

공시일 2022-08-19

기준일 2022-08-18

포커스농산물모(채권-파생형)

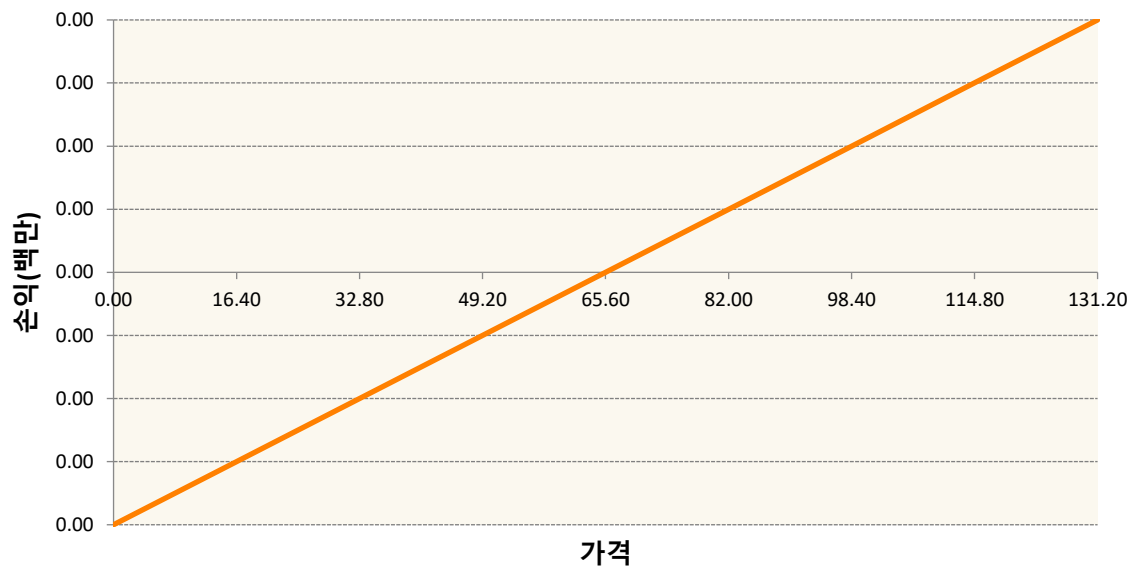
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

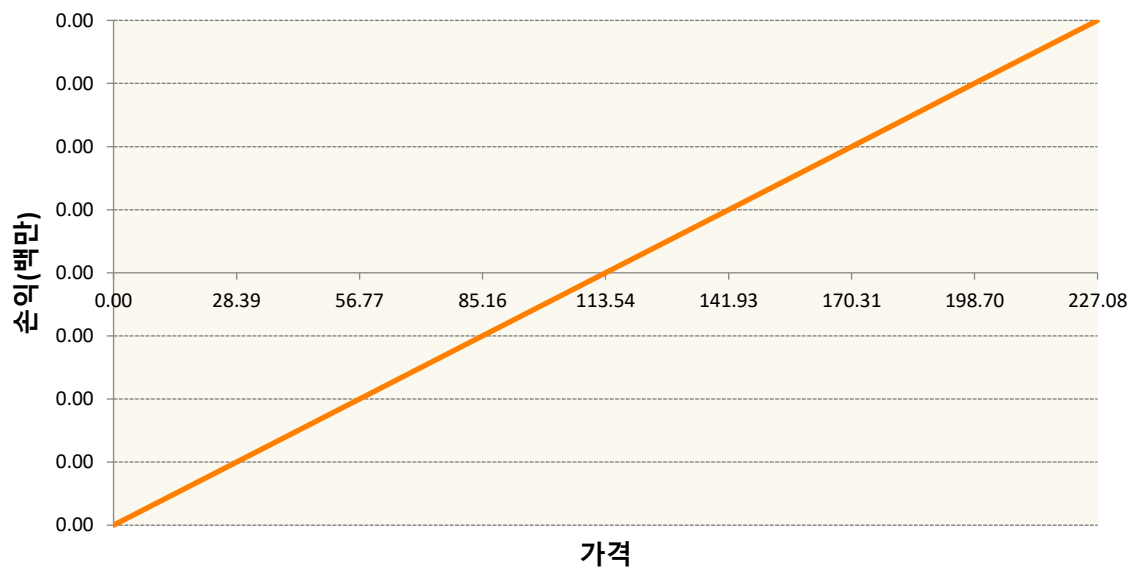
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,080	727	6,353	

2. 만기시점의 손익구조

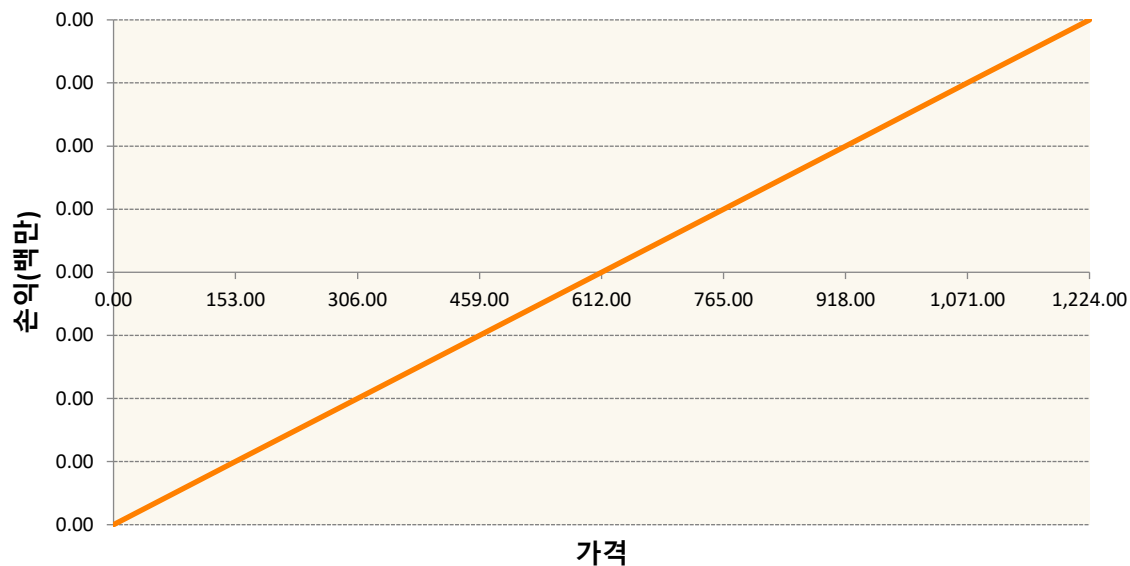
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



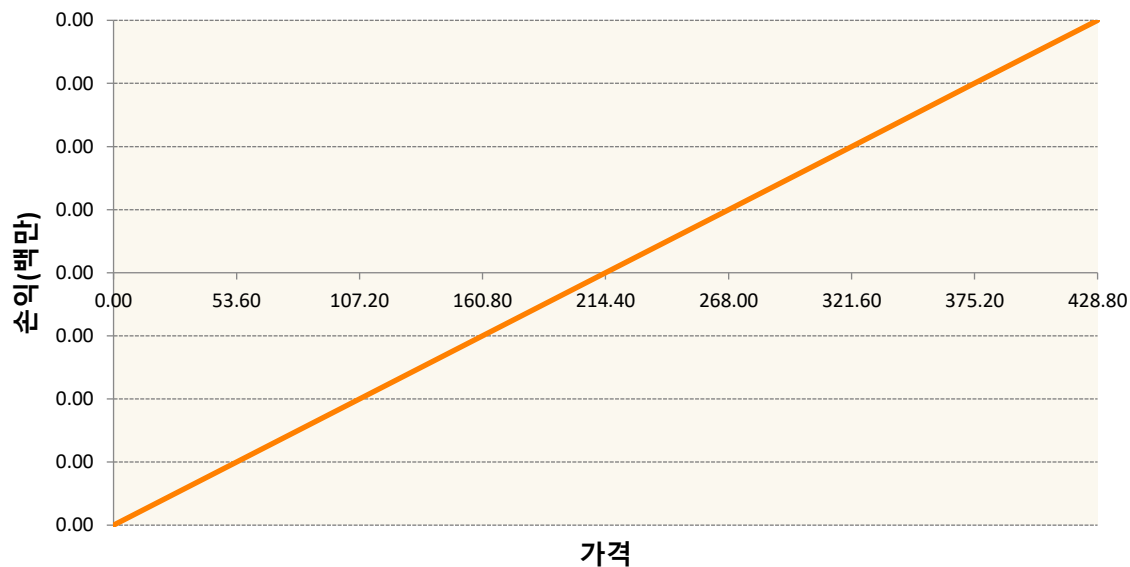
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



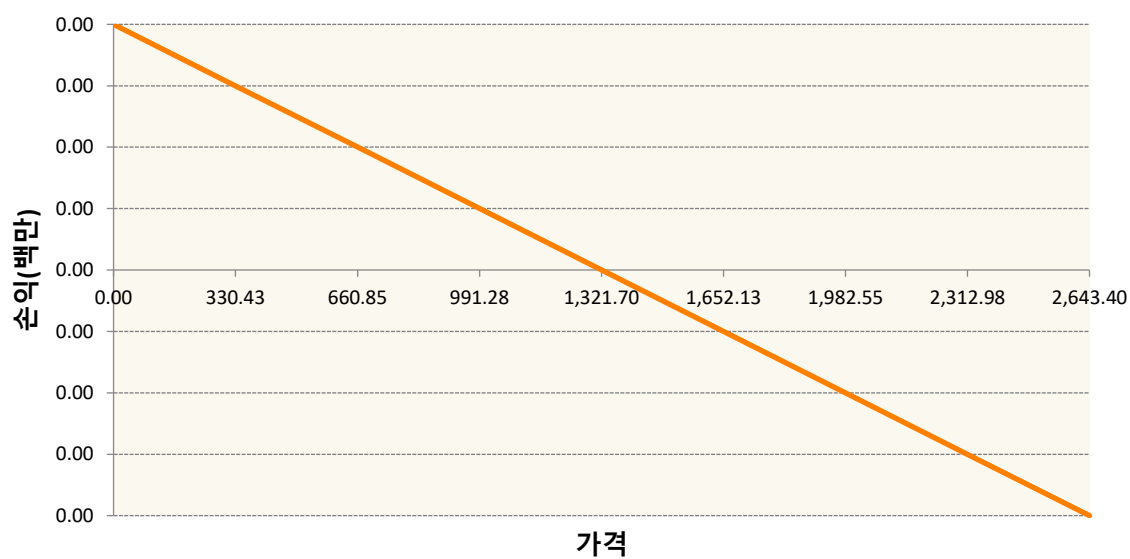
CZ2-CORN FUTURE Dec22



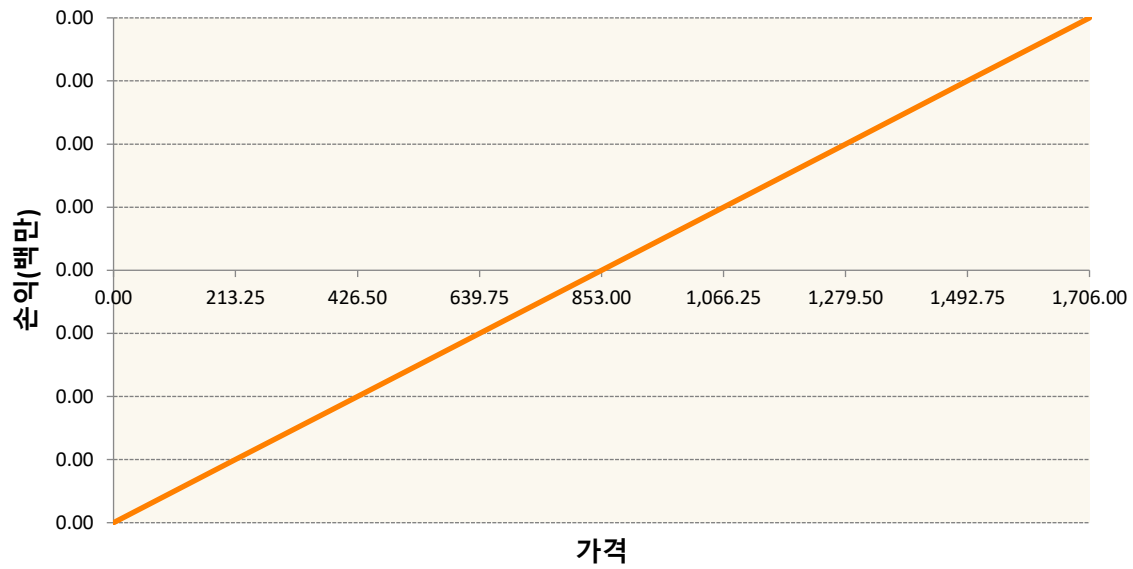
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



