

공시일 2022-03-18

기준일 2022-03-17

## 포커스농산물모(채권-파생형)

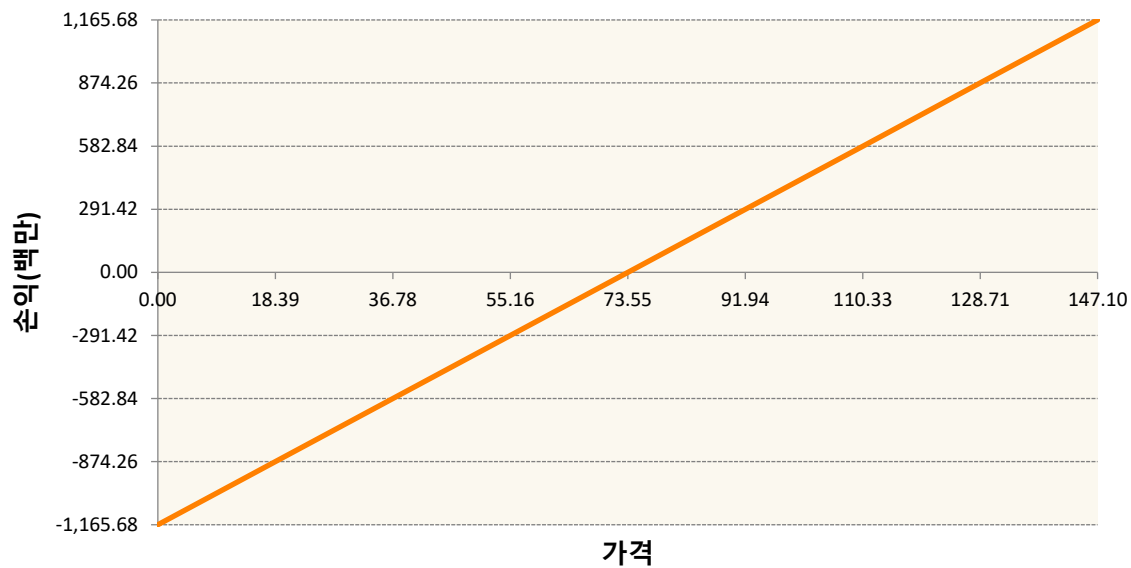
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

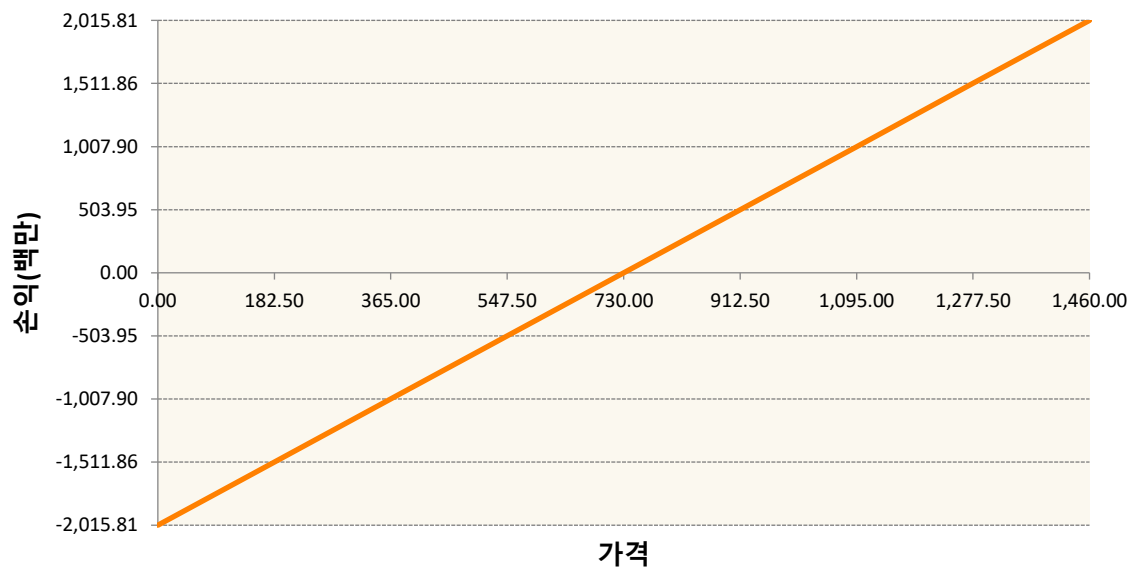
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 10,457 | 1,578 | 8,879     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

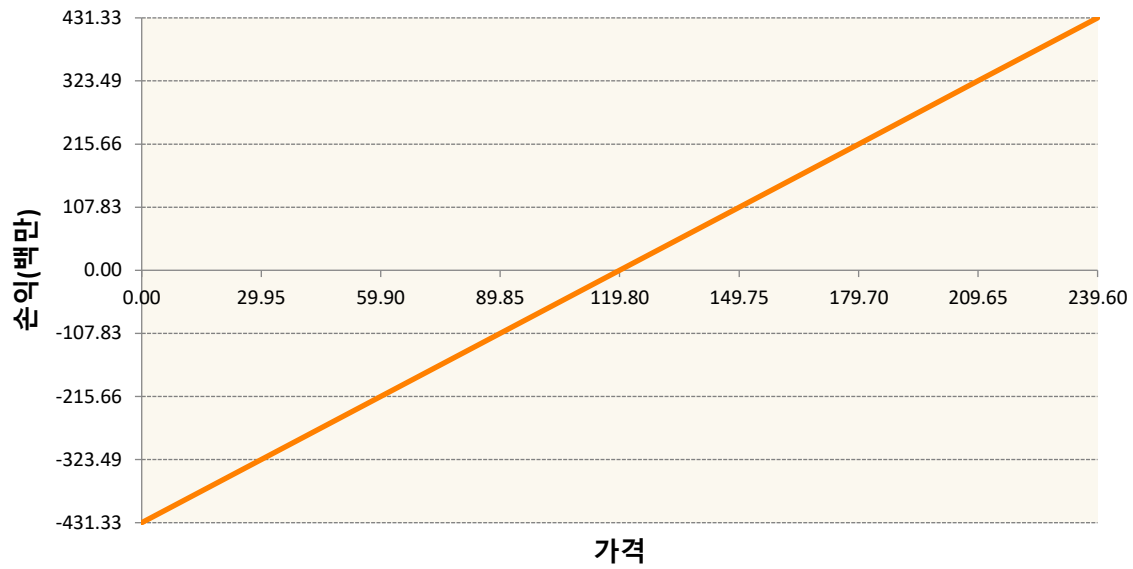
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



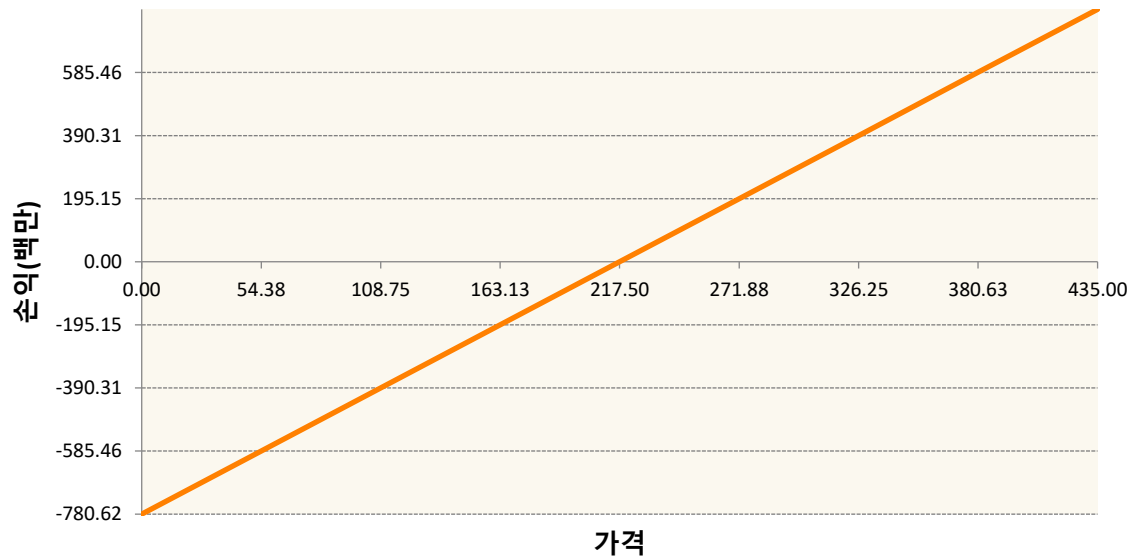
CK2-CORN FUTURE May22



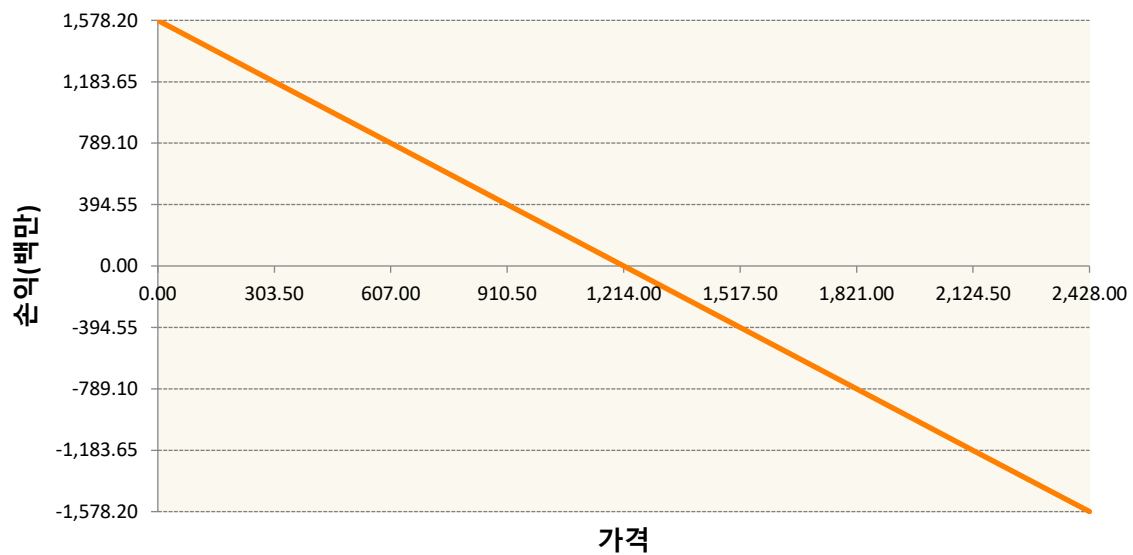
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



