

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

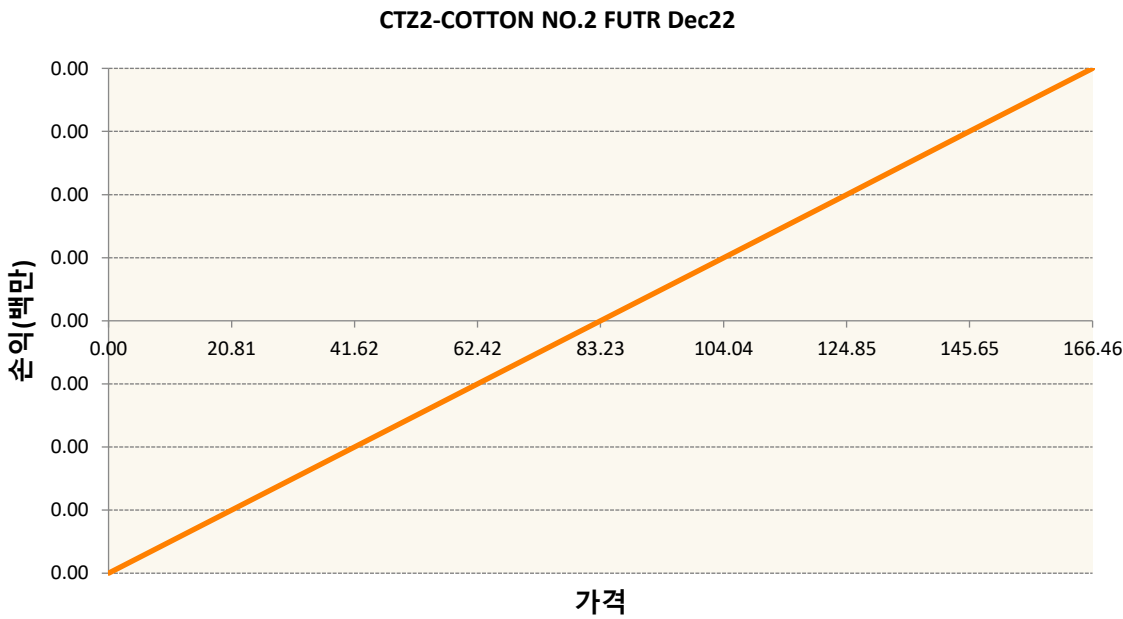
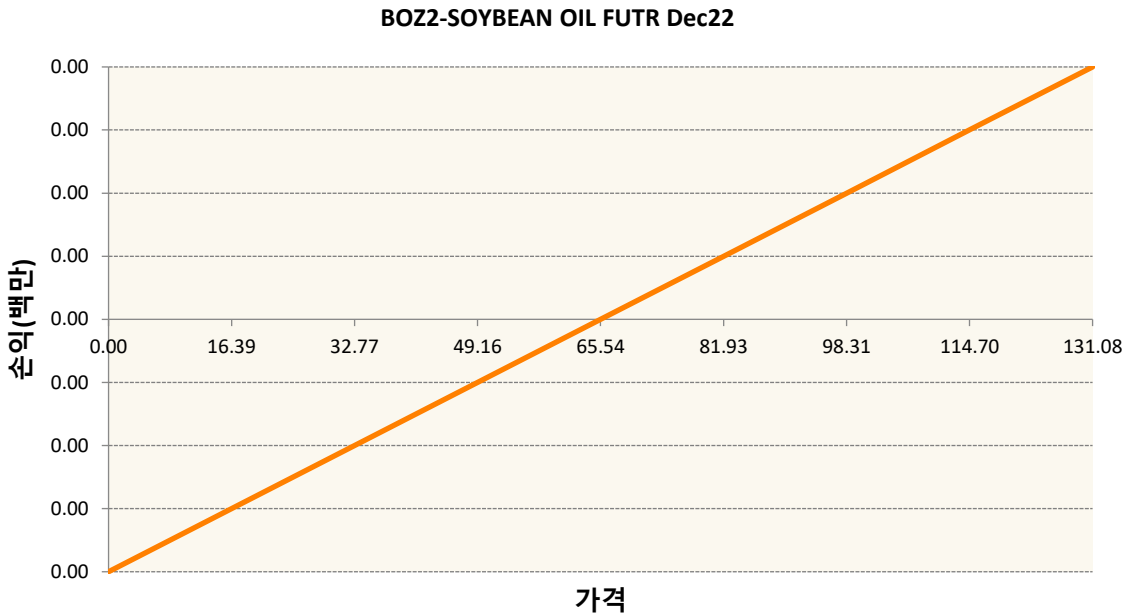
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

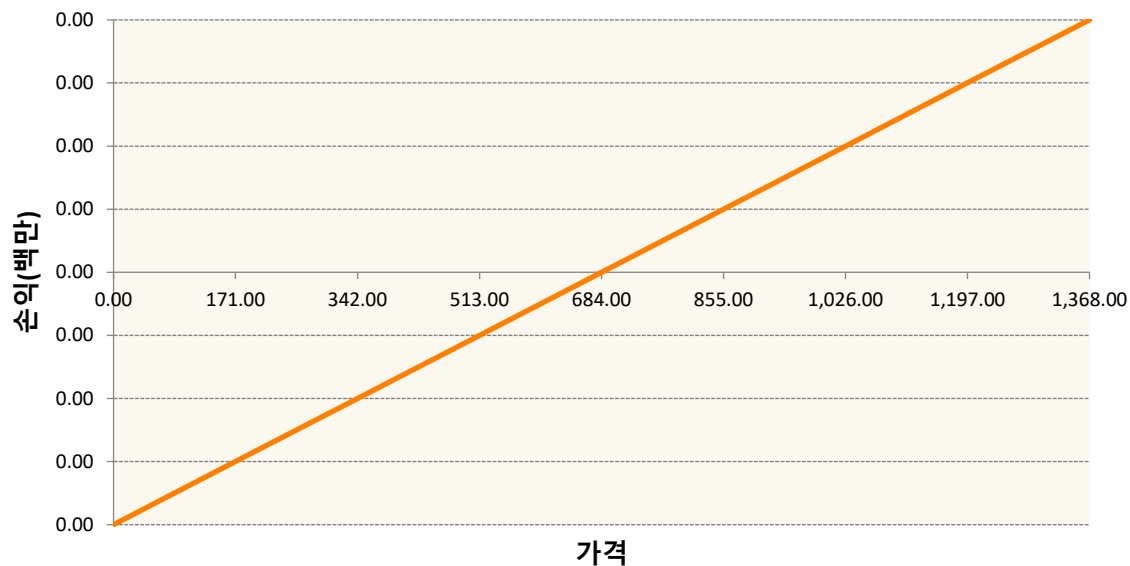
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,486	841	5,644	

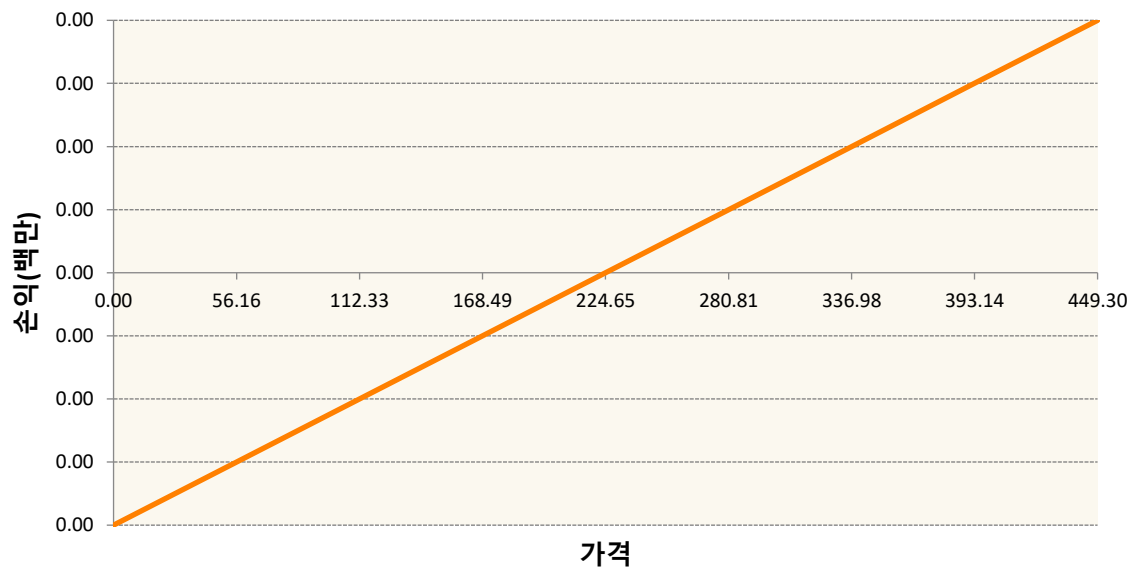
2. 만기시점의 손익구조



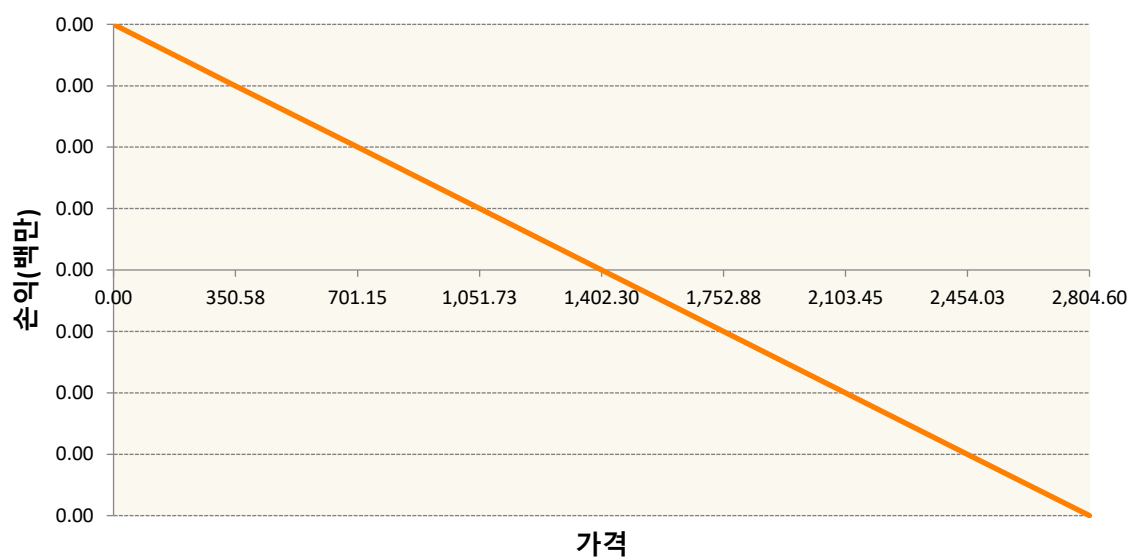
CZ2-CORN FUTURE Dec22



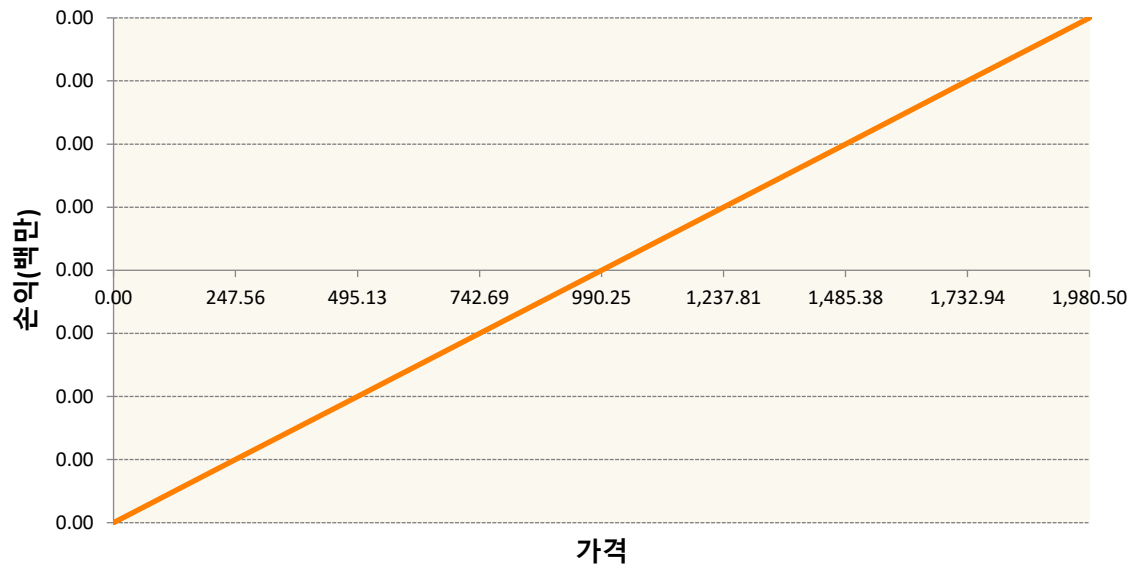
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



