

공시일 2022-03-31  
기준일 2022-03-30

## 포커스농산물모(채권-파생형)

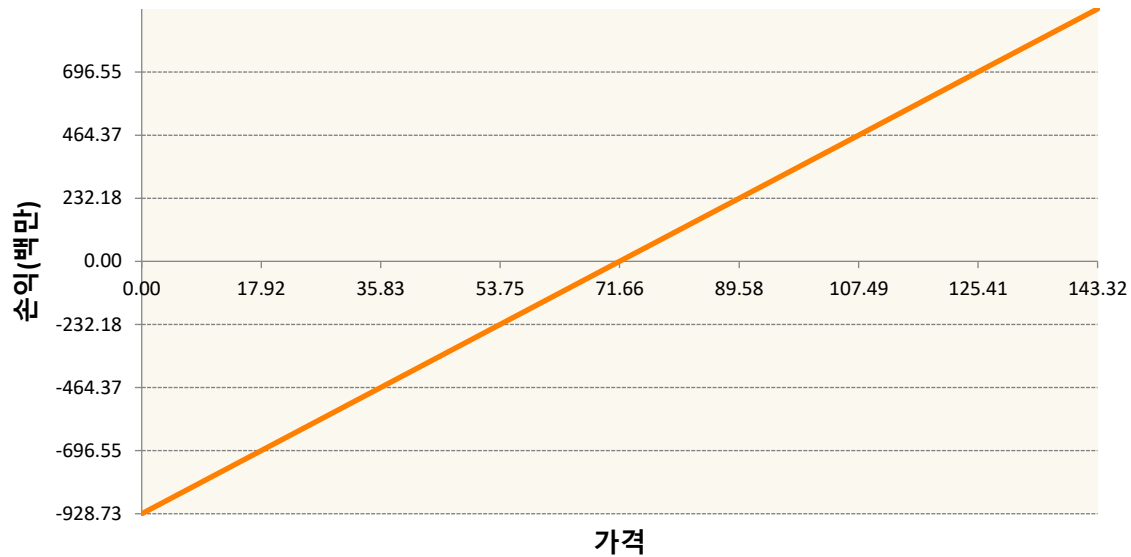
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

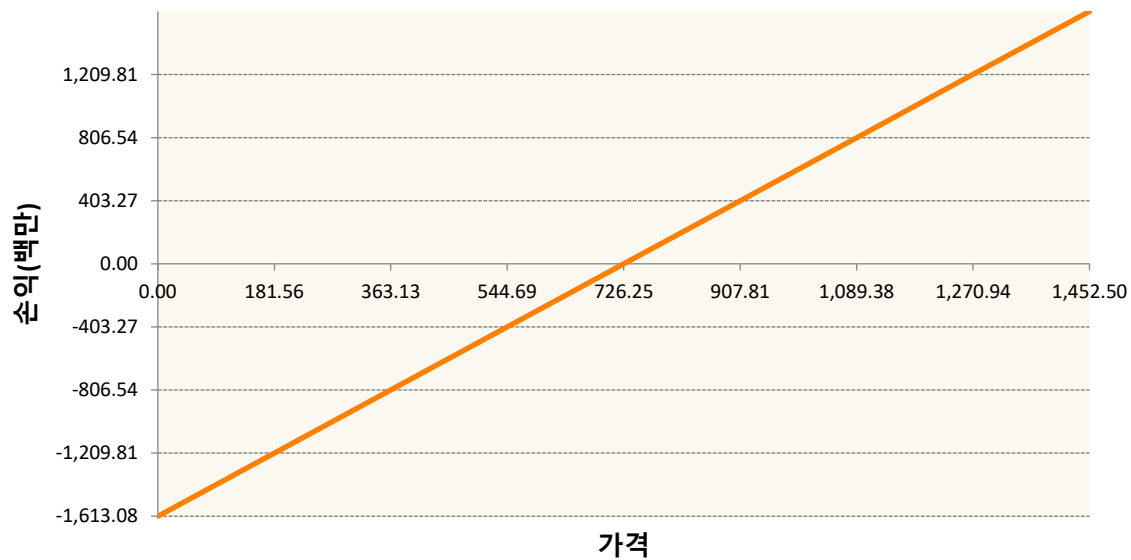
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,221 | 1,693 | 6,528     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

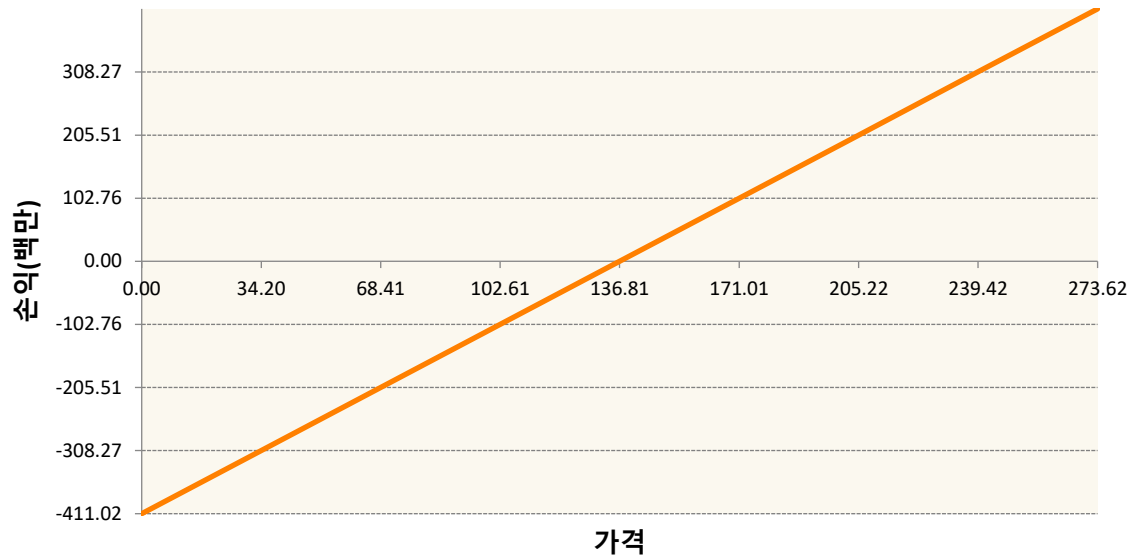
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



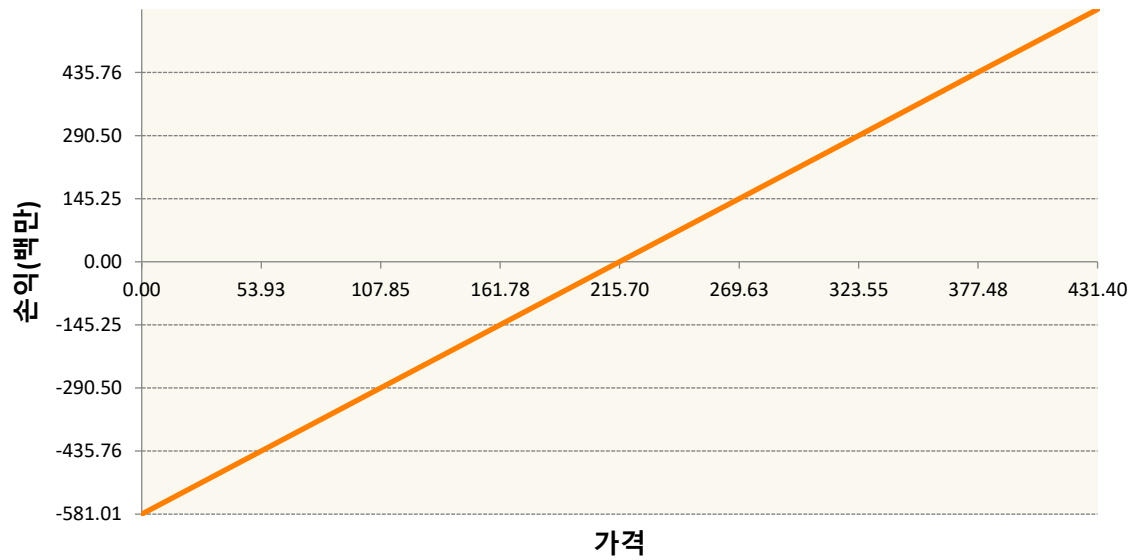
CK2-CORN FUTURE May22



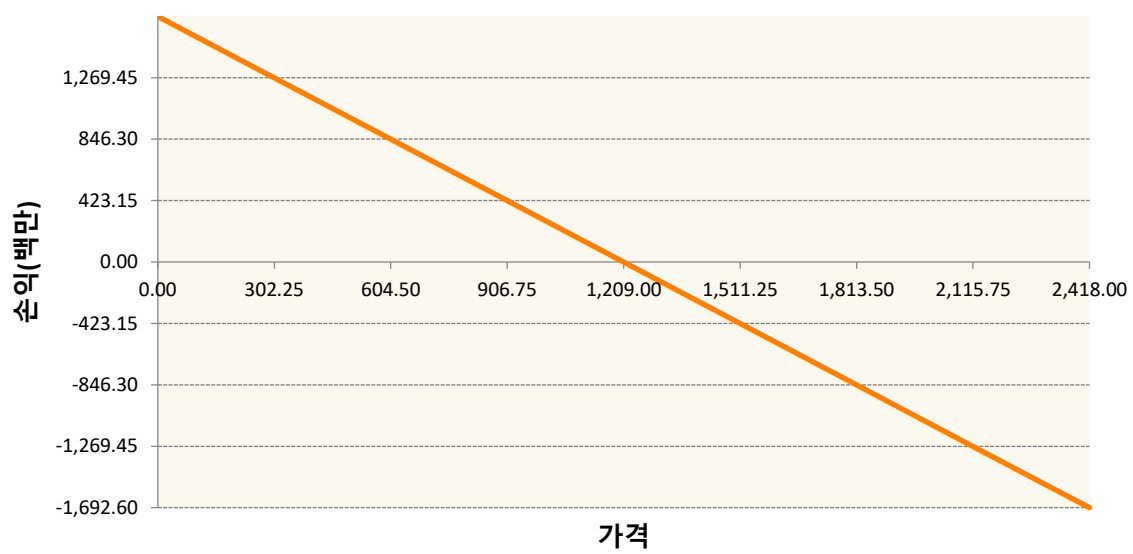
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



