

공시일 2022-09-28

기준일 2022-09-27

## 포커스농산물모(채권-파생형)

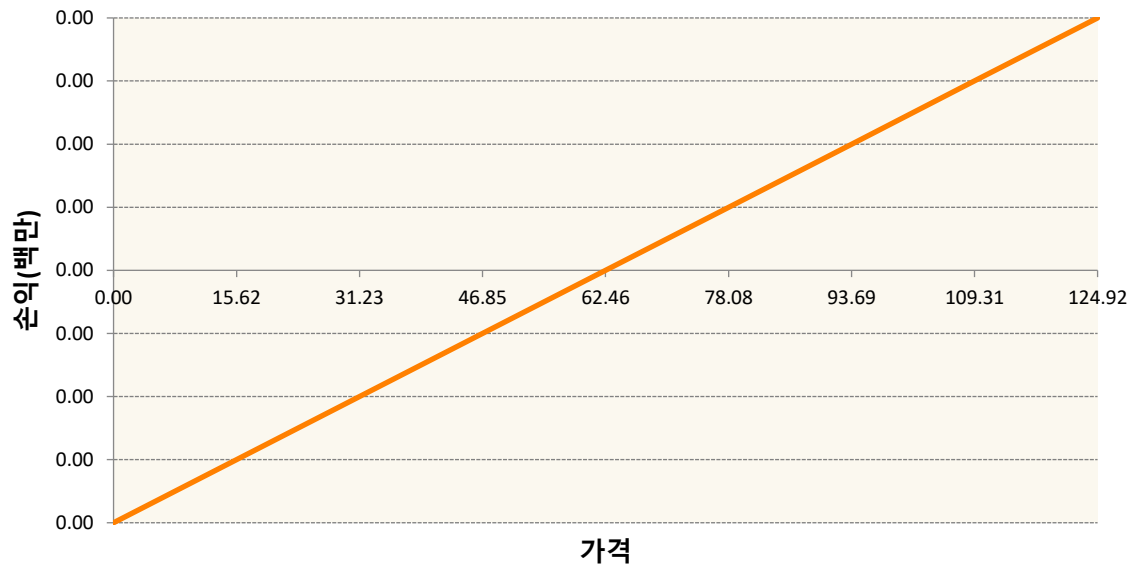
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

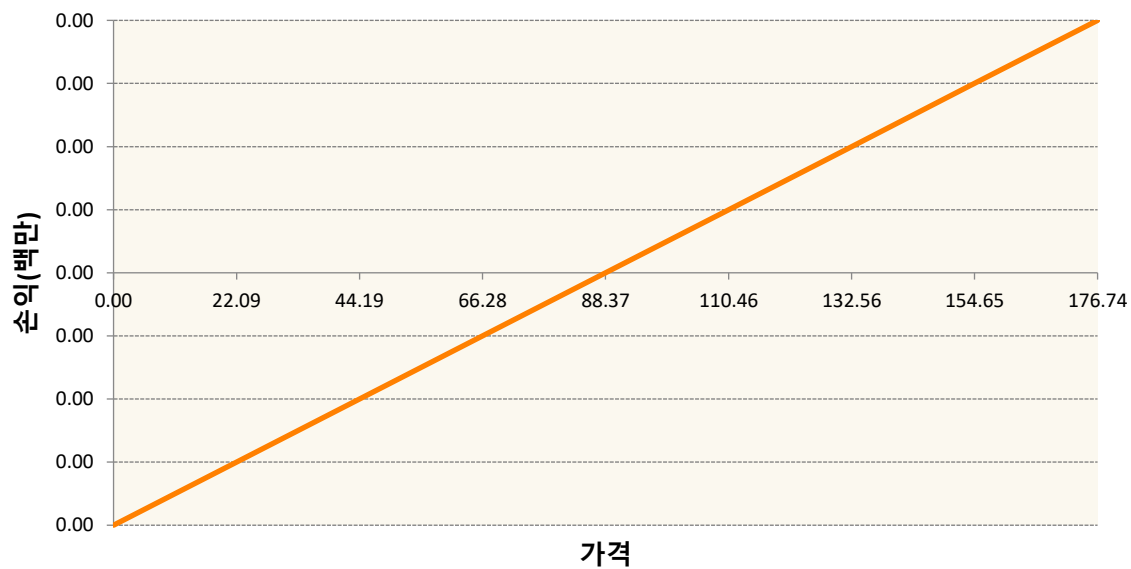
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,448 | 854   | 5,594     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

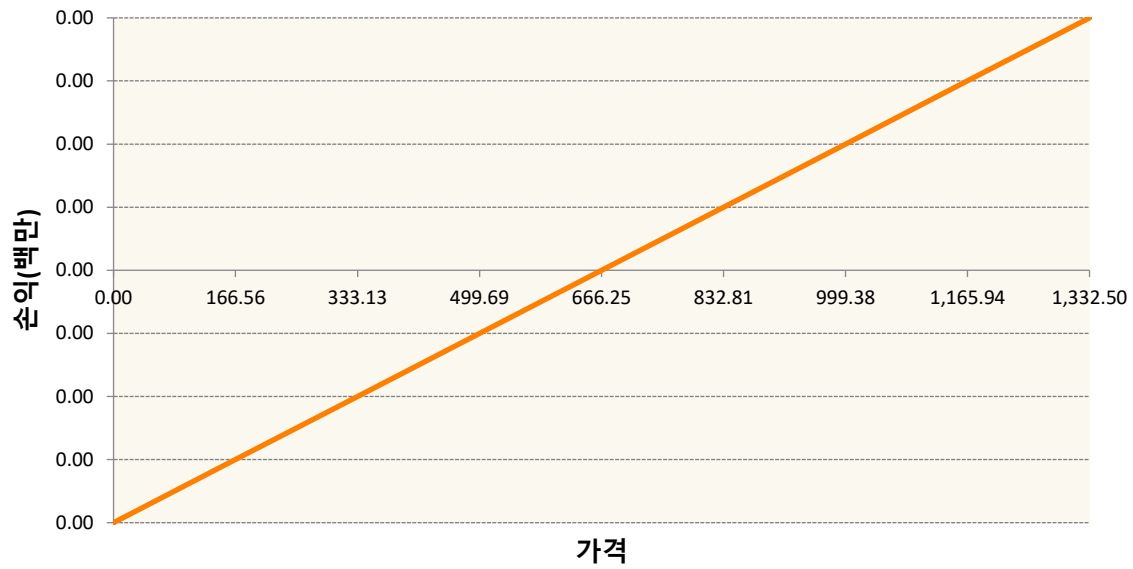
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



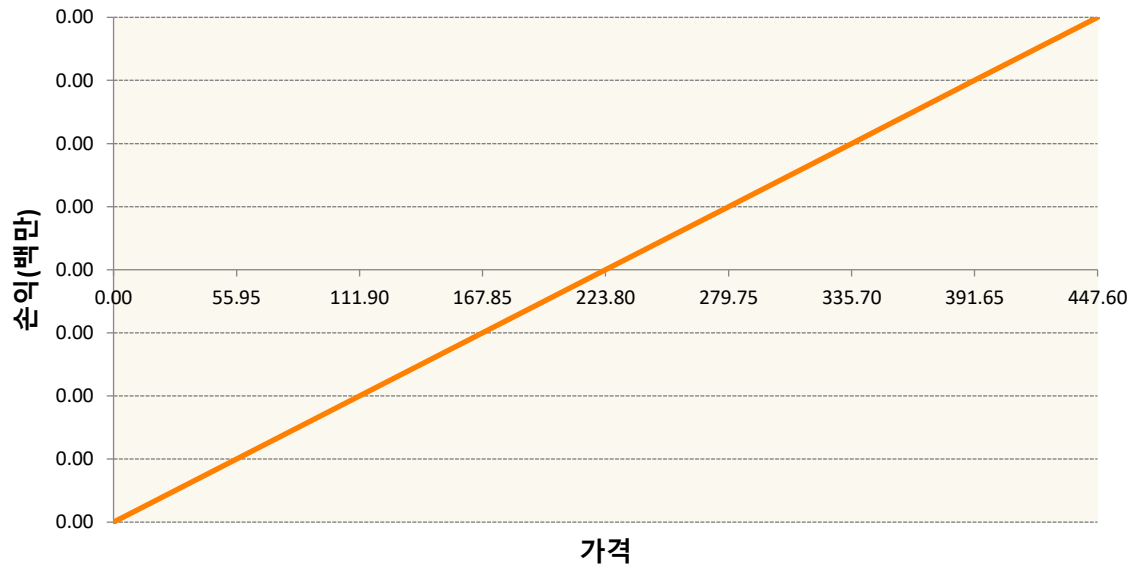
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



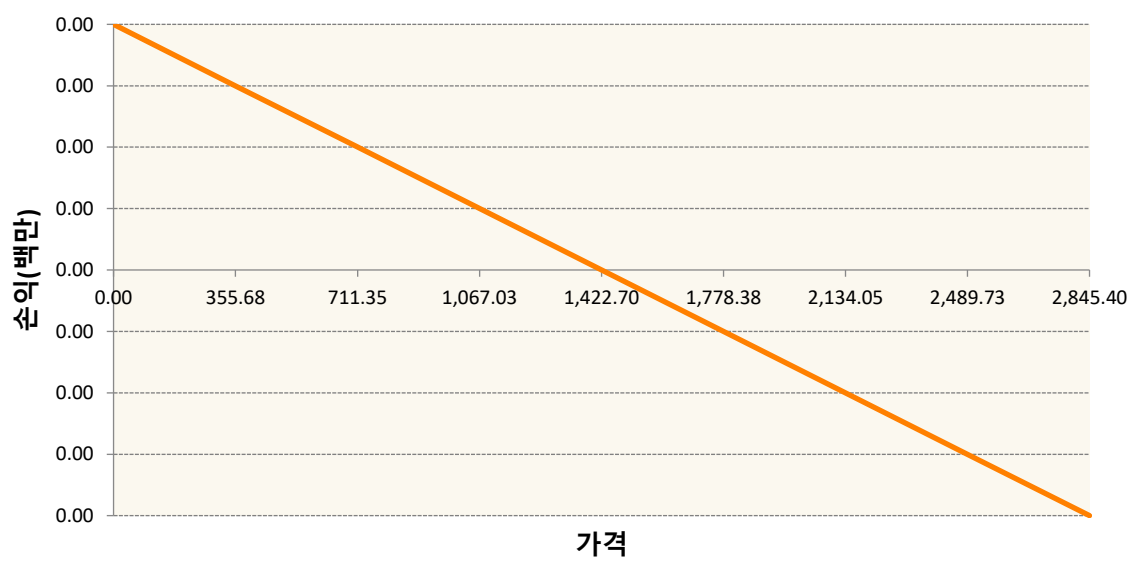
CZ2-CORN FUTURE Dec22



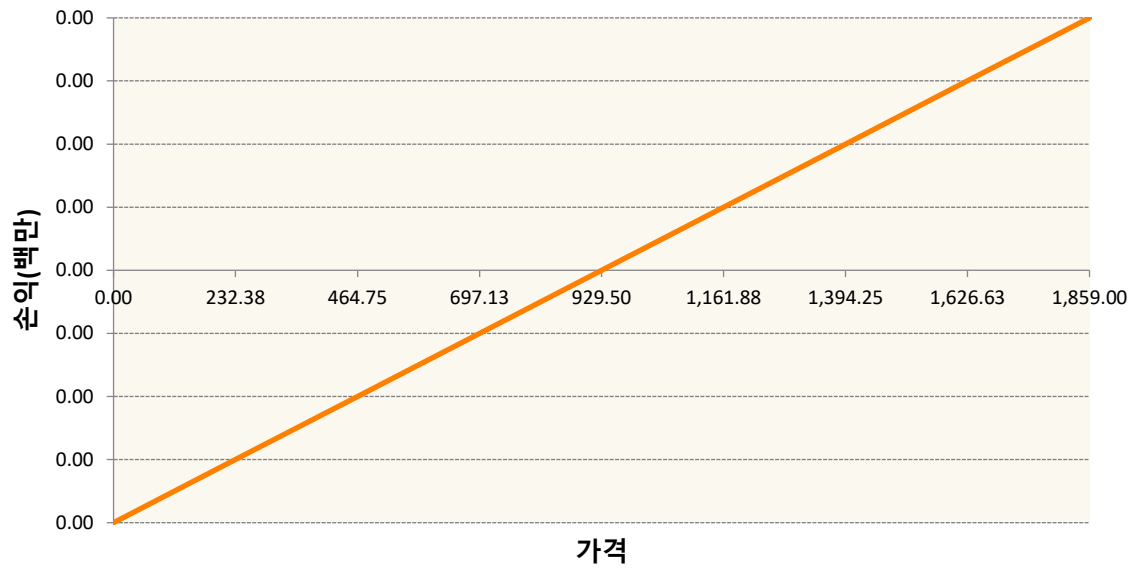
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



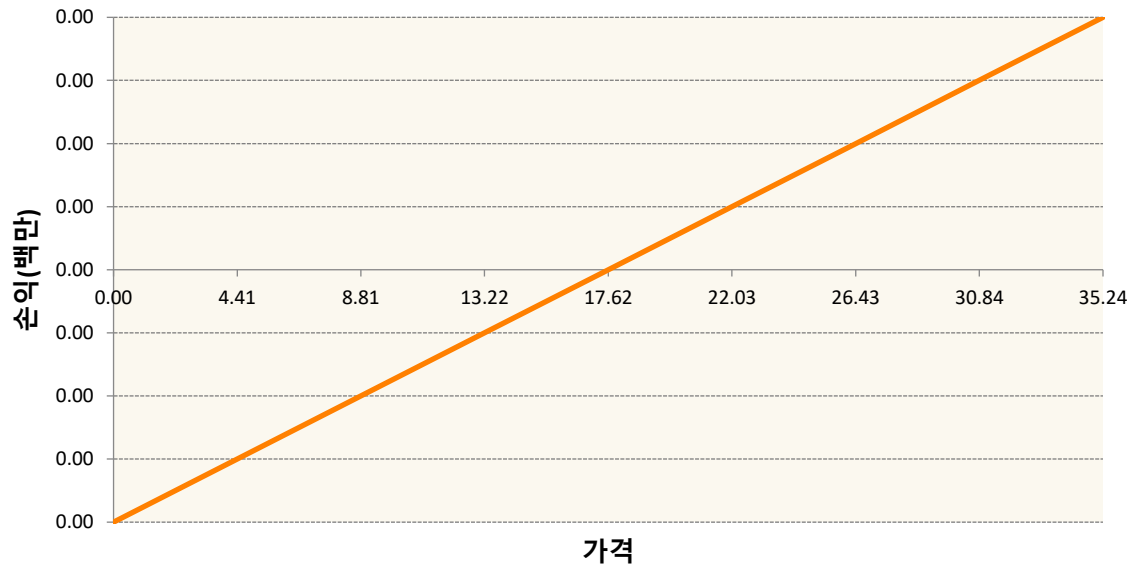
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



