

공시일 2022-10-05

기준일 2022-10-04

포커스농산물모(채권-파생형)

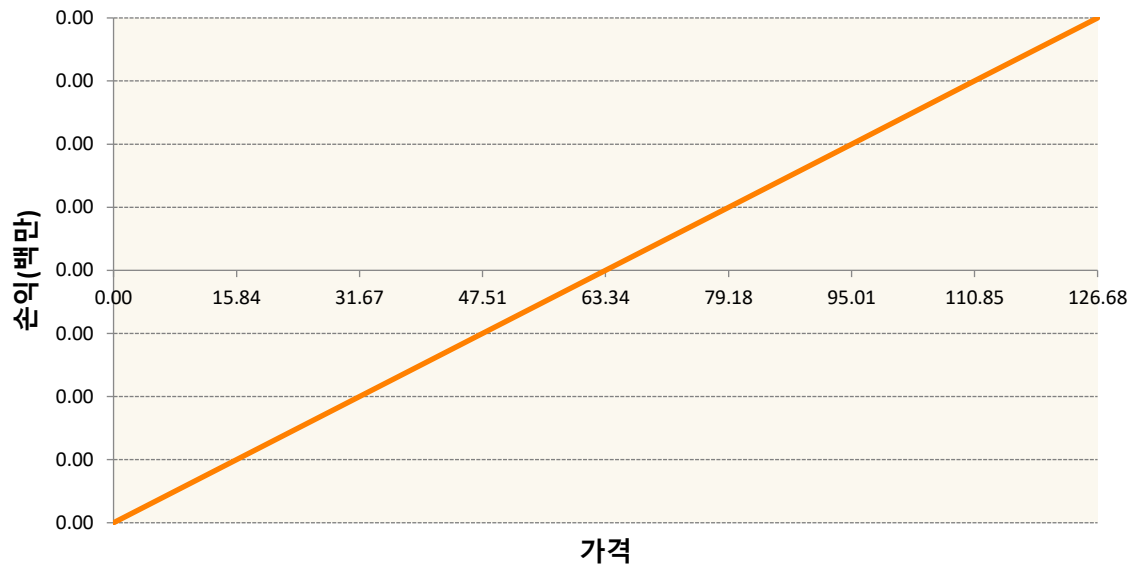
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

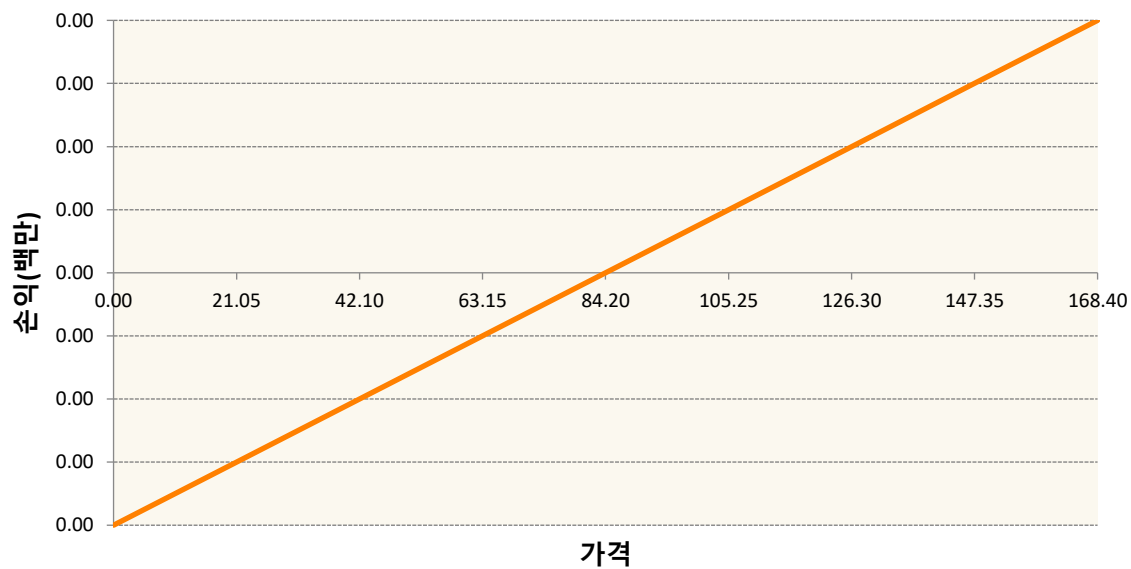
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,375	855	5,520	

2. 만기시점의 손익구조

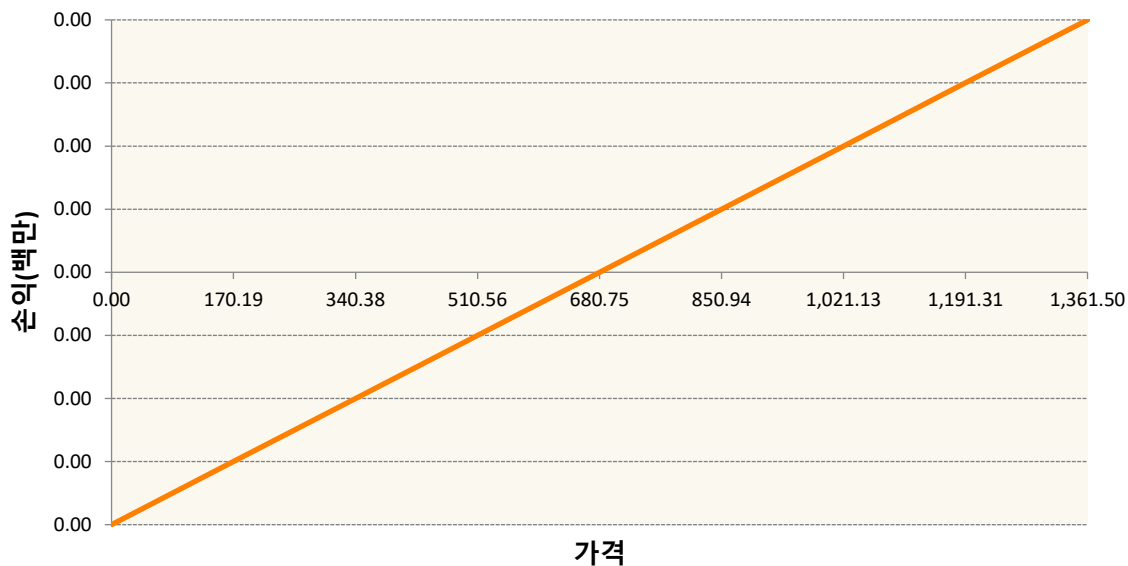
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



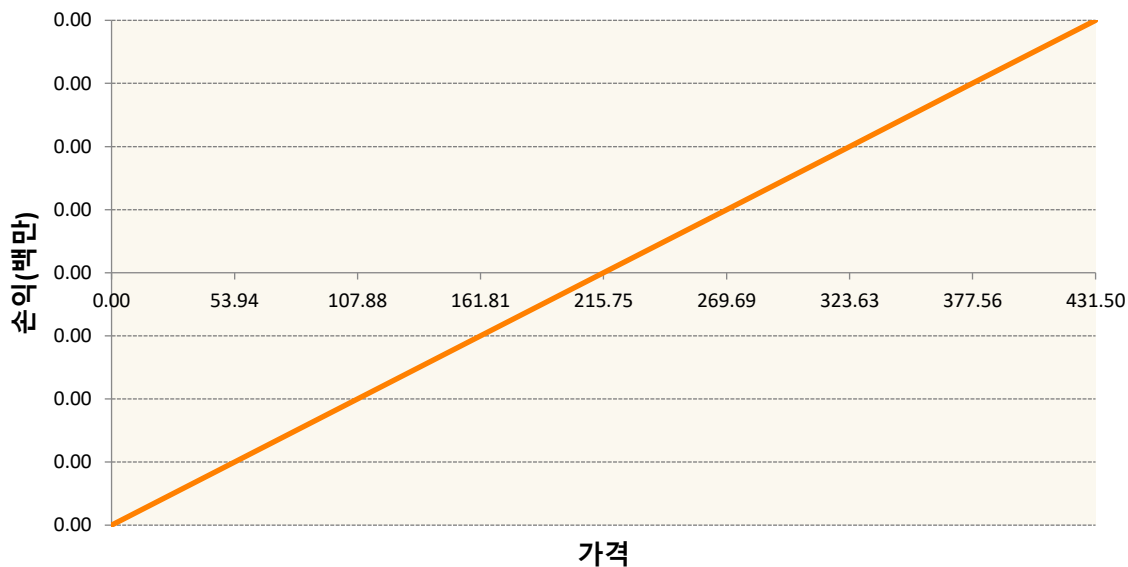
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



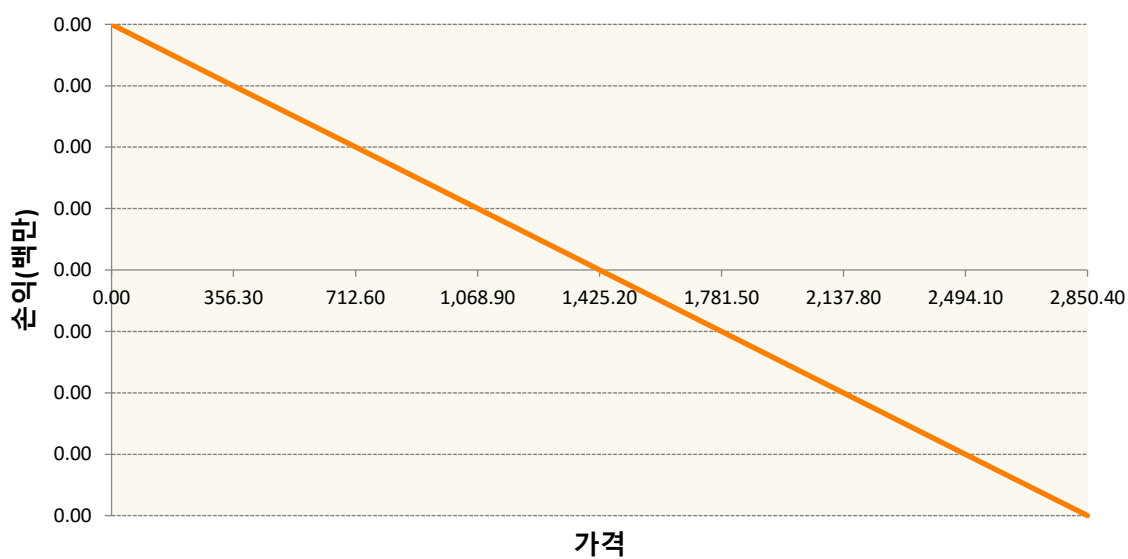
CZ2-CORN FUTURE Dec22



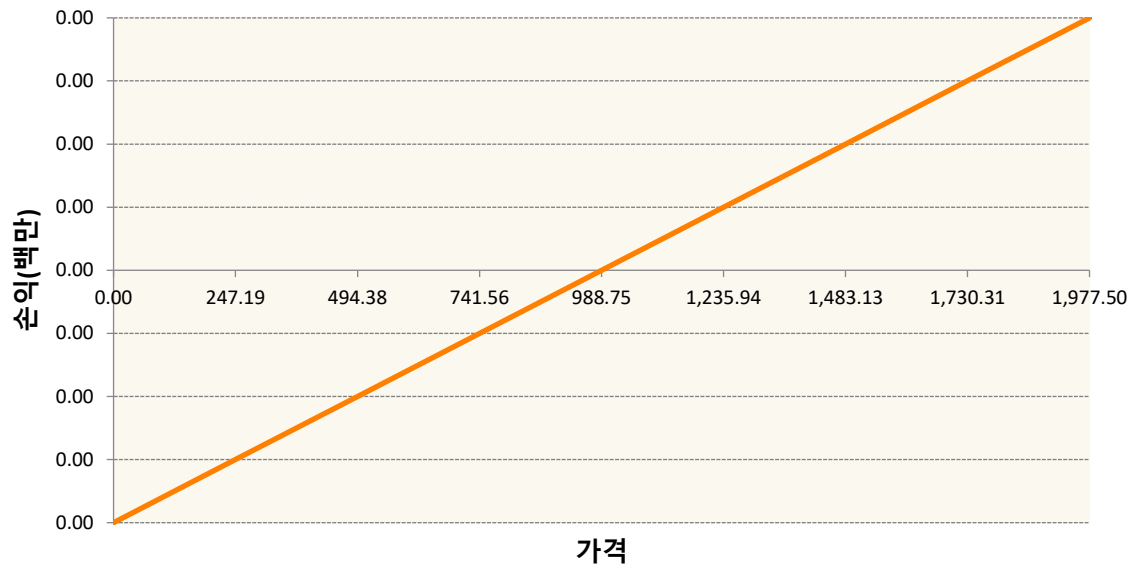
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



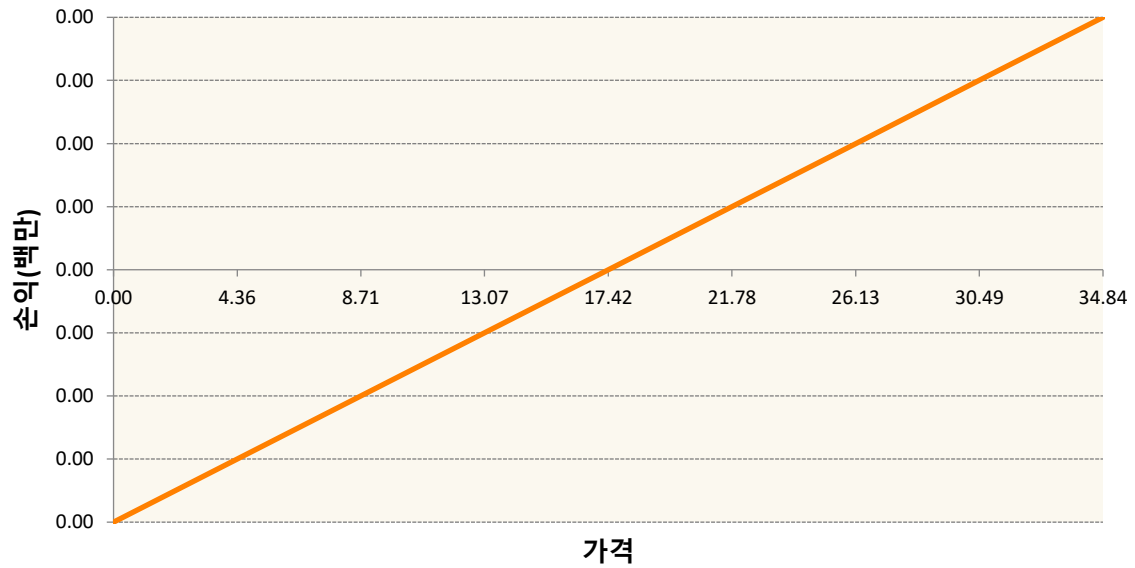
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



