

공시일 2022-05-09

기준일 2022-05-06

## 포커스농산물모(채권-파생형)

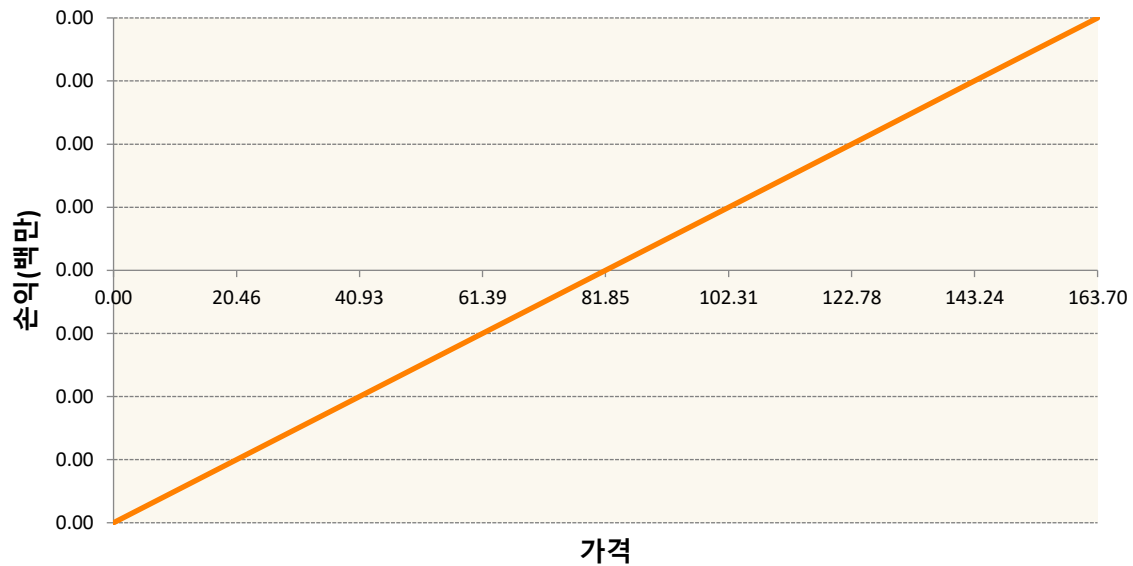
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

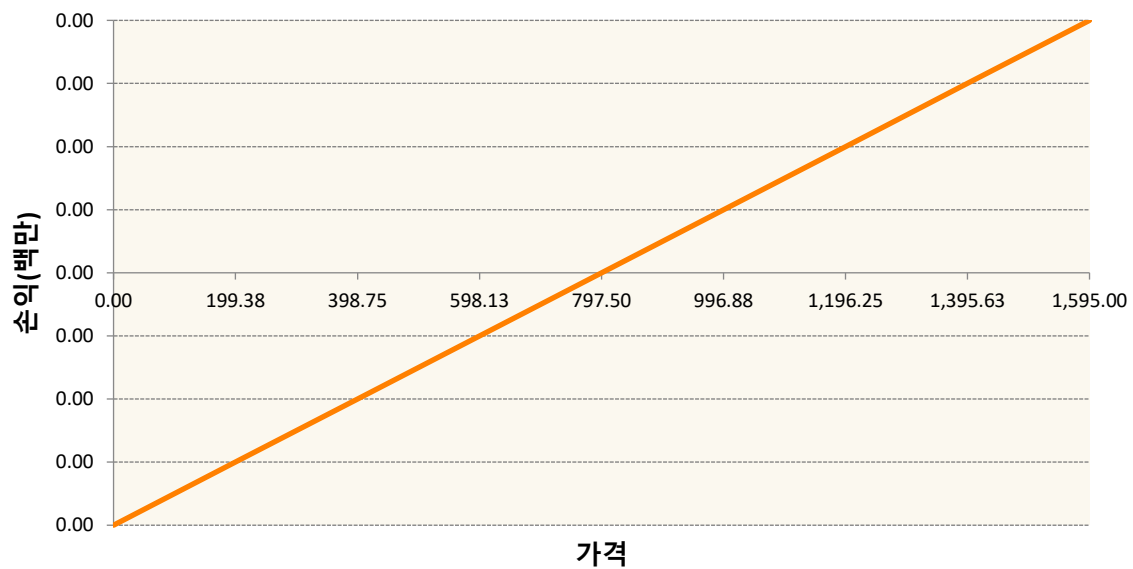
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,581 | 1,972 | 6,609     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

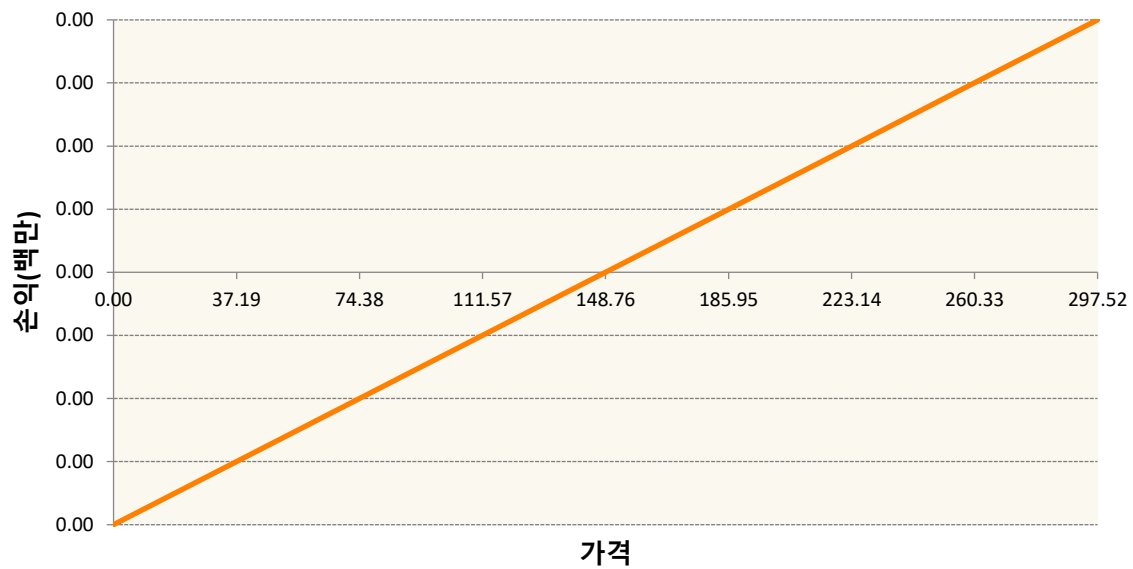
BON2-SOYBEAN OIL FUTR Jul22



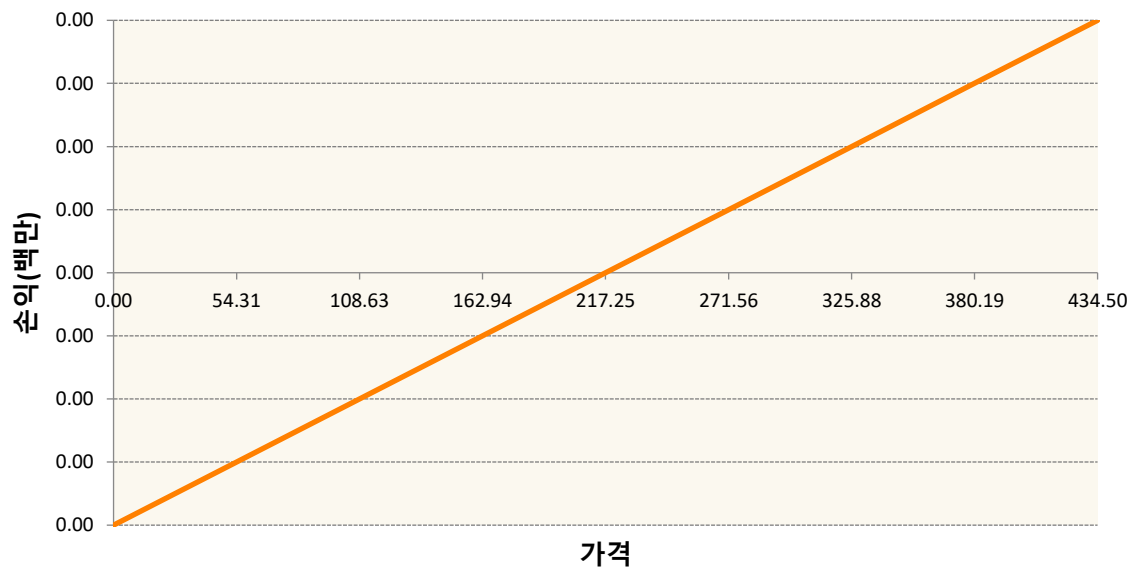
CN2-CORN FUTURE Jul22



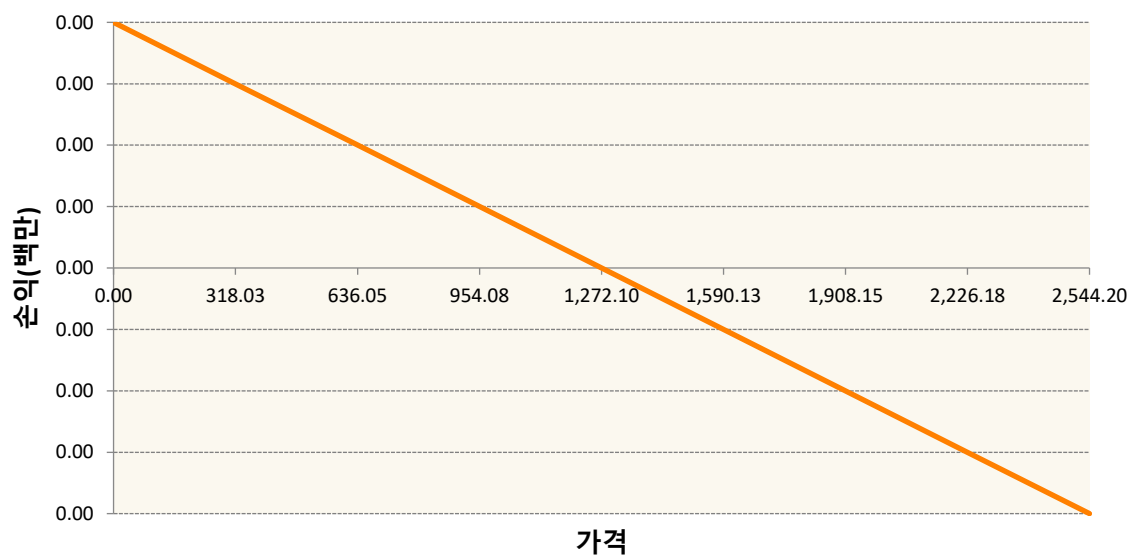
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



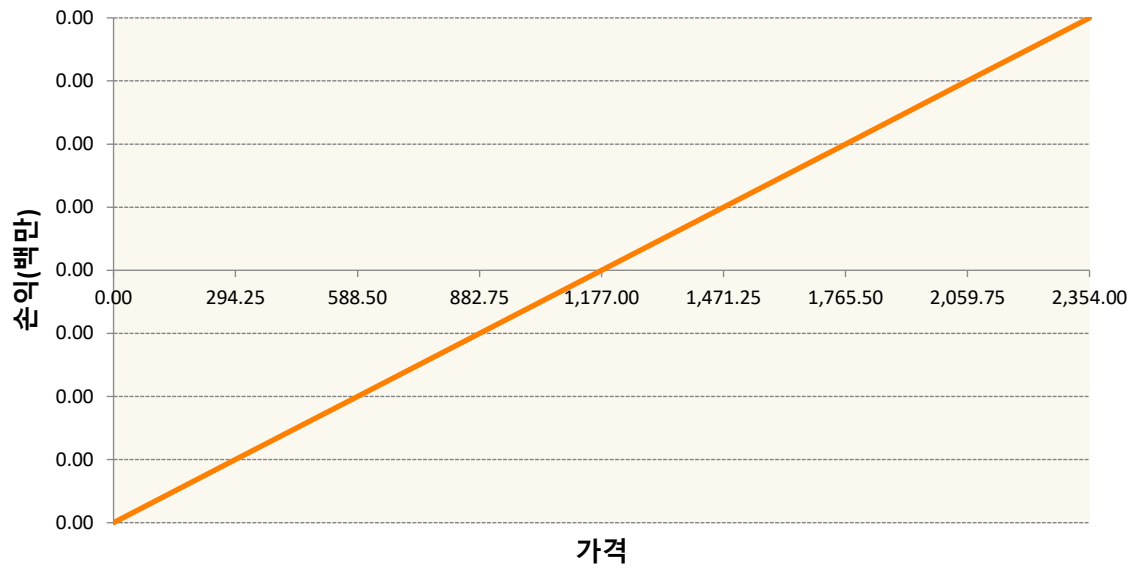
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