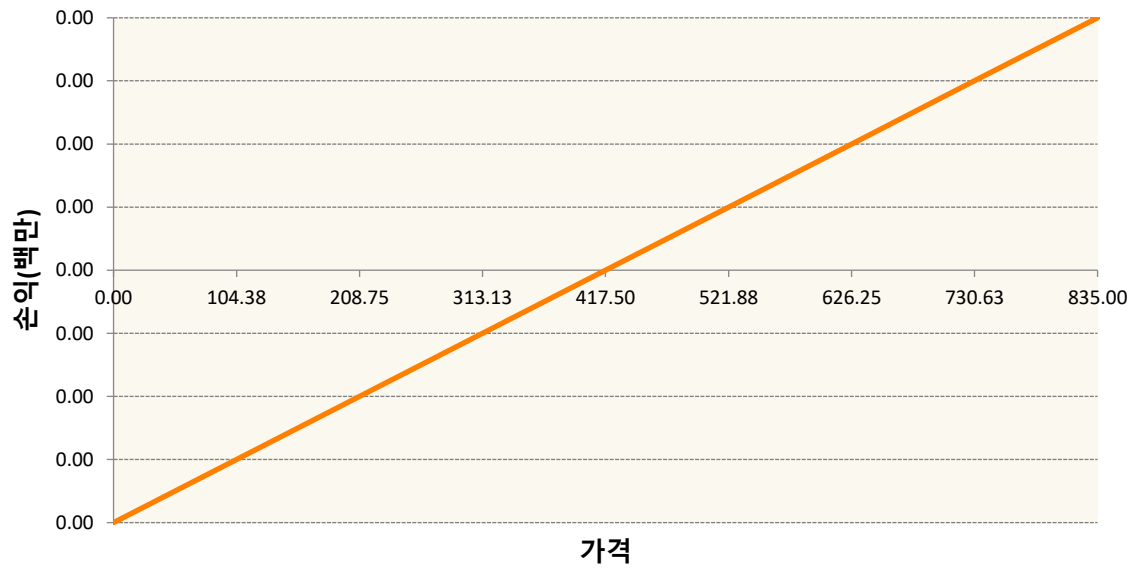
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22



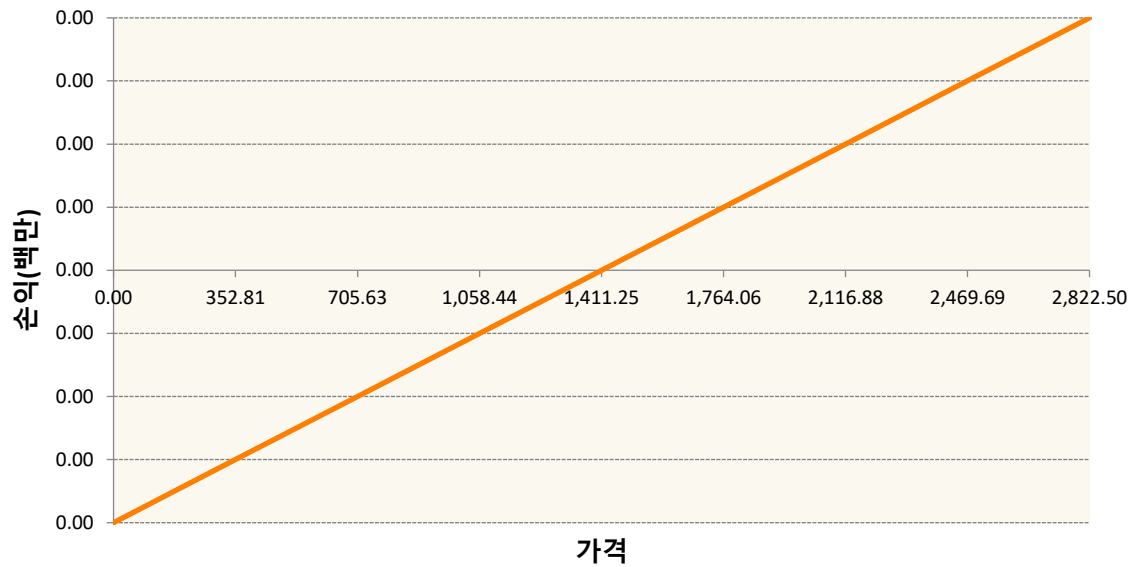
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



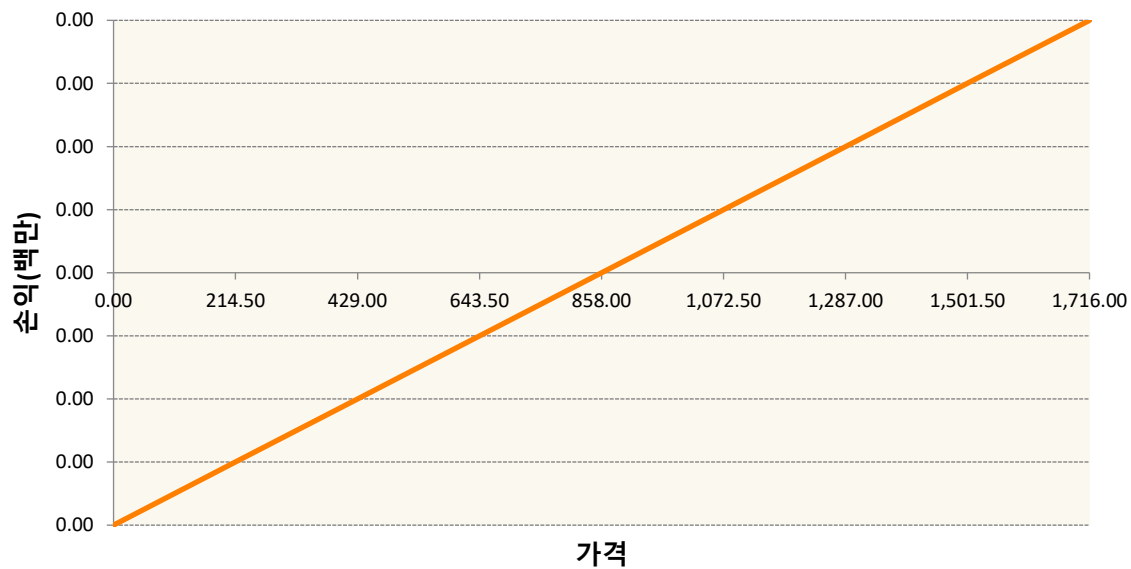
SMZ2-SOYBEAN MEAL FUTR Dec22



SX2-SOYBEAN FUTURE Nov22



WZ2-WHEAT FUTURE(CBT) 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 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

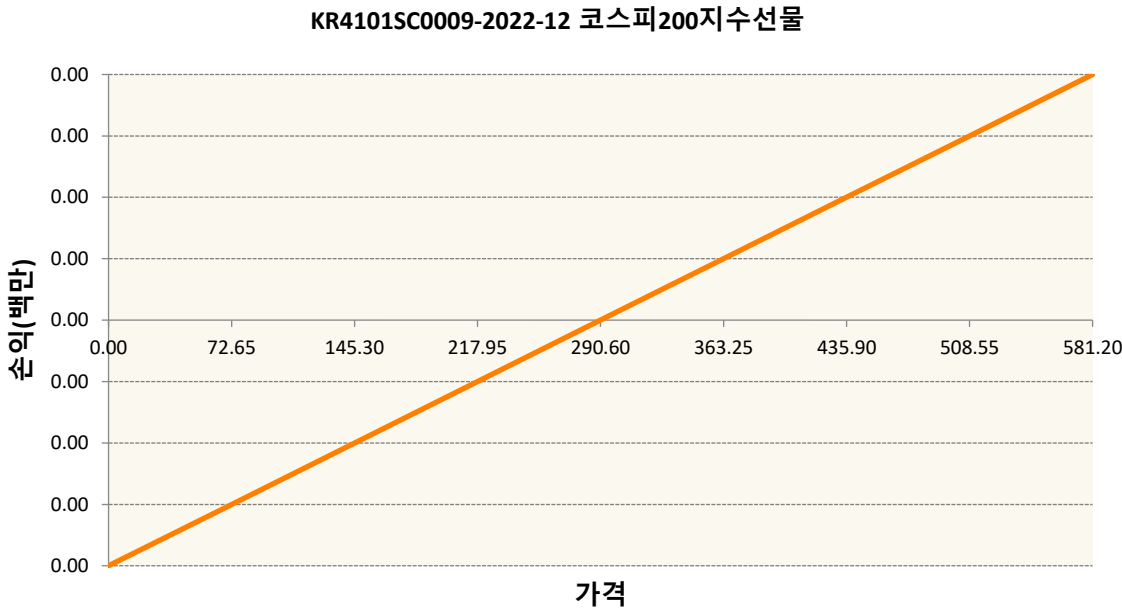
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 145   | 0     | 145       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 872   | 0     | 872       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101SC0009 |           |         | 2022-12 코스피200지수선물 |     |       |        | 70     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -70       | -70     | -70                | -70 | -70   | -70    | -70    |
| -5.33%       | -46       | -46     | -46                | -46 | -46   | -46    | -46    |
| -2.67%       | -23       | -23     | -23                | -23 | -23   | -23    | -23    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 23        | 23      | 23                 | 23  | 23    | 23     | 23     |
| 5.33%        | 46        | 46      | 46                 | 46  | 46    | 46     | 46     |
| 8.00%        | 70        | 70      | 70                 | 70  | 70    | 70     | 70     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

## 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   | 4,450 | 0     | 4,450     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래220311

321

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

425

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

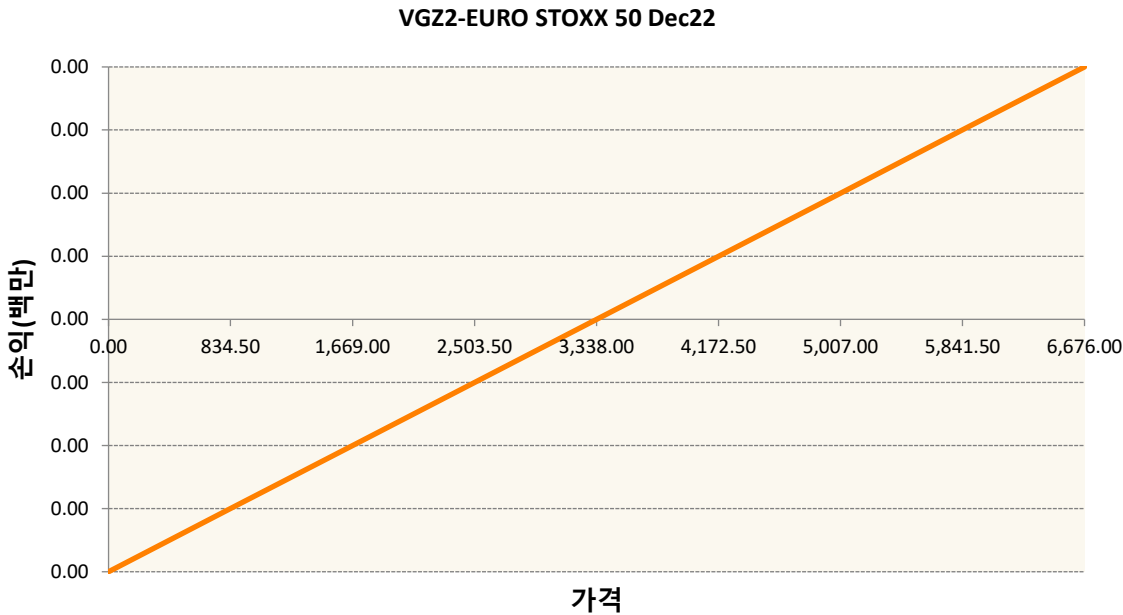
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 464   | 0     | 464       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGZ2 | EURO STOXX 50 Dec22 | 37 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 38 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

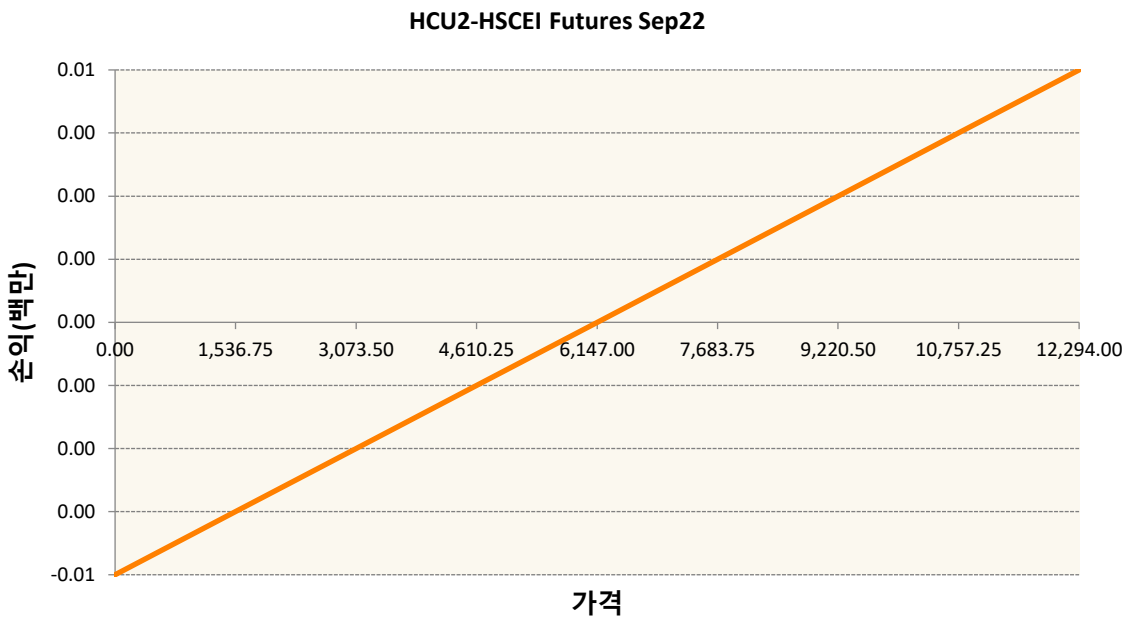
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 943   | 0     | 943       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCU2 | HSCEI Futures Sep22 | 75 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

