

공시일 2022-04-25

기준일 2022-04-22

## 포커스농산물모(채권-파생형)

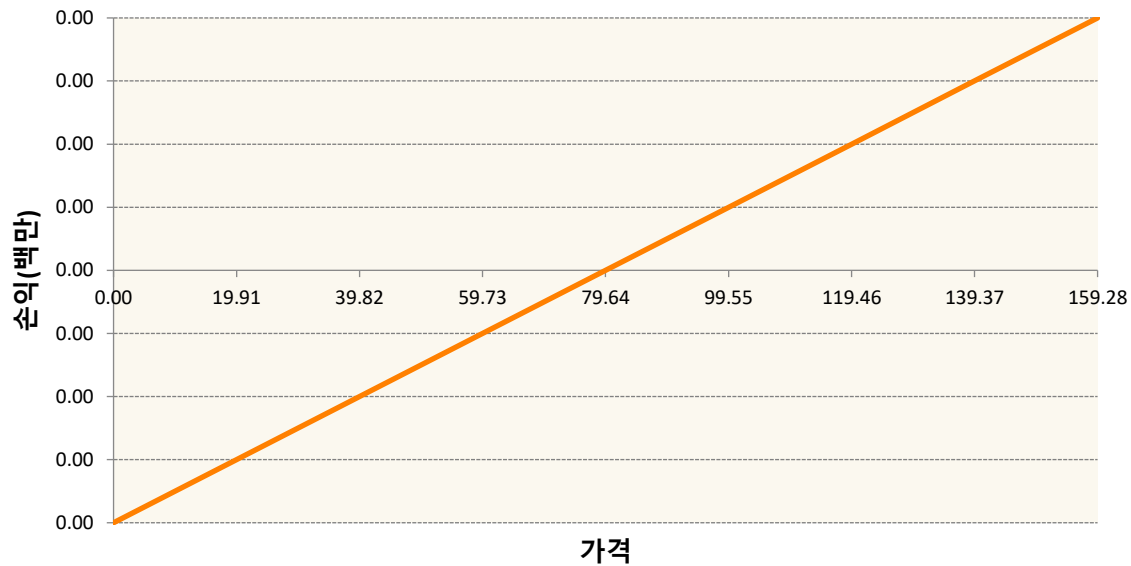
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

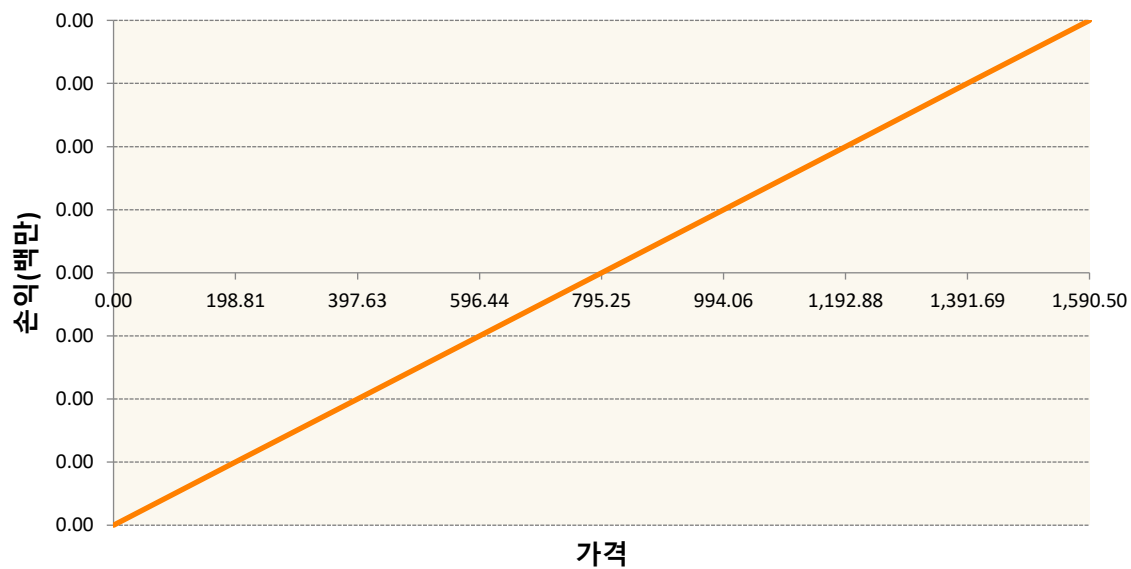
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,697 | 1,922 | 6,775     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

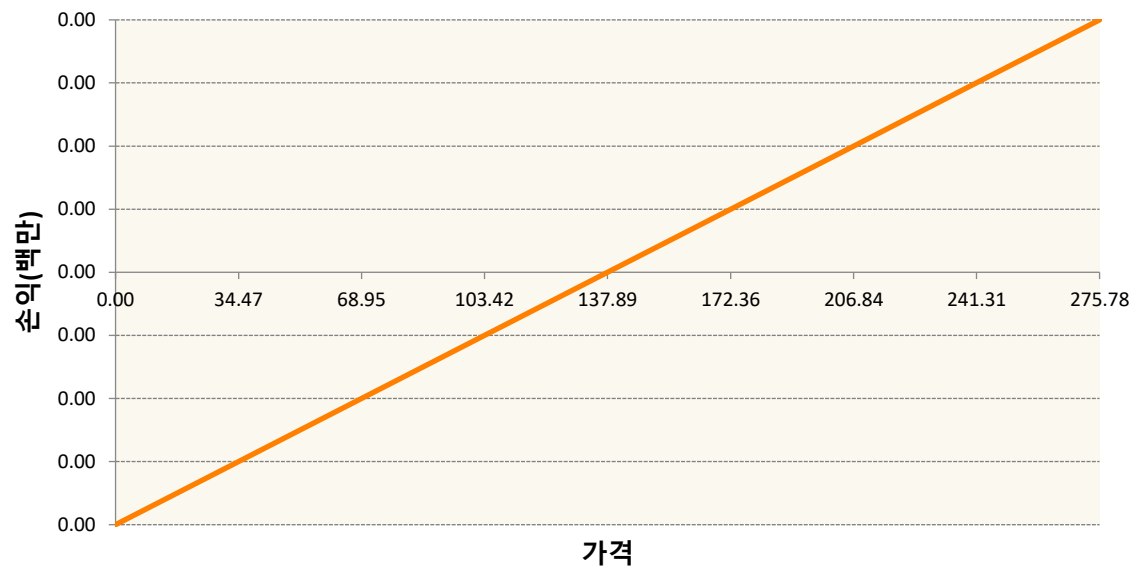
BON2-SOYBEAN OIL FUTR Jul22



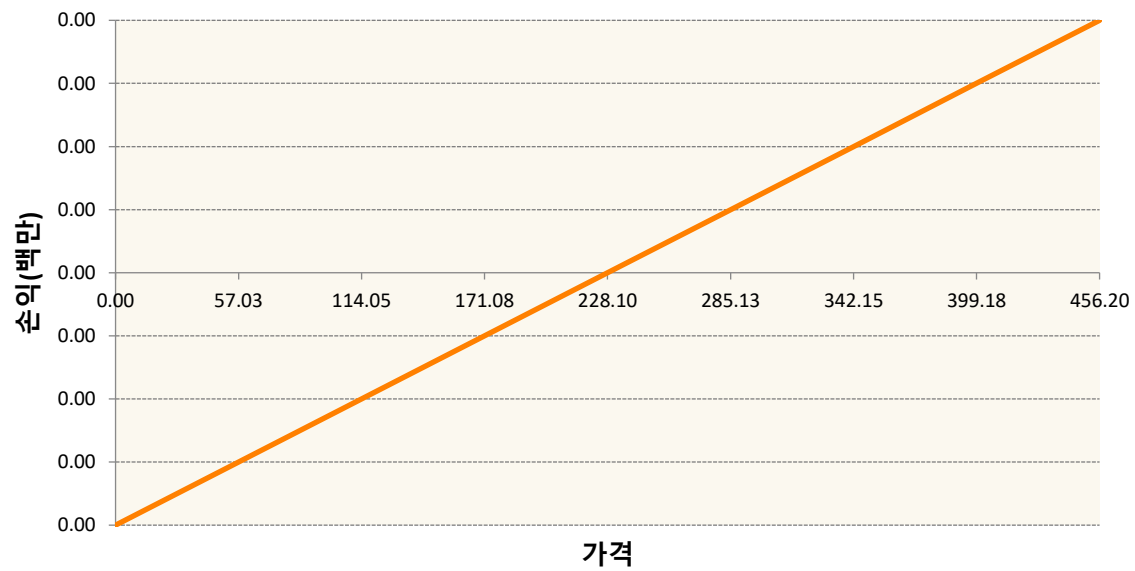
CN2-CORN FUTURE Jul22



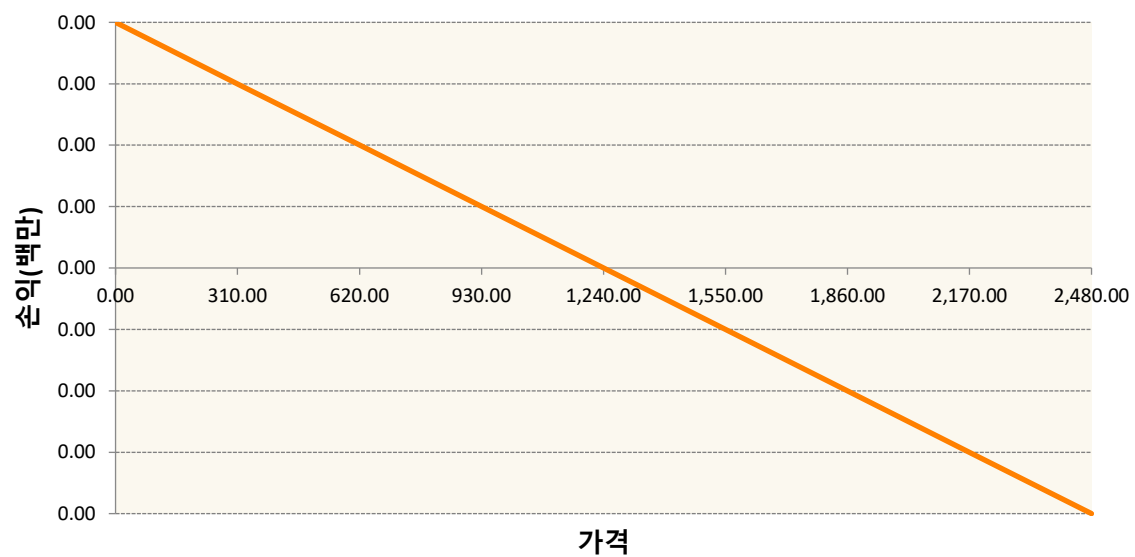
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



