

공시일 2022-11-22

기준일 2022-11-21

포커스농산물모(채권-파생형)

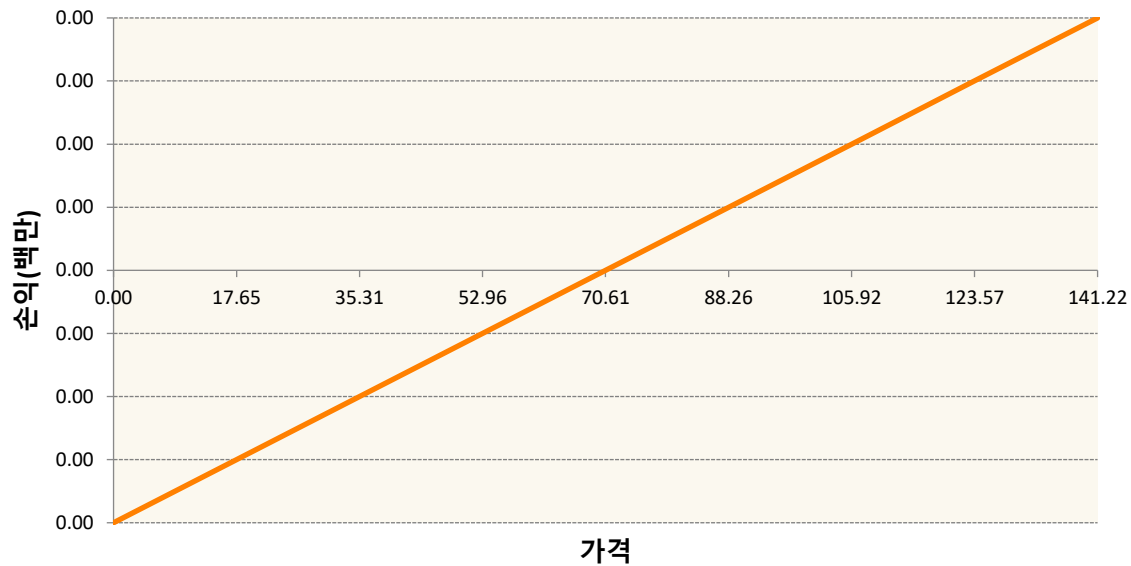
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

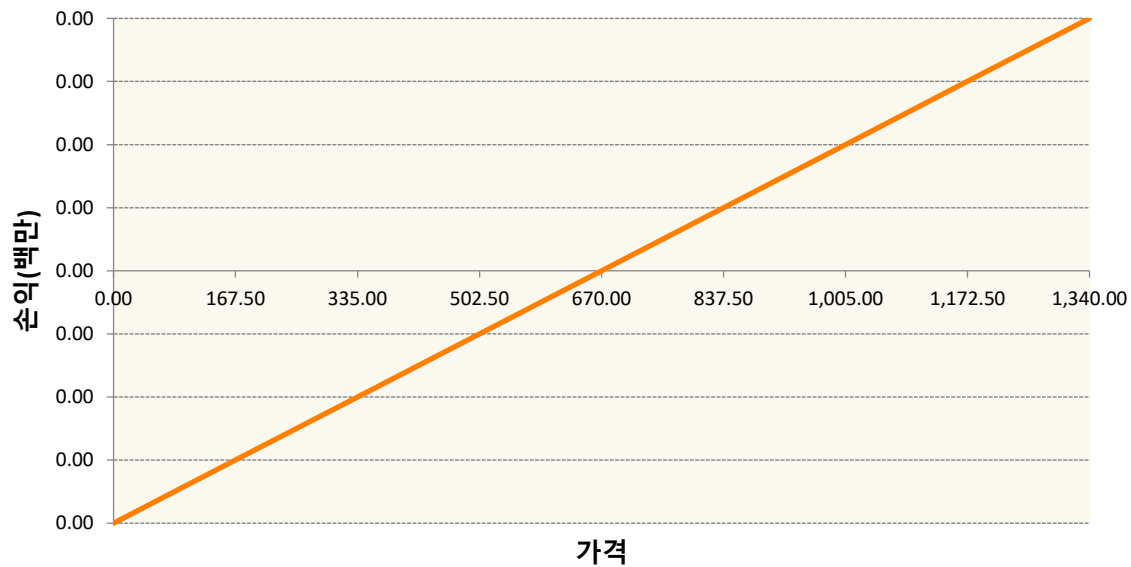
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,962	813	6,149	

2. 만기시점의 손익구조

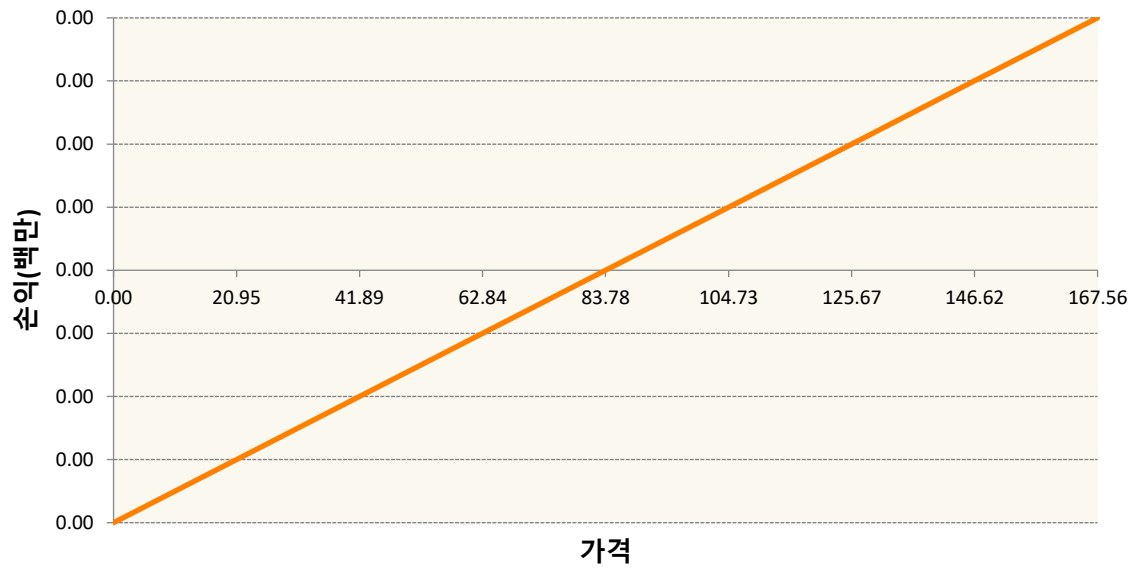
BOF3-SOYBEAN OIL FUTR Jan23



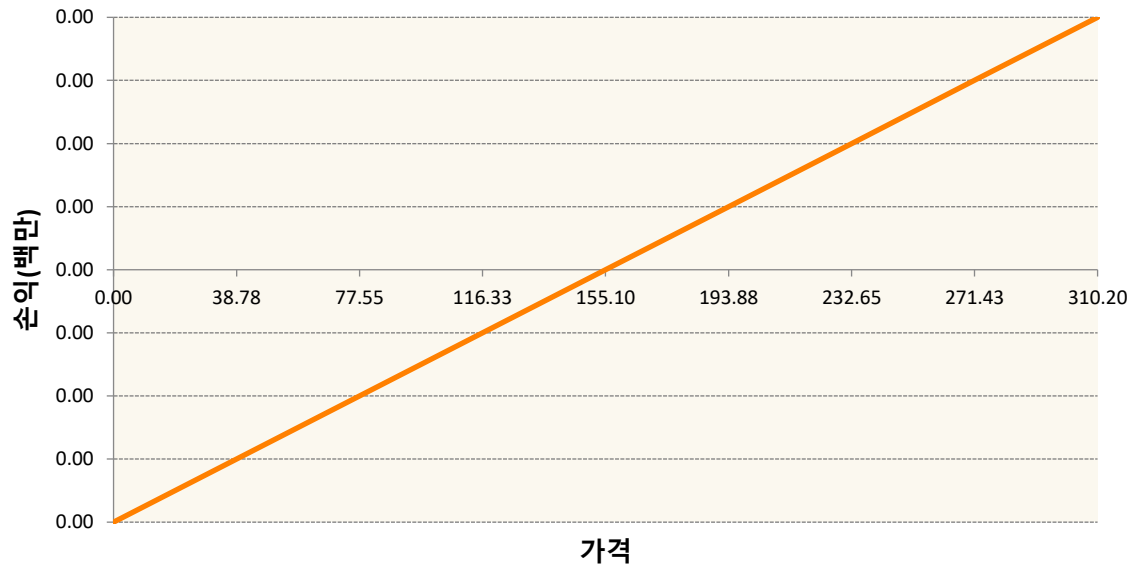
CH3-CORN FUTURE Mar23



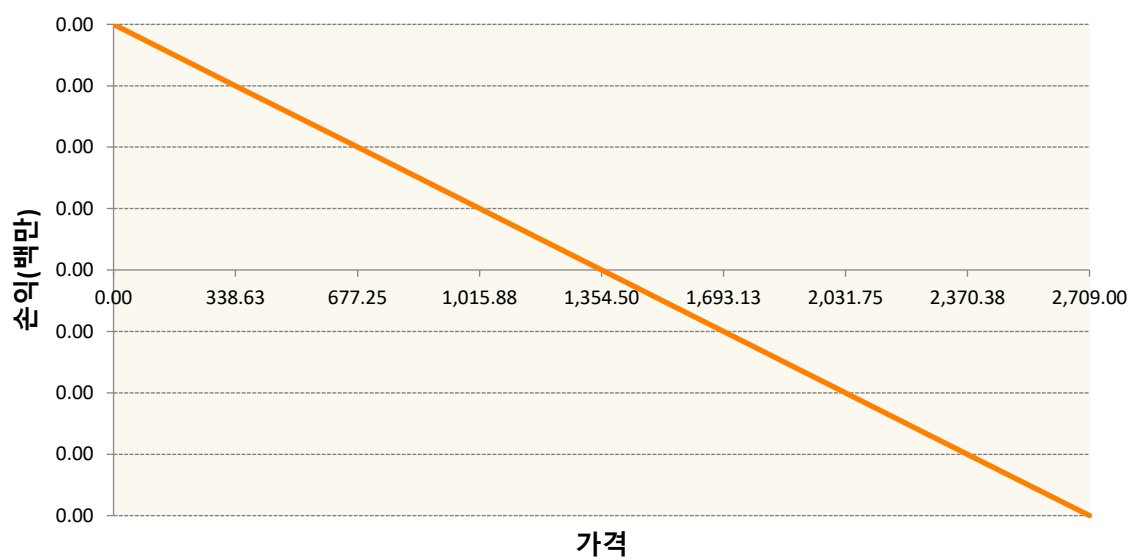
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



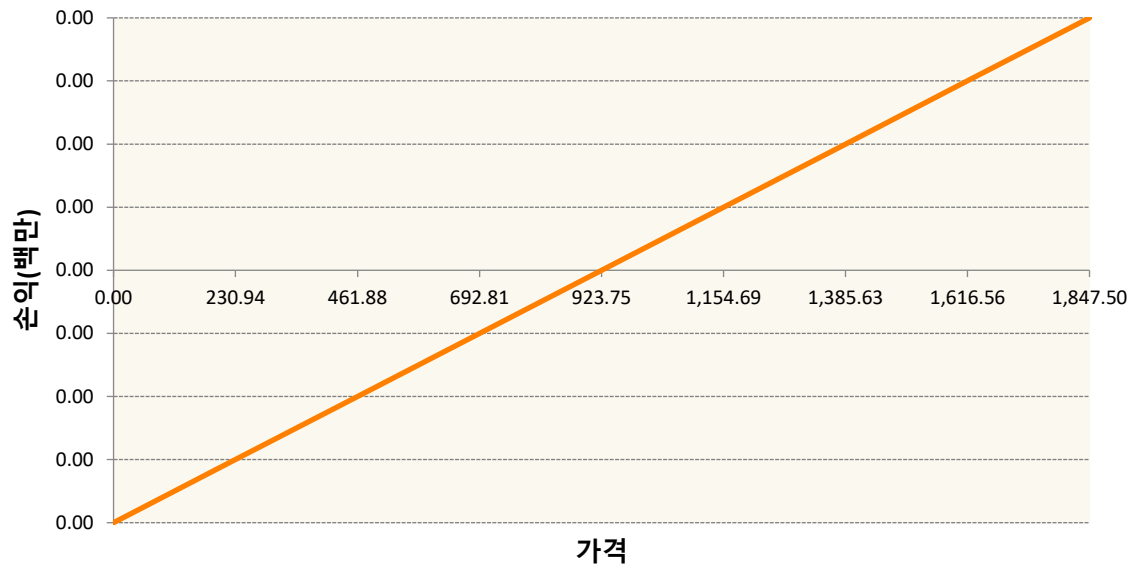
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