111

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

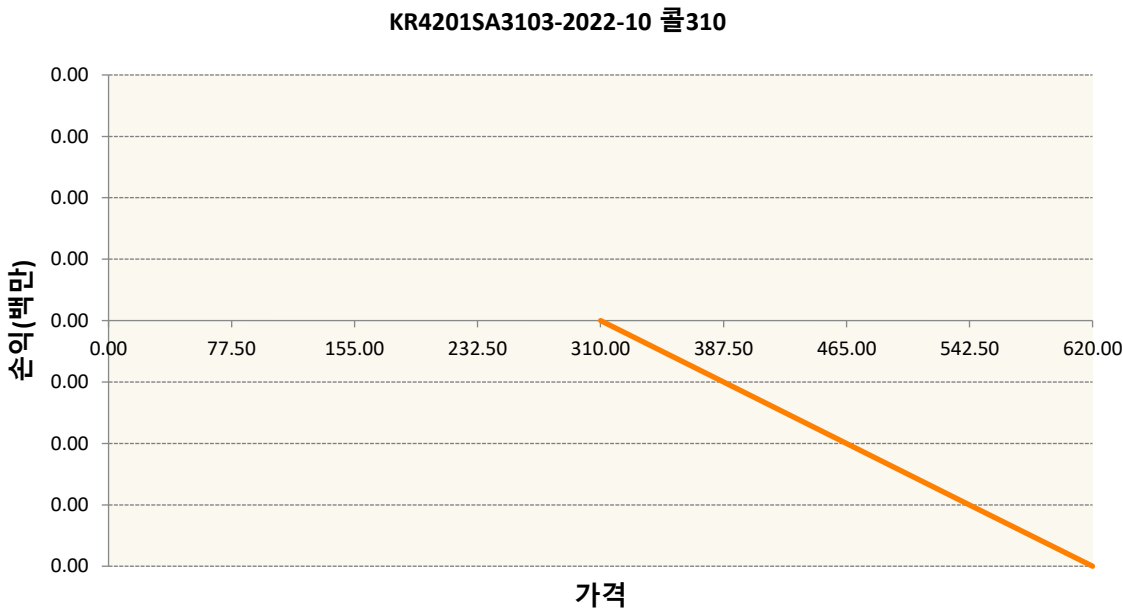
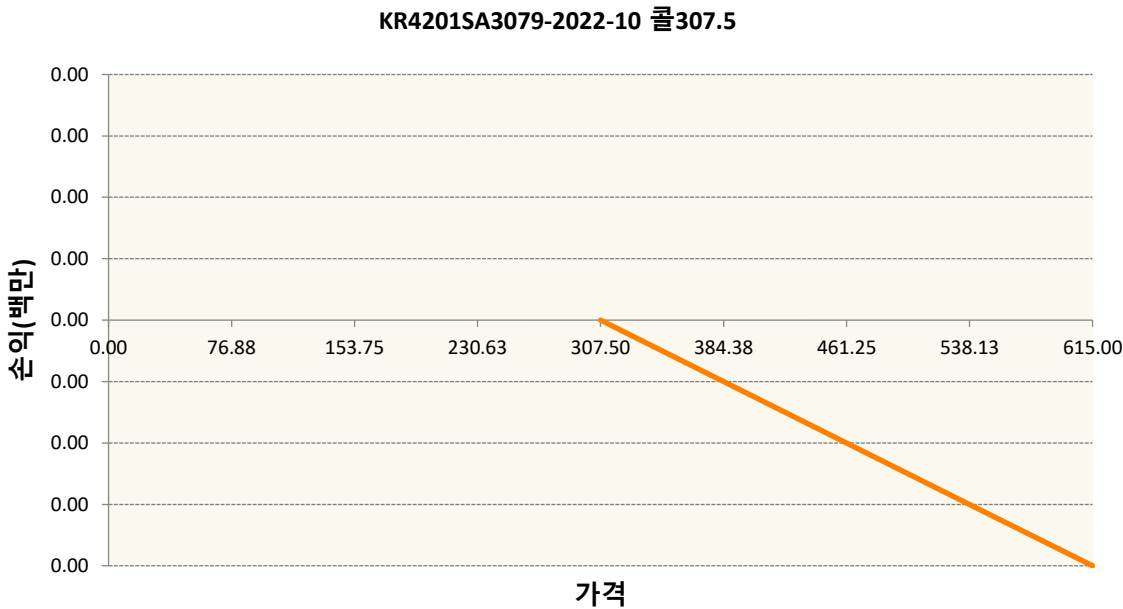
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

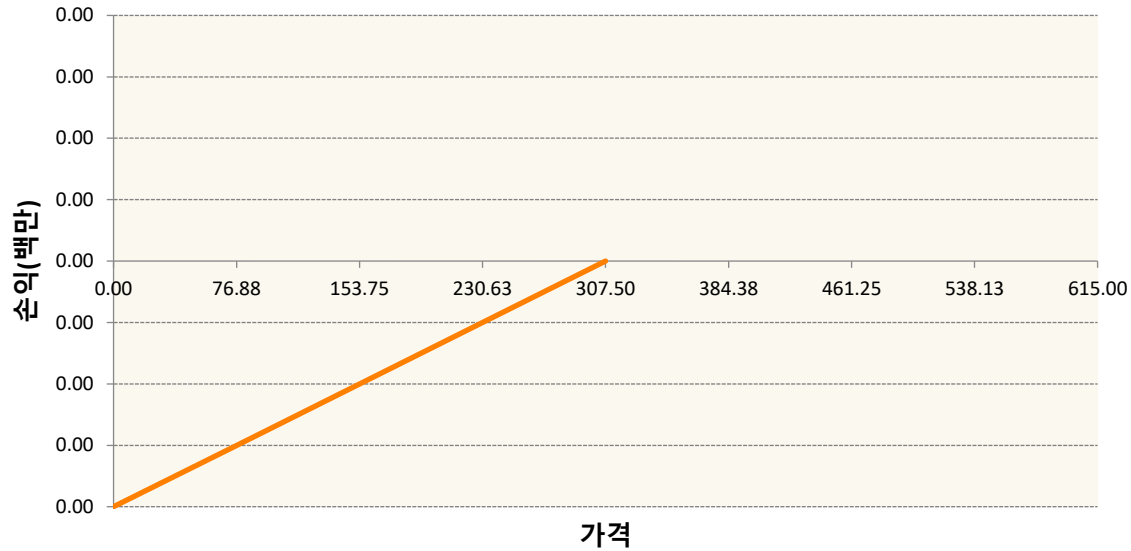
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 57,181 | -57,181   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301SA3078-2022-10 풋307.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |                |        |        |        |        |        |
|--------------|-----------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| KR4201SA3079 |           | 2022-10 콜307.5 |        |        |        |        | 389    |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 74        | 73             | 72     | 70     | 67     | 63     | 59     |
| -5.33%       | 72        | 70             | 66     | 61     | 55     | 48     | 39     |
| -2.67%       | 65        | 58             | 50     | 41     | 30     | 18     | 5      |
| 0%           | 42        | 29             | 15     | 0      | -16    | -33    | -51    |
| 2.67%        | -11       | -30            | -50    | -70    | -91    | -112   | -133   |
| 5.33%        | -108      | -131           | -154   | -177   | -200   | -223   | -246   |
| 8.00%        | -255      | -277           | -299   | -322   | -344   | -367   | -389   |
| KR4201SA3103 |           | 2022-10 콜310   |        |        |        |        | 1,243  |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 208       | 206            | 203    | 198    | 190    | 179    | 165    |
| -5.33%       | 203       | 197            | 188    | 174    | 157    | 135    | 109    |
| -2.67%       | 185       | 168            | 145    | 117    | 85     | 48     | 7      |
| 0%           | 127       | 90             | 47     | 0      | -51    | -105   | -162   |
| 2.67%        | -18       | -79            | -143   | -210   | -278   | -348   | -419   |
| 5.33%        | -303      | -381           | -460   | -539   | -618   | -698   | -777   |
| 8.00%        | -760      | -840           | -920   | -1,001 | -1,081 | -1,162 | -1,243 |
| KR4301SA3078 |           | 2022-10 풋307.5 |        |        |        |        | 724    |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -709      | -709           | -711   | -713   | -716   | -719   | -724   |
| -5.33%       | -450      | -452           | -456   | -461   | -467   | -474   | -482   |
| -2.67%       | -196      | -203           | -211   | -220   | -231   | -243   | -256   |
| 0%           | 42        | 29             | 15     | 0      | -16    | -33    | -51    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 250 | 231 | 211 | 191 | 170 | 149 | 128 |
| 5.33% | 414 | 391 | 368 | 345 | 322 | 299 | 276 |
| 8.00% | 527 | 506 | 484 | 461 | 439 | 416 | 393 |

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

(단위:백만원)

1,958

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

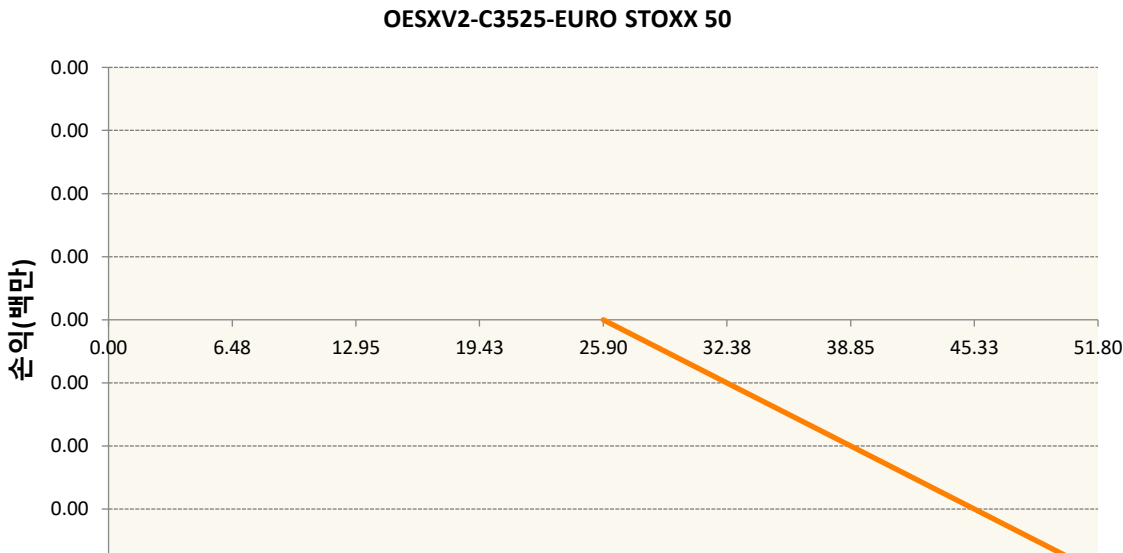
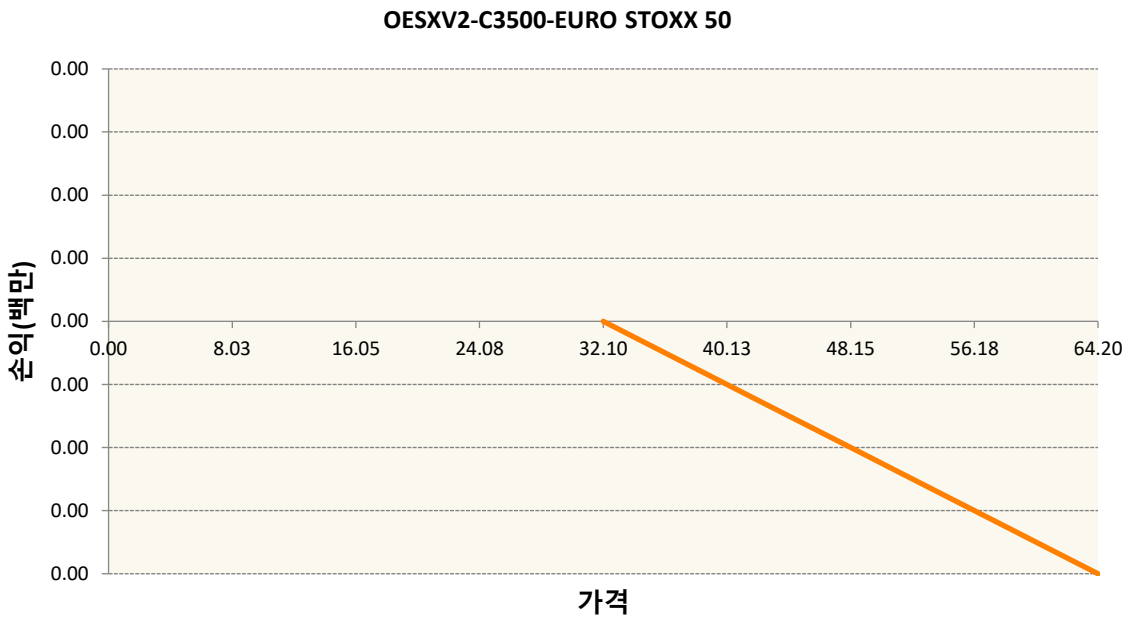
## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

