

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

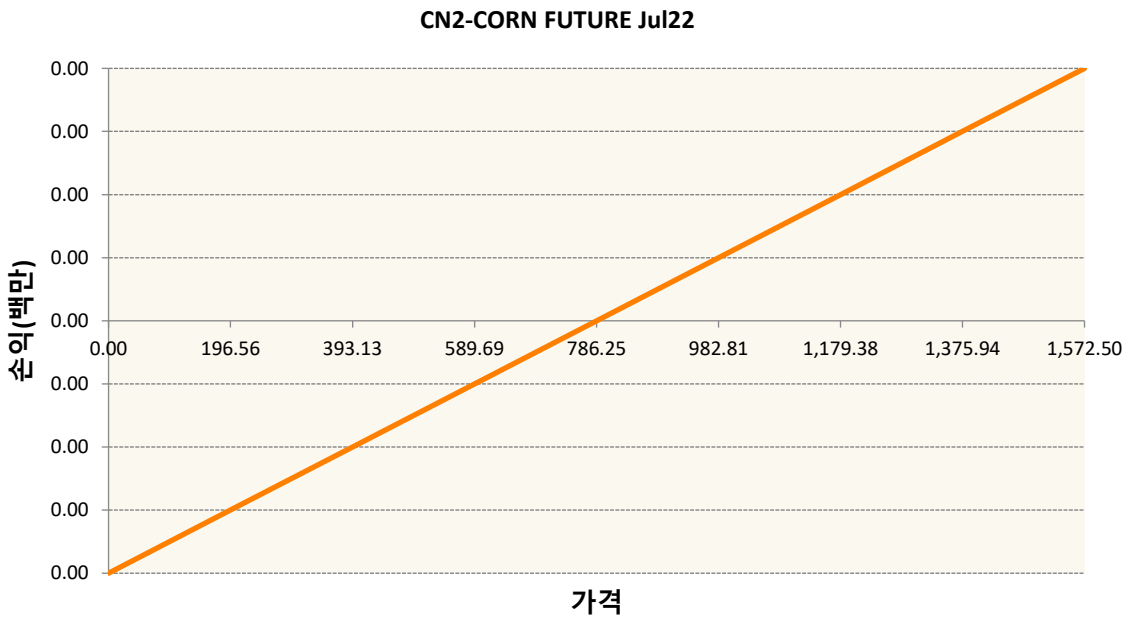
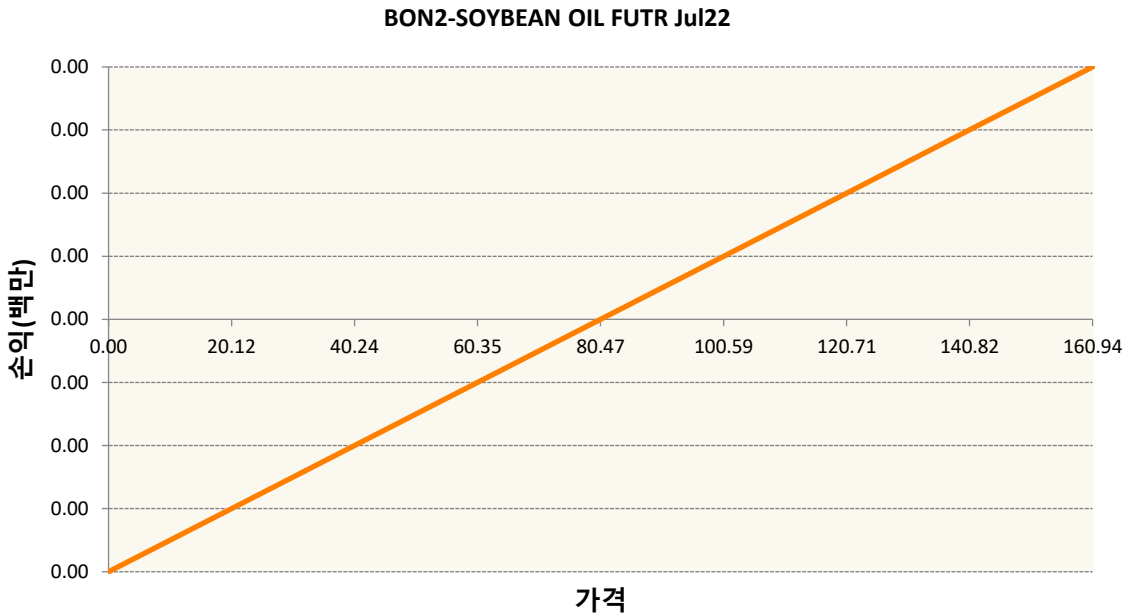
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

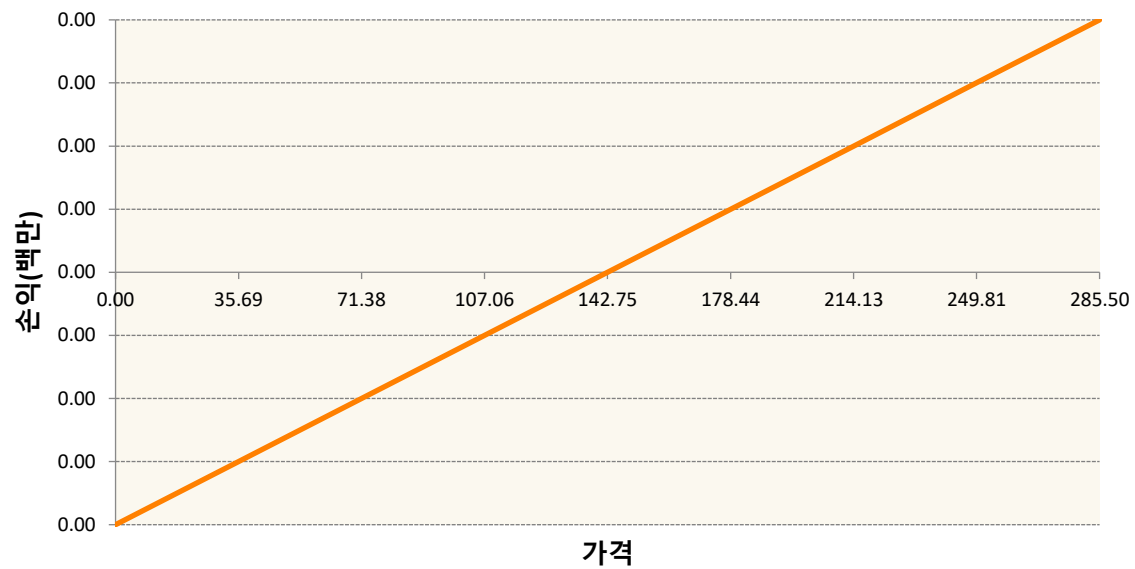
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,710 | 1,963 | 6,747     |    |

