

공시일 2022-07-26

기준일 2022-07-25

포커스농산물모(채권-파생형)

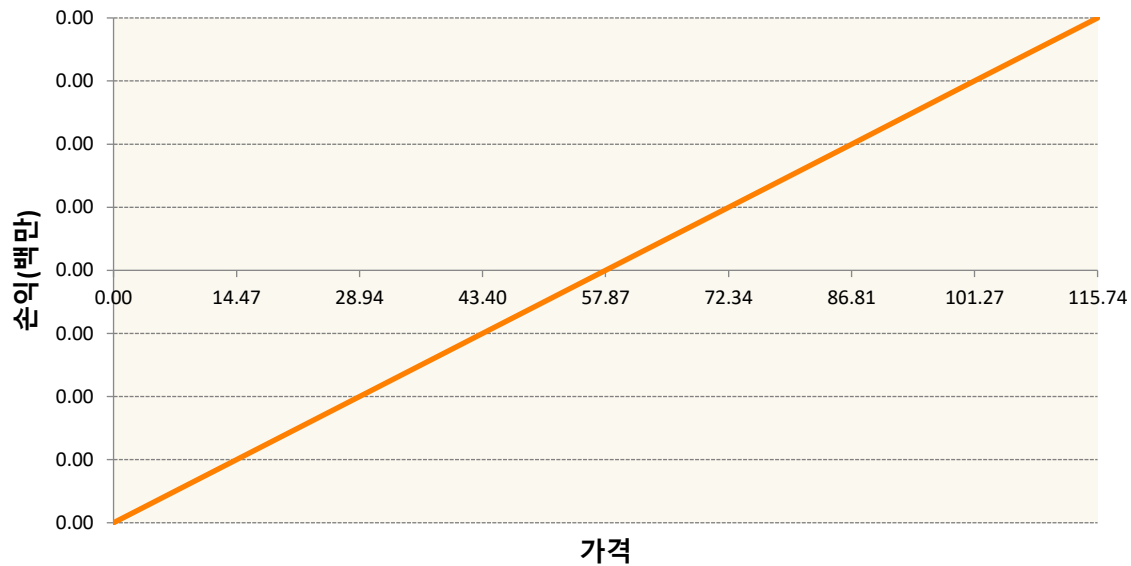
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

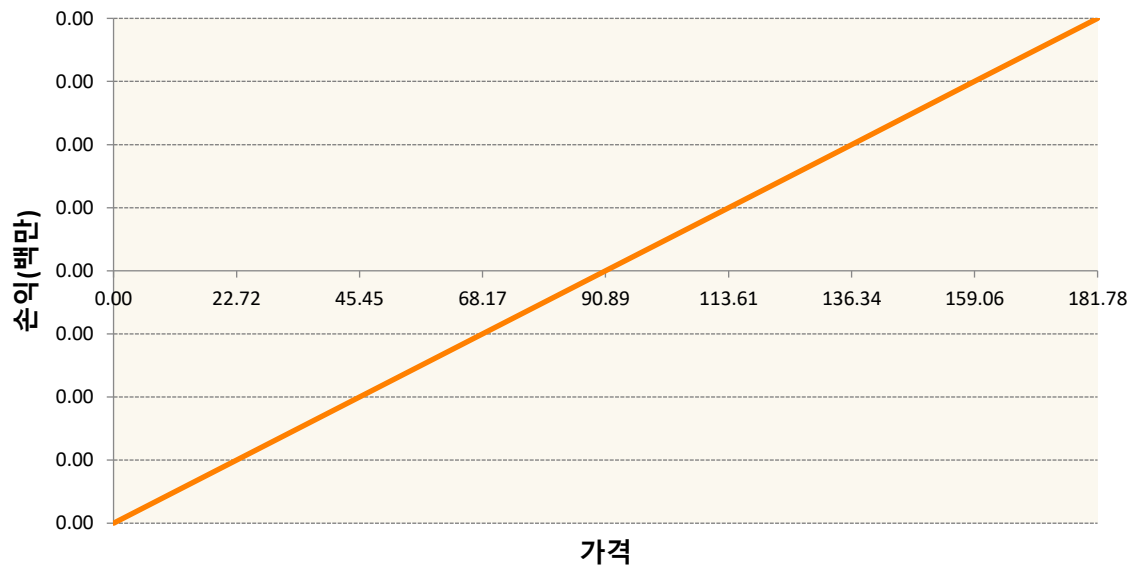
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,596	722	5,875	

2. 만기시점의 손익구조

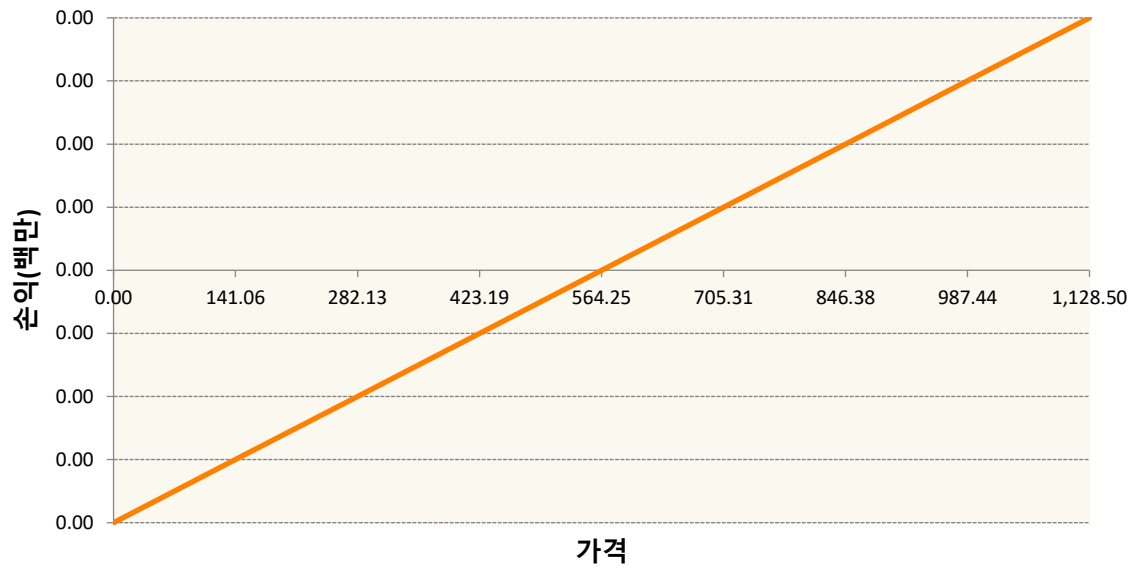
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



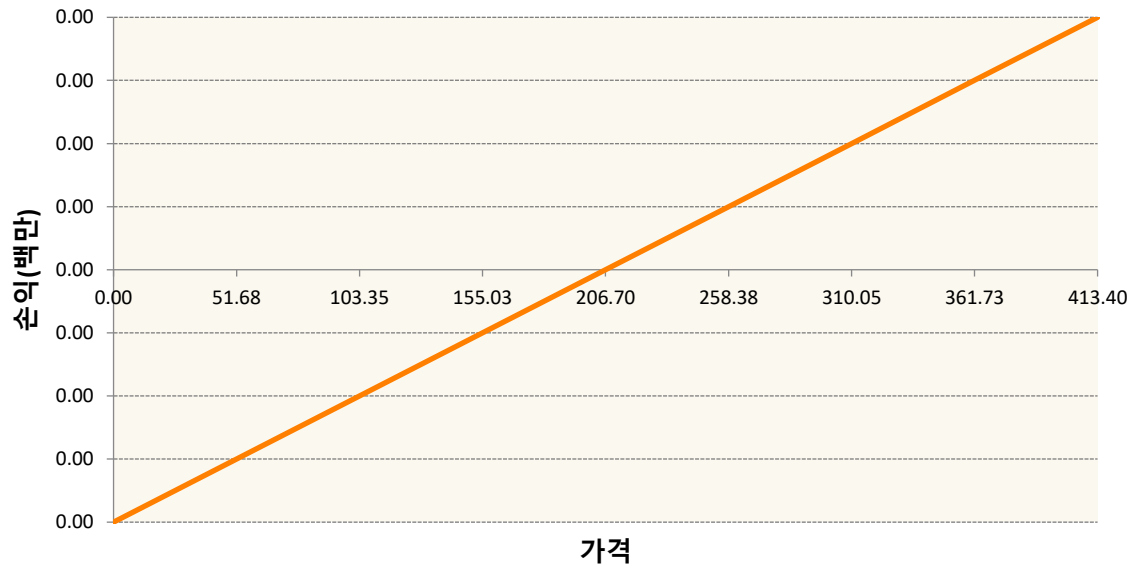
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



