

공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

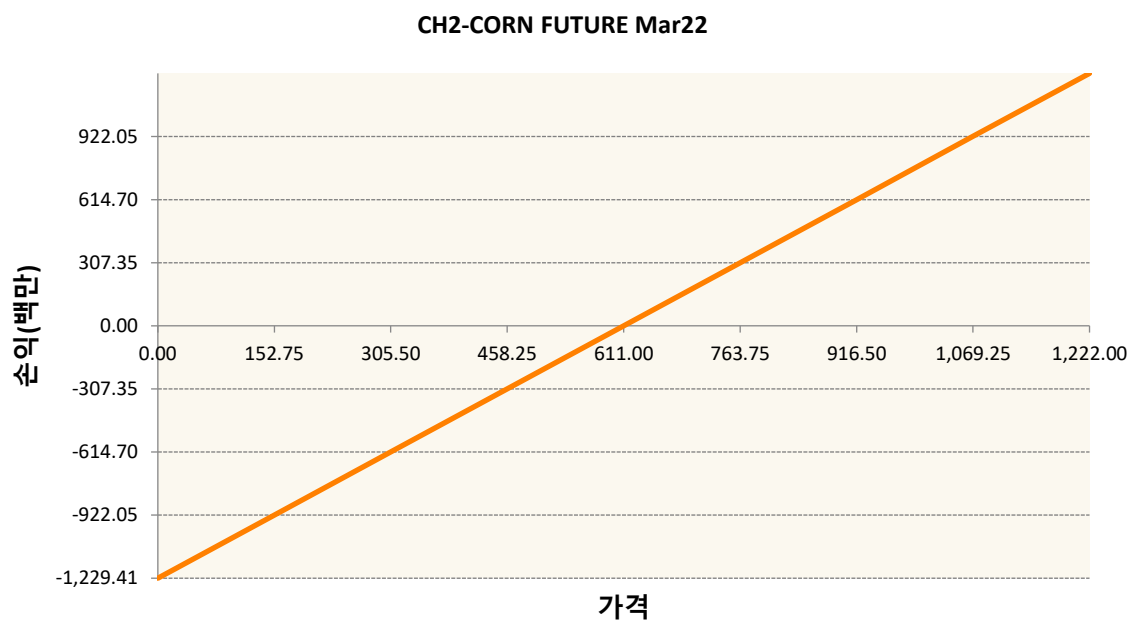
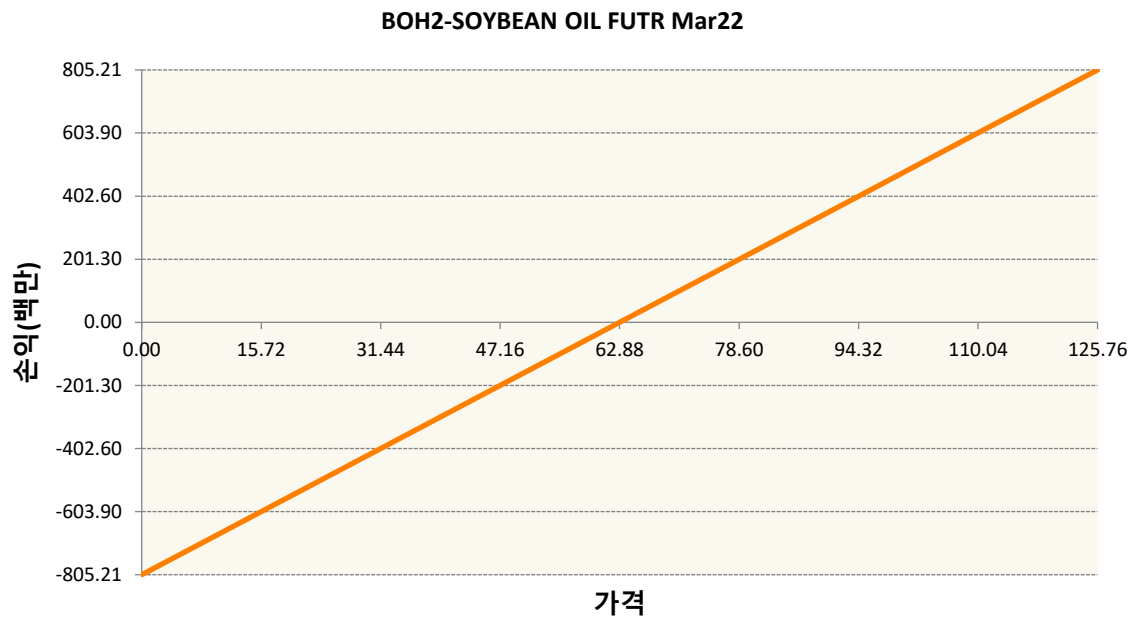
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

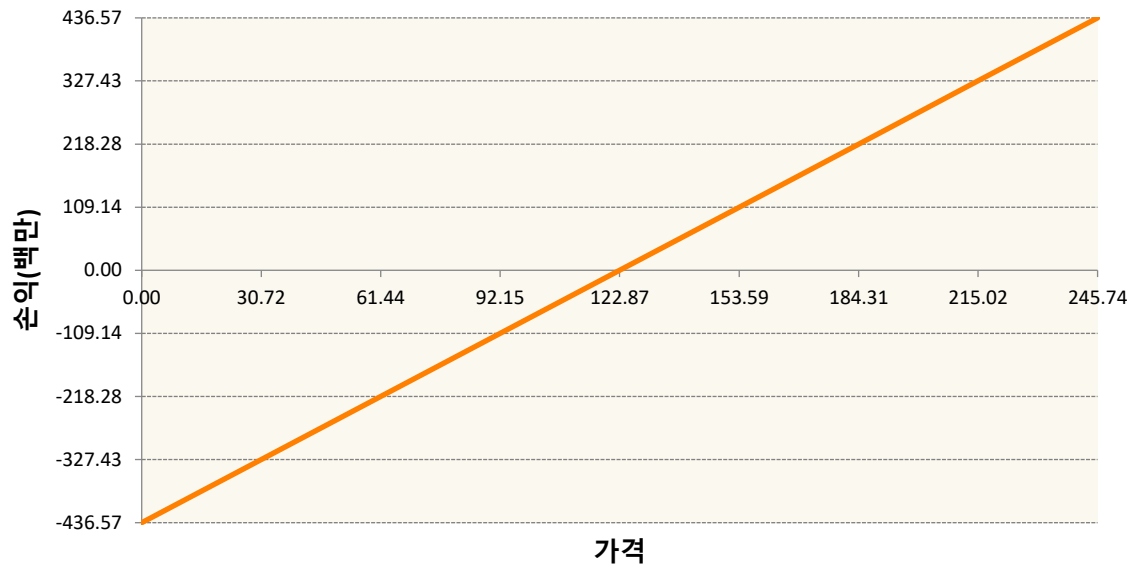
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,721 | 776   | 5,945     |    |

