

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 포커스농산물모(채권-파생형)

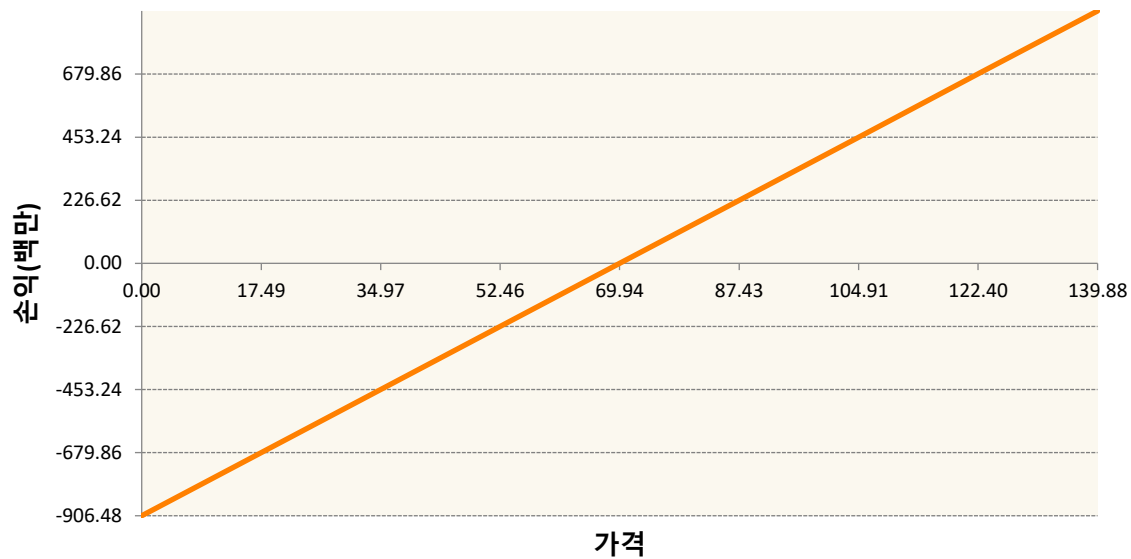
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

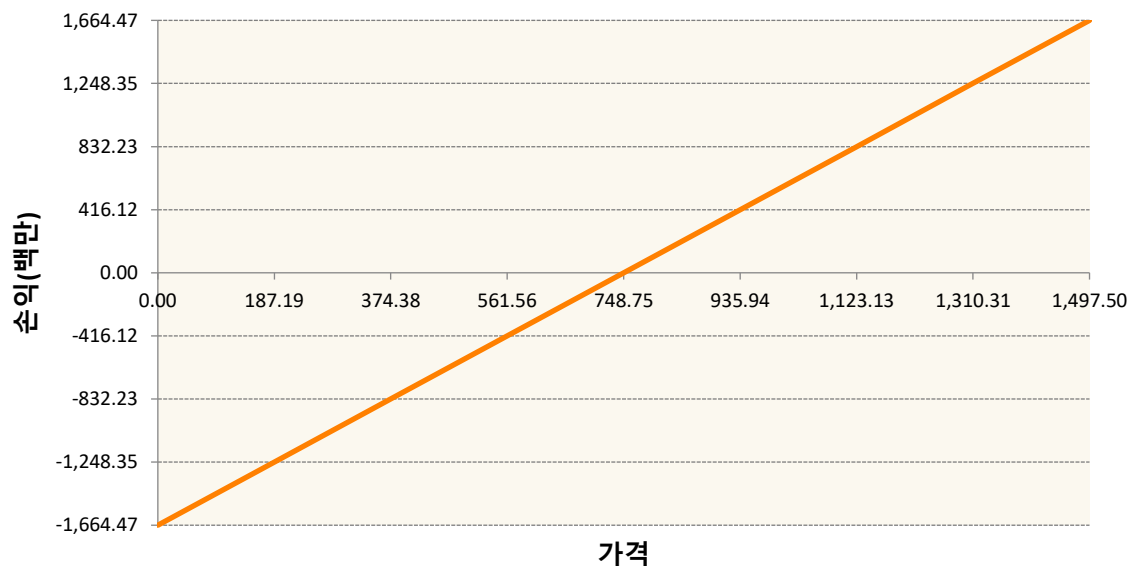
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,363 | 1,702 | 6,661     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