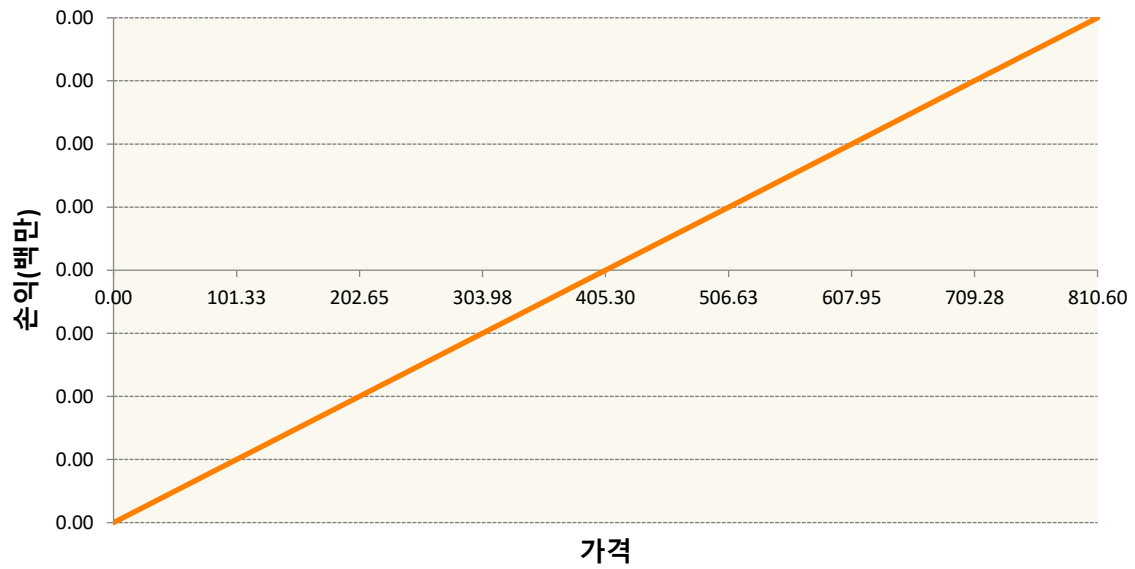
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

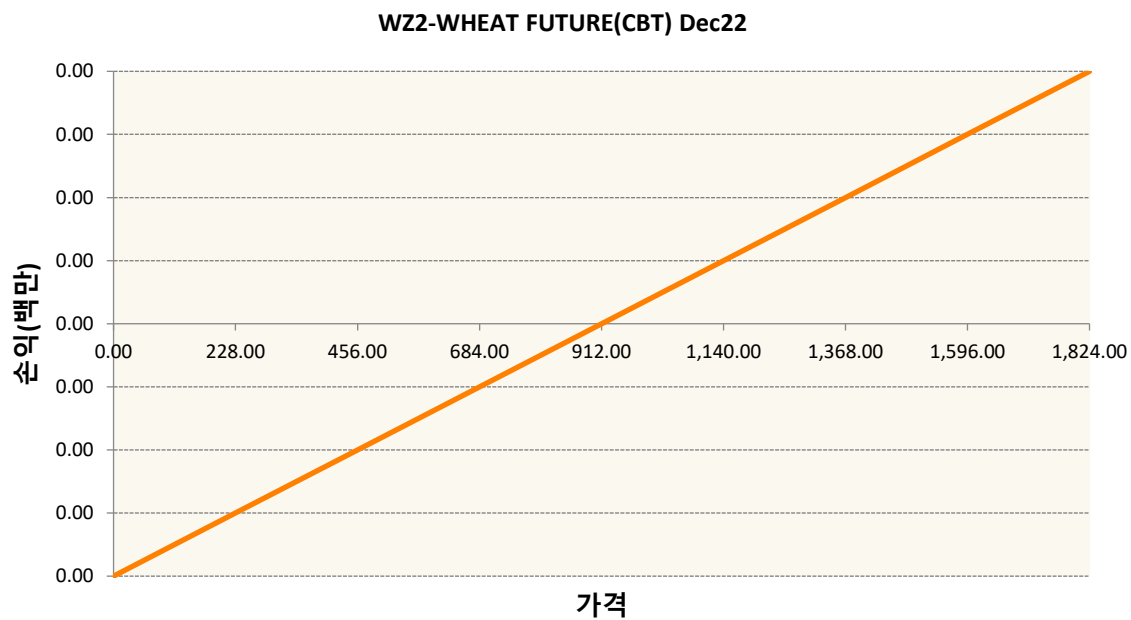
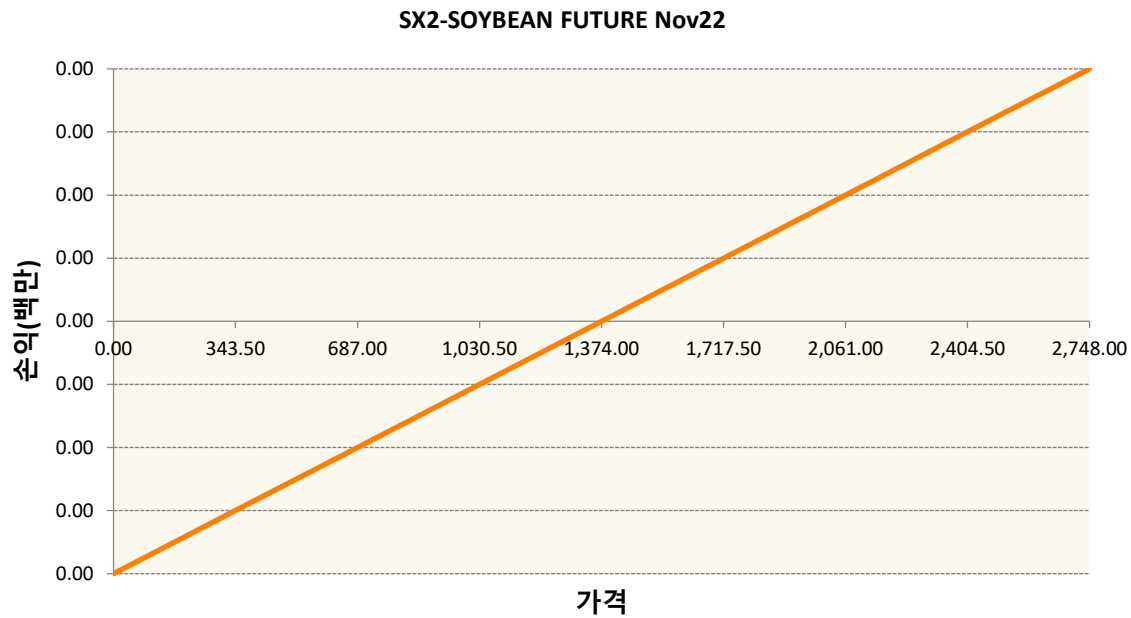


SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



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	2022-10-05
기준일	2022-10-04

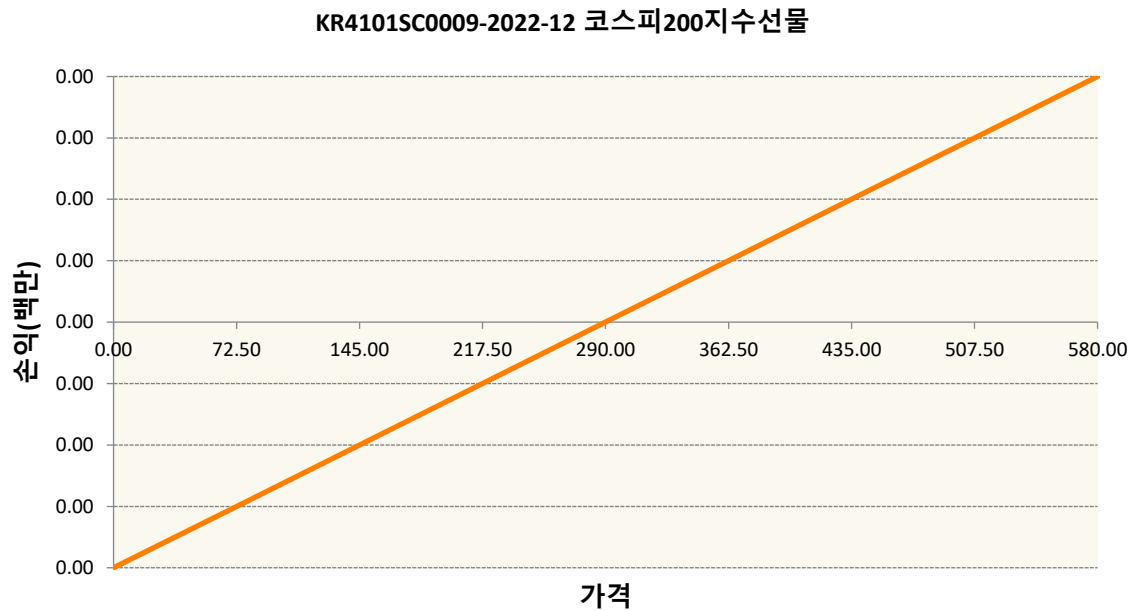
스마트인덱스모

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	943	0	943	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				75
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-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%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	75	75	75	75	75	75	75

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

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	319
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

423

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

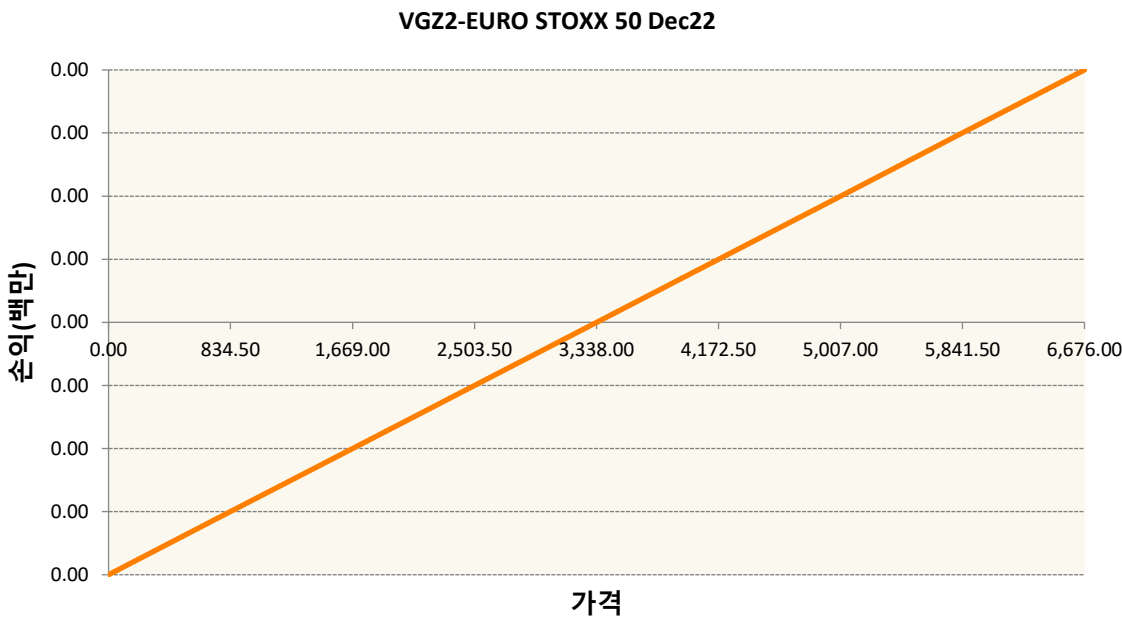
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	463	0	463	

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	2022-10-05
기준일	2022-10-04

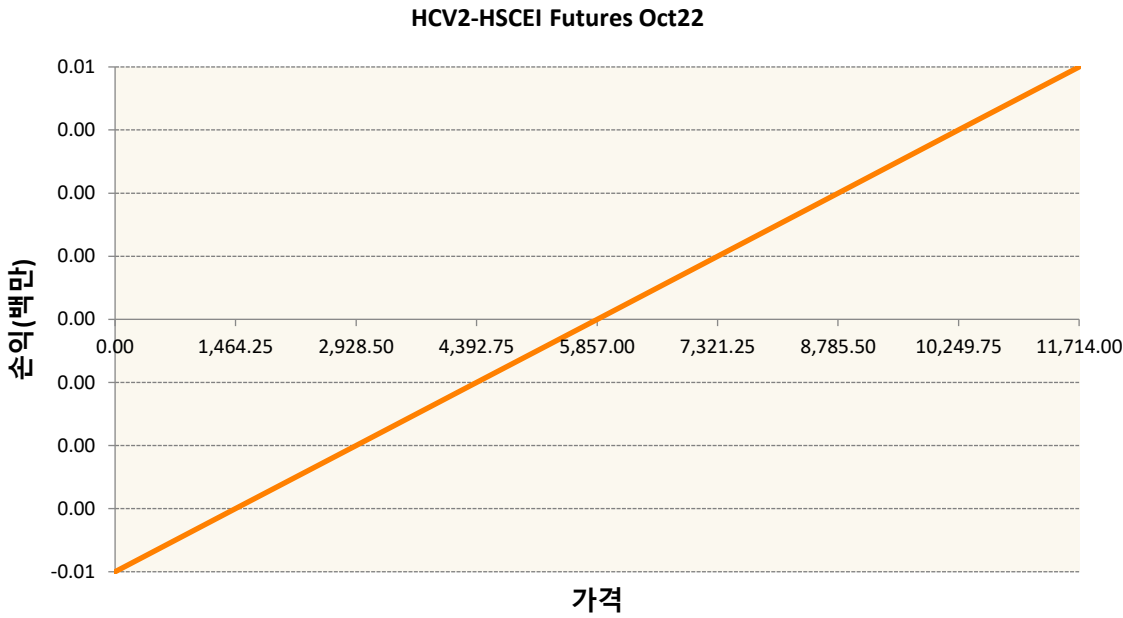
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	914	0	914	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV2	HSCEI Futures Oct22	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

