

공시일	2022-04-27
기준일	2022-04-26

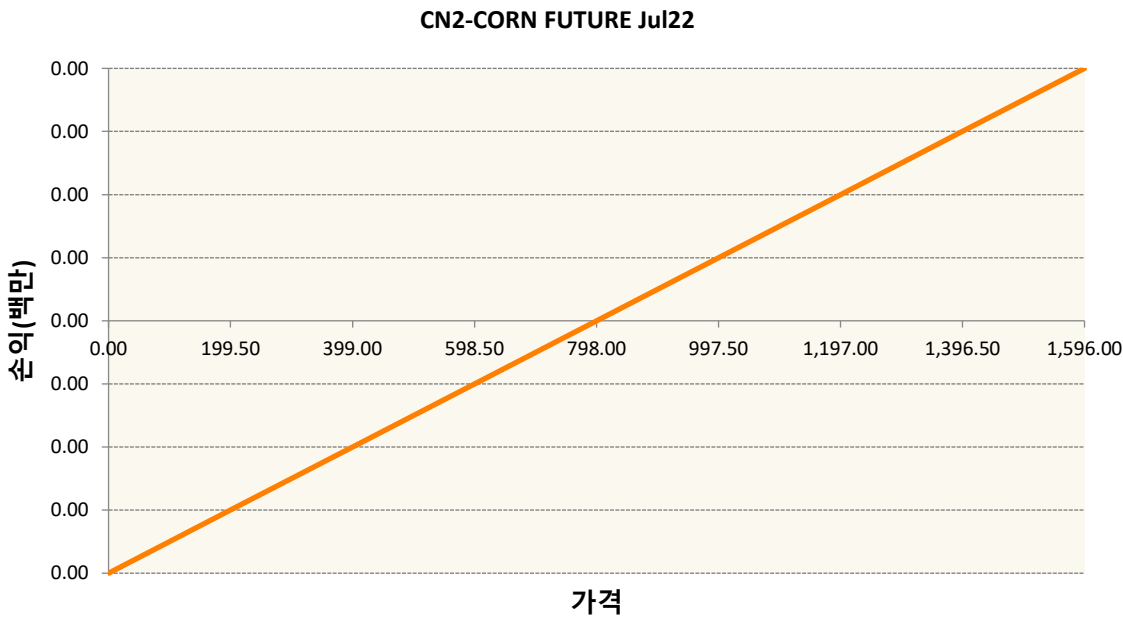
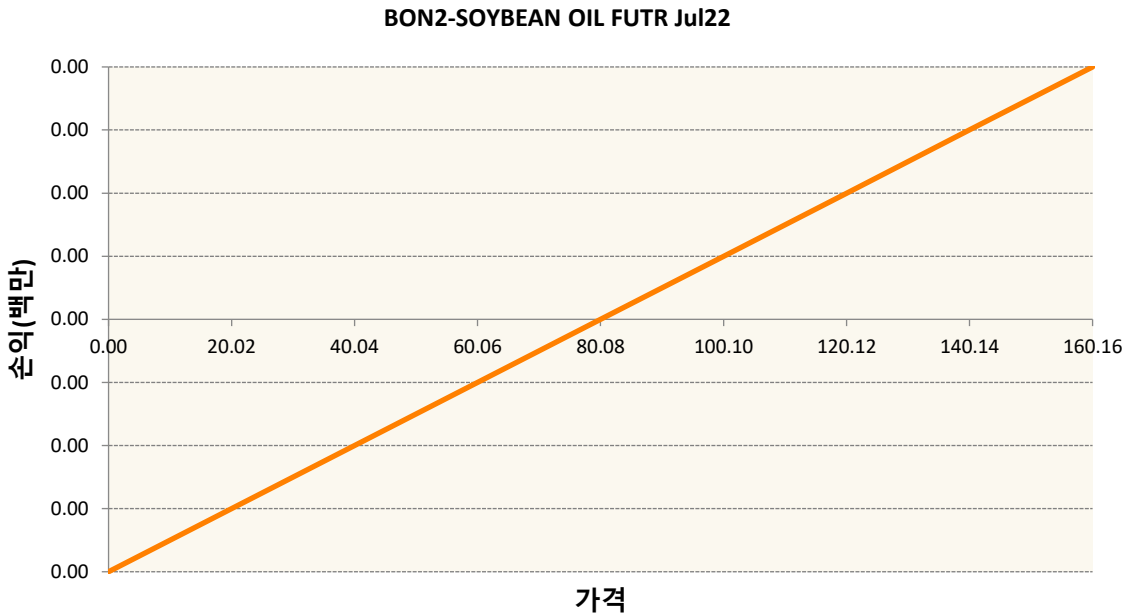
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

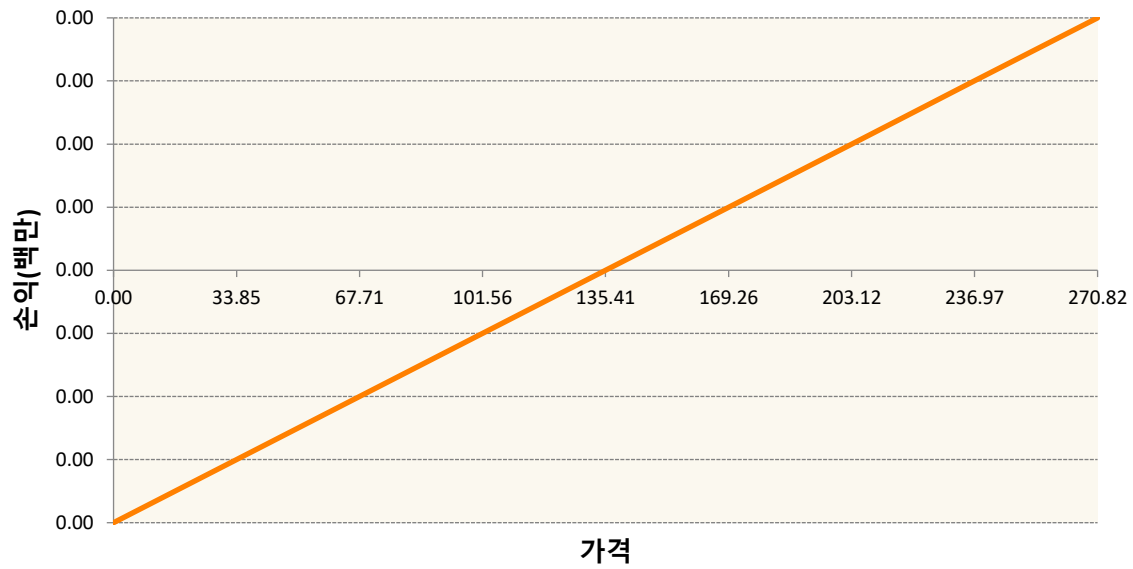
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,566	1,942	6,624	

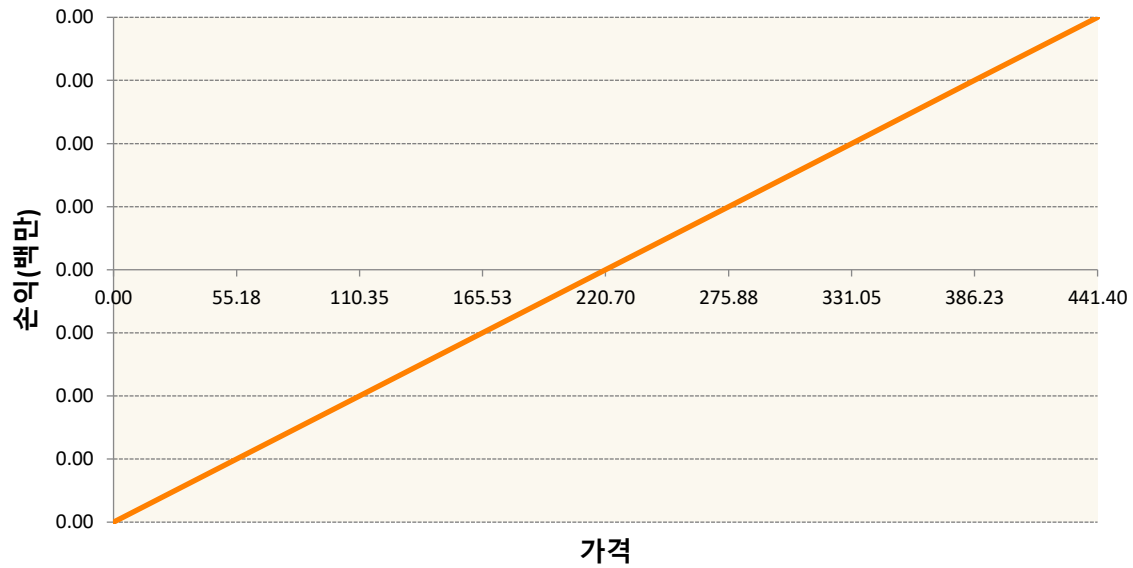
2. 만기시점의 손익구조



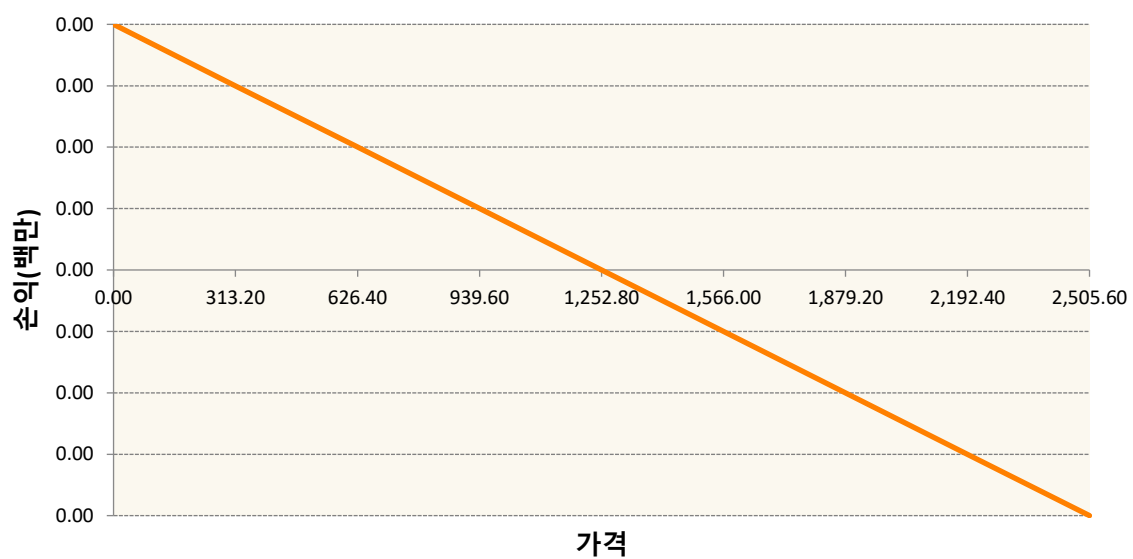
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