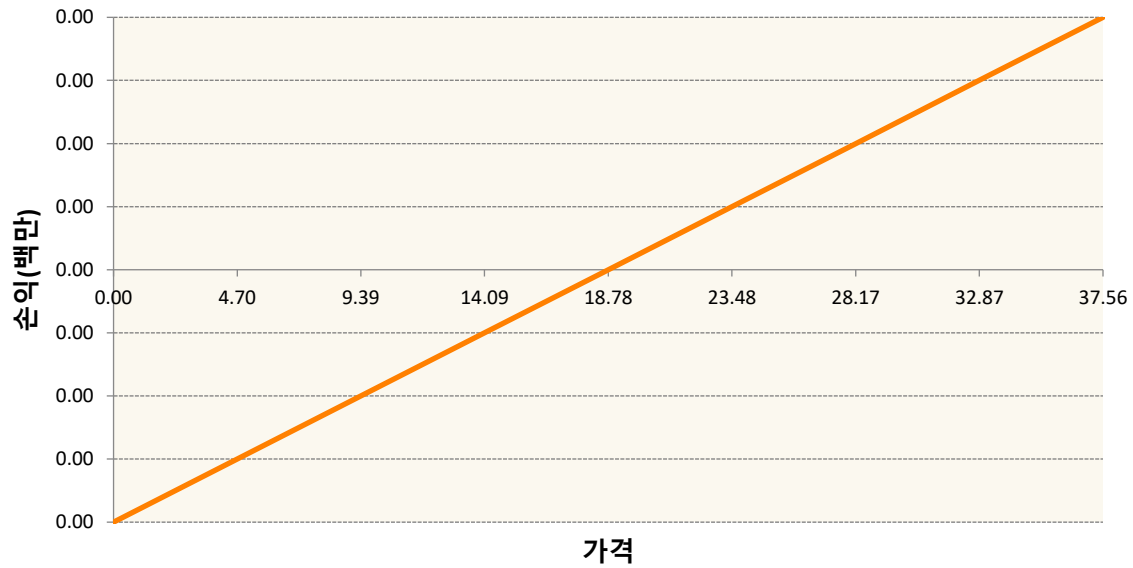
KR4175S50003-2022-05 달러선물



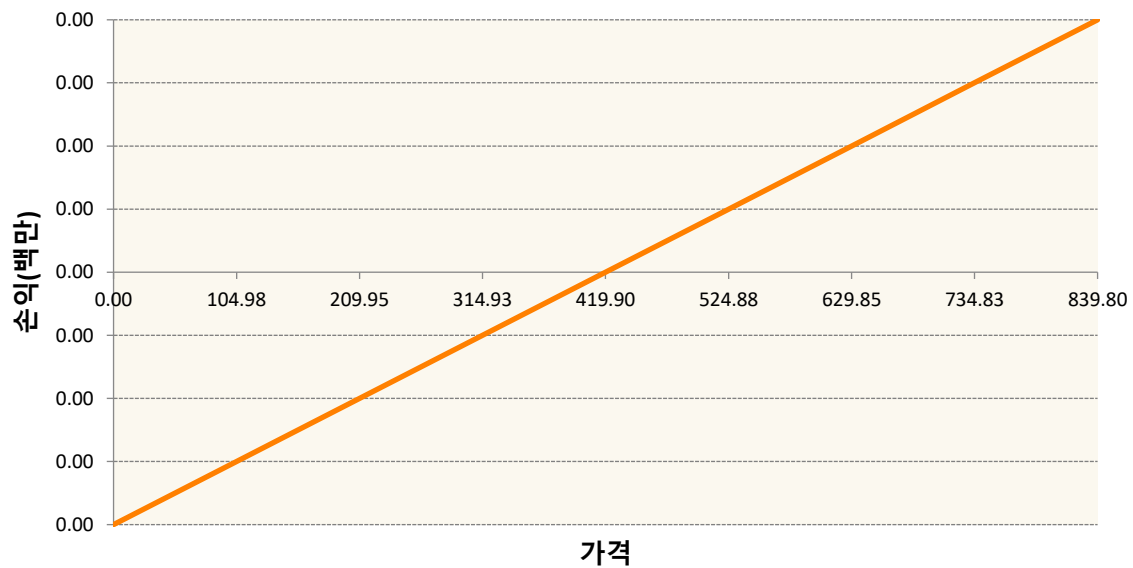
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22



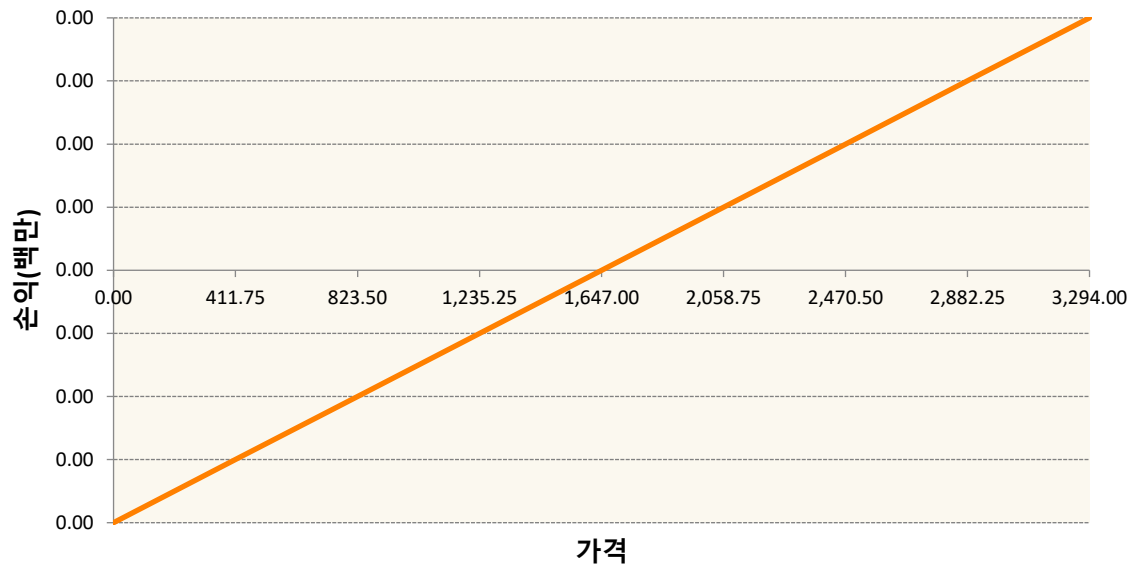
SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



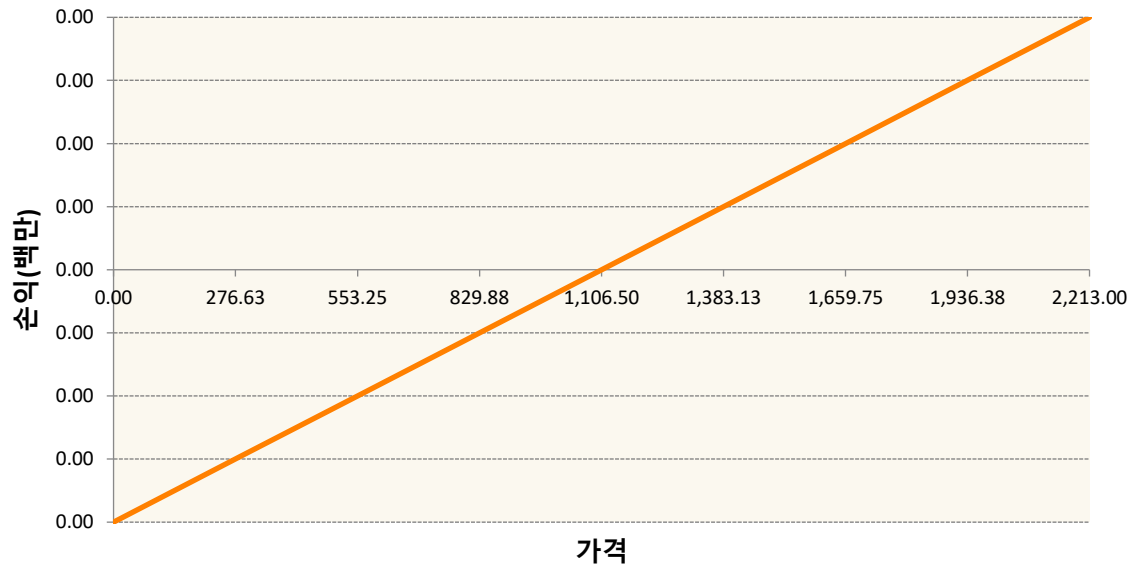
SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22



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 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

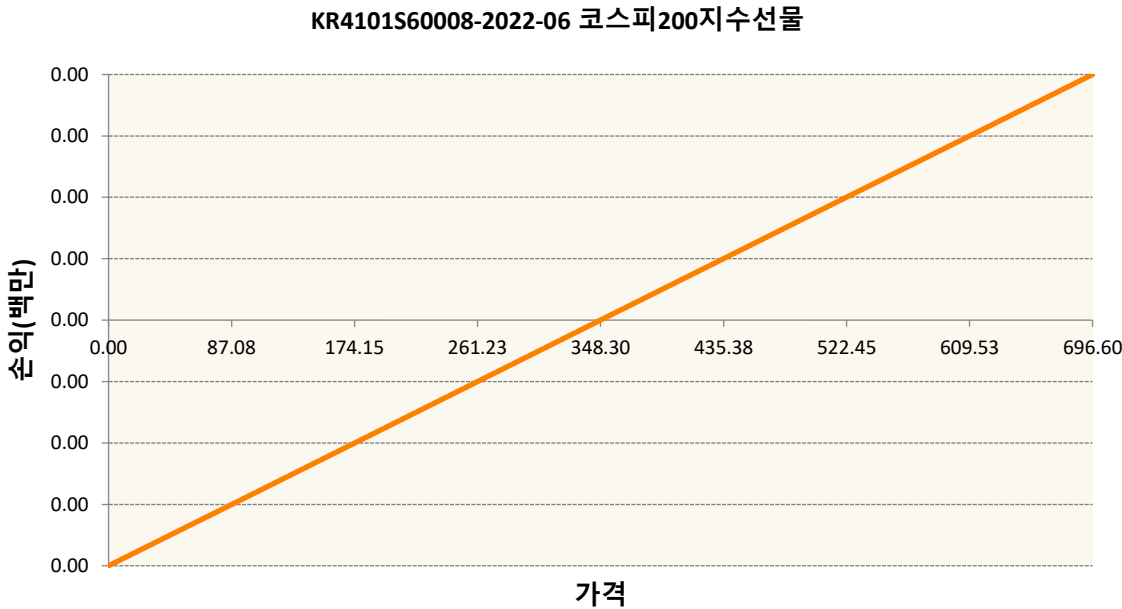
스마트인덱스모

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   | 784   | 0     | 784       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 63     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -63       | -63     | -63                | -63 | -63   | -63    | -63    |
| -5.33%       | -42       | -42     | -42                | -42 | -42   | -42    | -42    |
| -2.67%       | -21       | -21     | -21                | -21 | -21   | -21    | -21    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 21        | 21      | 21                 | 21  | 21    | 21     | 21     |
| 5.33%        | 42        | 42      | 42                 | 42  | 42    | 42     | 42     |
| 8.00%        | 63        | 63      | 63                 | 63  | 63    | 63     | 63     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