107

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

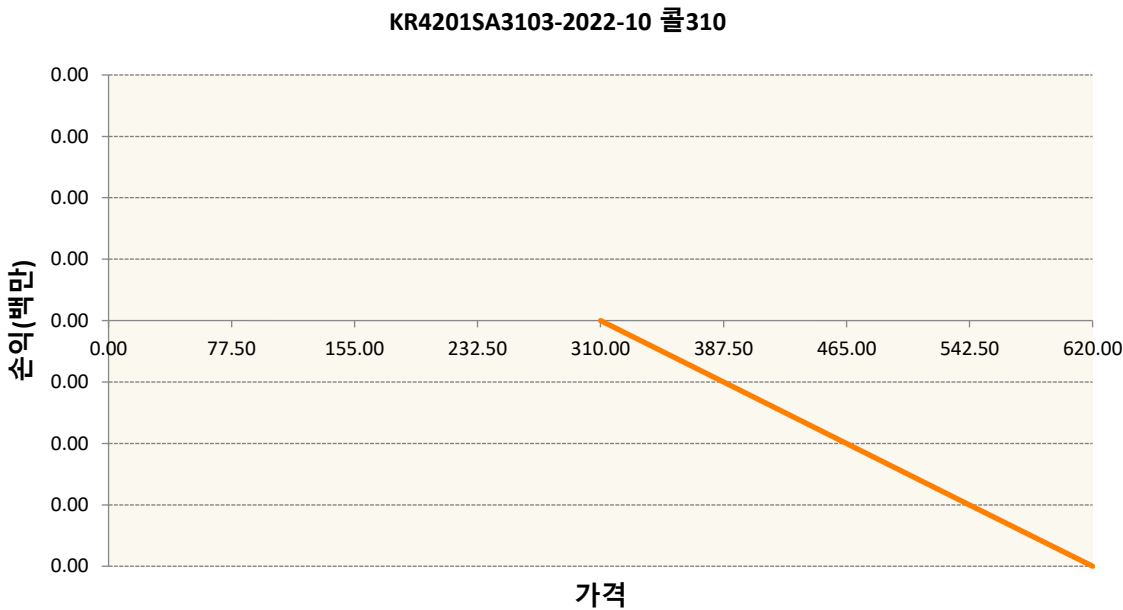
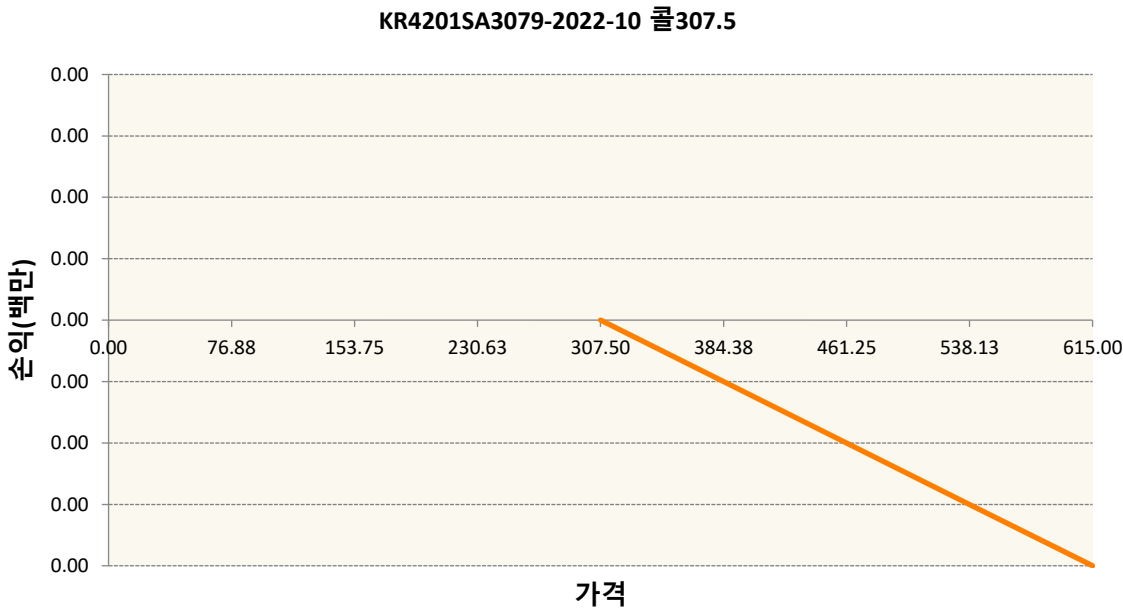
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

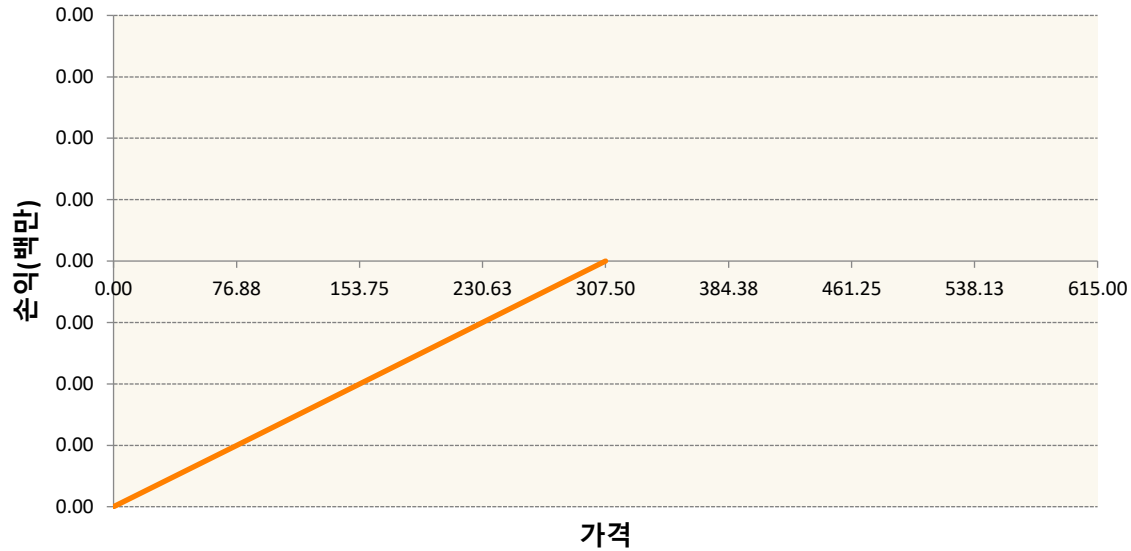
(단위:백만원)

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						366
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	68	66	64	61	58	53	
-5.33%	67	64	61	56	50	43	34	
-2.67%	60	54	46	37	27	15	2	
0%	40	28	15	0	-16	-33	-50	
2.67%	-5	-24	-43	-64	-84	-106	-127	
5.33%	-90	-114	-137	-161	-184	-208	-232	
8.00%	-223	-247	-271	-294	-318	-342	-366	
KR4201SA3103		2022-10 콜310						1,169
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	192	191	188	182	174	163	148	
-5.33%	188	183	173	160	142	121	95	
-2.67%	172	156	134	107	75	39	-2	
0%	122	87	46	0	-50	-104	-161	
2.67%	-4	-62	-125	-190	-258	-328	-400	
5.33%	-252	-330	-410	-490	-571	-652	-733	
8.00%	-660	-745	-829	-914	-999	-1,084	-1,169	
KR4301SA3078		2022-10 풋307.5						725
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-710	-710	-712	-714	-717	-720	-725	
-5.33%	-452	-454	-458	-463	-469	-476	-484	
-2.67%	-199	-205	-213	-222	-233	-245	-257	
0%	40	28	15	0	-16	-33	-50	

2.67%	254	235	216	196	175	154	132
5.33%	428	405	381	358	334	310	287
8.00%	555	531	507	483	460	436	411

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

(단위:백만원)

1,844

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

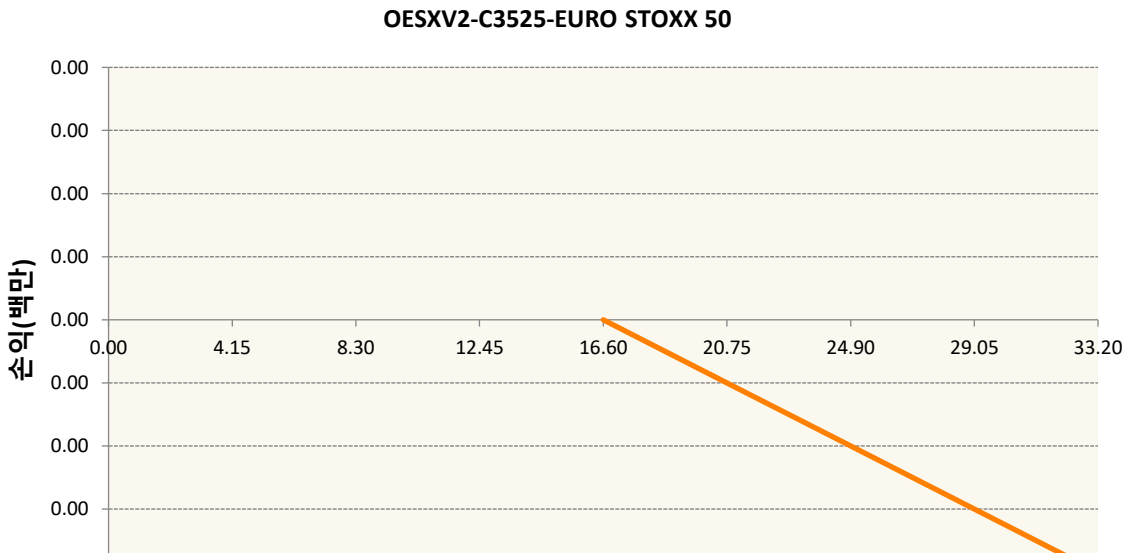
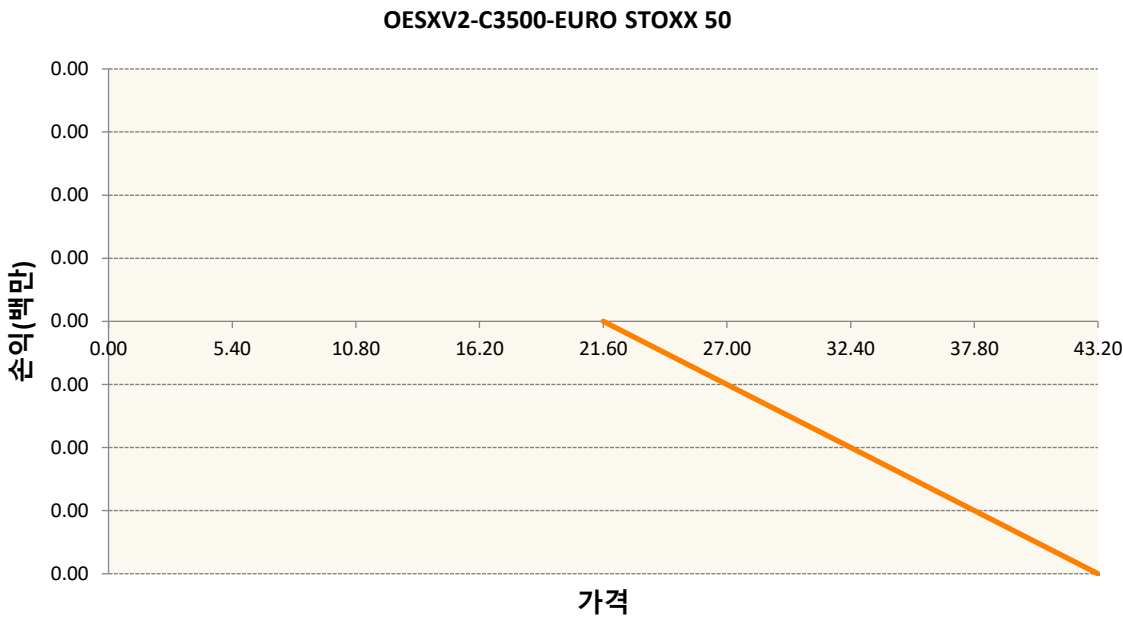
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

