

공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

## 포커스농산물모(채권-파생형)

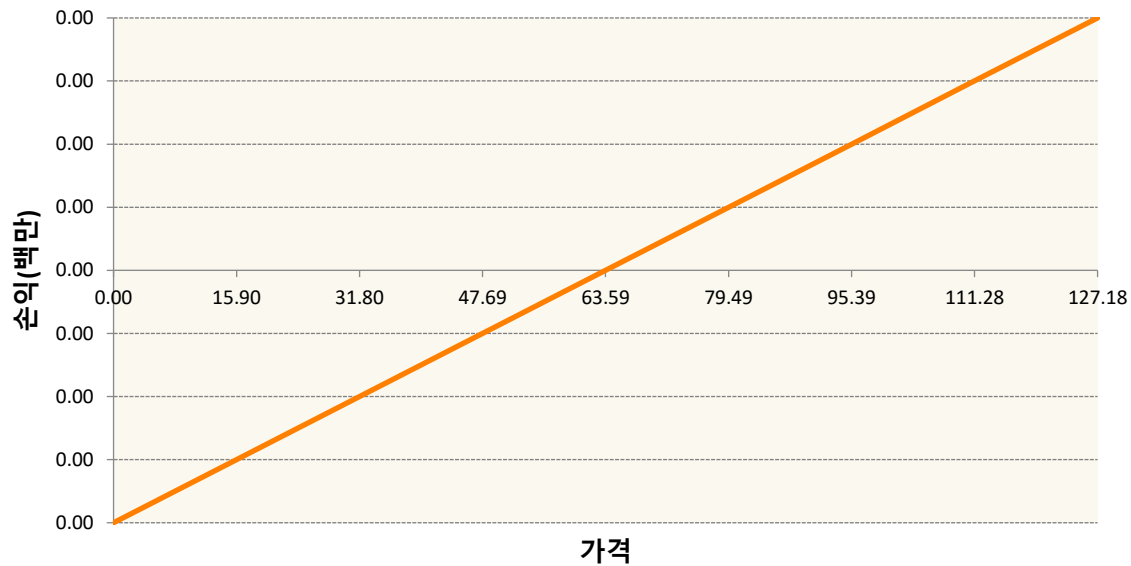
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

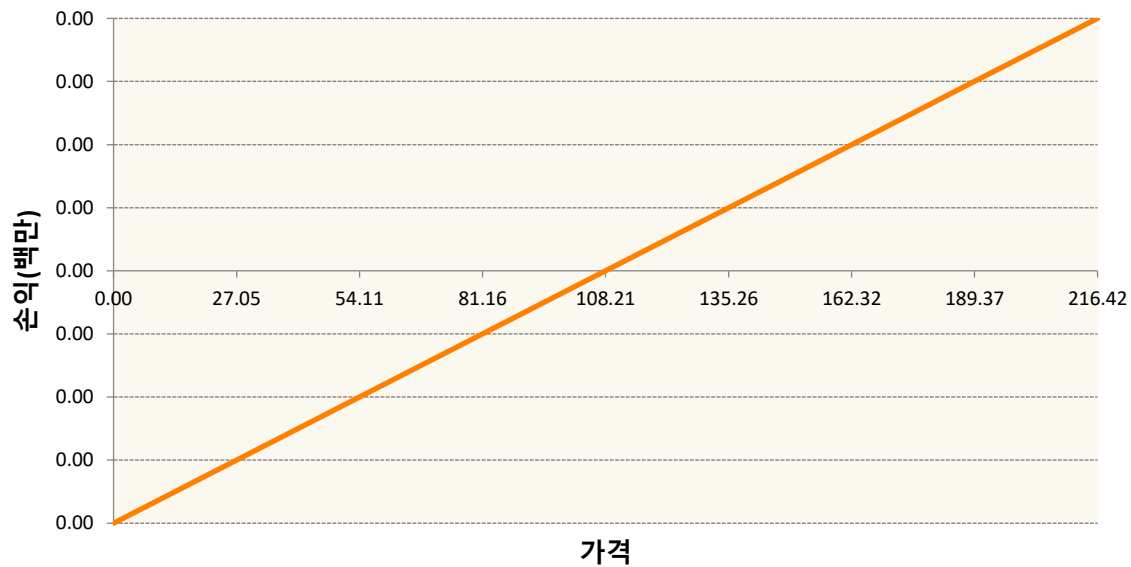
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,966 | 954   | 6,012     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

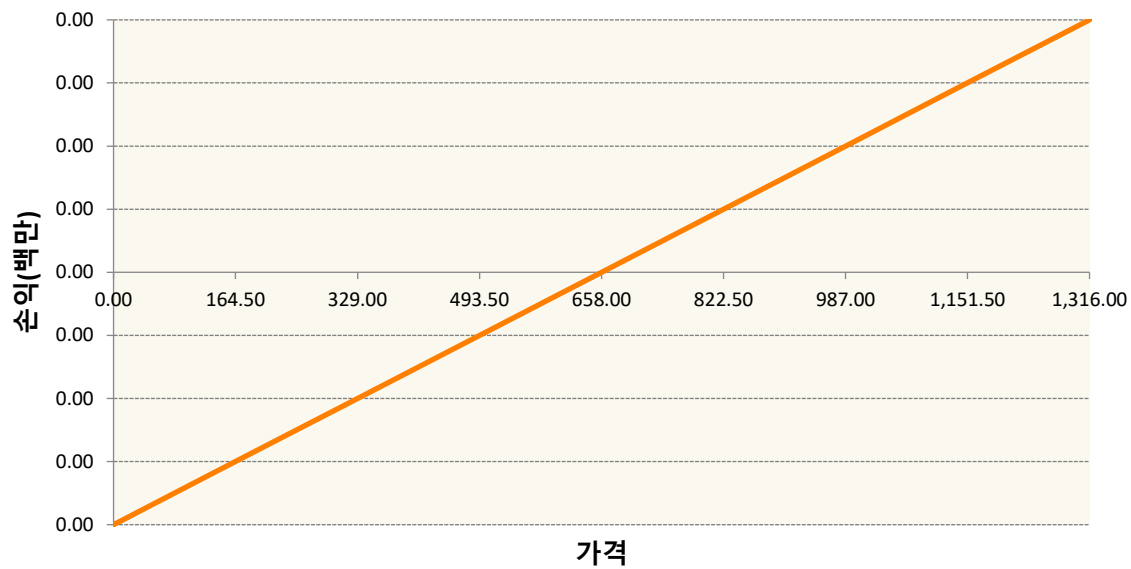
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



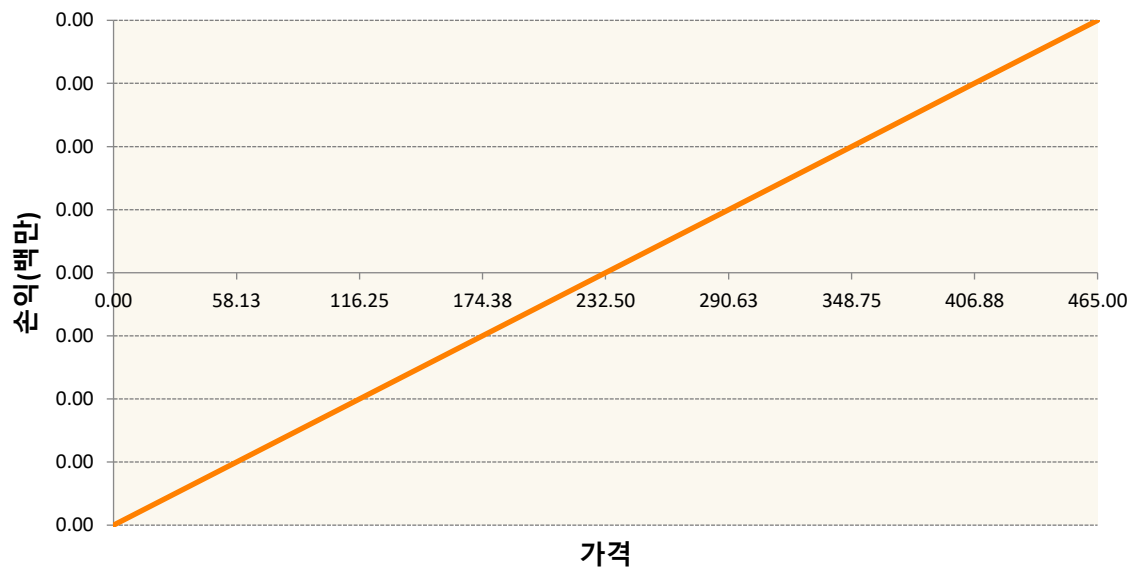
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



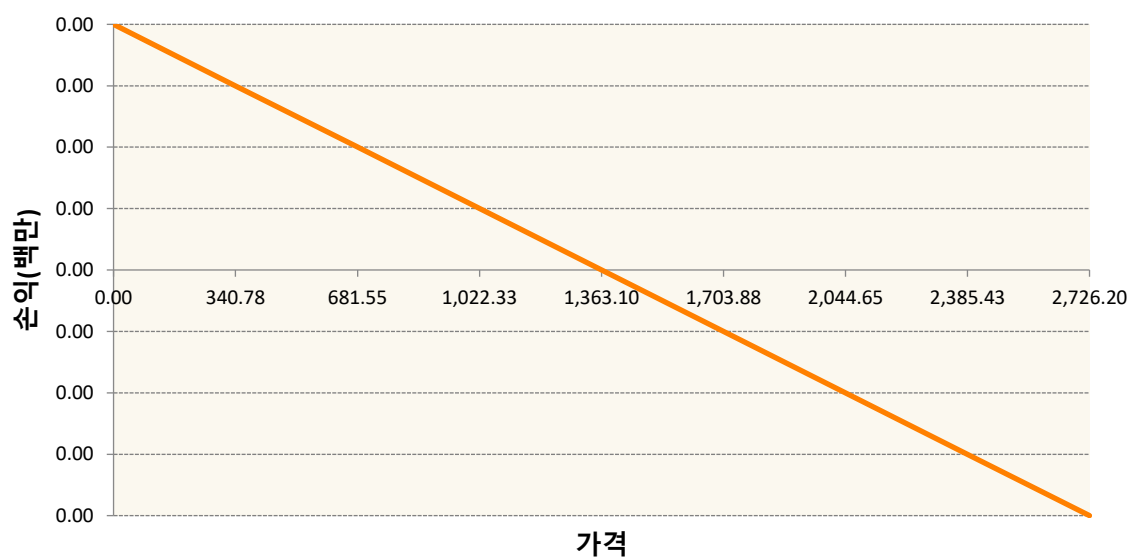
CZ2-CORN FUTURE Dec22



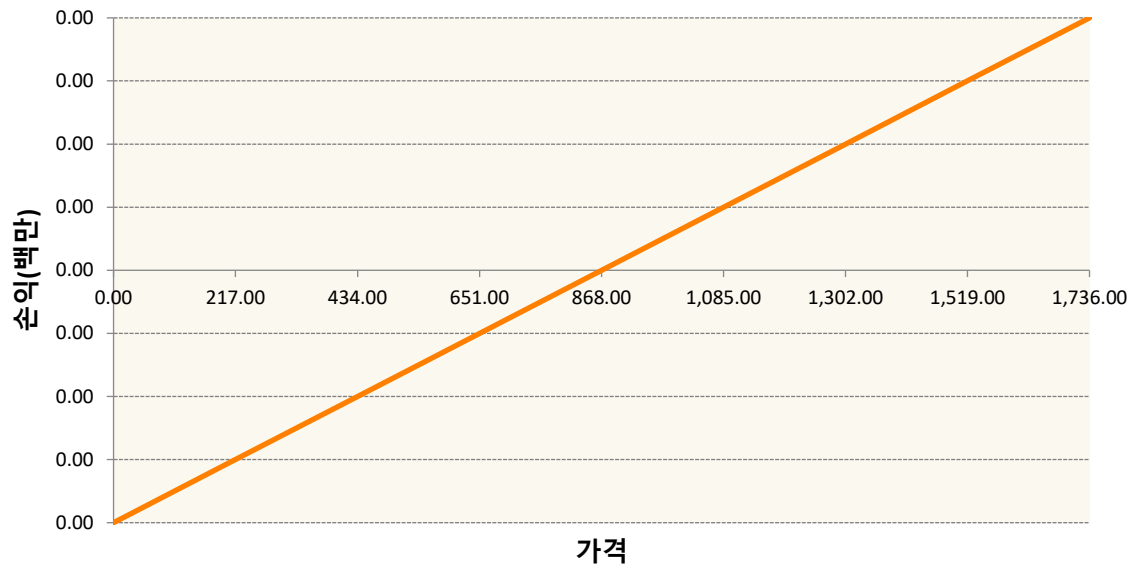
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



