

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

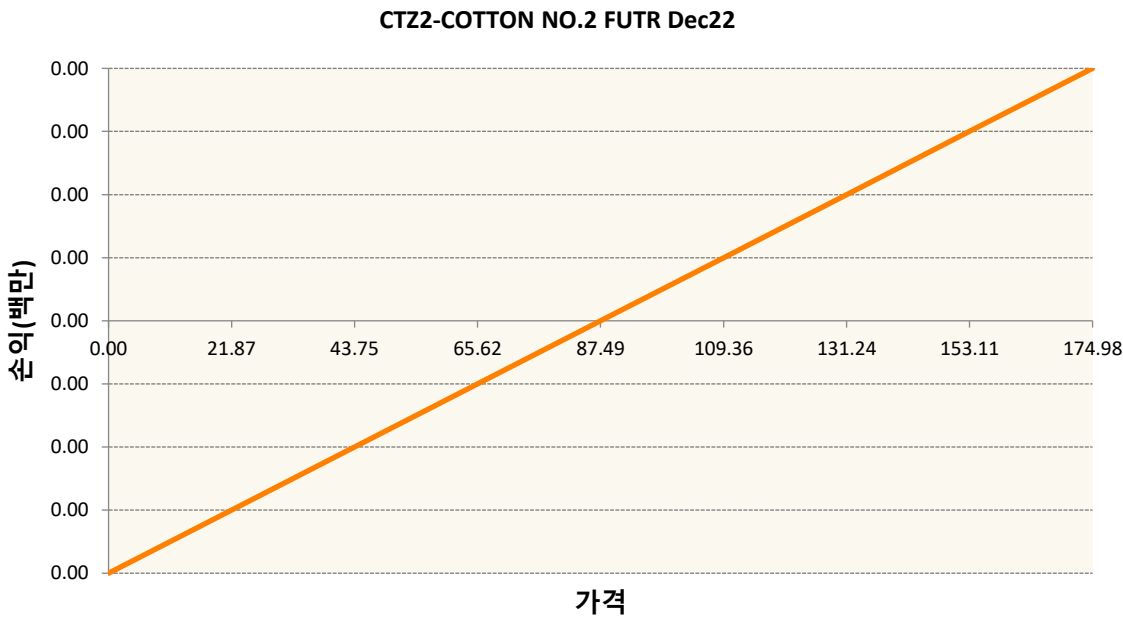
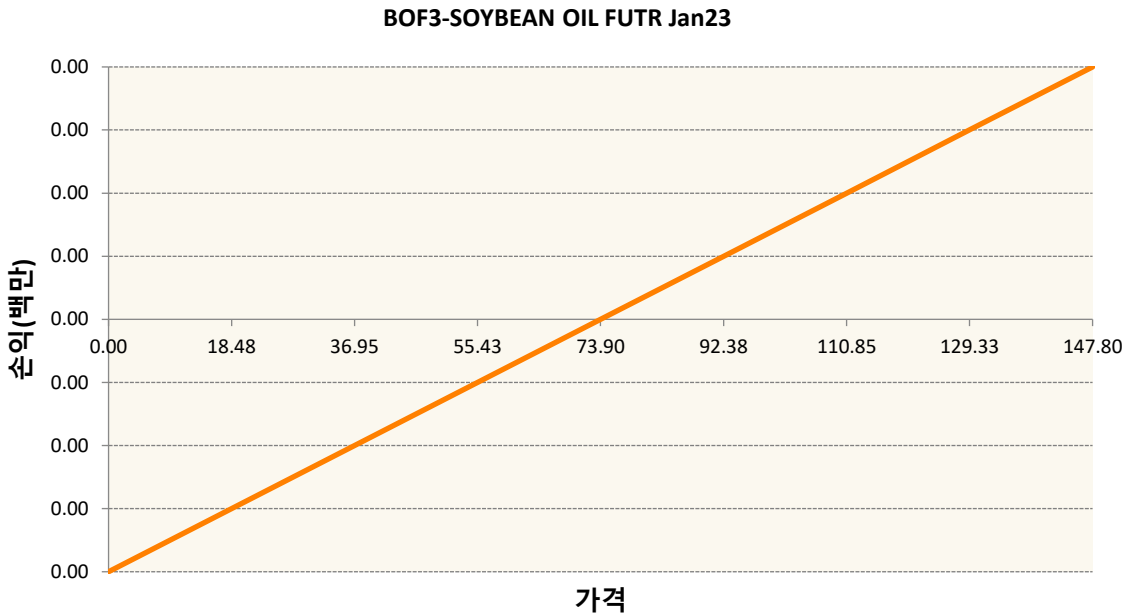
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

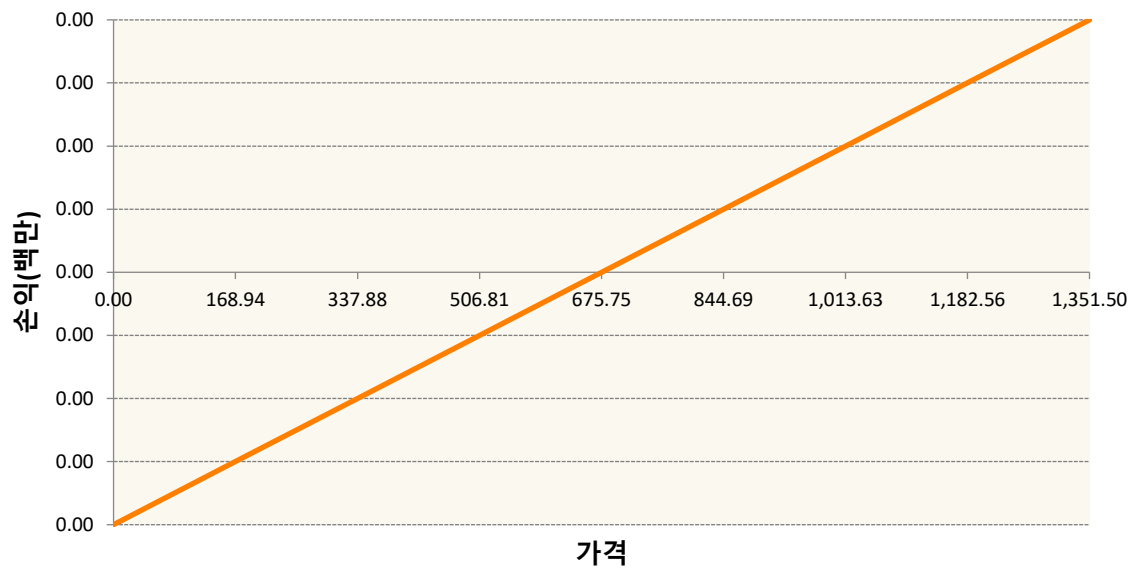
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,699 | 830   | 5,869     |    |

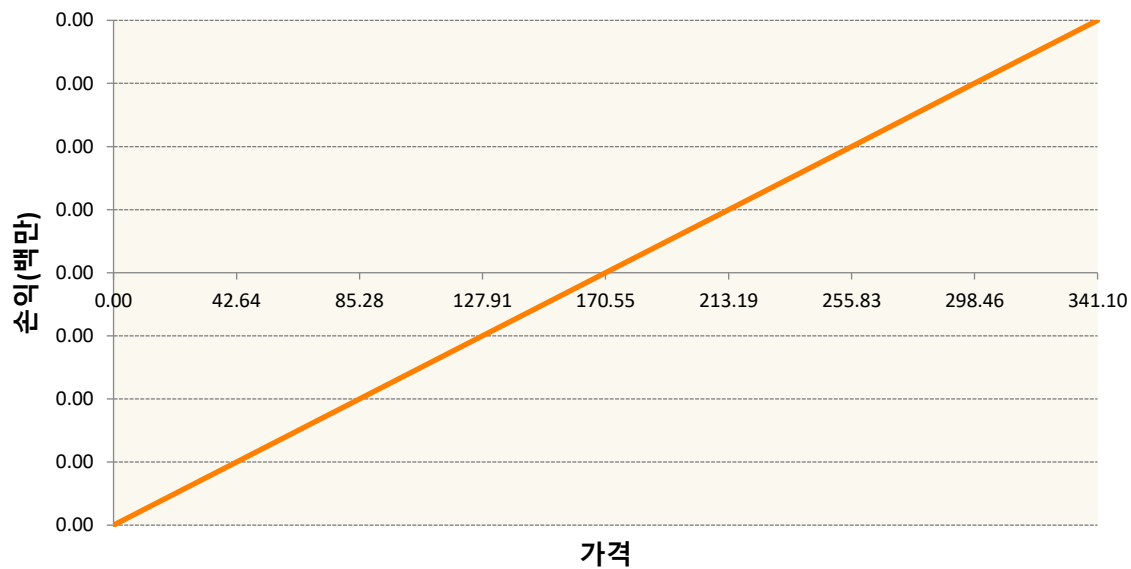
### 2. 만기시점의 손익구조



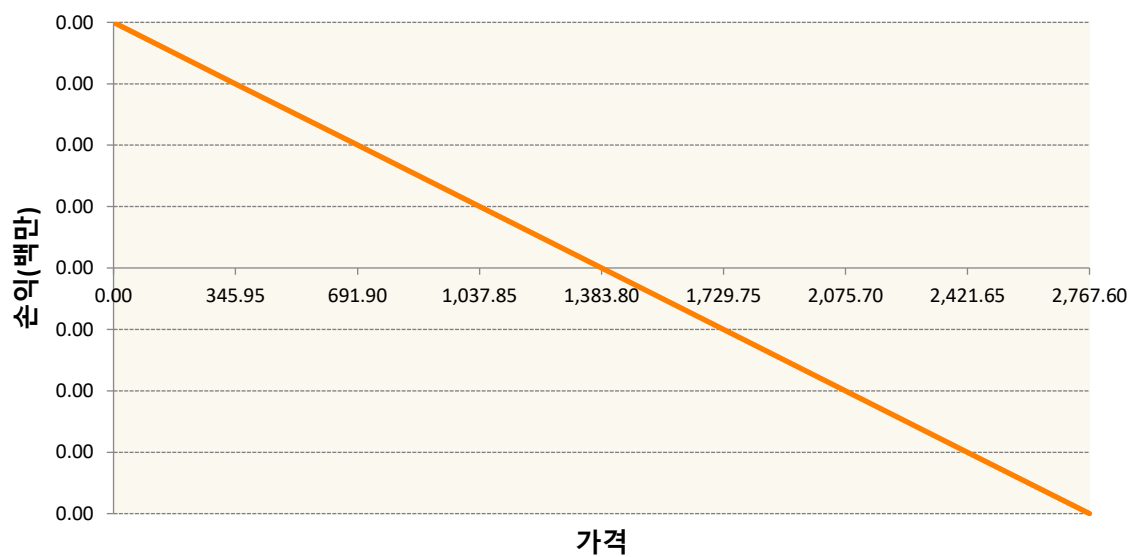
CZ2-CORN FUTURE Dec22



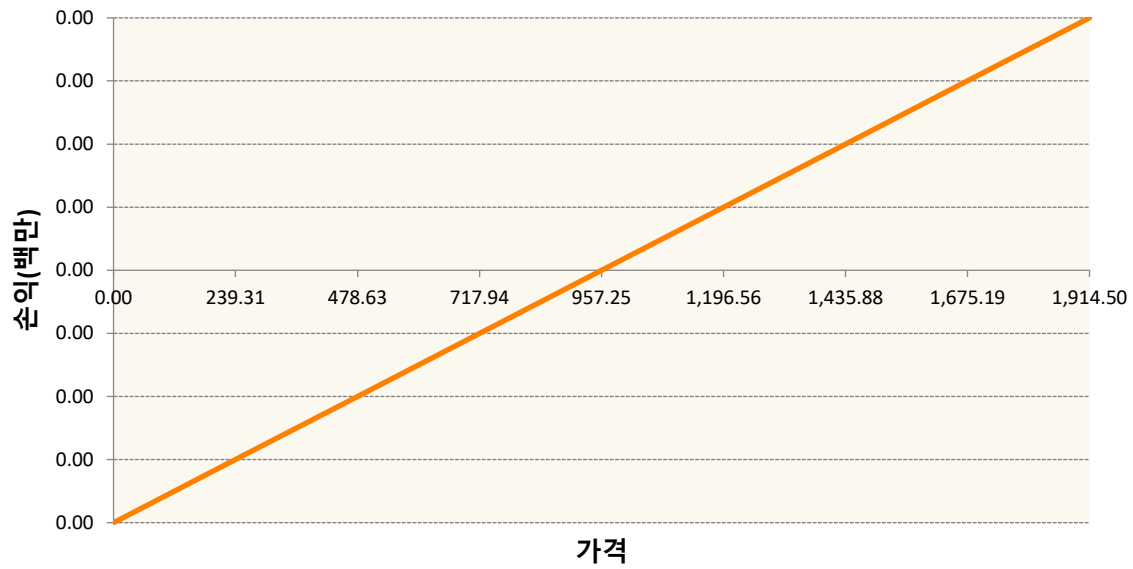
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



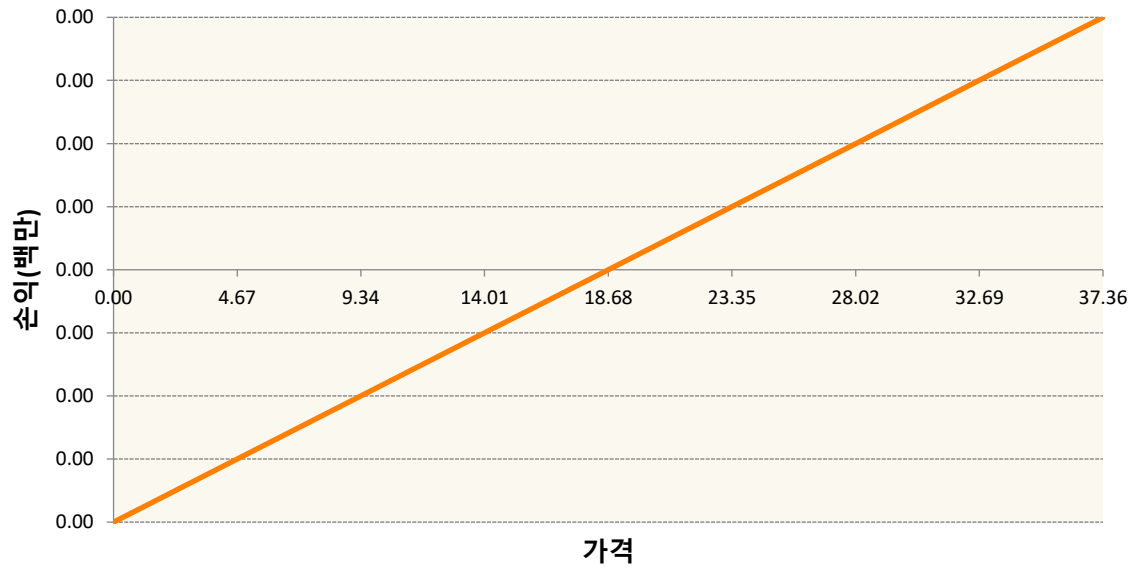
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



