

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

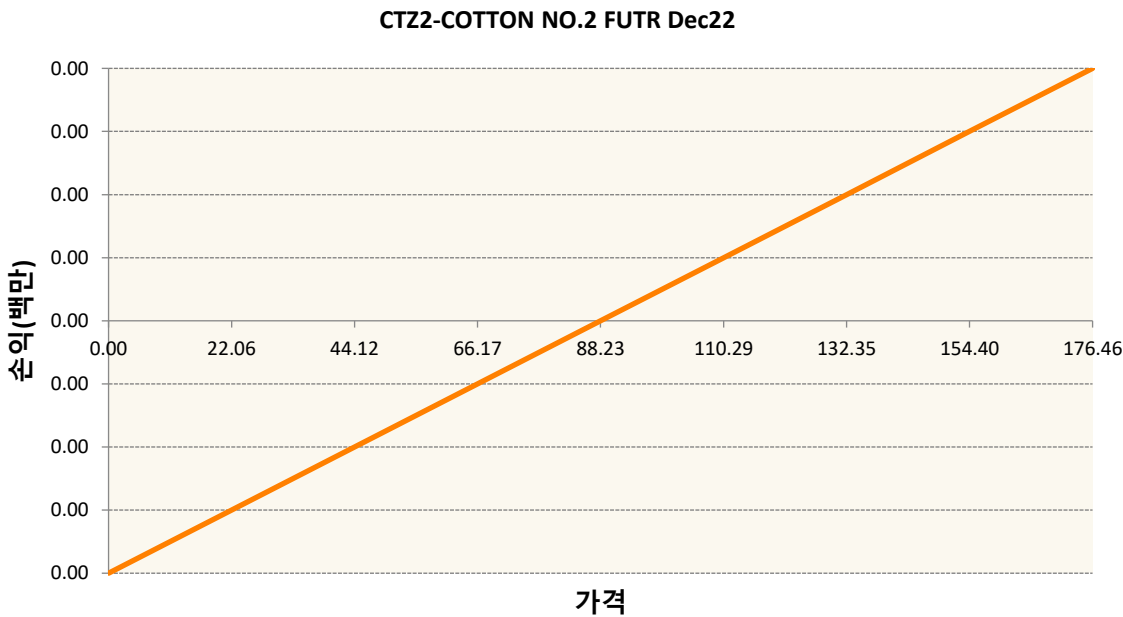
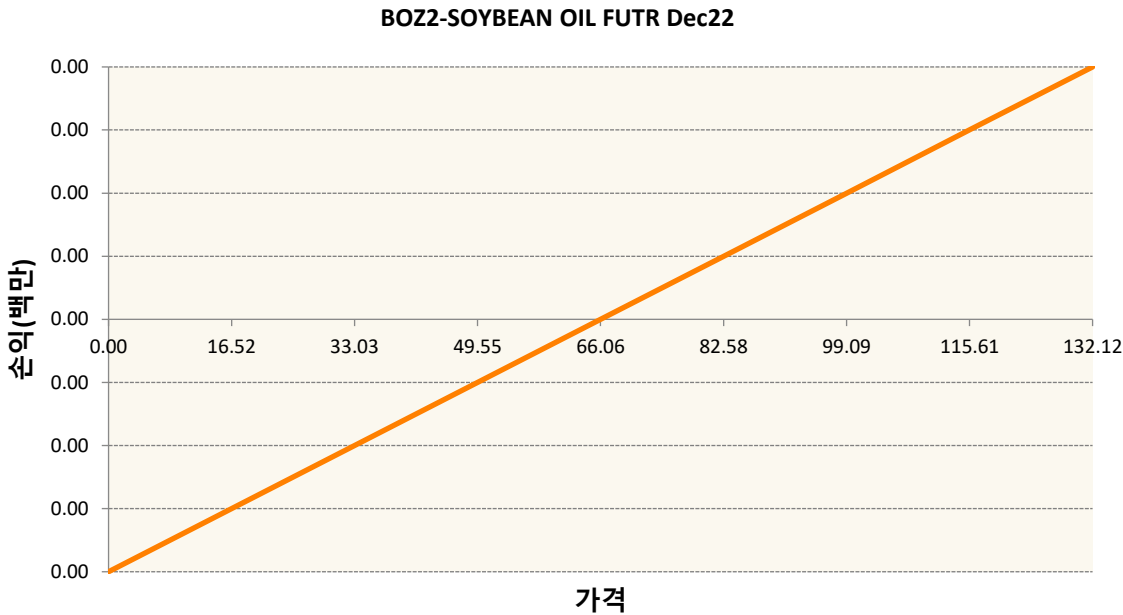
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

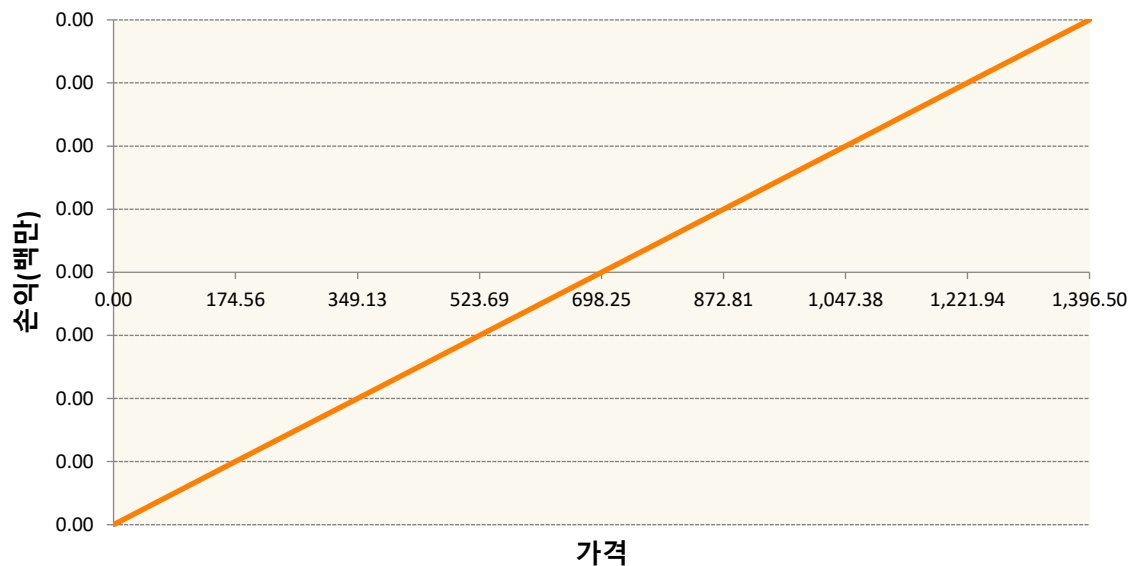
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,607 | 862   | 5,745     |    |

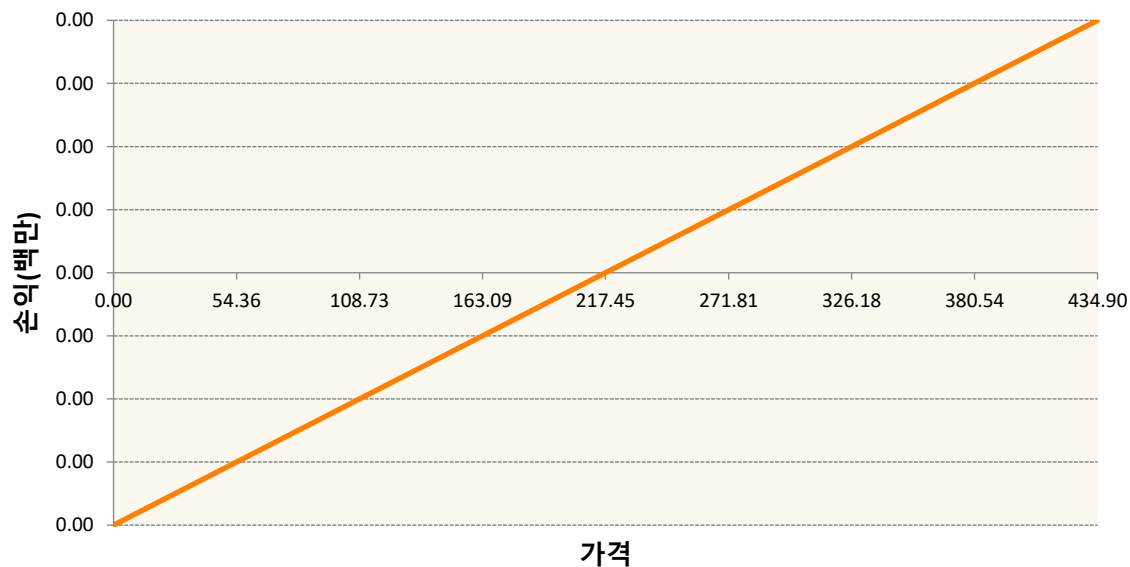
### 2. 만기시점의 손익구조



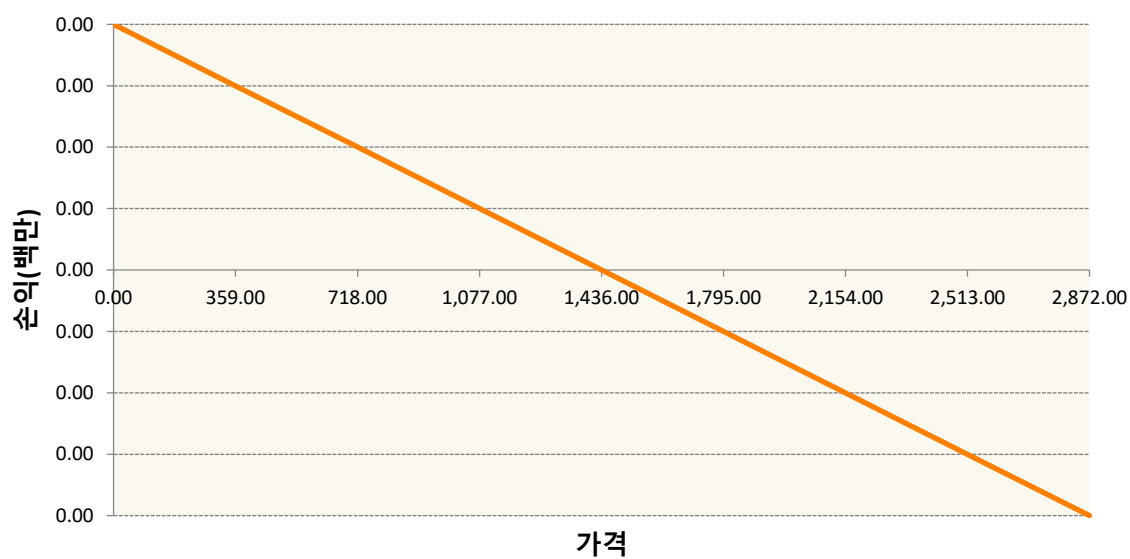
CZ2-CORN FUTURE Dec22



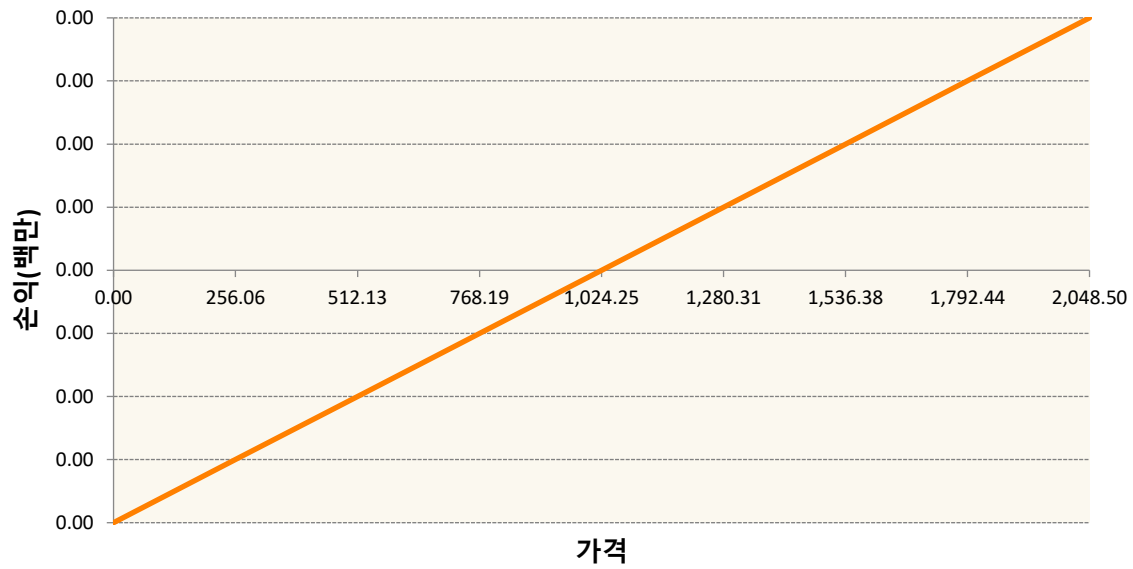
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



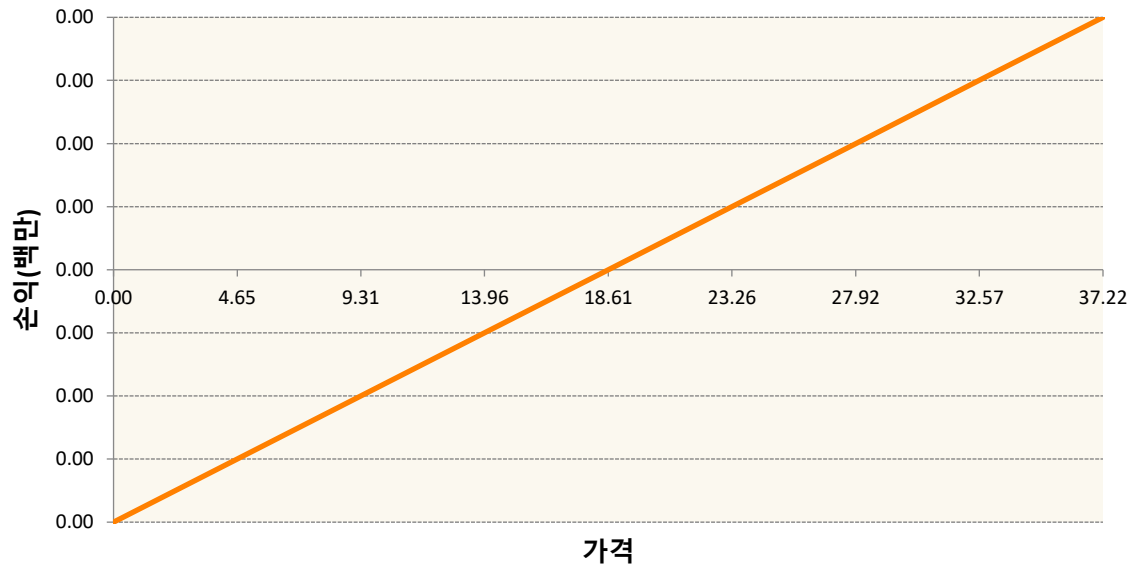
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