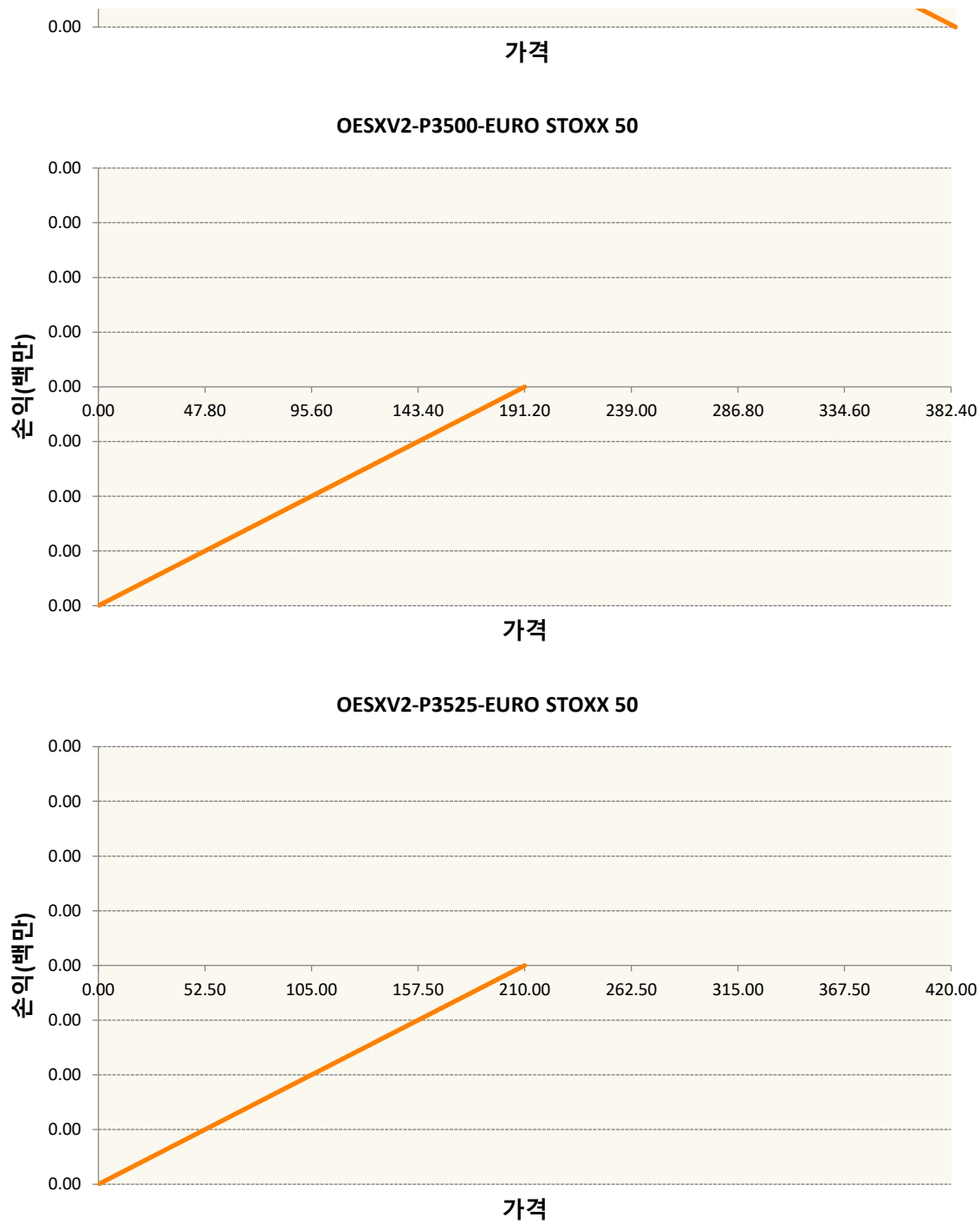
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 4     | 0     | 4         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 43    | -43       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 891   | -891      | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                          |
|------------------------------------------|
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY |
| FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E              |
| OESXV2-C35 EURO STOXX 50                 |
| OESXV2-C35 EURO STOXX 50                 |
| OESXV2-P35 EURO STOXX 50                 |
| OESXV2-P35 EURO STOXX 50                 |

|      |
|------|
| 10   |
| 71   |
| 0.42 |
| 0.03 |
| 3    |
| 0.46 |

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

(단위:백만원)



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

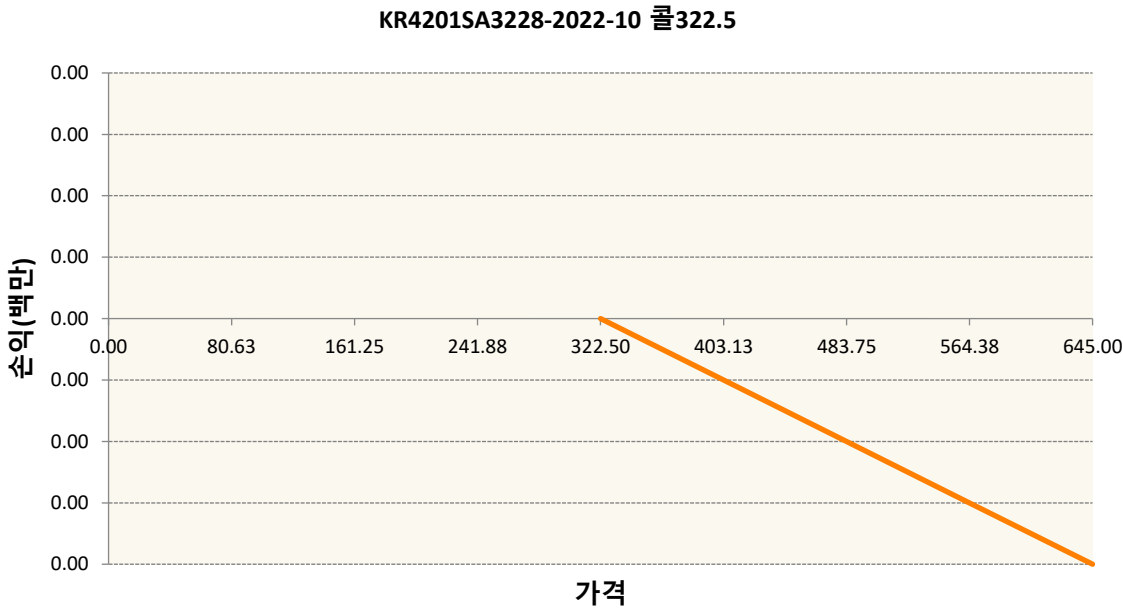
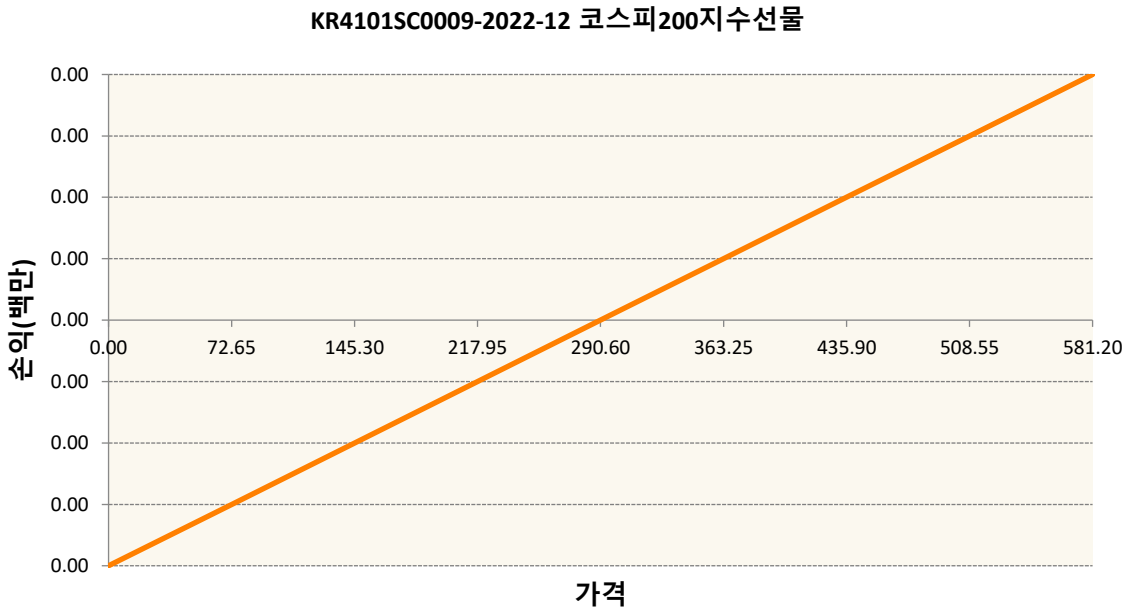
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

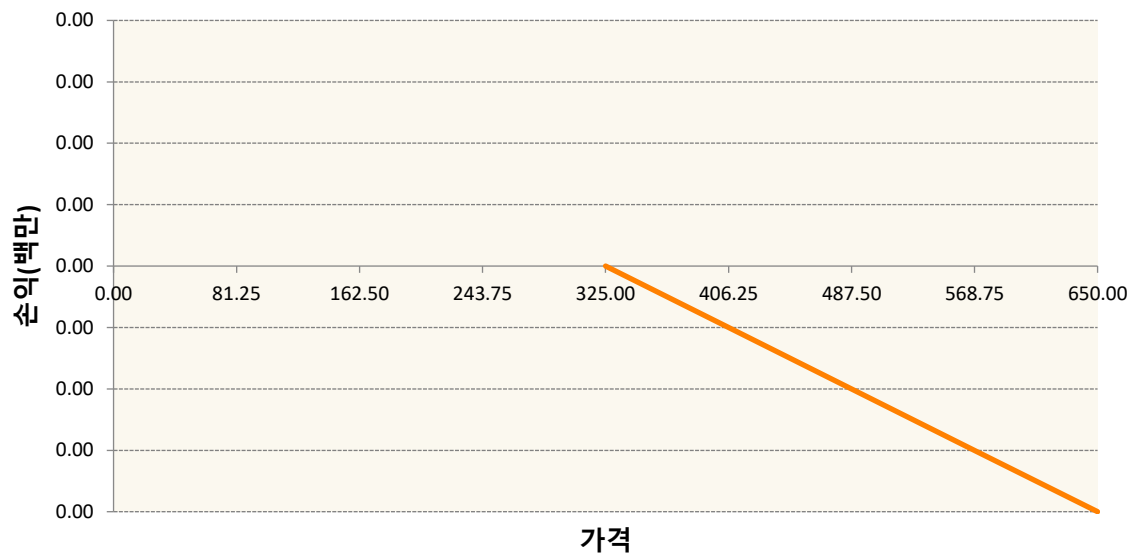
(단위:백만원)

| 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   | 363   | 0     | 363       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 386   | 4,219 | -3,834    | 장내 |

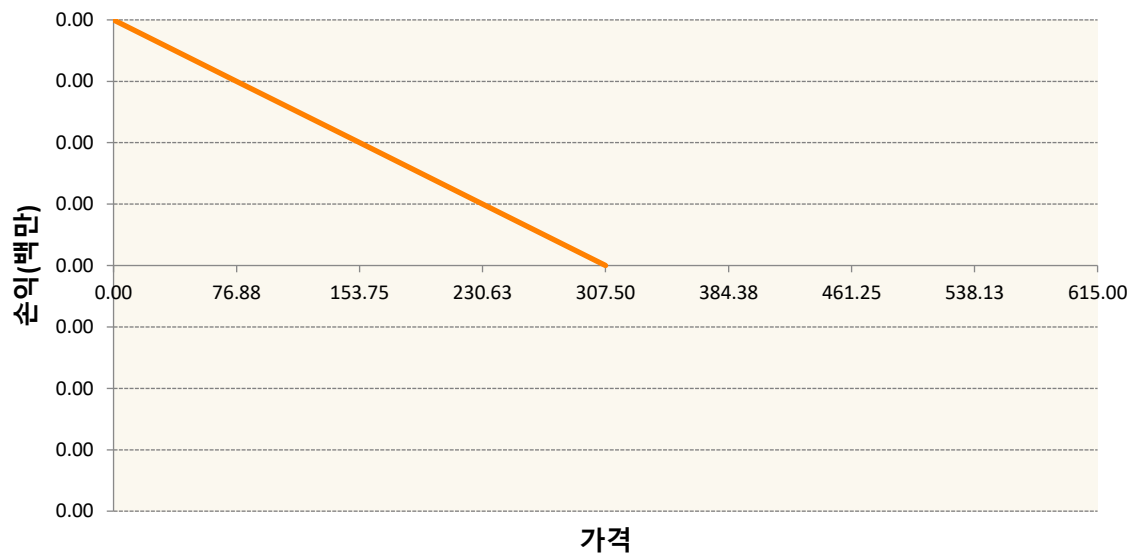
2. 만기시점의 손익구조



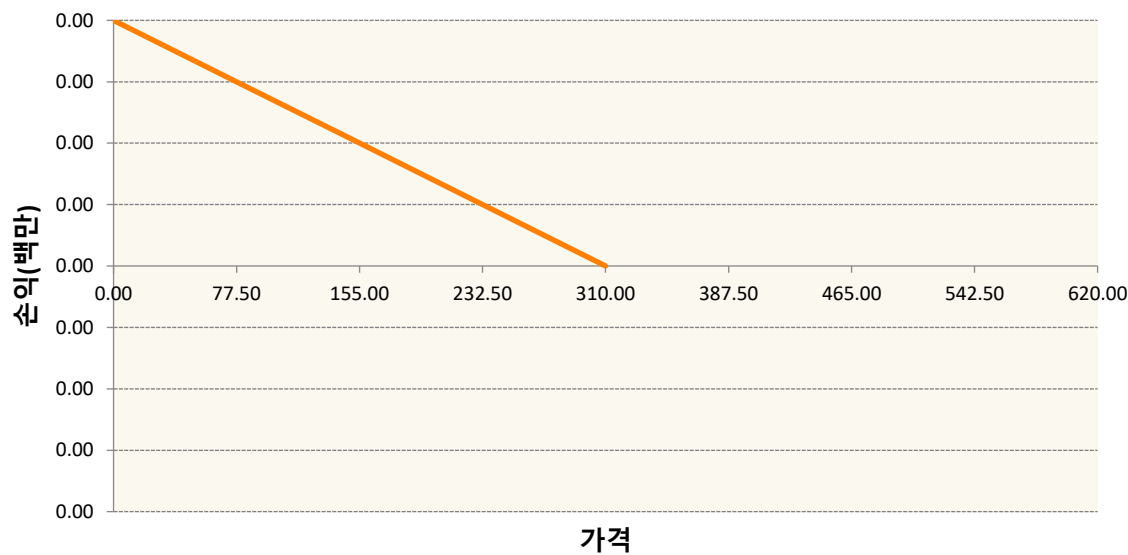
KR4201SA3251-2022-10 콜325



KR4301SA3078-2022-10 풋307.5



KR4301SA3102-2022-10 풋310



(단위:백만원)

