

공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

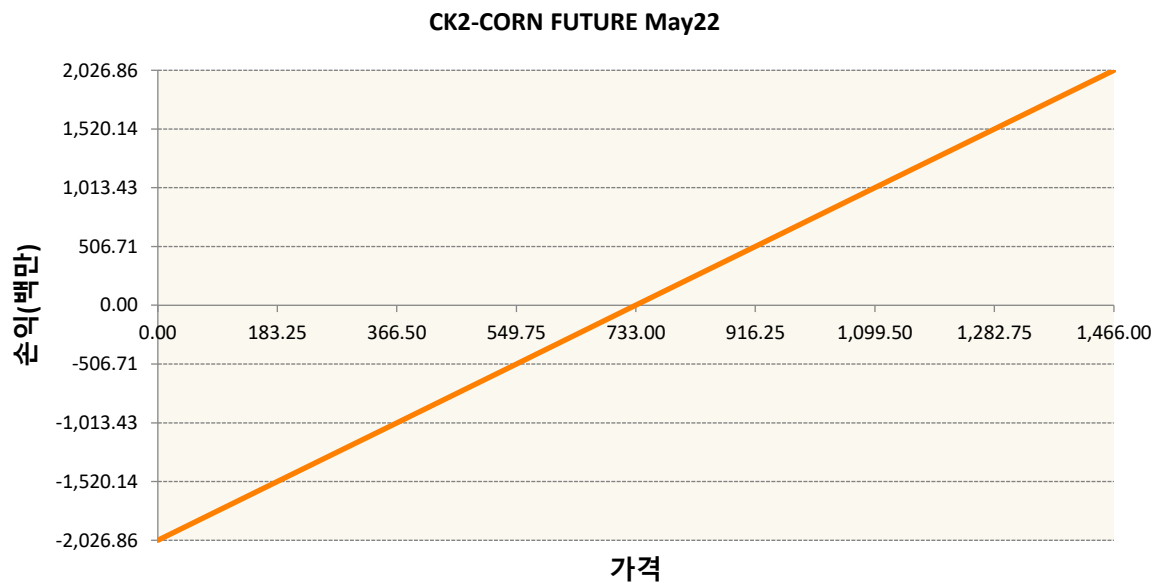
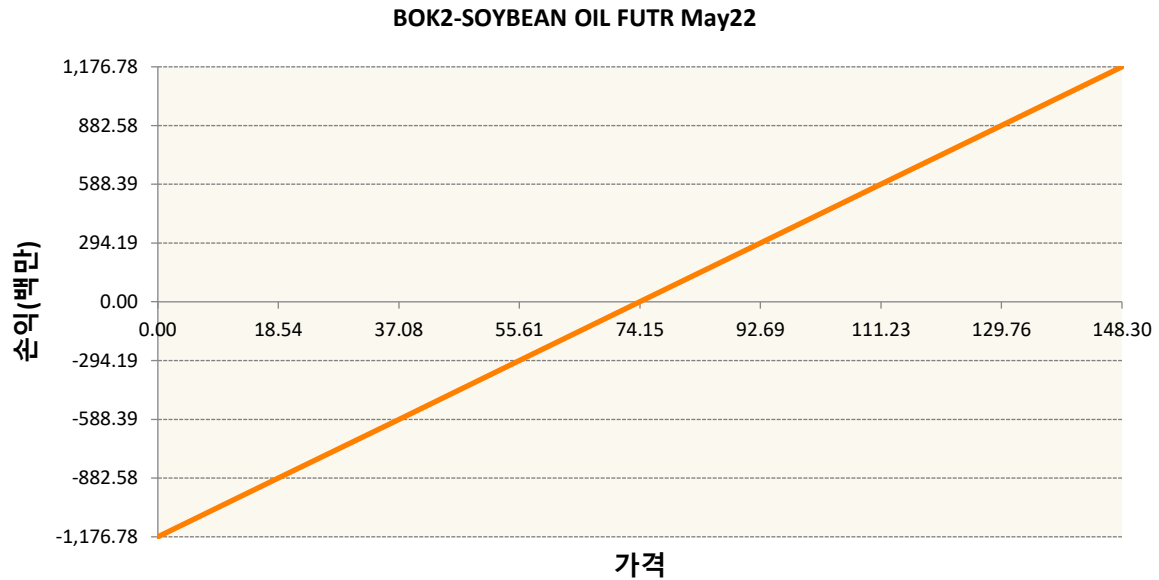
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

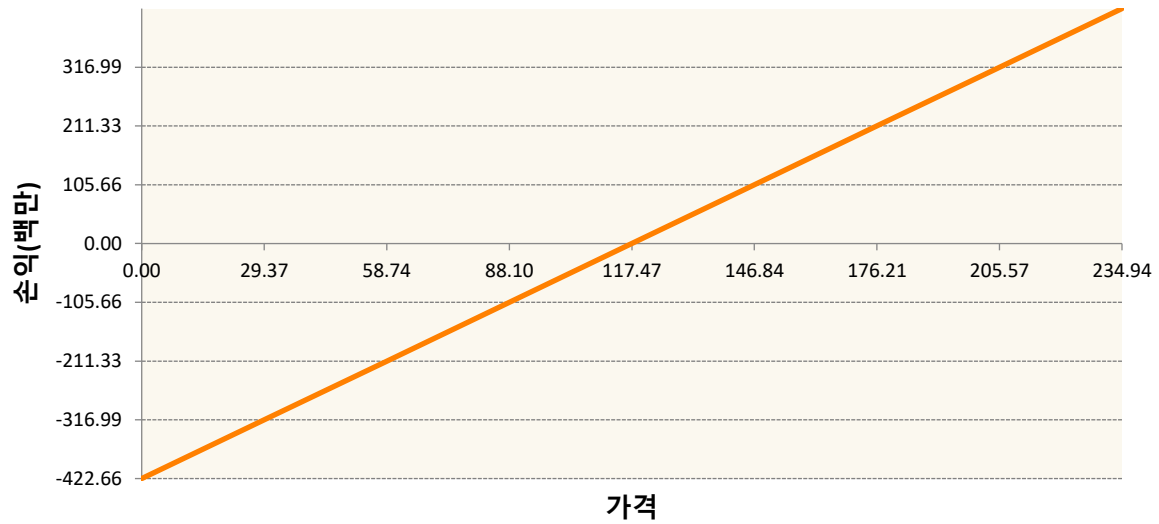
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 10,742 | 1,597 | 9,144     |    |

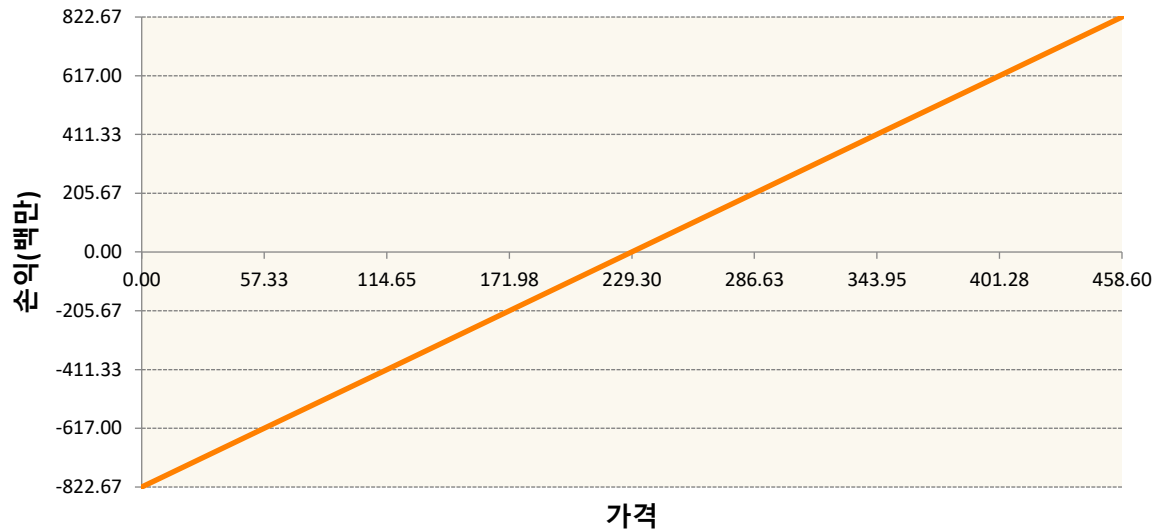
### 2. 만기시점의 손익구조



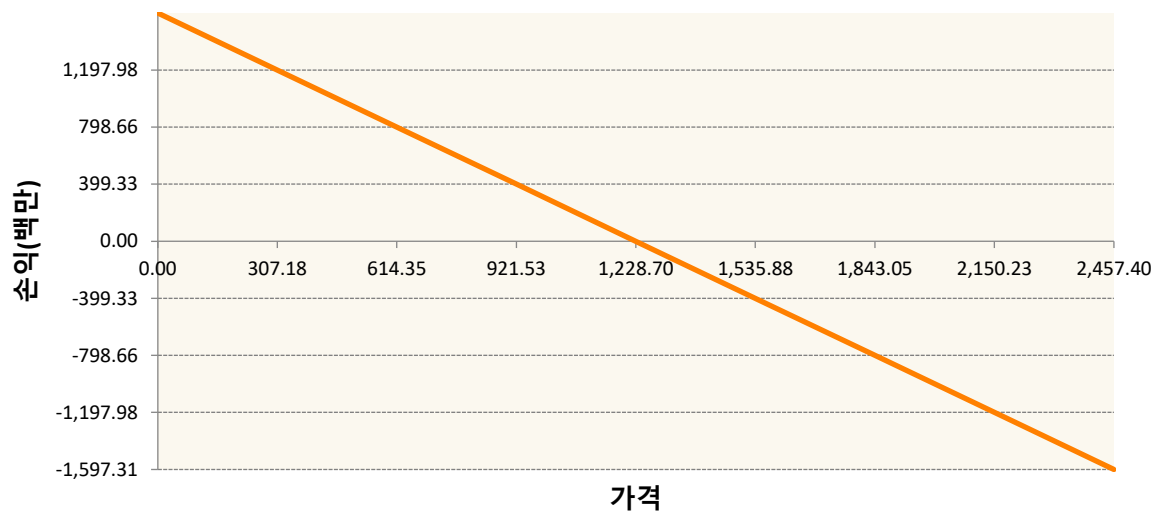
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



