

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

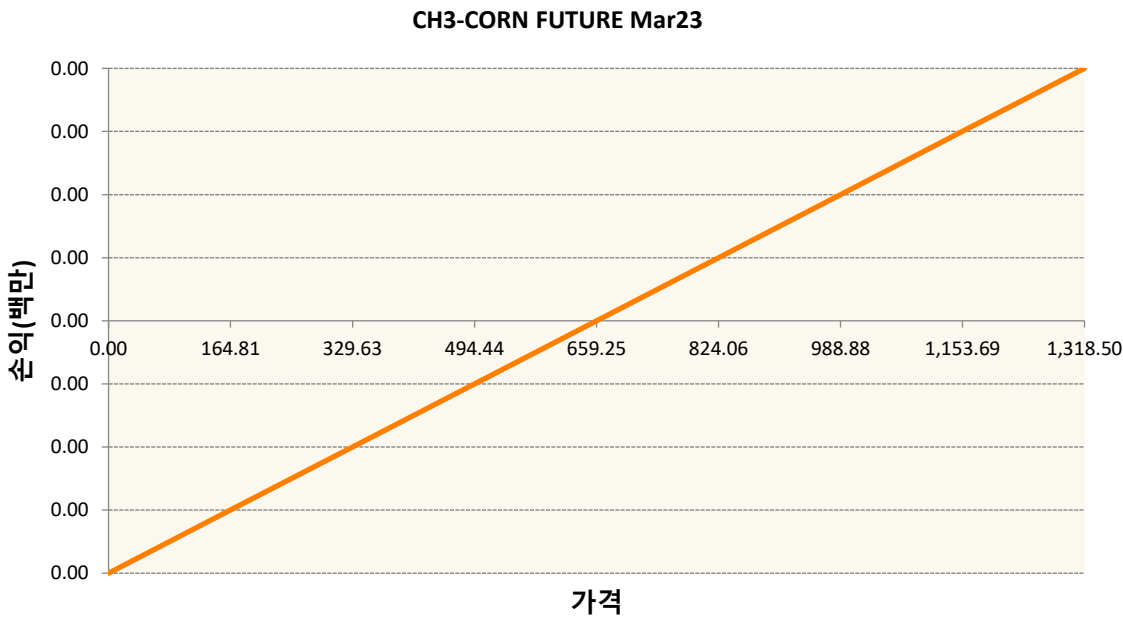
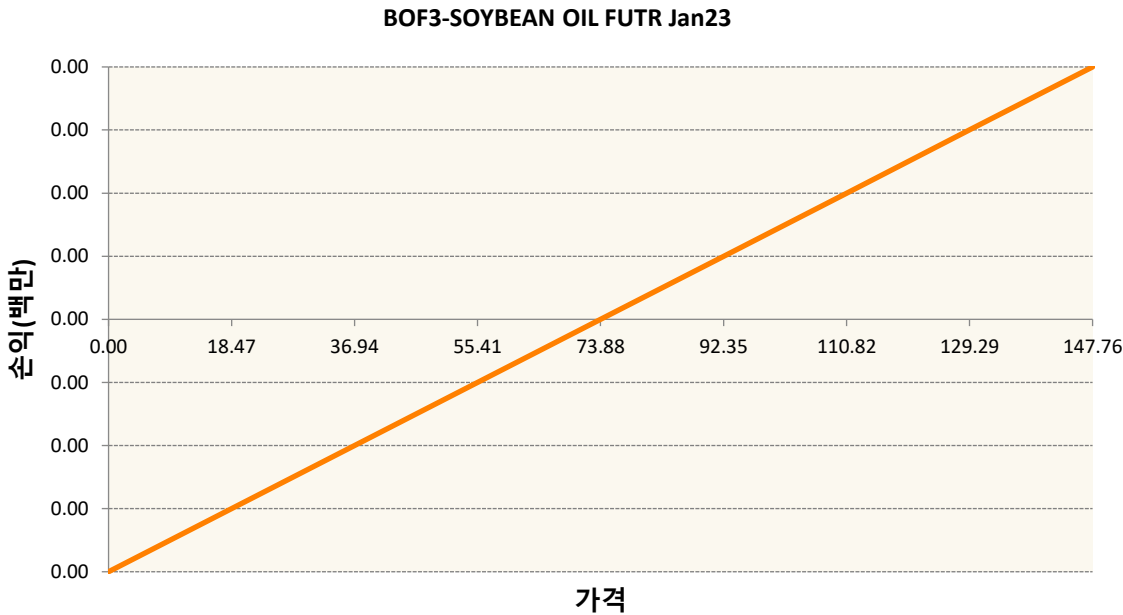
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

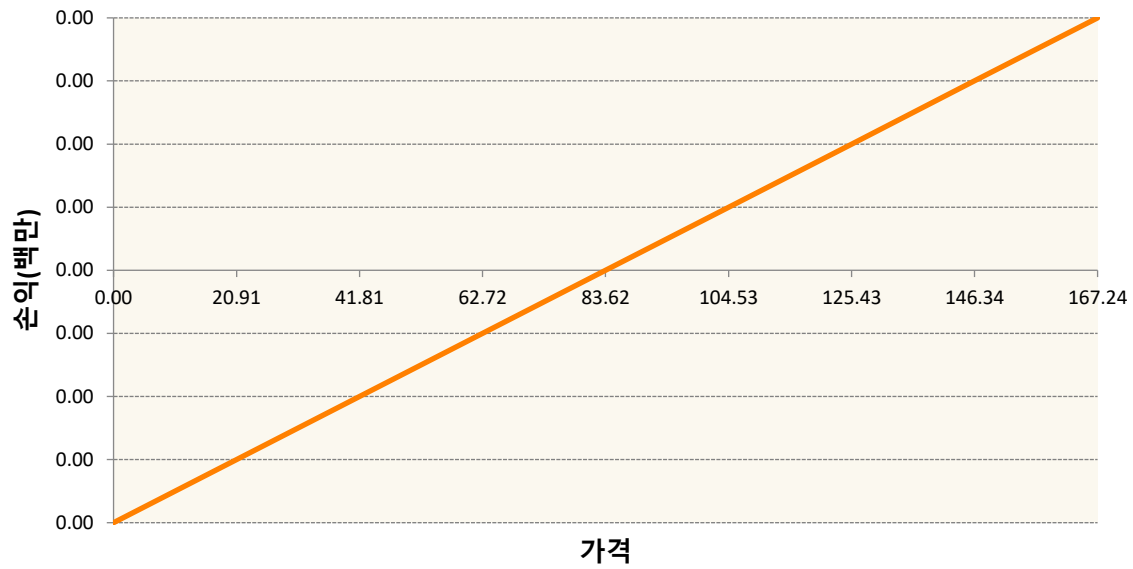
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,027	790	6,236	

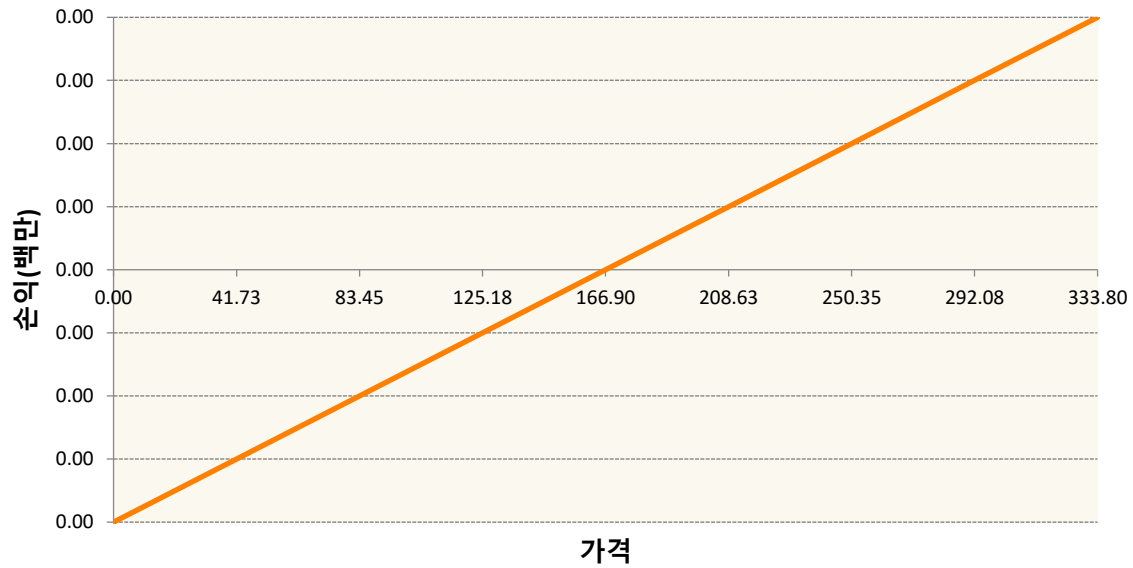
2. 만기시점의 손익구조



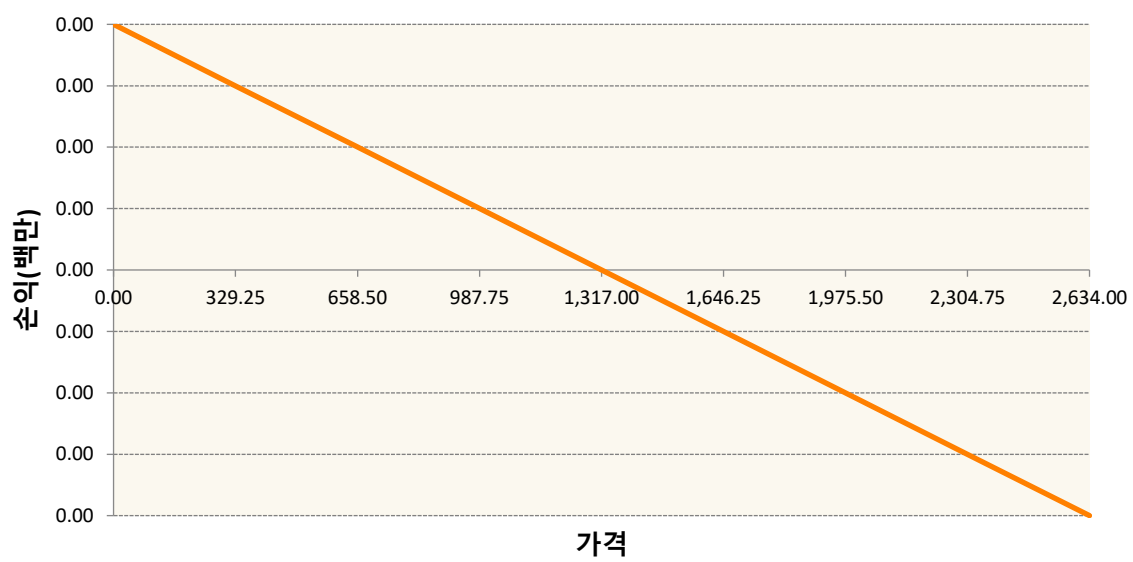
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



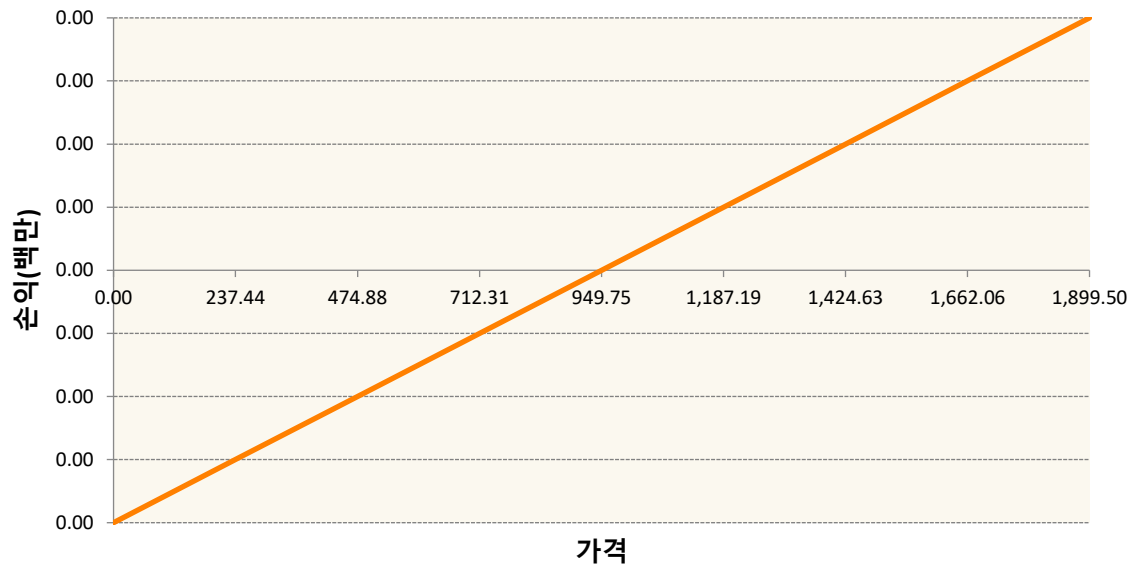
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