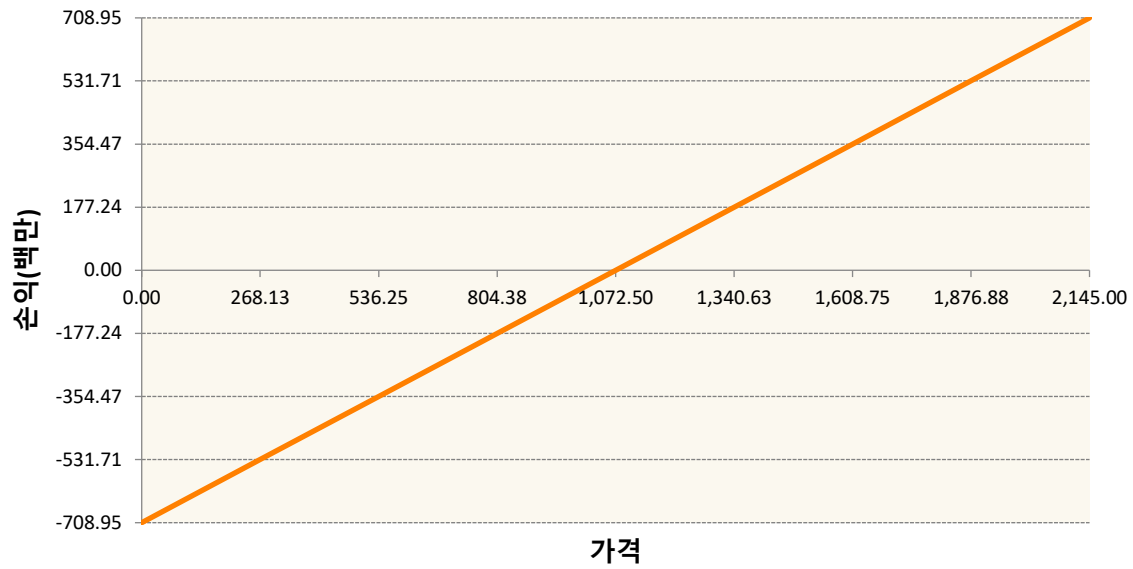
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



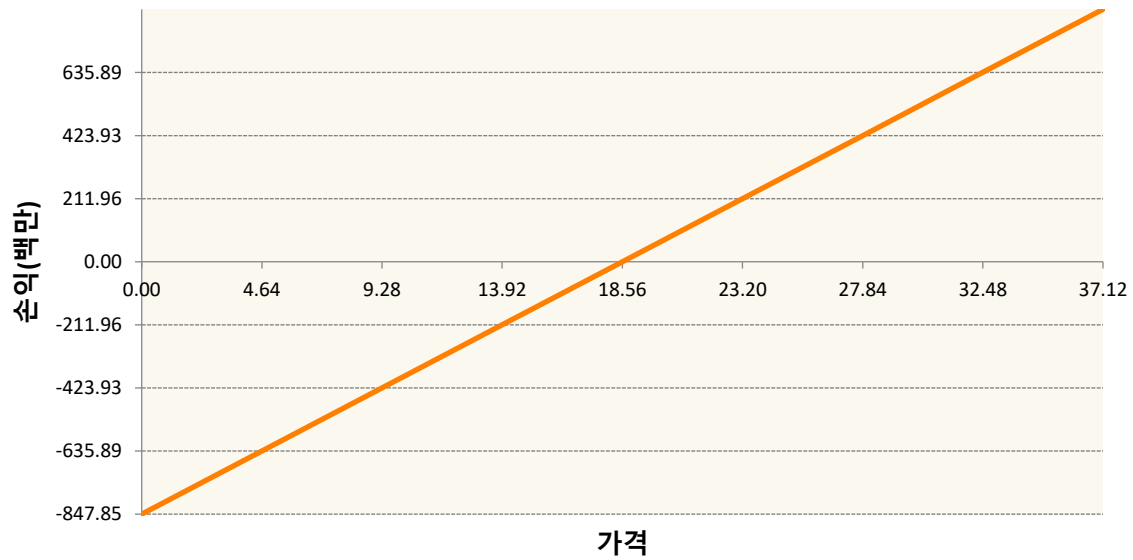
KR4175S40004-2022-04 달러선물



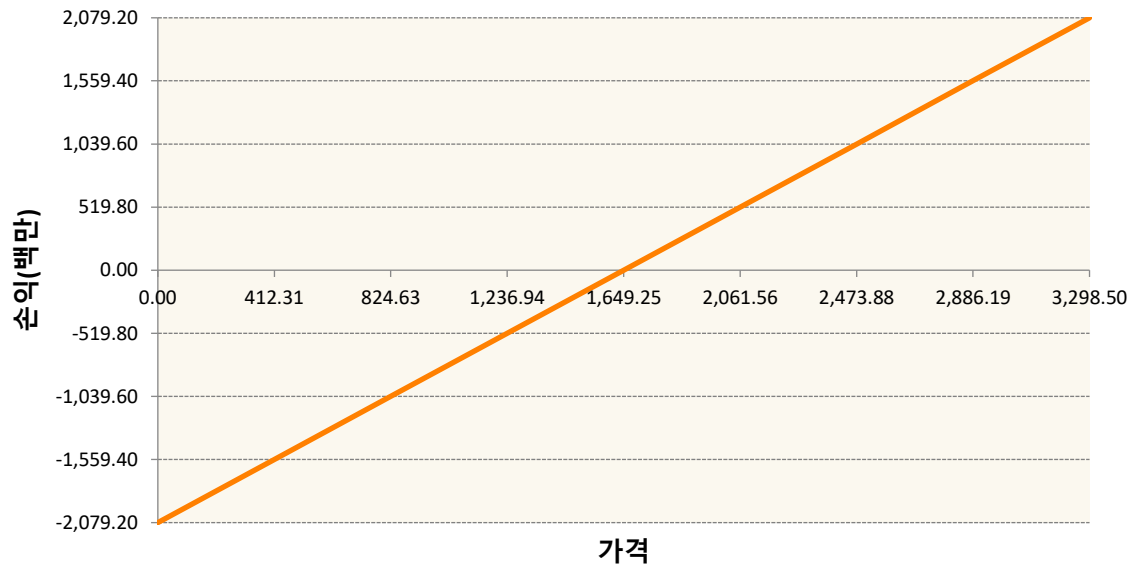
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22

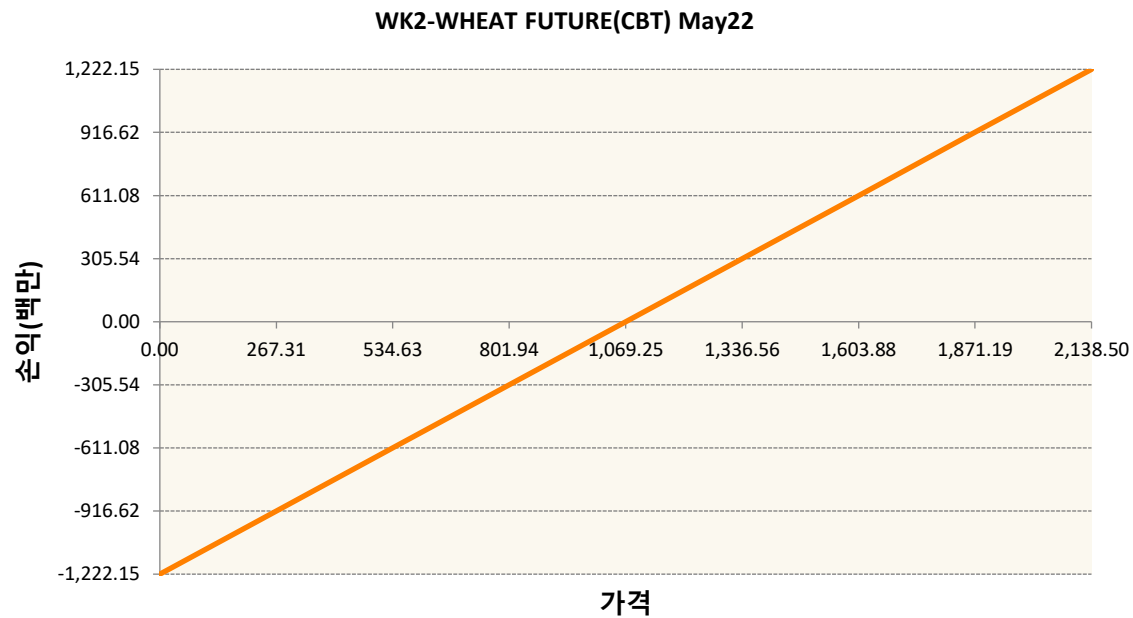
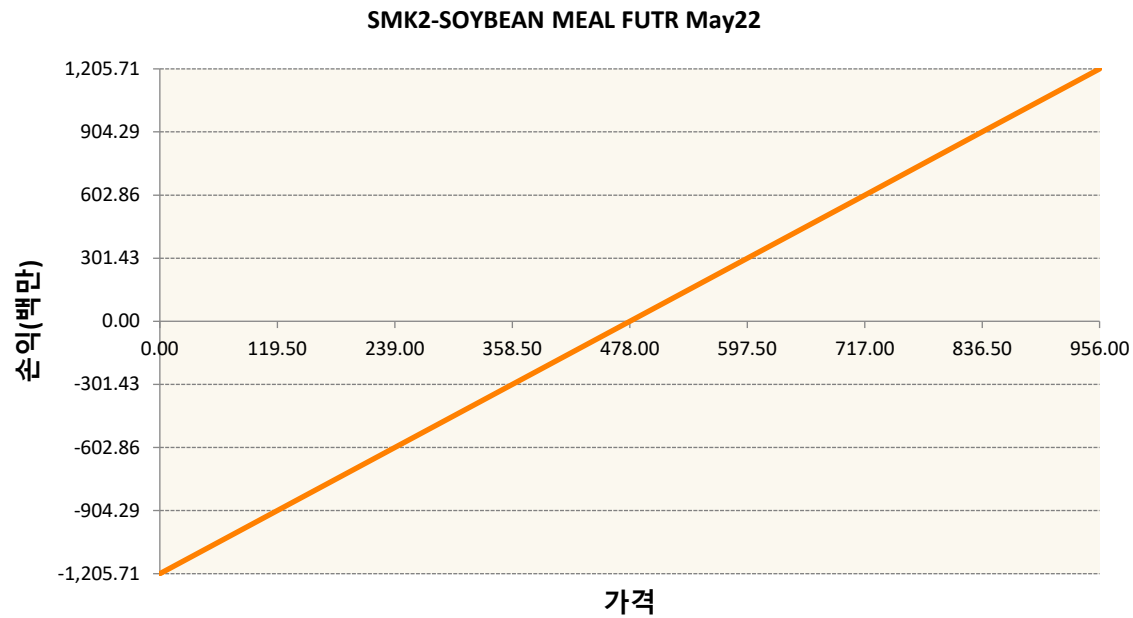