## 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

336

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

414

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

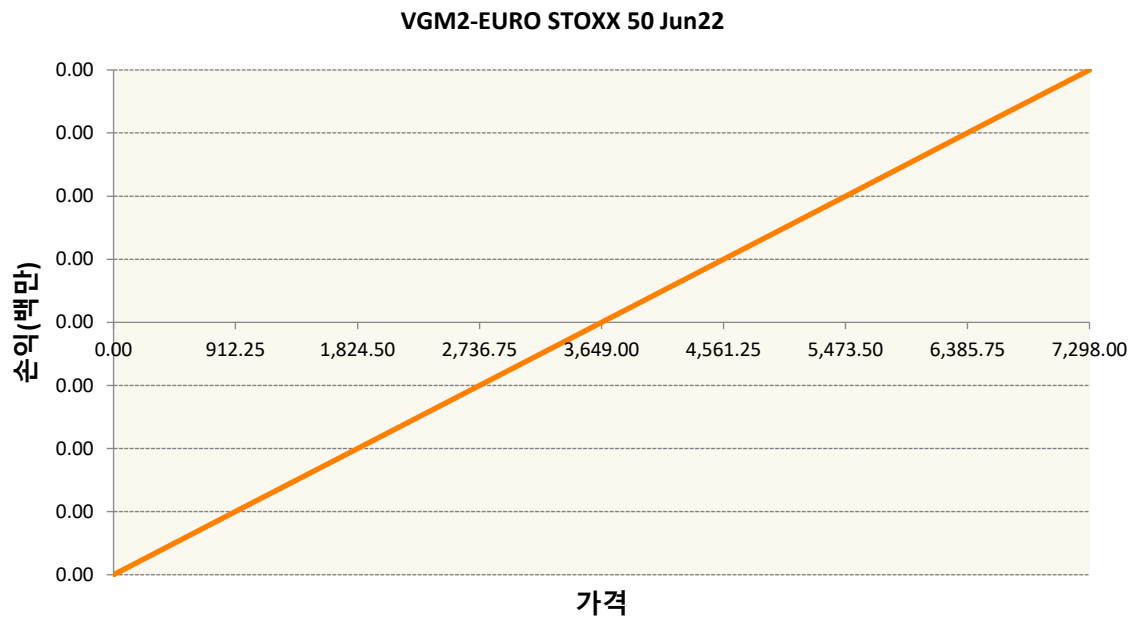
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGM2 | EURO STOXX 50 Jun22 | 44 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

41

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

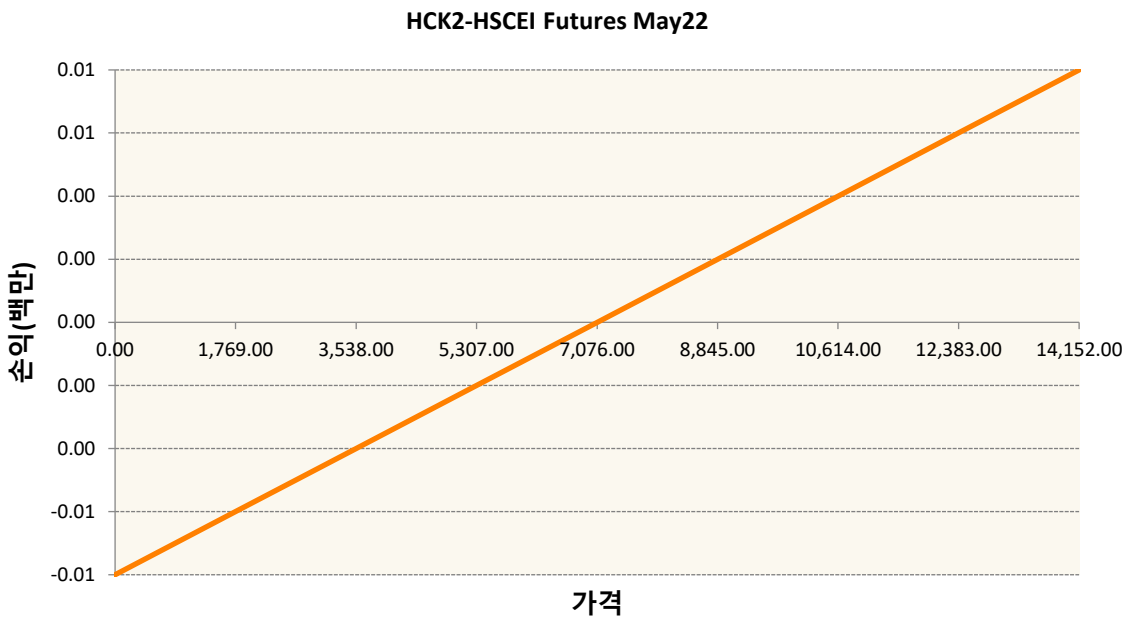
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,141 | 0     | 1,141     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCK2 | HSCEI Futures May22 | 91 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 126 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

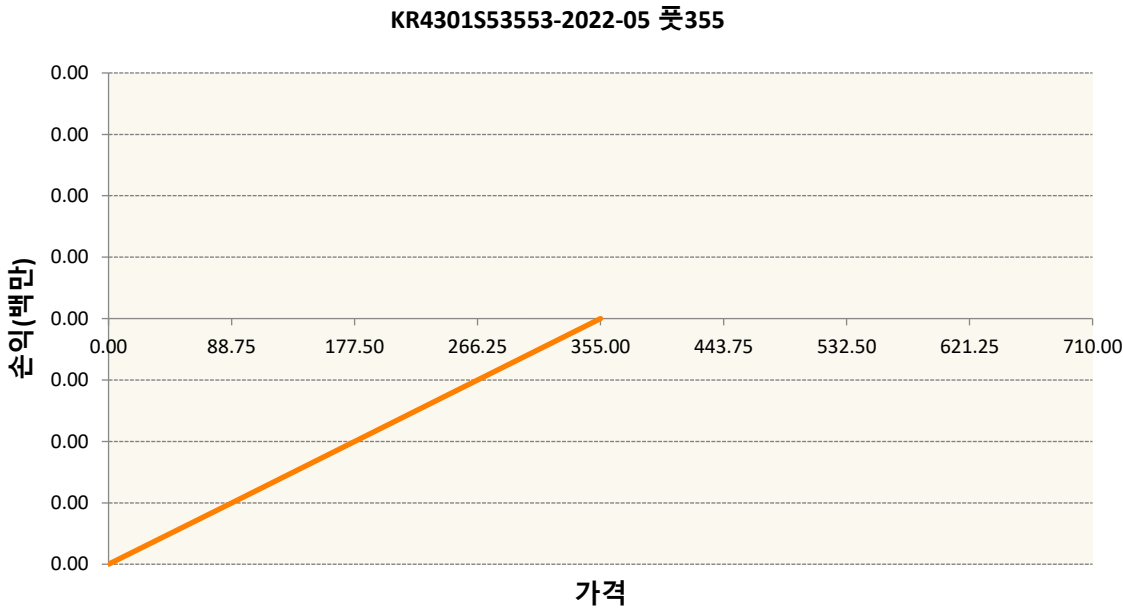
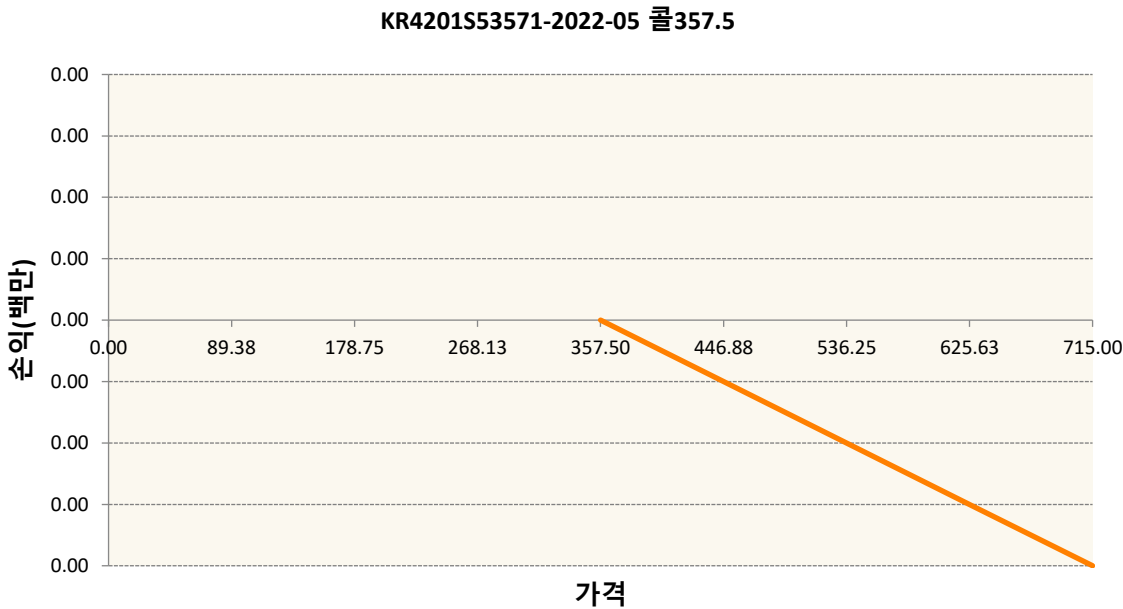
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

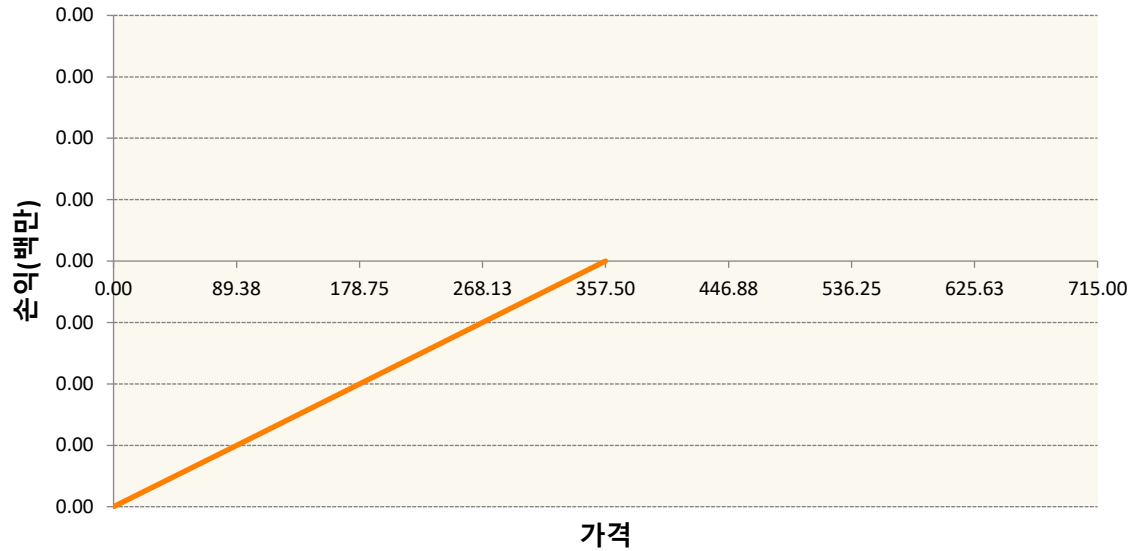
(단위:백만원)

| 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)