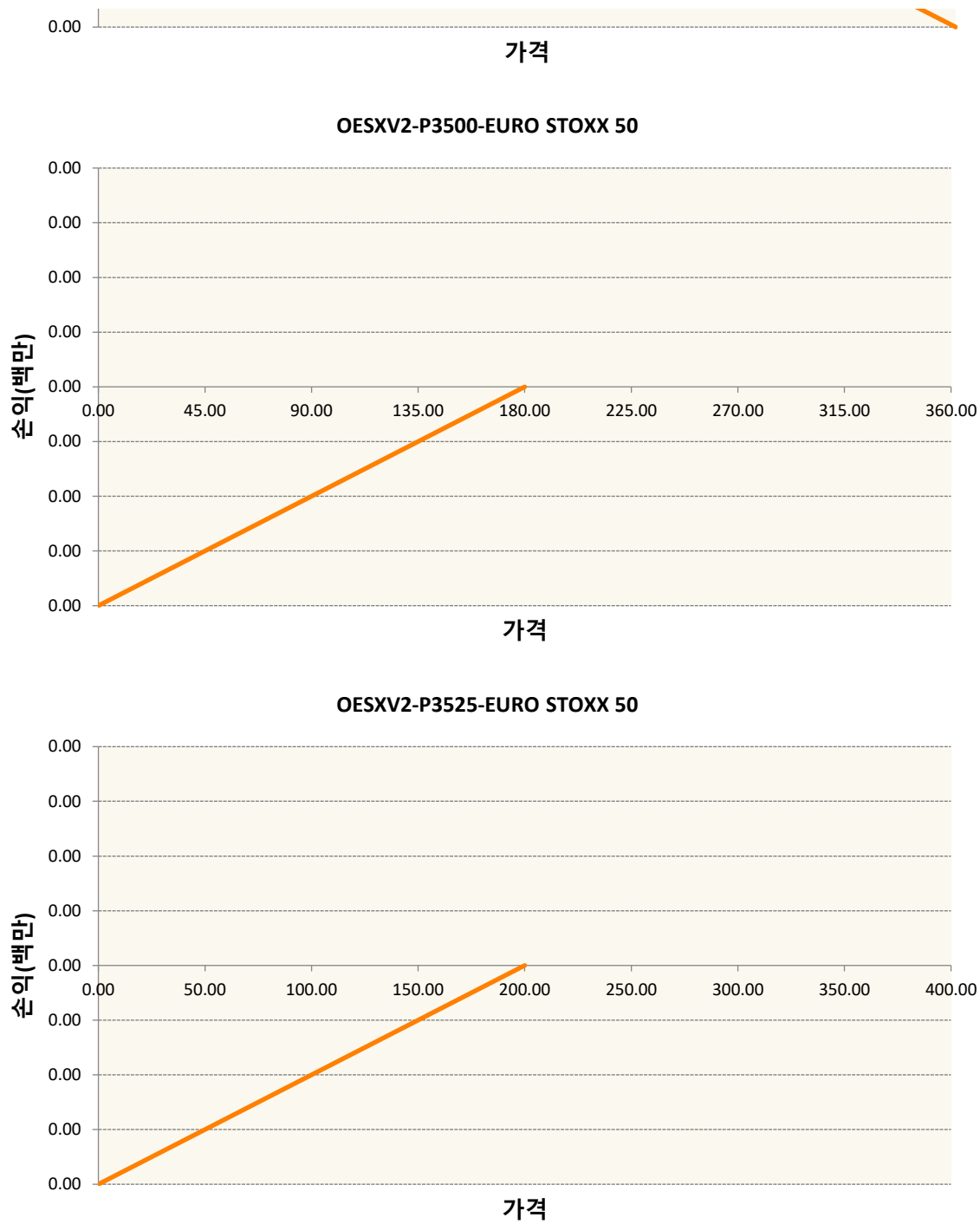
1. 계약금액

(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	915	-915	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

9
73
0.29
0.02
2
1

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

(단위:백만원)

공시일 2022-10-05

기준일 2022-10-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

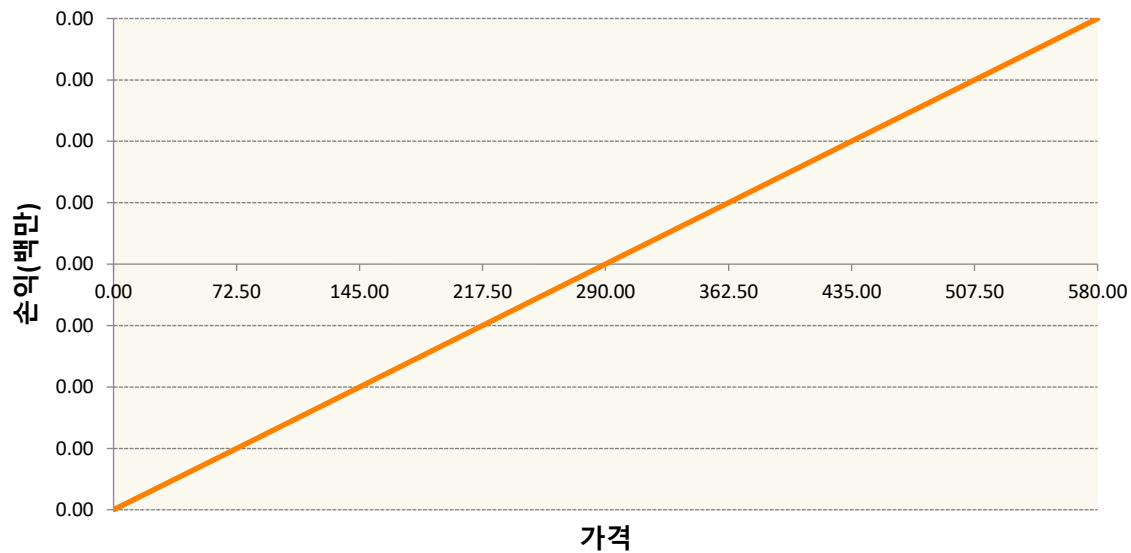
1. 계약금액

(단위:백만원)

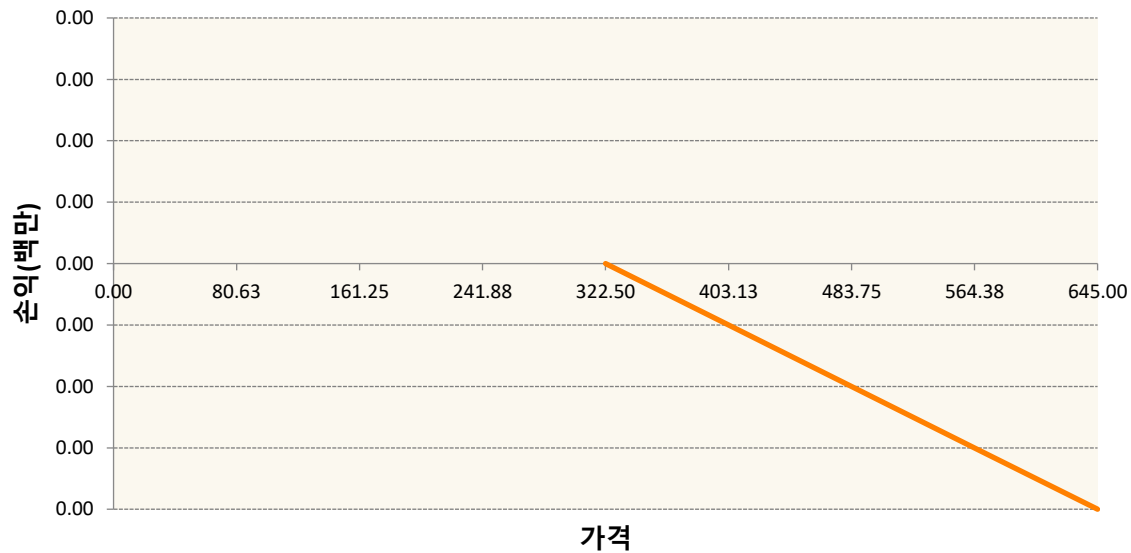
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	290	0	290	장내
누계	유가증권	옵션	308	4,219	-3,911	장내

2. 만기시점의 손익구조

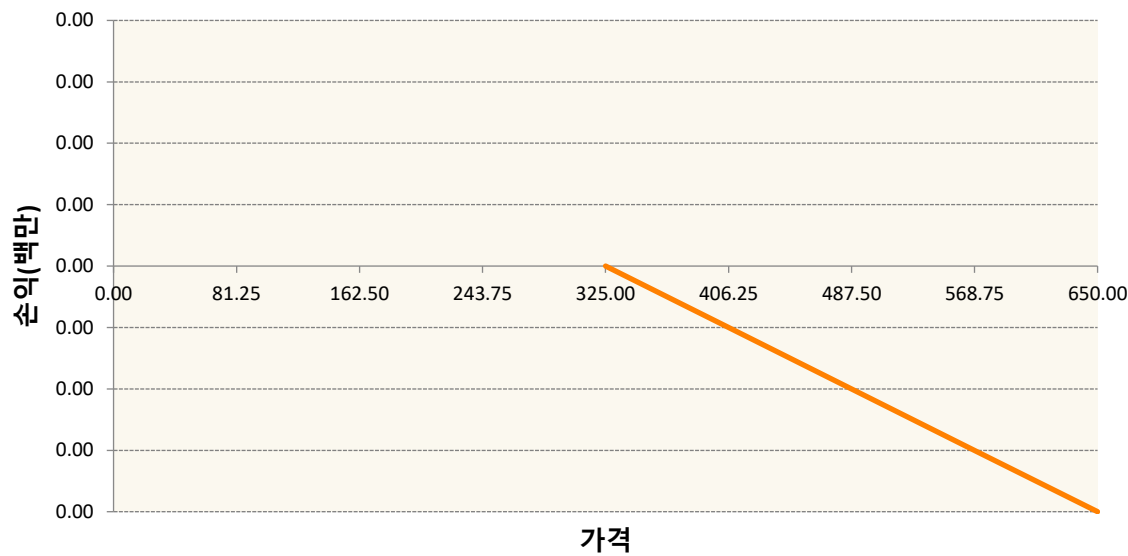
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



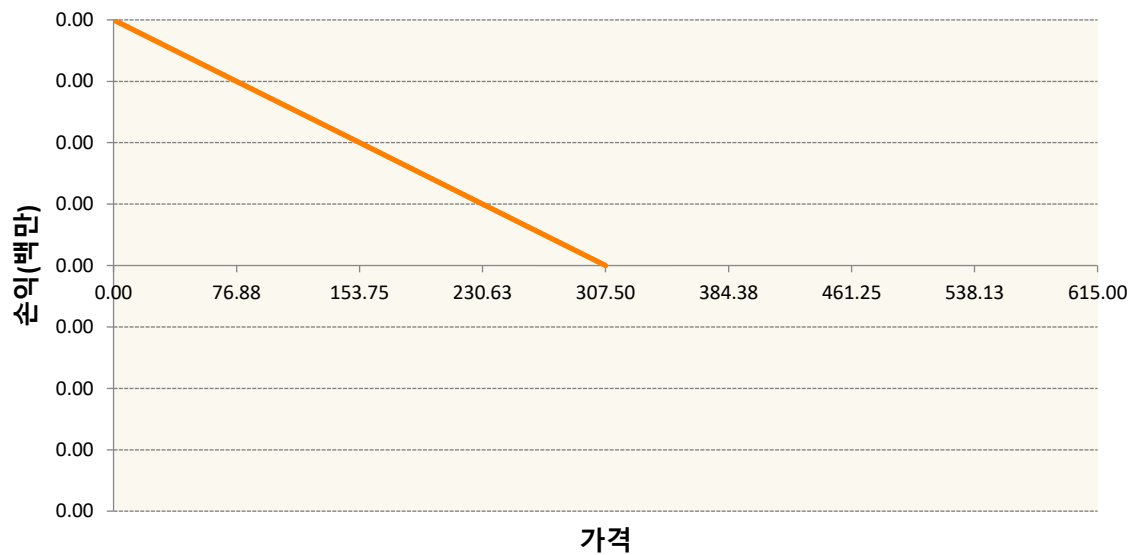
KR4201SA3228-2022-10 콜322.5



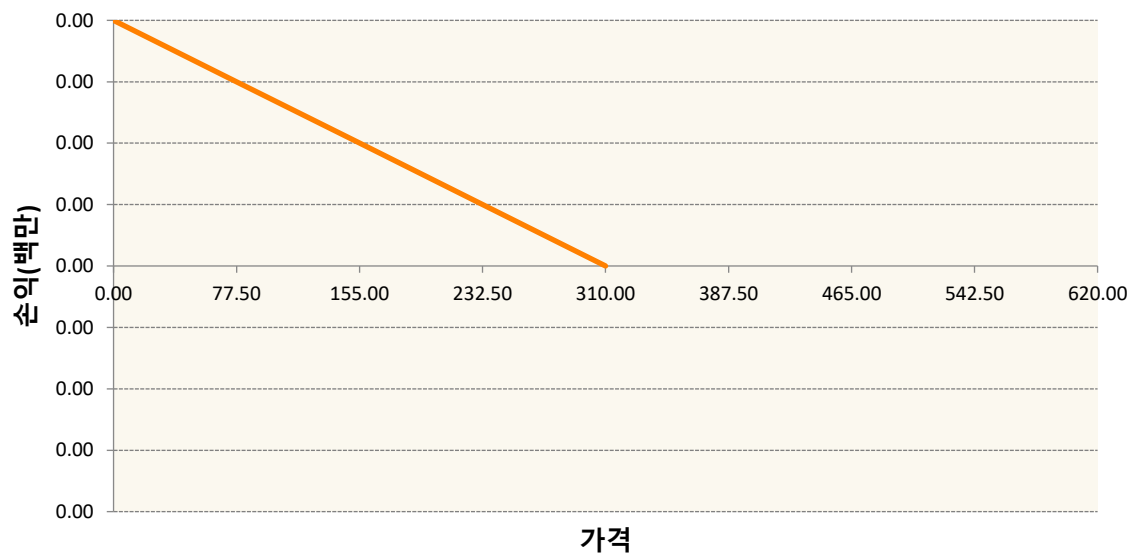
KR4201SA3251-2022-10 콜325



KR4301SA3078-2022-10 풋307.5



KR4301SA3102-2022-10 풋310



(단위:백만원)

KR4101SC0009							2022-12 코스피200지수선물		23		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23				
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15				
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	8	8	8	8	8	8	8				
5.33%	15	15	15	15	15	15	15				
8.00%	23	23	23	23	23	23	23				
KR4201SA3228							2022-10 콜322.5		13		
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	0			
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0	0			
0%	1	1	0	0	0	-1	-2	-2			
2.67%	0	0	-1	-1	-2	-3	-4	-4			
5.33%	-1	-2	-3	-4	-5	-7	-8	-8			
8.00%	-5	-6	-7	-9	-10	-12	-13	-13			
KR4201SA3251							2022-10 콜325		56		
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	3			
-5.33%	4	4	4	4	3	3	2	2			
-2.67%	4	4	3	3	2	0	-1	-1			
0%	3	3	2	0	-2	-4	-7	-7			
2.67%	1	0	-3	-6	-9	-13	-17	-17			
5.33%	-4	-8	-12	-17	-22	-27	-33	-33			
8.00%	-17	-23	-29	-36	-42	-49	-56	-56			
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	16			
-5.33%	10	10	10	10	10	11	11	11			
-2.67%	4	5	5	5	5	5	6	6			
0%	-1	-1	0	0	0	1	1	1			
2.67%	-6	-5	-5	-4	-4	-3	-3	-3			
5.33%	-10	-9	-8	-8	-7	-7	-6	-6			
8.00%	-12	-12	-11	-11	-10	-10	-9	-9			
KR4301SA3102							2022-10 풋310		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	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	-1	-1	-1
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-2	-2
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-3	-3