|              |           |         |        |     |       |        |                    |  |    |  |
|--------------|-----------|---------|--------|-----|-------|--------|--------------------|--|----|--|
| KR4101SC0009 |           |         |        |     |       |        | 2022-12 코스피200지수선물 |  | 29 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |     |       |        |                    |  |    |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |  |    |  |
| -8.00%       | -29       | -29     | -29    | -29 | -29   | -29    | -29                |  |    |  |
| -5.33%       | -19       | -19     | -19    | -19 | -19   | -19    | -19                |  |    |  |
| -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%        | 19        | 19      | 19     | 19  | 19    | 19     | 19                 |  |    |  |
| 8.00%        | 29        | 29      | 29     | 29  | 29    | 29     | 29                 |  |    |  |
| KR4201SA3228 |           |         |        |     |       |        | 2022-10 콜322.5     |  | 14 |  |
|              | 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%       | 1         | 1       | 1      | 1   | 0     | 0      | 0                  |  |    |  |
| 0%           | 1         | 1       | 0      | 0   | -1    | -1     | -2                 |  |    |  |
| 2.67%        | 0         | 0       | -1     | -2  | -2    | -3     | -4                 |  |    |  |
| 5.33%        | -2        | -2      | -4     | -5  | -6    | -7     | -8                 |  |    |  |
| 8.00%        | -5        | -7      | -8     | -10 | -11   | -13    | -14                |  |    |  |
| KR4201SA3251 |           |         |        |     |       |        | 2022-10 콜325       |  | 60 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |     |       |        |                    |  |    |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |  |    |  |
| -8.00%       | 4         | 4       | 4      | 4   | 4     | 4      | 3                  |  |    |  |
| -5.33%       | 4         | 4       | 4      | 4   | 3     | 3      | 2                  |  |    |  |
| -2.67%       | 4         | 4       | 4      | 3   | 2     | 0      | -1                 |  |    |  |
| 0%           | 4         | 3       | 2      | 0   | -2    | -4     | -7                 |  |    |  |
| 2.67%        | 1         | -1      | -3     | -6  | -10   | -14    | -18                |  |    |  |
| 5.33%        | -5        | -9      | -14    | -18 | -24   | -29    | -35                |  |    |  |
| 8.00%        | -20       | -26     | -33    | -39 | -46   | -53    | -60                |  |    |  |
| KR4301SA3078 |           |         |        |     |       |        | 2022-10 풋307.5     |  | 16 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |     |       |        |                    |  |    |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |  |    |  |
| -8.00%       | 16        | 16      | 16     | 16  | 16    | 16     | 16                 |  |    |  |
| -5.33%       | 10        | 10      | 10     | 10  | 10    | 11     | 11                 |  |    |  |
| -2.67%       | 4         | 5       | 5      | 5   | 5     | 5      | 6                  |  |    |  |
| 0%           | -1        | -1      | 0      | 0   | 0     | 1      | 1                  |  |    |  |
| 2.67%        | -6        | -5      | -5     | -4  | -4    | -3     | -3                 |  |    |  |
| 5.33%        | -9        | -9      | -8     | -8  | -7    | -7     | -6                 |  |    |  |
| 8.00%        | -12       | -11     | -11    | -10 | -10   | -9     | -9                 |  |    |  |
| KR4301SA3102 |           |         |        |     |       |        | 2022-10 풋310       |  | 11 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |     |       |        |                    |  |    |  |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| -8.00% | 11      | 11      | 11     | 11 | 11    | 11     | 11     |
| -5.33% | 7       | 7       | 7      | 7  | 7     | 7      | 7      |
| -2.67% | 3       | 3       | 3      | 3  | 4     | 4      | 4      |
| 0%     | -1      | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 1      |
| 2.67%  | -4      | -4      | -3     | -3 | -3    | -2     | -2     |
| 5.33%  | -6      | -6      | -6     | -5 | -5    | -5     | -4     |
| 8.00%  | -8      | -8      | -8     | -7 | -7    | -7     | -6     |

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

(단위:백만원)

91

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

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 | 7,419 | 0     | 7,419     |    |

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 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

## 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 | 6,203 | 0     | 6,203     |    |

### 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 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

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 | 19,495 | 0      | 19,495    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 20,647 | -20,647   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |                                 | (단위:백만원) |
|-----------------------------|---------------------------------|----------|
| IE00BD8RGM75                | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |          |
| FXW213C7R·KRW/USD 27-10-22E |                                 | 487      |
| FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E |                                 | 636      |
| FXW213C9P·KRW/USD 28-12-22E |                                 | 529      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 691      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

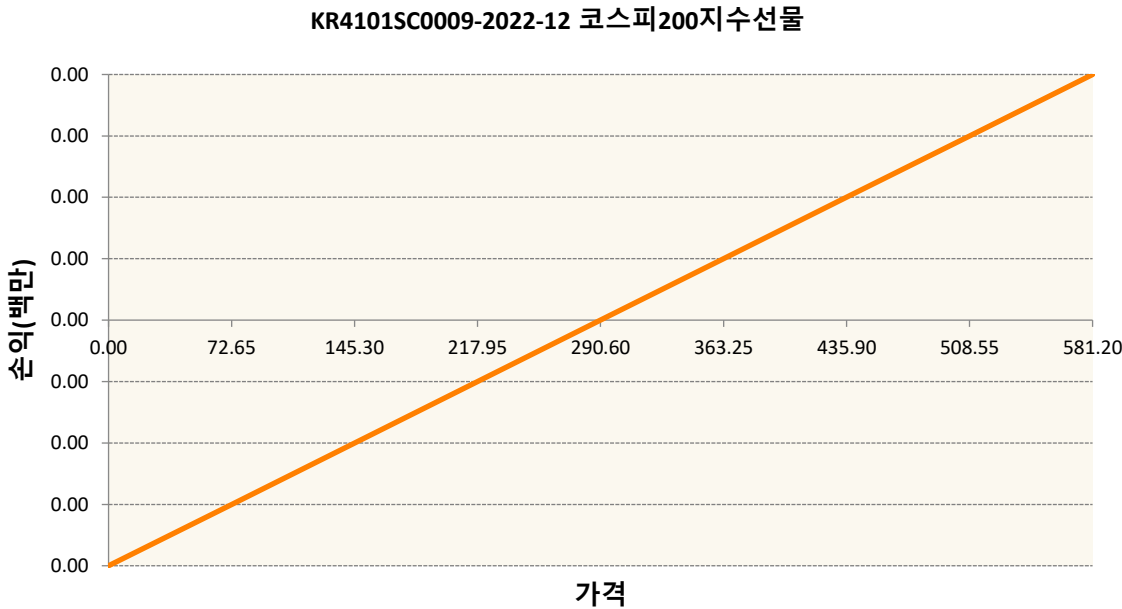
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 363   | 0     | 363       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101SC0009 |           |         | 2022-12 코스피200지수선물 |     |       |        | 29     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -29       | -29     | -29                | -29 | -29   | -29    | -29    |
| -5.33%       | -19       | -19     | -19                | -19 | -19   | -19    | -19    |
| -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%        | 19        | 19      | 19                 | 19  | 19    | 19     | 19     |
| 8.00%        | 29        | 29      | 29                 | 29  | 29    | 29     | 29     |



공시일 2022-09-28

기준일 2022-09-27

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

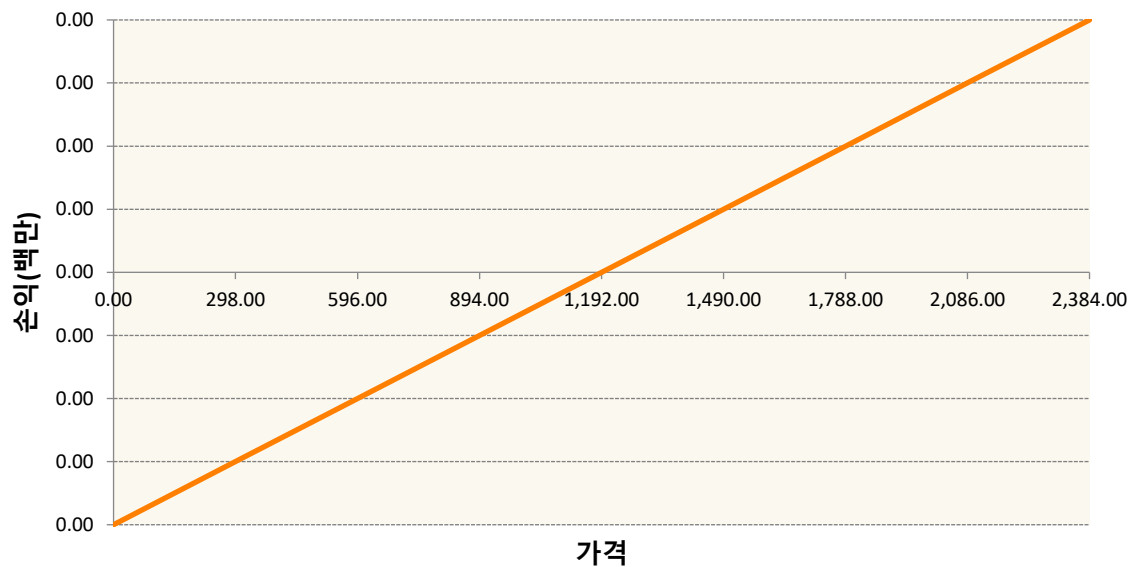
### 1. 계약금액

(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   | 545   | 0     | 545       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,688 | 0     | 1,688     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,097 | -1,097    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

VNCV2-VN30 Index Future OCT22



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| 2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)  | 135 |
| FXW213C7L KRW/EUR 21-10-22E   | 19  |
| FXW213C84 KRW/EUR 21-10-22E   | 5   |
| FXW213C8P KRW/EUR 18-11-22E   | 11  |
| FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E   | 31  |
| FXW213C9M KRW/EUR 23-12-22E   | 22  |
| VNCV2 VN30 Index Future OCT22 | 44  |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

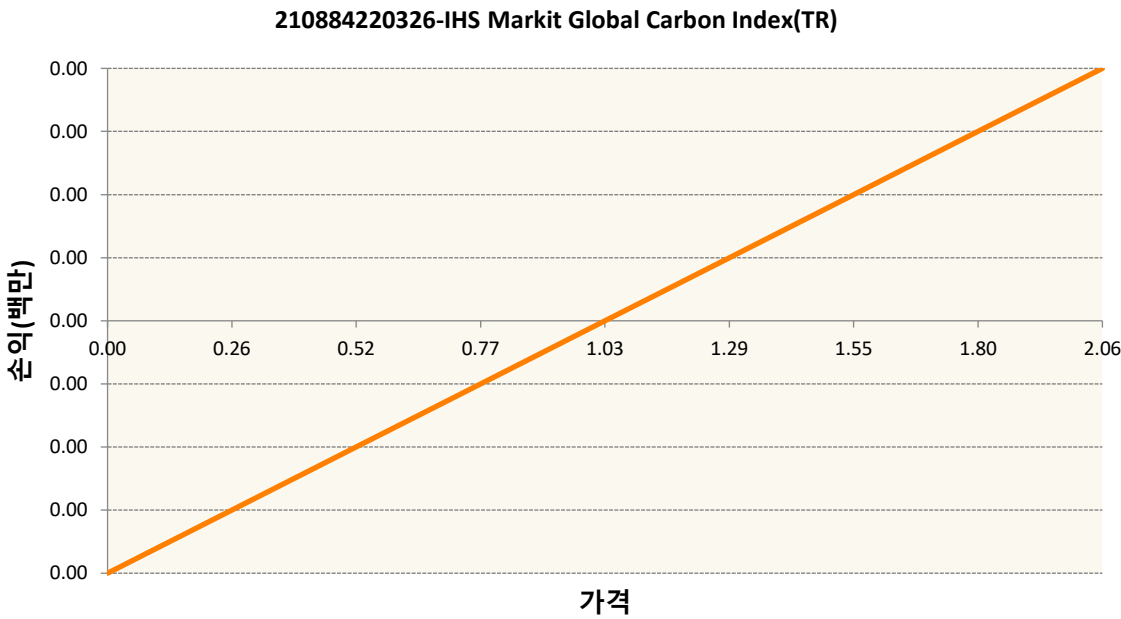
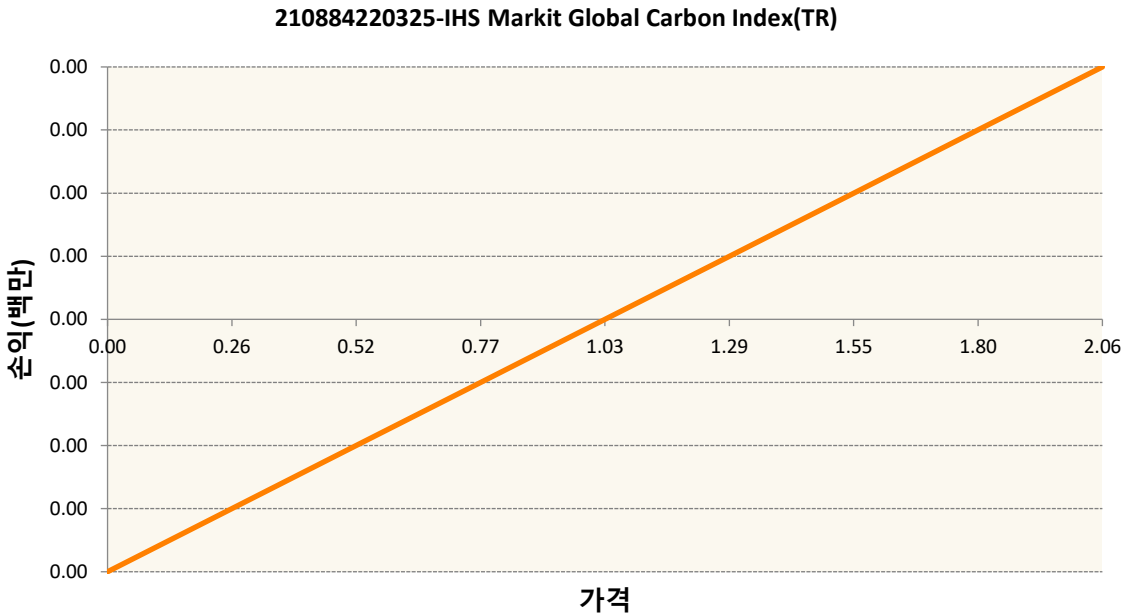
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 1. 계약금액