| KR4201S53571 2022-05 콜357.5 |         |         |        |        |        |        |        | 2,852 |
|-----------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성                   |         |         |        |        |        |        |        |       |
| 가격                          | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%                      | 374     | 373     | 373    | 371    | 369    | 364    | 358    |       |
| -5.33%                      | 371     | 368     | 362    | 353    | 341    | 325    | 306    |       |
| -2.67%                      | 343     | 323     | 298    | 268    | 233    | 195    | 153    |       |
| 0%                          | 174     | 118     | 60     | 0      | -62    | -126   | -191   |       |
| 2.67%                       | -359    | -433    | -508   | -582   | -656   | -730   | -804   |       |
| 5.33%                       | -1,357  | -1,408  | -1,463 | -1,521 | -1,581 | -1,644 | -1,707 |       |
| 8.00%                       | -2,663  | -2,682  | -2,707 | -2,737 | -2,771 | -2,810 | -2,852 |       |
| KR4301S53553 2022-05 풋355   |         |         |        |        |        |        |        | 244   |
| 기초자산의 변동성                   |         |         |        |        |        |        |        |       |
| 가격                          | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%                      | -244    | -244    | -244   | -244   | -244   | -244   | -244   |       |
| -5.33%                      | -158    | -158    | -158   | -158   | -158   | -158   | -159   |       |
| -2.67%                      | -72     | -73     | -73    | -74    | -75    | -76    | -77    |       |
| 0%                          | 7       | 5       | 2      | 0      | -2     | -5     | -7     |       |
| 2.67%                       | 55      | 53      | 50     | 47     | 44     | 42     | 39     |       |
| 5.33%                       | 68      | 68      | 67     | 65     | 64     | 62     | 61     |       |
| 8.00%                       | 69      | 69      | 69     | 69     | 69     | 68     | 68     |       |
| KR4301S53579 2022-05 풋357.5 |         |         |        |        |        |        |        | 674   |
| 기초자산의 변동성                   |         |         |        |        |        |        |        |       |
| 가격                          | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |       |
| -8.00%                      | -674    | -674    | -674   | -674   | -674   | -674   | -674   |       |
| -5.33%                      | -441    | -441    | -441   | -441   | -441   | -442   | -442   |       |
| -2.67%                      | -209    | -209    | -210   | -211   | -213   | -214   | -217   |       |
| 0%                          | 14      | 10      | 5      | 0      | -5     | -11    | -17    |       |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 174 | 166 | 158 | 150 | 142 | 134 | 126 |
| 5.33% | 230 | 226 | 222 | 218 | 213 | 207 | 202 |
| 8.00% | 236 | 236 | 235 | 234 | 233 | 231 | 229 |

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

(단위:백만원)

3,799

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

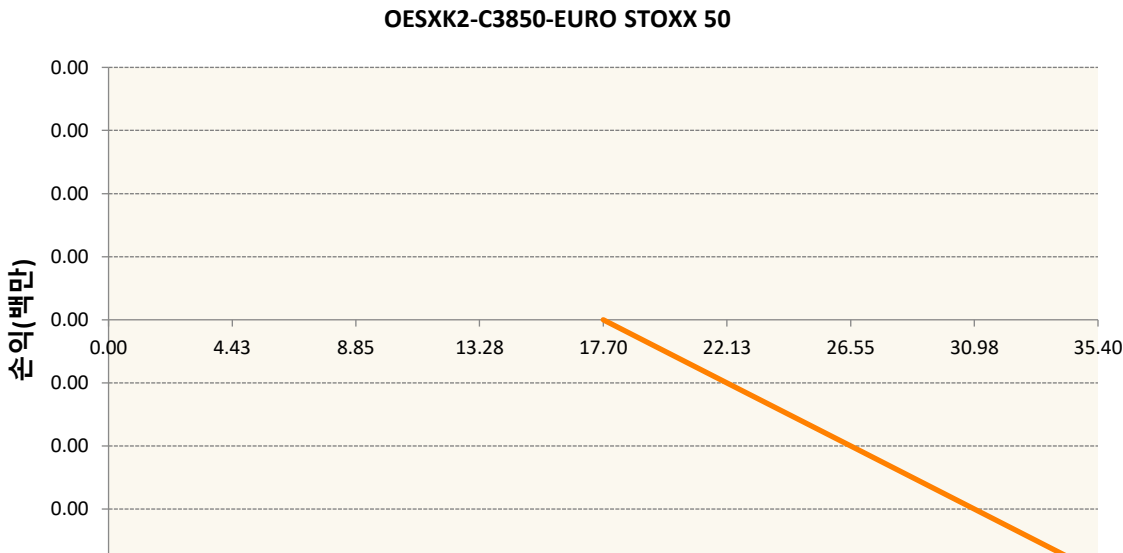
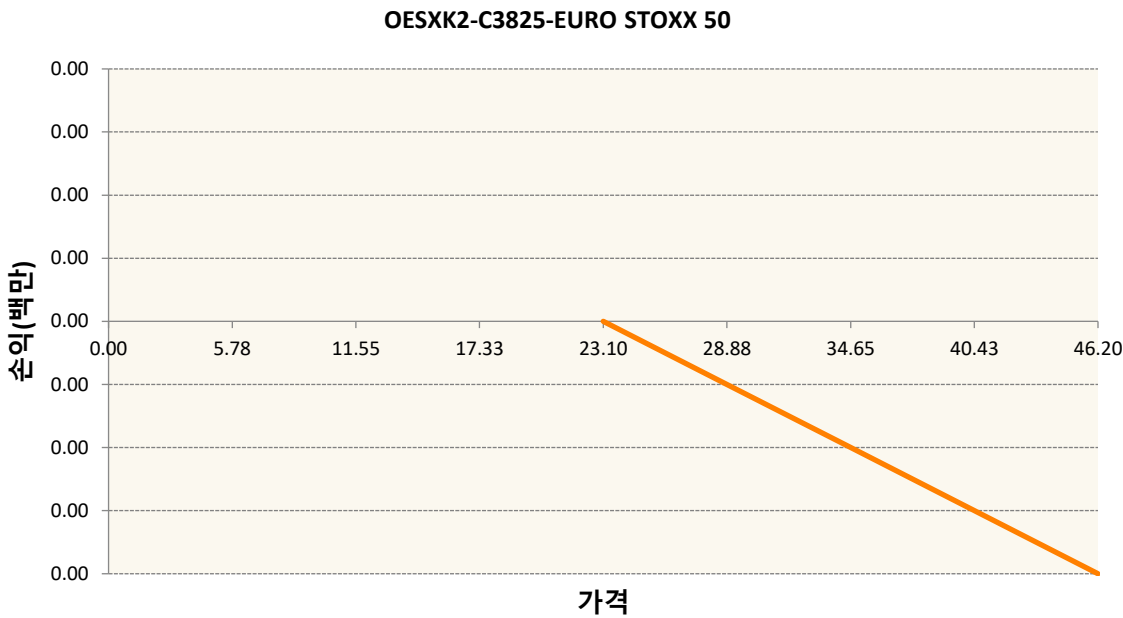
## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

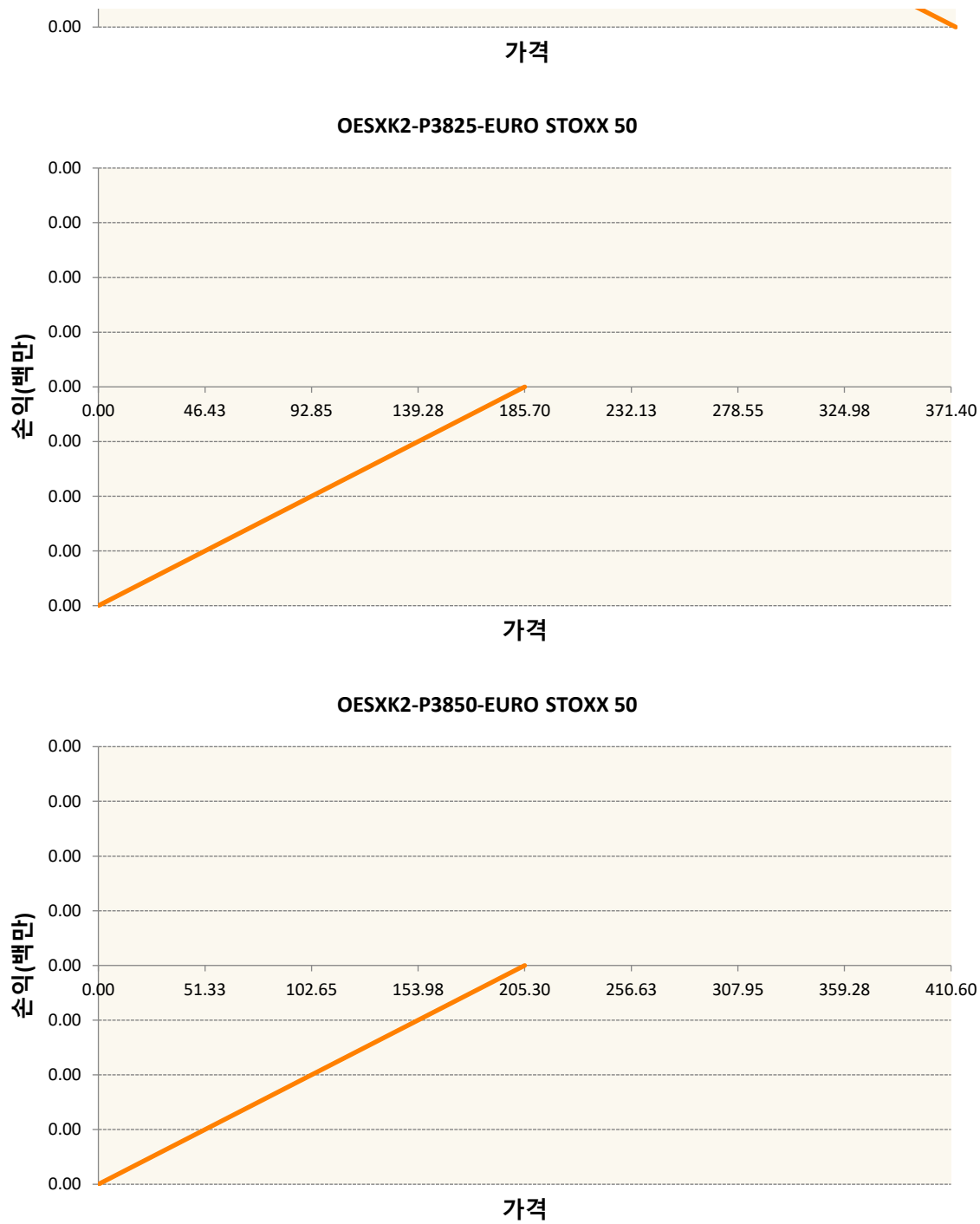
### 1. 계약금액

(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     | 80    | -80       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,472 | -1,472    | 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

|      |
|------|
| 26   |
| 21   |
| 64   |
| 32   |
| 0.02 |
| 0.49 |
| 0.2  |
| 6    |



공시일 2022-05-09

기준일 2022-05-06

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

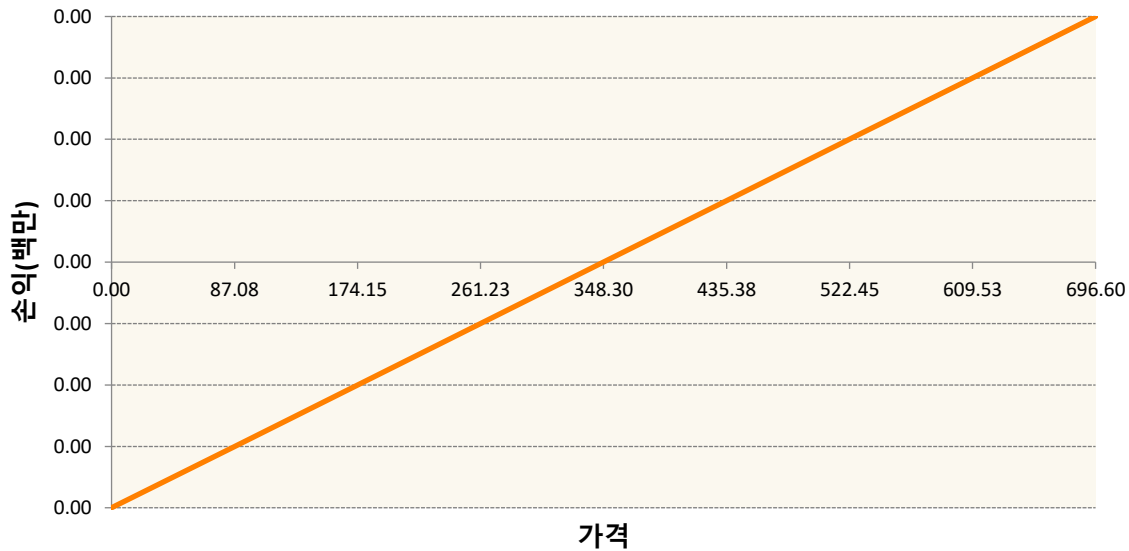
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