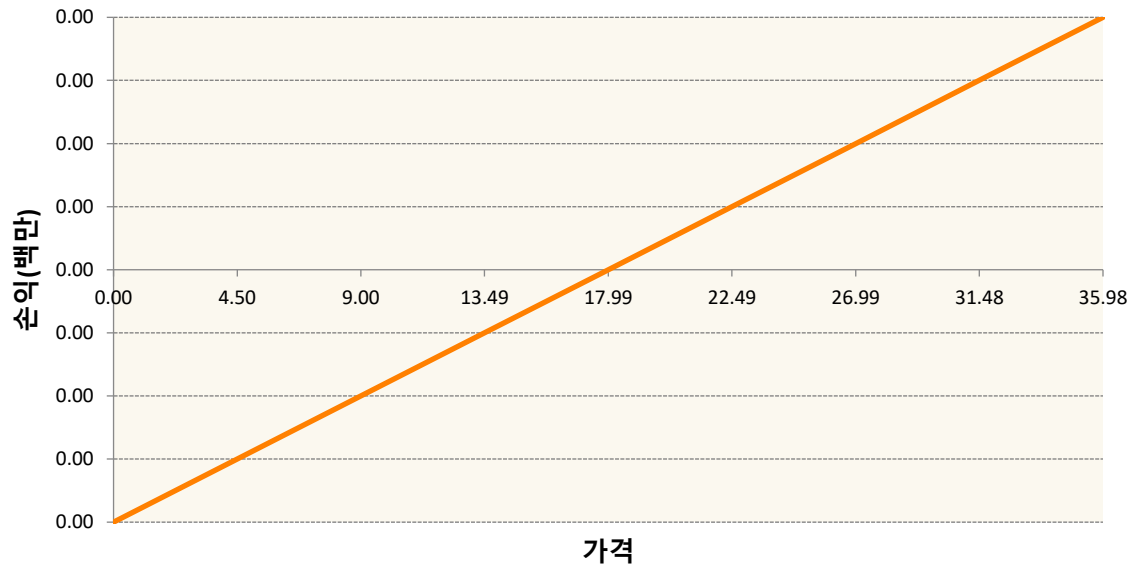
KR4175S90009-2022-09 달러선물



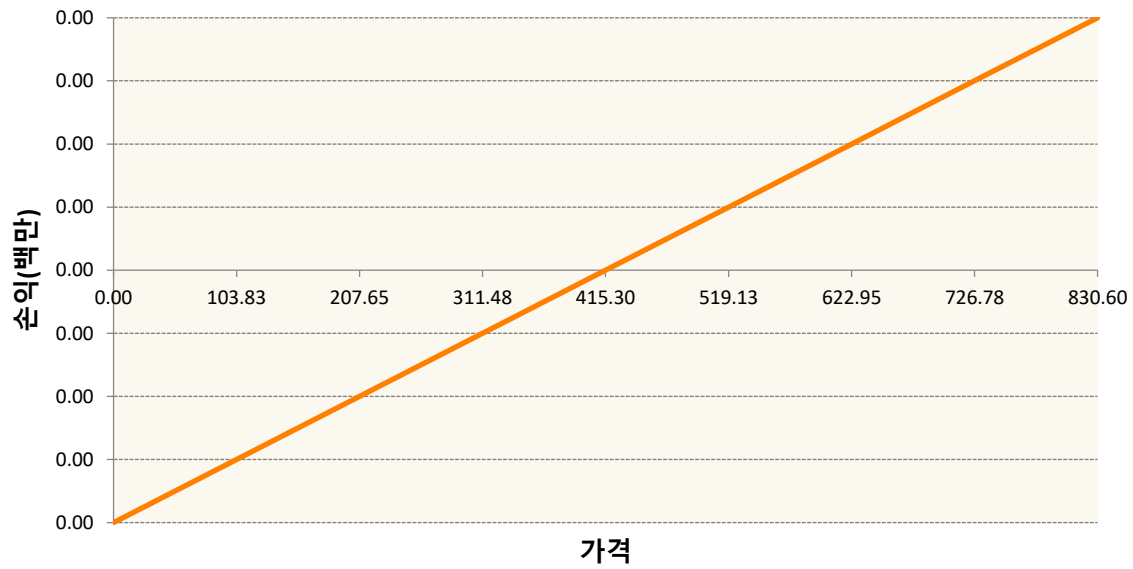
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

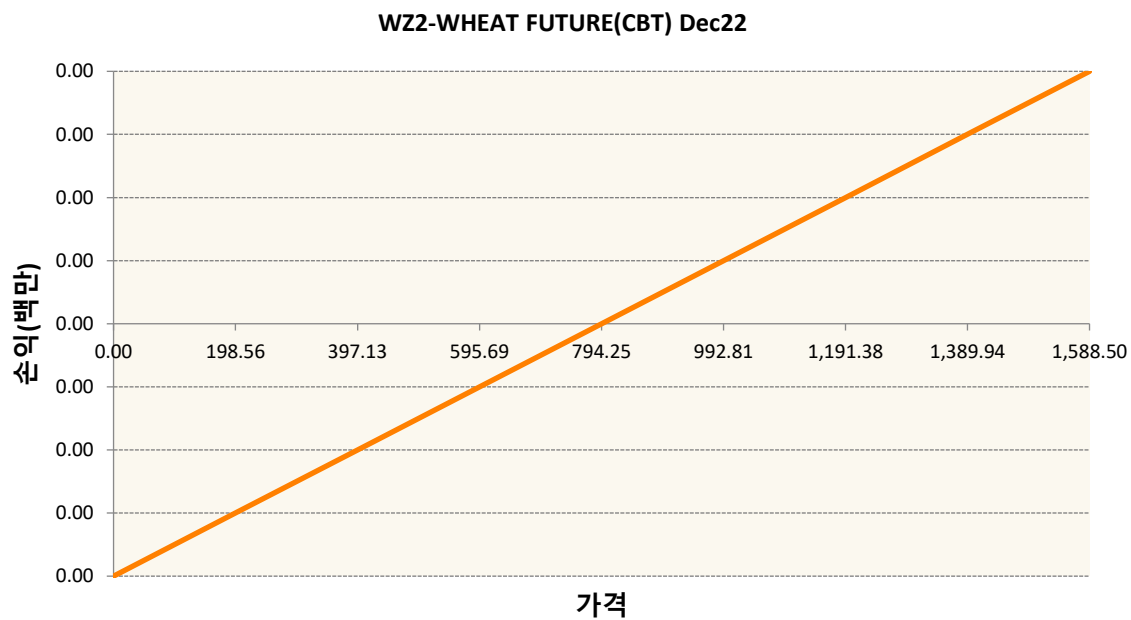
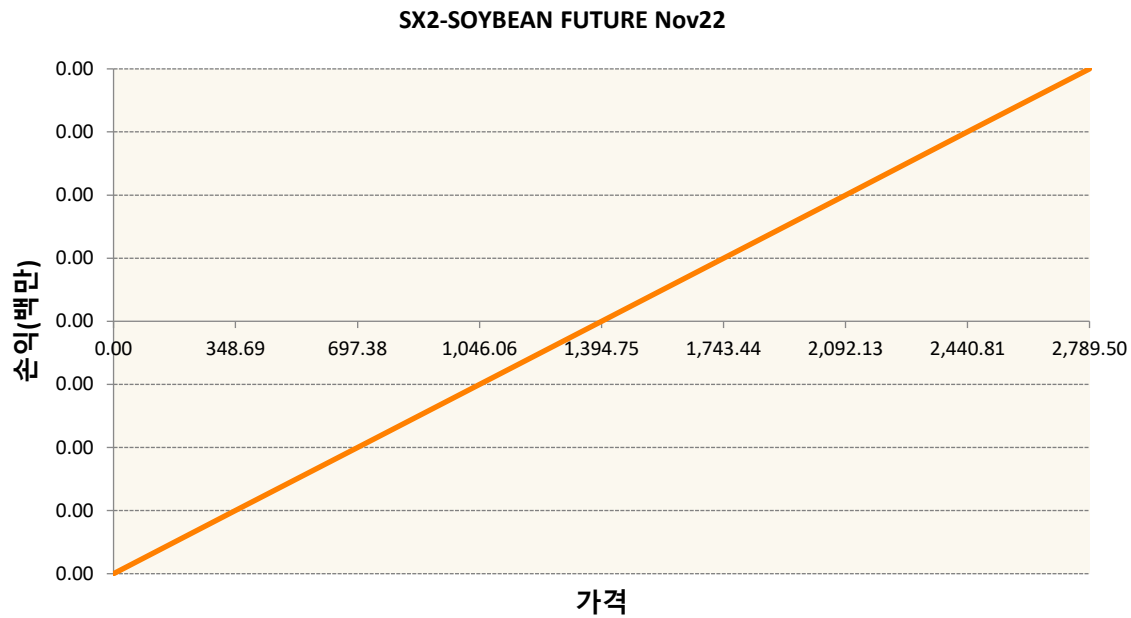


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



SMZ2-SOYBEAN MEAL FUTR Dec22





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

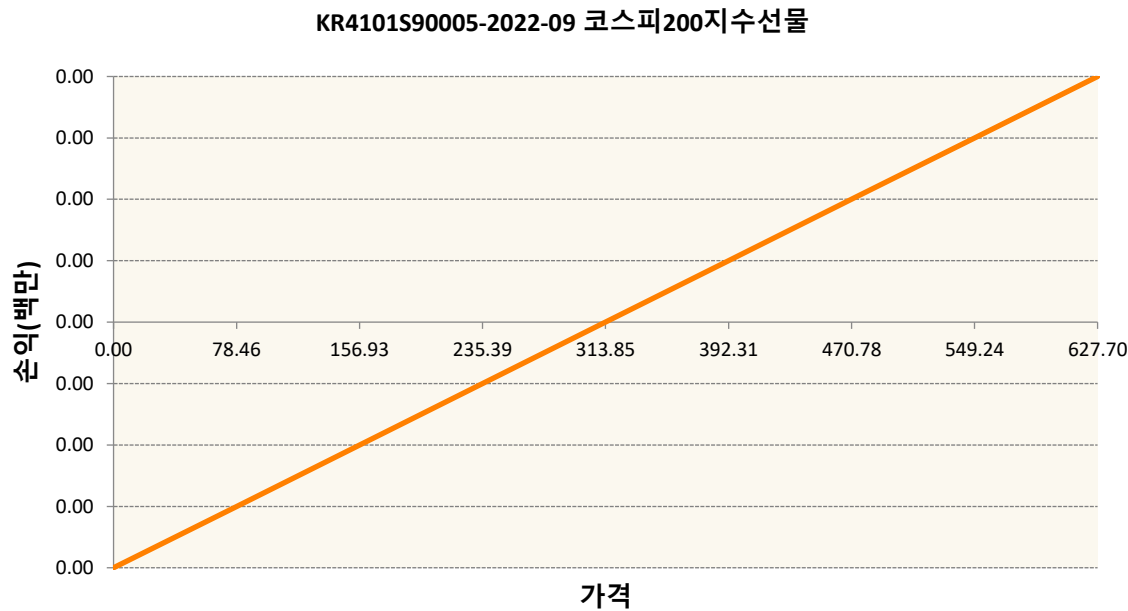
스마트인덱스모

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   | 1,020 | 0     | 1,020     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101S90005 |           |         | 2022-09 코스피200지수선물 |     |       |        | 81     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -81       | -81     | -81                | -81 | -81   | -81    | -81    |
| -5.33%       | -54       | -54     | -54                | -54 | -54   | -54    | -54    |
| -2.67%       | -27       | -27     | -27                | -27 | -27   | -27    | -27    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 27        | 27      | 27                 | 27  | 27    | 27     | 27     |
| 5.33%        | 54        | 54      | 54                 | 54  | 54    | 54     | 54     |
| 8.00%        | 81        | 81      | 81                 | 81  | 81    | 81     | 81     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

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   | 4,602 | 0     | 4,602     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래220311 | 353 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 463 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

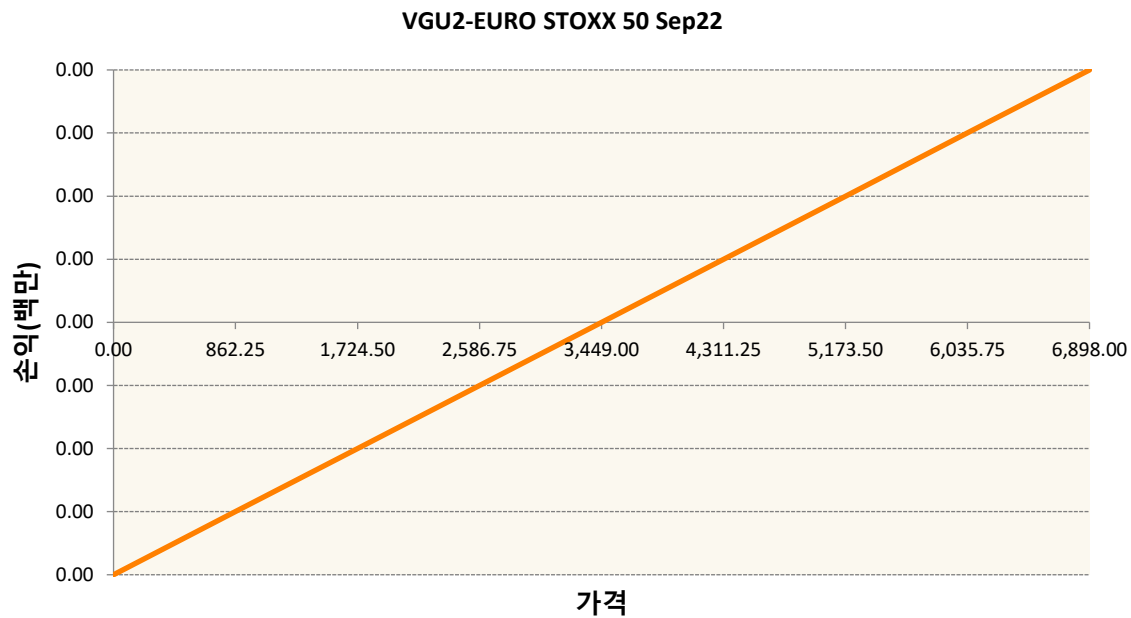
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 512   | 0     | 512       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGU2 | EURO STOXX 50 Sep22 | 41 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

42

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

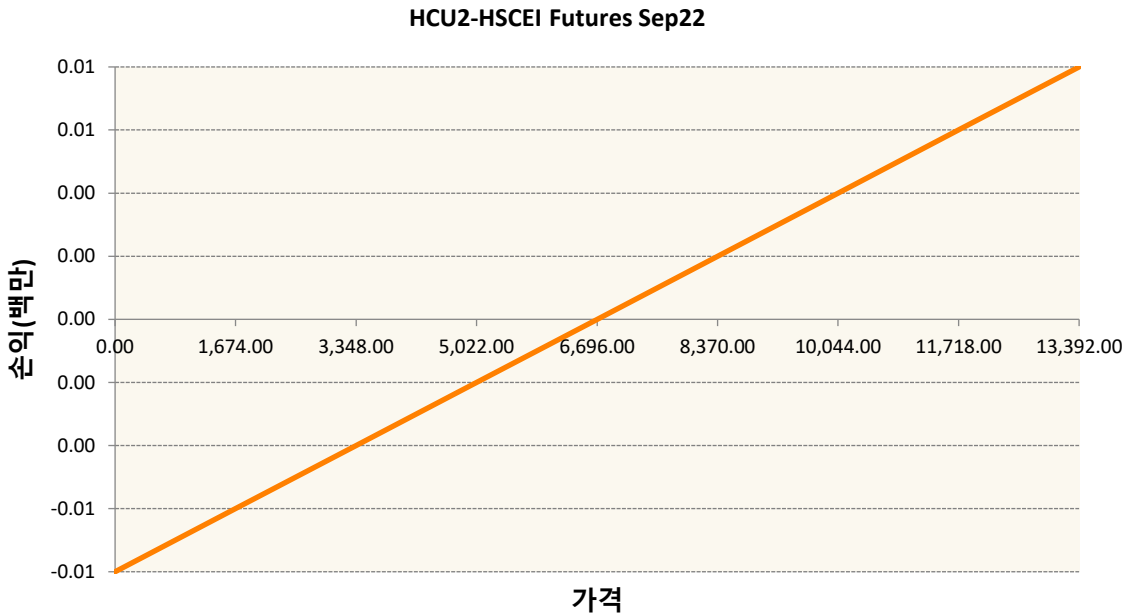
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,149 | 0     | 1,149     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCU2 | HSCEI Futures Sep22 | 92 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 135 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