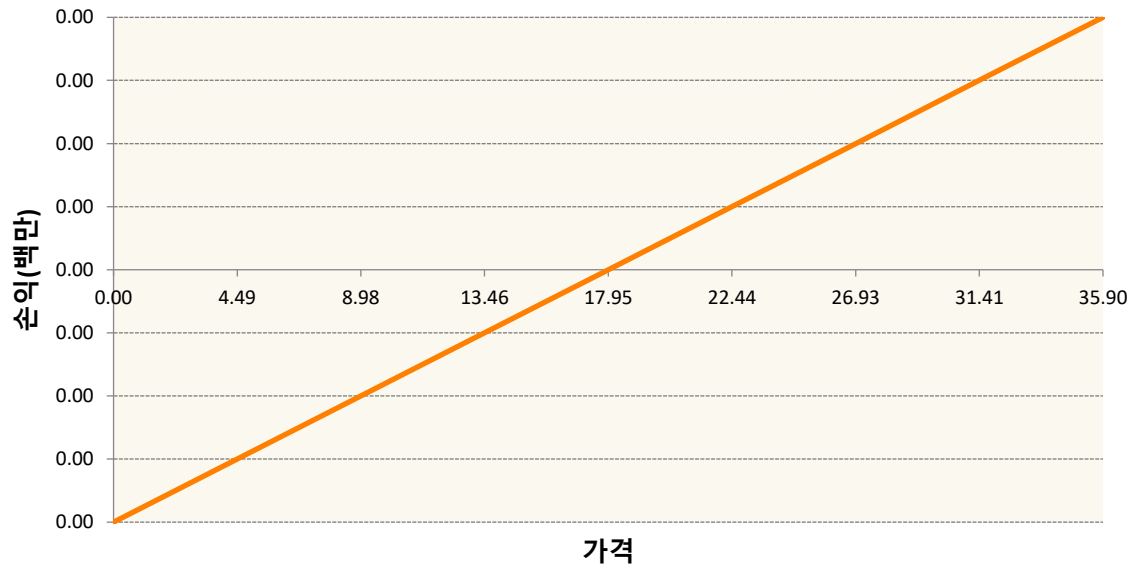
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



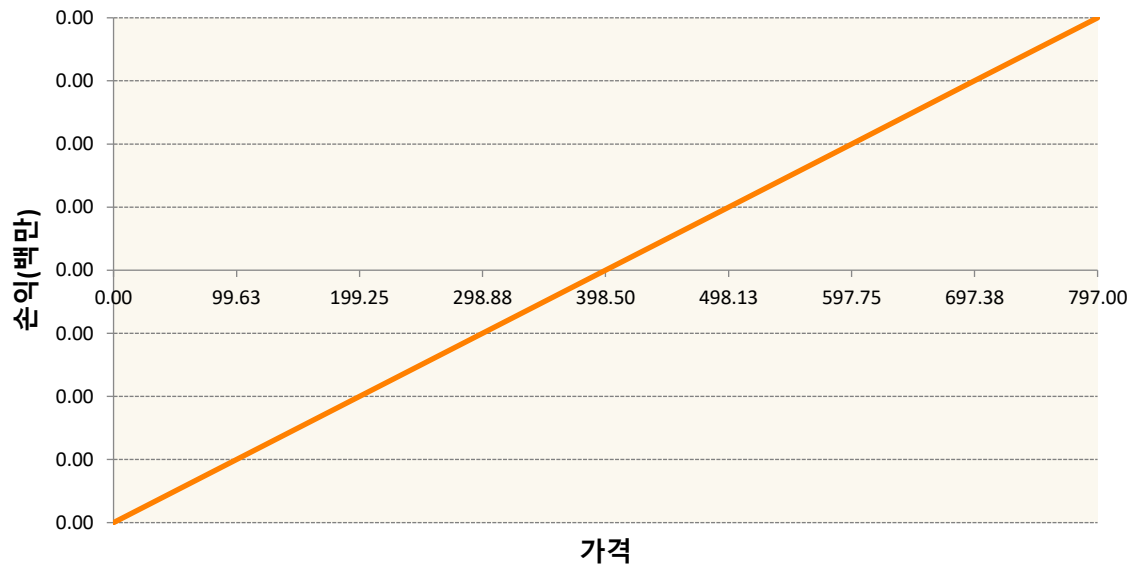
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

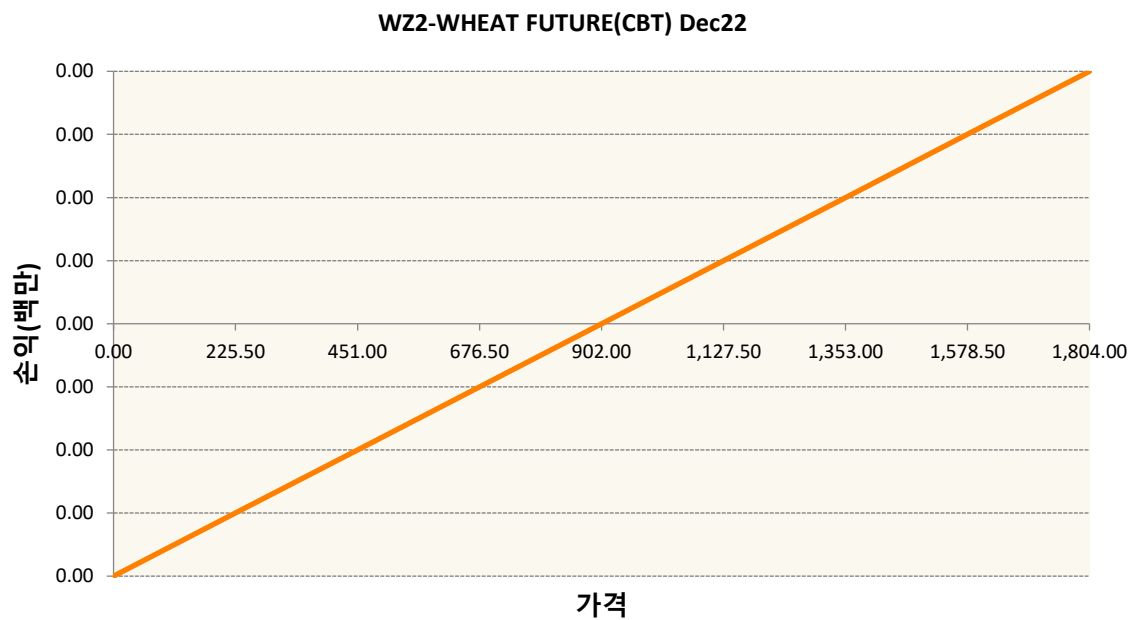
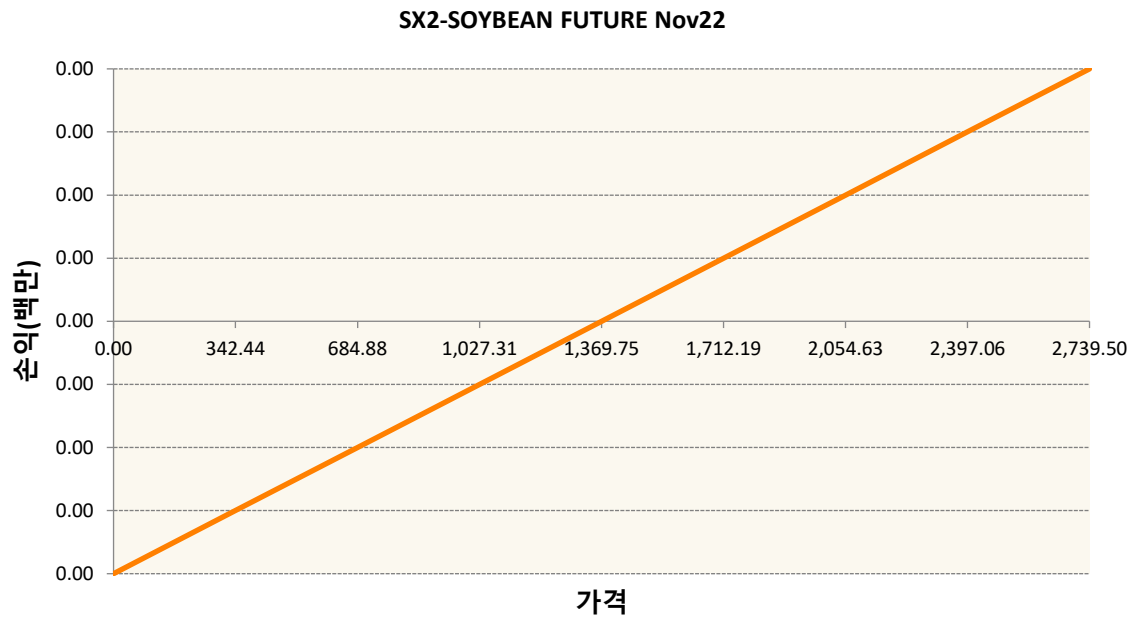


SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



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	2022-10-07
기준일	2022-10-06

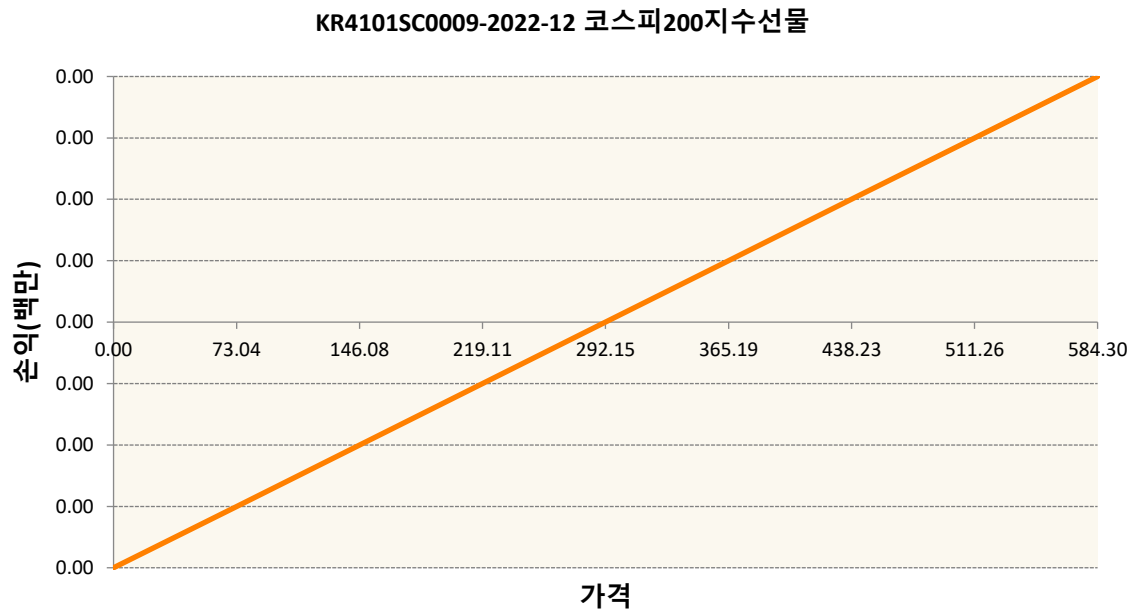
스마트인덱스모

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	949	0	949	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				76
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-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%	76	76	76	76	76	76	76

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

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	320
-----------------------------	-----

* 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	2022-10-07
기준일	2022-10-06

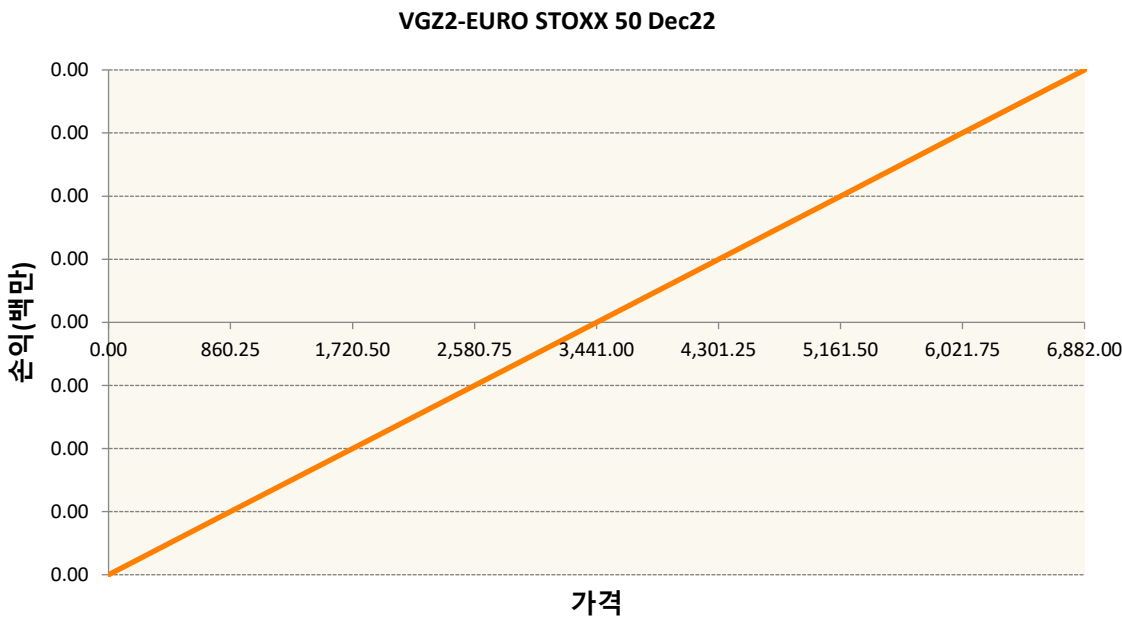
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	478	0	478	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ2	EURO STOXX 50 Dec22	38
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