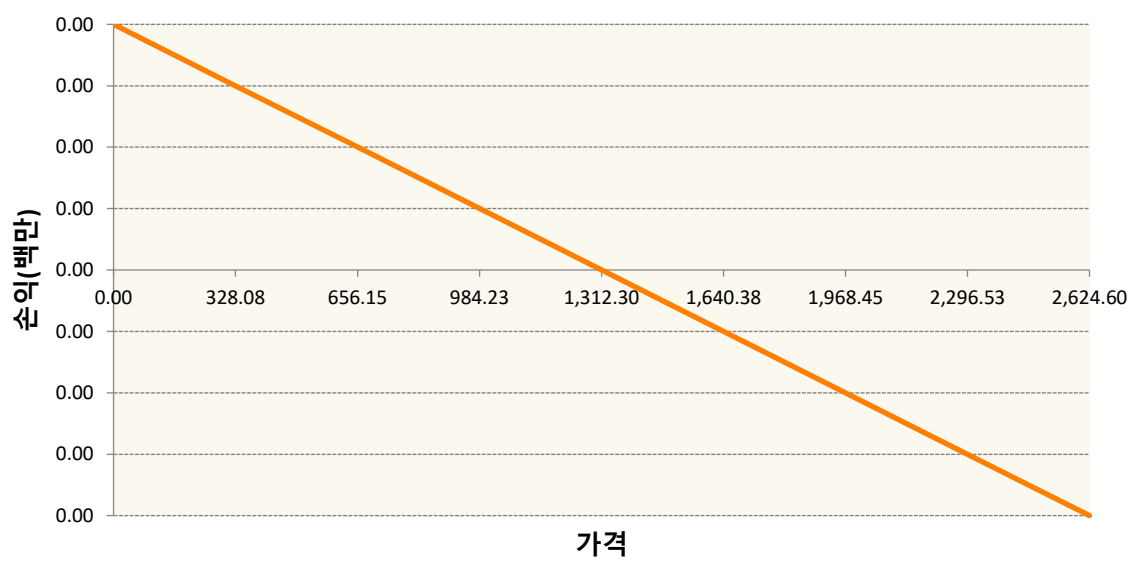
CU2-CORN FUTURE Sep22



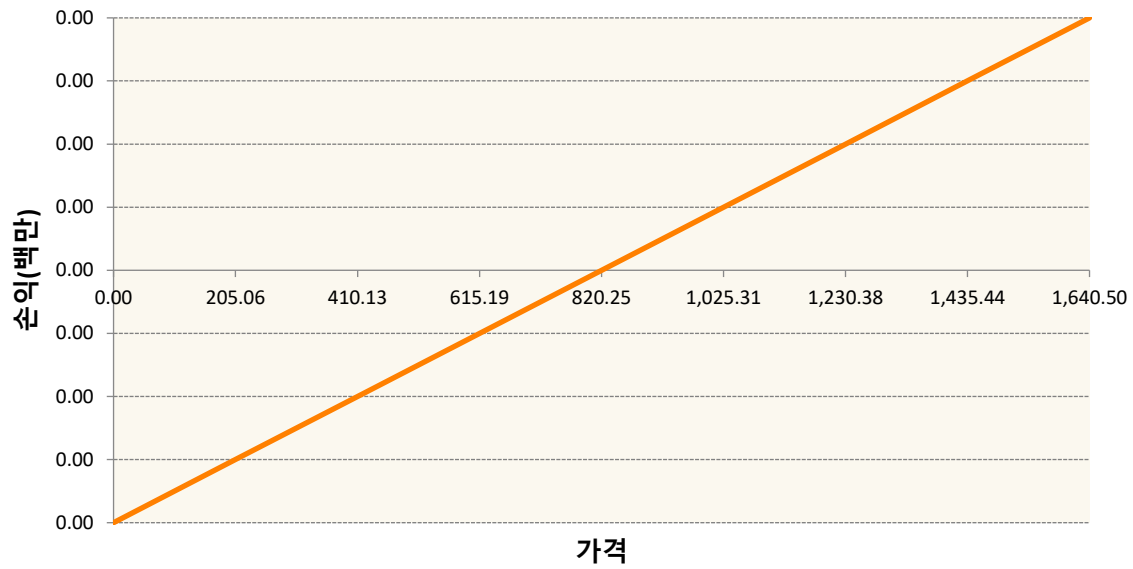
KCU2-COFFEE 'C' FUTURE Sep22



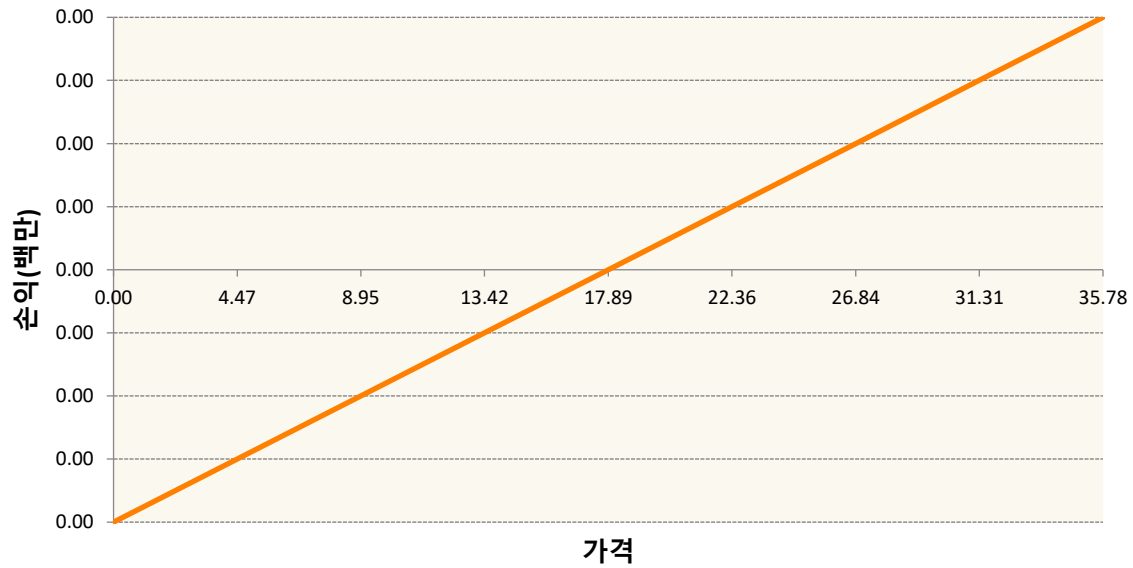
KR4175S80000-2022-08 달러선물



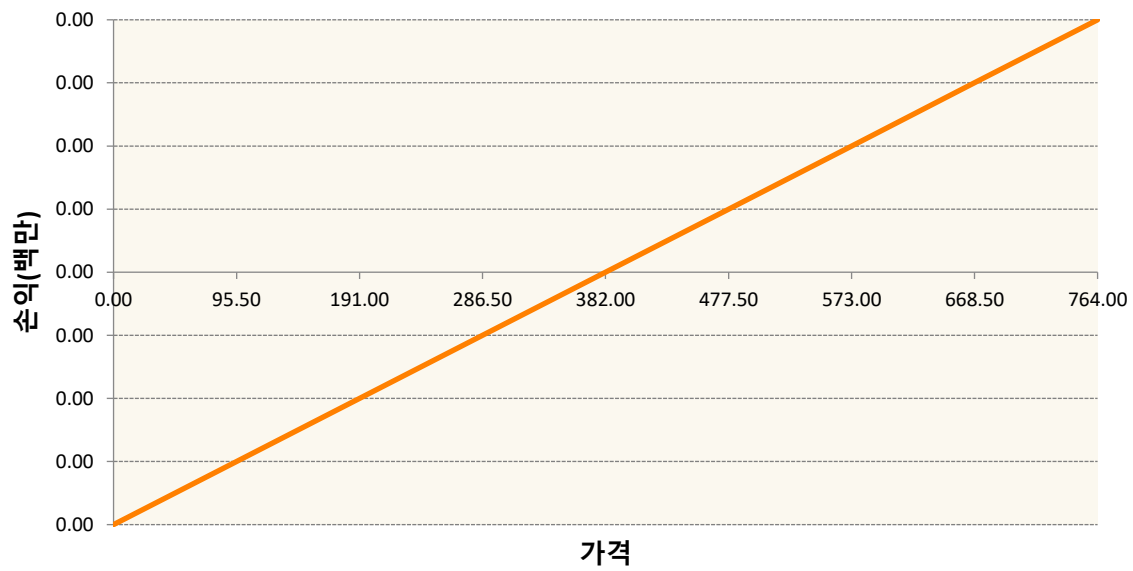
KWU2-KC HRW WHEAT FUT Sep22

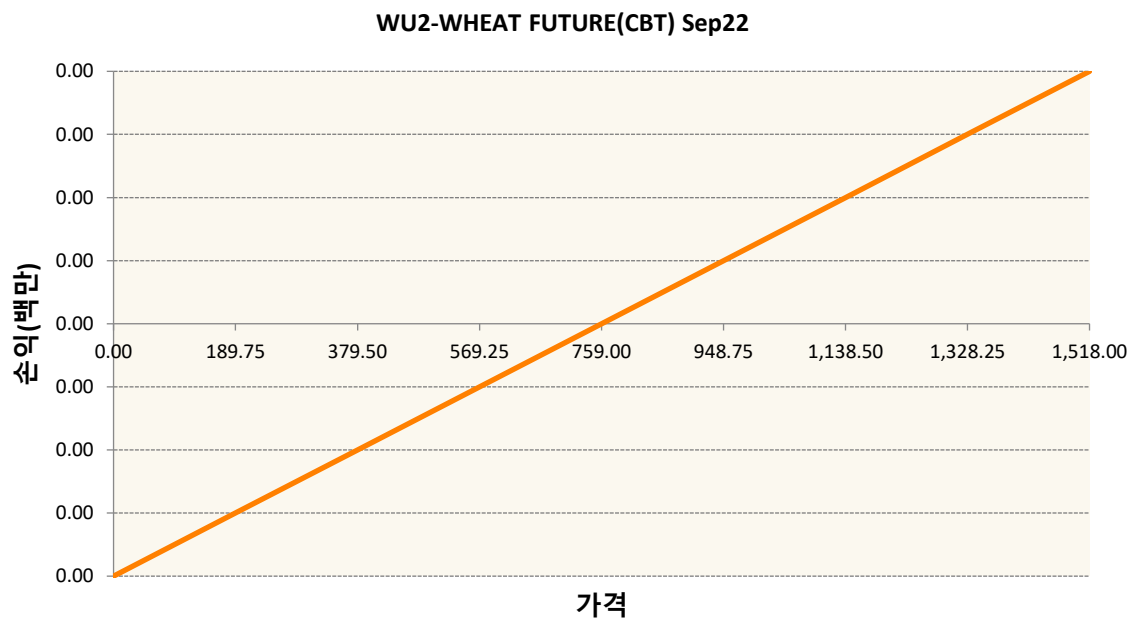
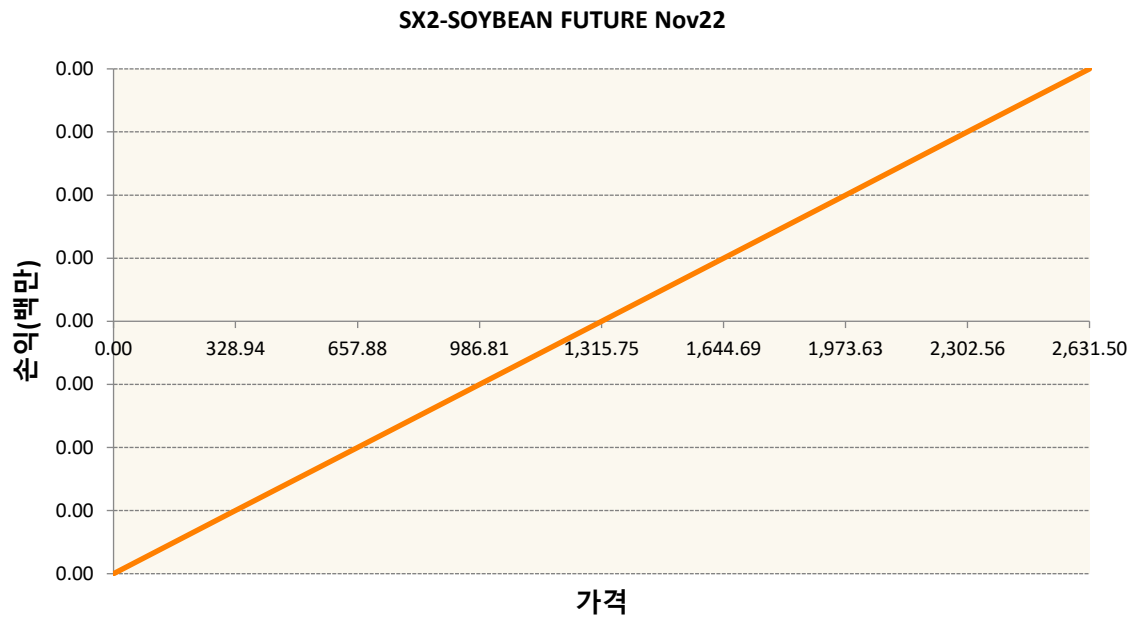


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



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	2022-07-26
기준일	2022-07-25

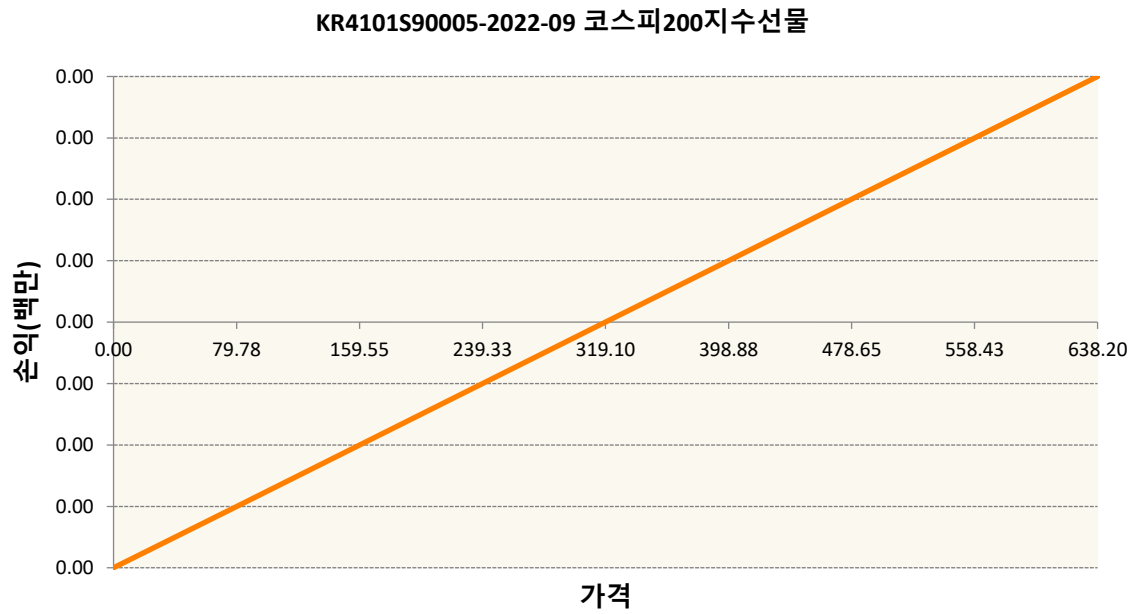
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	80	-80	장내
누계	유가증권	선물	1,037	0	1,037	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

공시일	2022-07-26
기준일	2022-07-25

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	370
-----------------------------	-----

* 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 2022-07-26

기준일 2022-07-25

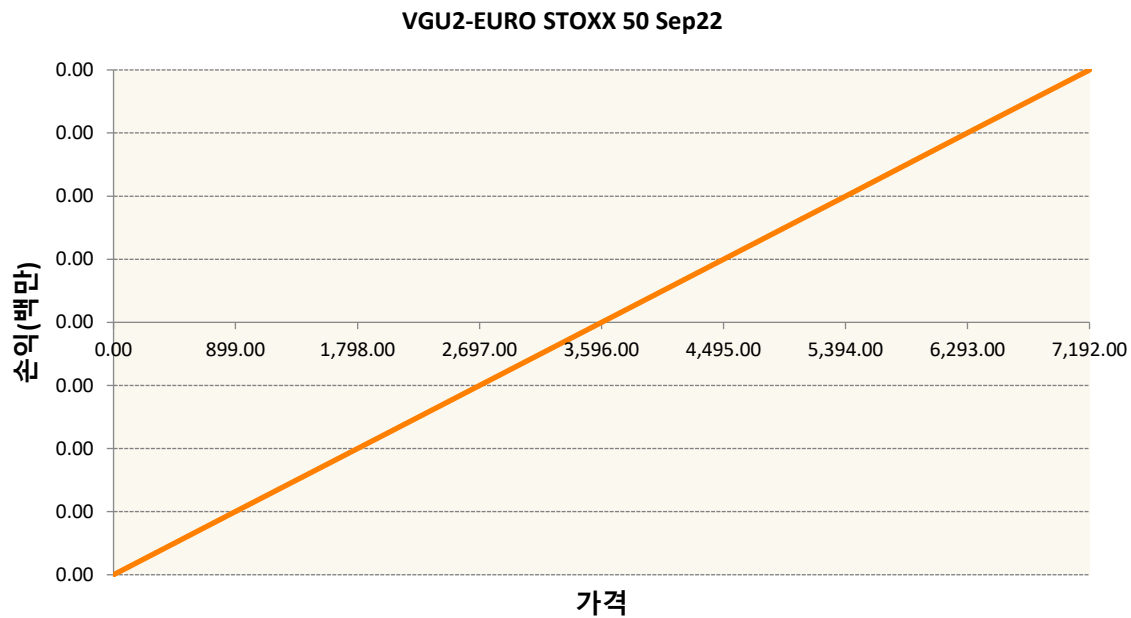
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	535	0	535	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU2	EURO STOXX 50 Sep22	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

43

공시일	2022-07-26
기준일	2022-07-25

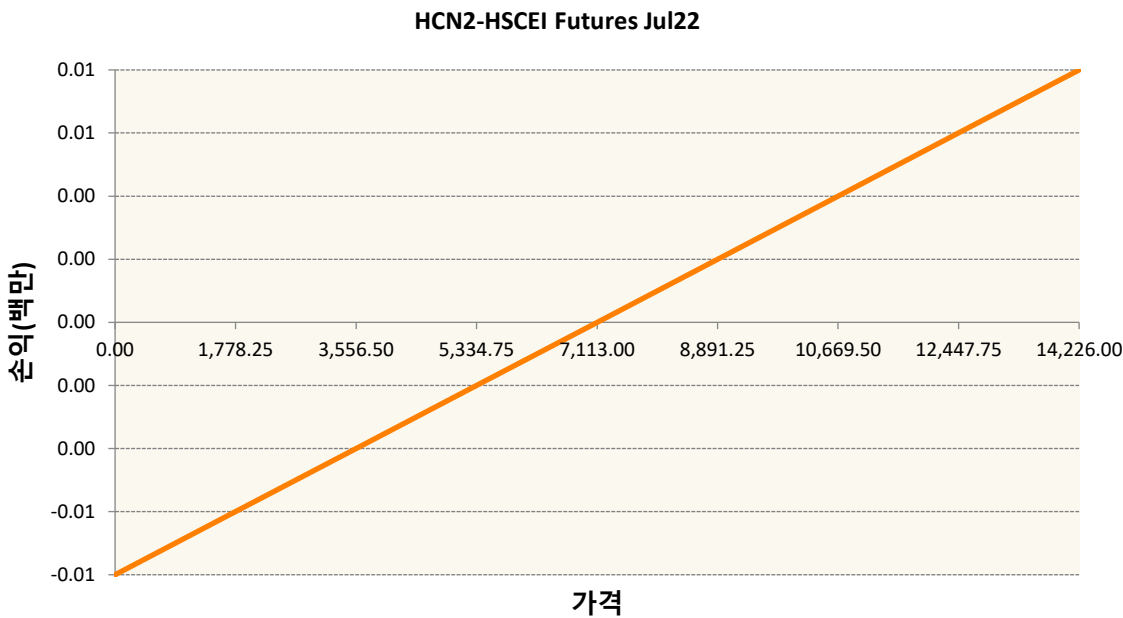
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,161	0	1,161	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN2	HSCEI Futures Jul22	93
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

