

공시일 2022-02-25

기준일 2022-02-24

## 포커스농산물모(채권-파생형)

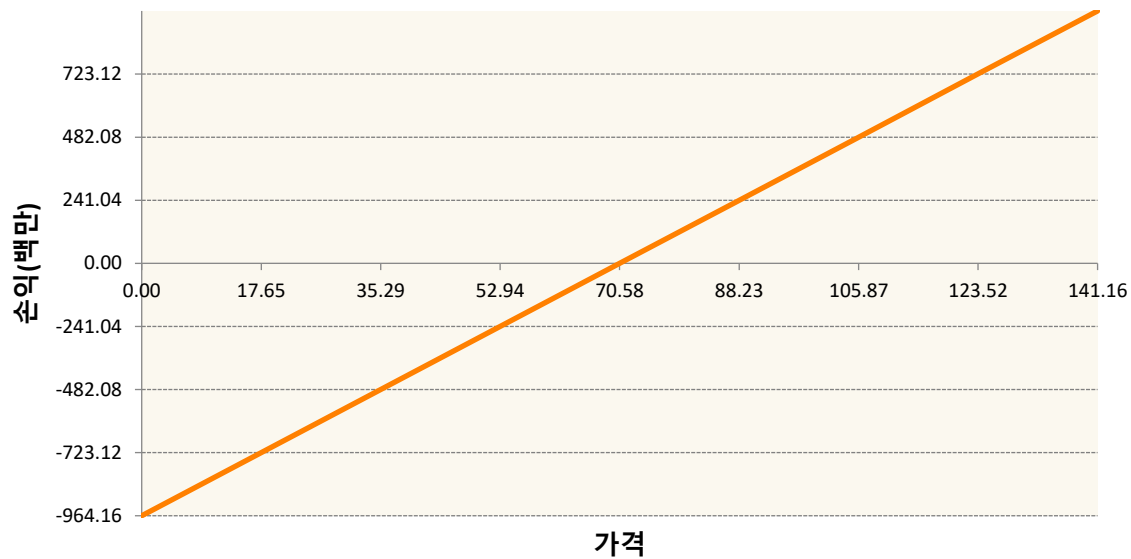
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

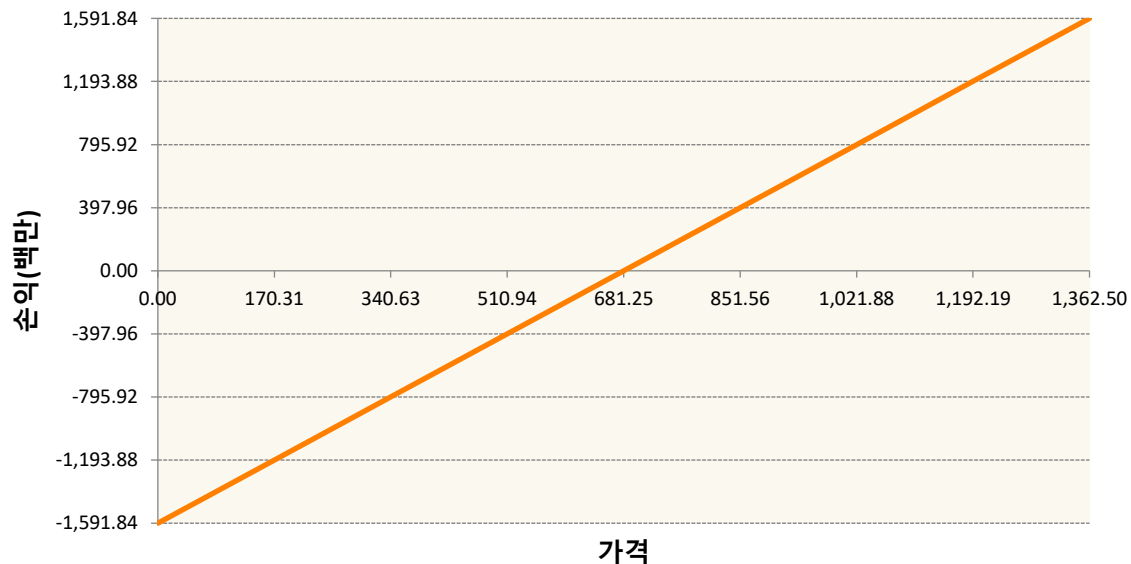
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,547 | 1,324 | 7,223     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

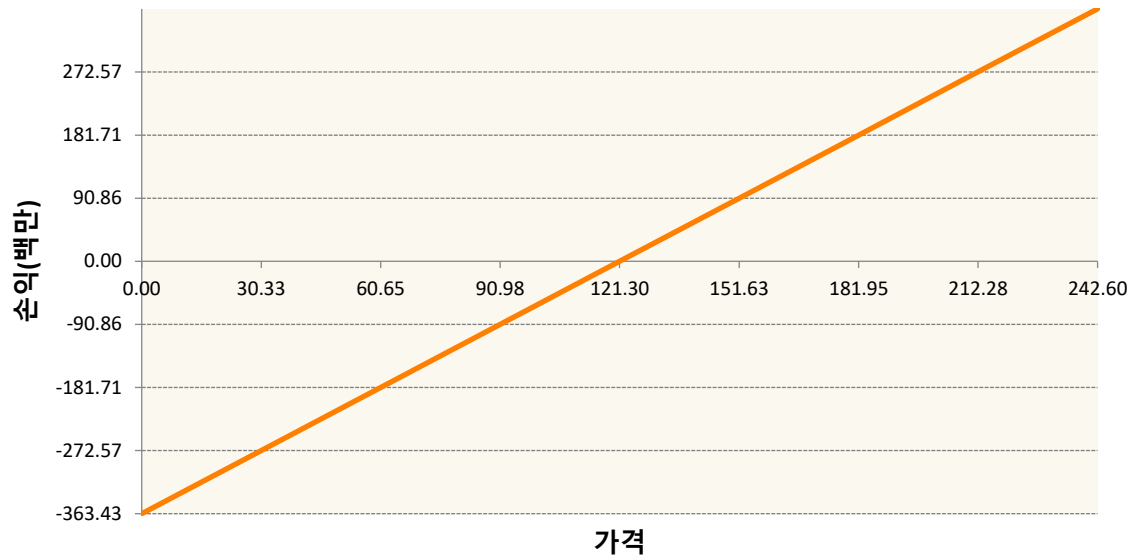
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



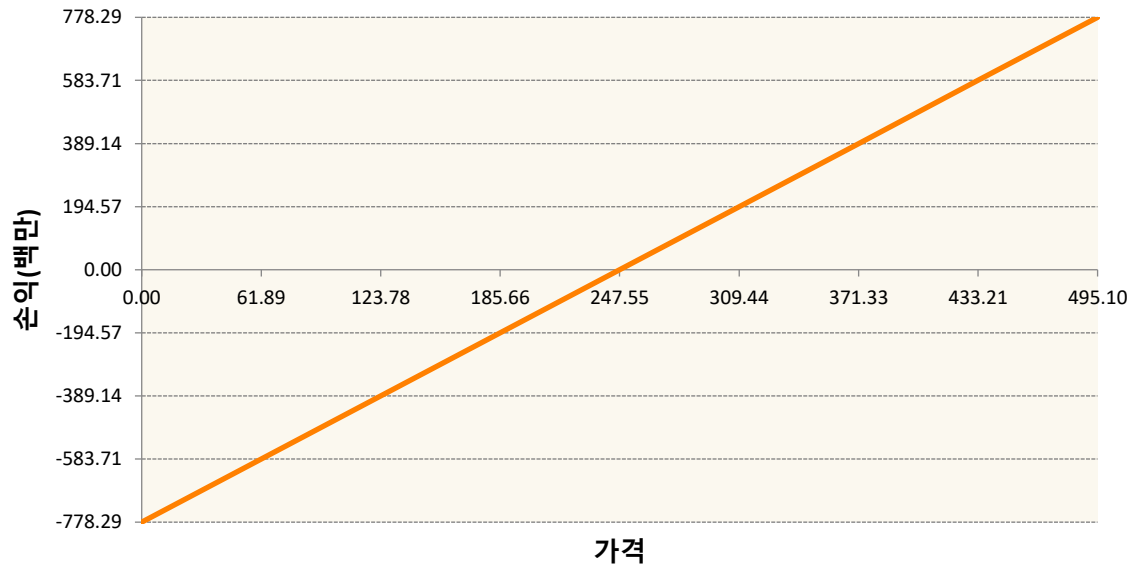
CK2-CORN FUTURE May22



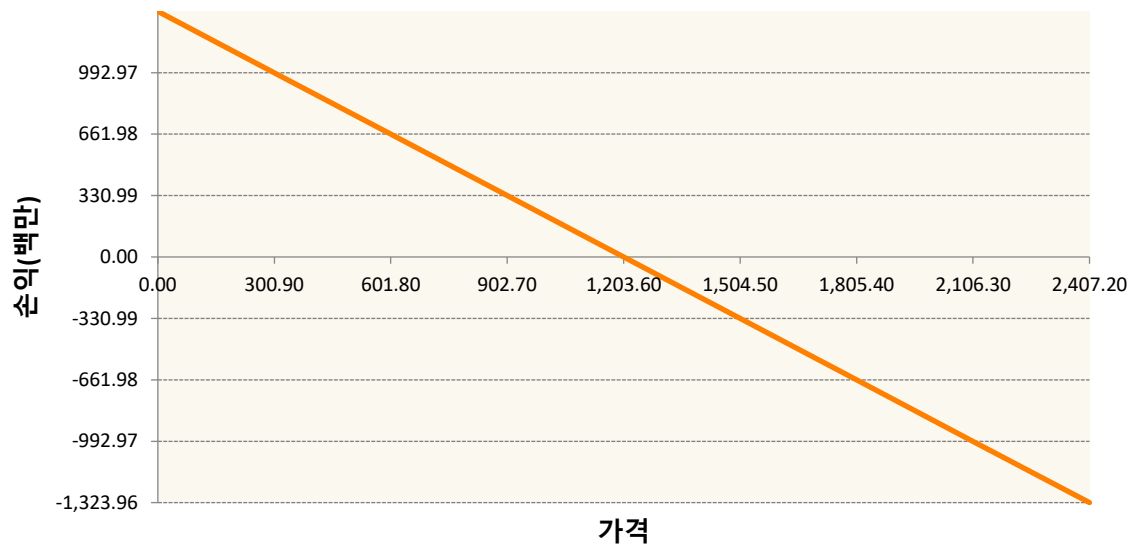
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