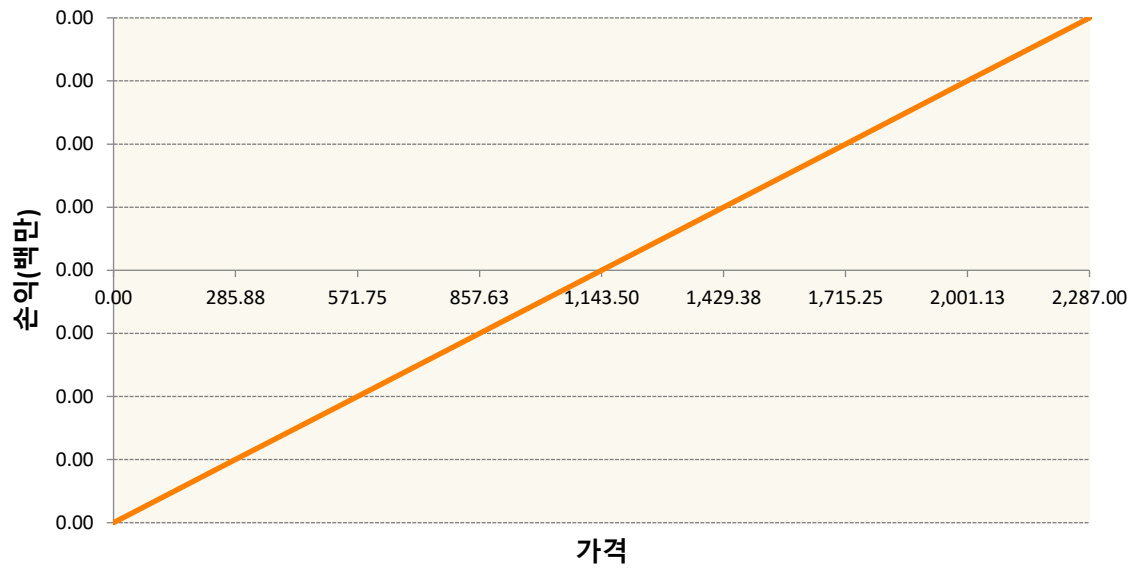
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



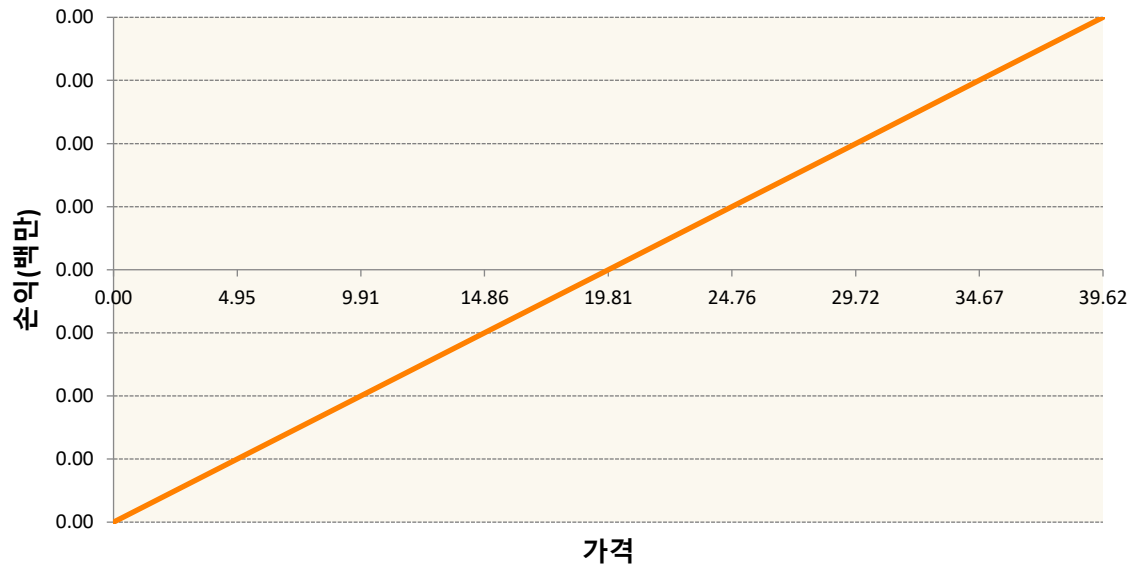
KR4175S50003-2022-05 달러선물



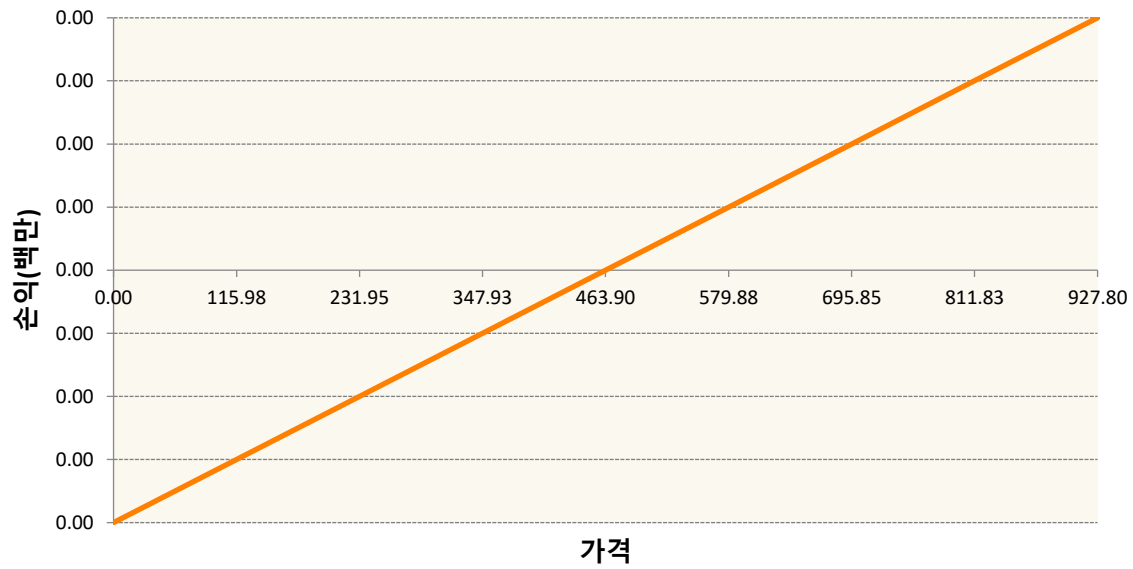
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22



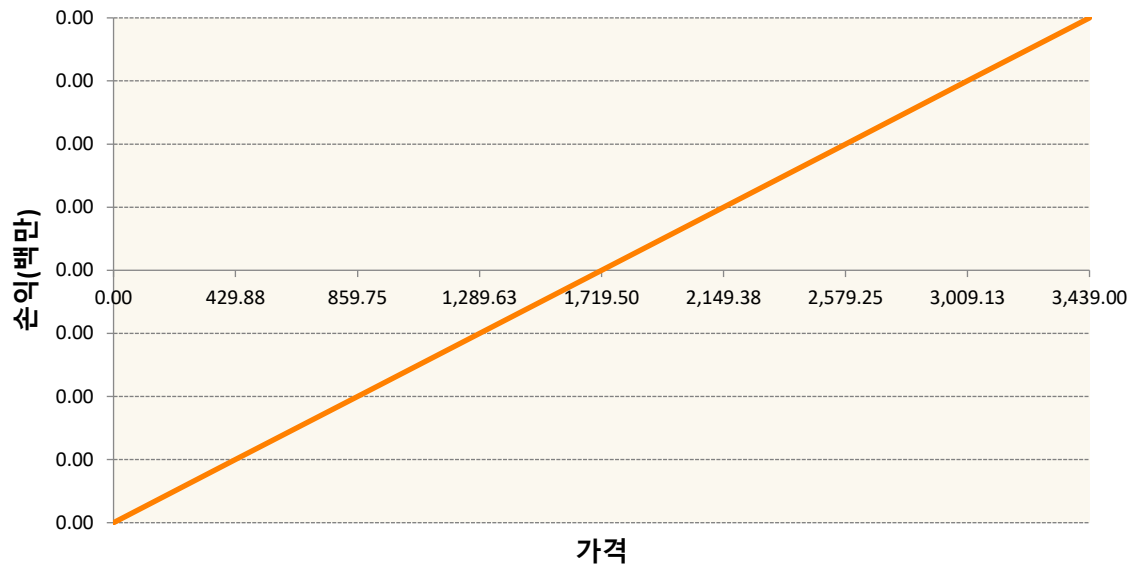
SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



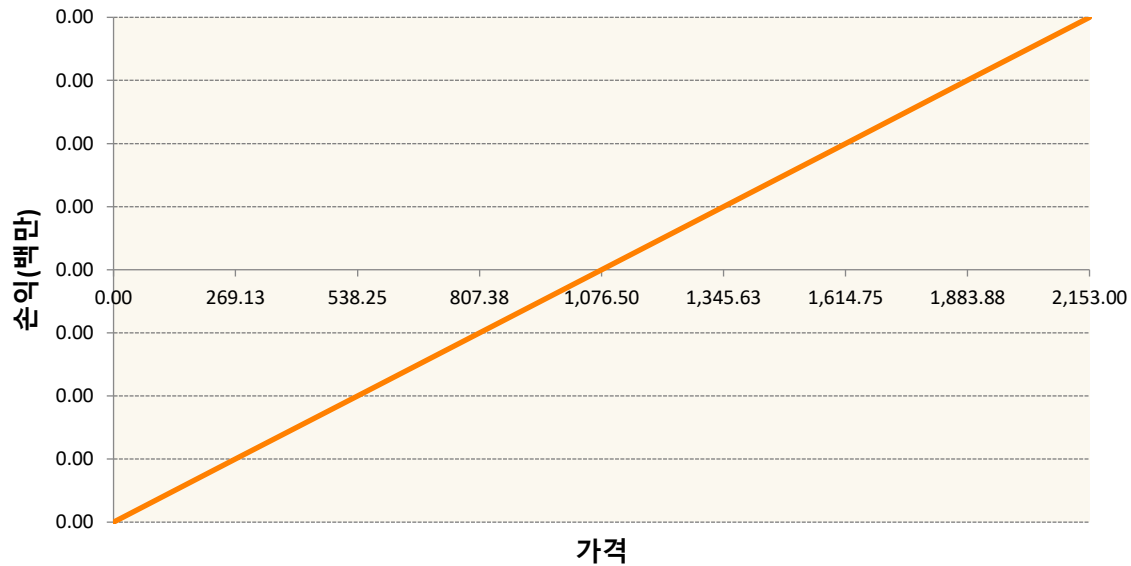
SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22



