

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

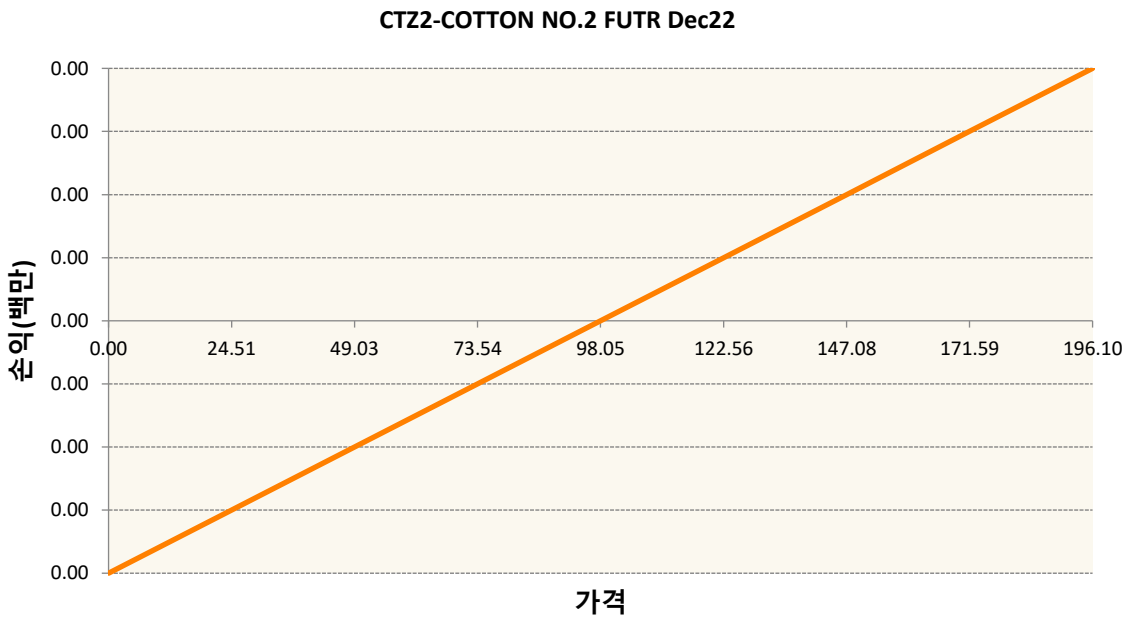
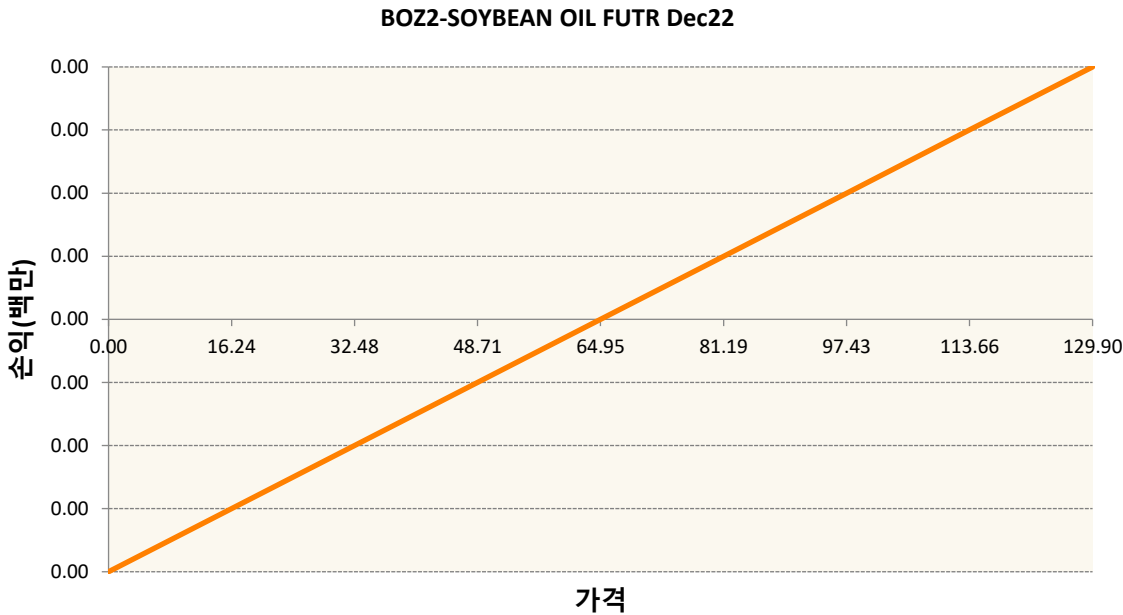
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

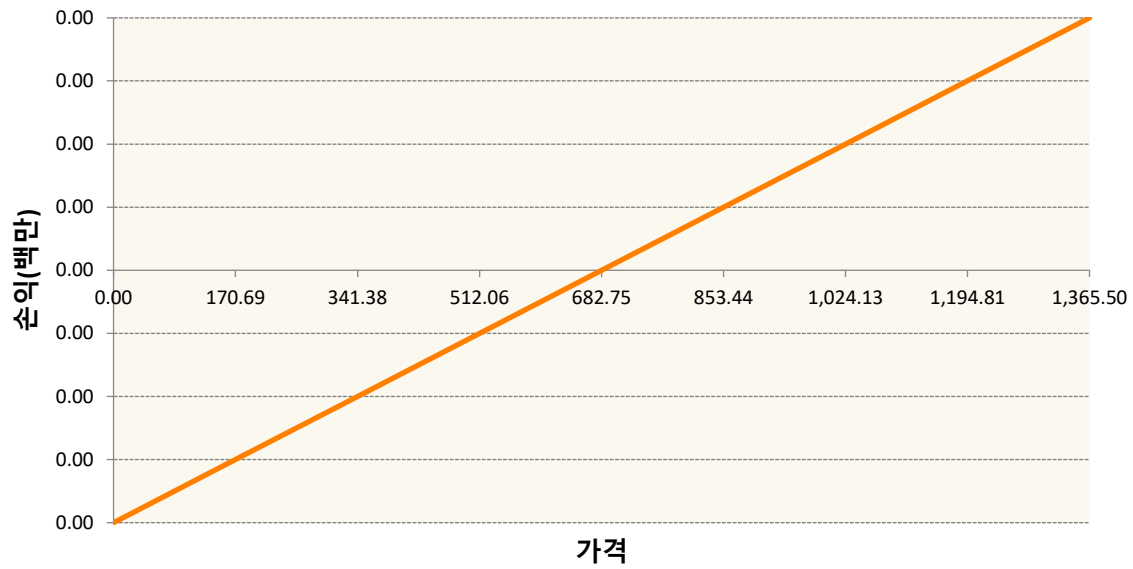
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,828	706	7,122	

