

공시일 2022-09-29

기준일 2022-09-28

포커스농산물모(채권-파생형)

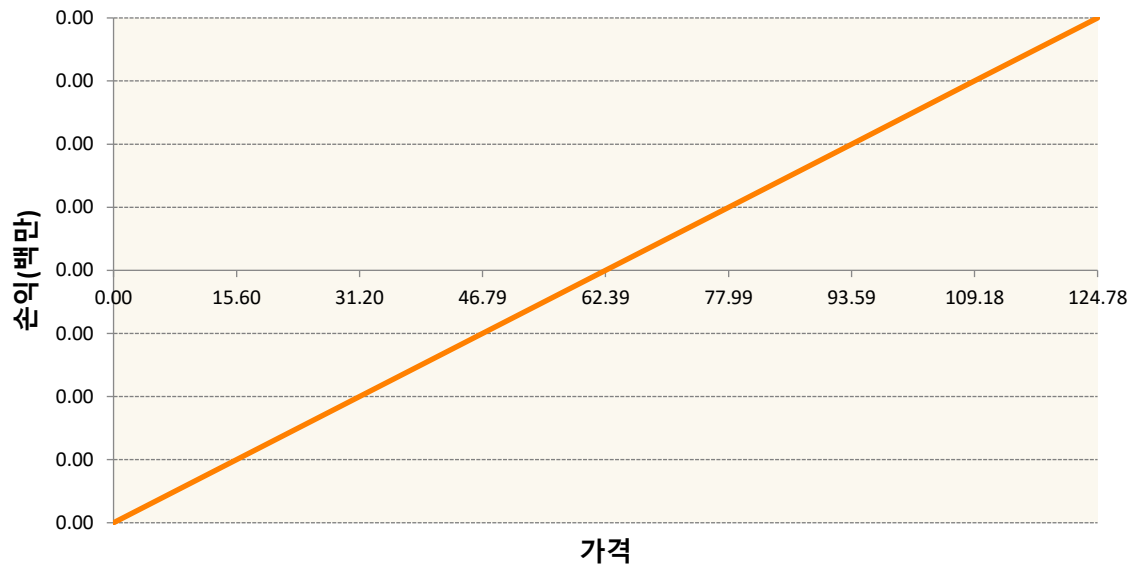
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

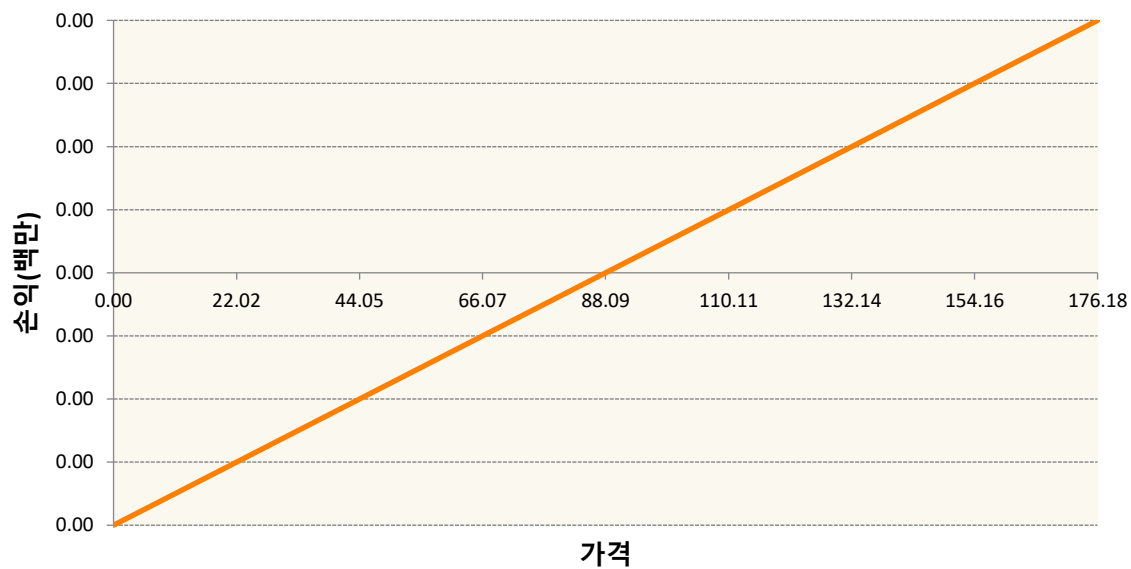
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,454	864	5,590	

2. 만기시점의 손익구조

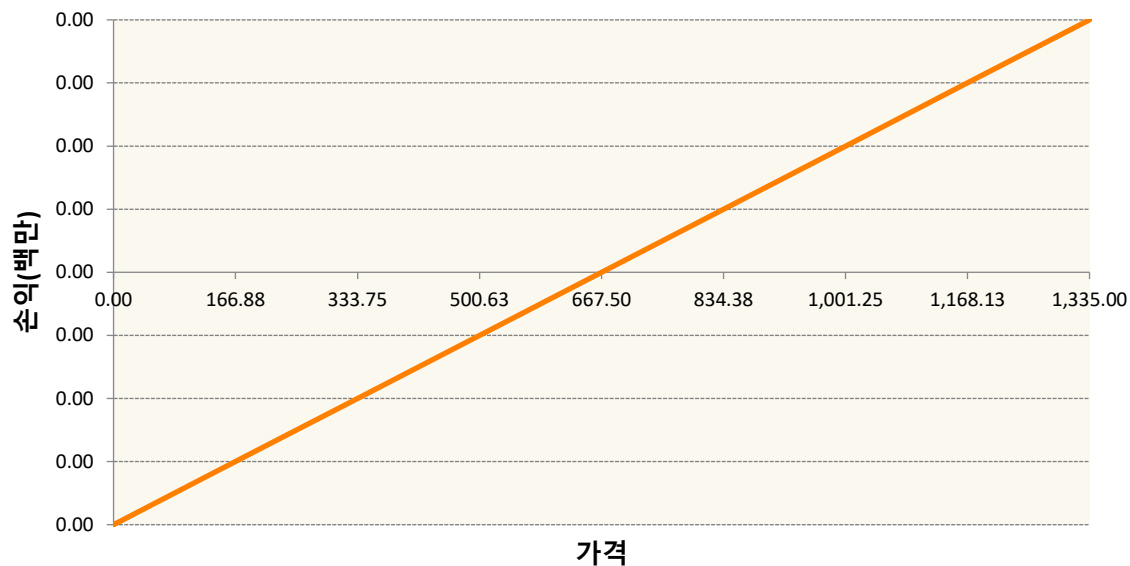
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



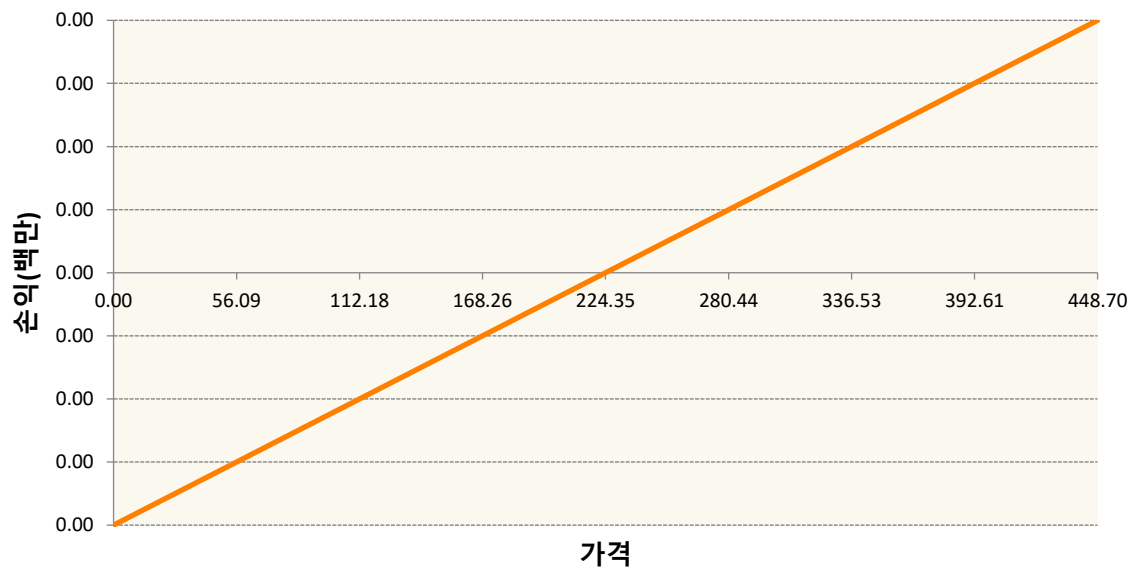
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



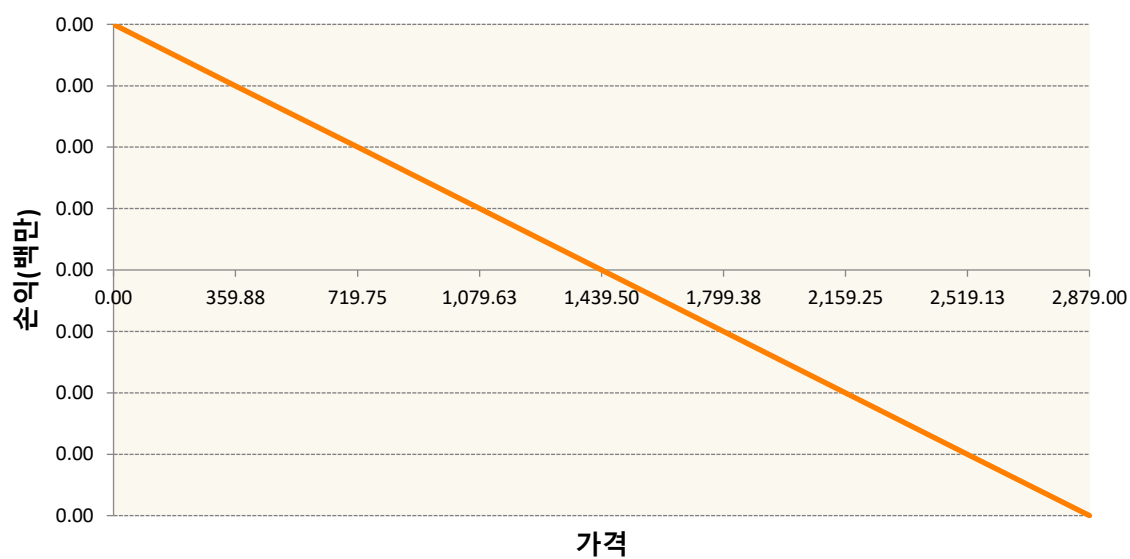
CZ2-CORN FUTURE Dec22



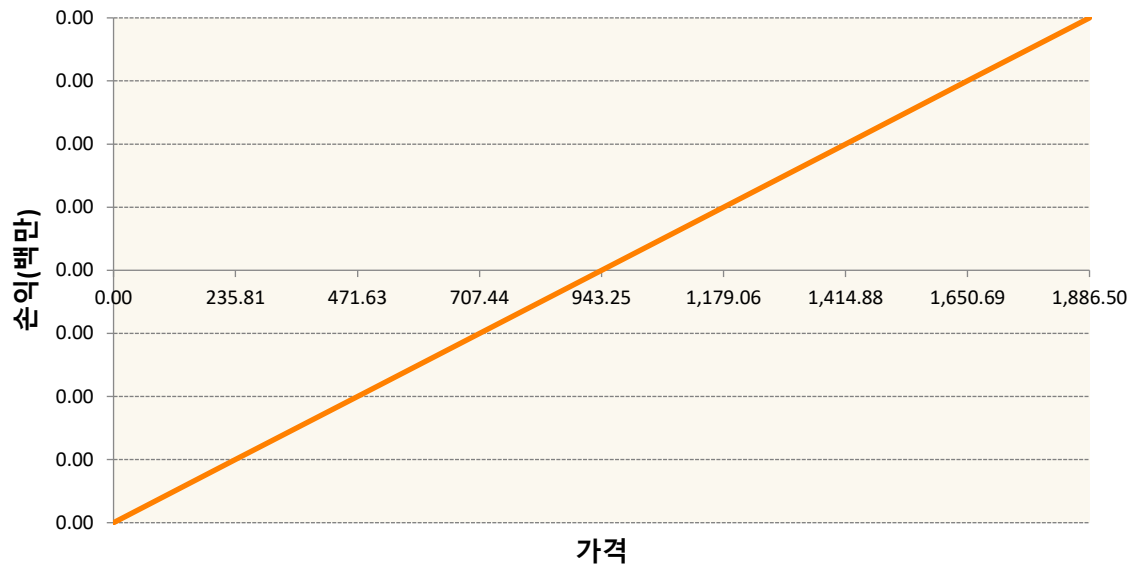
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



