

공시일 2022-11-07

기준일 2022-11-04

포커스농산물모(채권-파생형)

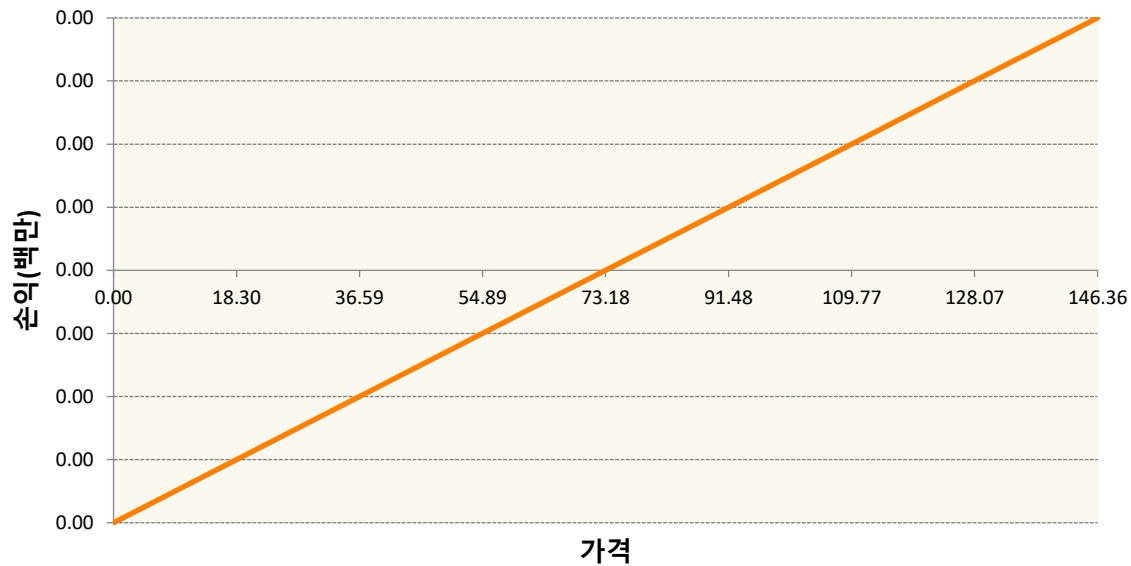
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

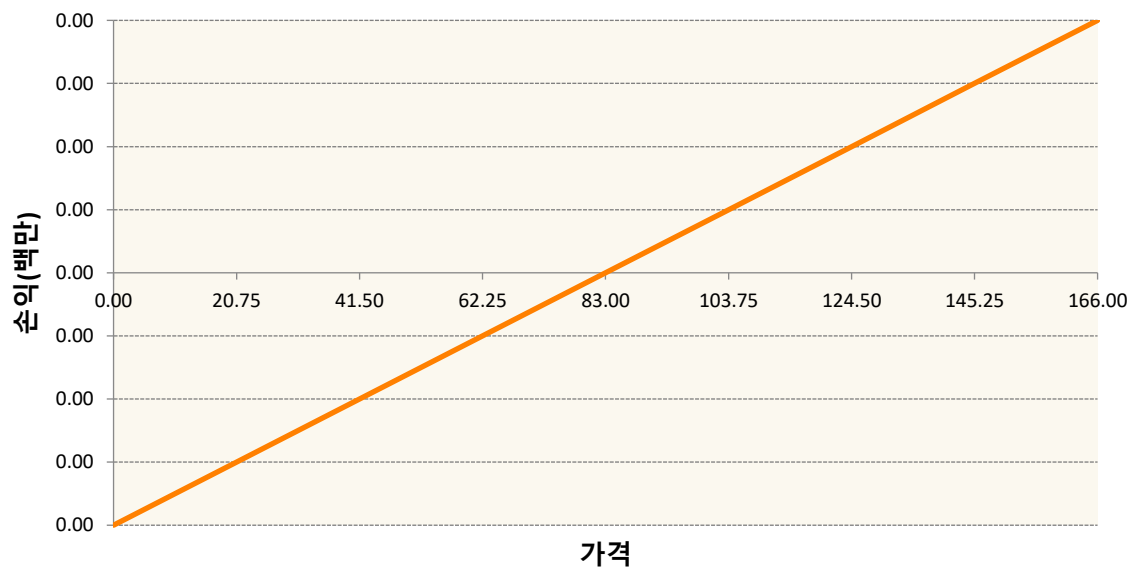
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,651	850	5,802	

2. 만기시점의 손익구조

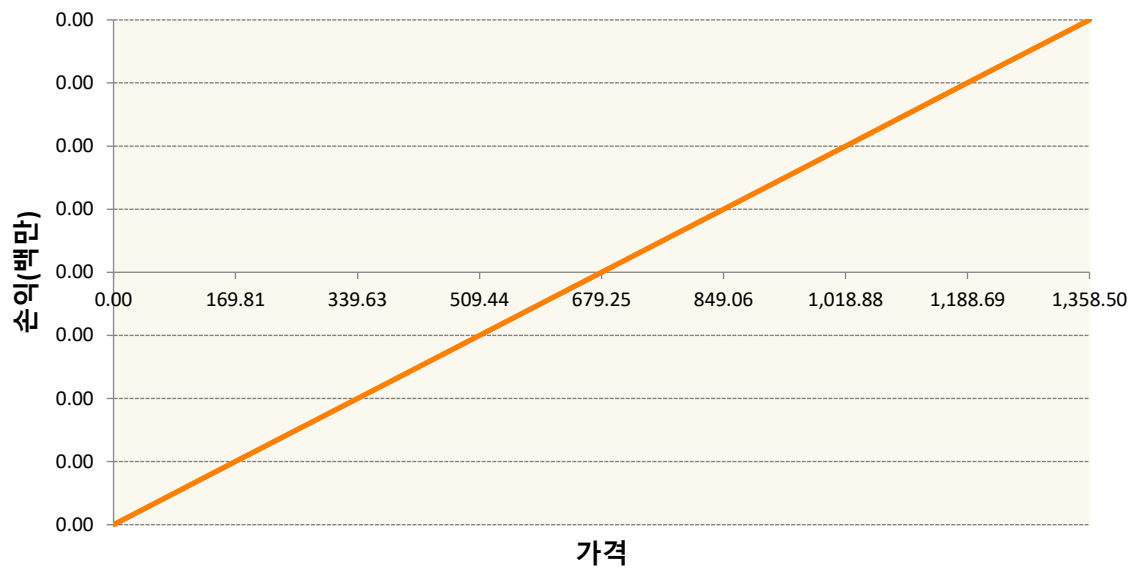
BOF3-SOYBEAN OIL FUTR Jan23



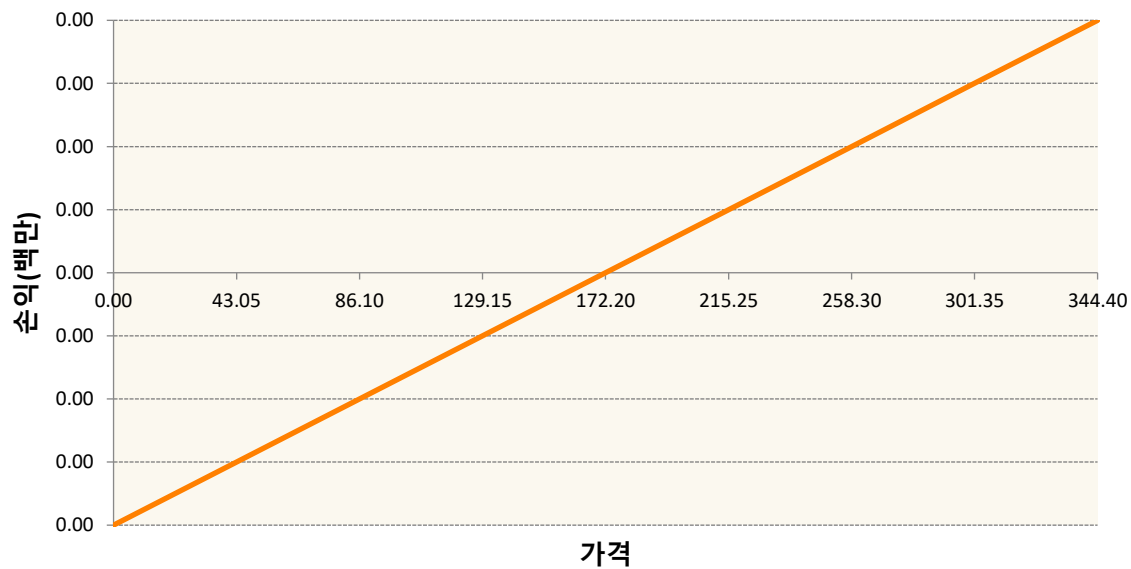
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



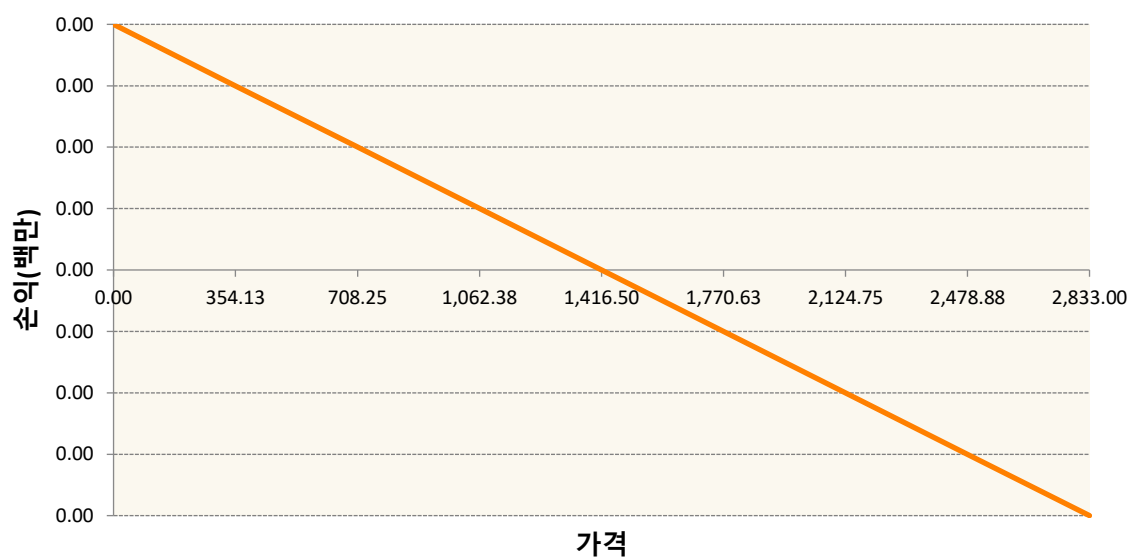
CZ2-CORN FUTURE Dec22



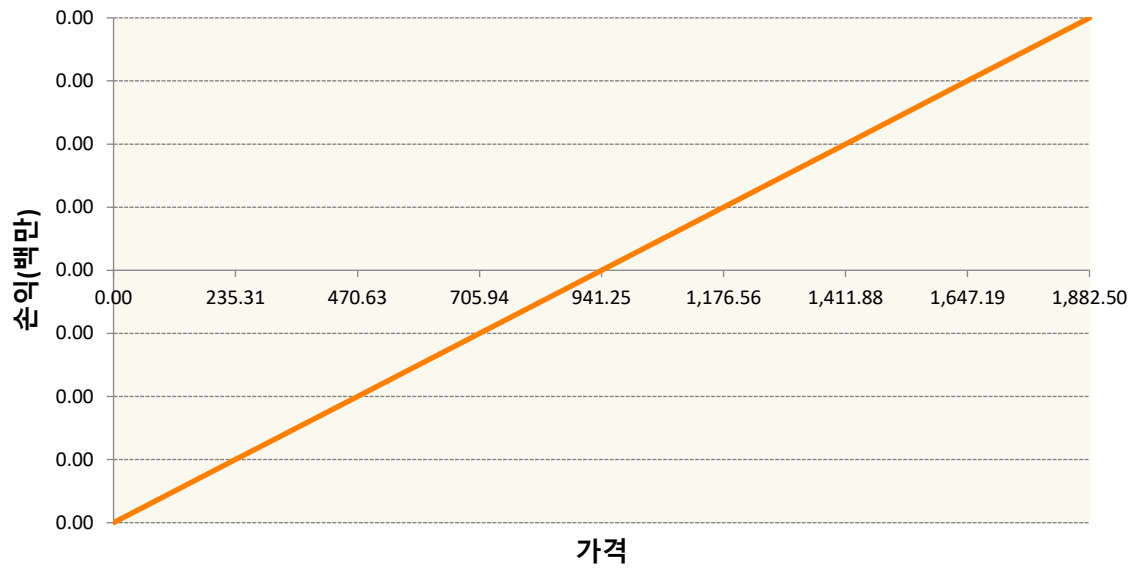
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



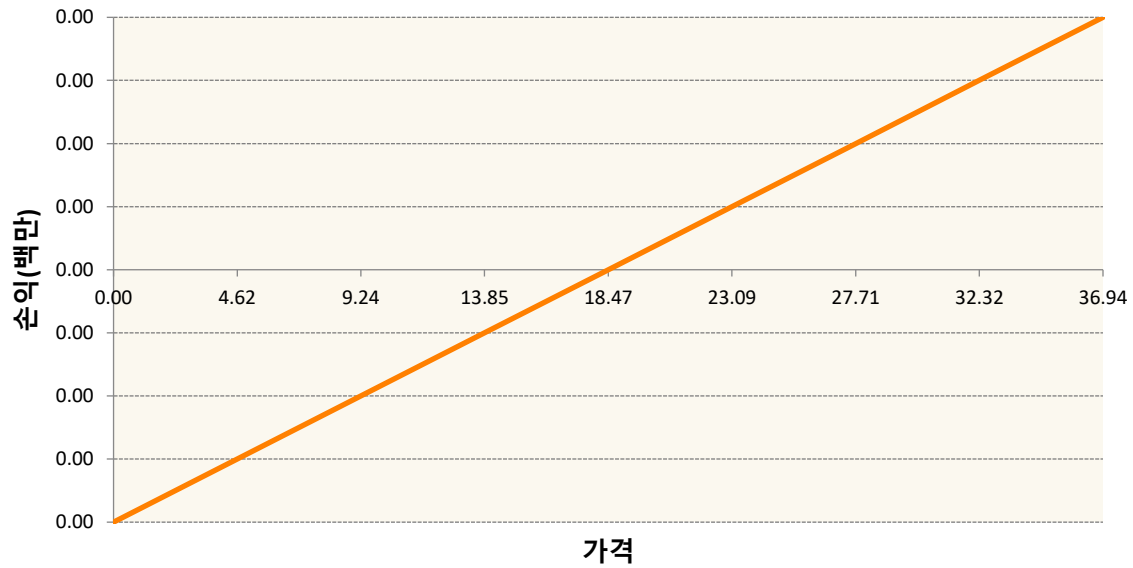
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