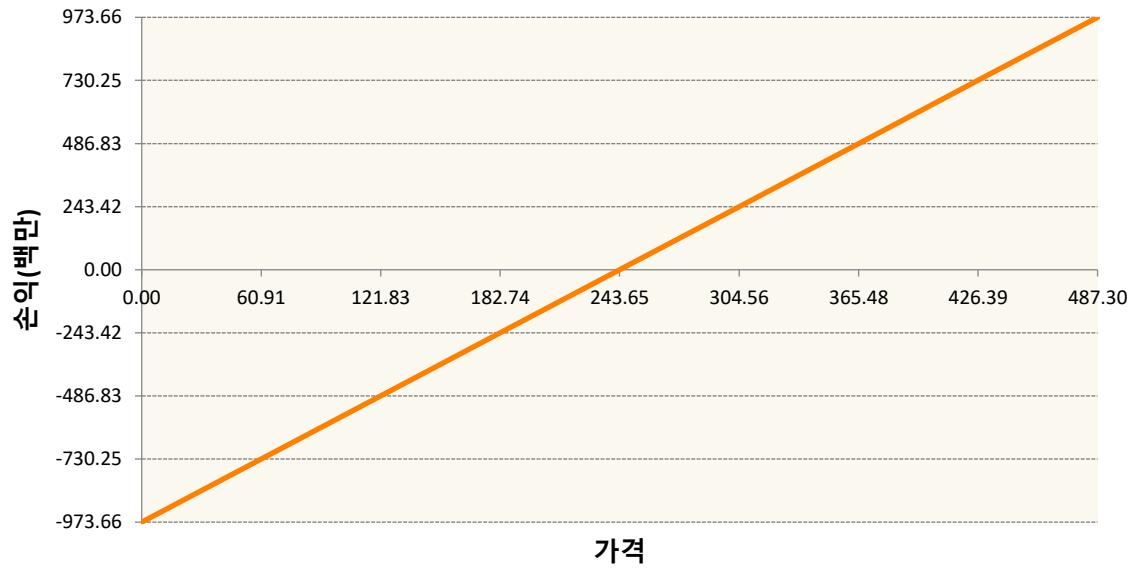
### 2. 만기시점의 손익구조



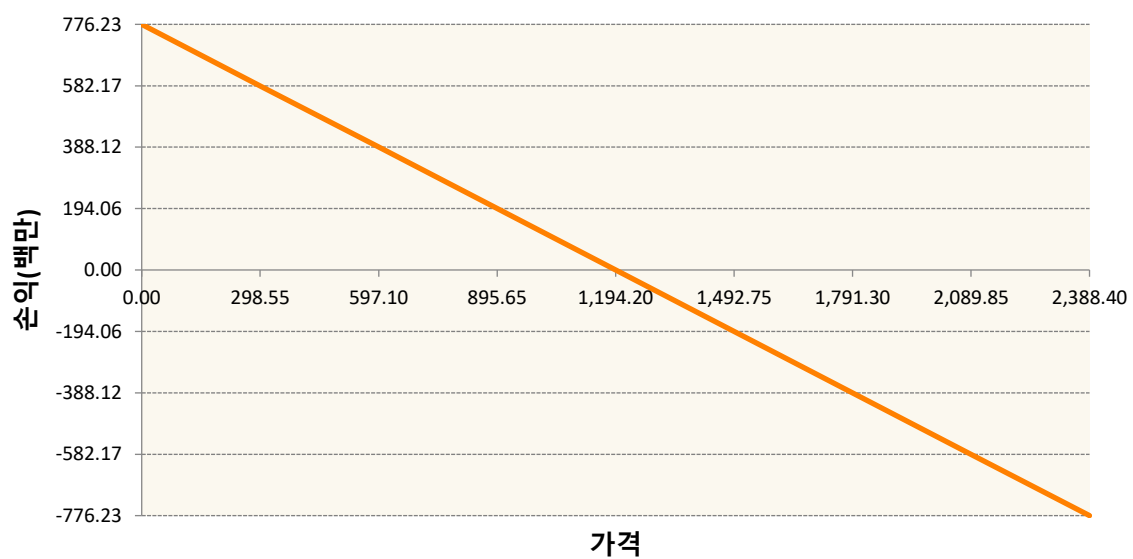
CTH2-COTTON NO.2 FUTR Mar22



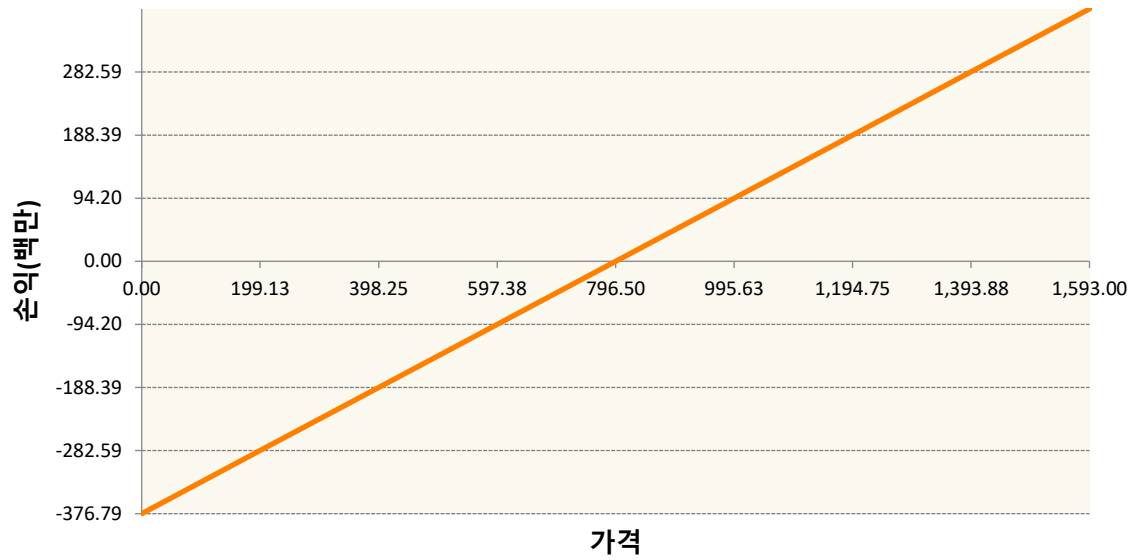
KCH2-COFFEE 'C' FUTURE Mar22



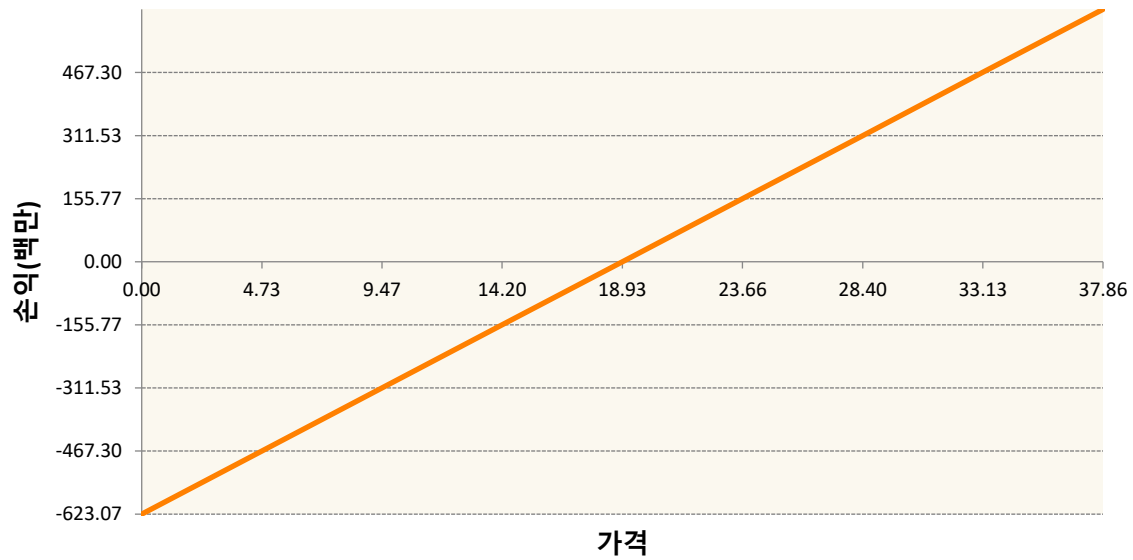
KR4175S20006-2022-02 달러선물



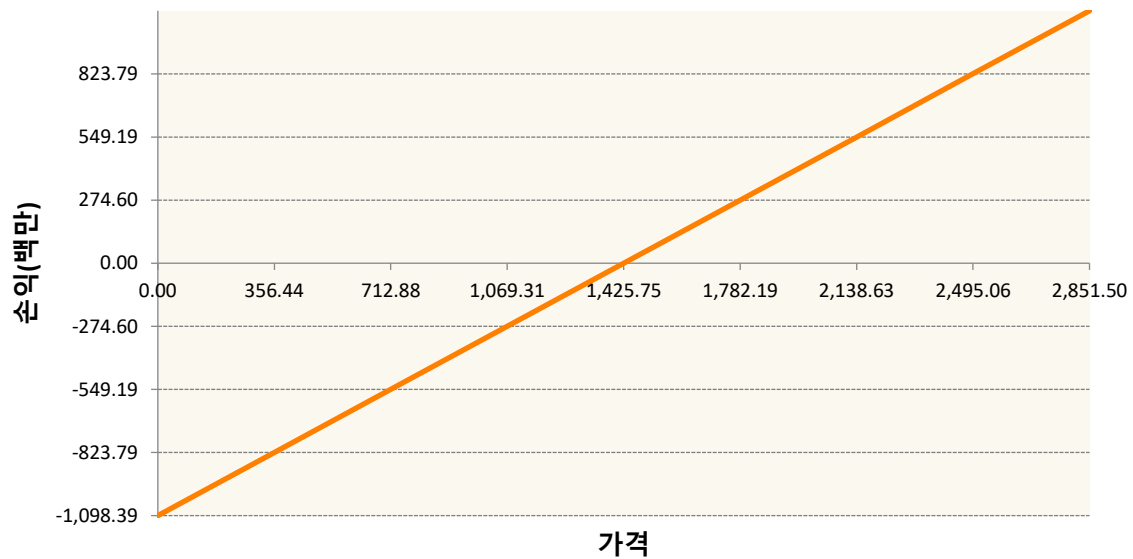
KWH2-KC HRW WHEAT FUT Mar22



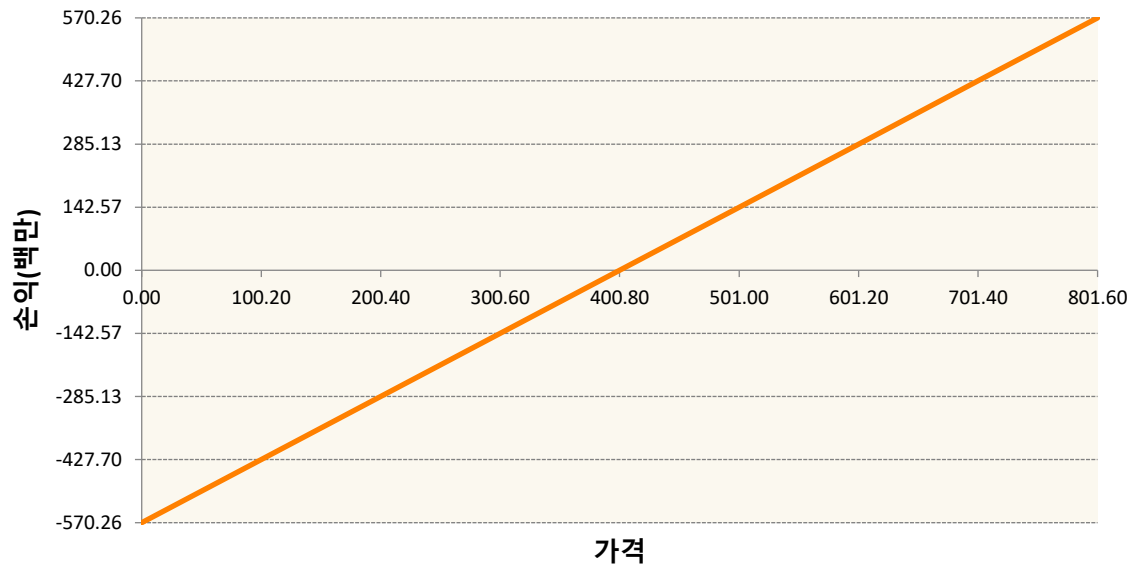
SBH2-Sugar #11 (WORLD) Mar22



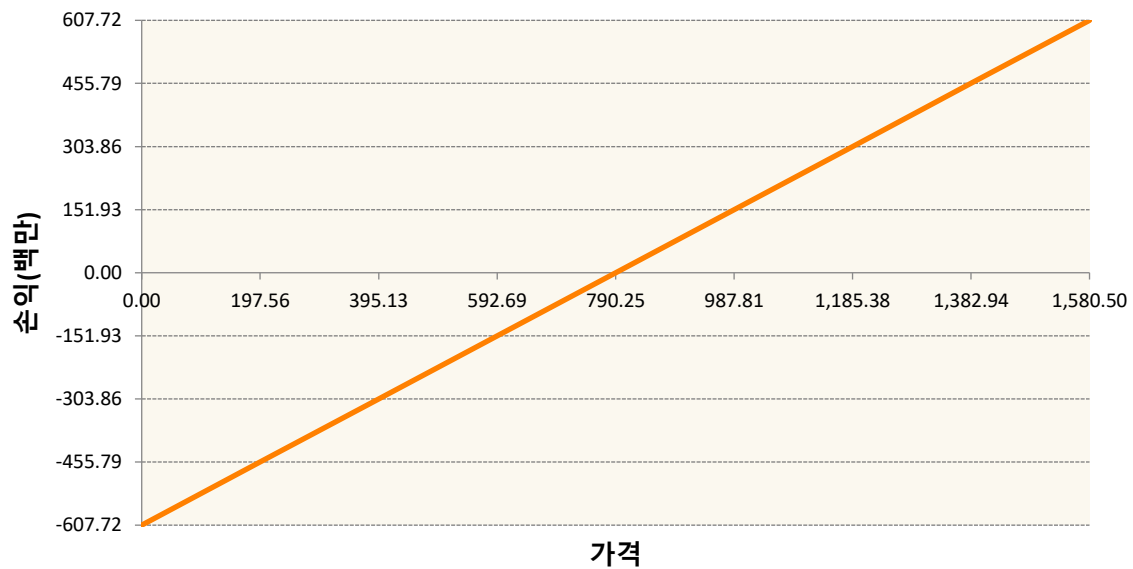
SH2-SOYBEAN FUTURE Mar22



SMH2-SOYBEAN MEAL FUTR Mar22



WH2-WHEAT FUTURE(CBT) Mar22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

## 스마트인덱스모

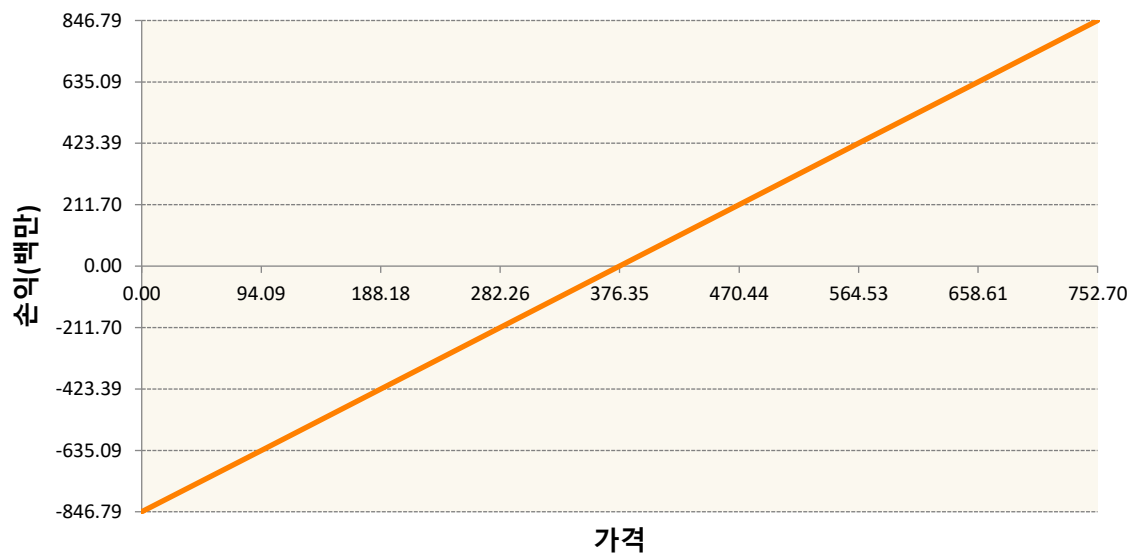
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

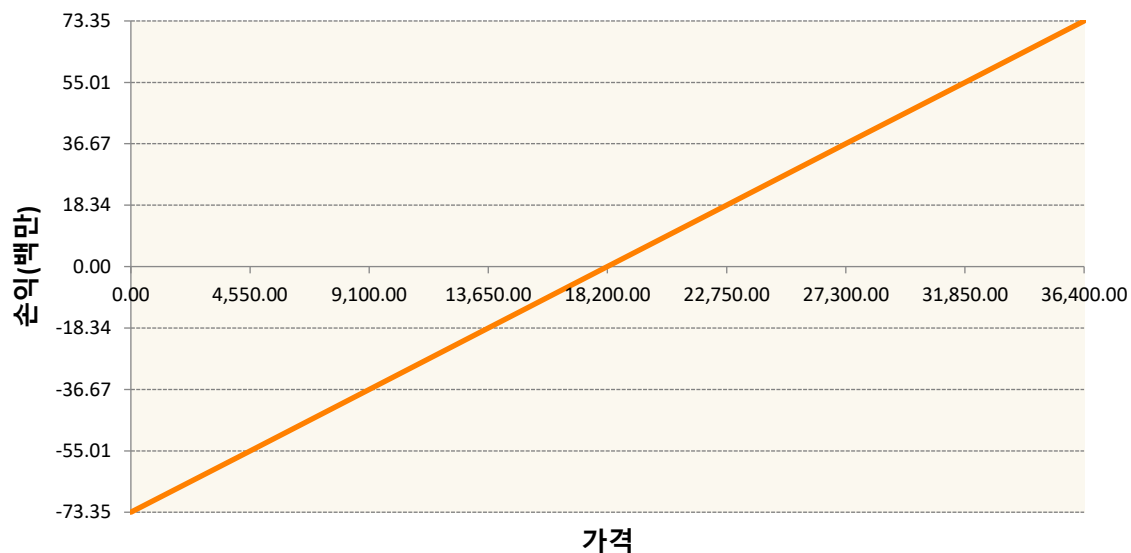
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 920   | 0     | 920       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4101S30001 |           | 2022-03 코스피200지수선물 |        |     |       |        | 68     |
|--------------|-----------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -68       | -68                | -68    | -68 | -68   | -68    | -68    |
| -5.33%       | -45       | -45                | -45    | -45 | -45   | -45    | -45    |
| -2.67%       | -23       | -23                | -23    | -23 | -23   | -23    | -23    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 23        | 23                 | 23     | 23  | 23    | 23     | 23     |
| 5.33%        | 45        | 45                 | 45     | 45  | 45    | 45     | 45     |
| 8.00%        | 68        | 68                 | 68     | 68  | 68    | 68     | 68     |
| KR41B9S20003 |           | 2022-02 두산중공업개별선물  |        |     |       |        | 6      |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -6        | -6                 | -6     | -6  | -6    | -6     | -6     |