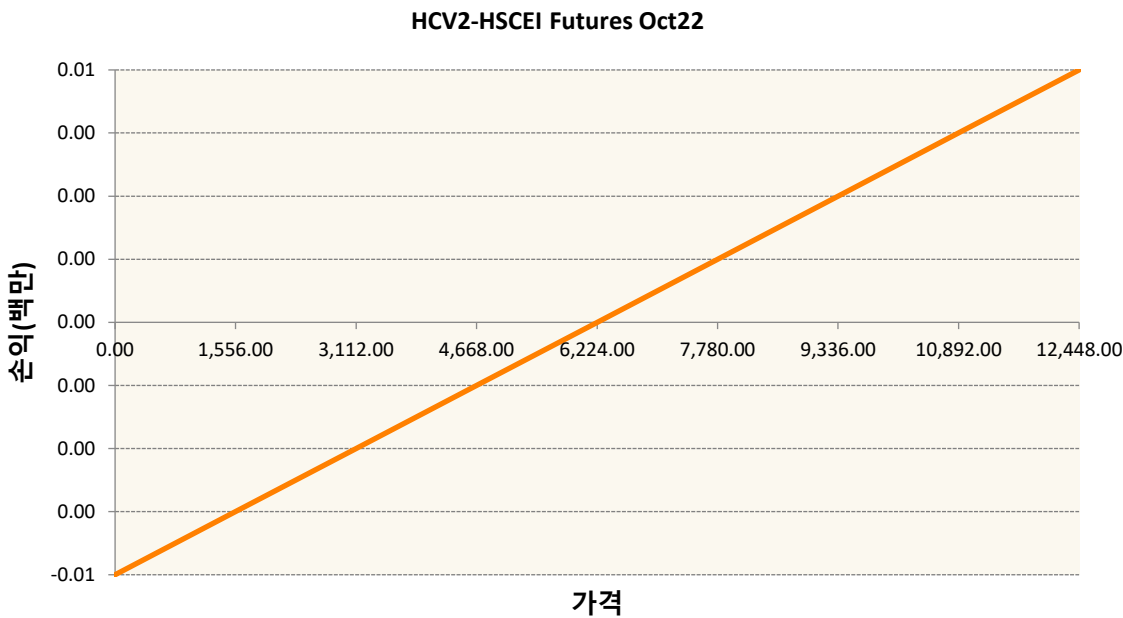
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,026	0	1,026	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV2	HSCEI Futures Oct22	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

120

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

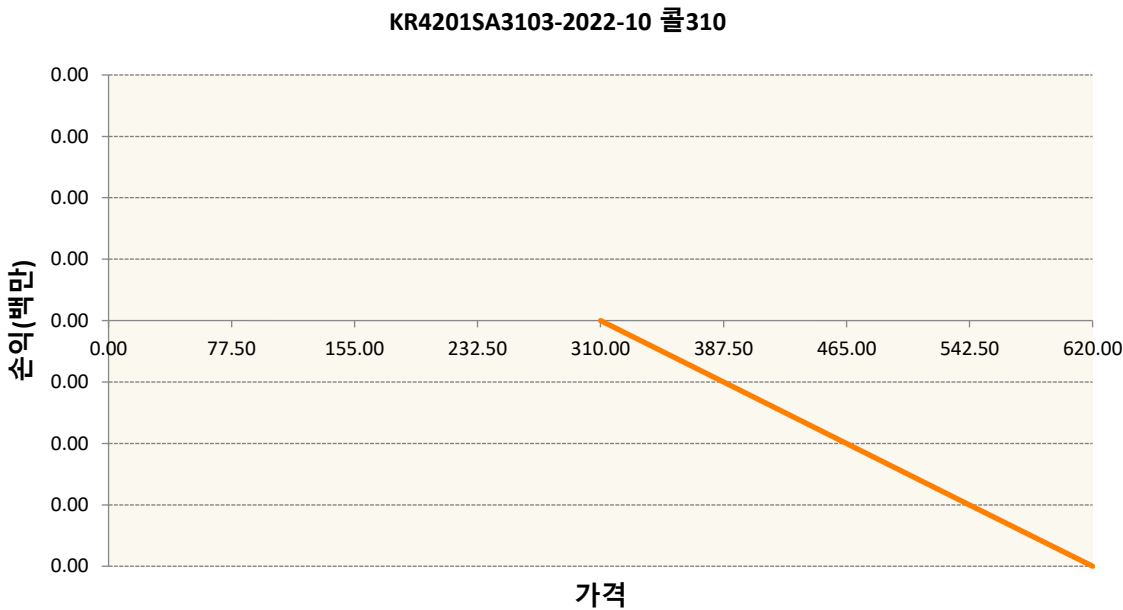
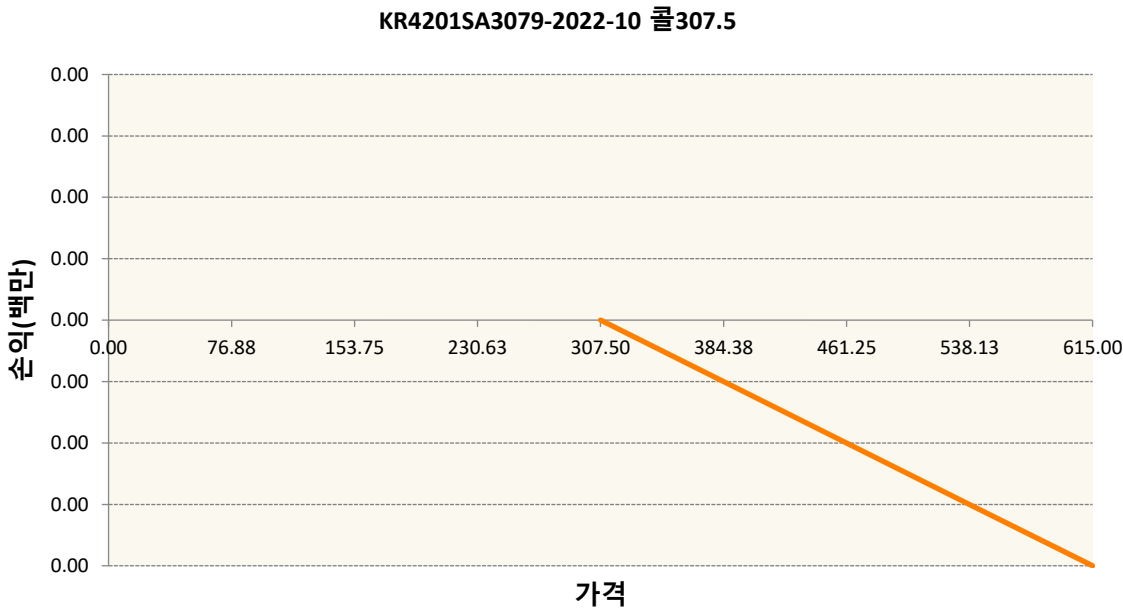
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

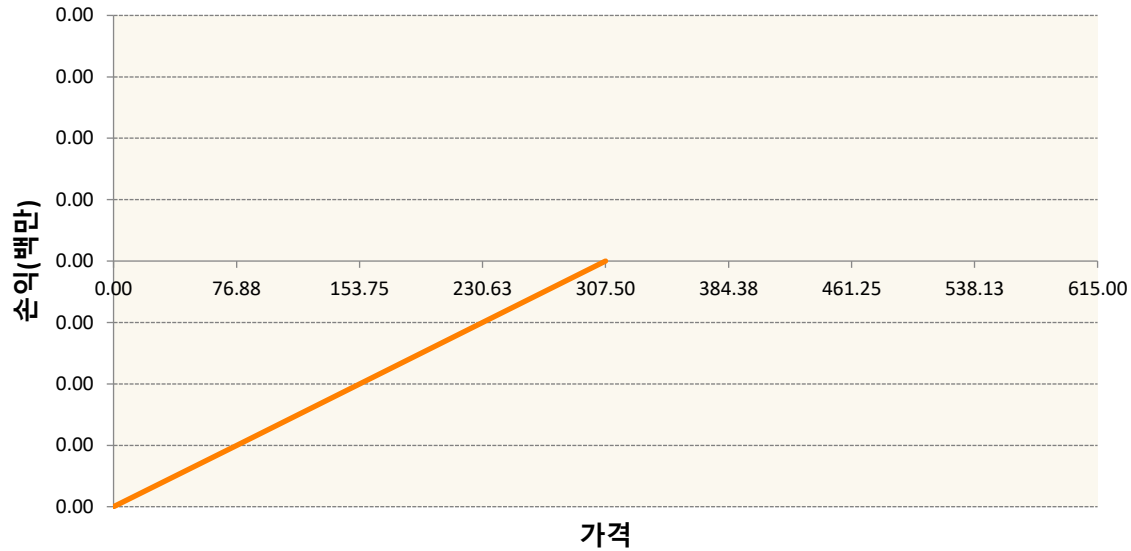
(단위:백만원)

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						388
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	61	60	59	57	55	51	
-5.33%	60	58	56	53	49	43	37	
-2.67%	55	50	44	37	28	18	8	
0%	35	25	13	0	-14	-29	-44	
2.67%	-15	-32	-50	-68	-87	-105	-124	
5.33%	-115	-136	-156	-177	-198	-218	-239	
8.00%	-272	-291	-310	-329	-349	-368	-388	
KR4201SA3103		2022-10 콜310						1,227
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	165	165	163	160	156	149	140	
-5.33%	163	160	154	145	133	118	99	
-2.67%	152	139	123	102	77	48	15	
0%	104	74	39	0	-43	-89	-138	
2.67%	-30	-84	-141	-199	-260	-322	-385	
5.33%	-318	-389	-460	-531	-603	-674	-746	
8.00%	-802	-872	-942	-1,013	-1,084	-1,156	-1,227	
KR4301SA3078		2022-10 풋307.5						735
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-725	-725	-726	-727	-729	-731	-735	
-5.33%	-464	-466	-468	-471	-476	-481	-487	
-2.67%	-207	-212	-218	-226	-234	-244	-254	
0%	35	25	13	0	-14	-29	-44	

2.67%	247	230	212	194	175	157	138
5.33%	409	388	368	347	326	306	285
8.00%	514	495	476	457	437	418	398

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

(단위:백만원)

1,968

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

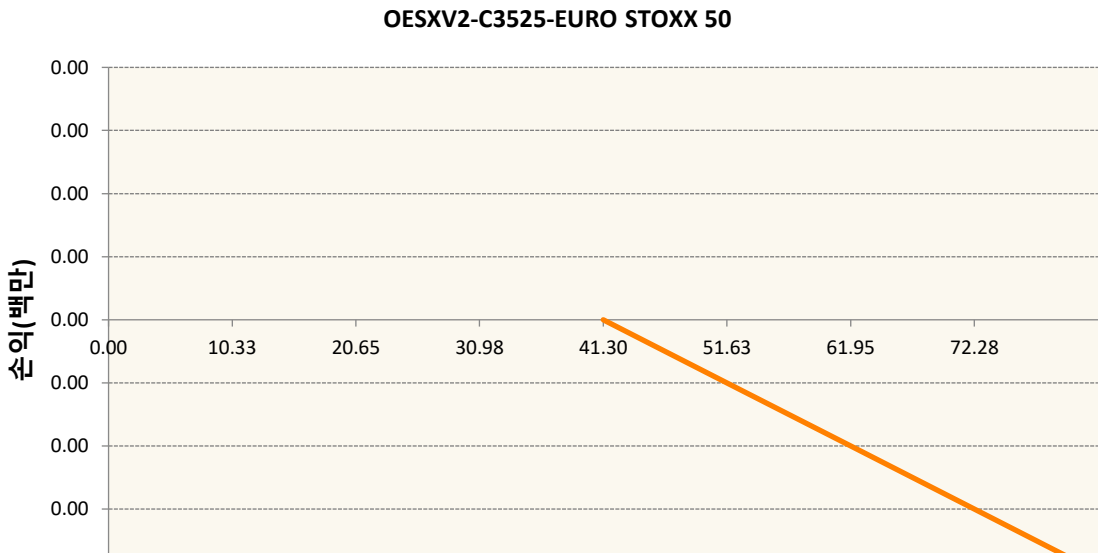
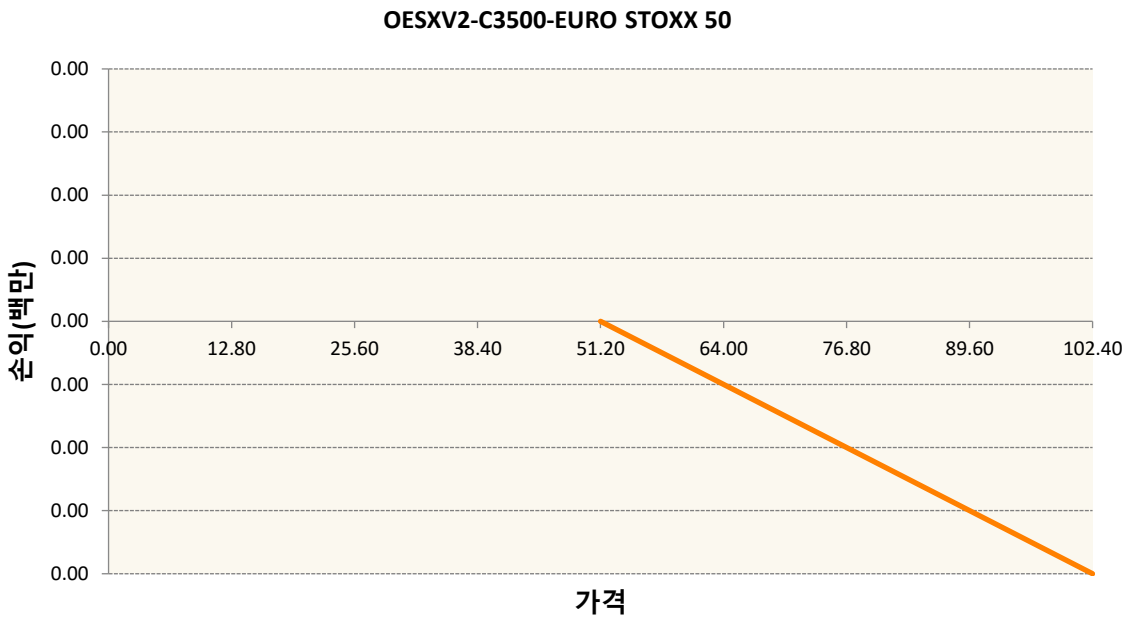
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

