

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

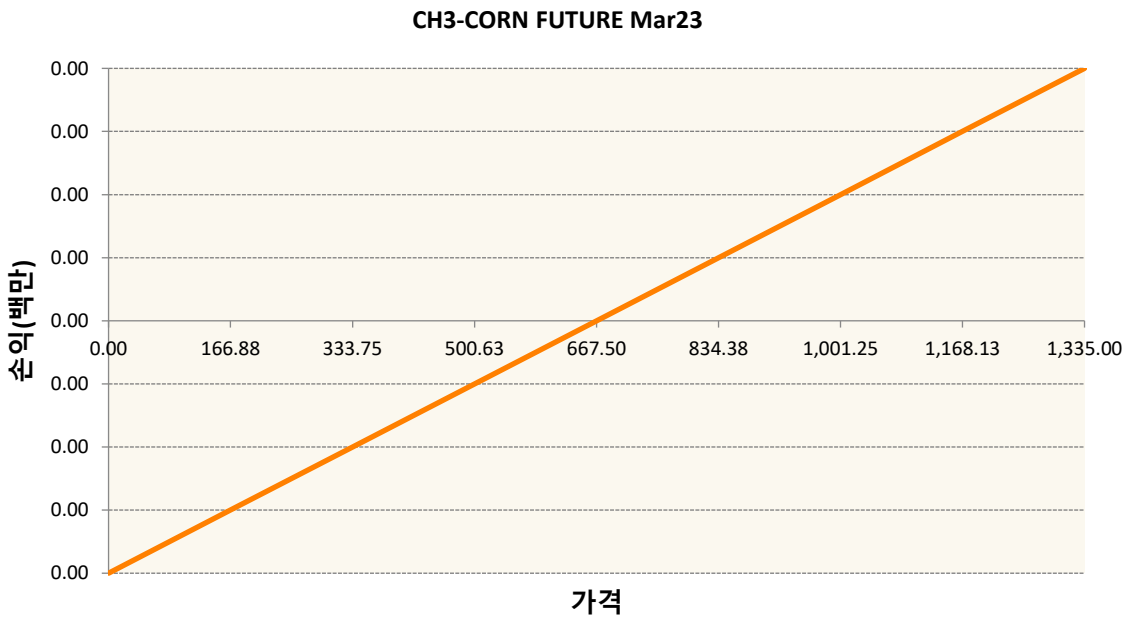
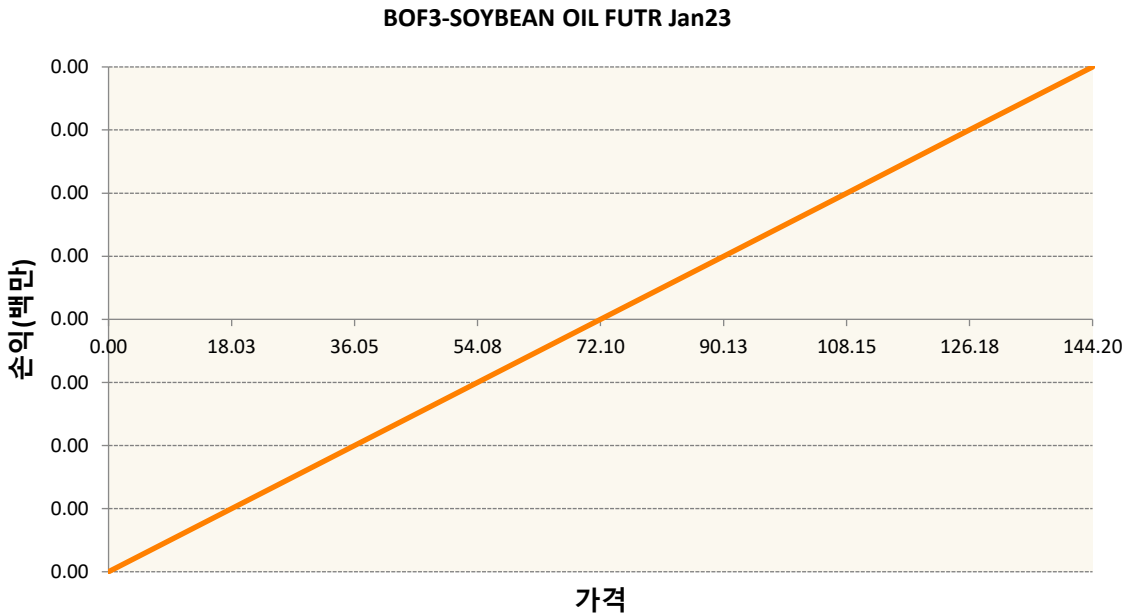
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

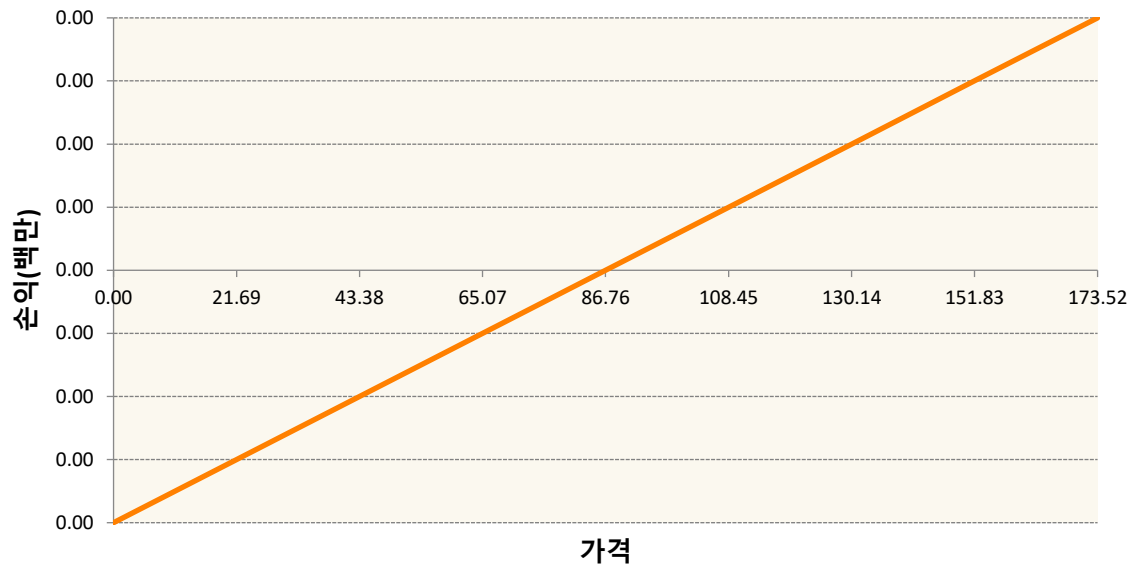
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,017	804	6,213	

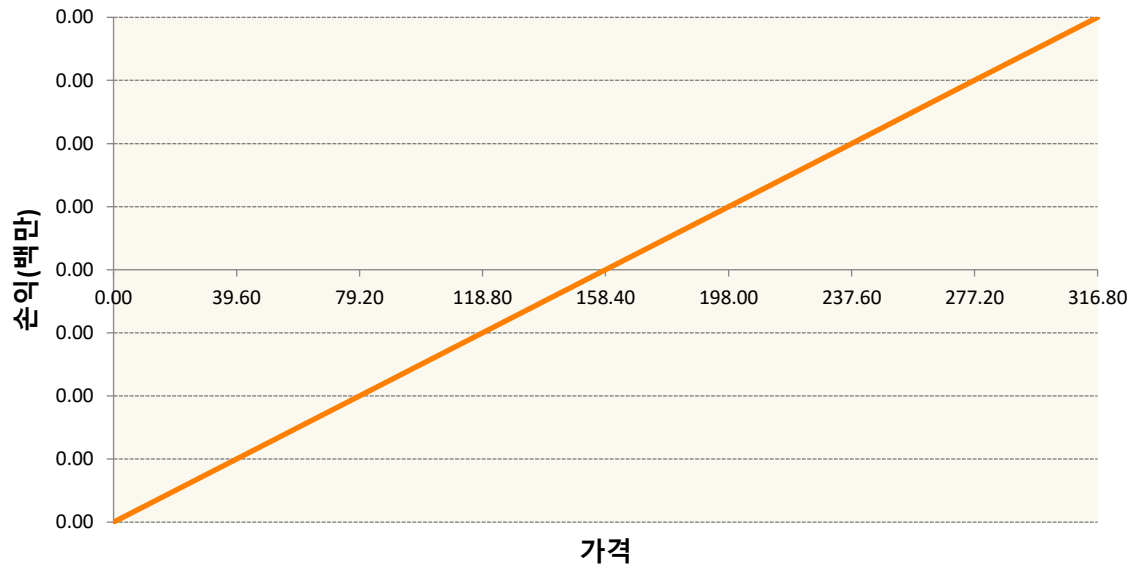
2. 만기시점의 손익구조



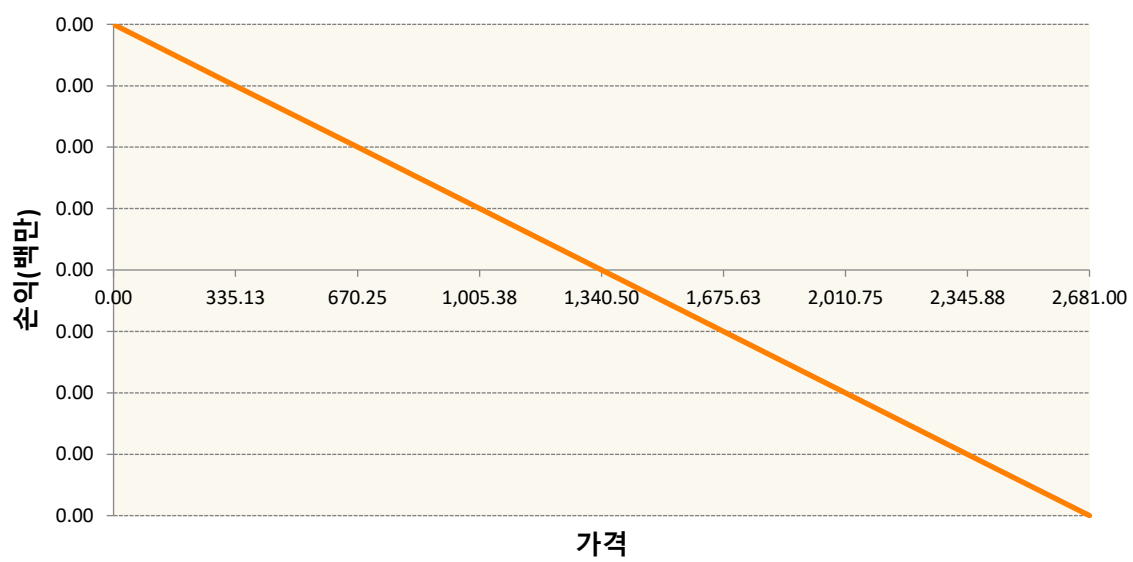
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



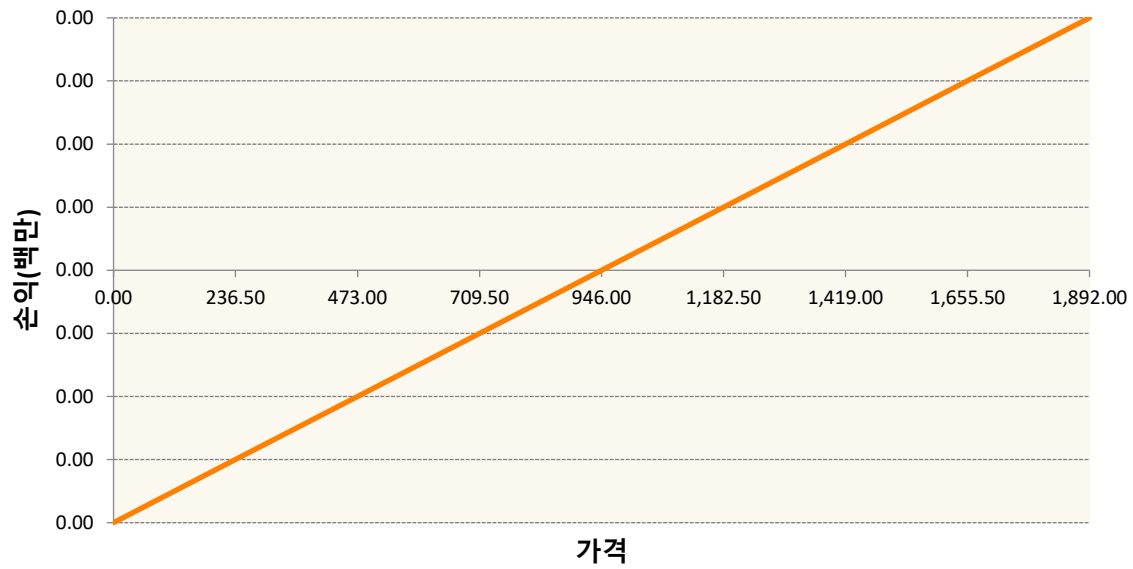
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