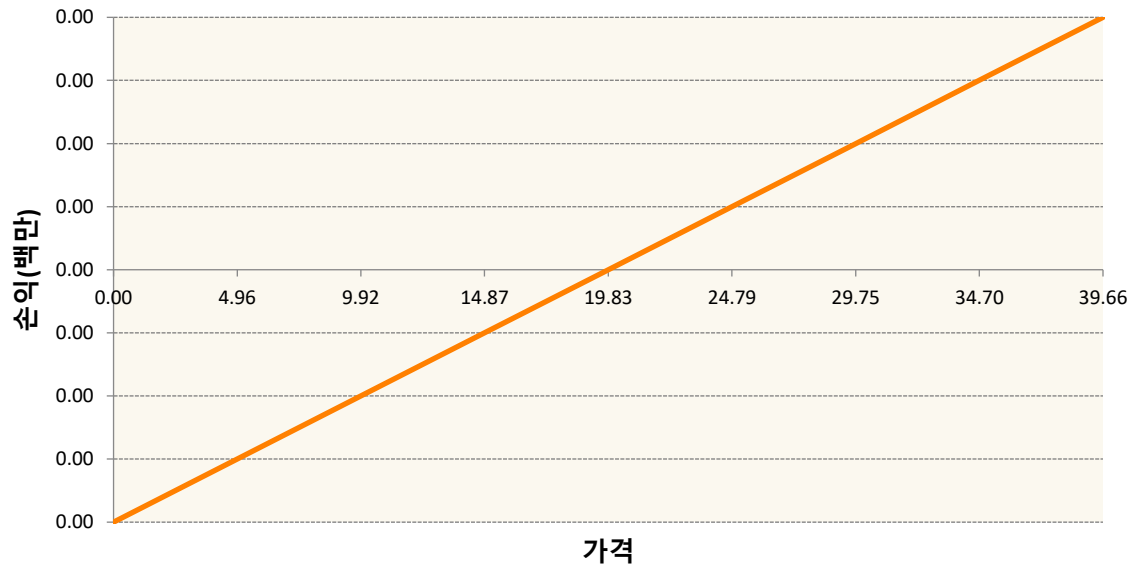
KR4175SB0001-2022-11 달러선물



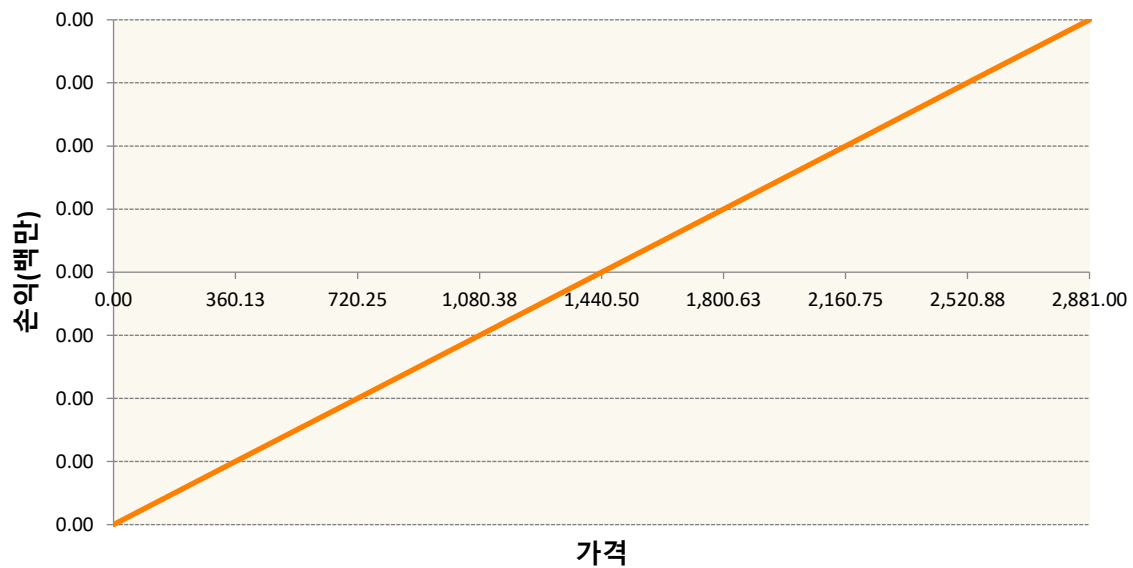
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



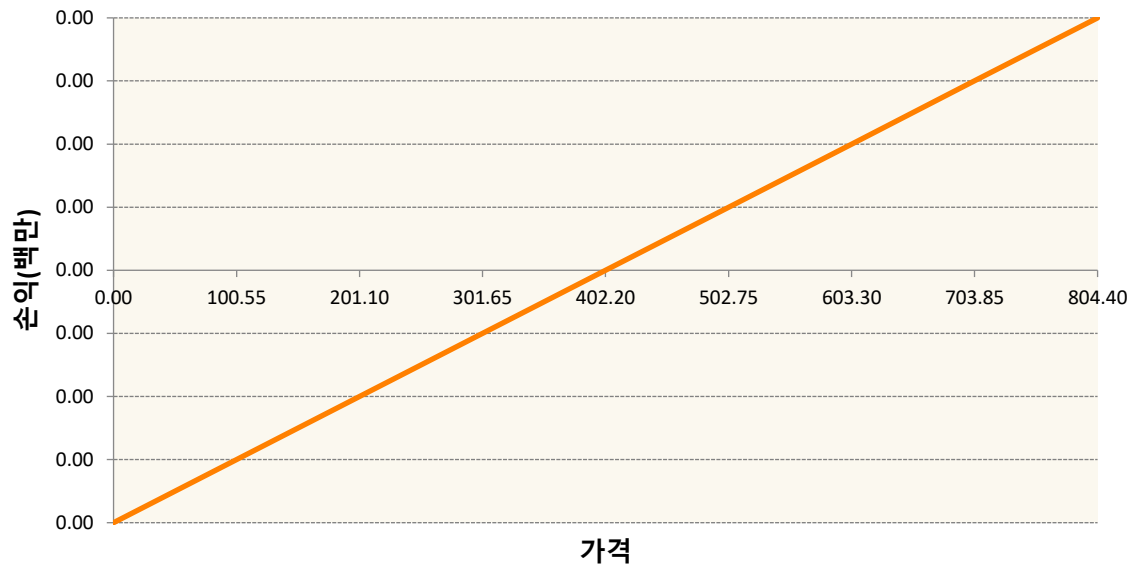
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



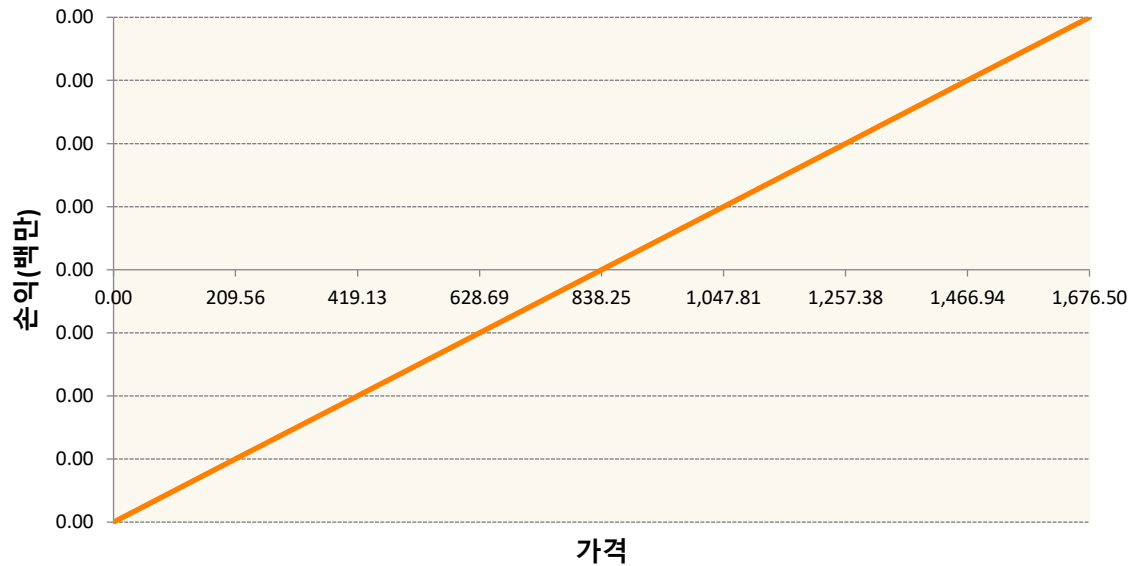
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



SMF3-SOYBEAN MEAL FUTR Jan23



WH3-WHEAT FUTURE(CBT) Mar23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

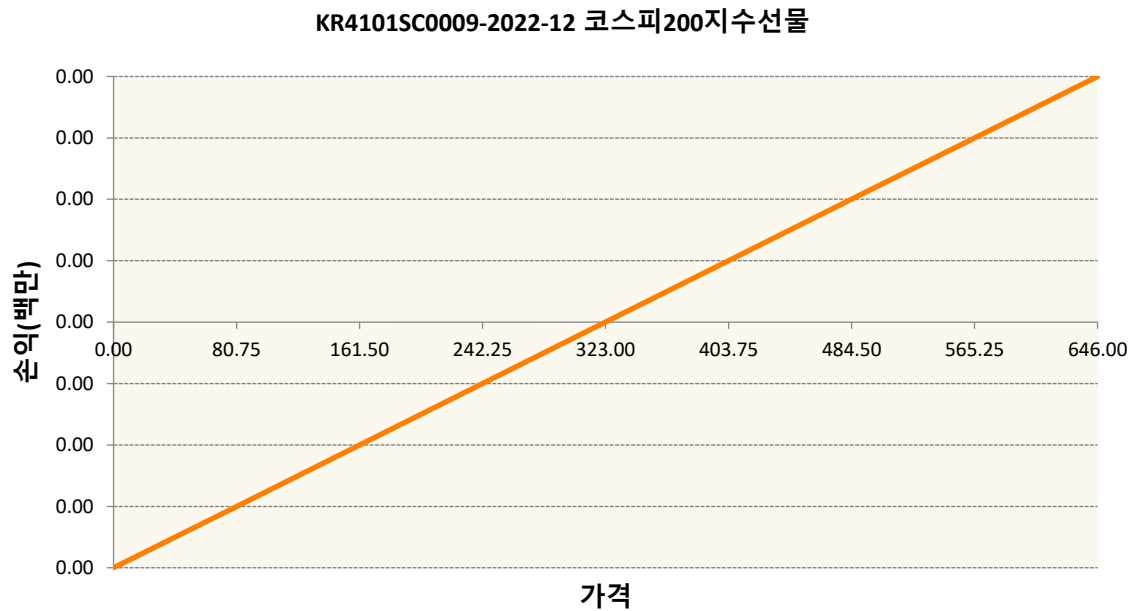
스마트인덱스모

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	808	0	808	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				64
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	64	64	64	64	64	64	64

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

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	346
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

479

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

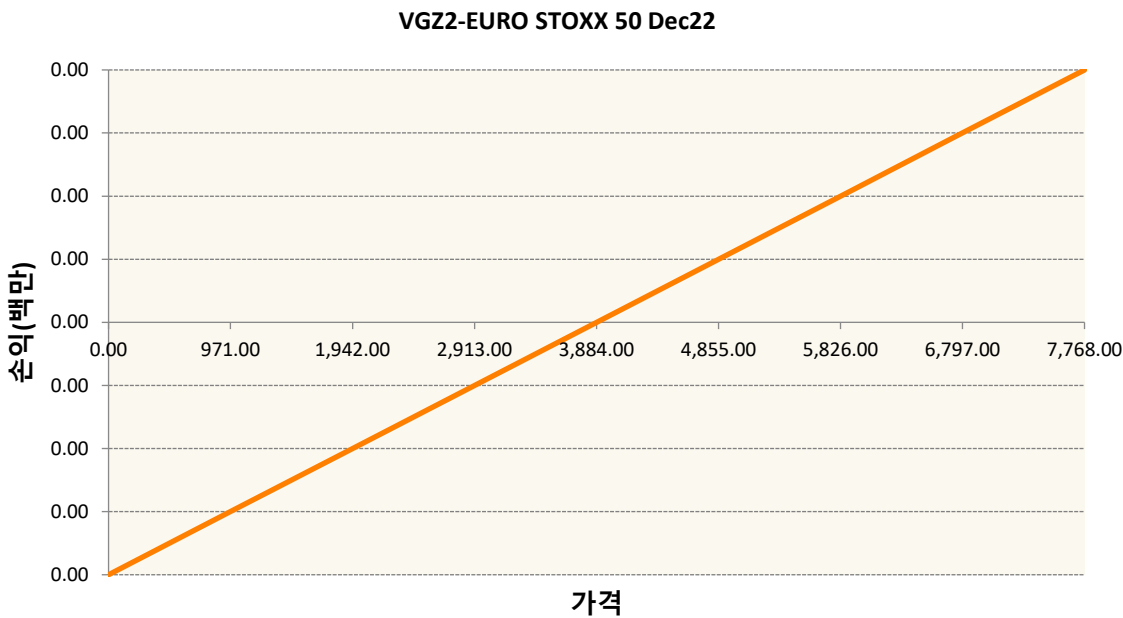
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	592	0	592	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ2	EURO STOXX 50 Dec22	47
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

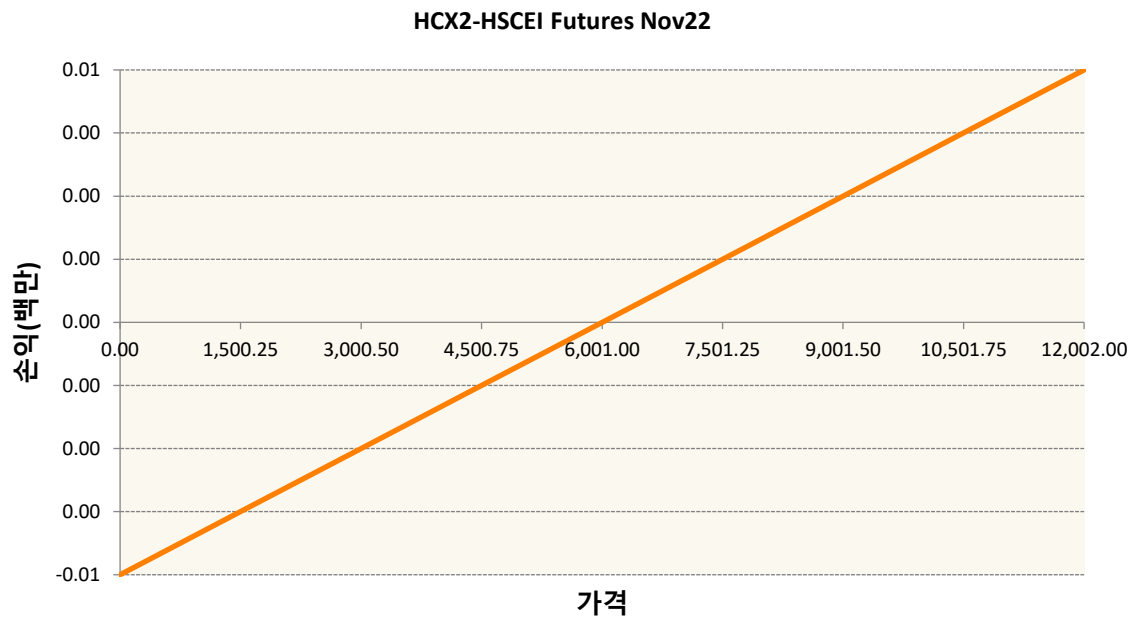
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,112	0	1,112	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX2	HSCEI Futures Nov22	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