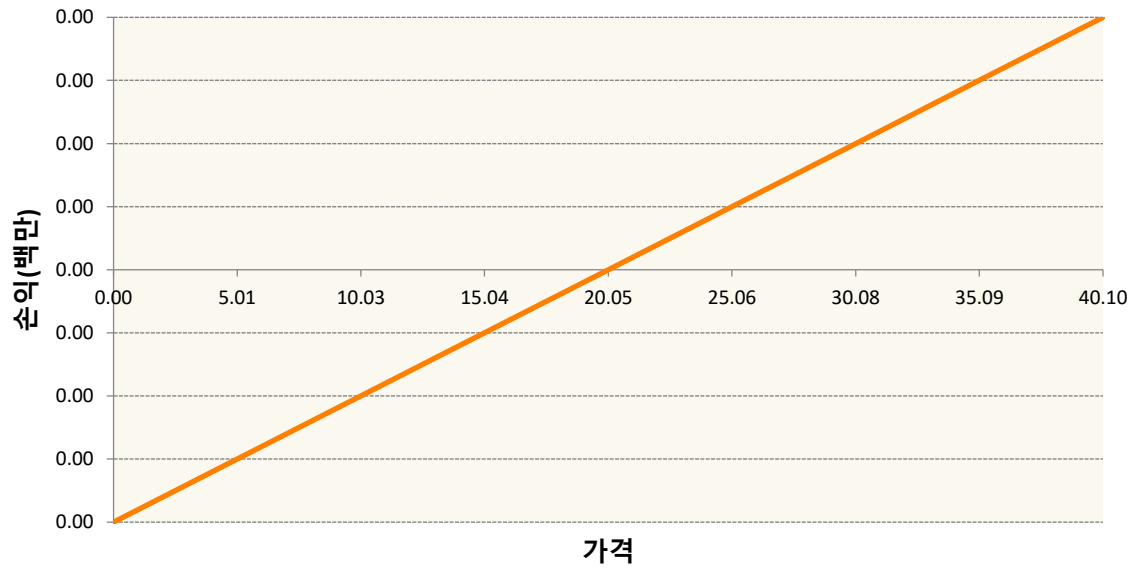
KR4175SC0000-2022-12 달러선물



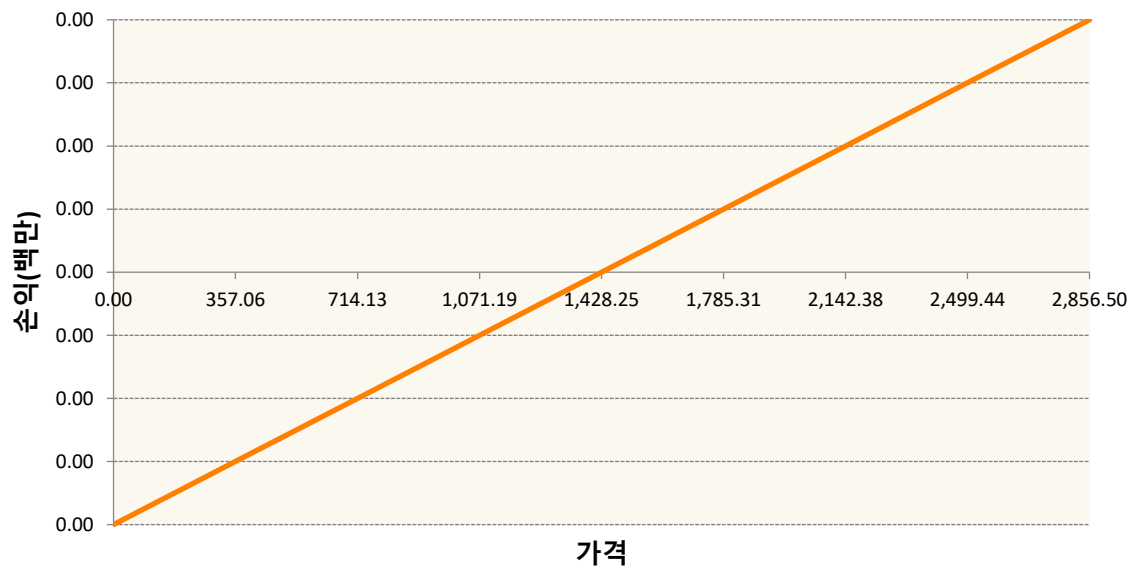
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



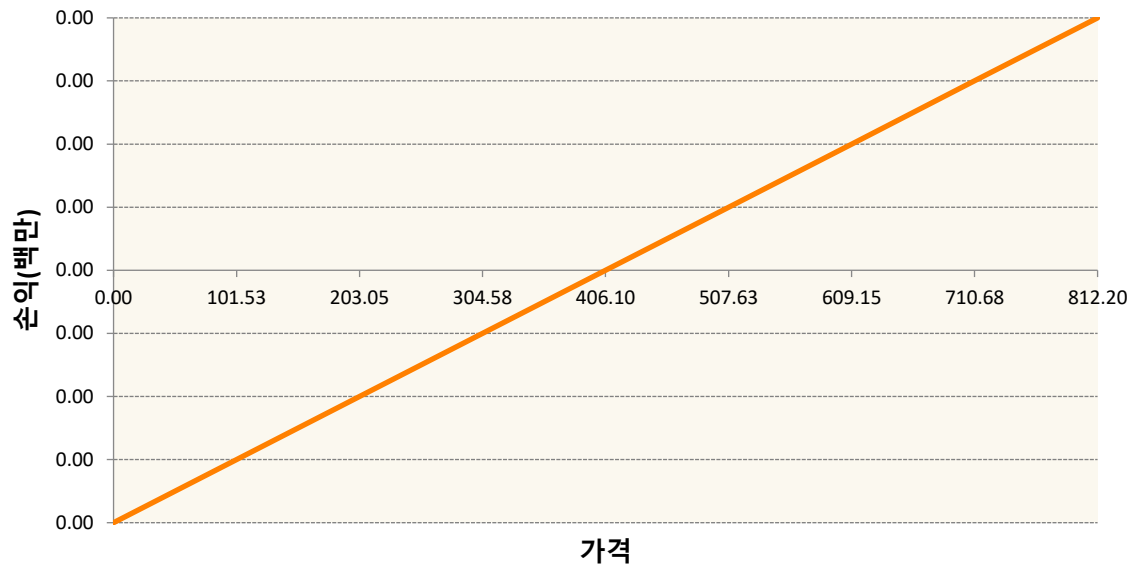
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



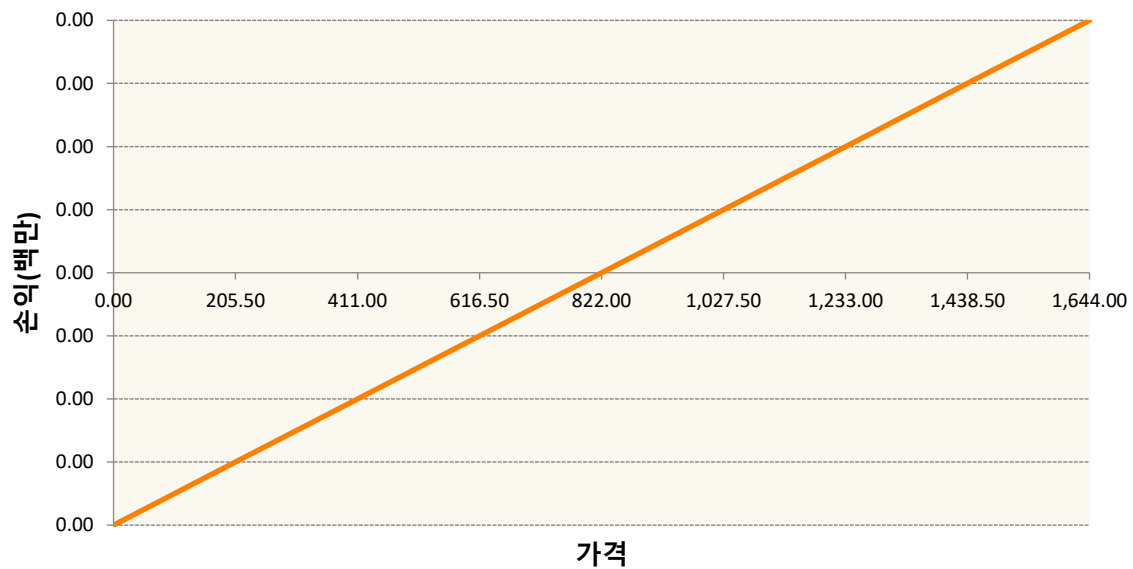
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



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	2022-11-22
기준일	2022-11-21

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	2022-11-22
기준일	2022-11-21

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	2022-11-22
기준일	2022-11-21

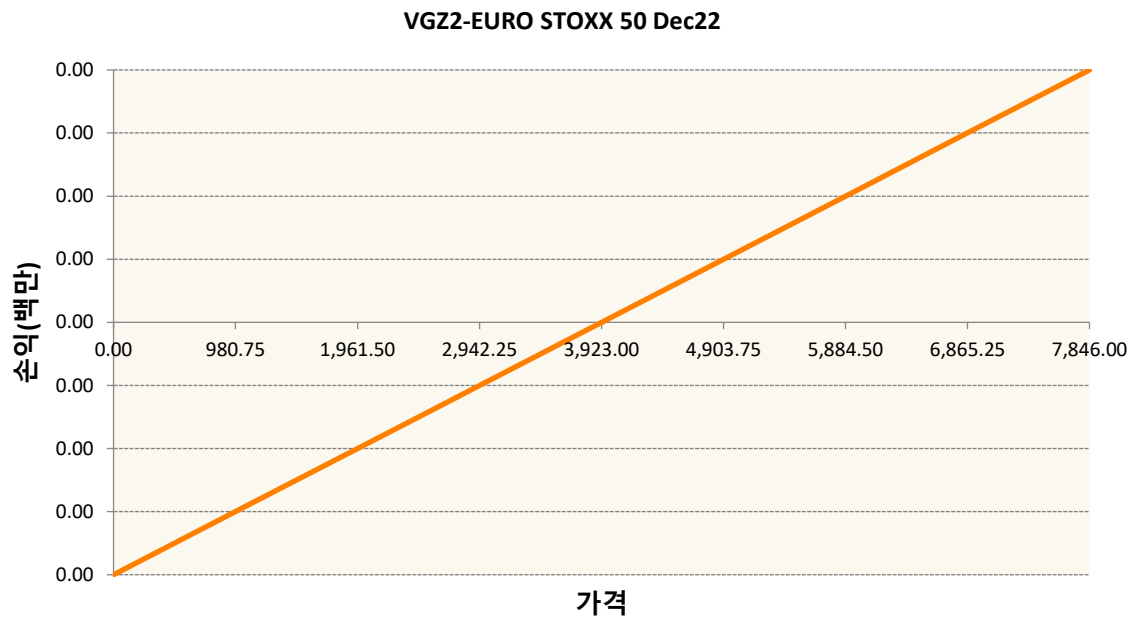
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	544	0	544	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ2	EURO STOXX 50 Dec22	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

46

공시일	2022-11-22
기준일	2022-11-21

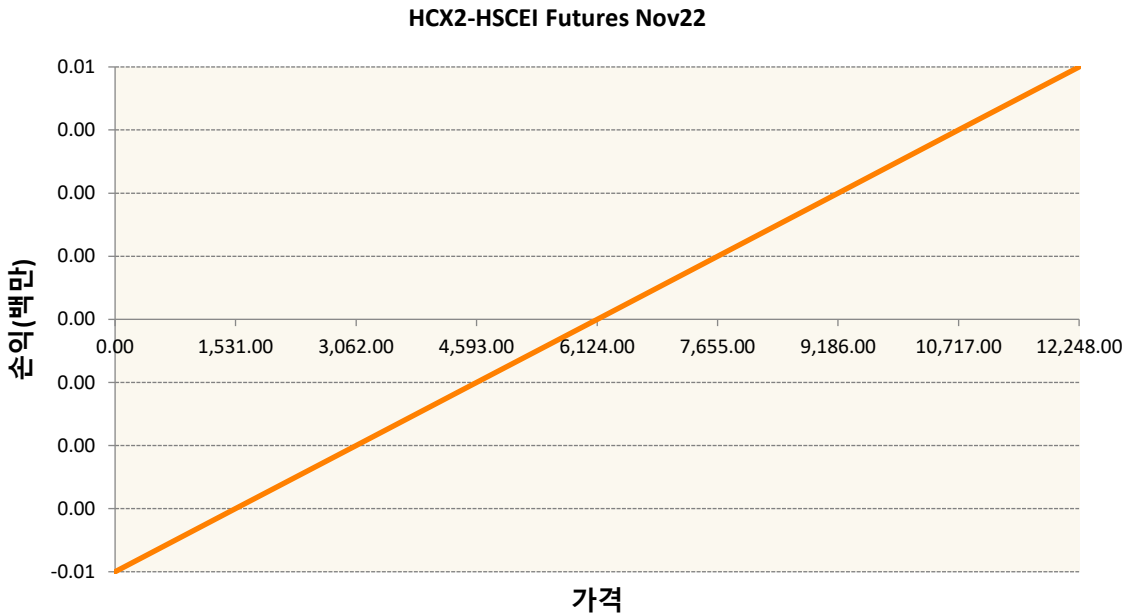
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,138	0	1,138	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX2	HSCEI Futures Nov22	91
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