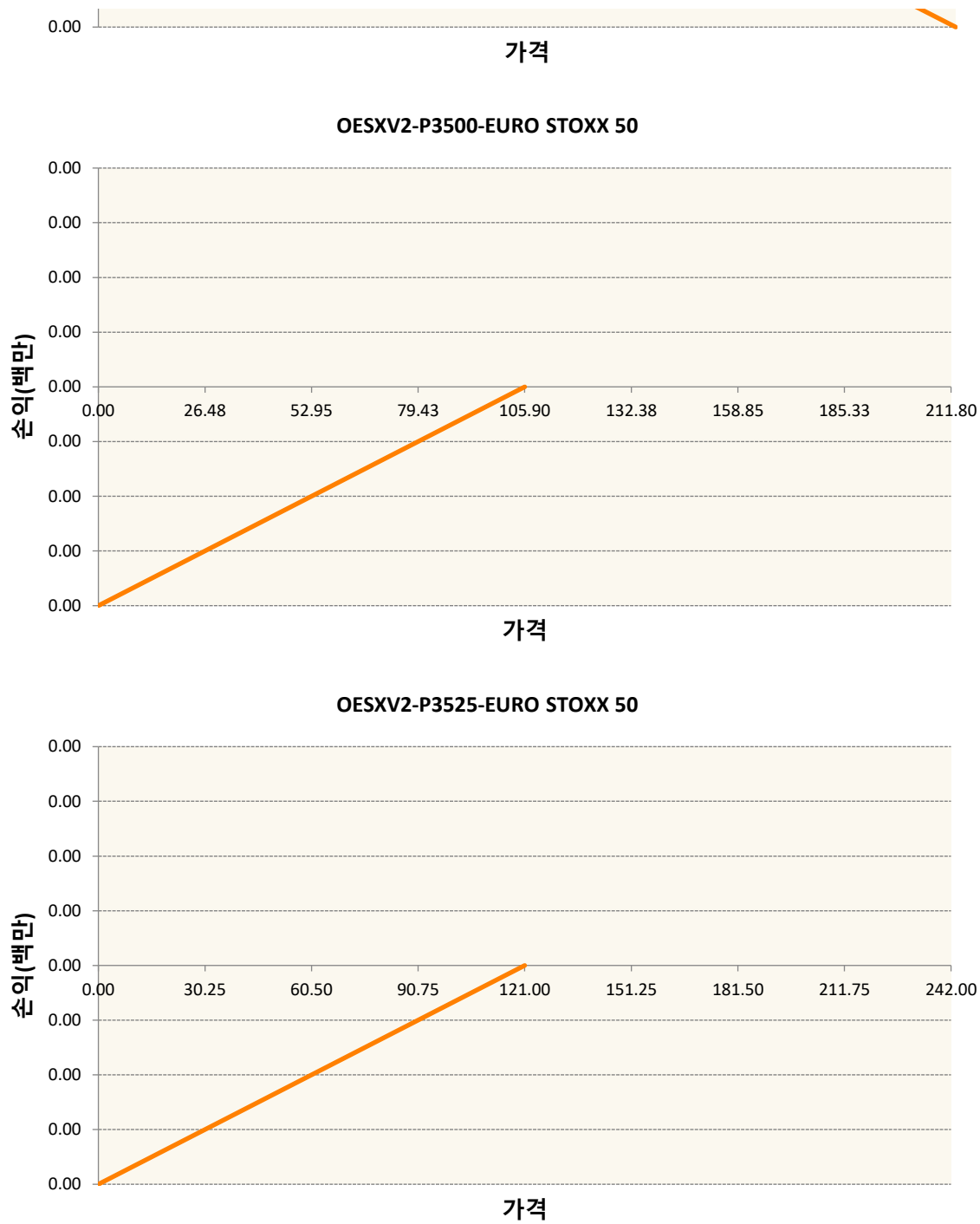
1. 계약금액

(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	28	-28	장내
누계	통화	선도	0	903	-903	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		3
FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E		72
OESXV2-C35 EURO STOXX 50		1
OESXV2-C35 EURO STOXX 50		0.05
OESXV2-P35 EURO STOXX 50		1
OESXV2-P35 EURO STOXX 50		0.13

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

공시일 2022-10-07

기준일 2022-10-06

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

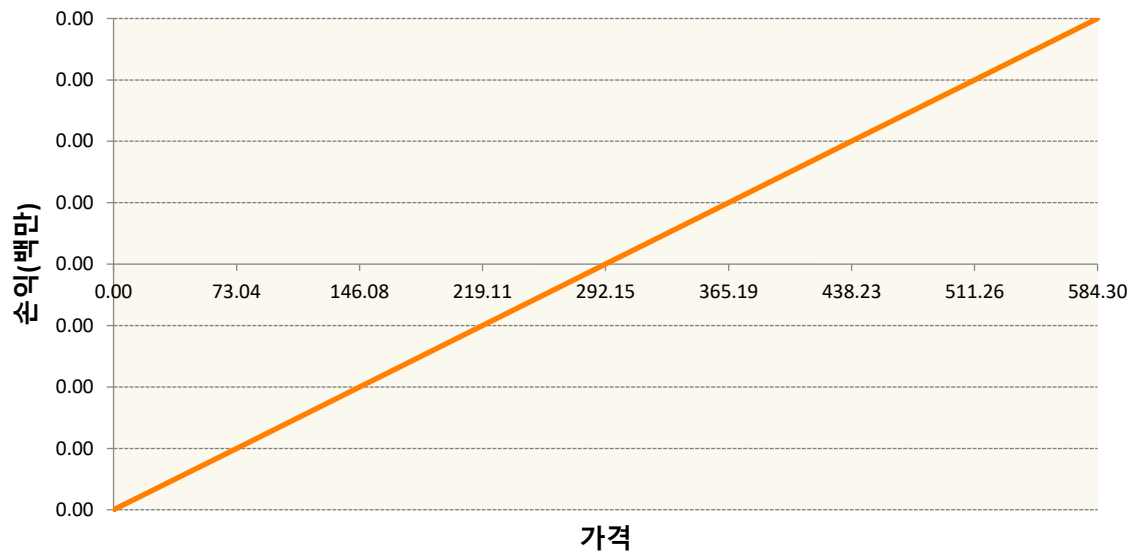
1. 계약금액

(단위:백만원)

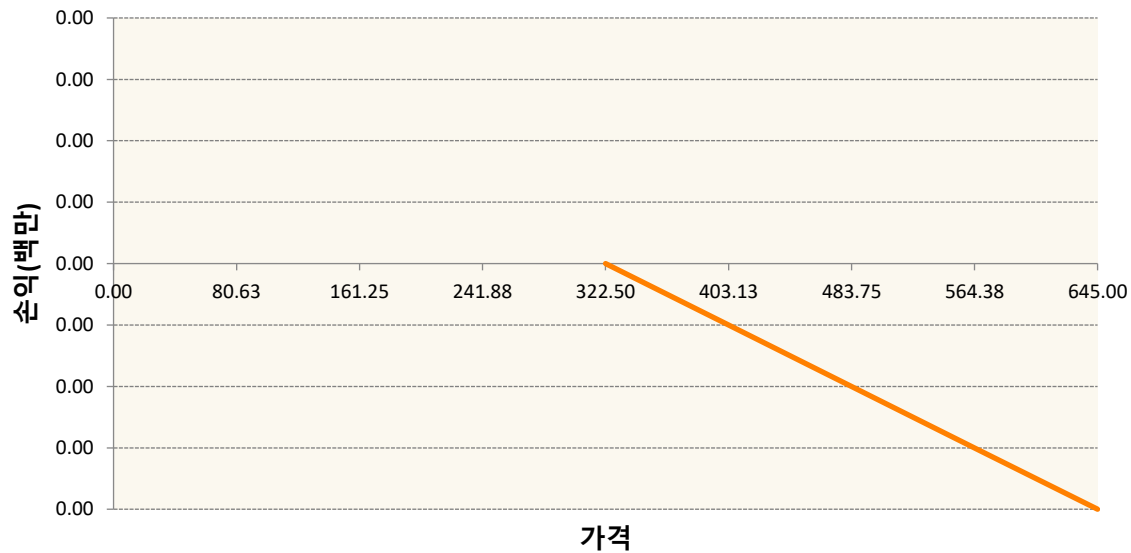
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	292	0	292	장내
누계	유가증권	옵션	308	4,219	-3,911	장내

2. 만기시점의 손익구조

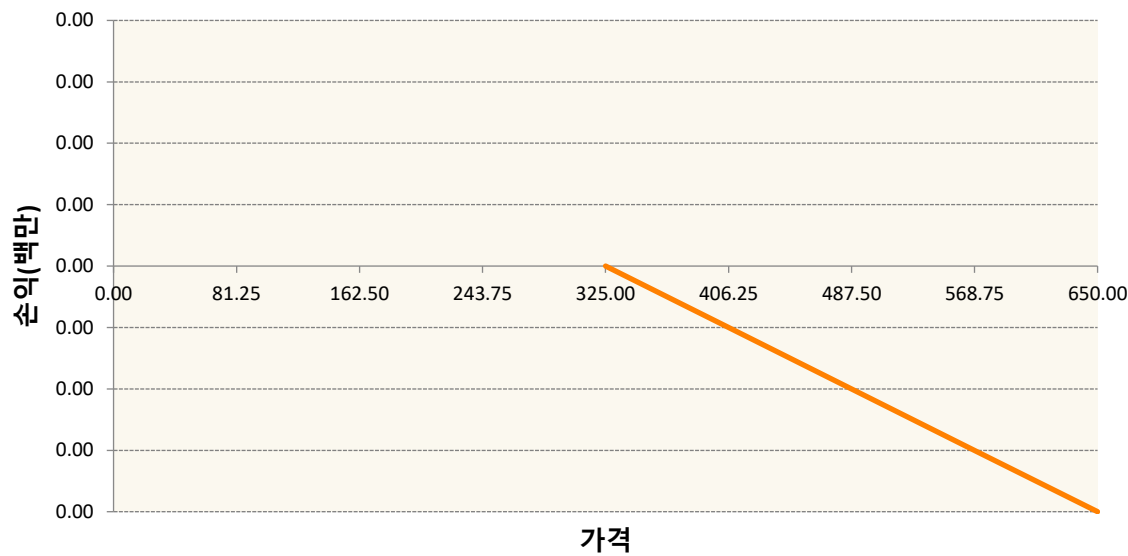
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



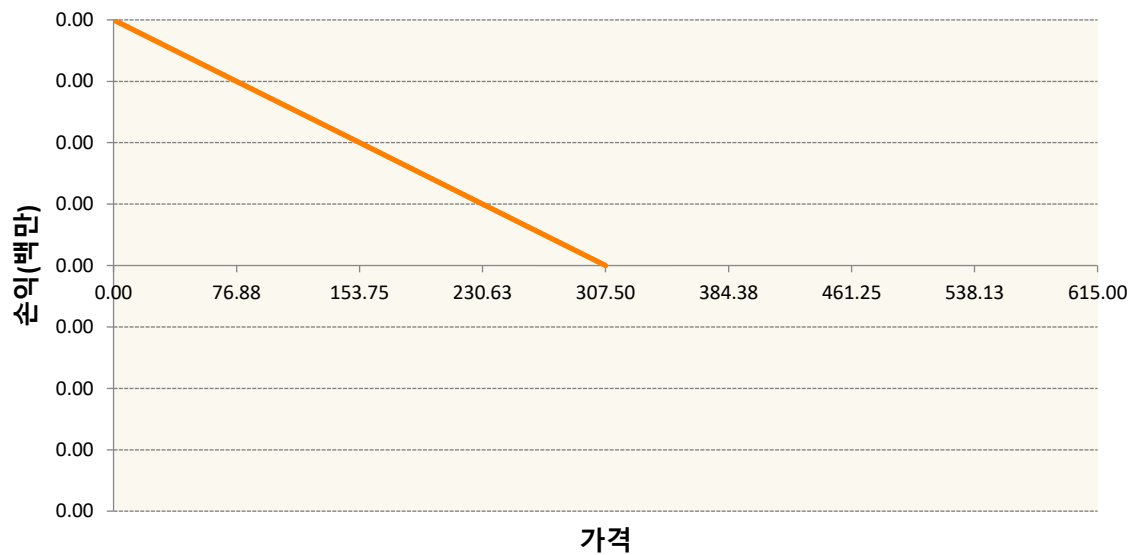
KR4201SA3228-2022-10 콜322.5



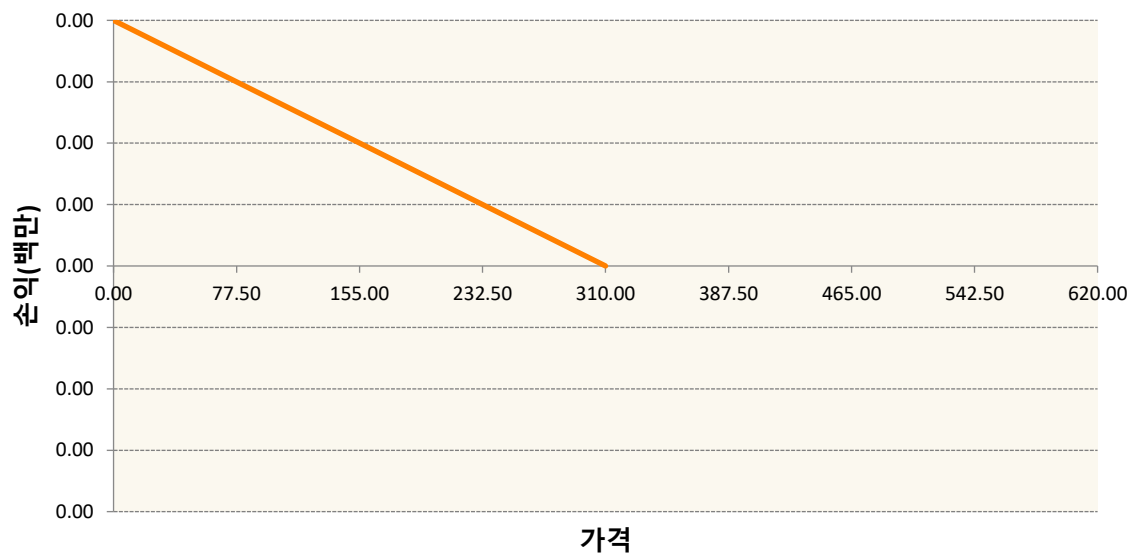
KR4201SA3251-2022-10 콜325



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%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16			
-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%	16	16	16	16	16	16	16			
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			
-2.67%	1	1	1	1	0	0	0			
0%	1	1	0	0	0	-1	-1			
2.67%	0	0	-1	-1	-2	-3	-4			
5.33%	-1	-2	-3	-4	-5	-6	-7			
8.00%	-5	-6	-8	-9	-10	-12	-13			
KR4201SA3251							2022-10 콜325		54	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	3	3	3	3	3	2	2			
-5.33%	3	3	3	3	2	2	1			
-2.67%	3	3	2	2	1	0	-1			
0%	2	2	1	0	-1	-3	-5			
2.67%	1	-1	-3	-5	-8	-11	-14			
5.33%	-5	-8	-12	-16	-20	-25	-30			
8.00%	-19	-24	-30	-36	-42	-48	-54			
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	11	11	11			
-2.67%	5	5	5	5	5	5	6			
0%	-1	-1	0	0	0	1	1			
2.67%	-5	-5	-5	-4	-4	-3	-3			
5.33%	-9	-9	-8	-8	-7	-7	-6			
8.00%	-11	-11	-11	-10	-10	-9	-9			
KR4301SA3102							2022-10 풋310		6	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	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	-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)