SBK2-Sugar May22



SK2-SOYBEAN FUTURE 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 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

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)

SWMXWO0C 신한MSCI선진국미래20220225

140

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

89

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

## 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

381

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

390

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

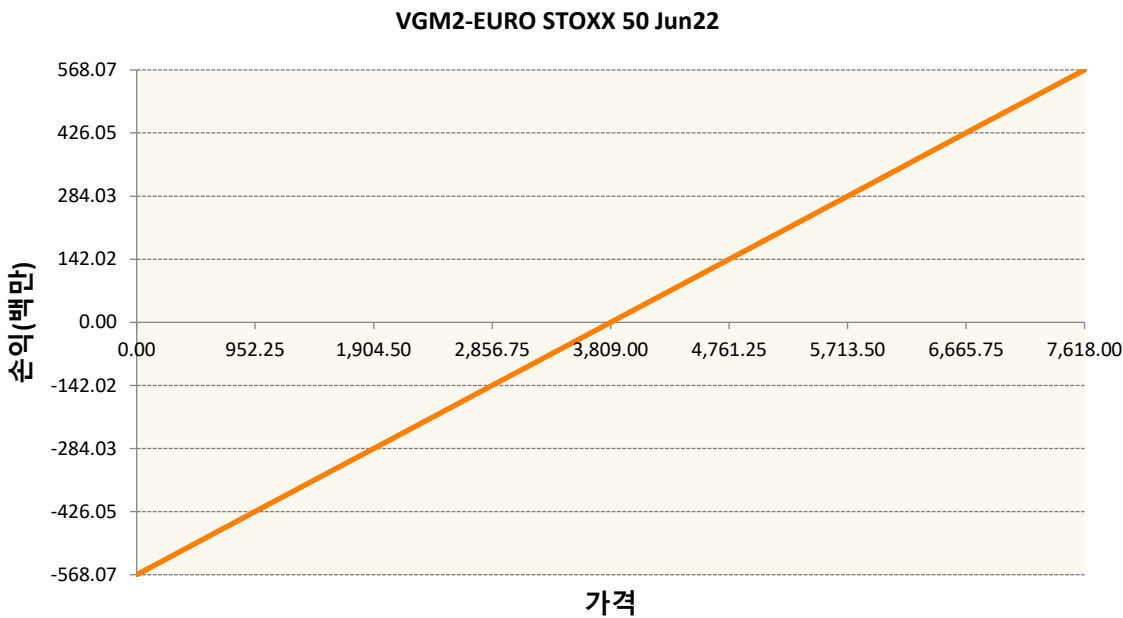
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 568   | 0     | 568       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGM2 | EURO STOXX 50 Jun22 | 45 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 45 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

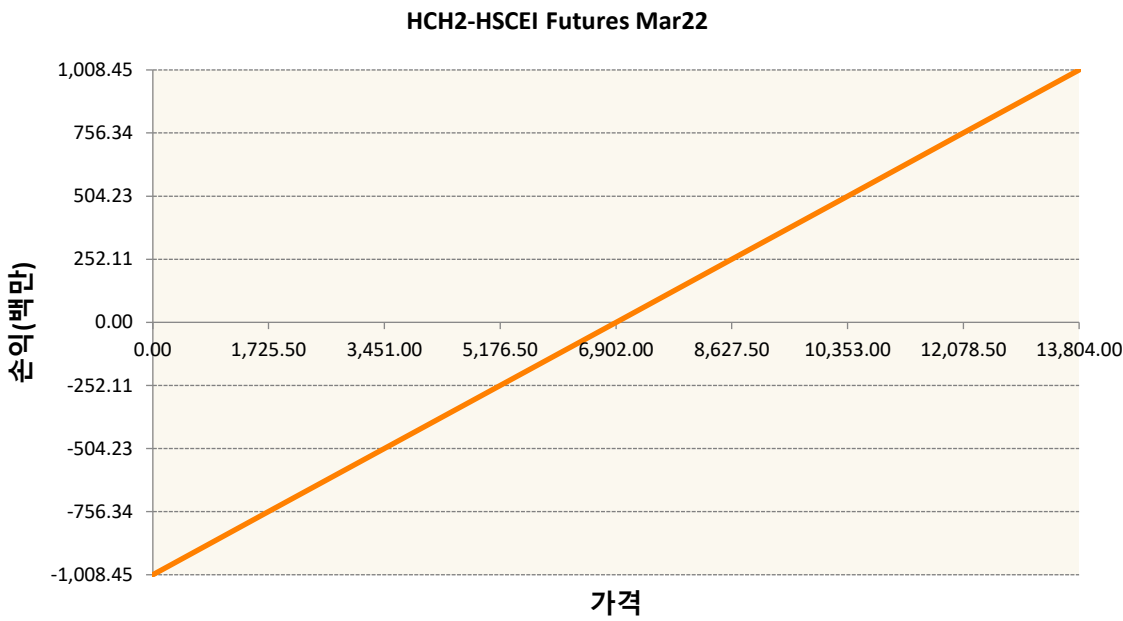
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,008 | 0     | 1,008     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCH2 | HSCEI Futures Mar22 | 81 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

104

공시일 2022-03-18

기준일 2022-03-17

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

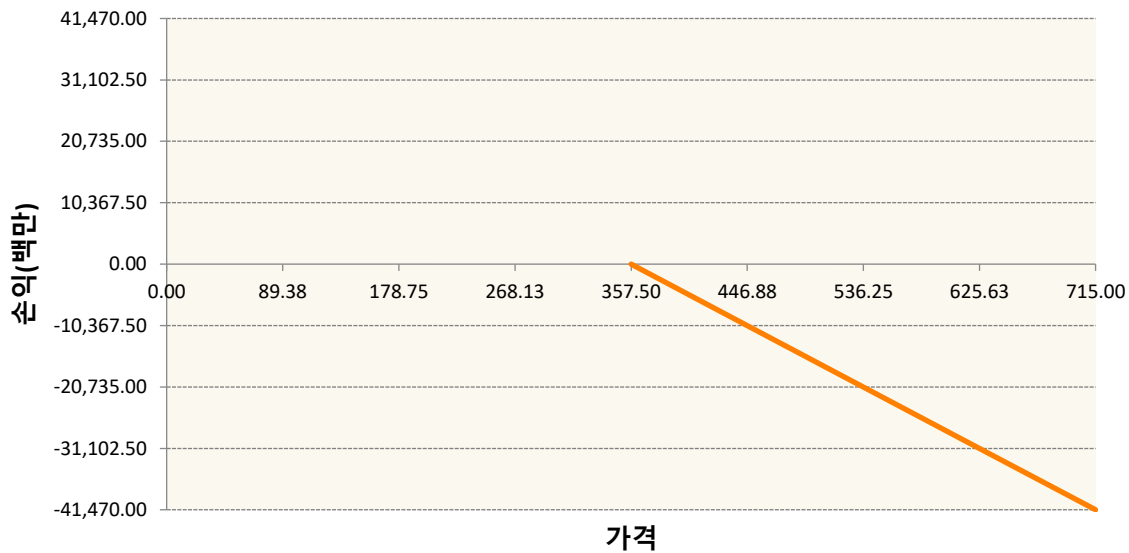
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

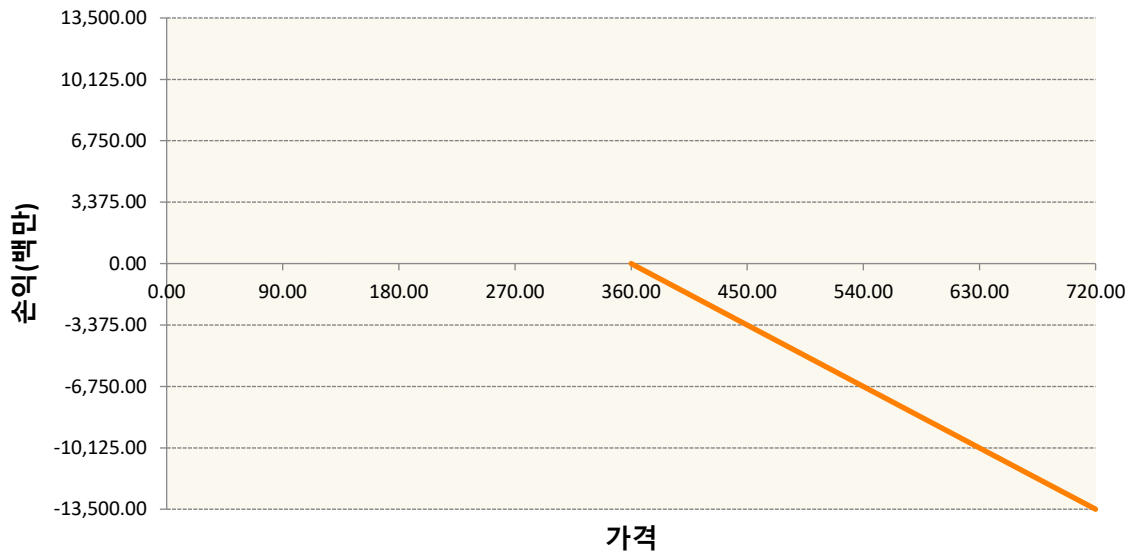
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 66,589 | -66,589   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

