

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

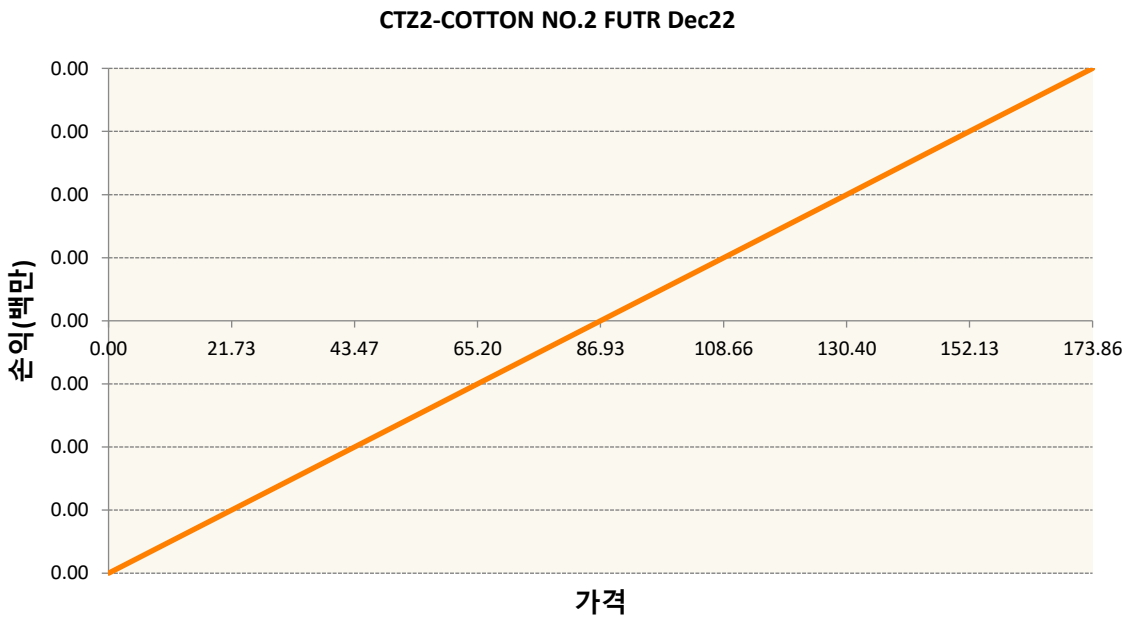
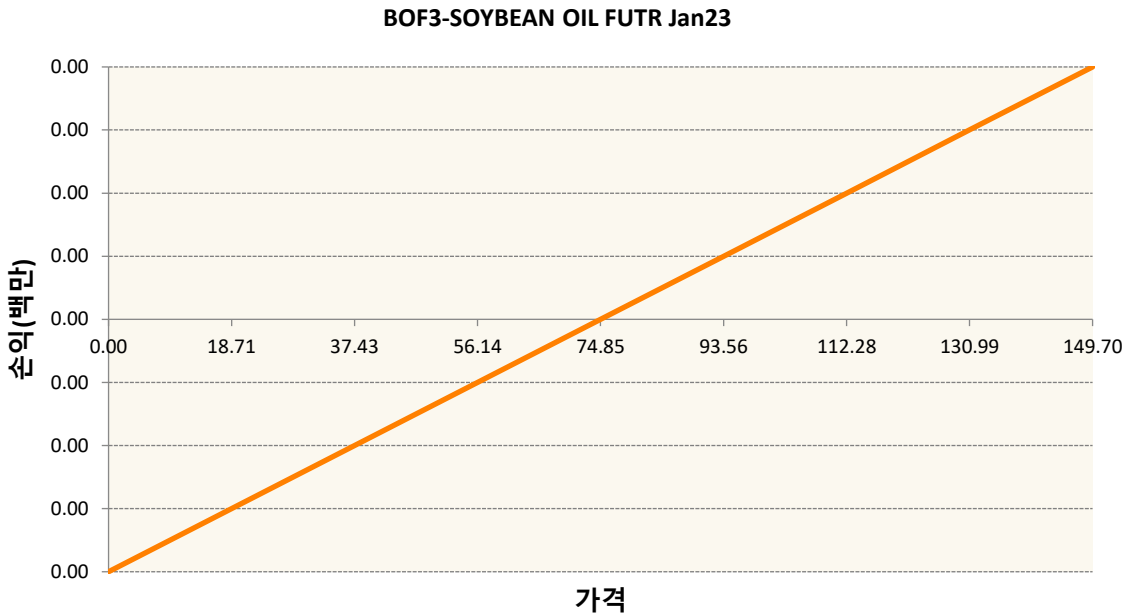
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

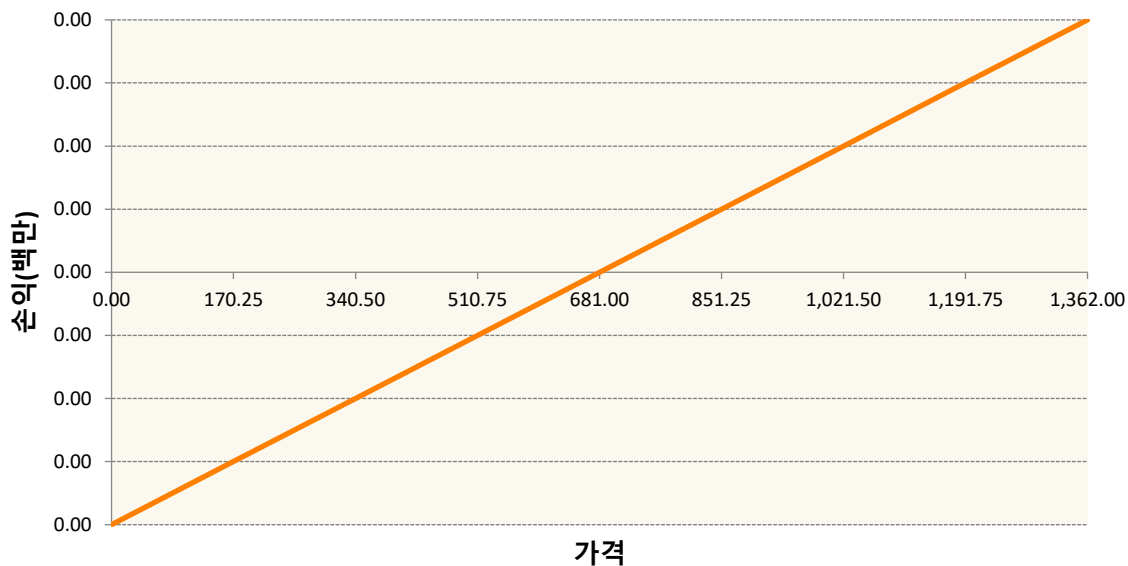
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,748	841	5,906	

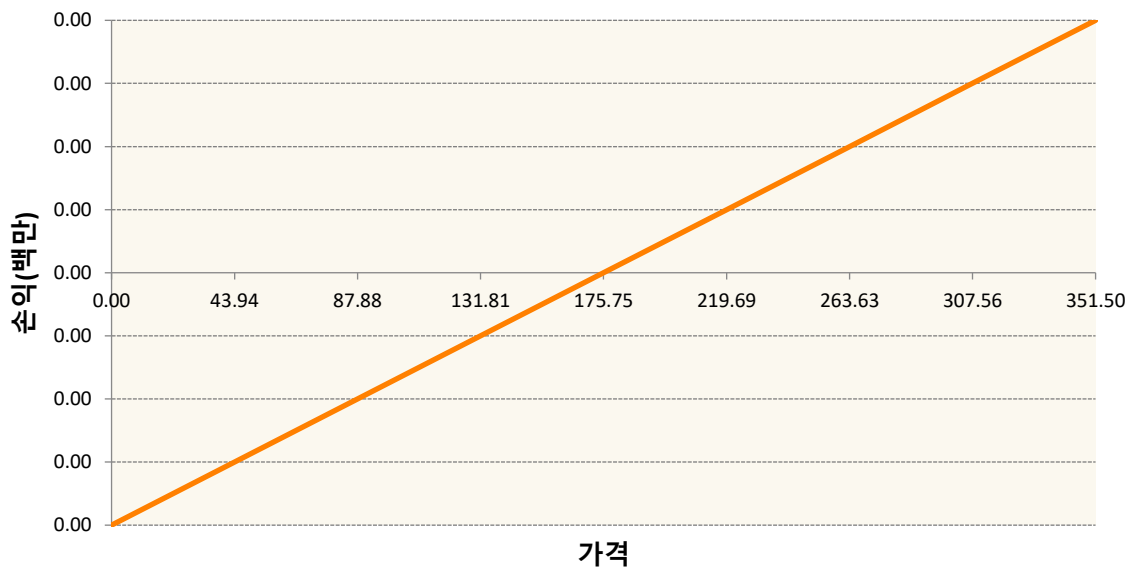
2. 만기시점의 손익구조



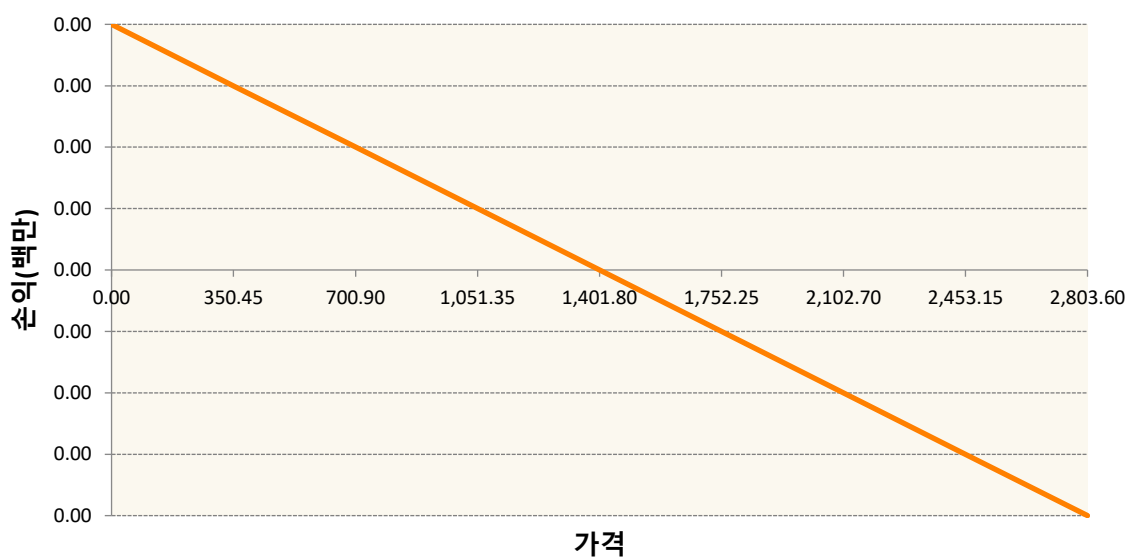
CZ2-CORN FUTURE Dec22



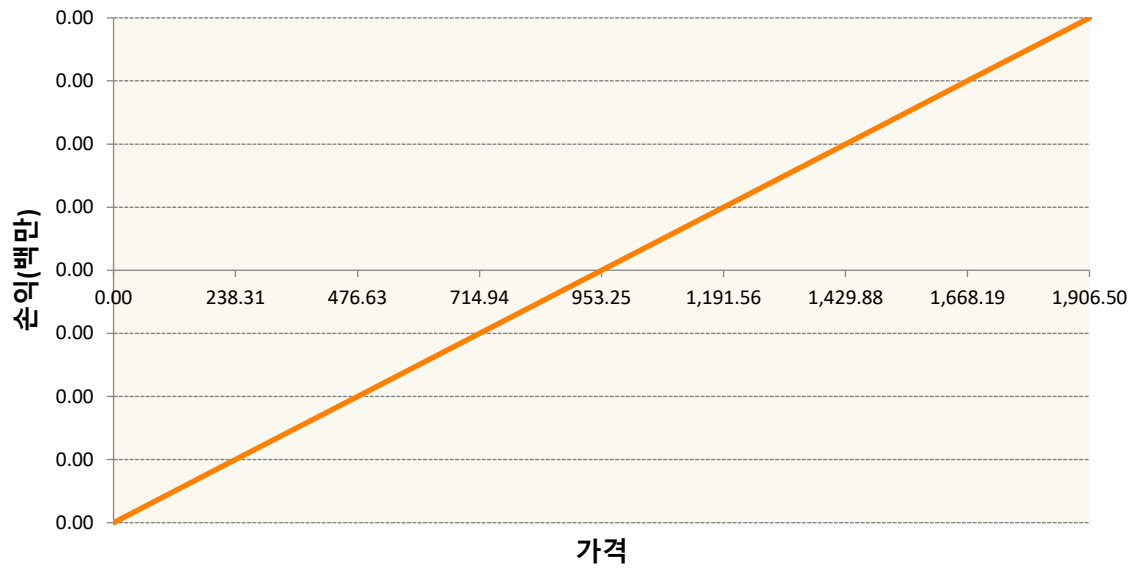
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



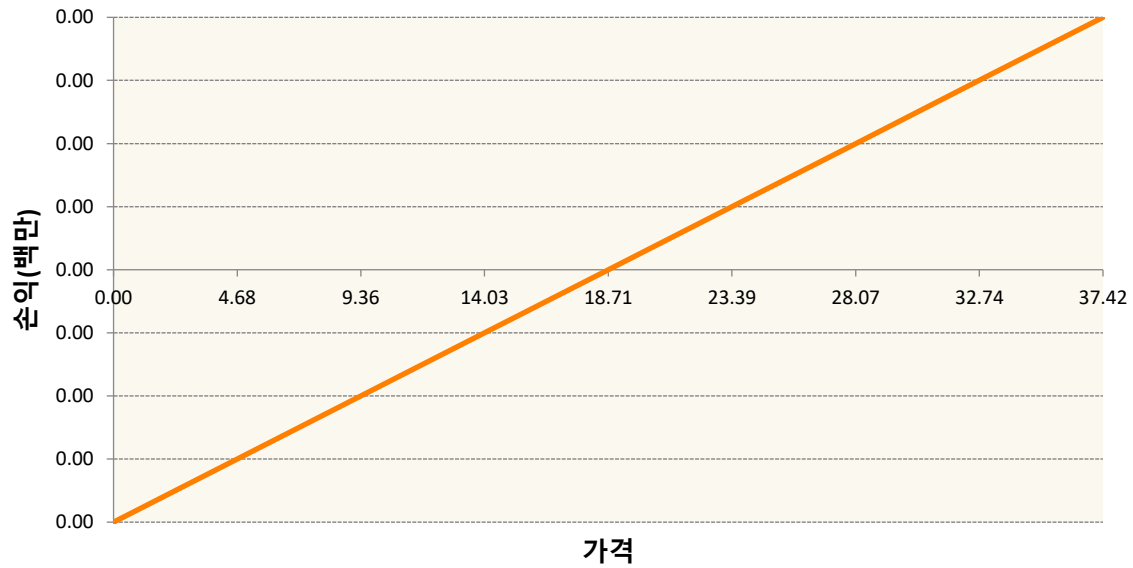
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



