

공시일 2022-06-17

기준일 2022-06-16

포커스농산물모(채권-파생형)

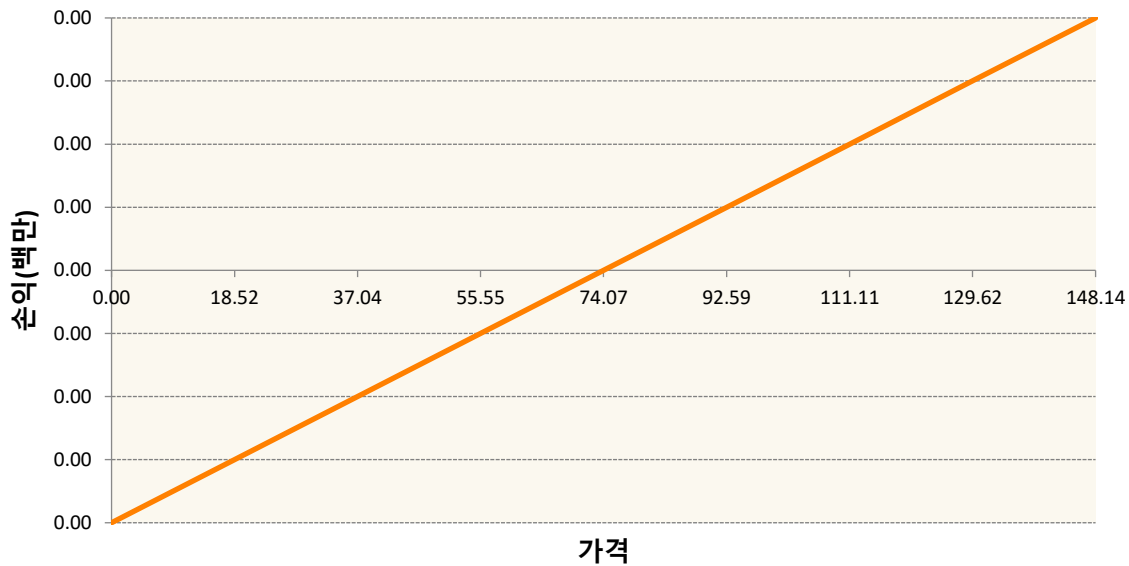
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

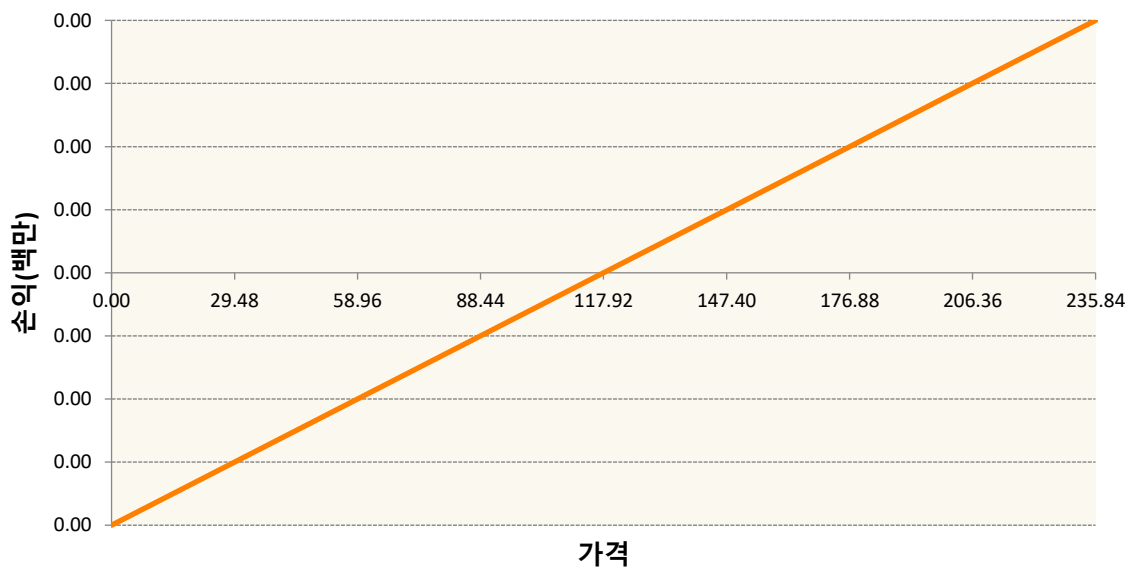
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,620	708	7,912	

2. 만기시점의 손익구조

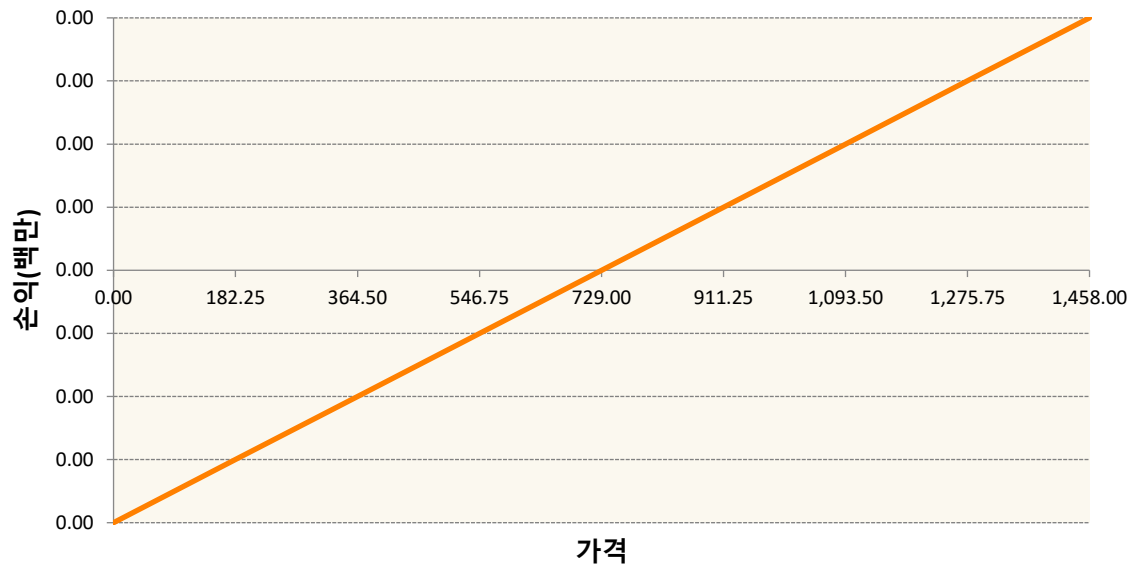
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



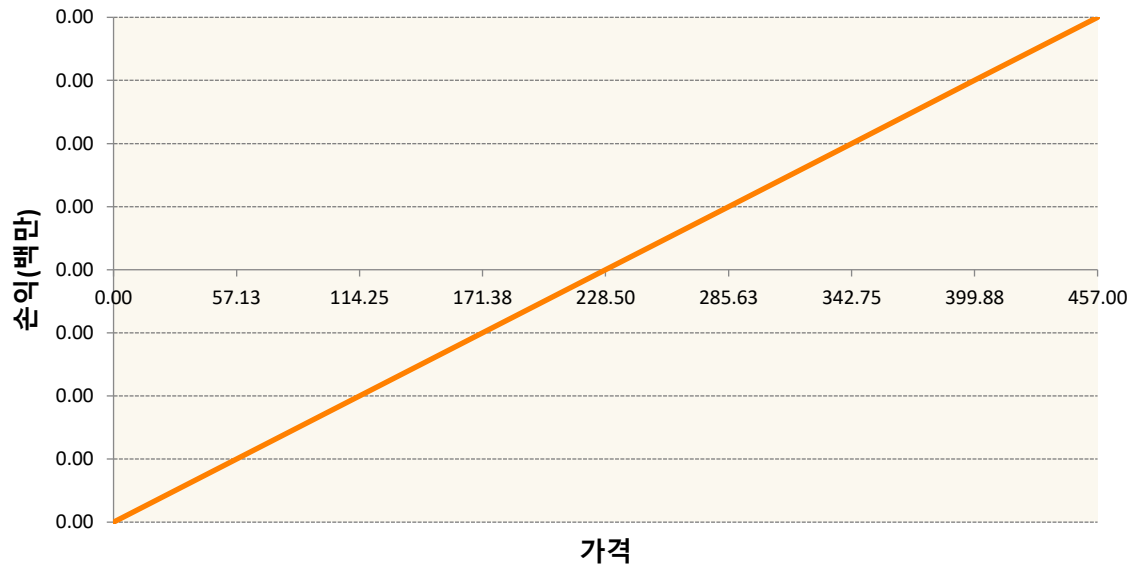
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