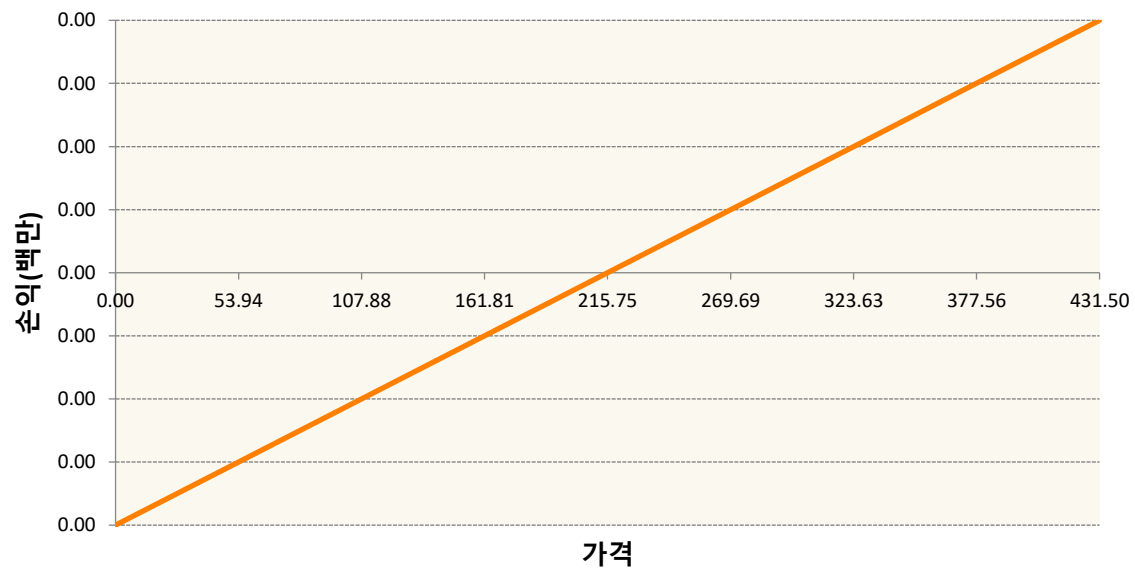
### 2. 만기시점의 손익구조



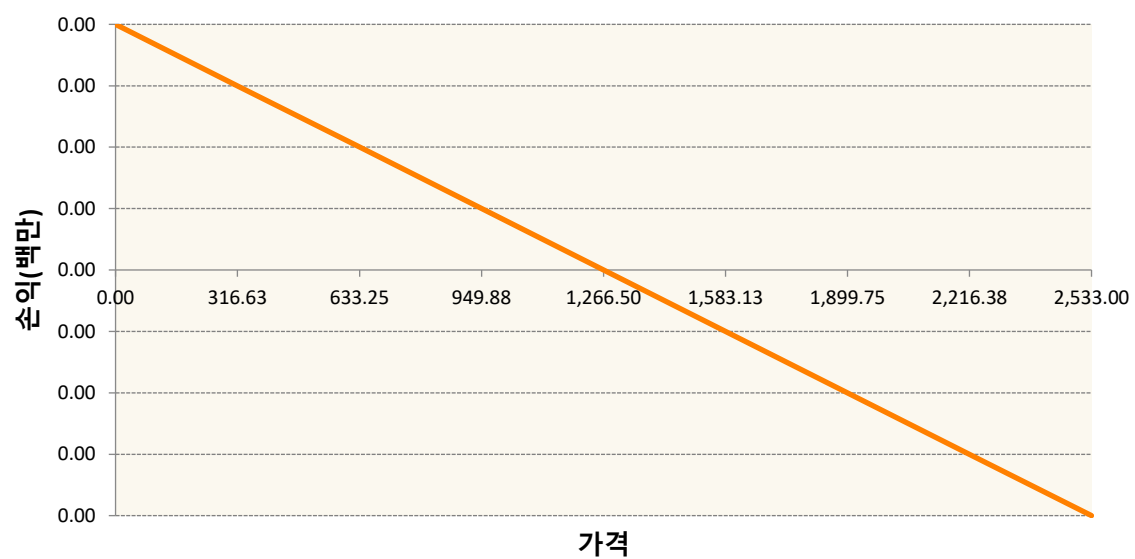
CTN2-COTTON NO.2 FUTR Jul22



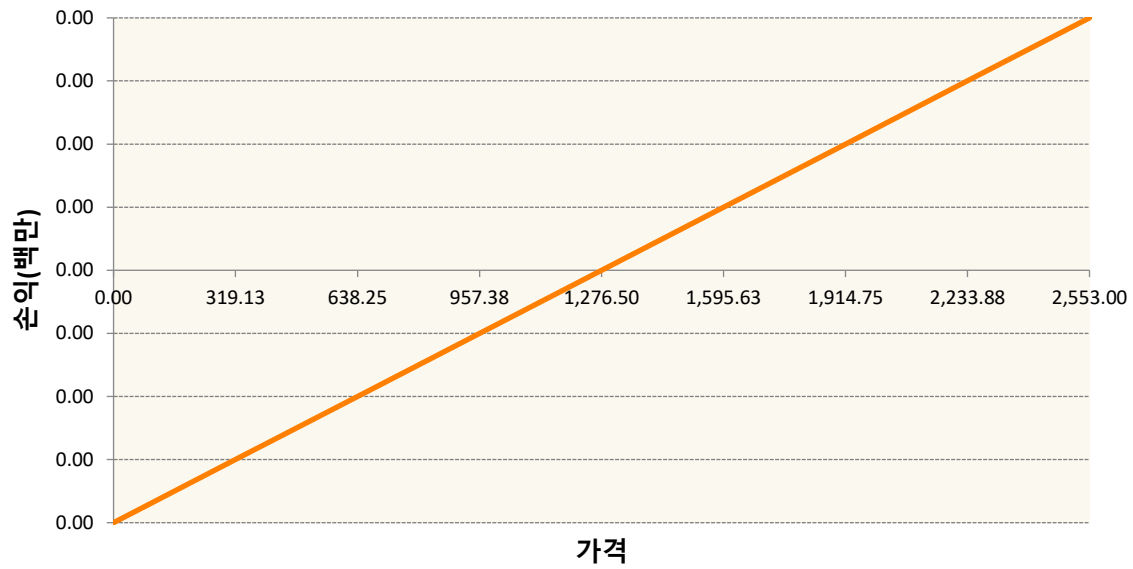
KCN2-COFFEE 'C' FUTURE Jul22



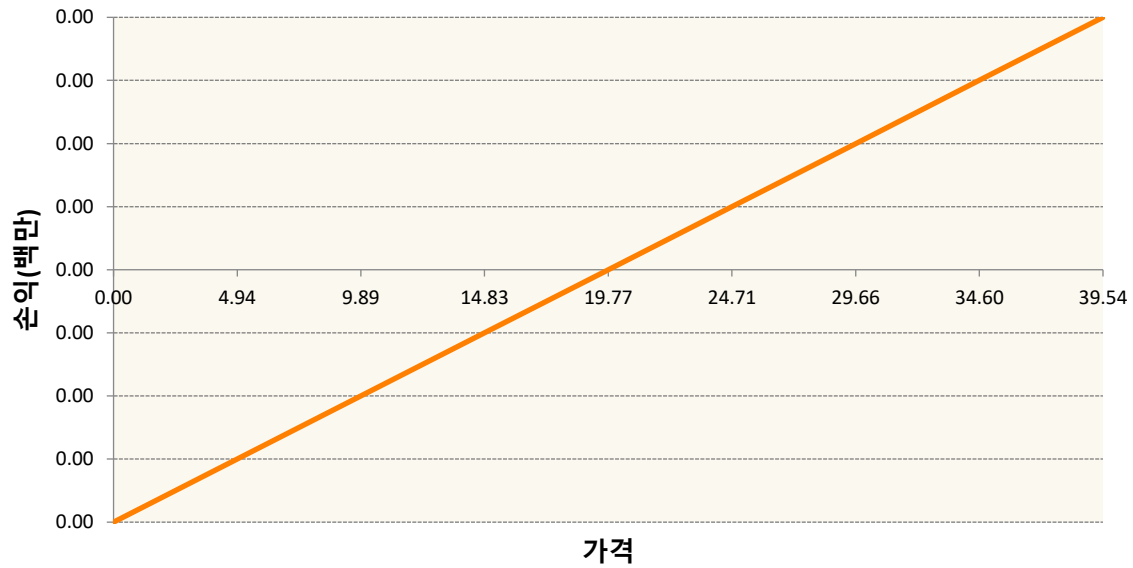
KR4175S60002-2022-06 달러선물



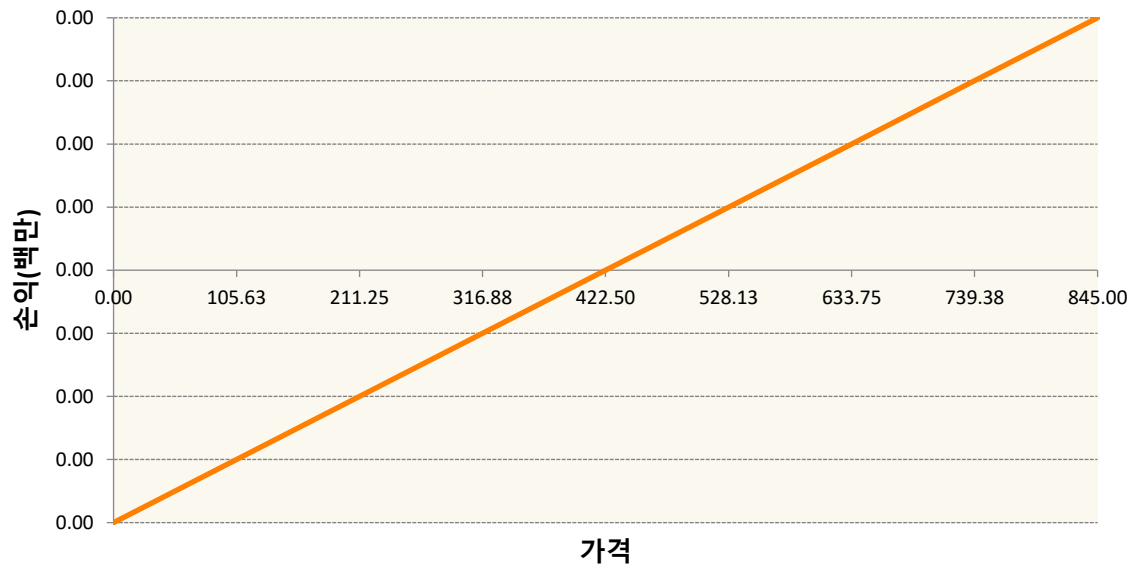
KWN2-KC HRW WHEAT FUT Jul22



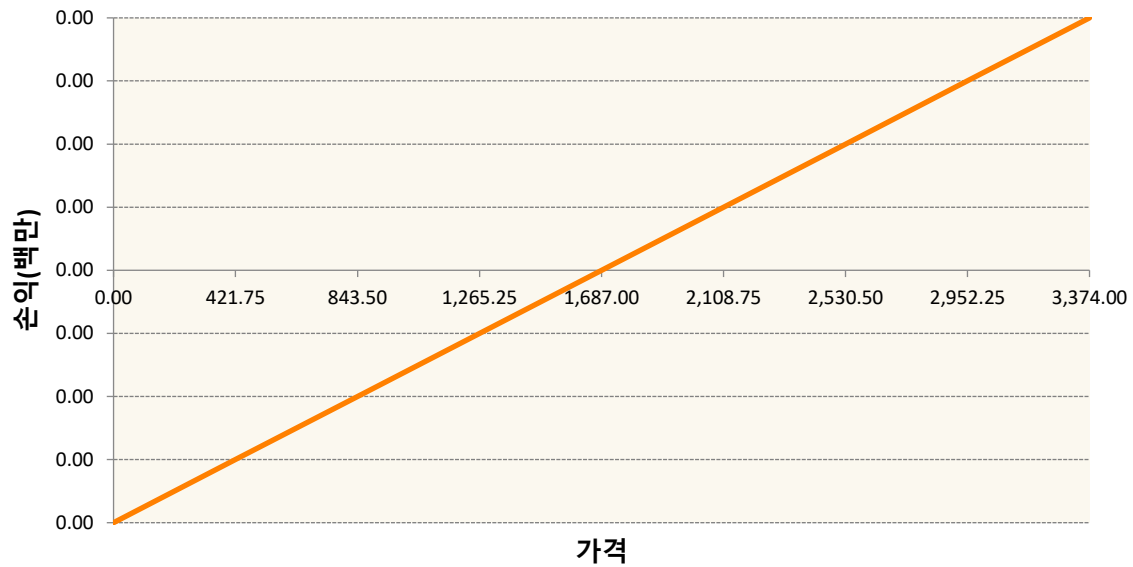
SBN2-Sugar #11 (WORLD) Jul22



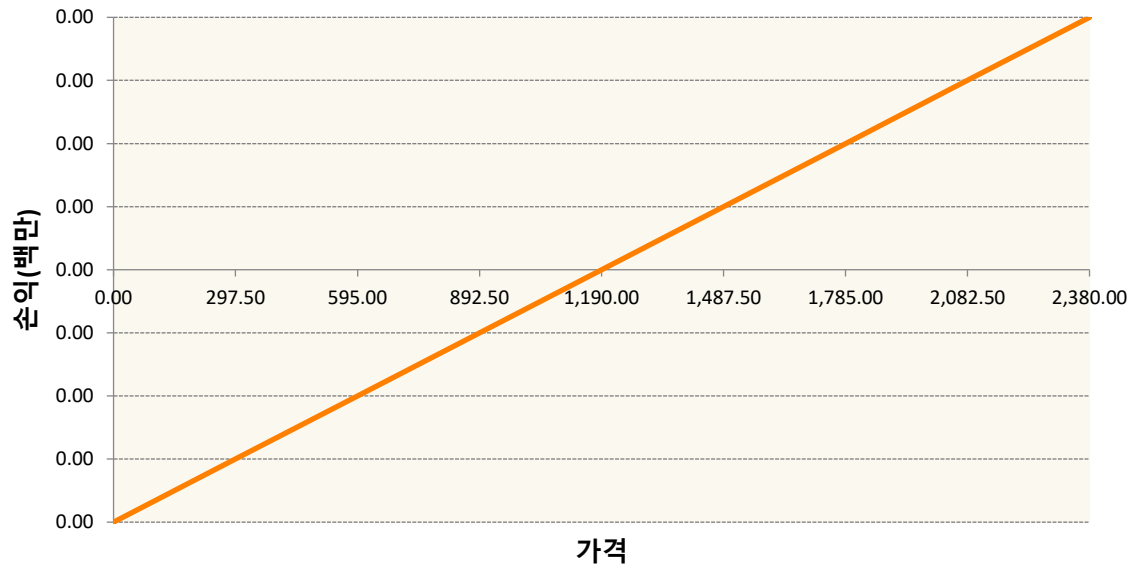
SMN2-SOYBEAN MEAL FUTR Jul22



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 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

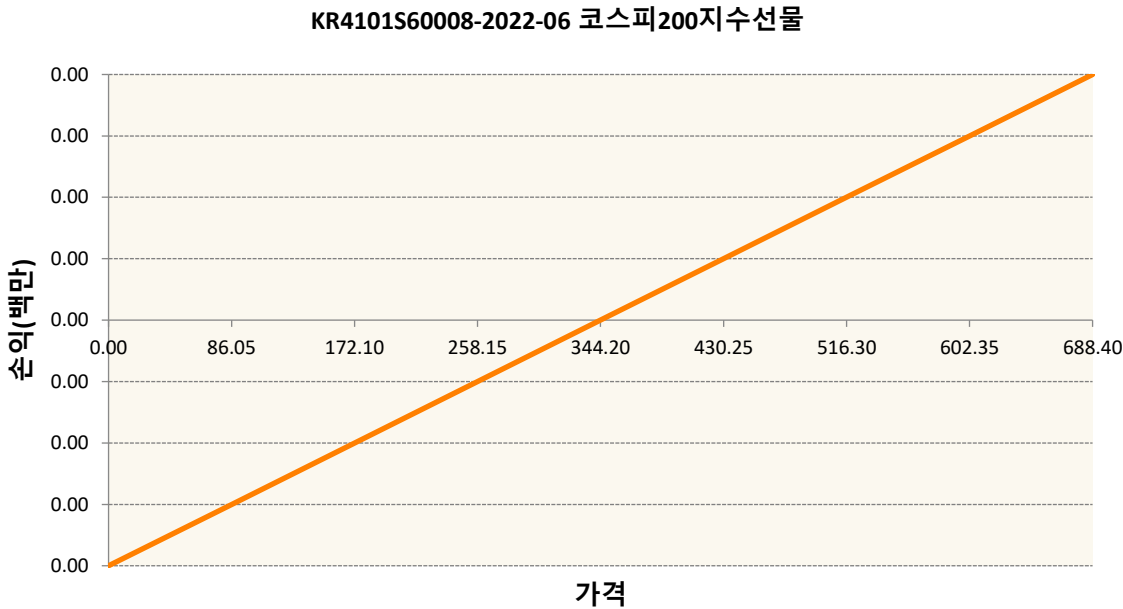
스마트인덱스모

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   | 688   | 0     | 688       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         |        | 2022-06 코스피200지수선물 |       |        | 55     |
|--------------|-----------|---------|--------|--------------------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                 | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -55       | -55     | -55    | -55                | -55   | -55    | -55    |
| -5.33%       | -37       | -37     | -37    | -37                | -37   | -37    | -37    |
| -2.67%       | -18       | -18     | -18    | -18                | -18   | -18    | -18    |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 18        | 18      | 18     | 18                 | 18    | 18     | 18     |
| 5.33%        | 37        | 37      | 37     | 37                 | 37    | 37     | 37     |
| 8.00%        | 55        | 55      | 55     | 55                 | 55    | 55     | 55     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

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 | 352 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 439 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

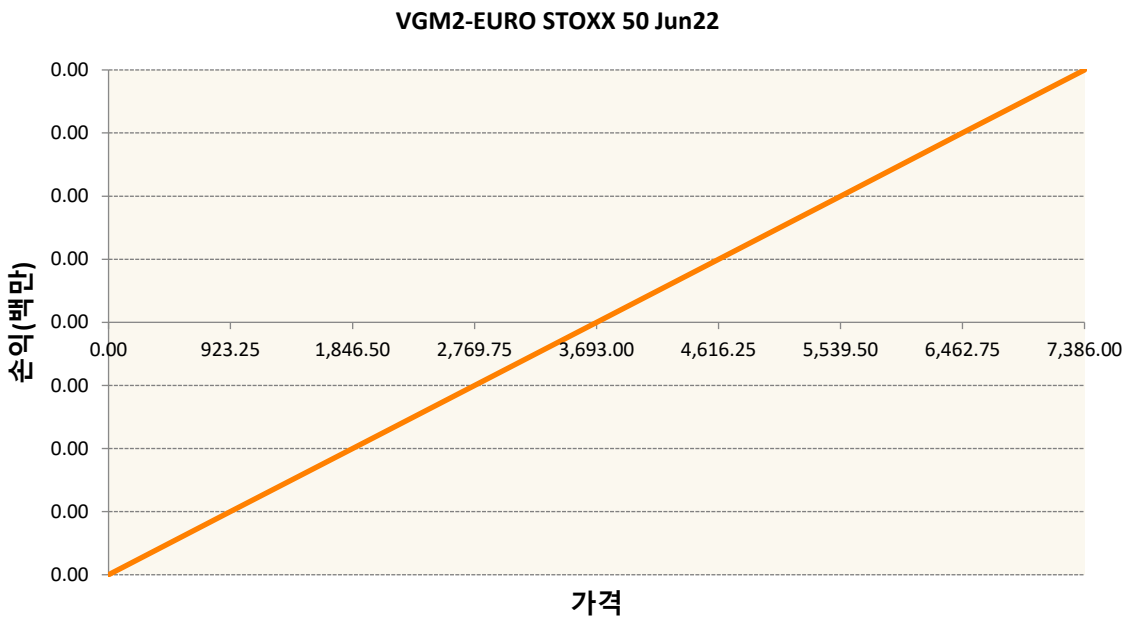
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 551   | 0     | 551       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 42 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