146

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

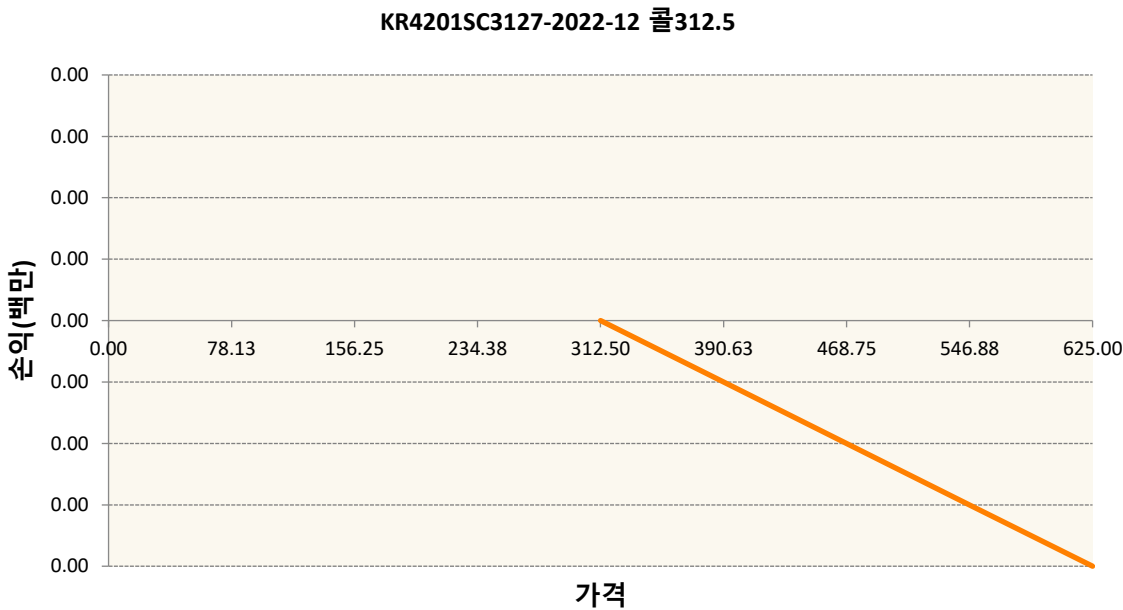
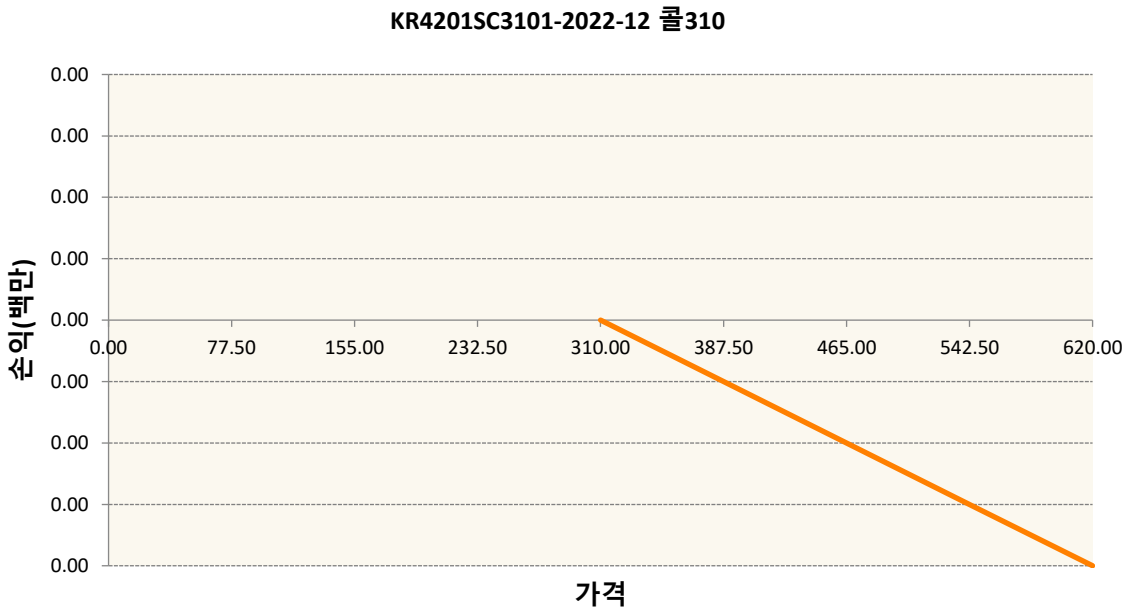
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	390	-390	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,203	-53,203	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph displays a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 620.00 with major ticks every 77.50 units. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A single orange line is plotted, starting at the origin (0, 0) and ending at (310, 0). This indicates that the profit is zero for all prices in the range from 0 to 310 million won.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
310.00	0.00

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
78.13	0.00
156.25	0.00
234.38	0.00
312.50	0.00
390.63	0.00
468.75	0.00
546.88	0.00
625.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201SC3101				2022-12 콜310				1,932
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,379	1,304	1,227	1,148	1,068	987	906	
-5.33%	1,108	1,021	934	847	759	672	584	
-2.67%	729	640	552	463	374	285	196	
0%	245	165	83	0	-84	-170	-256	
2.67%	-327	-392	-461	-534	-609	-686	-766	
5.33%	-967	-1,015	-1,068	-1,127	-1,190	-1,257	-1,327	
8.00%	-1,652	-1,684	-1,723	-1,768	-1,818	-1,873	-1,932	
KR4201SC3127				2022-12 콜312.5				1,221
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	837	792	744	695	645	595	543
-5.33%	682	627	571	516	460	404	348
-2.67%	457	400	342	284	226	168	110
0%	165	111	56	0	-56	-112	-169
2.67%	-188	-234	-281	-331	-382	-434	-487
5.33%	-589	-623	-661	-702	-746	-792	-839
8.00%	-1,022	-1,046	-1,074	-1,106	-1,142	-1,180	-1,221
KR4301SC3100 2022-12 풋310							115

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-80	-87	-94	-101	-108	-115
-5.33%	-33	-40	-48	-55	-63	-71	-78
-2.67%	-1	-9	-17	-24	-32	-40	-47
0%	21	14	7	0	-7	-15	-22
2.67%	36	30	24	18	12	5	-2
5.33%	45	41	36	31	26	20	14
8.00%	50	47	44	40	36	31	26
KR4301SC3126 2022-12 풋312.5							340

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-228	-245	-264	-282	-301	-321	-340
-5.33%	-105	-126	-147	-168	-190	-211	-232
-2.67%	-8	-30	-52	-74	-96	-118	-141
0%	63	42	21	0	-21	-43	-65
2.67%	111	93	75	56	37	17	-3
5.33%	140	127	113	97	81	63	45
8.00%	158	149	138	126	112	98	82

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

(단위:백만원)

3,320

공시일 2022-11-16

기준일 2022-11-15

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

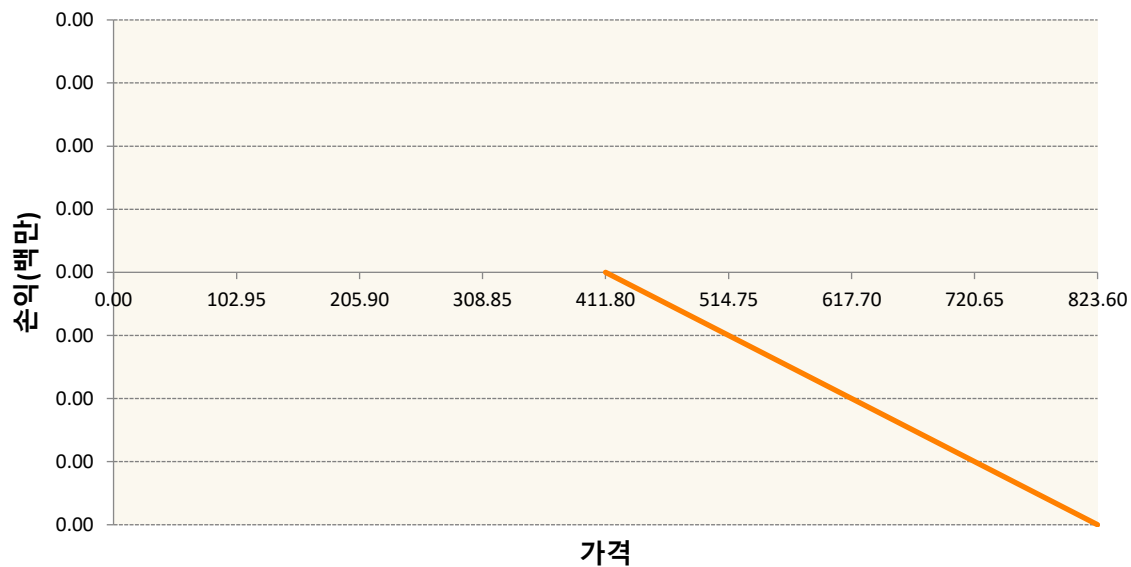
1. 계약금액

(단위:백만원)

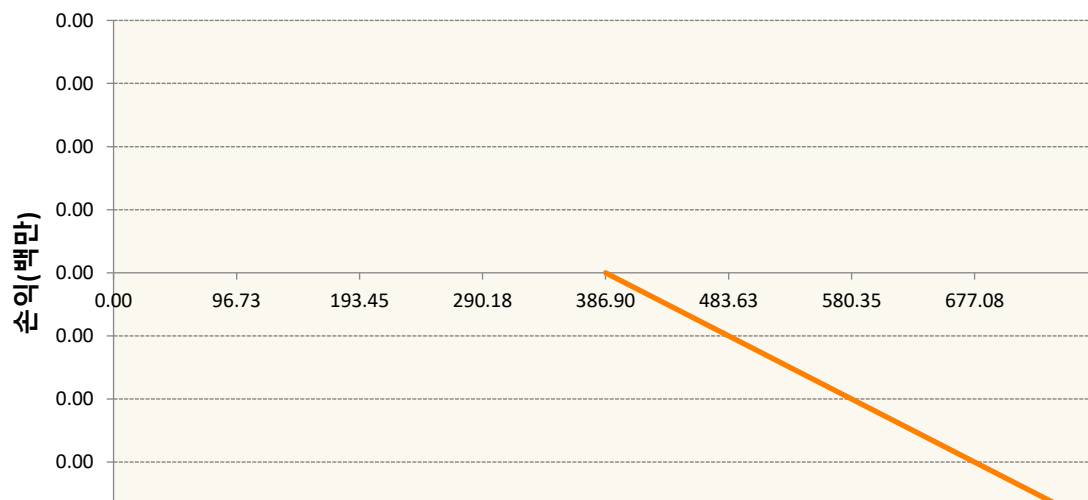
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,195	0	1,195	
누계	유가증권	옵션	0	263	-263	장내
누계	통화	선도	0	2,247	-2,247	장외