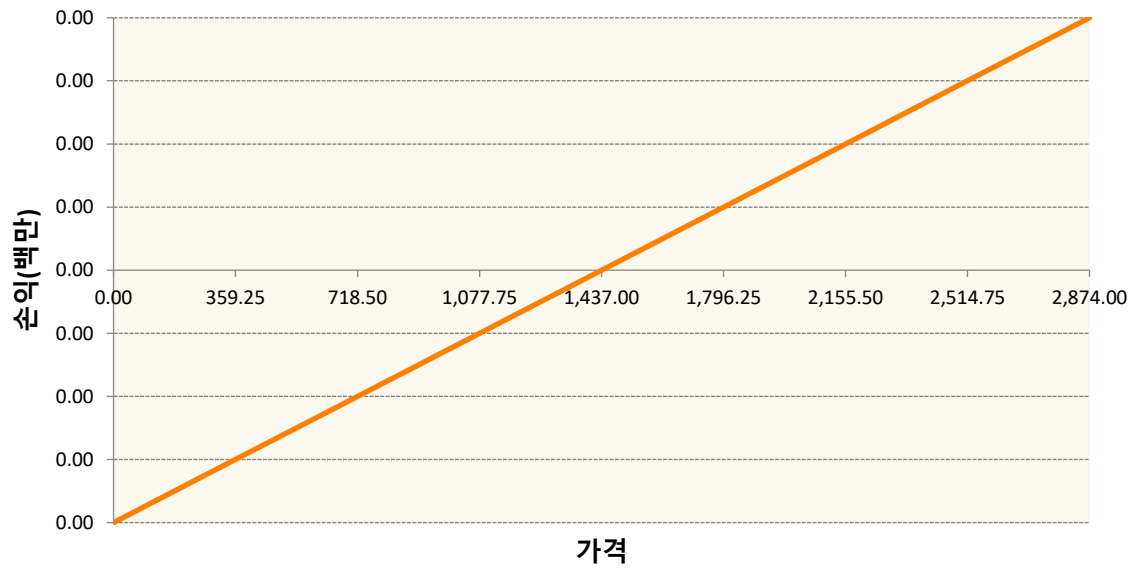
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22



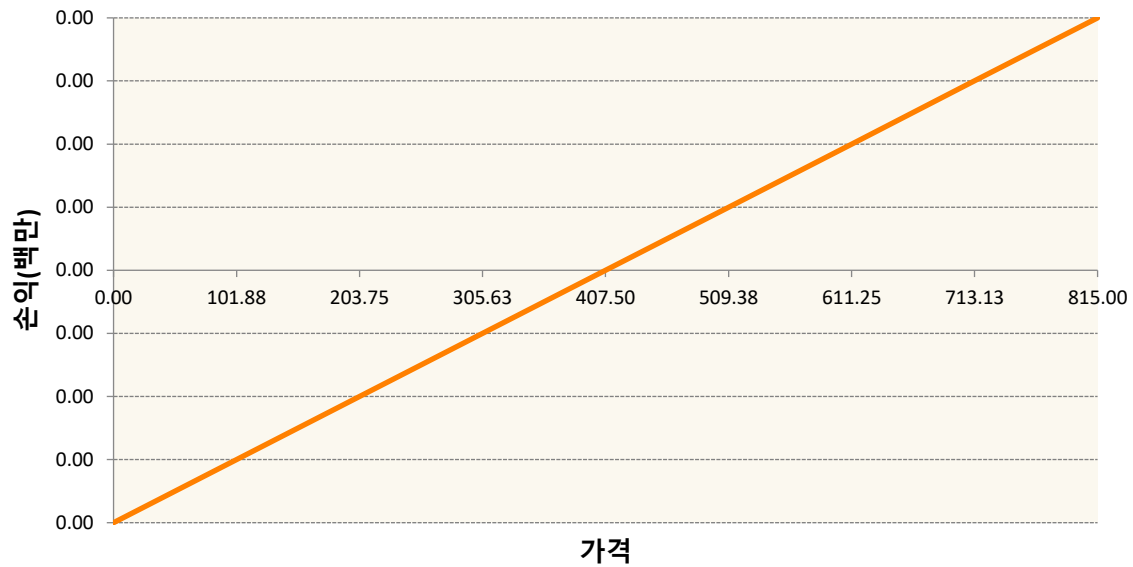
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



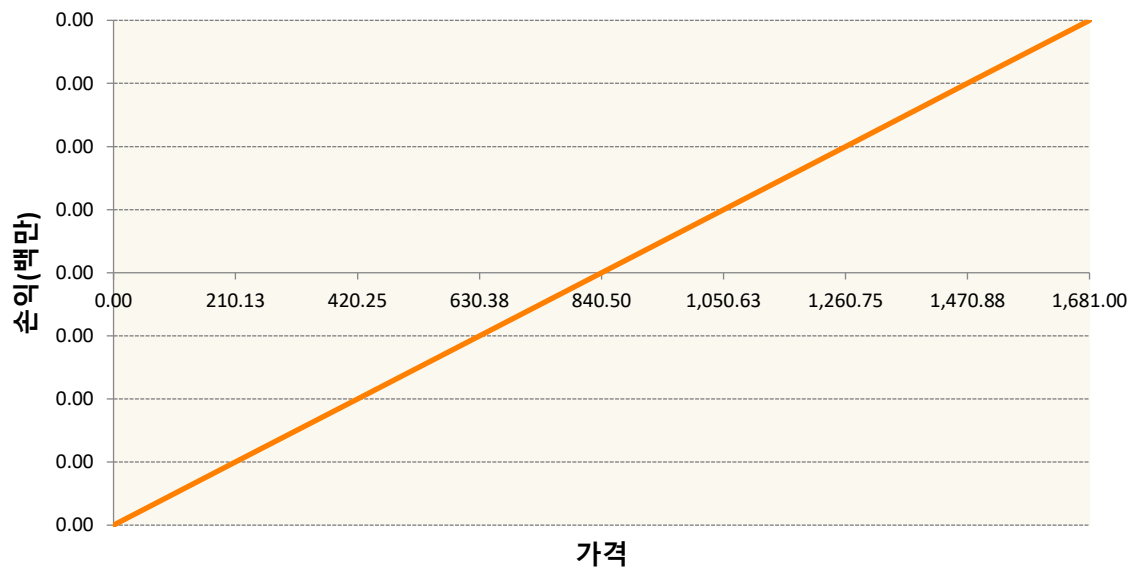
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



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	2022-11-07
기준일	2022-11-04

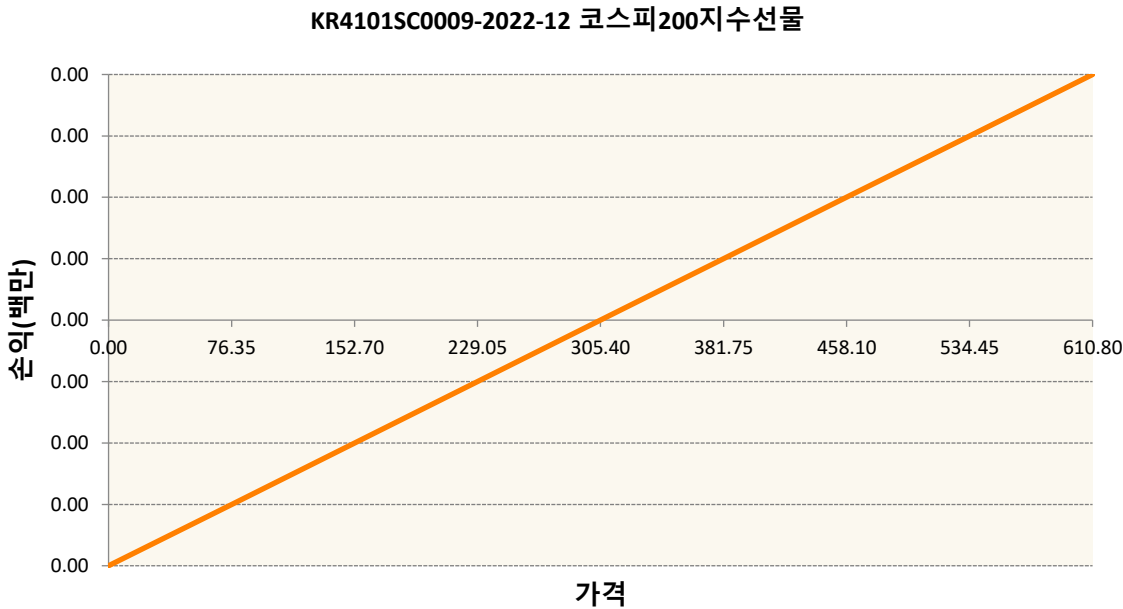
스마트인덱스모

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	1,222	0	1,222	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	2022-11-07
기준일	2022-11-04

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

325

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

444

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

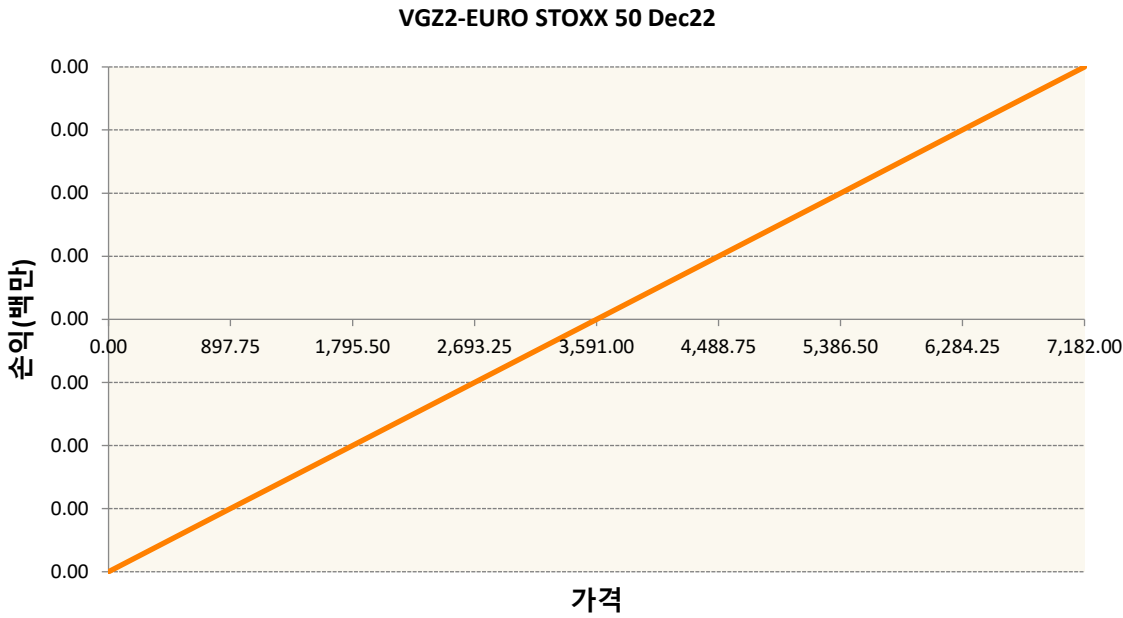
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	449	0	449	

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	2022-11-07
기준일	2022-11-04

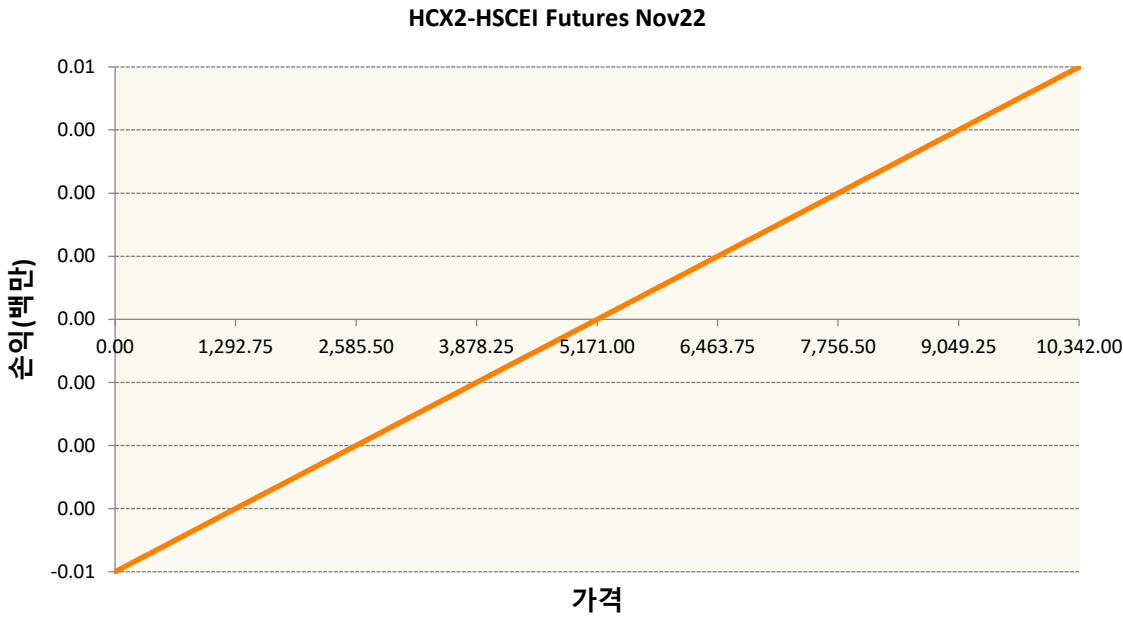
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	890	0	890	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX2	HSCEI Futures Nov22	71
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