137

공시일	2022-07-26
기준일	2022-07-25

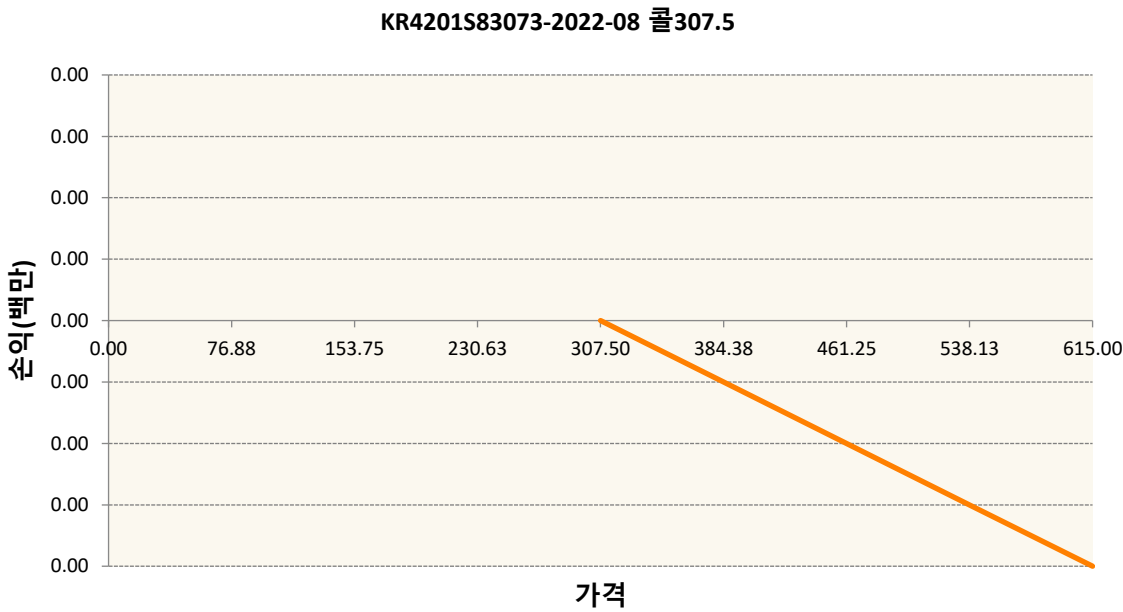
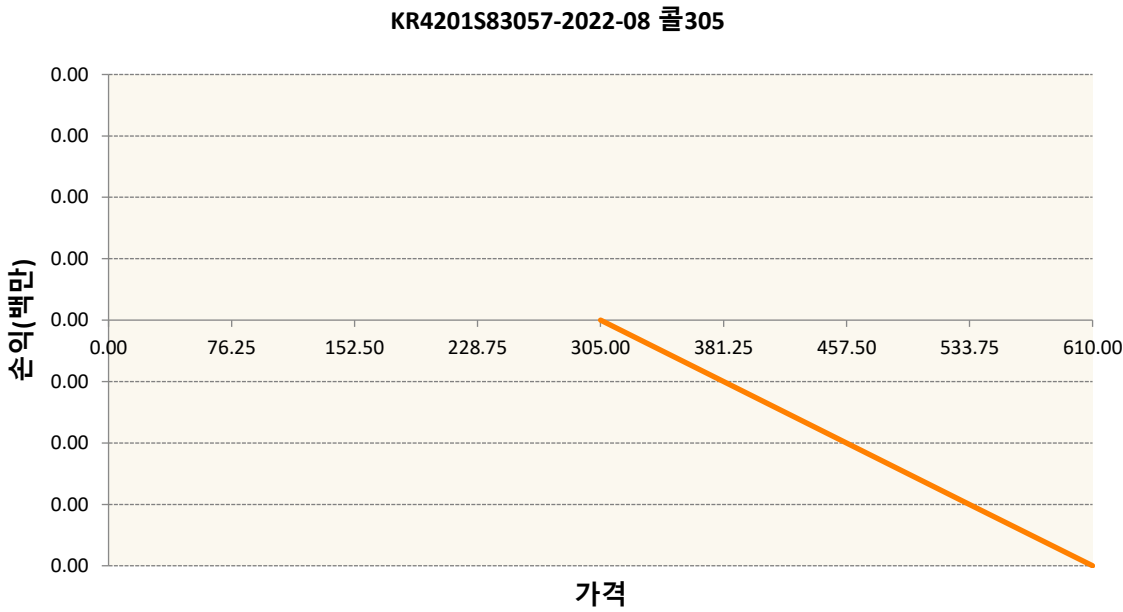
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

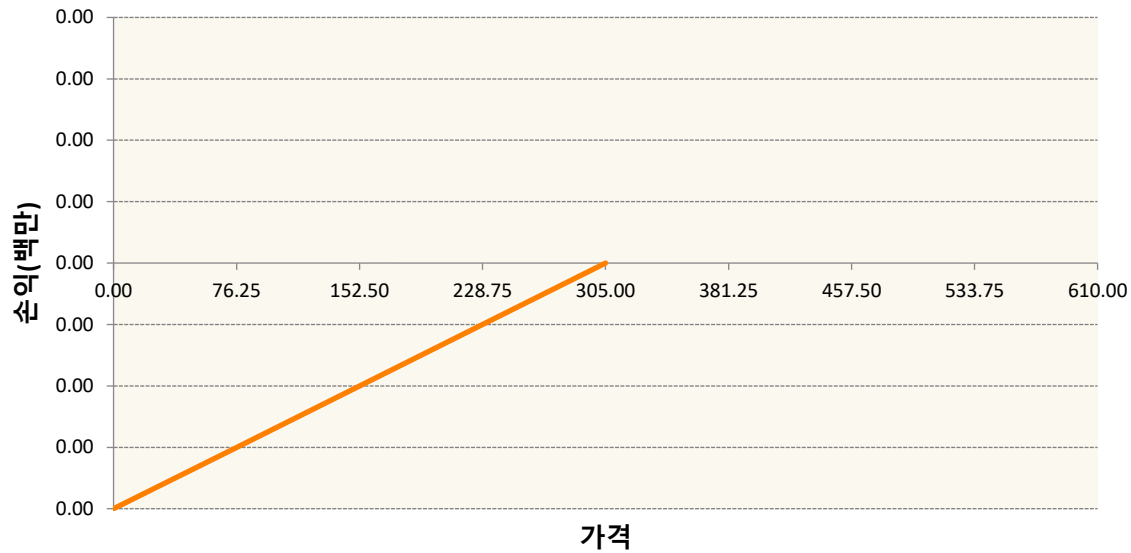
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	57,941	-57,941	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S83055-2022-08 풋305



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S83057		2022-08 콜305						3,020
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		1,941	1,877	1,810	1,741	1,669	1,595	1,520
-5.33%		1,596	1,511	1,426	1,341	1,256	1,171	1,085
-2.67%		1,011	927	843	758	673	587	501
0%		201	137	70	0	-73	-148	-225
2.67%		-768	-805	-849	-898	-952	-1,010	-1,072
5.33%		-1,823	-1,840	-1,864	-1,893	-1,928	-1,968	-2,013
8.00%		-2,914	-2,920	-2,931	-2,946	-2,966	-2,991	-3,020
KR4201S83073		2022-08 콜307.5						611
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		366	354	342	328	315	300	285
-5.33%		307	290	273	256	239	221	204
-2.67%		201	183	165	147	128	110	92
0%		46	31	16	0	-16	-33	-49
2.67%		-146	-156	-166	-178	-190	-204	-218
5.33%		-360	-365	-371	-378	-387	-396	-407
8.00%		-584	-586	-589	-593	-598	-604	-611
KR4301S83055		2022-08 풋305						419
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-367	-374	-382	-390	-399	-409	-419
-5.33%		-155	-168	-181	-194	-208	-221	-235
-2.67%		-27	-40	-53	-66	-79	-92	-106
0%		22	16	8	0	-9	-19	-29

2.67%	34	32	29	26	21	16	10
5.33%	35	35	34	33	32	30	27
8.00%	35	35	35	35	35	34	33

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

(단위:백만원)

4,059

공시일	2022-07-26
기준일	2022-07-25

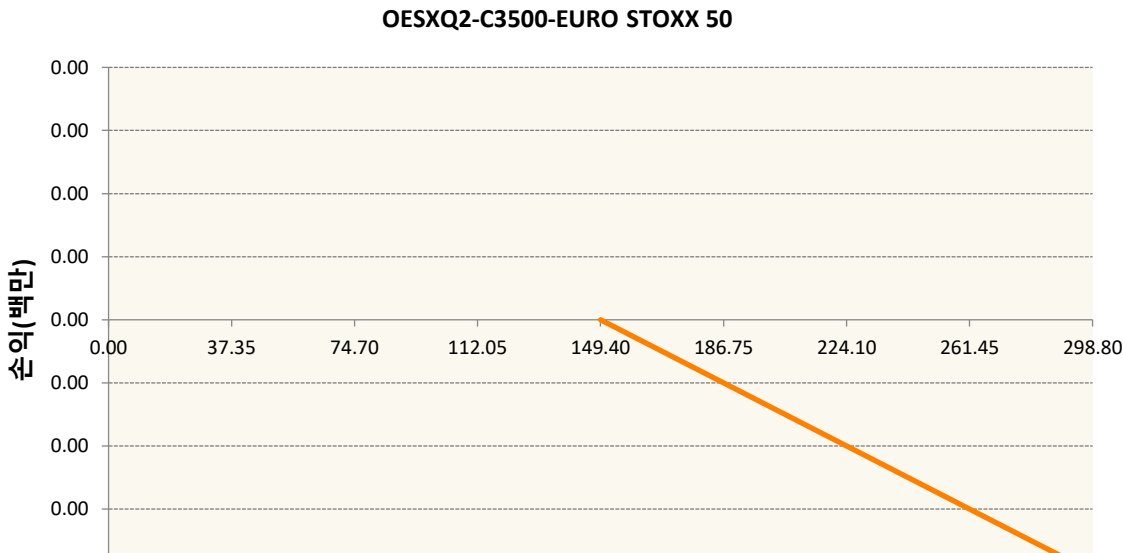
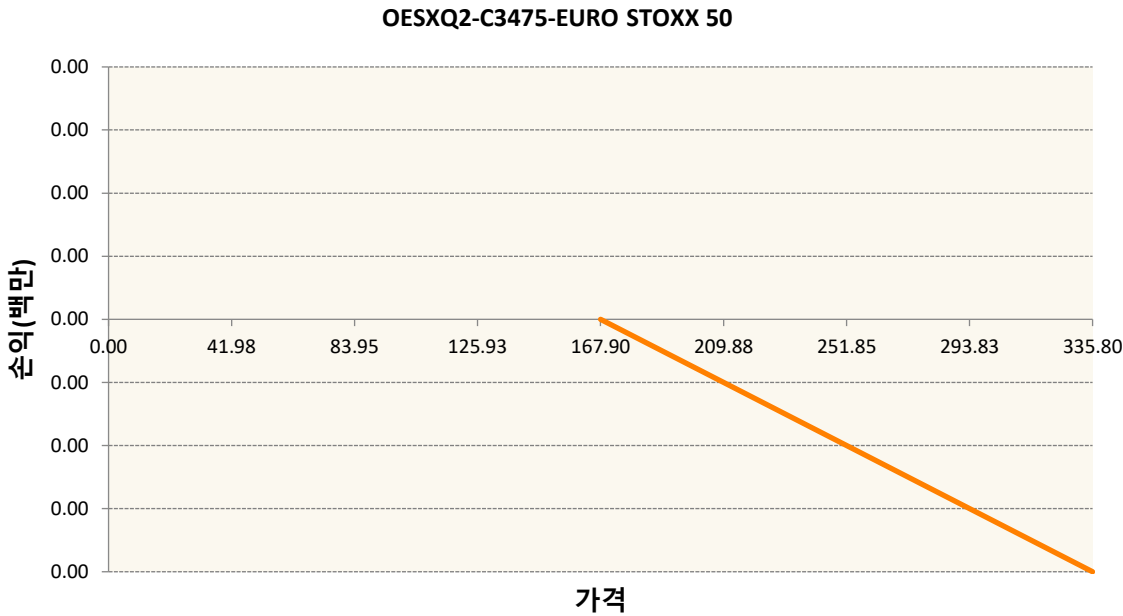
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