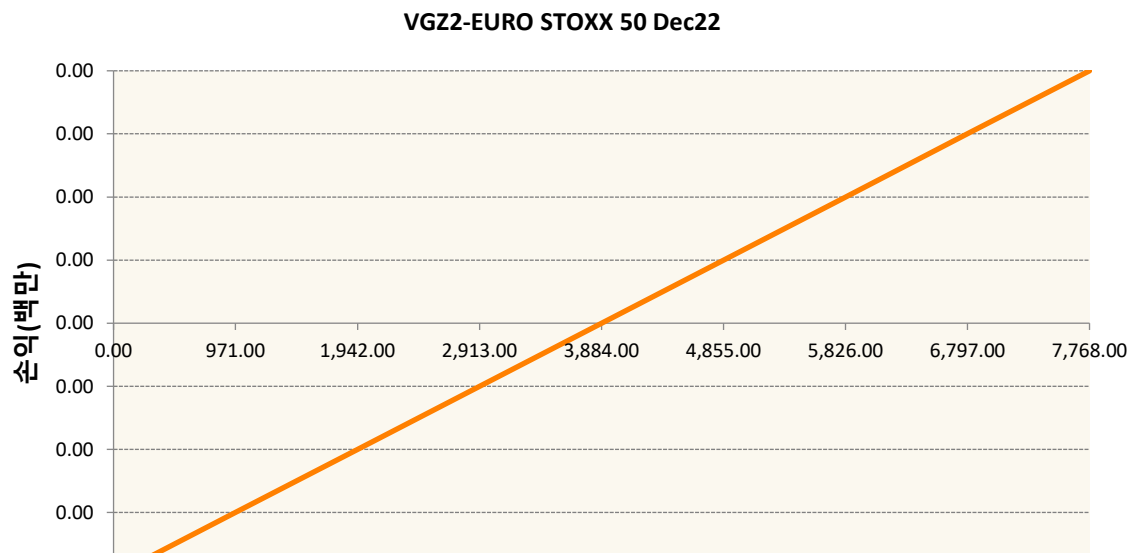
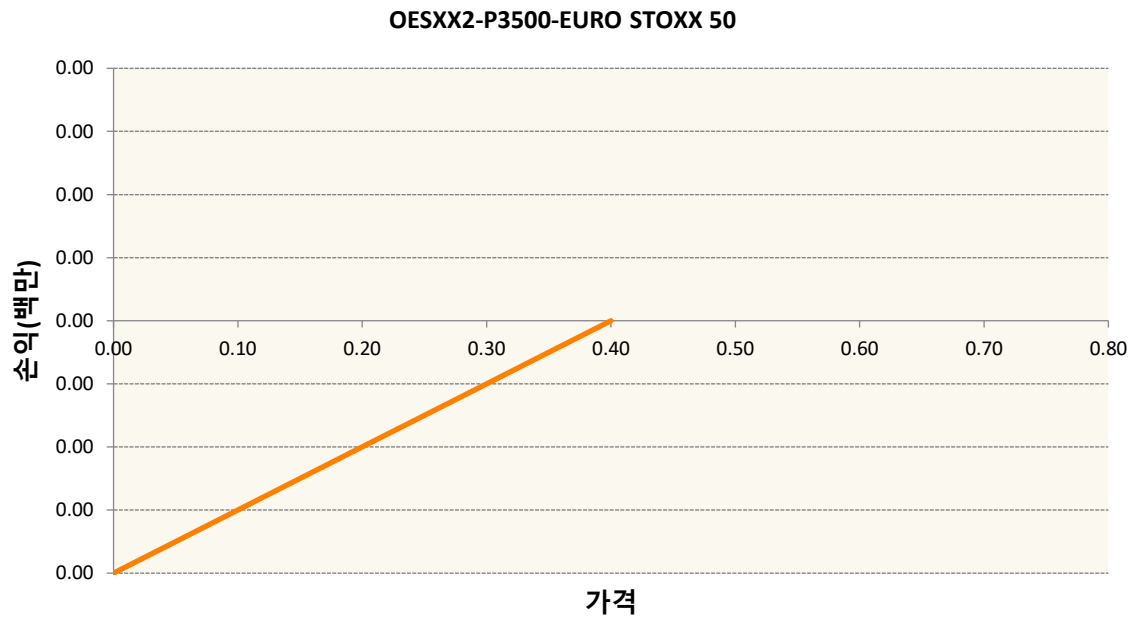
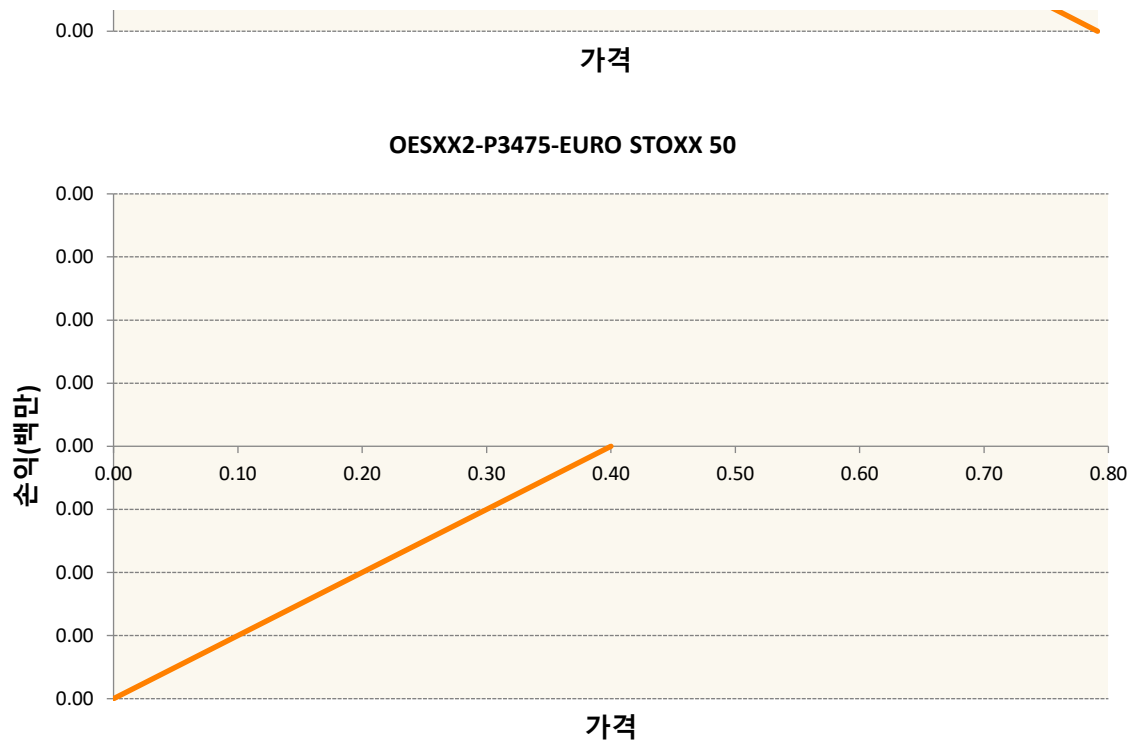
2. 만기시점의 손익구조

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	71
FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E	54
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E	54
OESXX2-C34 EURO STOXX 50	20
OESXX2-C35 EURO STOXX 50	1
OESXX2-P34 EURO STOXX 50	0.02
OESXX2-P35 EURO STOXX 50	0
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	96

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

(단위:백만원)

254

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

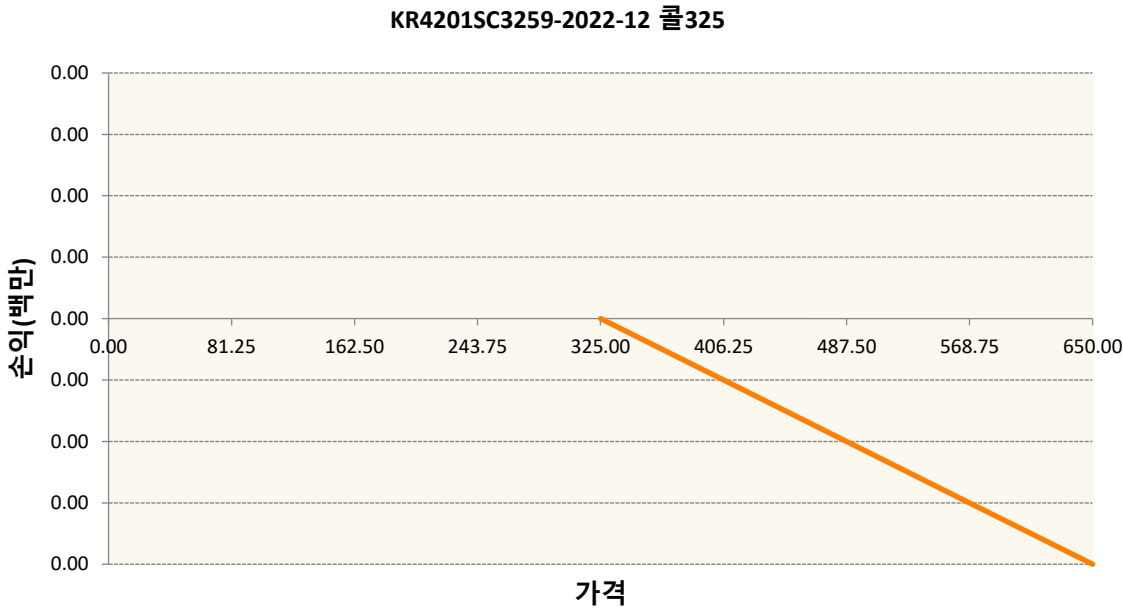
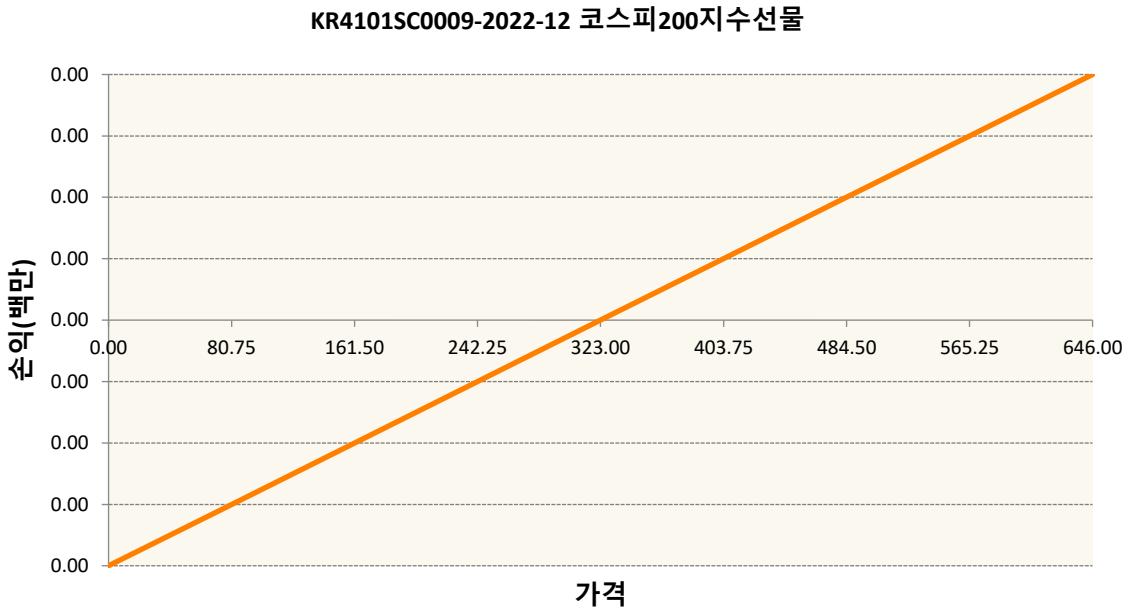
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

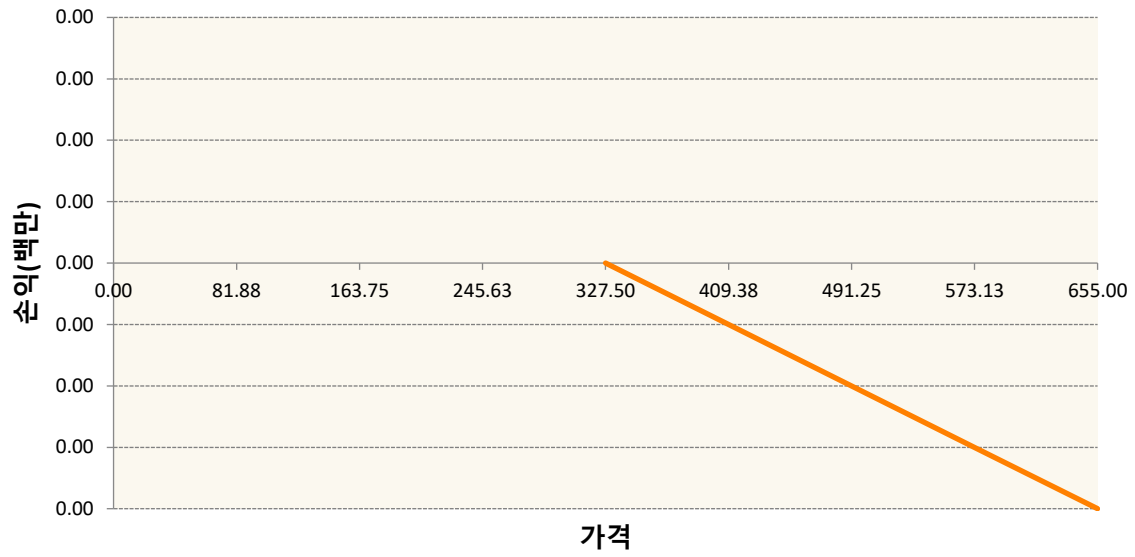
(단위:백만원)

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	404	0	404	장내
누계	유가증권	옵션	311	3,839	-3,528	장내

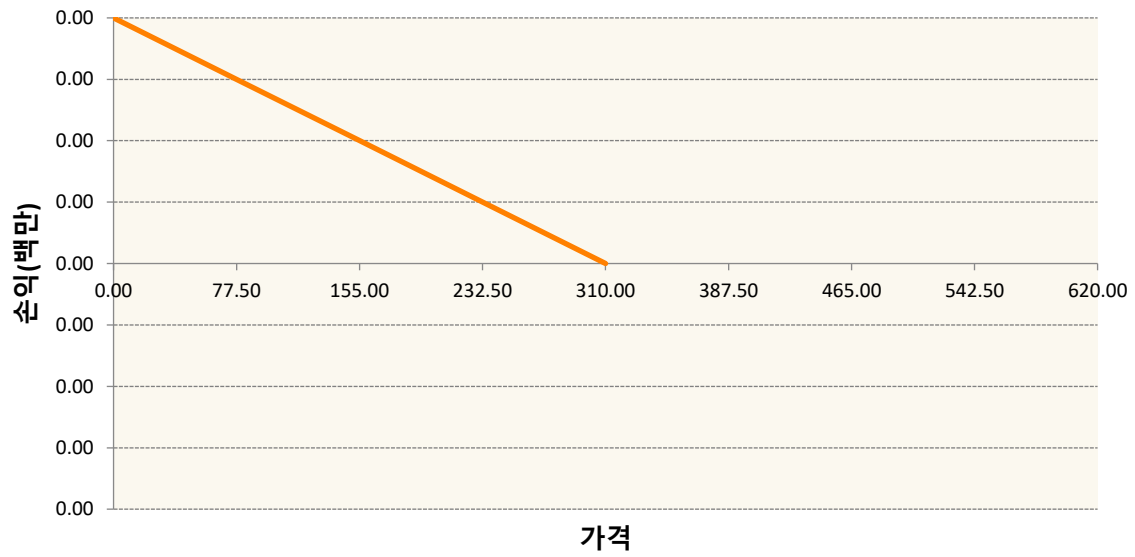
2. 만기시점의 손익구조



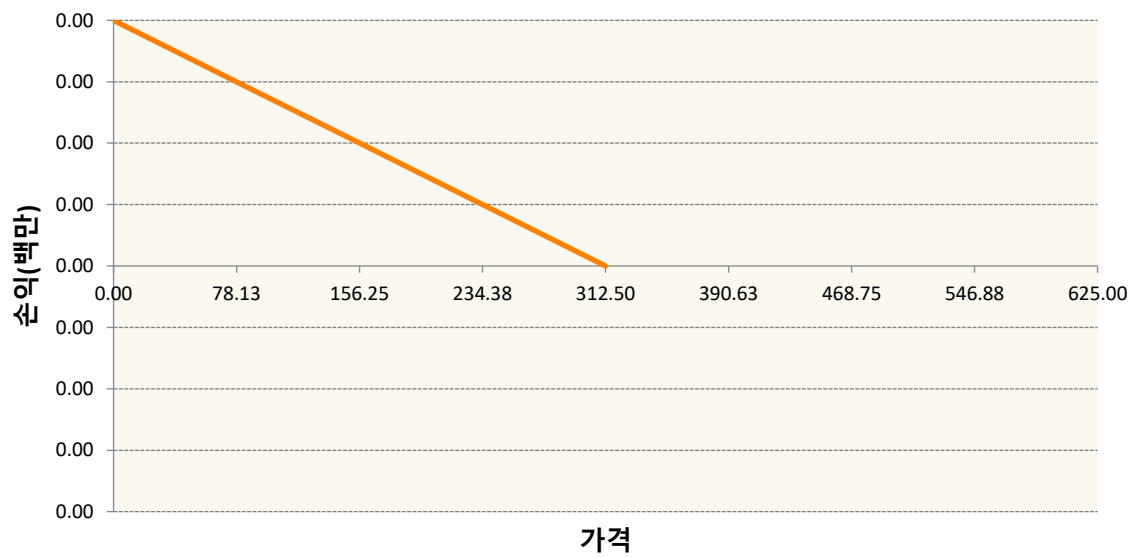
KR4201SC3275-2022-12 콜327.5



KR4301SC3100-2022-12 풋310



KR4301SC3126-2022-12 풋312.5



(단위:백만원)

