

공시일	2022-06-24
기준일	2022-06-23

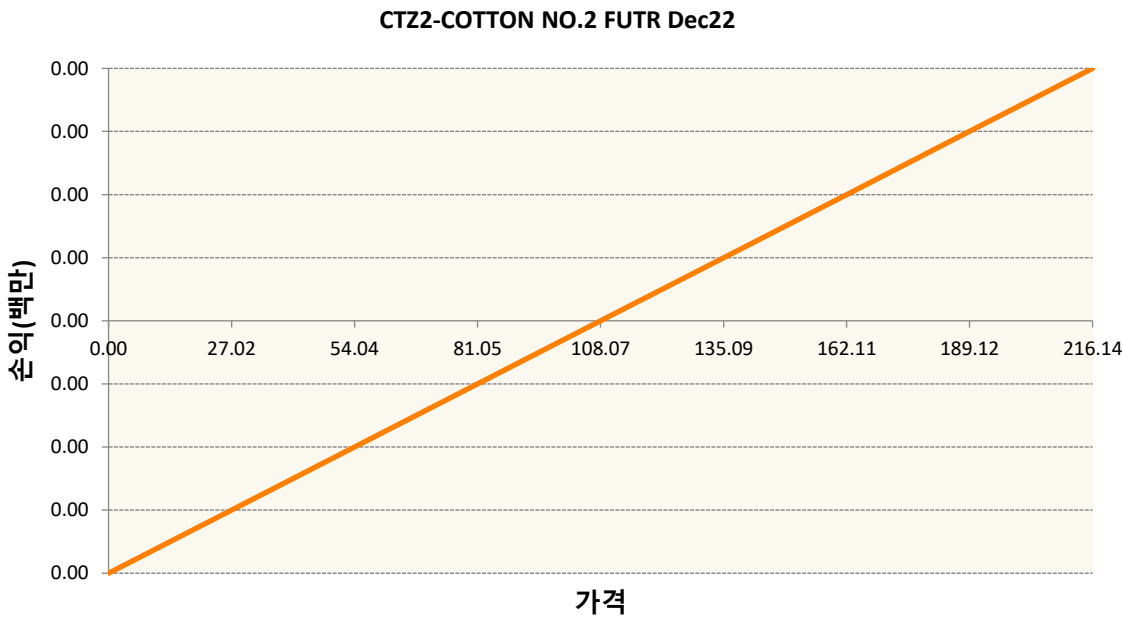
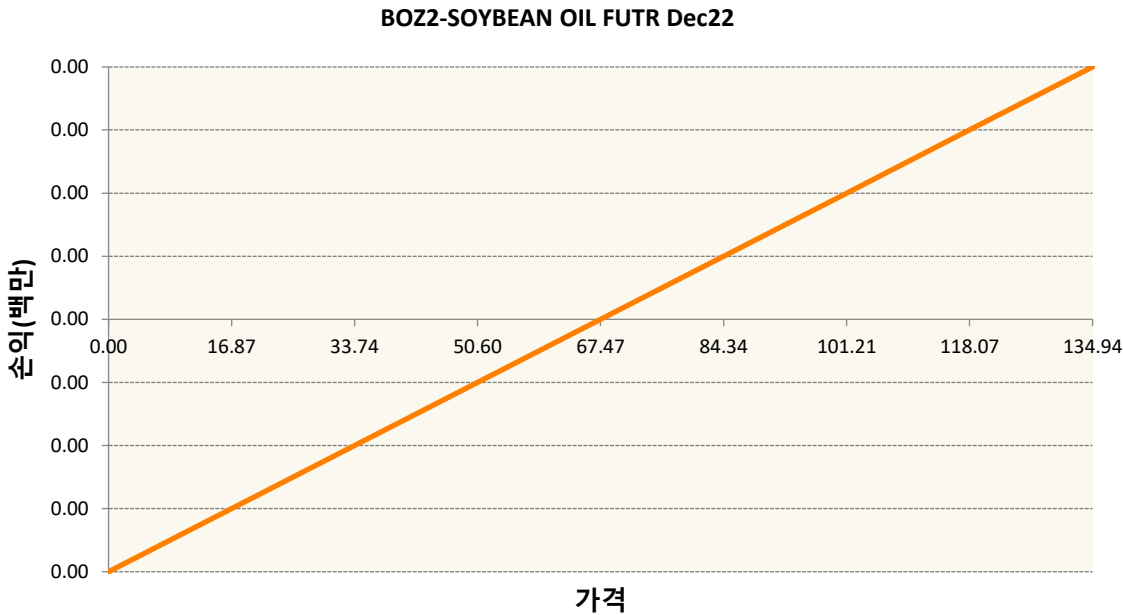
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

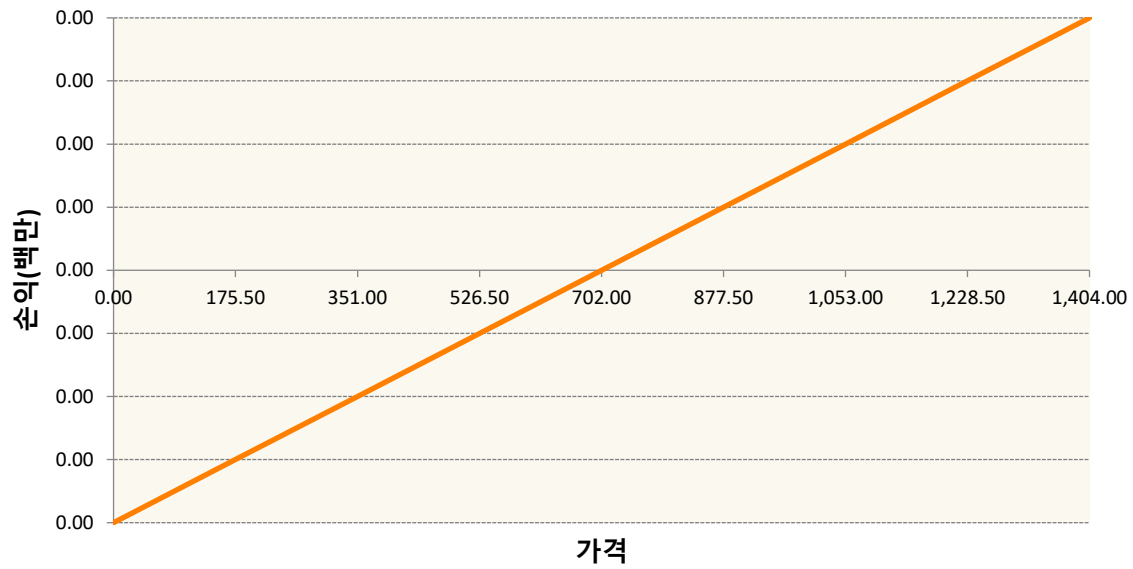
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,126	716	7,410	

