

공시일 2022-08-29

기준일 2022-08-26

포커스농산물모(채권-파생형)

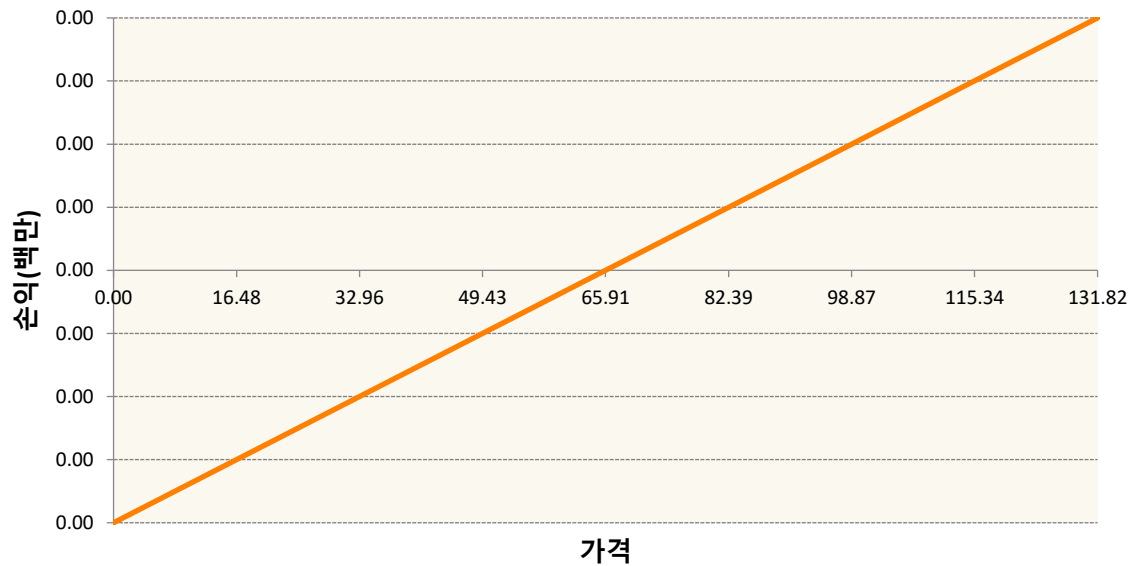
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

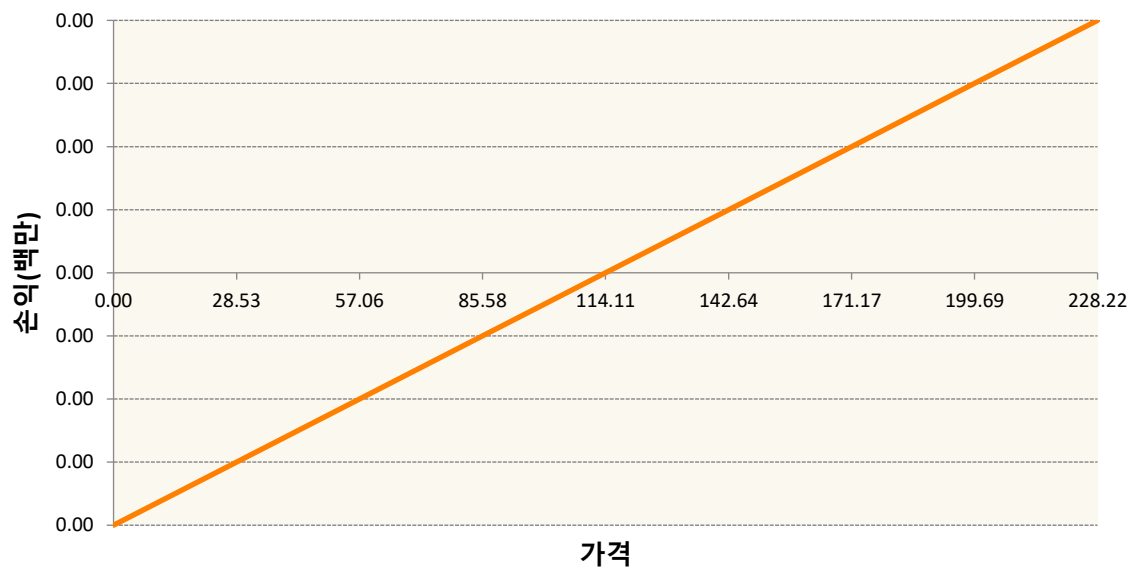
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,141	931	6,209	