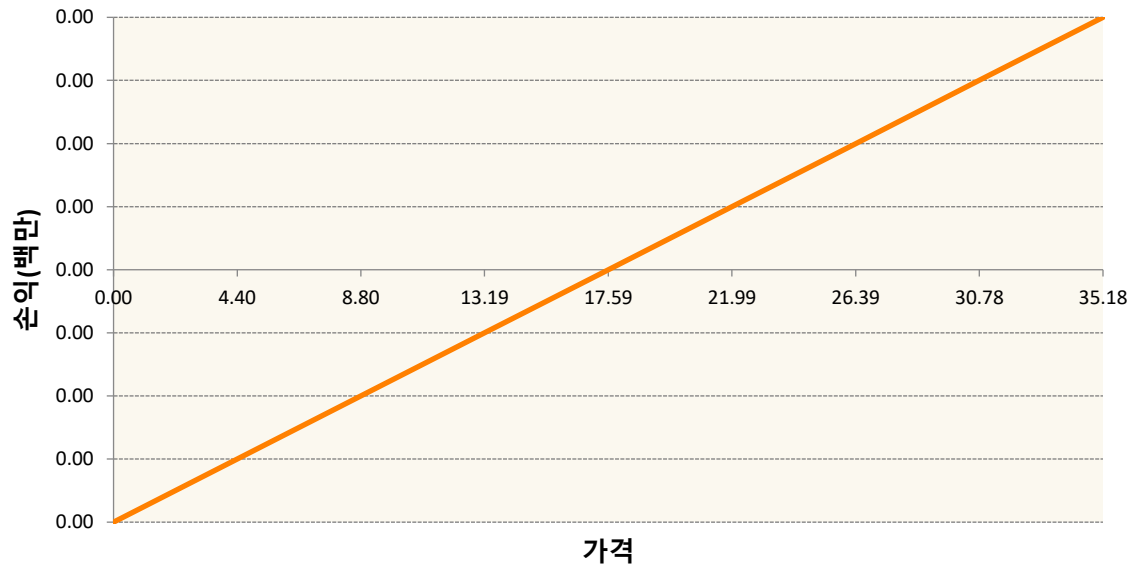
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



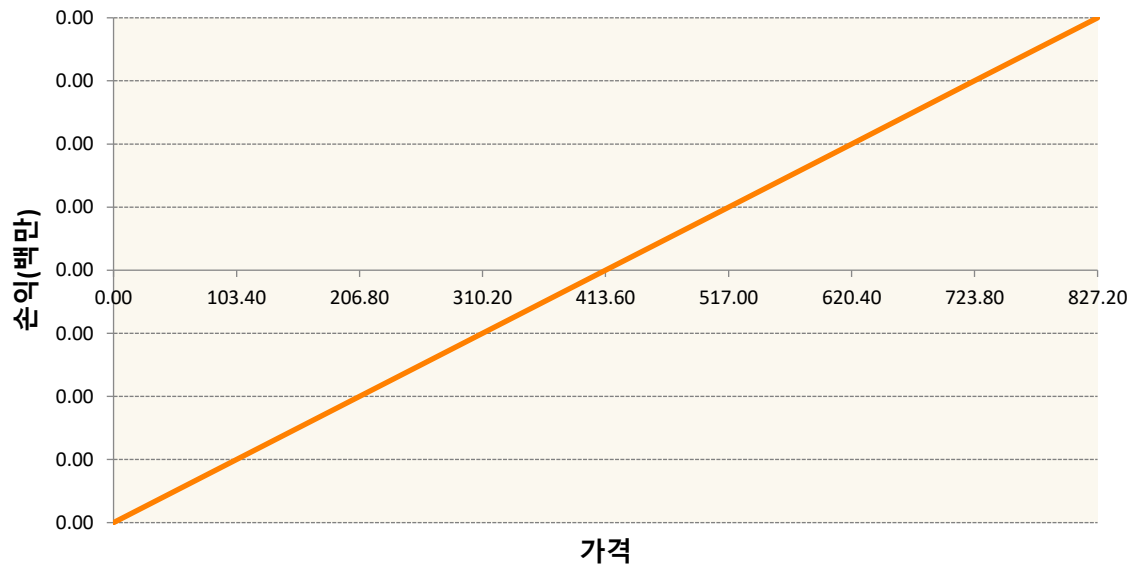
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

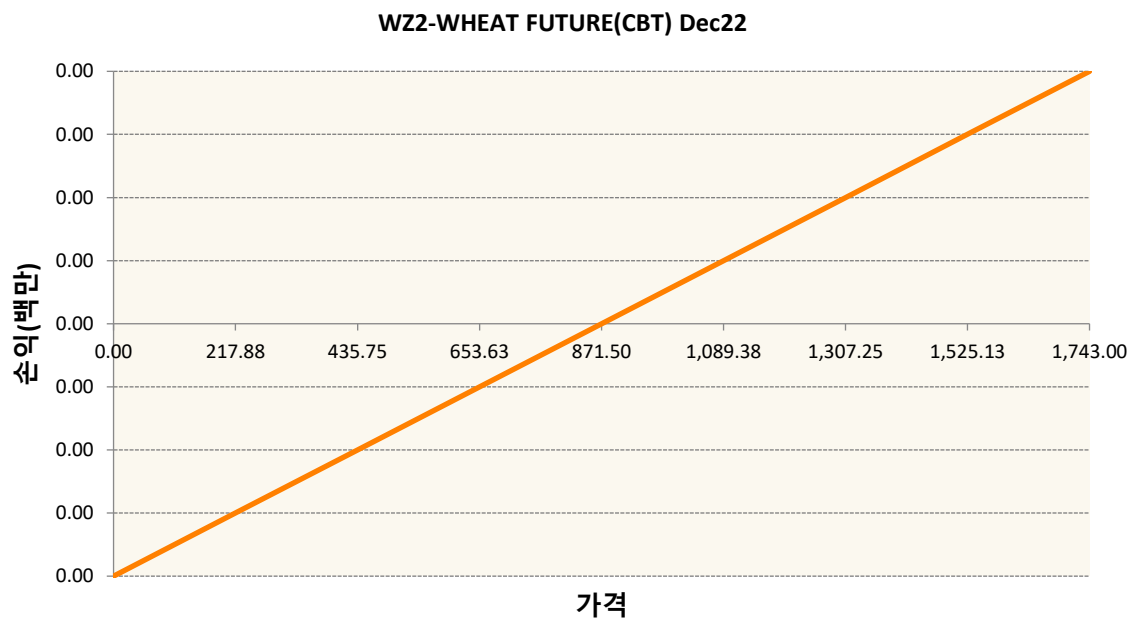
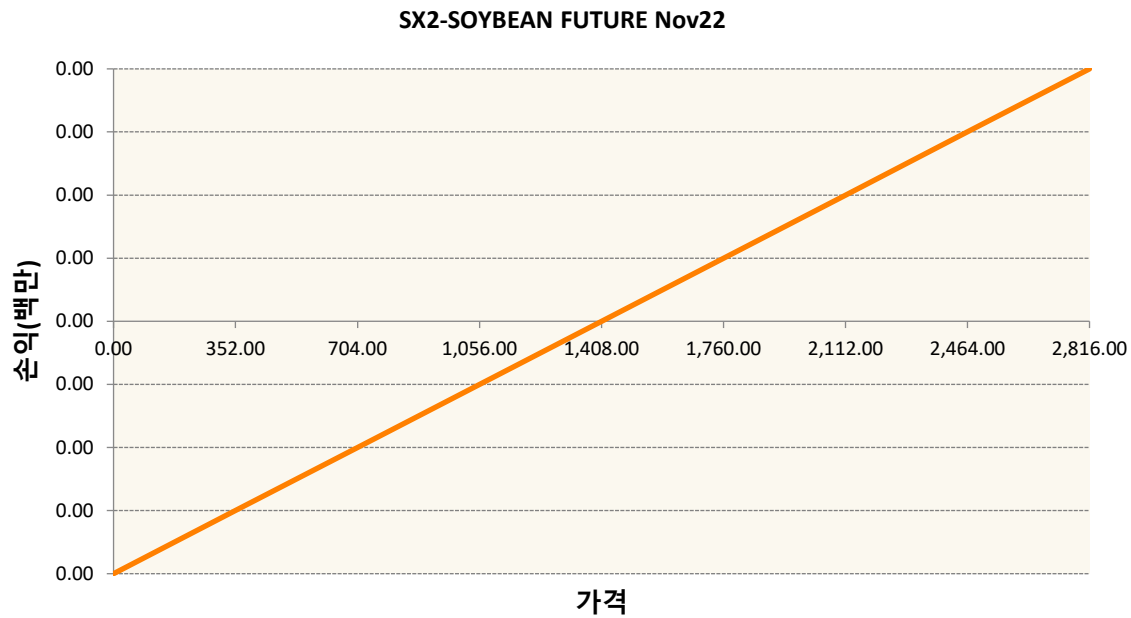


SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



SMZ2-SOYBEAN MEAL FUTR Dec22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

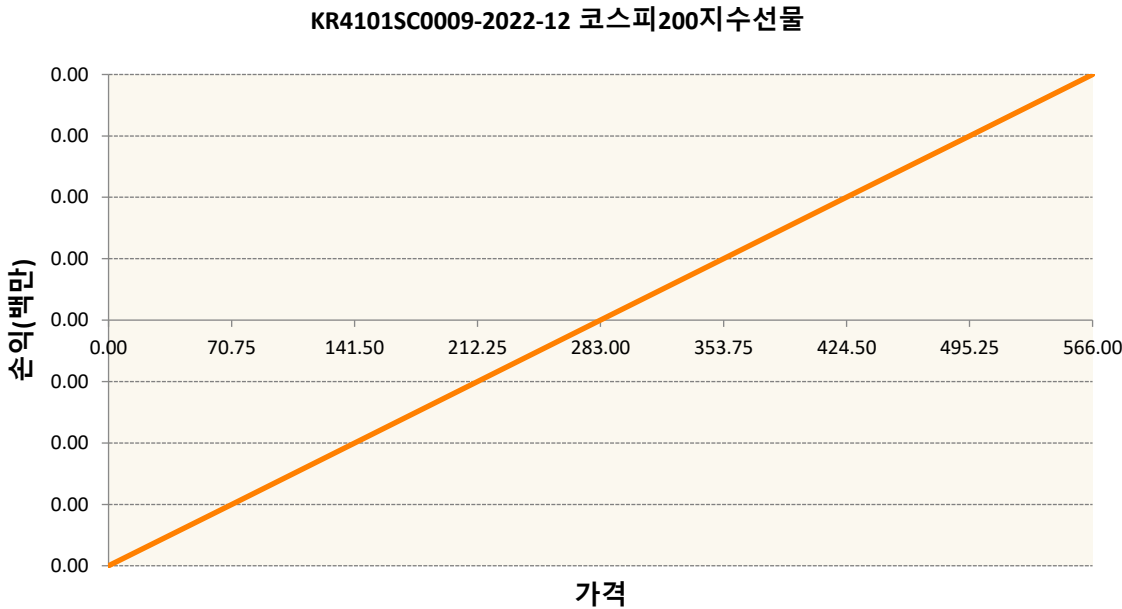
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	71	0	71	장내
누계	유가증권	선물	920	0	920	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				74
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	74	74	74	74	74	74	74

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

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	327
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

435

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

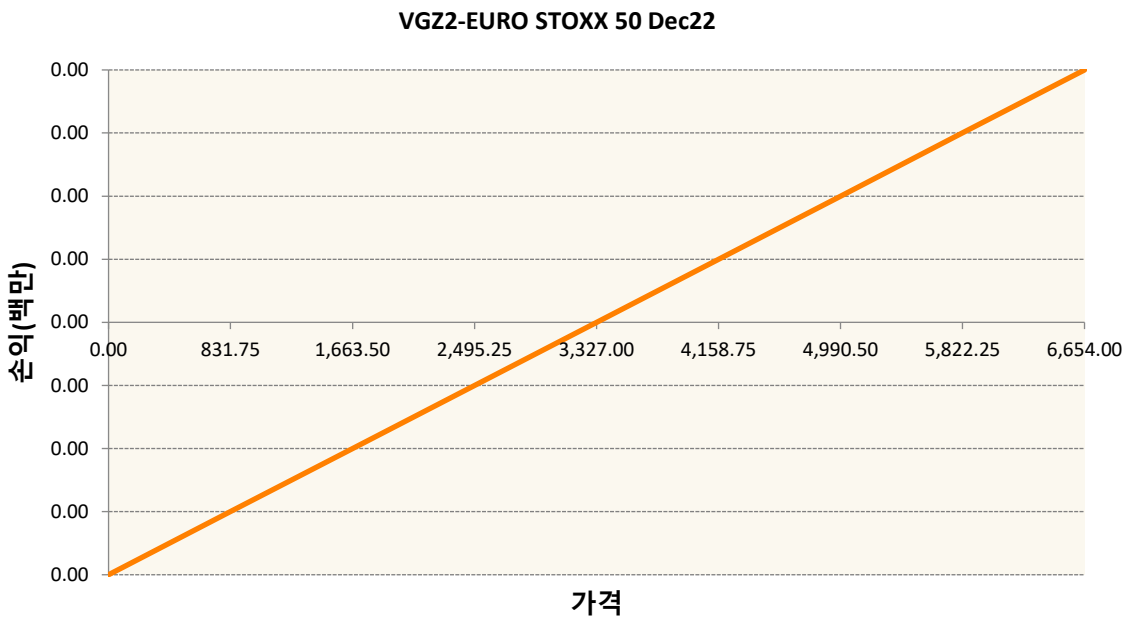
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	462	0	462	