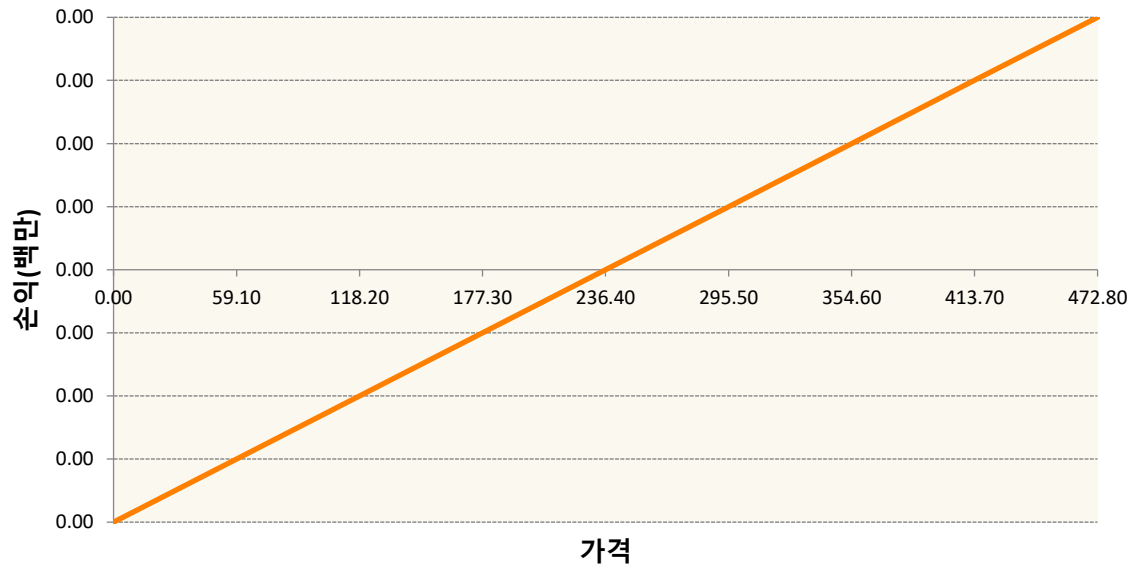
2. 만기시점의 손익구조



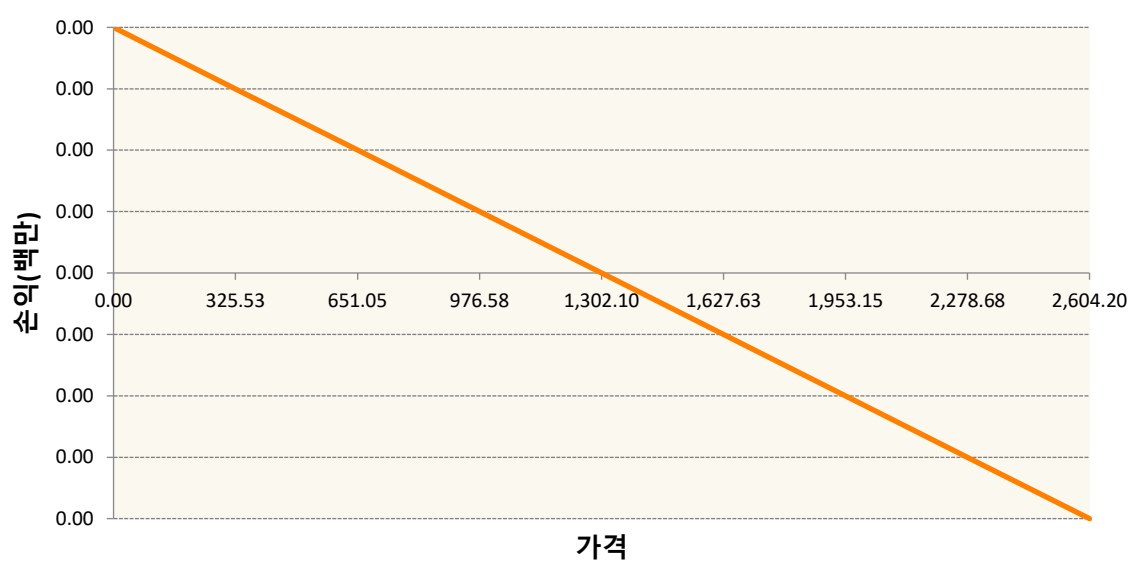
CU2-CORN FUTURE Sep22



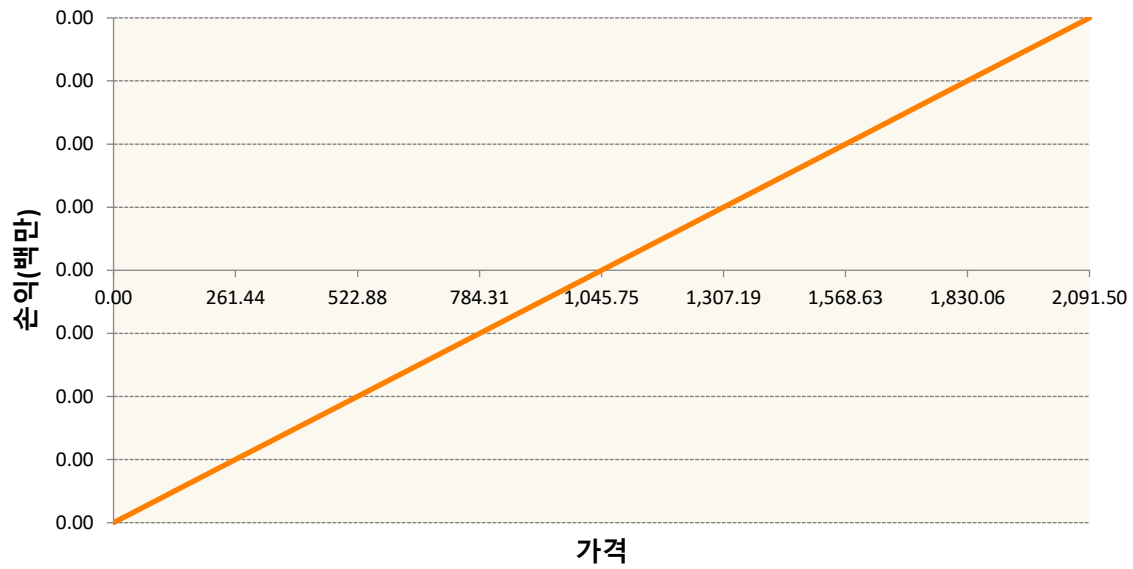
KCU2-COFFEE 'C' FUTURE Sep22



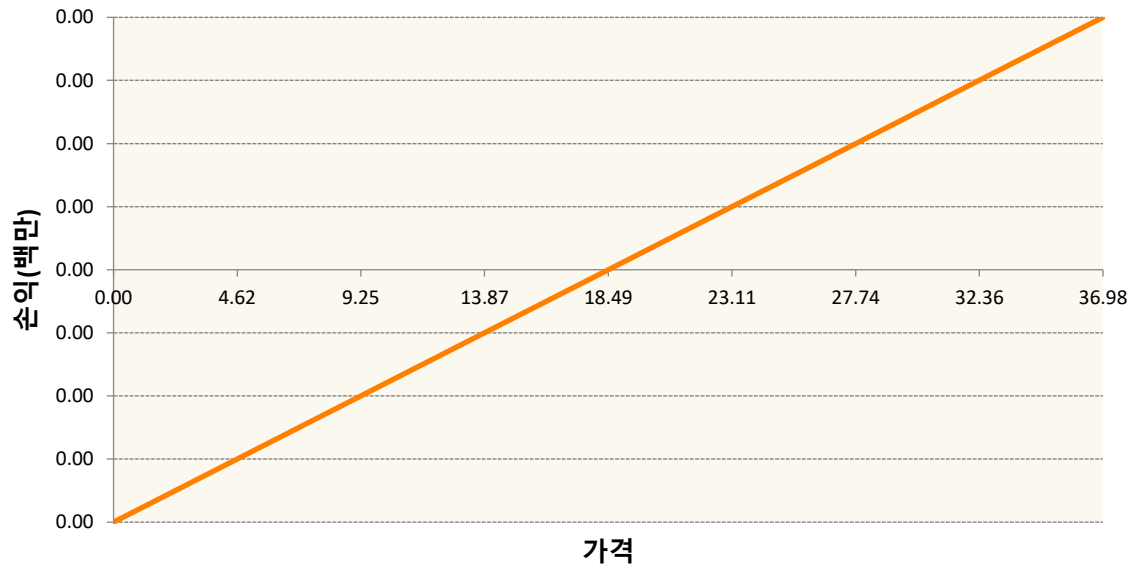
KR4175S70001-2022-07 달러선물



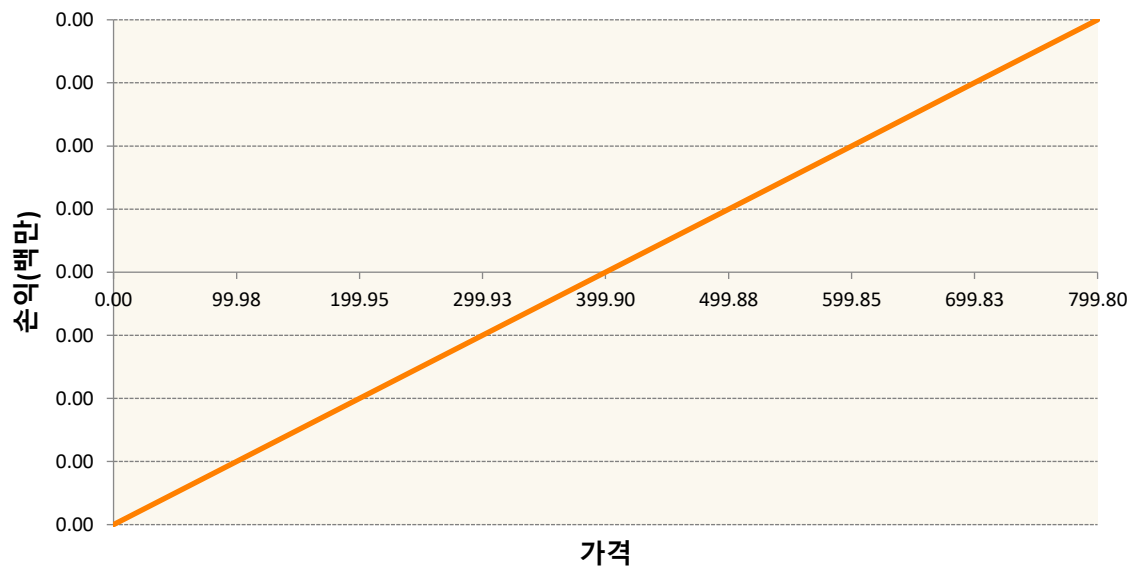
KWU2-KC HRW WHEAT FUT Sep22

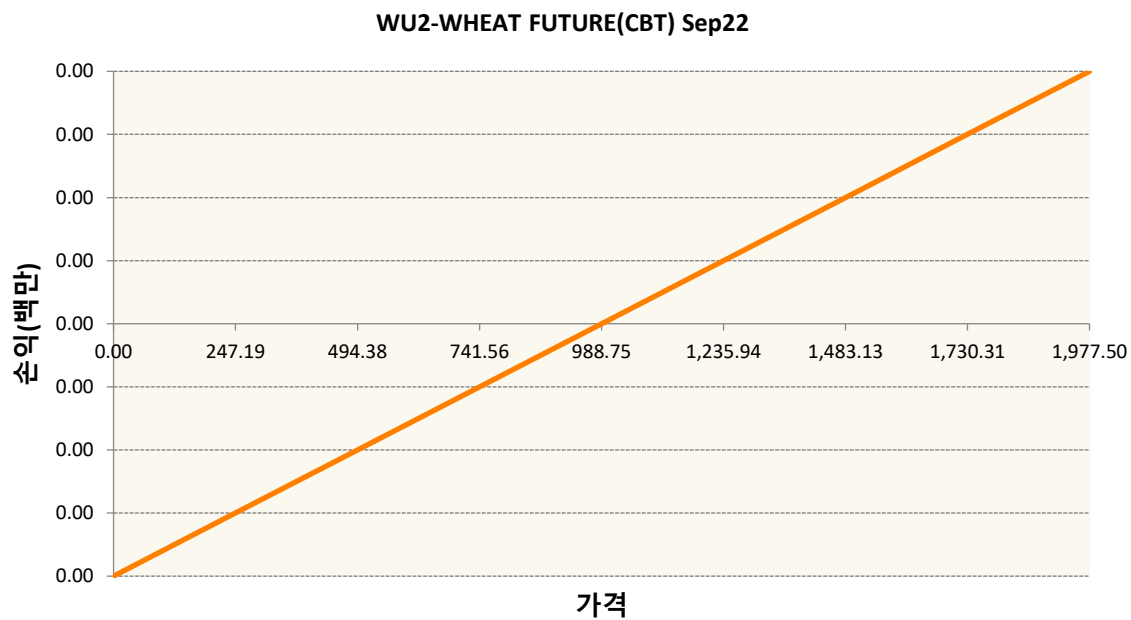
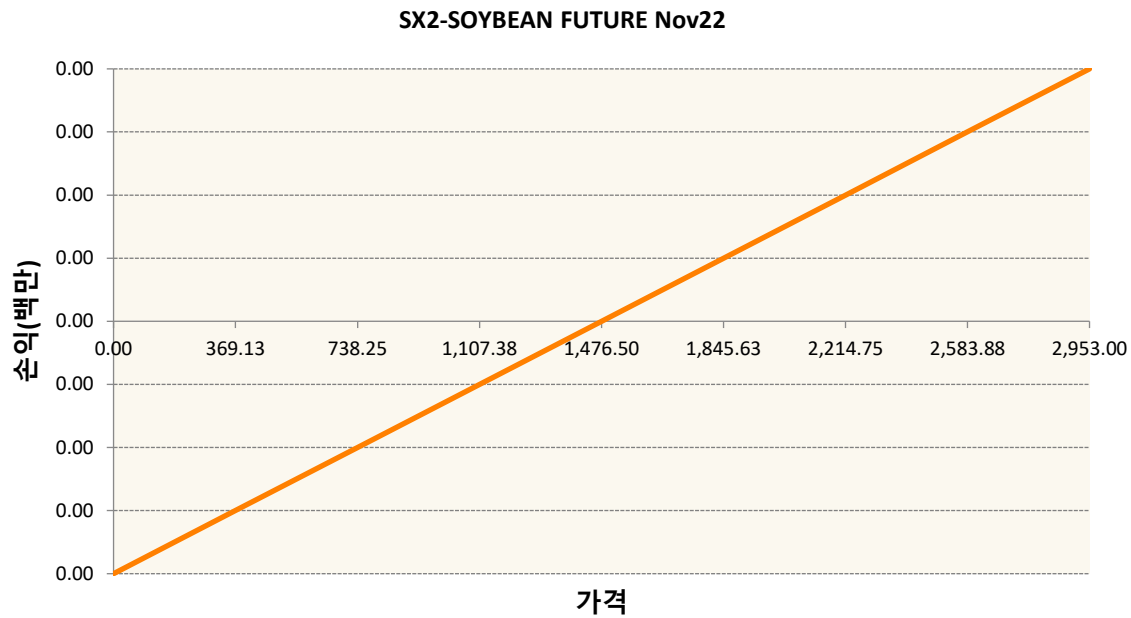


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



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	2022-06-24
기준일	2022-06-23

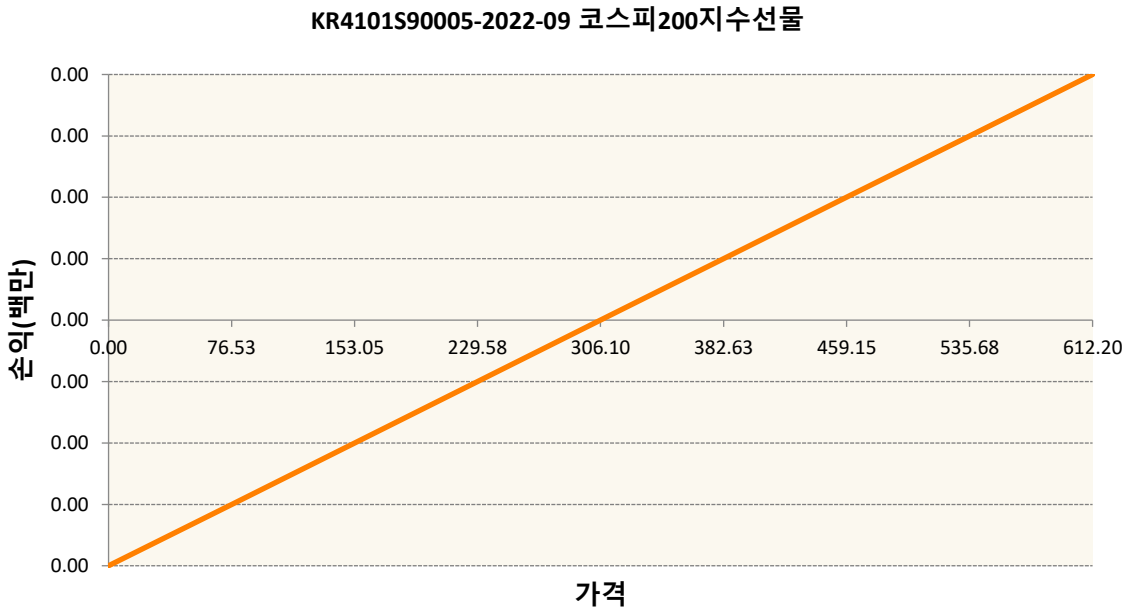
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	77	0	77	장내
누계	유가증권	선물	1,071	0	1,071	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				86
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	57	57	57	57	57	57	57
8.00%	86	86	86	86	86	86	86