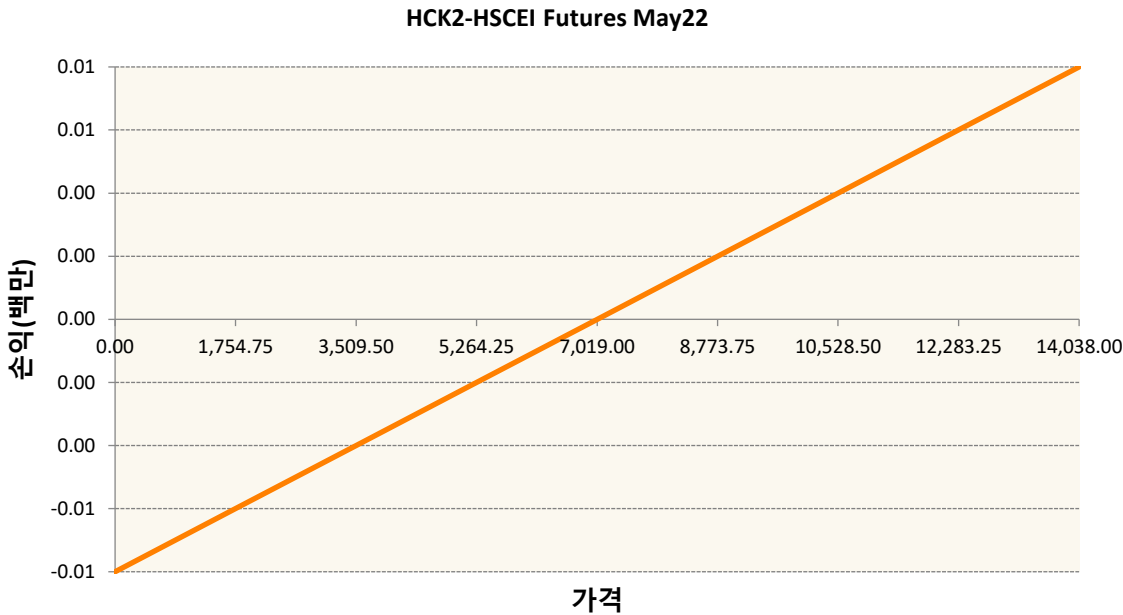
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,132 | 0     | 1,132     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 129 |
|-----|

공시일 2022-05-25

기준일 2022-05-24

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

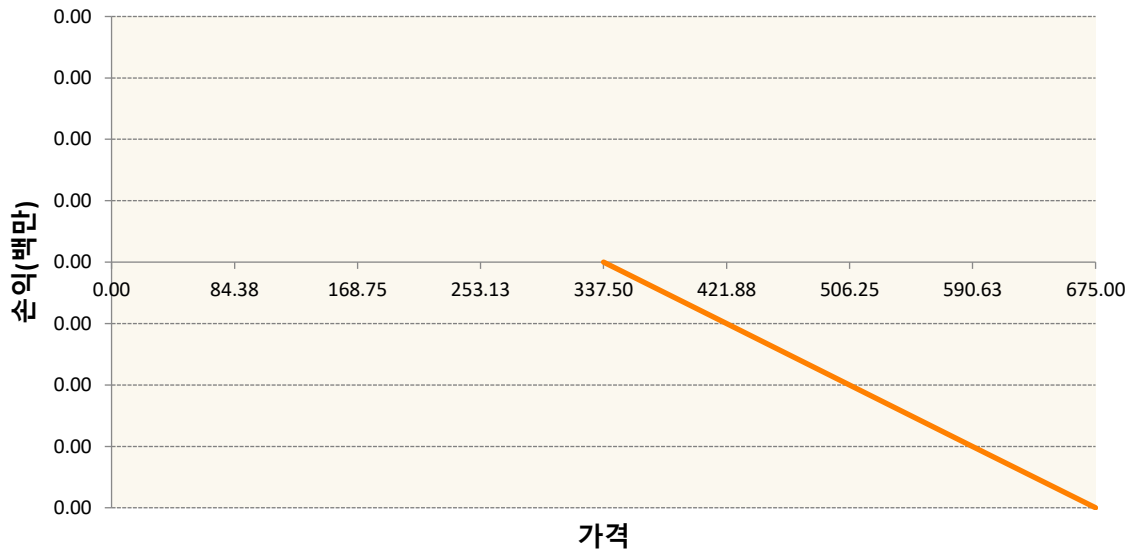
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

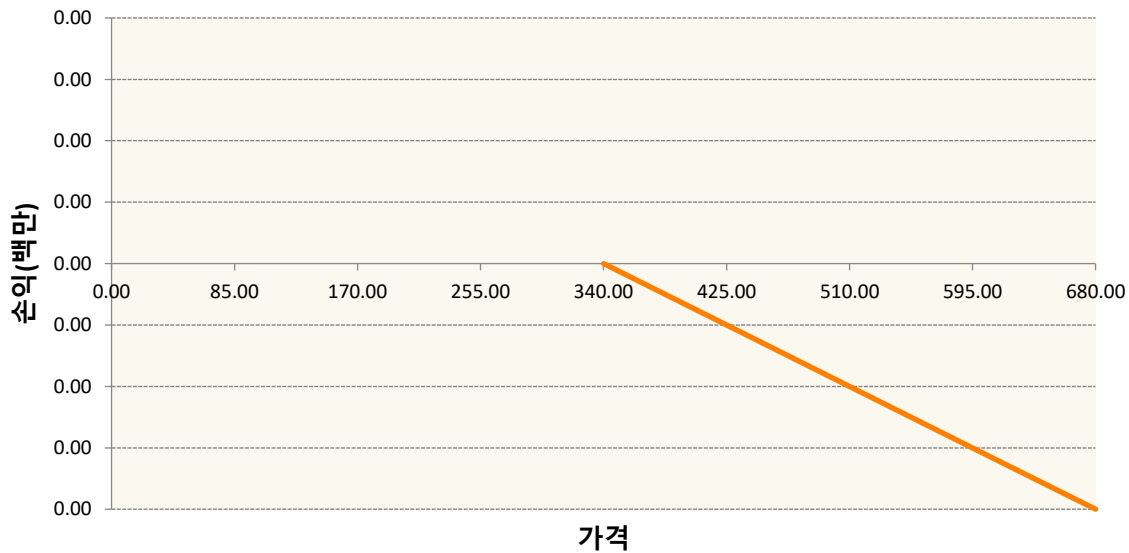
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 503   | 0      | 503       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 63,028 | -63,028   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

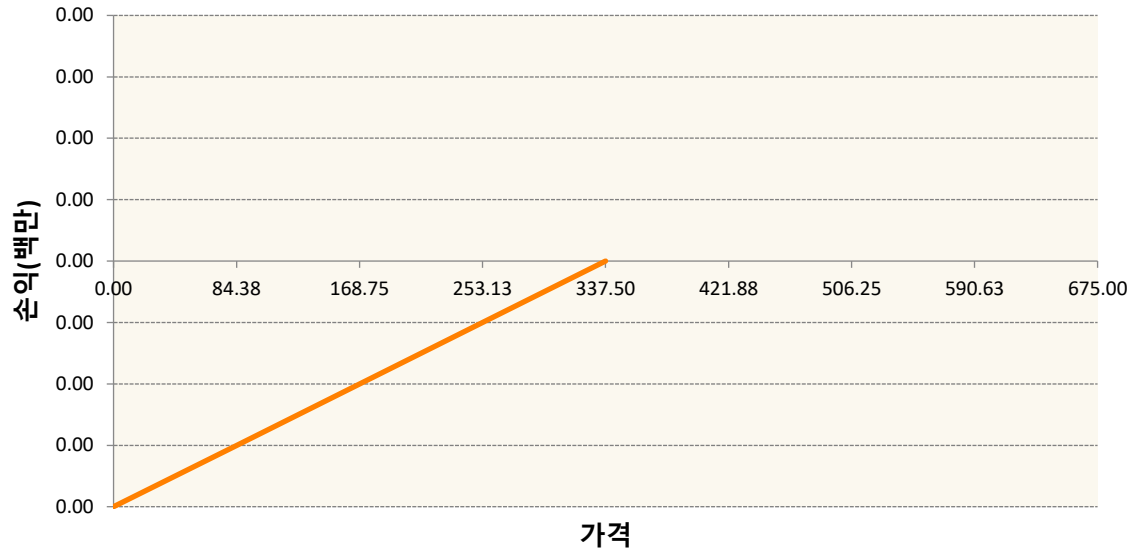
KR4201S63372-2022-06 콜337.5



KR4201S63406-2022-06 콜340



KR4301S63370-2022-06 풋337.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201S63372 |  | 2022-06 콜337.5 |         |        |        |        |        | 2,804  |
|--------------|--|----------------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
|              |  | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |  | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       |  | 1,399          | 1,363   | 1,321  | 1,274  | 1,223  | 1,168  | 1,110  |
| -5.33%       |  | 1,227          | 1,162   | 1,094  | 1,024  | 951    | 877    | 802    |
| -2.67%       |  | 857            | 773     | 689    | 605    | 521    | 437    | 352    |
| 0%           |  | 242            | 163     | 82     | 0      | -82    | -165   | -248   |
| 2.67%        |  | -593           | -651    | -713   | -778   | -847   | -918   | -991   |
| 5.33%        |  | -1,578         | -1,610  | -1,648 | -1,692 | -1,741 | -1,795 | -1,852 |
| 8.00%        |  | -2,638         | -2,652  | -2,672 | -2,697 | -2,727 | -2,763 | -2,804 |
| KR4201S63406 |  | 2022-06 콜340   |         |        |        |        |        | 757    |
|              |  | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |  | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       |  | 347            | 339     | 329    | 317    | 304    | 291    | 276    |
| -5.33%       |  | 309            | 293     | 276    | 258    | 239    | 219    | 199    |
| -2.67%       |  | 223            | 200     | 177    | 154    | 131    | 108    | 85     |
| 0%           |  | 70             | 47      | 24     | 0      | -24    | -47    | -71    |
| 2.67%        |  | -147           | -165    | -184   | -204   | -225   | -246   | -267   |
| 5.33%        |  | -412           | -422    | -435   | -449   | -465   | -481   | -499   |
| 8.00%        |  | -702           | -708    | -714   | -723   | -733   | -744   | -757   |
| KR4301S63370 |  | 2022-06 풋337.5 |         |        |        |        |        | 615    |
|              |  | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |  | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       |  | -585           | -588    | -592   | -596   | -602   | -608   | -615   |
| -5.33%       |  | -306           | -315    | -325   | -336   | -347   | -359   | -372   |
| -2.67%       |  | -85            | -101    | -116   | -132   | -147   | -163   | -178   |
| 0%           |  | 42             | 28      | 14     | 0      | -15    | -29    | -44    |

|       |     |     |     |     |    |    |    |
|-------|-----|-----|-----|-----|----|----|----|
| 2.67% | 90  | 83  | 75  | 67  | 57 | 47 | 36 |
| 5.33% | 101 | 99  | 97  | 93  | 88 | 83 | 76 |
| 8.00% | 103 | 102 | 102 | 101 | 99 | 97 | 94 |

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

(단위:백만원)