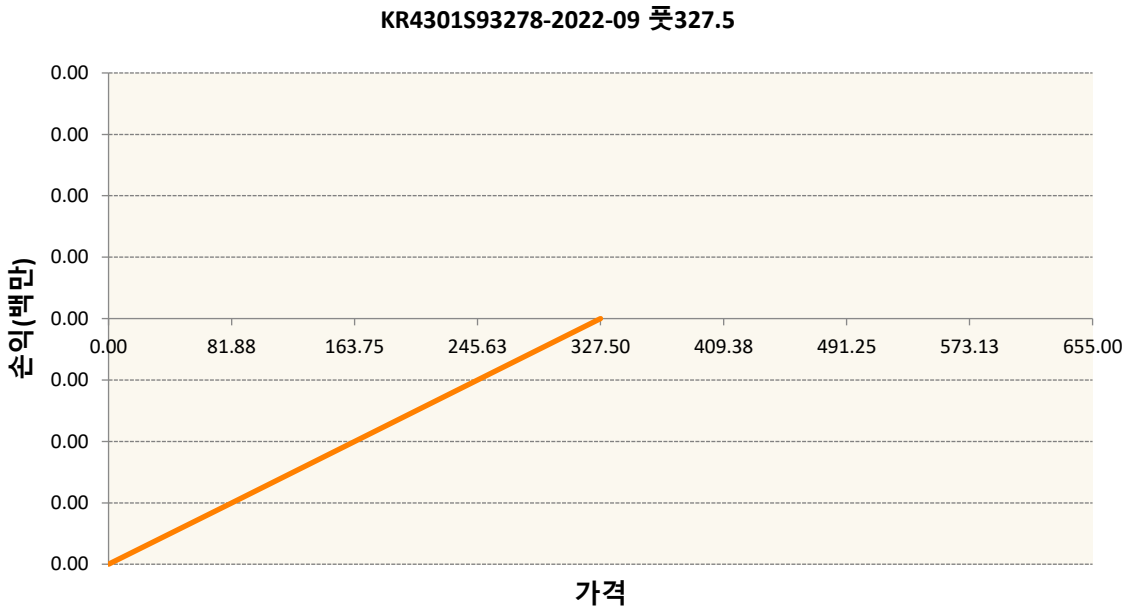
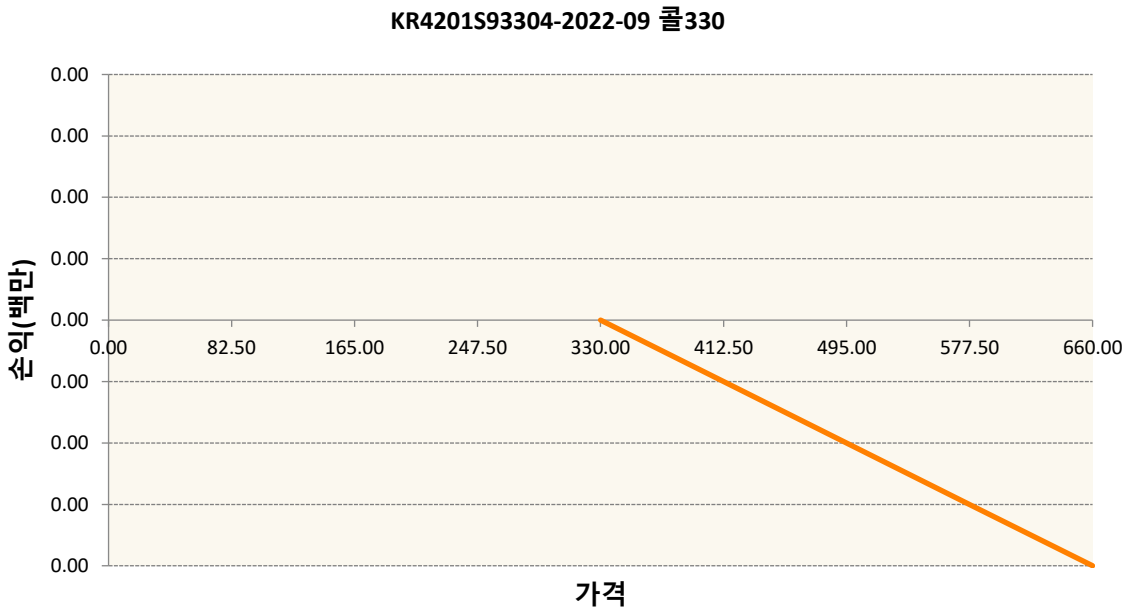
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

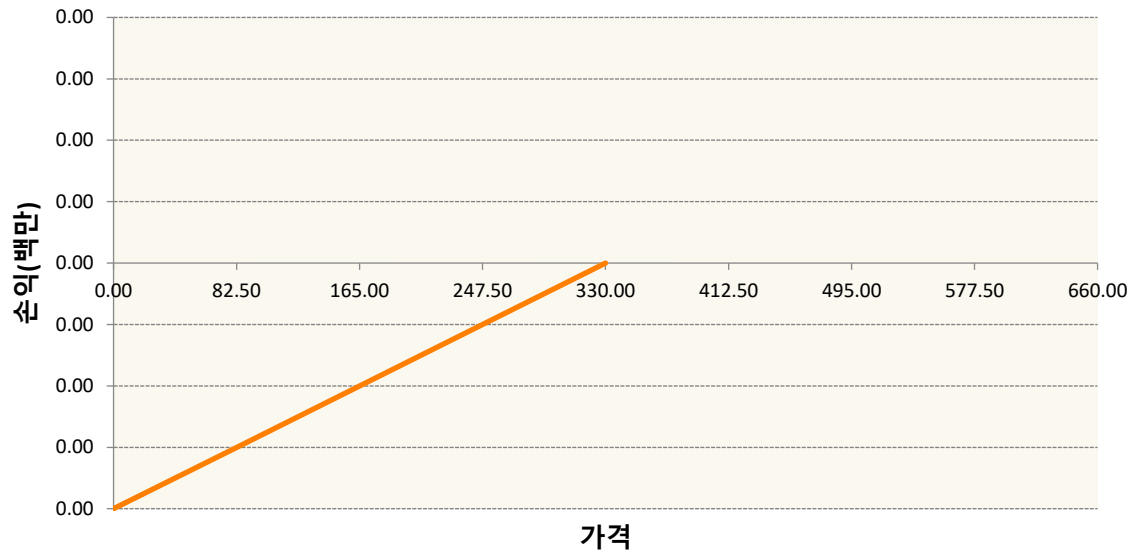
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 60,539 | -60,539   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301S93302-2022-09 풋330



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201S93304 |        | 2022-09 콜330   |         |        |        |        |        | 1,616  |
|--------------|--------|----------------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
|              |        | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |        | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 66     | 66             | 66      | 66     | 66     | 65     | 65     | 65     |
| -5.33%       | 66     | 66             | 65      | 65     | 63     | 61     | 57     | 57     |
| -2.67%       | 65     | 63             | 60      | 55     | 48     | 38     | 25     | 25     |
| 0%           | 50     | 37             | 21      | 0      | -24    | -52    | -83    | -83    |
| 2.67%        | -63    | -104           | -149    | -196   | -244   | -295   | -347   | -347   |
| 5.33%        | -473   | -536           | -598    | -661   | -723   | -786   | -848   | -848   |
| 8.00%        | -1,310 | -1,355         | -1,404  | -1,454 | -1,507 | -1,561 | -1,616 | -1,616 |
| KR4301S93278 |        | 2022-09 풋327.5 |         |        |        |        |        | 152    |
|              |        | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |        | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -152   | -152           | -152    | -152   | -152   | -152   | -152   | -152   |
| -5.33%       | -100   | -100           | -100    | -100   | -100   | -100   | -100   | -101   |
| -2.67%       | -48    | -48            | -48     | -49    | -49    | -50    | -50    | -50    |
| 0%           | 3      | 2              | 1       | 0      | -1     | -3     | -4     | -4     |
| 2.67%        | 48     | 46             | 44      | 41     | 39     | 37     | 35     | 35     |
| 5.33%        | 78     | 75             | 73      | 70     | 68     | 65     | 63     | 63     |
| 8.00%        | 91     | 90             | 88      | 86     | 84     | 82     | 80     | 80     |
| KR4301S93302 |        | 2022-09 풋330   |         |        |        |        |        | 621    |
|              |        | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |        | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -621   | -621           | -621    | -621   | -621   | -621   | -621   | -621   |
| -5.33%       | -410   | -410           | -410    | -411   | -411   | -411   | -412   | -412   |
| -2.67%       | -200   | -200           | -201    | -202   | -203   | -204   | -207   | -207   |
| 0%           | 8      | 6              | 3       | 0      | -4     | -9     | -14    | -14    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 200 | 193 | 186 | 178 | 170 | 162 | 153 |
| 5.33% | 343 | 332 | 322 | 312 | 301 | 291 | 280 |
| 8.00% | 414 | 407 | 399 | 390 | 382 | 373 | 364 |

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

(단위:백만원)

1,870

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

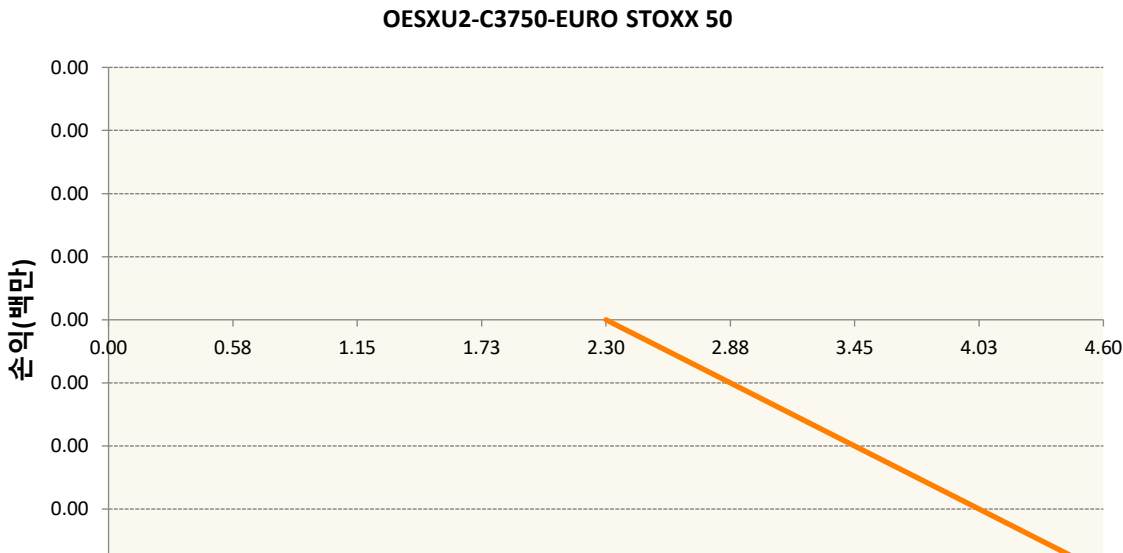
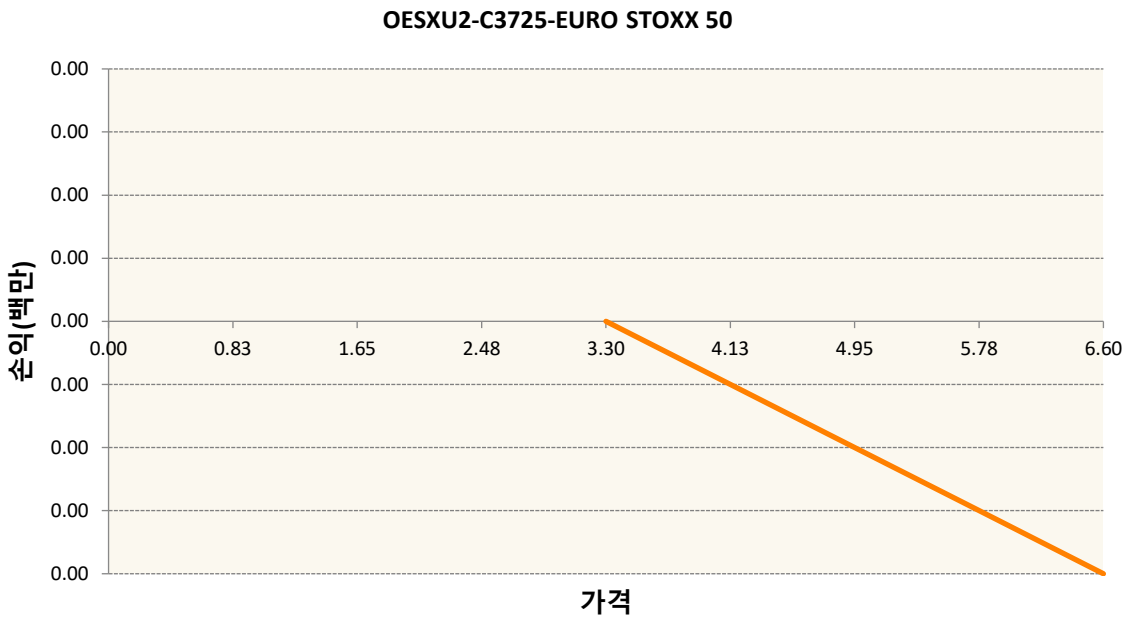
## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