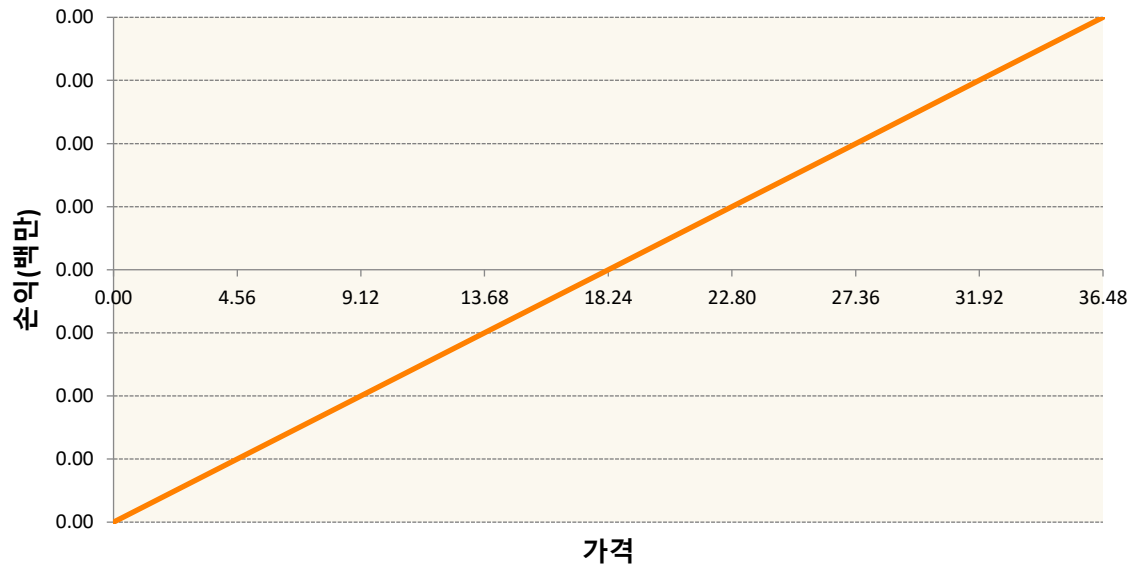
KR4175S90009-2022-09 달러선물



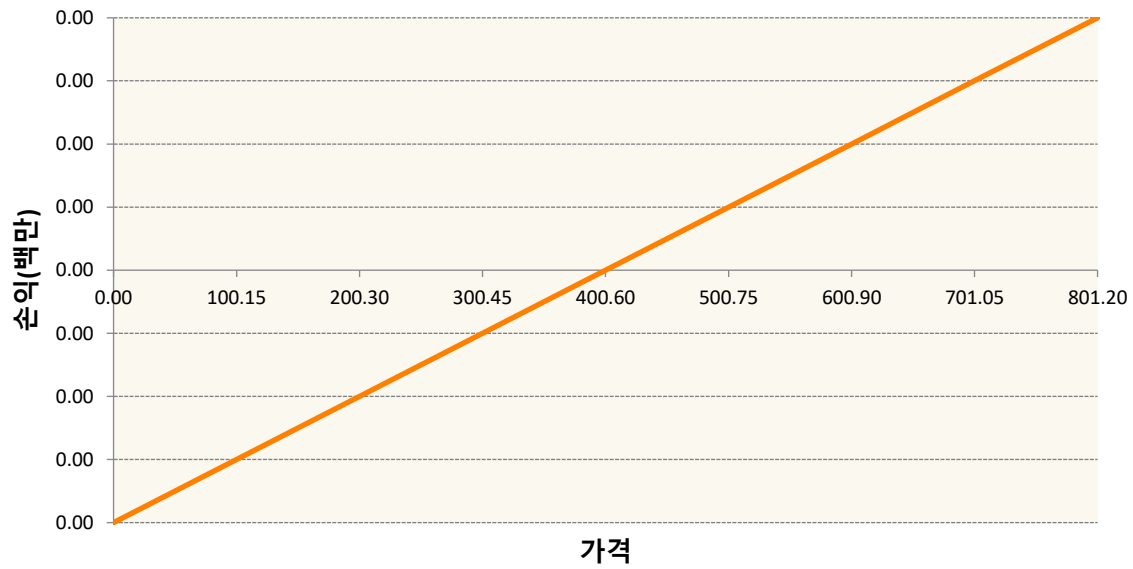
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

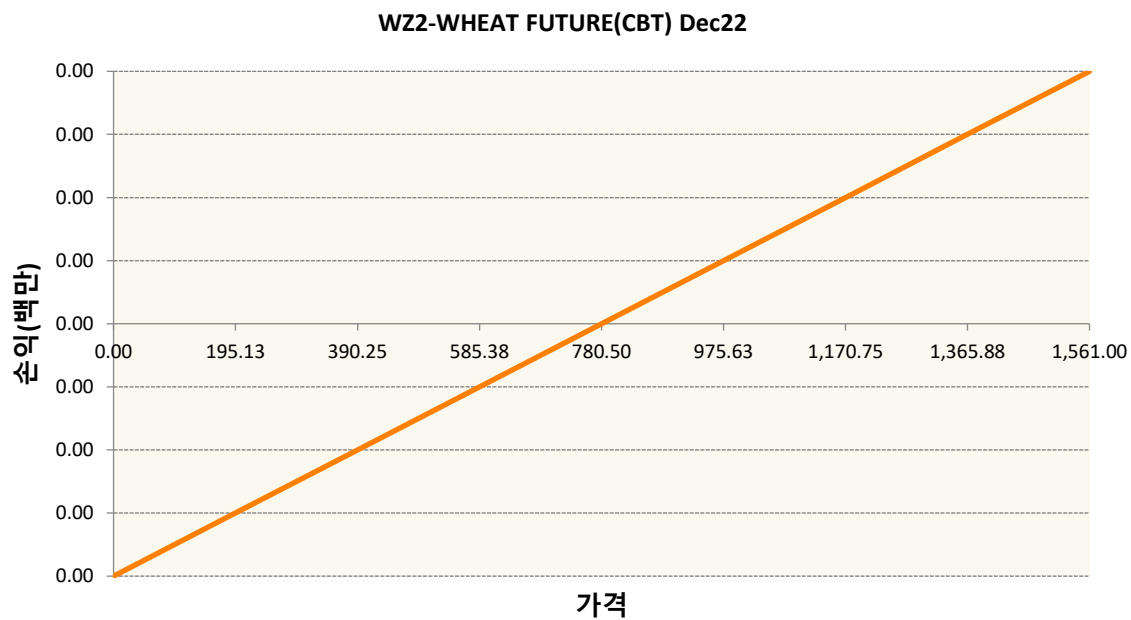
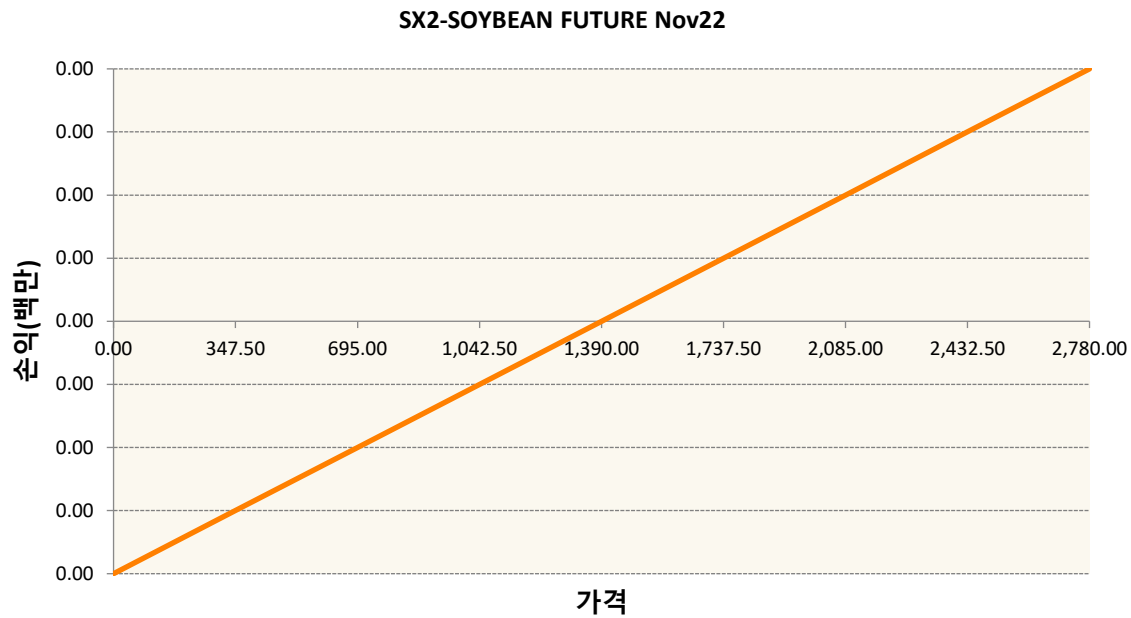


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



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	2022-08-19
기준일	2022-08-18

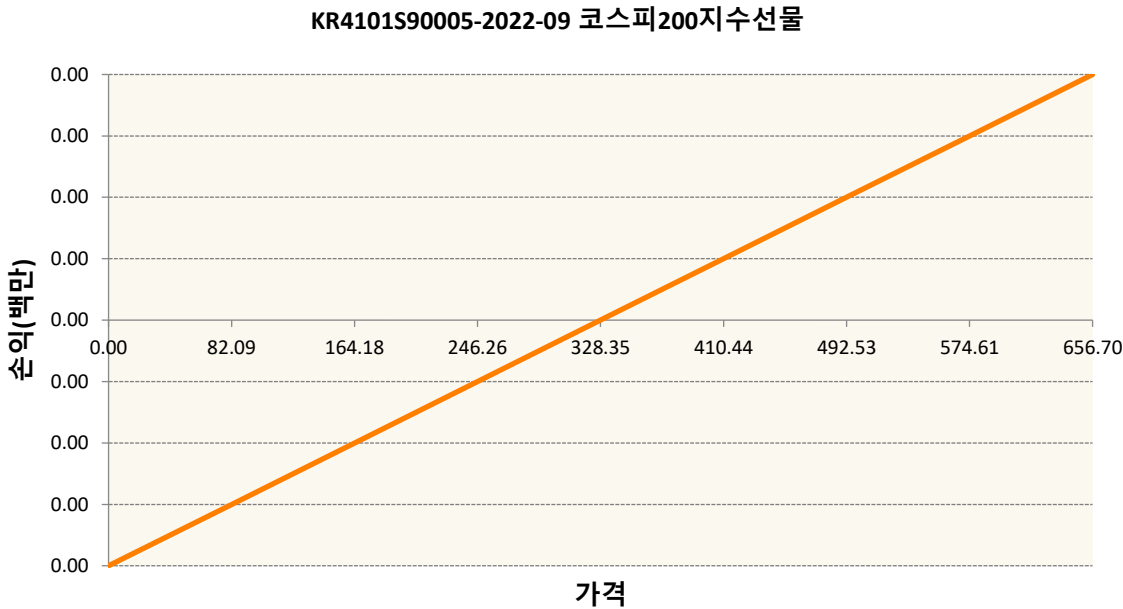
스마트인덱스모

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	1,067	0	1,067	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				85
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-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%	57	57	57	57	57	57	57
8.00%	85	85	85	85	85	85	85

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

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	382
-----------------------------	-----

* 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	2022-08-19
기준일	2022-08-18

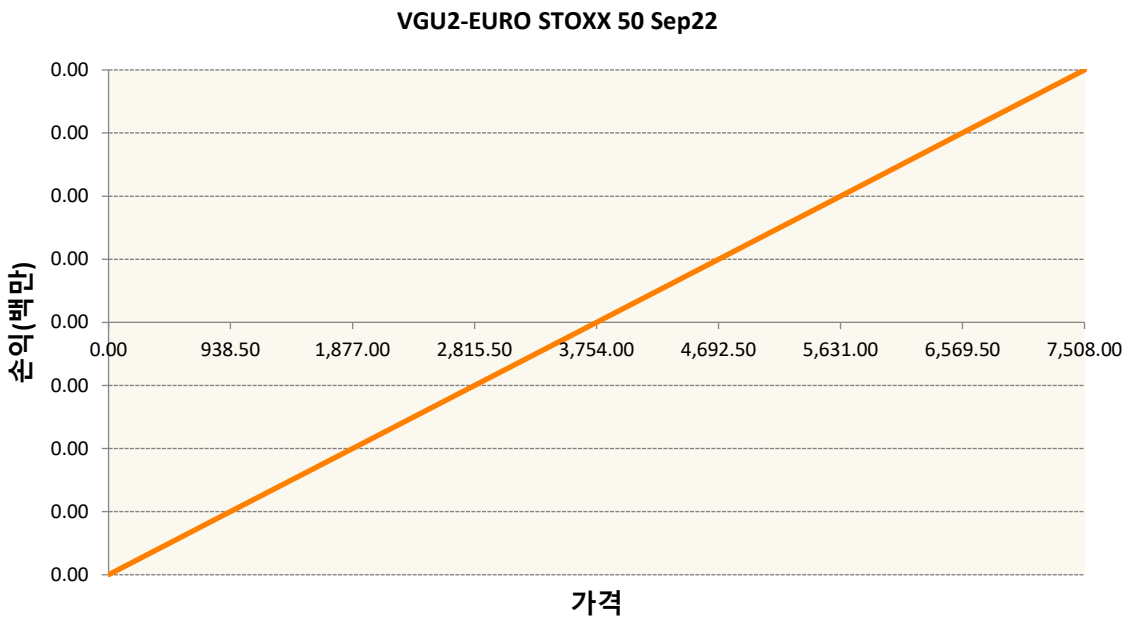
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	608	0	608	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU2	EURO STOXX 50 Sep22	49
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

49

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

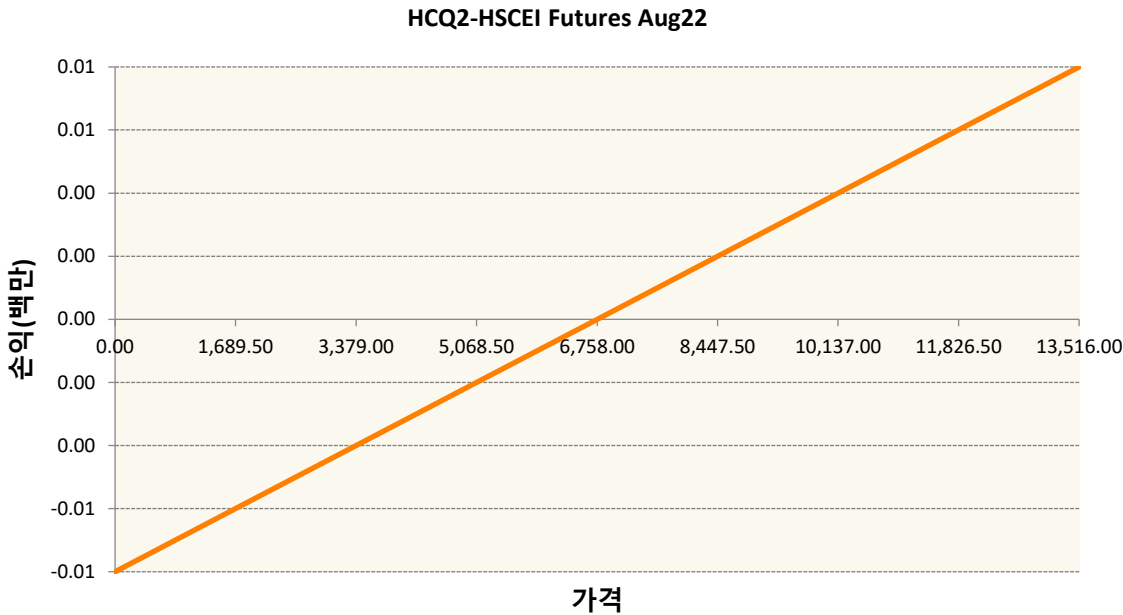
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,130	0	1,130	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ2	HSCEI Futures Aug22	90
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