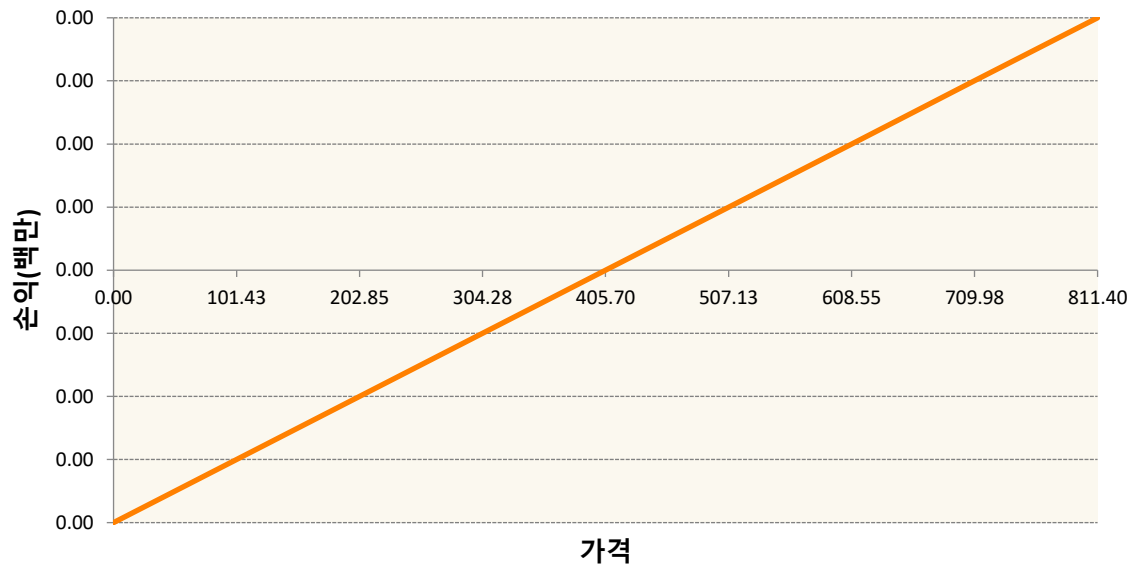
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

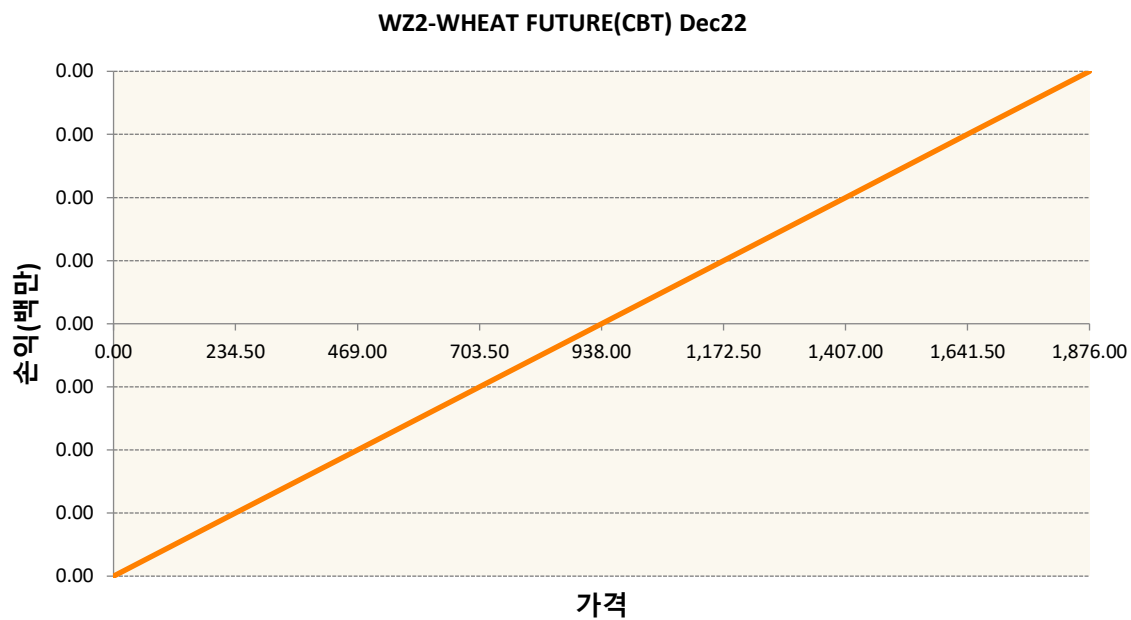
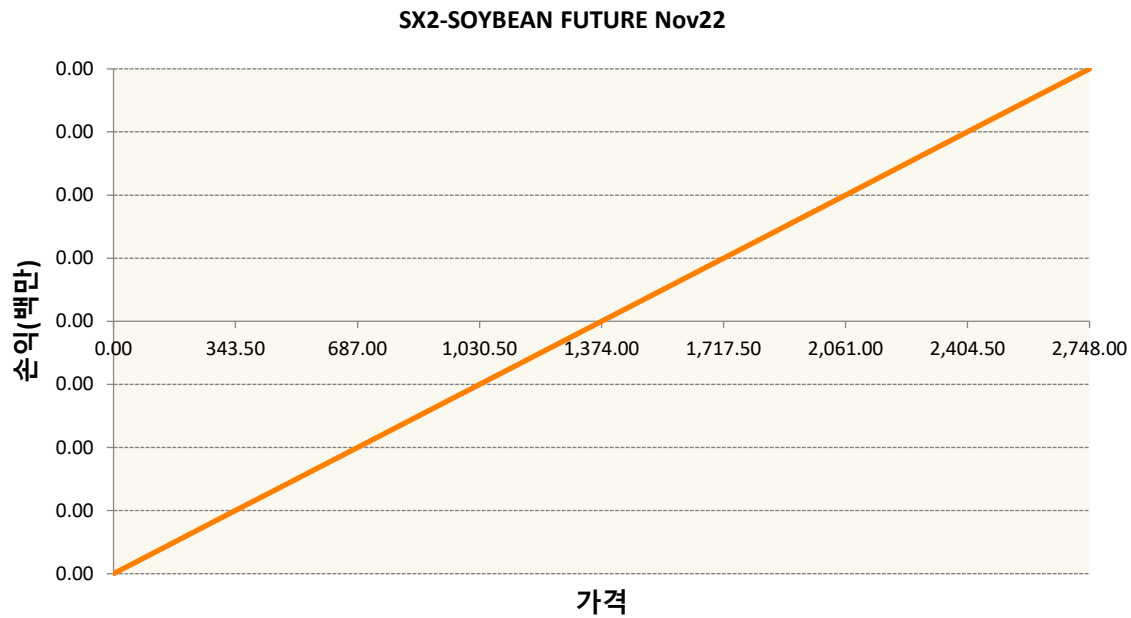


SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



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 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

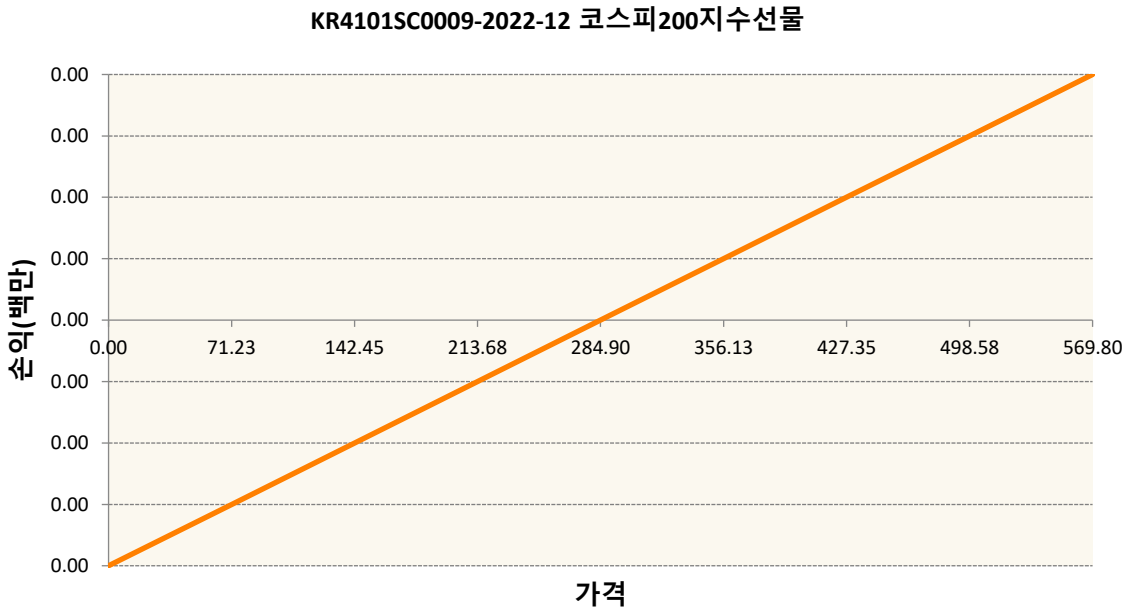
스마트인덱스모

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   | 855   | 0     | 855       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101SC0009 |           |         | 2022-12 코스피200지수선물 |     |       |        | 68     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -68       | -68     | -68                | -68 | -68   | -68    | -68    |
| -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%        | 68        | 68      | 68                 | 68  | 68    | 68     | 68     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

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 | 313 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 414 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

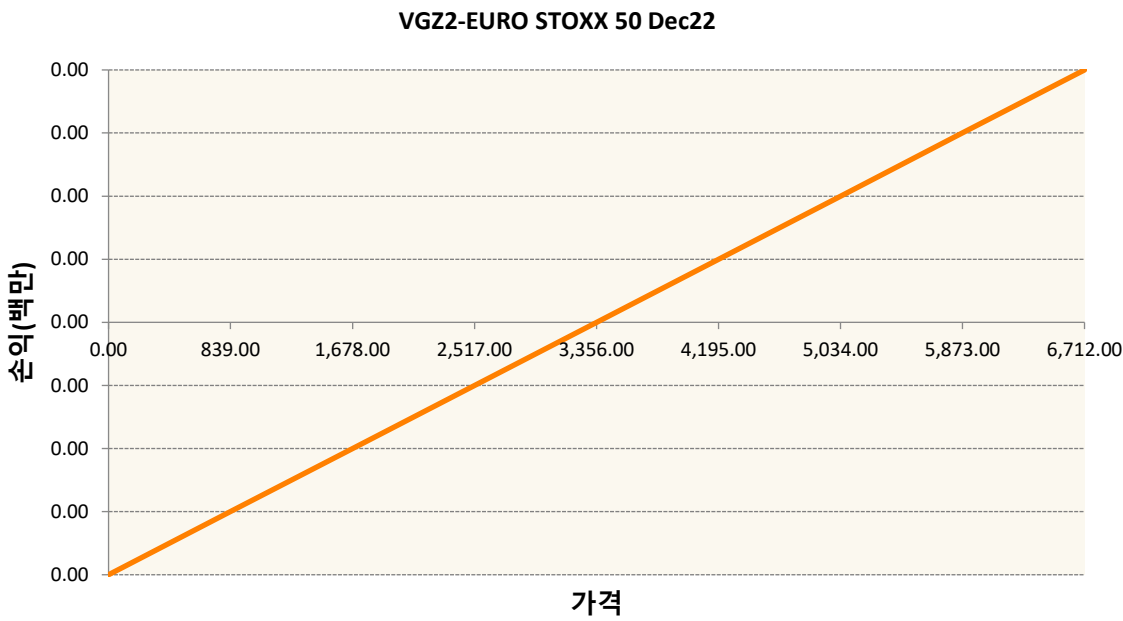
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 466   | 0     | 466       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 39 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

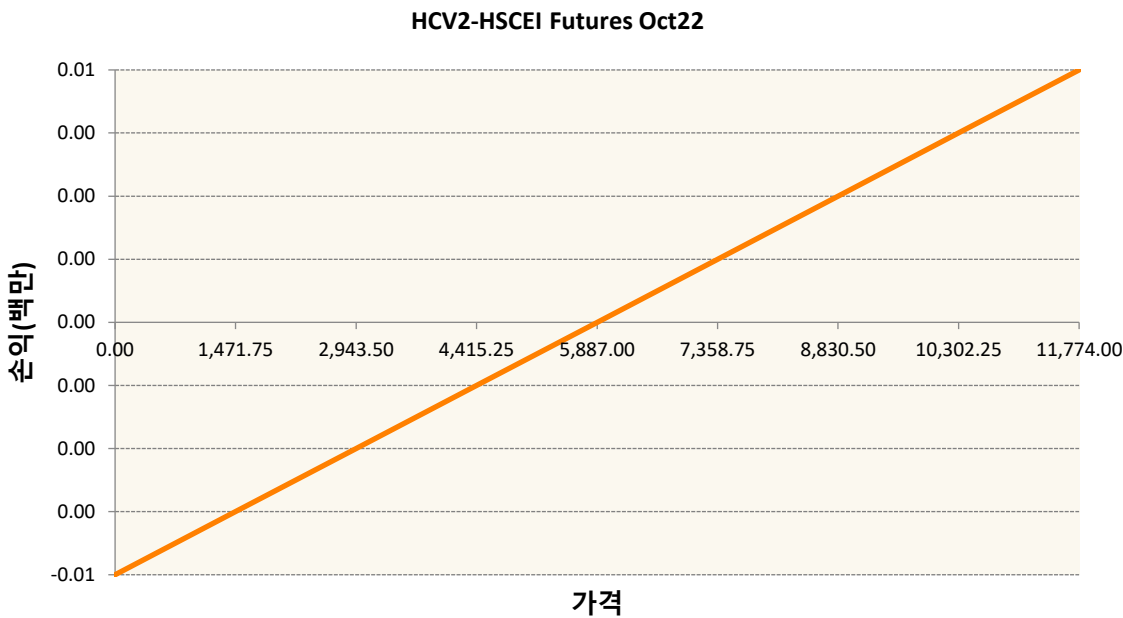
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 971   | 0     | 971       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCV2 | HSCEI Futures Oct22 | 78 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 116 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