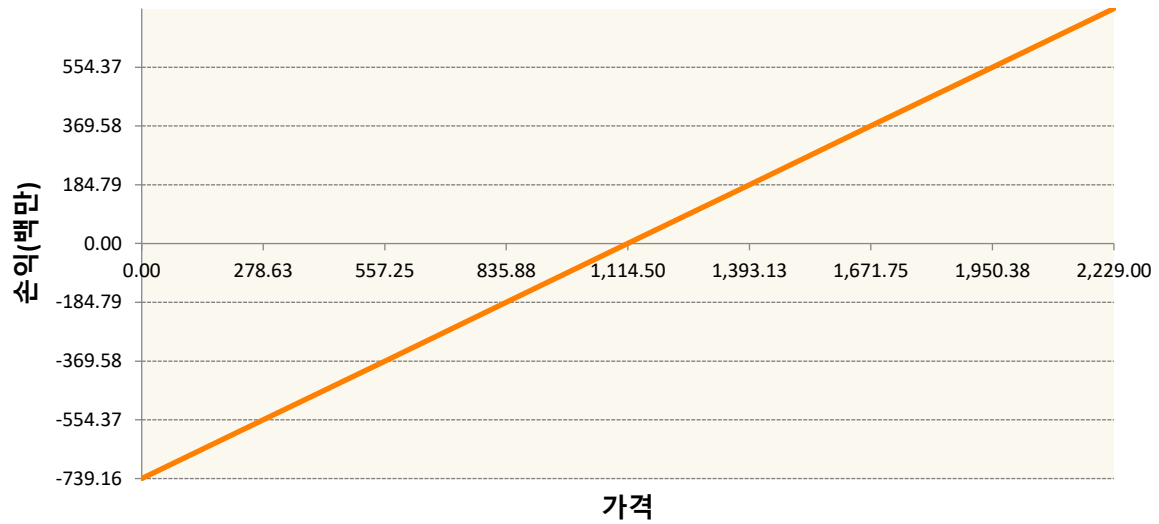
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



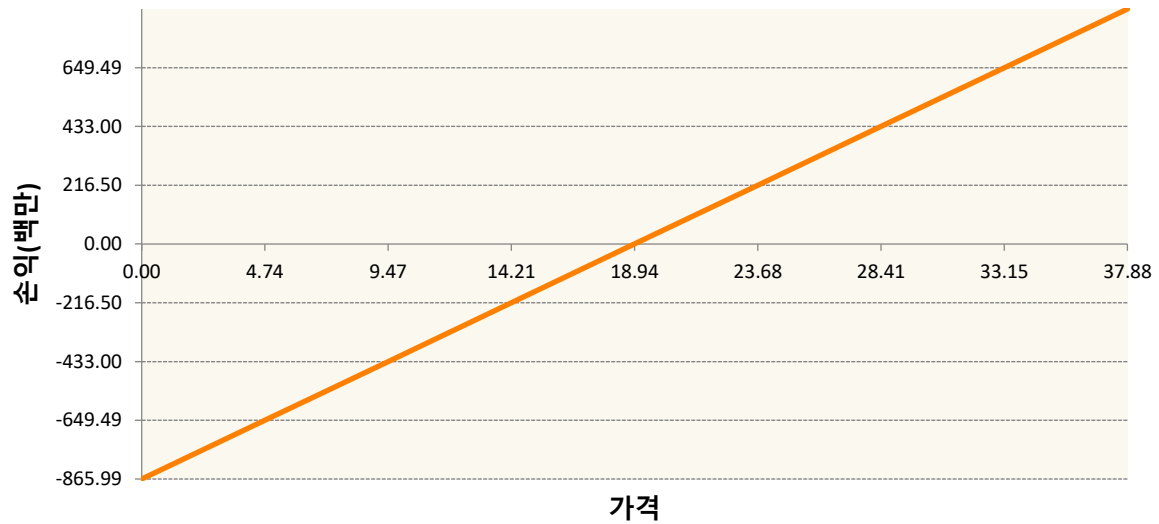
KR4175S30005-2022-03 달러선물



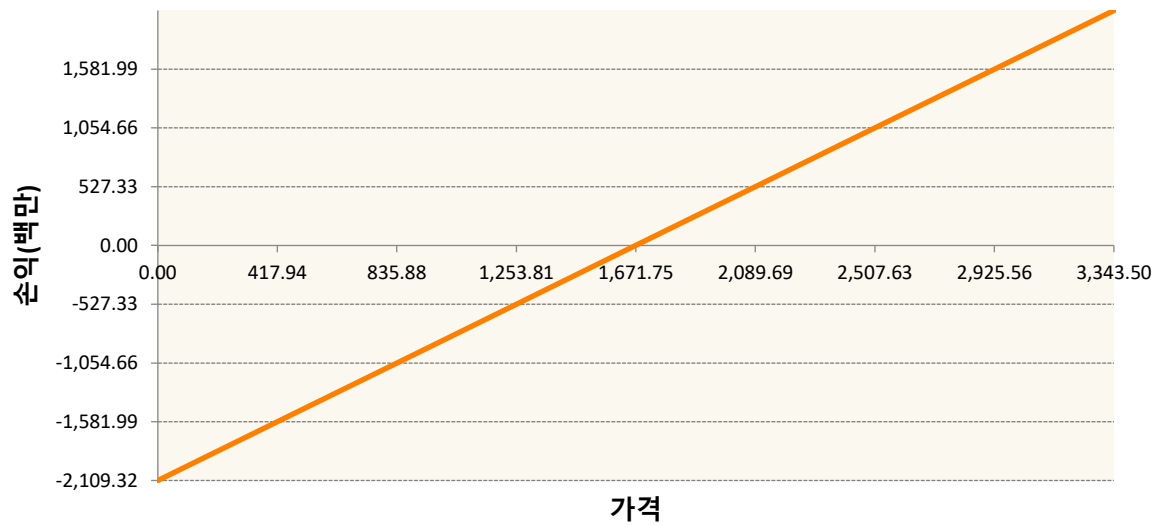
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



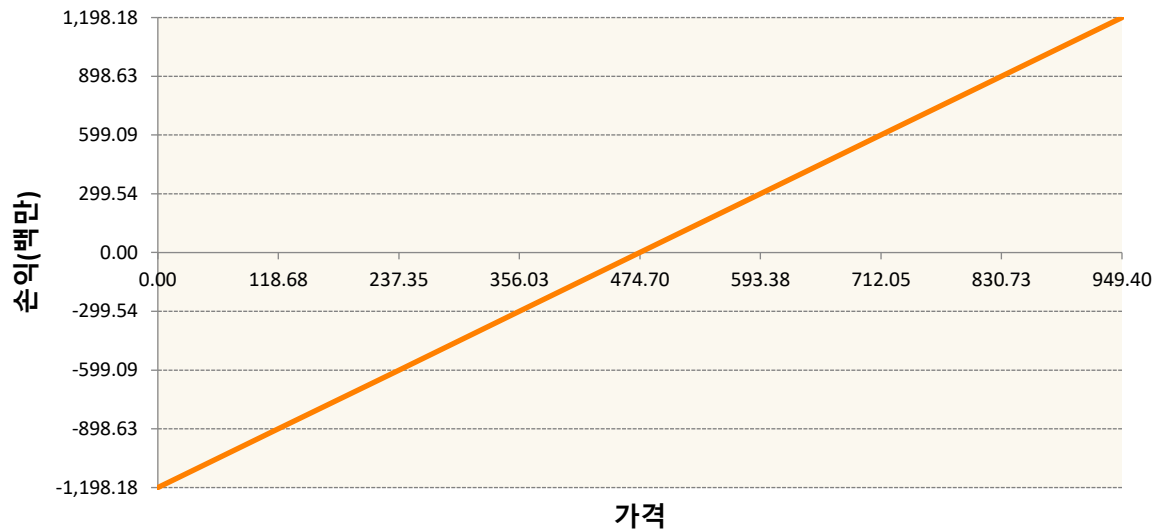
SBK2-Sugar May22



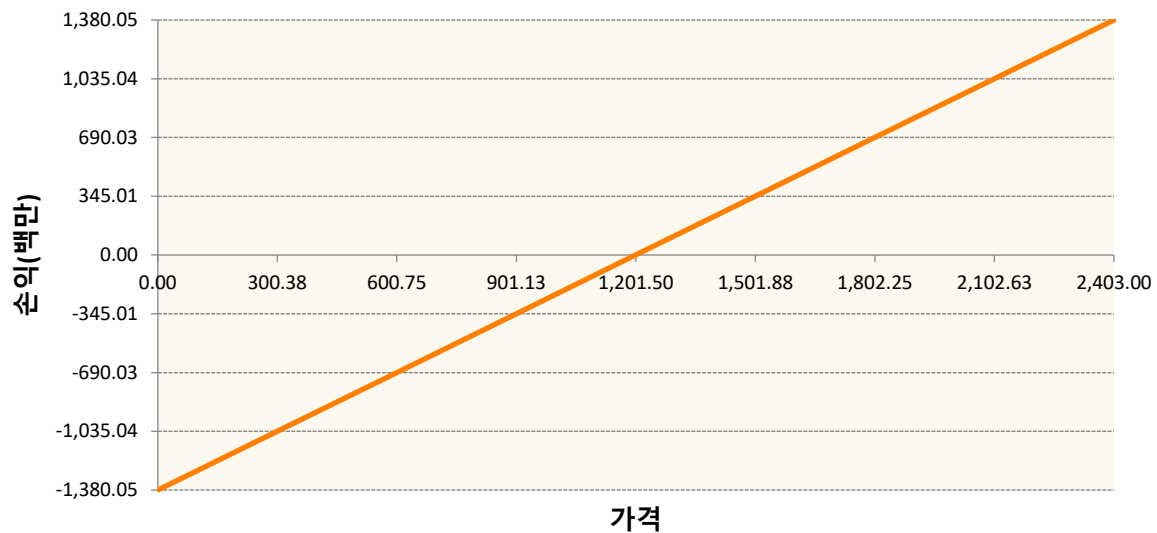
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



