

공시일 2022-11-03

기준일 2022-11-02

포커스농산물모(채권-파생형)

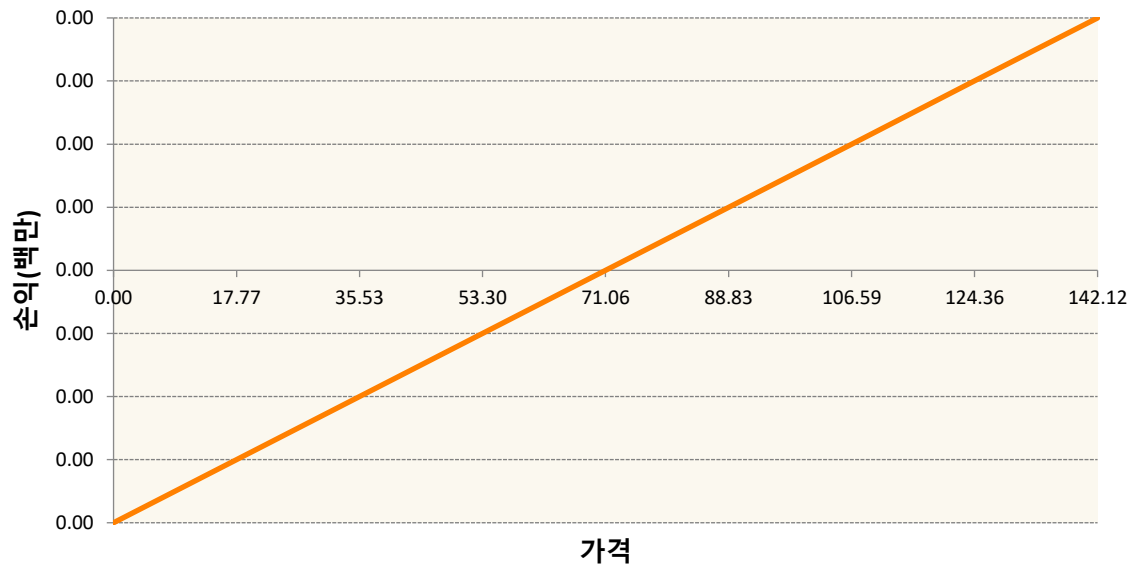
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

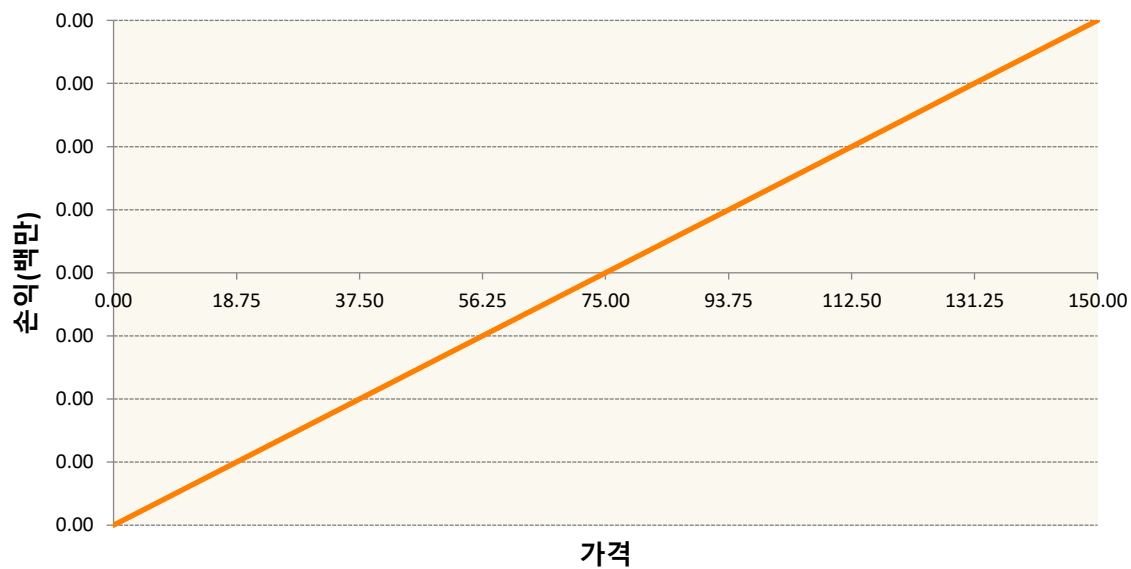
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,686	851	5,836	

2. 만기시점의 손익구조

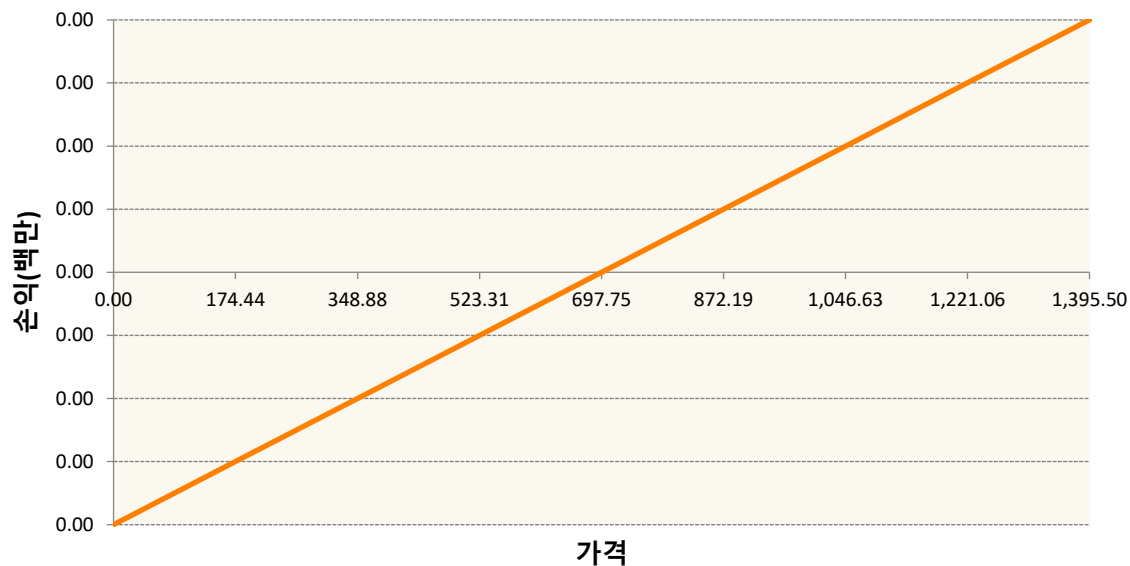
BOF3-SOYBEAN OIL FUTR Jan23



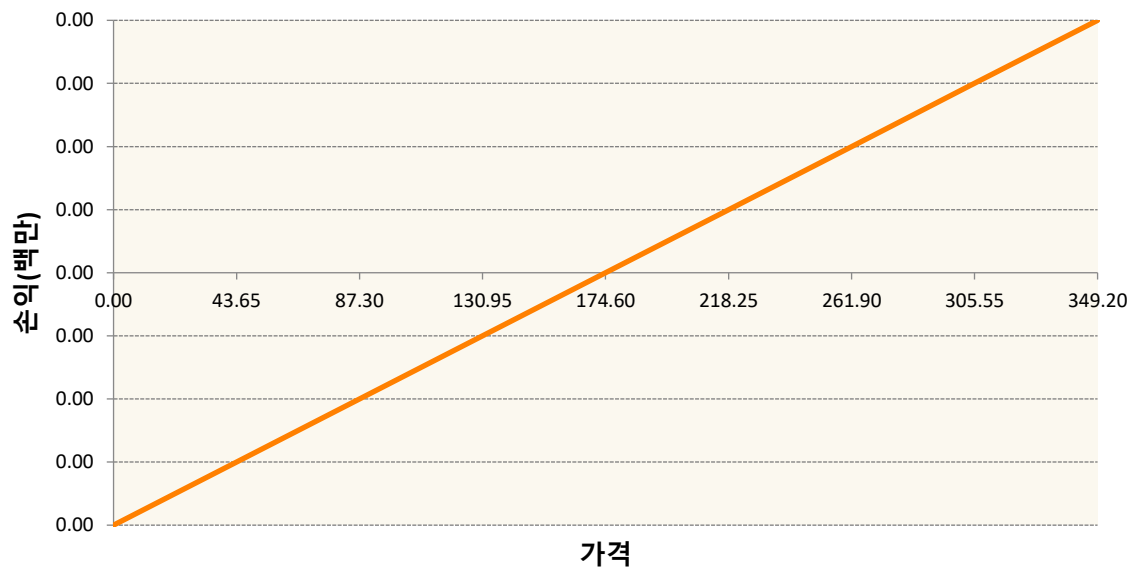
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



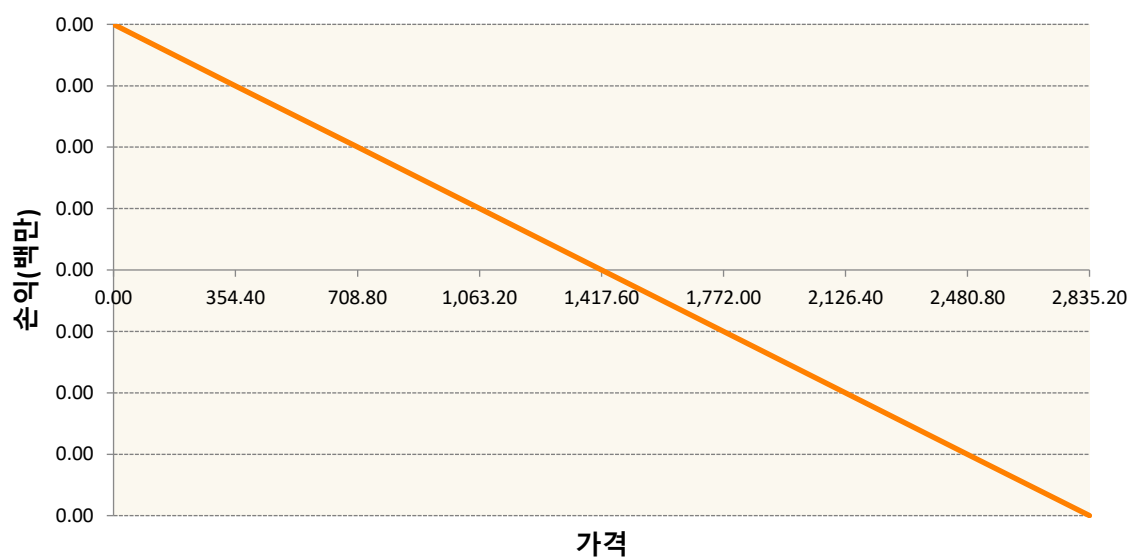
CZ2-CORN FUTURE Dec22



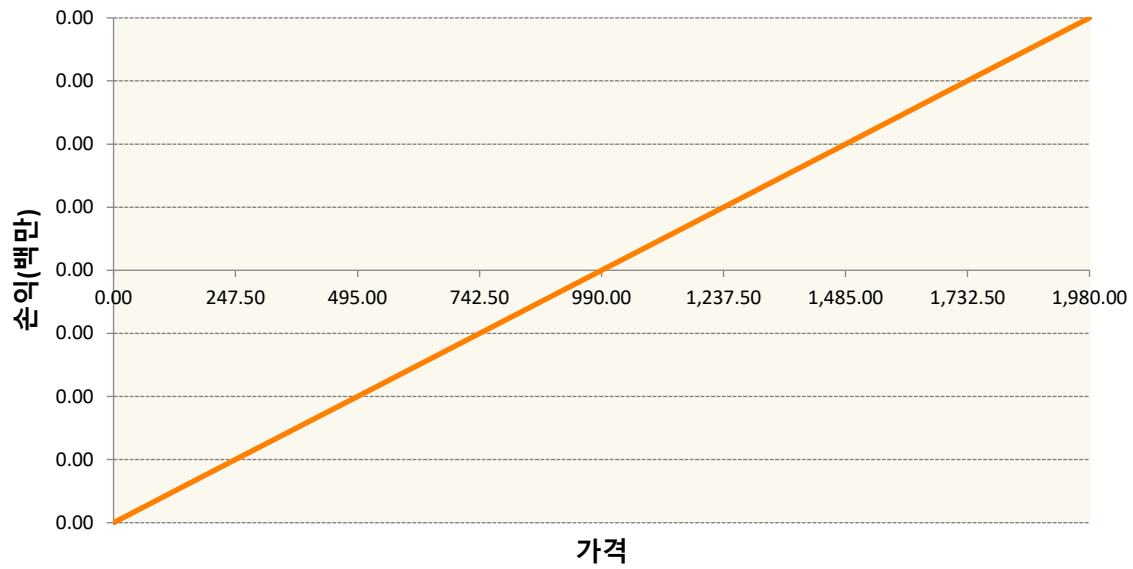
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