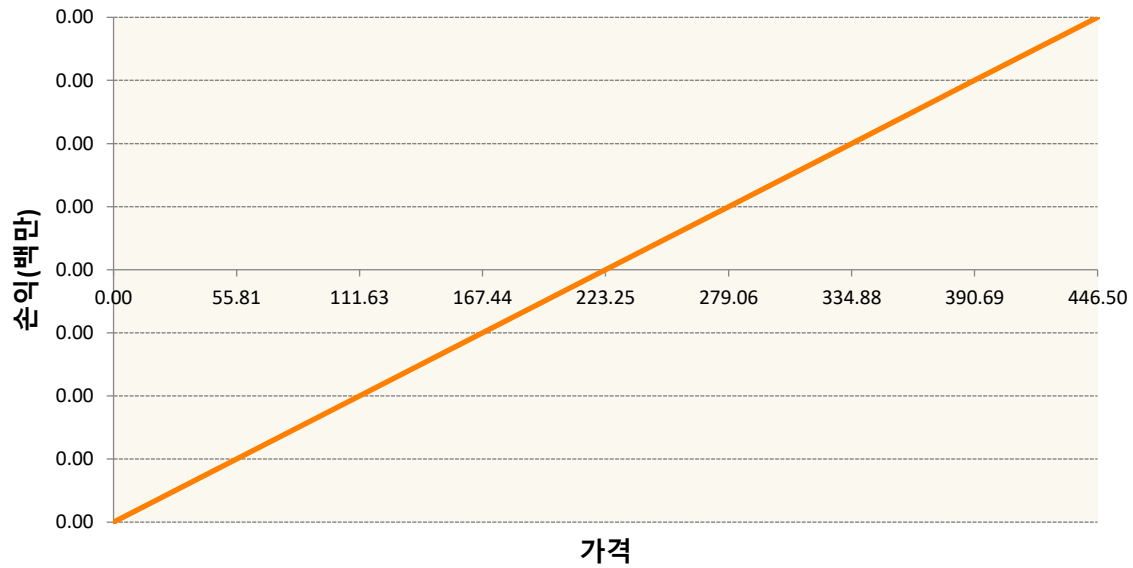
2. 만기시점의 손익구조



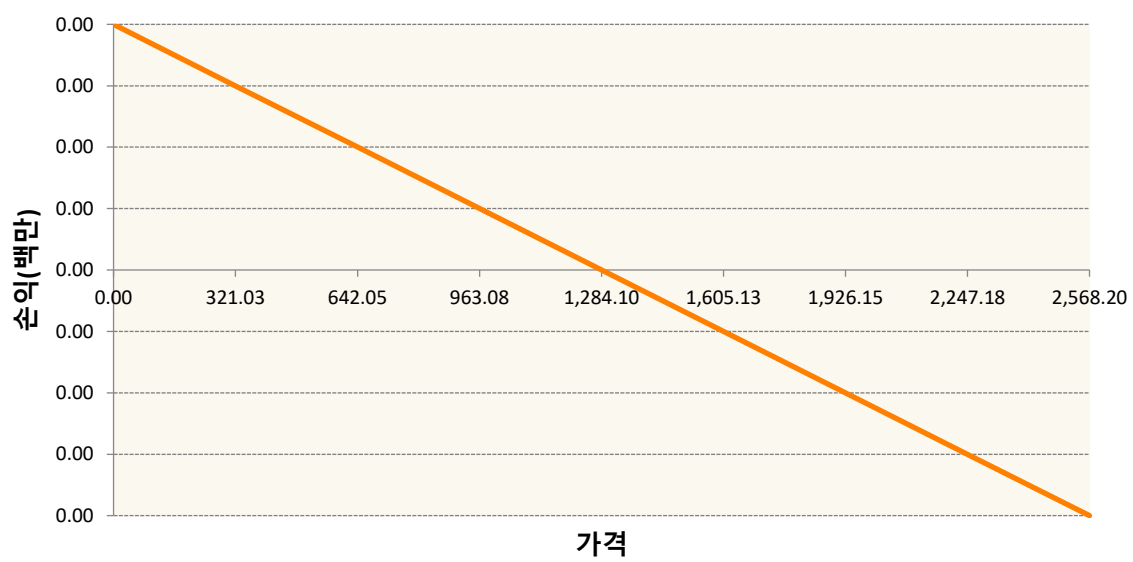
CU2-CORN FUTURE Sep22



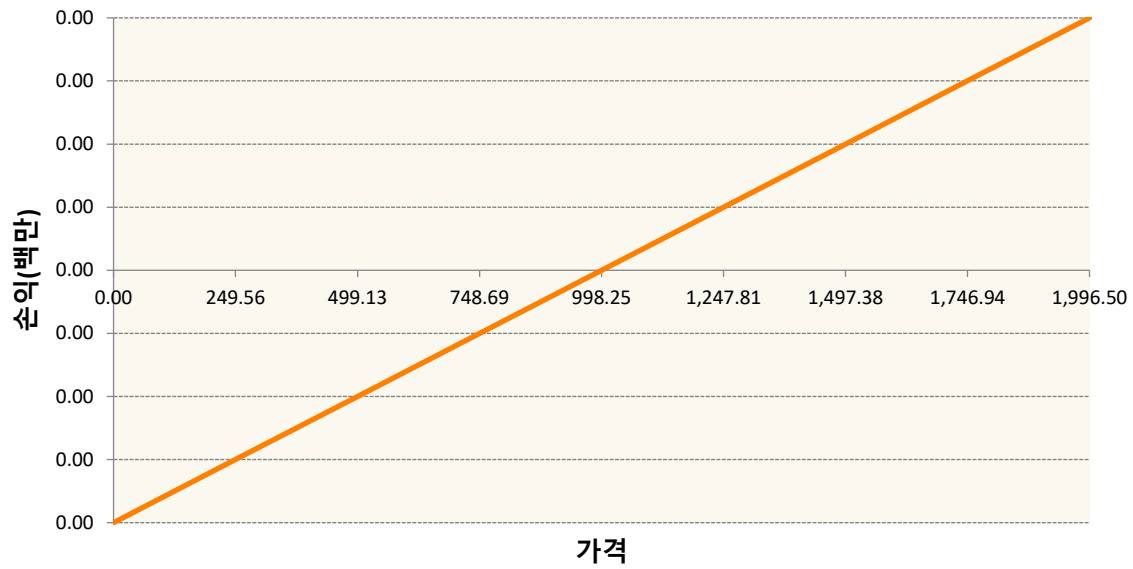
KCU2-COFFEE 'C' FUTURE Sep22



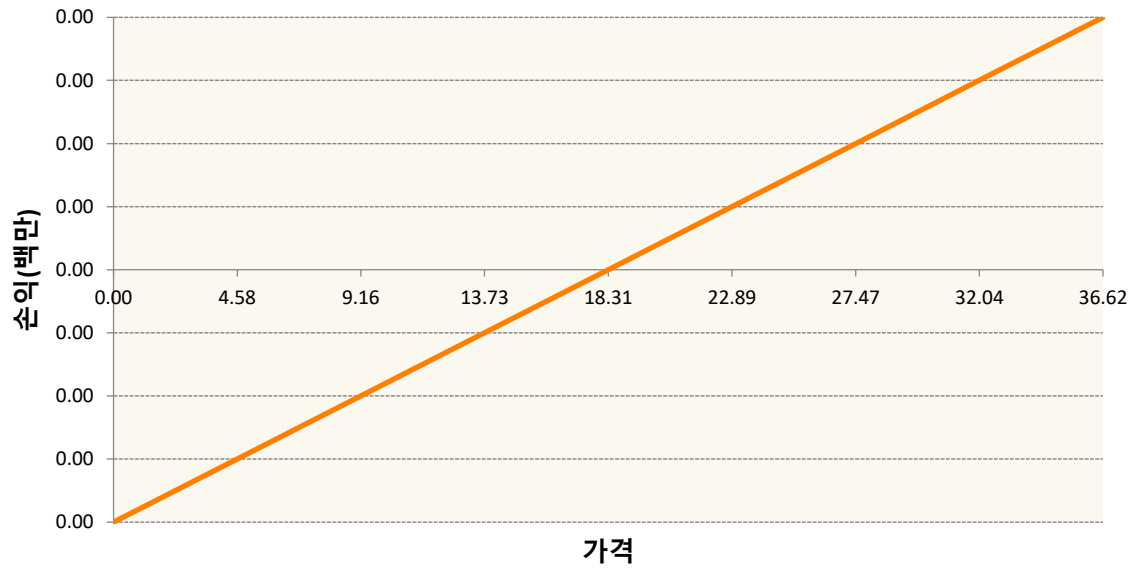
KR4175S70001-2022-07 달러선물



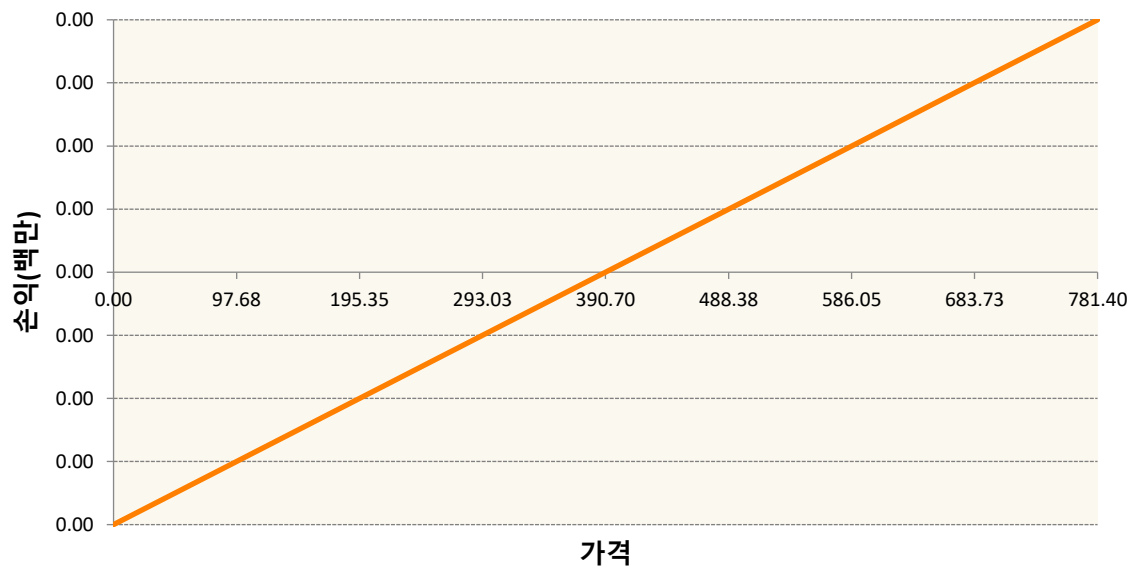
KWU2-KC HRW WHEAT FUT Sep22

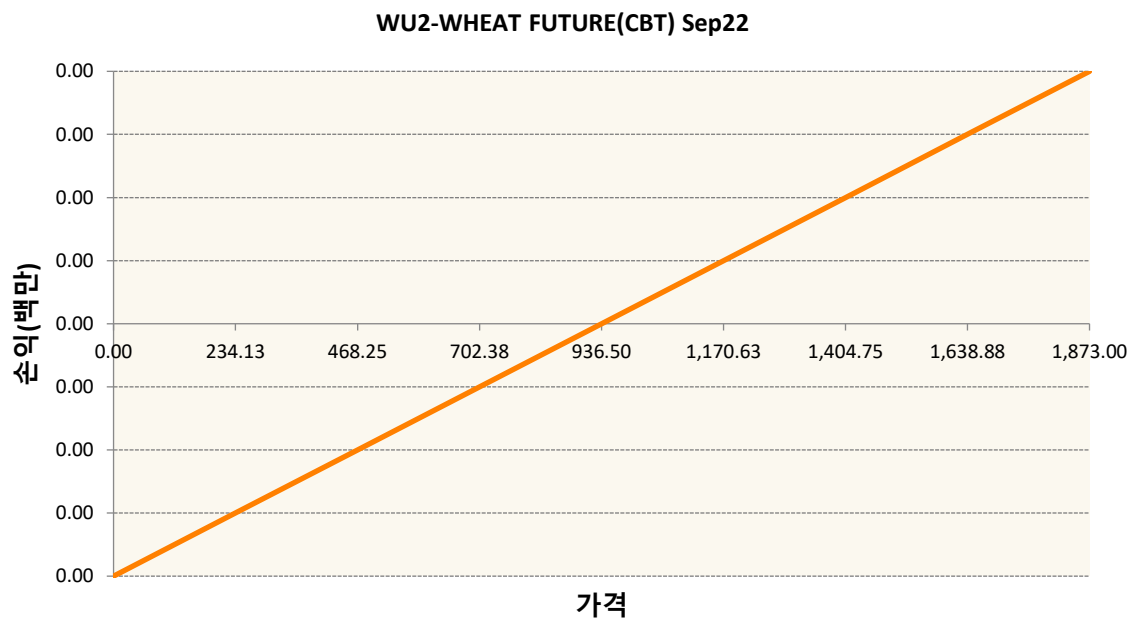
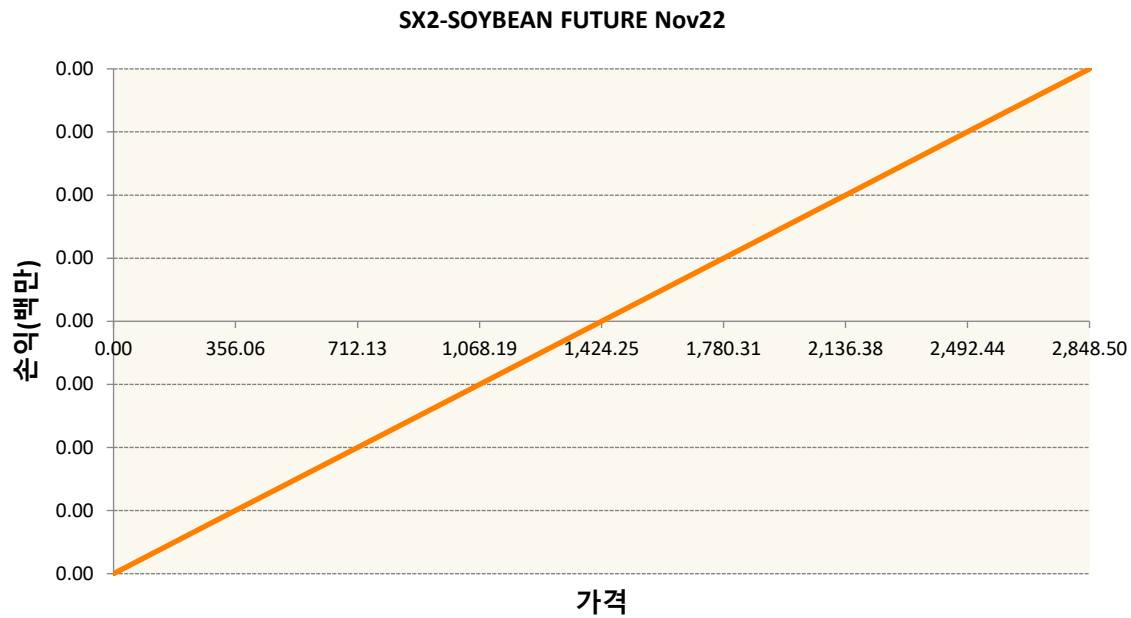


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



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	2022-06-28
기준일	2022-06-27

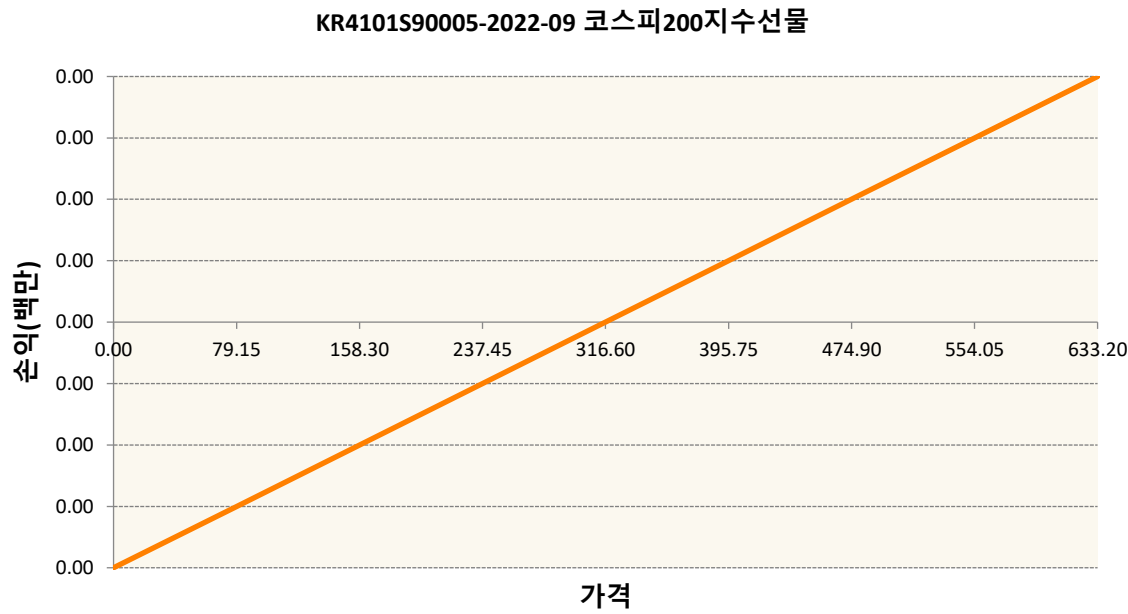
스마트인덱스모

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	1,108	0	1,108	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				89
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

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

376

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

488

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-06-28

기준일 2022-06-27

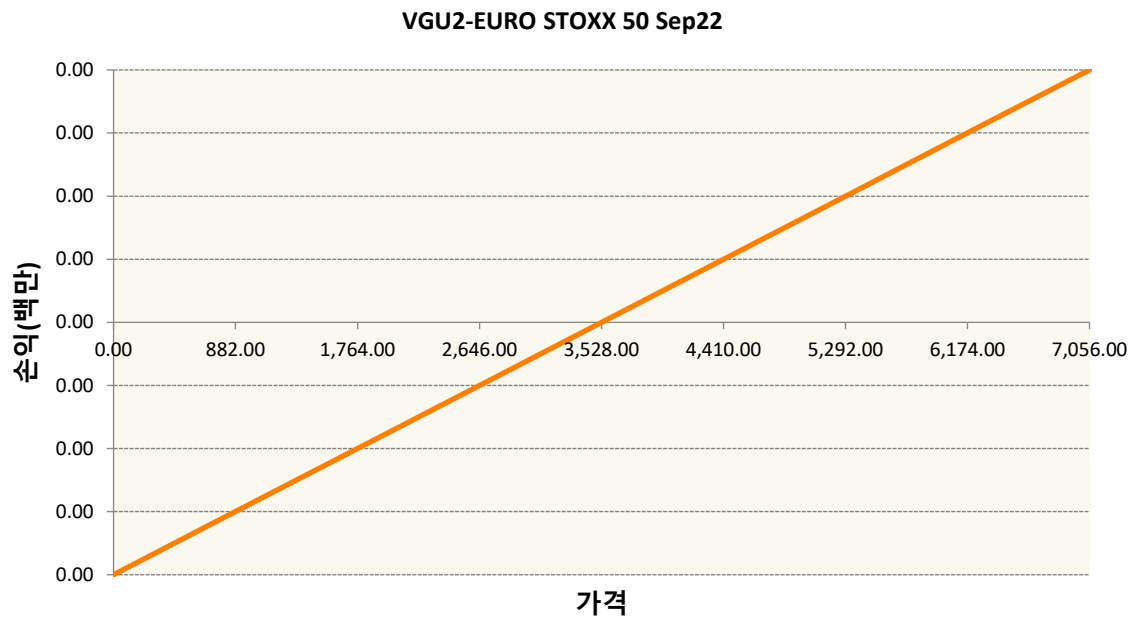
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	525	0	525	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU2	EURO STOXX 50 Sep22	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