75

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

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	7,352	0	7,352	

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	2022-10-07
기준일	2022-10-06

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	6,147	0	6,147	

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	2022-10-07
기준일	2022-10-06

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	18,745	0	18,745	
누계	통화	선도	1,192	20,370	-19,178	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C7R· KRW/USD 27-10-22E	481
FXW213C8R· KRW/USD 28-11-22E	627
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	522
FXW213C9V(USD/KRW 27-10-22E	73
FXW213C9X(USD/KRW 27-10-22E	22
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

726

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

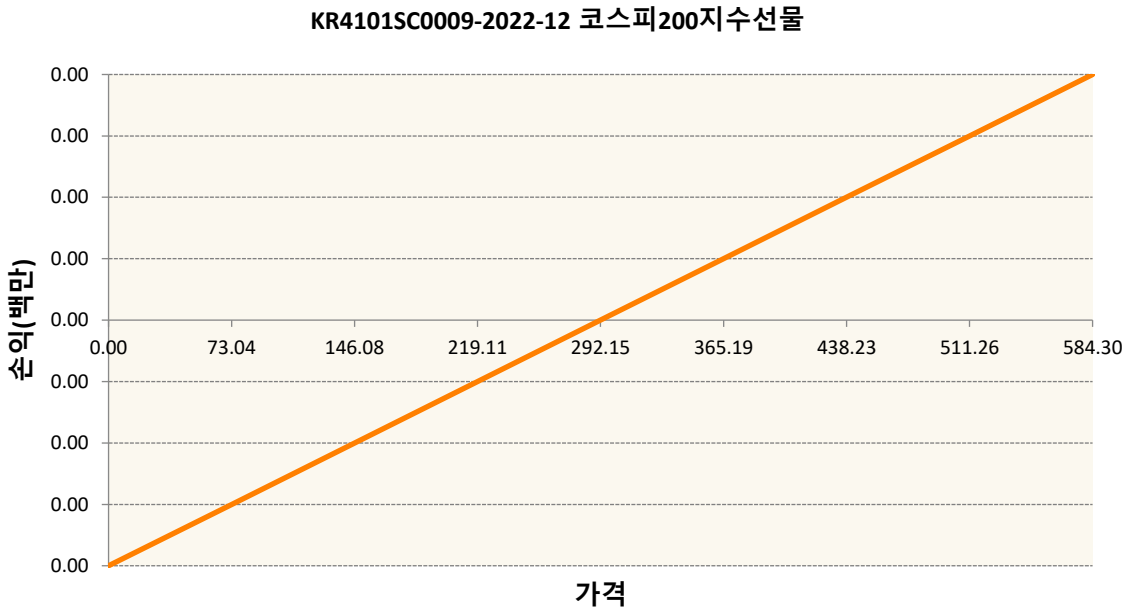
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	365	0	365	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 2022-10-07

기준일 2022-10-06

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

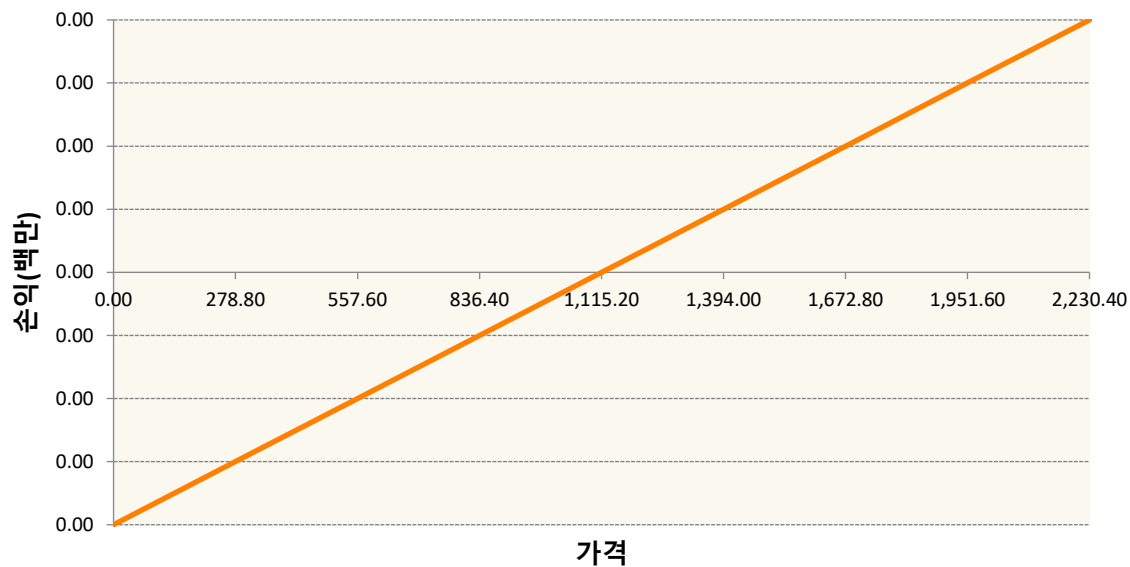
1. 계약금액

(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	1,710	0	1,710	장외
누계	통화	선도	306	1,112	-806	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCV2-VN30 Index Future OCT22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	137
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
FXW213C9X EUR/KRW 21-10-22E	8
FXW213CA4 EUR/KRW 21-10-22E	11
FXW213CA5 EUR/KRW 21-10-22E	6
VNCV2 VN30 Index Future OCT22	44

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

(단위:백만원)

261

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

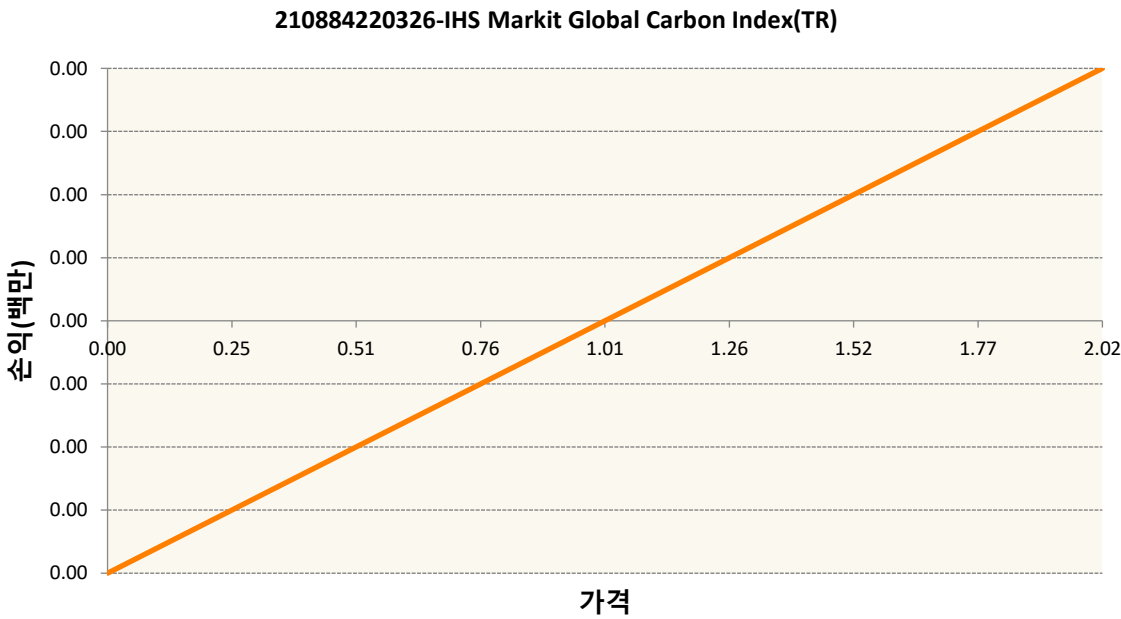
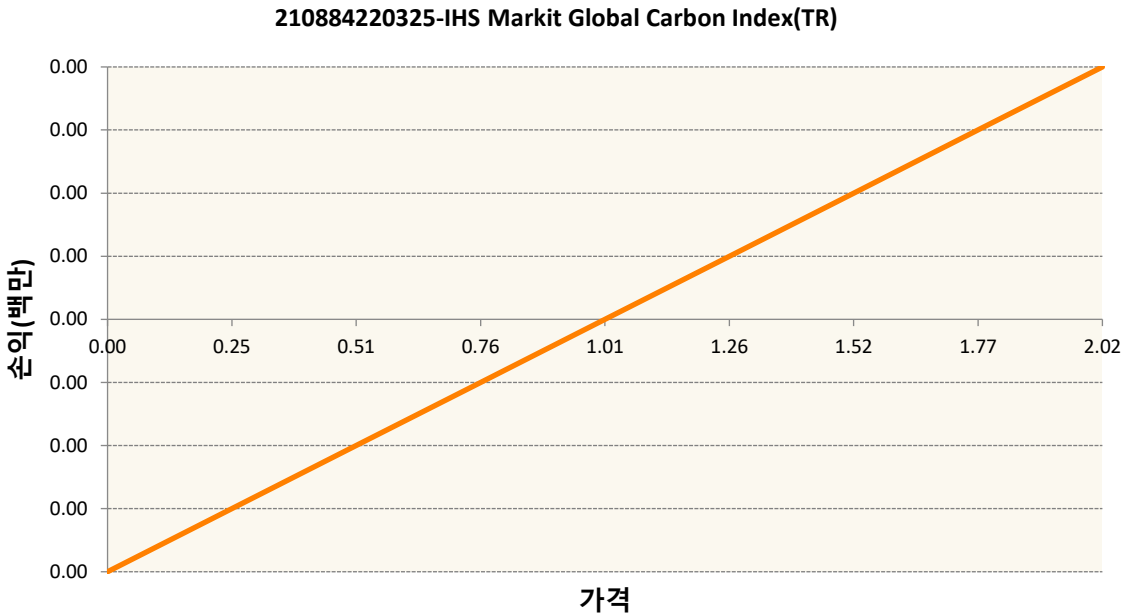
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

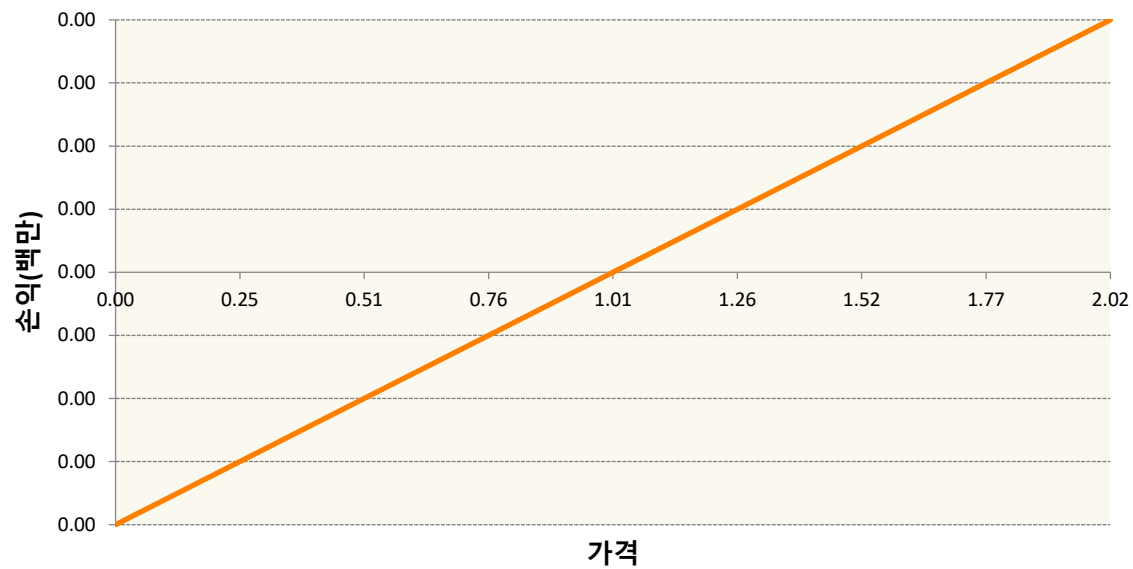
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	34,948	0	34,948	

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)

176

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

2,544

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

88

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

(단위:백만원)

