

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

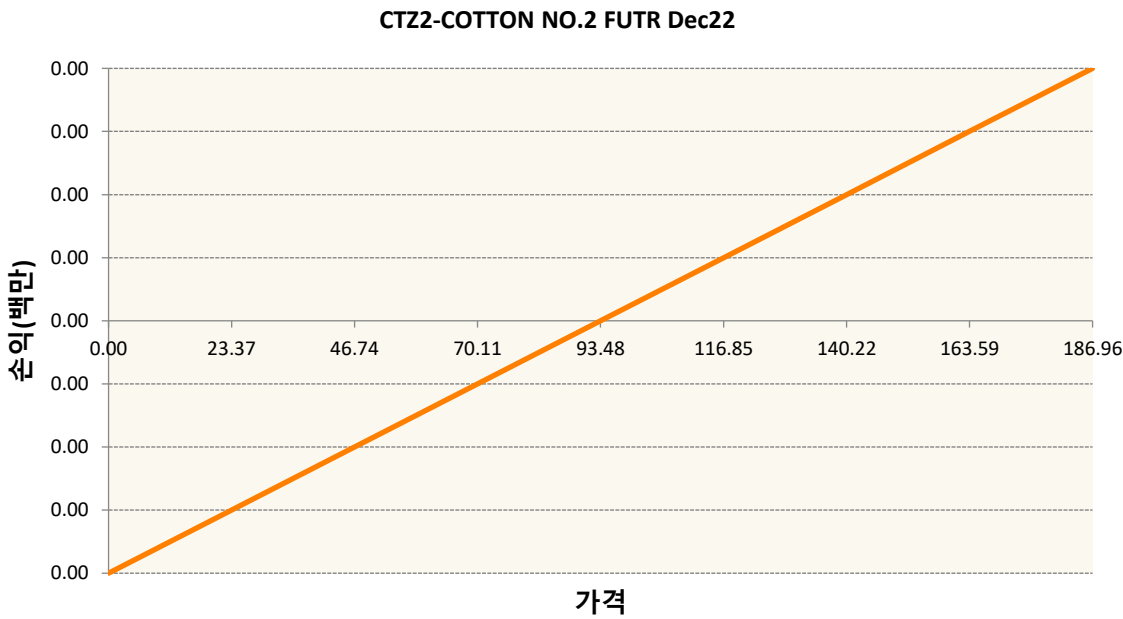
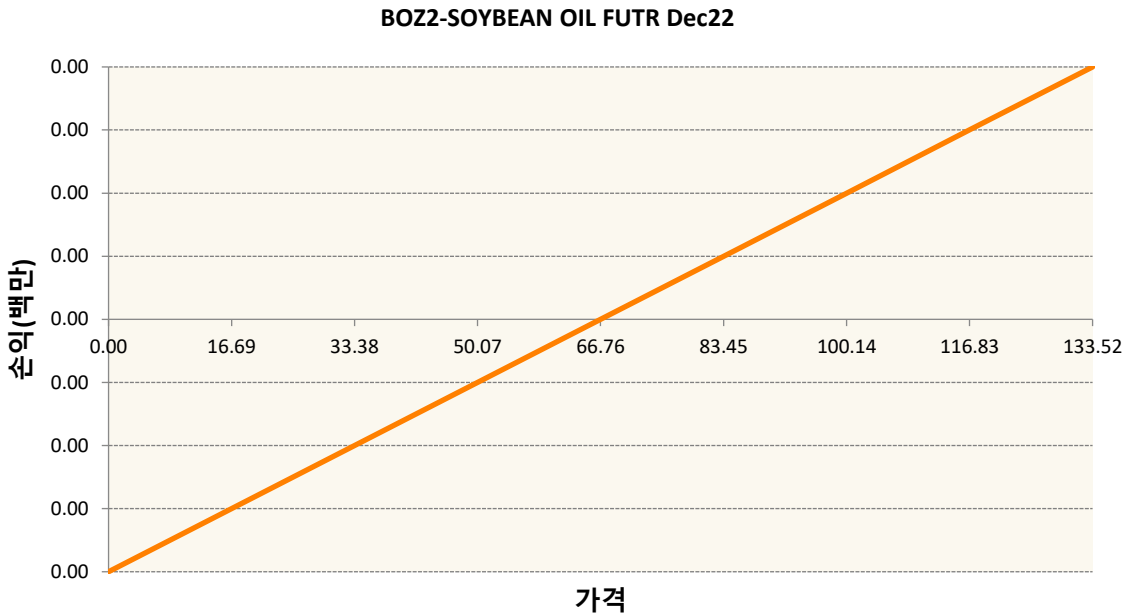
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

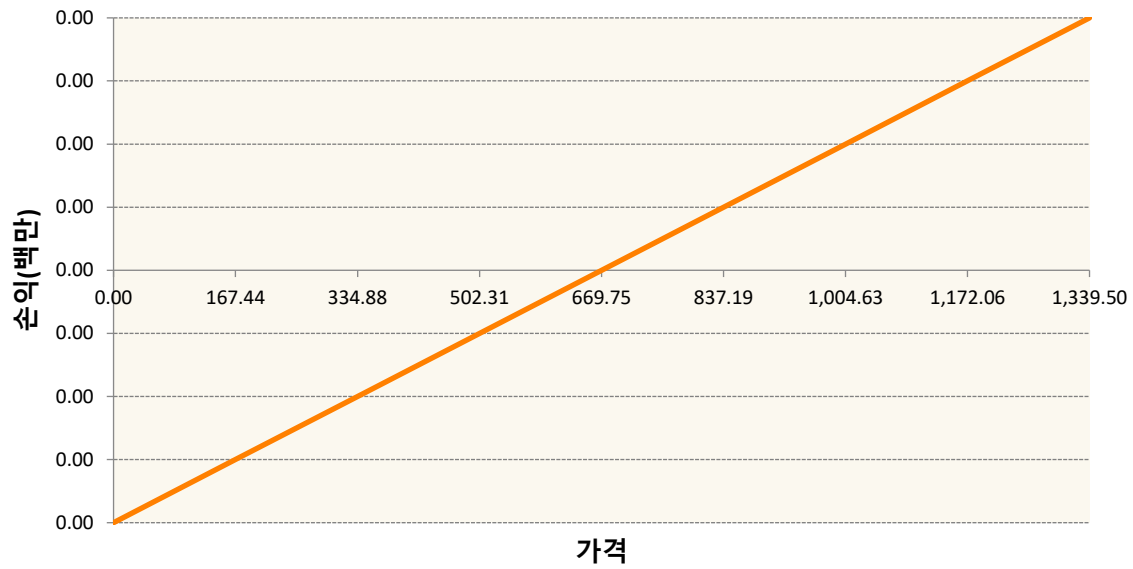
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,847	714	7,132	