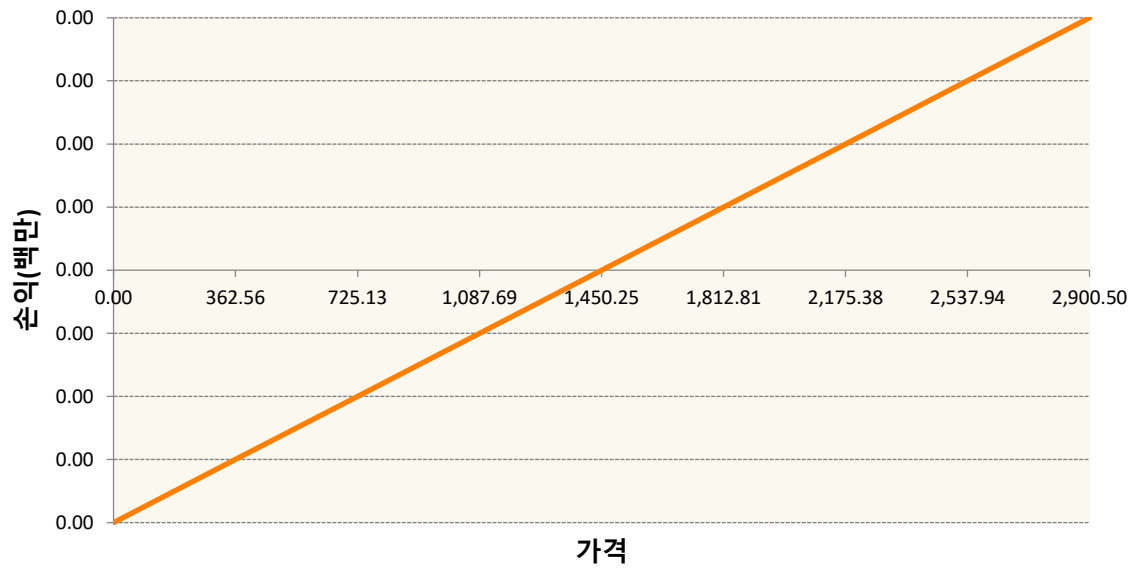
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22



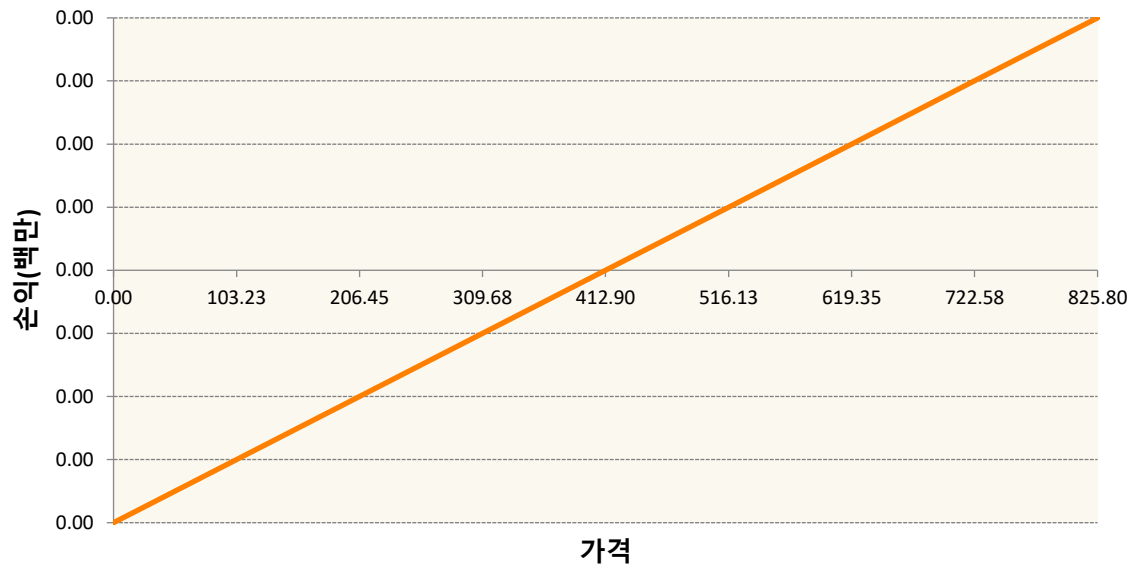
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



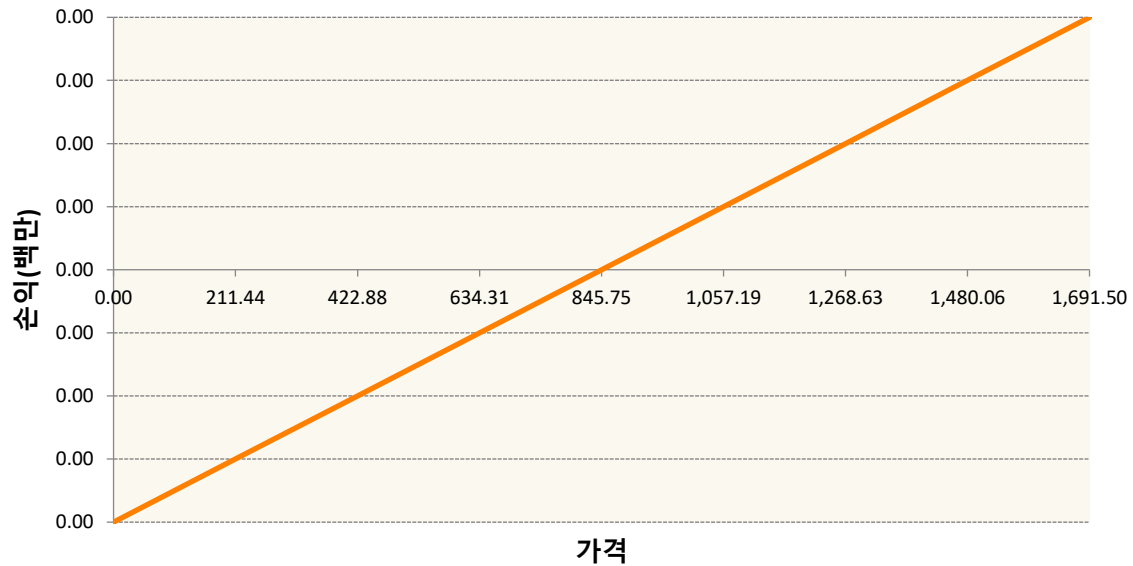
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



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 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

# 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

338

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

464

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

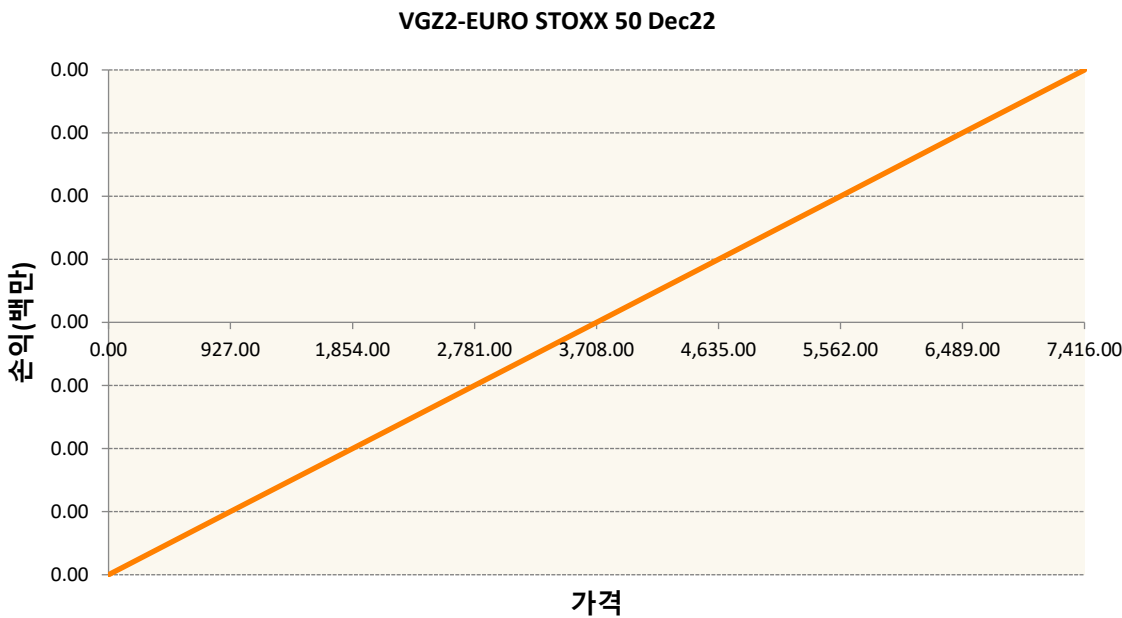
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 515   | 0     | 515       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

44

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

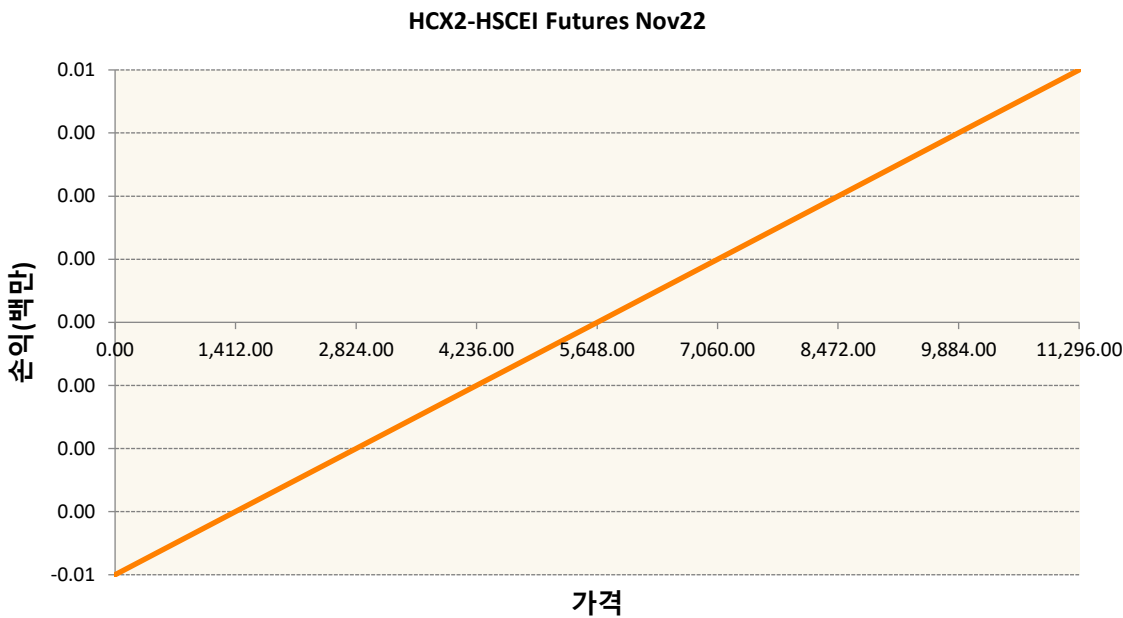
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 970   | 0     | 970       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HGX2 | HSCEI Futures Nov22 | 78 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

124

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

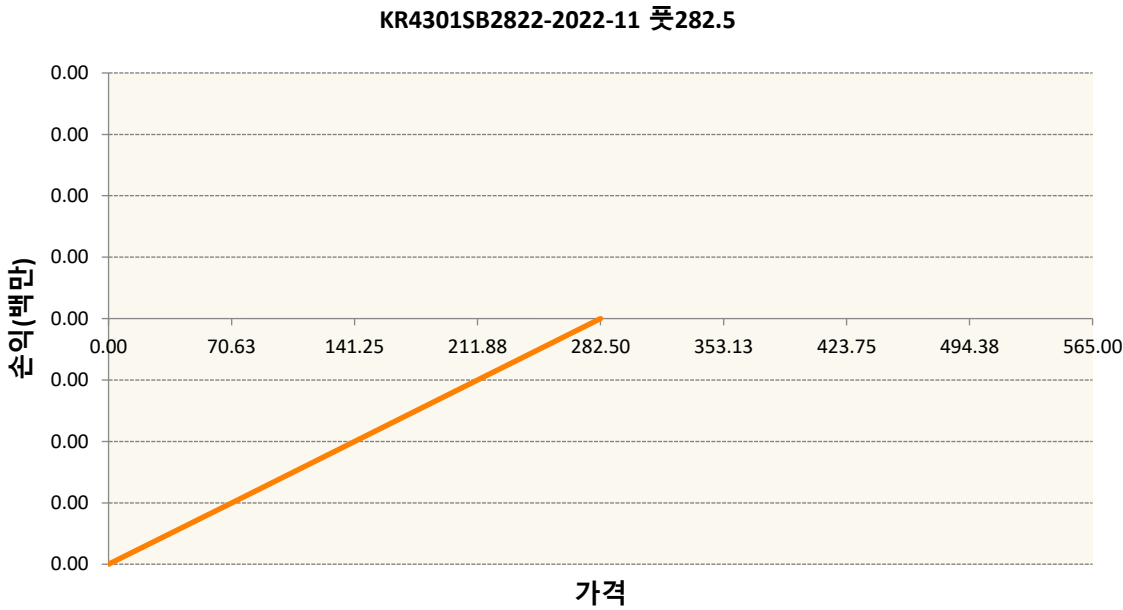
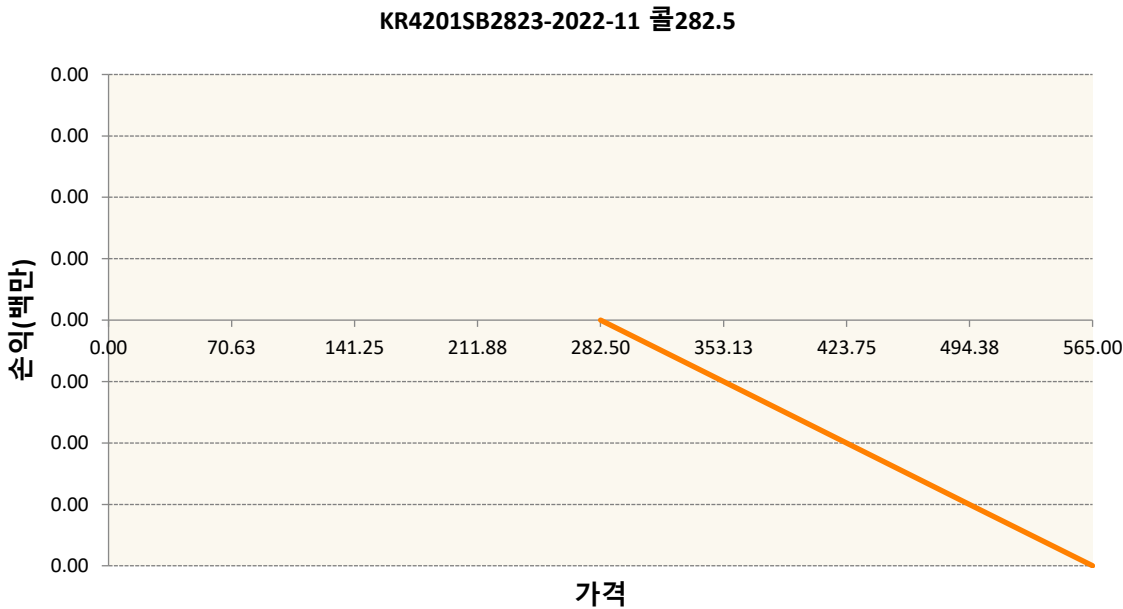
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