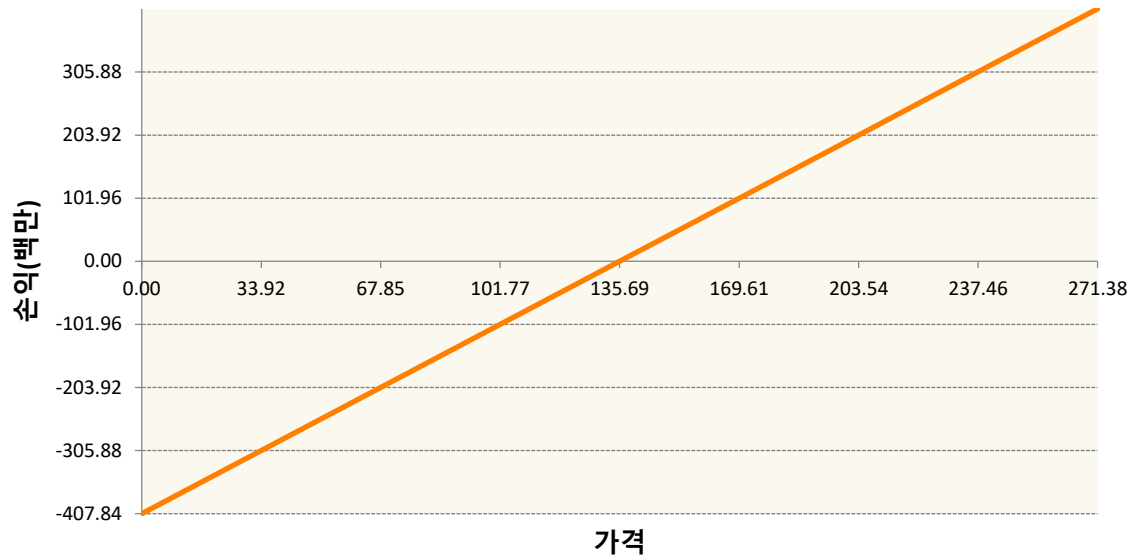
BOK2-SOYBEAN OIL FUTR May22



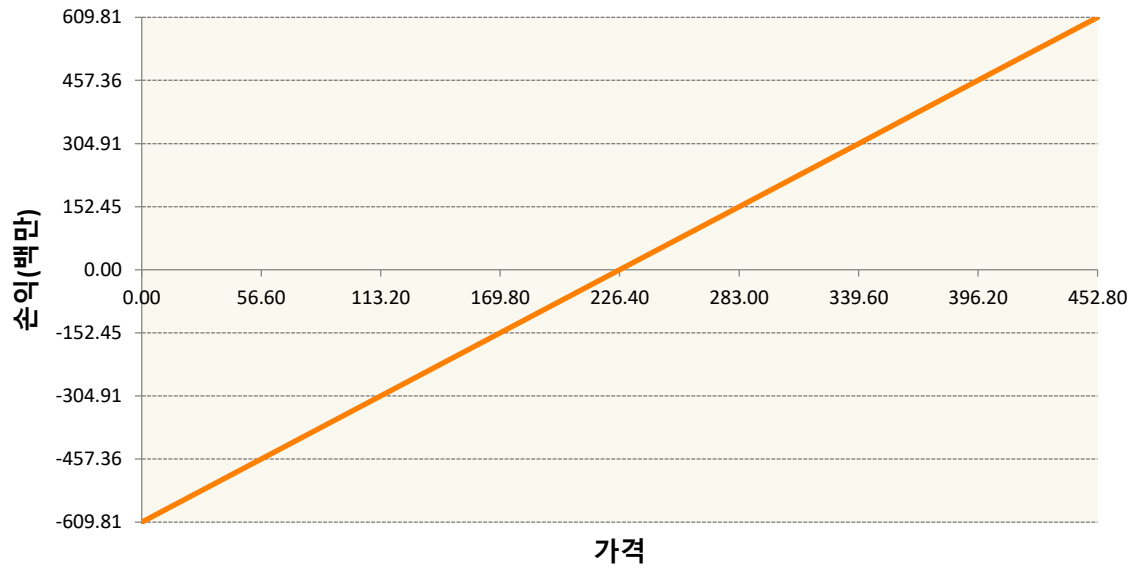
CK2-CORN FUTURE May22



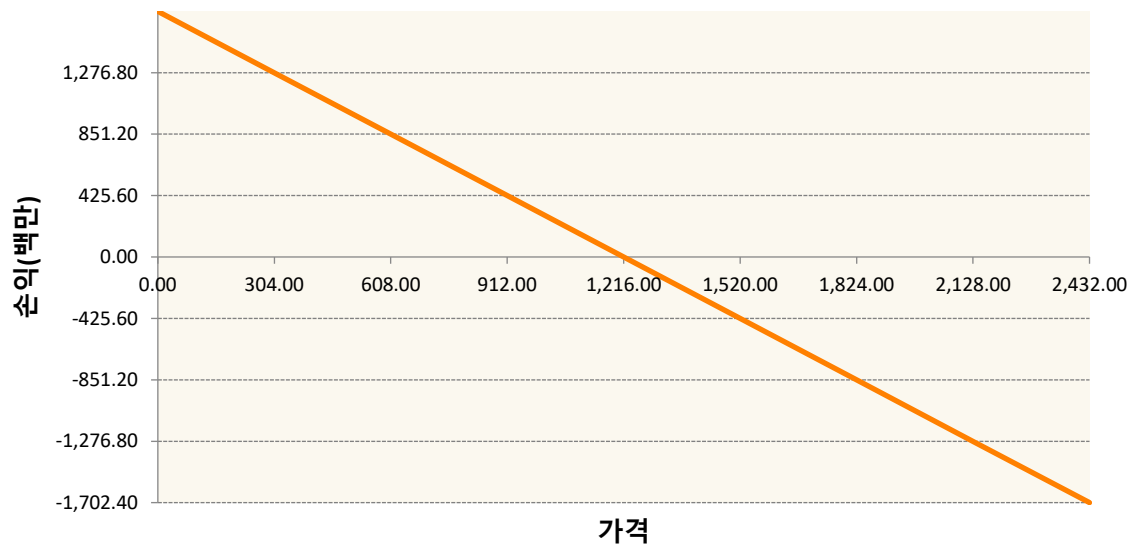
CTK2-COTTON NO.2 FUTR May22



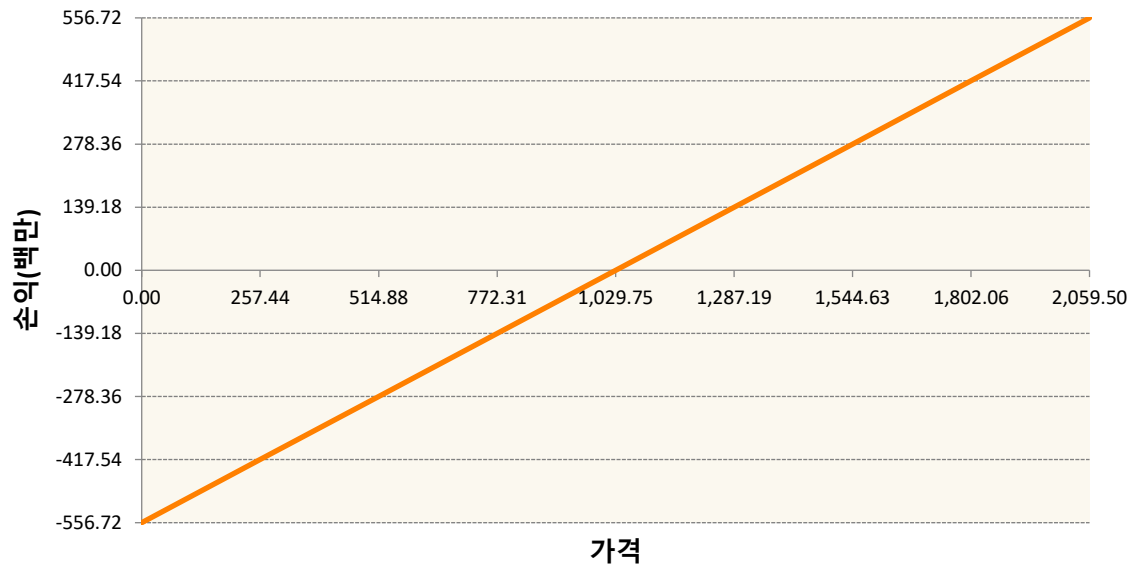
KCK2-COFFEE 'C' FUTURE May22



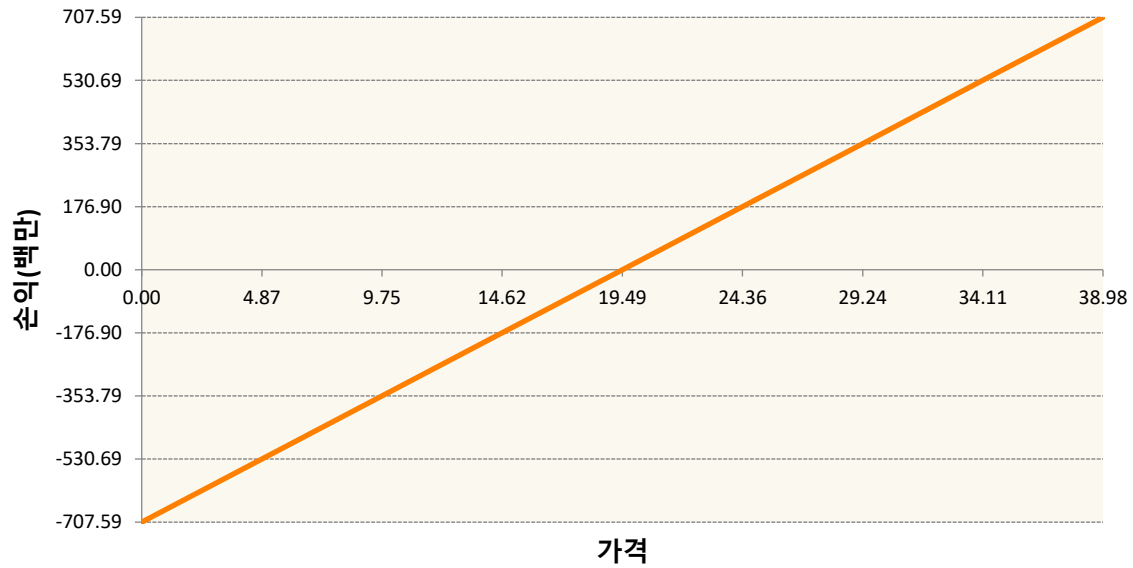
KR4175S40004-2022-04 달러선물



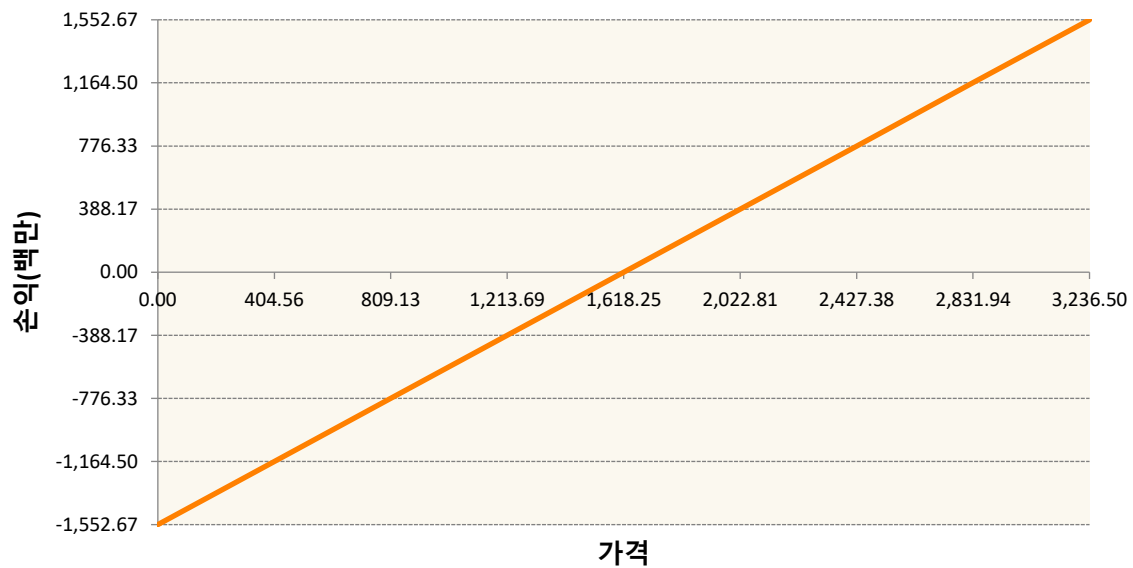
KWK2-KC HRW WHEAT FUT May22



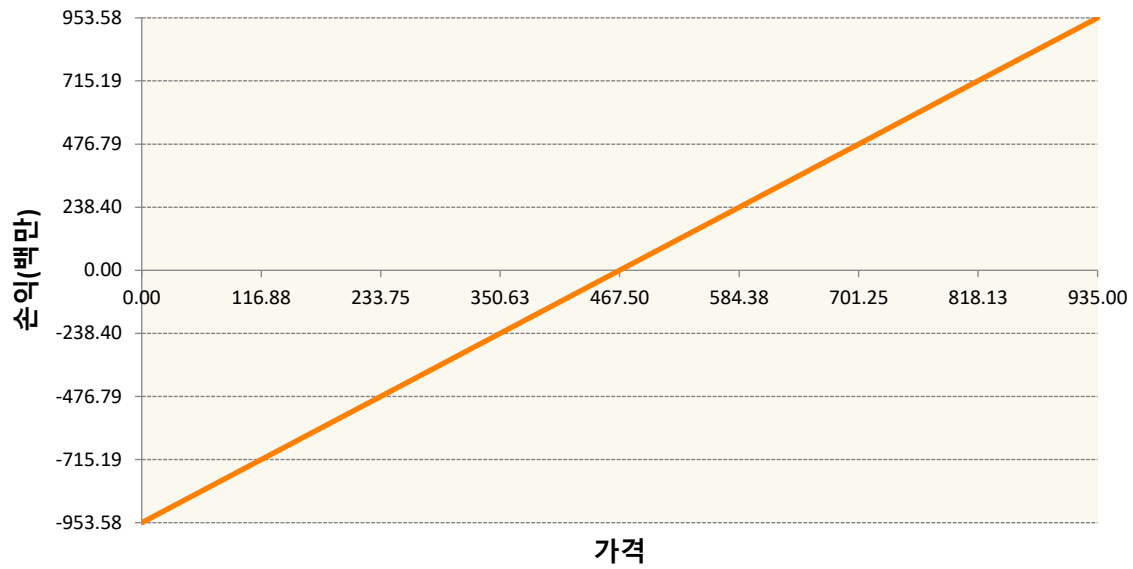
SBK2-Sugar May22



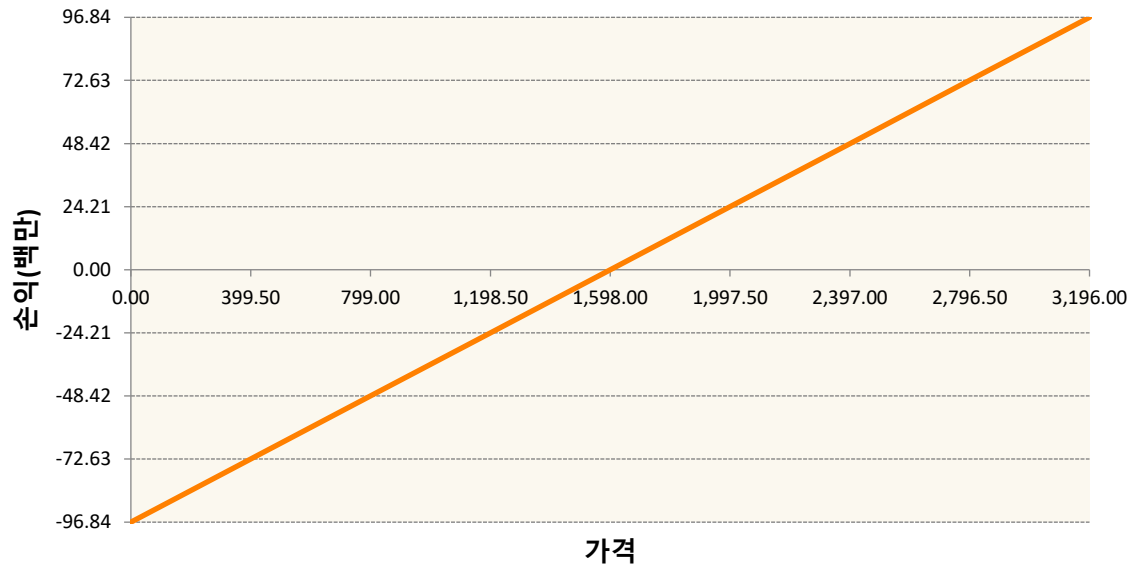
SK2-SOYBEAN FUTURE May22



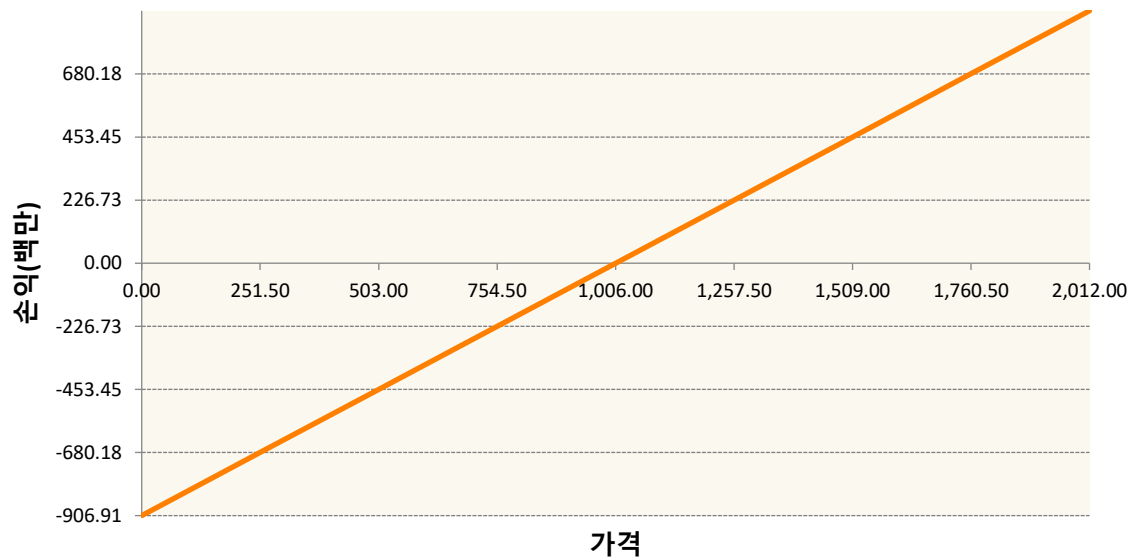
SMK2-SOYBEAN MEAL FUTR May22



SN2-SOYBEAN FUTURE Jul22



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 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 스마트인덱스모

