

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

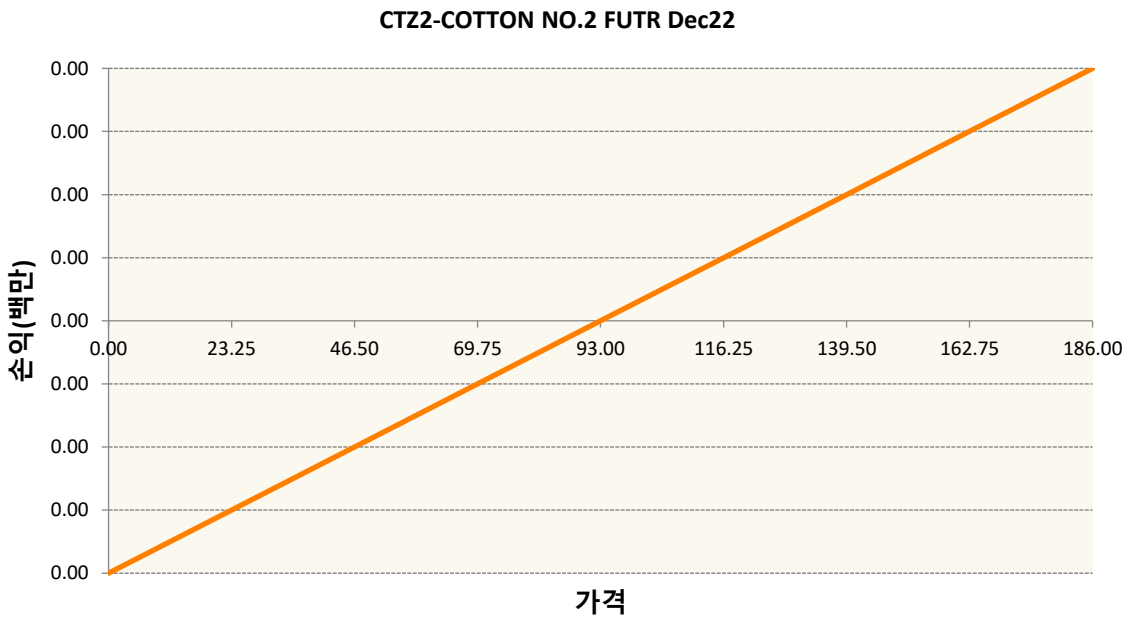
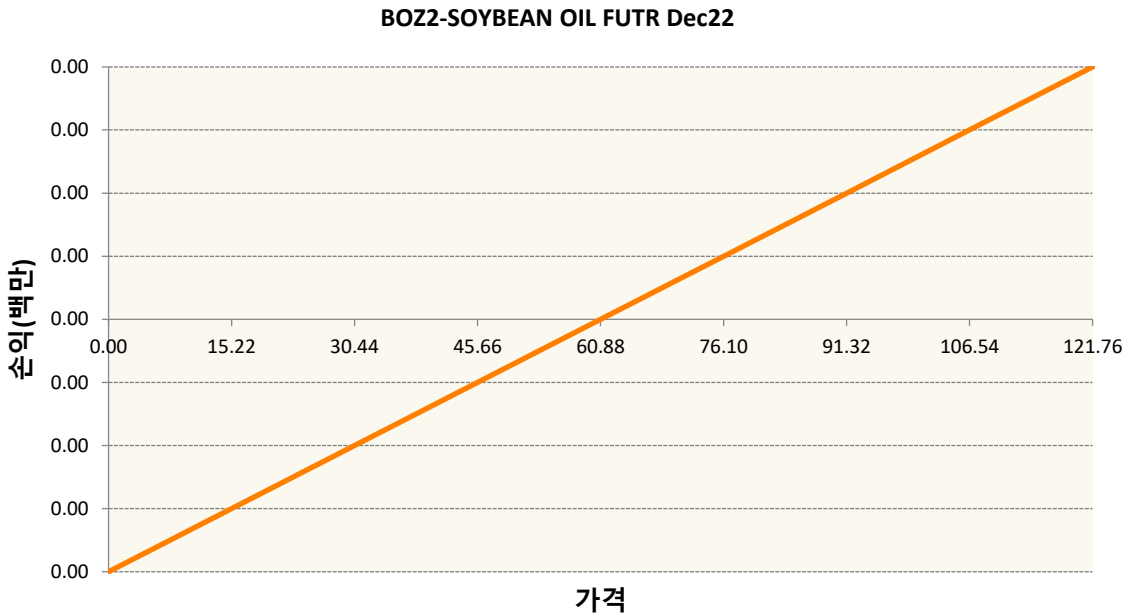
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

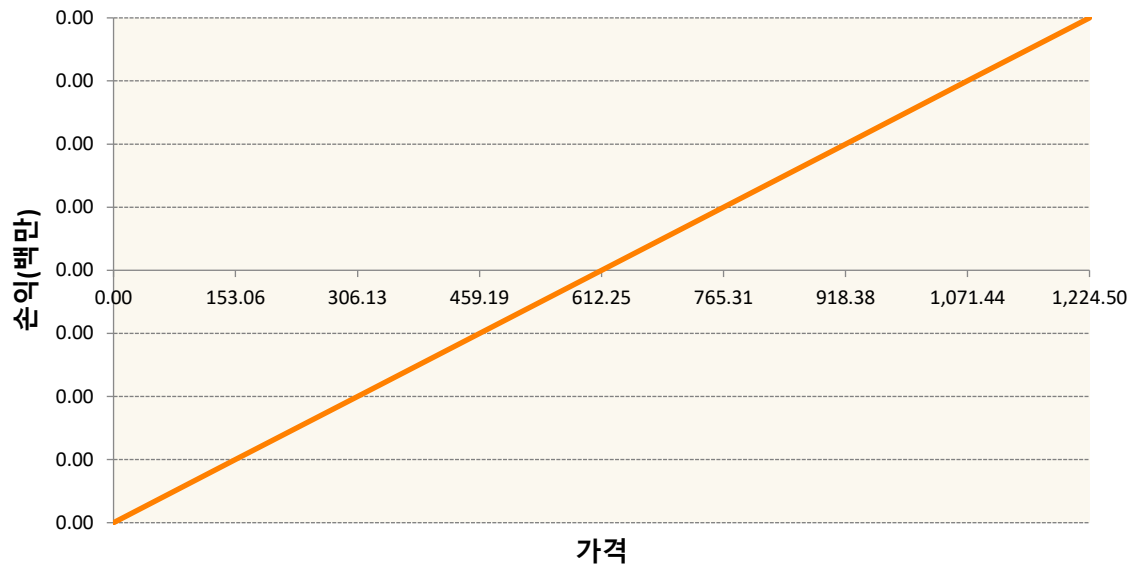
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,000	984	6,016	