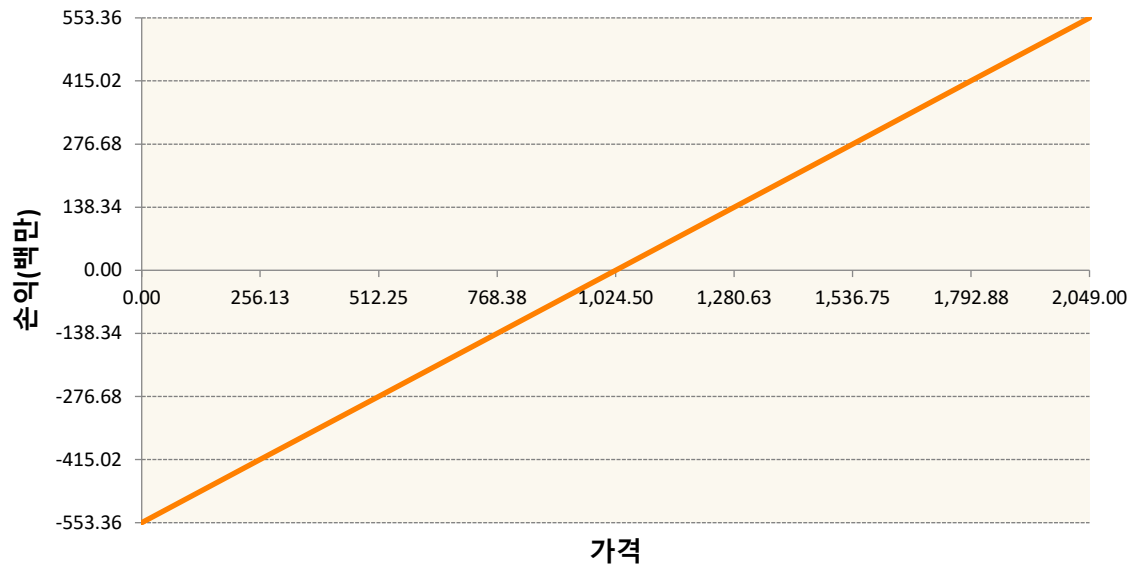
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



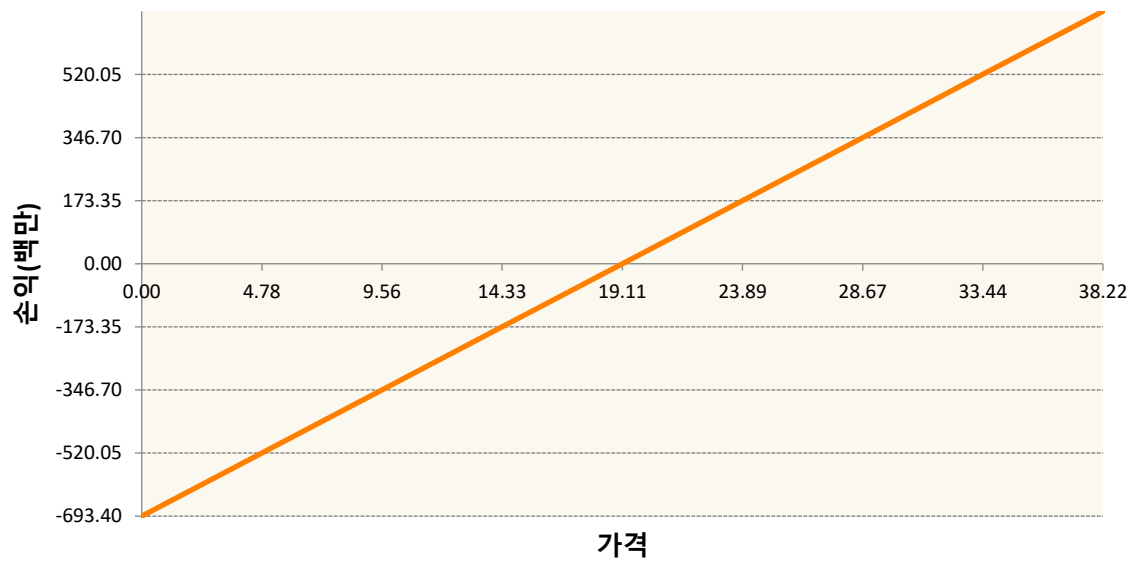
KR4175S40004-2022-04 달러선물



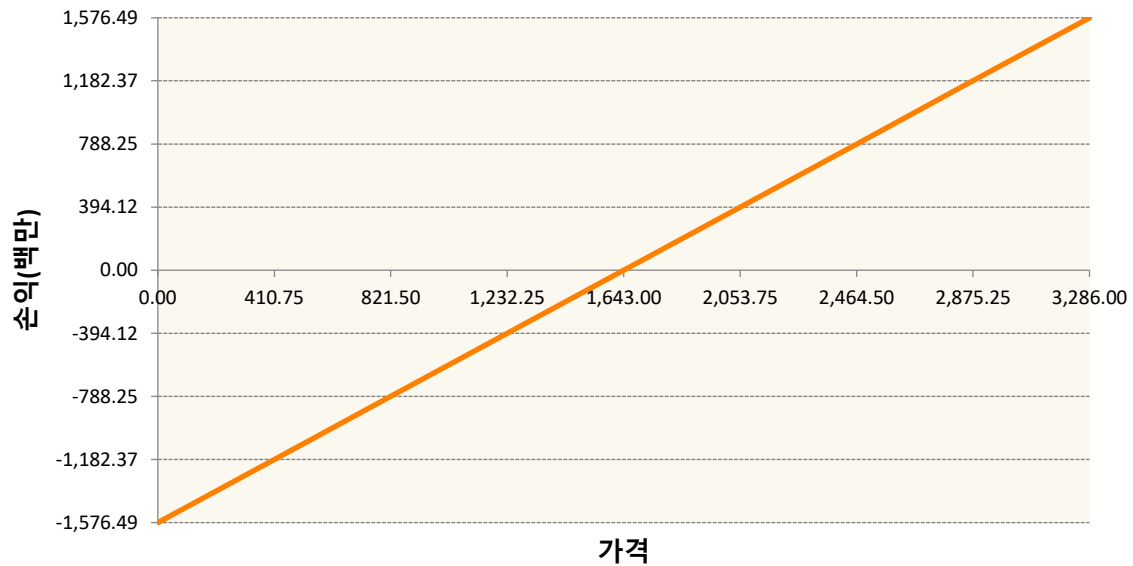
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



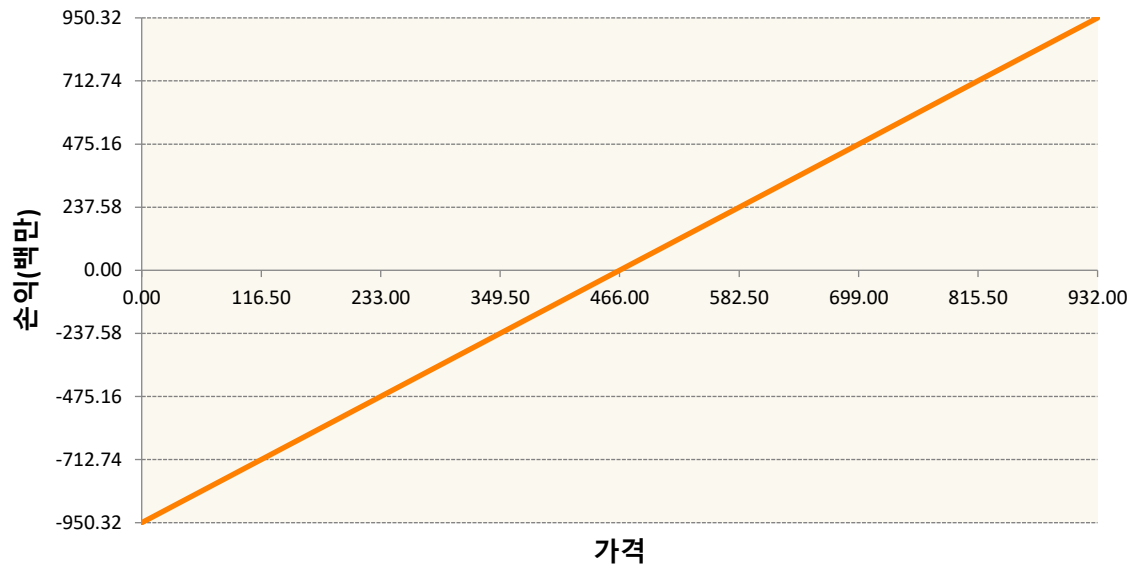
SBK2-Sugar May22



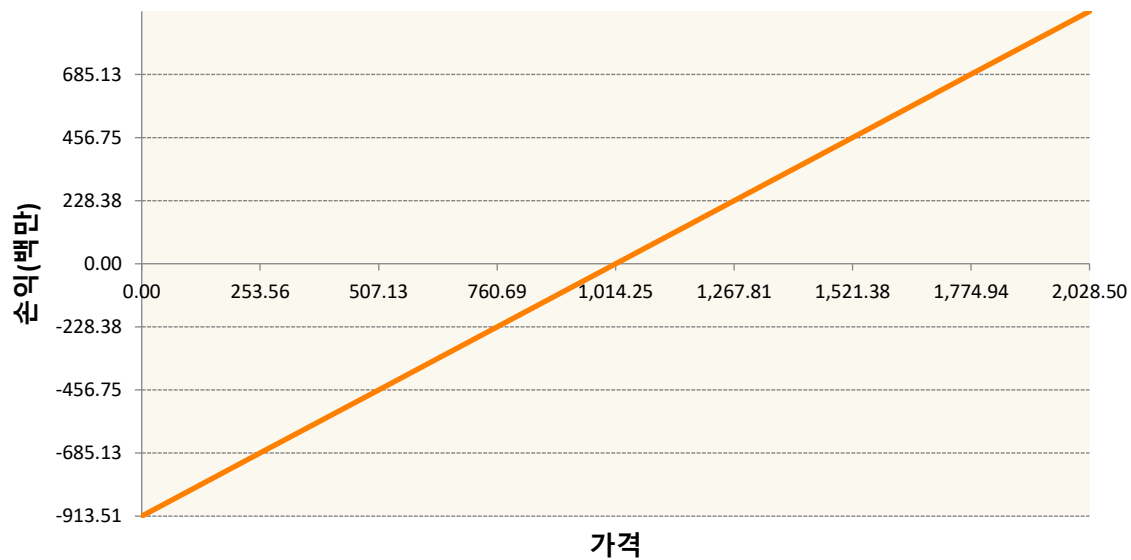
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



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 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

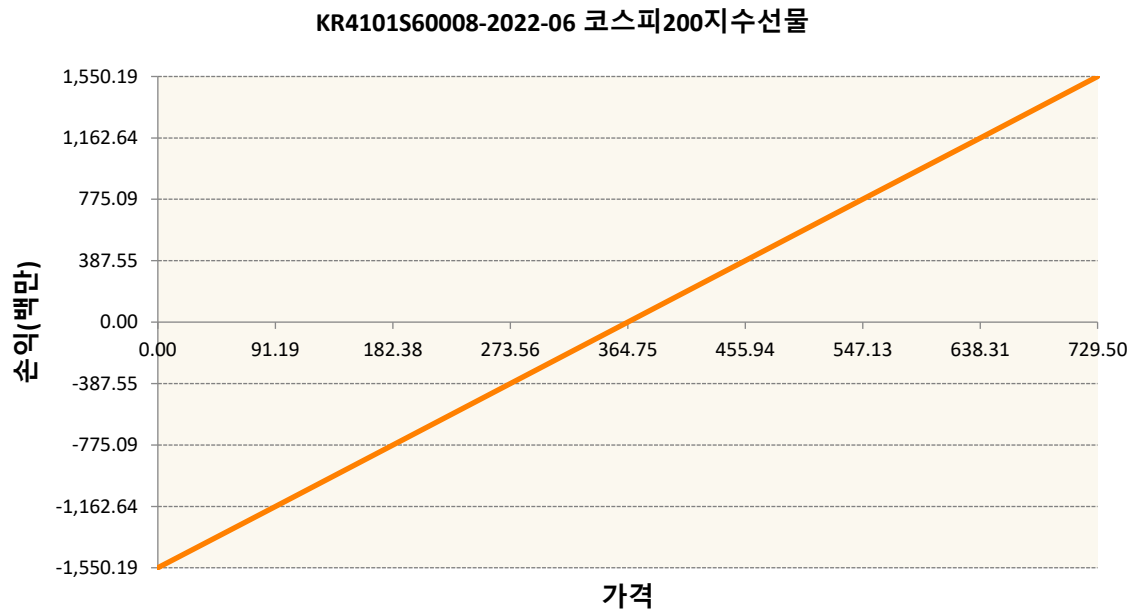
스마트인덱스모

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   | 1,550 | 0     | 1,550     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |      |       |        | 124    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -124      | -124    | -124               | -124 | -124  | -124   | -124   |
| -5.33%       | -83       | -83     | -83                | -83  | -83   | -83    | -83    |
| -2.67%       | -41       | -41     | -41                | -41  | -41   | -41    | -41    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 41        | 41      | 41                 | 41   | 41    | 41     | 41     |
| 5.33%        | 83        | 83      | 83                 | 83   | 83    | 83     | 83     |
| 8.00%        | 124       | 124     | 124                | 124  | 124   | 124    | 124    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