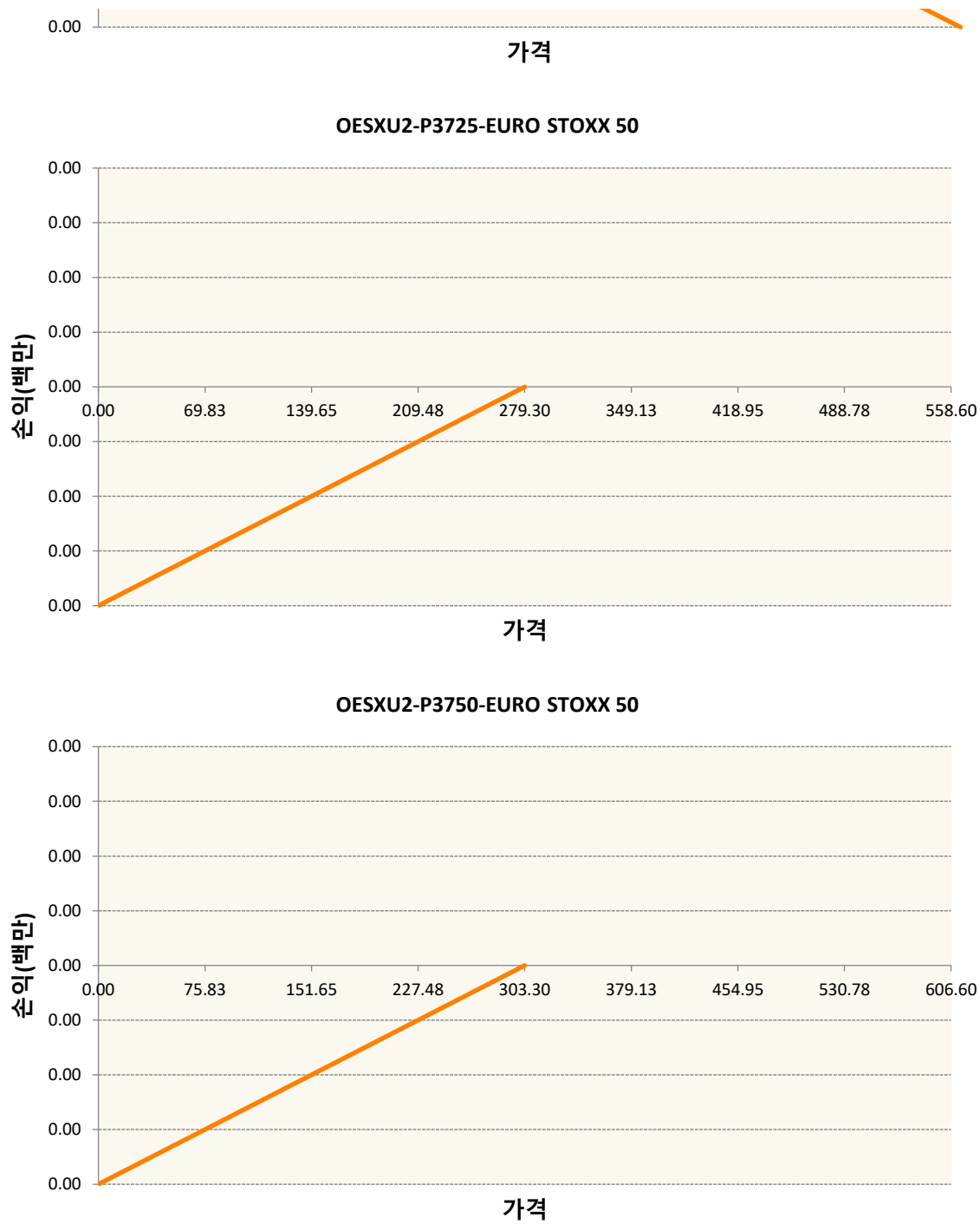
### 1. 계약금액

(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     | 55    | -55       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 4     | 0     | 4         | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,495 | -1,495    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY  
 FXW213C7L KRW/EUR 23-09-22E  
 FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E  
 FXW213C8R KRW/EUR 06-09-22E  
 OESXU2-C37 EURO STOXX 50  
 OESXU2-C37 EURO STOXX 50  
 OESXU2-P37 EURO STOXX 50  
 OESXU2-P37 EURO STOXX 50

|      |
|------|
| 6    |
| 33   |
| 71   |
| 16   |
| 0.05 |
| 0.01 |
| 3    |
| 1    |



공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

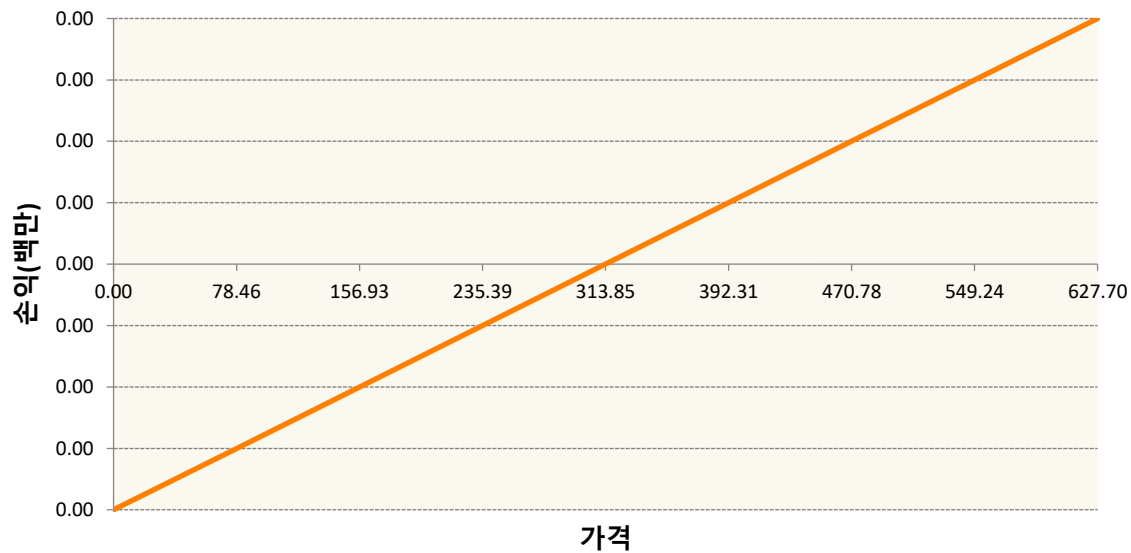
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

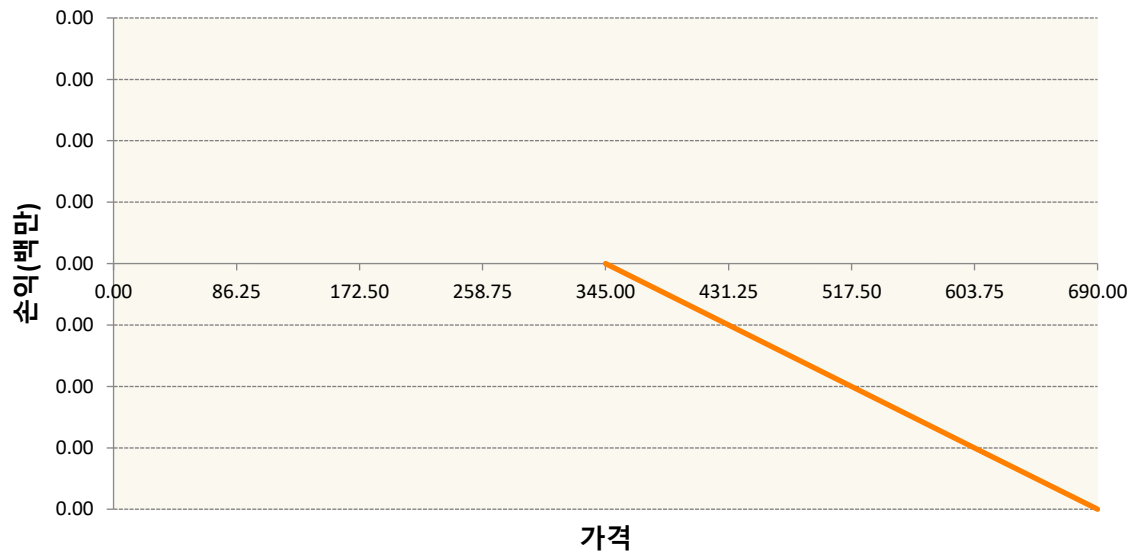
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 392   | 0     | 392       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 329   | 4,503 | -4,174    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

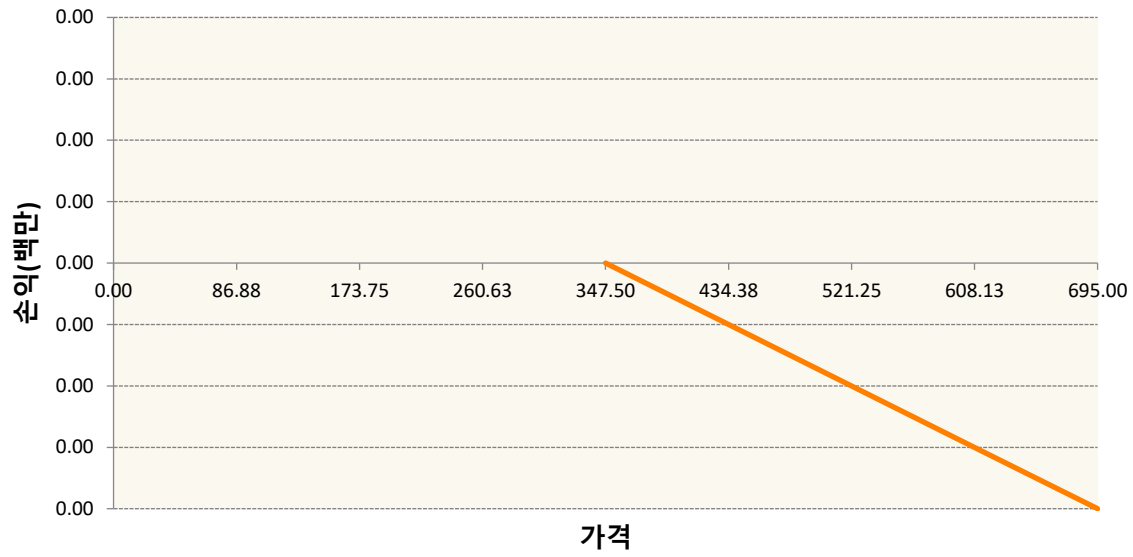
KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



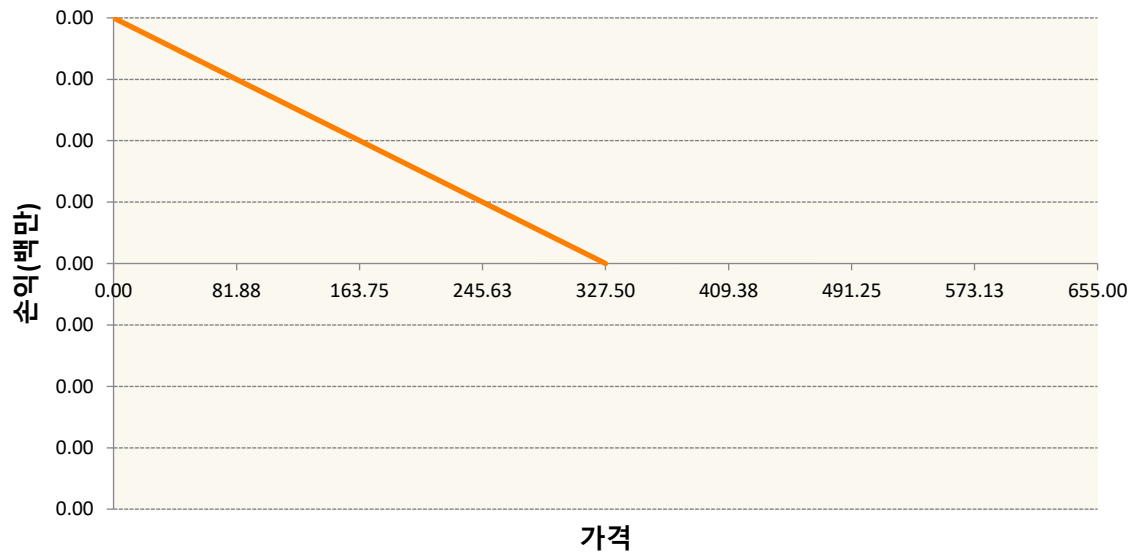
KR4201S93452-2022-09 콜345



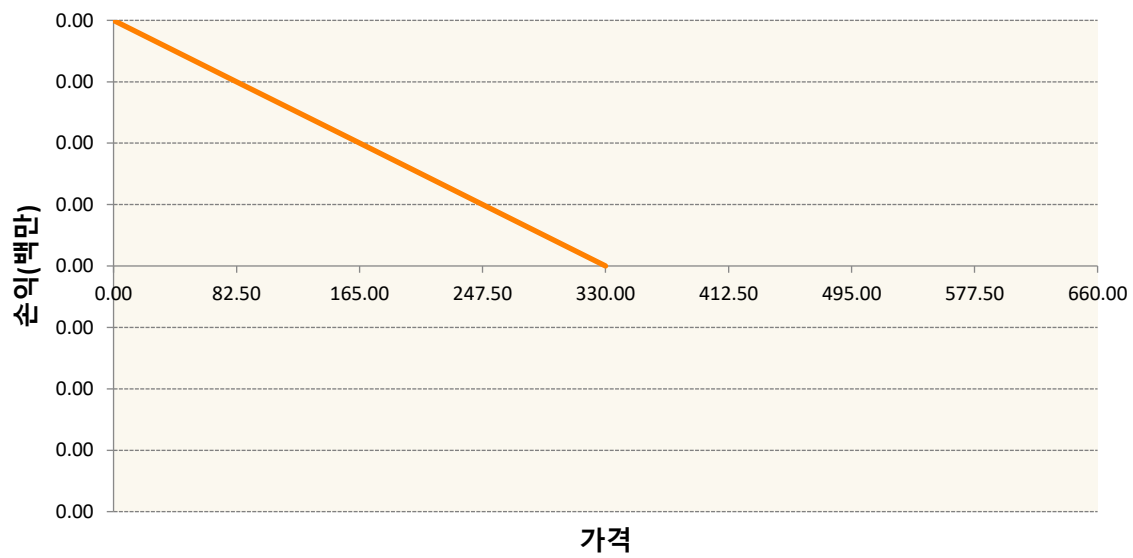
KR4201S93478-2022-09 콜347.5



KR4301S93278-2022-09 풋327.5



KR4301S93302-2022-09 풋330



(단위:백만원)

|              |           |         |        |                    |       |        |        |     |
|--------------|-----------|---------|--------|--------------------|-------|--------|--------|-----|
| KR4101S90005 |           |         |        | 2022-09 코스피200지수선물 |       |        |        | 31  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                 | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -31       | -31     | -31    | -31                | -31   | -31    | -31    | -31 |
| -5.33%       | -21       | -21     | -21    | -21                | -21   | -21    | -21    | -21 |
| -2.67%       | -10       | -10     | -10    | -10                | -10   | -10    | -10    | -10 |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      | 0   |
| 2.67%        | 10        | 10      | 10     | 10                 | 10    | 10     | 10     | 10  |
| 5.33%        | 21        | 21      | 21     | 21                 | 21    | 21     | 21     | 21  |
| 8.00%        | 31        | 31      | 31     | 31                 | 31    | 31     | 31     | 31  |
| KR4201S93452 |           |         |        | 2022-09 콜345       |       |        |        | 20  |
|              | 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      | 0   |
| -5.33%       | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      | 0   |
| -2.67%       | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      | 0   |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      | -1  |
| 2.67%        | 0         | 0       | 0      | -1                 | -1    | -2     | -2     | -2  |
| 5.33%        | -1        | -2      | -3     | -4                 | -5    | -6     | -8     | -8  |
| 8.00%        | -7        | -9      | -11    | -13                | -16   | -18    | -20    | -20 |
| KR4201S93478 |           |         |        | 2022-09 콜347.5     |       |        |        | 20  |
|              | 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      | 0   |
| -5.33%       | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      | 0   |
| -2.67%       | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      | 0   |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      | 0   |
| 2.67%        | 0         | 0       | 0      | -1                 | -1    | -1     | -2     | -2  |
| 5.33%        | -1        | -1      | -2     | -3                 | -5    | -6     | -7     | -7  |
| 8.00%        | -6        | -8      | -10    | -12                | -15   | -17    | -20    | -20 |
| KR4301S93278 |           |         |        | 2022-09 풋327.5     |       |        |        | 6   |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                 | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | 6         | 6       | 6      | 6                  | 6     | 6      | 6      | 6   |
| -5.33%       | 4         | 4       | 4      | 4                  | 4     | 4      | 4      | 4   |
| -2.67%       | 2         | 2       | 2      | 2                  | 2     | 2      | 2      | 2   |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      | 0   |
| 2.67%        | -2        | -2      | -2     | -2                 | -2    | -1     | -1     | -1  |
| 5.33%        | -3        | -3      | -3     | -3                 | -3    | -3     | -3     | -3  |
| 8.00%        | -4        | -4      | -4     | -3                 | -3    | -3     | -3     | -3  |
| KR4301S93302 |           |         |        | 2022-09 풋330       |       |        |        | 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% | 12      | 12      | 12     | 12  | 12    | 12     | 12     |
| -2.67% | 6       | 6       | 6      | 6   | 6     | 6      | 6      |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | -6      | -6      | -6     | -5  | -5    | -5     | -5     |
| 5.33%  | -10     | -10     | -10    | -9  | -9    | -9     | -8     |
| 8.00%  | -12     | -12     | -12    | -12 | -11   | -11    | -11    |