SN2-SOYBEAN FUTURE Jul22



WN2-WHEAT FUTURE(CBT) Jul22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

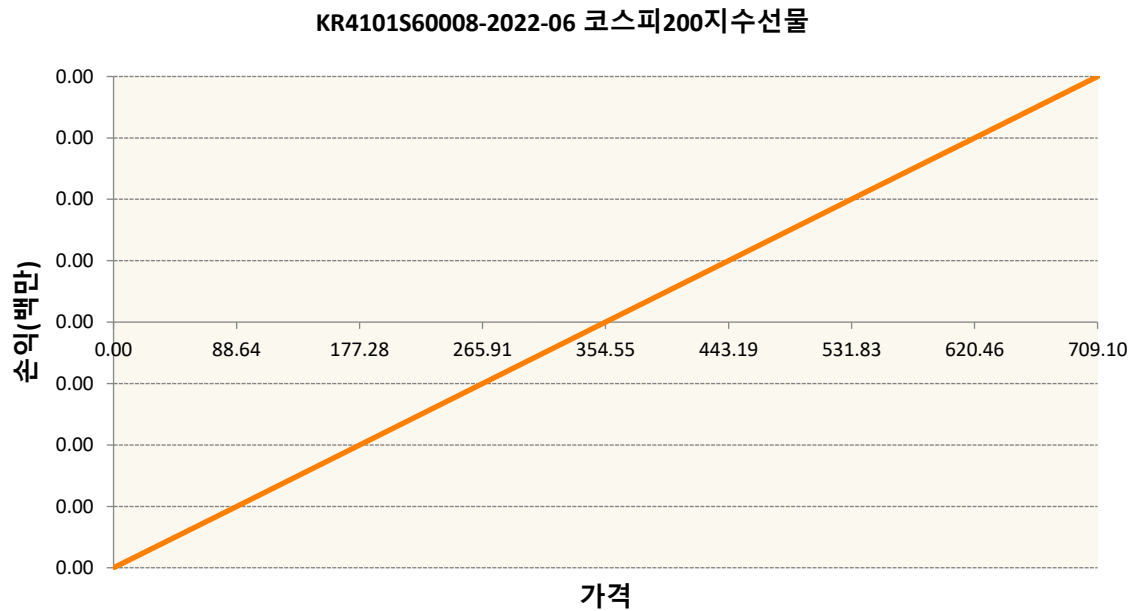
스마트인덱스모

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   | 1,595 | 0     | 1,595     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |      |       |        | 128    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -128      | -128    | -128               | -128 | -128  | -128   | -128   |
| -5.33%       | -85       | -85     | -85                | -85  | -85   | -85    | -85    |
| -2.67%       | -43       | -43     | -43                | -43  | -43   | -43    | -43    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 43        | 43      | 43                 | 43   | 43    | 43     | 43     |
| 5.33%        | 85        | 85      | 85                 | 85   | 85    | 85     | 85     |
| 8.00%        | 128       | 128     | 128                | 128  | 128   | 128    | 128    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

## 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 | 351 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 380 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

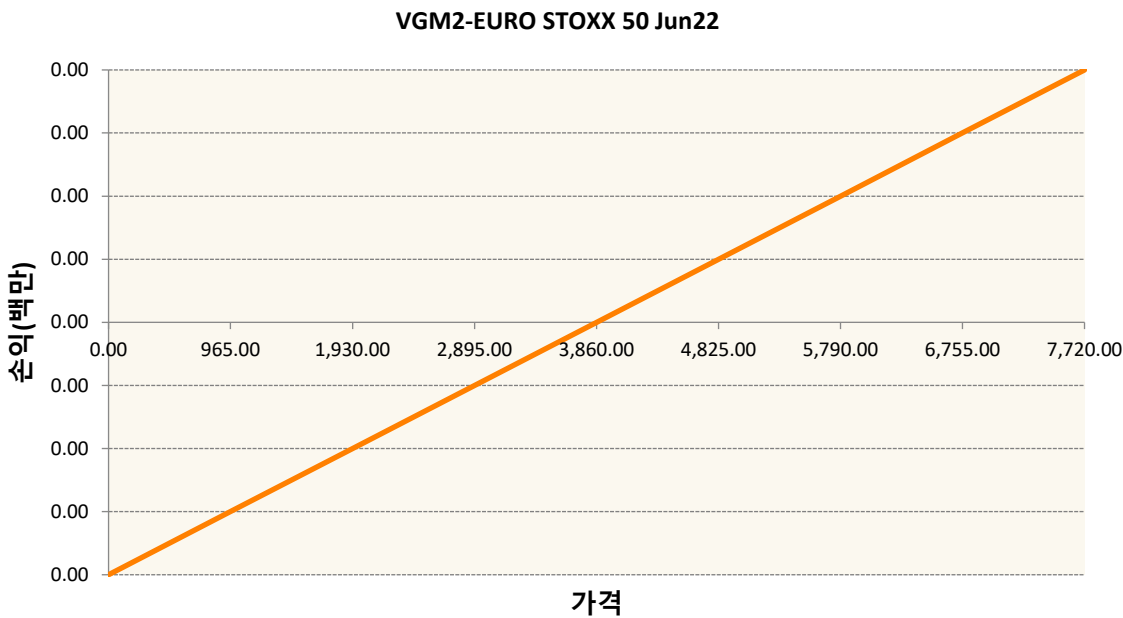
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 576   | 0     | 576       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGM2 | EURO STOXX 50 Jun22 | 46 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 43 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

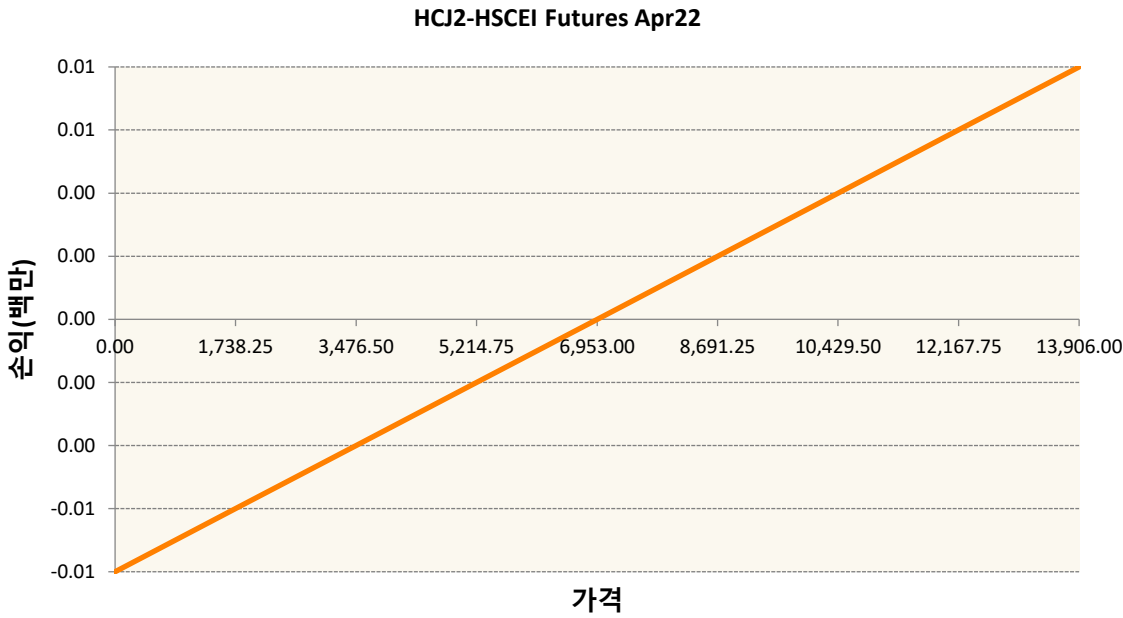
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,073 | 0     | 1,073     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCI2 | HSCEI Futures Apr22 | 86 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 115 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

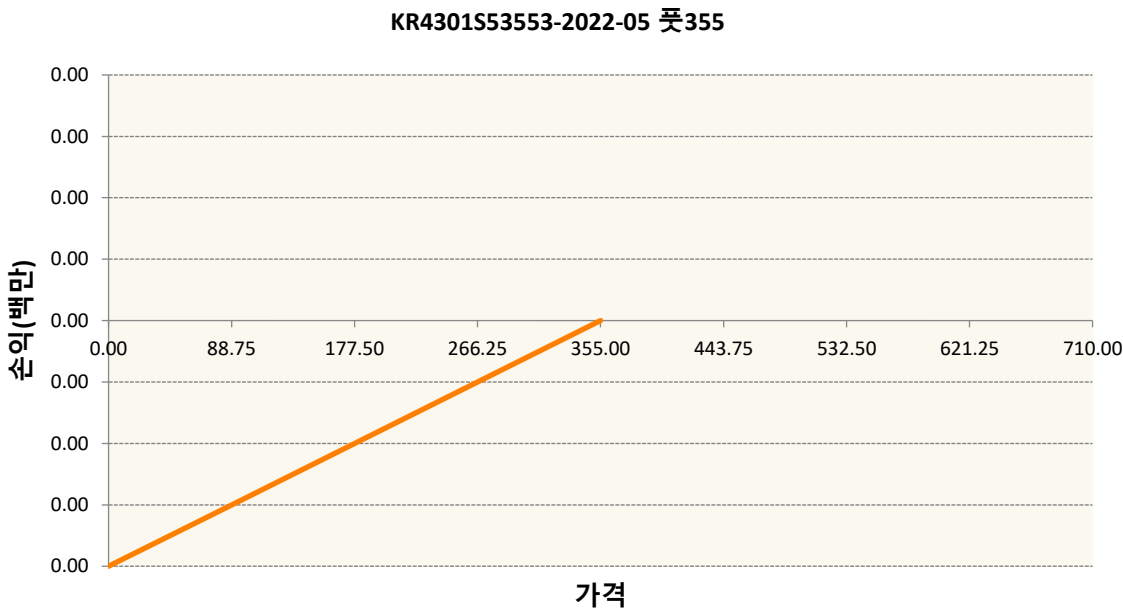
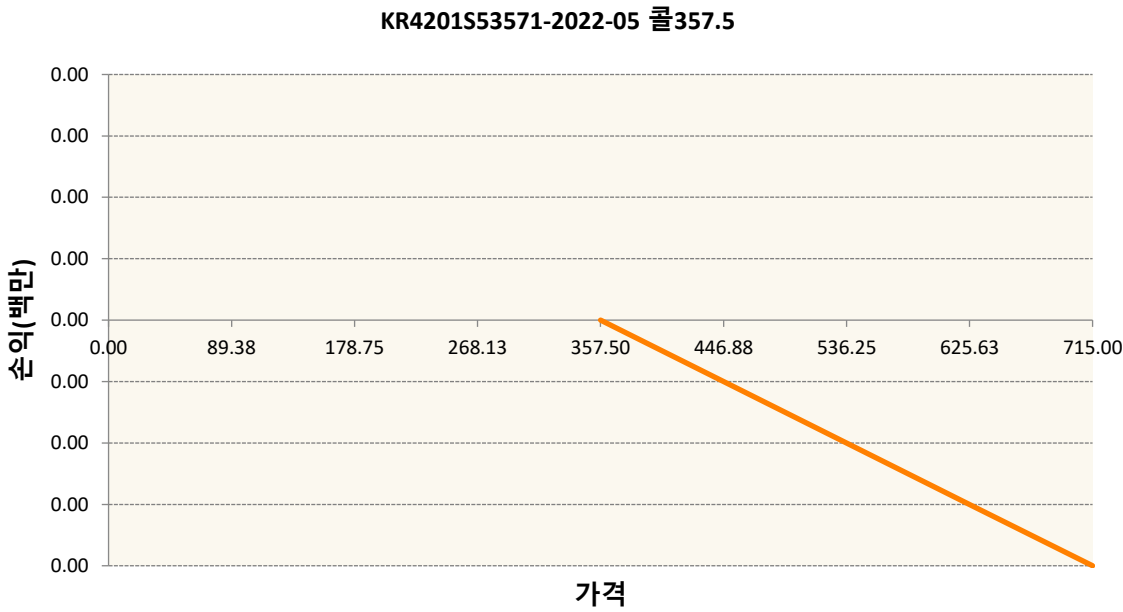
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