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	2022-09-29
기준일	2022-09-28

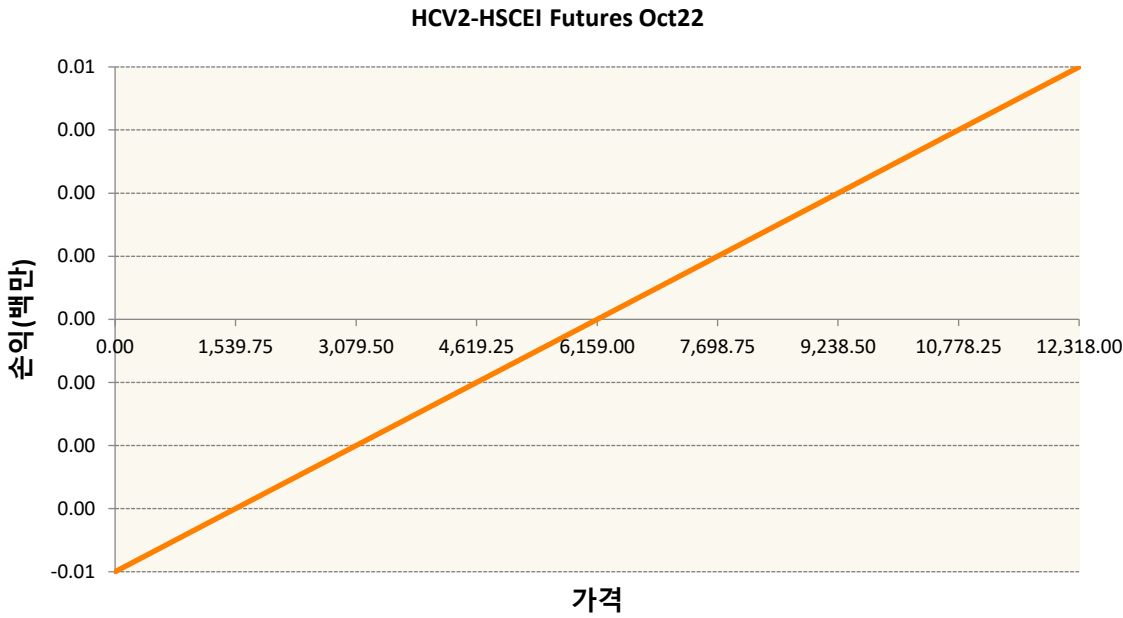
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,017	0	1,017	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV2	HSCEI Futures Oct22	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

119

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

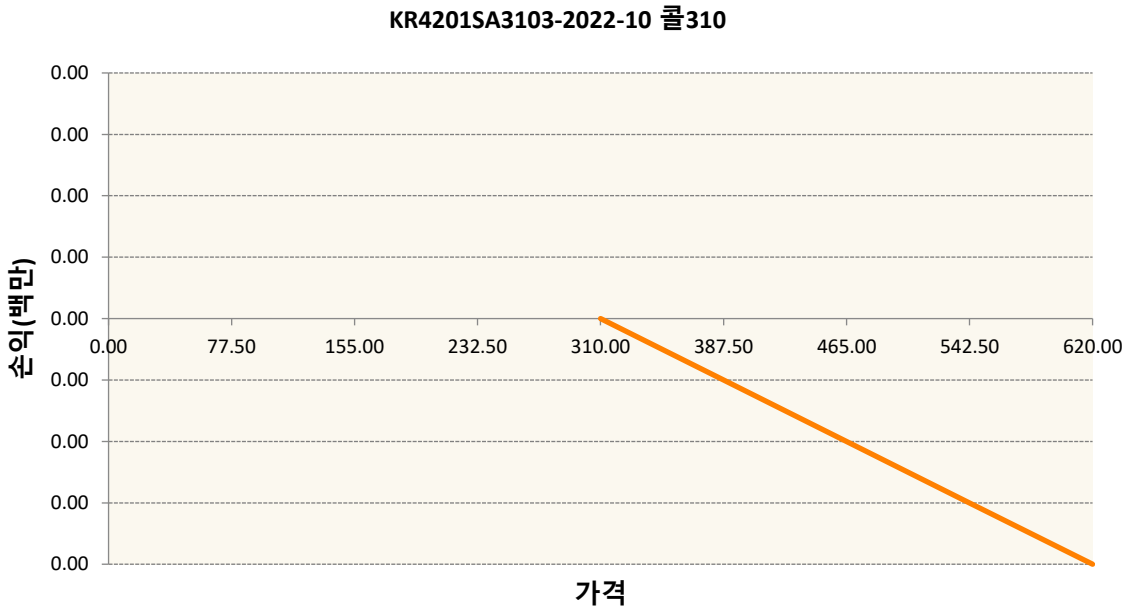
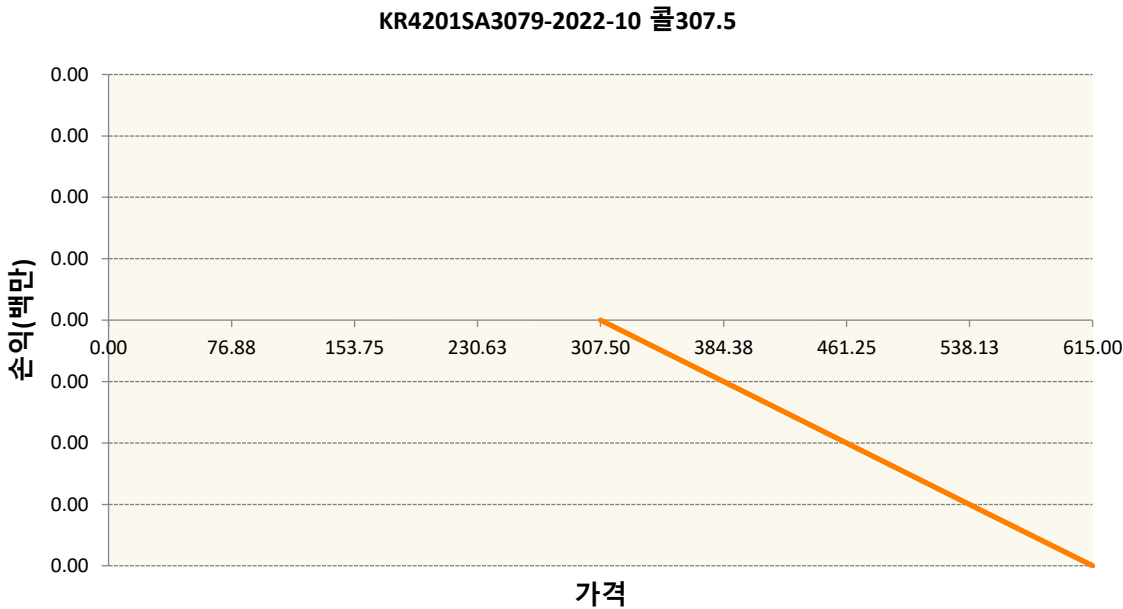
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

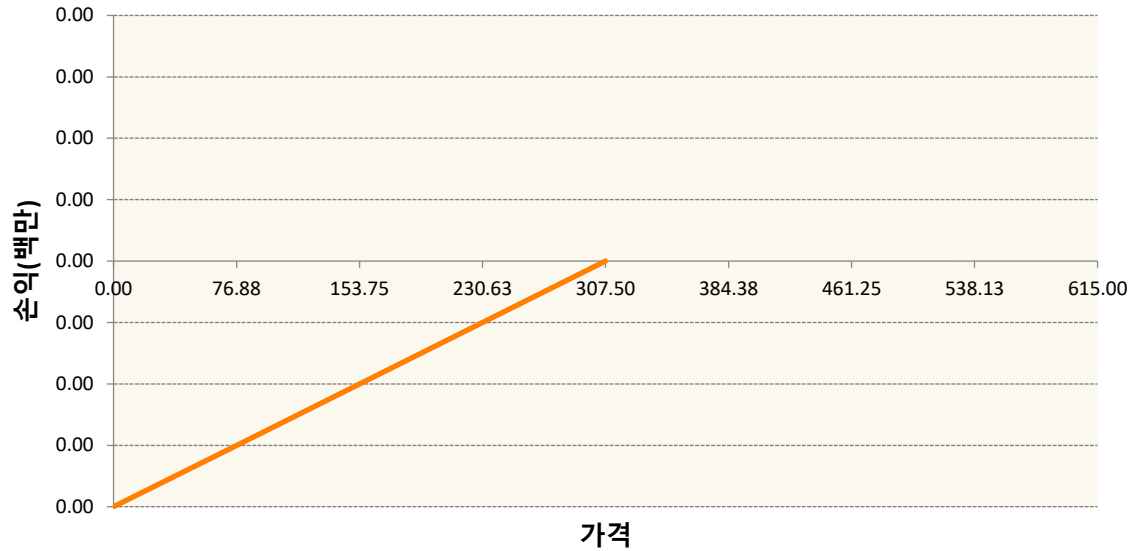
(단위:백만원)

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					292
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	40	39	38	36	34	31
-5.33%	39	38	37	34	30	25	20
-2.67%	37	33	29	23	16	8	-2
0%	27	20	11	0	-12	-25	-39
2.67%	2	-12	-27	-43	-61	-79	-97
5.33%	-53	-73	-94	-115	-137	-159	-180
8.00%	-150	-174	-197	-221	-245	-268	-292
KR4201SA3103		2022-10 콜310					917
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	109	109	107	105	101	94	85
-5.33%	108	106	101	94	84	70	53
-2.67%	102	94	82	65	44	19	-11
0%	79	58	32	0	-37	-78	-122
2.67%	12	-29	-76	-127	-181	-239	-300
5.33%	-141	-206	-273	-343	-414	-487	-561
8.00%	-428	-509	-590	-671	-753	-835	-917
KR4301SA3078		2022-10 풋307.5					733
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-724	-724	-725	-726	-727	-730	-733
-5.33%	-470	-471	-473	-475	-479	-484	-490
-2.67%	-218	-221	-226	-231	-239	-247	-257
0%	27	20	11	0	-12	-25	-39

2.67%	257	243	227	211	194	176	157
5.33%	456	436	415	394	373	351	329
8.00%	614	590	567	543	519	496	472

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

(단위:백만원)

1,517

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

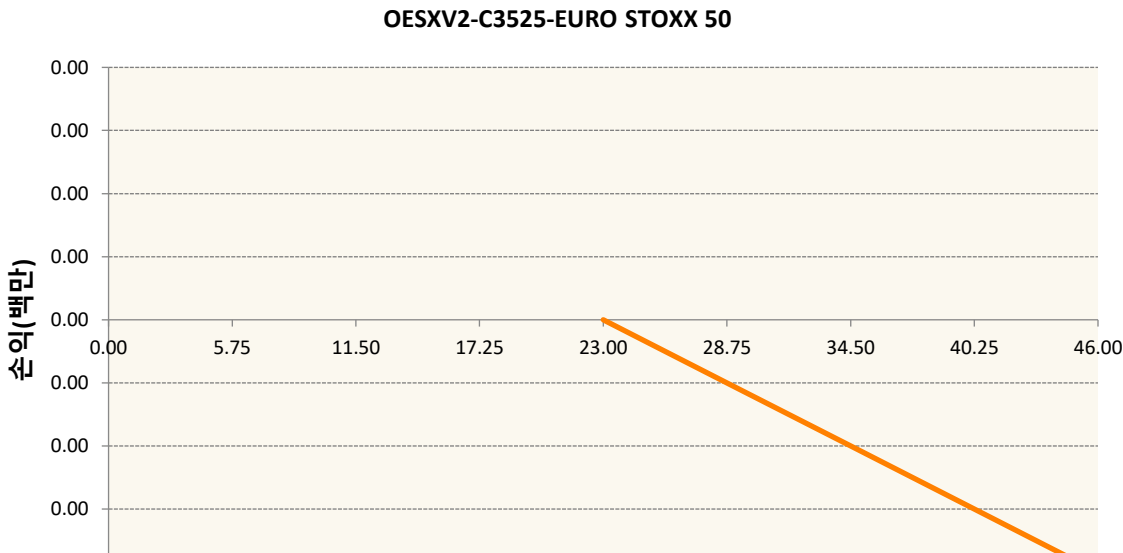
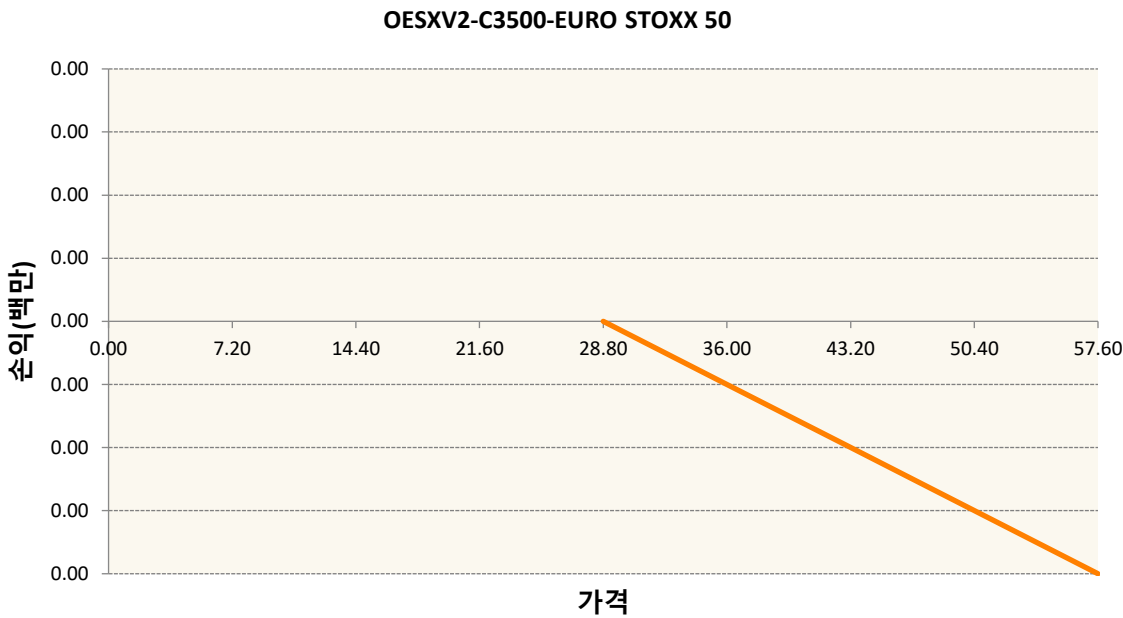
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