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 | 149 |
|------------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 93 |
|----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

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 | 386 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 392 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

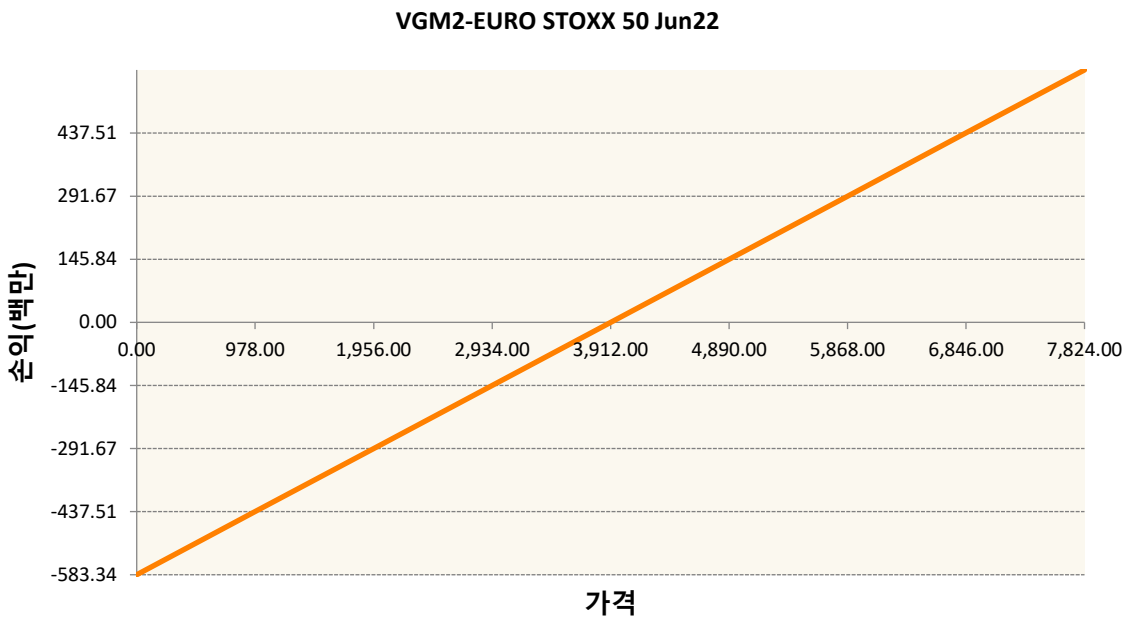
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 583   | 0     | 583       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGM2 | EURO STOXX 50 Jun22 | 47 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

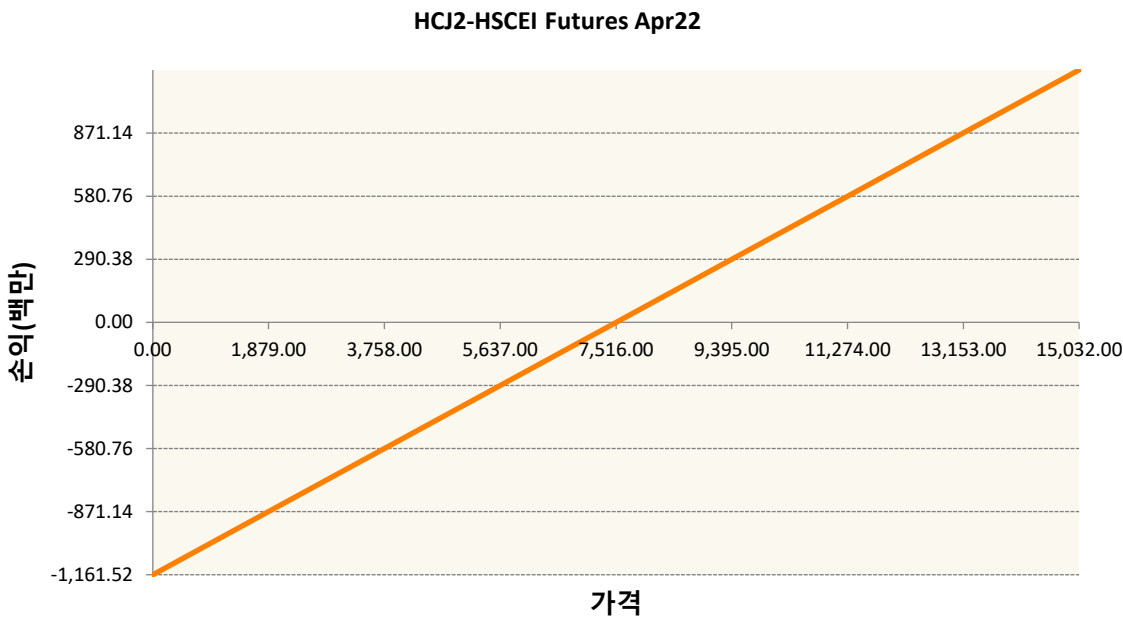
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,162 | 0     | 1,162     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCI2 | HSCEI Futures Apr22 | 93 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

123

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

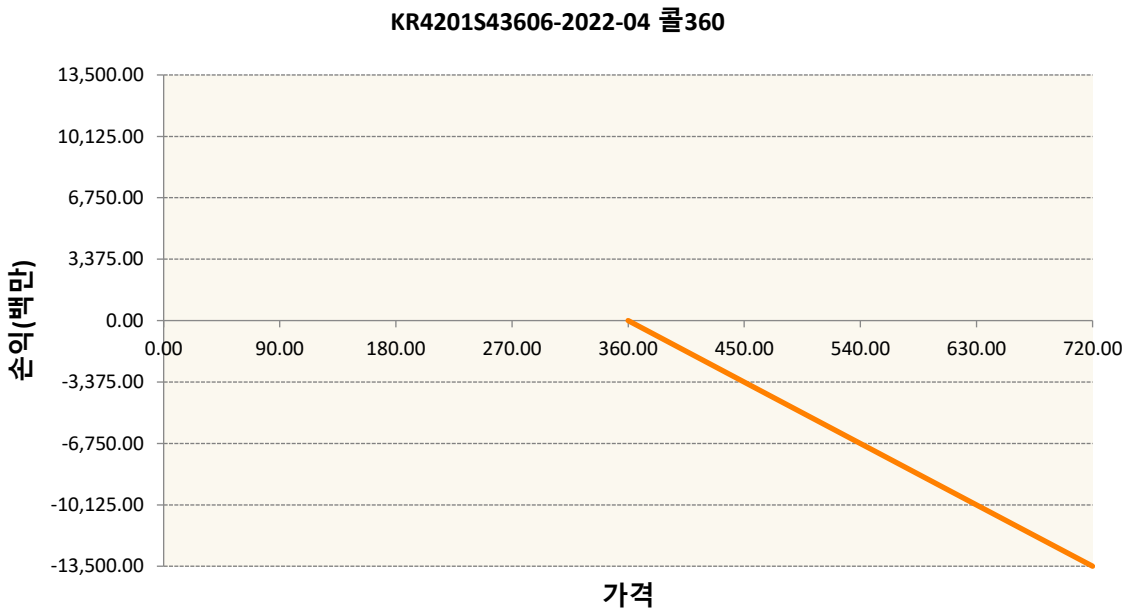
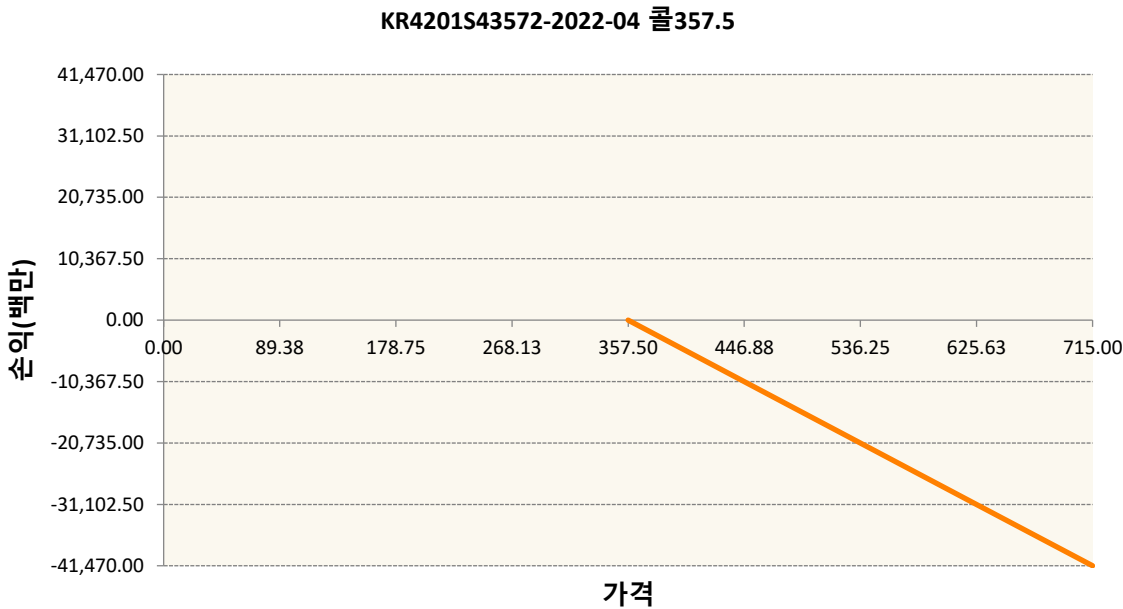
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