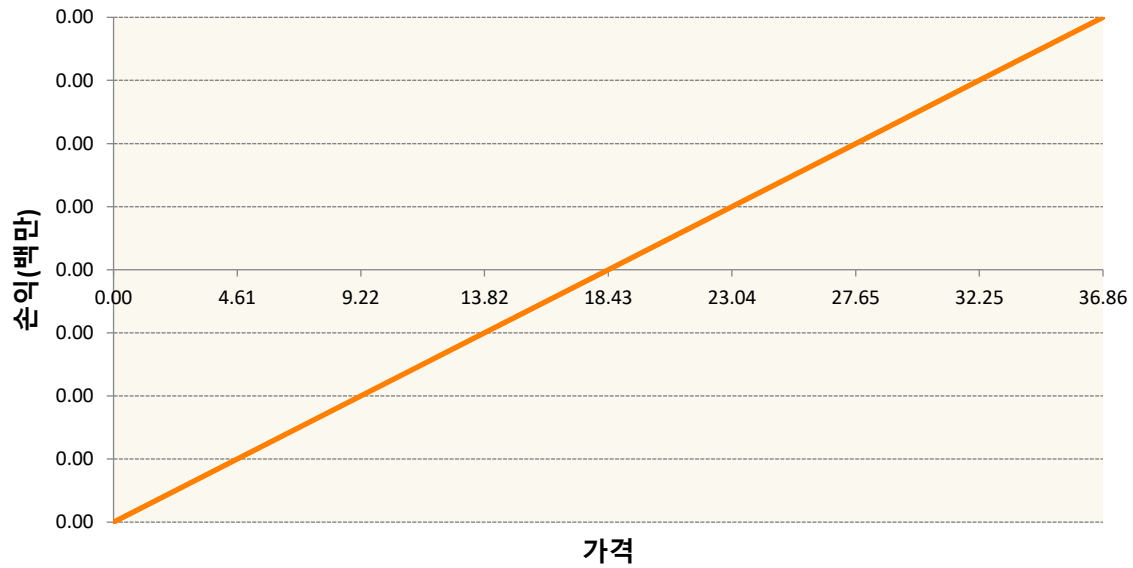
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



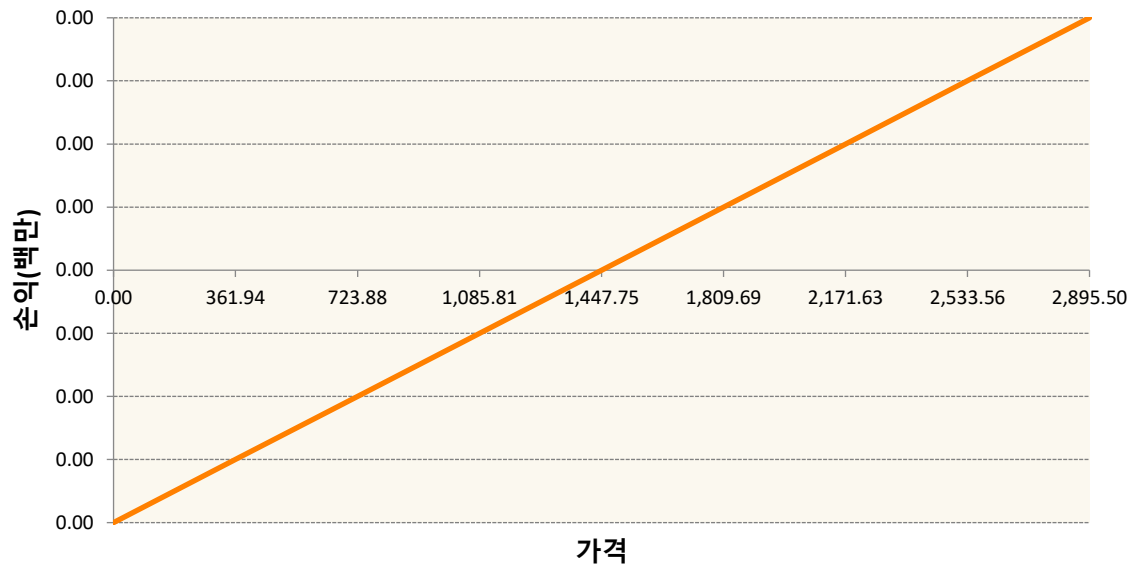
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22



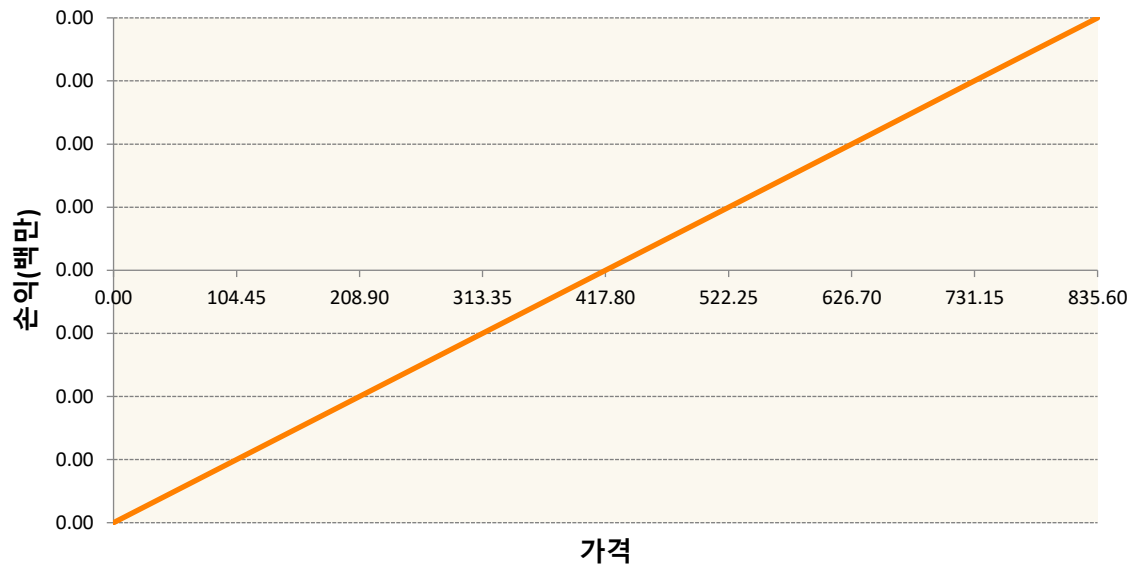
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



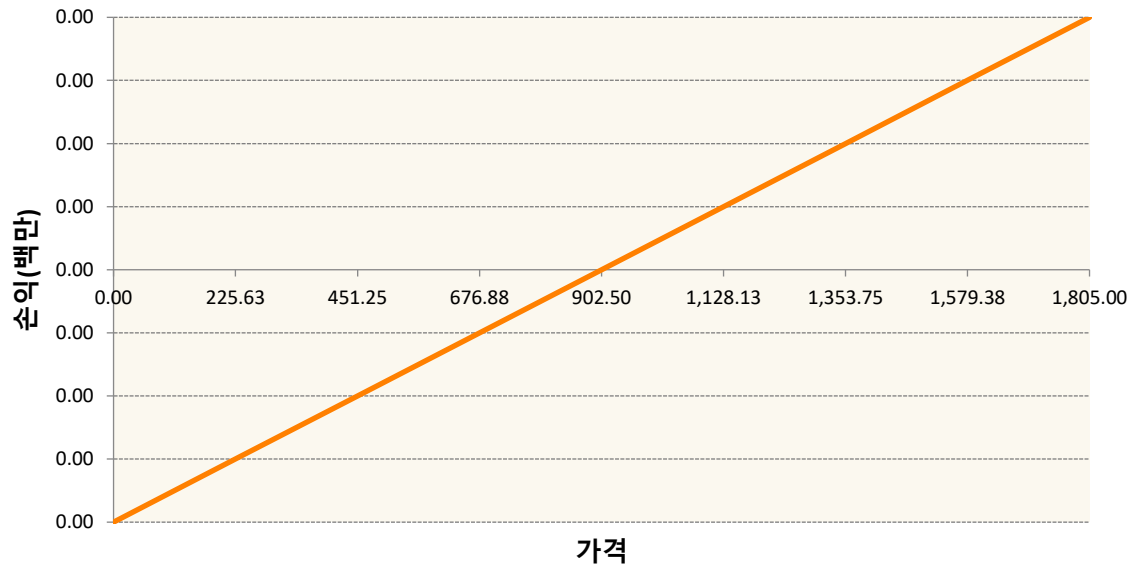
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



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	2022-11-03
기준일	2022-11-02

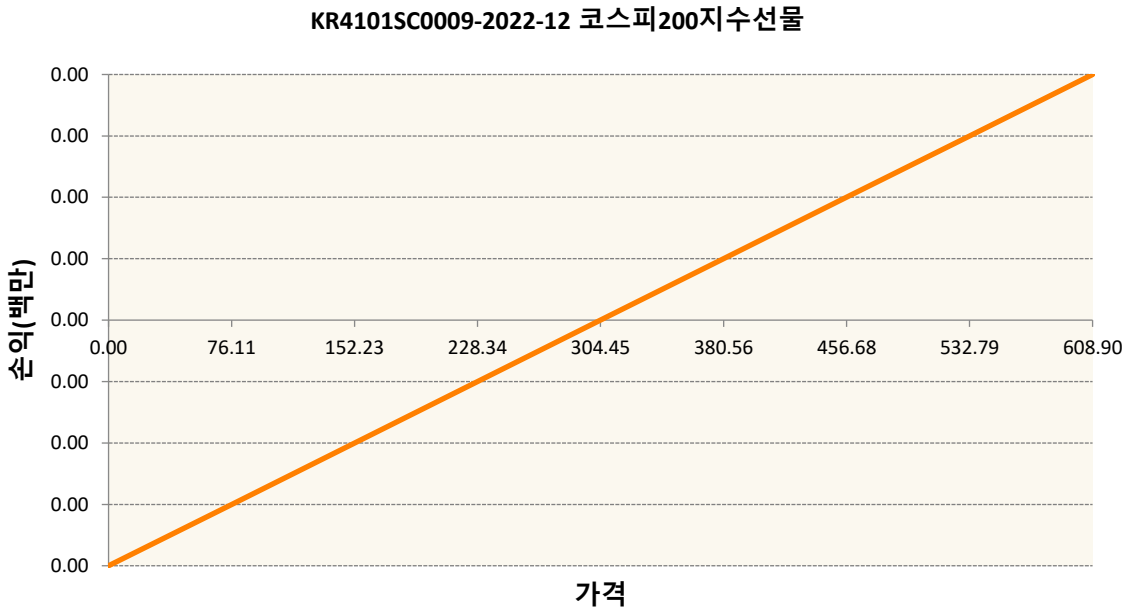
스마트인덱스모

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	1,218	0	1,218	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				97
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	32	32	32	32	32	32	32
5.33%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	97	97	97	97	97	97	97

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

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	324
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

441

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

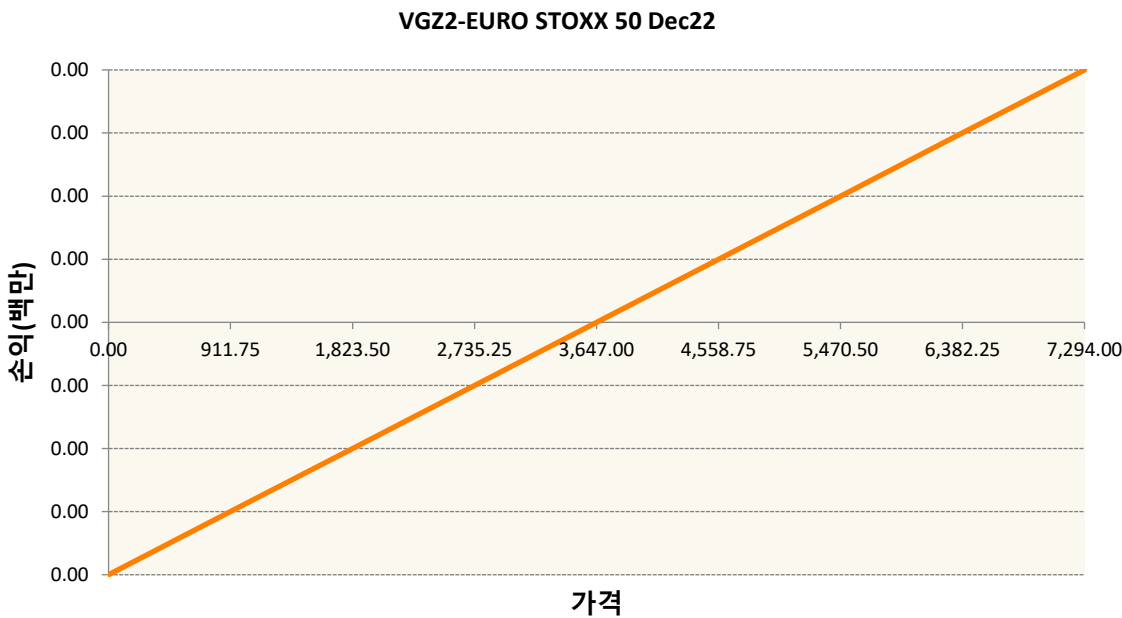
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	456	0	456	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ2	EURO STOXX 50 Dec22	36
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

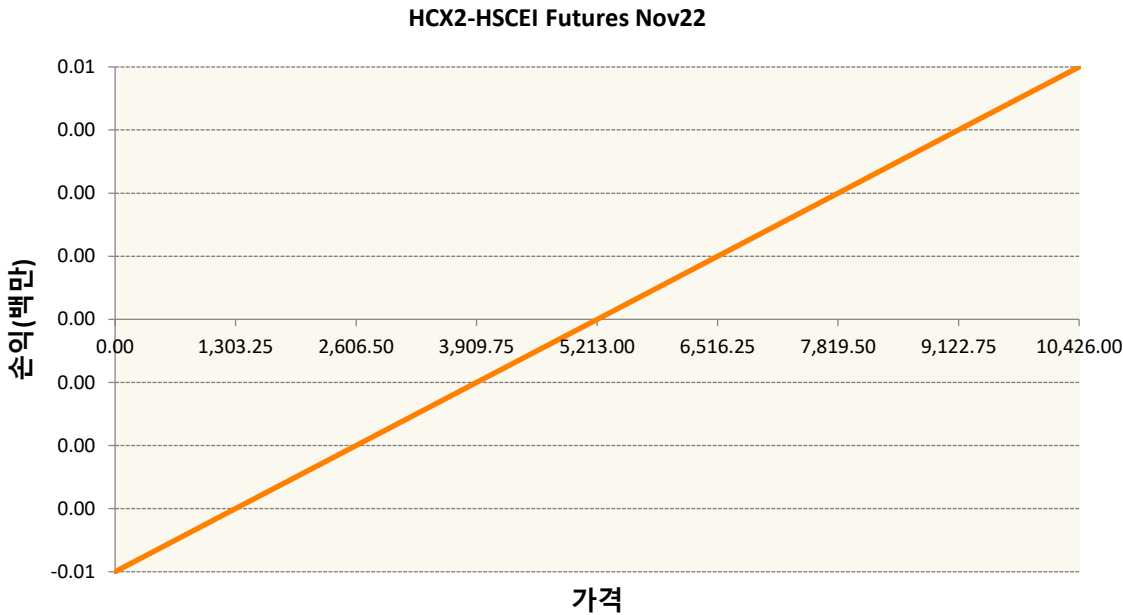
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	897	0	897	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX2	HSCEI Futures Nov22	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

