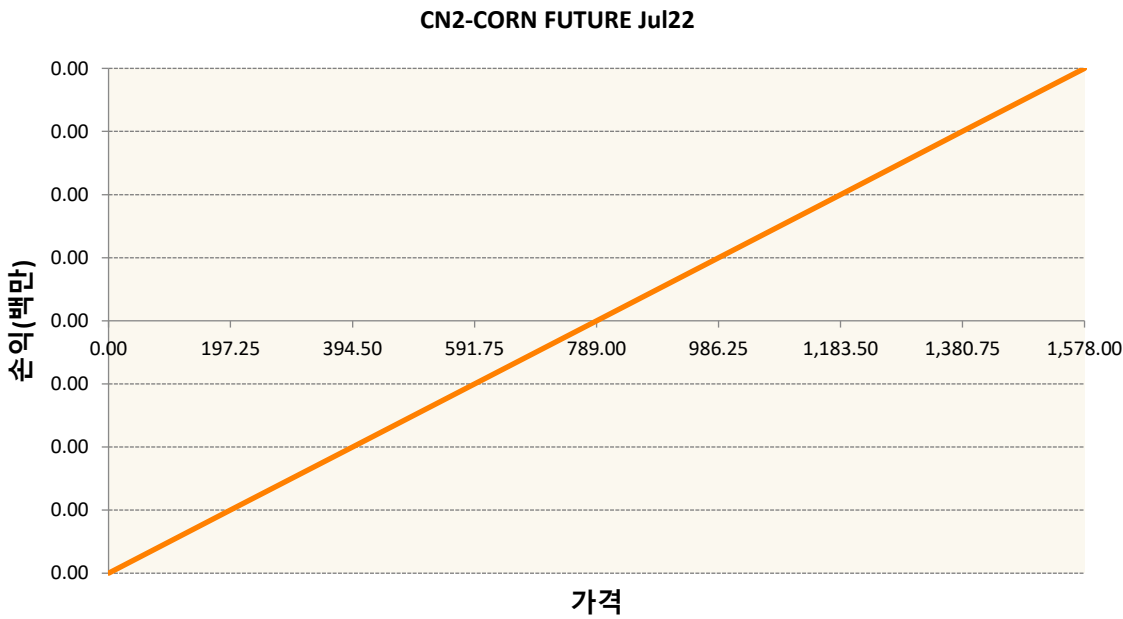
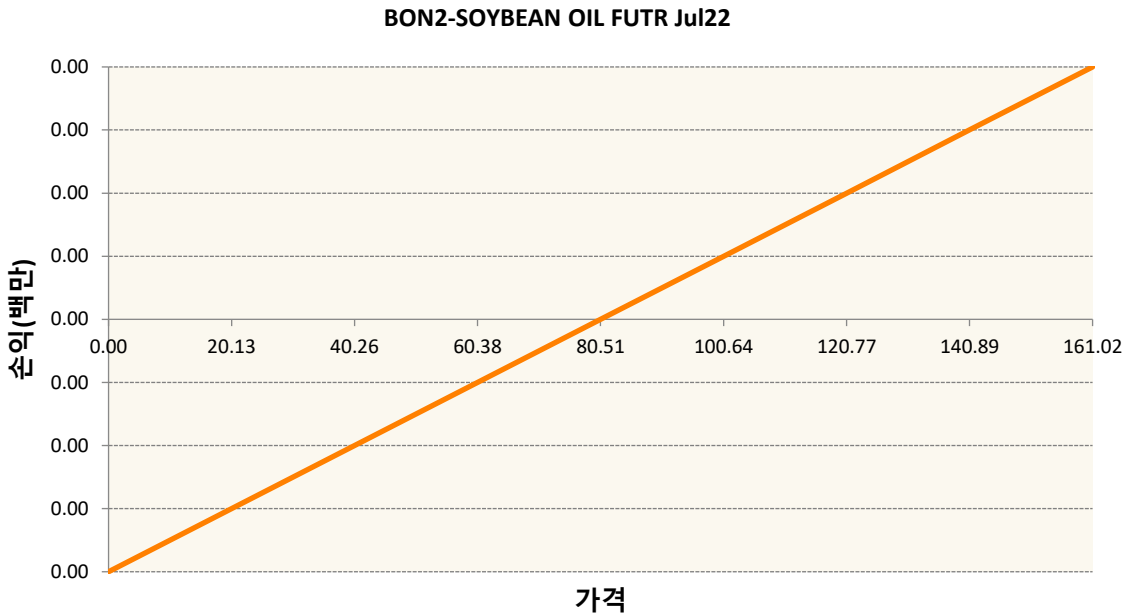
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

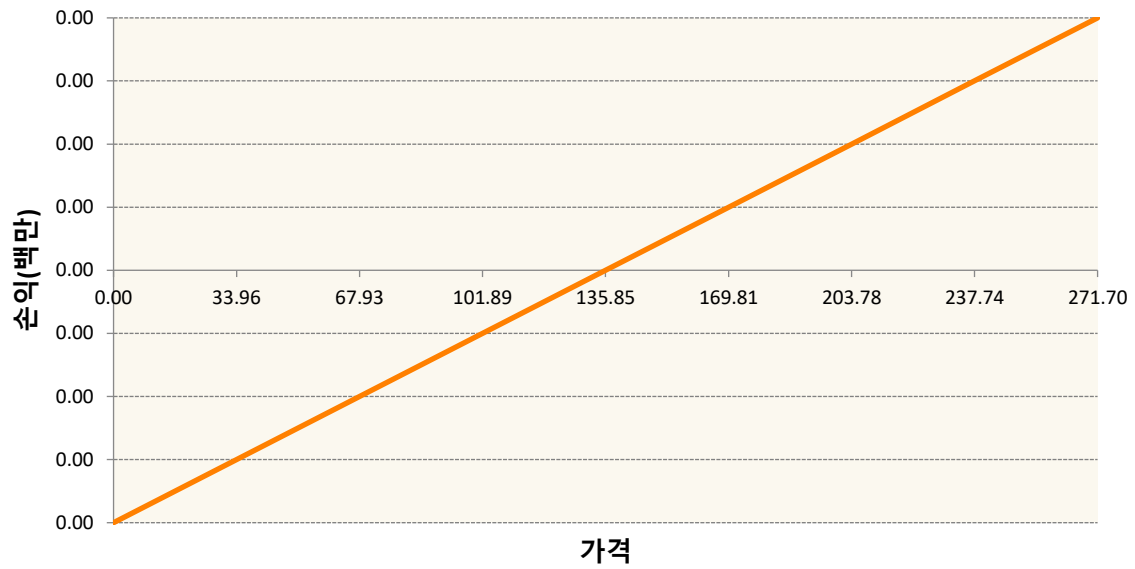
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,610	1,937	6,673	

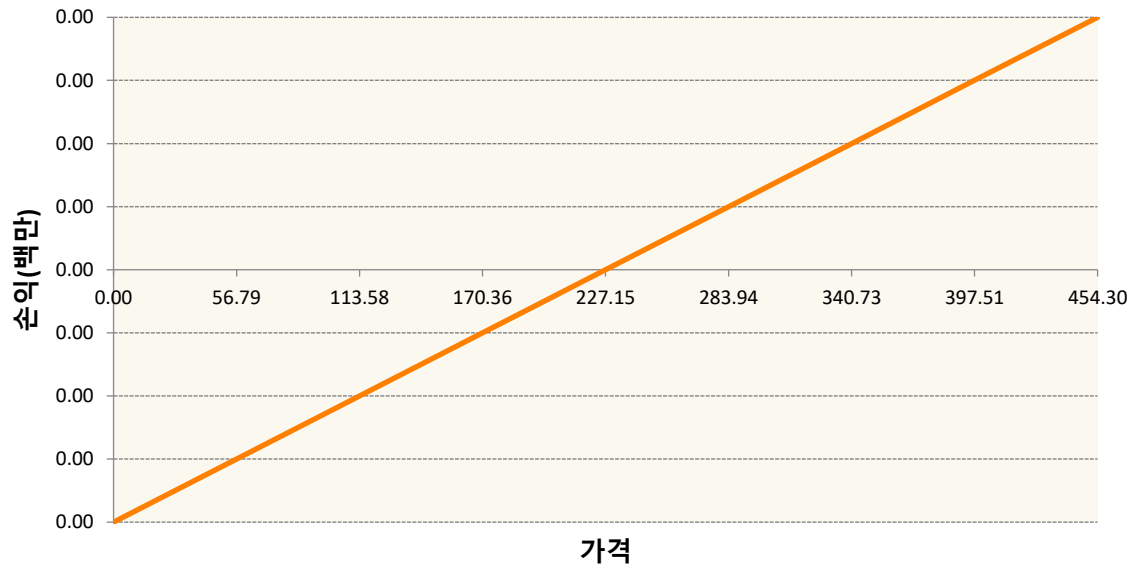
2. 만기시점의 손익구조



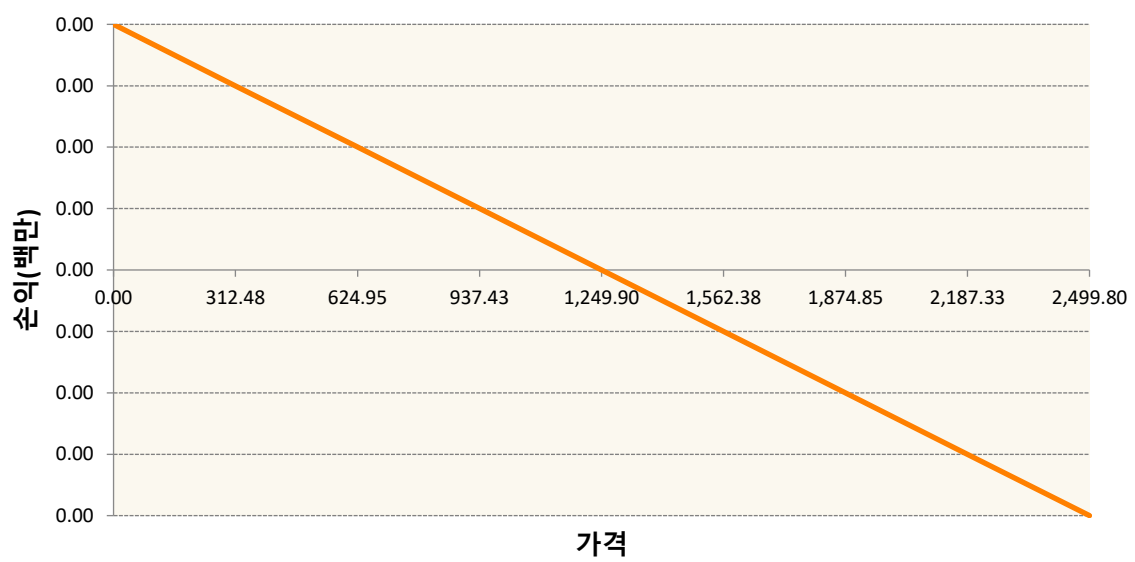
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