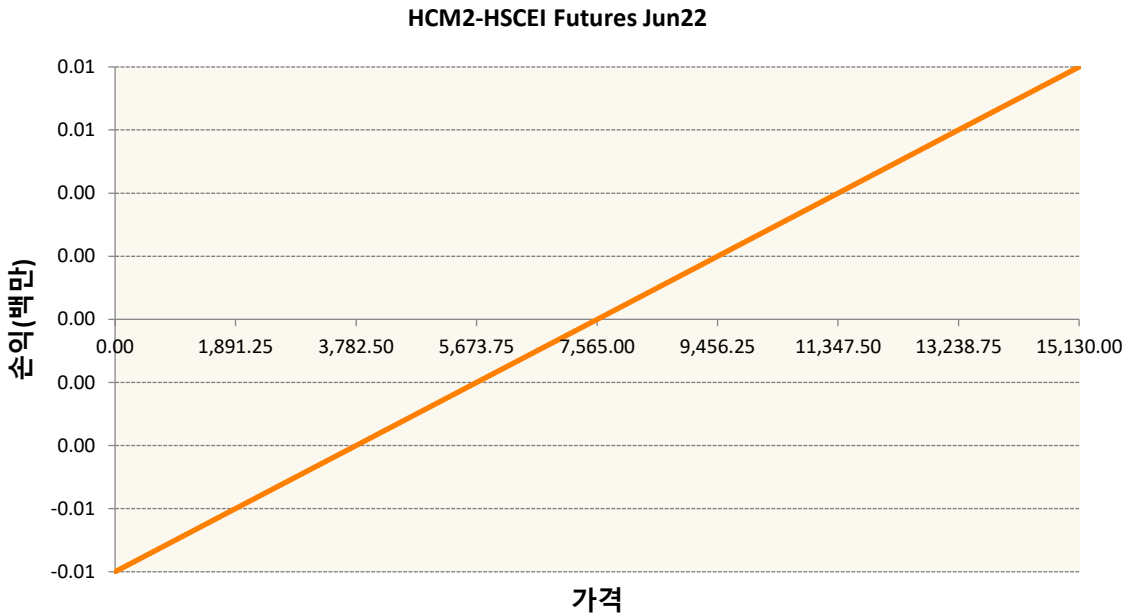
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,214	0	1,214	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM2	HSCEI Futures Jun22	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

143

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

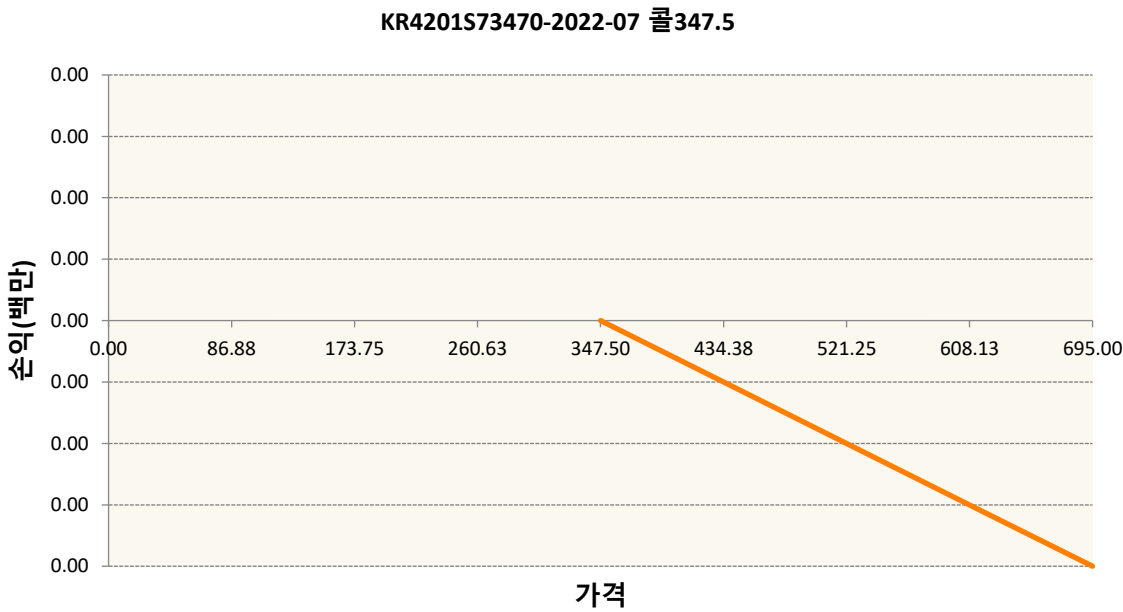
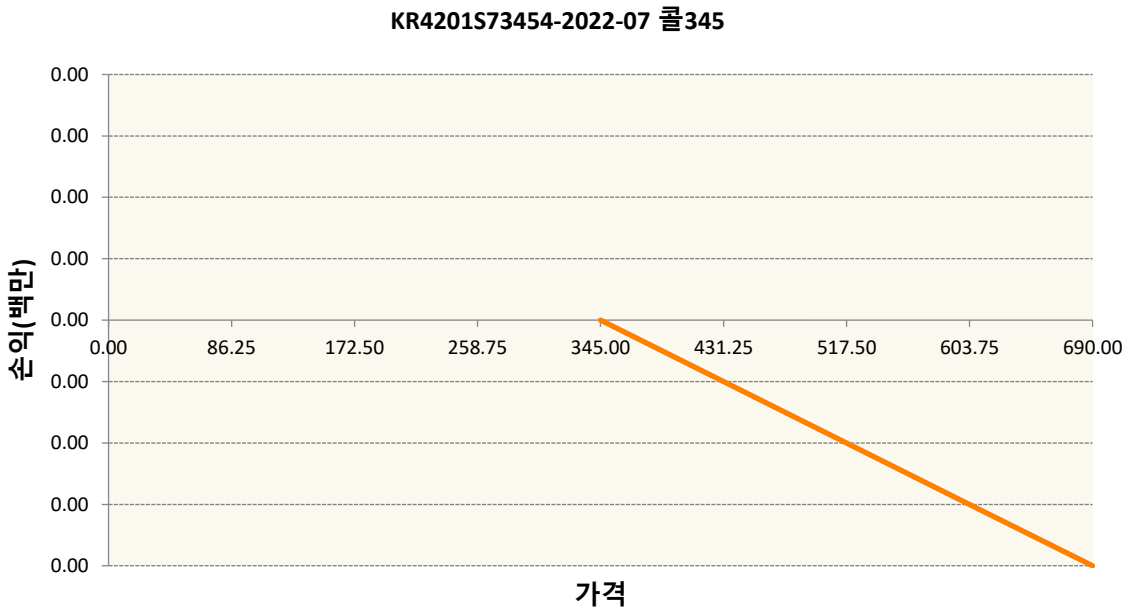
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

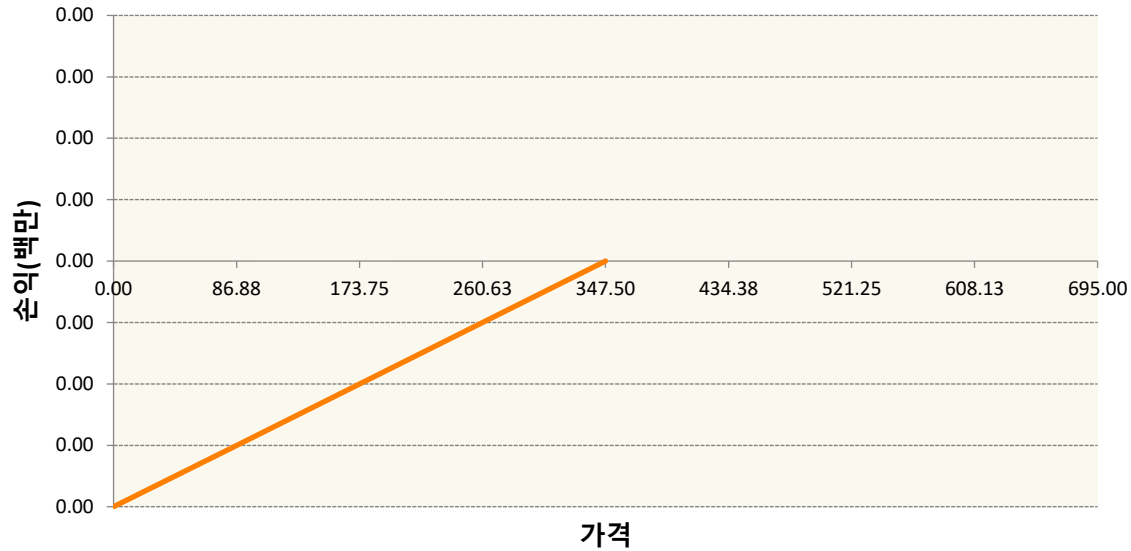
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	260	-260	장내
누계	유가증권	옵션	0	65,944	-65,944	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S73478-2022-07 풋347.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201S73454			2022-07 콜345				619
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	82	82	80	78	75	70	63
-5.33%	81	79	75	70	62	51	39
-2.67%	76	69	60	48	32	14	-7
0%	58	42	23	0	-26	-54	-85
2.67%	8	-22	-54	-89	-127	-166	-207
5.33%	-102	-146	-191	-238	-285	-334	-383
8.00%	-298	-351	-405	-458	-512	-566	-619
KR4201S73470			2022-07 콜347.5				742
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	87	86	84	80	75	67
-5.33%	86	84	81	75	66	55	40
-2.67%	82	75	65	52	34	13	-12
0%	64	48	26	0	-30	-64	-102
2.67%	13	-20	-58	-100	-146	-194	-245
5.33%	-105	-158	-214	-272	-331	-393	-455
8.00%	-327	-395	-464	-533	-603	-673	-742
KR4301S73478			2022-07 풋347.5				866
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-865	-865	-865	-865	-865	-865	-866
-5.33%	-574	-575	-575	-575	-575	-576	-577
-2.67%	-284	-284	-285	-285	-287	-288	-291
0%	6	5	3	0	-4	-8	-14

2.67%	291	287	281	274	265	256	246
5.33%	559	548	536	522	508	493	478
8.00%	784	766	748	729	711	692	673

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

(단위:백만원)

1,738

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

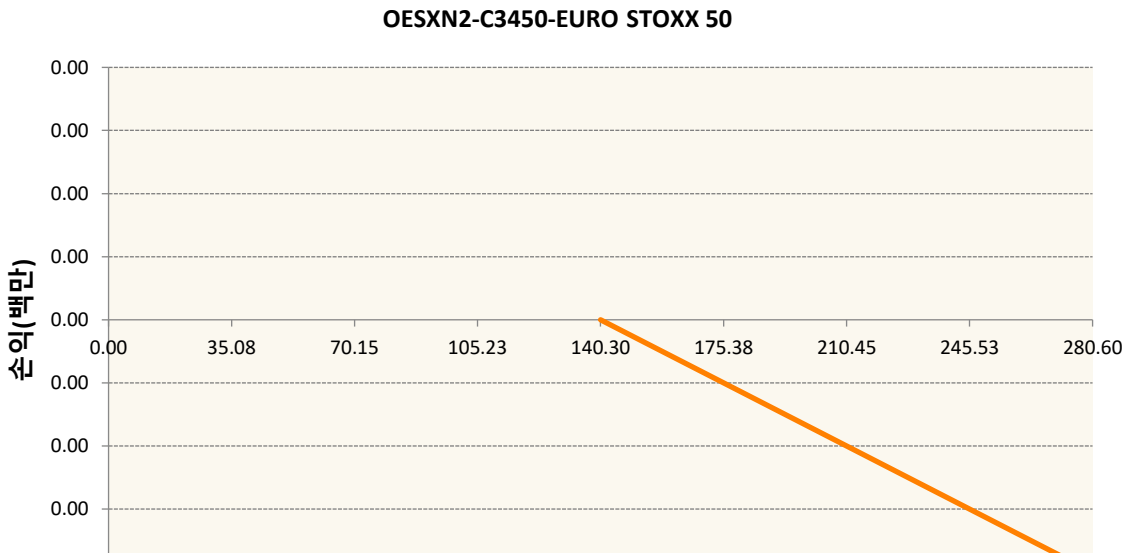
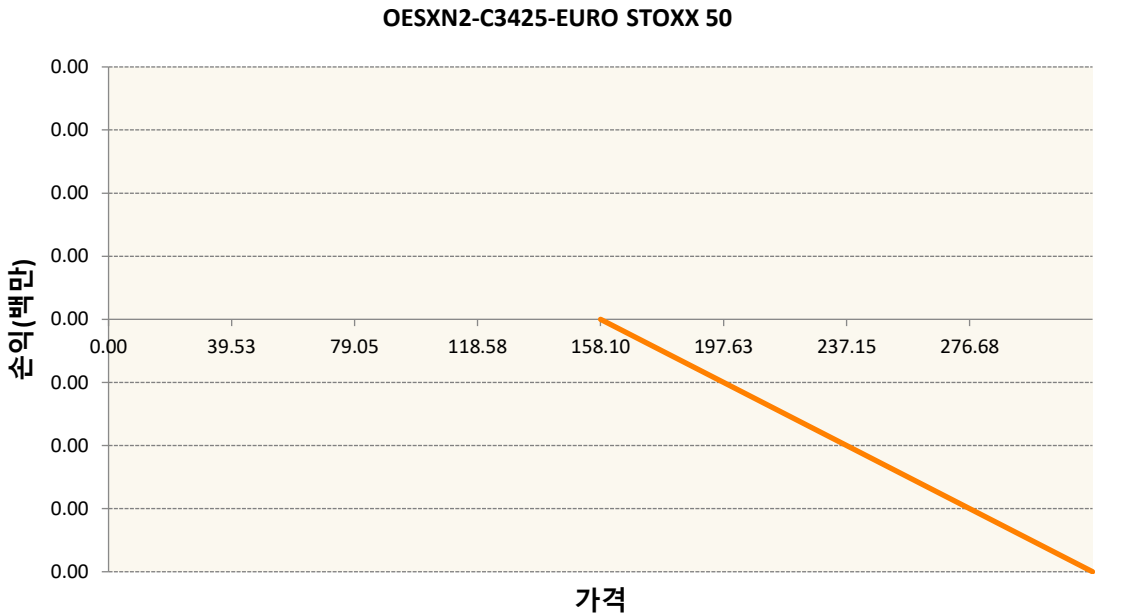
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