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

(단위:백만원)

78

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

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	7,306	0	7,306	

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	2022-10-05
기준일	2022-10-04

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	6,108	0	6,108	

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	2022-10-05
기준일	2022-10-04

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	138	-138	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	18,628	0	18,628	
누계	통화	선도	1,213	20,720	-19,507	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C7R· KRW/USD 27-10-22E	489
FXW213C8R· KRW/USD 28-11-22E	638
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	531
FXW213C9V(USD/KRW 27-10-22E	74
FXW213C9X(USD/KRW 27-10-22E	23
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

732

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

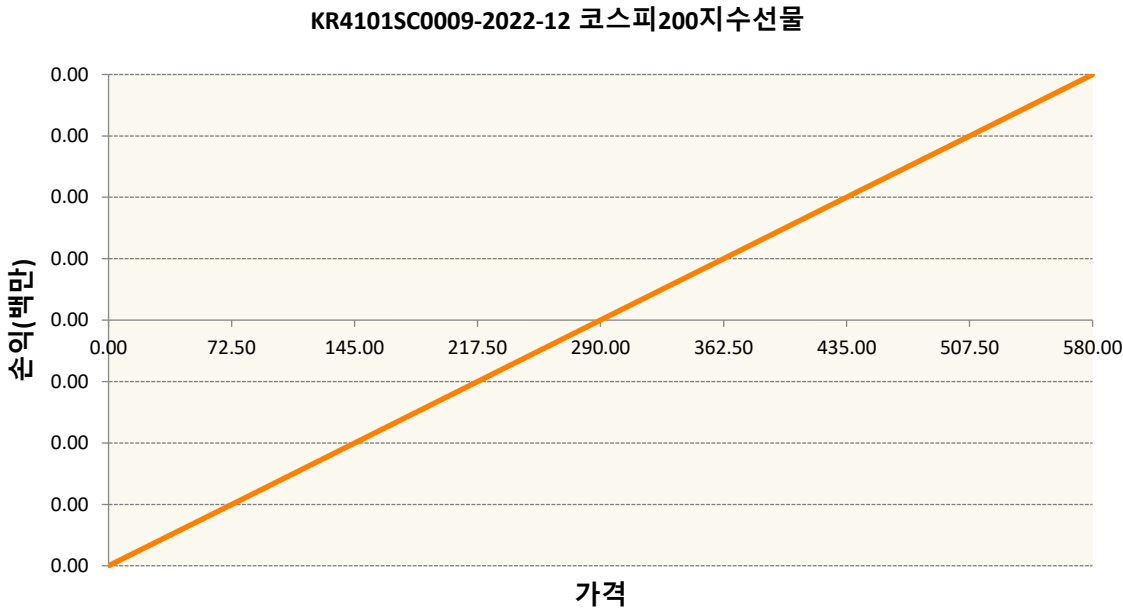
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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 2022-10-05

기준일 2022-10-04

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

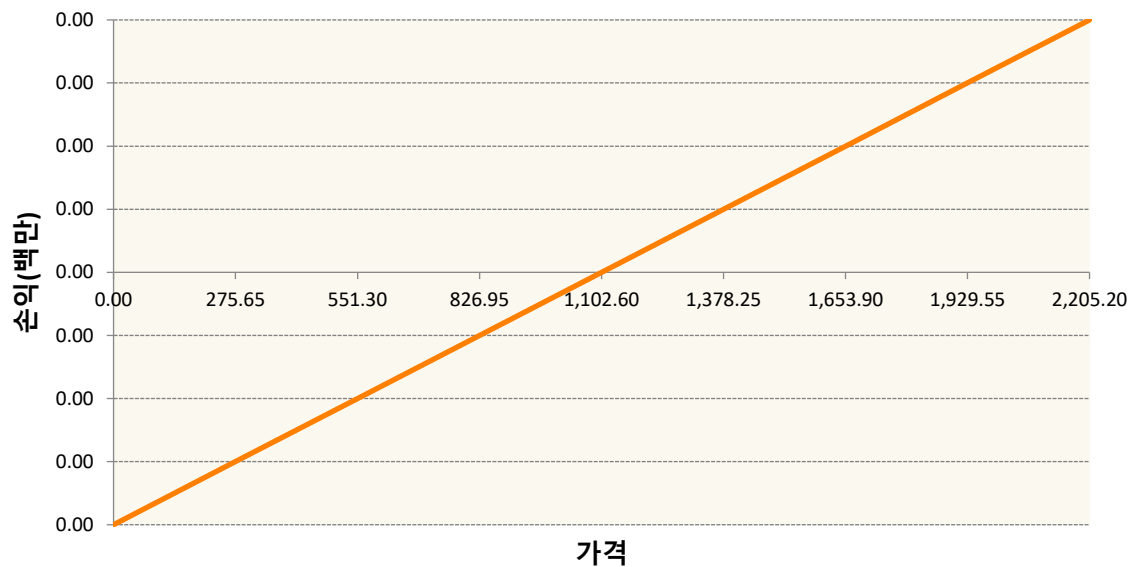
1. 계약금액

(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	537	0	537	
누계	유가증권	스왑	1,732	0	1,732	장외
누계	통화	선도	239	1,126	-887	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCV2-VN30 Index Future OCT22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	139
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	32
FXW213C9M KRW/EUR 23-12-22E	23
FXW213C9X EUR/KRW 21-10-22E	8
FXW213CA4 EUR/KRW 21-10-22E	11
VNCV2 VN30 Index Future OCT22	43

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

(단위:백만원)

259

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

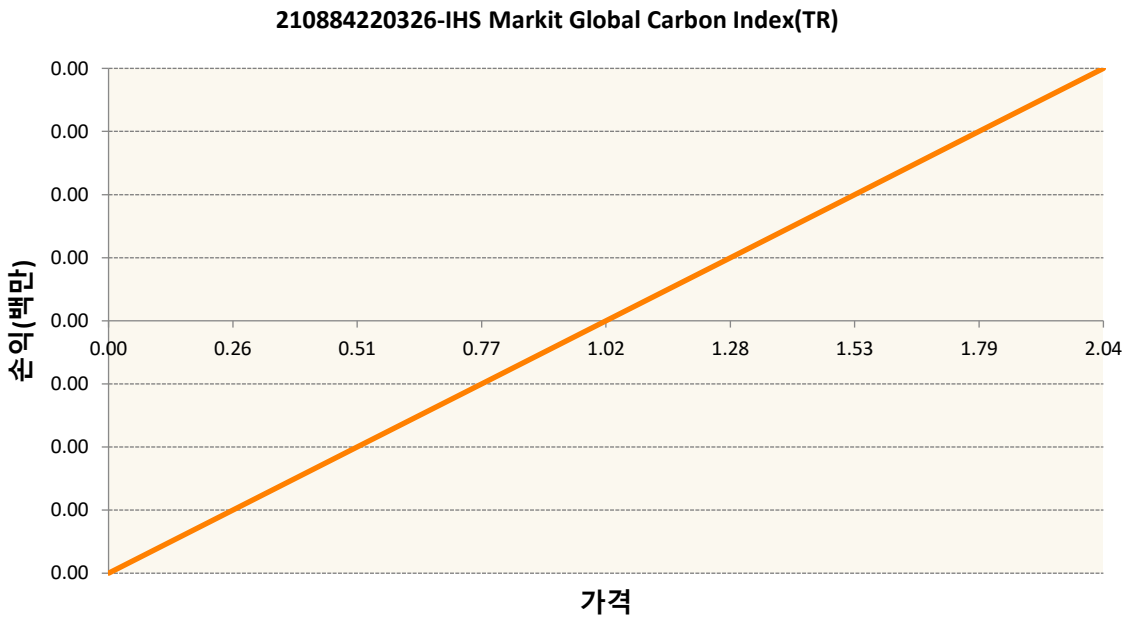
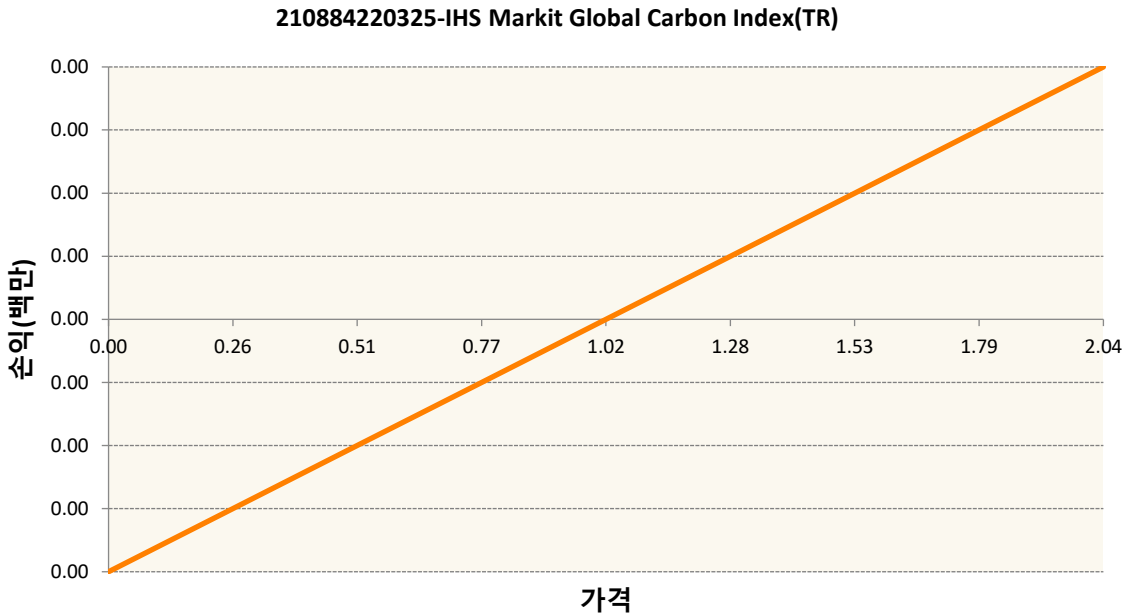
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

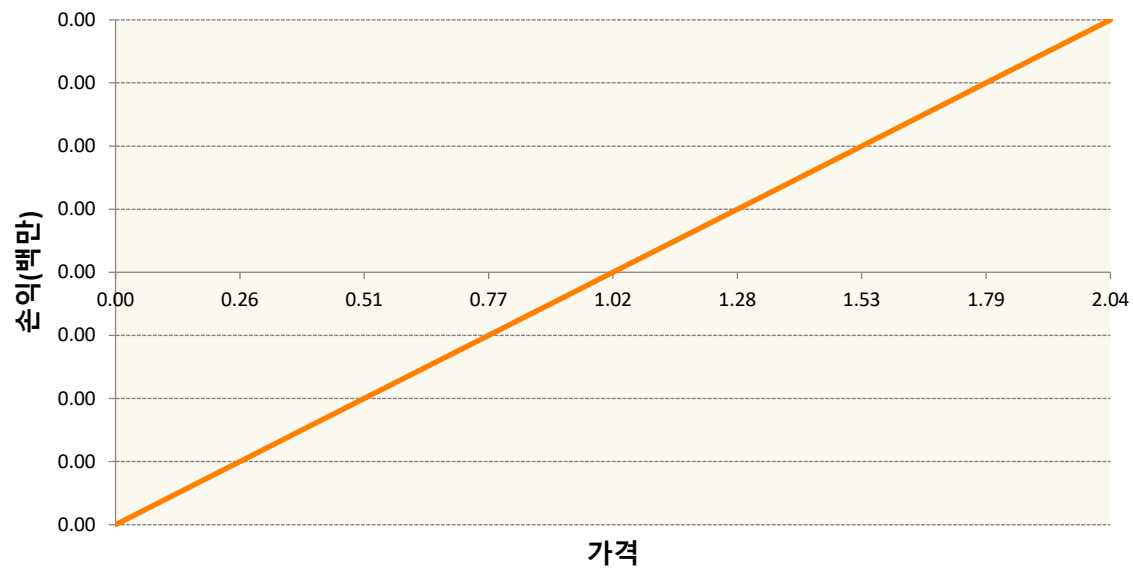
(단위:백만원)

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



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

5,467

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

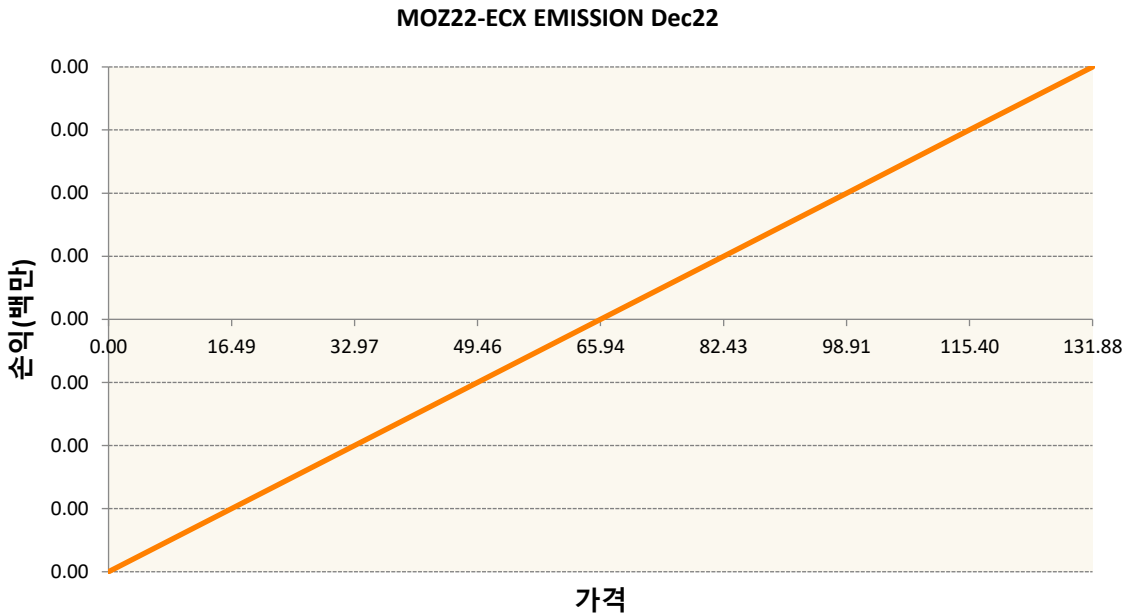
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	11,165	0	11,165	
누계	통화	선도	0	5,511	-5,511	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9T(KRW/EUR 27-10-22E	441
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	893