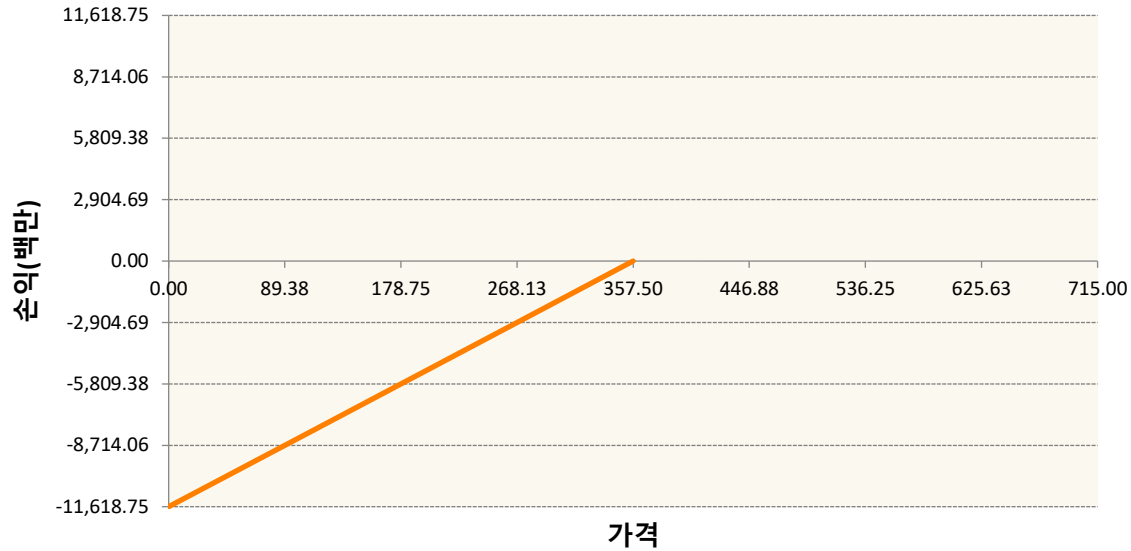
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201S43572 |           |         | 2022-04 콜357.5 |        |        |        | 2,672  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 1,525     | 1,455   | 1,379          | 1,296  | 1,209  | 1,118  | 1,024  |
| -5.33%       | 1,299     | 1,200   | 1,098          | 993    | 886    | 777    | 667    |
| -2.67%       | 921       | 802     | 683            | 564    | 444    | 324    | 203    |
| 0%           | 367       | 245     | 122            | 0      | -123   | -245   | -368   |
| 2.67%        | -359      | -468    | -580           | -694   | -810   | -927   | -1,044 |
| 5.33%        | -1,230    | -1,316  | -1,408         | -1,504 | -1,605 | -1,710 | -1,817 |
| 8.00%        | -2,206    | -2,266  | -2,334         | -2,410 | -2,493 | -2,580 | -2,672 |
| KR4201S43606 |           |         | 2022-04 콜360   |        |        |        | 841    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 456       | 436     | 413            | 388    | 362    | 334    | 304    |
| -5.33%       | 393       | 363     | 332            | 299    | 266    | 232    | 197    |
| -2.67%       | 284       | 247     | 209            | 171    | 133    | 94     | 56     |
| 0%           | 120       | 80      | 40             | 0      | -40    | -80    | -120   |
| 2.67%        | -101      | -138    | -175           | -214   | -252   | -291   | -330   |
| 5.33%        | -371      | -401    | -433           | -466   | -500   | -536   | -572   |
| 8.00%        | -678      | -700    | -724           | -751   | -780   | -810   | -841   |
| KR4301S43570 |           |         | 2022-04 풋357.5 |        |        |        | 665    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -597      | -605    | -614           | -625   | -637   | -650   | -665   |
| -5.33%       | -319      | -335    | -352           | -369   | -388   | -407   | -427   |
| -2.67%       | -90       | -113    | -135           | -158   | -181   | -204   | -227   |
| 0%           | 71        | 47      | 24             | 0      | -24    | -47    | -71    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 164 | 146 | 126 | 106 | 86  | 65  | 43  |
| 5.33% | 208 | 197 | 184 | 170 | 155 | 138 | 121 |
| 8.00% | 224 | 219 | 213 | 204 | 194 | 183 | 170 |

|                                        |          |
|----------------------------------------|----------|
| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|                                        | 3,875    |

공시일 2022-03-18

기준일 2022-03-17

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

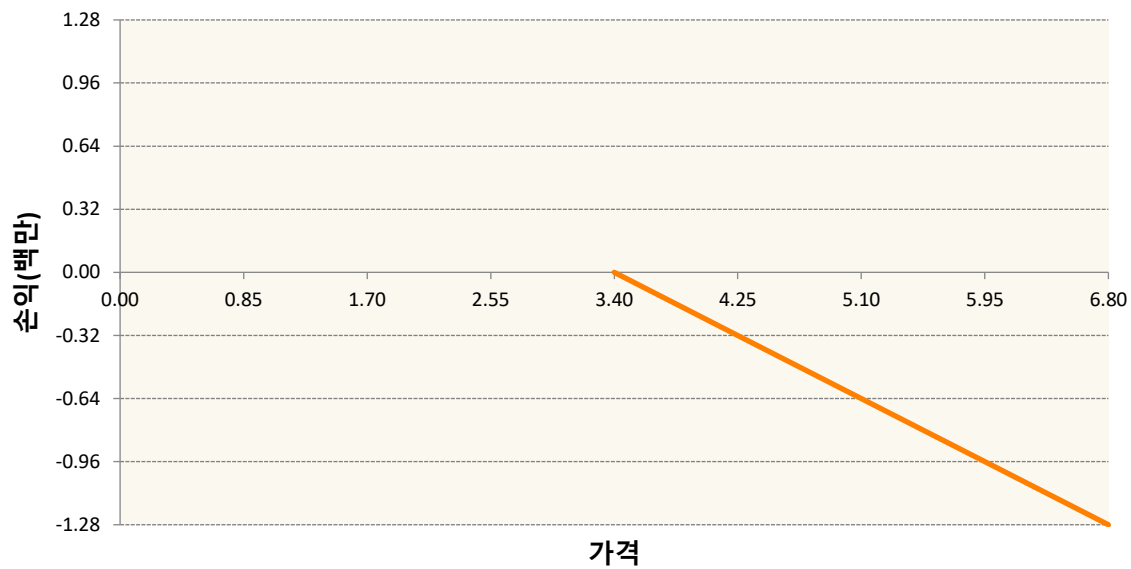
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

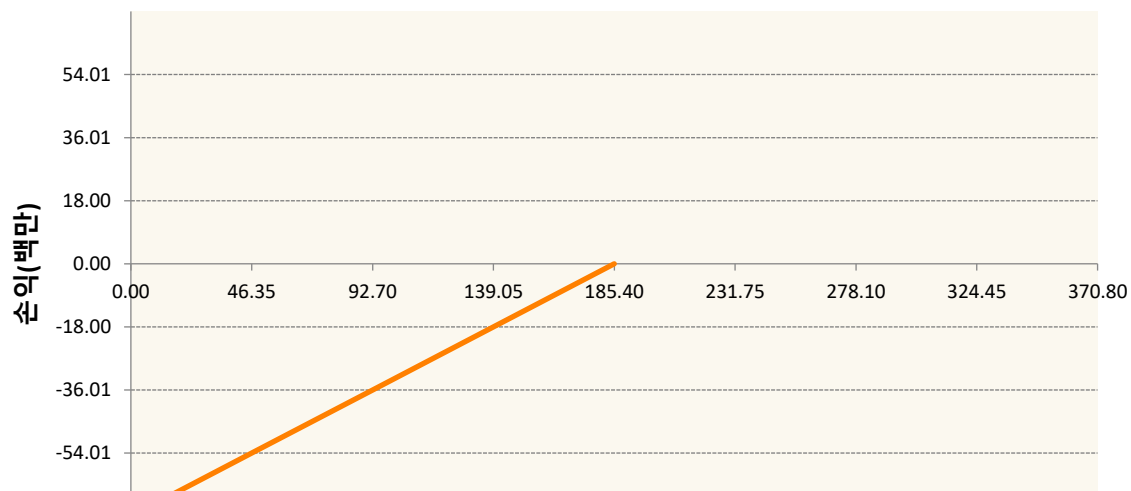
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 73    | -73       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,009 | -2,009    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

OESXH2-C4075-EURO STOXX 50



OESXH2-P4075-EURO STOXX 50



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                | (단위:백만원) |
|------------------------------------------|----------|
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | 71       |
| FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E              | 21       |
| FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E              | 32       |
| FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E              | 64       |
| FXW213C3A KRW/EUR 22-04-22E              | 43       |
| OESXH2-C4C EURO STOXX 50                 | 0.1      |
| OESXH2-P40 EURO STOXX 50                 | 6        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 208      |