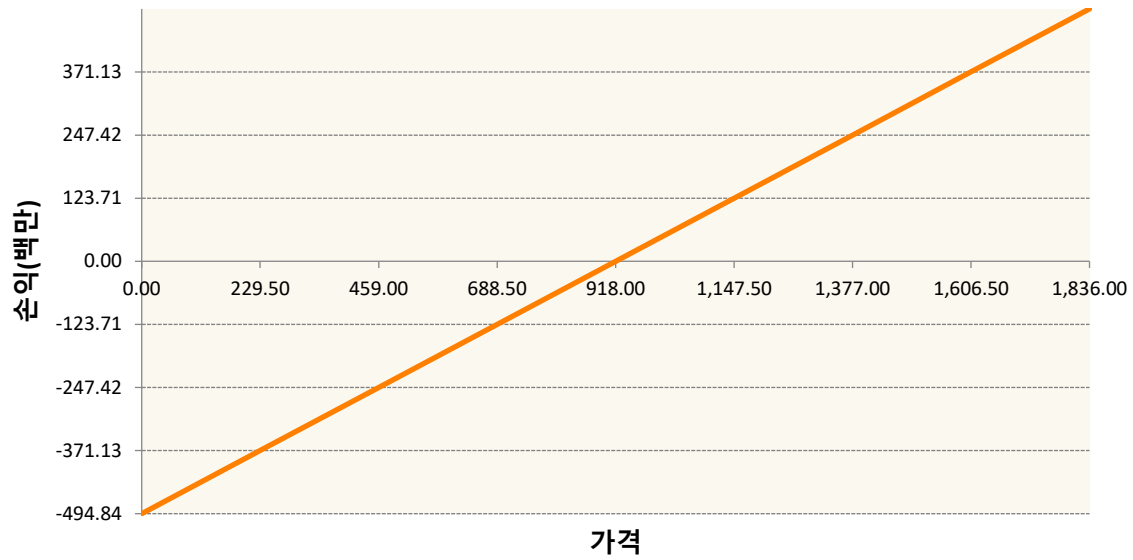
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



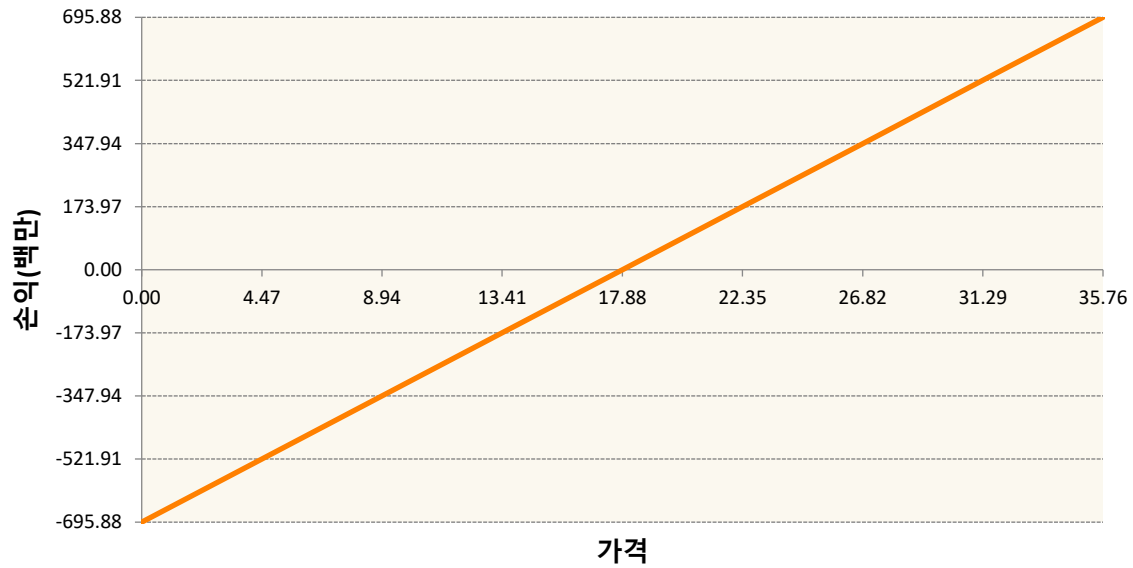
KR4175S30005-2022-03 달러선물



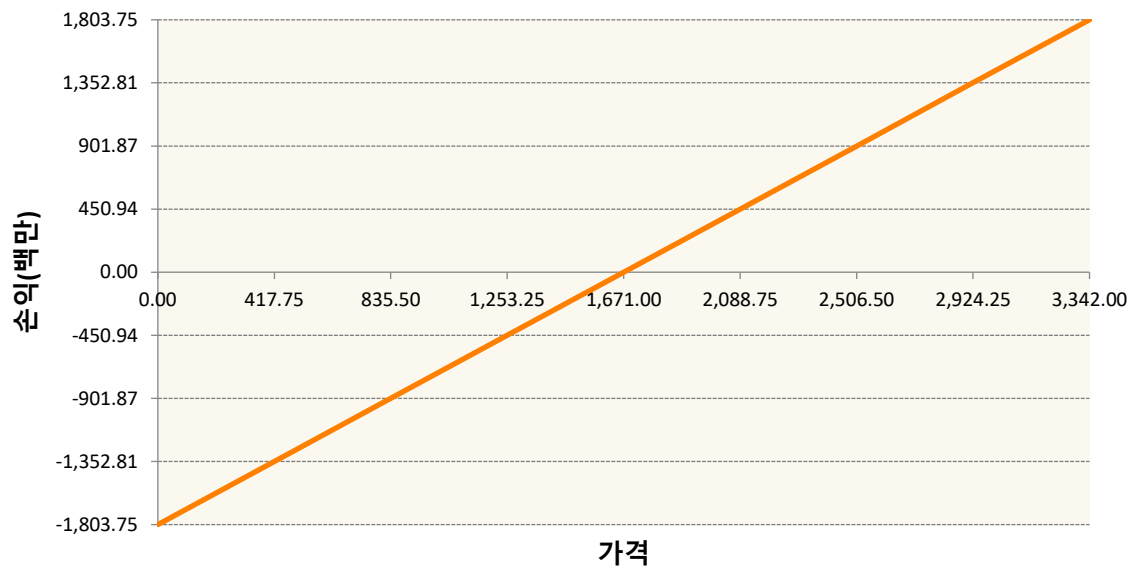
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



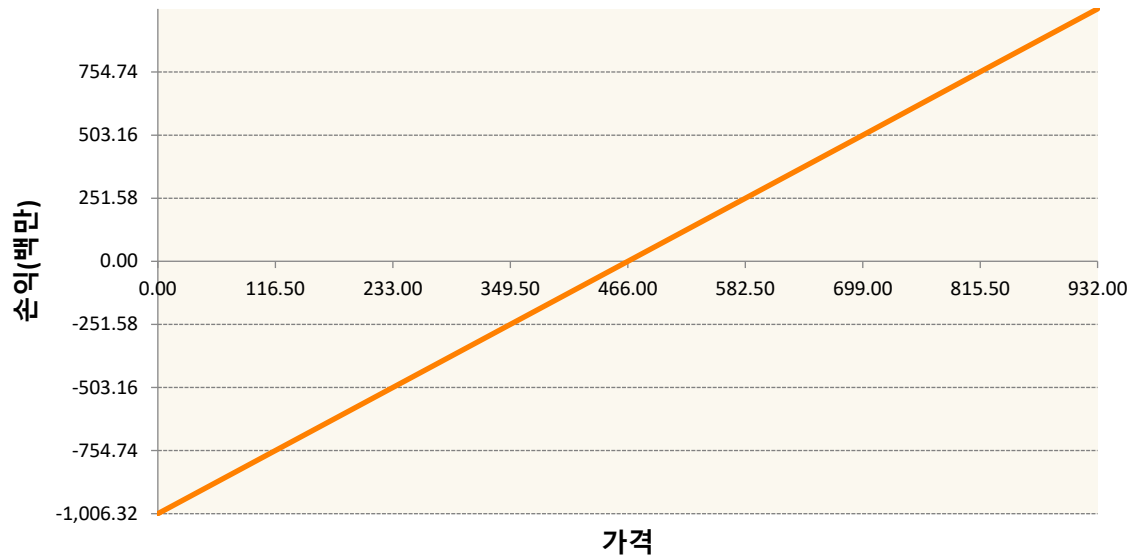
SBK2-Sugar May22



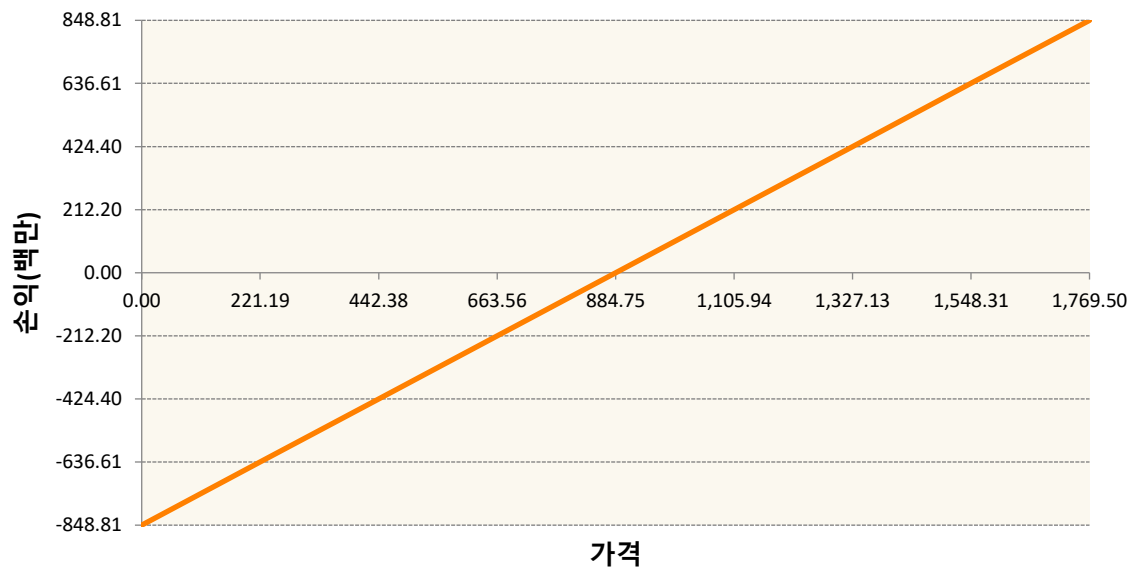
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



