

공시일 2022-12-05

기준일 2022-12-02

포커스농산물모(채권-파생형)

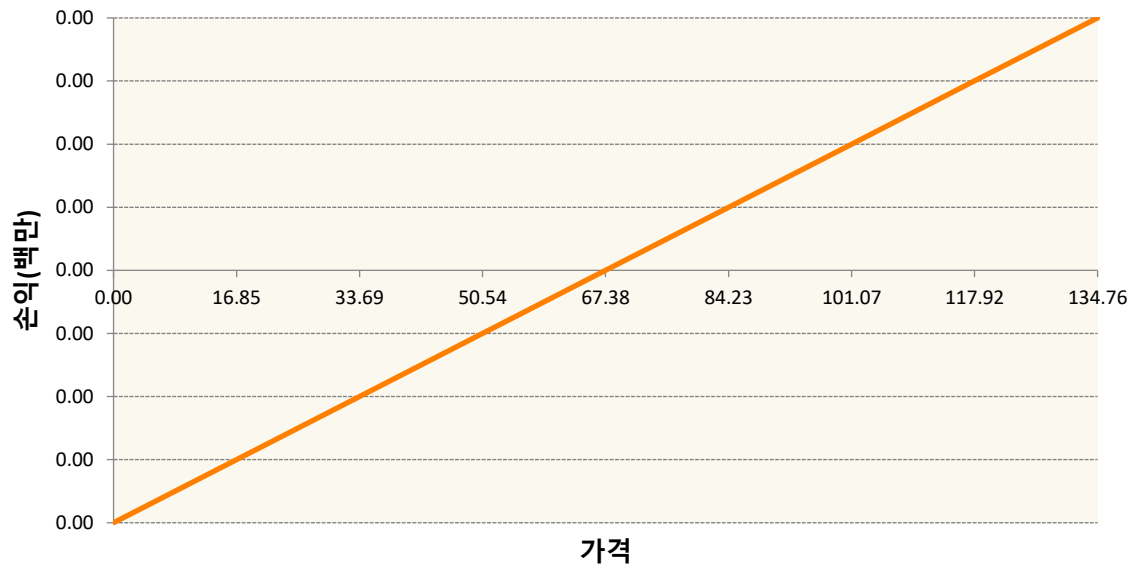
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

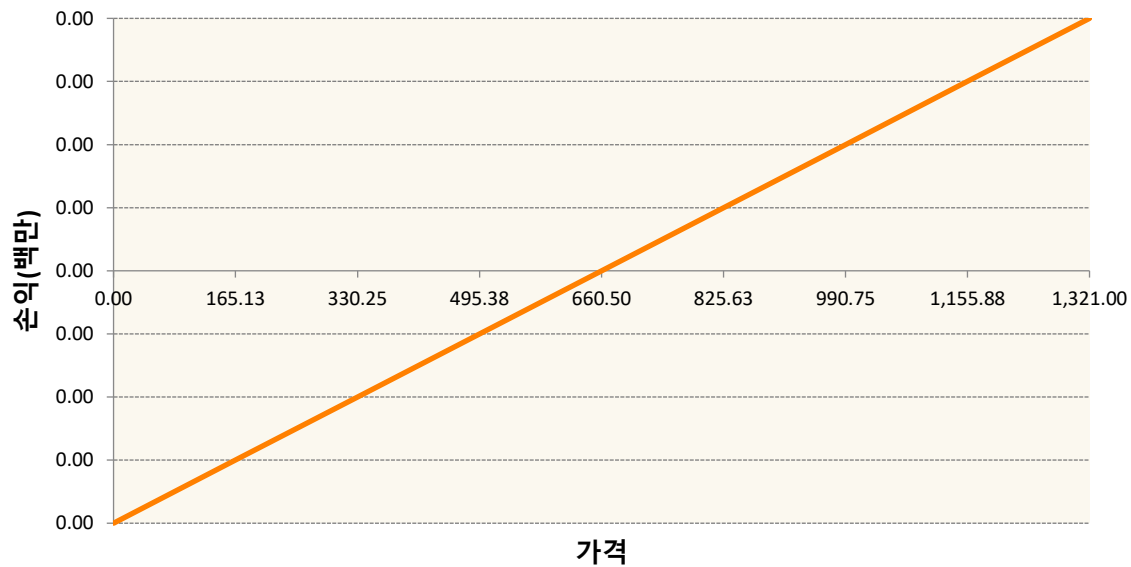
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,691	780	5,911	

2. 만기시점의 손익구조

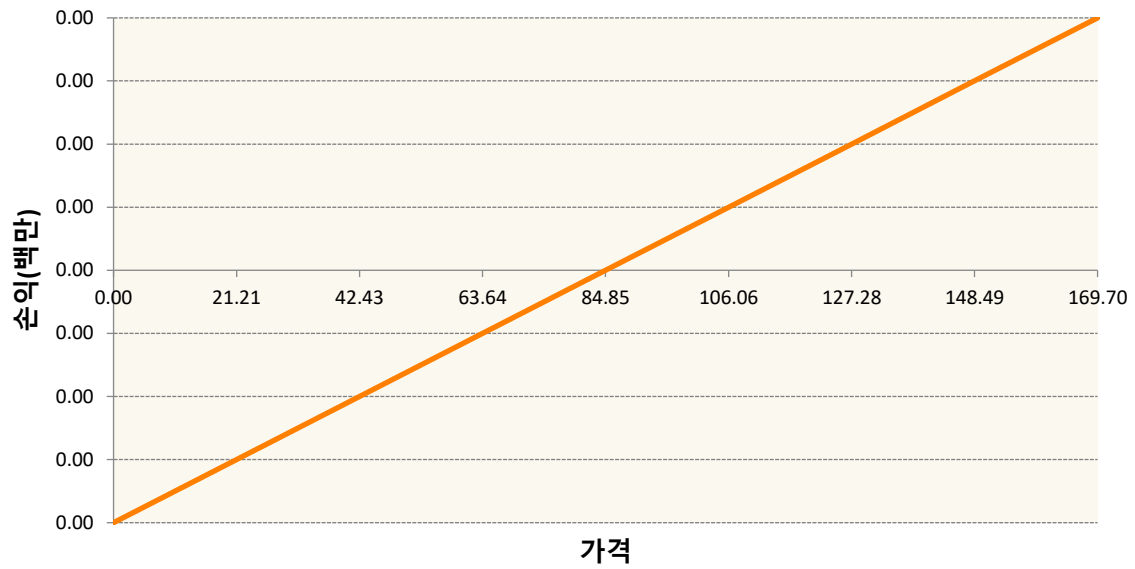
BOF3-SOYBEAN OIL FUTR Jan23



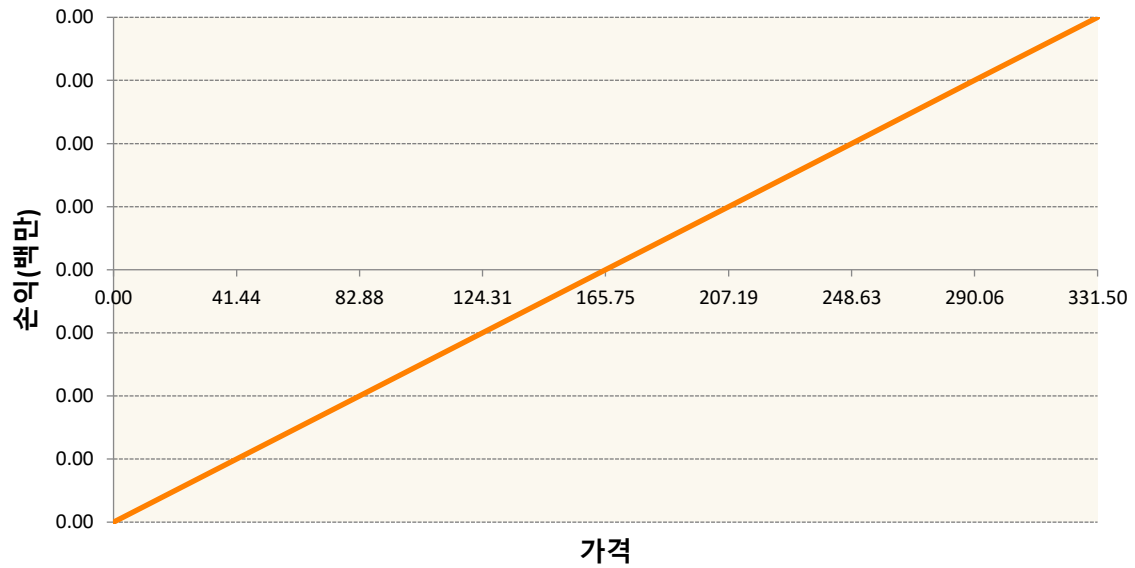
CH3-CORN FUTURE Mar23



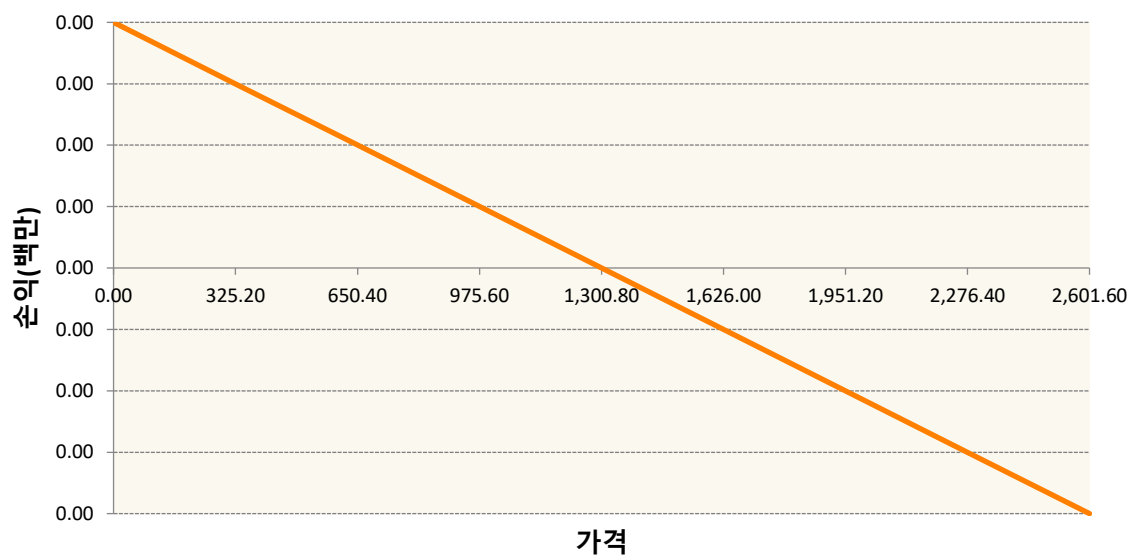
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



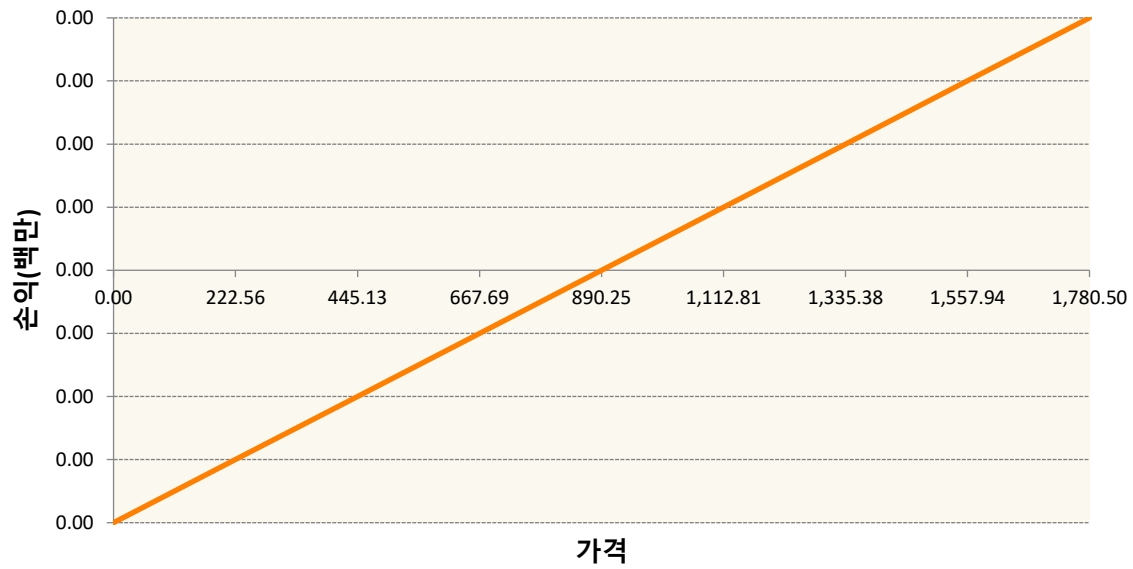
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