112

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

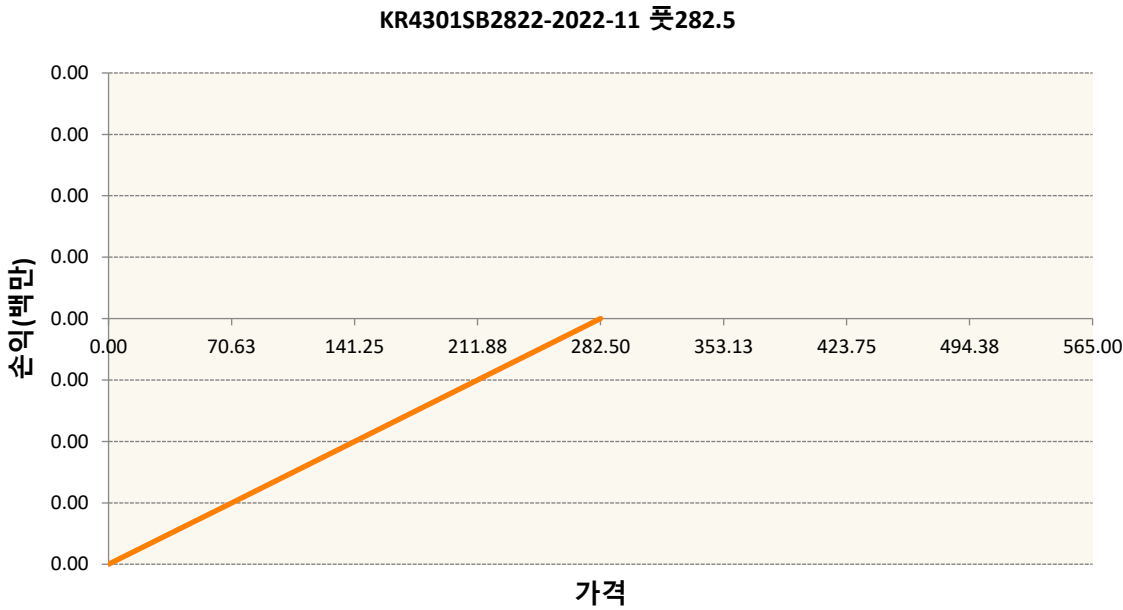
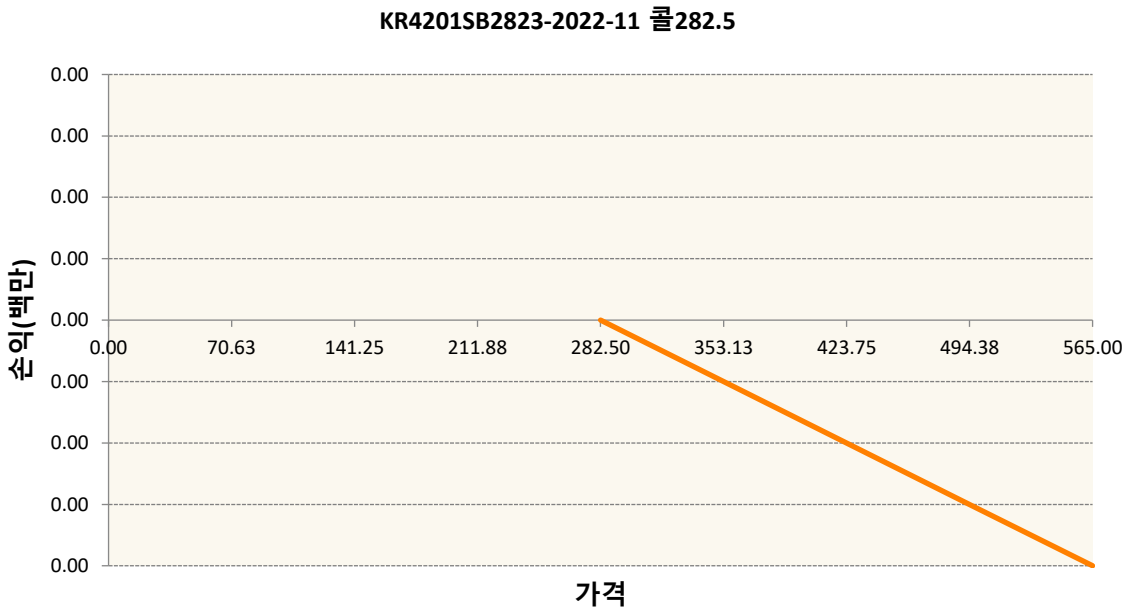
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

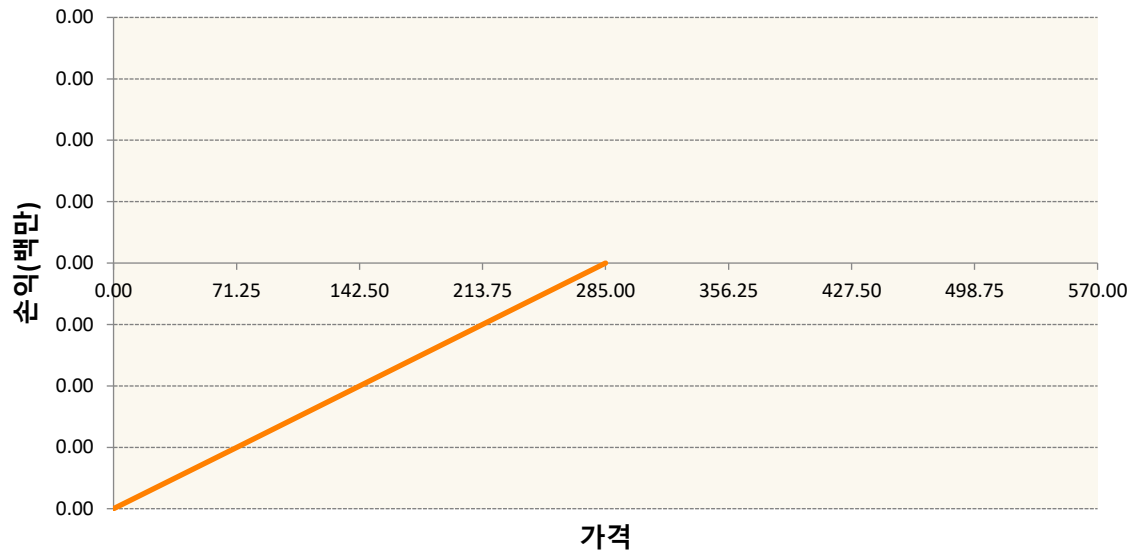
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,097	0	1,097	장내
누계	유가증권	옵션	0	51,286	-51,286	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301SB2855-2022-11 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201SB2823			2022-11 콜282.5				3,564
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,824	2,740	2,656	2,572	2,487	2,402	2,317
-5.33%	2,155	2,074	1,992	1,909	1,826	1,742	1,657
-2.67%	1,215	1,160	1,099	1,035	967	897	825
0%	103	75	40	0	-46	-96	-150
2.67%	-1,089	-1,099	-1,115	-1,136	-1,162	-1,193	-1,229
5.33%	-2,307	-2,311	-2,316	-2,325	-2,338	-2,355	-2,377
8.00%	-3,533	-3,534	-3,535	-3,539	-3,544	-3,553	-3,564
KR4301SB2822			2022-11 풋282.5				225
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-141	-155	-169	-183	-197	-211	-225
-5.33%	-49	-63	-76	-90	-104	-118	-131
-2.67%	-2	-11	-21	-32	-43	-54	-66
0%	17	12	7	0	-8	-16	-25
2.67%	23	21	18	15	11	6	0
5.33%	24	24	23	21	19	16	13
8.00%	24	24	24	24	23	21	19
KR4301SB2855			2022-11 풋285				51
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-37	-40	-43	-45	-48	-51
-5.33%	-13	-16	-19	-22	-24	-27	-30
-2.67%	-1	-3	-5	-8	-10	-13	-15
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6

2.67%	6	6	5	4	3	2	0
5.33%	6	6	6	6	5	4	3
8.00%	7	7	6	6	6	6	5

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

(단위:백만원)

3,889

공시일 2022-11-03

기준일 2022-11-02

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

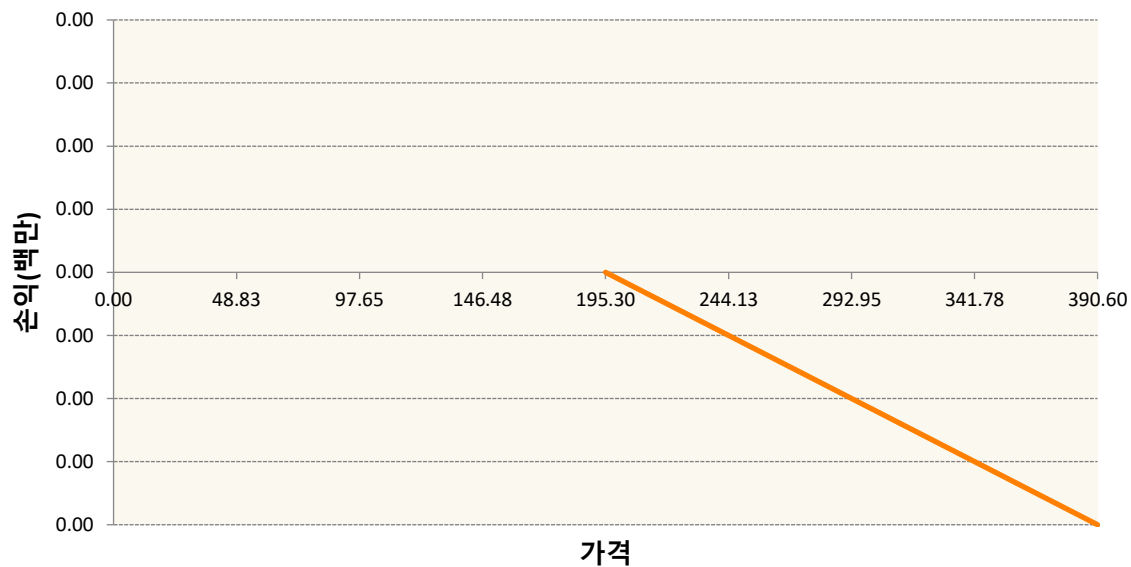
1. 계약금액

(단위:백만원)

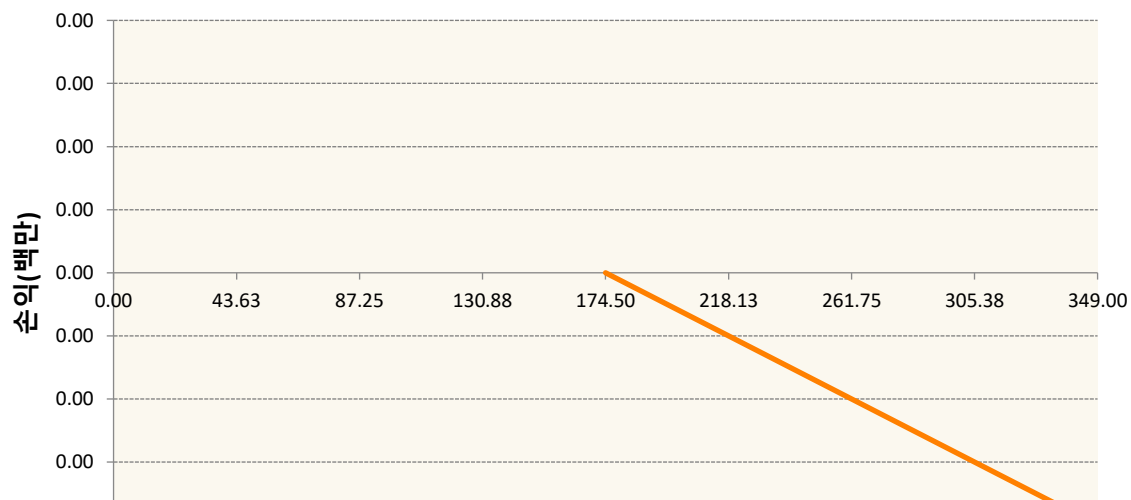
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,228	0	1,228	
누계	유가증권	옵션	0	151	-151	장내
누계	통화	선도	0	2,312	-2,312	장외