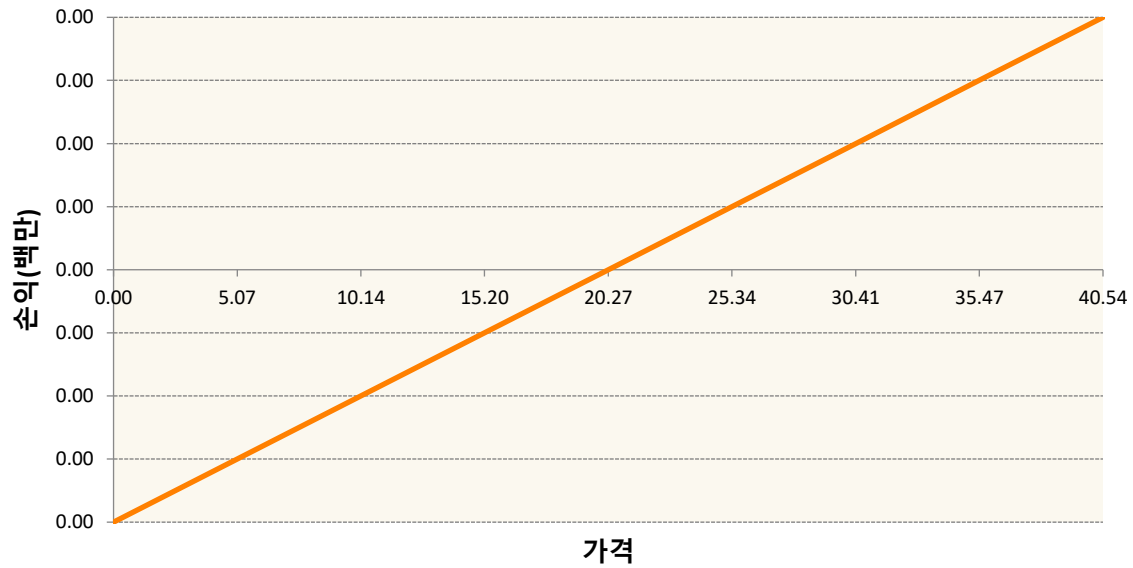
KR4175SC0000-2022-12 달러선물



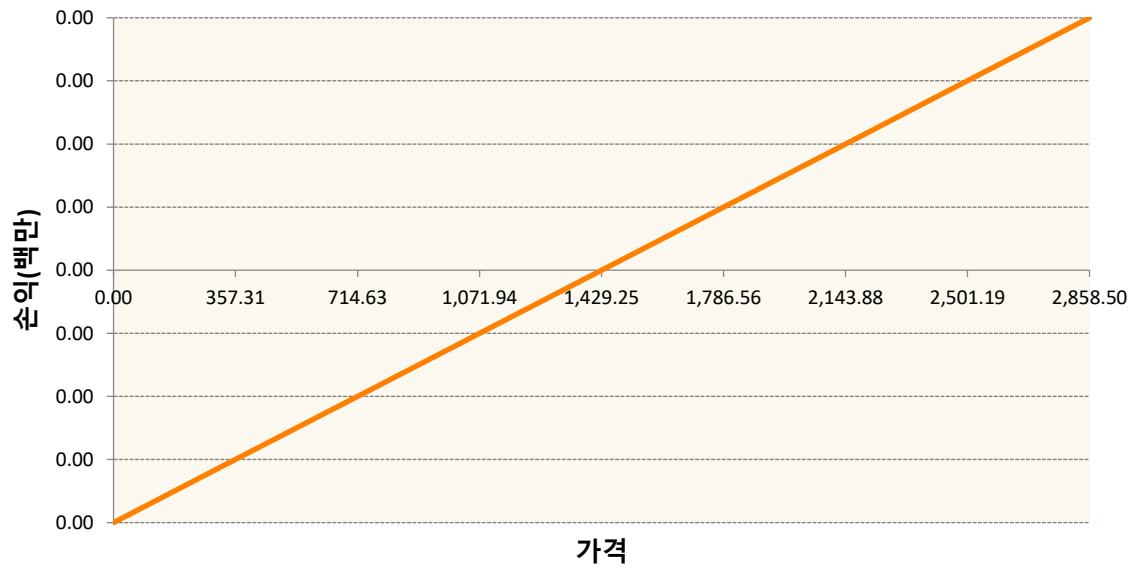
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



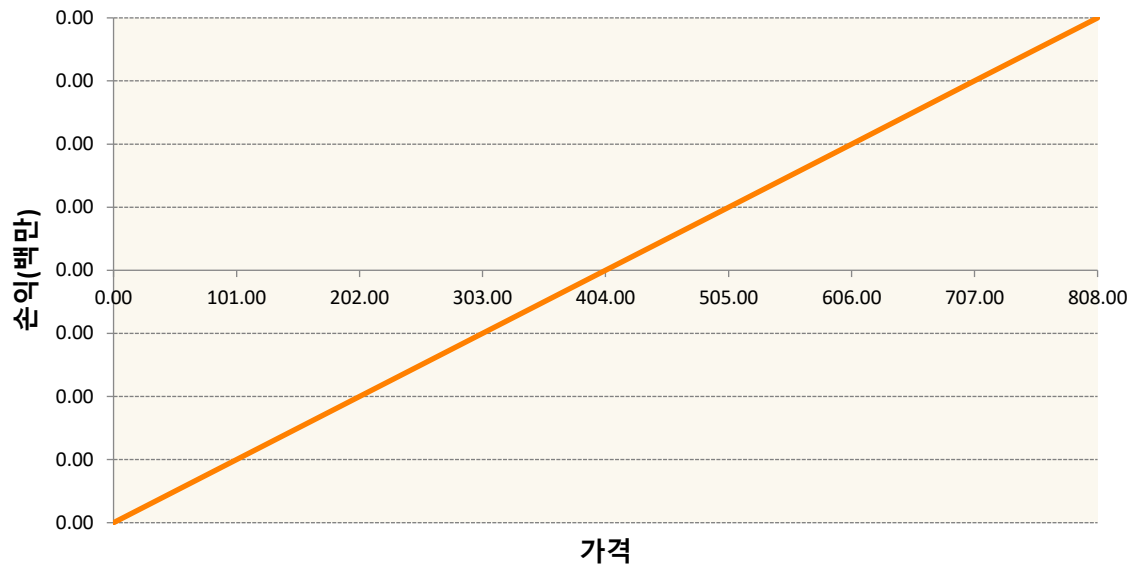
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



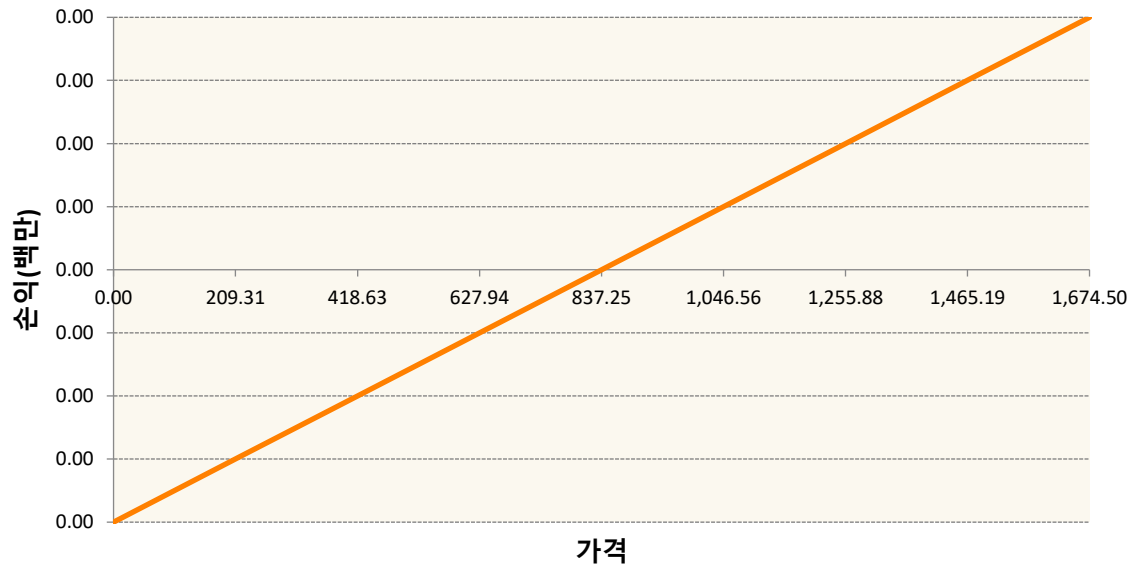
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



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	2022-11-18
기준일	2022-11-17

스마트인덱스모

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	2022-11-18
기준일	2022-11-17

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

349

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

483

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

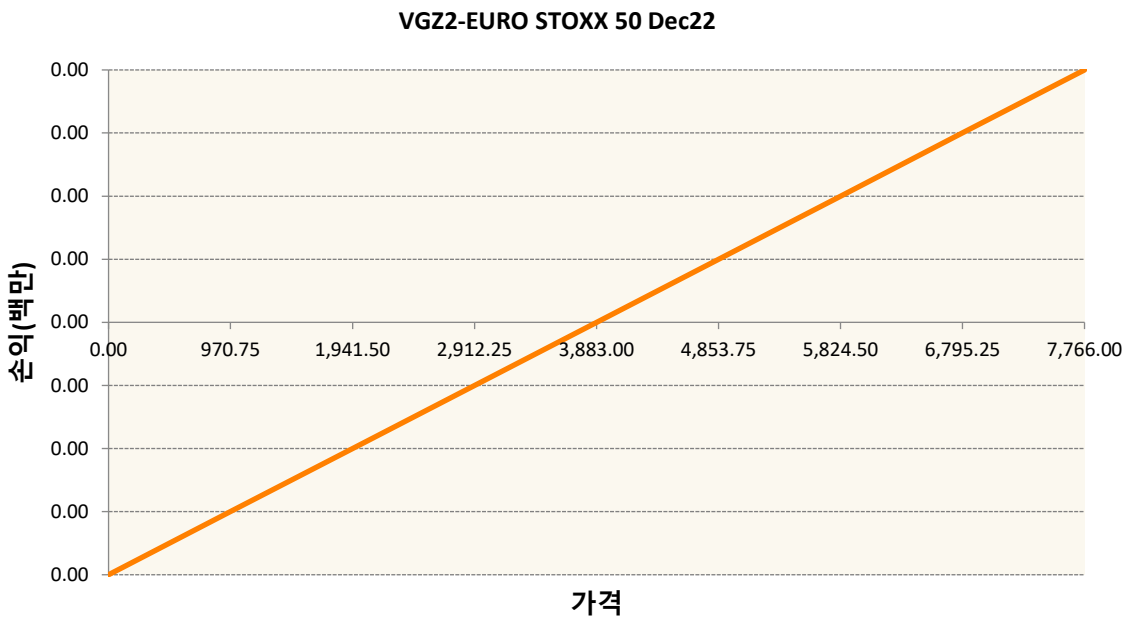
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	593	0	593	

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	2022-11-18
기준일	2022-11-17

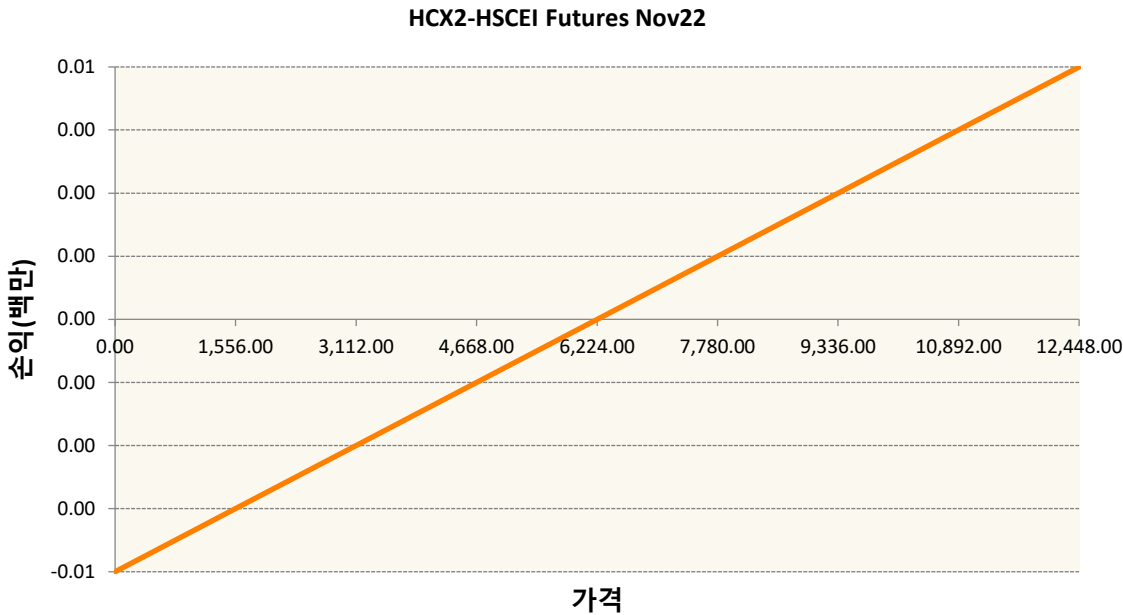
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,154	0	1,154	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX2	HSCEI Futures Nov22	92
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