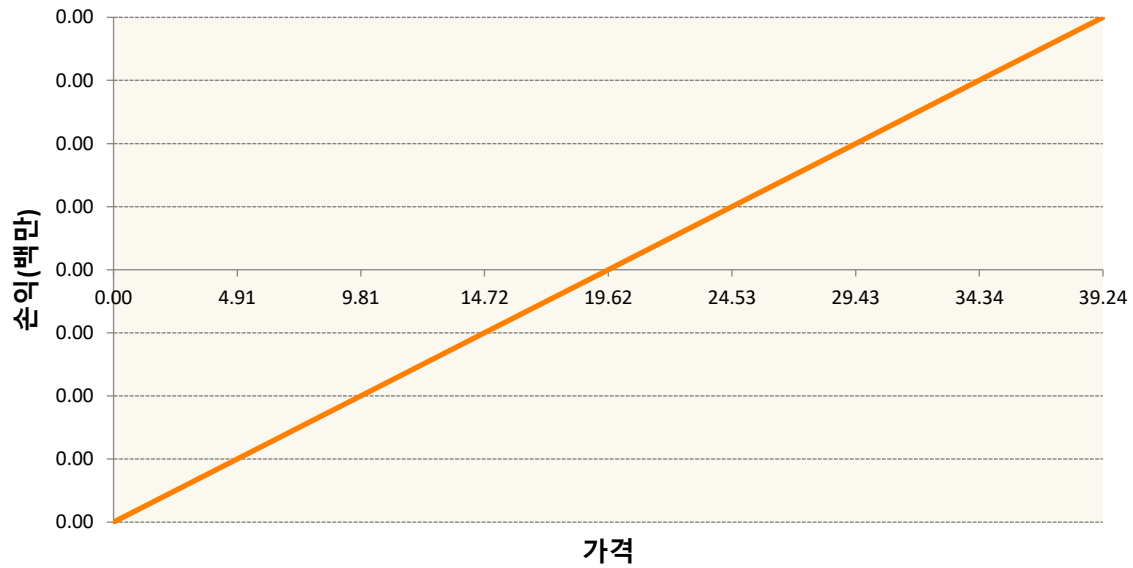
KR4175SC0000-2022-12 달러선물



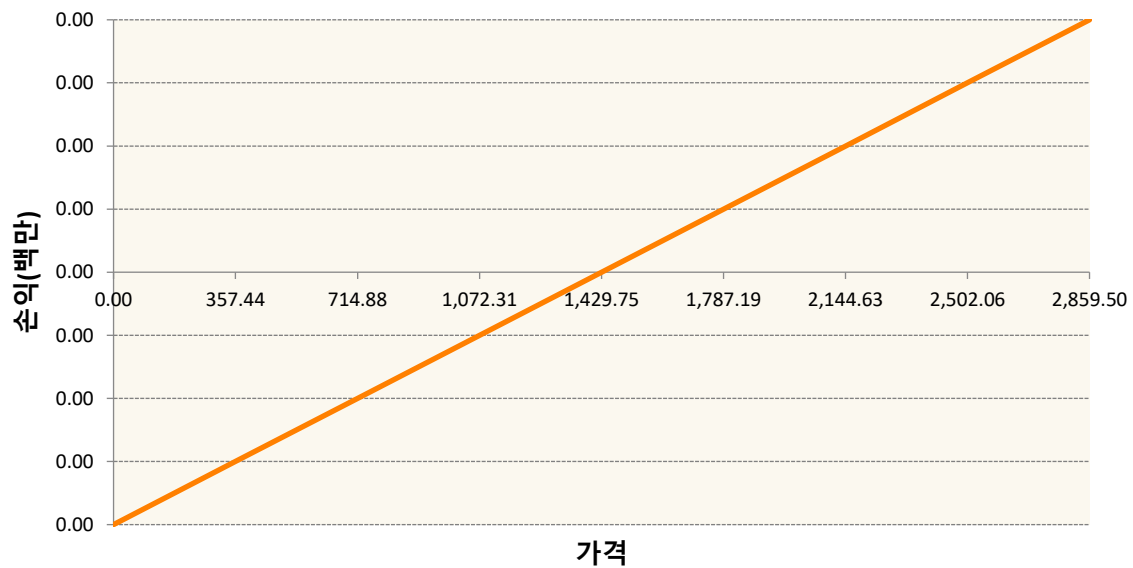
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



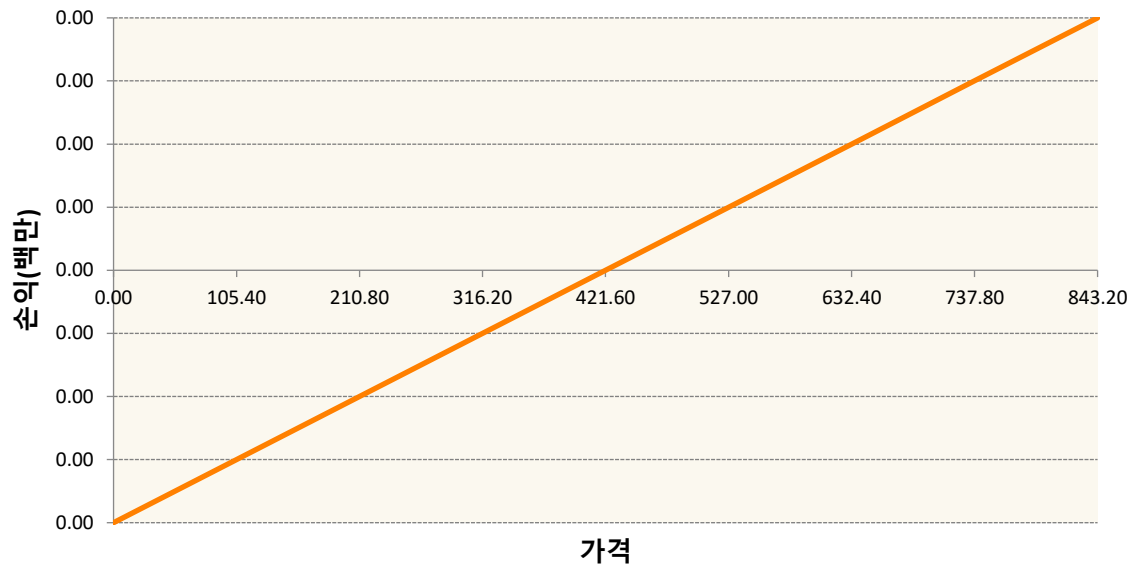
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



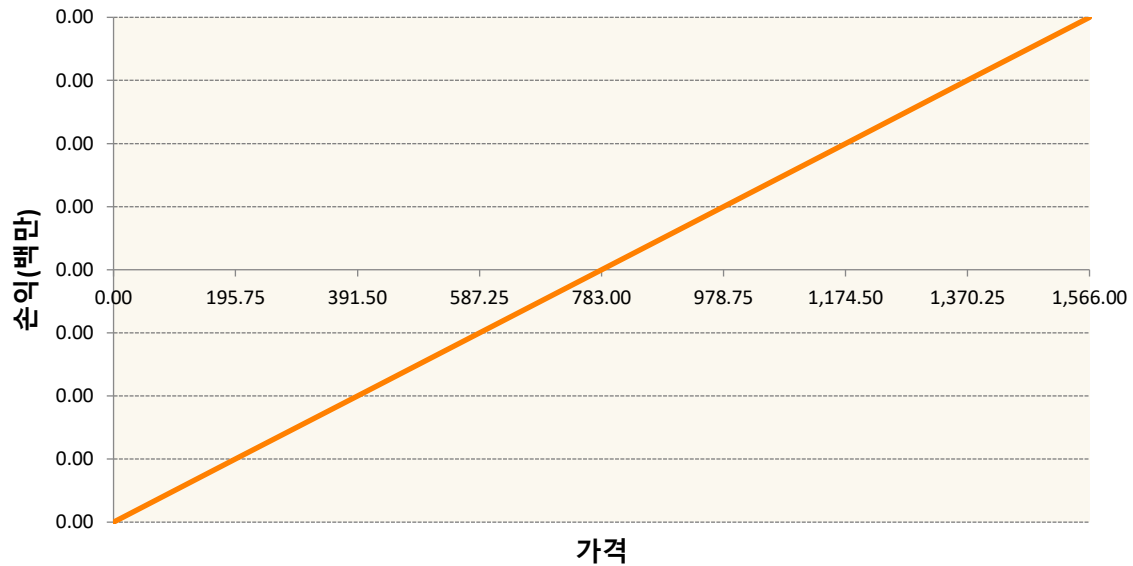
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



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	2022-12-05
기준일	2022-12-02

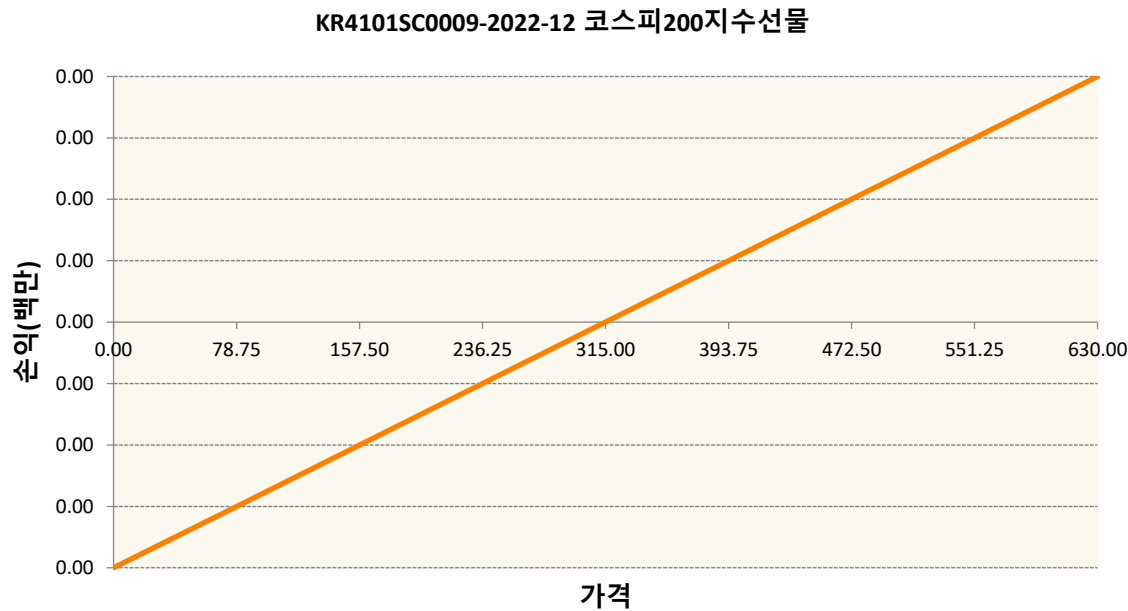
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	236	0	236	장내
누계	유가증권	선물	1,654	0	1,654	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-5.33%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	44	44	44	44	44	44	44
5.33%	88	88	88	88	88	88	88
8.00%	132	132	132	132	132	132	132

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

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)

486

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

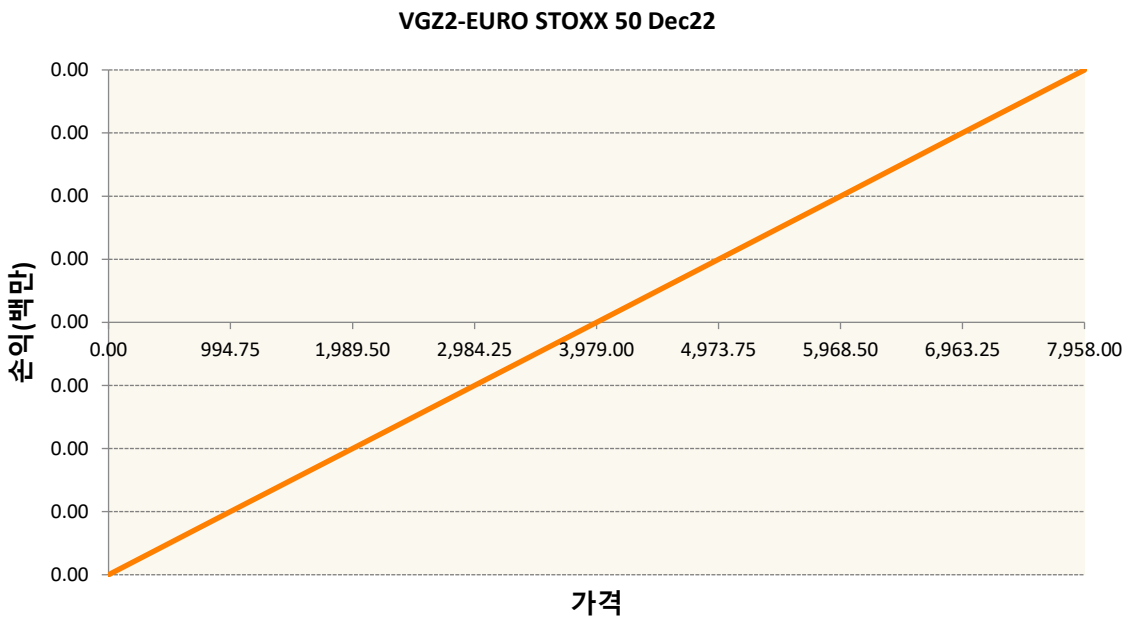
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	550	0	550	

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	2022-12-05
기준일	2022-12-02

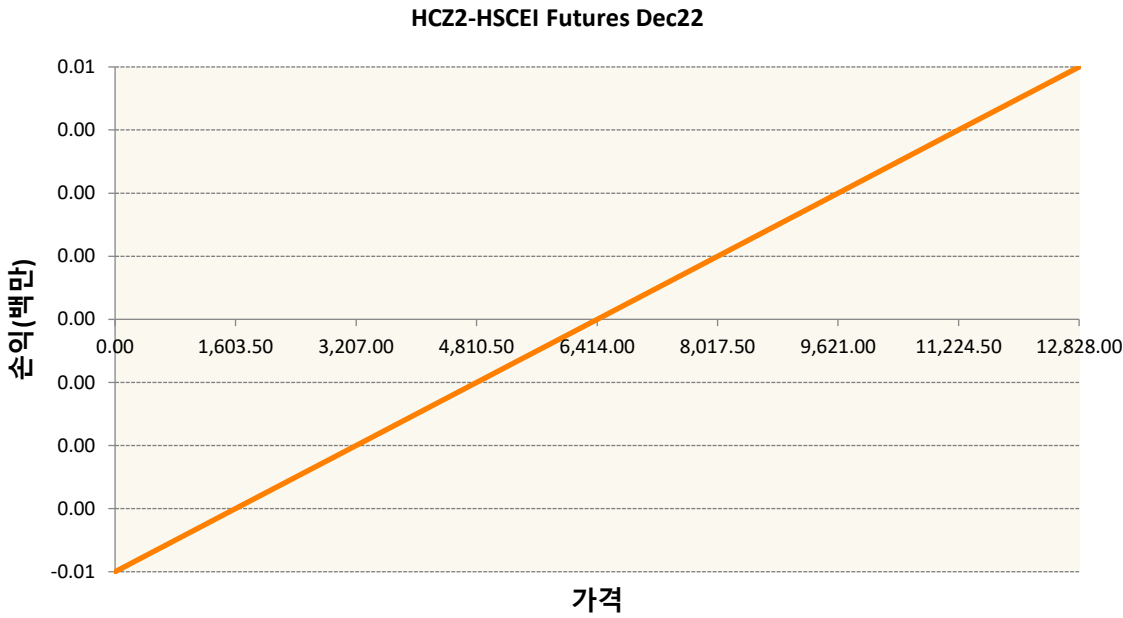
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,196	0	1,196	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ2	HSCEI Futures Dec22	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