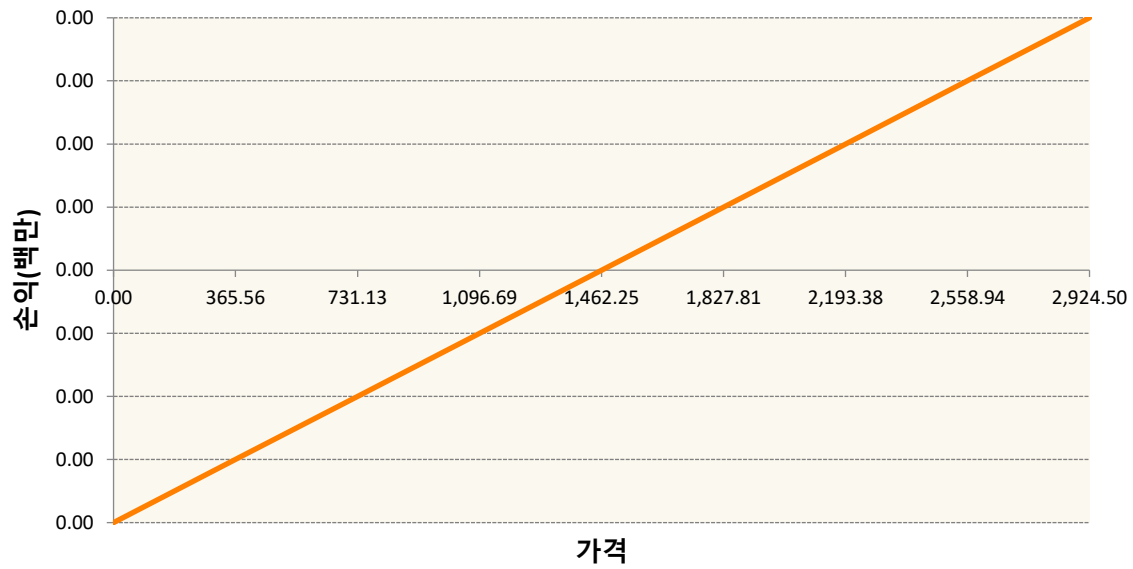
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22



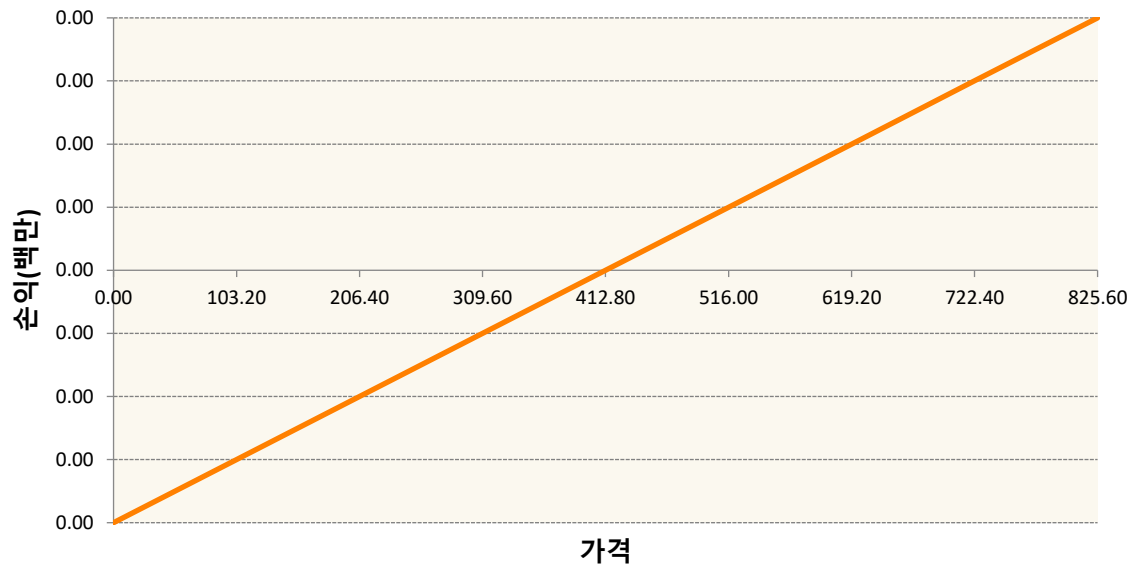
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



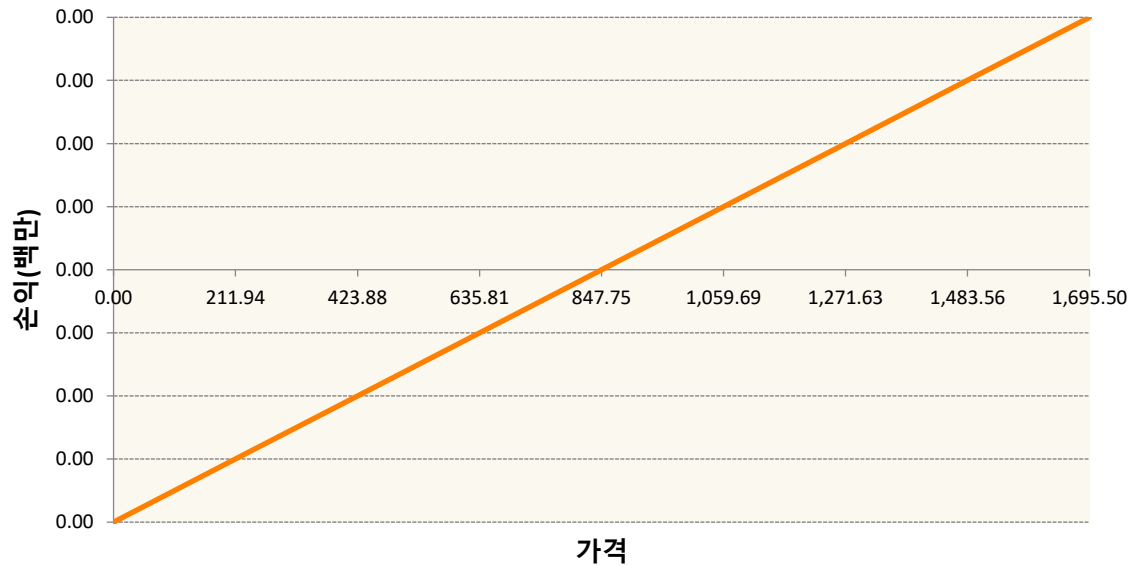
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



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	2022-11-08
기준일	2022-11-07

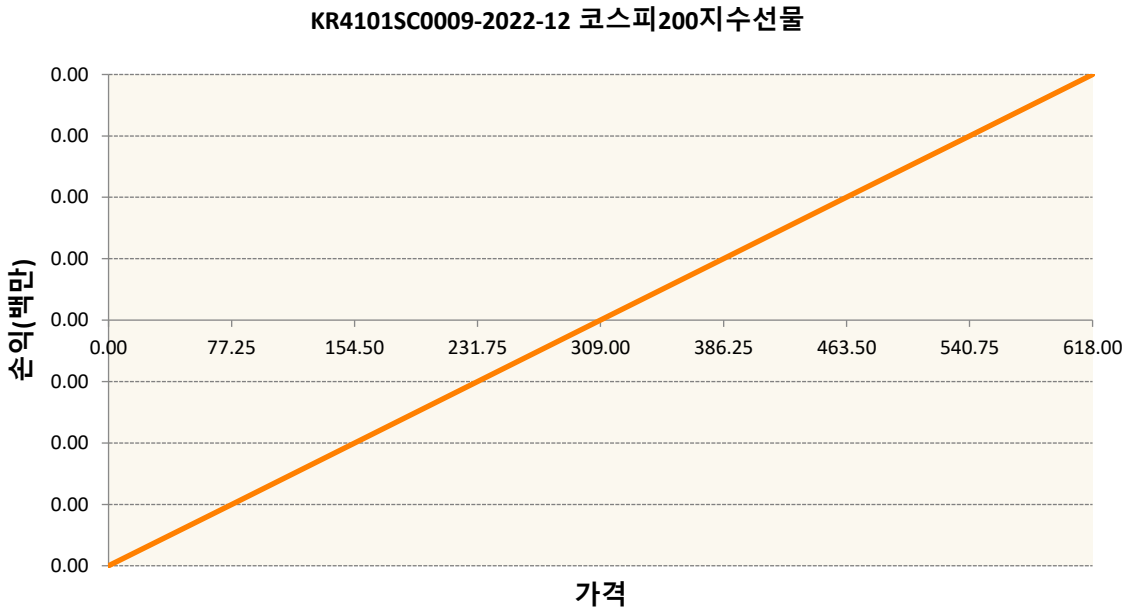
스마트인덱스모

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	1,236	0	1,236	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009				2022-12 코스피200지수선물			99
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	66	66	66	66	66	66	66
8.00%	99	99	99	99	99	99	99

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

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	336
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

462

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

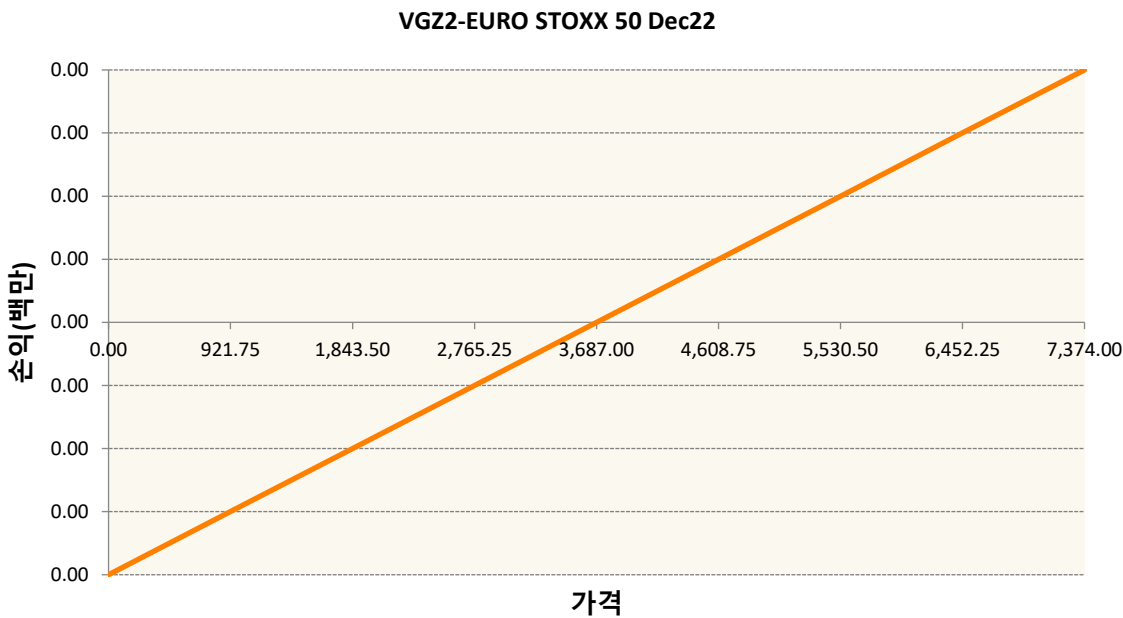
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	512	0	512	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ2	EURO STOXX 50 Dec22	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

43

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

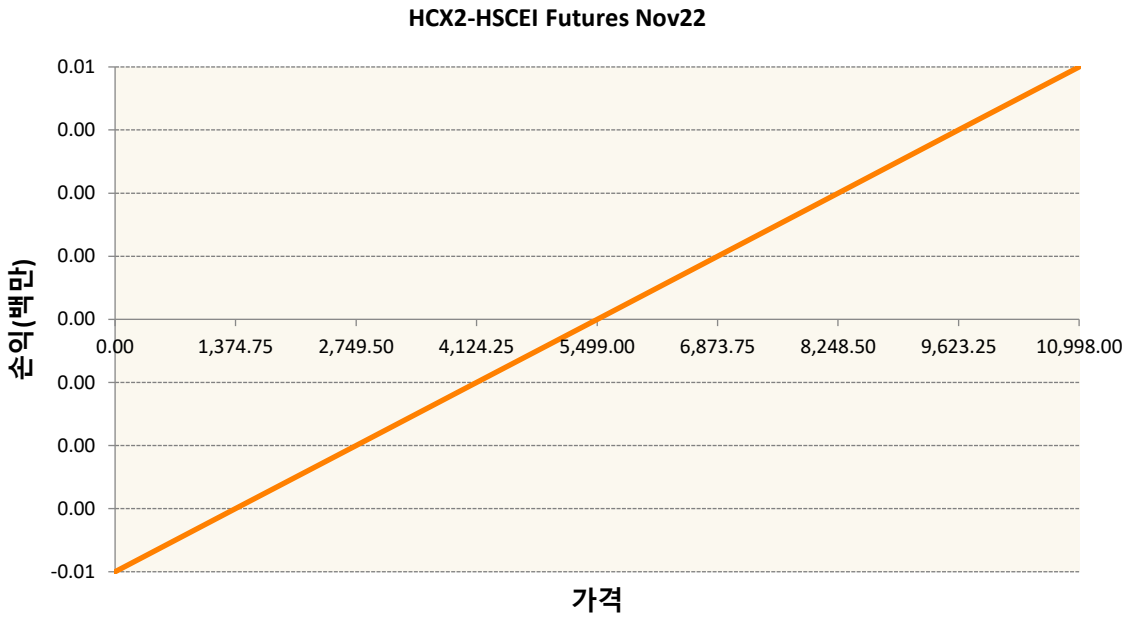
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	946	0	946	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX2	HSCEI Futures Nov22	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