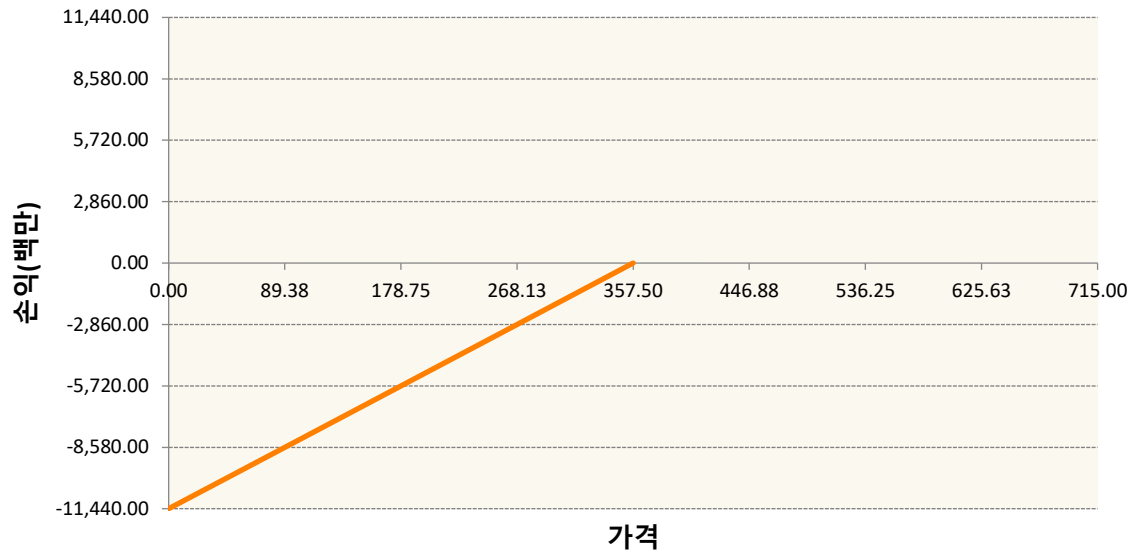
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 66,410 | -66,410   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |         |                |        |        |        |        |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
| KR4201S43572 |           |         | 2022-04 콜357.5 |        |        |        | 2,881  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 1,399     | 1,366   | 1,328          | 1,284  | 1,236  | 1,184  | 1,129  |
| -5.33%       | 1,235     | 1,173   | 1,108          | 1,040  | 970    | 899    | 826    |
| -2.67%       | 866       | 784     | 702            | 620    | 537    | 455    | 372    |
| 0%           | 236       | 158     | 80             | 0      | -80    | -161   | -242   |
| 2.67%        | -628      | -682    | -741           | -803   | -869   | -937   | -1,007 |
| 5.33%        | -1,644    | -1,673  | -1,708         | -1,748 | -1,794 | -1,844 | -1,898 |
| 8.00%        | -2,734    | -2,746  | -2,763         | -2,785 | -2,812 | -2,844 | -2,881 |
| KR4201S43606 |           |         | 2022-04 콜360   |        |        |        | 904    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 403       | 394     | 384            | 371    | 358    | 342    | 326    |
| -5.33%       | 362       | 344     | 325            | 304    | 283    | 261    | 239    |
| -2.67%       | 261       | 236     | 210            | 184    | 158    | 131    | 105    |
| 0%           | 80        | 53      | 27             | 0      | -27    | -54    | -81    |
| 2.67%        | -182      | -202    | -223           | -245   | -268   | -292   | -316   |
| 5.33%        | -500      | -511    | -525           | -540   | -556   | -574   | -593   |
| 8.00%        | -848      | -853    | -859           | -868   | -879   | -891   | -904   |
| KR4301S43570 |           |         | 2022-04 풋357.5 |        |        |        | 648    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -630      | -631    | -633           | -636   | -639   | -643   | -648   |
| -5.33%       | -333      | -339    | -347           | -355   | -364   | -373   | -383   |
| -2.67%       | -94       | -107    | -120           | -134   | -148   | -161   | -175   |
| 0%           | 35        | 24      | 12             | 0      | -12    | -25    | -38    |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 2.67% | 74 | 70 | 65 | 58 | 51 | 44 | 35 |
| 5.33% | 80 | 79 | 78 | 76 | 74 | 70 | 66 |
| 8.00% | 81 | 80 | 80 | 80 | 79 | 78 | 77 |

|                                        |          |
|----------------------------------------|----------|
| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|                                        | 4,506    |

공시일 2022-03-31

기준일 2022-03-30

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

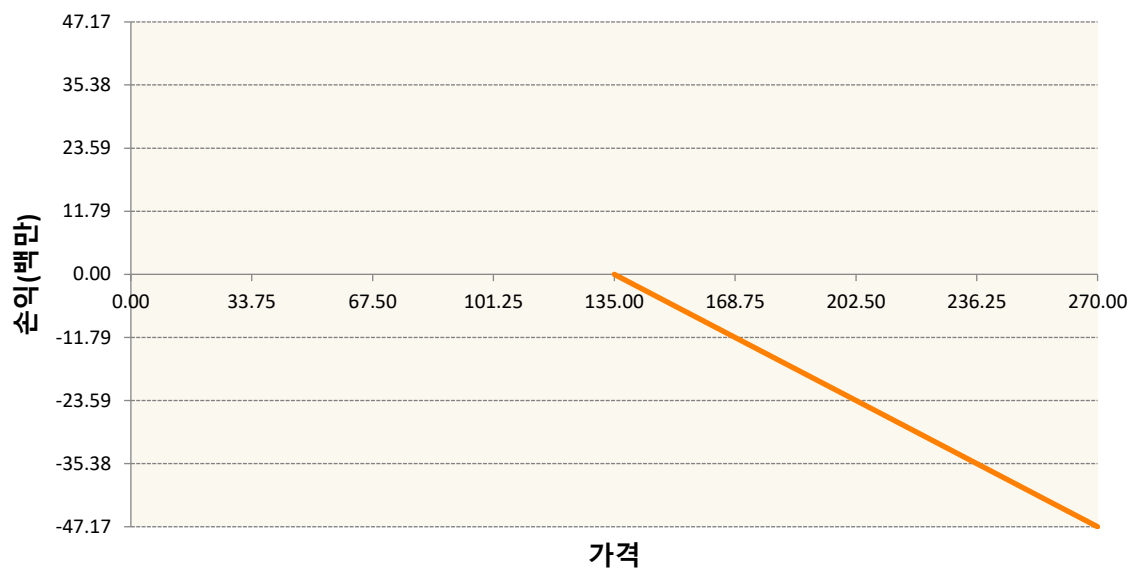
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

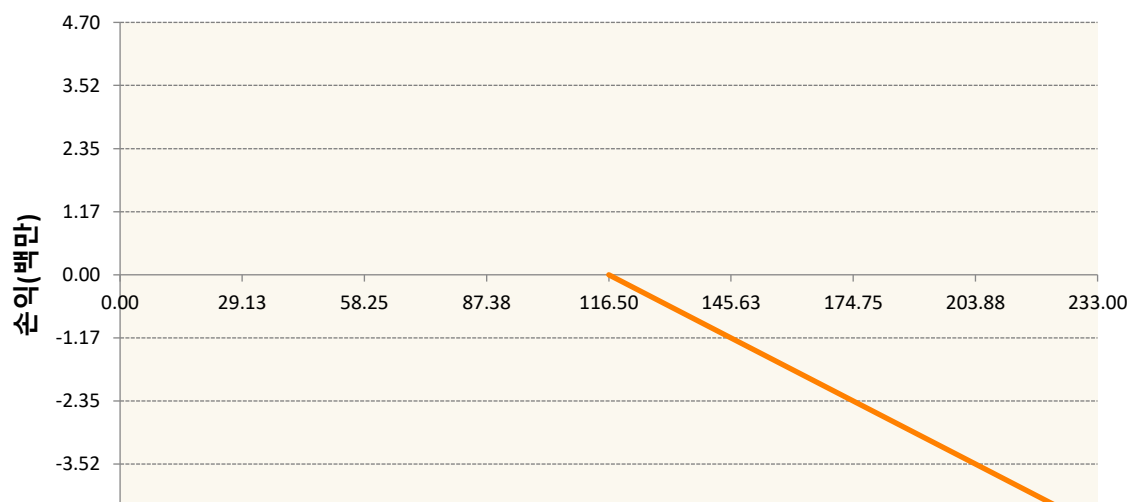
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 71    | -71       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,016 | -2,016    | 장외 |

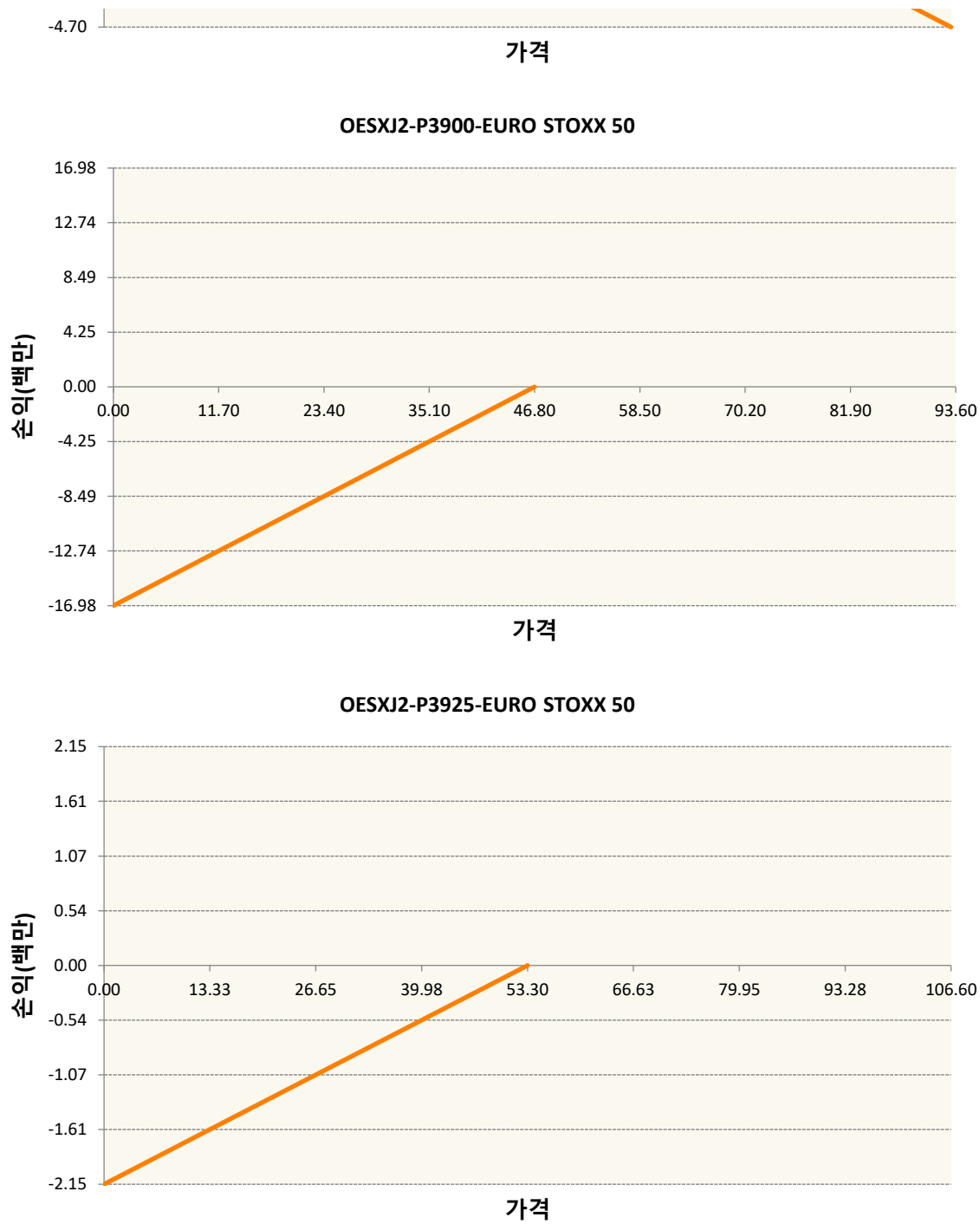
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXJ2-C3900-EURO STOXX 50