5,308

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

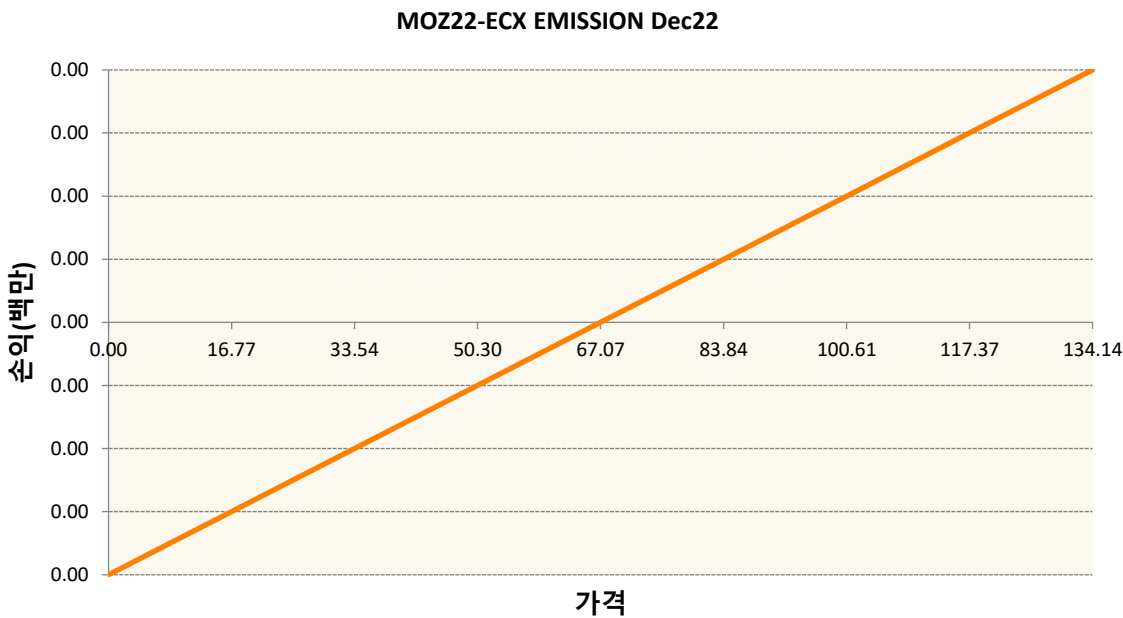
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,229	0	12,229	
누계	통화	선도	0	5,440	-5,440	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9T(KRW/EUR 27-10-22E	435
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	978

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

(단위:백만원)

2,747

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

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)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	11

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

(단위:백만원)

86

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

SOL차이나육성산업액티브상장지

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)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	24

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

(단위:백만원)

102

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

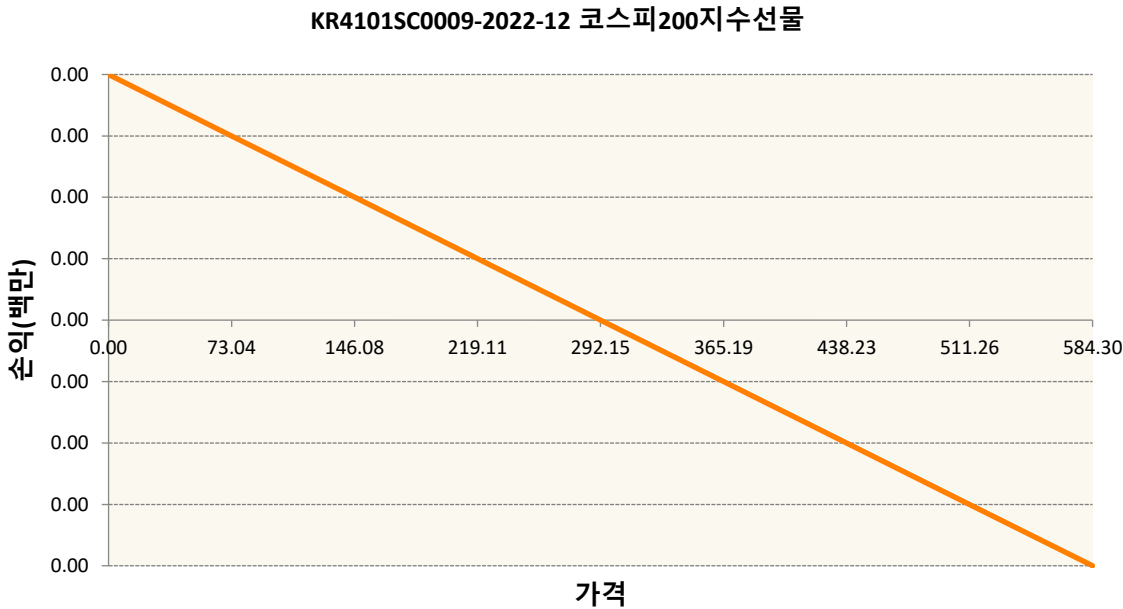
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	730	-730	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	730	-730	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물	58
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.17
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.13

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

(단위:백만원)

63

공시일 2022-10-07

기준일 2022-10-06

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

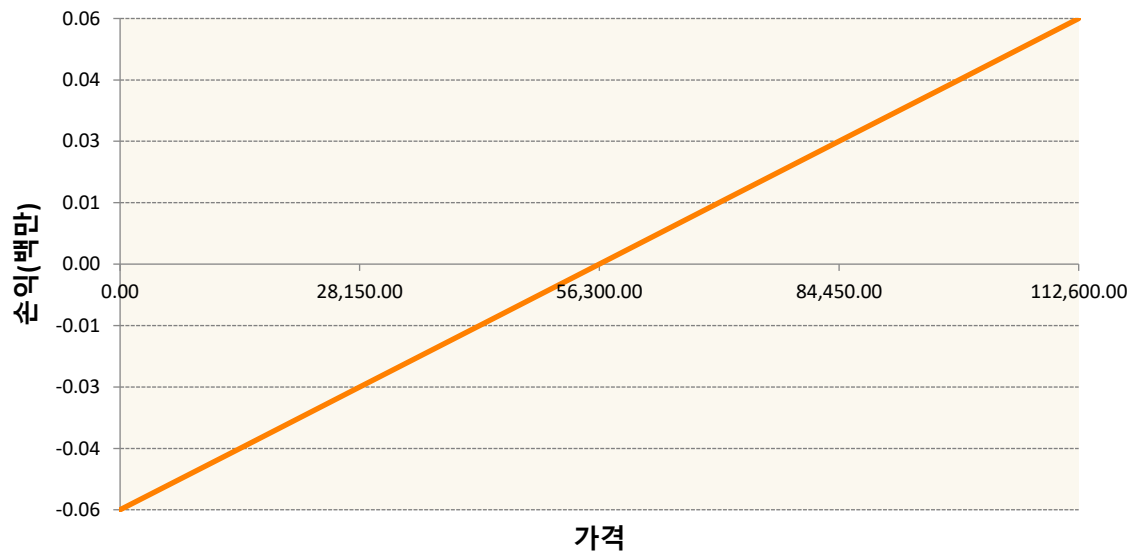
1. 계약금액

(단위:백만원)

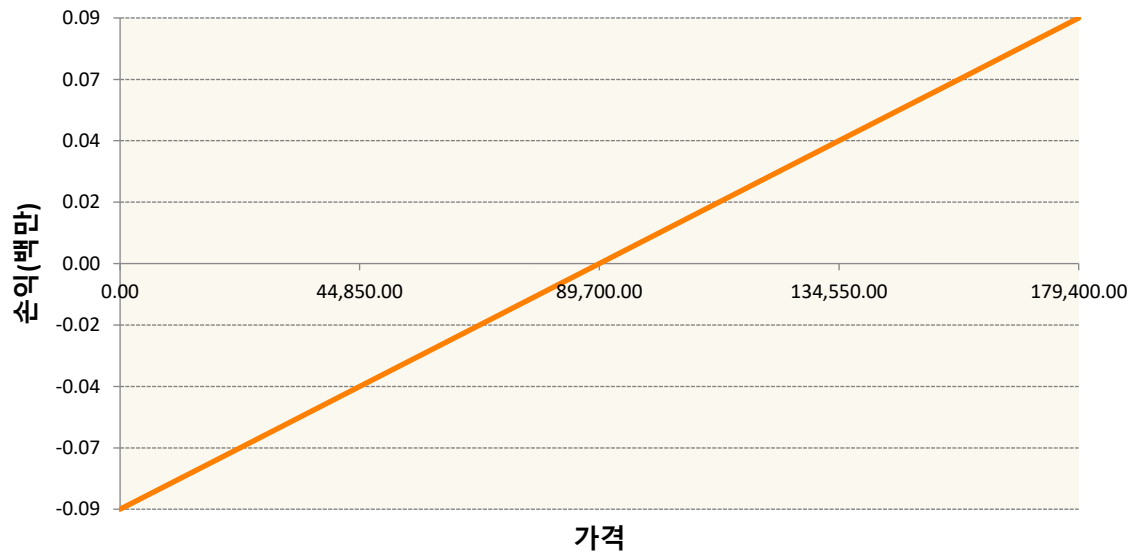
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	407	0	407	장내
누계	유가증권	ELS	389	0	389	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



KR4150SA0001-2022-10 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SA0009							2022-10 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	-33	
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	11	11	11	11	11	11	11	11	
5.33%	22	22	22	22	22	22	22	22	
8.00%	33	33	33	33	33	33	33	33	

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

32

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

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 2022-10-07

기준일 2022-10-06

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

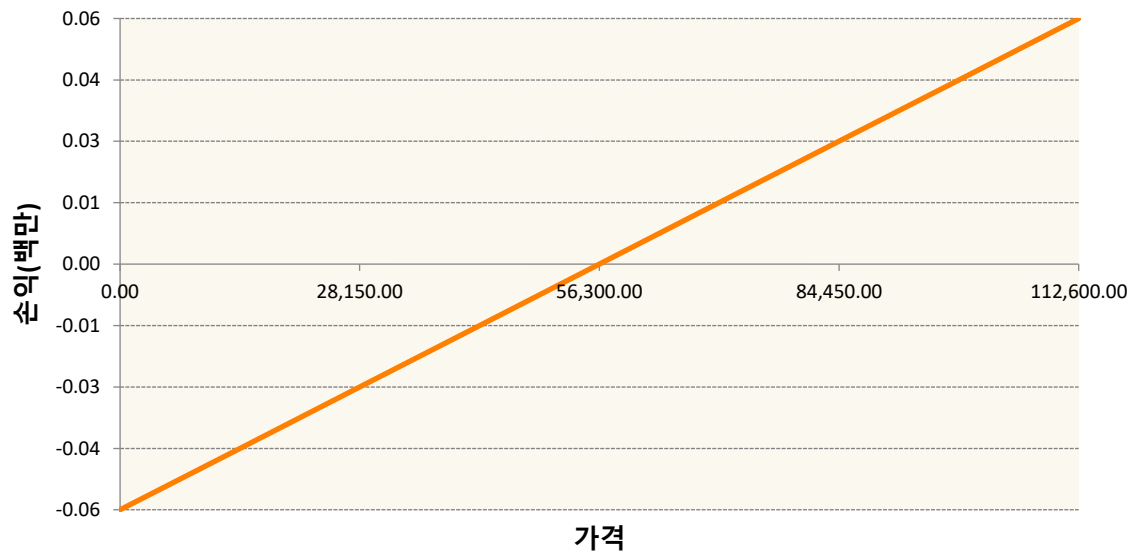
1. 계약금액

(단위:백만원)

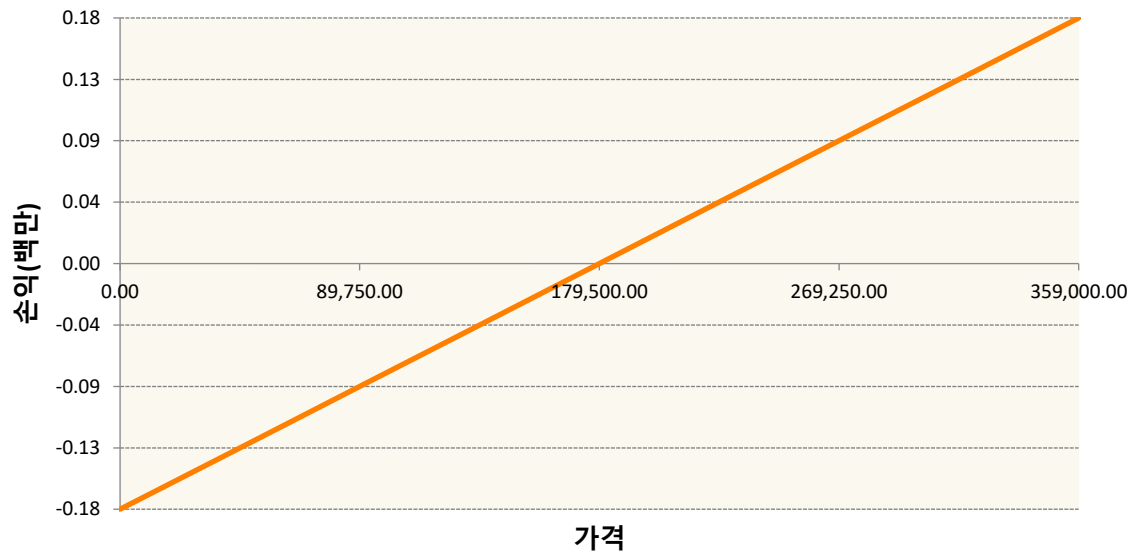
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	271	0	271	장내

