

공시일 2022-10-26

기준일 2022-10-25

포커스농산물모(채권-파생형)

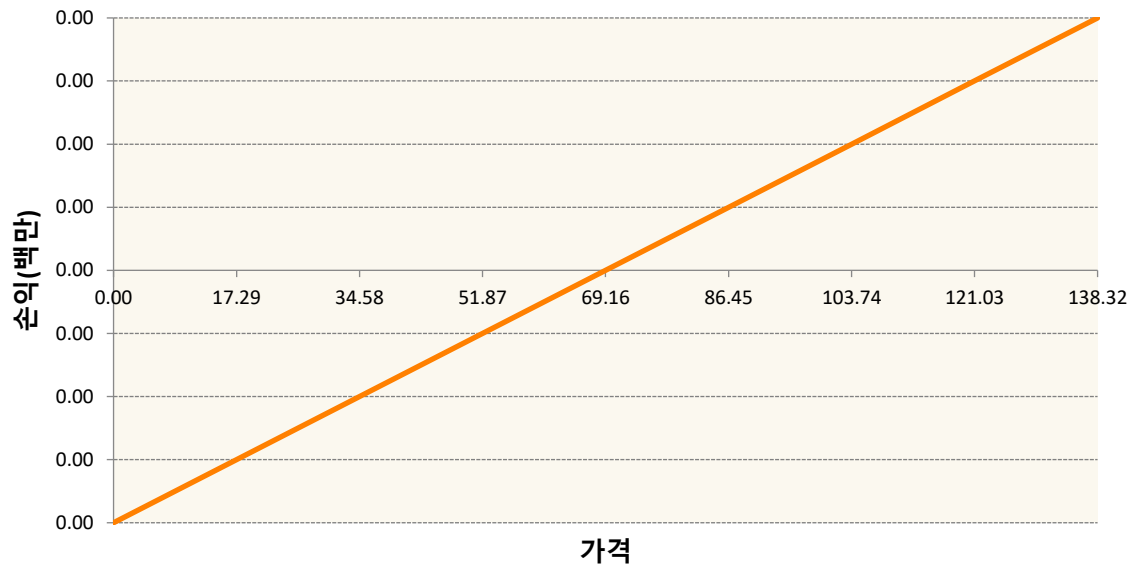
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

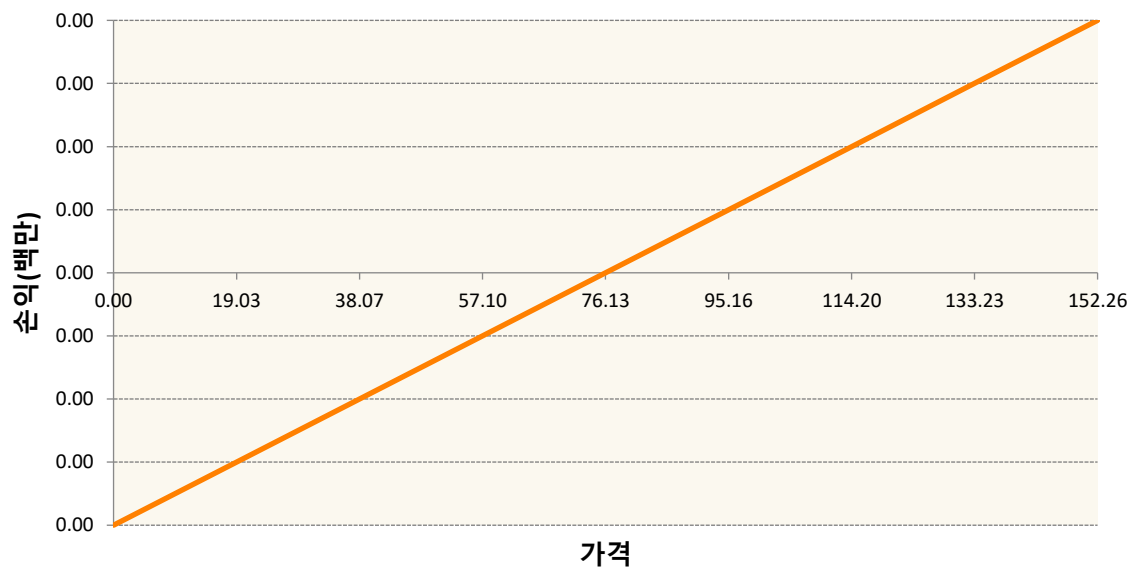
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,499	860	5,638	

2. 만기시점의 손익구조

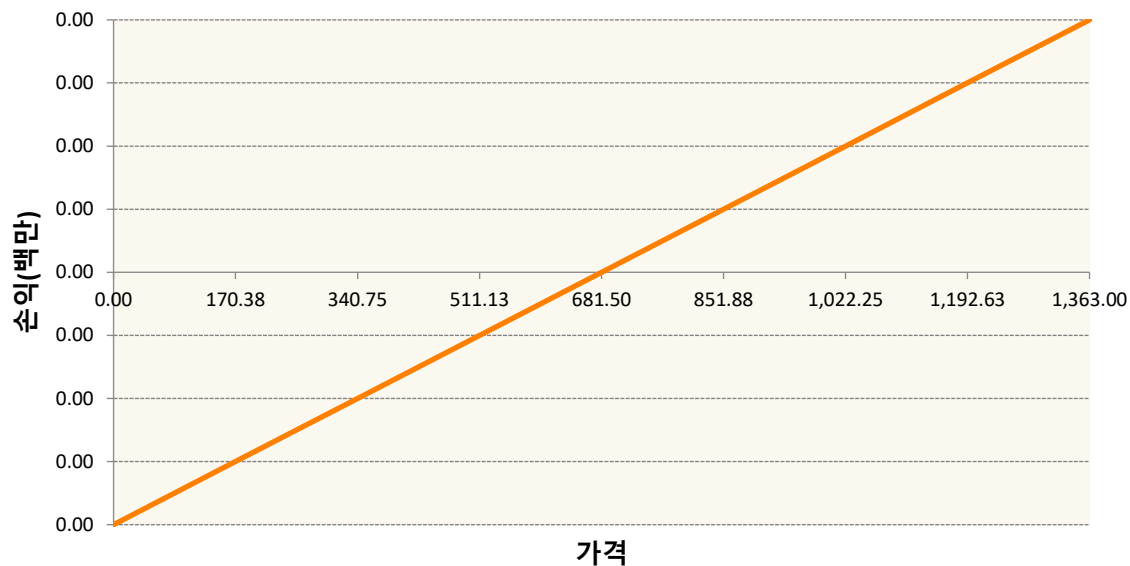
BOF3-SOYBEAN OIL FUTR Jan23



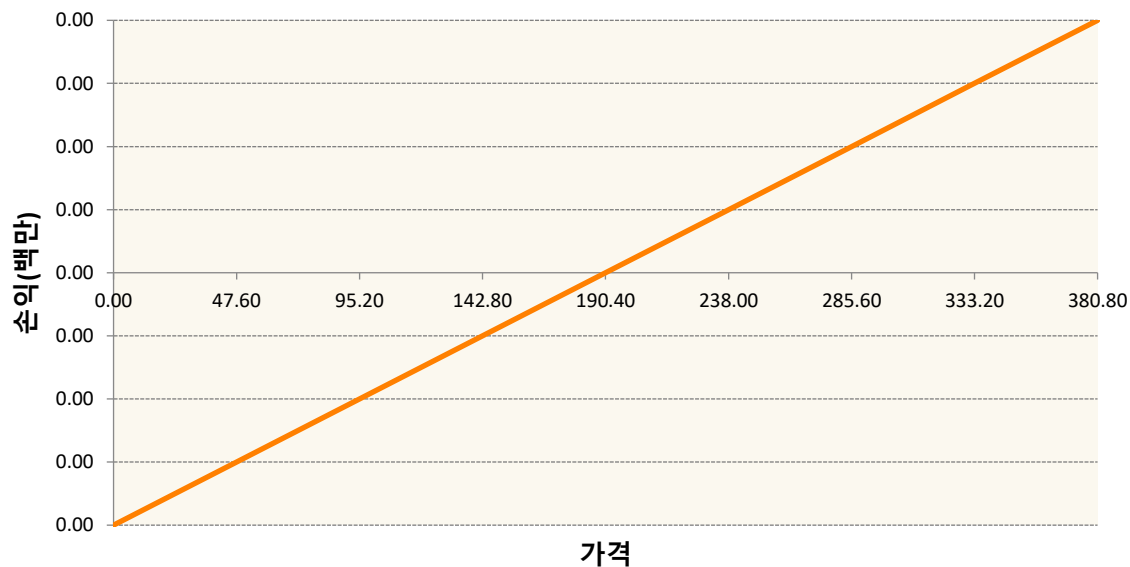
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



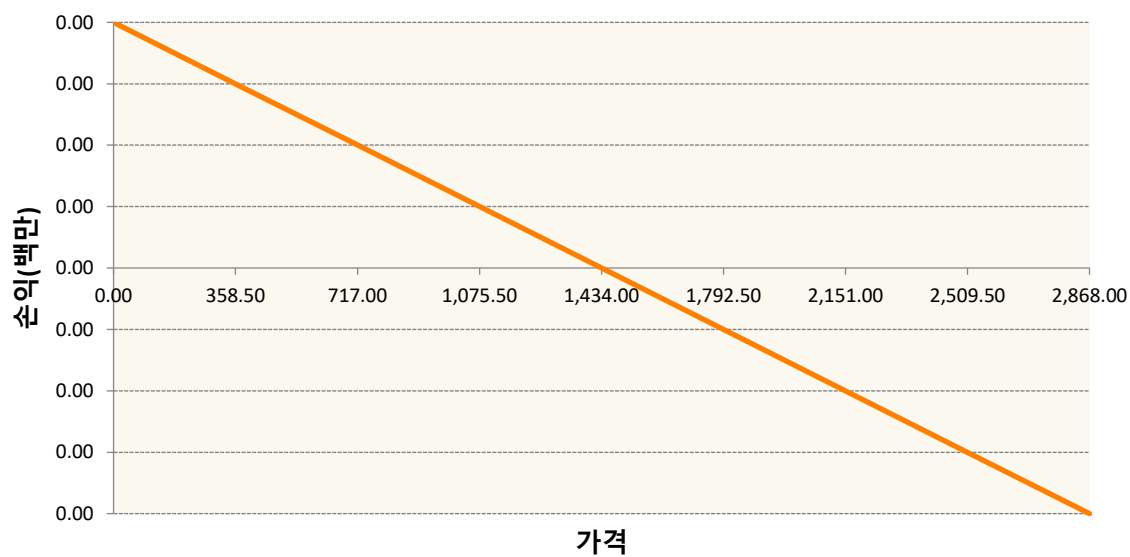
CZ2-CORN FUTURE Dec22



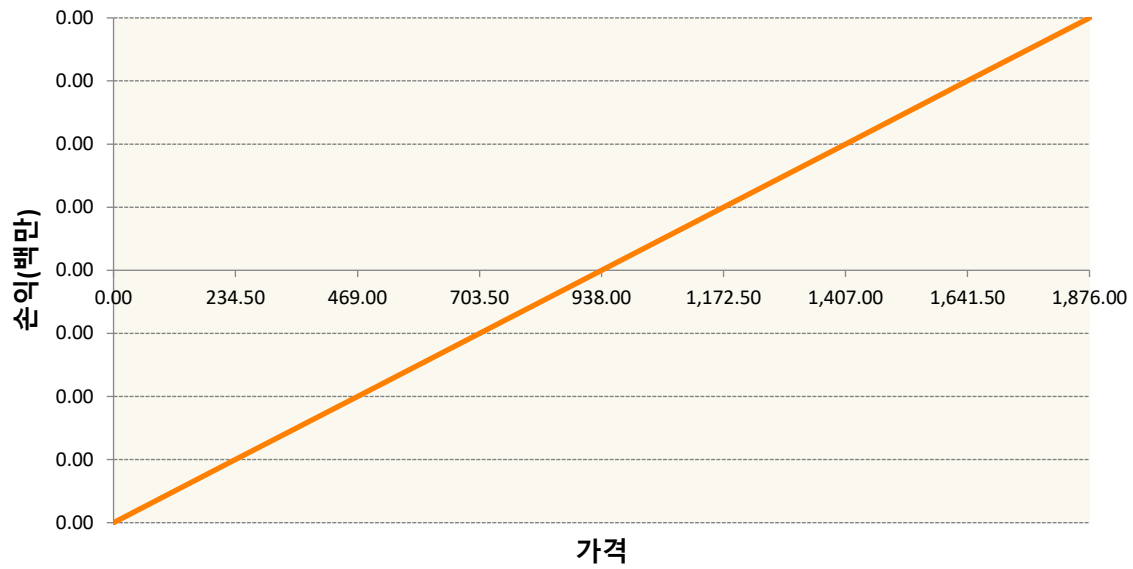
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



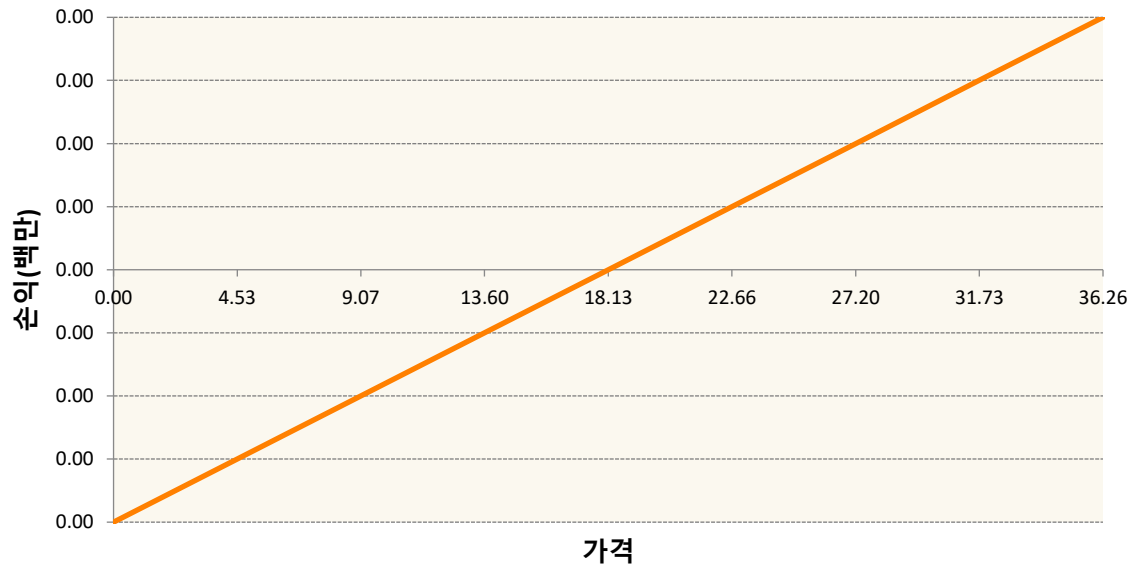
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