OESXJ2-C3925-EURO STOXX 50





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                          |      |
|------------------------------------------|------|
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | 18   |
| FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E              | 22   |
| FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E              | 32   |
| FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E              | 65   |
| FXW213C3A KRW/EUR 22-04-22E              | 43   |
| OESXJ2-C39( EURO STOXX 50                | 4    |
| OESXJ2-C39( EURO STOXX 50                | 0.38 |
| OESXJ2-P39( EURO STOXX 50                | 1    |
| OESXJ2-P39( EURO STOXX 50                | 0.17 |



공시일 2022-03-31

기준일 2022-03-30

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

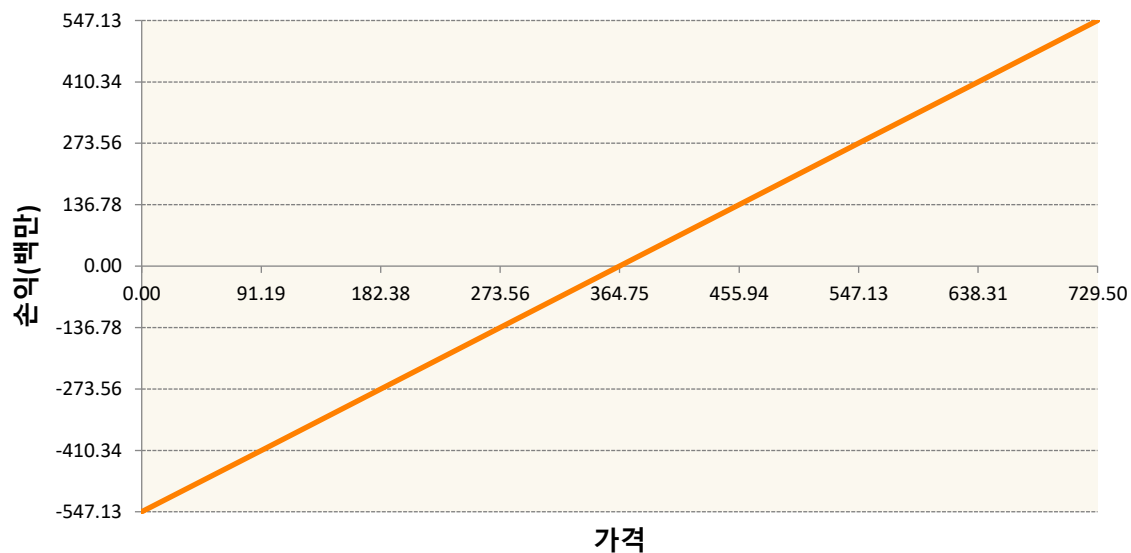
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

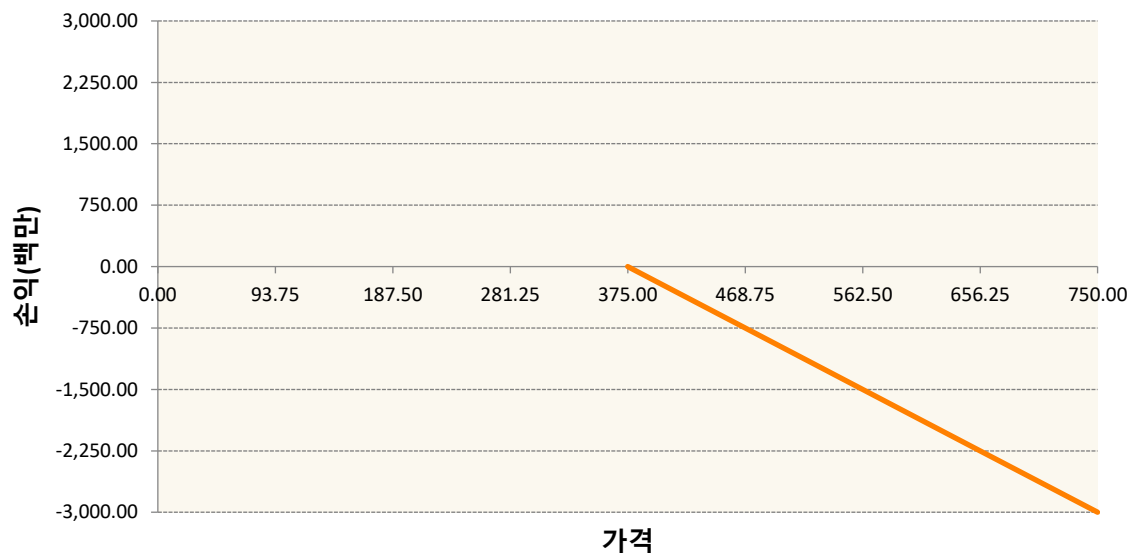
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 547   | 0     | 547       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 358   | 4,699 | -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 is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The blue line shows that as the price increases beyond 377.50, the profit decreases linearly, reaching a loss of 1,698.75 million at a price of 755.00.

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

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions). The blue line shows that as the price increases, the profit decreases linearly, starting at 357.50 million when the price is 0 and reaching 0 profit when the price is 357.50.

| 가격 (Price) | 이익 (Profit in millions) |
|------------|-------------------------|
| 0.00       | 357.50                  |
| 357.50     | 0.00                    |

(단위:백만원)

|              |           |         |        |                    |       |        |        |     |
|--------------|-----------|---------|--------|--------------------|-------|--------|--------|-----|
| KR4101S60008 |           |         |        | 2022-06 코스피200지수선물 |       |        |        | 44  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                 | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -44       | -44     | -44    | -44                | -44   | -44    | -44    |     |
| -5.33%       | -29       | -29     | -29    | -29                | -29   | -29    | -29    |     |
| -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%        | 29        | 29      | 29     | 29                 | 29    | 29     | 29     |     |
| 8.00%        | 44        | 44      | 44     | 44                 | 44    | 44     | 44     |     |
| KR4201S43754 |           |         |        | 2022-04 콜375       |       |        |        | 148 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | 37      | 36      | 36     | 35   | 34    | 32     | 30     |
| -5.33% | 35      | 34      | 32     | 30   | 28    | 25     | 22     |
| -2.67% | 30      | 27      | 24     | 20   | 16    | 12     | 7      |
| 0%     | 15      | 10      | 5      | 0    | -5    | -11    | -16    |
| 2.67%  | -14     | -20     | -26    | -32  | -38   | -44    | -50    |
| 5.33%  | -61     | -66     | -72    | -77  | -83   | -89    | -94    |
| 8.00%  | -122    | -126    | -130   | -134 | -139  | -144   | -148   |

KR4201S43770

2022-04 콜377.5

79

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 17      | 17      | 17     | 17  | 16    | 15     | 15     |
| -5.33%    | 17      | 16      | 16     | 15  | 13    | 12     | 11     |
| -2.67%    | 15      | 13      | 12     | 10  | 8     | 5      | 3      |
| 0%        | 8       | 5       | 3      | 0   | -3    | -6     | -9     |
| 2.67%     | -6      | -9      | -13    | -16 | -20   | -23    | -26    |
| 5.33%     | -30     | -33     | -36    | -40 | -43   | -46    | -50    |
| 8.00%     | -63     | -65     | -67    | -70 | -73   | -76    | -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%    | 20      | 20      | 20     | 20 | 20    | 20     | 20     |
| -5.33%    | 10      | 11      | 11     | 11 | 11    | 12     | 12     |
| -2.67%    | 3       | 3       | 4      | 4  | 5     | 5      | 5      |
| 0%        | -1      | -1      | 0      | 0  | 0     | 1      | 1      |
| 2.67%     | -2      | -2      | -2     | -2 | -2    | -1     | -1     |
| 5.33%     | -3      | -2      | -2     | -2 | -2    | -2     | -2     |
| 8.00%     | -3      | -3      | -3     | -2 | -2    | -2     | -2     |

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

(단위:백만원)

250

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

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 | 9,335 | 0     | 9,335     |    |

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 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 56    | -56       |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 7,535 | 0     | 7,535     |    |

### 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 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

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 | 25,485 | 0      | 25,485    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,693  | 27,494 | -25,801   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |                                 | (단위:백만원) |
|-----------------------------|---------------------------------|----------|
| IE00BD8RGM75                | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |          |
| FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E |                                 | 2,200    |
| FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E |                                 | 39       |
| FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E |                                 | 97       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 778      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

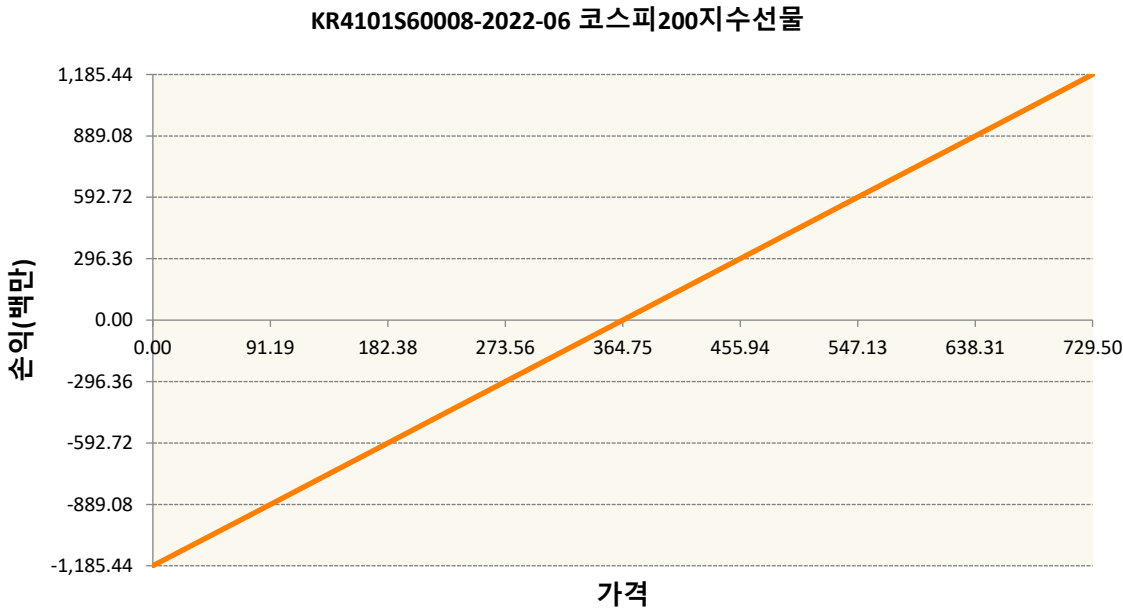
# 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