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 2022-03-11

기준일 2022-03-10

## 스마트인덱스모

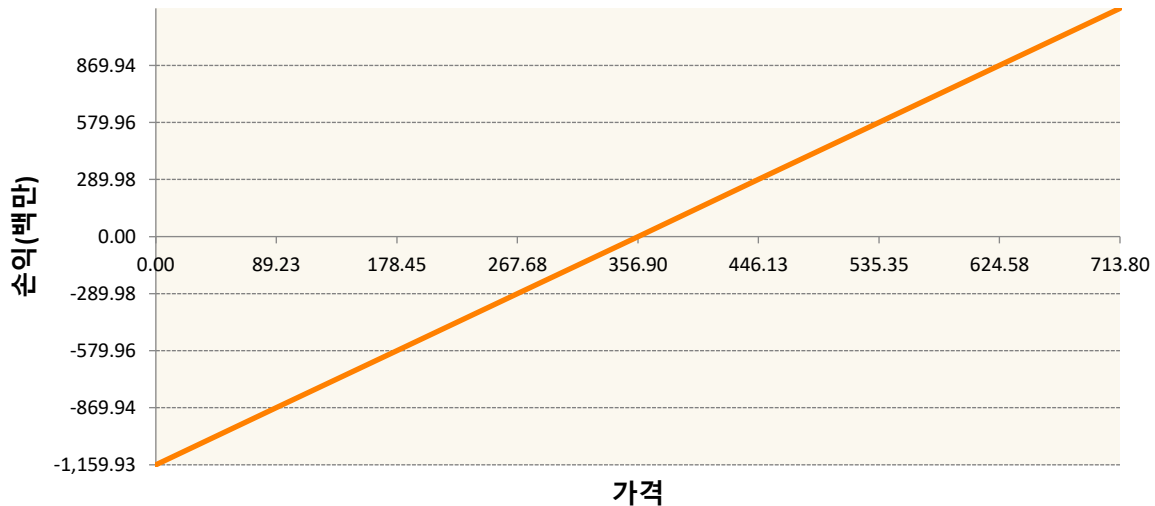
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 1,067 | 0     | 1,067     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,160 | 0     | 1,160     | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 93     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -93       | -93     | -93                | -93 | -93   | -93    | -93    |
| -5.33%       | -62       | -62     | -62                | -62 | -62   | -62    | -62    |
| -2.67%       | -31       | -31     | -31                | -31 | -31   | -31    | -31    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 31        | 31      | 31                 | 31  | 31    | 31     | 31     |
| 5.33%        | 62        | 62      | 62                 | 62  | 62    | 62     | 62     |
| 8.00%        | 93        | 93      | 93                 | 93  | 93    | 93     | 93     |





|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-11 |
| 기준일 | 2022-03-10 |

## 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   | 1,733 | 0     | 1,733     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO00 신한MSCI선진국미래20220225

137

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

87

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-11 |
| 기준일 | 2022-03-10 |

## 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

381

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

359

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

## 유로인덱스모(주식-파생형)

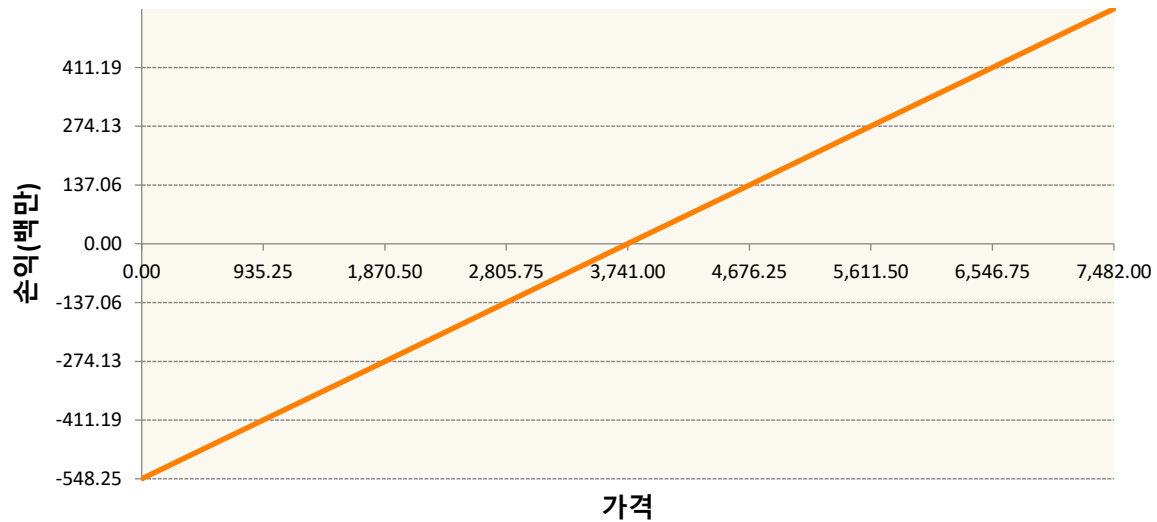
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 548   | 0     | 548       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

VGH2-EURO STOXX 50 Mar22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH2 EURO STOXX 50 Mar22

44

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

(단위:백만원)

41



공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

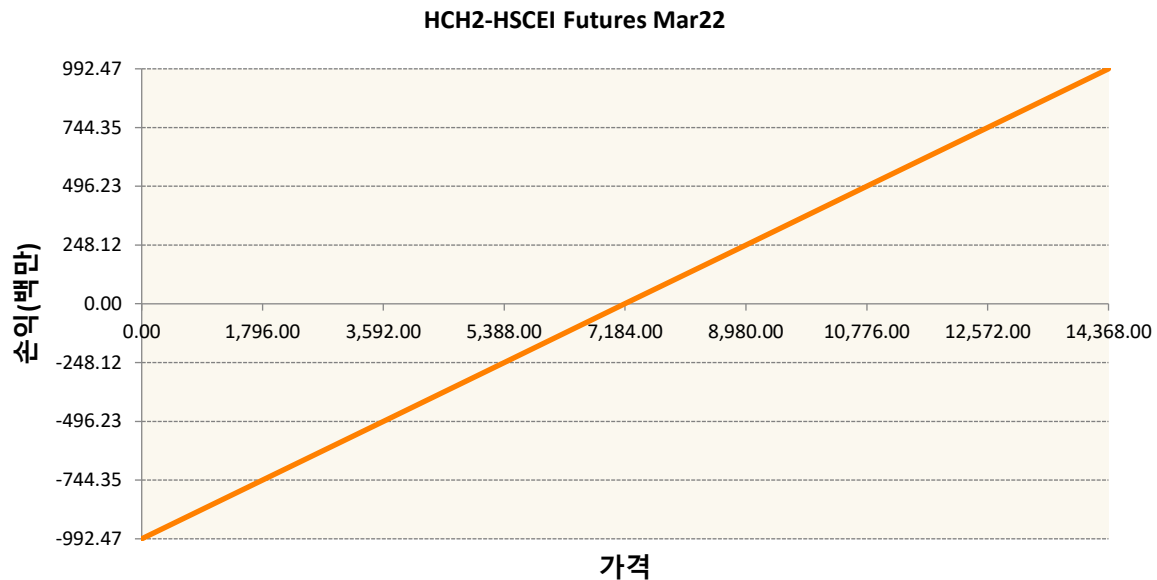
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 992   | 0     | 992       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCH2 | HSCEI Futures Mar22 | 79 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

87



공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

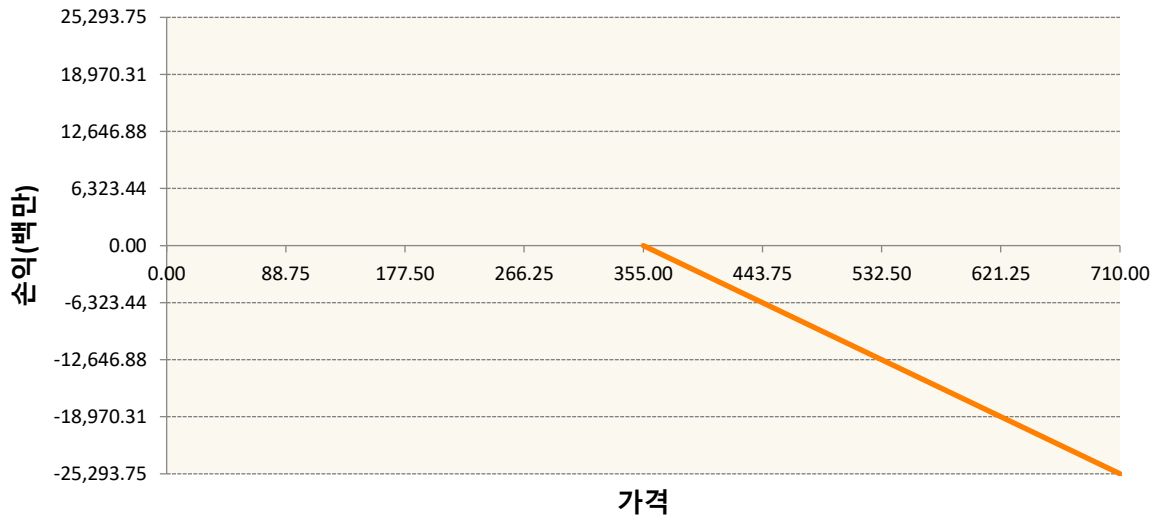
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