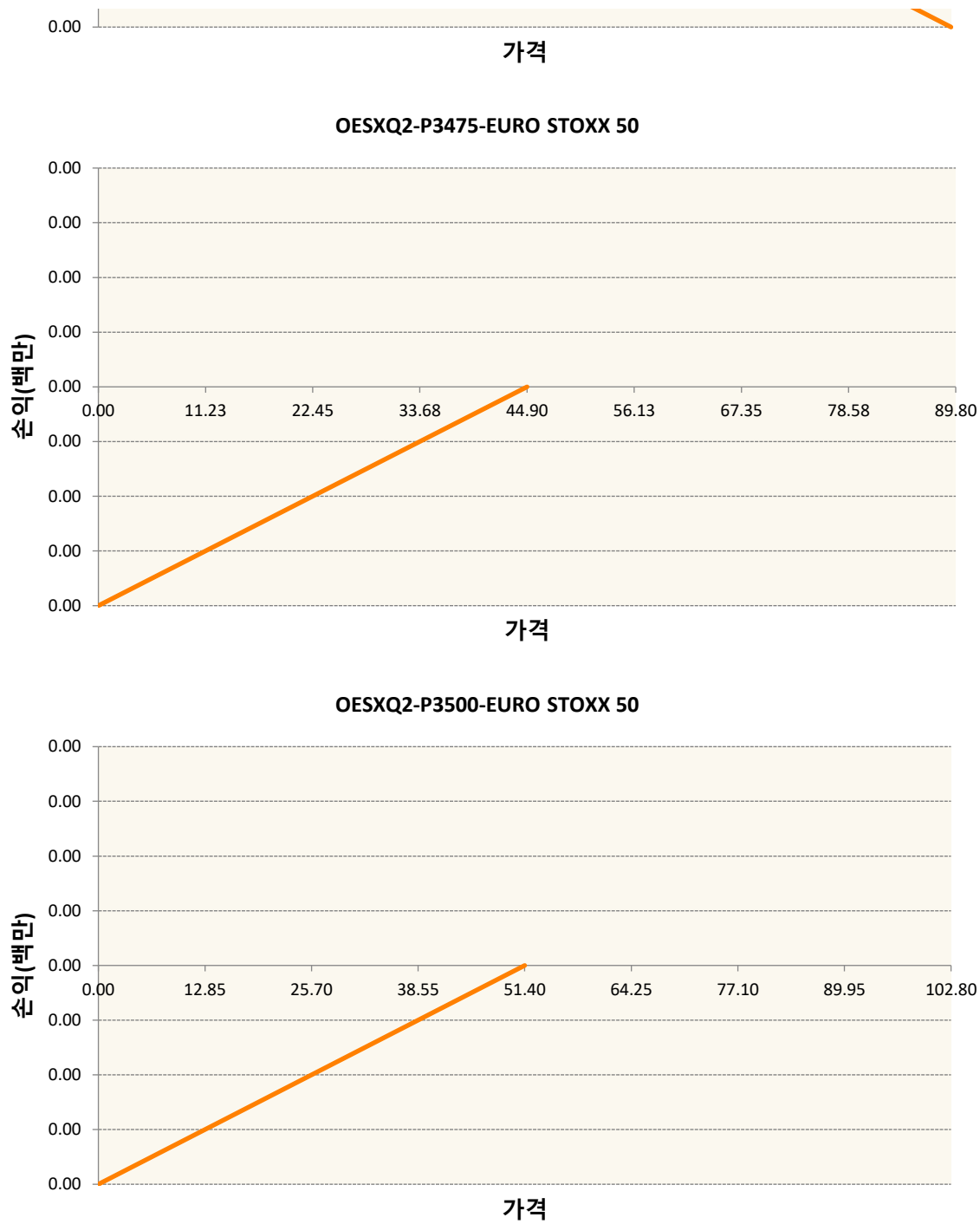
1. 계약금액

(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	60	-60	장내
누계	지수	스왑	4	0	4	장외
누계	통화	선도	0	1,474	-1,474	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213C5Q KRW/EUR 26-08-22E
 FXW213C7L KRW/EUR 23-09-22E
 OESXQ2-C34 EURO STOXX 50
 OESXQ2-C35 EURO STOXX 50
 OESXQ2-P34 EURO STOXX 50
 OESXQ2-P35 EURO STOXX 50

5
86
32
3
0.32
1
0.11

공시일 2022-07-26

기준일 2022-07-25

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

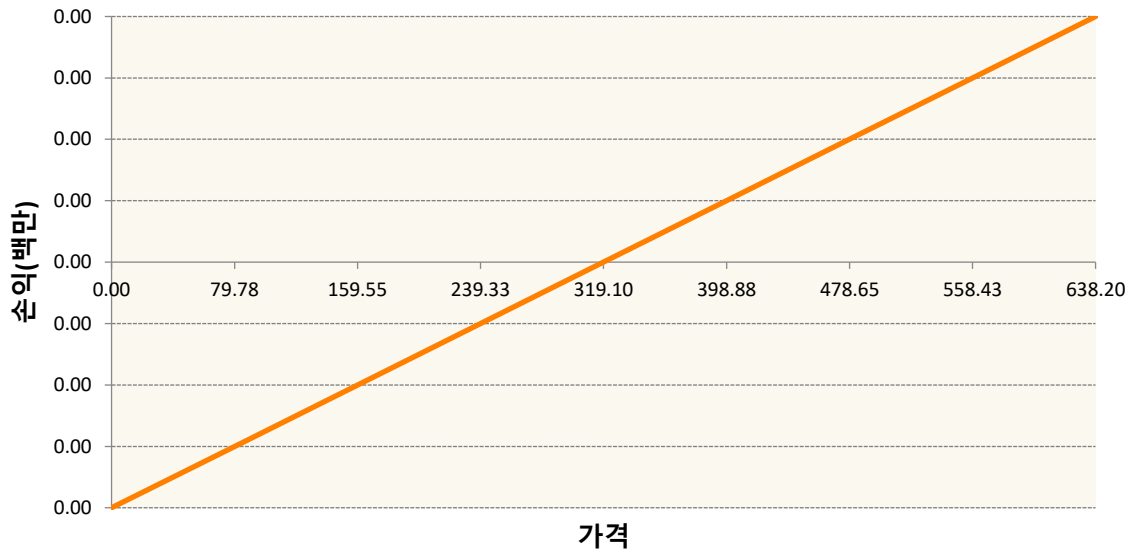
1. 계약금액

(단위:백만원)

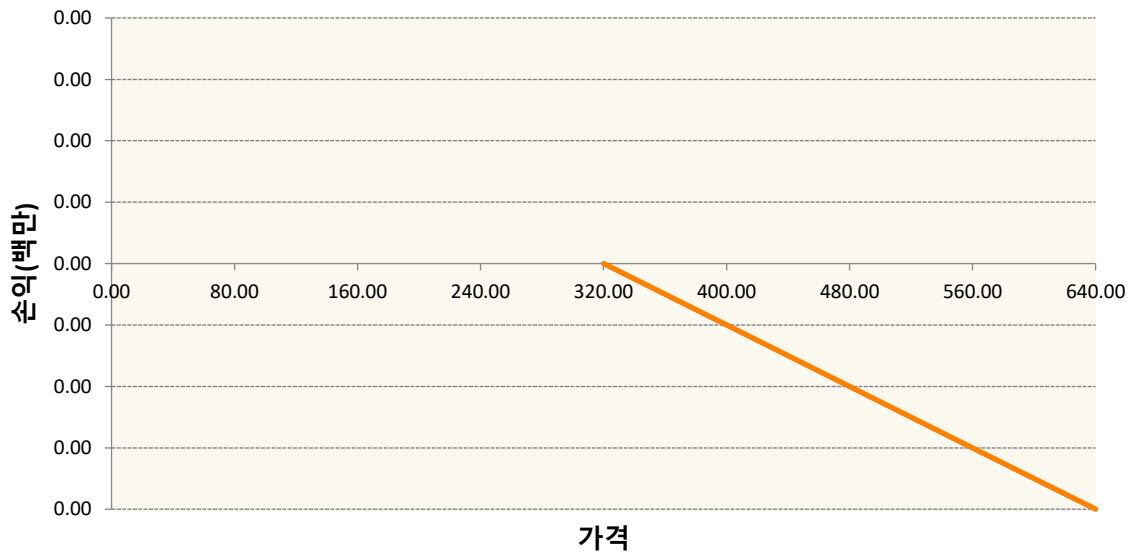
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	399	0	399	장내
누계	유가증권	옵션	458	4,248	-3,790	장내

2. 만기시점의 손익구조

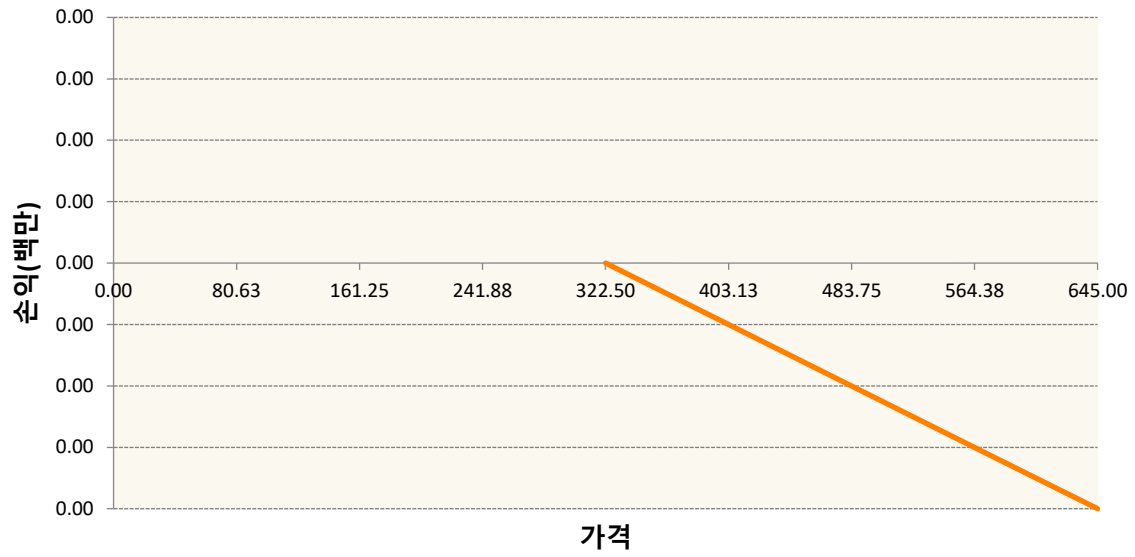
KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



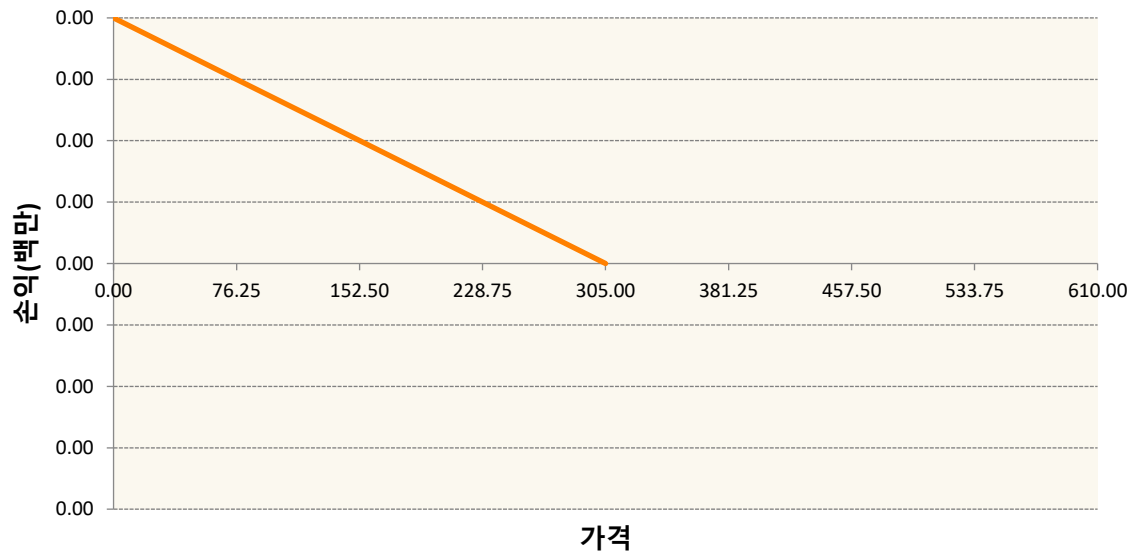
KR4201S83206-2022-08 콜320



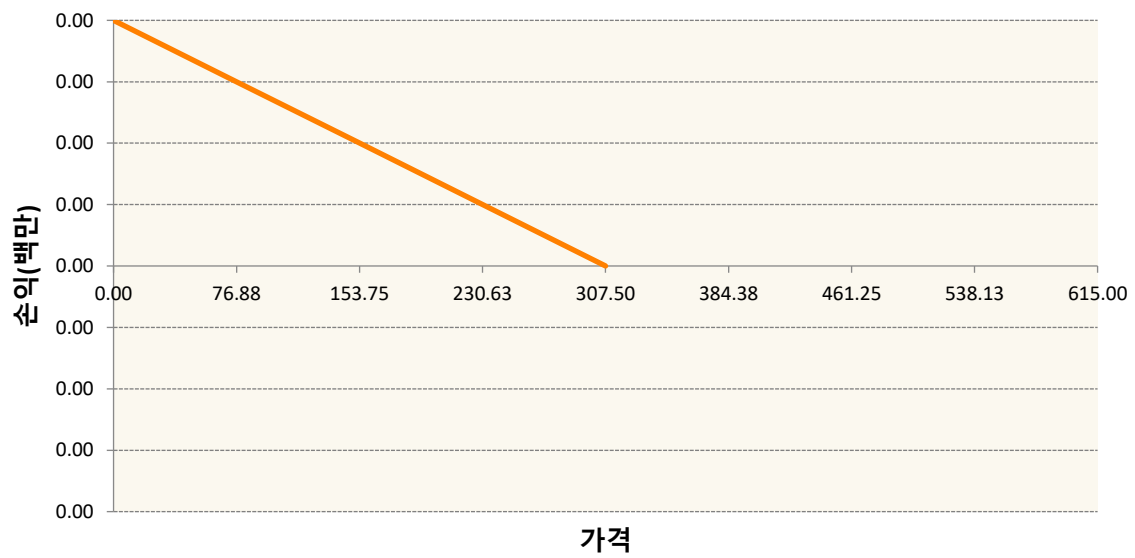
KR4201S83222-2022-08 콜322.5



KR4301S83055-2022-08 풋305



KR4301S83071-2022-08 풋307.5



(단위:백만원)

KR4101S90005				2022-09 코스피200지수선물				32
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	21	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	32	32	32	32	32	32	32	32
KR4201S83206				2022-08 콜320				191
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	74	73	70	68	65	62	58	
-5.33%	68	64	60	56	51	46	41	
-2.67%	52	46	40	34	28	22	15	
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21	
2.67%	-28	-35	-41	-48	-55	-61	-68	
5.33%	-93	-97	-103	-108	-114	-119	-125	
8.00%	-168	-171	-174	-178	-182	-187	-191	
KR4201S83222				2022-08 콜322.5				59
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	21	20	20	19	18	17	16	
-5.33%	19	18	17	16	15	13	12	
-2.67%	15	14	12	10	8	6	4	
0%	7	4	2	0	-2	-4	-7	
2.67%	-8	-10	-12	-14	-17	-19	-21	
5.33%	-27	-29	-31	-33	-35	-37	-39	
8.00%	-51	-52	-53	-55	-56	-58	-59	
KR4301S83055				2022-08 풋305				16
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	14	14	15	15	15	16	16	
-5.33%	6	7	7	8	8	9	9	
-2.67%	1	2	2	3	3	4	4	
0%	-1	-1	0	0	0	1	1	
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	0	
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
KR4301S83071				2022-08 풋307.5				4
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	4	4	4
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	0	0	1	1	1	1	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