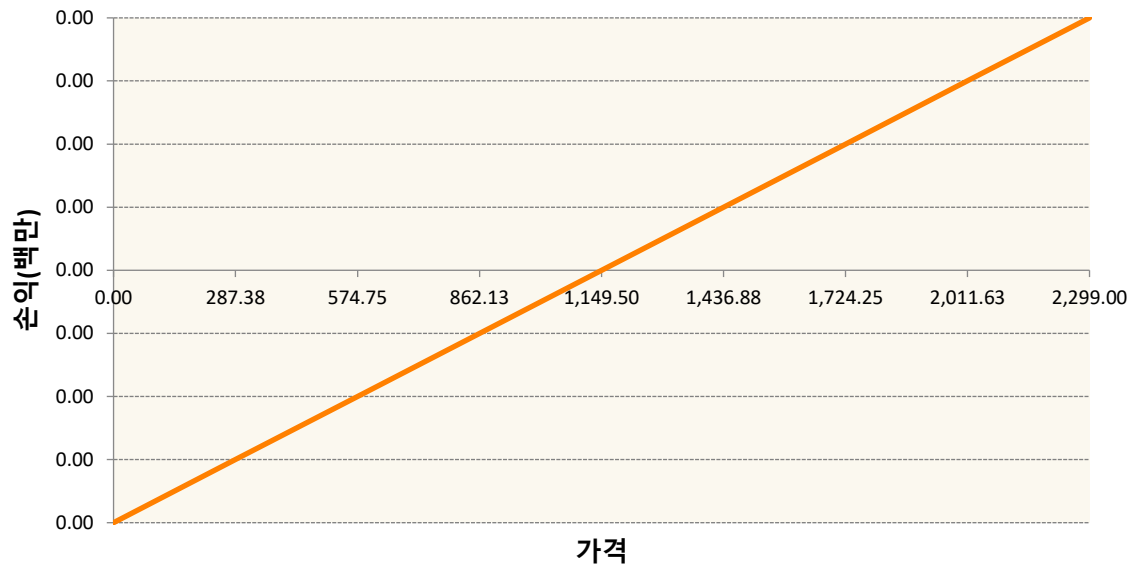
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



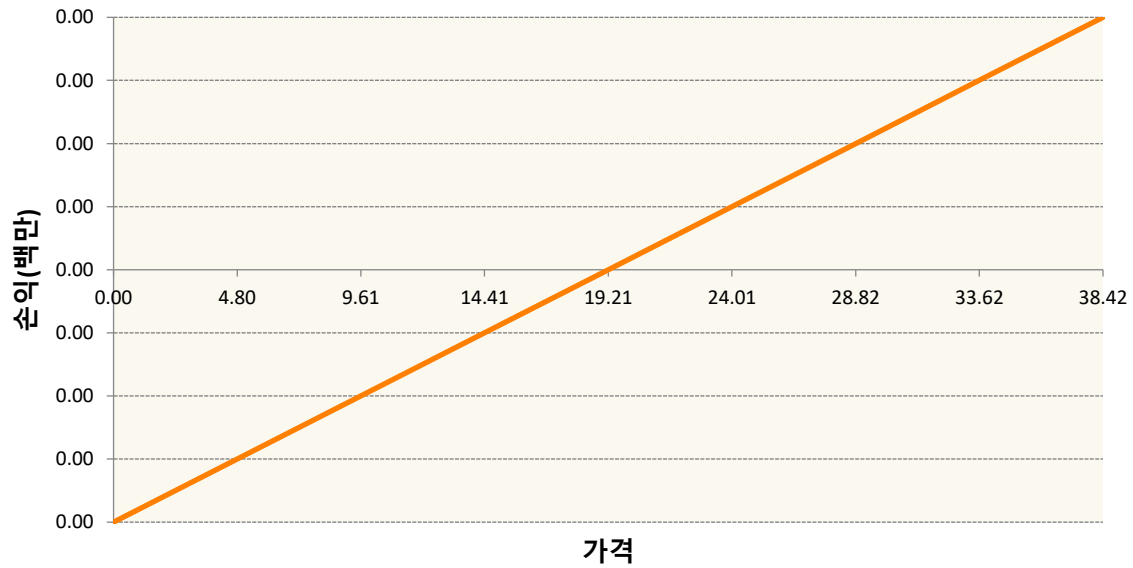
KR4175S50003-2022-05 달러선물



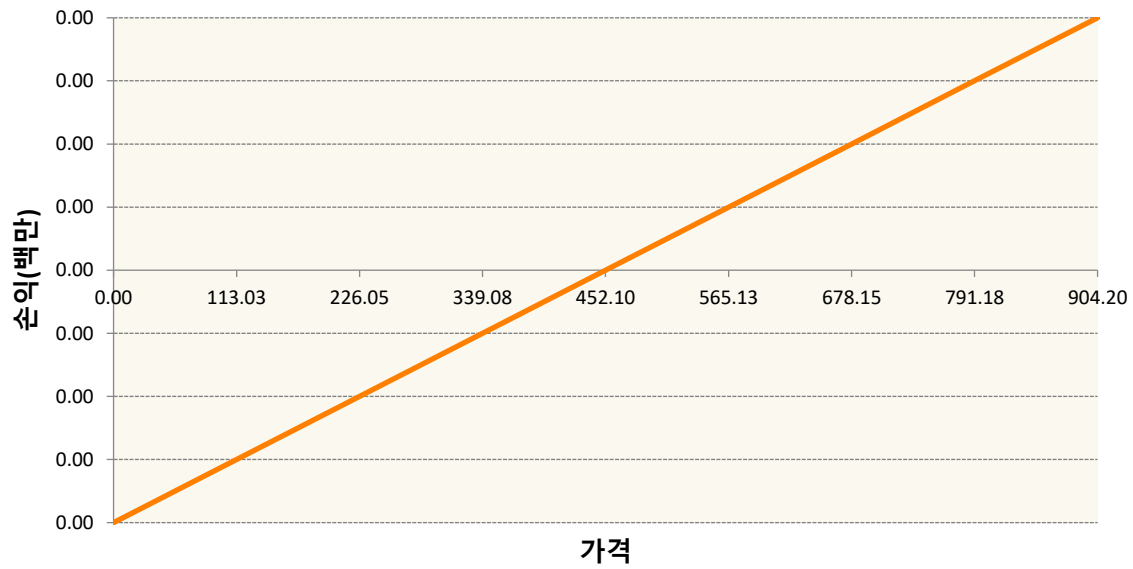
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22



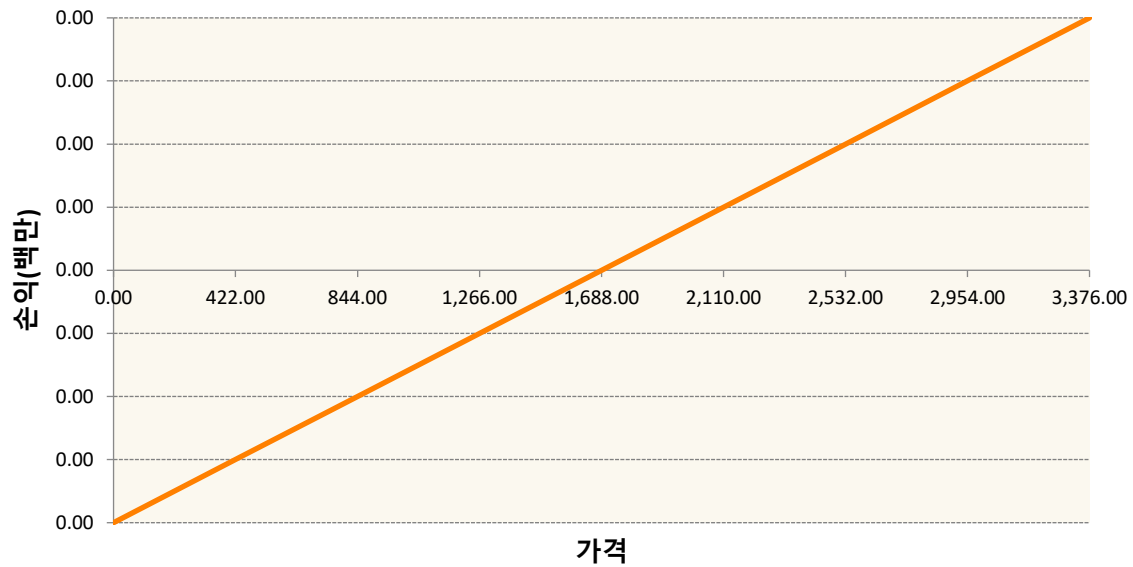
SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



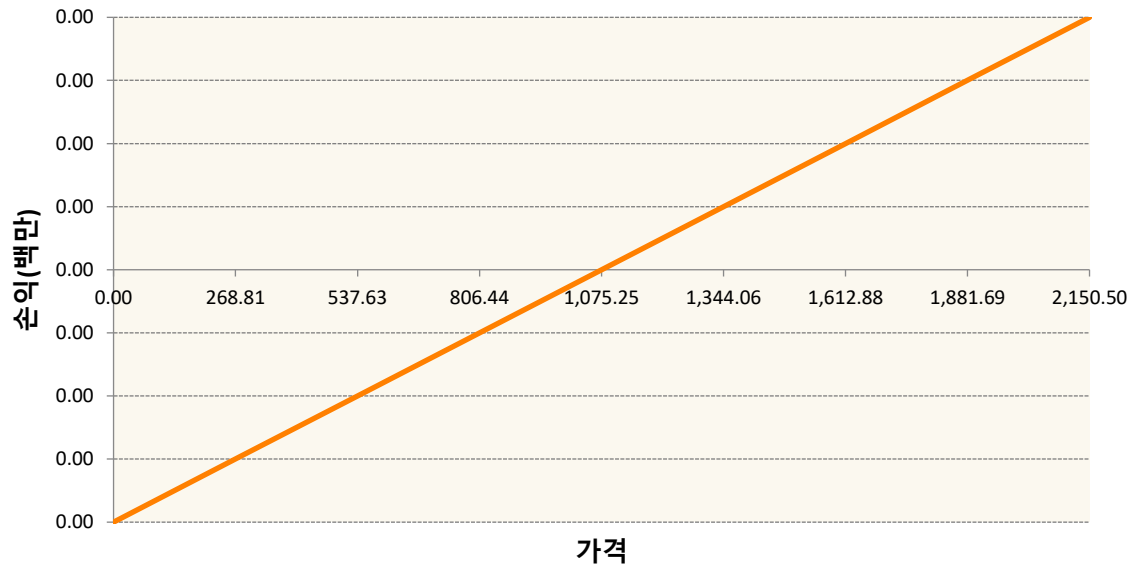
SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22