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 2022-02-25

기준일 2022-02-24

## 스마트인덱스모

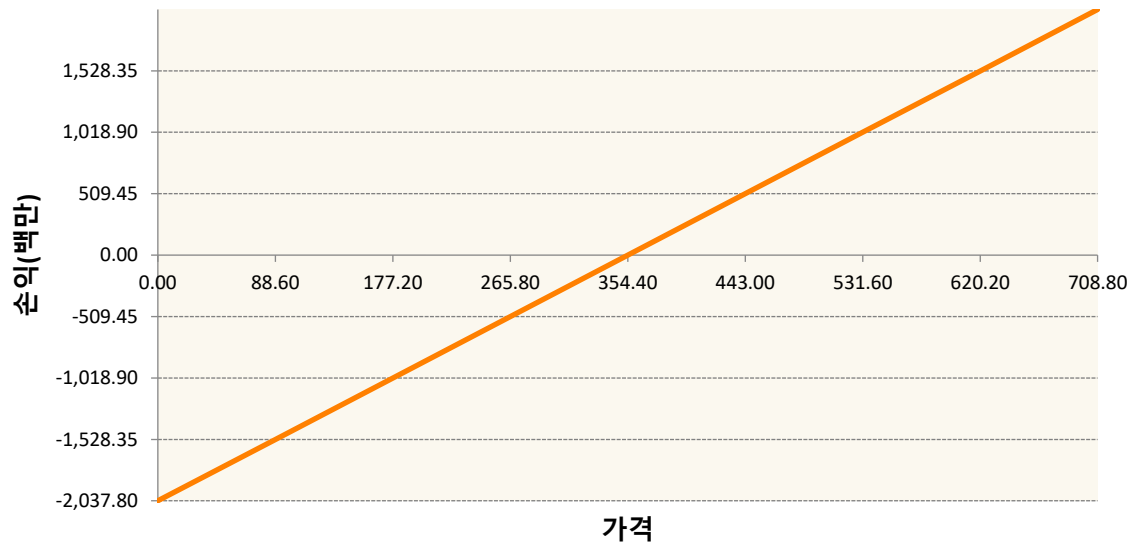
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,038 | 0     | 2,038     | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S30001

2022-03 코스피200지수선물

163

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -163    | -163    | -163   | -163 | -163  | -163   | -163   |
| -5.33%    | -109    | -109    | -109   | -109 | -109  | -109   | -109   |
| -2.67%    | -54     | -54     | -54    | -54  | -54   | -54    | -54    |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 54      | 54      | 54     | 54   | 54    | 54     | 54     |
| 5.33%     | 109     | 109     | 109    | 109  | 109   | 109    | 109    |
| 8.00%     | 163     | 163     | 163    | 163  | 163   | 163    | 163    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

# 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   | 1,902 | 0     | 1,902     | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20211125

139

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

84

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

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 | 418 |
|-----------------------------|-----|

\* 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 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

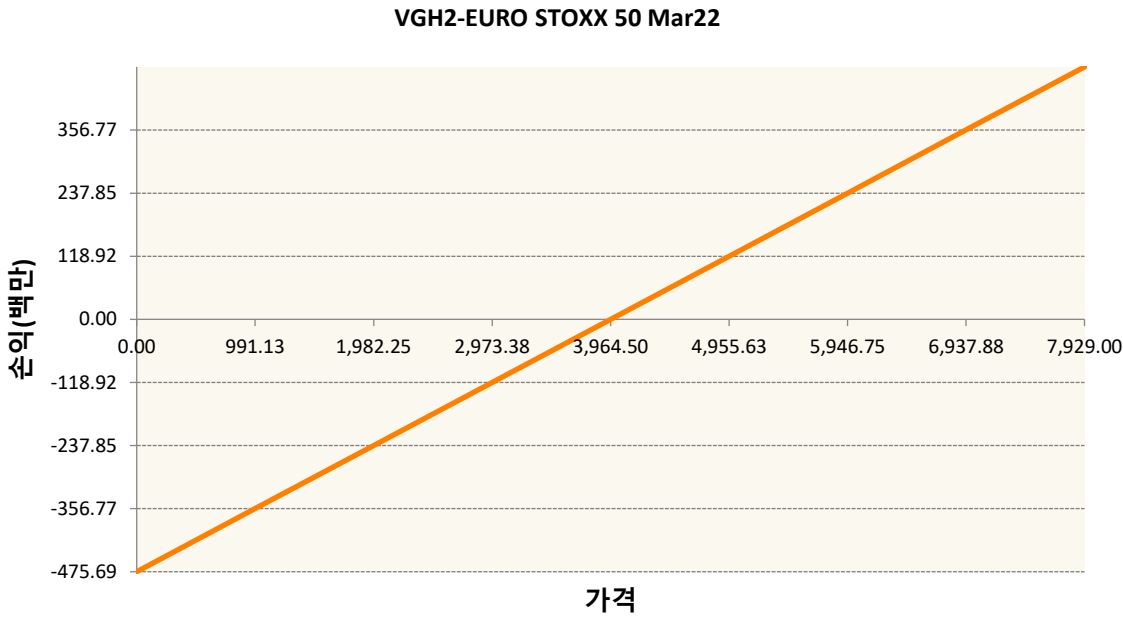
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 476   | 0     | 476       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGH2 | EURO STOXX 50 Mar22 | 38 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

33

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

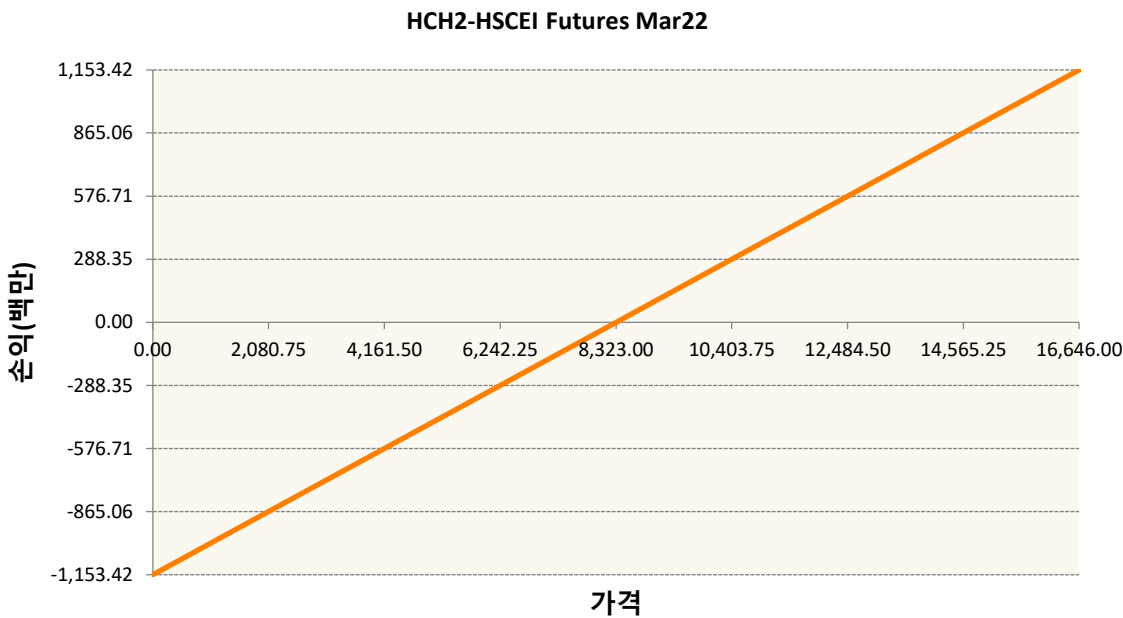
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,153 | 0     | 1,153     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCH2 | HSCEI Futures Mar22 | 92 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

99

공시일 2022-02-25

기준일 2022-02-24

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

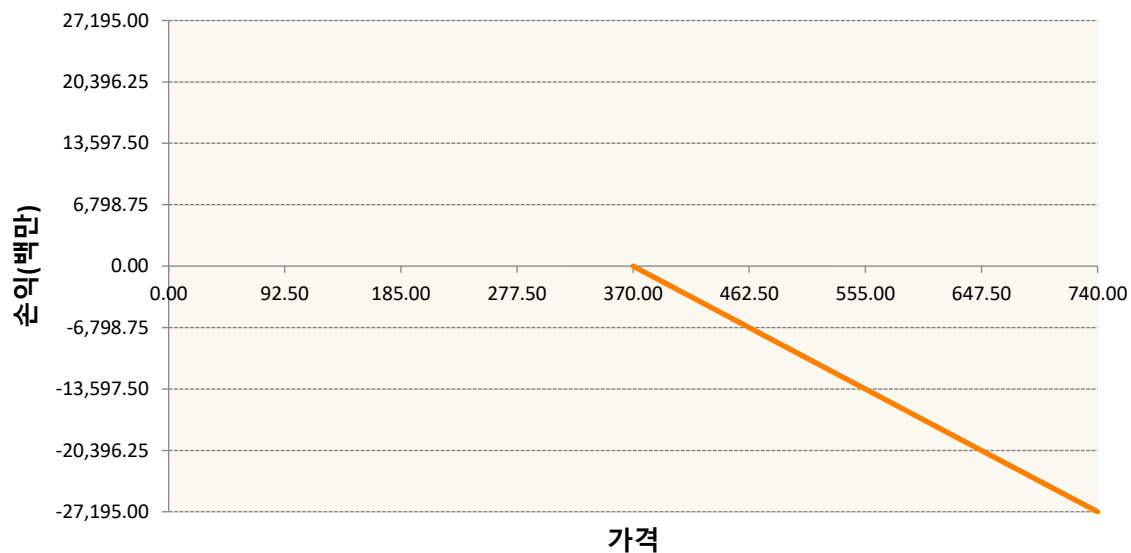
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

