

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

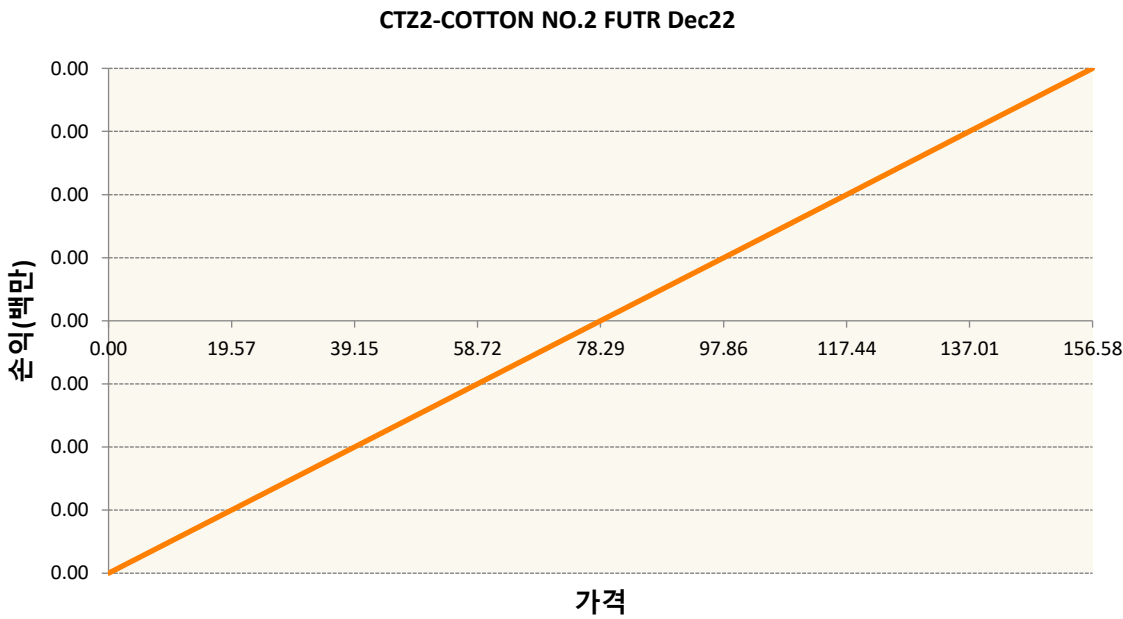
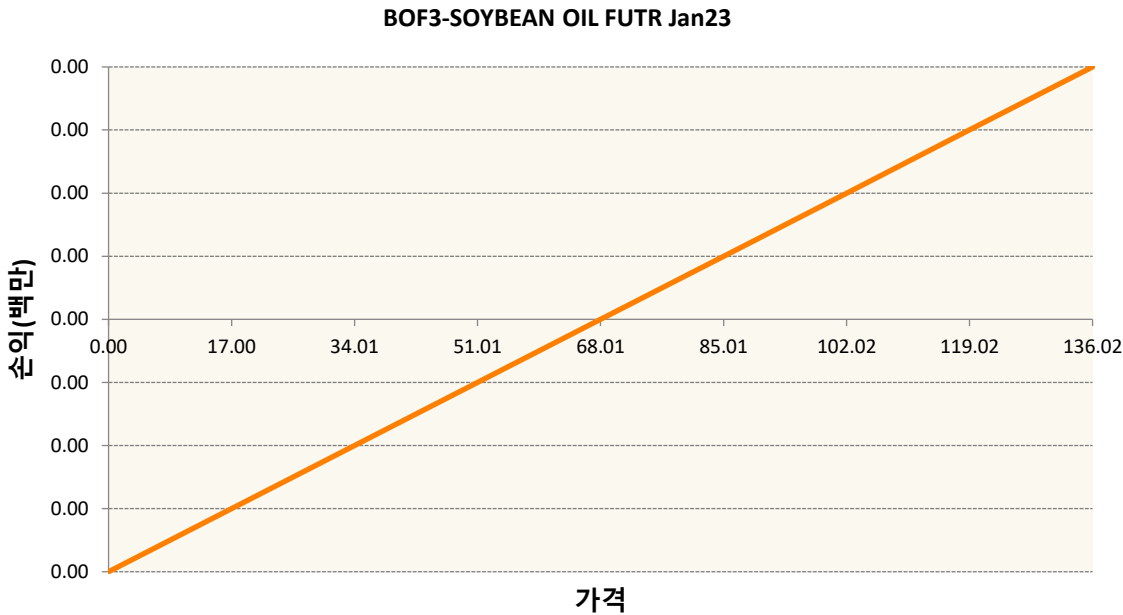
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

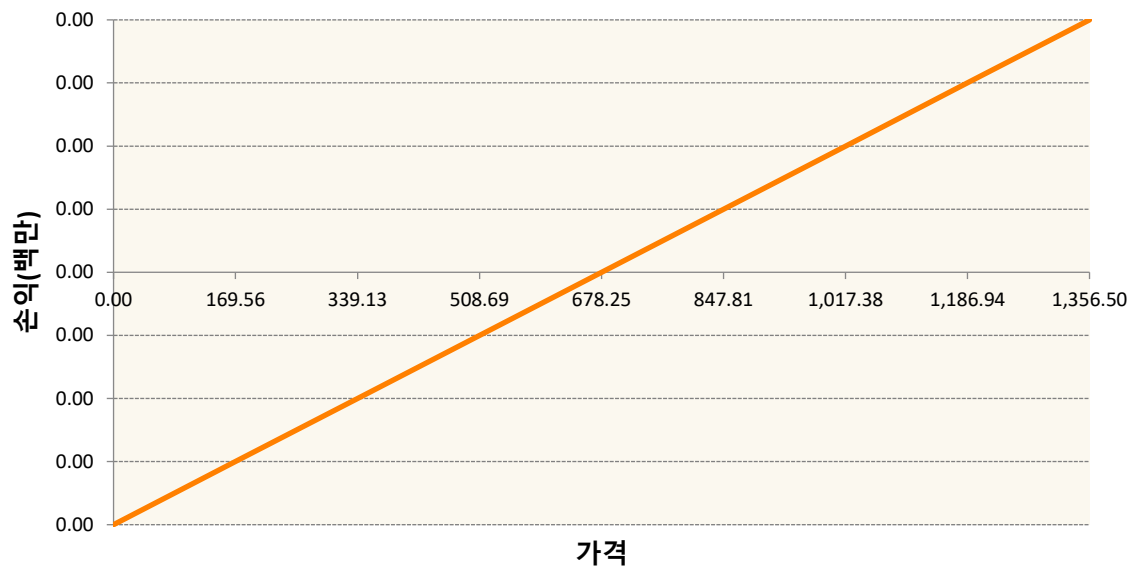
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,631	860	5,771	

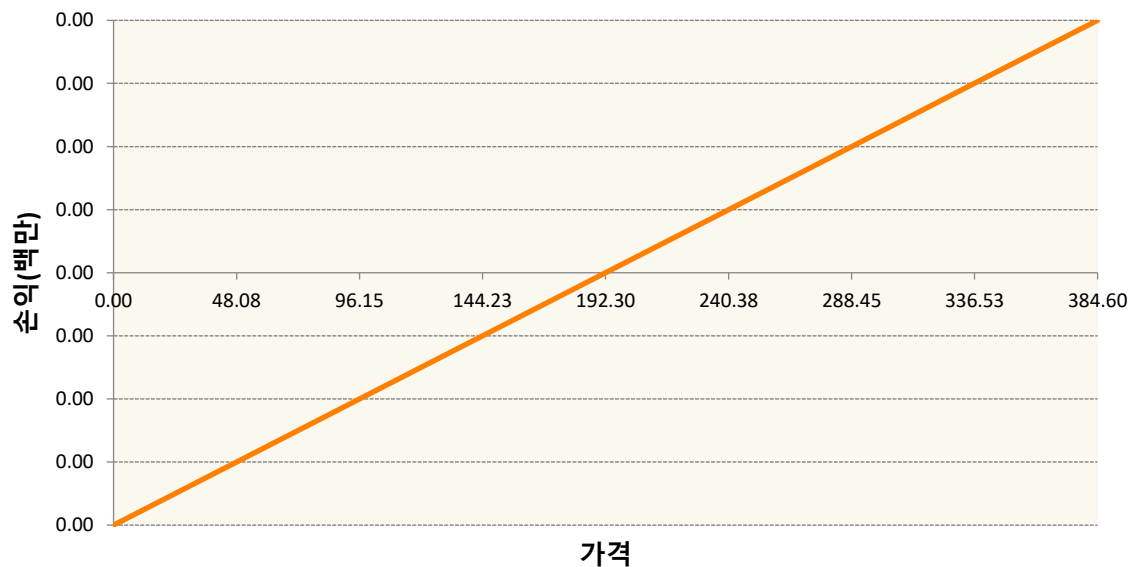
2. 만기시점의 손익구조



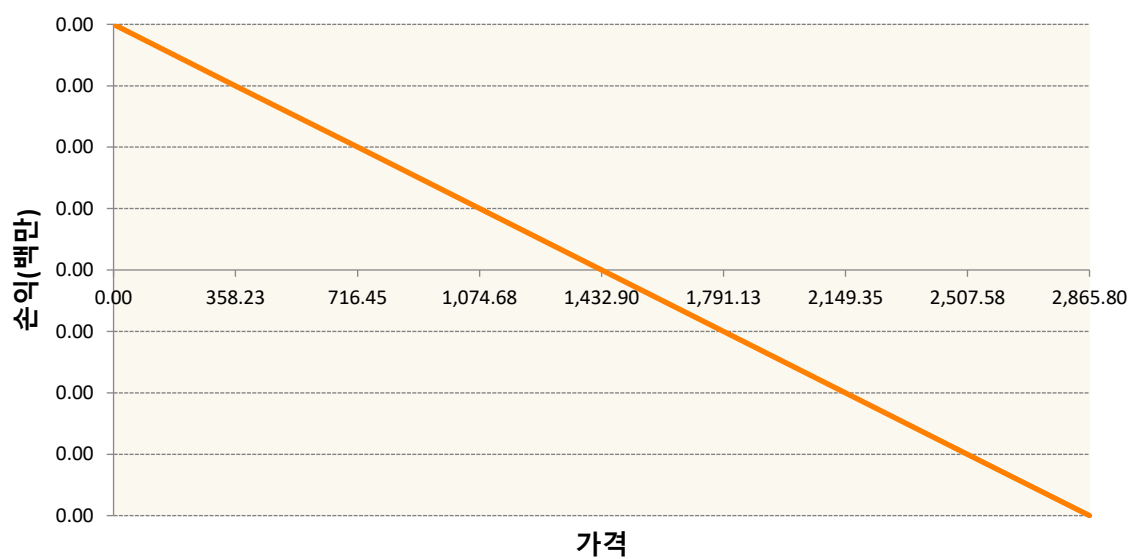
CZ2-CORN FUTURE Dec22



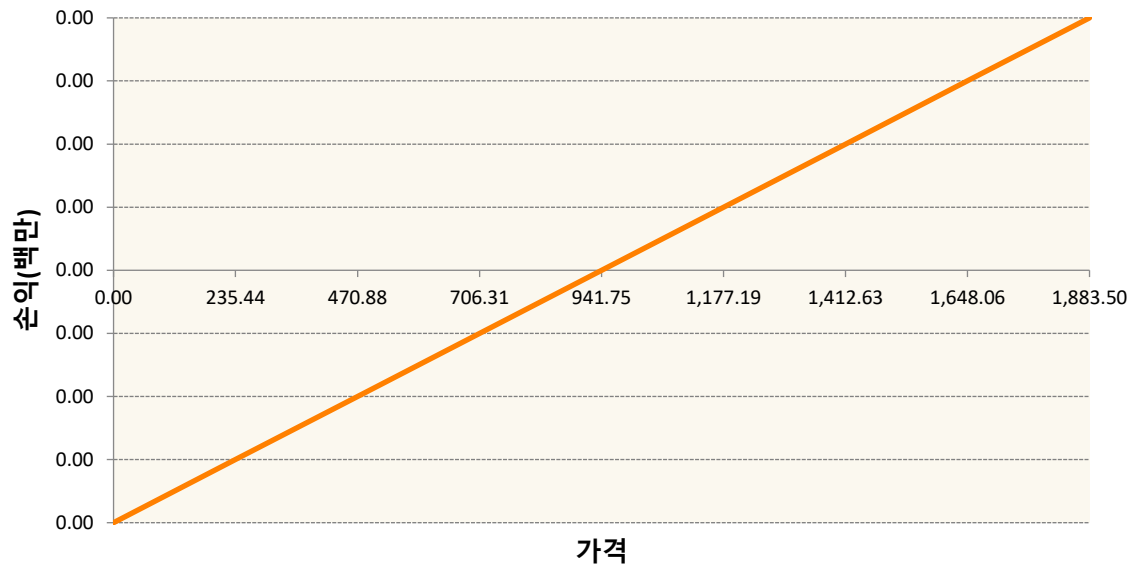
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



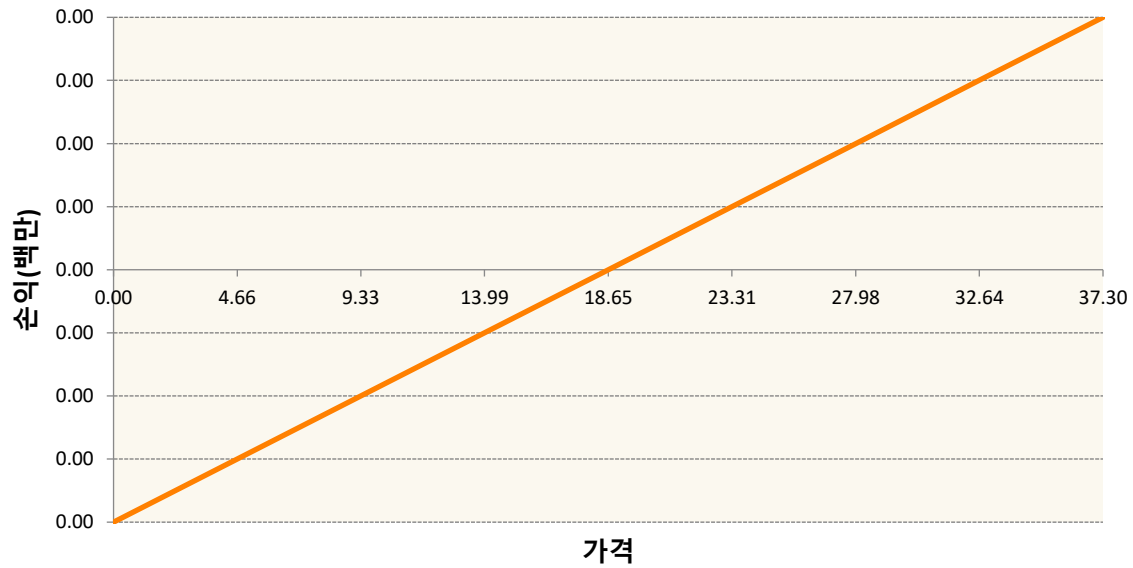
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