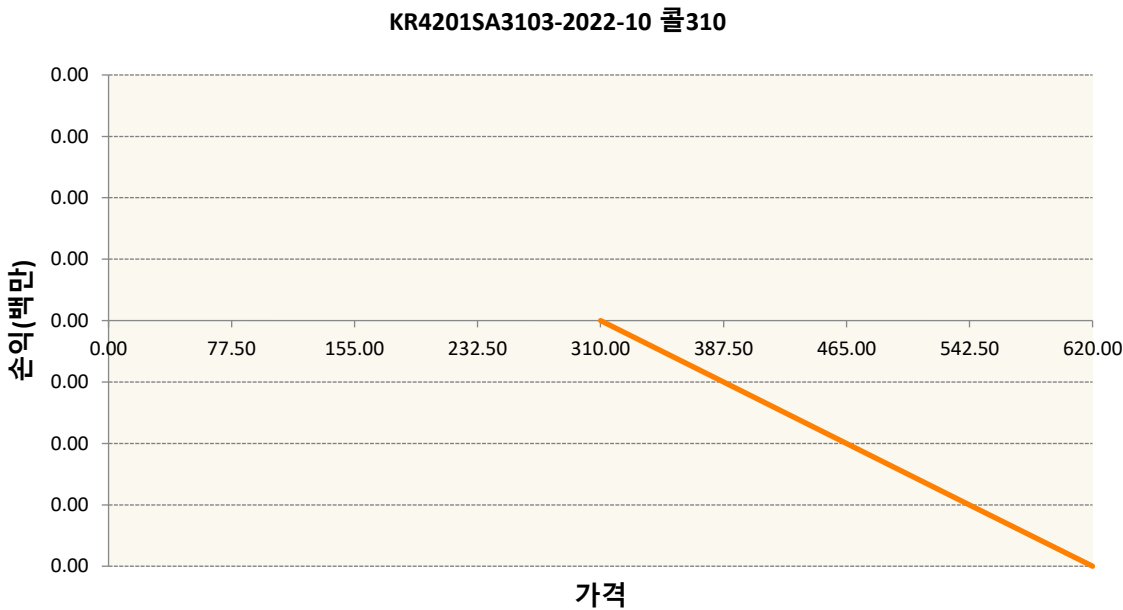
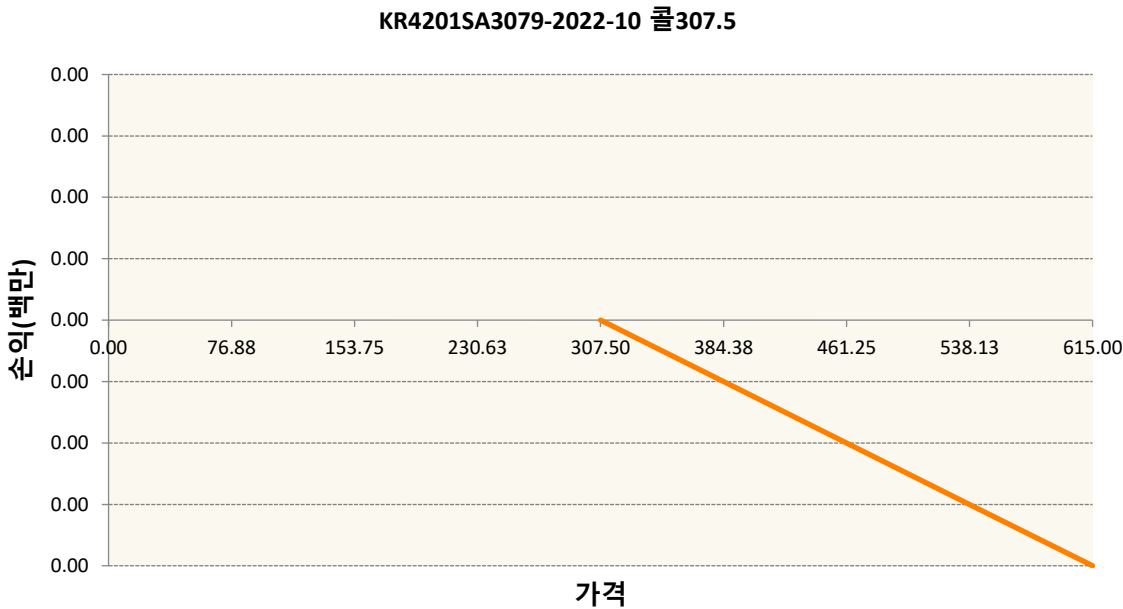
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

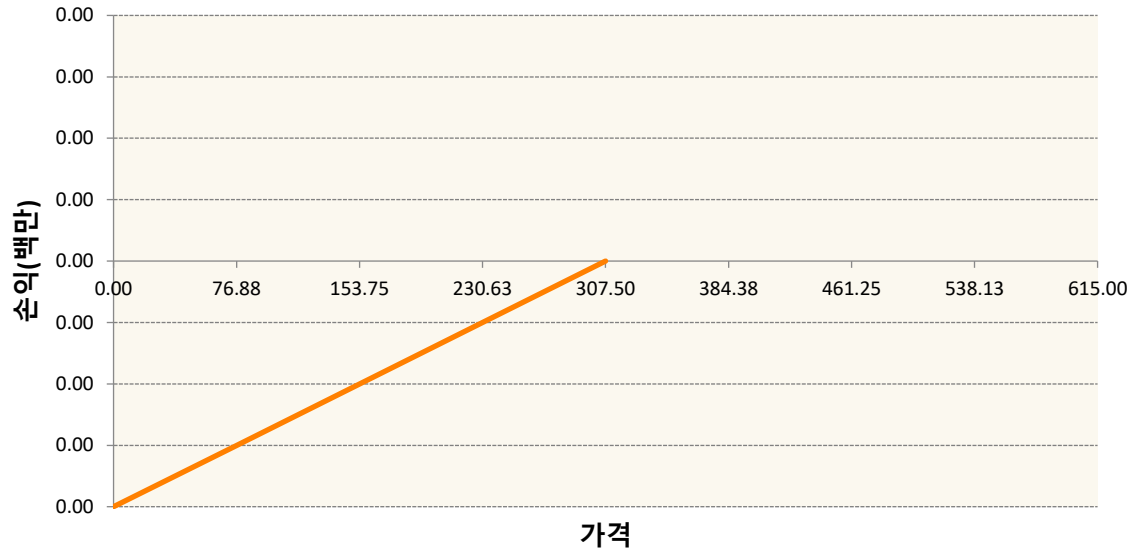
(단위:백만원)

| 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 |        |      |       |        | 173    |
|              | 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    | 1     | 1      | 0      |
| 0%           | 1         | 1              | 1      | 0    | -1    | -2     | -4     |
| 2.67%        | -1        | -3             | -5     | -8   | -12   | -16    | -21    |
| 5.33%        | -21       | -28            | -36    | -44  | -52   | -61    | -71    |
| 8.00%        | -105      | -116           | -128   | -139 | -150  | -162   | -173   |
| KR4201SA3103 |           | 2022-10 콜310   |        |      |       |        | 468    |
|              | 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     | 2      | 2      |
| -2.67%       | 2         | 2              | 2      | 2    | 2     | 1      | 0      |
| 0%           | 2         | 2              | 1      | 0    | -2    | -5     | -8     |
| 2.67%        | -1        | -4             | -9     | -16  | -25   | -36    | -49    |
| 5.33%        | -37       | -55            | -76    | -98  | -123  | -150   | -178   |
| 8.00%        | -238      | -276           | -314   | -352 | -391  | -429   | -468   |
| KR4301SA3078 |           | 2022-10 풋307.5 |        |      |       |        | 768    |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -768      | -768           | -768   | -768 | -768  | -768   | -768   |
| -5.33%       | -512      | -512           | -512   | -512 | -512  | -512   | -512   |
| -2.67%       | -255      | -255           | -255   | -255 | -256  | -256   | -256   |
| 0%           | 1         | 1              | 1      | 0    | -1    | -2     | -4     |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 256 | 254 | 251 | 248 | 245 | 240 | 235 |
| 5.33% | 492 | 485 | 477 | 469 | 460 | 451 | 442 |
| 8.00% | 664 | 653 | 642 | 630 | 619 | 608 | 597 |

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

(단위:백만원)

934

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

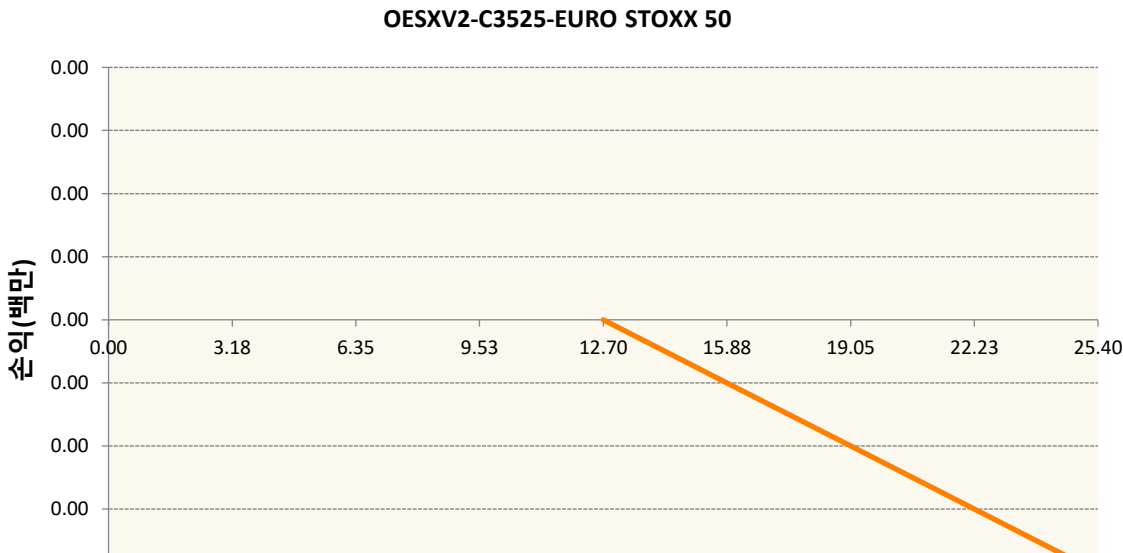
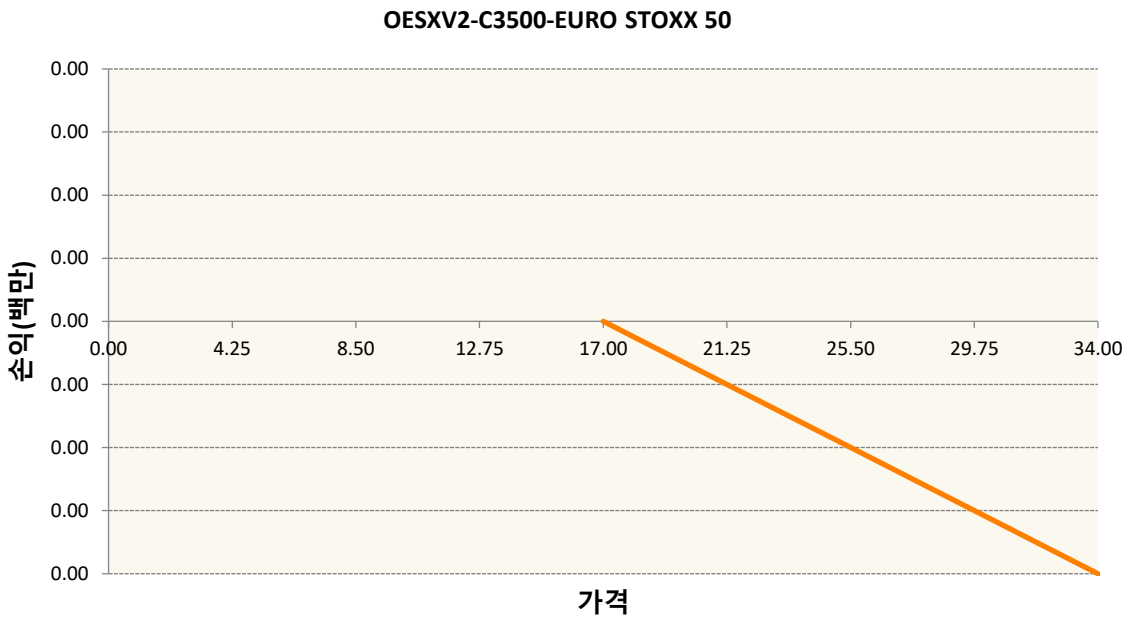
## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