132

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

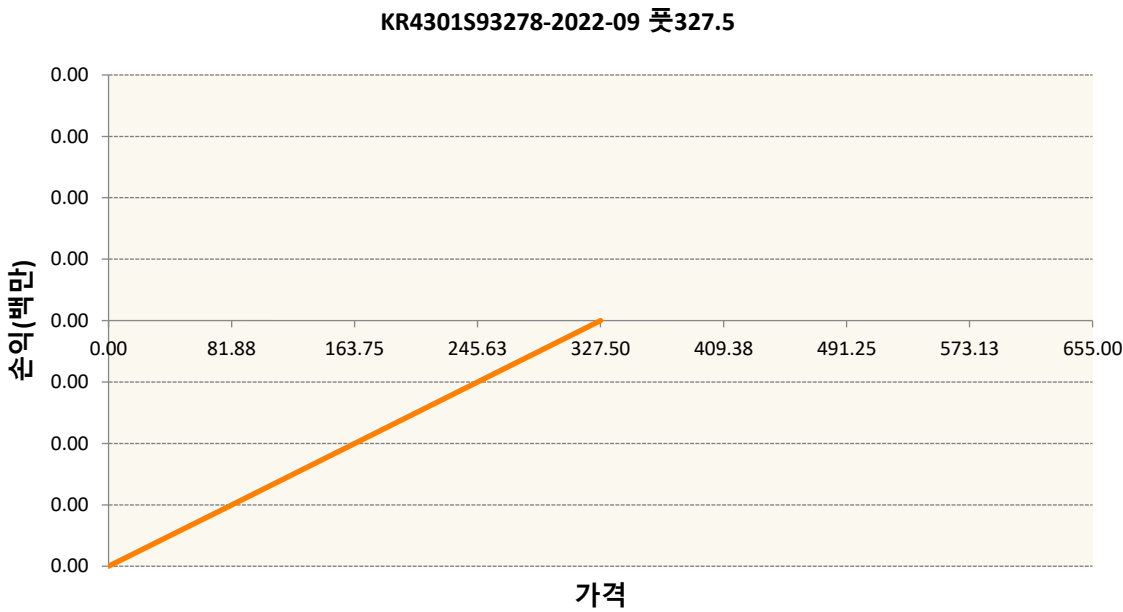
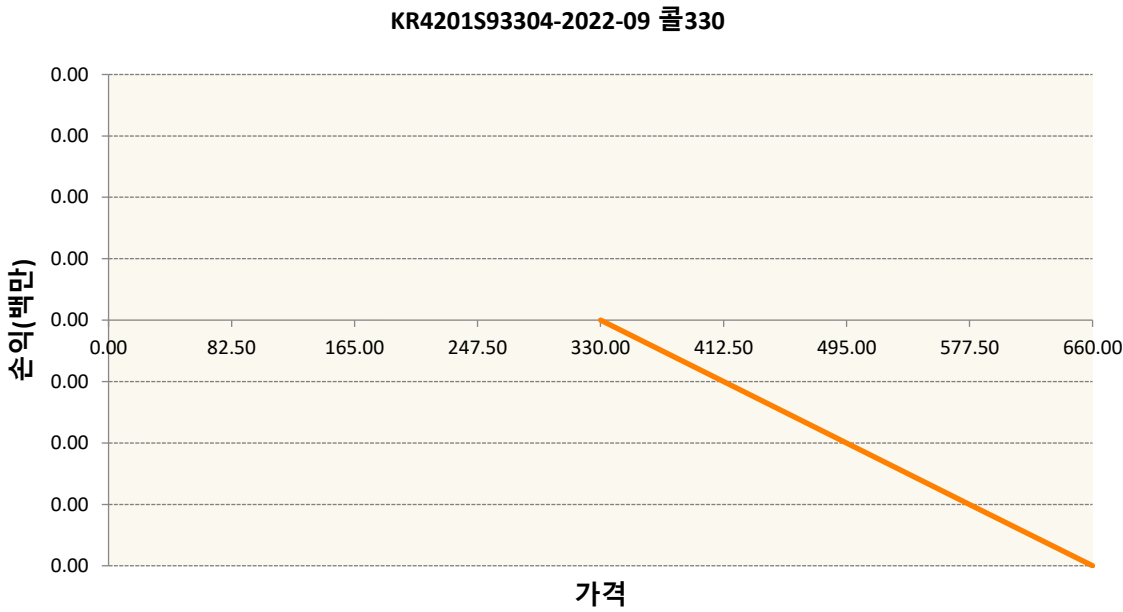
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

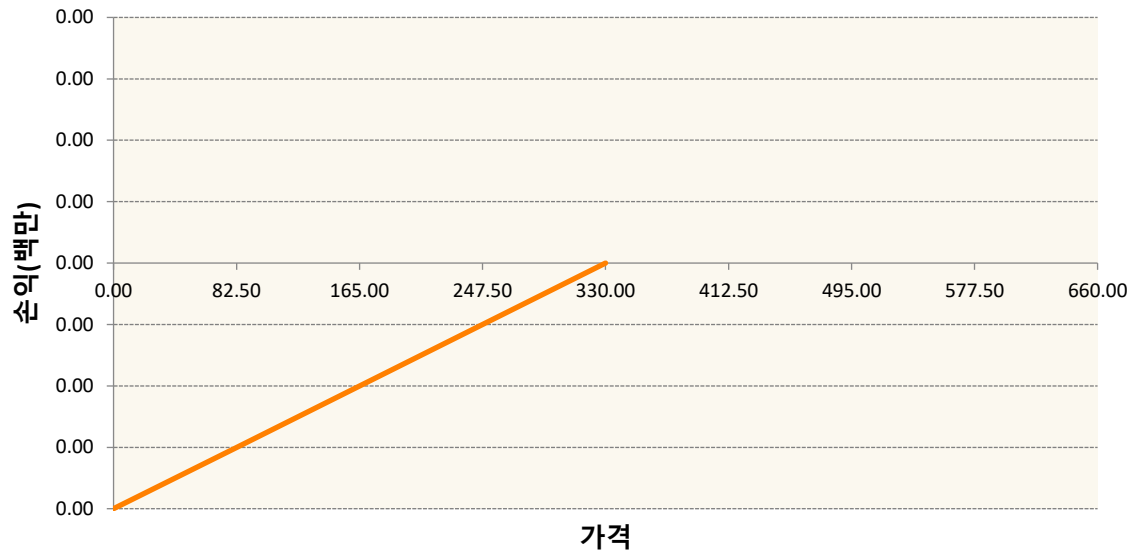
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	60,457	-60,457	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S93302-2022-09 풋330



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S93304			2022-09 콜330				3,023
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,246	1,215	1,176	1,130	1,077	1,018	954
-5.33%	1,130	1,066	996	921	840	756	669
-2.67%	854	758	658	556	453	349	243
0%	343	229	114	0	-114	-229	-343
2.67%	-436	-542	-650	-759	-870	-980	-1,092
5.33%	-1,451	-1,530	-1,614	-1,704	-1,797	-1,894	-1,993
8.00%	-2,628	-2,676	-2,732	-2,796	-2,866	-2,942	-3,023
KR4301S93278			2022-09 풋327.5				120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-106	-108	-110	-112	-114	-117	-120
-5.33%	-58	-61	-64	-67	-71	-74	-78
-2.67%	-17	-21	-25	-29	-34	-38	-43
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	34	30	25	21	17	12	8
5.33%	44	42	38	35	32	28	24
8.00%	49	48	46	43	41	38	35
KR4301S93302			2022-09 풋330				500
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-452	-457	-463	-471	-480	-489	-500
-5.33%	-252	-262	-274	-286	-300	-313	-328
-2.67%	-78	-94	-111	-127	-144	-162	-179
0%	56	38	19	0	-19	-38	-56

2.67%	147	130	112	94	76	58	39
5.33%	199	186	172	158	142	126	110
8.00%	224	217	207	197	185	173	160

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,483

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

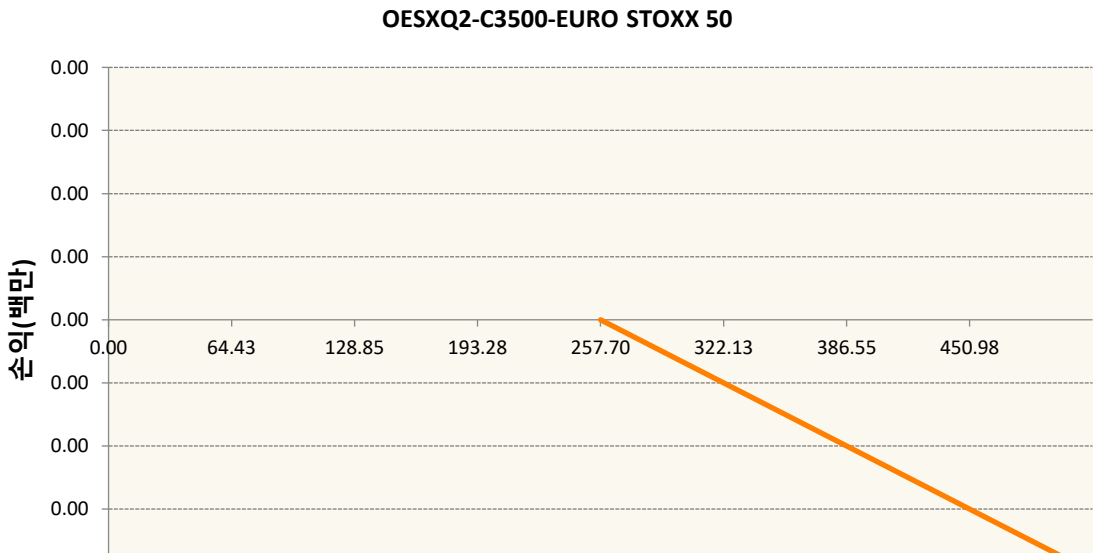
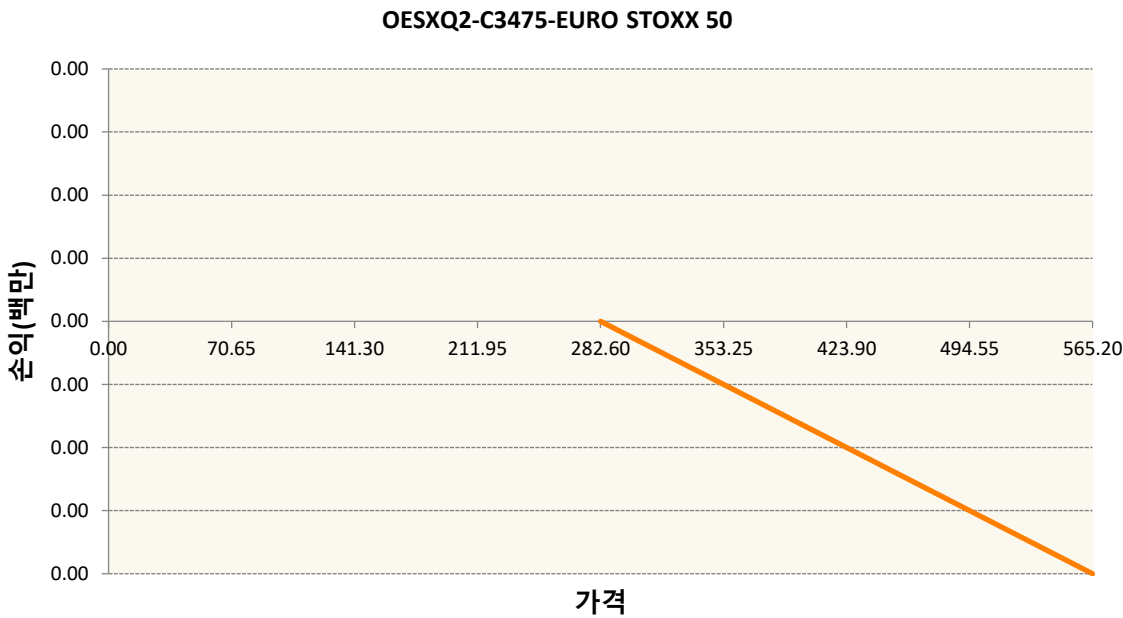
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

