

공시일 2022-11-23

기준일 2022-11-22

포커스농산물모(채권-파생형)

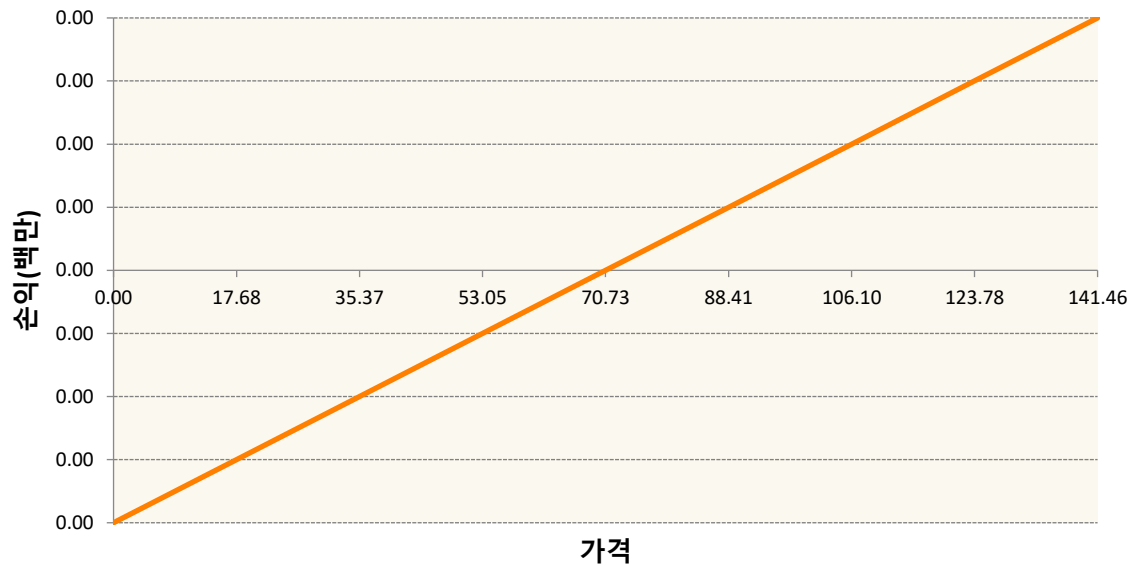
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

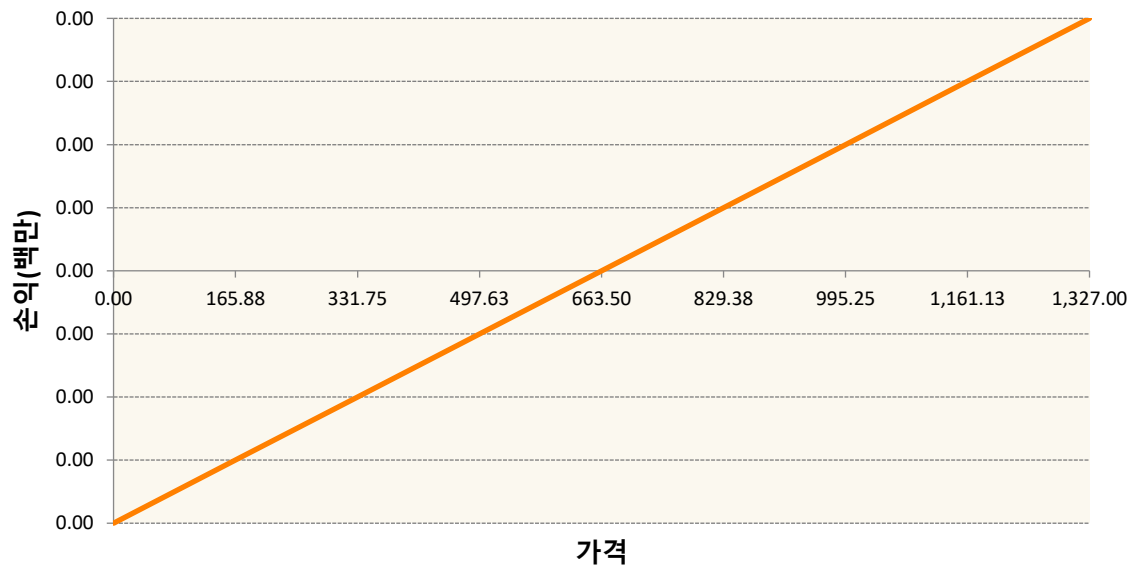
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,529	815	5,715	

2. 만기시점의 손익구조

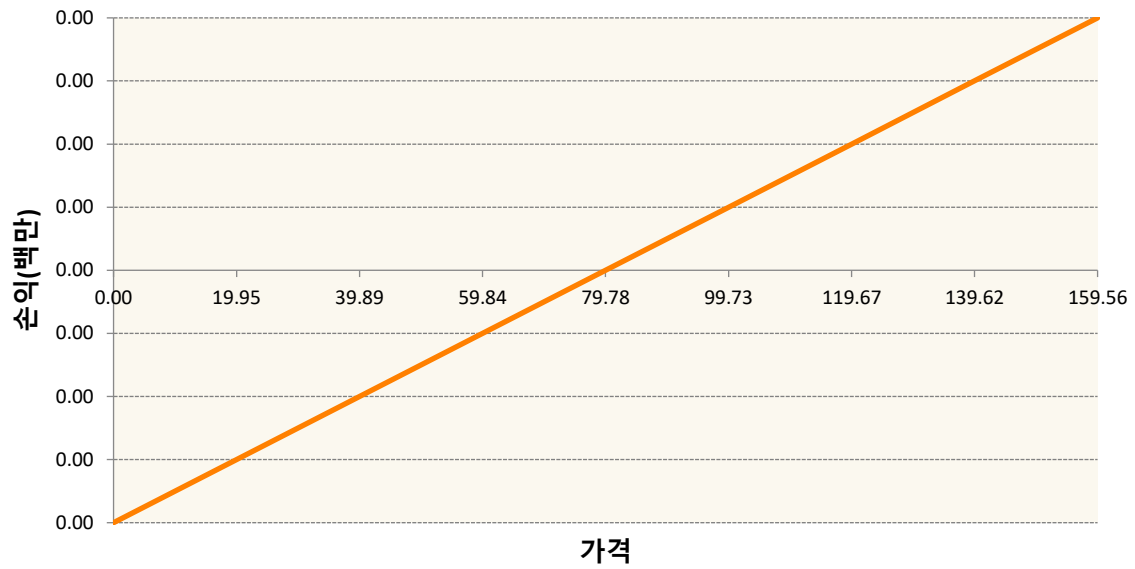
BOF3-SOYBEAN OIL FUTR Jan23



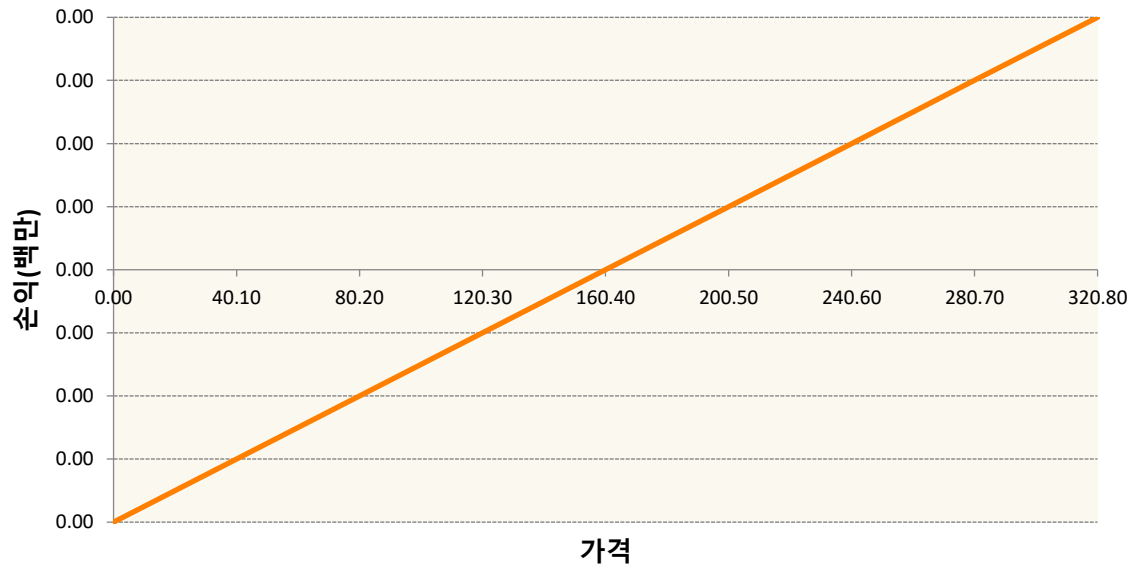
CH3-CORN FUTURE Mar23



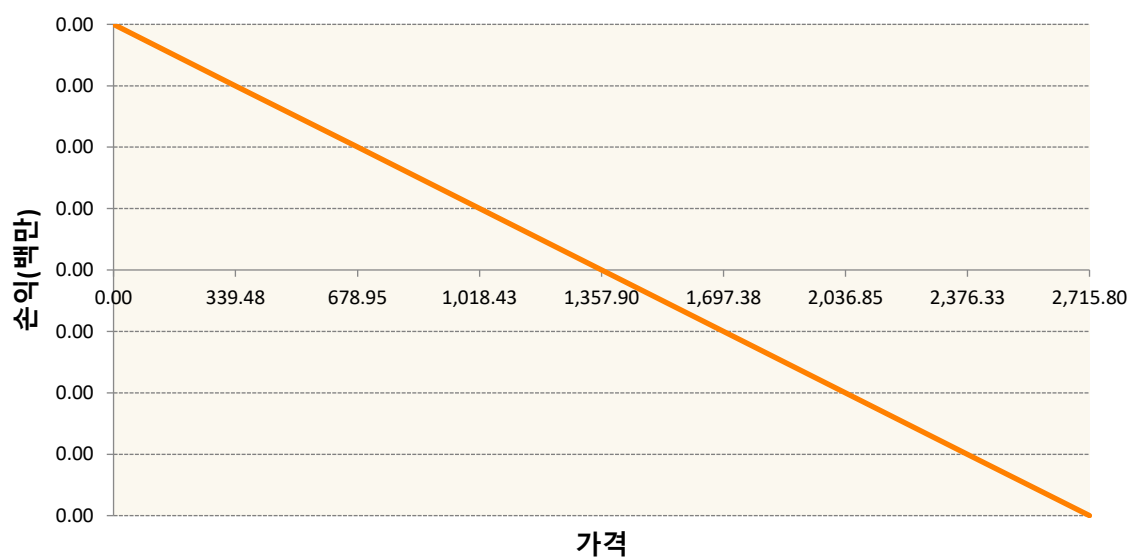
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



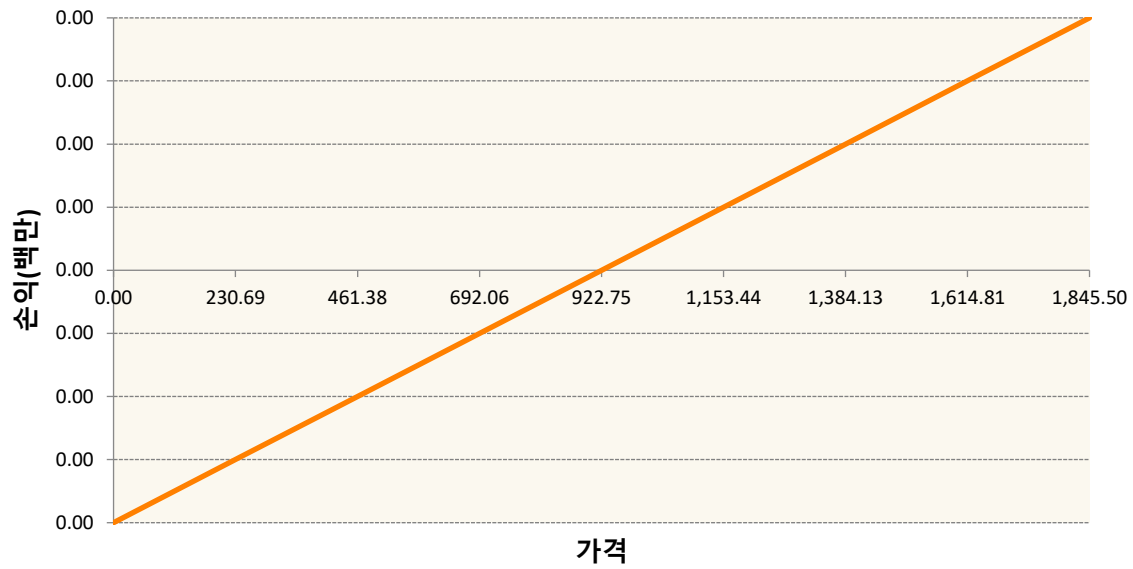
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