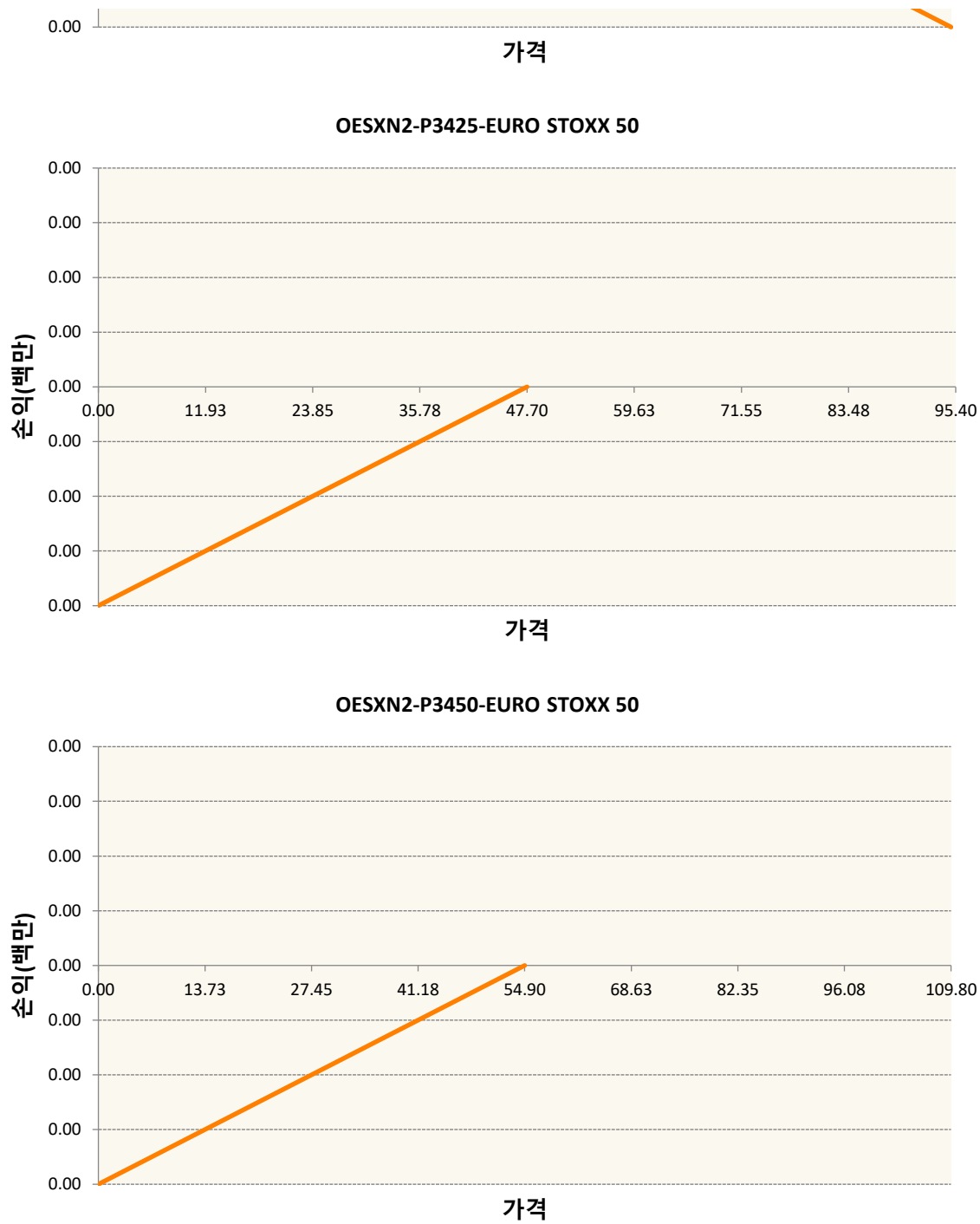
1. 계약금액

(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	54	-54	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,087	-1,087	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213C5Q KRW/EUR 26-08-22E
 OESXN2-C34 EURO STOXX 50
 OESXN2-C34 EURO STOXX 50
 OESXN2-P34 EURO STOXX 50
 OESXN2-P34 EURO STOXX 50

40
87
2
2
0.36
1

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

(단위:백만원)

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

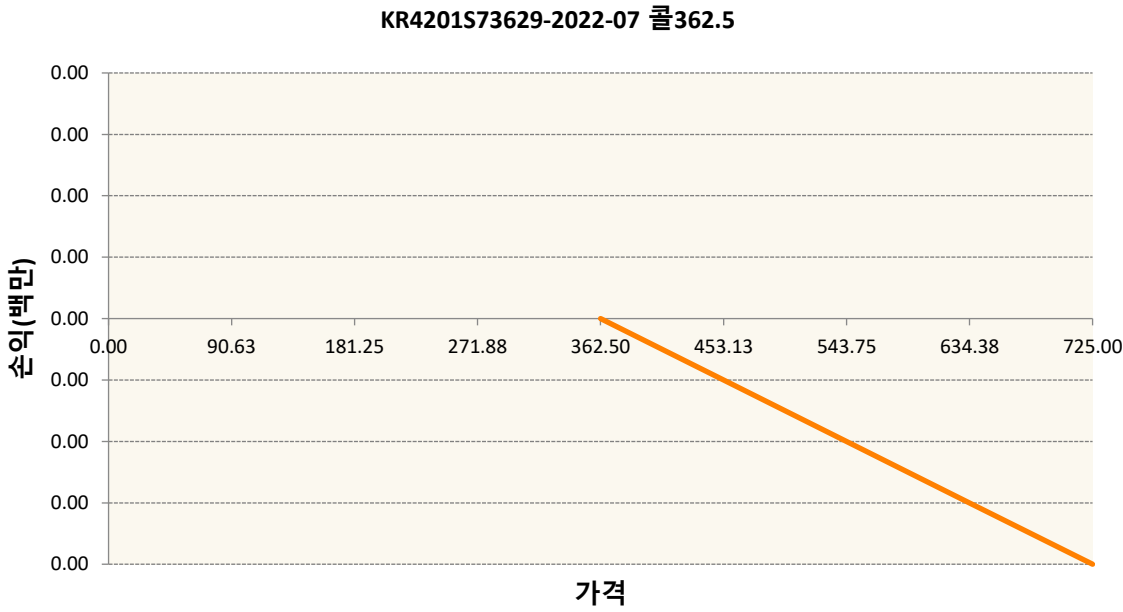
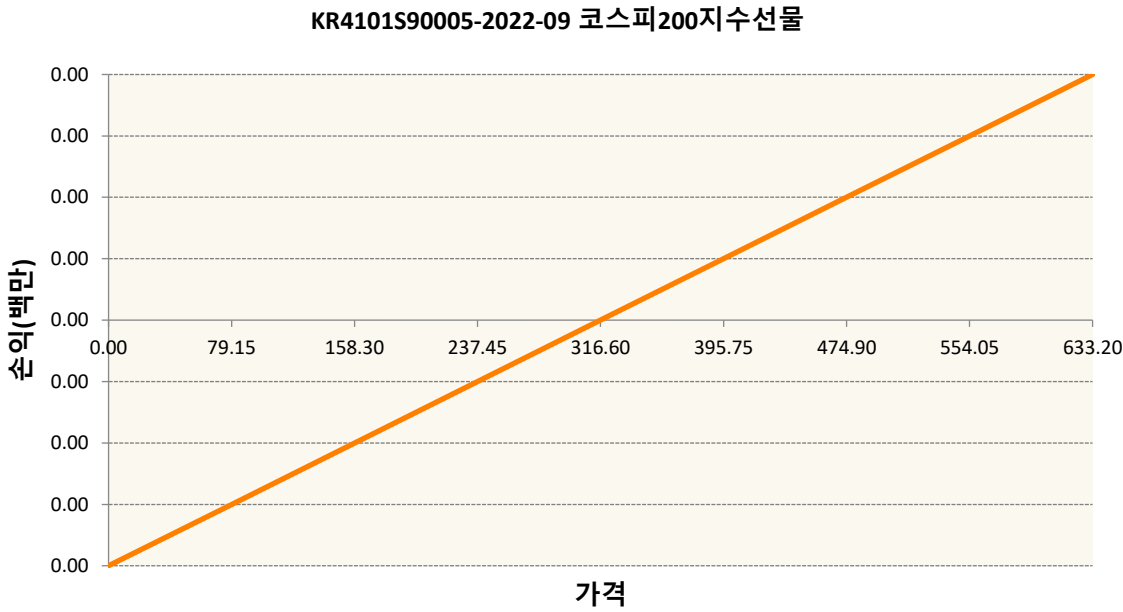
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	475	0	475	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 the profit/loss is zero at these price points.

가격	손익(백만)
365.00	0.00
730.00	0.00

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
347.50	0.00

(단위:백만원)

KR4101S90005				2022-09 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	
KR4201S73629				2022-07 콜362.5				24
	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	1	0	-1
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	1	0	-1	-2	-4	-5	-7
5.33%	-1	-2	-4	-6	-9	-11	-14
8.00%	-5	-8	-11	-14	-17	-21	-24
KR4201S73652 2022-07 콜365							29

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	1	0	-1
0%	1	1	1	0	-1	-2	-4
2.67%	1	0	-1	-2	-4	-6	-8
5.33%	-1	-3	-5	-7	-10	-13	-17
8.00%	-6	-9	-12	-16	-20	-25	-29

KR4301S73478 2022-07 풋347.5							19
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19
-5.33%	12	12	12	12	13	13	13
-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	-10
8.00%	-17	-17	-16	-16	-15	-15	-15

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

(단위:백만원)

77

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

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	8,959	0	8,959	

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	2022-06-28
기준일	2022-06-27

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	6,894	0	6,894	

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	2022-06-28
기준일	2022-06-27

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	360	-360	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	21,308	0	21,308	
누계	통화	선도	643	21,587	-20,944	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C6P* KRW/USD 29-08-22E		575
FXW213C6P* KRW/USD 27-09-22E		576
FXW213C6P* KRW/USD 27-07-22E		575
FXW213C6Q USD/KRW 27-07-22E		51

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

(단위:백만원)

660

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

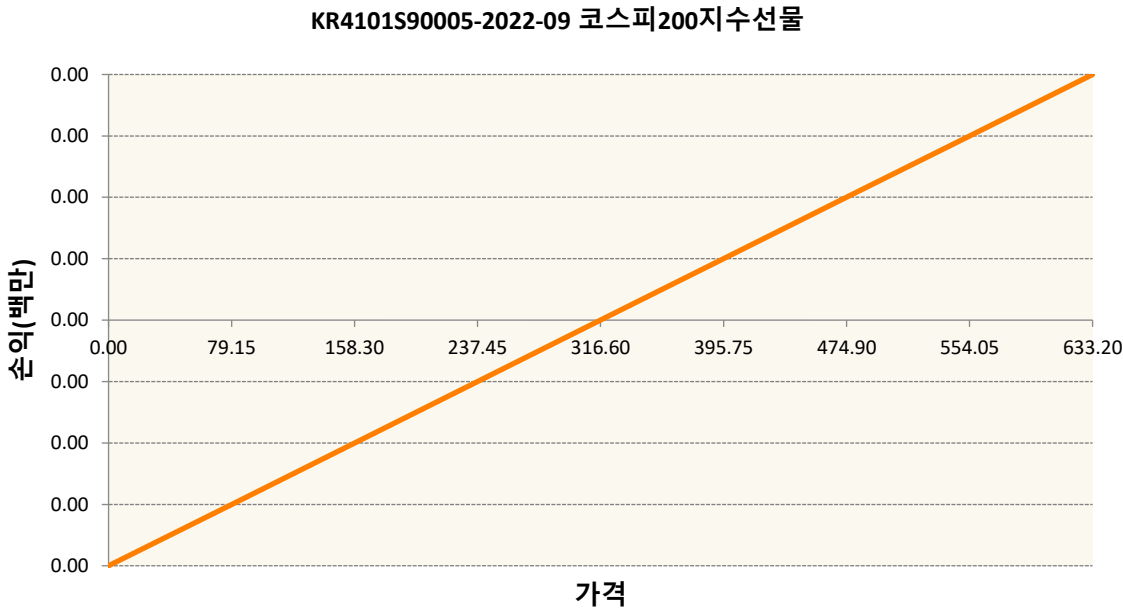
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	79	-79	장내
누계	유가증권	선물	554	0	554	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				44
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-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%	44	44	44	44	44	44	44