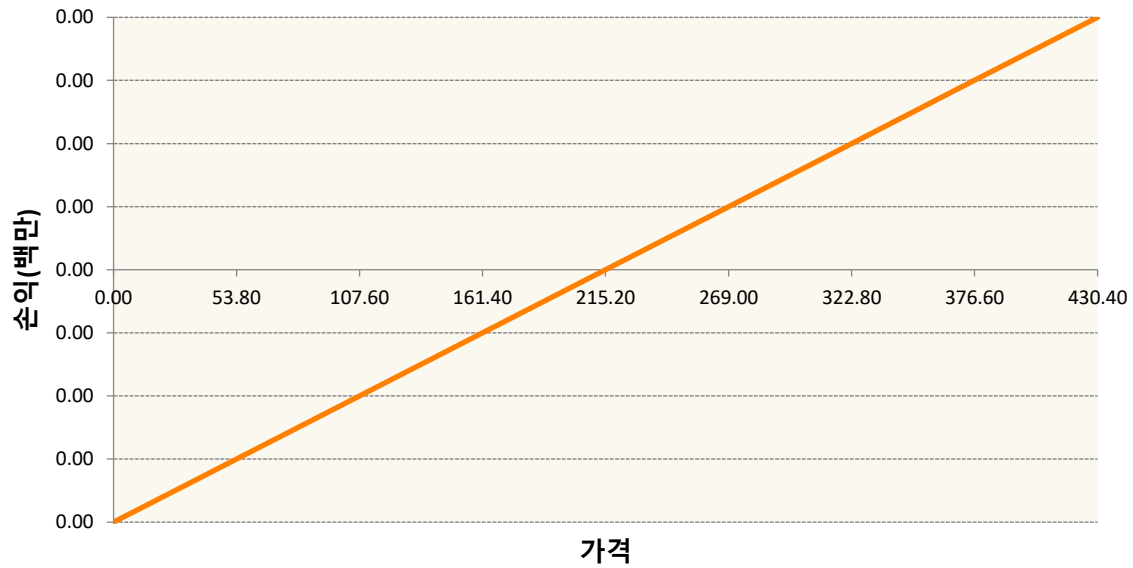
2. 만기시점의 손익구조



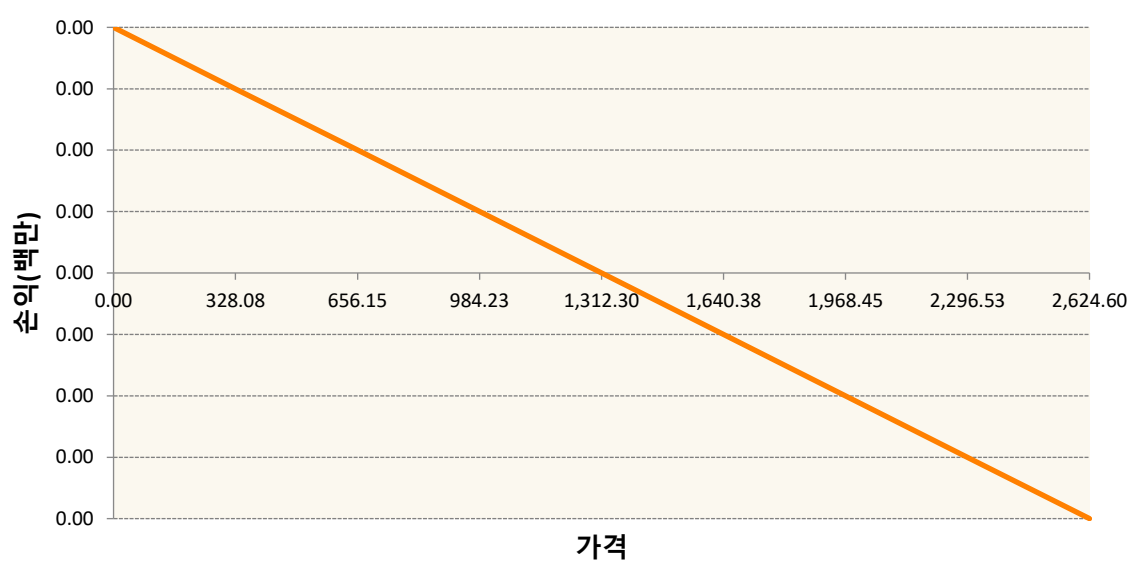
CU2-CORN FUTURE Sep22



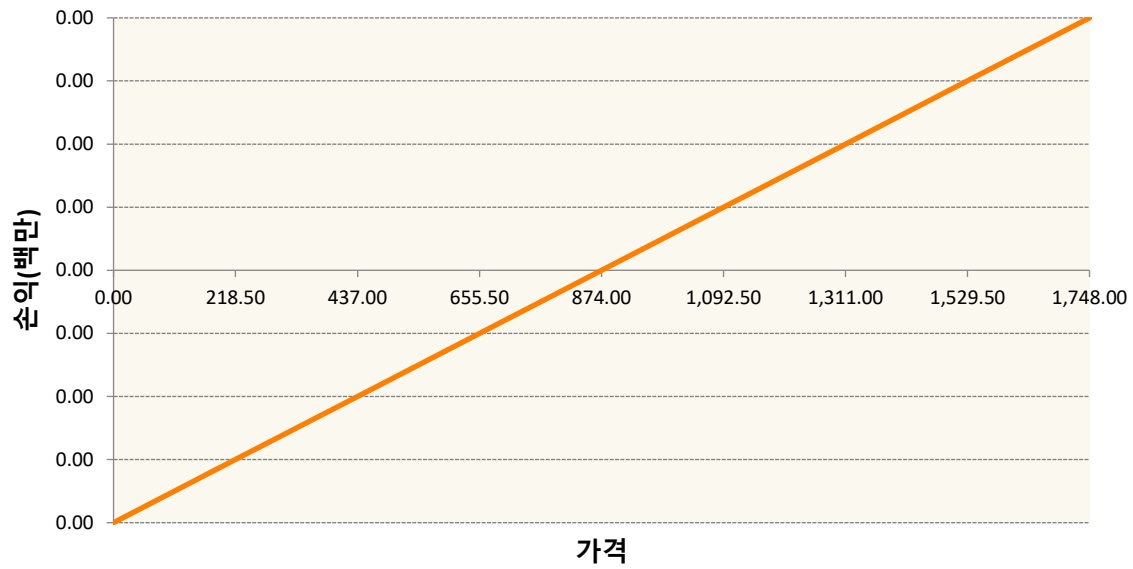
KCU2-COFFEE 'C' FUTURE Sep22



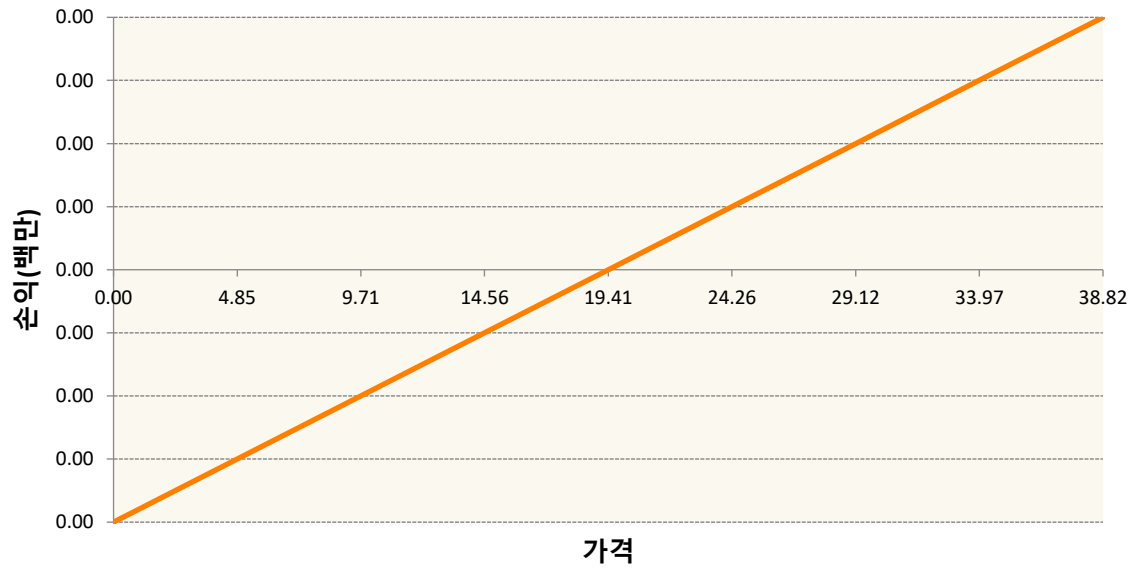
KR4175S80000-2022-08 달러선물



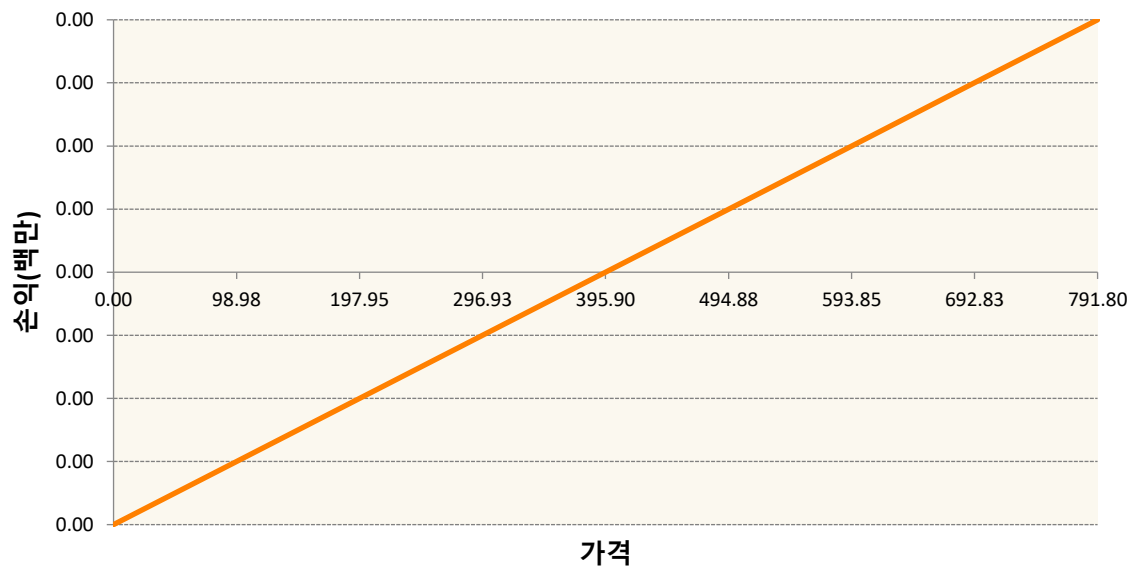
KWU2-KC HRW WHEAT FUT Sep22

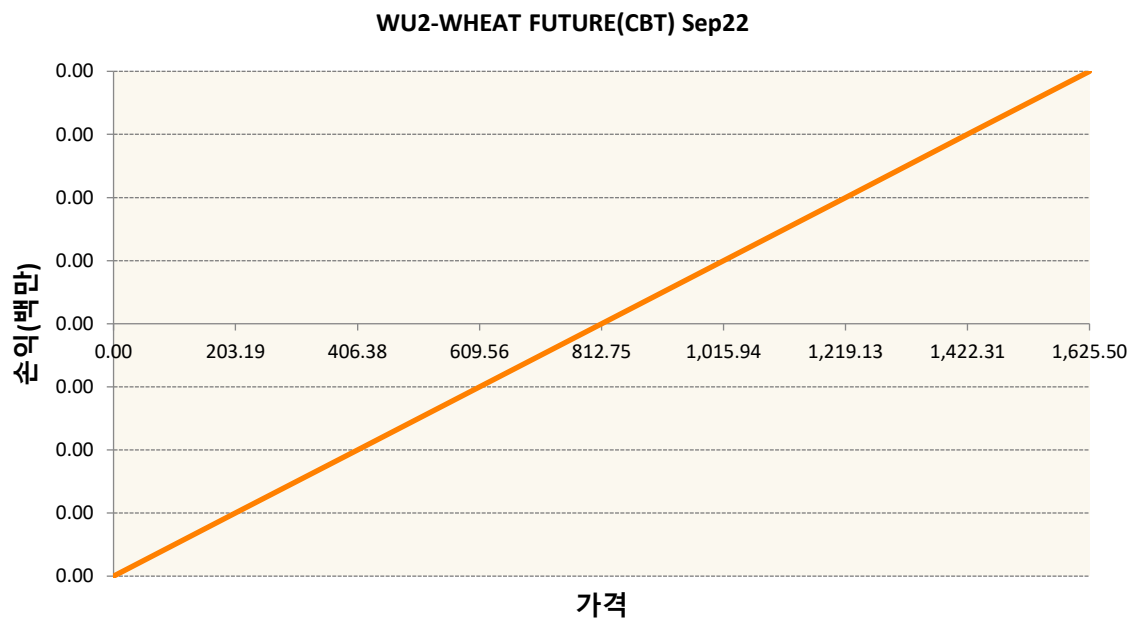
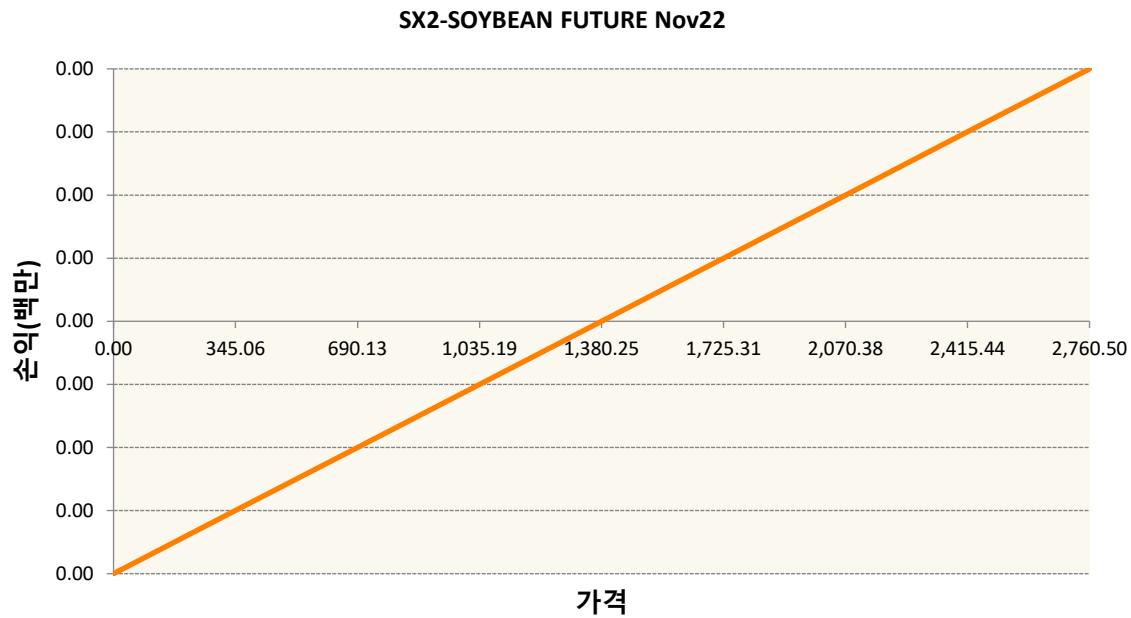


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



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	2022-07-20
기준일	2022-07-19

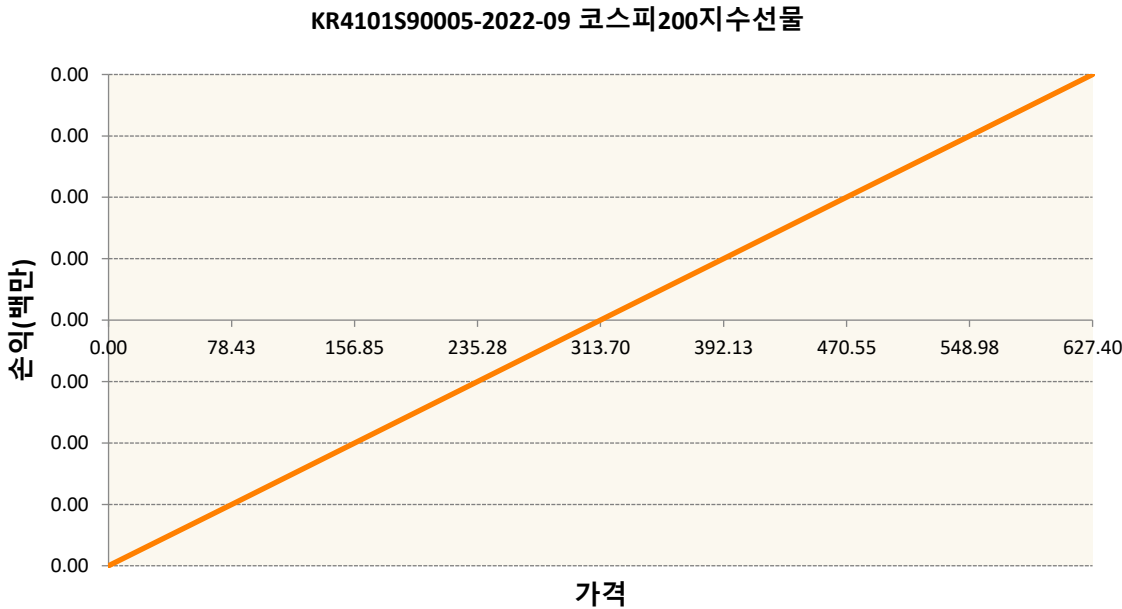
스마트인덱스모

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	1,098	0	1,098	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				88
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-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%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

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

372

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

489

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

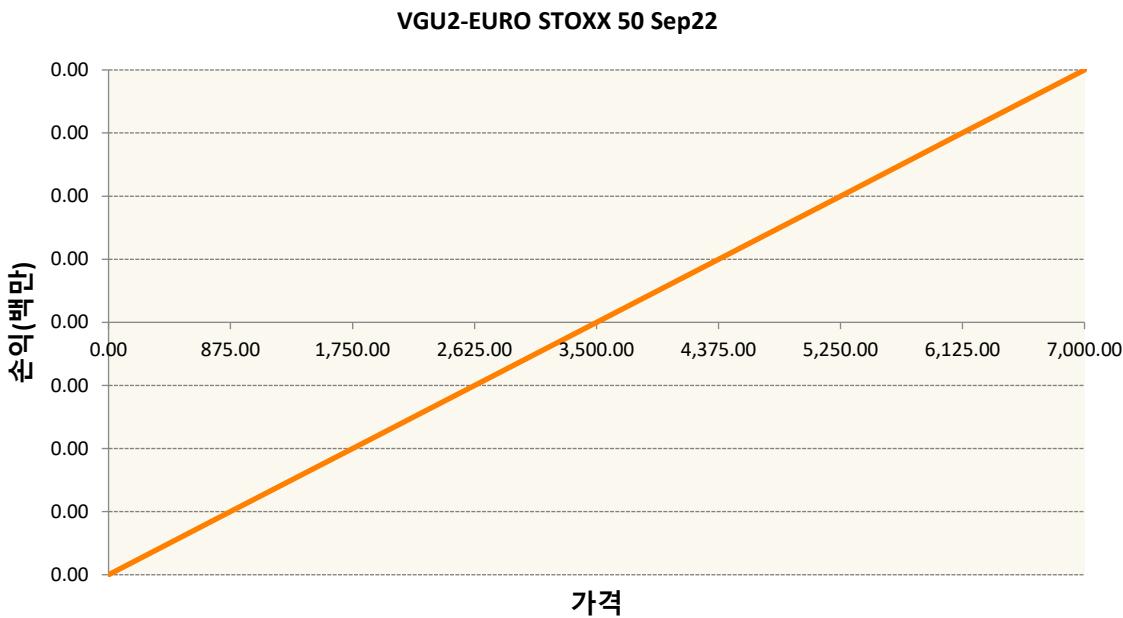
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	521	0	521	

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	2022-07-20
기준일	2022-07-19

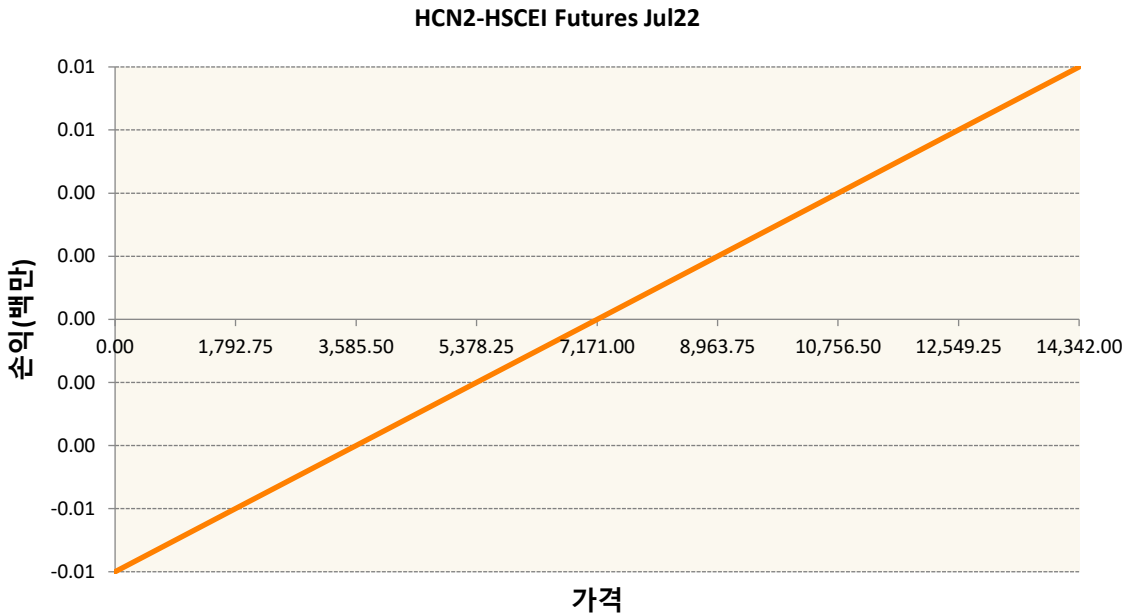
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,171	0	1,171	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN2	HSCEI Futures Jul22	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