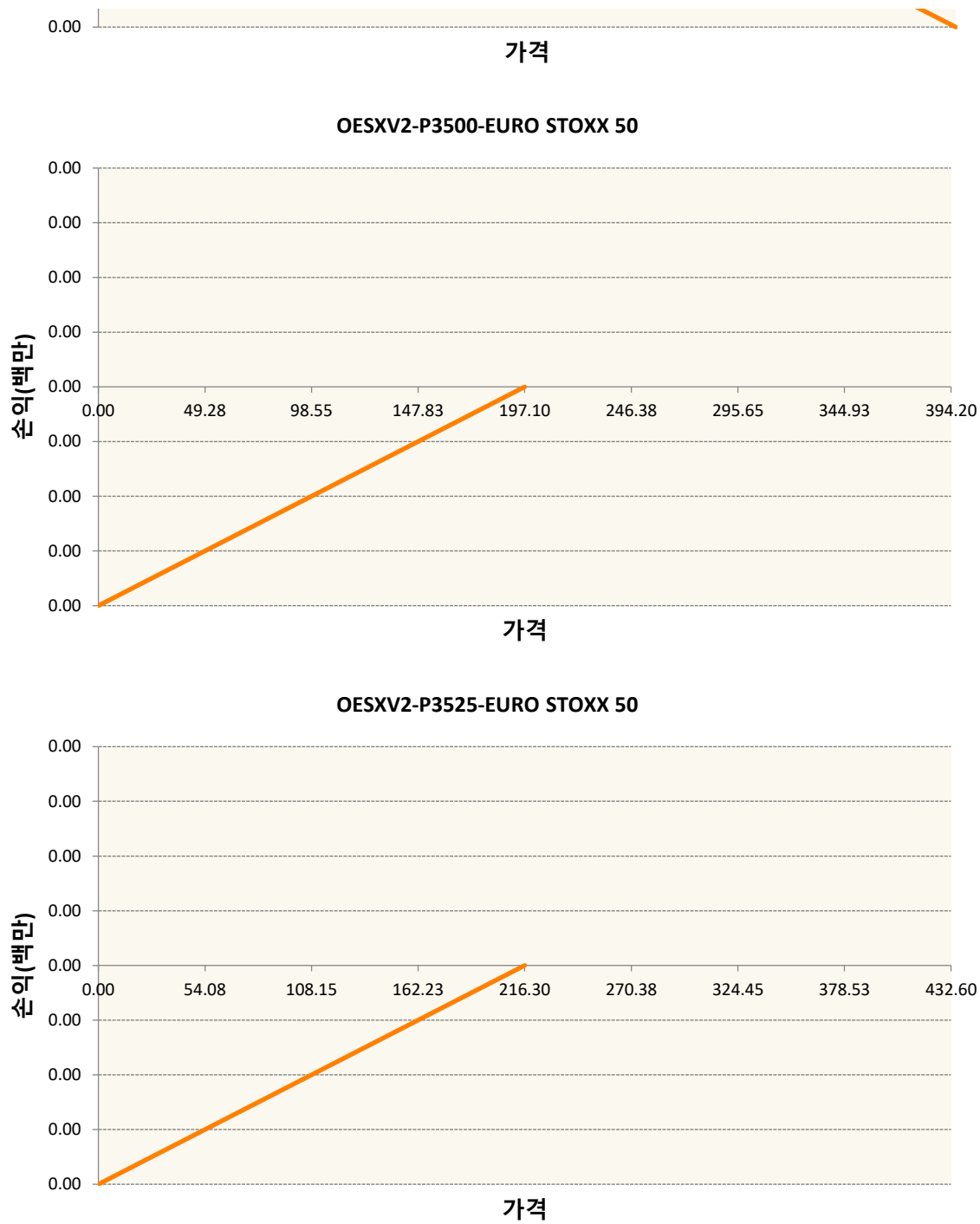
1. 계약금액

(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	44	-44	장내
누계	통화	선도	0	894	-894	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

11
72
0.38
0.03
3
0.48

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

(단위:백만원)

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

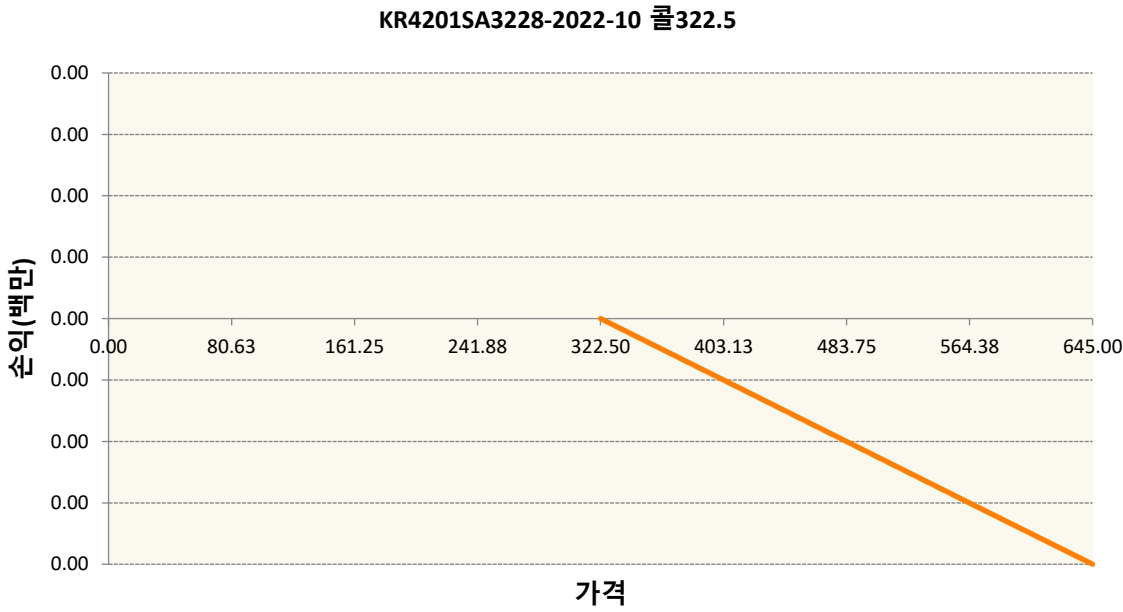
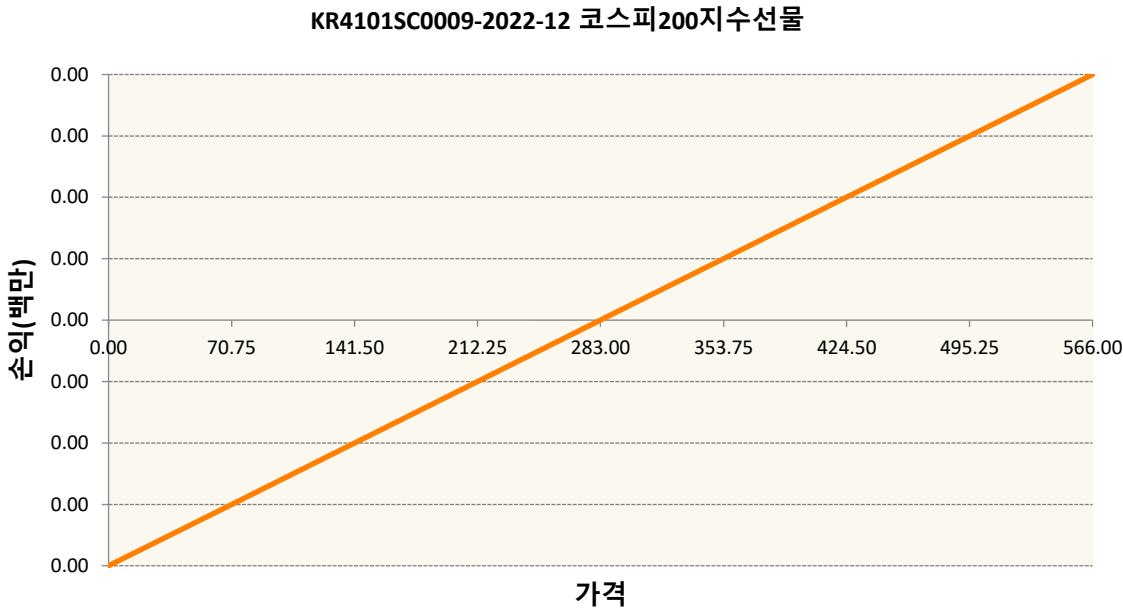
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

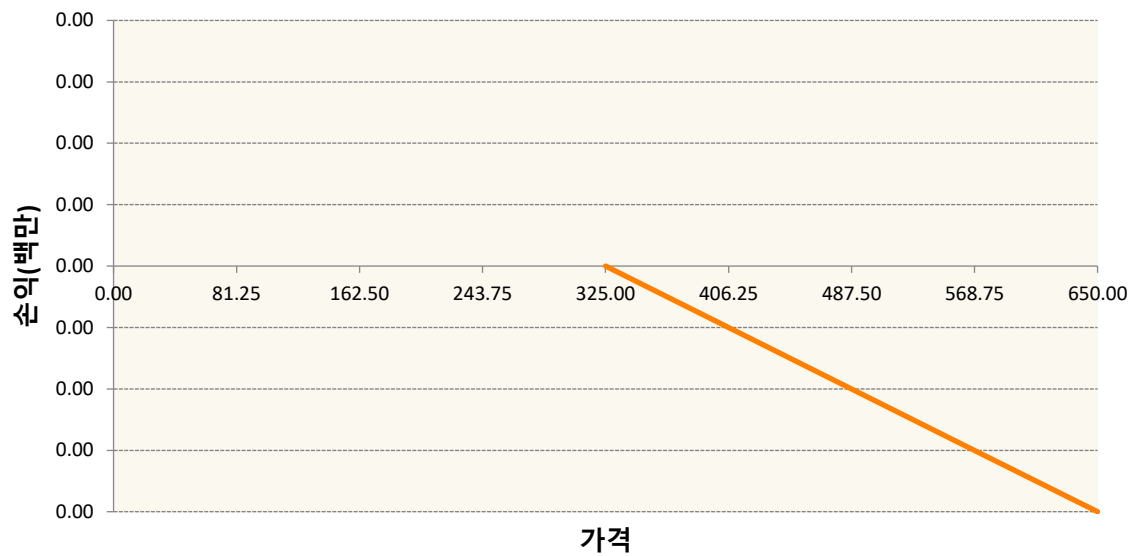
(단위:백만원)

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	354	0	354	장내
누계	유가증권	옵션	386	4,219	-3,834	장내

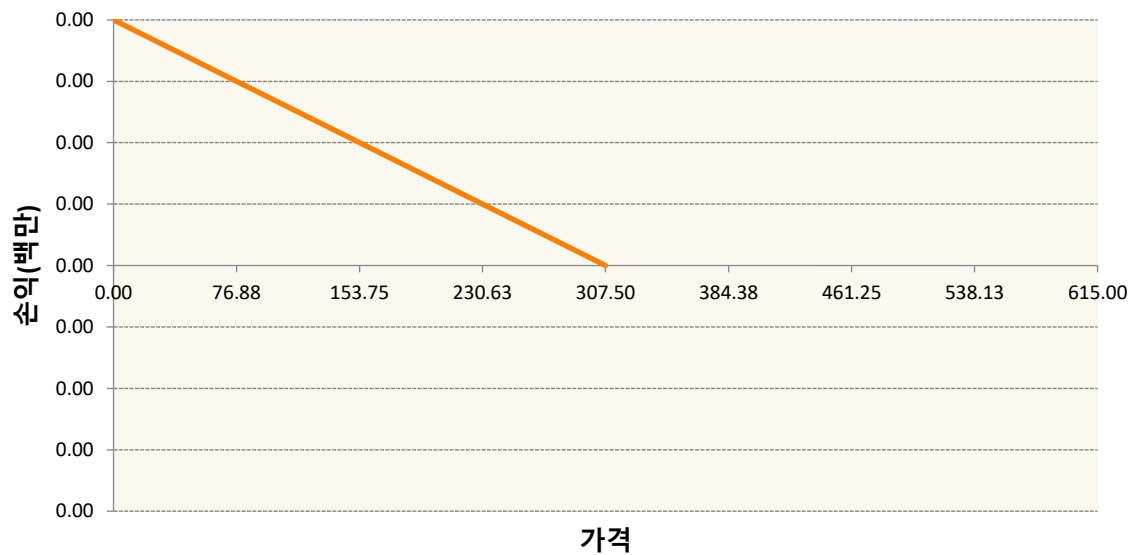
2. 만기시점의 손익구조



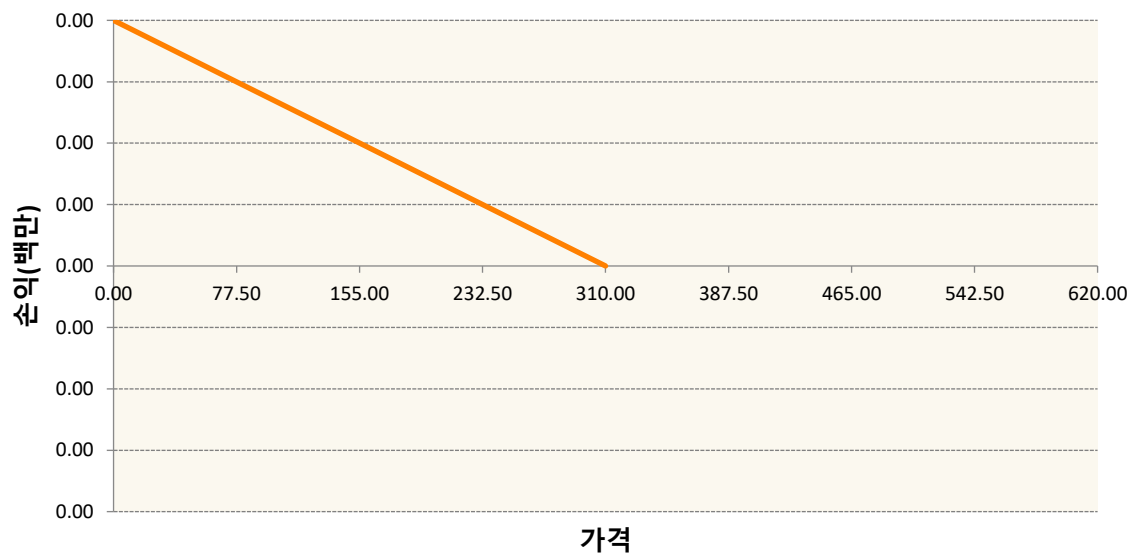
KR4201SA3251-2022-10 콜325



KR4301SA3078-2022-10 풋307.5



KR4301SA3102-2022-10 풋310



(단위:백만원)