4,203

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

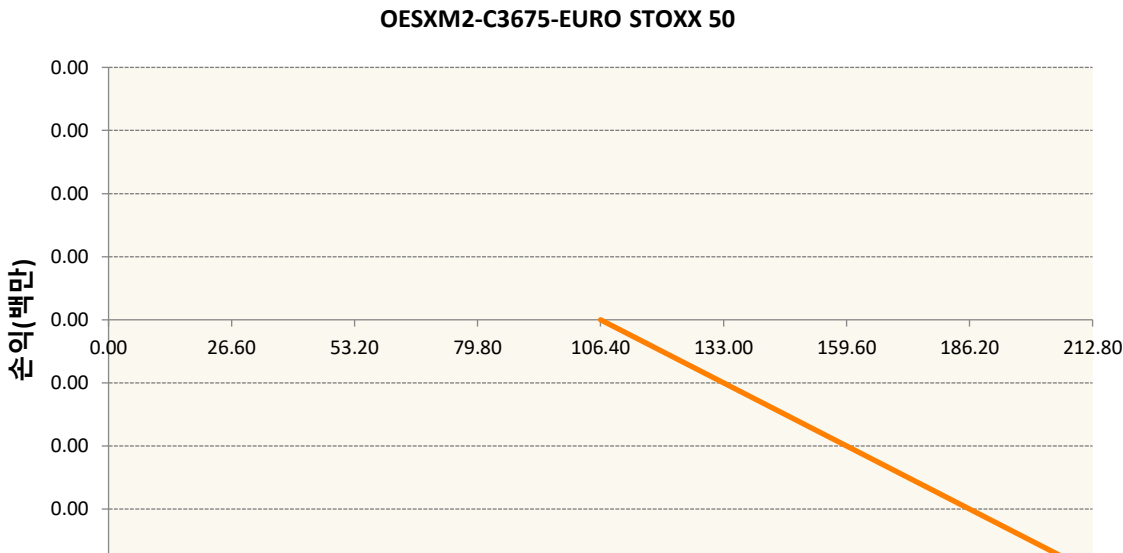
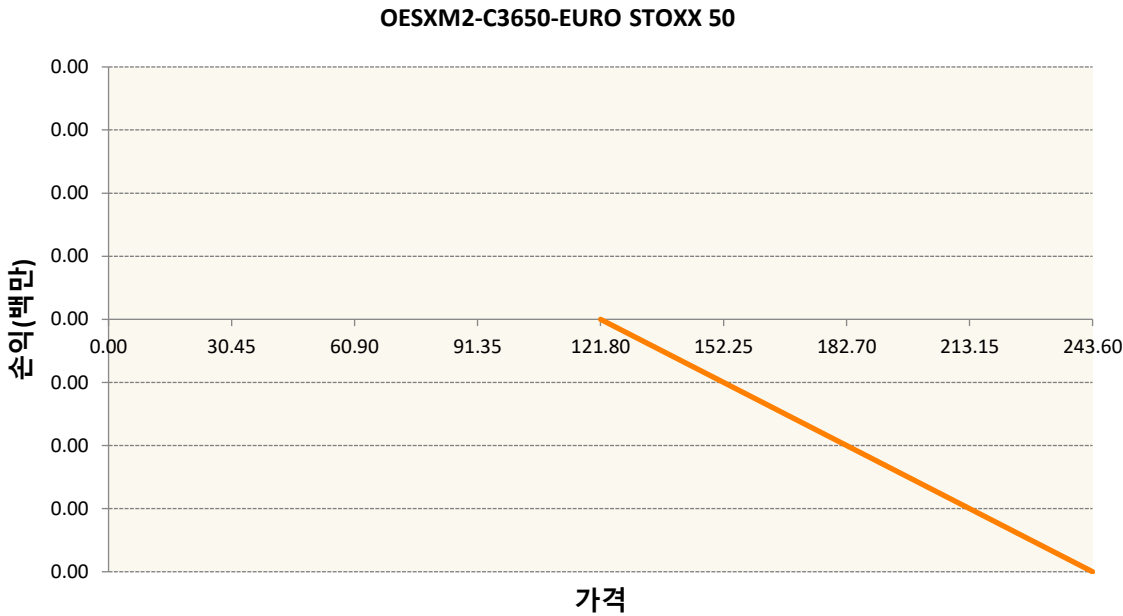
## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

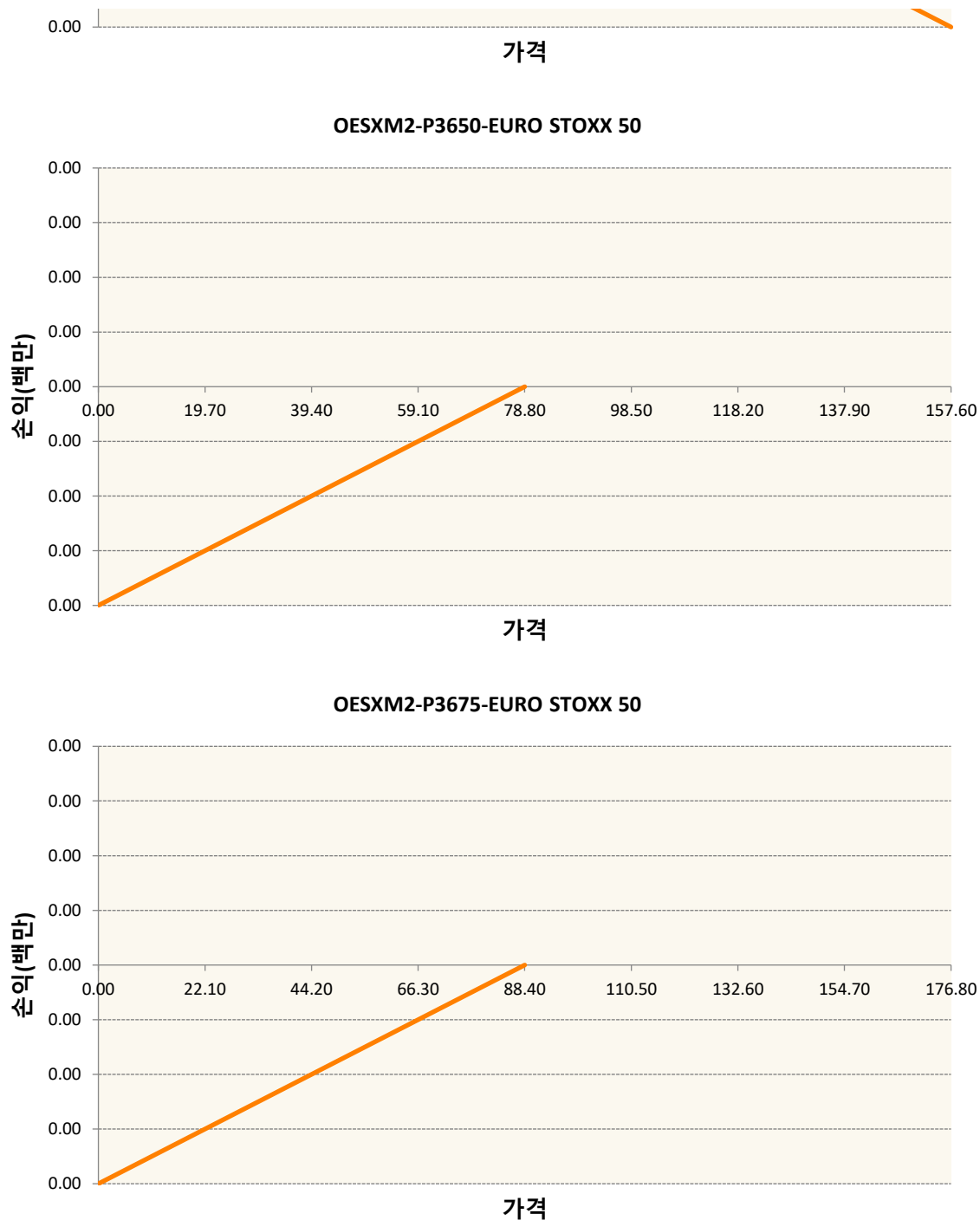
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 71    | -71       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 10    | 0     | 10        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,081 | 2,568 | -1,487    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY | 19 |
| FXW213C2F KRW/EUR 27-05-22E              | 22 |
| FXW213C38 KRW/EUR 27-05-22E              | 65 |
| FXW213C4L KRW/EUR 24-06-22E              | 32 |
| FXW213C5Q EUR/KRW 27-05-22E              | 86 |
| FXW213C5Q KRW/EUR 26-08-22E              | 86 |
| OESXM2-C3f EURO STOXX 50                 | 2  |
| OESXM2-C3f EURO STOXX 50                 | 1  |
| OESXM2-P3f EURO STOXX 50                 | 2  |
| OESXM2-P3f EURO STOXX 50                 | 1  |

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

(단위:백만원)

189

공시일 2022-05-25

기준일 2022-05-24

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

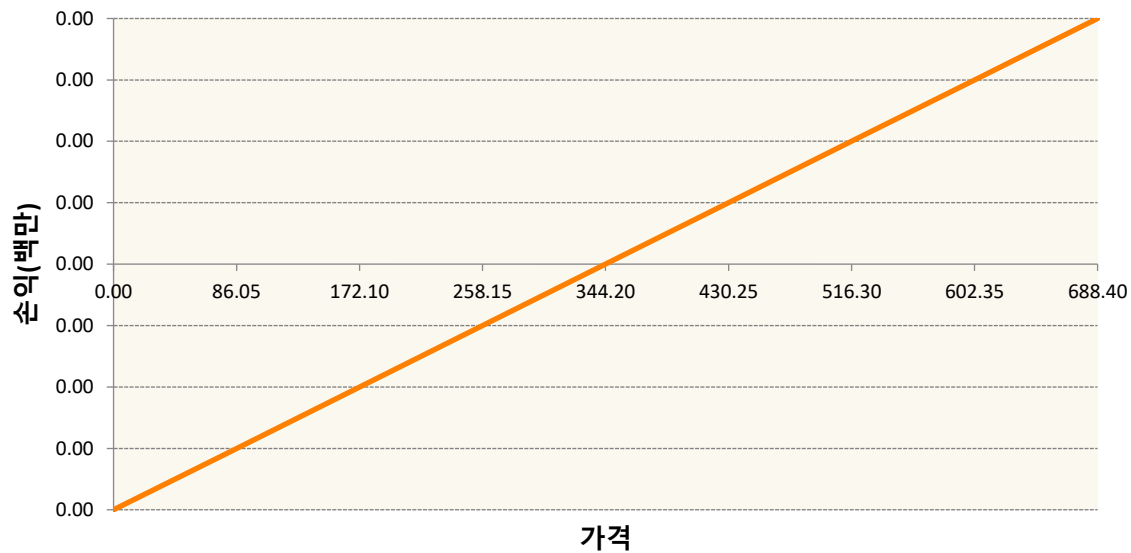
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

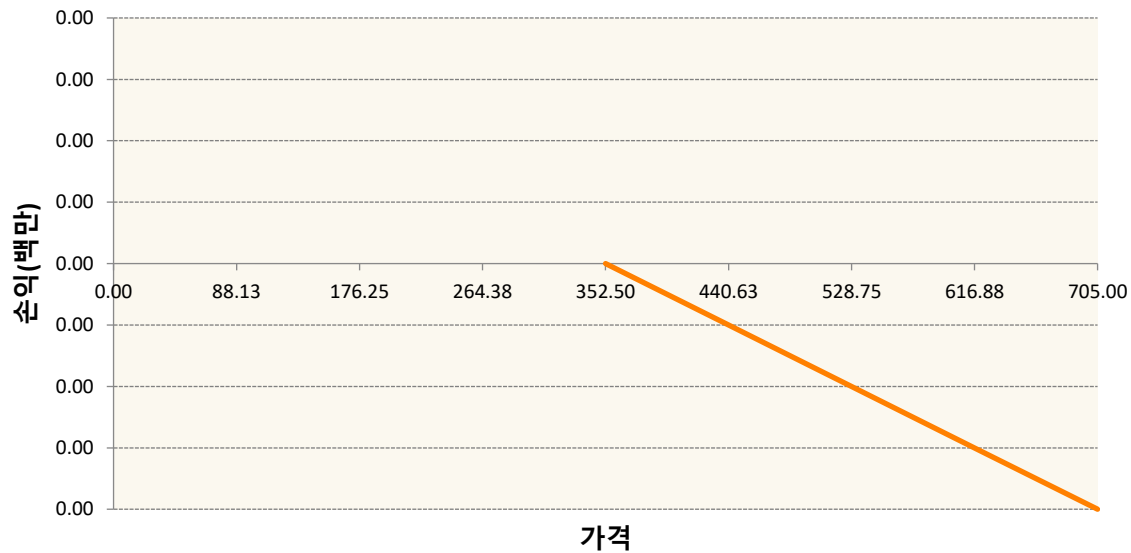
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 516   | 0     | 516       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 338   | 4,613 | -4,274    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