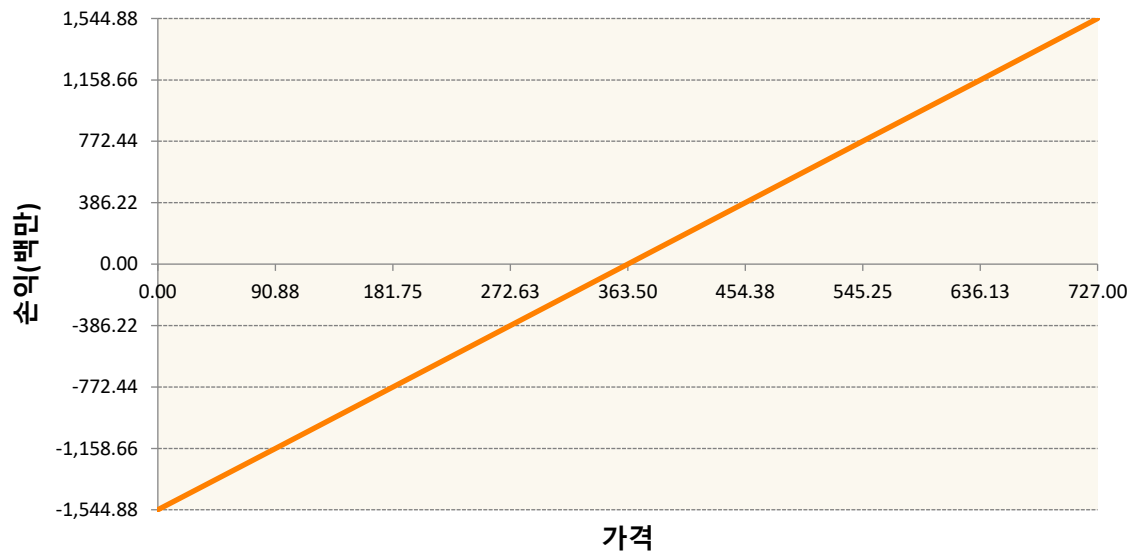
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,545 | 0     | 1,545     | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008

2022-06 코스피200지수선물

123

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -123    | -123    | -123   | -123 | -123  | -123   | -123   |
| -5.33%    | -82     | -82     | -82    | -82  | -82   | -82    | -82    |
| -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%     | 82      | 82      | 82     | 82   | 82    | 82     | 82     |
| 8.00%     | 123     | 123     | 123    | 123  | 123   | 123    | 123    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-04 |
| 기준일 | 2022-04-01 |

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

146

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

92

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-04 |
| 기준일 | 2022-04-01 |

## 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

392

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

402

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 유로인덱스모(주식-파생형)

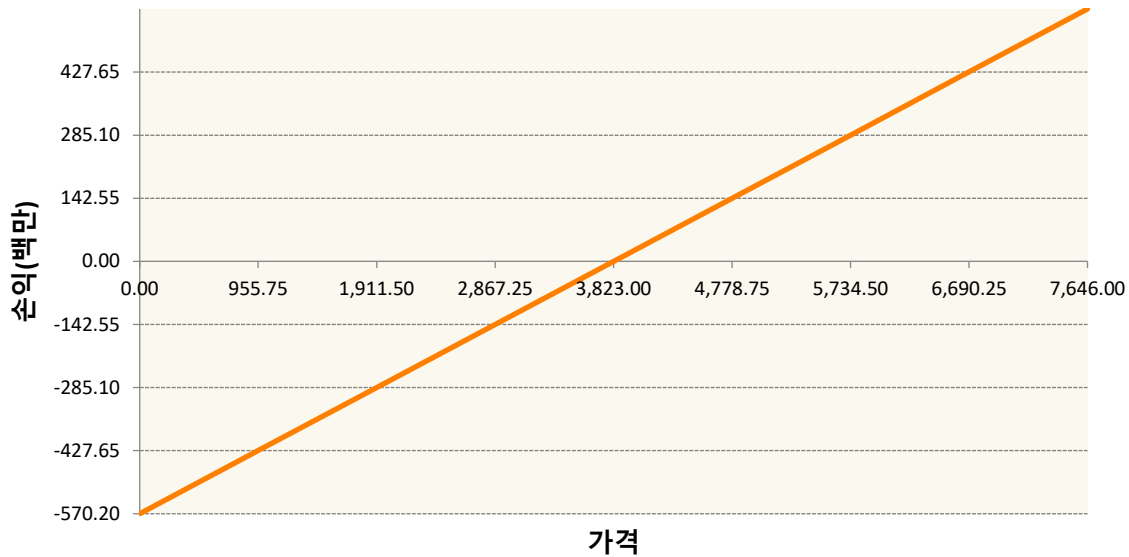
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 570   | 0     | 570       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

VGM2-EURO STOXX 50 Jun22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2 EURO STOXX 50 Jun22

46

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

(단위:백만원)

42

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

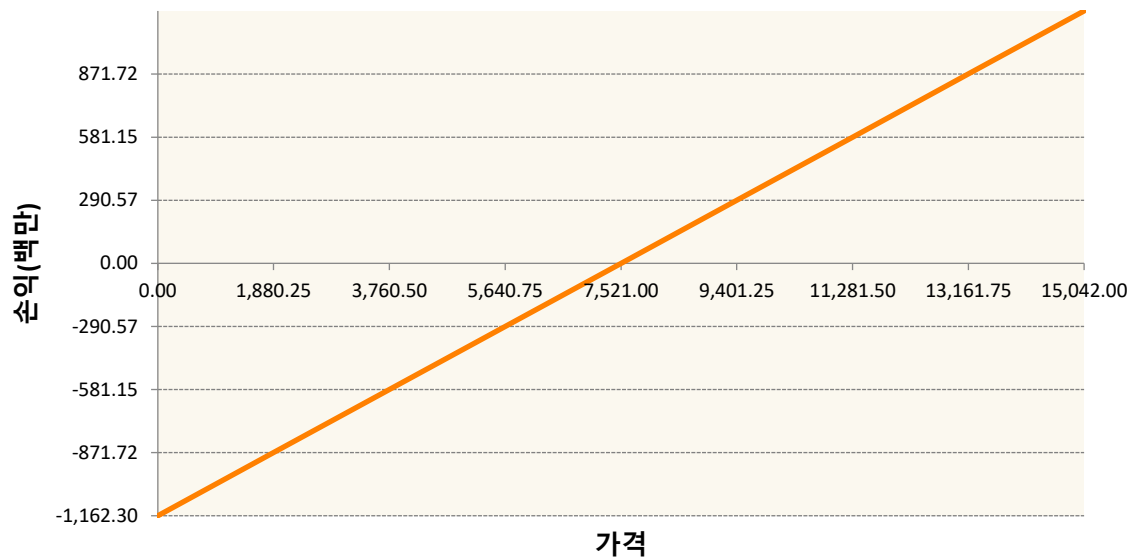
### 1. 계약금액

(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

HCJ2-HSCEI Futures Apr22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCJ2 | HSCEI Futures Apr22 | 93 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

124

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

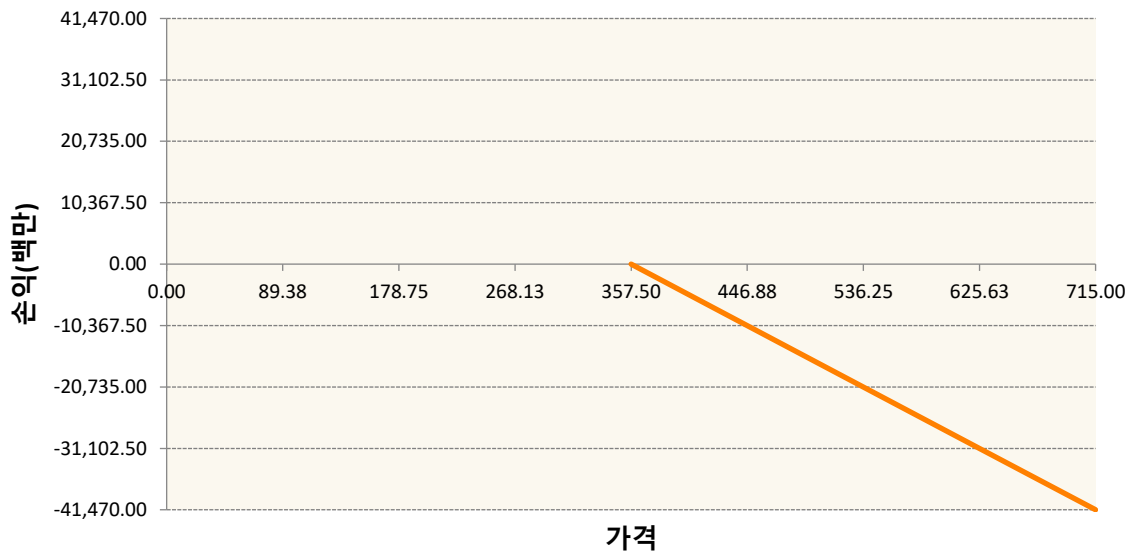
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