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

(단위:백만원)

2,584

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

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)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	8

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

(단위:백만원)

57

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

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)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	20

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

(단위:백만원)

86

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

에쿼티알파일반사모혼합자산

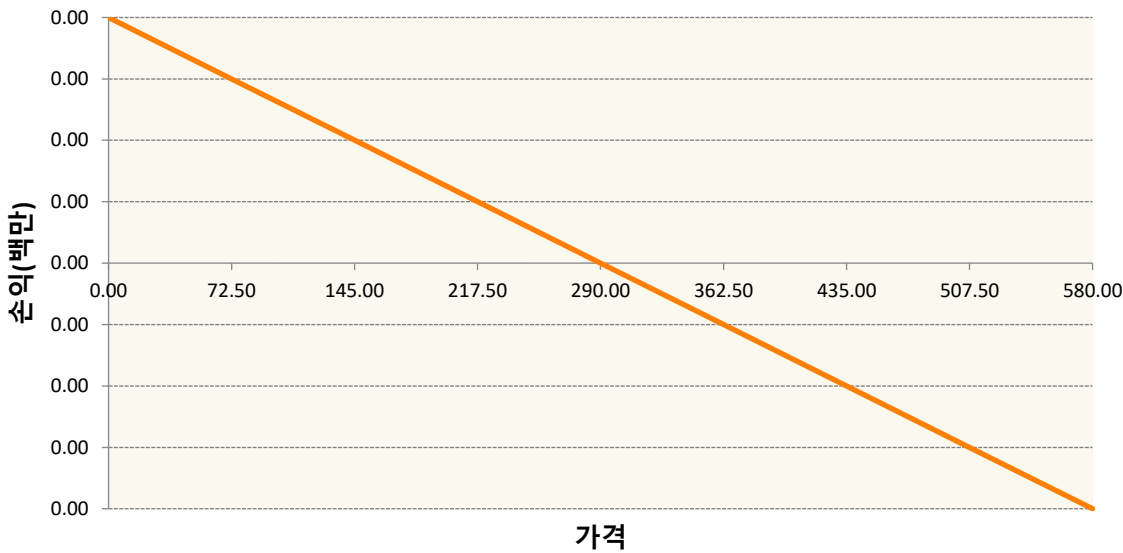
1. 계약금액

(단위:백만원)

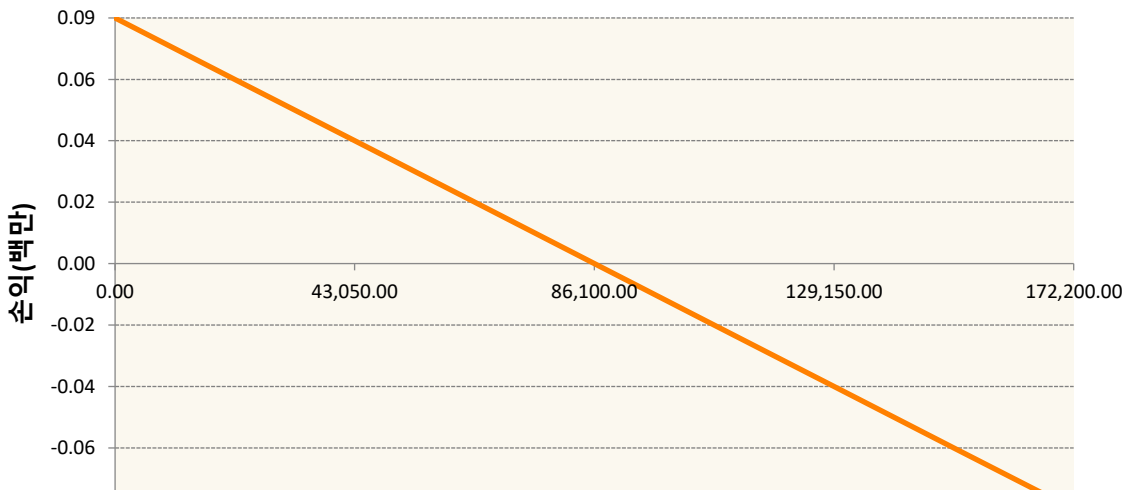
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	719	362	357	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,088	-1,088	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	0	172	-172	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



KR4150SA0001-2022-10 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물		87
KR4150SA00 2022-10 SK하이닉스개별선물		14
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		0.17
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	121

공시일 2022-10-05

기준일 2022-10-04

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

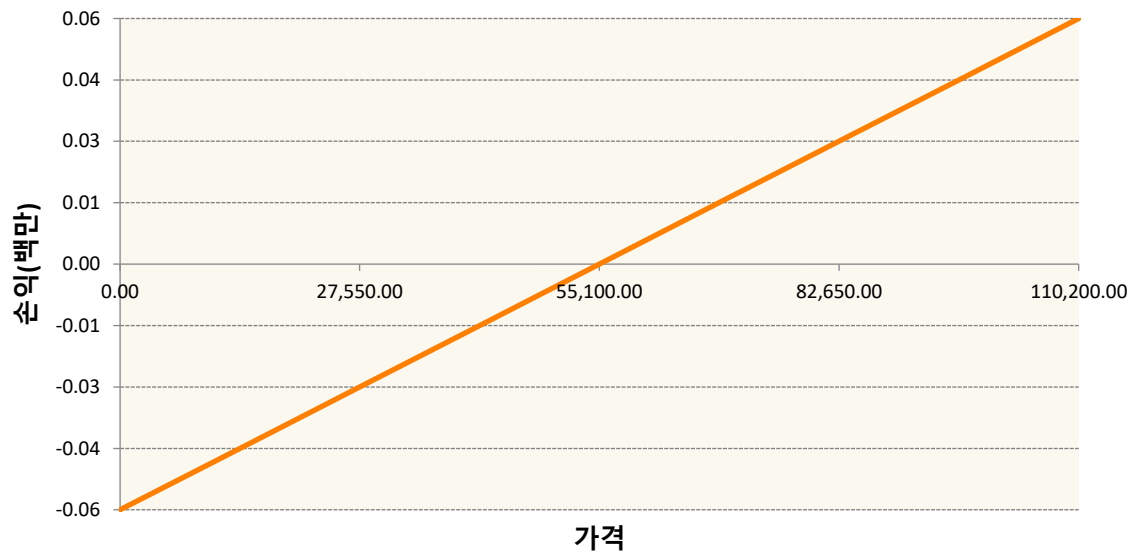
1. 계약금액

(단위:백만원)

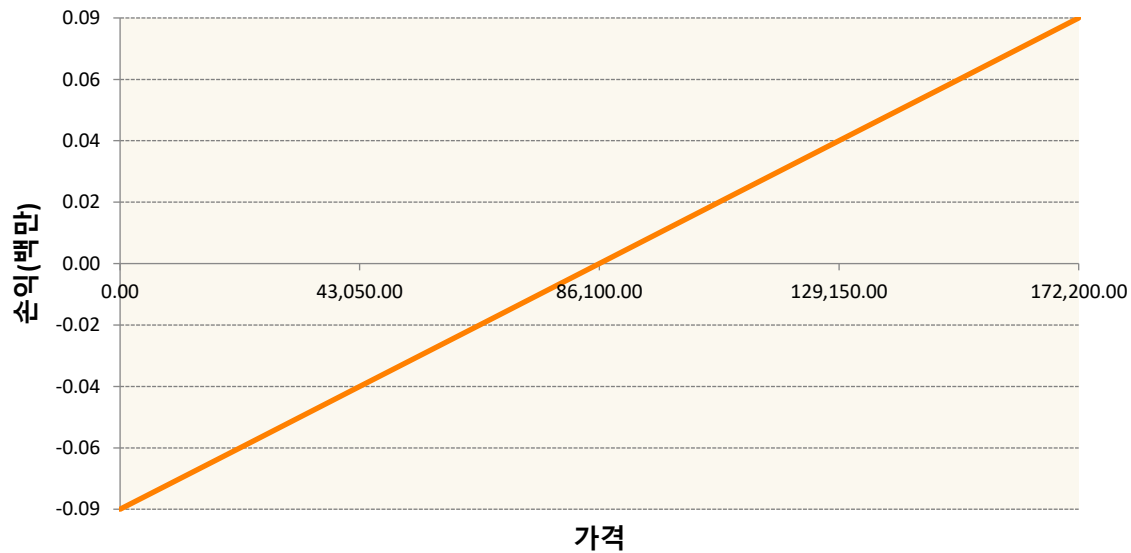
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	398	0	398	장내
누계	유가증권	ELS	374	0	374	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



KR4150SA0001-2022-10 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SA0009		2022-10 삼성전자개별선물					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)

32

공시일	2022-10-05
기준일	2022-10-04

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 2022-10-05

기준일 2022-10-04

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

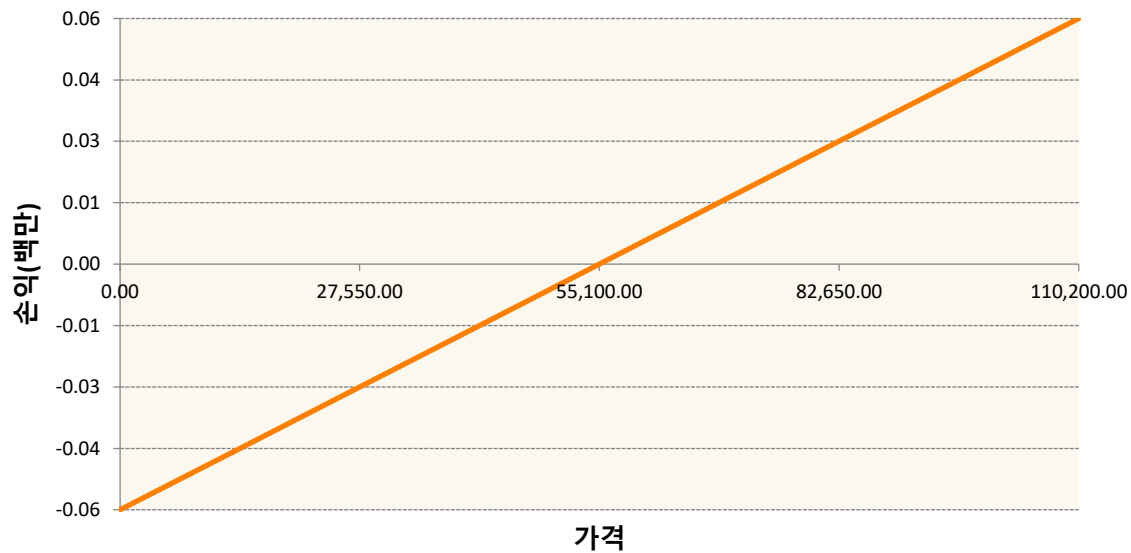
1. 계약금액

(단위:백만원)

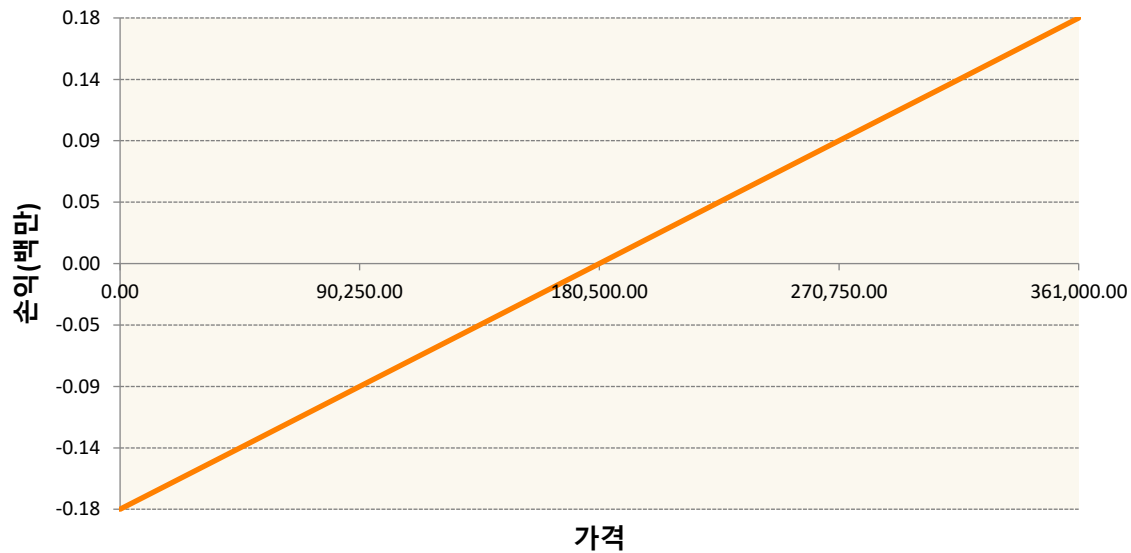
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	264	0	264	장내