공시일 2022-06-28

기준일 2022-06-27

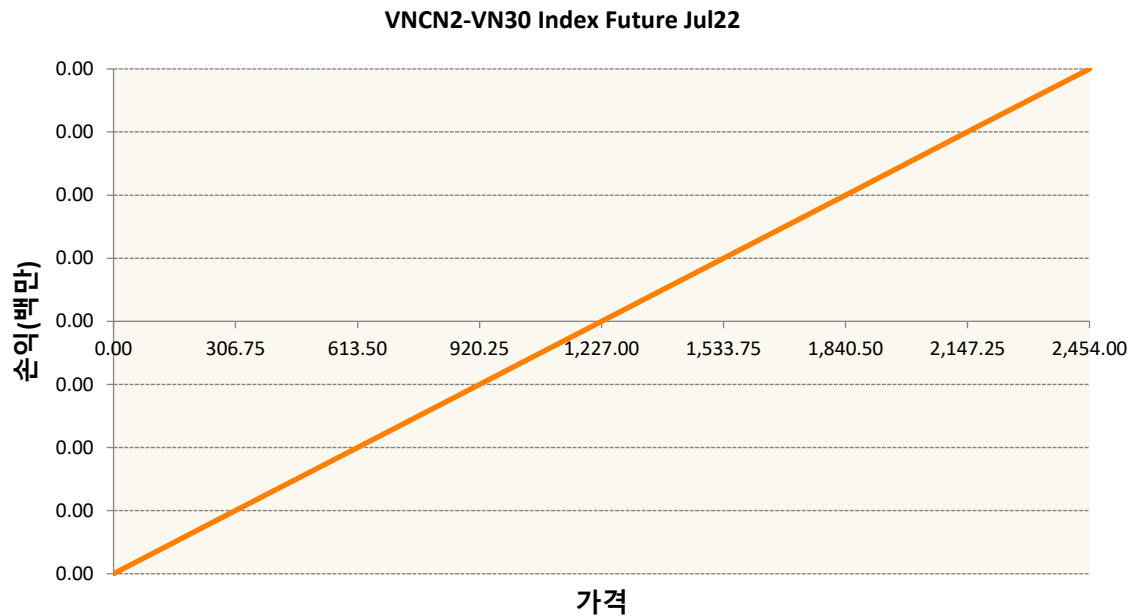
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	707	0	707	
누계	유가증권	스왑	1,756	0	1,756	장외
누계	통화	선도	0	924	-924	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	141
FXW213C4L KRW/EUR 22-07-22E	16
FXW213C5J4 KRW/EUR 26-08-22E	30
FXW213C6N KRW/EUR 23-09-22E	27
VNCN2 VN30 Index Future Jul22	57

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

(단위:백만원)

273

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

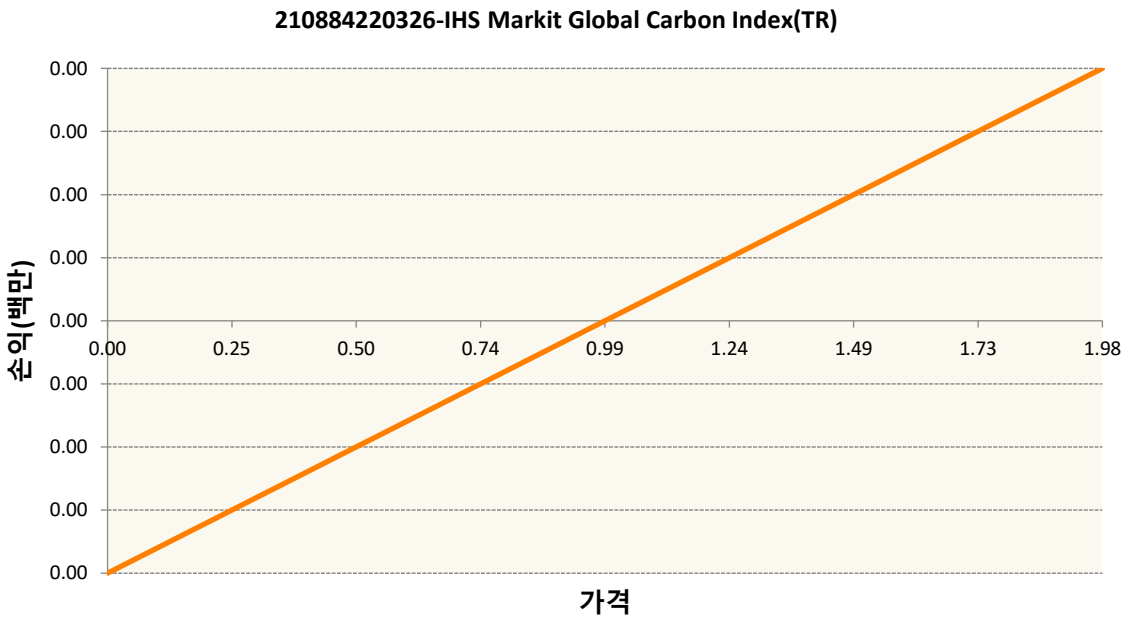
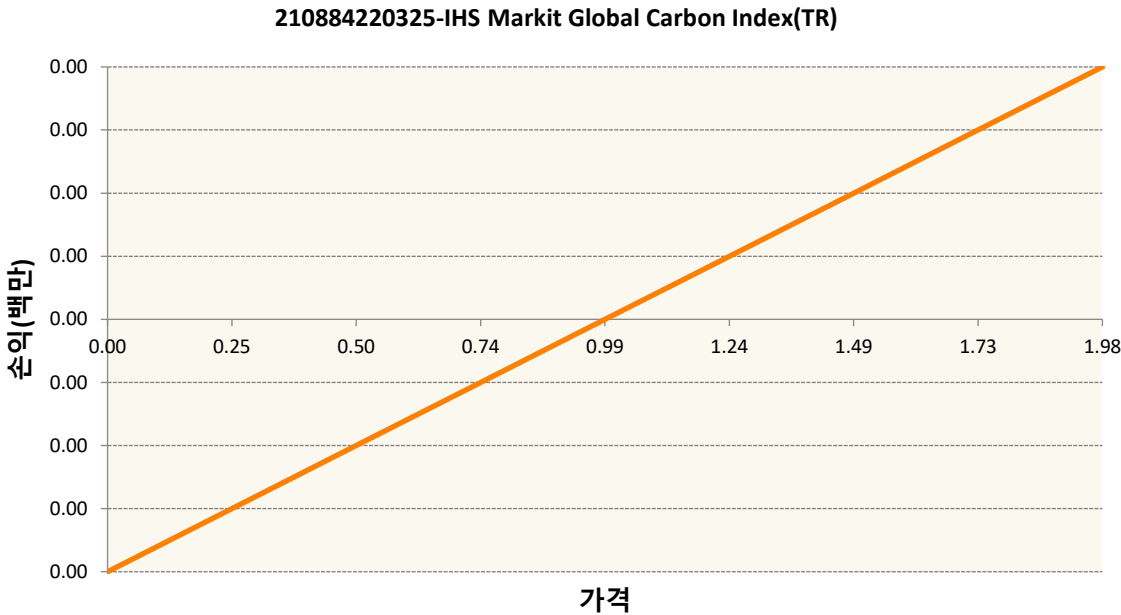
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

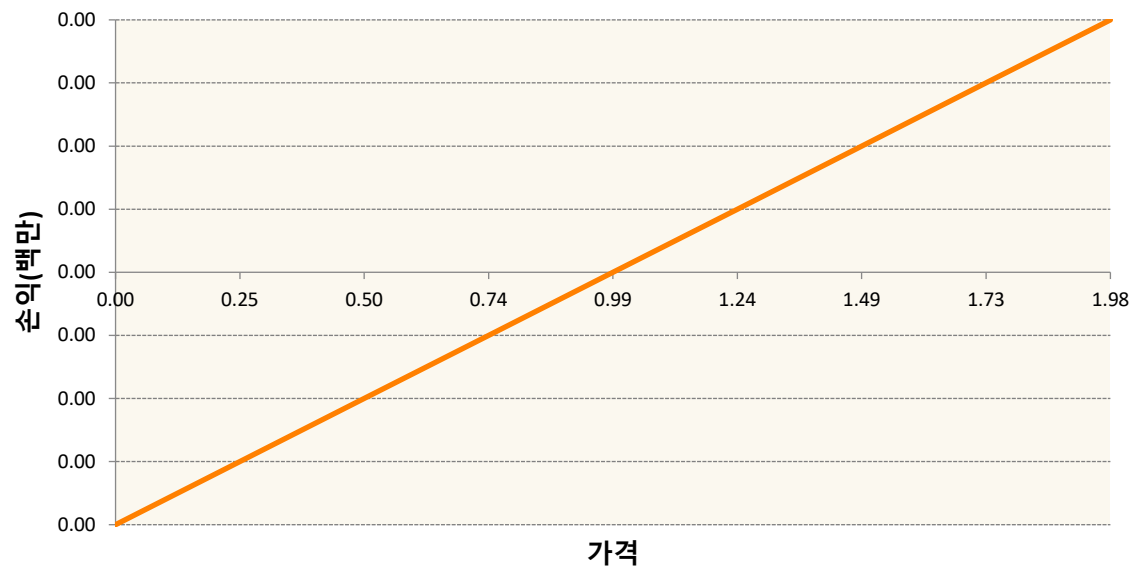
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	47,555	47,562	-6	
누계	유가증권	선물	47,080	0	47,080	

2. 만기시점의 손익구조



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

198
3,457
99

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

(단위:백만원)

6,937

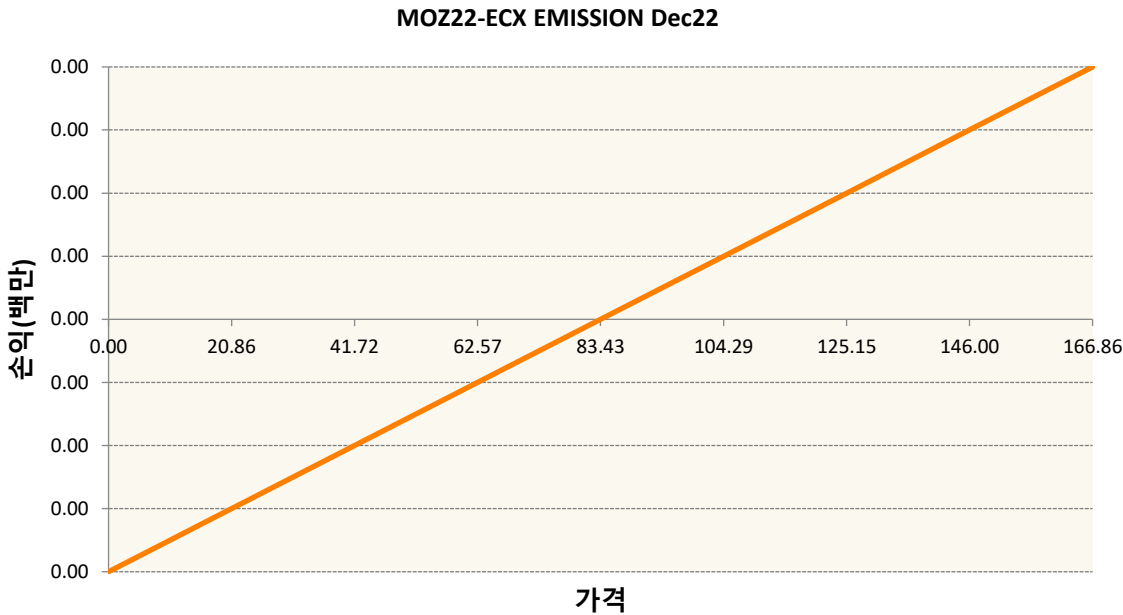
공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

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	14,430	0	14,430	
누계	통화	선도	0	8,595	-8,595	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213C6T	KRW/EUR	26-07-22E	688
MOZ22	ECX EMISSION	Dec22	1,154

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,188

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

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)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	9

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

(단위:백만원)