## 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   | 1,185 | 0     | 1,185     | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 95     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -95       | -95     | -95                | -95 | -95   | -95    | -95    |
| -5.33%       | -63       | -63     | -63                | -63 | -63   | -63    | -63    |
| -2.67%       | -32       | -32     | -32                | -32 | -32   | -32    | -32    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 32        | 32      | 32                 | 32  | 32    | 32     | 32     |
| 5.33%        | 63        | 63      | 63                 | 63  | 63    | 63     | 63     |
| 8.00%        | 95        | 95      | 95                 | 95  | 95    | 95     | 95     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

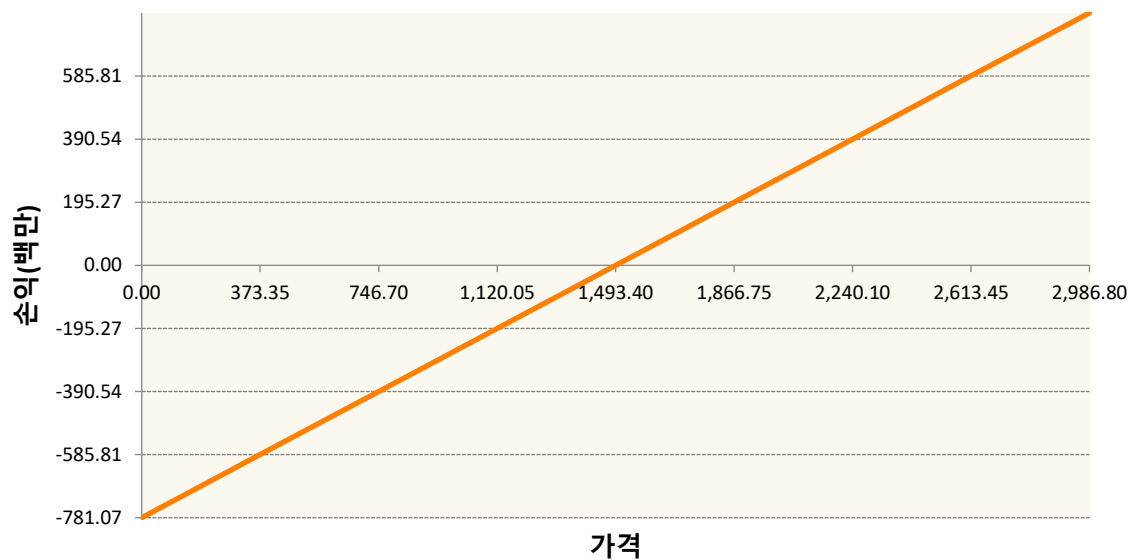
### 1. 계약금액

(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   | 781   | 0     | 781       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,837 | 0     | 1,837     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,183 | -1,183    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCJ2-VN30 Index Future Apr22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 147 |
| FXW213C1K·KRW/EUR 22-04-22E   | 16  |
| FXW213C2P·KRW/EUR 20-05-22E   | 46  |
| FXW213C3G·KRW/EUR 24-06-22E   | 32  |
| VNCJ2 VN30 Index Future Apr22 | 62  |

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

(단위:백만원)

266

공시일 2022-03-31

기준일 2022-03-30

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

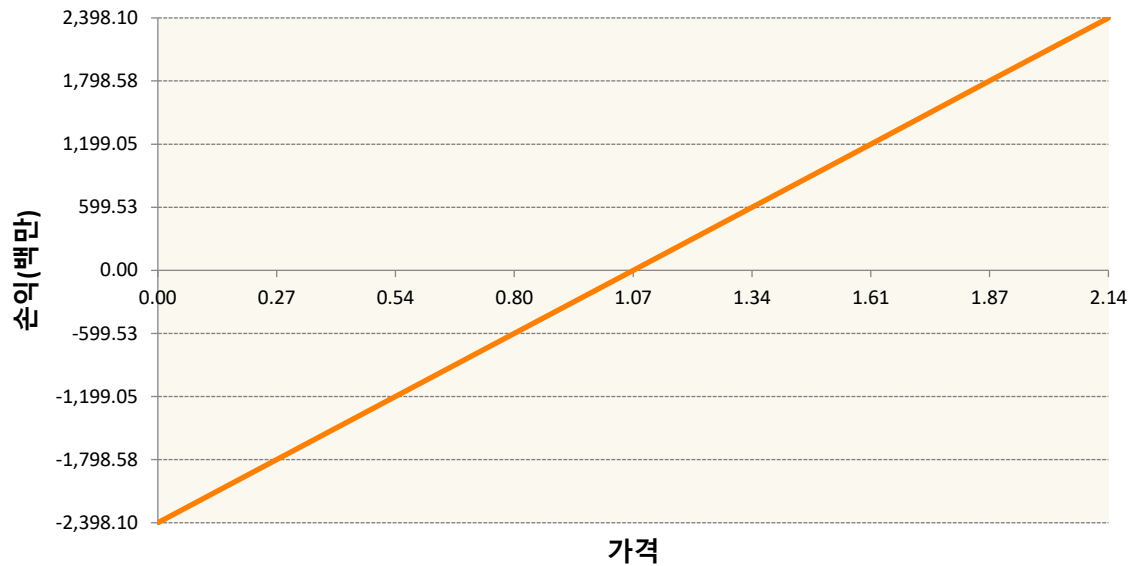
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

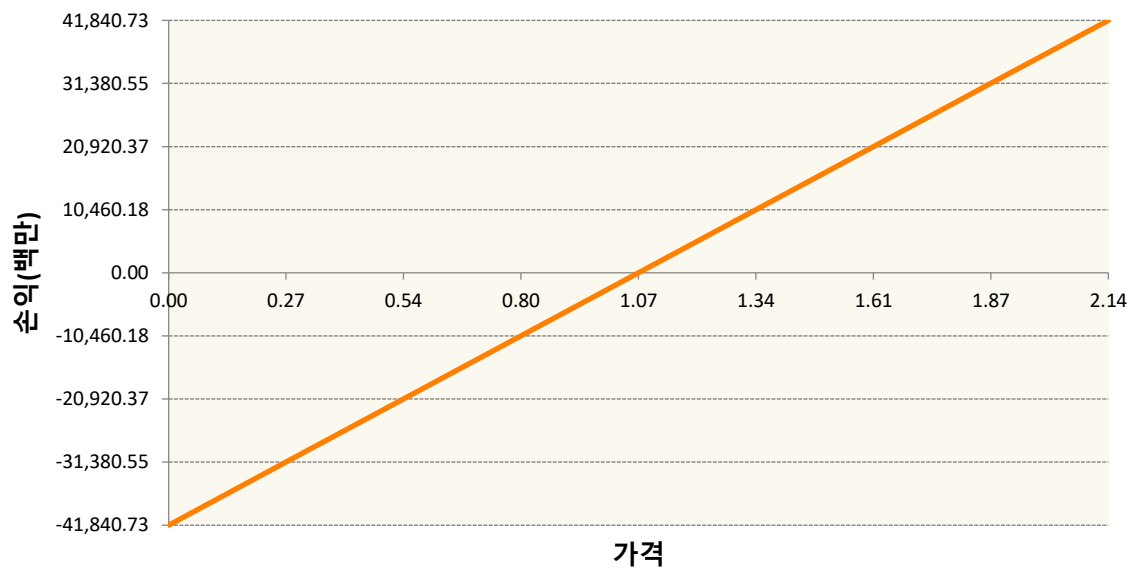
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 45,438 | 0     | 45,438    |    |

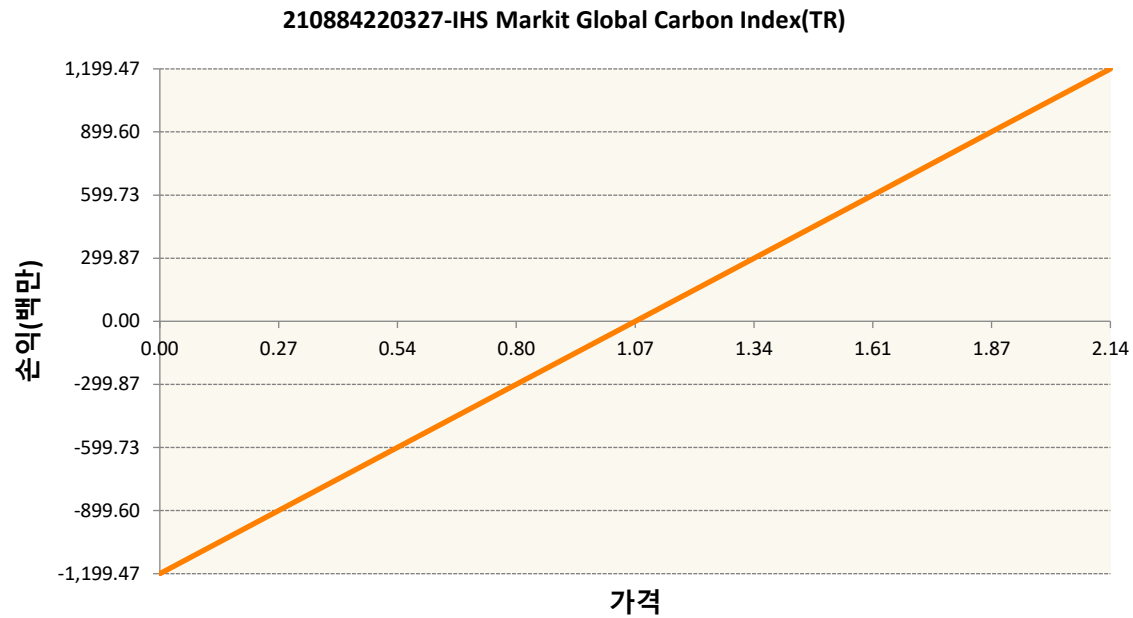
### 2. 만기시점의 손익구조

210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220326-IHS Markit Global Carbon Index(TR)





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                     |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------|--|----------|
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 192      |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 3,356    |
| 2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 96       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 6,705    |

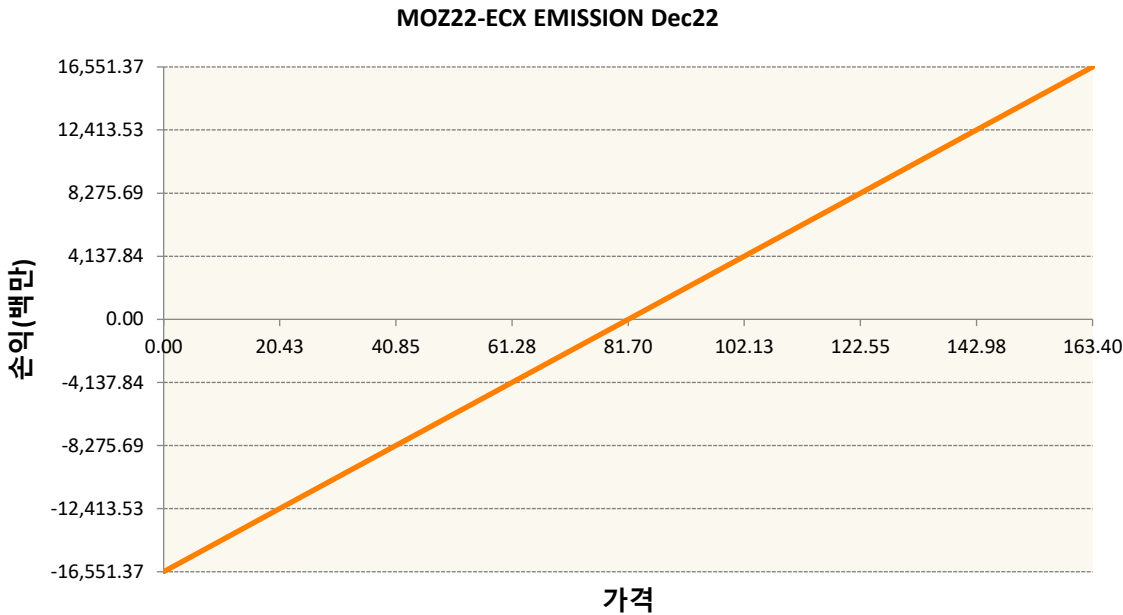
|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