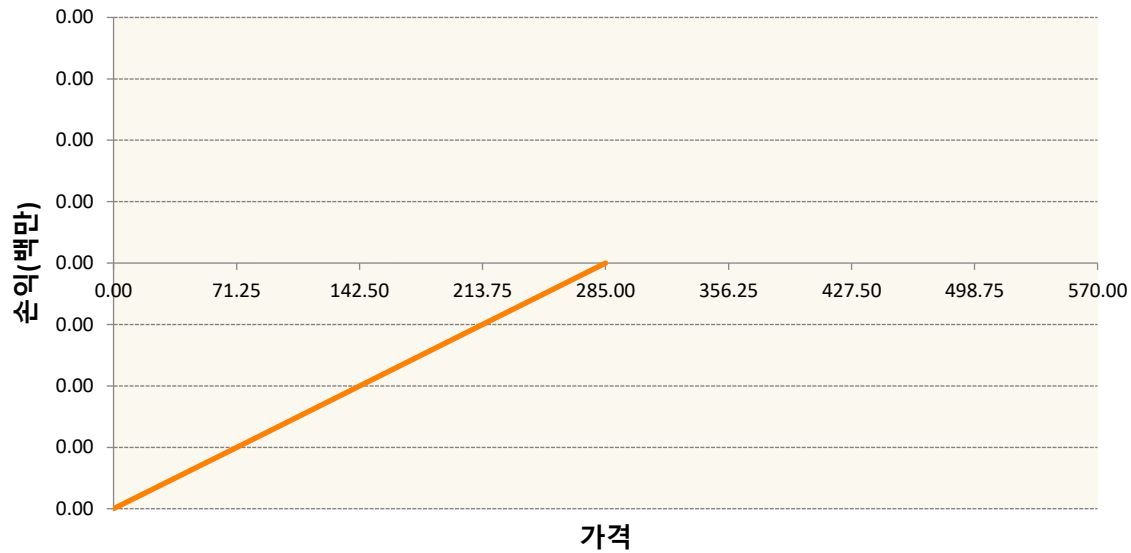
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 1,282 | 0      | 1,282     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 49,232 | -49,232   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301SB2855-2022-11 풋285



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|              |           |         |                |        |        |        |        |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
| KR4201SB2823 |           |         | 2022-11 콜282.5 |        |        |        | 3,662  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 3,540     | 3,508   | 3,475          | 3,441  | 3,406  | 3,370  | 3,333  |
| -5.33%       | 2,435     | 2,429   | 2,420          | 2,408  | 2,394  | 2,378  | 2,360  |
| -2.67%       | 1,221     | 1,221   | 1,220          | 1,218  | 1,216  | 1,212  | 1,207  |
| 0%           | 0         | 0       | 0              | 0      | 0      | -1     | -1     |
| 2.67%        | -1,221    | -1,221  | -1,221         | -1,221 | -1,221 | -1,221 | -1,221 |
| 5.33%        | -2,442    | -2,442  | -2,442         | -2,442 | -2,442 | -2,442 | -2,442 |
| 8.00%        | -3,662    | -3,662  | -3,662         | -3,662 | -3,662 | -3,662 | -3,662 |
| KR4301SB2822 |           |         | 2022-11 풋282.5 |        |        |        | 56     |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -21       | -26     | -32            | -38    | -44    | -50    | -56    |
| -5.33%       | -1        | -2      | -4             | -6     | -8     | -11    | -14    |
| -2.67%       | 0         | 0       | 0              | 0      | -1     | -1     | -2     |
| 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      |
| KR4301SB2855 |           |         | 2022-11 풋285   |        |        |        | 8      |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -4        | -5      | -5             | -6     | -7     | -7     | -8     |
| -5.33%       | 0         | -1      | -1             | -1     | -1     | -2     | -2     |
| -2.67%       | 0         | 0       | 0              | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 0%           | 0         | 0       | 0              | 0      | 0      | 0      | 0      |



공시일 2022-11-09

기준일 2022-11-08

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

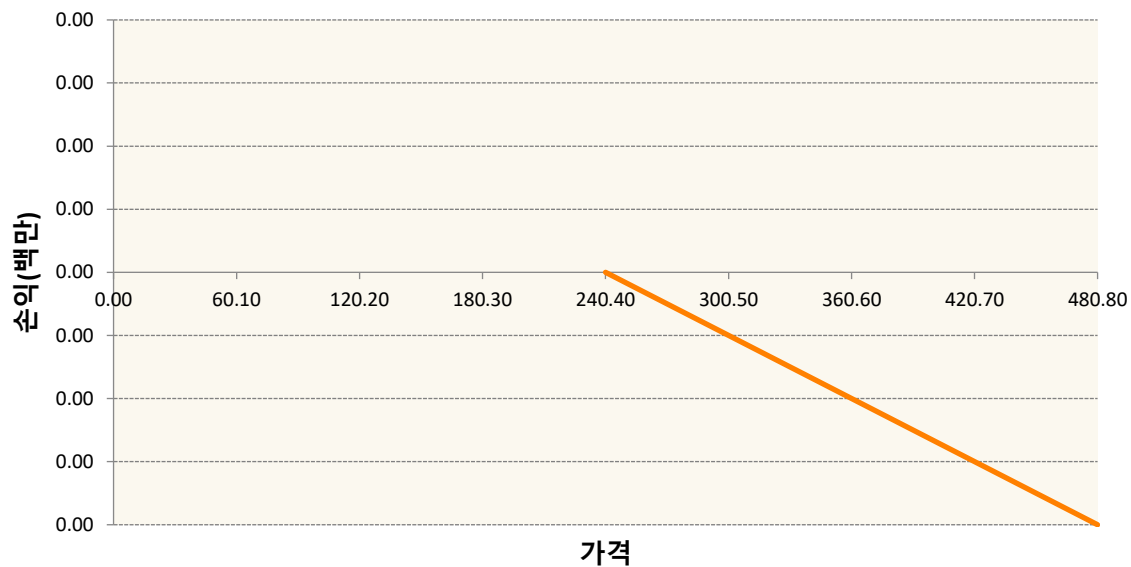
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

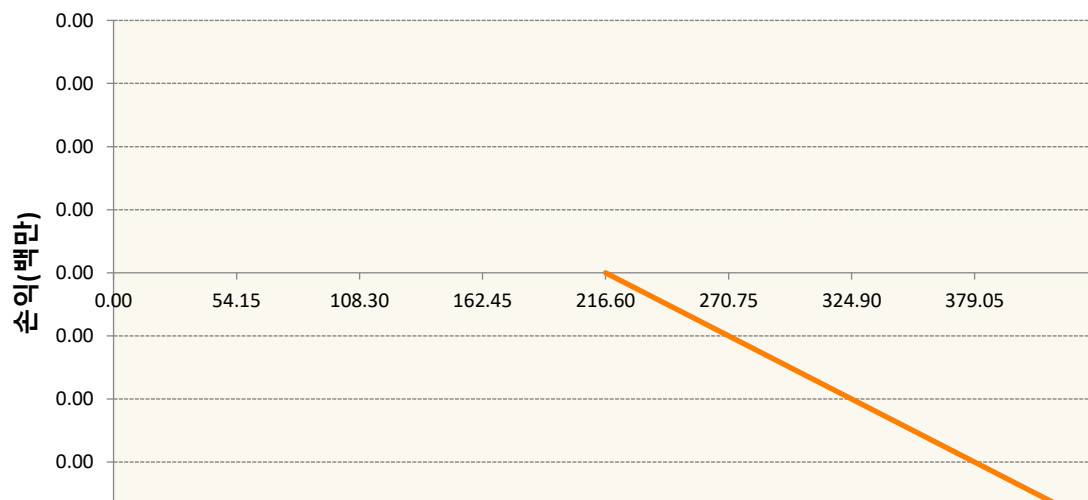
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,248 | 0     | 1,248     |    |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 172   | -172      | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,286 | -2,286    | 장외 |

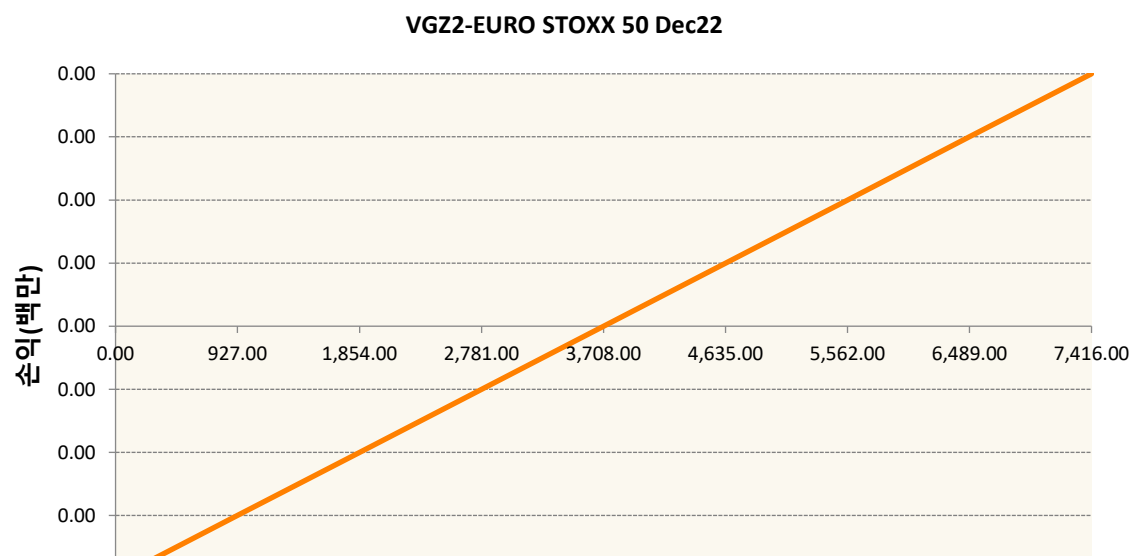
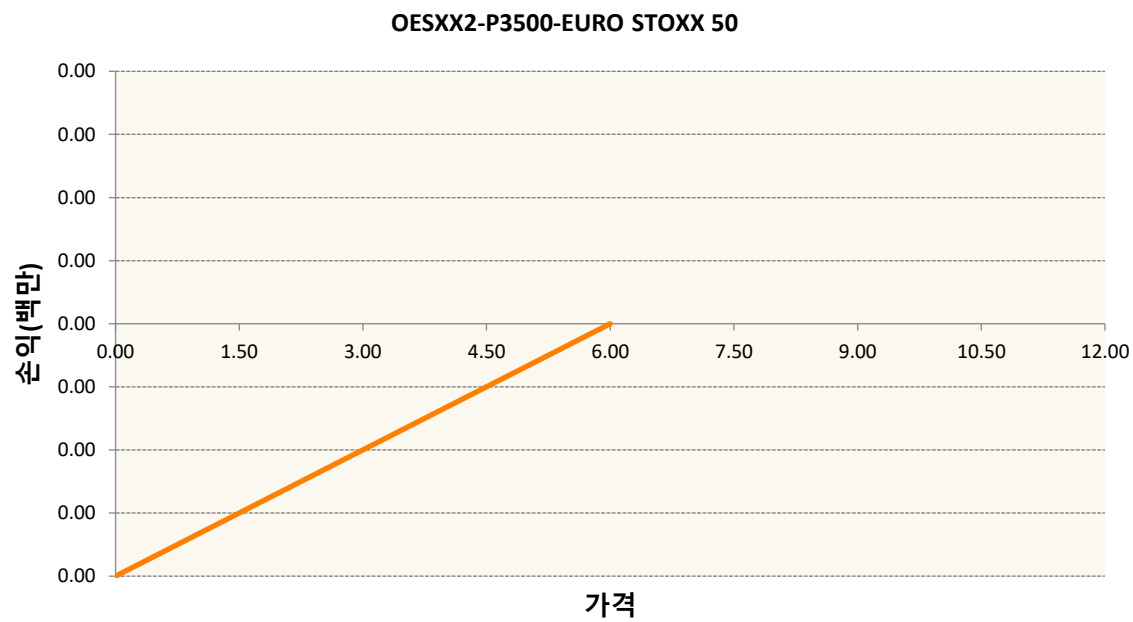
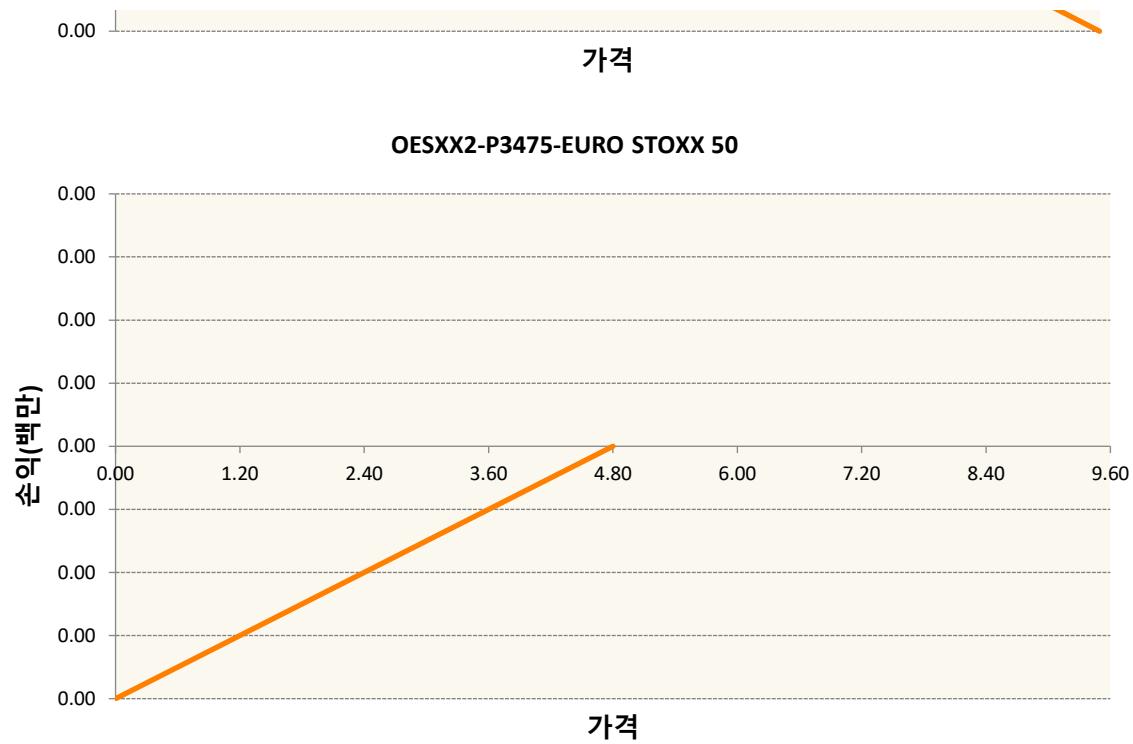
### 2. 만기시점의 손익구조