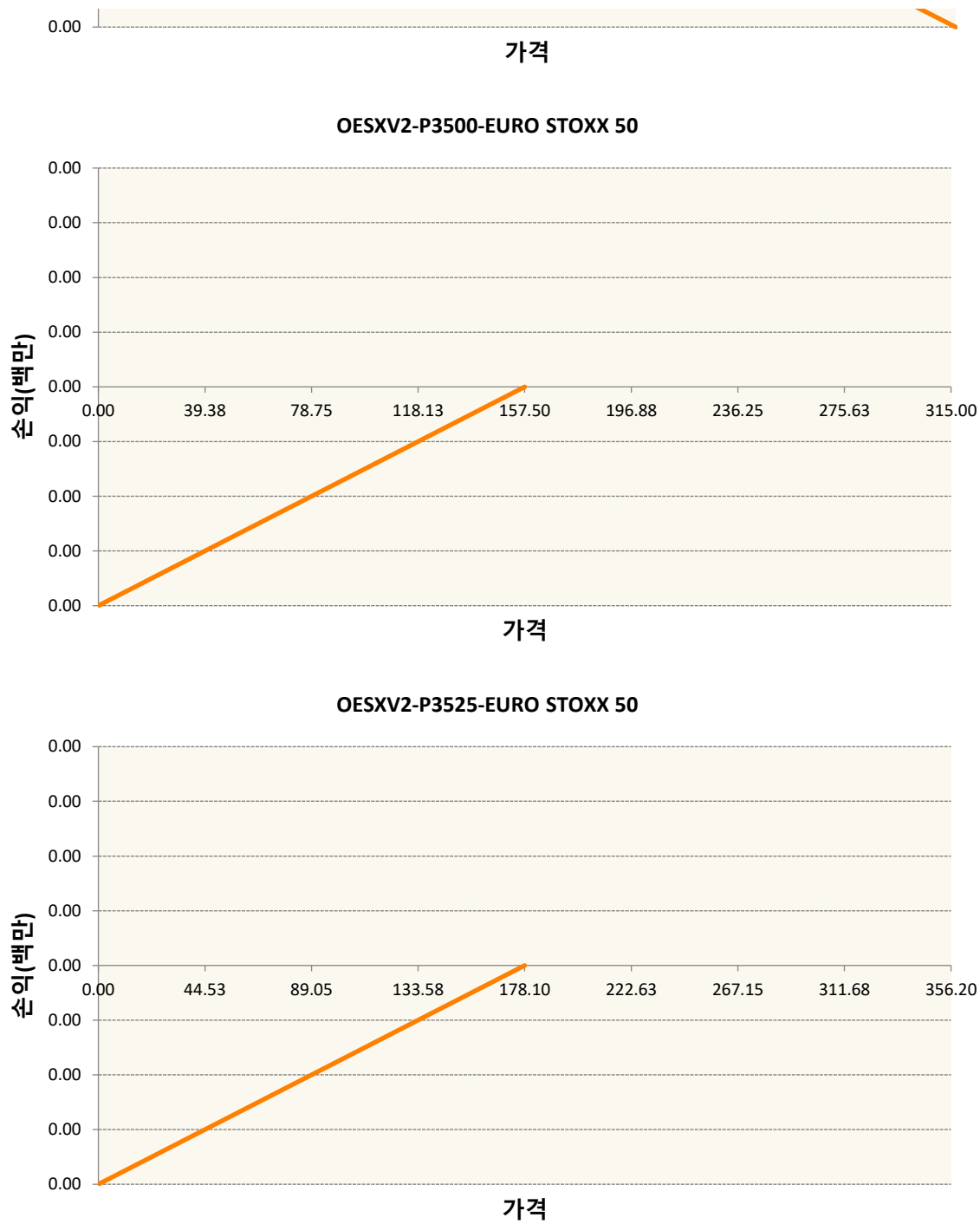
### 1. 계약금액

(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     | 32    | -32       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 905   | -905      | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                |  | (단위:백만원) |
|------------------------------------------|--|----------|
| 260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY |  | 8        |
| FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E              |  | 72       |
| OESXV2-C35 EURO STOXX 50                 |  | 0.23     |
| OESXV2-C35 EURO STOXX 50                 |  | 0.01     |
| OESXV2-P35 EURO STOXX 50                 |  | 2        |
| OESXV2-P35 EURO STOXX 50                 |  | 0.2      |

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



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

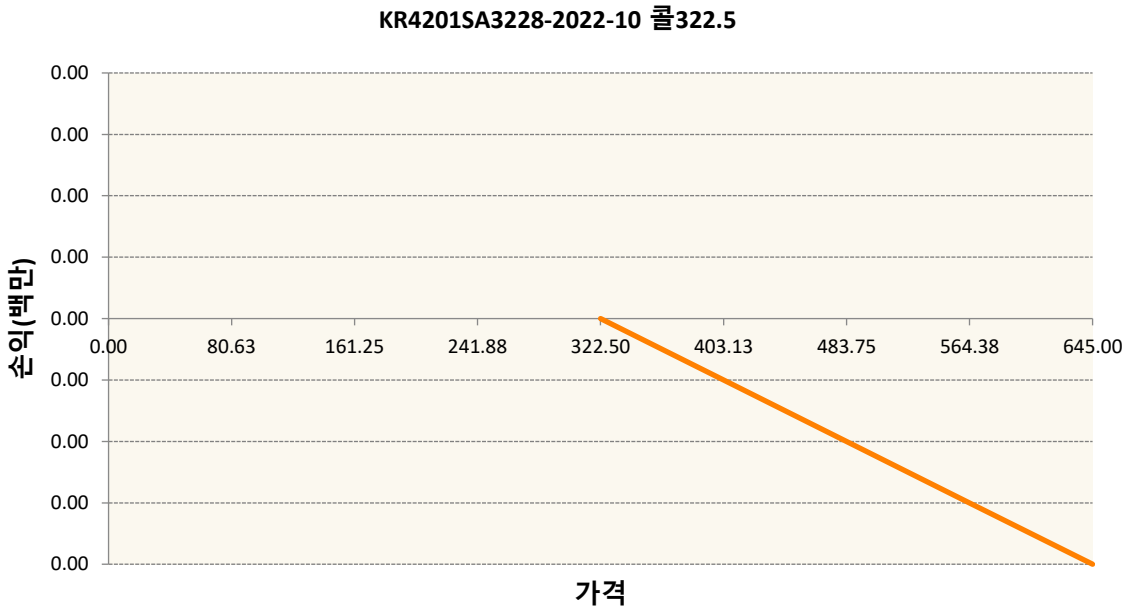
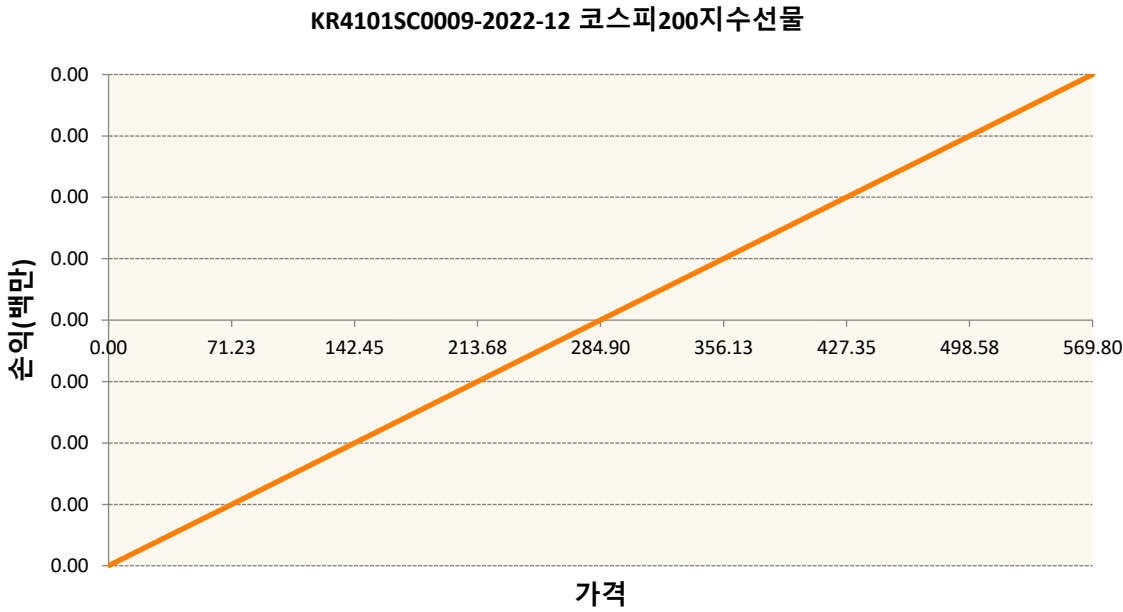
## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

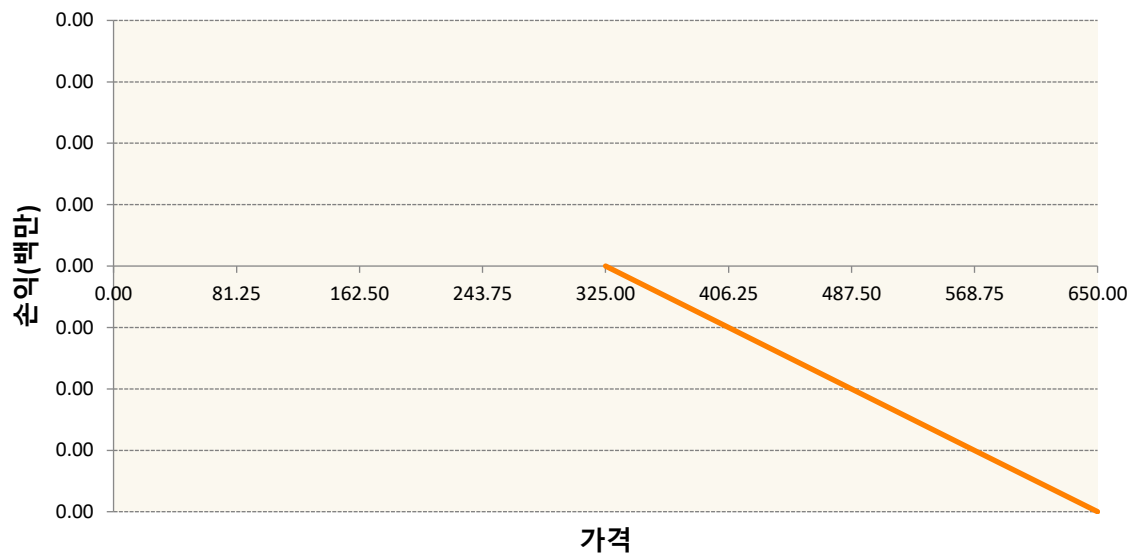
(단위:백만원)

| 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   | 285   | 0     | 285       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 308   | 4,219 | -3,911    | 장내 |

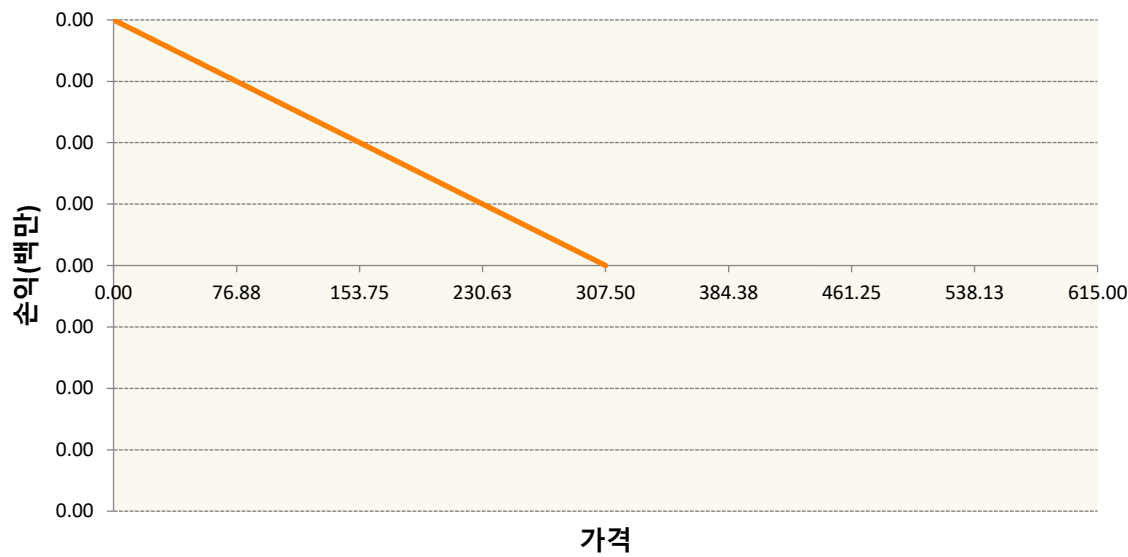
### 2. 만기시점의 손익구조



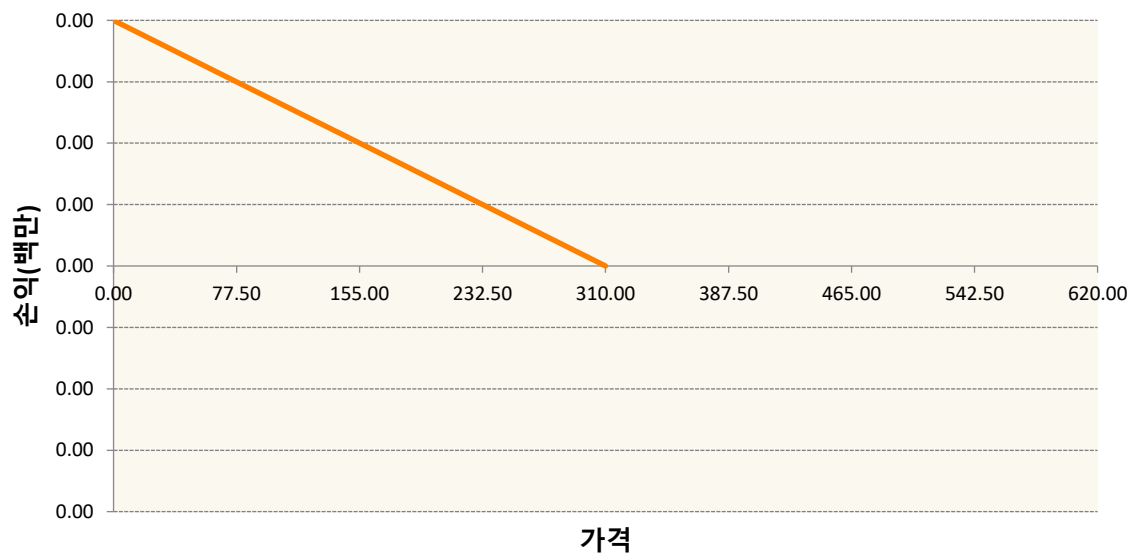
KR4201SA3251-2022-10 콜325



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     |  | 2  |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |     |       |        |                    |  |    |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |  |    |  |
| -8.00%       | 0         | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0                  |  |    |  |
| -5.33%       | 0         | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0                  |  |    |  |
| -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%        | 0         | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0                  |  |    |  |
| 8.00%        | 0         | 0       | -1     | -1  | -1    | -1     | -2                 |  |    |  |
| KR4201SA3251 |           |         |        |     |       |        | 2022-10 콜325       |  | 6  |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |     |       |        |                    |  |    |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |  |    |  |
| -8.00%       | 0         | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0                  |  |    |  |
| -5.33%       | 0         | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0                  |  |    |  |
| -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%        | 0         | 0       | 0      | 0   | -1    | -1     | -1                 |  |    |  |
| 8.00%        | 0         | -1      | -1     | -2  | -3    | -4     | -6                 |  |    |  |
| KR4301SA3078 |           |         |        |     |       |        | 2022-10 풋307.5     |  | 17 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |     |       |        |                    |  |    |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |  |    |  |
| -8.00%       | 17        | 17      | 17     | 17  | 17    | 17     | 17                 |  |    |  |
| -5.33%       | 11        | 11      | 11     | 11  | 11    | 11     | 11                 |  |    |  |
| -2.67%       | 6         | 6       | 6      | 6   | 6     | 6      | 6                  |  |    |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0                  |  |    |  |
| 2.67%        | -6        | -6      | -6     | -6  | -5    | -5     | -5                 |  |    |  |
| 5.33%        | -11       | -11     | -11    | -10 | -10   | -10    | -10                |  |    |  |
| 8.00%        | -15       | -15     | -14    | -14 | -14   | -14    | -13                |  |    |  |
| KR4301SA3102 |           |         |        |     |       |        | 2022-10 풋310       |  | 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    | -3     | -3     |
| 8.00%  | -5      | -5      | -5     | -5 | -5    | -5     | -5     |