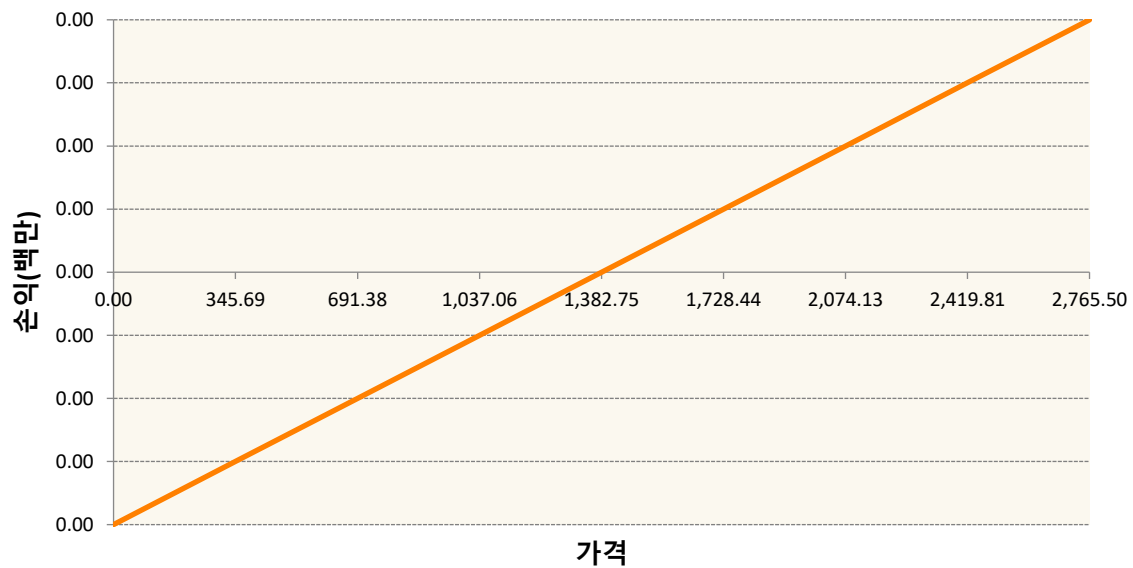
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22



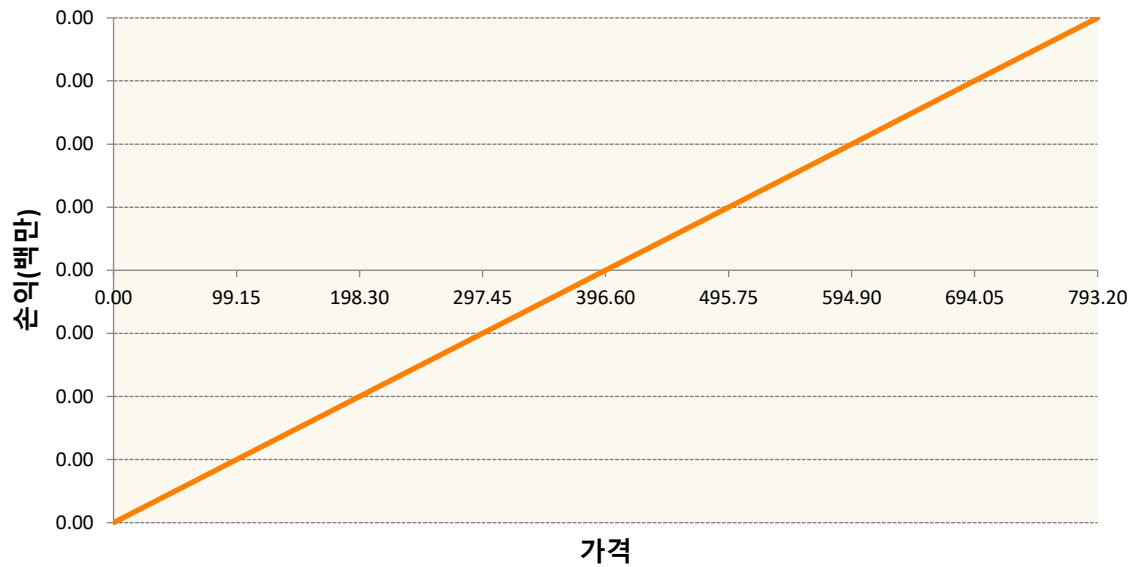
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



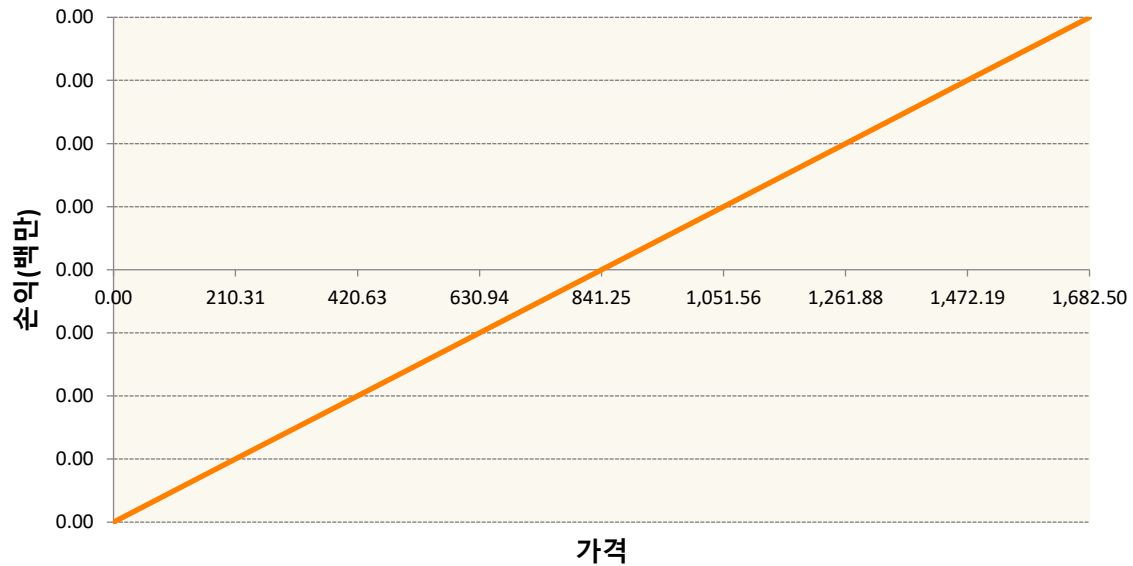
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



SMF3-SOYBEAN MEAL FUTR Jan23



WZ2-WHEAT FUTURE(CBT) Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

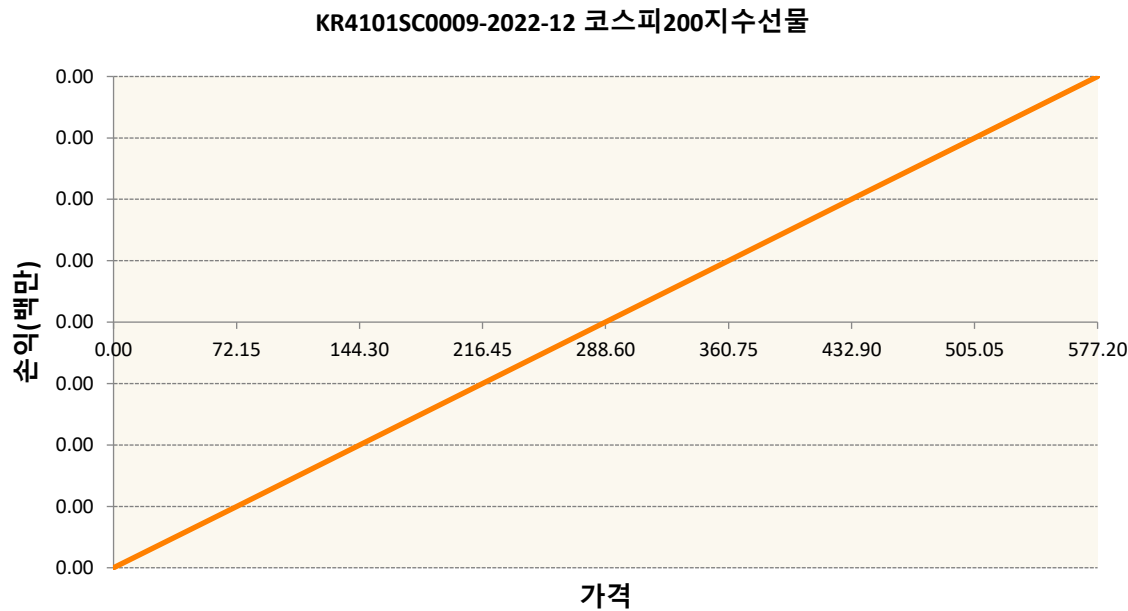
스마트인덱스모

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	1,154	0	1,154	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				92
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

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)

440

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

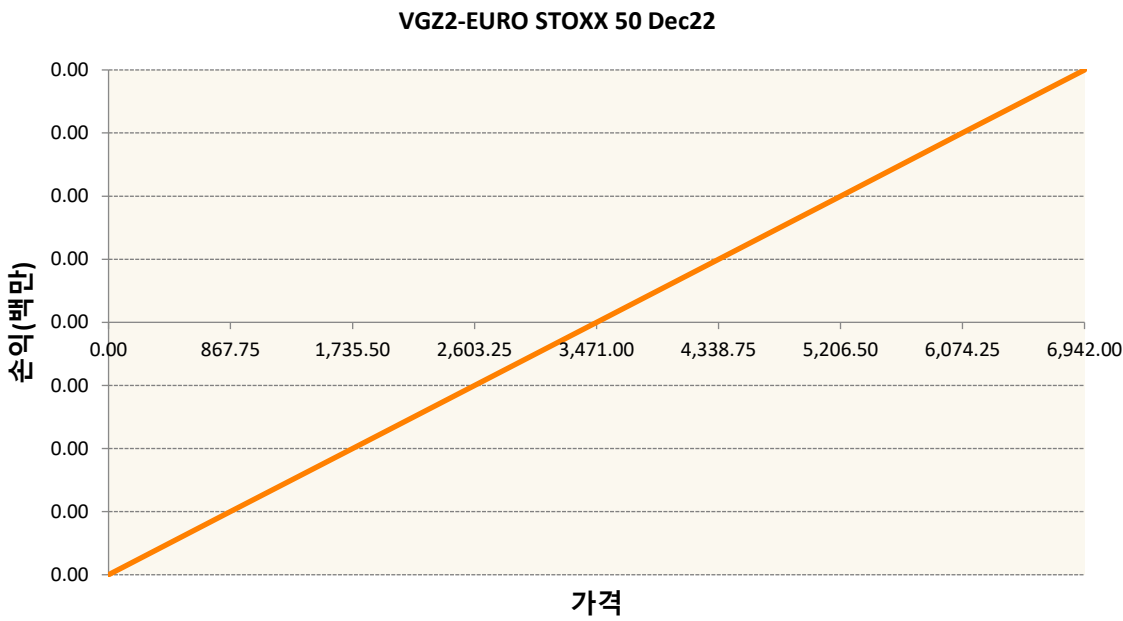
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	482	0	482	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ2	EURO STOXX 50 Dec22	39
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

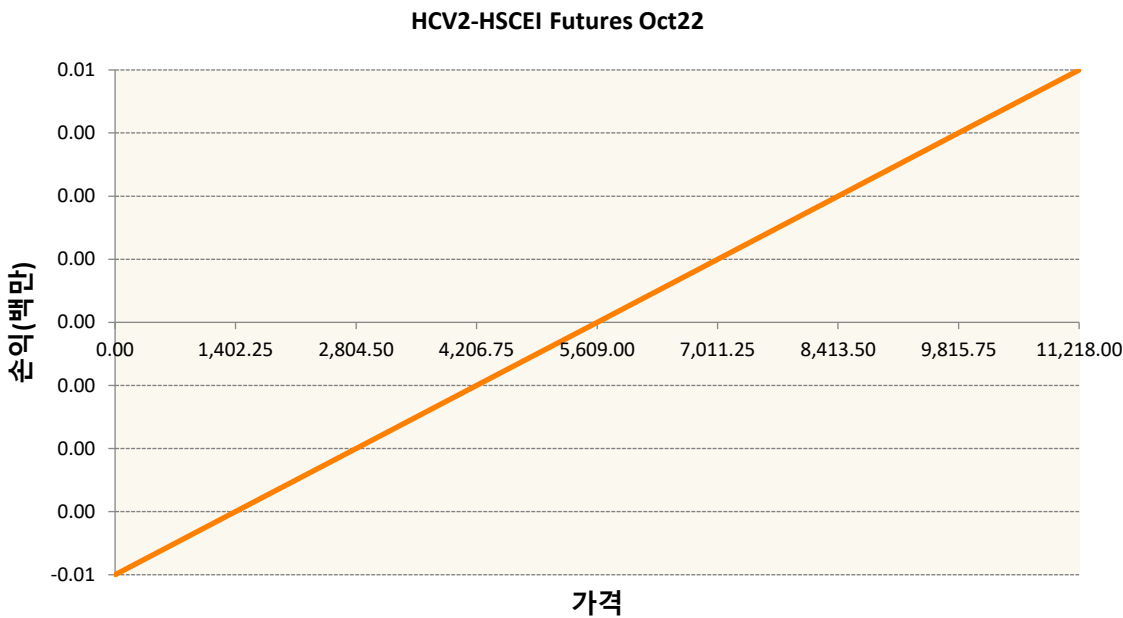
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	925	0	925	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV2	HSCEI Futures Oct22	74
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