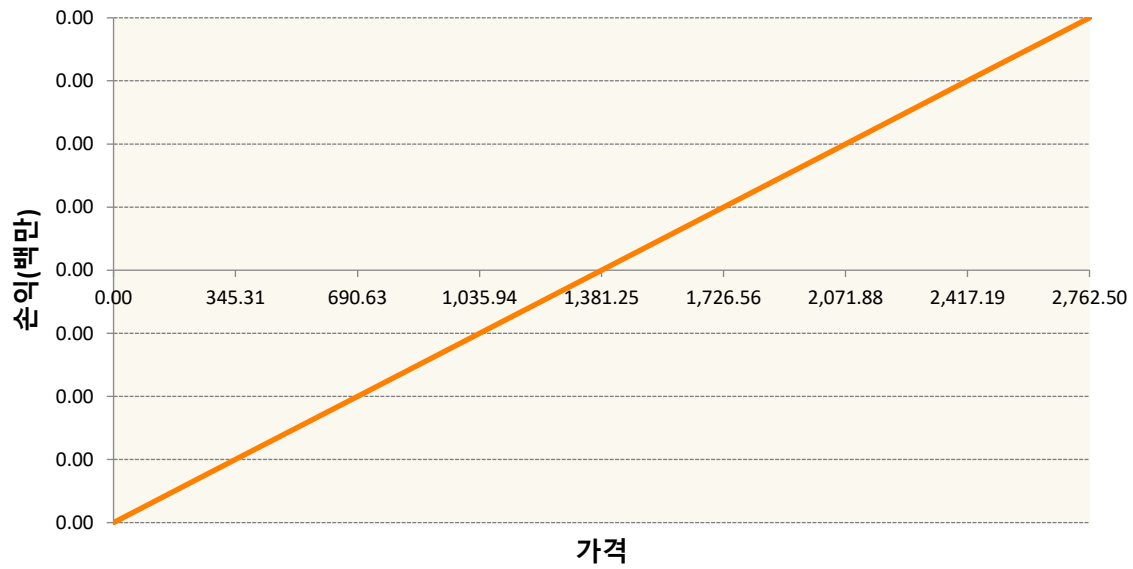
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22



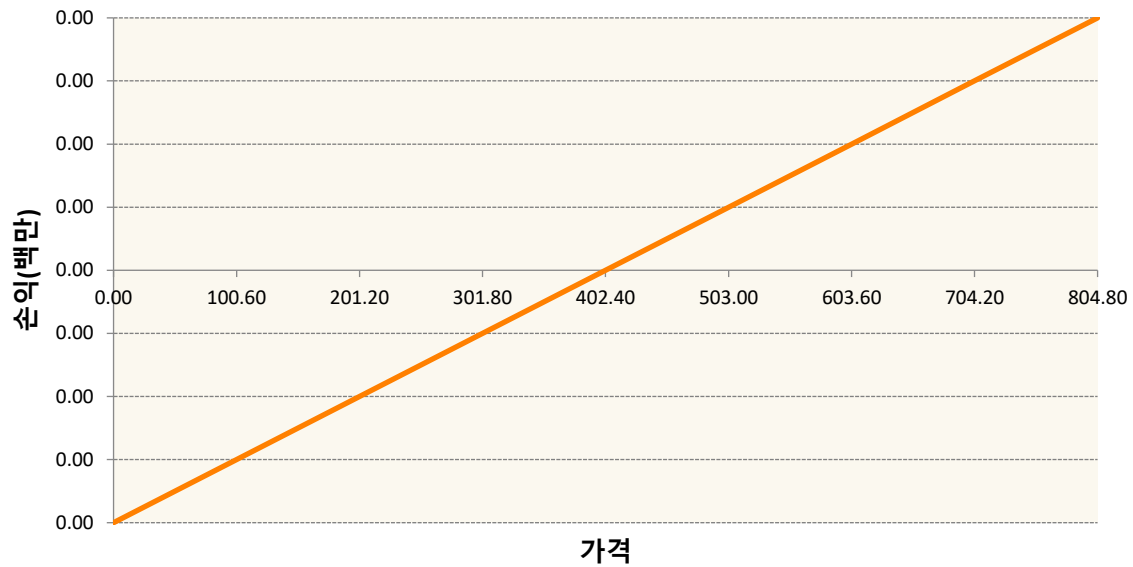
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



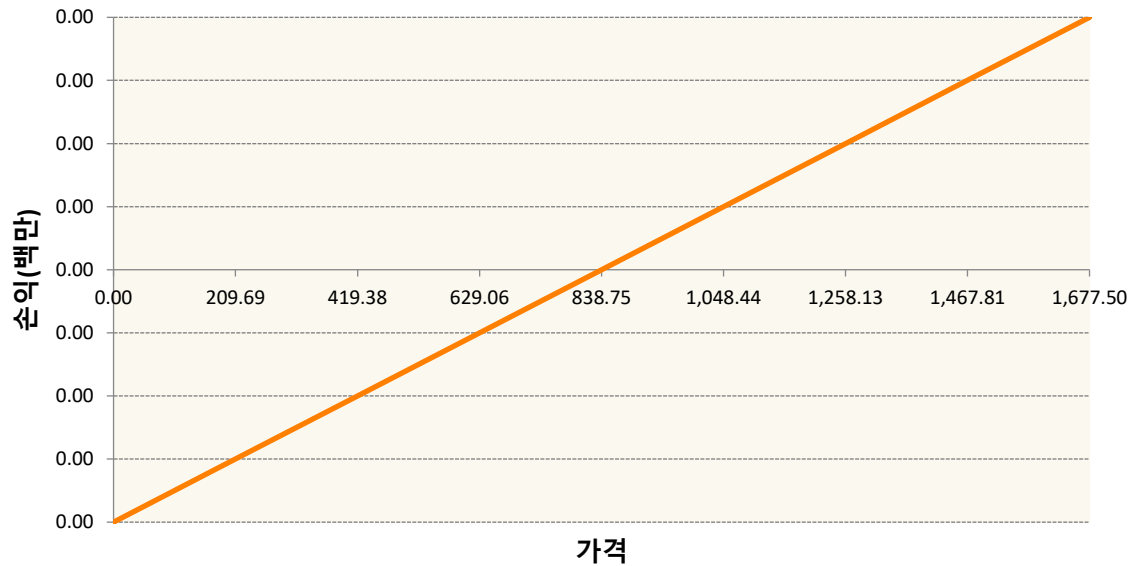
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



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	2022-10-26
기준일	2022-10-25

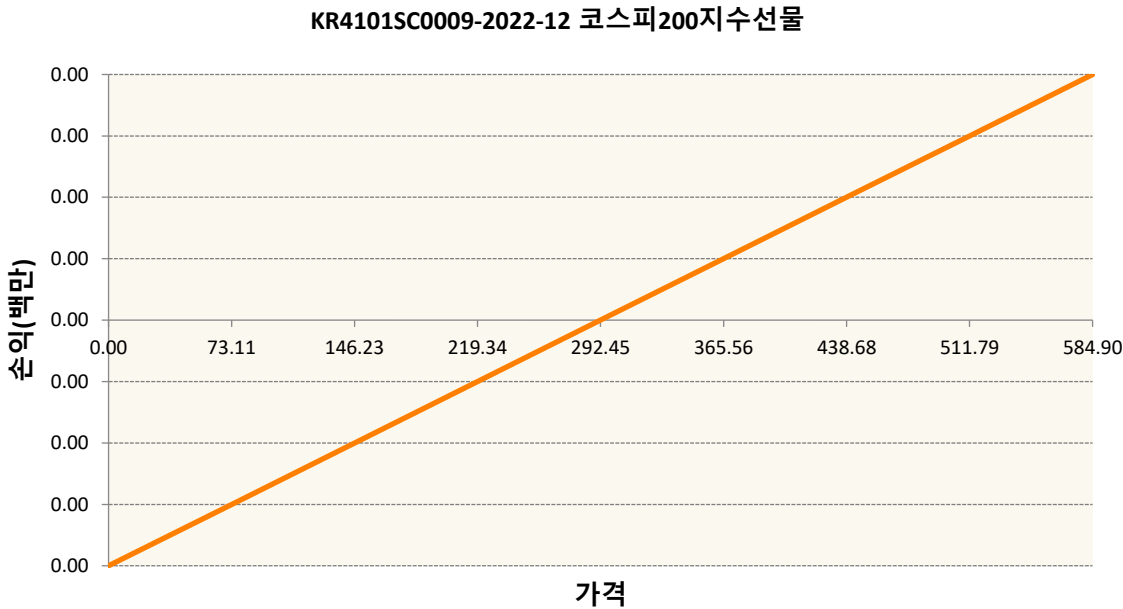
스마트인덱스모

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	1,170	0	1,170	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-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%	93	93	93	93	93	93	93

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

(단위:백만원)

100

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

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	322
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

432

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

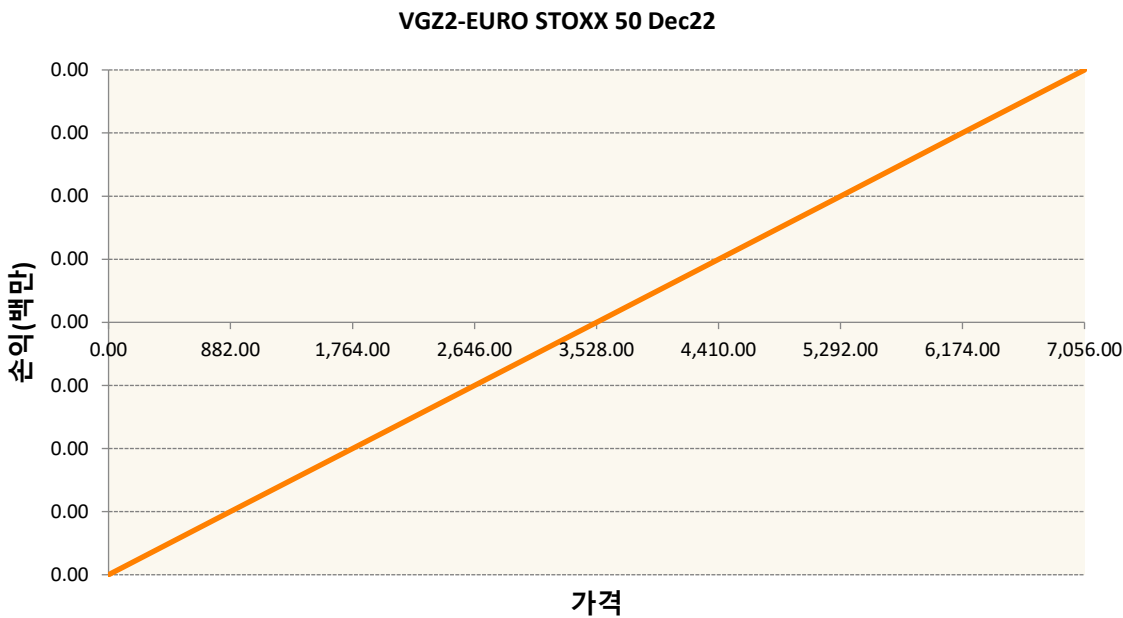
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	490	0	490	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

41

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

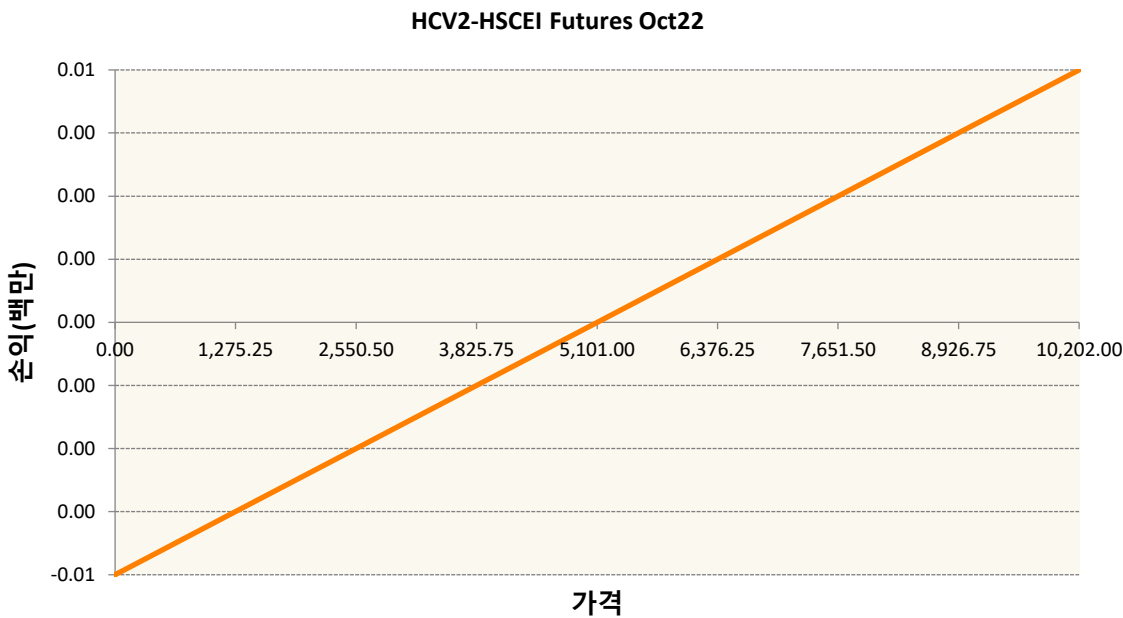
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	842	0	842	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV2	HSCEI Futures Oct22	67
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