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

(단위:백만원)

47

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

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 | 6,780 | 0     | 6,780     |    |

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 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

## 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 | 6,149 | 0     | 6,149     |    |

### 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 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

## 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 | 18,752 | 0      | 18,752    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,220  | 20,846 | -19,626   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FXW213C7R· KRW/USD 27-10-22E | 492 |
| FXW213C8R· KRW/USD 28-11-22E | 642 |
| FXW213C9P( KRW/USD 28-12-22E | 534 |
| FXW213C9V( USD/KRW 27-10-22E | 75  |
| FXW213C9X( USD/KRW 27-10-22E | 23  |
| IE00BD8RGM75                 |     |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

753

공시일 2022-10-12

기준일 2022-10-11

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

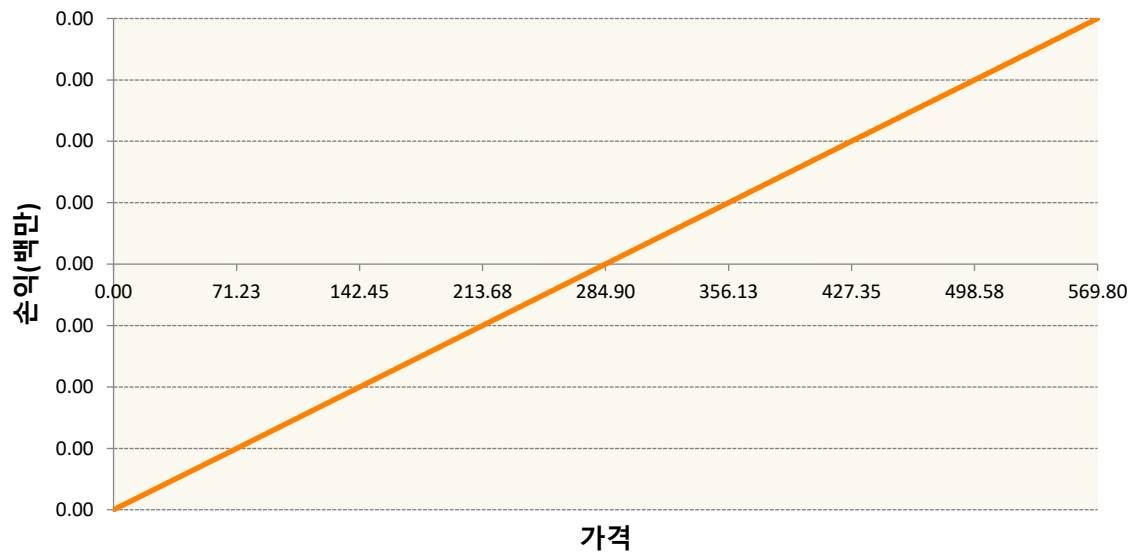
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 356   | 0     | 356       | 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 2022-10-12

기준일 2022-10-11

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

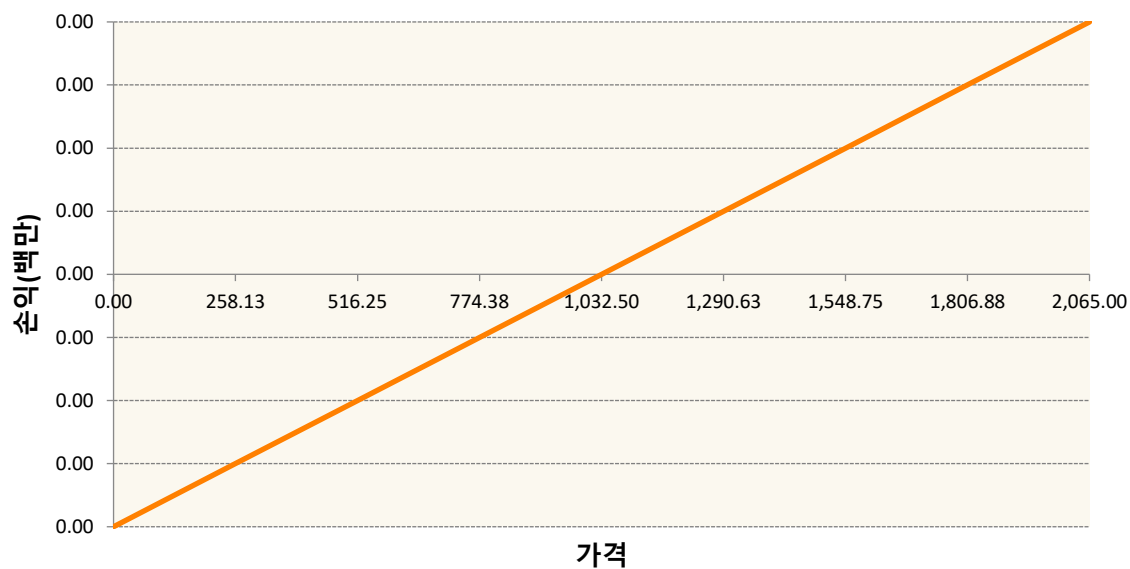
### 1. 계약금액

(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   | 502   | 0     | 502       |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,713 | 0     | 1,713     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 480   | 1,113 | -633      | 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   |
| FXW213CA7 EUR/KRW 18-11-22E  | 3   |

FXW213CABEUR/KRW 18-11-22E  
VNCV2 VN30 Index Future OCT22

|    |
|----|
| 11 |
| 40 |

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

(단위:백만원)

272

공시일 2022-10-12

기준일 2022-10-11

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

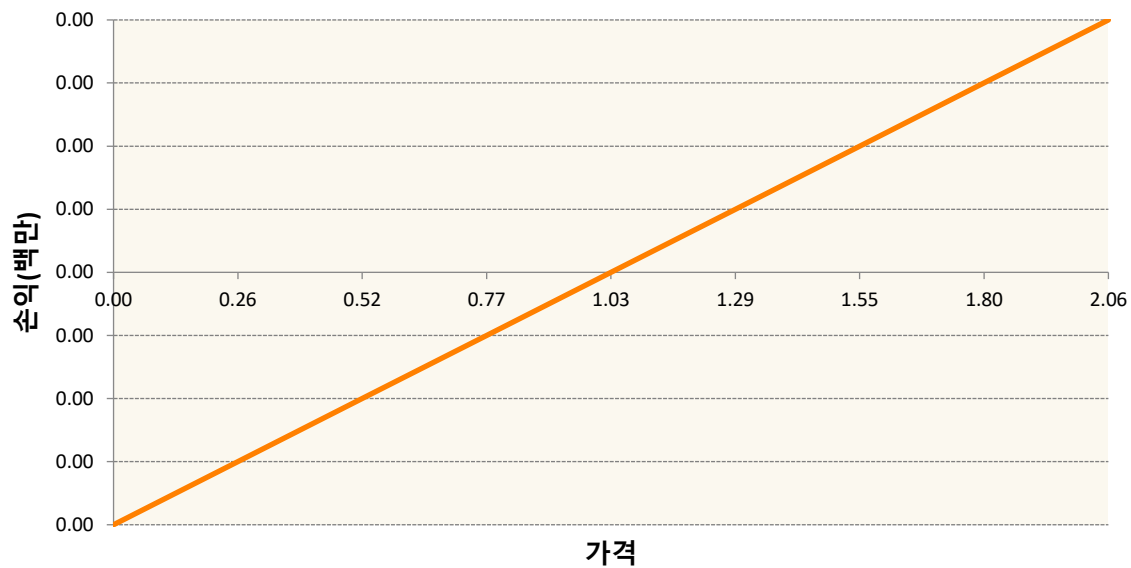
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

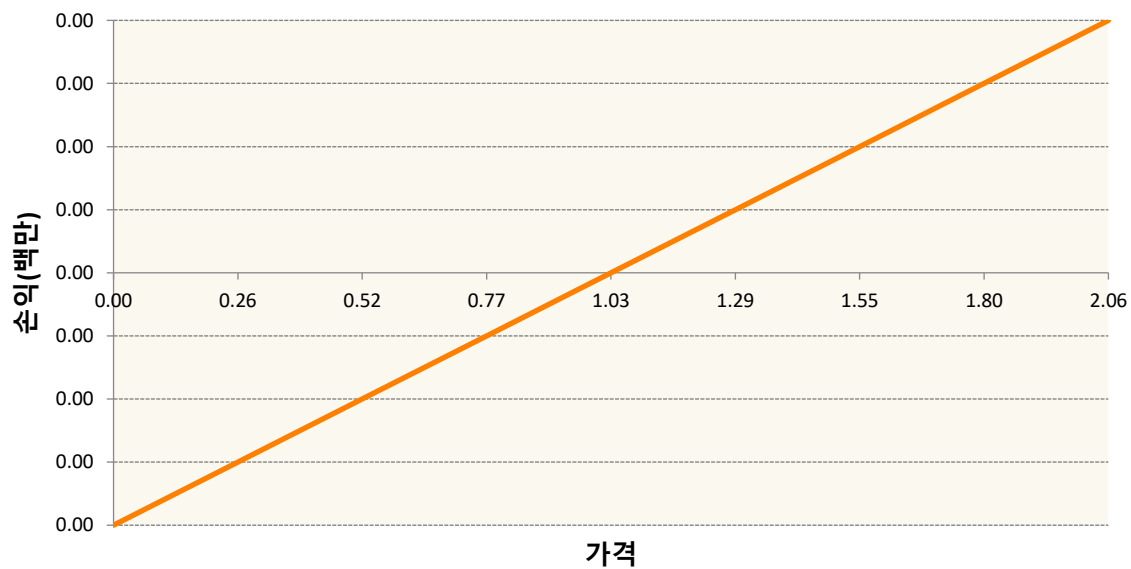
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 35,640 | 0     | 35,640    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

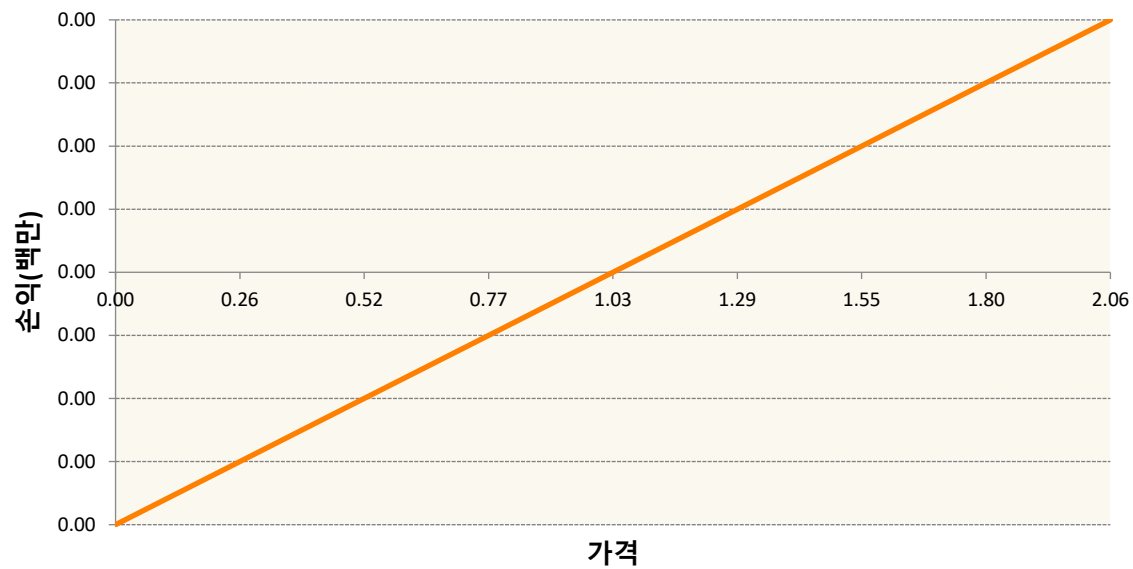
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220326-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

179

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

2,591

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

90

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

(단위:백만원)