152

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

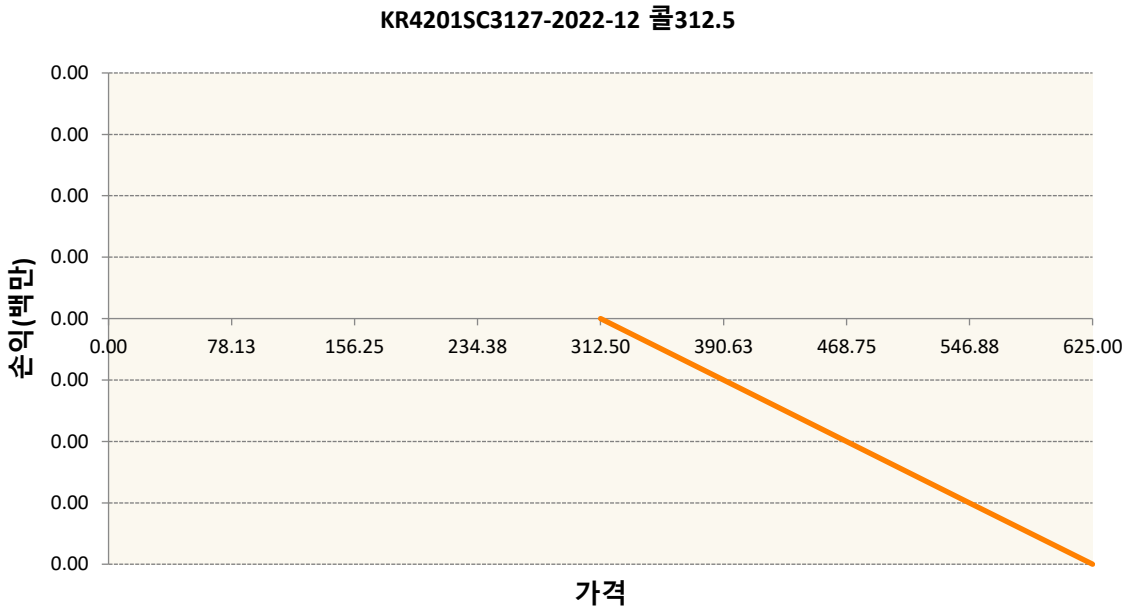
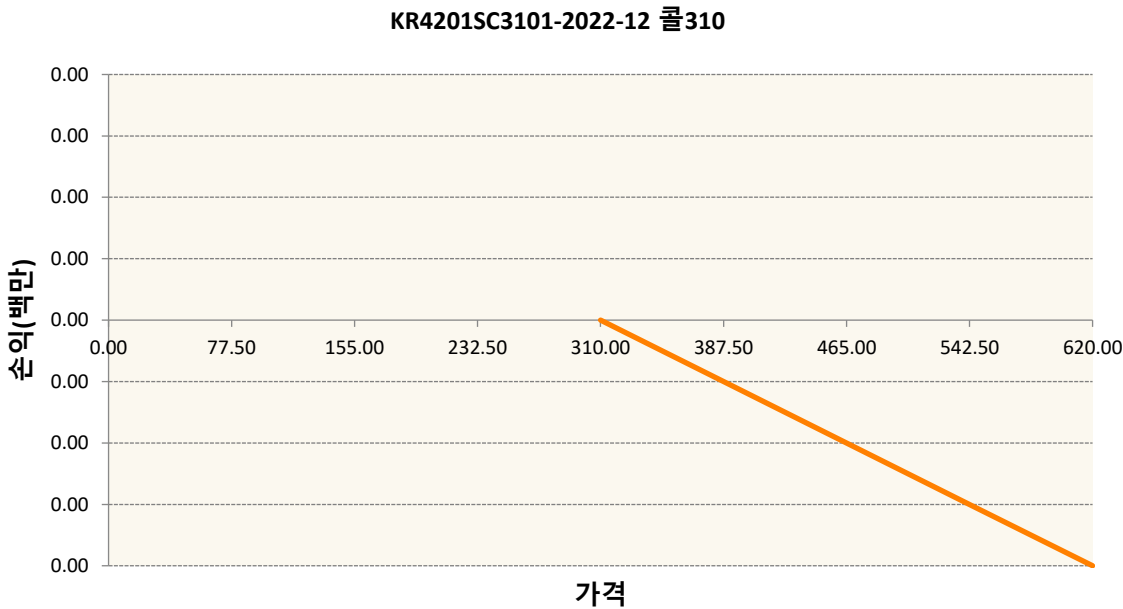
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	80	-80	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,281	-53,281	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
77.50	0.00
155.00	0.00
232.50	0.00
310.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price and profit/loss. The x-axis represents price ('가격') from 0.00 to 625.00. The y-axis represents profit/loss ('손익 (백만)') from -100.00 to 100.00. The orange line shows a linear relationship, starting at the origin (0,0) and reaching zero profit at a price of 312.50. The area under the line is shaded light orange.

가격	손익 (백만)
0.00	-100.00
78.13	-80.00
156.25	-60.00
234.38	-40.00
312.50	-20.00
390.63	0.00
468.75	20.00
546.88	40.00
625.00	60.00

(단위:백만원)

KR4201SC3101				2022-12 콜310			1,815
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,163	1,103	1,039	972	904	833	761
-5.33%	964	887	809	730	650	570	489
-2.67%	661	576	491	406	321	236	151
0%	250	167	84	0	-84	-169	-253
2.67%	-263	-334	-408	-484	-561	-640	-720
5.33%	-856	-911	-970	-1,034	-1,101	-1,171	-1,243
8.00%	-1,507	-1,545	-1,590	-1,640	-1,694	-1,753	-1,815
KR4201SC3127				2022-12 콜312.5			1,145
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	699	664	625	584	542	498	453
-5.33%	587	540	491	442	391	340	289
-2.67%	412	357	302	247	192	138	83
0%	166	111	55	0	-56	-111	-167
2.67%	-147	-196	-247	-298	-351	-404	-457
5.33%	-517	-556	-598	-642	-688	-736	-785
8.00%	-928	-956	-988	-1,024	-1,062	-1,103	-1,145
KR4301SC3100 2022-12 풋310							124

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-94	-100	-106	-111	-118	-124
-5.33%	-43	-50	-56	-63	-70	-77	-84
-2.67%	-6	-13	-21	-28	-35	-43	-50
0%	22	14	7	0	-7	-15	-22
2.67%	41	34	28	21	15	8	1
5.33%	52	48	42	37	31	25	19
8.00%	59	56	52	48	43	38	32

KR4301SC3126 2022-12 풋312.5							366
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-272	-286	-301	-316	-332	-349	-366
-5.33%	-136	-154	-172	-191	-210	-229	-249
-2.67%	-23	-44	-65	-85	-106	-127	-148
0%	63	42	21	0	-21	-42	-63
2.67%	123	105	86	66	46	26	6
5.33%	163	148	132	115	97	79	61
8.00%	186	175	163	149	135	119	103

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

(단위:백만원)

3,152

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

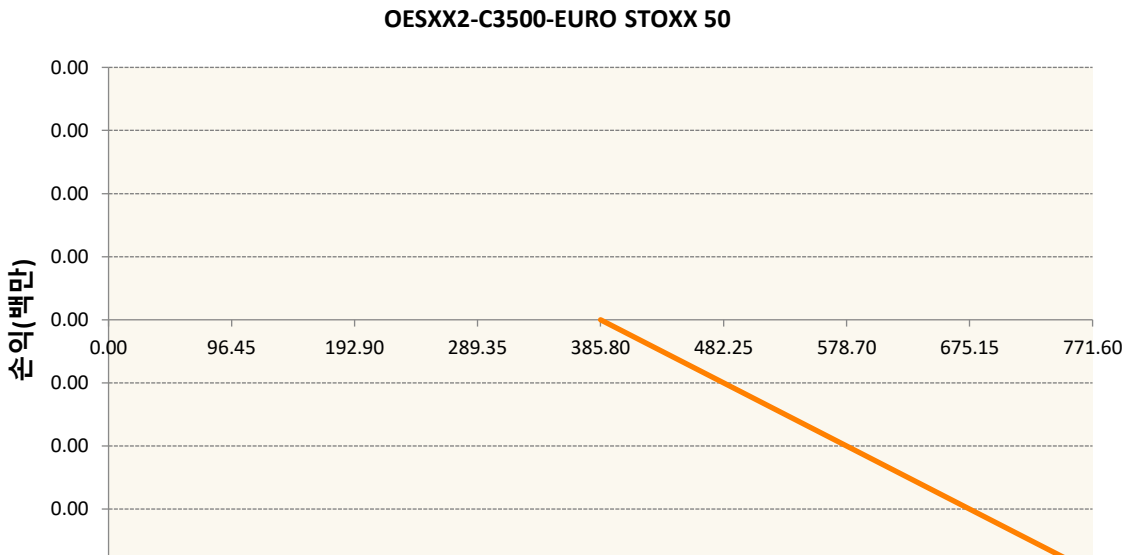
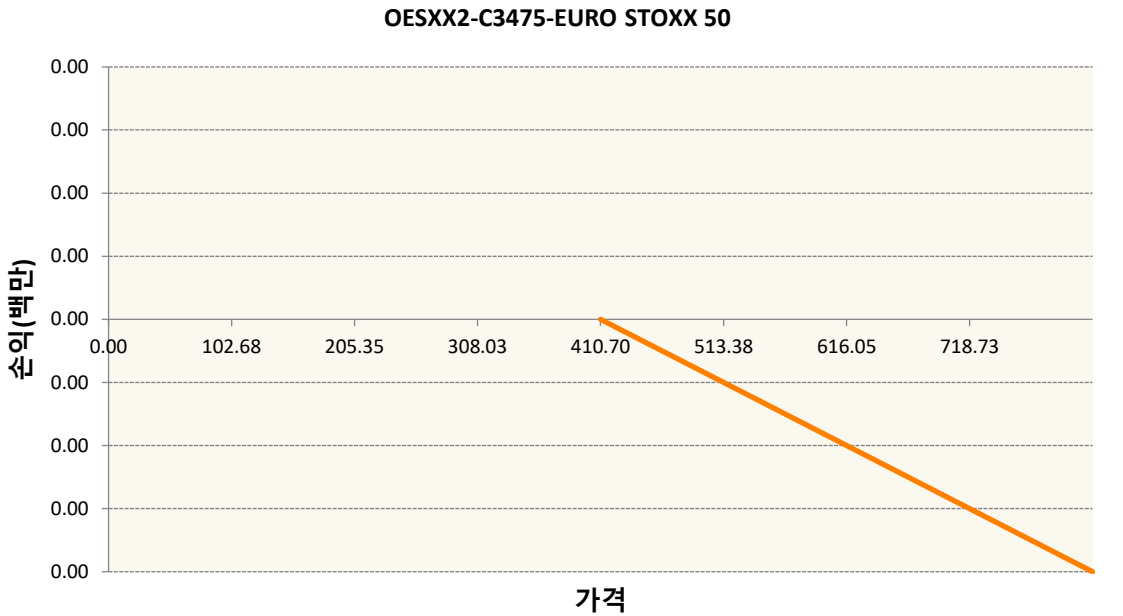
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