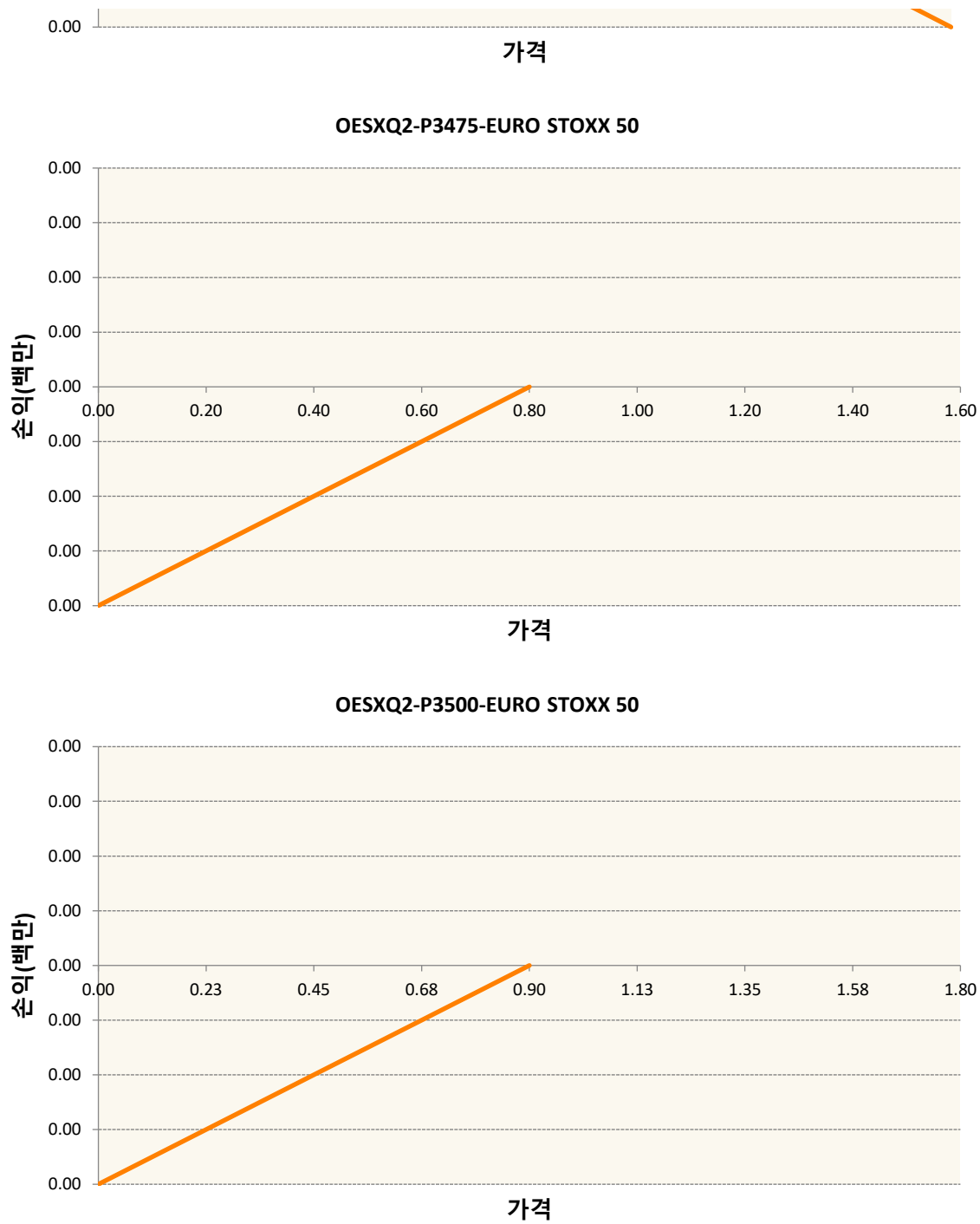
1. 계약금액

(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	79	-79	장내
누계	지수	스왑	4	0	4	장외
누계	통화	선도	0	1,476	-1,476	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

9
86
32
6
1
0.01
0

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

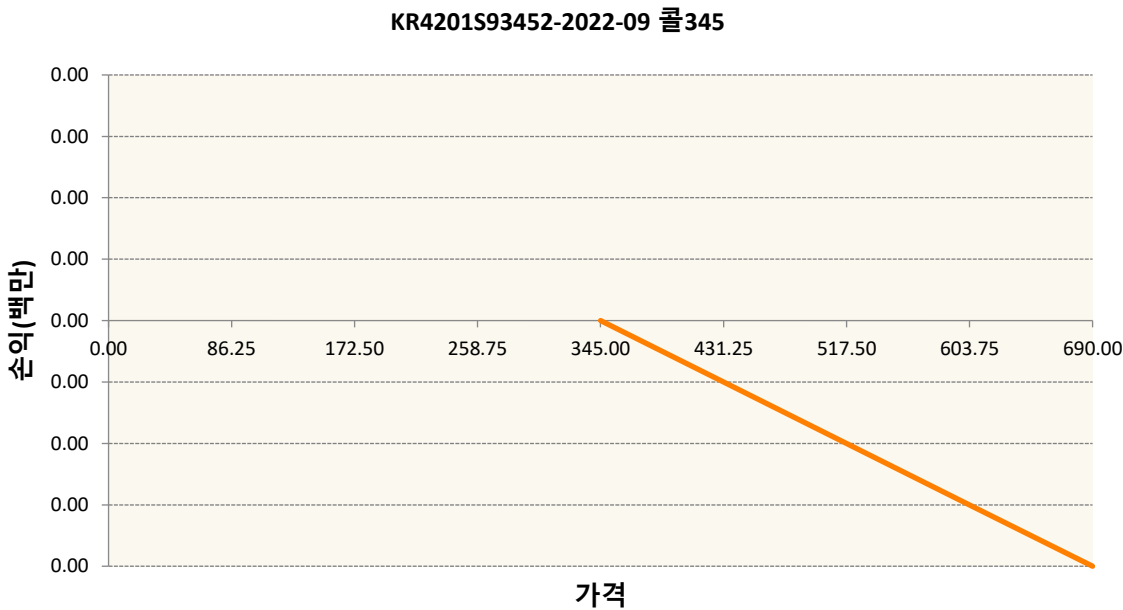
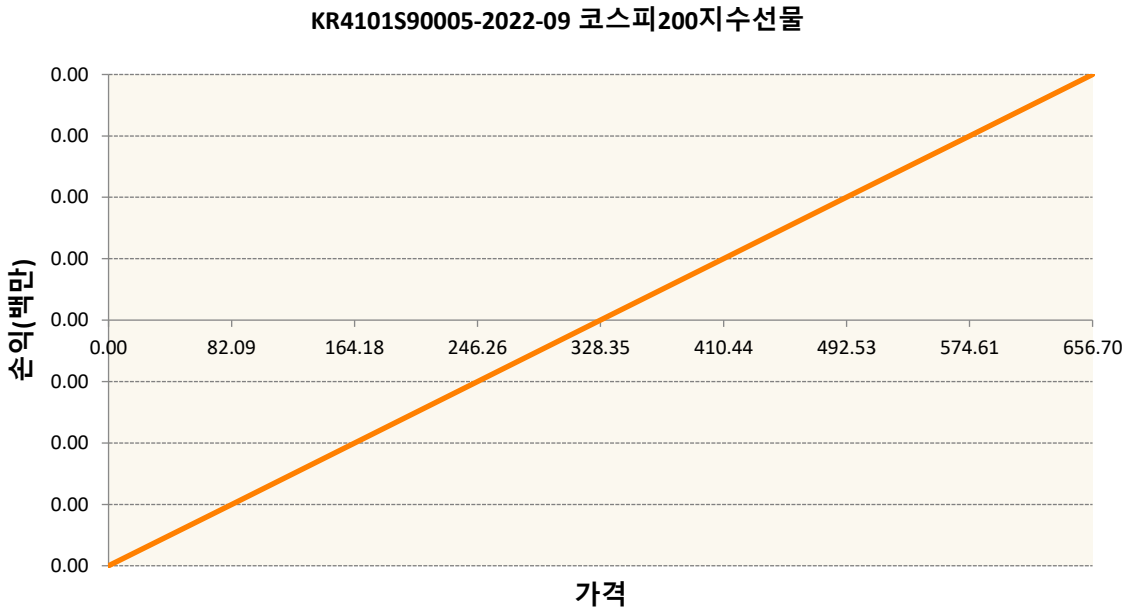
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

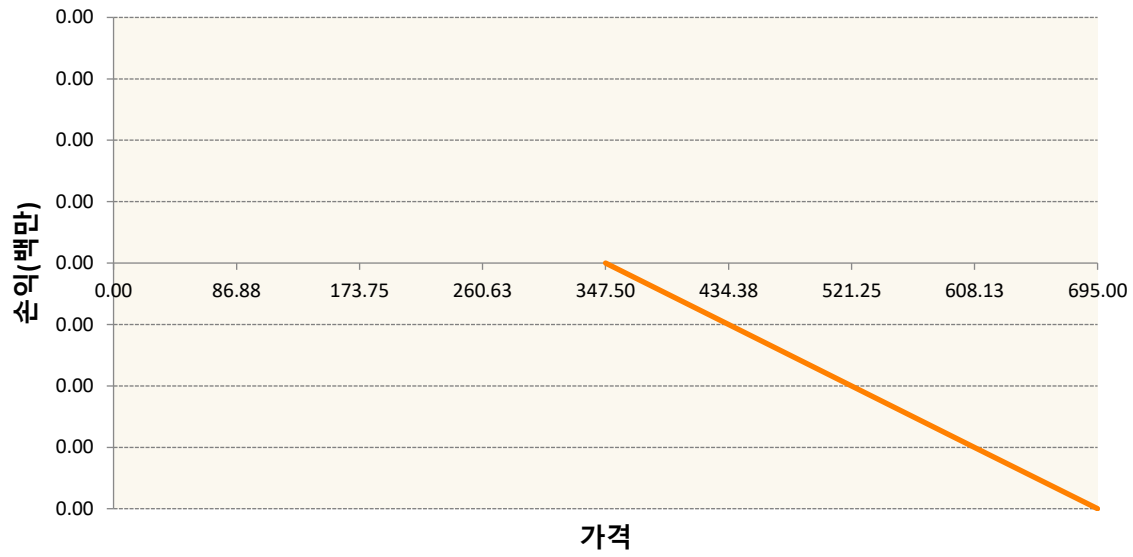
(단위:백만원)

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	410	0	410	장내
누계	유가증권	옵션	329	4,503	-4,174	장내

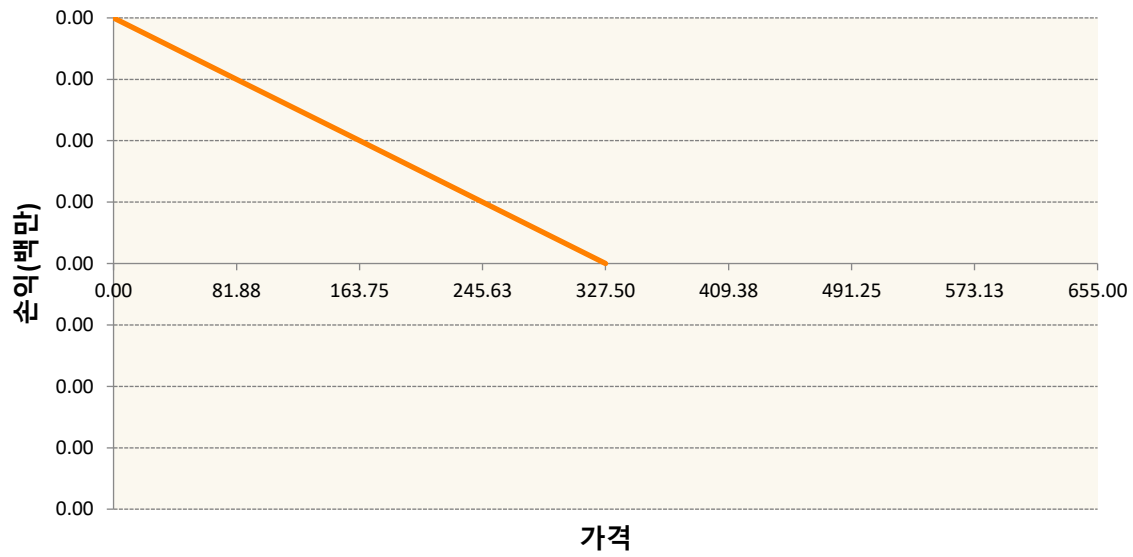
2. 만기시점의 손익구조



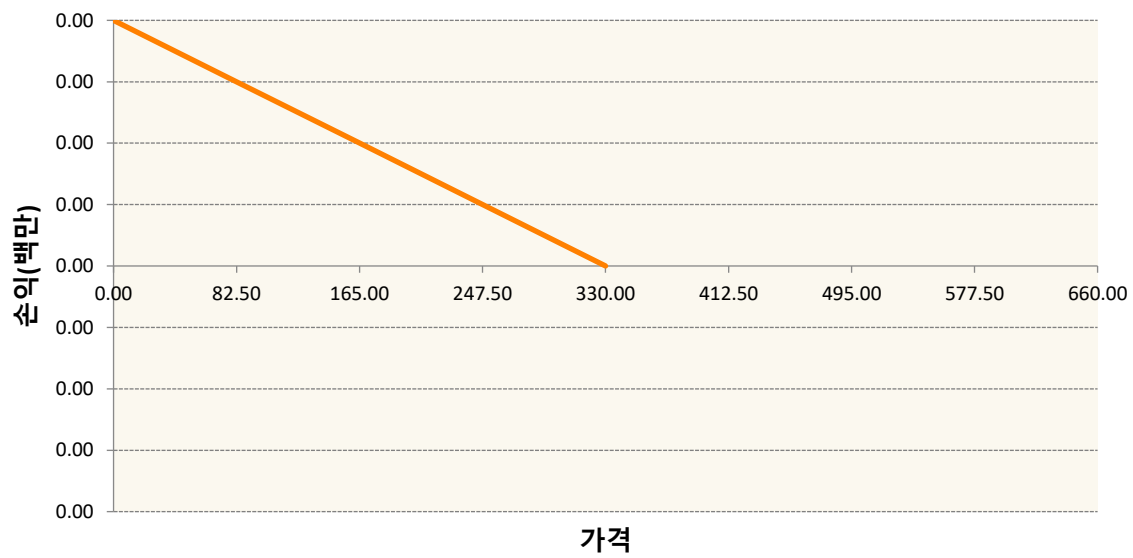
KR4201S93478-2022-09 콜347.5



KR4301S93278-2022-09 풋327.5



KR4301S93302-2022-09 풋330



(단위:백만원)

KR4101S90005				2022-09 코스피200지수선물				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	-33
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-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%	22	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	33	33	33	33	33	33	33	33
KR4201S93452				2022-09 콜345				83
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	19	19	18	18	17	16	15	
-5.33%	18	18	17	15	14	12	10	
-2.67%	16	14	12	10	7	5	2	
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11	
2.67%	-4	-8	-12	-16	-20	-25	-29	
5.33%	-26	-31	-35	-40	-44	-49	-53	
8.00%	-58	-62	-66	-70	-74	-79	-83	
KR4201S93478				2022-09 콜347.5				98
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	20	20	20	19	18	17	16	
-5.33%	20	19	18	16	15	13	11	
-2.67%	17	16	13	11	8	5	1	
0%	11	8	4	0	-4	-9	-13	
2.67%	-3	-8	-13	-18	-23	-29	-34	
5.33%	-28	-34	-39	-45	-51	-56	-62	
8.00%	-65	-70	-76	-81	-87	-92	-98	
KR4301S93278				2022-09 풋327.5				5
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	4	4	4	4	5	5	5	
-5.33%	2	2	3	3	3	3	3	
-2.67%	1	1	1	1	1	2	2	
0%	-1	0	0	0	0	0	1	
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0	
5.33%	-2	-2	-2	-1	-1	-1	-1	
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-1	
KR4301S93302				2022-09 풋330				15
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	14	15	15
-5.33%	8	8	8	9	9	9	10
-2.67%	2	3	3	4	4	5	5
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-4	-3	-3	-2	-2	-1
5.33%	-6	-6	-5	-5	-4	-4	-3
8.00%	-7	-6	-6	-6	-6	-5	-5