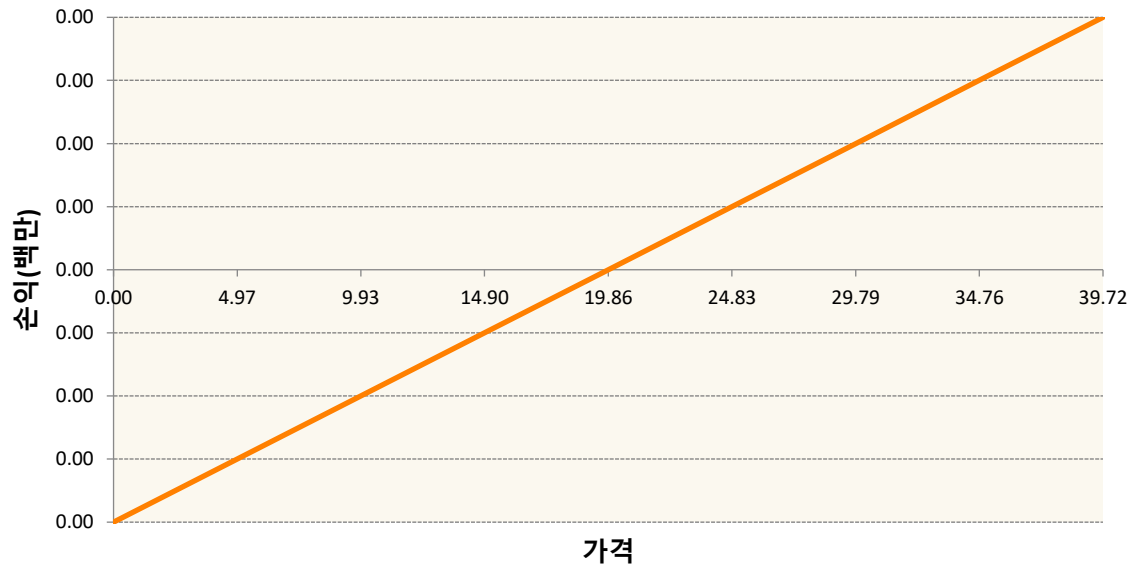
KR4175SC0000-2022-12 달러선물



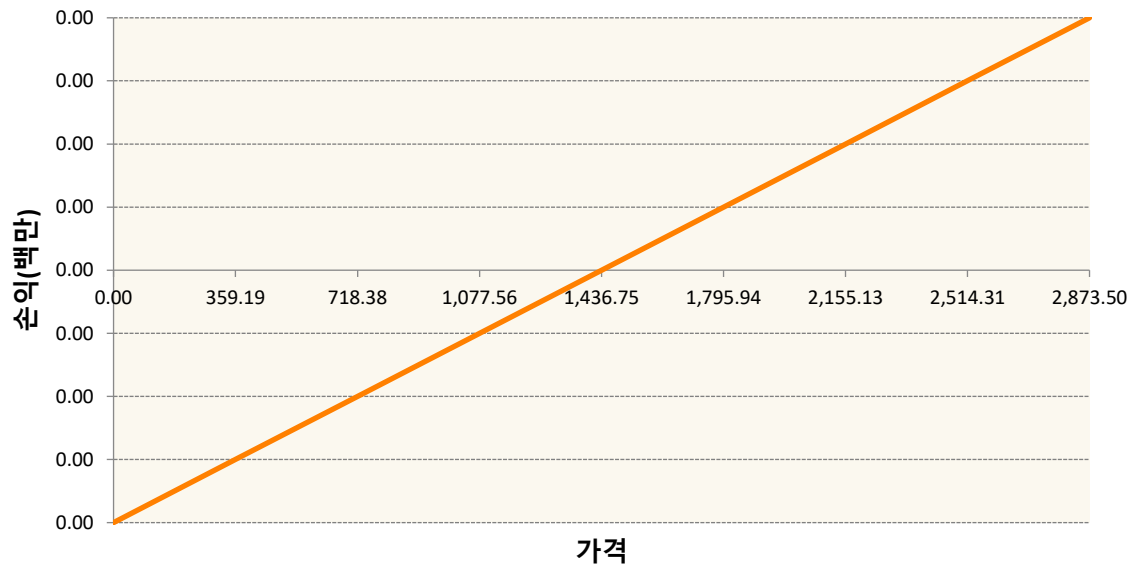
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



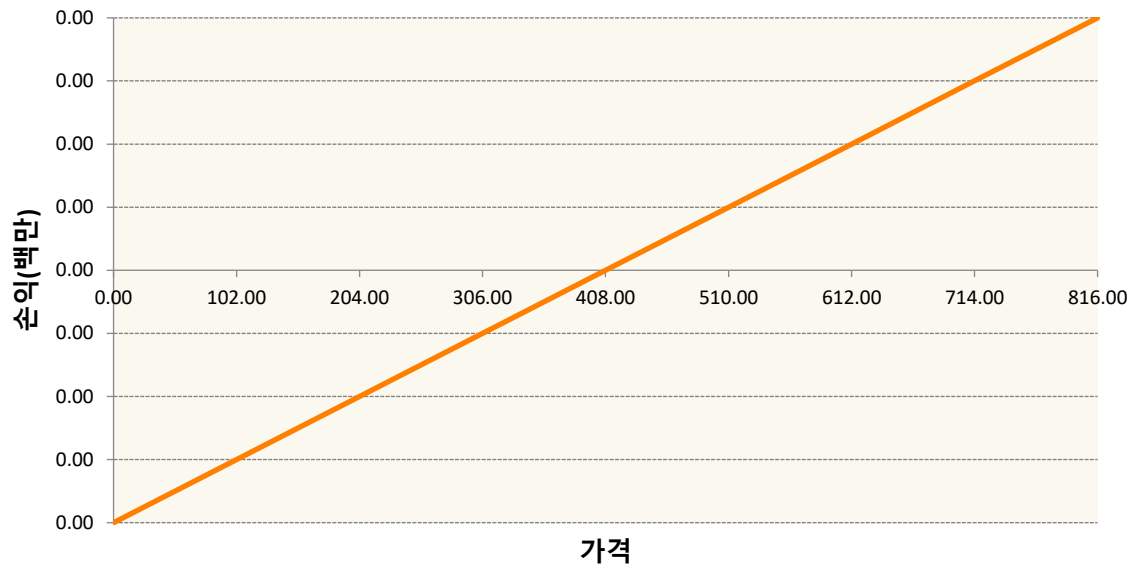
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



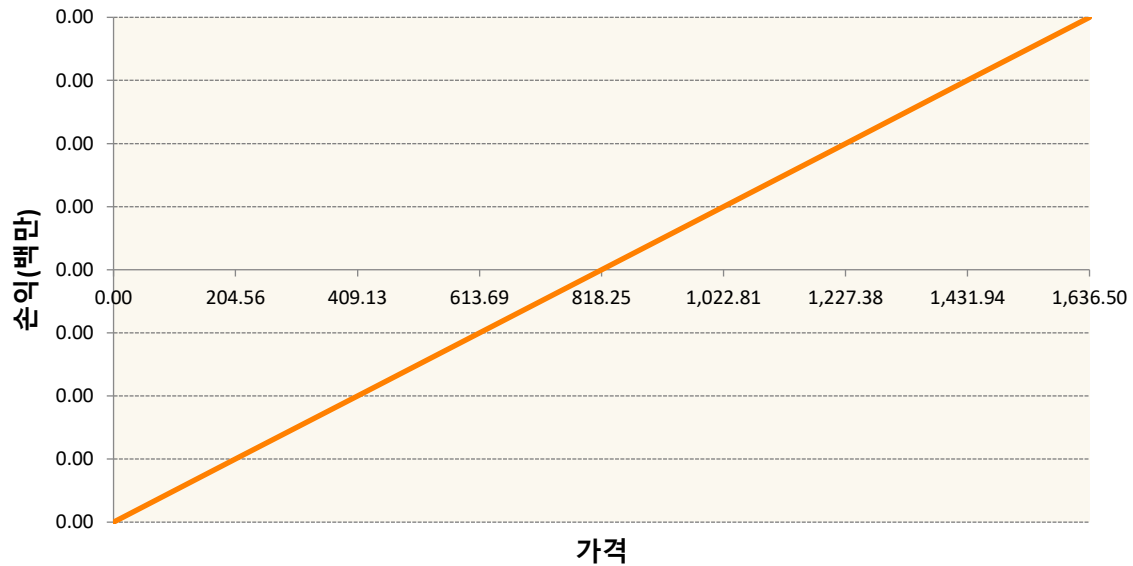
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



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	2022-11-23
기준일	2022-11-22

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	2022-11-23
기준일	2022-11-22

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

344

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

476

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-11-23

기준일 2022-11-22

유로인덱스모(주식-파생형)

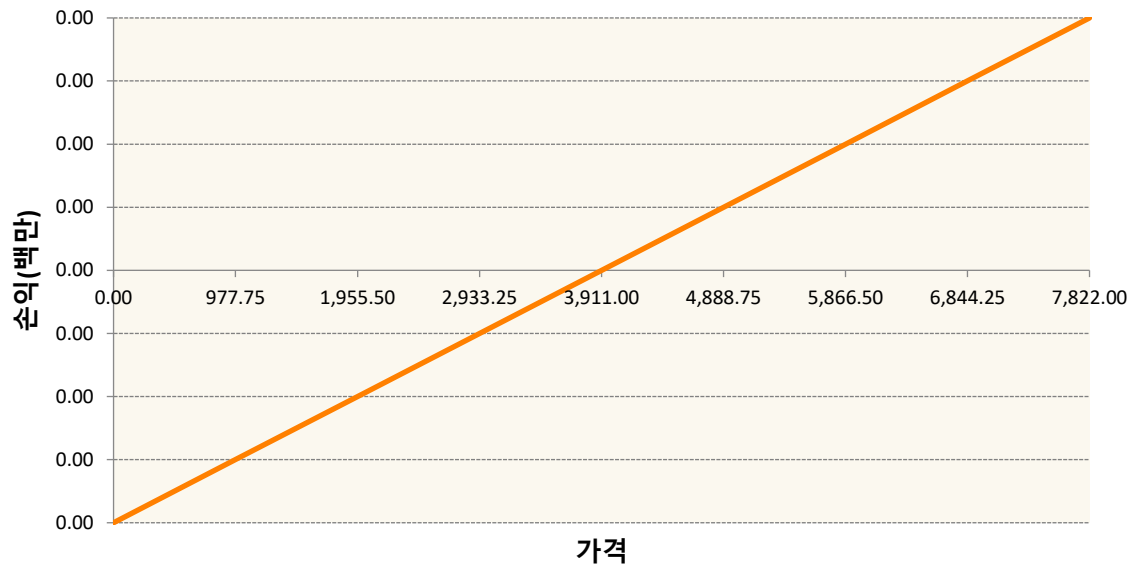
1. 계약금액

(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	542	0	542	
누계	통화	선도	0	42	-42	장외

2. 만기시점의 손익구조

VGZ2-EURO STOXX 50 Dec22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CBN KRW/EUR 25-11-22E

3

VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22

43

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

(단위:백만원)

49

공시일	2022-11-23
기준일	2022-11-22

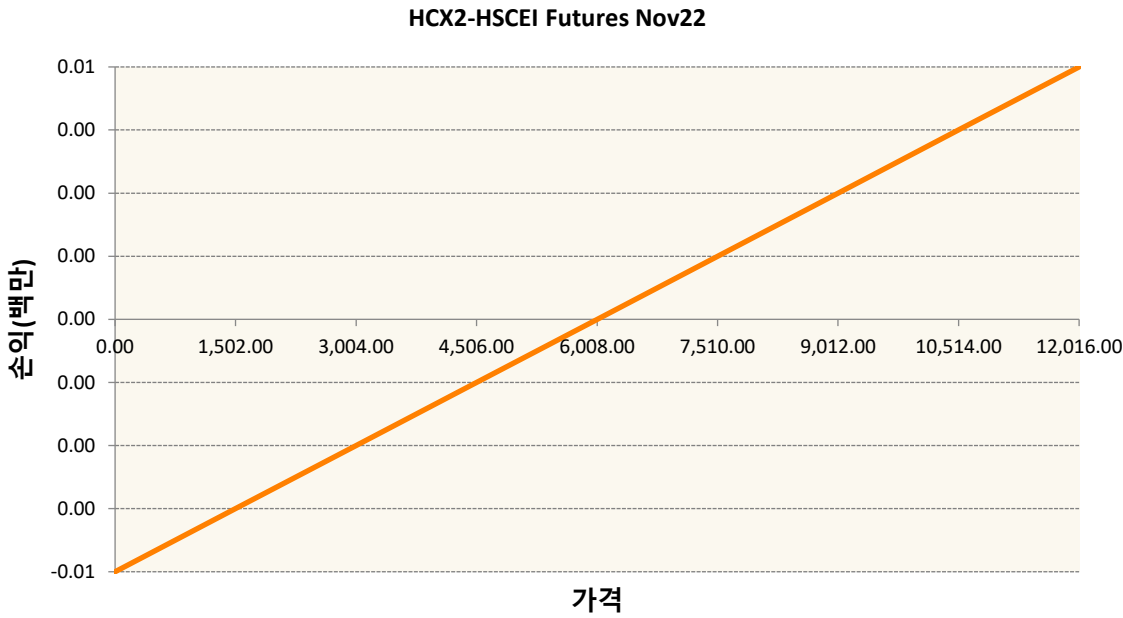
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,117	0	1,117	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