129

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

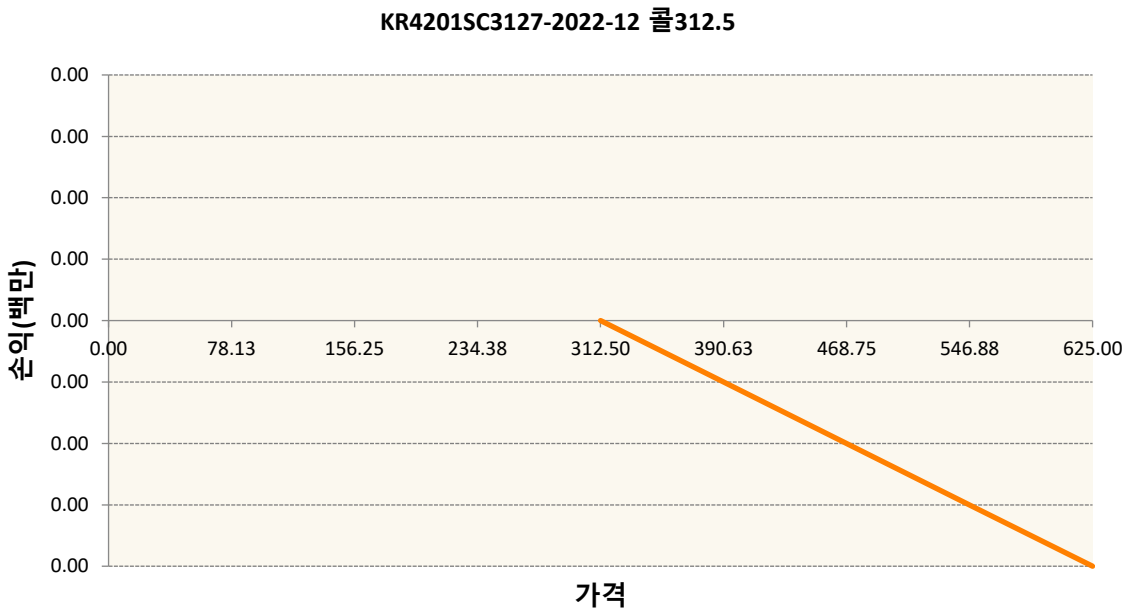
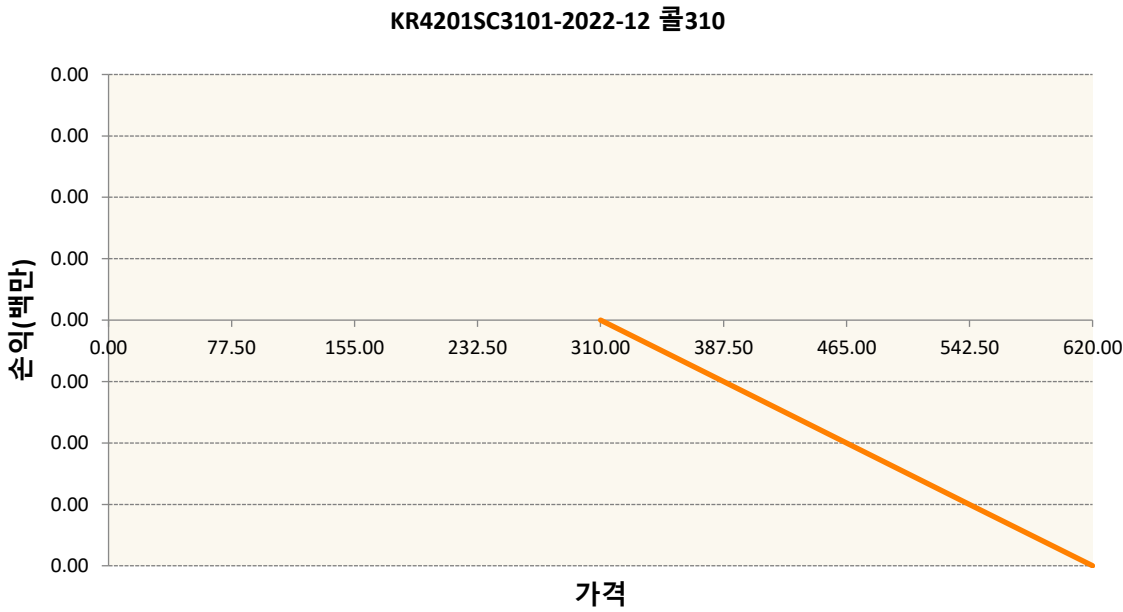
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	53,979	-53,979	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 620.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line is plotted, starting at (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

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 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
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			1,829
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	902	878	849	817	782	745	706
-5.33%	792	749	703	656	607	557	506
-2.67%	559	502	445	387	330	272	215
0%	170	114	57	0	-57	-115	-173
2.67%	-365	-408	-453	-500	-550	-600	-652
5.33%	-1,004	-1,029	-1,059	-1,092	-1,129	-1,168	-1,210
8.00%	-1,699	-1,711	-1,727	-1,747	-1,771	-1,798	-1,829
KR4201SC3127				2022-12 콜312.5			1,172
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	528	515	499	480	460	437	414
-5.33%	472	446	419	390	359	328	296
-2.67%	344	307	271	234	196	159	121
0%	117	78	39	0	-39	-78	-117
2.67%	-211	-243	-276	-311	-346	-381	-417
5.33%	-617	-638	-661	-686	-714	-742	-773
8.00%	-1,070	-1,080	-1,093	-1,110	-1,128	-1,149	-1,172
KR4301SC3100 2022-12 풋310							149

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-132	-135	-138	-142	-146	-149
-5.33%	-67	-72	-76	-81	-86	-91	-96
-2.67%	-17	-23	-29	-35	-40	-46	-52
0%	17	11	6	0	-6	-12	-17
2.67%	37	32	28	23	18	13	8
5.33%	46	43	40	37	33	29	25
8.00%	50	48	47	45	42	40	37

KR4301SC3126 2022-12 풋312.5							361
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-321	-326	-331	-338	-345	-352	-361
-5.33%	-173	-181	-191	-201	-211	-222	-233
-2.67%	-49	-61	-74	-87	-100	-113	-126
0%	40	27	13	0	-14	-27	-41
2.67%	95	84	72	60	48	36	23
5.33%	122	115	107	98	89	79	68
8.00%	133	130	125	120	113	106	98

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

(단위:백만원)

3,479

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

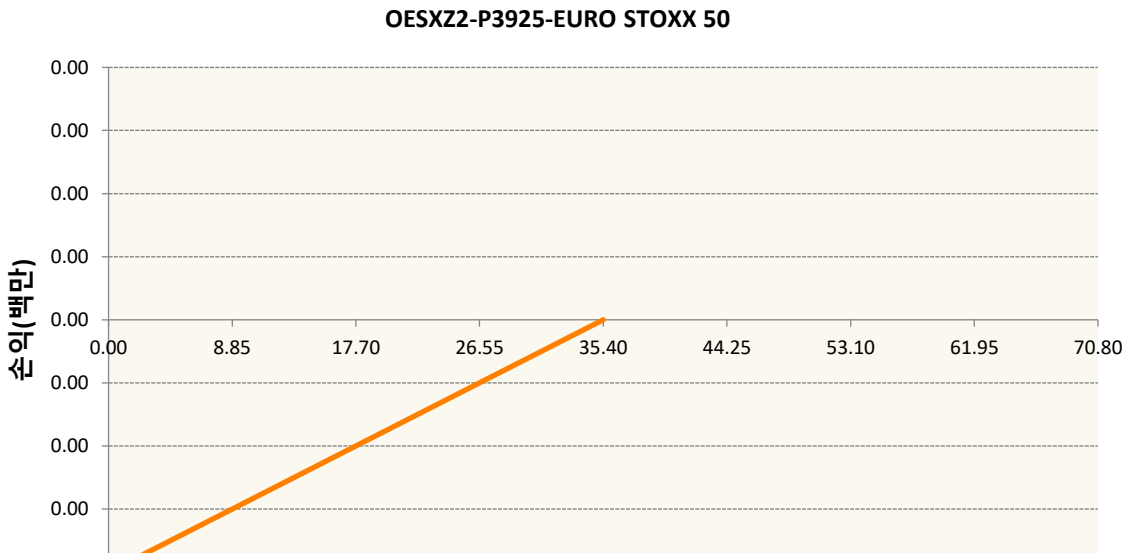
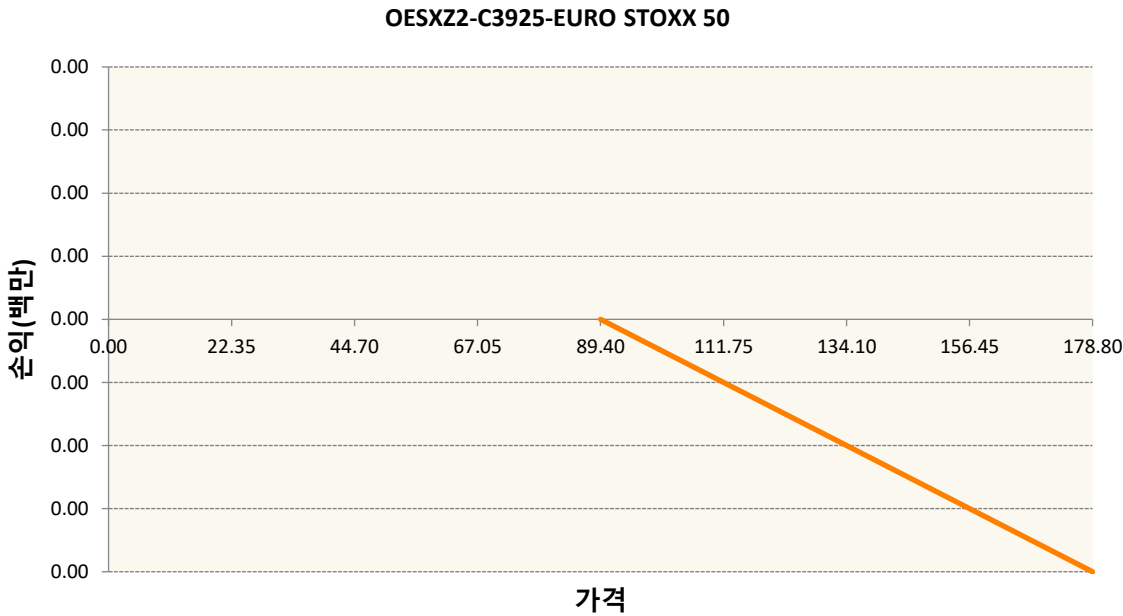
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

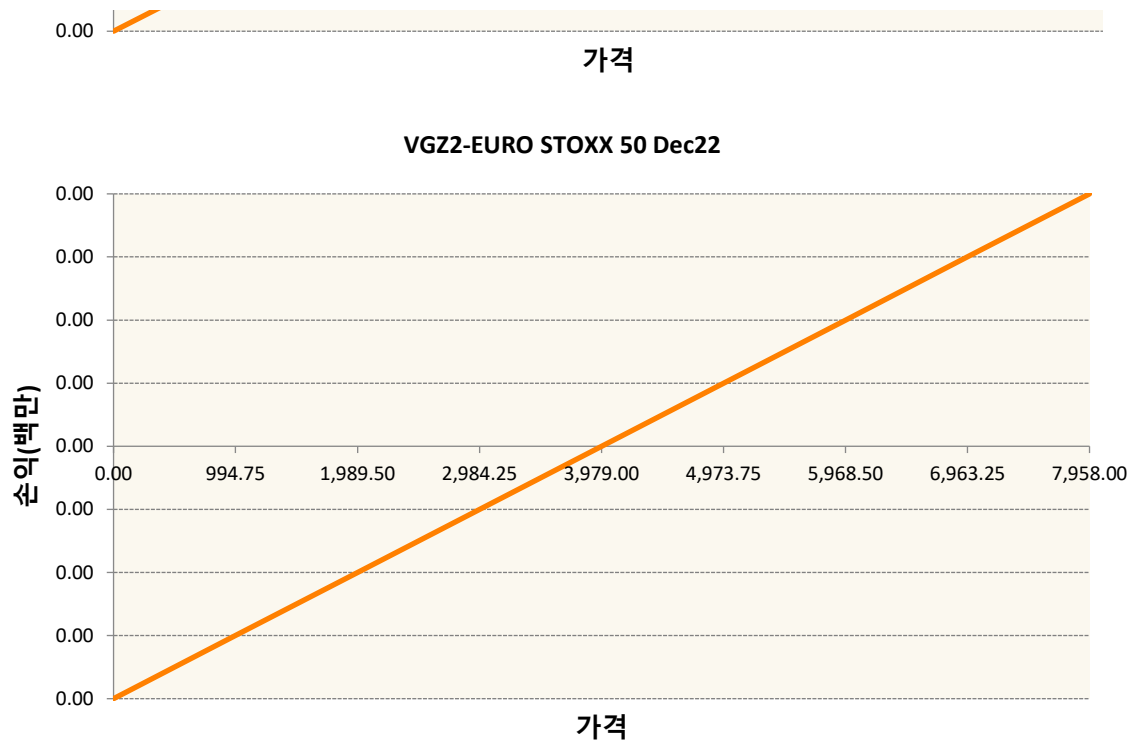
1. 계약금액

(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	1,113	0	1,113	
누계	유가증권	옵션	0	71	-71	장내
누계	통화	선도	137	2,259	-2,122	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E	55
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E	55
FXW213CBG KRW/EUR 24-02-23E	71
FXW213CBN EUR/KRW 24-02-23E	11
OESXZ2-C39 EURO STOXX 50	4
OESXZ2-P39 EURO STOXX 50	2
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	89

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

(단위:백만원)