| -5.33%       | -4        | -4                 | -4     | -4  | -4    | -4     | -4     |
| -2.67%       | -2        | -2                 | -2     | -2  | -2    | -2     | -2     |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 2         | 2                  | 2      | 2   | 2     | 2      | 2      |
| 5.33%        | 4         | 4                  | 4      | 4   | 4     | 4      | 4      |
| 8.00%        | 6         | 6                  | 6      | 6   | 6     | 6      | 6      |

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

70

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-01-24 |
| 기준일 | 2022-01-21 |

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   | 11,469 | 0     | 11,469    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20211125 | 885 |
|------------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 532 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-01-24 |
| 기준일 | 2022-01-21 |

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   | 5,505 | 0     | 5,505     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래211213 | 426 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 395 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-01-24 |
| 기준일 | 2022-01-21 |

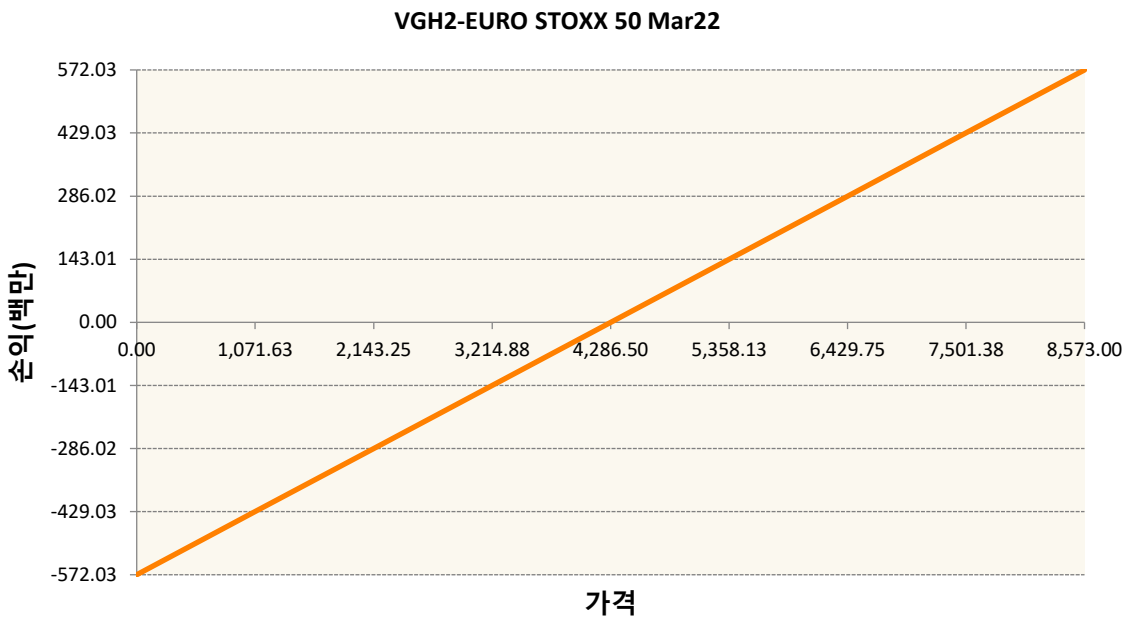
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 572   | 0     | 572       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGH2 | EURO STOXX 50 Mar22 | 46 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

40

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-01-24 |
| 기준일 | 2022-01-21 |

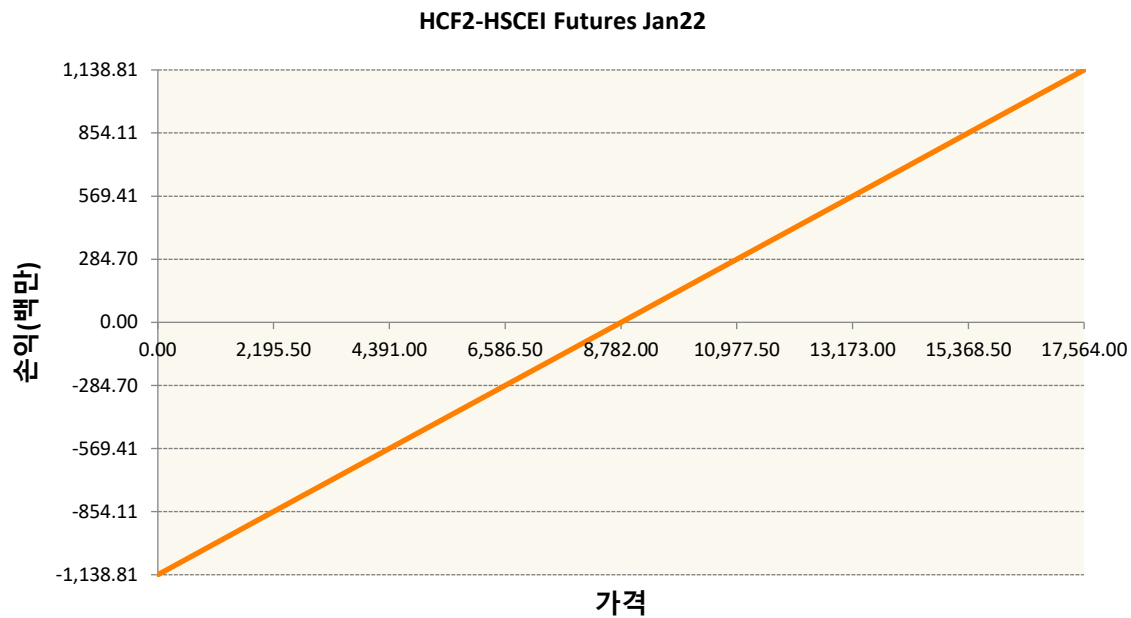
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,139 | 0     | 1,139     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCF2 | HSCEI Futures Jan22 | 91 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