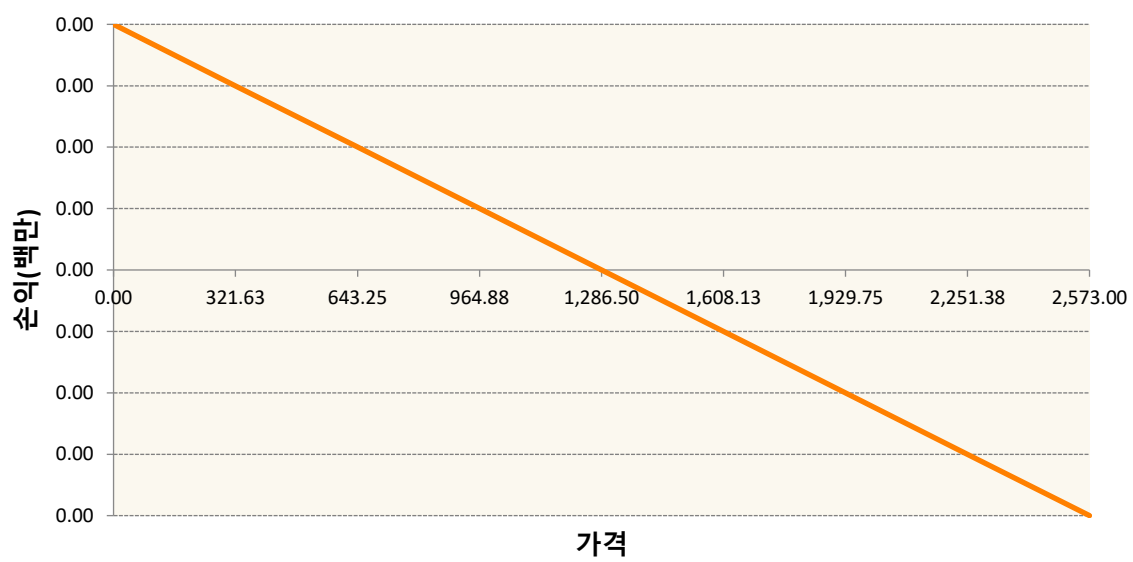
CU2-CORN FUTURE Sep22



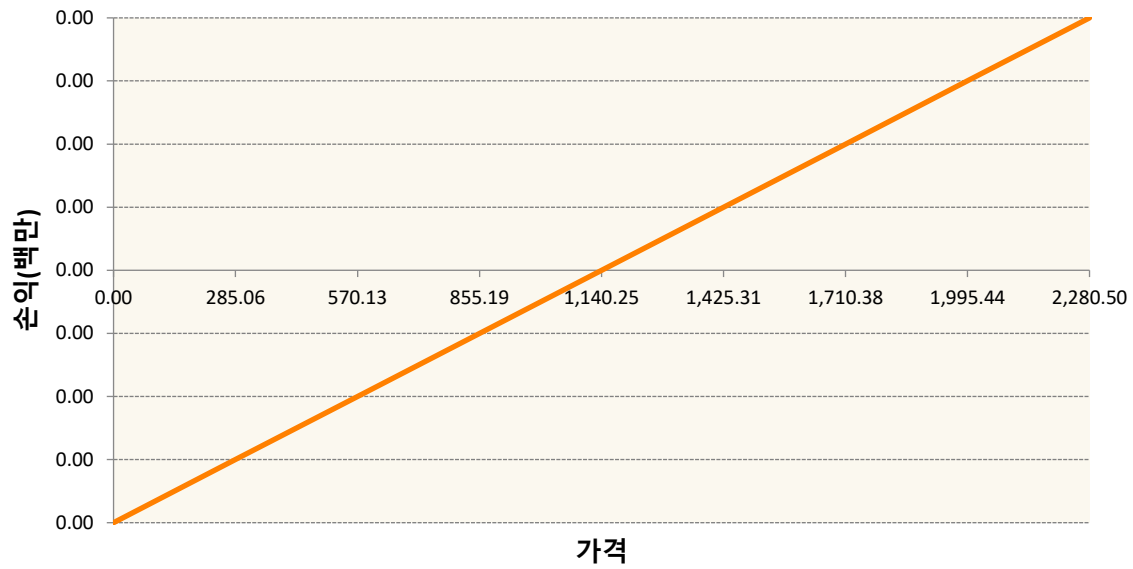
KCU2-COFFEE 'C' FUTURE Sep22



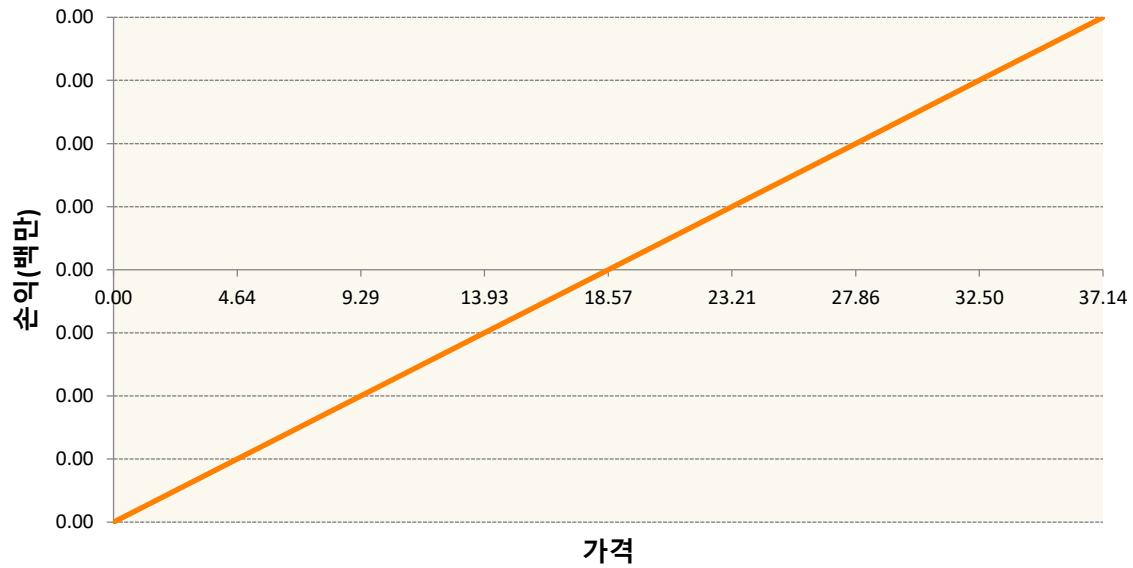
KR4175S70001-2022-07 달러선물



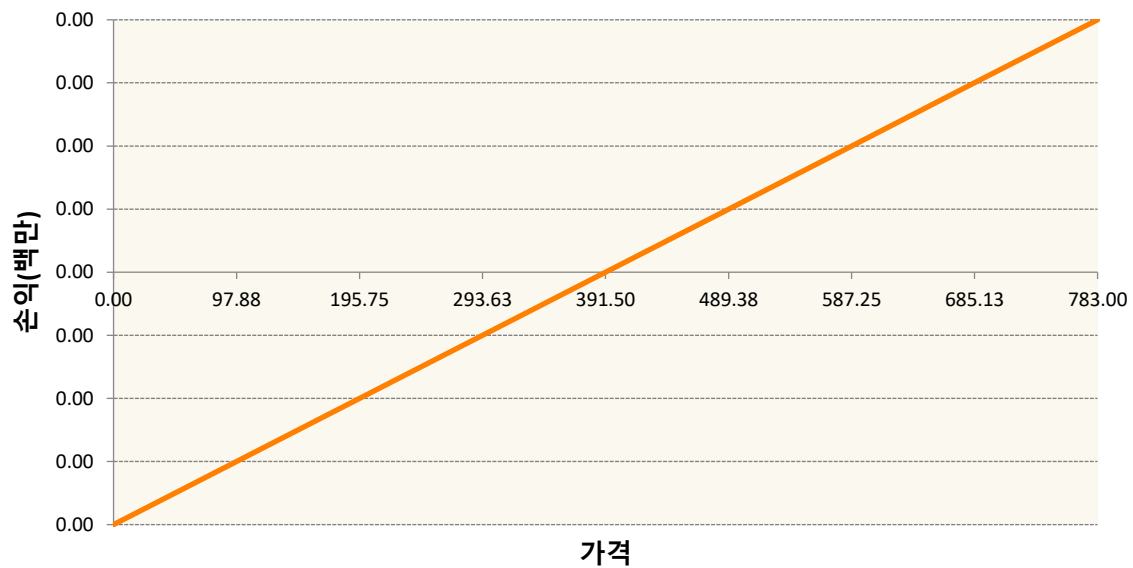
KWU2-KC HRW WHEAT FUT Sep22

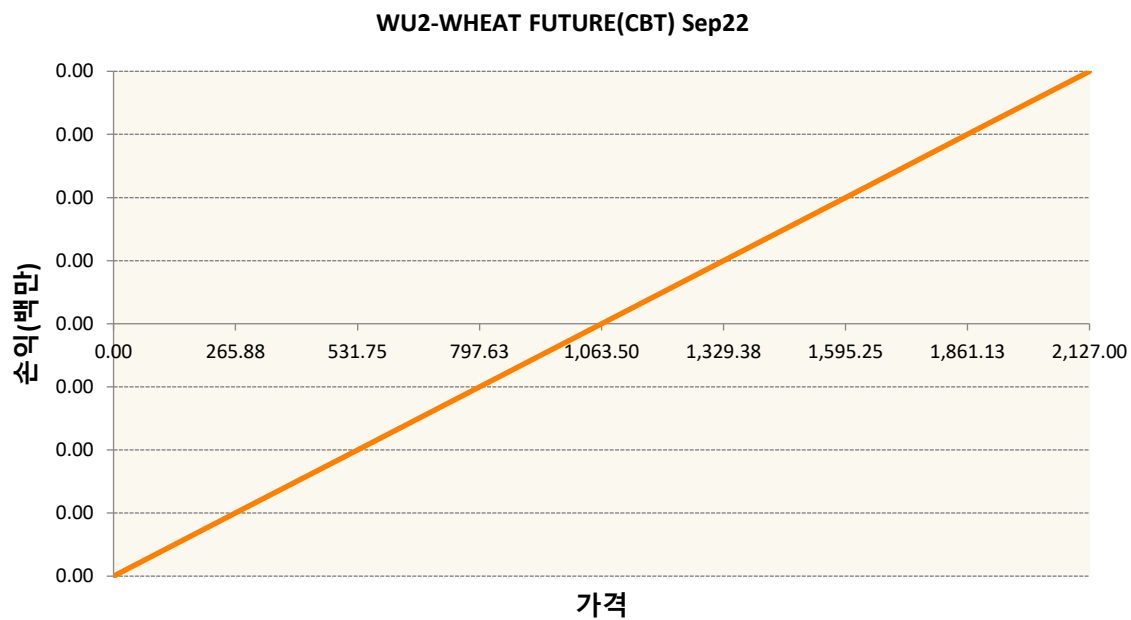
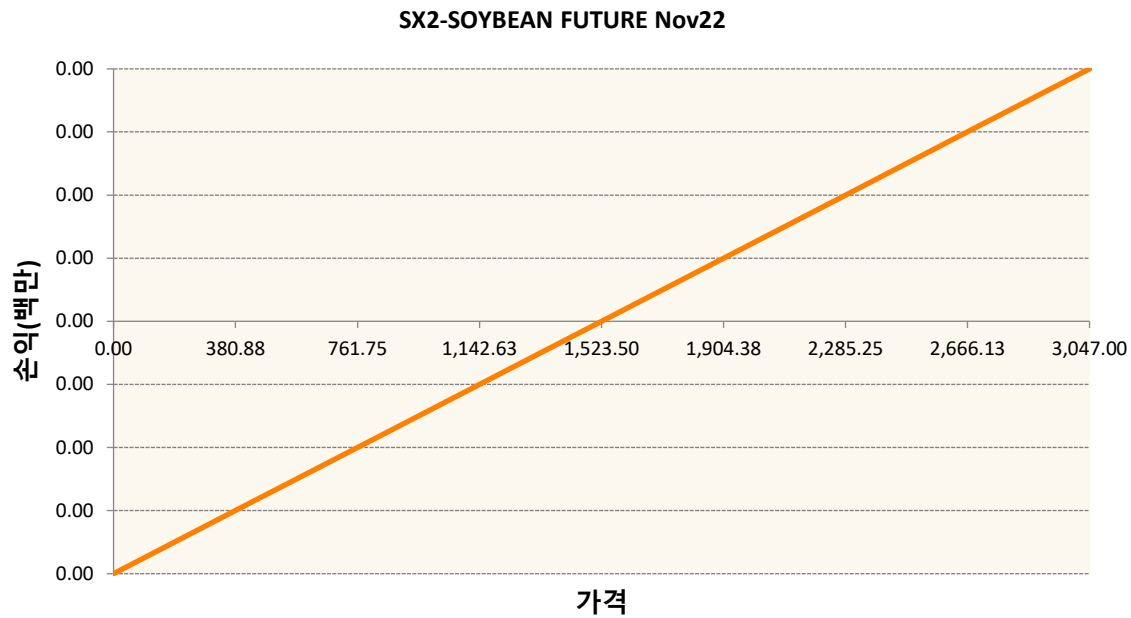


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



SMZ2-SOYBEAN MEAL FUTR Dec22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

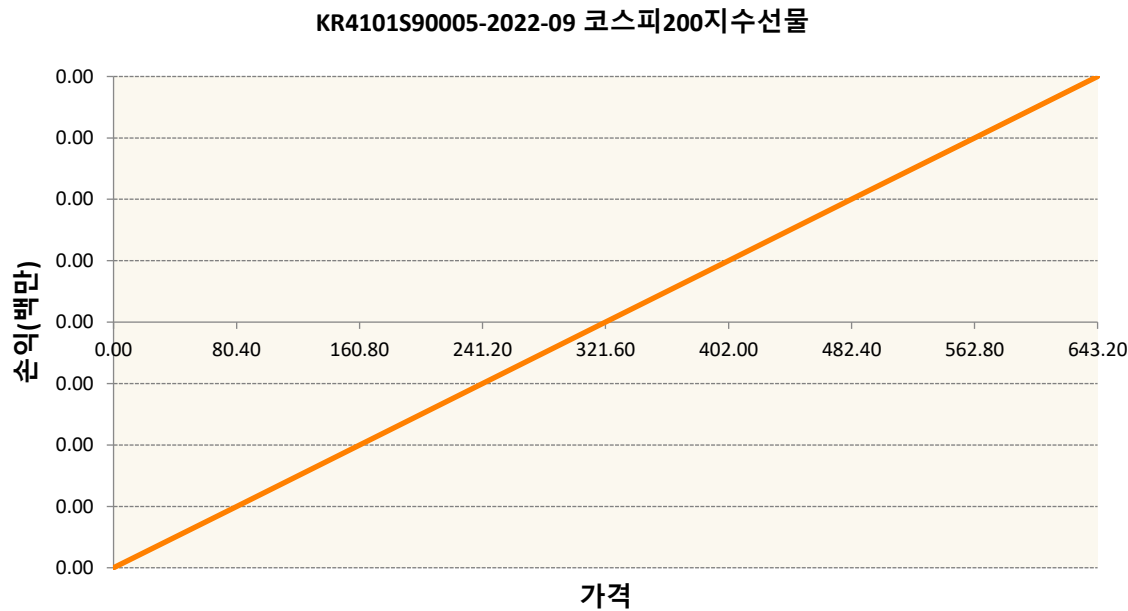
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	884	0	884	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				71
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	71	71	71	71	71	71	71

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

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	4,602	0	4,602	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래220311