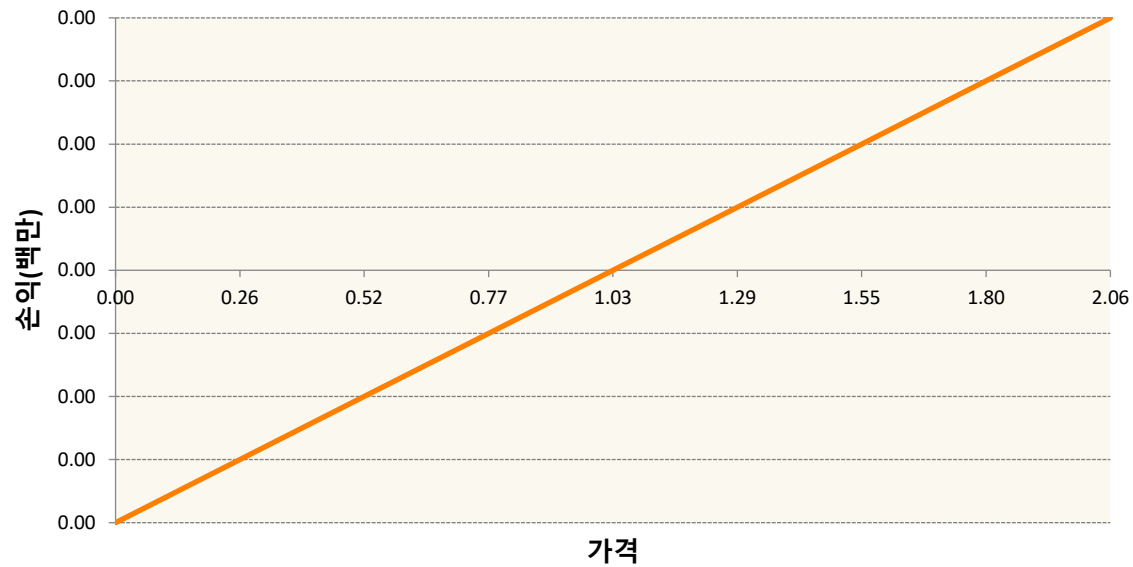
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 34,602 | 34,442 | 161       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 35,640 | 0      | 35,640    |    |

### 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)

178

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

2,573

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

89

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

(단위:백만원)

5,489

공시일 2022-09-28

기준일 2022-09-27

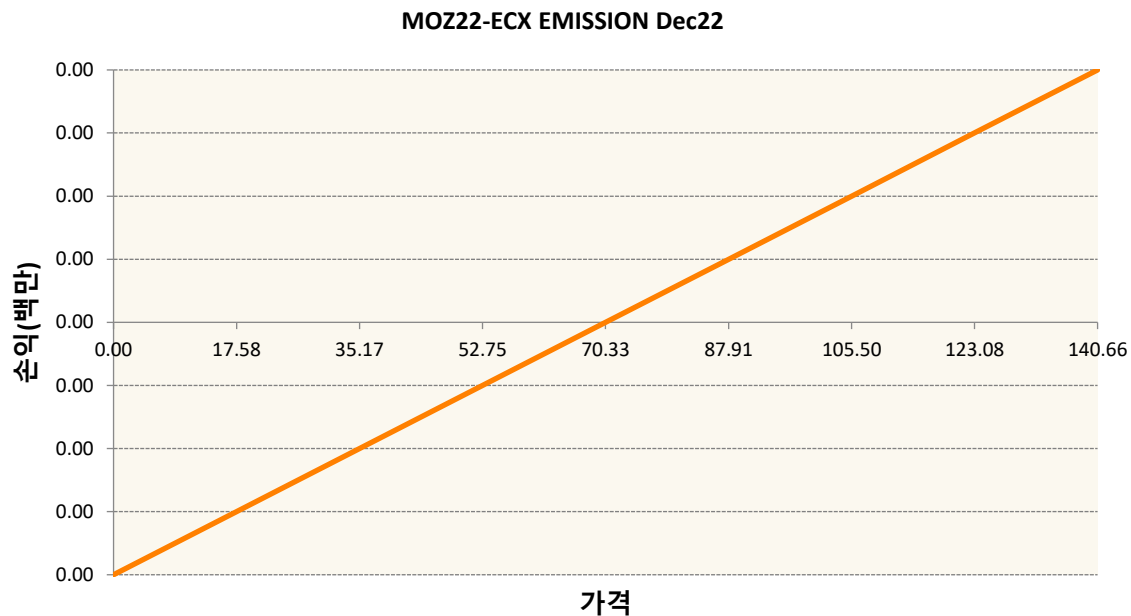
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 11,955 | 0     | 11,955    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 5,369 | -5,369    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9T(KRW/EUR 27-10-22E)

430

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

956

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

(단위:백만원)

2,737

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

# 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   | 11,500 | 0     | 11,500    | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조

## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                     |   |
|-------------------------------------|---|
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)  | 1 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)  | 1 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)  | 1 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠) | 1 |

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

(단위:백만원)

|   |
|---|
| 4 |
|---|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-09-28 |
| 기준일 | 2022-09-27 |

# 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)  | 12 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 14 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 12 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220714(메리츠) | 17 |

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

(단위:백만원)

71

공시일 2022-09-28

기준일 2022-09-27

## 에퀴티알파일반사모혼합자산

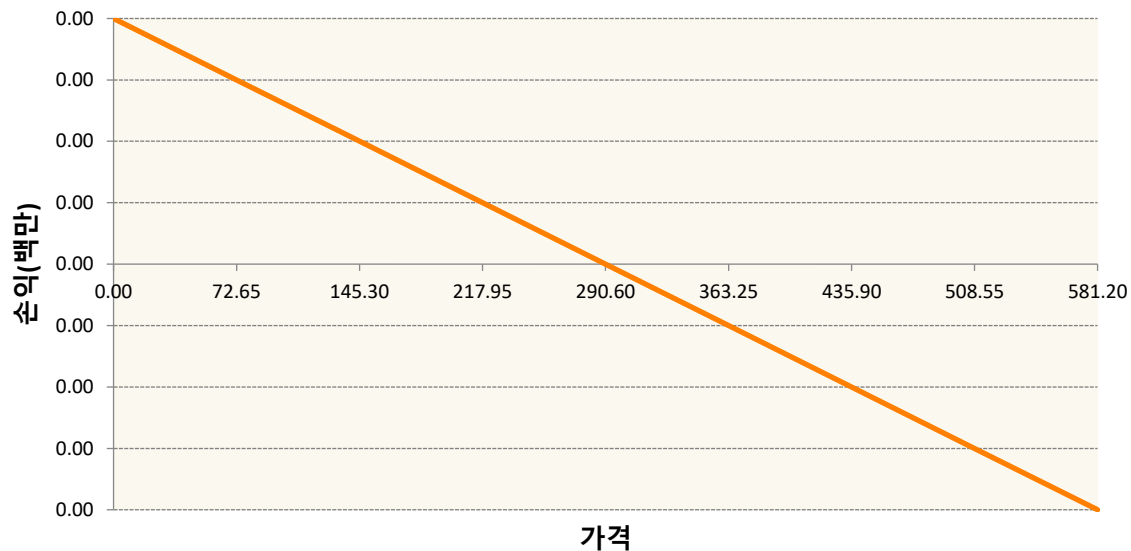
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 2,892 | 1,804 | 1,088     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 363   | -363      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                      |      |
|--------------------------------------|------|
| KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429    | 0.29 |
| KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602 | 1    |
| KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물        | 29   |

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

(단위:백만원)

33

공시일 2022-09-28

기준일 2022-09-27

## 신한SOL한국형글로벌반도체엑티

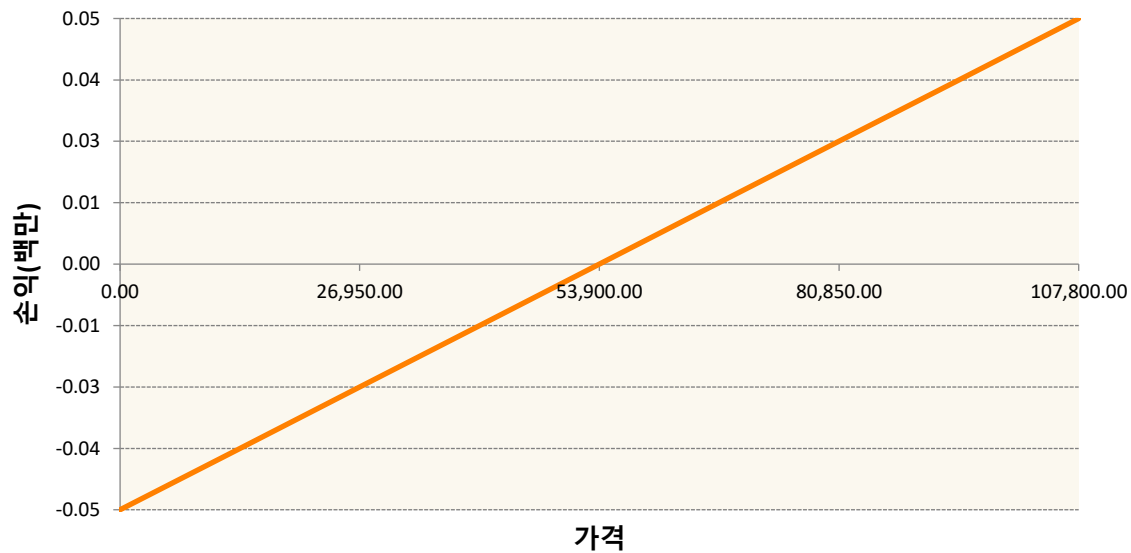
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

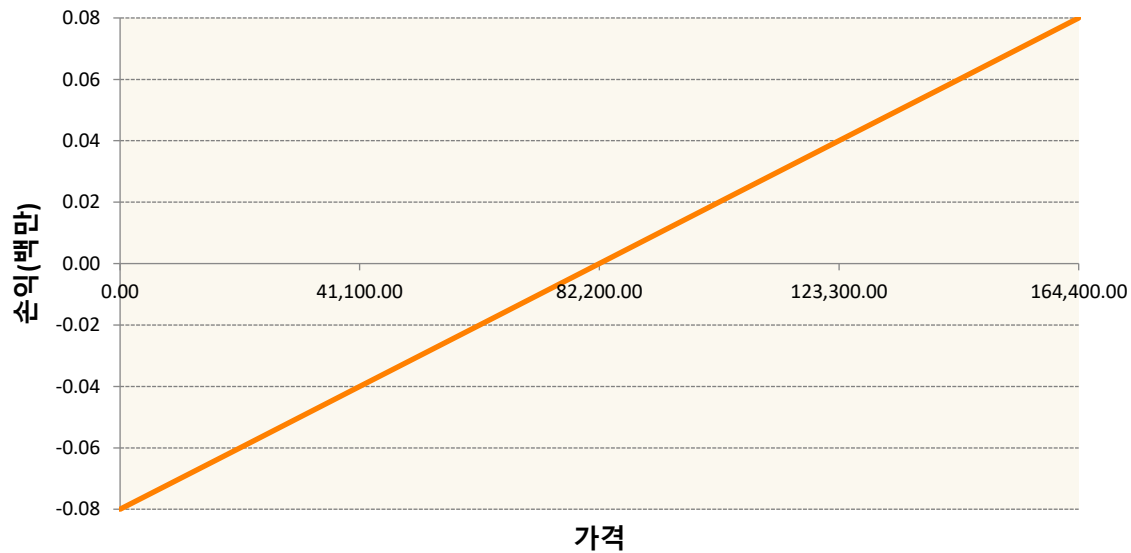
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 746   | 0     | 746       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



KR4150SA0001-2022-10 SK하이닉스개별선물



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

| KR4111SA0009 |           | 2022-10 삼성전자개별선물   |        |     |       |        | 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     |
| KR4150SA0001 |           | 2022-10 SK하이닉스개별선물 |        |     |       |        | 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%       | -19       | -19                | -19    | -19 | -19   | -19    | -19    |
| -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%        | 19        | 19                 | 19     | 19  | 19    | 19     | 19     |
| 8.00%        | 28        | 28                 | 28     | 28  | 28    | 28     | 28     |

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

69

공시일 2022-09-28

기준일 2022-09-27

## 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 2022-09-28

기준일 2022-09-27

## SOL한국형글로벌전기차&2차전지

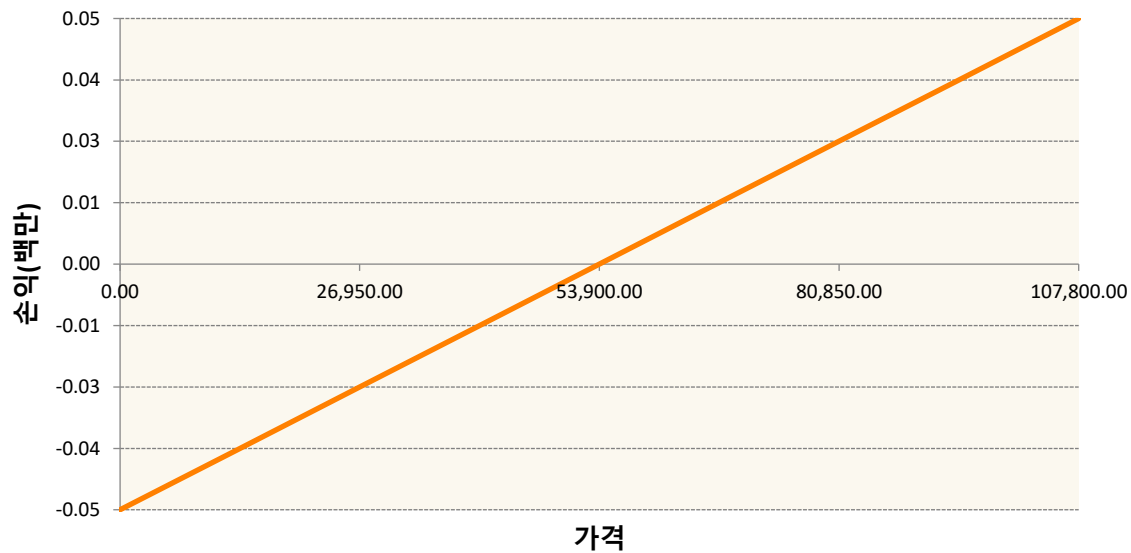
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