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	2022-04-26
기준일	2022-04-25

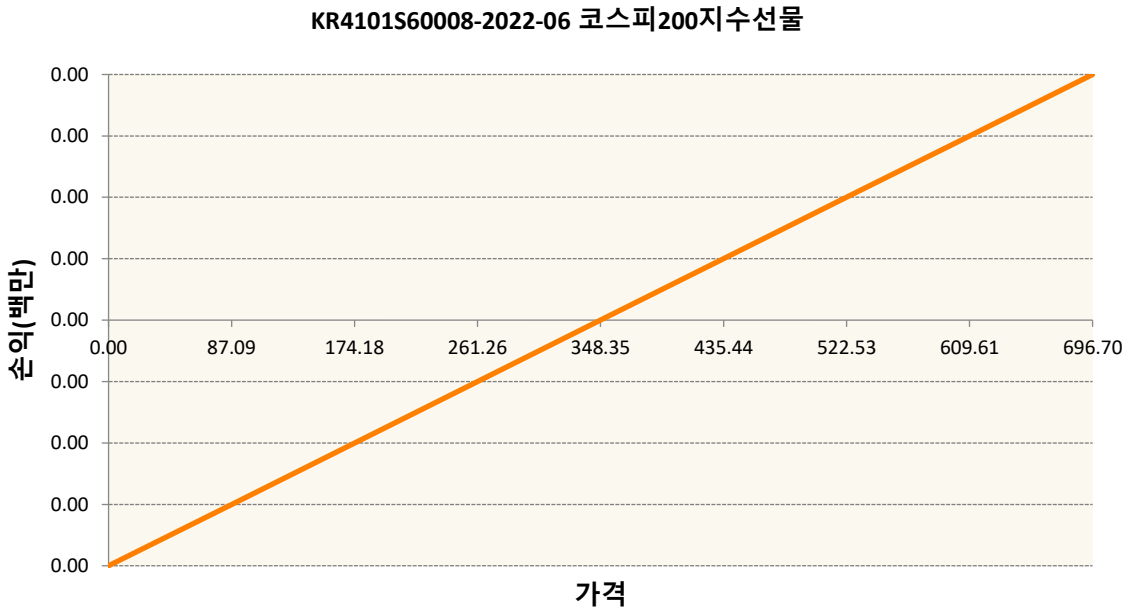
스마트인덱스모

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	1,568	0	1,568	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				126
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	126	126	126	126	126	126	126

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

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

348

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

378

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

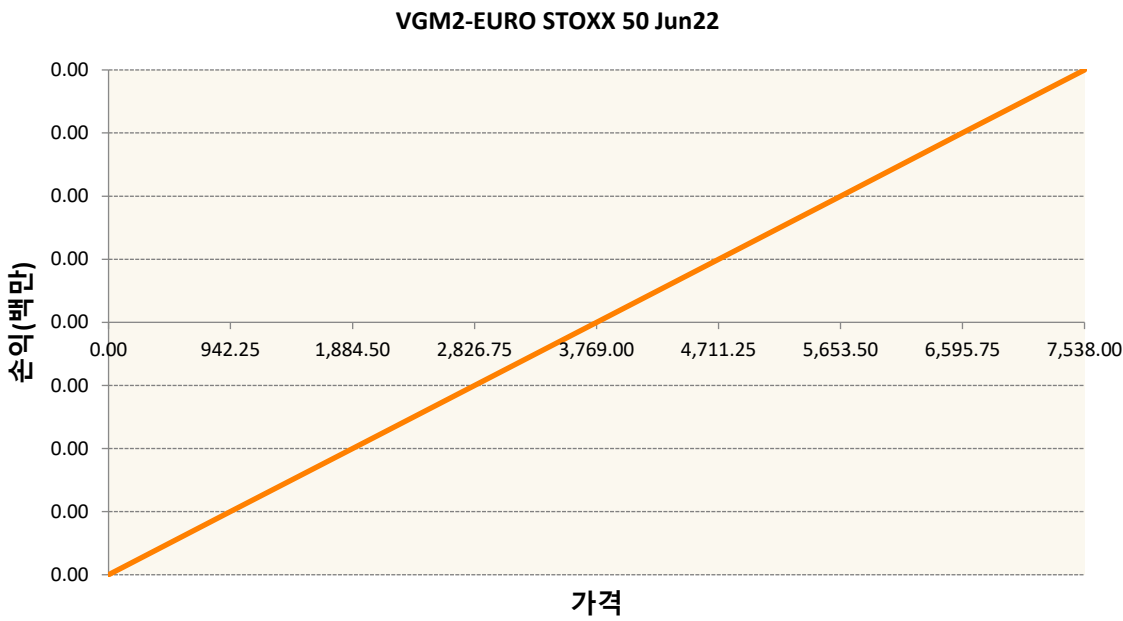
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	562	0	562	

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	2022-04-26
기준일	2022-04-25

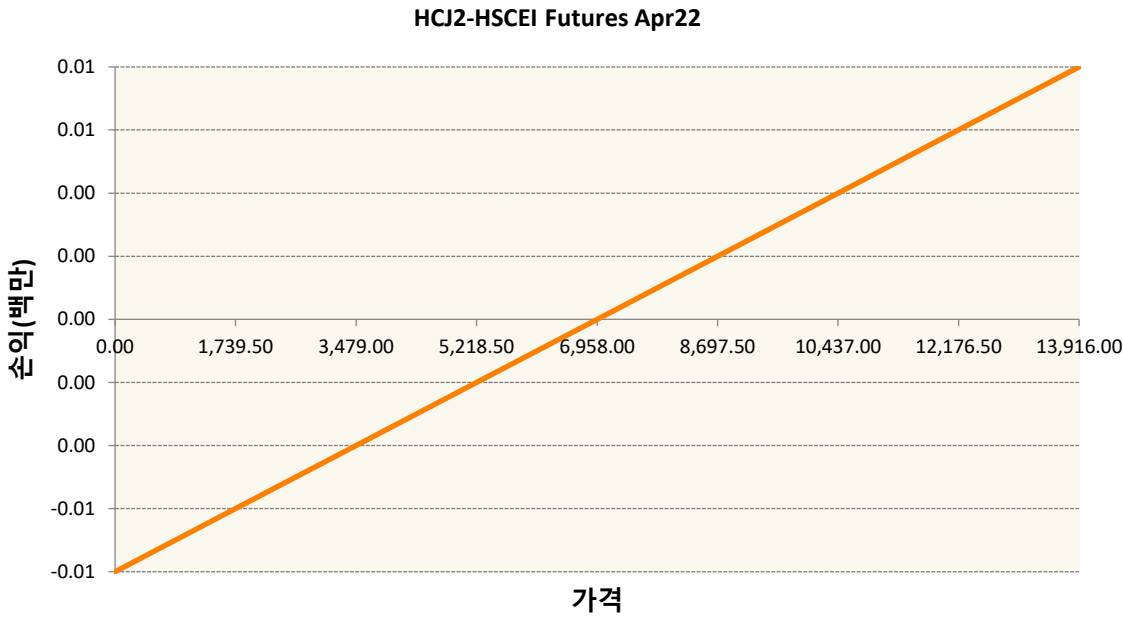
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,073	0	1,073	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI2	HSCEI Futures Apr22	86
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

115

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

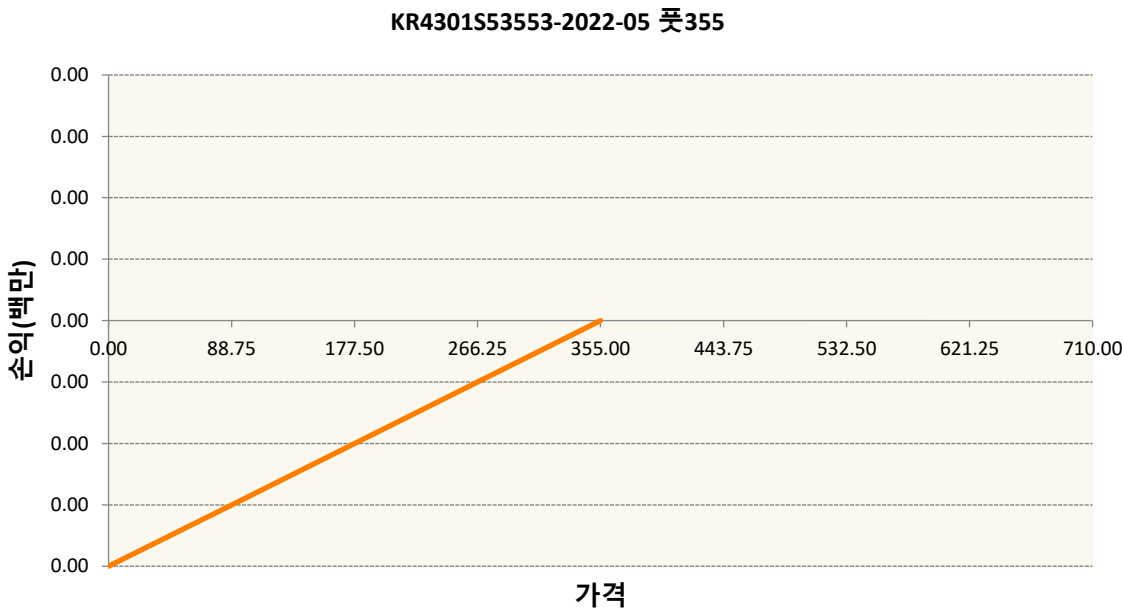
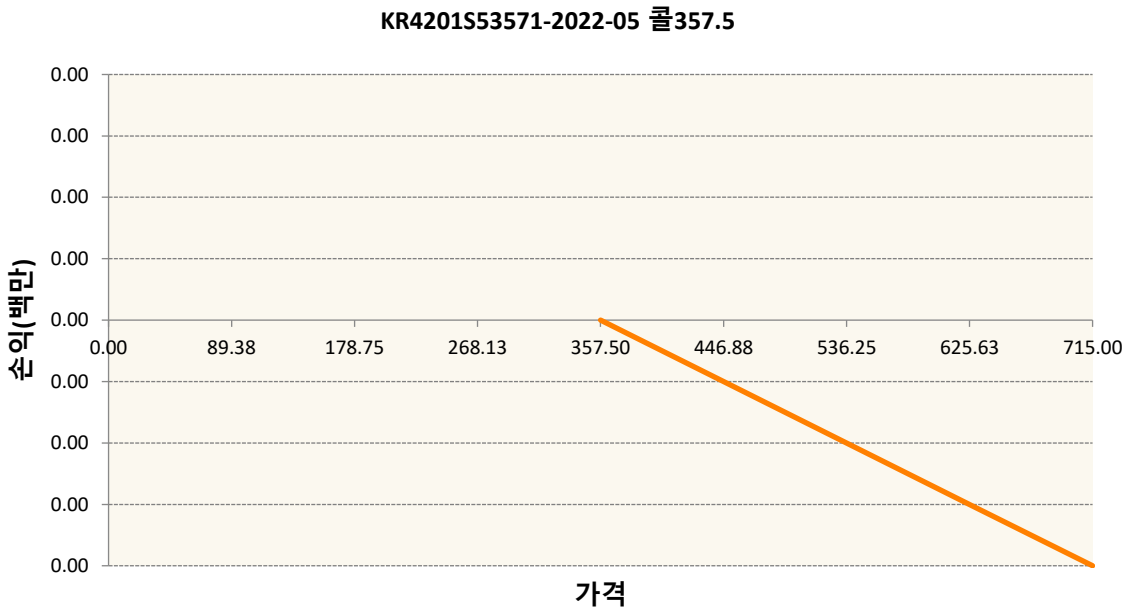
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