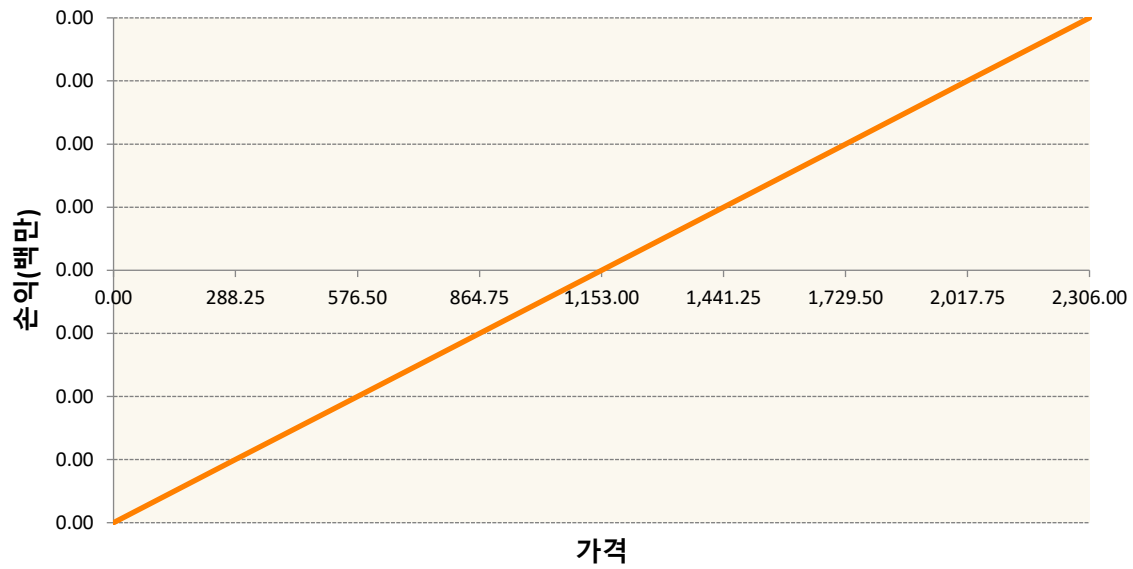
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



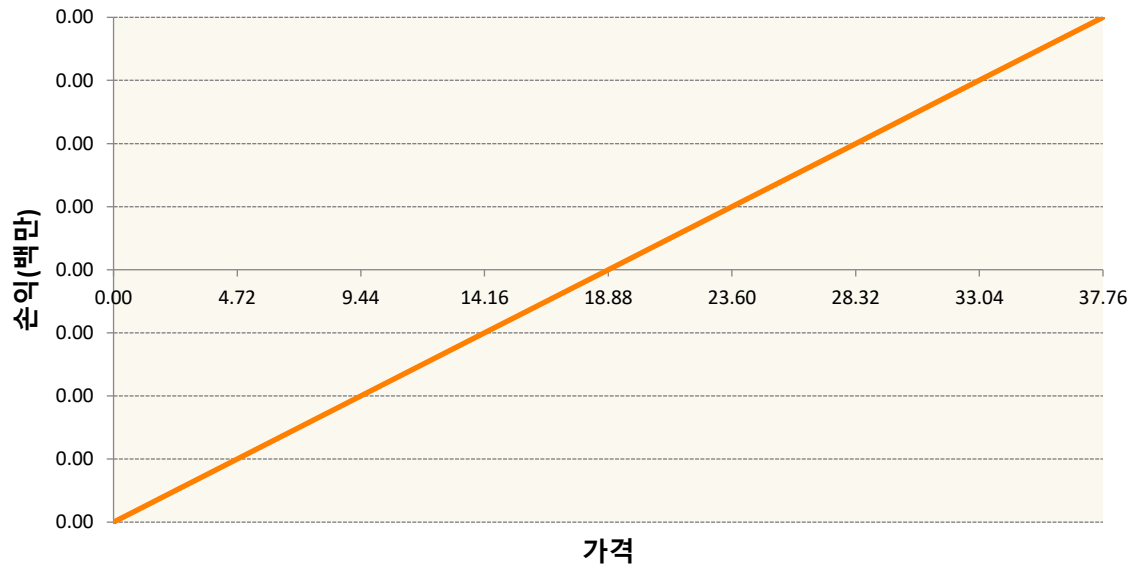
KR4175S50003-2022-05 달러선물



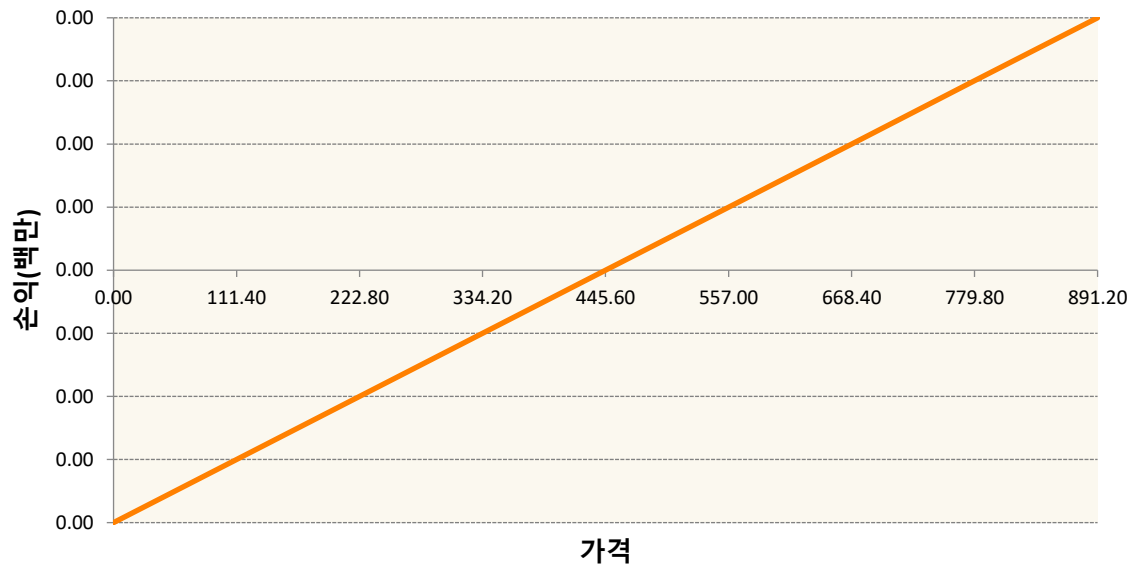
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22

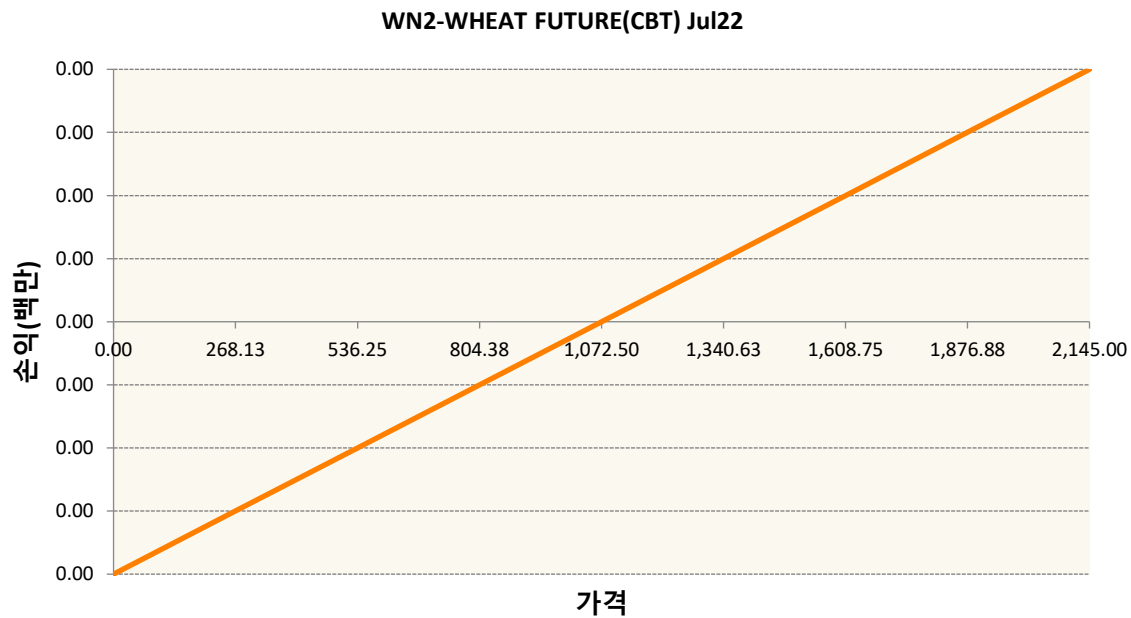
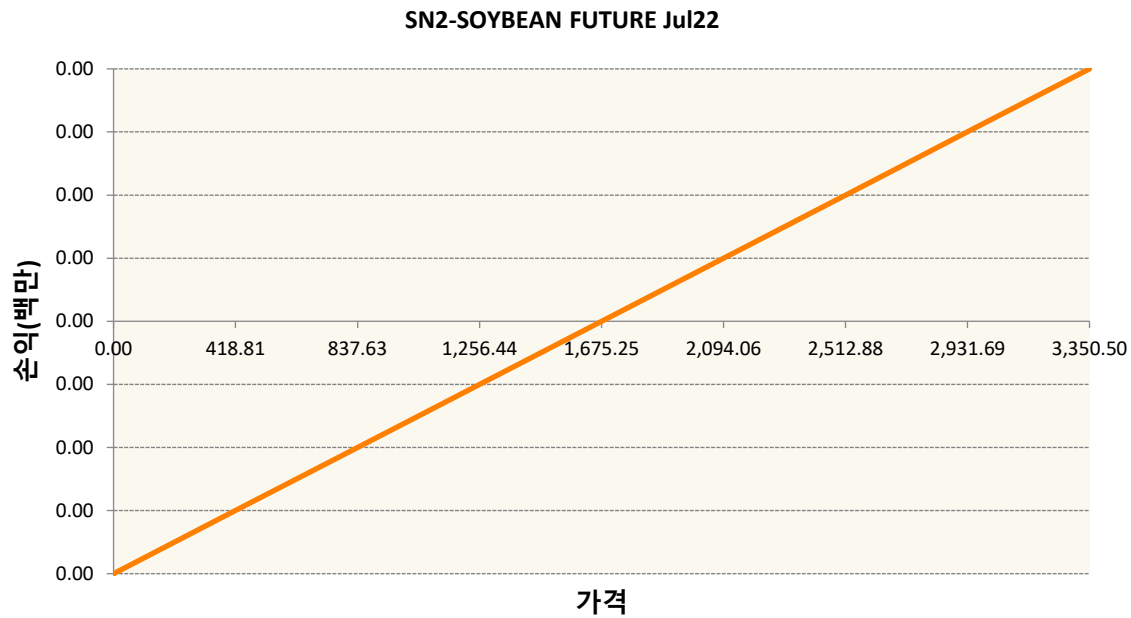


SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2022-04-27
기준일	2022-04-26

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	321
-----------------------------	-----

* 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	2022-04-27
기준일	2022-04-26

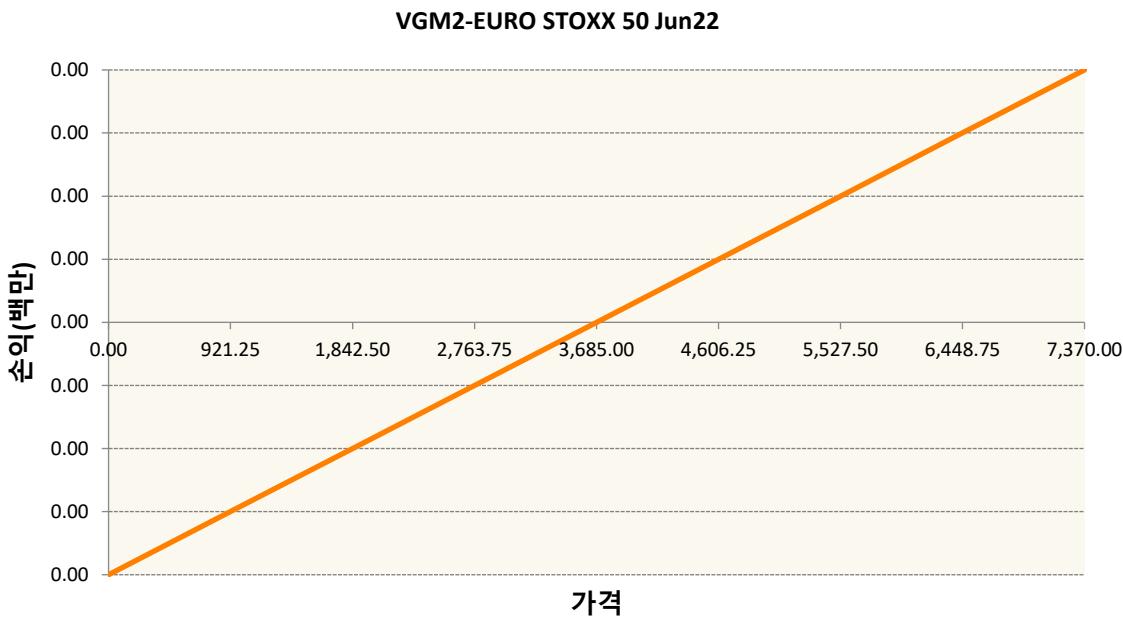
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	550	0	550	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2	EURO STOXX 50 Jun22	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-04-27
기준일	2022-04-26

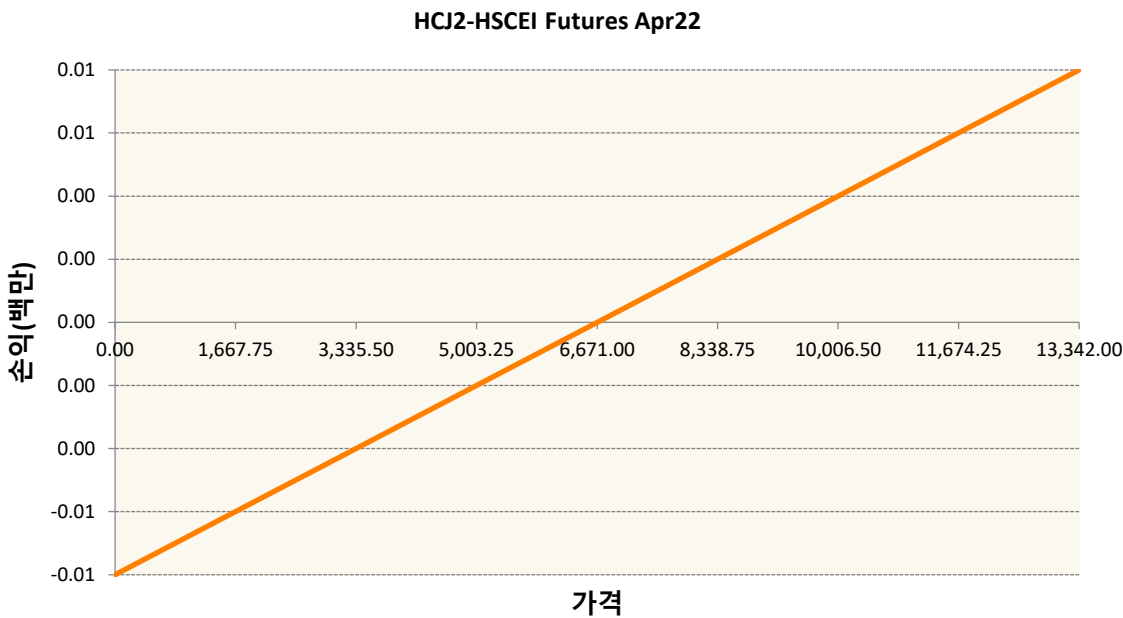
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,027	0	1,027	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI2	HSCEI Futures Apr22	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

111

공시일	2022-04-27
기준일	2022-04-26

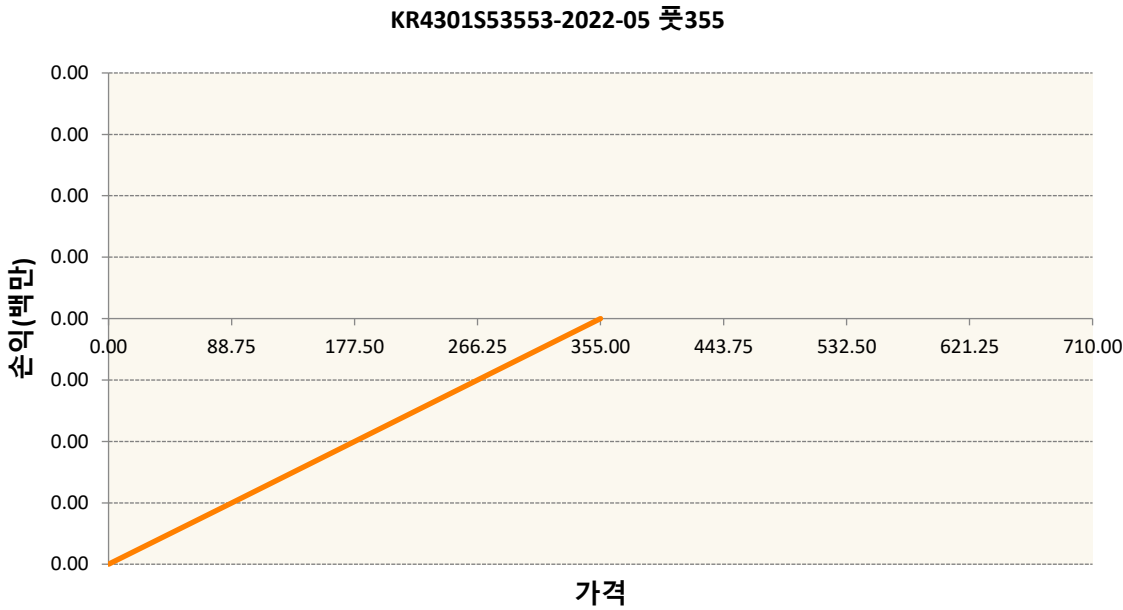
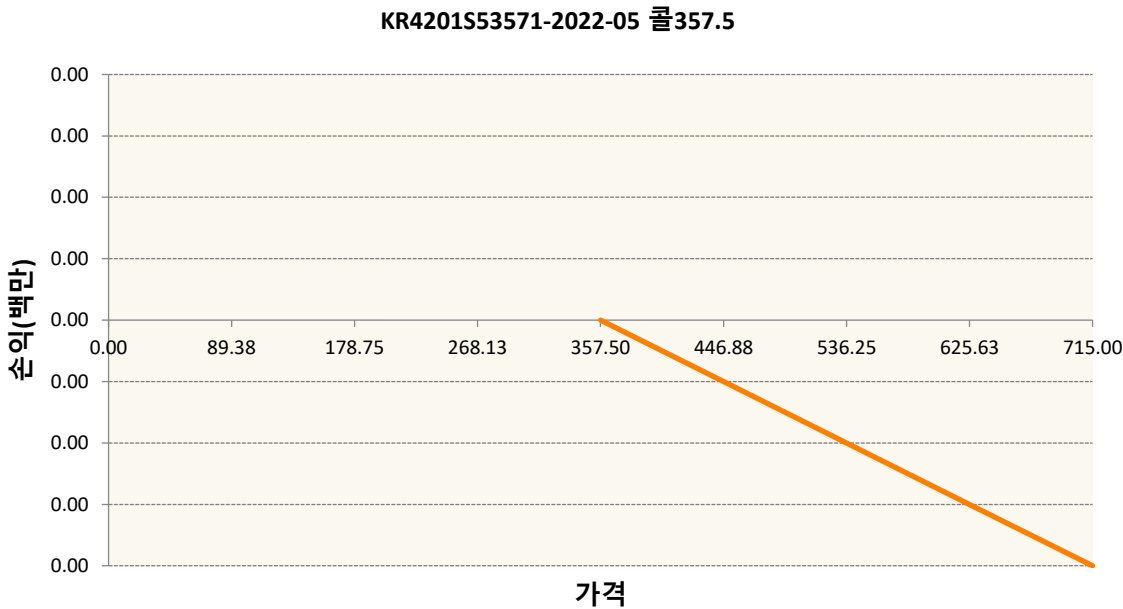
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