112

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

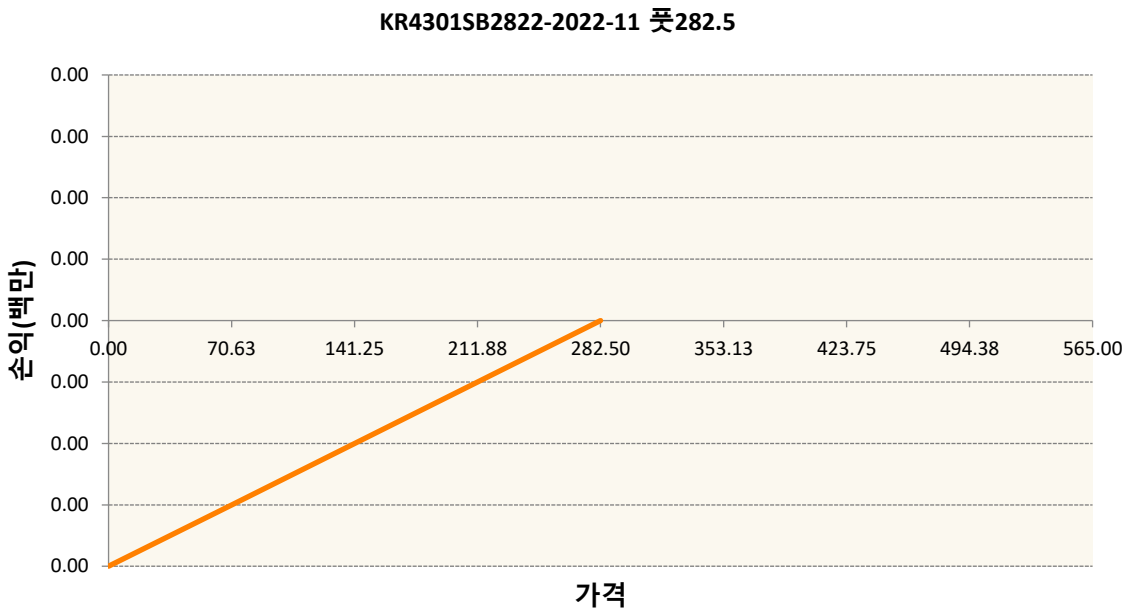
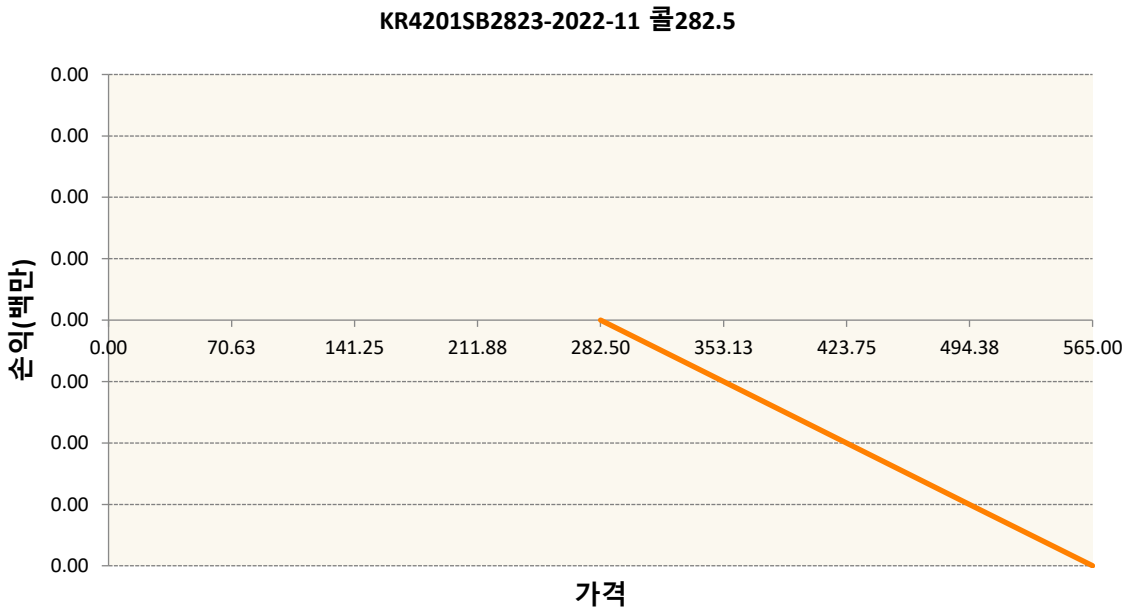
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

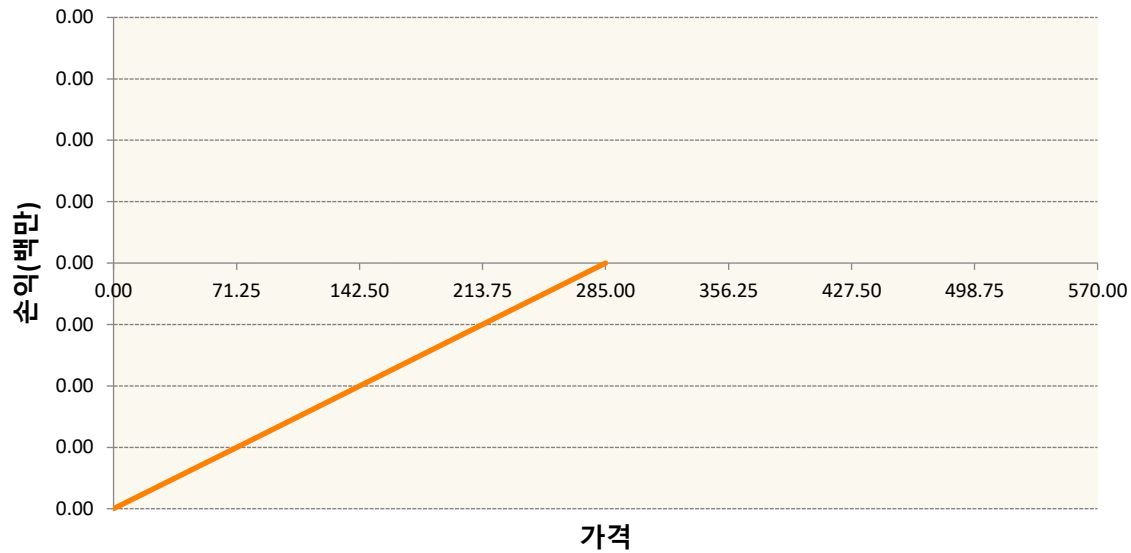
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301SB2855-2022-11 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201SB2823			2022-11 콜282.5				3,622
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,906	2,835	2,764	2,692	2,620	2,548	2,476
-5.33%	2,212	2,146	2,079	2,011	1,943	1,873	1,803
-2.67%	1,216	1,178	1,135	1,089	1,038	985	929
0%	57	43	24	0	-29	-61	-98
2.67%	-1,157	-1,161	-1,167	-1,176	-1,189	-1,206	-1,226
5.33%	-2,384	-2,385	-2,386	-2,389	-2,394	-2,401	-2,411
8.00%	-3,613	-3,613	-3,613	-3,614	-3,616	-3,618	-3,622
KR4301SB2822			2022-11 풋282.5				200
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-141	-152	-164	-176	-188	-200
-5.33%	-41	-51	-63	-74	-85	-97	-108
-2.67%	-2	-8	-15	-23	-31	-40	-49
0%	9	7	4	0	-5	-10	-16
2.67%	12	11	10	9	7	4	0
5.33%	12	12	12	11	11	9	8
8.00%	12	12	12	12	12	11	11
KR4301SB2855			2022-11 풋285				46
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-35	-37	-39	-42	-44	-46
-5.33%	-11	-14	-16	-19	-21	-23	-26
-2.67%	-1	-3	-4	-6	-8	-10	-12
0%	3	2	1	0	-1	-2	-4

2.67%	3	3	3	2	2	1	0
5.33%	4	4	3	3	3	3	2
8.00%	4	4	4	4	3	3	3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,932

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

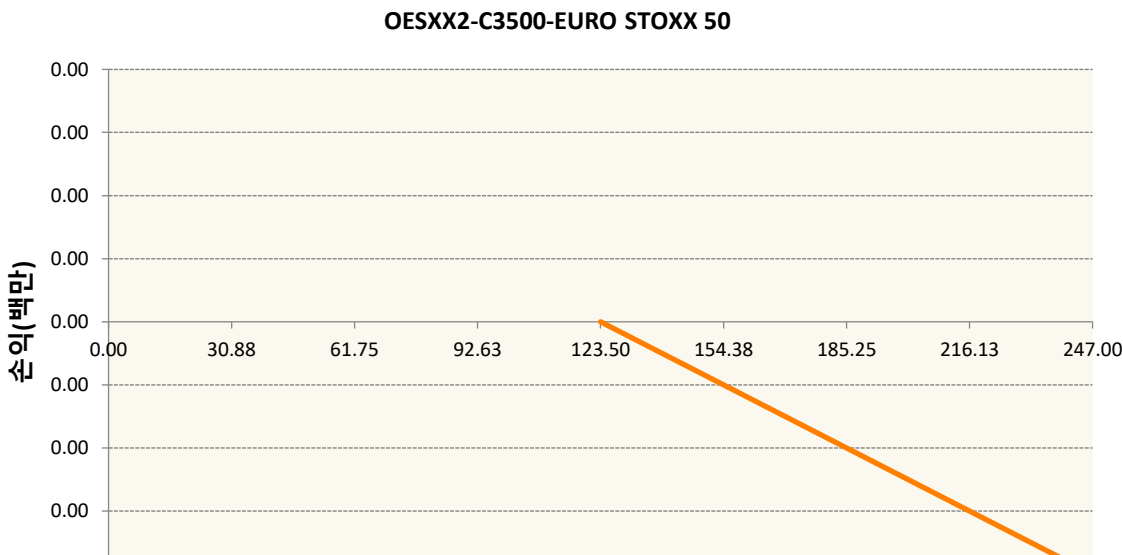
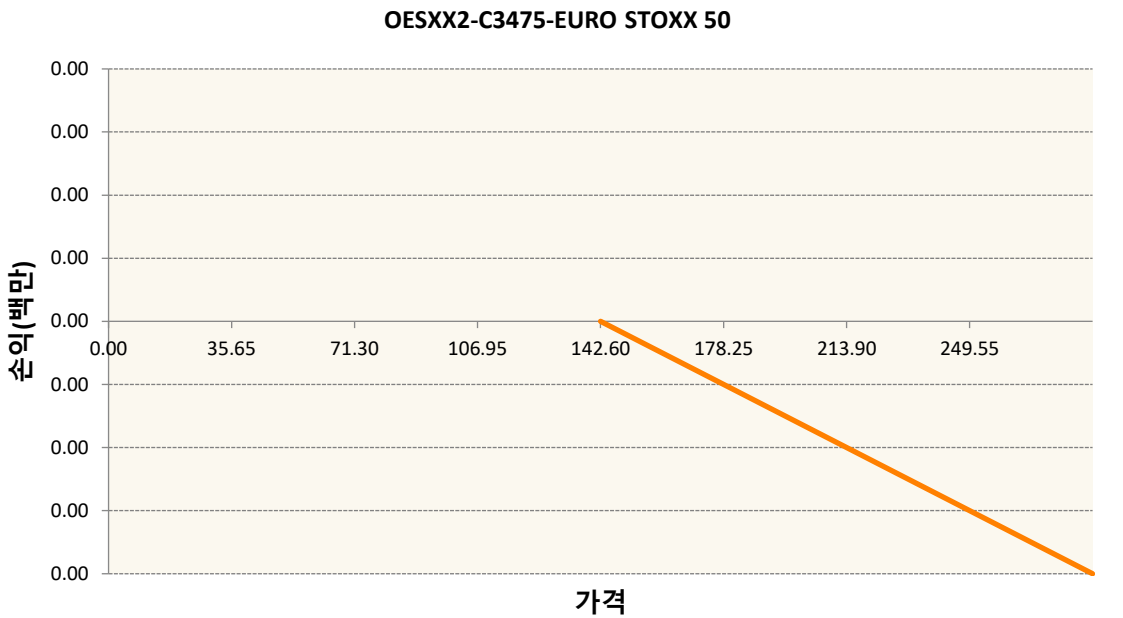
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