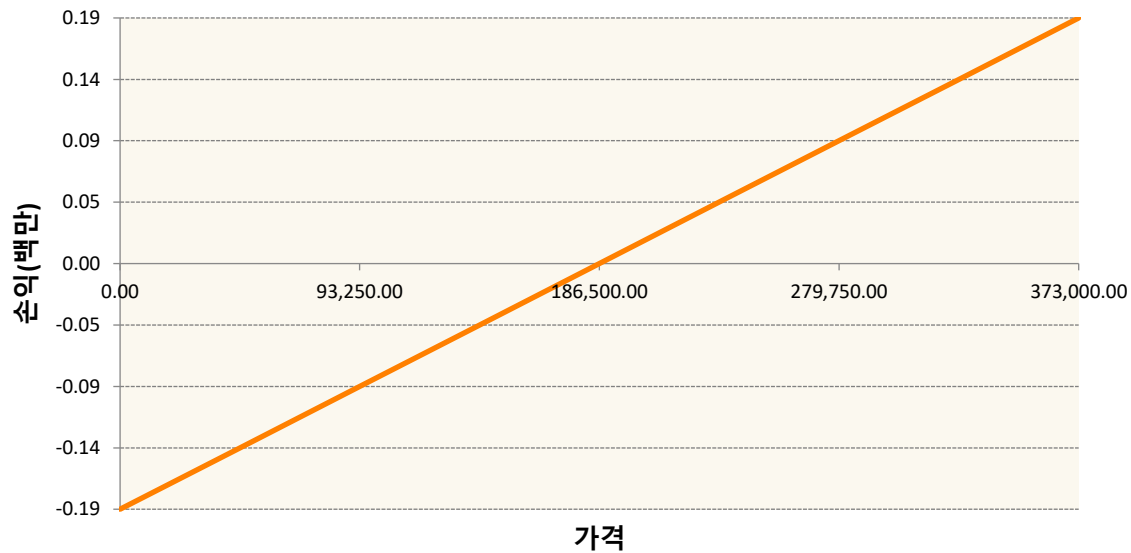
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 274   | 0     | 274       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

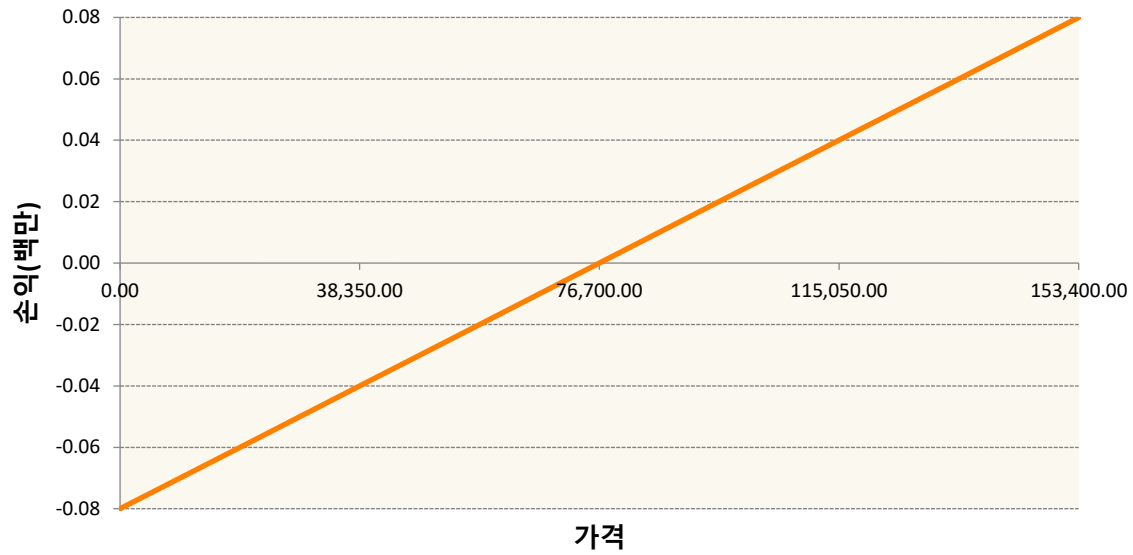
KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



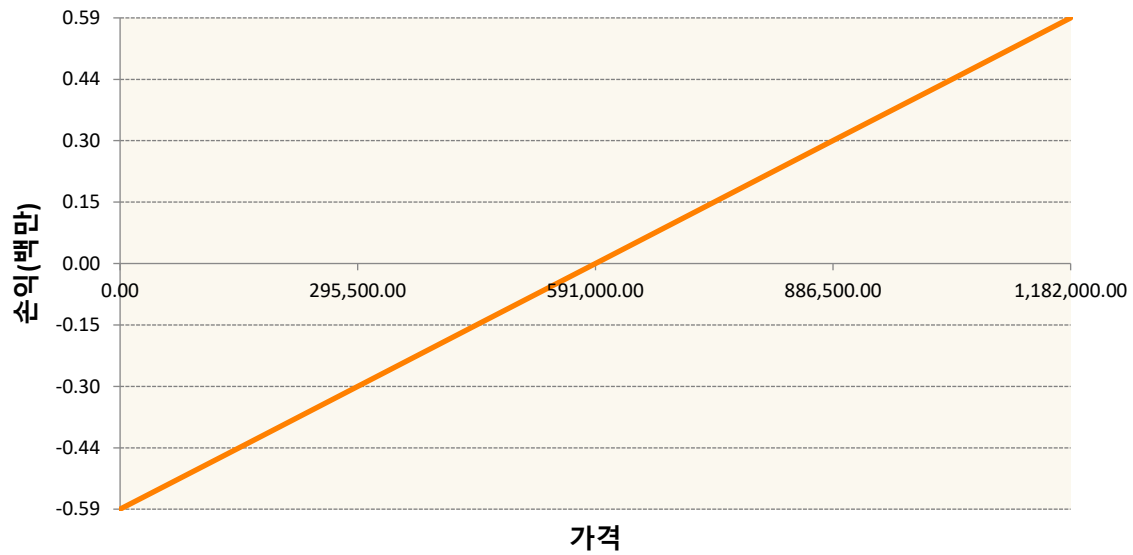
KR4116SA0004-2022-10 현대차개별선물



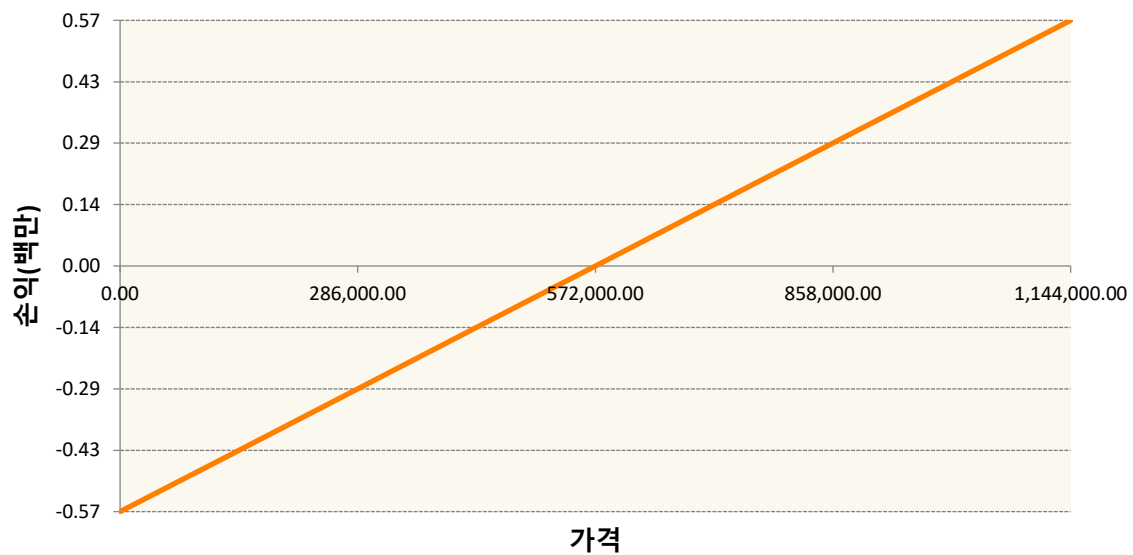
KR4119SA0001-2022-10 기아개별선물



KR4122SA0006-2022-10 삼성SDI개별선물



KR4147SA0007-2022-10 LG화학개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |        |    |       |        |                   |  |   |
|--------------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|-------------------|--|---|
| KR4111SA0009 |           |         |        |    |       |        | 2022-10 삼성전자개별선물  |  | 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                 |  |   |
| KR4116SA0004 |           |         |        |    |       |        | 2022-10 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                 |  |   |
| KR4119SA0001 |           |         |        |    |       |        | 2022-10 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                 |  |   |
| KR4122SA0006 |           |         |        |    |       |        | 2022-10 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                 |  |   |
| KR4147SA0007 |           |         |        |    |       |        | 2022-10 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)

25

공시일 2022-09-28

기준일 2022-09-27

## SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

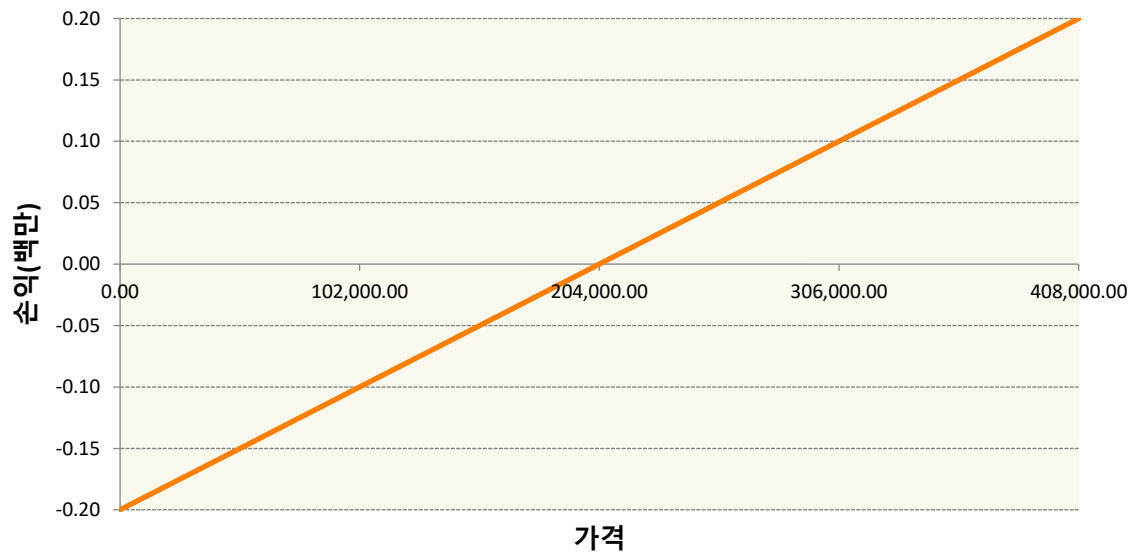
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

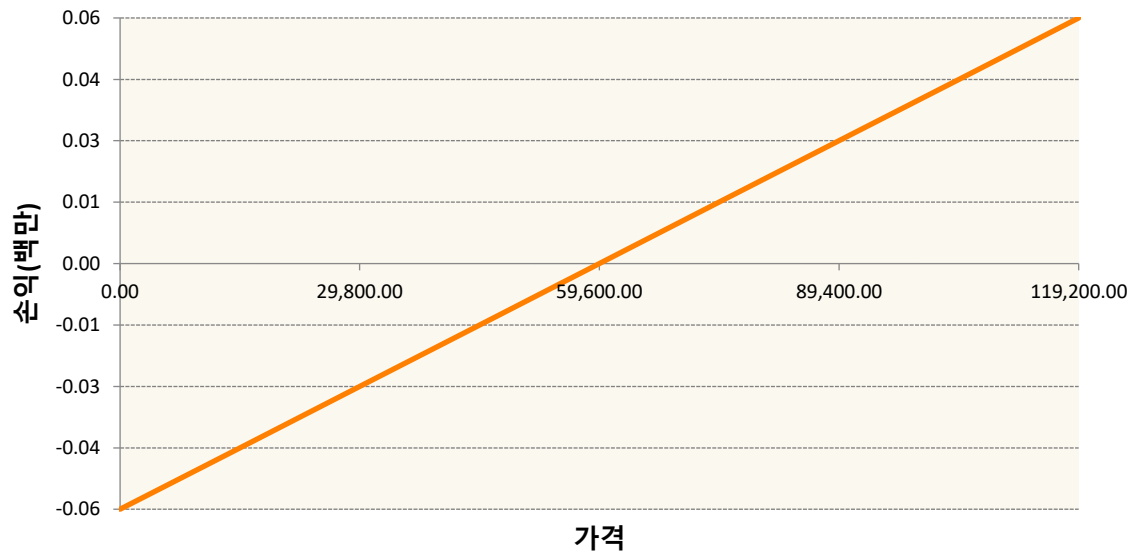
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 174   | 0     | 174       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4156SA0005-2022-10 NAVER개별선물



KR41CFSA0001-2022-10 카카오개별선물



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

|              |           |                   |        |    |       |        |        |
|--------------|-----------|-------------------|--------|----|-------|--------|--------|
| KR4156SA0005 |           | 2022-10 NAVER개별선물 |        |    |       |        | 8      |
|              | 기초자산의 변동성 |                   |        |    |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%           | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -8        | -8                | -8     | -8 | -8    | -8     | -8     |
| -5.33%       | -5        | -5                | -5     | -5 | -5    | -5     | -5     |
| -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%        | 5         | 5                 | 5      | 5  | 5     | 5      | 5      |
| 8.00%        | 8         | 8                 | 8      | 8  | 8     | 8      | 8      |
| KR41CFSA0001 |           | 2022-10 카카오개별선물   |        |    |       |        | 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     |
| -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%        | 6         | 6                 | 6      | 6  | 6     | 6      | 6      |

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

25

공시일 2022-09-28

기준일 2022-09-27

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

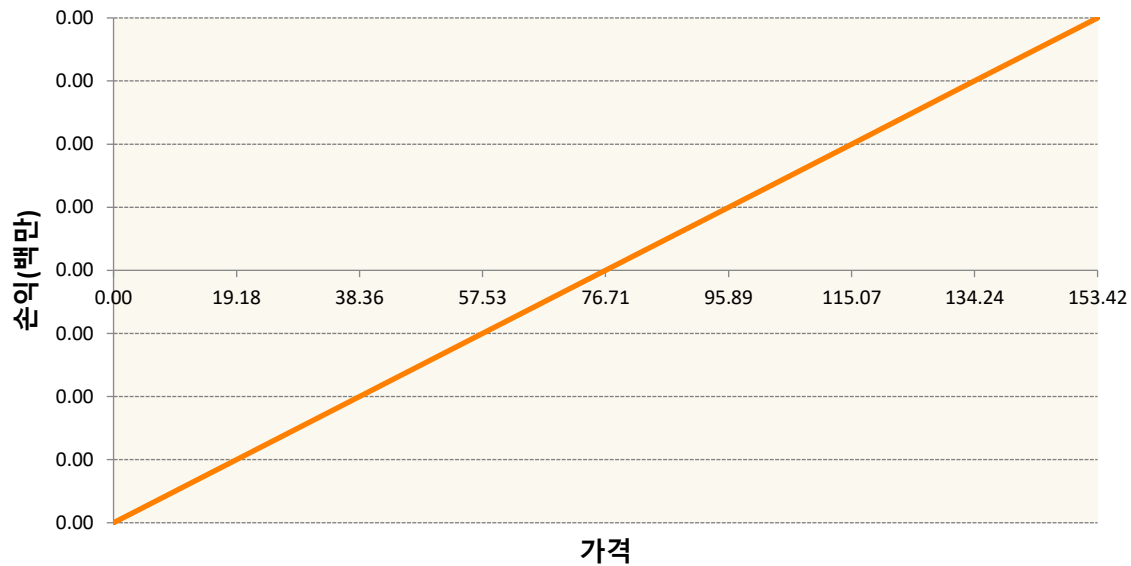
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