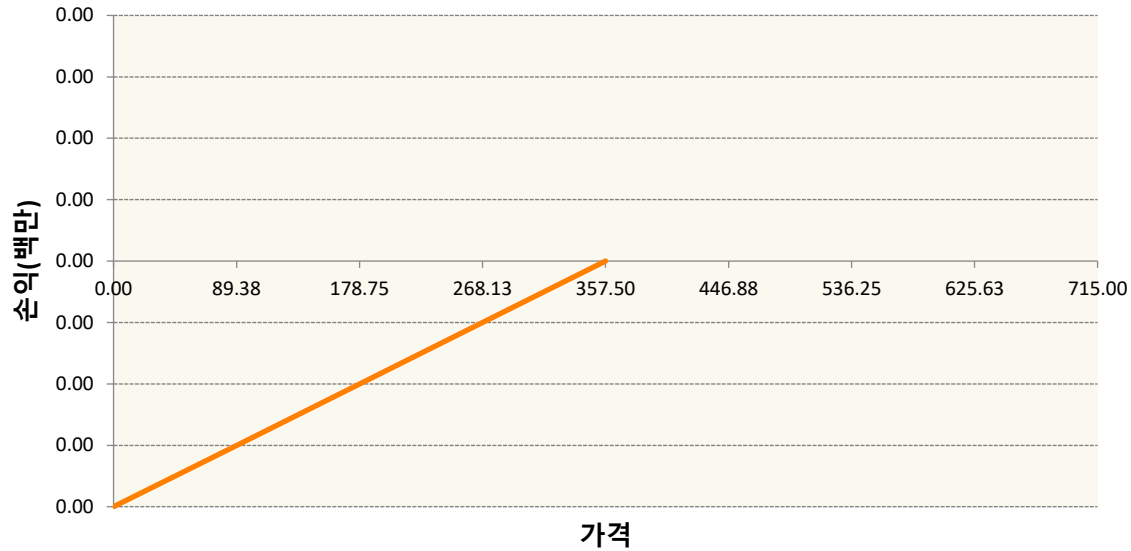
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 67,634 | -67,634   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301S53579-2022-05 풋357.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4301S53571 |  | 2022-05 콜357.5 |         |        |        |        |        | 3,288  |
|--------------|--|----------------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
|              |  | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |  | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       |  | 1,323          | 1,291   | 1,249  | 1,200  | 1,143  | 1,080  | 1,011  |
| -5.33%       |  | 1,204          | 1,137   | 1,062  | 980    | 893    | 802    | 707    |
| -2.67%       |  | 918            | 813     | 705    | 594    | 481    | 367    | 251    |
| 0%           |  | 379            | 253     | 127    | 0      | -127   | -253   | -380   |
| 2.67%        |  | -453           | -573    | -694   | -817   | -940   | -1,064 | -1,189 |
| 5.33%        |  | -1,548         | -1,640  | -1,737 | -1,839 | -1,945 | -2,054 | -2,166 |
| 8.00%        |  | -2,832         | -2,888  | -2,954 | -3,028 | -3,109 | -3,196 | -3,288 |
| KR4301S53553 |  | 2022-05 풋355   |         |        |        |        |        | 210    |
|              |  | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |  | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       |  | -206           | -206    | -207   | -207   | -208   | -209   | -210   |
| -5.33%       |  | -120           | -121    | -123   | -125   | -127   | -129   | -132   |
| -2.67%       |  | -43            | -46     | -49    | -53    | -57    | -61    | -65    |
| 0%           |  | 14             | 9       | 5      | 0      | -5     | -9     | -14    |
| 2.67%        |  | 42             | 38      | 35     | 31     | 28     | 24     | 20     |
| 5.33%        |  | 50             | 49      | 48     | 46     | 44     | 41     | 38     |
| 8.00%        |  | 52             | 52      | 51     | 51     | 50     | 49     | 47     |
| KR4301S53579 |  | 2022-05 풋357.5 |         |        |        |        |        | 594    |
|              |  | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |  | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       |  | -587           | -587    | -588   | -588   | -590   | -592   | -594   |
| -5.33%       |  | -352           | -355    | -358   | -361   | -366   | -371   | -377   |
| -2.67%       |  | -134           | -141    | -149   | -158   | -167   | -177   | -186   |
| 0%           |  | 36             | 24      | 12     | 0      | -12    | -24    | -37    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 132 | 121 | 111 | 100 | 89  | 77  | 66  |
| 5.33% | 166 | 161 | 156 | 149 | 142 | 134 | 126 |
| 8.00% | 173 | 172 | 170 | 168 | 164 | 160 | 156 |

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

(단위:백만원)

3,987

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

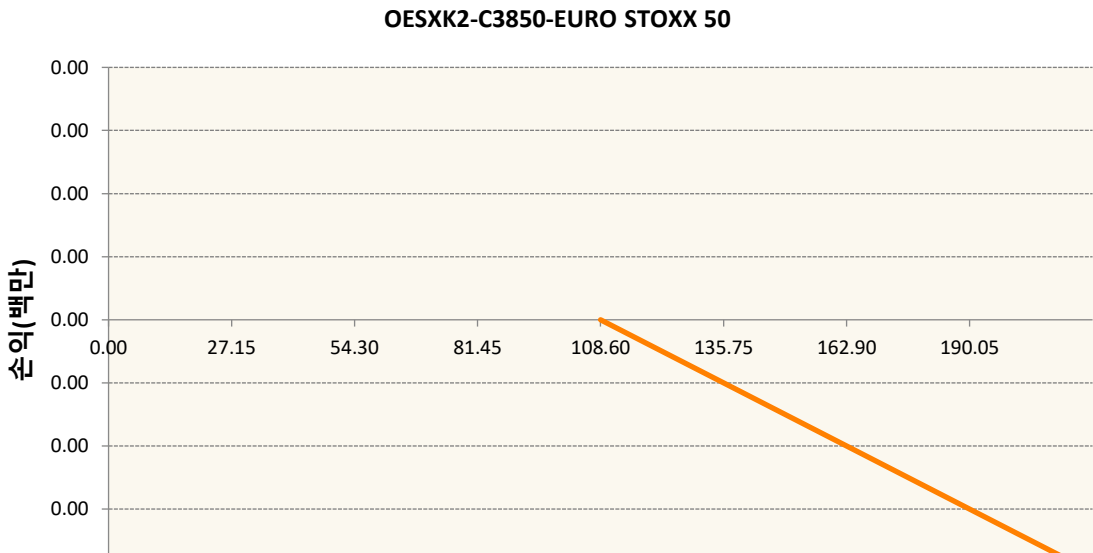
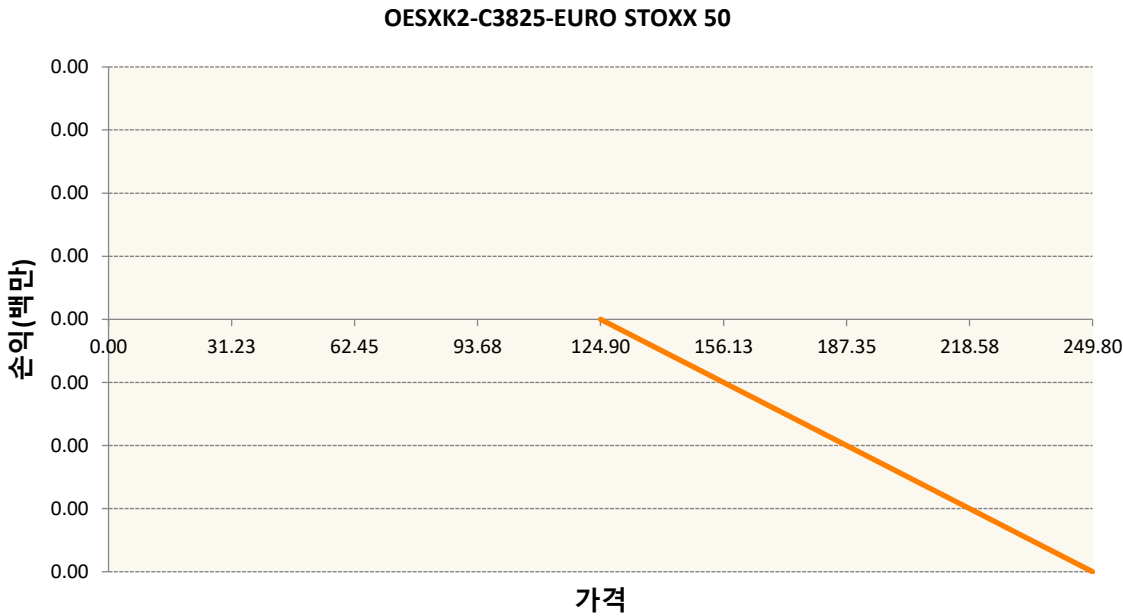
## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

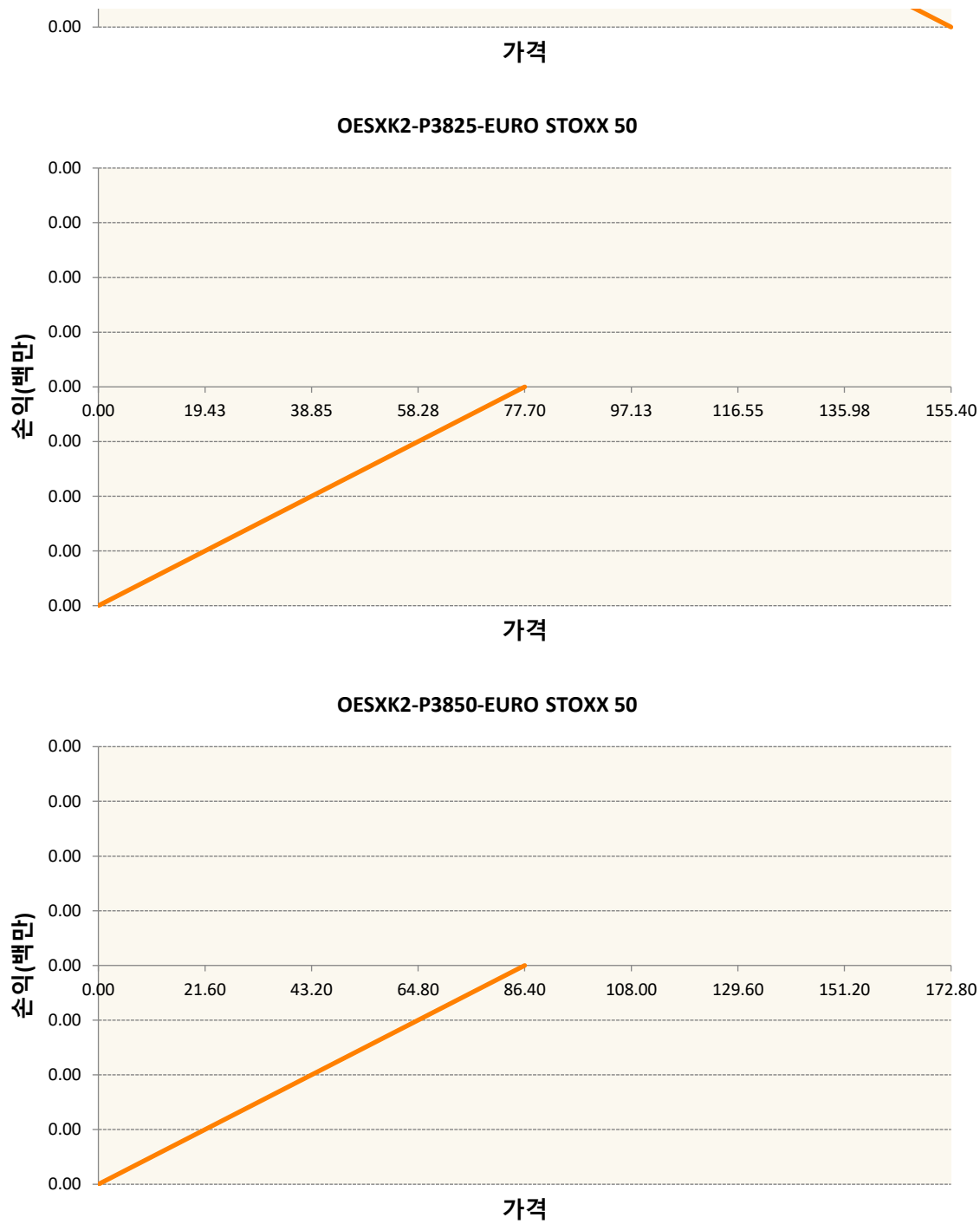
### 1. 계약금액

(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     | 72    | -72       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,477 | -1,477    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY  
 FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E  
 FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E  
 FXW213C4L KRW/EUR 24-06-22E  
 OESXK2-C38 EURO STOXX 50  
 OESXK2-C38 EURO STOXX 50  
 OESXK2-P38 EURO STOXX 50  
 OESXK2-P38 EURO STOXX 50

|      |
|------|
| 16   |
| 21   |
| 64   |
| 32   |
| 0.13 |
| 3    |
| 0.08 |
| 3    |