96

공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

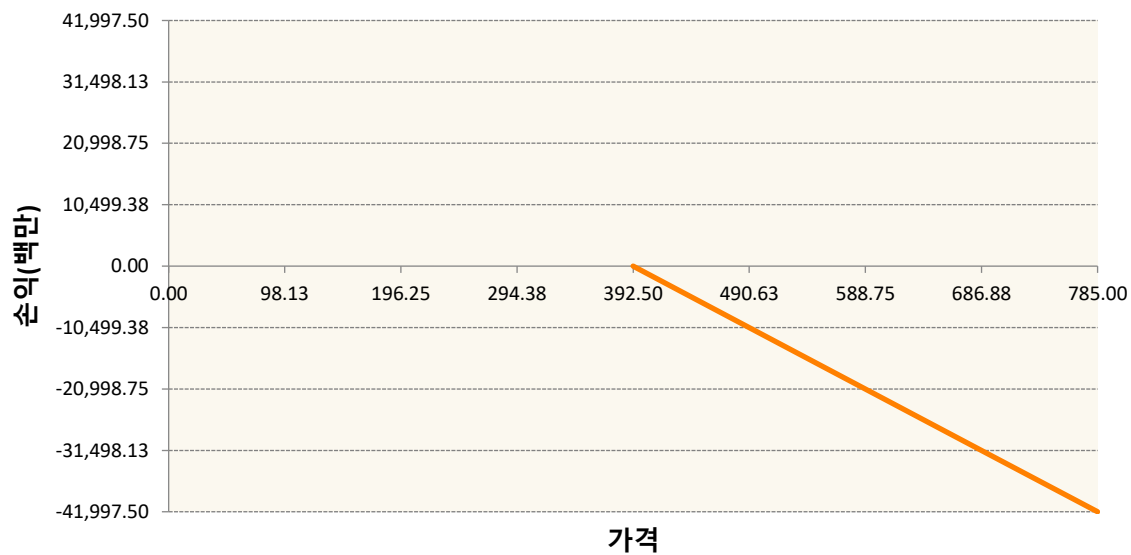
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

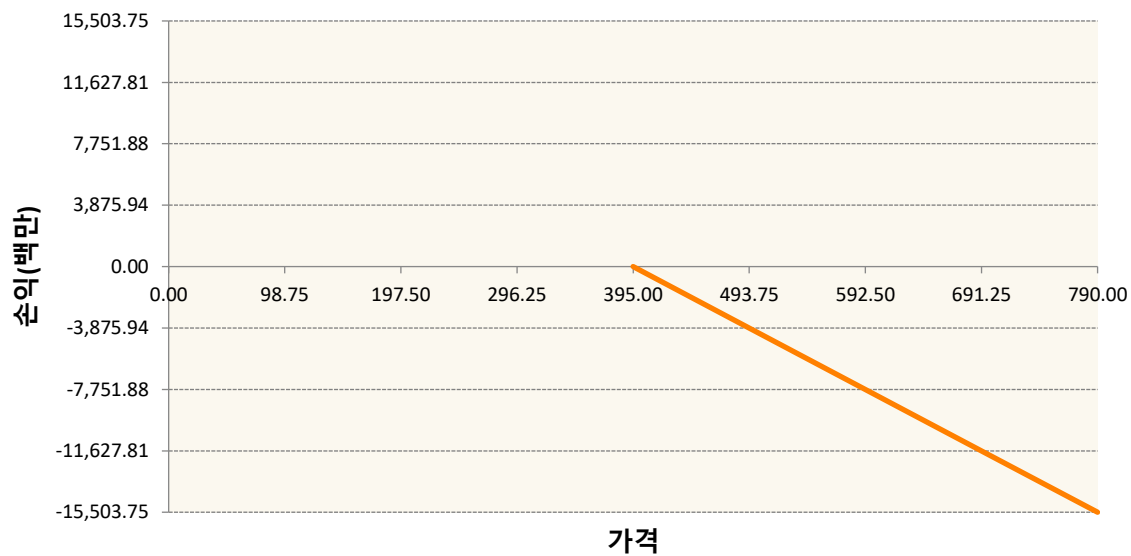
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 205    | -205      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 77,421 | -77,421   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

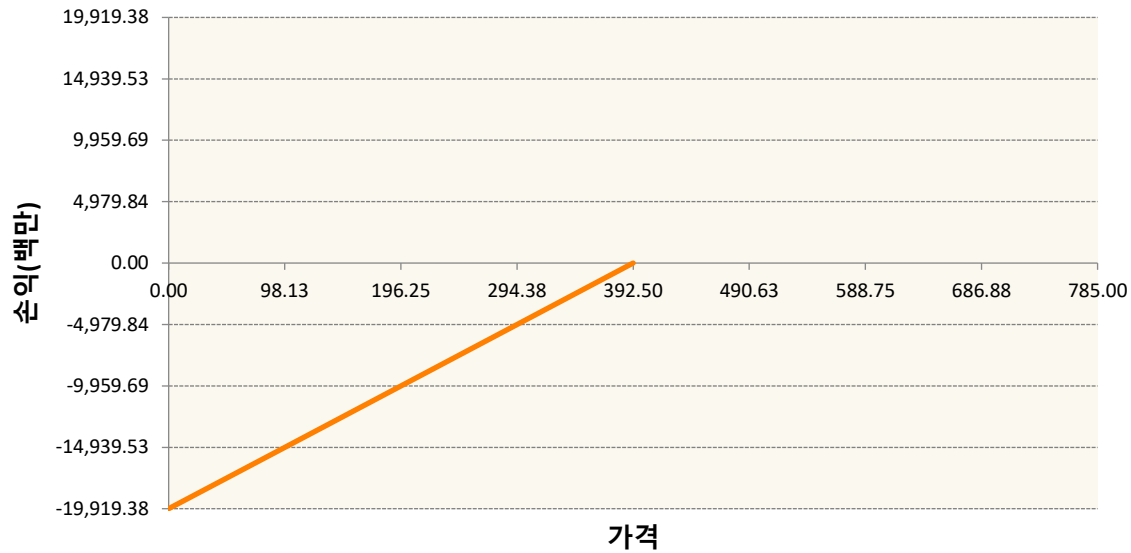
KR4201S23921-2022-02 콜392.5



KR4201S23954-2022-02 콜395



KR4301S23929-2022-02 풋392.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201S23921 |           |         | 2022-02 콜392.5 |        |        |        | 1,832  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 415       | 411     | 403            | 392    | 376    | 356    | 332    |
| -5.33%       | 401       | 386     | 366            | 339    | 308    | 272    | 231    |
| -2.67%       | 348       | 312     | 270            | 222    | 170    | 113    | 53     |
| 0%           | 203       | 139     | 71             | 0      | -74    | -149   | -227   |
| 2.67%        | -104      | -190    | -277           | -365   | -453   | -541   | -630   |
| 5.33%        | -622      | -712    | -803           | -893   | -984   | -1,075 | -1,166 |
| 8.00%        | -1,351    | -1,425  | -1,503         | -1,583 | -1,665 | -1,748 | -1,832 |
| KR4201S23954 |           |         | 2022-02 콜395   |        |        |        | 633    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 130       | 129     | 127            | 123    | 118    | 112    | 104    |
| -5.33%       | 126       | 122     | 116            | 107    | 97     | 85     | 72     |
| -2.67%       | 111       | 100     | 87             | 71     | 54     | 35     | 14     |
| 0%           | 68        | 47      | 24             | 0      | -25    | -52    | -79    |
| 2.67%        | -28       | -58     | -89            | -120   | -152   | -184   | -216   |
| 5.33%        | -198      | -232    | -265           | -299   | -333   | -367   | -400   |
| 8.00%        | -447      | -476    | -507           | -538   | -569   | -601   | -633   |
| KR4301S23929 |           |         | 2022-02 풋392.5 |        |        |        | 1,446  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -1,441    | -1,441  | -1,441         | -1,442 | -1,442 | -1,444 | -1,446 |
| -5.33%       | -933      | -933    | -935           | -937   | -941   | -946   | -952   |
| -2.67%       | -429      | -433    | -440           | -448   | -458   | -470   | -483   |
| 0%           | 50        | 35      | 19             | 0      | -20    | -41    | -63    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 454 | 426 | 399 | 371 | 342 | 314 | 285 |
| 5.33% | 724 | 694 | 665 | 635 | 605 | 575 | 545 |
| 8.00% | 856 | 836 | 815 | 792 | 769 | 744 | 719 |

|                                        |  |  |  |  |  |          |
|----------------------------------------|--|--|--|--|--|----------|
| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  |  |  |  | (단위:백만원) |
|                                        |  |  |  |  |  | 3,610    |

공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

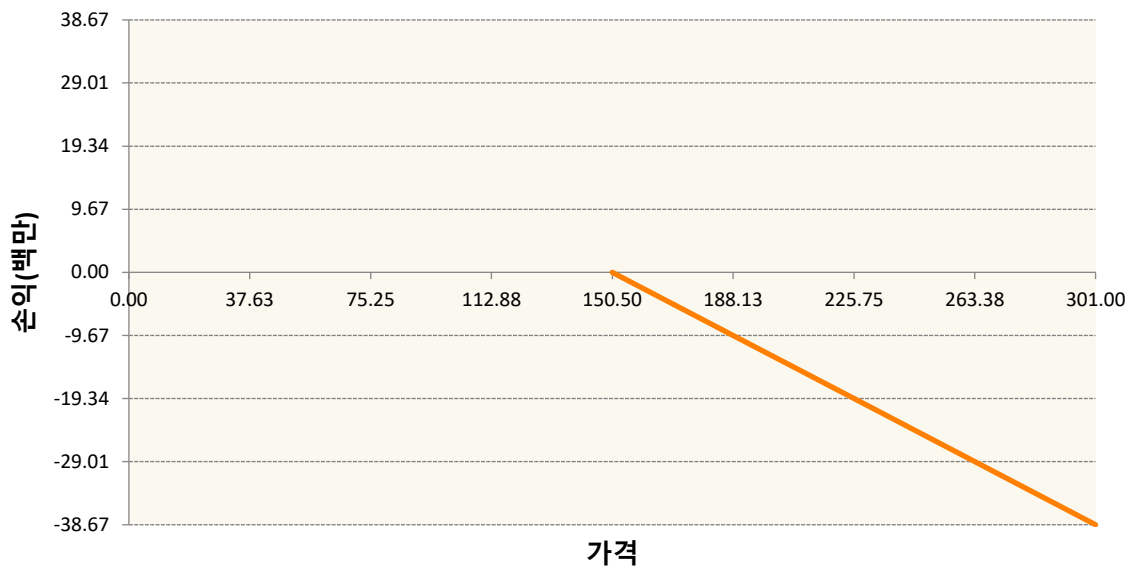
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