공시일 2022-03-18

기준일 2022-03-17

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

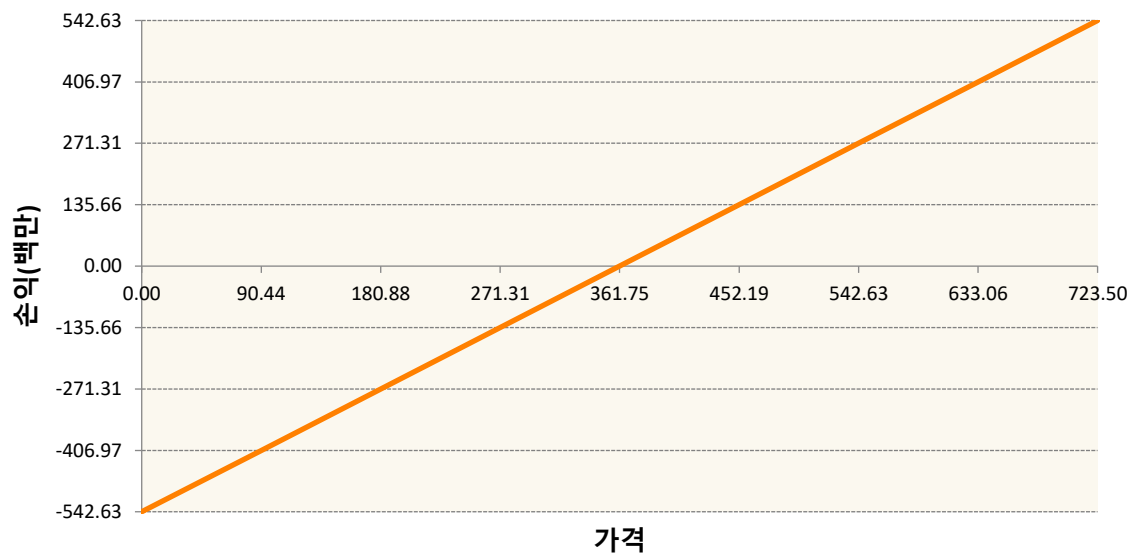
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

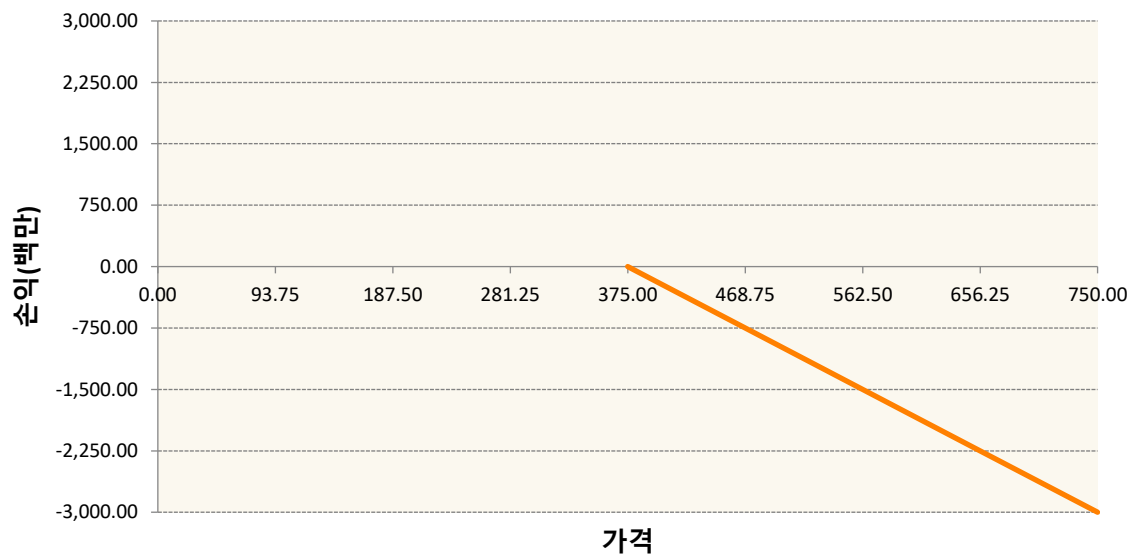
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 543   | 0     | 543       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 358   | 4,699 | -4,341    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S43754-2022-04 콜375



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 755.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -1,698.75 to 1,698.75. A blue line starts at the point (377.50, 0.00) and slopes downward to the point (755.00, -1,698.75).

| 가격 (Price) | 이익 (Profit in millions) |
|------------|-------------------------|
| 377.50     | 0.00                    |
| 755.00     | -1,698.75               |

The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가액' (Price), ranges from 0.00 to 715.00. The y-axis, labeled '순익 (백만)' (Net Income in millions), ranges from -357.50 to 357.50. A solid orange line represents the function, starting at (0.00, 357.50) and ending at (357.50, 0.00).

| 가액 (Price) | 순익 (백만) (Net Income) |
|------------|----------------------|
| 0.00       | 357.50               |
| 89.38      | 268.13               |
| 178.75     | 178.75               |
| 268.13     | 89.38                |
| 357.50     | 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     |     |
| KR4201S43754 |           |         |        | 2022-04 콜375       |       |        |        | 146 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |

| 가격                          | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|-----------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%                      | 56      | 54      | 52     | 49   | 45    | 41     | 37     |
| -5.33%                      | 52      | 48      | 44     | 39   | 34    | 28     | 22     |
| -2.67%                      | 41      | 36      | 30     | 23   | 16    | 9      | 2      |
| 0%                          | 23      | 16      | 8      | 0    | -8    | -16    | -24    |
| 2.67%                       | -5      | -14     | -23    | -32  | -40   | -49    | -58    |
| 5.33%                       | -46     | -55     | -63    | -72  | -81   | -90    | -99    |
| 8.00%                       | -97     | -105    | -113   | -121 | -130  | -138   | -146   |
| KR4201S43770 2022-04 콜377.5 |         |         |        |      |       |        | 79     |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 29      | 28      | 26     | 25  | 23    | 21     | 18     |
| -5.33%    | 26      | 25      | 22     | 20  | 17    | 14     | 11     |
| -2.67%    | 22      | 19      | 15     | 12  | 8     | 5      | 1      |
| 0%        | 13      | 9       | 4      | 0   | -4    | -9     | -13    |
| 2.67%     | -2      | -7      | -12    | -17 | -21   | -26    | -31    |
| 5.33%     | -23     | -28     | -33    | -38 | -43   | -48    | -53    |
| 8.00%     | -50     | -55     | -60    | -64 | -69   | -74    | -79    |

|                             |  |  |  |  |  |  |    |
|-----------------------------|--|--|--|--|--|--|----|
| KR4301S43570 2022-04 풋357.5 |  |  |  |  |  |  | 20 |
|-----------------------------|--|--|--|--|--|--|----|

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 18      | 19      | 19     | 19 | 20    | 20     | 20     |
| -5.33%    | 10      | 10      | 11     | 11 | 12    | 13     | 13     |
| -2.67%    | 3       | 3       | 4      | 5  | 6     | 6      | 7      |
| 0%        | -2      | -1      | -1     | 0  | 1     | 1      | 2      |
| 2.67%     | -5      | -4      | -4     | -3 | -3    | -2     | -1     |
| 5.33%     | -6      | -6      | -6     | -5 | -5    | -4     | -4     |
| 8.00%     | -7      | -7      | -7     | -6 | -6    | -6     | -5     |

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

(단위:백만원)

236

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

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 | 9,162 | 0     | 9,162     |    |

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 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

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 | 7,689 | 0     | 7,689     |    |

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 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0      | 274    | -274      |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 25,011 | 0      | 25,011    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 4,250  | 30,030 | -25,780   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| FXW213C1Q KRW/USD 25-03-22E  | 194   |
| FXW213C2J4 USD/KRW 25-03-22E | 68    |
| FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E  | 2,208 |
| FXW213C32 USD/KRW 25-03-22E  | 58    |
| FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E  | 39    |
| FXW213C37 USD/KRW 25-03-22E  | 49    |
| FXW213C3B USD/KRW 25-03-22E  | 78    |
| FXW213C3F USD/KRW 25-03-22E  | 49    |
| IE00BD8RGM75                 |       |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

863

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

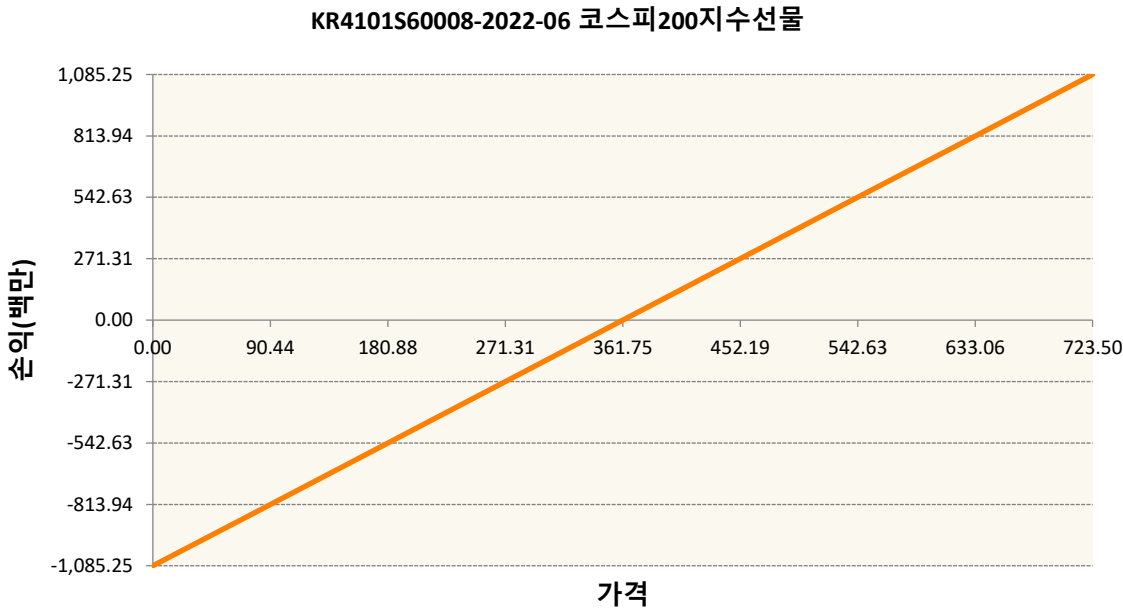
# 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

## 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   | 1,085 | 0     | 1,085     | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 87     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -87       | -87     | -87                | -87 | -87   | -87    | -87    |
| -5.33%       | -58       | -58     | -58                | -58 | -58   | -58    | -58    |
| -2.67%       | -29       | -29     | -29                | -29 | -29   | -29    | -29    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 29        | 29      | 29                 | 29  | 29    | 29     | 29     |
| 5.33%        | 58        | 58      | 58                 | 58  | 58    | 58     | 58     |
| 8.00%        | 87        | 87      | 87                 | 87  | 87    | 87     | 87     |