103

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

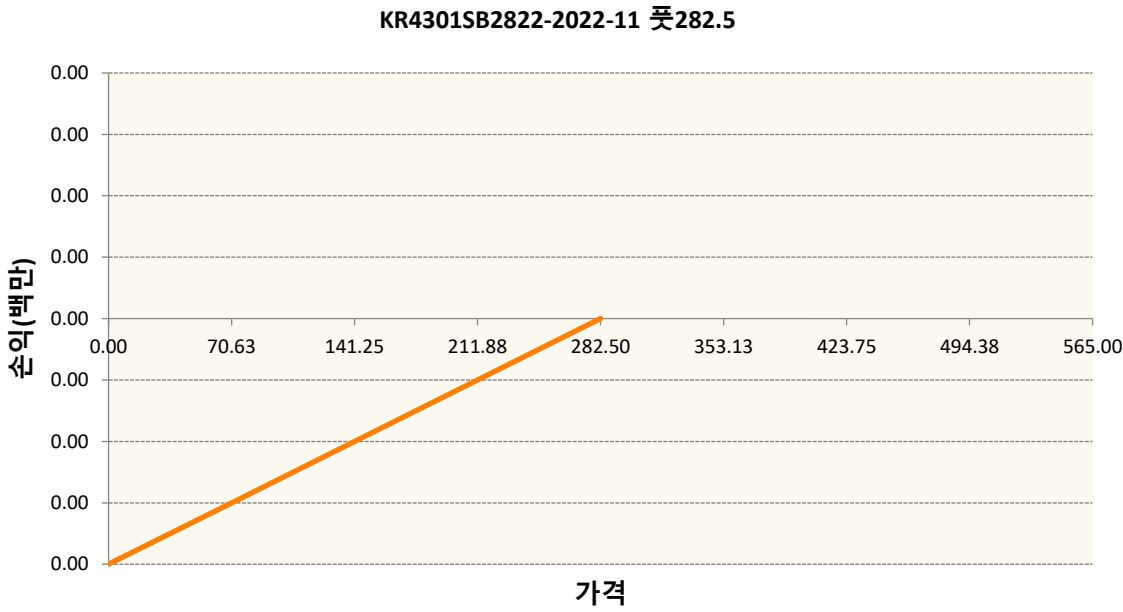
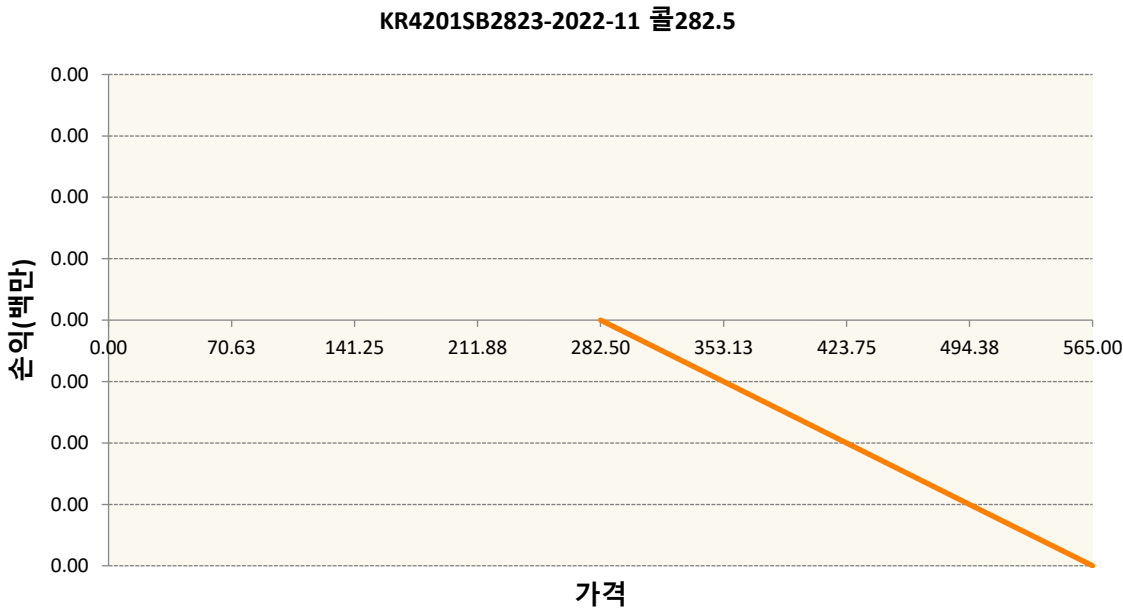
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

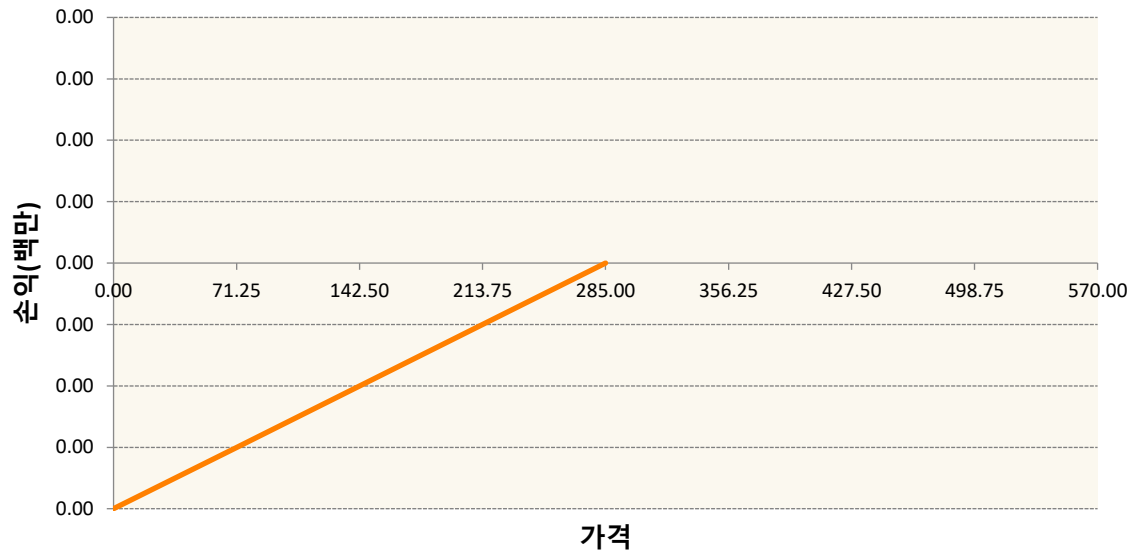
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301SB2855-2022-11 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201SB2823			2022-11 콜282.5				3,048
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,026	1,927	1,822	1,715	1,604	1,491	1,376
-5.33%	1,658	1,535	1,410	1,285	1,159	1,032	905
-2.67%	1,106	975	844	712	581	450	319
0%	368	247	124	0	-126	-252	-380
2.67%	-531	-629	-732	-839	-951	-1,066	-1,183
5.33%	-1,551	-1,621	-1,699	-1,785	-1,877	-1,975	-2,077
8.00%	-2,651	-2,695	-2,749	-2,813	-2,884	-2,963	-3,048
KR4301SB2822			2022-11 풋282.5				394
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-295	-313	-333	-353	-373	-394
-5.33%	-129	-151	-174	-196	-219	-242	-265
-2.67%	-15	-38	-62	-86	-109	-133	-156
0%	66	44	22	0	-23	-45	-68
2.67%	118	101	82	63	43	22	1
5.33%	148	136	122	106	90	72	54
8.00%	164	157	147	135	122	108	93
KR4301SB2855			2022-11 풋285				75
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-58	-61	-65	-68	-72	-75
-5.33%	-27	-31	-35	-39	-43	-47	-51
-2.67%	-4	-8	-13	-17	-21	-26	-30
0%	13	8	4	0	-4	-8	-13

2.67%	24	20	16	13	9	5	1
5.33%	30	28	25	22	18	15	12
8.00%	34	32	30	28	25	22	19

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

(단위:백만원)

3,290

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

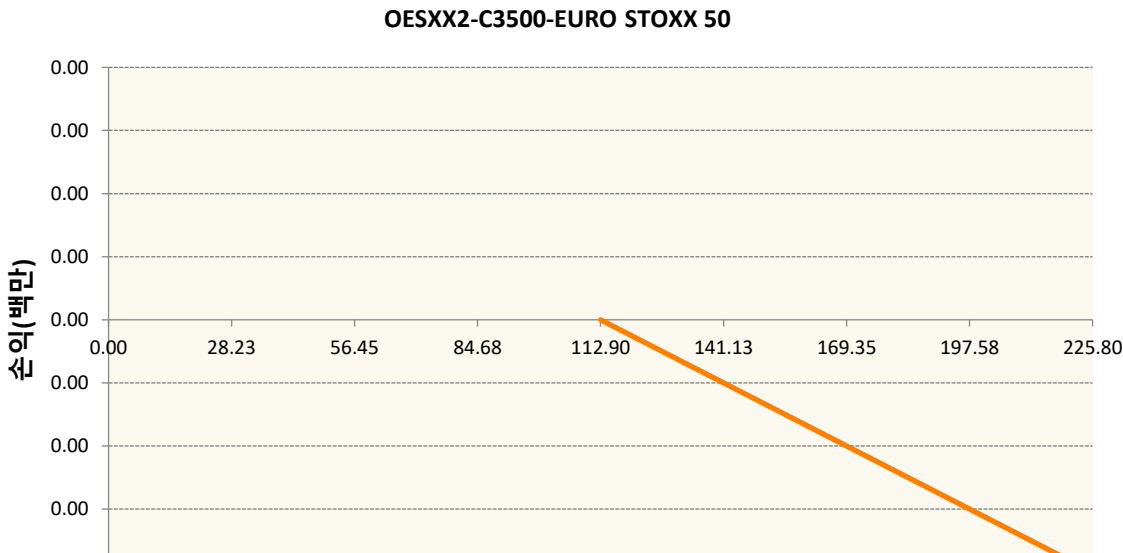
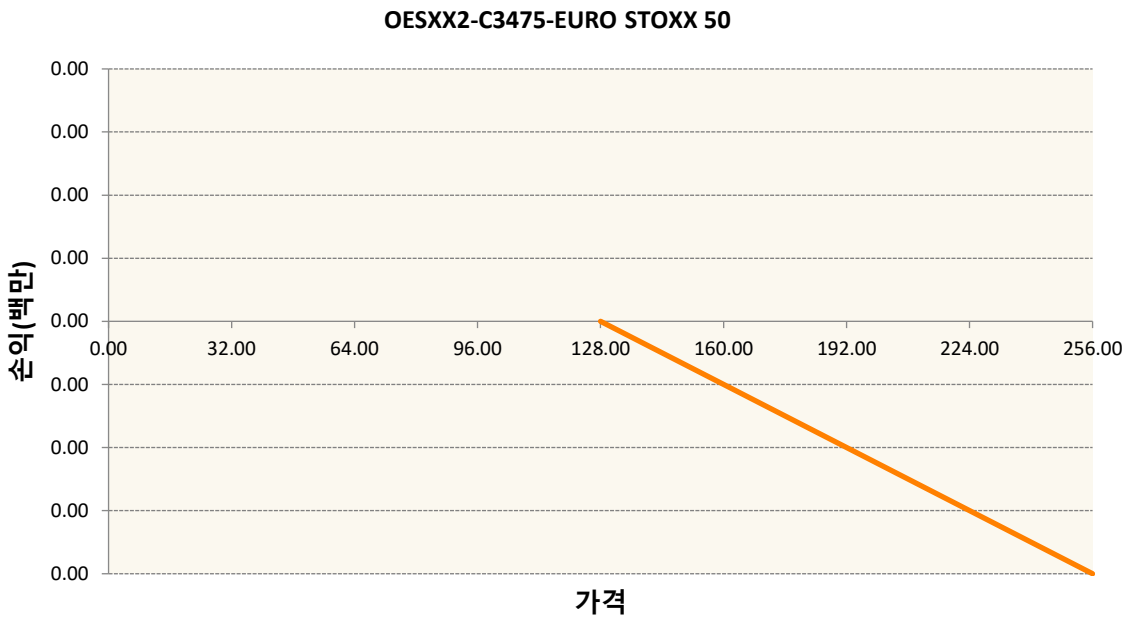
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

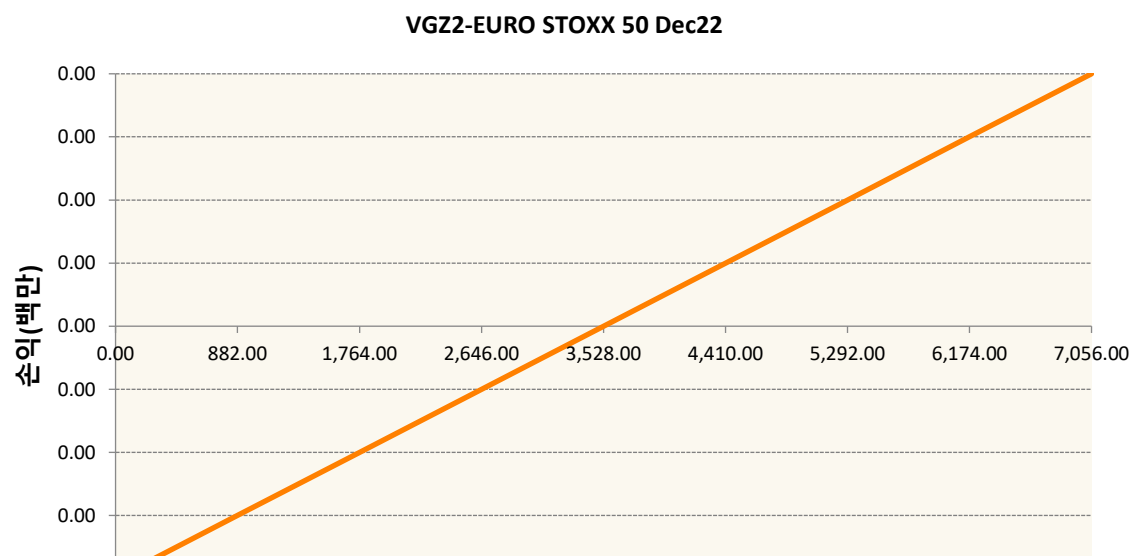
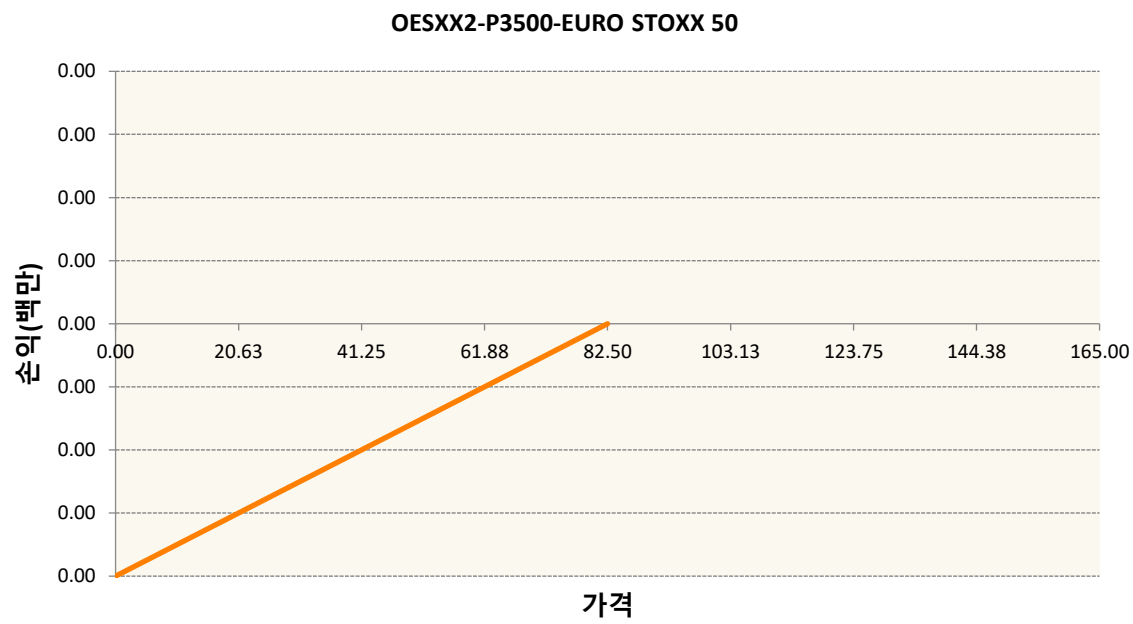
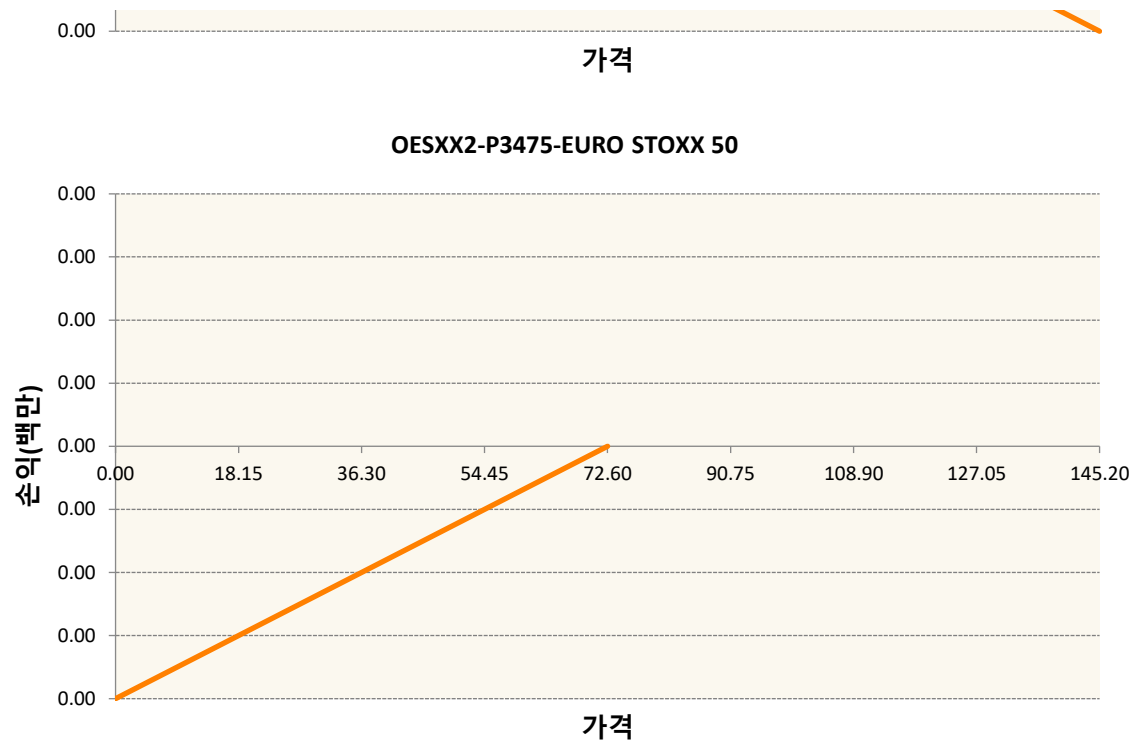
1. 계약금액