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   | 16,551 | 0     | 16,551    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 7,497 | -7,497    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



|                           |                    |  |          |
|---------------------------|--------------------|--|----------|
| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                    |  | (단위:백만원) |
| FXW213C3V                 | KRW/EUR 25-04-22E  |  | 600      |
| MOZ22                     | ECX EMISSION Dec22 |  | 1,324    |

|                                        |          |
|----------------------------------------|----------|
| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|                                        | 3,466    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

# 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 11,035 | 0     | 11,035    | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                     |    |
|-------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)  | 17 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)  | 17 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)  | 17 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠) | 17 |

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

(단위:백만원)

129

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

## 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)  | 32 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 37 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(메리츠) | 32 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 32 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 163 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-03-31 |
| 기준일 | 2022-03-30 |

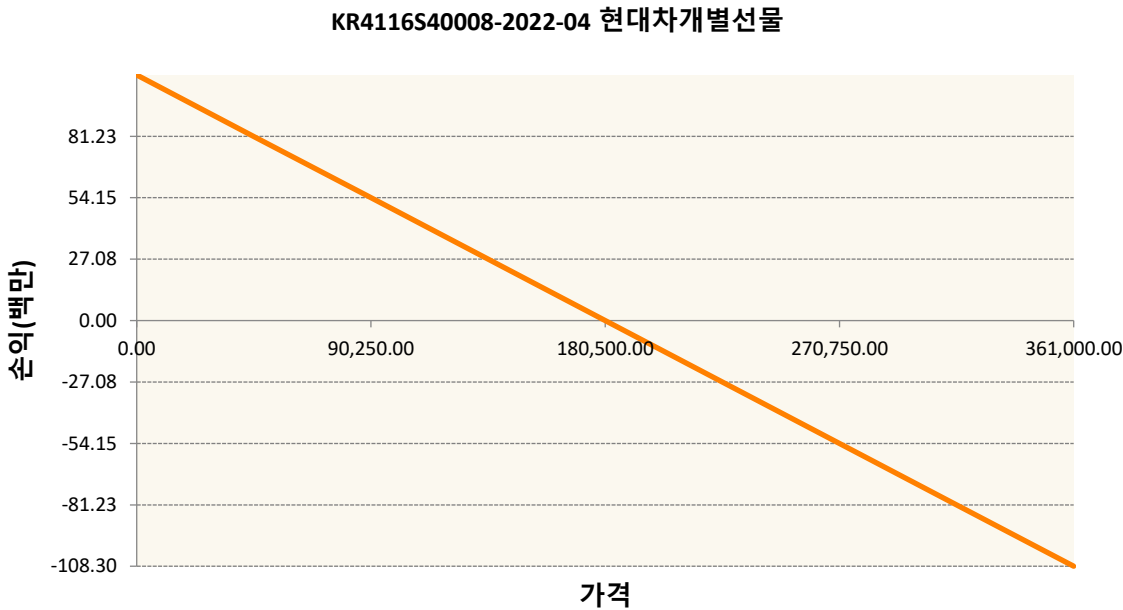
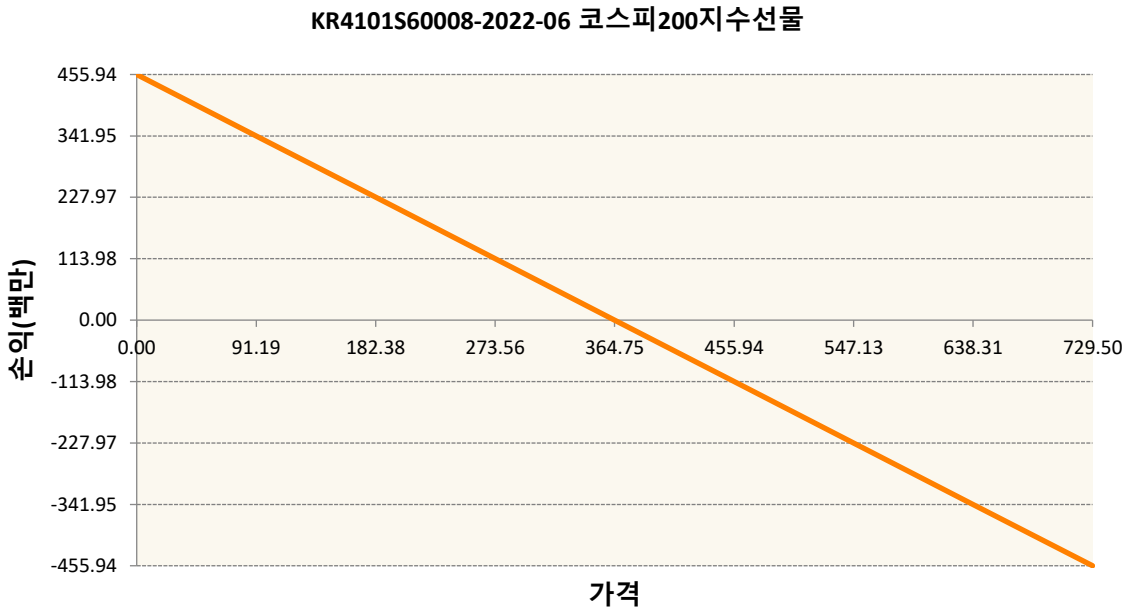
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 564   | -564      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)             |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------|--|----------|
| KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322 |  | 1        |
| KRS0003014 SWAP_APPLE INC_0322        |  | 2        |
| KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322      |  | 1        |
| KRS0003014 SWAP_TESLA INC_0322        |  | 3        |
| KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322 |  | 0.43     |
| KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물         |  | 36       |
| KR4116S400 2022-04 현대차개별선물            |  | 9        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 63       |

공시일 2022-03-31

기준일 2022-03-30

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

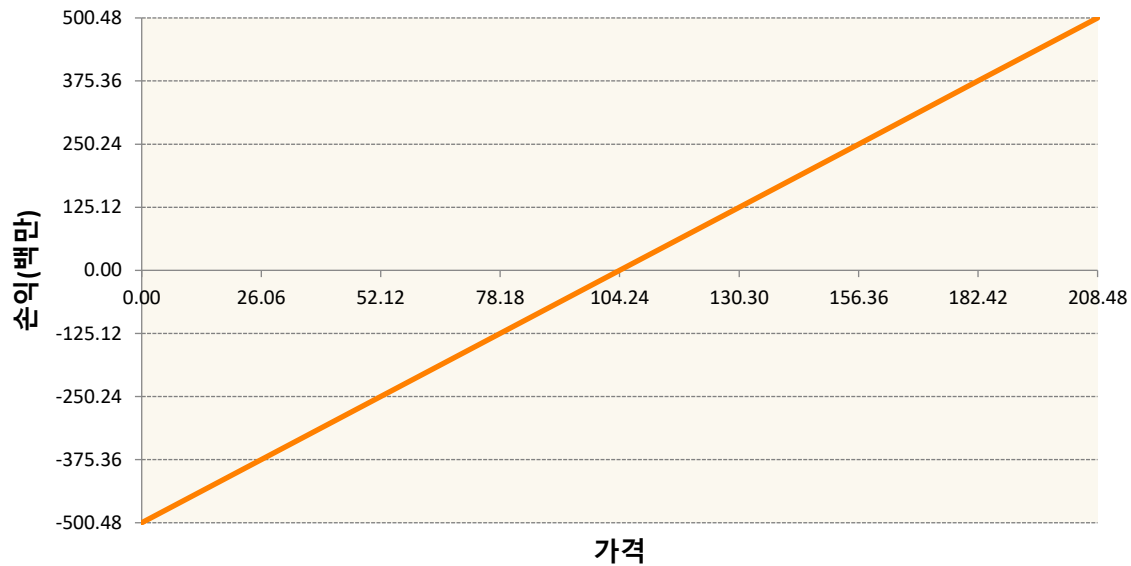
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

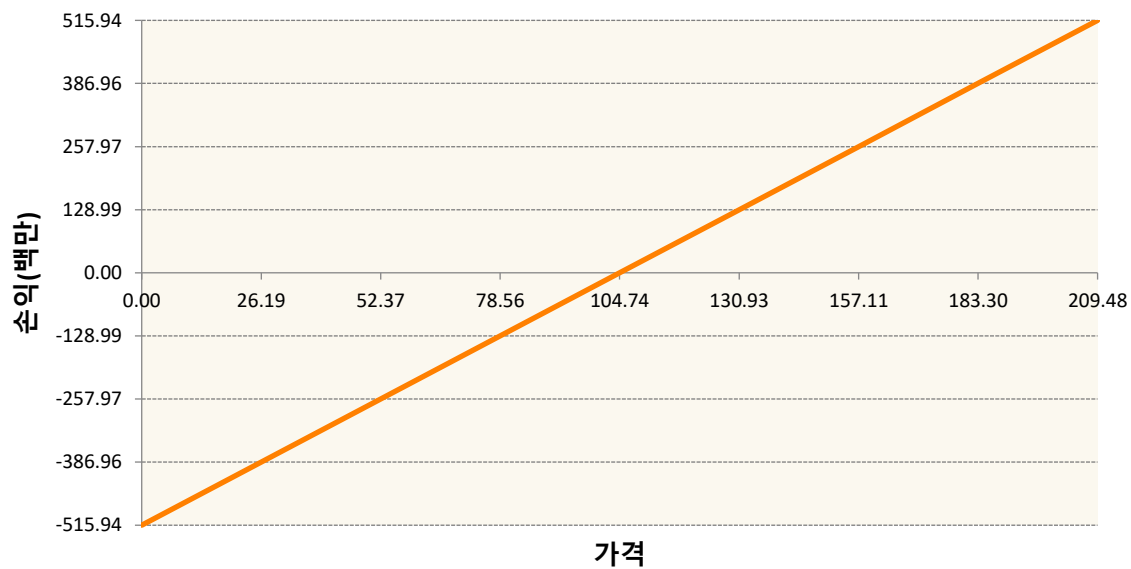
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,295 | 544   | 1,751     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