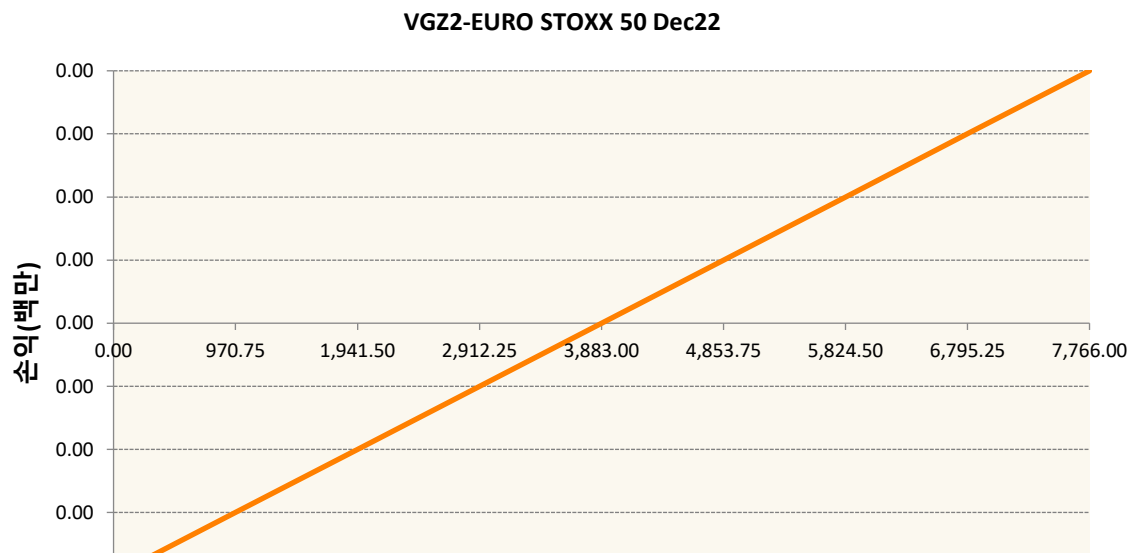
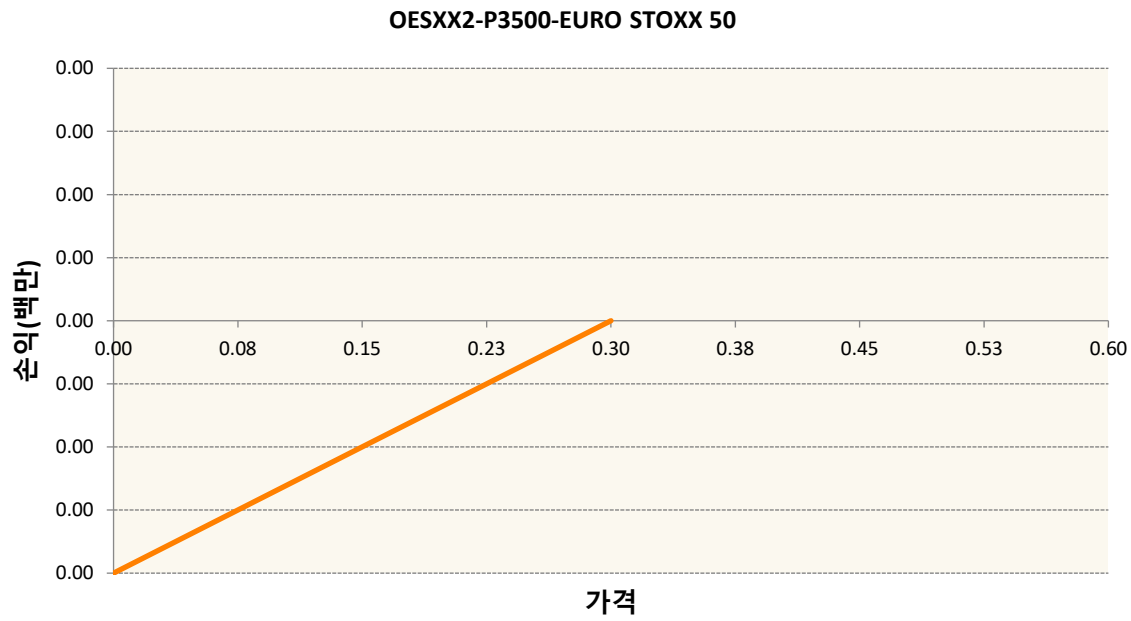
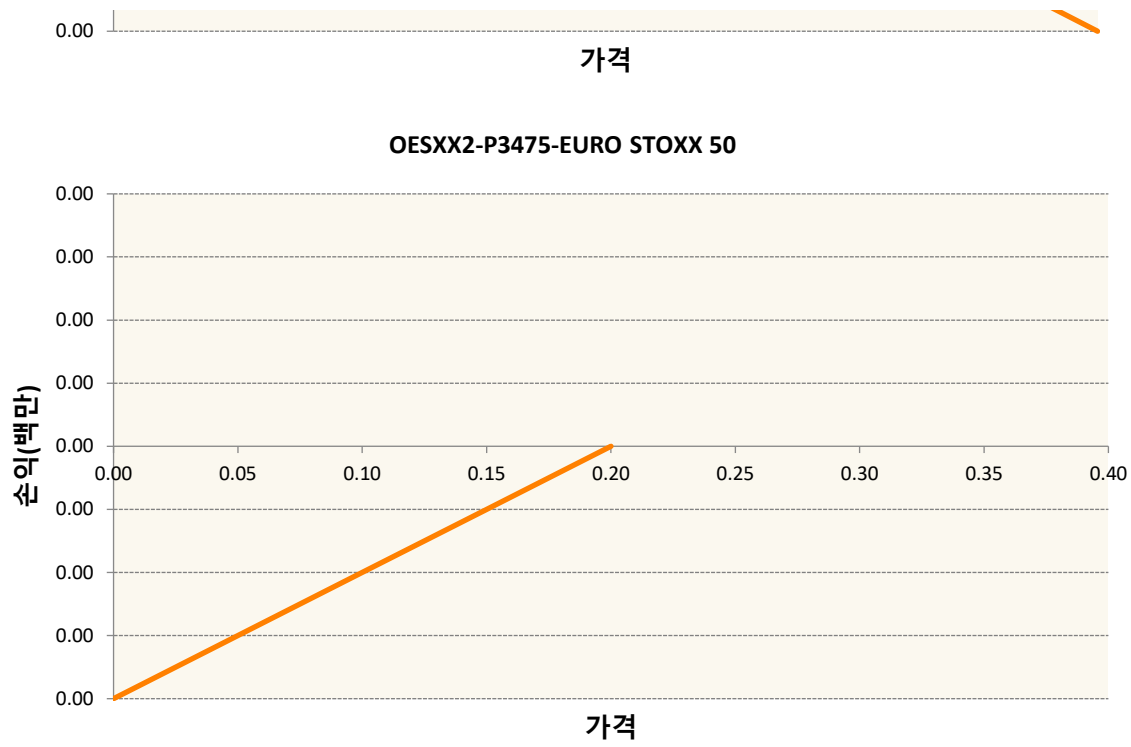
1. 계약금액

(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	1,035	0	1,035	
누계	유가증권	옵션	0	251	-251	장내
누계	통화	선도	0	3,199	-3,199	장외

2. 만기시점의 손익구조





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
FXW213CBG(KRW/EUR 24-02-23E		72
OESXX2-C34 EURO STOXX 50		19
OESXX2-C35 EURO STOXX 50		1
OESXX2-P34 EURO STOXX 50		0.01
OESXX2-P35 EURO STOXX 50		0
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22		83

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	294

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

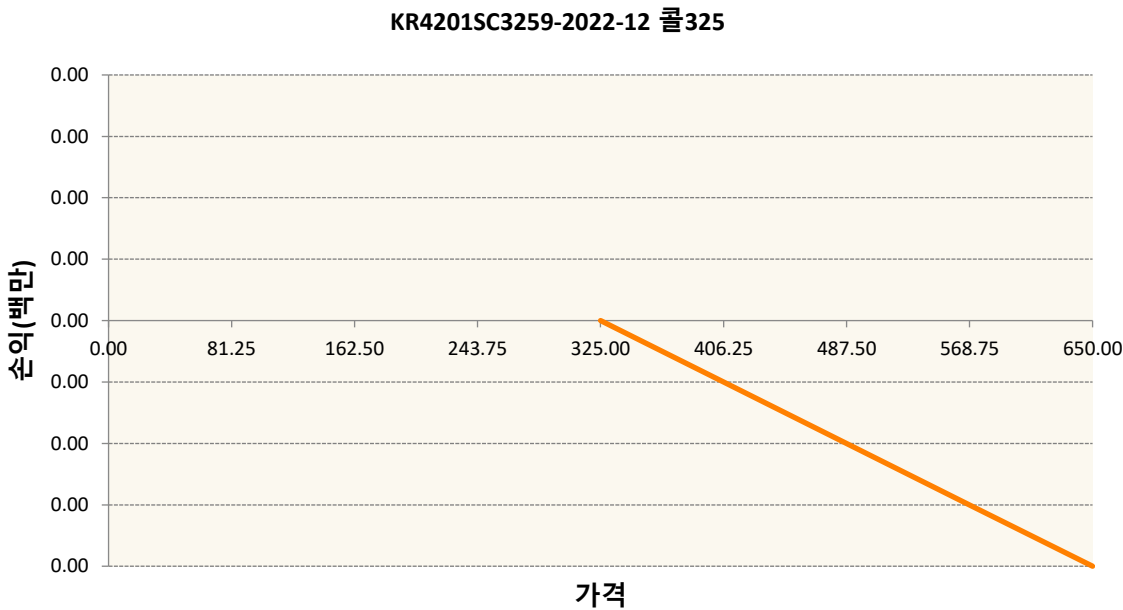
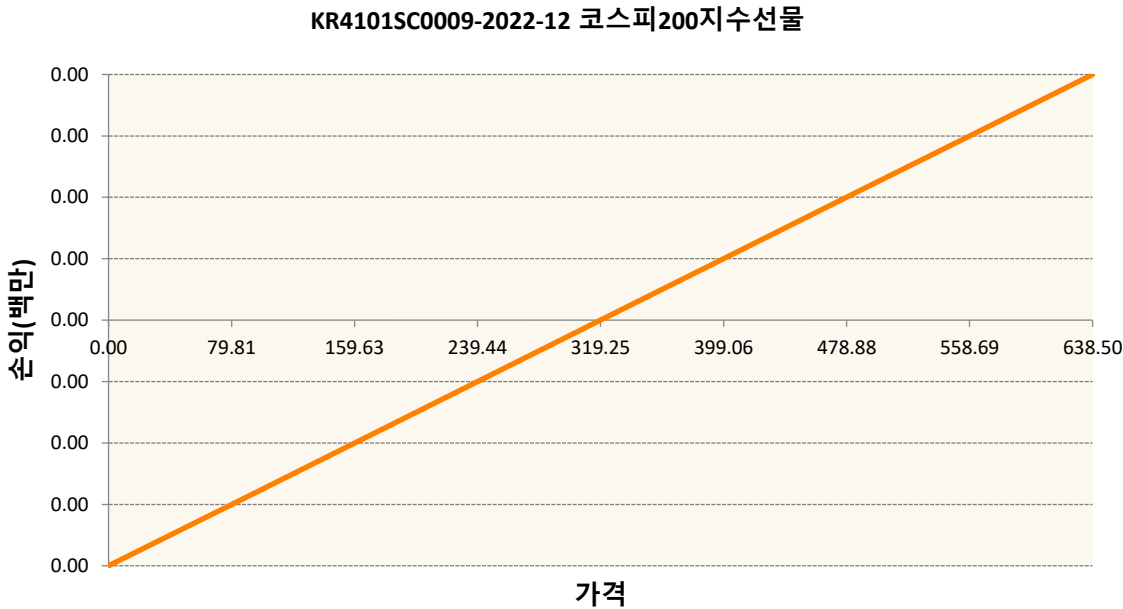
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

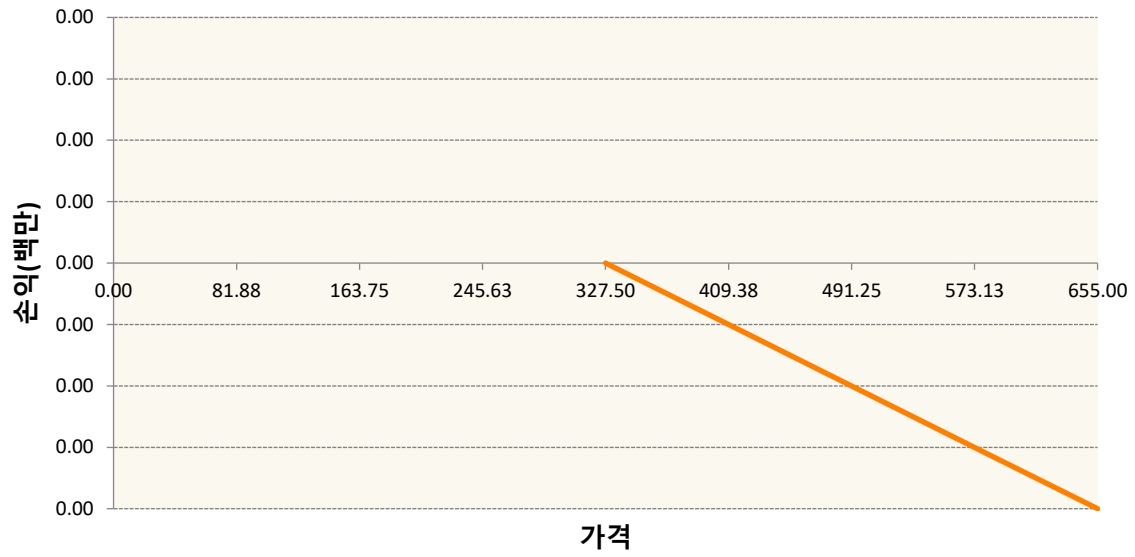
(단위:백만원)

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	399	0	399	장내
누계	유가증권	옵션	311	3,839	-3,528	장내