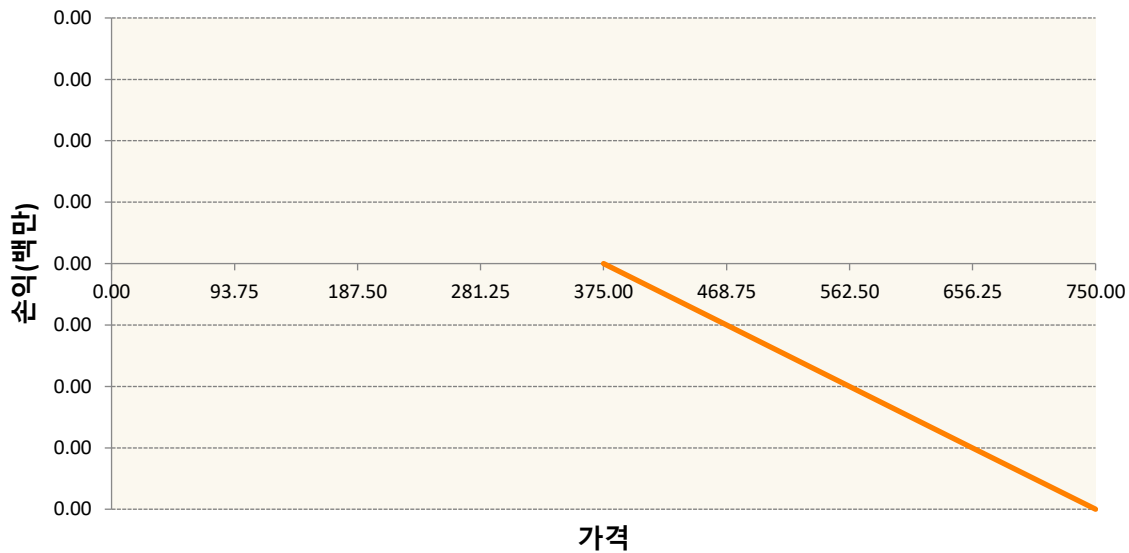
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 610   | 0     | 610       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 268   | 4,878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

### 2. 만기시점의 손익구조

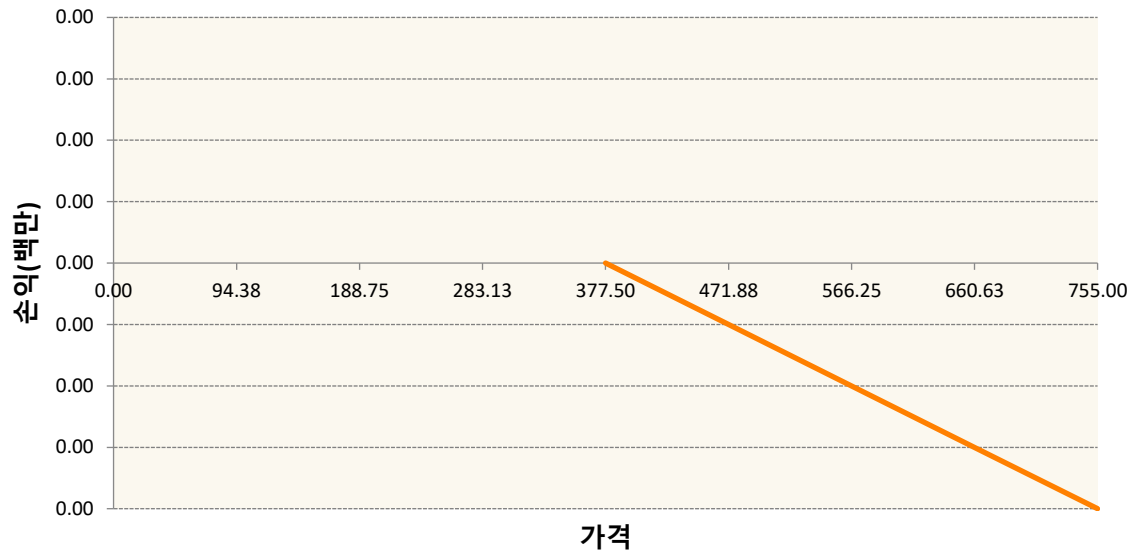
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



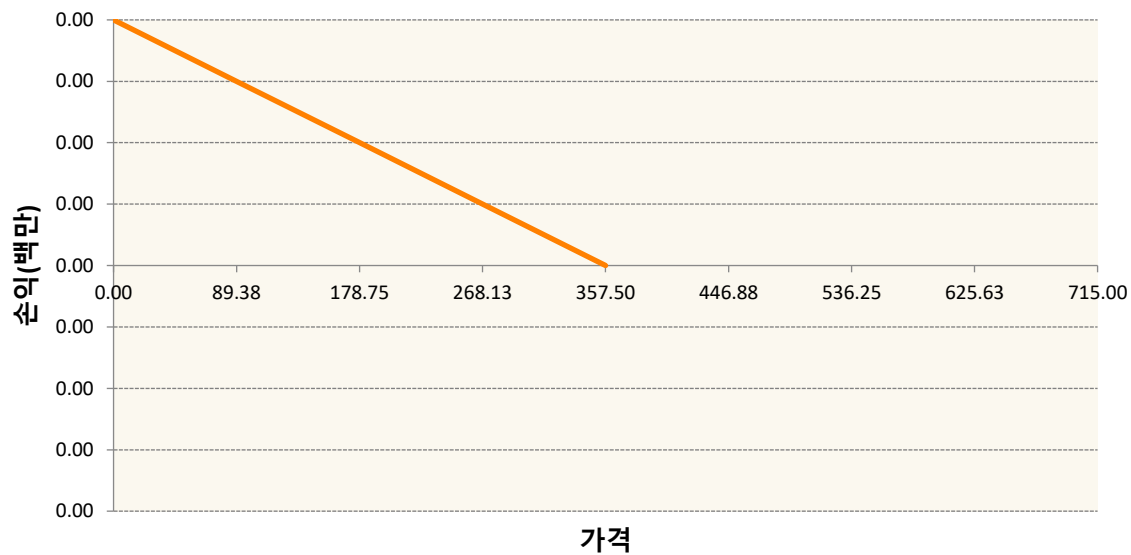
KR4201S53753-2022-05 콜375



KR4201S53779-2022-05 콜377.5



KR4301S53579-2022-05 ㄲ357.5



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |                    |        |     |       |        |        |
|--------------|-----------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
| KR4101S60008 |           | 2022-06 코스피200지수선물 |        |     |       |        | 49     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -49       | -49                | -49    | -49 | -49   | -49    | -49    |
| -5.33%       | -33       | -33                | -33    | -33 | -33   | -33    | -33    |
| -2.67%       | -16       | -16                | -16    | -16 | -16   | -16    | -16    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 16        | 16                 | 16     | 16  | 16    | 16     | 16     |
| 5.33%        | 33        | 33                 | 33     | 33  | 33    | 33     | 33     |
| 8.00%        | 49        | 49                 | 49     | 49  | 49    | 49     | 49     |
| KR4201S53753 |           | 2022-05 콜375       |        |     |       |        | 98     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |

| 가격                               | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|----------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| -8.00%                           | 3       | 3       | 3      | 3   | 3     | 3      | 2      |
| -5.33%                           | 3       | 3       | 3      | 3   | 2     | 2      | 2      |
| -2.67%                           | 3       | 2       | 2      | 2   | 2     | 1      | 1      |
| 0%                               | 2       | 2       | 1      | 0   | -1    | -3     | -5     |
| 2.67%                            | -1      | -3      | -6     | -9  | -12   | -15    | -19    |
| 5.33%                            | -18     | -22     | -27    | -33 | -38   | -43    | -48    |
| 8.00%                            | -63     | -69     | -74    | -80 | -86   | -92    | -98    |
| KR4201S53779      2022-05 콜377.5 |         |         |        |     |       |        | 9      |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| -5.33%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| -2.67%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 0       | 0       | 0      | -1 | -1    | -1     | -2     |
| 5.33%     | -1      | -2      | -2     | -3 | -3    | -4     | -4     |
| 8.00%     | -5      | -6      | -6     | -7 | -8    | -8     | -9     |

| KR4301S53579      2022-05 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%                           | 13      | 13      | 13     | 13 | 13    | 13     | 13     |
| -2.67%                           | 6       | 6       | 6      | 6  | 6     | 6      | 6      |
| 0%                               | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 1      |
| 2.67%                            | -5      | -5      | -5     | -5 | -4    | -4     | -4     |
| 5.33%                            | -7      | -7      | -7     | -7 | -6    | -6     | -6     |
| 8.00%                            | -7      | -7      | -7     | -7 | -7    | -7     | -7     |

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

(단위:백만원)

112

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

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 | 9,482 | 0     | 9,482     |    |

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 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

## 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 | 7,283 | 0     | 7,283     |    |

### 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 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

## 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 | 23,067 | 0      | 23,067    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,973  | 25,619 | -23,647   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |                                 |
|-----------------------------|---------------------------------|
| FXW213C4MKRW/USD 27-06-22E  | 2,050                           |
| FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E | 122                             |
| FXW213C52 USD/KRW 27-06-22E | 36                              |
| IE00BD8RGM75                | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

760

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

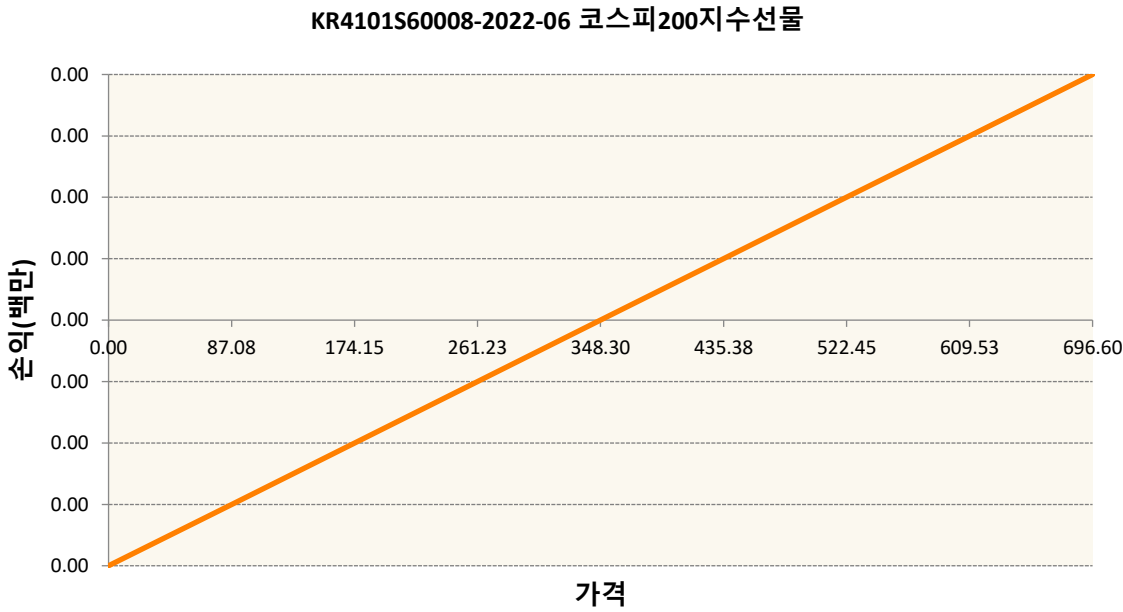
# 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