(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	1,189	0	1,189	
누계	유가증권	옵션	0	144	-144	장내
누계	통화	선도	0	2,333	-2,333	장외

2. 만기시점의 손익구조





0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E	74
FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E	57
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E	57
OESXX2-C34 EURO STOXX 50	7
OESXX2-C35 EURO STOXX 50	1
OESXX2-P34 EURO STOXX 50	4
OESXX2-P35 EURO STOXX 50	0.37
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	95

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

(단위:백만원)

240

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

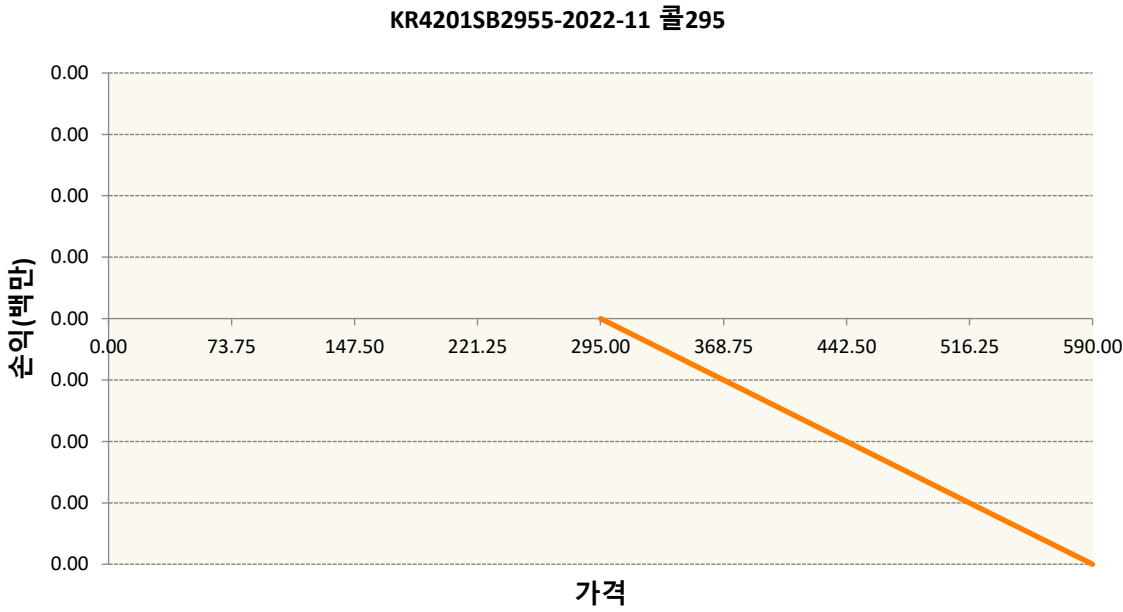
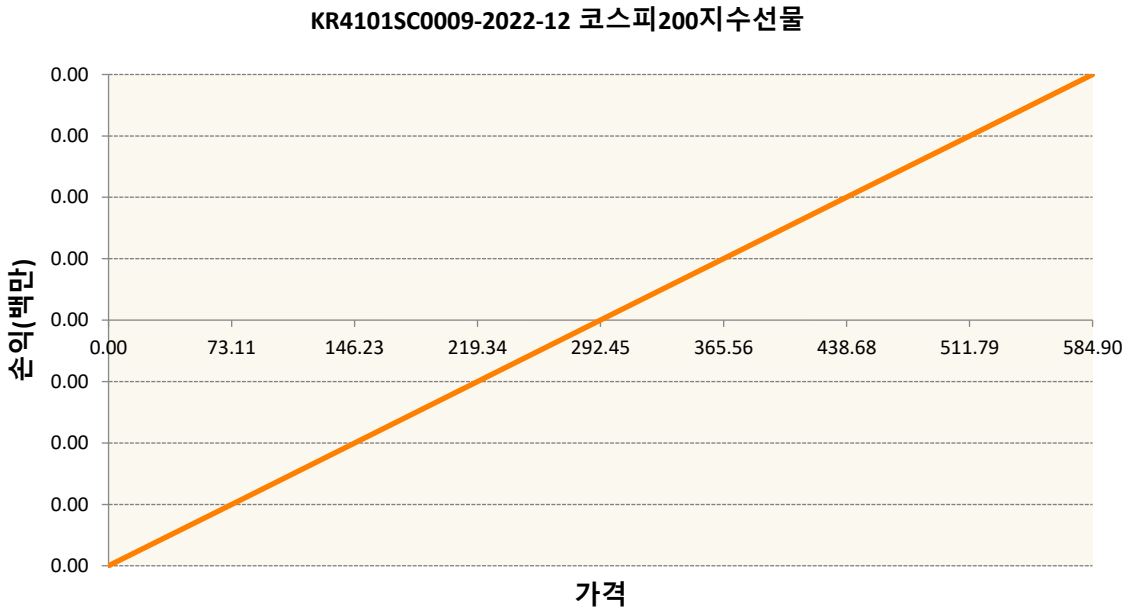
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

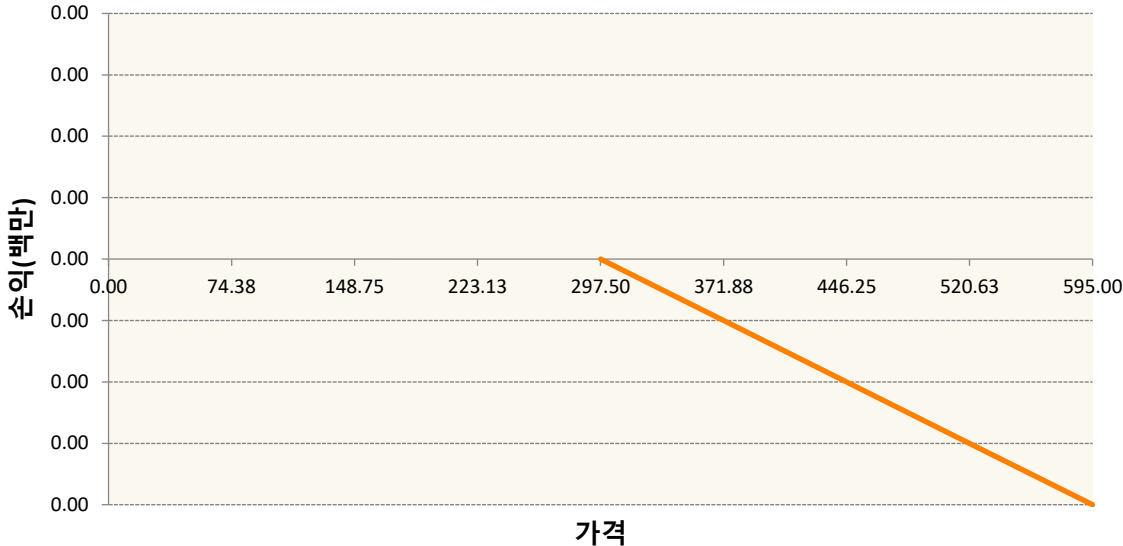
(단위:백만원)

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	424	3,708	-3,284	장내

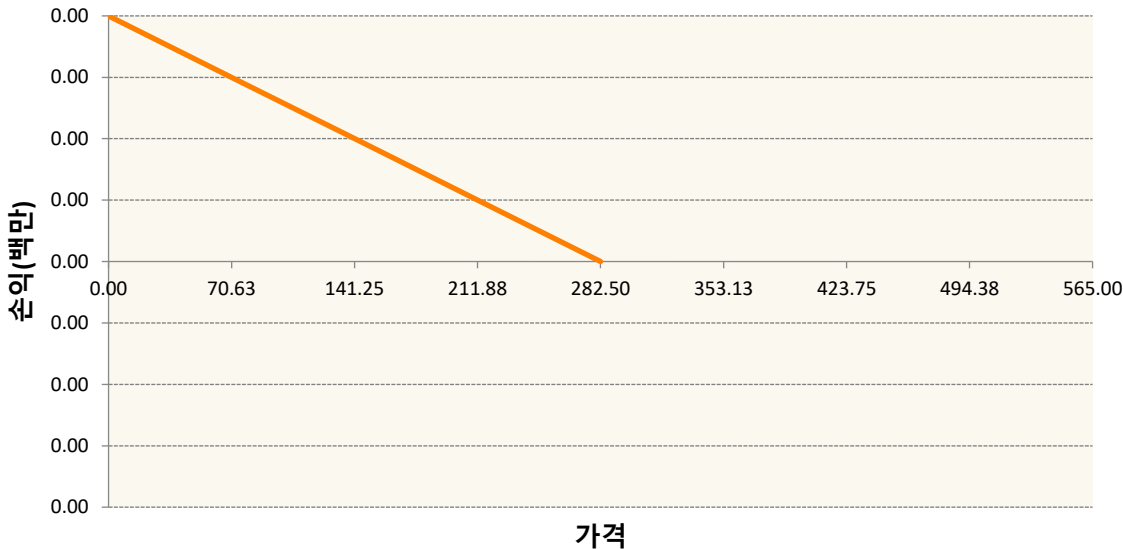
2. 만기시점의 손익구조



KR4201SB2971-2022-11 콜297.5



KR4301SB2822-2022-11 ㄲ282.5



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%	-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	
KR4201SB2955				2022-11 콜295				72
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	36	34	32	30	28	26	23
-5.33%	31	29	26	24	21	18	15
-2.67%	24	20	17	14	10	7	3
0%	11	7	4	0	-4	-8	-11
2.67%	-6	-10	-14	-17	-21	-25	-29
5.33%	-28	-32	-35	-39	-42	-46	-49
8.00%	-54	-57	-60	-63	-66	-69	-72
KR4201SB2971 2022-11 콜297.5							135

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	60	57	53	49	45	40
-5.33%	55	51	47	42	36	31	25
-2.67%	43	37	31	24	18	11	5
0%	21	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	-9	-17	-24	-32	-39	-46	-54
5.33%	-49	-56	-63	-70	-77	-84	-92
8.00%	-98	-103	-109	-115	-122	-128	-135

KR4301SB2822 2022-11 풋282.5							21
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	16	17	18	19	20	21
-5.33%	7	8	9	11	12	13	14
-2.67%	1	2	3	5	6	7	9
0%	-4	-2	-1	0	1	2	4
2.67%	-6	-5	-4	-3	-2	-1	0
5.33%	-8	-7	-7	-6	-5	-4	-3
8.00%	-9	-9	-8	-7	-7	-6	-5

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

(단위:백만원)

218

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

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	6,667	0	6,667	

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	2022-10-26
기준일	2022-10-25

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	5,854	0	5,854	

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	2022-10-26
기준일	2022-10-25

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	18,439	0	18,439	
누계	통화	선도	2,006	24,520	-22,514	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
FXW213CAR(KRW/USD 30-01-23E	296
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

927

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

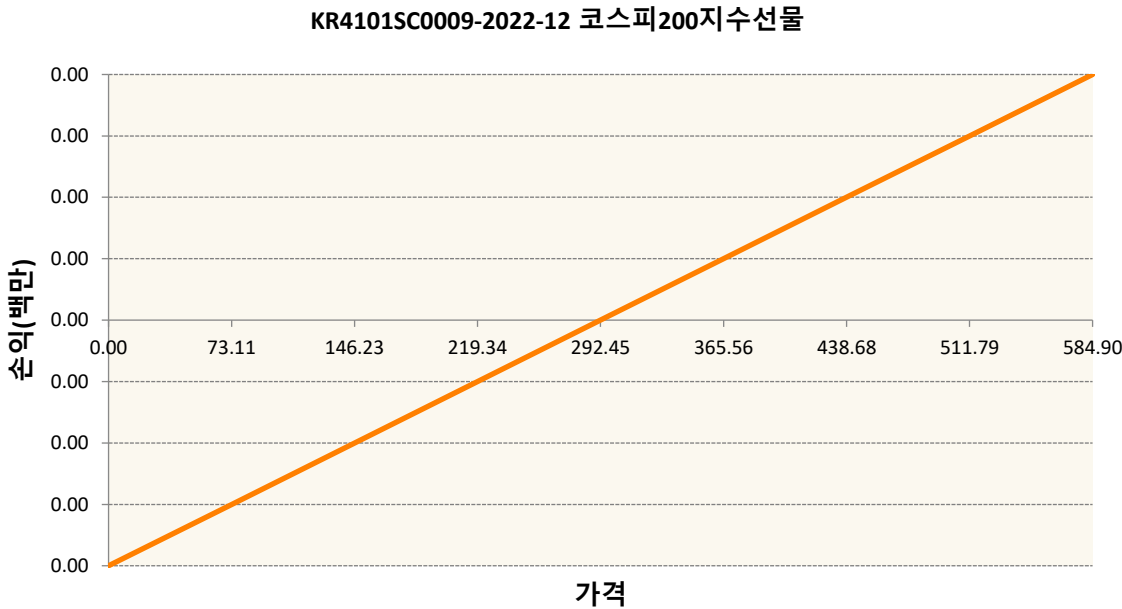
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	366	0	366	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 2022-10-26