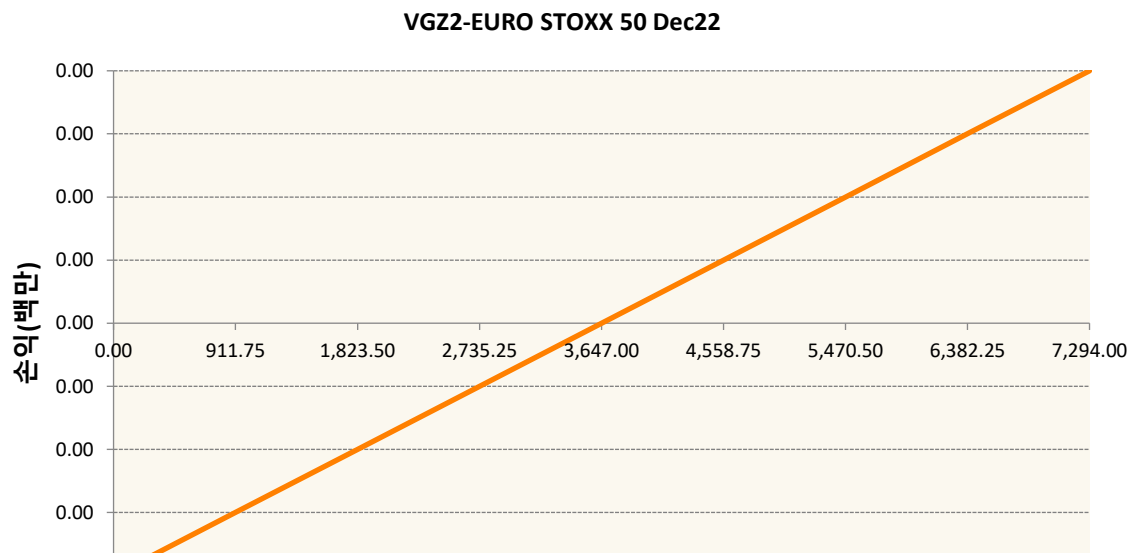
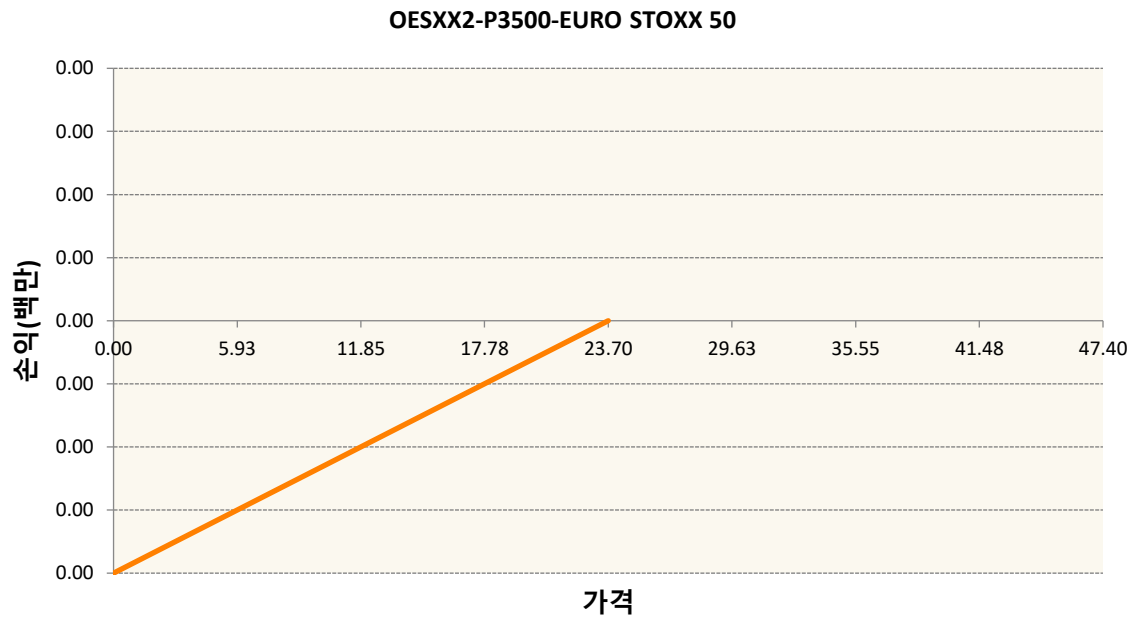
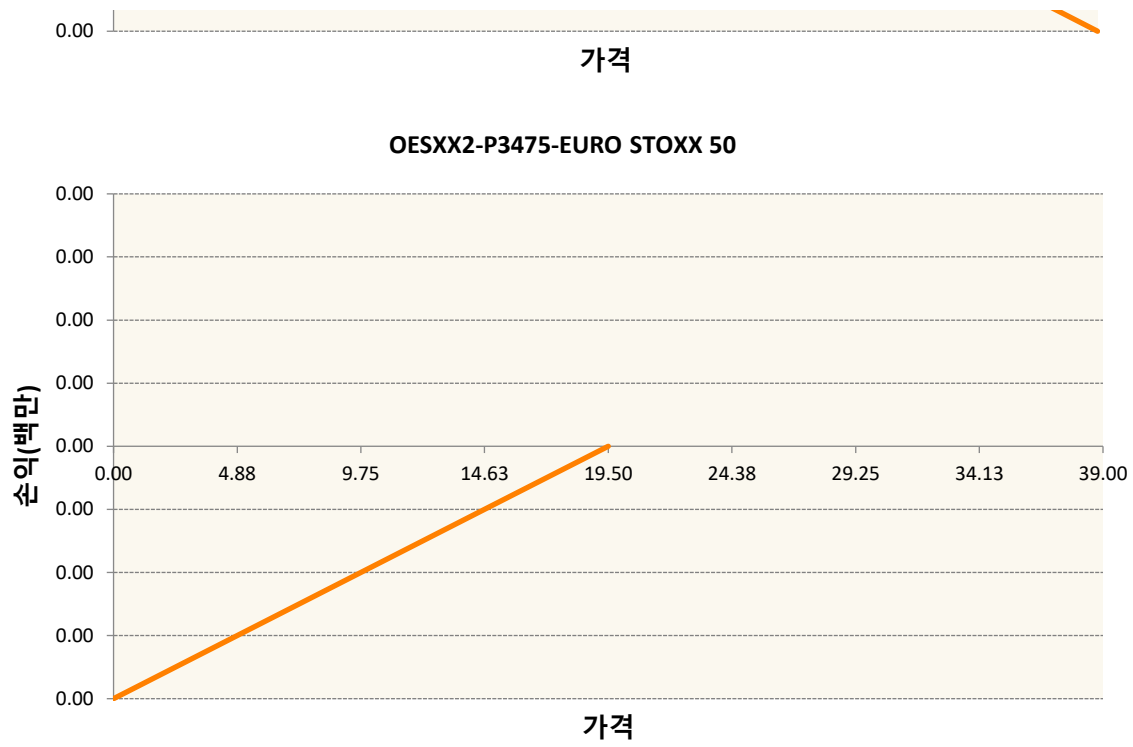
2. 만기시점의 손익구조

OESXX2-C3475-EURO STOXX 50



OESXX2-C3500-EURO STOXX 50





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
OESXX2-C34 EURO STOXX 50	10
OESXX2-C35 EURO STOXX 50	1
OESXX2-P34 EURO STOXX 50	1
OESXX2-P35 EURO STOXX 50	0.08
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	98

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

(단위:백만원)

244

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

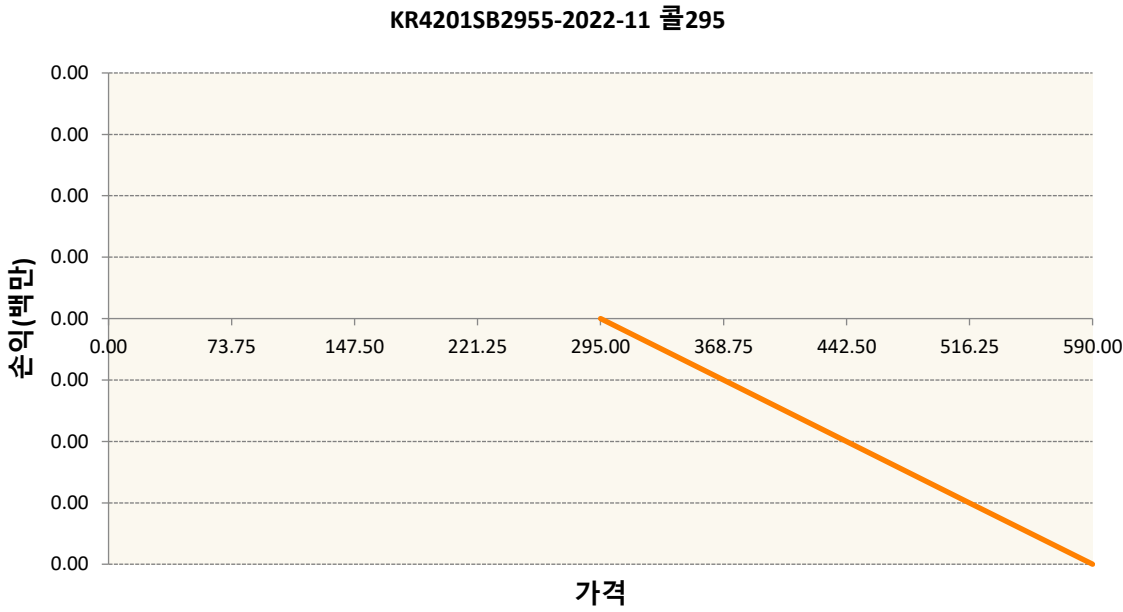
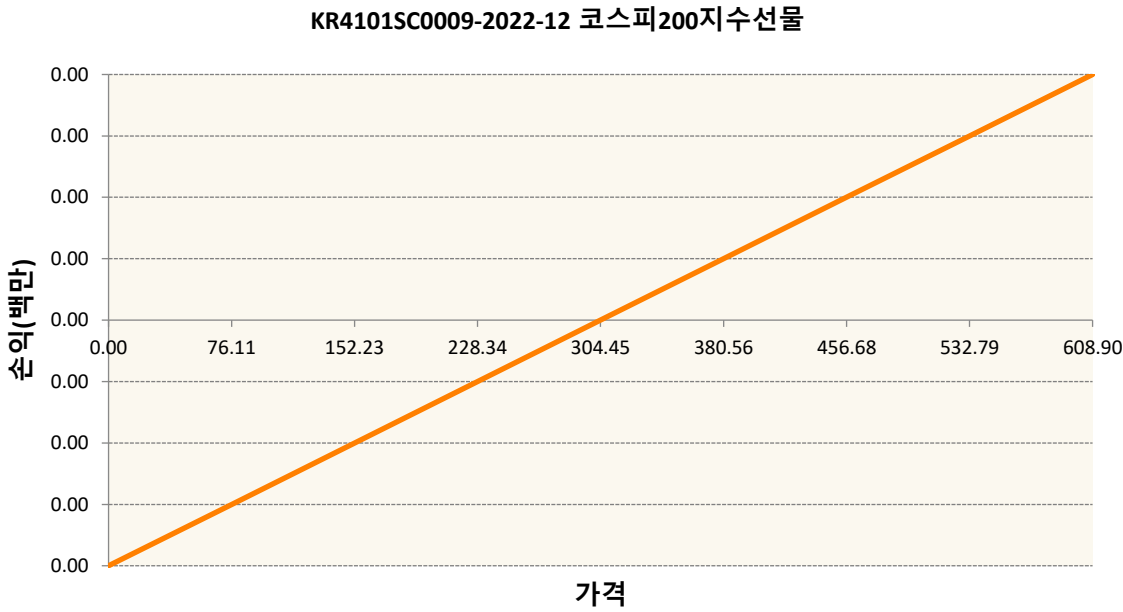
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	381	0	381	장내
누계	유가증권	옵션	353	3,708	-3,355	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 595.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the point (297.50, 0.00) and ends at (595.00, -0.00), indicating a negative slope.

가격	손익(백만)
297.50	0.00
595.00	-0.00

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
282.50	0.00

(단위:백만원)

KR4101SC0009				2022-12 코스피200지수선물				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	
KR4201SB2955							2022-11 콜295	91
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	49	47	46	44	42	40
-5.33%	43	41	39	36	34	32	29
-2.67%	29	26	24	21	19	16	14
0%	7	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	-22	-23	-25	-26	-28	-30	-32
5.33%	-54	-55	-56	-57	-58	-59	-61
8.00%	-88	-88	-89	-89	-90	-91	-91
KR4201SB2971 2022-11 콜297.5							172

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	84	82	79	76	73	69
-5.33%	76	72	68	64	59	55	51
-2.67%	52	48	43	38	33	28	23
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	-38	-41	-45	-48	-52	-56	-60
5.33%	-99	-101	-103	-105	-108	-111	-114
8.00%	-164	-165	-166	-167	-168	-170	-172

KR4301SB2822 2022-11 풋282.5							11
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	8	8	9	10	11	11
-5.33%	2	3	4	4	5	6	7
-2.67%	0	1	1	2	2	3	3
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	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)

309

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

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	6,861	0	6,861	

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	2022-11-03
기준일	2022-11-02

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	6,024	0	6,024	

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	2022-11-03
기준일	2022-11-02

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	18,976	0	18,976	
누계	통화	선도	0	18,887	-18,887	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E	634
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	527
FXW213CAR·KRW/USD 30-01-23E	293
FXW213CB1(KRW/USD 28-11-22E	57
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