150

공시일	2022-11-22
기준일	2022-11-21

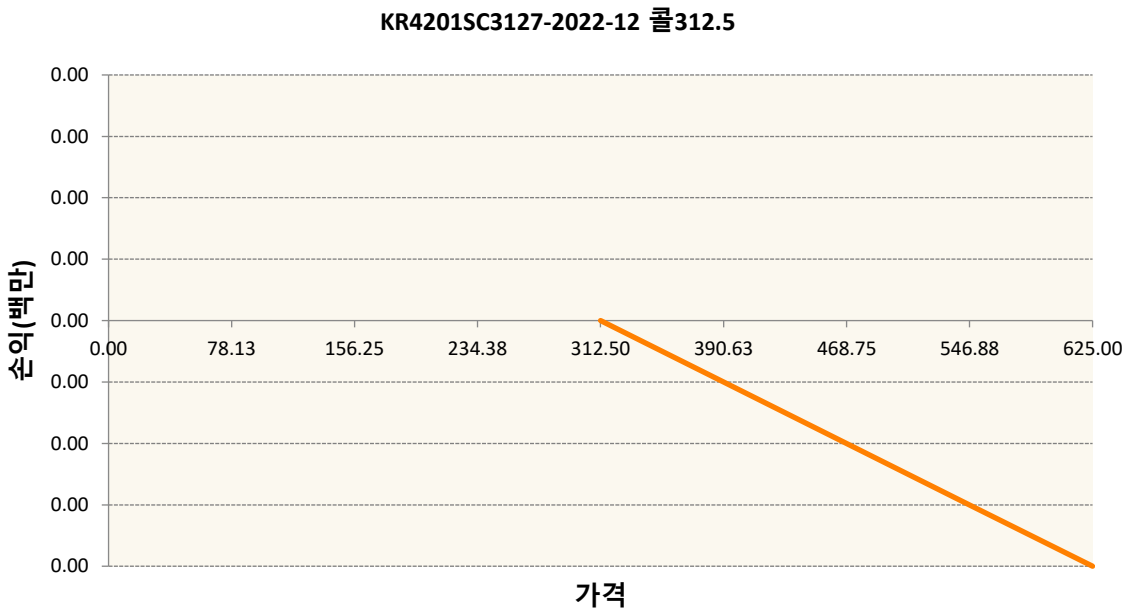
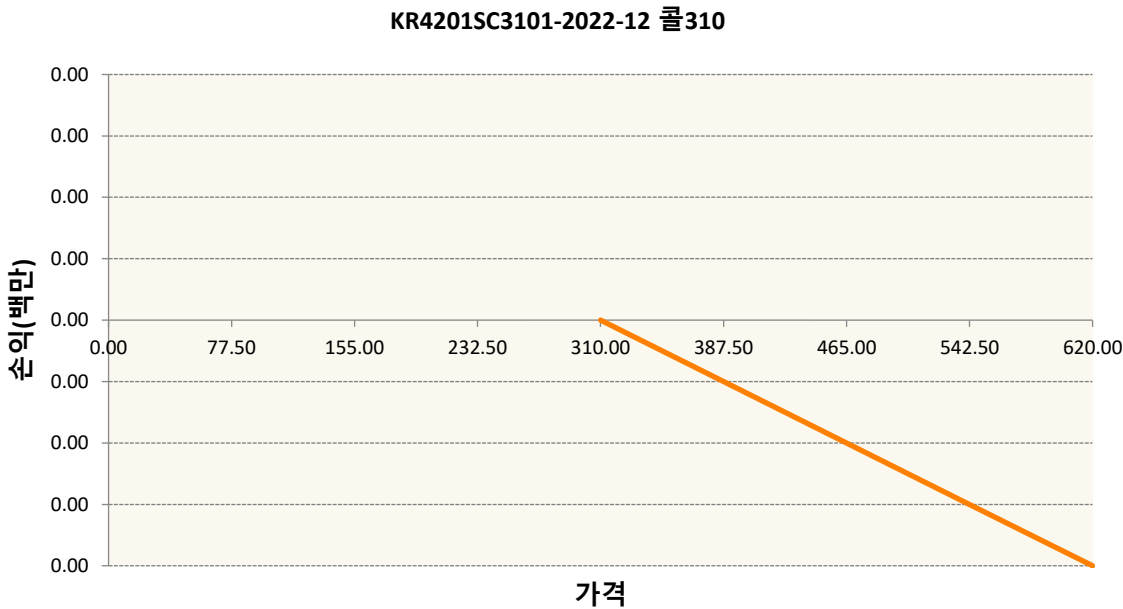
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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 the price (가액) and the profit/loss (손익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 625.00. The y-axis represents the profit/loss, ranging from -100.00 to 100.00. The line starts at the origin (0,0) and passes through the point (312.50, 0). The area under the line is shaded light orange.

가액 (Price)	손익 (백만) (Profit/Loss in millions)
0.00	-100.00
78.13	-20.00
156.25	-10.00
234.38	0.00
312.50	0.00
390.63	10.00
468.75	20.00
546.88	30.00
625.00	40.00

(단위:백만원)

KR4201SC3101							2022-12 콜310		1,771
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	1,026	981	932	879	824	766	707		
-5.33%	870	807	741	674	606	537	468		
-2.67%	608	533	458	383	308	232	157		
0%	226	151	76	0	-76	-152	-228		
2.67%	-271	-335	-401	-470	-540	-610	-682		
5.33%	-858	-906	-959	-1,015	-1,074	-1,136	-1,200		
8.00%	-1,510	-1,541	-1,579	-1,621	-1,667	-1,718	-1,771		
KR4201SC3127							2022-12 콜312.5		1,113
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	607	581	552	521	487	452	415
-5.33%	522	484	444	402	360	317	273
-2.67%	374	326	278	230	182	134	85
0%	149	100	50	0	-50	-100	-149
2.67%	-151	-195	-241	-288	-335	-382	-430
5.33%	-515	-550	-587	-626	-667	-710	-753
8.00%	-925	-949	-977	-1,007	-1,040	-1,076	-1,113
KR4301SC3100 2022-12 풋310							127

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-100	-104	-108	-112	-117	-122	-127
-5.33%	-50	-56	-61	-67	-73	-79	-85
-2.67%	-10	-17	-23	-30	-36	-43	-49
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20
2.67%	39	34	28	22	16	10	4
5.33%	51	47	43	38	33	27	22
8.00%	58	55	52	48	44	40	35

KR4301SC3126 2022-12 풋312.5							377
--	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-304	-314	-325	-337	-350	-363	-377
-5.33%	-158	-173	-188	-204	-220	-236	-253
-2.67%	-36	-54	-73	-91	-109	-127	-146
0%	57	38	19	0	-19	-38	-57
2.67%	121	104	87	69	51	33	15
5.33%	161	148	134	119	103	87	70
8.00%	183	174	164	152	140	126	112

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

(단위:백만원)

3,156

공시일	2022-11-22
기준일	2022-11-21

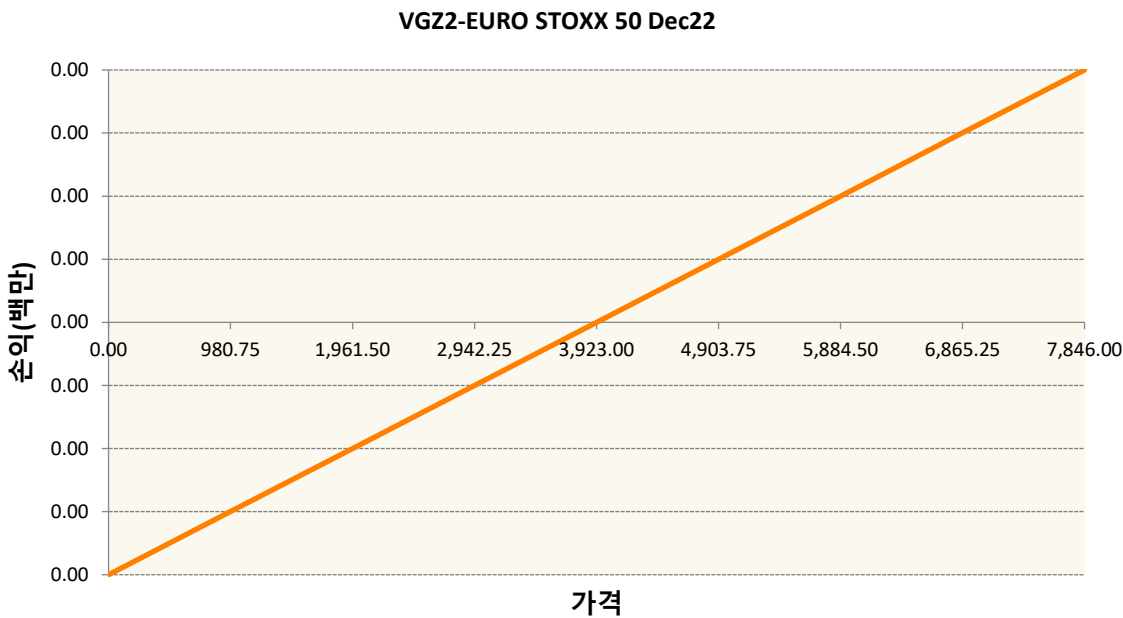
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,100	0	1,100	
누계	통화	선도	0	2,296	-2,296	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E	56
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E	56
FXW213CBG KRW/EUR 24-02-23E	72
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	88

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

(단위:백만원)

226

공시일 2022-11-22

기준일 2022-11-21

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

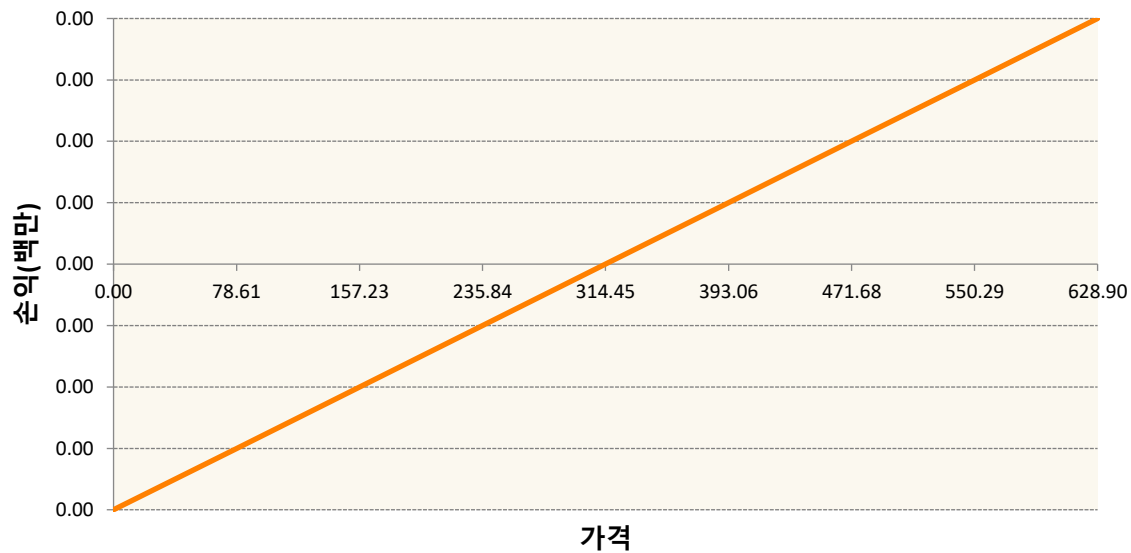
1. 계약금액

(단위:백만원)