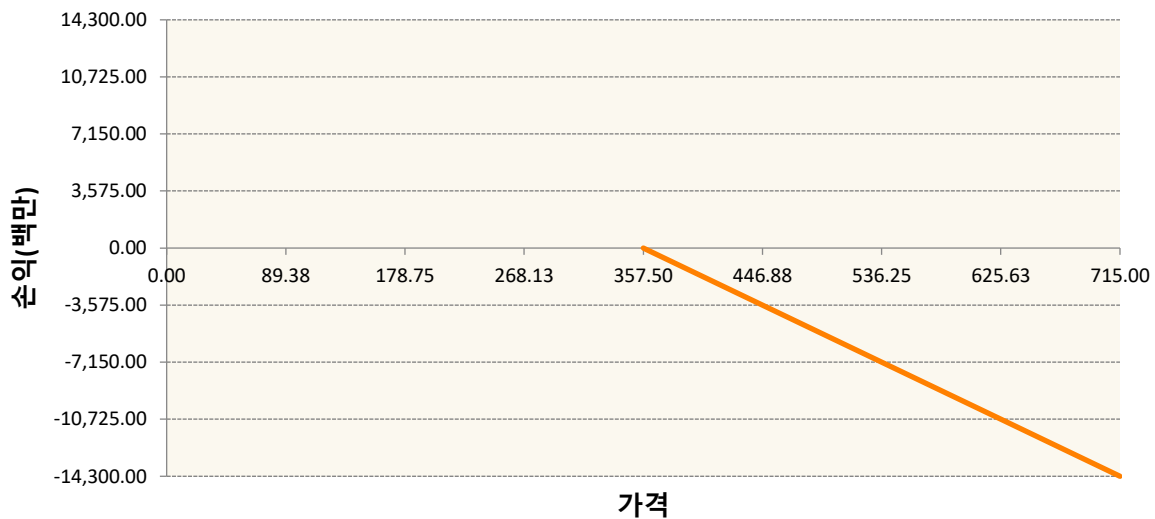
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 40,706 | -40,706   | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 39,594 | -39,594   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201S43556-2022-04 콜355



KR4201S43572-2022-04 콜357.5



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |         |                |        |        |        |        |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
| KR4201S43556 |           |         | 2022-04 콜355   |        |        |        | 1,613  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 999       | 941     | 880            | 815    | 747    | 677    | 605    |
| -5.33%       | 839       | 765     | 689            | 610    | 531    | 451    | 370    |
| -2.67%       | 598       | 513     | 426            | 340    | 253    | 166    | 79     |
| 0%           | 267       | 178     | 89             | 0      | -89    | -178   | -267   |
| 2.67%        | -154      | -237    | -321           | -407   | -493   | -580   | -667   |
| 5.33%        | -653      | -724    | -798           | -875   | -955   | -1,035 | -1,117 |
| 8.00%        | -1,215    | -1,271  | -1,332         | -1,397 | -1,466 | -1,538 | -1,613 |
| KR4201S43572 |           |         | 2022-04 콜357.5 |        |        |        | 884    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 526       | 496     | 464            | 429    | 393    | 355    | 316    |
| -5.33%       | 447       | 407     | 366            | 323    | 280    | 235    | 191    |
| -2.67%       | 324       | 276     | 229            | 181    | 132    | 84     | 35     |
| 0%           | 151       | 101     | 50             | 0      | -50    | -101   | -151   |
| 2.67%        | -72       | -121    | -169           | -219   | -268   | -318   | -368   |
| 5.33%        | -341      | -384    | -428           | -473   | -519   | -565   | -613   |
| 8.00%        | -648      | -682    | -719           | -758   | -799   | -841   | -884   |

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

(단위:백만원)

2,195



공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

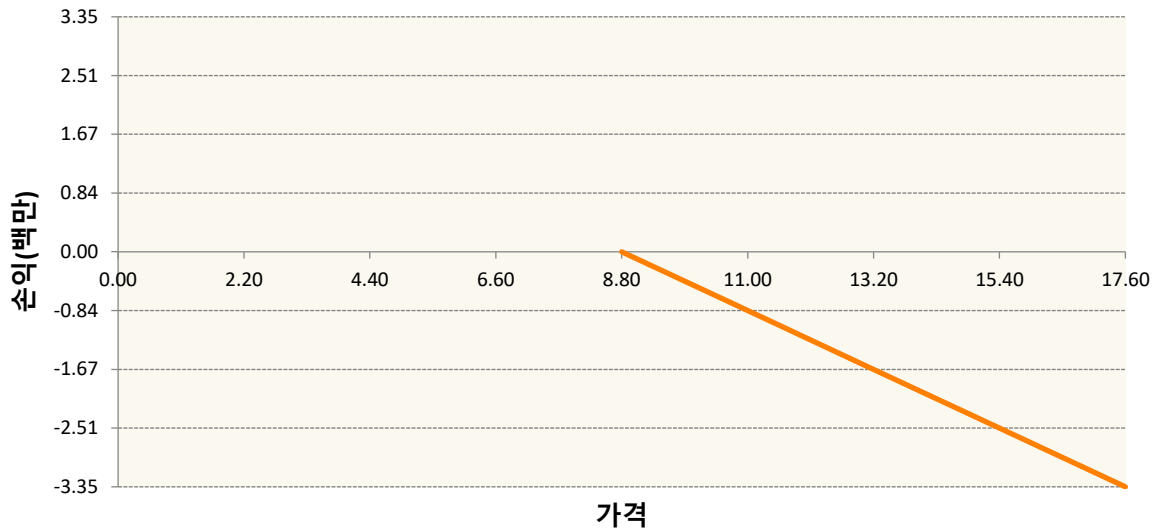
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

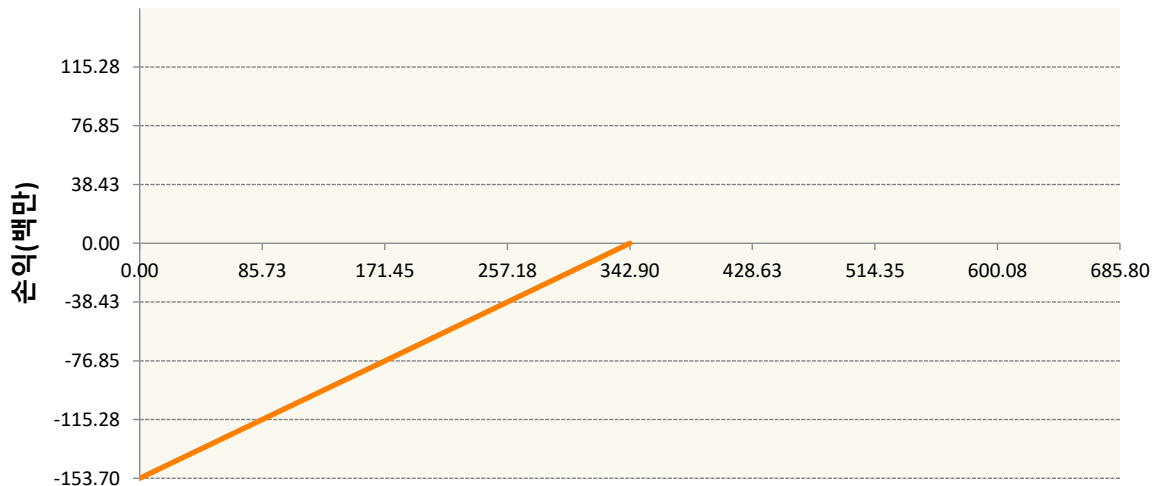
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 157   | -157      | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 679   | 2,717 | -2,037    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

OESXH2-C4075-EURO STOXX 50



OESXH2-P4075-EURO STOXX 50



## 가격

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                |  | (단위:백만원) |
|------------------------------------------|--|----------|
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY |  | 43       |
| FXW213BCF4 KRW/EUR 17-03-22E             |  | 54       |
| FXW213C2F4 KRW/EUR 27-05-22E             |  | 22       |
| FXW213C2F4 KRW/EUR 22-04-22E             |  | 33       |
| FXW213C324 EUR/KRW 17-03-22E             |  | 22       |
| FXW213C374 EUR/KRW 17-03-22E             |  | 33       |
| FXW213C384 KRW/EUR 27-05-22E             |  | 65       |
| FXW213C3A4 KRW/EUR 22-04-22E             |  | 43       |
| OESXH2-C40 EURO STOXX 50                 |  | 0.27     |
| OESXH2-P40 EURO STOXX 50                 |  | 12       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 211      |





공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

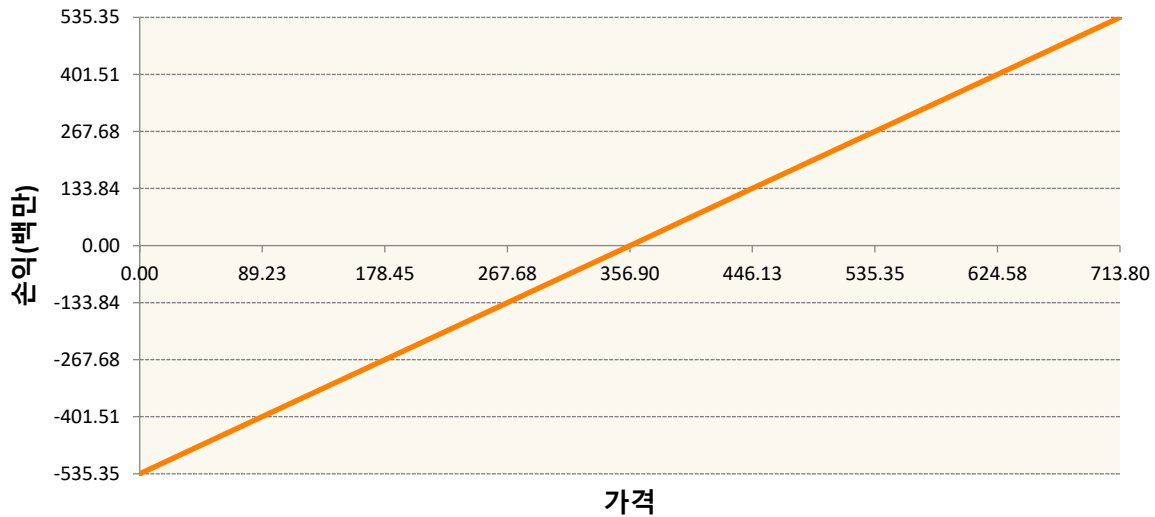
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