114

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

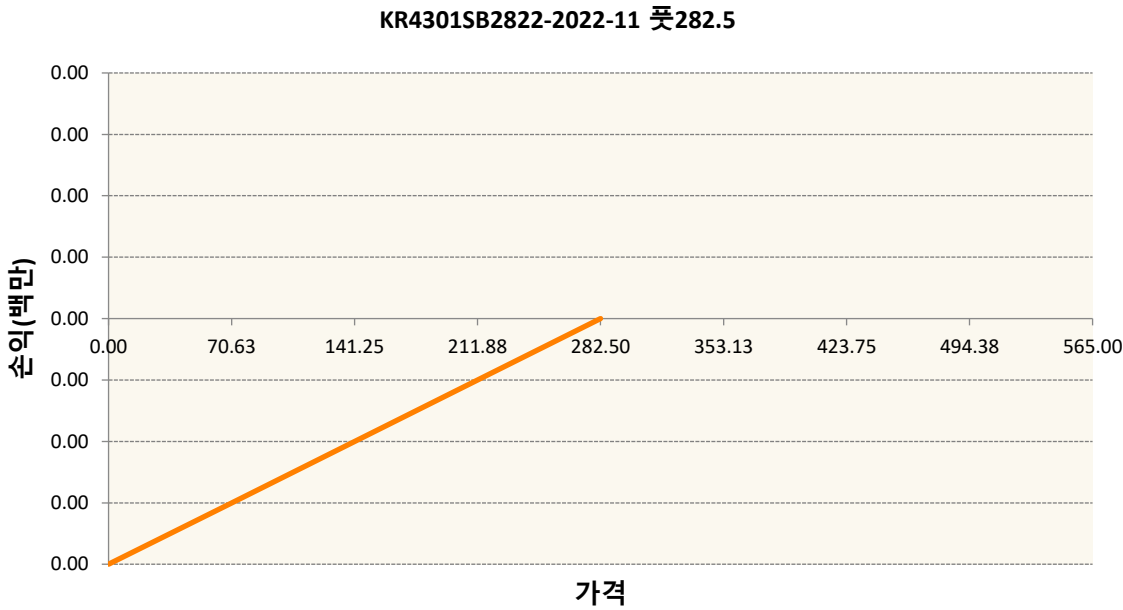
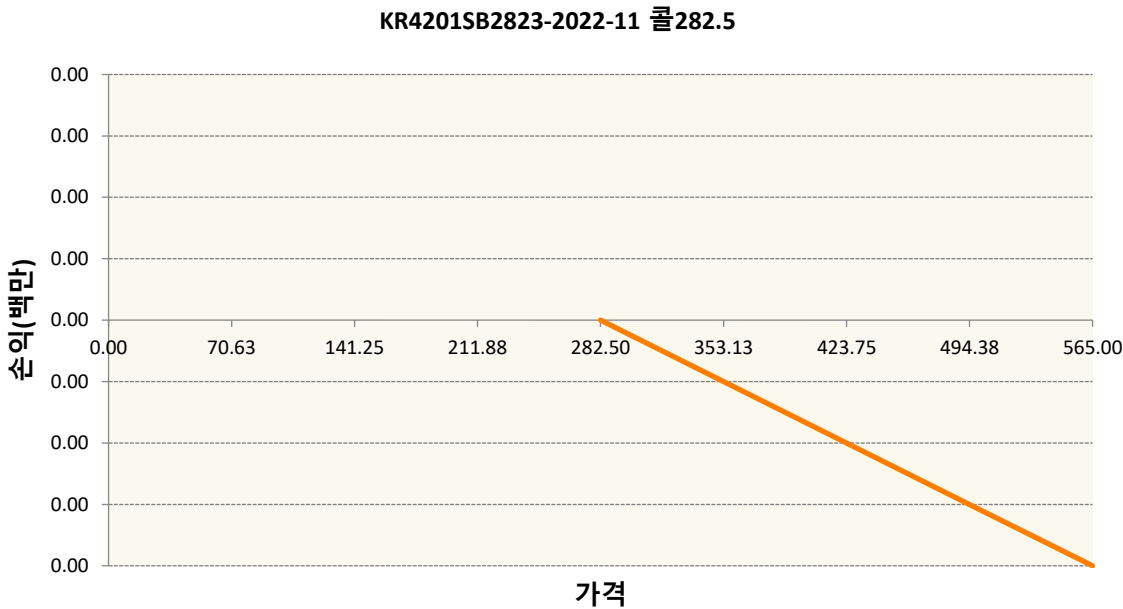
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

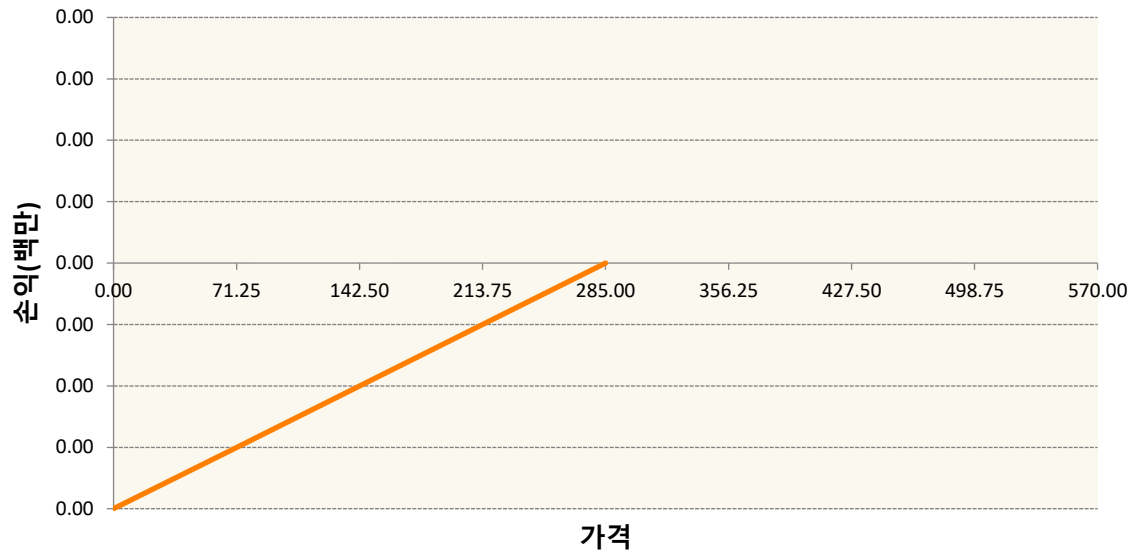
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	644	0	644	장내
누계	유가증권	옵션	0	50,580	-50,580	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301SB2855-2022-11 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201SB2823			2022-11 콜282.5				3,664
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,271	3,221	3,170	3,119	3,068	3,017	2,966
-5.33%	2,378	2,350	2,318	2,283	2,247	2,208	2,168
-2.67%	1,222	1,215	1,206	1,193	1,178	1,159	1,138
0%	5	4	3	0	-4	-10	-18
2.67%	-1,218	-1,218	-1,218	-1,219	-1,219	-1,221	-1,223
5.33%	-2,441	-2,441	-2,441	-2,441	-2,441	-2,442	-2,442
8.00%	-3,664	-3,664	-3,664	-3,664	-3,664	-3,664	-3,664
KR4301SB2822			2022-11 풋282.5				118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-75	-84	-92	-101	-109	-118
-5.33%	-11	-16	-22	-27	-33	-40	-47
-2.67%	0	-1	-3	-5	-8	-11	-14
0%	1	1	0	0	-1	-2	-3
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
KR4301SB2855			2022-11 풋285				30
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-21	-23	-25	-27	-28	-30
-5.33%	-4	-5	-7	-8	-10	-11	-13
-2.67%	0	-1	-1	-2	-2	-3	-4
0%	0	0	0	0	0	-1	-1

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

3,772

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

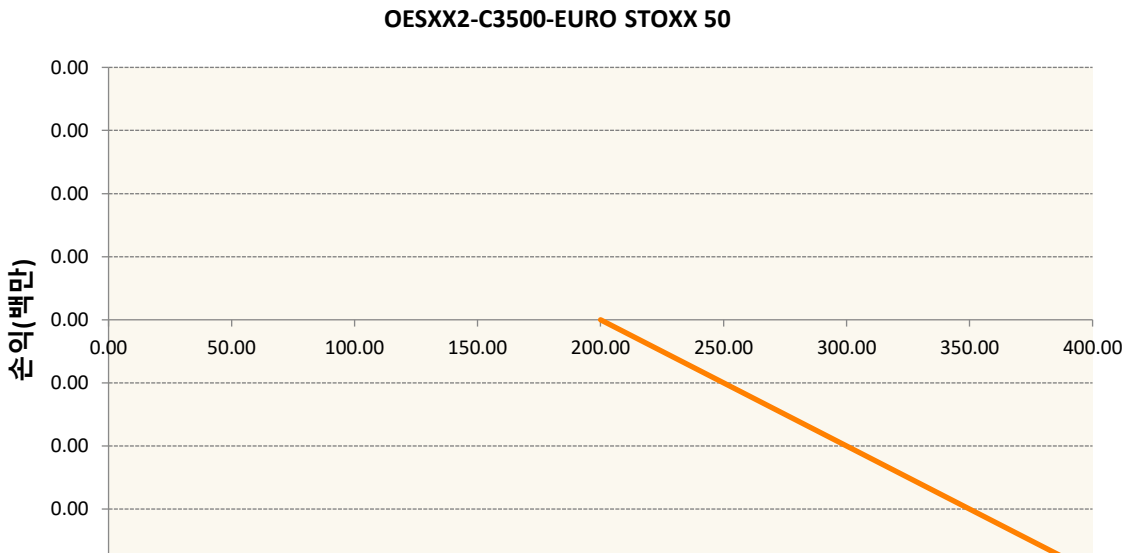
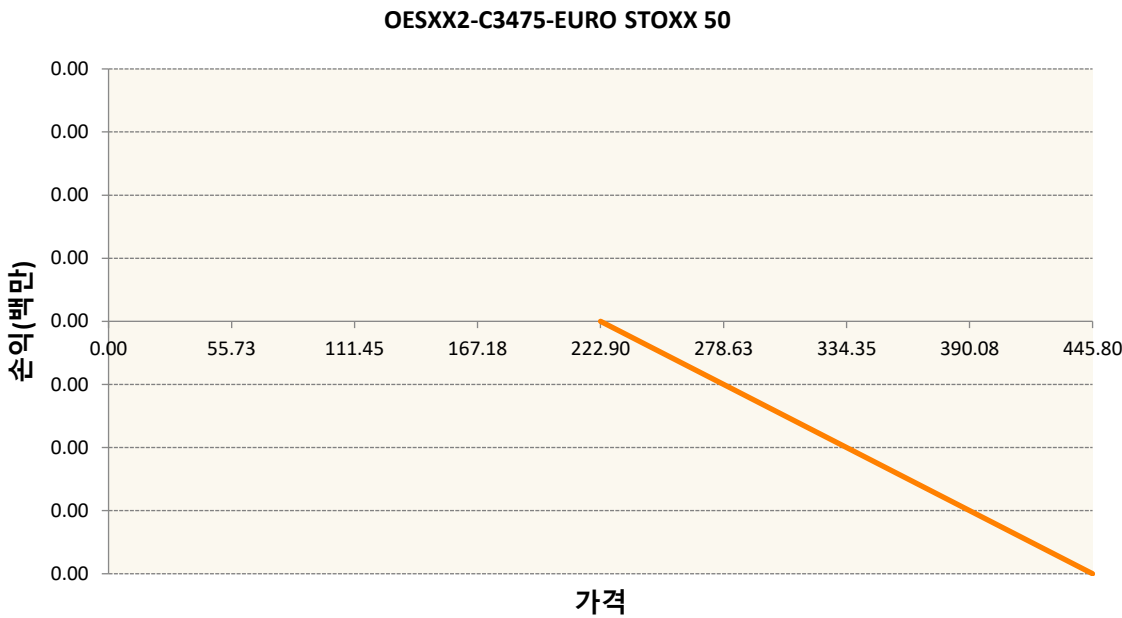
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