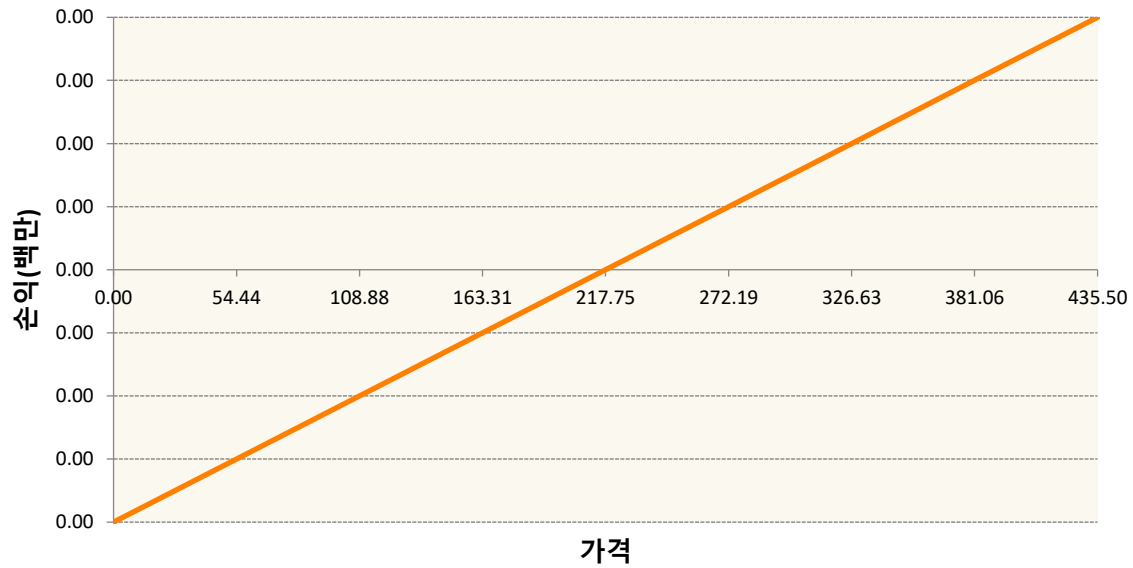
2. 만기시점의 손익구조



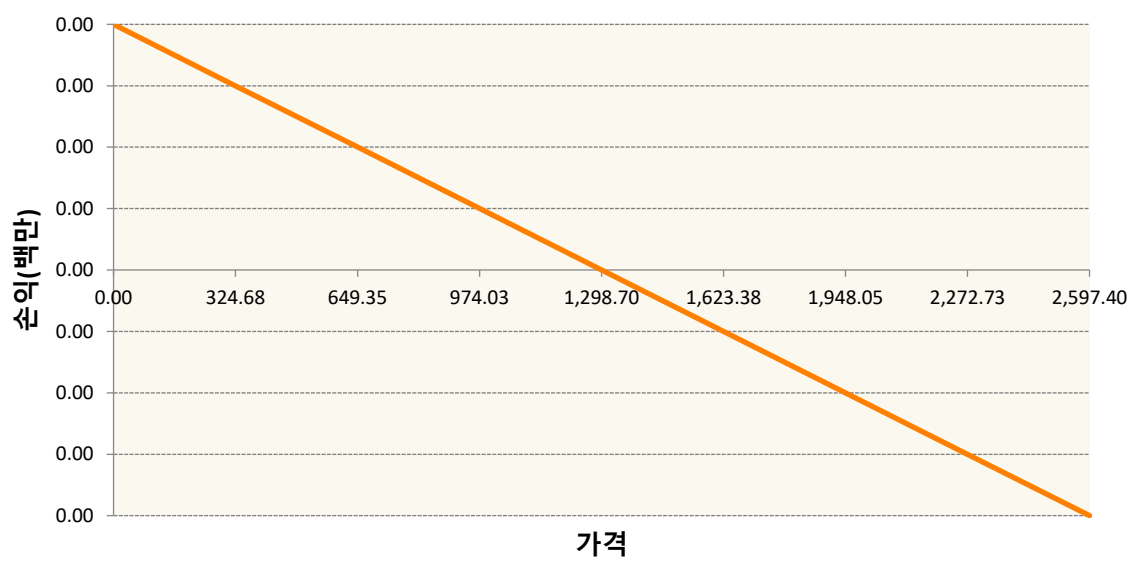
CU2-CORN FUTURE Sep22



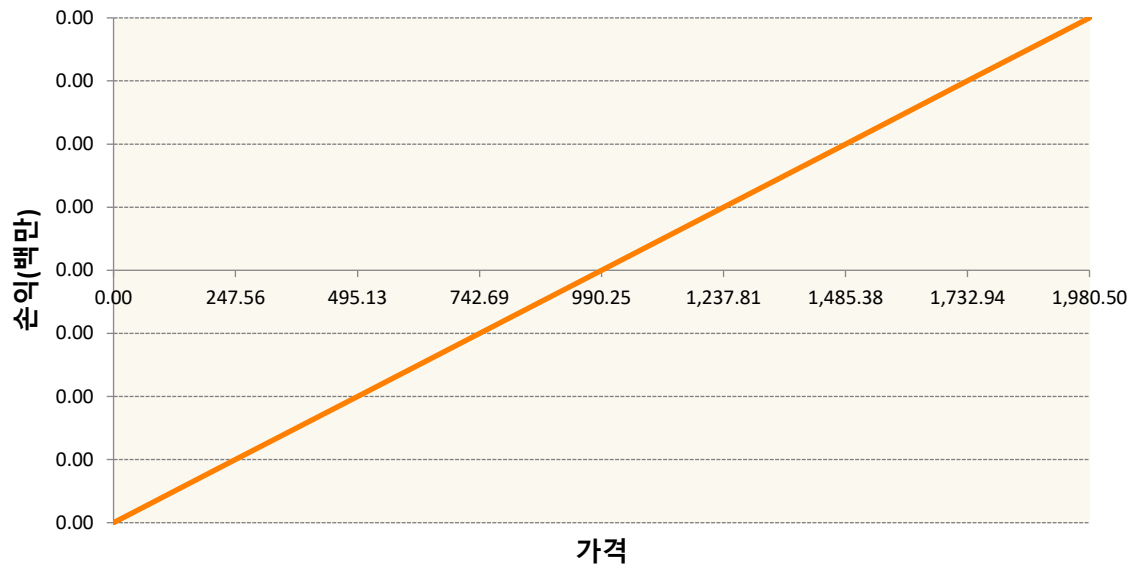
KCU2-COFFEE 'C' FUTURE Sep22



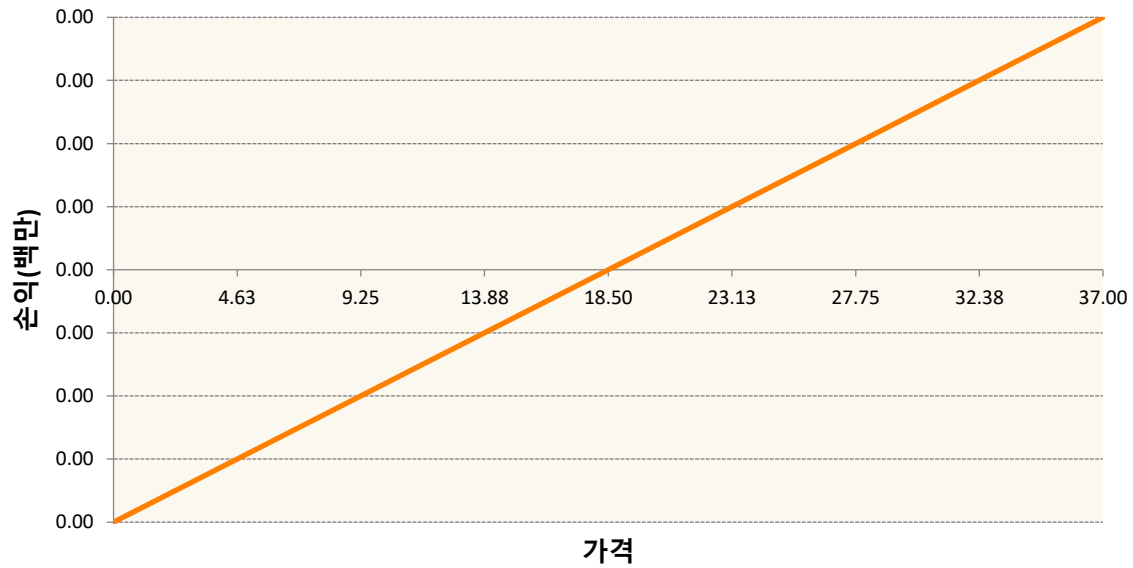
KR4175S70001-2022-07 달러선물



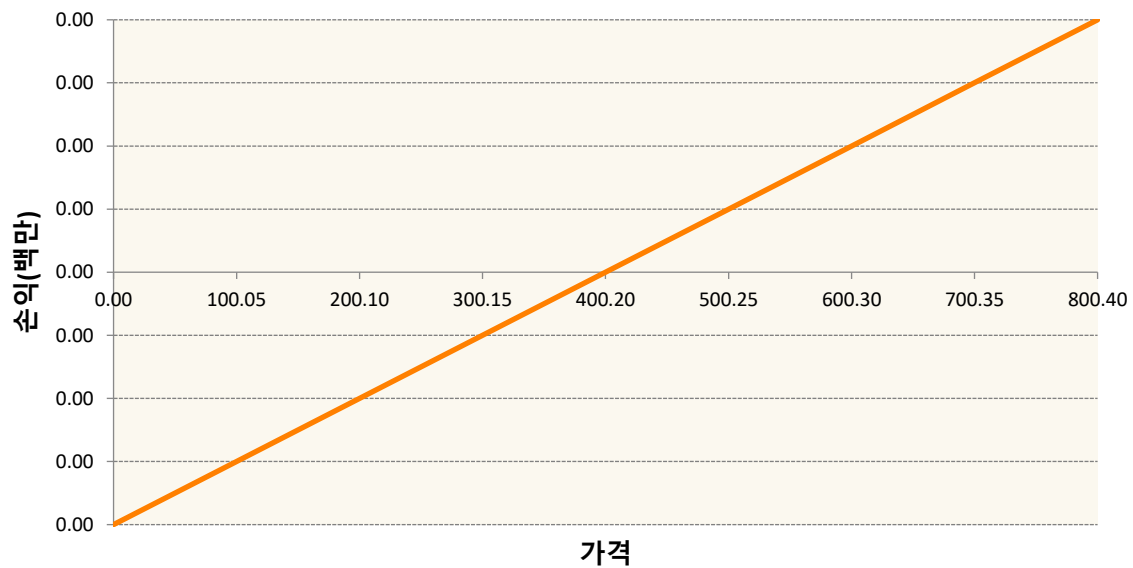
KWU2-KC HRW WHEAT FUT Sep22

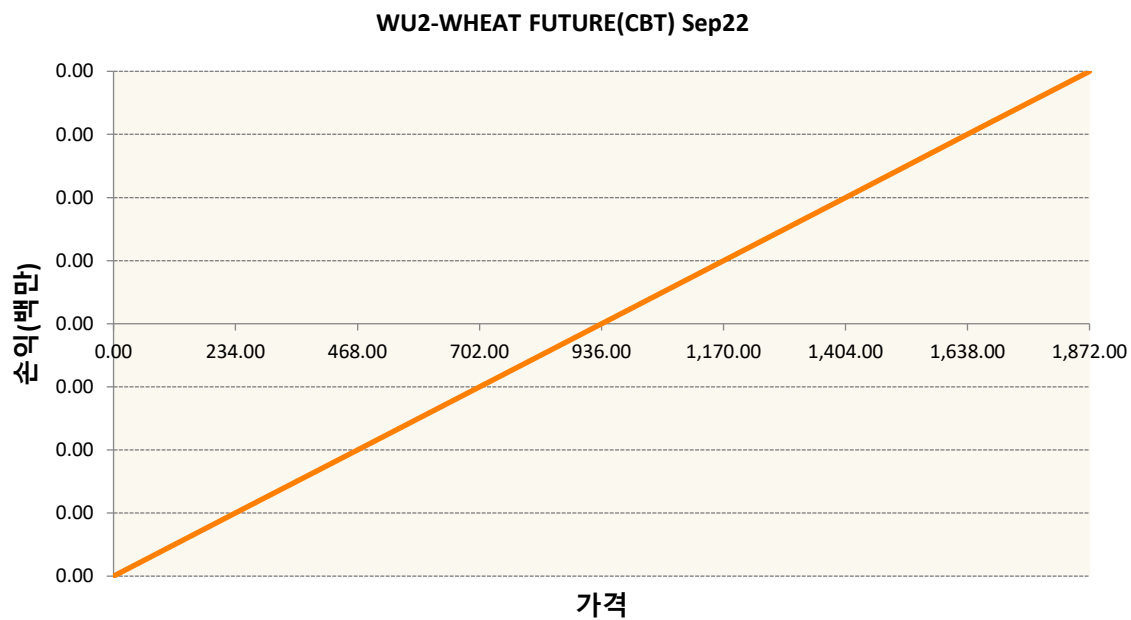
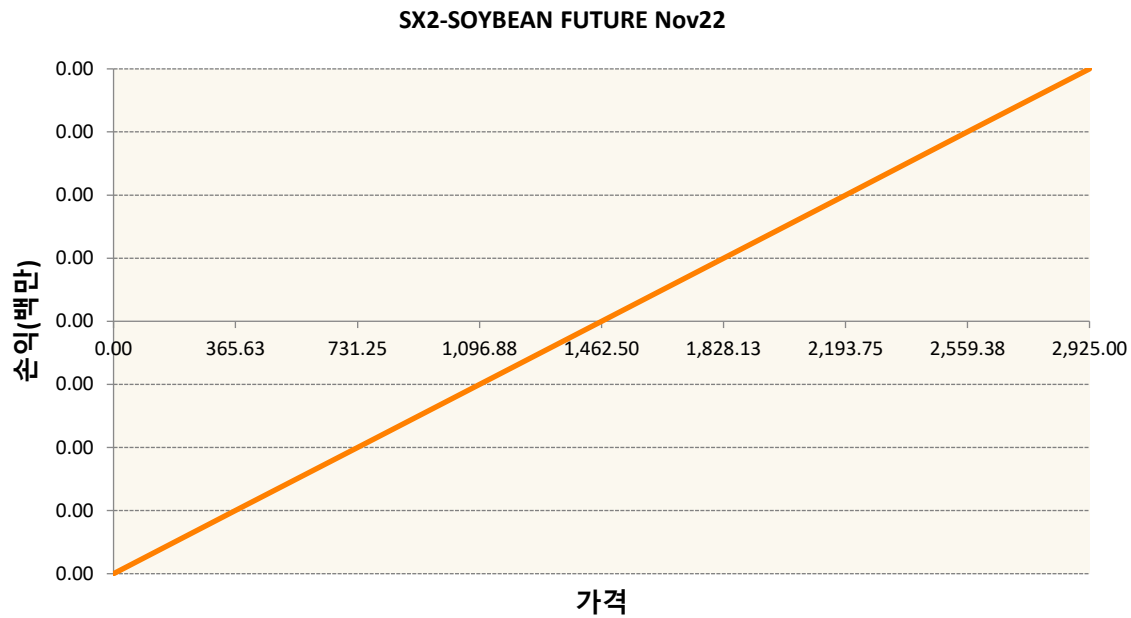


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



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	2022-06-30
기준일	2022-06-29

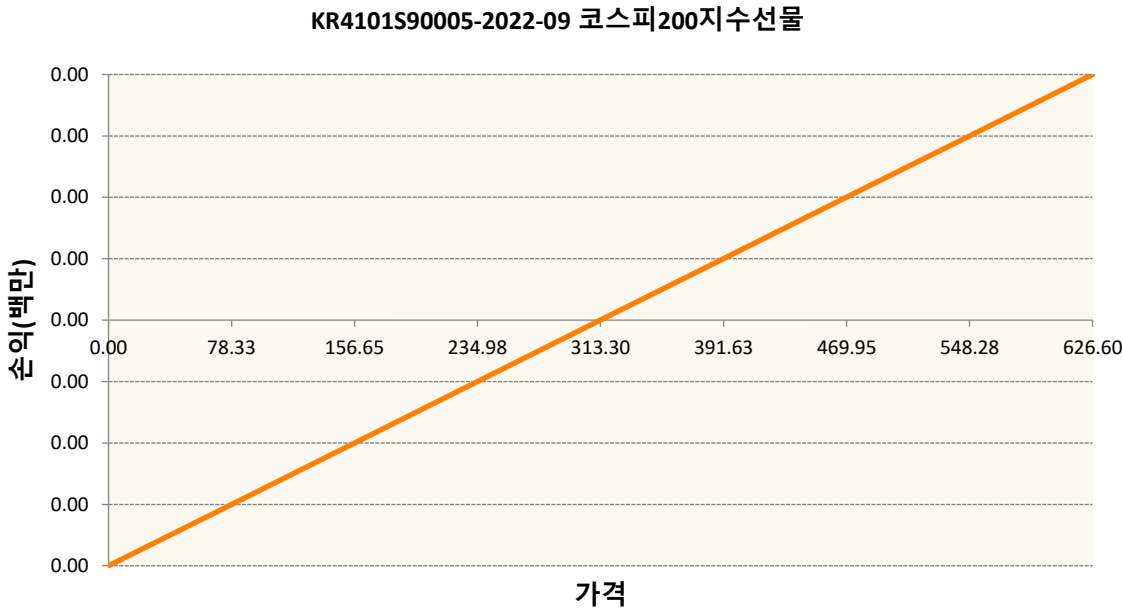
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	157	0	157	장내
누계	유가증권	선물	1,410	0	1,410	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

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	385
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

501

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

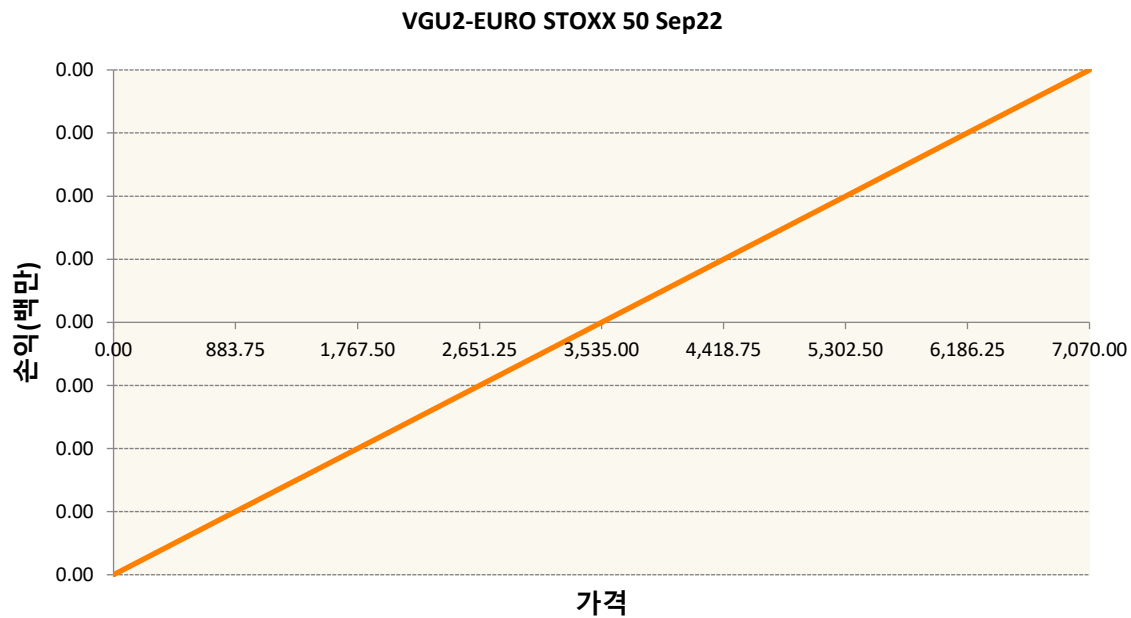
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	526	0	526	