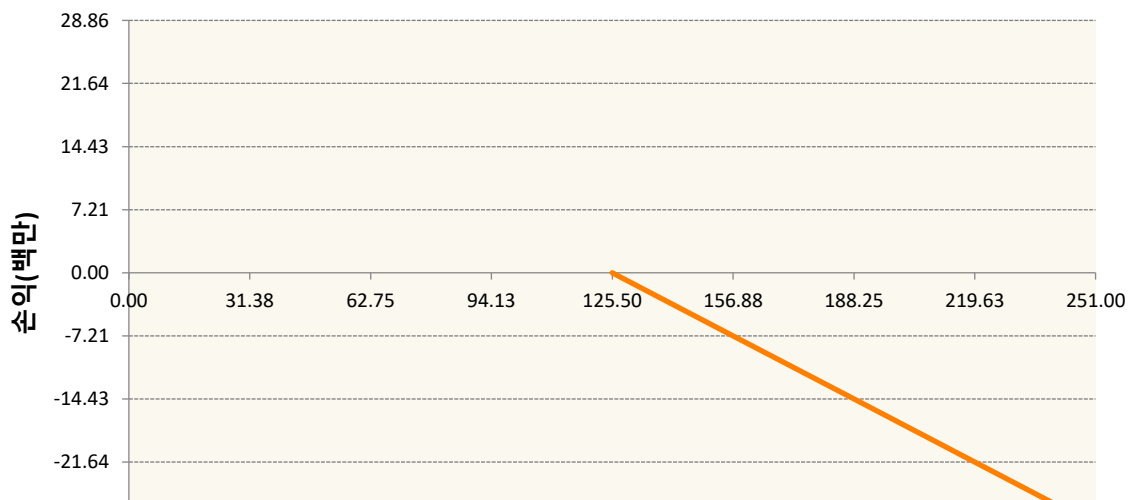
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 68    | -68       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,029 | -2,029    | 장외 |

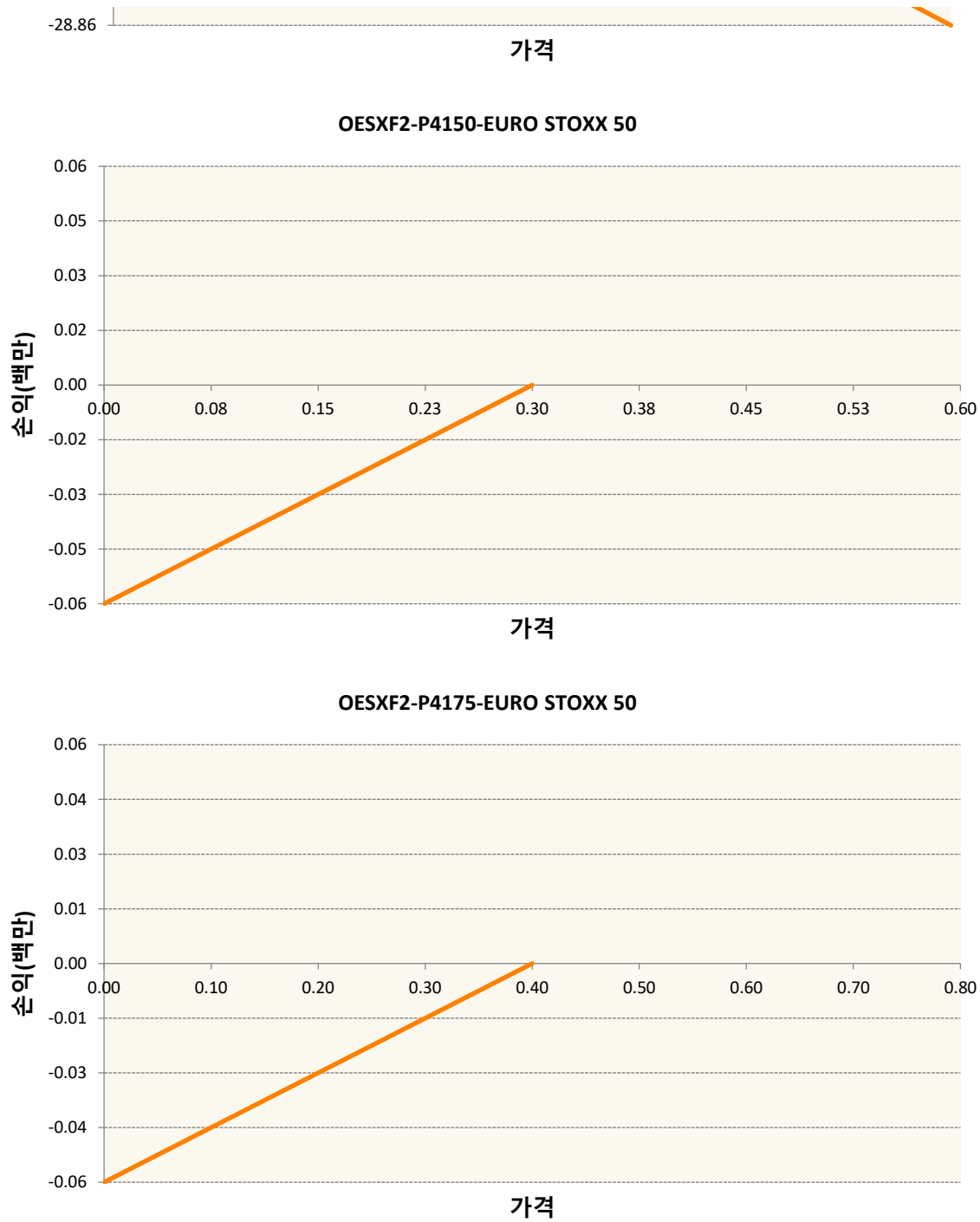
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXF2-C4150-EURO STOXX 50



OESXF2-C4175-EURO STOXX 50





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY  
 FXW213BCF KRW/EUR 17-03-22E  
 FXW213BCF KRW/EUR 17-02-22E  
 OESXF2-C41 EURO STOXX 50  
 OESXF2-C41 EURO STOXX 50  
 OESXF2-P41 EURO STOXX 50  
 OESXF2-P41 EURO STOXX 50

|     |
|-----|
| 1   |
| 54  |
| 108 |
| 3   |
| 2   |
| 0   |
| 0   |



공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

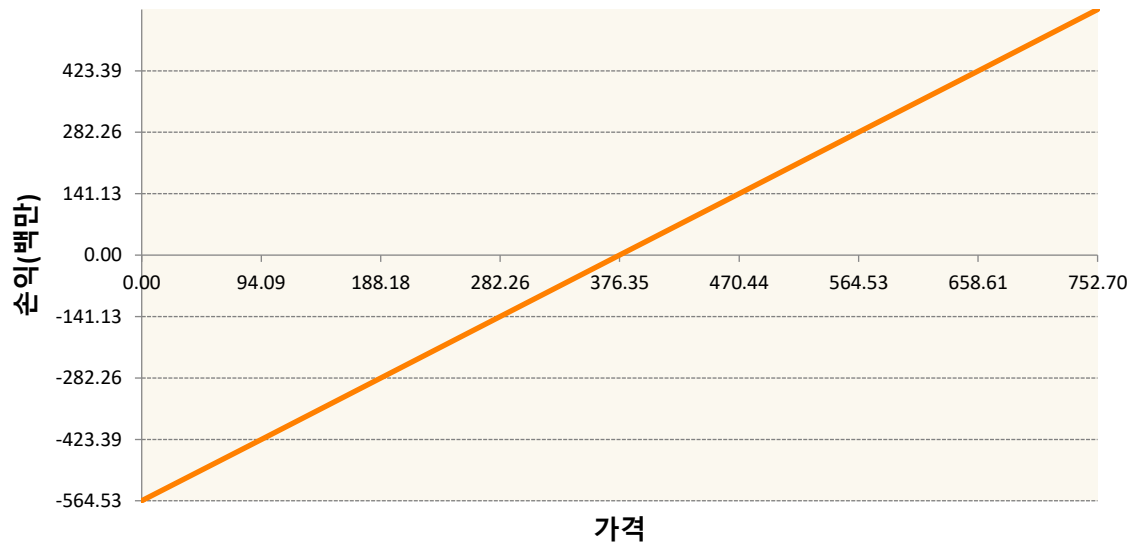
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

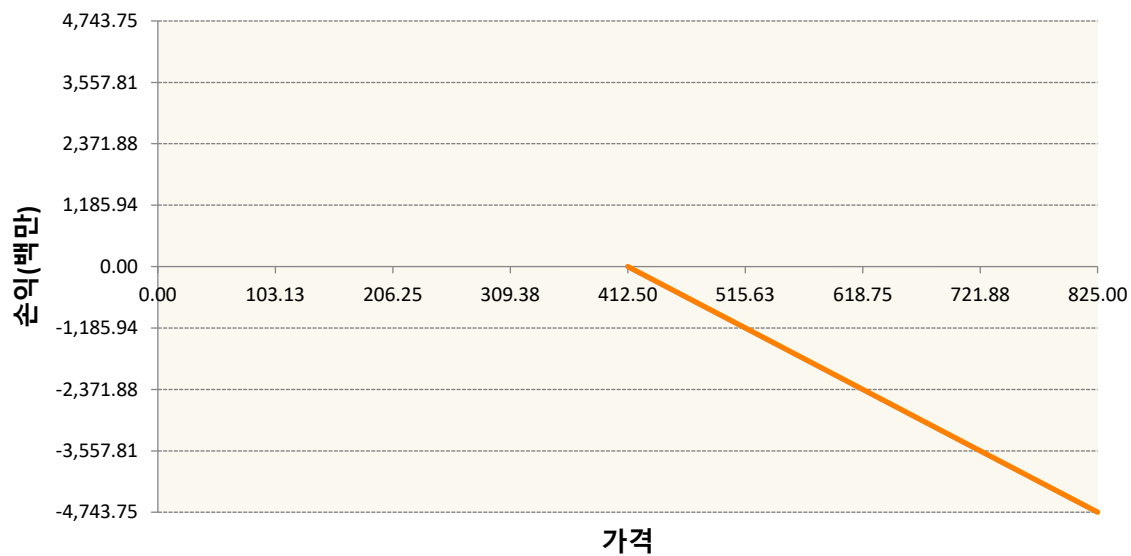
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 103   | -103      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 565   | 0     | 565       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 294   | 5,055 | -4,761    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR4201S24127-2022-02 콜412.5



The graph illustrates the relationship between the price of a product and its profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 830.00 in increments of 103.75. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -311.25 to 311.25 in increments of 77.81. A blue line starts at the point (415.00, 0.00) and slopes downward to the point (830.00, -311.25), indicating that as the price increases beyond 415.00, the profit decreases linearly.

| 가격 (Price) | 이익 (Profit) |
|------------|-------------|
| 415.00     | 0.00        |
| 518.75     | -77.81      |
| 622.50     | -155.63     |
| 726.25     | -233.44     |
| 830.00     | -311.25     |