5,558

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

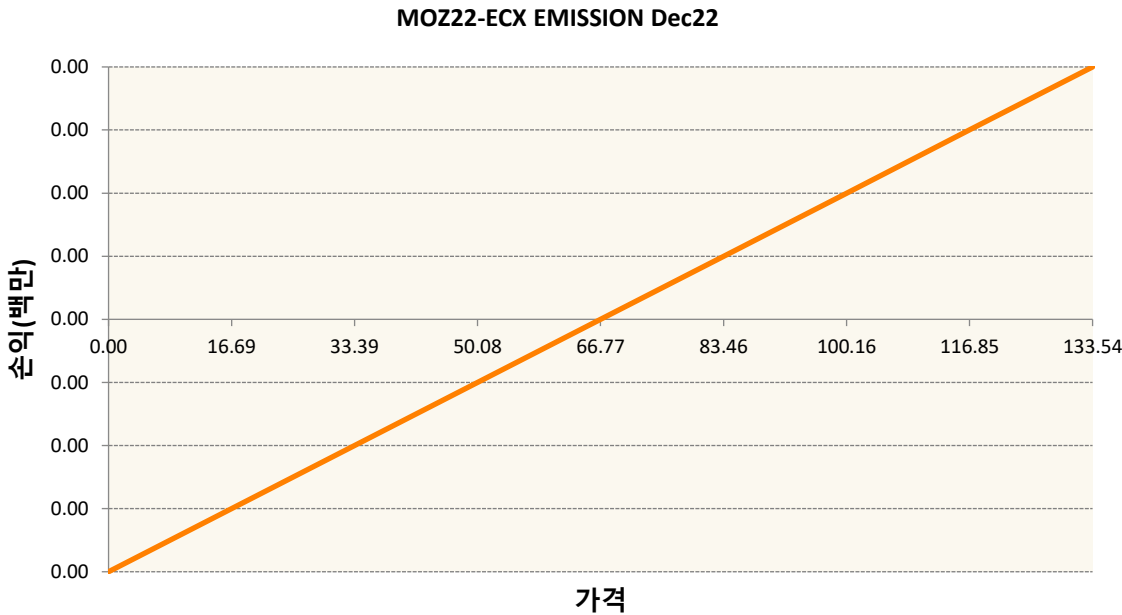
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 12,171 | 0     | 12,171    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 5,449 | -5,449    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| FXW213C9T(KRW/EUR 27-10-22E | 436 |
| MOZ22 ECX EMISSION Dec22    | 974 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 2,770 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

# 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)  | 13 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)  | 13 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)  | 13 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠) | 13 |

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

(단위:백만원)

99

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

## 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)  | 22 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 26 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 22 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220714(메리츠) | 31 |

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

(단위:백만원)

134

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

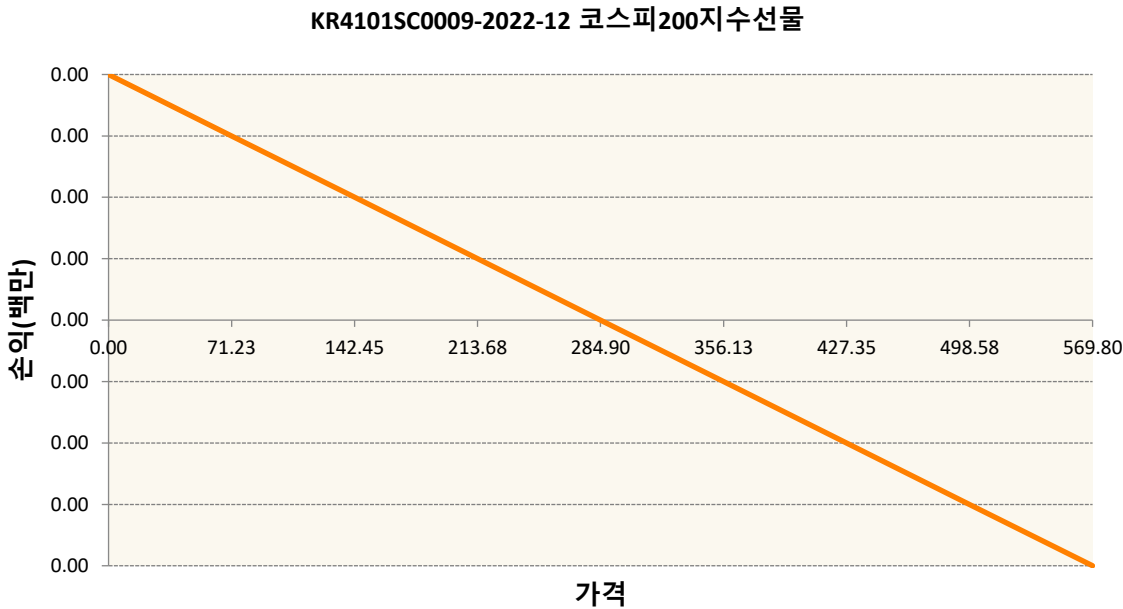
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 711   | -711      | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 2,137 | -2,137    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                      |     |
|--------------------------------------|-----|
| KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물        | 171 |
| KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429    | 1   |
| KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602 | 1   |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 186 |
|-----|

공시일 2022-10-12

기준일 2022-10-11

## 신한SOL한국형글로벌반도체엑티

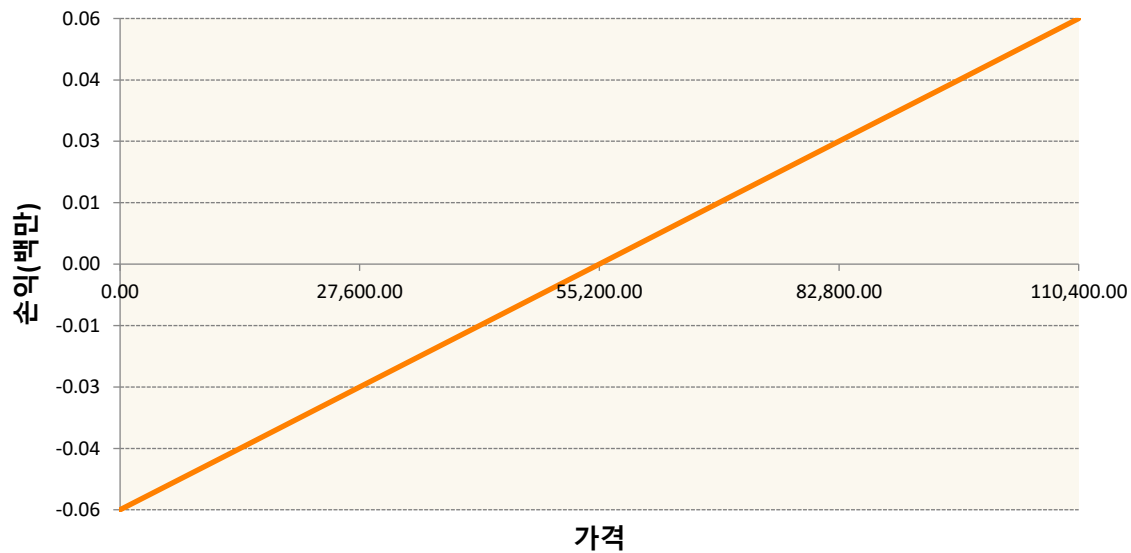
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

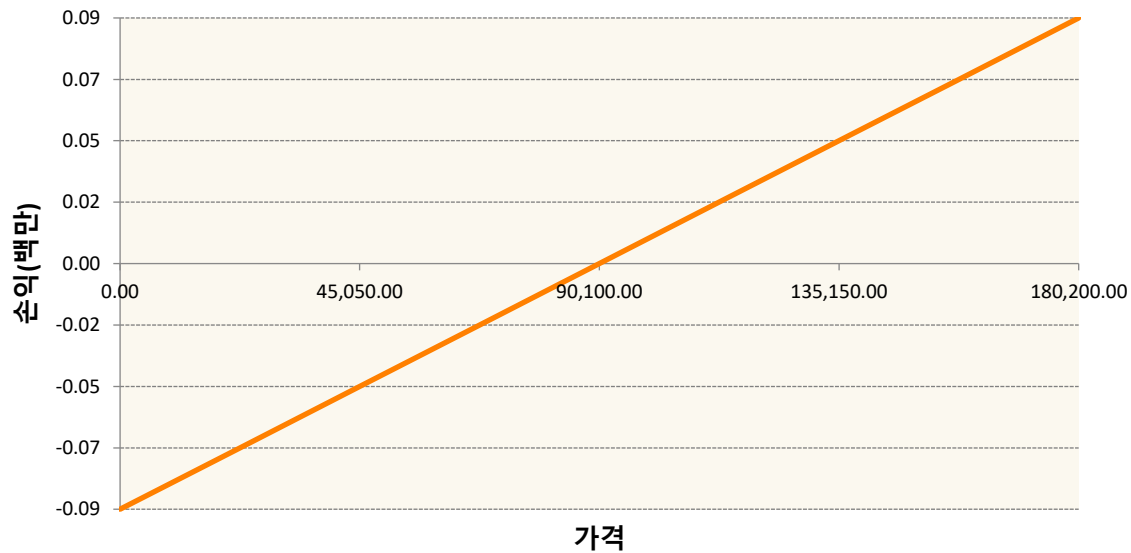
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 399   | 0     | 399       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 391   | 0     | 391       | 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 | 2022-10-12 |
| 기준일 | 2022-10-11 |

## 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 2022-10-12

기준일 2022-10-11

## SOL한국형글로벌전기차&2차전지

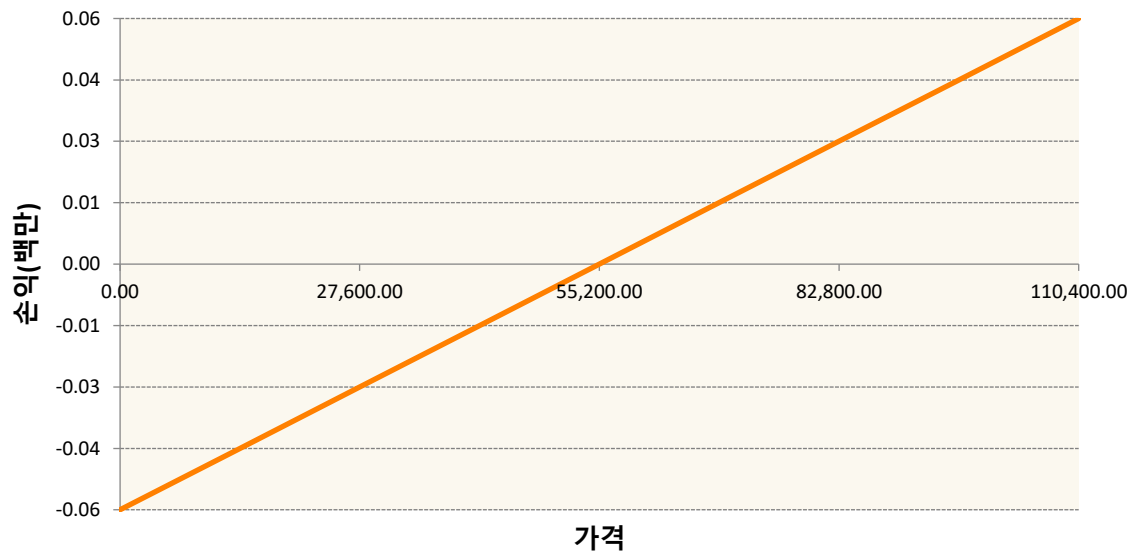
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

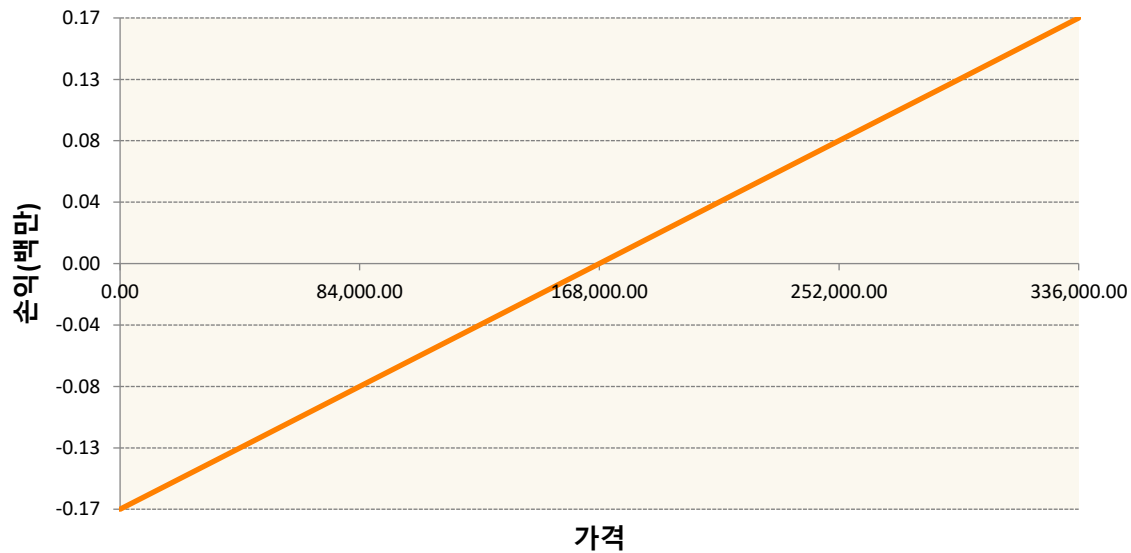
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 268   | 0     | 268       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

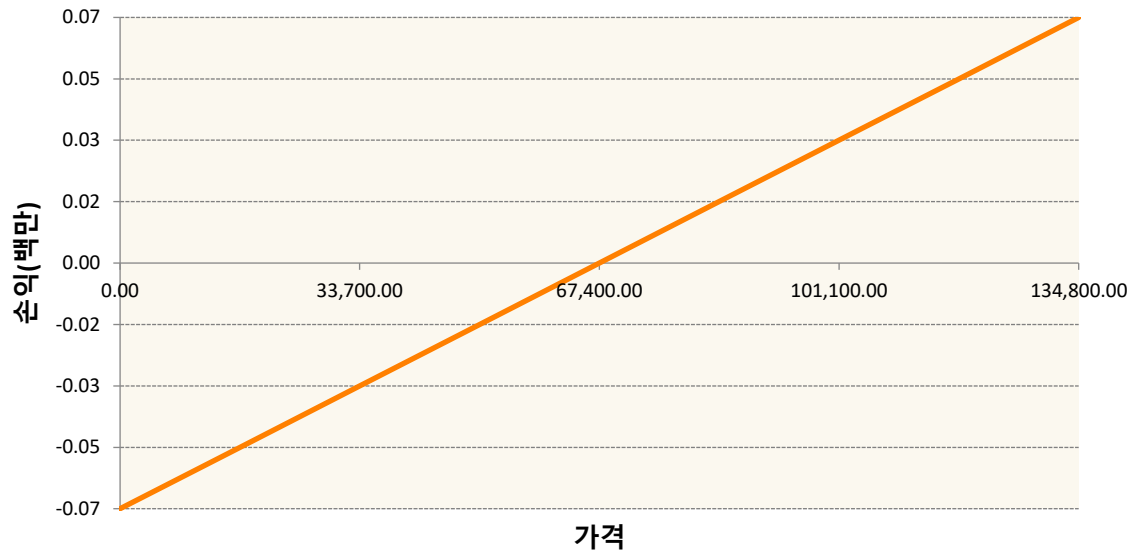
KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