138

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

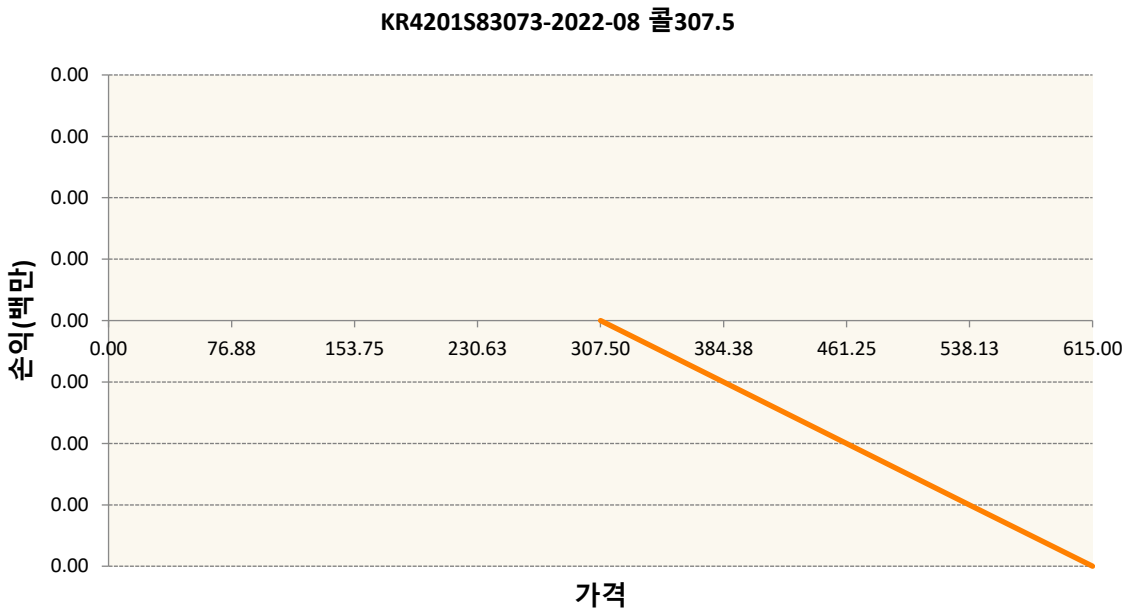
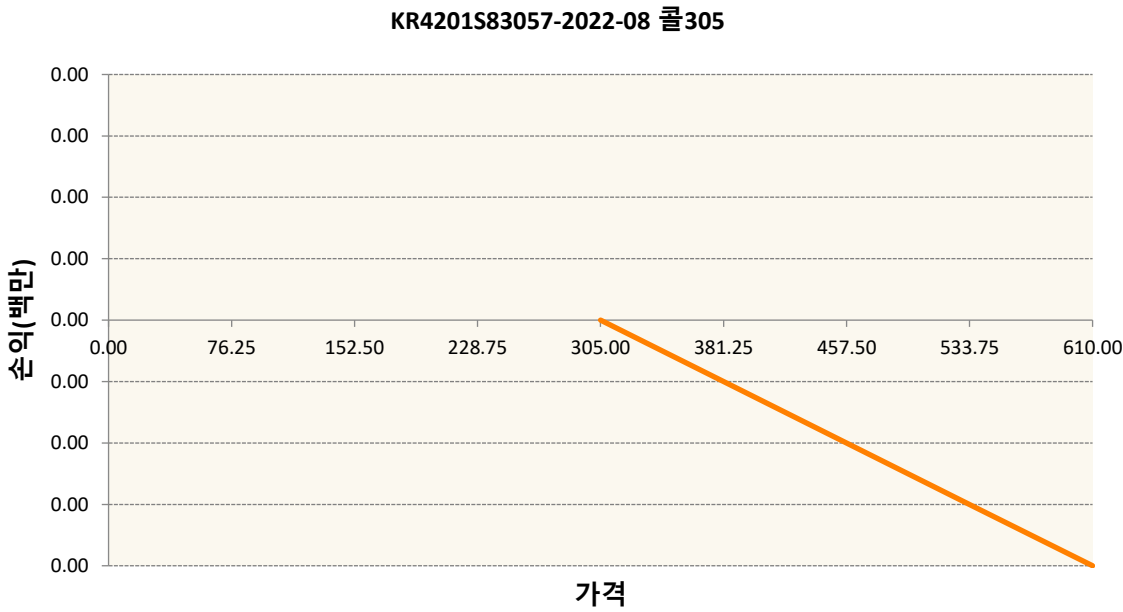
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

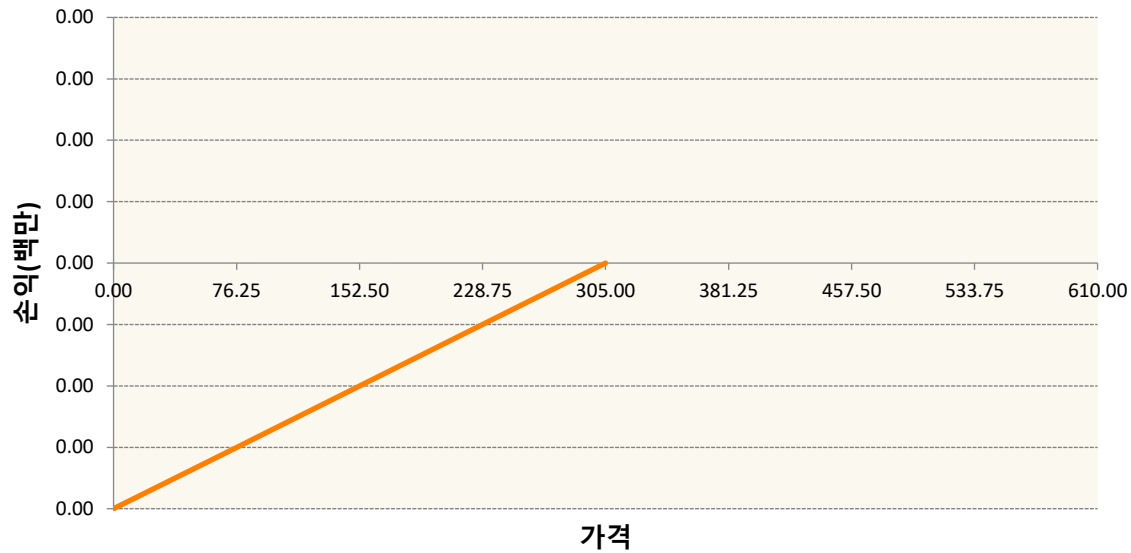
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	302	0	302	장내
누계	유가증권	옵션	0	58,323	-58,323	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S83055-2022-08 풋305



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S83057		2022-08 콜305					2,805
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,722	1,653	1,578	1,500	1,418	1,334	1,248
-5.33%	1,436	1,341	1,245	1,148	1,051	952	853
-2.67%	961	857	753	649	545	441	337
0%	289	194	98	0	-99	-199	-299
2.67%	-553	-625	-702	-783	-868	-956	-1,046
5.33%	-1,514	-1,560	-1,614	-1,675	-1,741	-1,812	-1,888
8.00%	-2,546	-2,572	-2,605	-2,646	-2,693	-2,747	-2,805
KR4201S83073		2022-08 콜307.5					565
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	326	313	299	284	268	252	235
-5.33%	276	258	239	219	200	180	160
-2.67%	190	168	147	125	104	82	60
0%	63	42	21	0	-21	-43	-64
2.67%	-102	-118	-136	-154	-173	-192	-212
5.33%	-294	-305	-318	-332	-347	-363	-380
8.00%	-504	-510	-518	-528	-539	-552	-565
KR4301S83055		2022-08 풋305					514
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-451	-459	-468	-478	-489	-501	-514
-5.33%	-219	-234	-250	-266	-282	-298	-315
-2.67%	-50	-69	-87	-105	-123	-141	-159
0%	45	31	16	0	-16	-32	-49

2.67%	86	78	68	58	47	35	22
5.33%	98	95	91	85	79	71	63
8.00%	101	100	99	96	93	89	84

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

(단위:백만원)

3,756

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

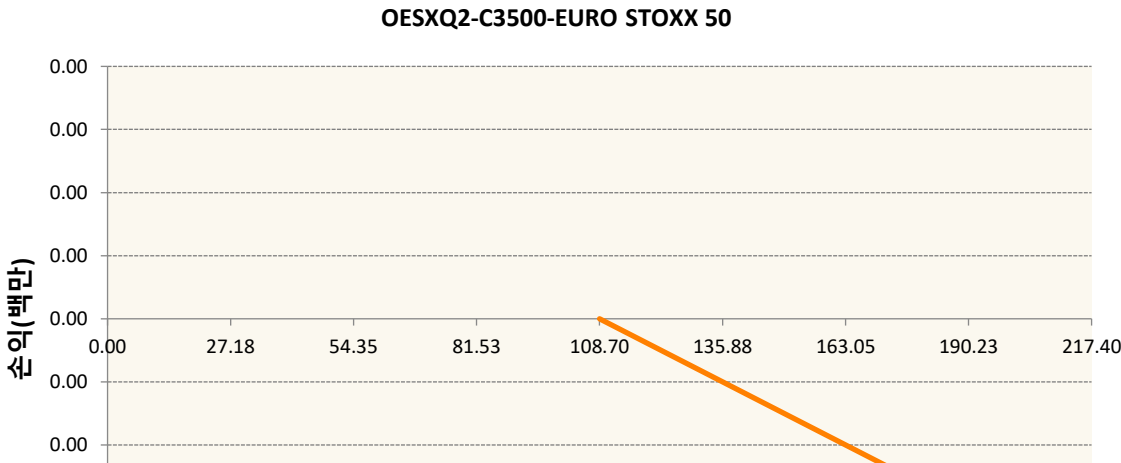
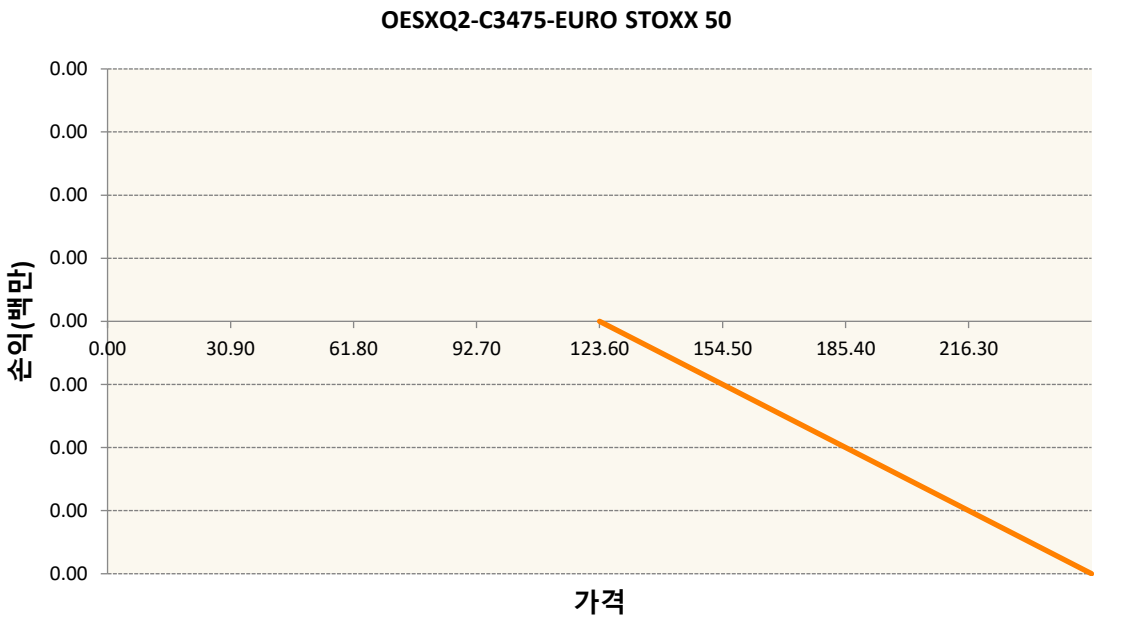
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

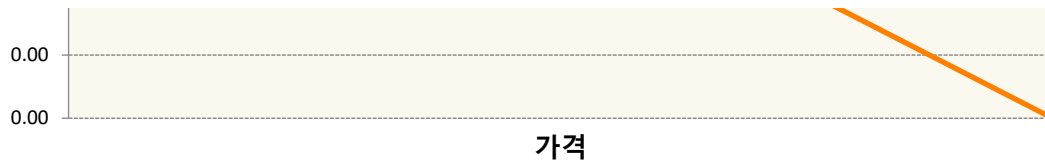
1. 계약금액

(단위:백만원)

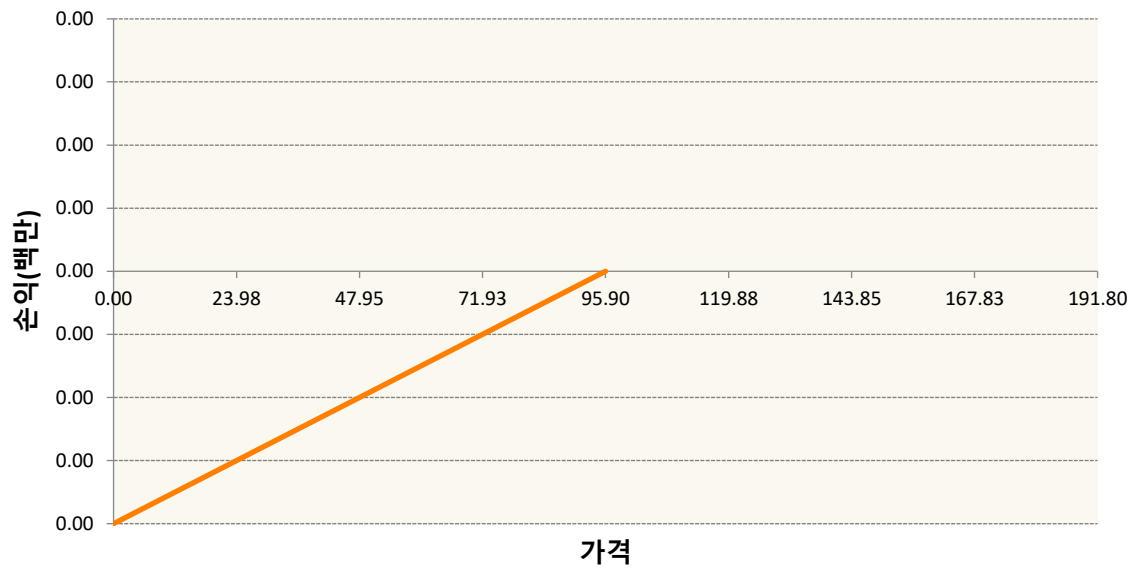
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,803	0	2,803	
누계	유가증권	옵션	0	61	-61	장내
누계	지수	스왑	3	0	3	장외
누계	통화	선도	0	1,068	-1,068	장외