240

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

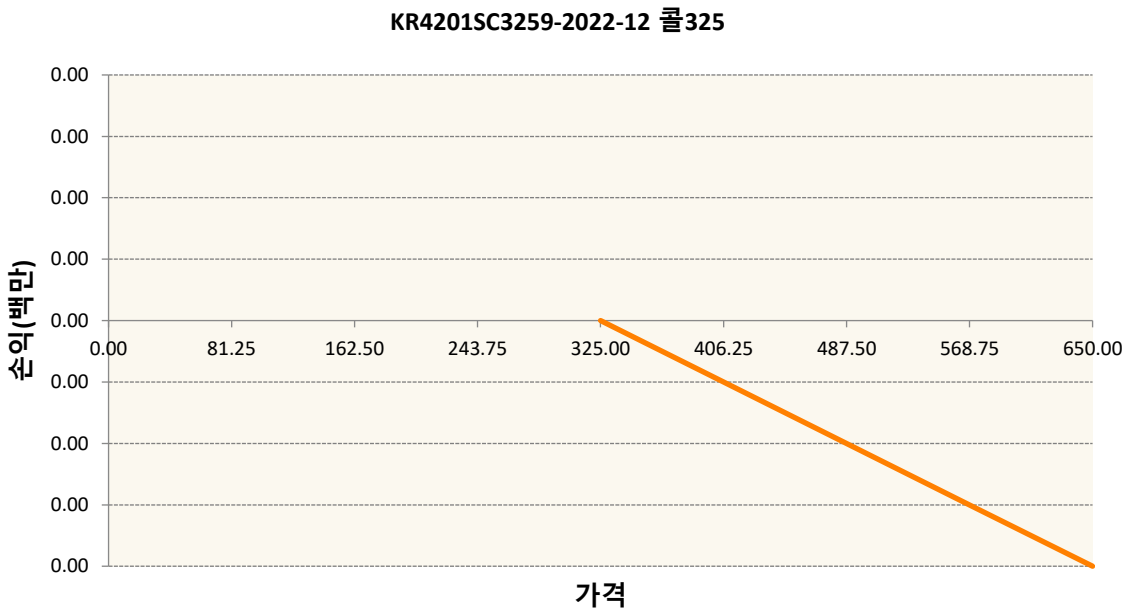
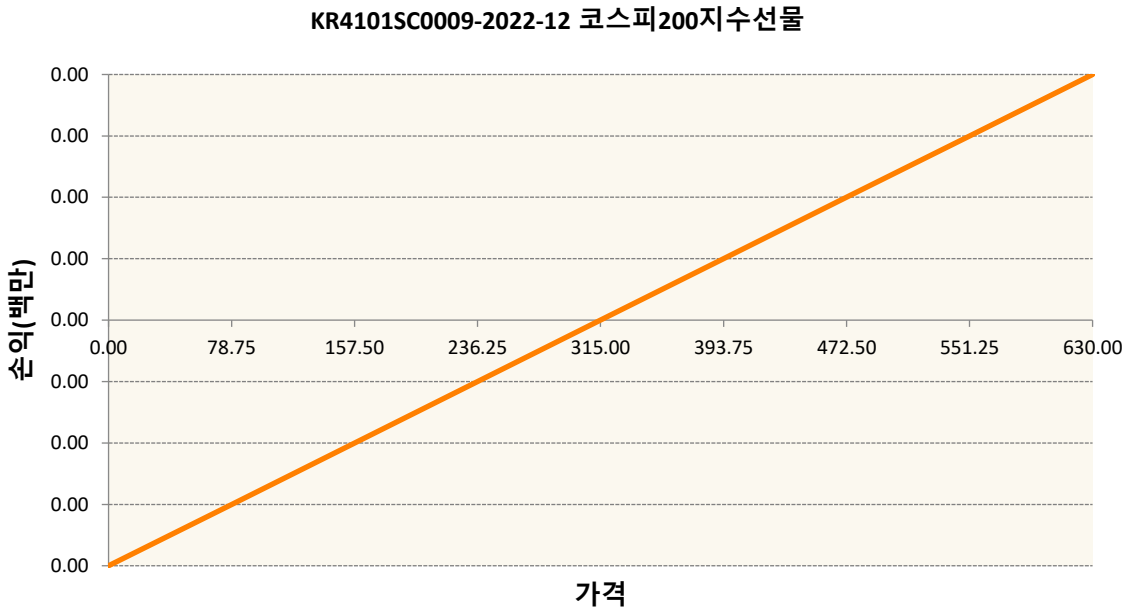
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

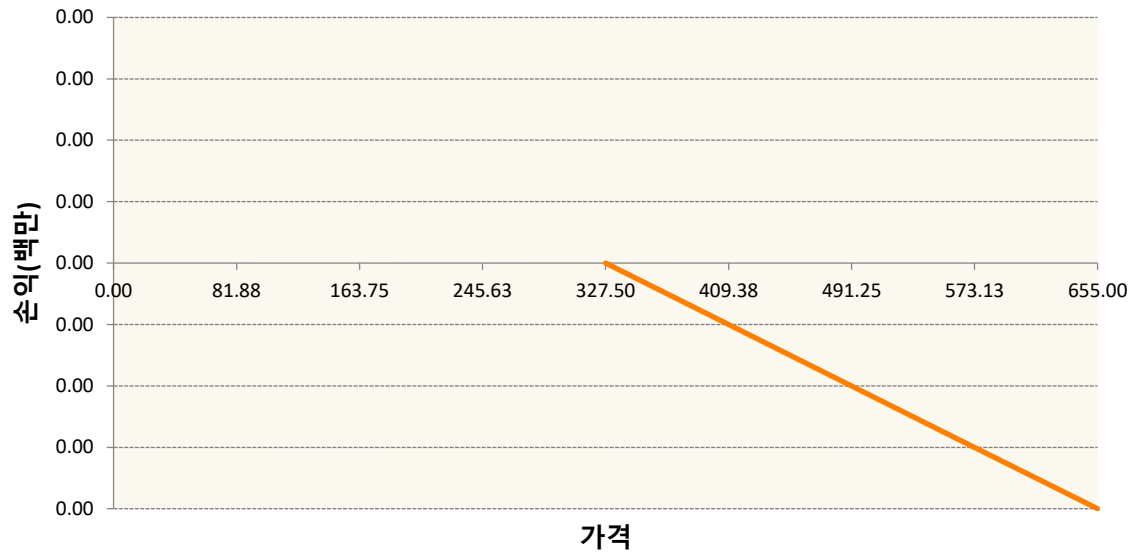
(단위:백만원)

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	394	0	394	장내
누계	유가증권	옵션	311	3,839	-3,528	장내

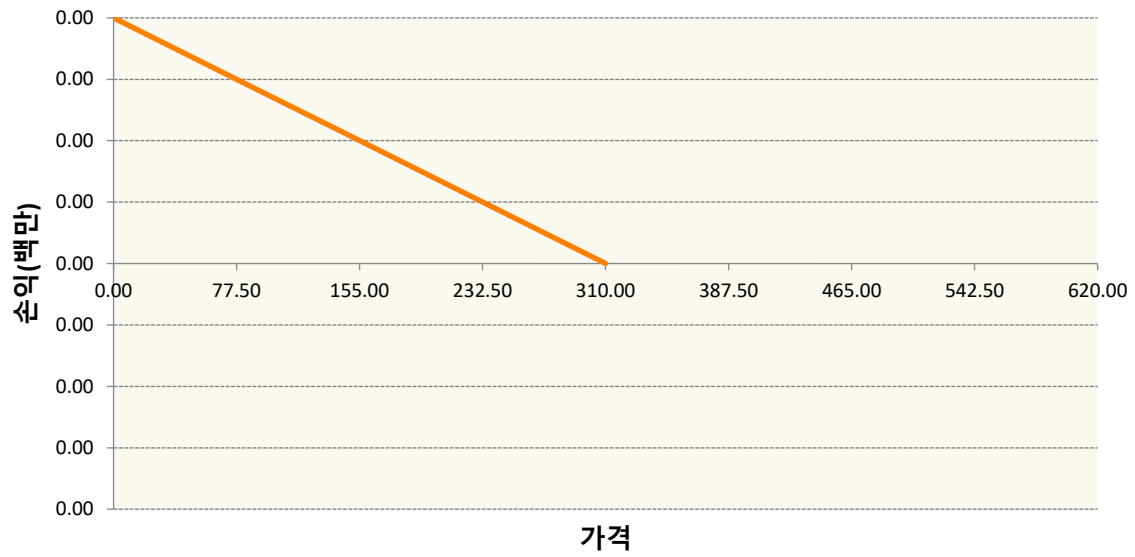
2. 만기시점의 손익구조



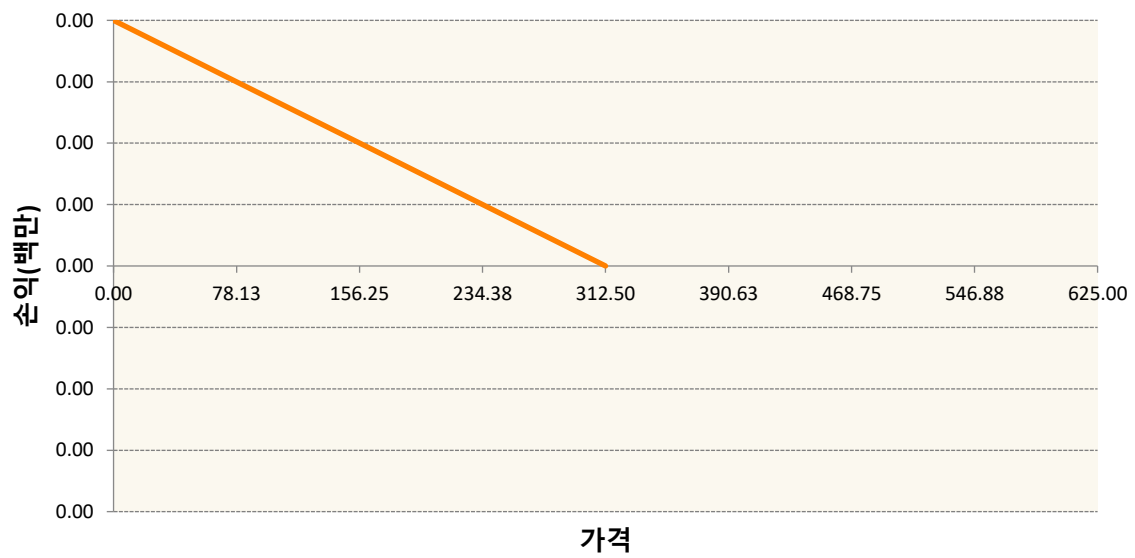
KR4201SC3275-2022-12 콜327.5



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		59	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	16	16	15	15	14	14	13			
-5.33%	15	15	14	13	12	10	9			
-2.67%	13	11	10	8	6	5	3			
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7			
2.67%	-5	-8	-10	-13	-15	-18	-21			
5.33%	-23	-26	-28	-31	-33	-36	-38			
8.00%	-47	-49	-51	-53	-55	-57	-59			
KR4201SC3275							2022-12 콜327.5		119	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	28	28	28	27	26	24	23			
-5.33%	27	26	25	23	21	19	16			
-2.67%	24	21	18	15	12	8	4			
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15			
2.67%	-8	-13	-19	-24	-30	-35	-41			
5.33%	-42	-48	-53	-59	-65	-70	-76			
8.00%	-90	-94	-99	-104	-109	-114	-119			
KR4301SC3100							2022-12 풋310		9	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	7	8	8	8	8	8	9			
-5.33%	4	4	4	5	5	5	5			
-2.67%	1	1	2	2	2	3	3			
0%	-1	-1	0	0	0	1	1			
2.67%	-2	-2	-2	-1	-1	-1	0			
5.33%	-3	-2	-2	-2	-2	-2	-1			
8.00%	-3	-3	-3	-3	-2	-2	-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%	8	8	8	8	9	9	9
-5.33%	4	5	5	5	5	6	6
-2.67%	1	2	2	2	2	3	3
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-2	-2	-1	-1	-1
5.33%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-2
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-2

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

(단위:백만원)

199

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

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	6,703	0	6,703	

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	2022-12-05
기준일	2022-12-02

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	5,779	0	5,779	

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	2022-12-05
기준일	2022-12-02

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	18,480	0	18,480	
누계	통화	선도	0	18,166	-18,166	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	484
FXW213CAR(KRW/USD 30-01-23E	269
FXW213CBQ(KRW/USD 28-02-23E	665
FXW213CBW(KRW/USD 28-12-22E	36
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

746

공시일 2022-12-05

기준일 2022-12-02

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

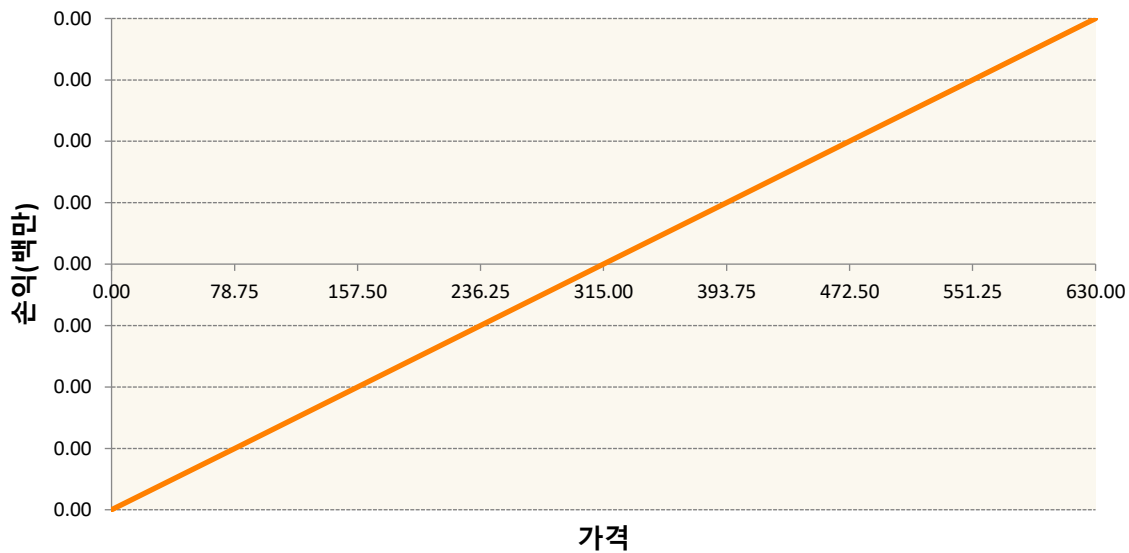
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	473	0	473	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009				2022-12 코스피200지수선물				38
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	13	13	13	13	13	13	13	
5.33%	25	25	25	25	25	25	25	
8.00%	38	38	38	38	38	38	38	

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	274	274	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9MKRW/EUR 23-12-22E	22
FXW213CBE(EUR/KRW 23-12-22E	22

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

(단위:백만원)