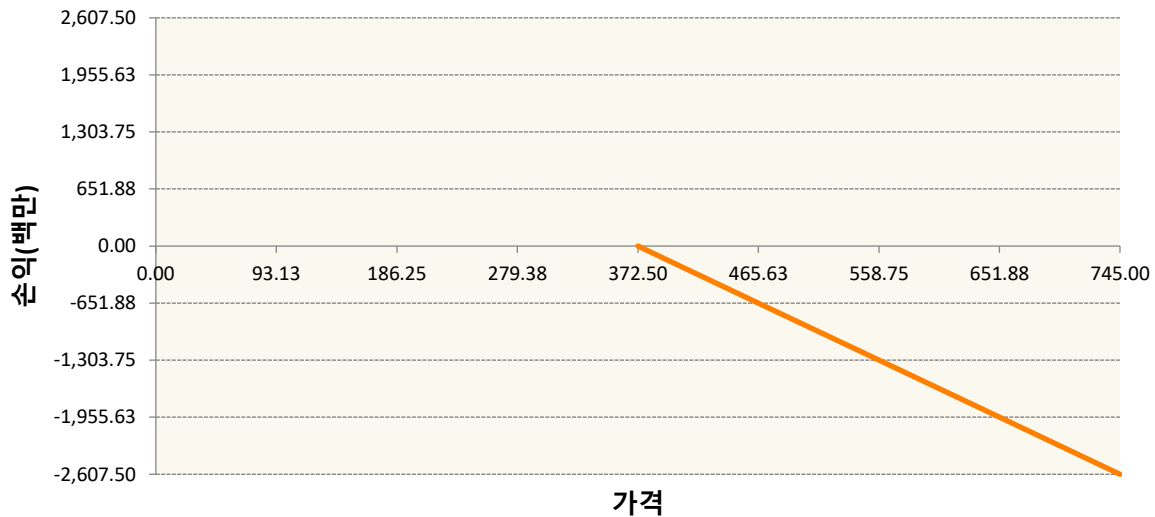
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 535   | 0     | 535       | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 345   | 4,703 | -4,358    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 535   | 0     | 535       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 355   | 4,670 | -4,315    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S43721-2022-04 콜372.5



The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 750.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from -2,062.50 to 2,062.50. A blue line represents the profit function, starting at a price of 375.00 with zero profit and decreasing linearly to a price of 750.00 with a profit of -2,062.50.

| 가격 (Price) | 이익 (Profit in millions) |
|------------|-------------------------|
| 375.00     | 0.00                    |
| 750.00     | -2,062.50               |

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 710.00. The y-axis, labeled '이익 (백만)' (Profit in millions), ranges from -355.00 to 355.00. A blue line starts at (0, 355) and ends at (355, 0), indicating that profit is maximized at a price of 0 and reaches zero at a price of 355.

| 가격 (Price) | 이익 (Profit in millions) |
|------------|-------------------------|
| 0.00       | 355.00                  |
| 355.00     | 0.00                    |

(단위:백만원)

|              |           |         |        |                    |       |        |        |     |
|--------------|-----------|---------|--------|--------------------|-------|--------|--------|-----|
| KR4101S60008 |           |         |        | 2022-06 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%       | -29       | -29     | -29    | -29                | -29   | -29    | -29    |     |
| -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%        | 29        | 29      | 29     | 29                 | 29    | 29     | 29     |     |
| 8.00%        | 43        | 43      | 43     | 43                 | 43    | 43     | 43     |     |
| KR4201S43721 |           |         |        | 2022-04 콜372.5     |       |        |        | 130 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |

| 가격                             | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%                         | 59      | 56      | 53     | 49   | 44    | 39     | 34     |
| -5.33%                         | 53      | 49      | 43     | 38   | 32    | 25     | 19     |
| -2.67%                         | 42      | 36      | 29     | 22   | 14    | 7      | -1     |
| 0%                             | 25      | 16      | 8      | 0    | -8    | -17    | -25    |
| 2.67%                          | -1      | -10     | -19    | -28  | -37   | -46    | -55    |
| 5.33%                          | -35     | -44     | -53    | -63  | -72   | -81    | -90    |
| 8.00%                          | -77     | -86     | -95    | -103 | -112  | -121   | -130   |
| KR4201S43754      2022-04 콜375 |         |         |        |      |       |        | 99     |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 43      | 41      | 38     | 35  | 32    | 28     | 24     |
| -5.33%    | 39      | 35      | 32     | 27  | 23    | 18     | 13     |
| -2.67%    | 31      | 26      | 21     | 16  | 10    | 5      | -1     |
| 0%        | 19      | 13      | 6      | 0   | -6    | -13    | -20    |
| 2.67%     | 0       | -7      | -14    | -21 | -28   | -35    | -42    |
| 5.33%     | -25     | -32     | -39    | -47 | -54   | -61    | -68    |
| 8.00%     | -56     | -63     | -70    | -77 | -84   | -92    | -99    |

| KR4301S43554      2022-04 풋355 |         |         |        |    |       |        | 20     |
|--------------------------------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                      |         |         |        |    |       |        |        |
| 가격                             | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                         | 17      | 17      | 18     | 18 | 19    | 19     | 20     |
| -5.33%                         | 9       | 9       | 10     | 11 | 12    | 13     | 13     |
| -2.67%                         | 2       | 3       | 4      | 5  | 6     | 7      | 8      |
| 0%                             | -3      | -2      | -1     | 0  | 1     | 2      | 3      |
| 2.67%                          | -6      | -5      | -5     | -4 | -3    | -2     | -1     |
| 5.33%                          | -8      | -8      | -7     | -6 | -5    | -5     | -4     |
| 8.00%                          | -9      | -9      | -8     | -8 | -7    | -7     | -6     |

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

(단위:백만원)

232





|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-11 |
| 기준일 | 2022-03-10 |

## 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 | 9,522 | 0     | 9,522     |    |

### 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 | 2022-03-11 |
| 기준일 | 2022-03-10 |

## 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 | 7,853 | 0     | 7,853     |    |

### 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 | 2022-03-11 |
| 기준일 | 2022-03-10 |

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0      | 302    | -302      |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 26,578 | 0      | 26,578    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 2,702  | 30,376 | -27,674   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E  | 197   |
| FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E | 69    |
| FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E  | 2,234 |
| FXW213C32 USD/KRW 25-03-22E  | 59    |
| FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E  | 39    |
| FXW213C37 USD/KRW 25-03-22E  | 49    |

IE00BD8RGM75

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

841

공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

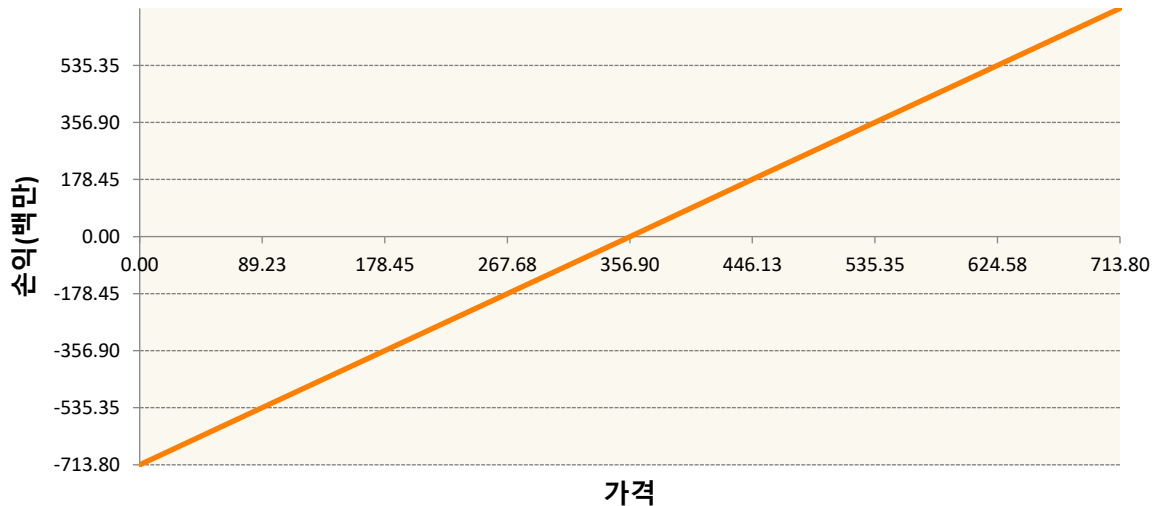
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 711   | 0     | 711       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 714   | 0     | 714       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           | 2022-06 코스피200지수선물 |        |     |       |        | 57     |
|--------------|-----------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -57       | -57                | -57    | -57 | -57   | -57    | -57    |
| -5.33%       | -38       | -38                | -38    | -38 | -38   | -38    | -38    |
| -2.67%       | -19       | -19                | -19    | -19 | -19   | -19    | -19    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 19        | 19                 | 19     | 19  | 19    | 19     | 19     |
| 5.33%        | 38        | 38                 | 38     | 38  | 38    | 38     | 38     |
| 8.00%        | 57        | 57                 | 57     | 57  | 57    | 57     | 57     |