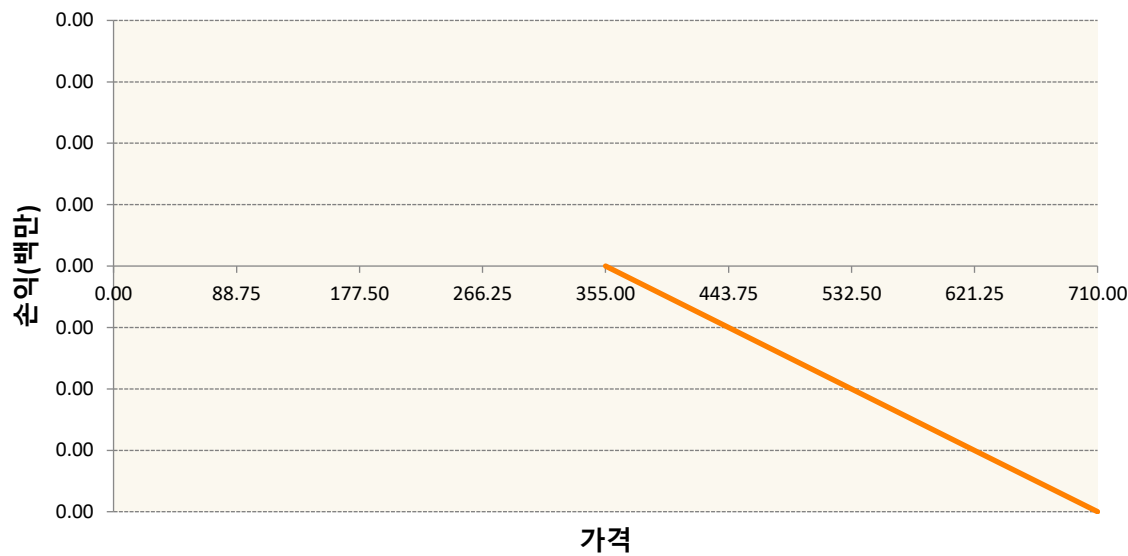
KR4101S60008-2022-06 코스피200지수선물



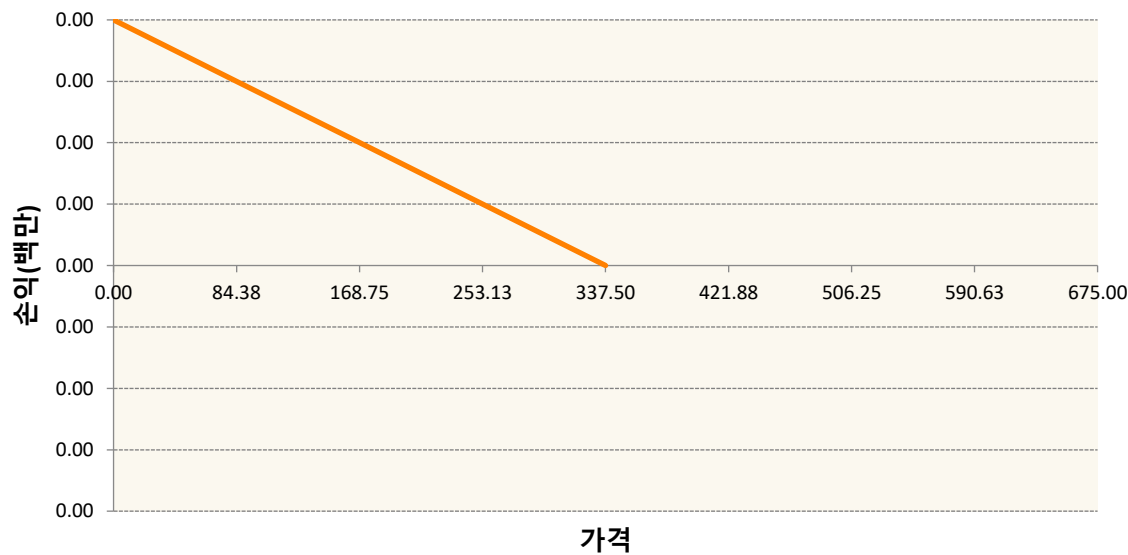
KR4201S63521-2022-06 콜352.5



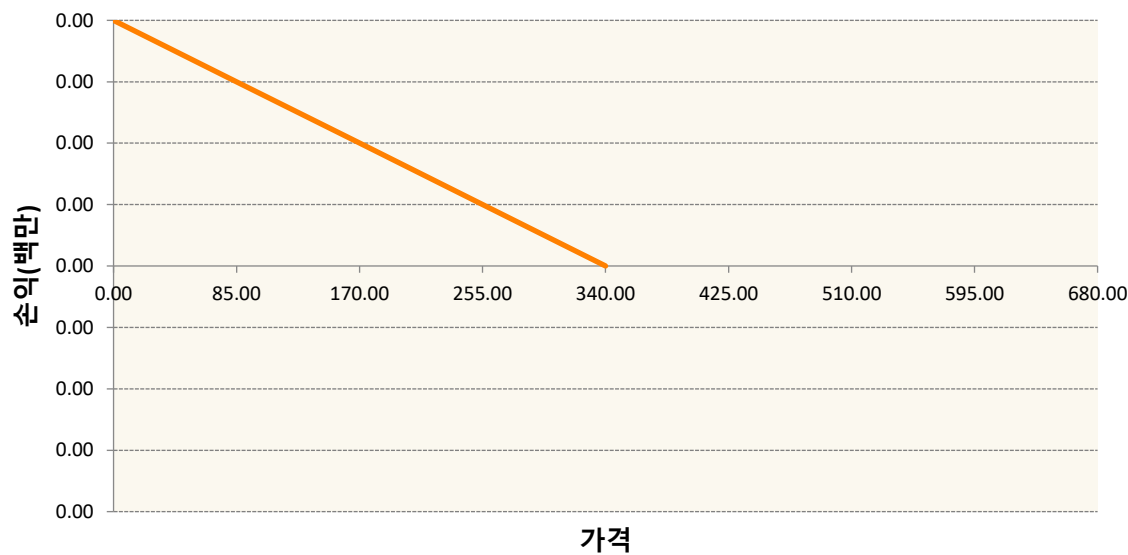
KR4201S63554-2022-06 콜355



KR4301S63370-2022-06 풋337.5



KR4301S63404-2022-06 풋340



(단위:백만원)

|              |           |         |        |      |       |                    |        |     |
|--------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------------------|--------|-----|
| KR4101S60008 |           |         |        |      |       | 2022-06 코스피200지수선물 |        | 41  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |                    |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67%             | 25.00% |     |
| -8.00%       | -41       | -41     | -41    | -41  | -41   | -41                | -41    |     |
| -5.33%       | -28       | -28     | -28    | -28  | -28   | -28                | -28    |     |
| -2.67%       | -14       | -14     | -14    | -14  | -14   | -14                | -14    |     |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0                  | 0      |     |
| 2.67%        | 14        | 14      | 14     | 14   | 14    | 14                 | 14     |     |
| 5.33%        | 28        | 28      | 28     | 28   | 28    | 28                 | 28     |     |
| 8.00%        | 41        | 41      | 41     | 41   | 41    | 41                 | 41     |     |
| KR4201S63521 |           |         |        |      |       | 2022-06 콜352.5     |        | 18  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |                    |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67%             | 25.00% |     |
| -8.00%       | 5         | 5       | 5      | 5    | 5     | 4                  | 4      |     |
| -5.33%       | 5         | 5       | 4      | 4    | 4     | 3                  | 3      |     |
| -2.67%       | 4         | 4       | 3      | 3    | 2     | 2                  | 1      |     |
| 0%           | 2         | 1       | 1      | 0    | -1    | -1                 | -2     |     |
| 2.67%        | -2        | -3      | -3     | -4   | -5    | -6                 | -6     |     |
| 5.33%        | -8        | -8      | -9     | -10  | -10   | -11                | -12    |     |
| 8.00%        | -15       | -15     | -16    | -16  | -17   | -18                | -18    |     |
| KR4201S63554 |           |         |        |      |       | 2022-06 콜355       |        | 206 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |                    |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67%             | 25.00% |     |
| -8.00%       | 52        | 52      | 51     | 49   | 47    | 45                 | 42     |     |
| -5.33%       | 50        | 48      | 46     | 43   | 39    | 35                 | 30     |     |
| -2.67%       | 42        | 38      | 33     | 28   | 22    | 16                 | 9      |     |
| 0%           | 22        | 15      | 8      | 0    | -8    | -16                | -24    |     |
| 2.67%        | -17       | -26     | -35    | -44  | -53   | -62                | -71    |     |
| 5.33%        | -81       | -89     | -97    | -106 | -114  | -123               | -132   |     |
| 8.00%        | -165      | -171    | -177   | -184 | -191  | -199               | -206   |     |
| KR4301S63370 |           |         |        |      |       | 2022-06 풋337.5     |        | 14  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |                    |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67%             | 25.00% |     |
| -8.00%       | 13        | 13      | 14     | 14   | 14    | 14                 | 14     |     |
| -5.33%       | 7         | 7       | 7      | 8    | 8     | 8                  | 9      |     |
| -2.67%       | 2         | 2       | 3      | 3    | 3     | 4                  | 4      |     |
| 0%           | -1        | -1      | 0      | 0    | 0     | 1                  | 1      |     |
| 2.67%        | -2        | -2      | -2     | -2   | -1    | -1                 | -1     |     |
| 5.33%        | -2        | -2      | -2     | -2   | -2    | -2                 | -2     |     |
| 8.00%        | -2        | -2      | -2     | -2   | -2    | -2                 | -2     |     |
| KR4301S63404 |           |         |        |      |       | 2022-06 풋340       |        | 5   |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |                    |        |     |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| -8.00% | 5       | 5       | 5      | 5  | 5     | 5      | 5      |
| -5.33% | 3       | 3       | 3      | 3  | 3     | 3      | 3      |
| -2.67% | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 2      |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | 0      | 0      |
| 5.33%  | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| 8.00%  | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |

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

(단위:백만원)

246

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

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 | 9,532 | 0     | 9,532     |    |

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 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

## 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 | 7,268 | 0     | 7,268     |    |

### 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 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

## 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 | 22,732 | 0      | 22,732    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 2,342  | 25,489 | -23,146   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| FXW213C4MKRW/USD 27-06-22E   | 2,039 |
| FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E  | 122   |
| FXW213C52 USD/KRW 27-06-22E  | 35    |
| FXW213C5C USD/KRW 27-06-22E  | 15    |
| FXW213C5J4 USD/KRW 27-06-22E | 15    |
| IE00BD8RGM75                 |       |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

769

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

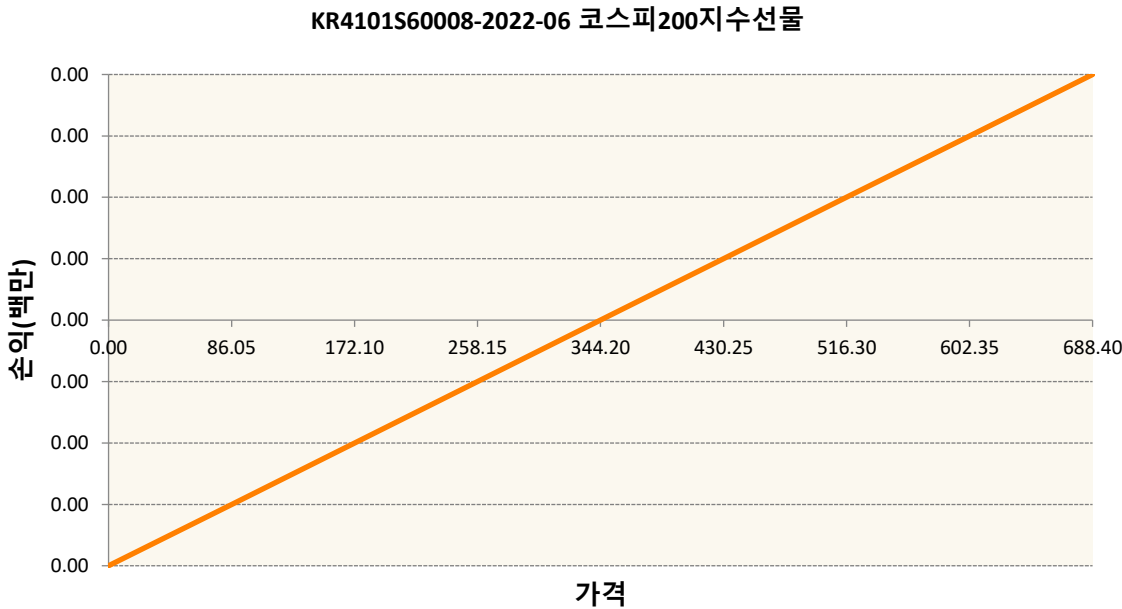
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,119 | 0     | 1,119     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 89     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -89       | -89     | -89                | -89 | -89   | -89    | -89    |
| -5.33%       | -60       | -60     | -60                | -60 | -60   | -60    | -60    |
| -2.67%       | -30       | -30     | -30                | -30 | -30   | -30    | -30    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 30        | 30      | 30                 | 30  | 30    | 30     | 30     |
| 5.33%        | 60        | 60      | 60                 | 60  | 60    | 60     | 60     |
| 8.00%        | 89        | 89      | 89                 | 89  | 89    | 89     | 89     |



공시일 2022-05-25

기준일 2022-05-24

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

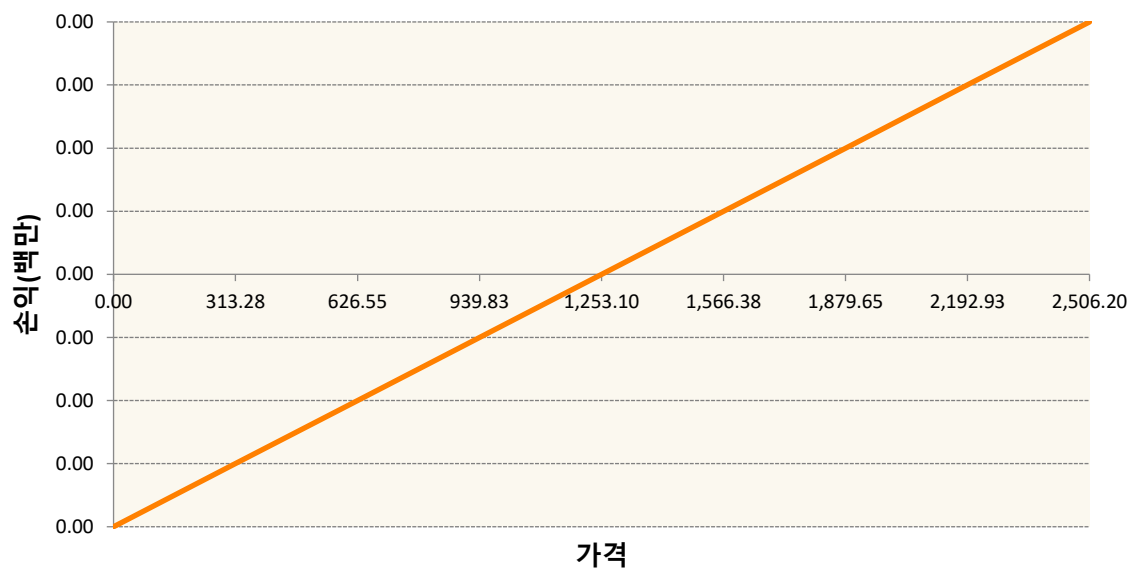
### 1. 계약금액

(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   | 735   | 0     | 735       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,747 | 0     | 1,747     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 987   | -987      | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCM2-VN30 Index Future Jun22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 140 |
| FXW213C3G·KRW/EUR 24-06-22E   | 32  |
| FXW213C4L·KRW/EUR 22-07-22E   | 16  |
| FXW213C5J4KRW/EUR 26-08-22E   | 30  |
| VNCM2 VN30 Index Future Jun22 | 59  |