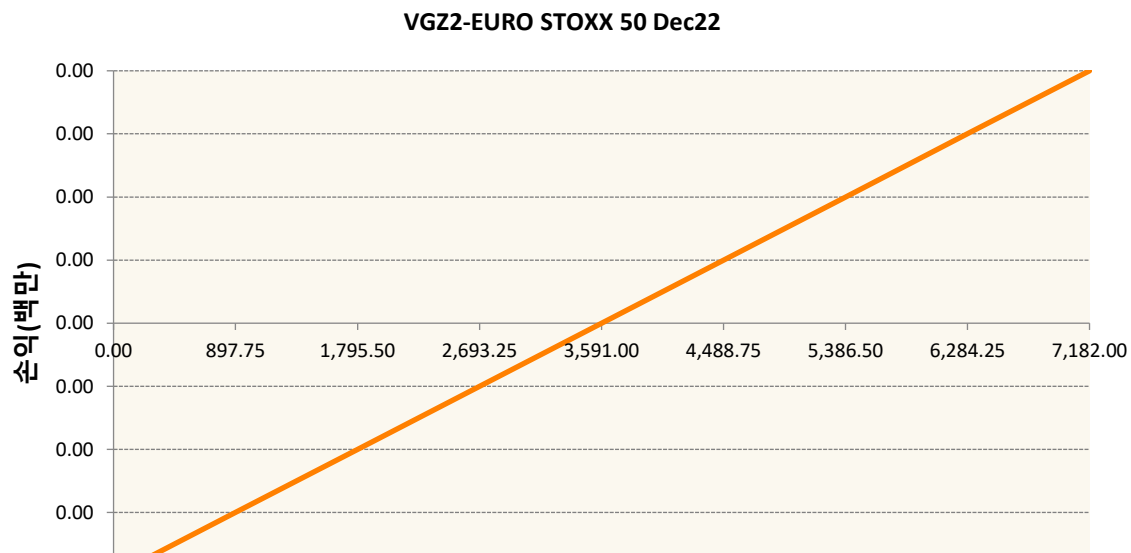
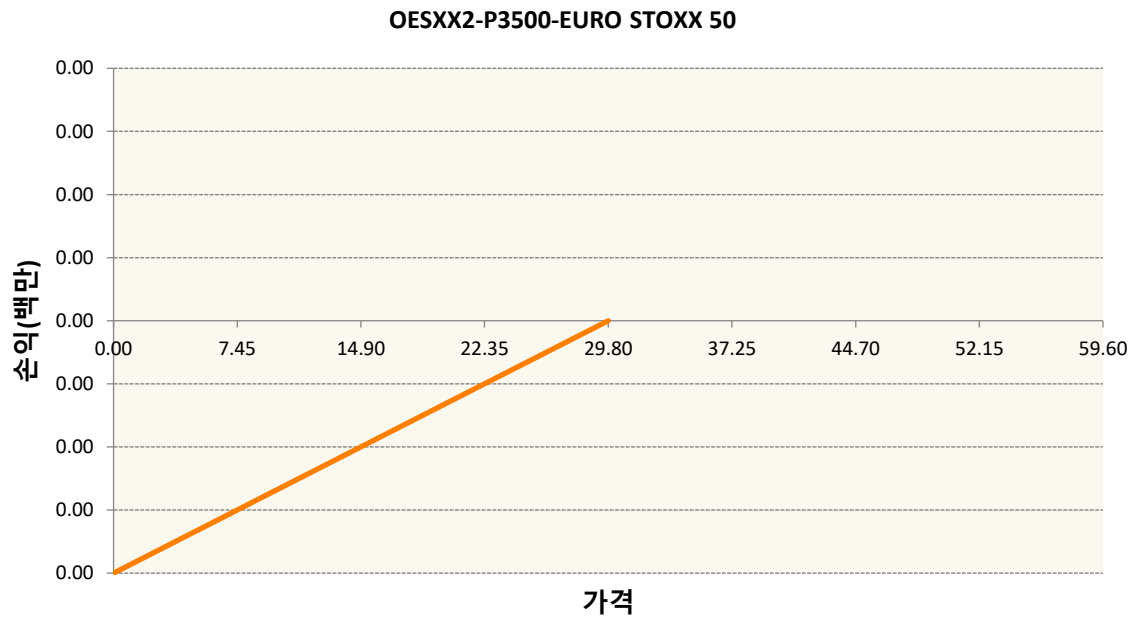
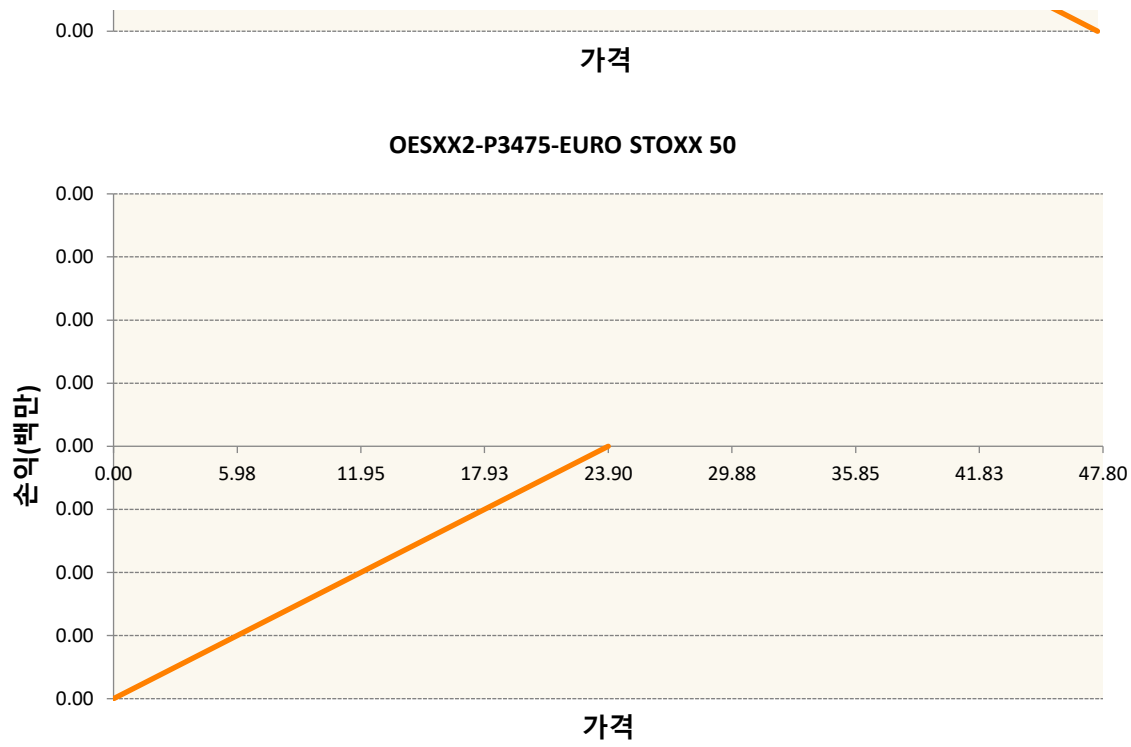
1. 계약금액

(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	1,209	0	1,209	
누계	유가증권	옵션	0	116	-116	장내
누계	통화	선도	0	2,291	-2,291	장외

2. 만기시점의 손익구조





0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E	72
FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E	56
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E	56
OESXX2-C34 EURO STOXX 50	7
OESXX2-C35 EURO STOXX 50	1
OESXX2-P34 EURO STOXX 50	1
OESXX2-P35 EURO STOXX 50	0.1
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	97

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

(단위:백만원)

238

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

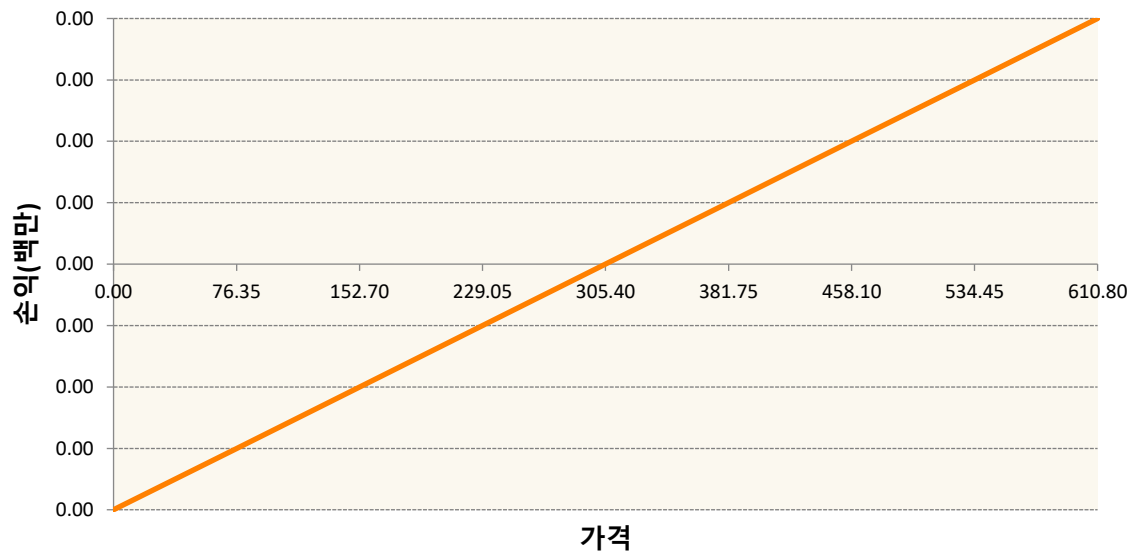
1. 계약금액

(단위:백만원)

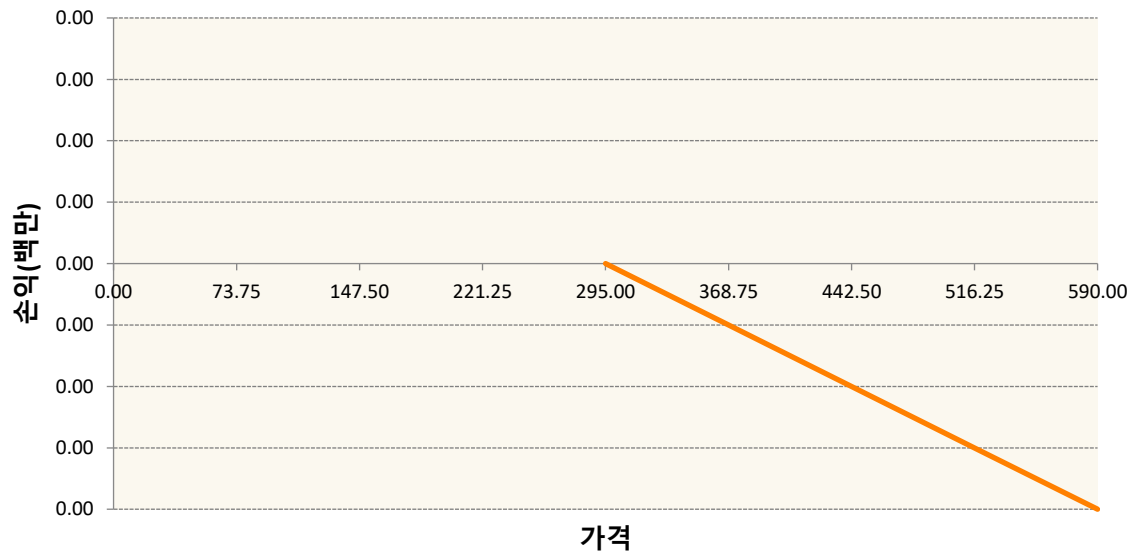
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	382	0	382	장내
누계	유가증권	옵션	353	3,708	-3,355	장내

2. 만기시점의 손익구조

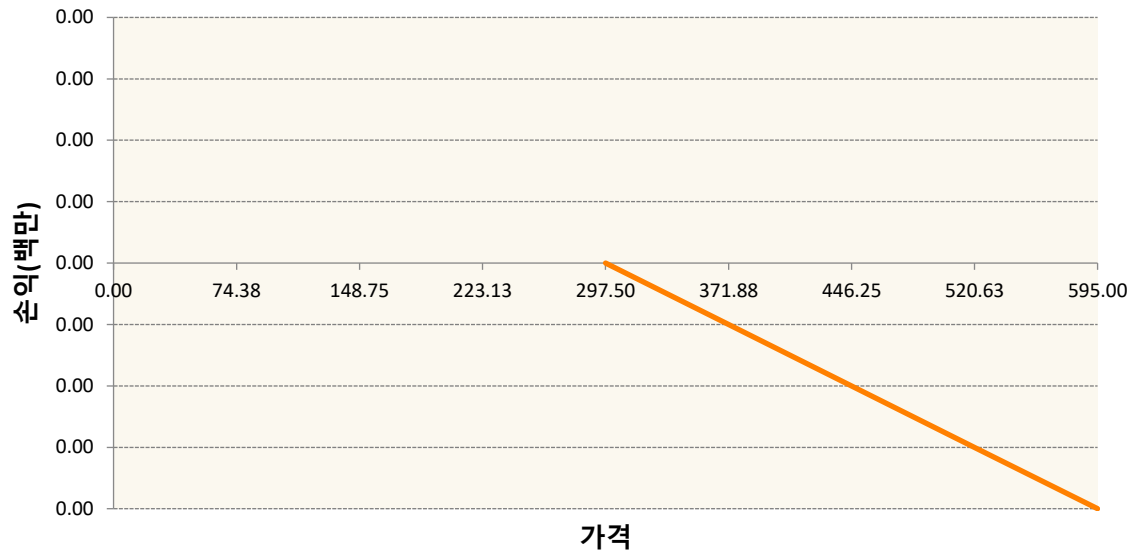
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



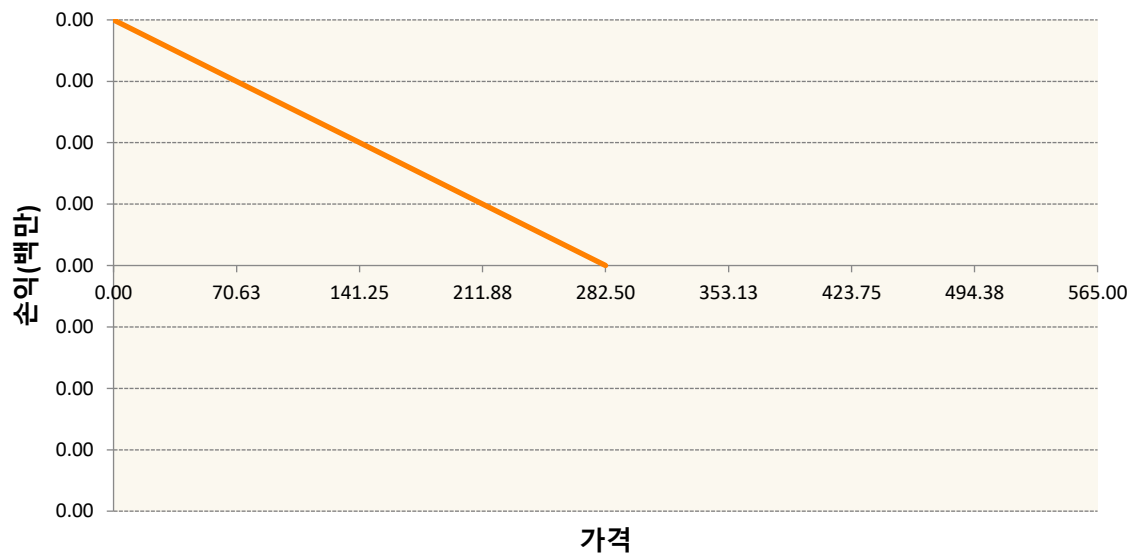
KR4201SB2955-2022-11 콜295



KR4201SB2971-2022-11 콜297.5



KR4301SB2822-2022-11 ㄱ282.5



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	
KR4201SB2955				2022-11 콜295				94
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	49	48	47	46	44	43	42
-5.33%	43	41	39	37	35	33	32
-2.67%	29	27	24	22	20	18	16
0%	5	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-25	-26	-27	-28	-29	-31	-32
5.33%	-58	-59	-59	-60	-60	-61	-62
8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-94	-94
KR4201SB2971 2022-11 콜297.5							178