279

공시일	2022-07-26
기준일	2022-07-25

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	8,932	0	8,932	

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	2022-07-26
기준일	2022-07-25

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	6,824	0	6,824	

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	2022-07-26
기준일	2022-07-25

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	20,649	0	20,649	
누계	통화	선도	1,714	27,673	-25,959	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C6P ² KRW/USD 29-08-22E	587
FXW213C6P ² KRW/USD 27-09-22E	589
FXW213C6P ² KRW/USD 27-07-22E	587
FXW213C6Q USD/KRW 27-07-22E	53
FXW213C78 ² USD/KRW 27-07-22E	37
FXW213C7C ² USD/KRW 27-07-22E	10
FXW213C7F ² USD/KRW 27-07-22E	8
FXW213C7J4 USD/KRW 27-07-22E	29
FXW213C7R ² KRW/USD 27-10-22E	450
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

909

공시일 2022-07-26

기준일 2022-07-25

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

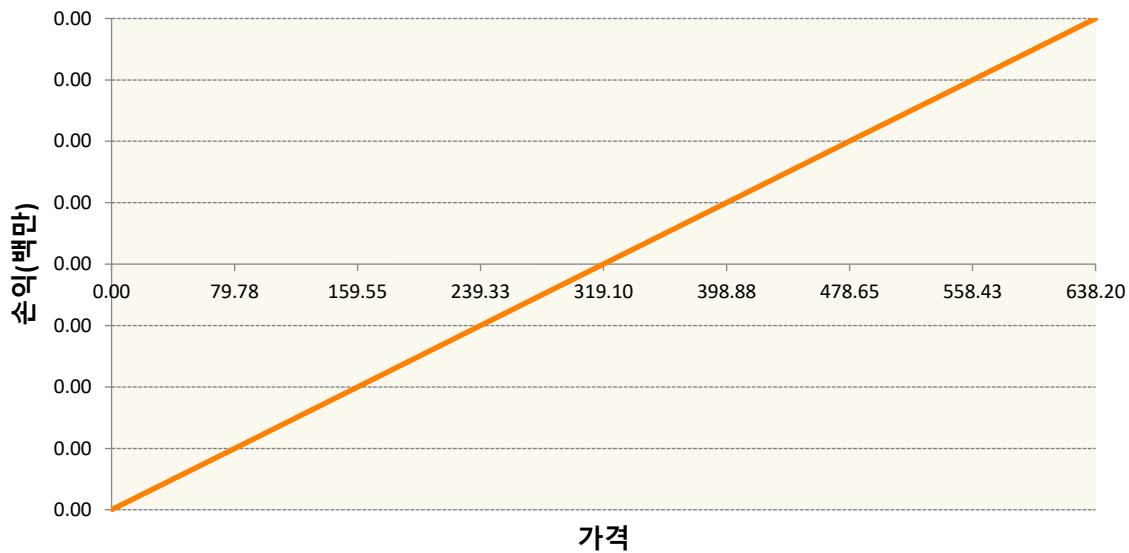
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	399	0	399	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005		2022-09 코스피200지수선물						32
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	
-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%	21	21	21	21	21	21	21	
8.00%	32	32	32	32	32	32	32	

공시일 2022-07-26

기준일 2022-07-25

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

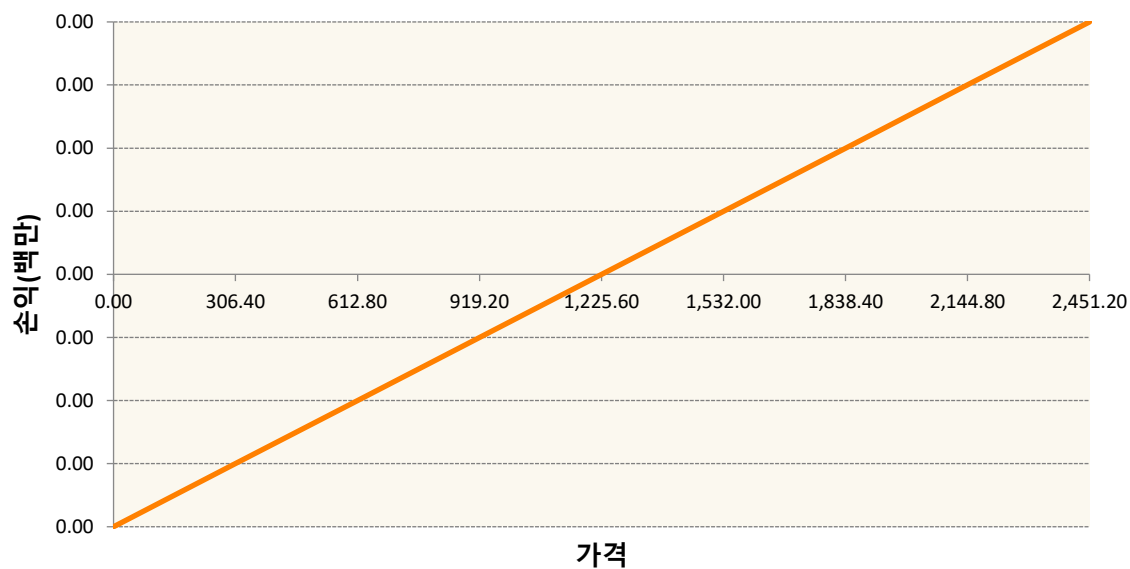
1. 계약금액

(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	798	0	798	
누계	유가증권	스왑	1,649	0	1,649	장외
누계	통화	선도	0	938	-938	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCQ2-VN30 Index Future Aug22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	132
FXW213C5J4 KRW/EUR 26-08-22E	30
FXW213C6N KRW/EUR 23-09-22E	27
FXW213C7L4 KRW/EUR 21-10-22E	18
VNCQ2 VN30 Index Future Aug22	64

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

(단위:백만원)

248

공시일	2022-07-26
기준일	2022-07-25

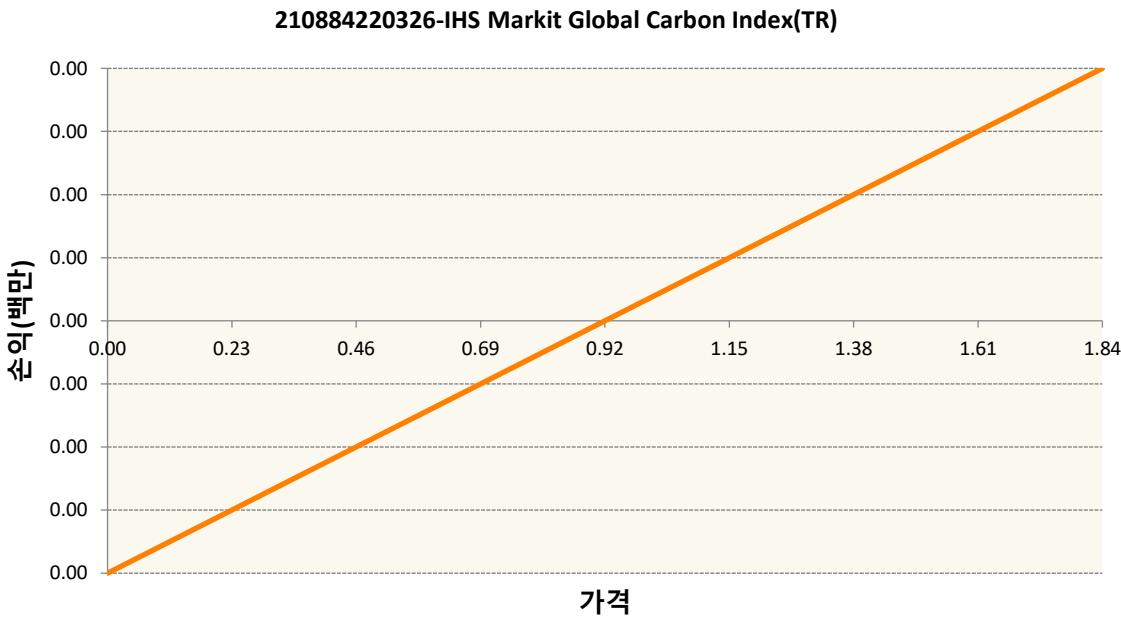
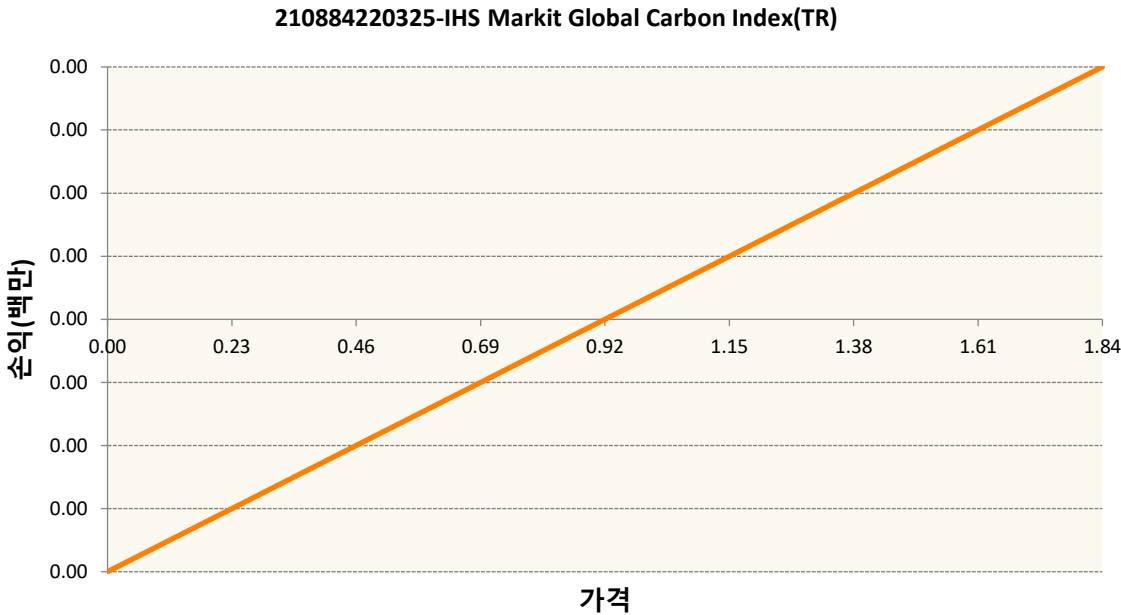
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

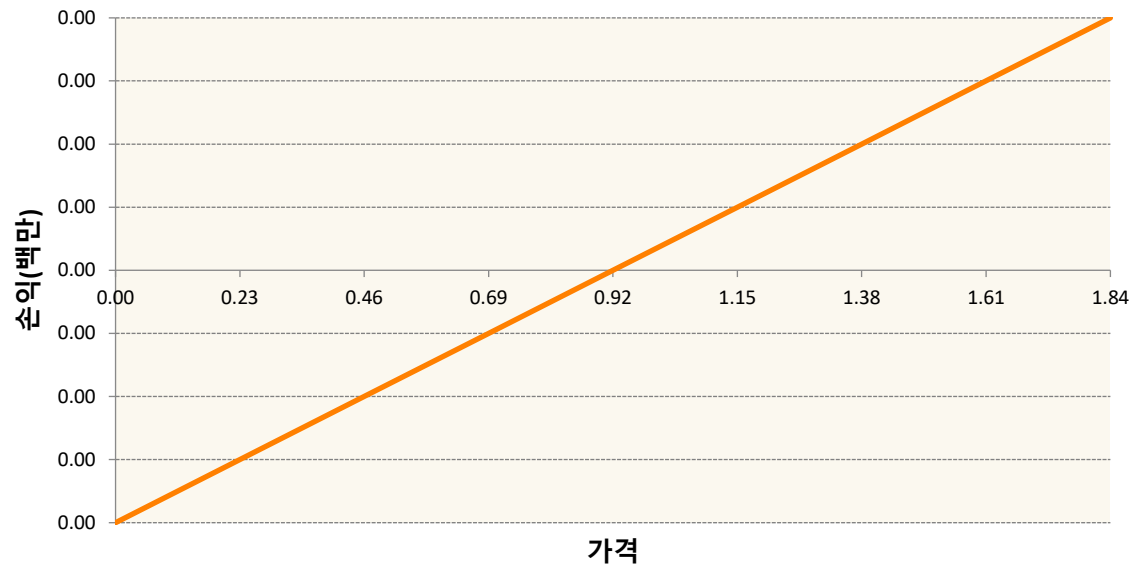
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	43,751	0	43,751	

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)

185
3,220
92

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

(단위:백만원)