2. 만기시점의 손익구조

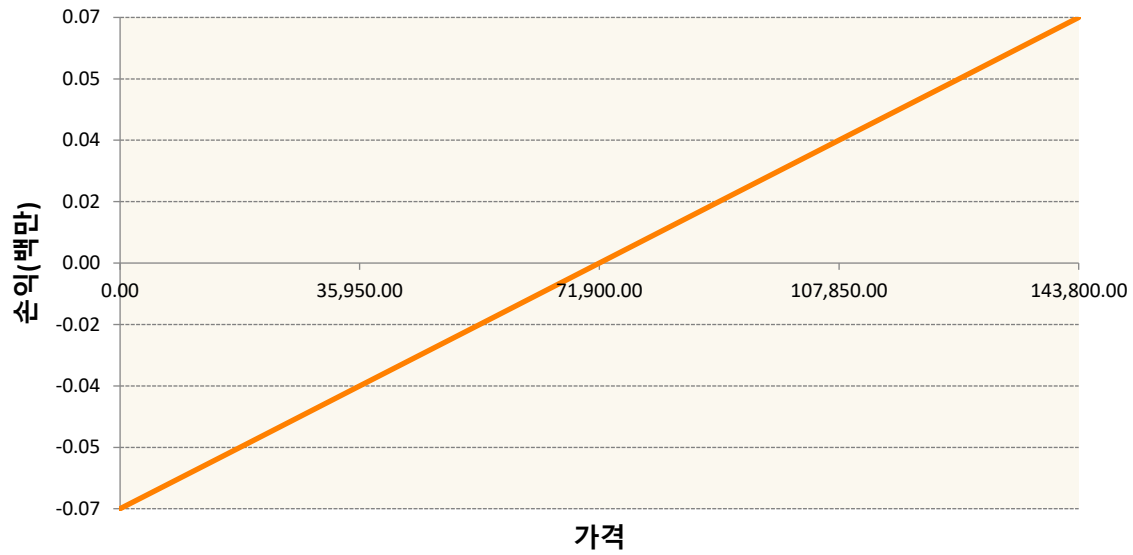
KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



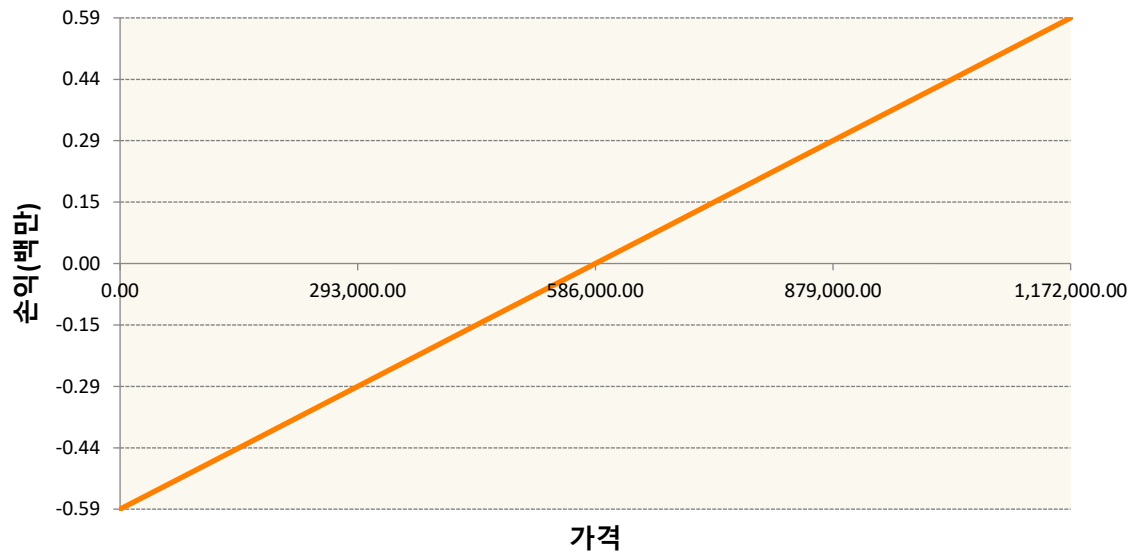
KR4116SA0004-2022-10 현대차개별선물



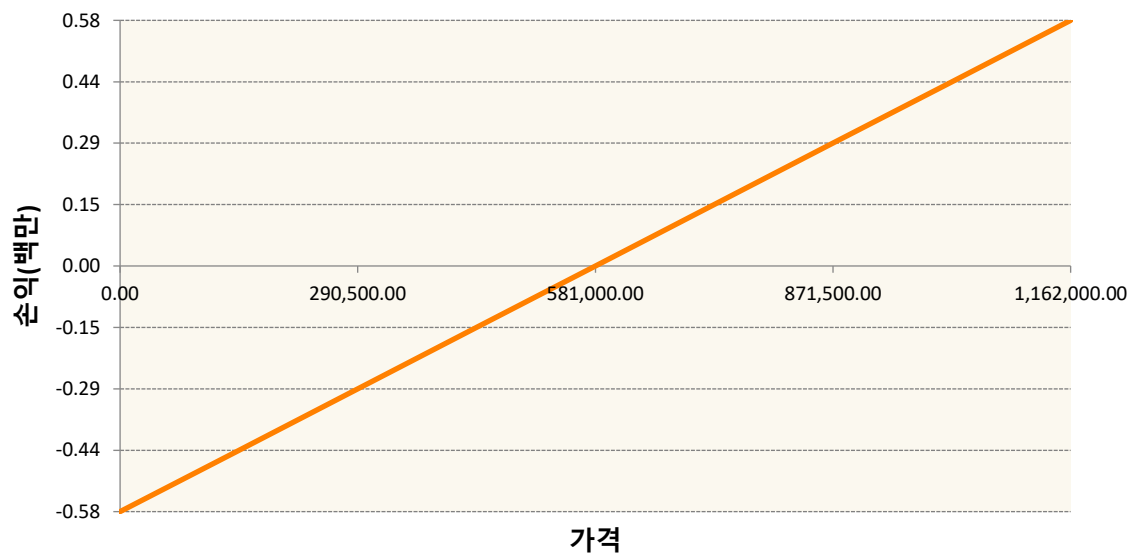
KR4119SA0001-2022-10 기아개별선물



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	-4	
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1	
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3	
8.00%	4	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	-4	
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1	
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3	
8.00%	4	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	-3	
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1	
5.33%	2	2	2	2	2	2	2	2	
8.00%	3	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	-9	
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	3	3	3	3	3	3	3	3	
5.33%	6	6	6	6	6	6	6	6	
8.00%	9	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)

26

공시일	2022-10-07
기준일	2022-10-06

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

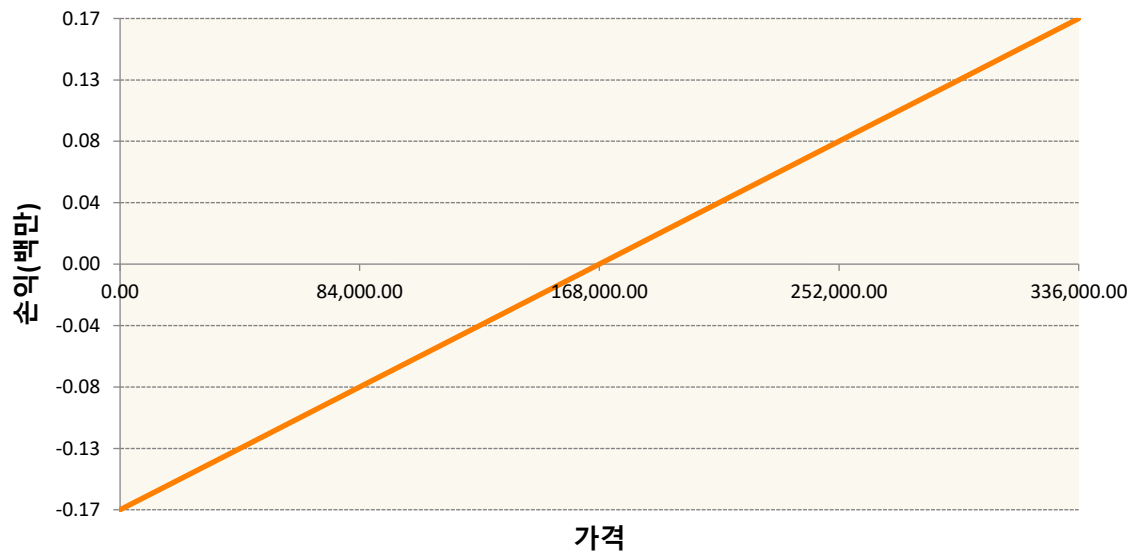
1. 계약금액

(단위:백만원)

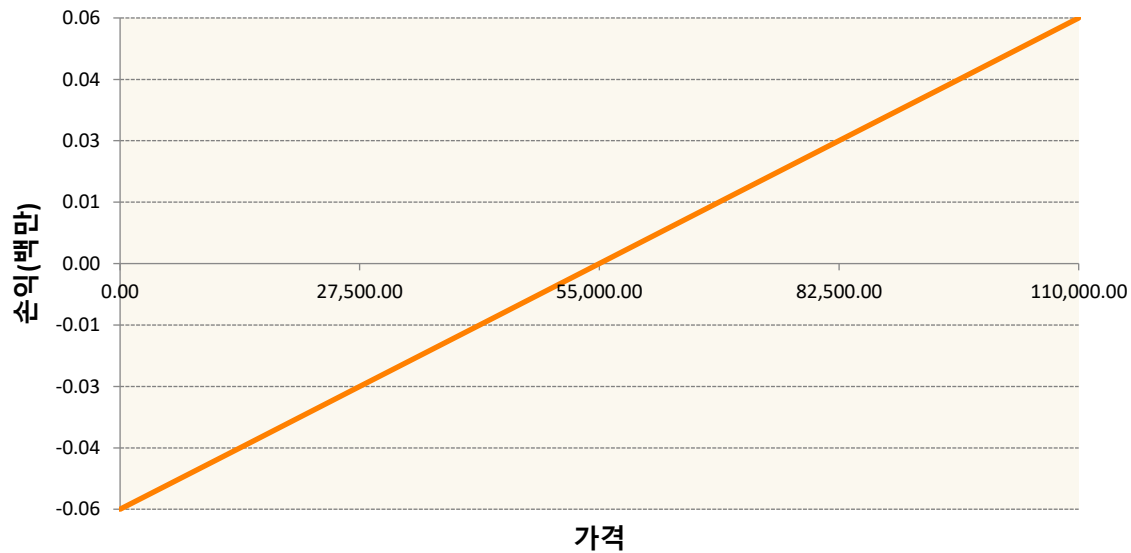
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	150	0	150	장내

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%	-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
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	2022-10-07
기준일	2022-10-06

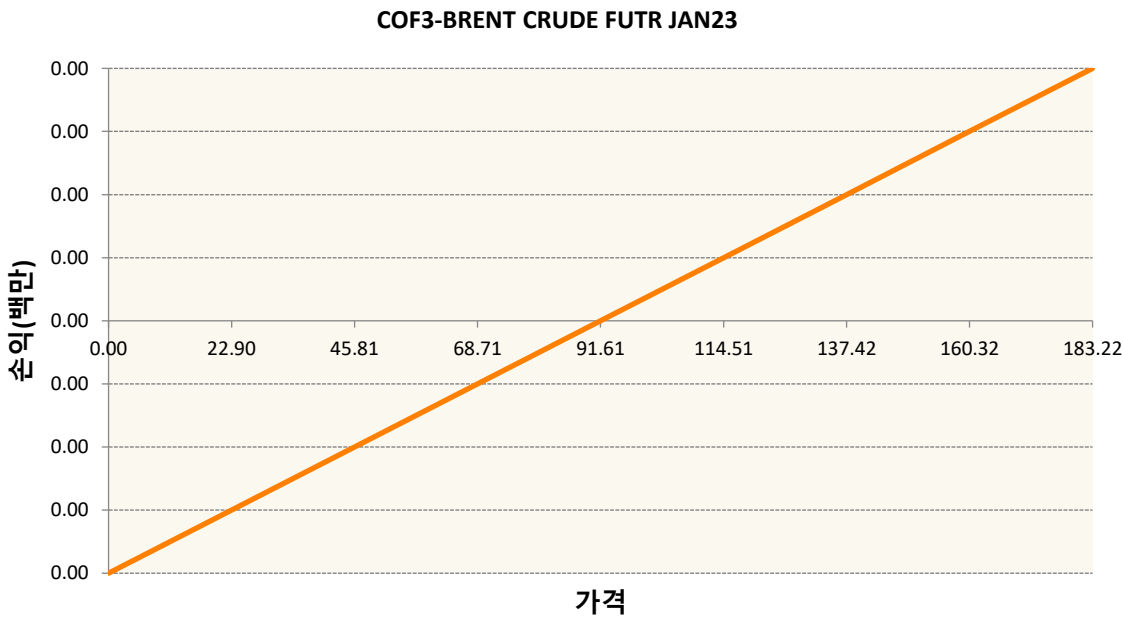
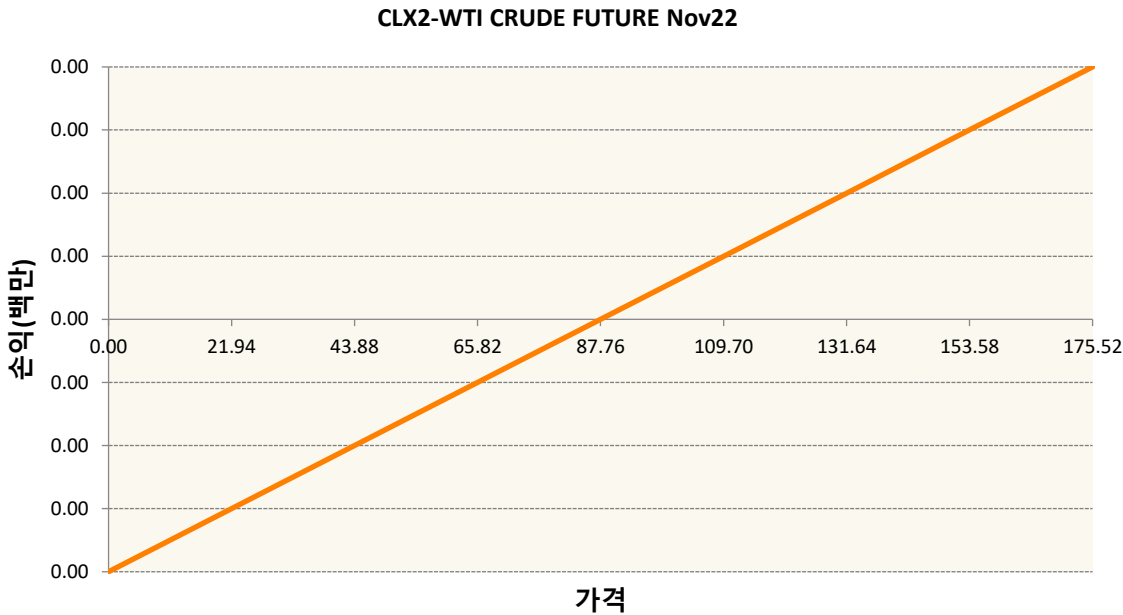
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