368

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

473

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

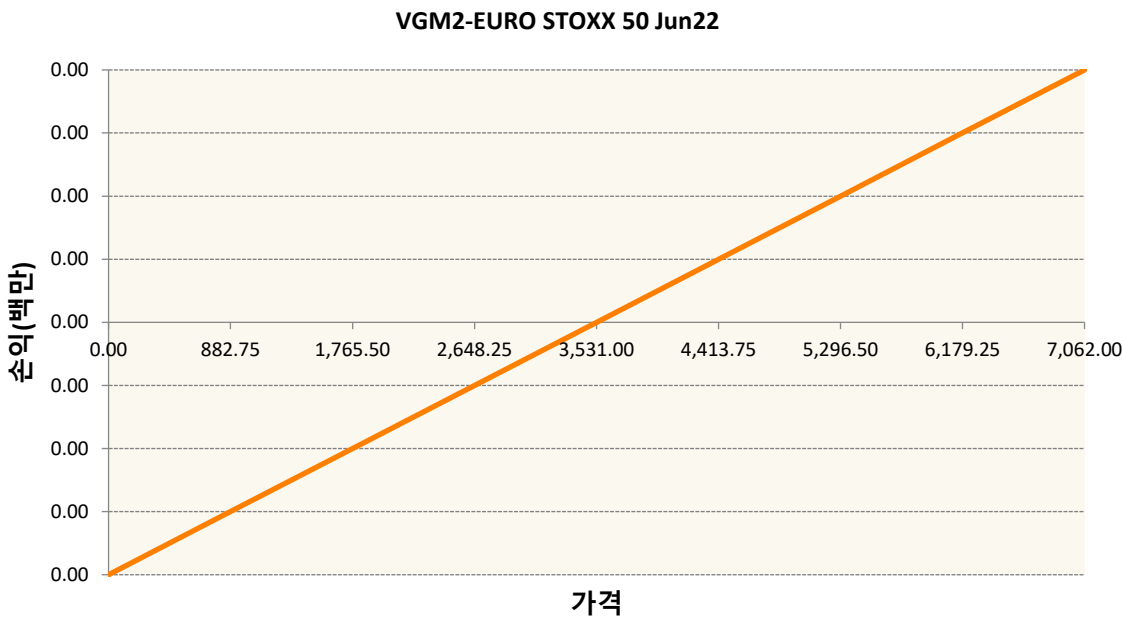
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	527	0	527	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM2	EURO STOXX 50 Jun22	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

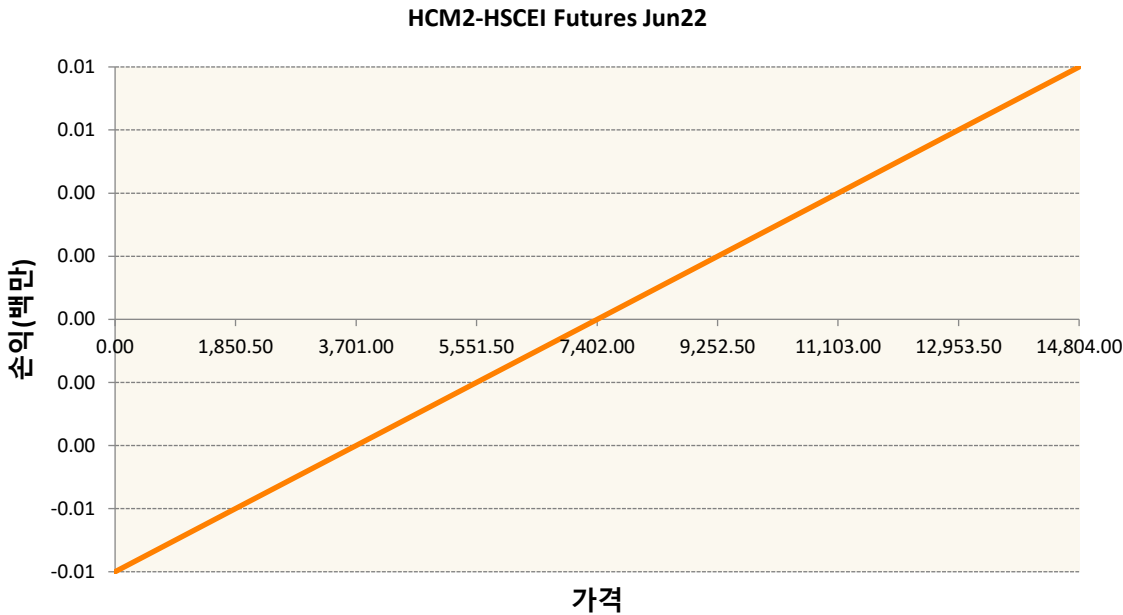
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,187	0	1,187	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM2	HSCEI Futures Jun22	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

138

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

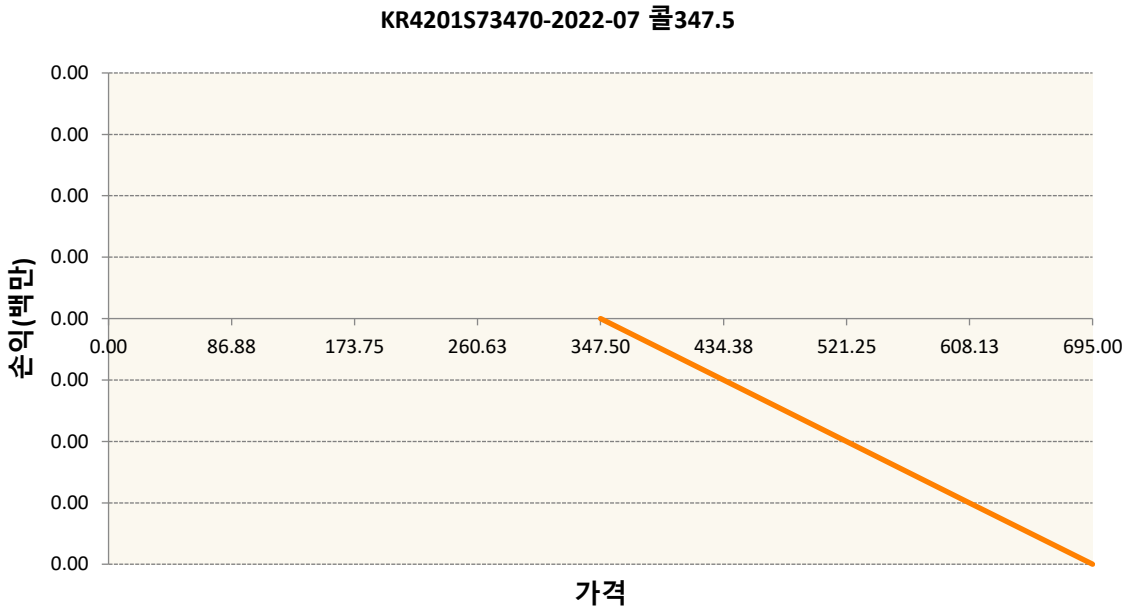
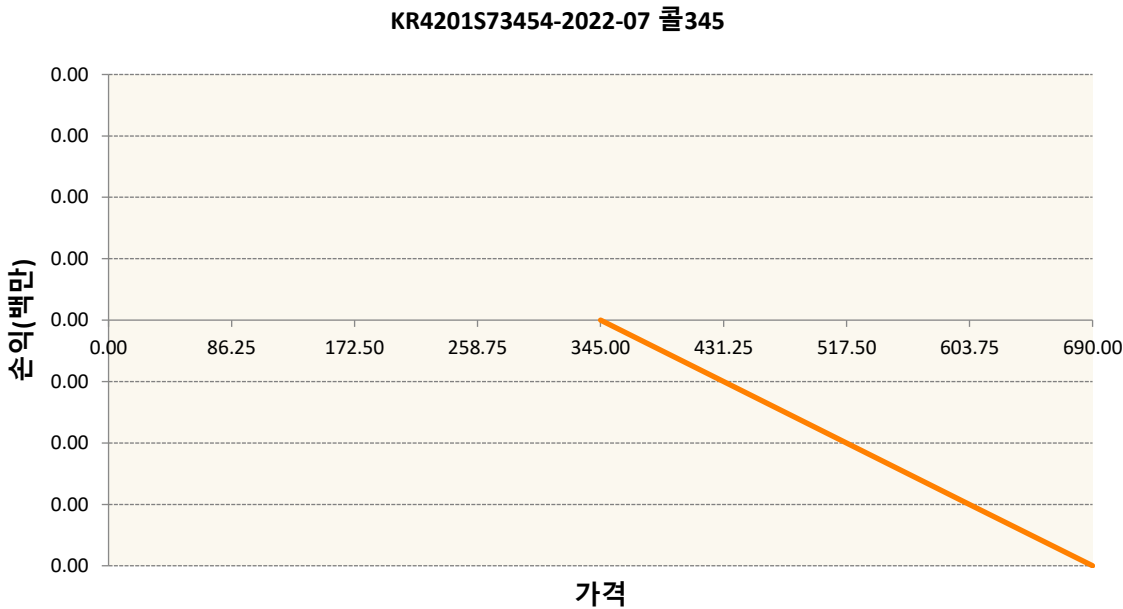
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

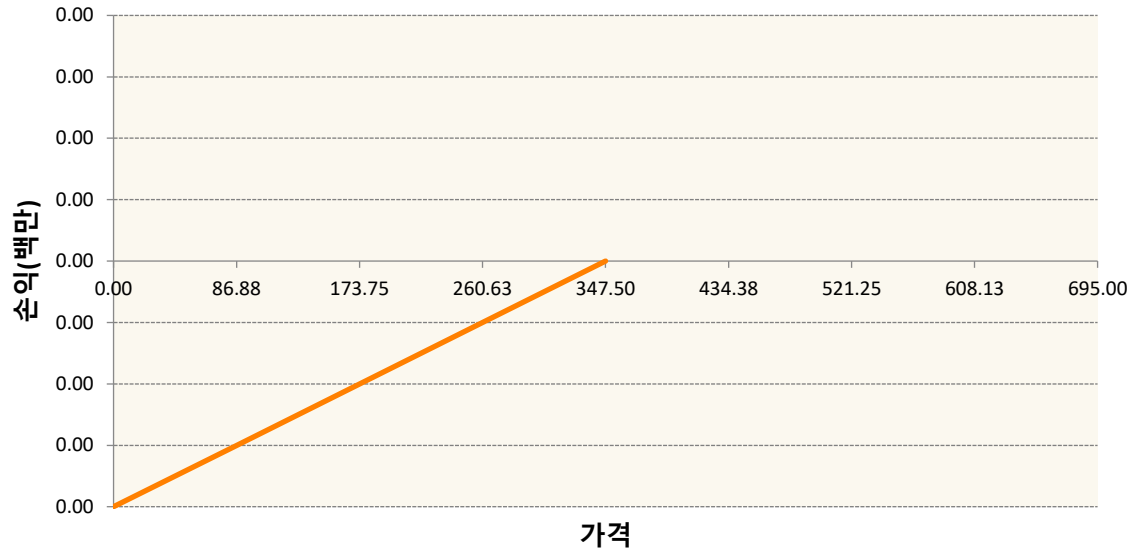
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	65,684	-65,684	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S73478-2022-07 풋347.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S73454		2022-07 콜345						882
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		249	242	233	220	203	183	159
-5.33%		236	221	203	180	154	123	90
-2.67%		203	177	146	111	73	31	-13
0%		134	93	48	0	-50	-103	-157
2.67%		9	-47	-105	-164	-224	-285	-347
5.33%		-190	-256	-322	-389	-455	-522	-589
8.00%		-473	-541	-609	-677	-746	-814	-882
KR4201S73470		2022-07 콜347.5						1,093
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		285	278	268	253	234	210	182
-5.33%		272	256	235	209	177	141	100
-2.67%		238	208	171	130	83	32	-22
0%		163	113	59	0	-63	-128	-196
2.67%		21	-48	-120	-195	-272	-350	-429
5.33%		-211	-296	-381	-467	-553	-640	-727
8.00%		-551	-642	-732	-822	-912	-1,002	-1,093
KR4301S73478		2022-07 풋347.5						850
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-841	-842	-842	-843	-845	-847	-850
-5.33%		-546	-547	-549	-552	-556	-561	-567
-2.67%		-253	-257	-262	-268	-276	-285	-296
0%		31	23	12	0	-14	-28	-44