공시일	2022-06-24
기준일	2022-06-23

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

363

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

468

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-06-24
기준일	2022-06-23

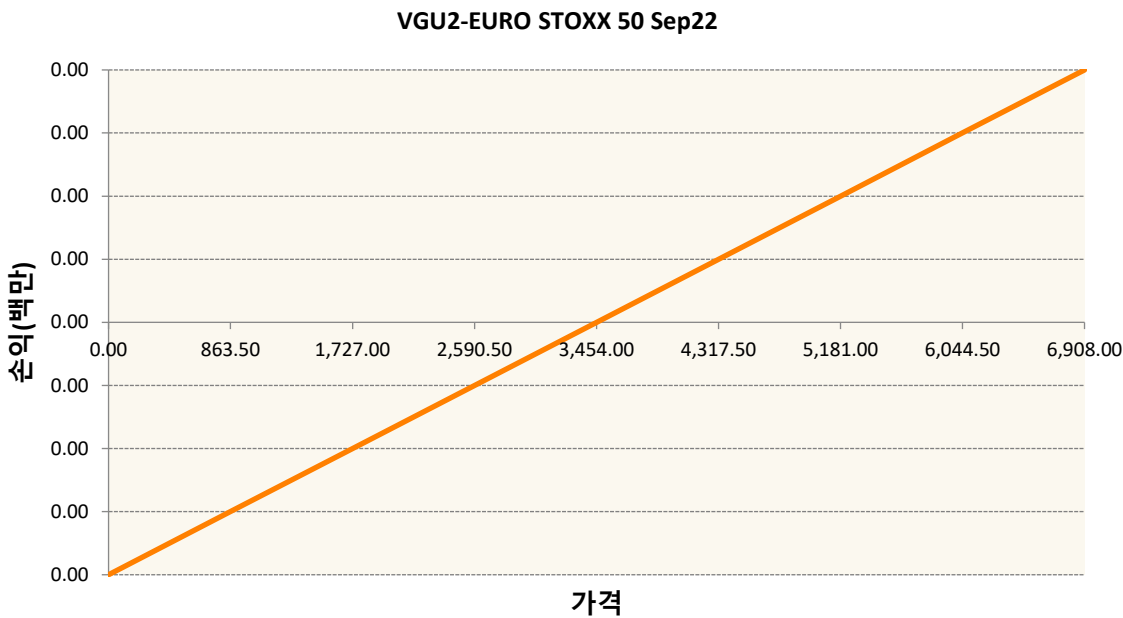
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	514	0	514	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU2	EURO STOXX 50 Sep22	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2022-06-24
기준일	2022-06-23

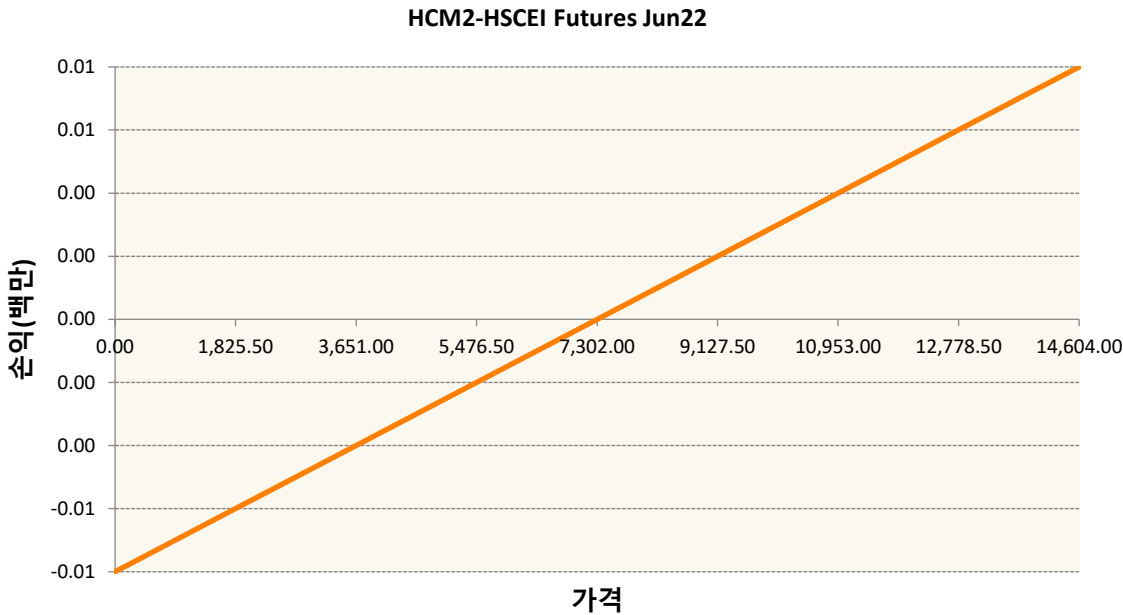
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,172	0	1,172	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM2	HSCEI Futures Jun22	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

138

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

커버드콜모(주식혼합-파생형)

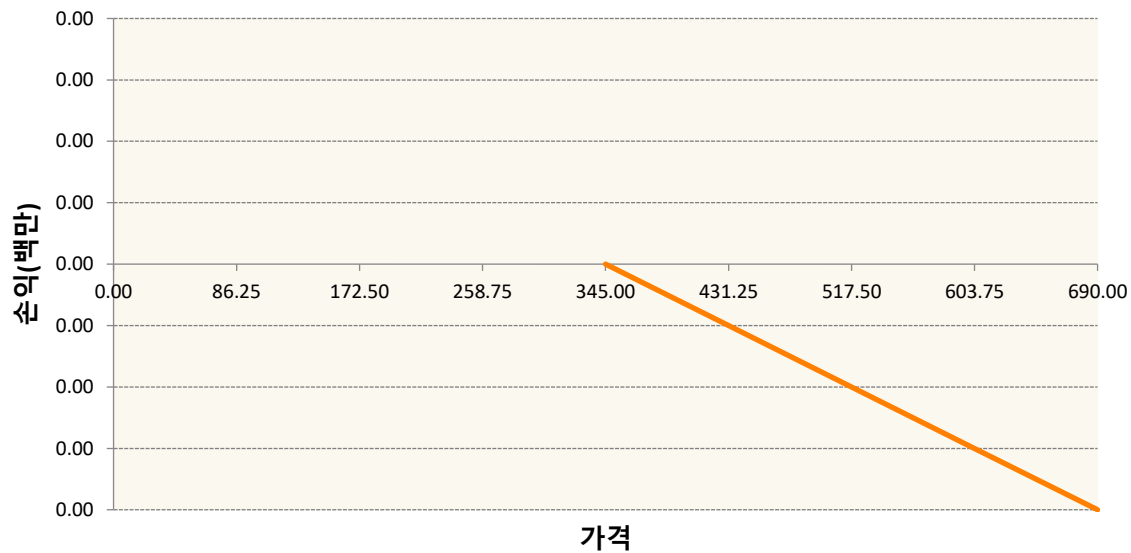
1. 계약금액

(단위:백만원)

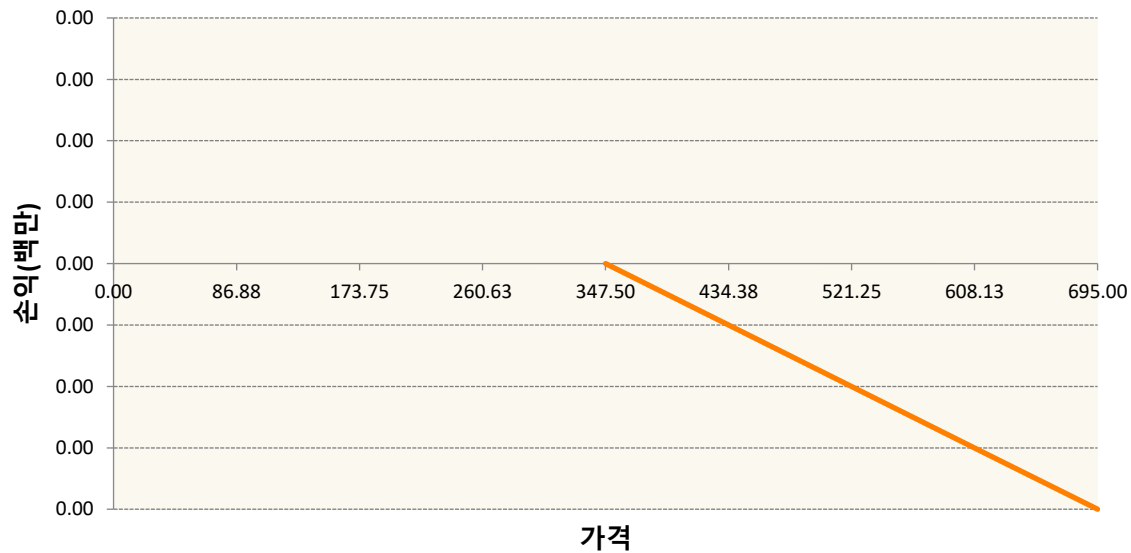
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	65,684	-65,684	장내

2. 만기시점의 손익구조

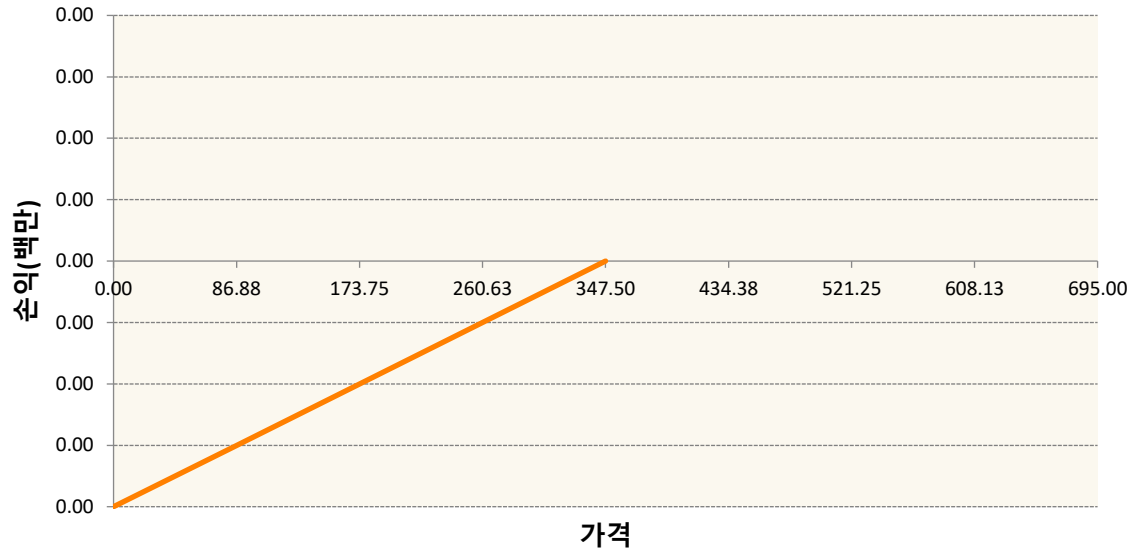
KR4201S73454-2022-07 콜345



KR4201S73470-2022-07 콜347.5



KR4301S73478-2022-07 풋347.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S73454		2022-07 콜345					454
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	55	54	52	48	43	37
-5.33%	54	53	50	45	38	29	17
-2.67%	52	47	40	30	17	1	-18
0%	43	32	18	0	-22	-47	-75
2.67%	19	-2	-27	-56	-88	-124	-162
5.33%	-34	-69	-107	-148	-192	-238	-286
8.00%	-137	-185	-236	-289	-343	-398	-454
KR4201S73470		2022-07 콜347.5					542
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	58	56	52	47	39
-5.33%	59	57	54	49	42	31	17
-2.67%	56	52	44	33	19	0	-23
0%	48	37	21	0	-25	-55	-89
2.67%	23	0	-28	-63	-101	-144	-191
5.33%	-33	-73	-119	-169	-223	-280	-339
8.00%	-146	-206	-269	-334	-402	-471	-542
KR4301S73478		2022-07 풋347.5					837
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-836	-836	-836	-836	-836	-837	-837
-5.33%	-556	-556	-556	-556	-556	-557	-559
-2.67%	-275	-275	-276	-277	-278	-280	-283
0%	5	4	3	0	-4	-8	-14

2.67%	283	280	276	270	263	254	244
5.33%	554	547	537	526	514	500	485
8.00%	808	794	778	760	742	723	704

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

(단위:백만원)

1,373

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

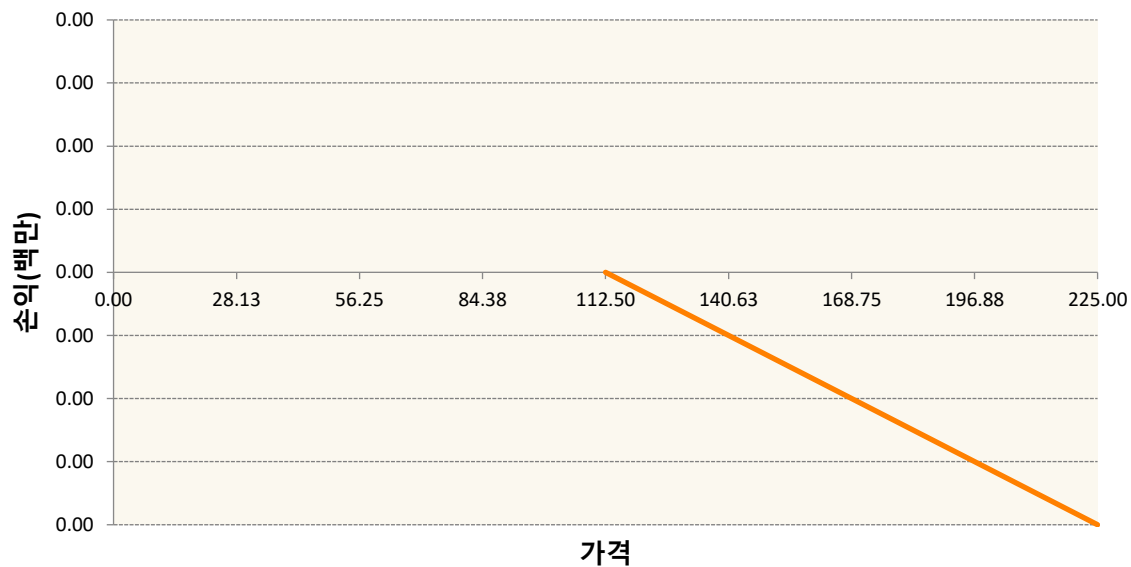
1. 계약금액

(단위:백만원)