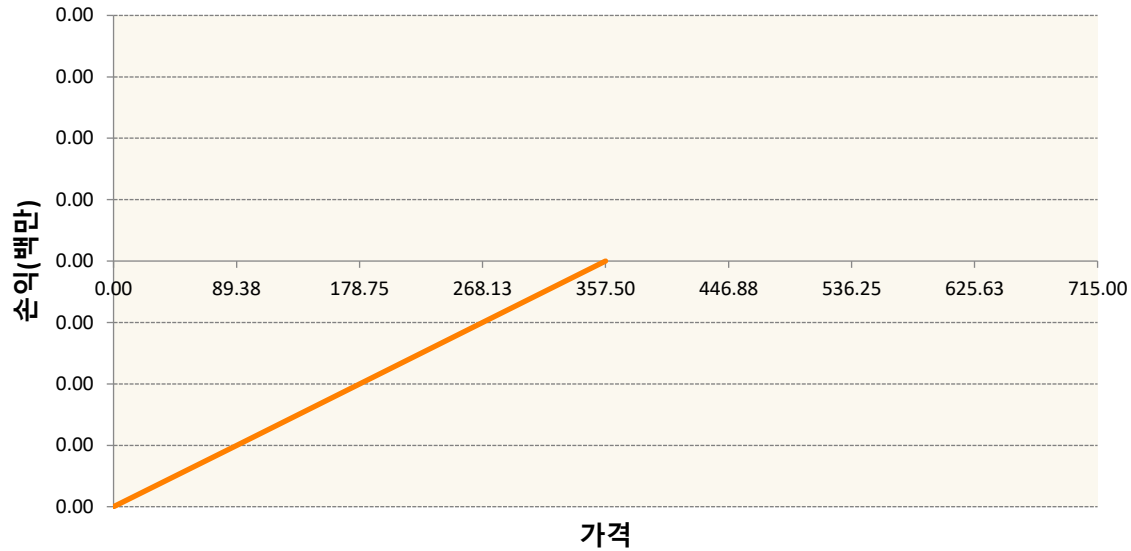
(단위:백만원)

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				2,982
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	923	908	887	859	825	784	737
-5.33%	869	830	782	727	666	599	527
-2.67%	705	629	547	460	369	275	179
0%	330	221	111	0	-112	-225	-338
2.67%	-336	-453	-571	-688	-806	-924	-1,042
5.33%	-1,303	-1,400	-1,501	-1,606	-1,712	-1,820	-1,930
8.00%	-2,505	-2,568	-2,640	-2,718	-2,802	-2,890	-2,982
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	-223	-224	-225
-5.33%	-137	-137	-138	-139	-141	-142	-144
-2.67%	-55	-57	-59	-62	-65	-68	-72
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	54	50	46	42	37	33	29
5.33%	72	69	67	64	61	58	54
8.00%	76	75	74	73	71	70	67
KR4301S53579			2022-05 풋357.5				627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-623	-623	-623	-624	-625	-626	-627
-5.33%	-390	-391	-393	-395	-398	-401	-405
-2.67%	-164	-169	-174	-181	-187	-195	-203
0%	32	22	11	0	-11	-22	-34

2.67%	165	153	140	128	116	104	91
5.33%	226	218	210	201	191	182	171
8.00%	244	242	238	233	228	222	215

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

(단위:백만원)

3,696

공시일 2022-04-27

기준일 2022-04-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

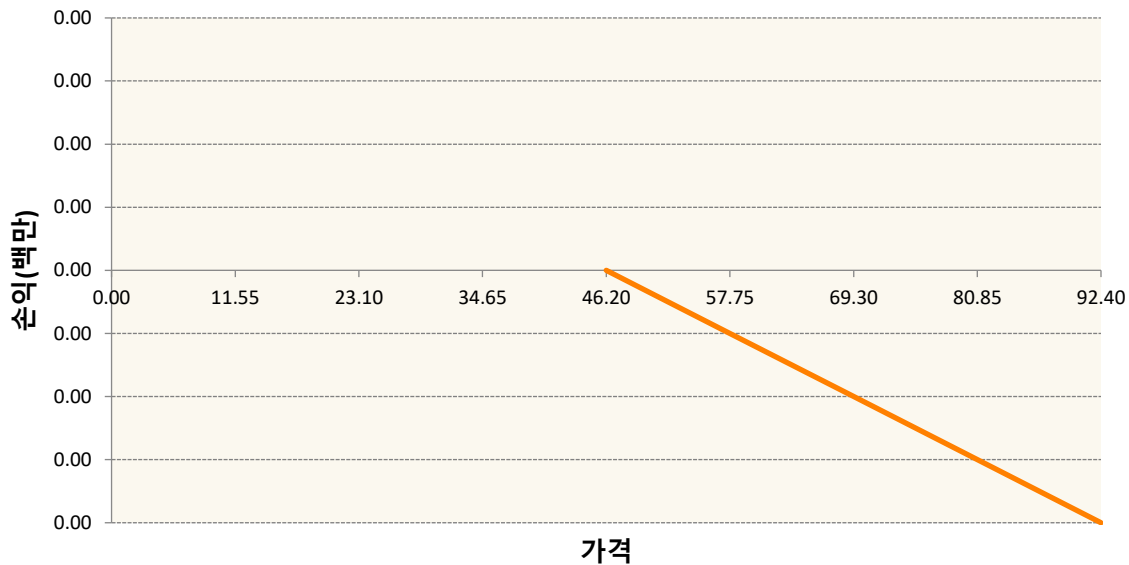
1. 계약금액

(단위:백만원)

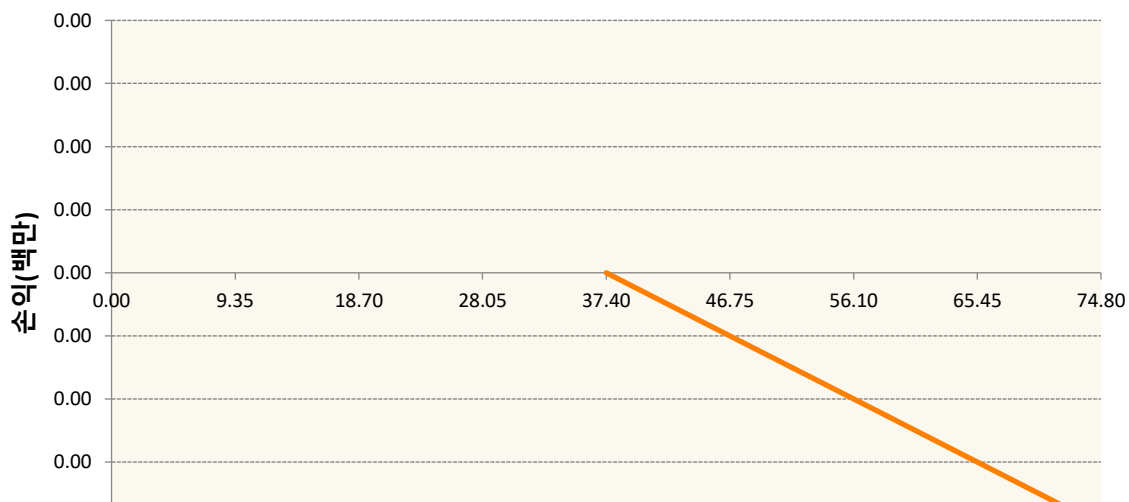
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	77	-77	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,473	-1,473	장외