32

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

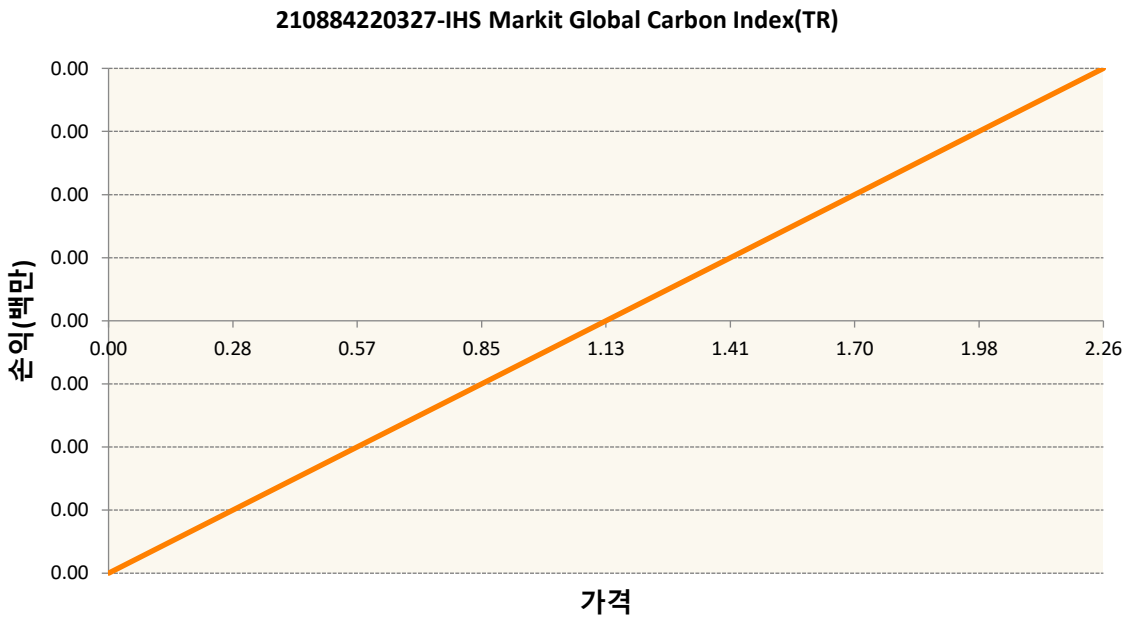
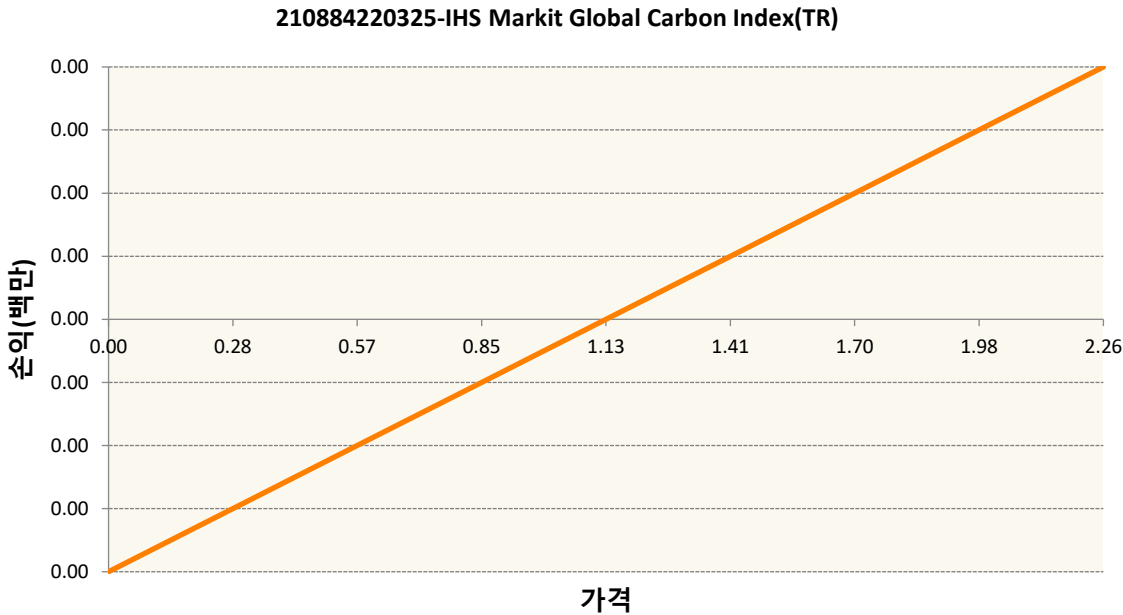
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

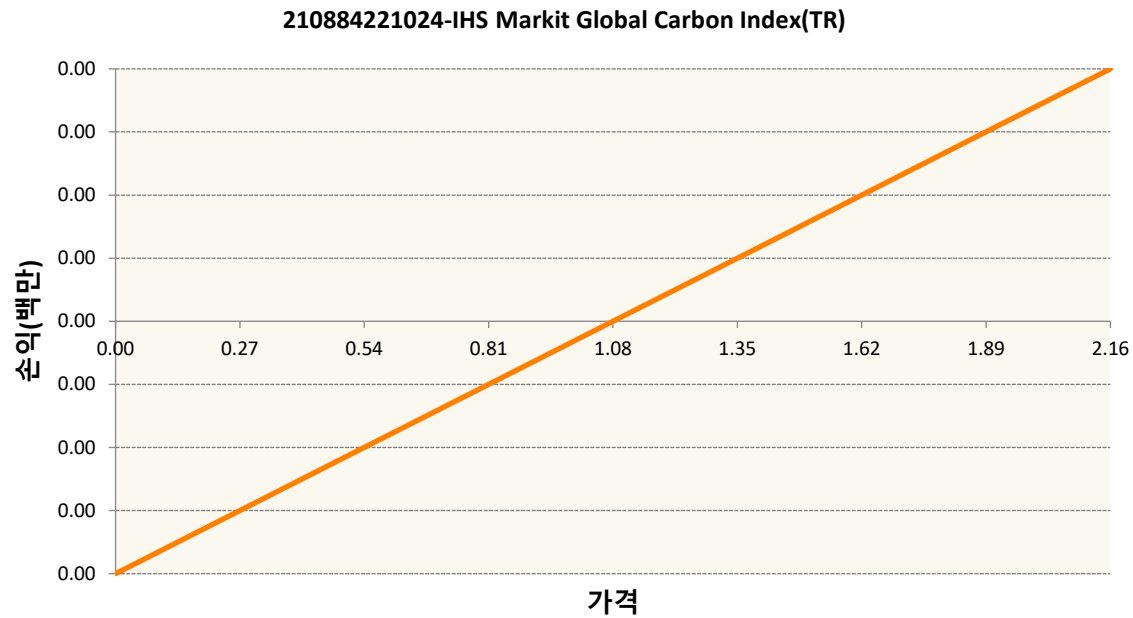
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	30,436	0	30,436	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		196
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		98
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		2,146

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		4,718

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

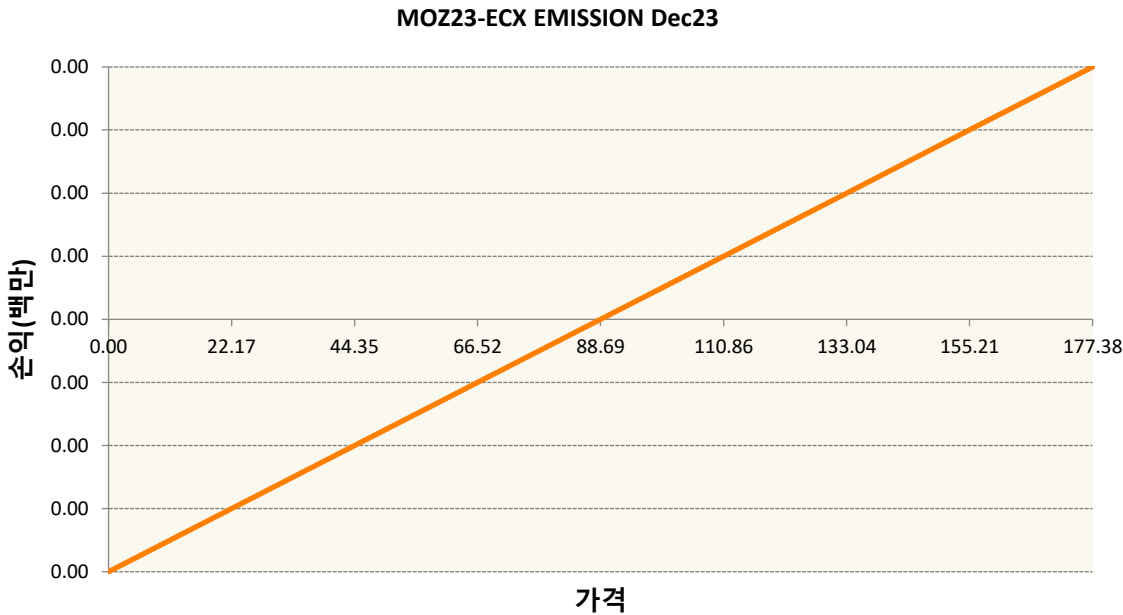
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,933	0	15,933	
누계	통화	선도	0	6,401	-6,401	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CBP(KRW/EUR 23-12-22E	359
FXW213CC1(KRW/EUR 23-12-22E	153
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,275

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

(단위:백만원)

3,654

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

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)	28
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	28
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	28
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	28

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

(단위:백만원)

219

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

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)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	1

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

(단위:백만원)

4

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

에쿼티알파일반사모혼합자산

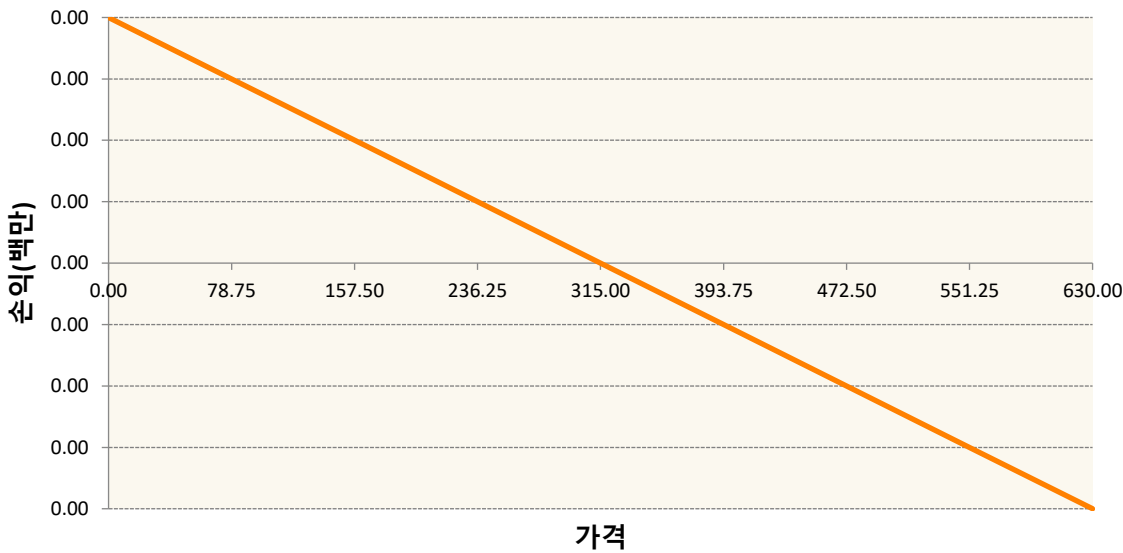
1. 계약금액

(단위:백만원)

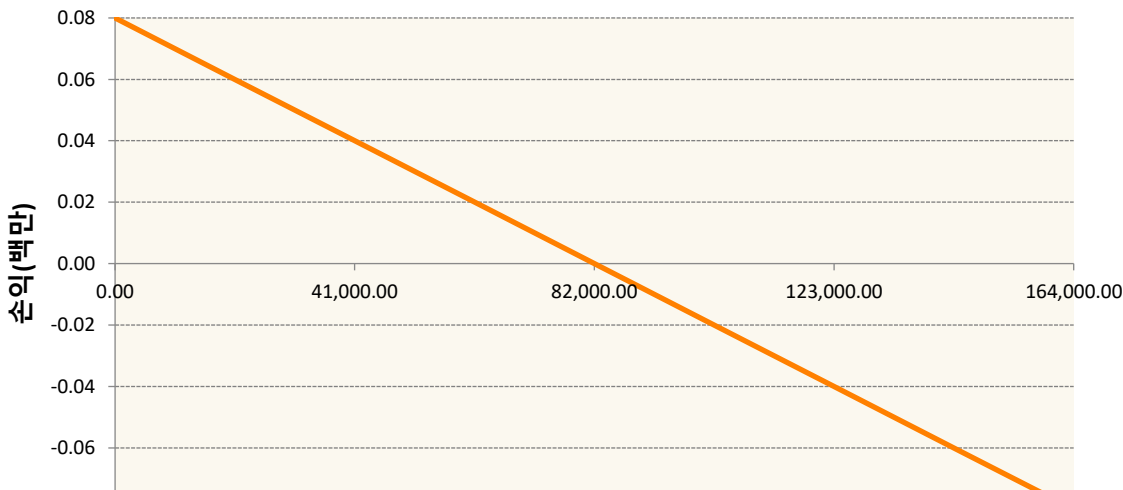
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,181	-1,181	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	0	369	-369	장외