2. 만기시점의 손익구조

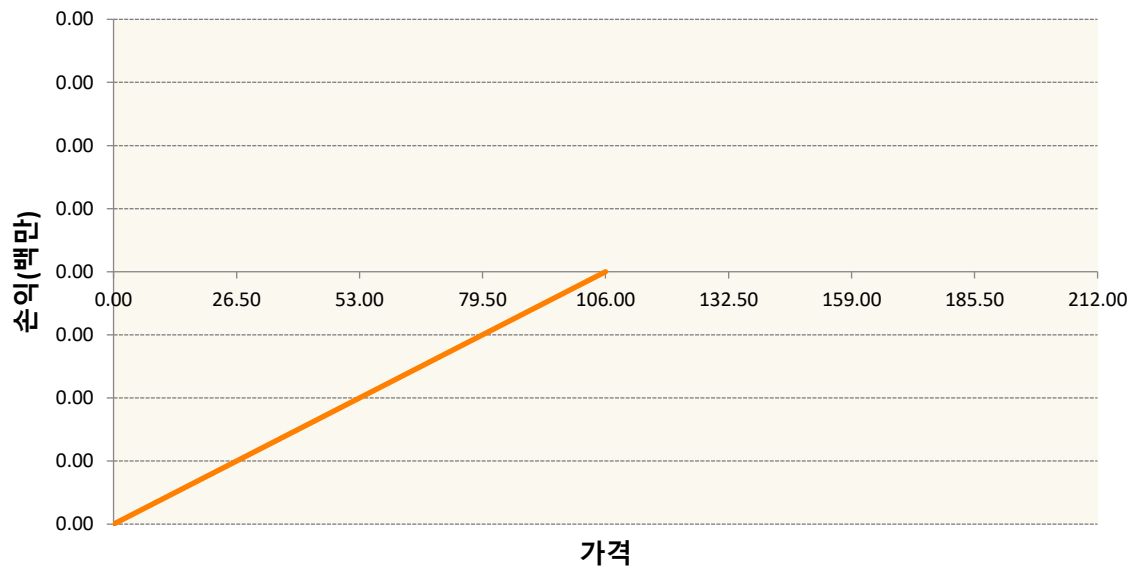




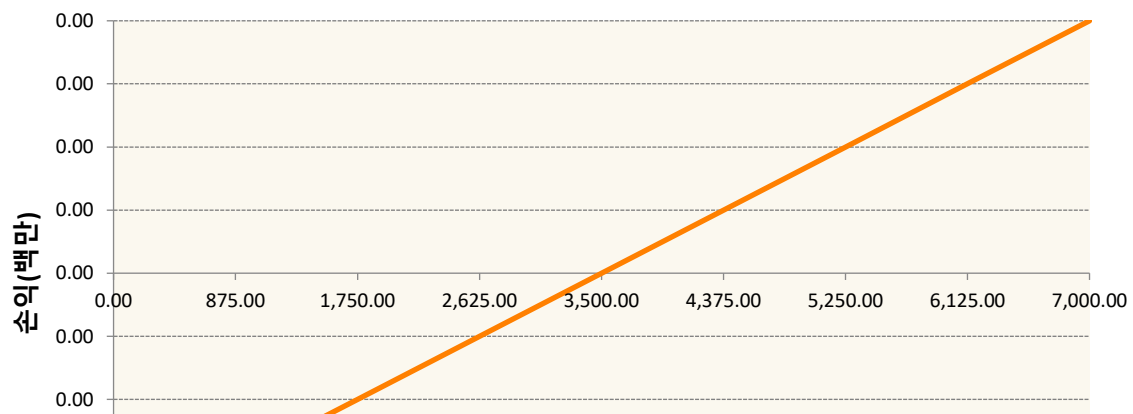
OESXQ2-P3475-EURO STOXX 50

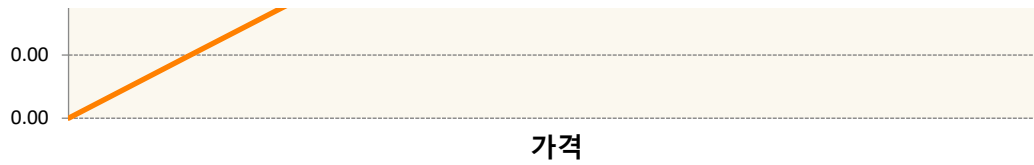


OESXQ2-P3500-EURO STOXX 50



VGU2-EURO STOXX 50 Sep22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		2
FXW213C5Q KRW/EUR 26-08-22E		85
OESXQ2-C34 EURO STOXX 50		3
OESXQ2-C35 EURO STOXX 50		0.23
OESXQ2-P34 EURO STOXX 50		2
OESXQ2-P35 EURO STOXX 50		0.23
VGU2 EURO STOXX 50 Sep22		224

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	282

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

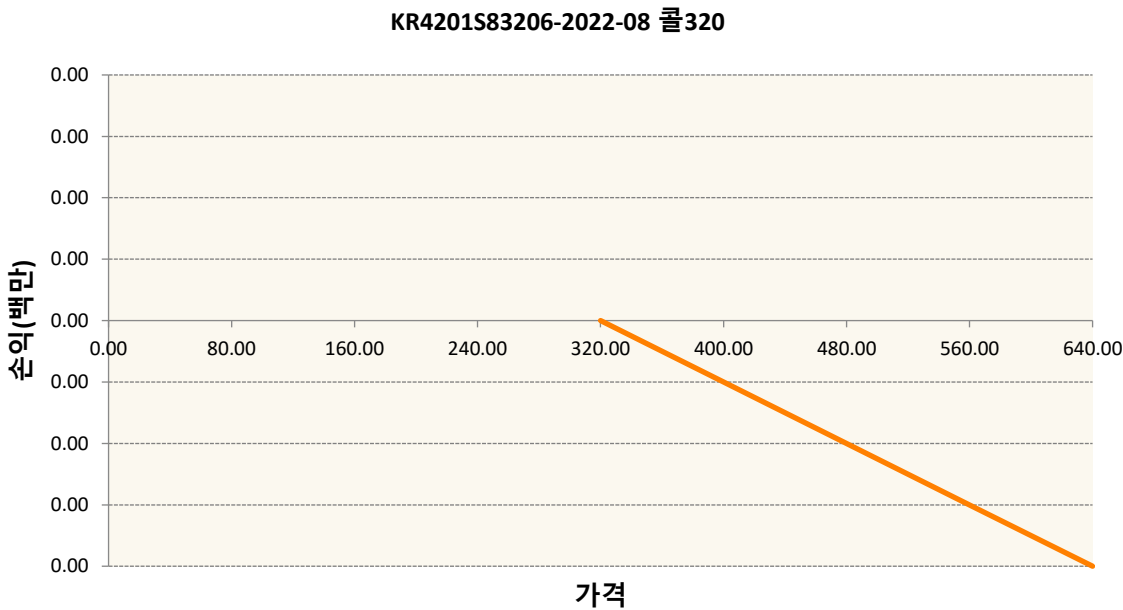
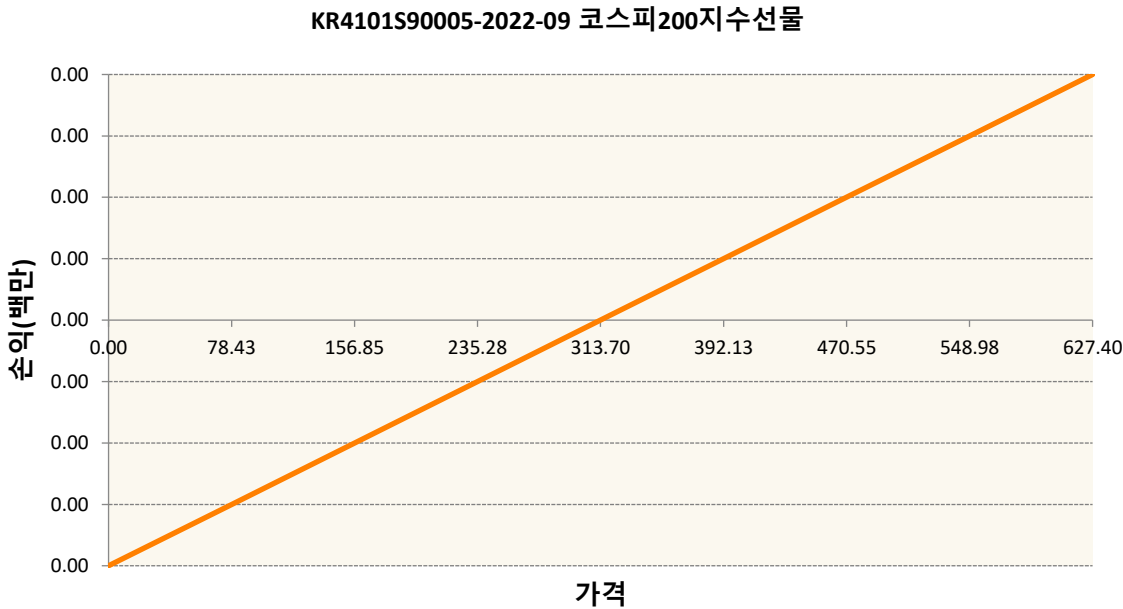
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

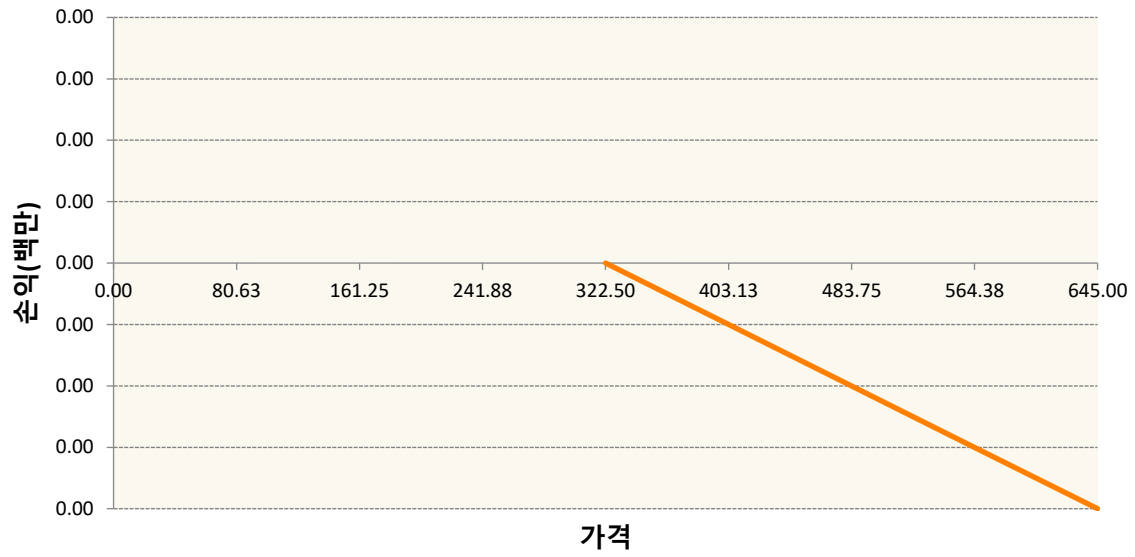
(단위:백만원)

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	392	0	392	장내
누계	유가증권	옵션	458	4,248	-3,790	장내

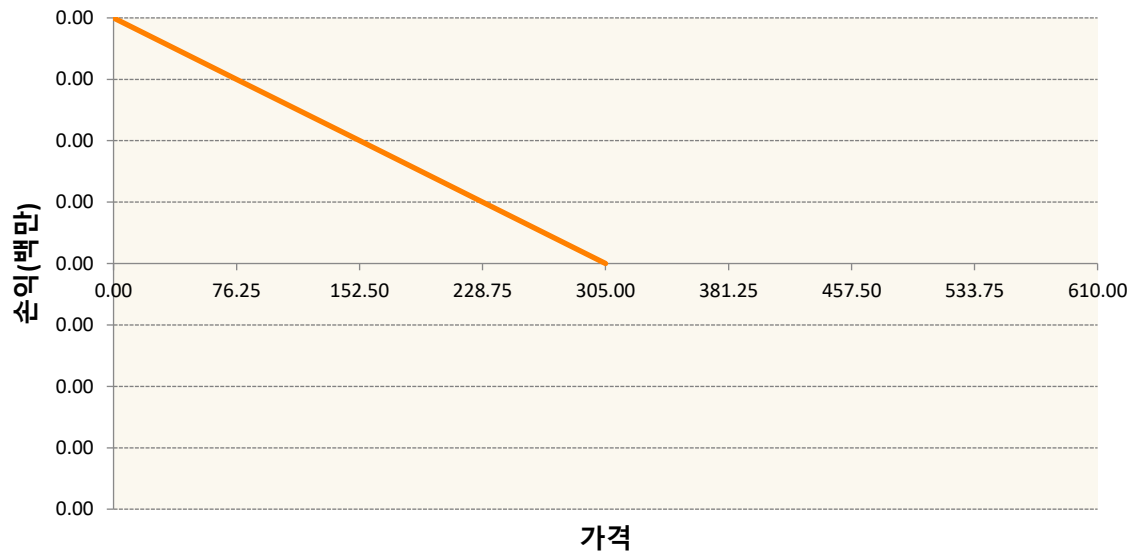
2. 만기시점의 손익구조



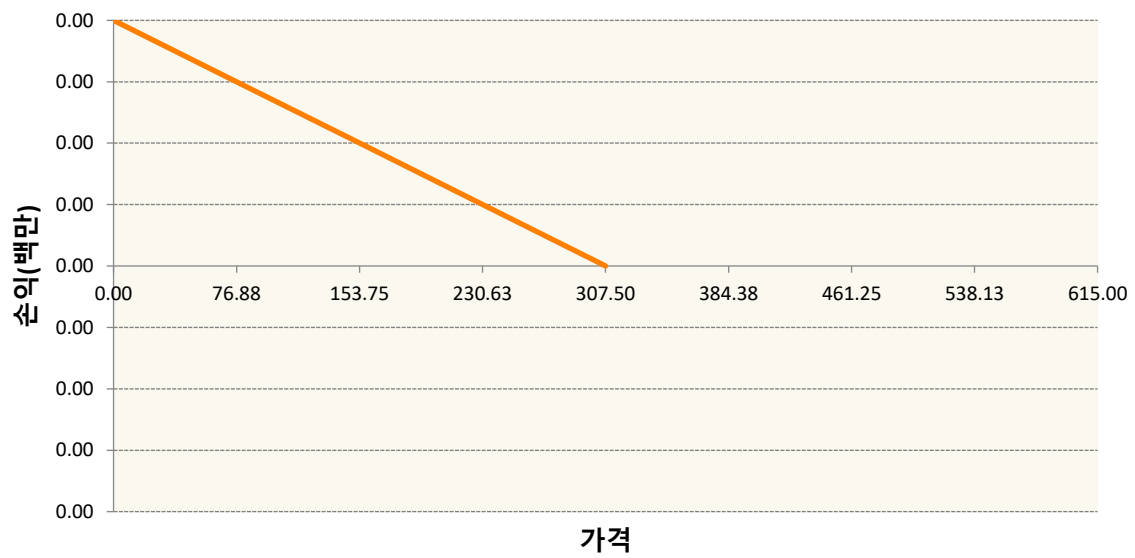
KR4201S83222-2022-08 콜322.5



KR4301S83055-2022-08 풋305



KR4301S83071-2022-08 풋307.5



(단위:백만원)