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	2022-06-30
기준일	2022-06-29

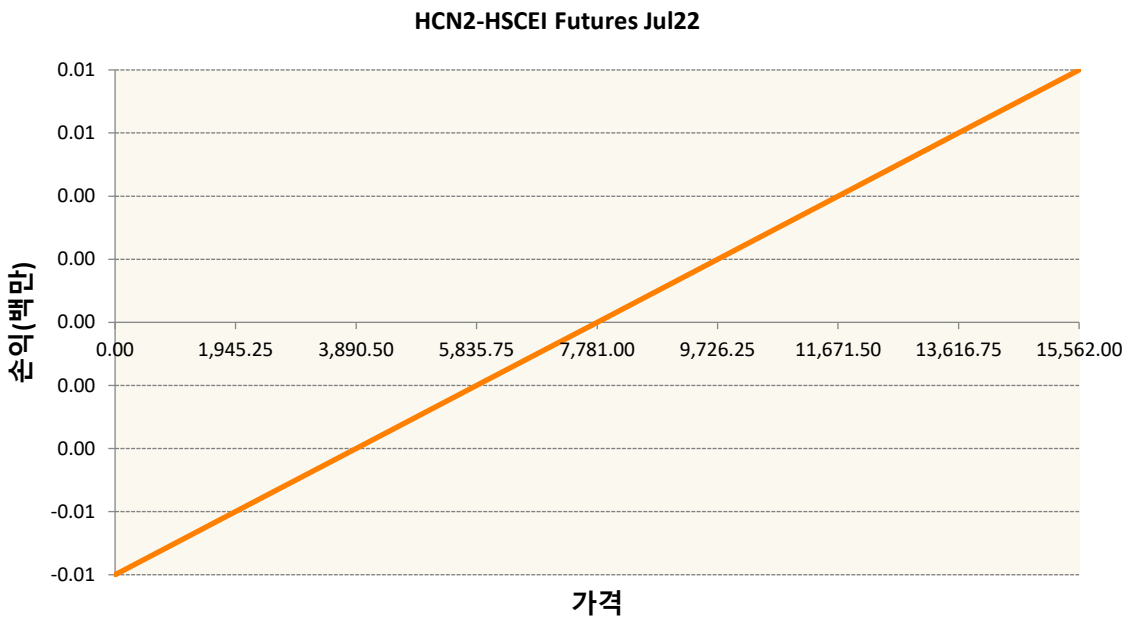
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,273	0	1,273	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN2	HSCEI Futures Jul22	102
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

150

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

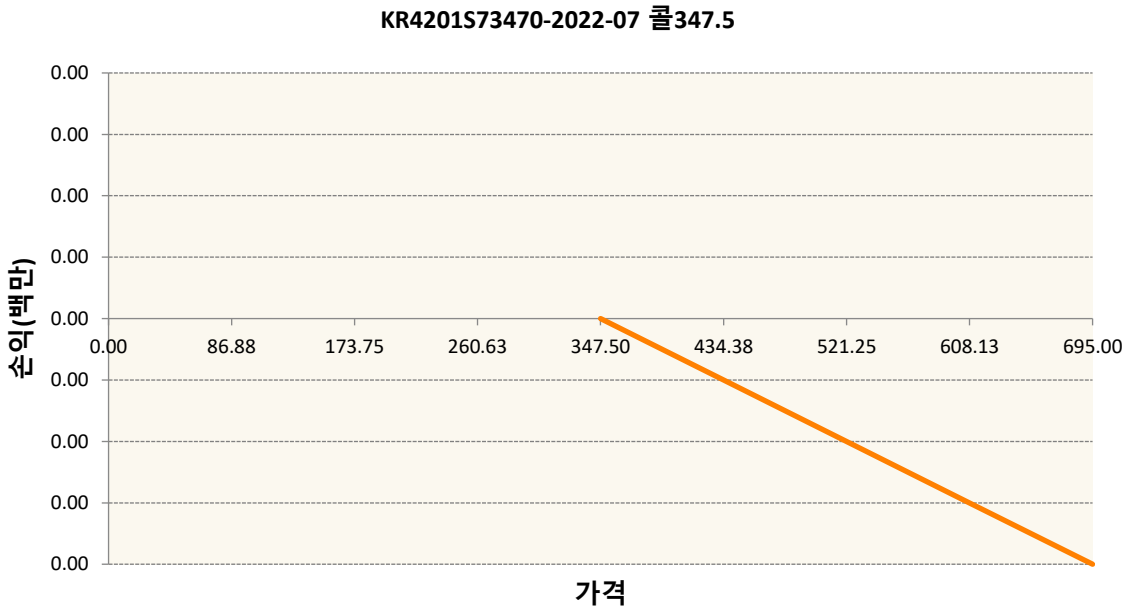
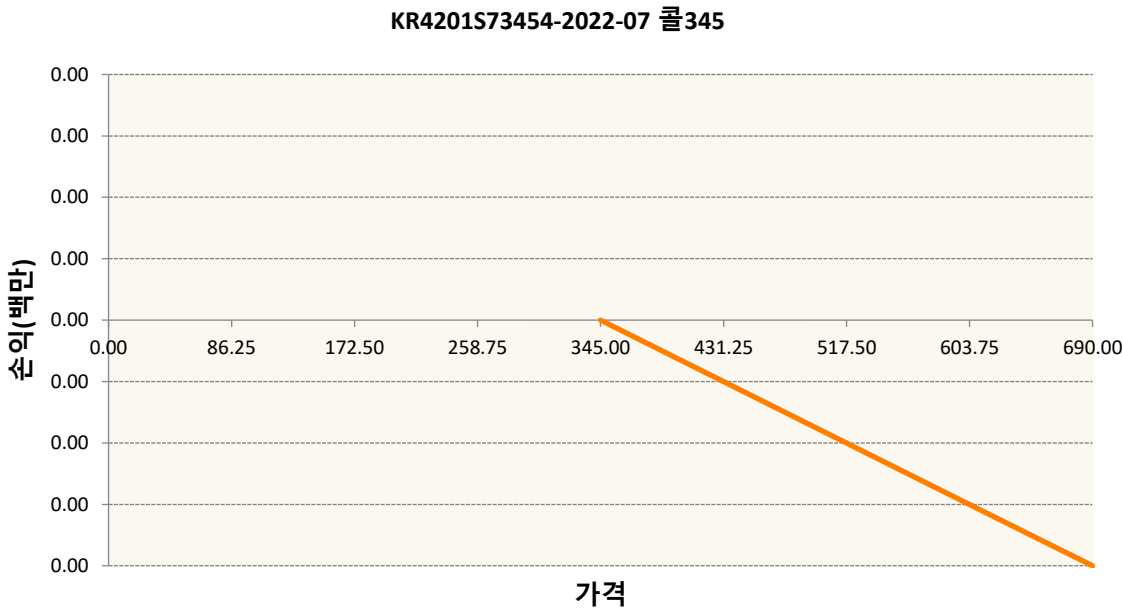
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

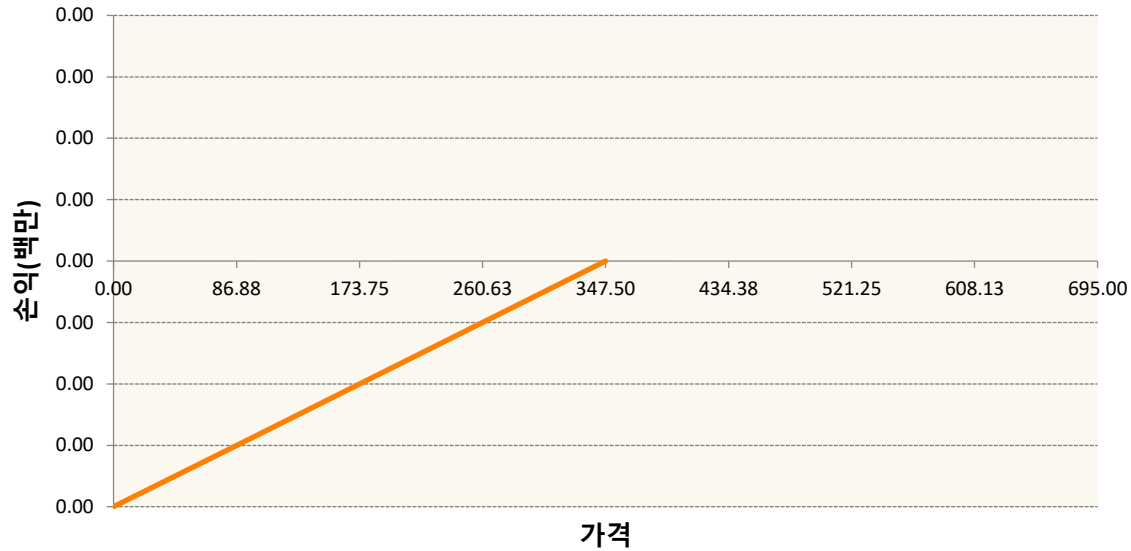
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	66,204	-66,204	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S73478-2022-07 풋347.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S73454			2022-07 콜345				496
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	44	43	43	41	39	36
-5.33%	44	43	42	39	35	30	22
-2.67%	42	39	35	28	19	7	-6
0%	34	26	14	0	-17	-38	-60
2.67%	7	-12	-34	-60	-88	-119	-152
5.33%	-63	-97	-133	-171	-211	-252	-294
8.00%	-210	-256	-303	-351	-399	-447	-496
KR4201S73470			2022-07 콜347.5				585
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	45	45	44	43	40	36
-5.33%	45	44	43	40	36	30	22
-2.67%	43	41	36	29	19	7	-9
0%	36	28	16	0	-20	-43	-70
2.67%	11	-10	-36	-65	-99	-136	-175
5.33%	-62	-101	-144	-190	-239	-290	-342
8.00%	-222	-280	-339	-399	-460	-522	-585
KR4301S73478			2022-07 풋347.5				861
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-861	-861	-861	-861	-861	-861	-861
-5.33%	-573	-573	-573	-573	-573	-573	-574
-2.67%	-285	-285	-286	-286	-286	-287	-288
0%	2	2	1	0	-2	-4	-7

2.67%	288	286	284	280	275	270	263
5.33%	566	560	552	543	534	523	511
8.00%	816	802	788	773	758	742	726

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

(단위:백만원)

1,462

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

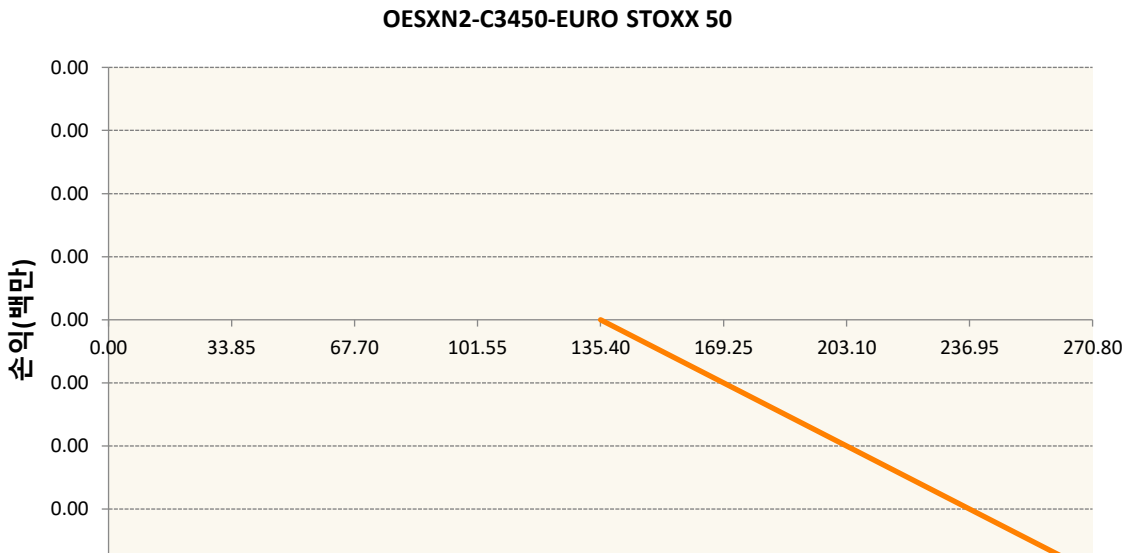
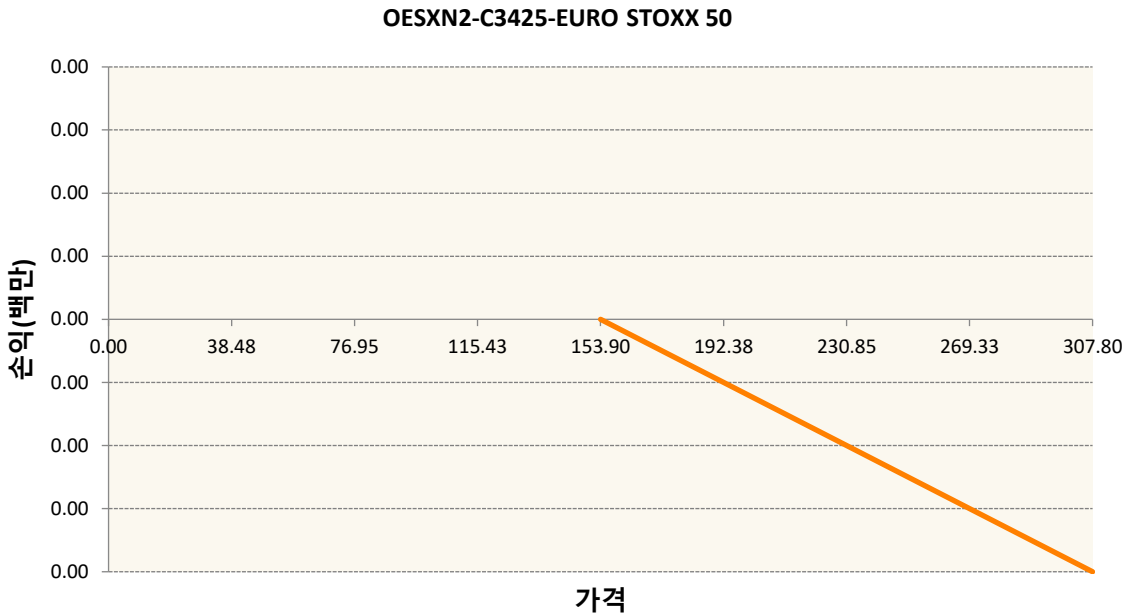
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