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

(단위:백만원)

191

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

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	8,202	0	8,202	

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	2022-08-19
기준일	2022-08-18

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	6,937	0	6,937	

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	2022-08-19
기준일	2022-08-18

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	21,702	0	21,702	
누계	통화	선도	0	21,626	-21,626	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C6P·KRW/USD 29-08-22E		591
FXW213C6P·KRW/USD 27-09-22E		592
FXW213C7R·KRW/USD 27-10-22E		453
FXW213C8G·KRW/USD 29-08-22E		95

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

(단위:백만원)

675

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

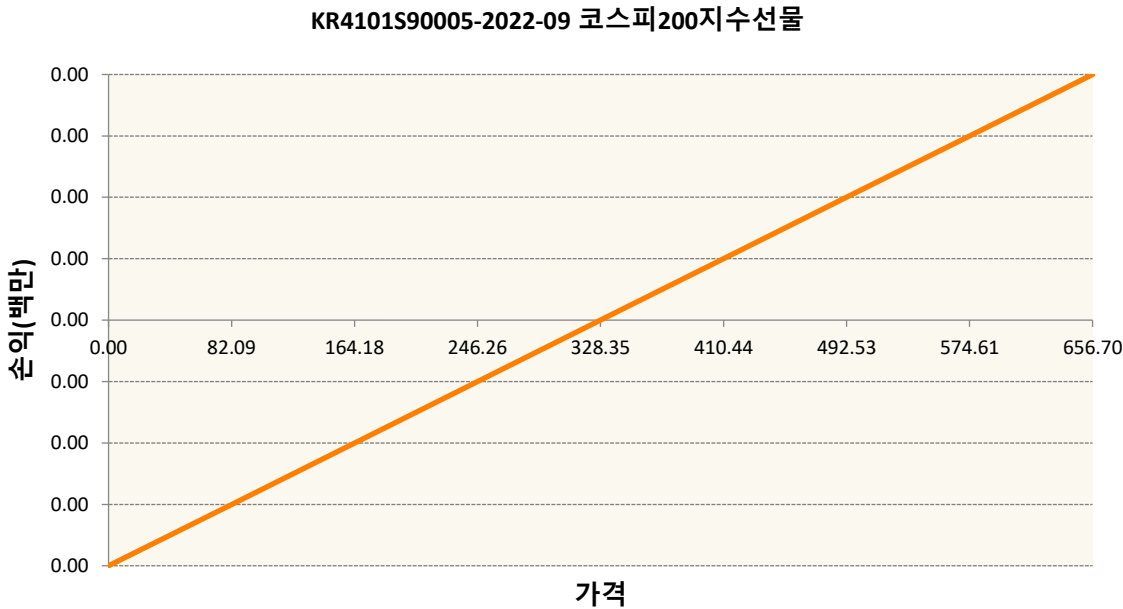
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	410	0	410	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				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

공시일 2022-08-19

기준일 2022-08-18

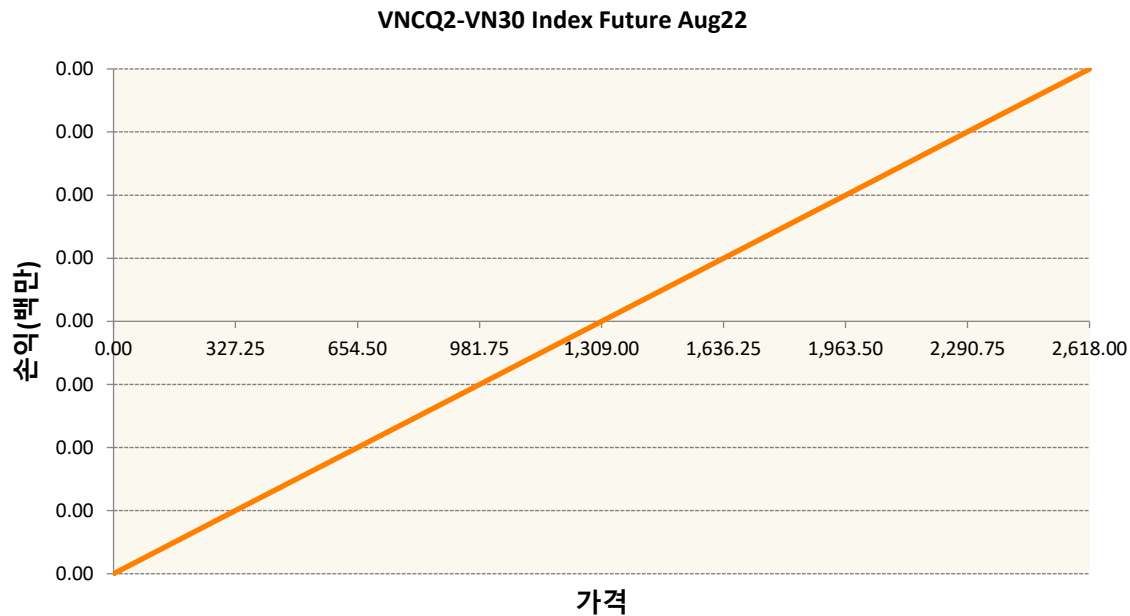
스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

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	867	0	867	
누계	유가증권	스왑	1,651	0	1,651	장외
누계	통화	선도	0	1,006	-1,006	장외

2. 만기시점의 손익구조



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
FXW213C84 KRW/EUR 21-10-22E	5
VNCQ2 VN30 Index Future Aug22	69

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

(단위:백만원)

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

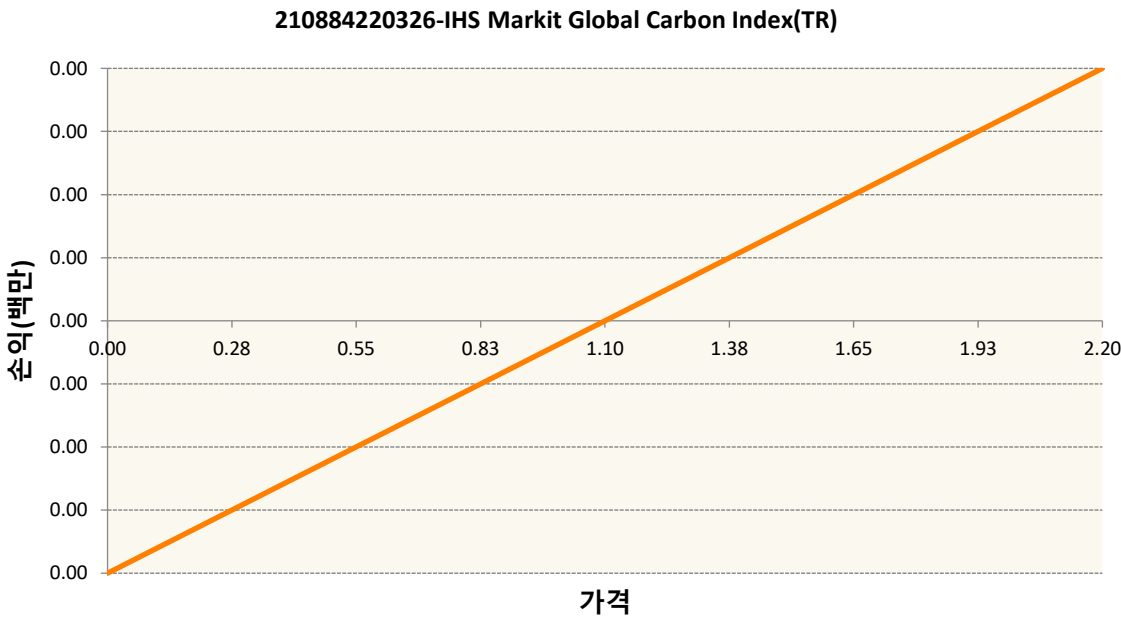
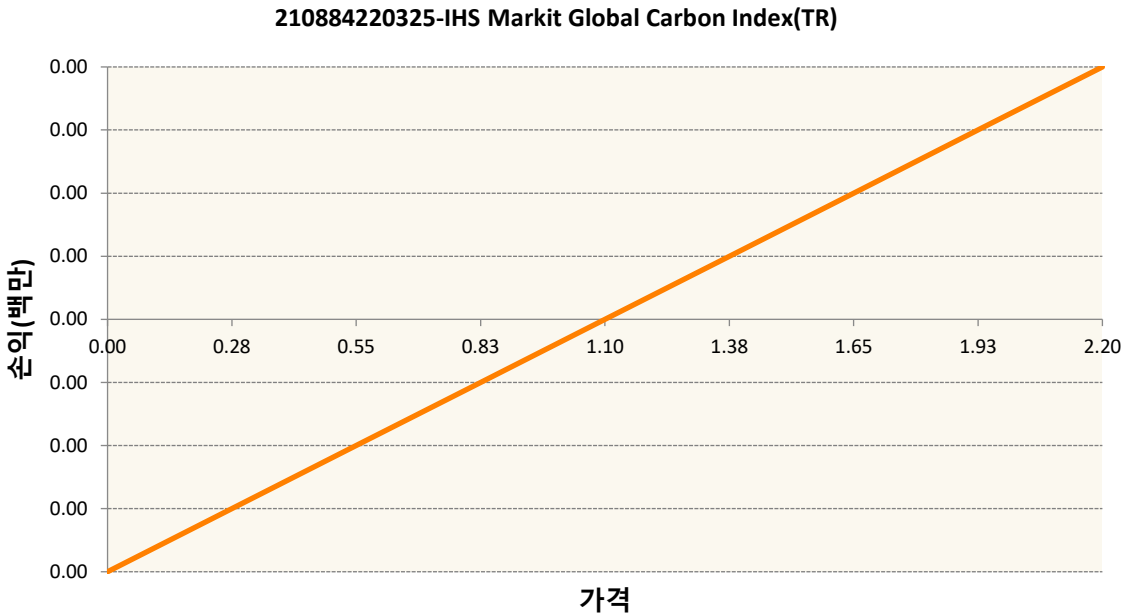
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

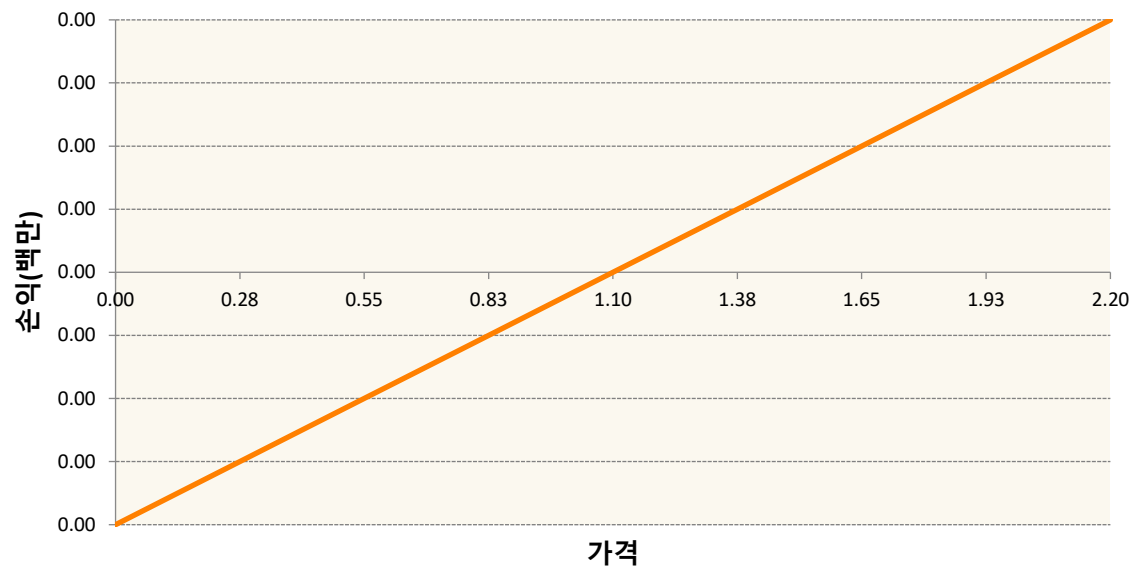
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	44,053	0	44,053	

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)

220

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

3,187

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

110

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

(단위:백만원)

6,481

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

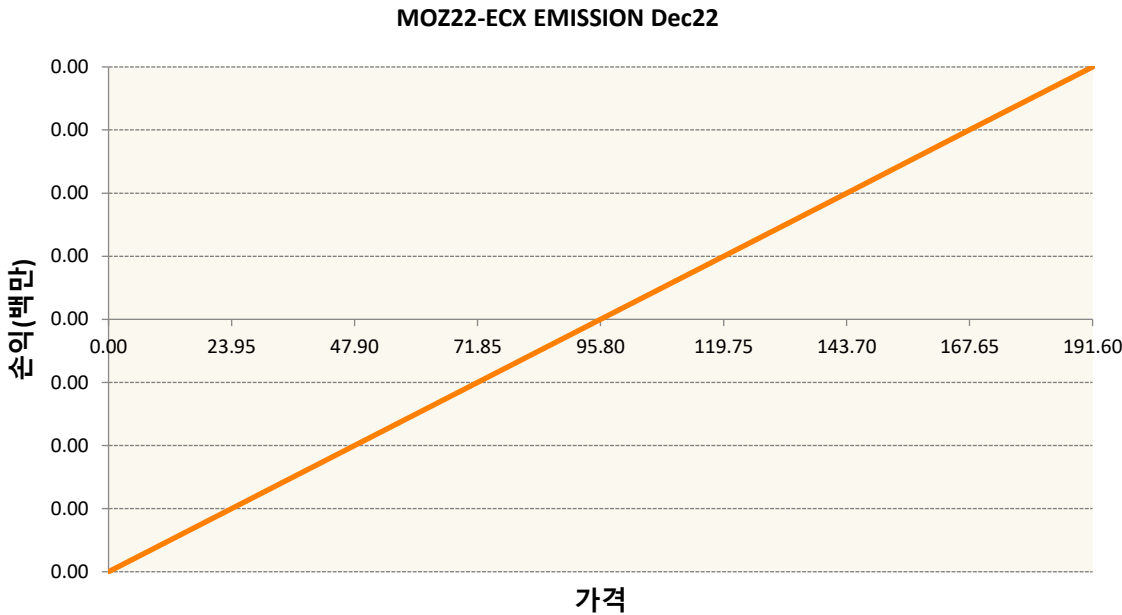
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	17,029	0	17,029	
누계	통화	선도	0	7,067	-7,067	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C7S KRW/EUR 26-08-22E	565
MOZ22 ECX EMISSION Dec22	1,362