147

공시일	2022-11-23
기준일	2022-11-22

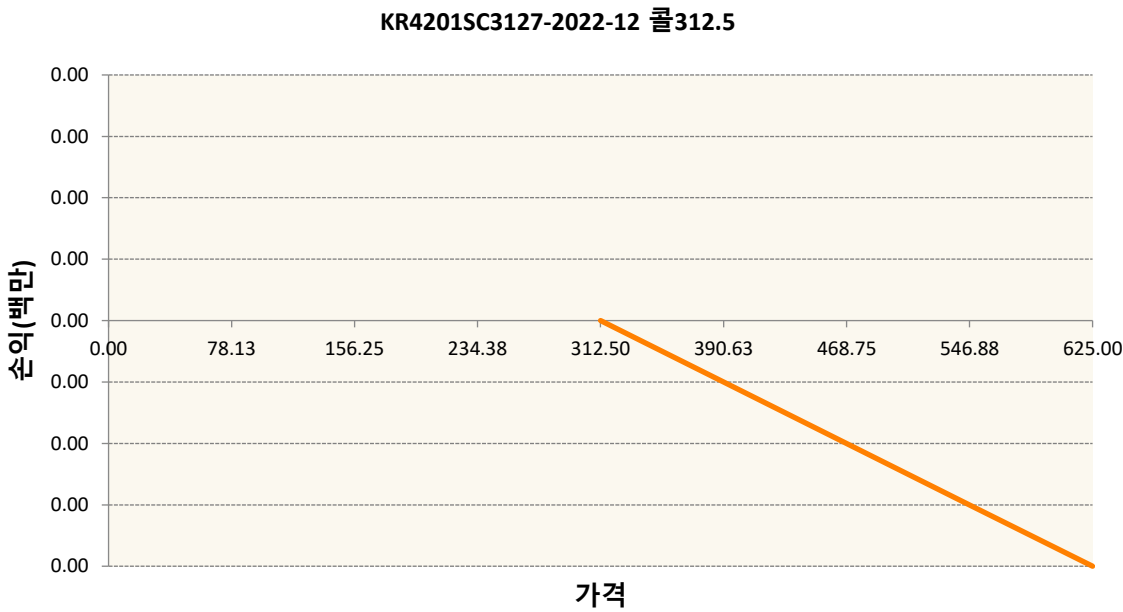
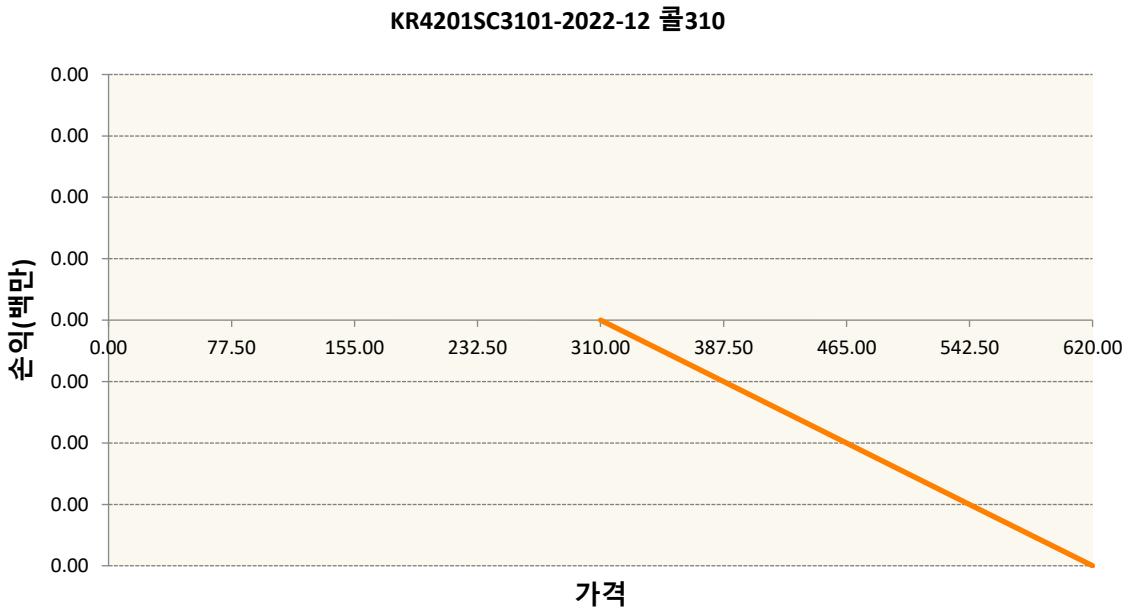
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	397	-397	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,671	-53,671	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.

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 '가격' (Price) from 0.00 to 625.00. The y-axis represents '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions) from -100.00 to 100.00. The line starts at (0,0) and passes through (312.50, 0). The area above the line is light blue, and the area below is light orange.

가격	손익 (백만)
0.00	-100.00
78.13	-20.00
156.25	-10.00
234.38	0.00
312.50	10.00
390.63	20.00
468.75	30.00
546.88	40.00
625.00	50.00

(단위:백만원)

KR4201SC3101				2022-12 콜310				1,703
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,039	981	918	852	783	711	637	
-5.33%	876	799	721	640	559	476	392	
-2.67%	625	536	447	357	268	177	87	
0%	277	185	92	0	-92	-185	-277	
2.67%	-167	-254	-342	-430	-520	-610	-700	
5.33%	-697	-770	-847	-927	-1,009	-1,092	-1,177	
8.00%	-1,294	-1,351	-1,414	-1,481	-1,552	-1,626	-1,703	
KR4201SC3127				2022-12 콜312.5				1,096
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	638	603	564	523	479	434	387
-5.33%	544	496	446	395	343	289	235
-2.67%	396	338	280	222	163	104	45
0%	185	123	62	0	-62	-123	-185
2.67%	-91	-150	-210	-270	-331	-392	-453
5.33%	-425	-477	-531	-586	-642	-700	-758
8.00%	-807	-849	-894	-941	-991	-1,043	-1,096
KR4301SC3100 2022-12 풋310							132

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-102	-107	-113	-119	-125	-132
-5.33%	-49	-55	-62	-69	-76	-83	-91
-2.67%	-8	-16	-24	-31	-39	-47	-55
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	48	40	33	25	17	9	2
5.33%	64	58	51	44	37	30	23
8.00%	75	70	64	59	52	46	39

KR4301SC3126 2022-12 풋312.5							386
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-293	-306	-321	-336	-352	-369	-386
-5.33%	-151	-169	-188	-207	-226	-246	-266
-2.67%	-30	-51	-73	-94	-116	-138	-160
0%	69	46	23	0	-23	-46	-69
2.67%	143	121	99	76	54	31	9
5.33%	196	176	156	136	115	94	72
8.00%	230	215	198	181	162	143	123

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

(단위:백만원)

2,919

공시일	2022-11-23
기준일	2022-11-22

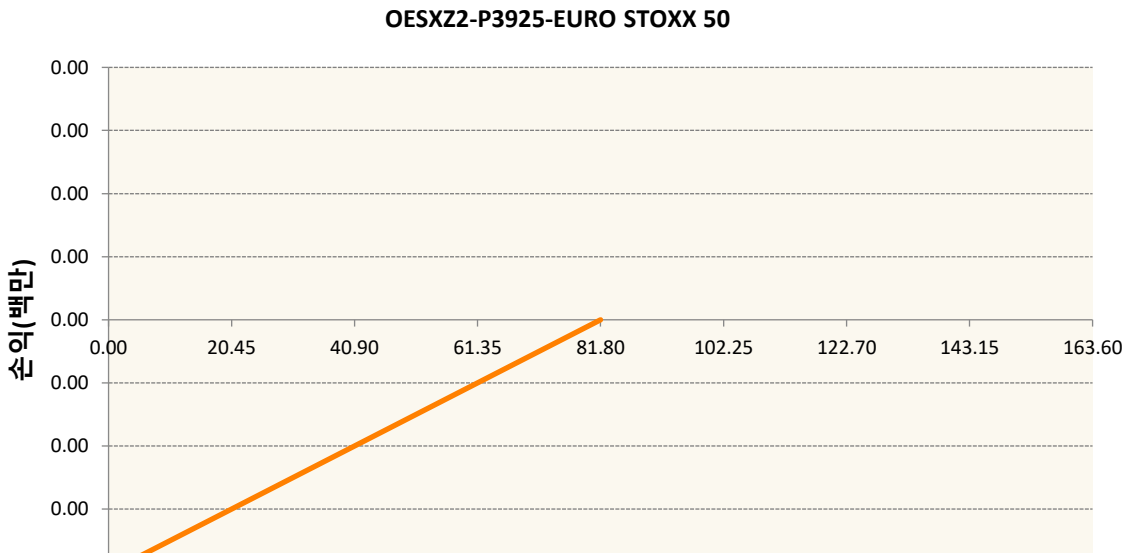
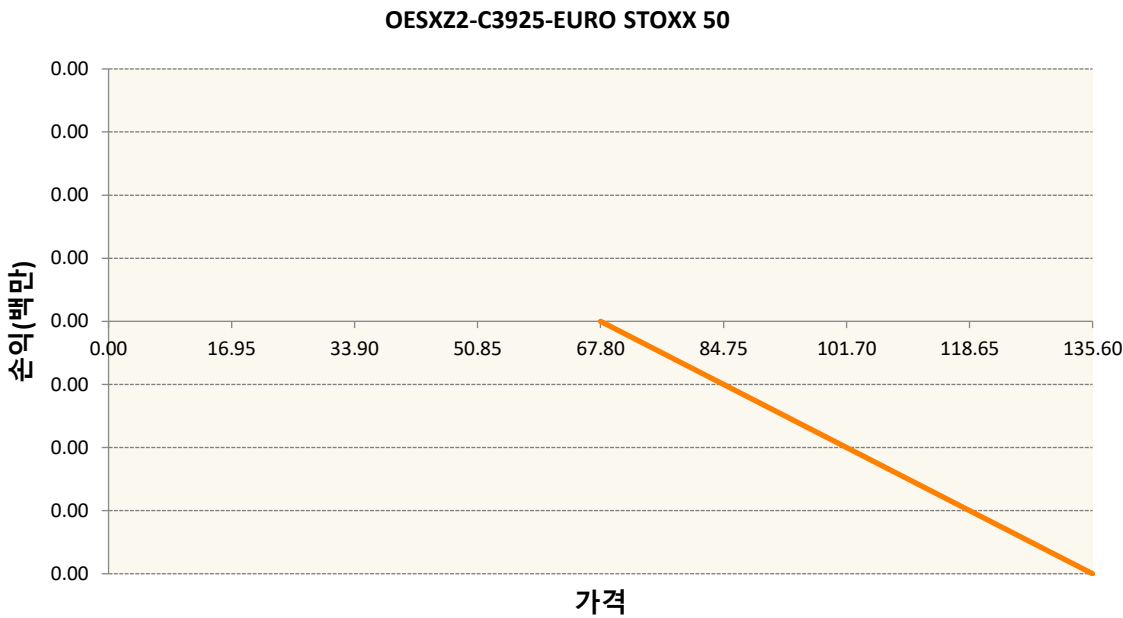
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

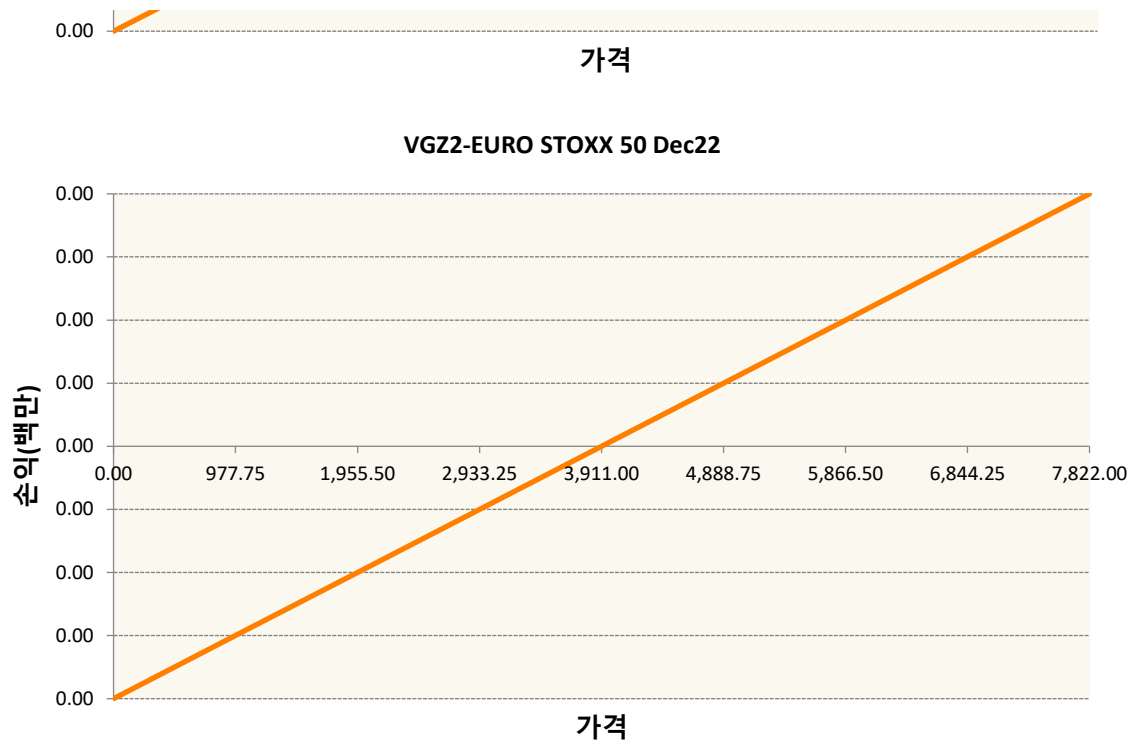
1. 계약금액

(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	1,096	0	1,096	
누계	유가증권	옵션	0	87	-87	장내
누계	통화	선도	139	2,435	-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
FXW213CBN EUR/KRW 24-02-23E	11
FXW213CBN KRW/EUR 25-11-22E	11
OESXZ2-C39 EURO STOXX 50	3
OESXZ2-P39 EURO STOXX 50	4
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	88