662

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

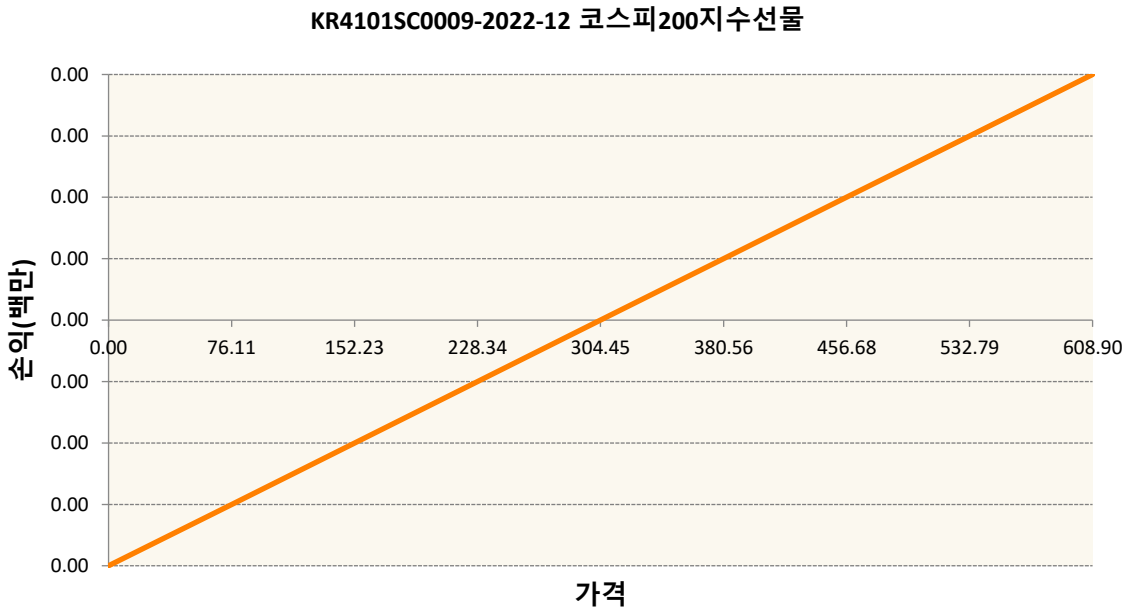
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	381	0	381	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				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

공시일 2022-11-03

기준일 2022-11-02

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

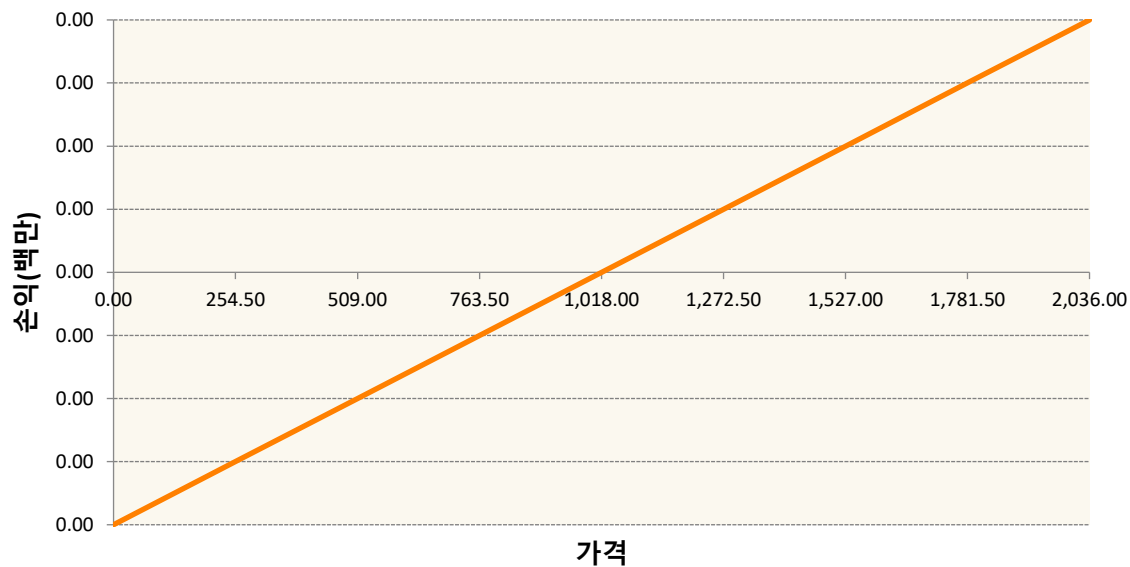
1. 계약금액

(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	190	0	190	
누계	유가증권	스왑	1,334	0	1,334	장외
누계	통화	선도	630	855	-224	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCX2-VN30 Index Future NOV22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	107
FXW213C8P KRW/EUR 18-11-22E	11
FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E	31
FXW213C9M KRW/EUR 23-12-22E	22
FXW213CA7I EUR/KRW 18-11-22E	3
FXW213CABI EUR/KRW 18-11-22E	11
FXW213CAD EUR/KRW 18-11-22E	17
FXW213CAKI EUR/KRW 18-11-22E	6
FXW213CAQ EUR/KRW 18-11-22E	6
FXW213CARI EUR/KRW 28-11-22E	8

FXW213CAYIKRW/EUR 28-11-22E
VNCX2 VN30 Index Future NOV22

3
15

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

(단위:백만원)

217

공시일 2022-11-03

기준일 2022-11-02

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

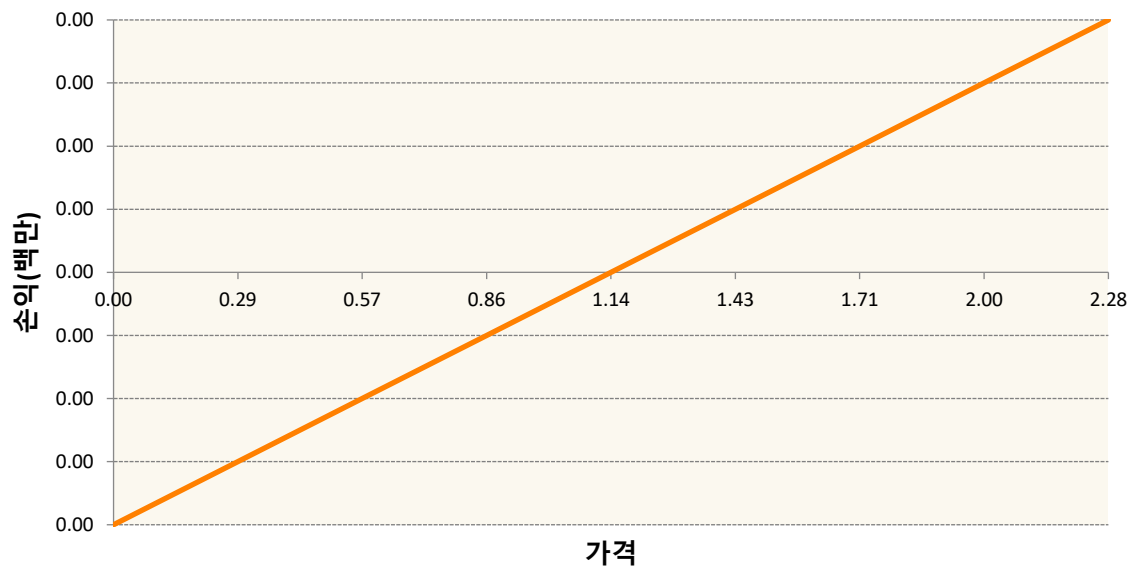
1. 계약금액

(단위:백만원)

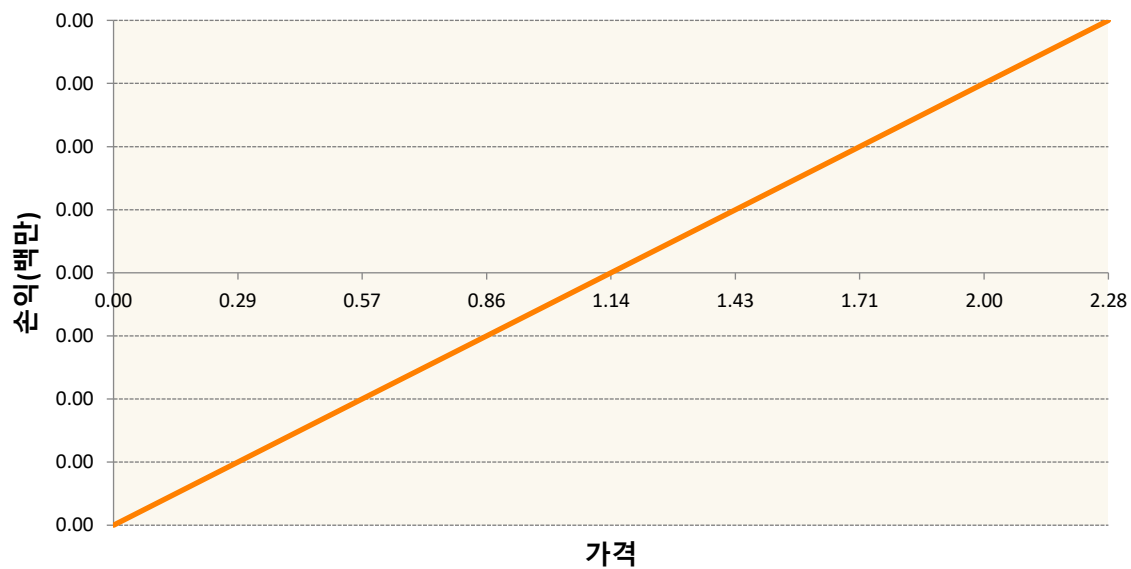
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	30,964	0	30,964	

2. 만기시점의 손익구조

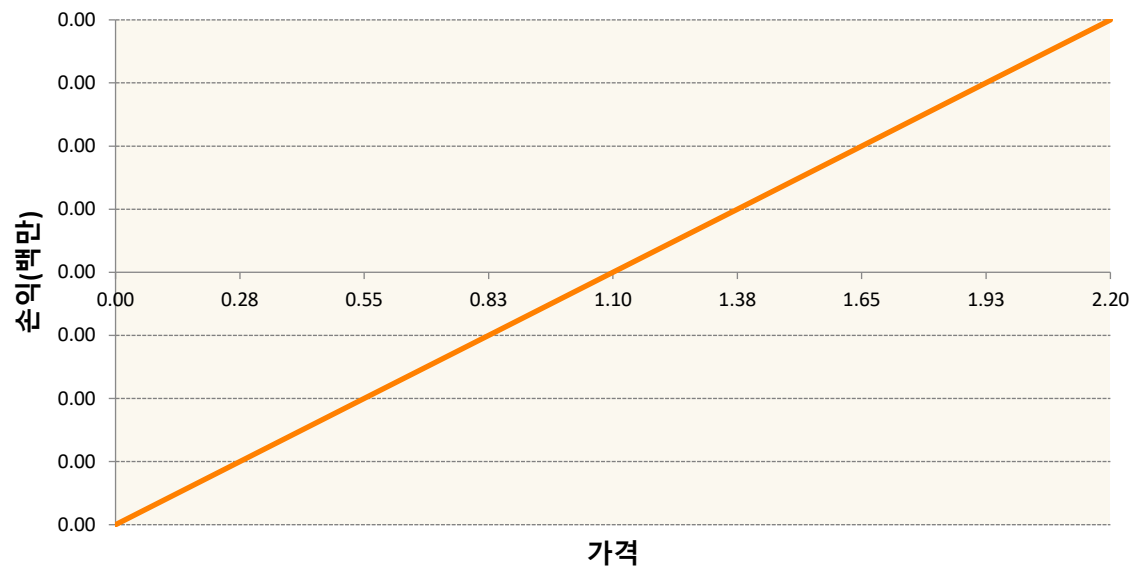
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884221024-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

198

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

99

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

2,174

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

(단위:백만원)

4,751

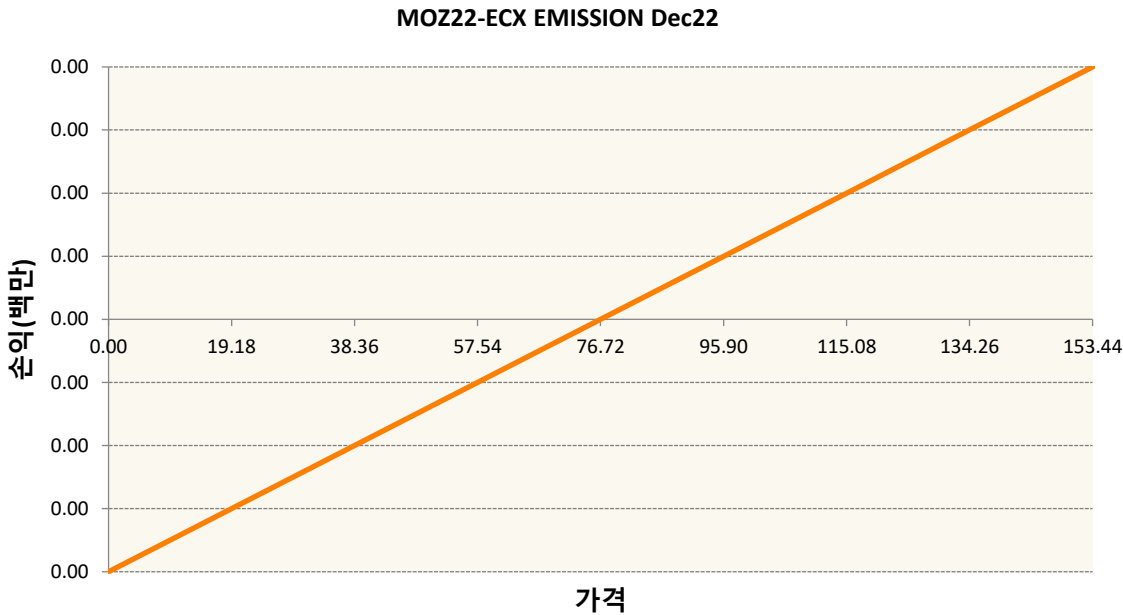
공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

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	13,837	0	13,837	
누계	통화	선도	0	4,635	-4,635	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213CAT(KRW/EUR 23-11-22E			371
MOZ22	ECX EMISSION Dec22		1,107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,107

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

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)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	6

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

(단위:백만원)

43

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

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	8,926	0	8,926	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	18

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

(단위:백만원)