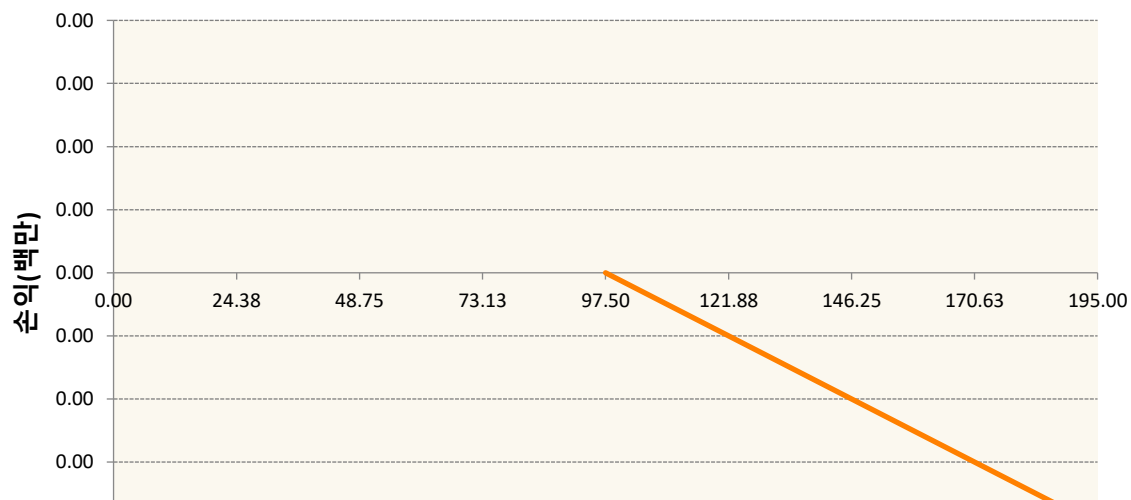
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	53	-53	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,512	-1,512	장외

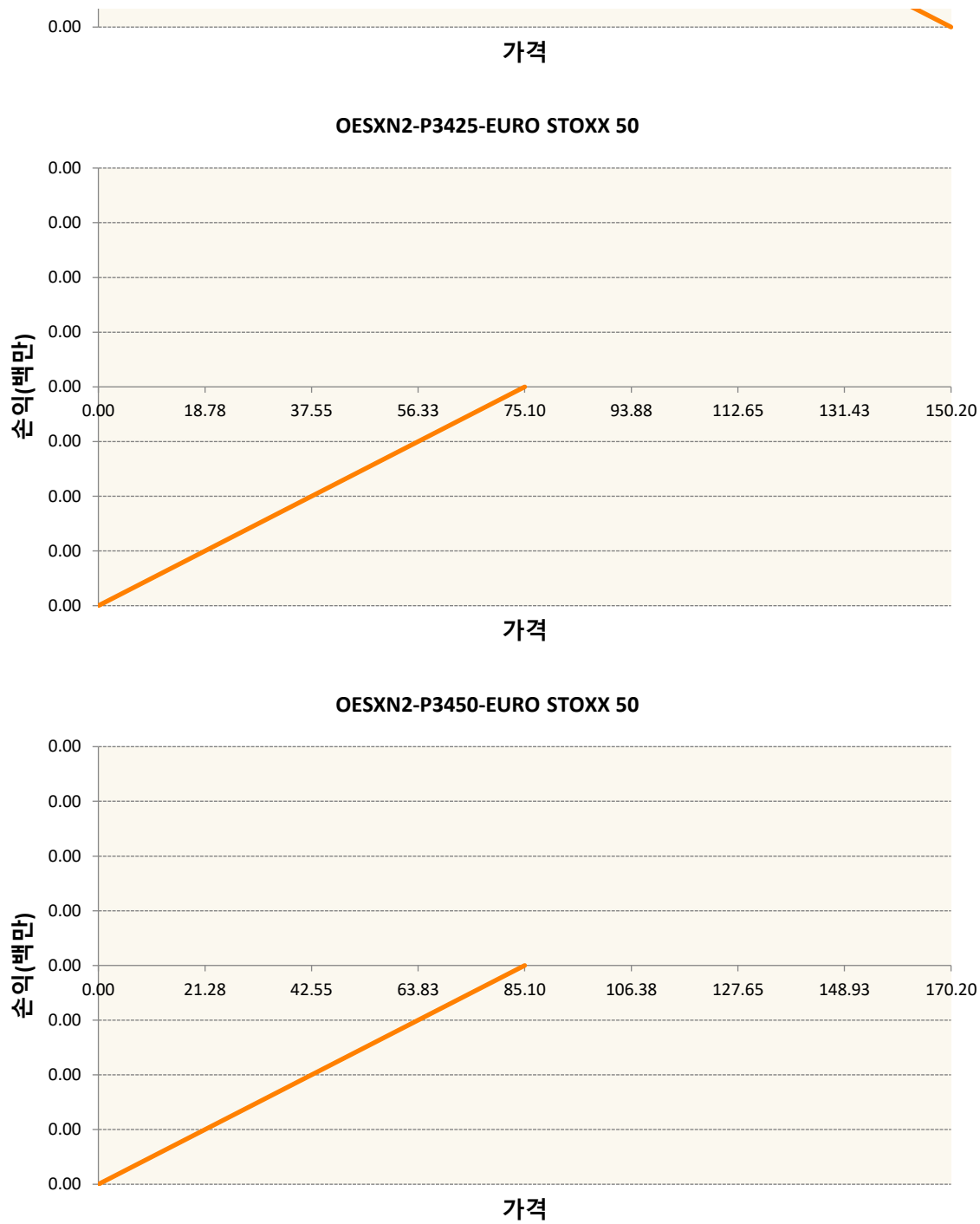
2. 만기시점의 손익구조

OESXN2-C3425-EURO STOXX 50



OESXN2-C3450-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	48
FXW213C4L KRW/EUR 24-06-22E	33
FXW213C5Q KRW/EUR 26-08-22E	88
OESXN2-C3 EURO STOXX 50	1
OESXN2-C3 EURO STOXX 50	1
OESXN2-P3 EURO STOXX 50	1
OESXN2-P3 EURO STOXX 50	1

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

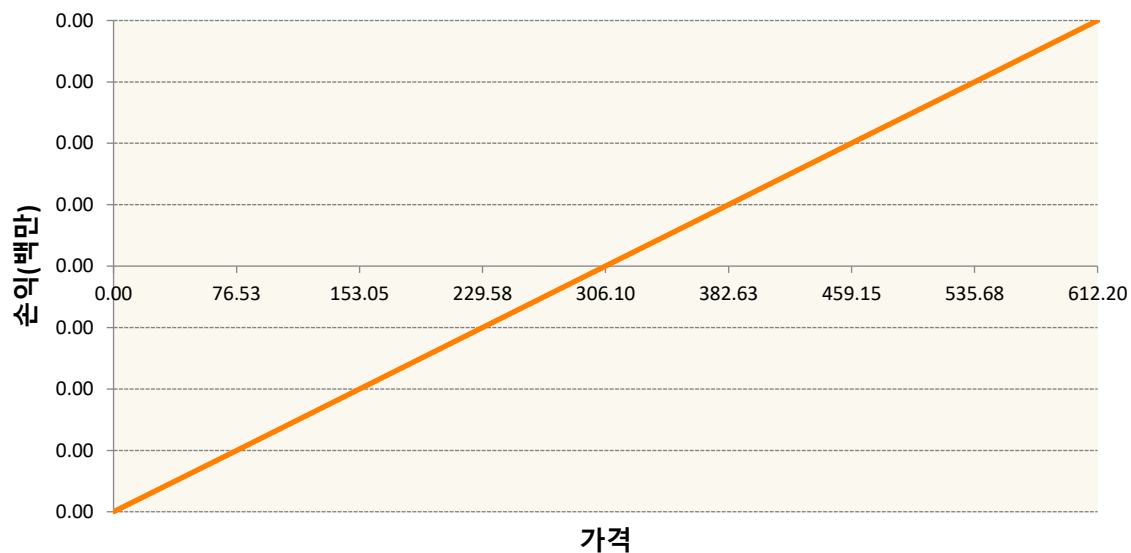
1. 계약금액

(단위:백만원)

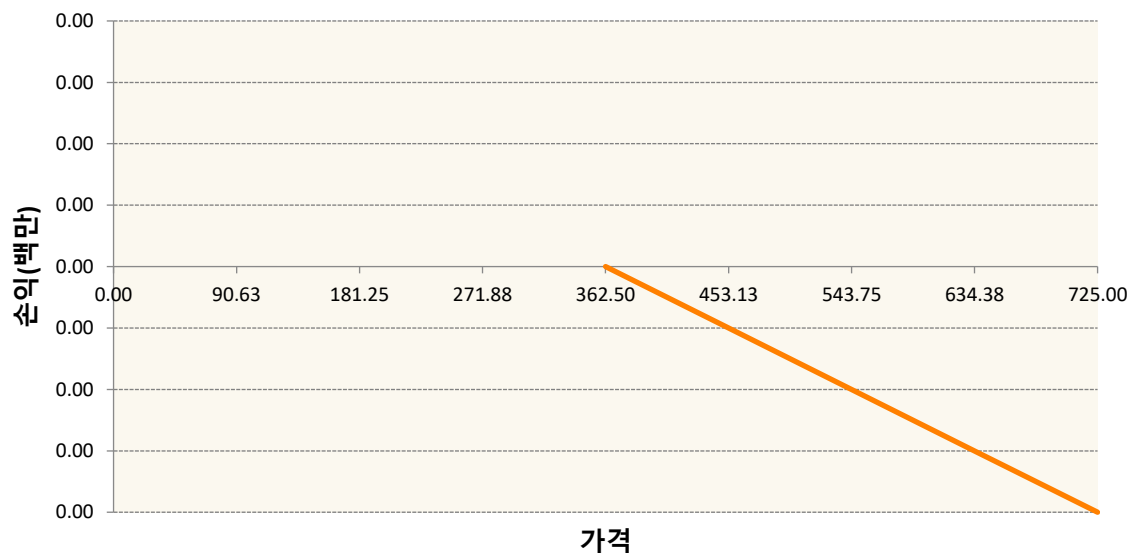
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	459	0	459	장내
누계	유가증권	옵션	261	4,731	-4,471	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



KR4201S73629-2022-07 콜362.5



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 extends to the right, indicating that profit/loss remains at 0.00 for prices greater than 365.00.