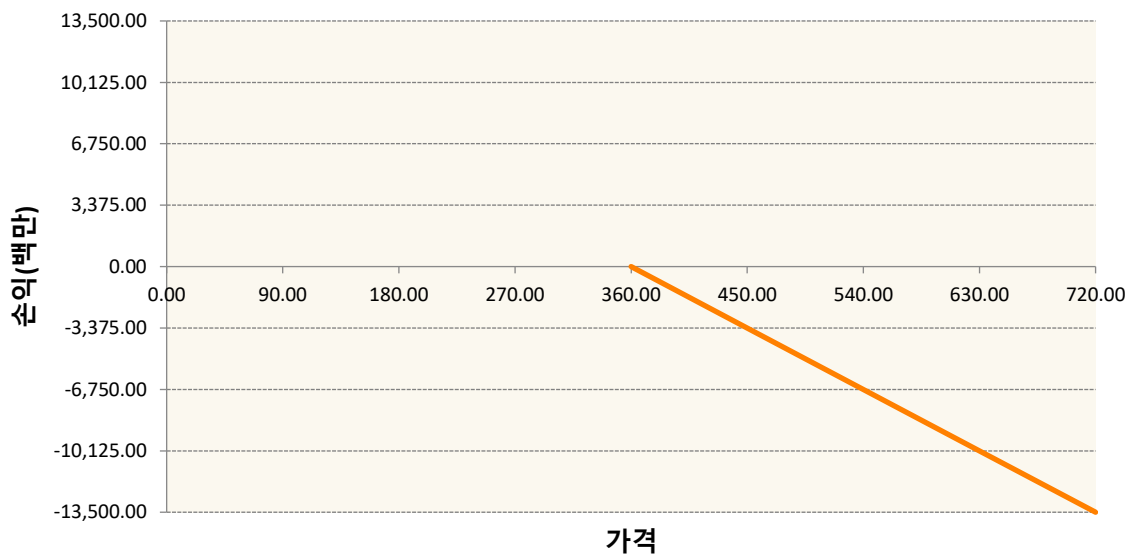
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 66,410 | -66,410   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

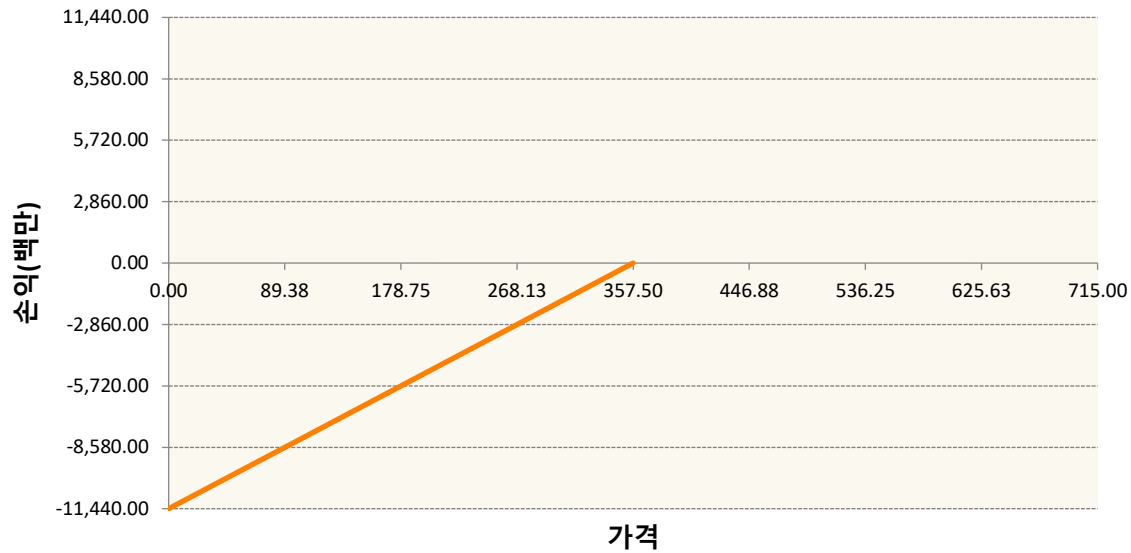
KR4201S43572-2022-04 콜357.5



KR4201S43606-2022-04 콜360



KR4301S43570-2022-04 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |         |                |        |        |        |        |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
| KR4201S43572 |           |         | 2022-04 콜357.5 |        |        |        | 2,861  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 1,257     | 1,234   | 1,206          | 1,173  | 1,135  | 1,094  | 1,049  |
| -5.33%       | 1,134     | 1,084   | 1,029          | 972    | 912    | 850    | 786    |
| -2.67%       | 815       | 741     | 667            | 592    | 517    | 442    | 367    |
| 0%           | 220       | 147     | 74             | 0      | -75    | -149   | -225   |
| 2.67%        | -632      | -682    | -736           | -793   | -853   | -916   | -980   |
| 5.33%        | -1,649    | -1,674  | -1,704         | -1,739 | -1,779 | -1,824 | -1,871 |
| 8.00%        | -2,741    | -2,749  | -2,763         | -2,780 | -2,803 | -2,830 | -2,861 |
| KR4201S43606 |           |         | 2022-04 콜360   |        |        |        | 895    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 356       | 351     | 343            | 334    | 324    | 312    | 299    |
| -5.33%       | 327       | 313     | 297            | 280    | 262    | 244    | 224    |
| -2.67%       | 243       | 220     | 197            | 173    | 150    | 126    | 102    |
| 0%           | 74        | 49      | 25             | 0      | -25    | -50    | -75    |
| 2.67%        | -182      | -200    | -220           | -240   | -262   | -283   | -305   |
| 5.33%        | -500      | -509    | -521           | -535   | -550   | -566   | -583   |
| 8.00%        | -848      | -852    | -857           | -865   | -873   | -884   | -895   |
| KR4301S43570 |           |         | 2022-04 풋357.5 |        |        |        | 678    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -669      | -669    | -670           | -671   | -673   | -675   | -678   |
| -5.33%       | -366      | -370    | -375           | -381   | -387   | -395   | -402   |
| -2.67%       | -109      | -121    | -133           | -145   | -156   | -169   | -181   |
| 0%           | 33        | 22      | 11             | 0      | -12    | -23    | -35    |



공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

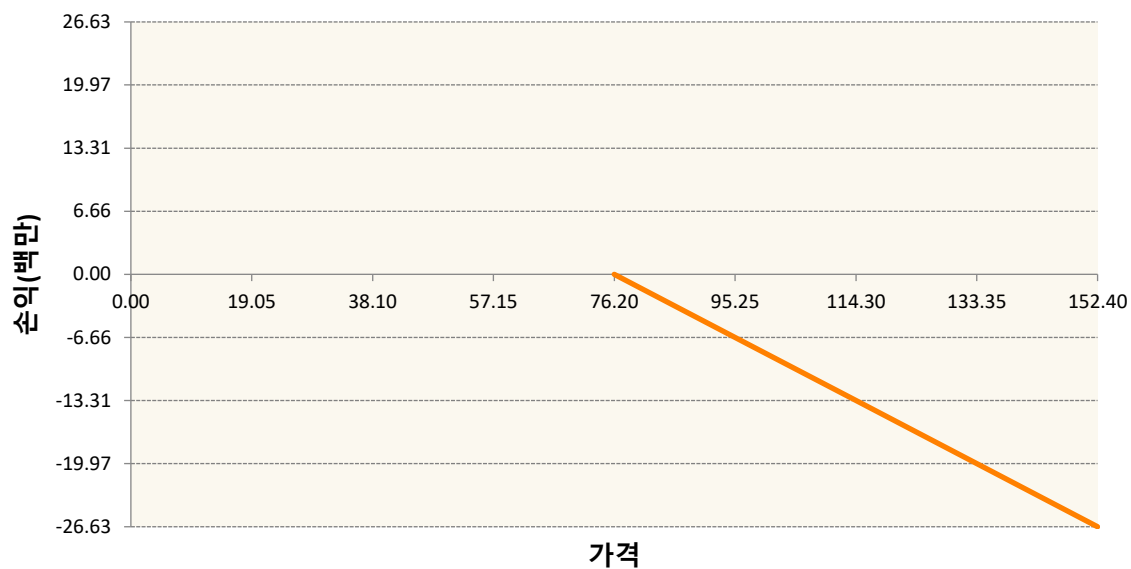
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

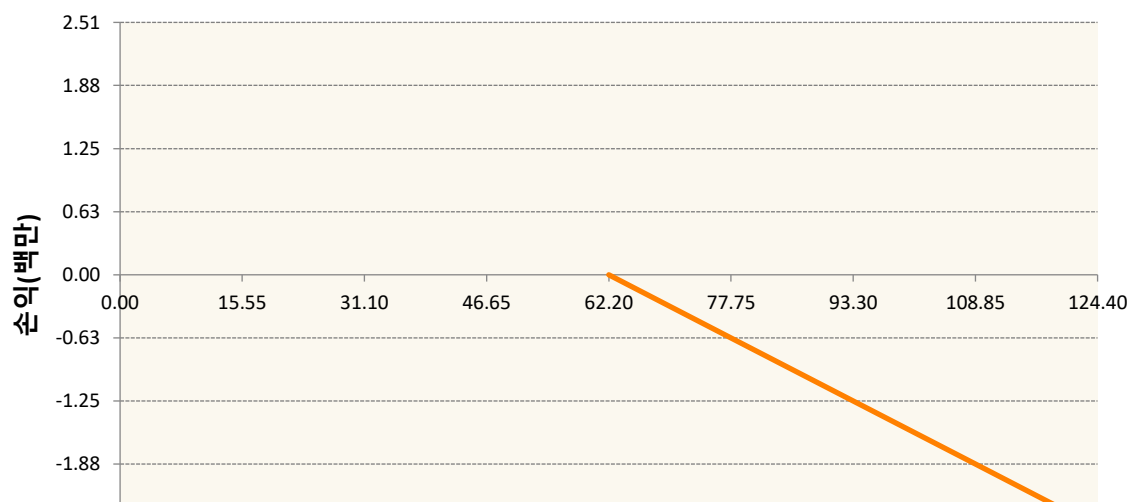
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 59    | -59       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,016 | -2,016    | 장외 |