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 | 72   |
| FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E | 55   |
| FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E | 55   |
| OESXX2-C34 EURO STOXX 50    | 13   |
| OESXX2-C35 EURO STOXX 50    | 1    |
| OESXX2-P34 EURO STOXX 50    | 0.23 |
| OESXX2-P35 EURO STOXX 50    | 0.02 |
| VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22    | 100  |

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

(단위:백만원)

248

공시일 2022-11-09

기준일 2022-11-08

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

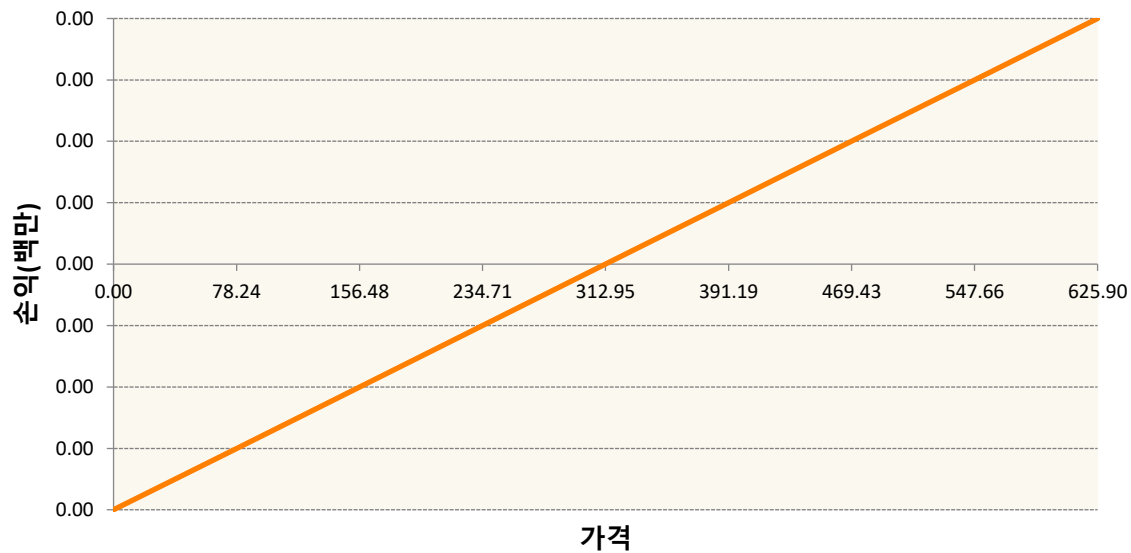
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

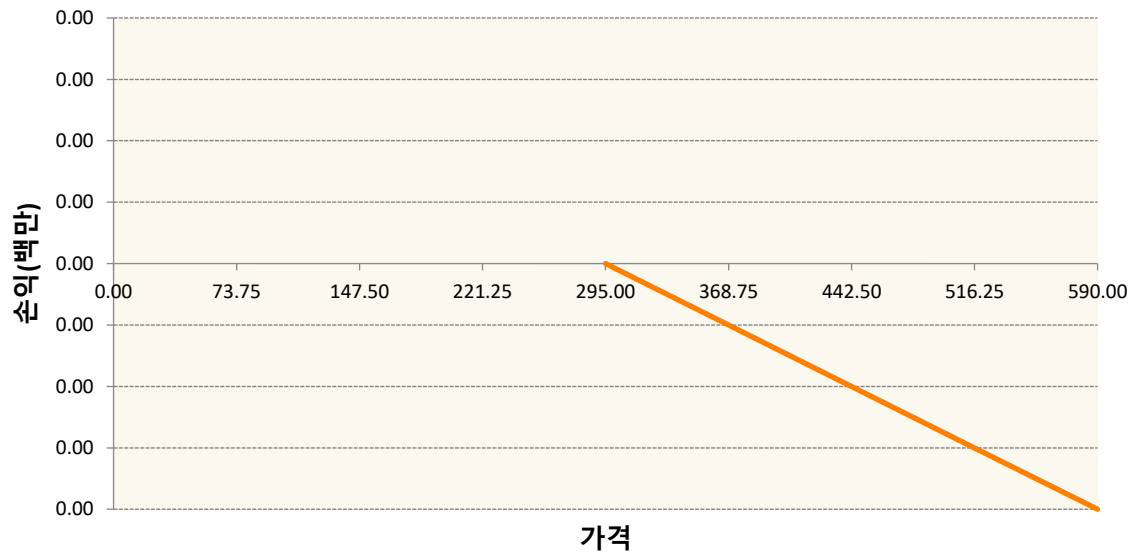
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 71    | 0     | 71        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 391   | 0     | 391       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 353   | 3,560 | -3,207    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

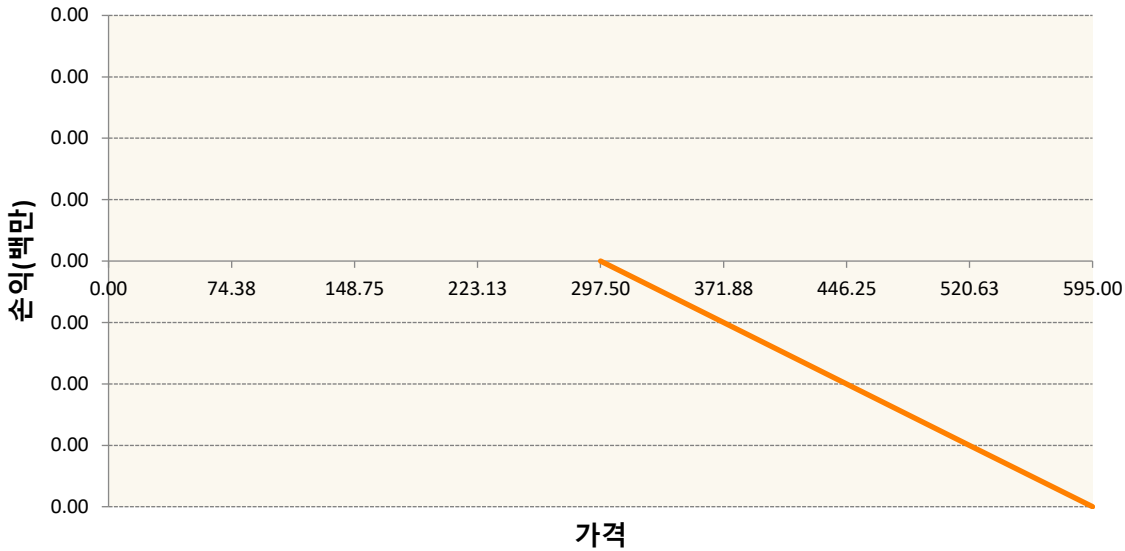
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



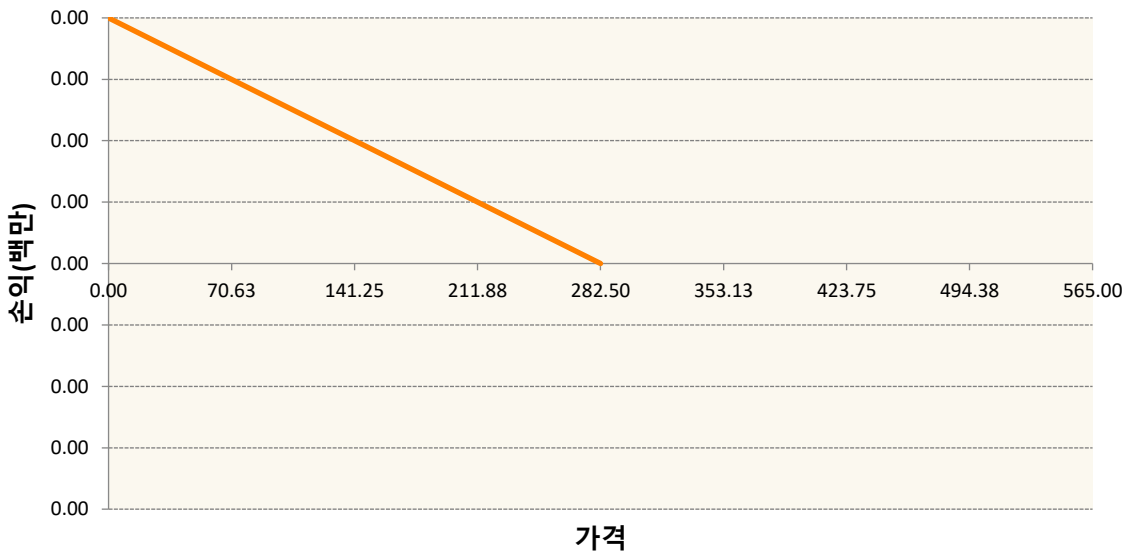
KR4201SB2955-2022-11 콜295



KR4201SB2971-2022-11 콜297.5



KR4301SB2822-2022-11 282.5



### 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 | 99 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |              |    |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| -8.00% | 67      | 67      | 66     | 65  | 65    | 64     | 63     |
| -5.33% | 57      | 56      | 55     | 54  | 53    | 52     | 51     |
| -2.67% | 33      | 32      | 31     | 31  | 30    | 29     | 28     |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | -1     |
| 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    |

KR4201SB2971

2022-11 콜297.5

198

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 117     | 116     | 115    | 114  | 113   | 112    | 110    |
| -5.33%    | 104     | 102     | 100    | 98   | 96    | 93     | 91     |
| -2.67%    | 63      | 62      | 60     | 58   | 56    | 54     | 53     |
| 0%        | 1       | 1       | 1      | 0    | -1    | -2     | -2     |
| 2.67%     | -65     | -65     | -65    | -65  | -65   | -65    | -66    |
| 5.33%     | -132    | -132    | -132   | -132 | -132  | -132   | -132   |
| 8.00%     | -198    | -198    | -198   | -198 | -198  | -198   | -198   |

KR4301SB2822

2022-11 풋282.5

3

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 1       | 1       | 2      | 2  | 2     | 2      | 3      |
| -5.33%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 1      | 1      |
| -2.67%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 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)

355

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

## 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 | 6,827 | 0     | 6,827     |    |

### 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 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

## 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 | 5,994 | 0     | 5,994     |    |

### 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 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

## 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 | 18,821 | 0      | 18,821    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 18,454 | -18,454   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E | 619 |
| FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E | 515 |
| FXW213CAR·KRW/USD 30-01-23E | 286 |
| FXW213CB1(KRW/USD 28-11-22E | 55  |
| IE00BD8RGM75                |     |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

653

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

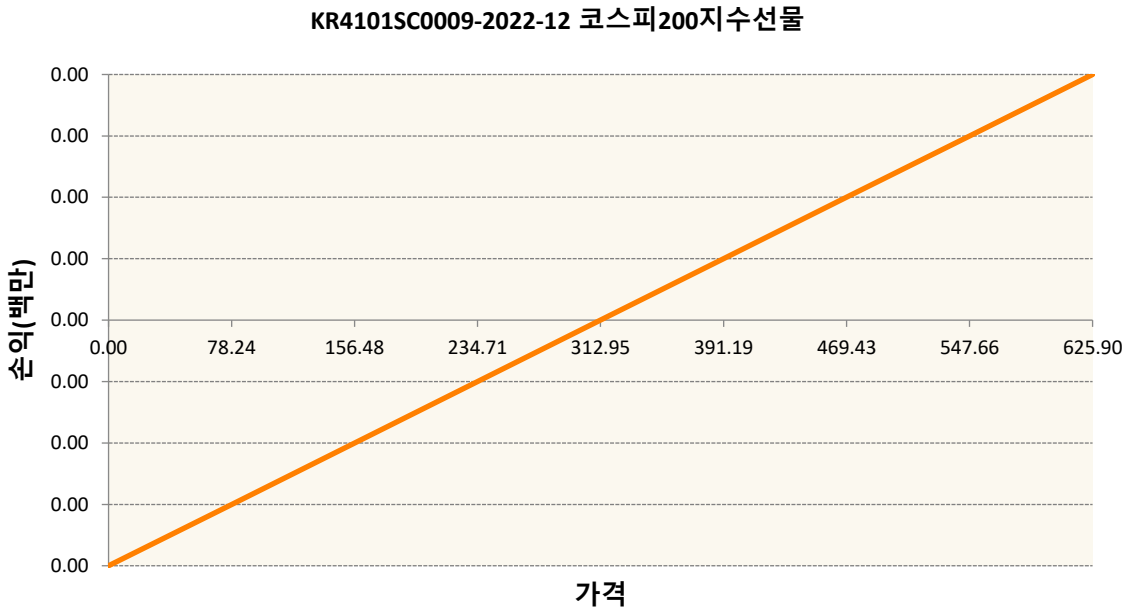
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 391   | 0     | 391       | 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 2022-11-09