KR4101SC0009							2022-12 코스피200지수선물		32	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32			
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21			
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	11	11	11	11	11	11	11			
5.33%	21	21	21	21	21	21	21			
8.00%	32	32	32	32	32	32	32			
KR4201SC3259							2022-12 콜325		72	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	39	37	35	33	30	27	24			
-5.33%	34	31	28	25	22	18	15			
-2.67%	25	22	18	14	10	7	3			
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12			
2.67%	-6	-10	-13	-18	-22	-26	-30			
5.33%	-27	-31	-35	-38	-42	-46	-50			
8.00%	-53	-56	-59	-62	-65	-69	-72			
KR4201SC3275							2022-12 콜327.5		149	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	77	73	69	64	59	53	47			
-5.33%	67	62	56	49	42	35	28			
-2.67%	51	43	36	28	20	12	4			
0%	26	17	9	0	-9	-17	-26			
2.67%	-9	-18	-27	-35	-44	-53	-61			
5.33%	-53	-61	-69	-77	-86	-94	-103			
8.00%	-105	-112	-119	-126	-134	-141	-149			
KR4301SC3100							2022-12 풋310		8	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	5	5	6	6	7	7	8			
-5.33%	2	3	3	4	4	5	5			
-2.67%	0	1	1	2	2	3	3			
0%	-1	-1	0	0	0	1	1			
2.67%	-2	-2	-2	-1	-1	0	0			
5.33%	-3	-3	-2	-2	-2	-1	-1			
8.00%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-2			
KR4301SC3126							2022-12 풋312.5		8	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	6	6	7	7	8	8
-5.33%	2	3	3	4	4	5	5
-2.67%	0	1	1	2	2	3	3
0%	-1	-1	0	0	1	1	2
2.67%	-3	-2	-2	-1	-1	0	0
5.33%	-3	-3	-3	-2	-2	-1	-1
8.00%	-4	-3	-3	-3	-3	-2	-2

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

(단위:백만원)

235

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

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	6,829	0	6,829	

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	2022-11-16
기준일	2022-11-15

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	5,937	0	5,937	

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	2022-11-16
기준일	2022-11-15

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	18,829	0	18,829	
누계	통화	선도	0	17,557	-17,557	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8R(KRW/USD 28-11-22E	589
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	490
FXW213CAR(KRW/USD 30-01-23E	272
FXW213CB1(KRW/USD 28-11-22E	53
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

684

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

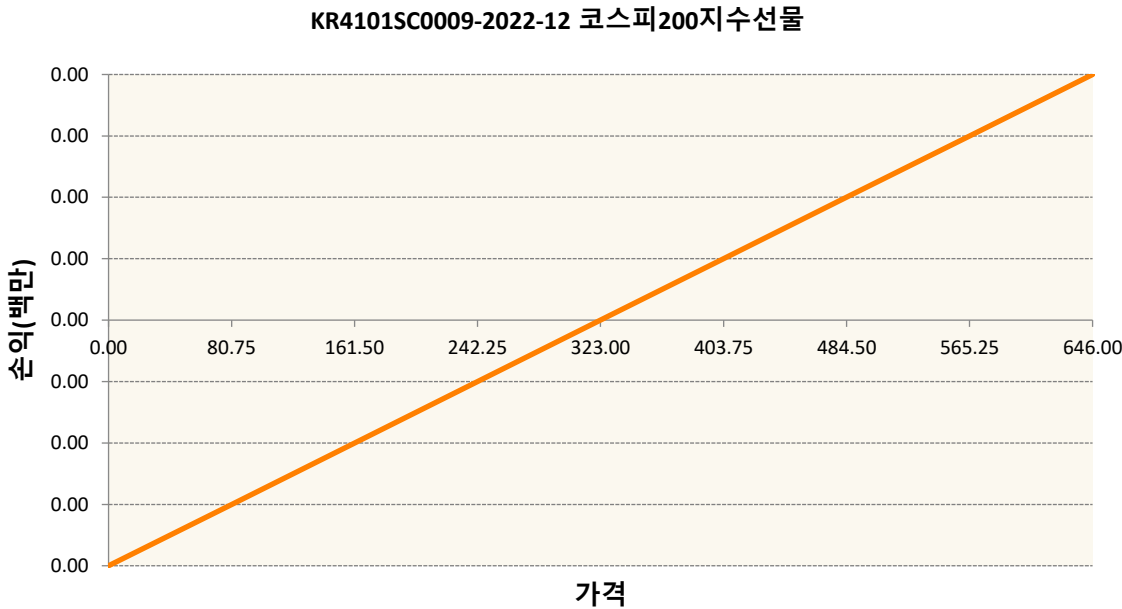
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	404	0	404	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				32
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	32	32	32	32	32	32	32

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	1,297	0	1,297	장외
누계	통화	선도	1,130	1,103	27	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	104
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
FXW213CAK EUR/KRW 18-11-22E	5
FXW213CAQ EUR/KRW 18-11-22E	5
FXW213CAR EUR/KRW 28-11-22E	8
FXW213CAYI KRW/EUR 28-11-22E	3
FXW213CBE(EUR/KRW 28-11-22E	20
FXW213CBE(EUR/KRW 23-12-22E	22
FXW213CBE(KRW/EUR 28-11-22E	22

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

(단위:백만원)

245

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

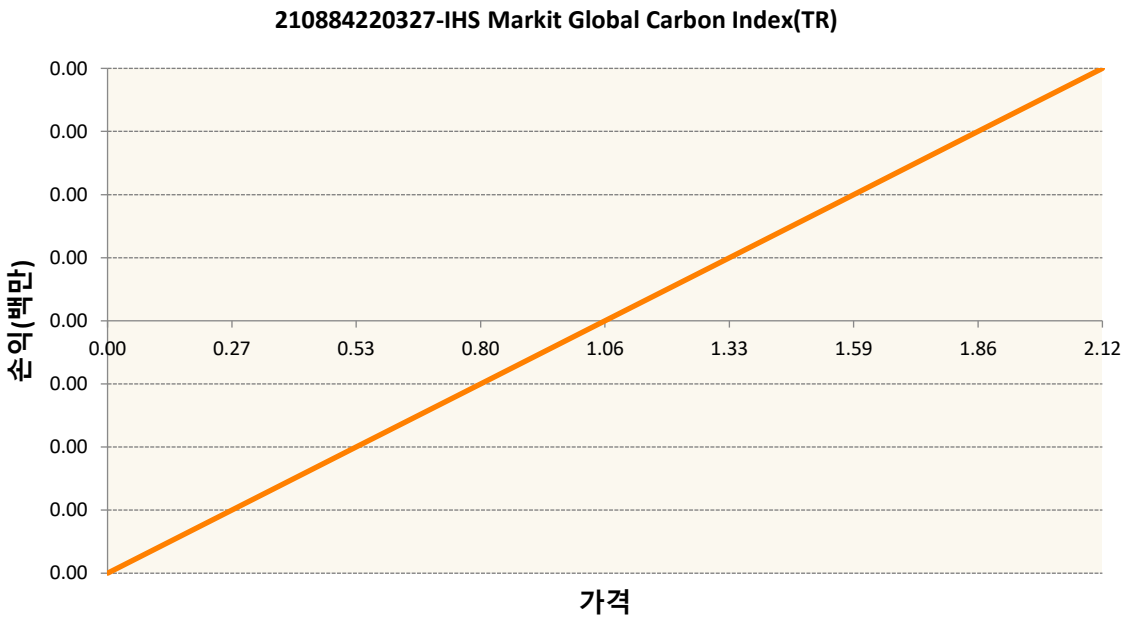
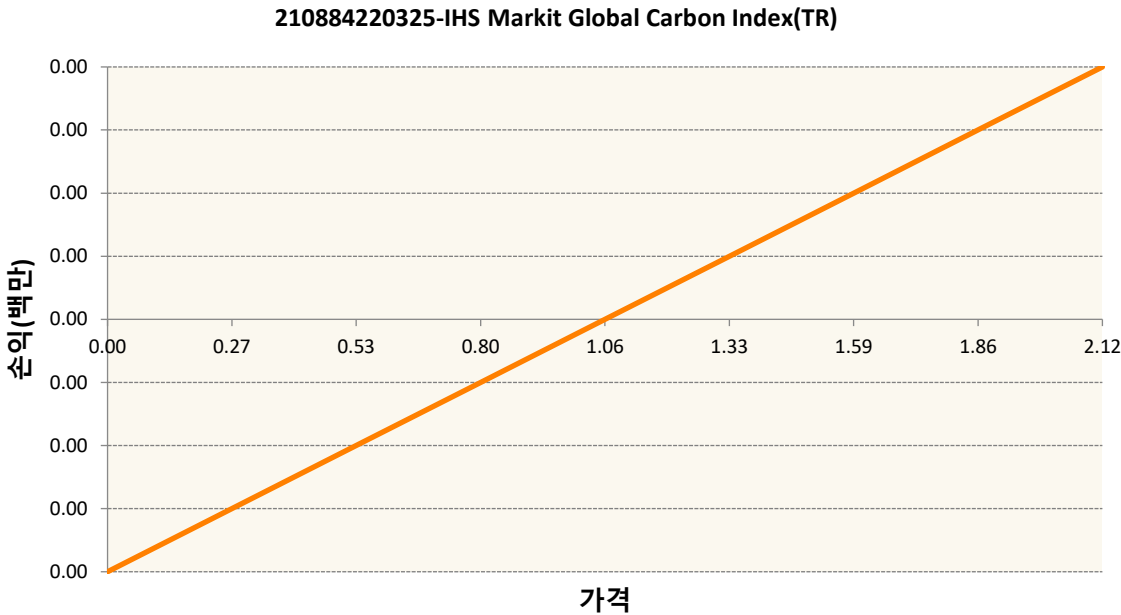
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

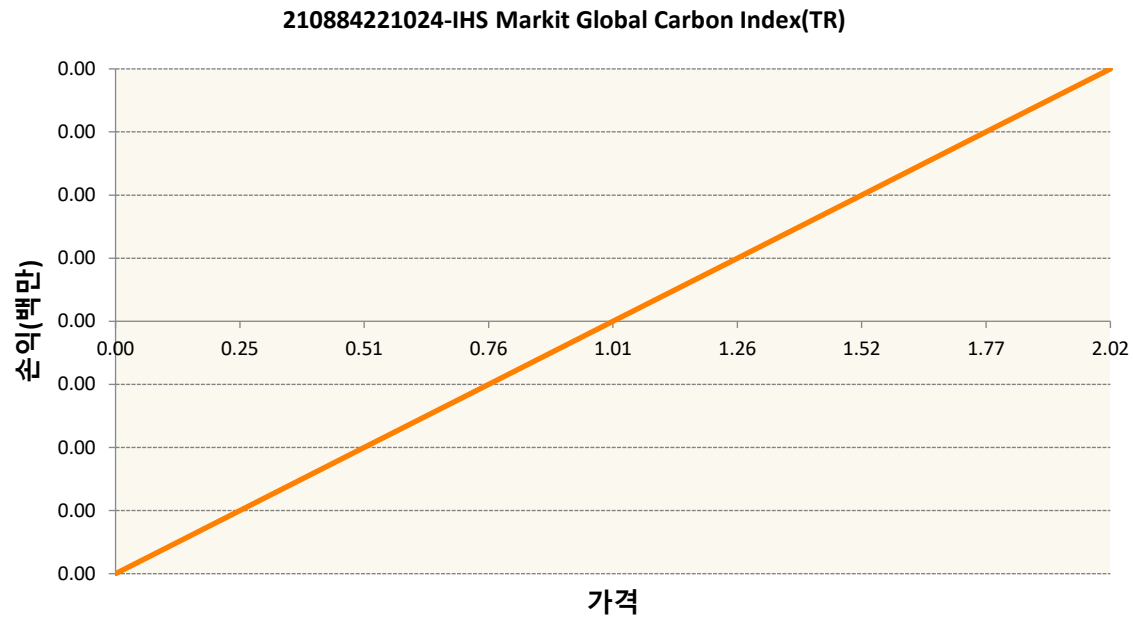
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	28,474	0	28,474	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		183
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		92
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		2,008