공시일 2022-04-25

기준일 2022-04-22

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

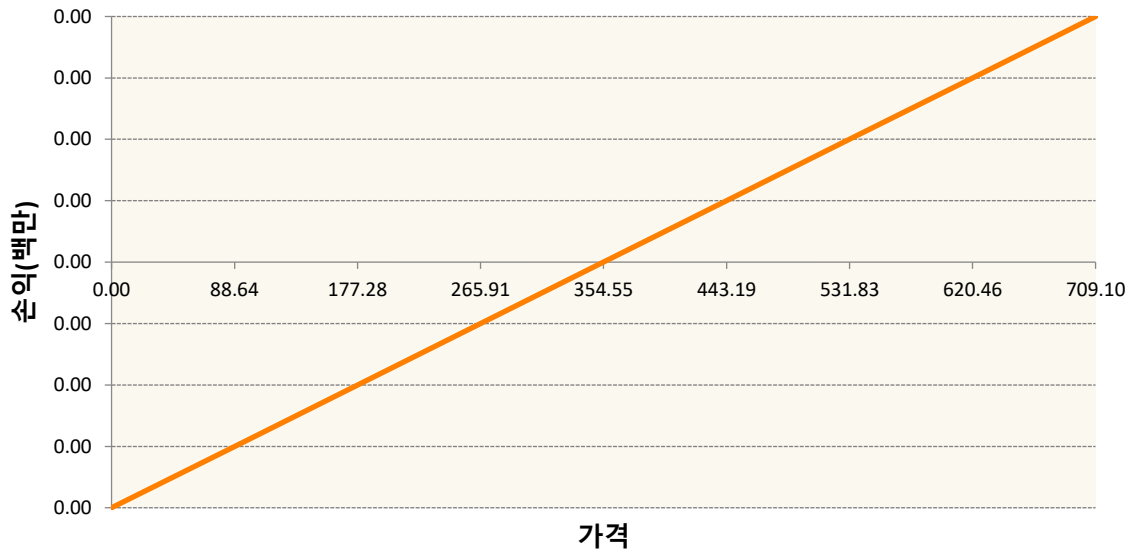
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

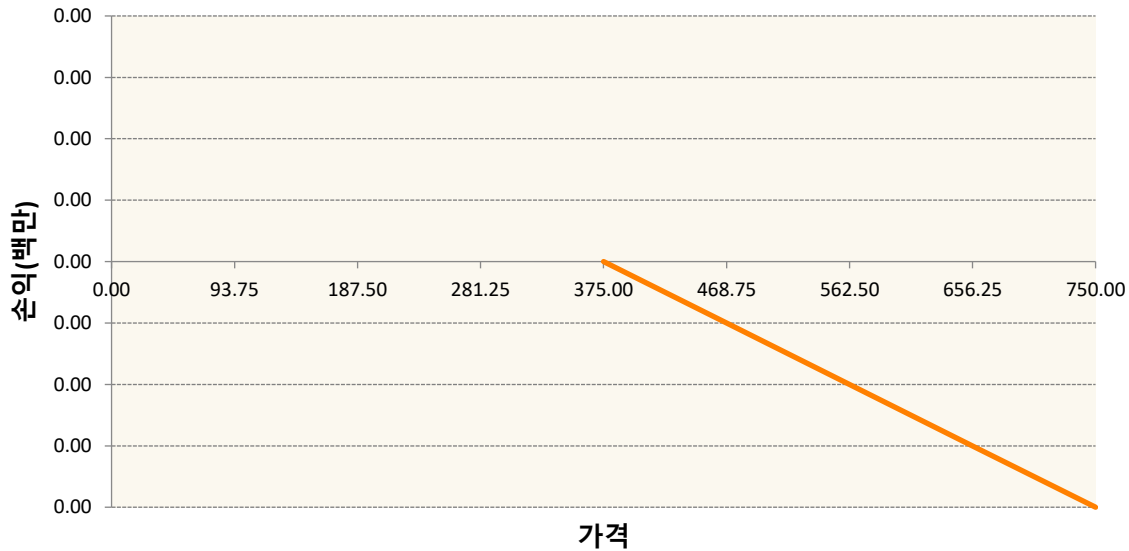
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 620   | 0     | 620       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 268   | 4,878 | -4,610    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



KR4201S53753-2022-05 콜375



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 755.00 with major ticks every 94.38 units. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A blue line starts at the point (377.50, 0.00) and ends at the point (755.00, 0.00), indicating that the profit/loss is zero at these price points.

| 가격     | 손익(백만) |
|--------|--------|
| 377.50 | 0.00   |
| 755.00 | 0.00   |

| 가격     | 순이익 (백만) |
|--------|----------|
| 0.00   | 0.00     |
| 357.50 | 0.00     |

(단위:백만원)

|              |           |         |        |                    |       |        |        |     |
|--------------|-----------|---------|--------|--------------------|-------|--------|--------|-----|
| KR4101S60008 |           |         |        | 2022-06 코스피200지수선물 |       |        |        | 50  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                 | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -50       | -50     | -50    | -50                | -50   | -50    | -50    |     |
| -5.33%       | -33       | -33     | -33    | -33                | -33   | -33    | -33    |     |
| -2.67%       | -17       | -17     | -17    | -17                | -17   | -17    | -17    |     |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      |     |
| 2.67%        | 17        | 17      | 17     | 17                 | 17    | 17     | 17     |     |
| 5.33%        | 33        | 33      | 33     | 33                 | 33    | 33     | 33     |     |
| 8.00%        | 50        | 50      | 50     | 50                 | 50    | 50     | 50     |     |
| KR4201S53753 |           |         |        | 2022-05 콜375       |       |        |        | 174 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |

| 가격                          | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|-----------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%                      | 37      | 37      | 36     | 35   | 33    | 31     | 29     |
| -5.33%                      | 36      | 35      | 33     | 30   | 27    | 23     | 19     |
| -2.67%                      | 32      | 28      | 24     | 20   | 14    | 9      | 3      |
| 0%                          | 20      | 14      | 7      | 0    | -7    | -15    | -23    |
| 2.67%                       | -6      | -14     | -23    | -33  | -42   | -51    | -61    |
| 5.33%                       | -50     | -60     | -71    | -81  | -91   | -101   | -111   |
| 8.00%                       | -116    | -126    | -135   | -145 | -155  | -164   | -174   |
| KR4201S53779 2022-05 콜377.5 |         |         |        |      |       |        | 17     |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 3       | 3       | 3      | 3   | 3     | 3      | 3      |
| -5.33%    | 3       | 3       | 3      | 3   | 2     | 2      | 2      |
| -2.67%    | 3       | 3       | 2      | 2   | 1     | 1      | 0      |
| 0%        | 2       | 1       | 1      | 0   | -1    | -2     | -2     |
| 2.67%     | 0       | -1      | -2     | -3  | -4    | -5     | -6     |
| 5.33%     | -5      | -6      | -7     | -8  | -9    | -10    | -11    |
| 8.00%     | -11     | -12     | -13    | -14 | -15   | -16    | -17    |

| KR4301S53579 2022-05 풋357.5 |         |         |        |    |       |        | 18     |
|-----------------------------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                   |         |         |        |    |       |        |        |
| 가격                          | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                      | 18      | 18      | 18     | 18 | 18    | 18     | 18     |
| -5.33%                      | 11      | 11      | 11     | 11 | 11    | 11     | 11     |
| -2.67%                      | 4       | 4       | 4      | 5  | 5     | 5      | 6      |
| 0%                          | -1      | -1      | 0      | 0  | 0     | 1      | 1      |
| 2.67%                       | -4      | -4      | -3     | -3 | -3    | -2     | -2     |
| 5.33%                       | -5      | -5      | -5     | -4 | -4    | -4     | -4     |
| 8.00%                       | -5      | -5      | -5     | -5 | -5    | -5     | -5     |

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

(단위:백만원)

207

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

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 | 9,437 | 0     | 9,437     |    |

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 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

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 | 7,397 | 0     | 7,397     |    |

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 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

## 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 | 23,955 | 0      | 23,955    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 4,709  | 53,108 | -48,399   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |       |
|-----------------------------|-------|
| FXW213C2N KRW/USD 25-04-22E | 2,253 |
| FXW213C33 USD/KRW 25-04-22E | 40    |
| FXW213C3P USD/KRW 25-04-22E | 99    |
| FXW213C4B USD/KRW 25-04-22E | 119   |
| FXW213C4M KRW/USD 27-06-22E | 1,995 |
| FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E | 119   |
| IE00BD8RGM75                |       |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

1,569





공시일 2022-04-25

기준일 2022-04-22

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

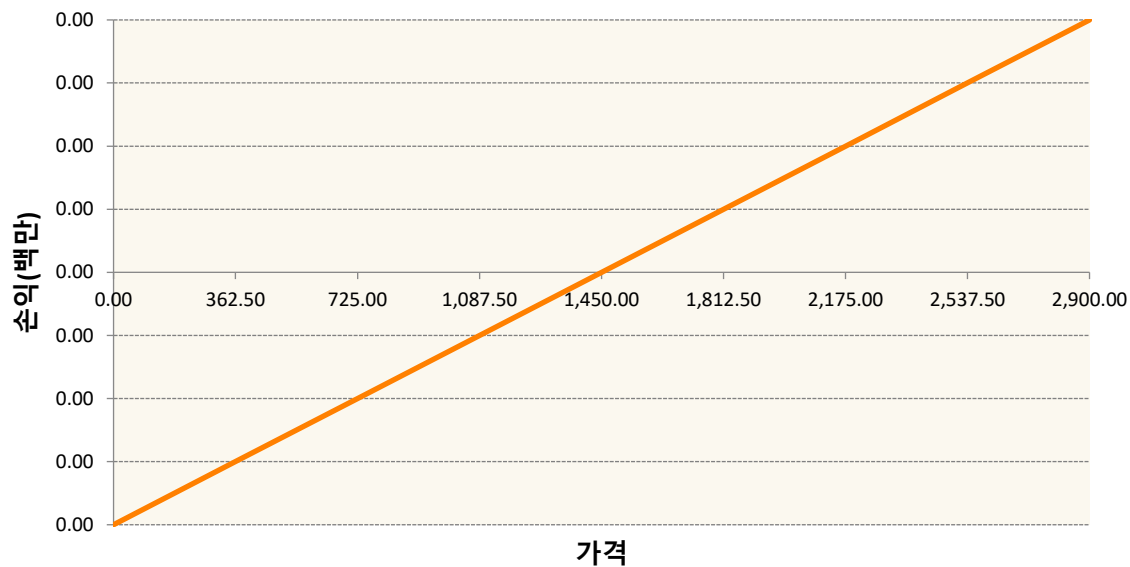
### 1. 계약금액

(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   | 813   | 0     | 813       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,836 | 0     | 1,836     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,182 | -1,182    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCK2-VN30 Index Future May22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 147 |
| FXW213C2P KRW/EUR 20-05-22E   | 46  |
| FXW213C3G KRW/EUR 24-06-22E   | 32  |
| FXW213C4L KRW/EUR 22-07-22E   | 16  |
| VNCK2 VN30 Index Future May22 | 65  |