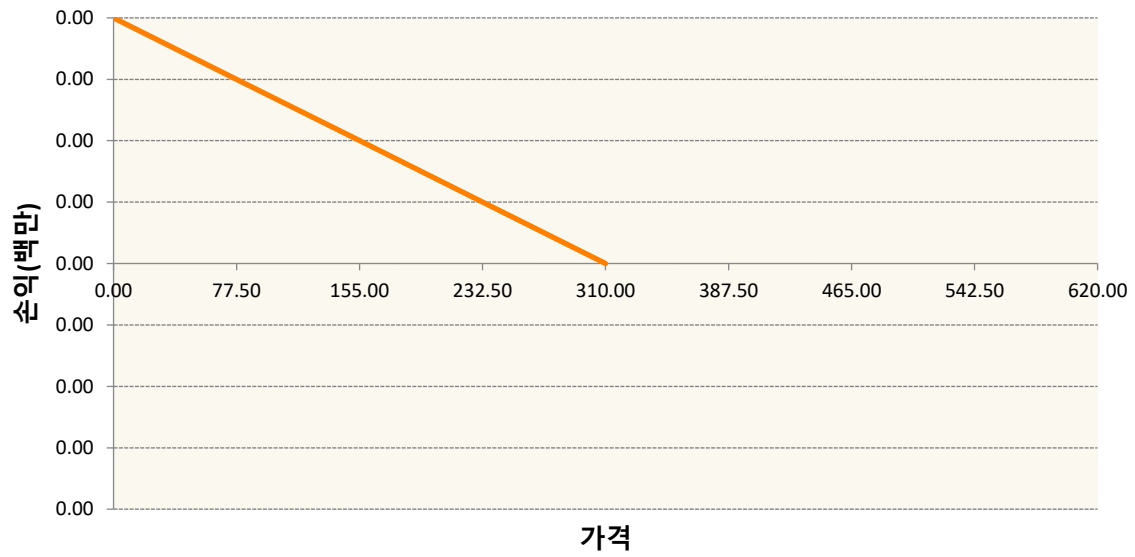
2. 만기시점의 손익구조



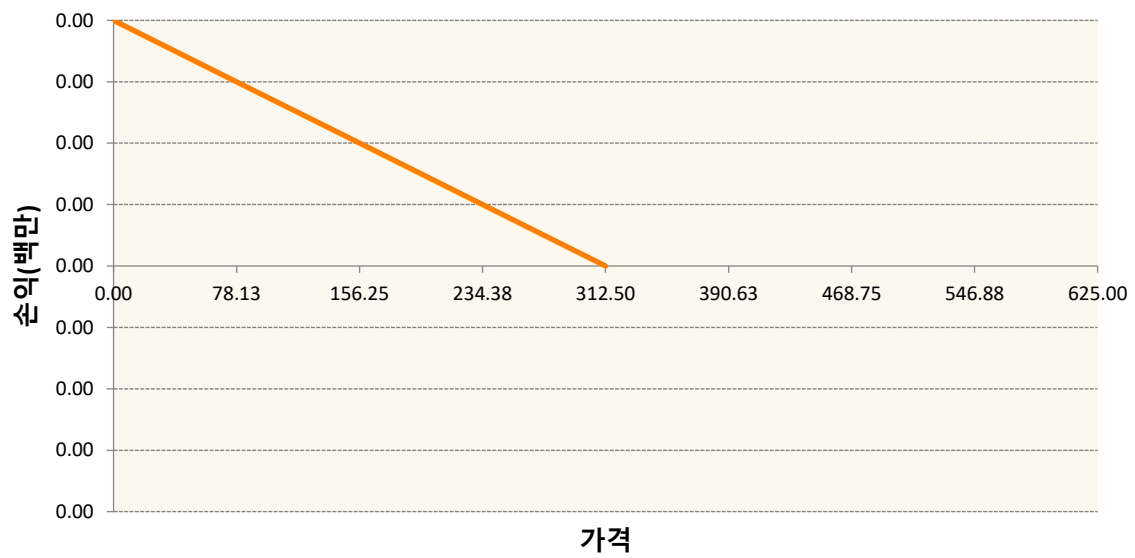
KR4201SC3275-2022-12 콜327.5



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		65	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	30	29	27	25	23	21	19			
-5.33%	27	25	22	20	17	14	11			
-2.67%	21	18	15	12	8	5	1			
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11			
2.67%	-3	-7	-11	-15	-19	-23	-27			
5.33%	-22	-26	-29	-33	-37	-41	-45			
8.00%	-45	-48	-51	-55	-58	-62	-65			
KR4201SC3275							2022-12 콜327.5		134	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	58	56	53	49	45	41	36			
-5.33%	53	48	44	39	33	27	21			
-2.67%	41	35	29	23	16	9	2			
0%	23	15	8	0	-8	-16	-24			
2.67%	-5	-13	-21	-30	-38	-46	-55			
5.33%	-42	-50	-58	-67	-75	-83	-91			
8.00%	-88	-95	-103	-110	-118	-126	-134			
KR4301SC3100							2022-12 풋310		8	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	6	6	7	7	7	8	8			
-5.33%	3	3	4	4	5	5	6			
-2.67%	0	1	1	2	2	3	3			
0%	-1	-1	0	0	0	1	1			
2.67%	-3	-2	-2	-1	-1	-1	0			
5.33%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-1			
8.00%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-2			
KR4301SC3126							2022-12 풋312.5		9	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	7	7	7	8	8	9
-5.33%	3	4	4	4	5	5	6
-2.67%	1	1	2	2	2	3	3
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-3	-2	-2	-2	-1	-1	0
5.33%	-4	-3	-3	-3	-2	-2	-1
8.00%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-2

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

(단위:백만원)

211

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

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	7,006	0	7,006	

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	2022-11-18
기준일	2022-11-17

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	6,091	0	6,091	

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	2022-11-18
기준일	2022-11-17

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	19,318	0	19,318	
누계	통화	선도	0	18,781	-18,781	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E	599
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	498
FXW213CAR·KRW/USD 30-01-23E	277
FXW213CB1(KRW/USD 28-11-22E	54
FXW213CBG·KRW/USD 28-11-22E	75
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

730

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

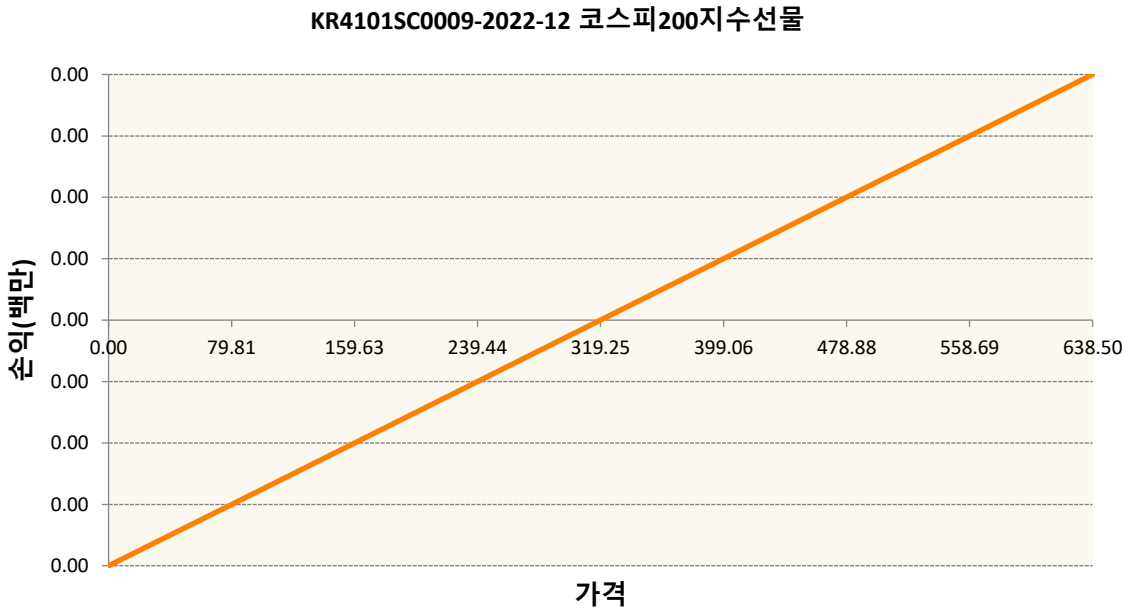
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	399	0	399	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	2022-11-18
기준일	2022-11-17

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	851	0	851	장외
누계	통화	선도	1,154	1,127	28	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	68
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	6
FXW213CAQ EUR/KRW 18-11-22E	6
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)

209

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

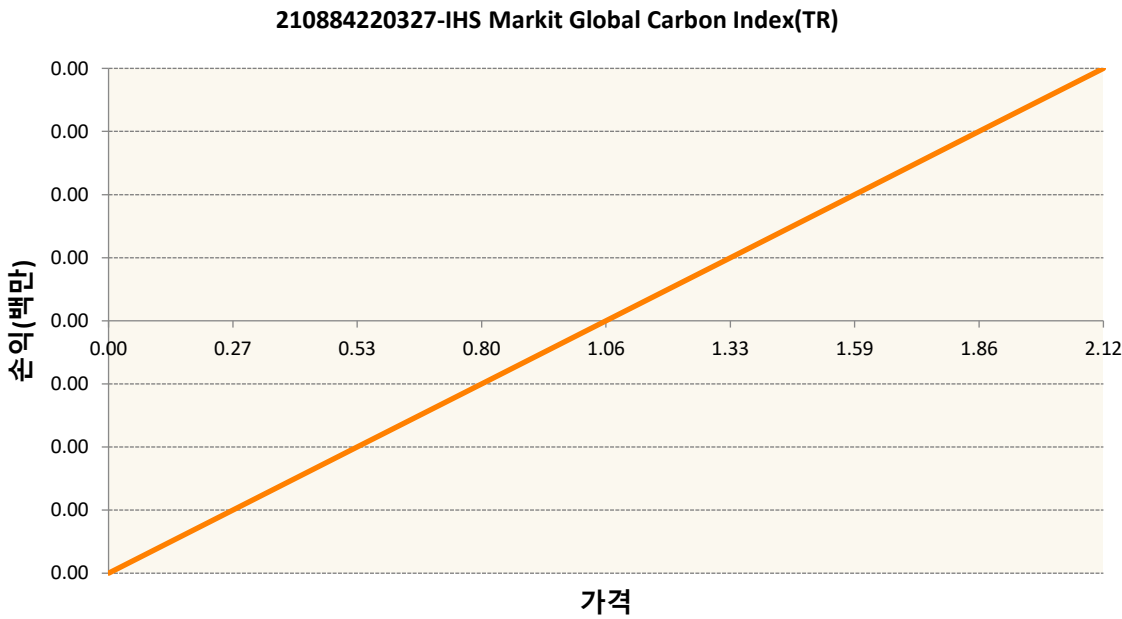
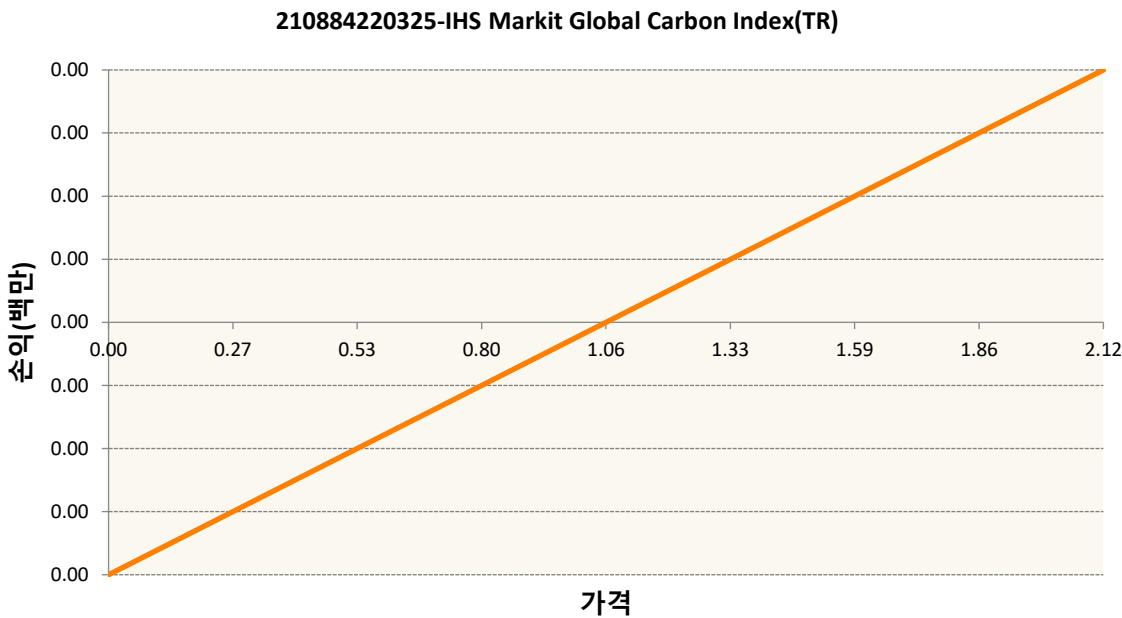
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

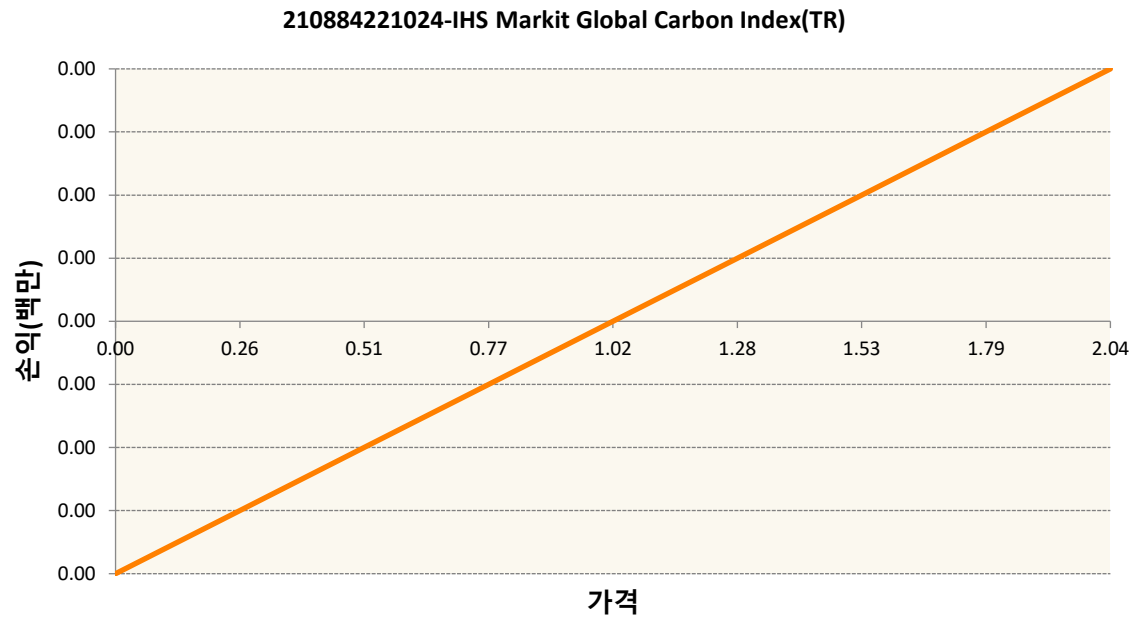
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	28,721	0	28,721	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		184
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		92
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		2,021