KR4101S90005				2022-09 코스피200지수선물				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	-31
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	21	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31	31
KR4201S83206				2022-08 콜320				174
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	70	68	65	62	58	54	49	
-5.33%	63	59	55	50	44	39	33	
-2.67%	49	43	37	30	23	16	8	
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24	
2.67%	-16	-24	-32	-41	-49	-58	-66	
5.33%	-70	-77	-85	-92	-100	-108	-116	
8.00%	-136	-141	-147	-154	-160	-167	-174	
KR4201S83222				2022-08 콜322.5				54
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	20	19	19	18	17	15	14	
-5.33%	18	17	16	14	13	11	9	
-2.67%	15	13	11	9	7	4	2	
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8	
2.67%	-4	-7	-9	-12	-15	-18	-20	
5.33%	-20	-23	-25	-28	-31	-33	-36	
8.00%	-41	-43	-45	-47	-49	-52	-54	
KR4301S83055				2022-08 풋305				19
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	17	17	17	18	18	19	19	
-5.33%	8	9	9	10	11	11	12	
-2.67%	2	3	3	4	5	5	6	
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2	
2.67%	-3	-3	-3	-2	-2	-1	-1	
5.33%	-4	-4	-3	-3	-3	-3	-2	
8.00%	-4	-4	-4	-4	-3	-3	-3	
KR4301S83071				2022-08 풋307.5				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%	2	2	2	2	2	2	3
-2.67%	0	1	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1	-1	-1	-1	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)

246

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

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	8,872	0	8,872	

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	2022-07-20
기준일	2022-07-19

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	6,778	0	6,778	

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	2022-07-20
기준일	2022-07-19

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	20,661	0	20,661	
누계	통화	선도	1,714	22,039	-20,325	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C6P² KRW/USD 29-08-22E	587
FXW213C6P² KRW/USD 27-09-22E	588
FXW213C6P² KRW/USD 27-07-22E	587
FXW213C6Q USD/KRW 27-07-22E	53
FXW213C78² USD/KRW 27-07-22E	37
FXW213C7C² USD/KRW 27-07-22E	10
FXW213C7F² USD/KRW 27-07-22E	8
FXW213C7J4 USD/KRW 27-07-22E	29
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

737

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

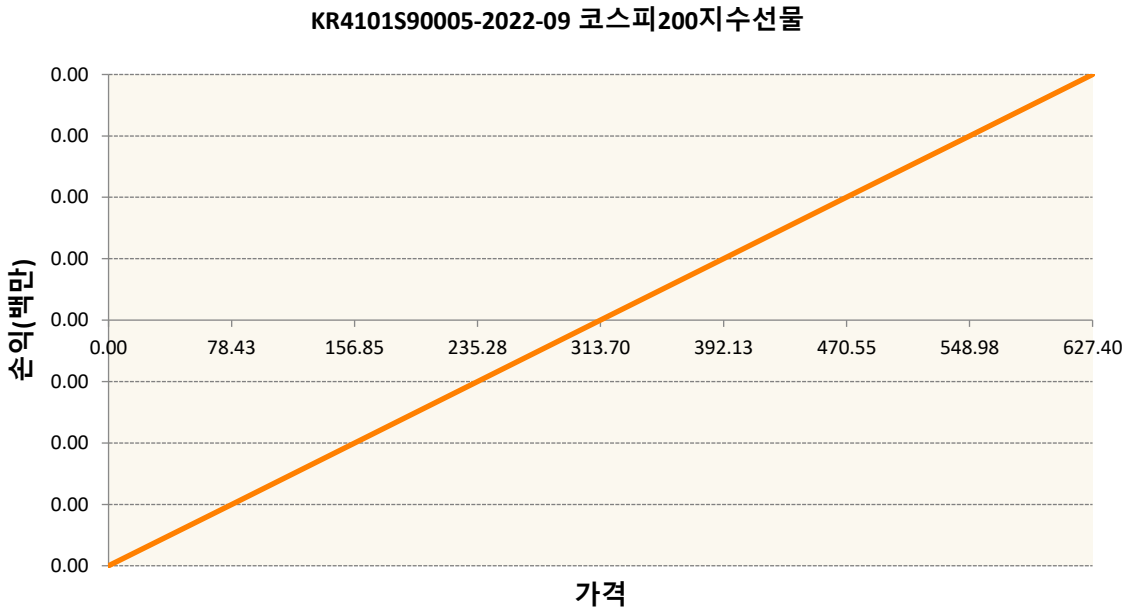
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	157	-157	장내
누계	유가증권	선물	392	0	392	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				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

공시일 2022-07-20

기준일 2022-07-19

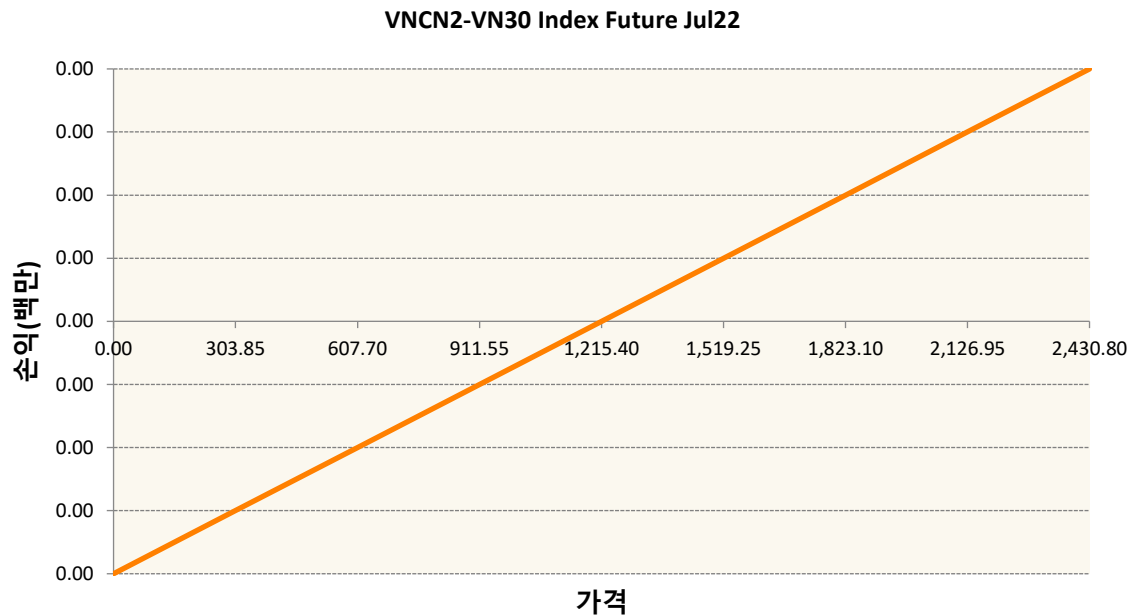
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	789	0	789	
누계	유가증권	스왑	1,726	0	1,726	장외
누계	통화	선도	0	908	-908	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	138
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	63

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

(단위:백만원)

257

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

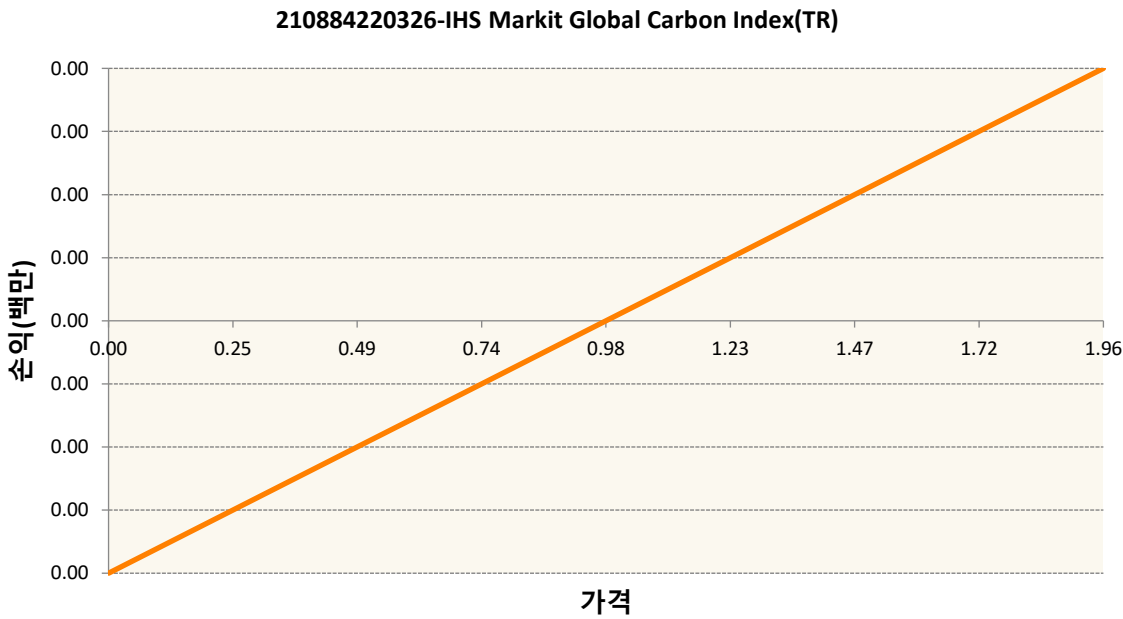
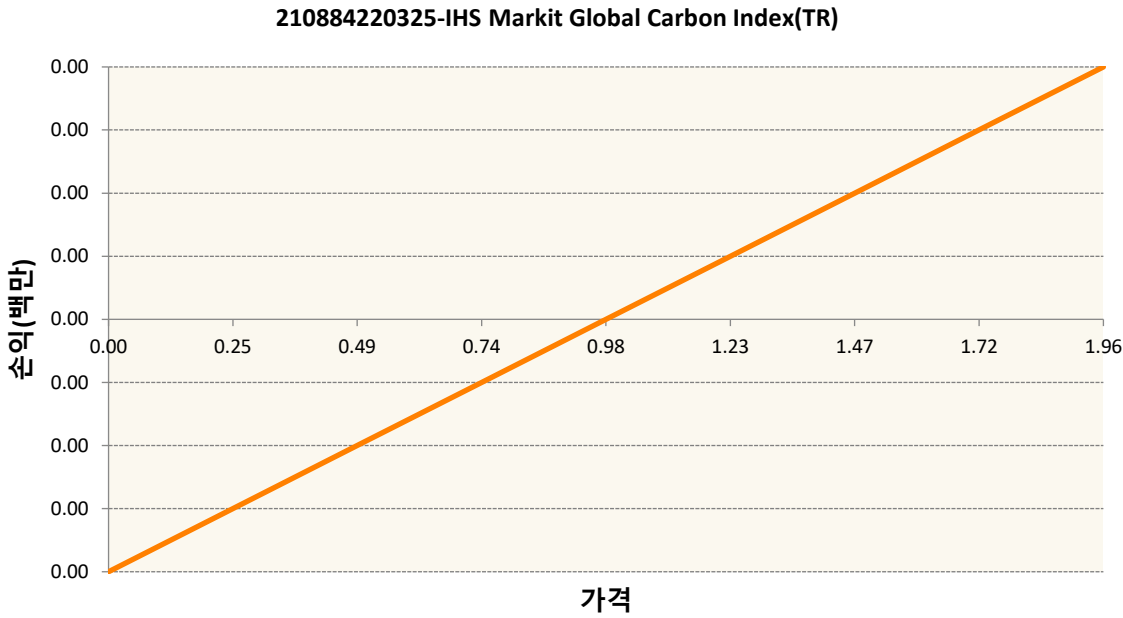
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

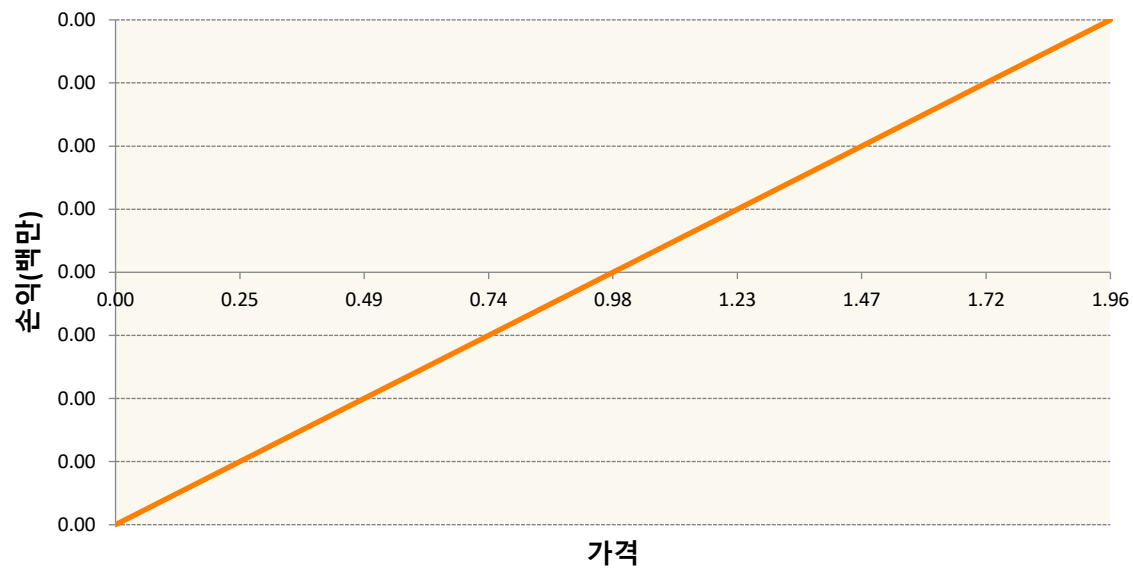
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	46,604	0	46,604	

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)

197
3,442
99

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

(단위:백만원)