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

(단위:백만원)

249

공시일 2022-11-23

기준일 2022-11-22

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

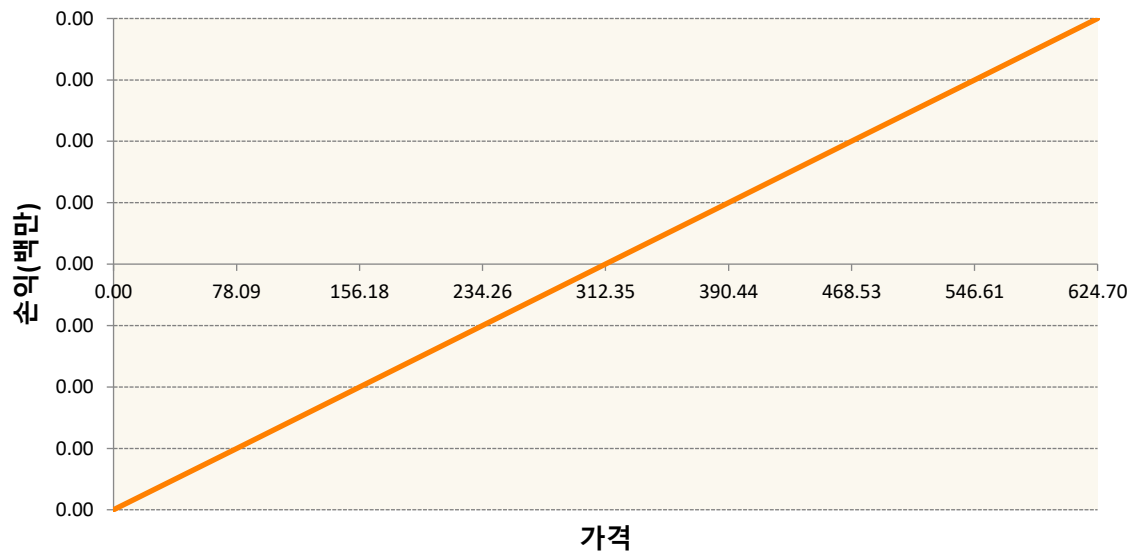
1. 계약금액

(단위:백만원)

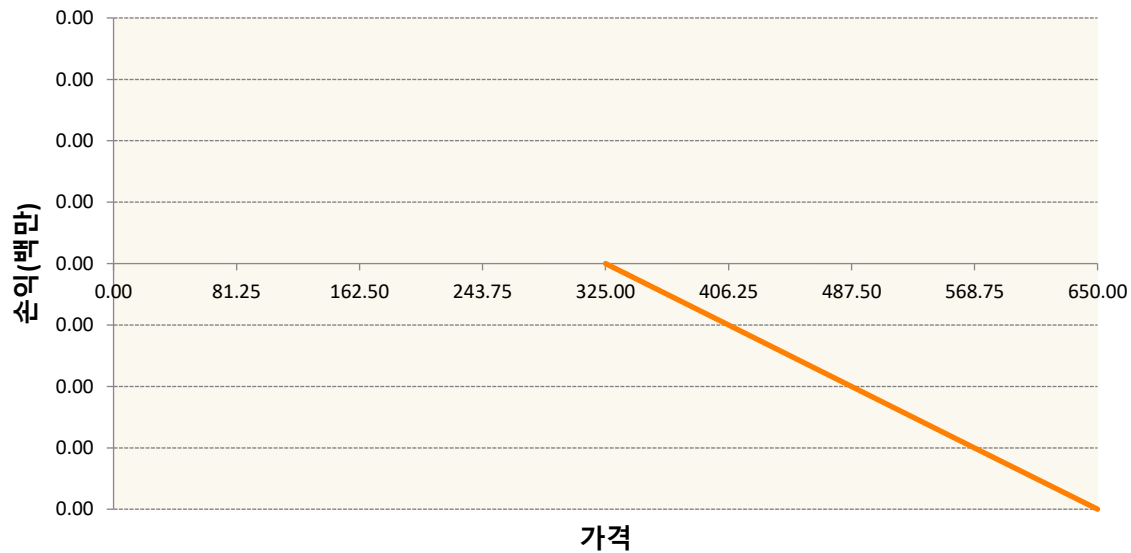
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	390	0	390	장내
누계	유가증권	옵션	311	3,839	-3,528	장내

2. 만기시점의 손익구조

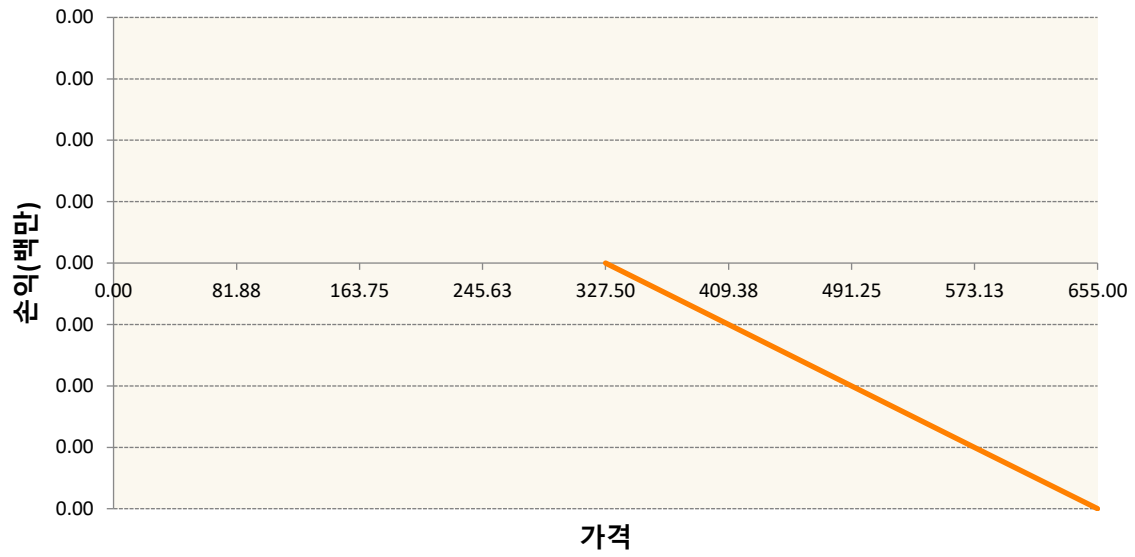
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



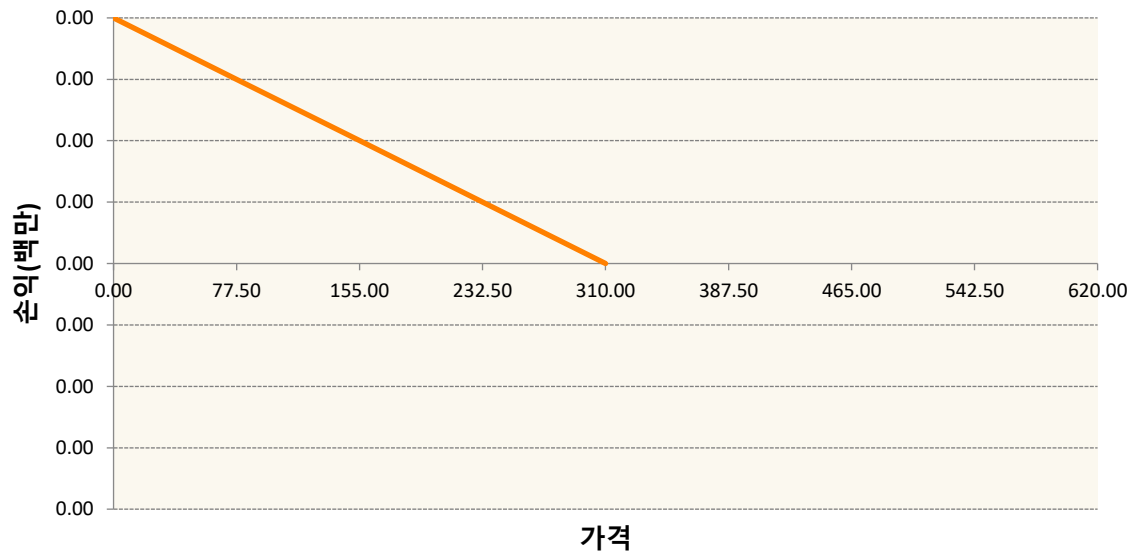
KR4201SC3259-2022-12 콜325



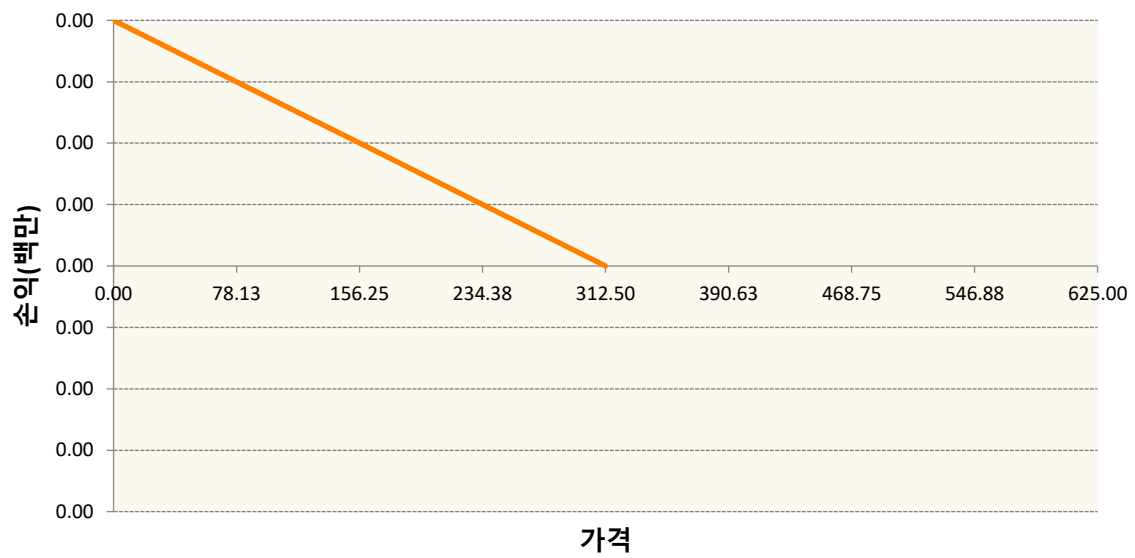
KR4201SC3275-2022-12 콜327.5



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		60	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	27	26	24	22	20	18	16			
-5.33%	24	22	20	17	15	12	9			
-2.67%	19	16	13	10	7	3	0			
0%	11	8	4	0	-4	-8	-12			
2.67%	-1	-5	-9	-13	-17	-21	-25			
5.33%	-17	-21	-25	-29	-33	-38	-42			
8.00%	-37	-40	-44	-48	-52	-56	-60			
KR4201SC3275							2022-12 콜327.5		124	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	52	50	47	43	39	35	30			
-5.33%	47	43	39	34	28	23	16			
-2.67%	38	32	26	20	13	6	-1			
0%	23	16	8	0	-8	-16	-24			
2.67%	0	-9	-17	-26	-35	-43	-52			
5.33%	-31	-40	-49	-58	-67	-76	-86			
8.00%	-71	-80	-89	-97	-106	-115	-124			
KR4301SC3100							2022-12 풋310		9	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	6	7	7	8	8	8	9			
-5.33%	3	4	4	5	5	6	6			
-2.67%	1	1	2	2	3	3	4			
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2			
2.67%	-3	-3	-2	-2	-1	-1	0			
5.33%	-4	-4	-3	-3	-2	-2	-2			
8.00%	-5	-5	-4	-4	-3	-3	-3			
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	4
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-3	-3	-2	-2	-1	-1	0
5.33%	-5	-4	-4	-3	-3	-2	-2
8.00%	-5	-5	-5	-4	-4	-3	-3

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

(단위:백만원)

191

공시일	2022-11-23
기준일	2022-11-22

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	6,952	0	6,952	

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	2022-11-23
기준일	2022-11-22

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	2022-11-23
기준일	2022-11-22

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	19,168	0	19,168	
누계	통화	선도	0	19,026	-19,026	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E	607
FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	505
FXW213CAR·KRW/USD 30-01-23E	281
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)