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

(단위:백만원)

271

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

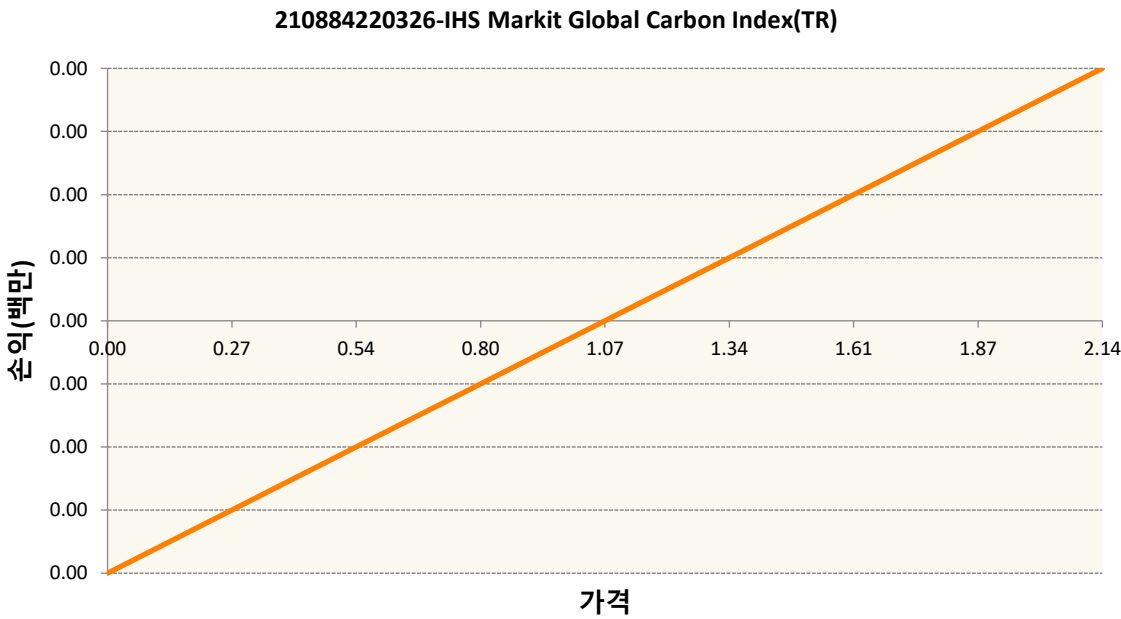
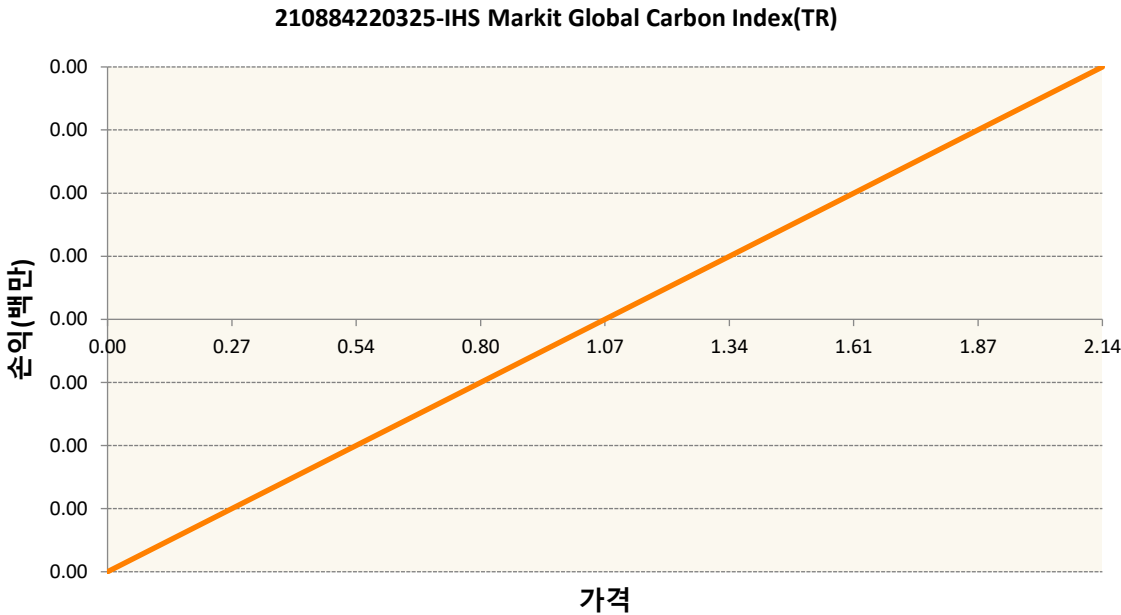
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 1. 계약금액

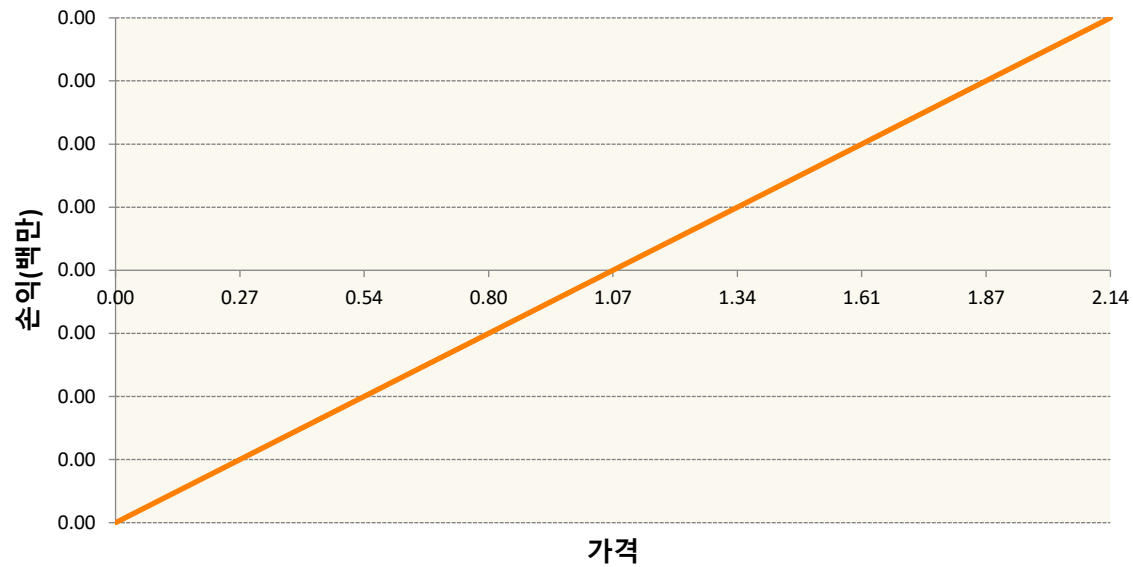
(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

|       |
|-------|
| 191   |
| 3,334 |
| 96    |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 6,749 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

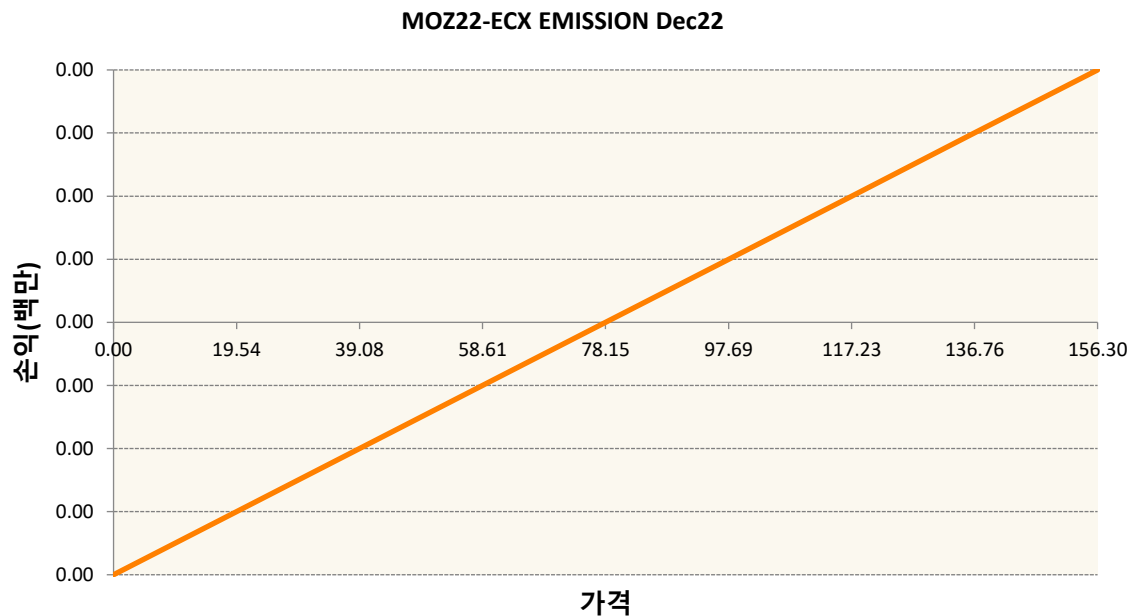
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 13,504 | 0     | 13,504    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 7,973 | -7,973    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                          |       |
|------------------------------------------|-------|
| FXW213C5P <sup>2</sup> KRW/EUR 27-06-22E | 638   |
| MOZ22 ECX EMISSION Dec22                 | 1,080 |

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

(단위:백만원)

2,987

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

# 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)  | 20 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)  | 20 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)  | 20 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠) | 20 |

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

(단위:백만원)

154

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

# 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)  | 5 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 6 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(메리츠) | 5 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 5 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220426(메리츠) | 3 |

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

(단위:백만원)

32

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

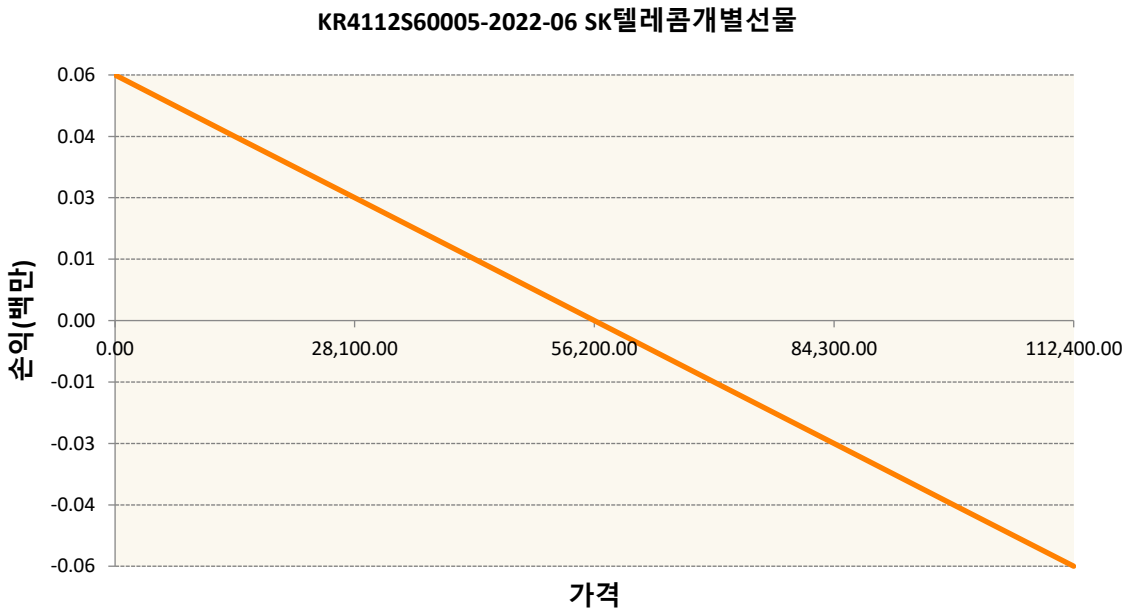
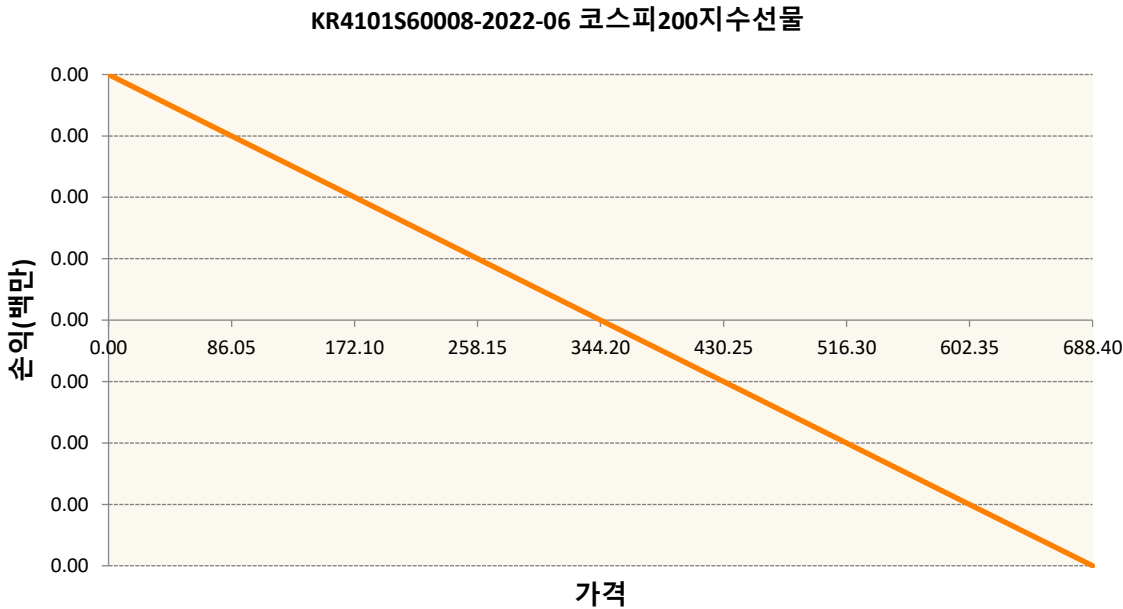
에쿼티알파일반사모혼합자산