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

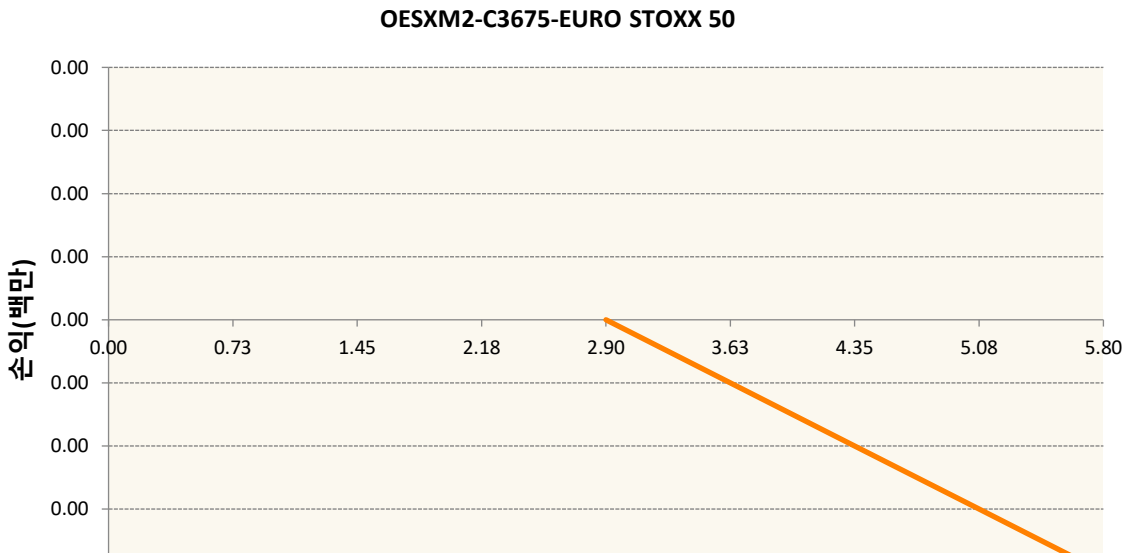
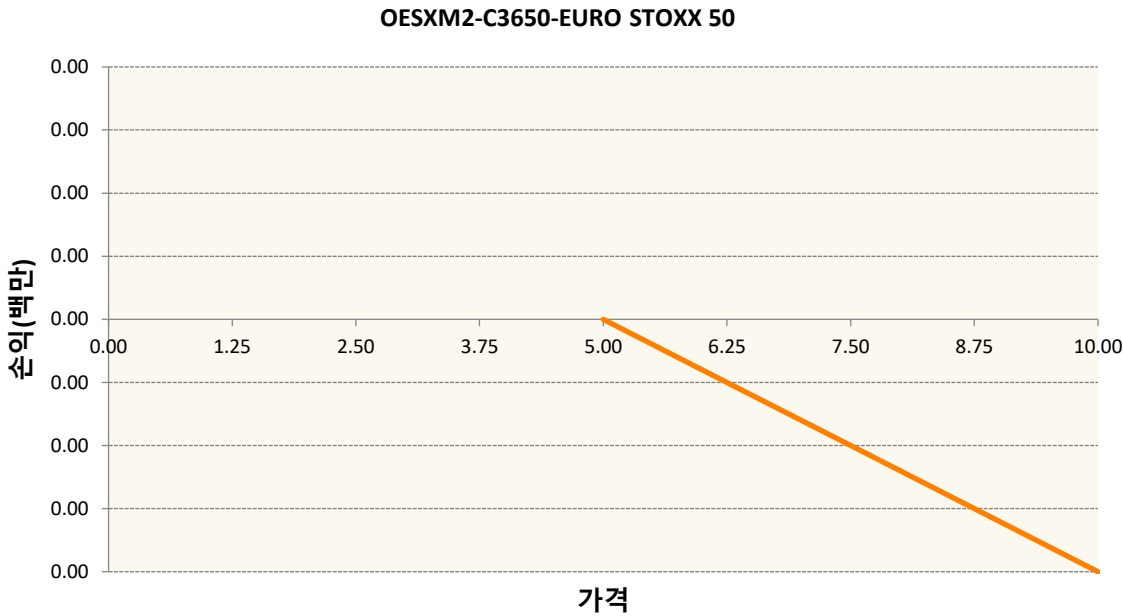
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

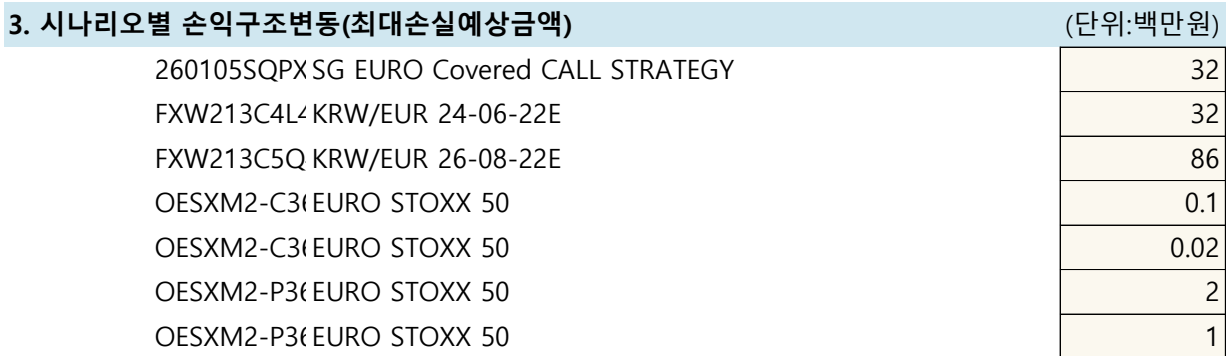
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	31	-31	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,473	-1,473	장외

2. 만기시점의 손익구조





공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

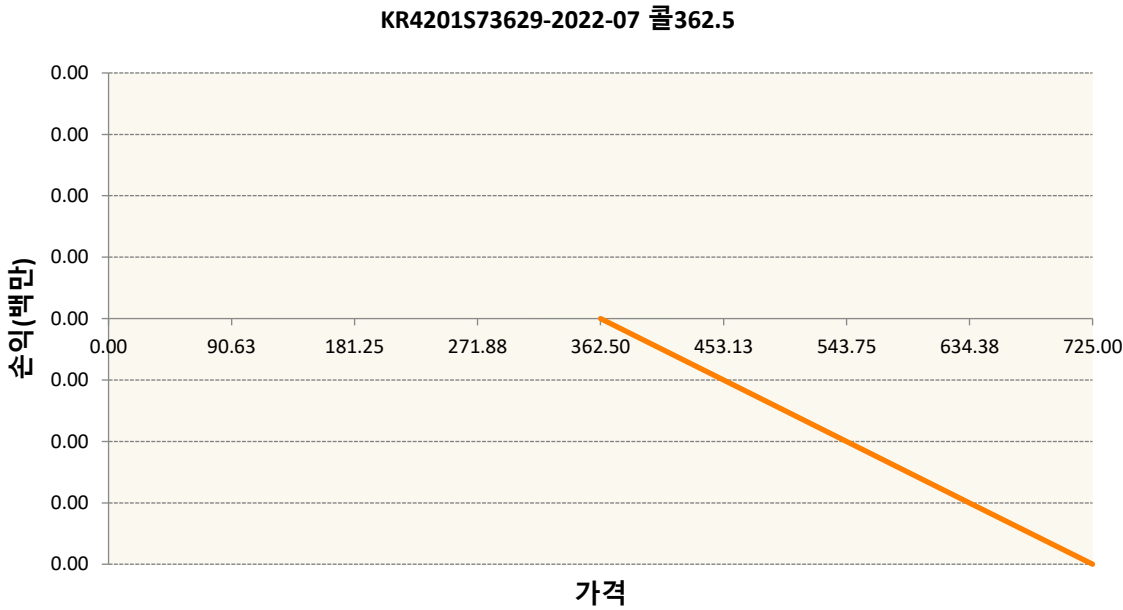
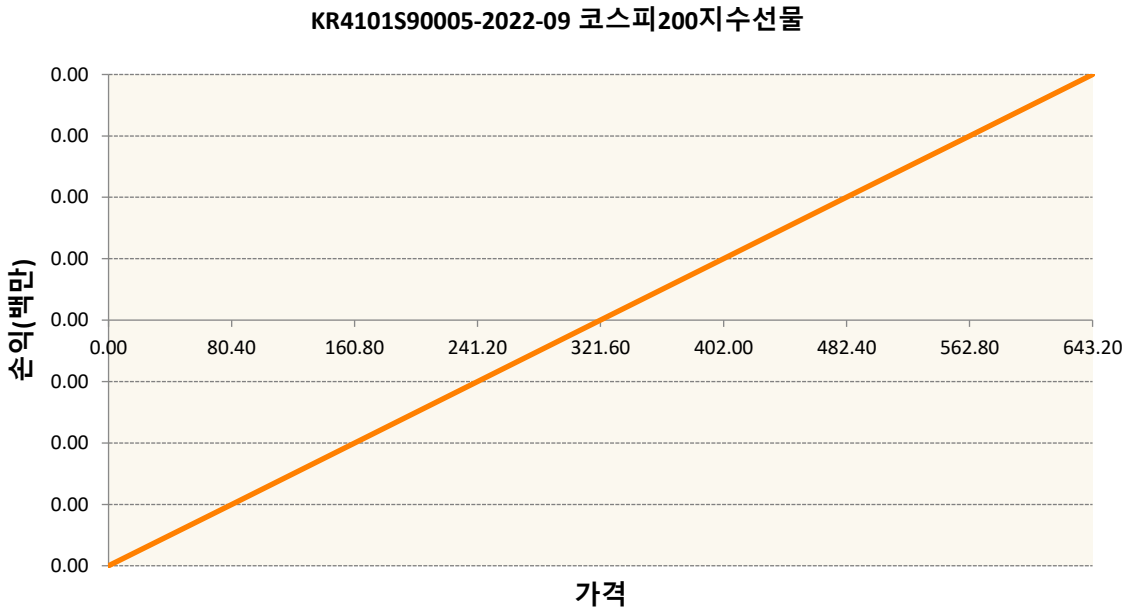
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	482	0	482	장내
누계	유가증권	옵션	261	4,731	-4,471	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 730.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the point (365.00, 0.00) and ends at (730.00, 0.00), indicating that profit/loss is zero at these price points.

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 695.00. The y-axis represents Net Income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at the origin (0.00, 0.00) and ends at (347.50, 0.00).

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
347.50	0.00

(단위:백만원)

KR4101S90005		2022-09 코스피200지수선물						39
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39	
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-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%	26	26	26	26	26	26	26	
8.00%	39	39	39	39	39	39	39	
KR4201S73629		2022-07 콜362.5						45
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	6	5	4
-5.33%	7	7	6	6	5	3	2
-2.67%	7	6	5	4	2	0	-2
0%	5	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	2	0	-3	-6	-10	-13	-17
5.33%	-4	-8	-12	-16	-20	-25	-30
8.00%	-14	-19	-24	-30	-35	-40	-45
KR4201S73652 2022-07 콜365							57

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	7	6	5
-5.33%	8	8	7	7	5	4	2
-2.67%	8	7	6	4	2	0	-3
0%	6	5	3	0	-3	-7	-10
2.67%	3	0	-3	-7	-12	-17	-22
5.33%	-4	-9	-14	-19	-25	-31	-37
8.00%	-17	-23	-29	-36	-43	-50	-57

KR4301S73478 2022-07 풋347.5							18
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	18	18	18	18
-5.33%	12	12	12	12	12	12	12
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6
0%	-1	0	0	0	0	1	1
2.67%	-6	-6	-6	-5	-5	-4	-4
5.33%	-11	-11	-10	-10	-9	-9	-8
8.00%	-15	-14	-14	-13	-13	-12	-12

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

(단위:백만원)

112

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

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	8,984	0	8,984	

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	2022-06-17
기준일	2022-06-16

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	6,710	0	6,710	

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	2022-06-17
기준일	2022-06-16

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	335	-335	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	21,089	0	21,089	
누계	통화	선도	3,407	25,879	-22,472	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4M KRW/USD 27-06-22E	2,070
FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E	123
FXW213C52 USD/KRW 27-06-22E	36
FXW213C5C USD/KRW 27-06-22E	15
FXW213C5J4 USD/KRW 27-06-22E	15
FXW213C6F USD/KRW 27-06-22E	31
FXW213C6G USD/KRW 27-06-22E	51
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

877

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

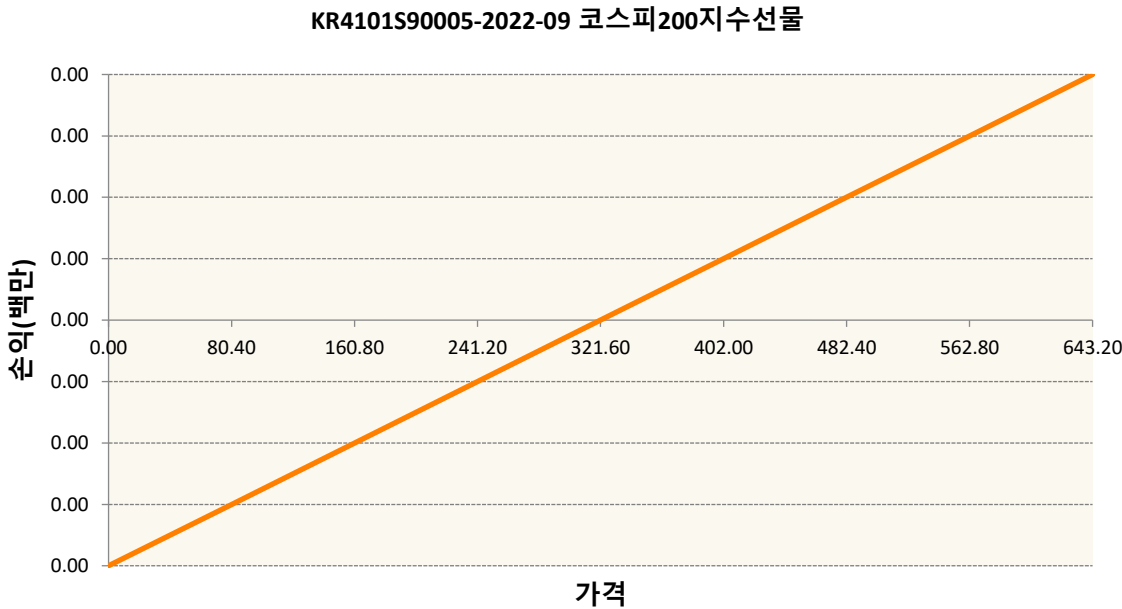
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	80	-80	장내
누계	유가증권	선물	563	0	563	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