기준일 2022-11-08

## 스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

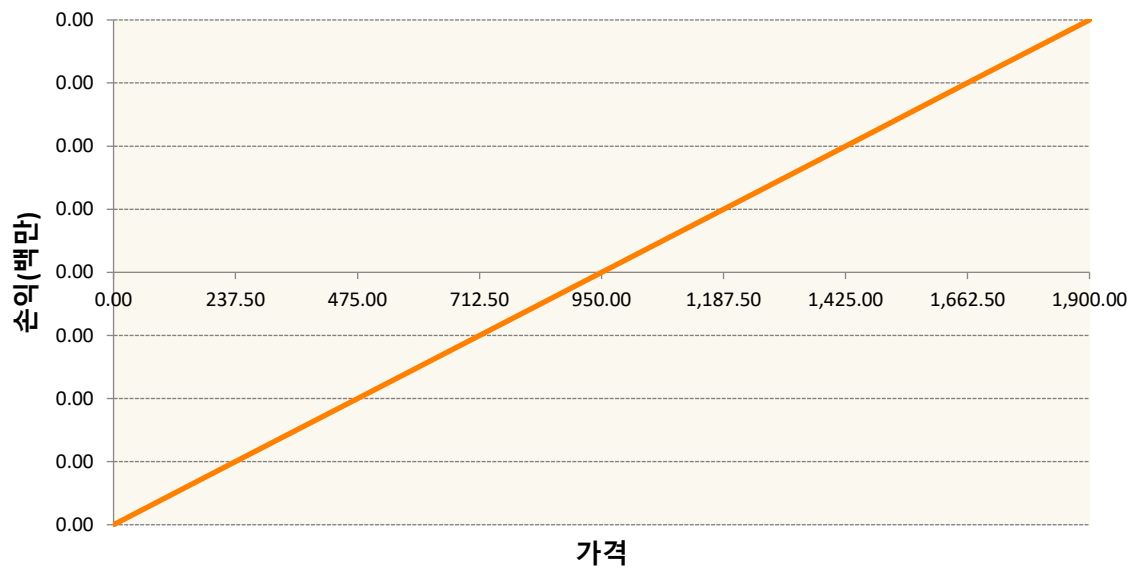
### 1. 계약금액

(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   | 83    | 0     | 83        |    |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 1,319 | 0     | 1,319     | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 623   | 845   | -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 |
| 7 |

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

(단위:백만원)

207

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

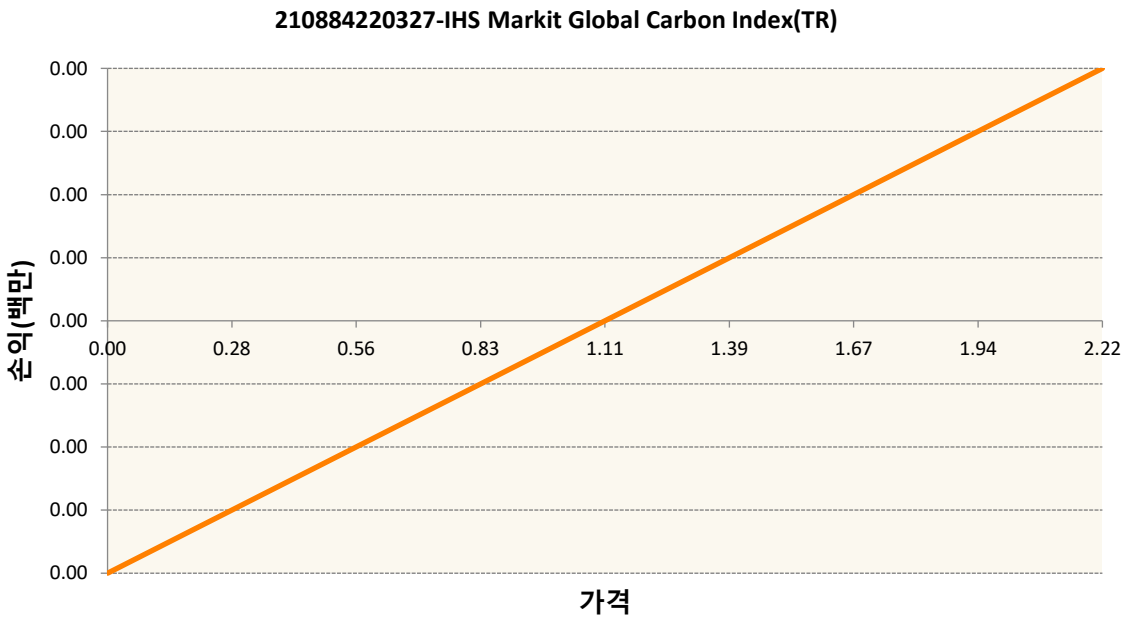
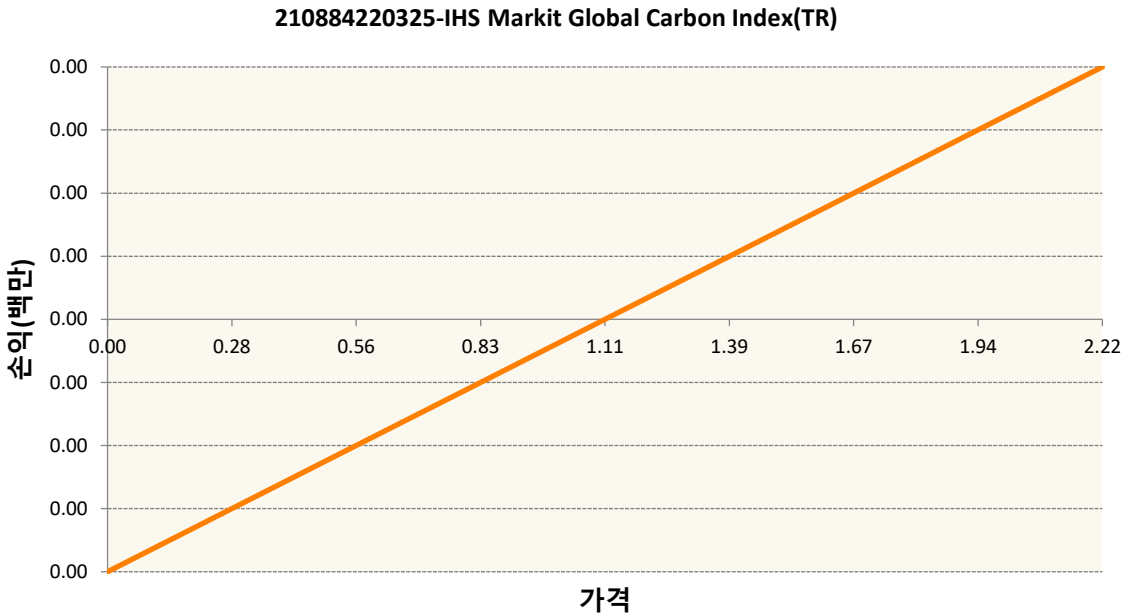
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 1. 계약금액

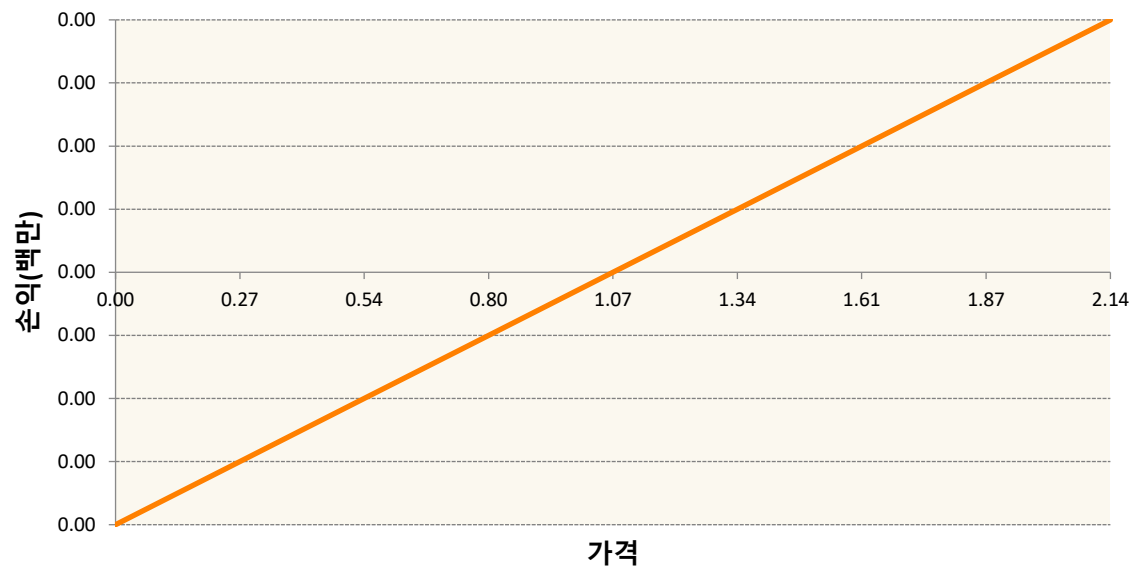
(단위:백만원)

| 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



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) | 2,121 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 4,628 |
|-------|

공시일 2022-11-09

기준일 2022-11-08

## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

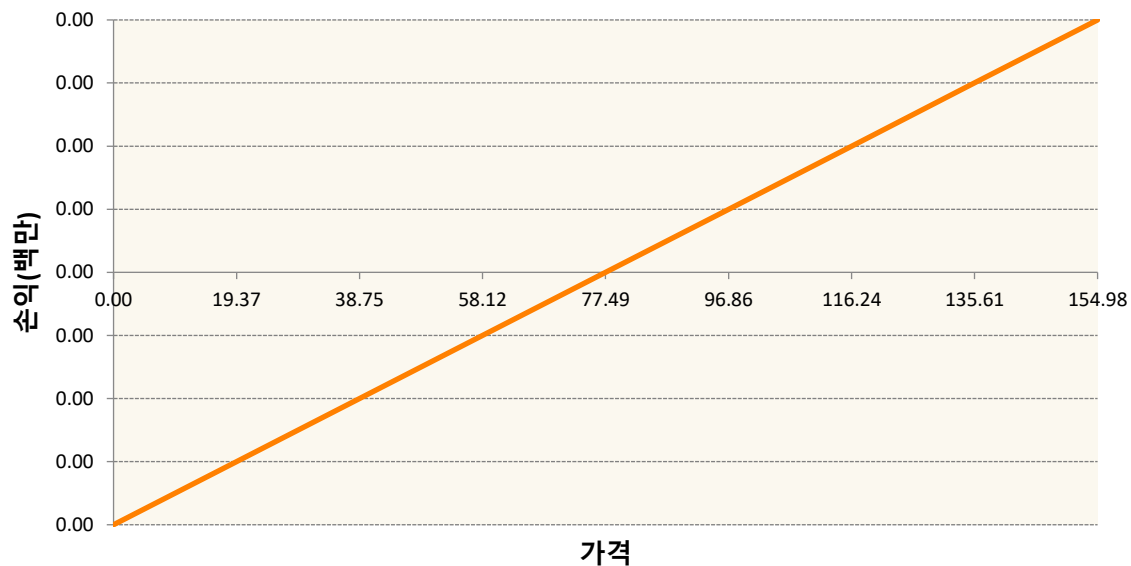
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

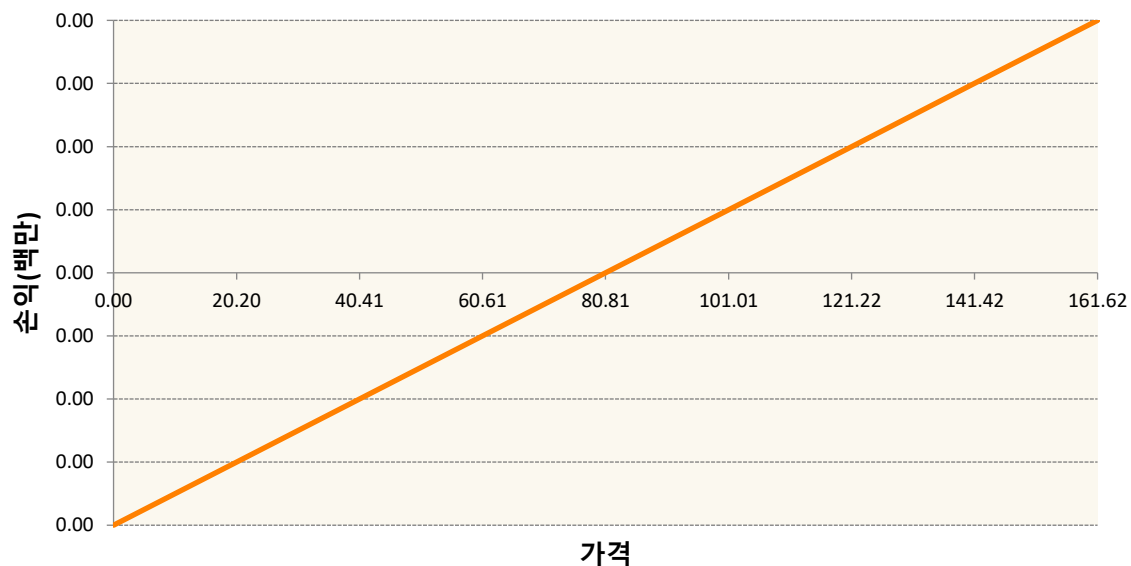
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 14,577 | 0     | 14,577    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 4,894 | -4,894    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