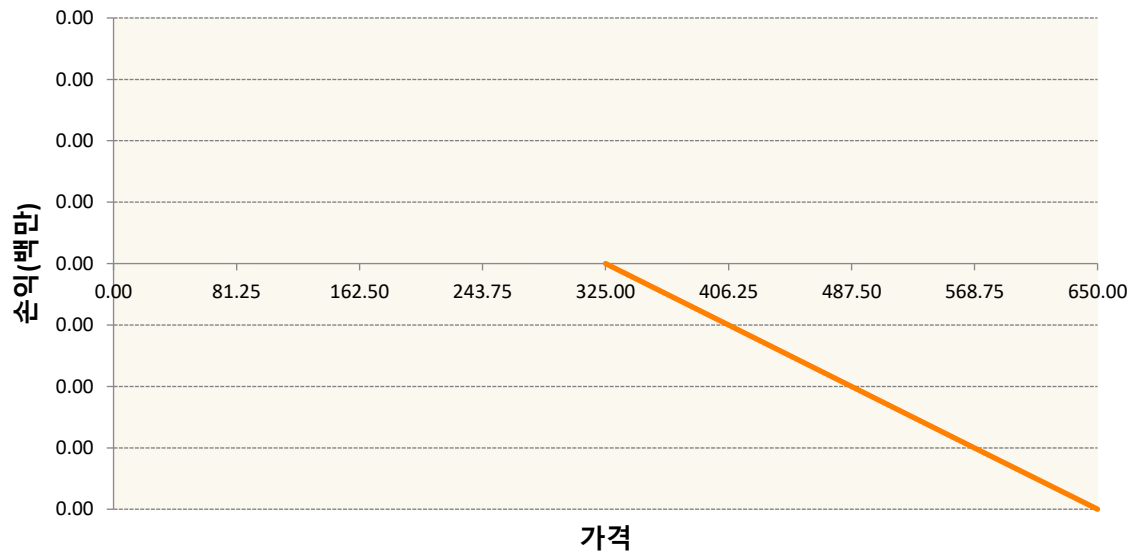
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	393	0	393	장내
누계	유가증권	옵션	311	3,839	-3,528	장내

2. 만기시점의 손익구조

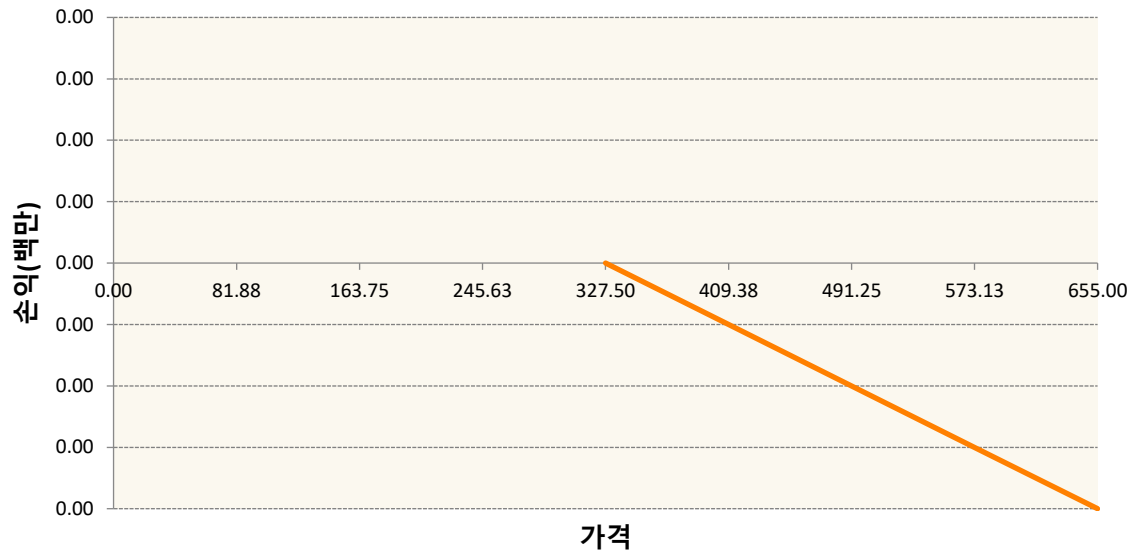
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



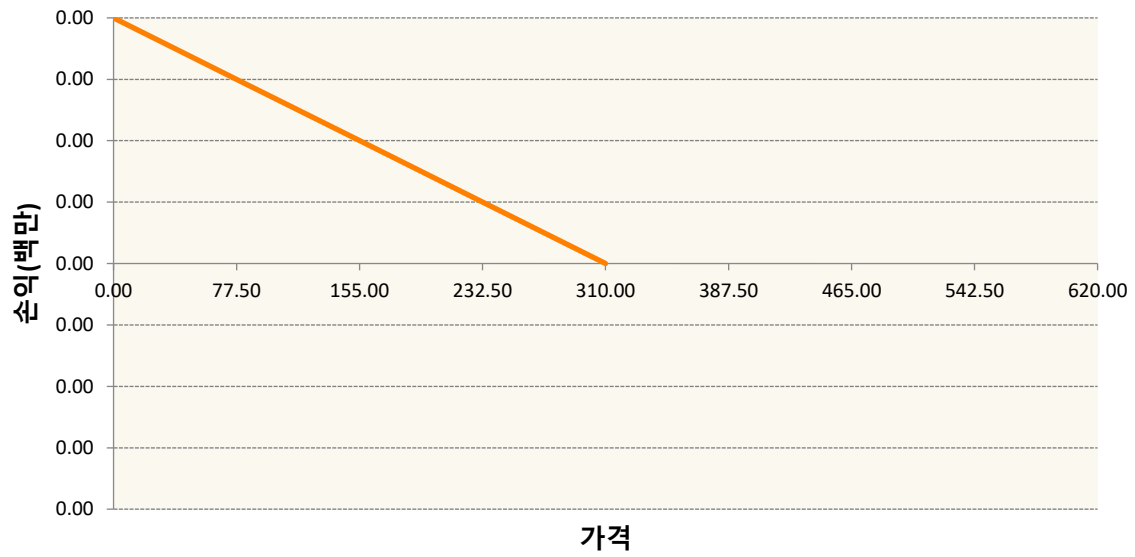
KR4201SC3259-2022-12 콜325



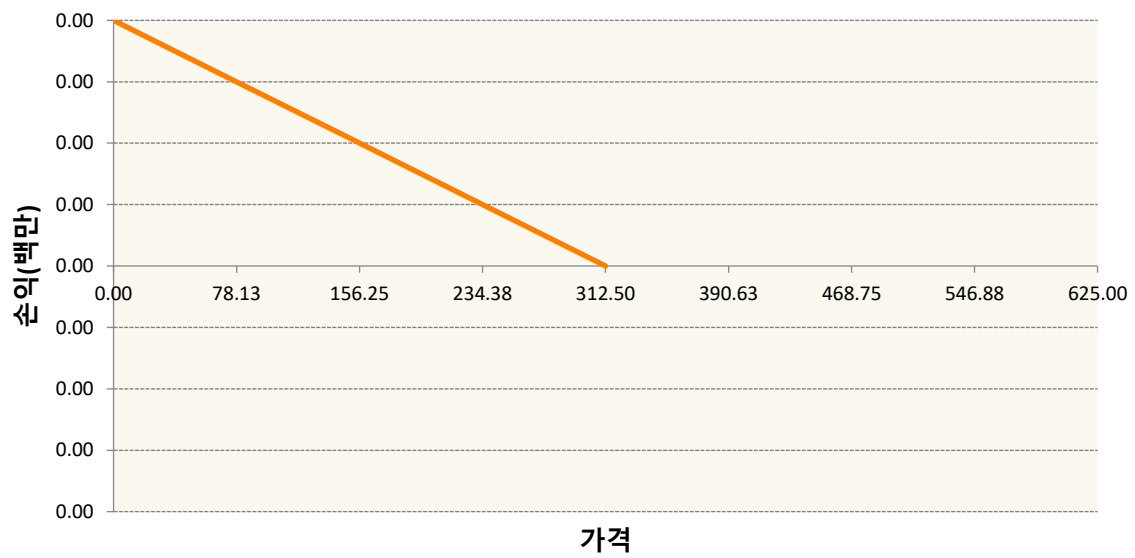
KR4201SC3275-2022-12 콜327.5



KR4301SC3100-2022-12 풋310



KR4301SC3126-2022-12 풋312.5



(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			
KR4201SC3259							2022-12 콜325		61	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	24	23	22	21	19	18	16			
-5.33%	22	20	19	17	15	12	10			
-2.67%	17	15	13	10	7	4	2			
0%	9	6	3	0	-3	-6	-10			
2.67%	-3	-7	-10	-14	-17	-21	-24			
5.33%	-21	-24	-28	-31	-34	-38	-41			
8.00%	-43	-46	-49	-52	-55	-58	-61			
KR4201SC3275							2022-12 콜327.5		125	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	45	43	42	39	37	33	30			
-5.33%	41	39	35	32	28	23	19			
-2.67%	34	29	24	19	14	8	2			
0%	19	13	7	0	-7	-13	-20			
2.67%	-5	-12	-19	-27	-34	-41	-49			
5.33%	-39	-47	-54	-61	-69	-76	-84			
8.00%	-84	-90	-97	-104	-111	-118	-125			
KR4301SC3100							2022-12 풋310		8	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	7	7	7	7	8	8	8			
-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	-1	-1	-1	0			
5.33%	-3	-3	-3	-3	-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%	7	7	8	8	8	9	9
-5.33%	4	4	4	5	5	6	6
-2.67%	1	1	2	2	3	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	-2
8.00%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

201

공시일	2022-11-22
기준일	2022-11-21

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	6,978	0	6,978	

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	2022-11-22
기준일	2022-11-21

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	6,016	0	6,016	

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	2022-11-22
기준일	2022-11-21

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	19,240	0	19,240	
누계	통화	선도	0	19,000	-19,000	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E	606
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	504
FXW213CAR·KRW/USD 30-01-23E	280
FXW213CB1(KRW/USD 28-11-22E	54
FXW213CBG·KRW/USD 28-11-22E	76
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

743

공시일 2022-11-22

기준일 2022-11-21

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

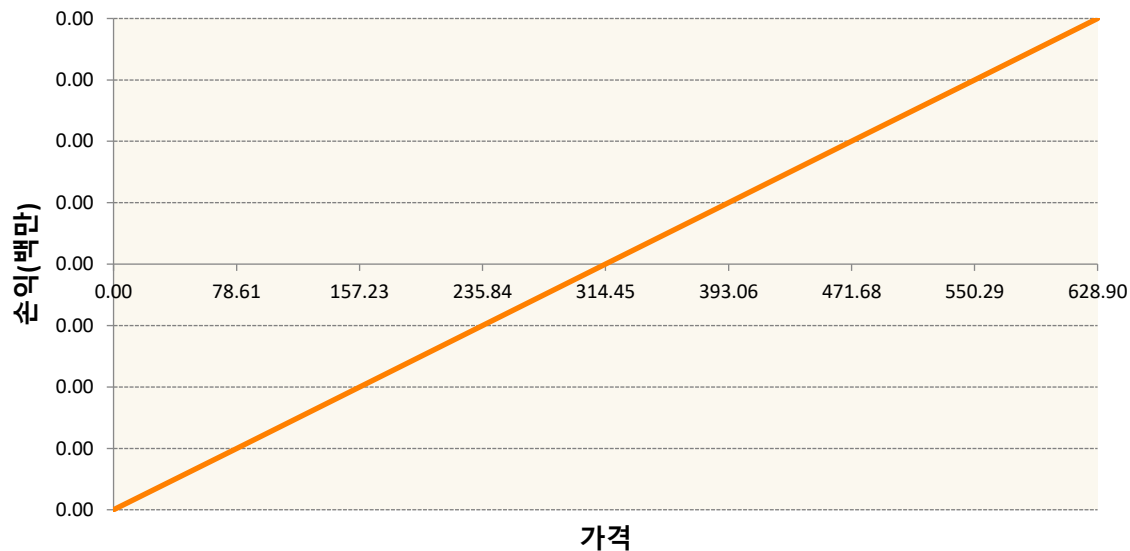
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	393	0	393	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



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	2022-11-22
기준일	2022-11-21

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	852	0	852	장외
누계	통화	선도	626	626	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	68
FXW213C9MKRW/EUR 23-12-22E	22
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
FXW213CBJC KRW/EUR 28-11-22E	2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	150