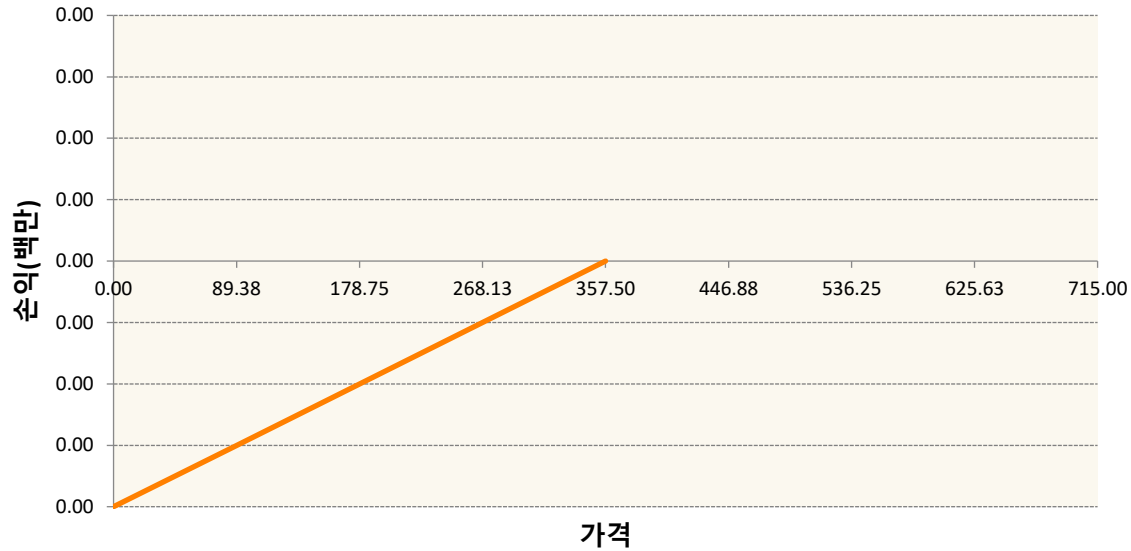
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	67,634	-67,634	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S53579-2022-05 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S53571			2022-05 콜357.5				2,873
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	887	872	850	820	784	741	692
-5.33%	835	795	747	690	627	558	484
-2.67%	681	605	522	434	342	246	147
0%	337	227	114	0	-115	-232	-349
2.67%	-276	-400	-524	-648	-772	-896	-1,019
5.33%	-1,178	-1,288	-1,400	-1,514	-1,630	-1,747	-1,866
8.00%	-2,321	-2,399	-2,484	-2,575	-2,670	-2,770	-2,873
KR4301S53553			2022-05 풋355				225
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-223	-223	-223	-223	-224	-224	-225
-5.33%	-137	-138	-139	-140	-142	-143	-145
-2.67%	-56	-58	-61	-63	-67	-70	-74
0%	13	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	60	55	50	45	40	35	30
5.33%	82	79	75	72	68	64	60
8.00%	89	88	86	84	82	79	76
KR4301S53579			2022-05 풋357.5				627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-621	-622	-622	-623	-624	-625	-627
-5.33%	-390	-391	-393	-396	-399	-403	-407
-2.67%	-165	-170	-176	-183	-190	-198	-206
0%	33	23	11	0	-12	-24	-36

2.67%	176	163	149	136	122	109	95
5.33%	252	242	231	220	209	197	185
8.00%	280	276	270	263	256	247	239

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

(단위:백만원)

3,517

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

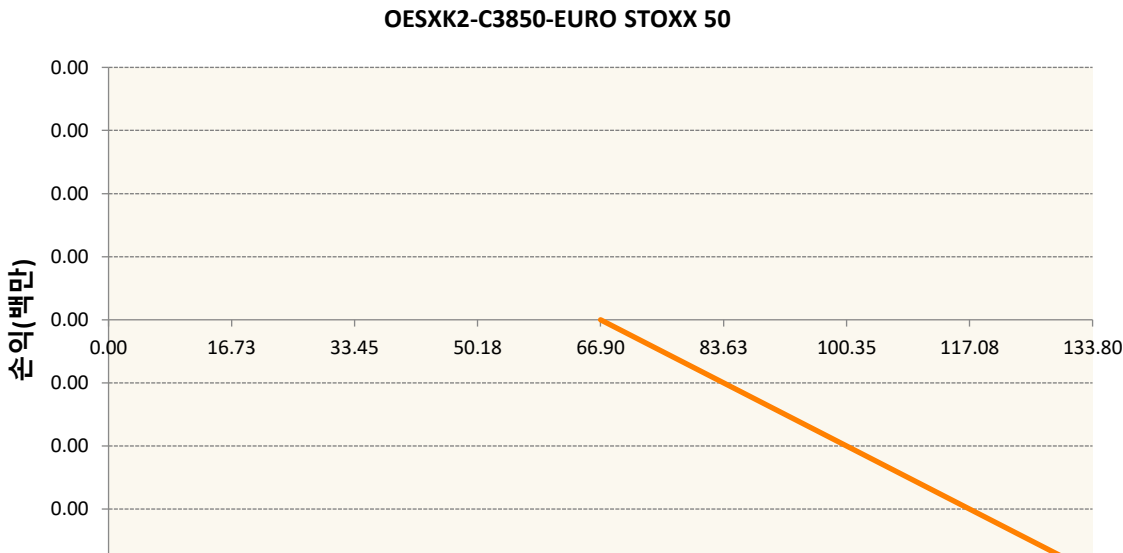
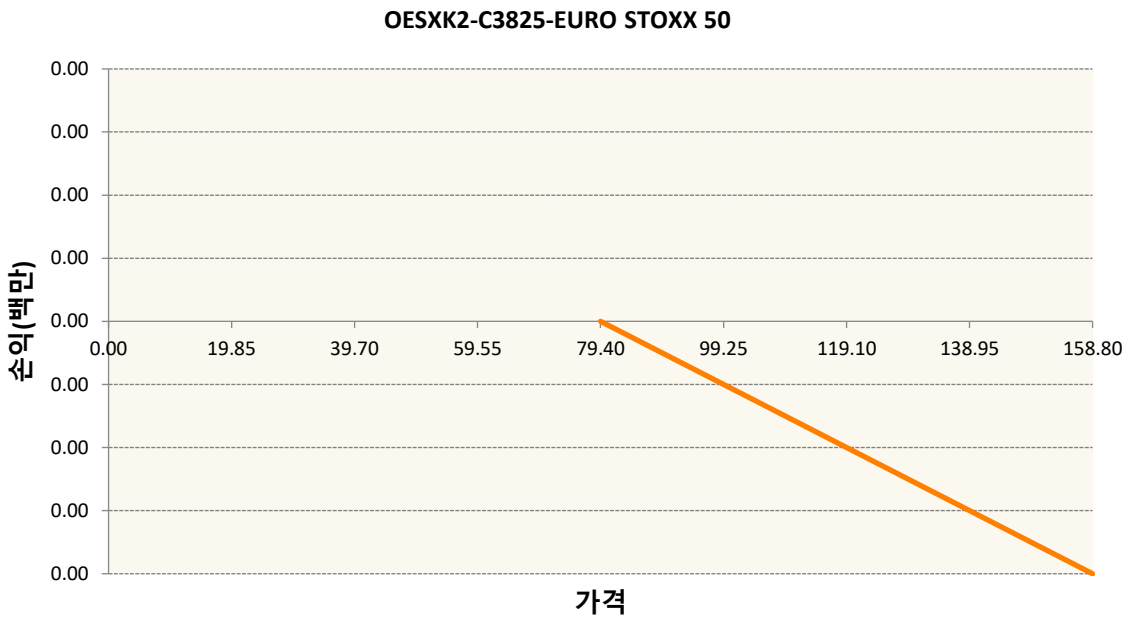
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

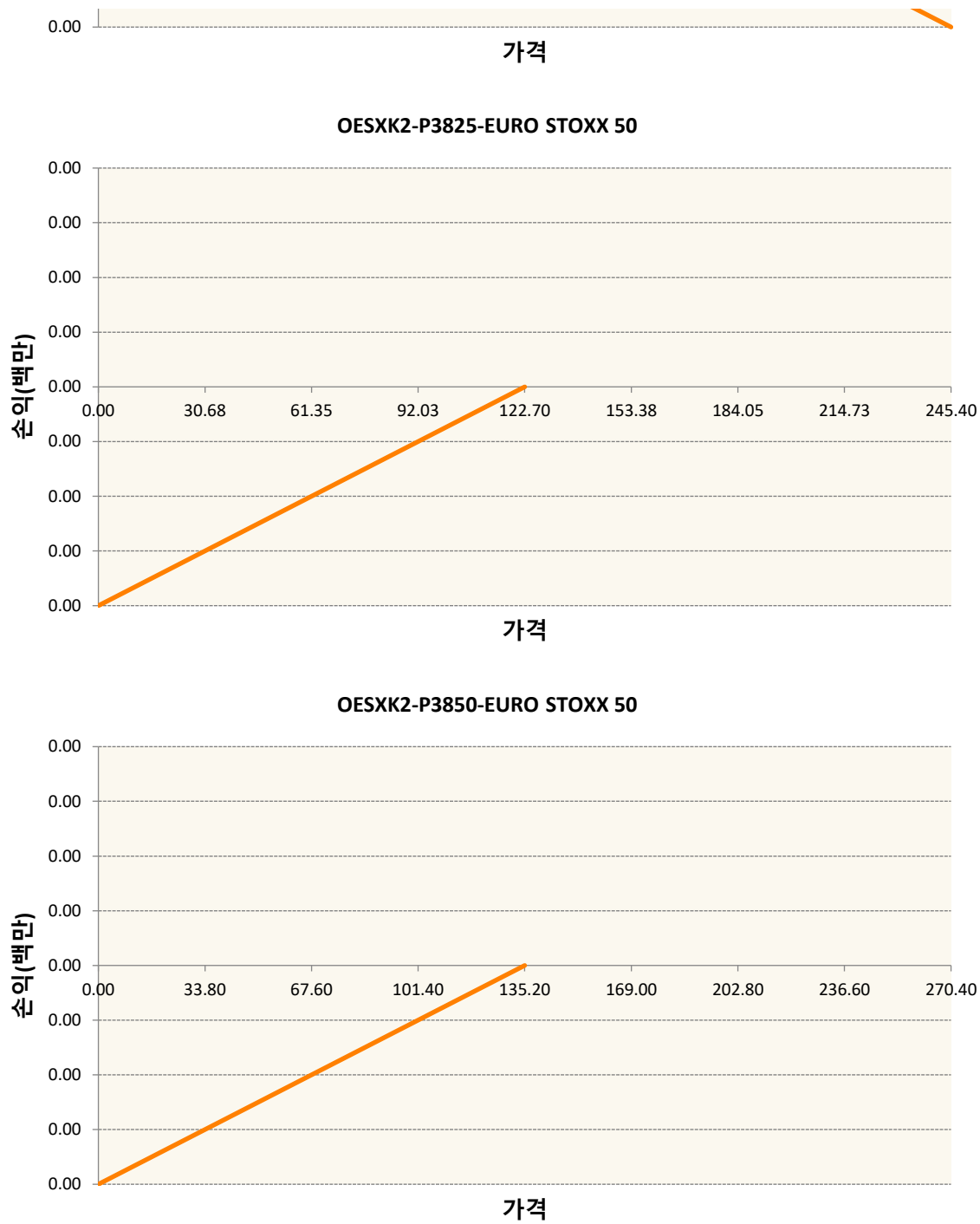
1. 계약금액

(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	70	-70	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,475	-1,475	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E
 FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E
 FXW213C4L KRW/EUR 24-06-22E
 OESXK2-C38 EURO STOXX 50
 OESXK2-C38 EURO STOXX 50
 OESXK2-P38 EURO STOXX 50
 OESXK2-P38 EURO STOXX 50