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		4,428

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

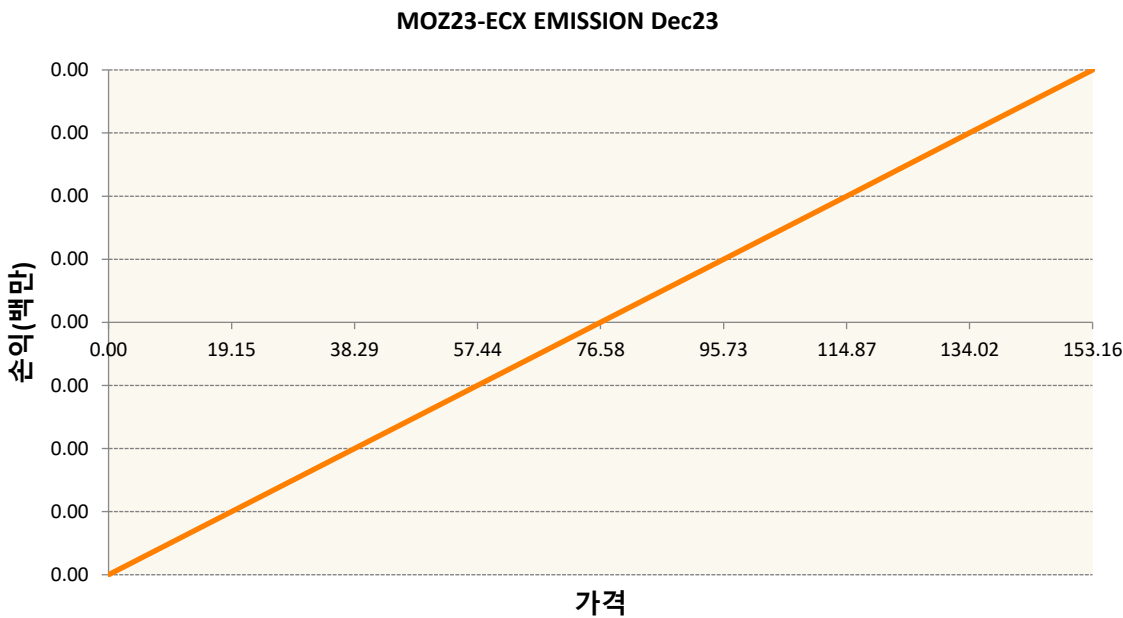
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,862	0	13,862	
누계	통화	선도	0	4,914	-4,914	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CAT(KRW/EUR 23-11-22E	368
FXW213CB7(KRW/EUR 23-11-22E	8
FXW213CB8(KRW/EUR 23-11-22E	17
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,109

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

(단위:백만원)

3,156

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

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)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	19

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

(단위:백만원)

149

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

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)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	12

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

(단위:백만원)

50

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

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	0.09
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.33

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

(단위:백만원)

1

공시일	2022-11-18
기준일	2022-11-17

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

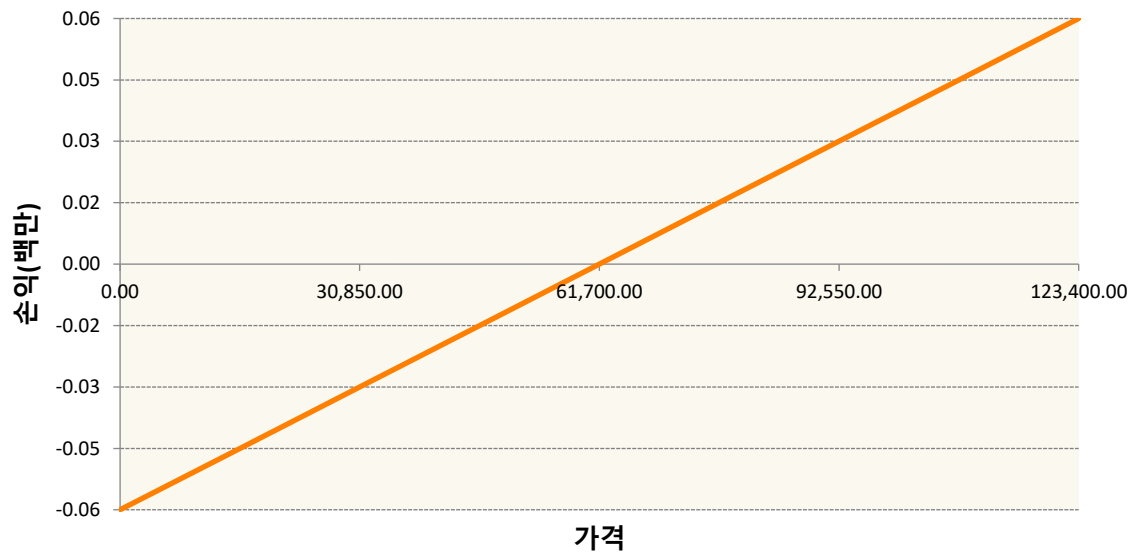
1. 계약금액

(단위:백만원)

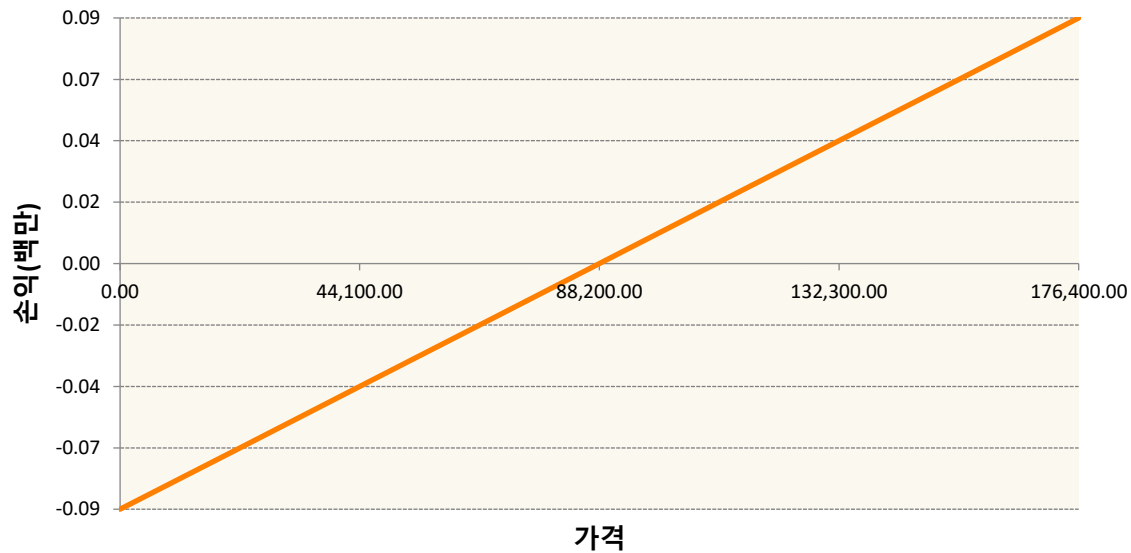
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	152	0	152	장내

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 2022-11-18

기준일 2022-11-17

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 2022-11-18

기준일 2022-11-17

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

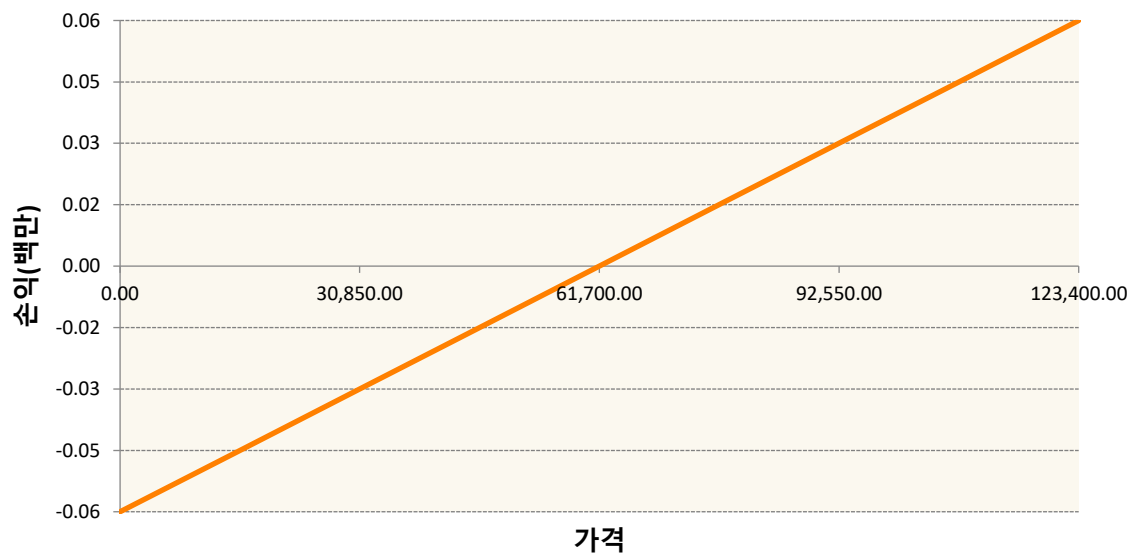
1. 계약금액

(단위:백만원)

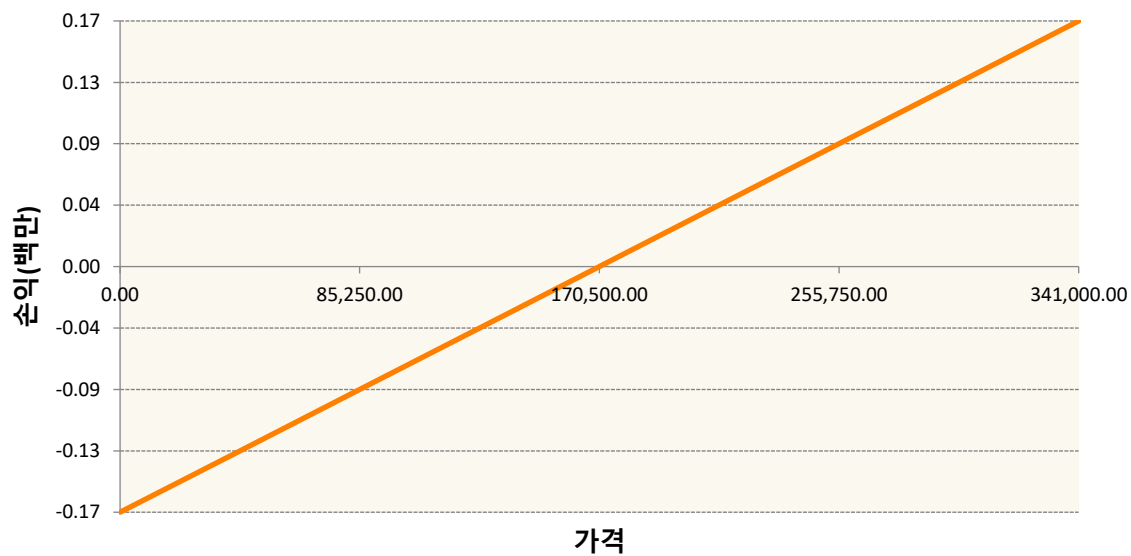
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	299	0	299	장내