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		4,398

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

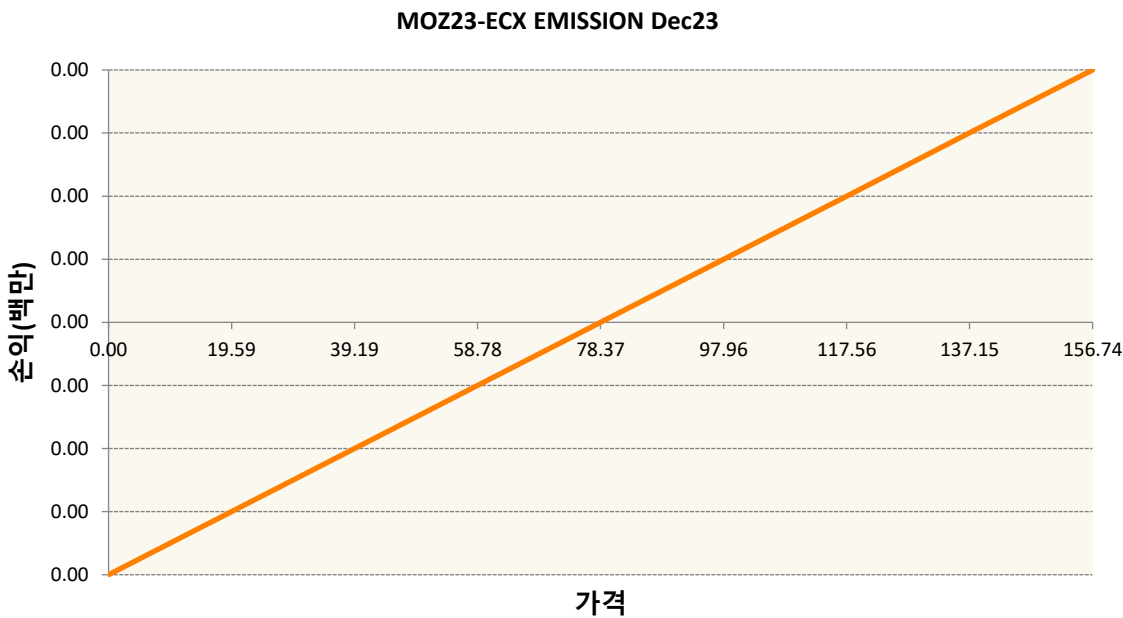
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	14,082	0	14,082	
누계	통화	선도	0	4,811	-4,811	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CAT(KRW/EUR 23-11-22E	360
FXW213CB7(KRW/EUR 23-11-22E	8
FXW213CB8(KRW/EUR 23-11-22E	16
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,127

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

(단위:백만원)

3,188

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

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)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	21

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

(단위:백만원)

164

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

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)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	8

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

(단위:백만원)

33

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.08
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.33

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

(단위:백만원)

1

공시일 2022-11-16

기준일 2022-11-15

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

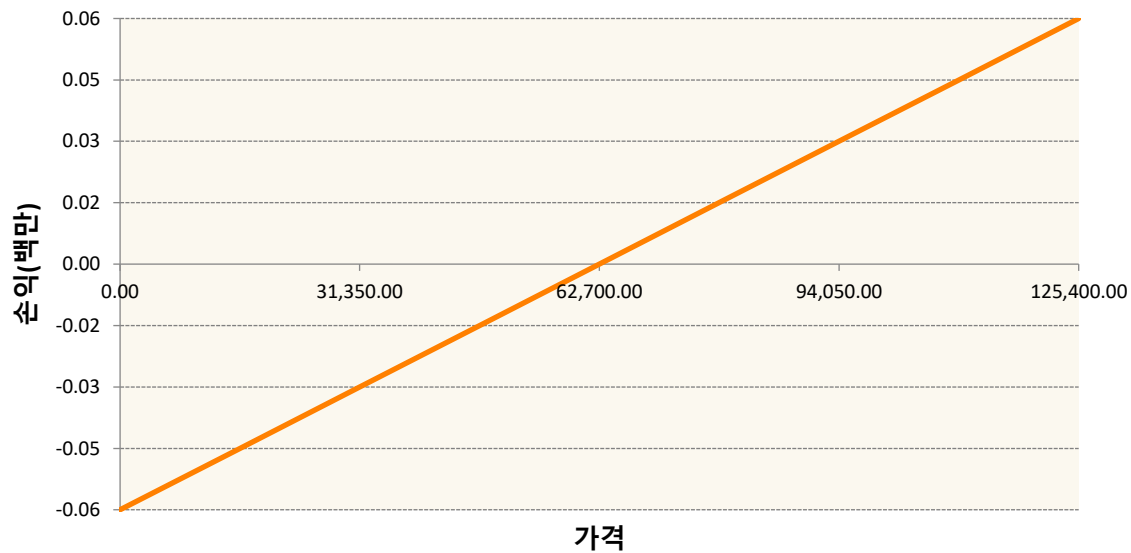
1. 계약금액

(단위:백만원)

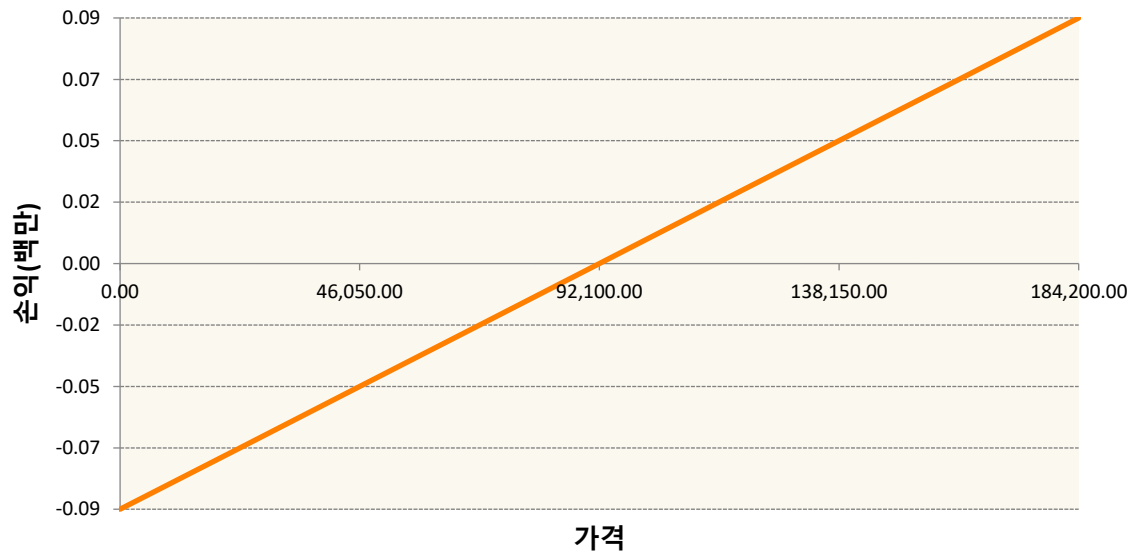
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	156	0	156	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111SC0007-2022-12 삼성전자개별선물



KR4150SC0009-2022-12 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SC0007		2022-12 삼성전자개별선물					8
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	8	8	8	8	8	8	8
KR4150SC0009		2022-12 SK하이닉스개별선물					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)

15

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일 2022-11-16

기준일 2022-11-15

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

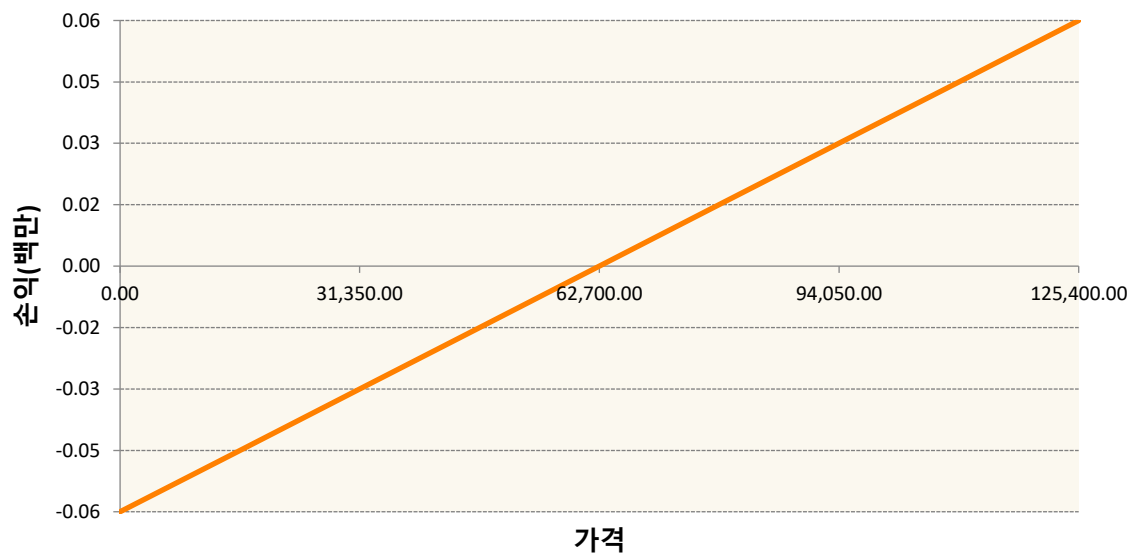
1. 계약금액

(단위:백만원)

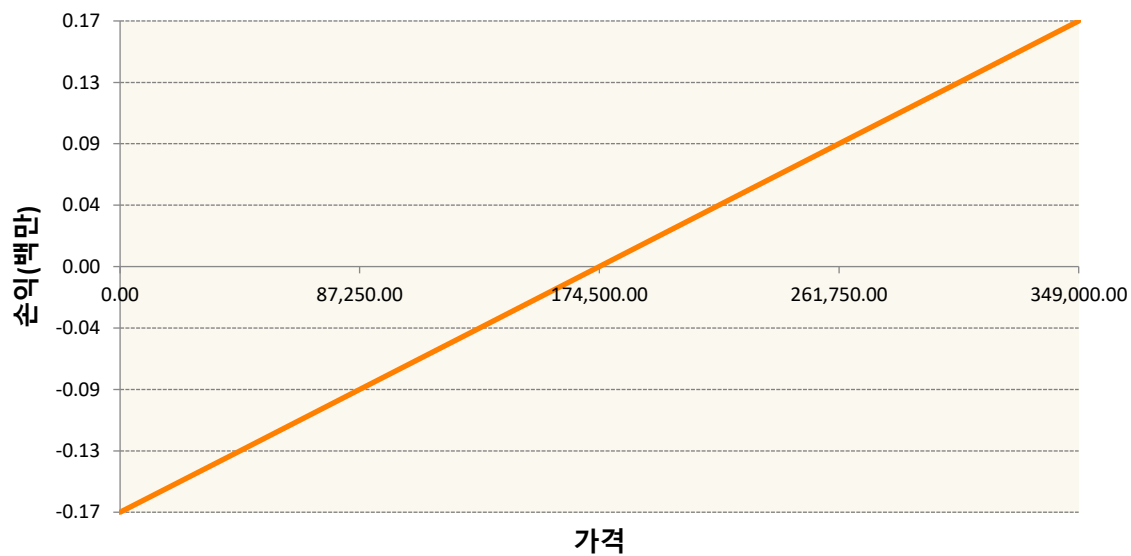
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	306	0	306	장내