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
347.50	0.00

(단위:백만원)

KR4101S90005		2022-09 코스피200지수선물					37
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-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%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	37	37	37	37	37	37	37
KR4201S73629		2022-07 콜362.5					18
	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	0	0
-2.67%	1	1	1	1	0	0	-1
0%	1	1	0	0	-1	-2	-3
2.67%	1	0	0	-1	-3	-4	-6
5.33%	0	-1	-2	-4	-6	-8	-11
8.00%	-2	-4	-6	-9	-12	-15	-18
KR4201S73652 2022-07 콜365							22

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	0
-2.67%	1	1	1	1	0	0	-1
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	1	0	0	-2	-3	-5	-7
5.33%	0	-1	-3	-5	-7	-10	-13
8.00%	-2	-4	-7	-10	-14	-18	-22

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%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-5
5.33%	-12	-12	-12	-11	-11	-11	-11
8.00%	-18	-17	-17	-17	-16	-16	-15

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

(단위:백만원)

67

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

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 2022-06-24

기준일 2022-06-23

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	6,913	0	6,913	

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	2022-06-24
기준일	2022-06-23

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	21,728	0	21,728	
누계	통화	선도	4,361	48,049	-43,688	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C4M KRW/USD 27-06-22E	2,096
FXW213C4N USD/KRW 27-06-22E	125
FXW213C52 USD/KRW 27-06-22E	36
FXW213C5C USD/KRW 27-06-22E	16
FXW213C5J4 USD/KRW 27-06-22E	16
FXW213C6F USD/KRW 27-06-22E	31
FXW213C6G USD/KRW 27-06-22E	52
FXW213C6H USD/KRW 27-06-22E	73
FXW213C6P KRW/USD 29-08-22E	582
FXW213C6P KRW/USD 27-09-22E	583
FXW213C6P KRW/USD 27-07-22E	582
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

1,556

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

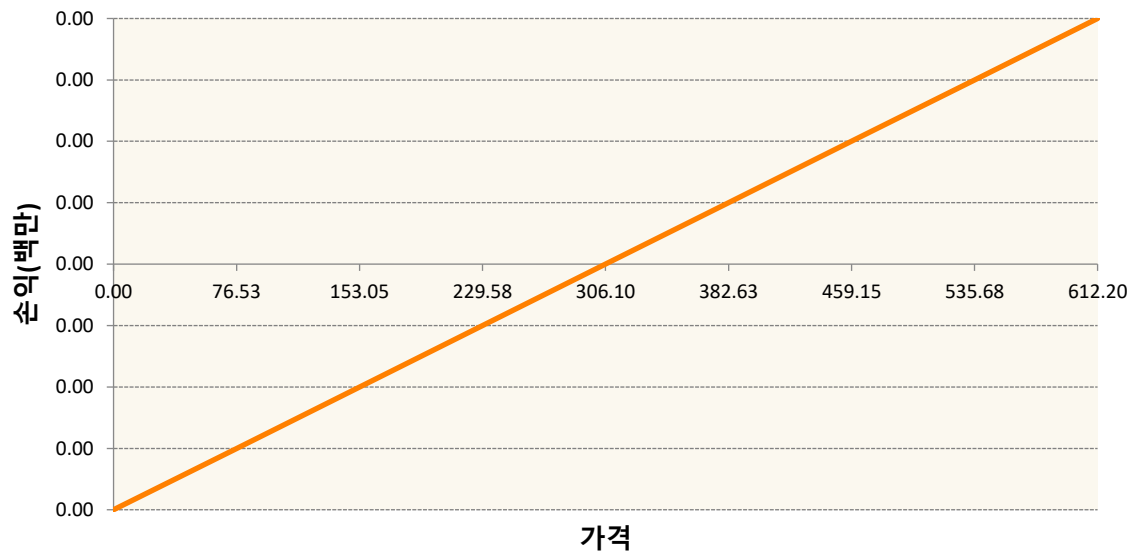
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	612	0	612	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물					49
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	33	33	33	33	33	33	33	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

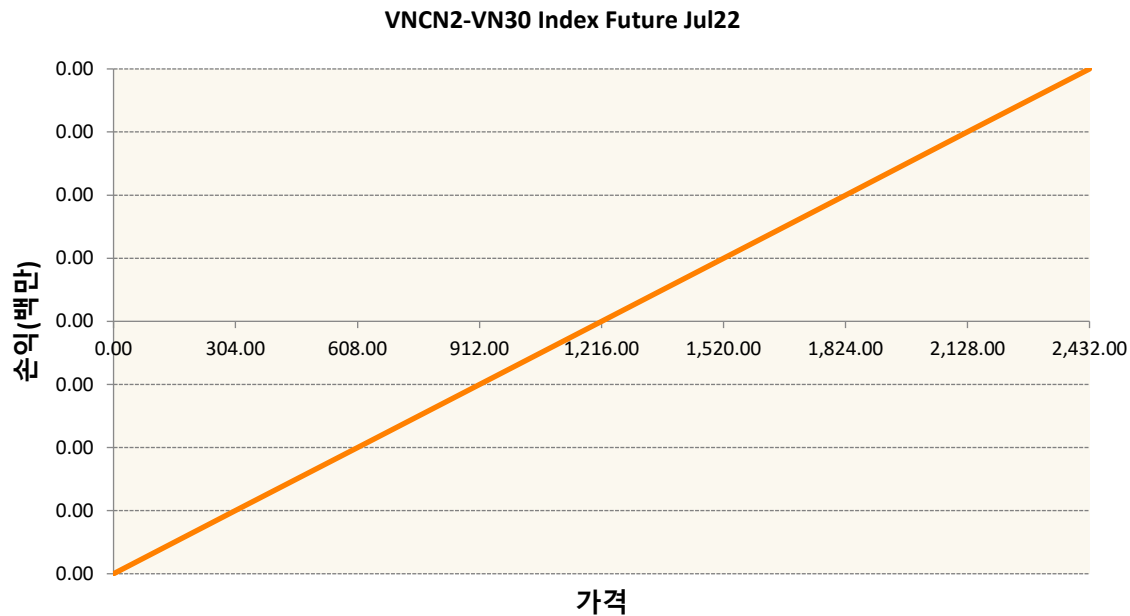
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	721	0	721	
누계	유가증권	스왑	1,777	0	1,777	장외
누계	통화	선도	0	1,347	-1,347	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	142
FXW213C3G·KRW/EUR 24-06-22E	33
FXW213C4L·KRW/EUR 22-07-22E	16
FXW213C5J4KRW/EUR 26-08-22E	31
FXW213C6N KRW/EUR 23-09-22E	27
VNCN2 VN30 Index Future Jul22	58

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

(단위:백만원)

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

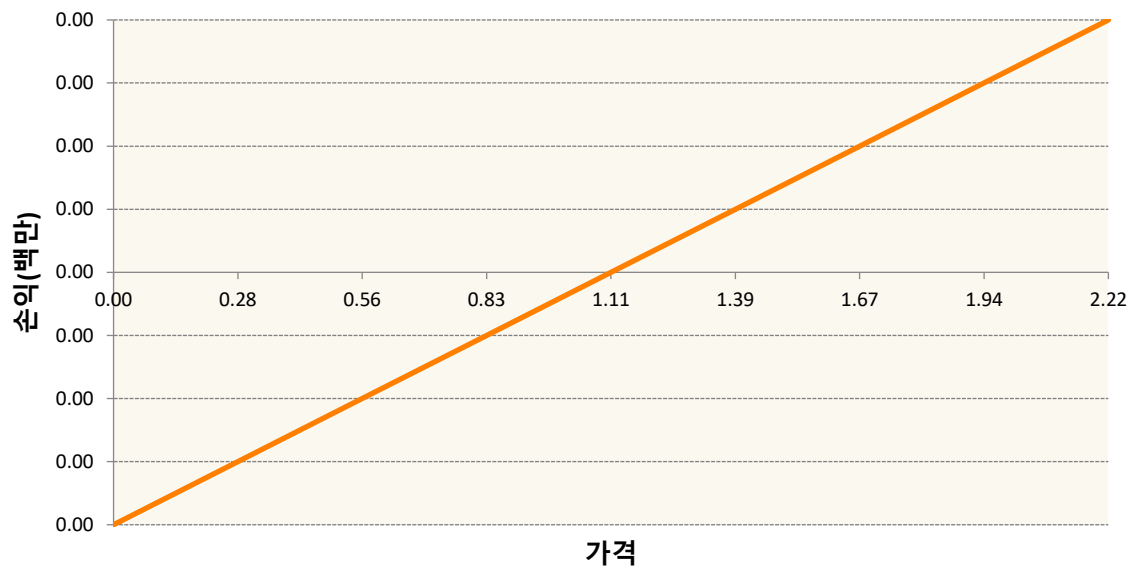
1. 계약금액

(단위:백만원)

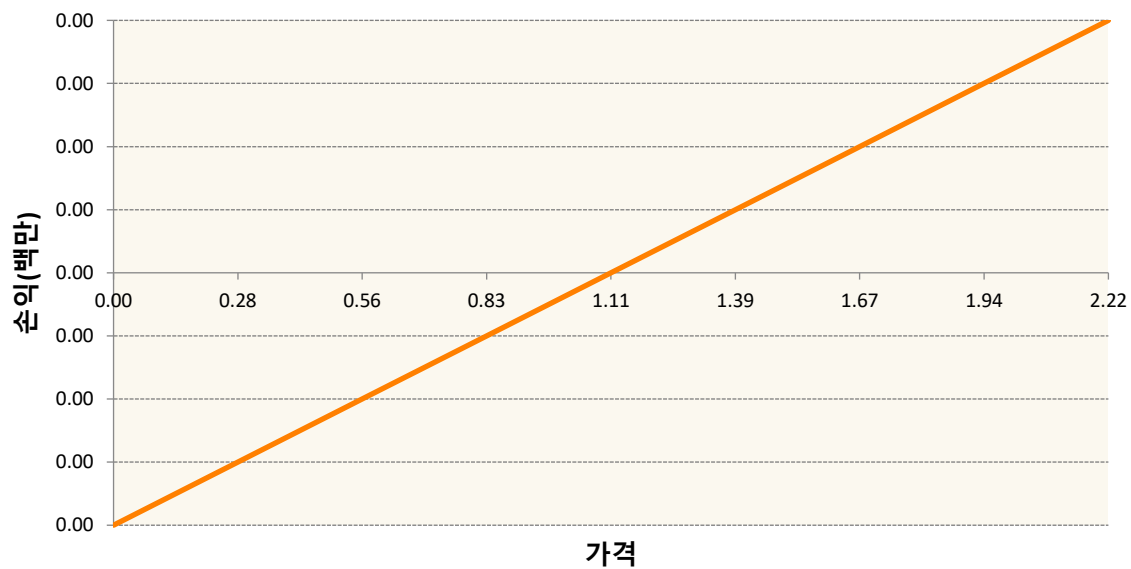
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	47,137	0	47,137	

2. 만기시점의 손익구조

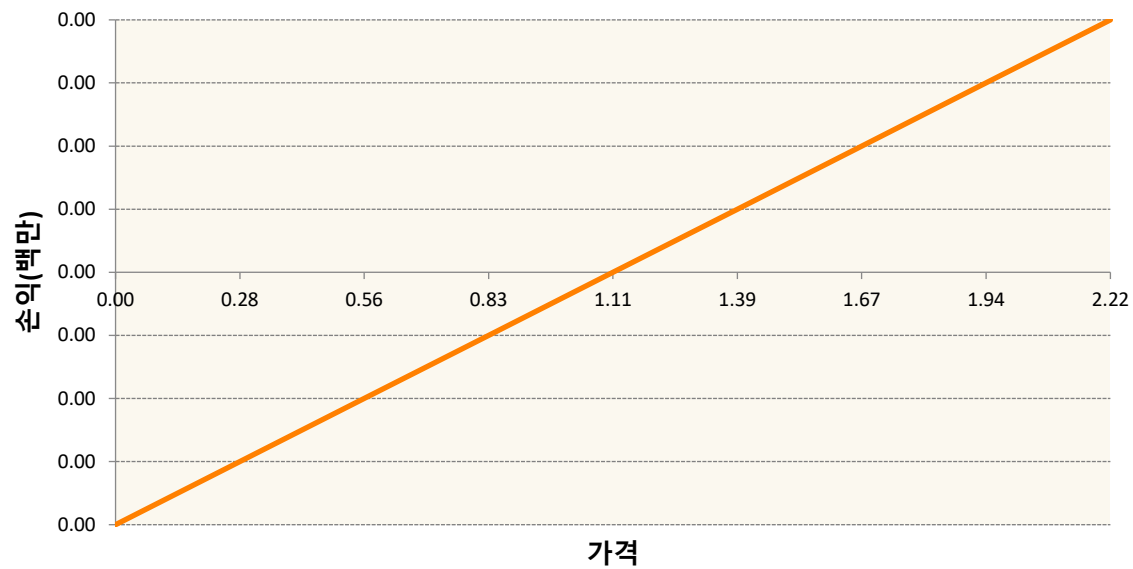
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220326-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

198

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

3,457

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

99

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

(단위:백만원)

6,947

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

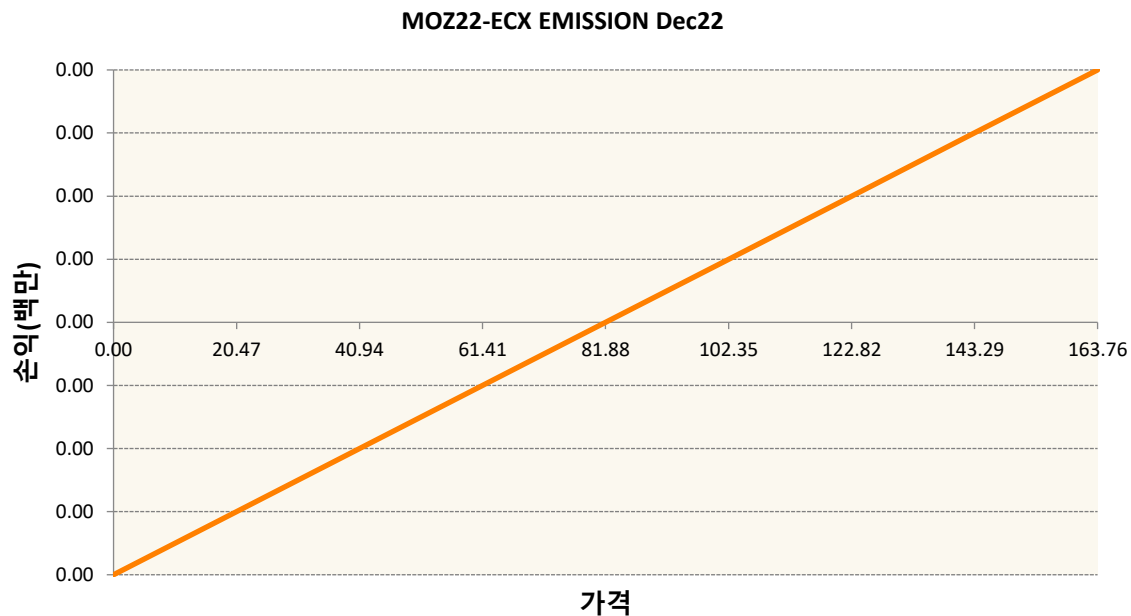
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	14,186	0	14,186	
누계	통화	선도	0	8,111	-8,111	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C5P KRW/EUR 27-06-22E