공시일	2022-11-22
기준일	2022-11-21

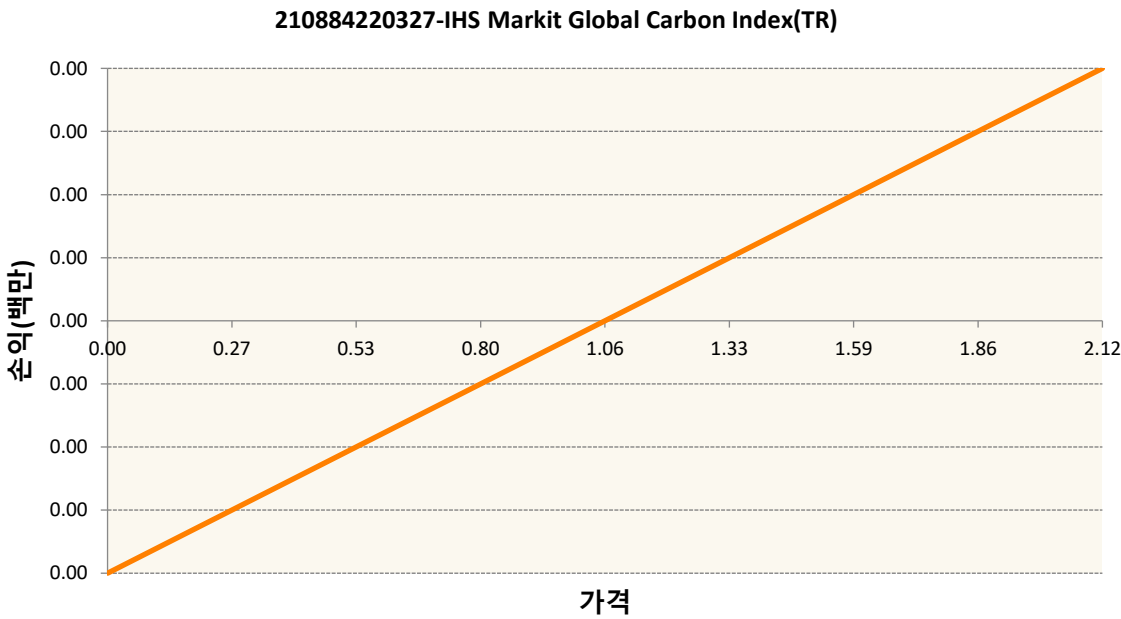
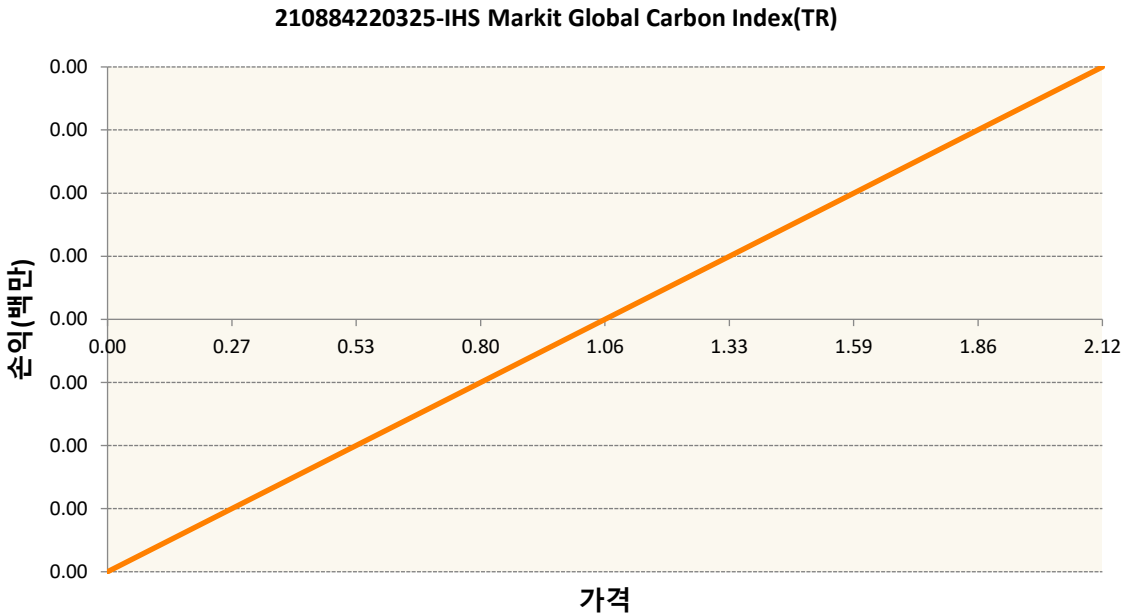
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

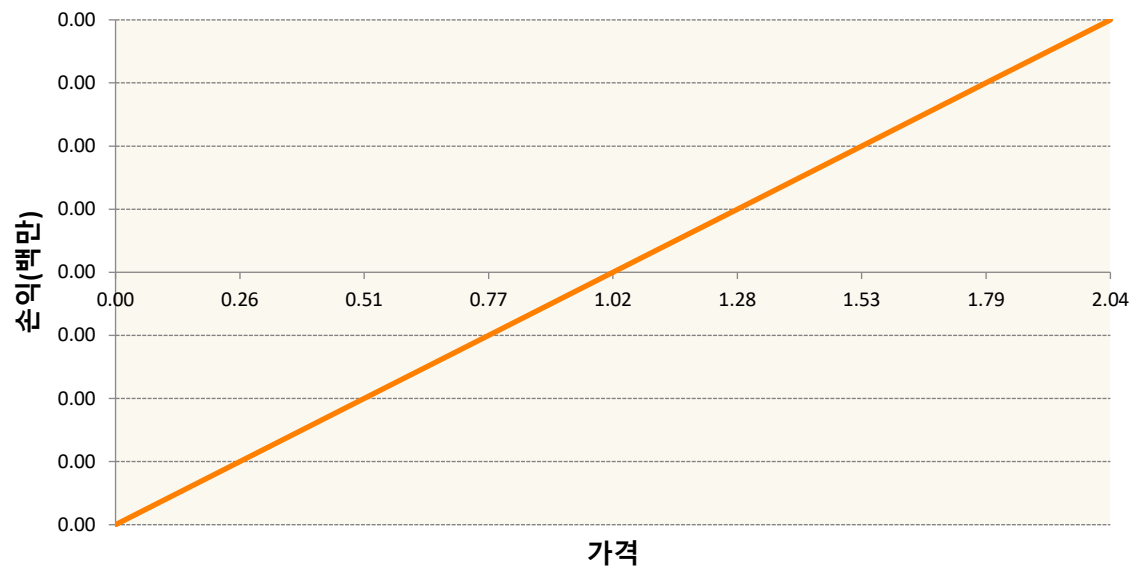
(단위:백만원)

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



210884221024-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

2,019

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

(단위:백만원)

4,423

공시일 2022-11-22

기준일 2022-11-21

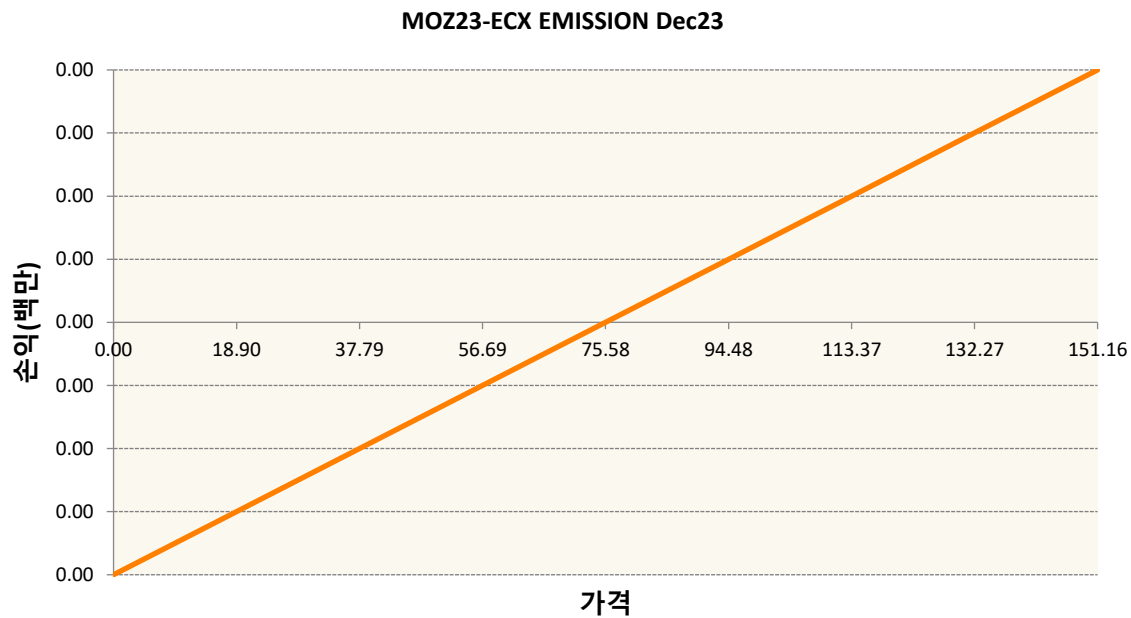
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,678	0	13,678	
누계	통화	선도	0	4,915	-4,915	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	1,094

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

(단위:백만원)

3,117

공시일	2022-11-22
기준일	2022-11-21

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)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	20

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

(단위:백만원)

158

공시일	2022-11-22
기준일	2022-11-21

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	12

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

(단위:백만원)

53

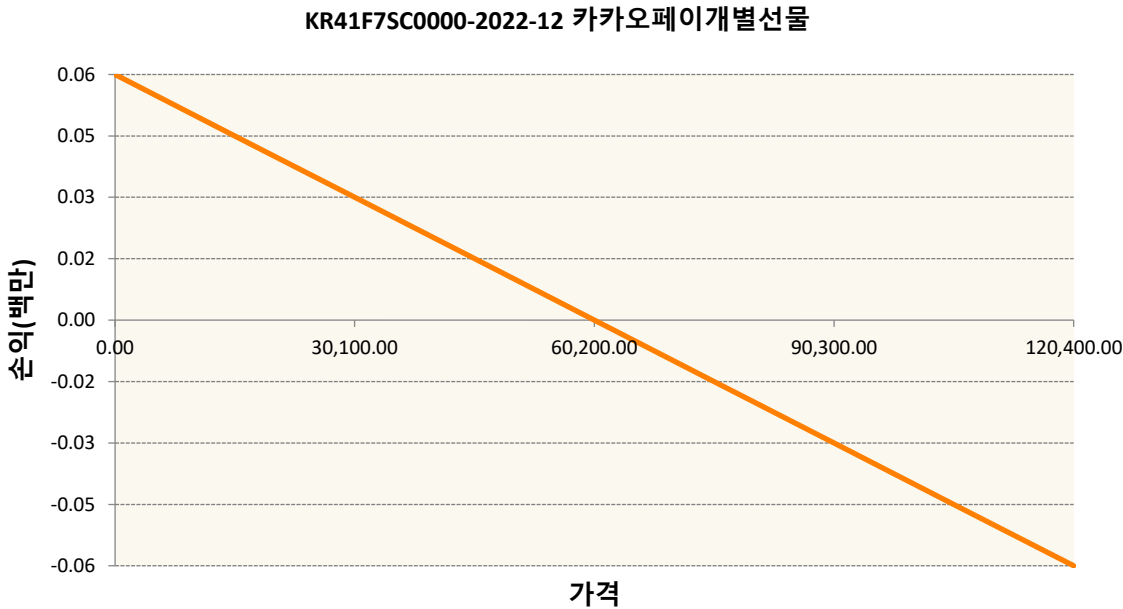
공시일	2022-11-22
기준일	2022-11-21

에쿼티알파일반사모혼합자산

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	181	-181	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR41F7SC00 2022-12 카카오페이개별선물	14
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0

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

58

공시일 2022-11-22

기준일 2022-11-21

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

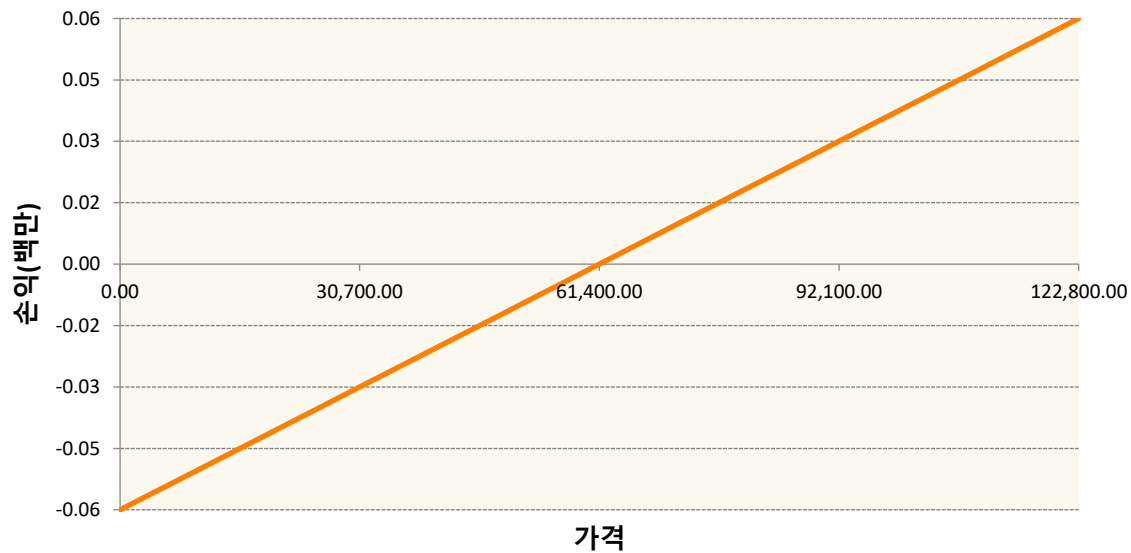
1. 계약금액

(단위:백만원)