2. 만기시점의 손익구조

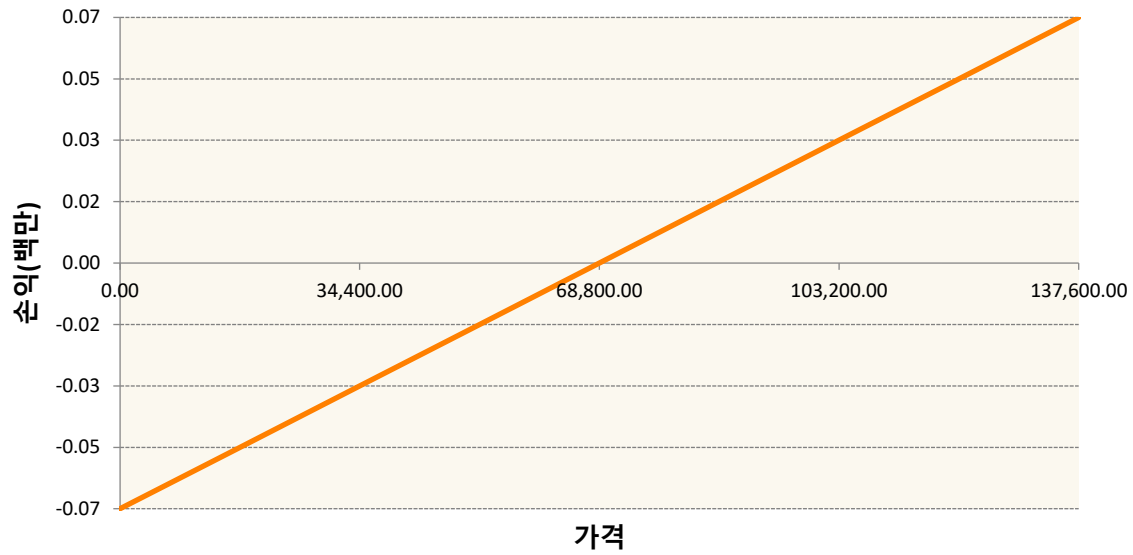
KR4111SC0007-2022-12 삼성전자개별선물



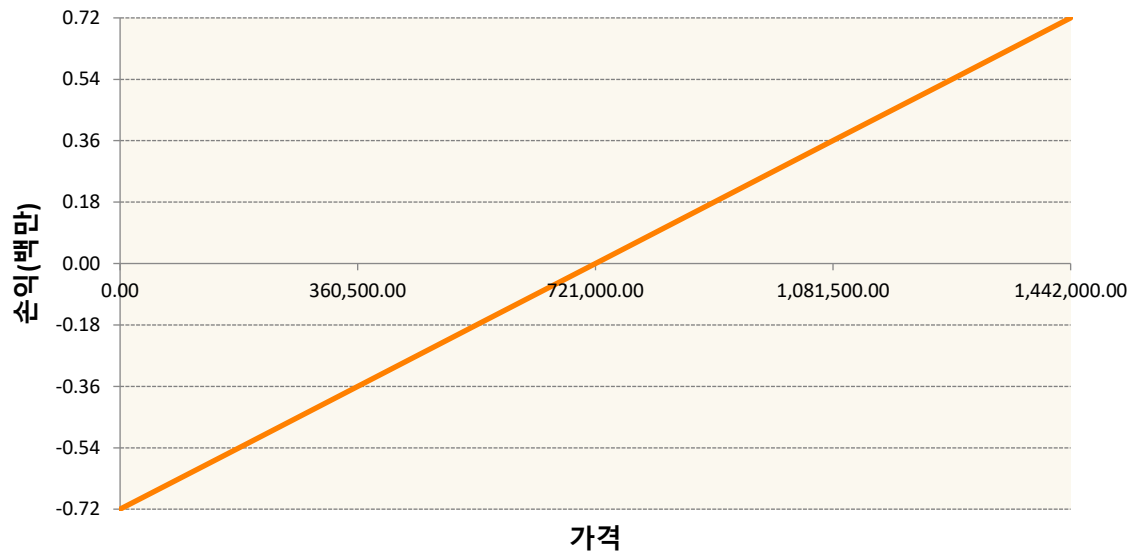
KR4116SC0002-2022-12 현대차개별선물



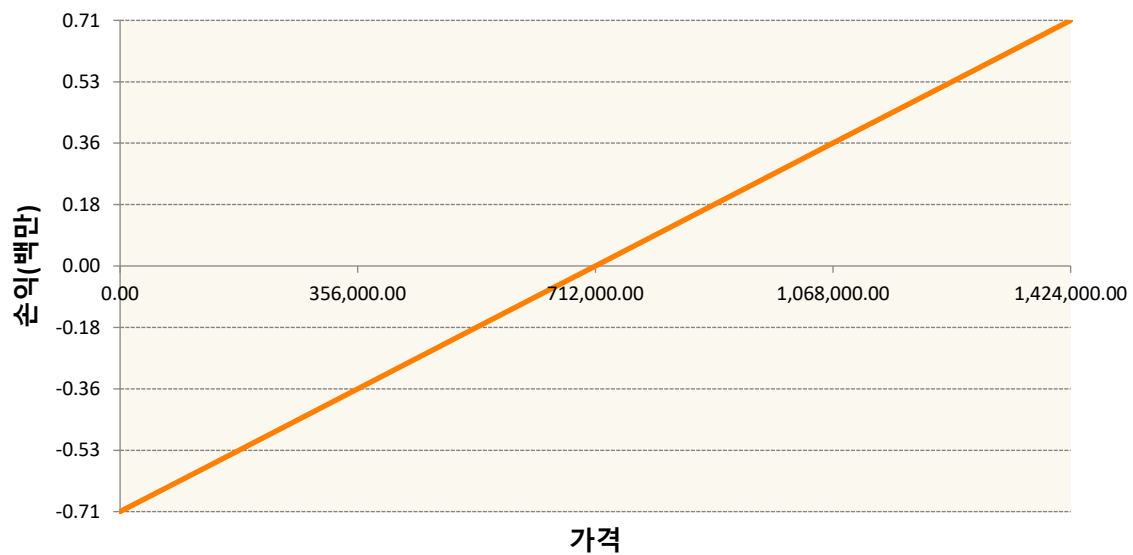
KR4119SC0009-2022-12 기아차개별선물



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%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
-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%	3	3	3	3	3	3	3	3	
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		11
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
-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%	11	11	11	11	11	11	11	11	
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 2022-11-16

기준일 2022-11-15

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

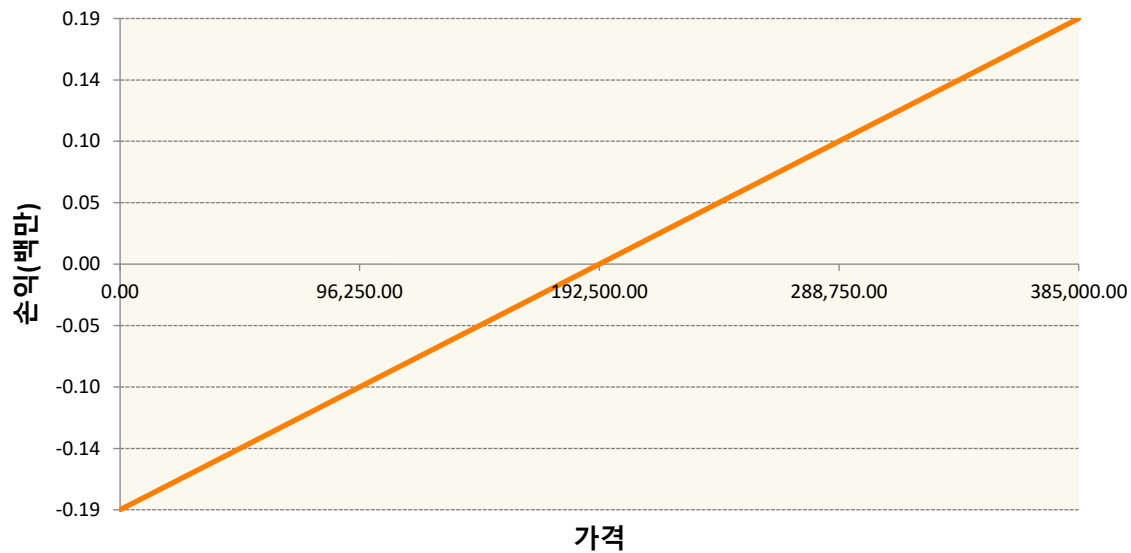
1. 계약금액

(단위:백만원)

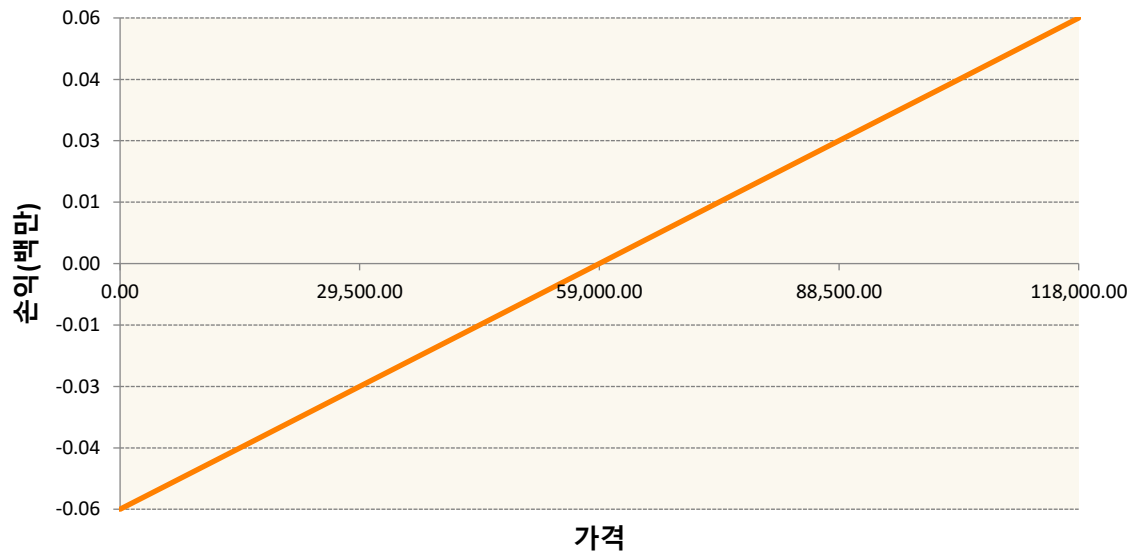
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	120	0	120	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156SC0003-2022-12 NAVER개별선물



KR41CFSC0009-2022-12 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4156SC0003		2022-12 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%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-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%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR41CFSC0009		2022-12 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)

19

공시일	2022-11-16
기준일	2022-11-15

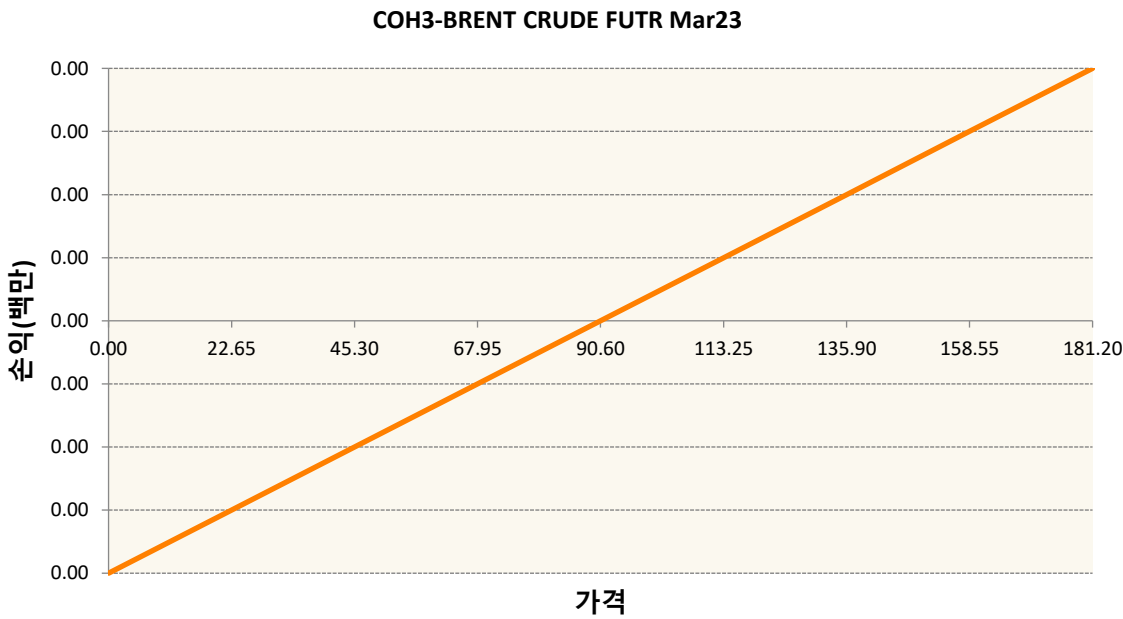
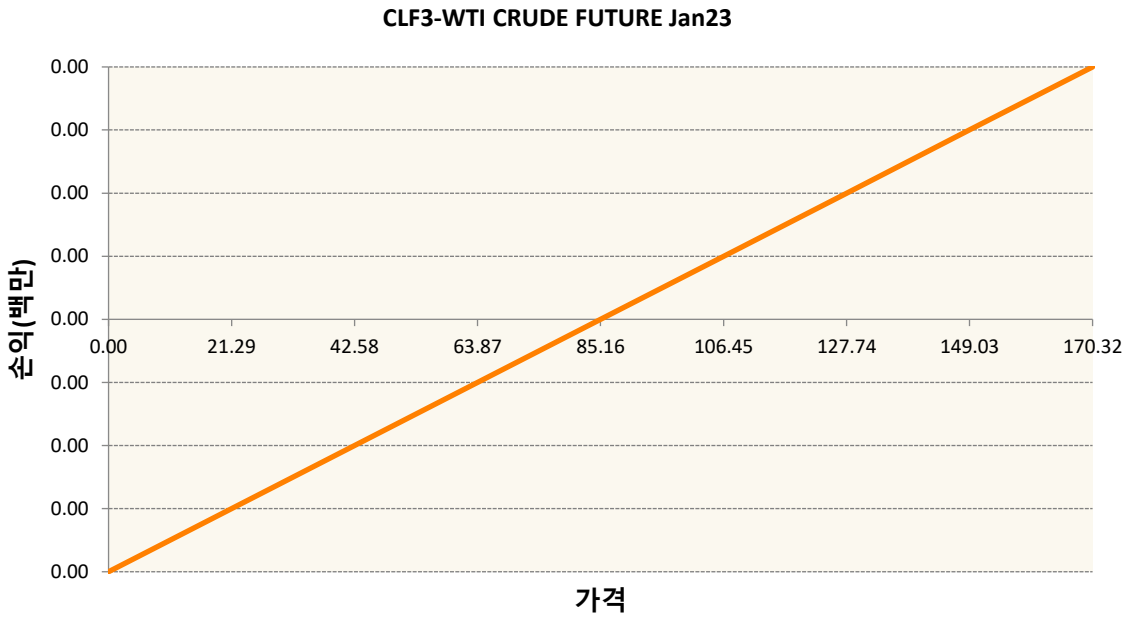
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

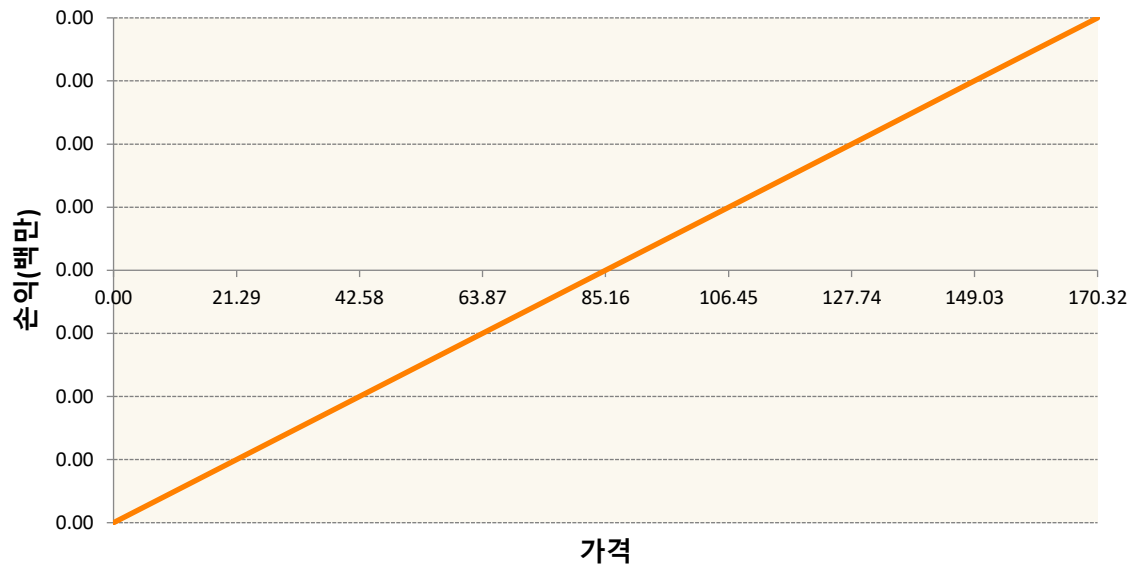
(단위:백만원)