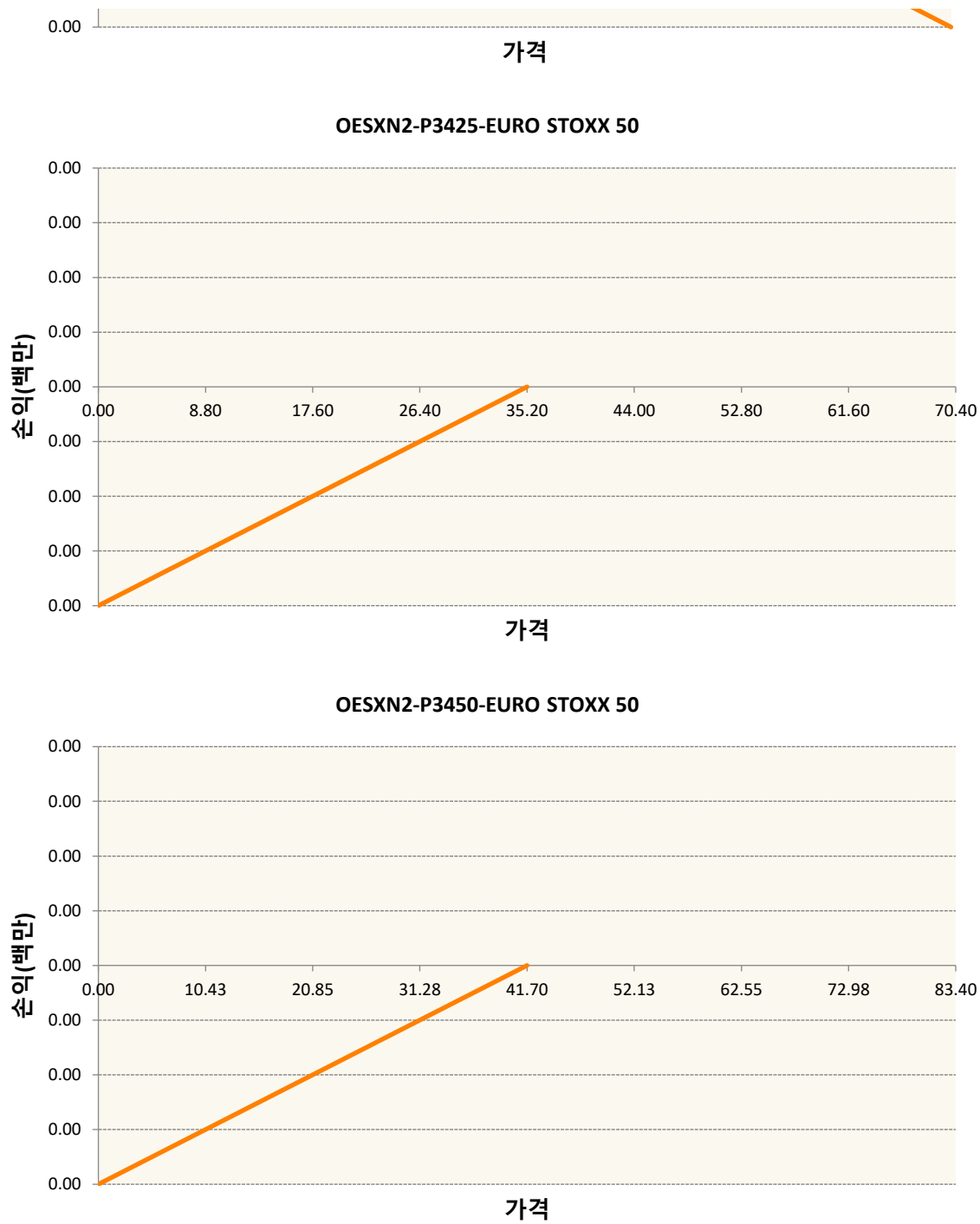
1. 계약금액

(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	50	-50	장내
누계	지수	스왑	10	0	10	장외
누계	통화	선도	0	1,090	-1,090	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

37
87
2
2
0.27
0.45

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

(단위:백만원)

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

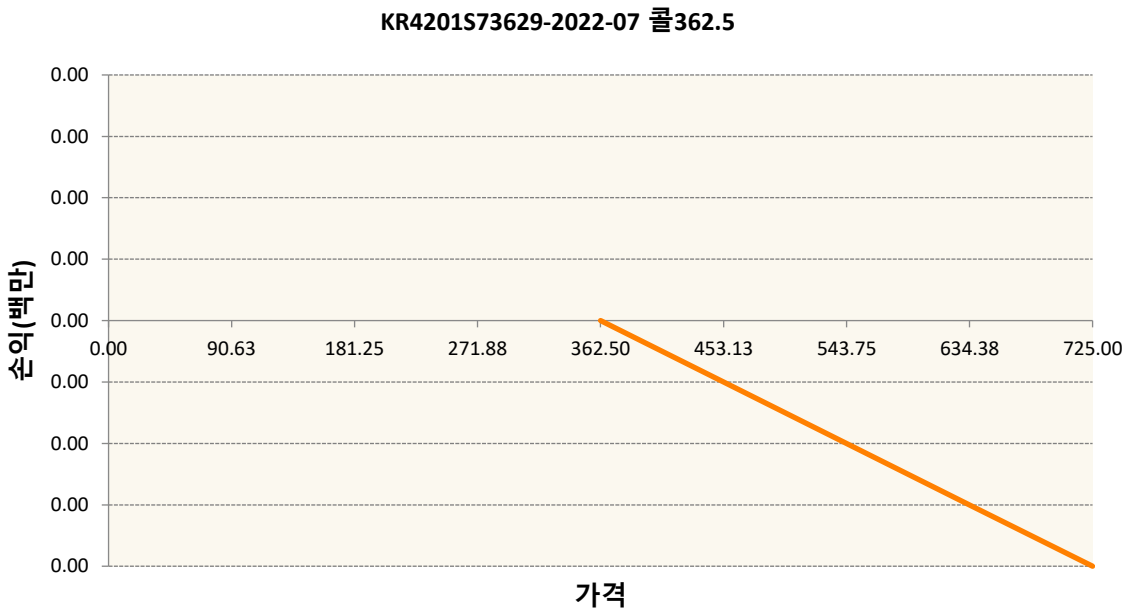
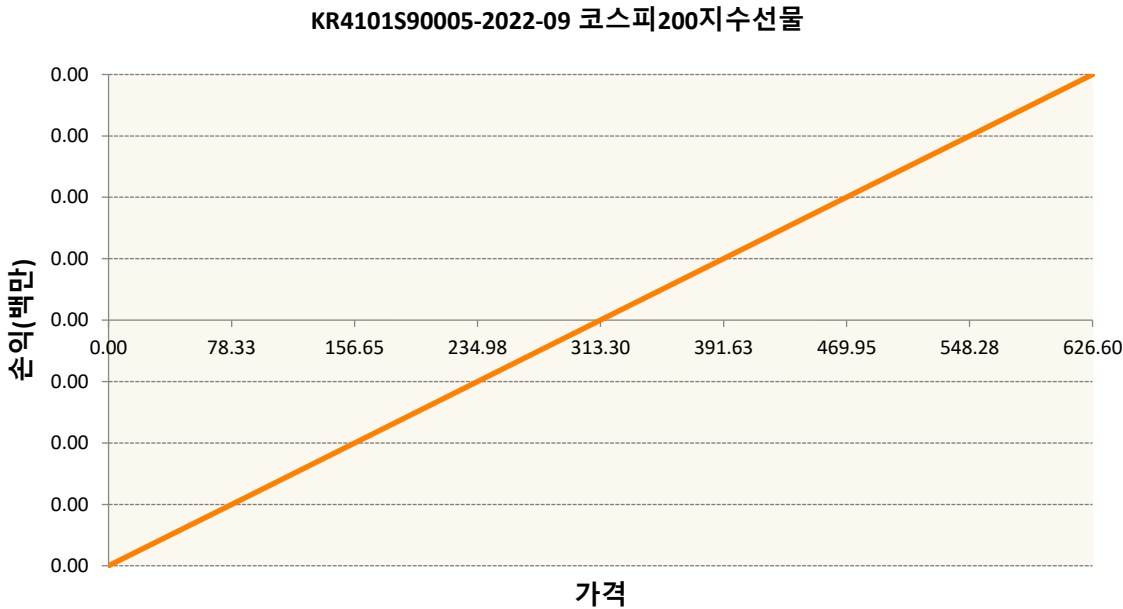
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	470	0	470	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 (365.00, 0.00) and ends at (730.00, 0.00).

가격	손익(백만)
365.00	0.00
730.00	0.00

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					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					17
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	0	0
-5.33%	1	1	1	0	0	0	0
-2.67%	1	1	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	0	0	0	-1	-2	-3	-4
5.33%	0	-1	-2	-4	-5	-7	-9
8.00%	-3	-4	-6	-9	-11	-14	-17
KR4201S73652 2022-07 콜365							20

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	0	0
-5.33%	1	1	1	0	0	0	0
-2.67%	1	1	0	0	0	0	0
0%	1	0	0	0	0	-1	-2
2.67%	0	0	0	-1	-2	-3	-5
5.33%	0	-1	-2	-4	-6	-8	-10
8.00%	-3	-5	-7	-10	-13	-16	-20

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	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	-6
5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-11	-11
8.00%	-18	-17	-17	-17	-16	-16	-16

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

(단위:백만원)

67

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

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	9,070	0	9,070	

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	2022-06-30
기준일	2022-06-29

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	6,979	0	6,979	

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	2022-06-30
기준일	2022-06-29

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	21,572	0	21,572	
누계	통화	선도	650	21,797	-21,148	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C6P² KRW/USD 29-08-22E		581
FXW213C6P² KRW/USD 27-09-22E		582
FXW213C6P² KRW/USD 27-07-22E		581
FXW213C6Q USD/KRW 27-07-22E		52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	676

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

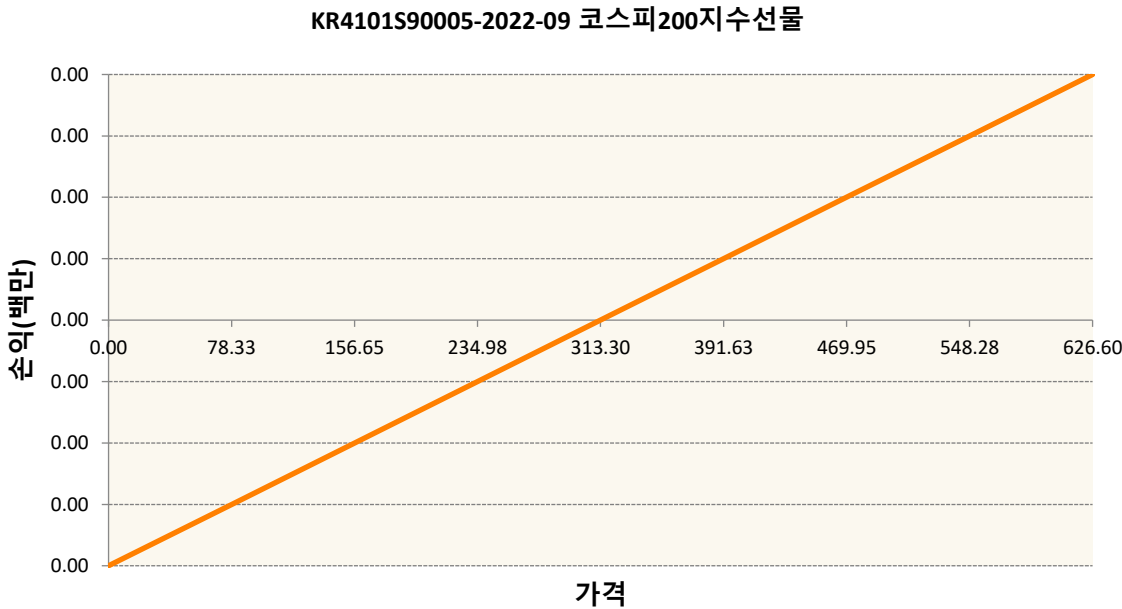
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	548	0	548	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%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-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%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	44	44	44	44	44	44	44