## 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   | 1,219 | 0     | 1,219     | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 98     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -98       | -98     | -98                | -98 | -98   | -98    | -98    |
| -5.33%       | -65       | -65     | -65                | -65 | -65   | -65    | -65    |
| -2.67%       | -33       | -33     | -33                | -33 | -33   | -33    | -33    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 33        | 33      | 33                 | 33  | 33    | 33     | 33     |
| 5.33%        | 65        | 65      | 65                 | 65  | 65    | 65     | 65     |
| 8.00%        | 98        | 98      | 98                 | 98  | 98    | 98     | 98     |



공시일 2022-05-09

기준일 2022-05-06

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

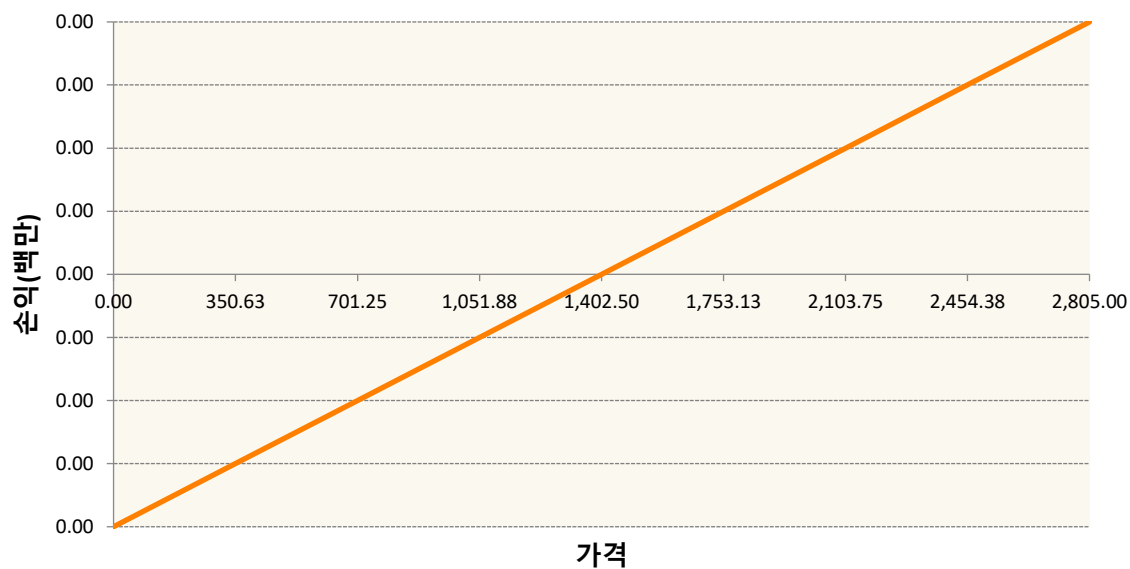
### 1. 계약금액

(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   | 771   | 0     | 771       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,853 | 0     | 1,853     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 67    | 1,178 | -1,111    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCK2-VN30 Index Future May22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 148 |
| FXW213C2P KRW/EUR 20-05-22E   | 46  |
| FXW213C3G KRW/EUR 24-06-22E   | 32  |
| FXW213C4L KRW/EUR 22-07-22E   | 16  |
| FXW213C4T EUR/KRW 20-05-22E   | 5   |
| VNCK2 VN30 Index Future May22 | 62  |

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

(단위:백만원)



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

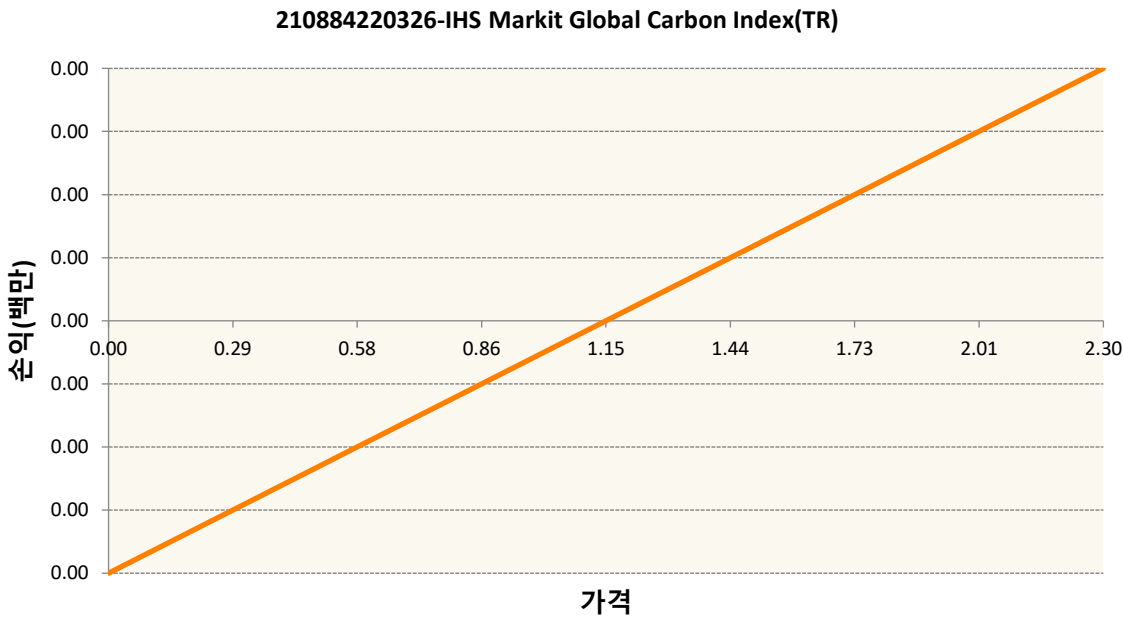
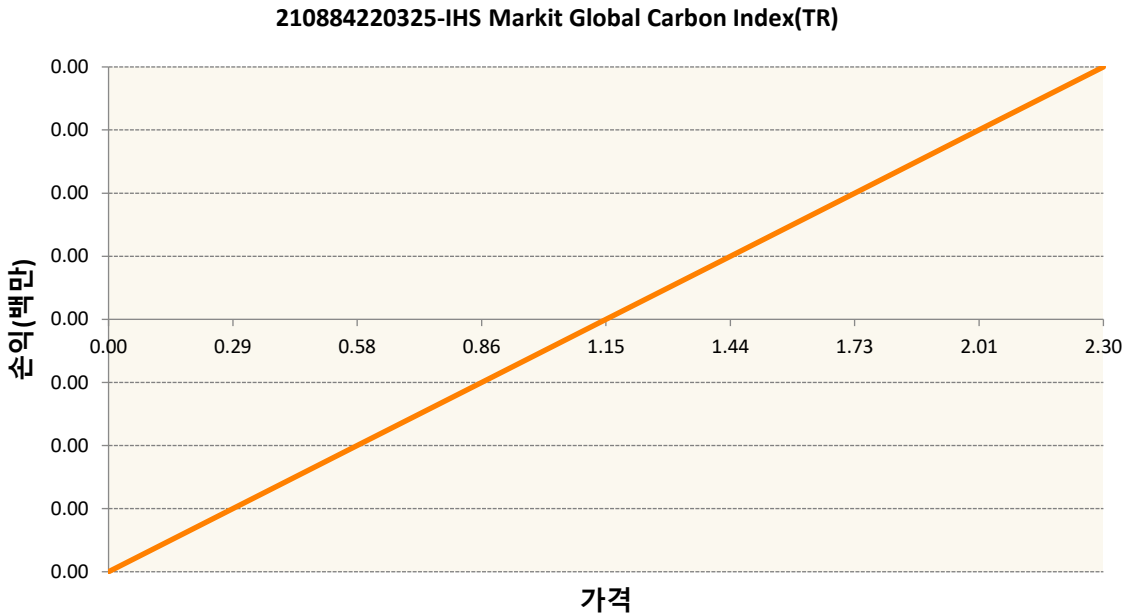
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 1. 계약금액

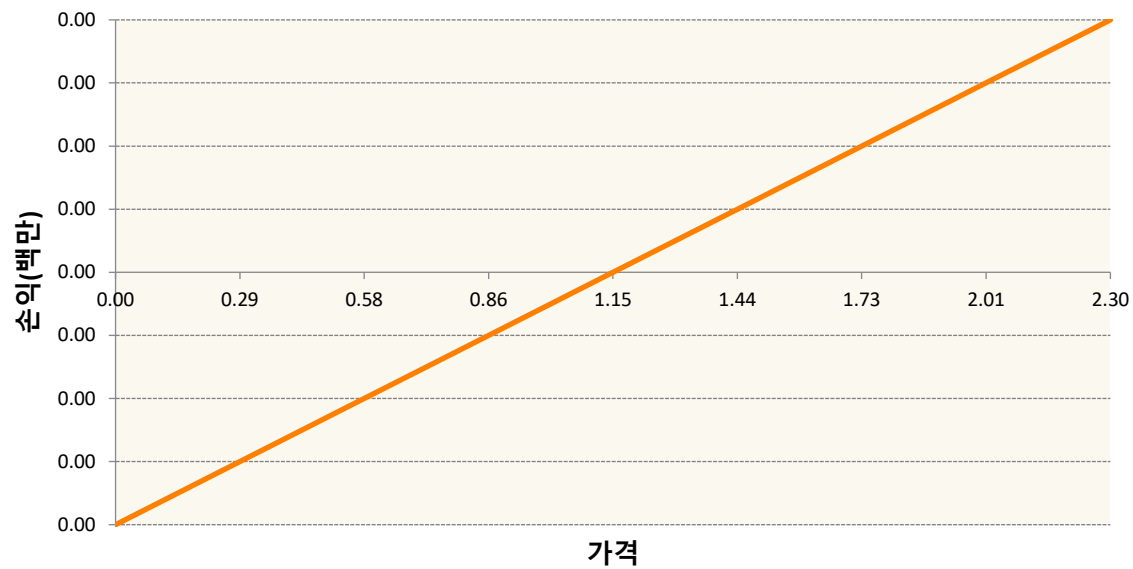
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 48,836 | 0     | 48,836    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

206

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

3,601

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

103

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

(단위:백만원)

7,221

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

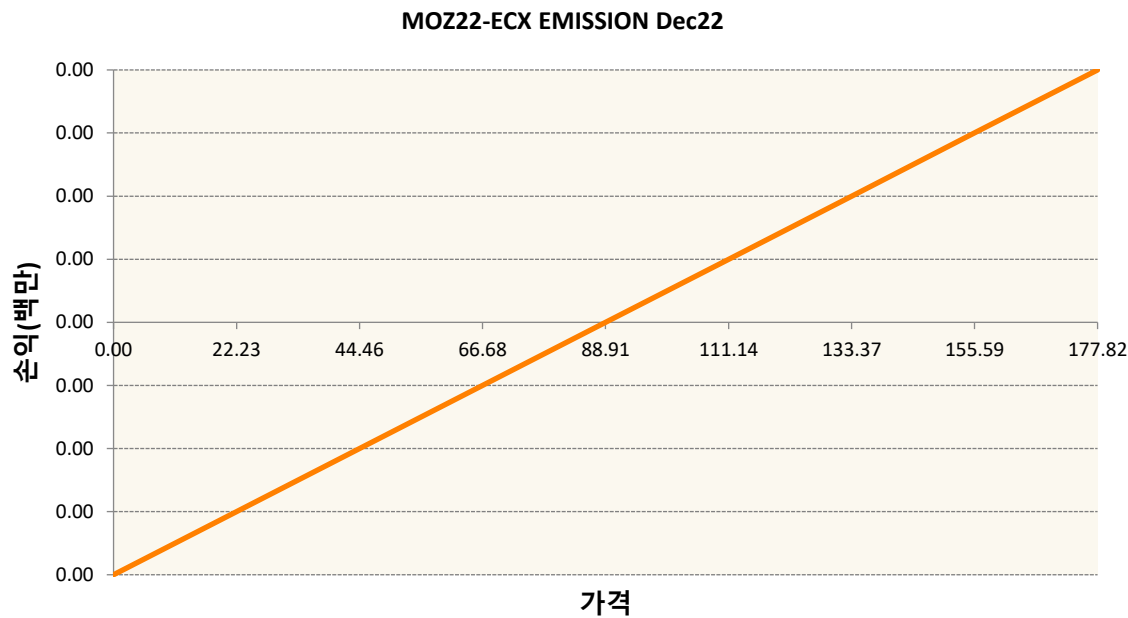
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 17,989 | 0     | 17,989    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 9,706 | -9,706    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |       |
|-----------------------------|-------|
| FXW213C4R KRW/EUR 23-05-22E | 777   |
| MOZ22 ECX EMISSION Dec22    | 1,439 |