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 785.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from -294.38 to 294.38. A blue line starts at (0, 294.38) and ends at (392.50, 0). The area under the line is shaded light blue.

| 가격 (Price) | 이익 (Profit) |
|------------|-------------|
| 0.00       | 294.38      |
| 392.50     | 0.00        |

(단위:백만원)

|              |           |         |        |                    |       |        |        |     |
|--------------|-----------|---------|--------|--------------------|-------|--------|--------|-----|
| KR4101S30001 |           |         |        | 2022-03 코스피200지수선물 |       |        |        | 45  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                 | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -45       | -45     | -45    | -45                | -45   | -45    | -45    |     |
| -5.33%       | -30       | -30     | -30    | -30                | -30   | -30    | -30    |     |
| -2.67%       | -15       | -15     | -15    | -15                | -15   | -15    | -15    |     |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 15        | 15      | 15     | 15                 | 15    | 15     | 15     |     |
| 5.33%        | 30        | 30      | 30     | 30                 | 30    | 30     | 30     |     |
| 8.00%        | 45        | 45      | 45     | 45                 | 45    | 45     | 45     |     |
| KR4201S24127 |           |         |        | 2022-02 콜412.5     |       |        |        | 110 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |

| 가격                                             | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|------------------------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| -8.00%                                         | 11      | 11      | 11     | 10  | 10    | 9      | 9      |
| -5.33%                                         | 11      | 10      | 10     | 9   | 9     | 7      | 5      |
| -2.67%                                         | 10      | 9       | 8      | 7   | 5     | 2      | -1     |
| 0%                                             | 8       | 6       | 3      | 0   | -4    | -8     | -13    |
| 2.67%                                          | 1       | -3      | -8     | -14 | -20   | -27    | -34    |
| 5.33%                                          | -16     | -23     | -31    | -39 | -48   | -57    | -66    |
| 8.00%                                          | -50     | -60     | -70    | -80 | -90   | -100   | -110   |
| KR4201S24150                      2022-02 콜415 |         |         |        |     |       |        | 7      |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 0      |
| -5.33%    | 1       | 1       | 1      | 1  | 0     | 0      | 0      |
| -2.67%    | 1       | 1       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | -1     |
| 2.67%     | 0       | 0       | 0      | -1 | -1    | -2     | -2     |
| 5.33%     | -1      | -1      | -2     | -2 | -3    | -3     | -4     |
| 8.00%     | -3      | -3      | -4     | -5 | -5    | -6     | -7     |

| KR4301S23929                      2022-02 풋392.5 |         |         |        |     |       |        | 21     |
|--------------------------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                                        |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                                               | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                                           | 21      | 21      | 21     | 21  | 21    | 21     | 21     |
| -5.33%                                           | 14      | 14      | 14     | 14  | 14    | 14     | 14     |
| -2.67%                                           | 6       | 6       | 7      | 7   | 7     | 7      | 7      |
| 0%                                               | -1      | -1      | 0      | 0   | 0     | 1      | 1      |
| 2.67%                                            | -7      | -6      | -6     | -5  | -5    | -5     | -4     |
| 5.33%                                            | -11     | -10     | -10    | -9  | -9    | -8     | -8     |
| 8.00%                                            | -13     | -12     | -12    | -12 | -11   | -11    | -11    |

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

(단위:백만원)

128

공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

## 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 | 10,545 | 0     | 10,545    |    |

### 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 | 2022-01-24 |
| 기준일 | 2022-01-21 |

## 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 | 9,085 | 0     | 9,085     |    |

### 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 | 2022-01-24 |
| 기준일 | 2022-01-21 |

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 | 30,703 | 0      | 30,703    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 13,253 | 28,059 | -14,806   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |  | (단위:백만원)                        |
|-----------------------------|--|---------------------------------|
| FXW213BCN KRW/USD 24-02-22E |  | 2,245                           |
| FXW213C17 USD/KRW 26-01-22E |  | 1,060                           |
| IE00BD8RGM75                |  | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,075    |

공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

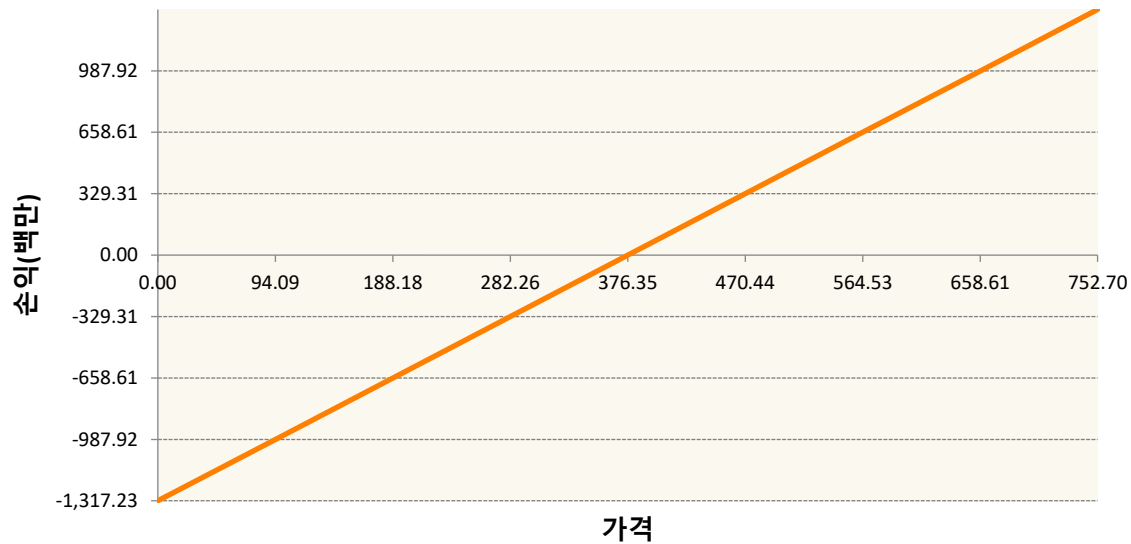
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

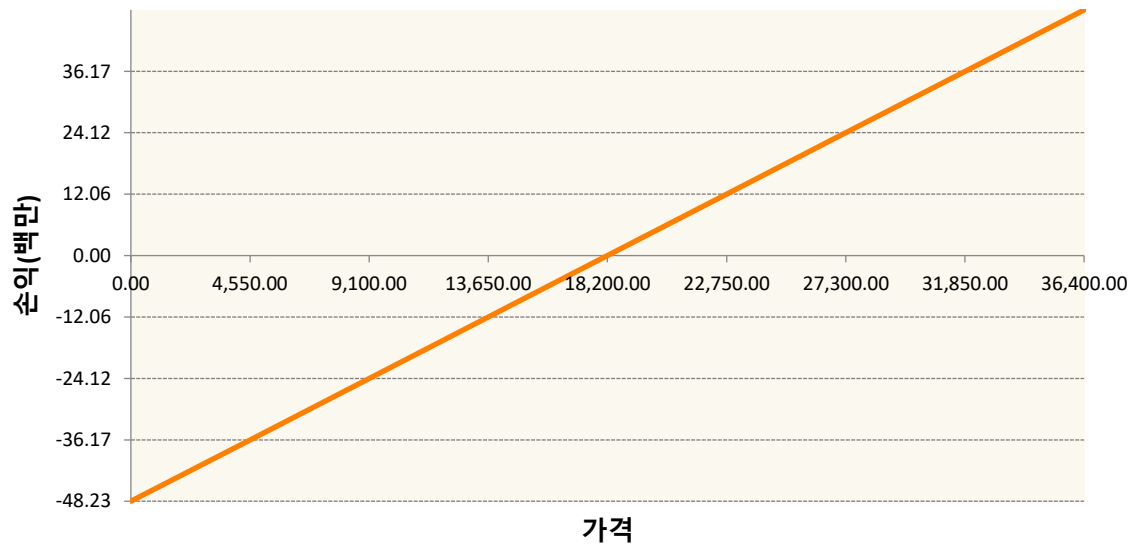
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,365 | 0     | 1,365     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



KR41B9S20003-2022-02 두산중공업개별선물



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

|              |           |                    |        |      |       |        |        |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
| KR4101S30001 |           | 2022-03 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 105    |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -105      | -105               | -105   | -105 | -105  | -105   | -105   |
| -5.33%       | -70       | -70                | -70    | -70  | -70   | -70    | -70    |
| -2.67%       | -35       | -35                | -35    | -35  | -35   | -35    | -35    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 35        | 35                 | 35     | 35   | 35    | 35     | 35     |
| 5.33%        | 70        | 70                 | 70     | 70   | 70    | 70     | 70     |
| 8.00%        | 105       | 105                | 105    | 105  | 105   | 105    | 105    |
| KR41B9S20003 |           | 2022-02 두산중공업개별선물  |        |      |       |        | 4      |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -4        | -4                 | -4     | -4   | -4    | -4     | -4     |
| -5.33%       | -3        | -3                 | -3     | -3   | -3    | -3     | -3     |
| -2.67%       | -1        | -1                 | -1     | -1   | -1    | -1     | -1     |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 1         | 1                  | 1      | 1    | 1     | 1      | 1      |
| 5.33%        | 3         | 3                  | 3      | 3    | 3     | 3      | 3      |
| 8.00%        | 4         | 4                  | 4      | 4    | 4     | 4      | 4      |

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

103

공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

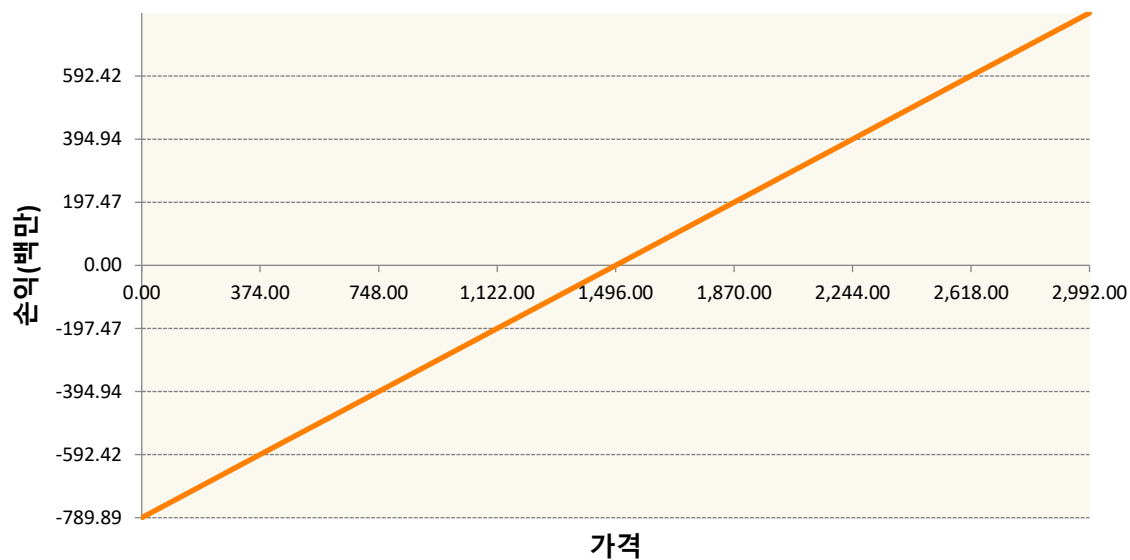
### 1. 계약금액

(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   | 790   | 0     | 790       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,806 | 0     | 1,806     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,325 | -1,325    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCG2-VN30 Index Future Feb22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 144 |
| FXW213BBQ KRW/EUR 25-02-22E   | 36  |
| FXW213BBS KRW/EUR 25-02-22E   | 11  |
| FXW213BCN KRW/EUR 18-03-22E   | 43  |
| FXW213C1K KRW/EUR 22-04-22E   | 16  |
| VNCG2 VN30 Index Future Feb22 | 63  |