649

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

1,135

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

(단위:백만원)

3,149

공시일	2022-06-24
기준일	2022-06-23

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	11,616	0	11,616	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	1

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

(단위:백만원)

11

공시일	2022-06-24
기준일	2022-06-23

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)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220426(메리츠)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220614(메리츠)	1

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

(단위:백만원)

74

공시일	2022-06-24
기준일	2022-06-23

에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.2
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.3

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

(단위:백만원)

1

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

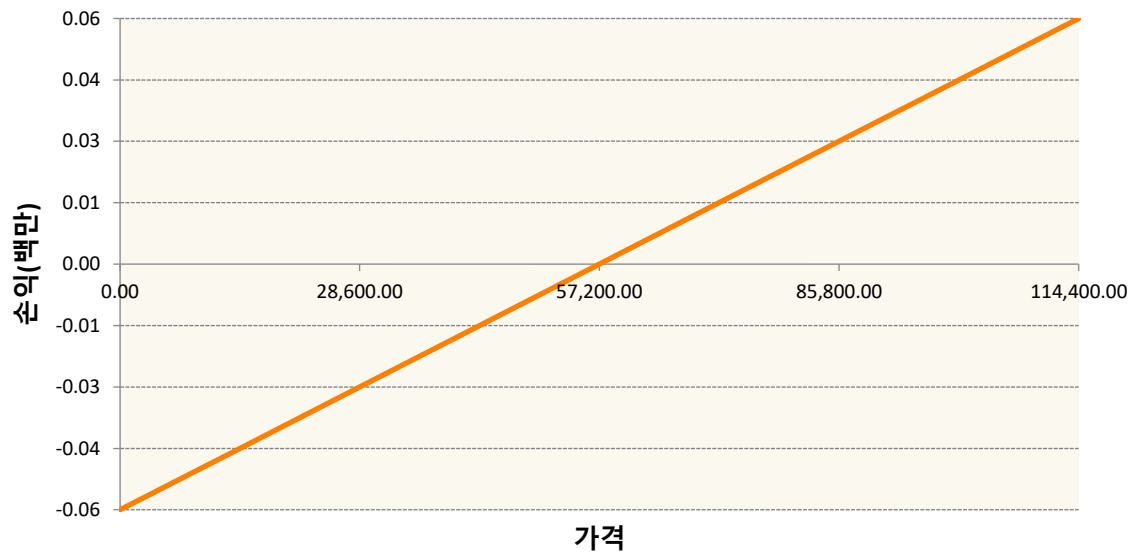
1. 계약금액

(단위:백만원)

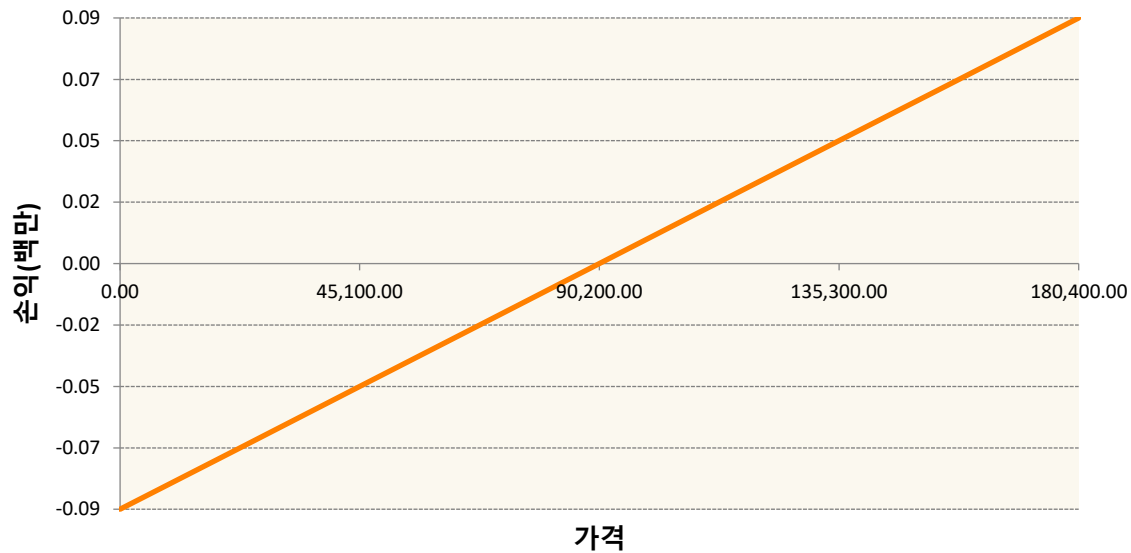
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	805	0	805	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S70006-2022-07 삼성전자개별선물



KR4150S70004-2022-07 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S70006		2022-07 삼성전자개별선물					33
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-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%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	33	33	33	33	33	33	33
KR4150S70004		2022-07 SK하이닉스개별선물					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

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

72

공시일	2022-06-24
기준일	2022-06-23

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

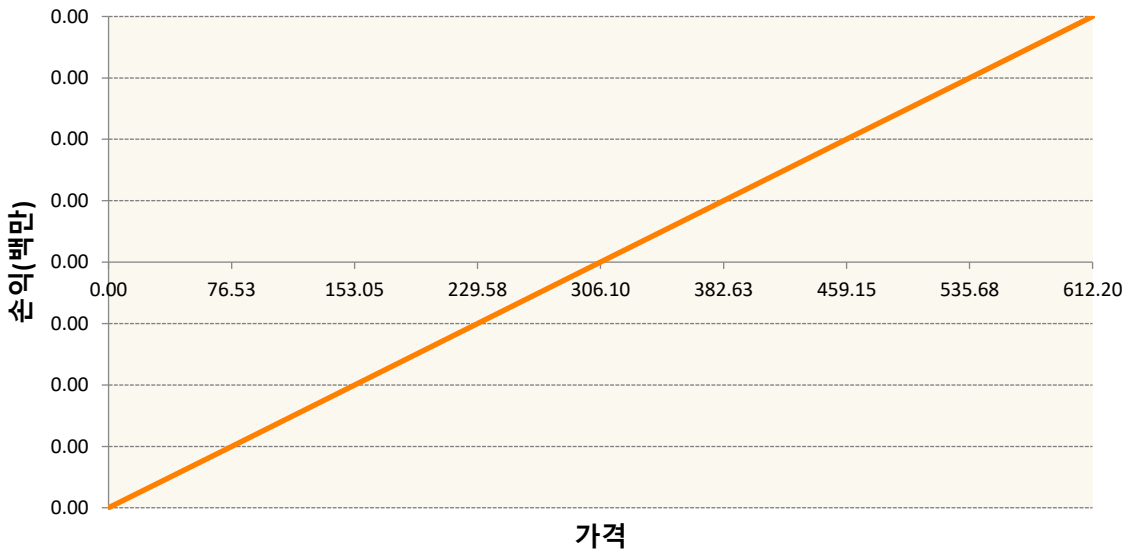
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	459	0	459	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				37
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-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%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

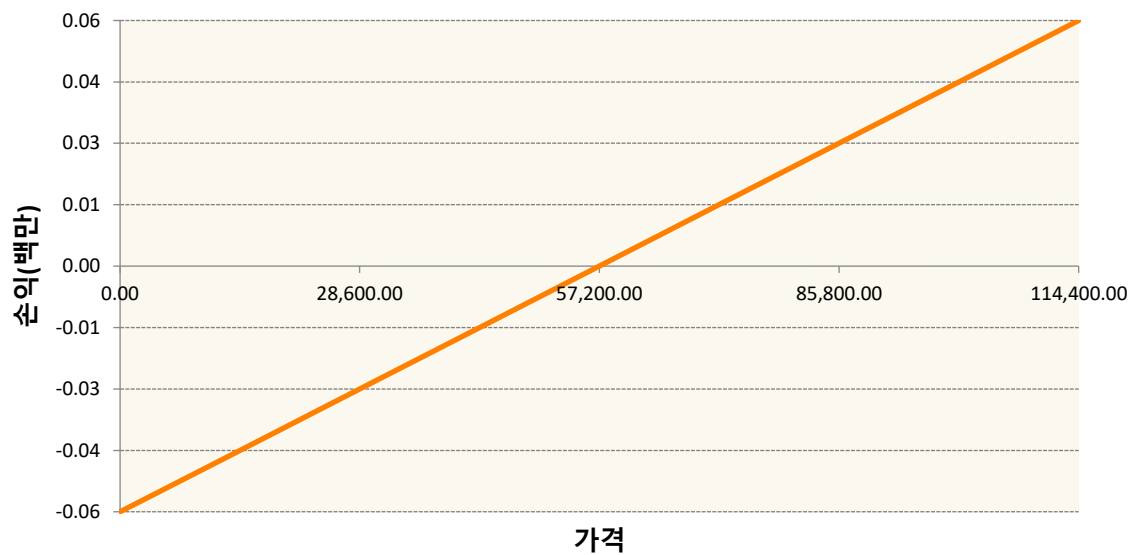
1. 계약금액

(단위:백만원)

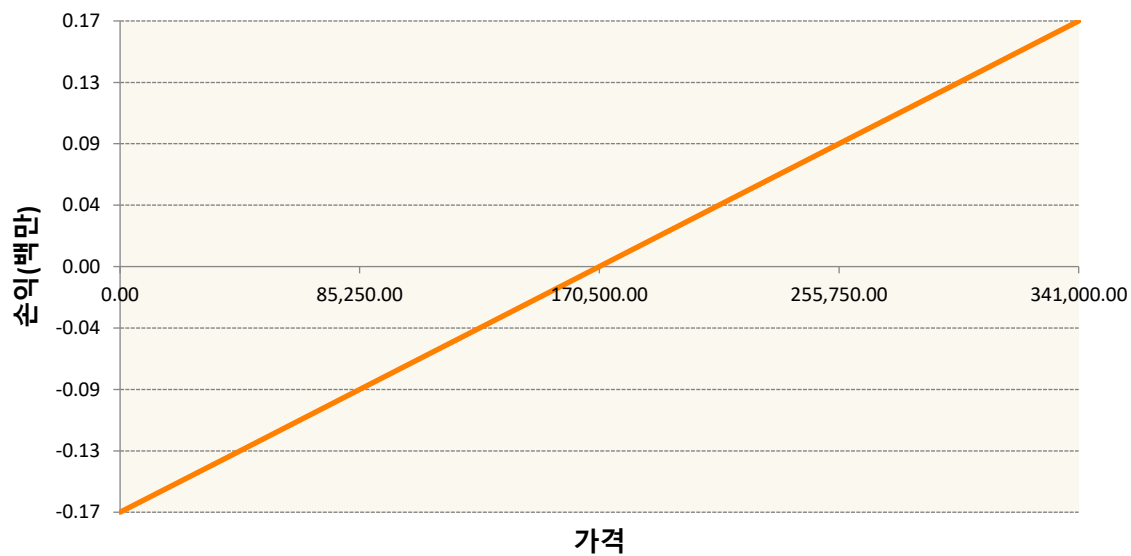
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	261	0	261	장내