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

(단위:백만원)

62

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 118   | -118      |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 7,901 | 0     | 7,901     |    |

### 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 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

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 | 6,735 | 0     | 6,735     |    |

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 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

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 | 20,875 | 0      | 20,875    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 21,086 | -21,086   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    |                                 | (단위:백만원) |
|------------------------------|---------------------------------|----------|
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |          |
| FXW213C6P₩ KRW/USD 27-09-22E |                                 | 610      |
| FXW213C7R₩ KRW/USD 27-10-22E |                                 | 467      |
| FXW213C8R₩ KRW/USD 28-11-22E |                                 | 609      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 670      |

공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

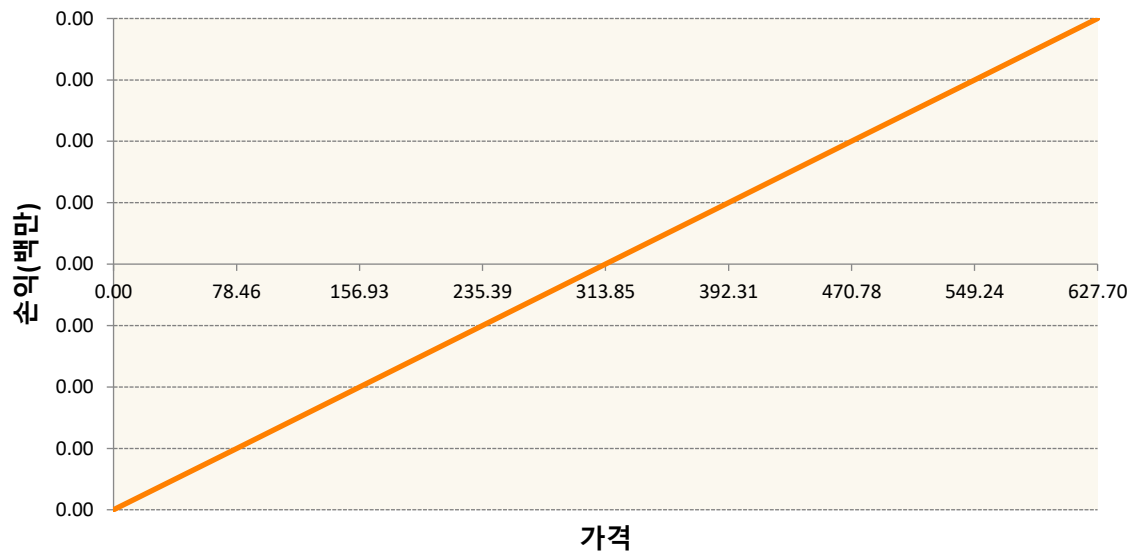
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 392   | 0     | 392       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005

2022-09 코스피200지수선물

31

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -31     | -31     | -31    | -31 | -31   | -31    | -31    |
| -5.33%    | -21     | -21     | -21    | -21 | -21   | -21    | -21    |
| -2.67%    | -10     | -10     | -10    | -10 | -10   | -10    | -10    |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 10      | 10      | 10     | 10  | 10    | 10     | 10     |
| 5.33%     | 21      | 21      | 21     | 21  | 21    | 21     | 21     |
| 8.00%     | 31      | 31      | 31     | 31  | 31    | 31     | 31     |



공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

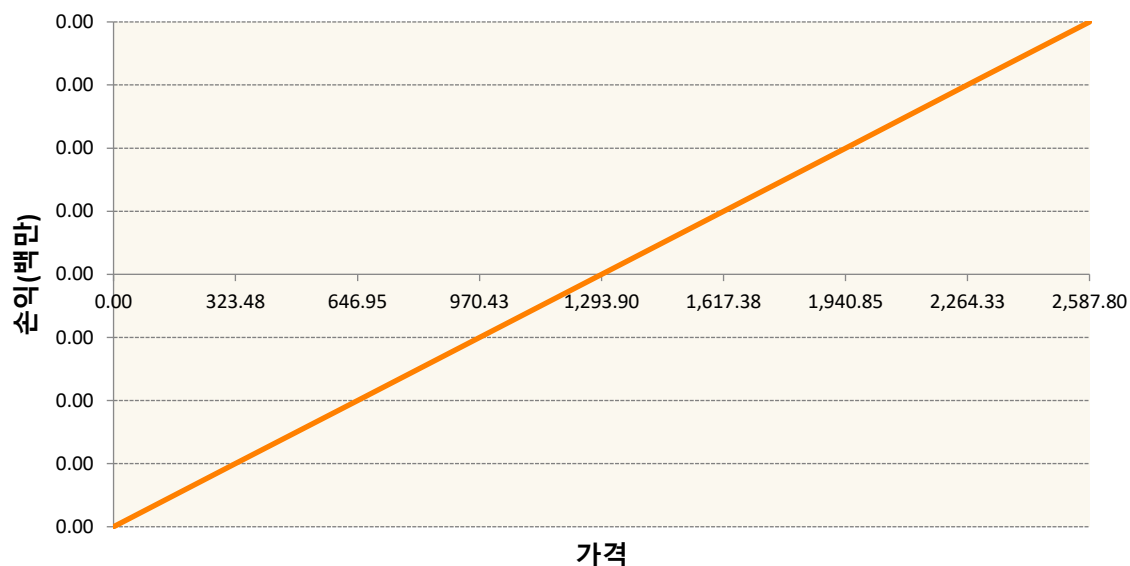
### 1. 계약금액

(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   | 756   | 0     | 756       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,672 | 0     | 1,672     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,155 | -1,155    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCU2-VN30 Index Future SEP22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 134 |
| FXW213C6N KRW/EUR 23-09-22E   | 27  |
| FXW213C7L KRW/EUR 21-10-22E   | 18  |
| FXW213C84 KRW/EUR 21-10-22E   | 5   |
| FXW213C8P KRW/EUR 18-11-22E   | 11  |
| FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E   | 30  |
| VNCU2 VN30 Index Future SEP22 | 60  |

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

(단위:백만원)

256

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

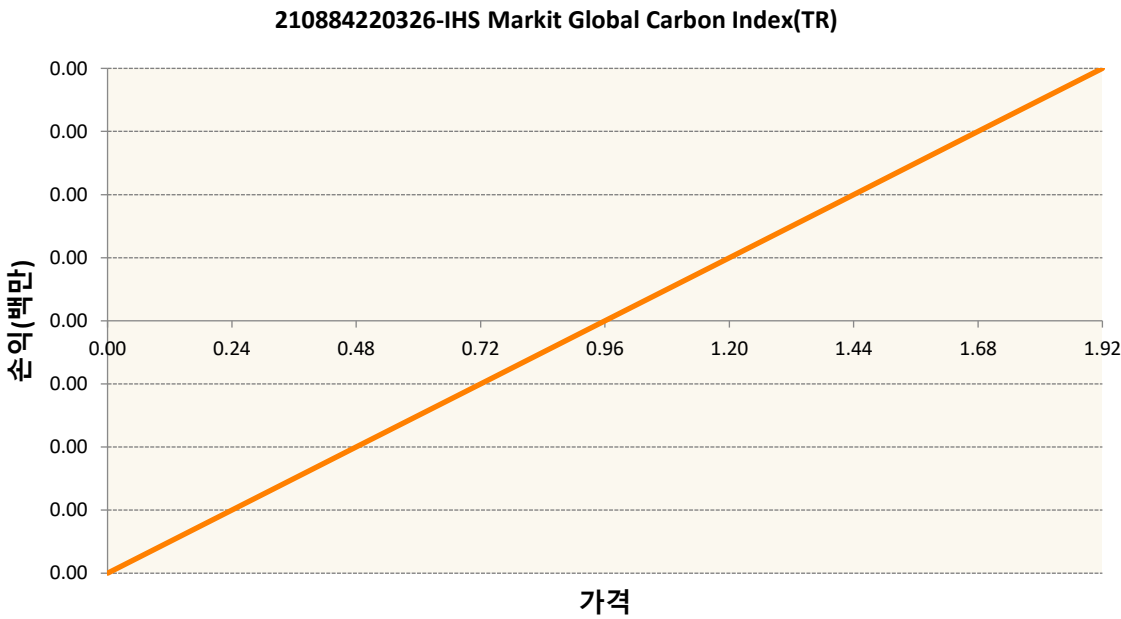
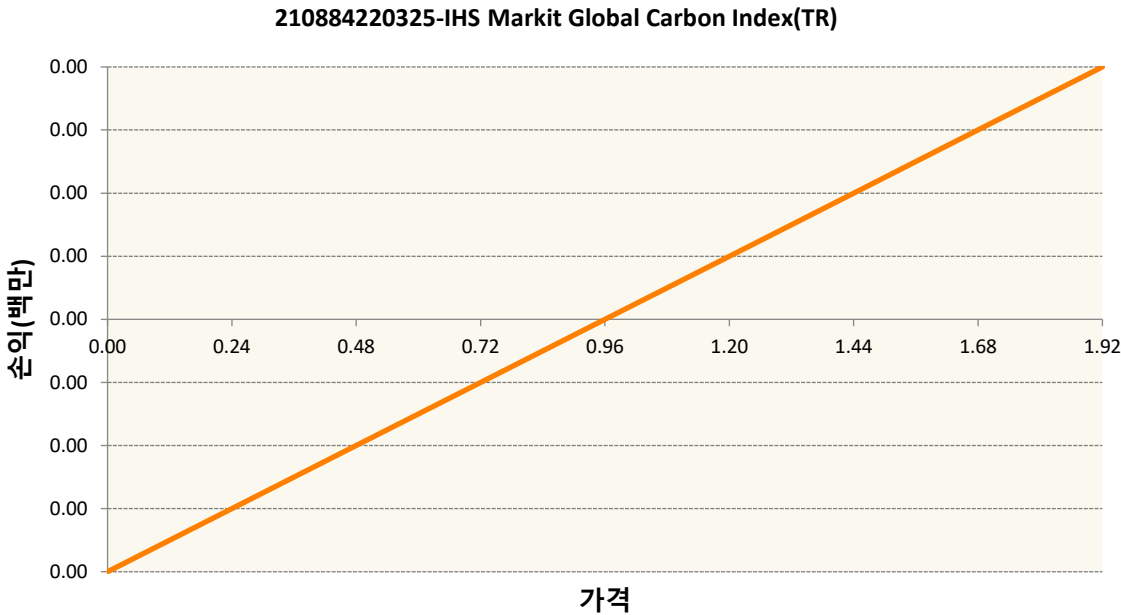
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 1. 계약금액

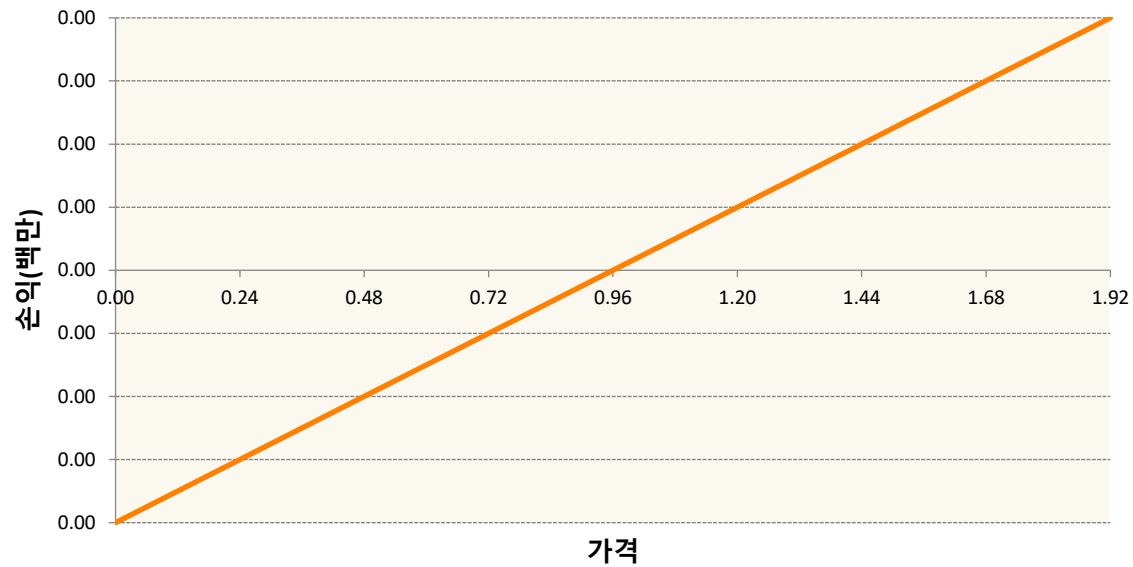
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 38,446 | 0     | 38,446    |    |

### 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)

193

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

2,785

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

96

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

(단위:백만원)