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

(단위:백만원)



공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

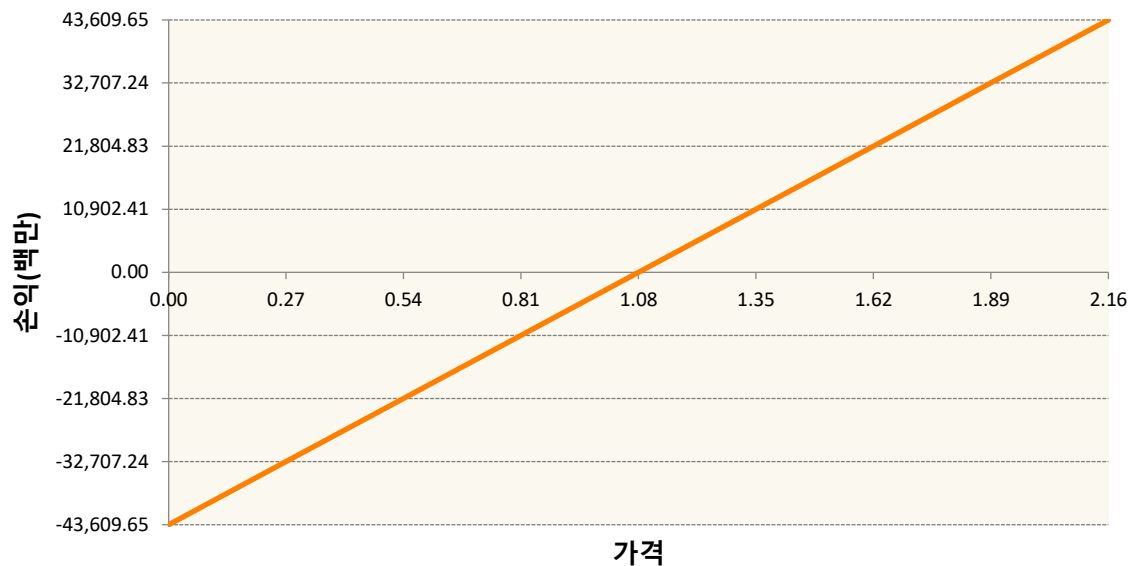
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 43,610 | 0     | 43,610    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

3,480

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

(단위:백만원)

5,621

공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

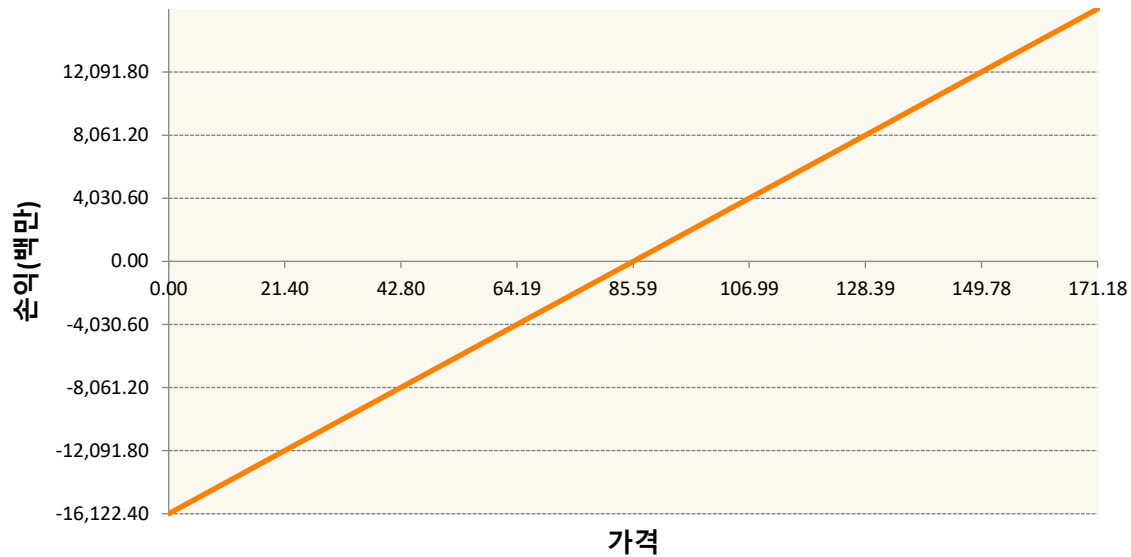
### 1. 계약금액

(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   | 16,122 | 0     | 16,122    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 6,111 | -6,111    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213BCV·KRW/EUR 28-01-22E

489

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,290

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

(단위:백만원)

2,997

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-01-24 |
| 기준일 | 2022-01-21 |

## 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)  | 22 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)  | 22 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)  | 22 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠) | 22 |

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

(단위:백만원)

163

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-01-24 |
| 기준일 | 2022-01-21 |

## 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)  | 3 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 4 |
| 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)

|    |
|----|
| 17 |
|----|

공시일 2022-01-24

기준일 2022-01-21

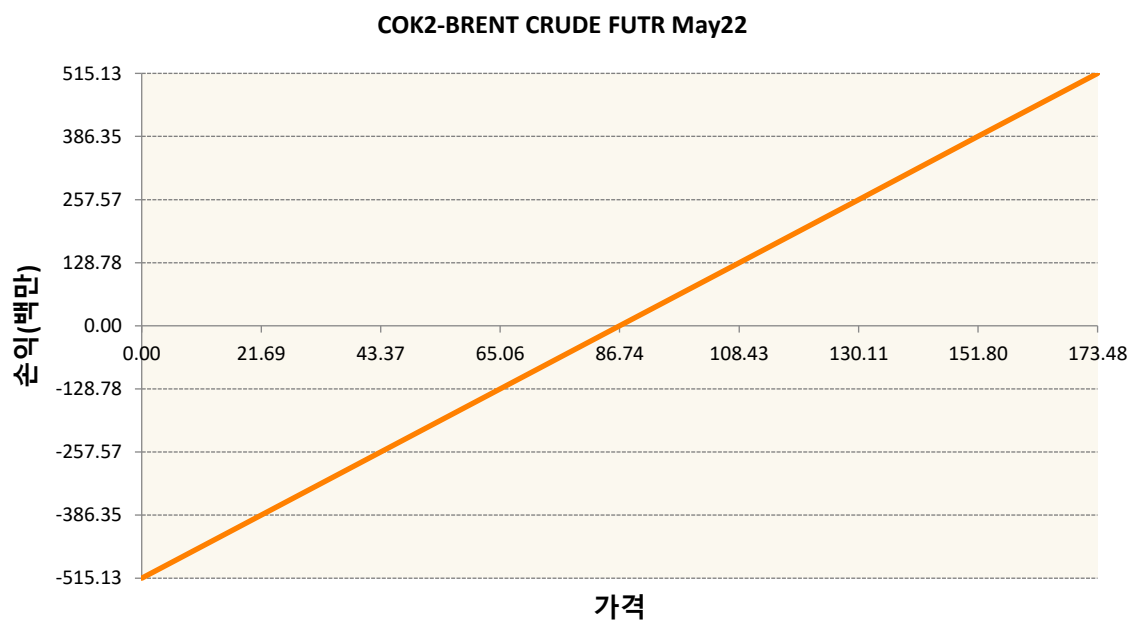
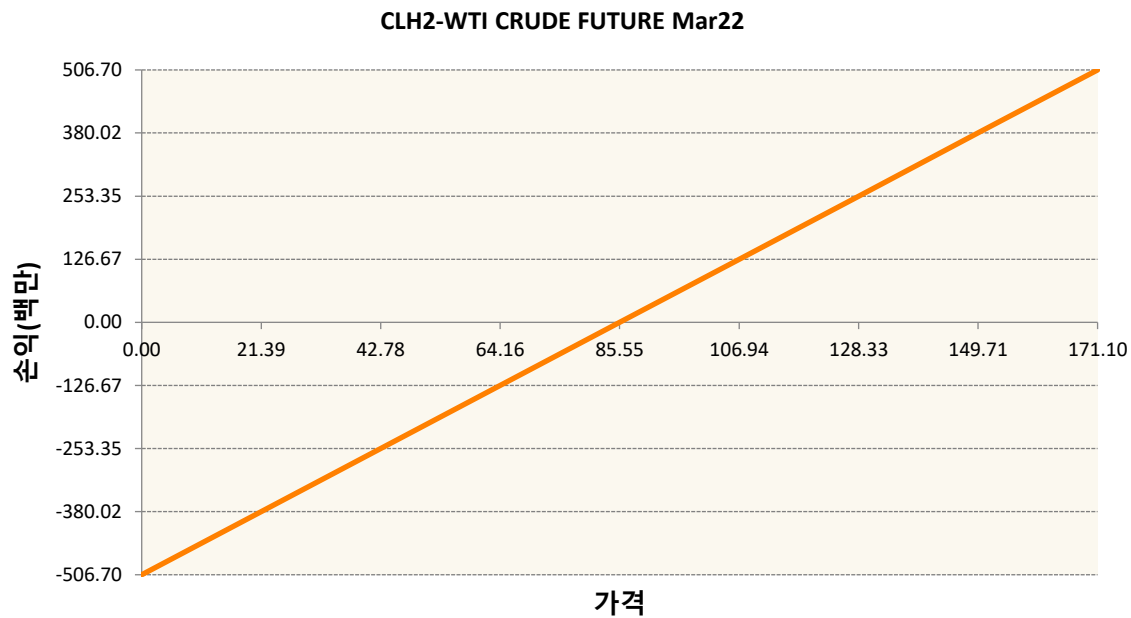
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