공시일 2022-06-30

기준일 2022-06-29

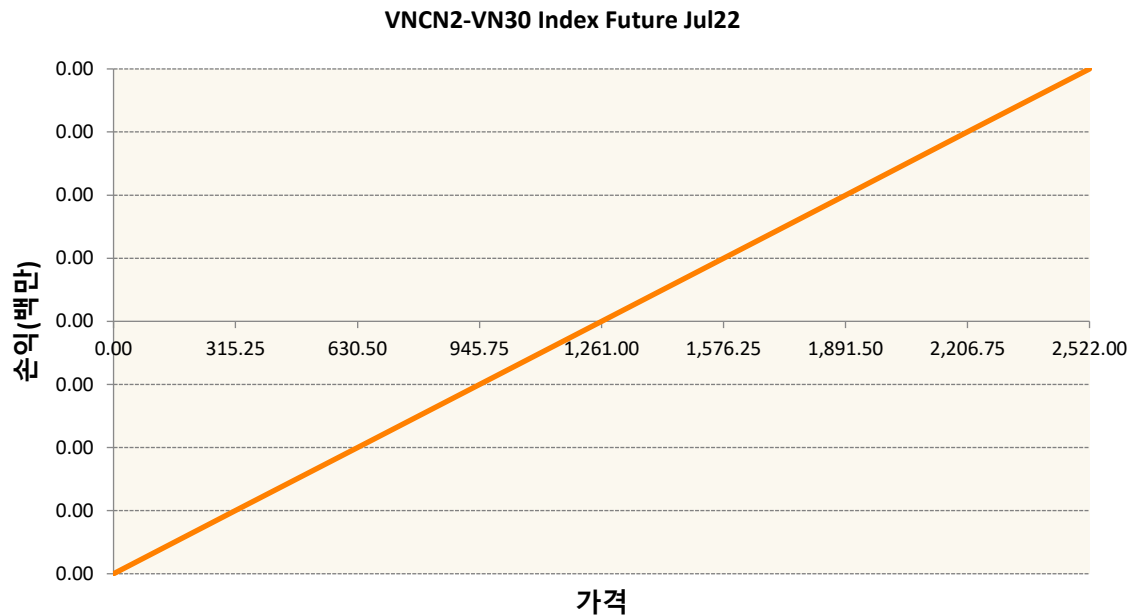
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	762	0	762	
누계	유가증권	스왑	1,762	0	1,762	장외
누계	통화	선도	0	927	-927	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	31
FXW213C6N KRW/EUR 23-09-22E	27
VNCN2 VN30 Index Future Jul22	61

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

(단위:백만원)

279

공시일 2022-06-30

기준일 2022-06-29

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

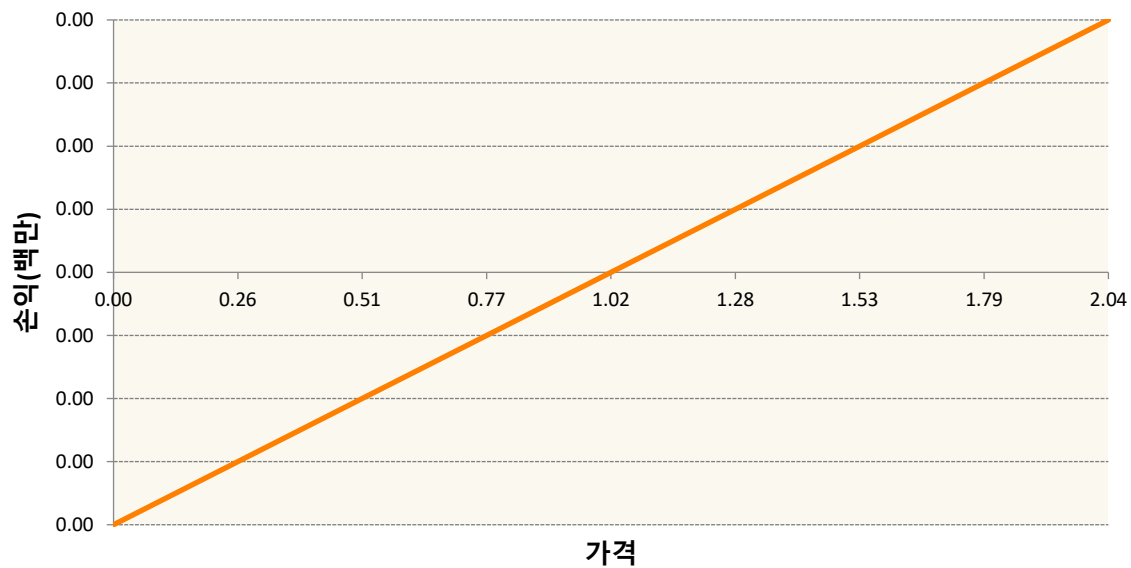
1. 계약금액

(단위:백만원)

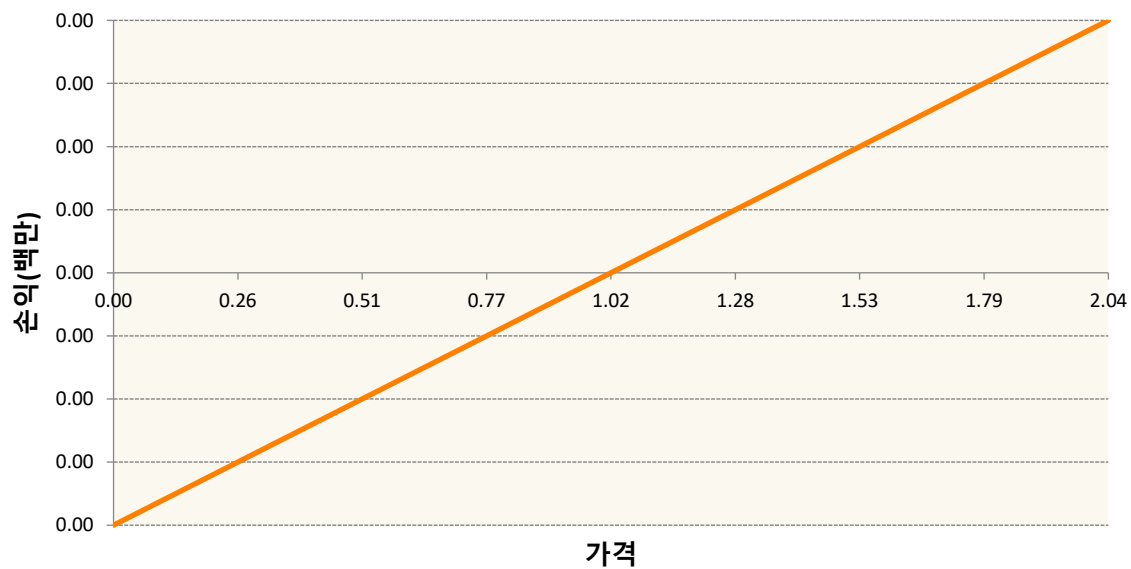
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	48,506	0	48,506	

2. 만기시점의 손익구조

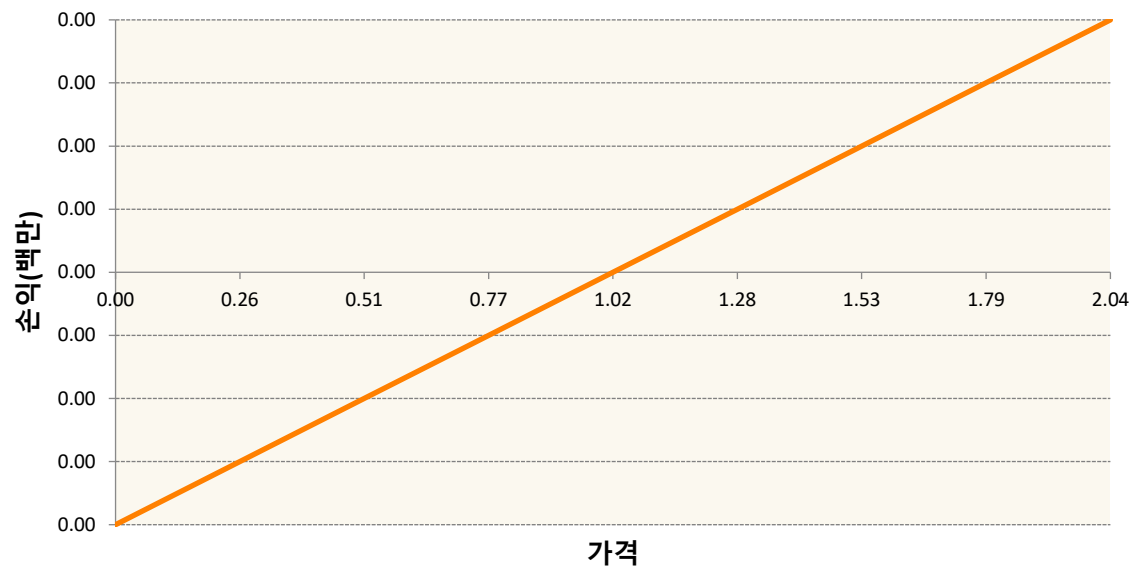
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



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)

205

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

3,579

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

103

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

(단위:백만원)

7,174

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

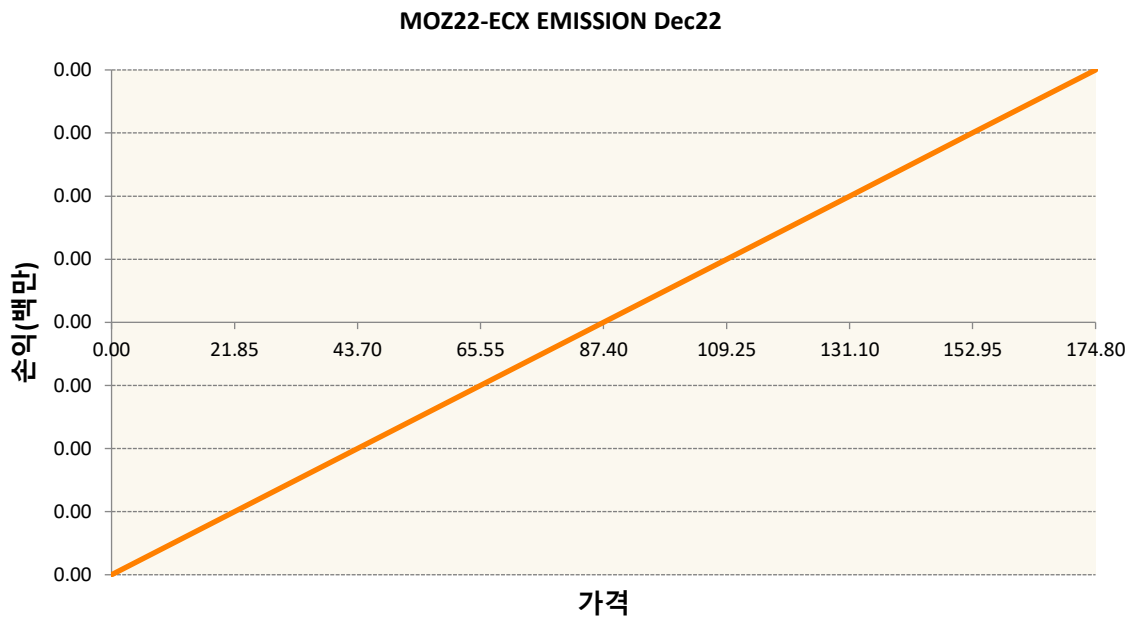
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,130	0	15,130	
누계	통화	선도	0	8,622	-8,622	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C6T KRW/EUR 26-07-22E	690
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,210

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

(단위:백만원)

3,331

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

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)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	17

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

(단위:백만원)

130

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

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)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	24
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(메리츠)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220426(메리츠)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220614(메리츠)	1

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

(단위:백만원)