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     | 2,058 | -2,058    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)             |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------|--|----------|
| KR4101S600 2022-06 코스피200지수선물         |  | 138      |
| KR4112S600 2022-06 SK텔레콤개별선물          |  | 27       |
| KRS0003014 SWAP_SPDR S&P O&G EXP_0322 |  | 1        |
| KRS0003041 SWAP_MICRON TECH CORP_0331 |  | 0.35     |
| KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429     |  | 0.23     |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 174      |

공시일 2022-05-25

기준일 2022-05-24

## 신한SOL한국형글로벌반도체엑티

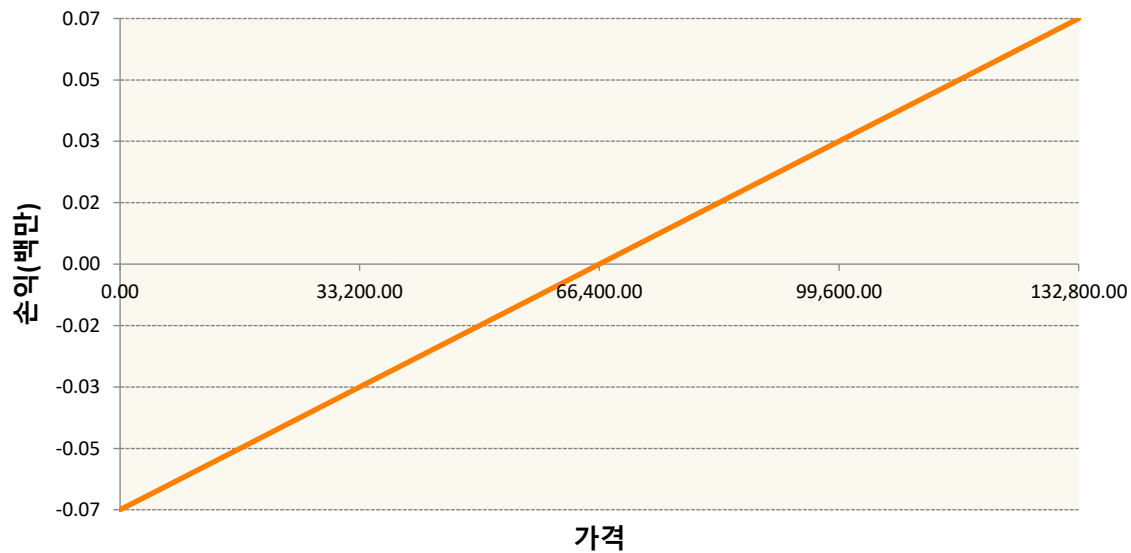
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

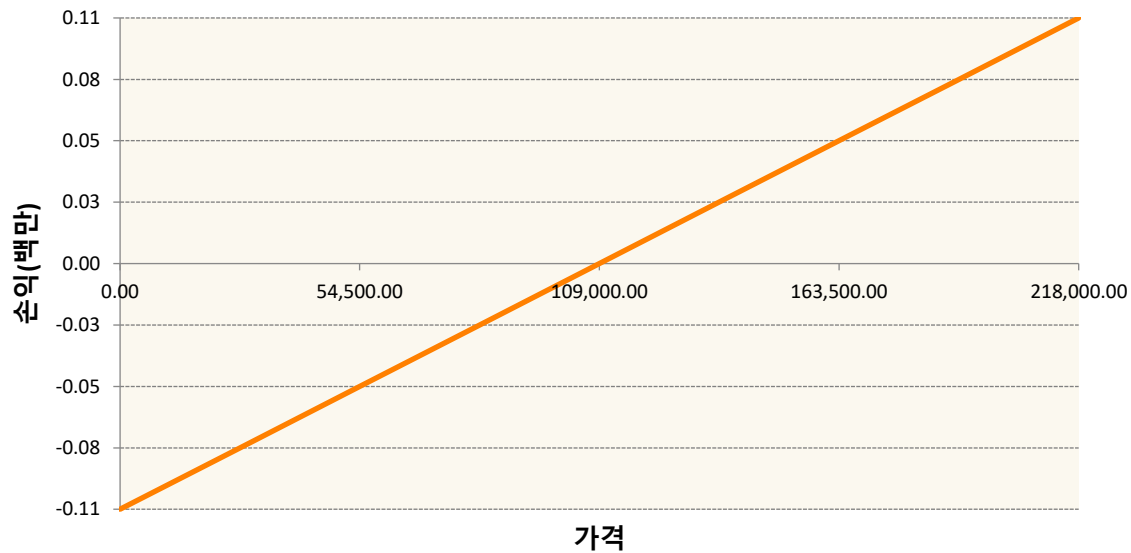
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 953   | 0     | 953       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111S60007-2022-06 삼성전자개별선물



KR4150S60005-2022-06 SK하이닉스개별선물



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

|              |           |                    |        |     |       |        |        |
|--------------|-----------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
| KR4111S60007 |           | 2022-06 삼성전자개별선물   |        |     |       |        | 38     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -38       | -38                | -38    | -38 | -38   | -38    | -38    |
| -5.33%       | -26       | -26                | -26    | -26 | -26   | -26    | -26    |
| -2.67%       | -13       | -13                | -13    | -13 | -13   | -13    | -13    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 13        | 13                 | 13     | 13  | 13    | 13     | 13     |
| 5.33%        | 26        | 26                 | 26     | 26  | 26    | 26     | 26     |
| 8.00%        | 38        | 38                 | 38     | 38  | 38    | 38     | 38     |
| KR4150S60005 |           | 2022-06 SK하이닉스개별선물 |        |     |       |        | 38     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -38       | -38                | -38    | -38 | -38   | -38    | -38    |
| -5.33%       | -25       | -25                | -25    | -25 | -25   | -25    | -25    |
| -2.67%       | -13       | -13                | -13    | -13 | -13   | -13    | -13    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 13        | 13                 | 13     | 13  | 13    | 13     | 13     |
| 5.33%        | 25        | 25                 | 25     | 25  | 25    | 25     | 25     |
| 8.00%        | 38        | 38                 | 38     | 38  | 38    | 38     | 38     |

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

83

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-05-25 |
| 기준일 | 2022-05-24 |

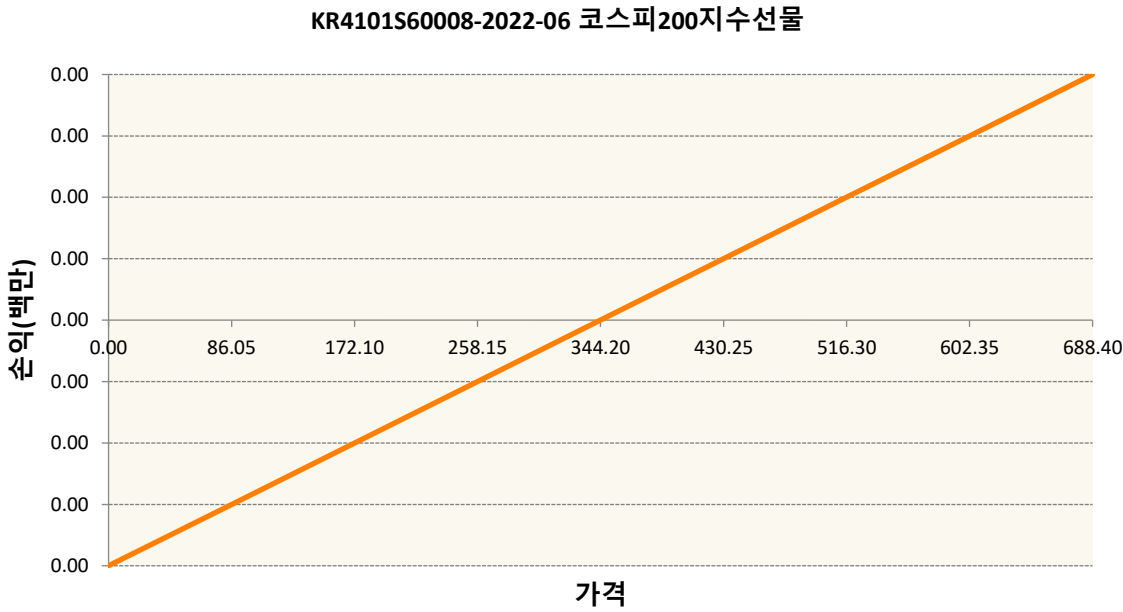
## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 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   | 344   | 0     | 344       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S60008 |           |         | 2022-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 28     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -28       | -28     | -28                | -28 | -28   | -28    | -28    |
| -5.33%       | -18       | -18     | -18                | -18 | -18   | -18    | -18    |
| -2.67%       | -9        | -9      | -9                 | -9  | -9    | -9     | -9     |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 9         | 9       | 9                  | 9   | 9     | 9      | 9      |
| 5.33%        | 18        | 18      | 18                 | 18  | 18    | 18     | 18     |
| 8.00%        | 28        | 28      | 28                 | 28  | 28    | 28     | 28     |



공시일 2022-05-25

기준일 2022-05-24

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

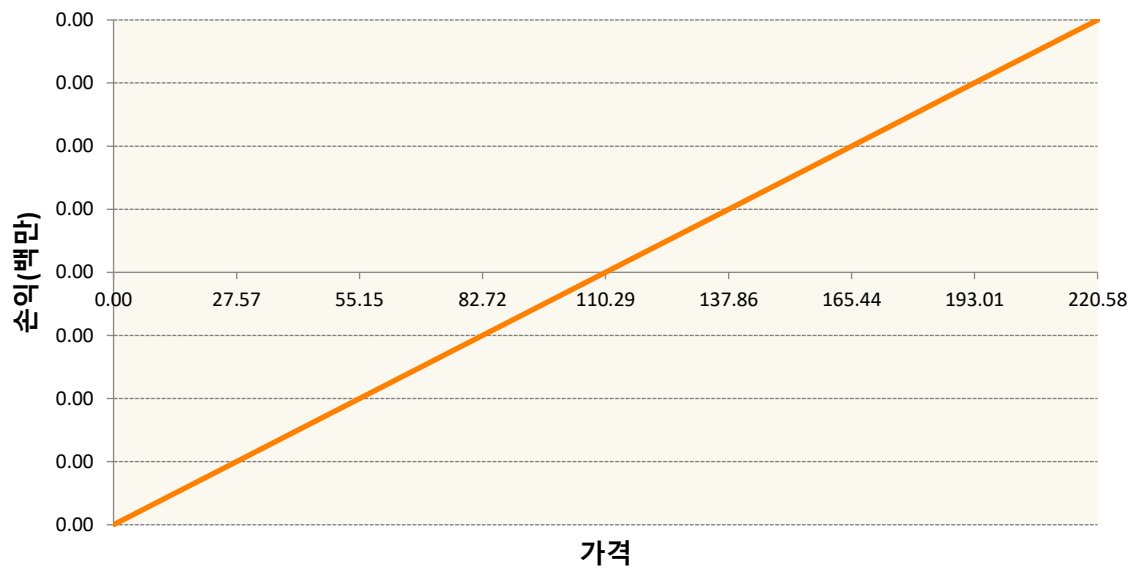
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