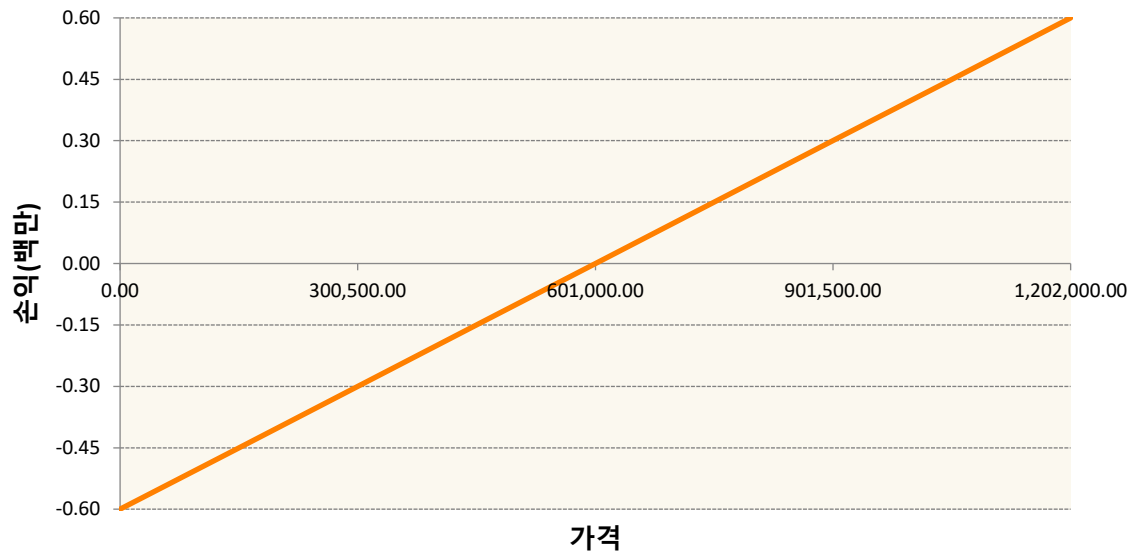
KR4116SA0004-2022-10 현대차개별선물



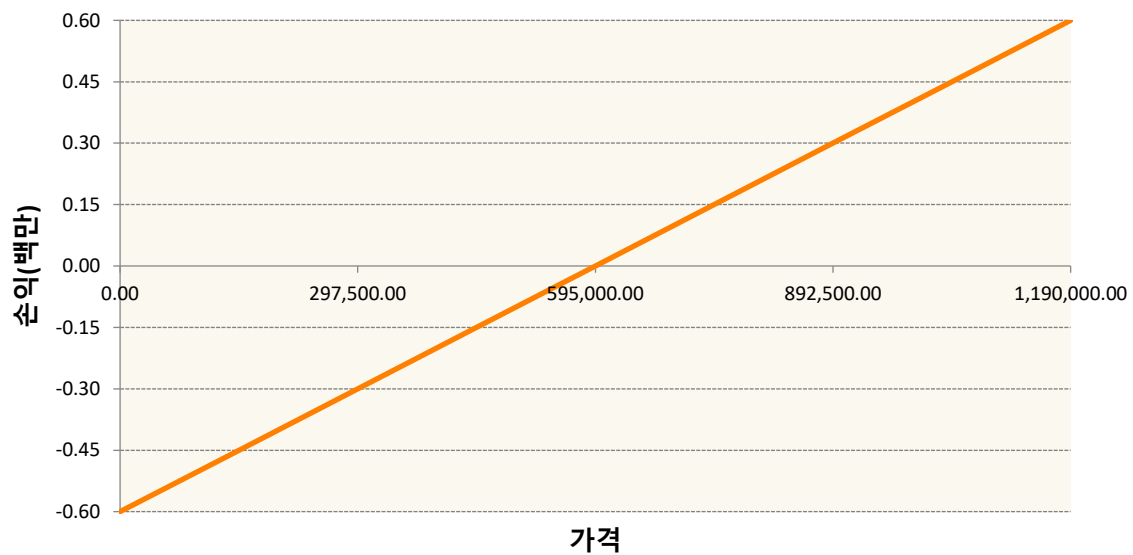
KR4119SA0001-2022-10 기아개별선물



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%       | -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%        | 4         | 4       | 4      | 4   | 4     | 4      | 4                 | 4   |    |
| KR4119SA0001 |           |         |        |     |       |        | 2022-10 기아개별선물    |     | 2  |
|              | 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                | -2  |    |
| -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%        | 2         | 2       | 2      | 2   | 2     | 2      | 2                 | 2   |    |
| KR4122SA0006 |           |         |        |     |       |        | 2022-10 삼성SDI개별선물 |     | 10 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |     |       |        |                   |     |    |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00%            |     |    |
| -8.00%       | -10       | -10     | -10    | -10 | -10   | -10    | -10               | -10 |    |
| -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%        | 10        | 10      | 10     | 10  | 10    | 10     | 10                | 10  |    |
| 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 2022-10-12

기준일 2022-10-11

## SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

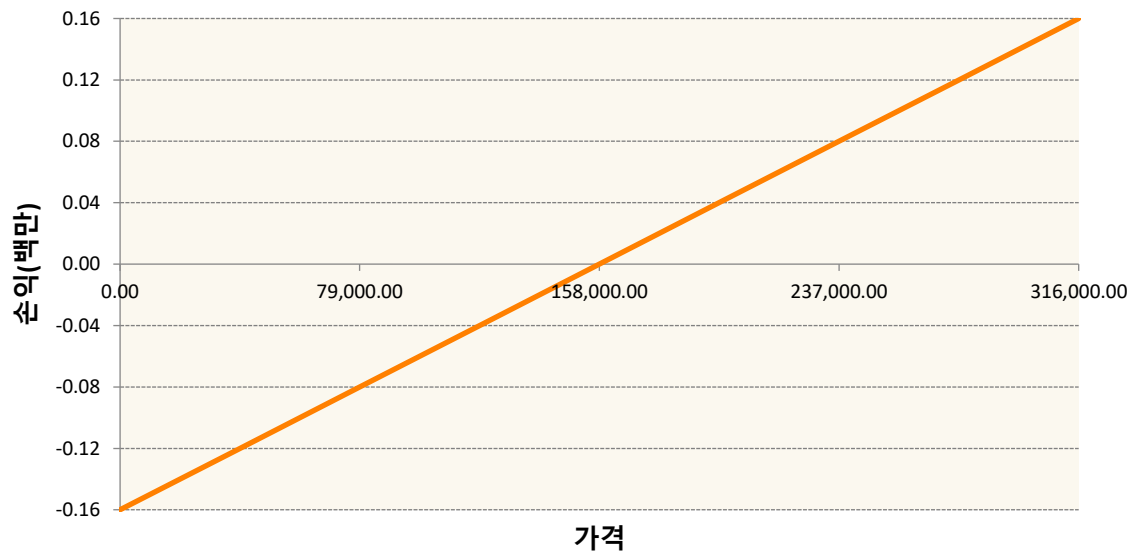
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

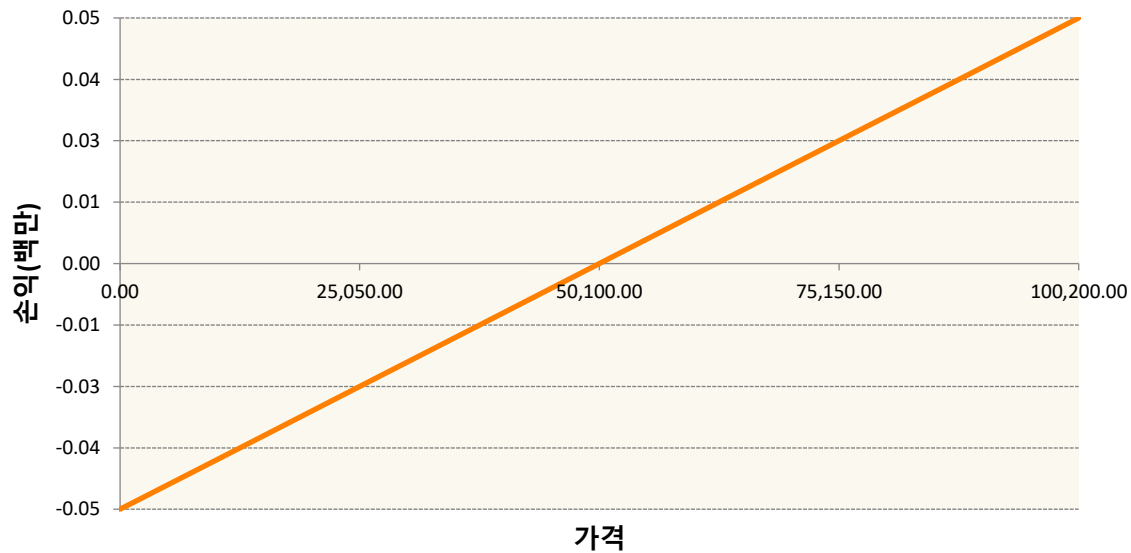
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 139   | 0     | 139       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4156SA0005-2022-10 NAVER개별선물



KR41CFSA0001-2022-10 카카오개별선물



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

| KR4156SA0005 |           |         | 2022-10 NAVER개별선물 |    |       |        | 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      |
| 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%       | -3        | -3      | -3                | -3 | -3    | -3     | -3     |
| -2.67%       | -2        | -2      | -2                | -2 | -2    | -2     | -2     |
| 0%           | 0         | 0       | 0                 | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 2         | 2       | 2                 | 2  | 2     | 2      | 2      |
| 5.33%        | 3         | 3       | 3                 | 3  | 3     | 3      | 3      |
| 8.00%        | 5         | 5       | 5                 | 5  | 5     | 5      | 5      |

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

19

공시일 2022-10-12

기준일 2022-10-11

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

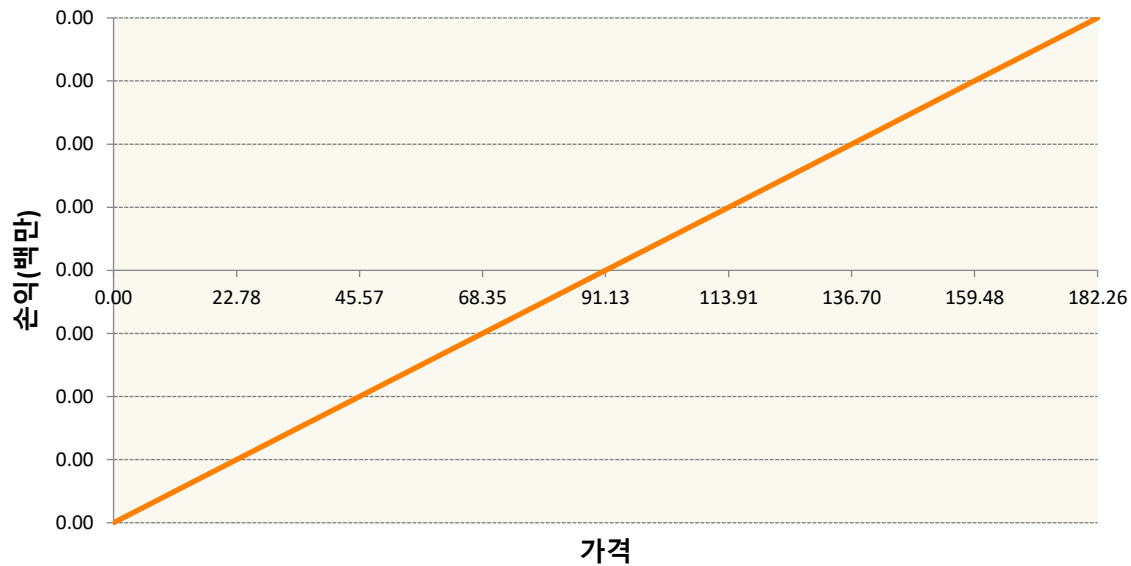
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

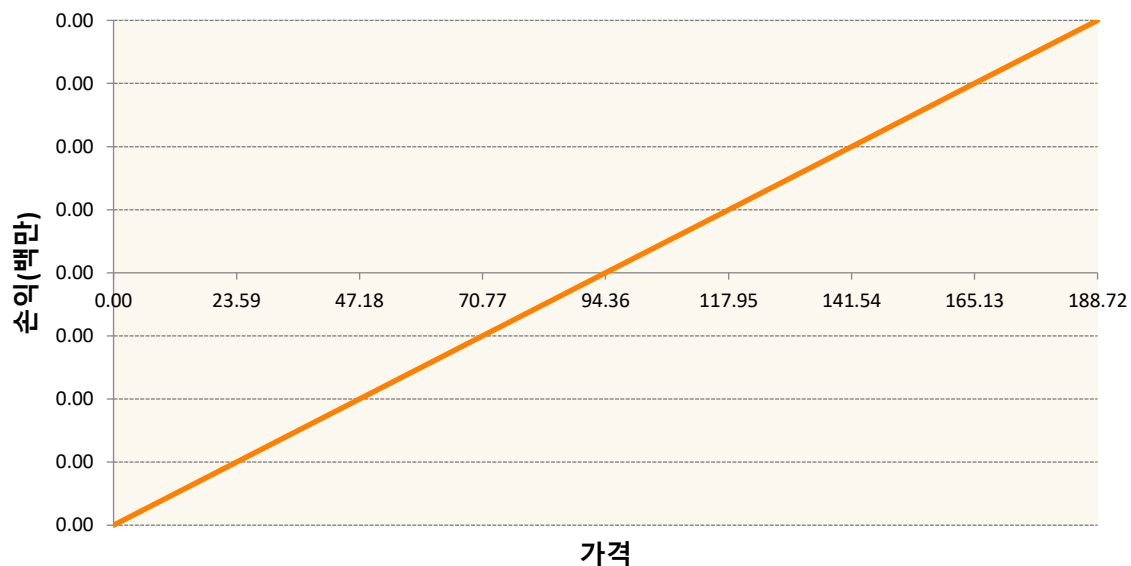
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,700 | 287   | 1,413     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