72

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

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)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220426(메리츠)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220614(메리츠)	0.27

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

(단위:백만원)

101

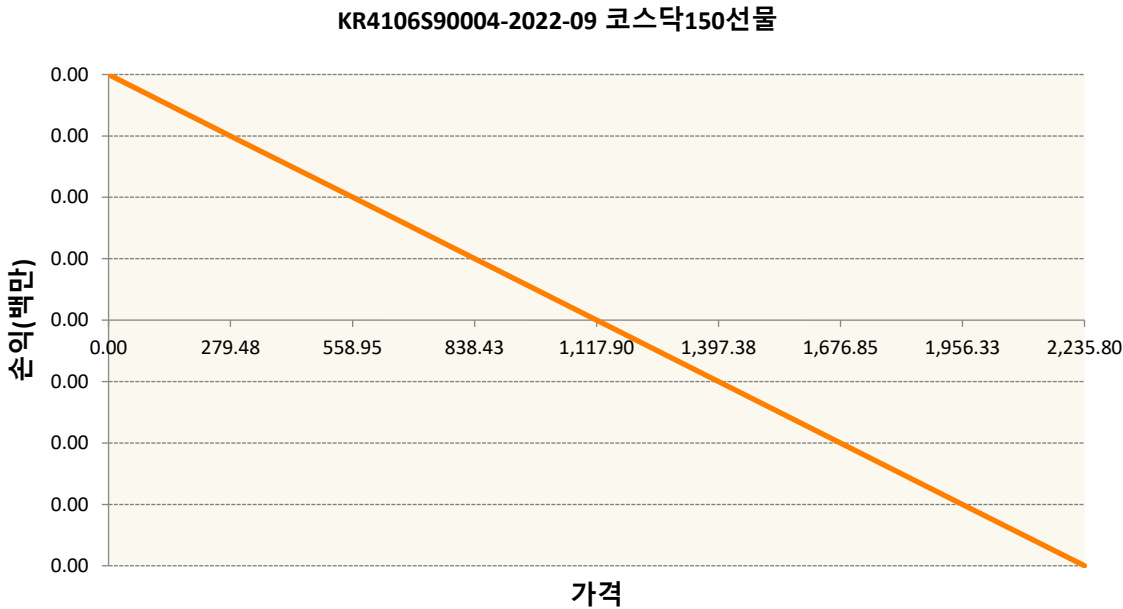
공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

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
누계	유가증권	선물	0	335	-335	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)	
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	1
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	1
KR4106S900 2022-09 코스닥150선물	27

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)
45

공시일 2022-06-28

기준일 2022-06-27

신한SOL한국형글로벌반도체액티

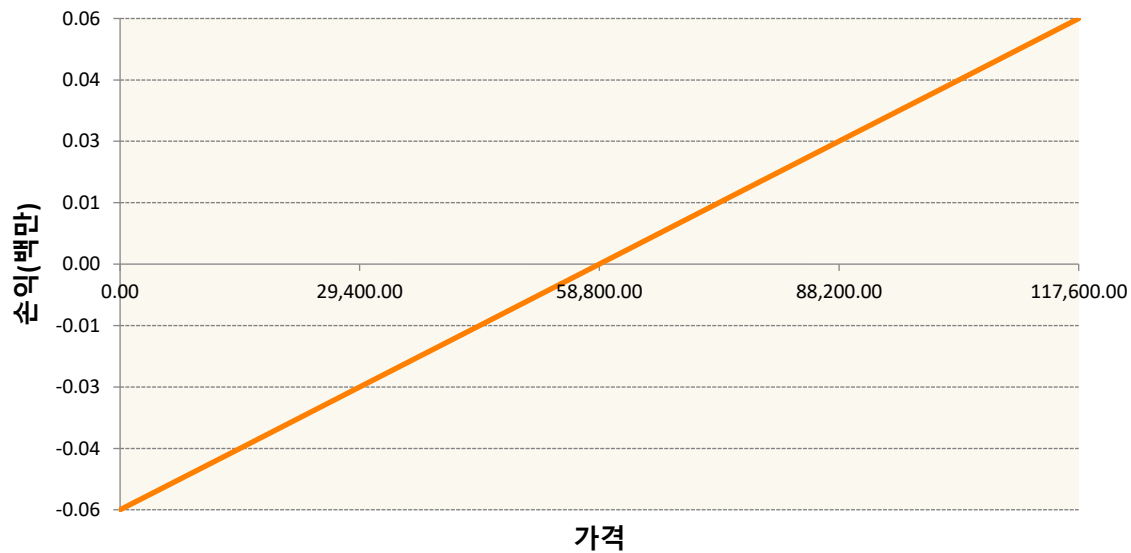
1. 계약금액

(단위:백만원)

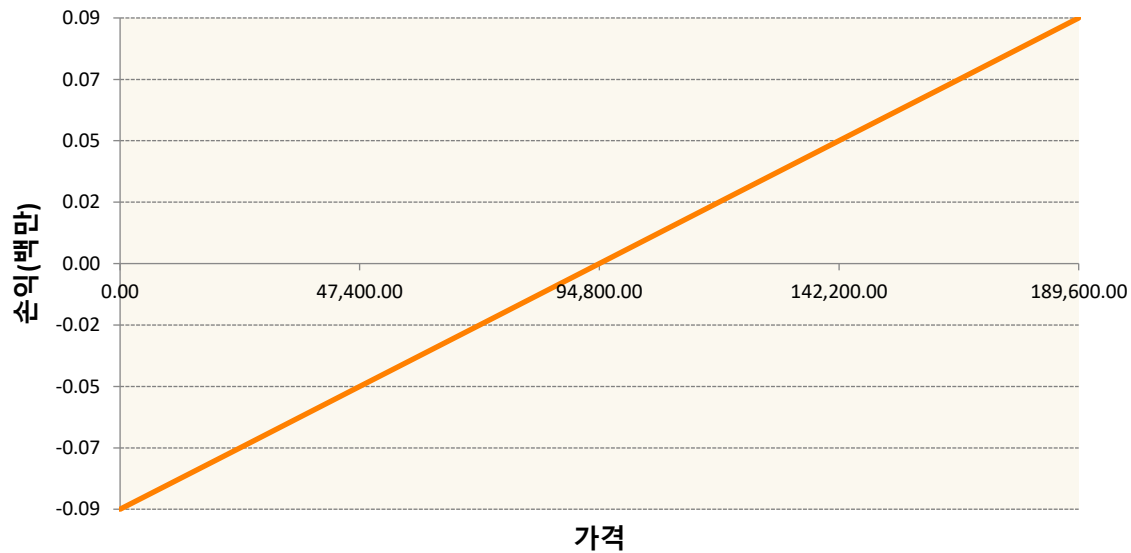
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	837	0	837	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S70006-2022-07 삼성전자개별선물



KR4150S70004-2022-07 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S70006		2022-07 삼성전자개별선물					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
KR4150S70004		2022-07 SK하이닉스개별선물					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

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

75

공시일 2022-06-28

기준일 2022-06-27

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

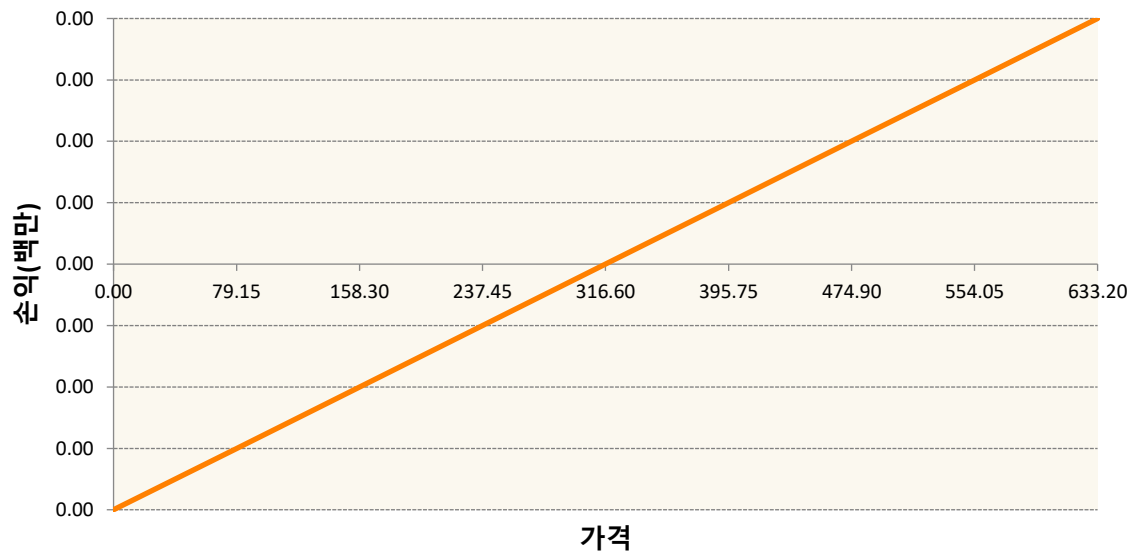
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	475	0	475	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005				2022-09 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 2022-06-28

기준일 2022-06-27

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

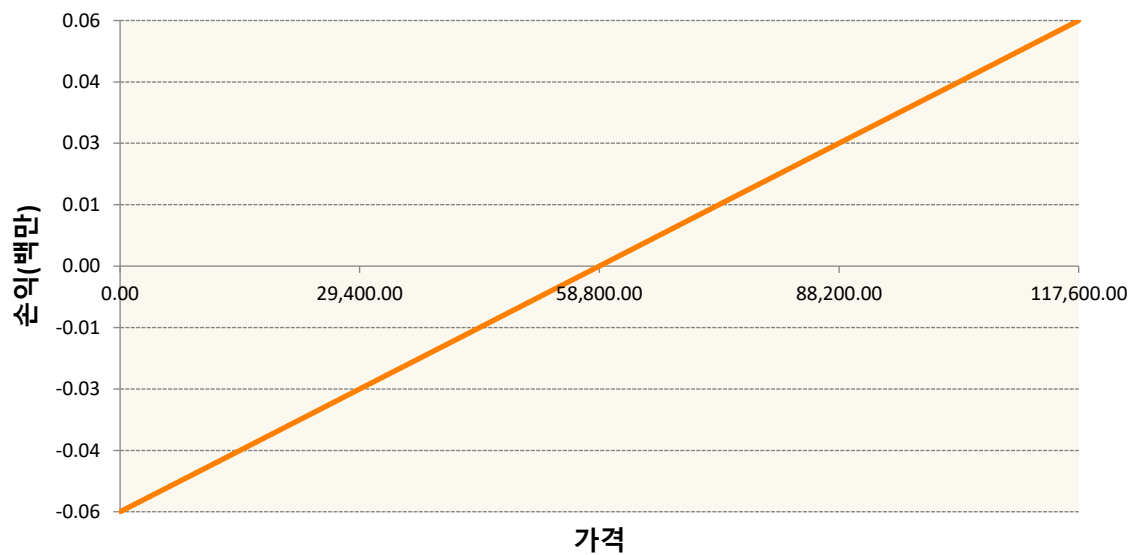
1. 계약금액

(단위:백만원)

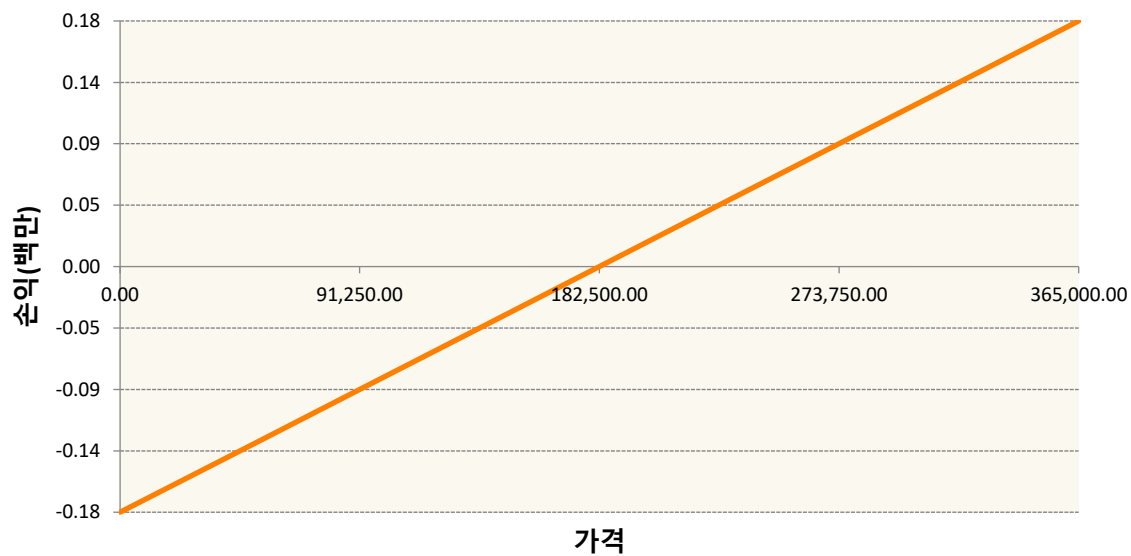
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	275	0	275	장내