5,717

공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

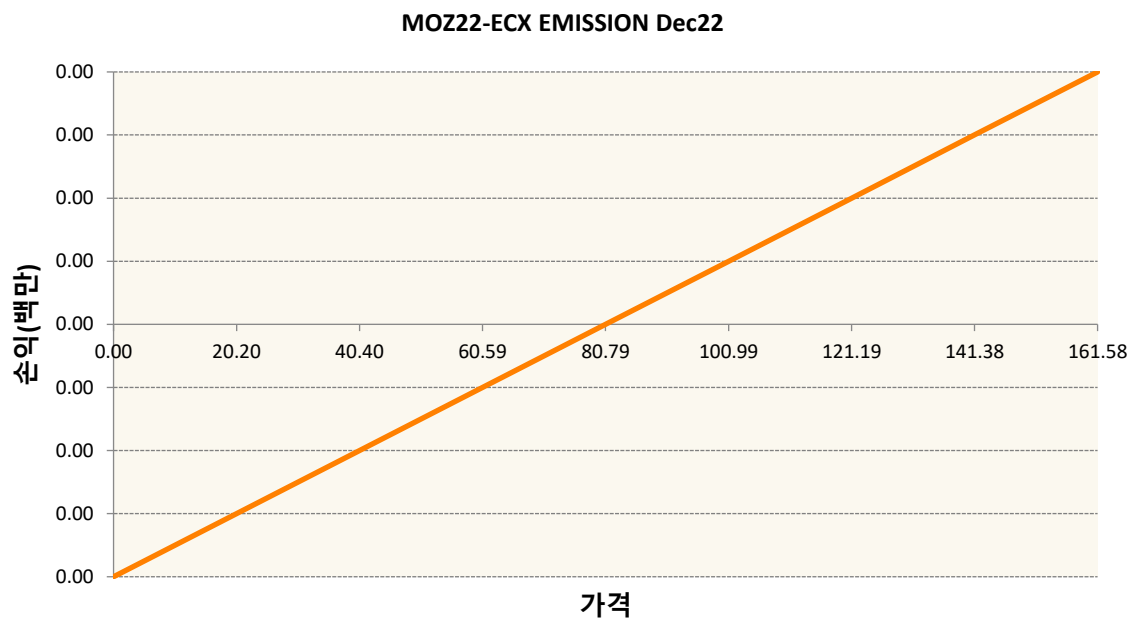
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 11,630 | 0     | 11,630    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 5,109 | -5,109    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8S KRW/EUR 27-09-22E

409

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

930

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

(단위:백만원)

2,557

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

# 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   | 11,616 | 0     | 11,616    | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                     |   |
|-------------------------------------|---|
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)  | 5 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)  | 5 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)  | 5 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠) | 5 |

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

(단위:백만원)

36

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

## 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   | 9,881 | 0     | 9,881     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |   |
|-----------------------------------------|---|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(키움)  | 2 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 2 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 2 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220714(메리츠) | 3 |

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

(단위:백만원)

11

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-05 |
| 기준일 | 2022-09-02 |

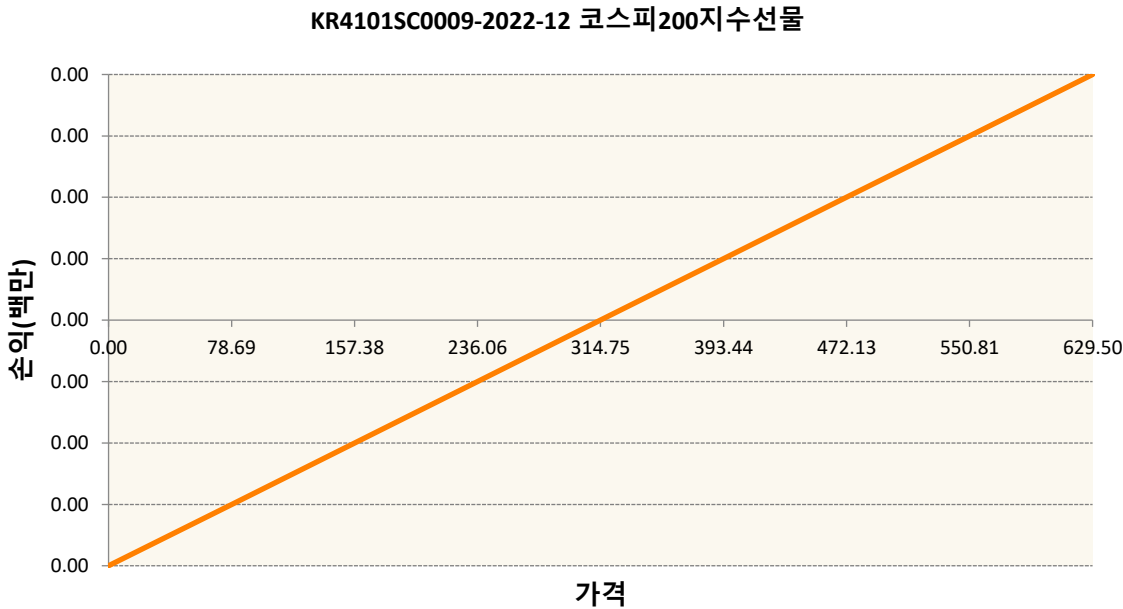
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 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   | 944   | 0     | 944       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                      |    |
|--------------------------------------|----|
| KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429    | 1  |
| KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602 | 2  |
| KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물        | 76 |

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

(단위:백만원)

84

공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

## 신한SOL한국형글로벌반도체엑티

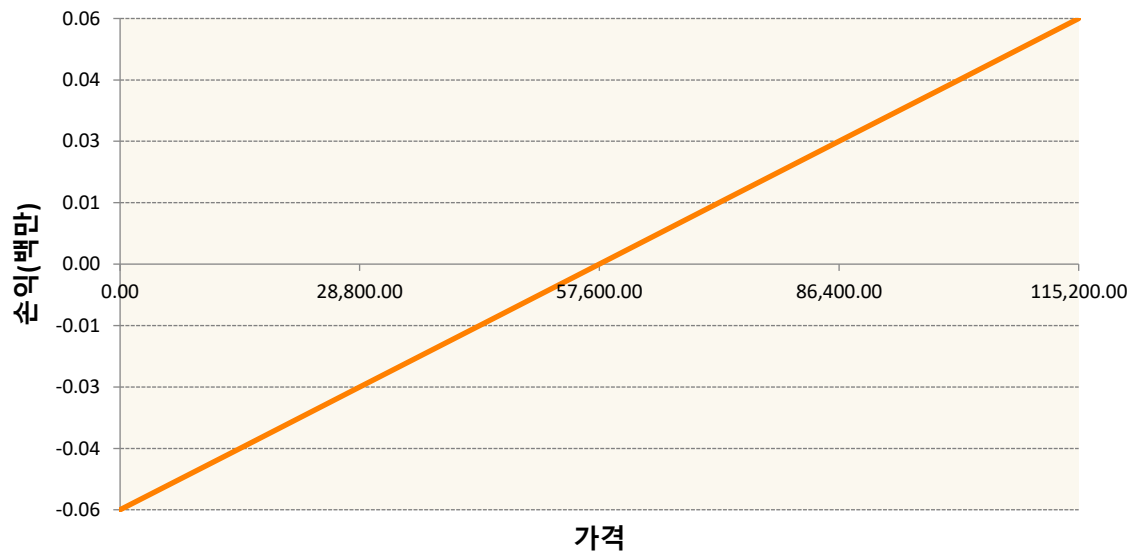
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

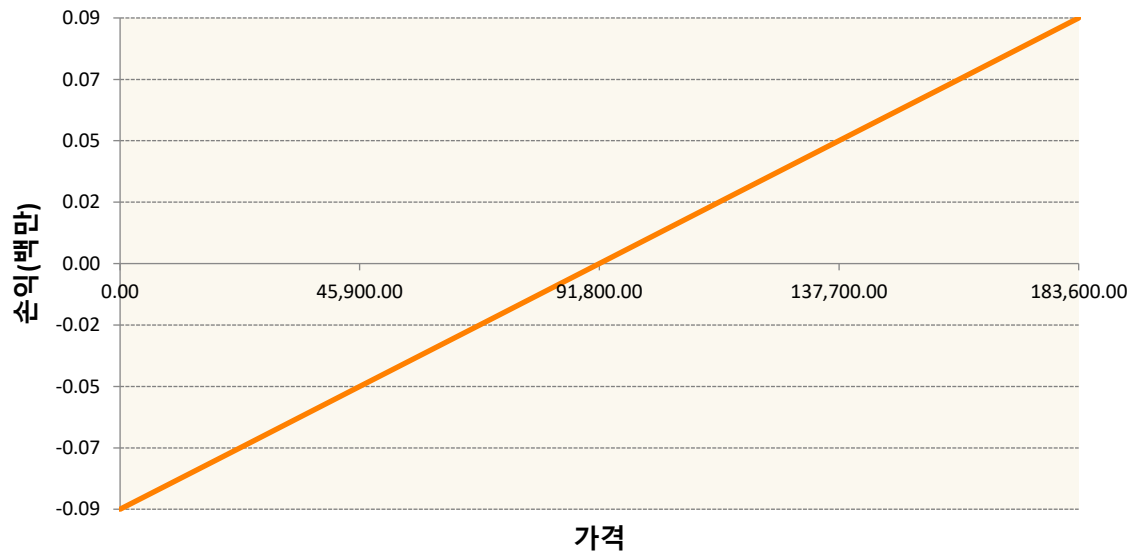
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 815   | 0     | 815       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111S90004-2022-09 삼성전자개별선물



KR4150S90002-2022-09 SK하이닉스개별선물



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

| KR4111S90004 |           | 2022-09 삼성전자개별선물   |        |     |       |        | 33     |
|--------------|-----------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -33       | -33                | -33    | -33 | -33   | -33    | -33    |
| -5.33%       | -22       | -22                | -22    | -22 | -22   | -22    | -22    |
| -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%        | 22        | 22                 | 22     | 22  | 22    | 22     | 22     |
| 8.00%        | 33        | 33                 | 33     | 33  | 33    | 33     | 33     |
| KR4150S90002 |           | 2022-09 SK하이닉스개별선물 |        |     |       |        | 32     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -32       | -32                | -32    | -32 | -32   | -32    | -32    |
| -5.33%       | -21       | -21                | -21    | -21 | -21   | -21    | -21    |
| -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%        | 21        | 21                 | 21     | 21  | 21    | 21     | 21     |
| 8.00%        | 32        | 32                 | 32     | 32  | 32    | 32     | 32     |

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

74

공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 1. 계약금액

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 2. 만기시점의 손익구조

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

## SOL한국형글로벌전기차&2차전지

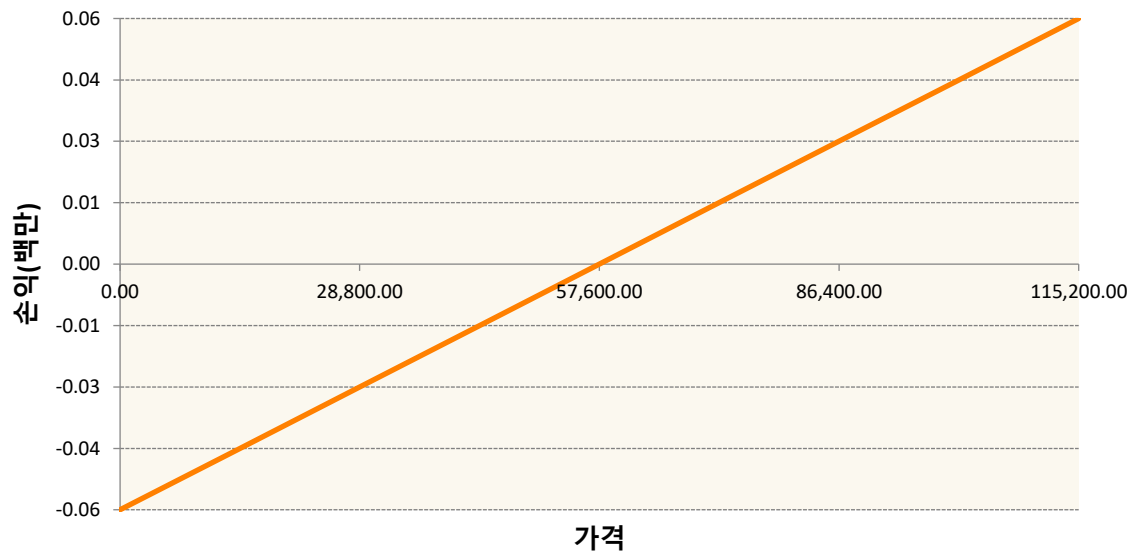
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

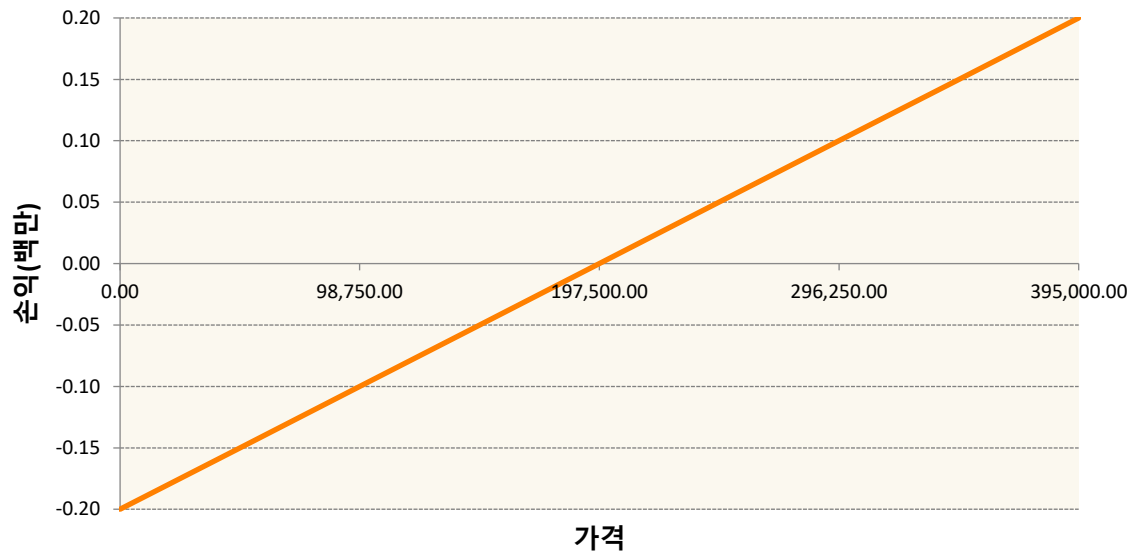
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 281   | 0     | 281       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