MOZ22-ECX EMISSION Dec22



MOZ23-ECX EMISSION Dec23



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |                    | (단위:백만원) |
|-----------------------------|--------------------|----------|
| FXW213CAT(KRW/EUR 23-11-22E |                    | 367      |
| FXW213CB7(KRW/EUR 23-11-22E |                    | 8        |
| FXW213CB8(KRW/EUR 23-11-22E |                    | 17       |
| MOZ22                       | ECX EMISSION Dec22 | 924      |
| MOZ23                       | ECX EMISSION Dec23 | 242      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 3,274    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

# 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)  | 3 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)  | 3 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)  | 3 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠) | 3 |

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

(단위:백만원)

26

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

# 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)  | 15 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 18 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 15 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220714(메리츠) | 22 |

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

(단위:백만원)

94

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

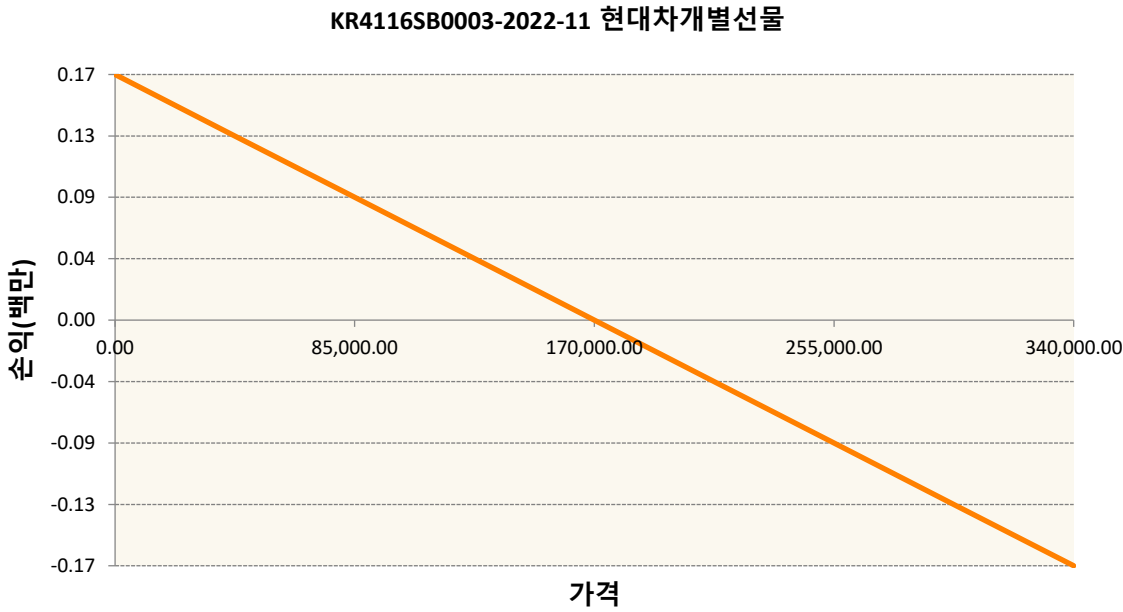
## 에퀴티알파일반사모혼합자산

### 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    | 0.43 |
| KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602 | 0.46 |

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

(단위:백만원)

64

공시일 2022-11-09

기준일 2022-11-08

## 신한SOL한국형글로벌반도체엑티

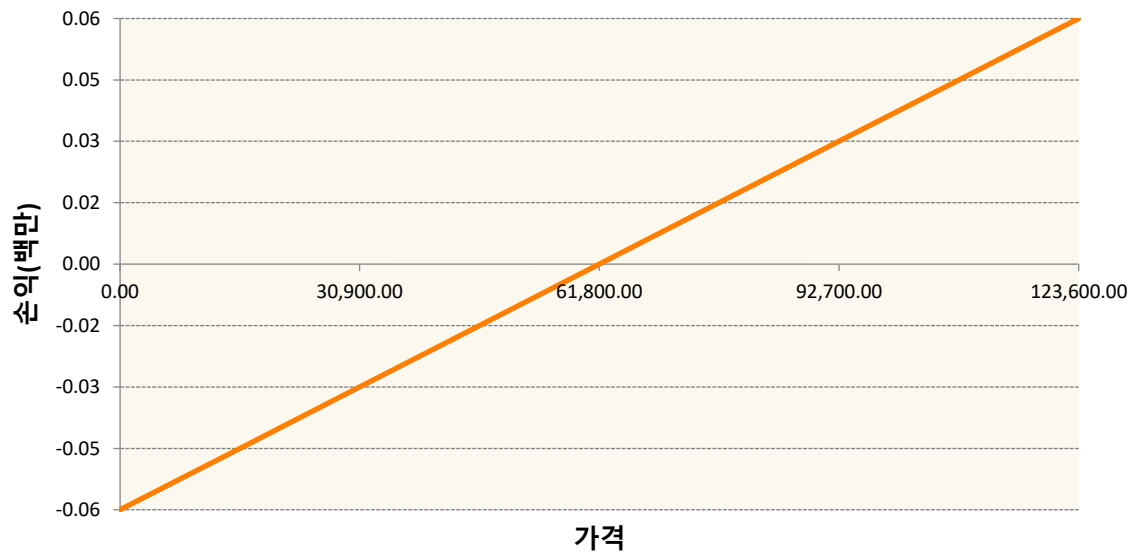
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

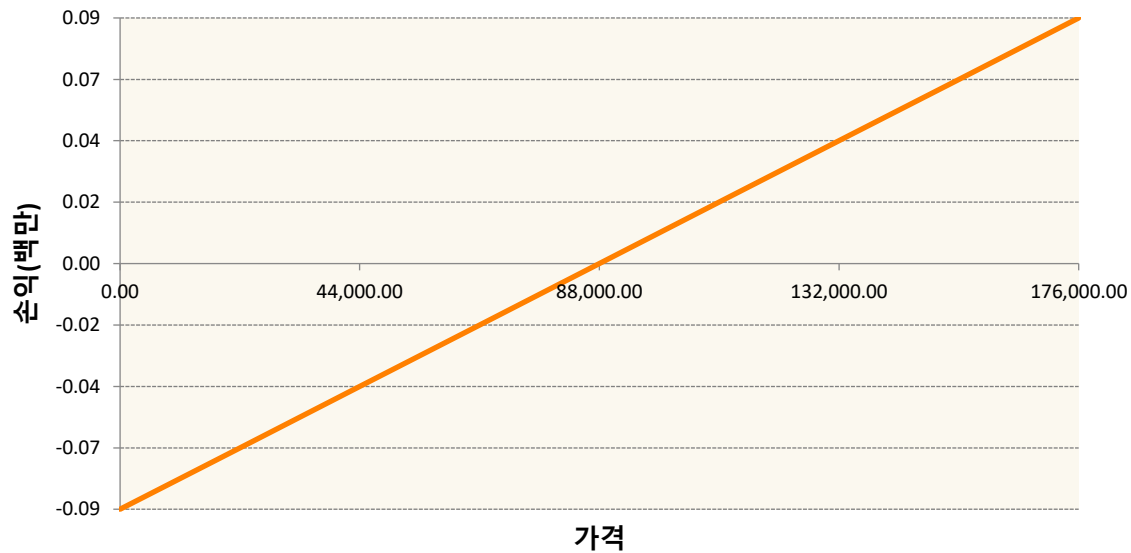
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 668   | 0     | 668       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4111SB0008-2022-11 삼성전자개별선물



KR4150SB0000-2022-11 SK하이닉스개별선물



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4111SB0008 |           | 2022-11 삼성전자개별선물   |        |     |       |        | 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     |
| KR4150SB0000 |           | 2022-11 SK하이닉스개별선물 |        |     |       |        | 25     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -25       | -25                | -25    | -25 | -25   | -25    | -25    |
| -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%        | 25        | 25                 | 25     | 25  | 25    | 25     | 25     |

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

64

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

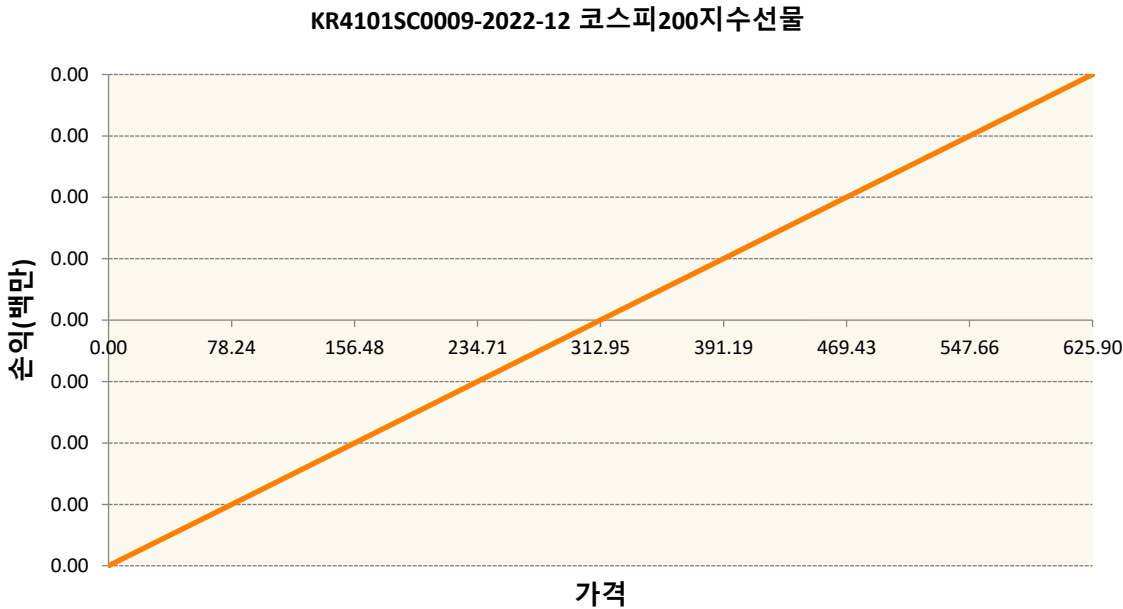
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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   | 391   | 0     | 391       | 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 2022-11-09

기준일 2022-11-08

## SOL한국형글로벌전기차&2차전지

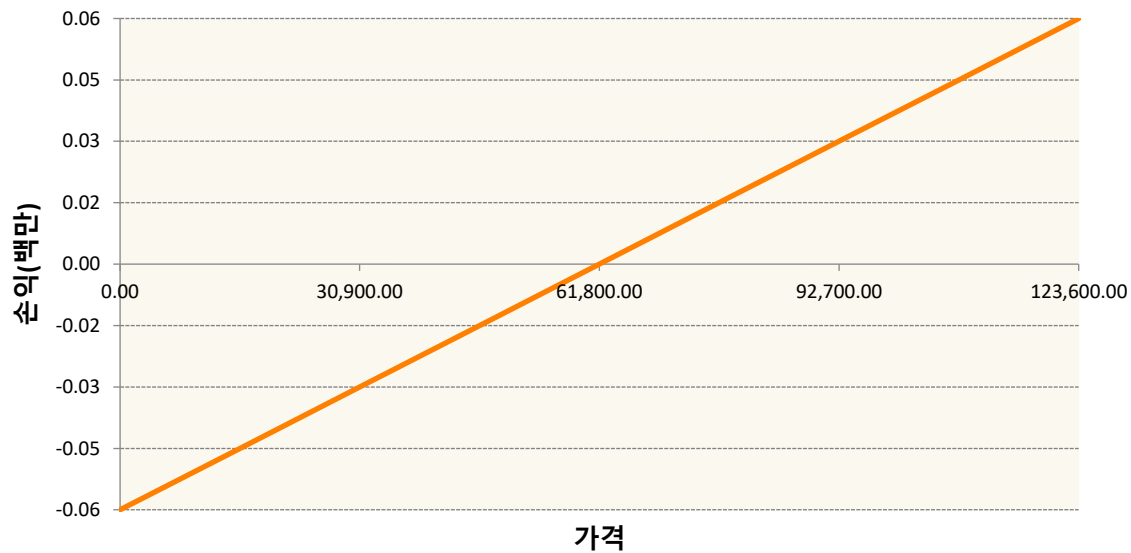
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

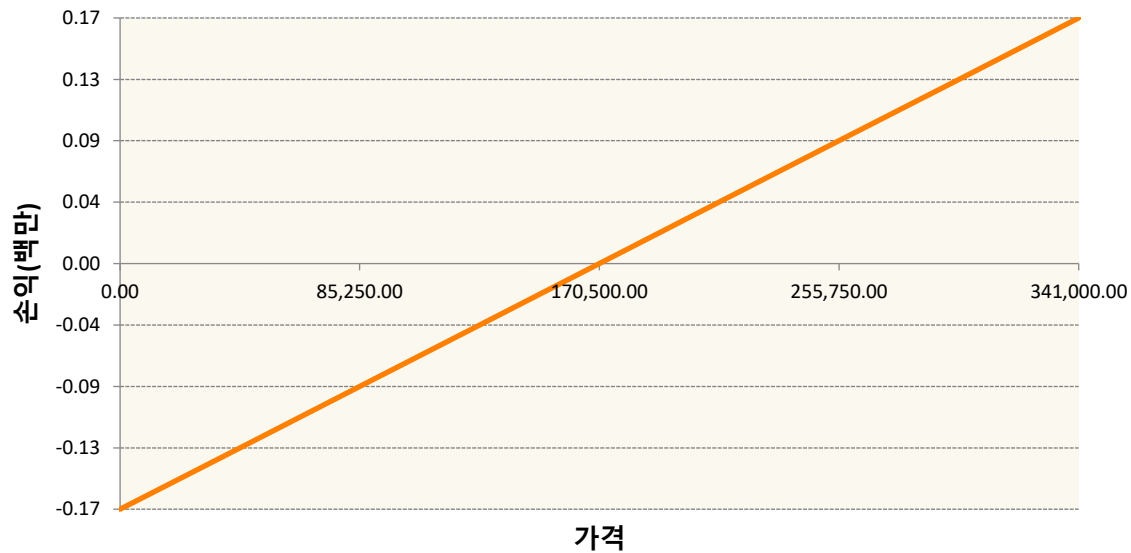
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 303   | 0     | 303       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 305   | 0     | 305       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