기준일 2022-10-25

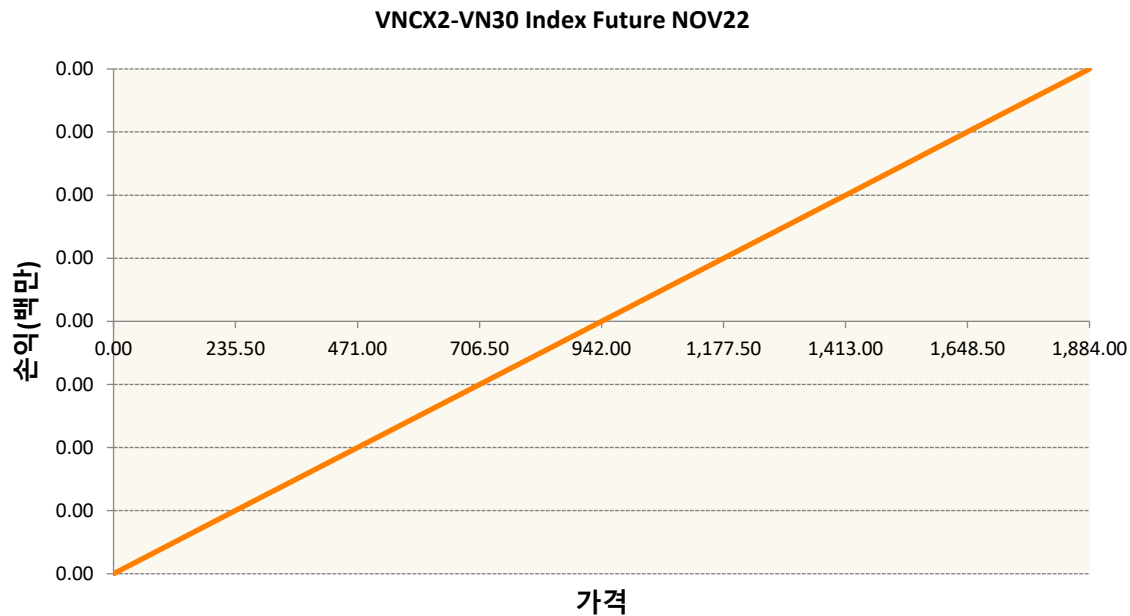
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	362	0	362	
누계	유가증권	스왑	1,346	0	1,346	장외
누계	통화	선도	636	820	-184	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	108
FXW213C8P KRW/EUR 18-11-22E	11
FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E	32
FXW213C9M KRW/EUR 23-12-22E	23
FXW213CA7I EUR/KRW 18-11-22E	3
FXW213CABI EUR/KRW 18-11-22E	11
FXW213CAD EUR/KRW 18-11-22E	18
FXW213CAKI EUR/KRW 18-11-22E	6
FXW213CAQ EUR/KRW 18-11-22E	6
FXW213CAR EUR/KRW 28-11-22E	8

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

(단위:백만원)

230

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

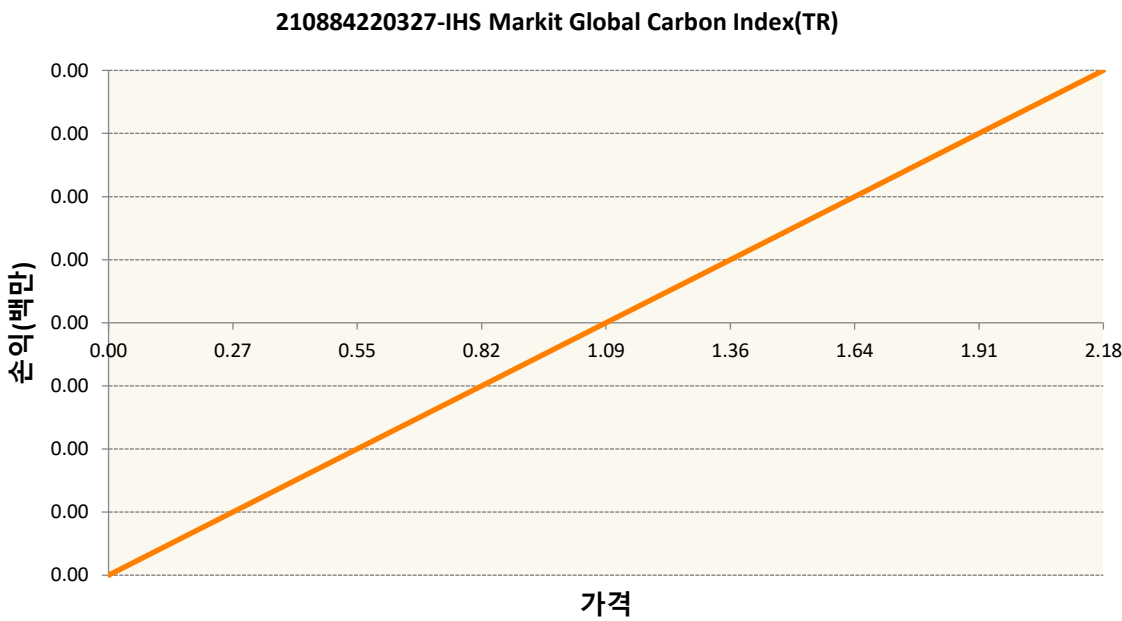
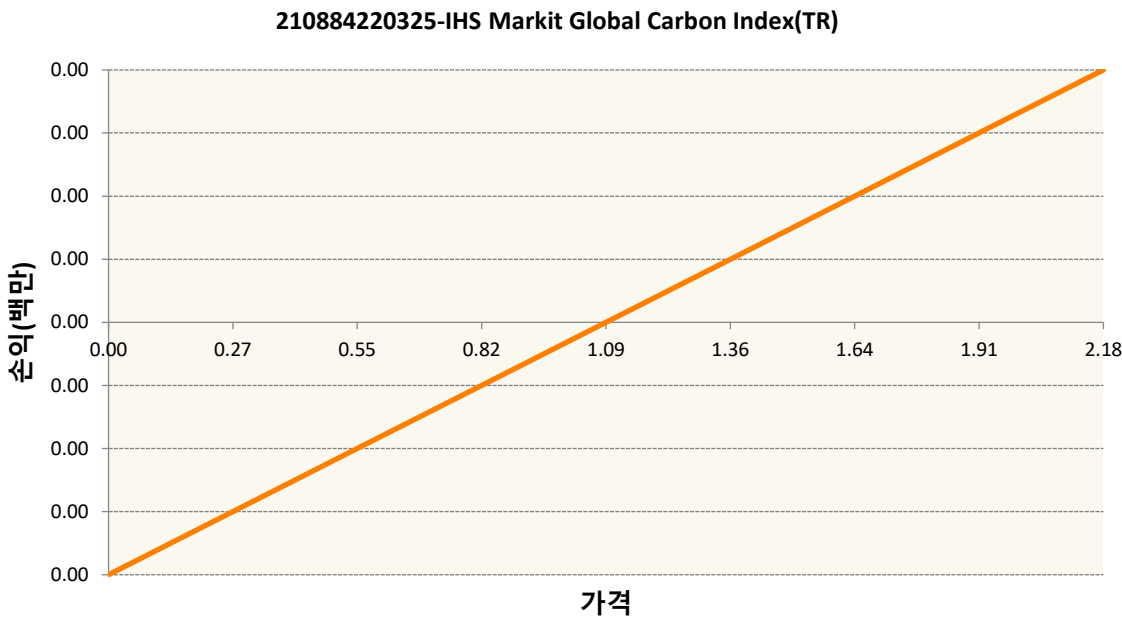
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

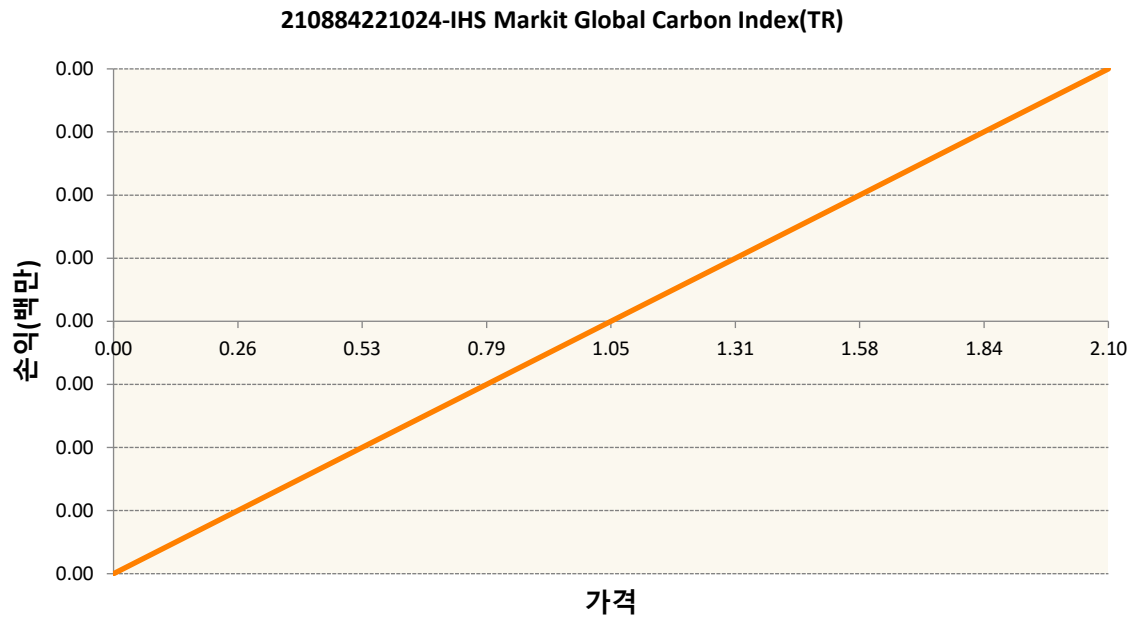
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	29,562	0	29,562	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		190
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		95
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		2,083

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		4,521

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

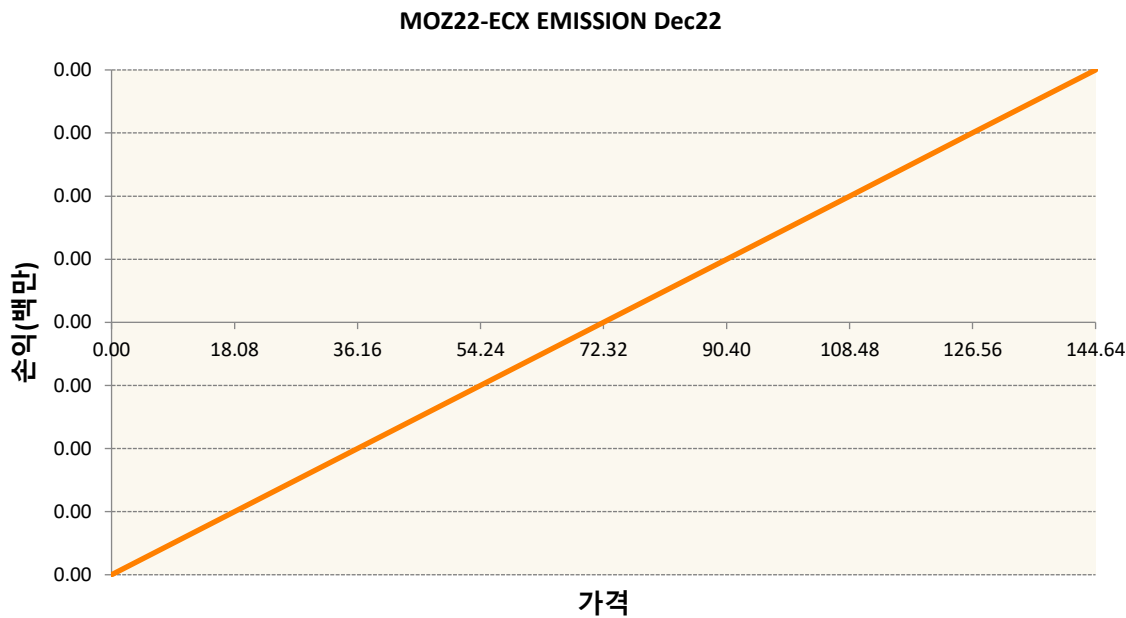
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,214	0	13,214	
누계	통화	선도	0	5,535	-5,535	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9T(KRW/EUR 27-10-22E)	443
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,057

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

(단위:백만원)

3,000

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

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)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	12

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

(단위:백만원)

92

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

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)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	7

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

(단위:백만원)

30

공시일 2022-10-26

기준일 2022-10-25

에쿼티알파일반사모혼합자산

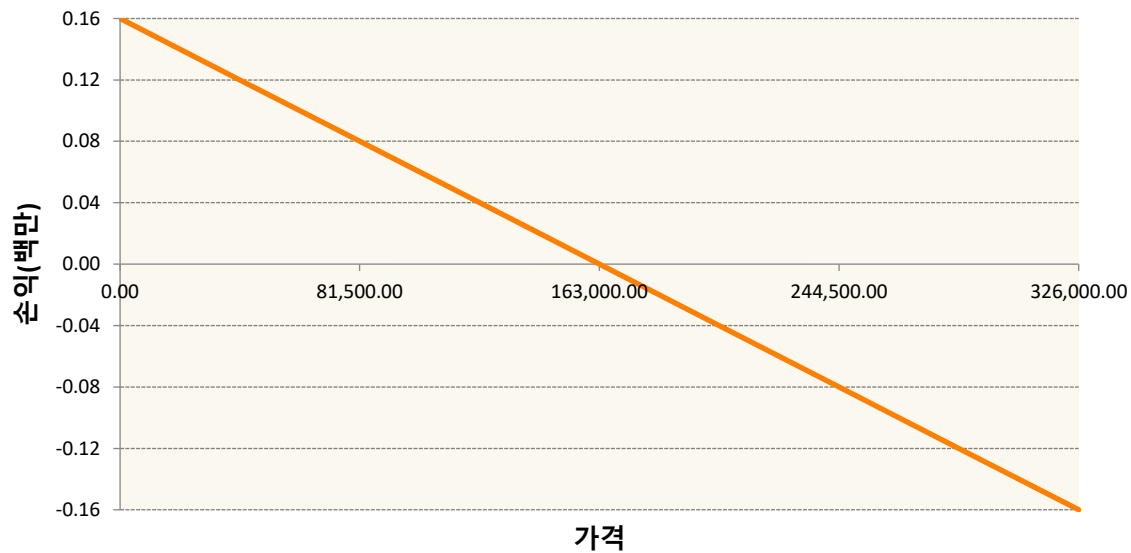
1. 계약금액

(단위:백만원)