78

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

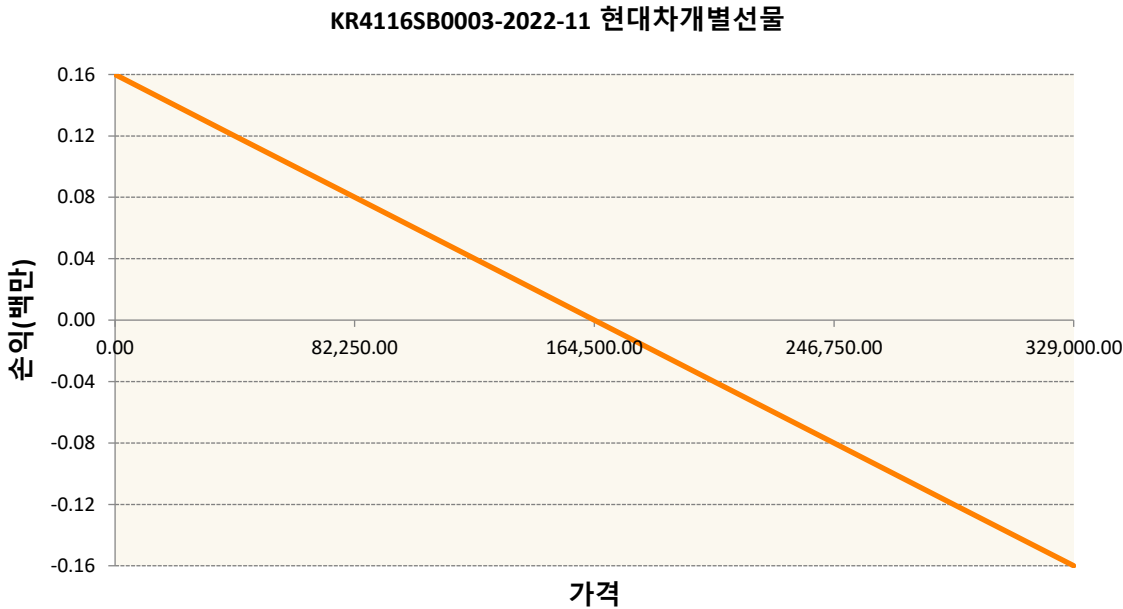
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	494	-494	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4116SB00 2022-11 현대차개별선물	39
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.42
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	1

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

(단위:백만원)

62

공시일 2022-11-03

기준일 2022-11-02

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

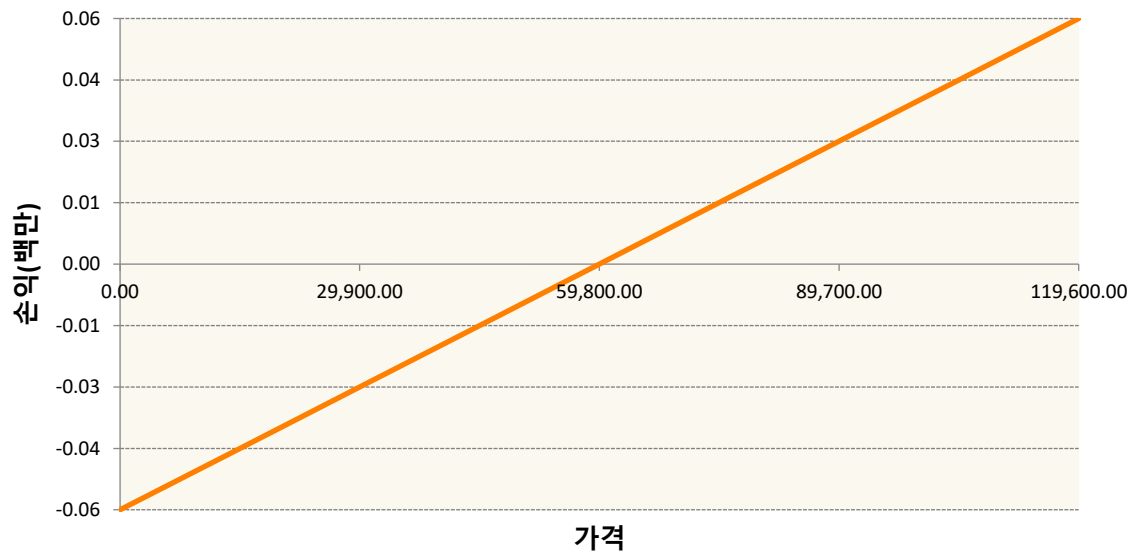
1. 계약금액

(단위:백만원)

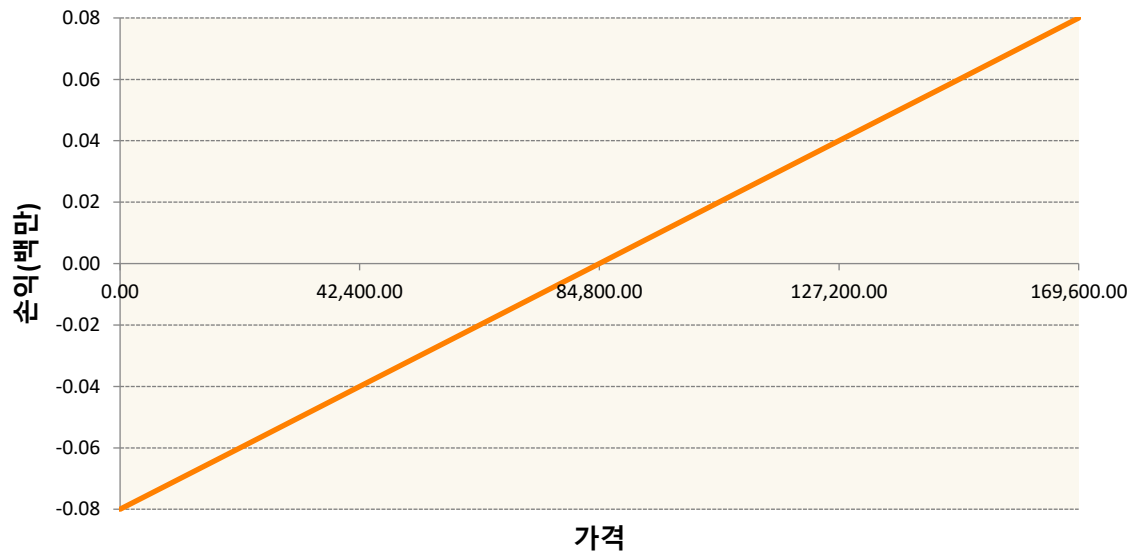
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	645	0	645	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111SB0008-2022-11 삼성전자개별선물



KR4150SB0000-2022-11 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SB0008			2022-11 삼성전자개별선물				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%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-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%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	28	28	28	28	28	28	28
KR4150SB0000			2022-11 SK하이닉스개별선물				24
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-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%	24	24	24	24	24	24	24

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

61

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

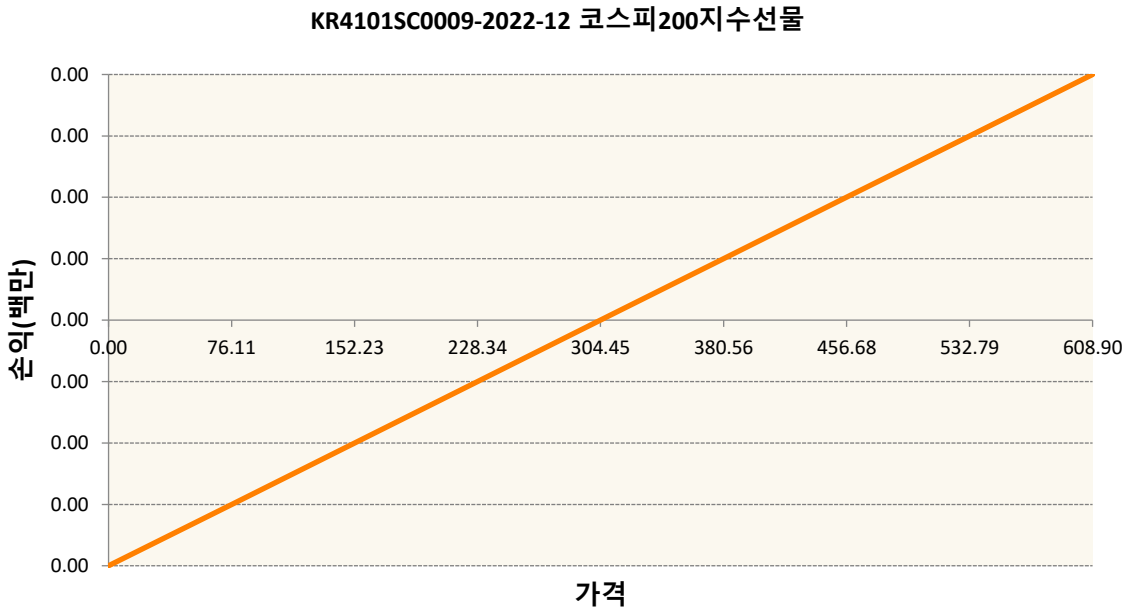
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	381	0	381	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				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

공시일 2022-11-03

기준일 2022-11-02

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

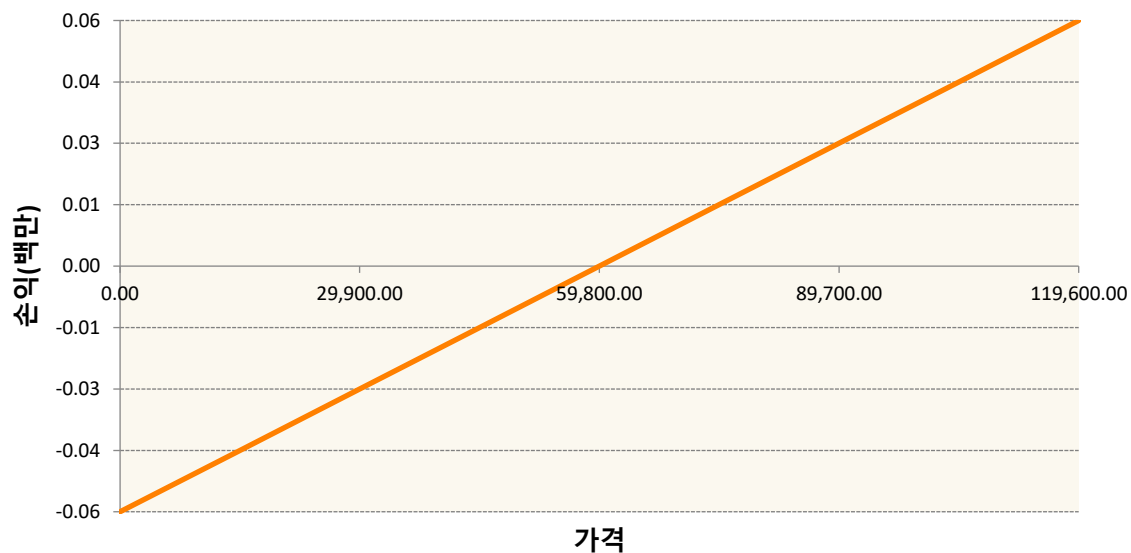
1. 계약금액

(단위:백만원)

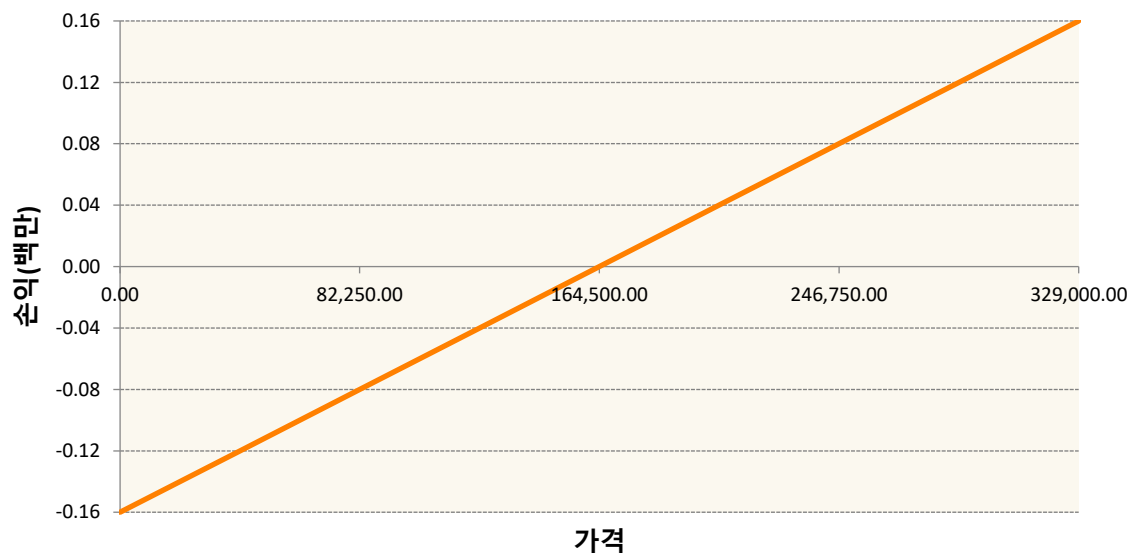
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	235	0	235	장내
누계	유가증권	ELS	65	0	65	장외