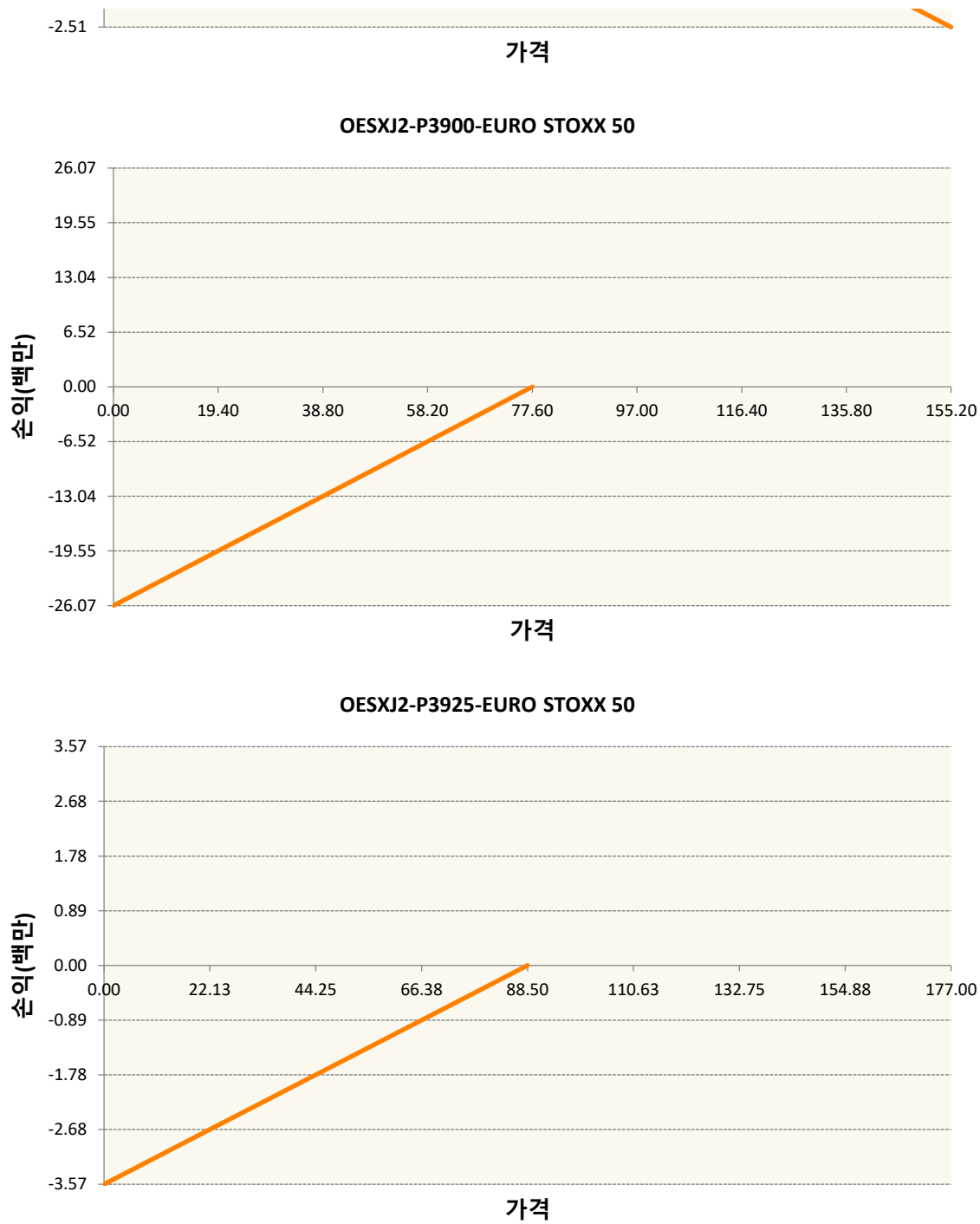
### 2. 만기시점의 손익구조

OESXJ2-C3900-EURO STOXX 50



OESXJ2-C3925-EURO STOXX 50





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY  
 FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E  
 FXW213C2F KRW/EUR 22-04-22E  
 FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E  
 FXW213C3A KRW/EUR 22-04-22E  
 OESXJ2-C39( EURO STOXX 50  
 OESXJ2-C39( EURO STOXX 50  
 OESXJ2-P39( EURO STOXX 50  
 OESXJ2-P39( EURO STOXX 50

|      |
|------|
| 10   |
| 22   |
| 32   |
| 65   |
| 43   |
| 2    |
| 0.2  |
| 2    |
| 0.29 |

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

(단위:백만원)

102

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

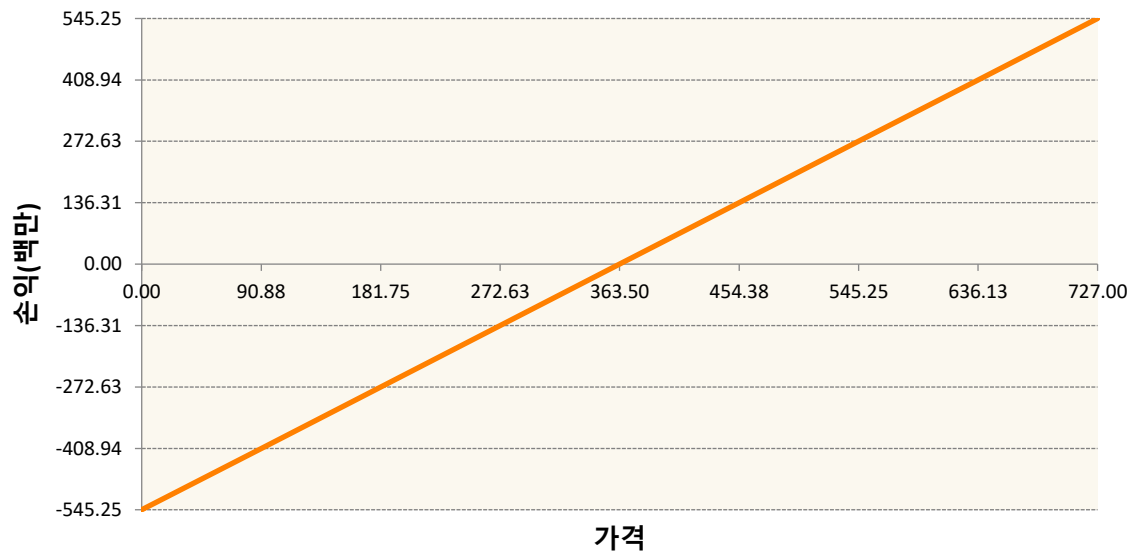
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

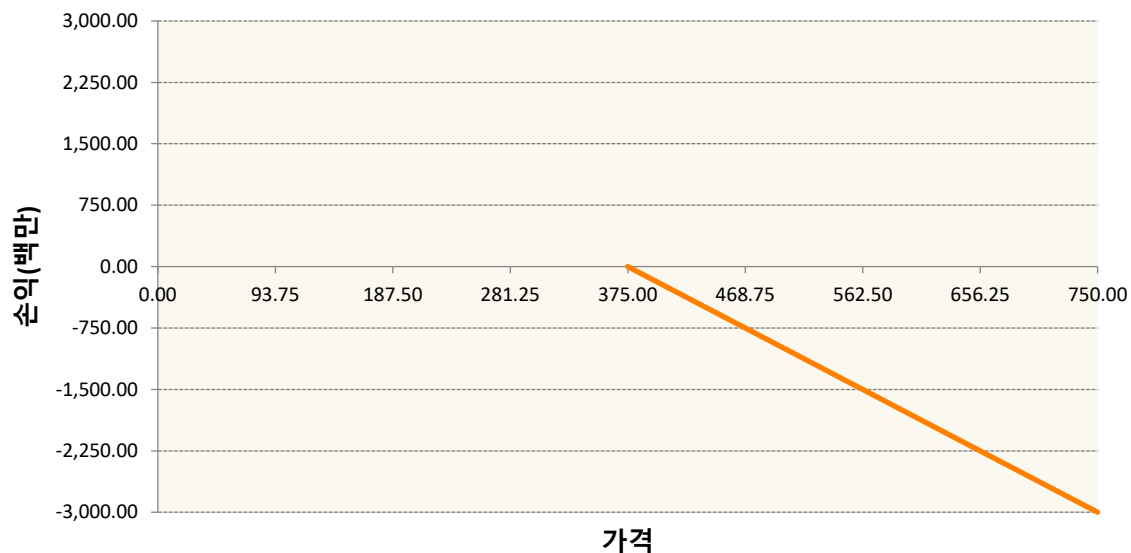
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 545   | 0     | 545       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 358   | 4,699 | -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. An orange 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 the price (가액) and the net income (순익). The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 715.00. The y-axis represents the net income, ranging from -357.50 to 357.50. A solid orange line shows that as the price increases, the net income decreases linearly, starting at 357.50 million when the price is 0.00 and reaching 0.00 million when the price is 357.50.

| 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 |       |        |        | 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       |       |        |        | 142 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |

| 가격                                               | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------------------------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%                                           | 29      | 29      | 28     | 28   | 27    | 26     | 25     |
| -5.33%                                           | 28      | 27      | 26     | 25   | 23    | 21     | 19     |
| -2.67%                                           | 25      | 22      | 20     | 17   | 14    | 10     | 7      |
| 0%                                               | 13      | 9       | 5      | 0    | -5    | -9     | -14    |
| 2.67%                                            | -13     | -18     | -24    | -29  | -35   | -40    | -46    |
| 5.33%                                            | -57     | -62     | -68    | -73  | -78   | -83    | -89    |
| 8.00%                                            | -118    | -122    | -125   | -129 | -133  | -138   | -142   |
| KR4201S43770                      2022-04 콜377.5 |         |         |        |      |       |        | 75     |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 13      | 13      | 13     | 13  | 13    | 12     | 12     |
| -5.33%    | 13      | 13      | 12     | 12  | 11    | 10     | 9      |
| -2.67%    | 12      | 11      | 9      | 8   | 6     | 5      | 3      |
| 0%        | 7       | 5       | 2      | 0   | -2    | -5     | -8     |
| 2.67%     | -6      | -9      | -12    | -15 | -18   | -21    | -24    |
| 5.33%     | -28     | -31     | -34    | -37 | -40   | -43    | -46    |
| 8.00%     | -60     | -62     | -64    | -67 | -70   | -72    | -75    |

| KR4301S43570                      2022-04 풋357.5 |         |         |        |    |       |        | 21     |
|--------------------------------------------------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                                        |         |         |        |    |       |        |        |
| 가격                                               | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                                           | 21      | 21      | 21     | 21 | 21    | 21     | 21     |
| -5.33%                                           | 11      | 12      | 12     | 12 | 12    | 12     | 13     |
| -2.67%                                           | 3       | 4       | 4      | 5  | 5     | 5      | 6      |
| 0%                                               | -1      | -1      | 0      | 0  | 0     | 1      | 1      |
| 2.67%                                            | -2      | -2      | -2     | -2 | -2    | -1     | -1     |
| 5.33%                                            | -2      | -2      | -2     | -2 | -2    | -2     | -2     |
| 8.00%                                            | -2      | -2      | -2     | -2 | -2    | -2     | -2     |

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

(단위:백만원)

239

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-04 |
| 기준일 | 2022-04-01 |

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 | 9,550 | 0     | 9,550     |    |

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 | 2022-04-04 |
| 기준일 | 2022-04-01 |

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 162   | -162      |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 7,545 | 0     | 7,545     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-04 |
| 기준일 | 2022-04-01 |

## 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 | 26,071 | 0      | 26,071    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,702  | 27,628 | -25,927   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |                                 |
|-----------------------------|---------------------------------|
| FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E | 2,210                           |
| FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E | 39                              |
| FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E | 97                              |
| IE00BD8RGM75                | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