KR4101SC0009							2022-12 코스피200지수선물		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			
KR4201SA3228							2022-10 콜322.5		10	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	1	1	1	1	1	0	0			
-5.33%	1	1	1	1	0	0	0			
-2.67%	1	1	0	0	0	0	0			
0%	0	0	0	0	0	-1	-1			
2.67%	0	0	0	-1	-1	-2	-3			
5.33%	-1	-1	-2	-3	-4	-4	-6			
8.00%	-2	-3	-5	-6	-7	-8	-10			
KR4201SA3251							2022-10 콜325		40	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	2	2	2	2	2	2	2			
-5.33%	2	2	2	2	2	1	1			
-2.67%	2	2	2	1	1	0	-1			
0%	2	1	1	0	-1	-3	-5			
2.67%	1	0	-1	-3	-6	-8	-11			
5.33%	-2	-4	-7	-10	-14	-18	-23			
8.00%	-9	-13	-18	-23	-28	-34	-40			
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	11	11	11	11	11			
-2.67%	5	5	5	5	5	5	6			
0%	-1	0	0	0	0	1	1			
2.67%	-6	-5	-5	-5	-4	-4	-3			
5.33%	-10	-10	-9	-9	-8	-8	-7			
8.00%	-14	-13	-13	-12	-12	-11	-10			
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%	0	0	0	0	0	0	1
2.67%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-2
5.33%	-7	-7	-6	-6	-6	-5	-5
8.00%	-9	-9	-9	-8	-8	-8	-7

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

(단위:백만원)

75

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

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	7,373	0	7,373	

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	2022-09-29
기준일	2022-09-28

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	6,165	0	6,165	

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	2022-09-29
기준일	2022-09-28

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	178	-178	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	19,197	0	19,197	
누계	통화	선도	936	20,915	-19,979	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C7R·KRW/USD 27-10-22E		494
FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E		644
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E		536
FXW213C9V(USD/KRW 27-10-22E		75

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	731

공시일 2022-09-29

기준일 2022-09-28

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

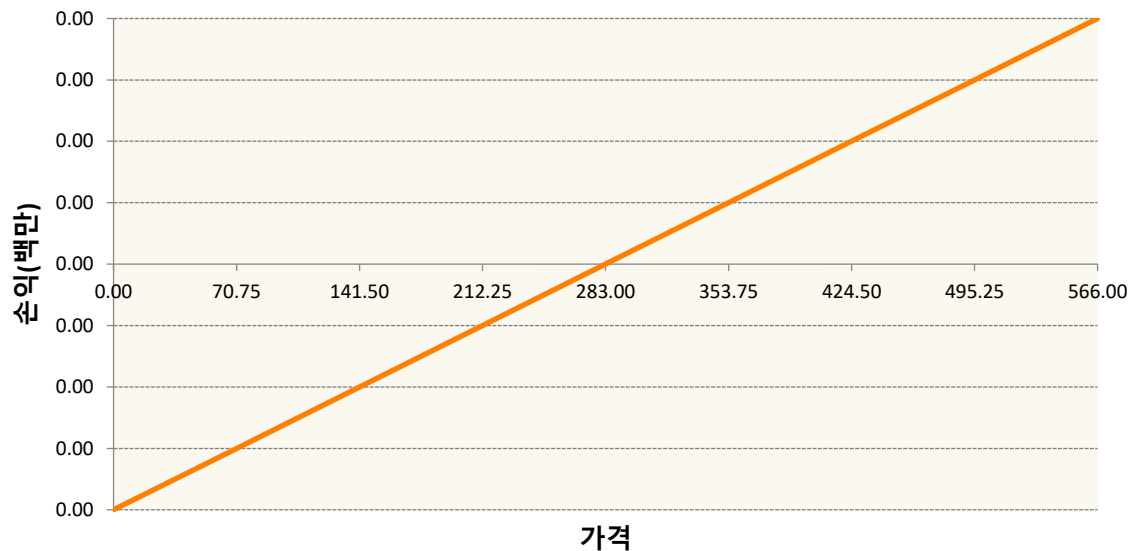
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	354	0	354	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 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%	-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	

공시일 2022-09-29

기준일 2022-09-28

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

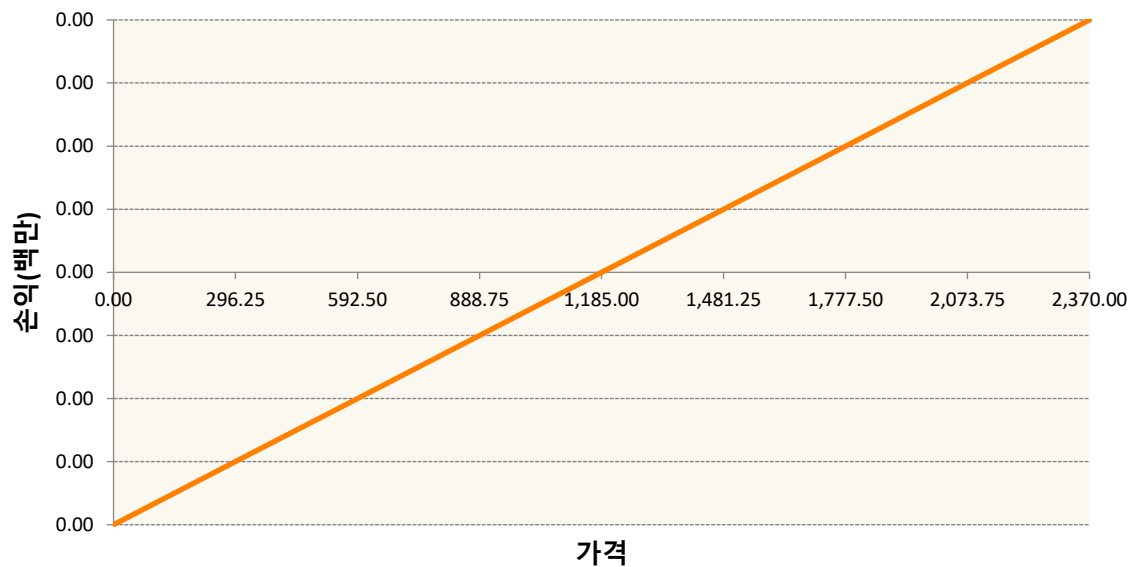
1. 계약금액

(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	556	0	556	
누계	유가증권	스왑	1,693	0	1,693	장외
누계	통화	선도	0	1,101	-1,101	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	6
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

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

(단위:백만원)

242

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

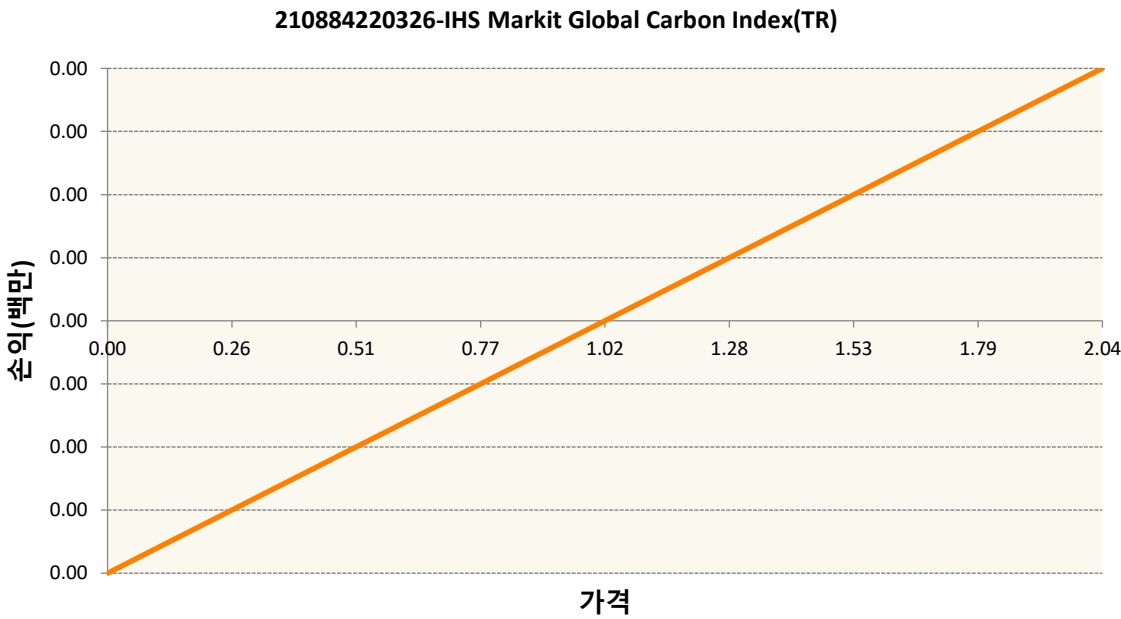
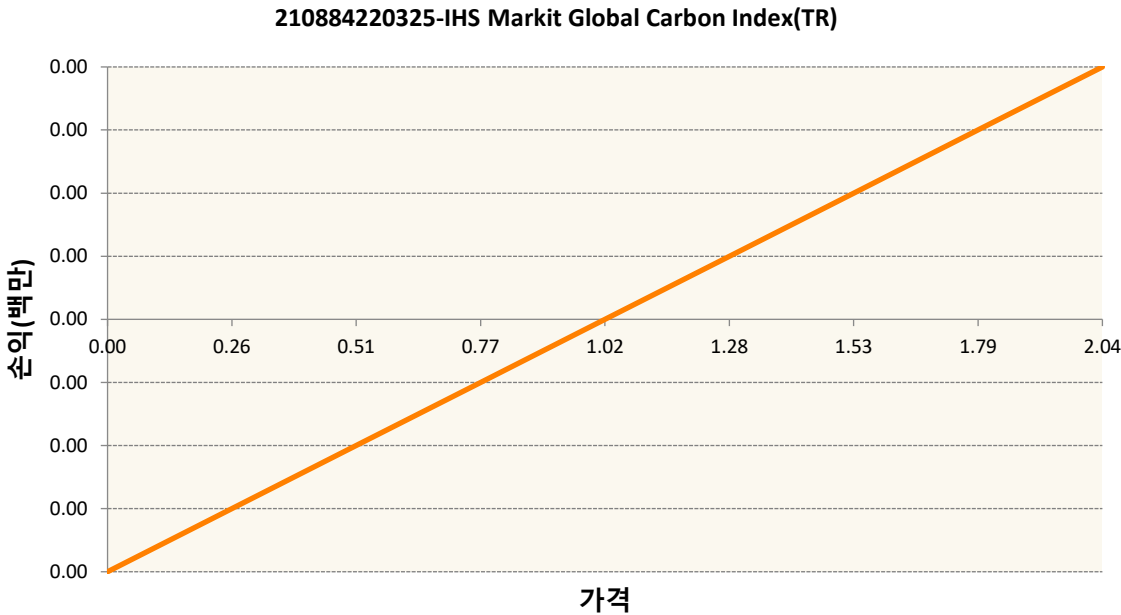
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

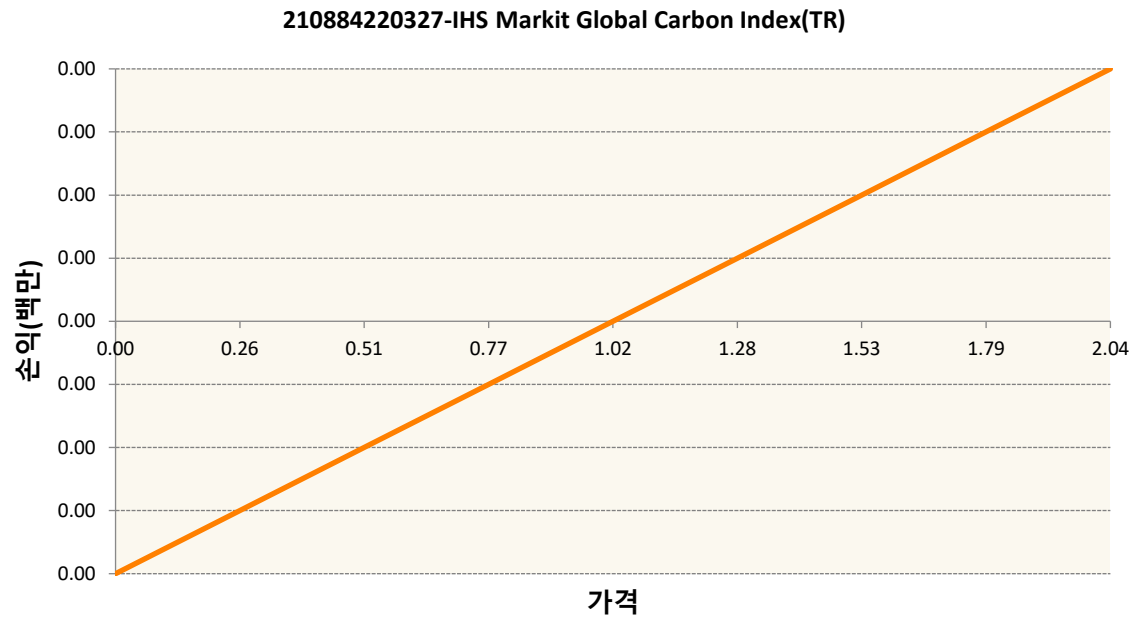
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	35,294	0	35,294	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		177
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		2,556
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		88