2. 만기시점의 손익구조

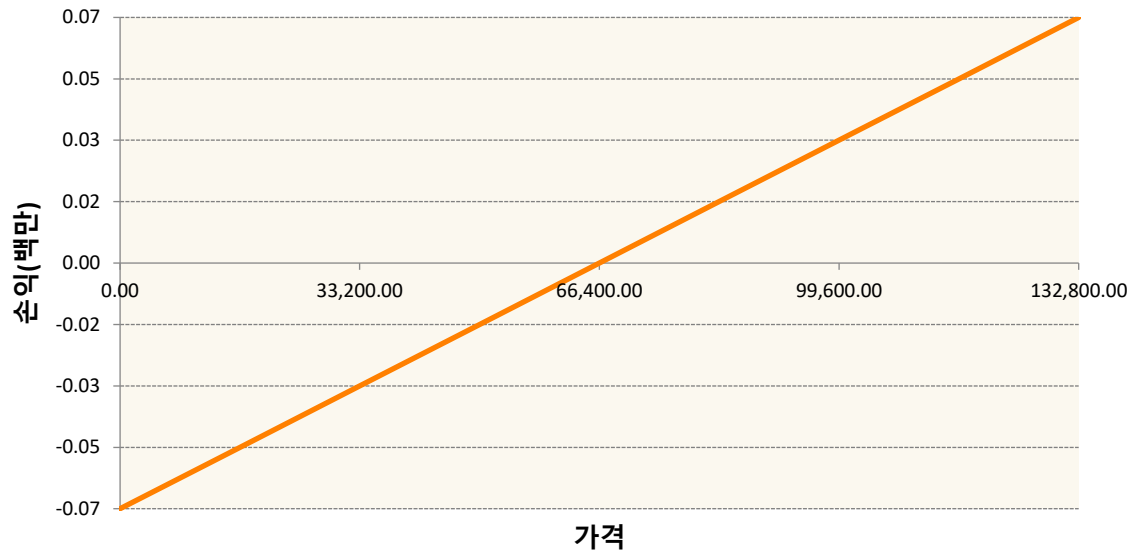
KR4111SB0008-2022-11 삼성전자개별선물



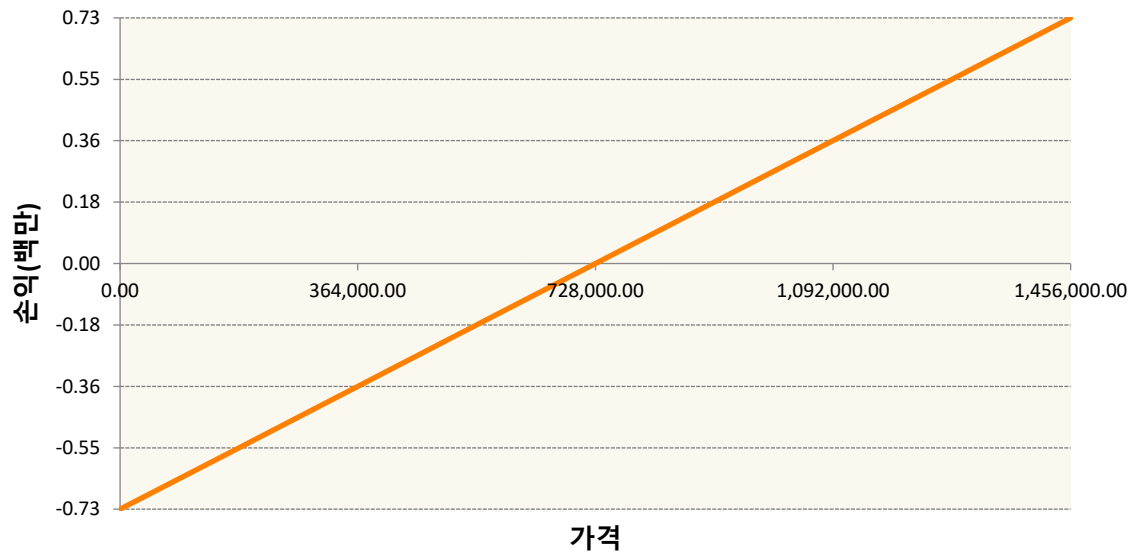
KR4116SB0003-2022-11 현대차개별선물



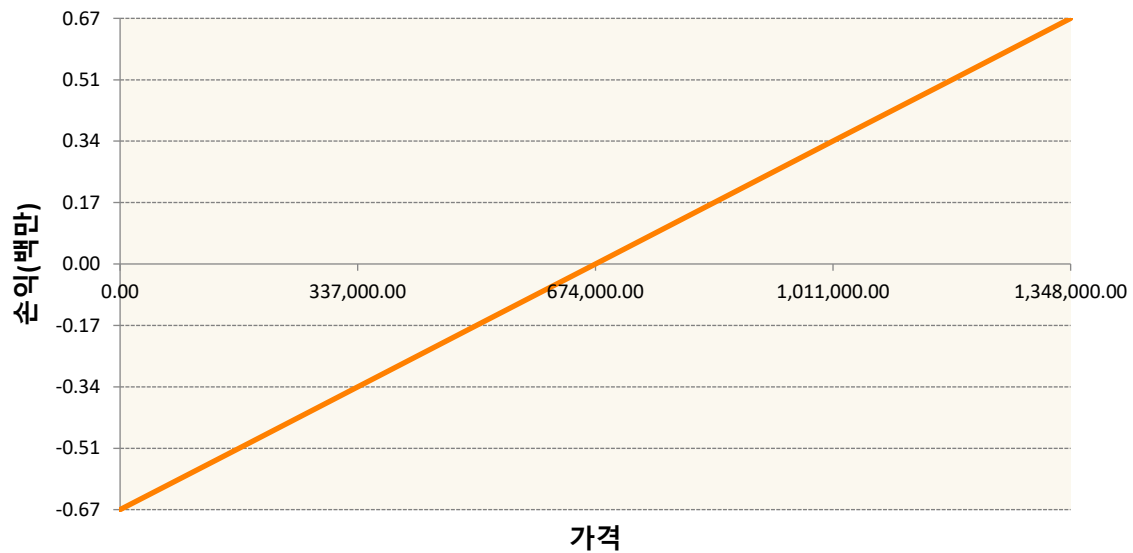
KR4119SB0000-2022-11 기아개별선물



KR4122SB0005-2022-11 삼성SDI개별선물



KR4147SB0006-2022-11 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SB0008		2022-11 삼성전자개별선물						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
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5	5
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						12
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	8	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	12	12	12	12	12	12	12	12

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

24

공시일 2022-11-03

기준일 2022-11-02

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

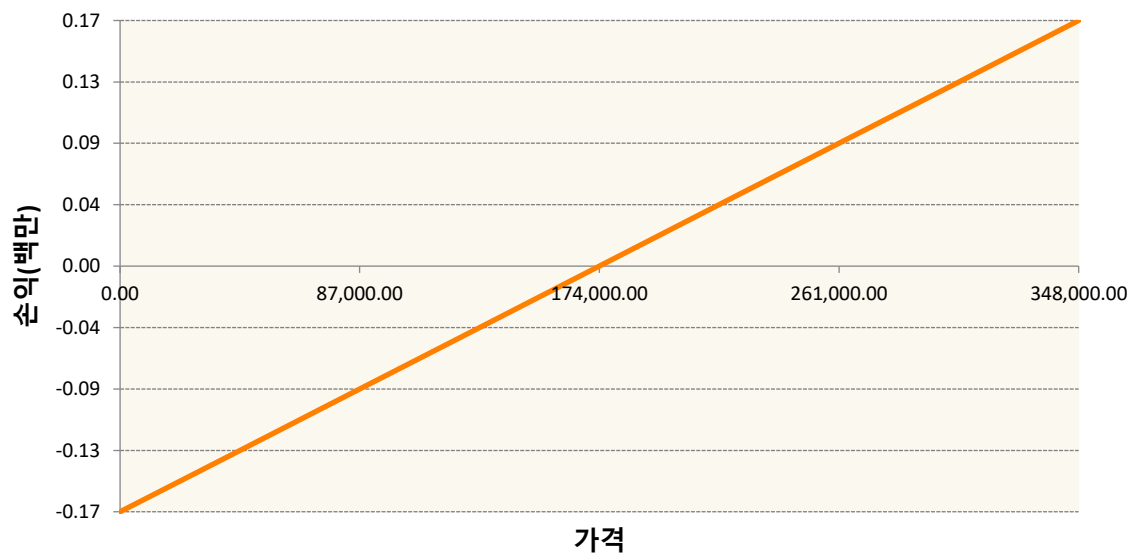
1. 계약금액

(단위:백만원)

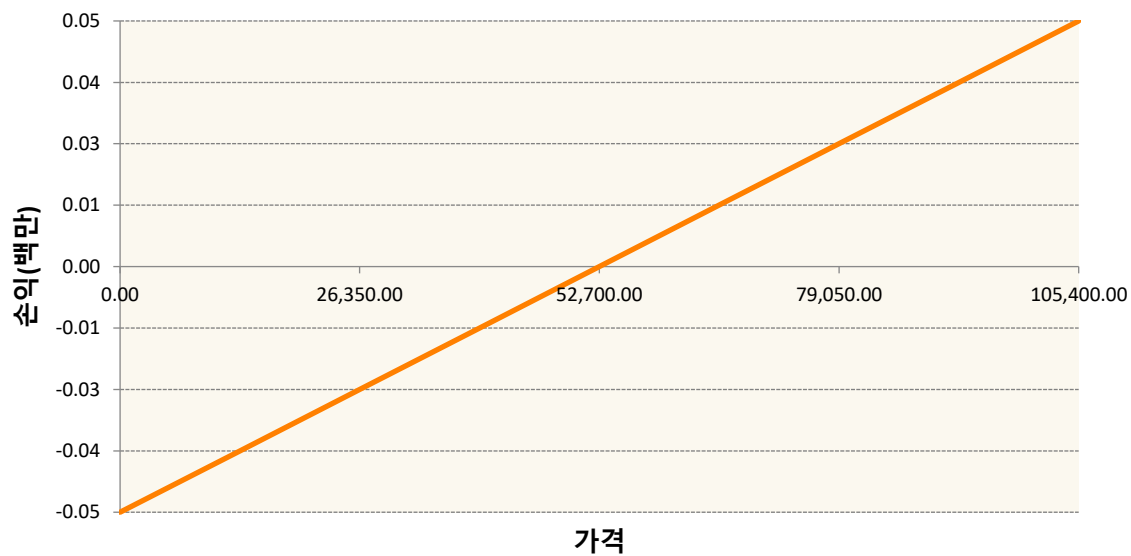
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	108	0	108	장내

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					4
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

16

공시일	2022-11-03
기준일	2022-11-02

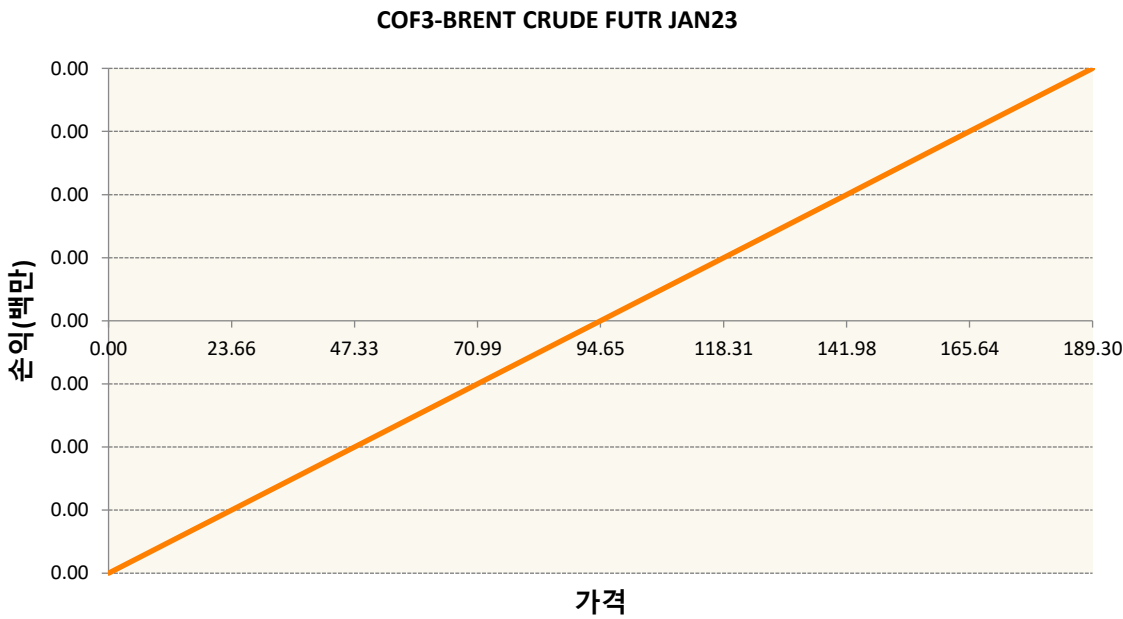
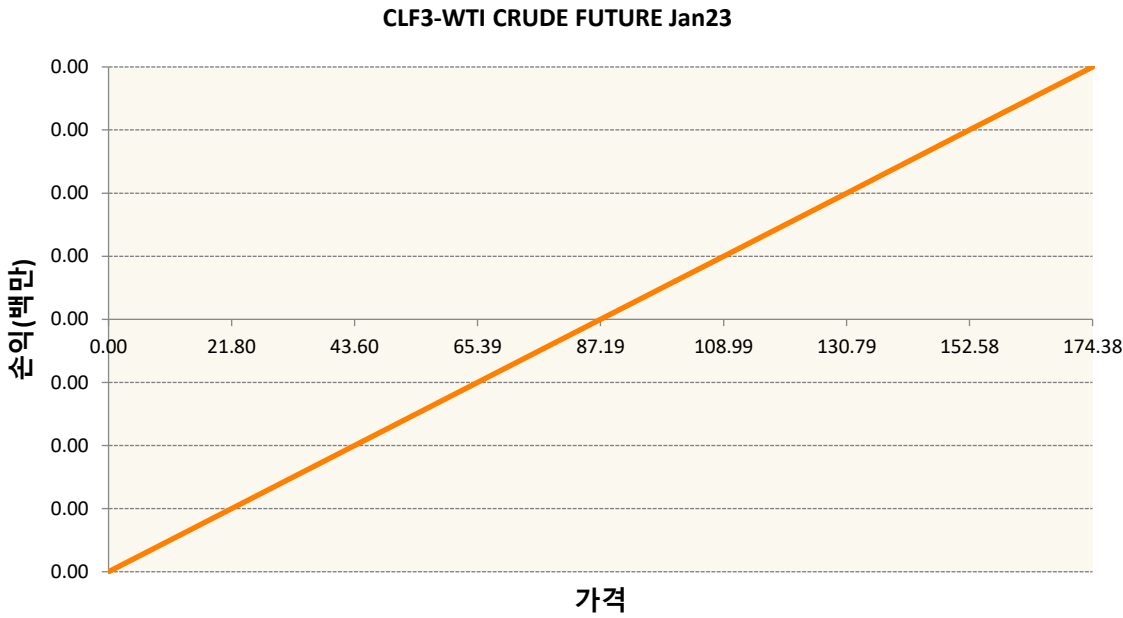
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