공시일 2022-06-17

기준일 2022-06-16

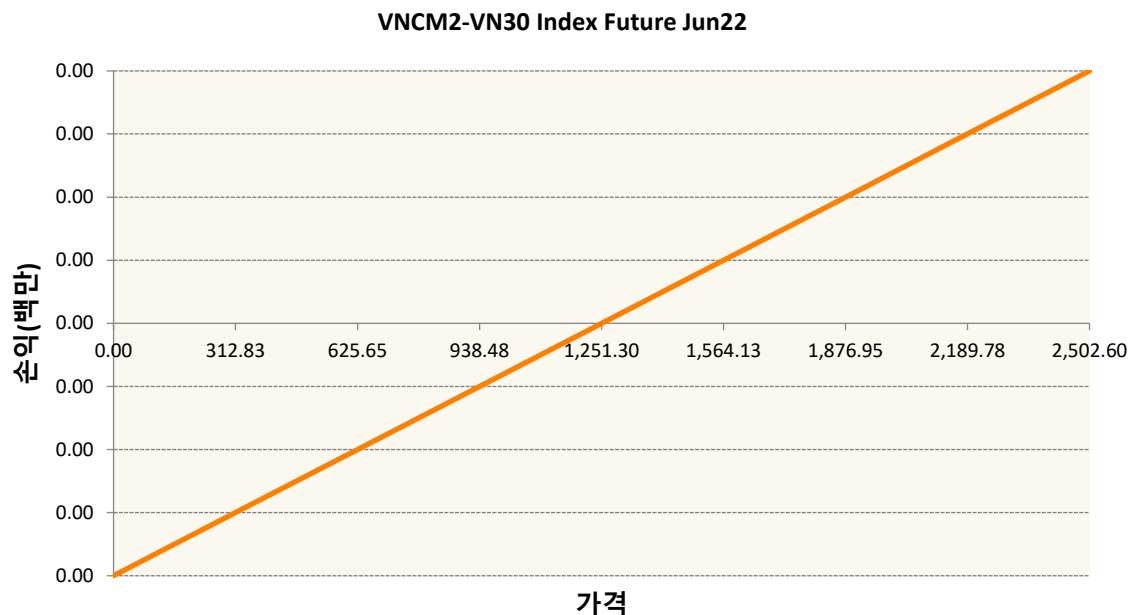
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	753	0	753	
누계	유가증권	스왑	1,731	0	1,731	장외
누계	통화	선도	0	978	-978	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	138
FXW213C3G·KRW/EUR 24-06-22E	32
FXW213C4L·KRW/EUR 22-07-22E	16
FXW213C5J4KRW/EUR 26-08-22E	30
VNCM2 VN30 Index Future Jun22	60

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

(단위:백만원)

277

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

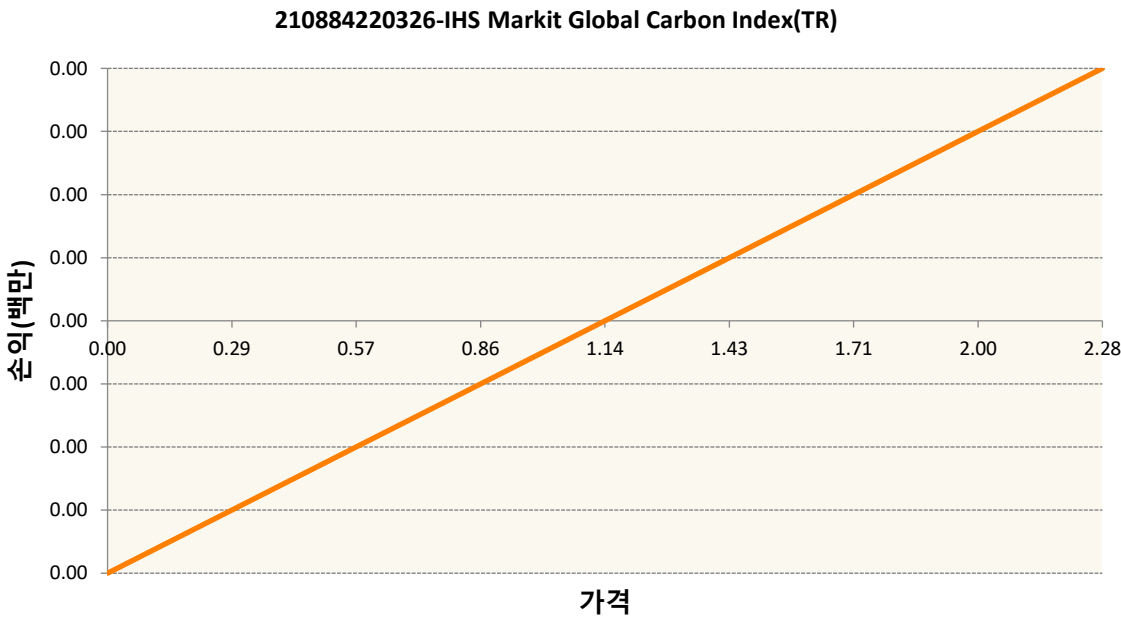
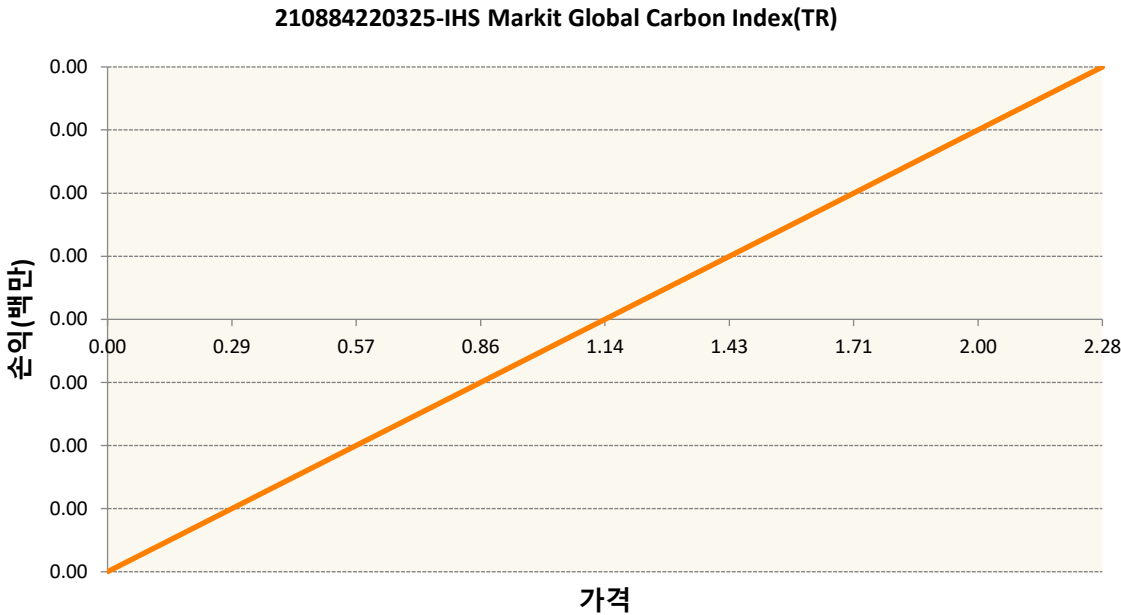
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

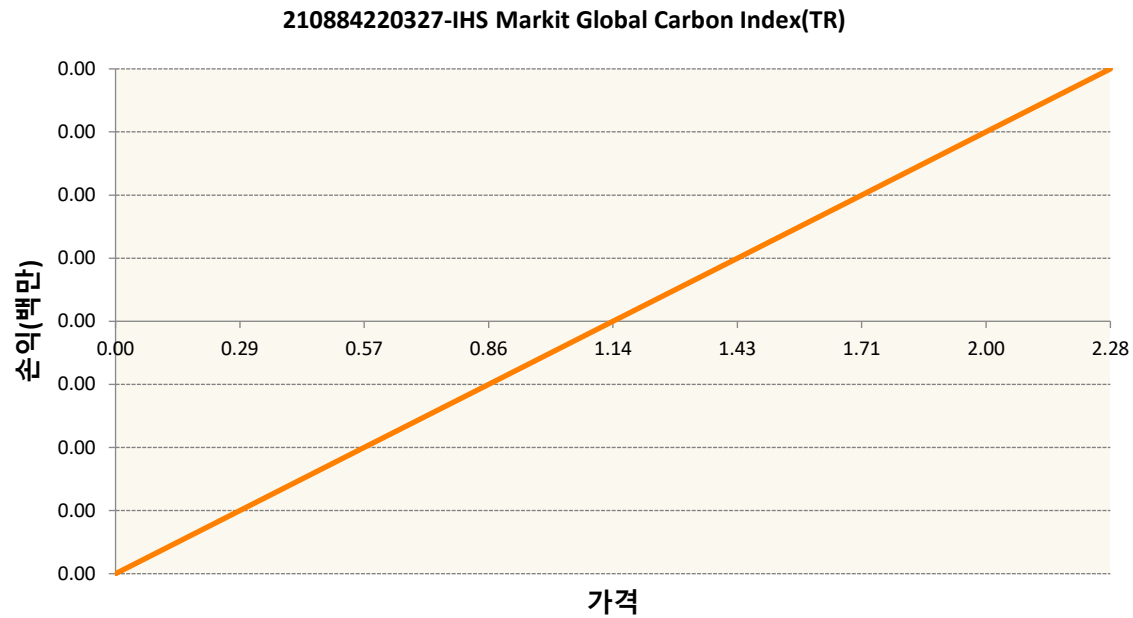
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	48,411	0	48,411	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		204
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		3,552
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7,170

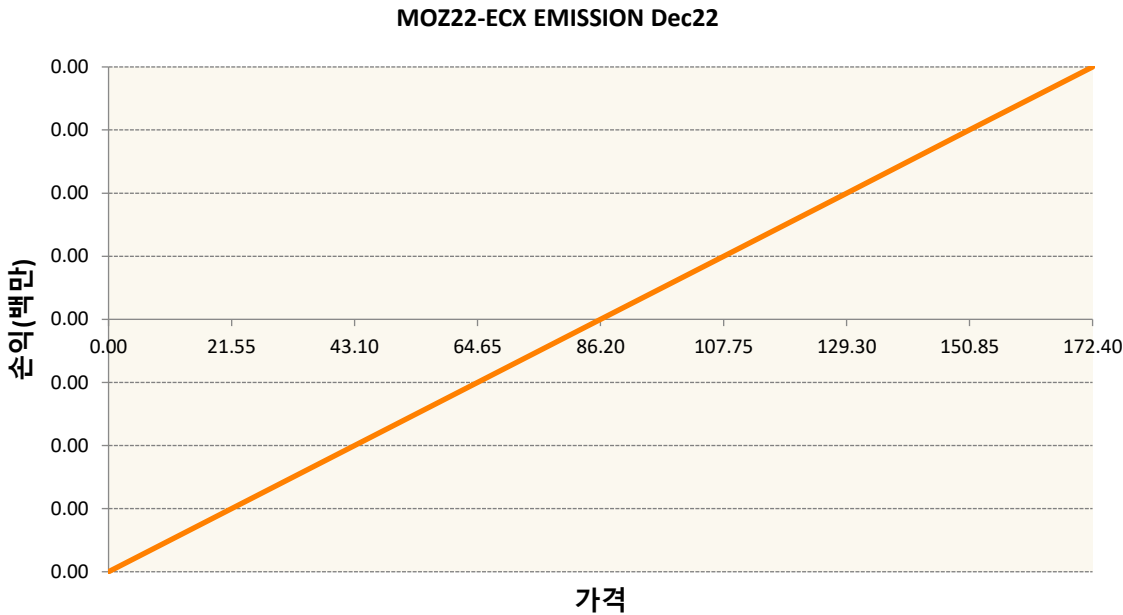
공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

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	14,870	0	14,870	
누계	통화	선도	0	7,901	-7,901	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213C5P² KRW/EUR 27-06-22E		632
MOZ22 ECX EMISSION Dec22		1,190

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,270

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

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	11,035	0	11,035	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	5

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

(단위:백만원)

43

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

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	9,277	0	9,277	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220426(메리츠)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220614(메리츠)	1