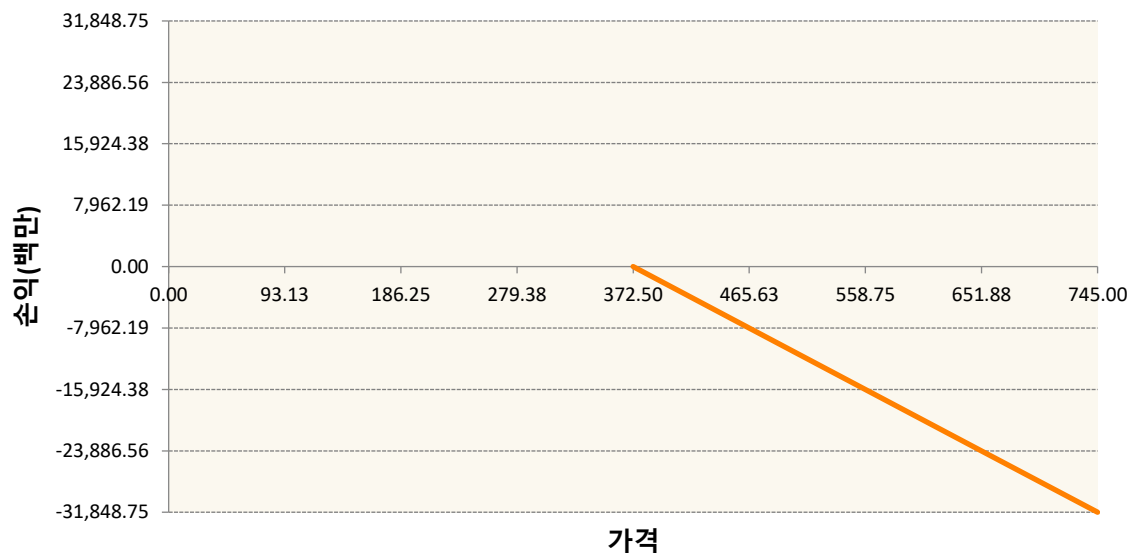
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 73,199 | -73,199   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

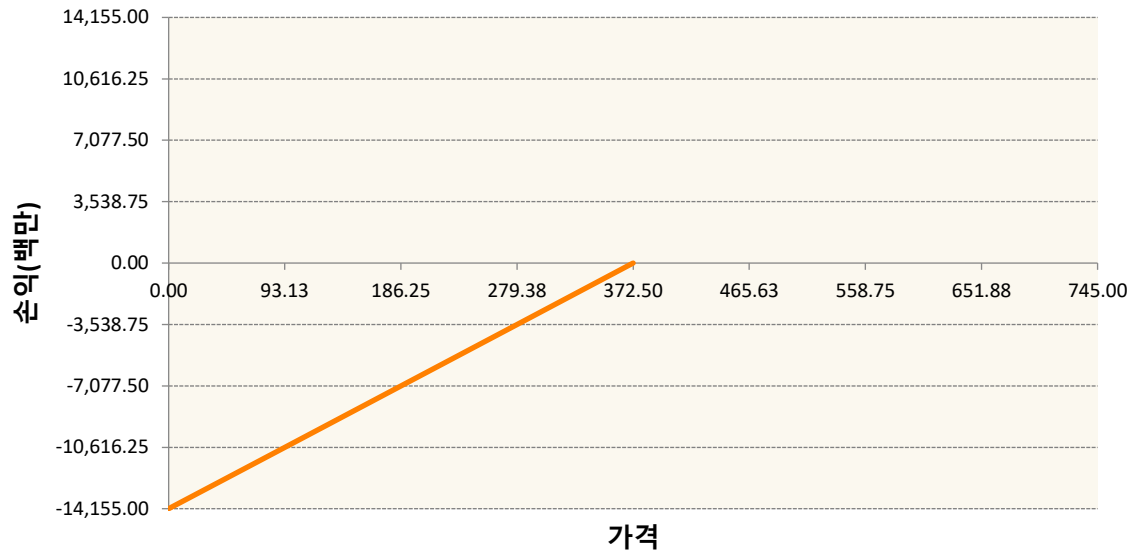
KR4201S33706-2022-03 콜370



KR4201S33722-2022-03 콜372.5



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201S33706 |           |         | 2022-03 콜370   |        |        |        | 1,221  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 323       | 318     | 310            | 299    | 284    | 267    | 246    |
| -5.33%       | 308       | 294     | 276            | 253    | 227    | 198    | 165    |
| -2.67%       | 262       | 232     | 199            | 161    | 121    | 78     | 33     |
| 0%           | 150       | 103     | 52             | 0      | -54    | -109   | -165   |
| 2.67%        | -65       | -126    | -188           | -250   | -312   | -375   | -438   |
| 5.33%        | -408      | -472    | -535           | -599   | -663   | -727   | -791   |
| 8.00%        | -878      | -932    | -987           | -1,044 | -1,102 | -1,162 | -1,221 |
| KR4201S33722 |           |         | 2022-03 콜372.5 |        |        |        | 1,341  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 324       | 319     | 312            | 301    | 286    | 268    | 246    |
| -5.33%       | 311       | 298     | 280            | 257    | 230    | 199    | 164    |
| -2.67%       | 269       | 239     | 205            | 165    | 122    | 76     | 26     |
| 0%           | 162       | 111     | 57             | 0      | -59    | -120   | -183   |
| 2.67%        | -54       | -123    | -192           | -263   | -334   | -406   | -478   |
| 5.33%        | -413      | -488    | -563           | -638   | -714   | -789   | -864   |
| 8.00%        | -922      | -989    | -1,058         | -1,127 | -1,198 | -1,269 | -1,341 |
| KR4301S33720 |           |         | 2022-03 풋372.5 |        |        |        | 1,004  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -993      | -994    | -994           | -996   | -998   | -1,001 | -1,004 |
| -5.33%       | -635      | -637    | -640           | -644   | -649   | -656   | -664   |
| -2.67%       | -283      | -289    | -297           | -307   | -318   | -331   | -345   |
| 0%           | 48        | 34      | 17             | 0      | -19    | -38    | -58    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 330 | 307 | 283 | 259 | 235 | 210 | 185 |
| 5.33% | 537 | 510 | 484 | 457 | 431 | 404 | 378 |
| 8.00% | 660 | 639 | 616 | 592 | 569 | 544 | 520 |

|                                        |          |
|----------------------------------------|----------|
| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|                                        | 3,167    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

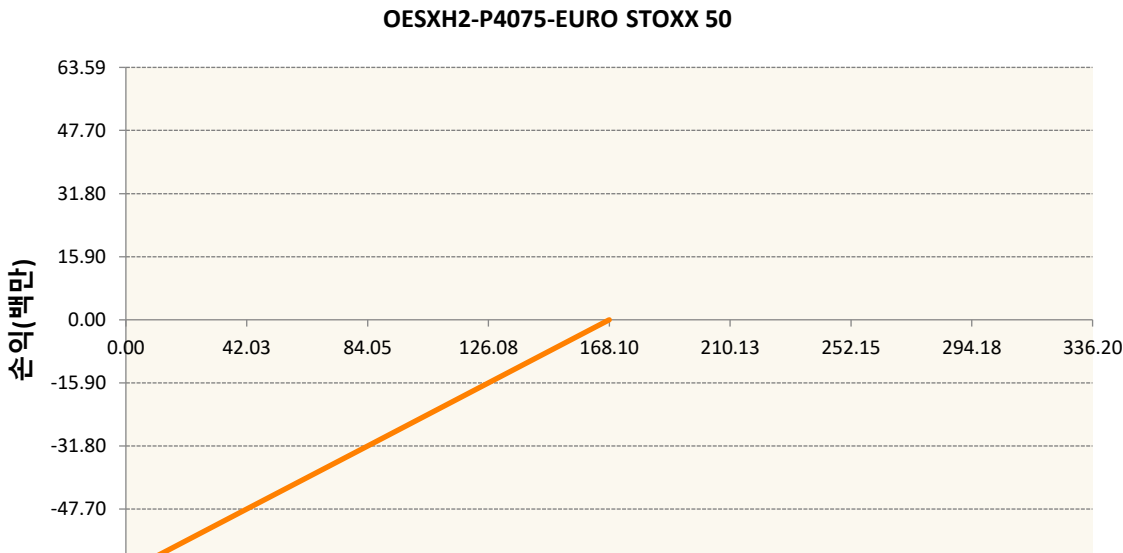
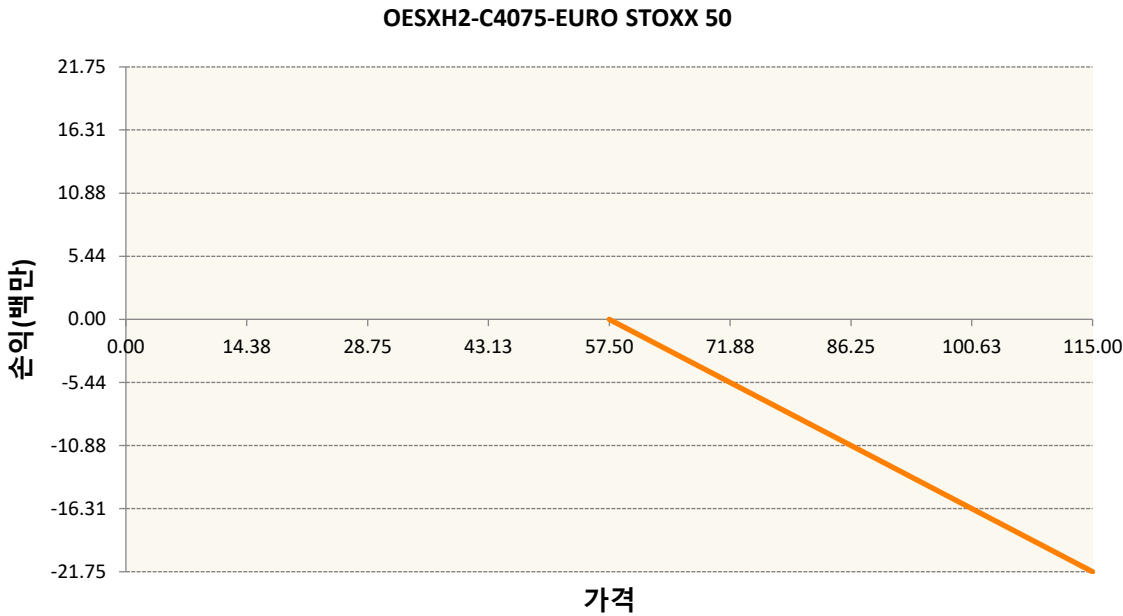
## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 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     | 85    | -85       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,351 | -1,351    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                | (단위:백만원) |
|------------------------------------------|----------|
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | 22       |
| FXW213BCF <sup>2</sup> KRW/EUR 17-03-22E | 54       |
| FXW213C2F <sup>2</sup> KRW/EUR 27-05-22E | 22       |
| FXW213C2F <sup>2</sup> KRW/EUR 22-04-22E | 32       |
| OESXH2-C4C EURO STOXX 50                 | 2        |
| OESXH2-P40 EURO STOXX 50                 | 5        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 83       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