공시일 2022-03-18

기준일 2022-03-17

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

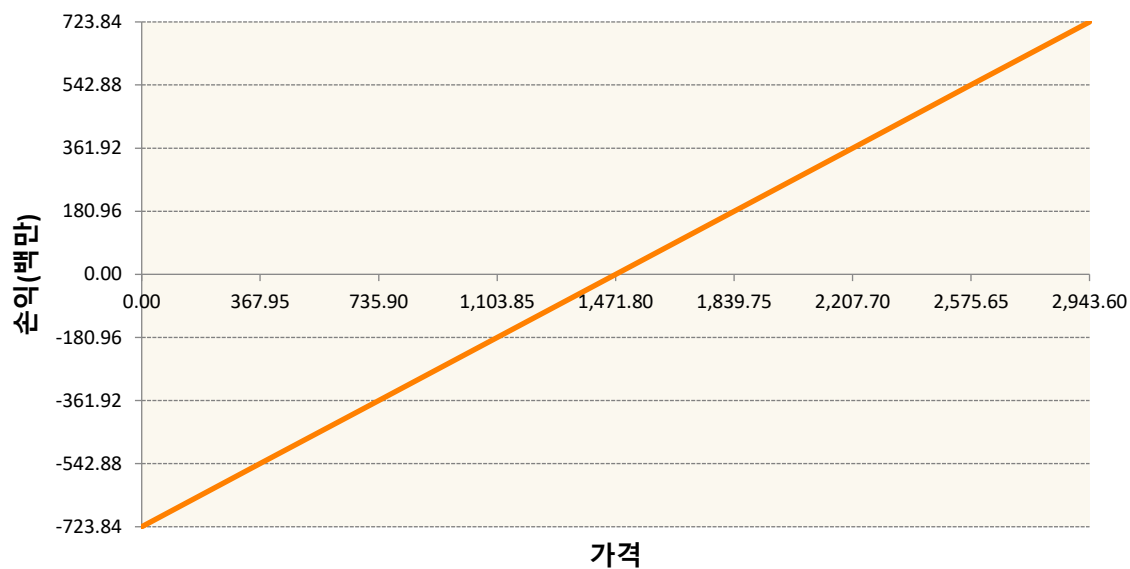
### 1. 계약금액

(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   | 724   | 0     | 724       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,831 | 0     | 1,831     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,715 | -1,715    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCH2-VN30 Index Future Mar22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 146 |
| FXW213BCN KRW/EUR 18-03-22E   | 43  |
| FXW213C1K KRW/EUR 22-04-22E   | 16  |
| FXW213C2P KRW/EUR 20-05-22E   | 46  |
| FXW213C3G KRW/EUR 24-06-22E   | 32  |
| VNCH2 VN30 Index Future Mar22 | 58  |

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

(단위:백만원)



공시일 2022-03-18

기준일 2022-03-17

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

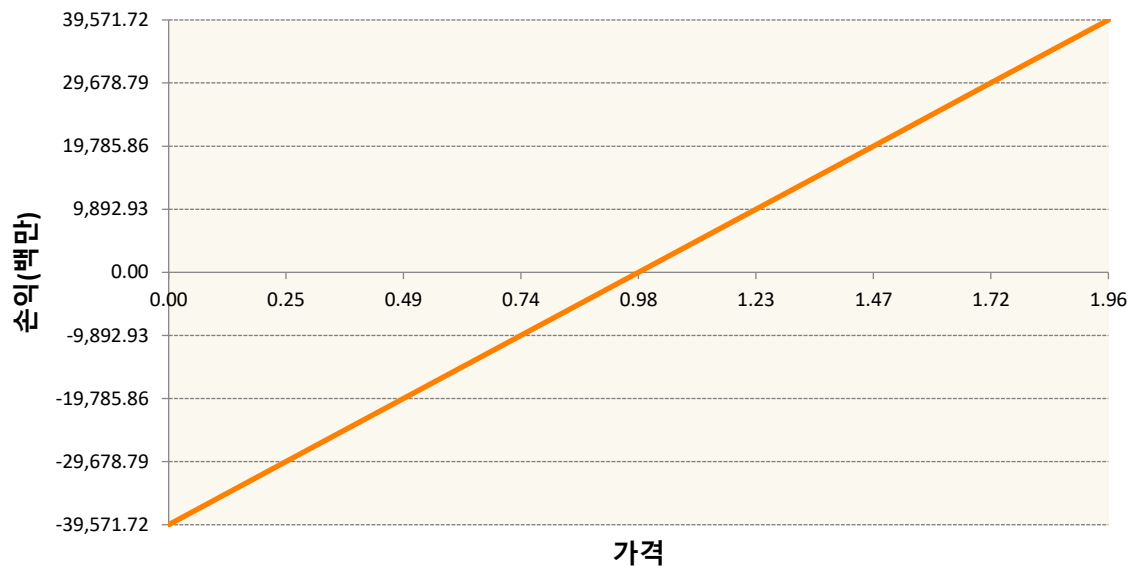
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

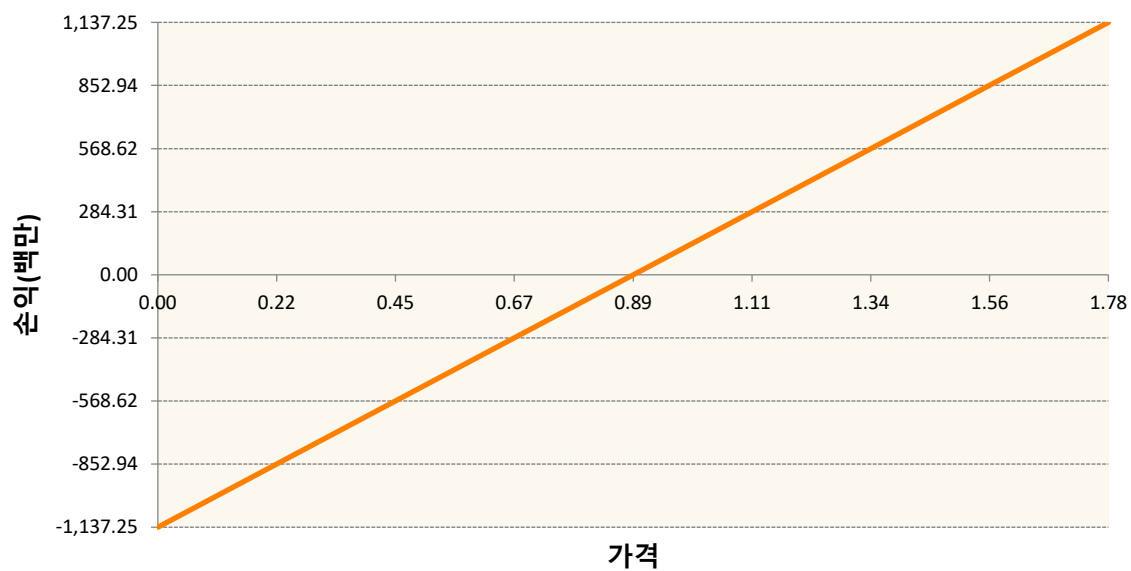
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 42,973 | 0     | 42,973    |    |

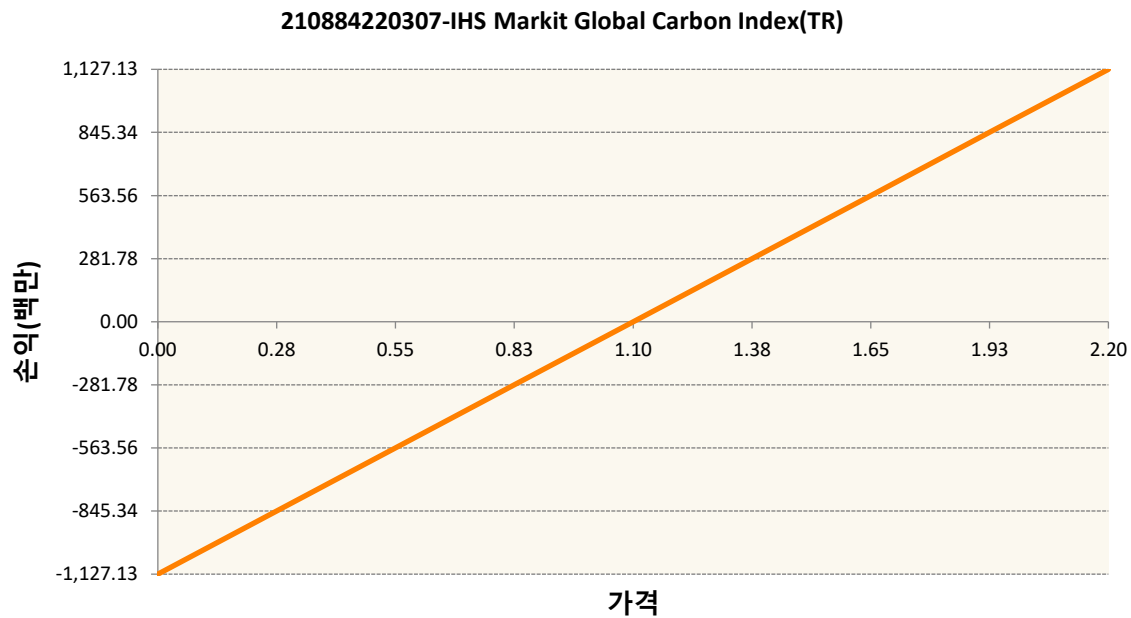
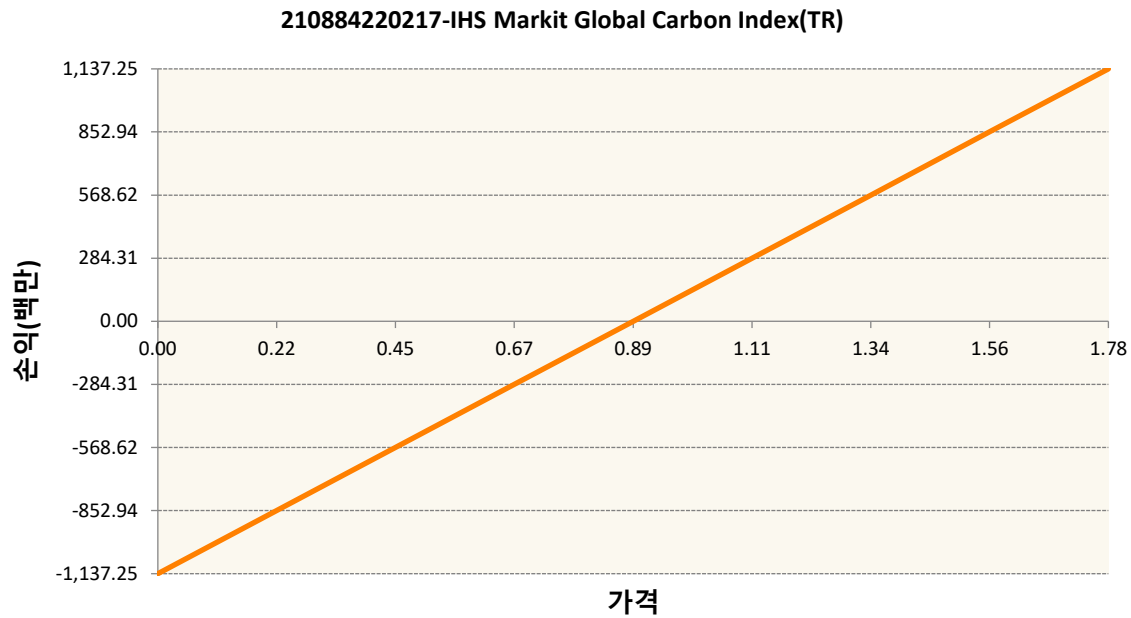
### 2. 만기시점의 손익구조