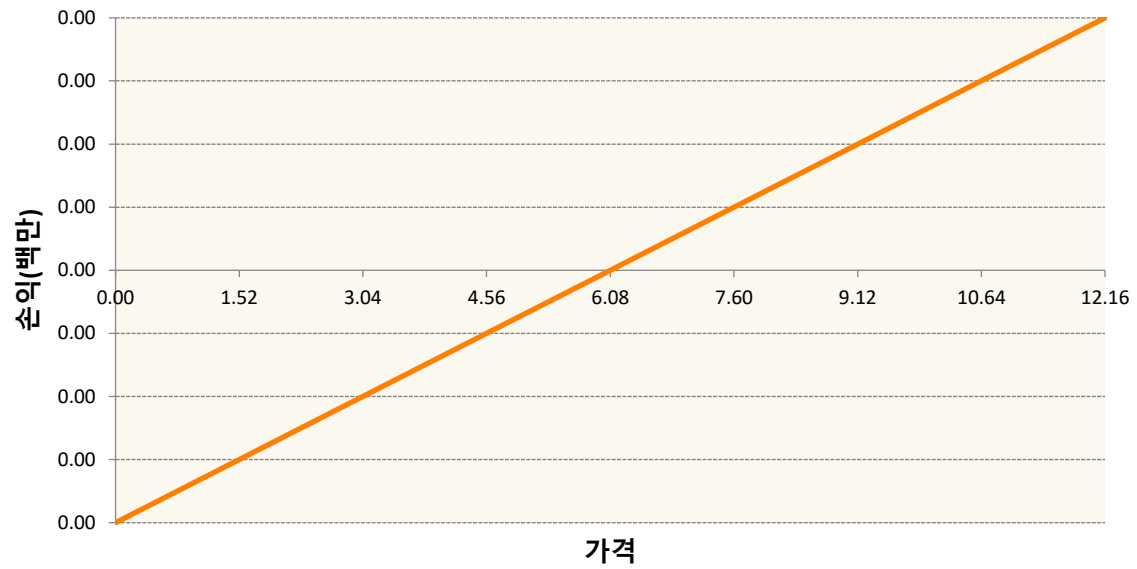
(단위:백만원)

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	248	0	248	
누계	유가증권	선물	1,478	213	1,265	

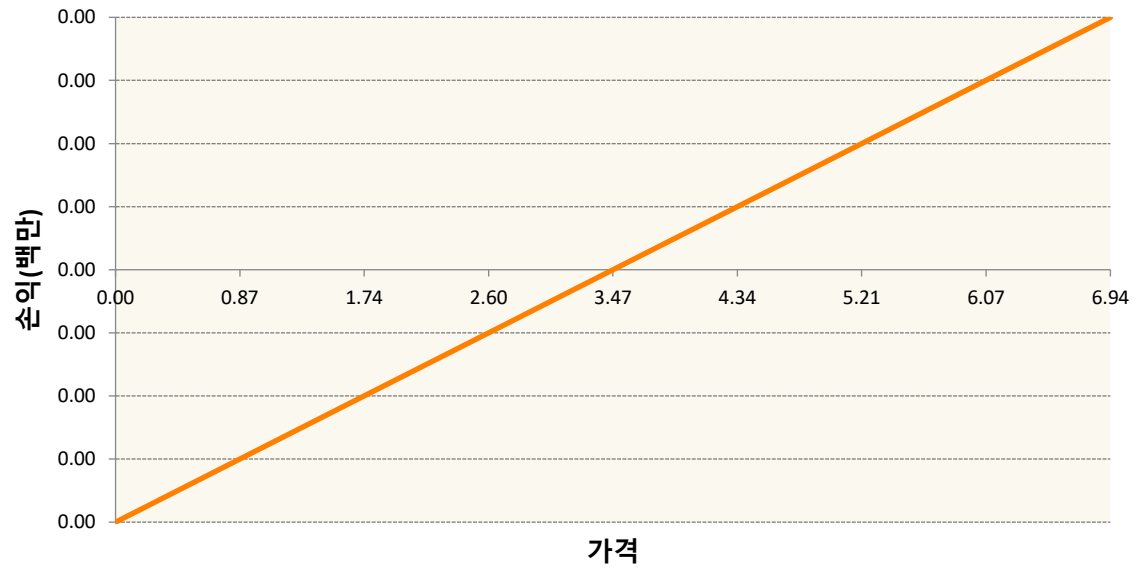
2. 만기시점의 손익구조



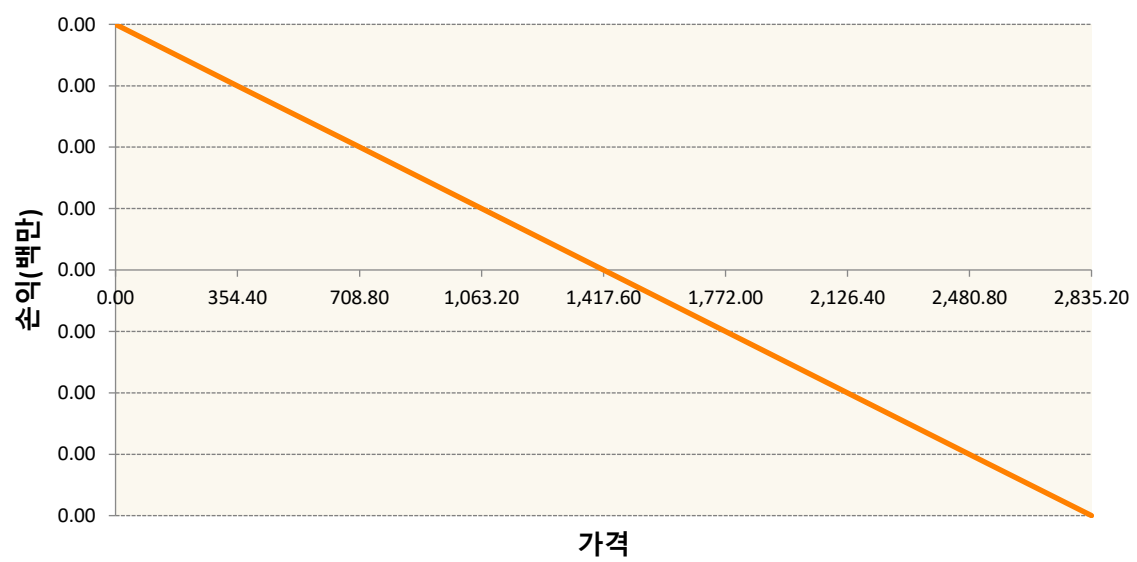
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



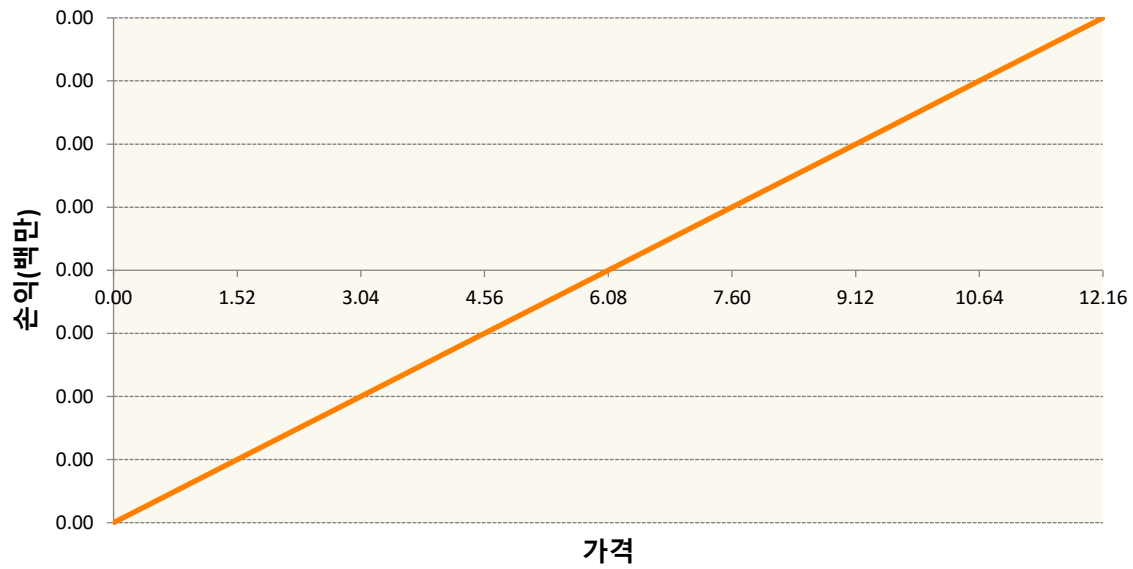
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



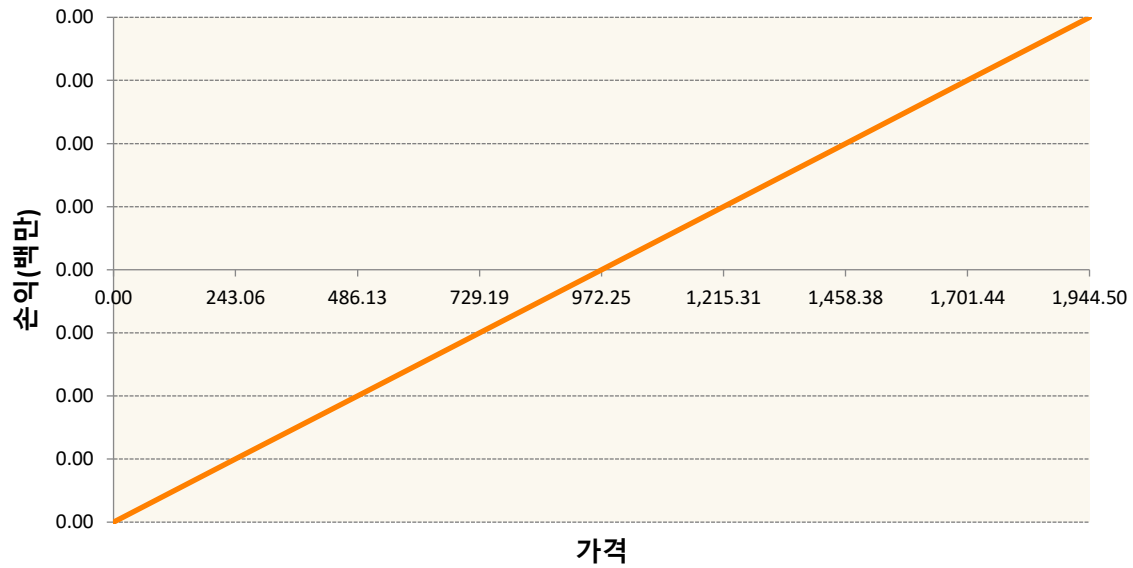
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



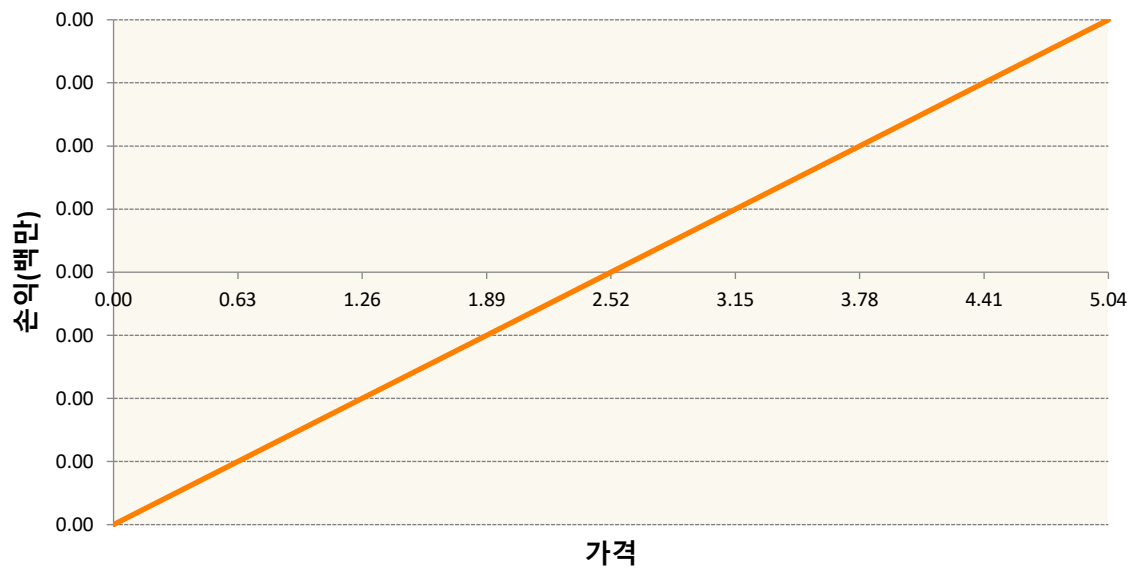
NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



QSF3-Low Su Gasoil G Jan23



XBF3-GASOLINE RBOB FUT Jan23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF3	WTI CRUDE FUTURE Jan23	20
COF3	BRENT CRUDE FUTR JAN23	32
EOF3	E-MINI NATURAL GAS Jan23	5
HOF3	NY Harb ULSD Fut Jan23	17
KR4175SB00	2022-11 달러선물	17
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)

451