6,451

공시일	2022-07-26
기준일	2022-07-25

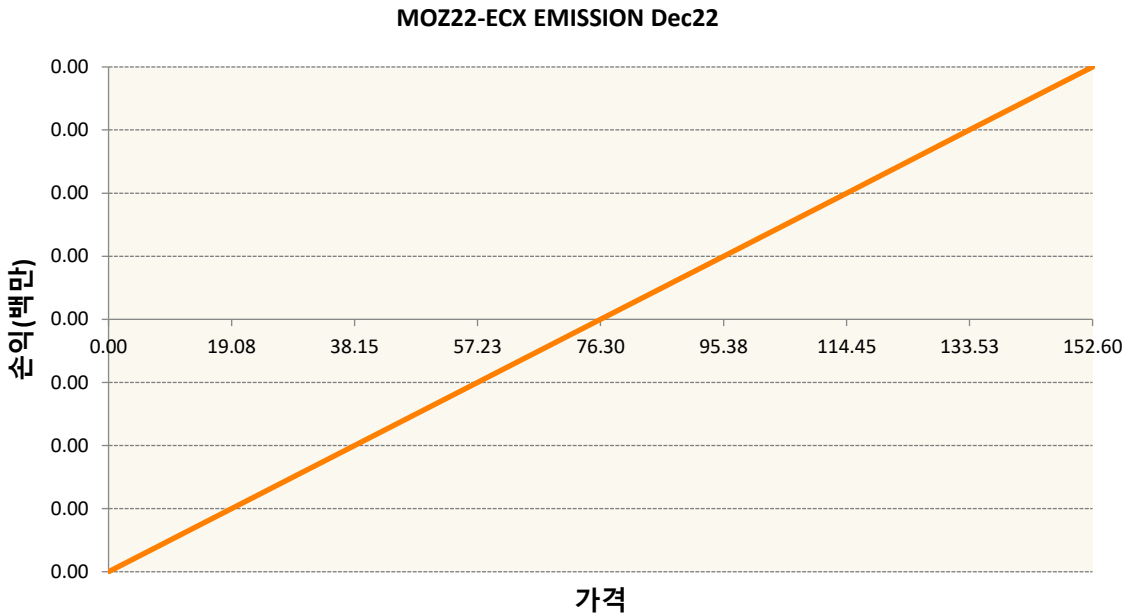
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,575	0	13,575	
누계	통화	선도	0	8,480	-8,480	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C6T+KRW/EUR 26-07-22E	678
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,086

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

(단위:백만원)

3,049

공시일	2022-07-26
기준일	2022-07-25

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)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	20

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

(단위:백만원)

154

공시일	2022-07-26
기준일	2022-07-25

SOL차이나육성산업액티브상장지

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)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	8

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

(단위:백만원)

36

공시일 2022-07-26

기준일 2022-07-25

에퀴티알파일반사모혼합자산

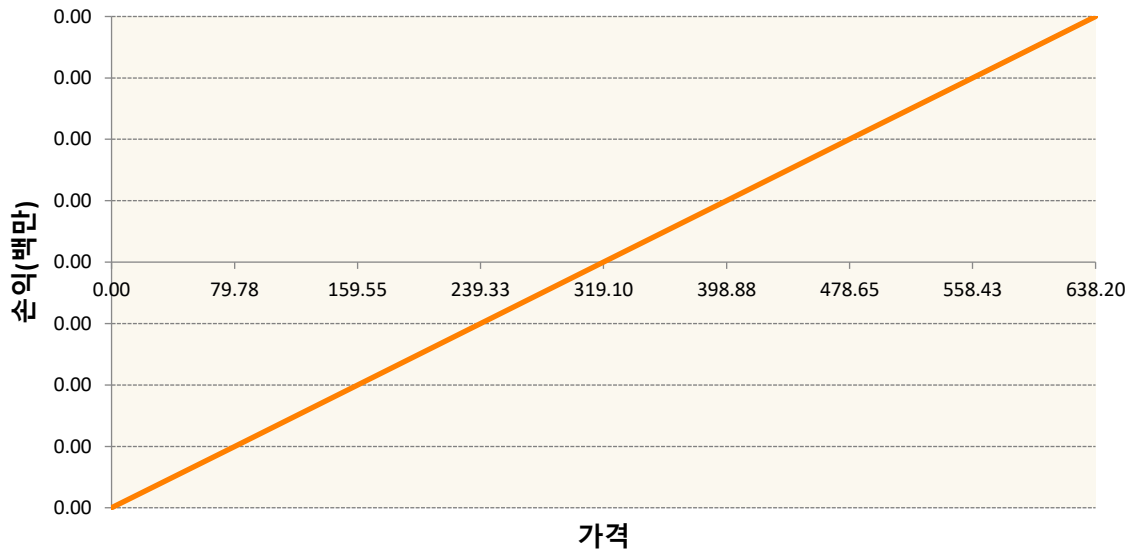
1. 계약금액

(단위:백만원)

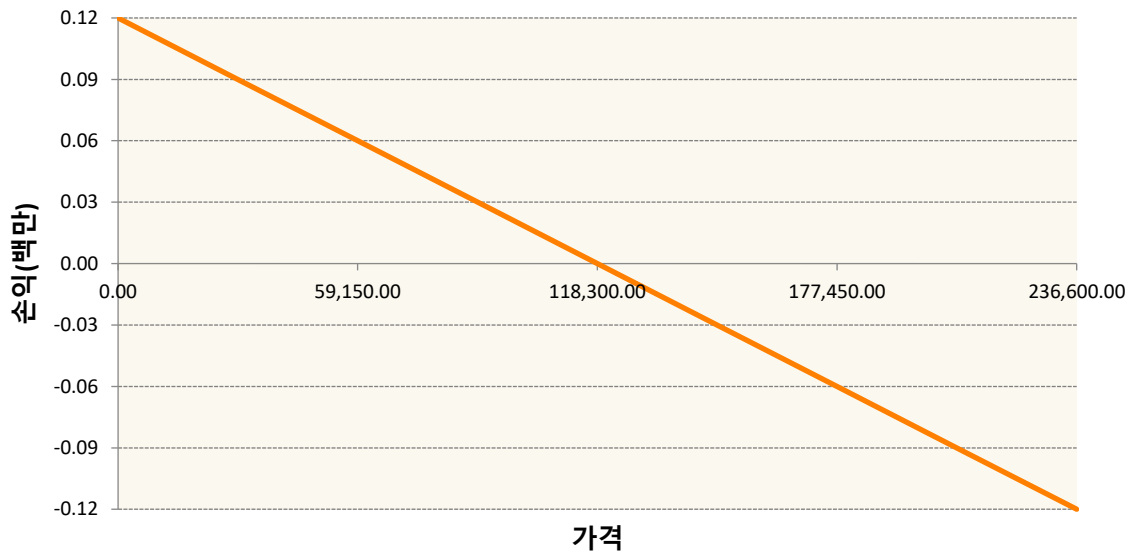
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	800	799	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,994	118	1,876	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



KR41EYS80008-2022-08 에코프로비엠개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101S900	2022-09 코스피200지수선물	160
KR41EYS800	2022-08 에코프로비엠개별선물	9
KRS0003135	SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.22
KRS0003224	SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	181

공시일 2022-07-26

기준일 2022-07-25

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

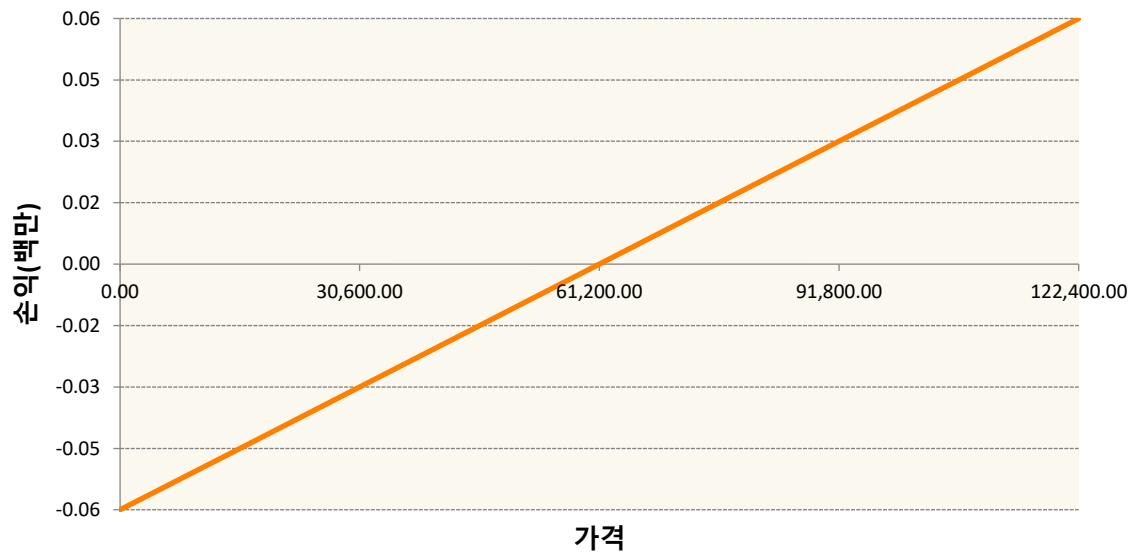
1. 계약금액

(단위:백만원)

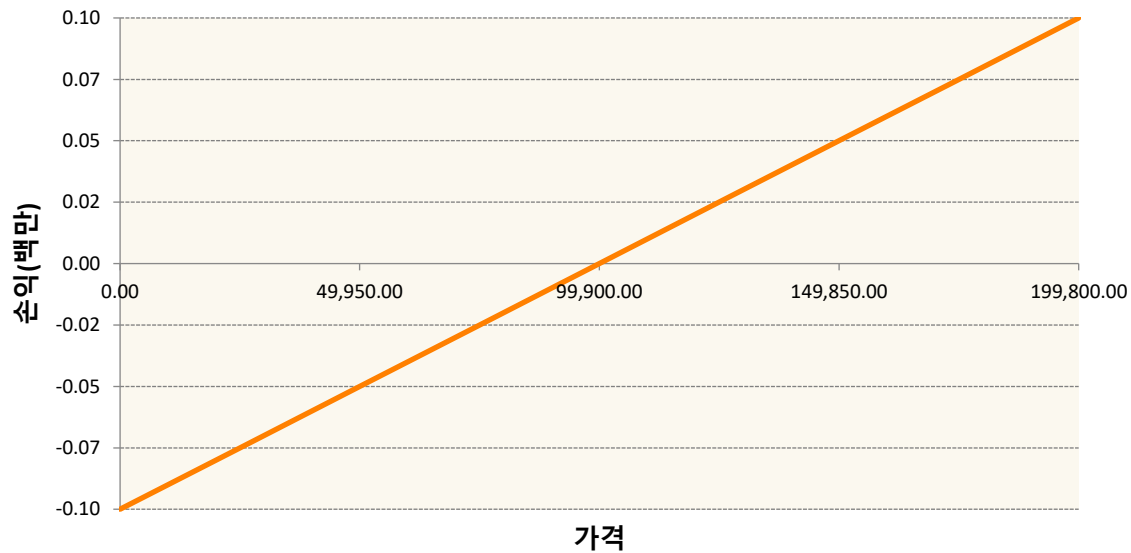
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	876	0	876	장내

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%	-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%	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 2022-07-26

기준일 2022-07-25

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

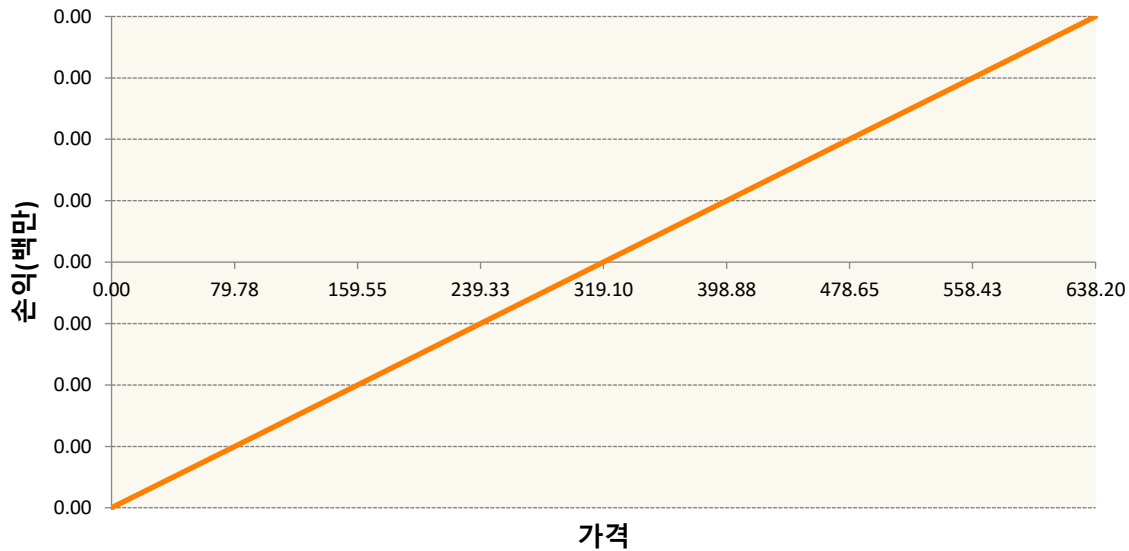
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물					70
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70	
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-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%	47	47	47	47	47	47	47	
8.00%	70	70	70	70	70	70	70	

공시일 2022-07-26

기준일 2022-07-25

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

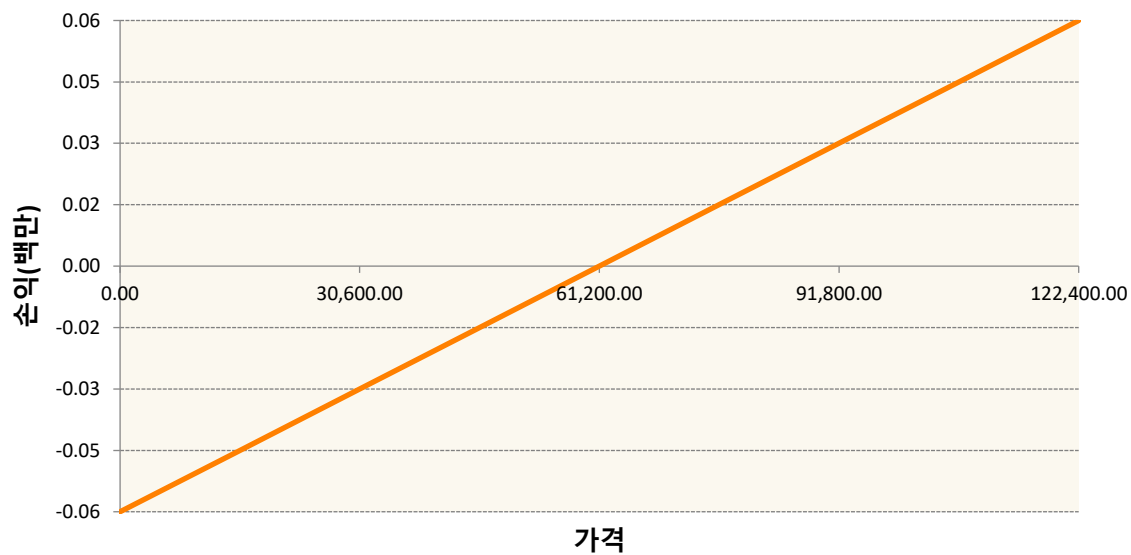
1. 계약금액

(단위:백만원)