6,880

공시일 2022-07-20

기준일 2022-07-19

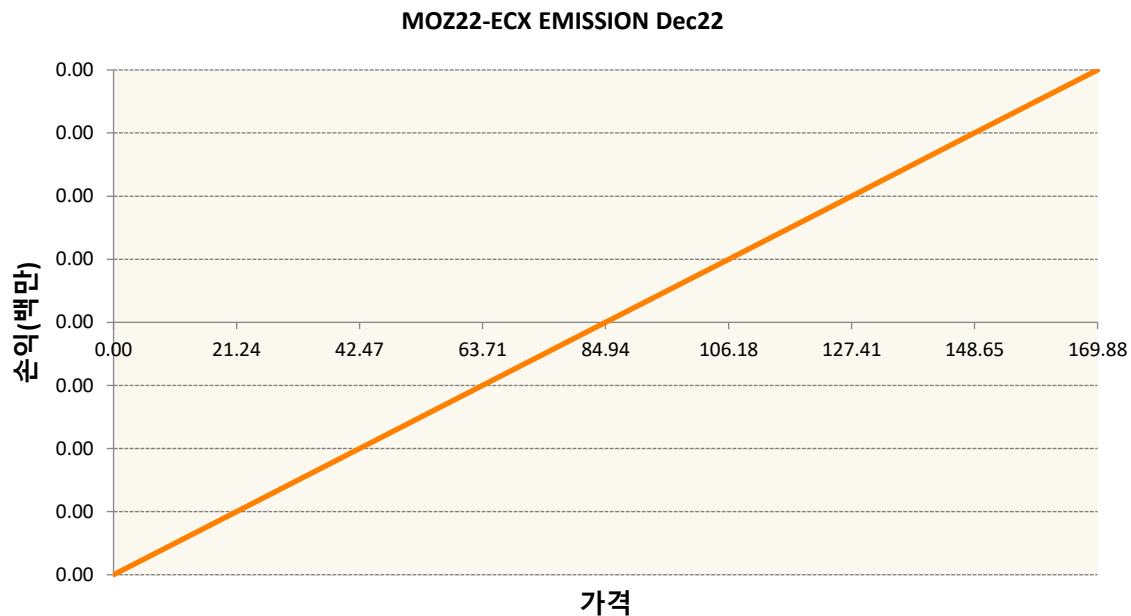
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	15,093	0	15,093	
누계	통화	선도	0	8,446	-8,446	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C6T KRW/EUR 26-07-22E
MOZ22 ECX EMISSION Dec22

676
1,207

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

(단위:백만원)

3,336

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

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)	25
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	25
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	25
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	25

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

(단위:백만원)

189

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

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	9,881	0	9,881	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	5

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

(단위:백만원)

20

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

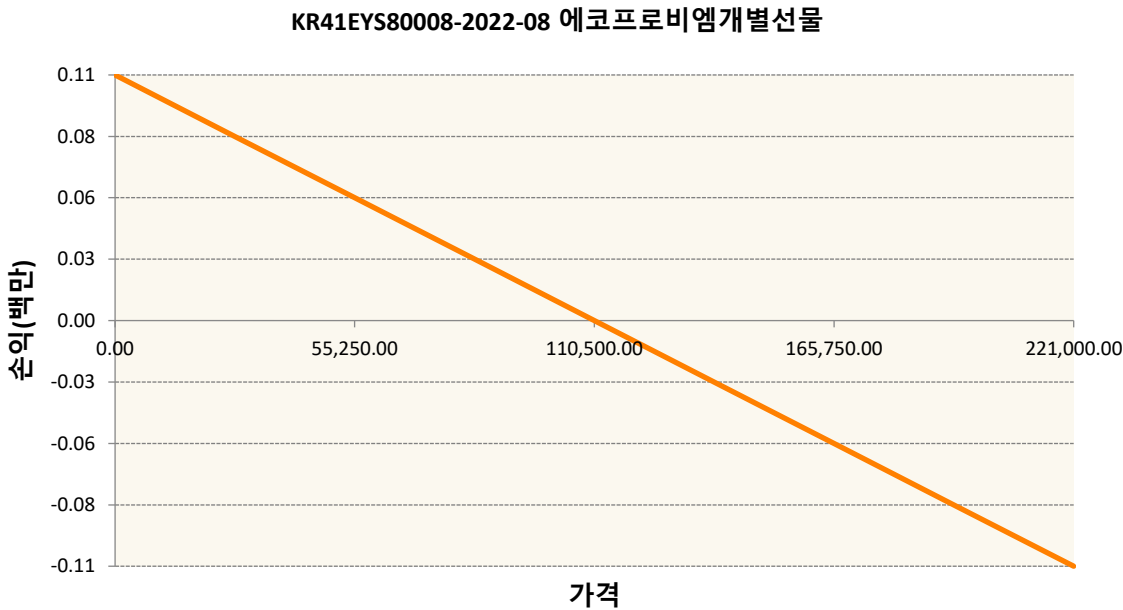
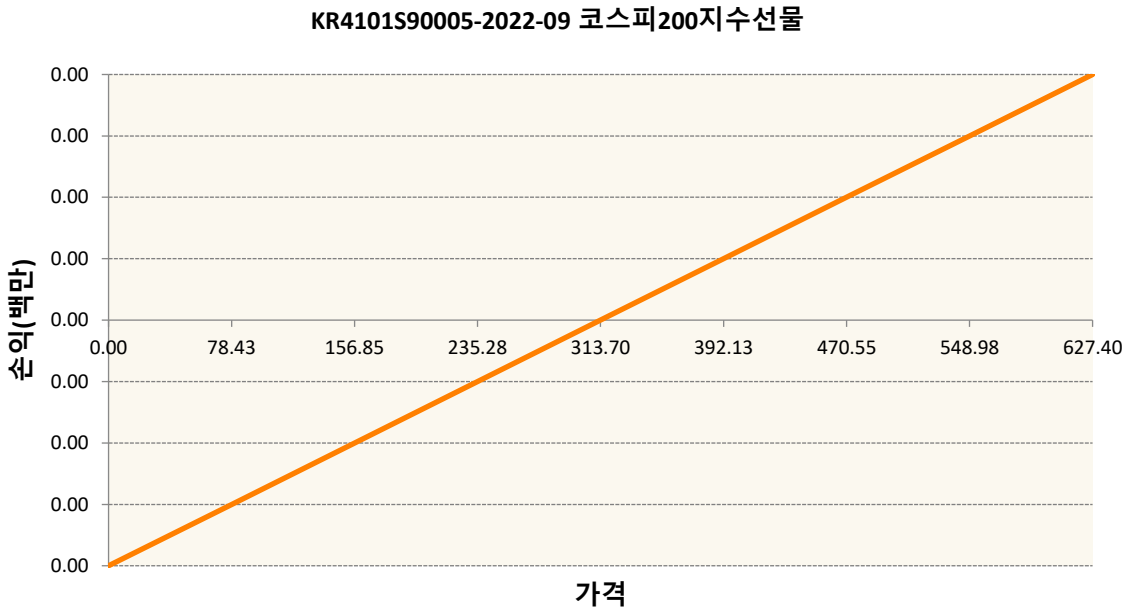
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	783	0	783	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,569	111	1,458	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101S900	2022-09 코스피200지수선물	125
KR41EYS800	2022-08 에코프로비엠개별선물	9
KRS0003135	SWAP_MICROSOFT CP_0429	0
KRS0003224	SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	143

공시일 2022-07-20

기준일 2022-07-19

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

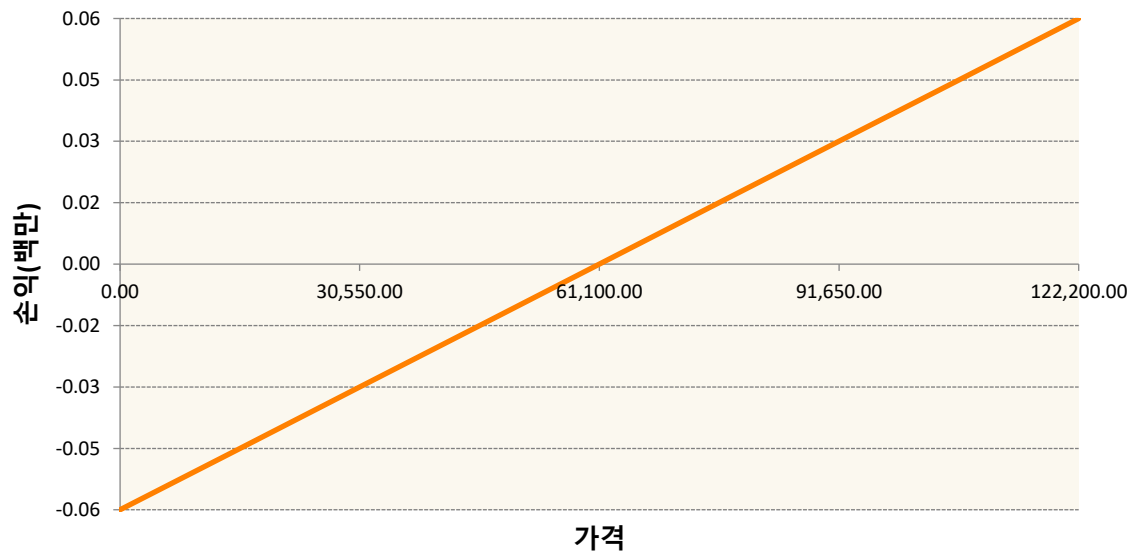
1. 계약금액

(단위:백만원)

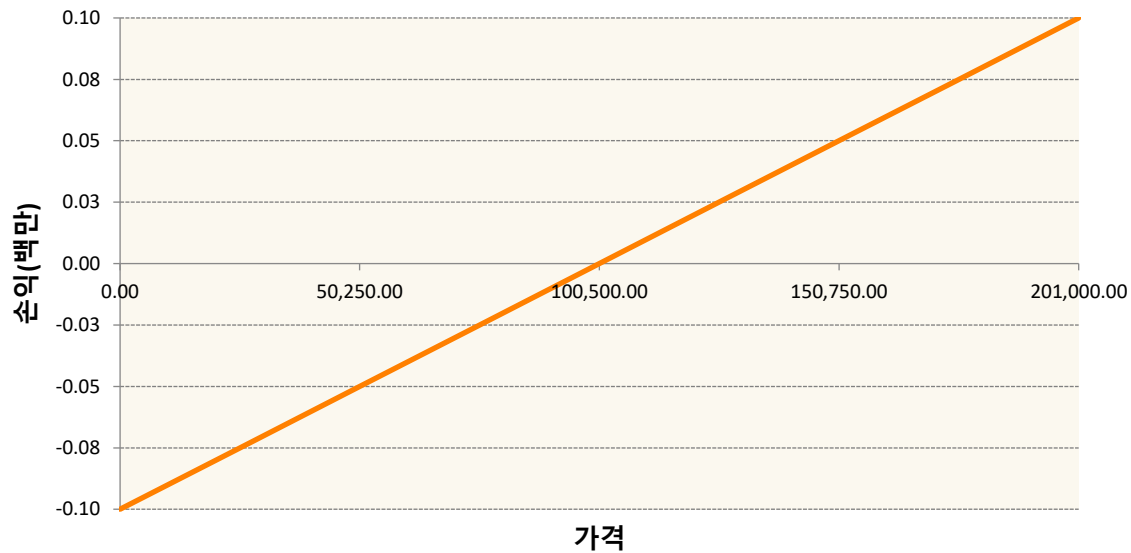
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	878	0	878	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S80005-2022-08 삼성전자개별선물



KR4150S80003-2022-08 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4111S80005		2022-08 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
KR4150S80003		2022-08 SK하이닉스개별선물					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

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

(단위:백만원)

83

공시일	2022-07-20
기준일	2022-07-19

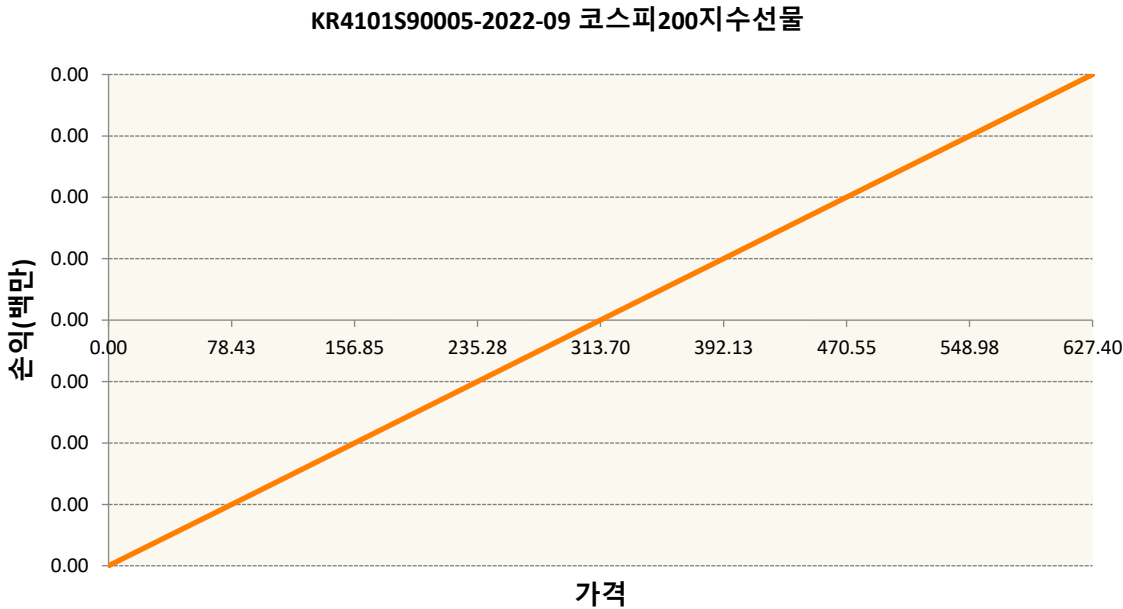
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	863	0	863	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 2022-07-20

기준일 2022-07-19

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

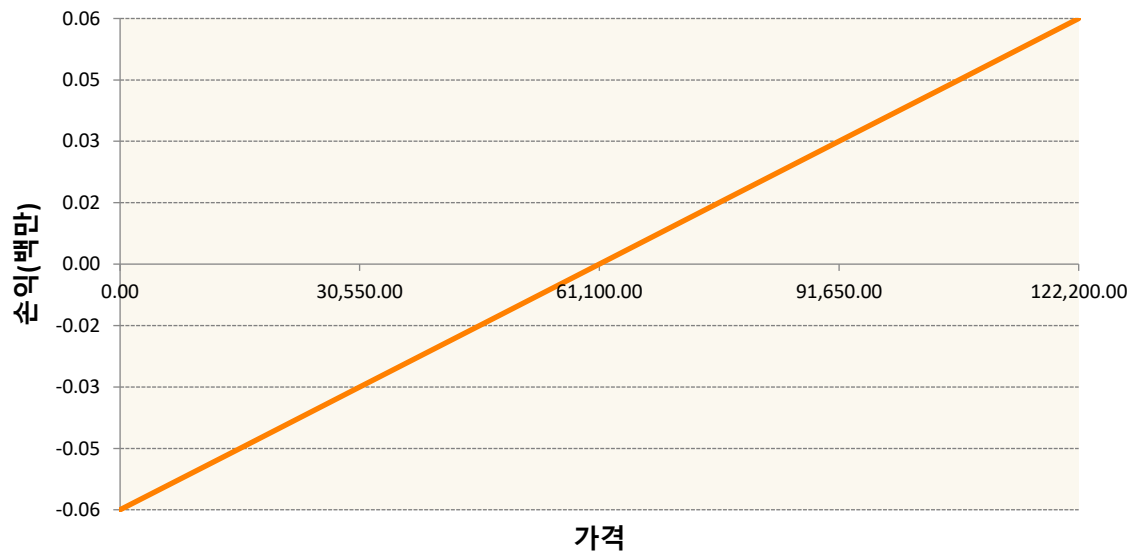
1. 계약금액

(단위:백만원)