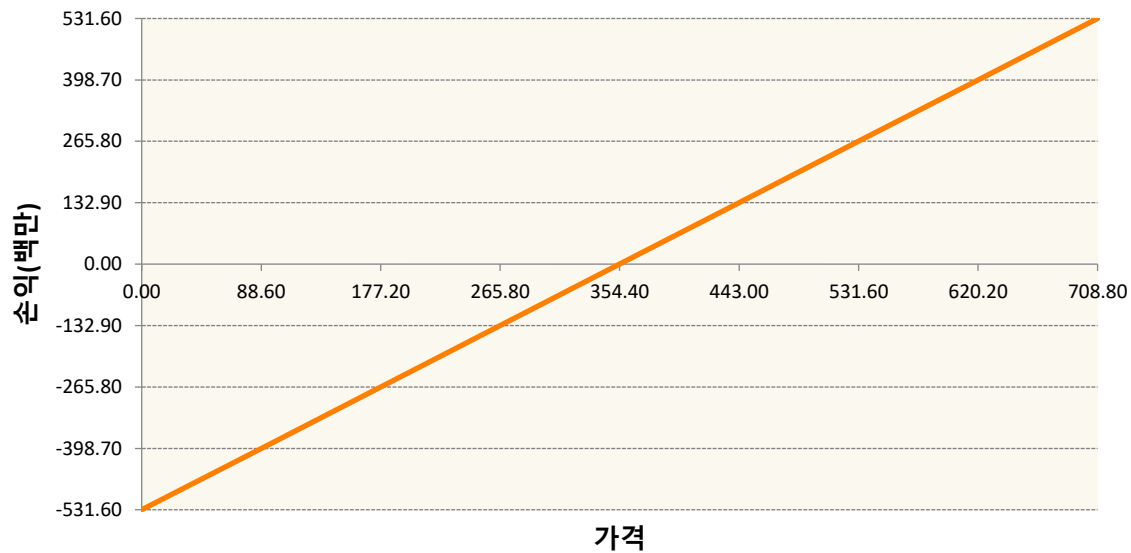
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

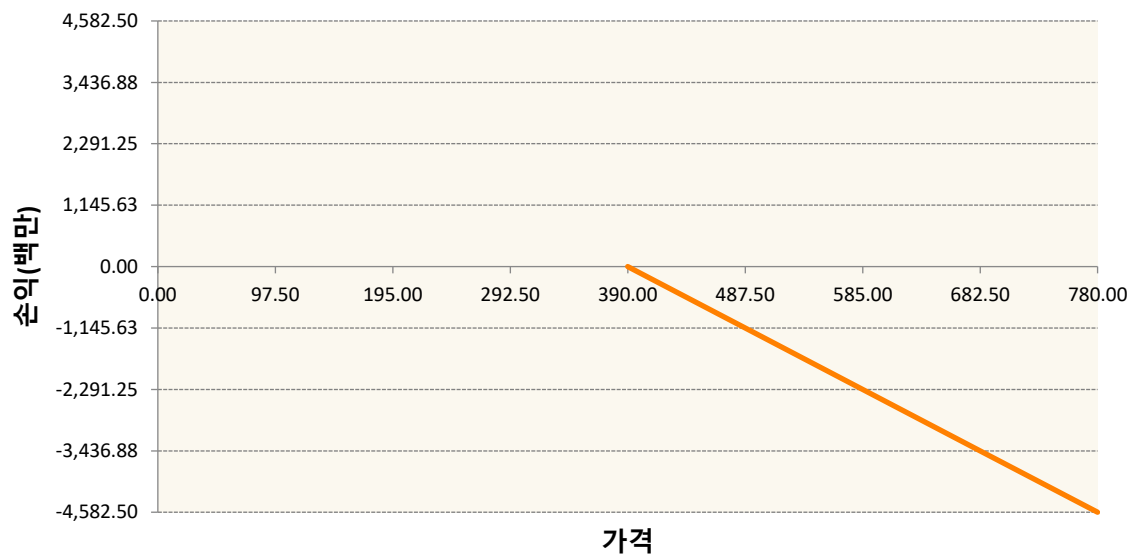
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 532   | 0     | 532       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 372   | 4,877 | -4,505    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

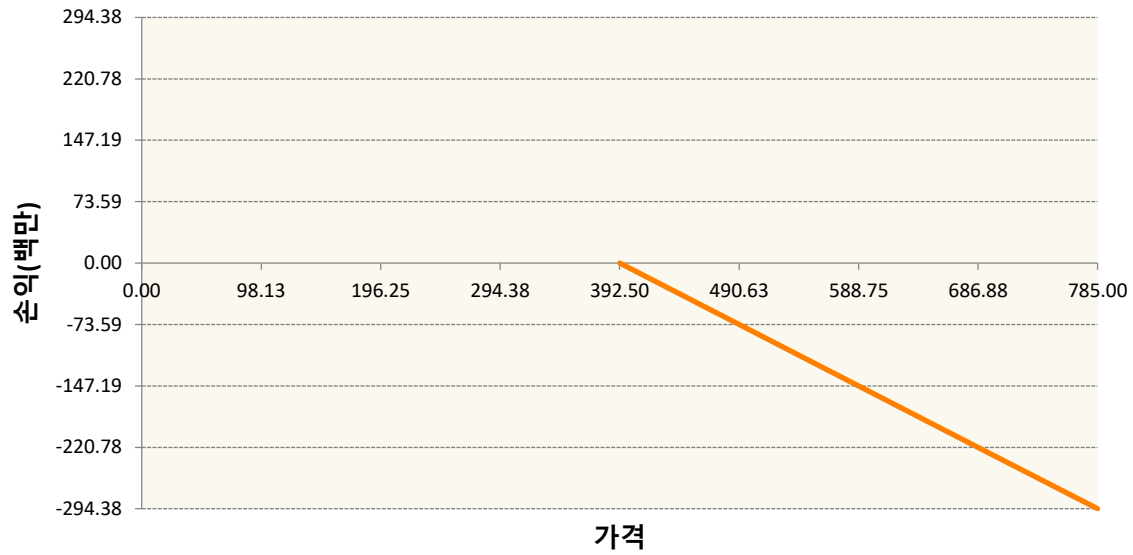
KR4101S30001-2022-03 코스피200지수선물



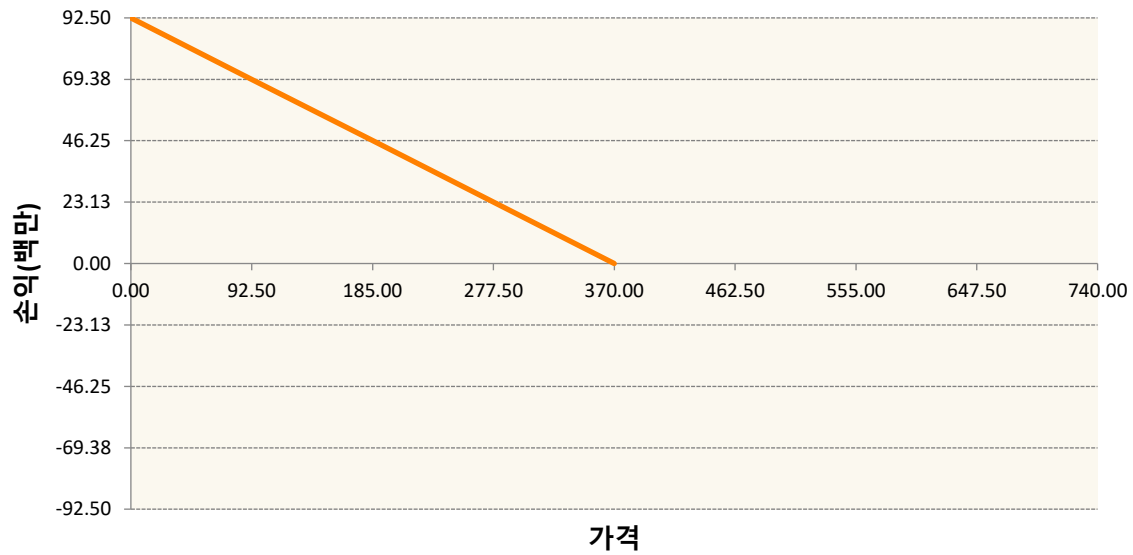
KR4201S33904-2022-03 콜390



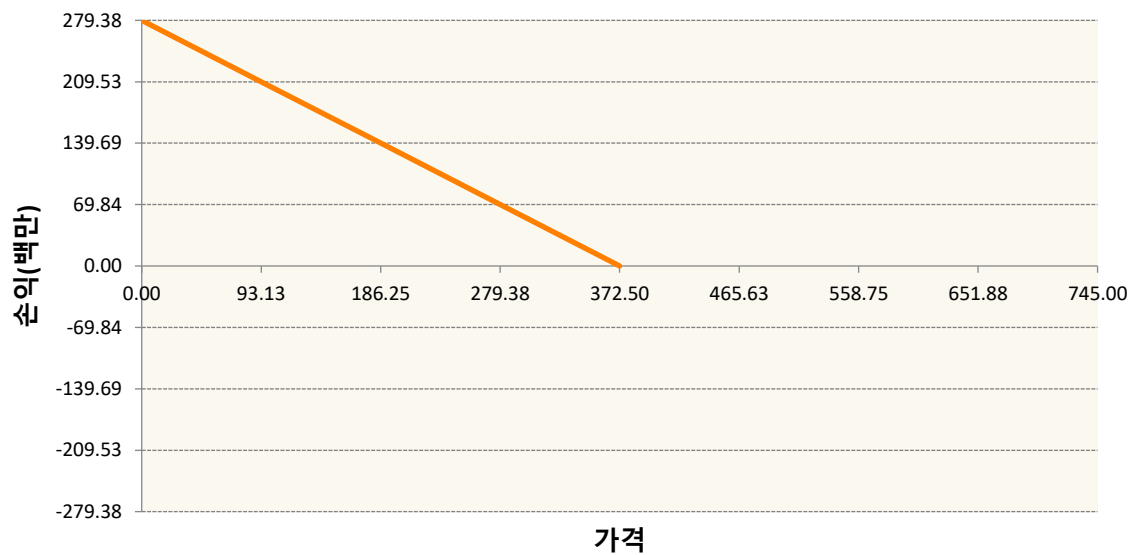
KR4201S33920-2022-03 콜392.5



KR4301S33704-2022-03 풋370



KR4301S33720-2022-03 풋372.5



(단위:백만원)