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	243	0	243	
누계	유가증권	선물	1,563	263	1,300	

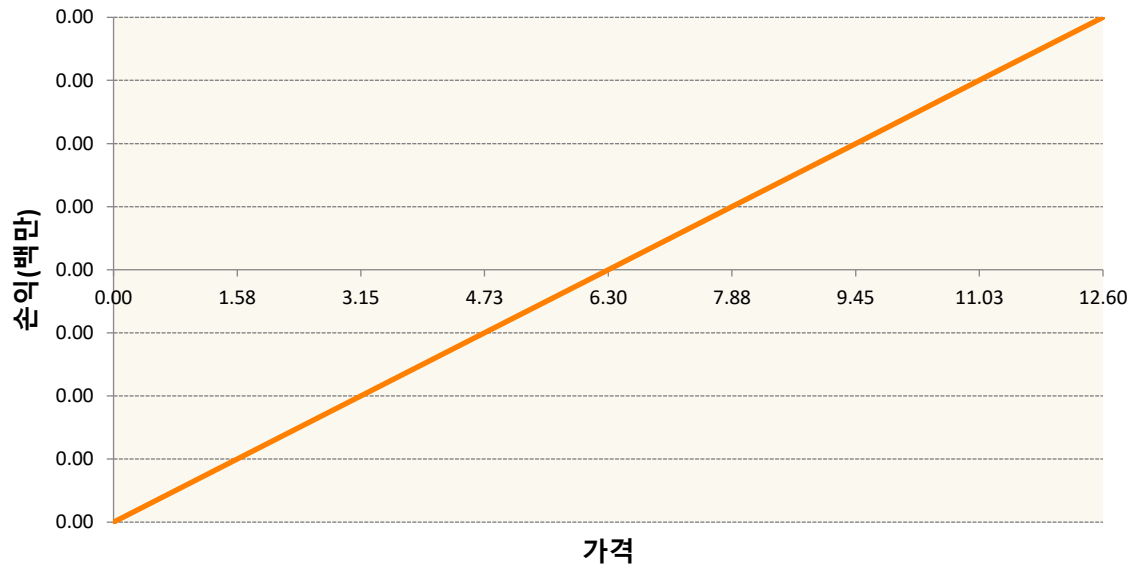
2. 만기시점의 손익구조



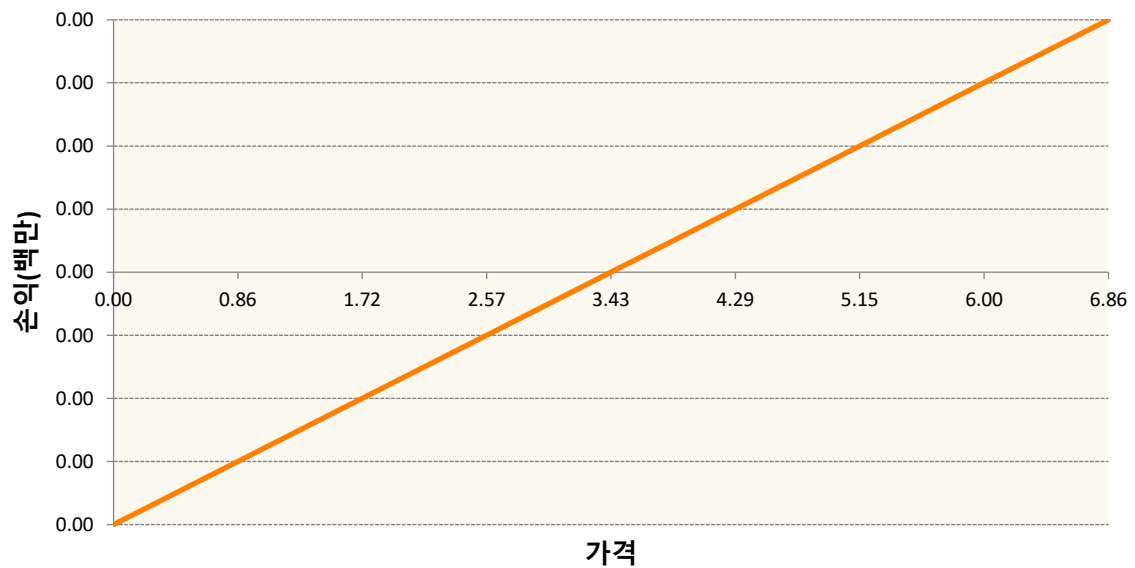
ECF3-E-mini Crude Oil Jan23



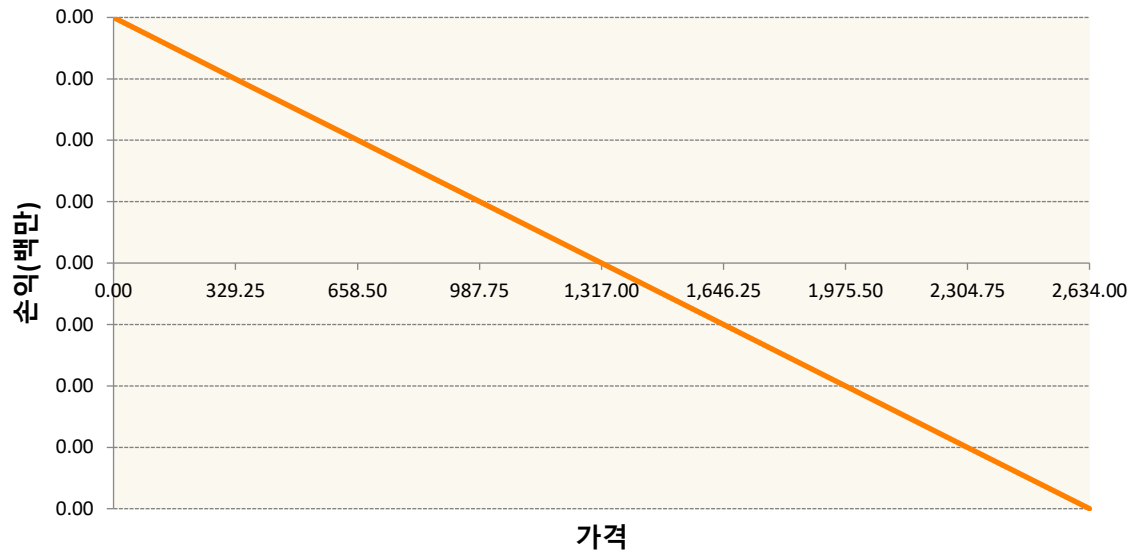
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



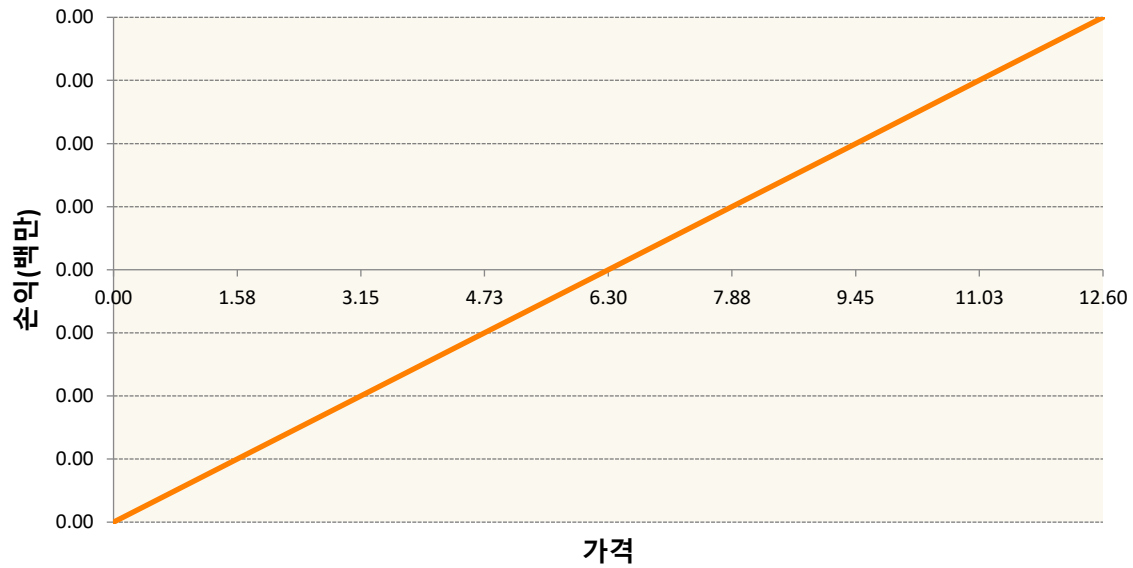
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



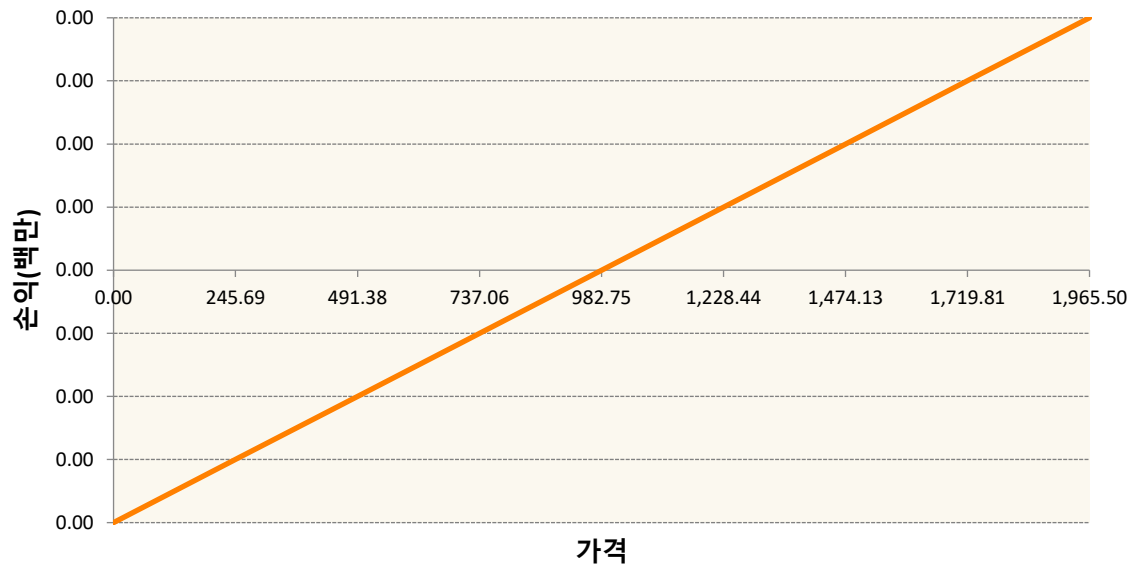
KR4175SB0001-2022-11 달러선물

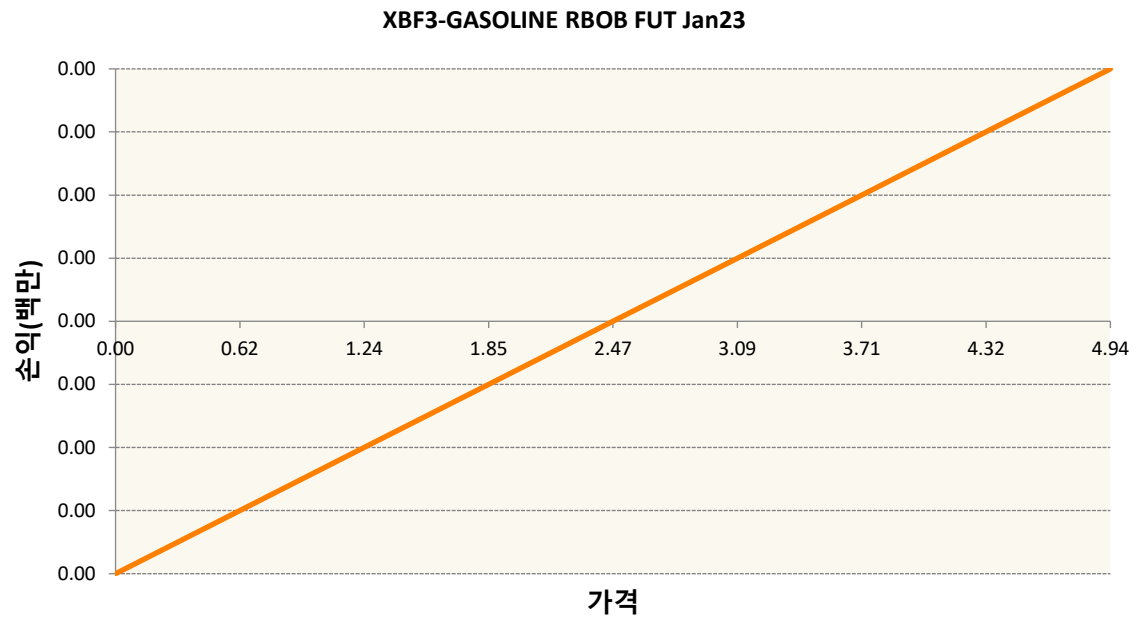


NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



QSF3-Low Su Gasoil G Jan23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF3	WTI CRUDE FUTURE Jan23	19
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	29
ECF3	E-mini Crude Oil Jan23	5
EOF3	E-MINI NATURAL GAS Jan23	9
HOF3	NY Harb ULSD Fut Jan23	16
KR4175SB00 2022-11 달러선물		21
NGF23	NATURAL GAS FUTR Jan23	44
QSF3	Low Su Gasoil G Jan23	11
XBF3	GASOLINE RBOB FUT Jan23	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	479