108

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

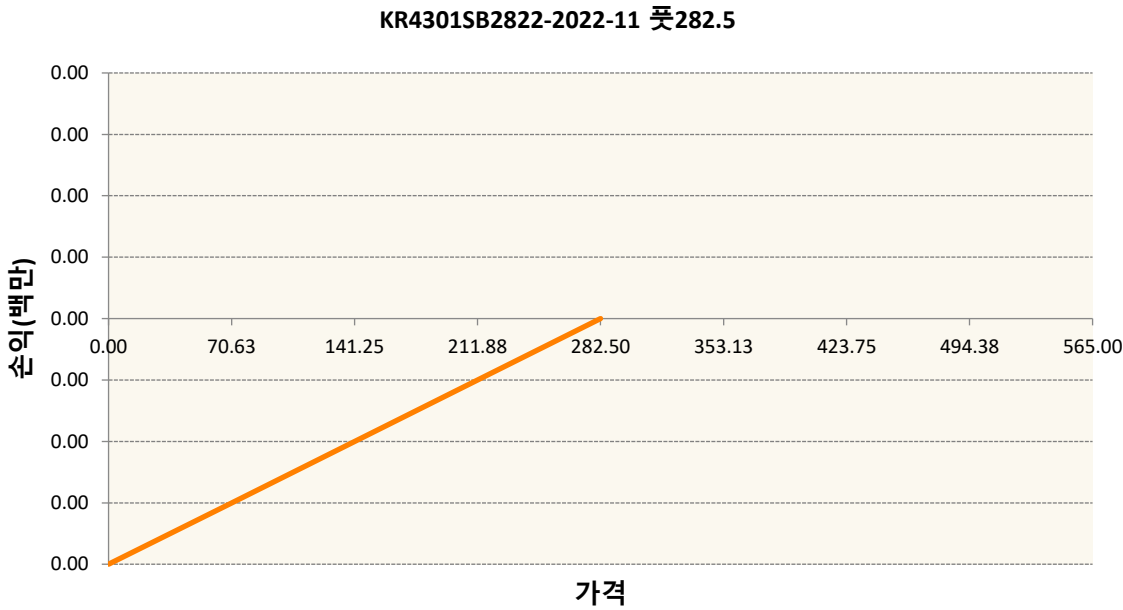
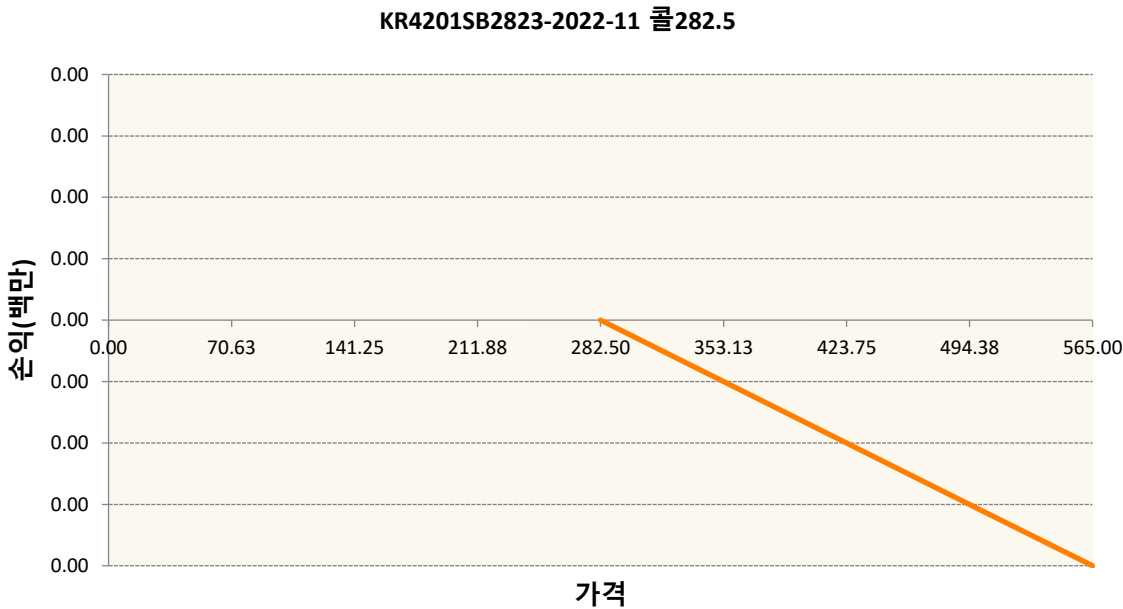
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

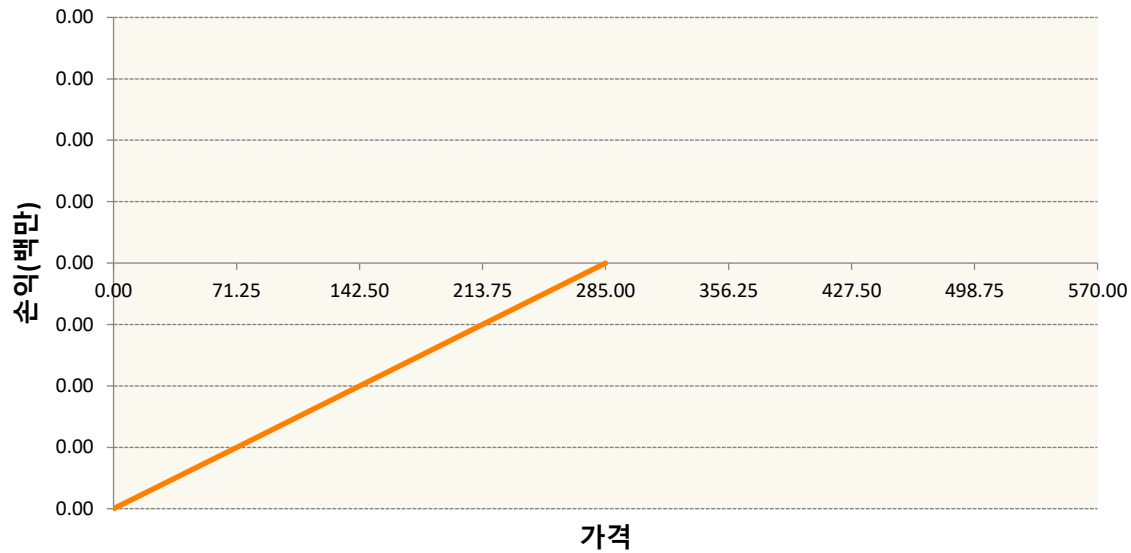
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	292	-292	장내
누계	유가증권	옵션	0	52,416	-52,416	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301SB2855-2022-11 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201SB2823			2022-11 콜282.5				2,919
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,935	1,825	1,709	1,589	1,466	1,340	1,211
-5.33%	1,595	1,459	1,321	1,182	1,041	900	758
-2.67%	1,098	950	801	652	504	355	206
0%	439	294	147	0	-148	-296	-444
2.67%	-371	-499	-632	-768	-906	-1,046	-1,188
5.33%	-1,306	-1,409	-1,520	-1,637	-1,760	-1,886	-2,016
8.00%	-2,334	-2,410	-2,496	-2,592	-2,695	-2,804	-2,919
KR4301SB2822			2022-11 풋282.5				417
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-286	-306	-327	-349	-371	-393	-417
-5.33%	-136	-161	-185	-210	-236	-261	-286
-2.67%	-14	-41	-67	-94	-121	-148	-174
0%	79	53	26	0	-27	-53	-80
2.67%	145	122	98	73	49	23	-2
5.33%	188	170	150	129	107	84	60
8.00%	215	201	186	168	150	130	110
KR4301SB2855			2022-11 풋285				79
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-60	-63	-67	-71	-75	-79
-5.33%	-28	-32	-36	-41	-45	-50	-54
-2.67%	-4	-9	-14	-18	-23	-28	-33
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15

2.67%	28	24	19	15	10	5	0
5.33%	37	34	30	26	21	17	13
8.00%	43	40	37	34	30	26	22

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

(단위:백만원)

3,064

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

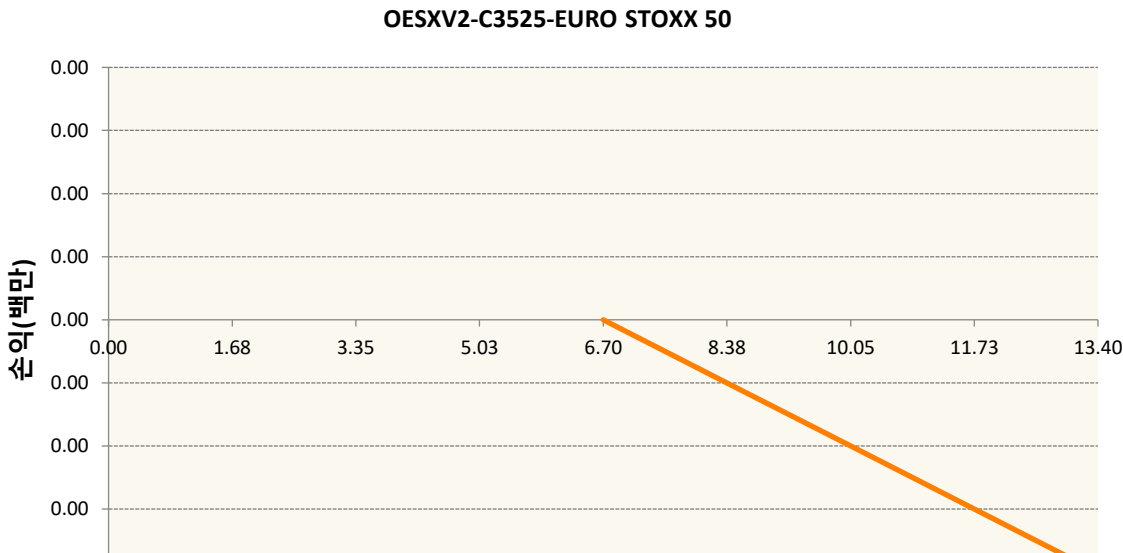
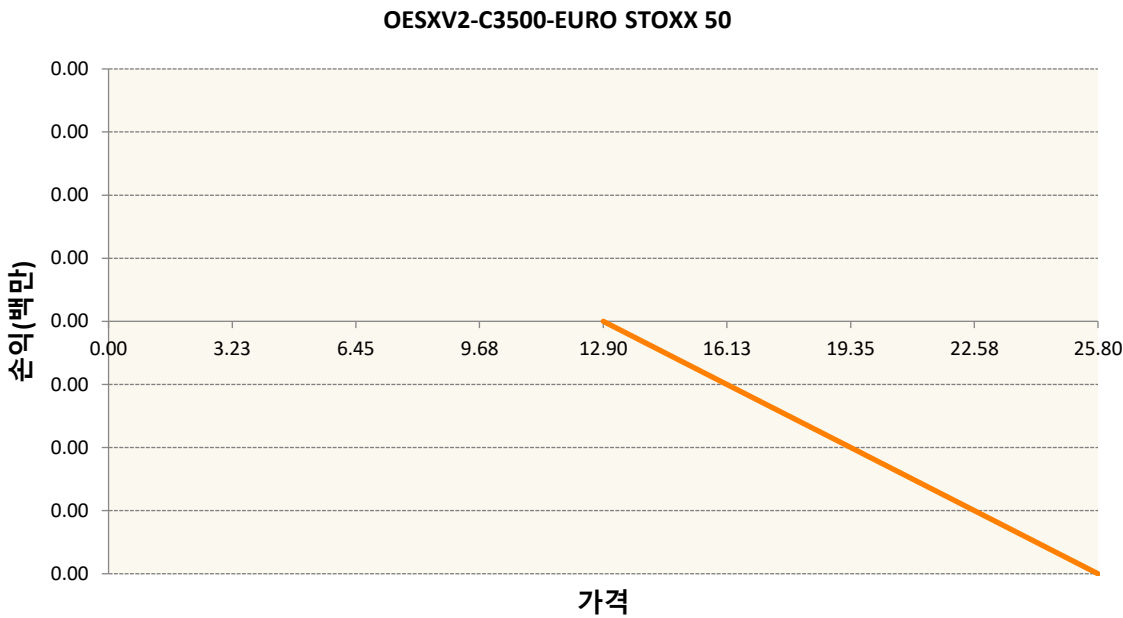
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

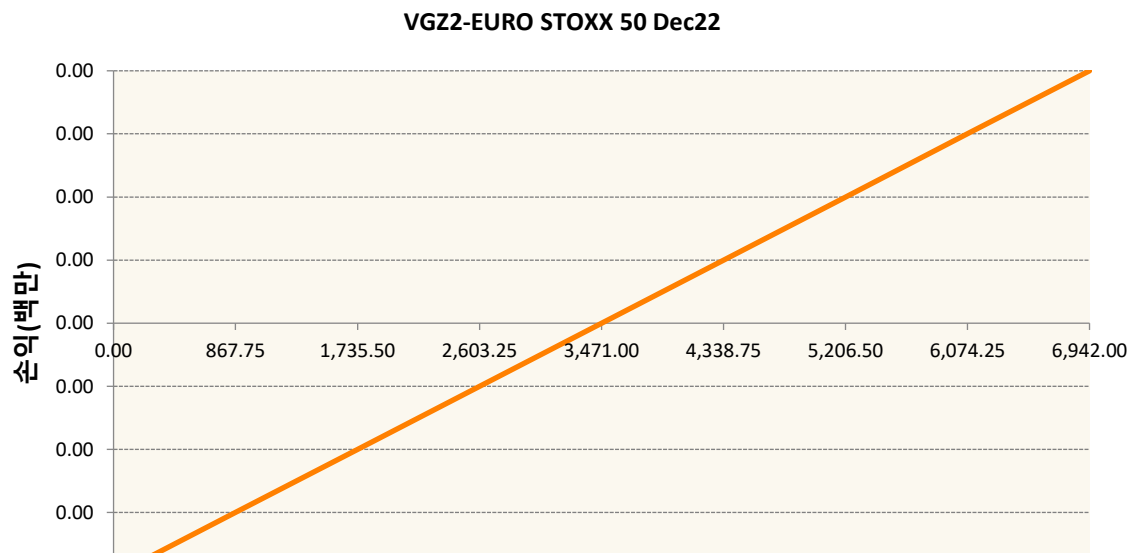
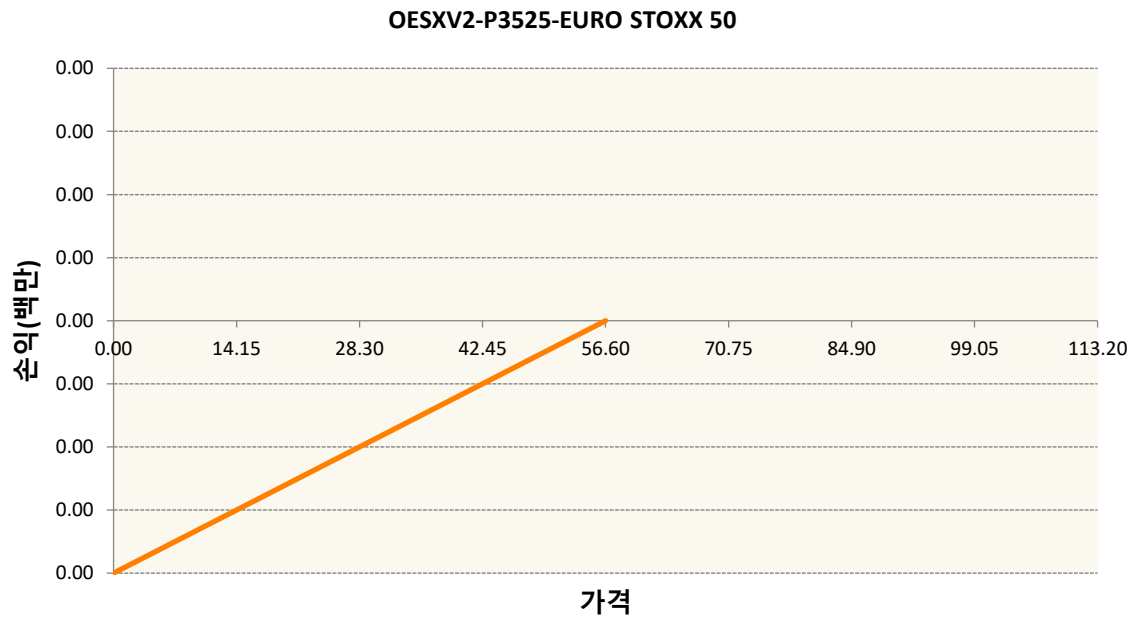
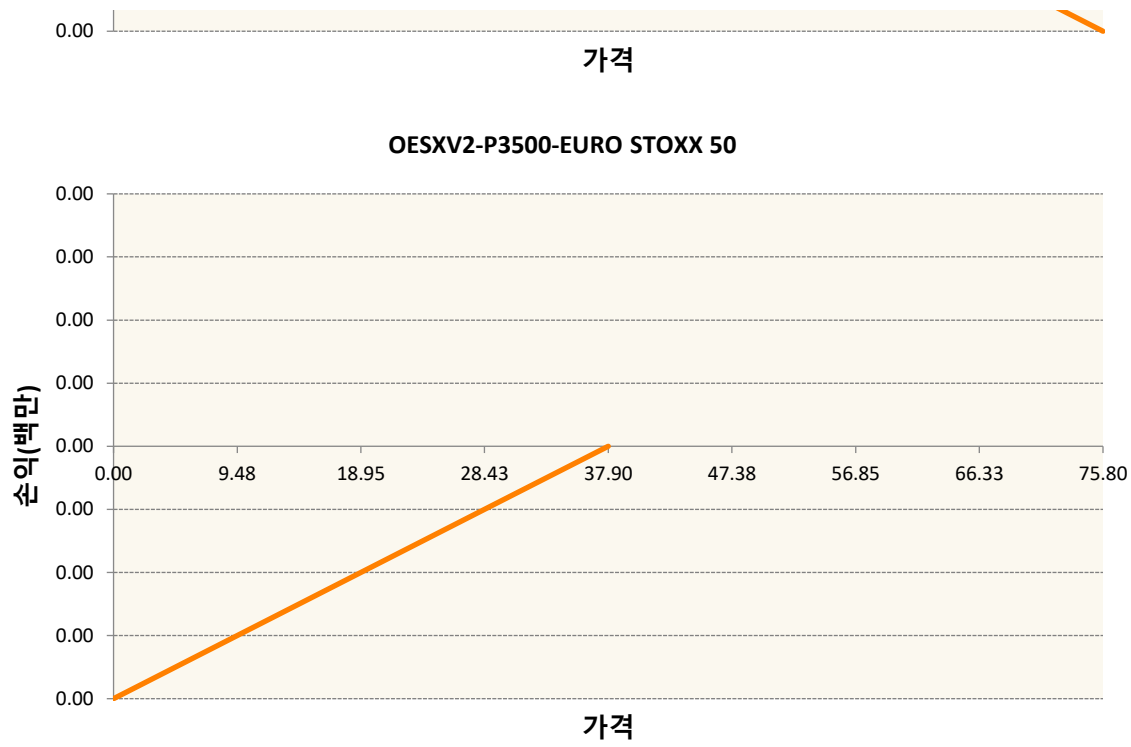
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	3,021	0	3,021	
누계	유가증권	옵션	0	23	-23	장내
누계	통화	선도	0	2,315	-2,315	장외