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		5,456

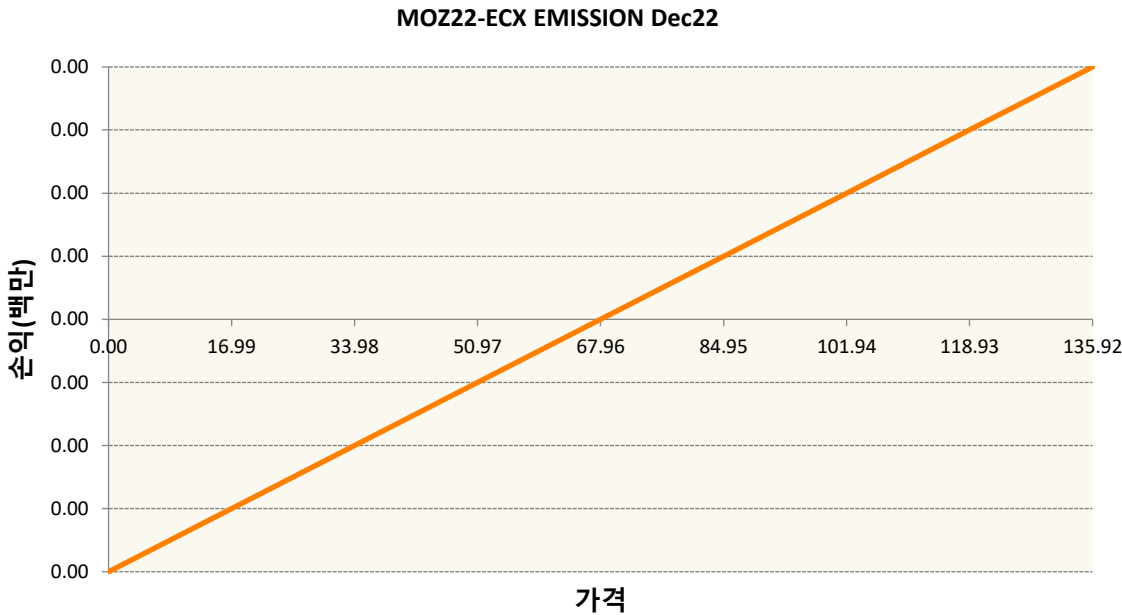
공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

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	11,543	0	11,543	
누계	통화	선도	0	5,387	-5,387	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213C9T(KRW/EUR 27-10-22E			431
MOZ22 ECX EMISSION Dec22			923

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,654

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

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)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	3

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

(단위:백만원)

21

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	13

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

(단위:백만원)

54

공시일	2022-09-29
기준일	2022-09-28

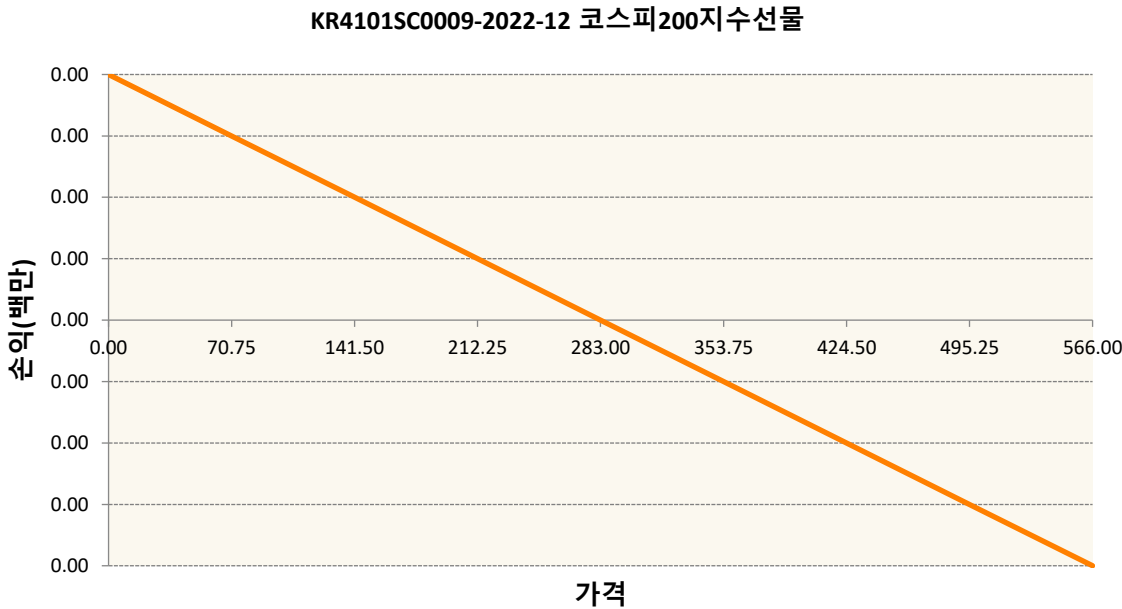
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,417	2,495	-1,078	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,415	-1,415	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.33
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	1
KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물	113

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

(단위:백만원)

123

공시일 2022-09-29

기준일 2022-09-28

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

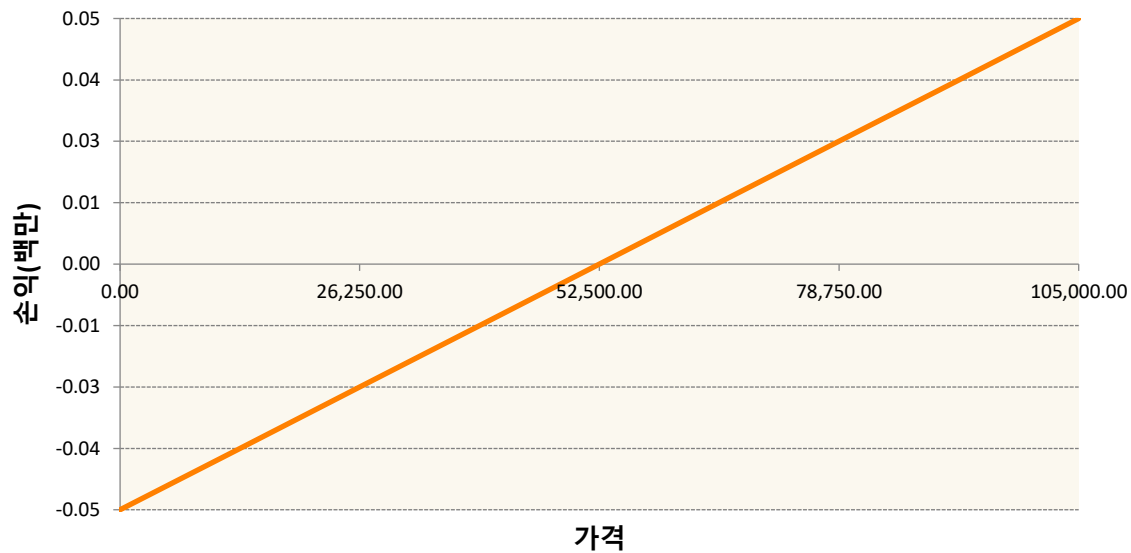
1. 계약금액

(단위:백만원)

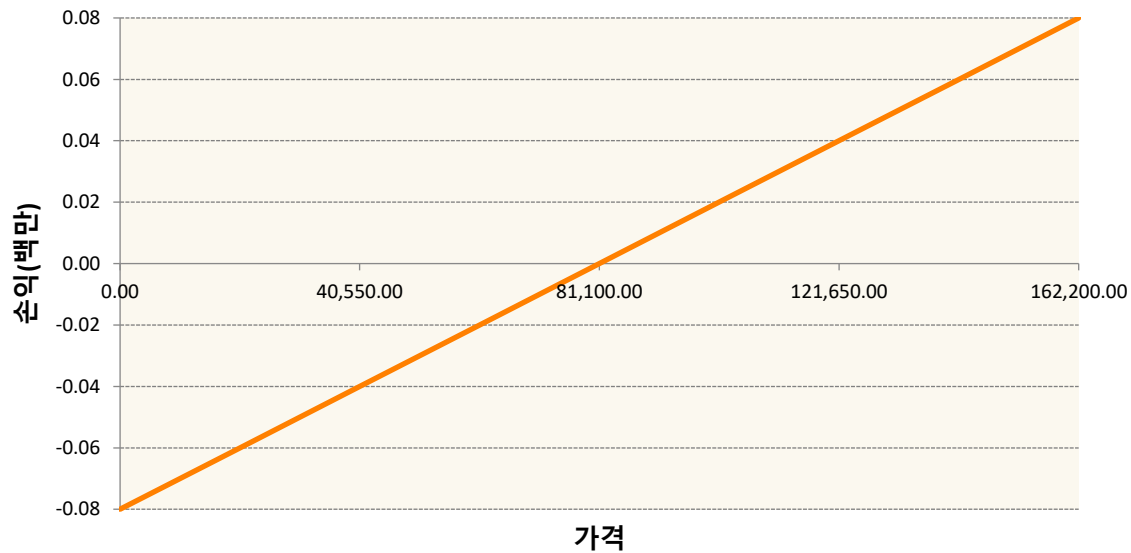
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	732	0	732	장내

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%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-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%	20	20	20	20	20	20	20
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)

68

공시일 2022-09-29

기준일 2022-09-28

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 2022-09-29

기준일 2022-09-28

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

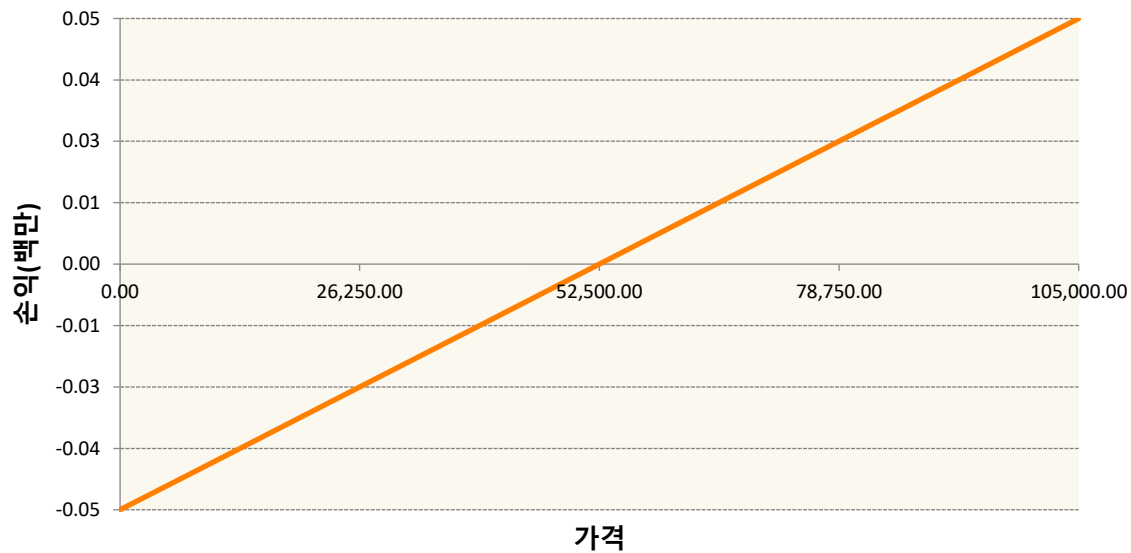
1. 계약금액

(단위:백만원)

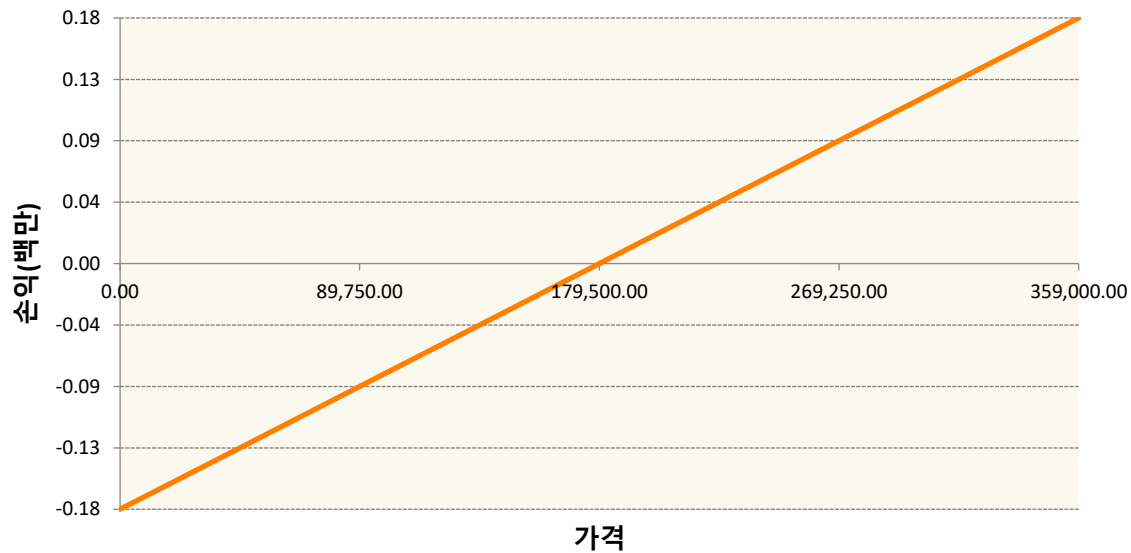
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	264	0	264	장내