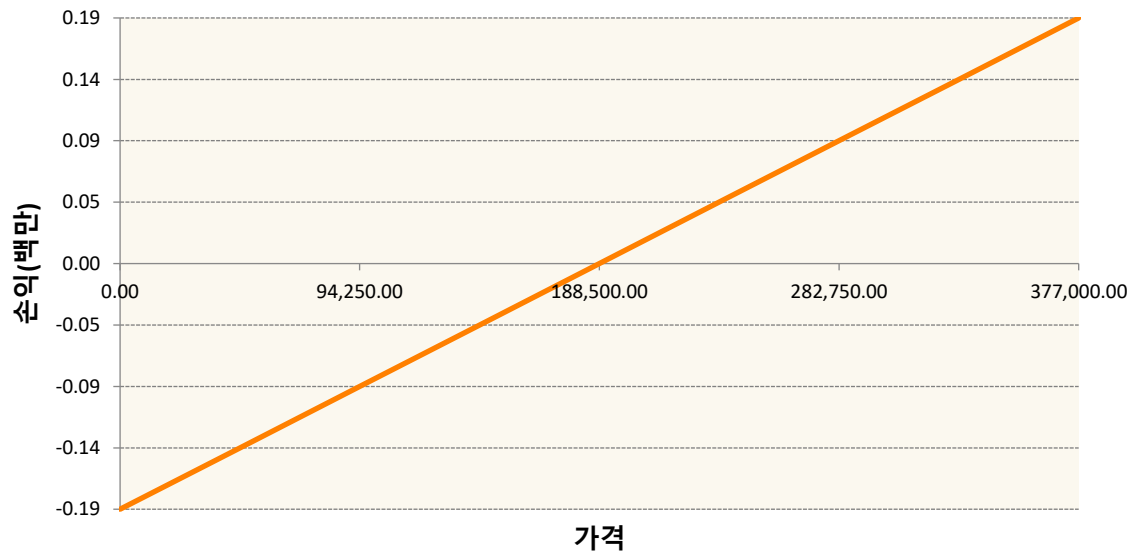
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	273	0	273	장내

2. 만기시점의 손익구조

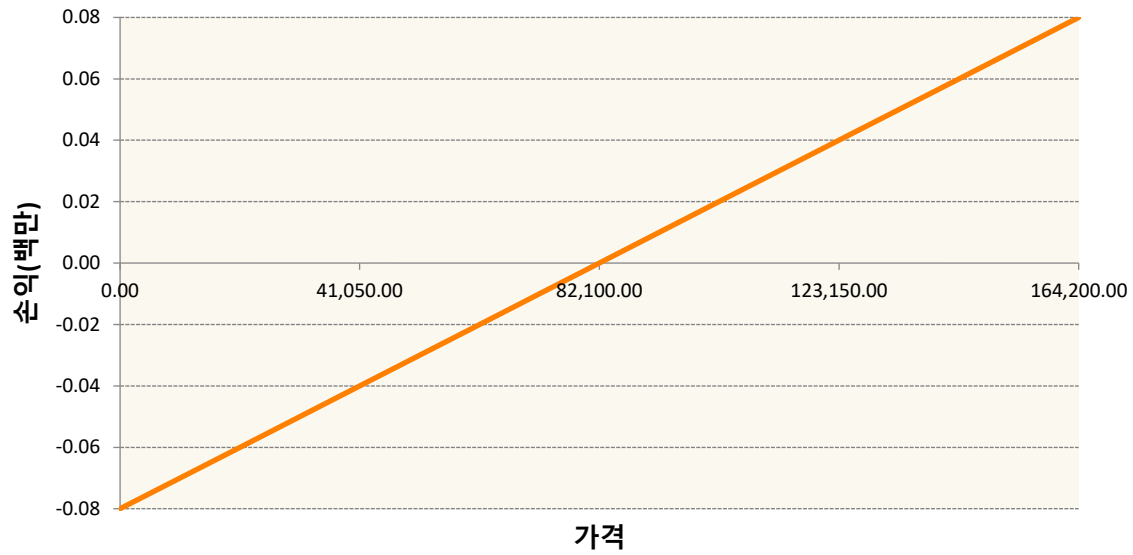
KR4111S80005-2022-08 삼성전자개별선물



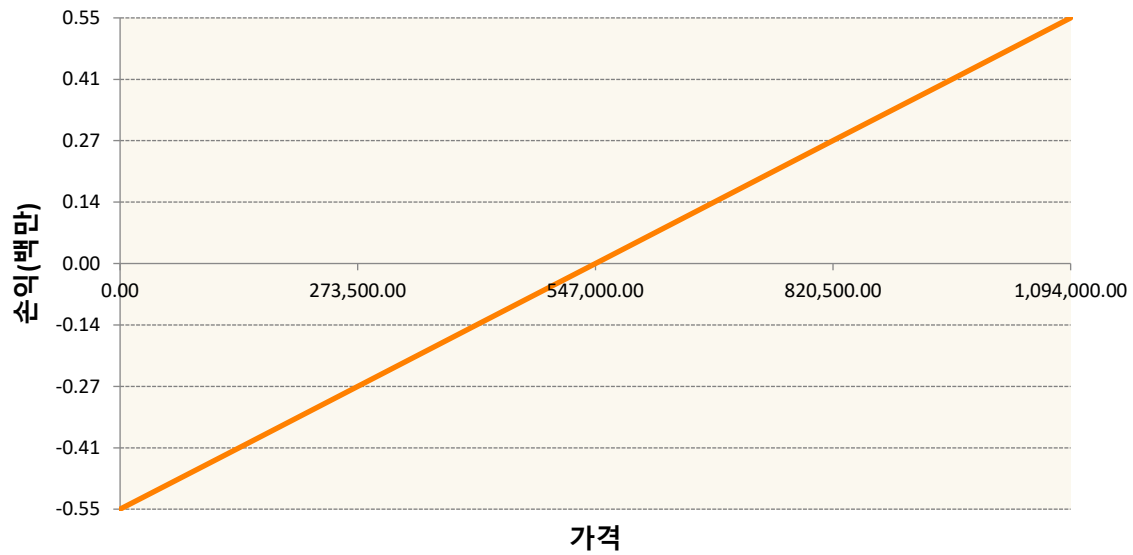
KR4116S80004-2022-08 현대차개별선물



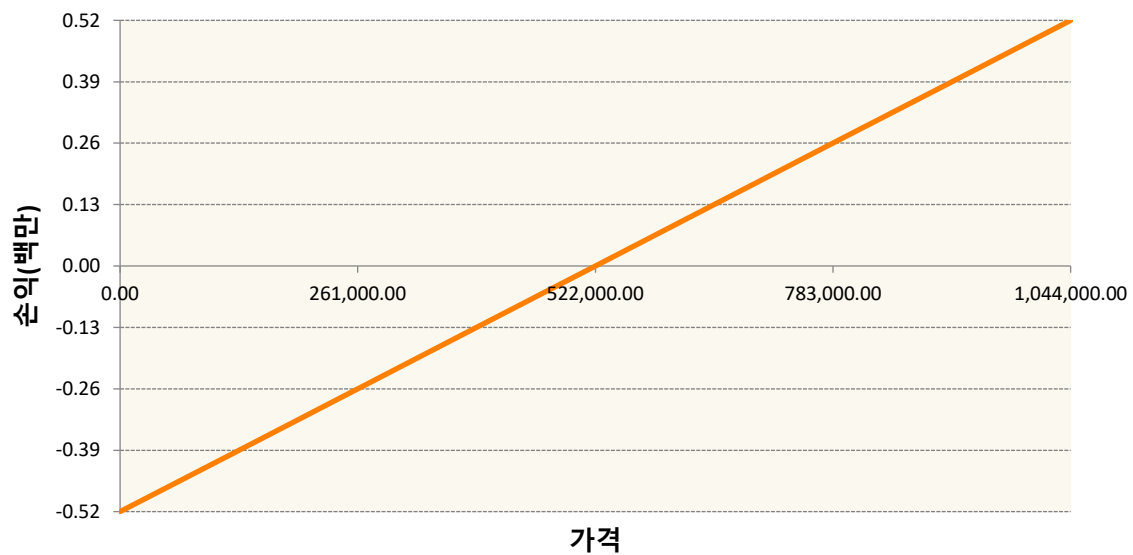
KR4119S80008-2022-08 기아개별선물



KR4122S80002-2022-08 삼성SDI개별선물



KR4147S80009-2022-08 LG화학개별선물



(단위:백만원)

KR4111S80005							2022-08 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	
KR4116S80004							2022-08 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	
KR4119S80008							2022-08 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	
KR4122S80002							2022-08 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	
KR4147S80009							2022-08 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)

24

공시일 2022-07-20

기준일 2022-07-19

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

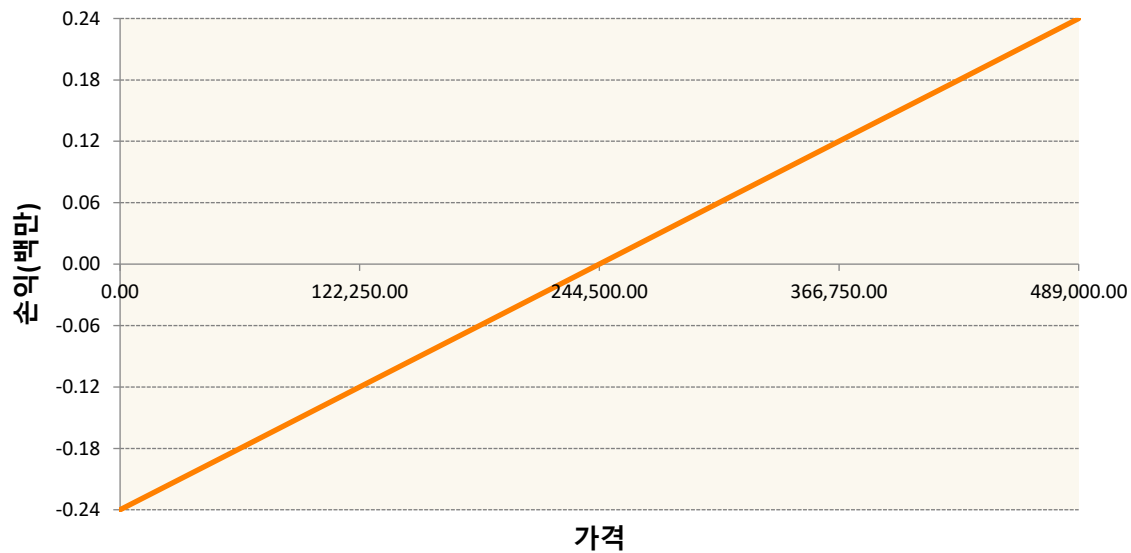
1. 계약금액

(단위:백만원)

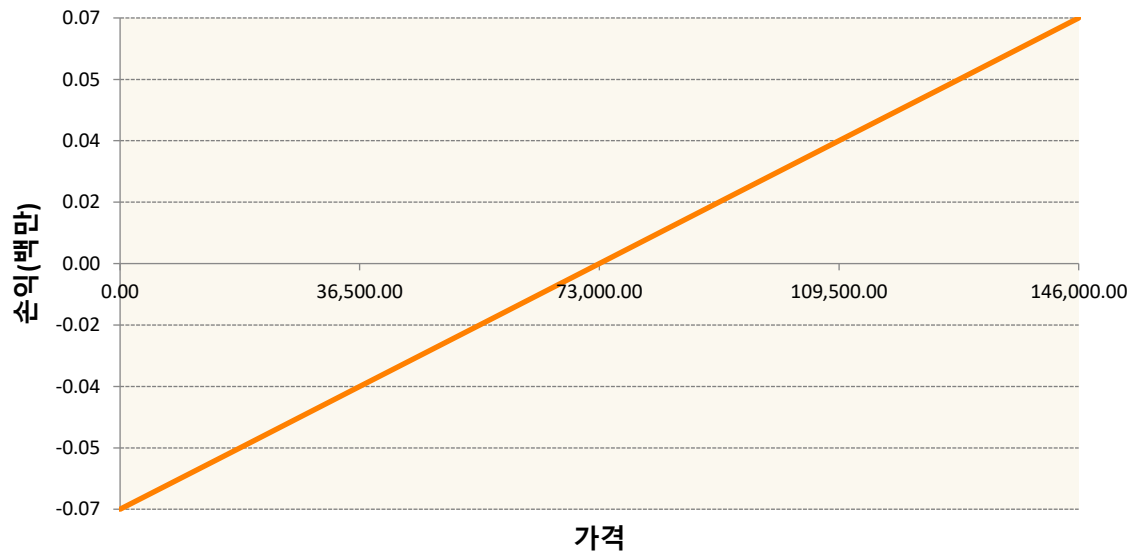
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	210	0	210	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156S80000-2022-08 NAVER개별선물



KR41CFS80001-2022-08 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156S80000		2022-08 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
KR41CFS80001		2022-08 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 2022-07-20

기준일 2022-07-19

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

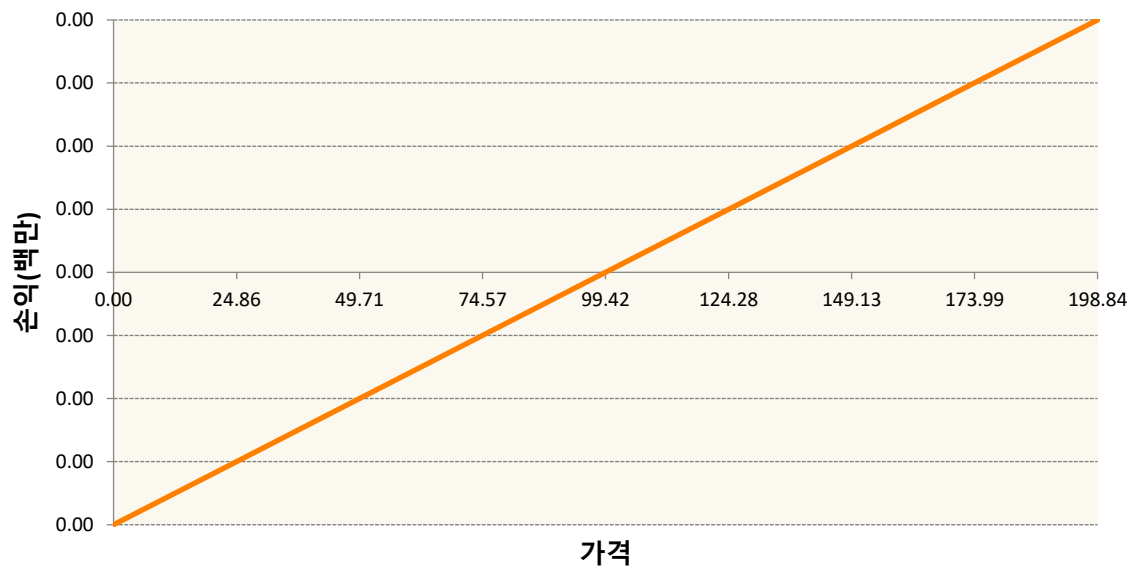
1. 계약금액

(단위:백만원)