789

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

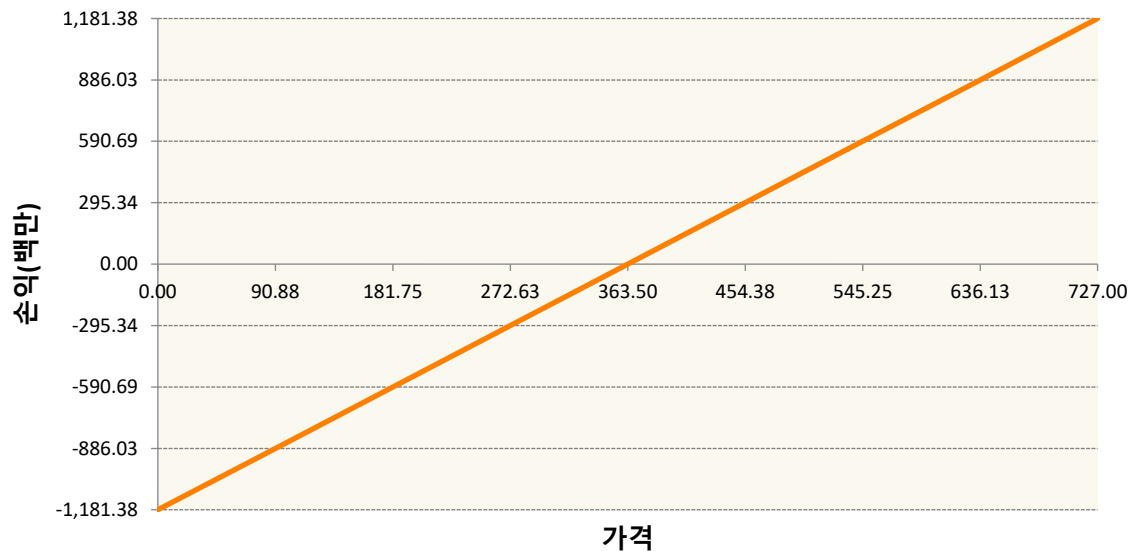
## 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,181 | 0     | 1,181     | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S60008

2022-06 코스피200지수선물

94

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -94     | -94     | -94    | -94 | -94   | -94    | -94    |
| -5.33%    | -63     | -63     | -63    | -63 | -63   | -63    | -63    |
| -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%     | 63      | 63      | 63     | 63  | 63    | 63     | 63     |
| 8.00%     | 94      | 94      | 94     | 94  | 94    | 94     | 94     |



공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

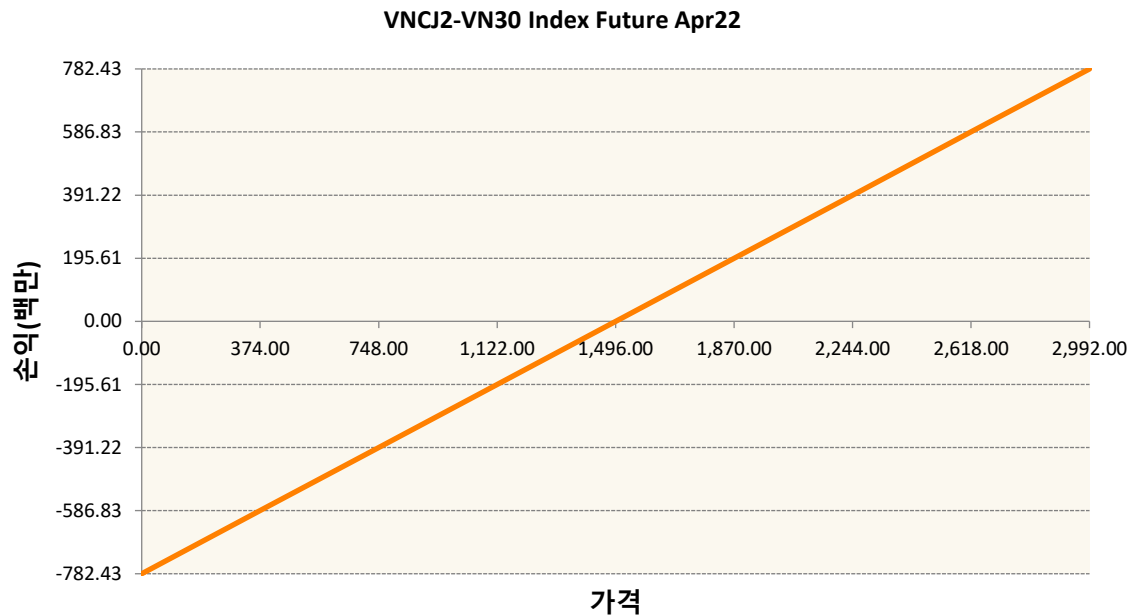
## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

### 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   | 782   | 0     | 782       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,837 | 0     | 1,837     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,183 | -1,183    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 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 | 63  |

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

(단위:백만원)

267

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

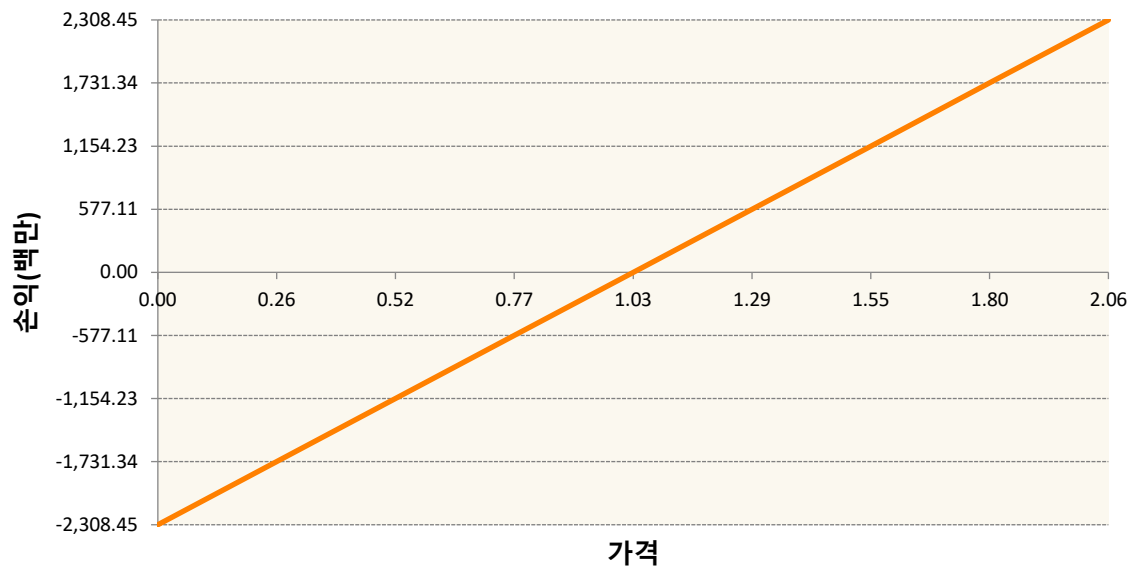
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

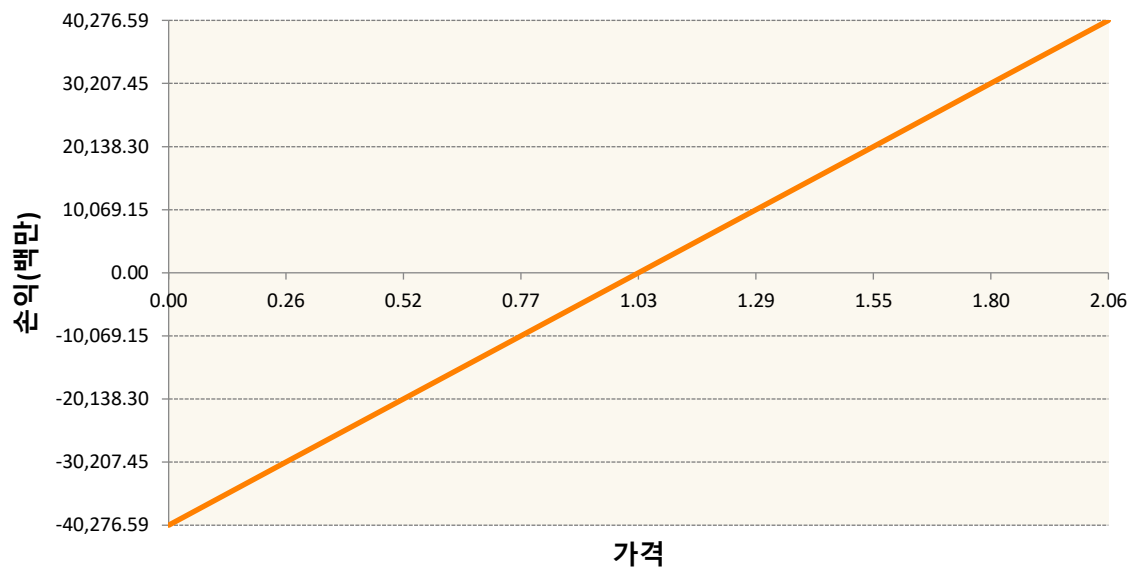
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 43,740 | 0     | 43,740    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

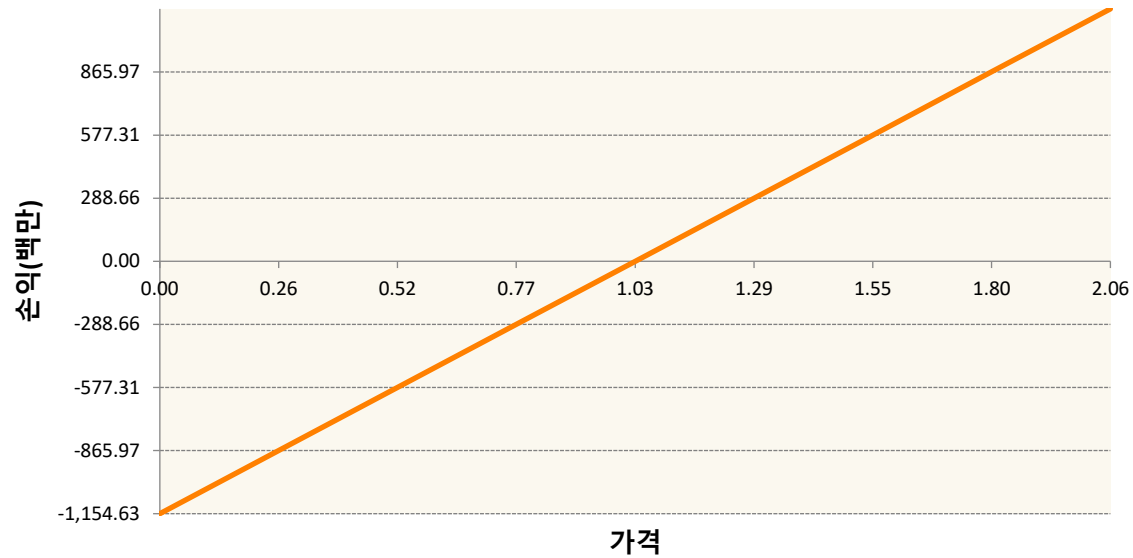
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220326-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



### 210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

185

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

3,236

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

93

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

(단위:백만원)