12
21
64
32
0.09
2
0.13
3

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

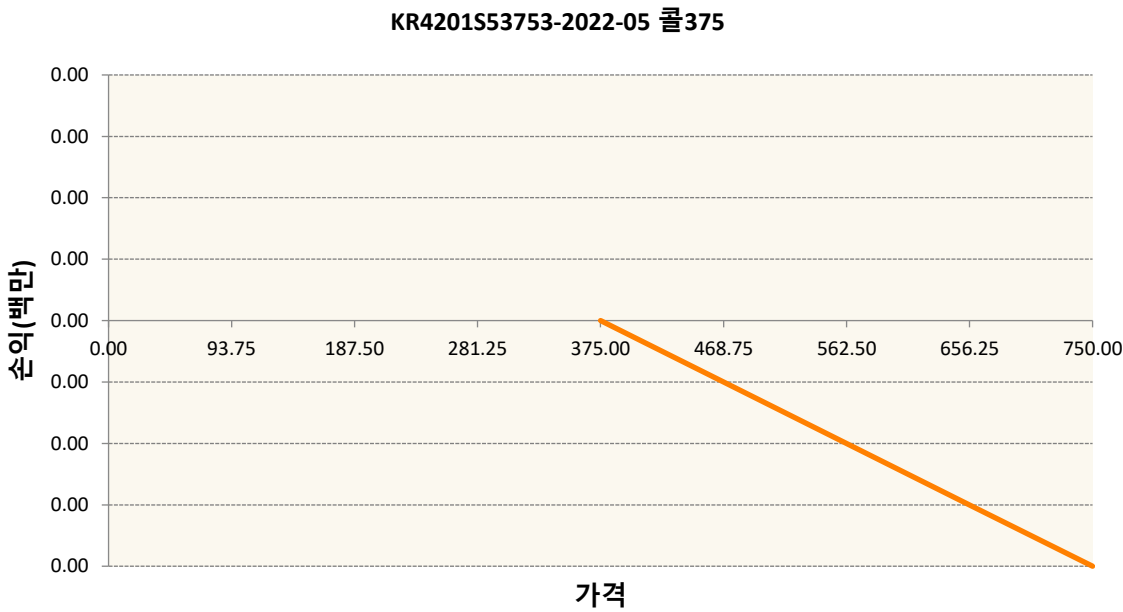
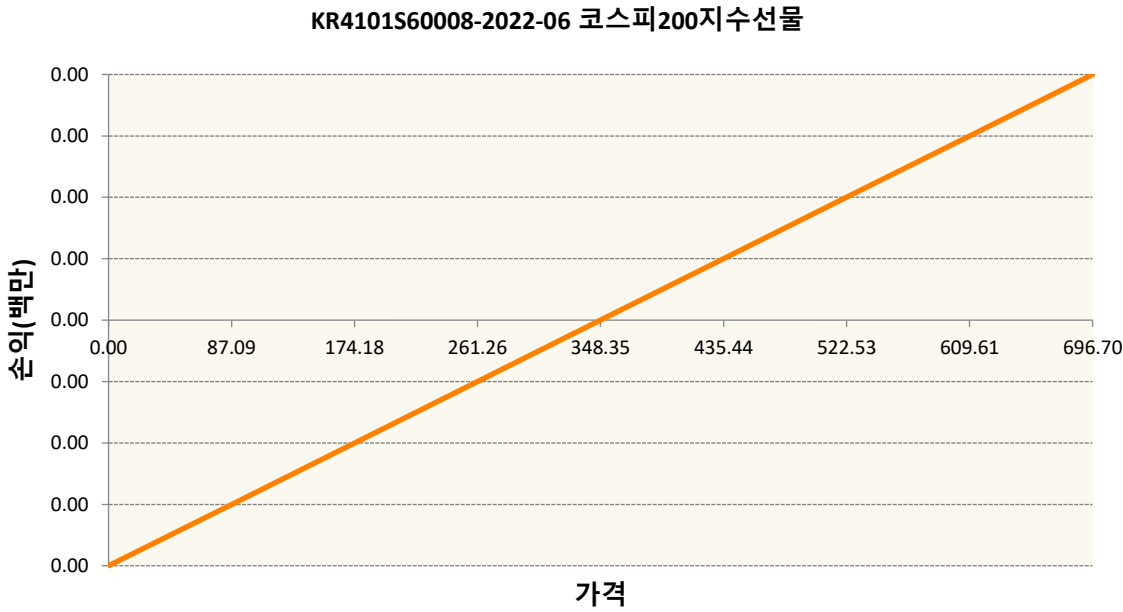
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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

2. 만기시점의 손익구조



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					49
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49
KR4201S53753		2022-05 콜375					139
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	20	20	19	18	17
-5.33%	20	20	19	18	16	14	11
-2.67%	19	17	15	12	9	5	0
0%	13	10	5	0	-6	-12	-18
2.67%	-1	-8	-15	-22	-30	-38	-46
5.33%	-30	-39	-49	-58	-67	-77	-86
8.00%	-80	-89	-99	-109	-119	-129	-139
KR4201S53779 2022-05 콜377.5							14

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

KR4301S53579 2022-05 풋357.5							19
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19
-5.33%	12	12	12	12	12	12	12
-2.67%	5	5	5	5	6	6	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-5	-5	-4	-4	-4	-3	-3
5.33%	-8	-7	-7	-7	-6	-6	-6
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-7	-7

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

(단위:백만원)

165

공시일 2022-04-26

기준일 2022-04-25

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	9,466	0	9,466	

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	2022-04-26
기준일	2022-04-25

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	7,419	0	7,419	

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	2022-04-26
기준일	2022-04-25

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	24,028	0	24,028	
누계	통화	선도	1,500	25,160	-23,661	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4MKRW/USD 27-06-22E	2,013
FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E	120
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

723

공시일 2022-04-26

기준일 2022-04-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

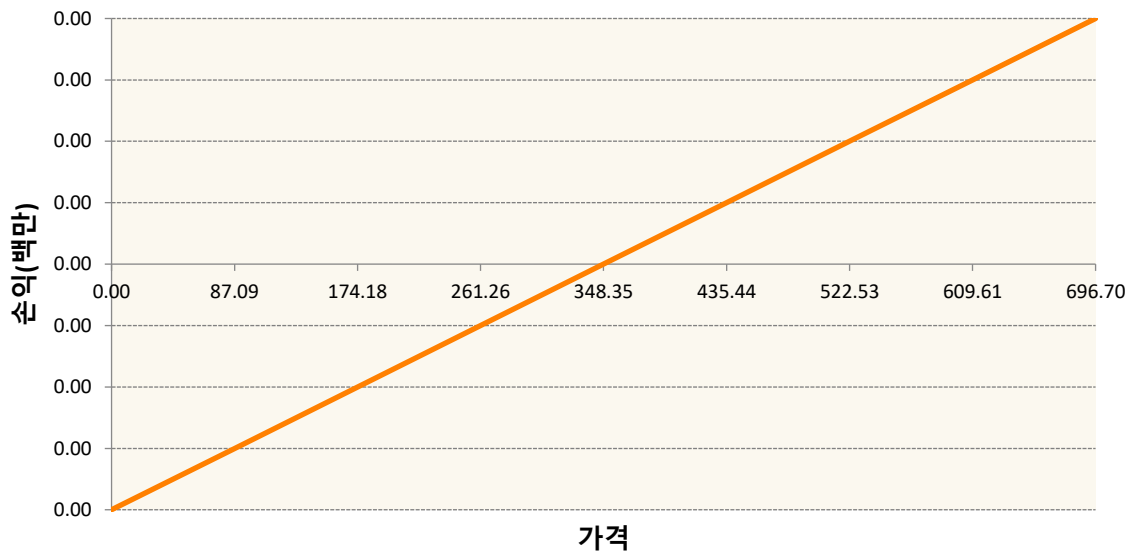
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,219	0	1,219	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008			2022-06 코스피200지수선물				98
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-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%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	98	98	98	98	98	98	98

공시일 2022-04-26

기준일 2022-04-25

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

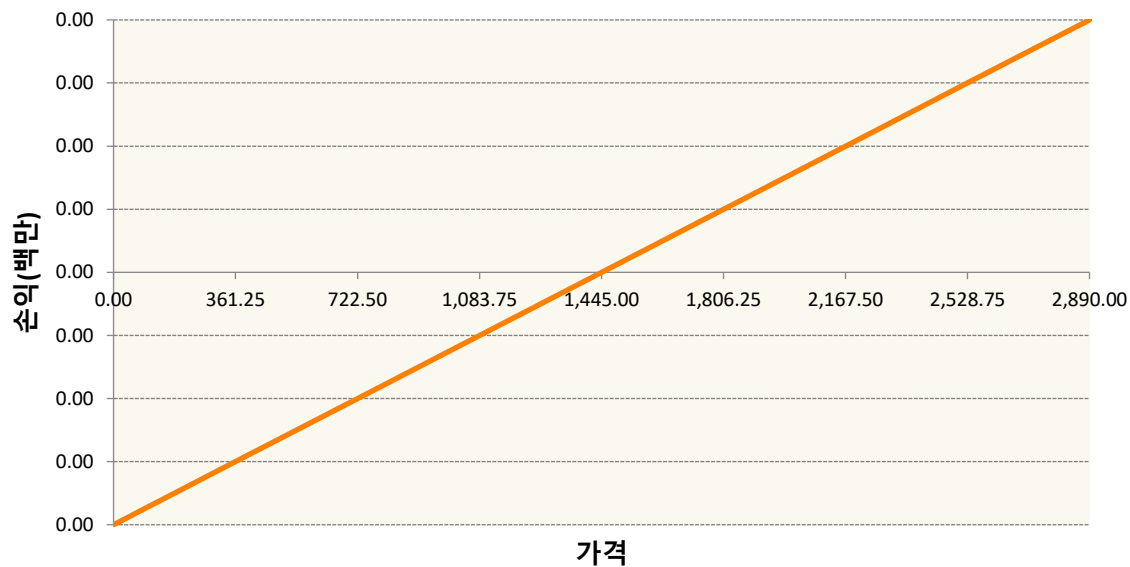
1. 계약금액

(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	787	0	787	
누계	유가증권	스왑	1,833	0	1,833	장외
누계	통화	선도	0	1,180	-1,180	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK2-VN30 Index Future May22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	147
FXW213C2P KRW/EUR 20-05-22E	46
FXW213C3G KRW/EUR 24-06-22E	32
FXW213C4L KRW/EUR 22-07-22E	16
VNCK2 VN30 Index Future May22	63