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

(단위:백만원)

62

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

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)

KRS0003041·SWAP_MICRON TECH CORP_0331	3
KRS0003135·SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.1
KRS0003224·SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	1

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

(단위:백만원)

8

공시일 2022-06-17

기준일 2022-06-16

신한SOL한국형글로벌반도체액티

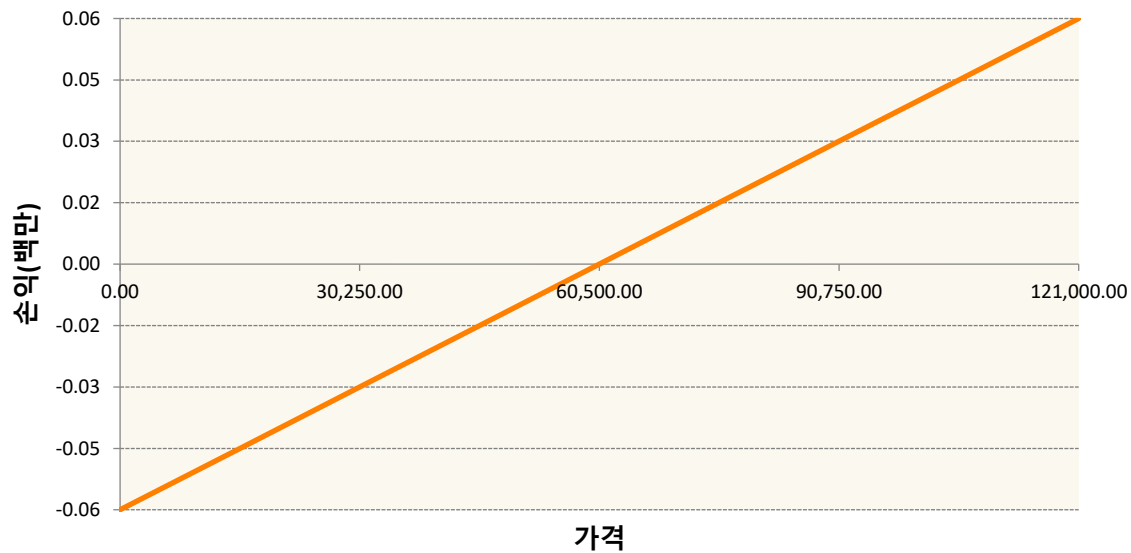
1. 계약금액

(단위:백만원)

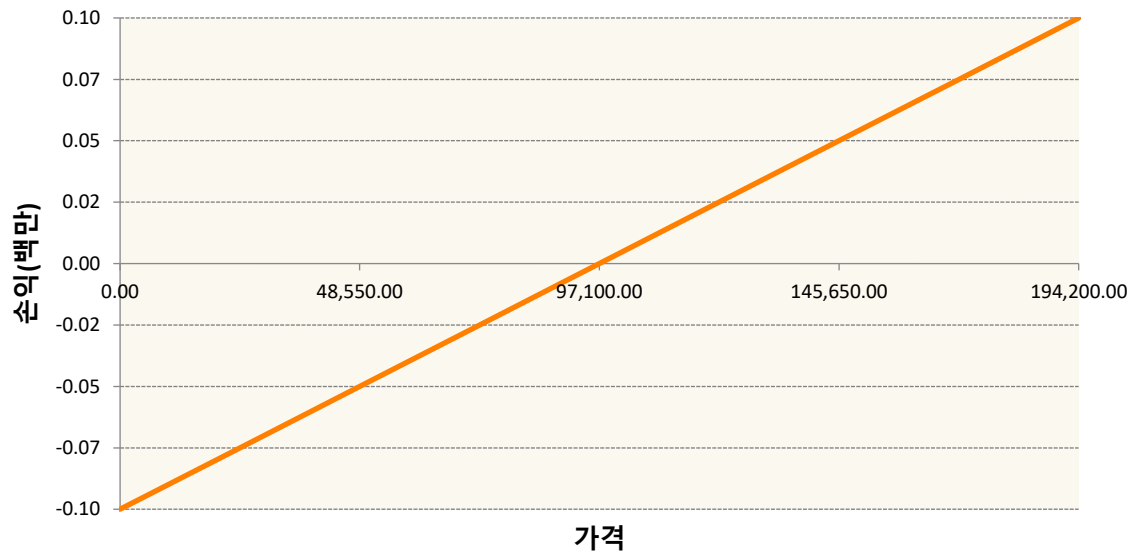
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	859	0	859	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S70006-2022-07 삼성전자개별선물



KR4150S70004-2022-07 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S70006		2022-07 삼성전자개별선물					35
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	35	35	35	35	35	35	35
KR4150S70004		2022-07 SK하이닉스개별선물					34
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-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%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

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

77

공시일	2022-06-17
기준일	2022-06-16

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

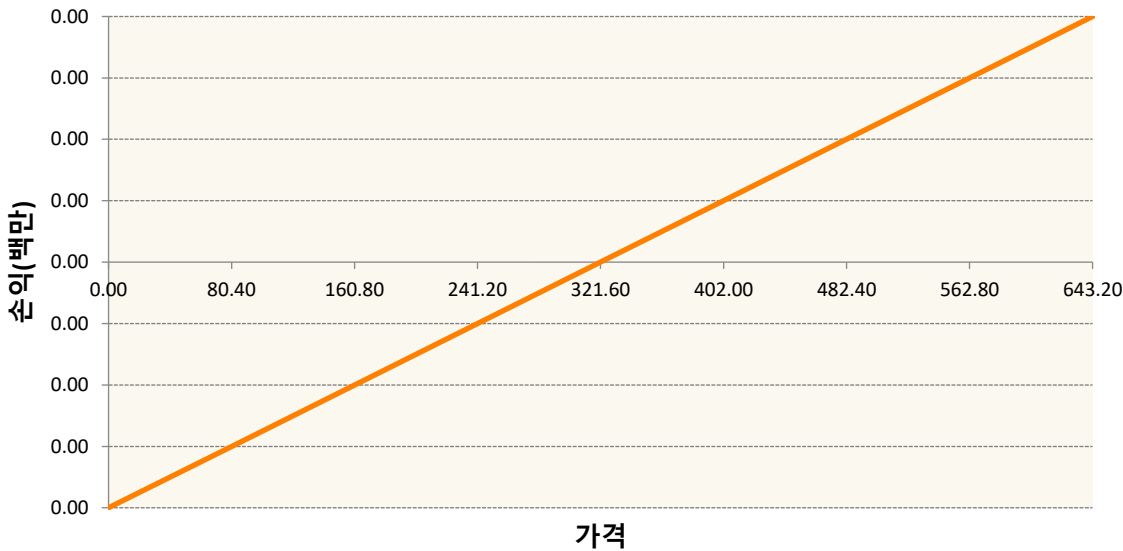
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	482	0	482	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				39
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-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%	26	26	26	26	26	26	26
8.00%	39	39	39	39	39	39	39

공시일 2022-06-17

기준일 2022-06-16

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

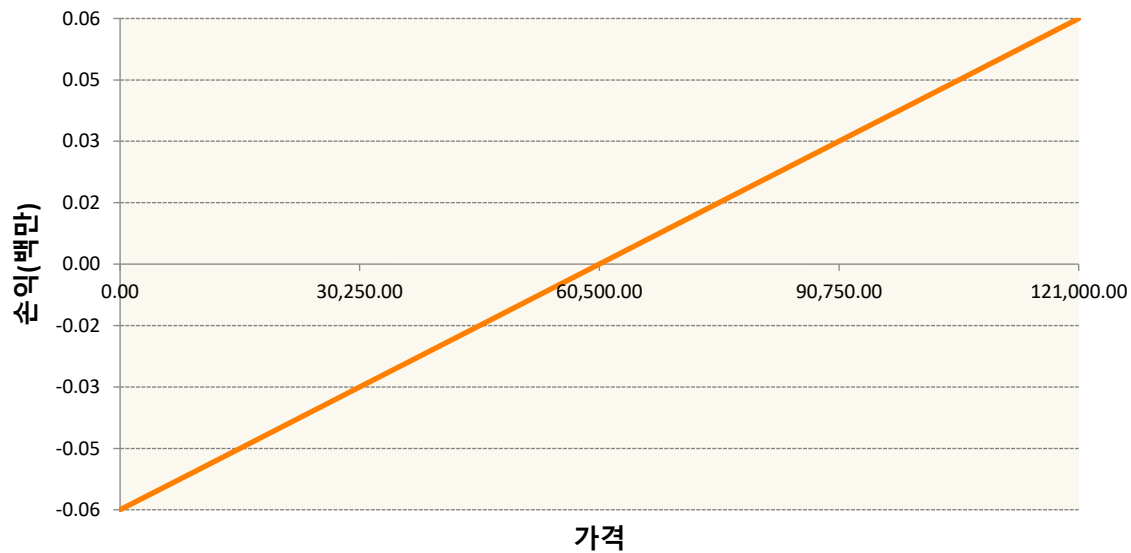
1. 계약금액

(단위:백만원)

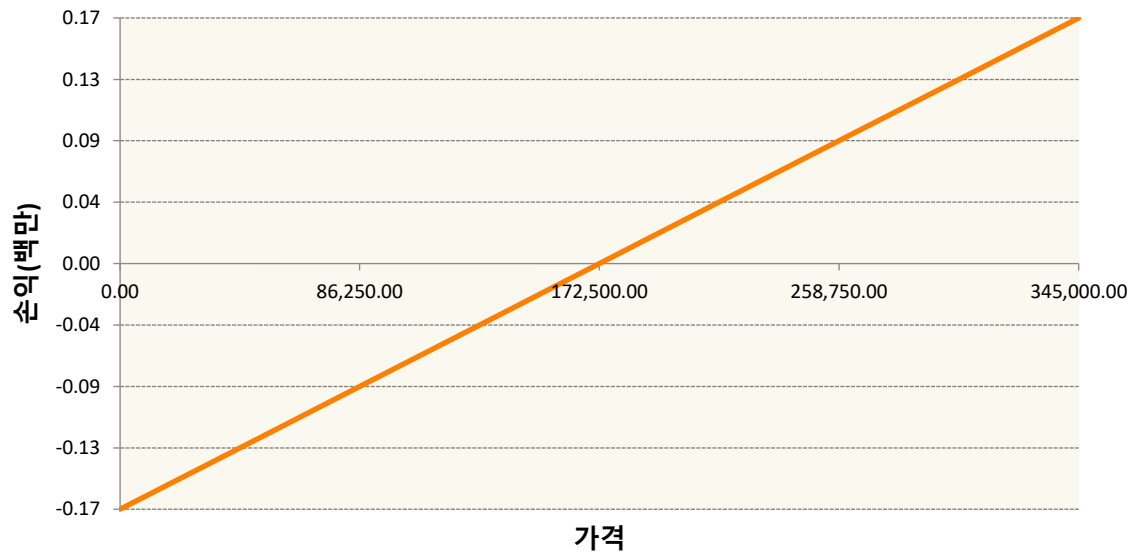
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	269	0	269	장내