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	82	81	79	77	75	73	70
-5.33%	74	71	67	64	61	57	54
-2.67%	52	47	43	39	35	31	26
0%	11	8	4	0	-4	-8	-12
2.67%	-44	-46	-49	-51	-54	-57	-60
5.33%	-107	-108	-109	-111	-112	-114	-116
8.00%	-174	-174	-174	-175	-176	-177	-178

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

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

(단위:백만원)

326

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	7,027	0	7,027	

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	2022-11-07
기준일	2022-11-04

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	6,170	0	6,170	

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	2022-11-07
기준일	2022-11-04

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	19,436	0	19,436	
누계	통화	선도	0	18,911	-18,911	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E	635
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	528
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	2022-11-07
기준일	2022-11-04

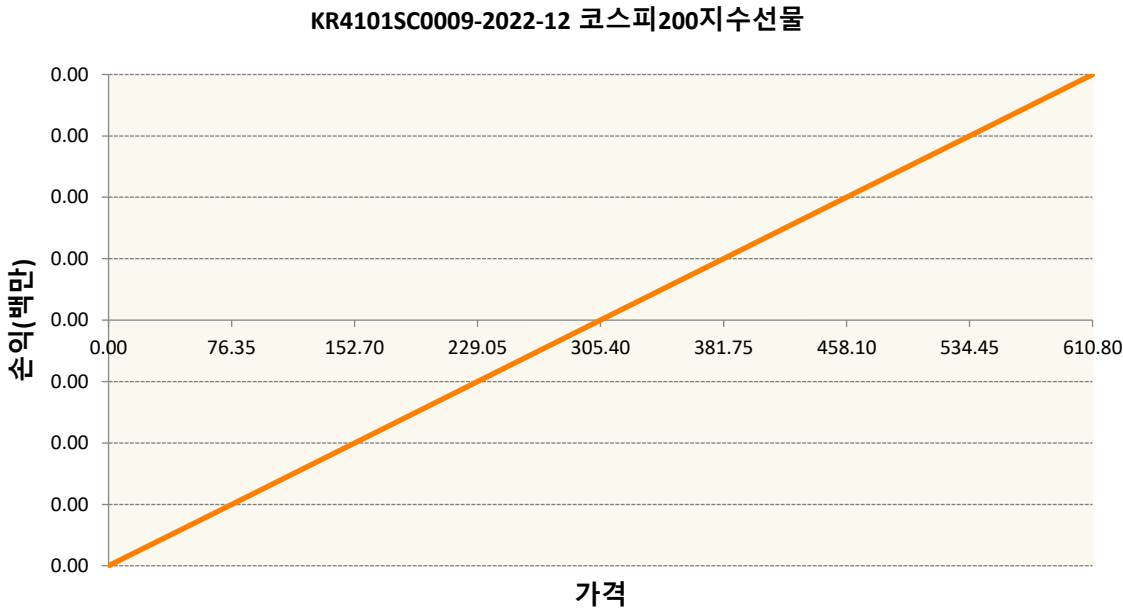
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	382	0	382	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 2022-11-07

기준일 2022-11-04

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

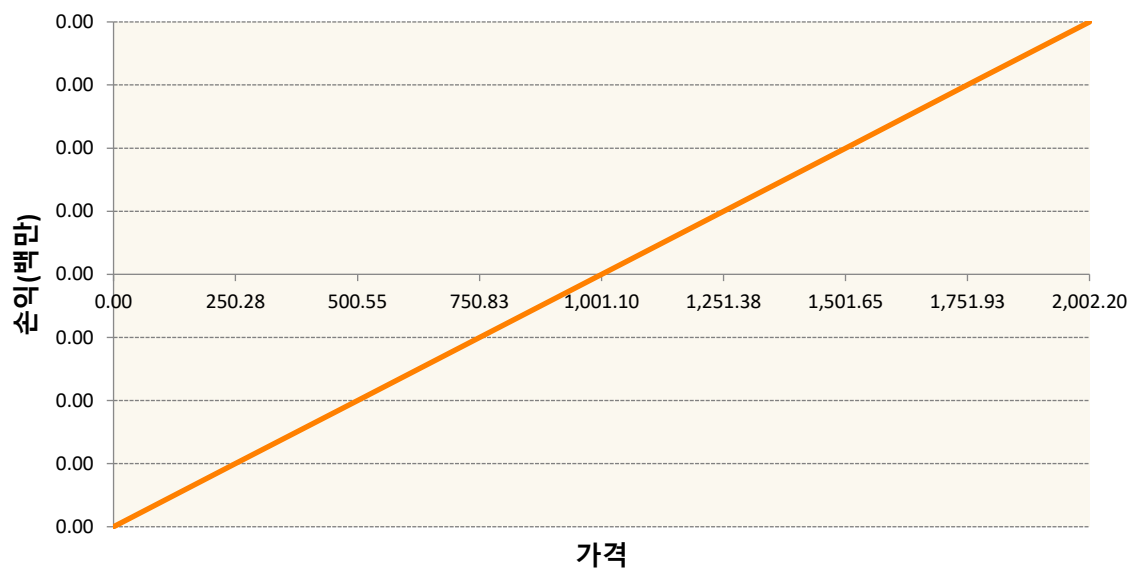
1. 계약금액

(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	163	0	163	
누계	유가증권	스왑	1,322	0	1,322	장외
누계	통화	선도	625	847	-222	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCX2-VN30 Index Future NOV22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	106
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
13

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

(단위:백만원)

213

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

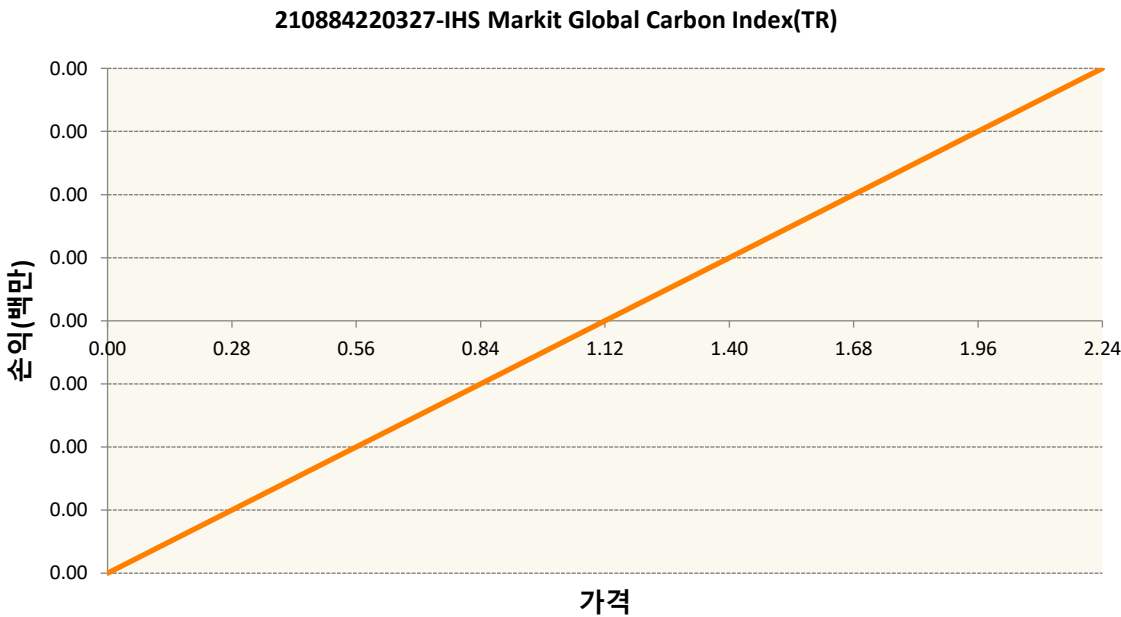
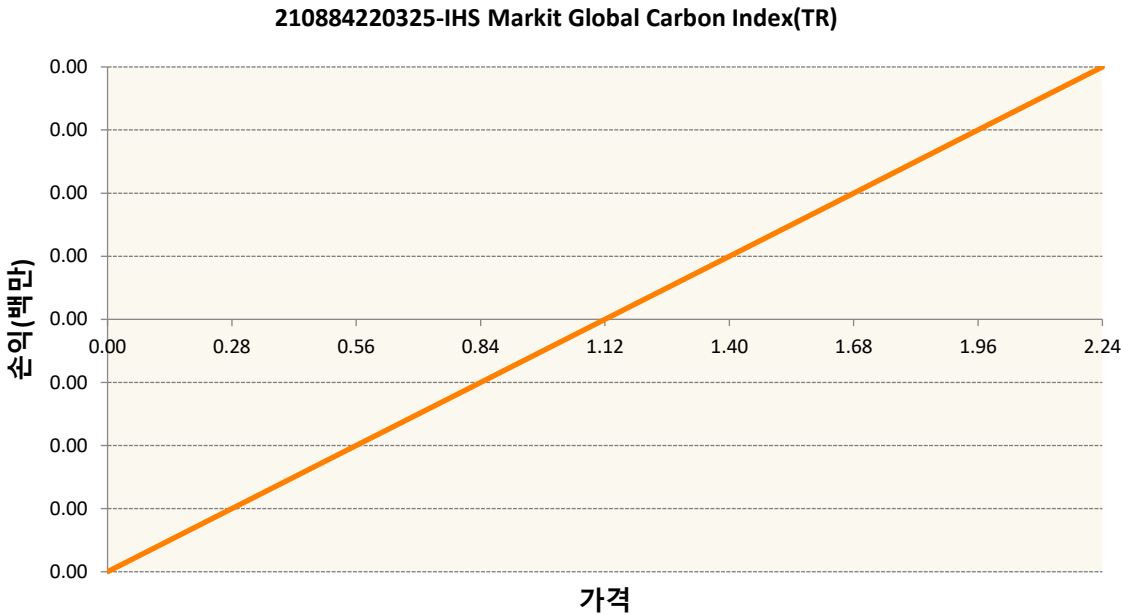
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

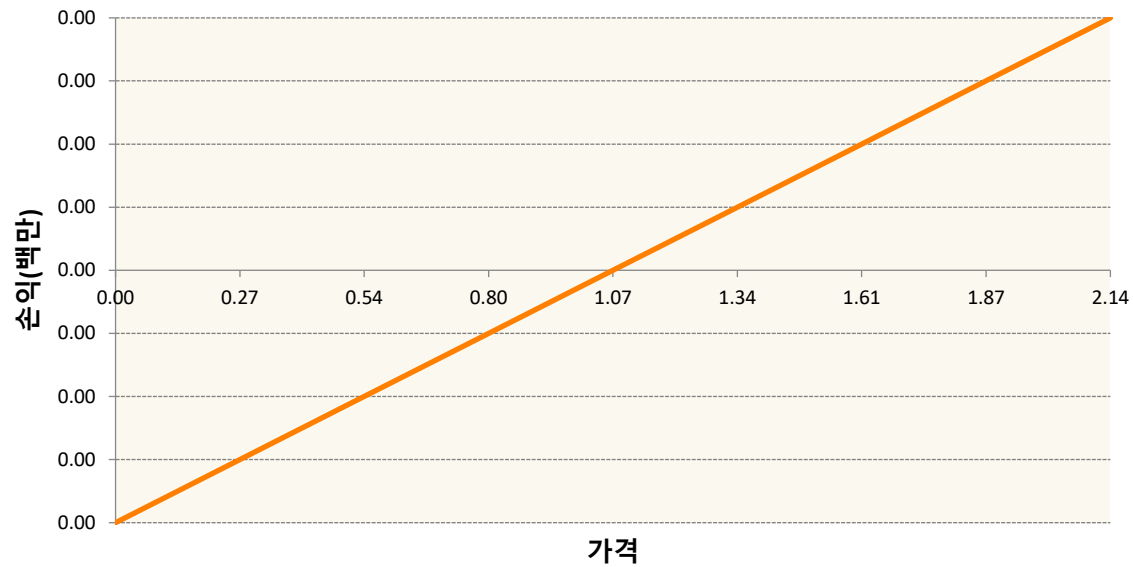
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	30,155	0	30,155	

2. 만기시점의 손익구조



210884221024-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

193

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

97

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

2,122

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

(단위:백만원)

4,635

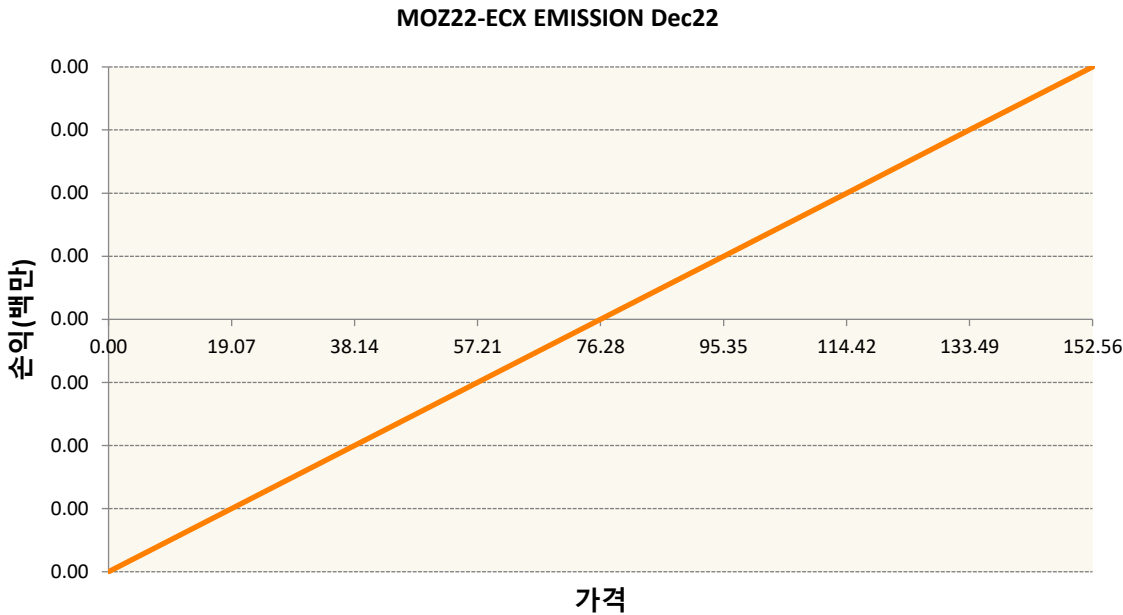
공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