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

(단위:백만원)

3,671

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

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)	34
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	34
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	34
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	34

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

(단위:백만원)

260

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

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)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	19

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

(단위:백만원)

80

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

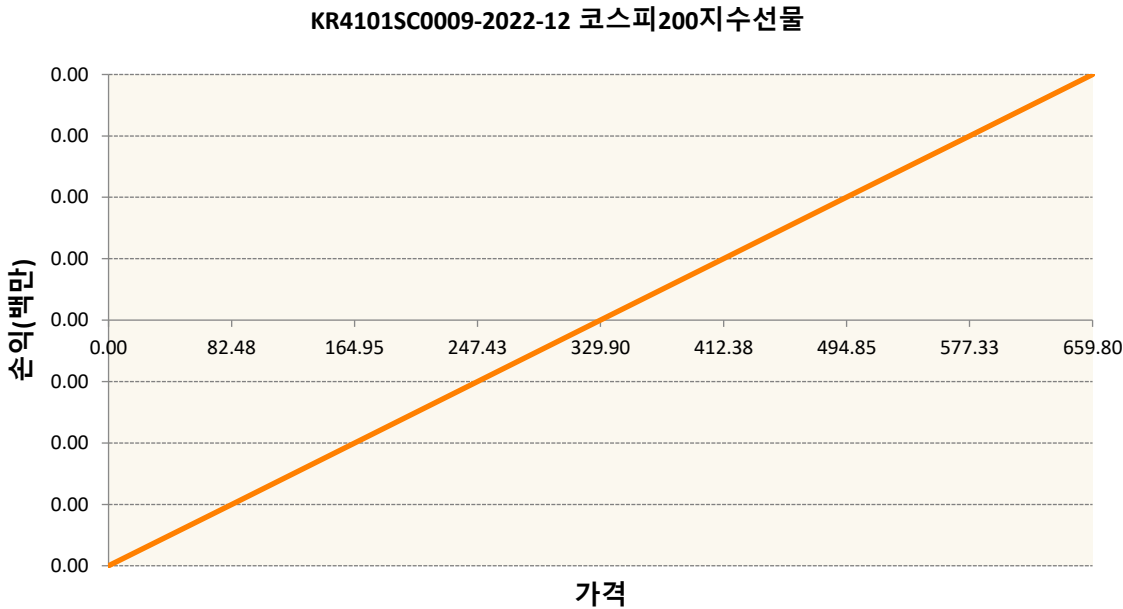
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	990	0	990	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
KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물	79

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

(단위:백만원)

88

공시일 2022-08-19

기준일 2022-08-18

신한SOL한국형글로벌반도체액티

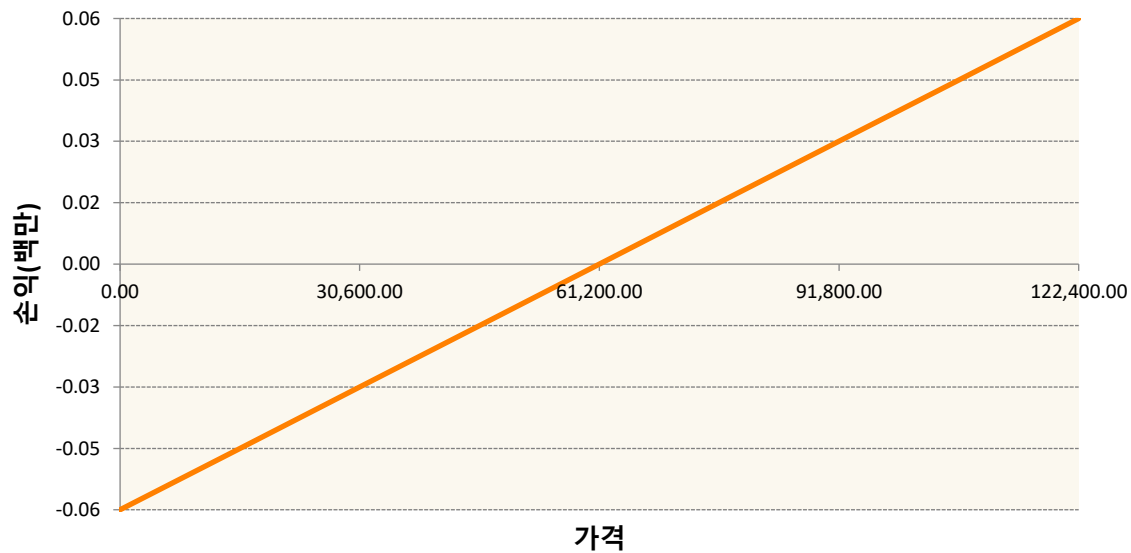
1. 계약금액

(단위:백만원)

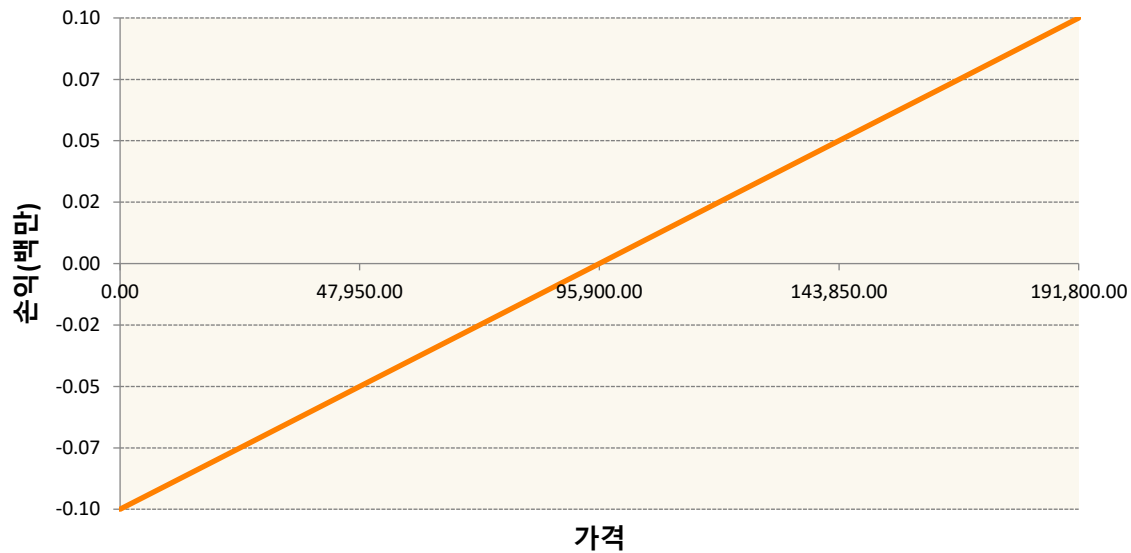
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	859	0	859	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S90004-2022-09 삼성전자개별선물



KR4150S90002-2022-09 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S90004		2022-09 삼성전자개별선물					36
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-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%	36	36	36	36	36	36	36
KR4150S90002		2022-09 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)

78

공시일 2022-08-19

기준일 2022-08-18

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일 2022-08-19

기준일 2022-08-18

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

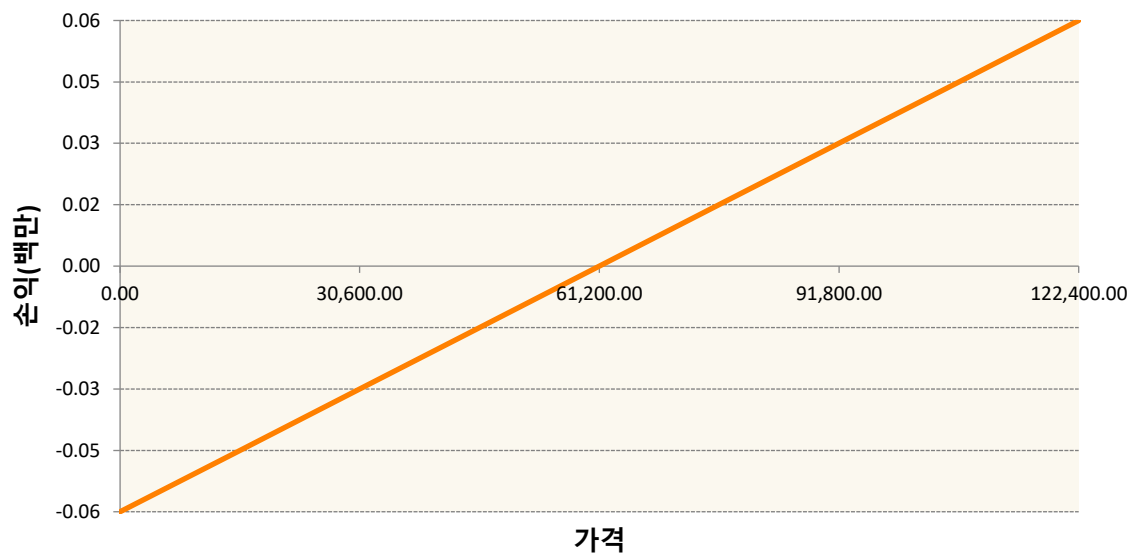
1. 계약금액

(단위:백만원)

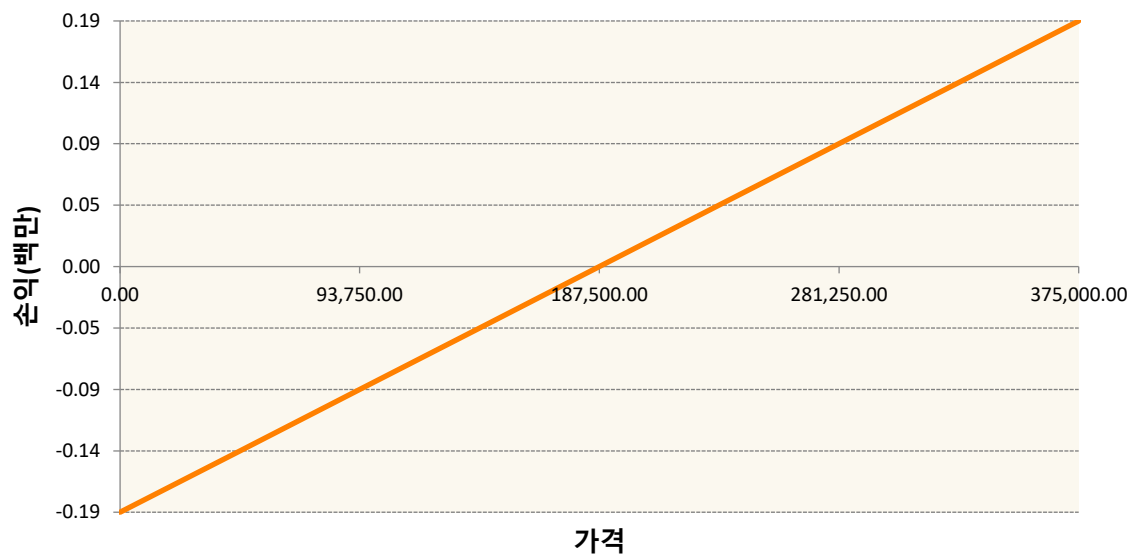
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	290	0	290	장내