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

(단위:백만원)

3,895

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

## 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)  | 46 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)  | 46 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)  | 46 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠) | 46 |

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

(단위:백만원)

359

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-09 |
| 기준일 | 2022-05-06 |

## 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   | 8,851 | 0     | 8,851     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |      |
|-----------------------------------------|------|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(키움)  | 8    |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 10   |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(메리츠) | 8    |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 8    |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220426(메리츠) | 0.44 |

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

(단위:백만원)

45

공시일 2022-05-09

기준일 2022-05-06

## 에퀴티알파일반사모혼합자산

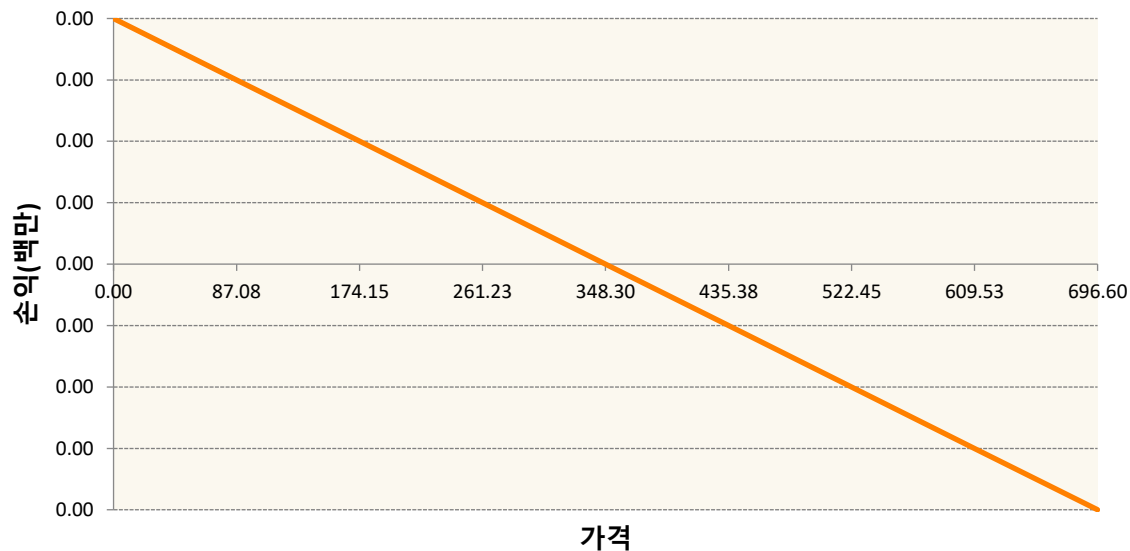
### 1. 계약금액

(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     | 2,177 | -2,177    | 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         | 174  |
| KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322 | 1    |
| KRS0003014 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0322 | 1    |
| KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331 | 0.02 |
| KRS0003070 SWAP_PRSR ST FTRS ETF_0407 | 1    |
| KRS0003070 SWAP_CRWDSTRK HLD INC_0407 | 1    |
| KRS0003086 SWAP_PRSR ST FTRS ETF_0412 | 2    |
| KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429     | 0.35 |

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

(단위:백만원)



공시일 2022-05-09

기준일 2022-05-06

## 신한SOL한국형글로벌반도체액티

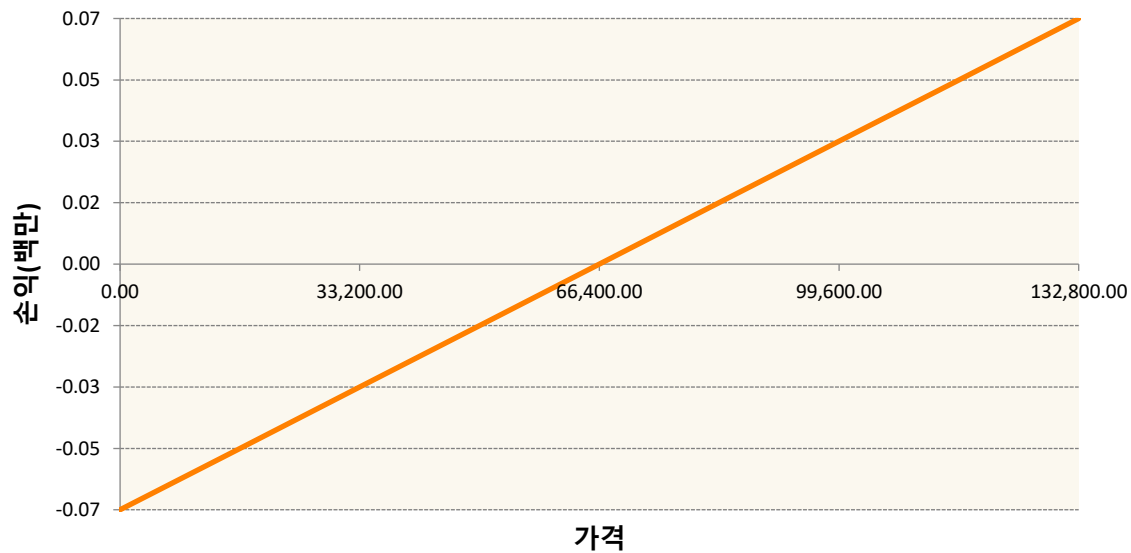
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

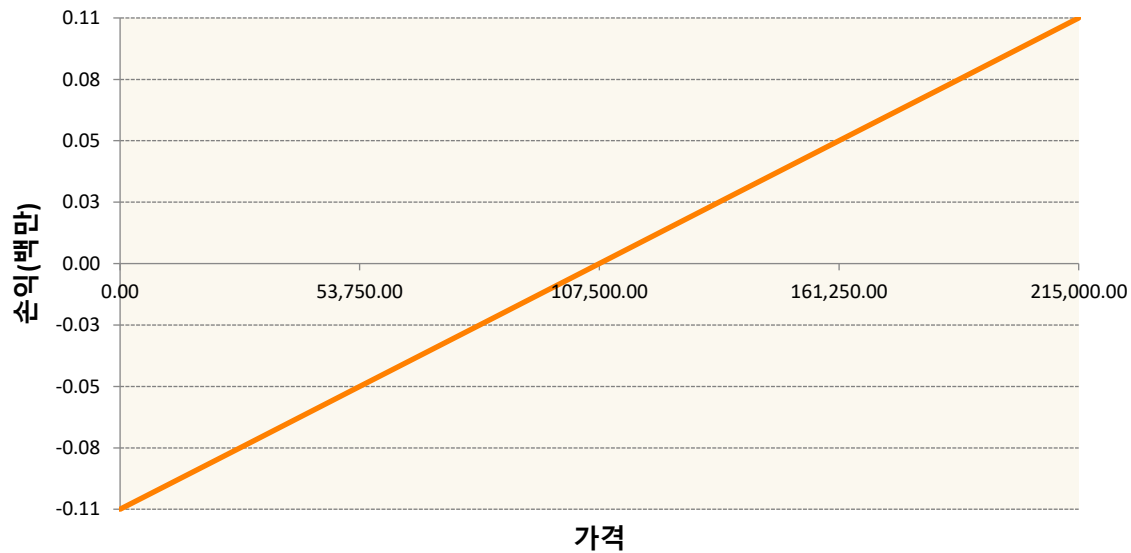
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 867   | 0     | 867       | 장내 |

### 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 |        |     |       |        | 35     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -35       | -35                | -35    | -35 | -35   | -35    | -35    |
| -5.33%       | -23       | -23                | -23    | -23 | -23   | -23    | -23    |
| -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%        | 23        | 23                 | 23     | 23  | 23    | 23     | 23     |
| 8.00%        | 35        | 35                 | 35     | 35  | 35    | 35     | 35     |

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

74

공시일 2022-05-09

기준일 2022-05-06

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

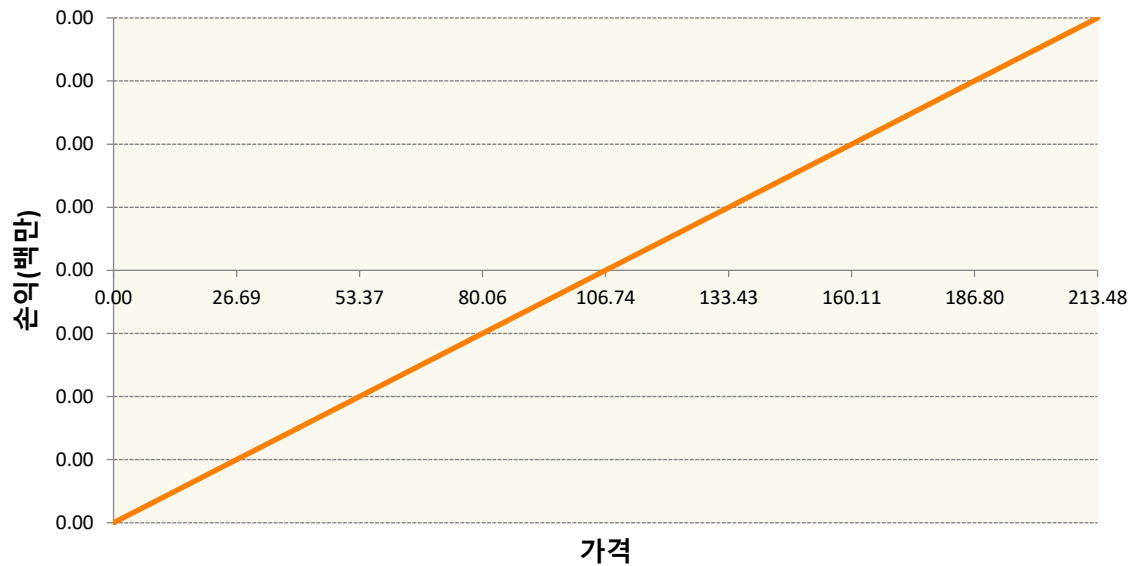
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

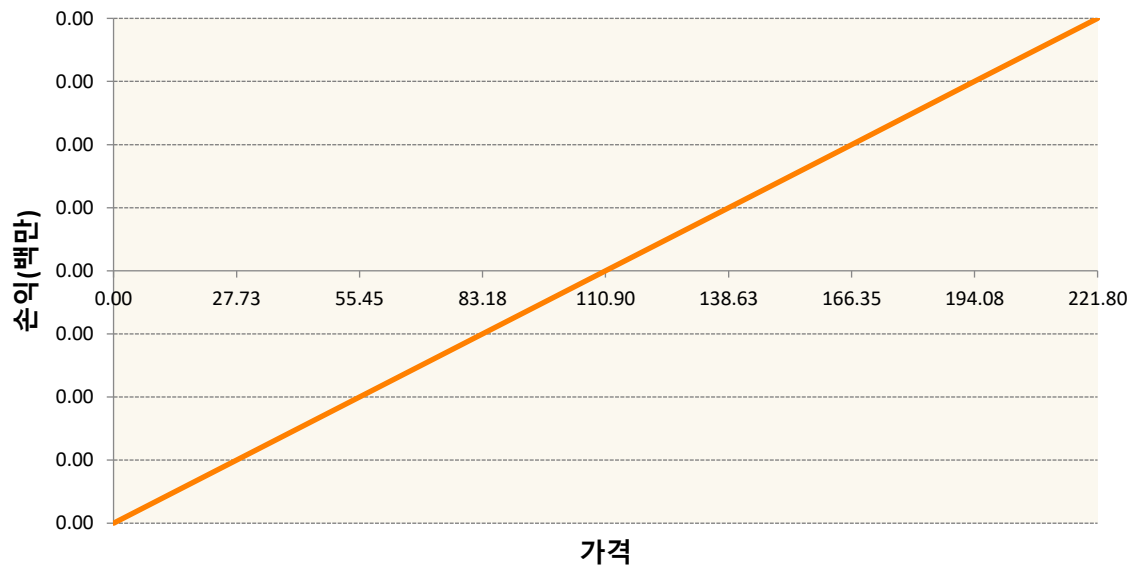
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,936 | 636   | 2,300     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