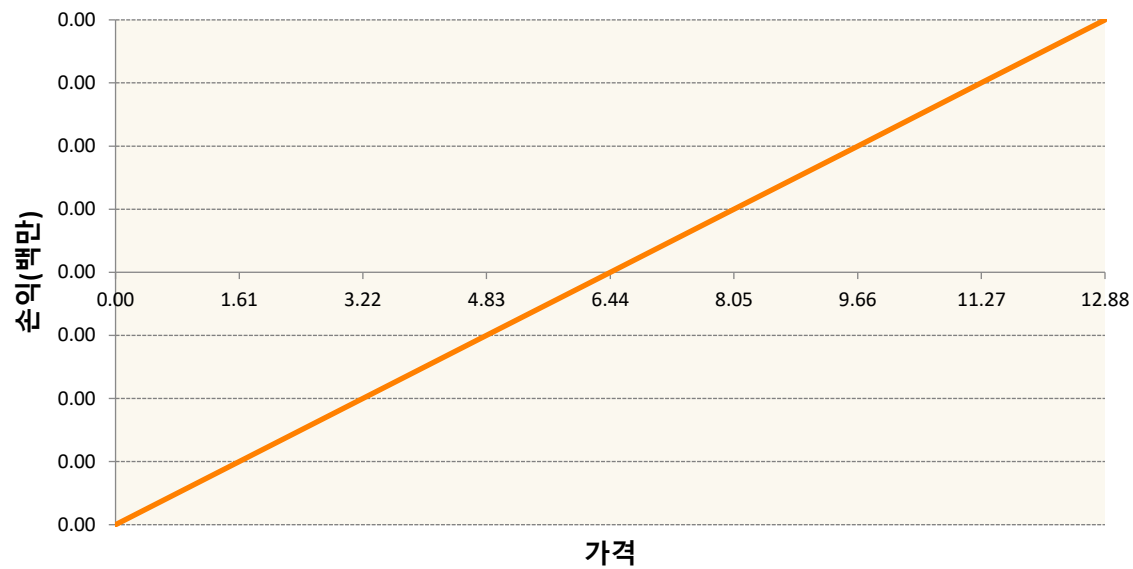
CLX2-WTI CRUDE FUTURE Nov22



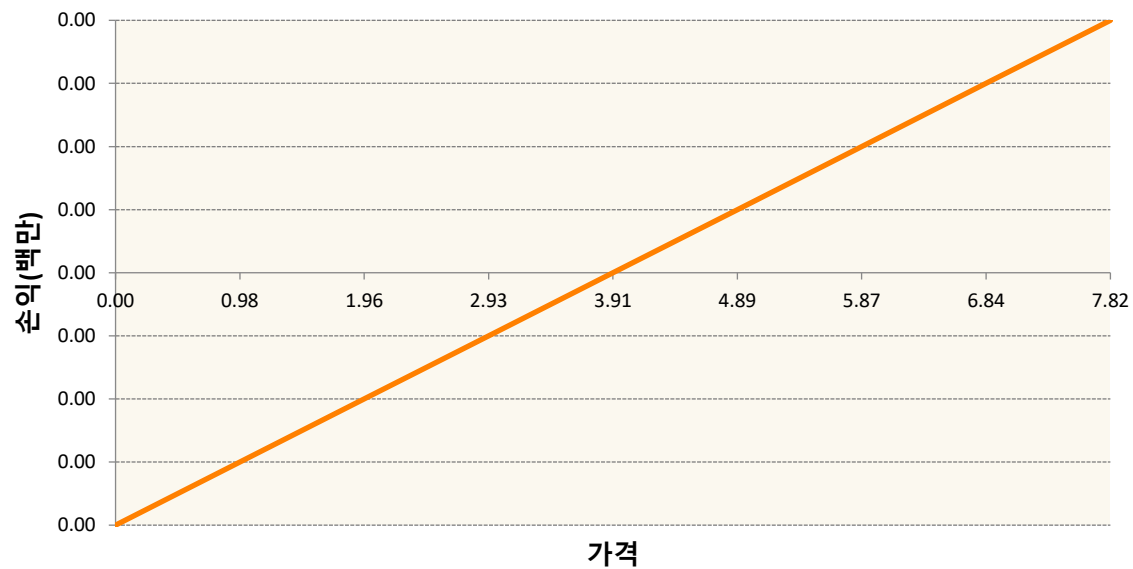
COF3-BRENT CRUDE FUTR JAN23



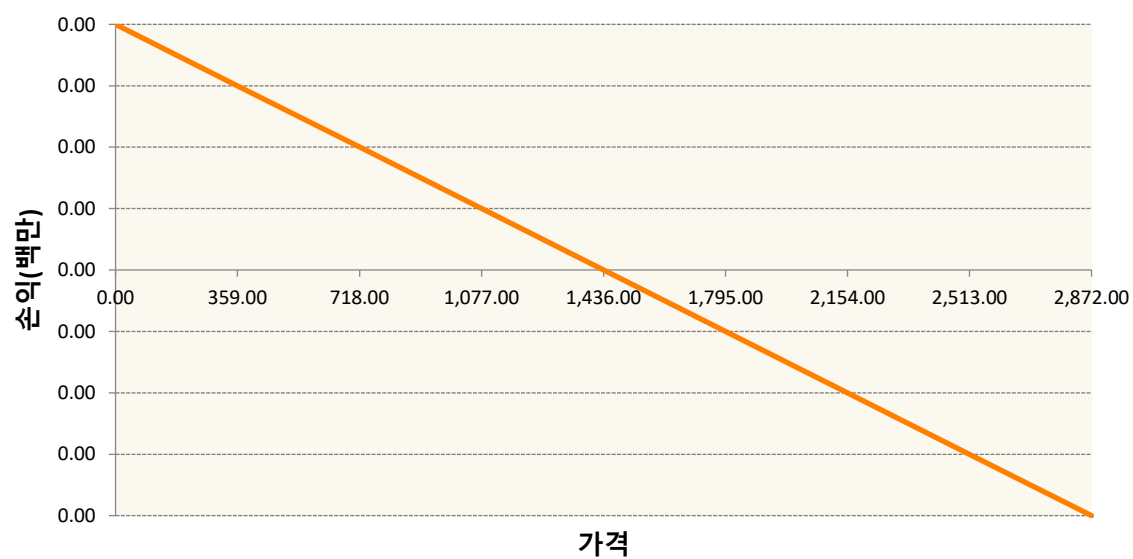
EOX2-E-MINI NATURAL GAS Nov22



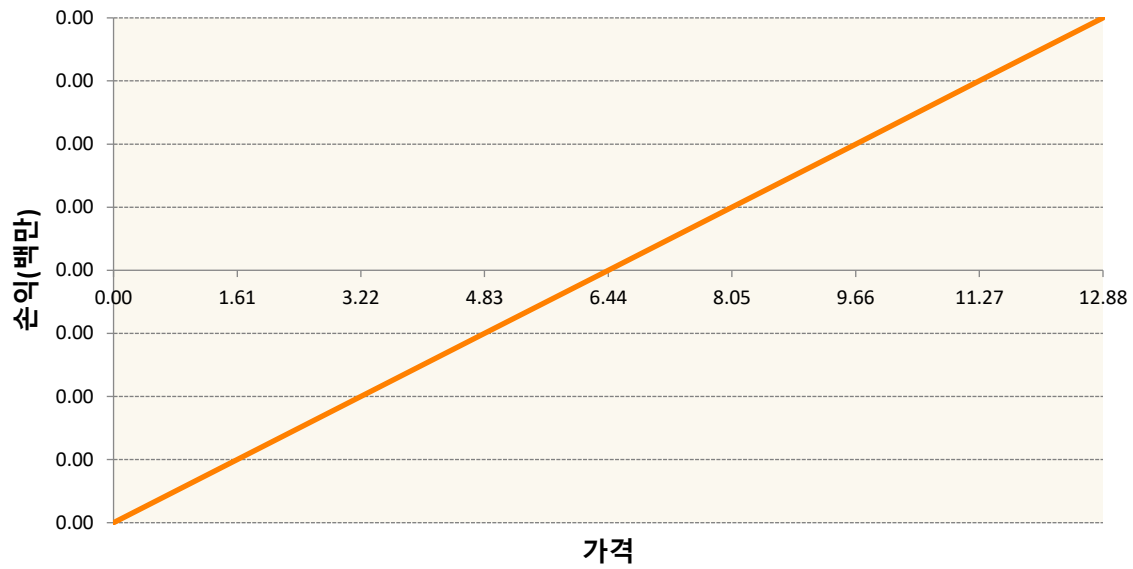
HOX2-NY Harb ULSD Fut Nov22



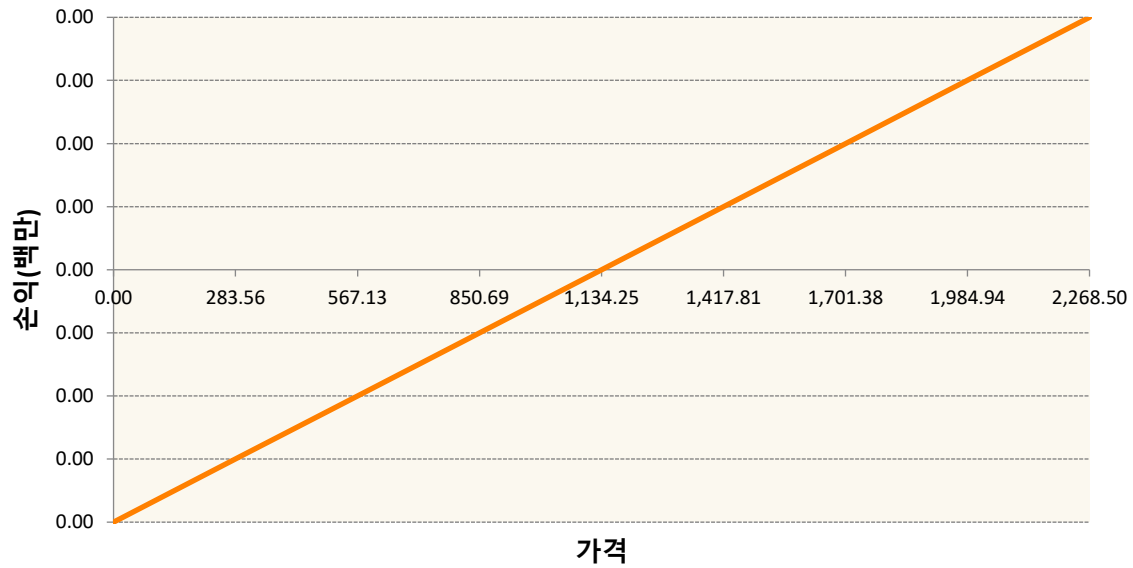
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



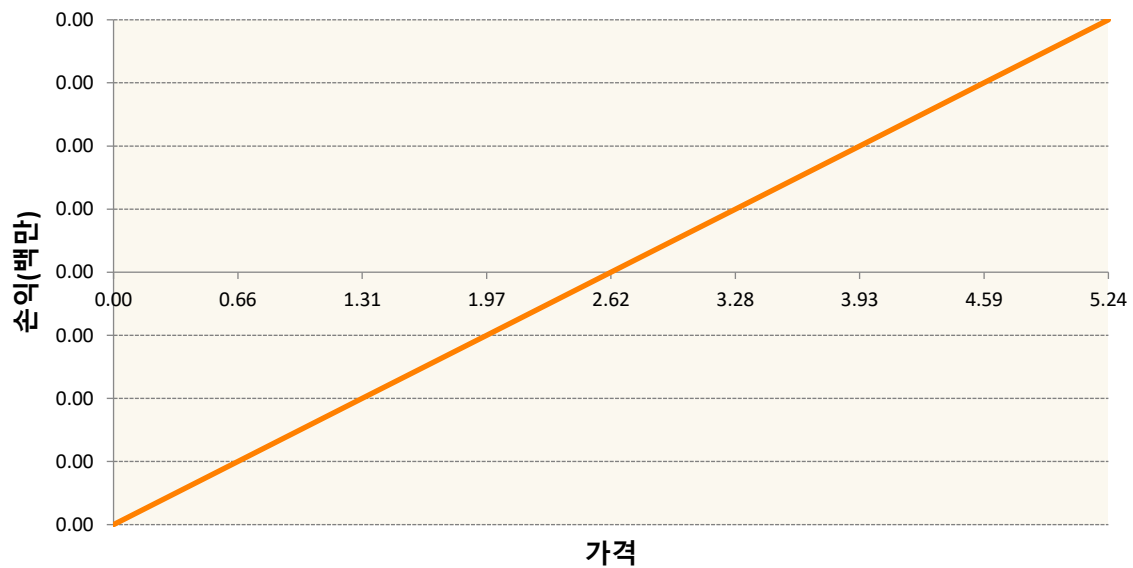
NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QX22-Low Su Gasoil G Nov22



XB22-GASOLINE RBOB FUT Nov22



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

|                         |                          |    |
|-------------------------|--------------------------|----|
| CLX2                    | WTI CRUDE FUTURE Nov22   | 19 |
| COF3                    | BRENT CRUDE FUTR JAN23   | 32 |
| EOX2                    | E-MINI NATURAL GAS Nov22 | 6  |
| HOX2                    | NY Harb ULSD Fut Nov22   | 17 |
| KR4175SA00 2022-10 달러선물 |                          | 23 |
| NGX22                   | NATURAL GAS FUTR Nov22   | 39 |
| QSX2                    | Low Su Gasoil G Nov22    | 12 |
| XBX2                    | GASOLINE RBOB FUT Nov22  | 11 |

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

**433**