2. 만기시점의 손익구조





0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E	73
FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E	56
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E	56
OESXV2-C35 EURO STOXX 50	1
OESXV2-C35 EURO STOXX 50	0.01
OESXV2-P35 EURO STOXX 50	1
OESXV2-P35 EURO STOXX 50	0.06
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	242

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

376

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

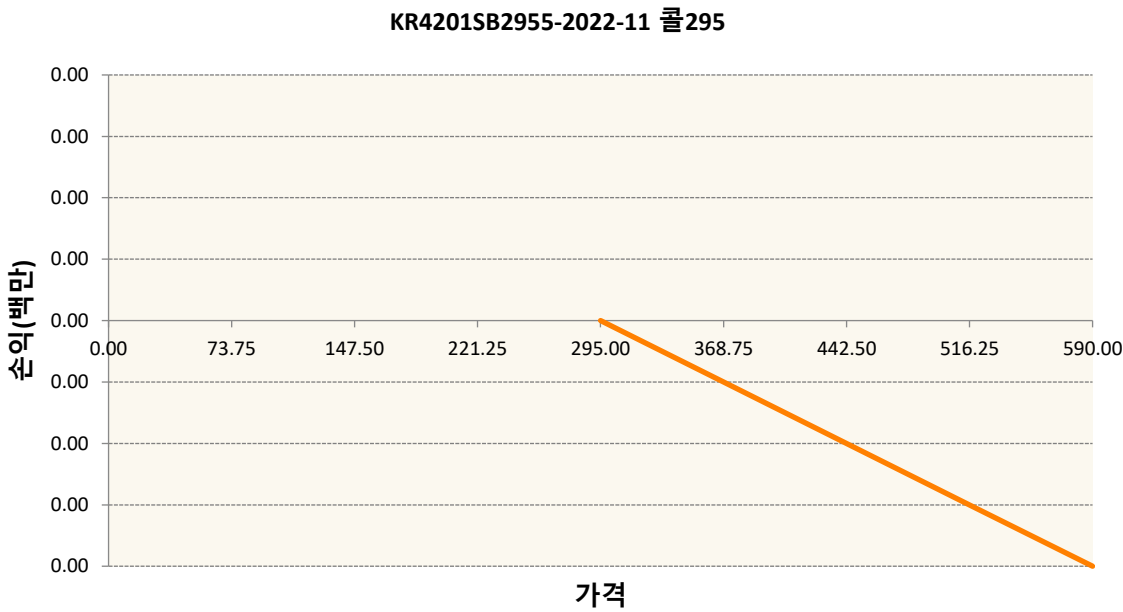
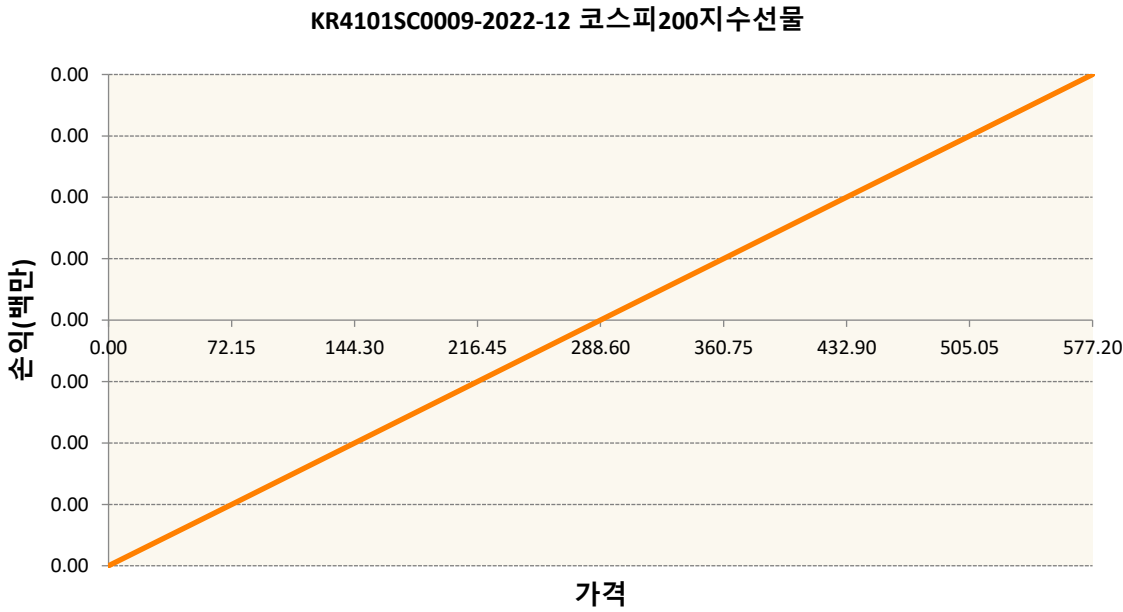
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

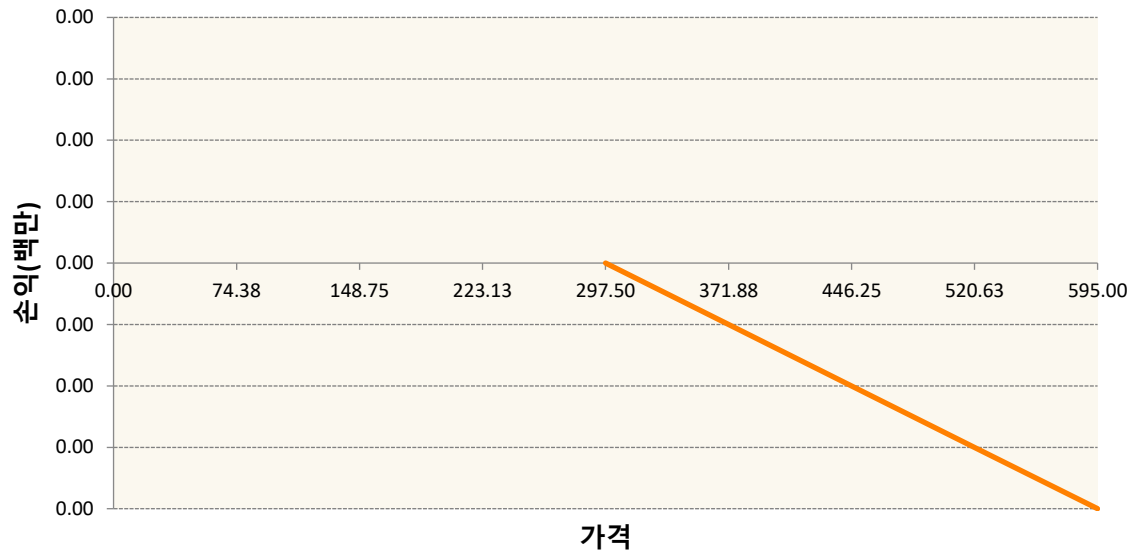
1. 계약금액

(단위:백만원)

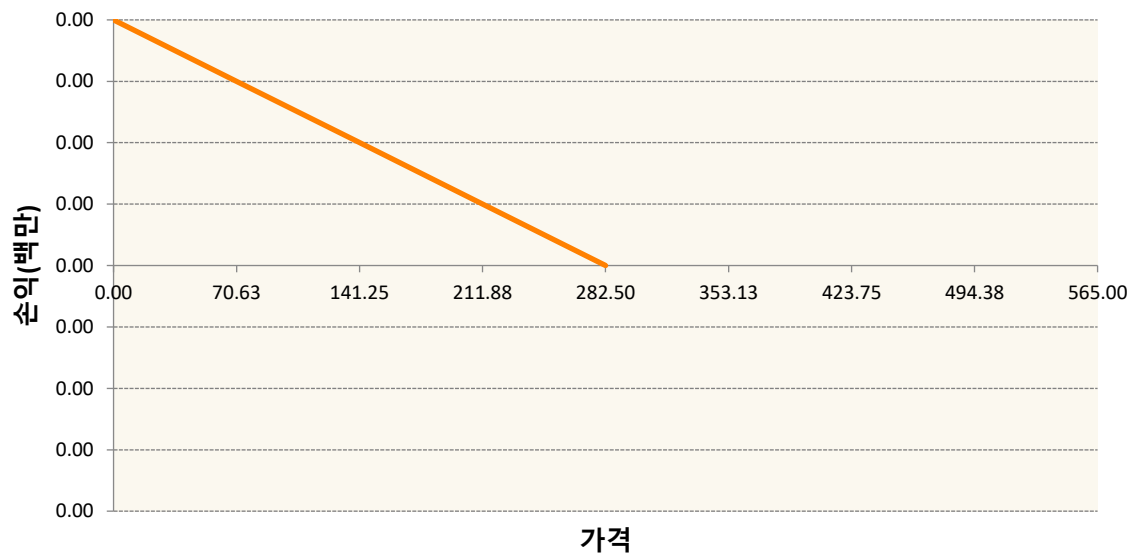
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	289	0	289	장내
누계	유가증권	옵션	424	3,708	-3,284	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4201SB2971-2022-11 **콜**297.5

KR4301SB2822-2022-11 ㄱ282.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(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
KR4201SB2955		2022-11 콜295					69
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	34	32	29	27	24	21
-5.33%	31	28	26	22	19	16	12
-2.67%	24	20	17	13	9	5	1
0%	13	8	4	0	-4	-8	-13
2.67%	-3	-7	-12	-16	-20	-25	-29
5.33%	-23	-27	-31	-35	-40	-44	-48
8.00%	-47	-50	-54	-58	-61	-65	-69
KR4201SB2971 2022-11 콜297.5							130

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	60	56	52	47	42	37
-5.33%	56	51	45	40	34	28	21
-2.67%	43	37	30	23	16	8	1
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-4	-12	-21	-29	-38	-46	-54
5.33%	-40	-48	-56	-65	-73	-81	-90
8.00%	-83	-90	-98	-106	-114	-122	-130

KR4301SB2822 2022-11 풋282.5							23
--	--	--	--	--	--	--	----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	17	18	19	20	21	23
-5.33%	7	9	10	11	13	14	16
-2.67%	1	2	4	5	7	8	10
0%	-4	-3	-1	0	1	3	4
2.67%	-8	-7	-5	-4	-3	-1	0
5.33%	-10	-9	-8	-7	-6	-5	-3
8.00%	-12	-11	-10	-9	-8	-7	-6

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

(단위:백만원)

203

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

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	6,709	0	6,709	

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	2022-10-21
기준일	2022-10-20

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	5,891	0	5,891	

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	2022-10-21
기준일	2022-10-20

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	18,557	0	18,557	
누계	통화	선도	2,007	20,819	-18,812	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C7R· KRW/USD 27-10-22E	491
FXW213C8R· KRW/USD 28-11-22E	641
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	533
FXW213C9V(USD/KRW 27-10-22E	75
FXW213C9X(USD/KRW 27-10-22E	23
FXW213CAJ(USD/KRW 27-10-22E	40
FXW213CAK(USD/KRW 27-10-22E	23
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