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) |  | 3,168    |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 91       |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 91       |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 91       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 6,305    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

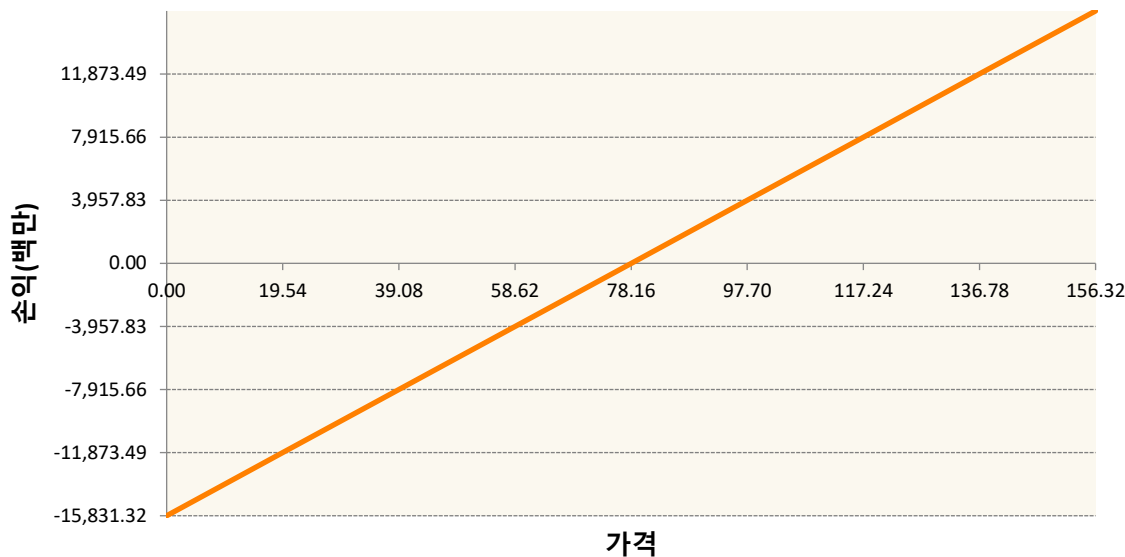
### 1. 계약금액

(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   | 15,831 | 0     | 15,831    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 8,194 | -8,194    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| FXW213C2R₩ KRW/EUR 28-03-22E | 656   |
| MOZ22 ECX EMISSION Dec22     | 1,267 |

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

(단위:백만원)

3,373

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

# 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)  | 15 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (키움)  | 15 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (미래)  | 15 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 211222 (메리츠) | 15 |

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

(단위:백만원)

112

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-18 |
| 기준일 | 2022-03-17 |

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)  | 23 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 27 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(메리츠) | 23 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 23 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 122 |
|-----|





공시일 2022-03-18

기준일 2022-03-17

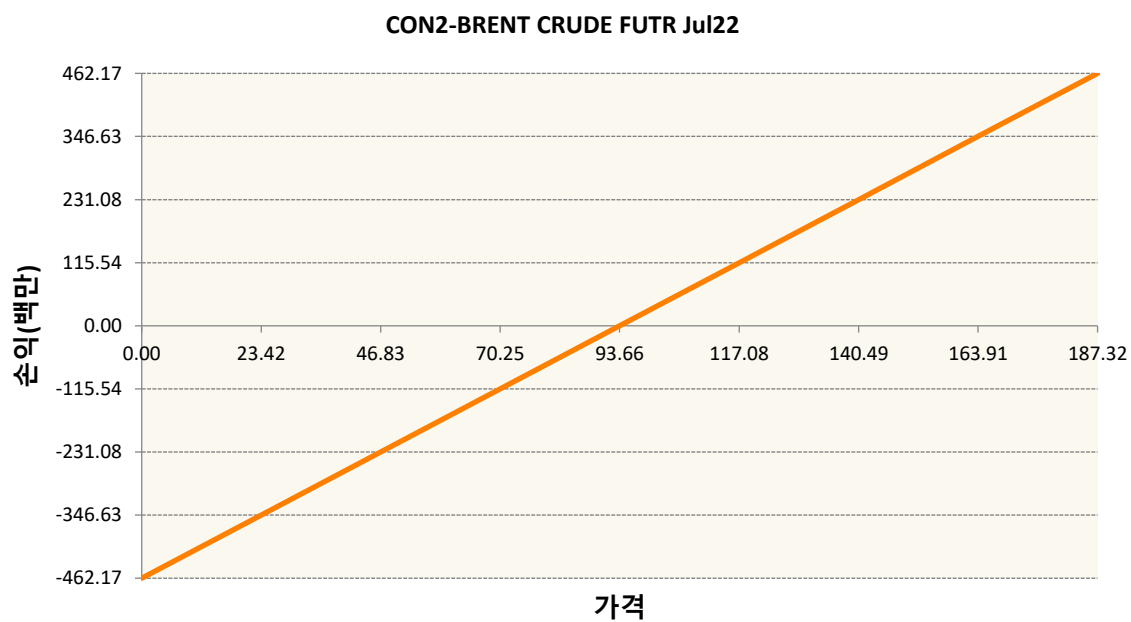
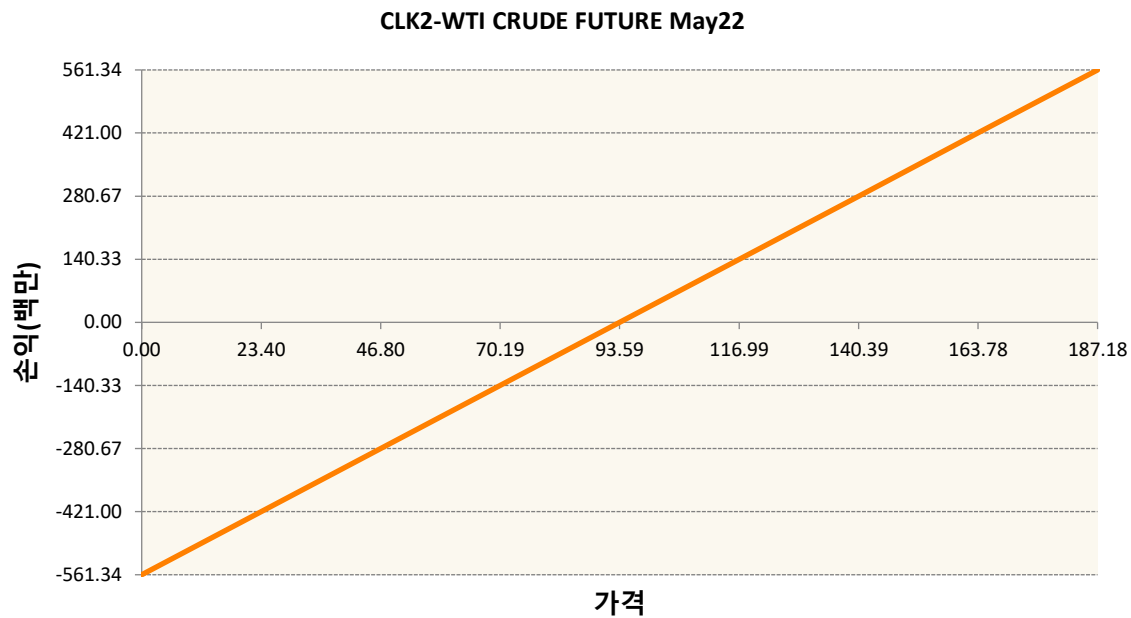
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