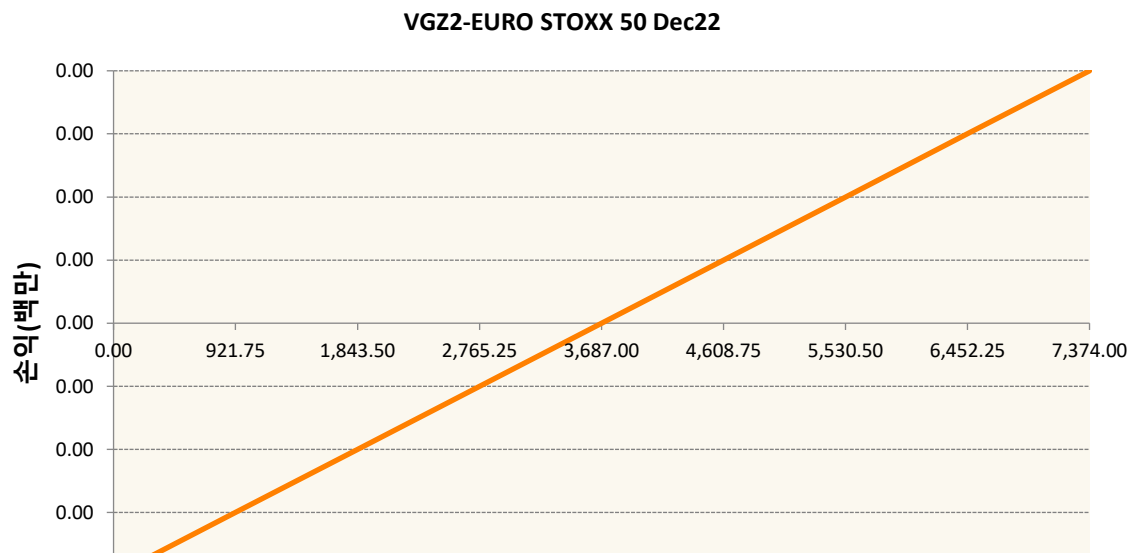
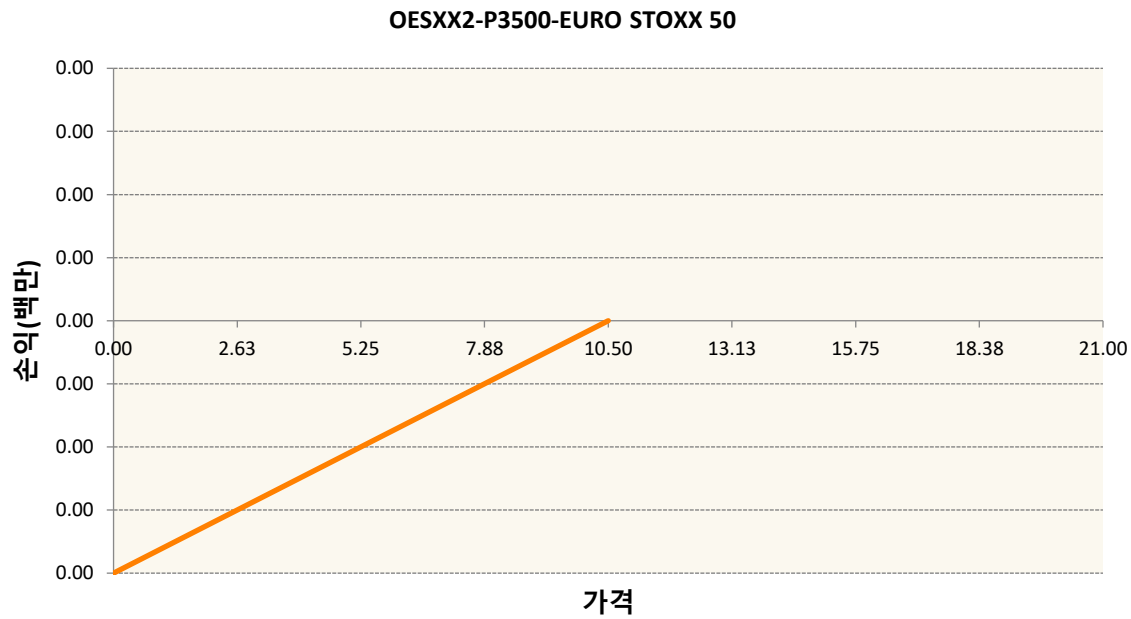
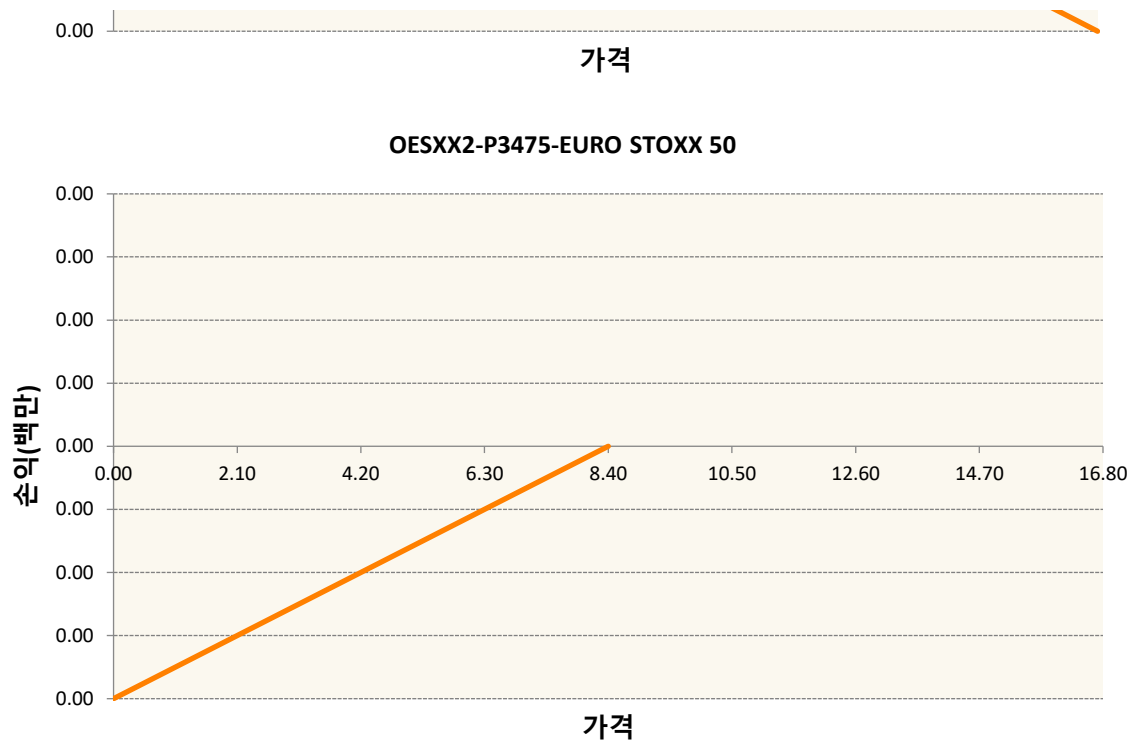
1. 계약금액

(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	1,241	0	1,241	
누계	유가증권	옵션	0	163	-163	장내
누계	통화	선도	0	2,299	-2,299	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	12
OESXX2-C35 EURO STOXX 50	1
OESXX2-P34 EURO STOXX 50	0.42
OESXX2-P35 EURO STOXX 50	0.05
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	99

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

(단위:백만원)

246

공시일 2022-11-08

기준일 2022-11-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

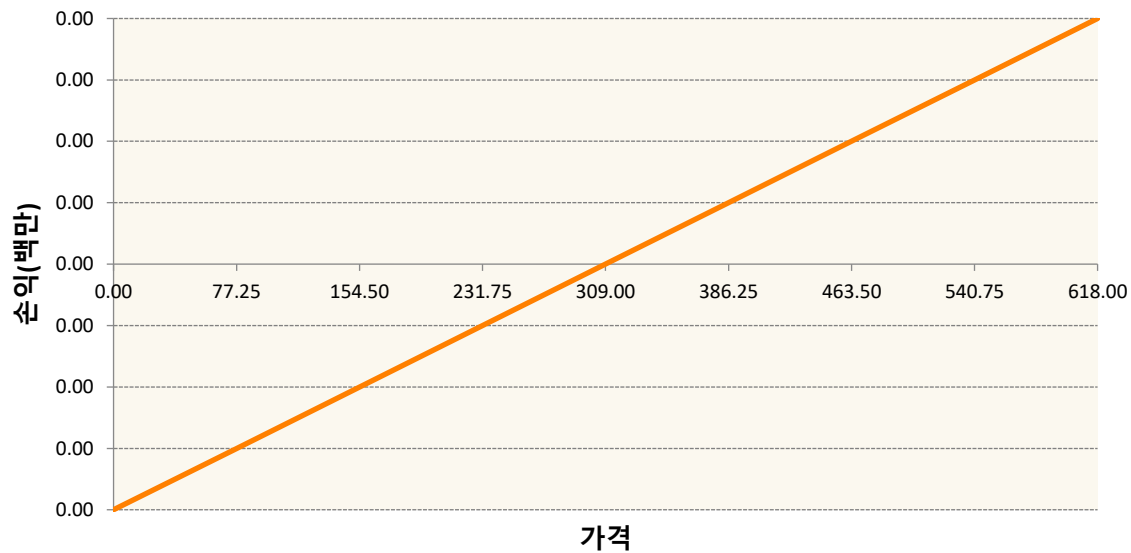
1. 계약금액

(단위:백만원)

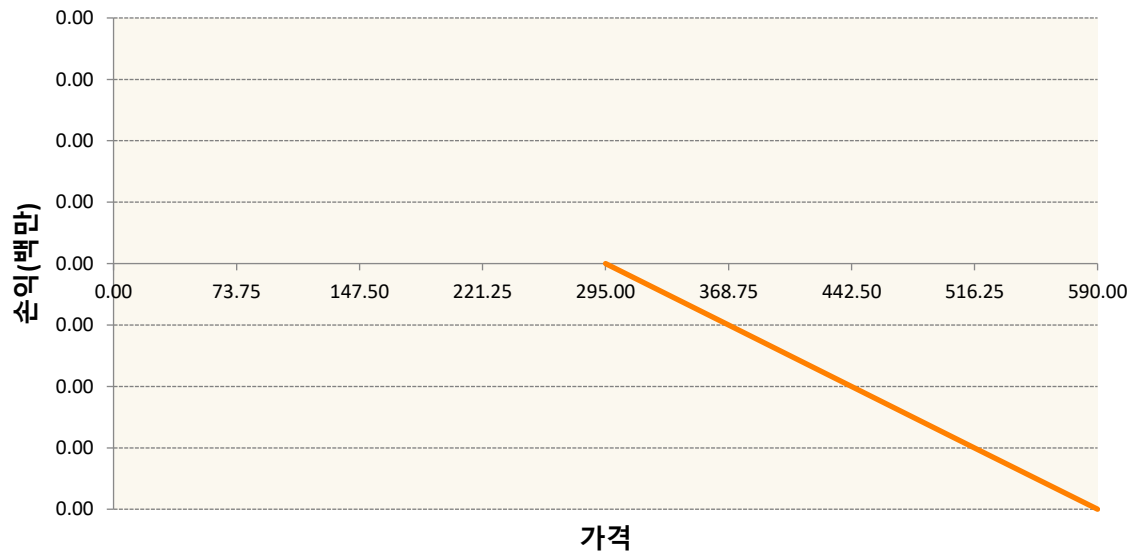
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	70	0	70	장내
누계	유가증권	선물	386	0	386	장내
누계	유가증권	옵션	353	3,634	-3,281	장내

2. 만기시점의 손익구조

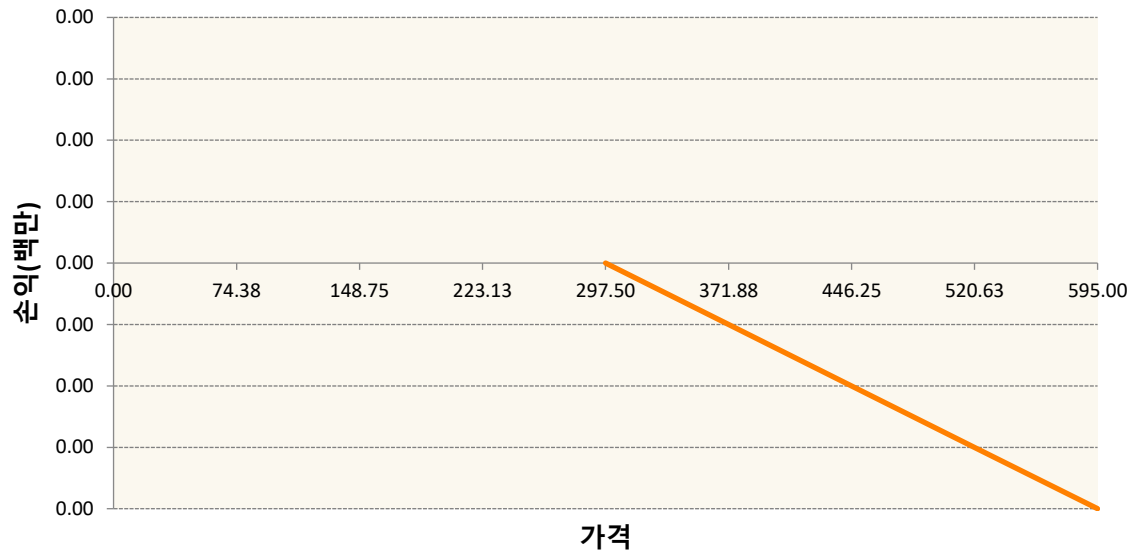
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



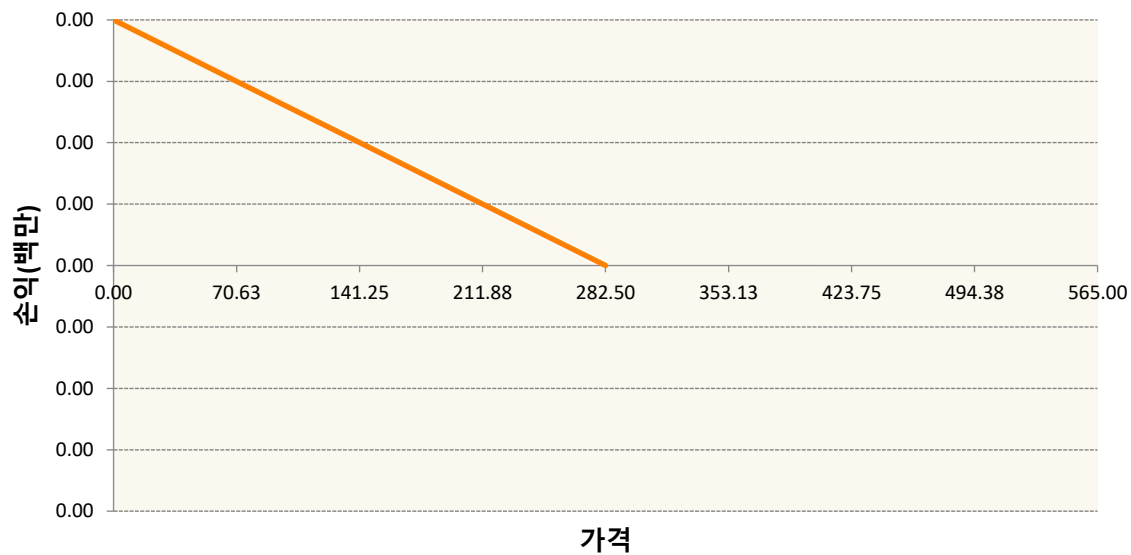
KR4201SB2955-2022-11 콜295



KR4201SB2971-2022-11 콜297.5



KR4301SB2822-2022-11 ㄱ282.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009		2022-12 코스피200지수선물					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
KR4201SB2955		2022-11 콜295					96
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	53	52	51	51	50	49
-5.33%	47	46	45	43	42	41	39
-2.67%	30	29	27	26	25	23	22
0%	2	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-30	-30	-31	-31	-31	-31	-32
5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
8.00%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96