|              |           |         |                    |     |       |        |        |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
| KR4101S30001 |           |         | 2022-03 코스피200지수선물 |     |       |        | 43     |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -43       | -43     | -43                | -43 | -43   | -43    | -43    |
| -5.33%       | -28       | -28     | -28                | -28 | -28   | -28    | -28    |
| -2.67%       | -14       | -14     | -14                | -14 | -14   | -14    | -14    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 14        | 14      | 14                 | 14  | 14    | 14     | 14     |
| 5.33%        | 28        | 28      | 28                 | 28  | 28    | 28     | 28     |
| 8.00%        | 43        | 43      | 43                 | 43  | 43    | 43     | 43     |
| KR4201S33904 |           |         | 2022-03 콜390       |     |       |        | 112    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 13        | 13      | 13                 | 13  | 12    | 11     | 10     |
| -5.33%       | 13        | 13      | 12                 | 11  | 10    | 8      | 6      |
| -2.67%       | 13        | 12      | 10                 | 8   | 5     | 2      | -2     |
| 0%           | 10        | 7       | 4                  | 0   | -5    | -10    | -15    |
| 2.67%        | 2         | -3      | -9                 | -15 | -22   | -29    | -37    |
| 5.33%        | -16       | -24     | -32                | -41 | -50   | -59    | -69    |
| 8.00%        | -49       | -59     | -70                | -80 | -91   | -101   | -112   |
| KR4201S33920 |           |         | 2022-03 콜392.5     |     |       |        | 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      | 1      |
| -5.33%       | 1         | 1       | 1                  | 1   | 1     | 0      | 0      |
| -2.67%       | 1         | 1       | 1                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 0%           | 1         | 0       | 0                  | 0   | 0     | -1     | -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     |
| KR4301S33704 |           |         | 2022-03 풋370       |     |       |        | 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  | -1    | -1     | -1     |
| 5.33%        | -3        | -3      | -3                 | -3  | -3    | -2     | -2     |
| 8.00%        | -4        | -4      | -4                 | -4  | -3    | -3     | -3     |
| KR4301S33720 |           |         | 2022-03 풋372.5     |     |       |        | 20     |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| -8.00% | 20      | 20      | 20     | 20  | 20    | 20     | 20     |
| -5.33% | 13      | 13      | 13     | 13  | 13    | 13     | 13     |
| -2.67% | 6       | 6       | 6      | 6   | 6     | 7      | 7      |
| 0%     | -1      | -1      | 0      | 0   | 0     | 1      | 1      |
| 2.67%  | -7      | -6      | -6     | -5  | -5    | -4     | -4     |
| 5.33%  | -11     | -10     | -10    | -9  | -8    | -8     | -7     |
| 8.00%  | -13     | -13     | -12    | -12 | -11   | -11    | -10    |

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

(단위:백만원)

133

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

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 | 10,216 | 0     | 10,216    |    |

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 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 35    | -35       |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 8,425 | 0     | 8,425     |    |

### 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 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

## 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 | 29,025 | 0      | 29,025    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 842    | 29,735 | -28,894   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E  | 192   |
| FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E | 67    |
| FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E  | 2,186 |
| IE00BD8RGM75                 |       |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

766





|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

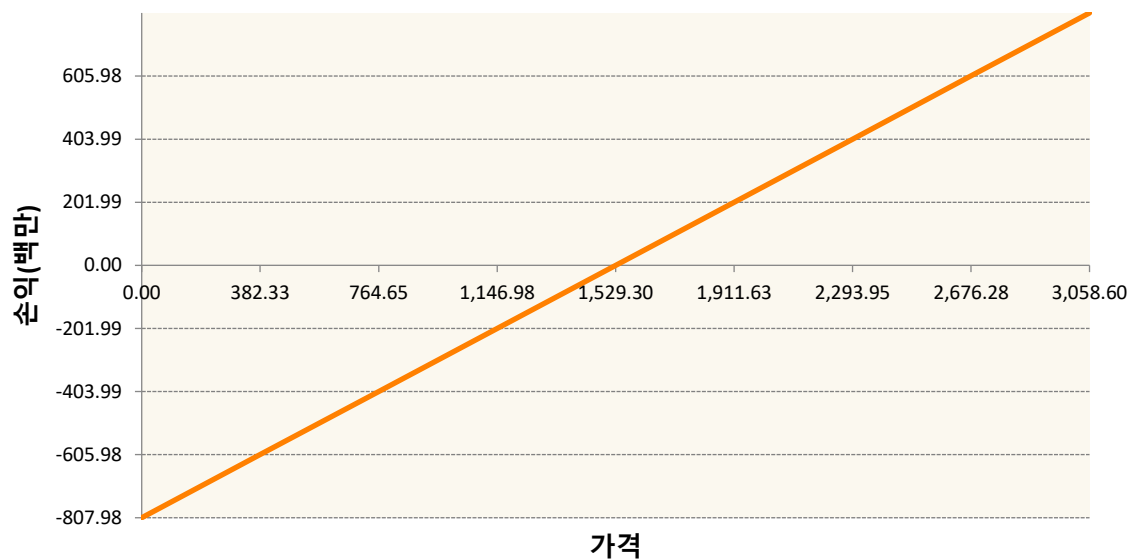
### 1. 계약금액

(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   | 808   | 0     | 808       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,847 | 0     | 1,847     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,905 | -1,905    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCH2-VN30 Index Future Mar22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 148 |
| 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  |
| FXW213C2P KRW/EUR 20-05-22E   | 46  |
| VNCH2 VN30 Index Future Mar22 | 65  |

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

(단위:백만원)

290

공시일 2022-02-25

기준일 2022-02-24

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

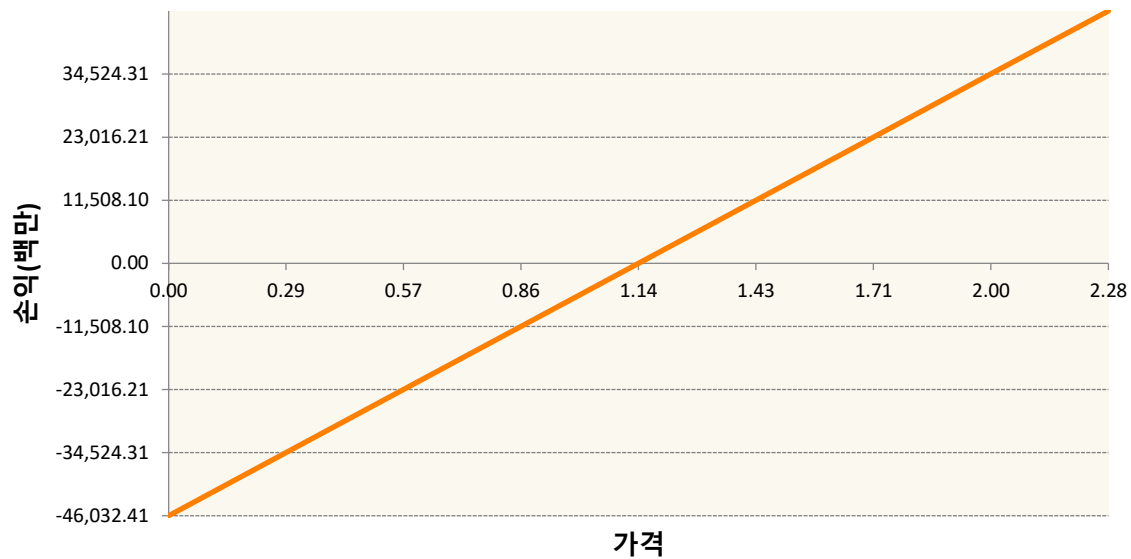
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

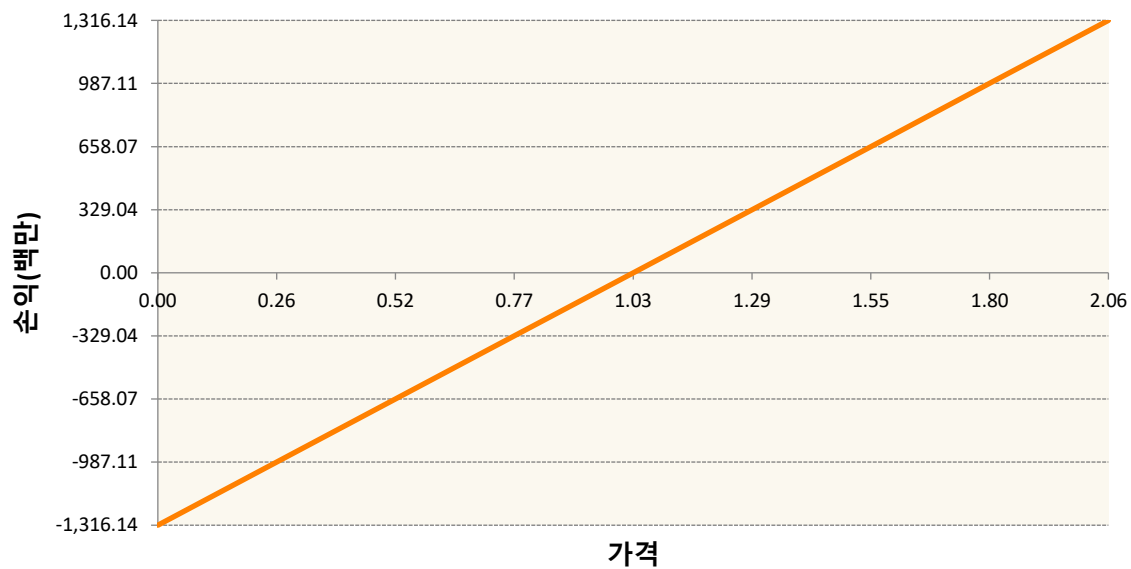
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 48,665 | 0     | 48,665    |    |