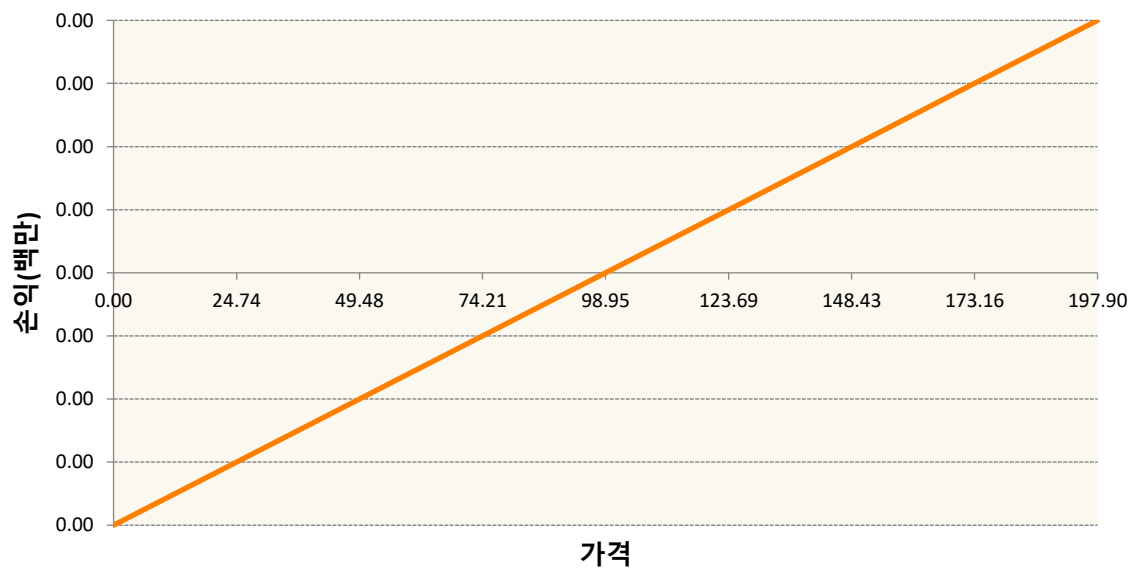
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,121	354	1,767	

2. 만기시점의 손익구조

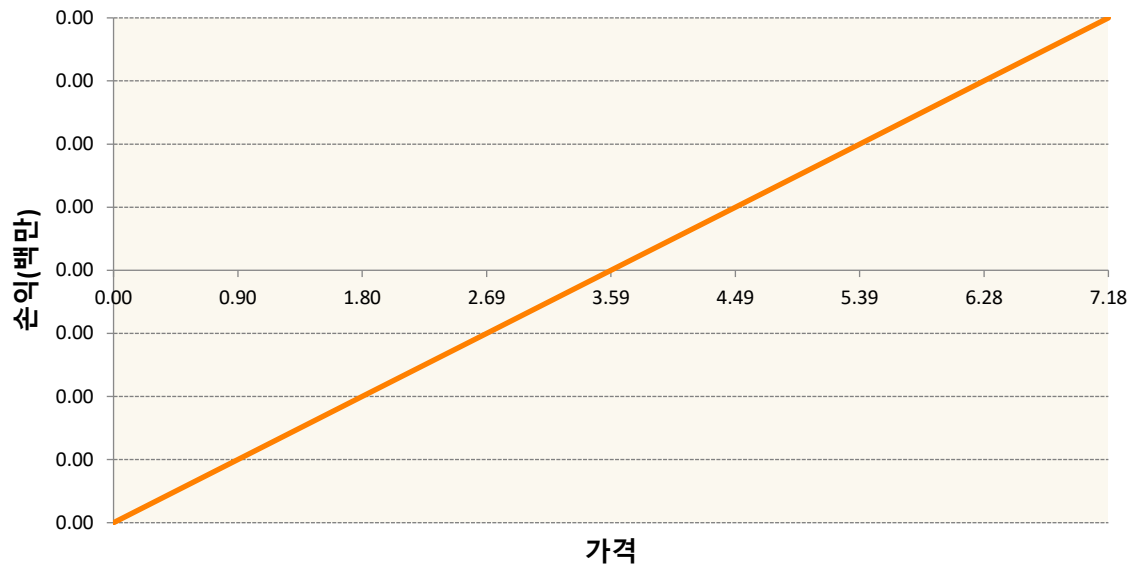
CLU2-WTI CRUDE FUTURE Sep22



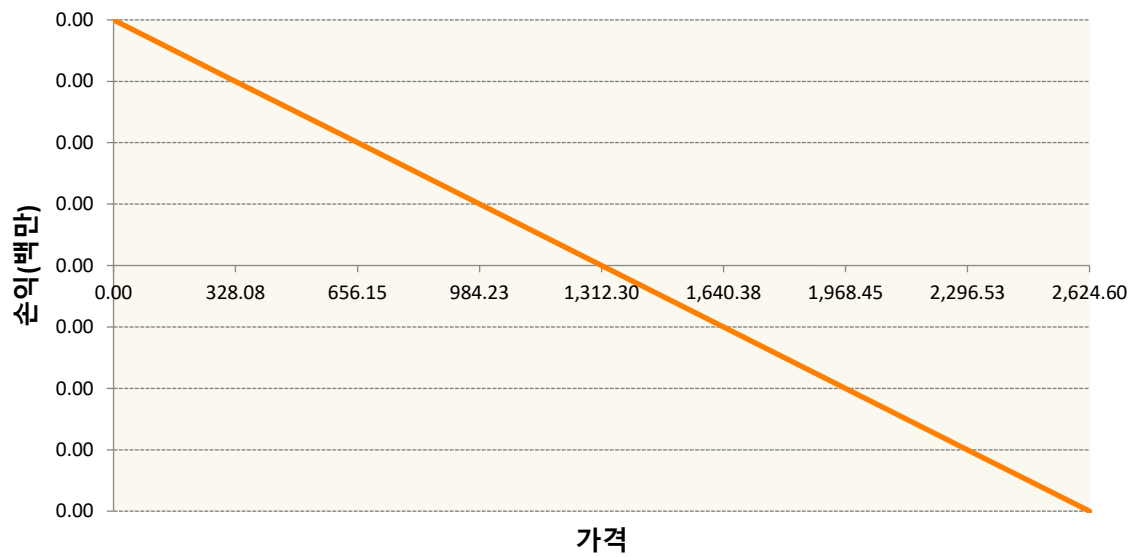
COX2-BRENT CRUDE FUTR Nov22



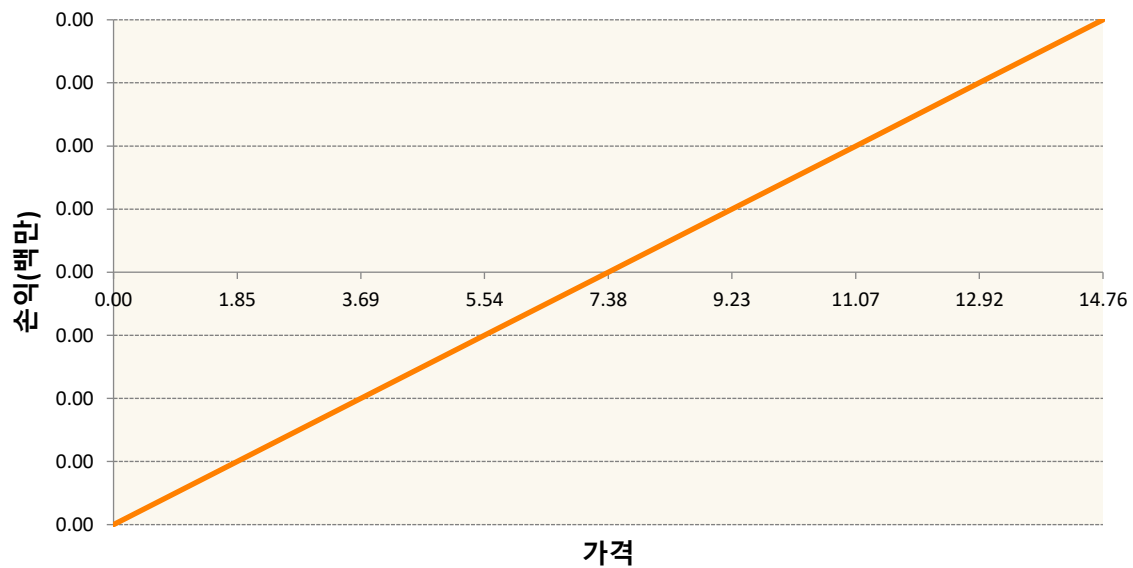
HOU2-NY Harb ULSD Fut Sep22

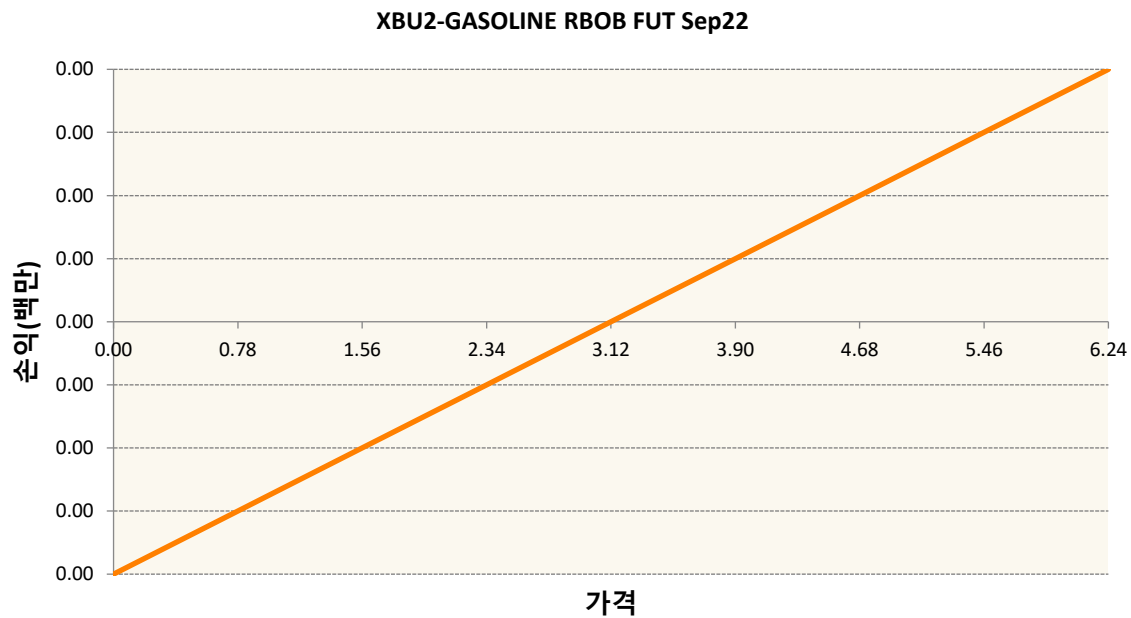
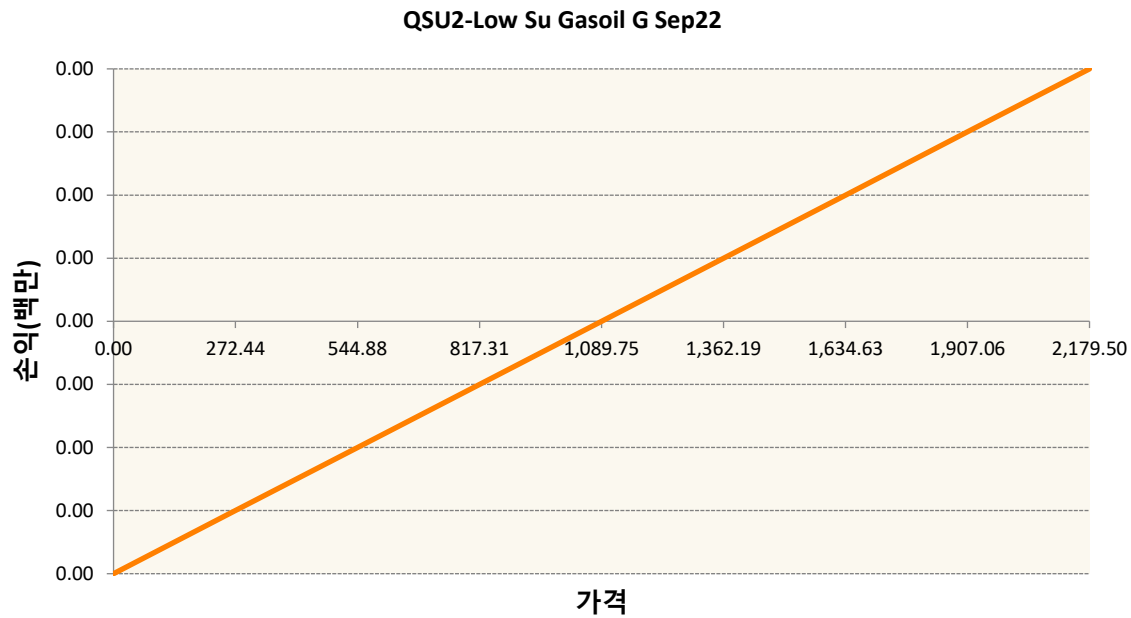


KR4175S80000-2022-08 달러선물



NGU22-NATURAL GAS FUTR Sep22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU2	WTI CRUDE FUTURE Sep22		31
COX2	BRENT CRUDE FUTR Nov22		31
HOU2	NY Harb ULSD Fut Sep22		15
KR4175S800 2022-08 달러선물			28
NGU22	NATURAL GAS FUTR Sep22		68
QSU2	Low Su Gasoil G Sep22		11
XBU2	GASOLINE RBOB FUT Sep22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		540