KR4201SB2971

2022-11 콜297.5

195

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	93	93	92	91	89	88	86
-5.33%	86	83	81	78	76	73	71
-2.67%	57	55	52	49	46	43	40
0%	5	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-60	-60	-60	-61	-62	-63	-64
5.33%	-127	-127	-127	-127	-128	-128	-128
8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195

KR4301SB2822

2022-11 풋282.5

6

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	4	4	5	5	5	6
-5.33%	1	1	1	1	2	2	2
-2.67%	0	0	0	0	0	1	1
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	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

360

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

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	6,842	0	6,842	

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	2022-11-08
기준일	2022-11-07

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	6,007	0	6,007	

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	2022-11-08
기준일	2022-11-07

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	60	-60	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	18,863	0	18,863	
누계	통화	선도	0	18,671	-18,671	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E		627
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E		521
FXW213CAR·KRW/USD 30-01-23E		290
FXW213CB1(KRW/USD 28-11-22E		56
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	653

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

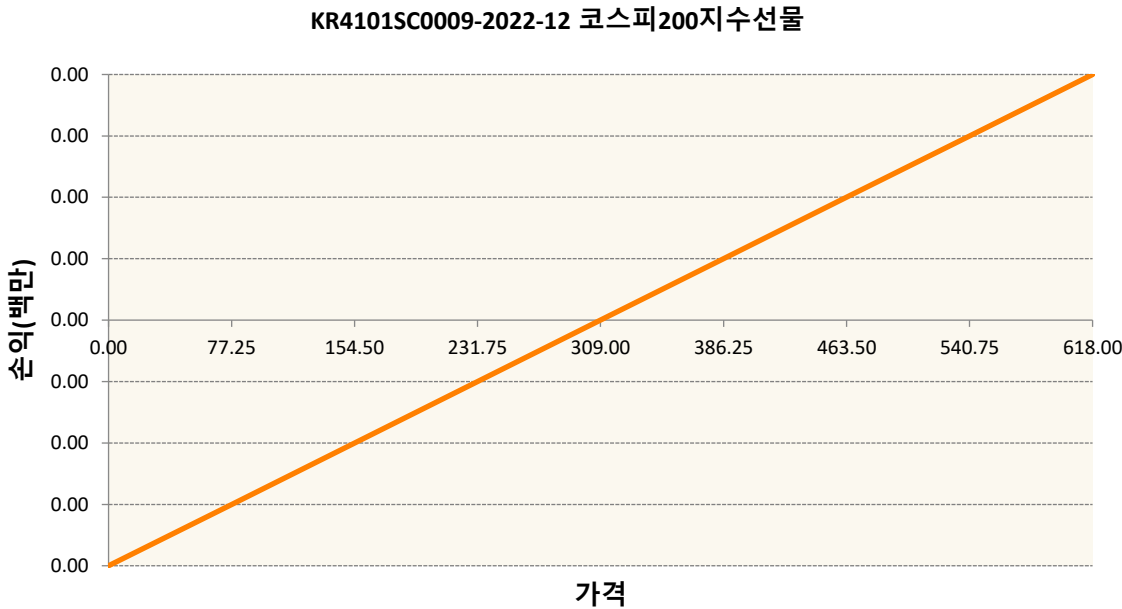
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	386	0	386	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				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

공시일 2022-11-08

기준일 2022-11-07

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

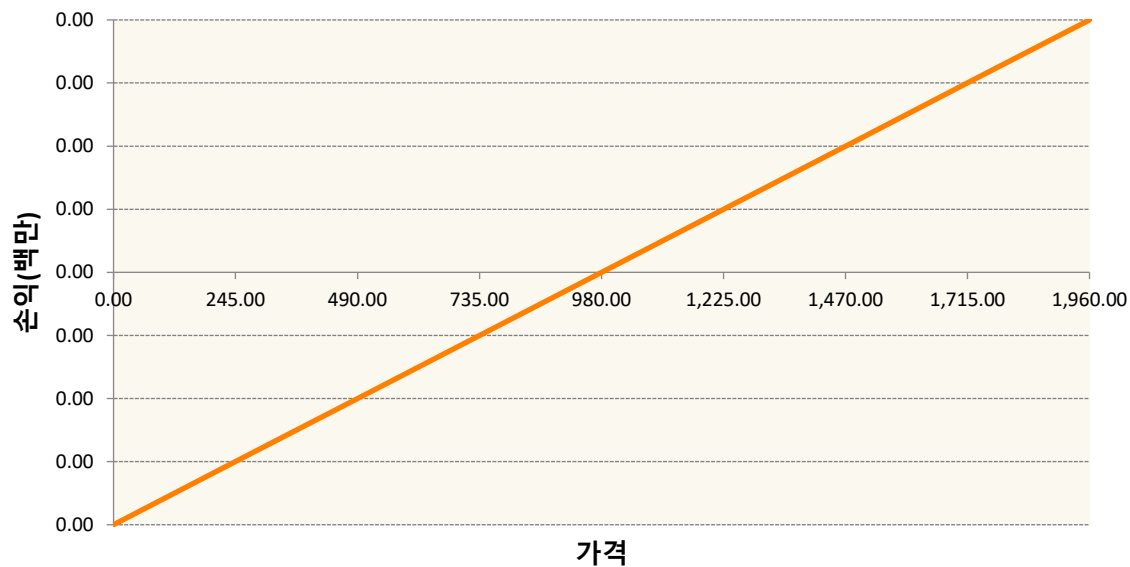
1. 계약금액

(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	109	0	109	
누계	유가증권	스왑	1,327	0	1,327	장외
누계	통화	선도	627	850	-223	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
FXW213CAR EUR/KRW 28-11-22E	8

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

3
9

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

(단위:백만원)

206

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

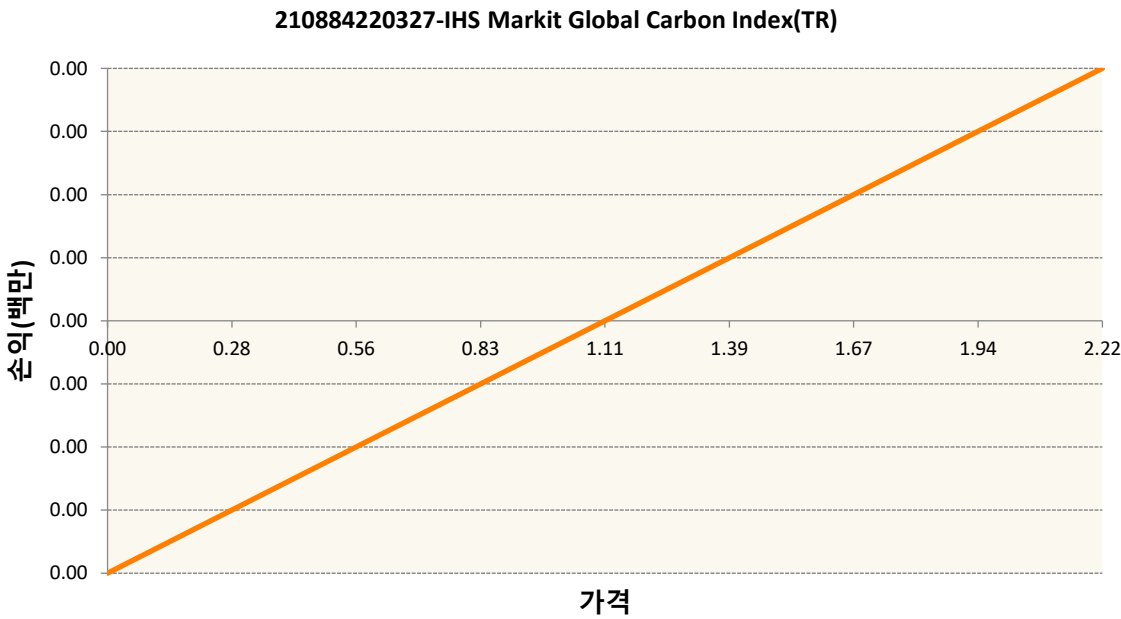
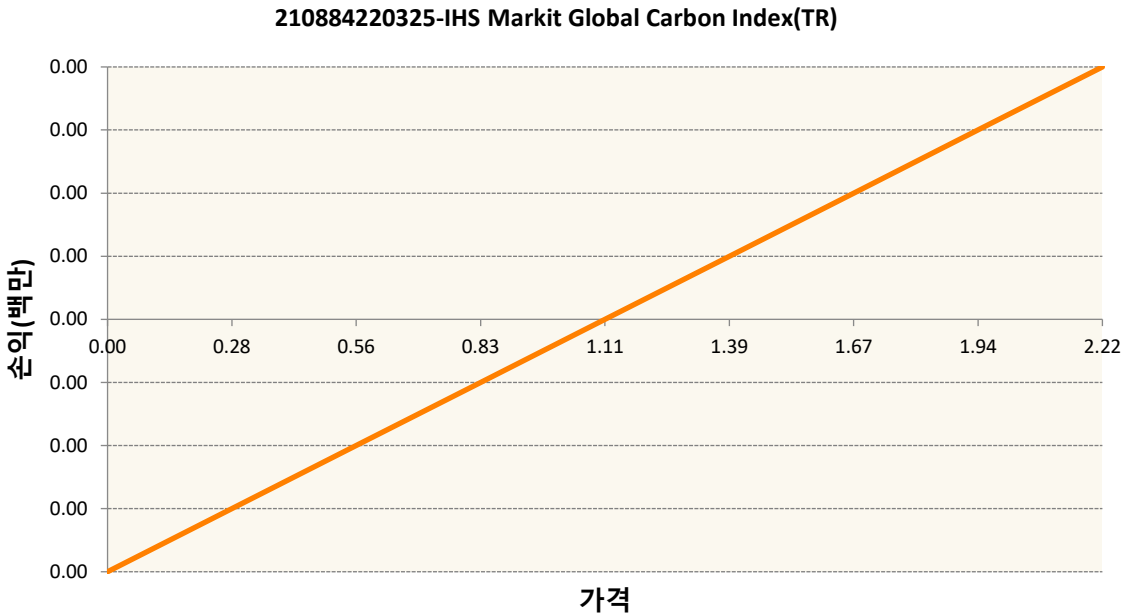
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

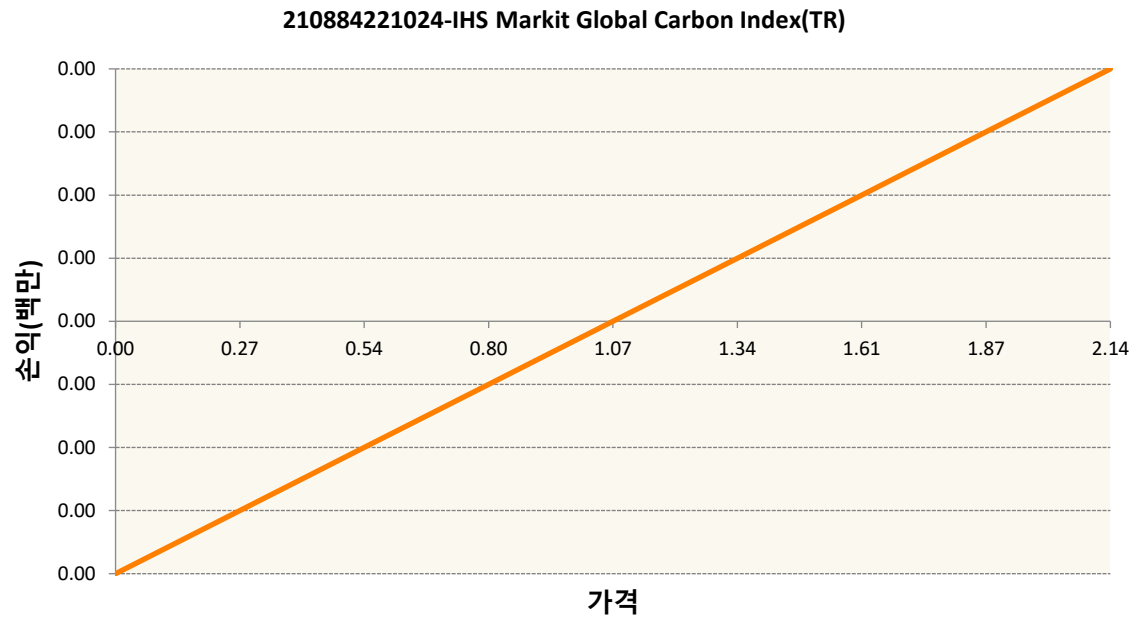
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	30,123	0	30,123	

2. 만기시점의 손익구조





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)		96
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		2,114

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		4,598

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

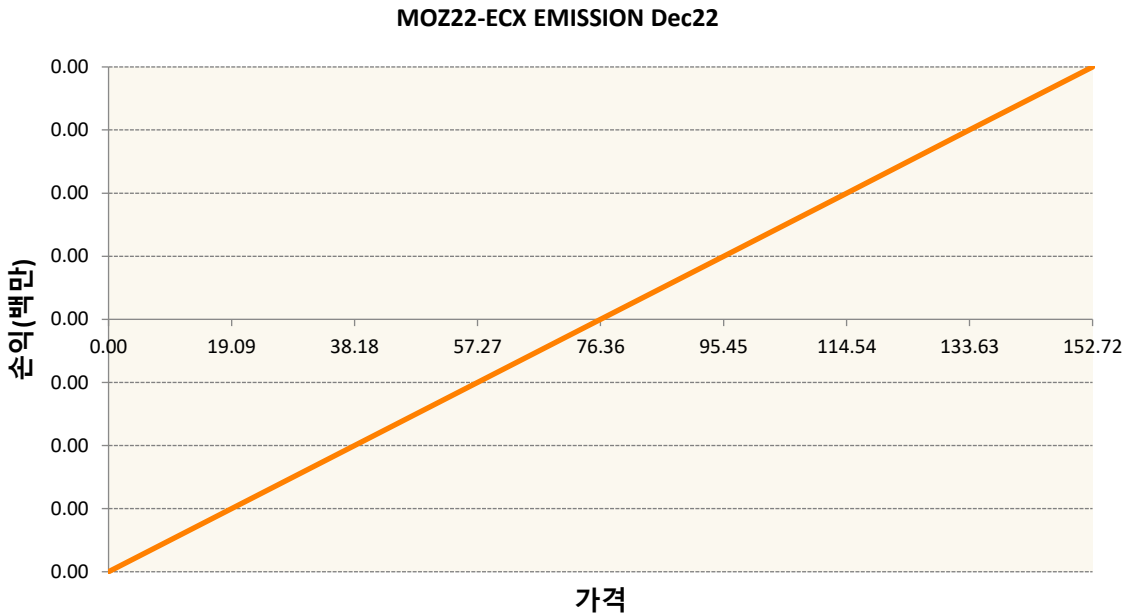
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,766	0	13,766	
누계	통화	선도	0	4,713	-4,713	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CAT(KRW/EUR 23-11-22E	369
FXW213CB7(KRW/EUR 23-11-22E	8
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,101