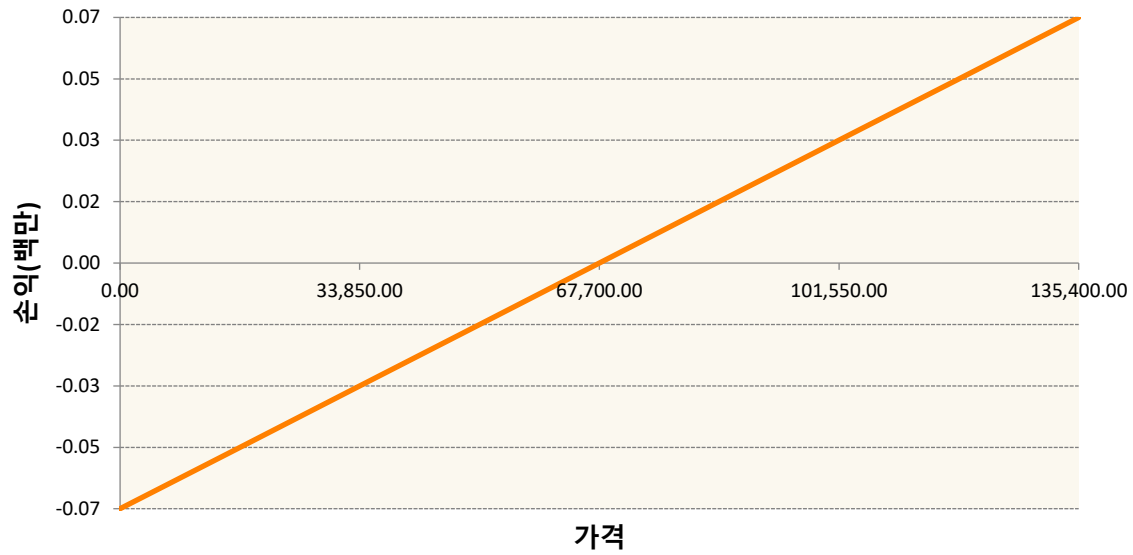
KR4111SC0007-2022-12 삼성전자개별선물



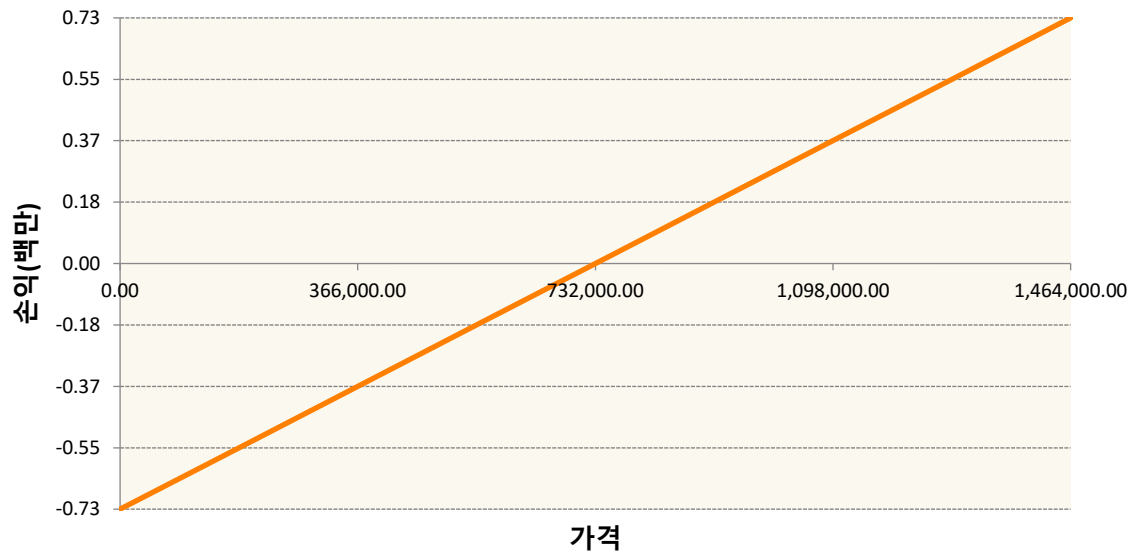
KR4116SC0002-2022-12 현대차개별선물



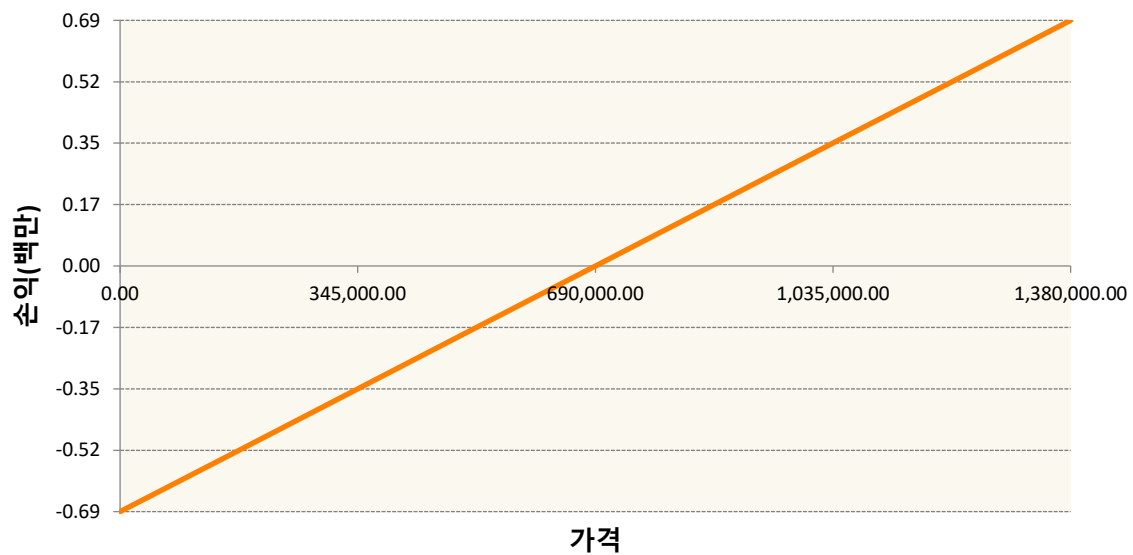
KR4119SC0009-2022-12 기아차개별선물



KR4122SC0004-2022-12 삼성SDI개별선물



KR4147SC0005-2022-12 LG화학개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |        |     |       |        |                   |     |    |
|--------------|-----------|---------|--------|-----|-------|--------|-------------------|-----|----|
| KR4111SC0007 |           |         |        |     |       |        | 2022-12 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   |    |
| KR4116SC0002 |           |         |        |     |       |        | 2022-12 현대차개별선물   |     | 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%       | -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%        | 4         | 4       | 4      | 4   | 4     | 4      | 4                 | 4   |    |
| KR4119SC0009 |           |         |        |     |       |        | 2022-12 기아차개별선물   |     | 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   |    |
| KR4122SC0004 |           |         |        |     |       |        | 2022-12 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  |    |
| KR4147SC0005 |           |         |        |     |       |        | 2022-12 LG화학개별선물  |     | 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     |
| -5.33% | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -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%  | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |
| 8.00%  | 2       | 2       | 2      | 2  | 2     | 2      | 2      |

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

(단위:백만원)

29

공시일 2022-11-09

기준일 2022-11-08

## SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

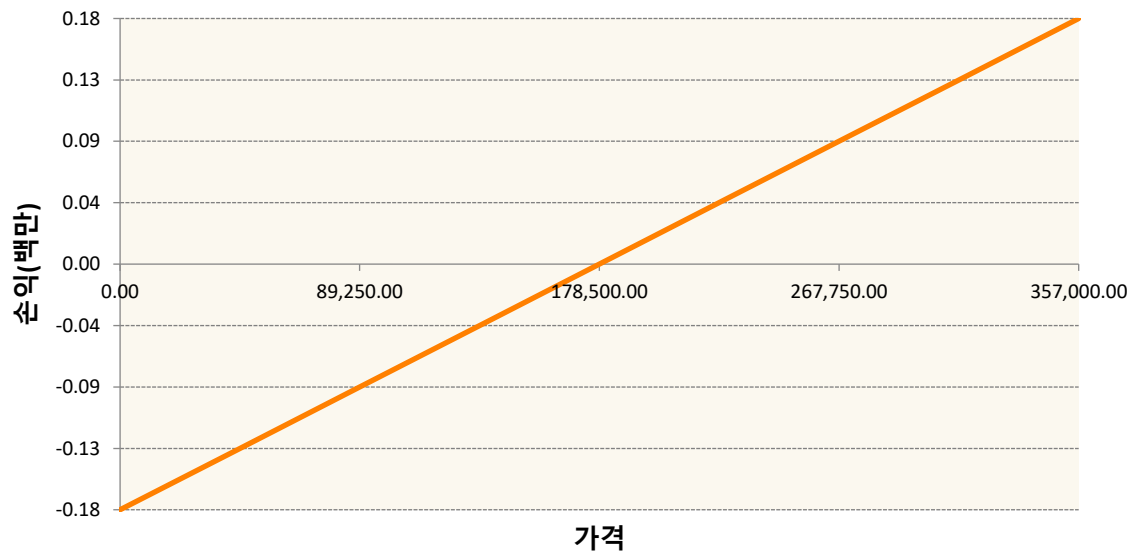
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

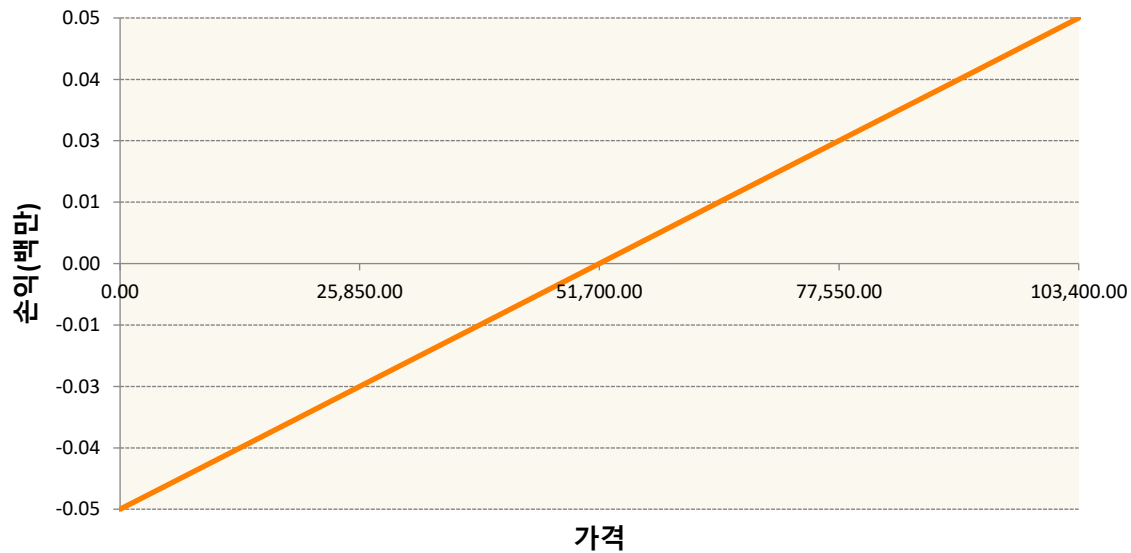
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 109   | 0     | 109       | 장내 |

### 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)

16

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2022-11-09 |
| 기준일 | 2022-11-08 |

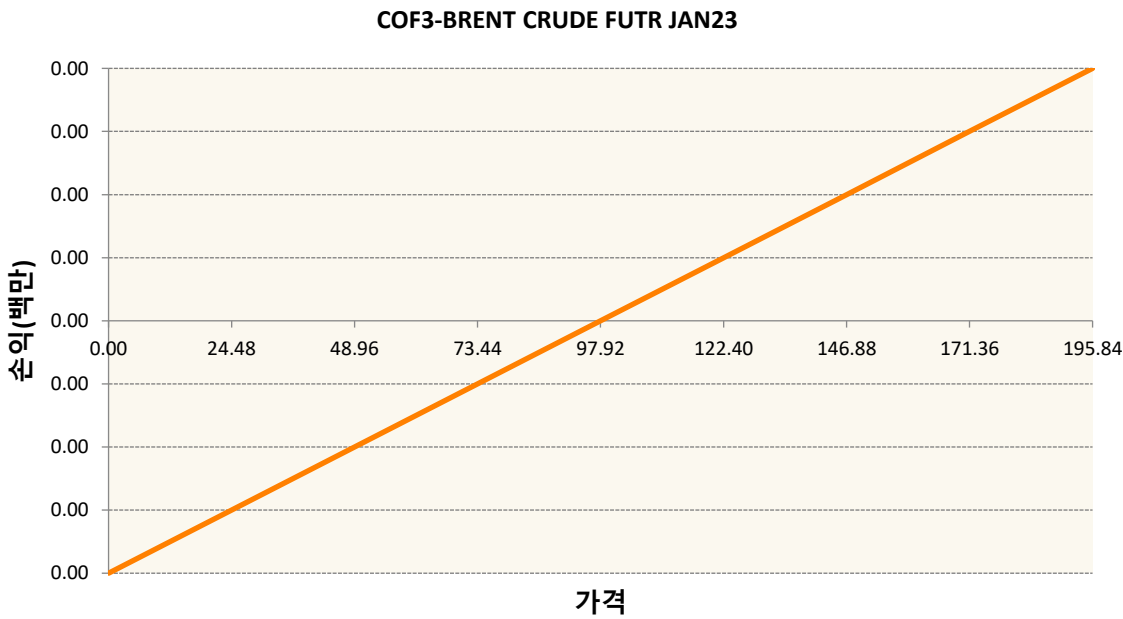
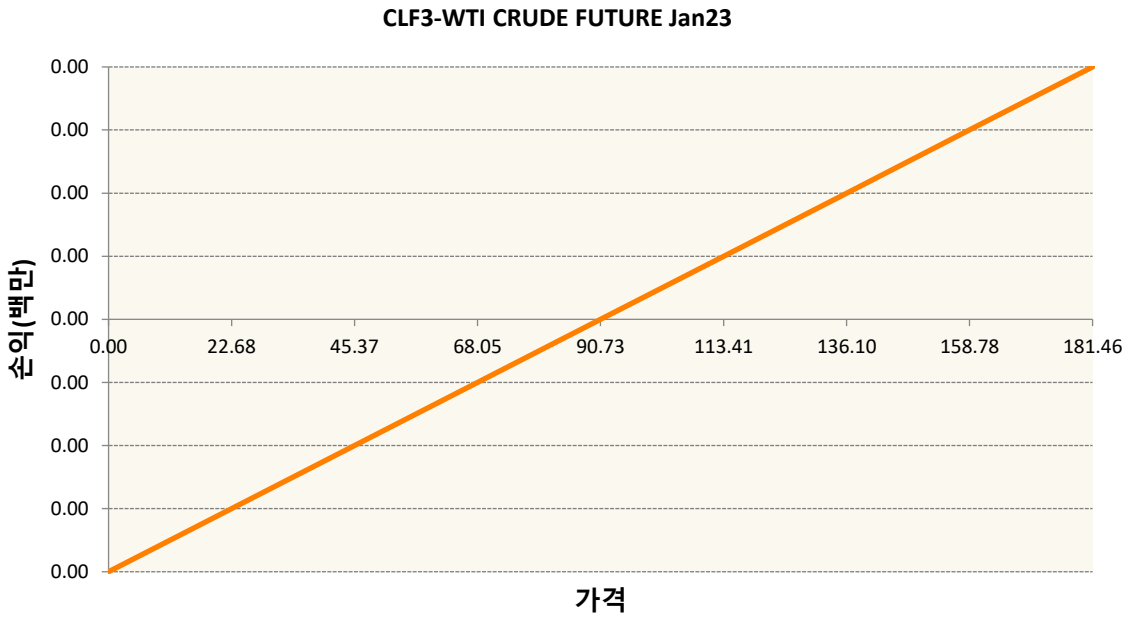
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