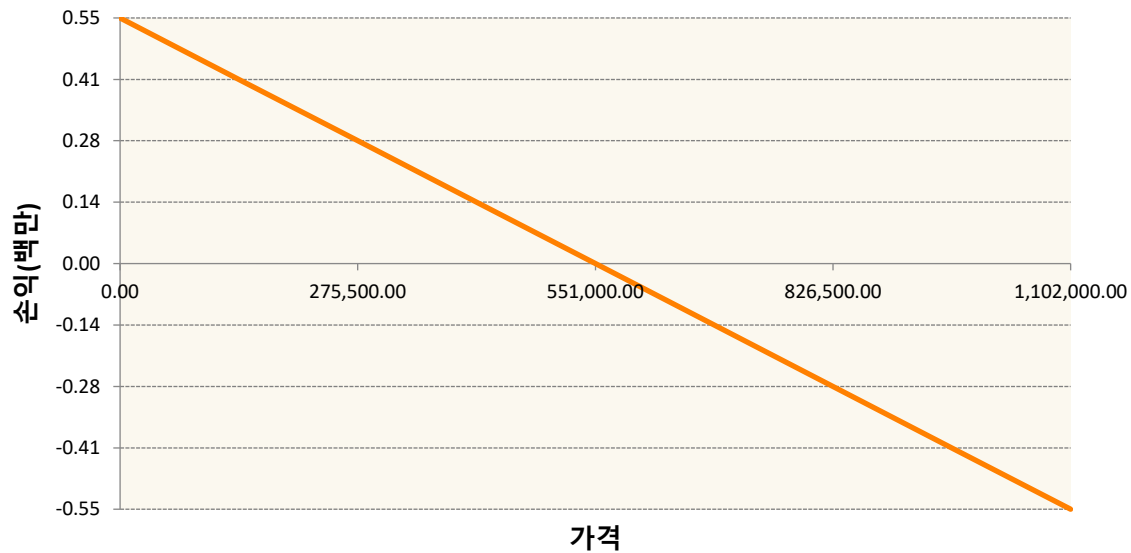
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	0	921	-921	장외

2. 만기시점의 손익구조

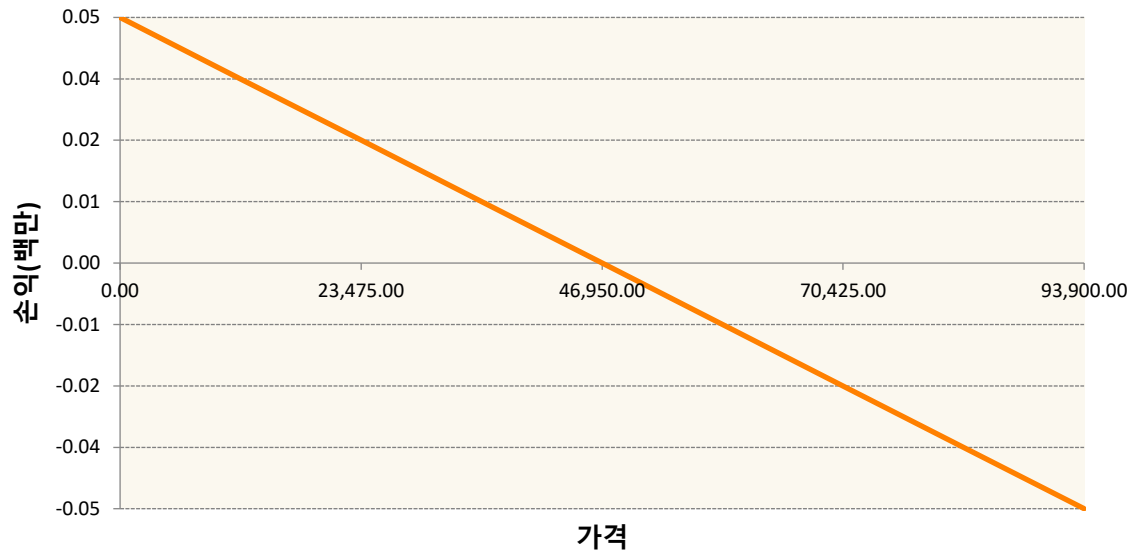
KR4116SB0003-2022-11 현대차개별선물



KR4147SB0006-2022-11 LG화학개별선물



KR41CBSB0004-2022-11 한화솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4116SB00 2022-11 현대차개별선물	39
KR4147SB00 2022-11 LG화학개별선물	18
KR41CBSB00 2022-11 한화솔루션개별선물	17
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.34
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.2

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

(단위:백만원)

155

공시일 2022-10-26

기준일 2022-10-25

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

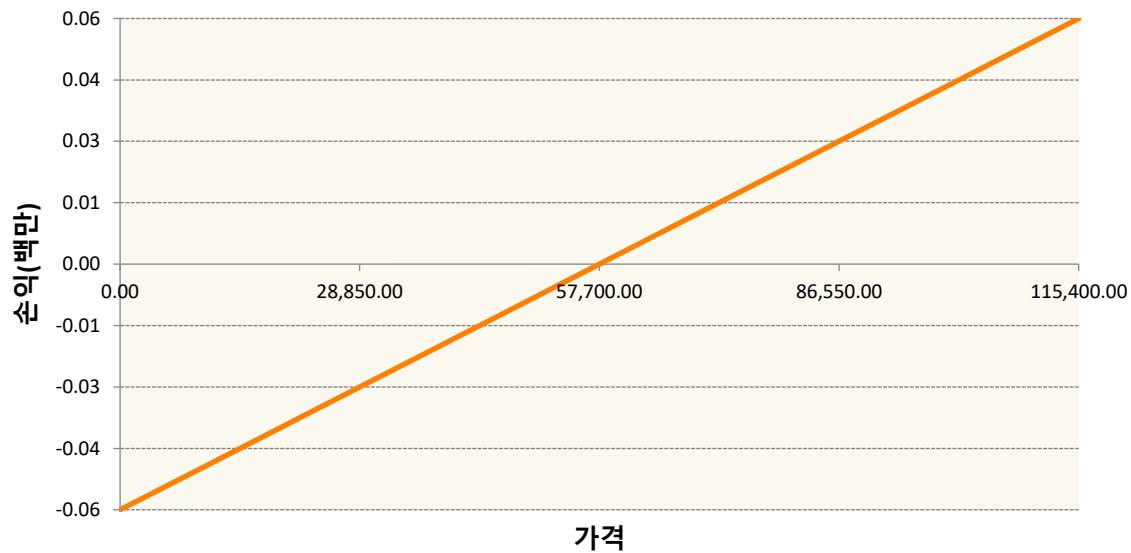
1. 계약금액

(단위:백만원)

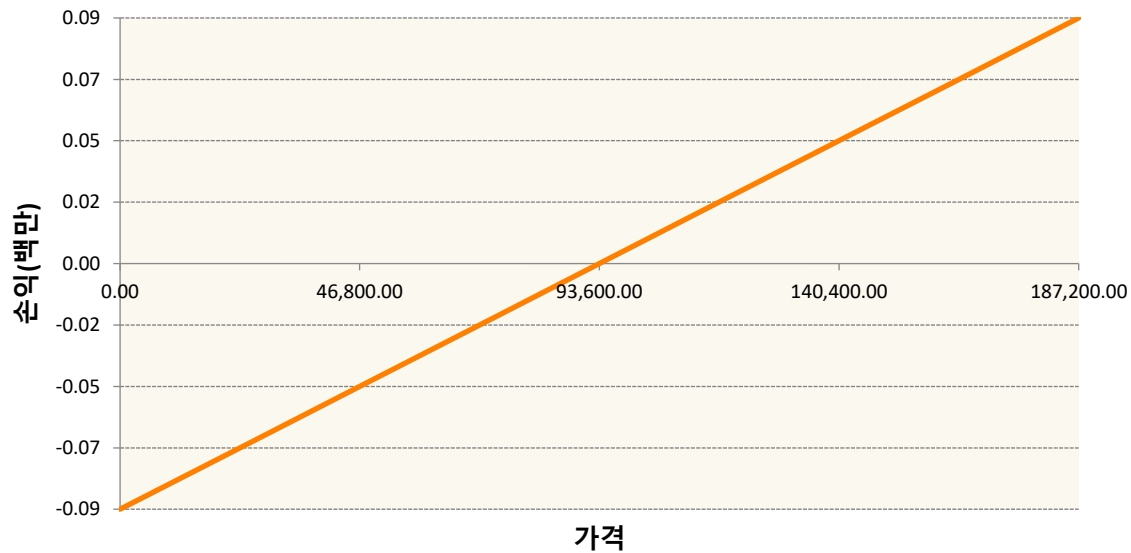
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	766	0	766	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111SB0008-2022-11 삼성전자개별선물



KR4150SB0000-2022-11 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SB0008		2022-11 삼성전자개별선물					31
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-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%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31
KR4150SB0000		2022-11 SK하이닉스개별선물					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

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

73

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

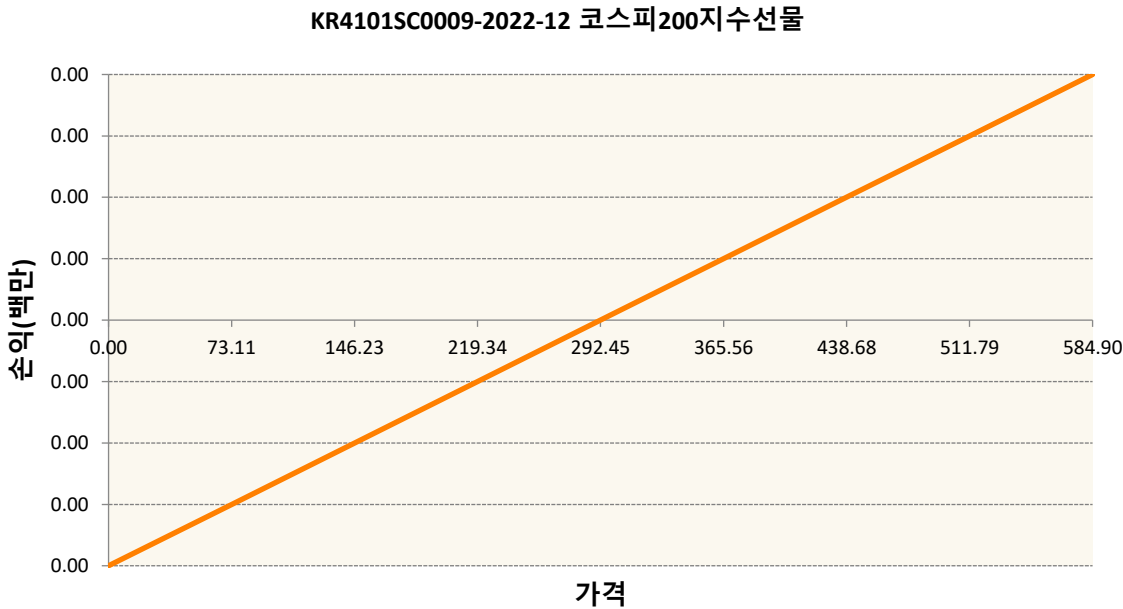
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	366	0	366	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 2022-10-26

기준일 2022-10-25

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

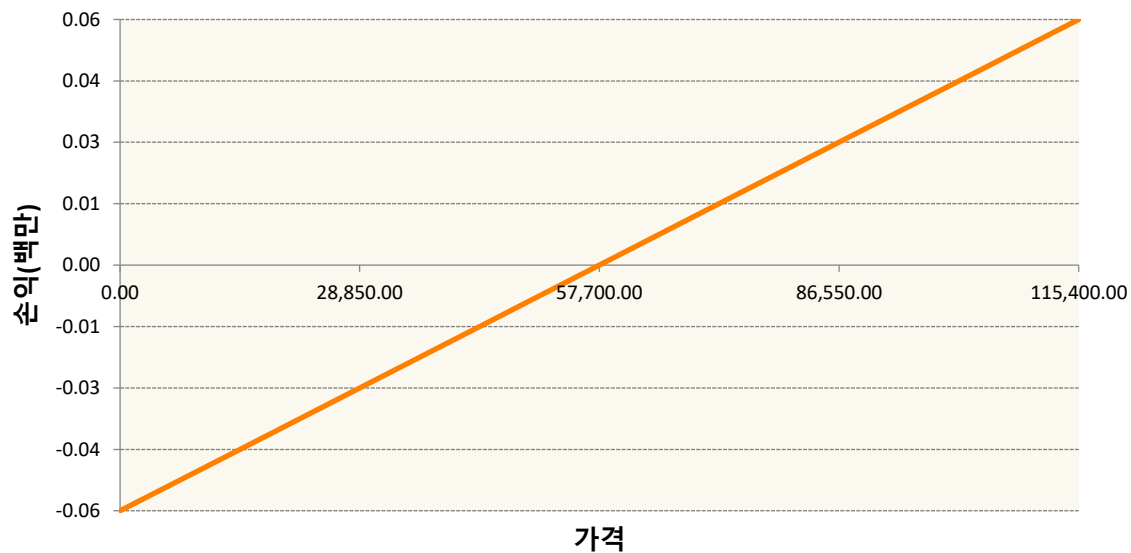
1. 계약금액

(단위:백만원)

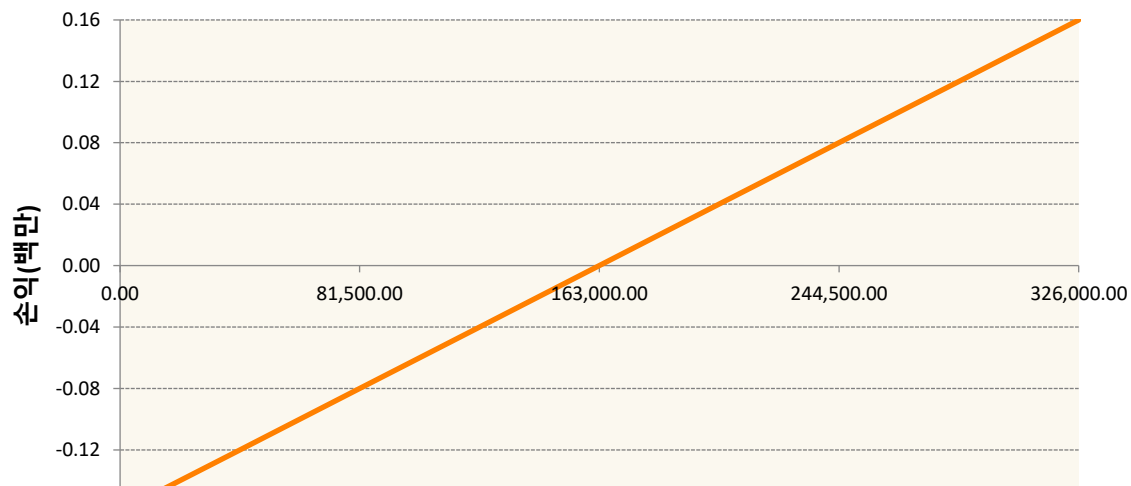
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	218	0	218	장내
누계	유가증권	ELS	61	0	61	장외
누계	통화	선도	0	1,132	-1,132	장외