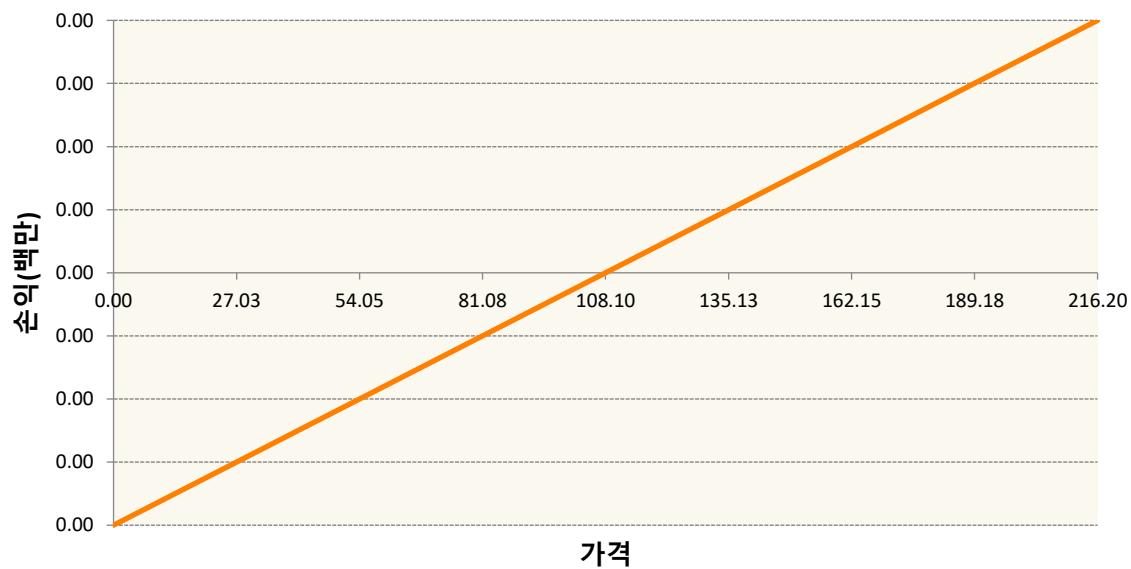
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,941 | 633   | 2,308     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

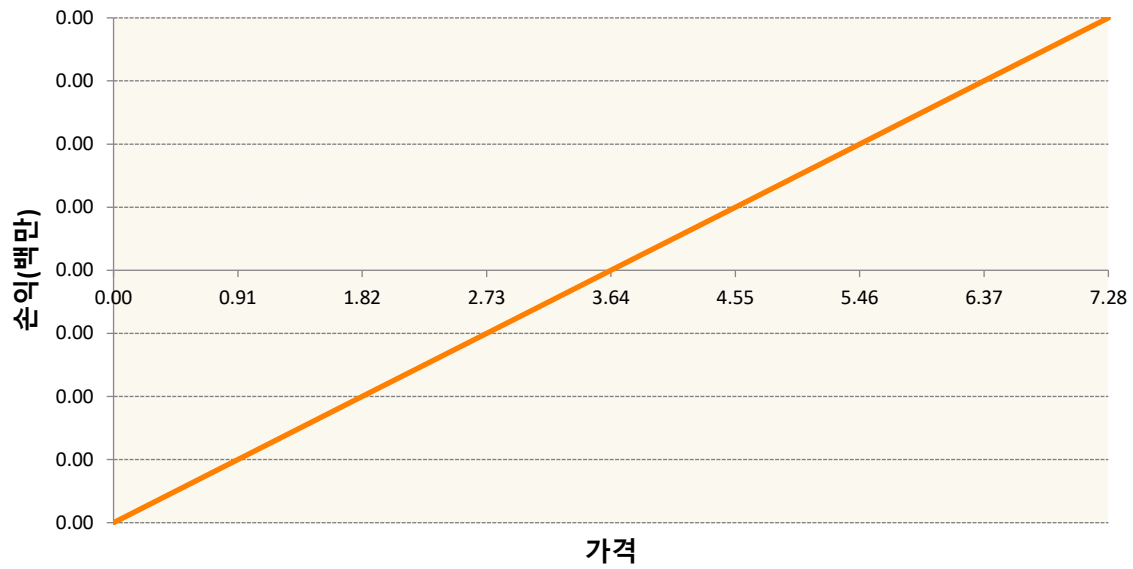
CLN2-WTI CRUDE FUTURE Jul22



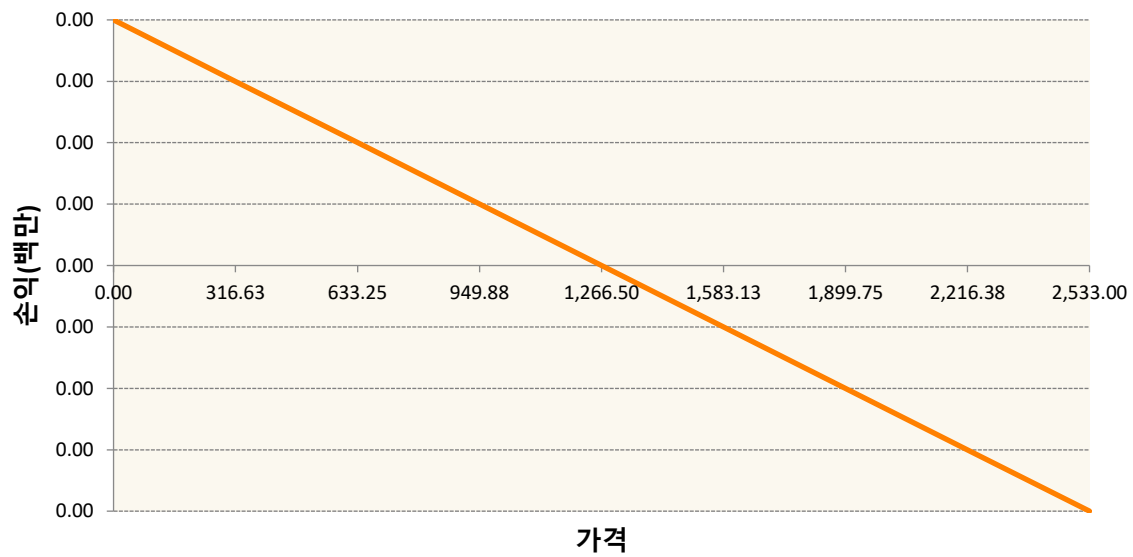
COU2-BRENT CRUDE FUTR Sep22



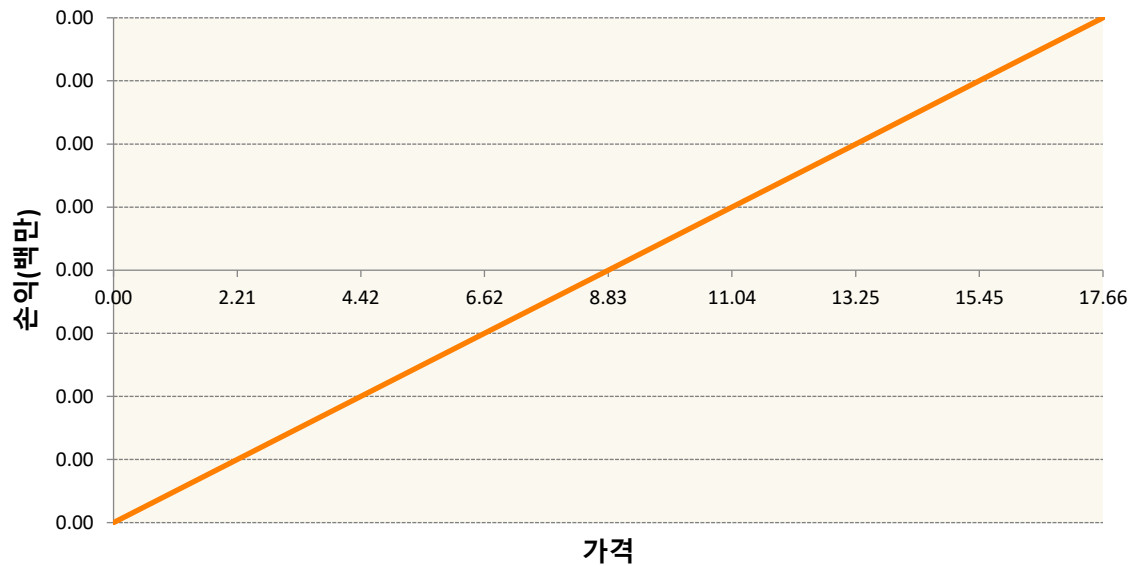
HON2-NY Harb ULSD Fut Jul22

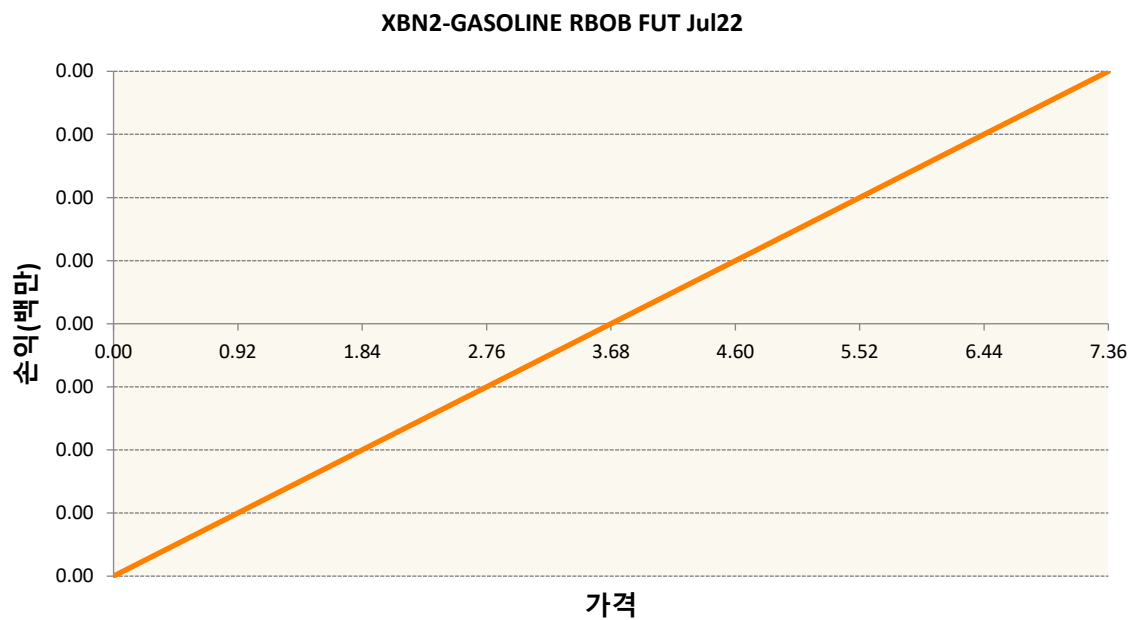
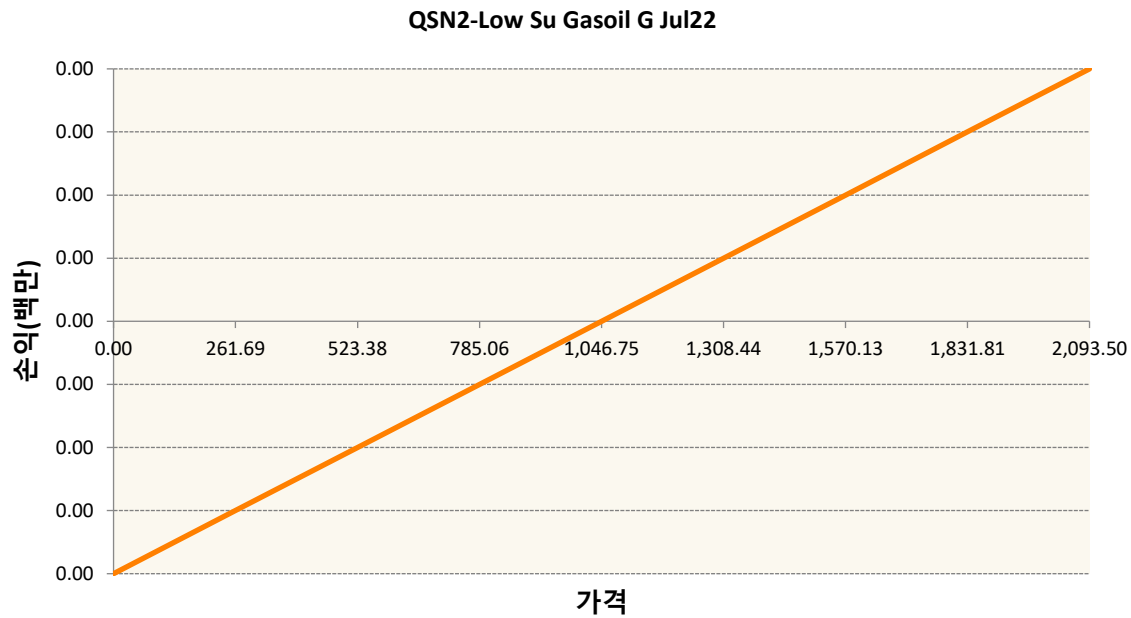


KR4175S60002-2022-06 달러선물



NGN22-NATURAL GAS FUTR Jul22





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| CLN2                      | WTI CRUDE FUTURE Jul22  |  | 43       |
| COU2                      | BRENT CRUDE FUTR Sep22  |  | 45       |
| HON2                      | NY Harb ULSD Fut Jul22  |  | 15       |
| KR4175S600 2022-06 달러선물   |                         |  | 51       |
| NGN22                     | NATURAL GAS FUTR Jul22  |  | 96       |
| QSN2                      | Low Su Gasoil G Jul22   |  | 21       |
| XBN2                      | GASOLINE RBOB FUT Jul22 |  | 15       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 713      |