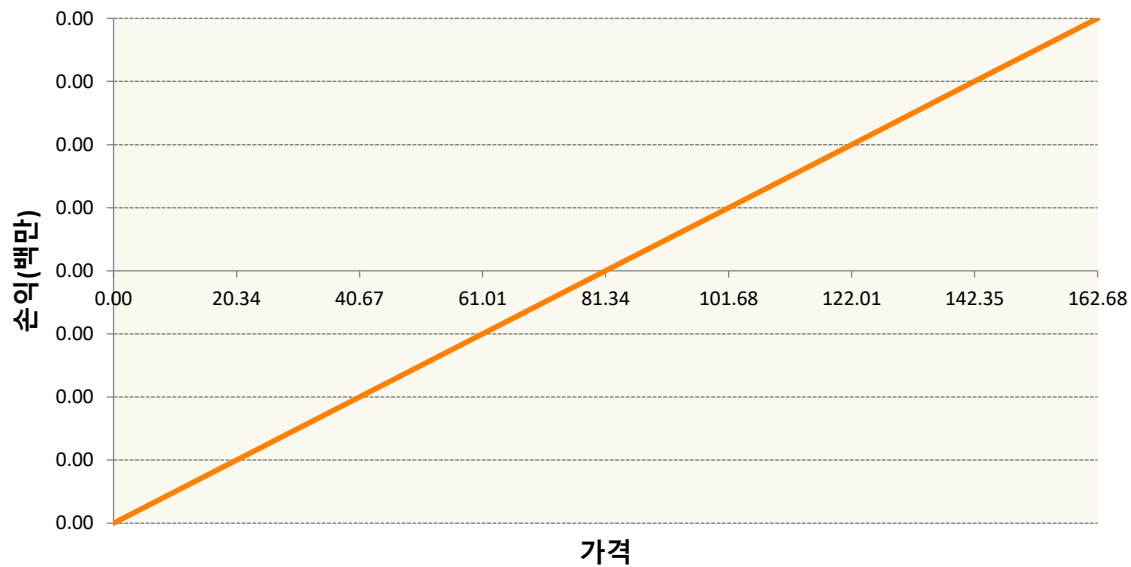
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,569 | 213   | 1,356     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

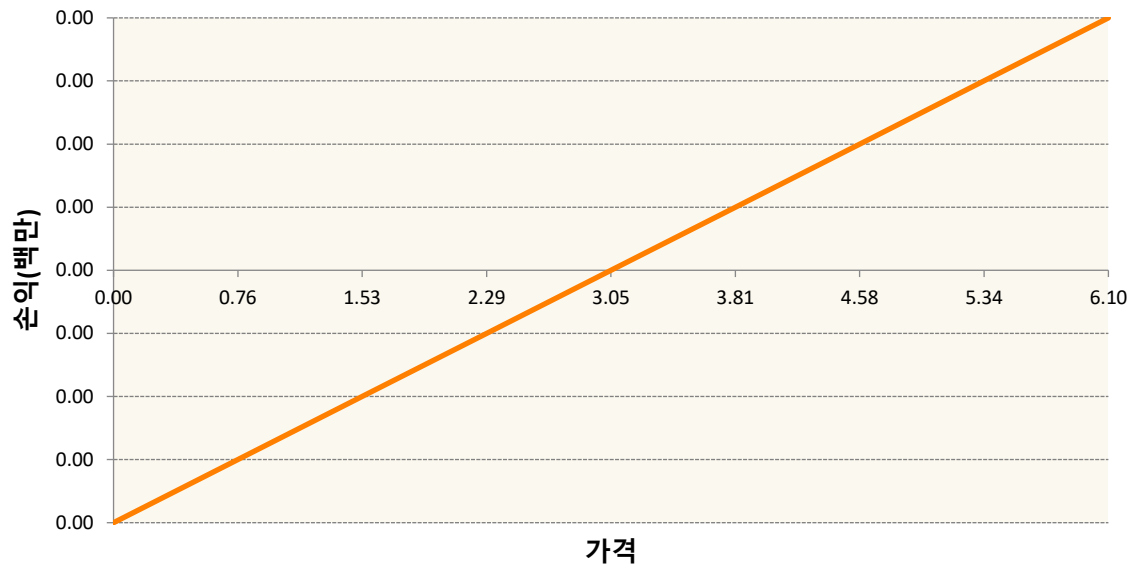
CLX2-WTI CRUDE FUTURE Nov22



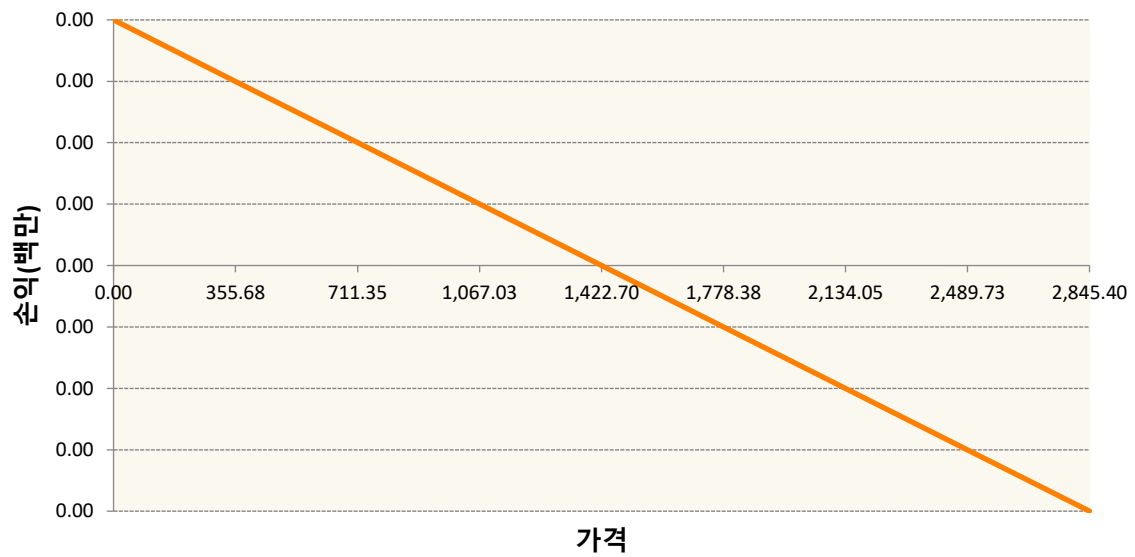
COF3-BRENT CRUDE FUTR JAN23



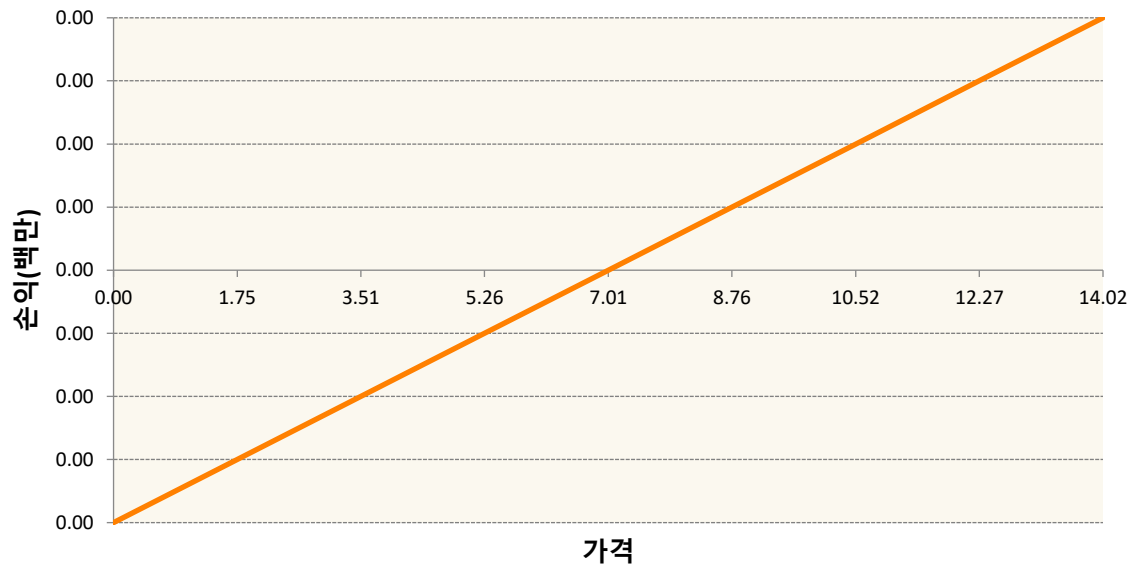
HOX2-NY Harb ULSD Fut Nov22

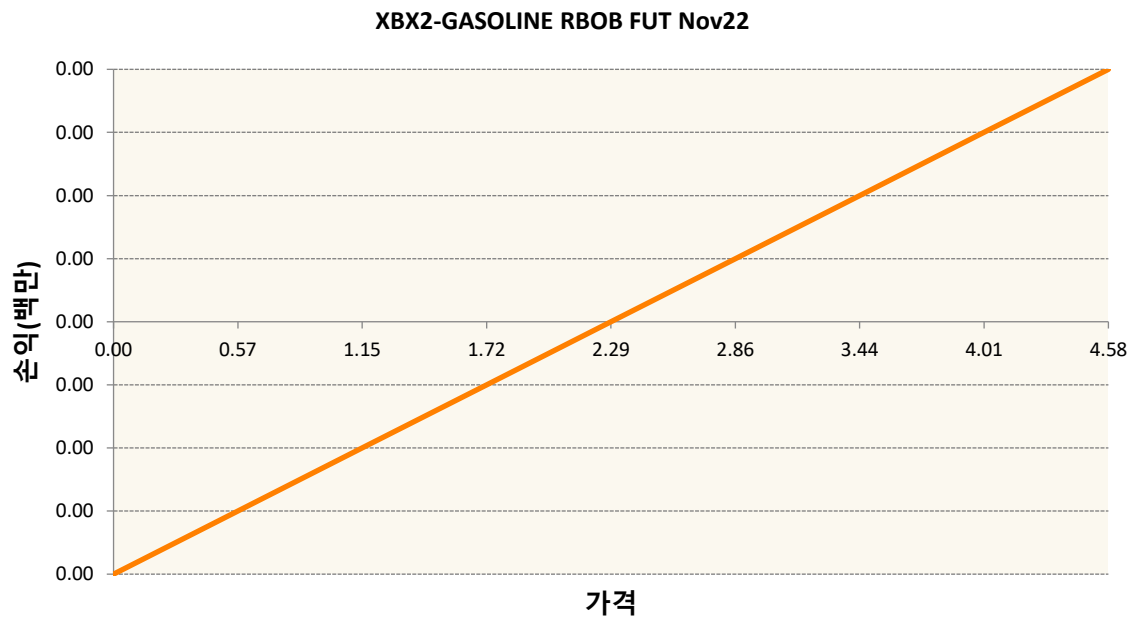
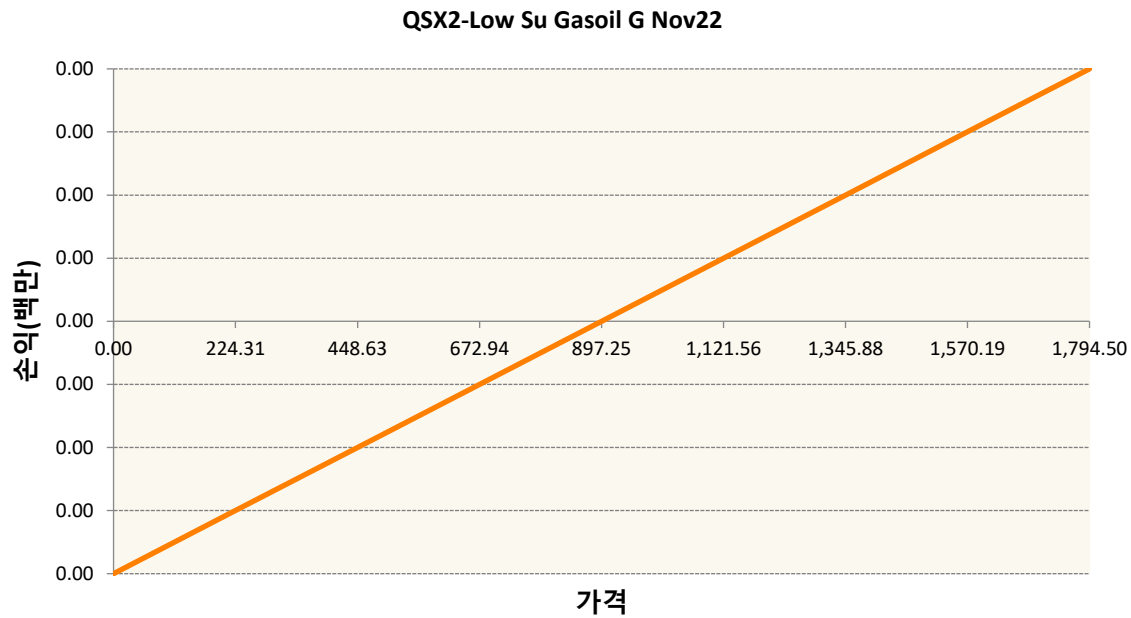


KR4175SA0002-2022-10 달러선물



NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| CLX2                      | WTI CRUDE FUTURE Nov22  |  | 16       |
| COF3                      | BRENT CRUDE FUTR JAN23  |  | 27       |
| HOX2                      | NY Harb ULSD Fut Nov22  |  | 13       |
| KR4175SA00 2022-10 달러선물   |                         |  | 17       |
| NGX22                     | NATURAL GAS FUTR Nov22  |  | 50       |
| QX2                       | Low Su Gasoil G Nov22   |  | 9        |
| XB2                       | GASOLINE RBOB FUT Nov22 |  | 10       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 413      |