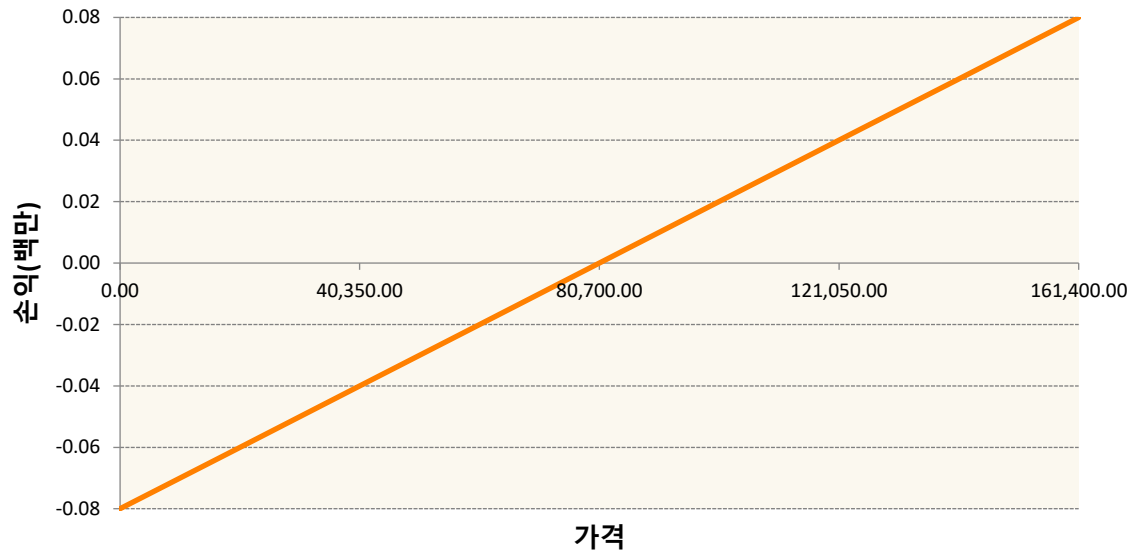
KR4111S90004-2022-09 삼성전자개별선물



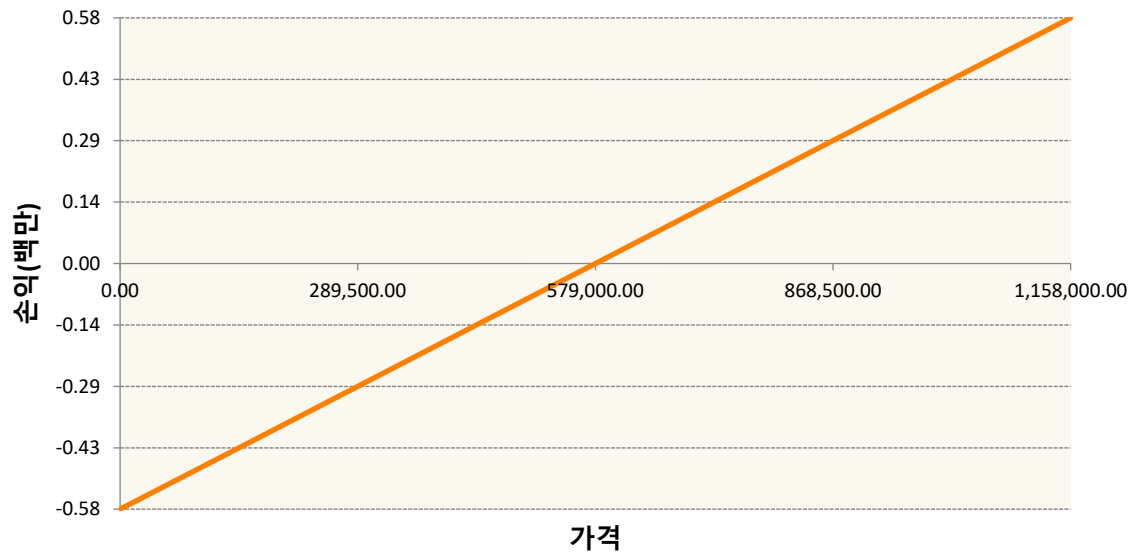
KR4116S90003-2022-09 현대차개별선물



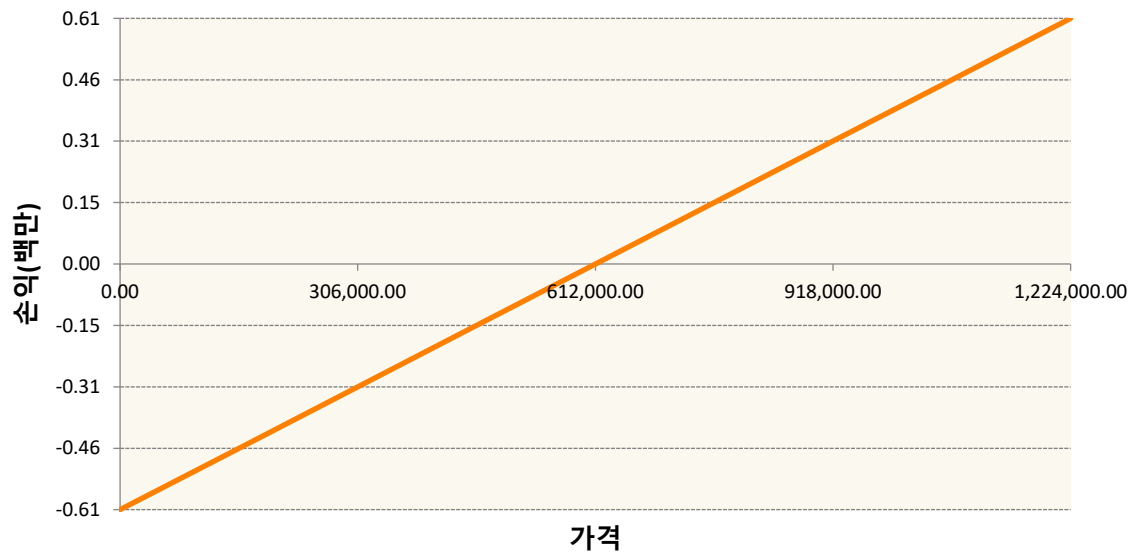
KR4119S90007-2022-09 기아개별선물



KR4122S90001-2022-09 삼성SDI개별선물



KR4147S90008-2022-09 LG화학개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |        |    |       |        |                   |  |   |  |
|--------------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|-------------------|--|---|--|
| KR4111S90004 |           |         |        |    |       |        | 2022-09 삼성전자개별선물  |  | 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%       | -2        | -2      | -2     | -2 | -2    | -2     | -2                |  |   |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0                 |  |   |  |
| 2.67%        | 2         | 2       | 2      | 2  | 2     | 2      | 2                 |  |   |  |
| 5.33%        | 3         | 3       | 3      | 3  | 3     | 3      | 3                 |  |   |  |
| 8.00%        | 5         | 5       | 5      | 5  | 5     | 5      | 5                 |  |   |  |
| KR4116S90003 |           |         |        |    |       |        | 2022-09 현대차개별선물   |  | 4 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |    |       |        |                   |  |   |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00%            |  |   |  |
| -8.00%       | -4        | -4      | -4     | -4 | -4    | -4     | -4                |  |   |  |
| -5.33%       | -3        | -3      | -3     | -3 | -3    | -3     | -3                |  |   |  |
| -2.67%       | -1        | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1                |  |   |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0                 |  |   |  |
| 2.67%        | 1         | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1                 |  |   |  |
| 5.33%        | 3         | 3       | 3      | 3  | 3     | 3      | 3                 |  |   |  |
| 8.00%        | 4         | 4       | 4      | 4  | 4     | 4      | 4                 |  |   |  |
| KR4119S90007 |           |         |        |    |       |        | 2022-09 기아개별선물    |  | 3 |  |
|              | 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%       | -2        | -2      | -2     | -2 | -2    | -2     | -2                |  |   |  |
| -2.67%       | -1        | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1                |  |   |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0                 |  |   |  |
| 2.67%        | 1         | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1                 |  |   |  |
| 5.33%        | 2         | 2       | 2      | 2  | 2     | 2      | 2                 |  |   |  |
| 8.00%        | 3         | 3       | 3      | 3  | 3     | 3      | 3                 |  |   |  |
| KR4122S90001 |           |         |        |    |       |        | 2022-09 삼성SDI개별선물 |  | 9 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |    |       |        |                   |  |   |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00%            |  |   |  |
| -8.00%       | -9        | -9      | -9     | -9 | -9    | -9     | -9                |  |   |  |
| -5.33%       | -6        | -6      | -6     | -6 | -6    | -6     | -6                |  |   |  |
| -2.67%       | -3        | -3      | -3     | -3 | -3    | -3     | -3                |  |   |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0                 |  |   |  |
| 2.67%        | 3         | 3       | 3      | 3  | 3     | 3      | 3                 |  |   |  |
| 5.33%        | 6         | 6       | 6      | 6  | 6     | 6      | 6                 |  |   |  |
| 8.00%        | 9         | 9       | 9      | 9  | 9     | 9      | 9                 |  |   |  |
| KR4147S90008 |           |         |        |    |       |        | 2022-09 LG화학개별선물  |  | 1 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |    |       |        |                   |  |   |  |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| -8.00% | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -5.33% | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -2.67% | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 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)

26

공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

## SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

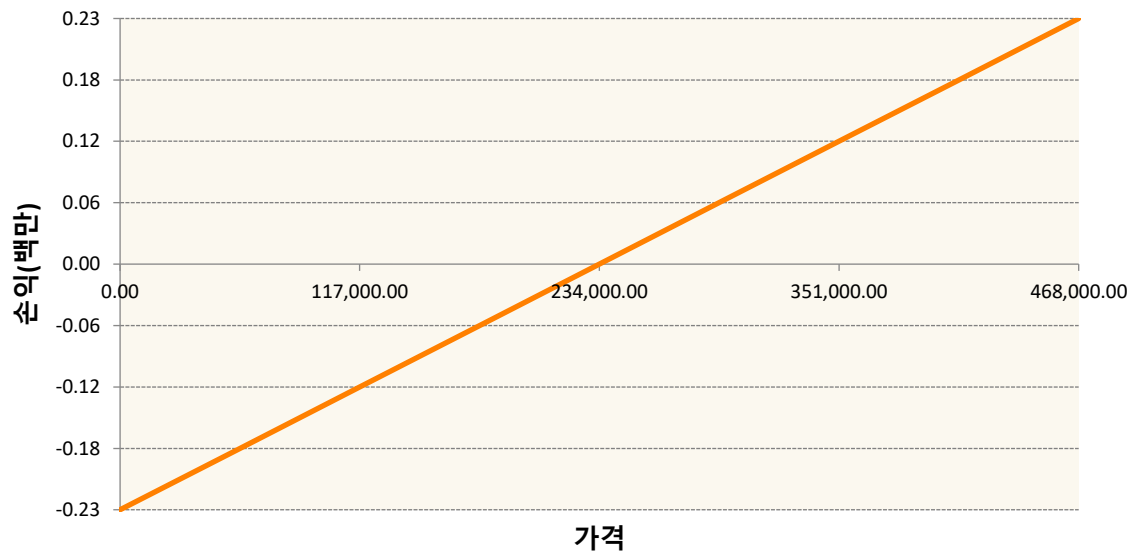
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

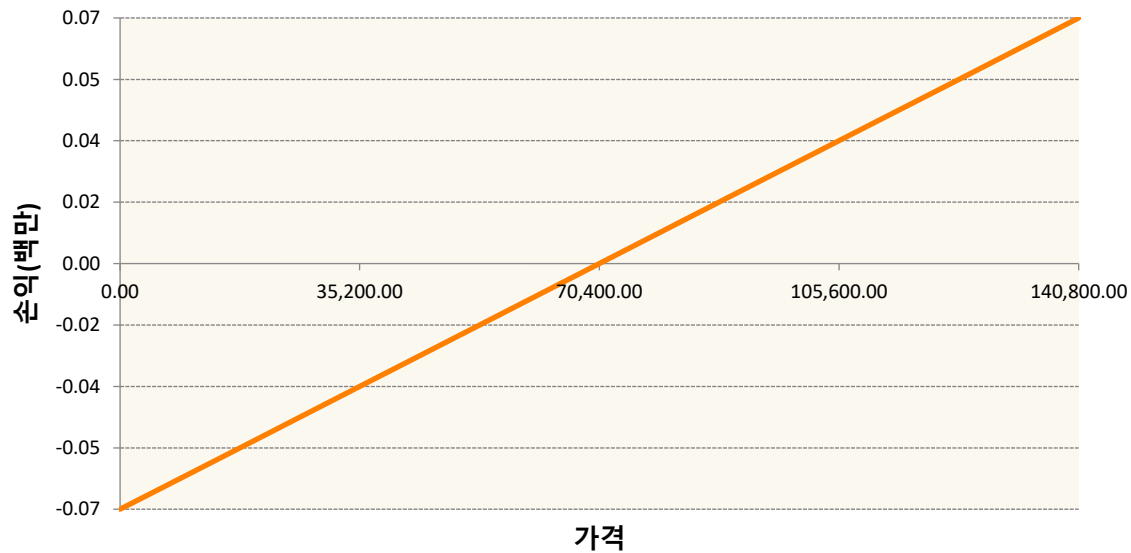
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 201   | 0     | 201       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4156S90009-2022-09 NAVER개별선물



KR41CFS90000-2022-09 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|              |           |                   |        |    |       |        |        |
|--------------|-----------|-------------------|--------|----|-------|--------|--------|
| KR4156S90009 |           | 2022-09 NAVER개별선물 |        |    |       |        | 9      |
|              | 기초자산의 변동성 |                   |        |    |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%           | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -9        | -9                | -9     | -9 | -9    | -9     | -9     |
| -5.33%       | -6        | -6                | -6     | -6 | -6    | -6     | -6     |
| -2.67%       | -3        | -3                | -3     | -3 | -3    | -3     | -3     |
| 0%           | 0         | 0                 | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 3         | 3                 | 3      | 3  | 3     | 3      | 3      |
| 5.33%        | 6         | 6                 | 6      | 6  | 6     | 6      | 6      |
| 8.00%        | 9         | 9                 | 9      | 9  | 9     | 9      | 9      |
| KR41CFS90000 |           | 2022-09 카카오개별선물   |        |    |       |        | 7      |
|              | 기초자산의 변동성 |                   |        |    |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%           | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -7        | -7                | -7     | -7 | -7    | -7     | -7     |
| -5.33%       | -4        | -4                | -4     | -4 | -4    | -4     | -4     |
| -2.67%       | -2        | -2                | -2     | -2 | -2    | -2     | -2     |
| 0%           | 0         | 0                 | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 2         | 2                 | 2      | 2  | 2     | 2      | 2      |
| 5.33%        | 4         | 4                 | 4      | 4  | 4     | 4      | 4      |
| 8.00%        | 7         | 7                 | 7      | 7  | 7     | 7      | 7      |