2. 만기시점의 손익구조

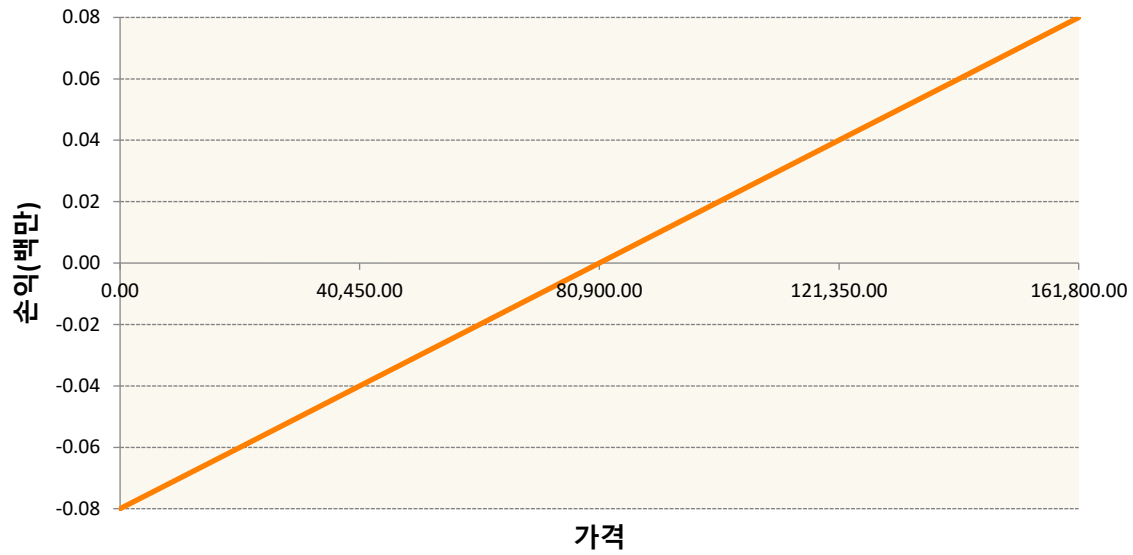
KR4111S70006-2022-07 삼성전자개별선물



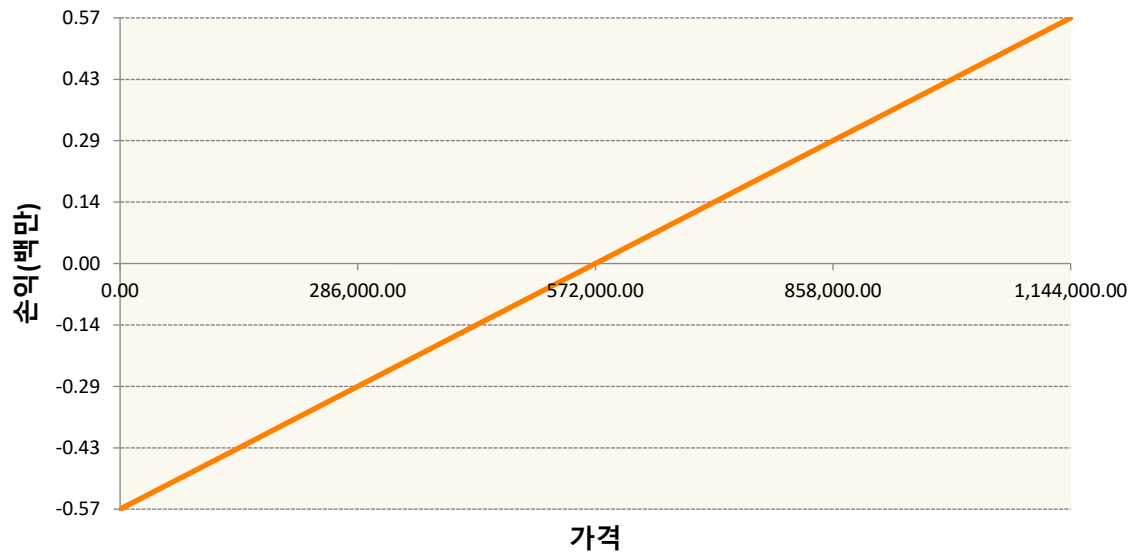
KR4116S70005-2022-07 현대차개별선물



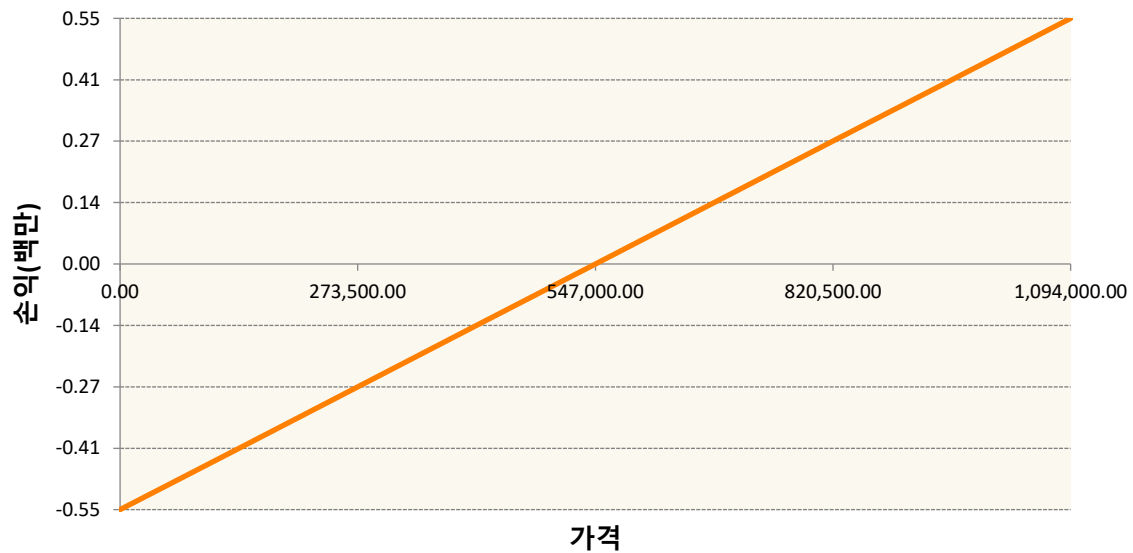
KR4119S70009-2022-07 기아개별선물



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%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
-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%	3	3	3	3	3	3	3	3	
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)

23

공시일 2022-06-28

기준일 2022-06-27

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

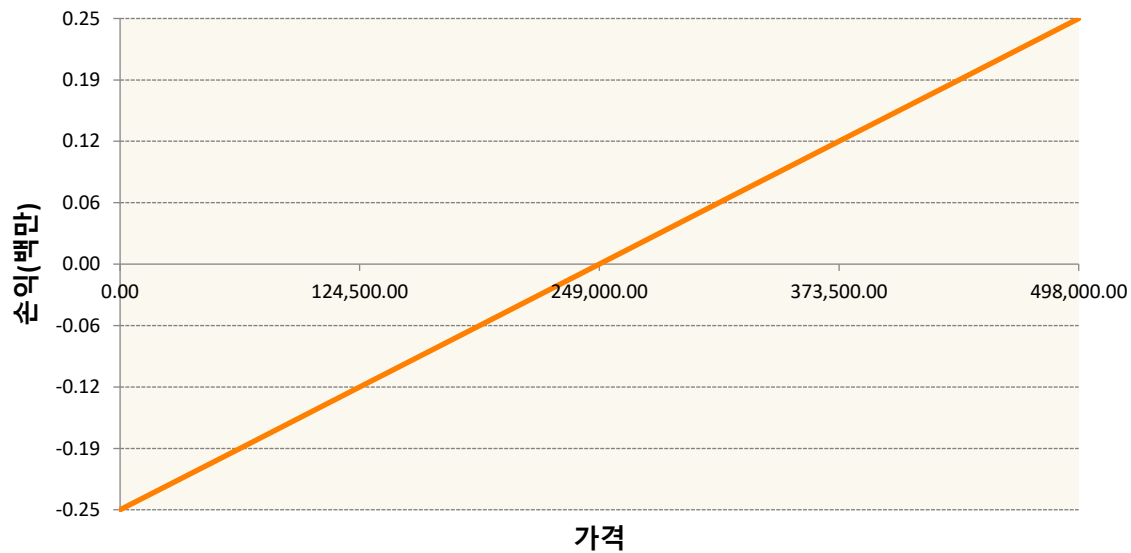
1. 계약금액

(단위:백만원)

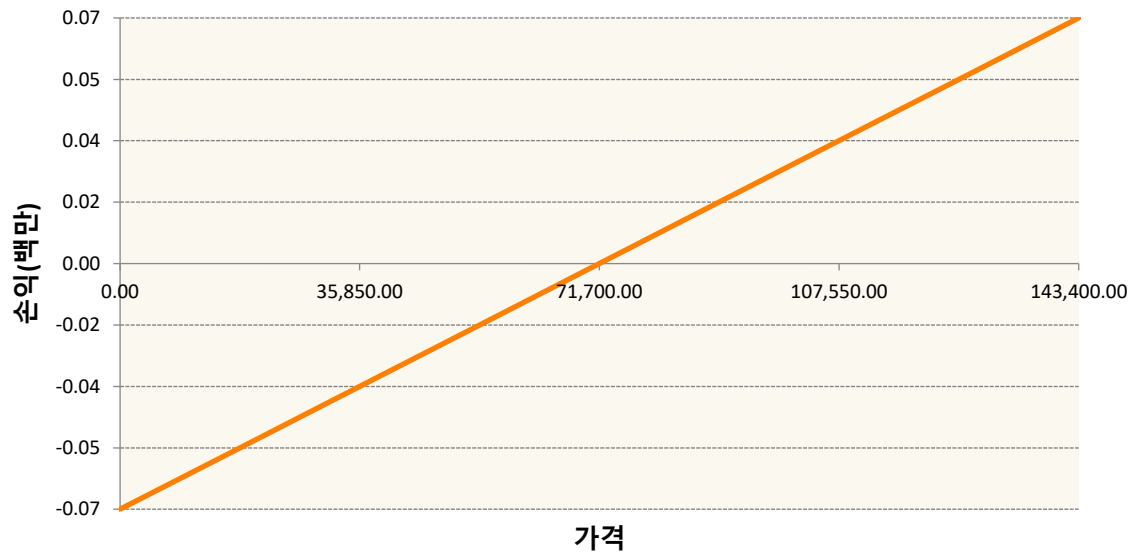
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	211	0	211	장내

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%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-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%	7	7	7	7	7	7	7
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)

28

공시일	2022-06-28
기준일	2022-06-27

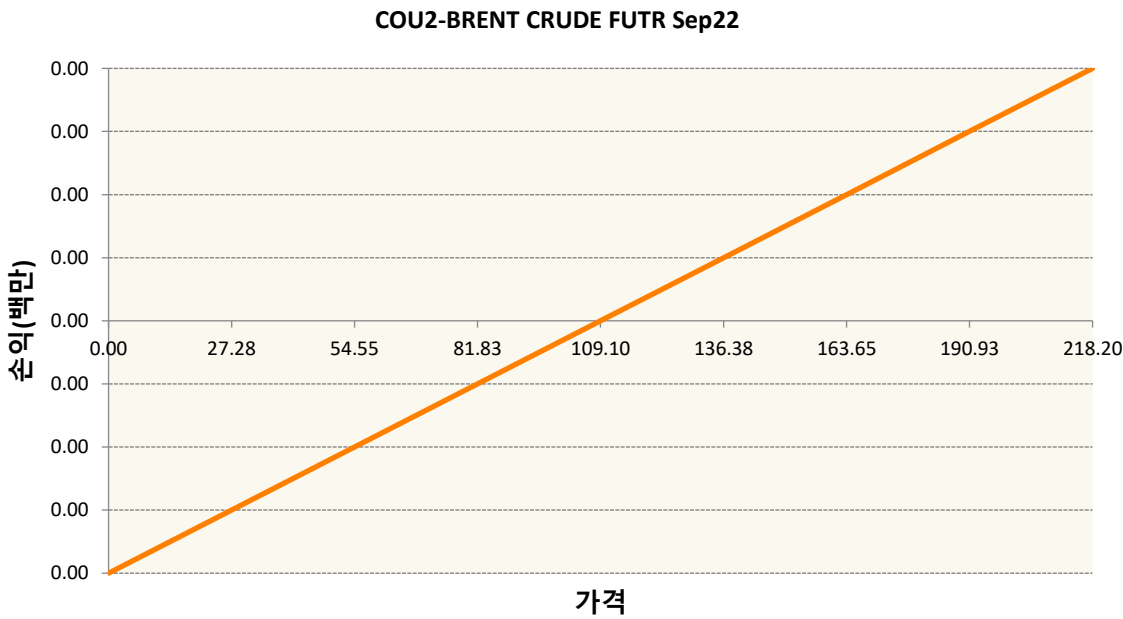
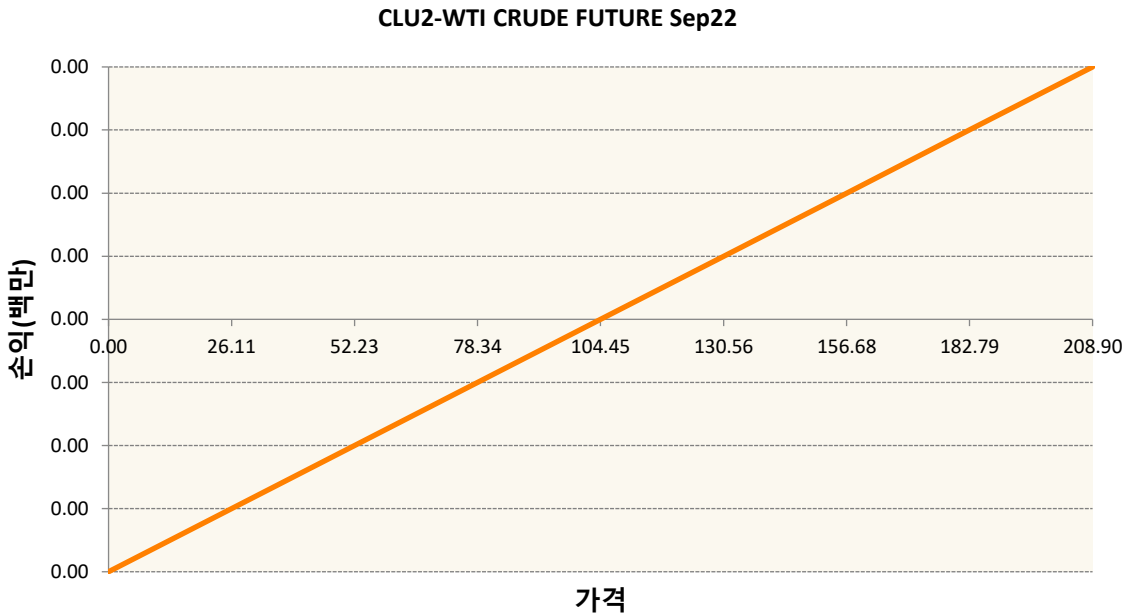
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