797

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

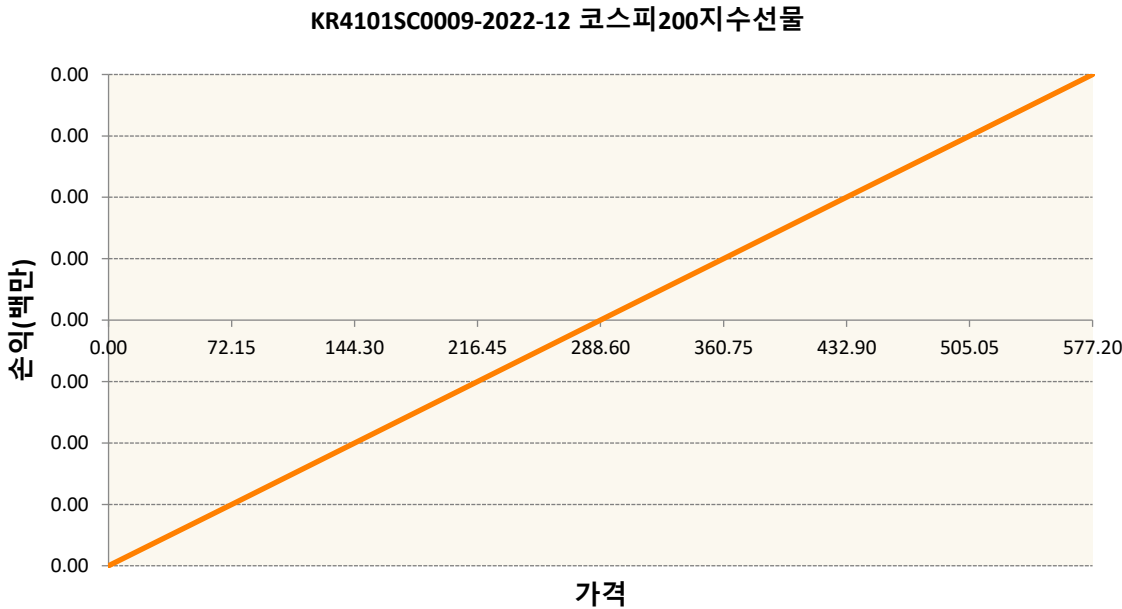
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	361	0	361	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	2022-10-21
기준일	2022-10-20

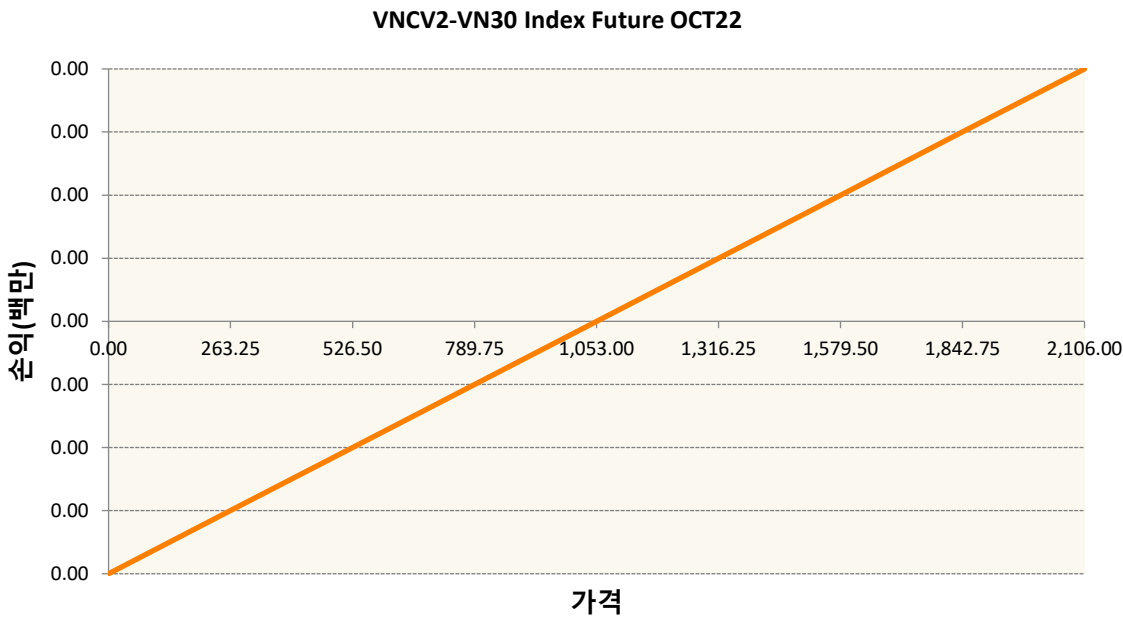
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	416	0	416	
누계	유가증권	스왑	1,726	0	1,726	장외
누계	통화	선도	772	1,122	-351	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	138
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

FXW213CAB EUR/KRW 18-11-22E
FXW213CAD EUR/KRW 18-11-22E
FXW213CAK EUR/KRW 18-11-22E
VNCV2 VN30 Index Future OCT22

11
17
6
33

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

(단위:백만원)

281

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

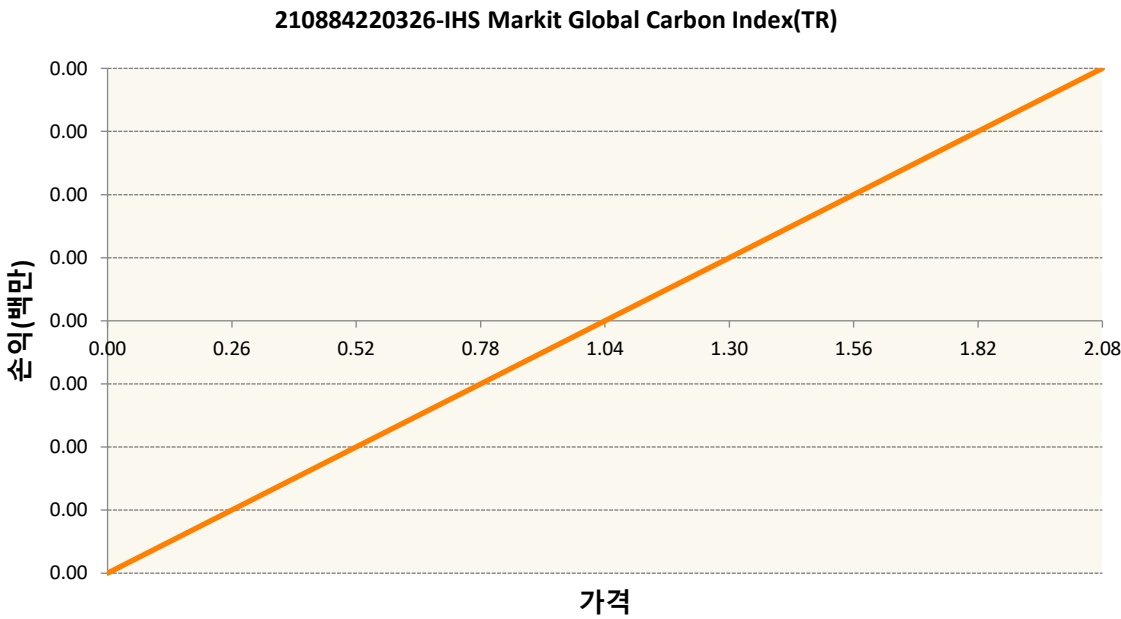
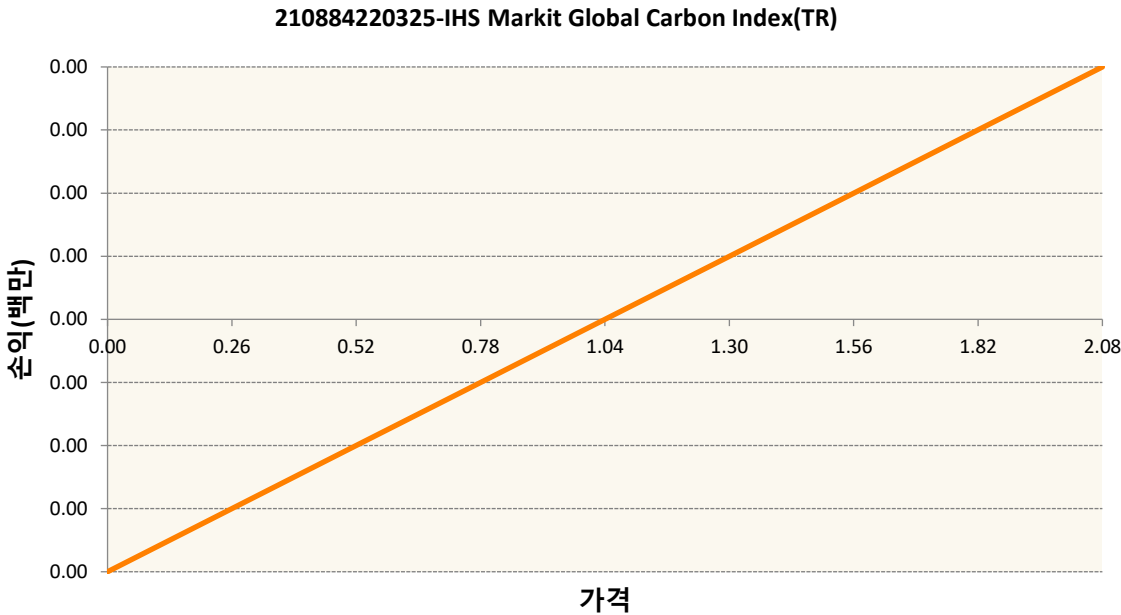
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

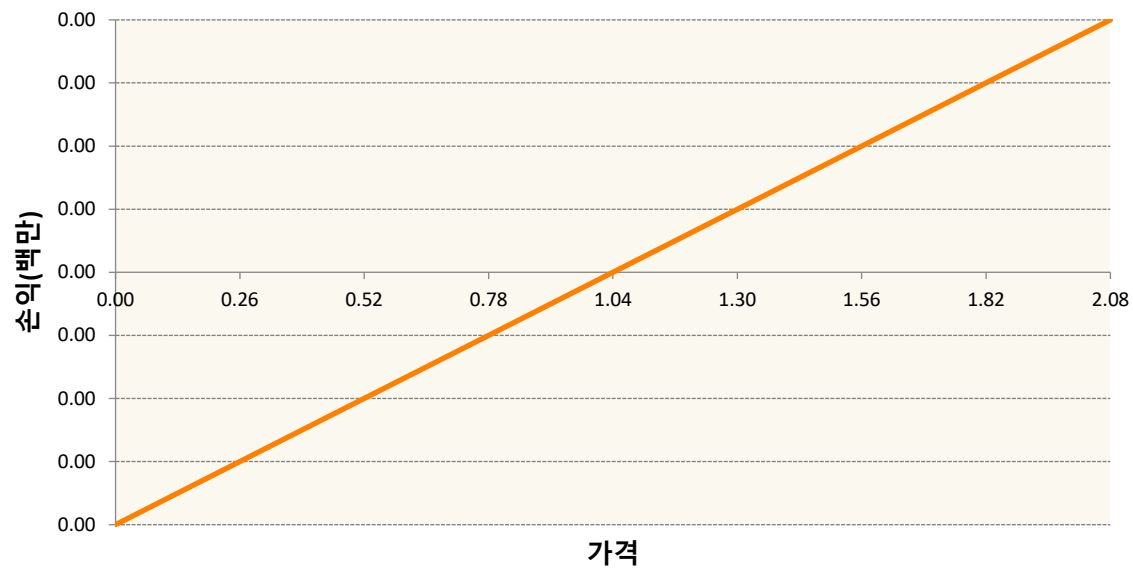
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	35,986	0	35,986	

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)

180

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

2,603

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

90

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

(단위:백만원)

5,431

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

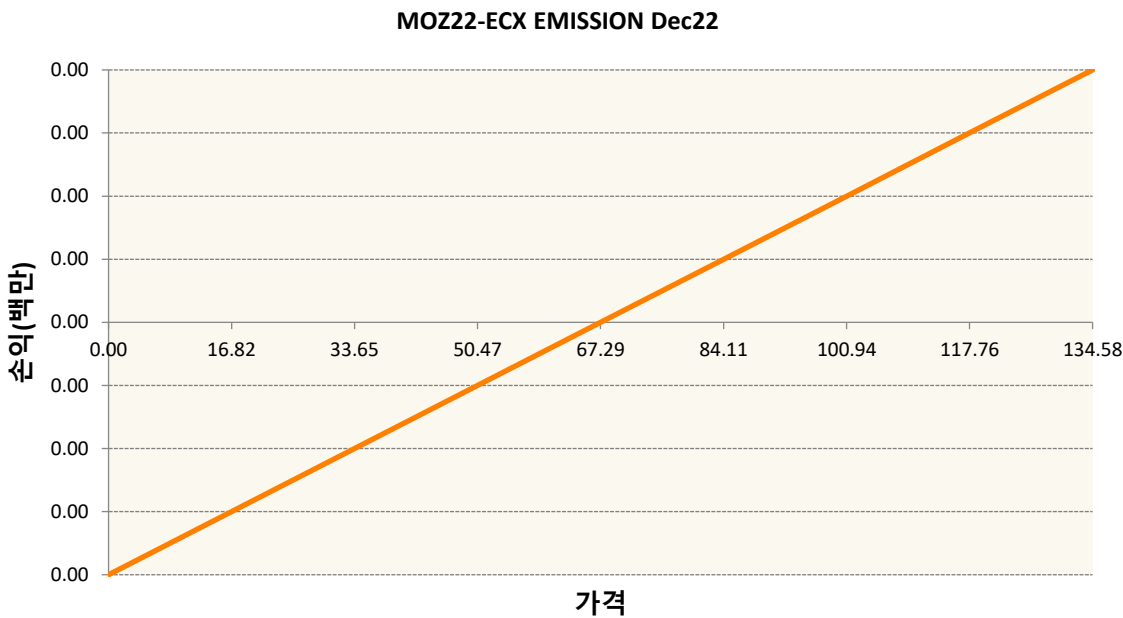
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,262	0	12,262	
누계	통화	선도	0	5,492	-5,492	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9T(KRW/EUR 27-10-22E	439
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	981

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

(단위:백만원)

2,769

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

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)	0.01
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	0.01
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	0.01
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	0.01

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

(단위:백만원)

0

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

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	8,926	0	8,926	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	5

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

(단위:백만원)

20

공시일 2022-10-21

기준일 2022-10-20

에쿼티알파일반사모혼합자산

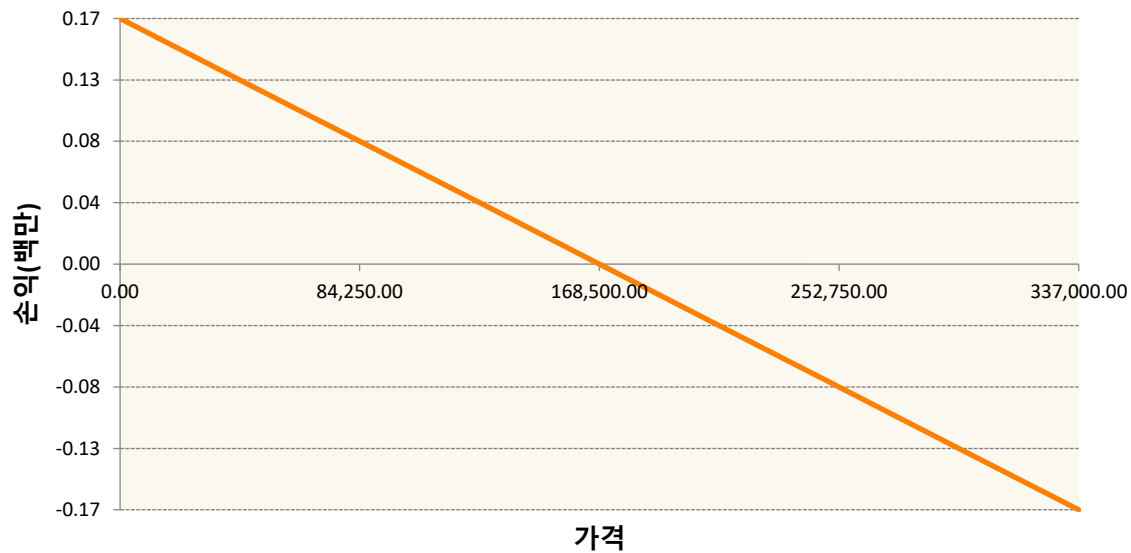
1. 계약금액

(단위:백만원)