2. 만기시점의 손익구조

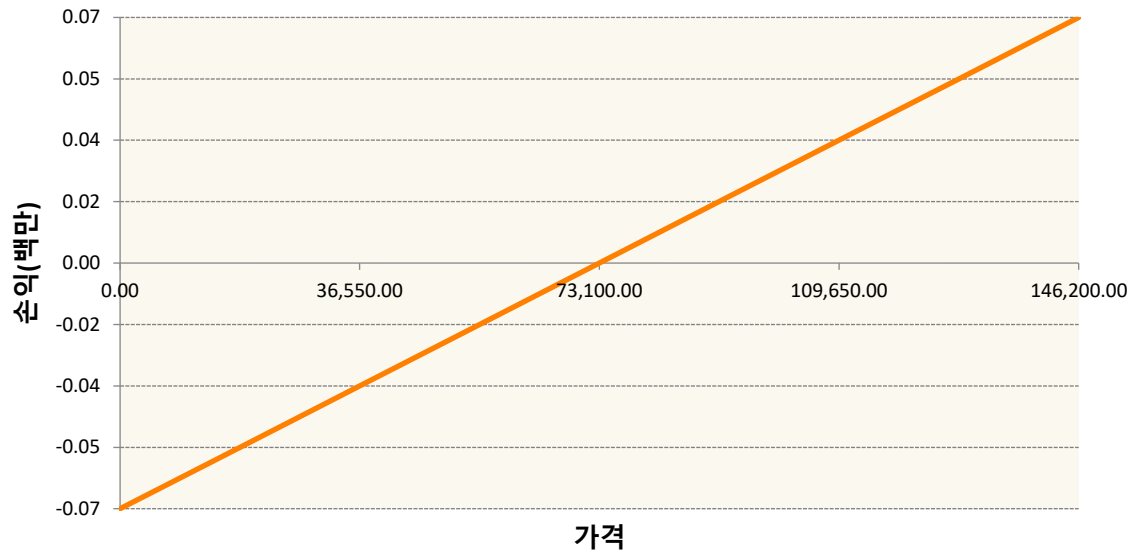
KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



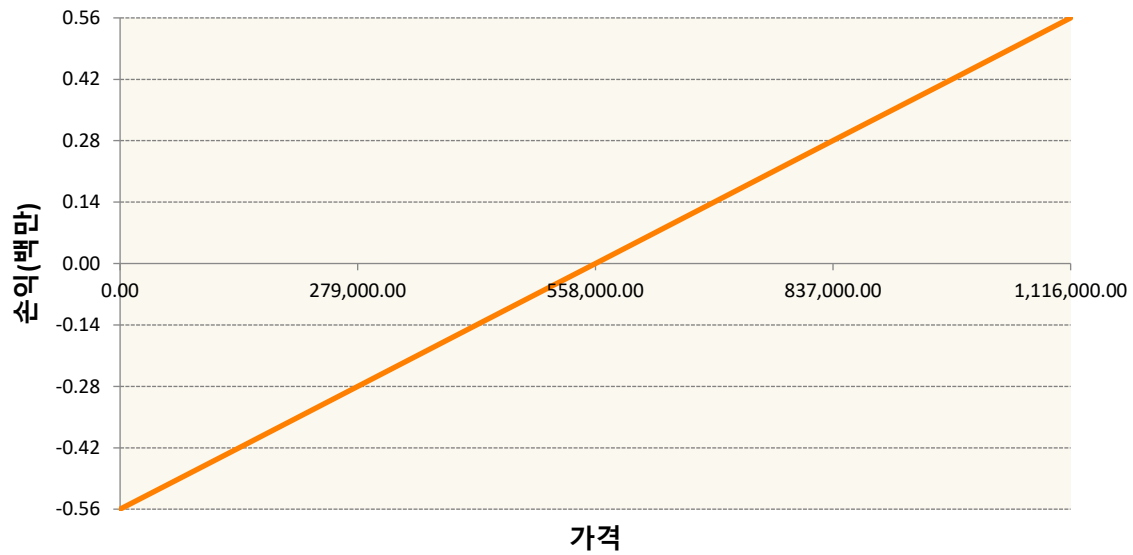
KR4116SA0004-2022-10 현대차개별선물



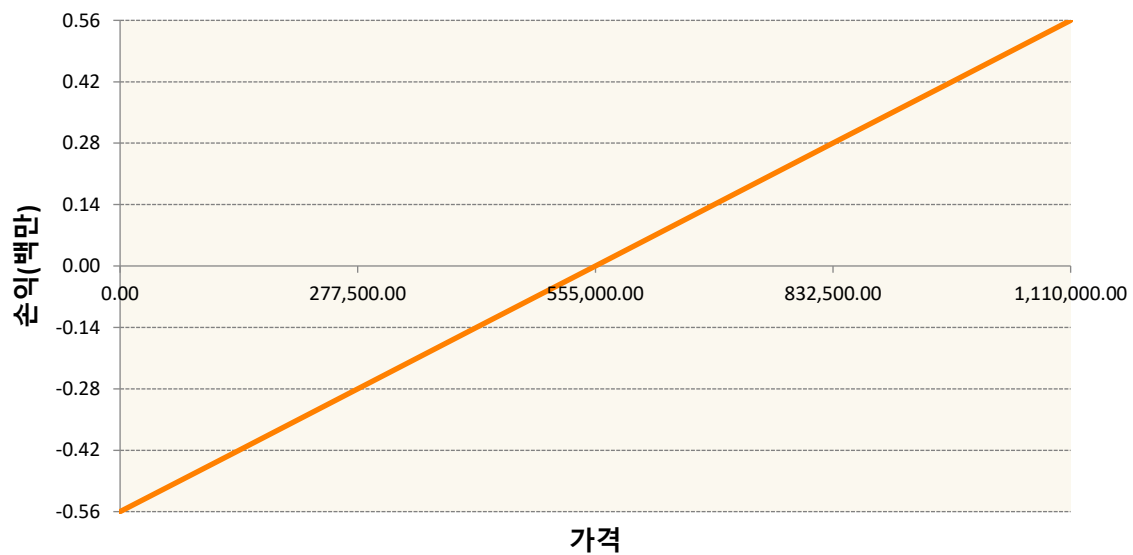
KR4119SA0001-2022-10 기아개별선물



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 2022-10-05

기준일 2022-10-04

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

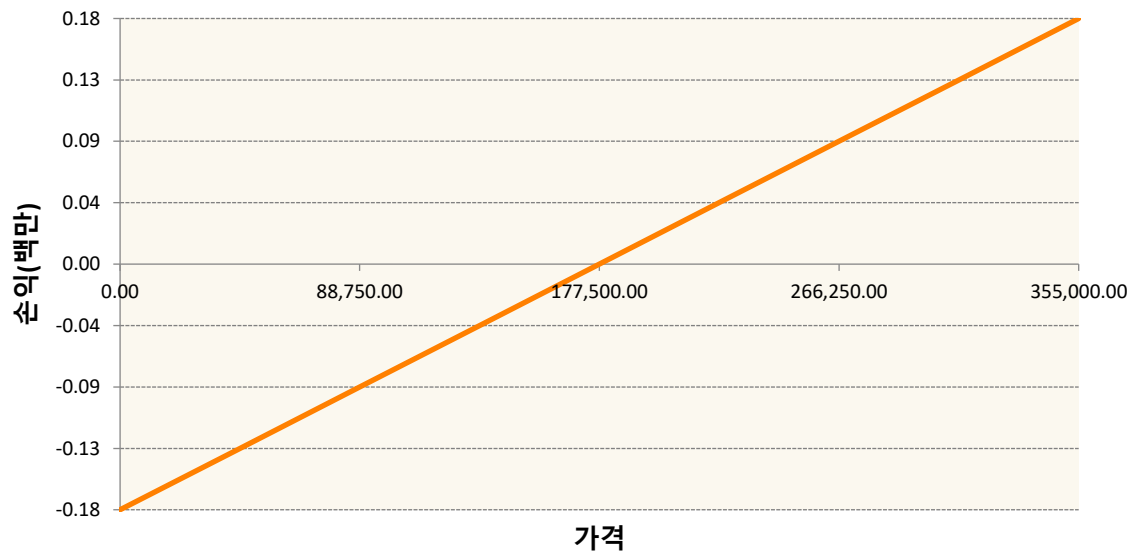
1. 계약금액

(단위:백만원)

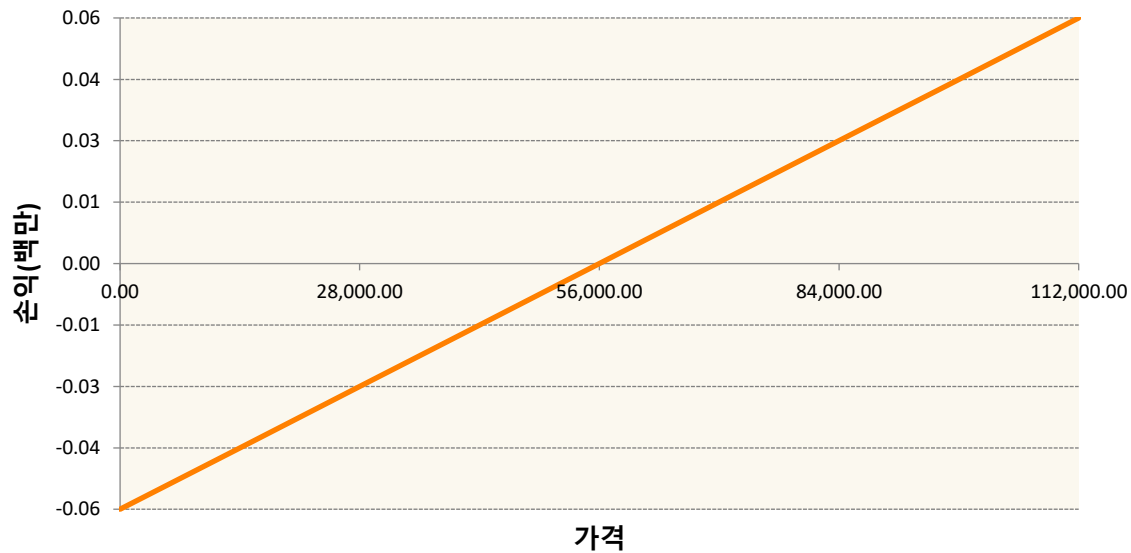
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	156	0	156	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156SA0005-2022-10 NAVER개별선물



KR41CFSA0001-2022-10 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156SA0005		2022-10 NAVER개별선물					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%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-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%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	7
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)

21

공시일 2022-10-05

기준일 2022-10-04

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

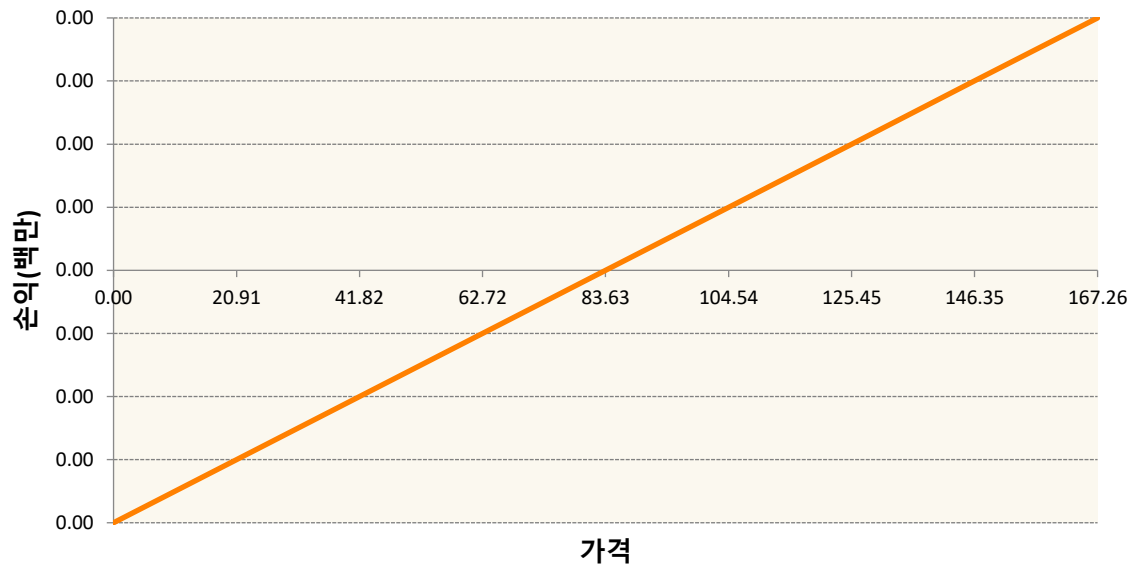
1. 계약금액

(단위:백만원)

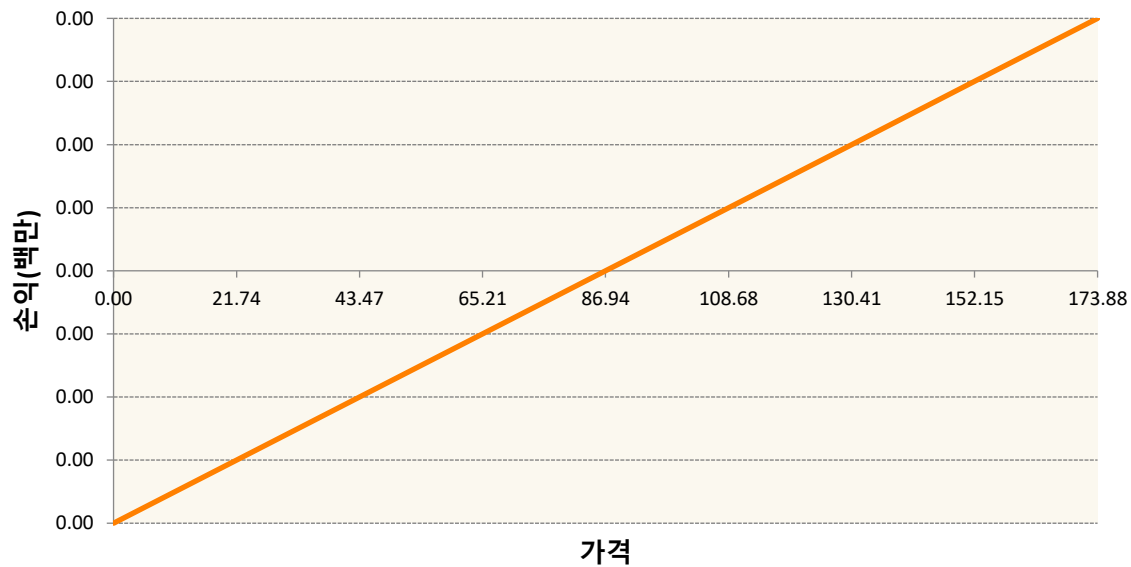
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,589	214	1,375	