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

(단위:백만원)

270

공시일 2022-04-25

기준일 2022-04-22

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

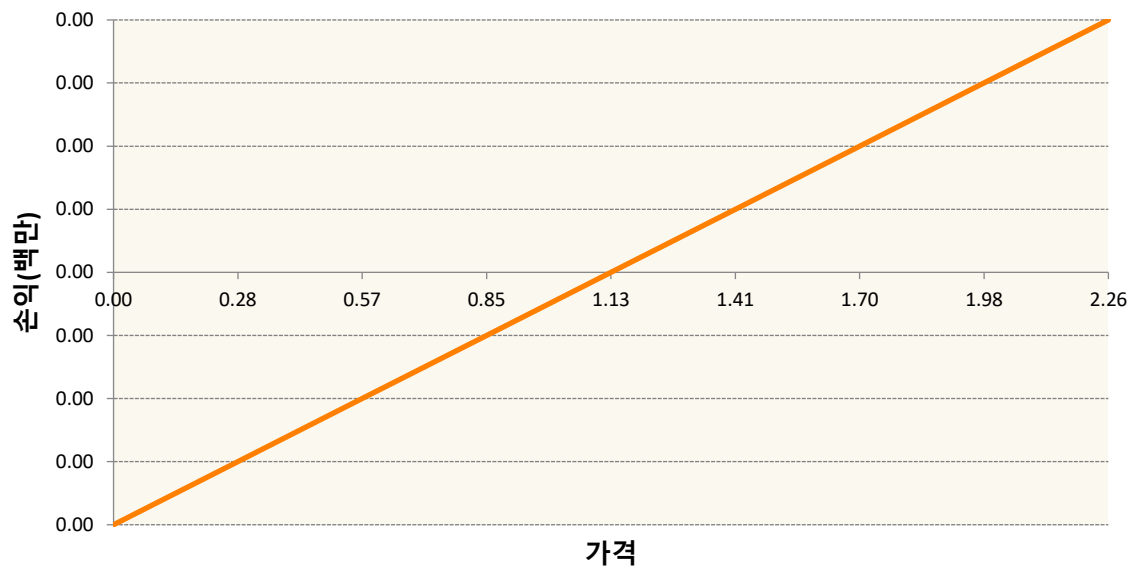
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

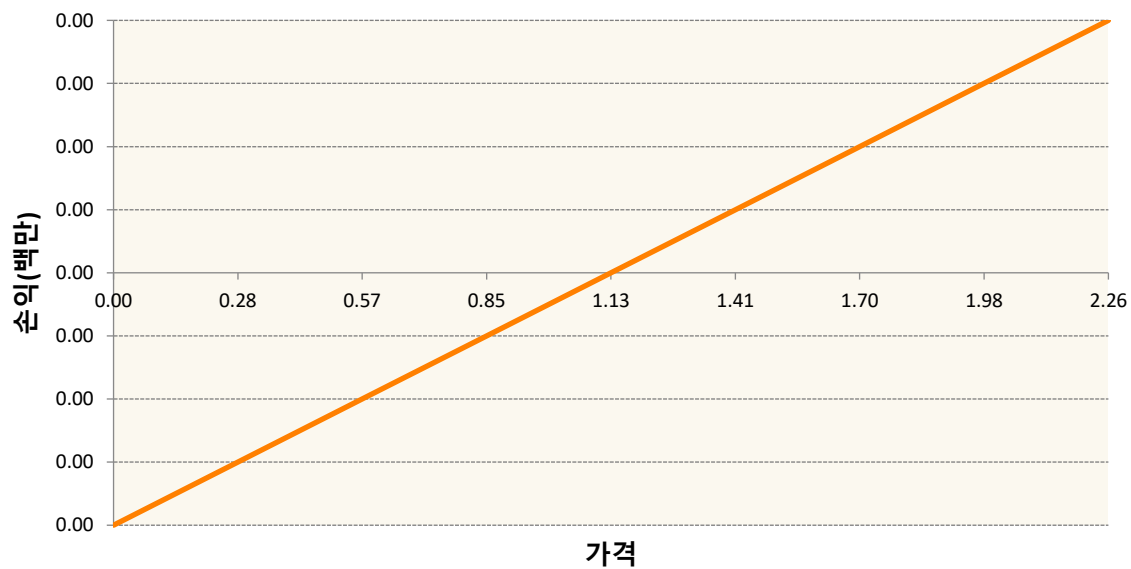
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 47,986 | 0     | 47,986    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

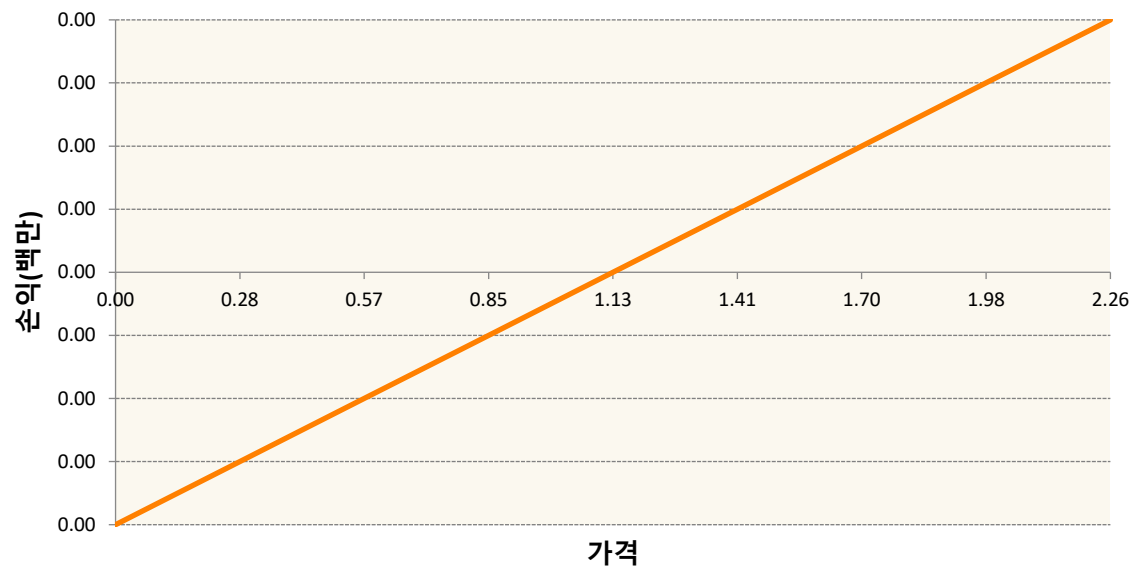
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

203

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

3,543

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

102

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

(단위:백만원)

7,060

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

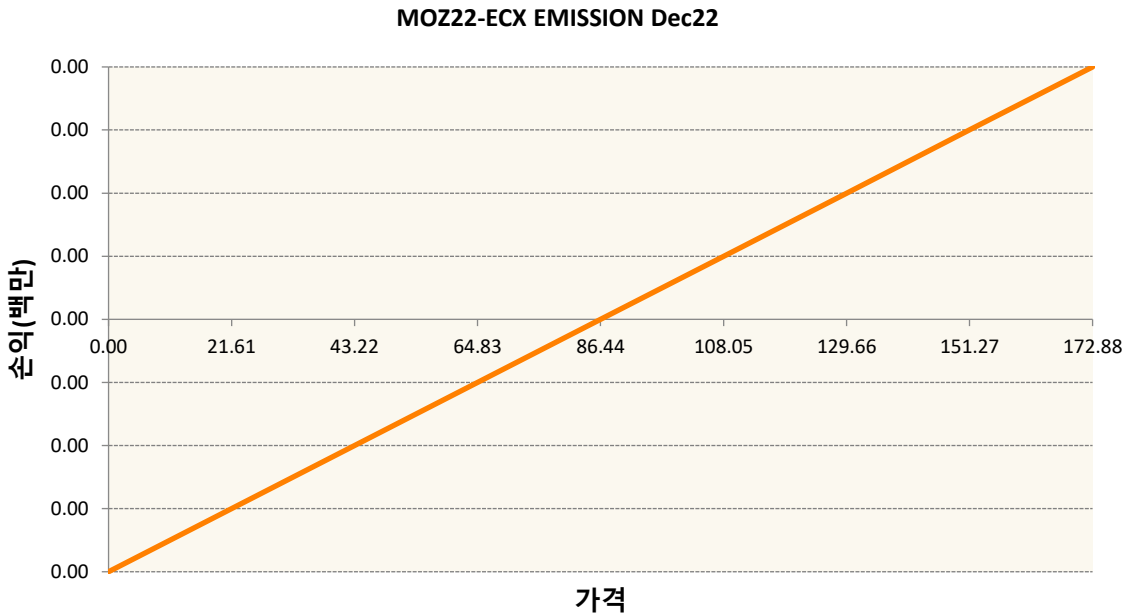
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 17,504 | 0     | 17,504    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 7,492 | -7,492    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |       |
|-----------------------------|-------|
| FXW213C3V·KRW/EUR 25-04-22E | 599   |
| MOZ22 ECX EMISSION Dec22    | 1,400 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 3,692 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

# 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)  | 51 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)  | 51 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)  | 51 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠) | 51 |

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

(단위:백만원)

386

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-04-25 |
| 기준일 | 2022-04-22 |

# 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   | 8,439 | 0     | 8,439     | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