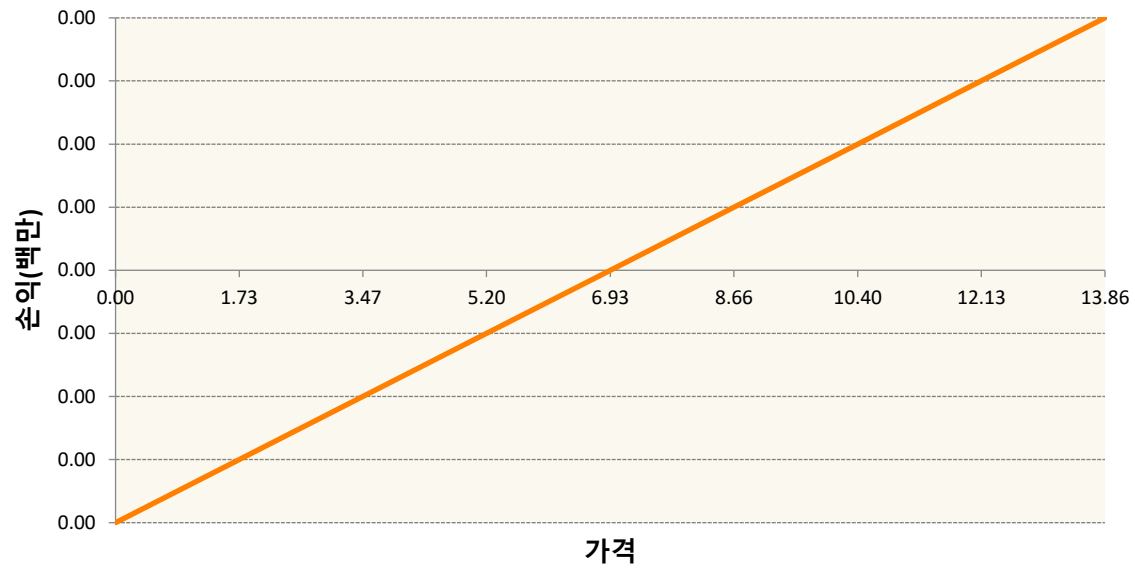
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,710	280	1,430	

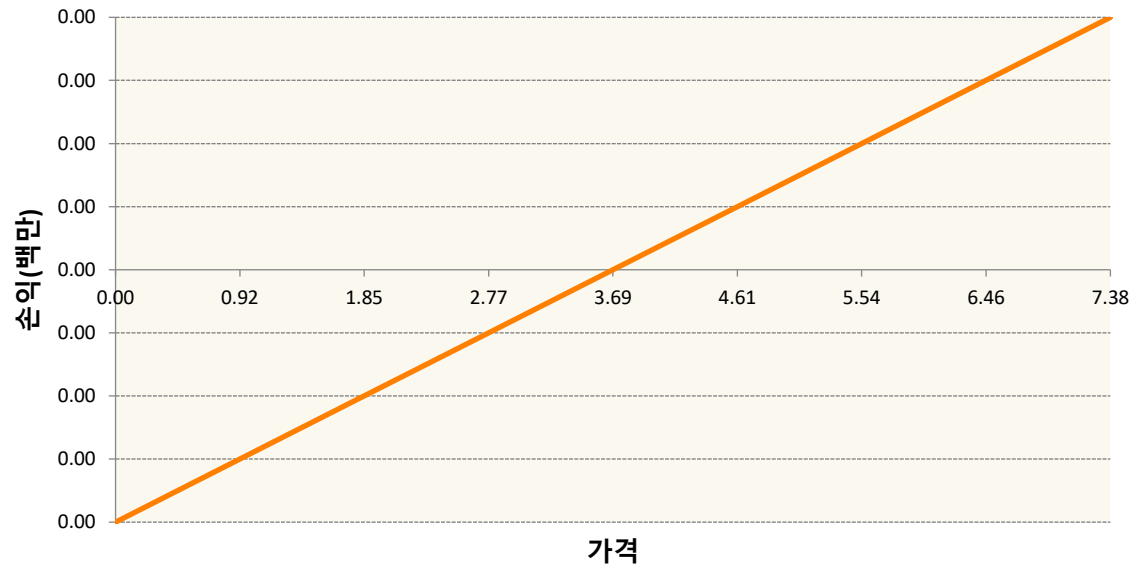
2. 만기시점의 손익구조



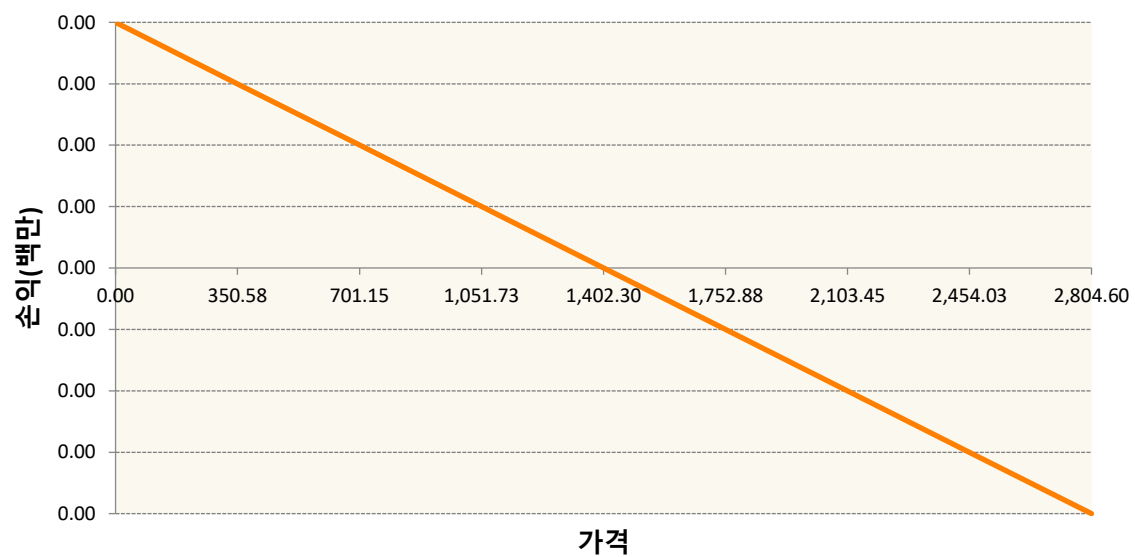
EOX2-E-MINI NATURAL GAS Nov22



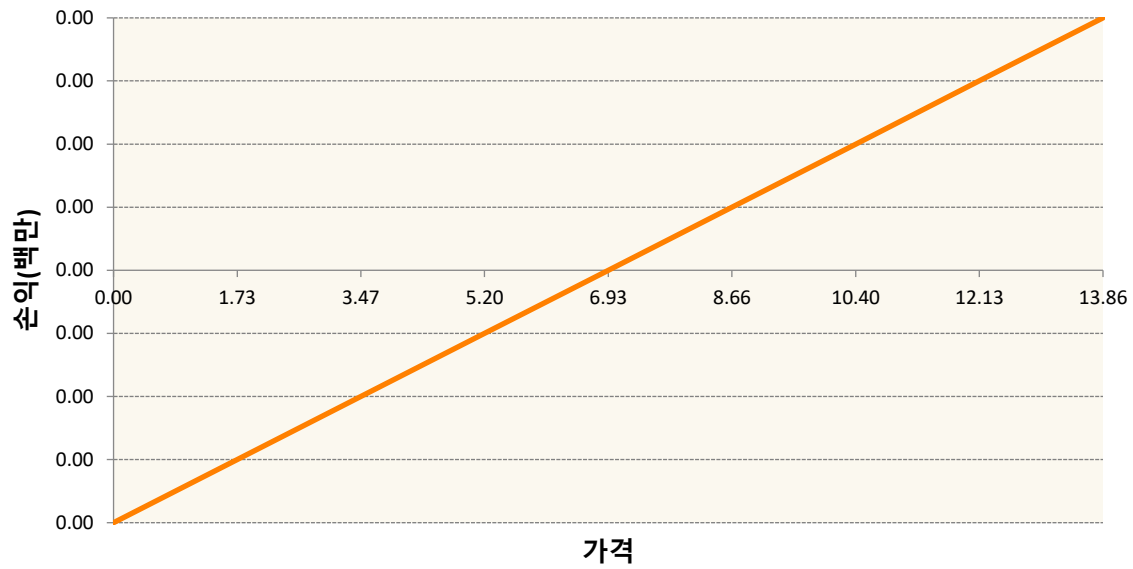
HOX2-NY Harb ULSD Fut Nov22



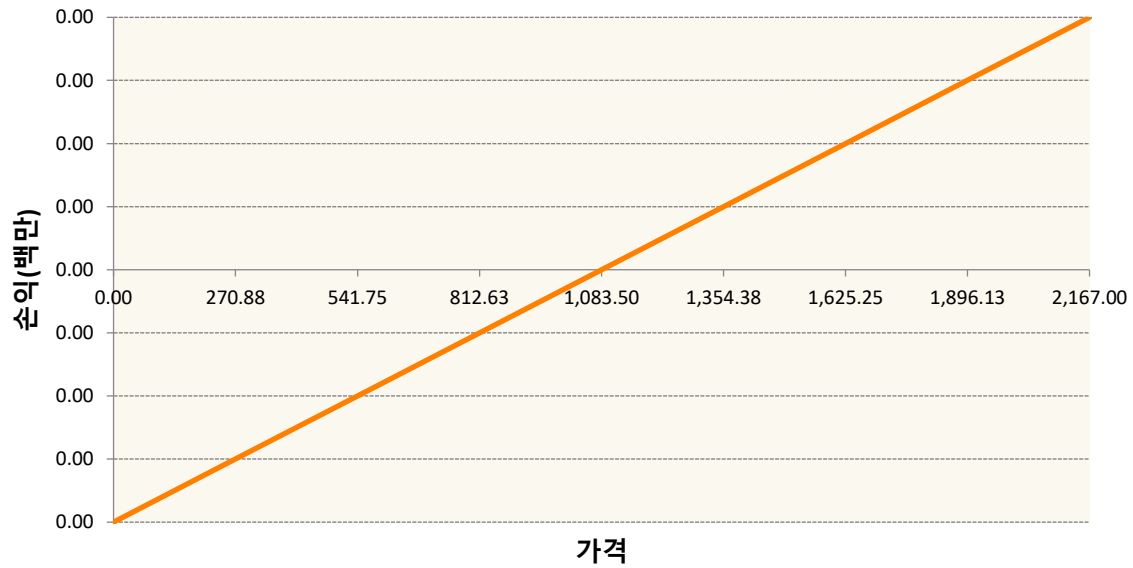
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



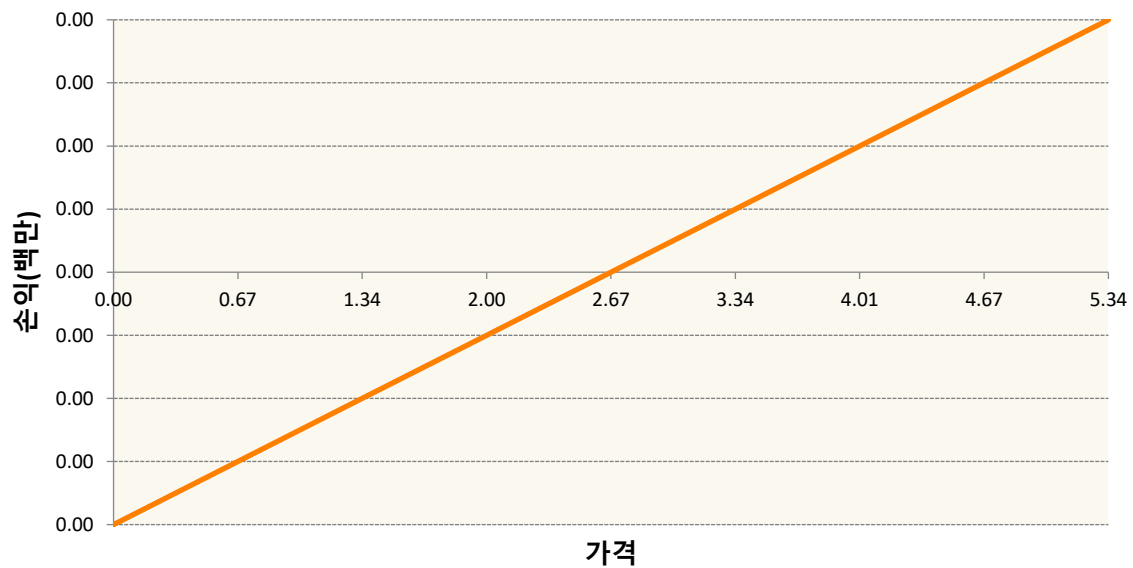
NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QX22-Low Su Gasoil G Nov22



XB22-GASOLINE RBOB FUT Nov22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX2	WTI CRUDE FUTURE Nov22	18
COF3	BRENT CRUDE FUTR JAN23	31
EOX2	E-MINI NATURAL GAS Nov22	6
HOX2	NY Harb ULSD Fut Nov22	16
KR4175SA00 2022-10 달러선물		22
NGX22	NATURAL GAS FUTR Nov22	43
QSX2	Low Su Gasoil G Nov22	11
XBX2	GASOLINE RBOB FUT Nov22	12

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

433