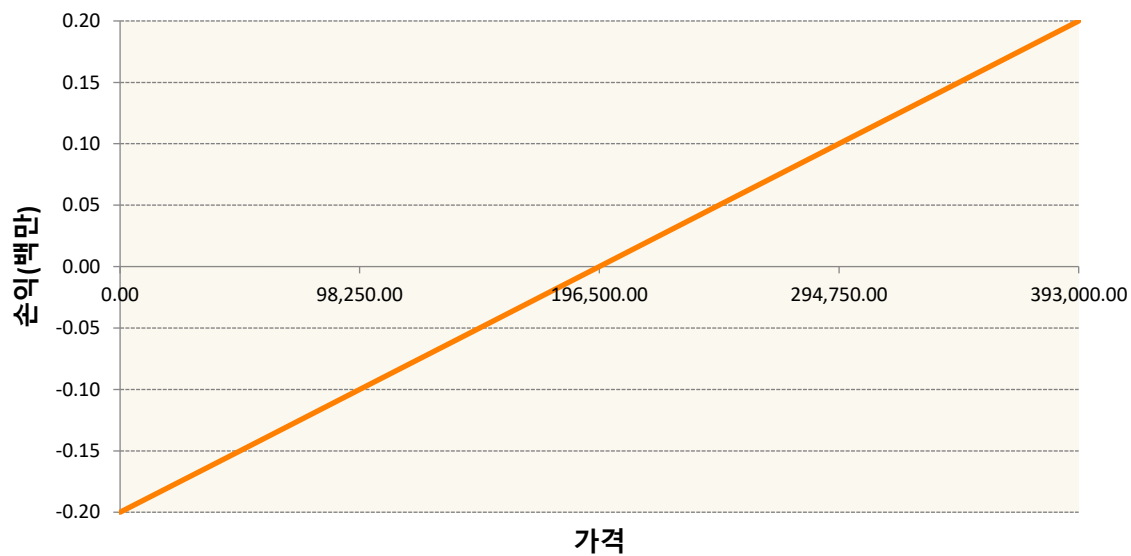
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	280	0	280	장내

2. 만기시점의 손익구조

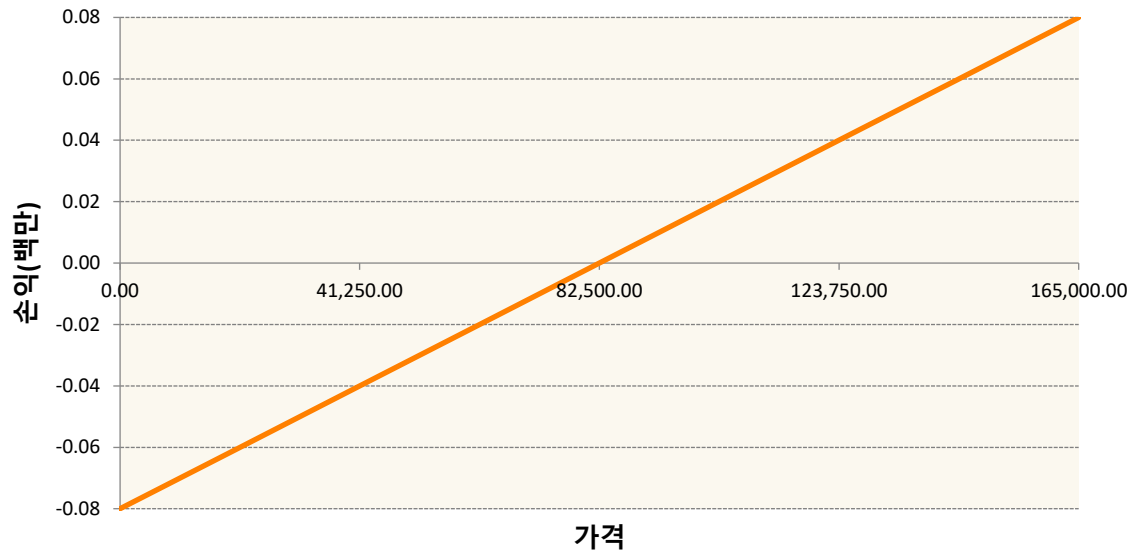
KR4111S80005-2022-08 삼성전자개별선물



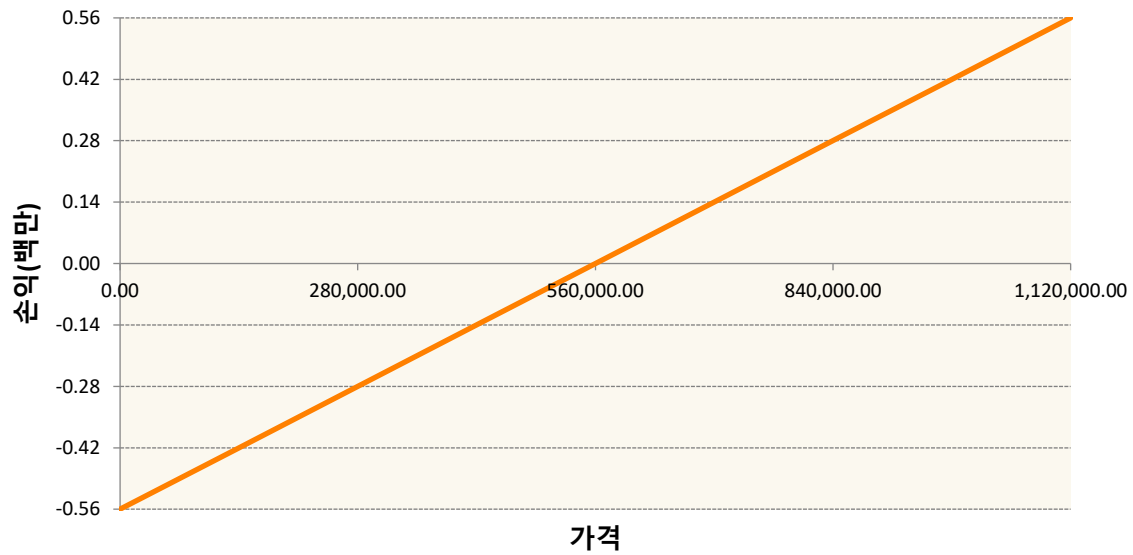
KR4116S80004-2022-08 현대차개별선물



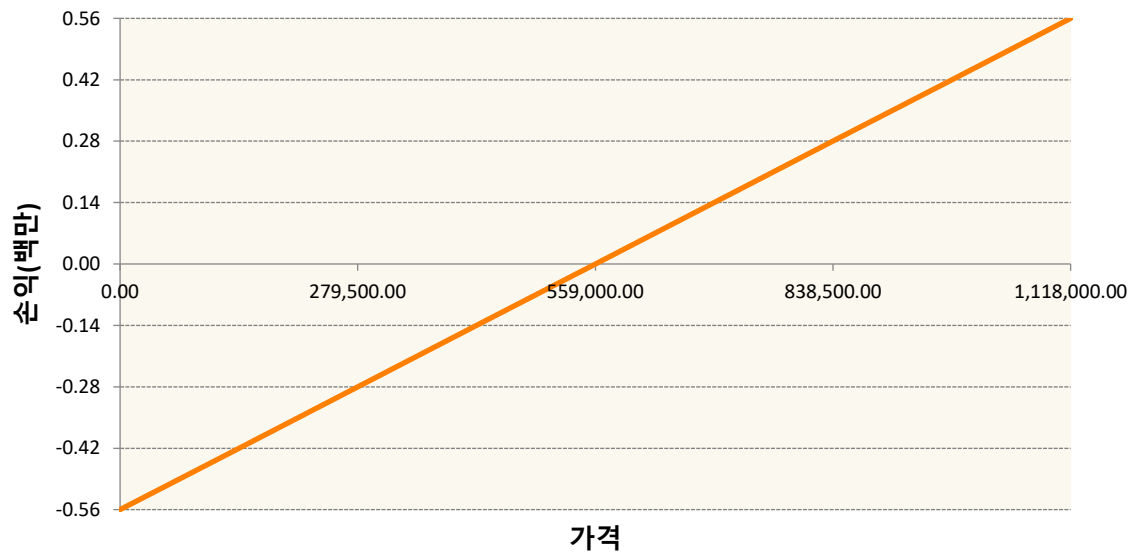
KR4119S80008-2022-08 기아개별선물



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 2022-07-26

기준일 2022-07-25

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

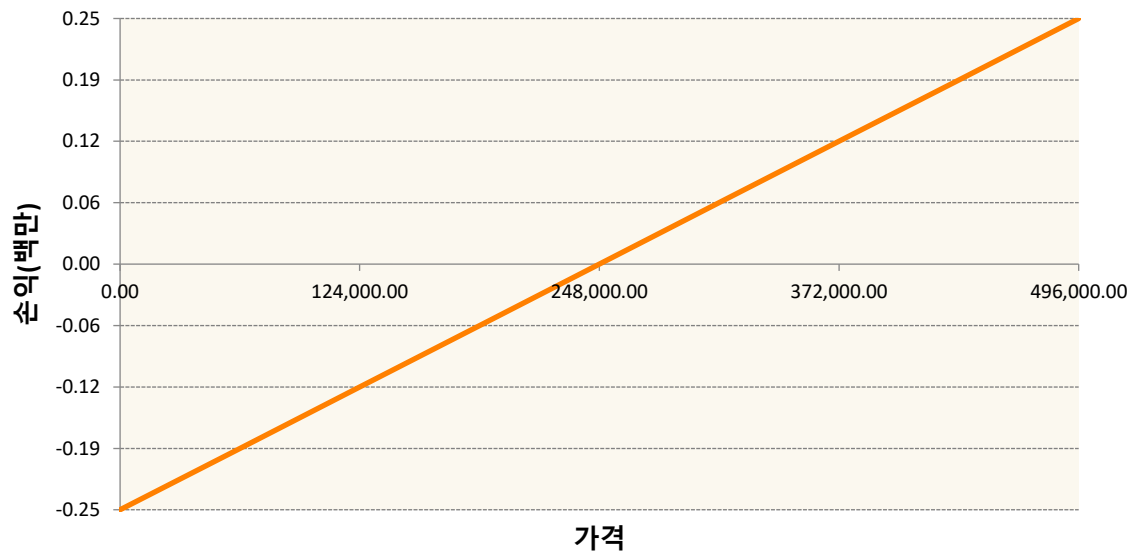
1. 계약금액

(단위:백만원)

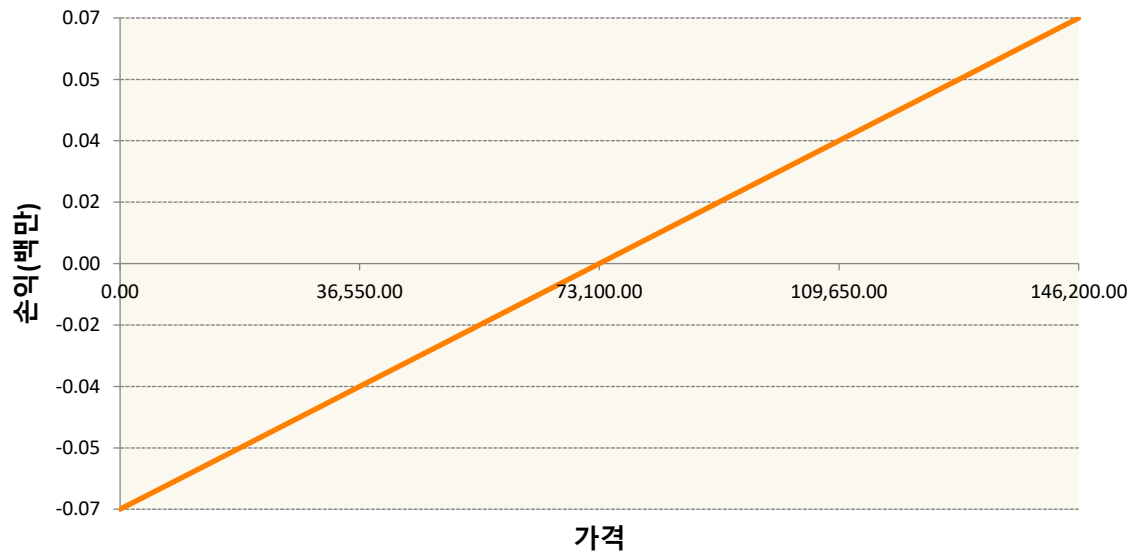
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	212	0	212	장내

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%	-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
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)

28

공시일 2022-07-26

기준일 2022-07-25

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

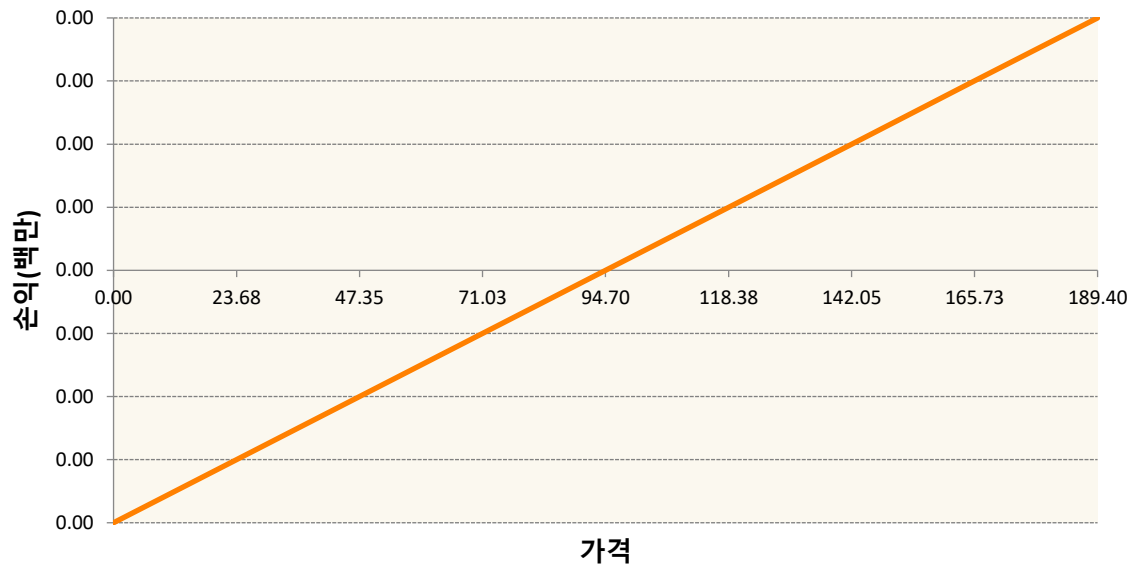
1. 계약금액

(단위:백만원)