6,427

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

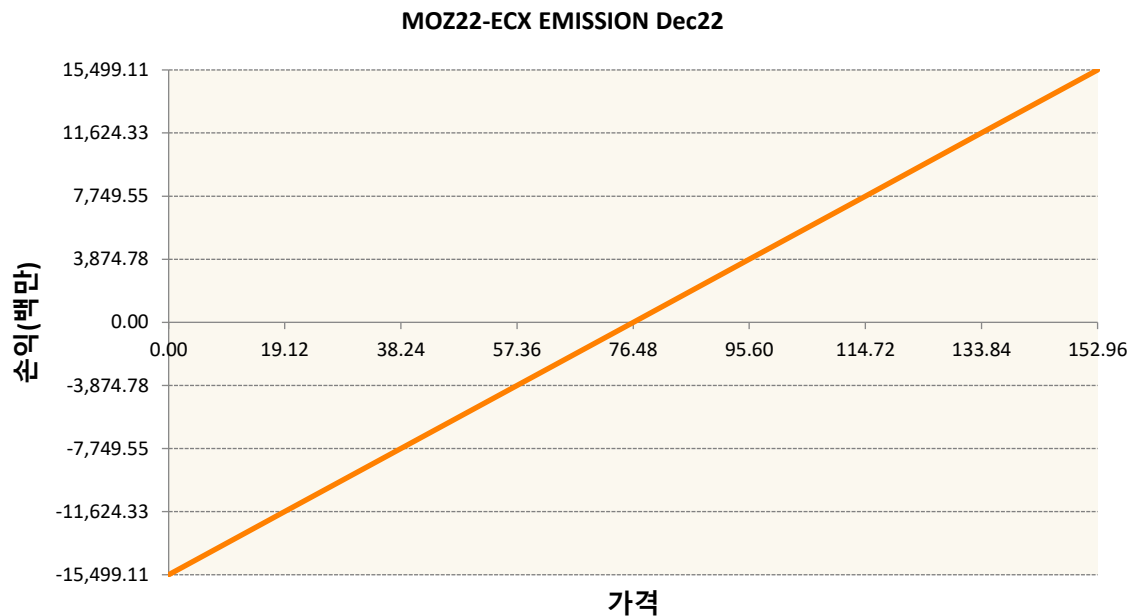
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 15,499 | 0     | 15,499    |    |
| 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

1,240

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

(단위:백만원)

3,268

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-04 |
| 기준일 | 2022-04-01 |

# 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)

130

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-04 |
| 기준일 | 2022-04-01 |

## 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)  | 29 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 34 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(메리츠) | 29 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 29 |

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

(단위:백만원)

149

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 에퀴티알파일반사모혼합자산

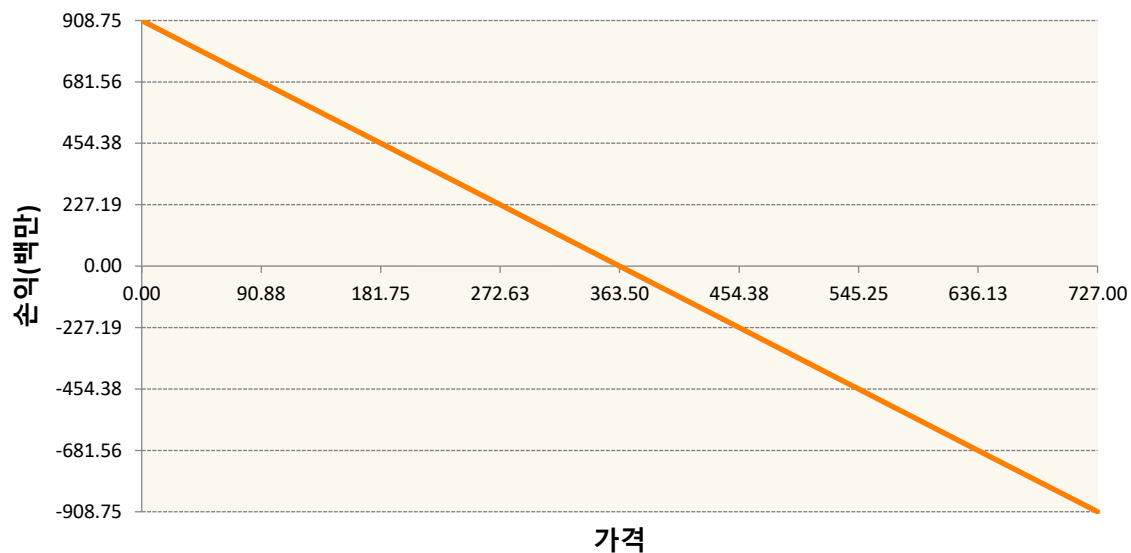
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

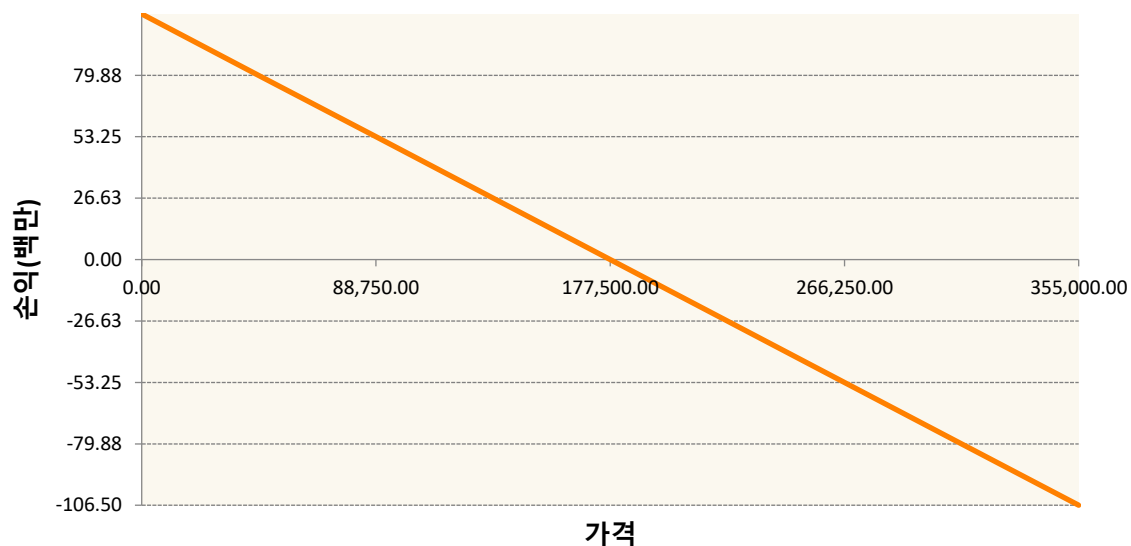
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 454   | -454      | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 1,015 | -1,015    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4116S40008-2022-04 현대차개별선물



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

|                                       |      |
|---------------------------------------|------|
| KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물         | 73   |
| KR4116S400 2022-04 현대차개별선물            | 9    |
| KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322 | 1    |
| KRS0003014 SWAP_APPLE INC_0322        | 2    |
| KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322      | 0.35 |
| KRS0003014 SWAP_TESLA INC_0322        | 3    |
| KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322 | 1    |
| KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331 | 1    |

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

**94**

공시일 2022-04-04

기준일 2022-04-01

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

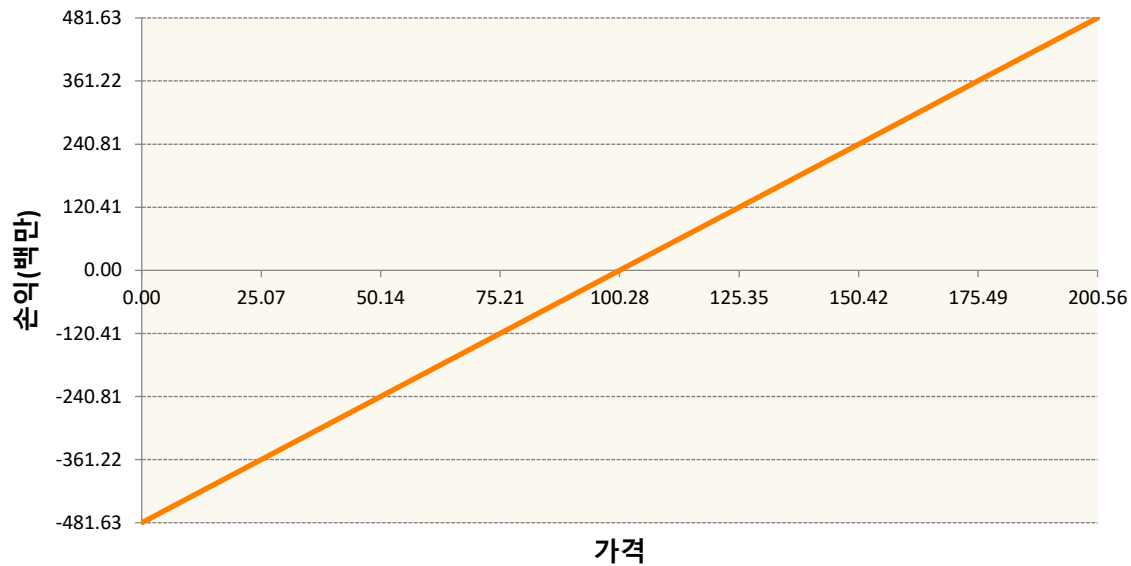
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

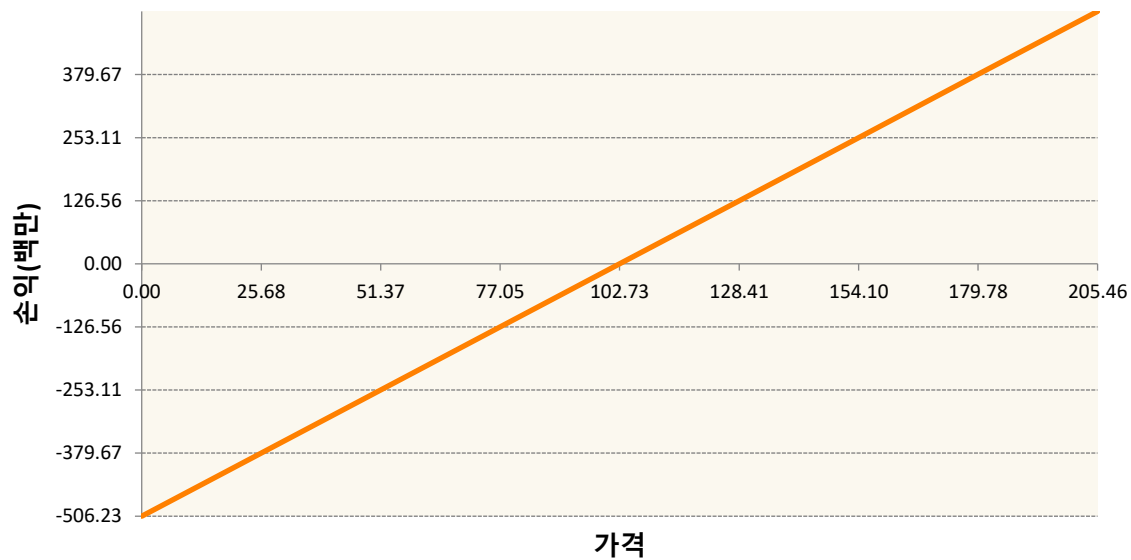
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,306 | 547   | 1,759     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