2. 만기시점의 손익구조

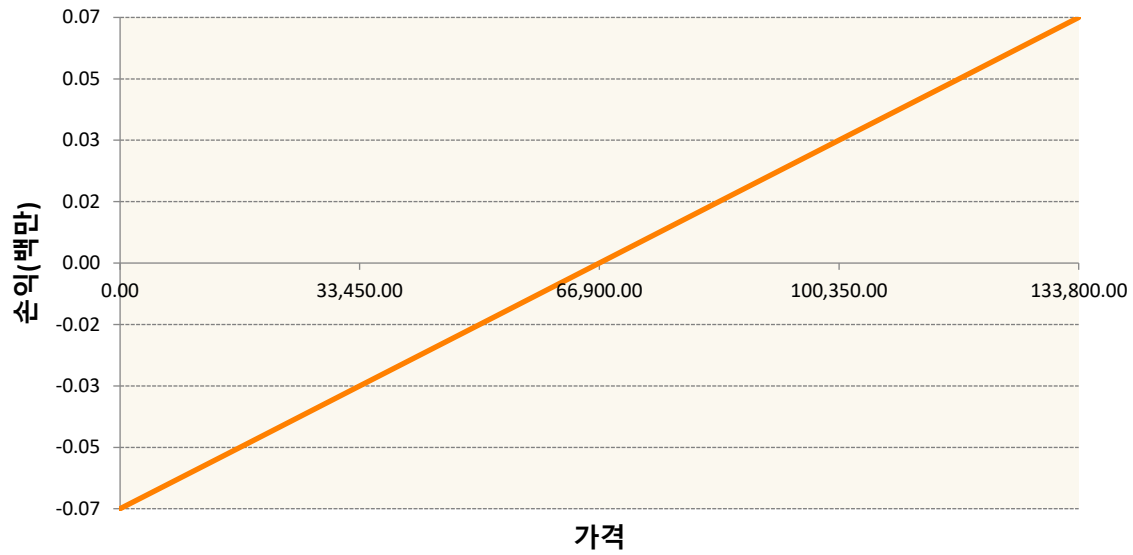
KR4111SC0007-2022-12 삼성전자개별선물



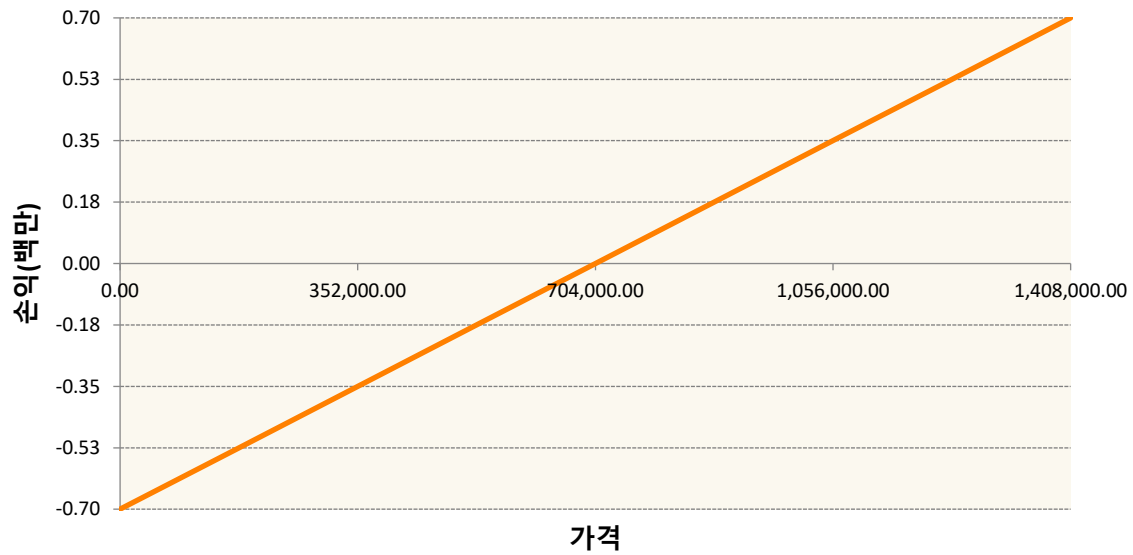
KR4116SC0002-2022-12 현대차개별선물



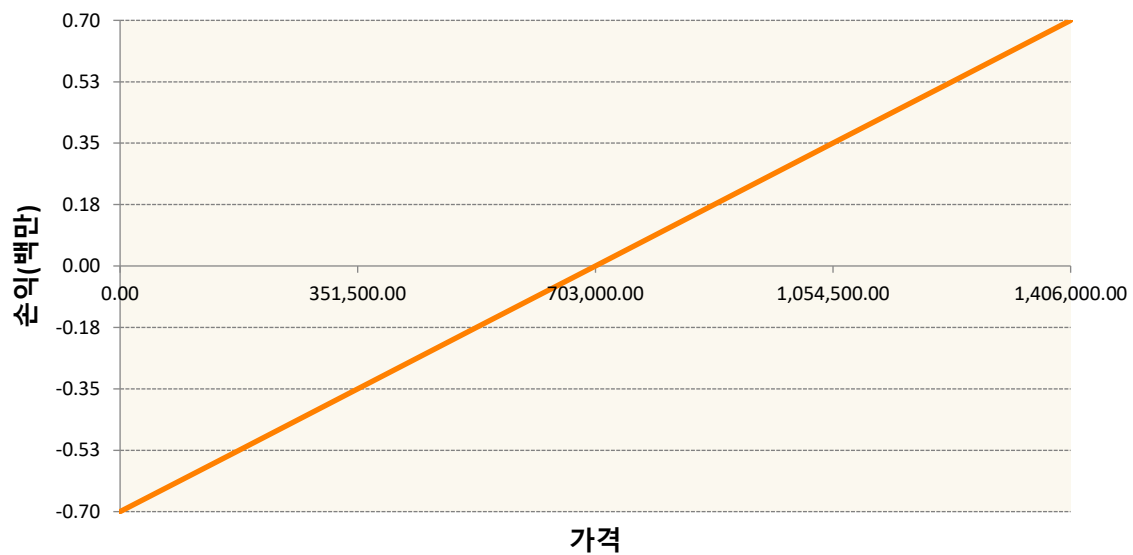
KR4119SC0009-2022-12 기아차개별선물



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		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%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
-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%	7	7	7	7	7	7	7	7	
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)

28

공시일 2022-11-18

기준일 2022-11-17

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

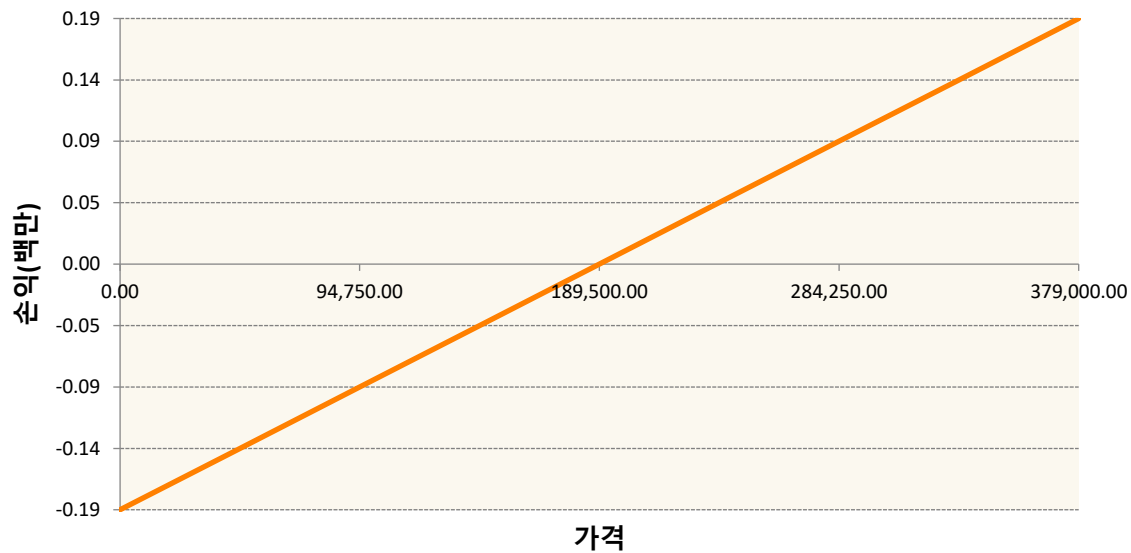
1. 계약금액

(단위:백만원)

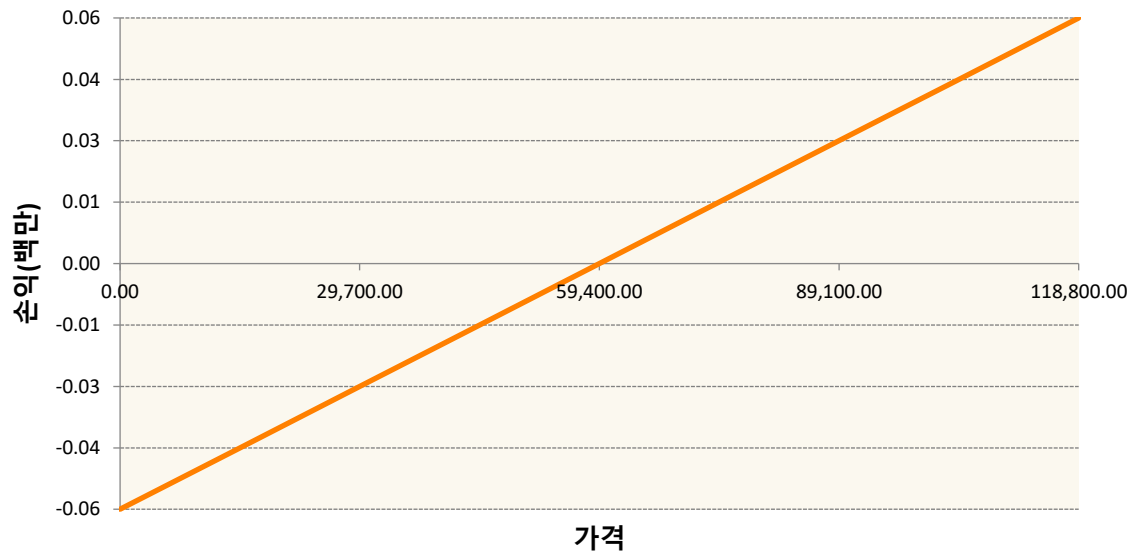
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	120	0	120	장내

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	2022-11-18
기준일	2022-11-17

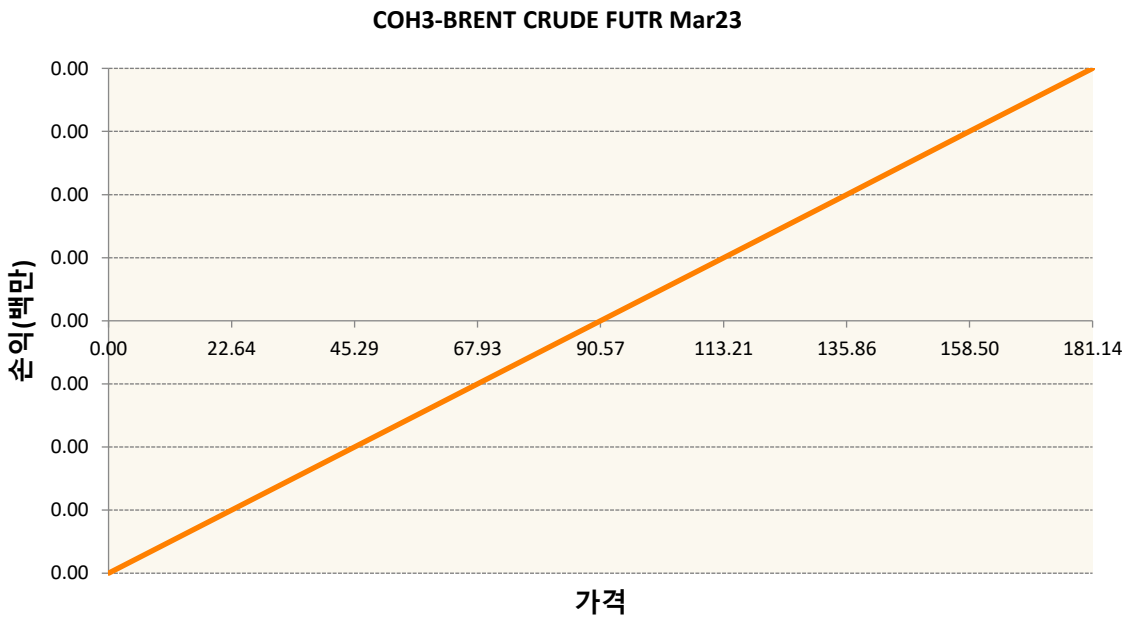
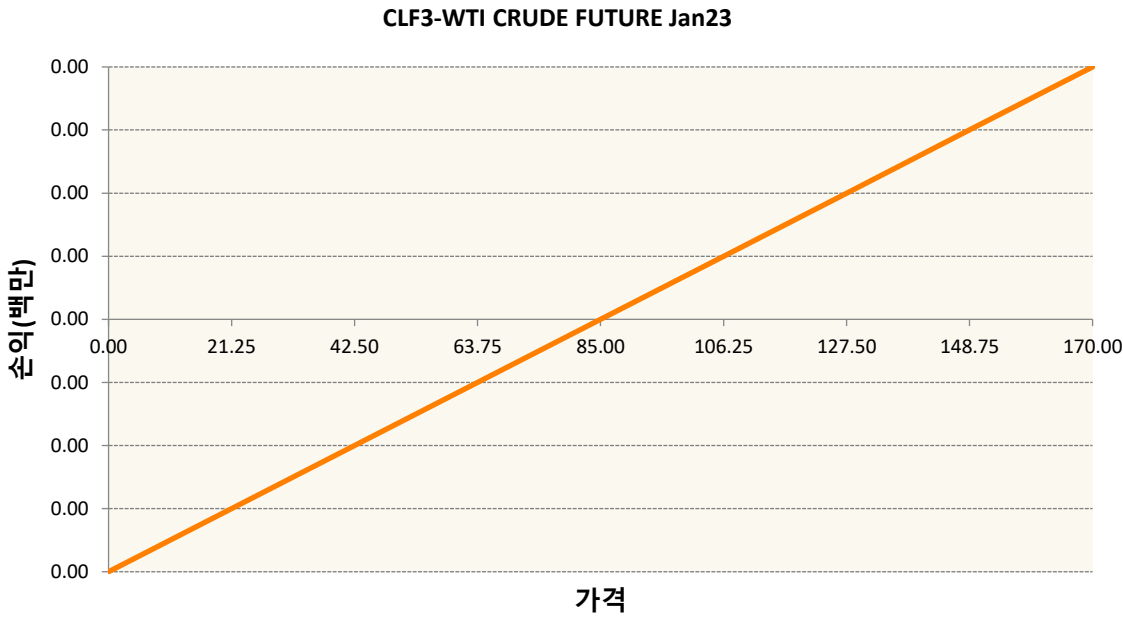
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

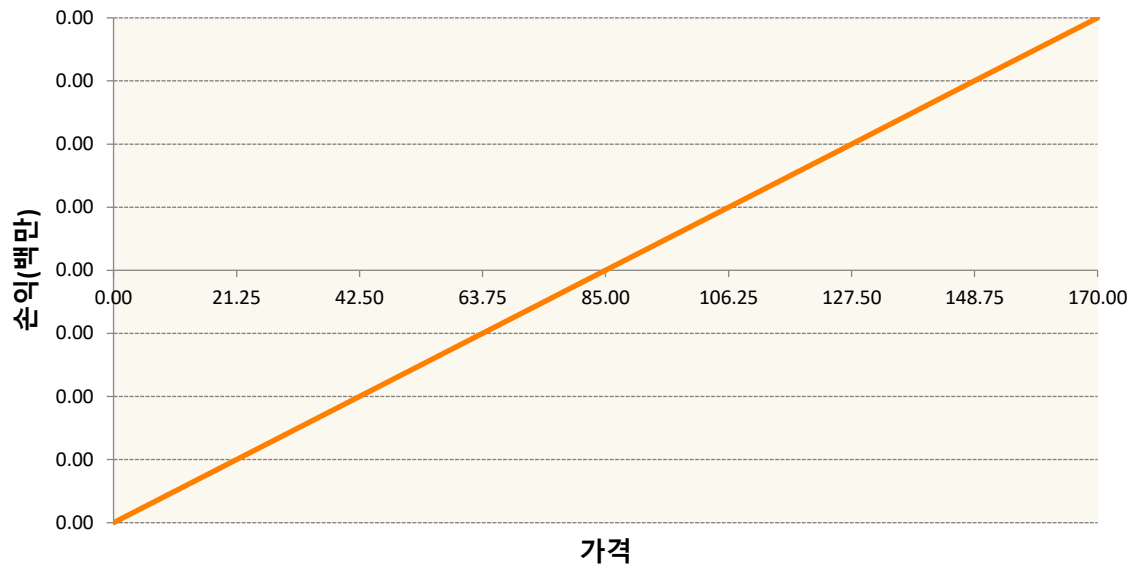
(단위:백만원)