공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

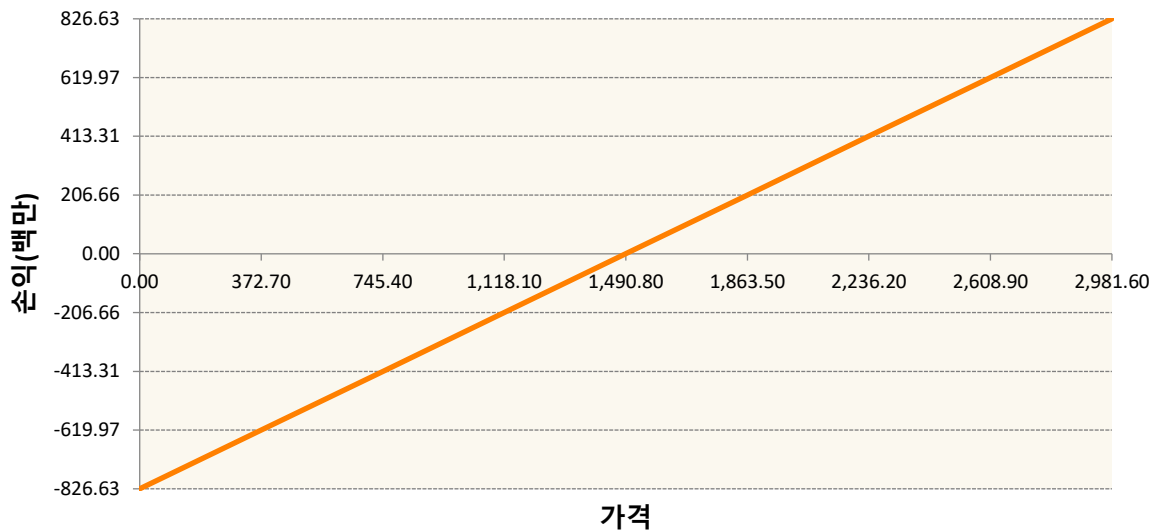
### 1. 계약금액

(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   | 827   | 0     | 827       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,857 | 0     | 1,857     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,331 | -1,331    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCH2-VN30 Index Future Mar22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 149 |
| FXW213BCN KRW/EUR 18-03-22E   | 43  |
| FXW213C1K KRW/EUR 22-04-22E   | 16  |
| FXW213C2P KRW/EUR 20-05-22E   | 47  |
| VNCH2 VN30 Index Future Mar22 | 66  |

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

(단위:백만원)

277



공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

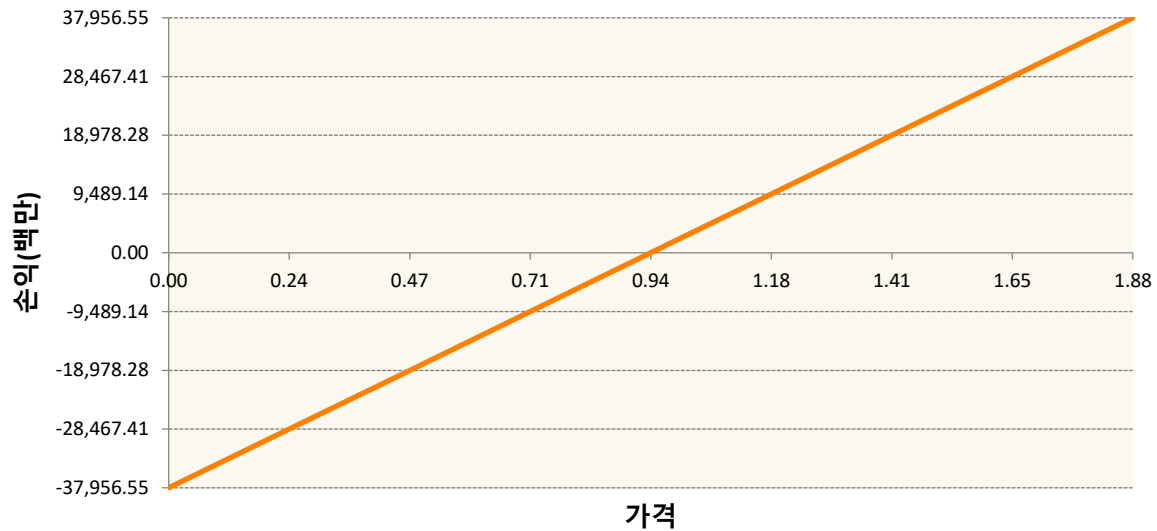
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

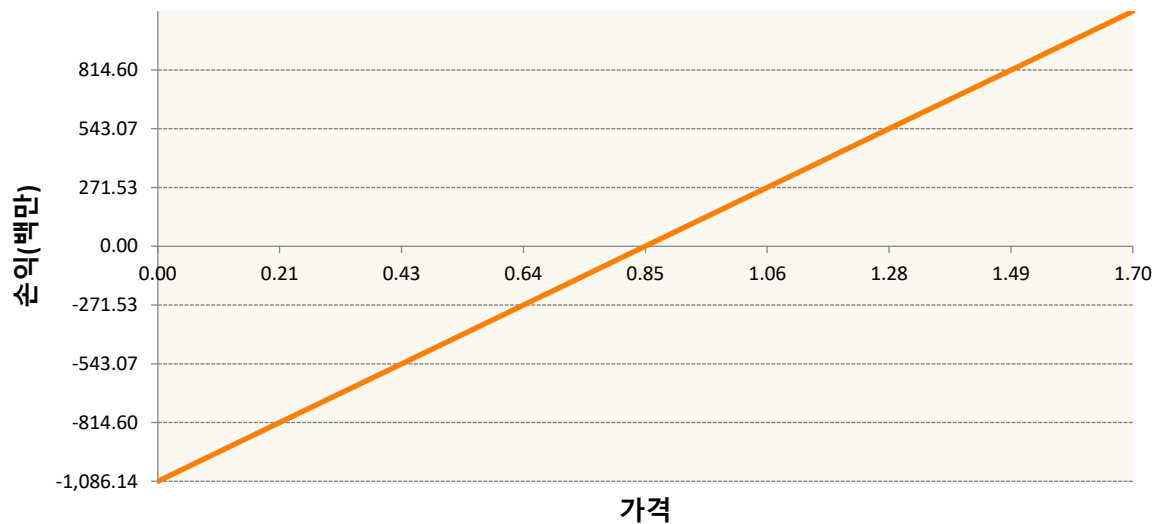
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 41,205 | 0     | 41,205    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

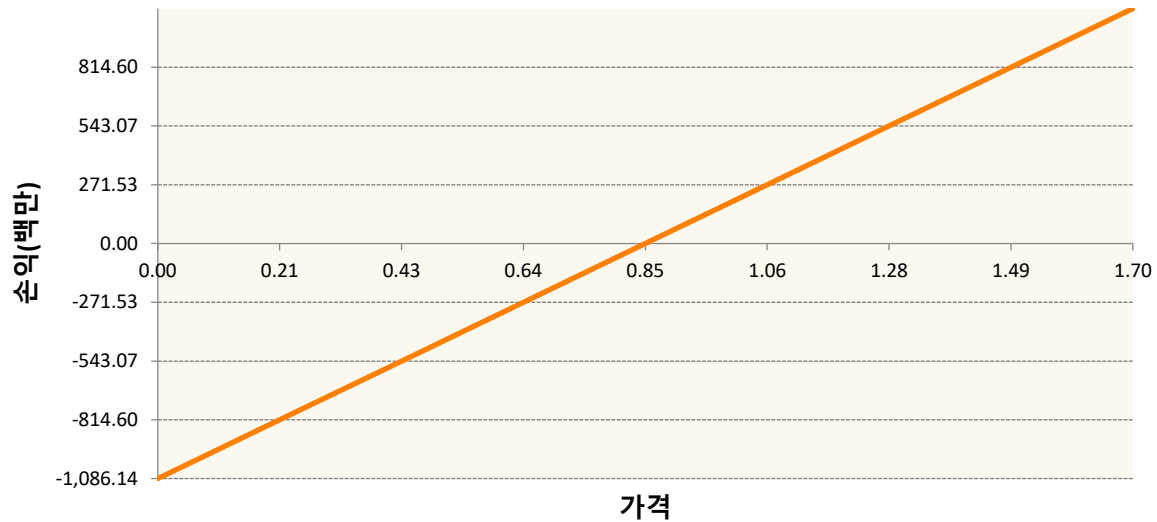
210884211224-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



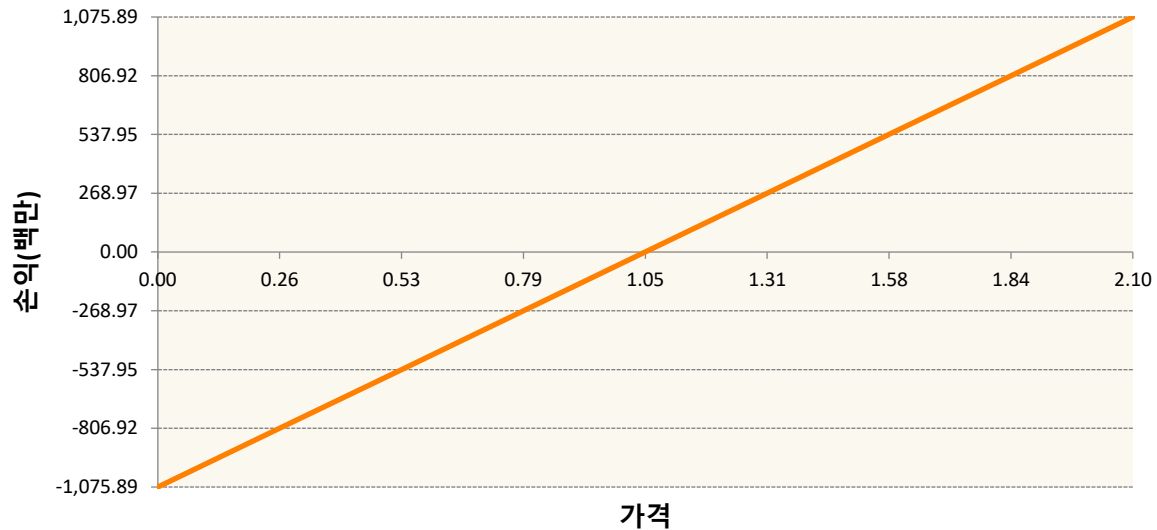
210884220216-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220217-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220307-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                               |       |
|-----------------------------------------------|-------|
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) | 3,024 |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) | 86    |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) | 86    |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) | 86    |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 5,933 |
|-------|