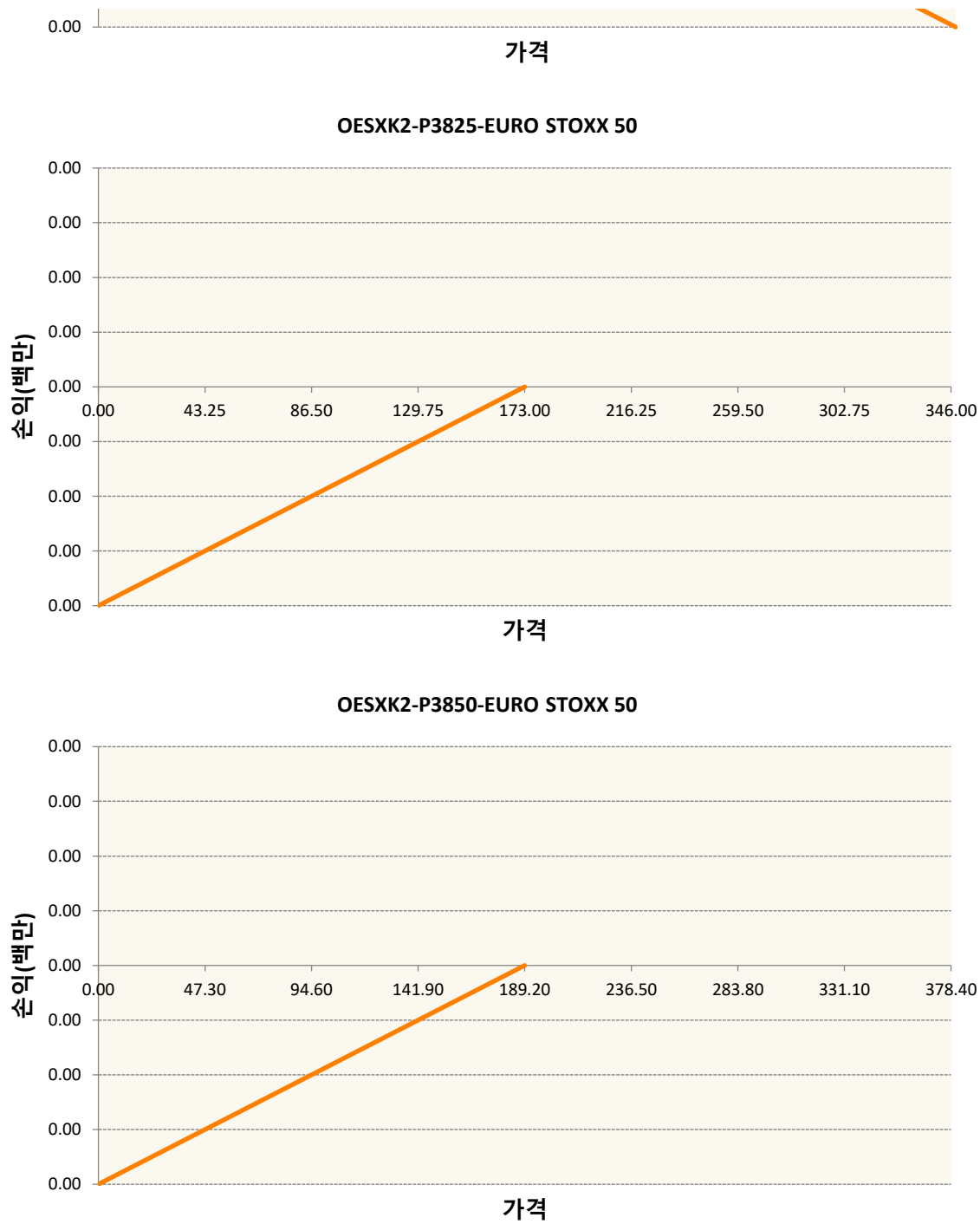
2. 만기시점의 손익구조

OESXK2-C3825-EURO STOXX 50



OESXK2-C3850-EURO STOXX 50





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

23
21
64
32
0.05
1
0.19
5

공시일 2022-04-27

기준일 2022-04-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

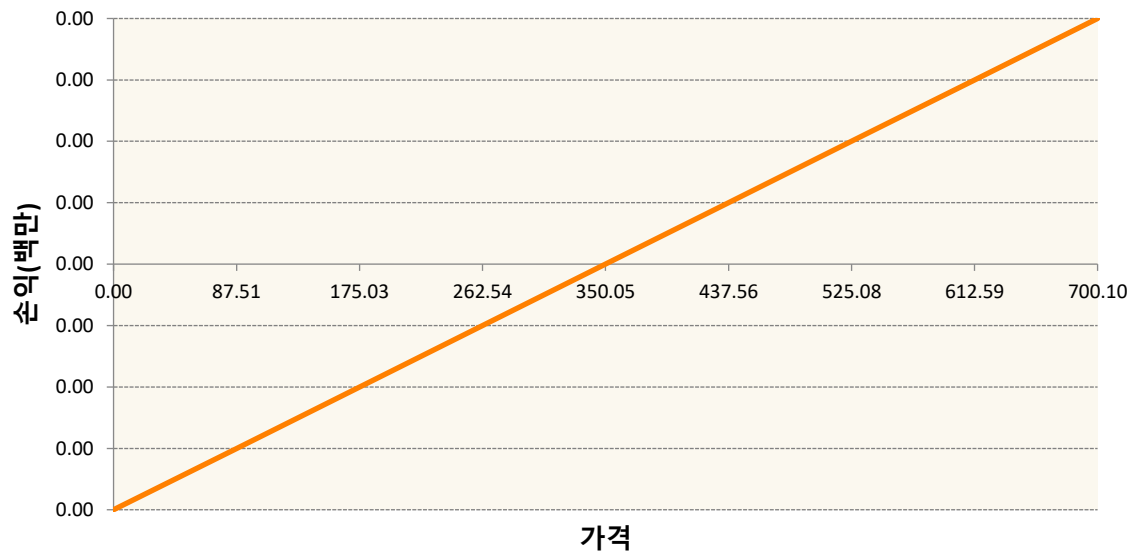
1. 계약금액

(단위:백만원)

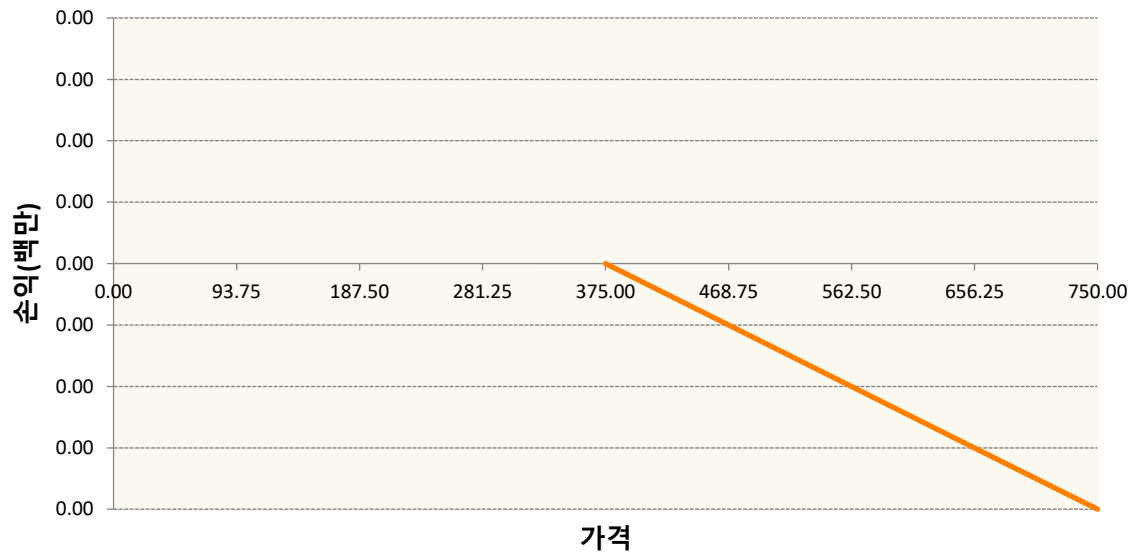
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	613	0	613	장내
누계	유가증권	옵션	268	4,878	-4,610	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S53753-2022-05 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	순이익 (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					144
	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	12
-2.67%	19	17	15	12	9	5	1
0%	13	9	5	0	-5	-11	-18
2.67%	-2	-9	-16	-23	-31	-39	-47
5.33%	-34	-43	-52	-61	-70	-79	-88
8.00%	-88	-97	-106	-116	-125	-134	-144
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	-5
5.33%	-3	-4	-5	-6	-7	-8	-9
8.00%	-8	-9	-10	-11	-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	-3	-3	-3
5.33%	-7	-7	-6	-6	-6	-5	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-6

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

(단위:백만원)

171

공시일 2022-04-27

기준일 2022-04-26

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	9,388	0	9,388	

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	2022-04-27
기준일	2022-04-26

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	109	-109	
누계	유가증권	수익증권	7,249	0	7,249	

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	2022-04-27
기준일	2022-04-26

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	260	-260	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	23,570	0	23,570	
누계	통화	선도	1,501	25,179	-23,678	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4MKRW/USD 27-06-22E	2,014
FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E	120
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

724

공시일 2022-04-27

기준일 2022-04-26

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

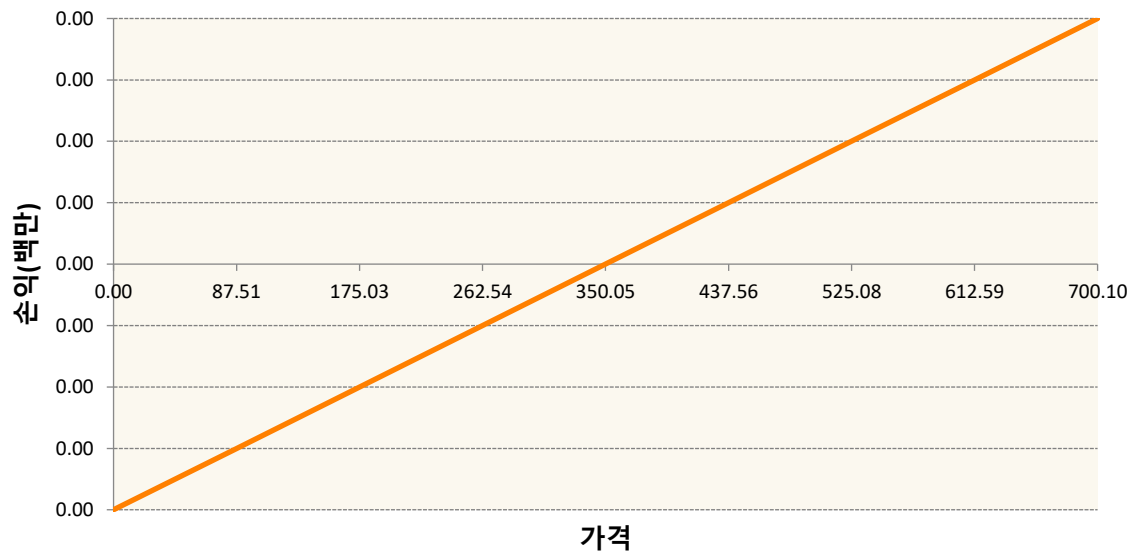
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,225	0	1,225	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 2022-04-27

기준일 2022-04-26

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

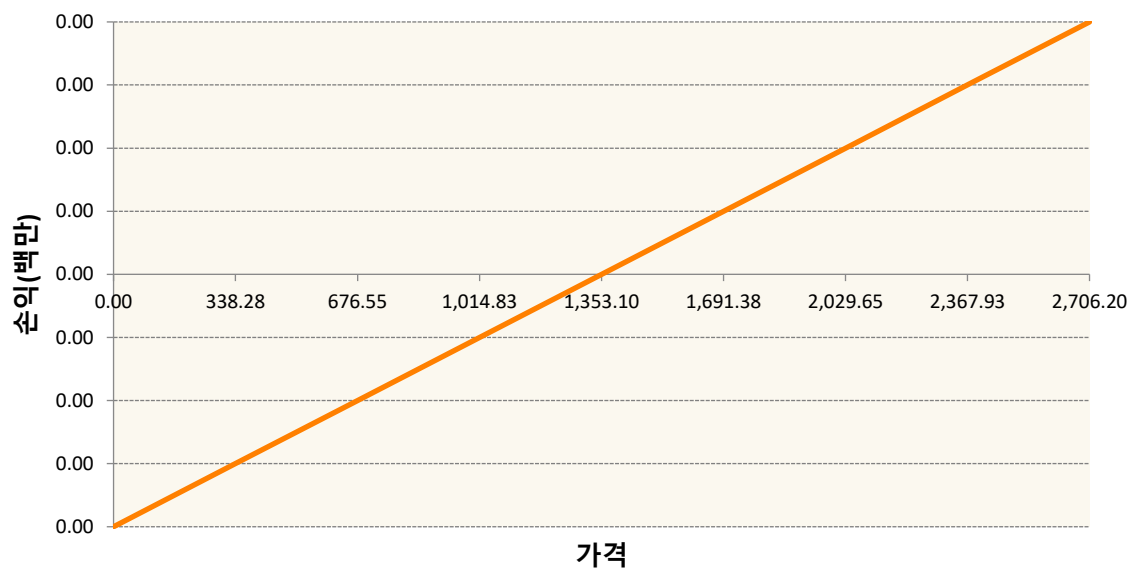
1. 계약금액

(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	736	0	736	
누계	유가증권	스왑	1,854	0	1,854	장외
누계	통화	선도	0	1,179	-1,179	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCK2-VN30 Index Future May22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	148
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	59

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

(단위:백만원)