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	1,594	268	1,326	

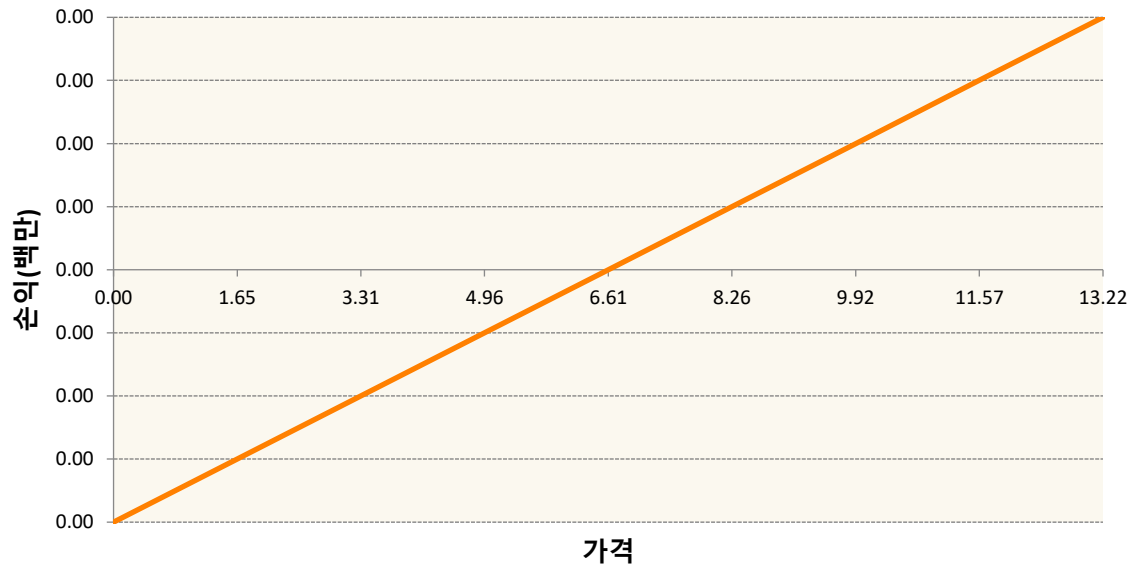
2. 만기시점의 손익구조



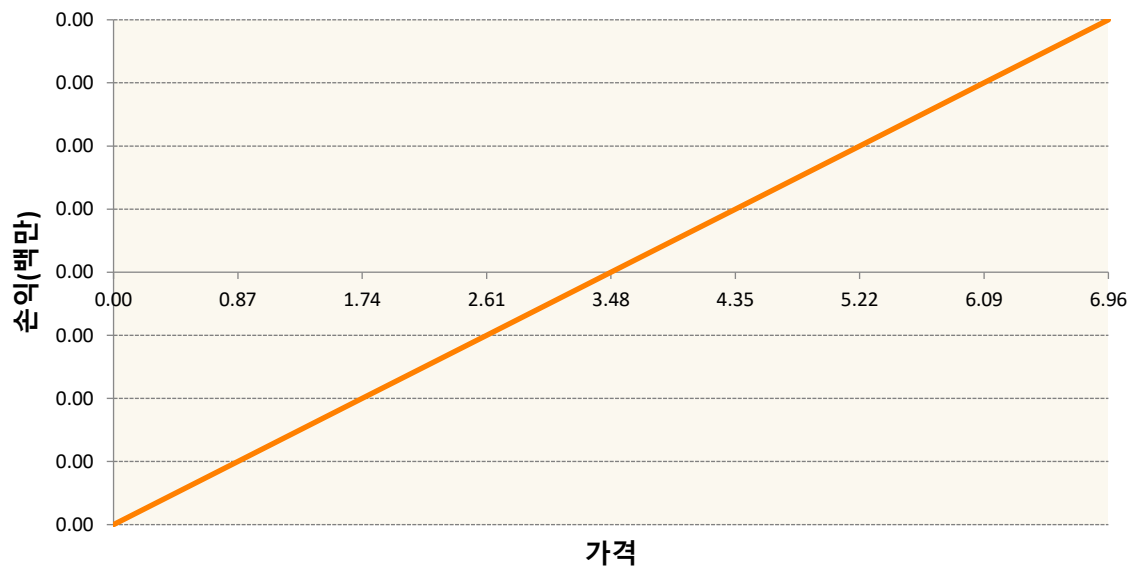
ECF3-E-mini Crude Oil Jan23



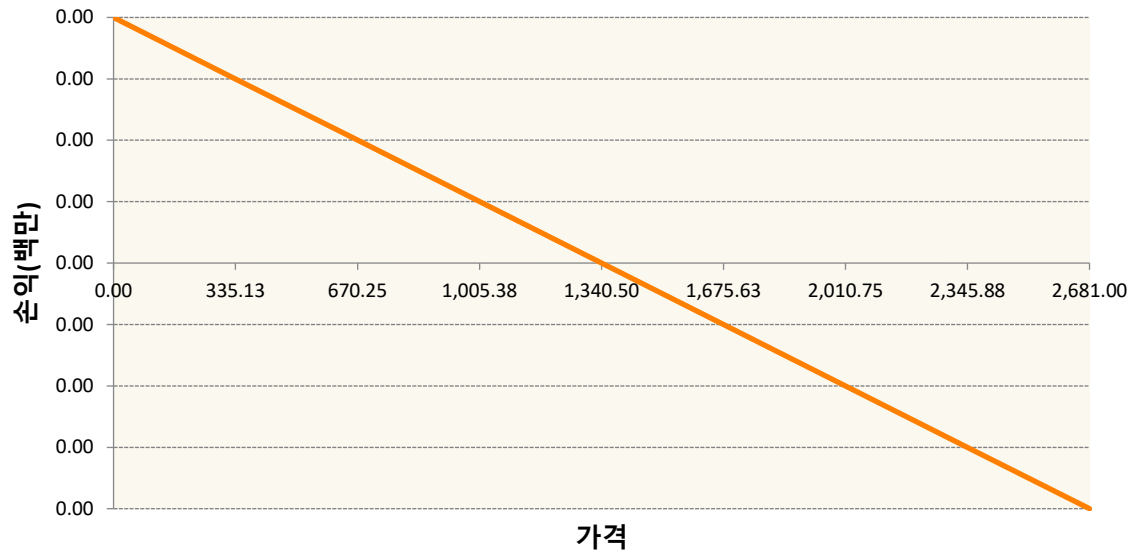
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



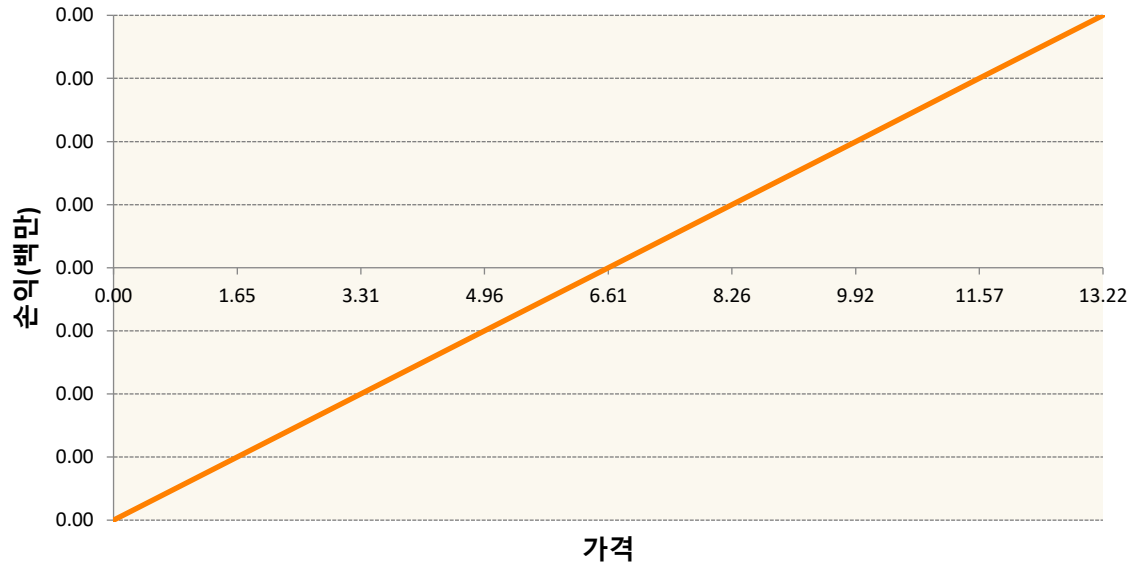
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



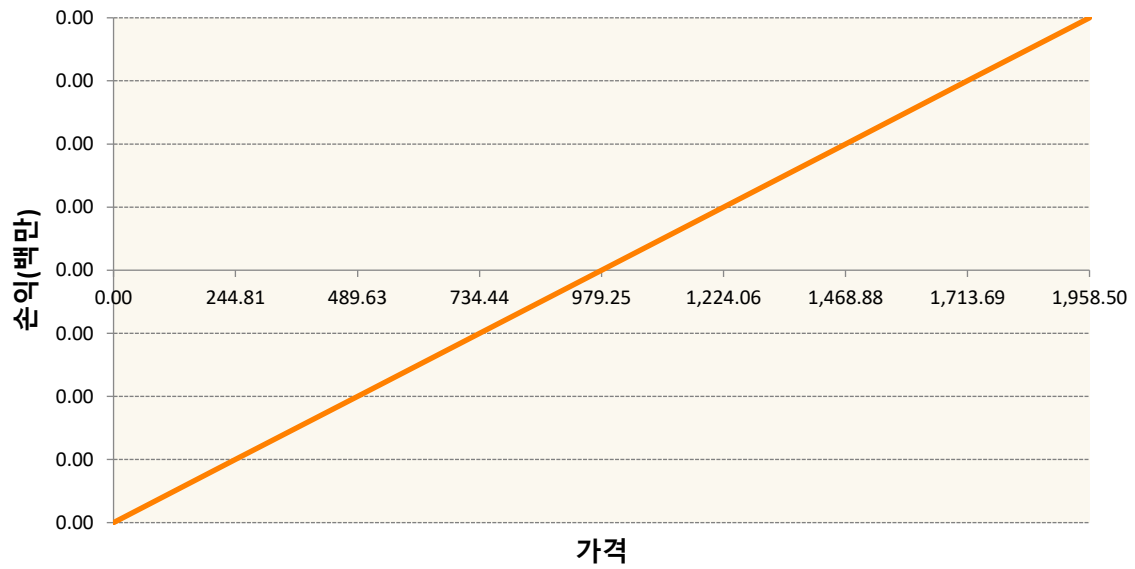
KR4175SC0000-2022-12 달러선물

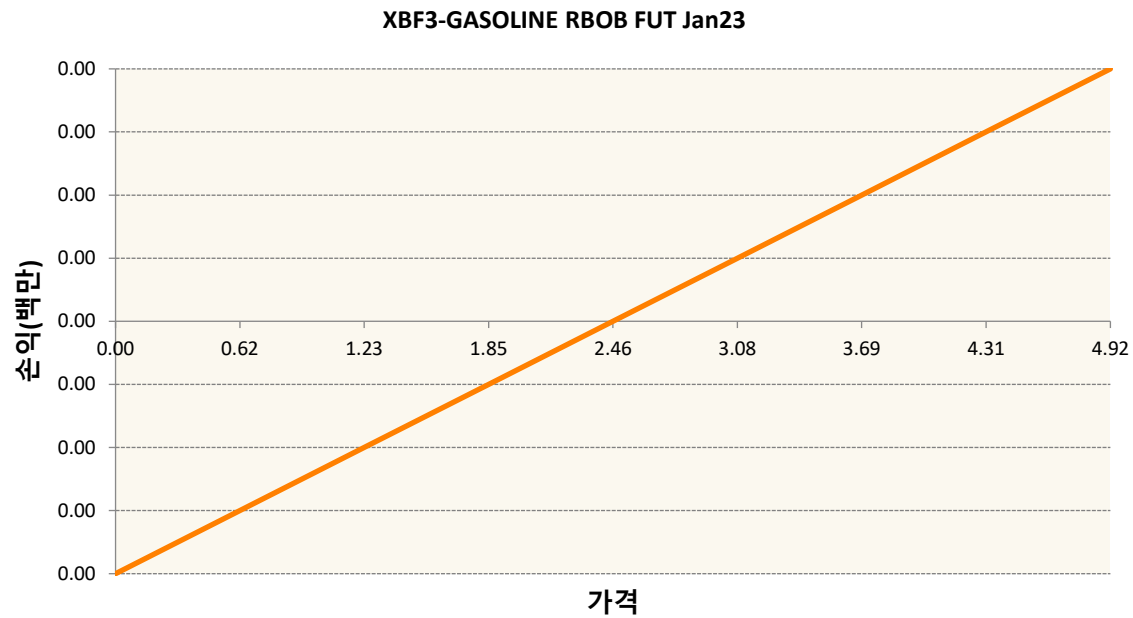


NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



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	17
KR4175SC00 2022-12 달러선물		21
NGF23	NATURAL GAS FUTR Jan23	45
QSF3	Low Su Gasoil G Jan23	11
XBF3	GASOLINE RBOB FUT Jan23	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	489