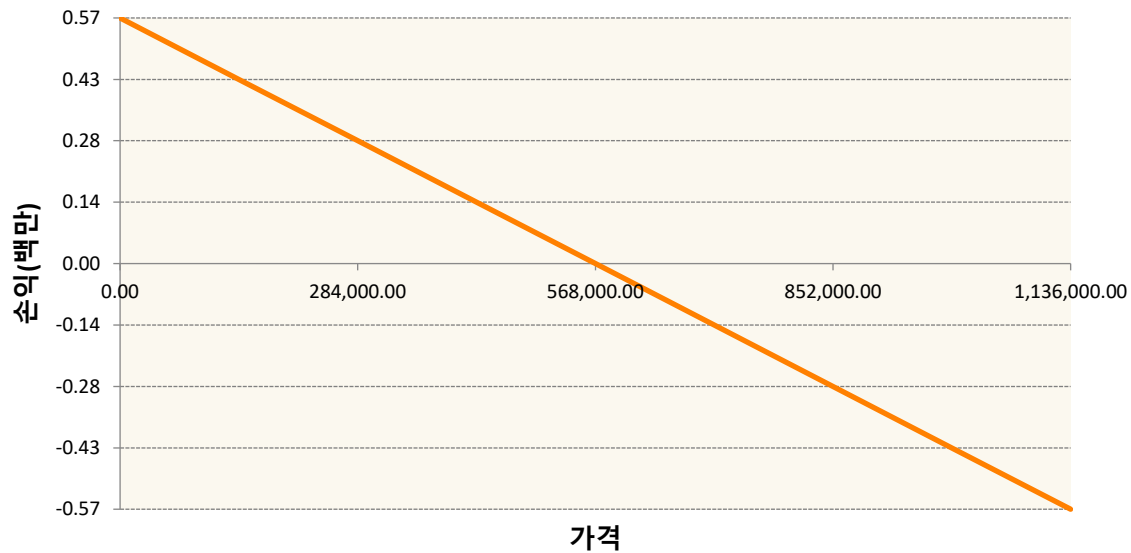
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	0	540	-540	장외

2. 만기시점의 손익구조

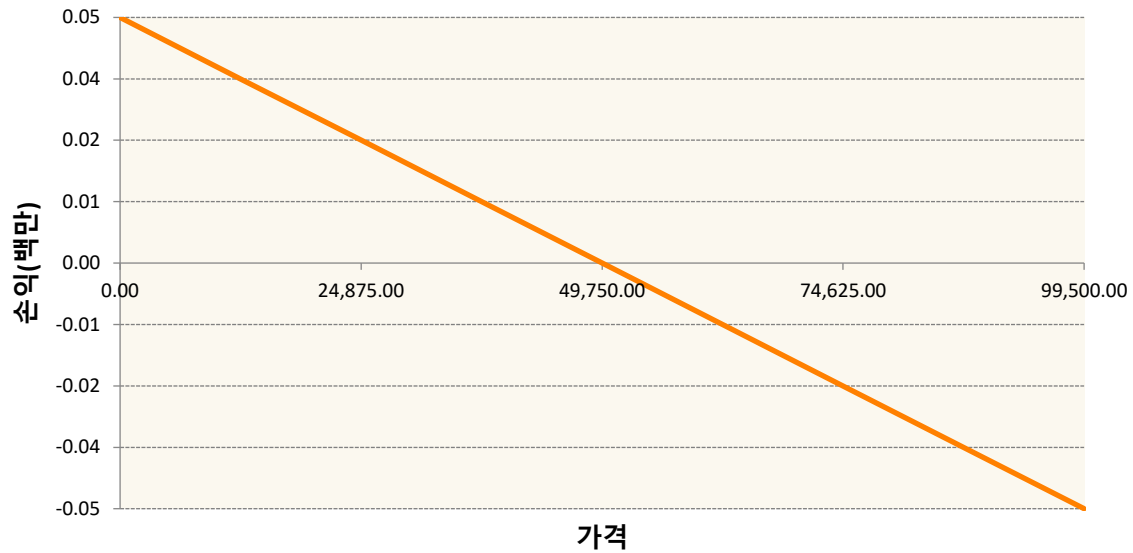
KR4116SB0003-2022-11 현대차개별선물



KR4147SB0006-2022-11 LG화학개별선물



KR41CBSB0004-2022-11 한화솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4116SB00 2022-11 현대차개별선물
 KR4147SB00 2022-11 LG화학개별선물
 KR41CBSB00 2022-11 한화솔루션개별선물
 KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429
 KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602

16
 9
 18
 0.08
 0.16

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

(단위:백만원)

100

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

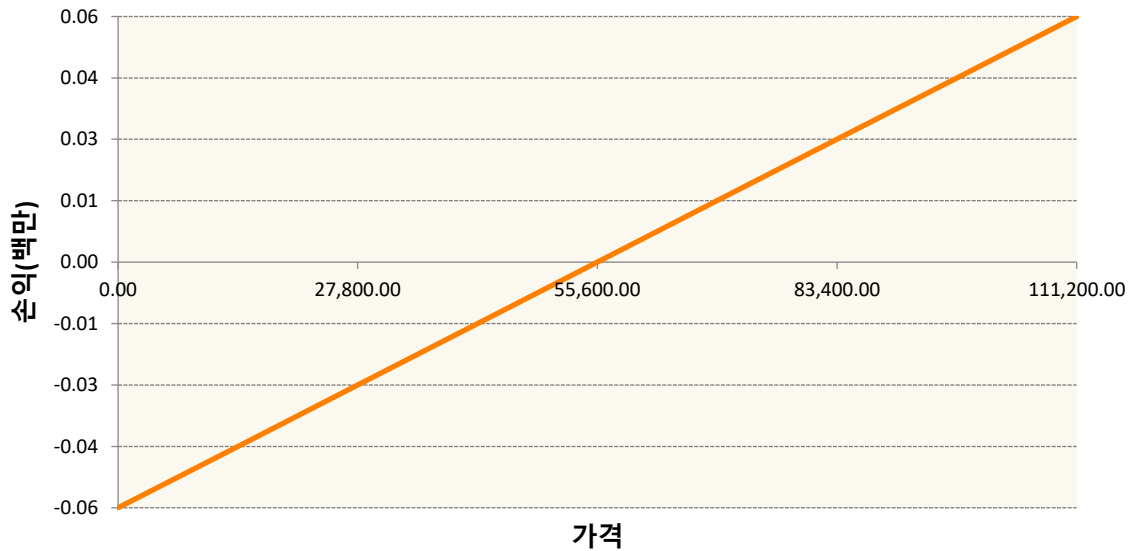
1. 계약금액

(단위:백만원)

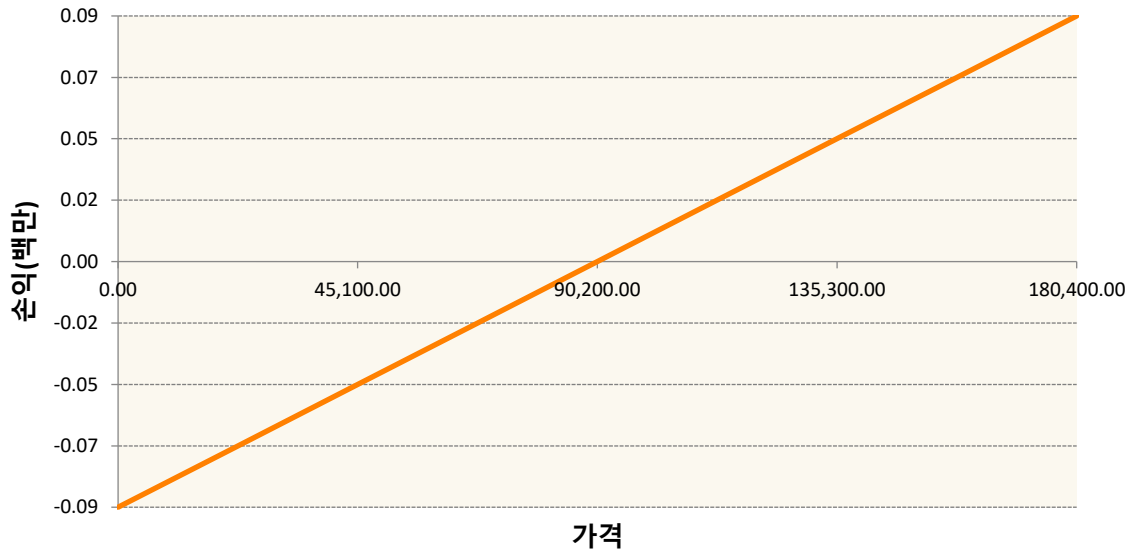
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	55	-55	장내
누계	유가증권	선물	739	0	739	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111SB0008-2022-11 삼성전자개별선물



KR4150SB0000-2022-11 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SB0008		2022-11 삼성전자개별선물					30
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-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%	30	30	30	30	30	30	30
KR4150SB0000		2022-11 SK하이닉스개별선물					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

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

69

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

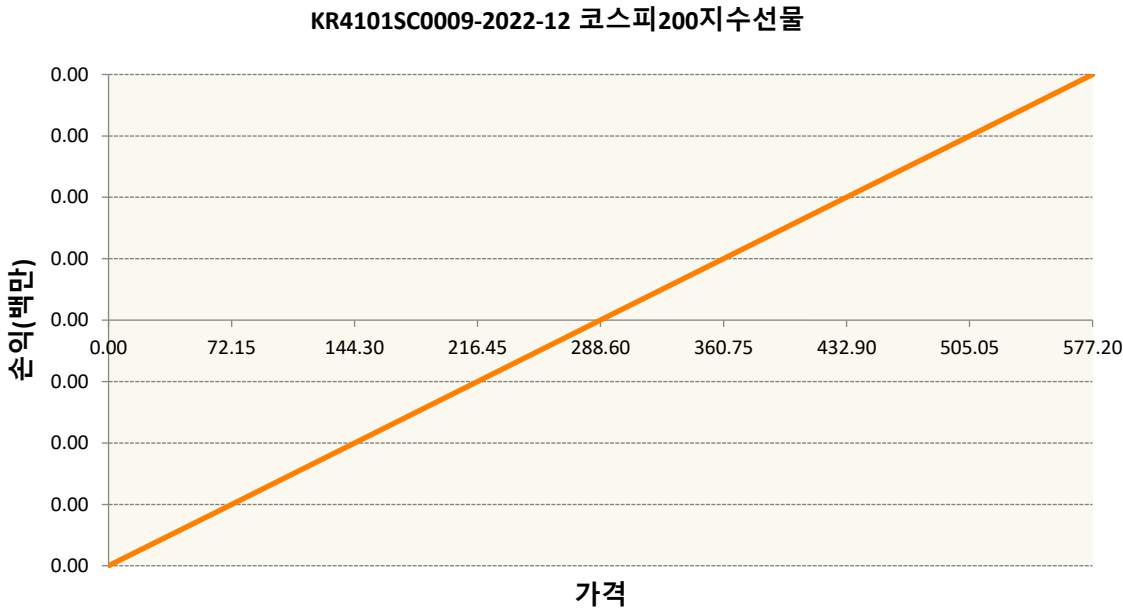
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	361	0	361	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 2022-10-21

기준일 2022-10-20

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

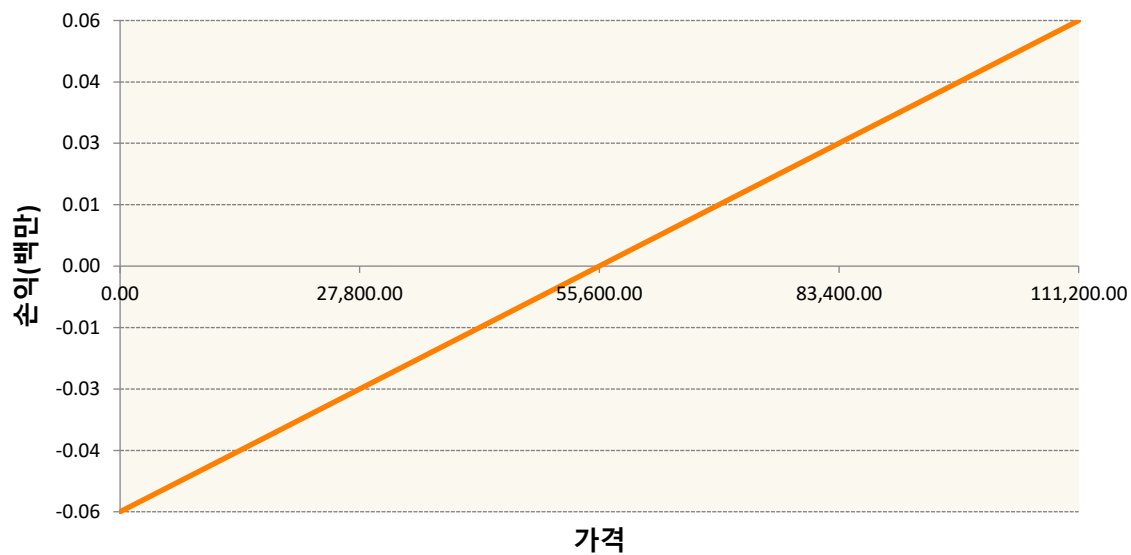
1. 계약금액

(단위:백만원)