2. 만기시점의 손익구조

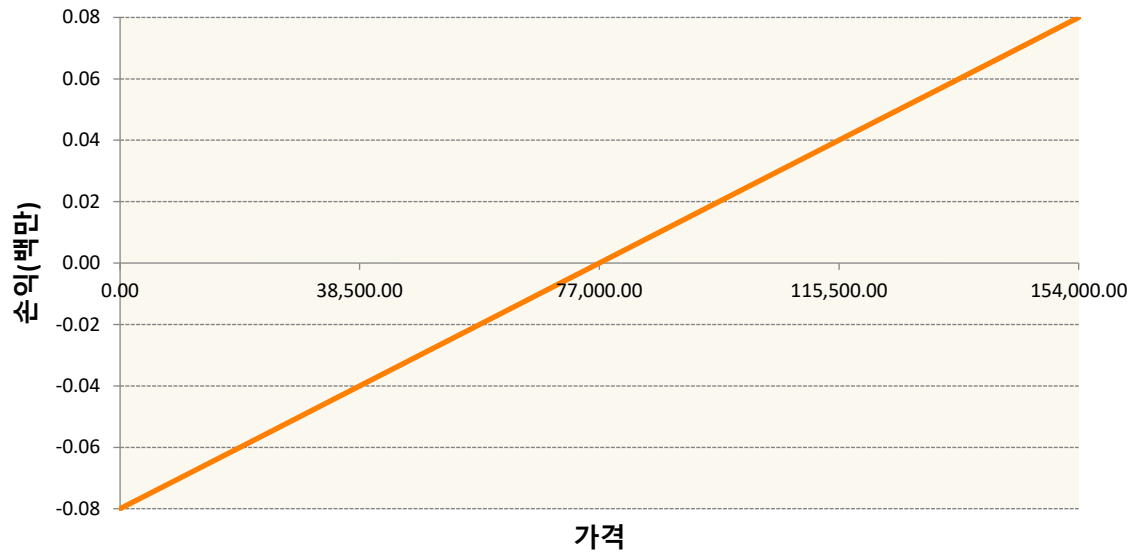
KR4111S70006-2022-07 삼성전자개별선물



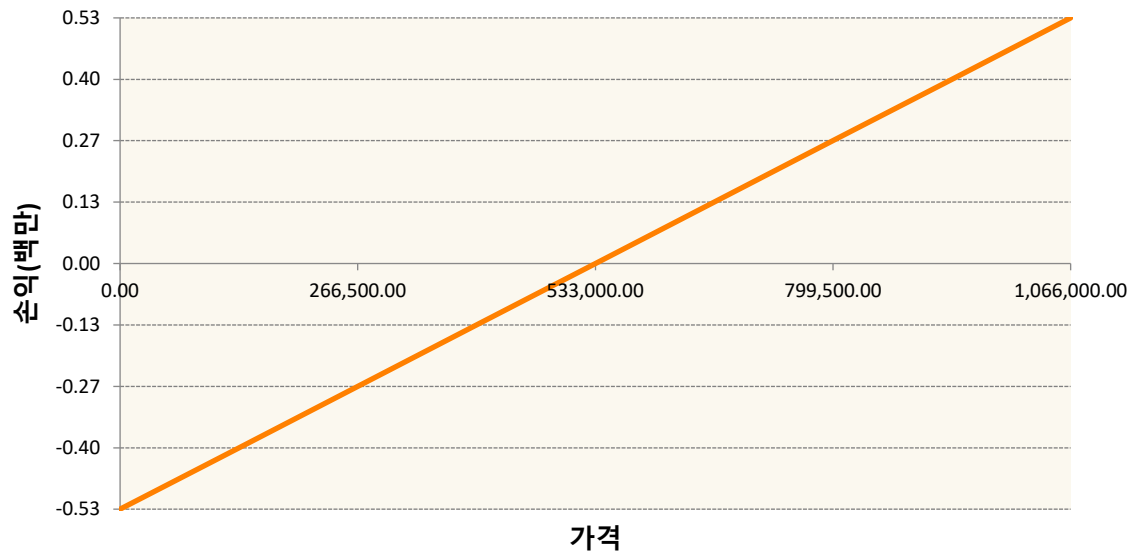
KR4116S70005-2022-07 현대차개별선물



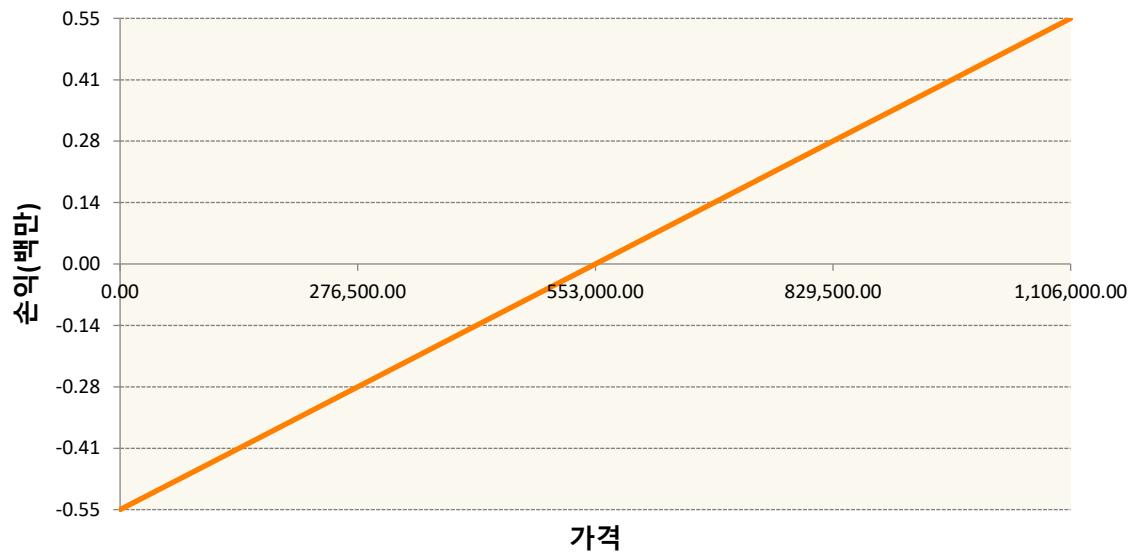
KR4119S70009-2022-07 기아개별선물



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)

21

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

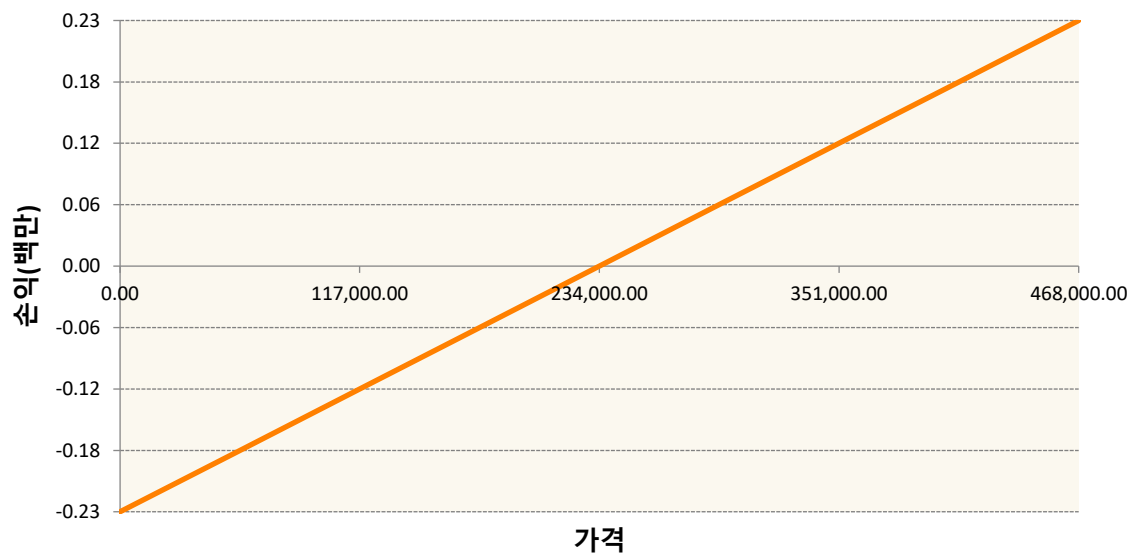
1. 계약금액

(단위:백만원)

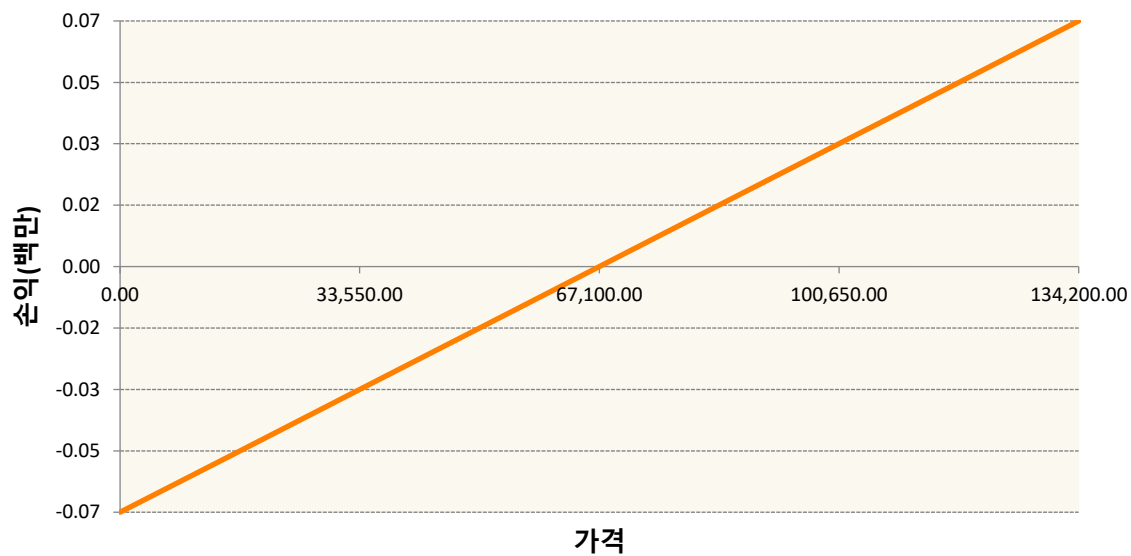
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	198	0	198	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156S70001-2022-07 NAVER개별선물



KR41CFS70002-2022-07 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156S70001		2022-07 NAVER개별선물					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
-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%	9	9	9	9	9	9	9
KR41CFS70002		2022-07 카카오개별선물					6
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

25

공시일 2022-06-24

기준일 2022-06-23

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

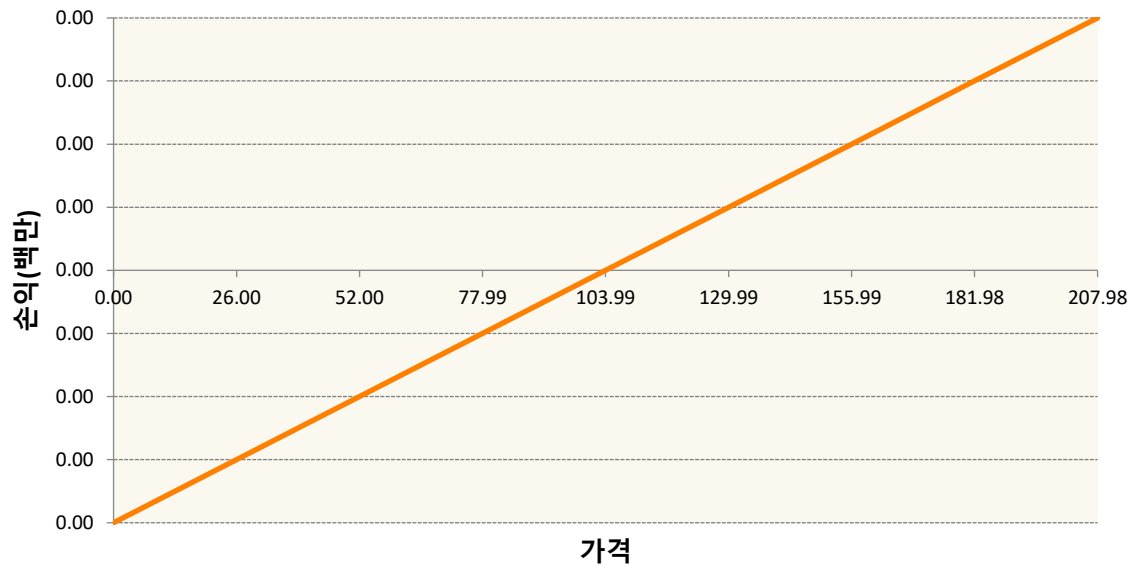
1. 계약금액

(단위:백만원)