124

공시일 2022-06-30

기준일 2022-06-29

에퀴티알파일반사모혼합자산

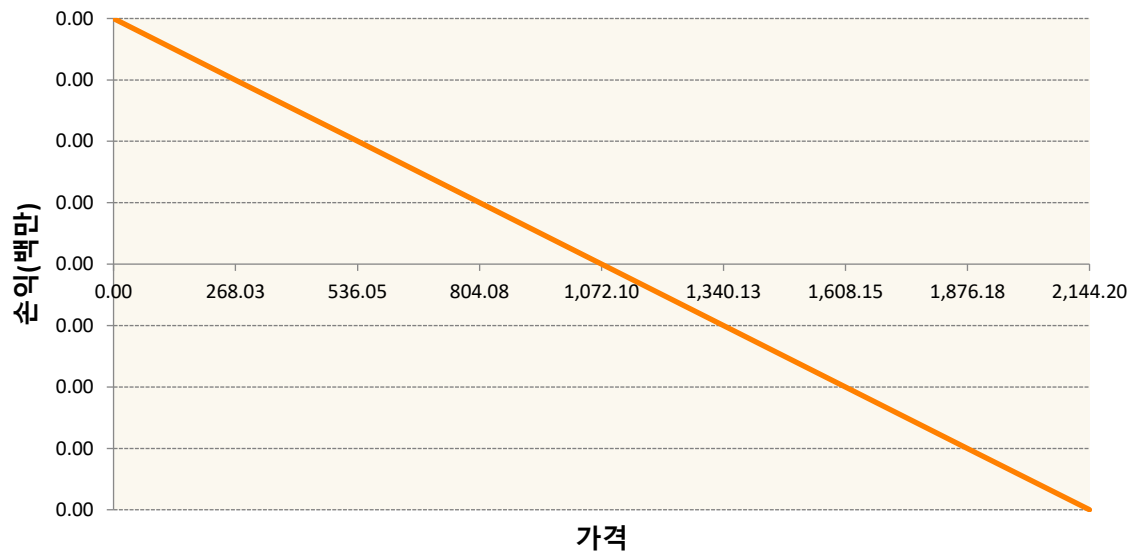
1. 계약금액

(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	322	-322	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4106S90004-2022-09 코스닥150선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.32
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	1
KR4106S900 2022-09 코스닥150선물	26

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

(단위:백만원)

41

공시일 2022-06-30

기준일 2022-06-29

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

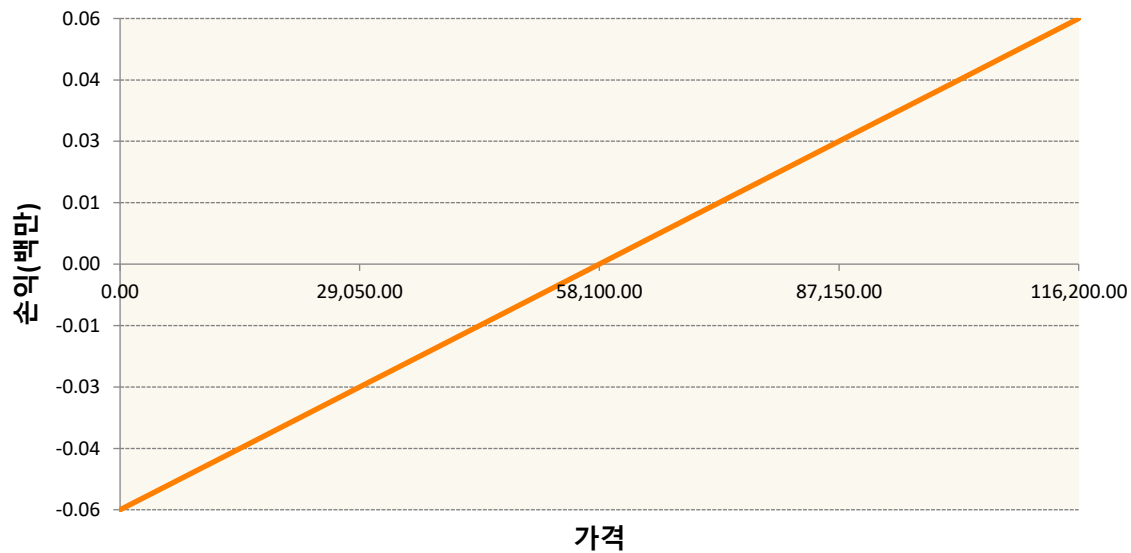
1. 계약금액

(단위:백만원)

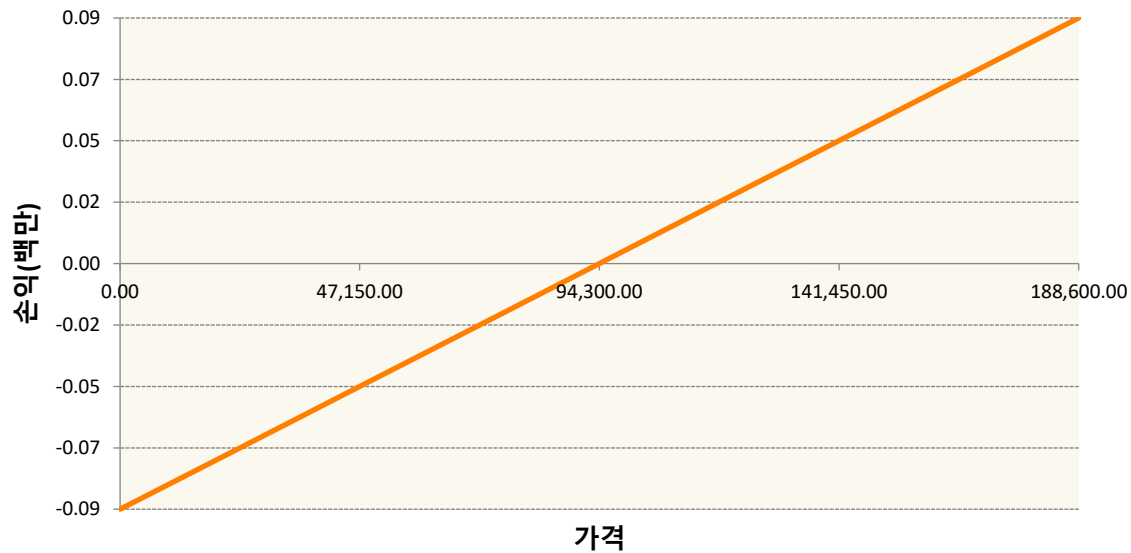
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	829	0	829	장내

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%	-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%	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)

76

공시일	2022-06-30
기준일	2022-06-29

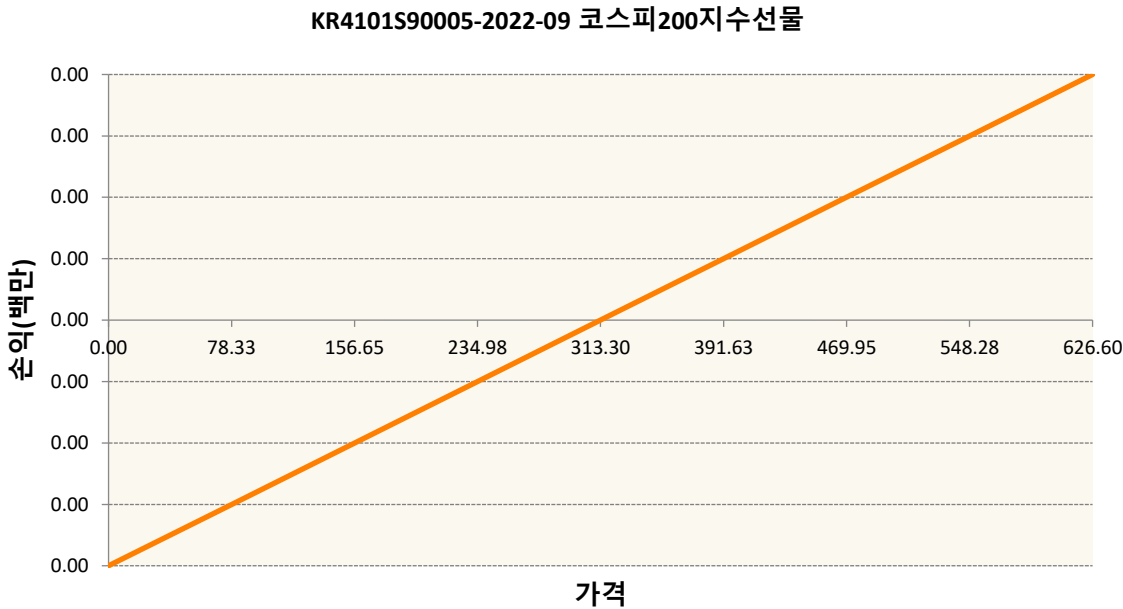
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	313	0	313	장내
누계	유가증권	선물	862	0	862	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005		2022-09 코스피200지수선물					69
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	46	46	46	46	46	46	46
8.00%	69	69	69	69	69	69	69

공시일 2022-06-30

기준일 2022-06-29

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

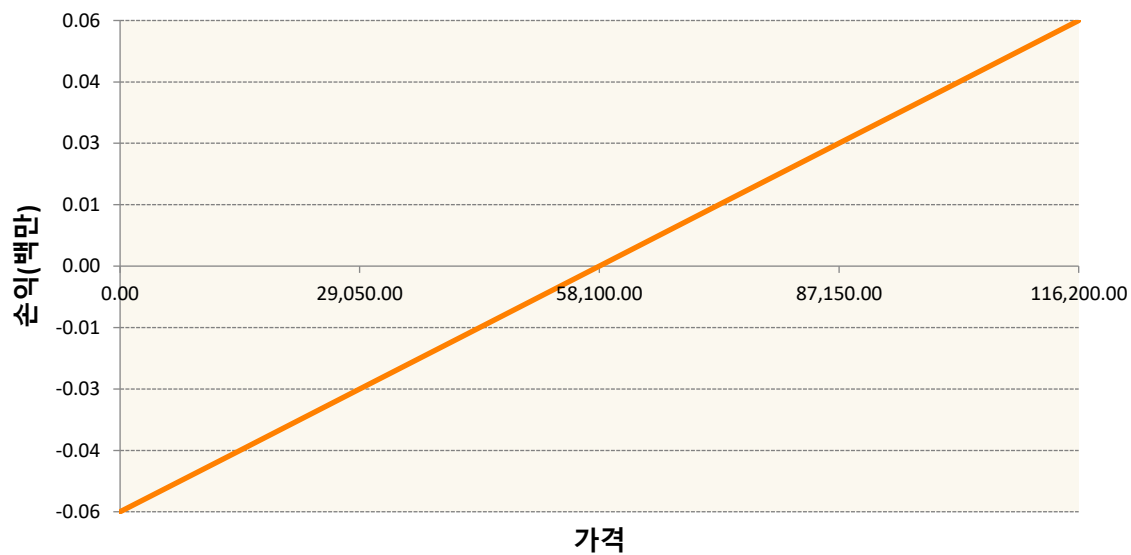
1. 계약금액

(단위:백만원)

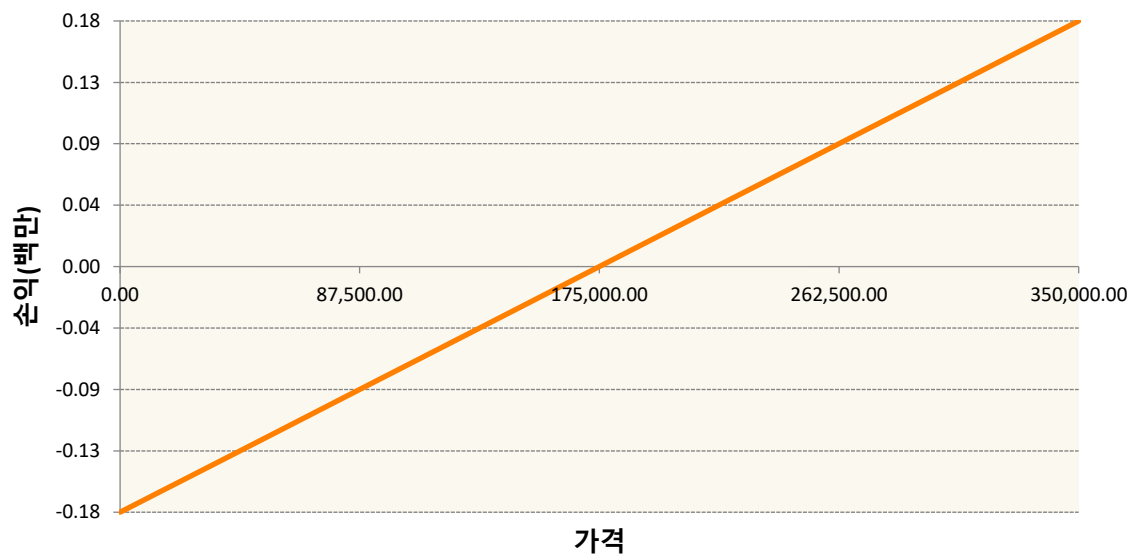
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	269	0	269	장내