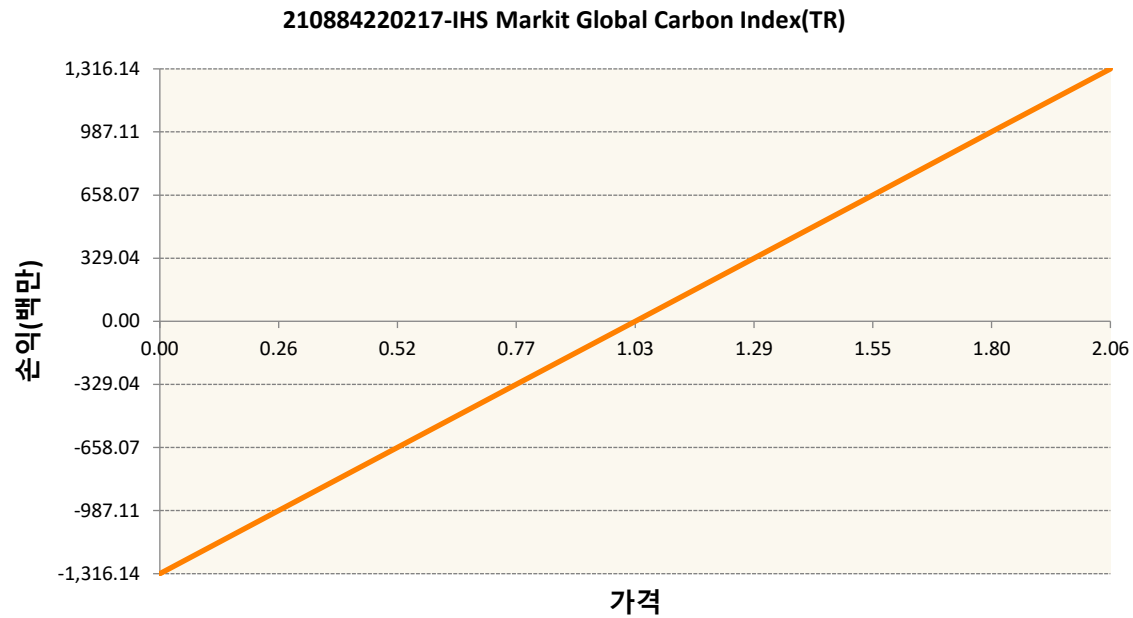
### 2. 만기시점의 손익구조

210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220216-IHS Markit Global Carbon Index(TR)





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                     |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------|--|----------|
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 3,687    |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 105      |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 105      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 6,199    |

공시일 2022-02-25

기준일 2022-02-24

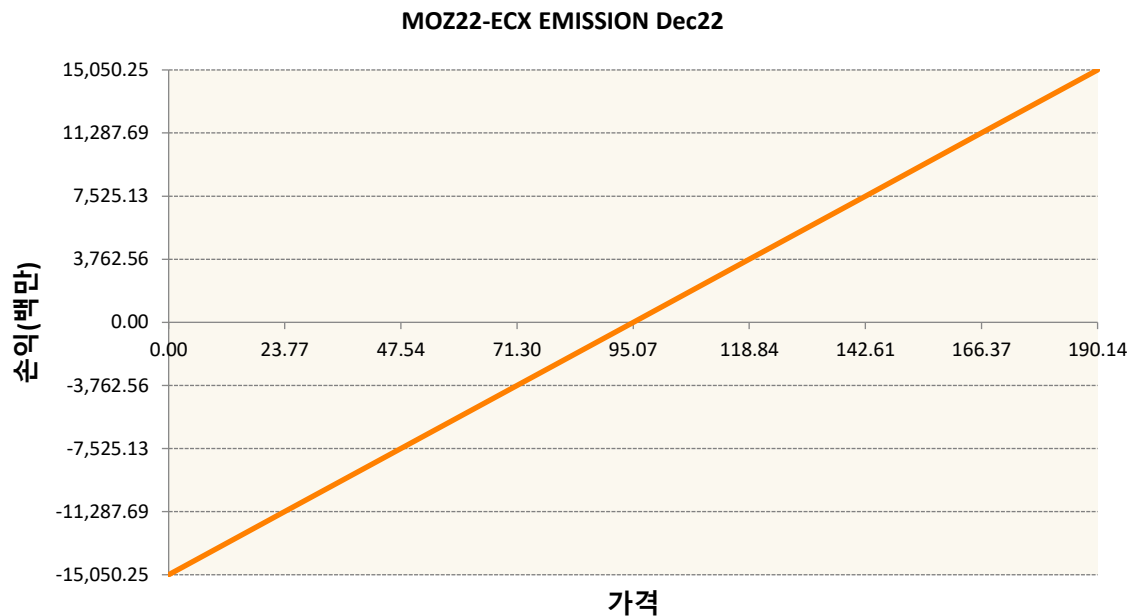
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 15,050 | 0     | 15,050    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 8,724 | -8,724    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C1V·KRW/EUR 25-02-22E

698

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,204

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

(단위:백만원)

2,835

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

## 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)  | 20 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)  | 20 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)  | 20 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠) | 20 |

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

(단위:백만원)

151

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-02-25 |
| 기준일 | 2022-02-24 |

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)  | 7 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 8 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(메리츠) | 7 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 7 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원) |
|-------------------------------------------------|
| 37                                              |

공시일 2022-02-25

기준일 2022-02-24

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

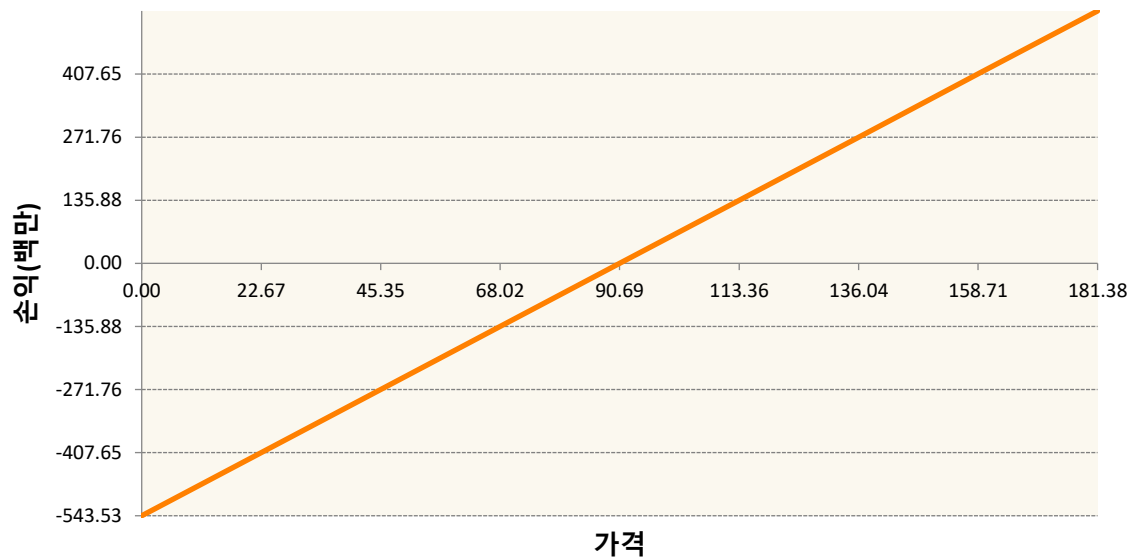
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

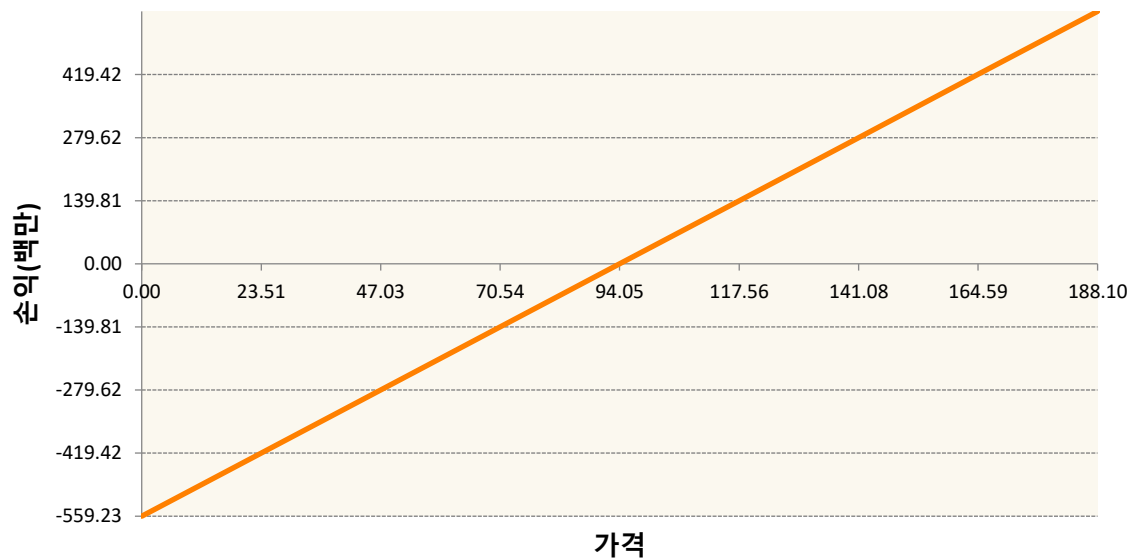
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,390 | 421   | 1,969     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