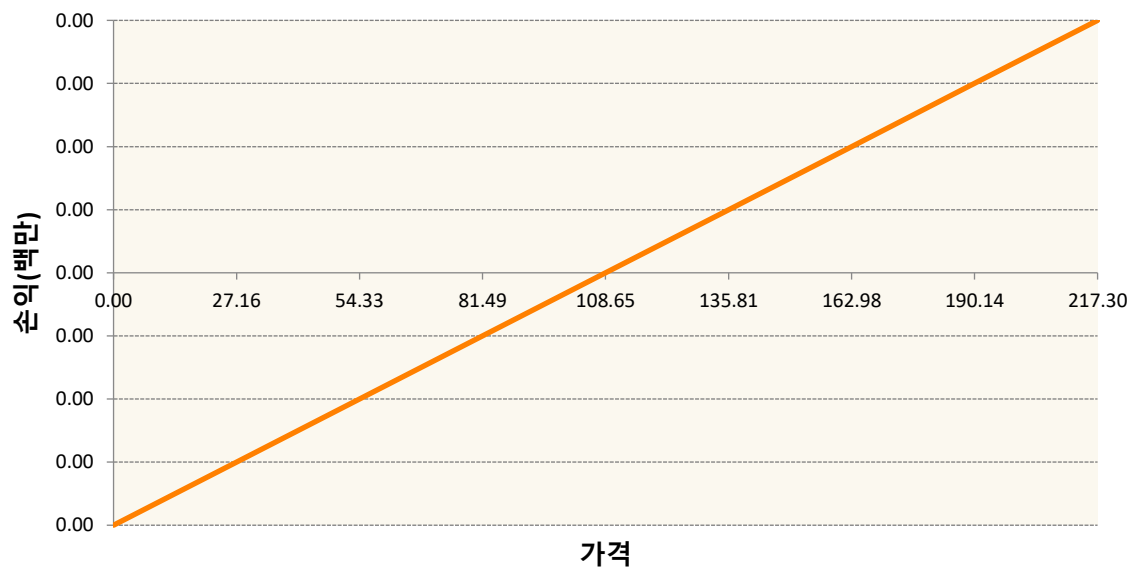
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,696	456	2,240	

2. 만기시점의 손익구조

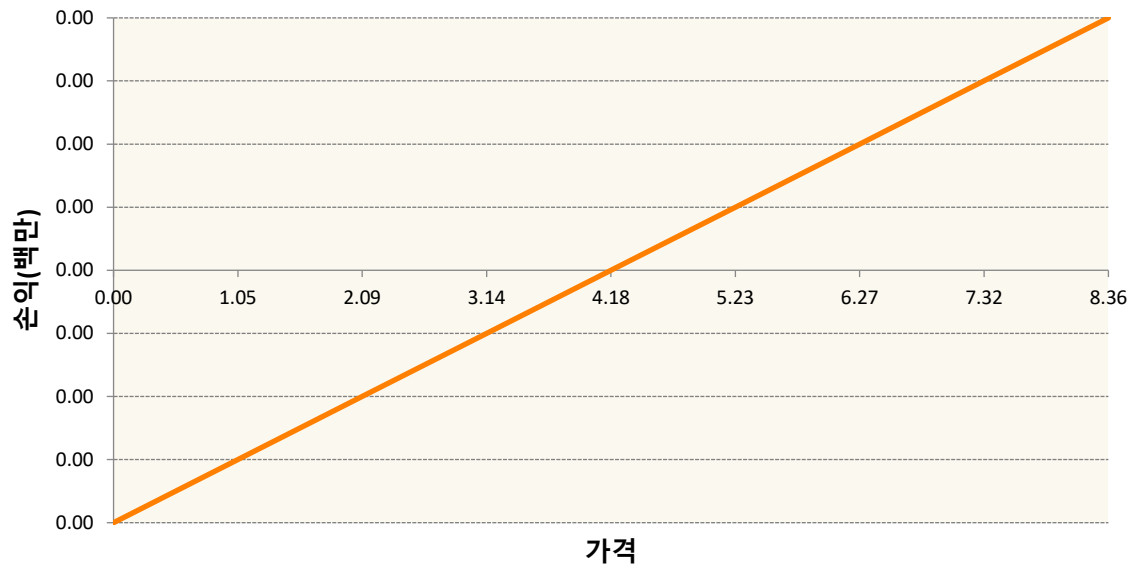
CLU2-WTI CRUDE FUTURE Sep22



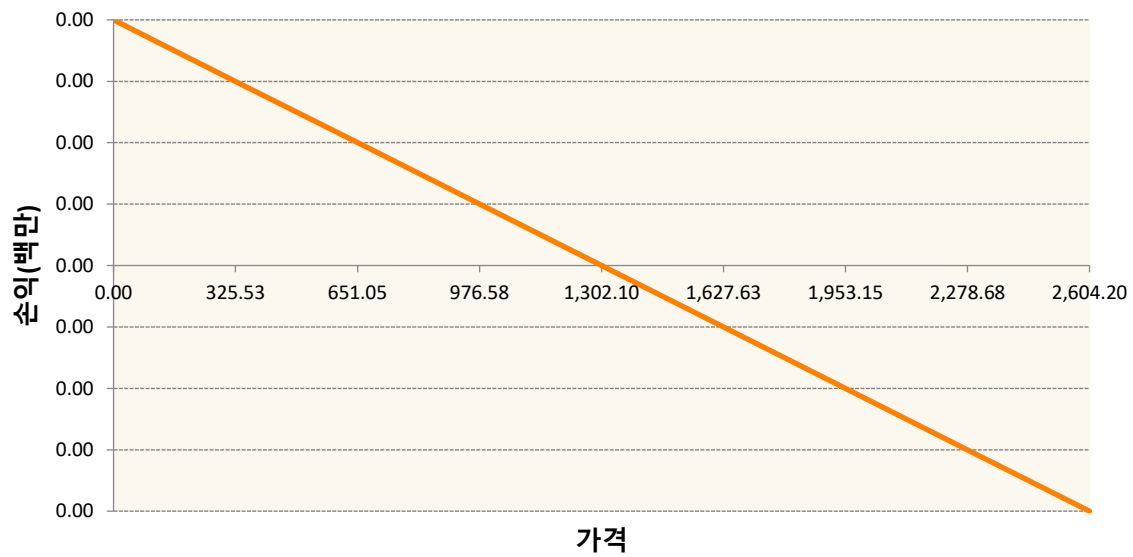
COU2-BRENT CRUDE FUTR Sep22



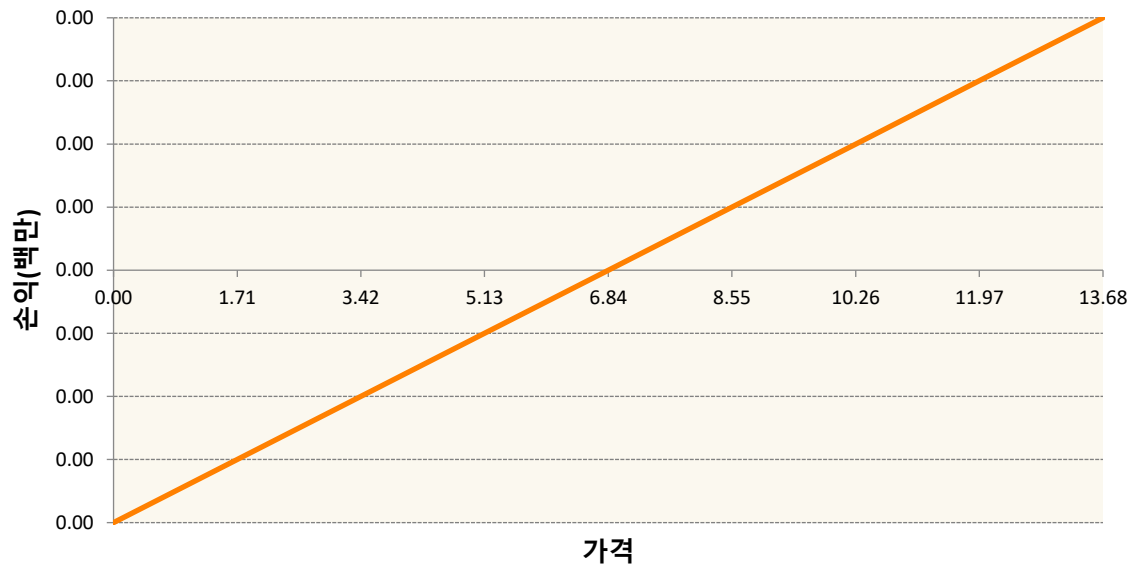
HOU2-NY Harb ULSD Fut Sep22

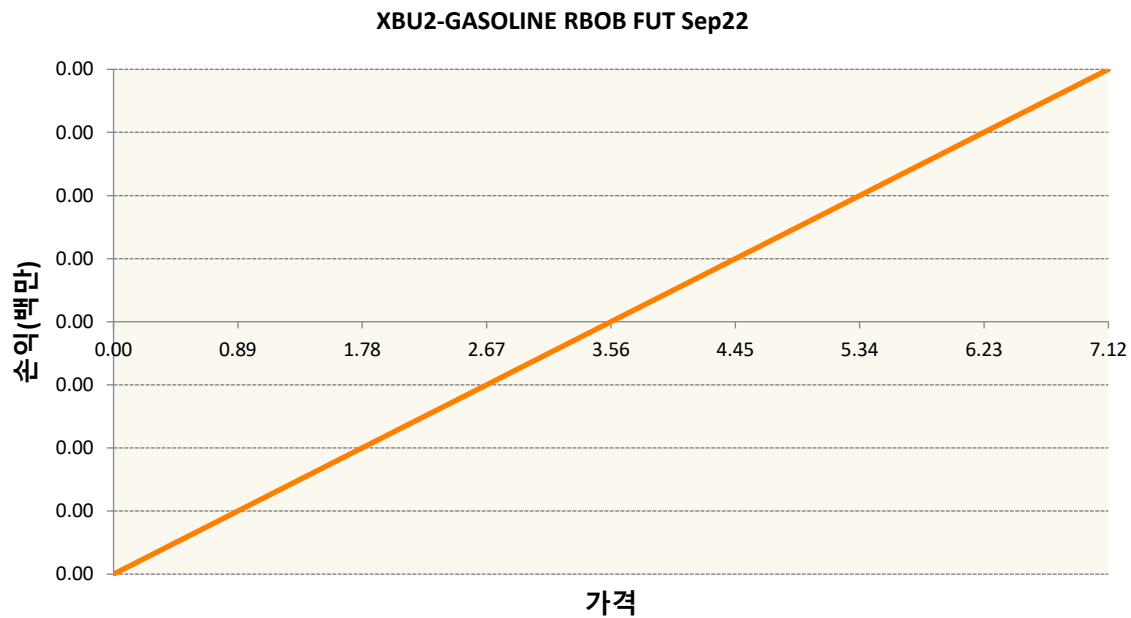
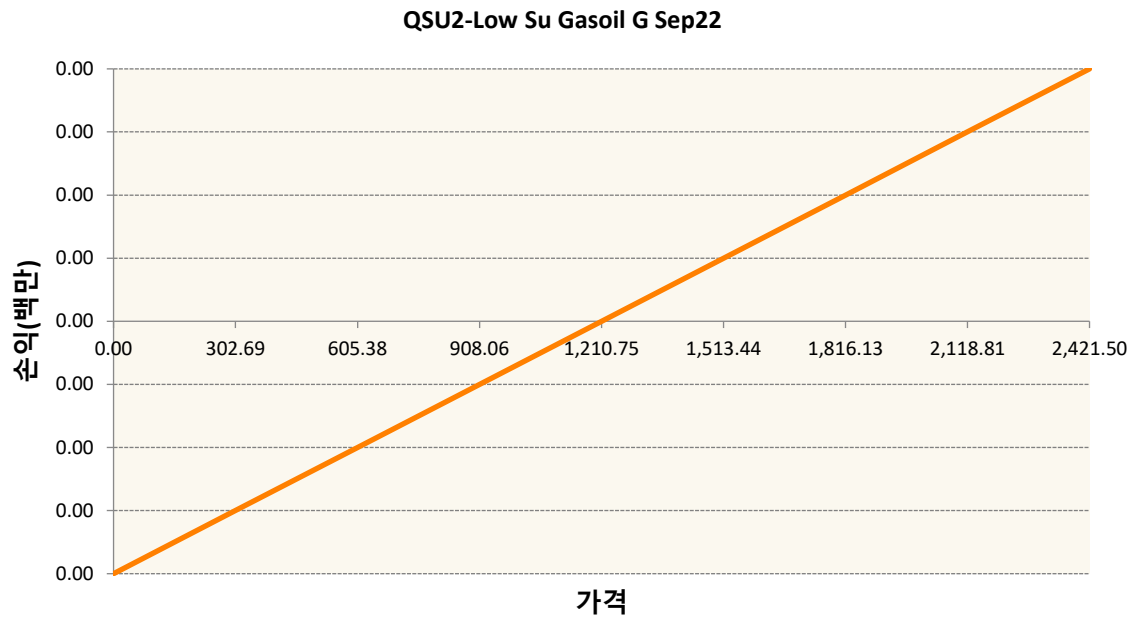


KR4175S70001-2022-07 달러선물



NGU22-NATURAL GAS FUTR Sep22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU2	WTI CRUDE FUTURE Sep22		43
COU2	BRENT CRUDE FUTR Sep22		45
HOU2	NY Harb ULSD Fut Sep22		18
KR4175S700 2022-07 달러선물			36
NGU22	NATURAL GAS FUTR Sep22		70
QSU2	Low Su Gasoil G Sep22		25
XBU2	GASOLINE RBOB FUT Sep22		15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		636