2. 만기시점의 손익구조

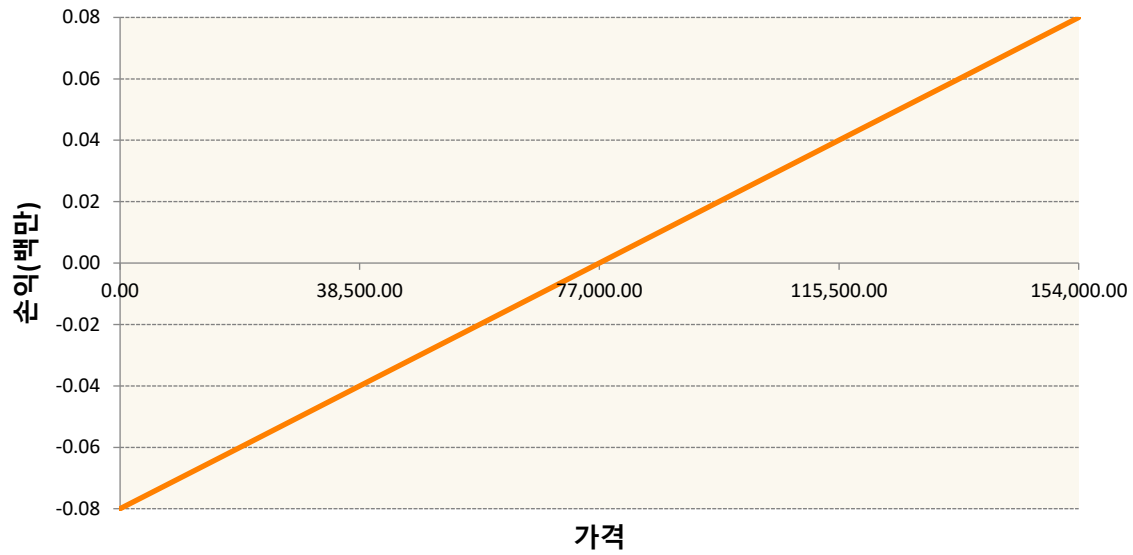
KR4111S70006-2022-07 삼성전자개별선물



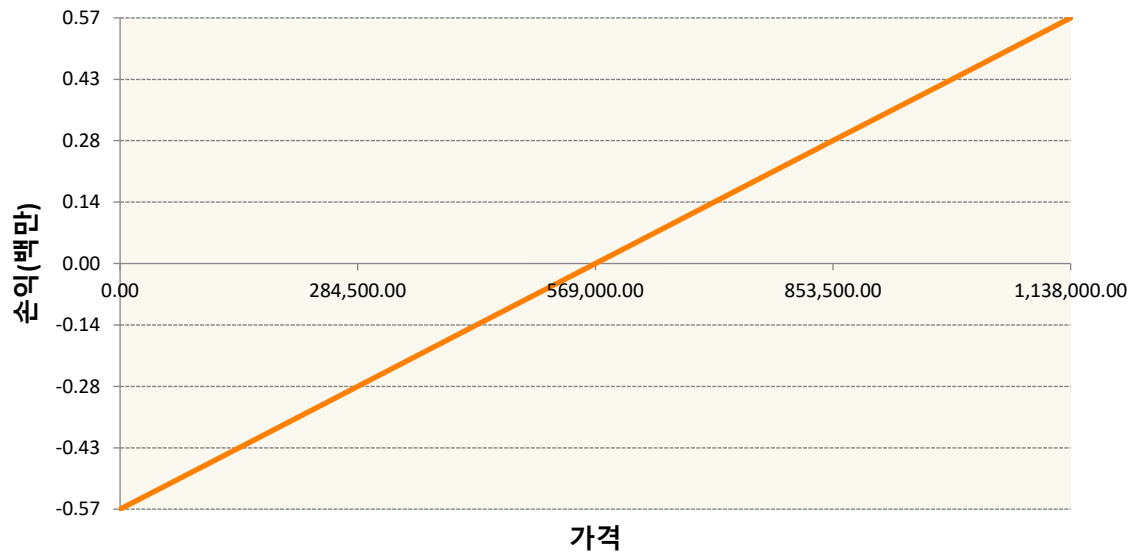
KR4116S70005-2022-07 현대차개별선물



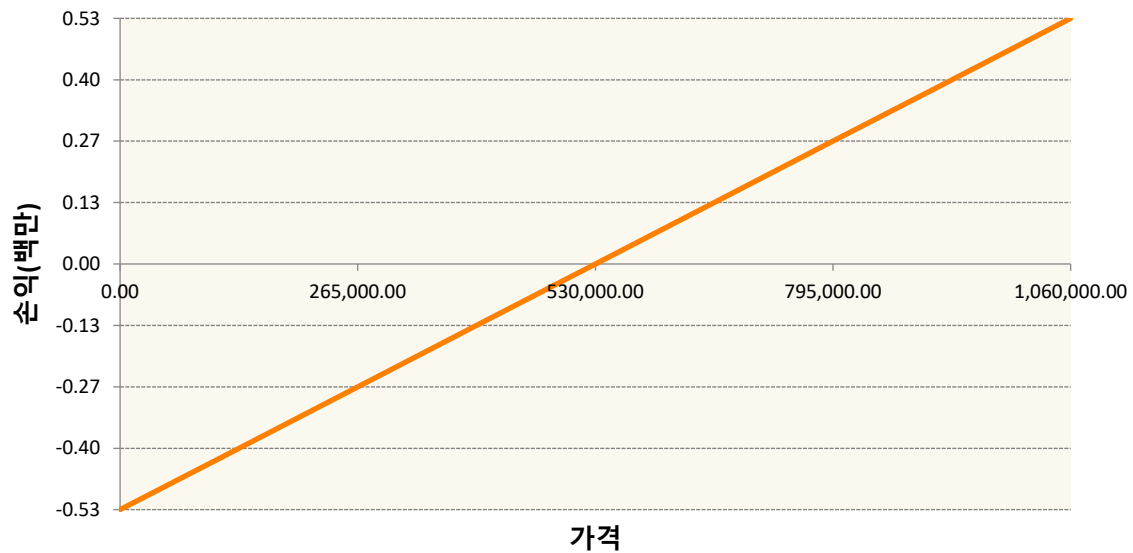
KR4119S70009-2022-07 기아개별선물



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%	-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 2022-06-30

기준일 2022-06-29

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

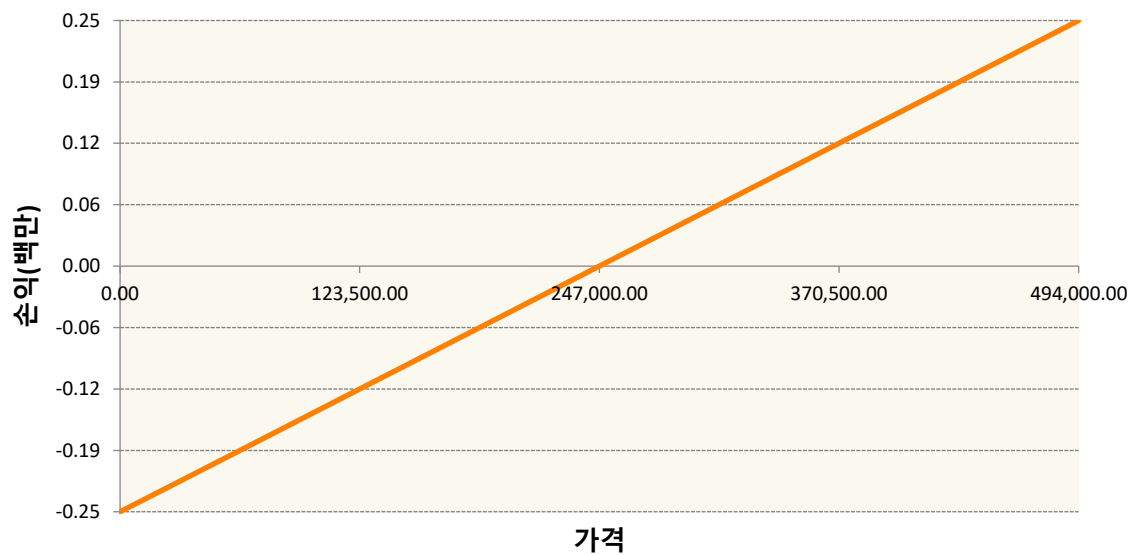
1. 계약금액

(단위:백만원)

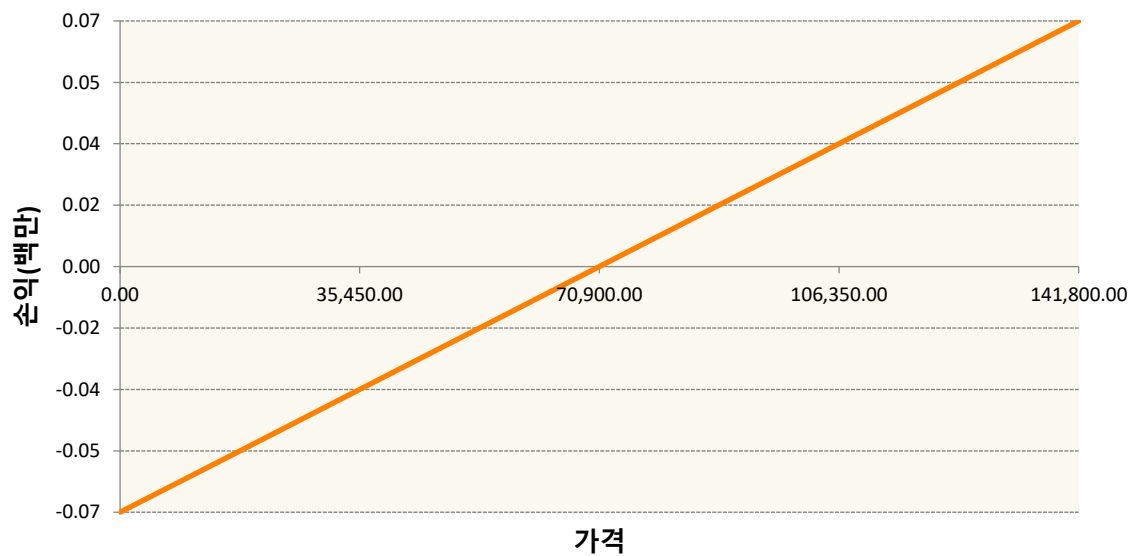
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	209	0	209	장내

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)

27

공시일 2022-06-30

기준일 2022-06-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

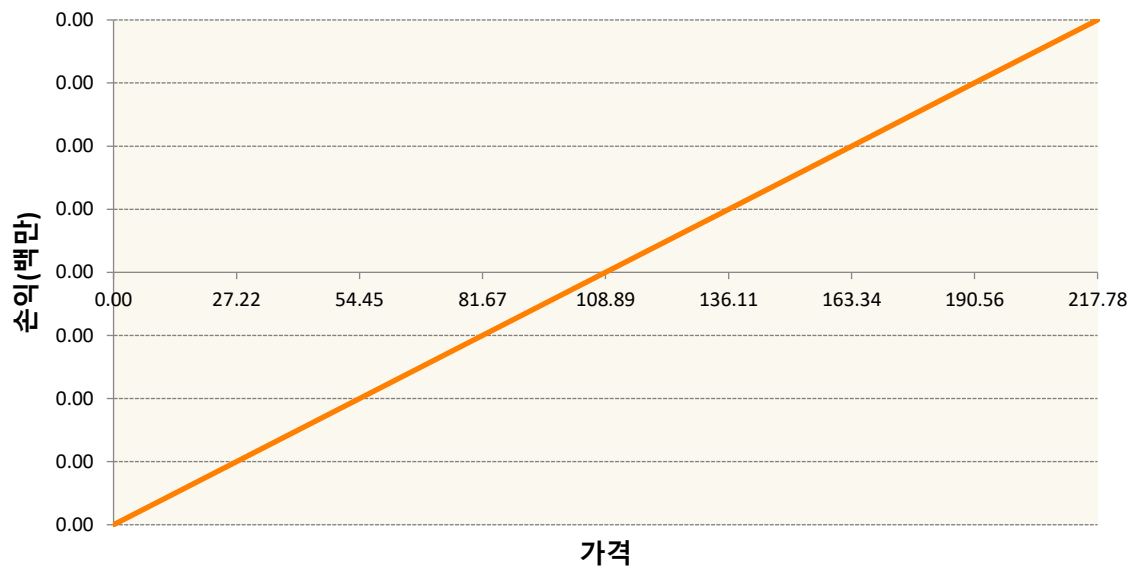
1. 계약금액

(단위:백만원)