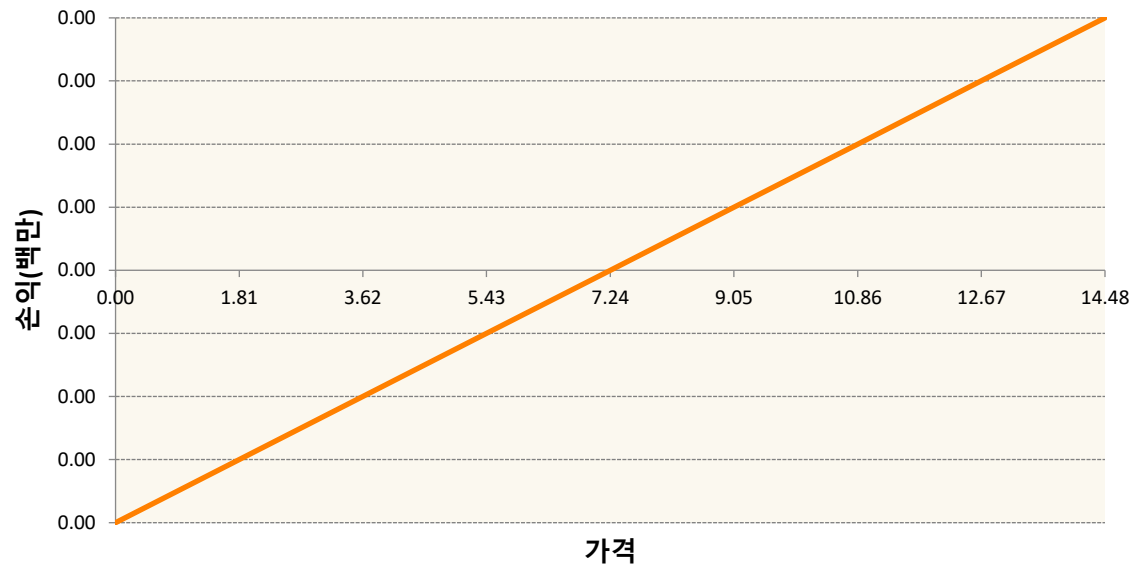
(단위:백만원)

| 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 | 258   | 0     | 258       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,624 | 277   | 1,347     |    |

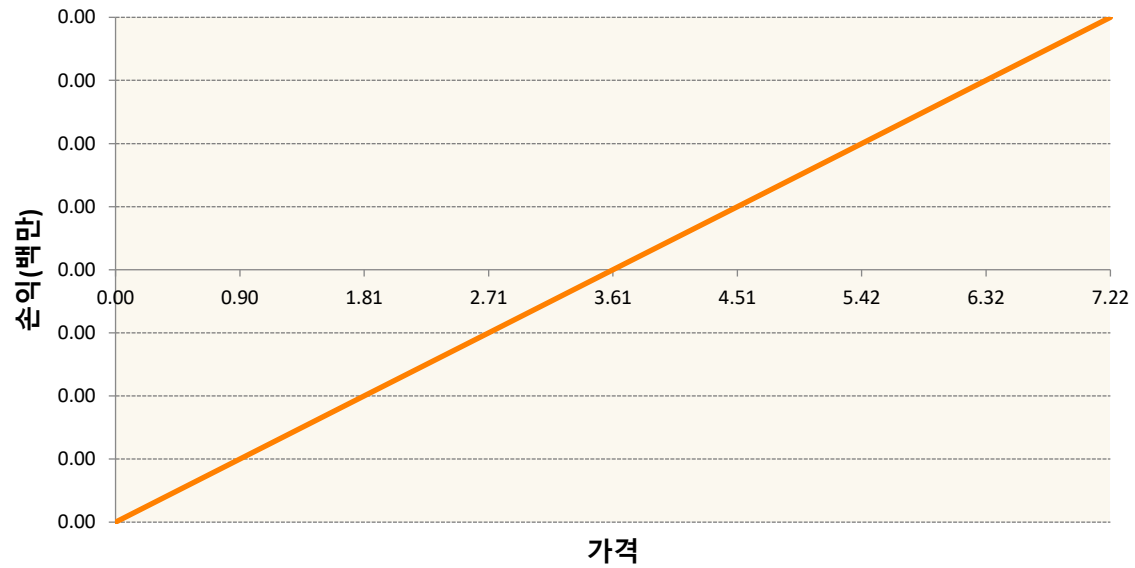
### 2. 만기시점의 손익구조



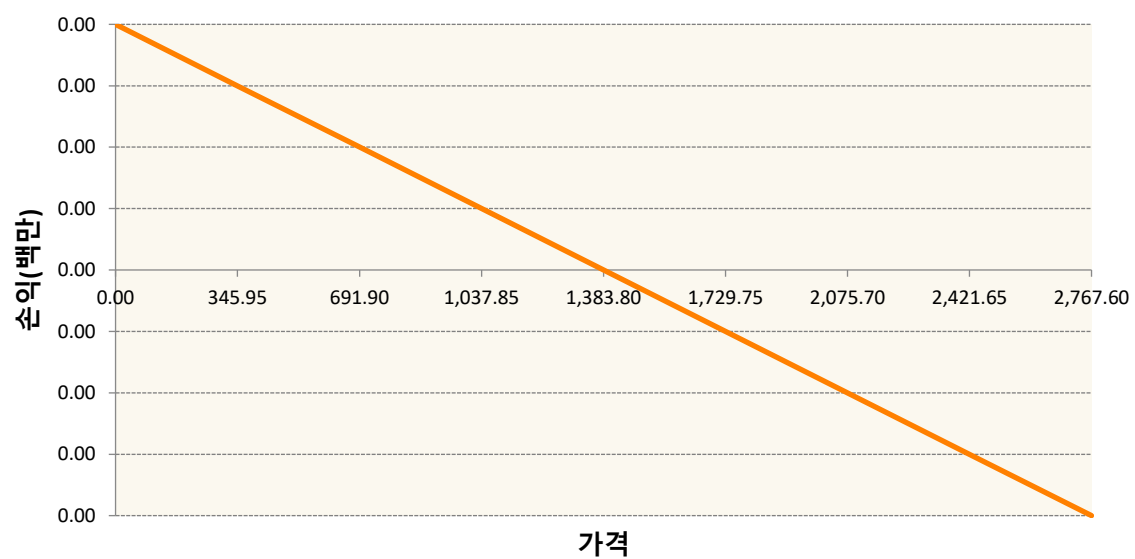
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



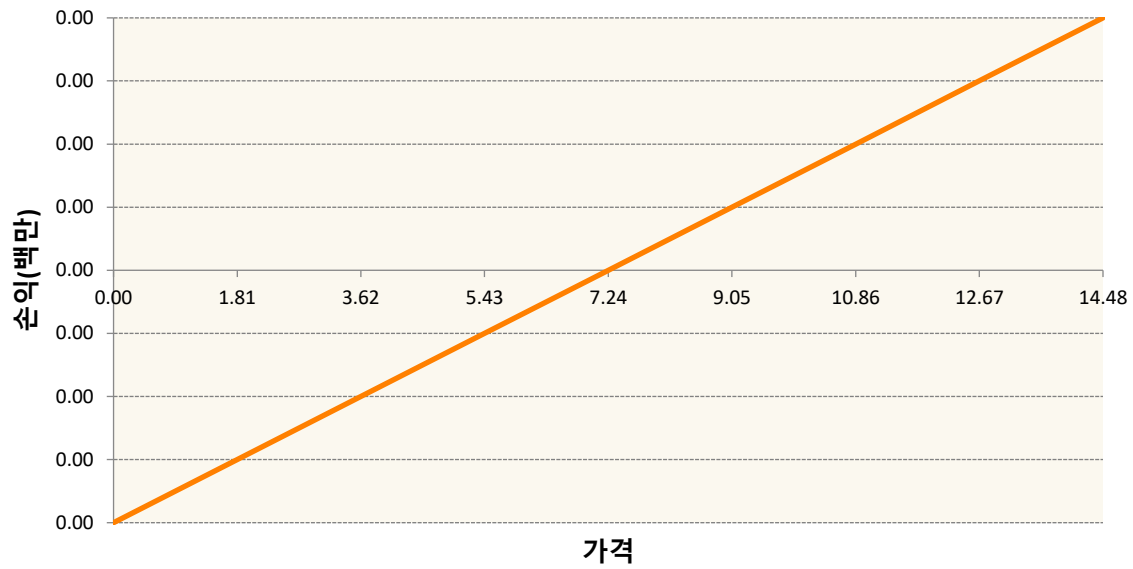
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



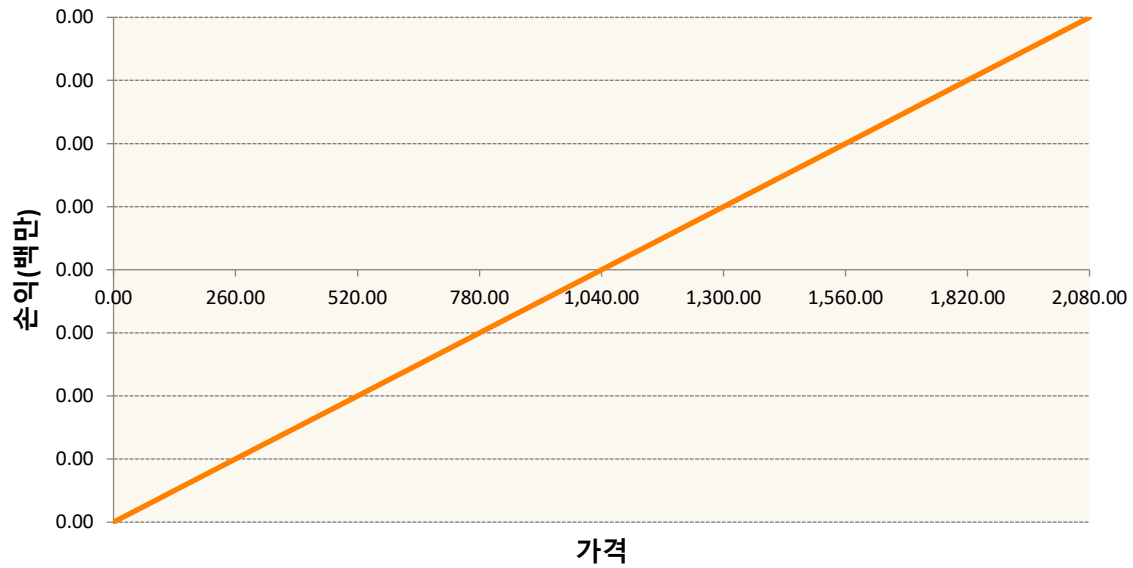
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



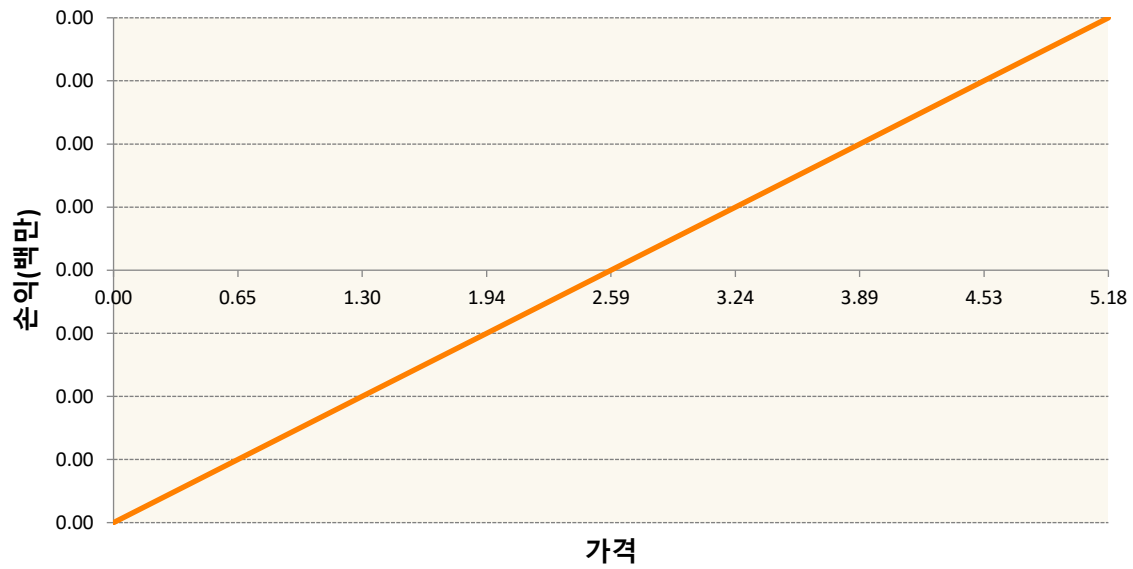
NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



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   | 17 |
| KR4175SB00 | 2022-11 달러선물             | 22 |
| NGF23      | NATURAL GAS FUTR Jan23   | 50 |
| QSF3       | Low Su Gasoil G Jan23    | 12 |
| XBF3       | GASOLINE RBOB FUT Jan23  | 12 |

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

**503**