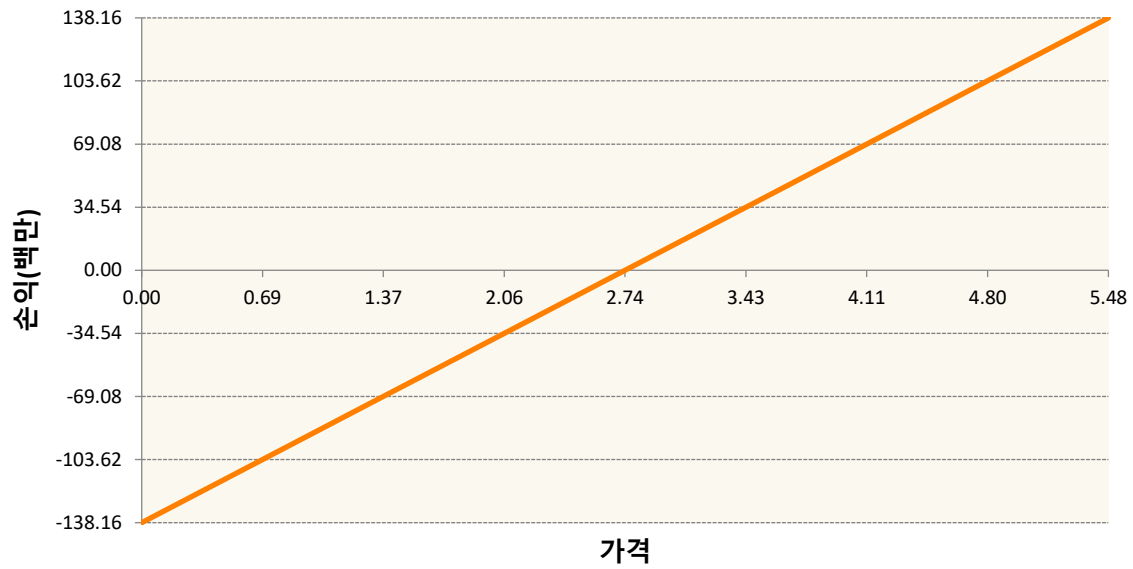
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



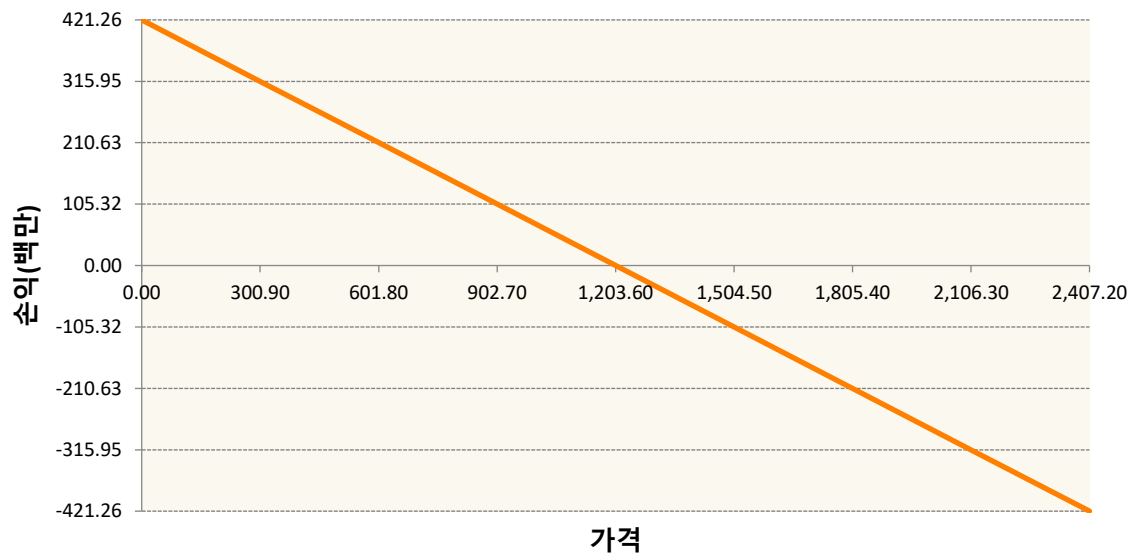
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



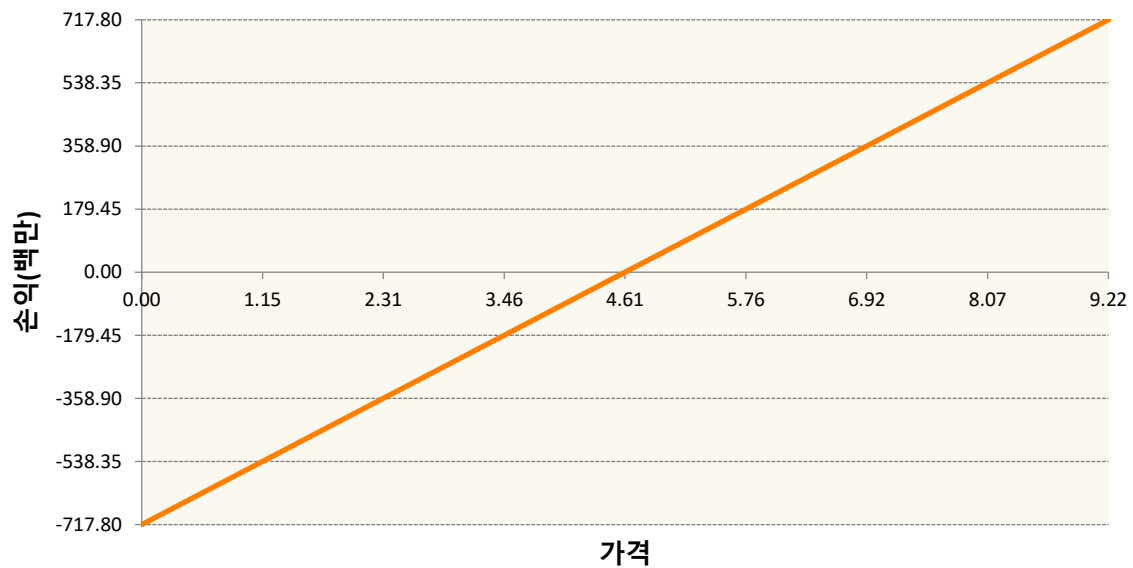
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22



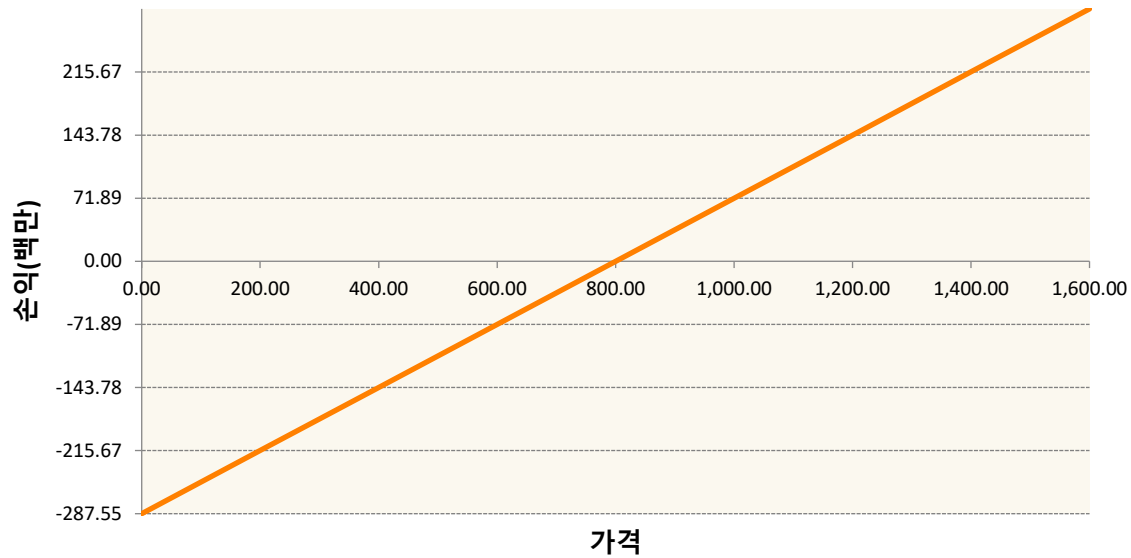
KR4175S30005-2022-03 달러선물



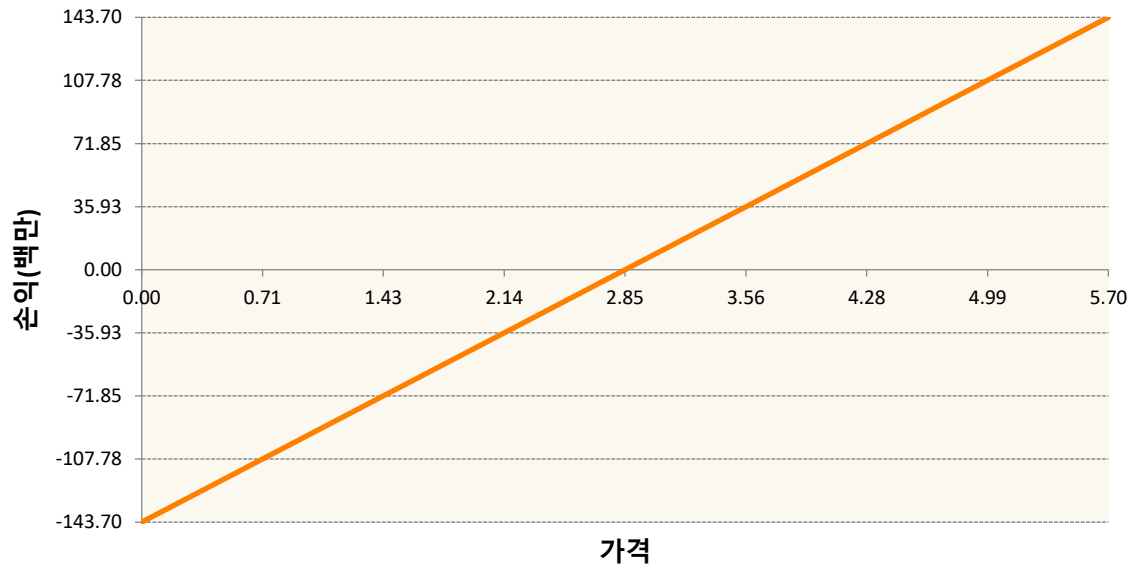
NGK22-NATURAL GAS FUTR May22



QSK2-Low Su Gasoil G MAY22



XBK2-GASOLINE RBOB FUT May22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| CLK2       | WTI CRUDE FUTURE May22  | 43 |
| COK2       | BRENT CRUDE FUTR May22  | 45 |
| HOK2       | NY Harb ULSD Fut May22  | 11 |
| KR4175S300 | 2022-03 달러선물            | 34 |
| NGK22      | NATURAL GAS FUTR May22  | 57 |
| QSK2       | Low Su Gasoil G MAY22   | 23 |
| XBK2       | GASOLINE RBOB FUT May22 | 11 |

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

(단위:백만원)

477