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	13,749	0	13,749	
누계	통화	선도	0	4,594	-4,594	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213CAT(KRW/EUR 23-11-22E			367
MOZ22	ECX EMISSION Dec22		1,100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,085

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

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)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	1

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

(단위:백만원)

7

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

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)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	25

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

(단위:백만원)

107

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

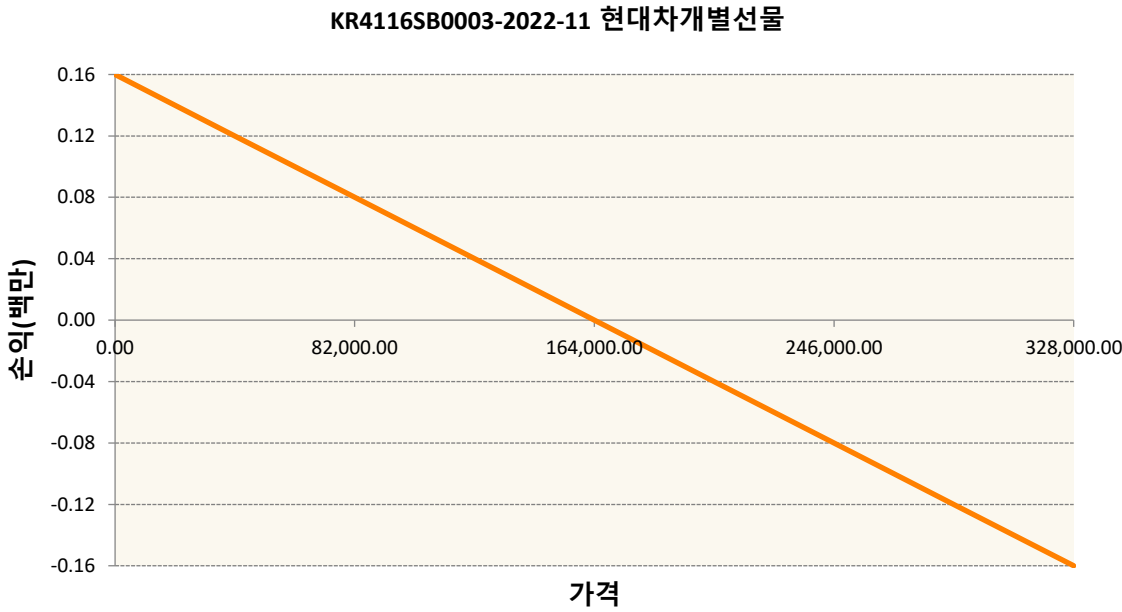
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	492	-492	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4116SB00 2022-11 현대차개별선물	39
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	1
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.27

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

(단위:백만원)

63

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

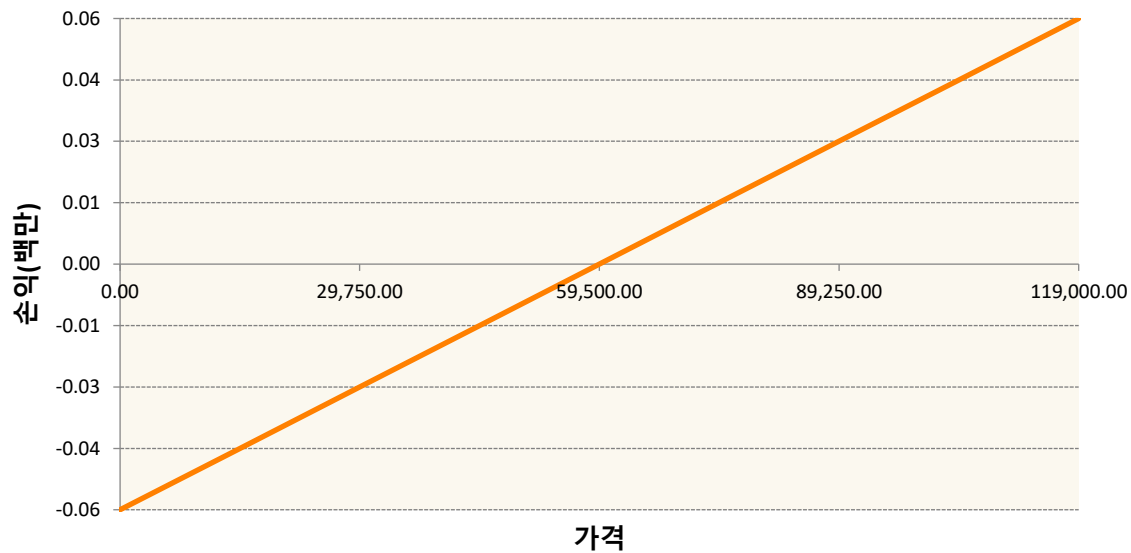
1. 계약금액

(단위:백만원)

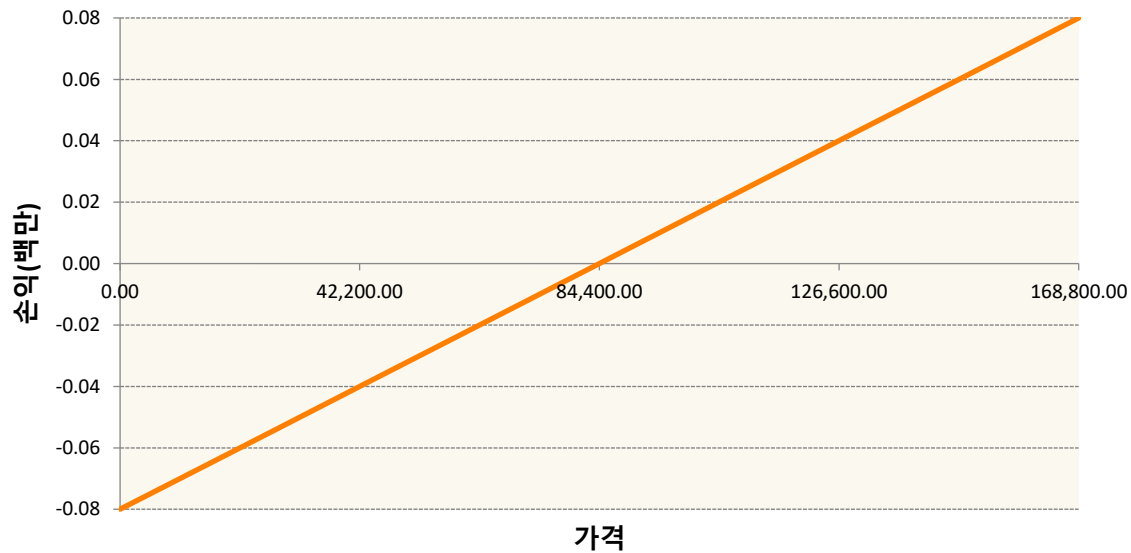
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	642	0	642	장내

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	2022-11-07
기준일	2022-11-04

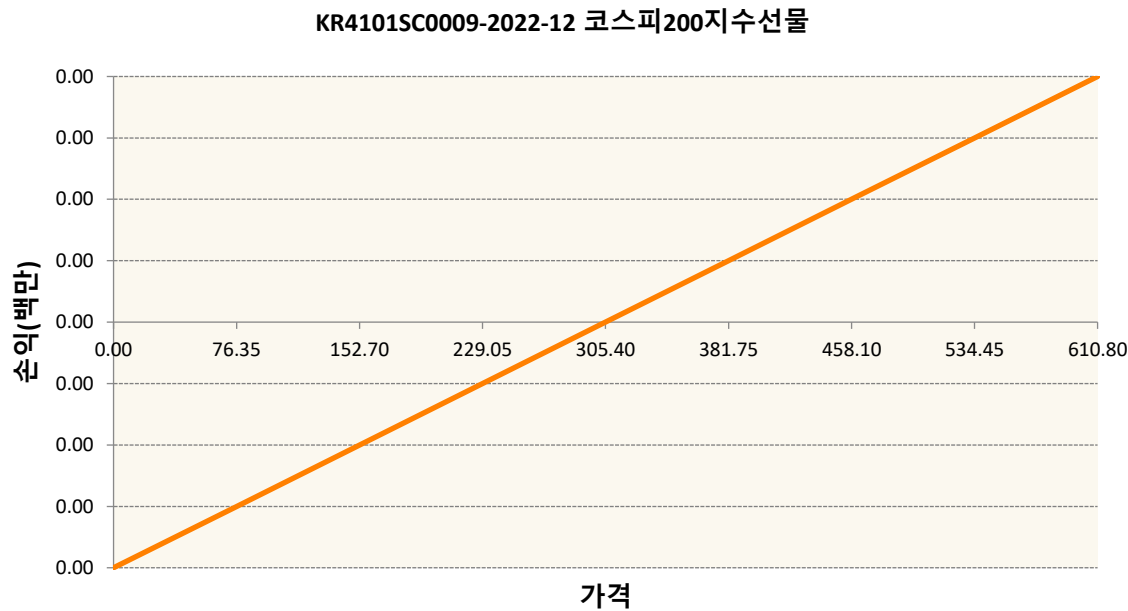
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	382	0	382	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 2022-11-07

기준일 2022-11-04

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

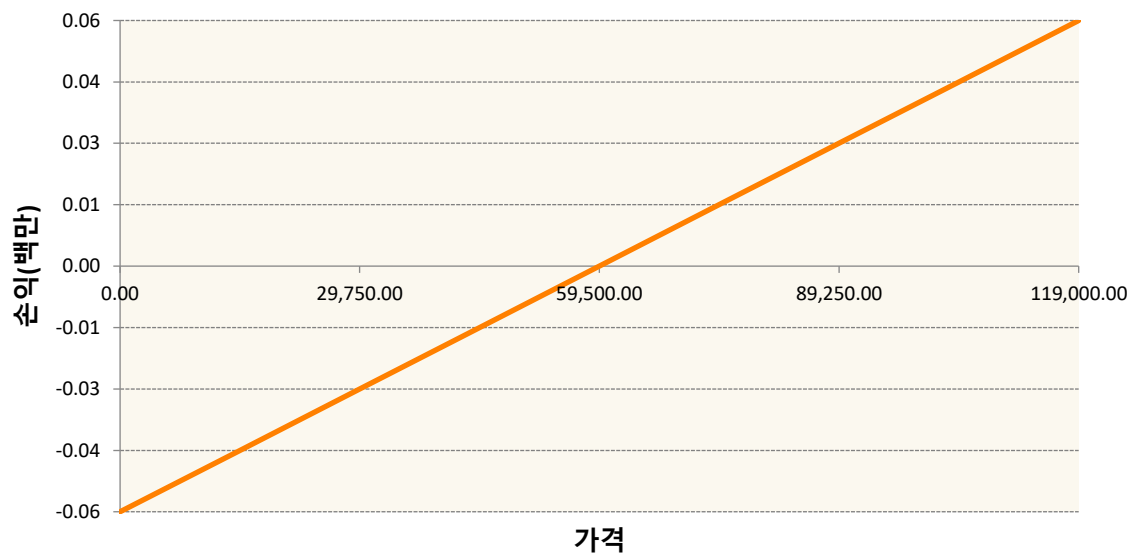
1. 계약금액

(단위:백만원)

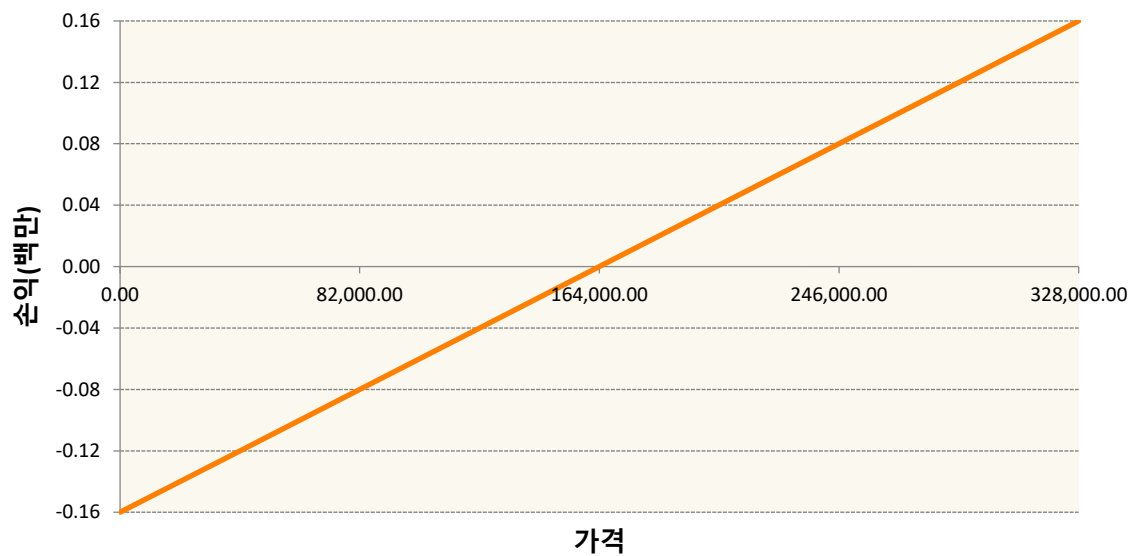
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	236	0	236	장내
누계	유가증권	ELS	65	0	65	장외