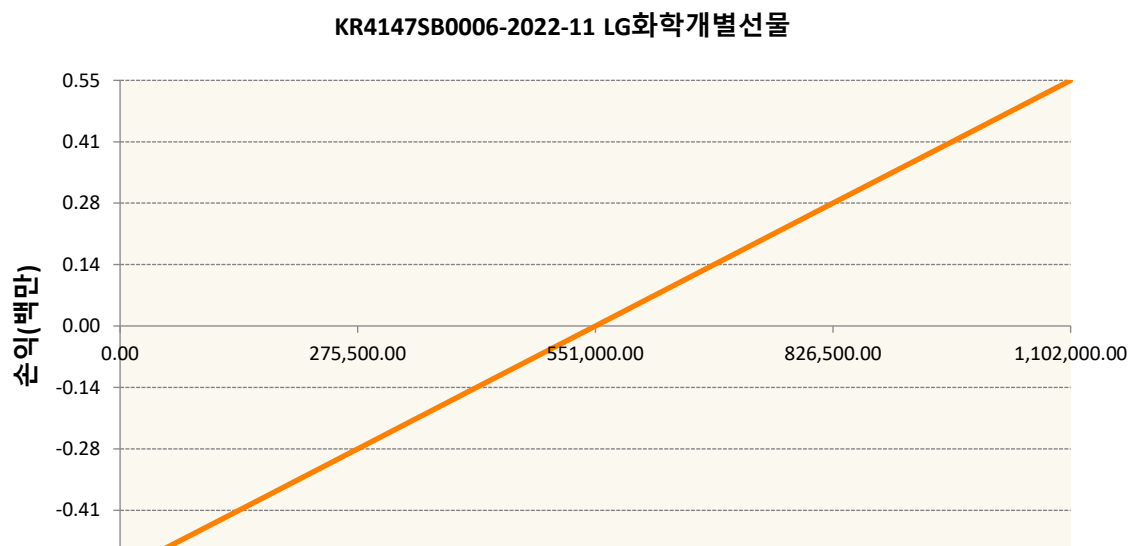
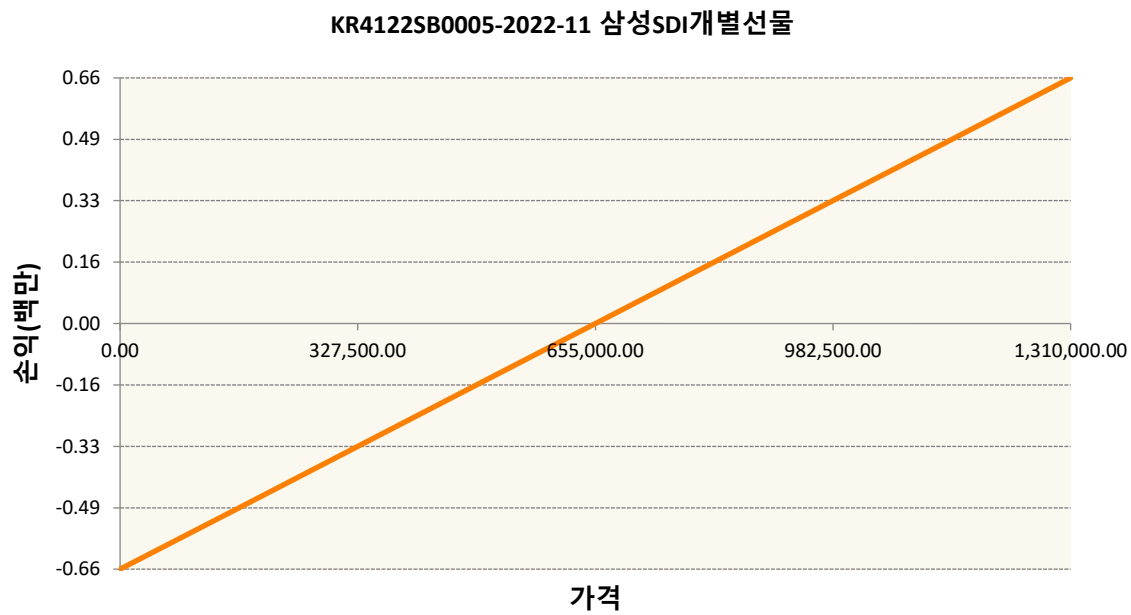
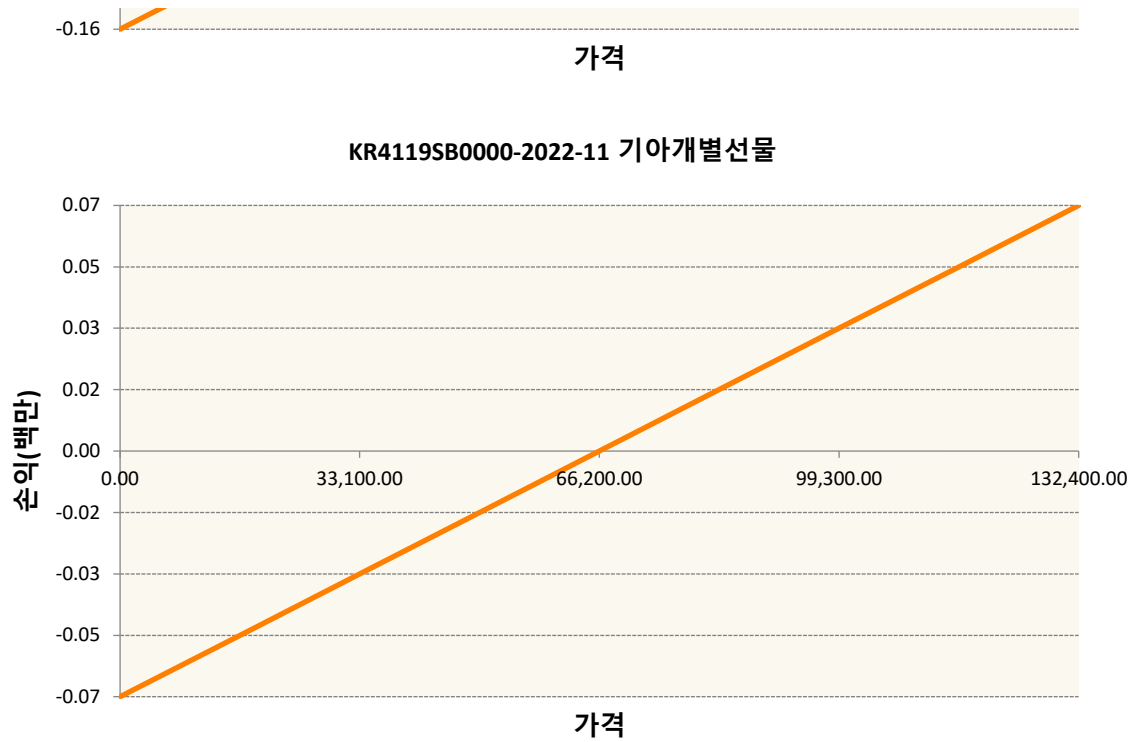
2. 만기시점의 손익구조

KR4111SB0008-2022-11 삼성전자개별선물



KR4116SB0003-2022-11 현대차개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213CAM002	KRW/USD 26-10-22E		91
KR4111SB0008	2022-11 삼성전자개별선물		5
KR4119SB0000	2022-11 기아개별선물		2
KR4122SB0005	2022-11 삼성SDI개별선물		10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	65

공시일 2022-10-26

기준일 2022-10-25

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

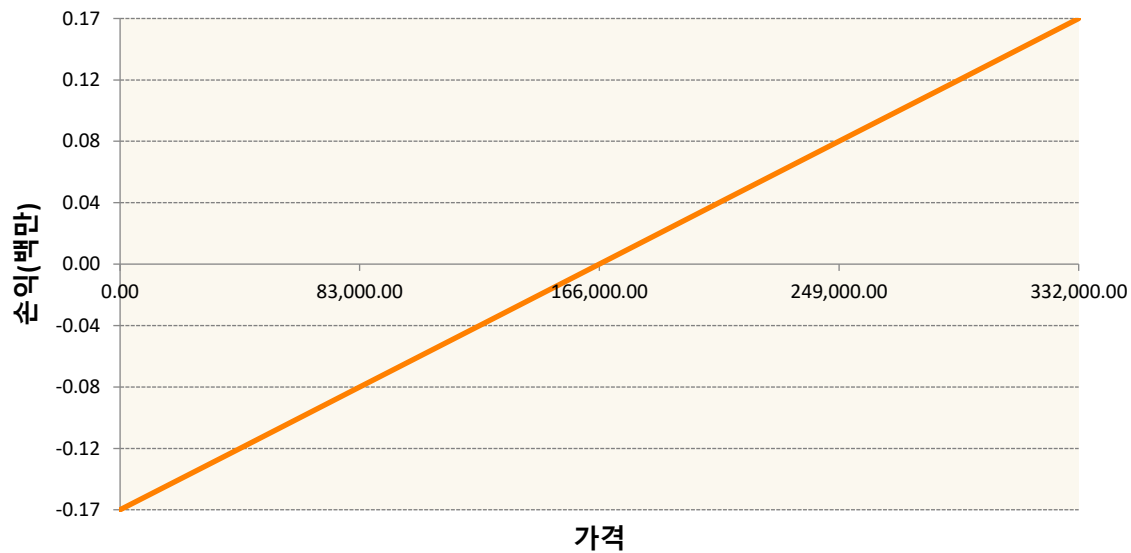
1. 계약금액

(단위:백만원)

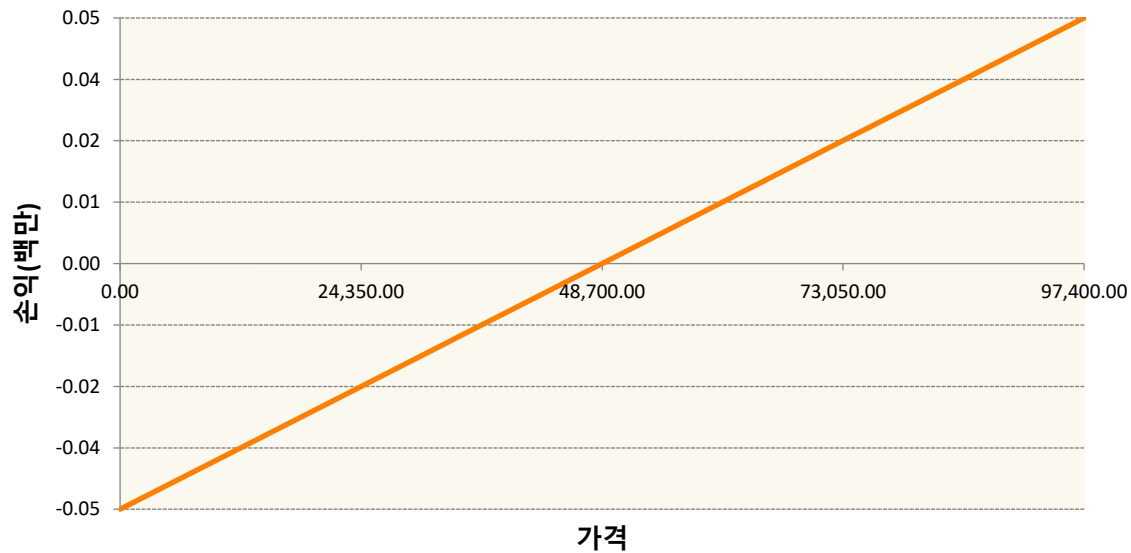
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	102	0	102	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156SB0004-2022-11 NAVER개별선물



KR41CFSB0000-2022-11 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
KR4156SB0004	2022-11 NAVER개별선물		5
KR41CFSB0000	2022-11 카카오개별선물		4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			15

공시일	2022-10-26
기준일	2022-10-25

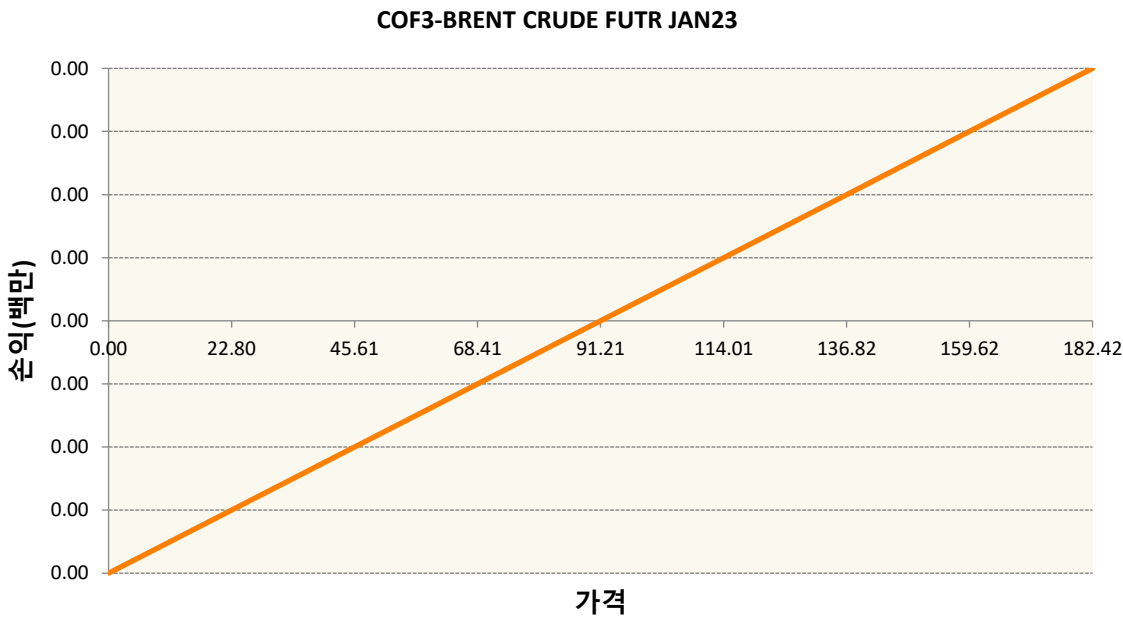
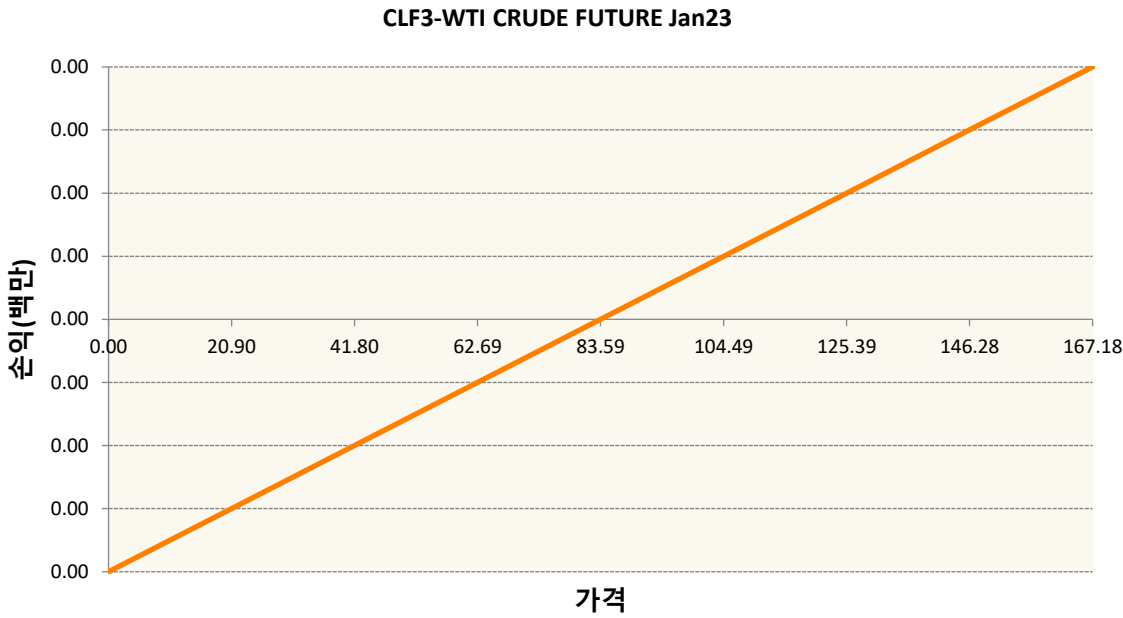
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