271

공시일	2022-04-27
기준일	2022-04-26

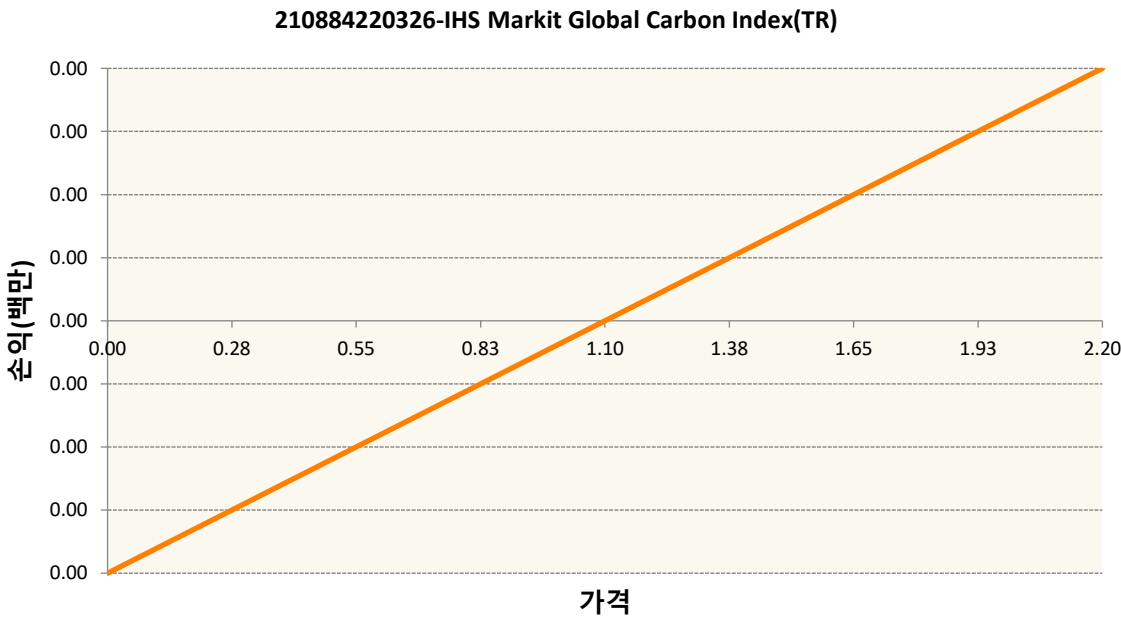
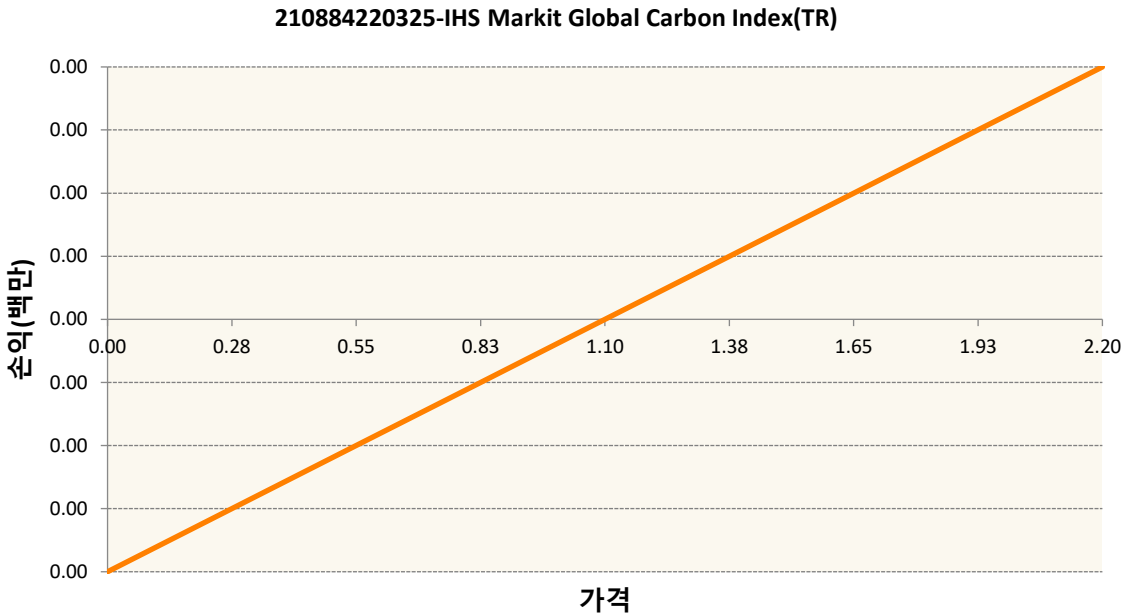
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

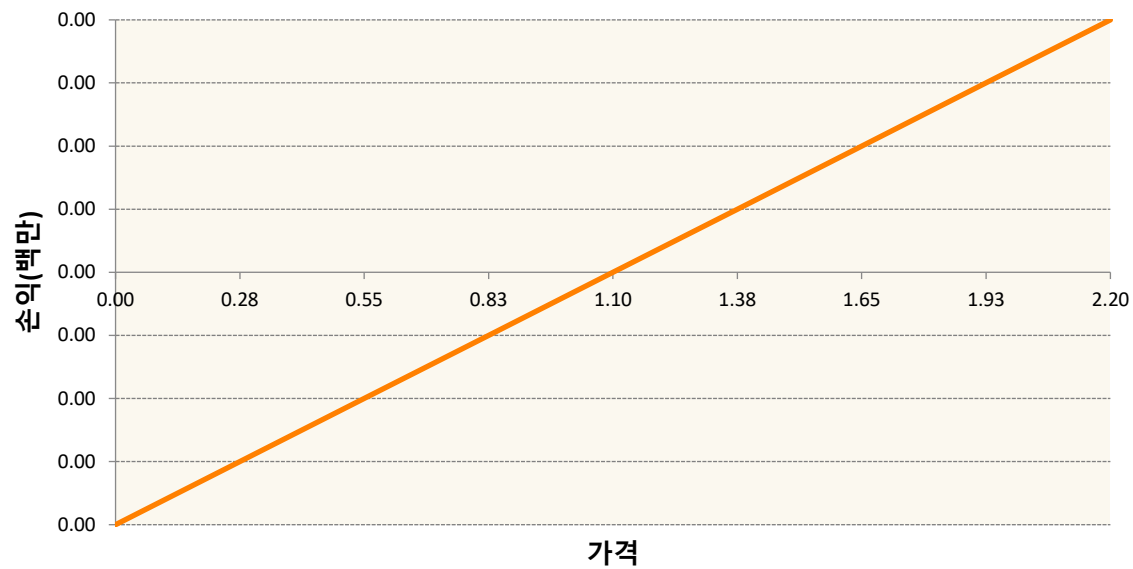
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	46,712	0	46,712	

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)

197

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

3,443

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

99

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

(단위:백만원)

6,904

공시일	2022-04-27
기준일	2022-04-26

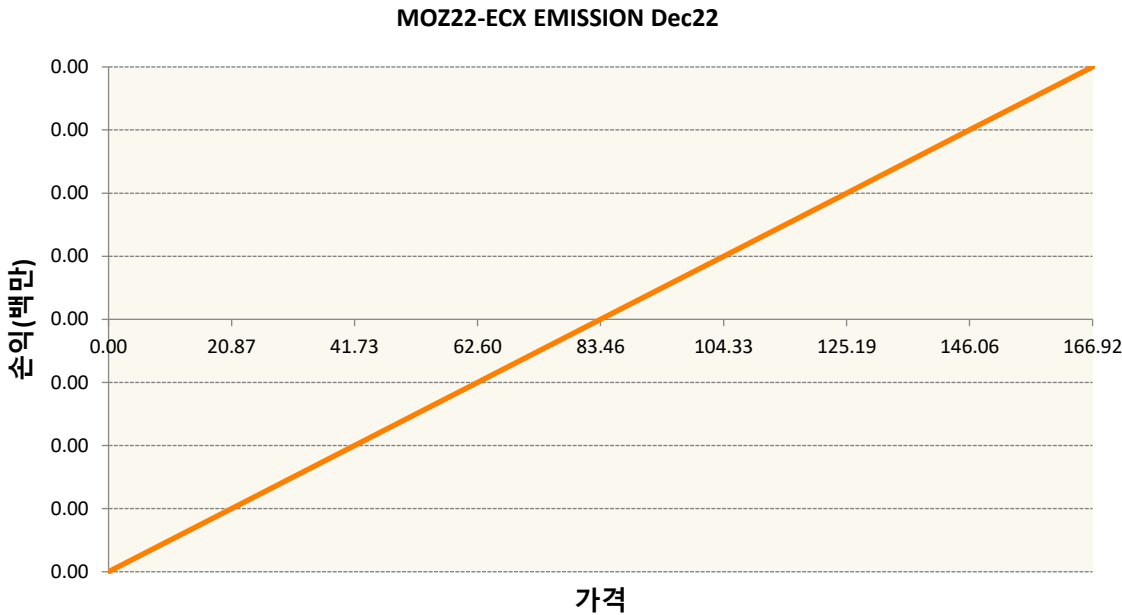
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	16,896	0	16,896	
누계	통화	선도	0	9,712	-9,712	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4R₩ KRW/EUR 23-05-22E	777
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,352

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

(단위:백만원)

3,680

공시일	2022-04-27
기준일	2022-04-26

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)	66
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	66
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	66
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	66

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

(단위:백만원)

507

공시일	2022-04-27
기준일	2022-04-26

SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	412	0	412	장외
누계	지수	스왑	8,851	0	8,851	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)	23
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220426(메리츠)	2

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

(단위:백만원)

106

공시일 2022-04-27

기준일 2022-04-26

에쿼티알파일반사모혼합자산

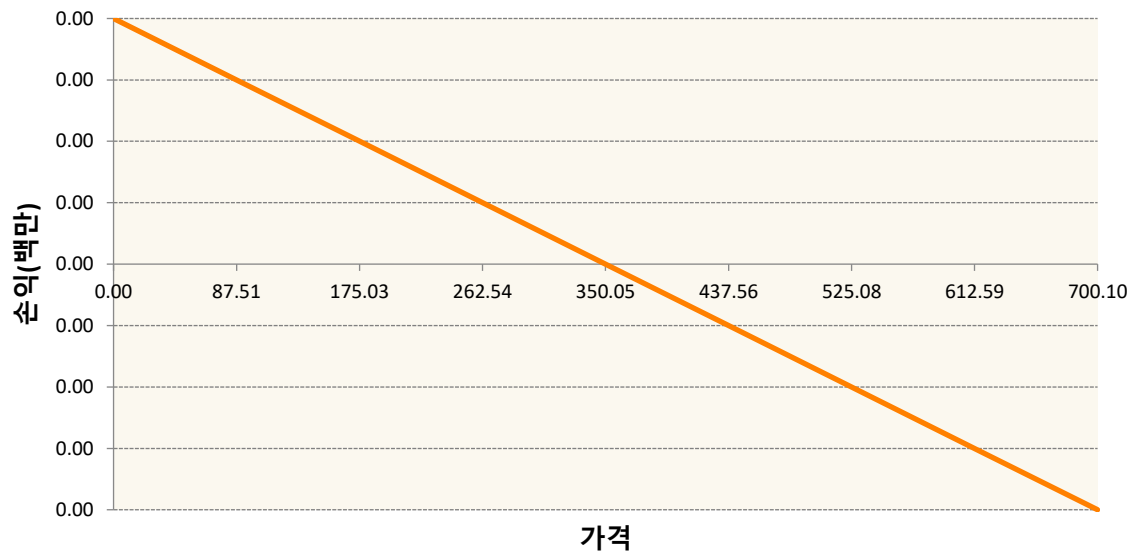
1. 계약금액

(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	2,188	-2,188	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	175
KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322	3
KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322	1
KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322	0.21
KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331	0.25
KRS0003070 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0407	1
KRS0003070 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0407	0.21
KRS0003086 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0412	1