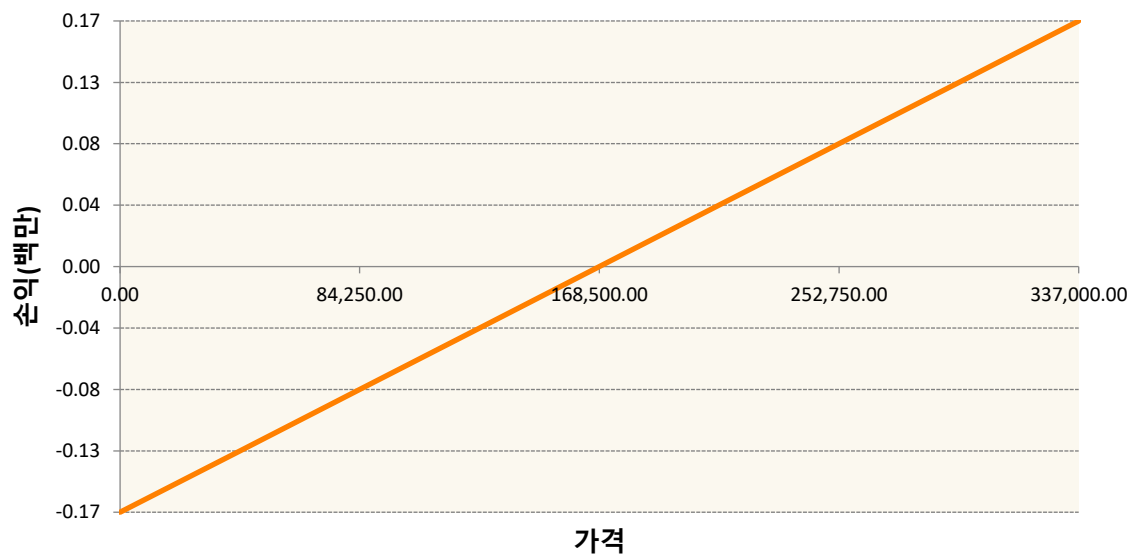
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	203	0	203	장내
누계	유가증권	ELS	63	0	63	장외

2. 만기시점의 손익구조

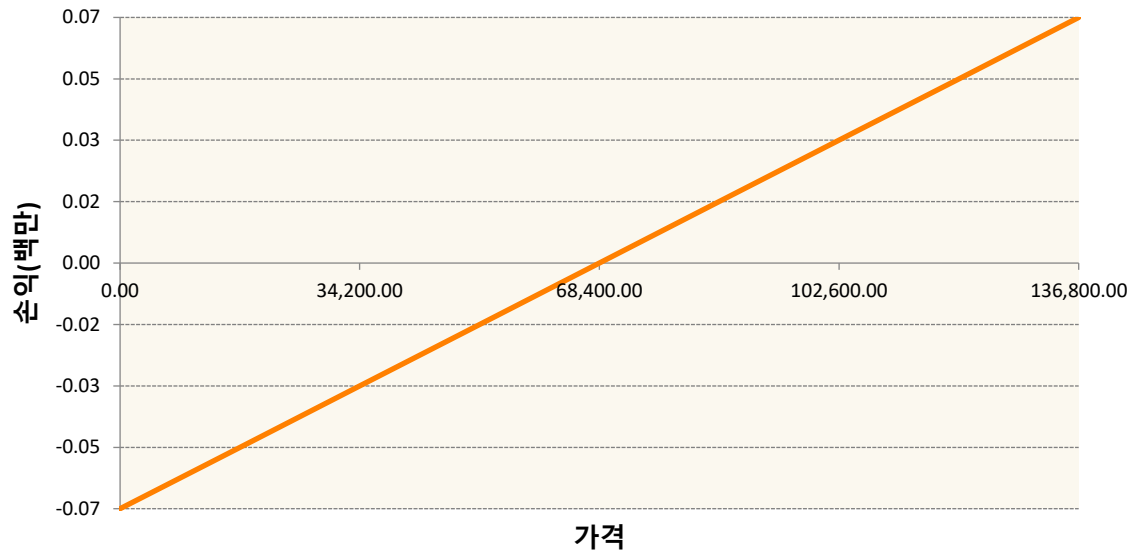
KR4111SB0008-2022-11 삼성전자개별선물



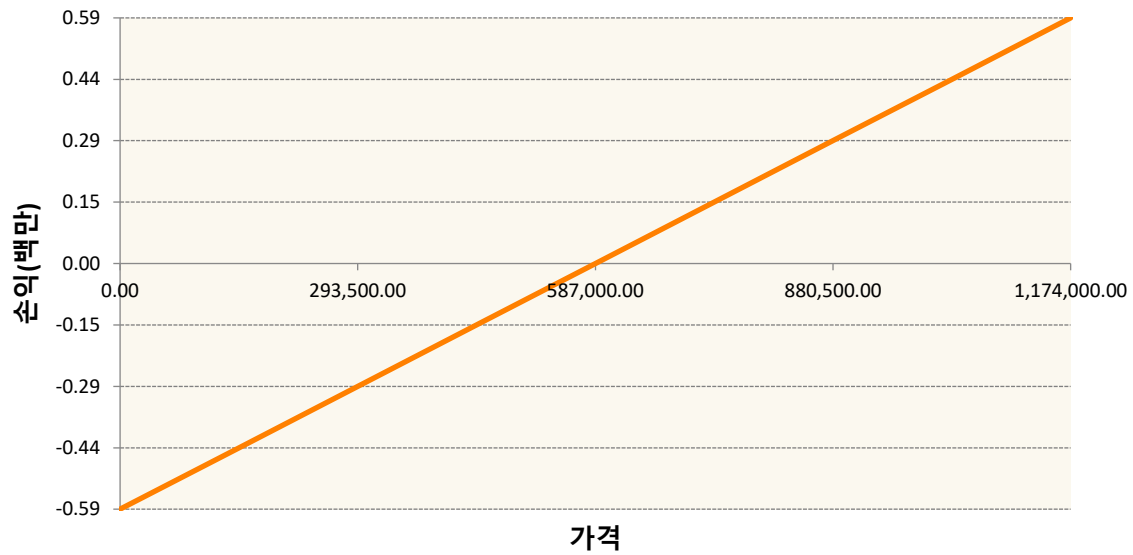
KR4116SB0003-2022-11 현대차개별선물



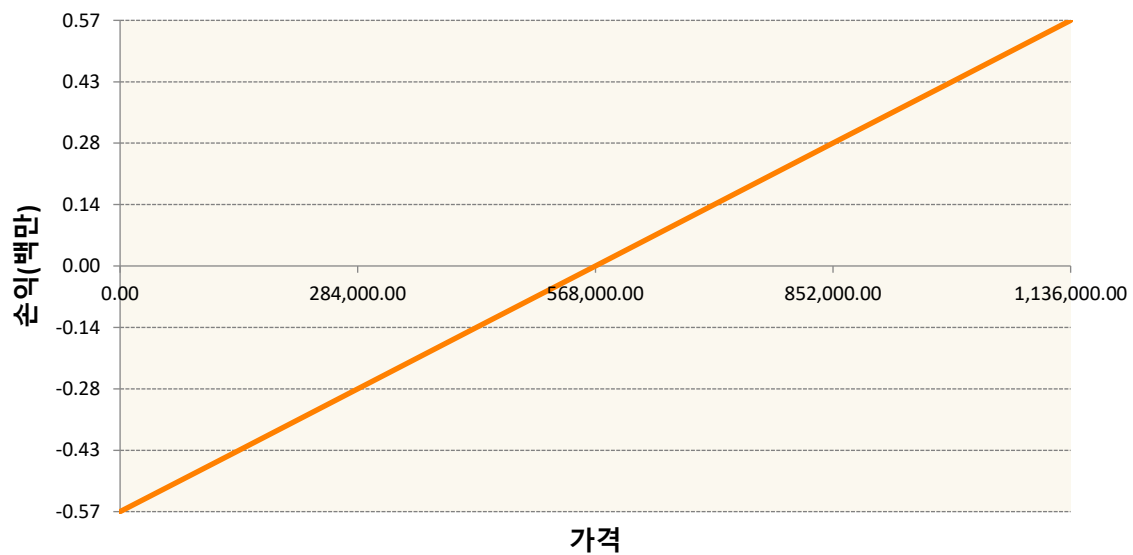
KR4119SB0000-2022-11 기아개별선물



KR4122SB0005-2022-11 삼성SDI개별선물



KR4147SB0006-2022-11 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SB0008		2022-11 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
KR4119SB0000		2022-11 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
KR4122SB0005		2022-11 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

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

19

공시일 2022-10-21

기준일 2022-10-20

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

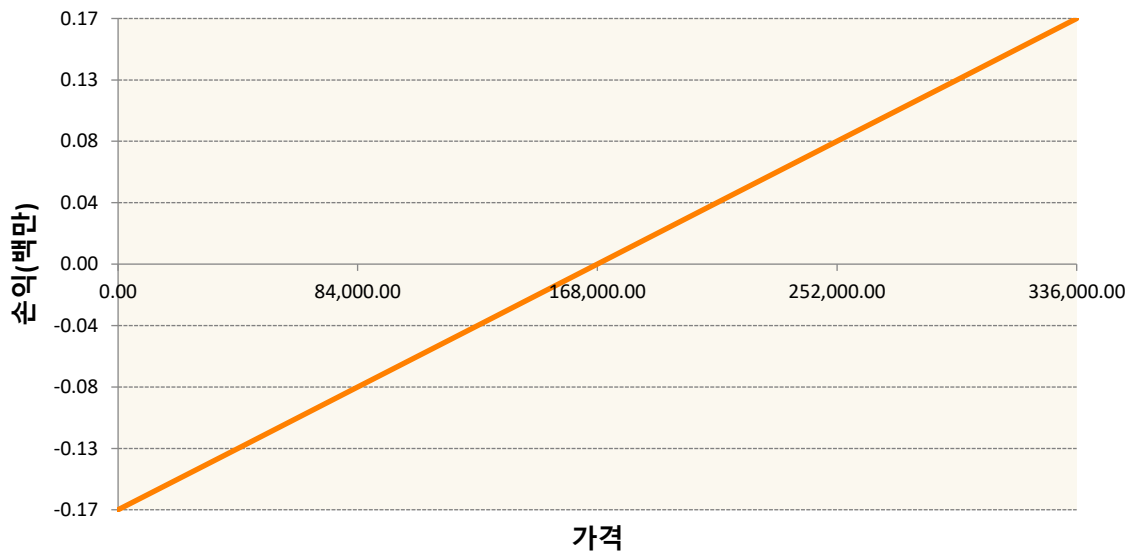
1. 계약금액

(단위:백만원)

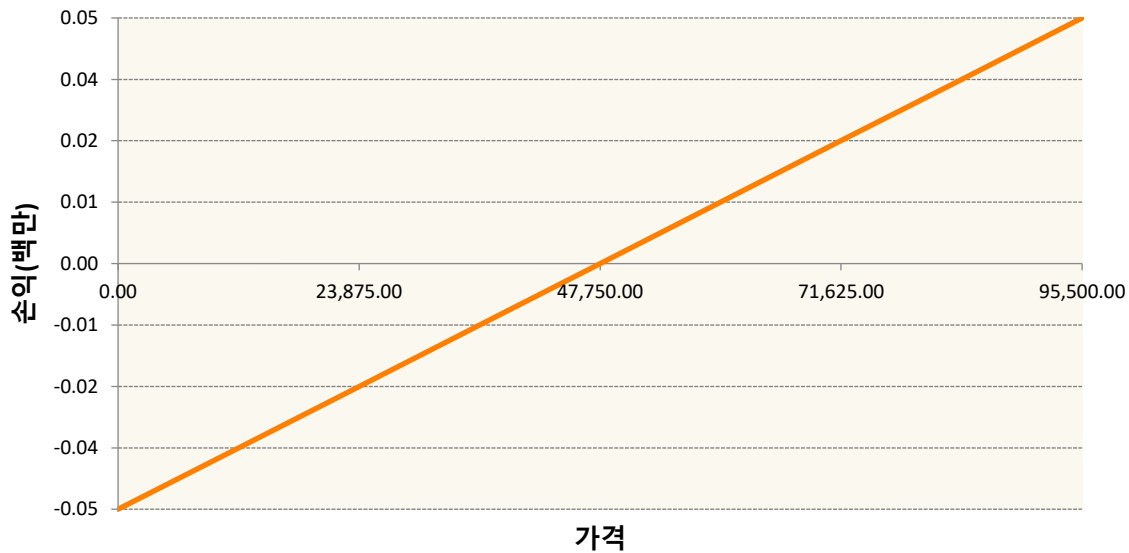
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	40	-40	장내
누계	유가증권	선물	102	0	102	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156SB0004-2022-11 NAVER개별선물



KR41CFSB0000-2022-11 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156SB0004			2022-11 NAVER개별선물				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
KR41CFSB0000			2022-11 카카오개별선물				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

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

14

공시일	2022-10-21
기준일	2022-10-20

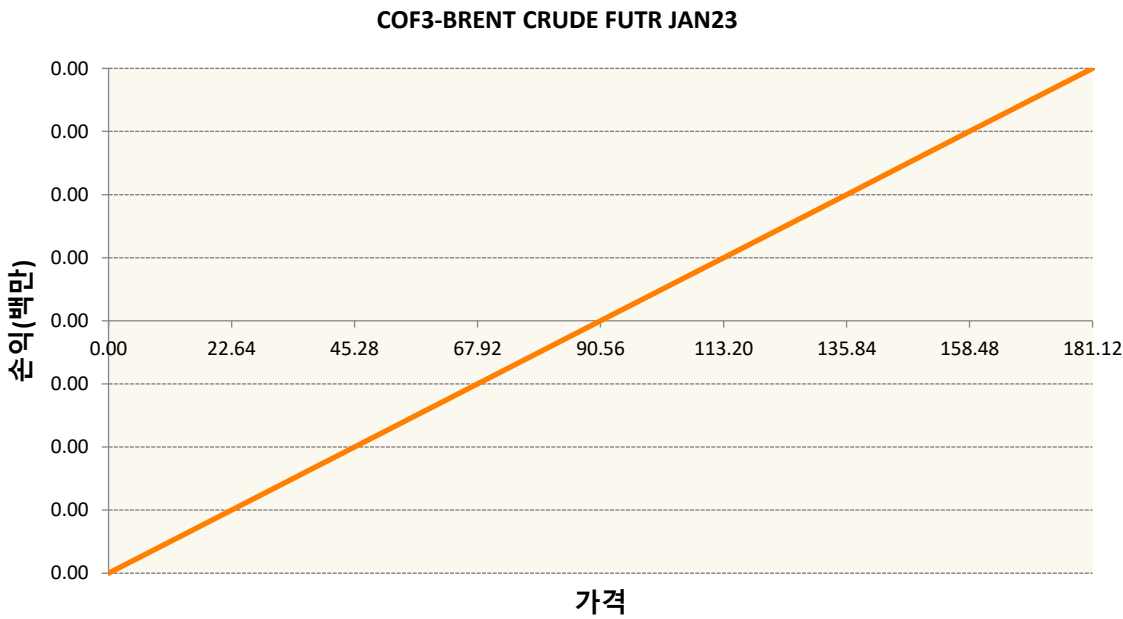
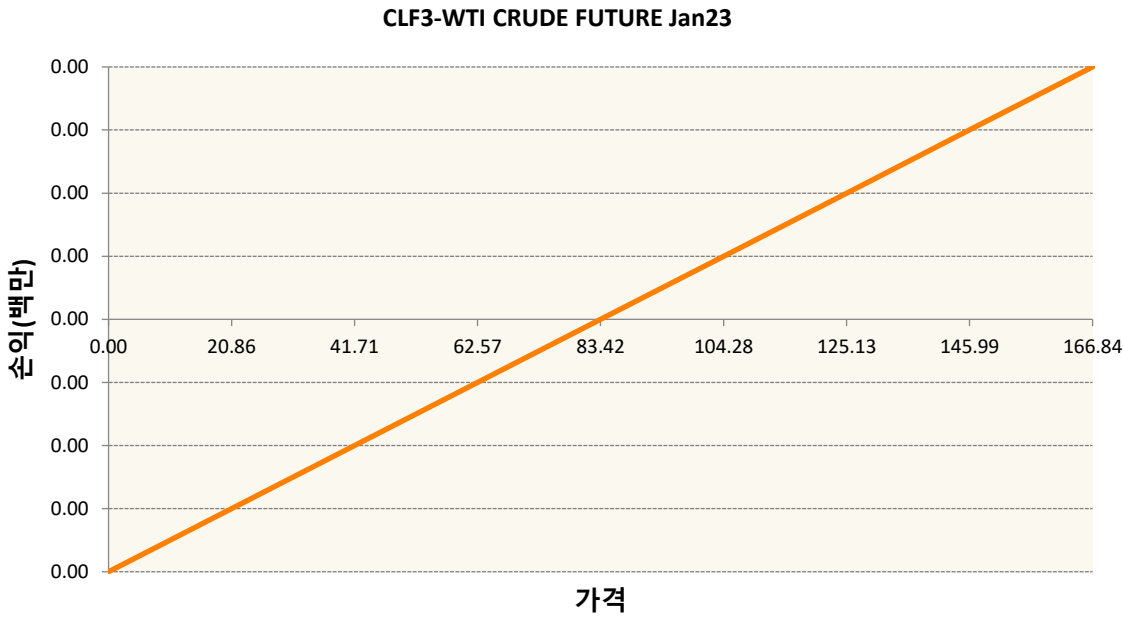
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