2. 만기시점의 손익구조

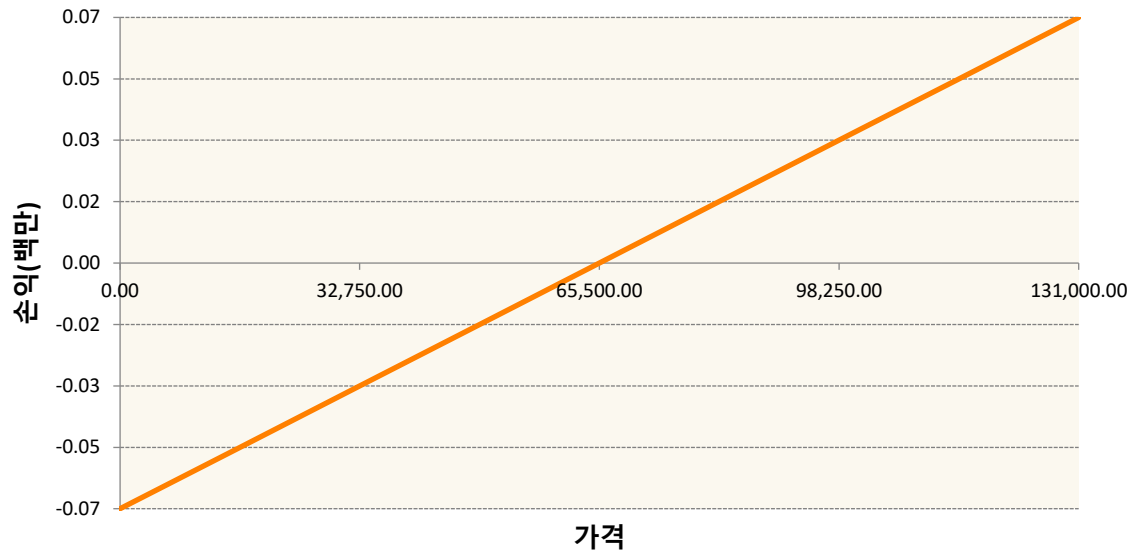
KR4111SB0008-2022-11 삼성전자개별선물



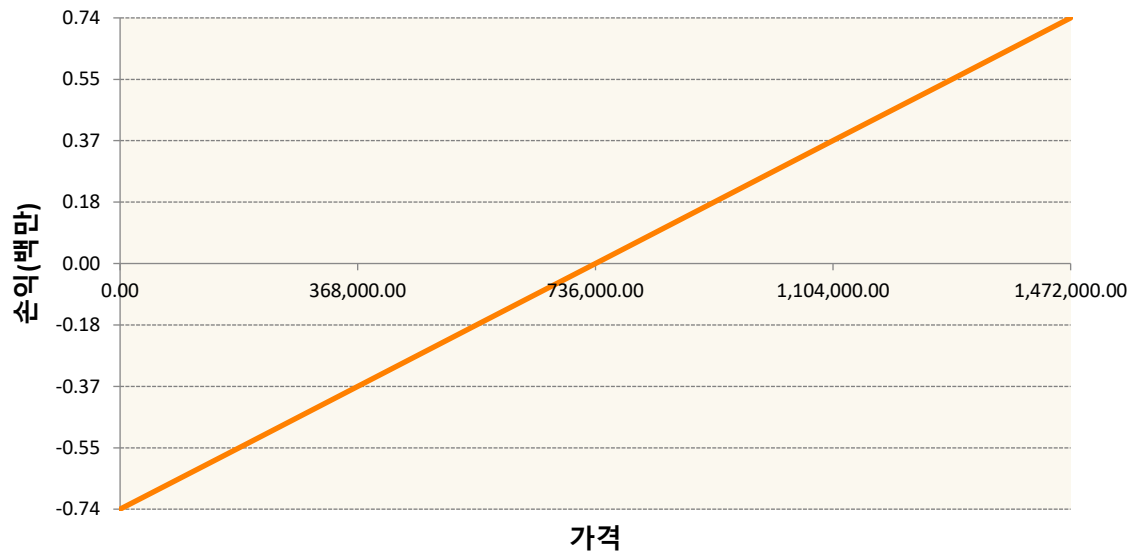
KR4116SB0003-2022-11 현대차개별선물



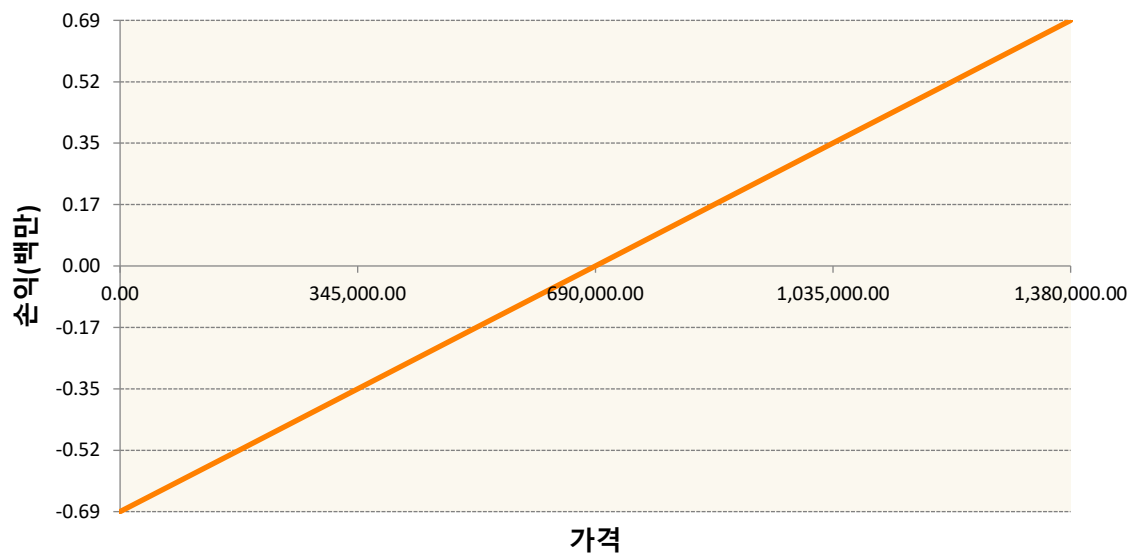
KR4119SB0000-2022-11 기아개별선물



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 2022-11-07

기준일 2022-11-04

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

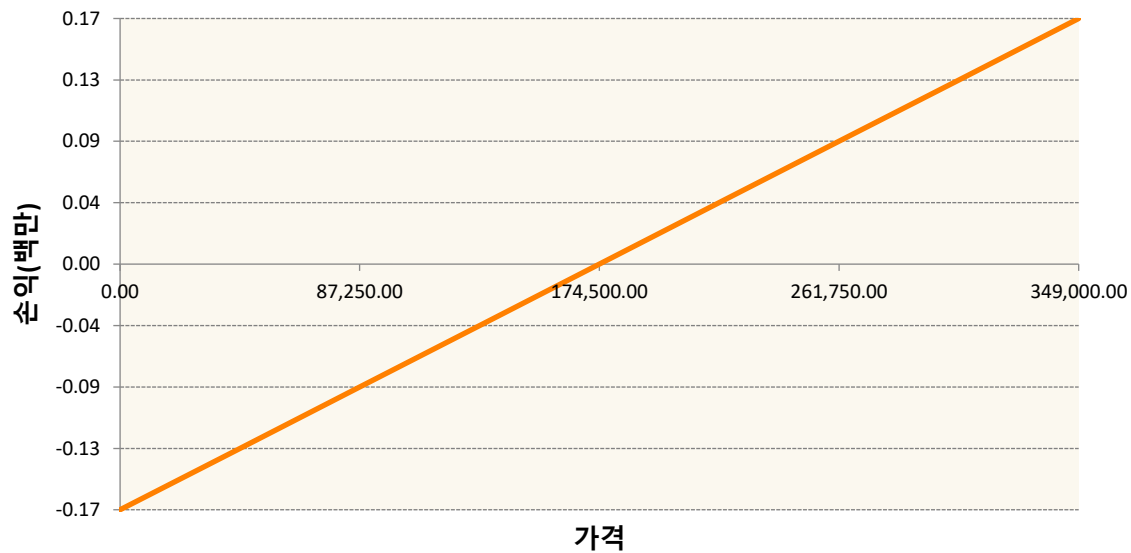
1. 계약금액

(단위:백만원)

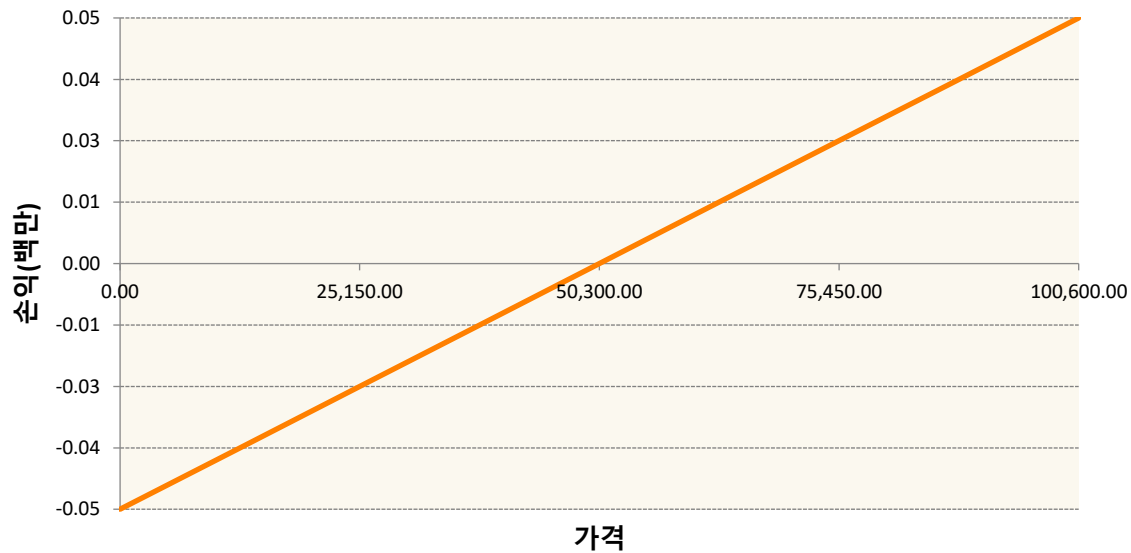
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	106	0	106	장내

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%	-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%	4	4	4	4	4	4	4

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

15

공시일	2022-11-07
기준일	2022-11-04

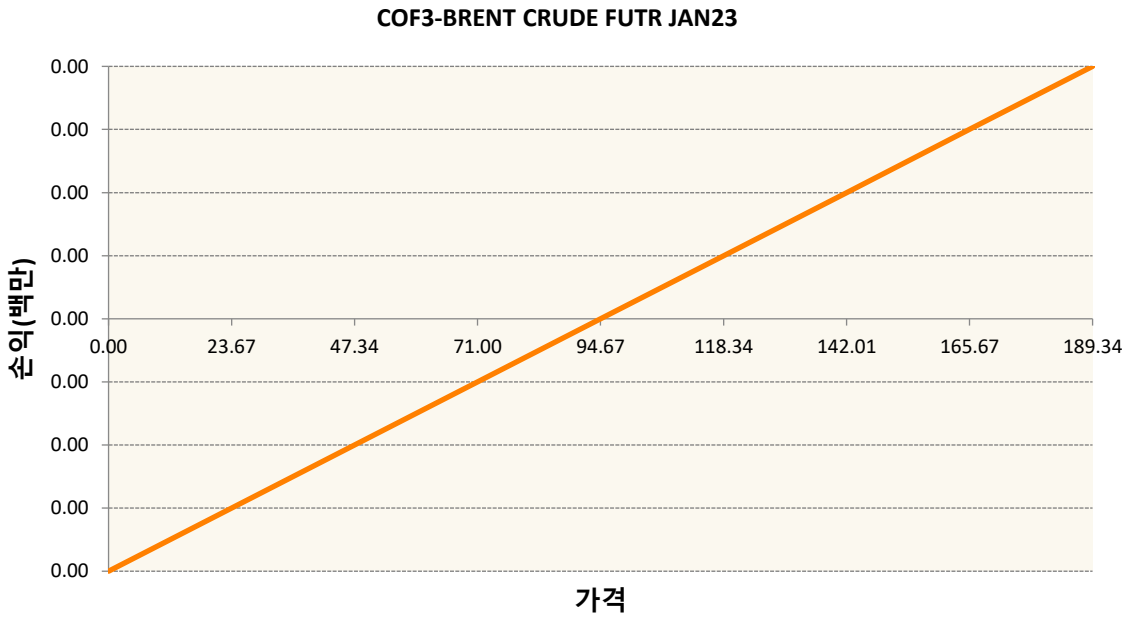
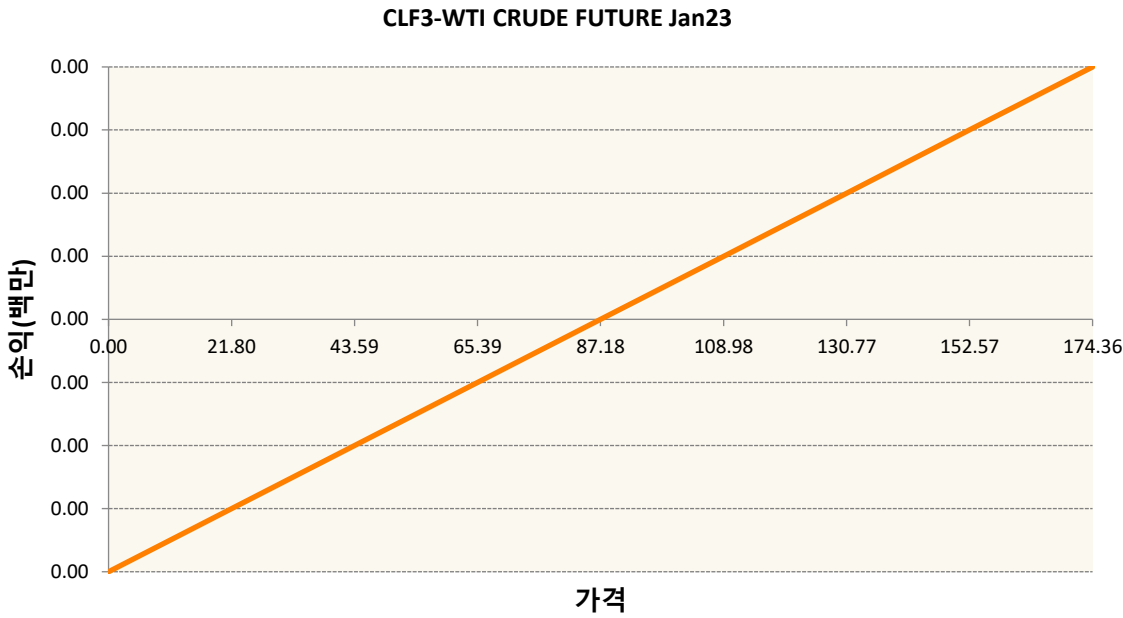
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