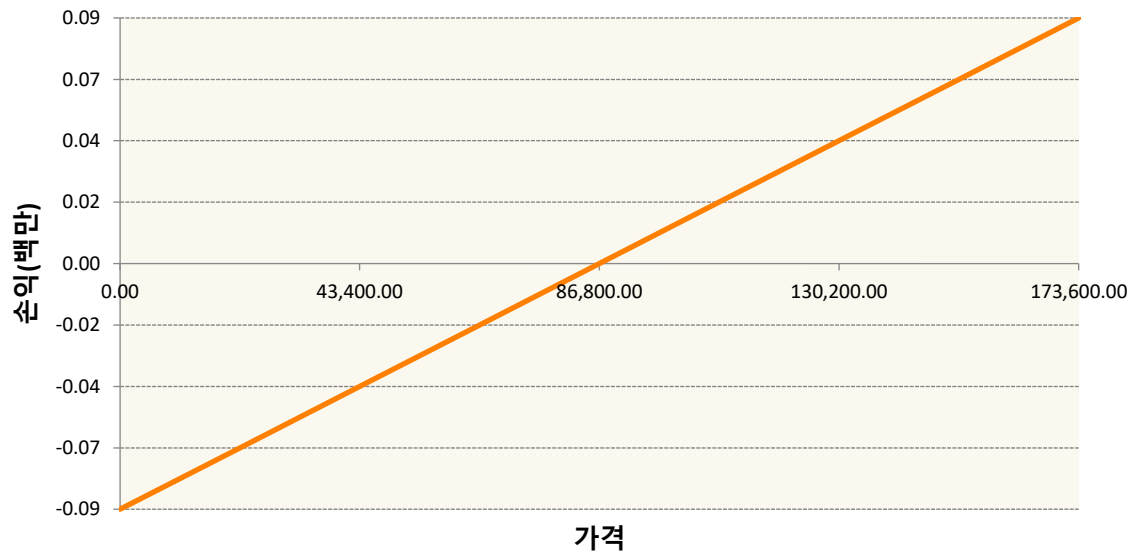
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	150	0	150	장내

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)

14

공시일 2022-11-22

기준일 2022-11-21

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 2022-11-22

기준일 2022-11-21

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

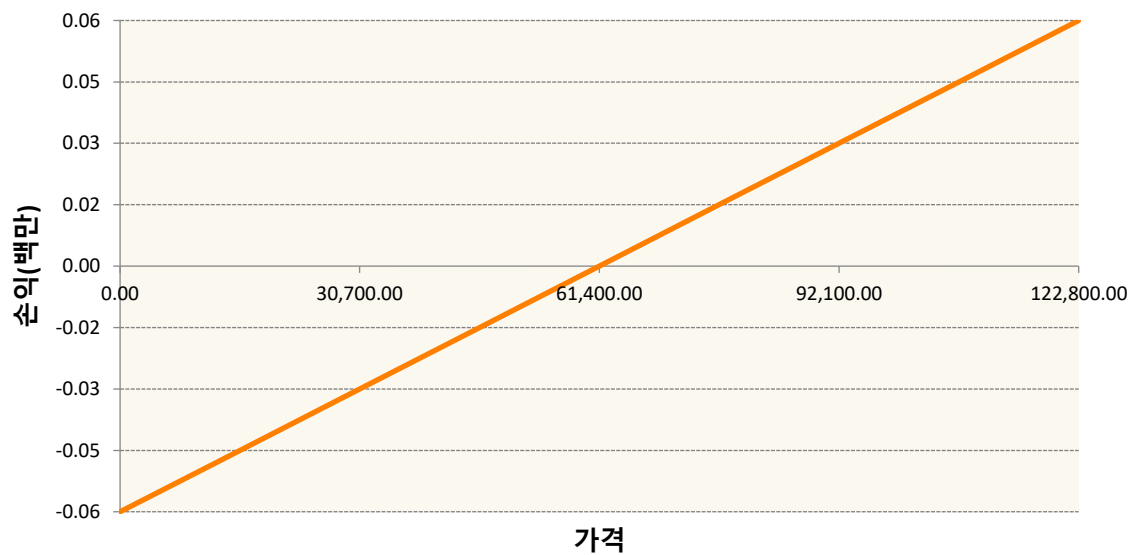
1. 계약금액

(단위:백만원)

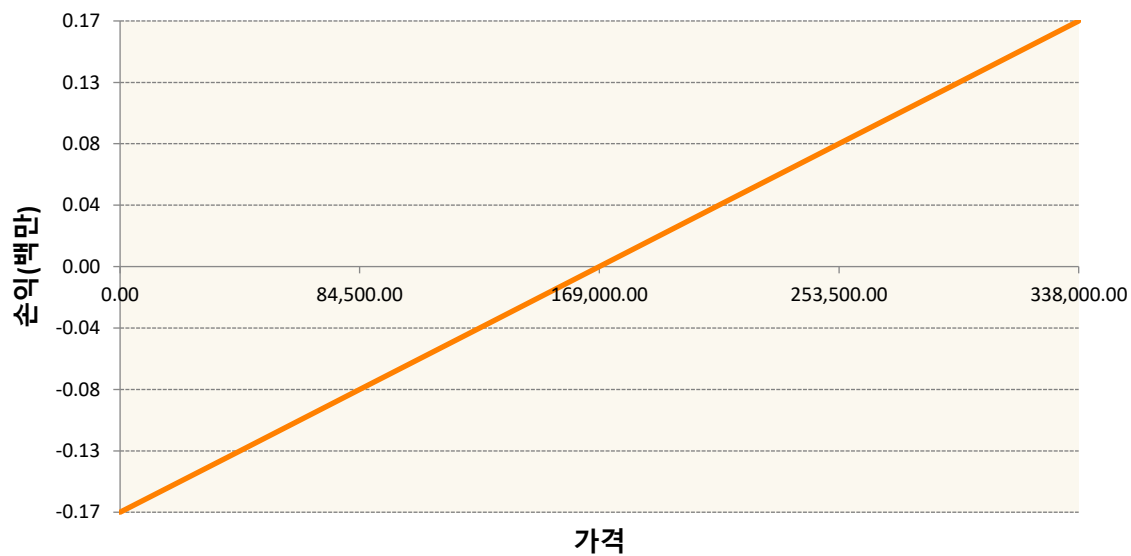
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	295	0	295	장내

2. 만기시점의 손익구조

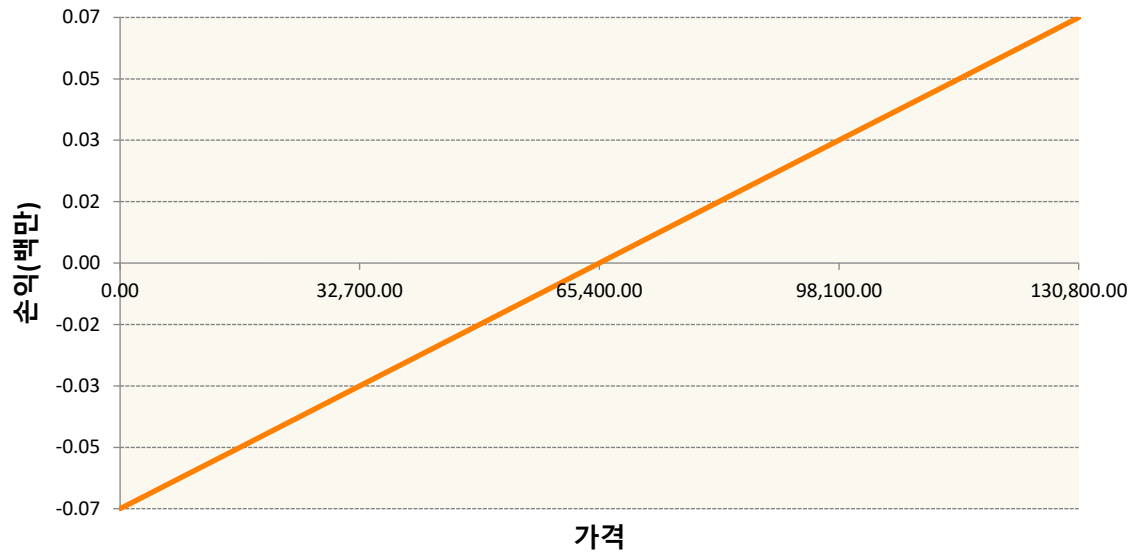
KR4111SC0007-2022-12 삼성전자개별선물



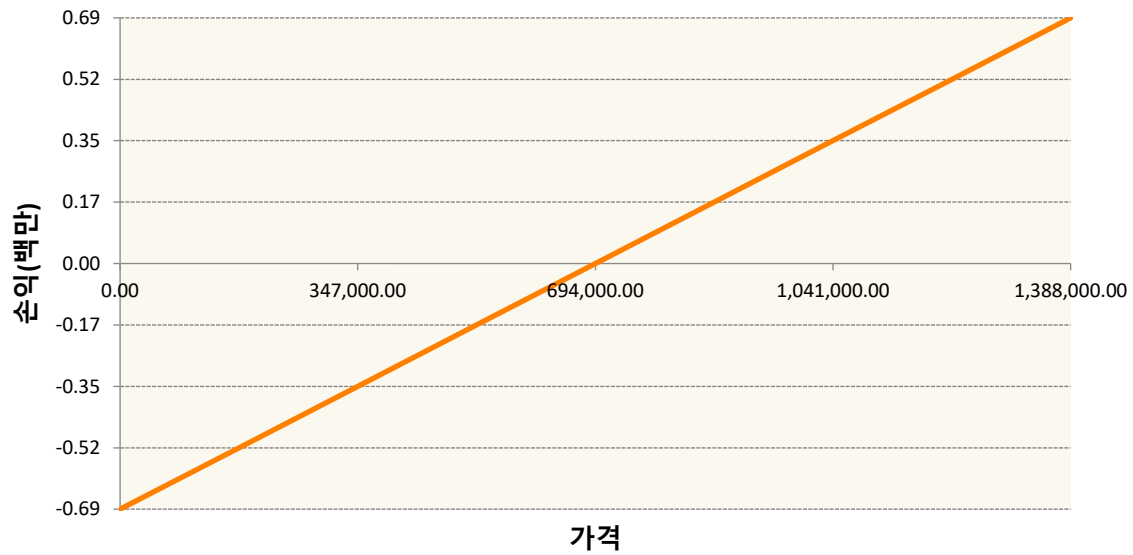
KR4116SC0002-2022-12 현대차개별선물



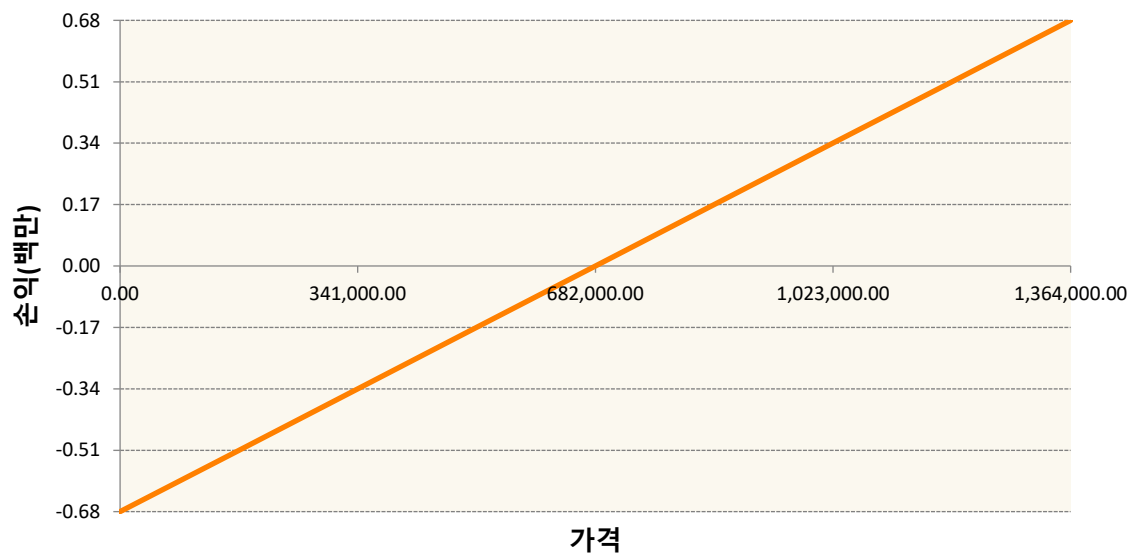
KR4119SC0009-2022-12 기아차개별선물



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		
-5.33%	-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		
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		
-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		
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		
-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%	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		
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7		
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4		
0%	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	4	4	4	4	4	4	4		
5.33%	7	7	7	7	7	7	7		
8.00%	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 2022-11-22