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

29

공시일 2022-09-05

기준일 2022-09-02

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

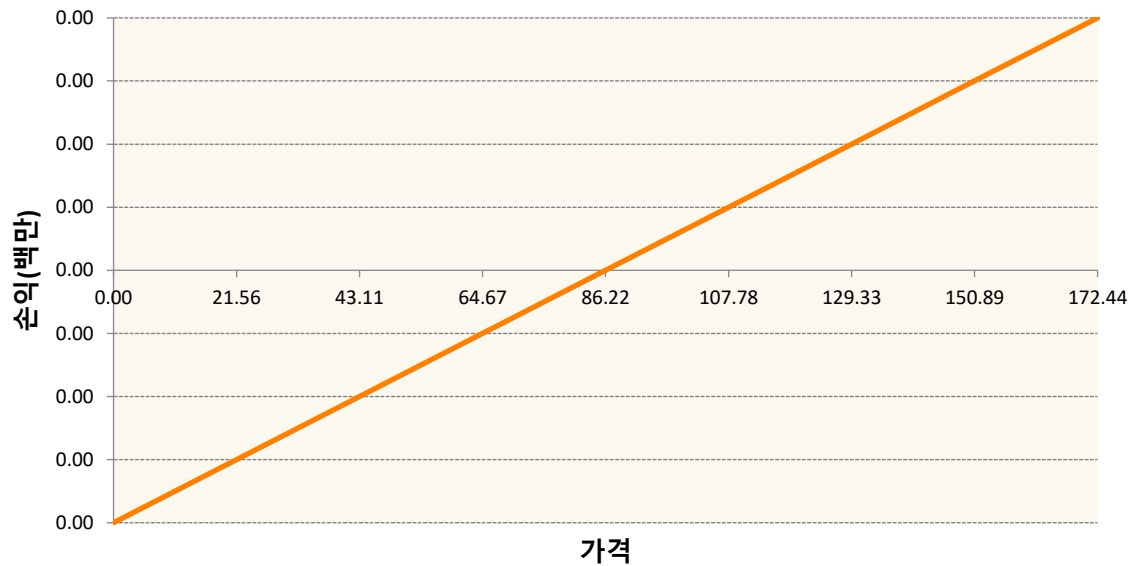
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

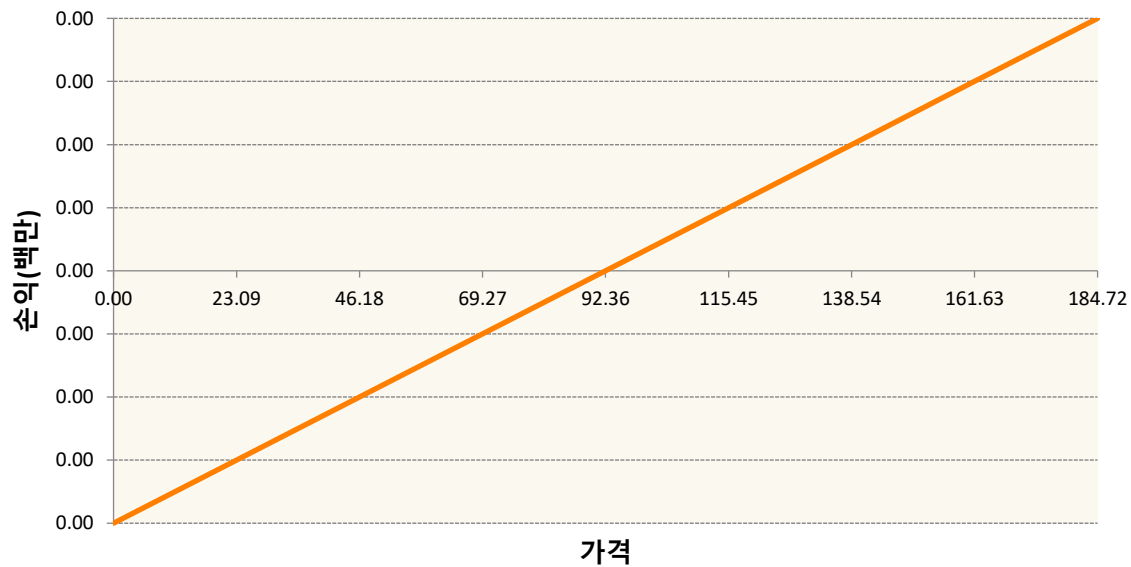
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,012 | 436   | 1,575     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

CLX2-WTI CRUDE FUTURE Nov22



COX2-BRENT CRUDE FUTR Nov22



The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Revenue (수익) in millions. The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 172.44 with major ticks every 21.56 units. The y-axis represents Revenue, ranging from 0.00 to 10.00 with major ticks every 2.00 units. A solid orange line starts at the origin (0,0) and extends to the point (172.44, 10.00).

| 가격     | 수익(백만) |
|--------|--------|
| 0.00   | 0.00   |
| 21.56  | 1.00   |
| 43.11  | 2.00   |
| 64.67  | 3.00   |
| 86.22  | 4.00   |
| 107.78 | 5.00   |
| 129.33 | 6.00   |
| 150.89 | 7.00   |
| 172.44 | 8.00   |

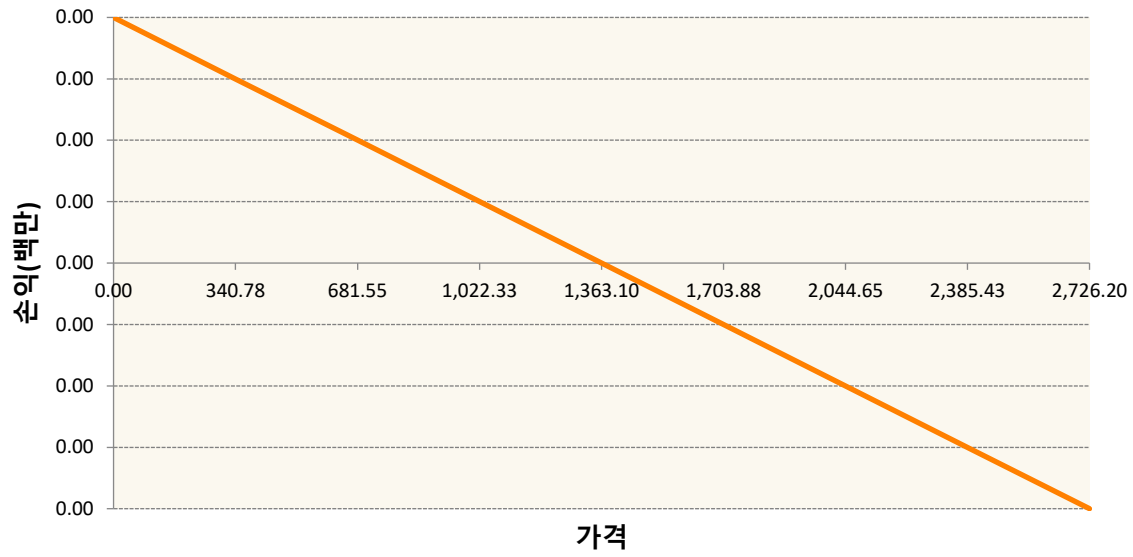
The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 18.66. The y-axis, labeled '순이익(백만원)' (Net Income in 100 million won), ranges from 0.00 to 18.66. A solid orange line represents the function, starting at the origin (0,0) and extending to the point (18.66, 18.66). The line has a constant positive slope of 1, indicating that net income increases proportionally with price.

| 가격 (Price) | 순이익 (Net Income in 100 million won) |
|------------|-------------------------------------|
| 0.00       | 0.00                                |
| 2.33       | 2.33                                |
| 4.67       | 4.67                                |
| 7.00       | 7.00                                |
| 9.33       | 9.33                                |
| 11.66      | 11.66                               |
| 14.00      | 14.00                               |
| 16.33      | 16.33                               |
| 18.66      | 18.66                               |

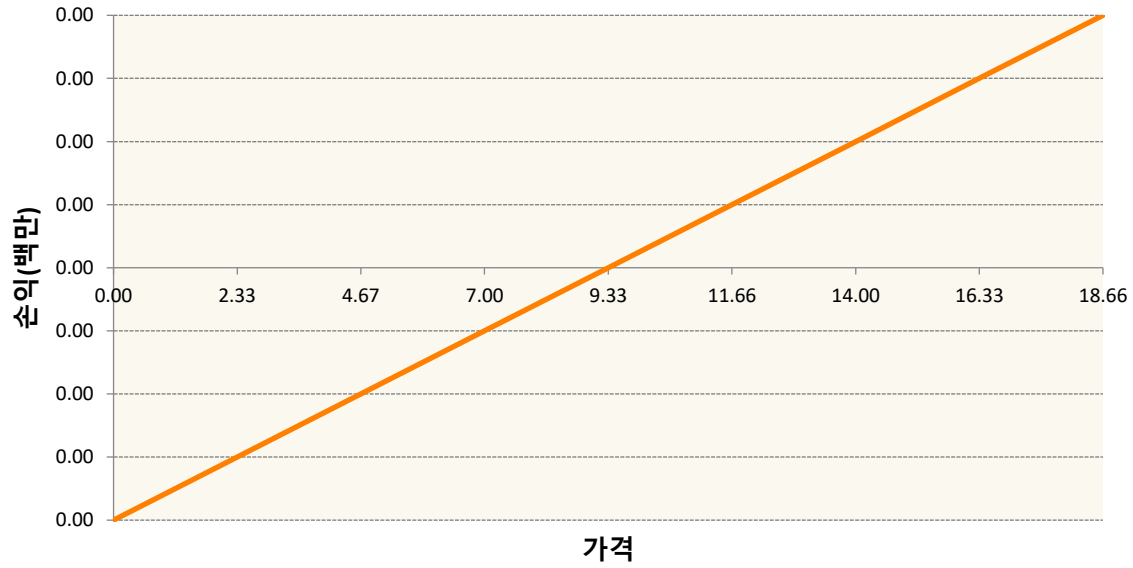
The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 7.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A solid blue line represents the relationship, starting at (0.00, 0.00) and ending at (7.00, 0.00).

| 가격   | 순이익(백만) |
|------|---------|
| 0.00 | 0.00    |
| 0.88 | 0.00    |
| 1.75 | 0.00    |
| 2.63 | 0.00    |
| 3.50 | 0.00    |
| 4.38 | 0.00    |
| 5.25 | 0.00    |
| 6.13 | 0.00    |
| 7.00 | 0.00    |

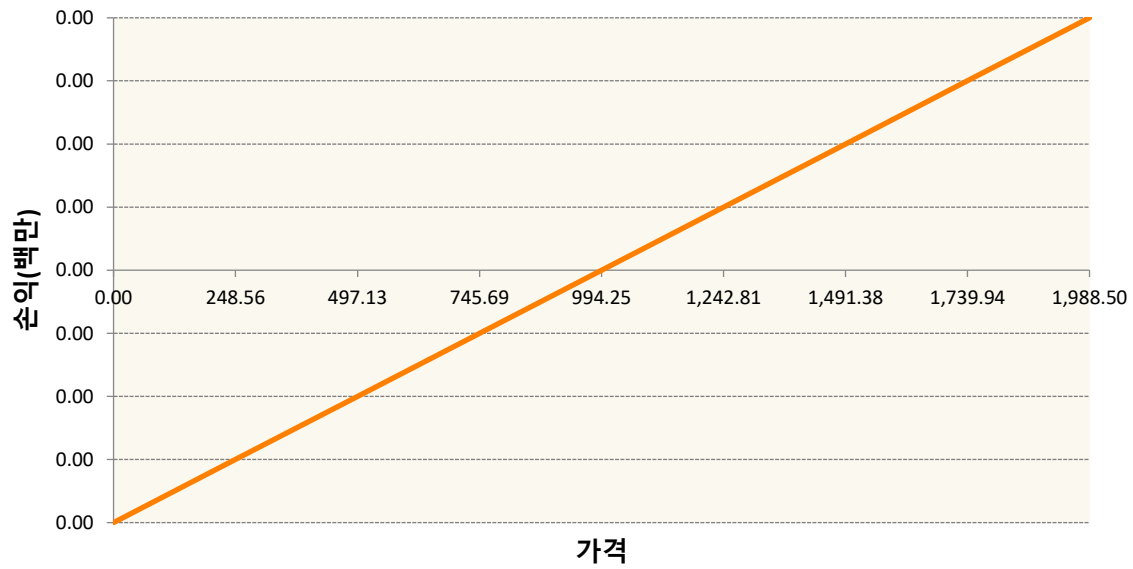
KR4175S90009-2022-09 달러선물

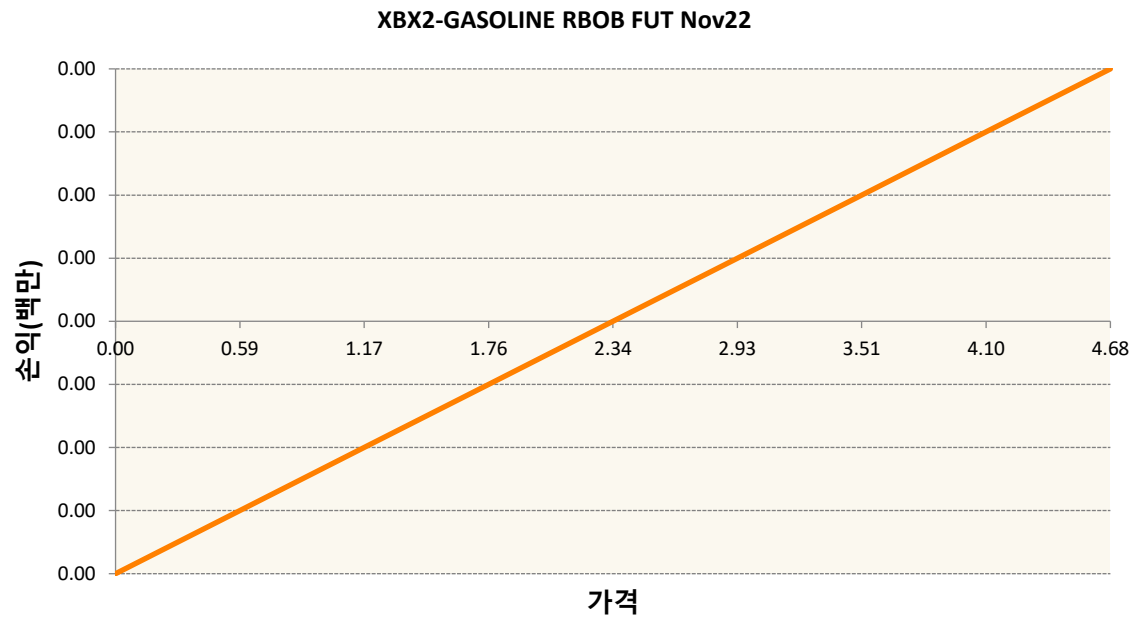


NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QSX2-Low Su Gasoil G Nov22





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| CLX2                      | WTI CRUDE FUTURE Nov22   | 18       |
| COX2                      | BRENT CRUDE FUTR Nov22   | 29       |
| ECX2                      | E-MINI CRUDE OIL Nov22   | 5        |
| EOX2                      | E-MINI NATURAL GAS Nov22 | 5        |
| HOX2                      | NY Harb ULSD Fut Nov22   | 15       |
| KR4175S900 2022-09 달러선물   |                          | 35       |
| NGX22                     | NATURAL GAS FUTR Nov22   | 68       |
| QSX2                      | Low Su Gasoil G Nov22    | 10       |
| XBX2                      | GASOLINE RBOB FUT Nov22  | 10       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 529      |