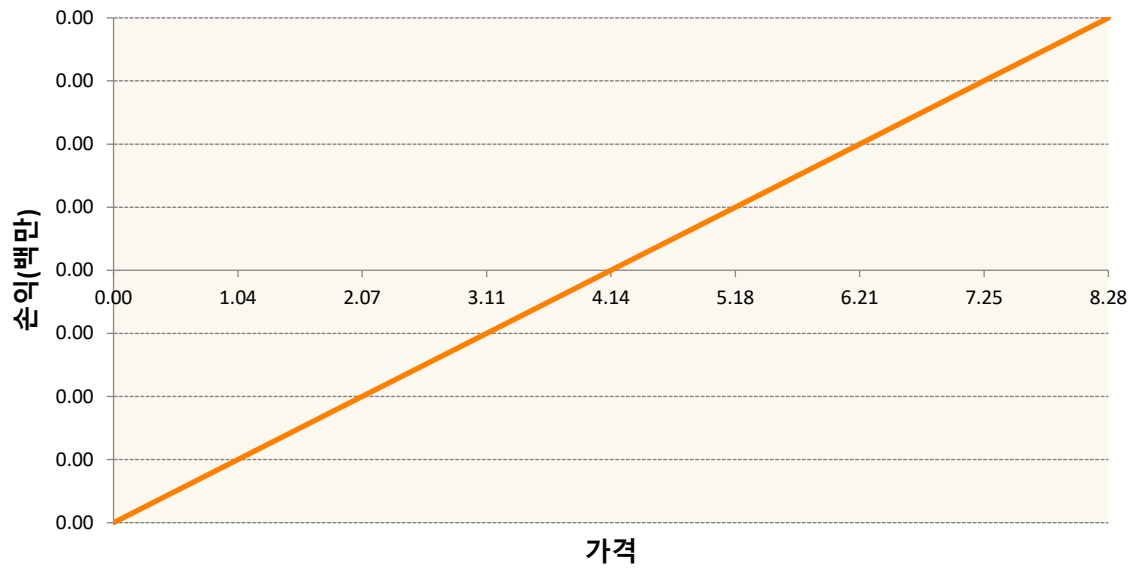
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,633	347	2,287	

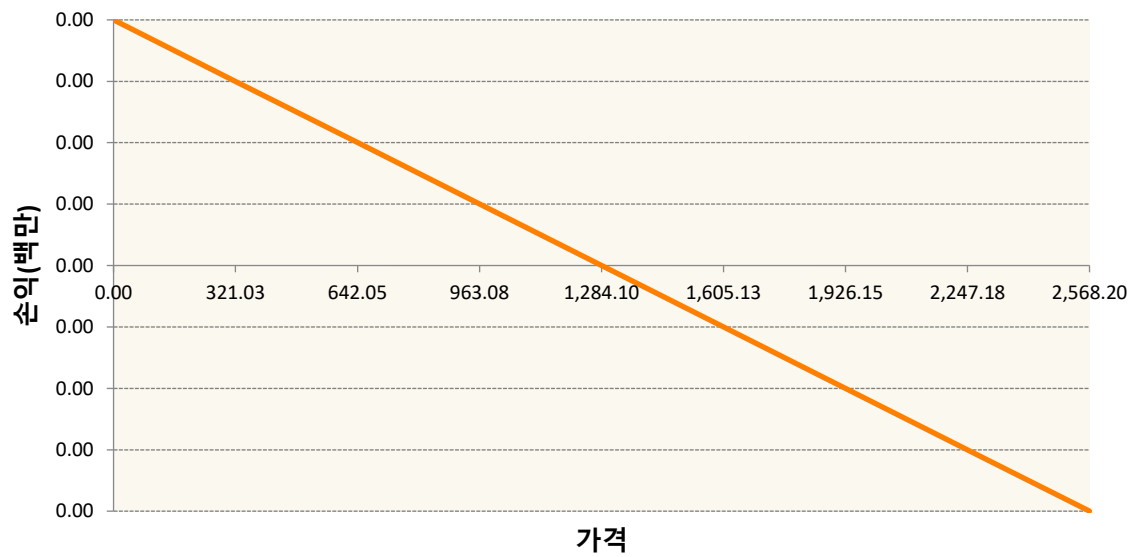
2. 만기시점의 손익구조



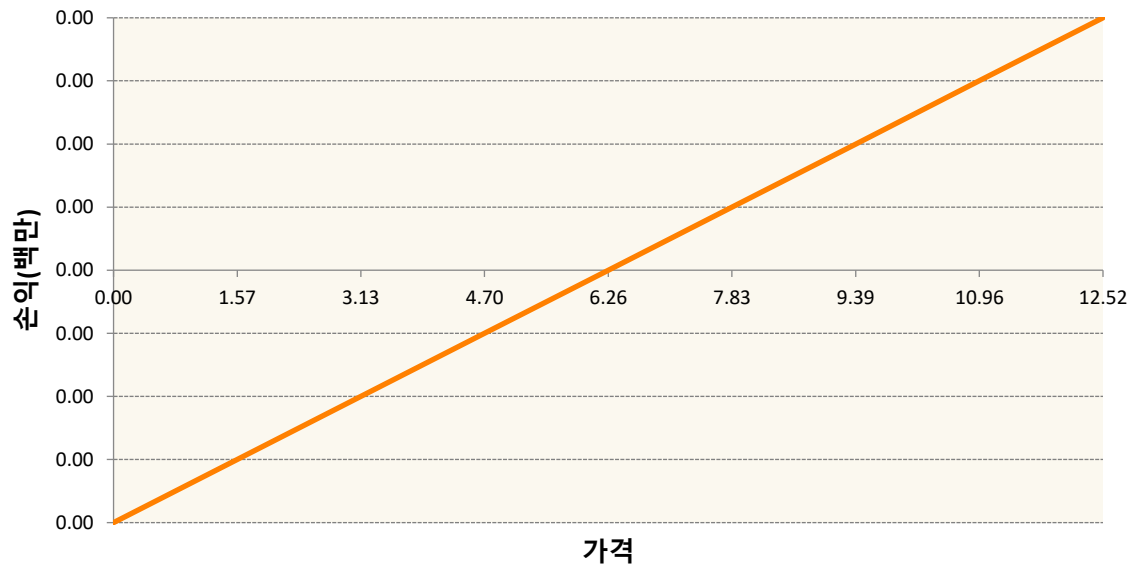
HOU2-NY Harb ULSD Fut Sep22

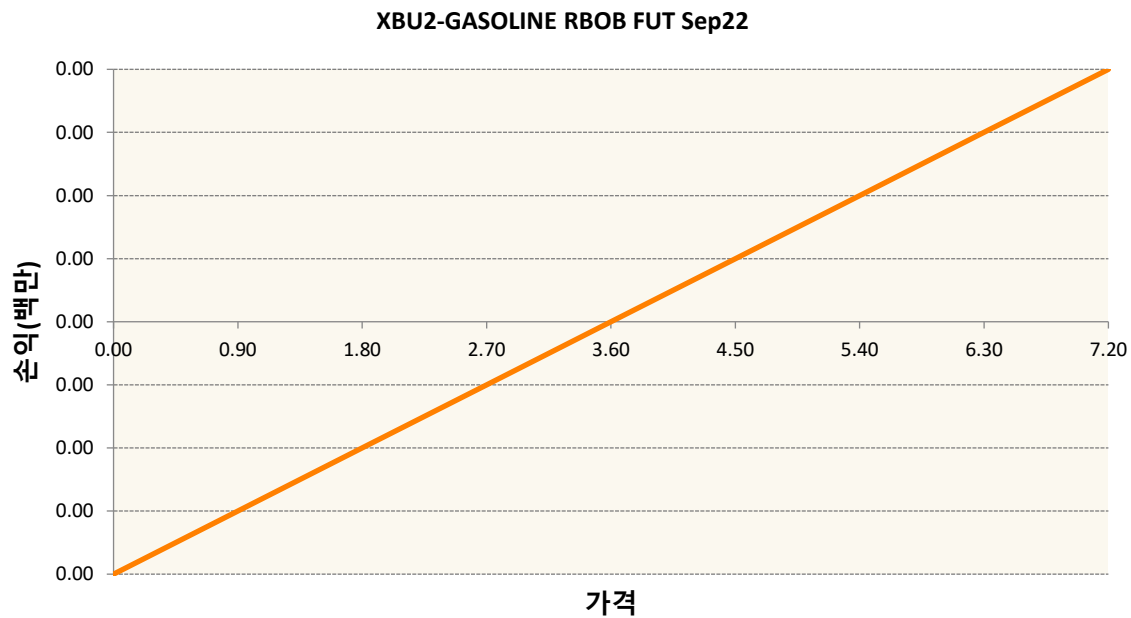
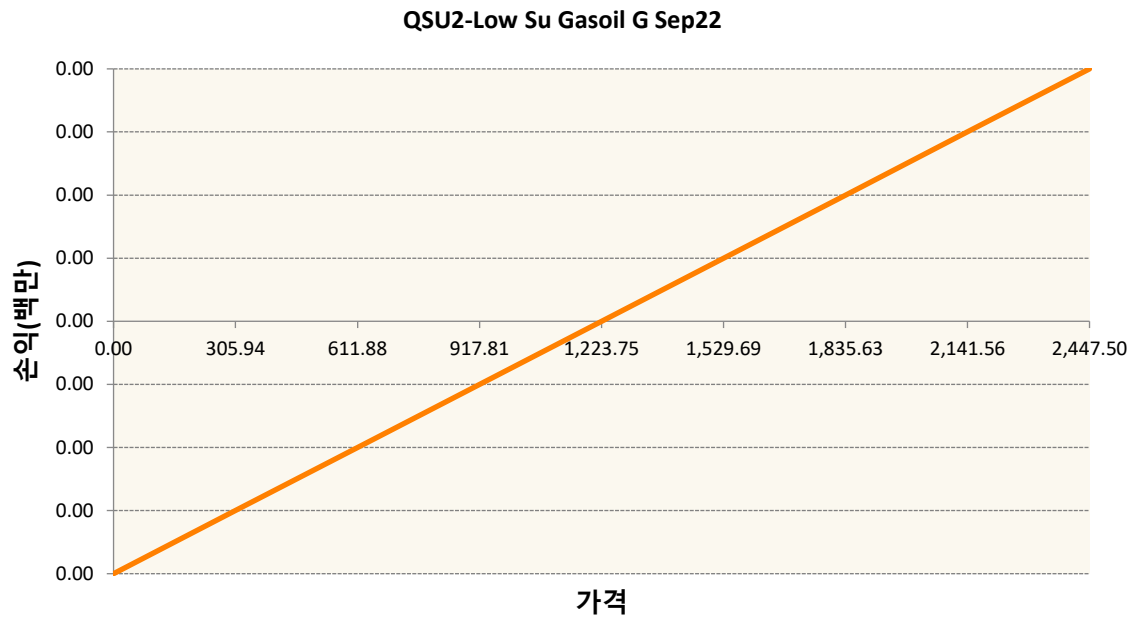


KR4175S70001-2022-07 달러선물



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			28
NGU22	NATURAL GAS FUTR Sep22		64
QSU2	Low Su Gasoil G Sep22		25
XBU2	GASOLINE RBOB FUT Sep22		16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		615