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

(단위:백만원)

공시일 2022-04-27

기준일 2022-04-26

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

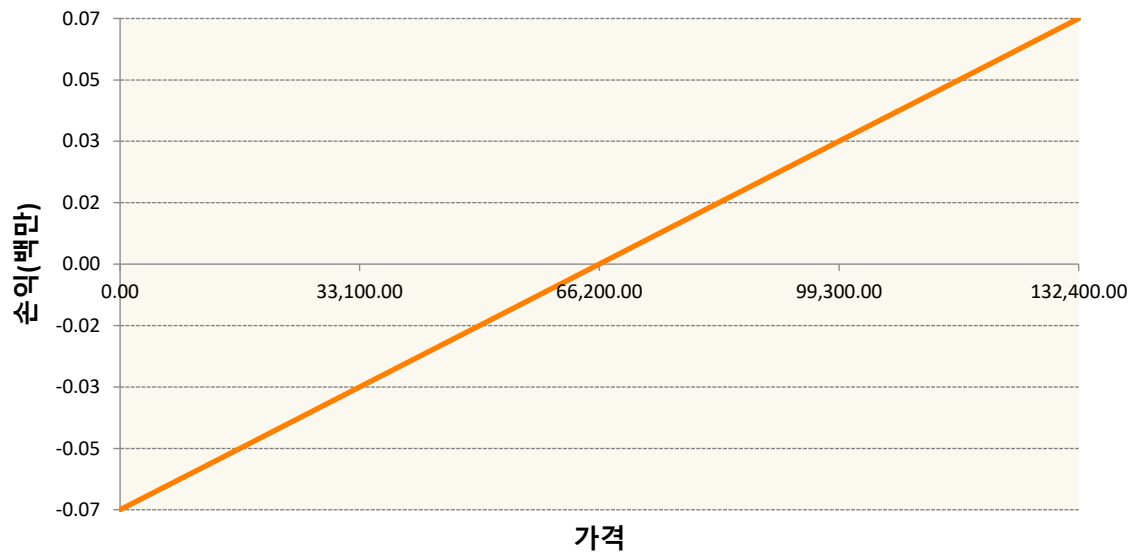
1. 계약금액

(단위:백만원)

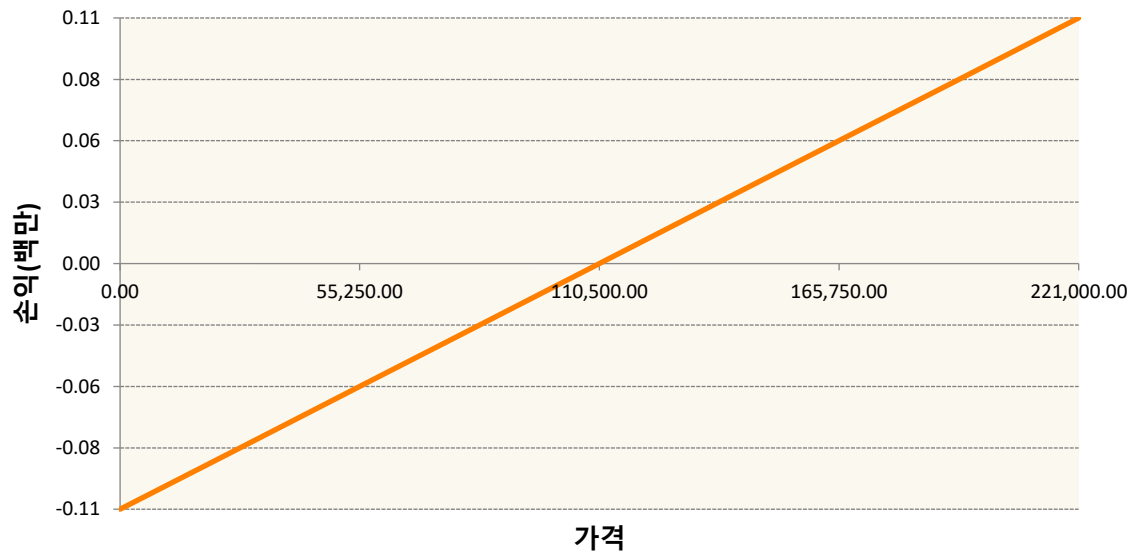
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	878	0	878	장내

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					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

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

76

공시일 2022-04-27

기준일 2022-04-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

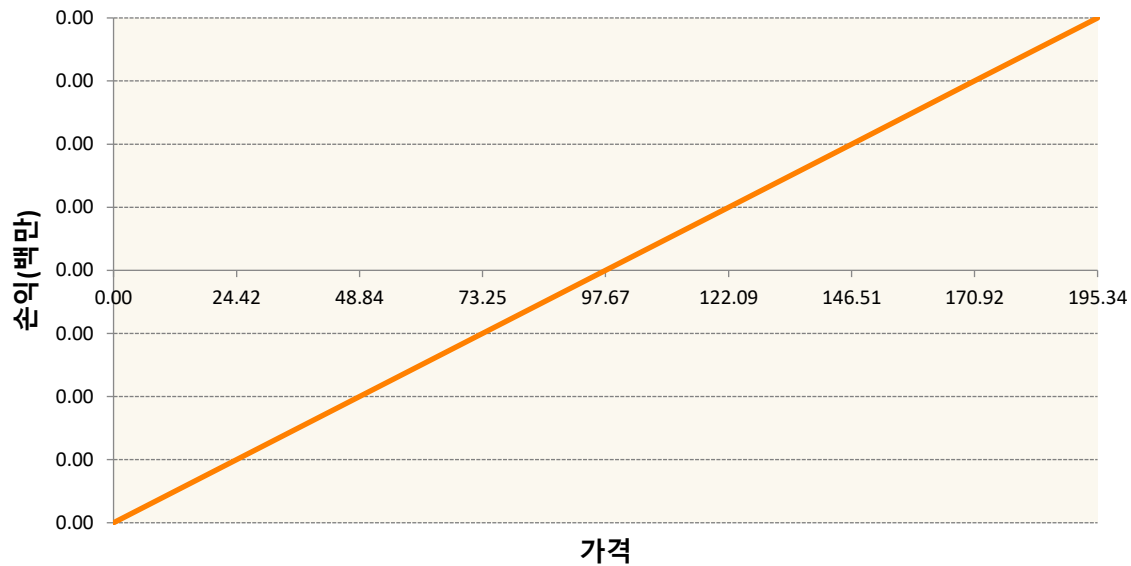
1. 계약금액

(단위:백만원)

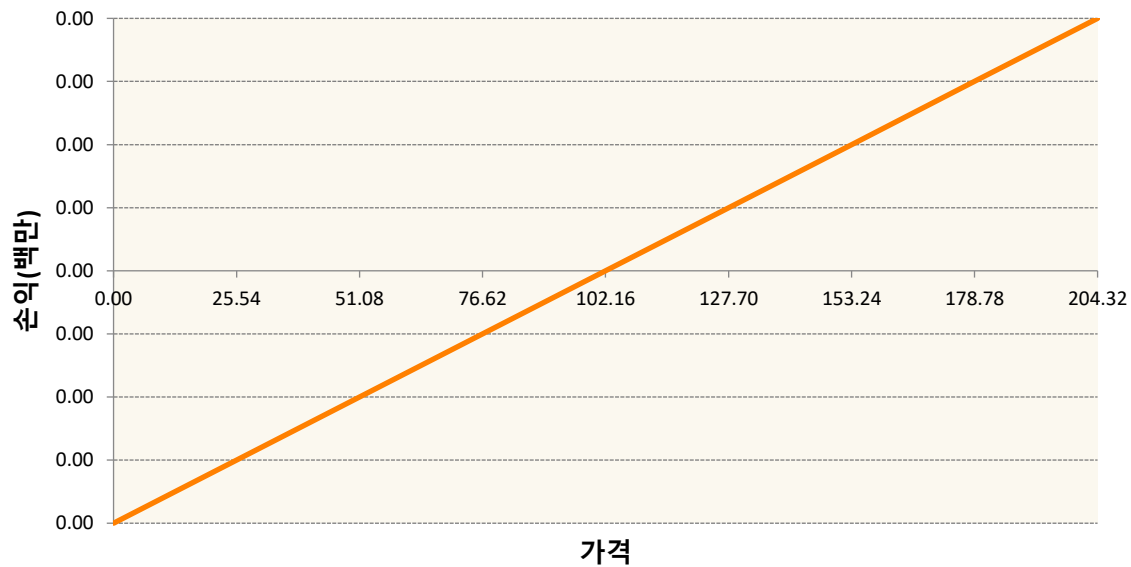
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,496	626	1,870	