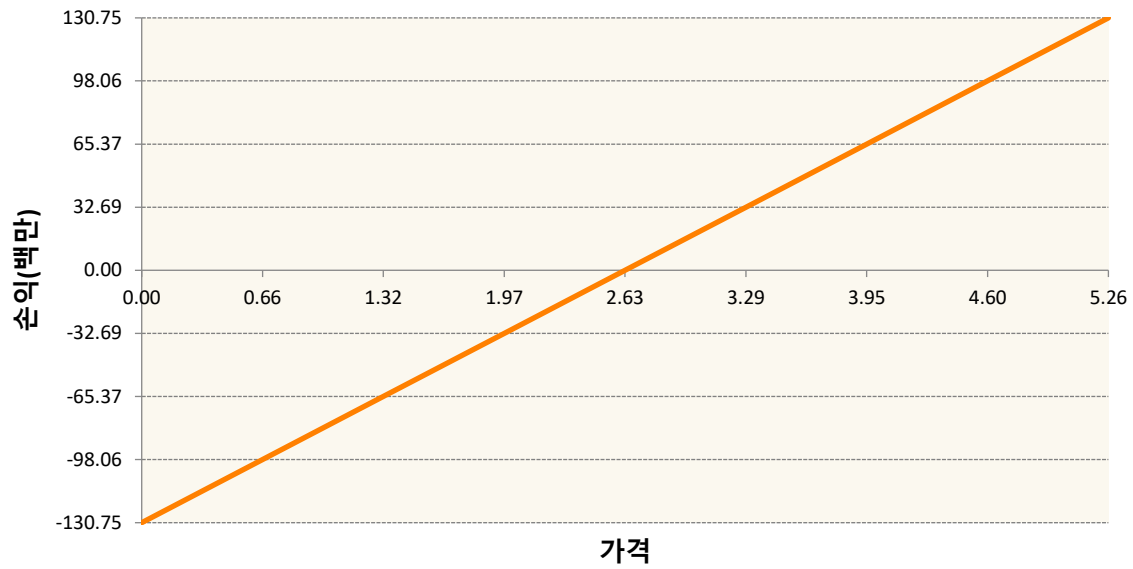
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,140 | 358   | 1,782     |    |

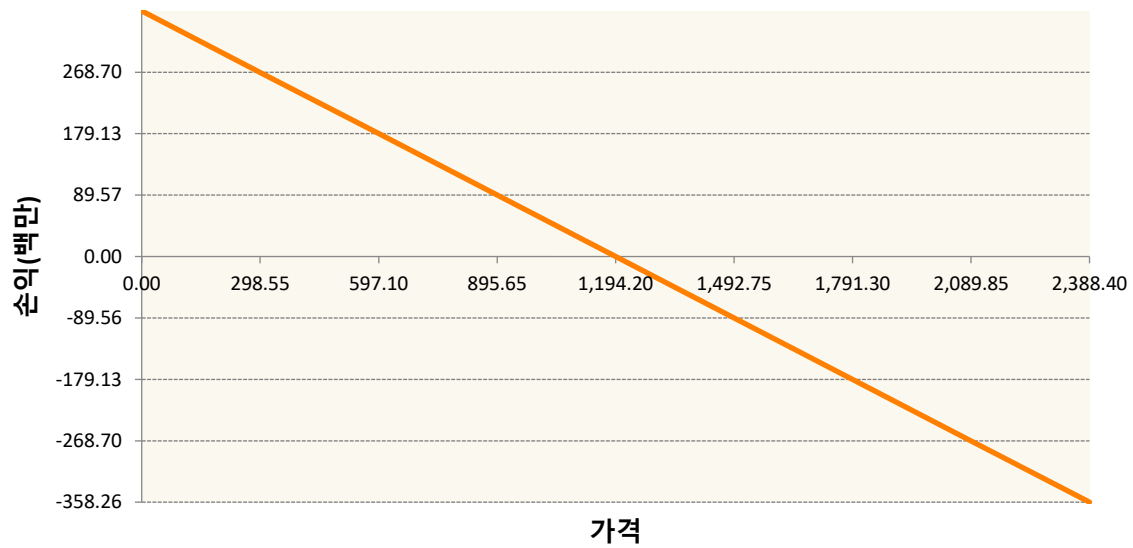
### 2. 만기시점의 손익구조



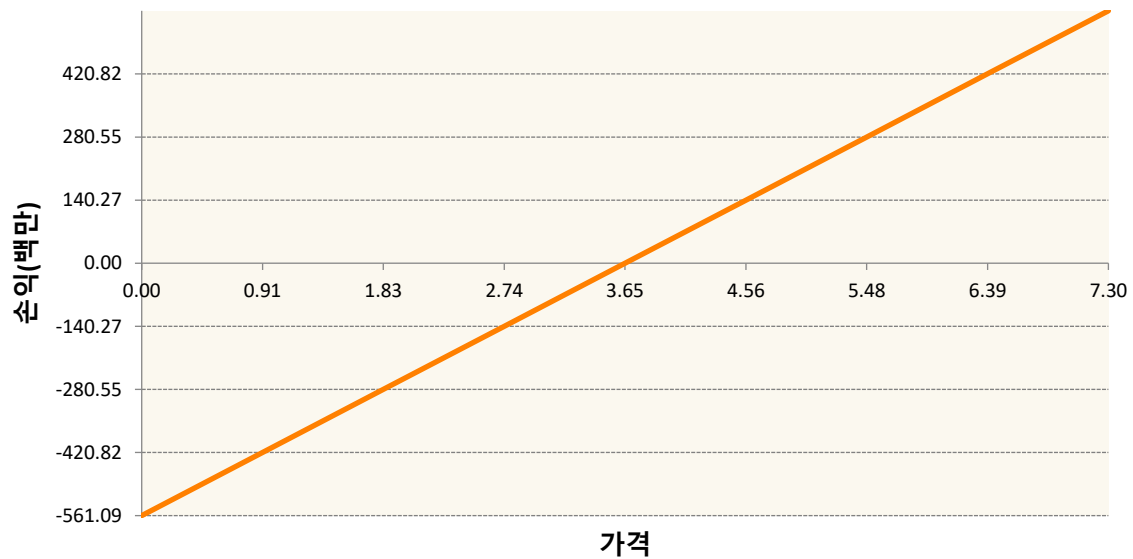
HOH2-NY Harb ULSD Fut Mar22



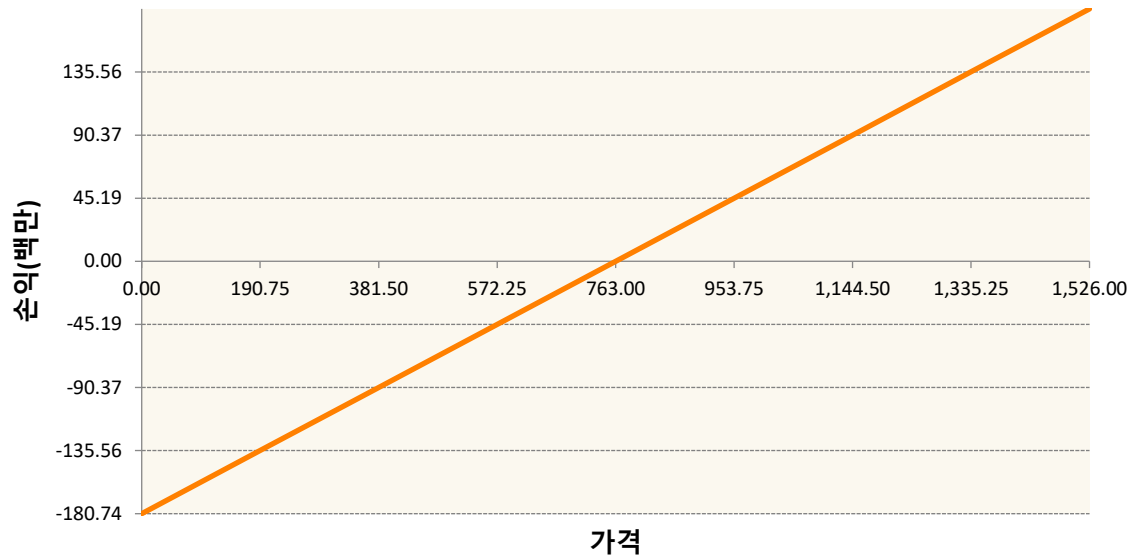
KR4175S20006-2022-02 달러선물



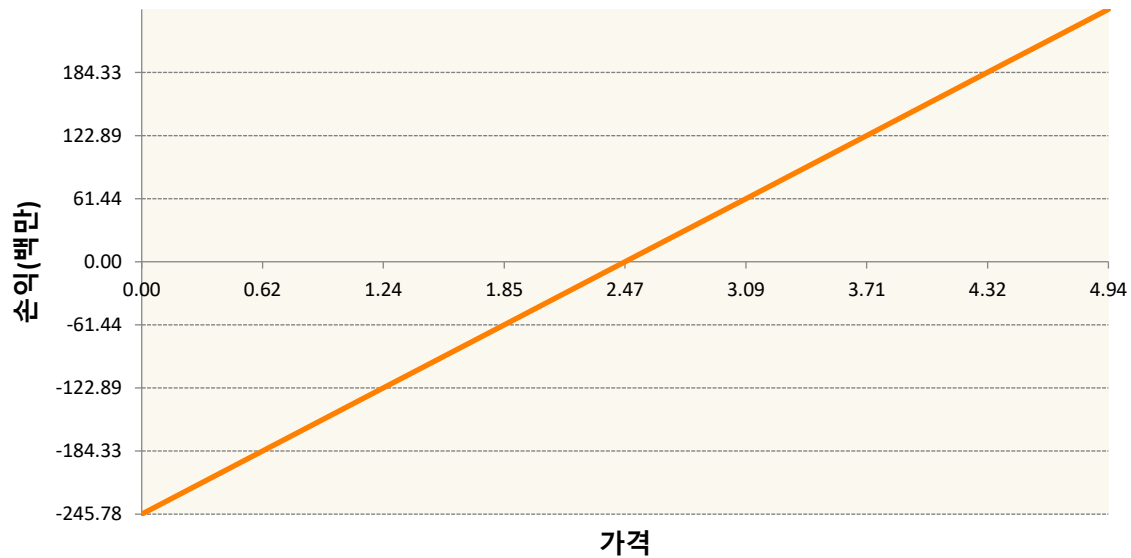
NGH22-NATURAL GAS FUTR Mar22



QSH2-Low Su Gasoil G Mar22



XBH2-GASOLINE RBOB FUT Mar22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| CLH2       | WTI CRUDE FUTURE Mar22  | 41 |
| COK2       | BRENT CRUDE FUTR May22  | 41 |
| HOH2       | NY Harb ULSD Fut Mar22  | 10 |
| KR4175S200 | 2022-02 달러선물            | 29 |
| NGH22      | NATURAL GAS FUTR Mar22  | 45 |
| QSH2       | Low Su Gasoil G Mar22   | 14 |
| XBH2       | GASOLINE RBOB FUT Mar22 | 20 |

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

(단위:백만원)

386