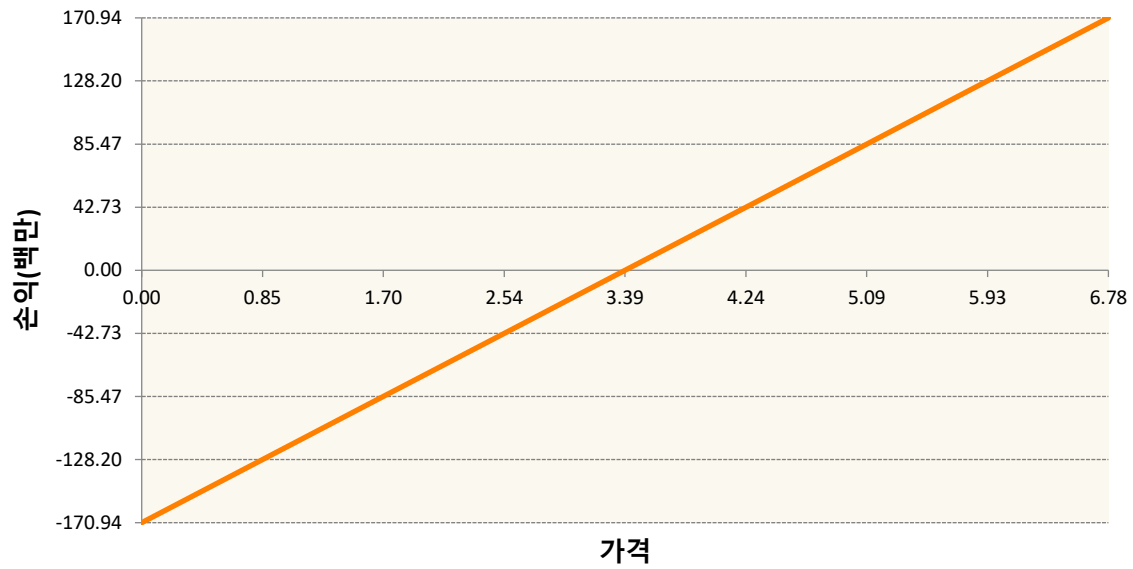
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



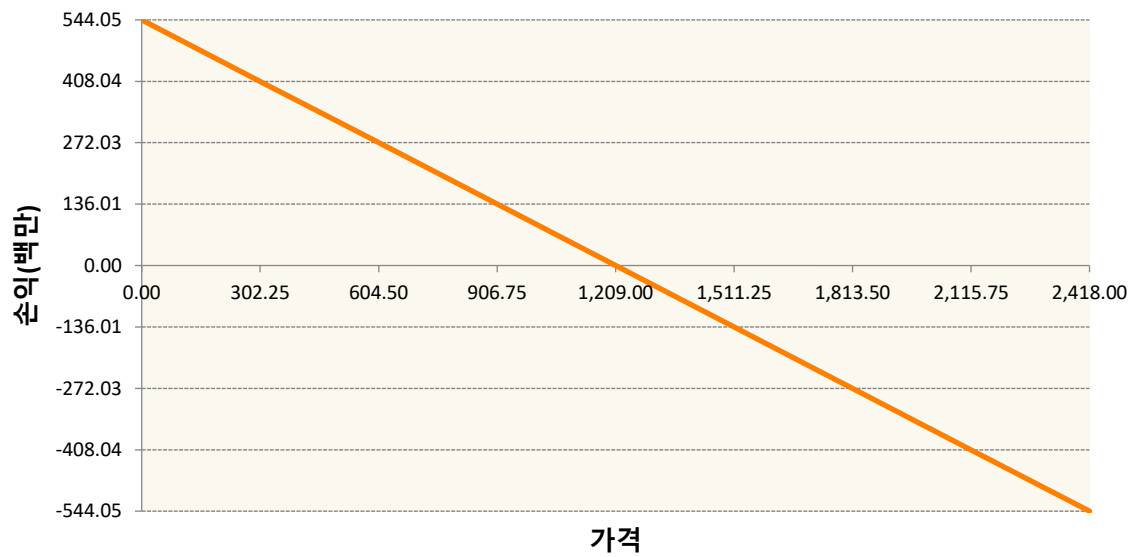
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



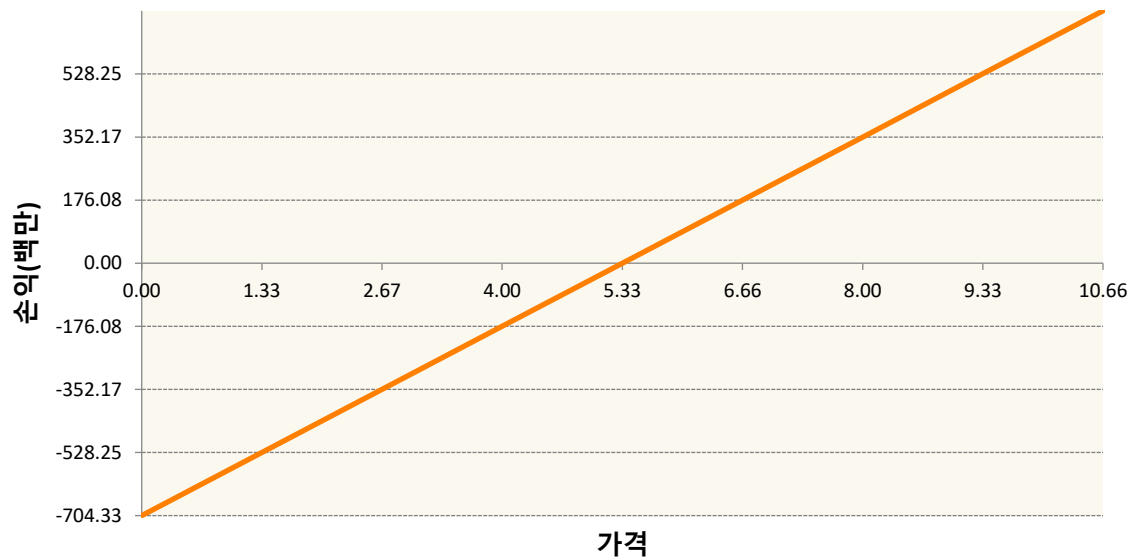
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

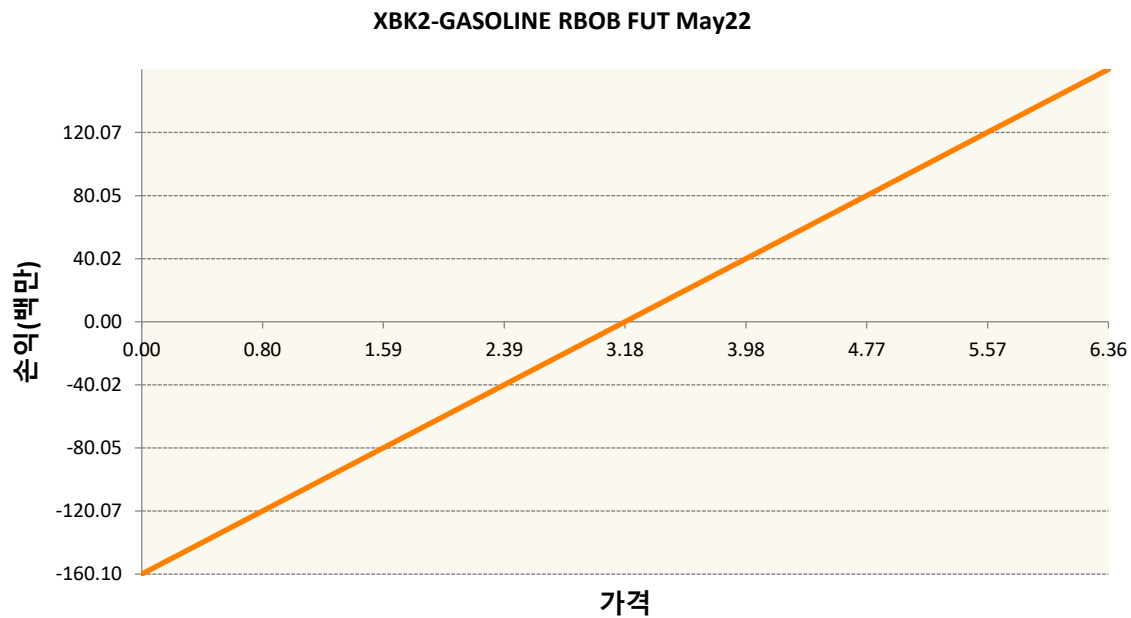
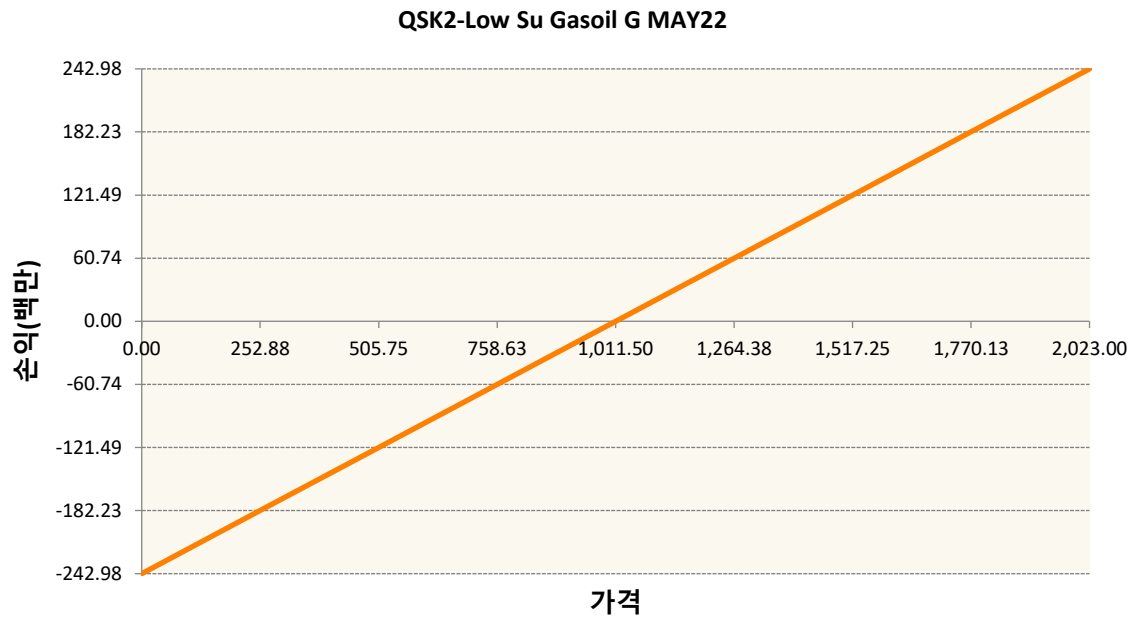


KR4175S40004-2022-04 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| CLK2                      | WTI CRUDE FUTURE May22  |  | 40       |
| CON2                      | BRENT CRUDE FUTR Jul22  |  | 41       |
| HOK2                      | NY Harb ULSD Fut May22  |  | 14       |
| KR4175S400 2022-04 달러선물   |                         |  | 44       |
| NGK22                     | NATURAL GAS FUTR May22  |  | 56       |
| QSK2                      | Low Su Gasoil G MAY22   |  | 19       |
| XBK2                      | GASOLINE RBOB FUT May22 |  | 13       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 509      |