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

(단위:백만원)

268

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

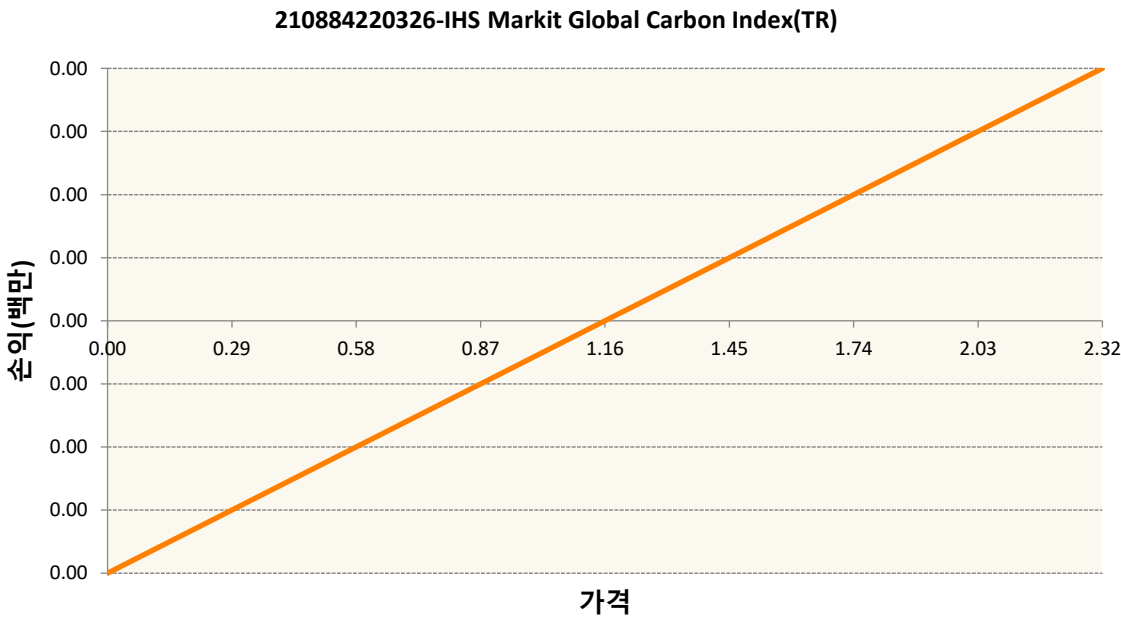
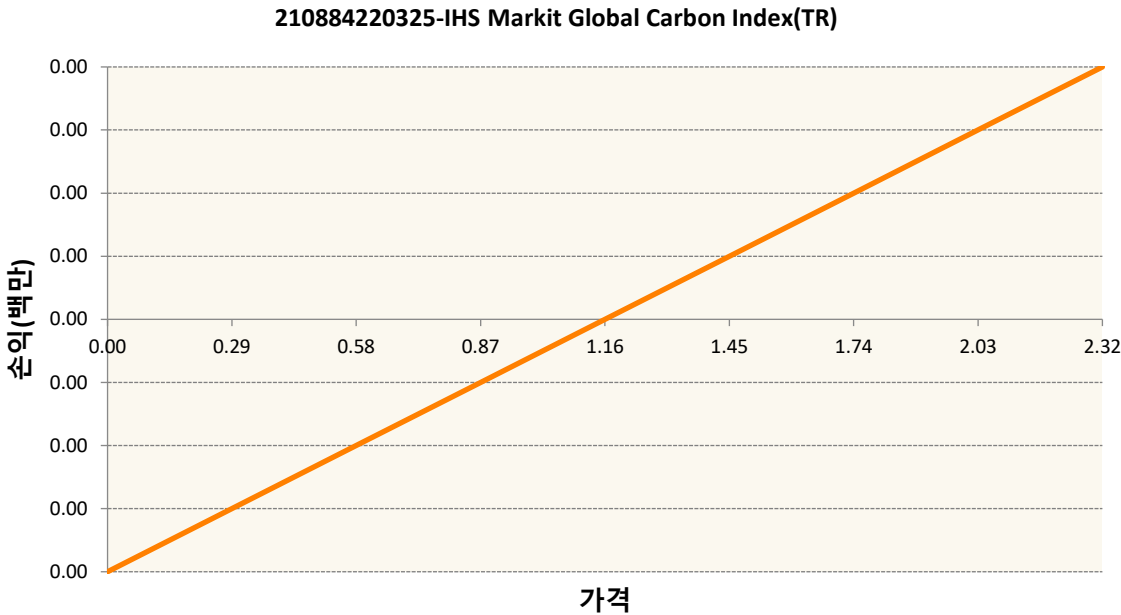
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

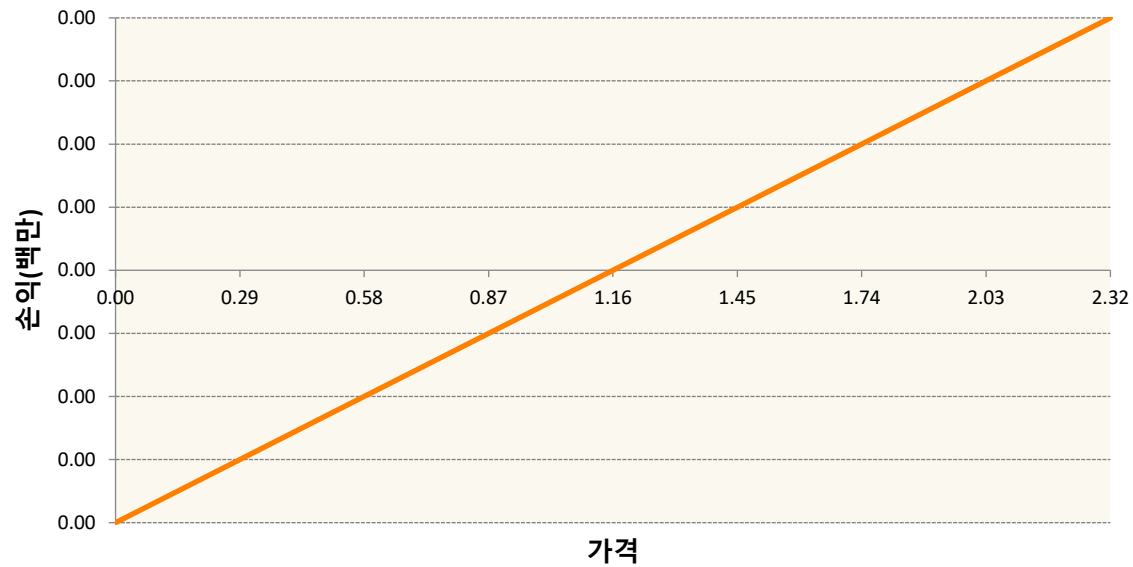
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	49,260	0	49,260	

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)

208

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

3,621

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

104

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

(단위:백만원)

7,209

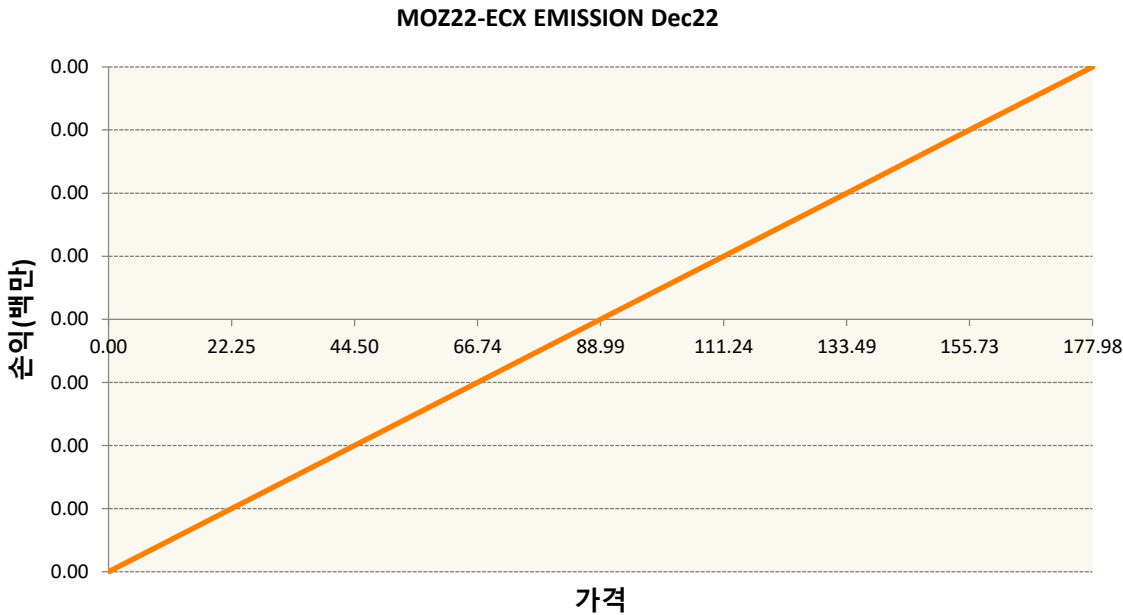
공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

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	18,012	0	18,012	
누계	통화	선도	0	9,723	-9,723	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213C4R	KRW/EUR 23-05-22E		778
MOZ22	ECX EMISSION Dec22		1,441

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,876

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

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)	54
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	54
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	54
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	54

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

(단위:백만원)

409

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

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)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	10

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

(단위:백만원)