기준일 2022-11-21

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

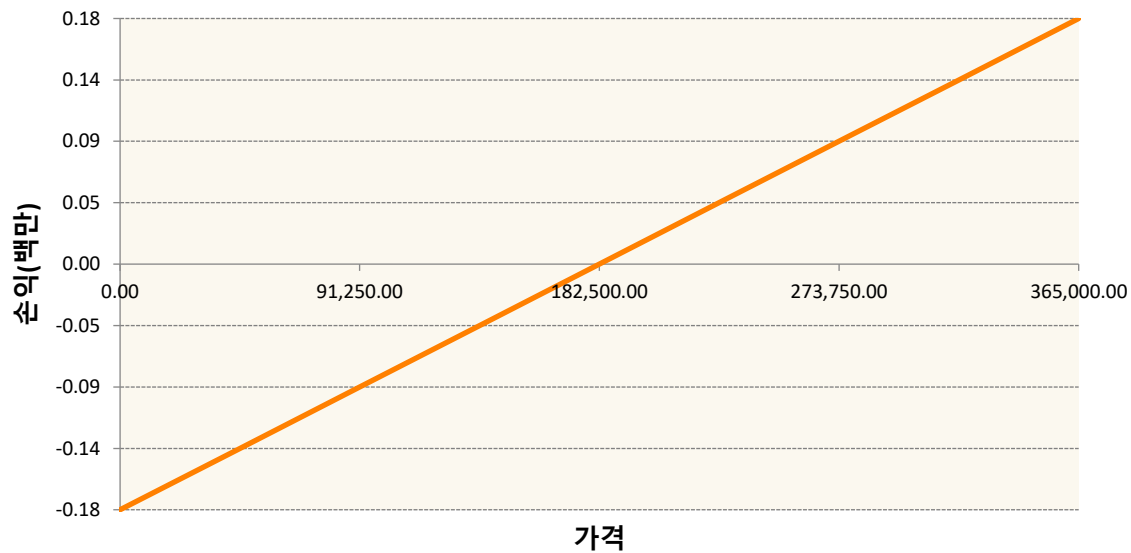
1. 계약금액

(단위:백만원)

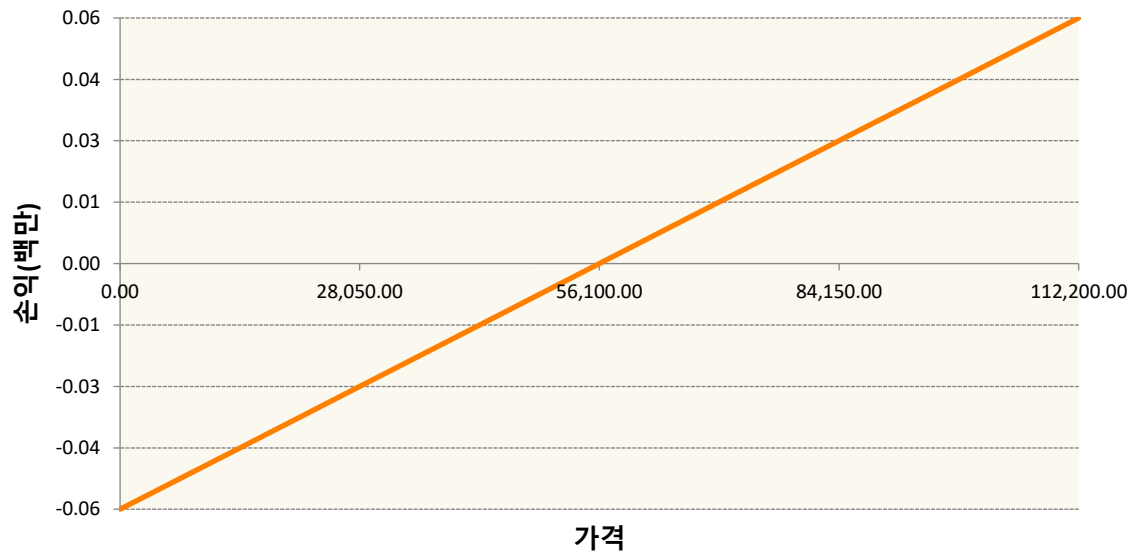
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	114	0	114	장내

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%	-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
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)

18

공시일 2022-11-22

기준일 2022-11-21

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

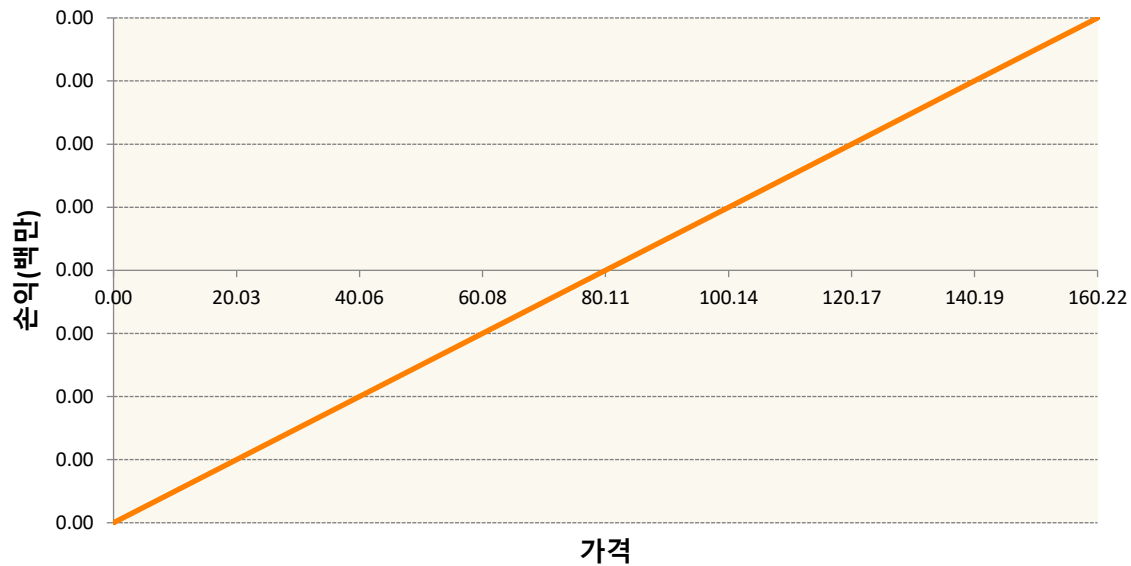
1. 계약금액

(단위:백만원)

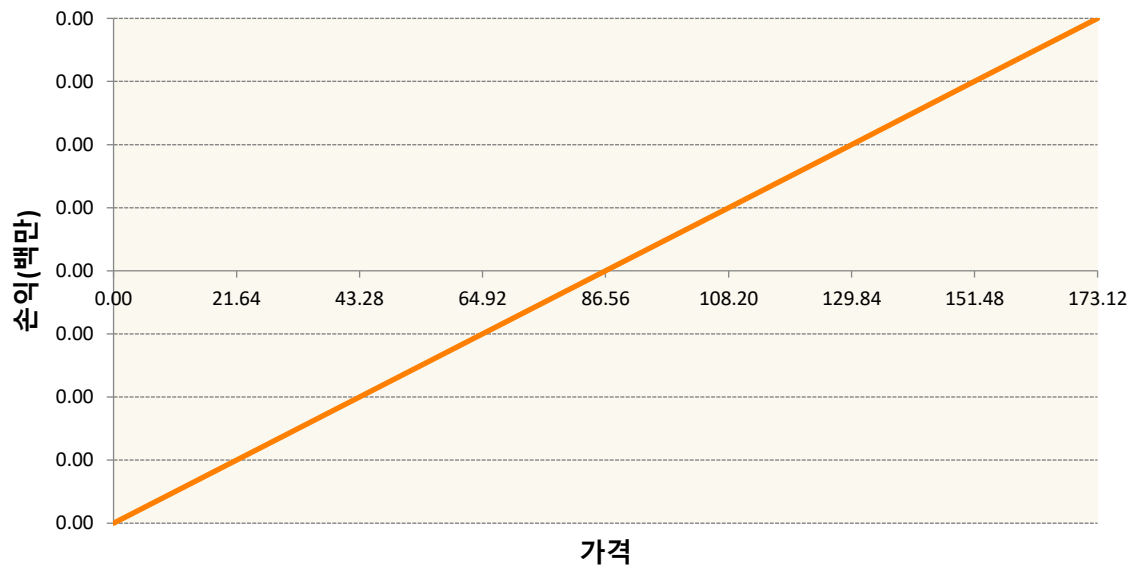
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	229	0	229	
누계	유가증권	선물	1,567	271	1,296	