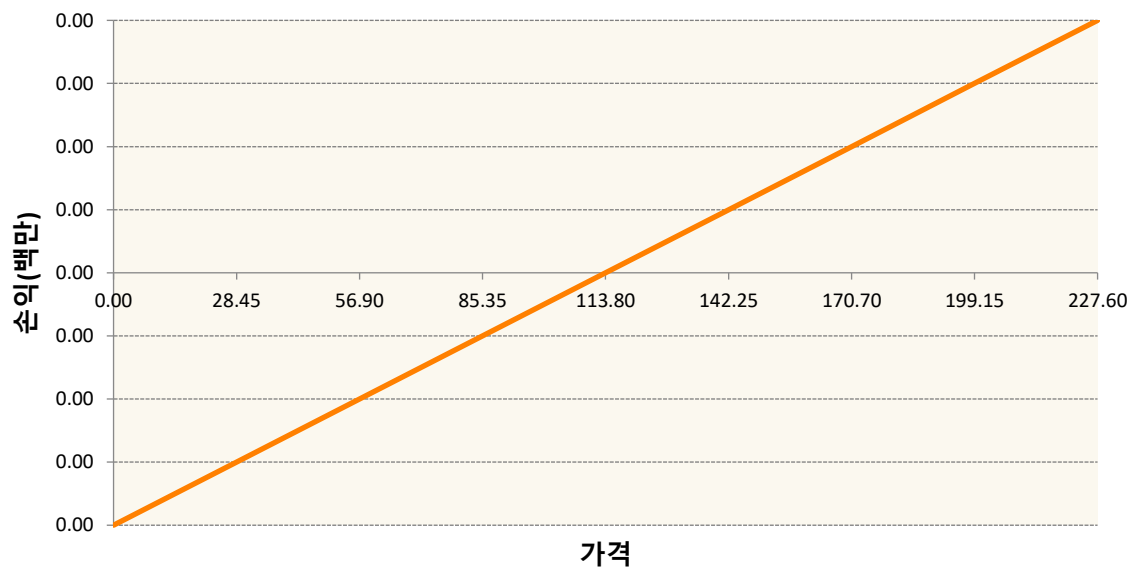
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,783	351	2,433	

2. 만기시점의 손익구조

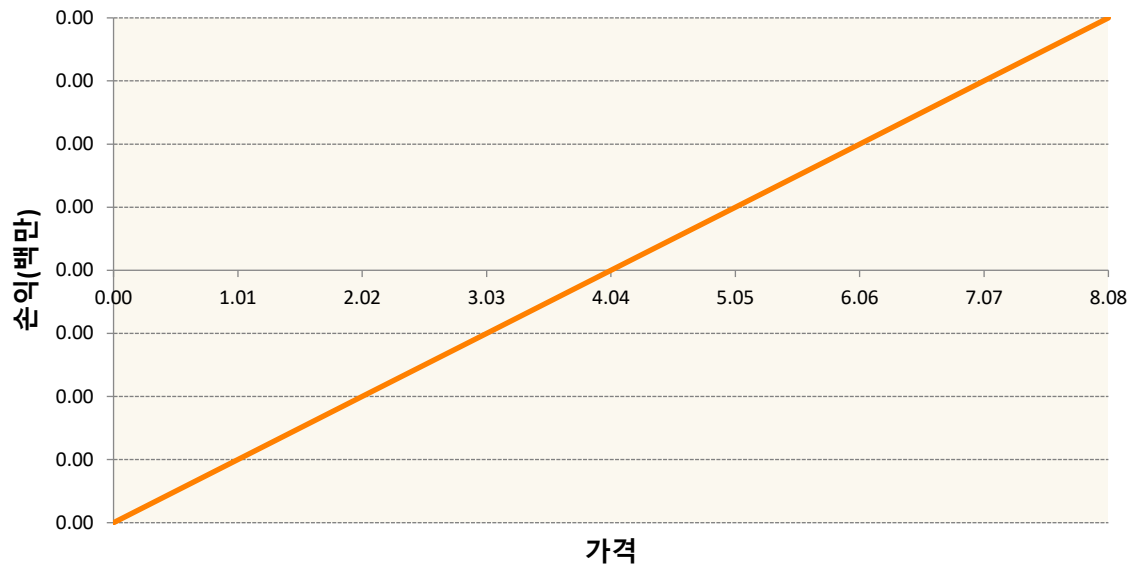
CLU2-WTI CRUDE FUTURE Sep22



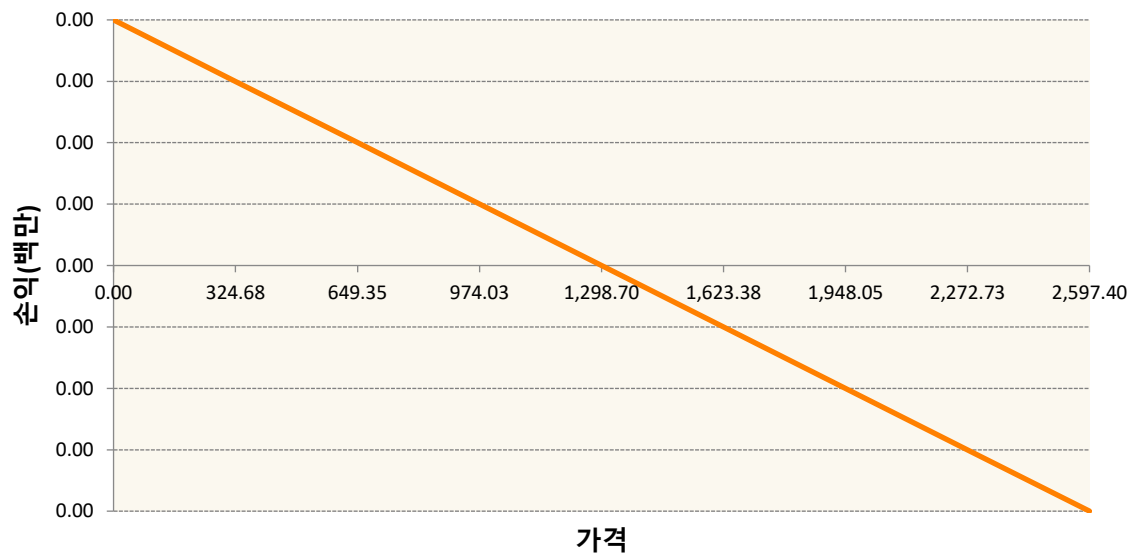
COU2-BRENT CRUDE FUTR Sep22



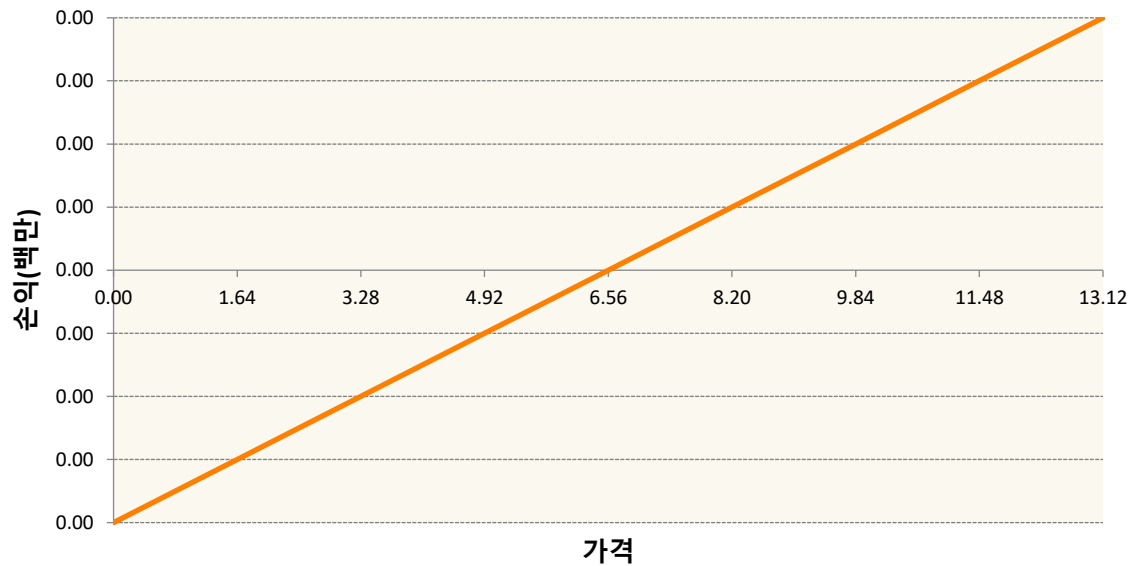
HOU2-NY Harb ULSD Fut Sep22

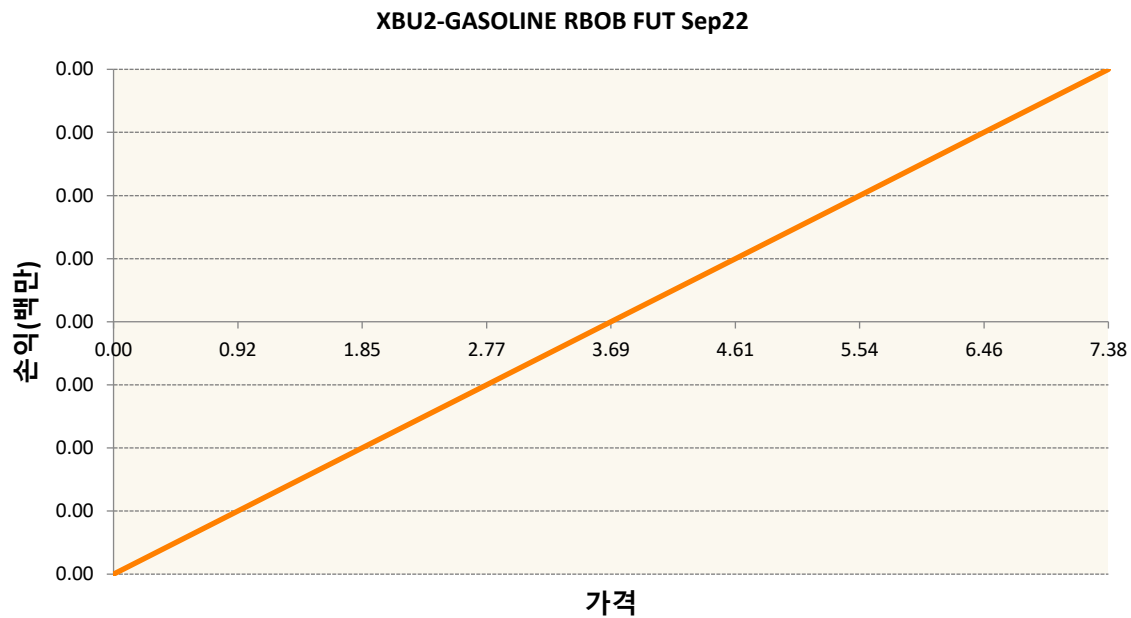
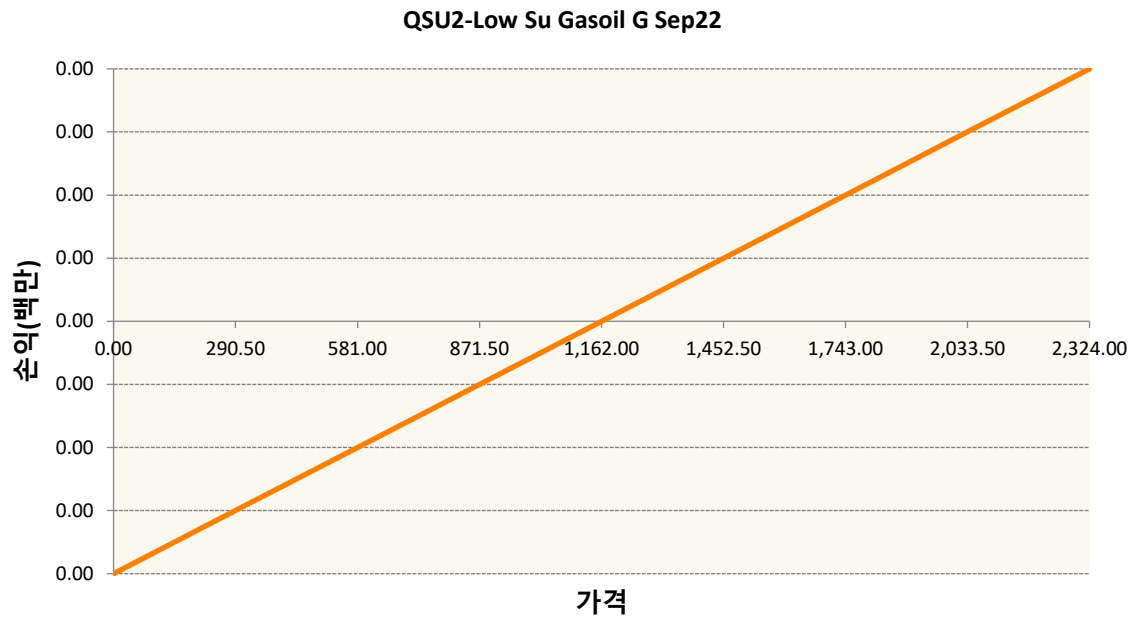


KR4175S70001-2022-07 달러선물



NGU22-NATURAL GAS FUTR Sep22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU2	WTI CRUDE FUTURE Sep22		45
COU2	BRENT CRUDE FUTR Sep22		47
HOU2	NY Harb ULSD Fut Sep22		17
KR4175S700 2022-07 달러선물			28
NGU22	NATURAL GAS FUTR Sep22		74
QSU2	Low Su Gasoil G Sep22		24
XBU2	GASOLINE RBOB FUT Sep22		16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		659