2. 만기시점의 손익구조

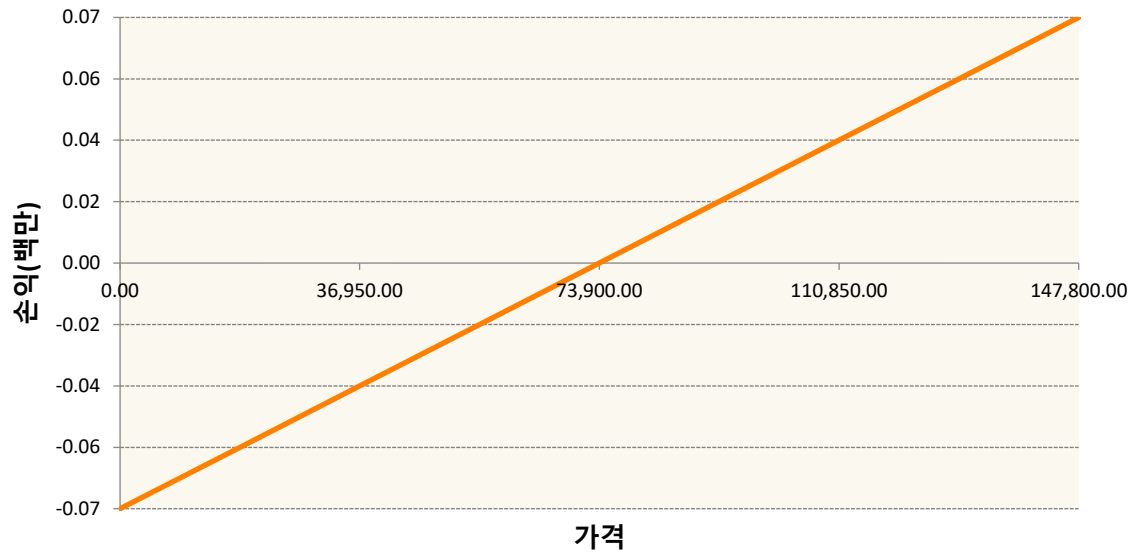
KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



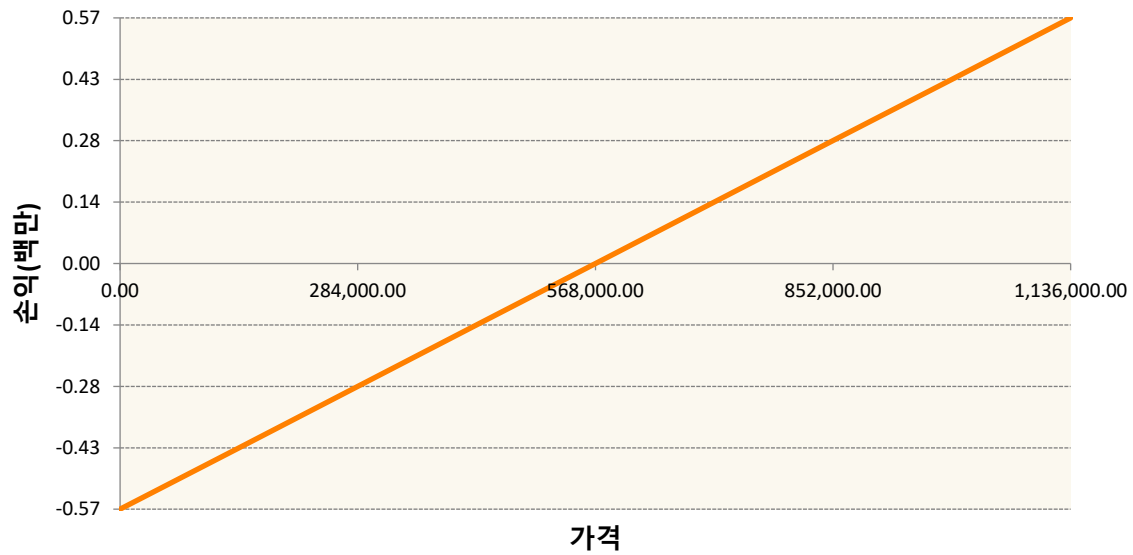
KR4116SA0004-2022-10 현대차개별선물



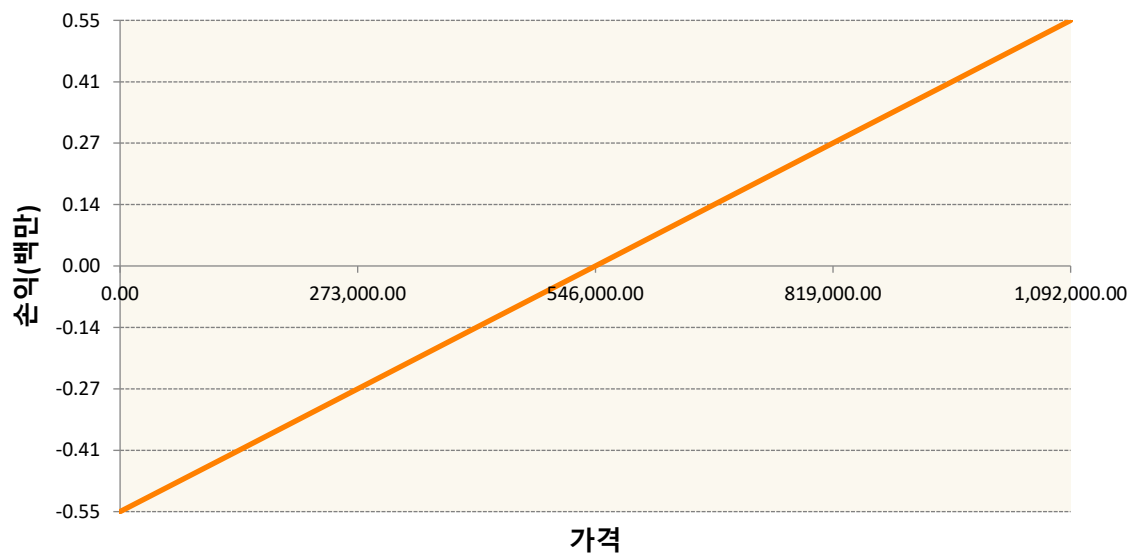
KR4119SA0001-2022-10 기아개별선물



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 2022-09-29

기준일 2022-09-28

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

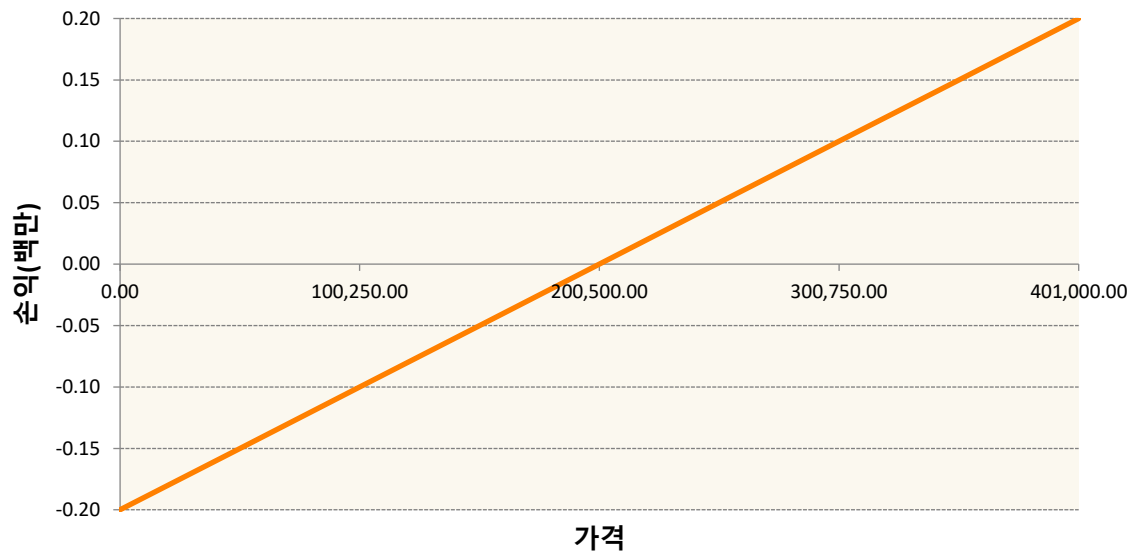
1. 계약금액

(단위:백만원)

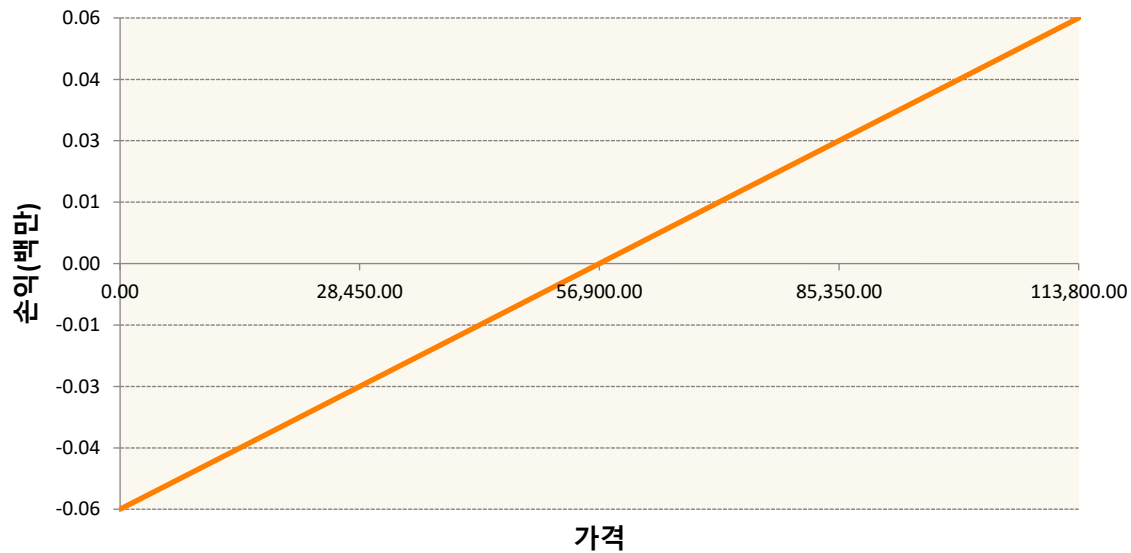
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	169	0	169	장내

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					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%	-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%	5	5	5	5	5	5	5

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

24

공시일 2022-09-29

기준일 2022-09-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

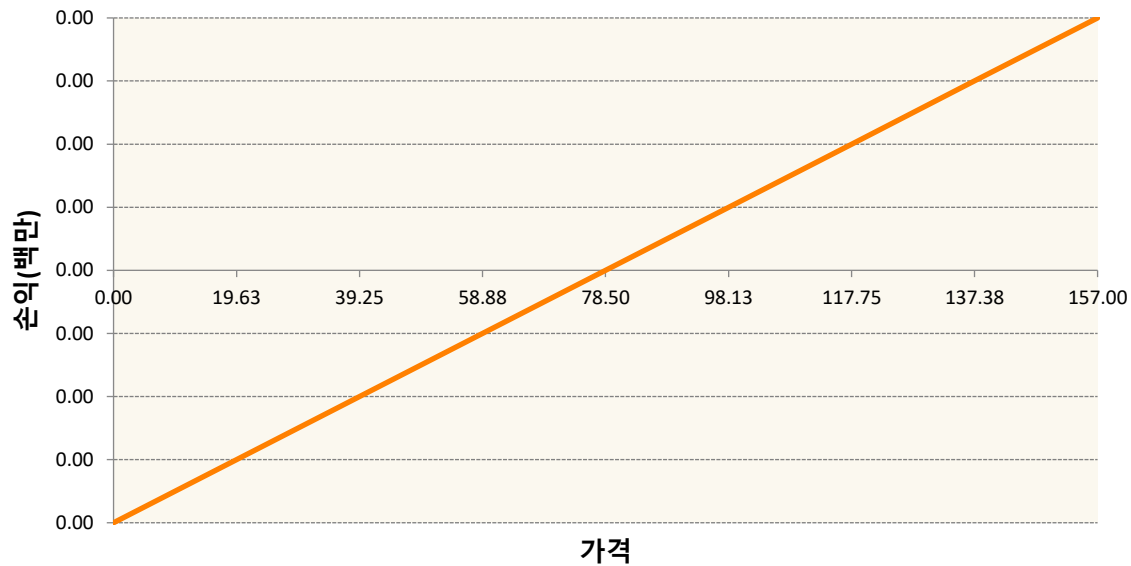
1. 계약금액

(단위:백만원)