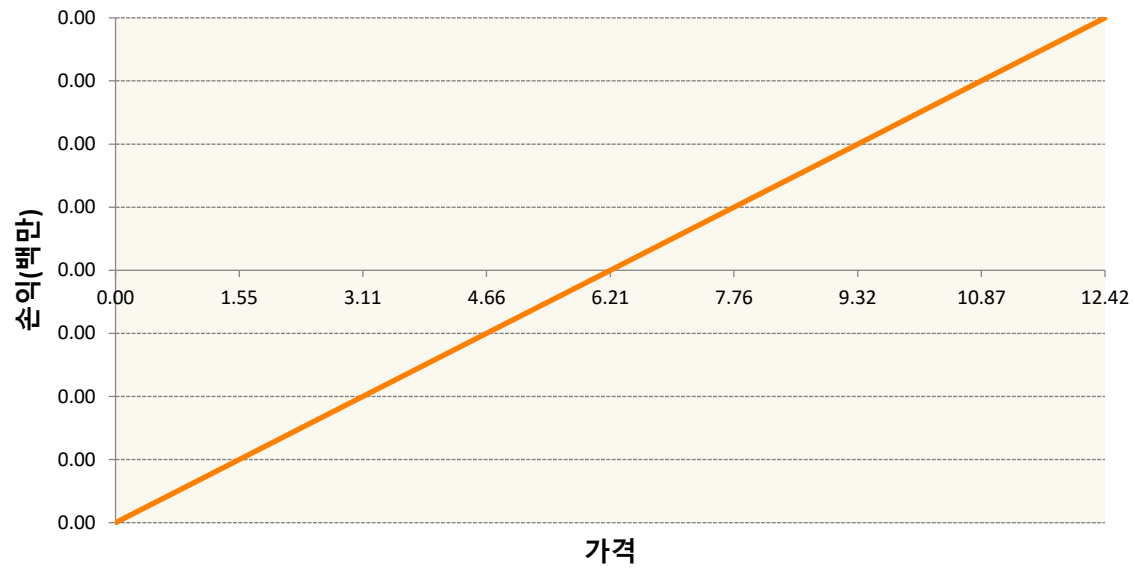
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	238	0	238	
누계	유가증권	선물	1,463	287	1,177	

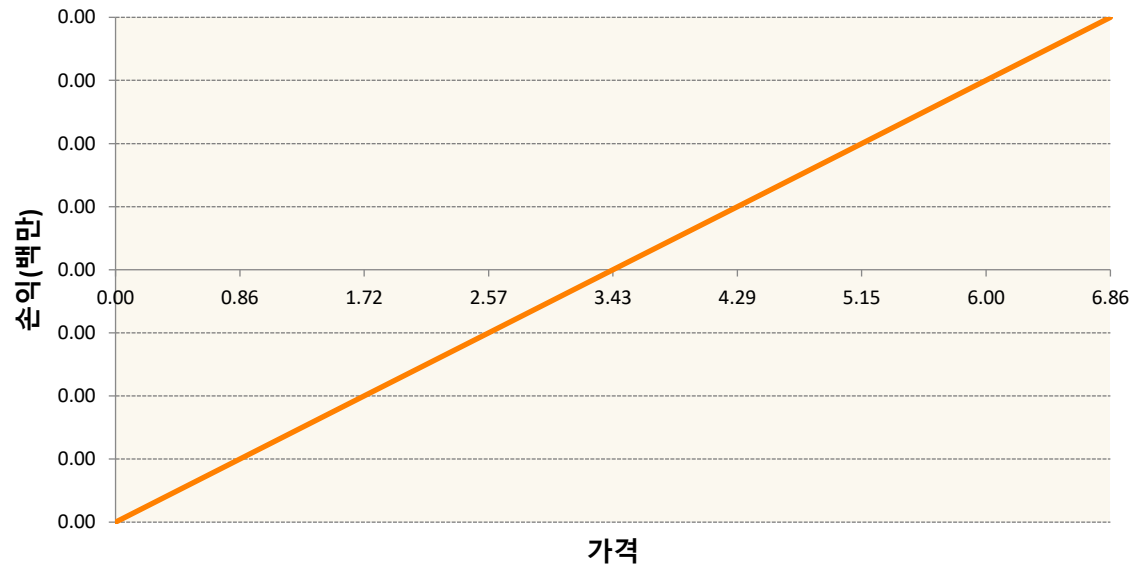
2. 만기시점의 손익구조



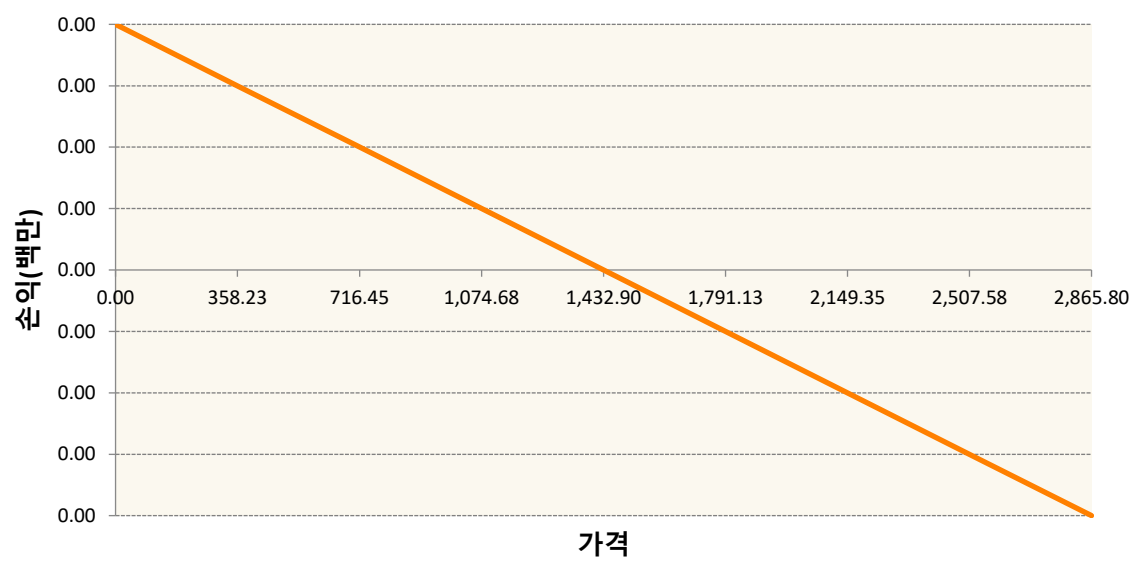
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



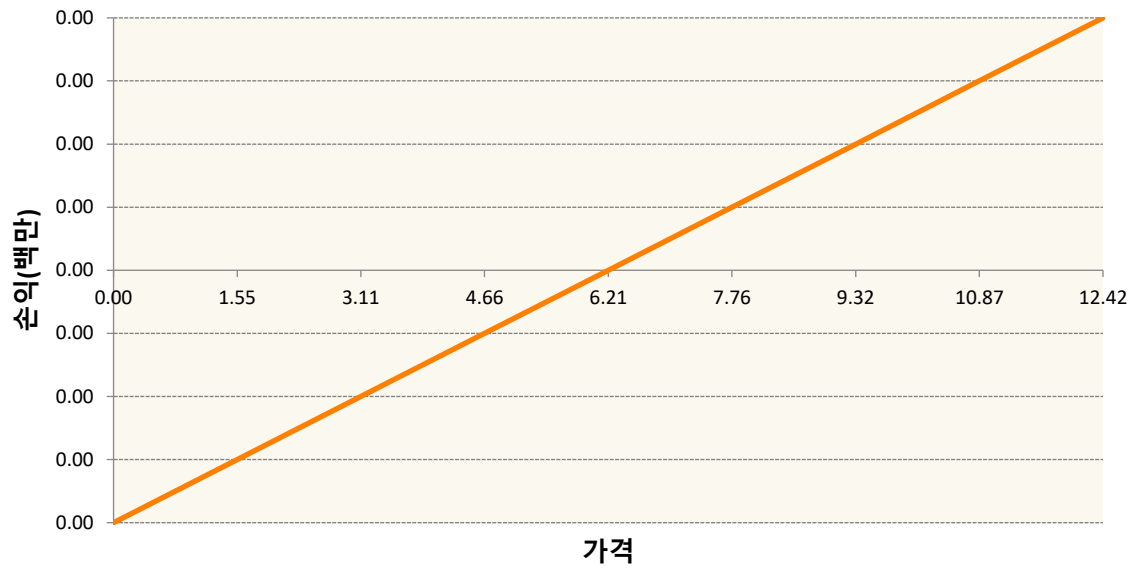
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



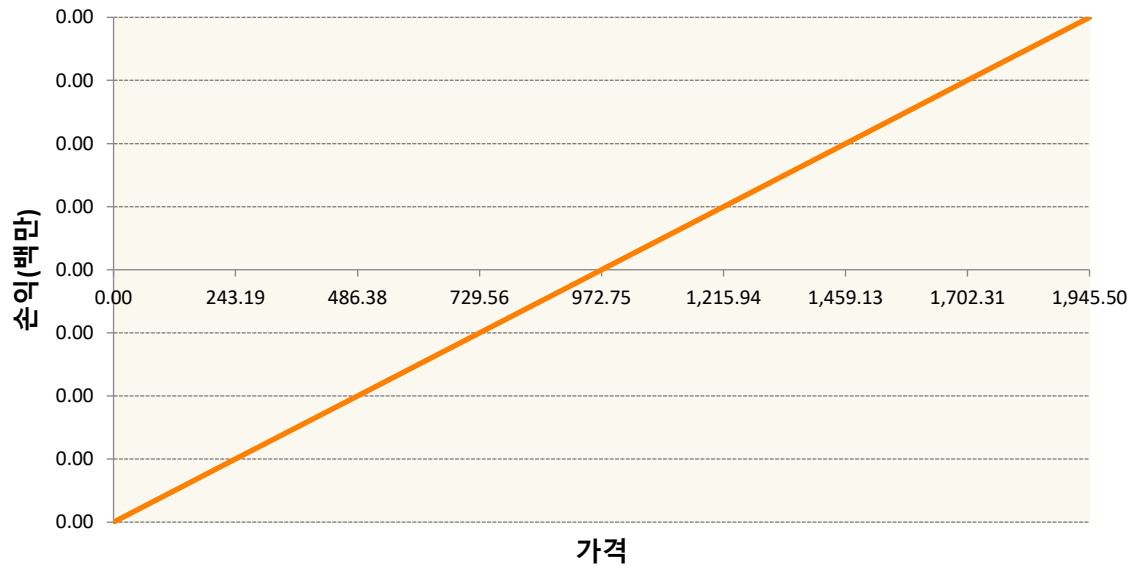
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



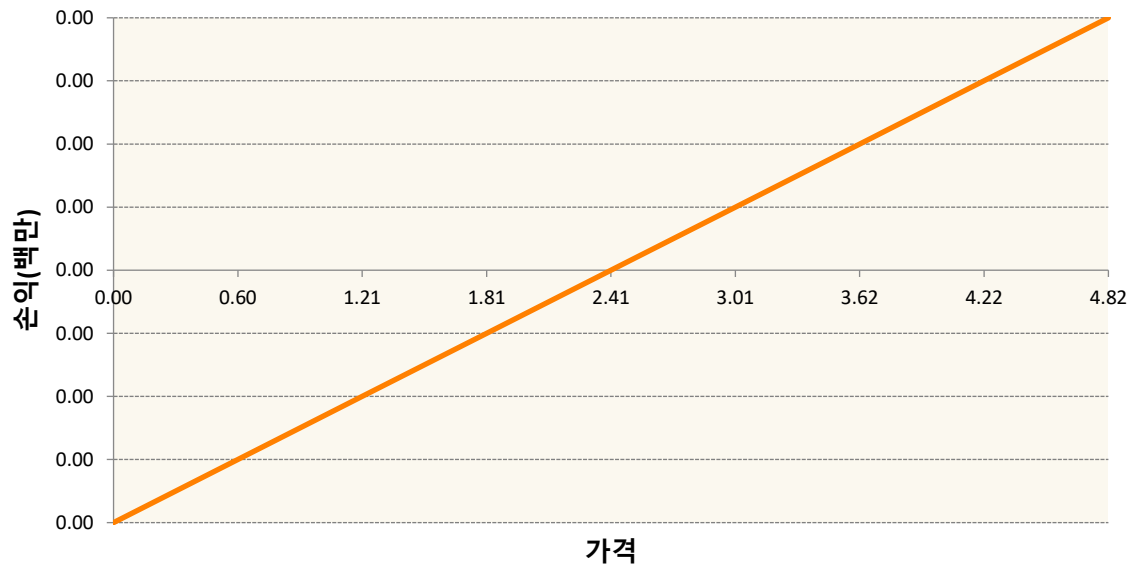
NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



QSF3-Low Su Gasoil G Jan23



XBF3-GASOLINE RBOB FUT Jan23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF3	WTI CRUDE FUTURE Jan23	19
COF3	BRENT CRUDE FUTR JAN23	30
EOF3	E-MINI NATURAL GAS Jan23	5
HOF3	NY Harb ULSD Fut Jan23	16
KR4175SB00	2022-11 달러선물	23
NGF23	NATURAL GAS FUTR Jan23	42
QSF3	Low Su Gasoil G Jan23	11
XBF3	GASOLINE RBOB FUT Jan23	12

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

432