54

공시일	2022-04-26
기준일	2022-04-25

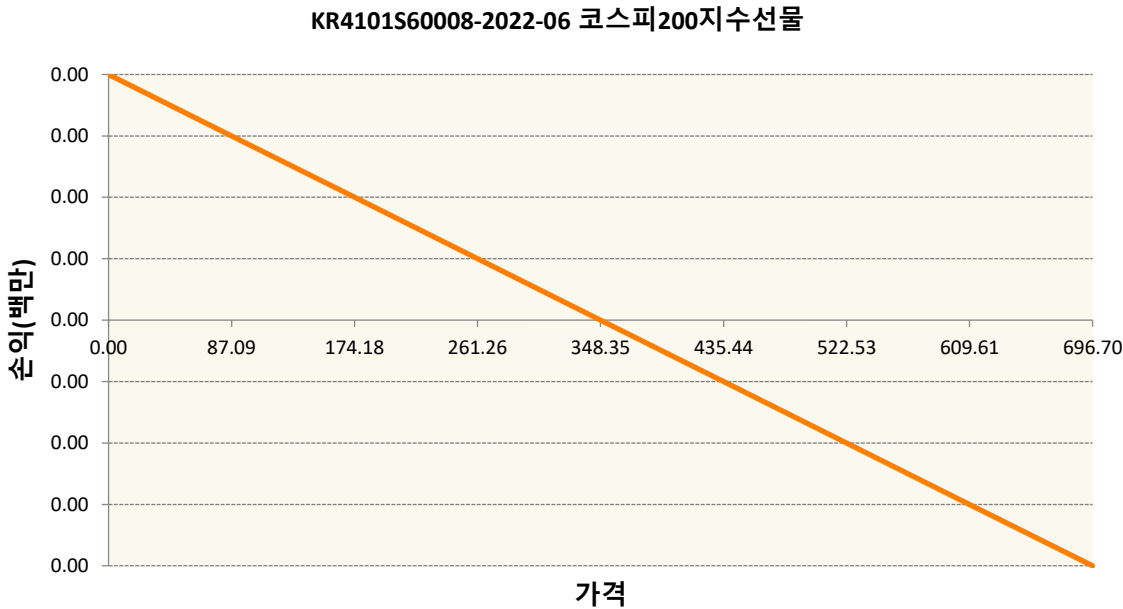
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	436	-436	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	2,177	-2,177	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물	174
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322	2
KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322	1
KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	0.39
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331	0.41
KRS0003070 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0407	1
KRS0003070 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0407	0.39
KRS0003086 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0412	1

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

(단위:백만원)

공시일 2022-04-26

기준일 2022-04-25

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

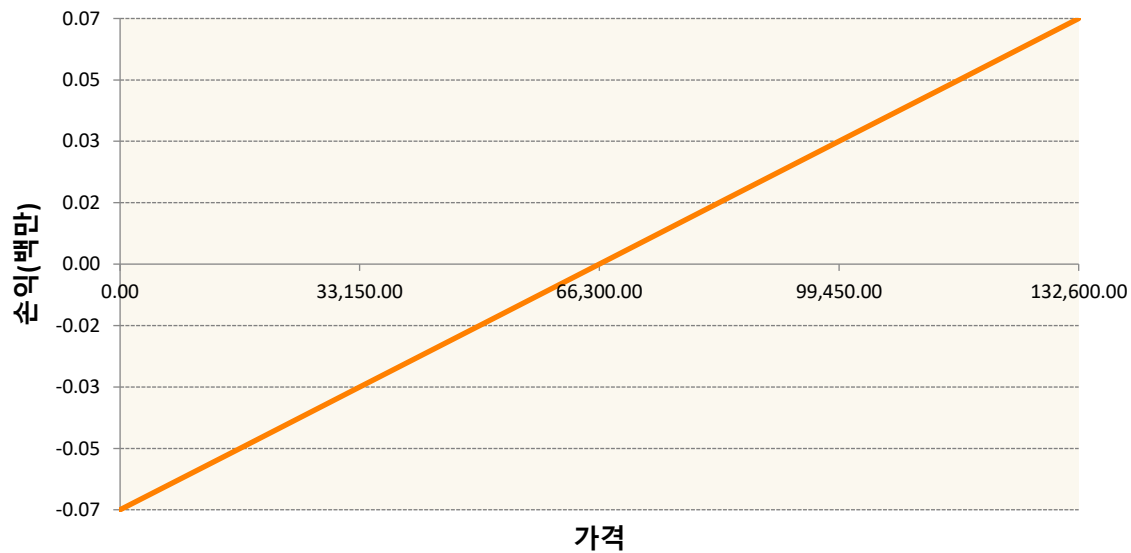
1. 계약금액

(단위:백만원)

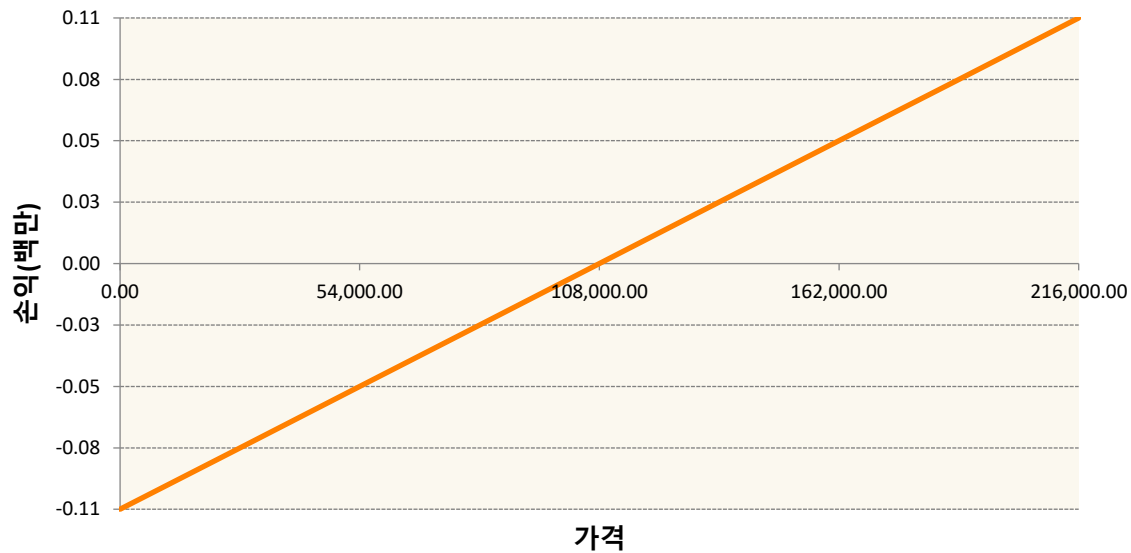
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	868	0	868	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S50008-2022-05 삼성전자개별선물



KR4150S50006-2022-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S50008		2022-05 삼성전자개별선물					34
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34
KR4150S50006		2022-05 SK하이닉스개별선물					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%	-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%	35	35	35	35	35	35	35

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

75

공시일 2022-04-26

기준일 2022-04-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

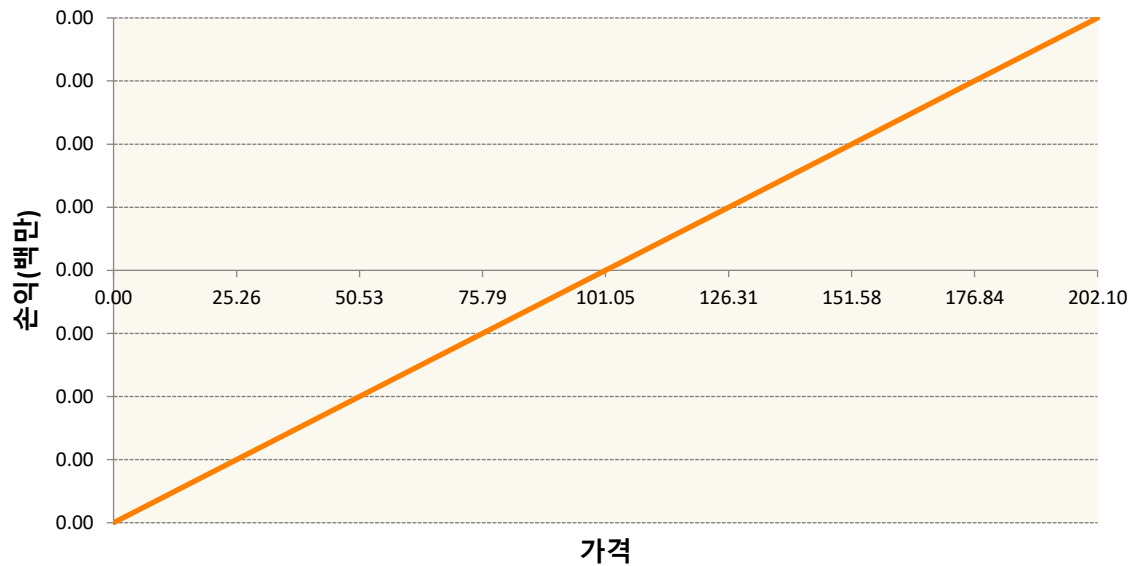
1. 계약금액

(단위:백만원)

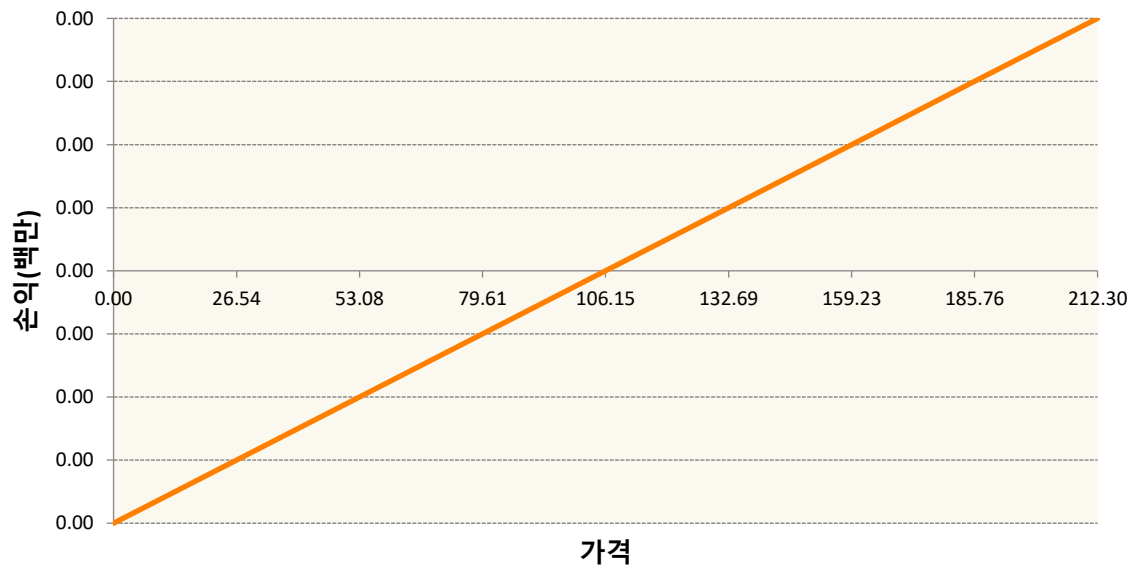
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,532	625	1,907	