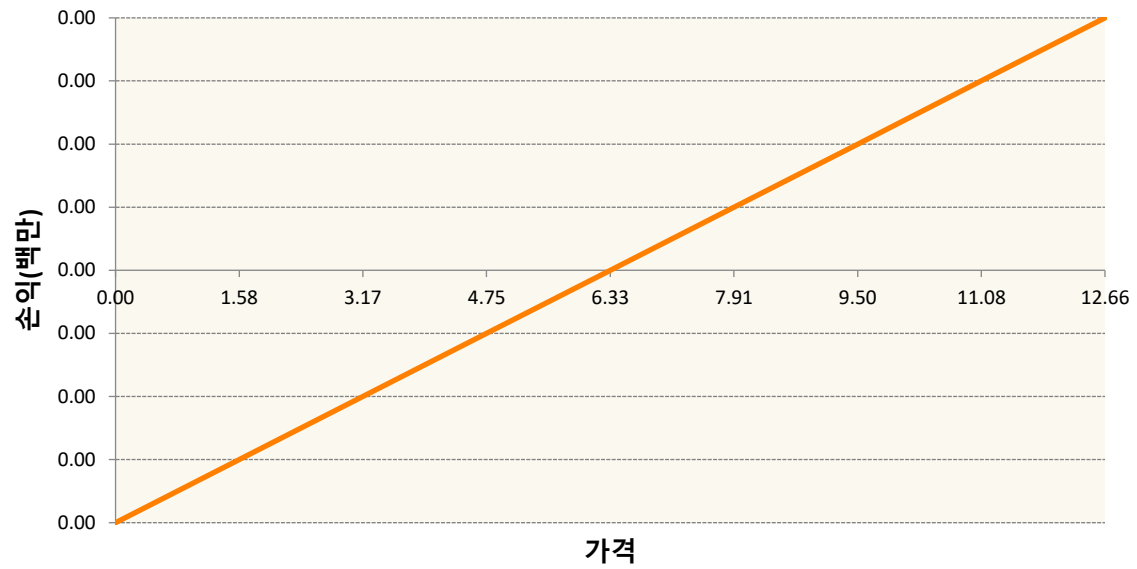
(단위:백만원)

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	1,523	212	1,311	

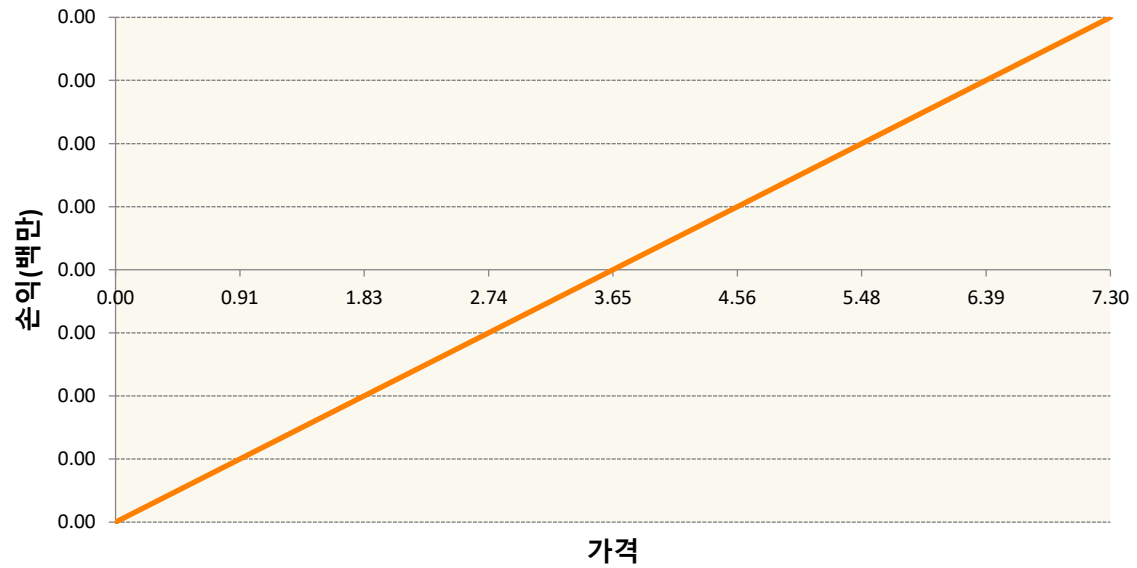
2. 만기시점의 손익구조



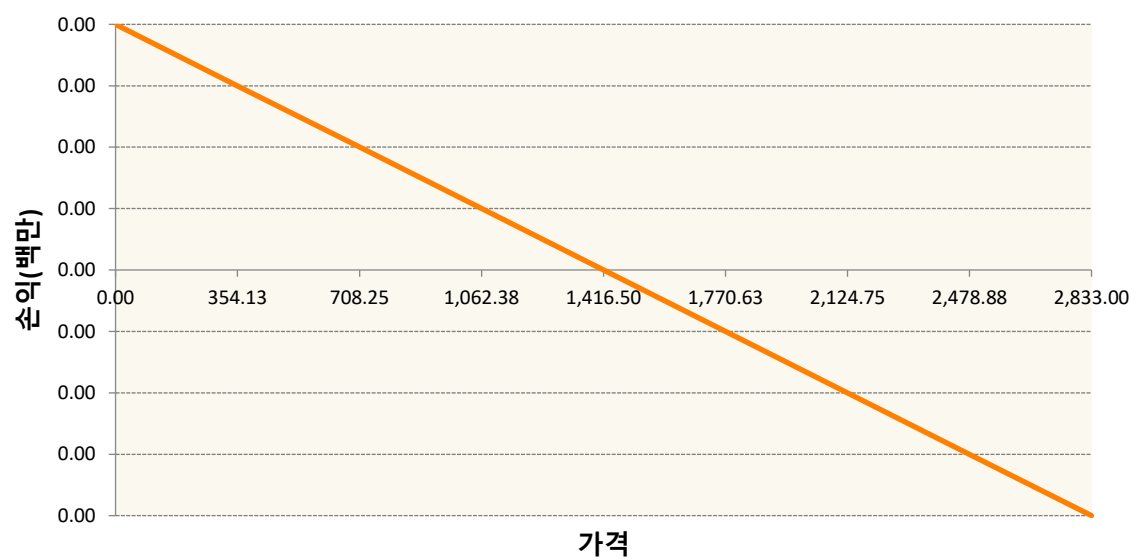
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



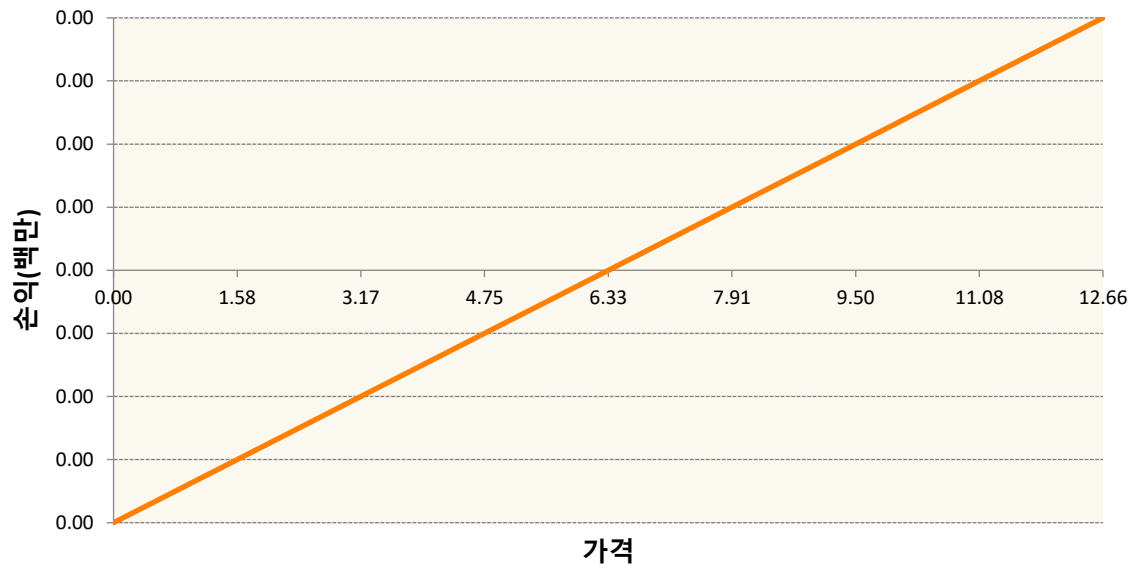
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



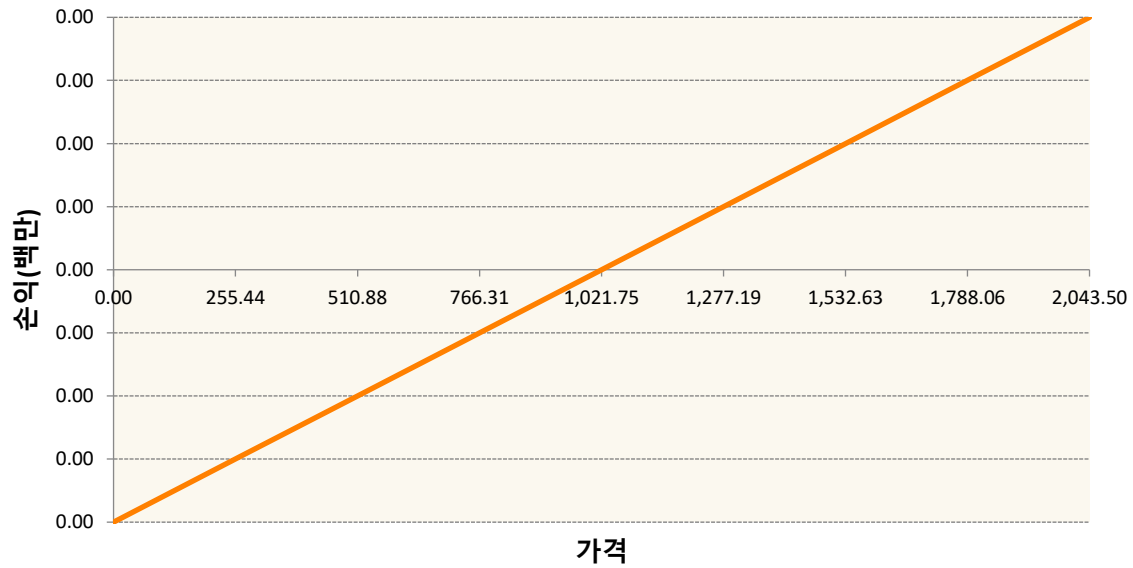
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



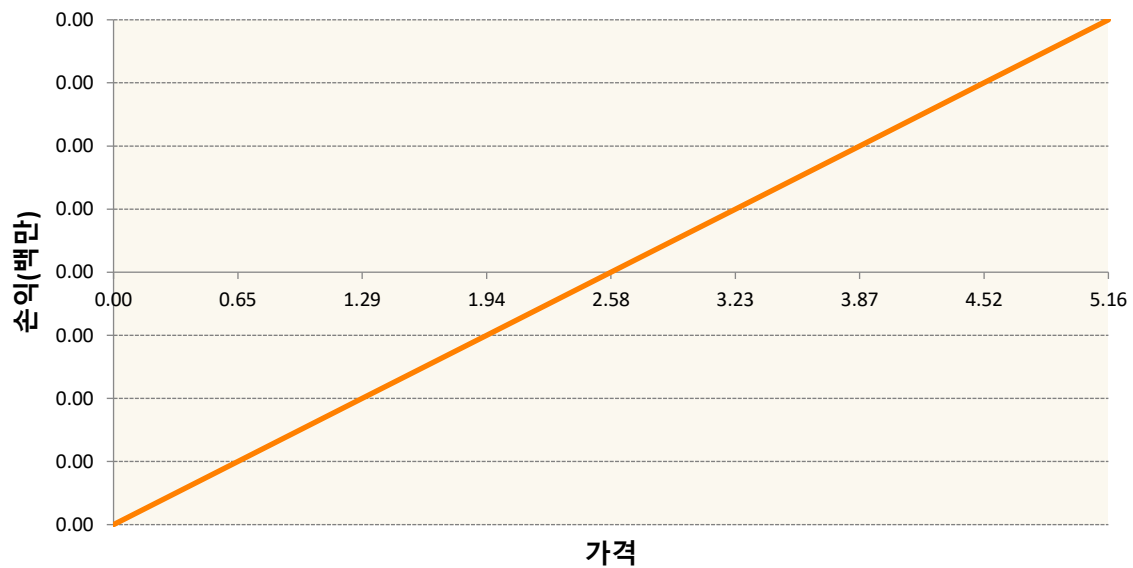
NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



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	43
QSF3	Low Su Gasoil G Jan23	12
XBF3	GASOLINE RBOB FUT Jan23	12

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

465