2. 만기시점의 손익구조

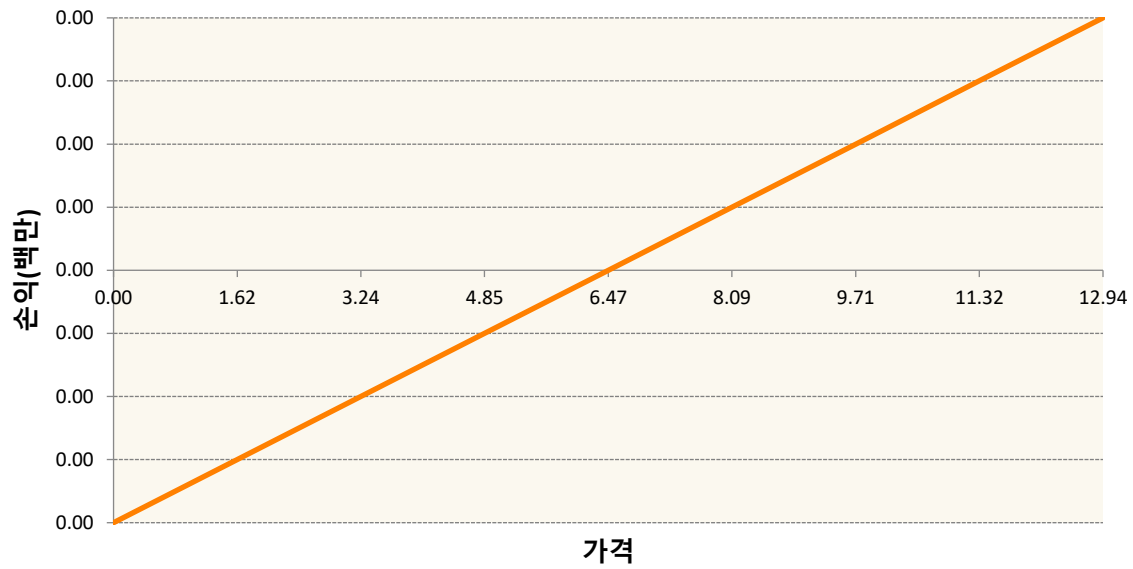
CLX2-WTI CRUDE FUTURE Nov22



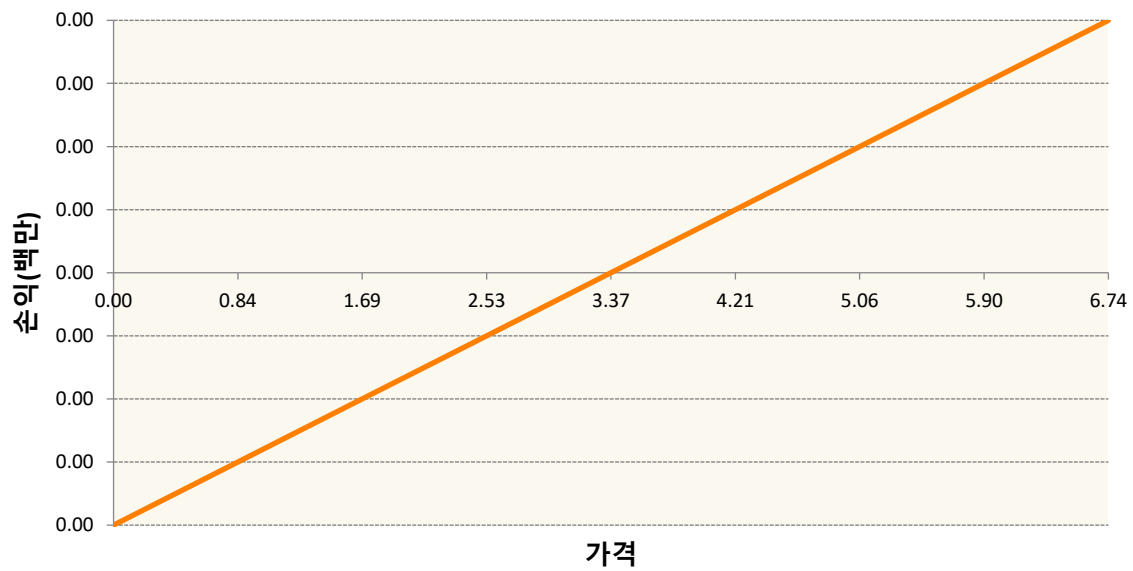
COF3-BRENT CRUDE FUTR JAN23



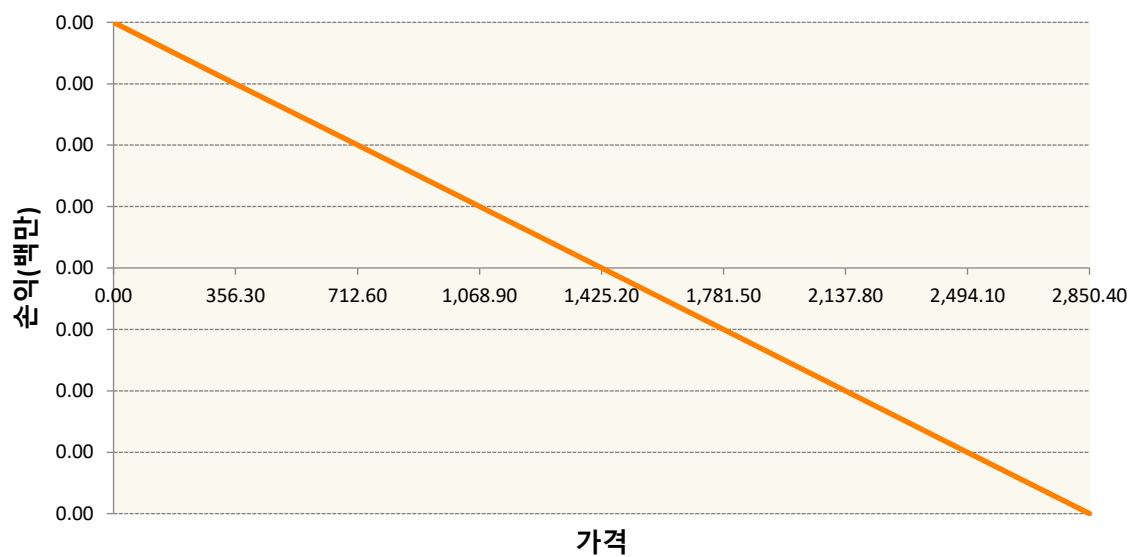
EOX2-E-MINI NATURAL GAS Nov22



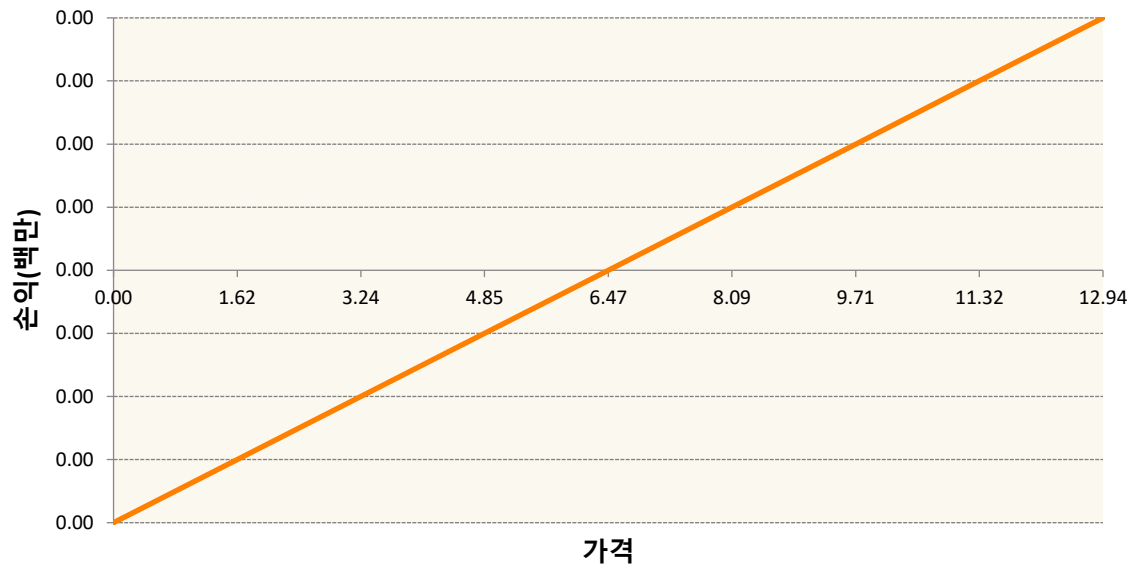
HOX2-NY Harb ULSD Fut Nov22



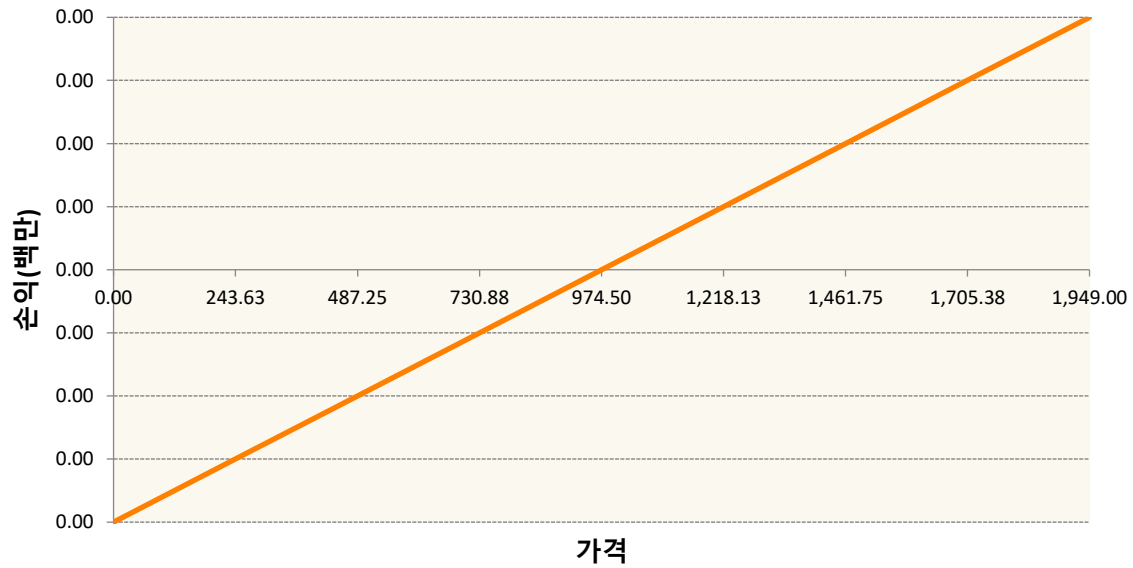
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



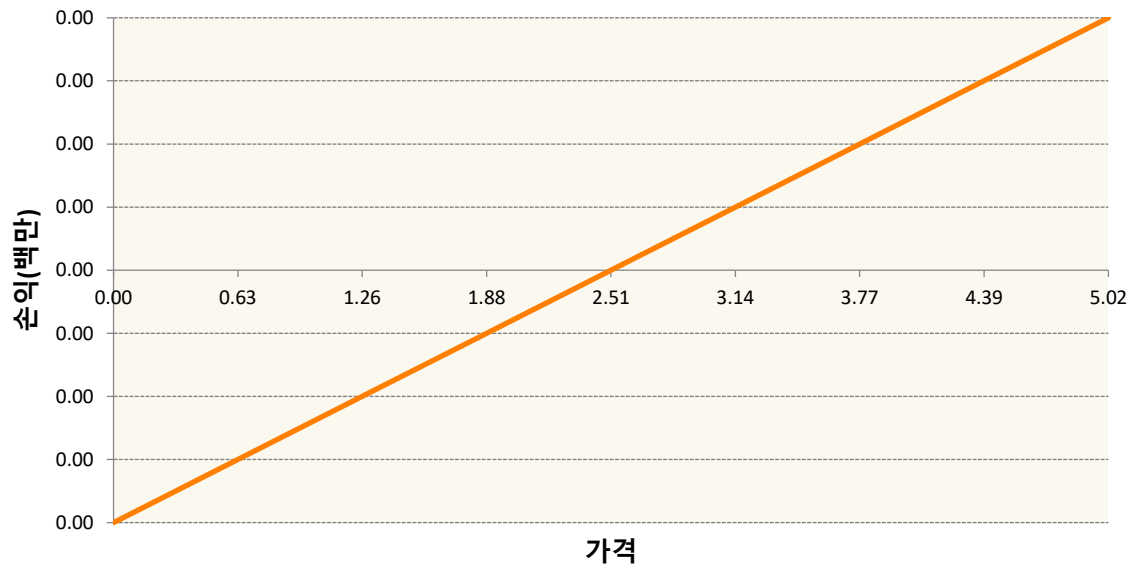
NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QSX2-Low Su Gasoil G Nov22



XBX2-GASOLINE RBOB FUT Nov22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX2	WTI CRUDE FUTURE Nov22	17
COF3	BRENT CRUDE FUTR JAN23	29
EOX2	E-MINI NATURAL GAS Nov22	6
HOX2	NY Harb ULSD Fut Nov22	15
KR4175SA00 2022-10 달러선물		17
NGX22	NATURAL GAS FUTR Nov22	39
QSX2	Low Su Gasoil G Nov22	10
XBX2	GASOLINE RBOB FUT Nov22	11

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

405