37

공시일 2022-04-25

기준일 2022-04-22

## 에퀴티알파일반사모혼합자산

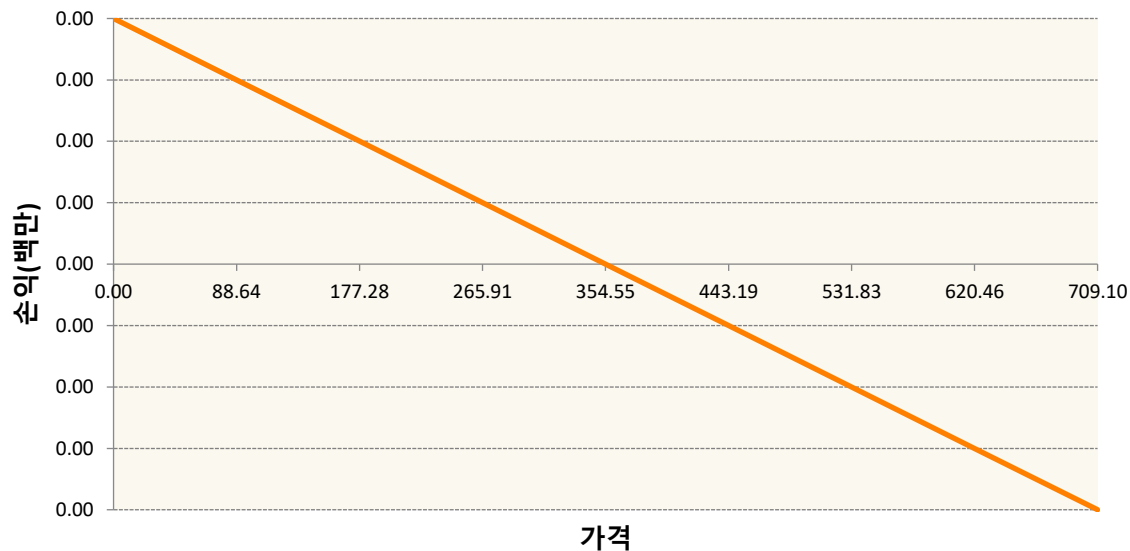
### 1. 계약금액

(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     | 1,773 | -1,773    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |      |
|---------------------------------------|------|
| KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물         | 142  |
| KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322 | 1    |
| KRS0003014 SWAP_NVIDIA CORP_0322      | 1    |
| KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322 | 0.3  |
| KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331 | 0.06 |
| KRS0003070 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0407 | 0.04 |
| KRS0003070 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0407 | 0.3  |
| KRS0003086 SWAP_PRSH ST FTRS ETF_0412 | 0.04 |

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

(단위:백만원)



공시일 2022-04-25

기준일 2022-04-22

## 신한SOL한국형글로벌반도체액티

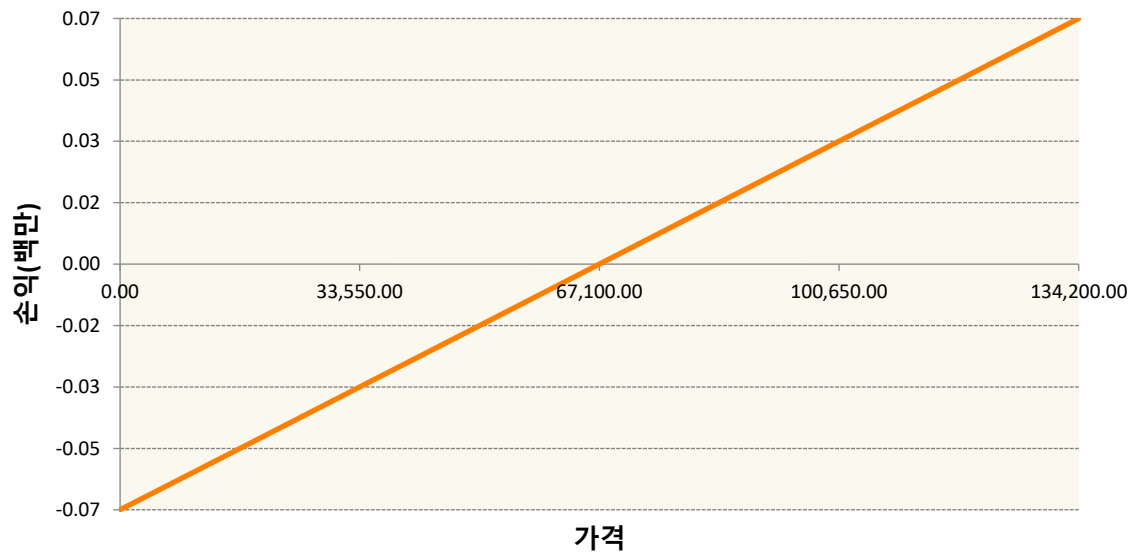
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

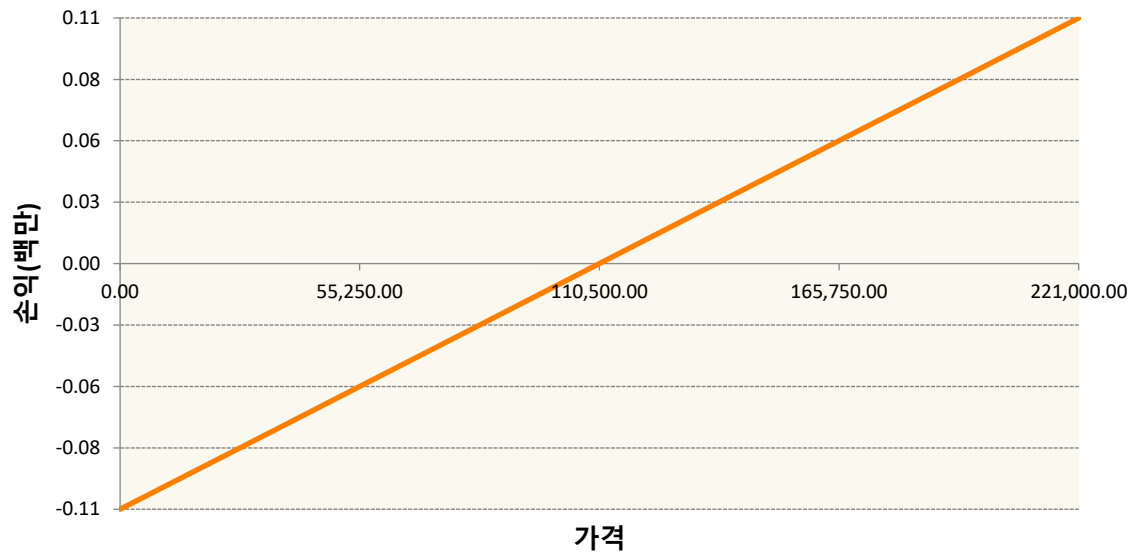
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 883   | 0     | 883       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111S50008-2022-05 삼성전자개별선물



KR4150S50006-2022-05 SK하이닉스개별선물



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

| KR4111S50008 |           | 2022-05 삼성전자개별선물   |        |     |       |        | 34     |
|--------------|-----------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -34       | -34                | -34    | -34 | -34   | -34    | -34    |
| -5.33%       | -23       | -23                | -23    | -23 | -23   | -23    | -23    |
| -2.67%       | -11       | -11                | -11    | -11 | -11   | -11    | -11    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 11        | 11                 | 11     | 11  | 11    | 11     | 11     |
| 5.33%        | 23        | 23                 | 23     | 23  | 23    | 23     | 23     |
| 8.00%        | 34        | 34                 | 34     | 34  | 34    | 34     | 34     |
| KR4150S50006 |           | 2022-05 SK하이닉스개별선물 |        |     |       |        | 36     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -36       | -36                | -36    | -36 | -36   | -36    | -36    |
| -5.33%       | -24       | -24                | -24    | -24 | -24   | -24    | -24    |
| -2.67%       | -12       | -12                | -12    | -12 | -12   | -12    | -12    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 12        | 12                 | 12     | 12  | 12    | 12     | 12     |
| 5.33%        | 24        | 24                 | 24     | 24  | 24    | 24     | 24     |
| 8.00%        | 36        | 36                 | 36     | 36  | 36    | 36     | 36     |

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

76

공시일 2022-04-25

기준일 2022-04-22

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

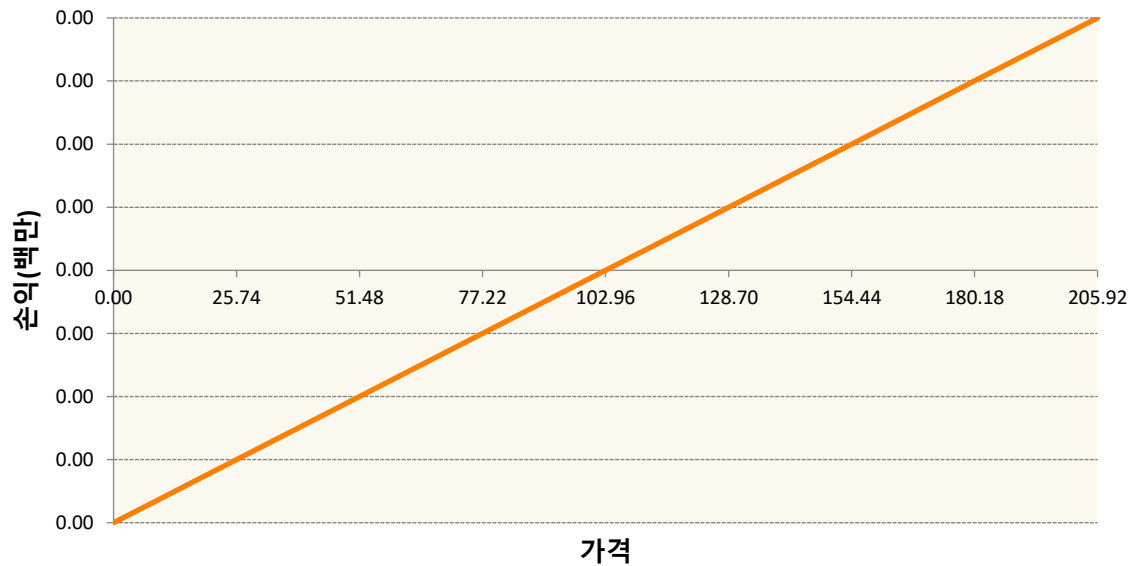
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

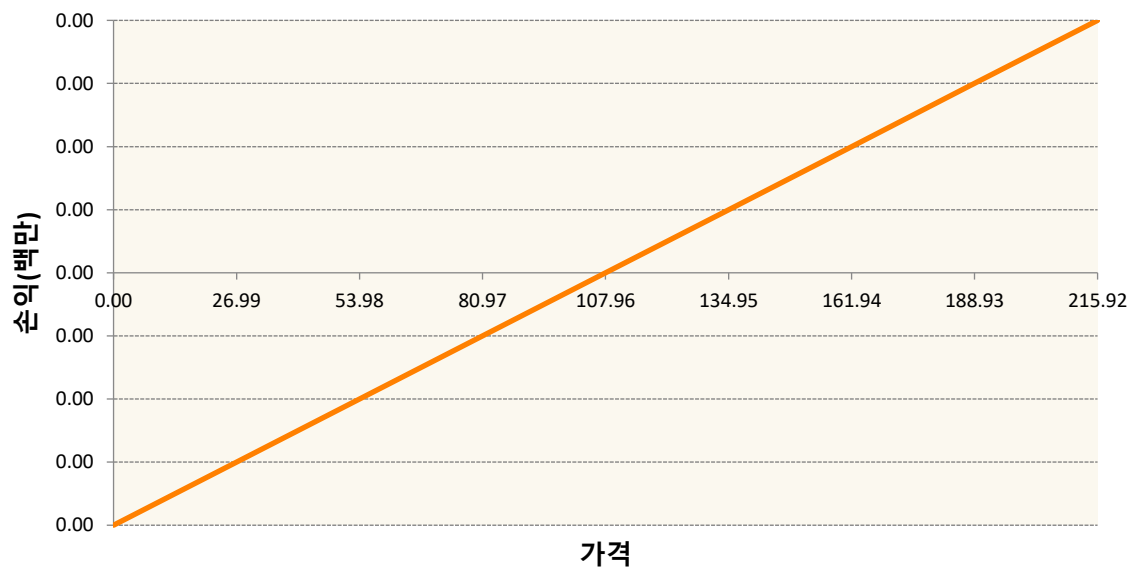
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,610 | 620   | 1,990     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