747

공시일	2022-11-23
기준일	2022-11-22

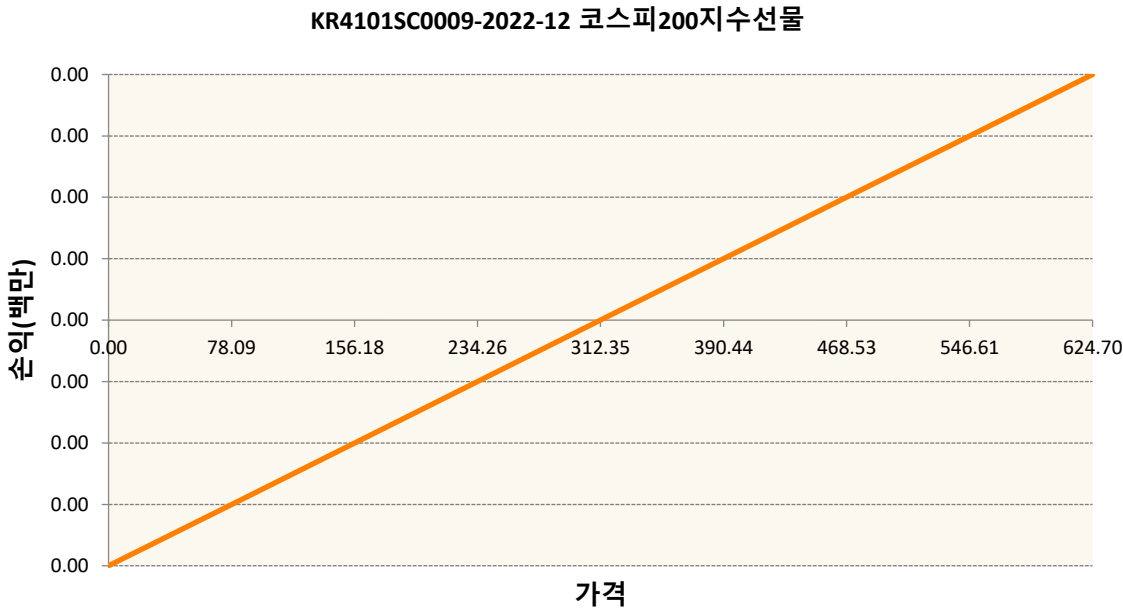
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	390	0	390	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	2022-11-23
기준일	2022-11-22

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	2022-11-23
기준일	2022-11-22

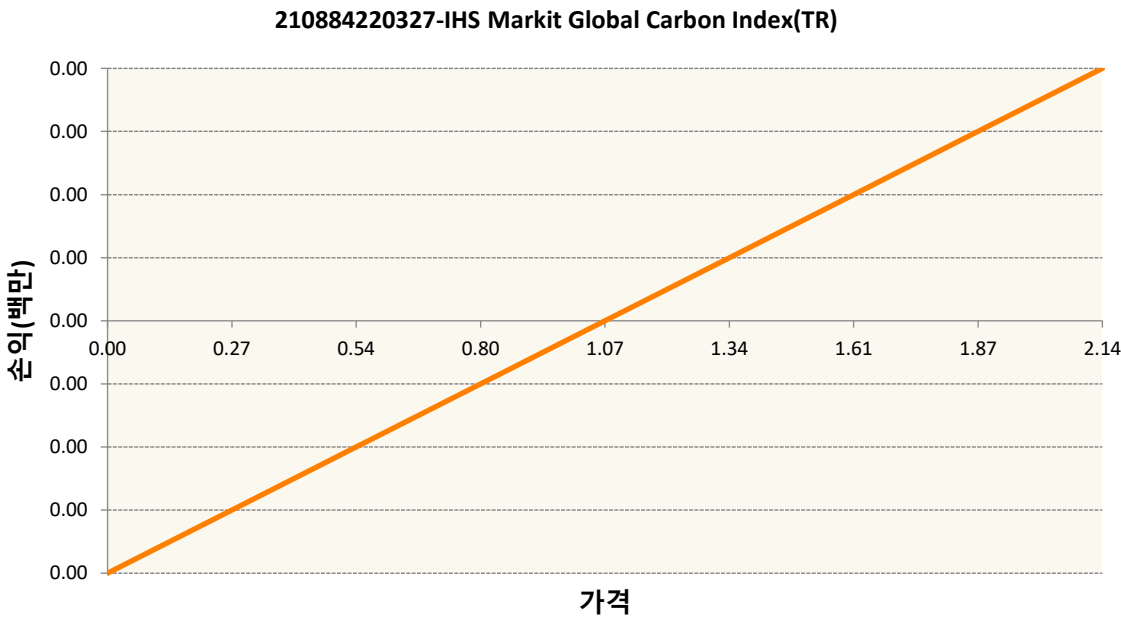
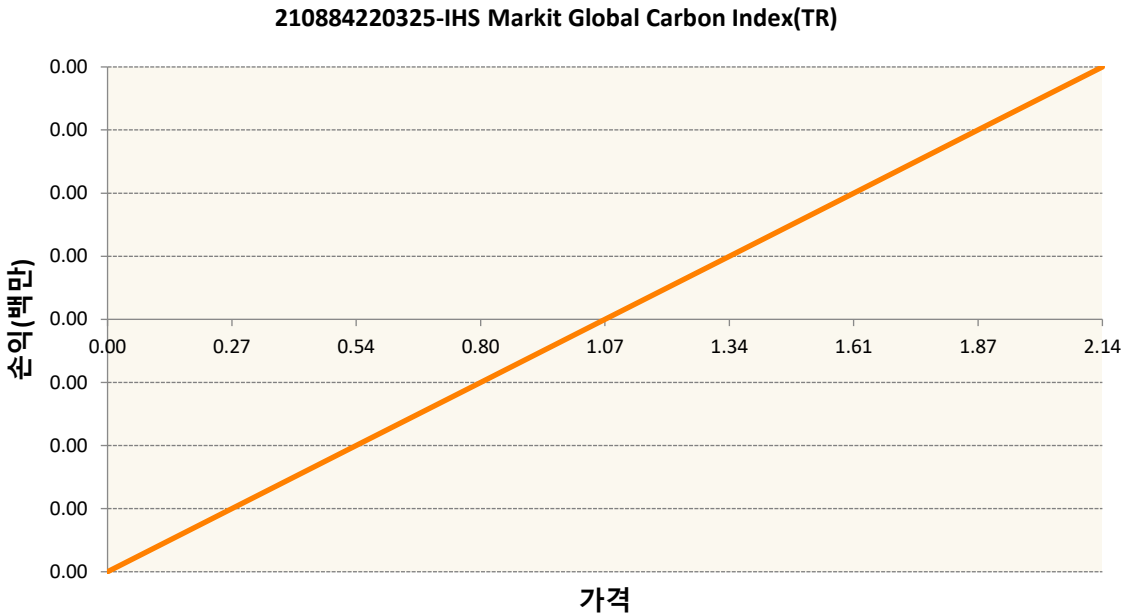
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

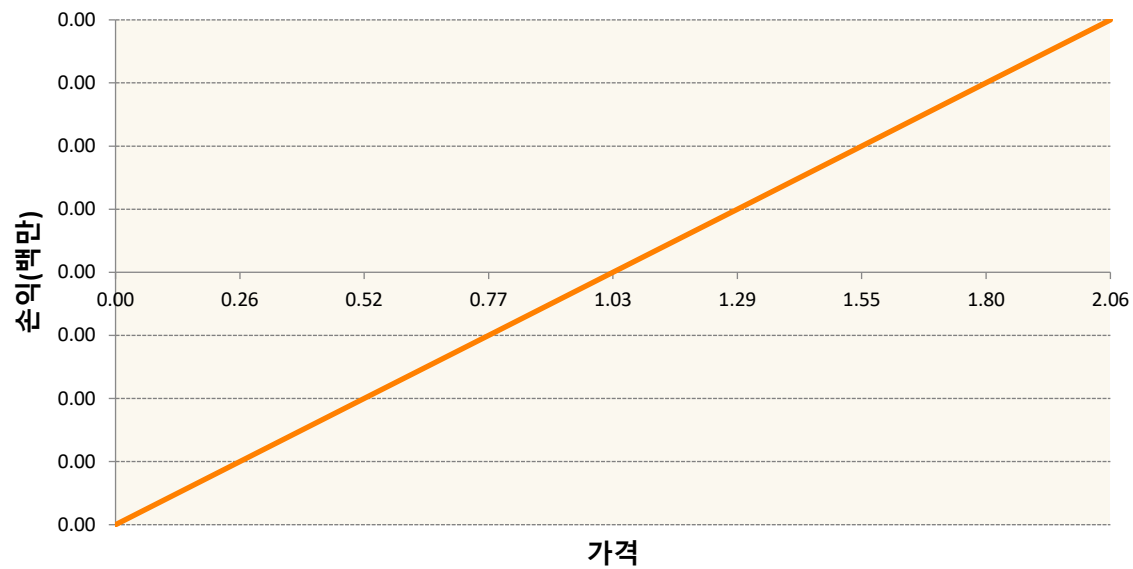
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	29,002	0	29,002	

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)

186

2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)

93

2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)

2,040

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

(단위:백만원)

4,467

공시일	2022-11-23
기준일	2022-11-22

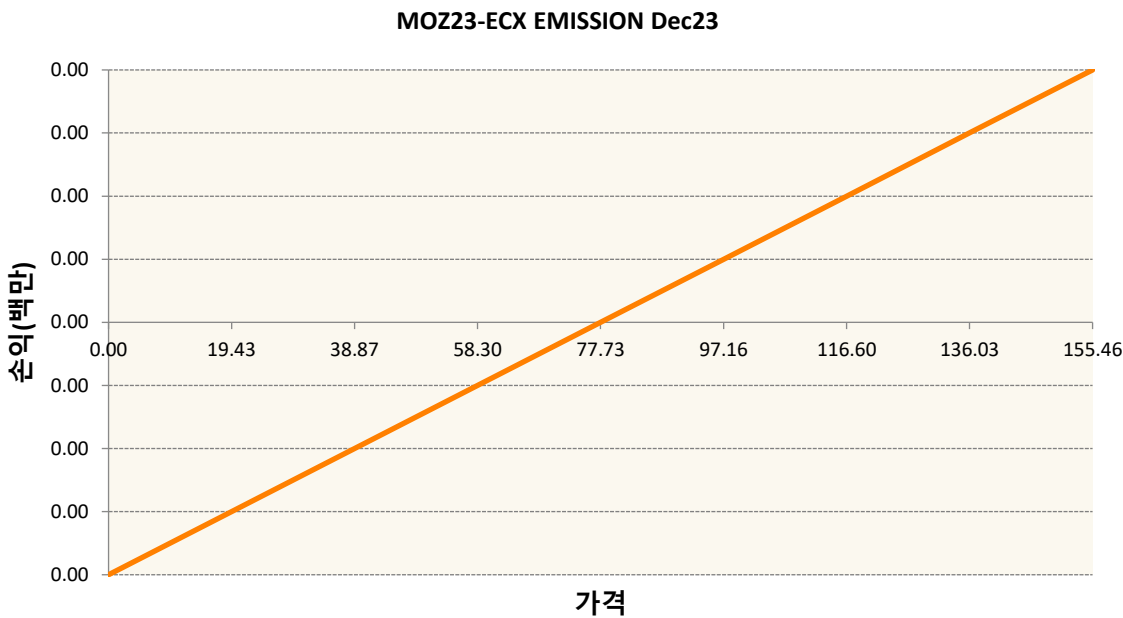
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	14,073	0	14,073	
누계	통화	선도	0	4,916	-4,916	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	1,126

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

(단위:백만원)

3,202

공시일	2022-11-23
기준일	2022-11-22

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)

146

공시일	2022-11-23
기준일	2022-11-22

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	13

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

(단위:백만원)

55

공시일	2022-11-23
기준일	2022-11-22

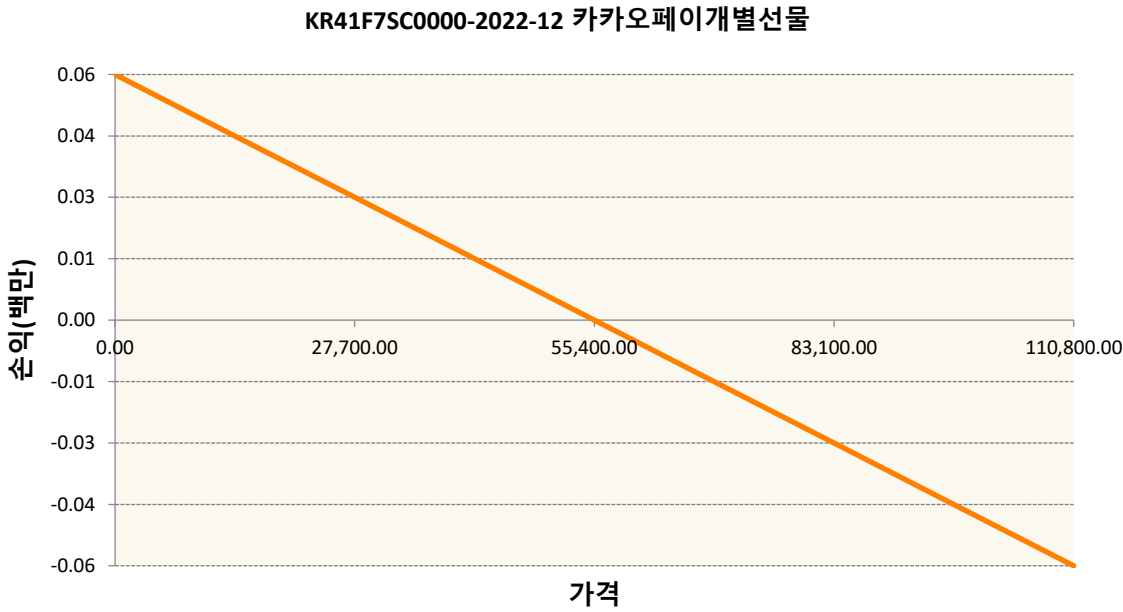
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	166	-166	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR41F7SC00 2022-12 카카오페이개별선물	13
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.03
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.06