2. 만기시점의 손익구조

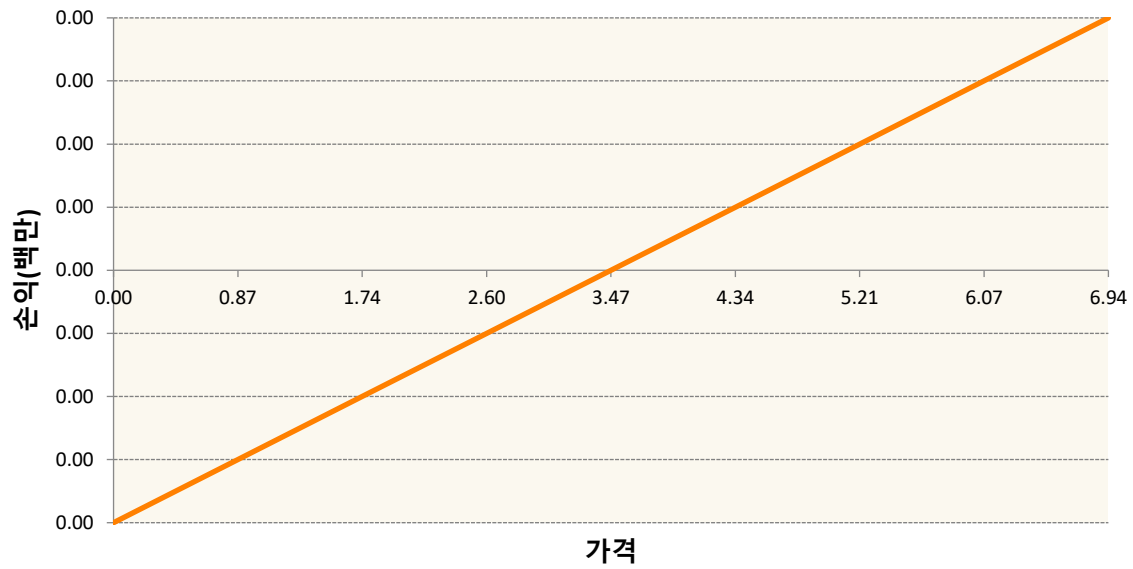
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



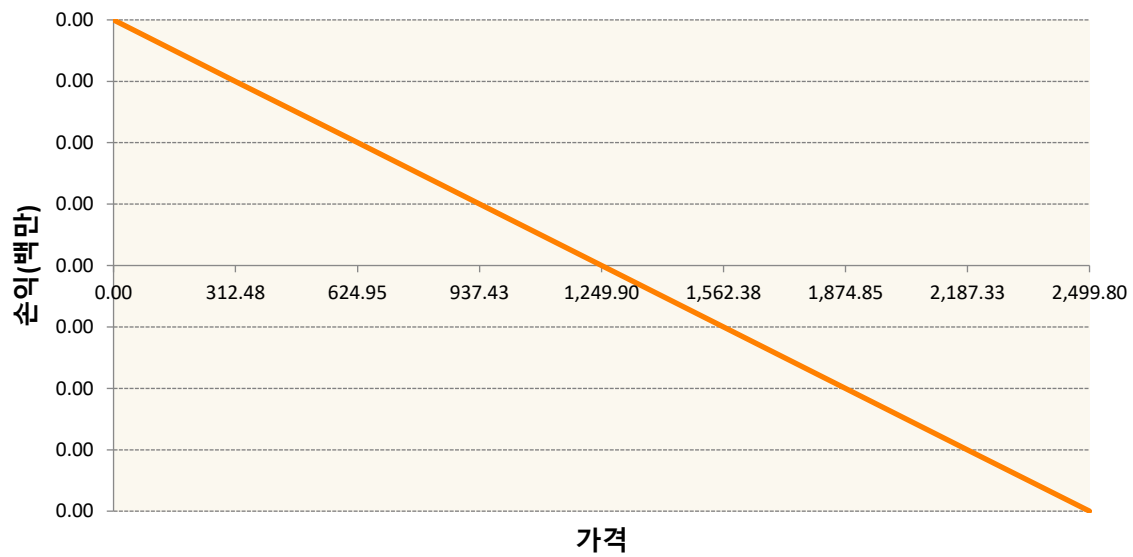
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



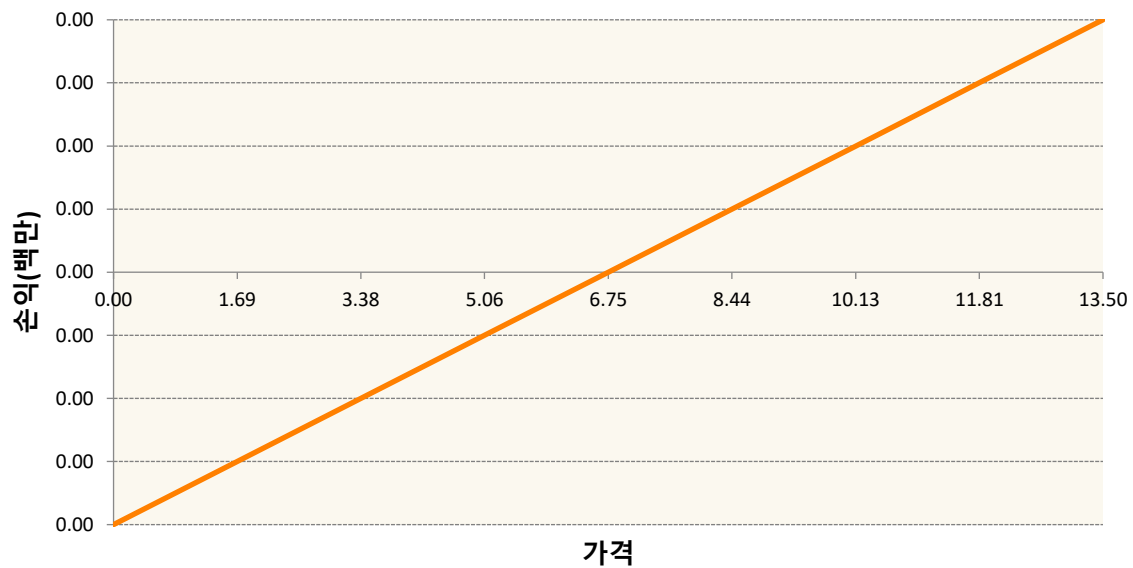
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

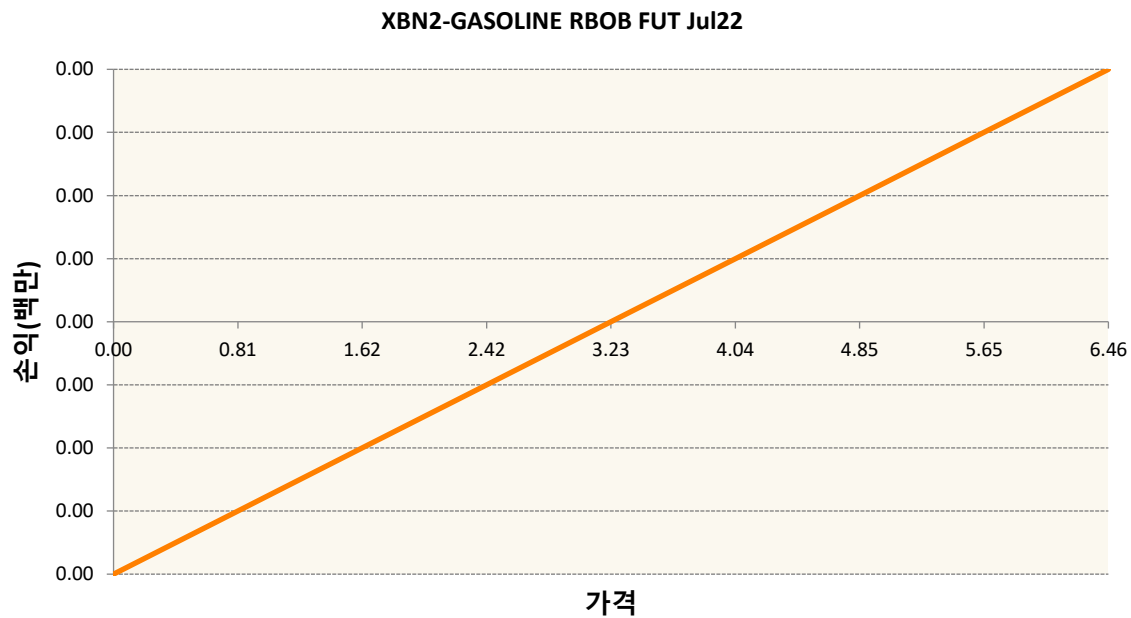
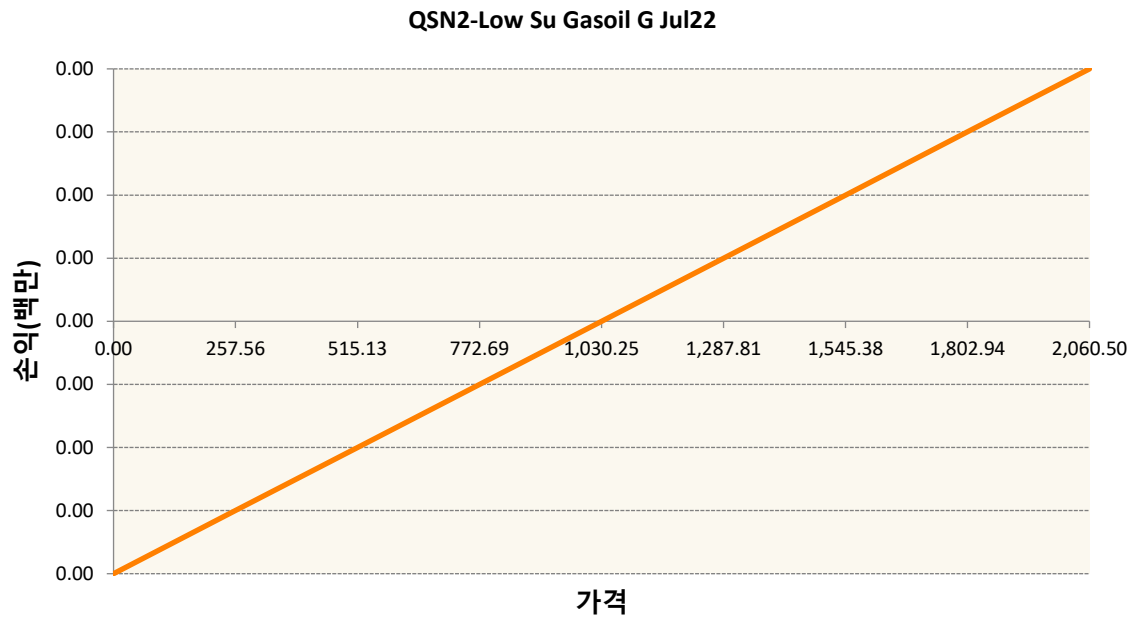


KR4175S50003-2022-05 달러선물



NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLN2	WTI CRUDE FUTURE Jul22		40
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		42
HON2	NY Harb ULSD Fut Jul22		14
KR4175S500 2022-05 달러선물			50
NGN22	NATURAL GAS FUTR Jul22		73
QSN2	Low Su Gasoil G Jul22		20
XBN2	GASOLINE RBOB FUT Jul22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		588