2. 만기시점의 손익구조

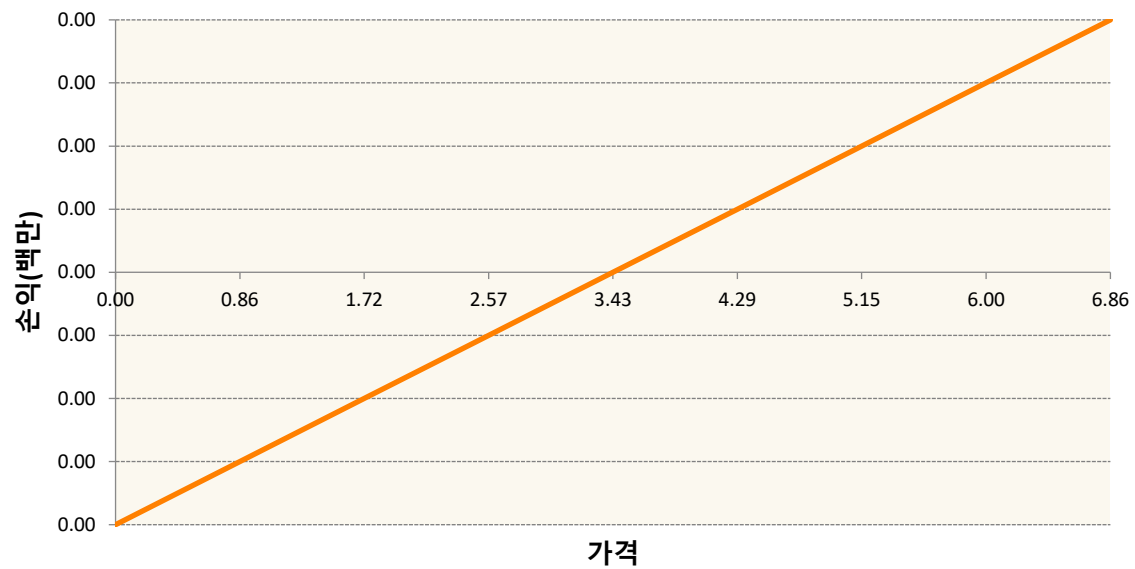
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



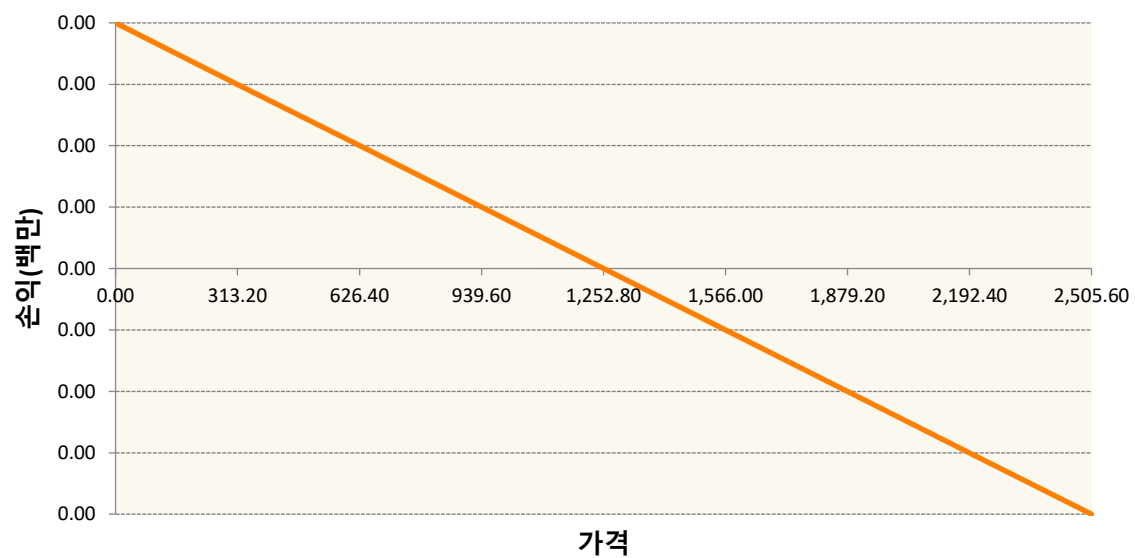
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



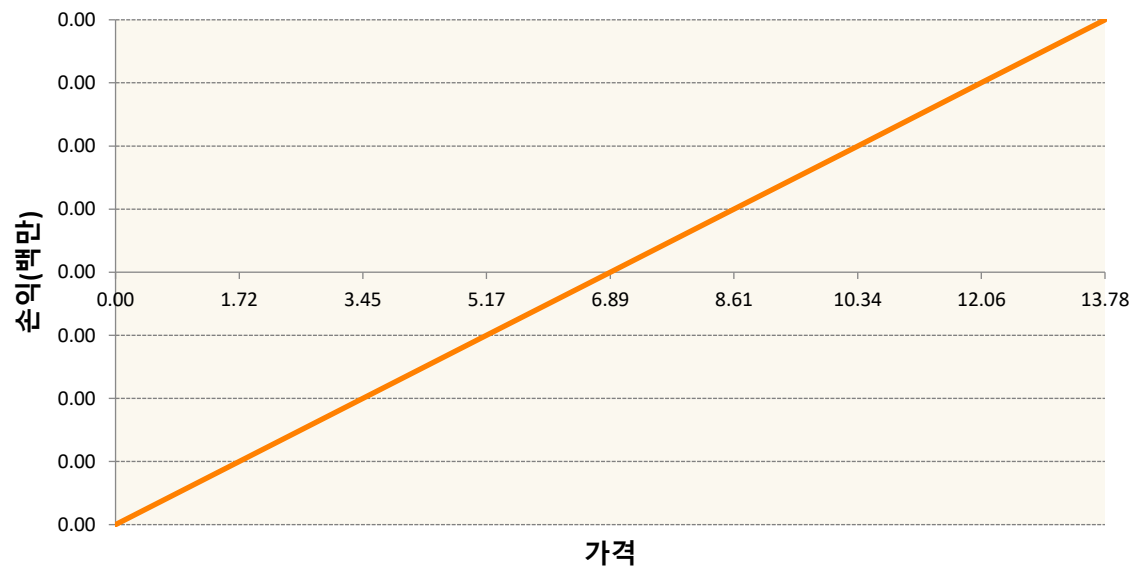
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

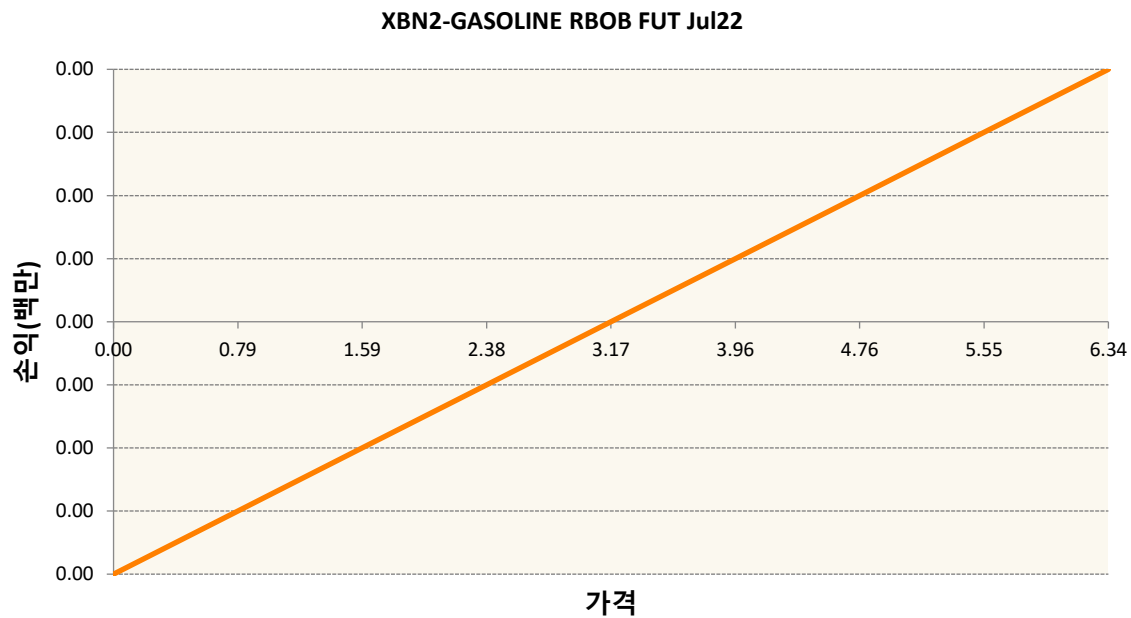
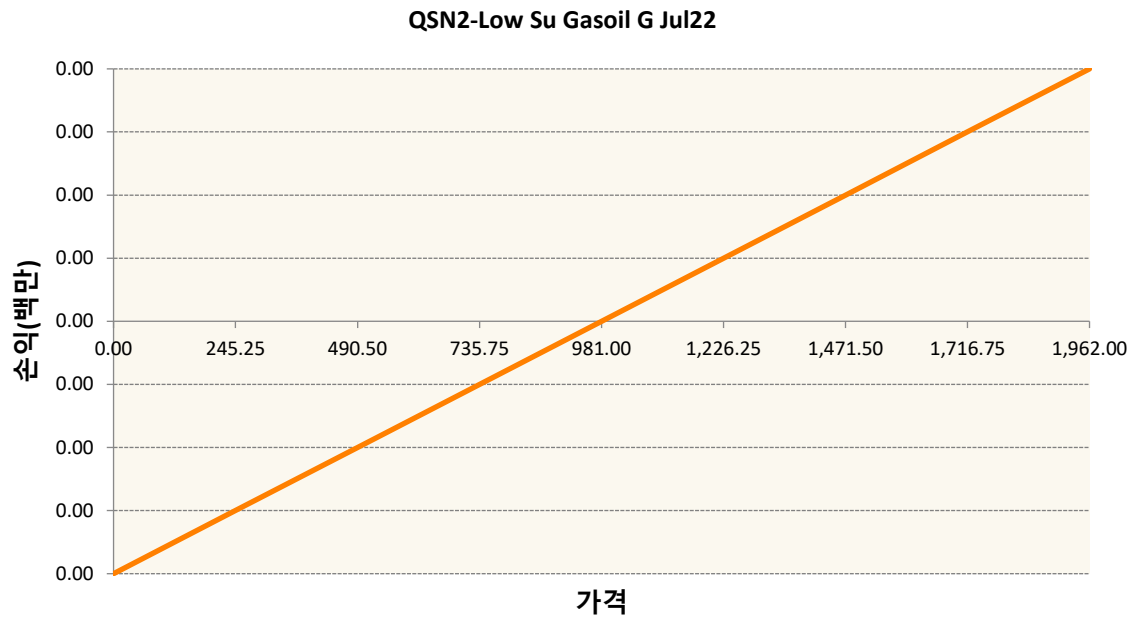


KR4175S50003-2022-05 달러선물



NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLN2	WTI CRUDE FUTURE Jul22		38
CON2	BRENT CRUDE FUTR Jul22		40
HON2	NY Harb ULSD Fut Jul22		14
KR4175S500 2022-05 달러선물			50
NGN22	NATURAL GAS FUTR Jul22		75
QSN2	Low Su Gasoil G Jul22		19
XBN2	GASOLINE RBOB FUT Jul22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		584