2. 만기시점의 손익구조

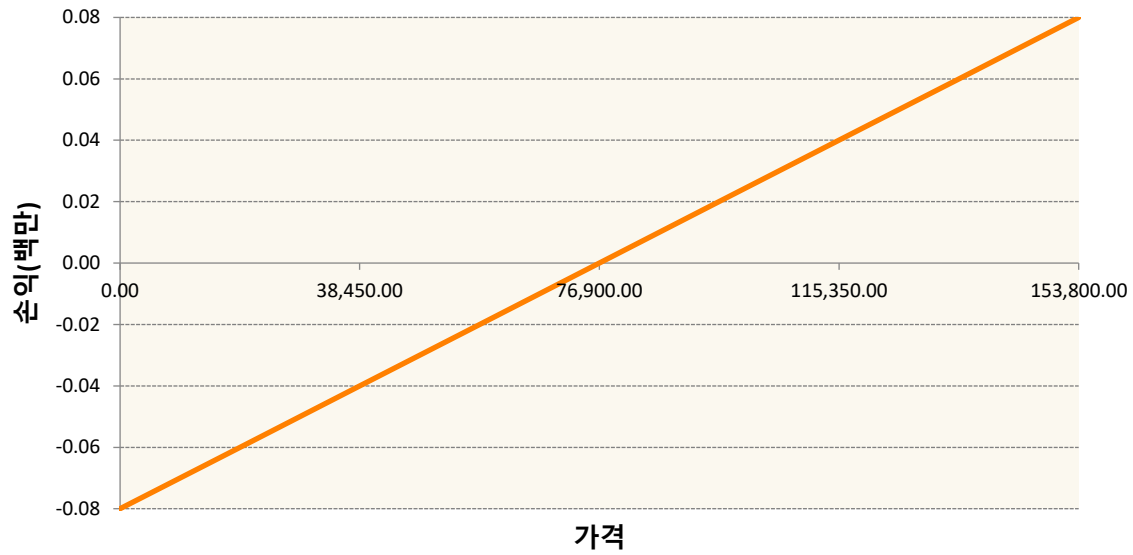
KR4111S90004-2022-09 삼성전자개별선물



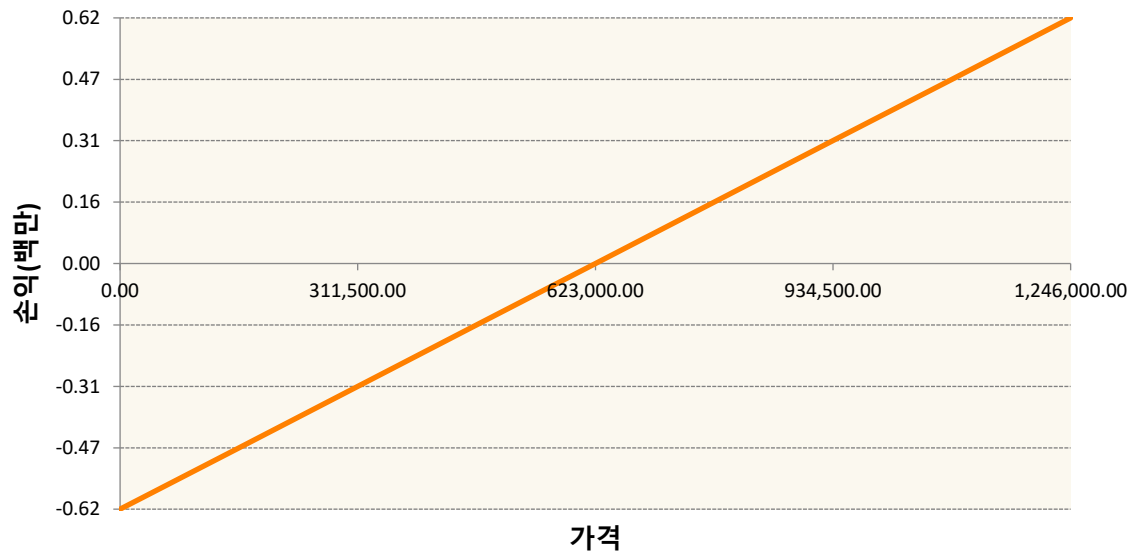
KR4116S90003-2022-09 현대차개별선물



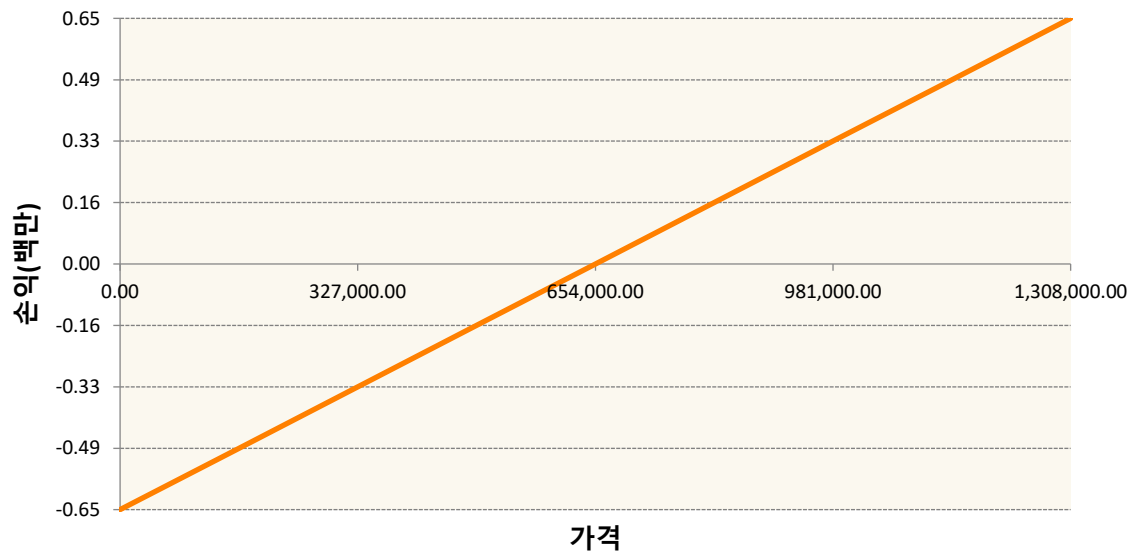
KR4119S90007-2022-09 기아개별선물



KR4122S90001-2022-09 삼성SDI개별선물



KR4147S90008-2022-09 LG화학개별선물



(단위:백만원)

KR4111S90004							2022-09 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	
KR4116S90003							2022-09 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	
KR4119S90007							2022-09 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	
KR4122S90001							2022-09 삼성SDI개별선물		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	-10	
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
-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%	7	7	7	7	7	7	7	7	
8.00%	10	10	10	10	10	10	10	10	
KR4147S90008							2022-09 LG화학개별선물		2
	기초자산의 변동성								

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

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

(단위:백만원)

26

공시일 2022-08-19

기준일 2022-08-18

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

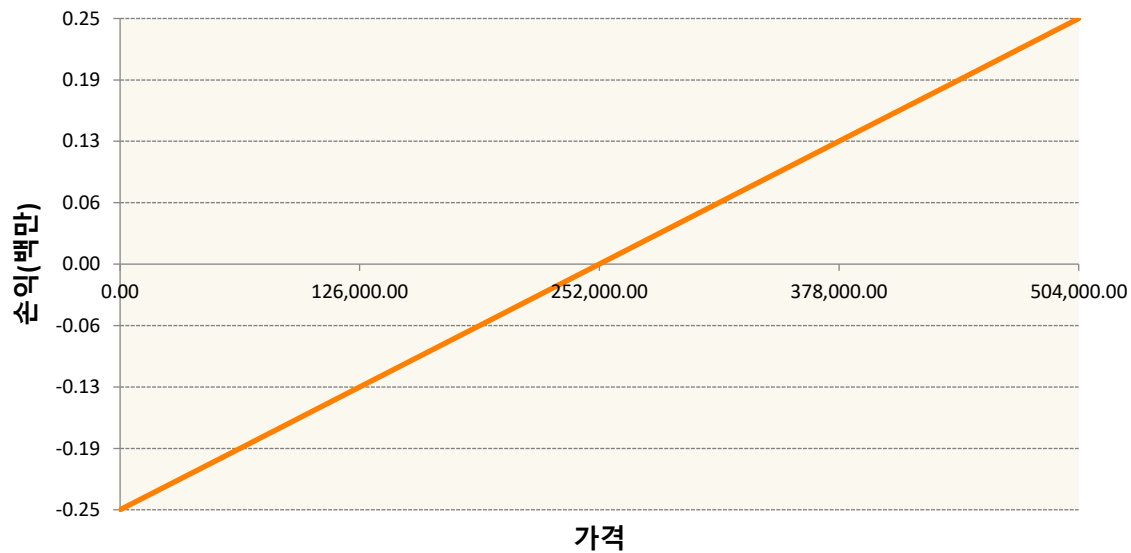
1. 계약금액

(단위:백만원)

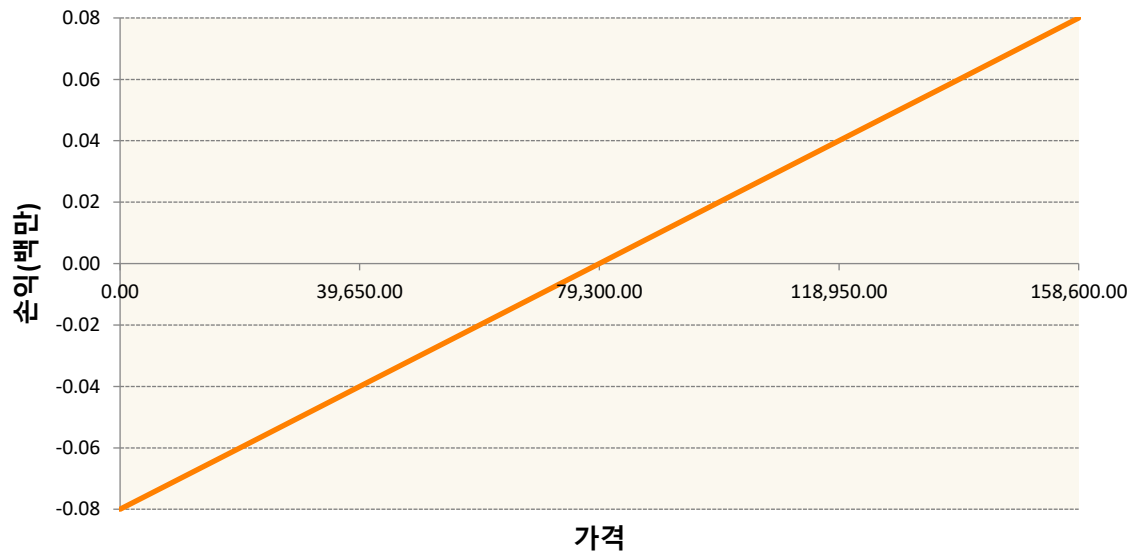
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	221	0	221	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156S90009-2022-09 NAVER개별선물



KR41CFS90000-2022-09 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156S90009		2022-09 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
KR41CFS90000		2022-09 카카오개별선물					8
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-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%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

30

공시일	2022-08-19
기준일	2022-08-18

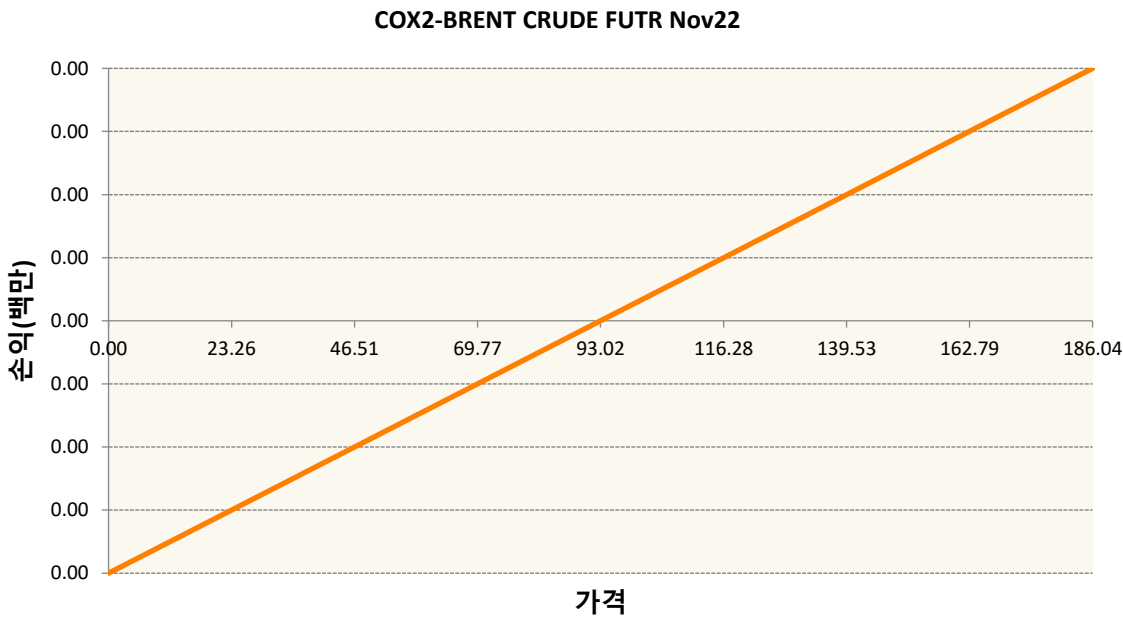
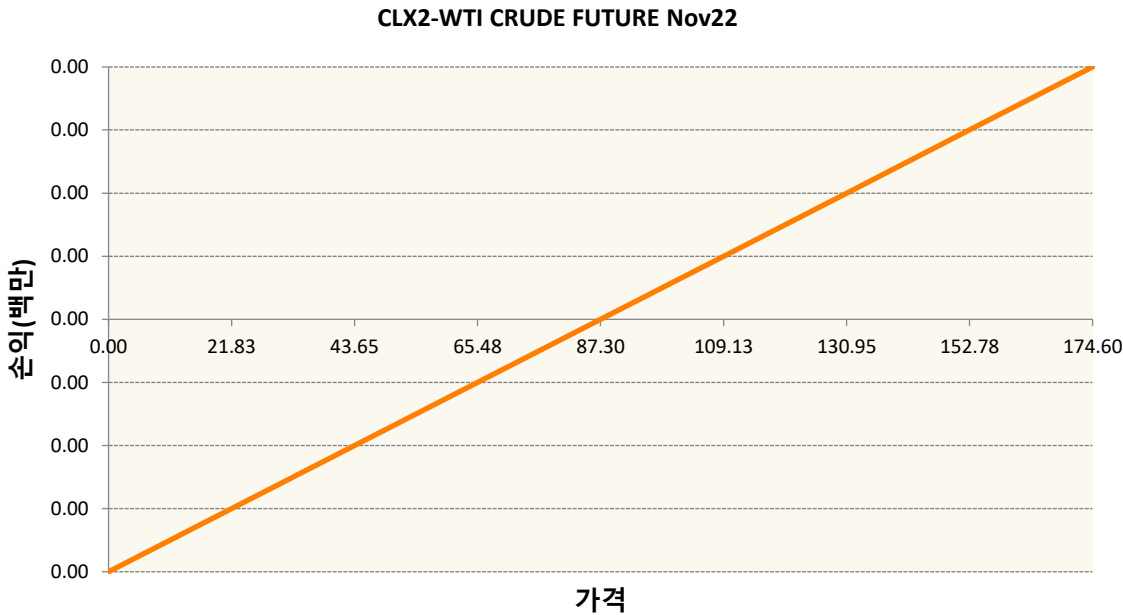
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

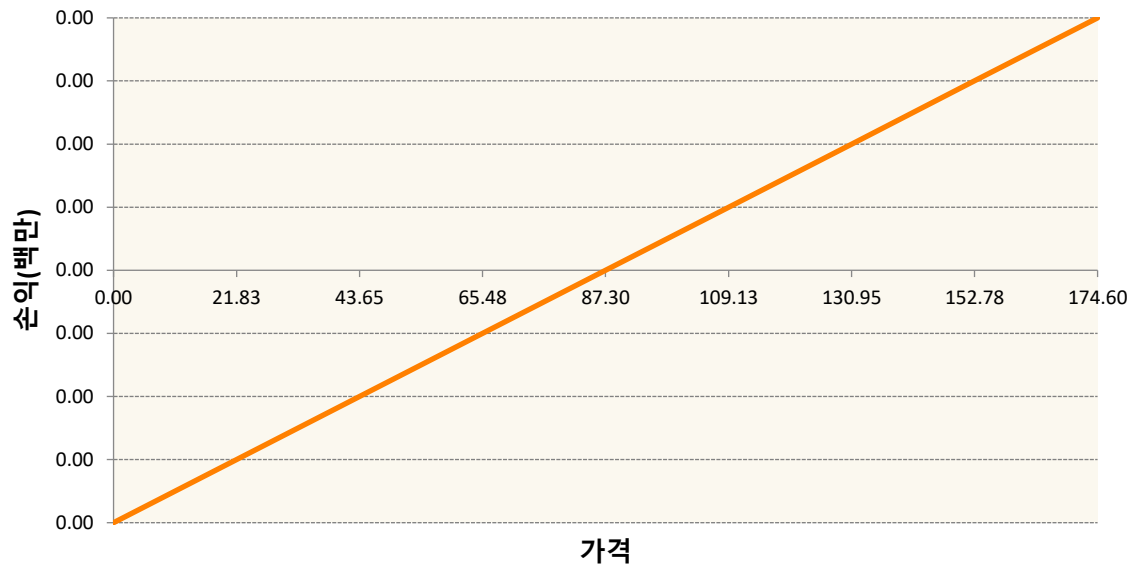
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,229	397	1,833	