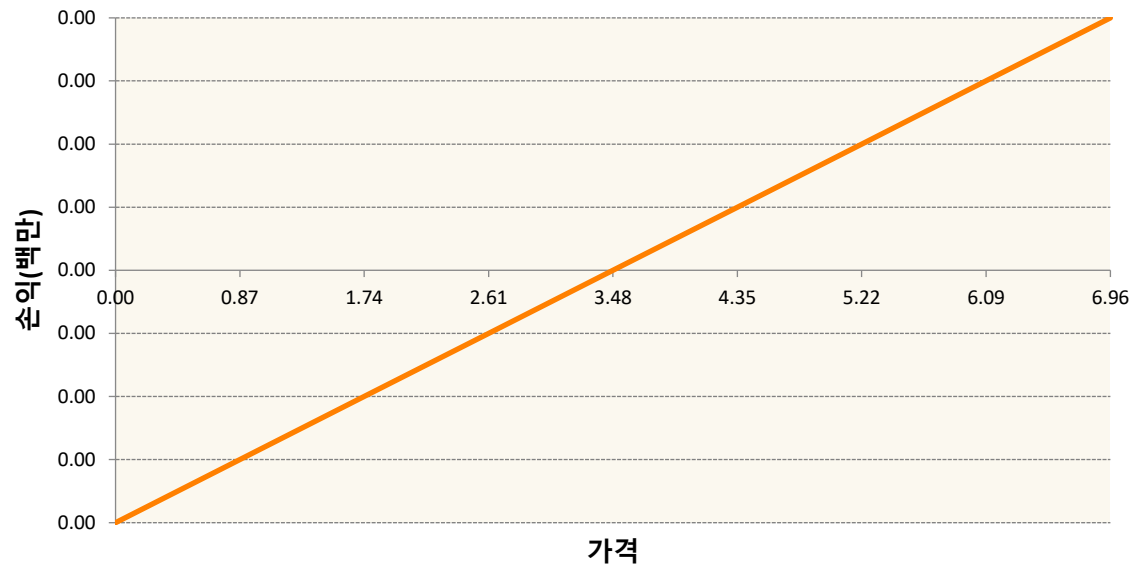
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



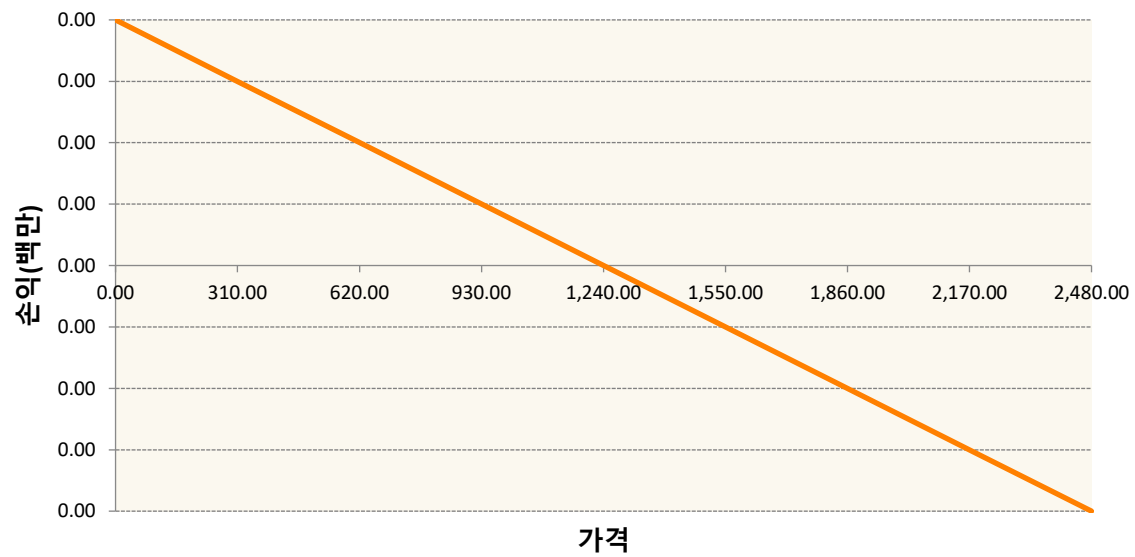
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



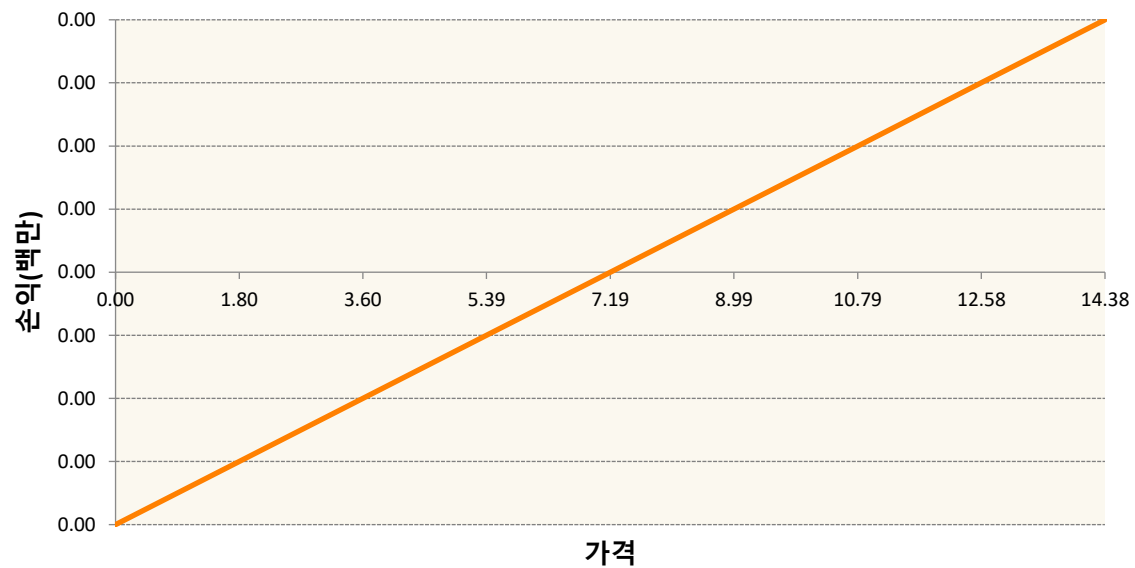
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

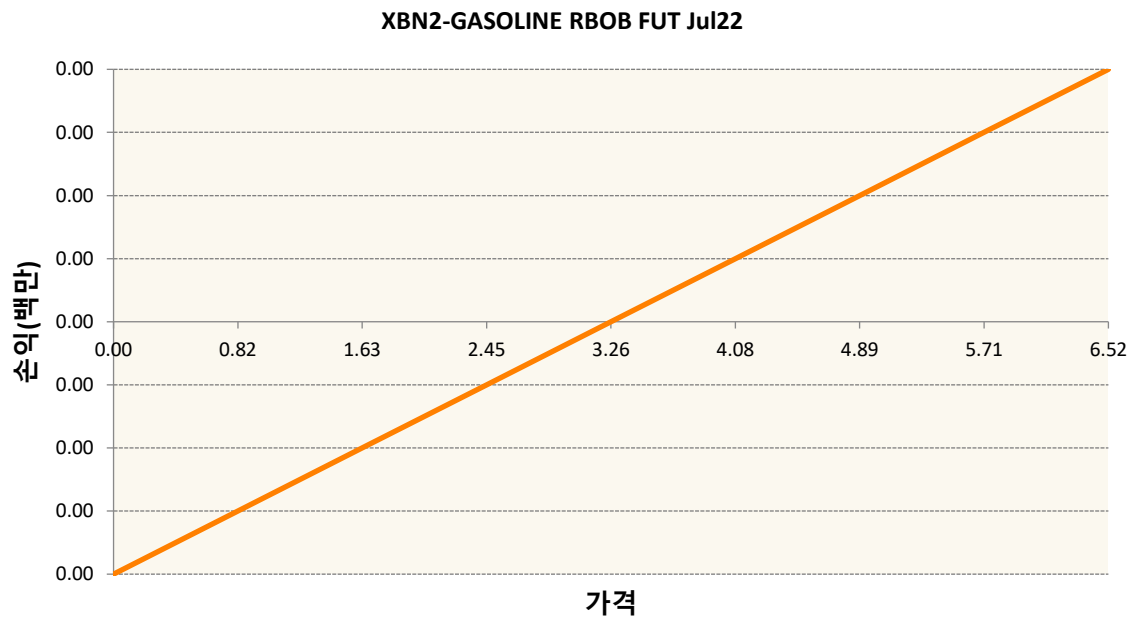
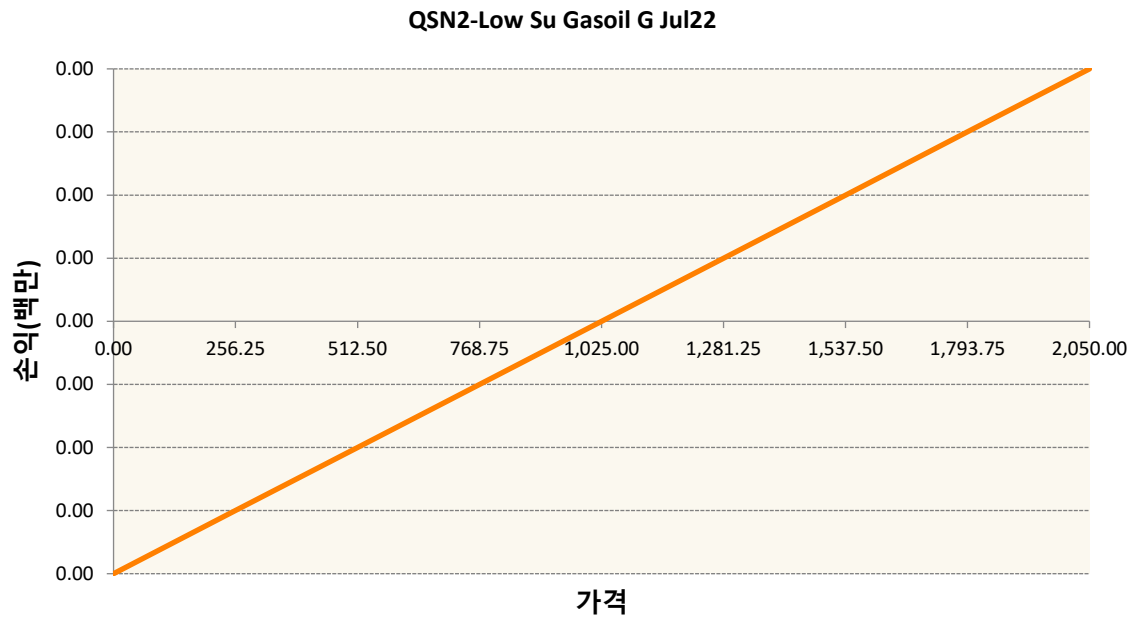


KR4175S50003-2022-05 달러선물



NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| CLN2                      | WTI CRUDE FUTURE Jul22  |  | 40       |
| CON2                      | BRENT CRUDE FUTR Jul22  |  | 43       |
| HON2                      | NY Harb ULSD Fut Jul22  |  | 14       |
| KR4175S500 2022-05 달러선물   |                         |  | 50       |
| NGN22                     | NATURAL GAS FUTR Jul22  |  | 78       |
| QSN2                      | Low Su Gasoil G Jul22   |  | 20       |
| XBN2                      | GASOLINE RBOB FUT Jul22 |  | 13       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 608      |