공시일 2022-03-11  
기준일 2022-03-10

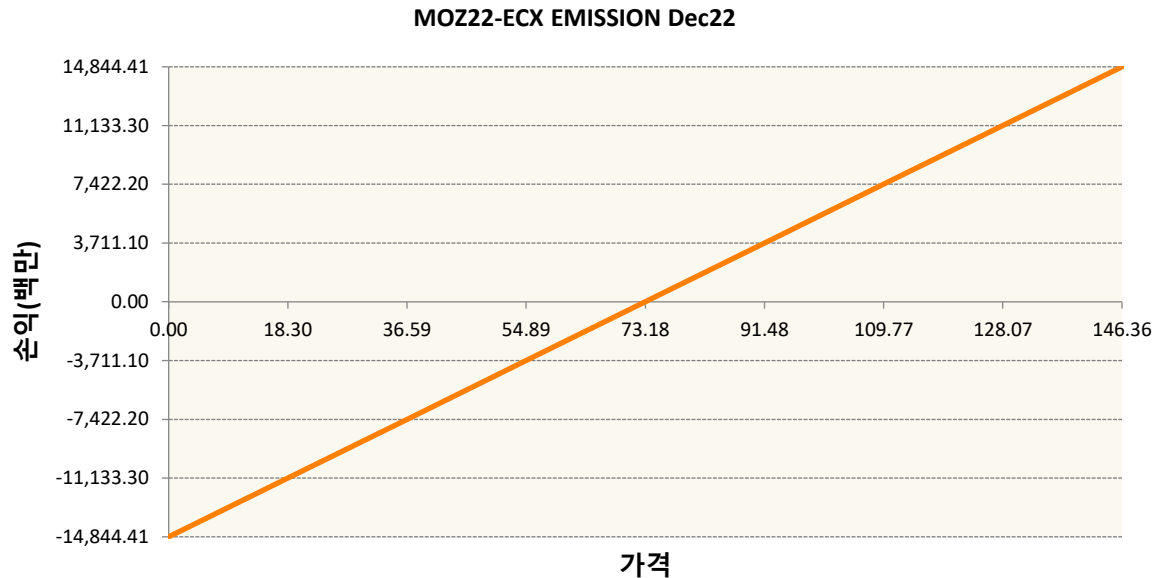
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 14,844 | 0     | 14,844    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 8,309 | -8,309    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C2R KRW/EUR 28-03-22E

665

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,188

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

(단위:백만원)

3,184



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-11 |
| 기준일 | 2022-03-10 |

# 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)  | 13 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)  | 13 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)  | 13 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠) | 13 |

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

(단위:백만원)

101

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-11 |
| 기준일 | 2022-03-10 |

# 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)  | 20 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 23 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(메리츠) | 20 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 20 |

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

(단위:백만원)

102

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-11 |
| 기준일 | 2022-03-10 |

## 에쿼티알파일반사모혼합자산

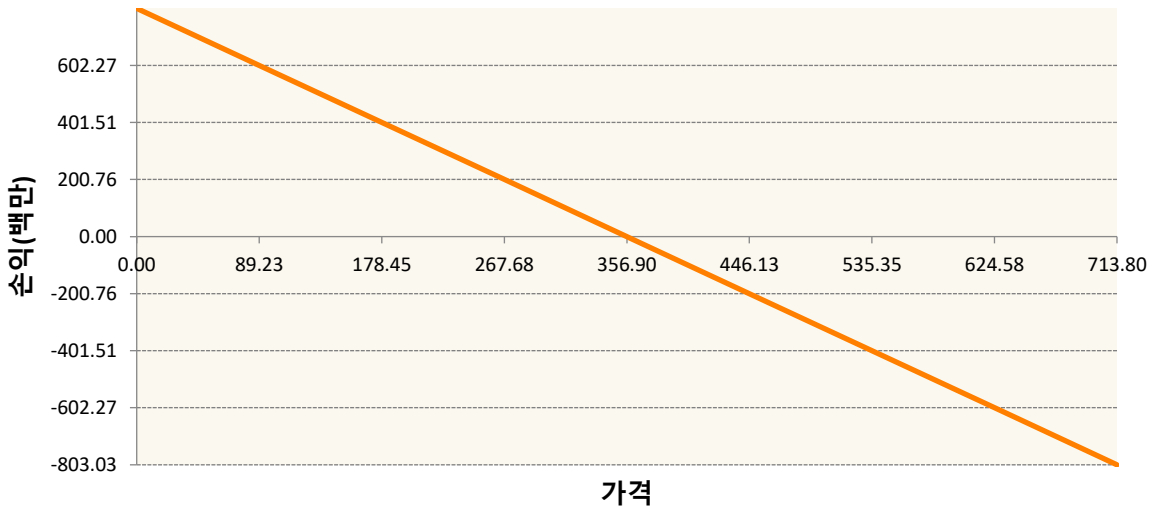
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 803   | -803      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 803   | -803      | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 64     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 64        | 64      | 64                 | 64  | 64    | 64     | 64     |
| -5.33%       | 43        | 43      | 43                 | 43  | 43    | 43     | 43     |
| -2.67%       | 21        | 21      | 21                 | 21  | 21    | 21     | 21     |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | -21       | -21     | -21                | -21 | -21   | -21    | -21    |
| 5.33%        | -43       | -43     | -43                | -43 | -43   | -43    | -43    |
| 8.00%        | -64       | -64     | -64                | -64 | -64   | -64    | -64    |





공시일 2022-03-11

기준일 2022-03-10

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

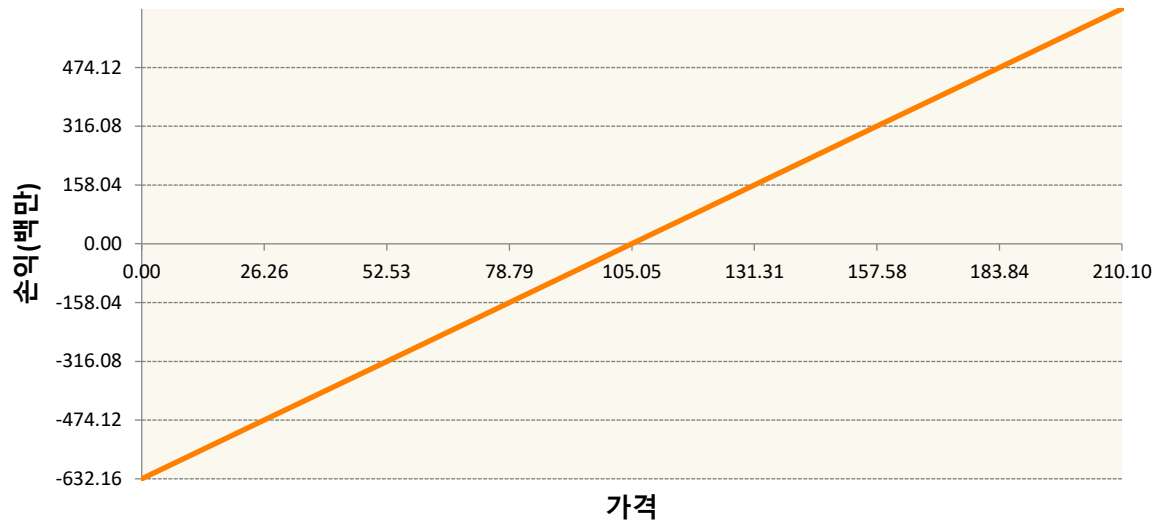
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

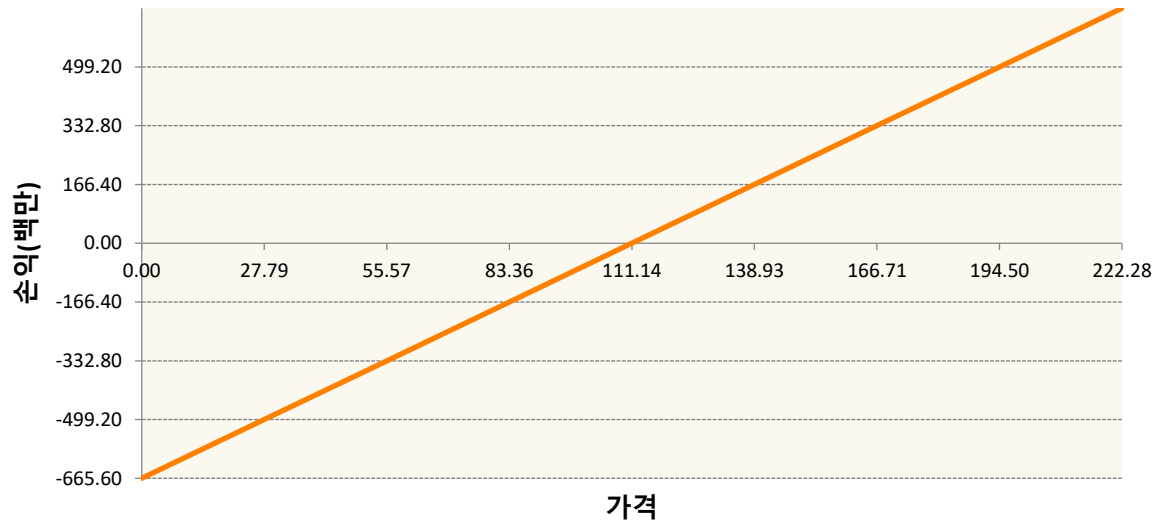
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,556 | 553   | 2,003     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

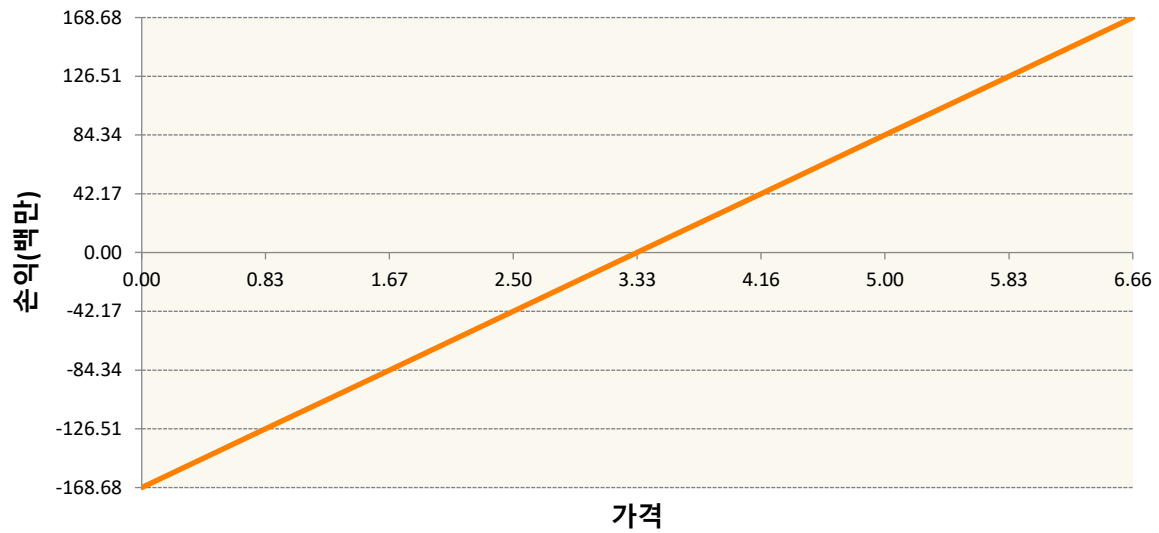
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