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

(단위:백만원)

3,062

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

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)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	9

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

(단위:백만원)

67

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

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)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	23
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	28

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

(단위:백만원)

121

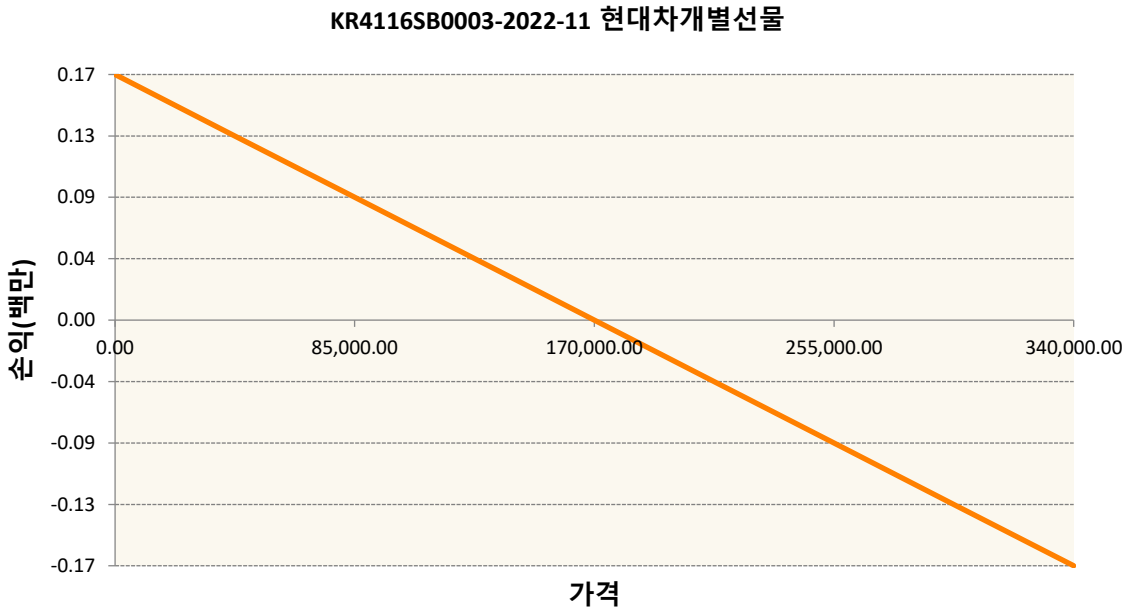
공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

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	510	-510	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4116SB00 2022-11 현대차개별선물	41
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	1
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.49

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

65

공시일 2022-11-08

기준일 2022-11-07

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

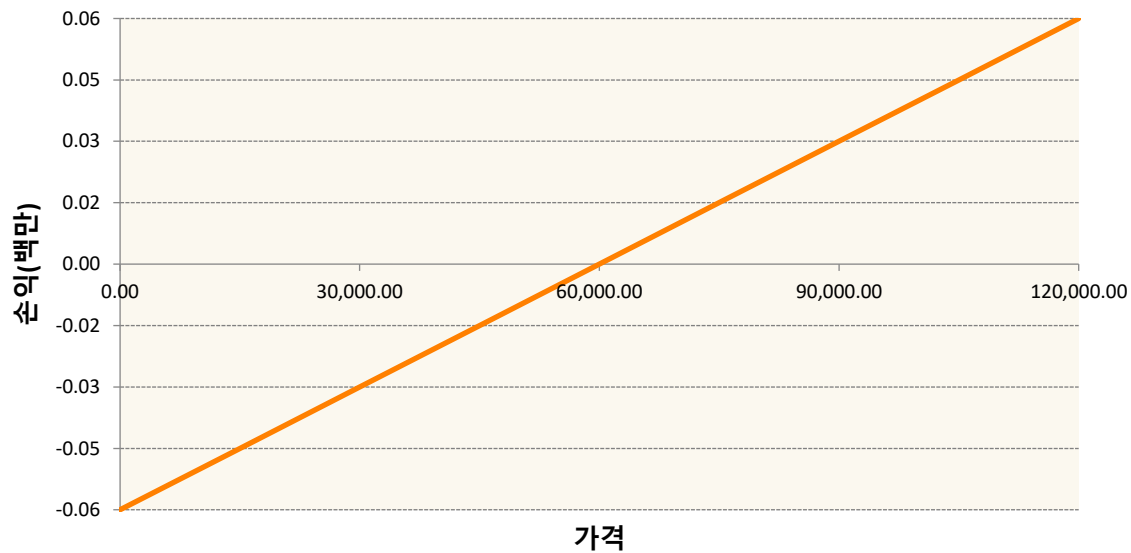
1. 계약금액

(단위:백만원)

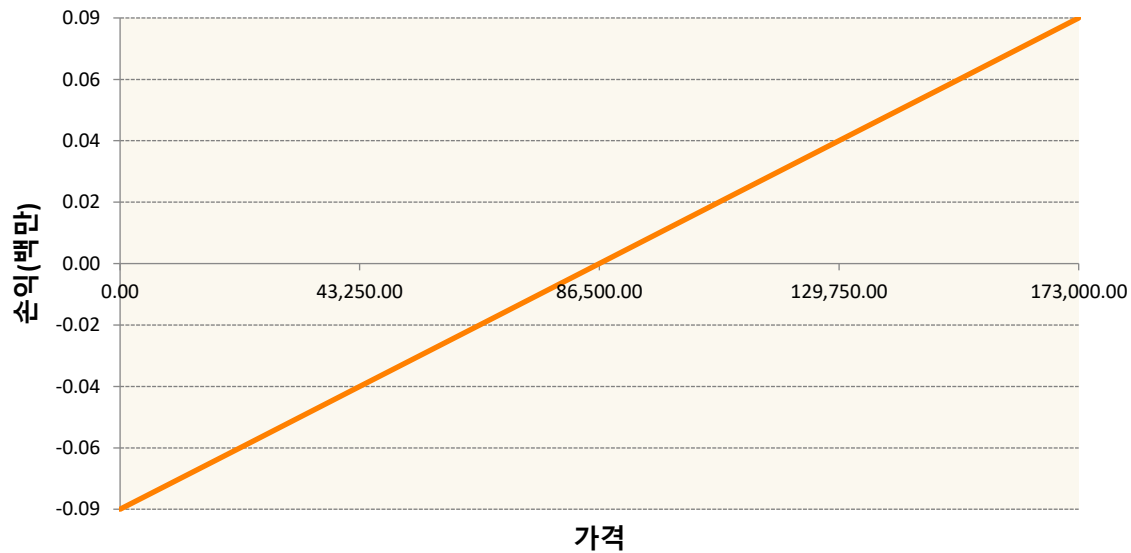
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	652	0	652	장내

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%	-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
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)

62

공시일	2022-11-08
기준일	2022-11-07

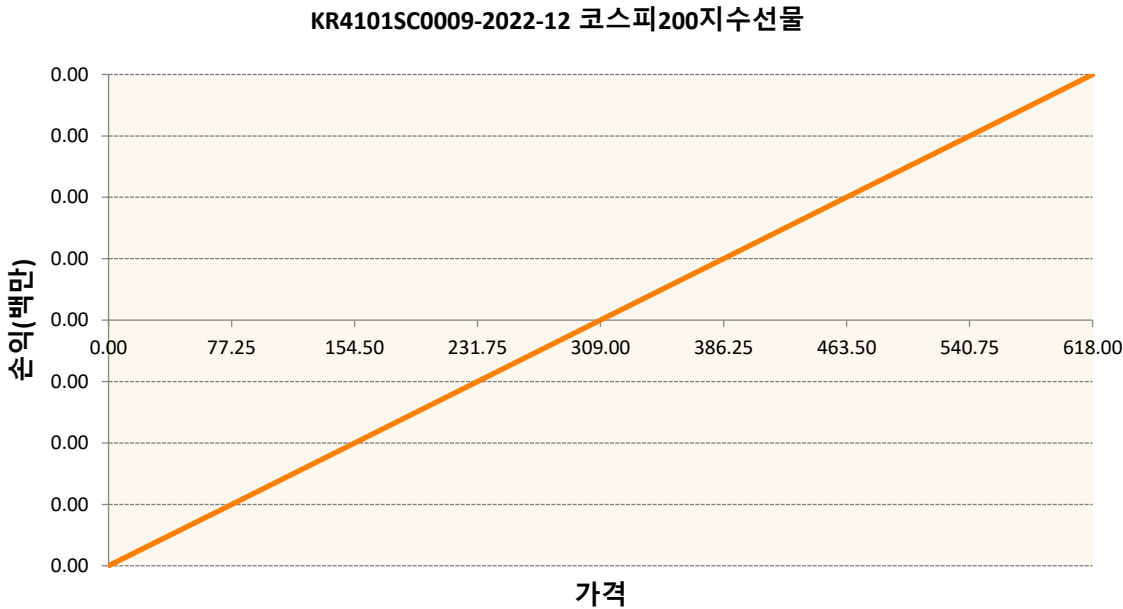
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	386	0	386	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				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

공시일 2022-11-08

기준일 2022-11-07

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

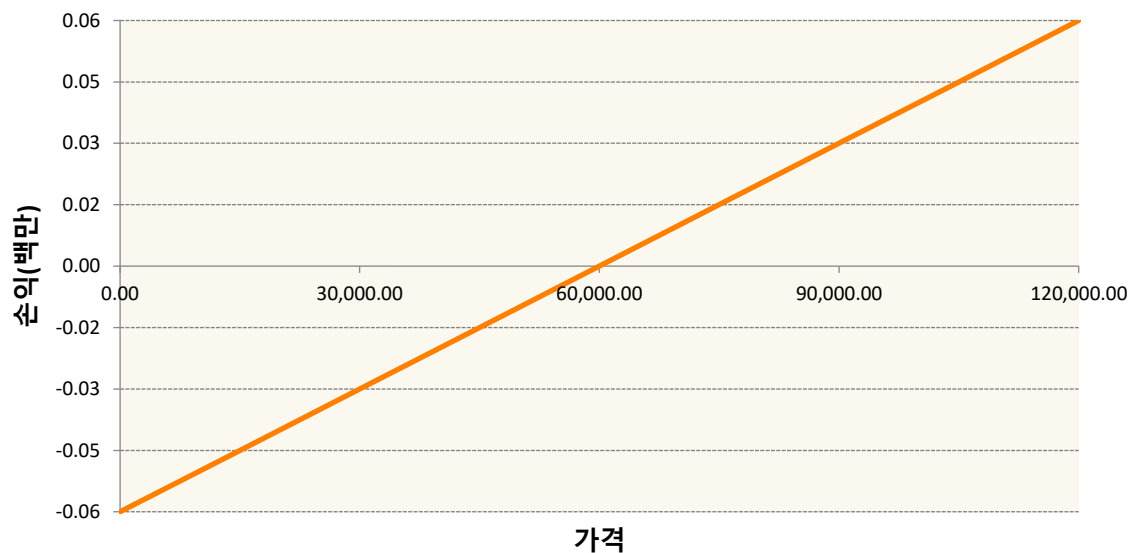
1. 계약금액

(단위:백만원)

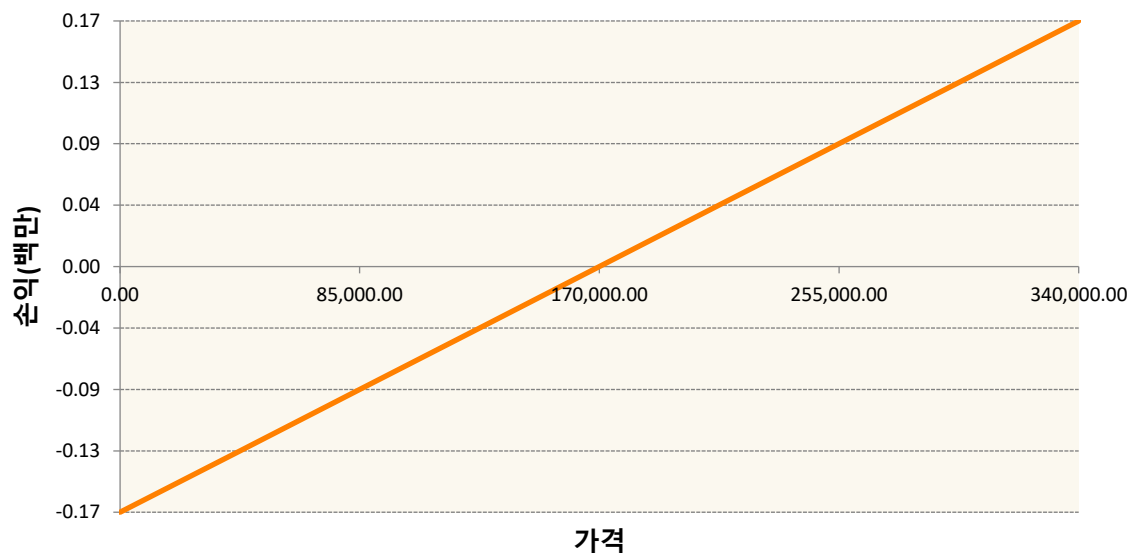
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	238	0	238	장내
누계	유가증권	ELS	67	0	67	장외