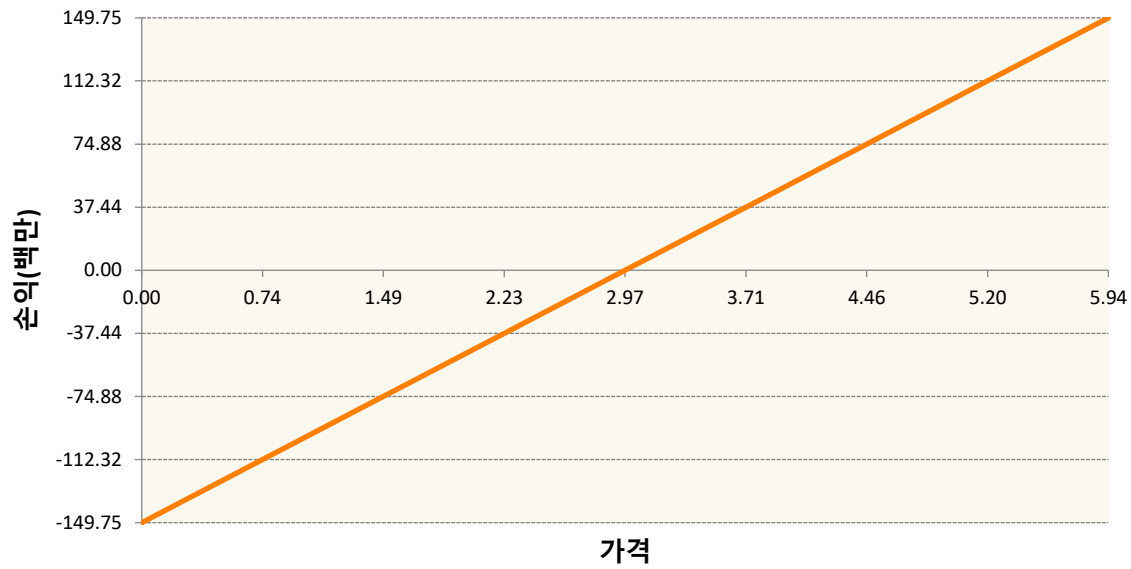
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,167 | 425   | 1,742     |    |

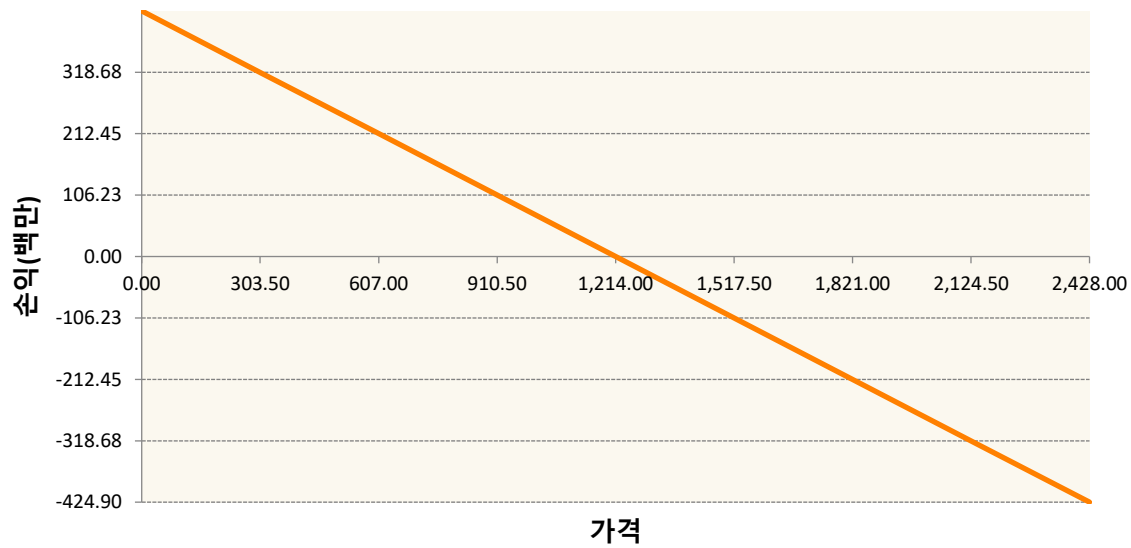
### 2. 만기시점의 손익구조



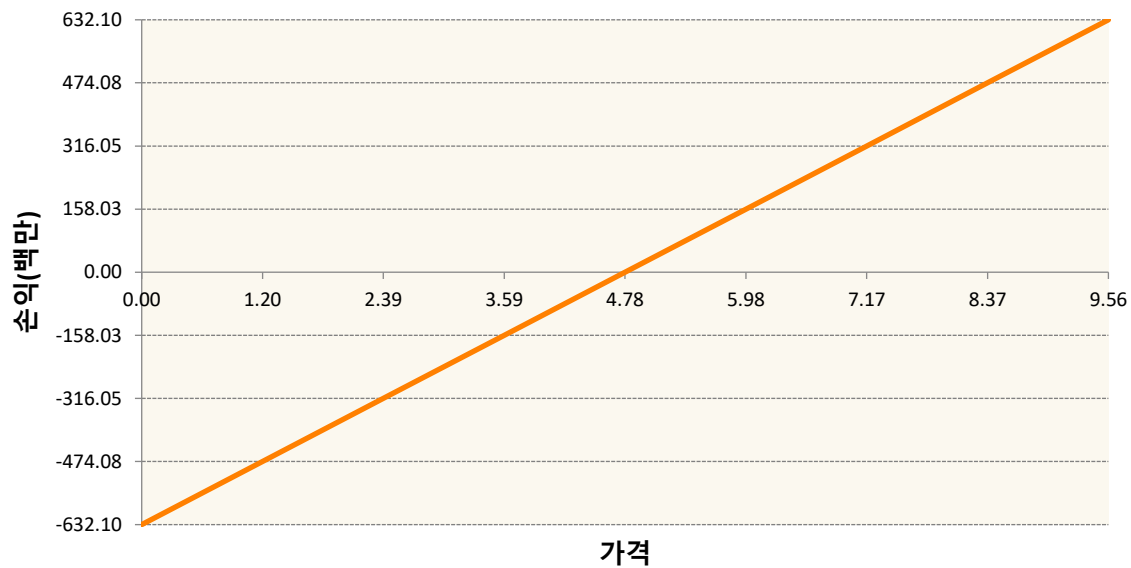
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22



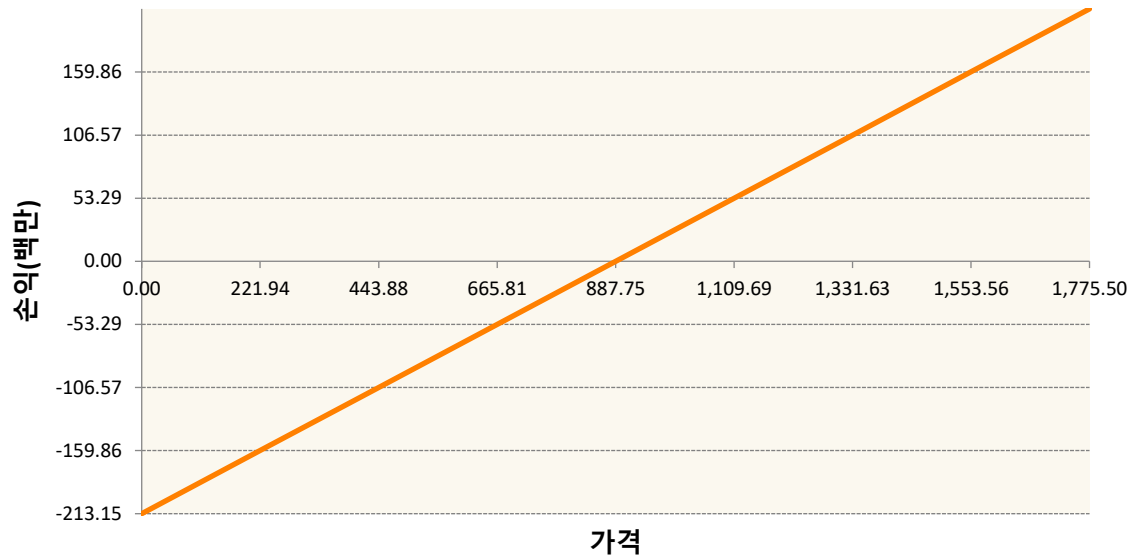
KR4175S40004-2022-04 달러선물



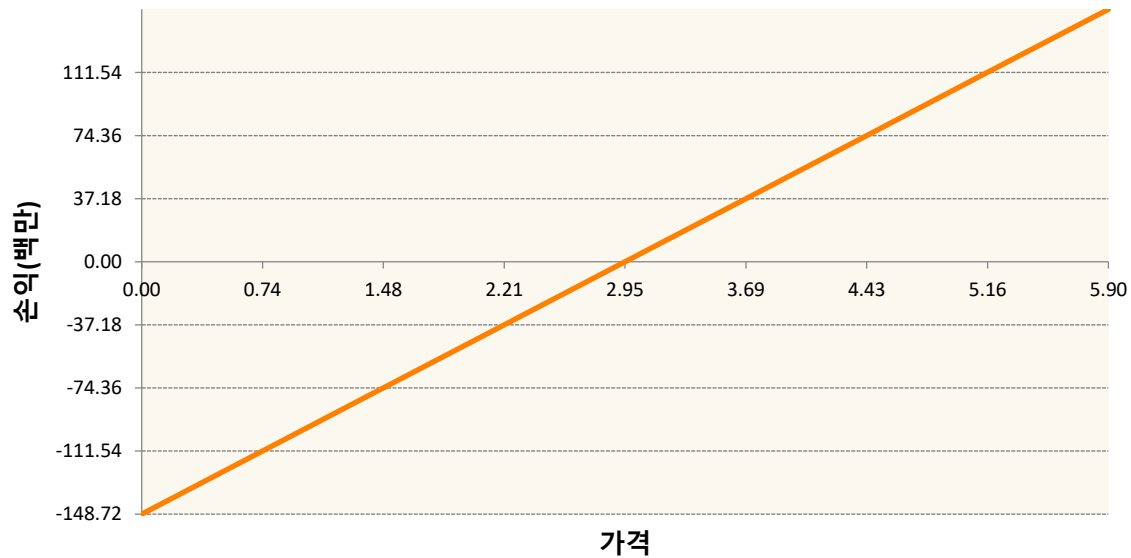
NGK22-NATURAL GAS FUTR May22



QSK2-Low Su Gasoil G MAY22



XBK2-GASOLINE RBOB FUT May22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                         |    |
|------------|-------------------------|----|
| CLK2       | WTI CRUDE FUTURE May22  | 45 |
| CON2       | BRENT CRUDE FUTR Jul22  | 37 |
| HOK2       | NY Harb ULSD Fut May22  | 12 |
| KR4175S400 | 2022-04 달러선물            | 34 |
| NGK22      | NATURAL GAS FUTR May22  | 51 |
| QSK2       | Low Su Gasoil G MAY22   | 17 |
| XBK2       | GASOLINE RBOB FUT May22 | 12 |

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

(단위:백만원)

473