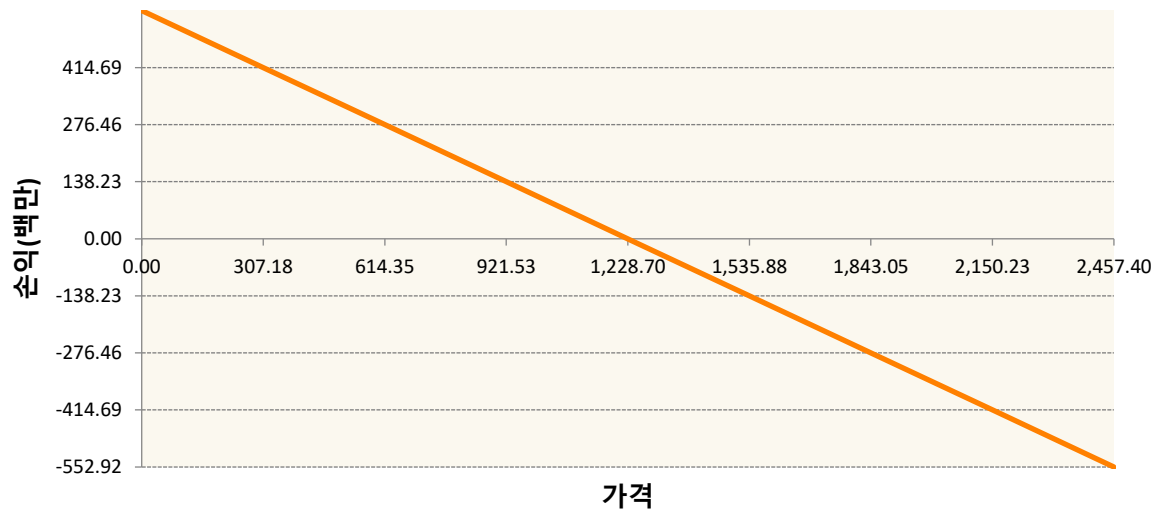
COK2-BRENT CRUDE FUTR May22



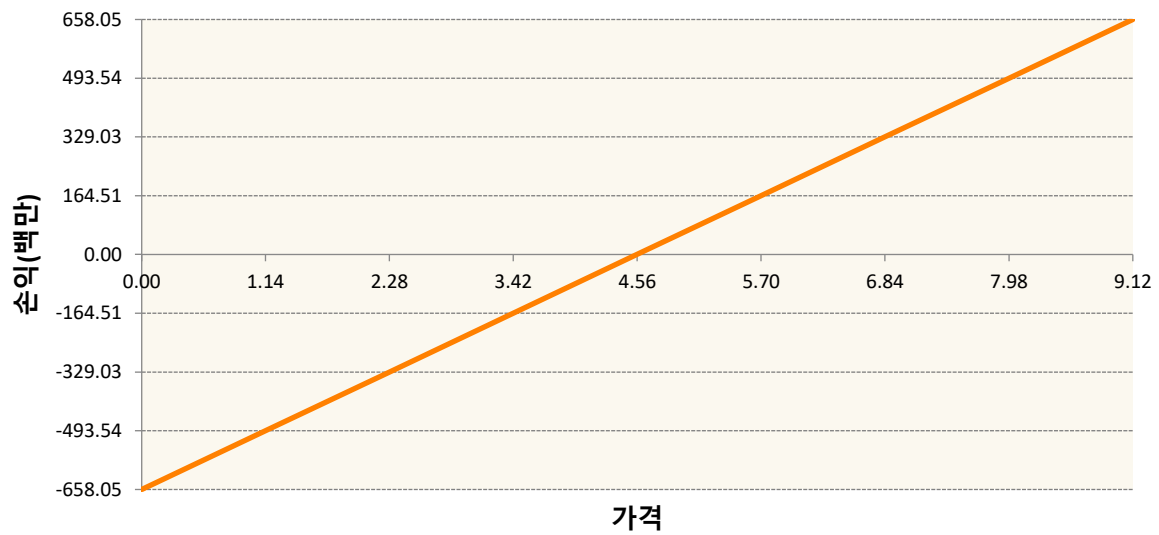
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

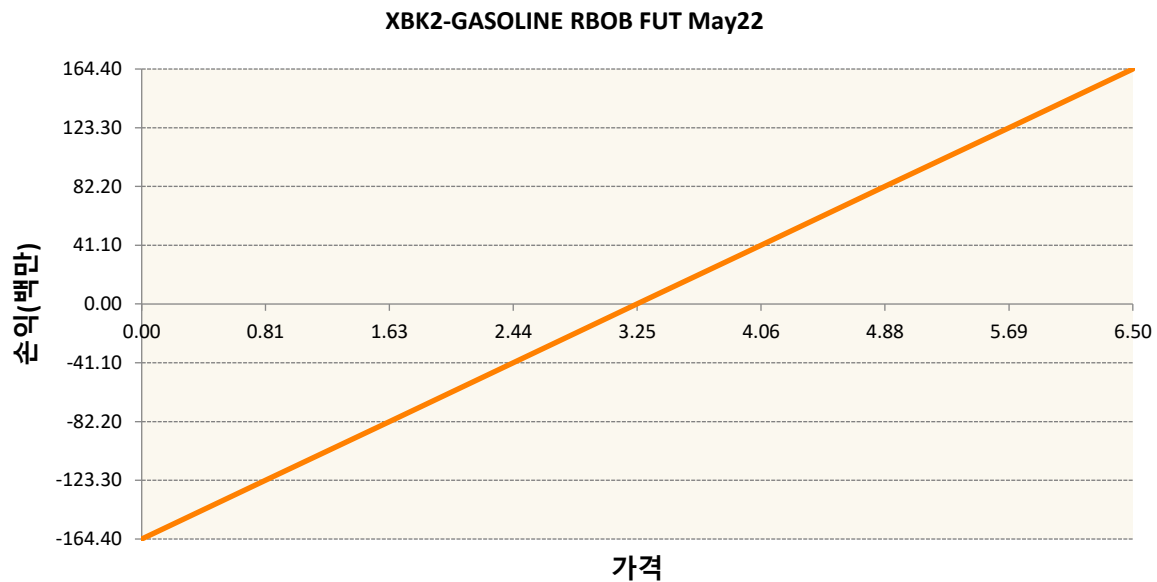
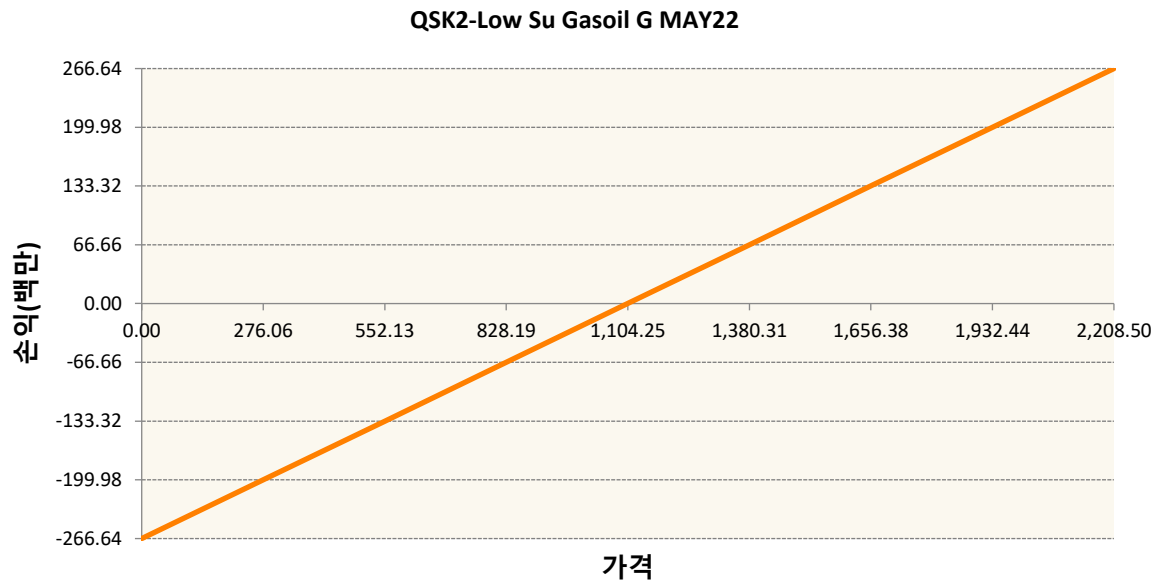


KR4175S30005-2022-03 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| CLK2                      | WTI CRUDE FUTURE May22  |  | 51       |
| COK2                      | BRENT CRUDE FUTR May22  |  | 53       |
| HOK2                      | NY Harb ULSD Fut May22  |  | 13       |
| KR4175S300                | 2022-03 달러선물            |  | 44       |
| NGK22                     | NATURAL GAS FUTR May22  |  | 53       |
| QSK2                      | Low Su Gasoil G MAY22   |  | 21       |
| XBK2                      | GASOLINE RBOB FUT May22 |  | 13       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원)   |
|----------------------------------------|--|------------|
|                                        |  | <b>513</b> |