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

(단위:백만원)

54

공시일 2022-11-23

기준일 2022-11-22

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

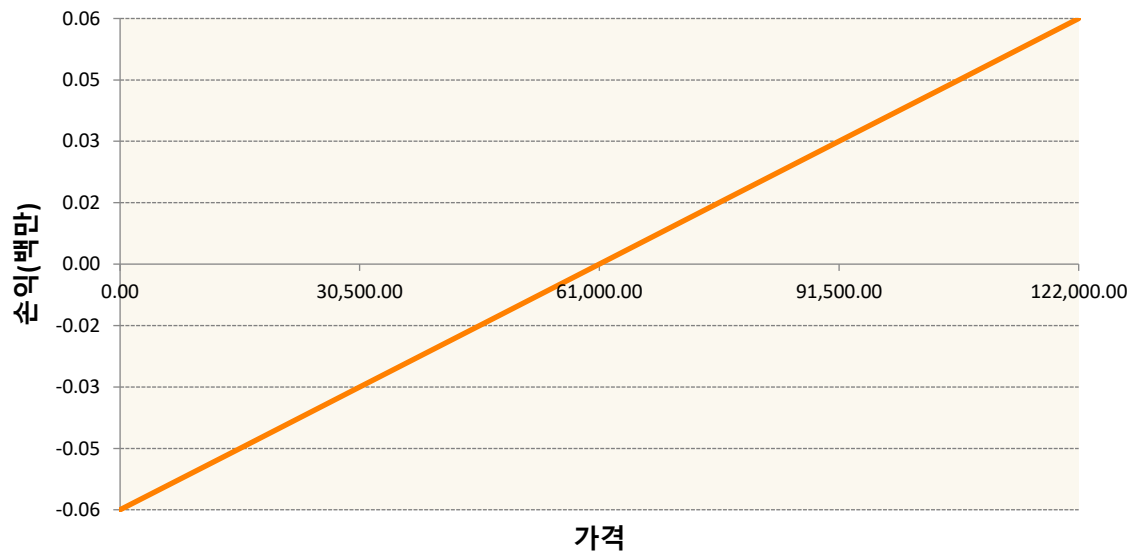
1. 계약금액

(단위:백만원)

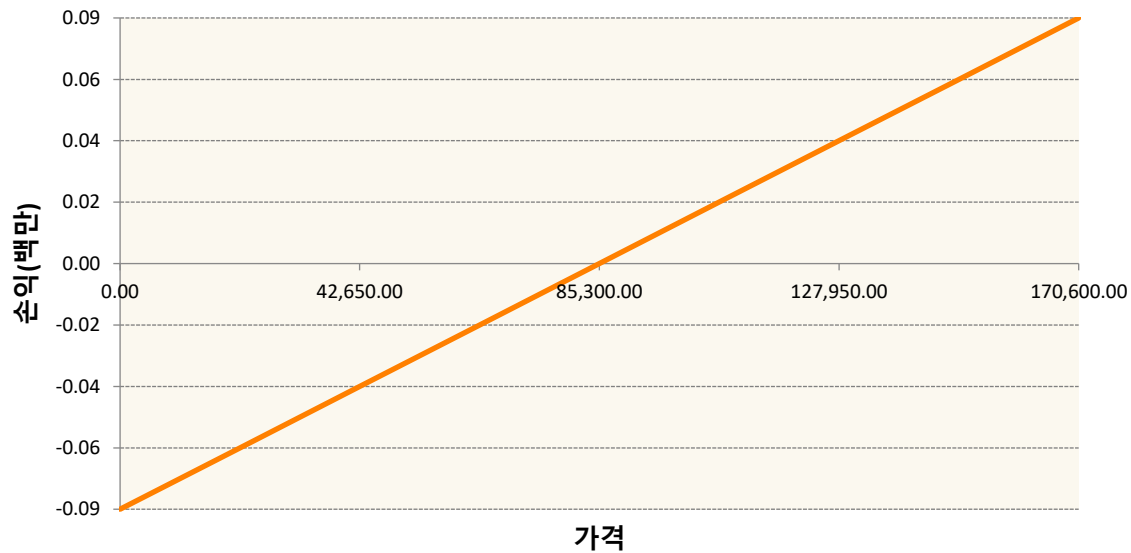
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	149	0	149	장내

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	2022-11-23
기준일	2022-11-22

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 2022-11-23

기준일 2022-11-22

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

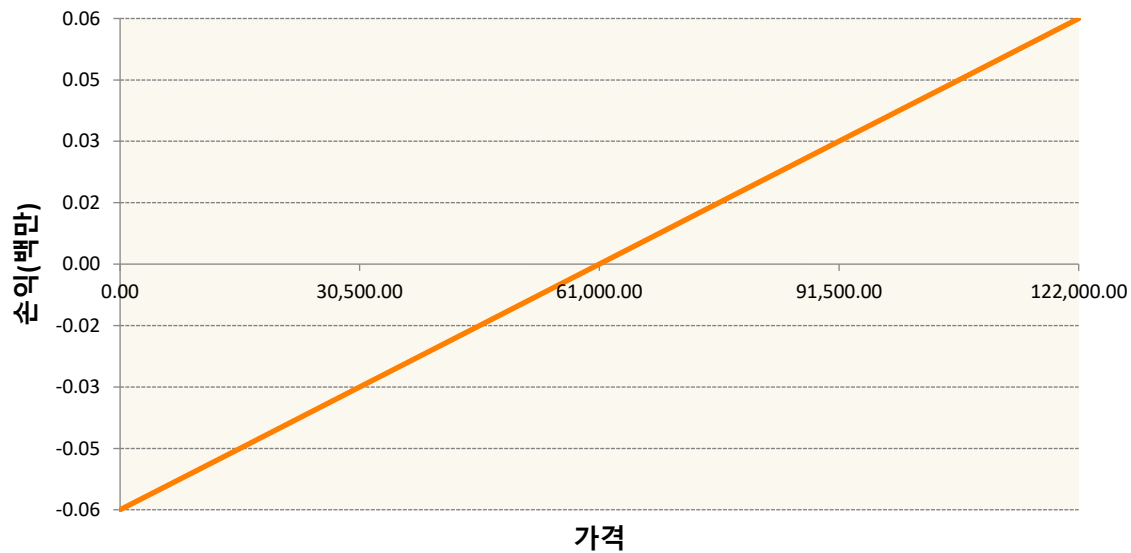
1. 계약금액

(단위:백만원)

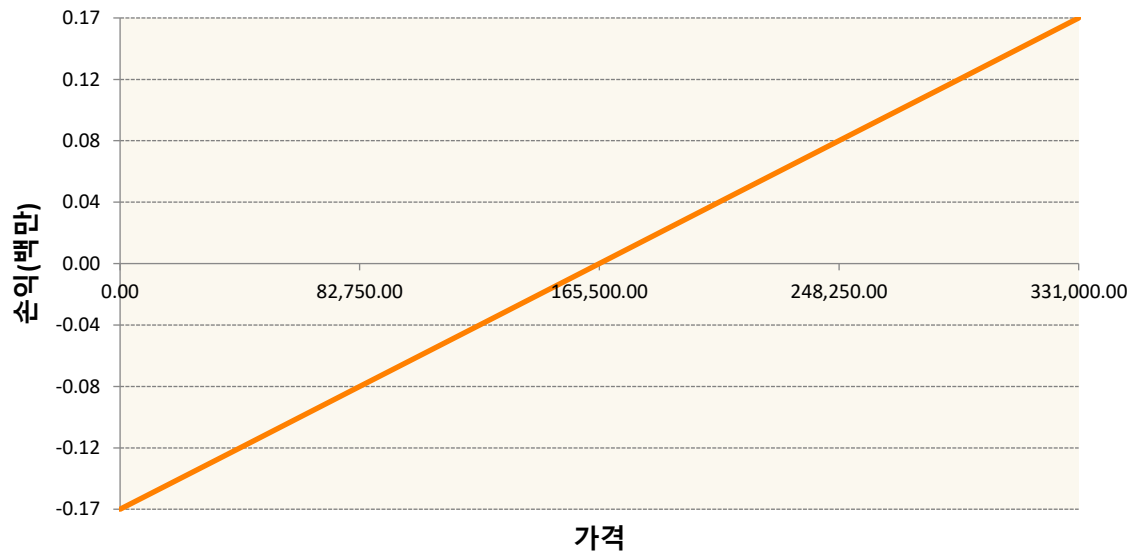
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	291	0	291	장내