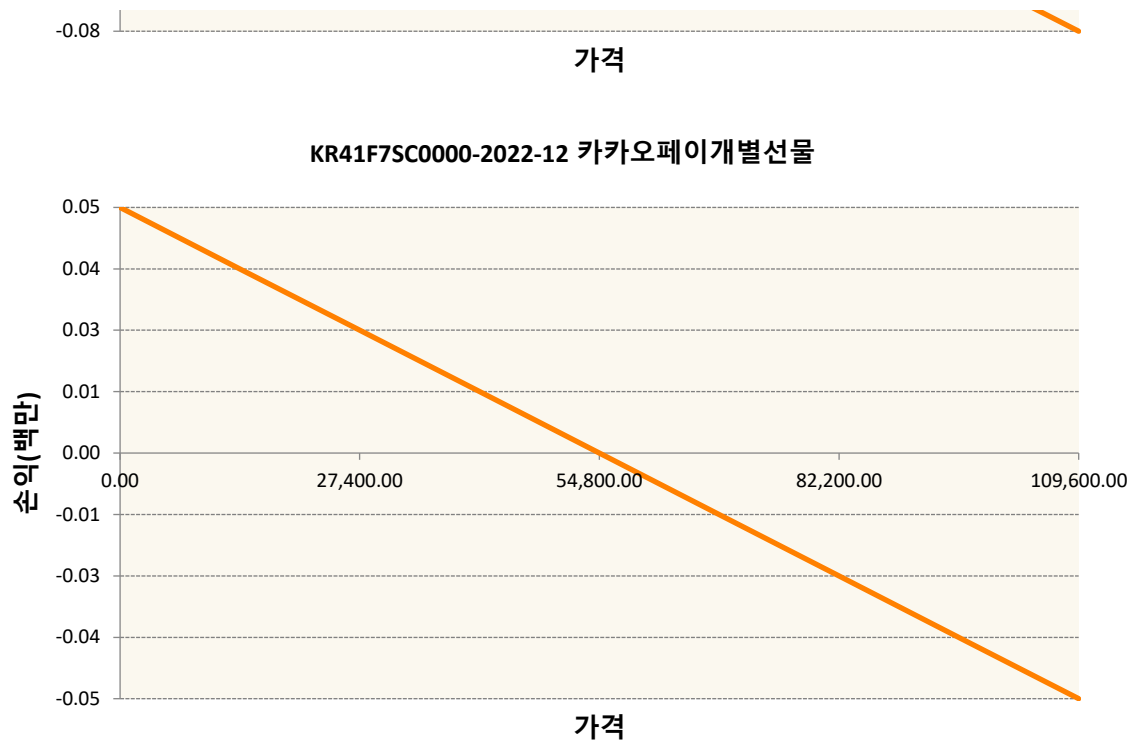
2. 만기시점의 손익구조

KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



KR4150SC0009-2022-12 SK하이닉스개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물	95
KR4150SC00 2022-12 SK하이닉스개별선물	16
KR41F7SC00 2022-12 카카오페이개별선물	13
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.48
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.49

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

(단위:백만원)

189

공시일 2022-12-05

기준일 2022-12-02

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

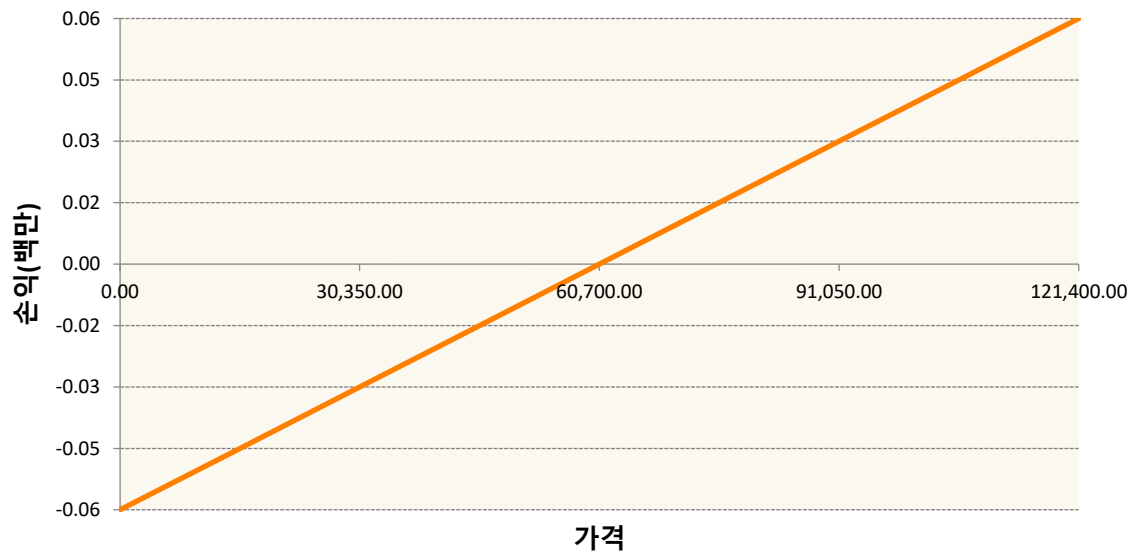
1. 계약금액

(단위:백만원)

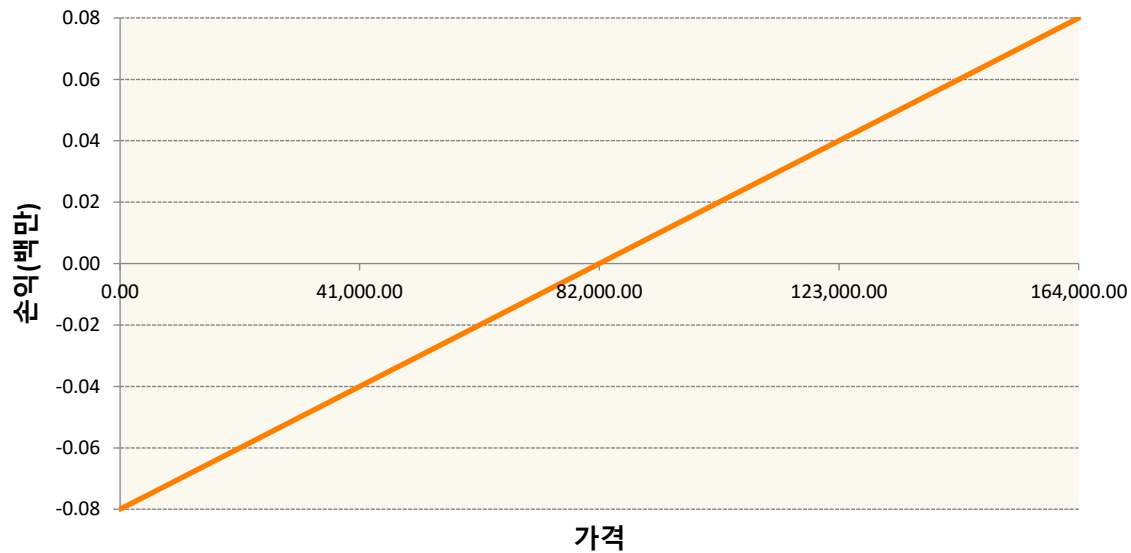
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	97	0	97	장내
누계	유가증권	ELS	49	0	49	장외

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	

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

9

공시일	2022-12-05
기준일	2022-12-02

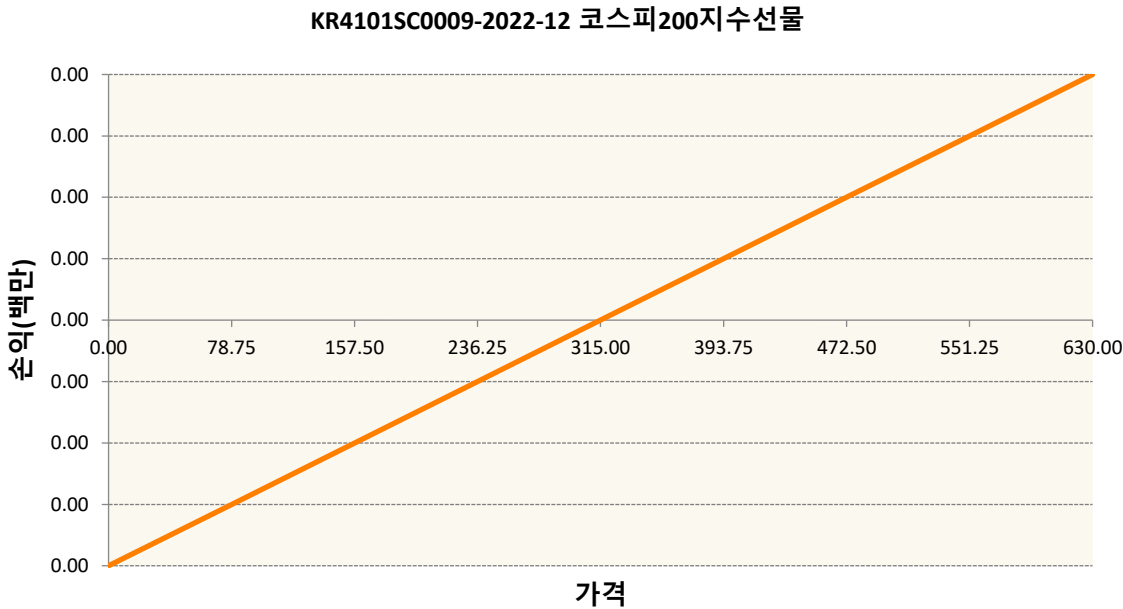
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	236	0	236	장내
누계	유가증권	선물	788	0	788	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-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%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	63	63	63	63	63	63	63

공시일 2022-12-05

기준일 2022-12-02

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

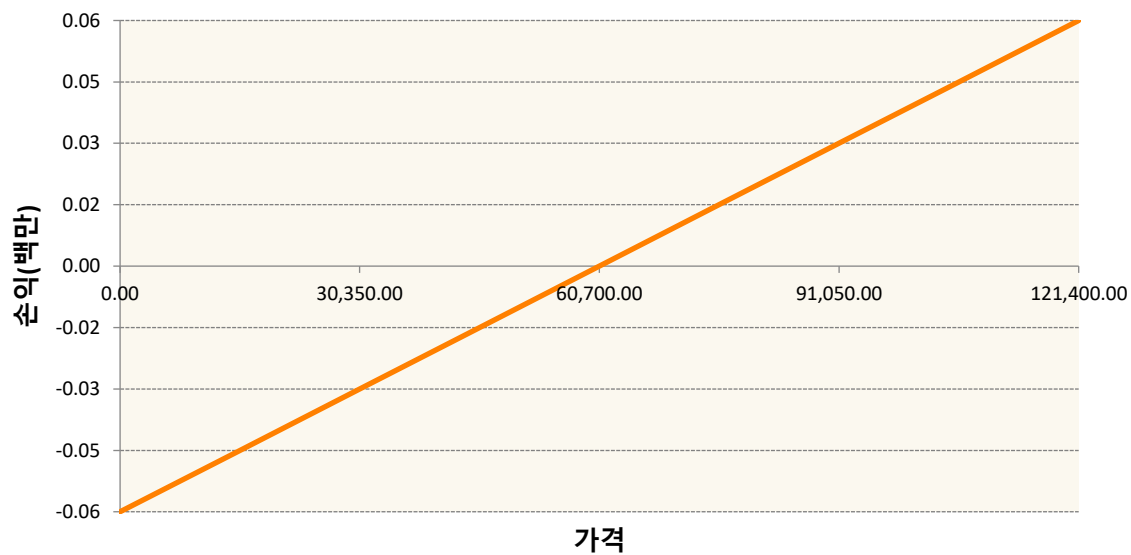
1. 계약금액

(단위:백만원)

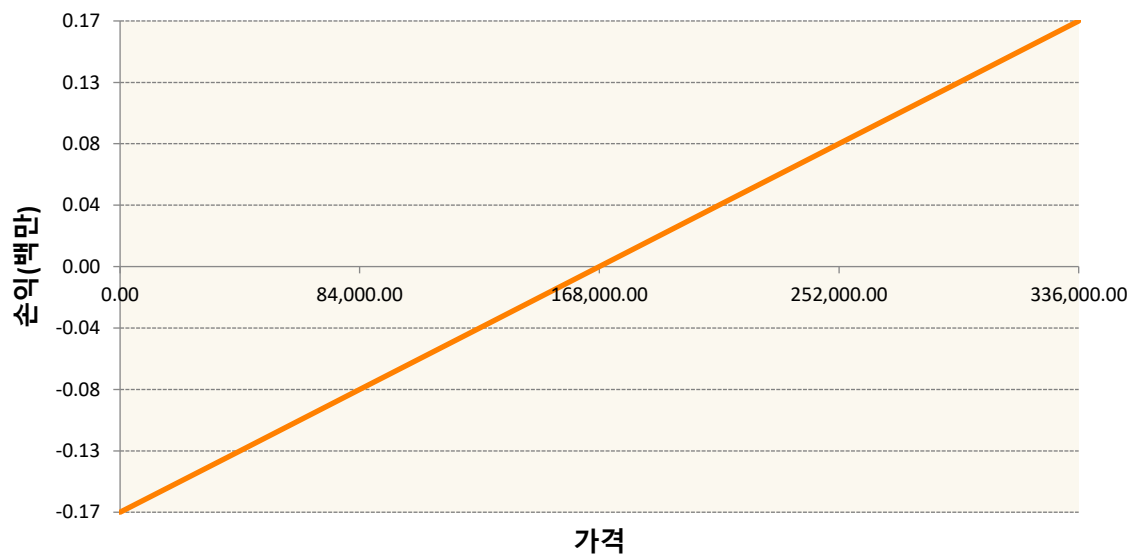
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	300	0	300	장내