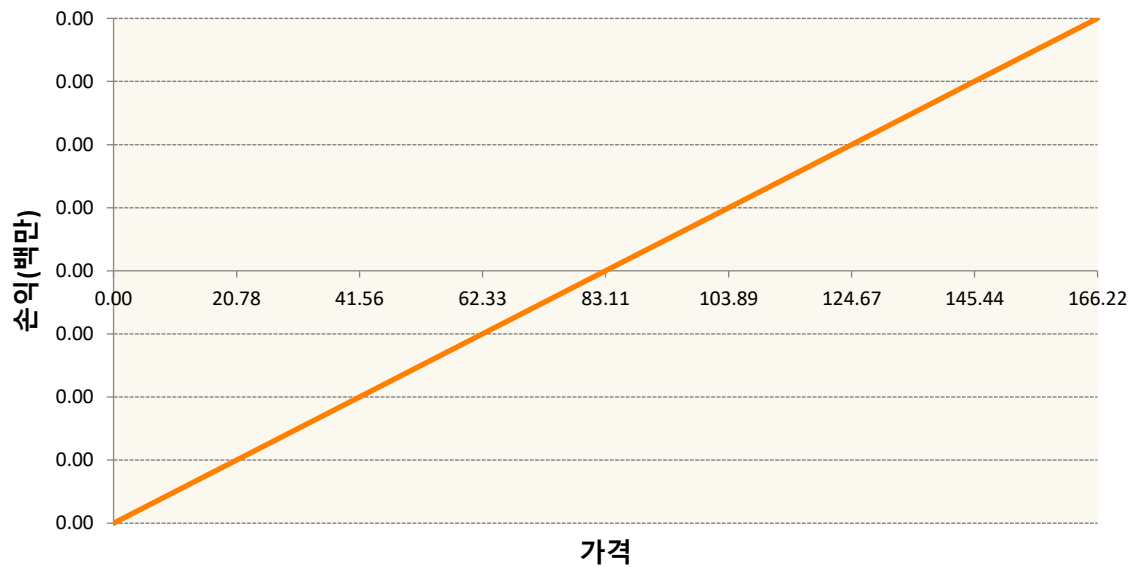
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,569	216	1,353	

2. 만기시점의 손익구조

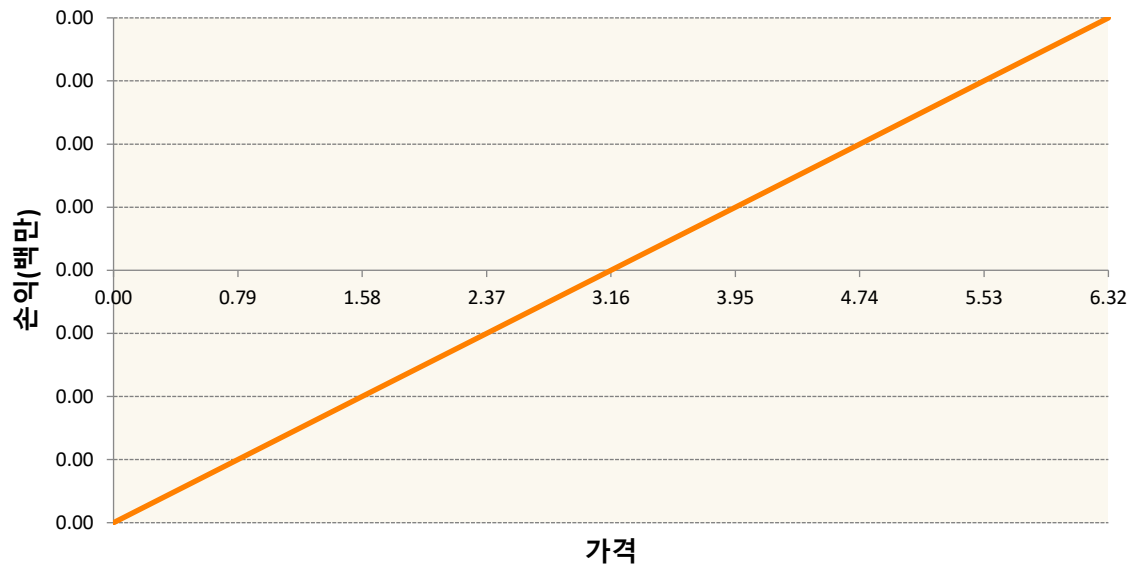
CLX2-WTI CRUDE FUTURE Nov22



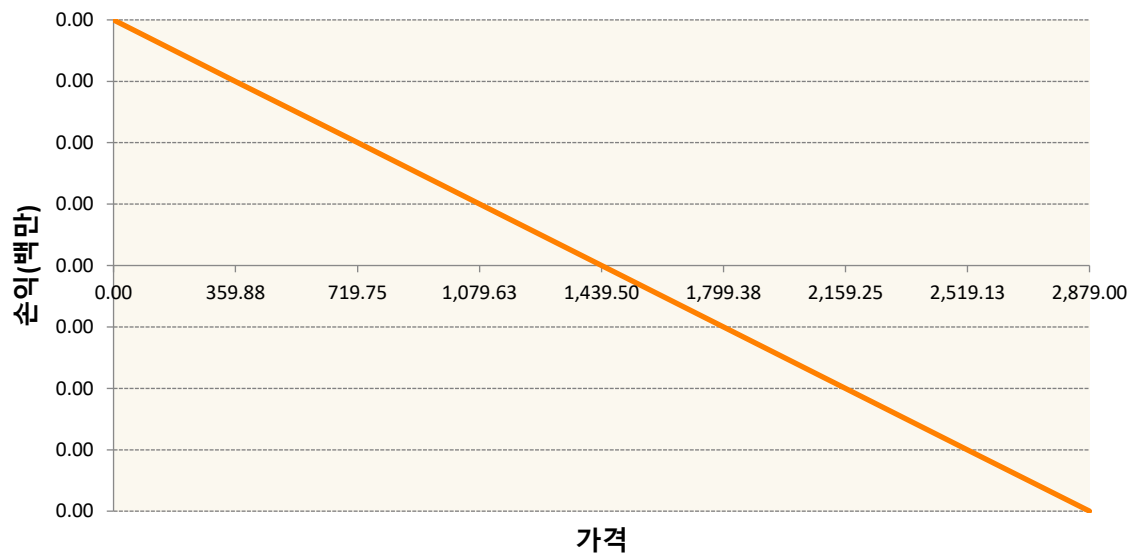
COF3-BRENT CRUDE FUTR JAN23



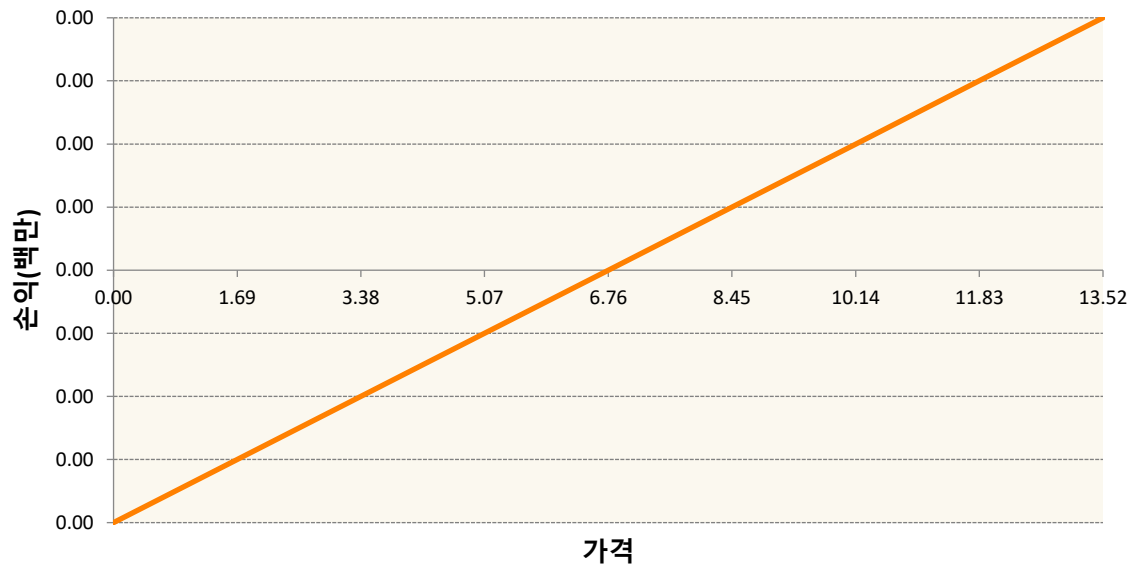
HOX2-NY Harb ULSD Fut Nov22

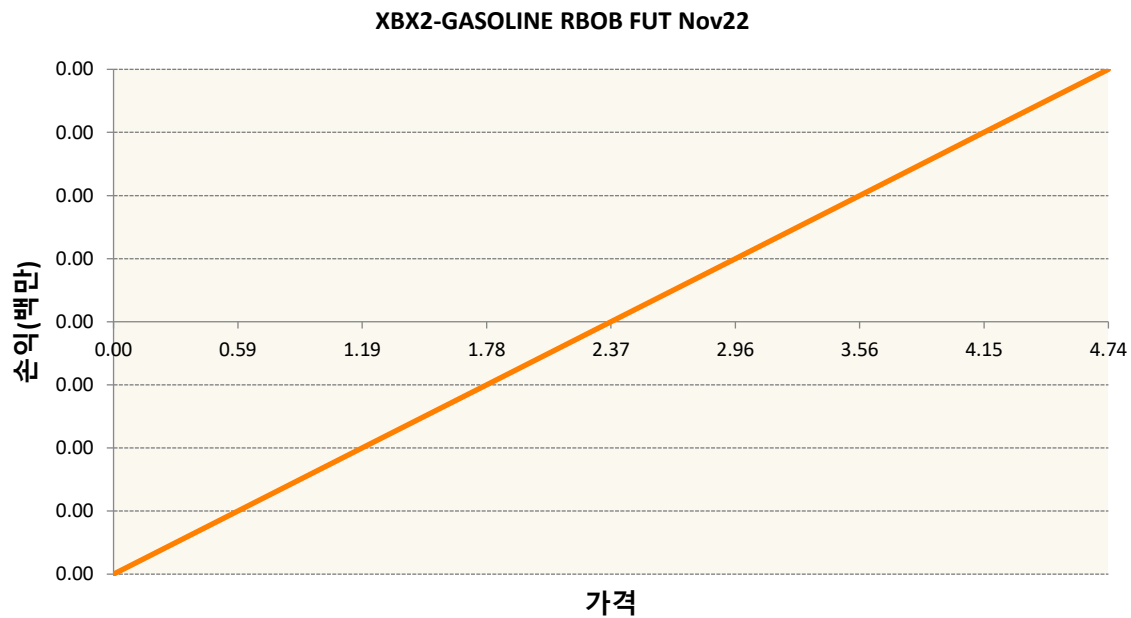
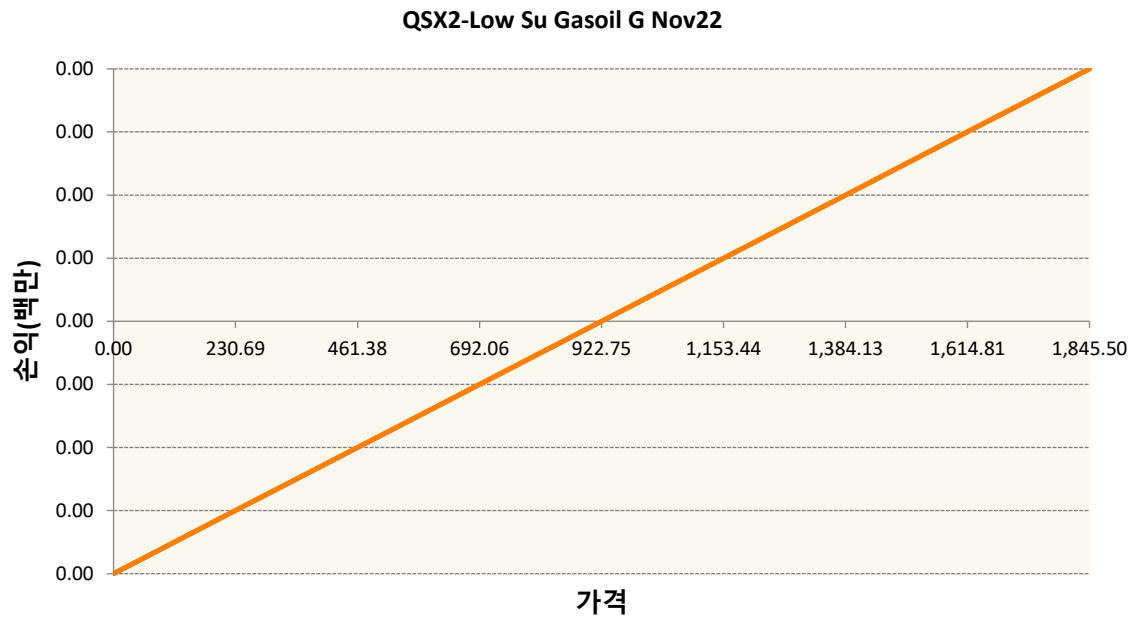


KR4175SA0002-2022-10 달러선물



NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLX2	WTI CRUDE FUTURE Nov22		16
COF3	BRENT CRUDE FUTR JAN23		28
HOX2	NY Harb ULSD Fut Nov22		14
KR4175SA00 2022-10 달러선물			17
NGX22	NATURAL GAS FUTR Nov22		48
QX2	Low Su Gasoil G Nov22		10
XB2	GASOLINE RBOB FUT Nov22		10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		410