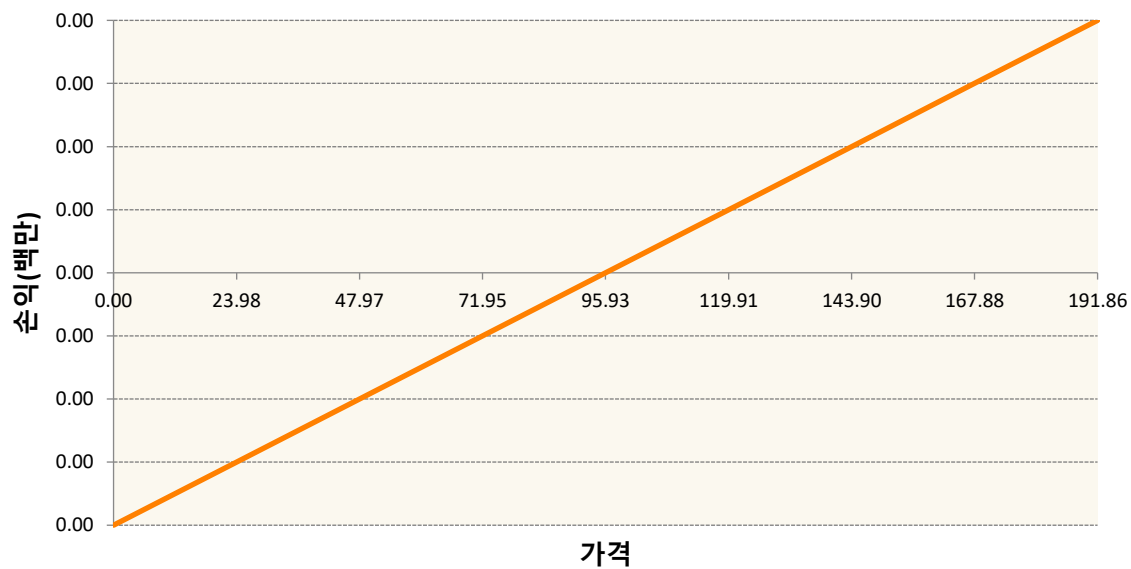
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,165	486	1,680	

2. 만기시점의 손익구조

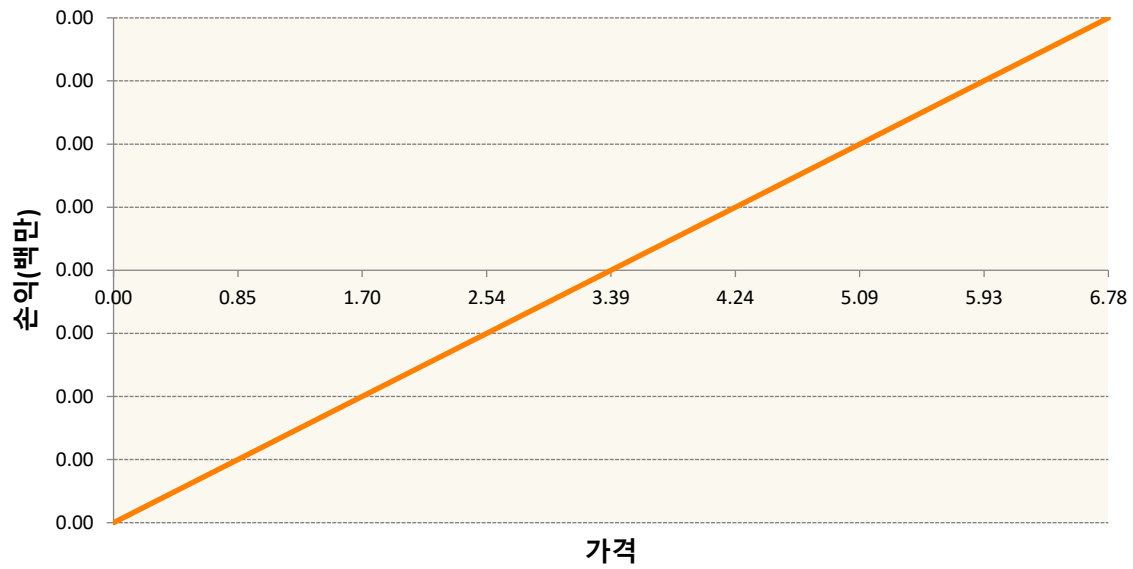
CLU2-WTI CRUDE FUTURE Sep22



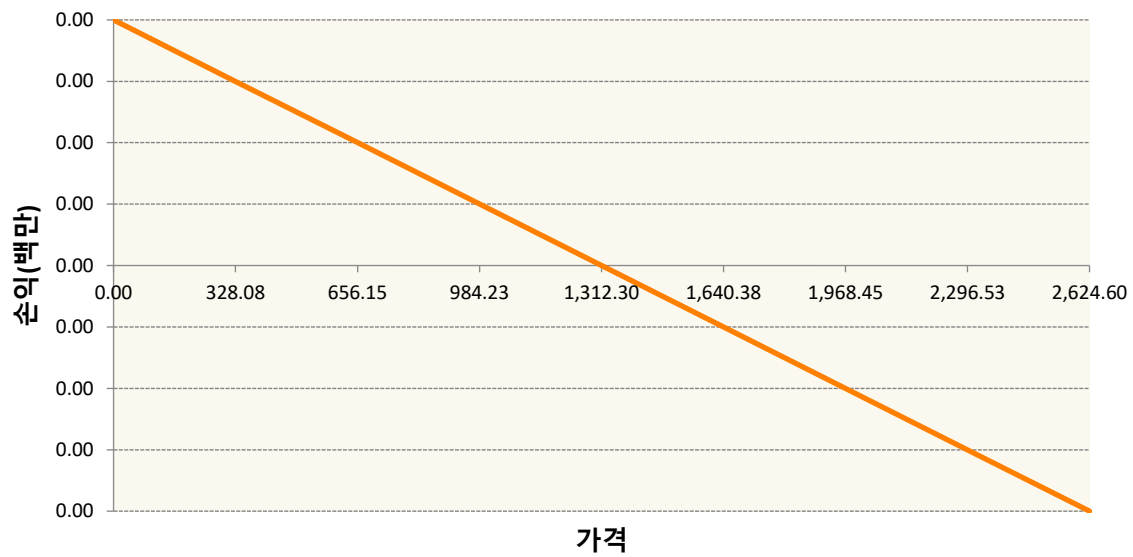
COX2-BRENT CRUDE FUTR Nov22



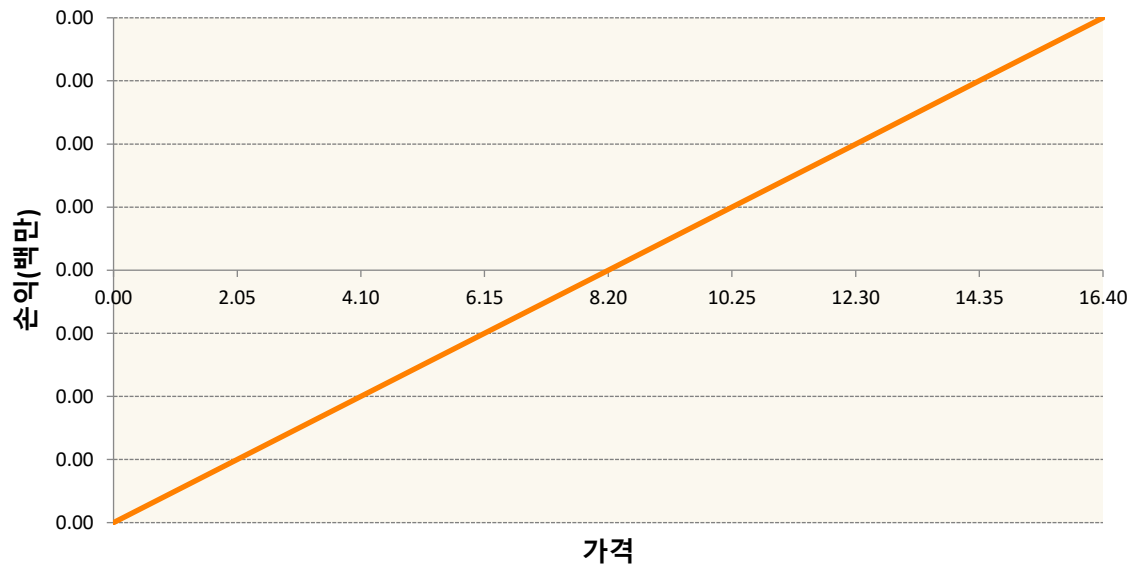
HOU2-NY Harb ULSD Fut Sep22

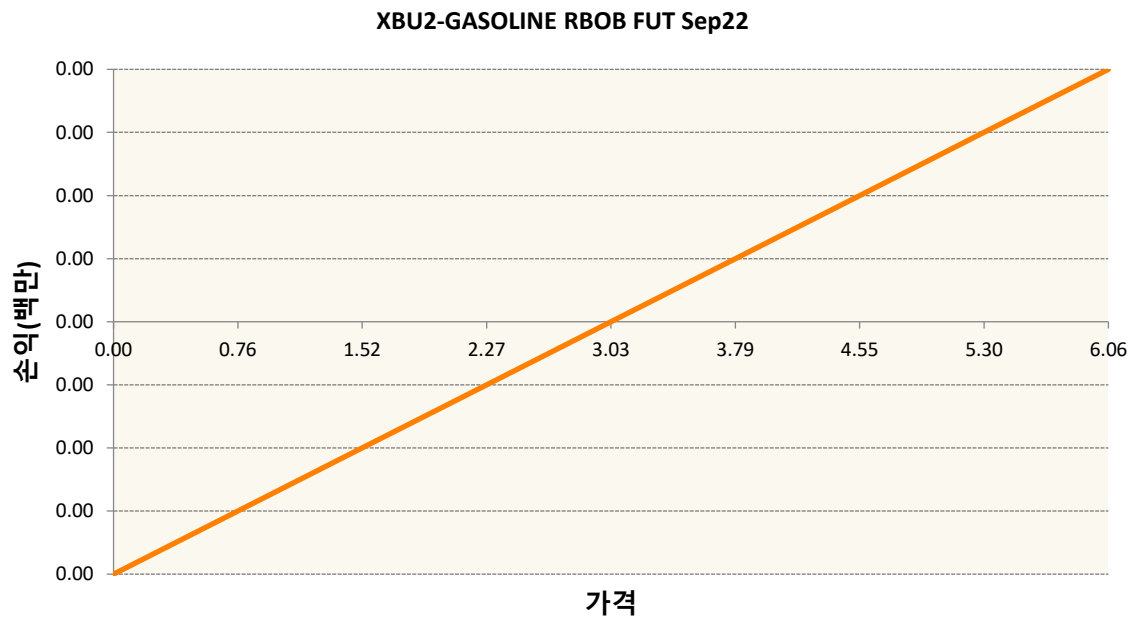
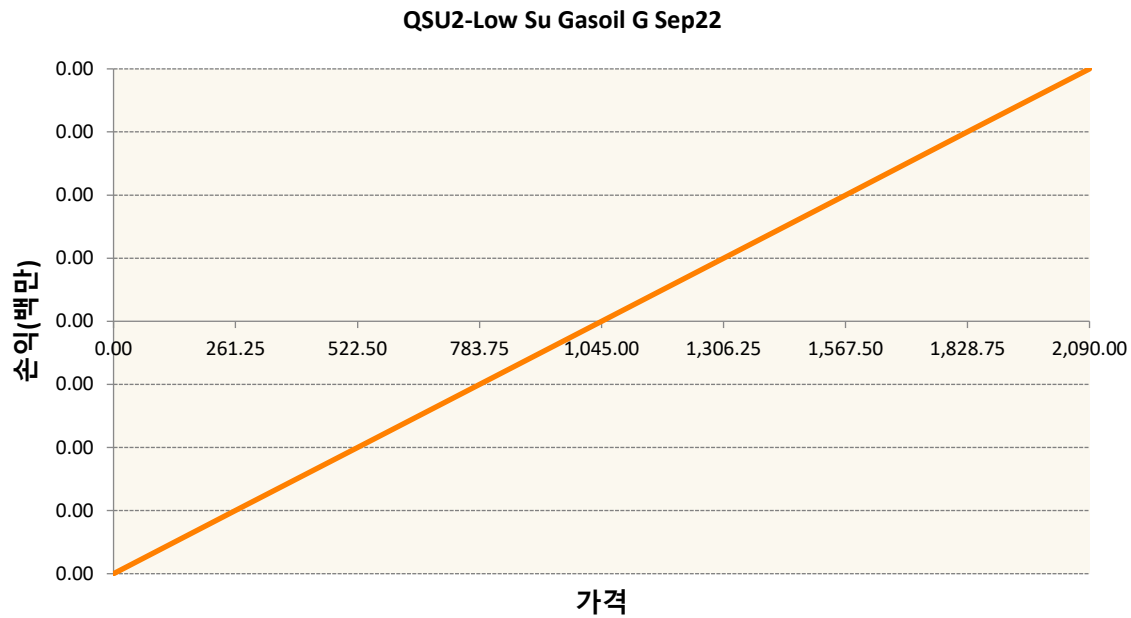


KR4175S80000-2022-08 달러선물



NGU22-NATURAL GAS FUTR Sep22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU2	WTI CRUDE FUTURE Sep22		29
COX2	BRENT CRUDE FUTR Nov22		30
HOU2	NY Harb ULSD Fut Sep22		15
KR4175S800 2022-08 달러선물			39
NGU22	NATURAL GAS FUTR Sep22		76
QSU2	Low Su Gasoil G Sep22		11
XBU2	GASOLINE RBOB FUT Sep22		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		563