2. 만기시점의 손익구조

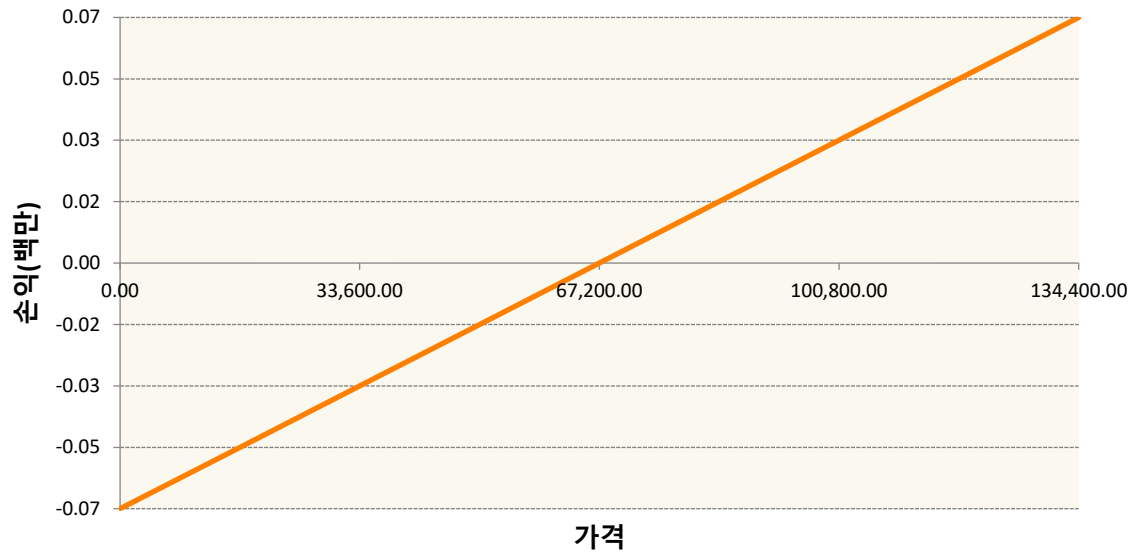
KR4111SB0008-2022-11 삼성전자개별선물



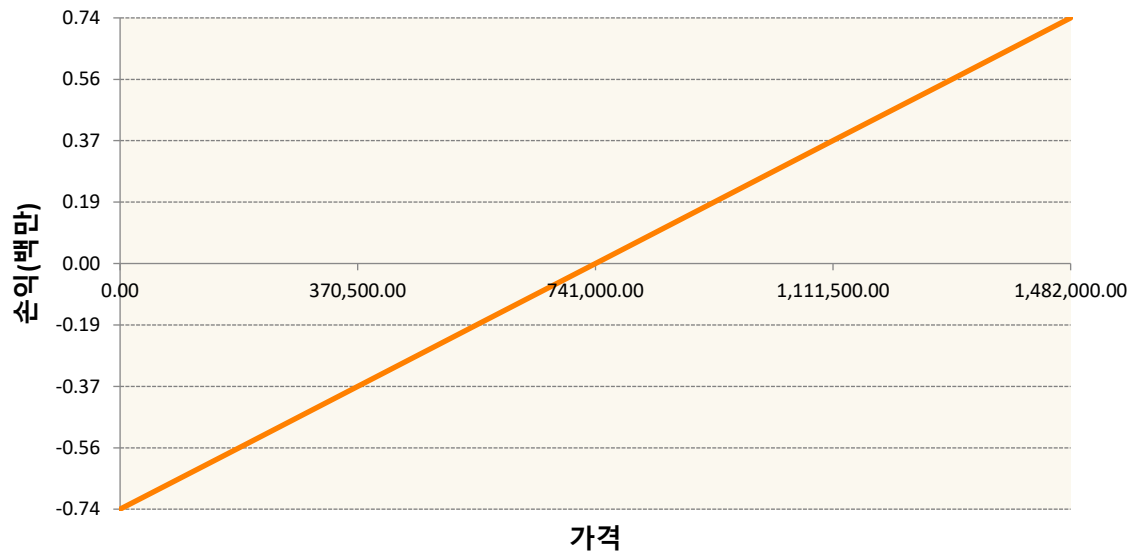
KR4116SB0003-2022-11 현대차개별선물



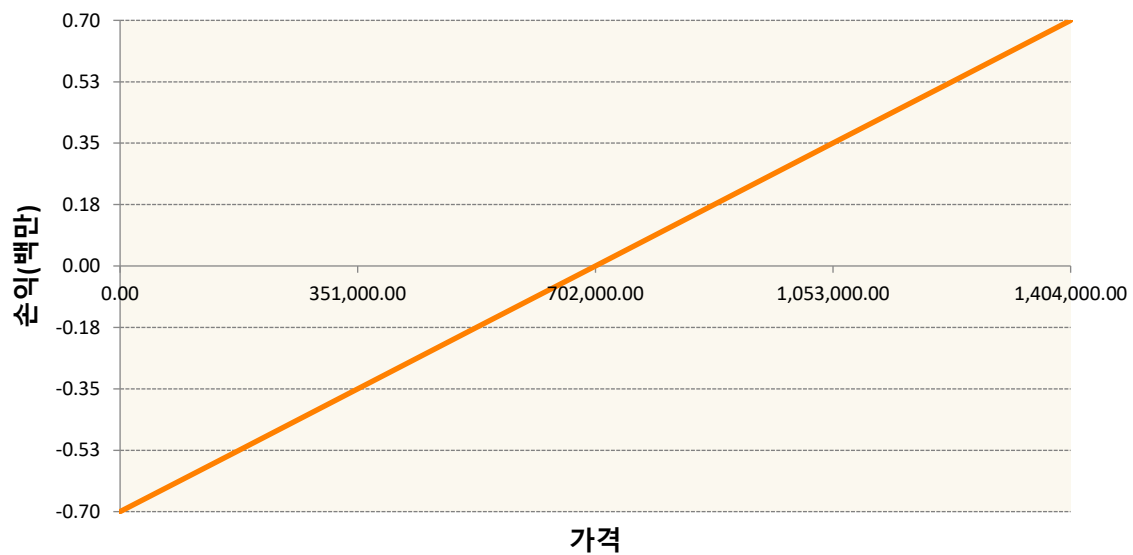
KR4119SB0000-2022-11 기아개별선물



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 2022-11-08

기준일 2022-11-07

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

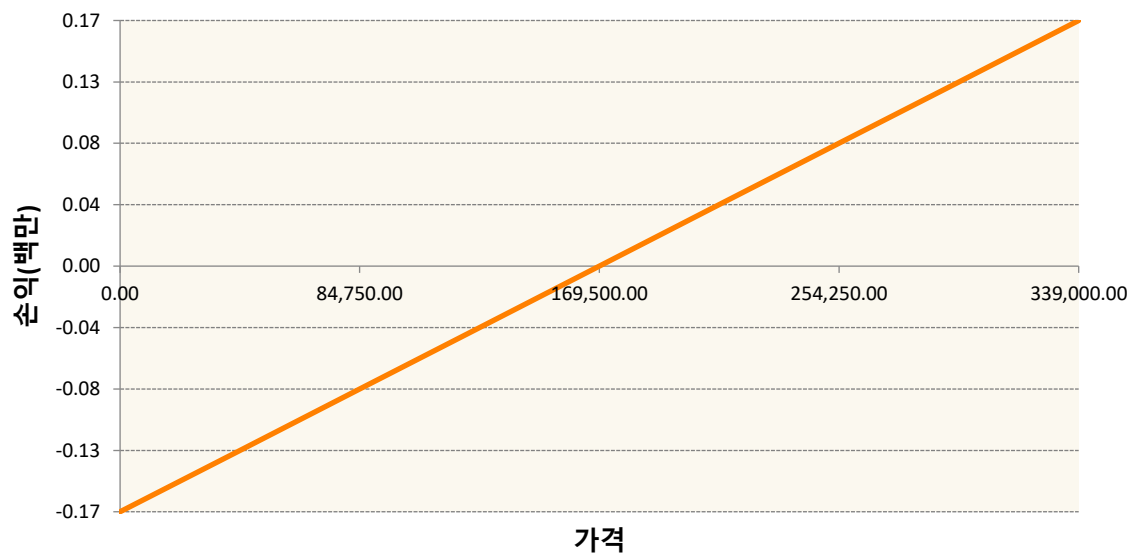
1. 계약금액

(단위:백만원)

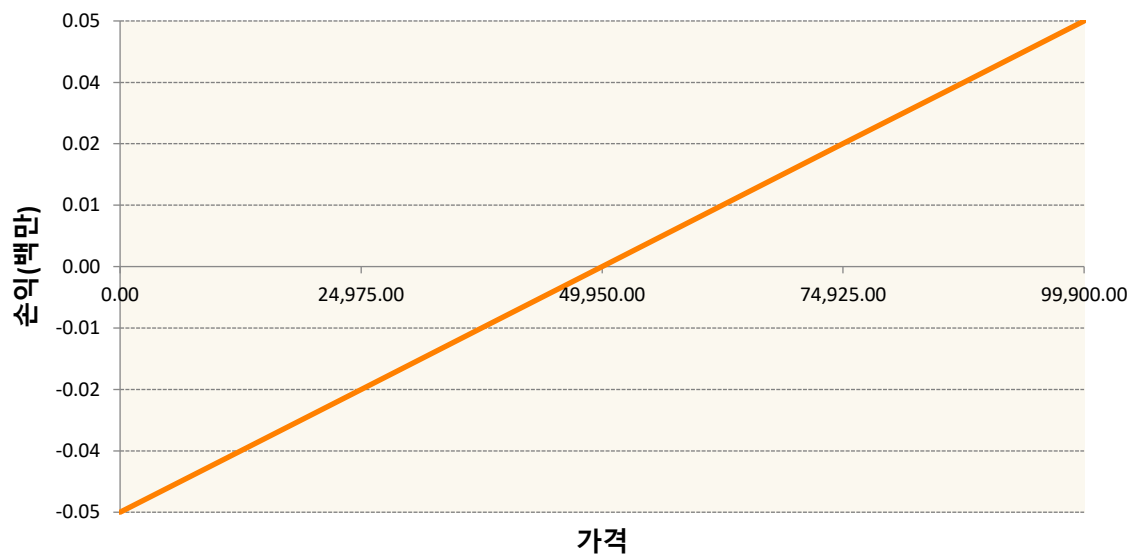
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	104	0	104	장내

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	2022-11-08
기준일	2022-11-07

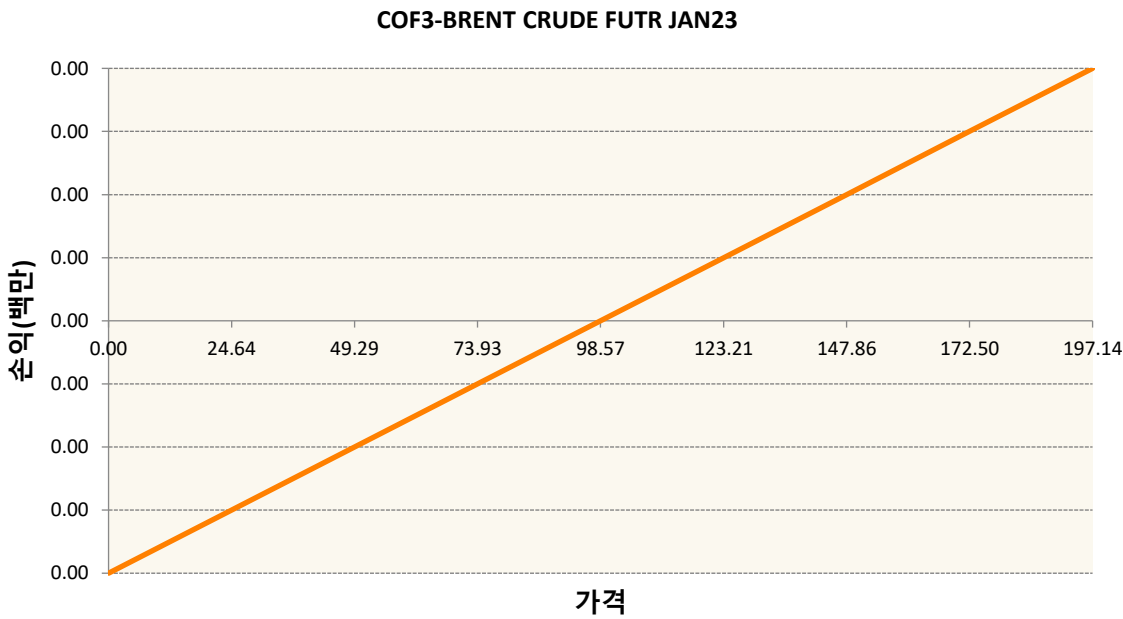
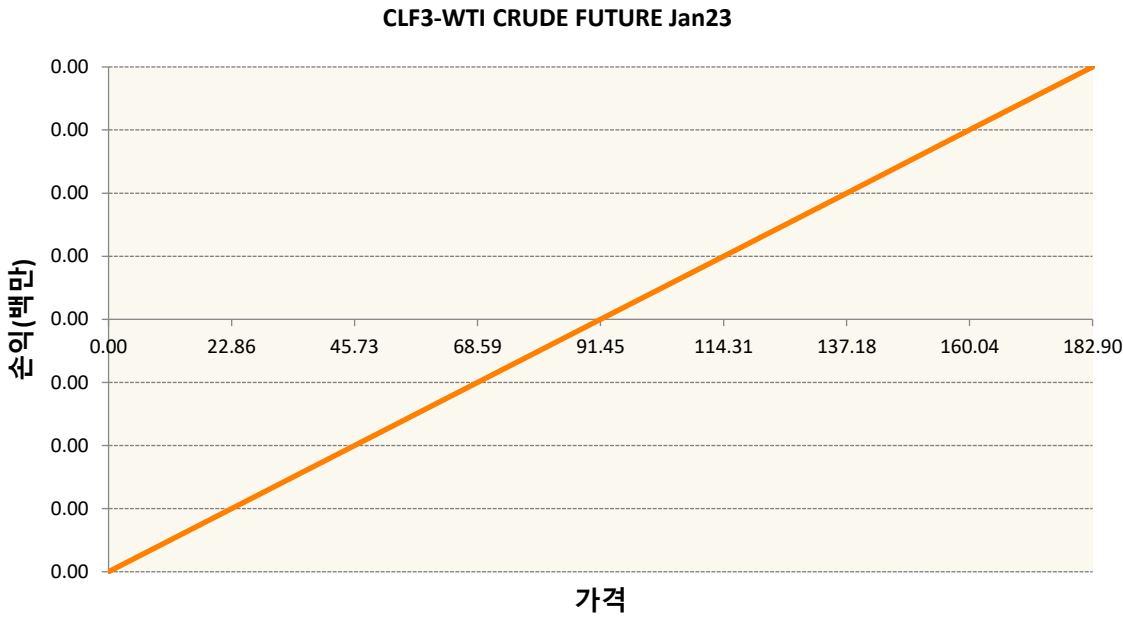
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