2. 만기시점의 손익구조

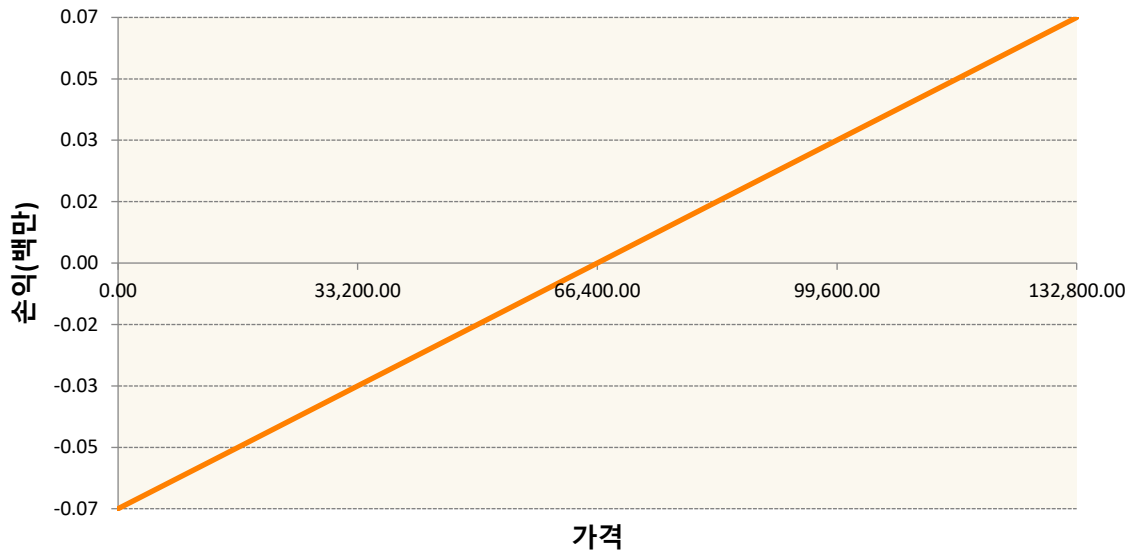
KR4111SC0007-2022-12 삼성전자개별선물



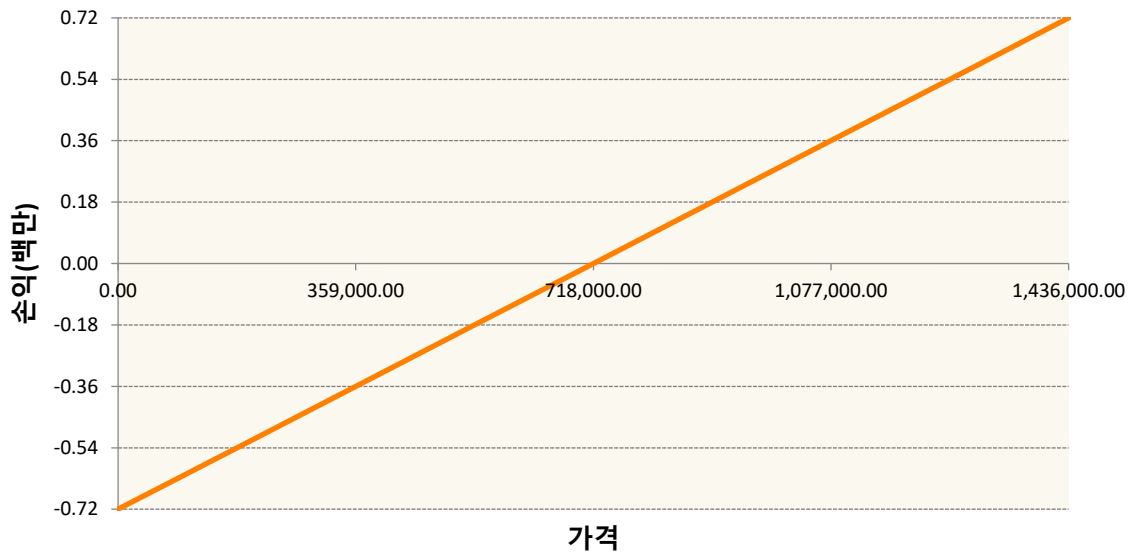
KR4116SC0002-2022-12 현대차개별선물



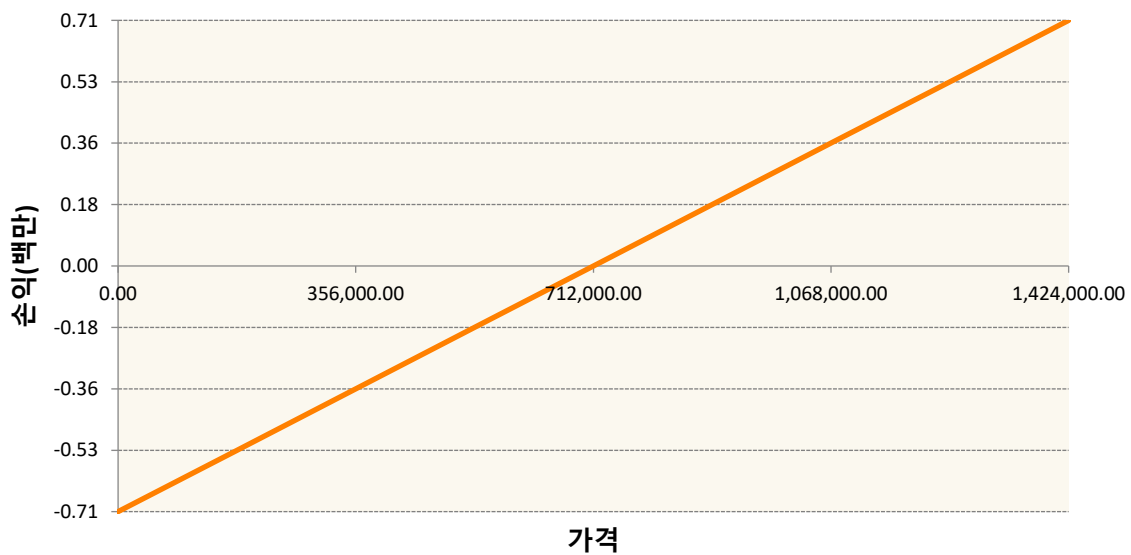
KR4119SC0009-2022-12 기아차개별선물



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%	-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)

28

공시일 2022-12-05

기준일 2022-12-02

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

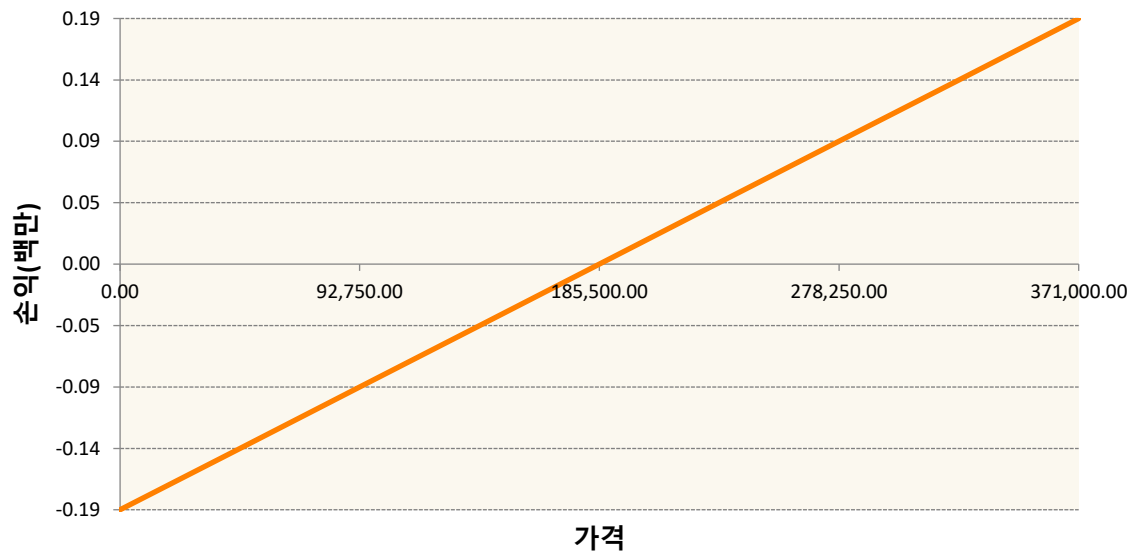
1. 계약금액

(단위:백만원)

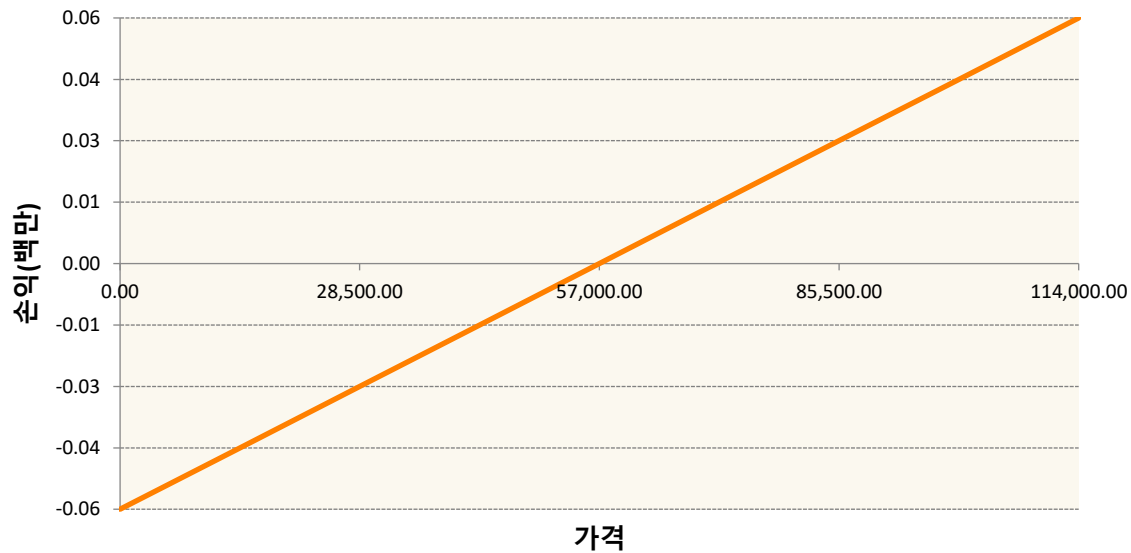
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	116	0	116	장내

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	2022-12-05
기준일	2022-12-02

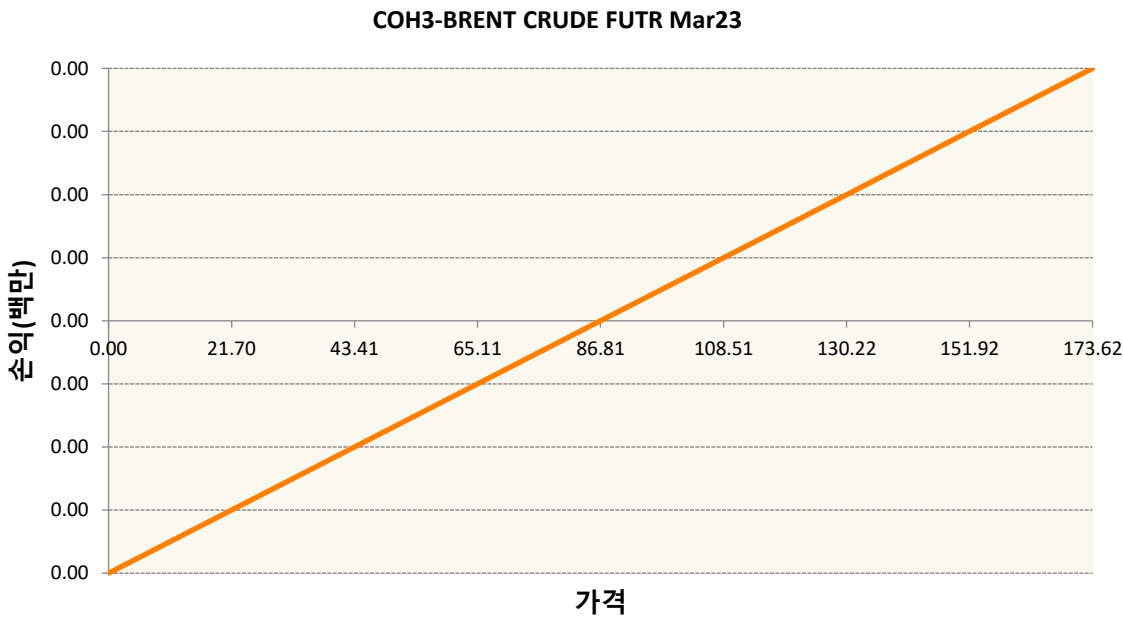
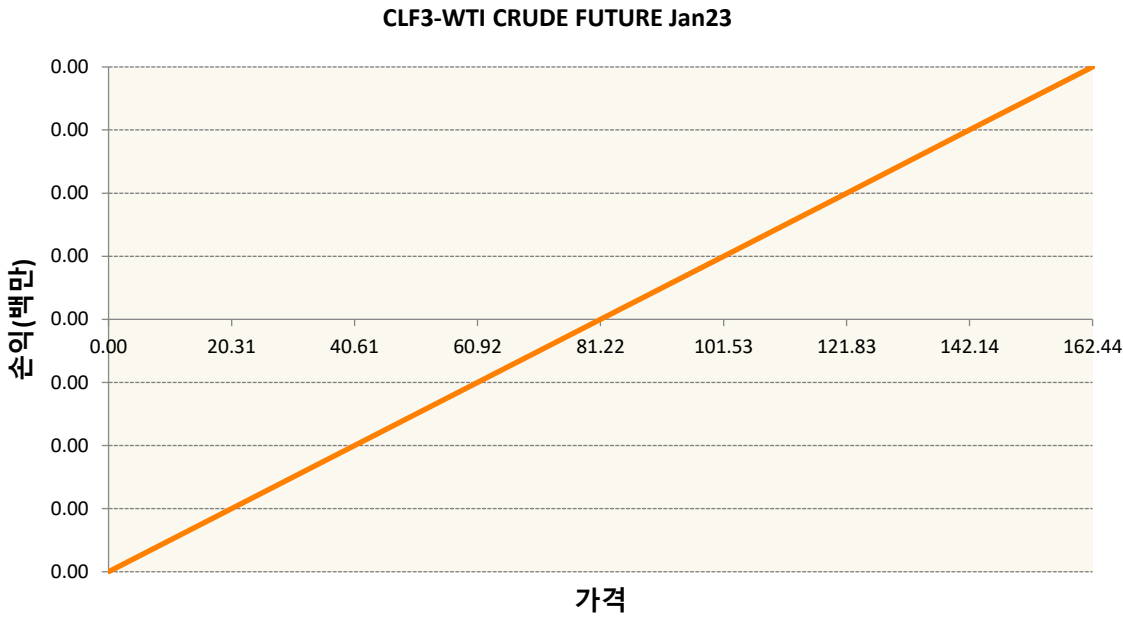
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

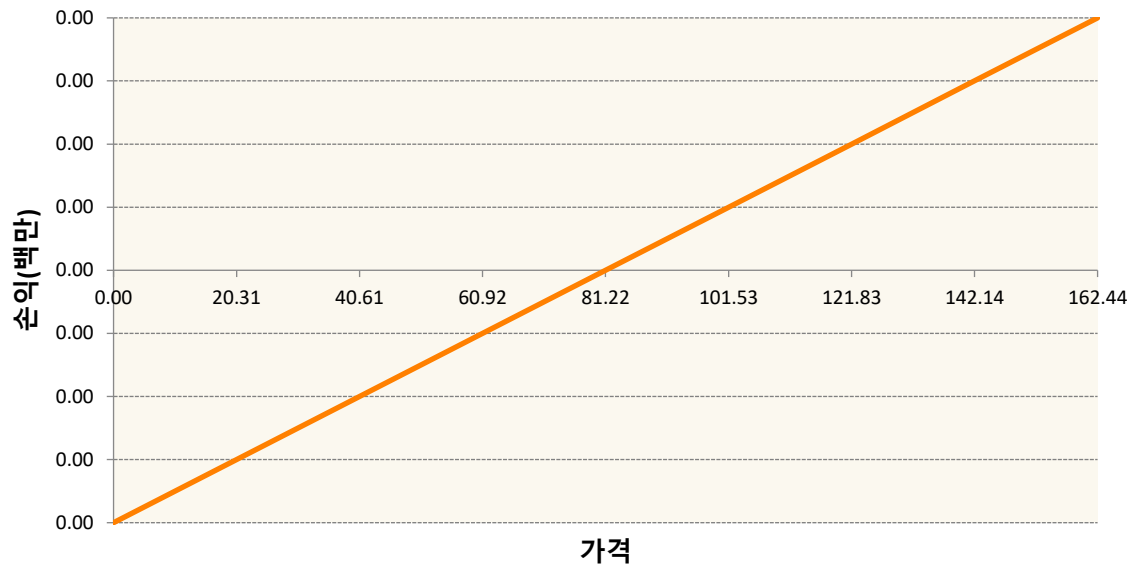
(단위:백만원)