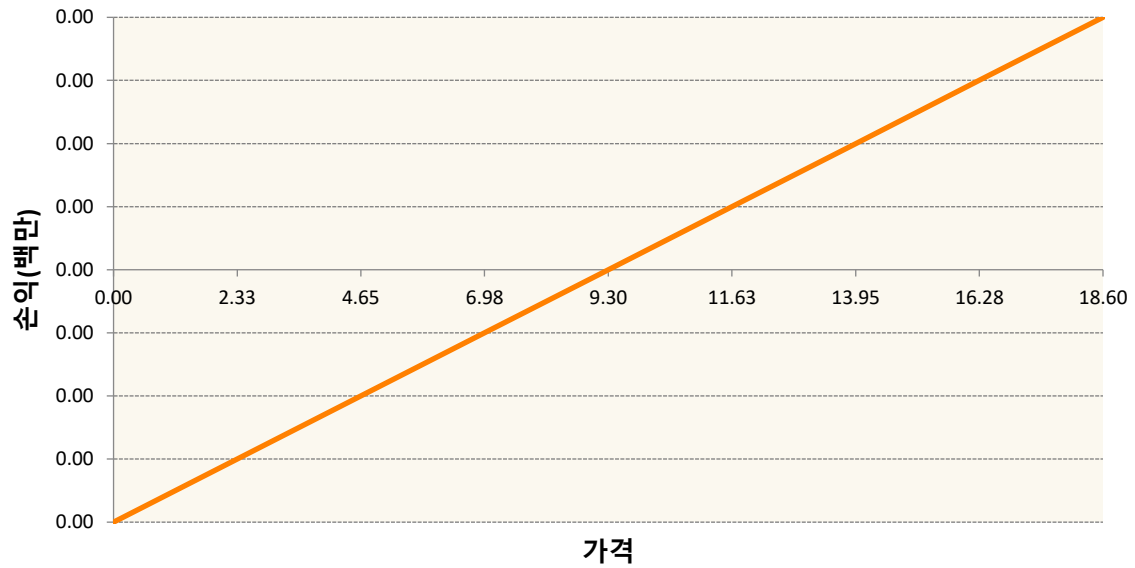
2. 만기시점의 손익구조



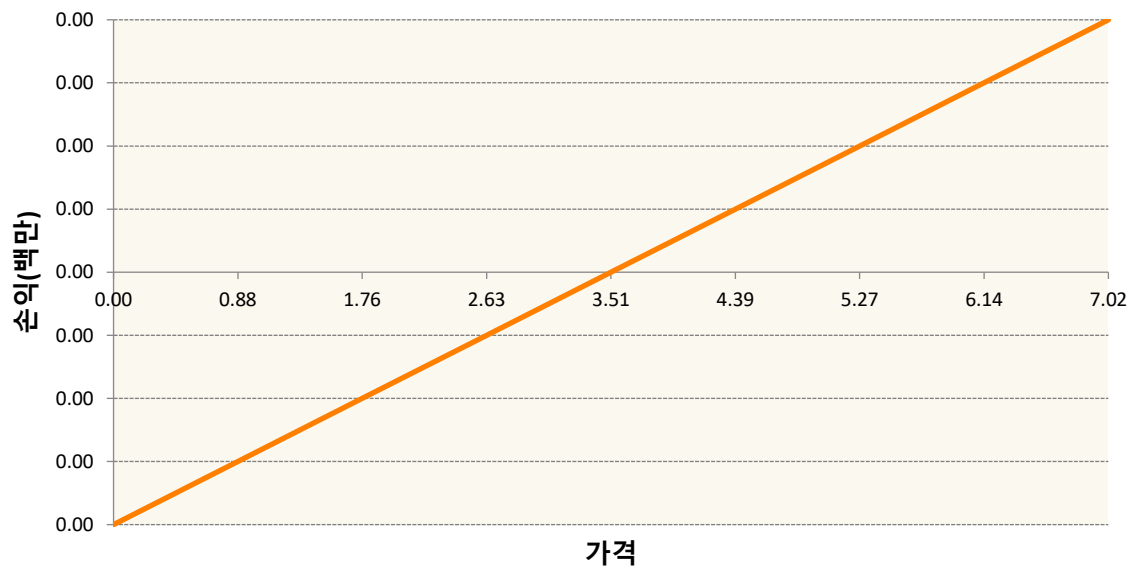
ECX2-E-MINI CRUDE OIL Nov22



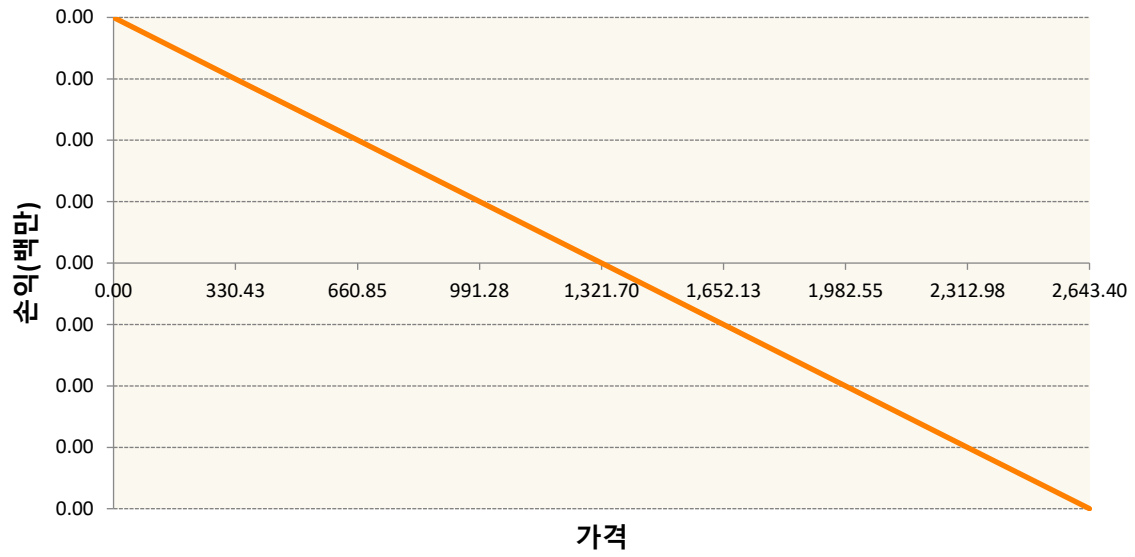
EOX2-E-MINI NATURAL GAS Nov22



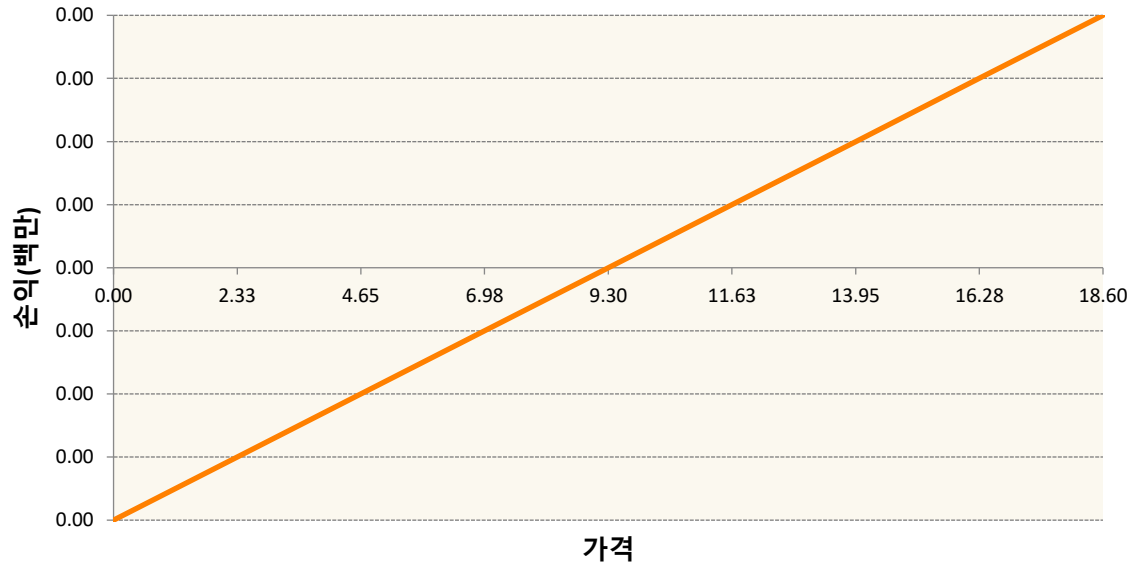
HOX2-NY Harb ULSD Fut Nov22



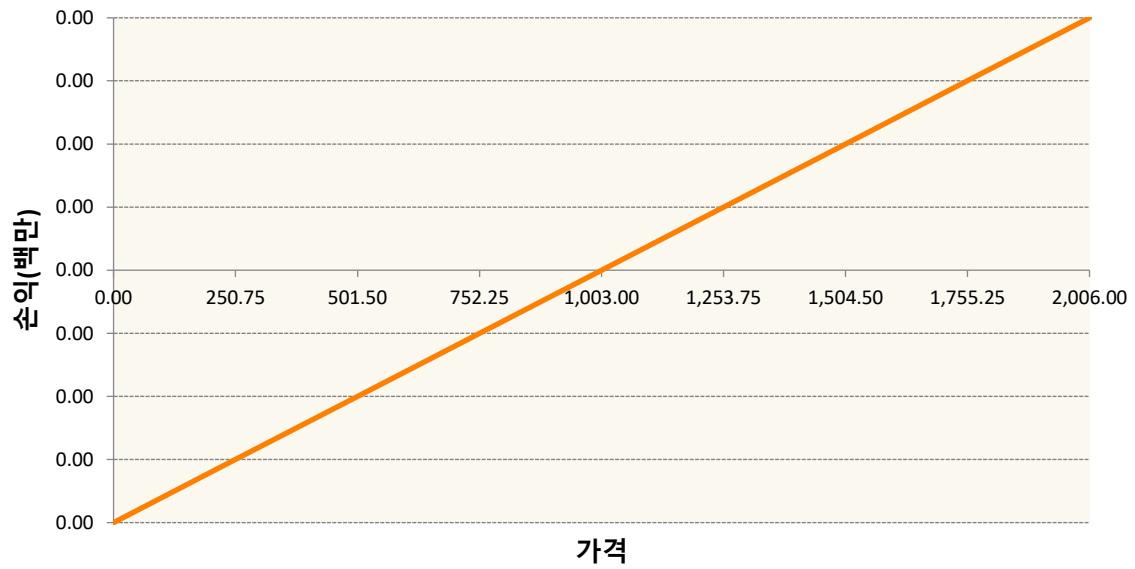
KR4175S90009-2022-09 달러선물

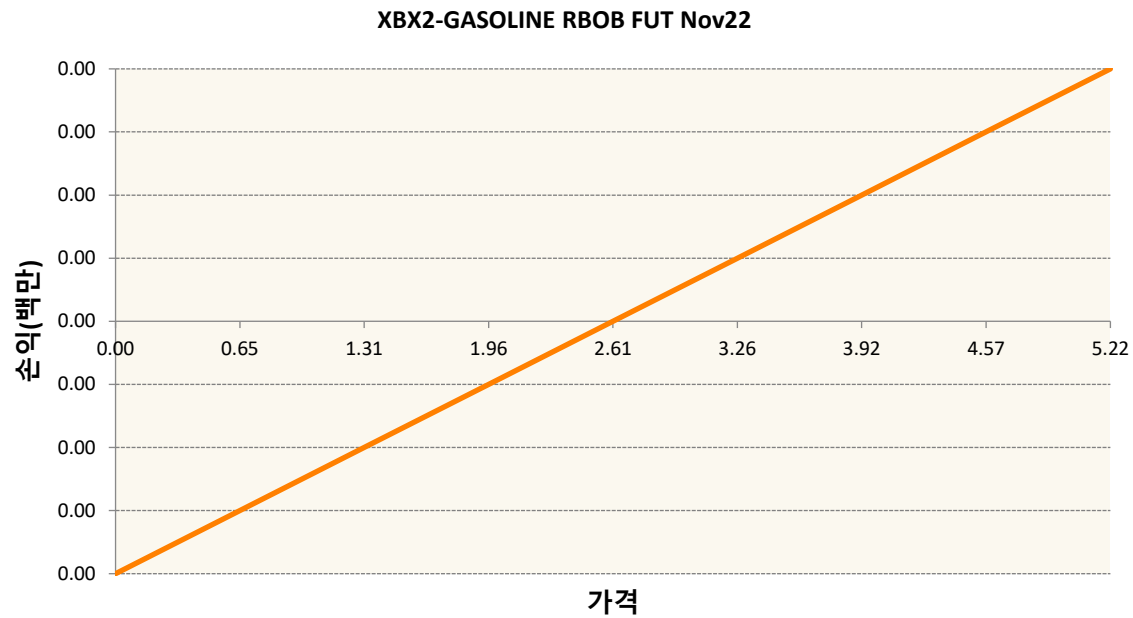


NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QSX2-Low Su Gasoil G Nov22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX2	WTI CRUDE FUTURE Nov22	27
COX2	BRENT CRUDE FUTR Nov22	29
ECX2	E-MINI CRUDE OIL Nov22	5
EOX2	E-MINI NATURAL GAS Nov22	2
HOX2	NY Harb ULSD Fut Nov22	15
KR4175S900 2022-09 달러선물		32
NGX22	NATURAL GAS FUTR Nov22	78
QSX2	Low Su Gasoil G Nov22	10
XBX2	GASOLINE RBOB FUT Nov22	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	585