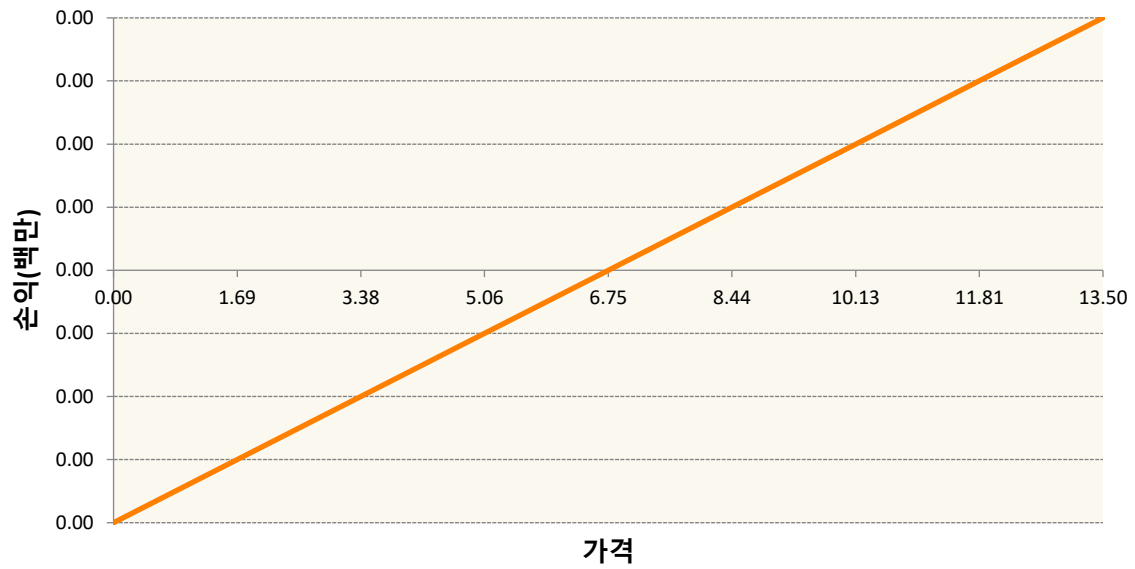
(단위:백만원)

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	260	0	260	
누계	유가증권	선물	1,589	280	1,309	

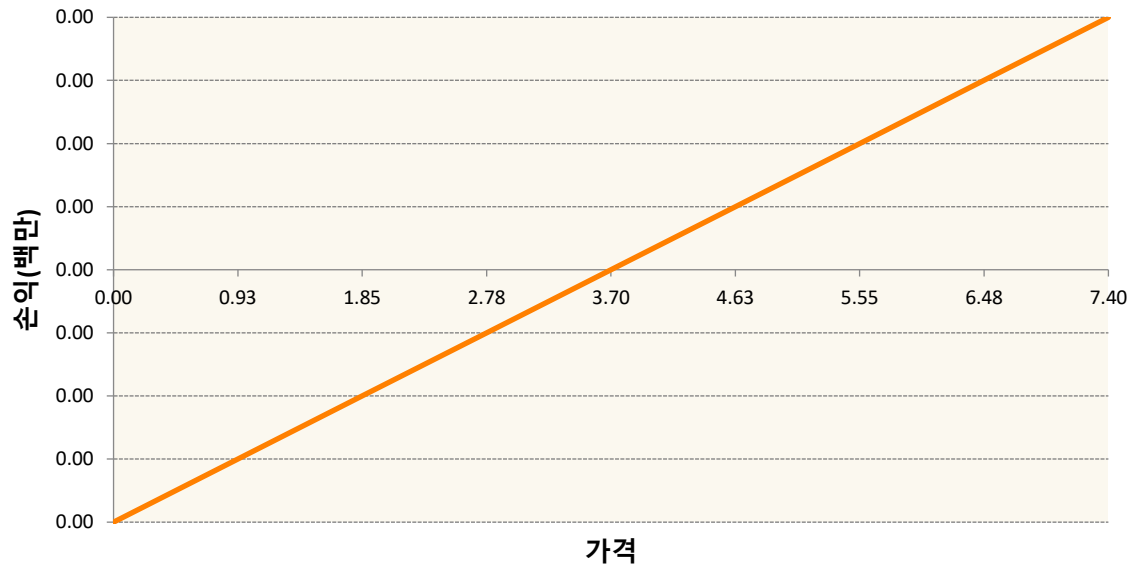
2. 만기시점의 손익구조



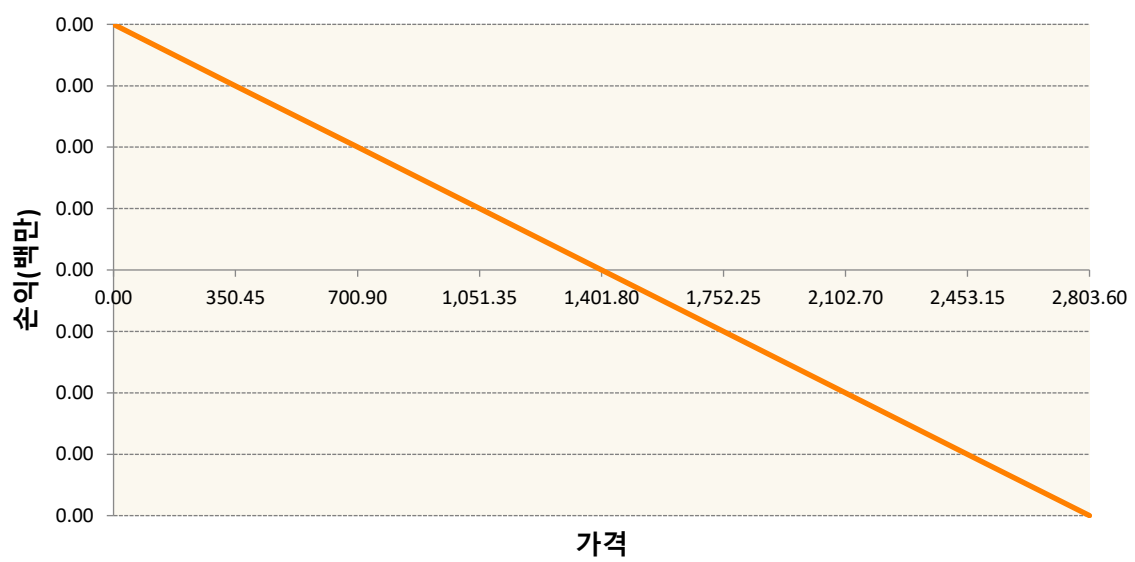
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



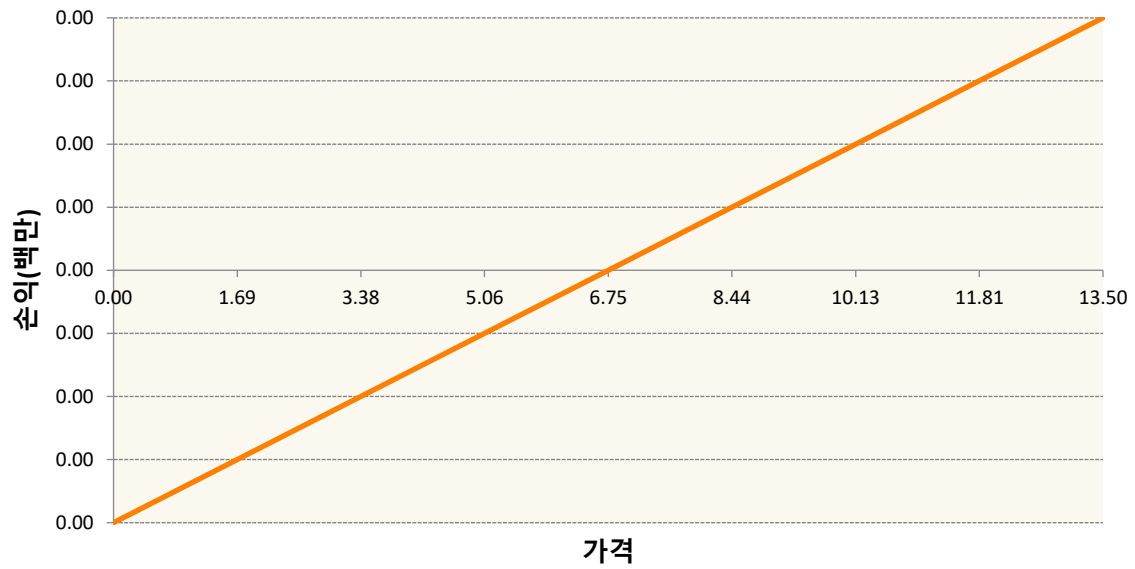
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



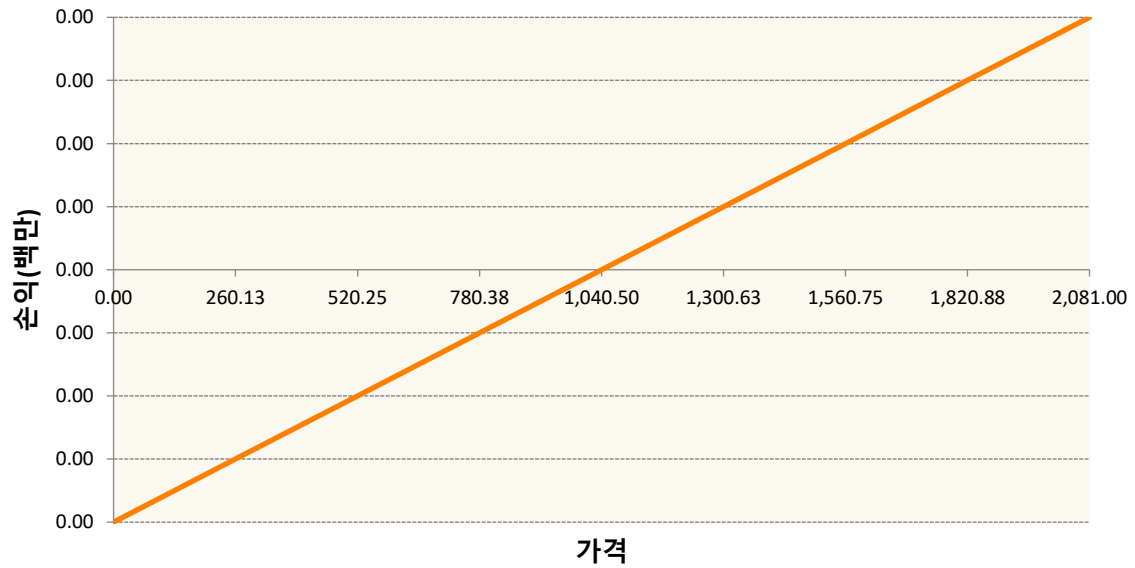
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



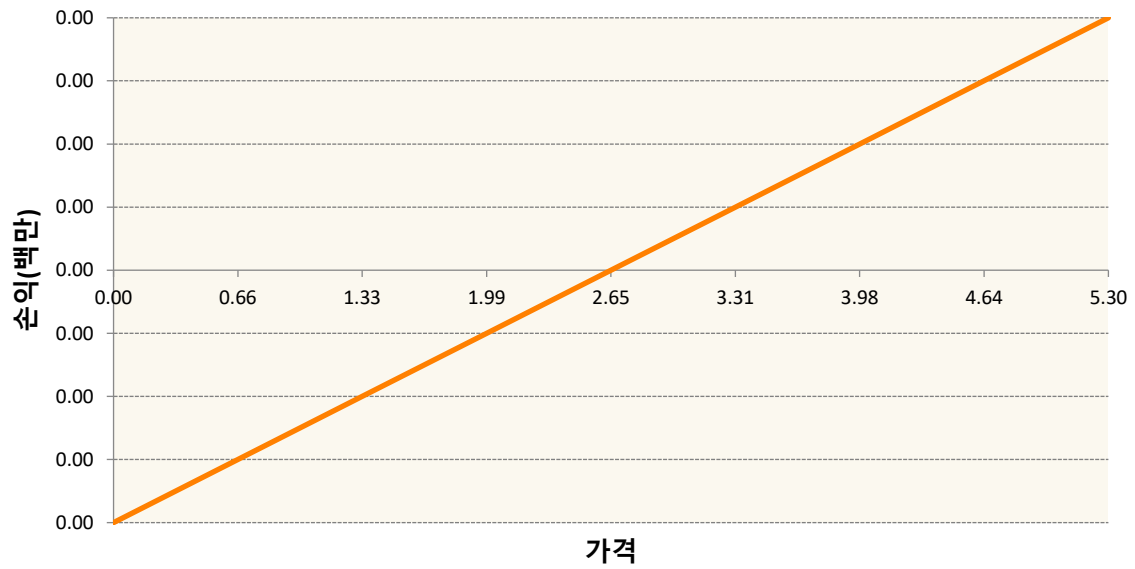
NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



QSF3-Low Su Gasoil G Jan23



XBF3-GASOLINE RBOB FUT Jan23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF3	WTI CRUDE FUTURE Jan23	21
COF3	BRENT CRUDE FUTR JAN23	33
EOF3	E-MINI NATURAL GAS Jan23	6
HOF3	NY Harb ULSD Fut Jan23	18
KR4175SB00	2022-11 달러선물	22
NGF23	NATURAL GAS FUTR Jan23	46
QSF3	Low Su Gasoil G Jan23	12
XBF3	GASOLINE RBOB FUT Jan23	13

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

480