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	233	0	233	
누계	유가증권	선물	1,597	260	1,337	

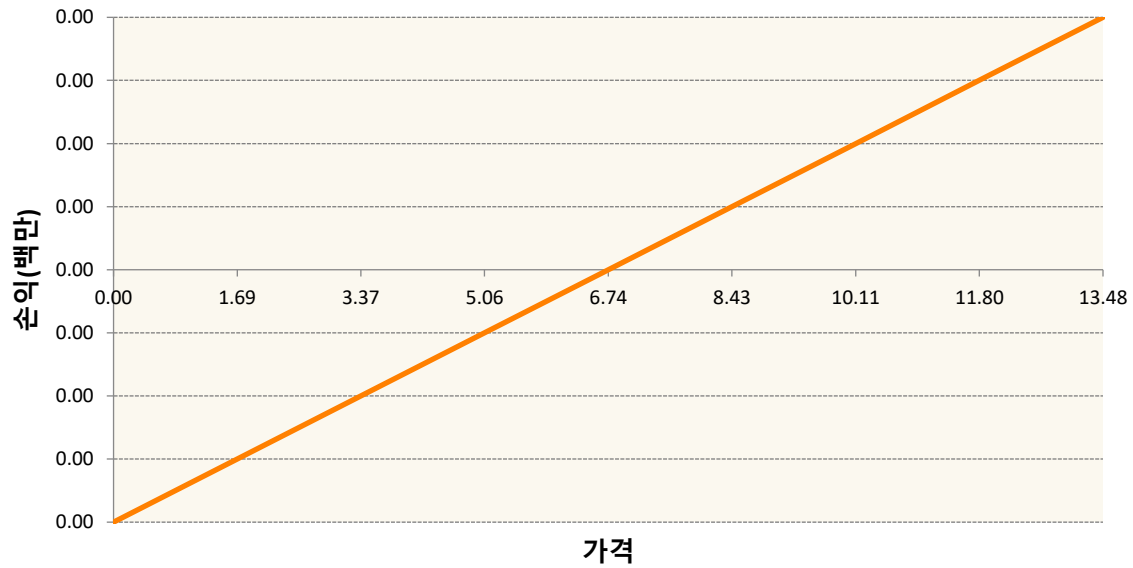
2. 만기시점의 손익구조



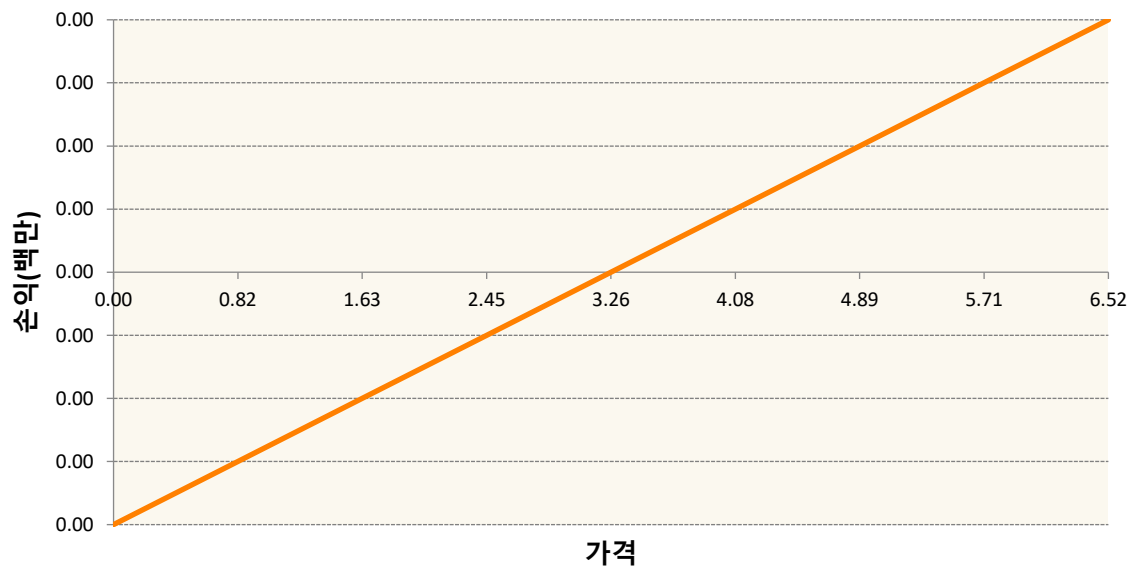
ECF3-E-mini Crude Oil Jan23



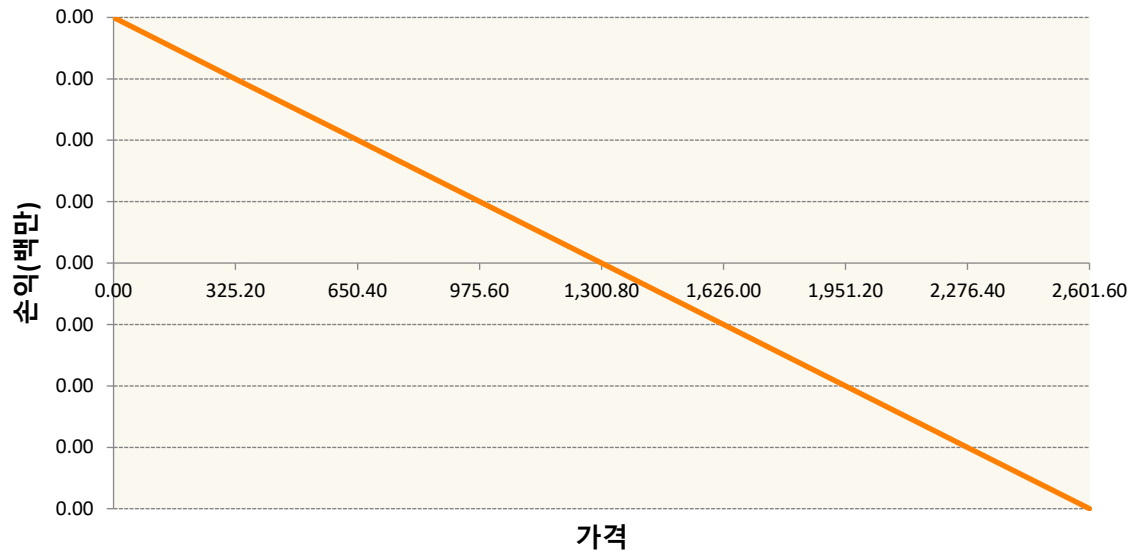
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



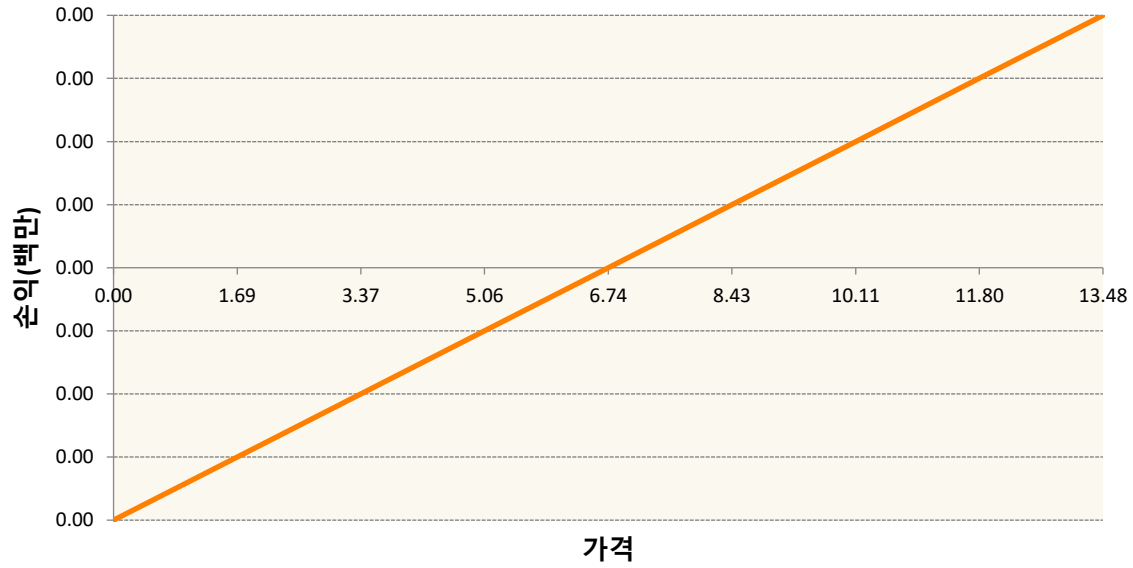
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



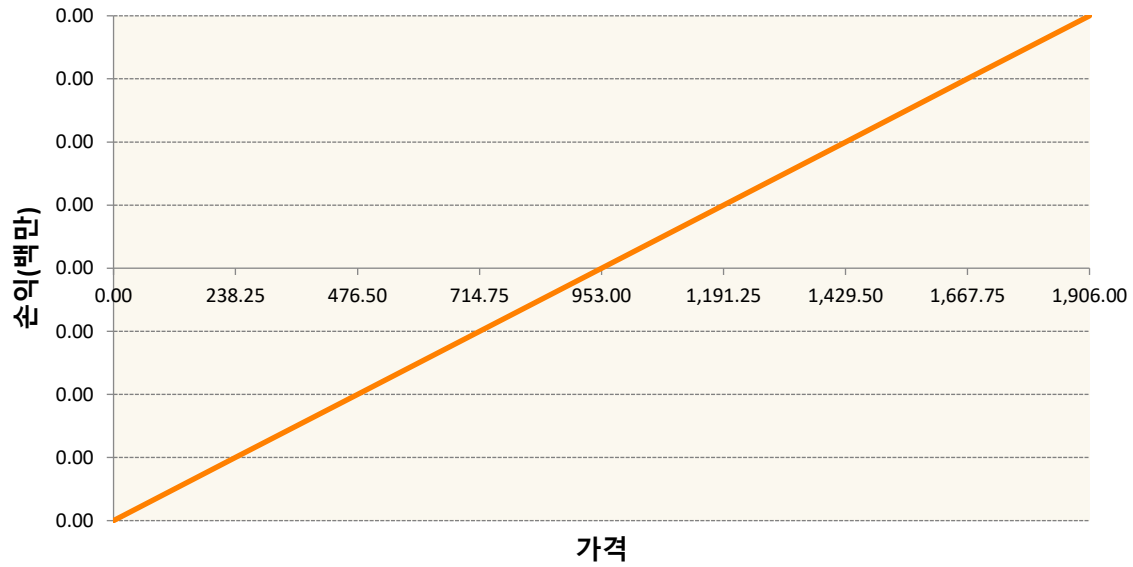
KR4175SC0000-2022-12 달러선물

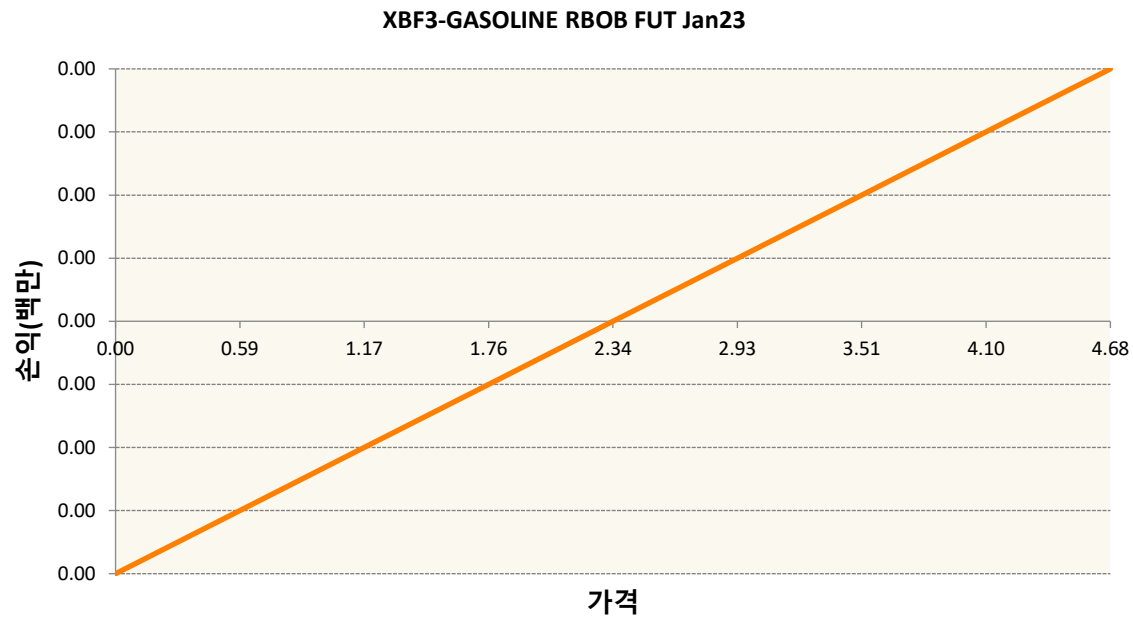


NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



QSF3-Low Su Gasoil G Jan23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF3	WTI CRUDE FUTURE Jan23	19
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	27
ECF3	E-mini Crude Oil Jan23	9
EOF3	E-MINI NATURAL GAS Jan23	8
HOF3	NY Harb ULSD Fut Jan23	16
KR4175SC00 2022-12 달러선물		21
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)
	484