2. 만기시점의 손익구조

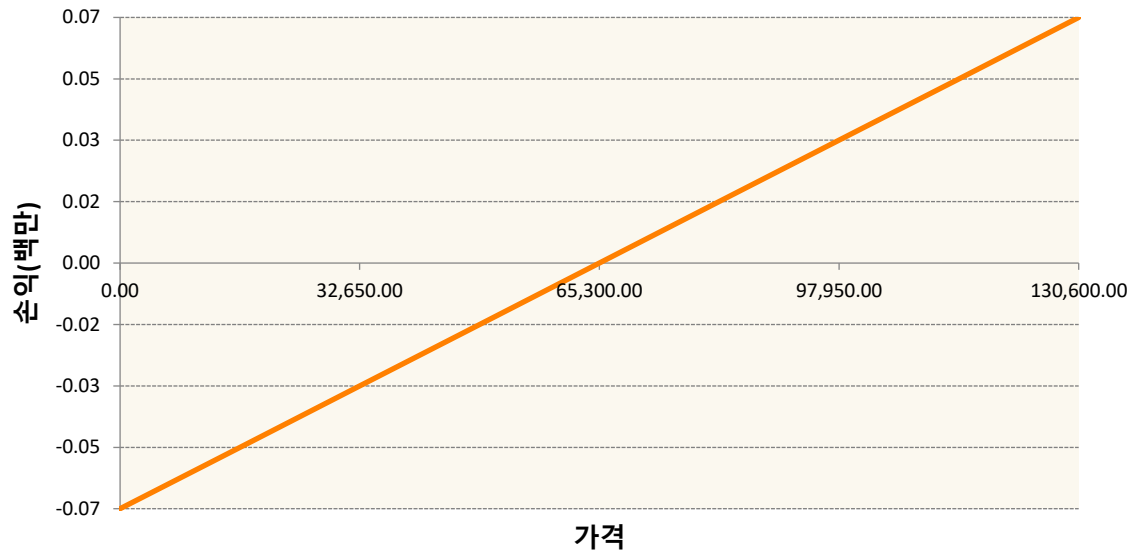
KR4111SC0007-2022-12 삼성전자개별선물



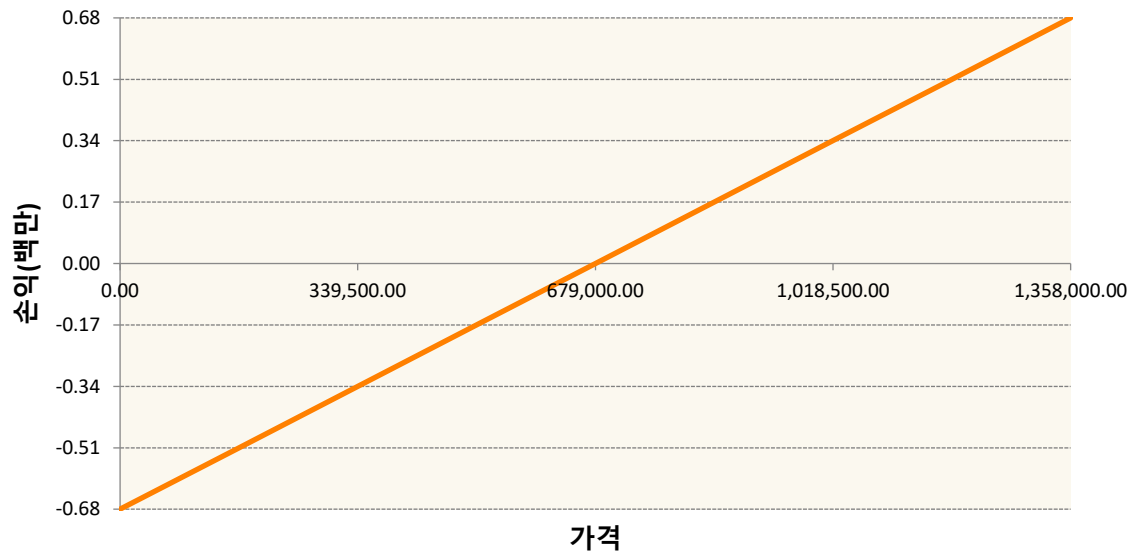
KR4116SC0002-2022-12 현대차개별선물



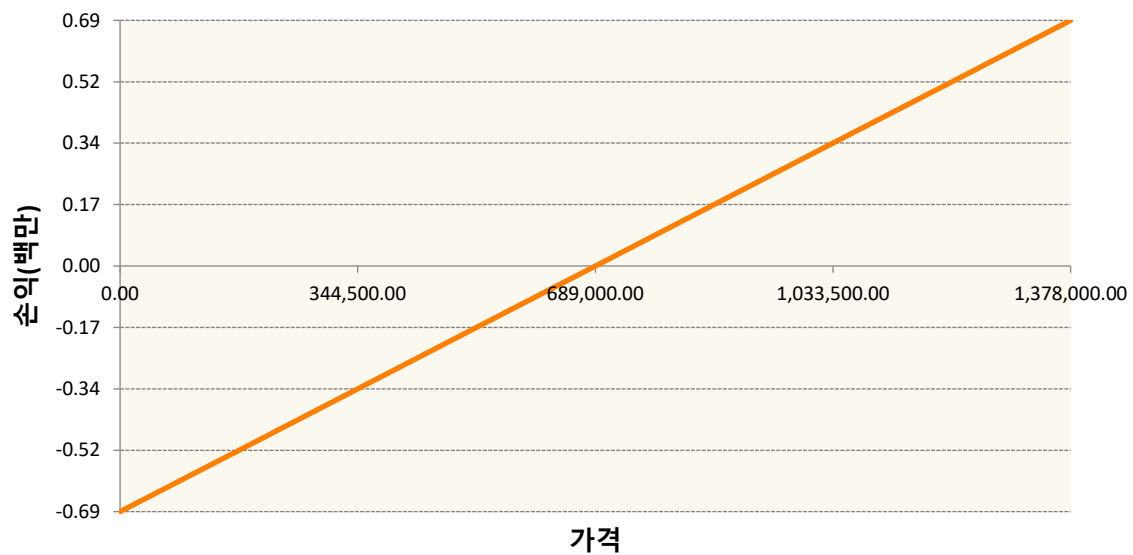
KR4119SC0009-2022-12 기아차개별선물



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)

27

공시일 2022-11-23

기준일 2022-11-22

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

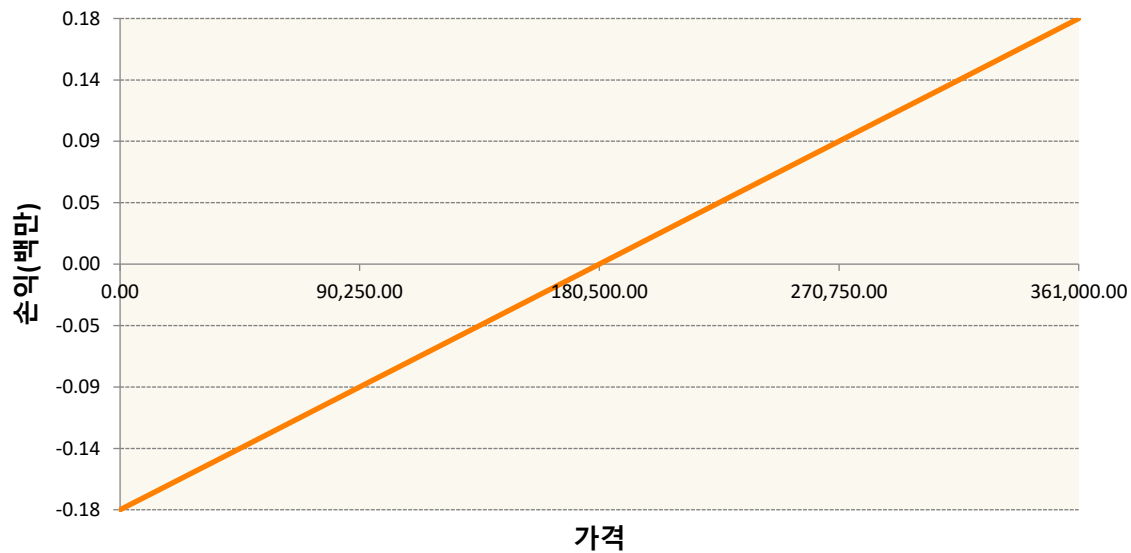
1. 계약금액

(단위:백만원)

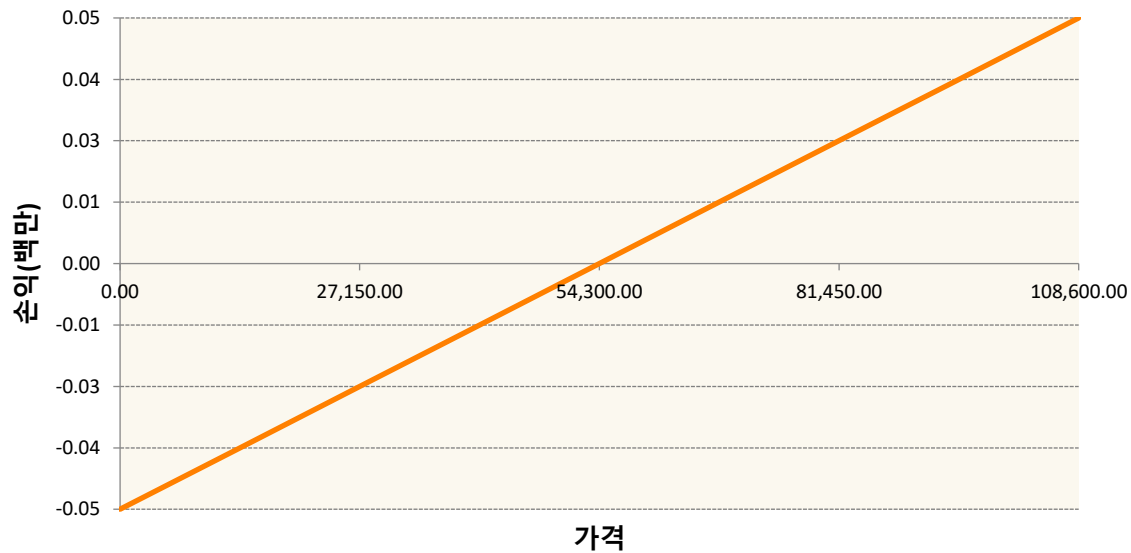
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	112	0	112	장내

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	2022-11-23
기준일	2022-11-22

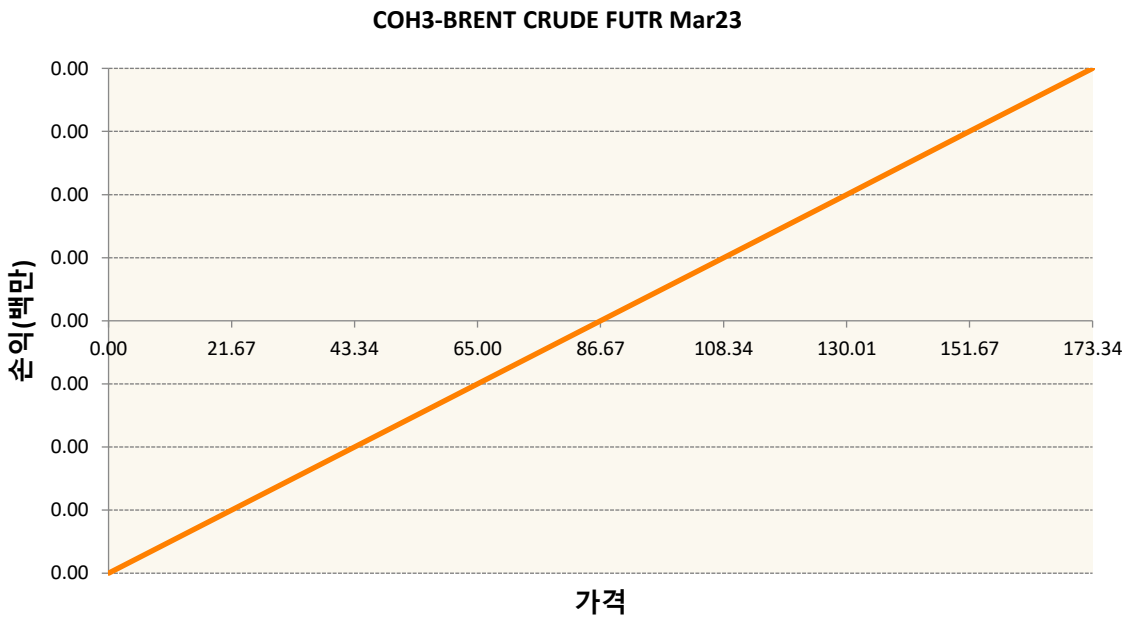
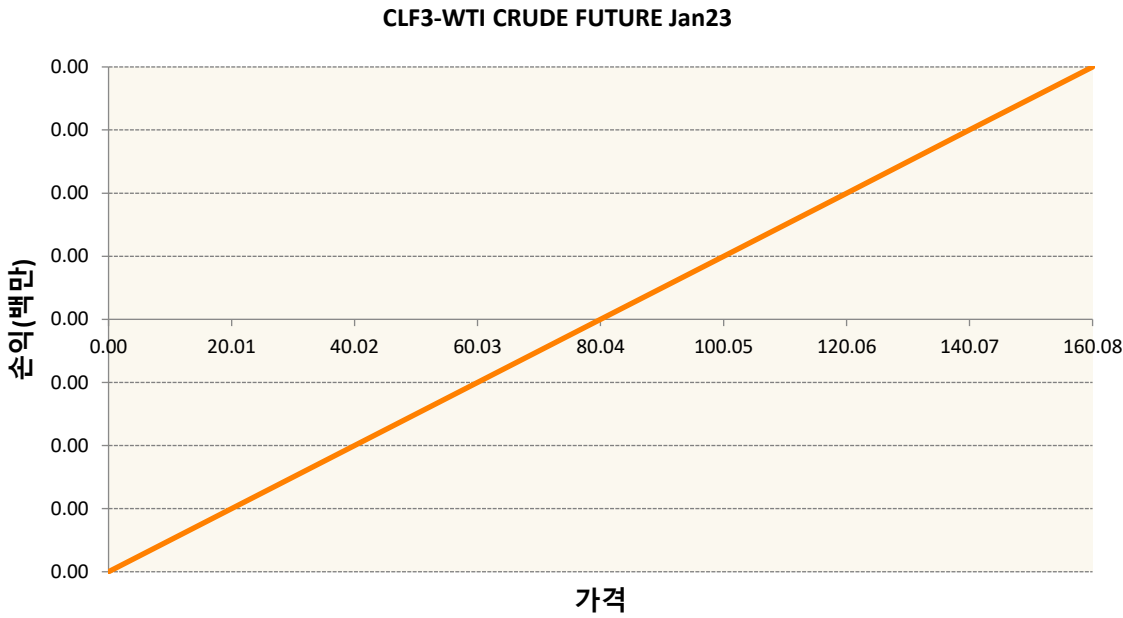
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

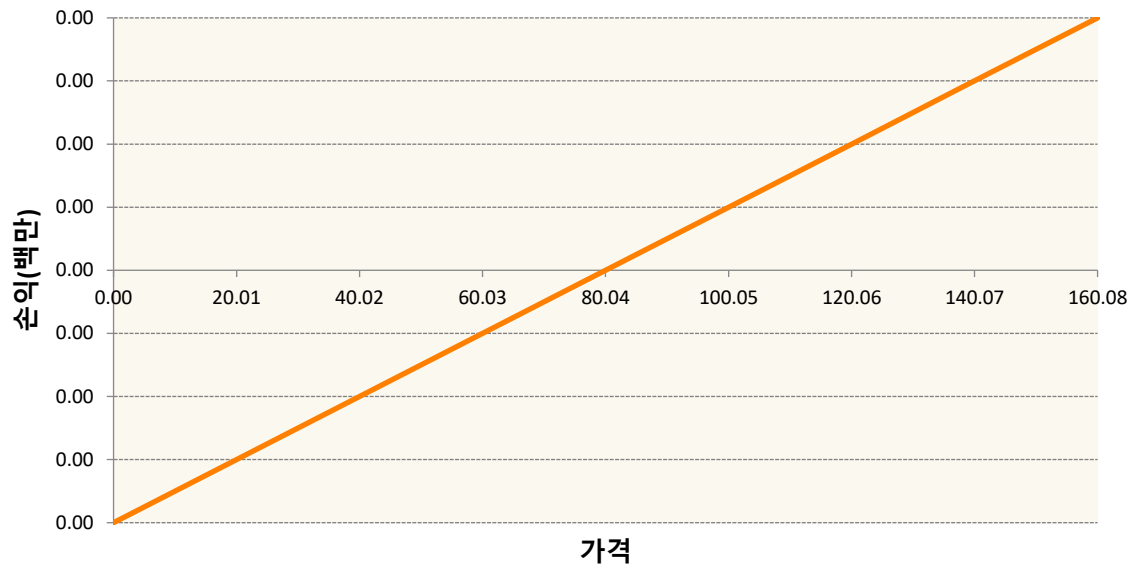
(단위:백만원)