2. 만기시점의 손익구조

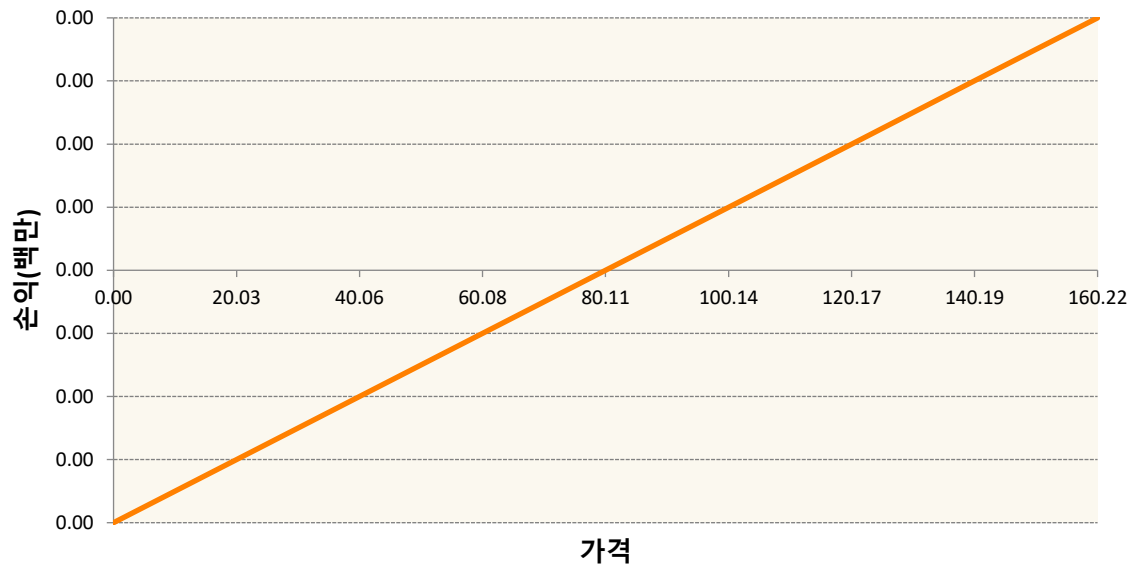
CLF3-WTI CRUDE FUTURE Jan23



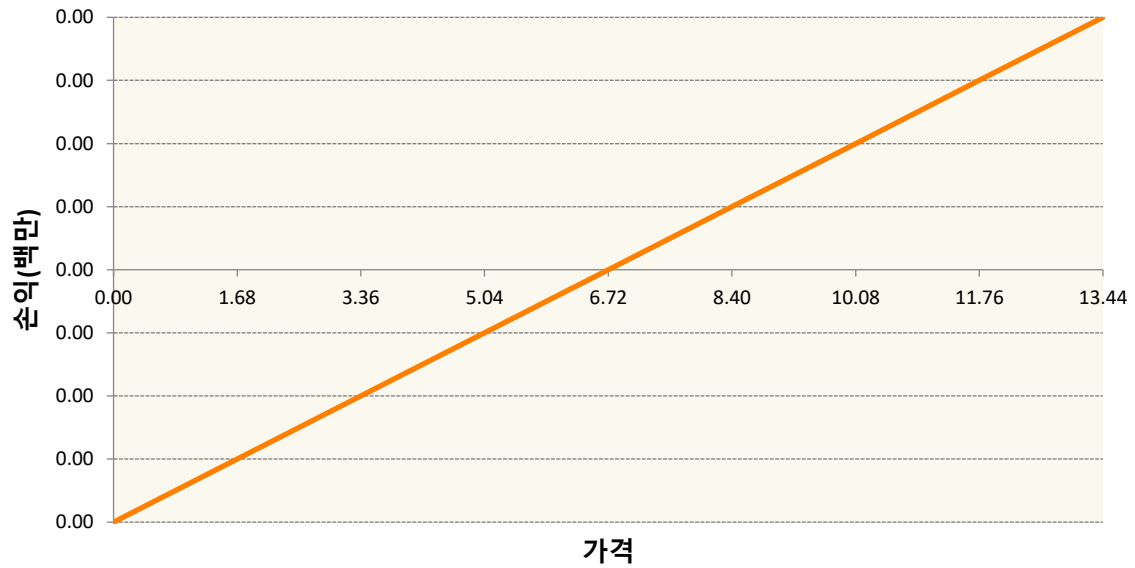
COH3-BRENT CRUDE FUTR Mar23



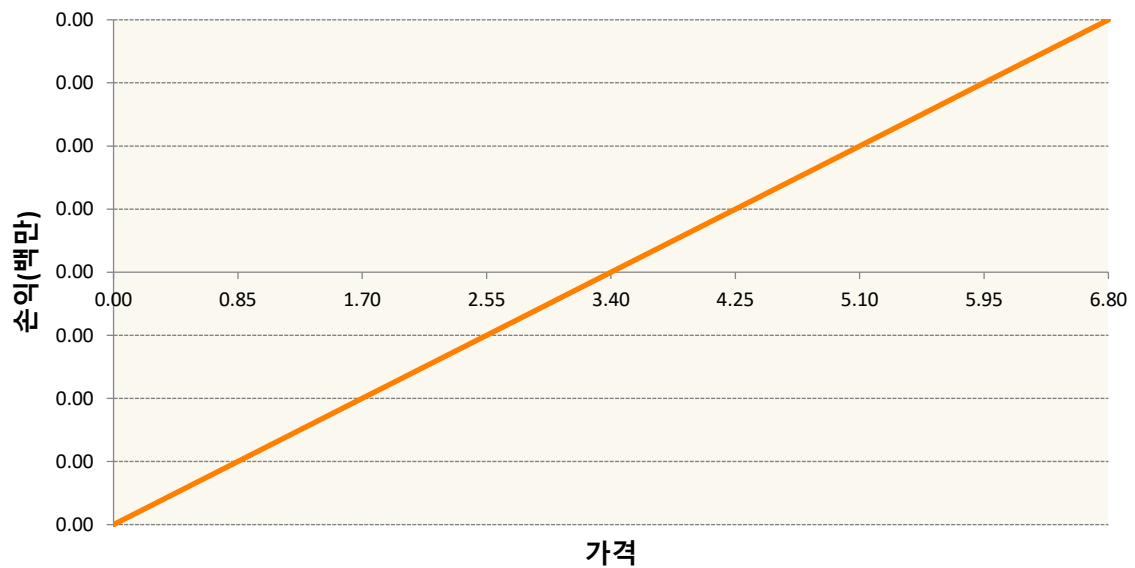
ECF3-E-mini Crude Oil Jan23



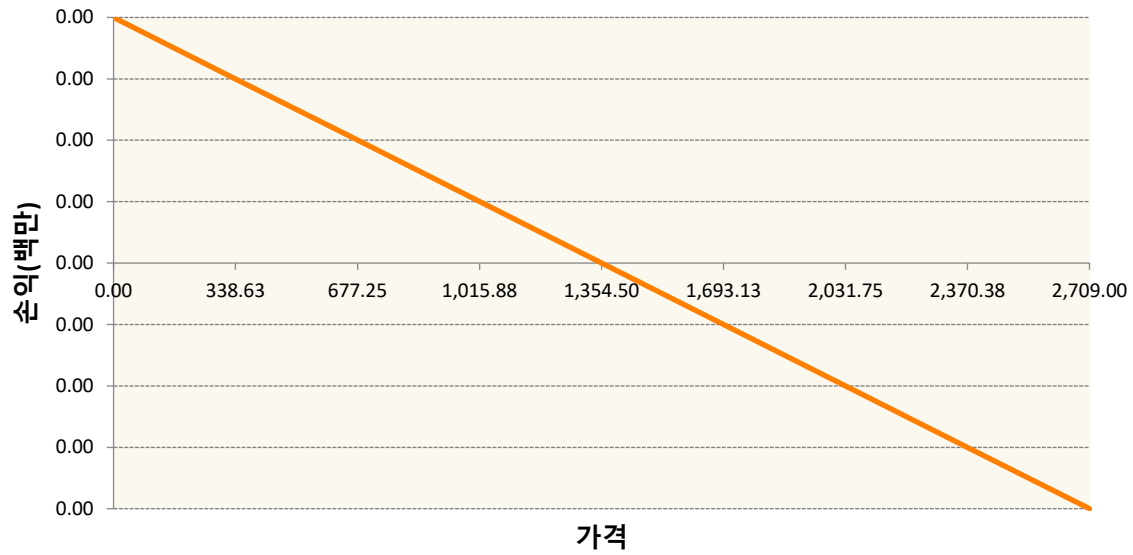
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



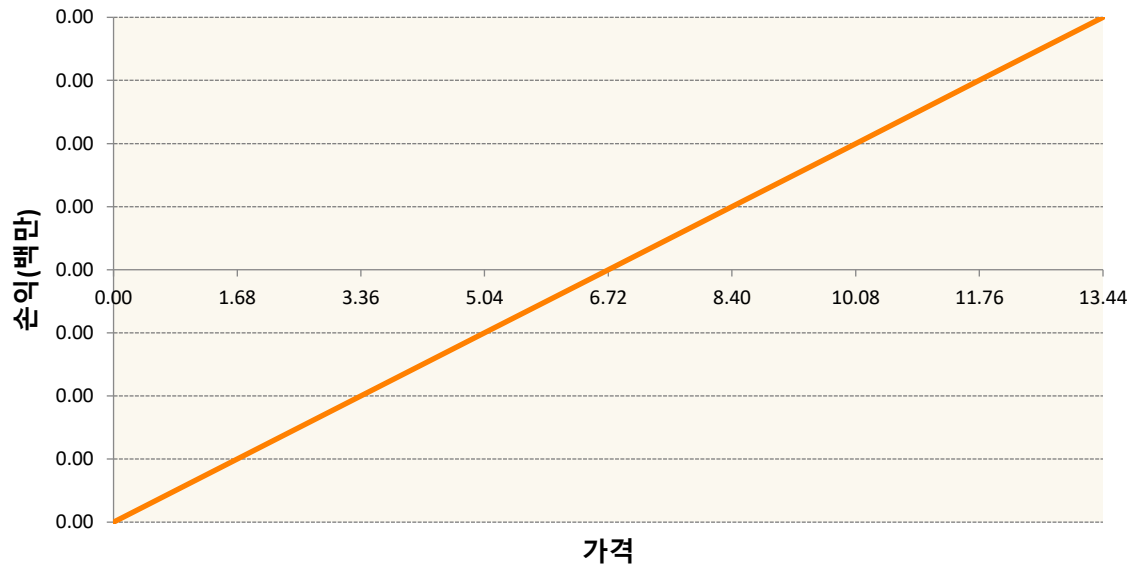
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



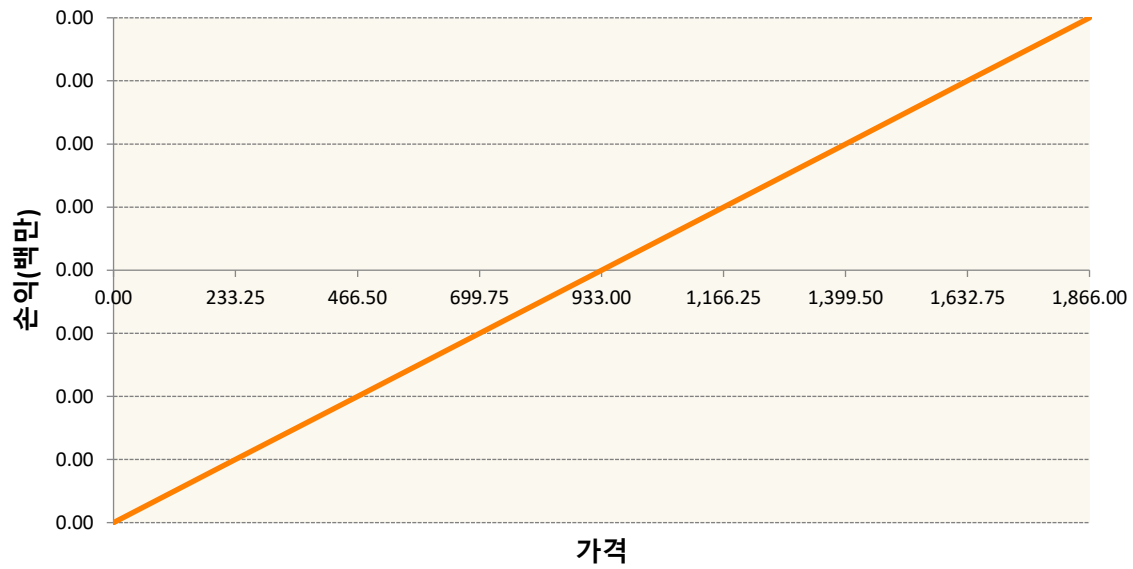
KR4175SC0000-2022-12 달러선물

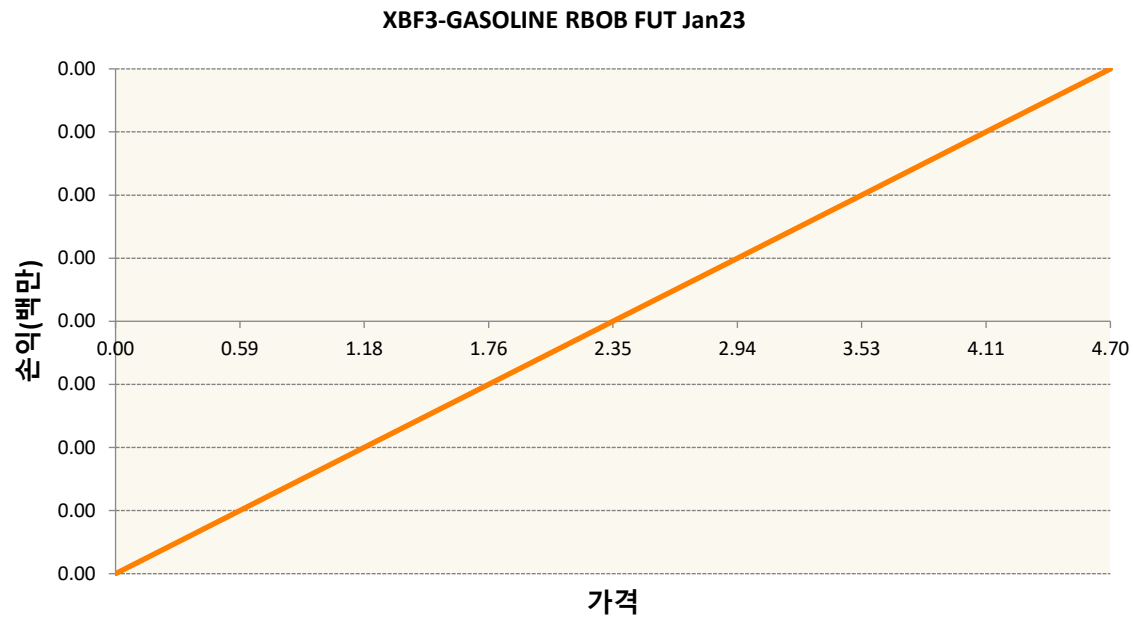


NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



QSF3-Low Su Gasoil G Jan23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF3	WTI CRUDE FUTURE Jan23	18
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	27
ECF3	E-mini Crude Oil Jan23	4
EOF3	E-MINI NATURAL GAS Jan23	9
HOF3	NY Harb ULSD Fut Jan23	16
KR4175SC00 2022-12 달러선물		22
NGF23	NATURAL GAS FUTR Jan23	46
QSF3	Low Su Gasoil G Jan23	11
XBF3	GASOLINE RBOB FUT Jan23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	482