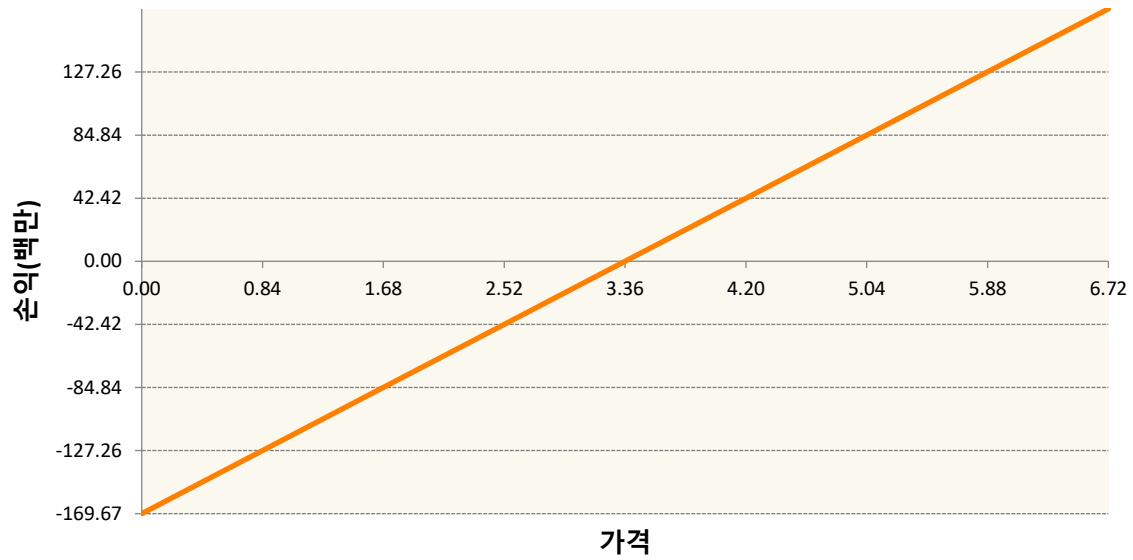
CLK2-WTI CRUDE FUTURE May22



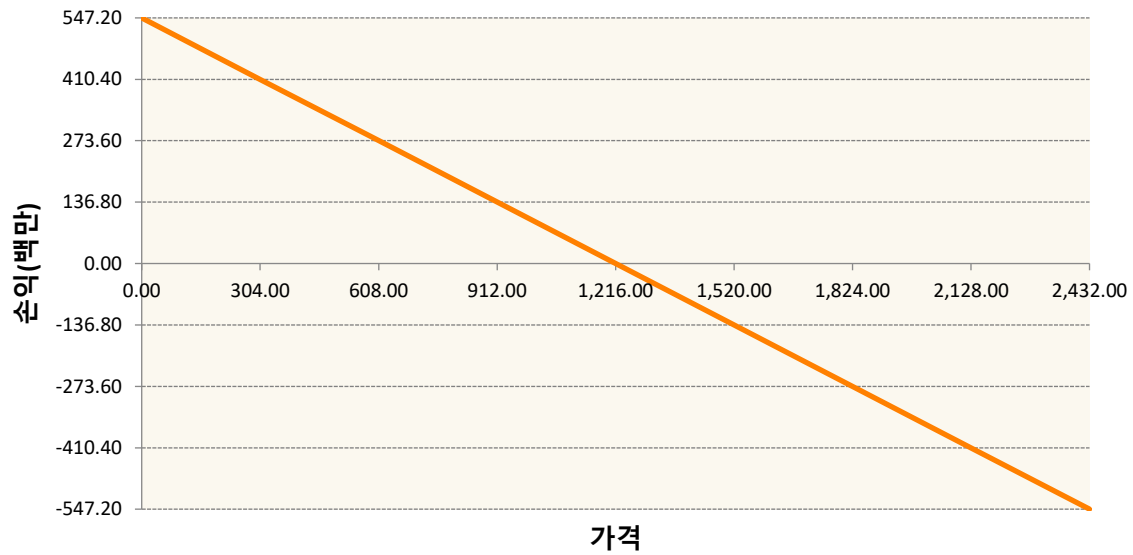
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



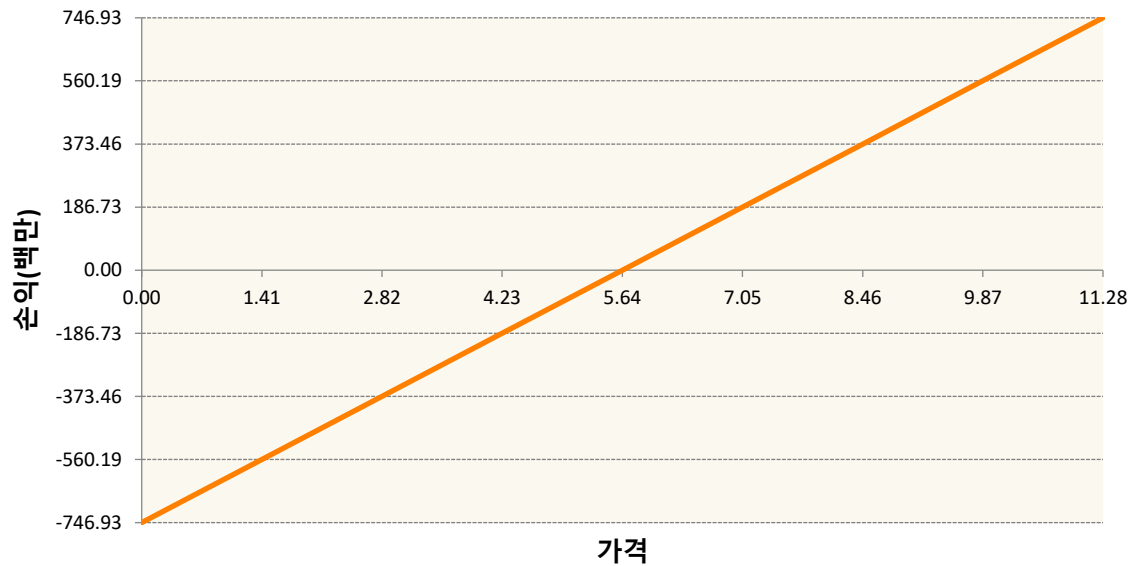
HOK2-NY Harb ULSD Fut May22

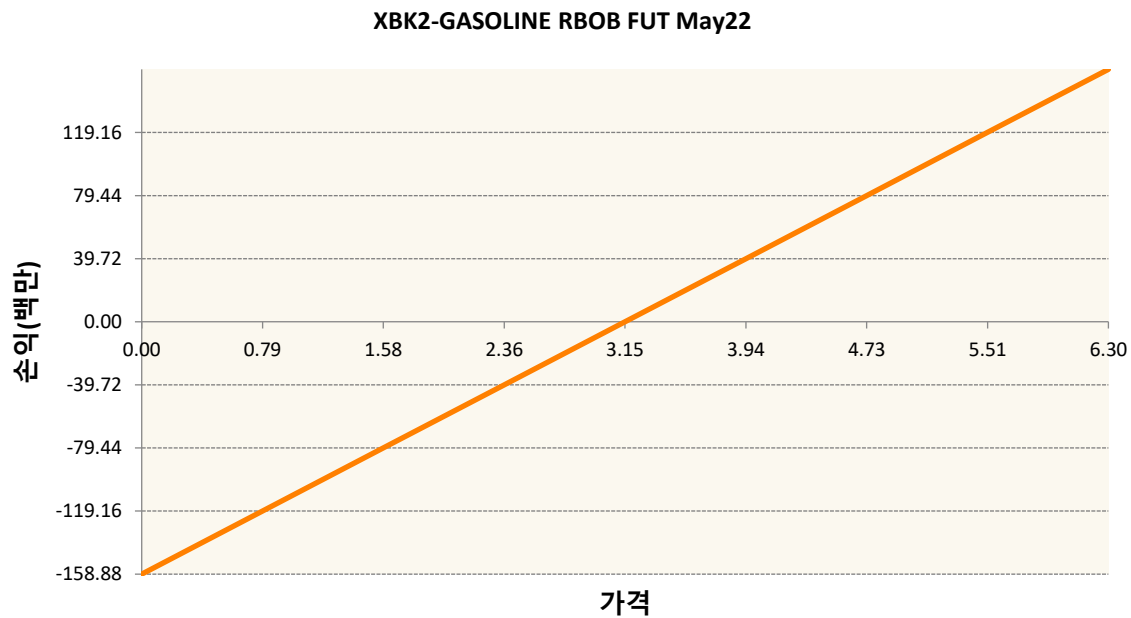
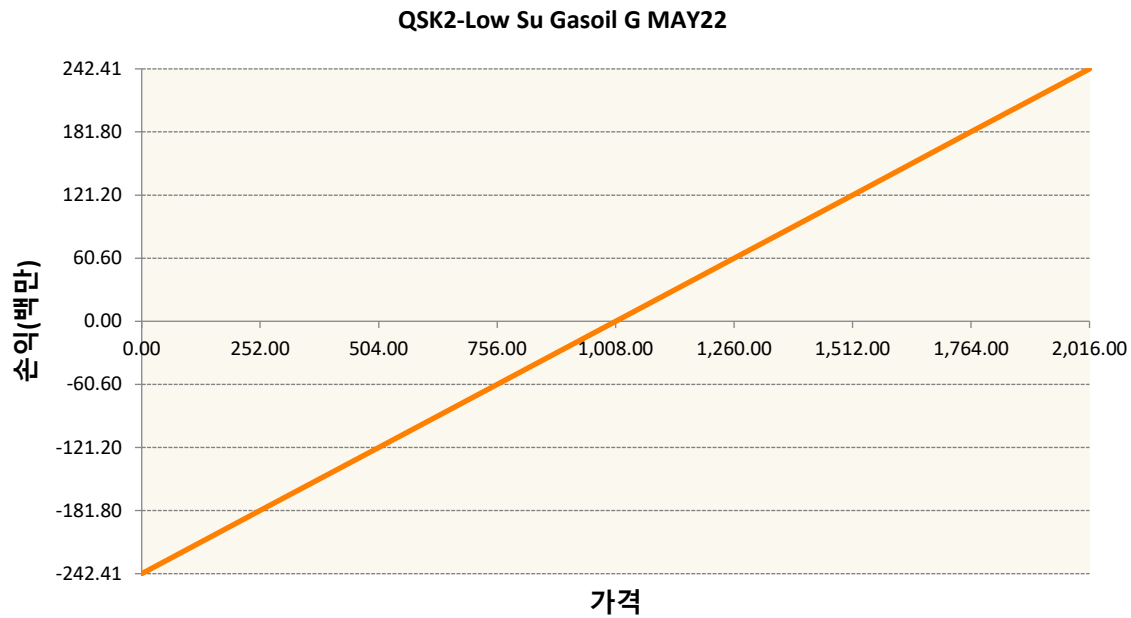


KR4175S40004-2022-04 달러선물



NGK22-NATURAL GAS FUTR May22





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| CLK2                      | WTI CRUDE FUTURE May22  |  | 39       |
| CON2                      | BRENT CRUDE FUTR Jul22  |  | 40       |
| HOK2                      | NY Harb ULSD Fut May22  |  | 14       |
| KR4175S400 2022-04 달러선물   |                         |  | 44       |
| NGK22                     | NATURAL GAS FUTR May22  |  | 60       |
| QSK2                      | Low Su Gasoil G MAY22   |  | 19       |
| XBK2                      | GASOLINE RBOB FUT May22 |  | 13       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 518      |