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	1,587	272	1,316	

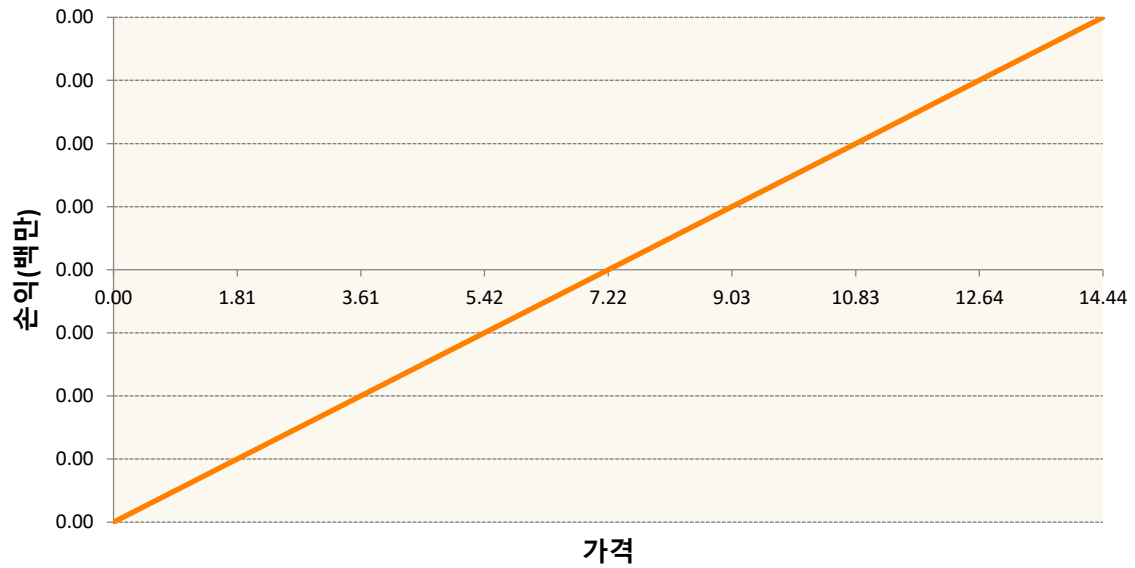
2. 만기시점의 손익구조



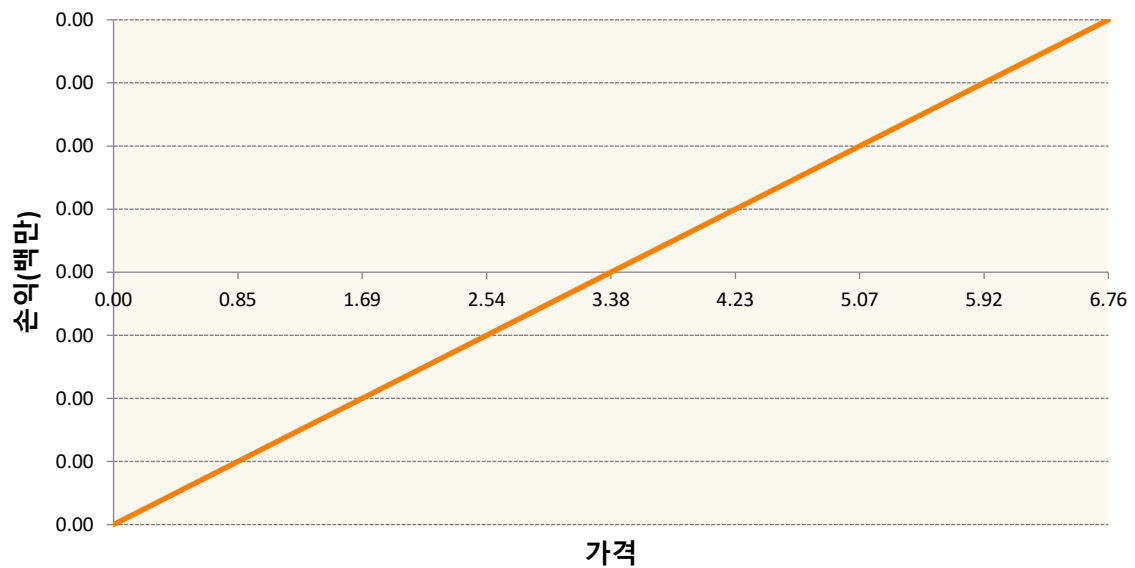
ECF3-E-mini Crude Oil Jan23



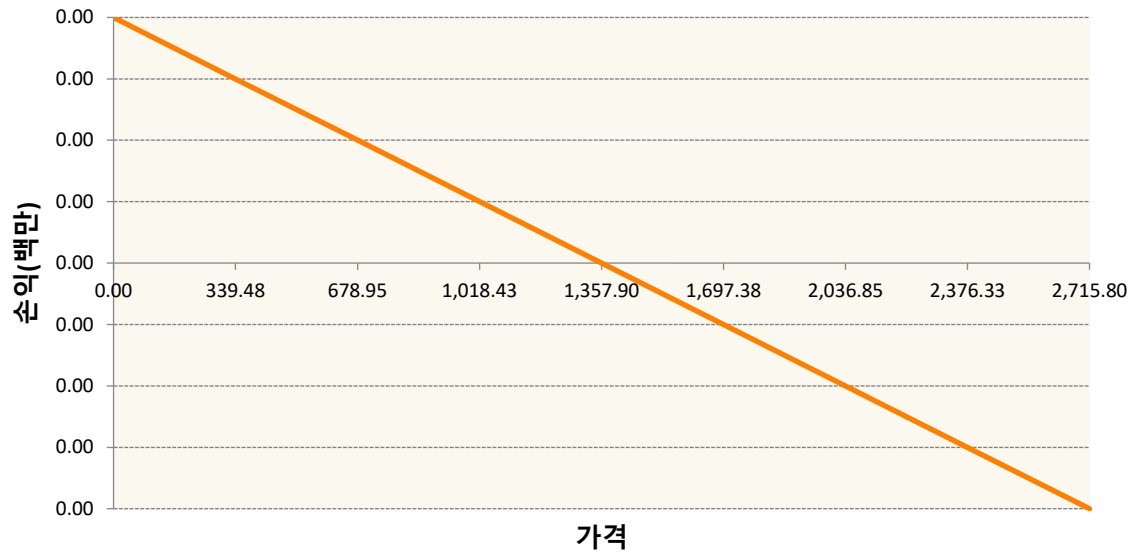
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



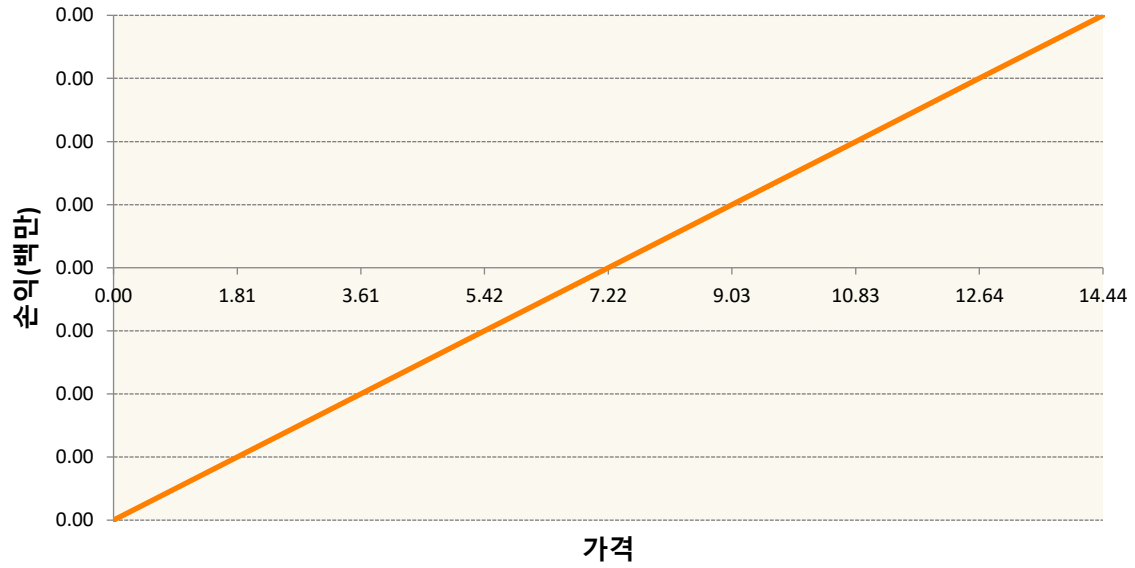
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



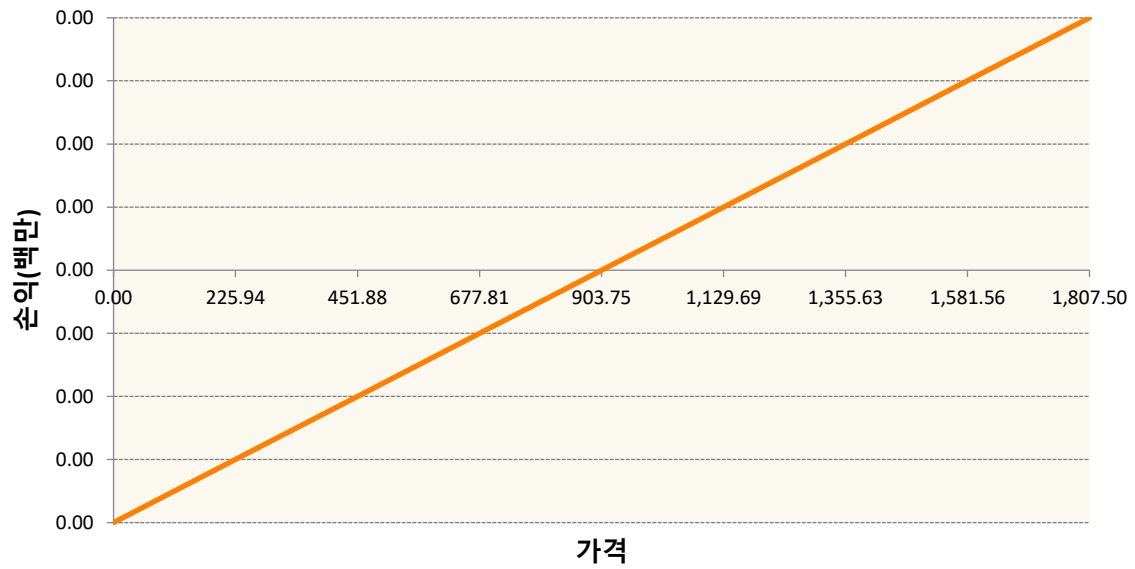
KR4175SC0000-2022-12 달러선물

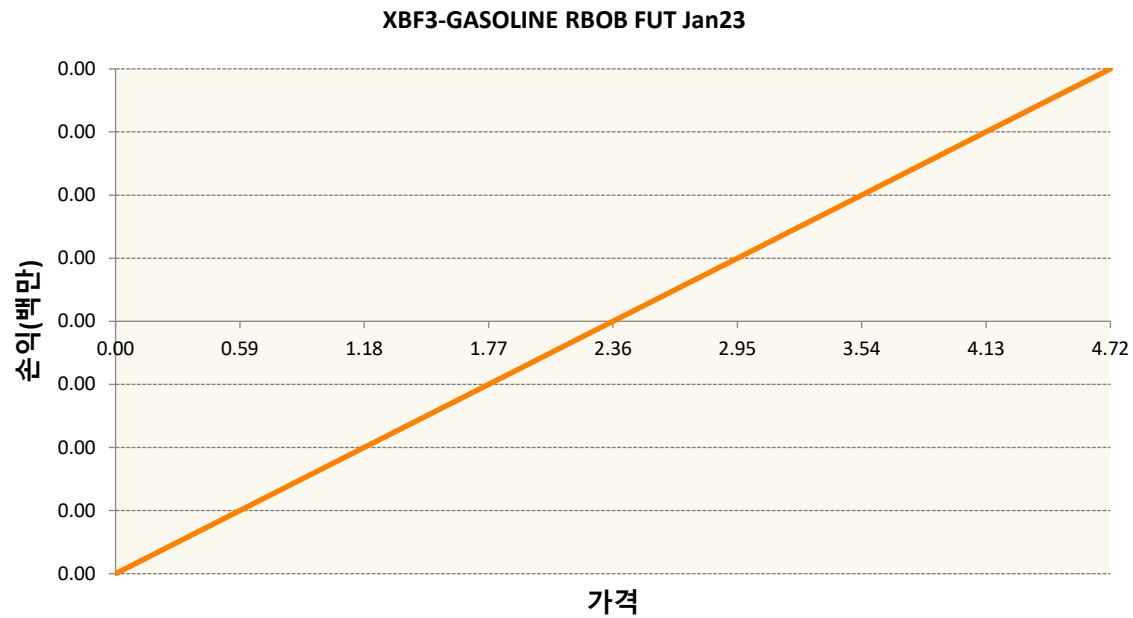


NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



QSF3-Low Su Gasoil G Jan23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF3	WTI CRUDE FUTURE Jan23	18
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	27
ECF3	E-mini Crude Oil Jan23	4
EOF3	E-MINI NATURAL GAS Jan23	8
HOF3	NY Harb ULSD Fut Jan23	16
KR4175SC00 2022-12 달러선물		22
NGF23	NATURAL GAS FUTR Jan23	49
QSF3	Low Su Gasoil G Jan23	10
XBF3	GASOLINE RBOB FUT Jan23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	492