2. 만기시점의 손익구조

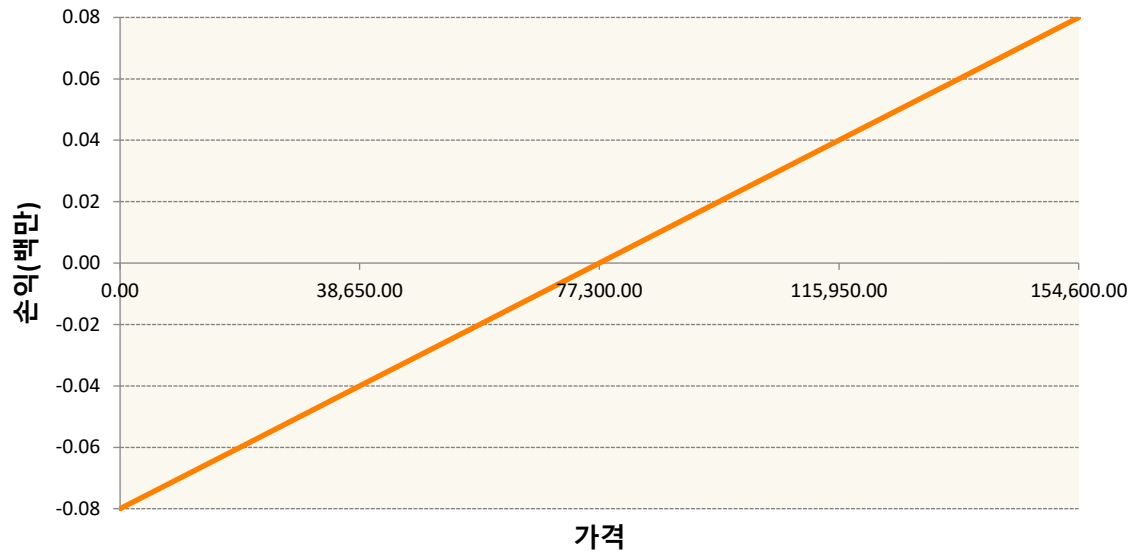
KR4111S70006-2022-07 삼성전자개별선물



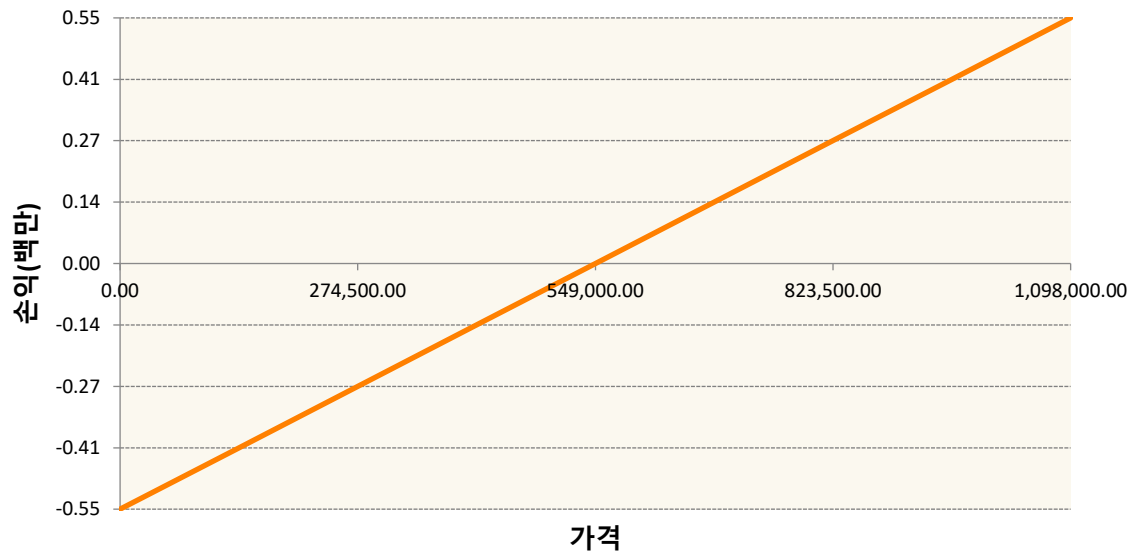
KR4116S70005-2022-07 현대차개별선물



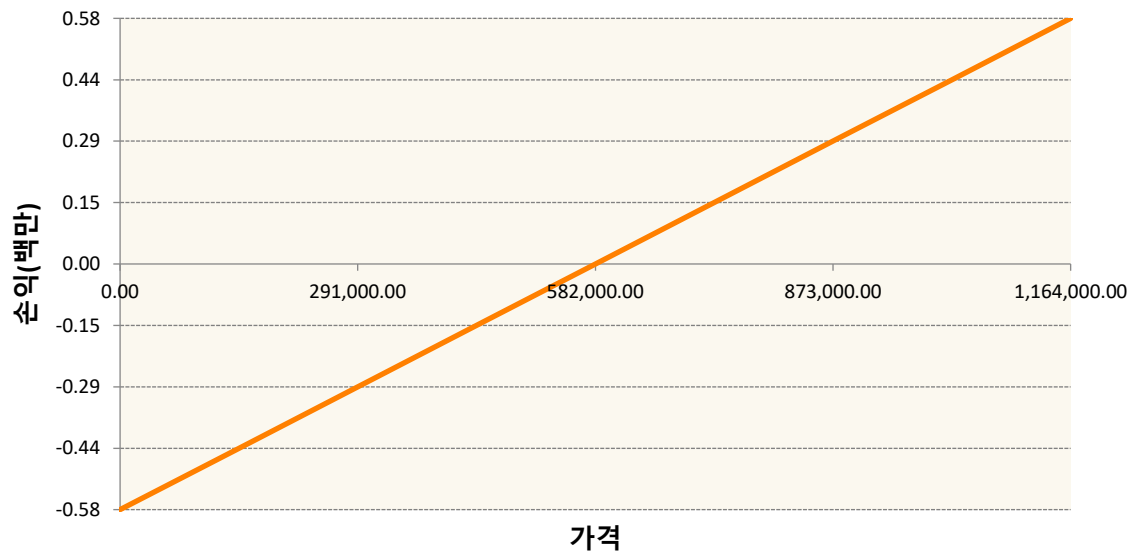
KR4119S70009-2022-07 기아개별선물



KR4122S70003-2022-07 삼성SDI개별선물



KR4147S70000-2022-07 LG화학개별선물



(단위:백만원)

KR4111S70006							2022-07 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	
KR4116S70005							2022-07 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	
KR4119S70009							2022-07 기아개별선물		3
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
-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%	3	3	3	3	3	3	3	3	
KR4122S70003							2022-07 삼성SDI개별선물		9
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	3	3	3	3	3	3	3	3	
5.33%	6	6	6	6	6	6	6	6	
8.00%	9	9	9	9	9	9	9	9	
KR4147S70000							2022-07 LG화학개별선물		1
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

22

공시일 2022-06-17

기준일 2022-06-16

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

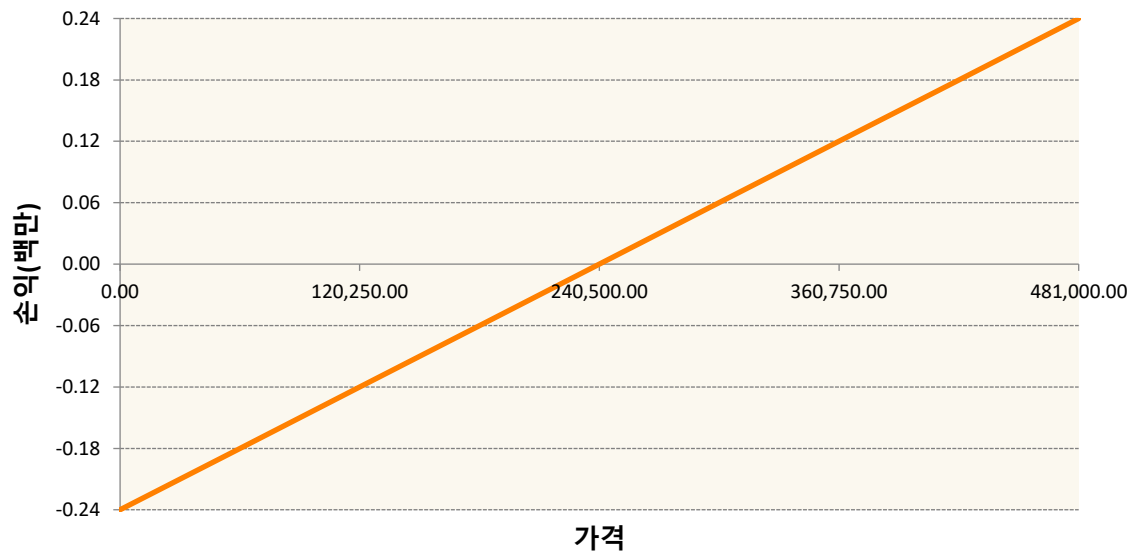
1. 계약금액

(단위:백만원)

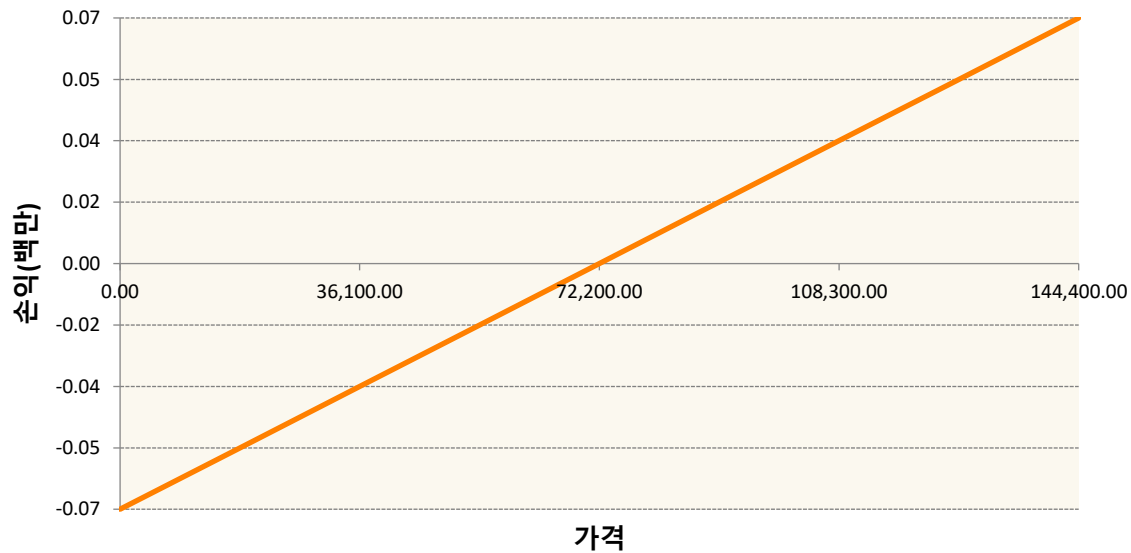
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	207	0	207	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156S70001-2022-07 NAVER개별선물



KR41CFS70002-2022-07 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156S70001		2022-07 NAVER개별선물					10
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-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%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
KR41CFS70002		2022-07 카카오개별선물					7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-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%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

26

공시일 2022-06-17

기준일 2022-06-16

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

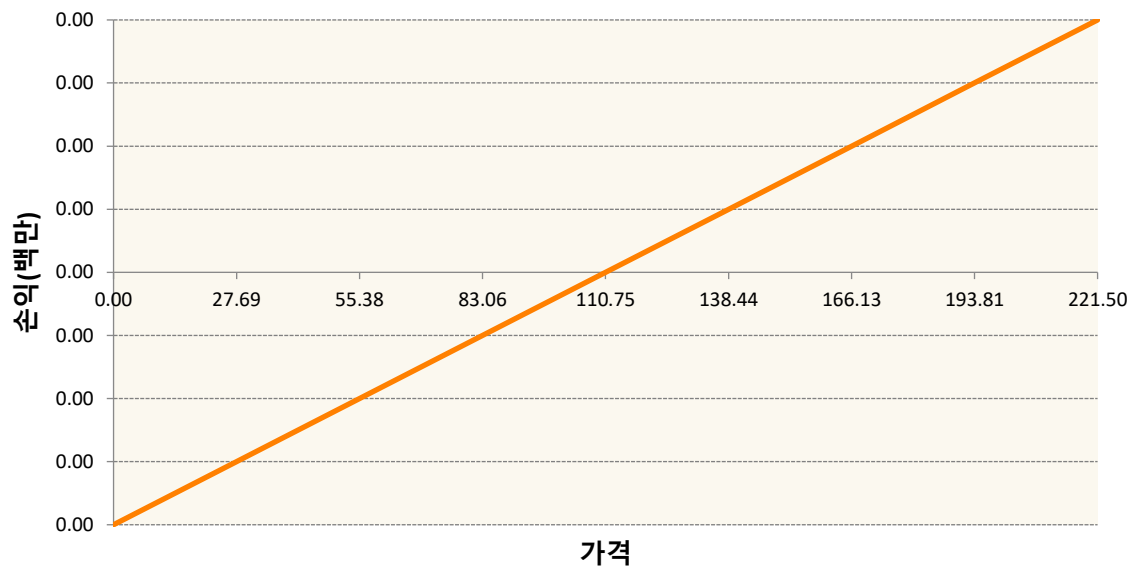
1. 계약금액

(단위:백만원)