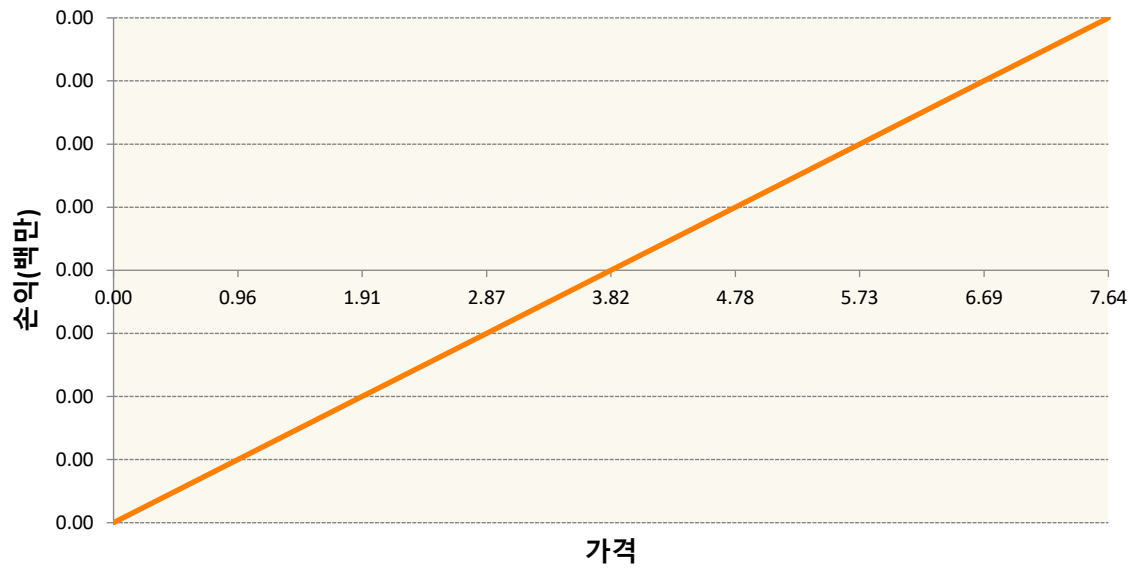
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



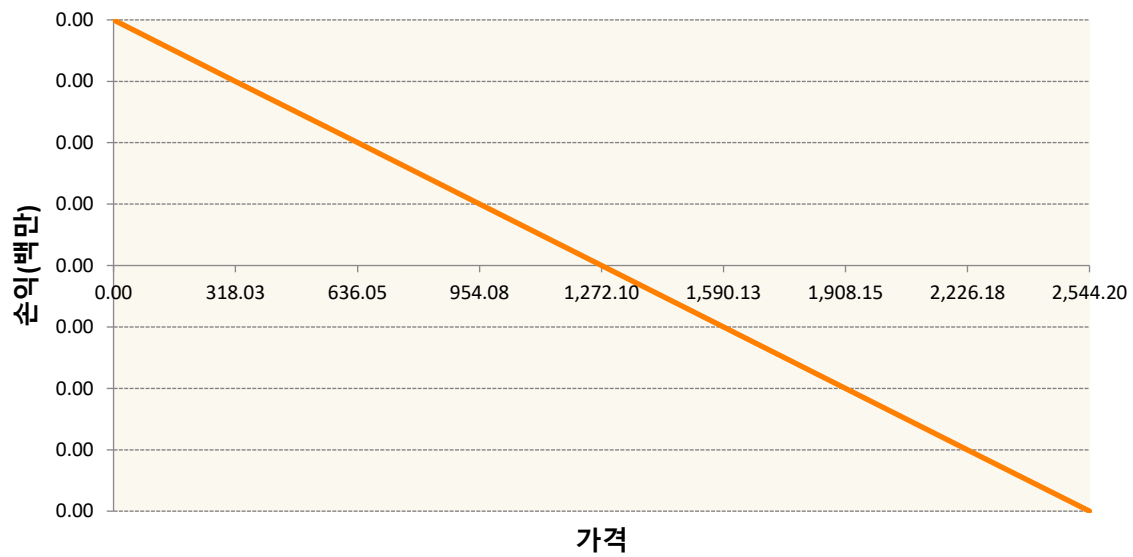
CON2-BRENT CRUDE FUTR Jul22



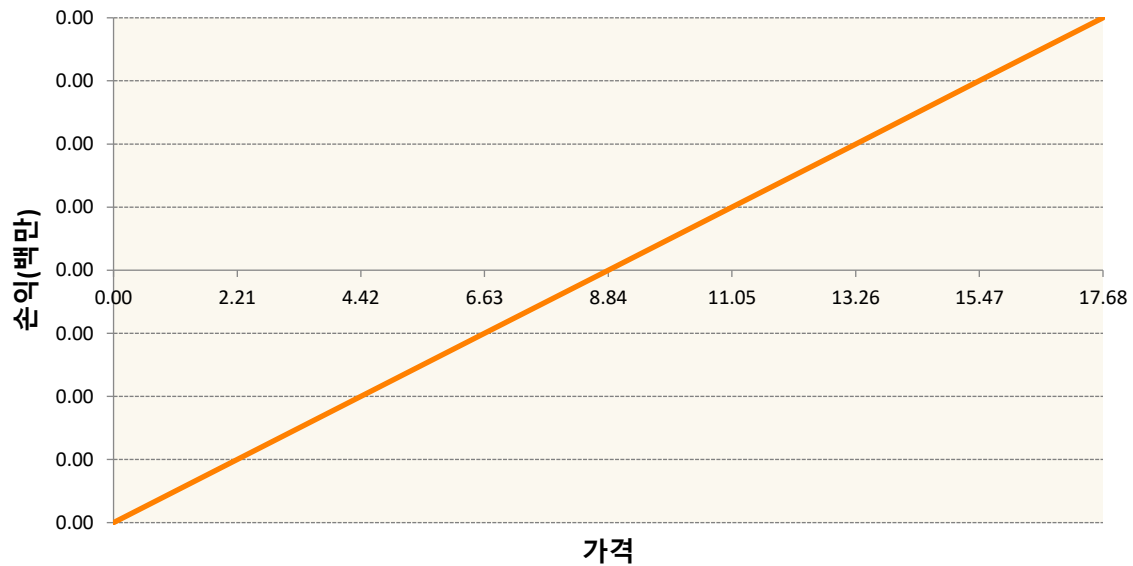
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

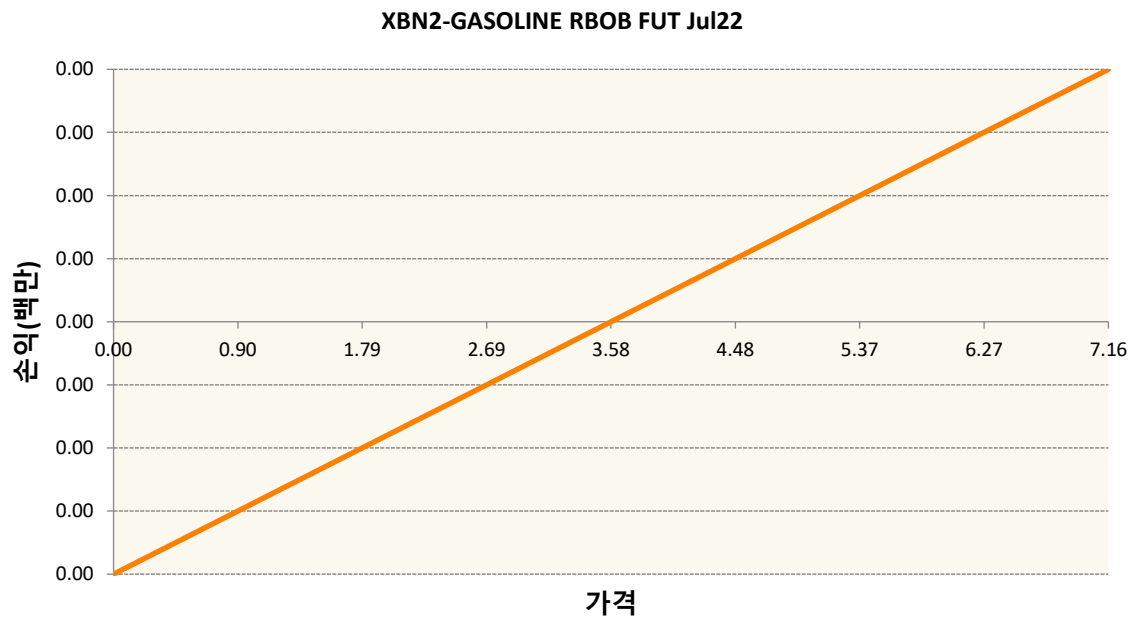
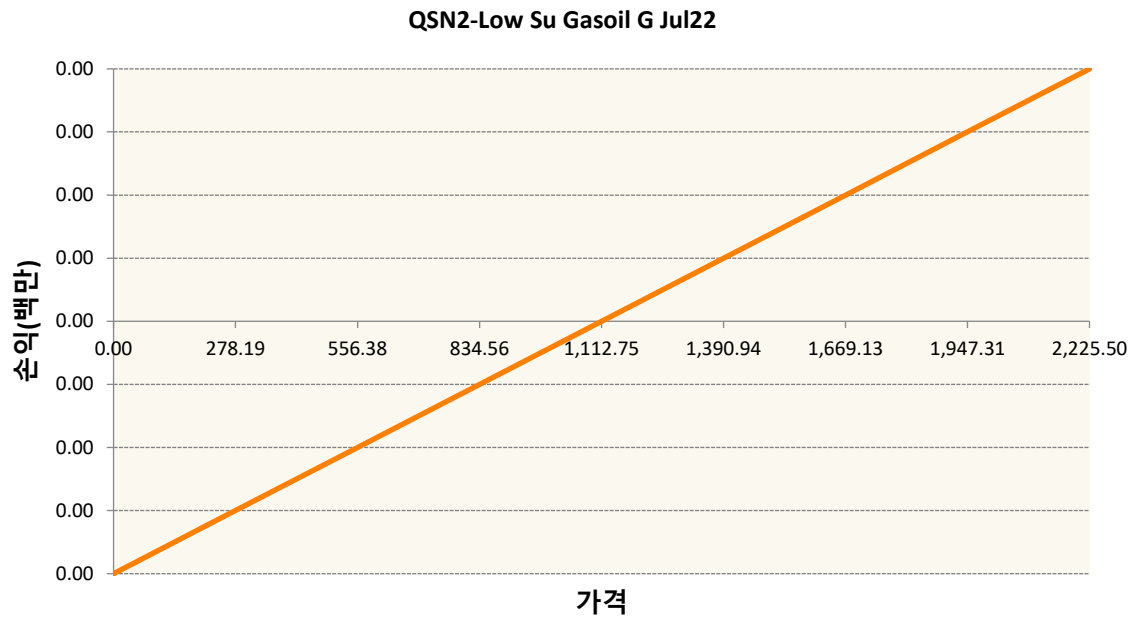


KR4175S50003-2022-05 달러선물



NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| CLN2                      | WTI CRUDE FUTURE Jul22  |  | 42       |
| CON2                      | BRENT CRUDE FUTR Jul22  |  | 44       |
| HON2                      | NY Harb ULSD Fut Jul22  |  | 16       |
| KR4175S500 2022-05 달러선물   |                         |  | 51       |
| NGN22                     | NATURAL GAS FUTR Jul22  |  | 96       |
| QSN2                      | Low Su Gasoil G Jul22   |  | 22       |
| XBN2                      | GASOLINE RBOB FUT Jul22 |  | 15       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 702      |