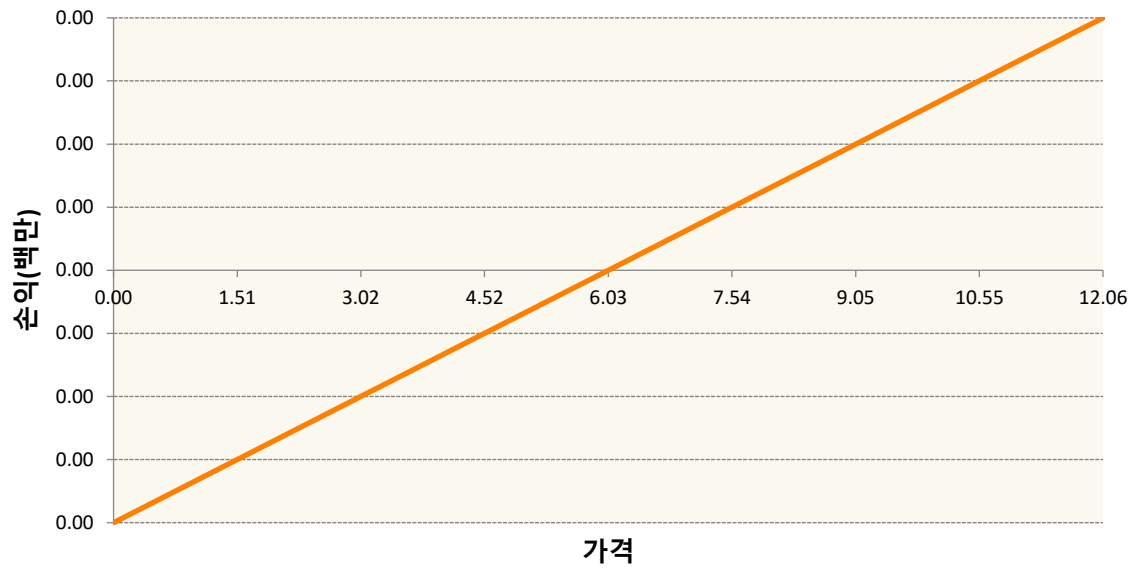
(단위:백만원)

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	1,452	215	1,237	

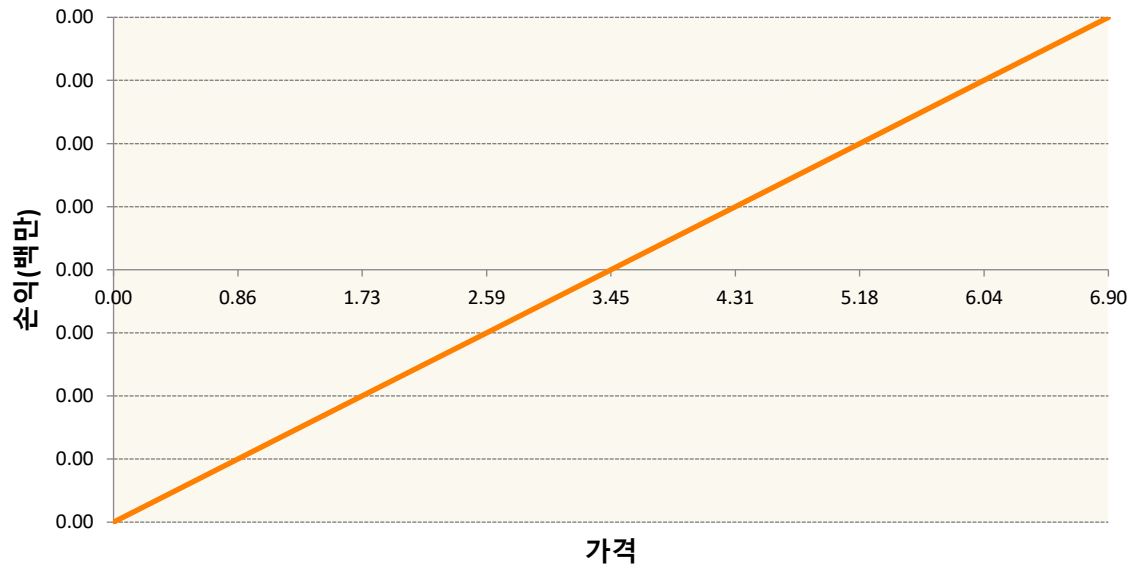
2. 만기시점의 손익구조



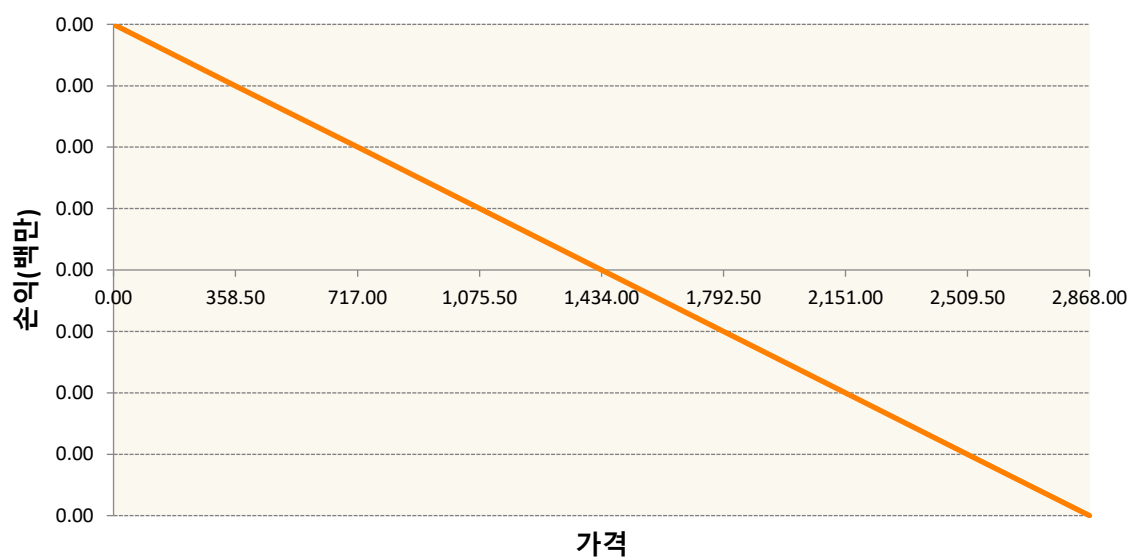
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



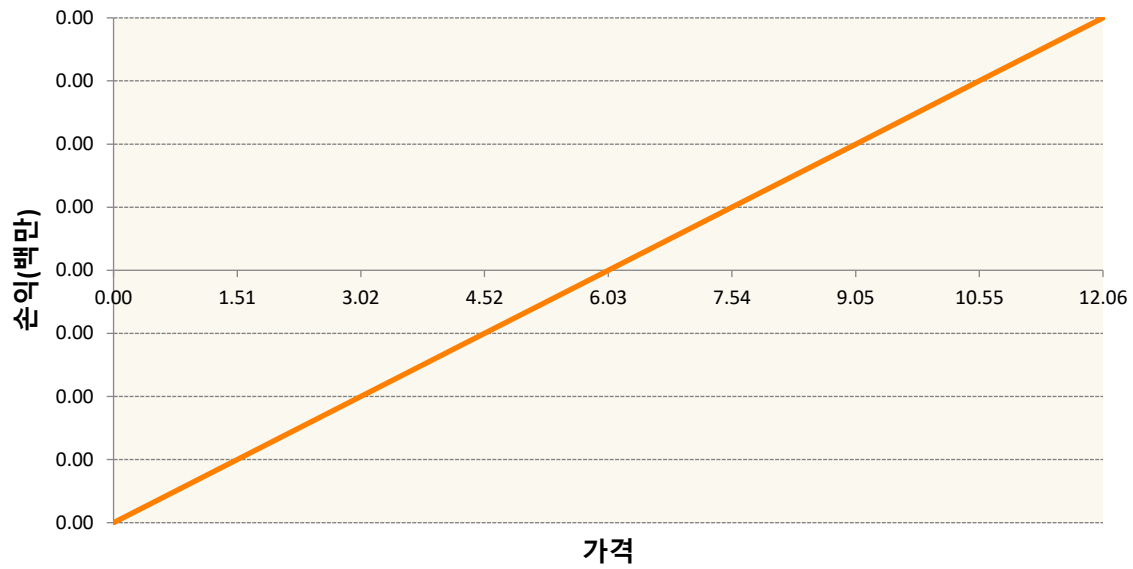
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



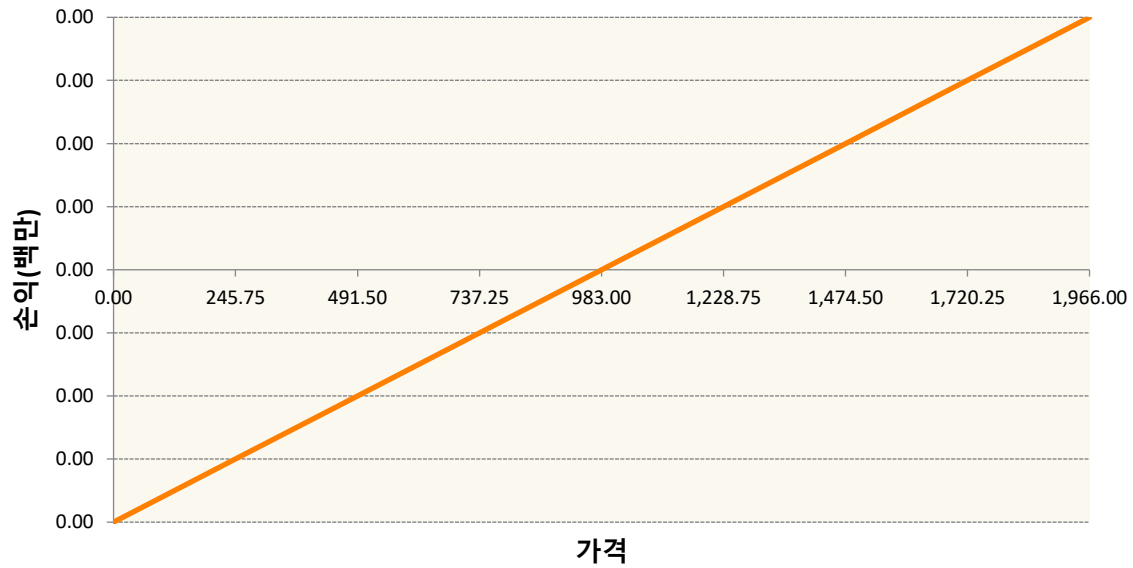
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



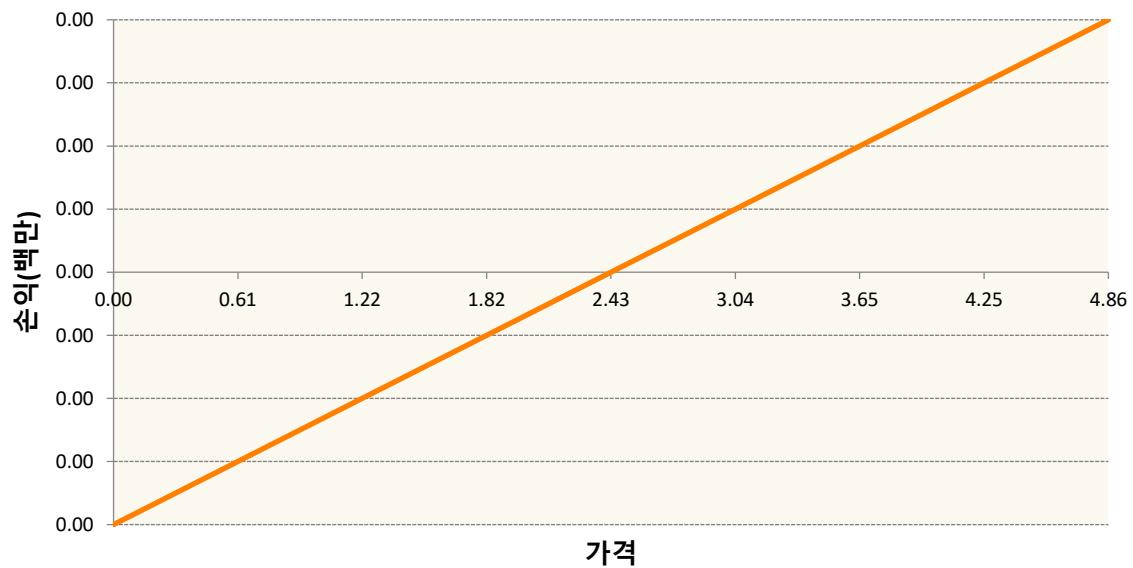
NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



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	17
NGF23	NATURAL GAS FUTR Jan23	41
QSF3	Low Su Gasoil G Jan23	11
XBF3	GASOLINE RBOB FUT Jan23	12

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

436