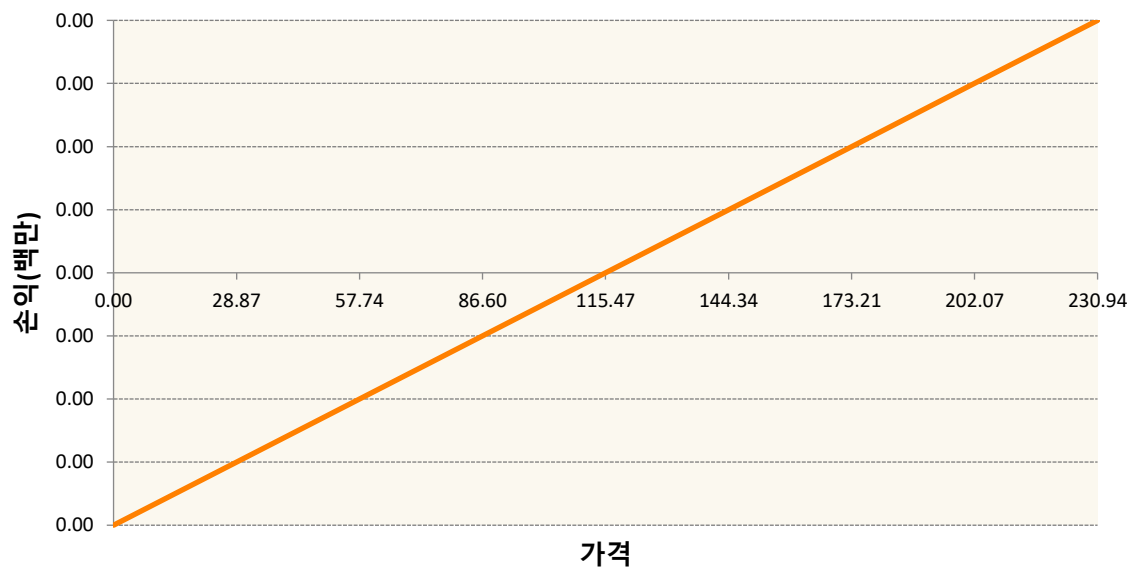
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,949	450	2,499	

2. 만기시점의 손익구조

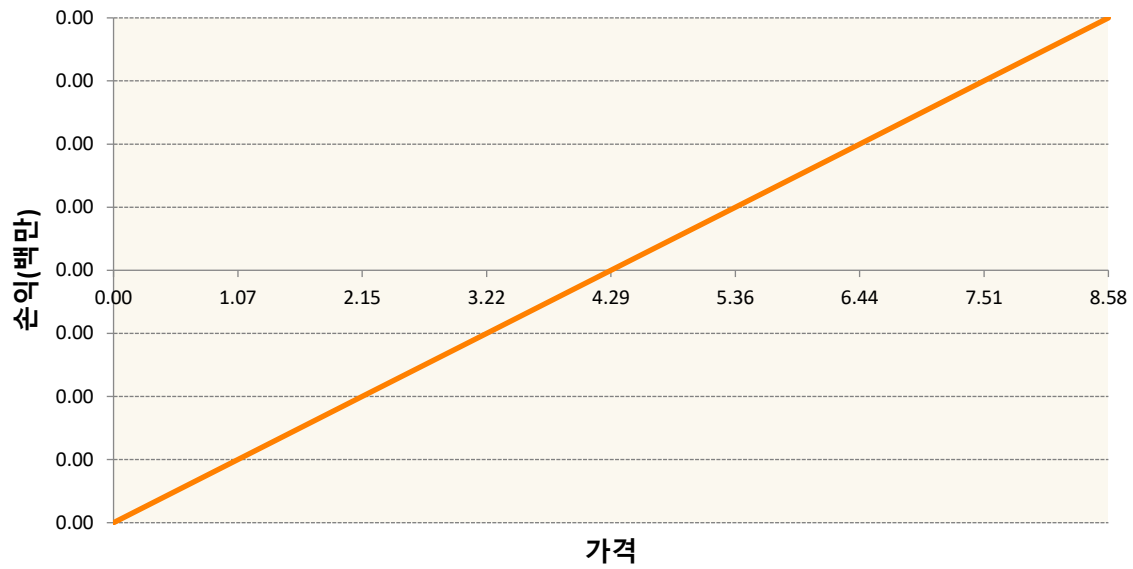
CLU2-WTI CRUDE FUTURE Sep22



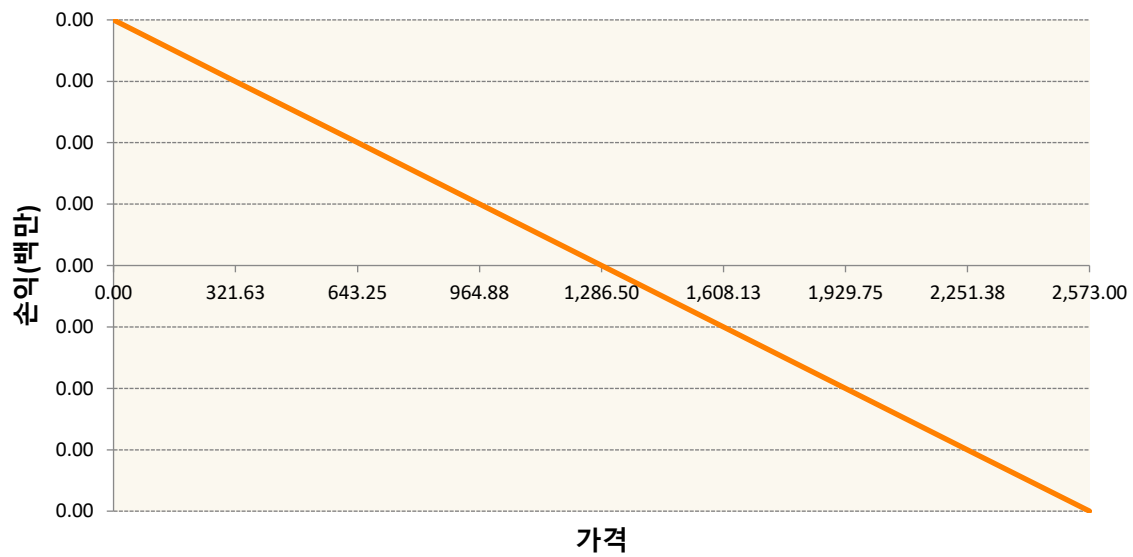
COU2-BRENT CRUDE FUTR Sep22



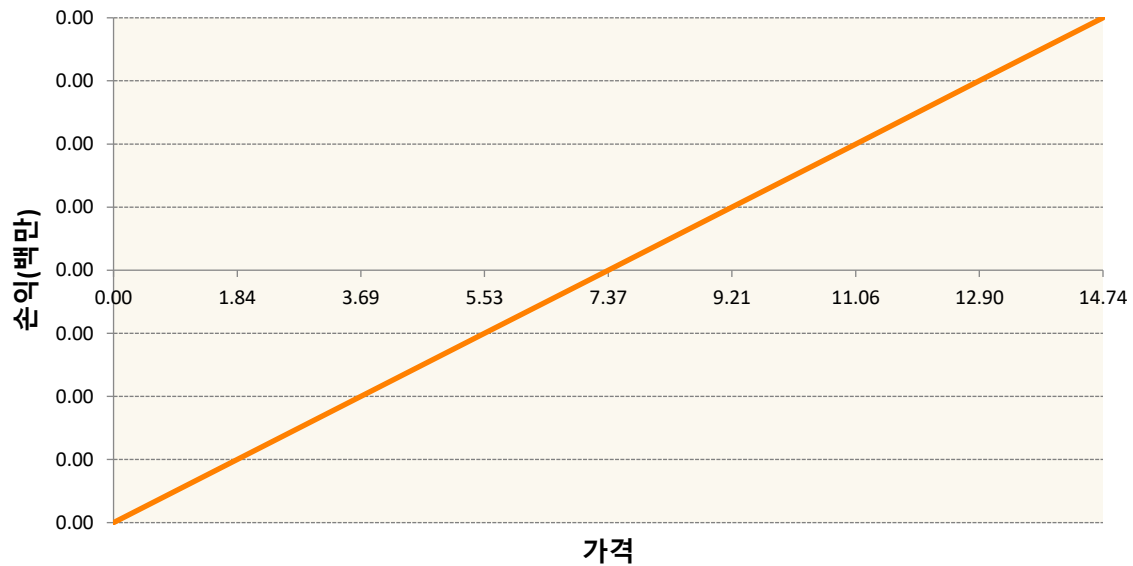
HOU2-NY Harb ULSD Fut Sep22

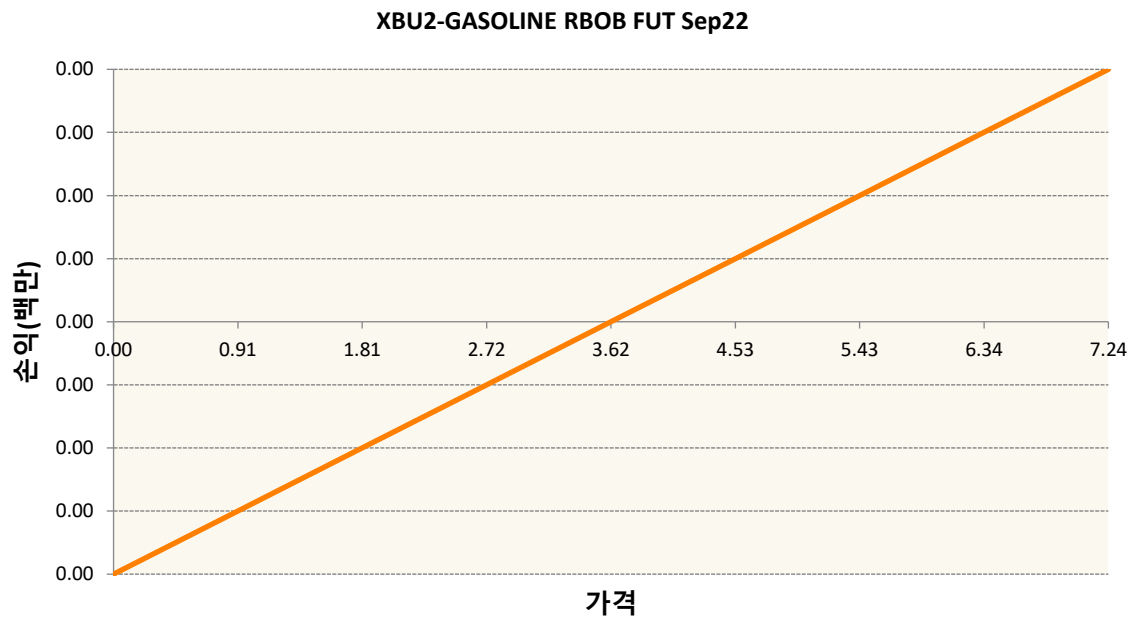
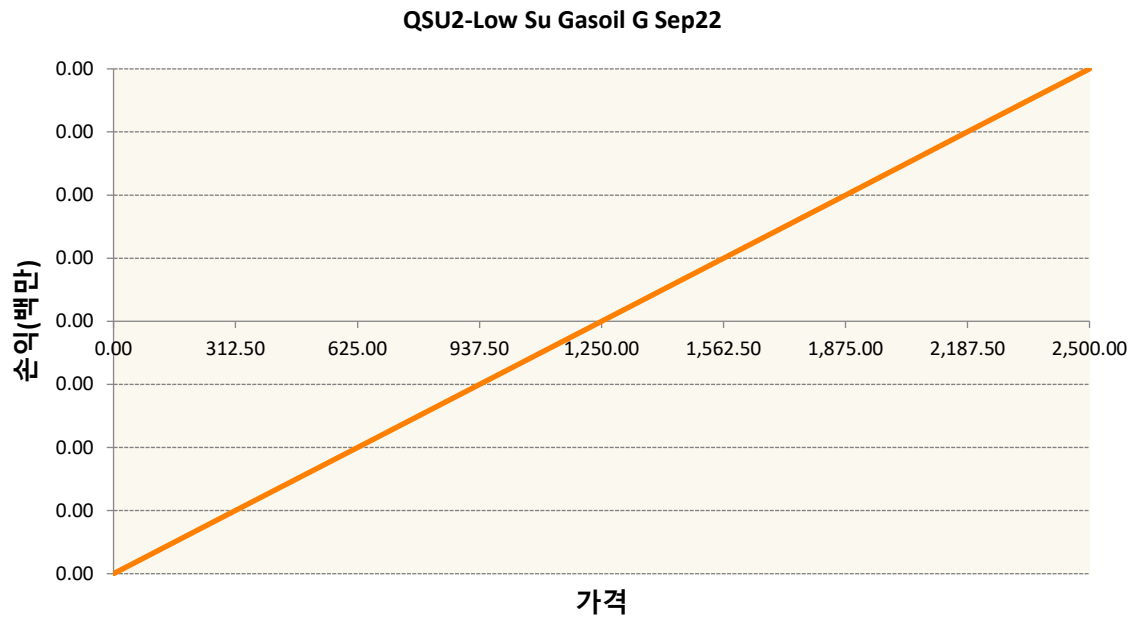


KR4175S70001-2022-07 달러선물



NGU22-NATURAL GAS FUTR Sep22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU2	WTI CRUDE FUTURE Sep22		46
COU2	BRENT CRUDE FUTR Sep22		48
HOU2	NY Harb ULSD Fut Sep22		18
KR4175S700 2022-07 달러선물			36
NGU22	NATURAL GAS FUTR Sep22		83
QSU2	Low Su Gasoil G Sep22		26
XBU2	GASOLINE RBOB FUT Sep22		16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		701