2. 만기시점의 손익구조

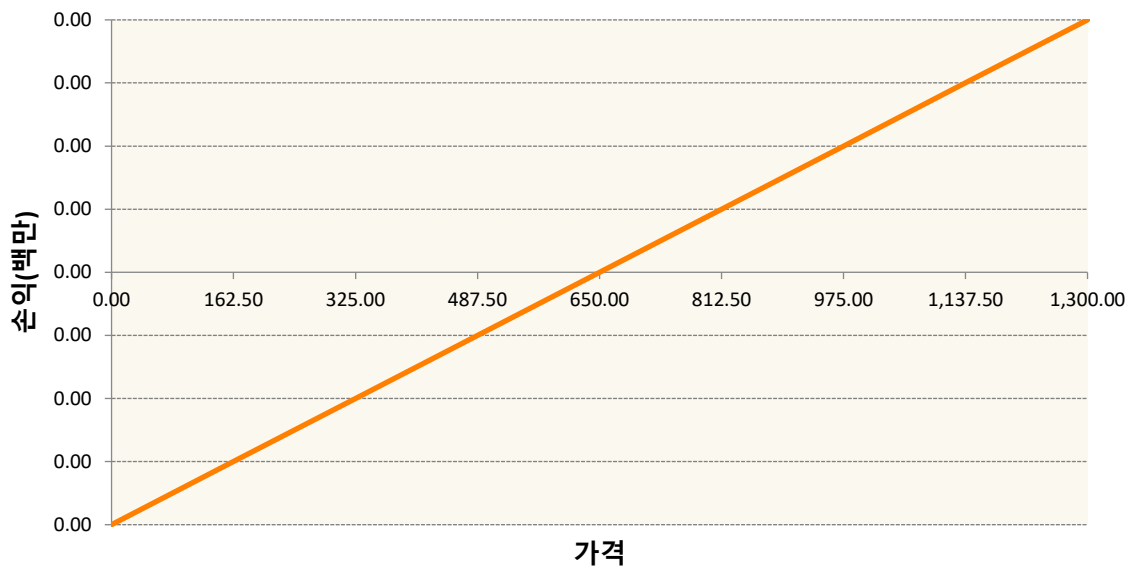
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



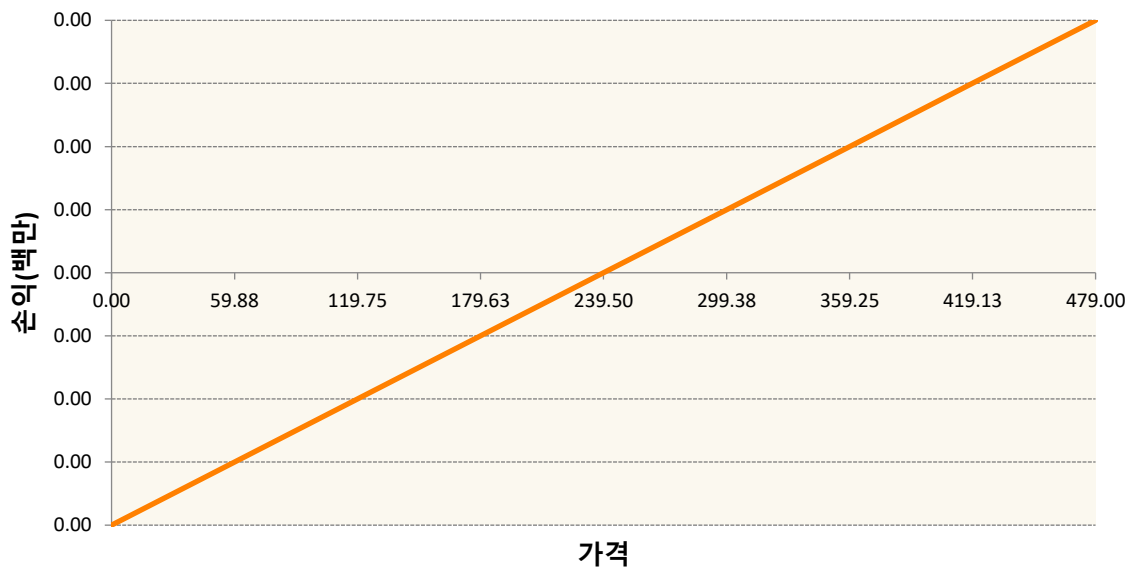
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



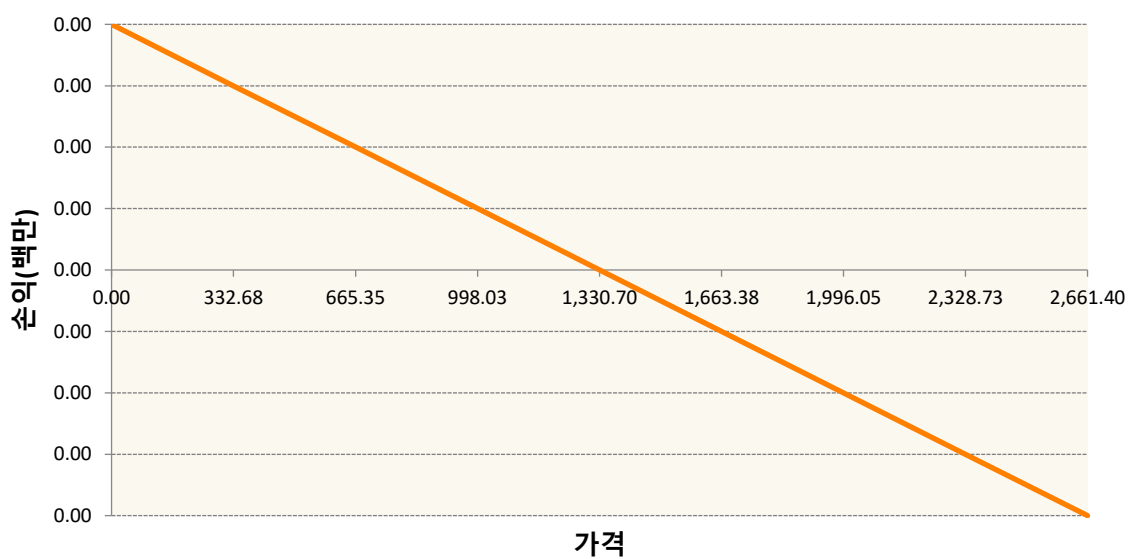
CZ2-CORN FUTURE Dec22



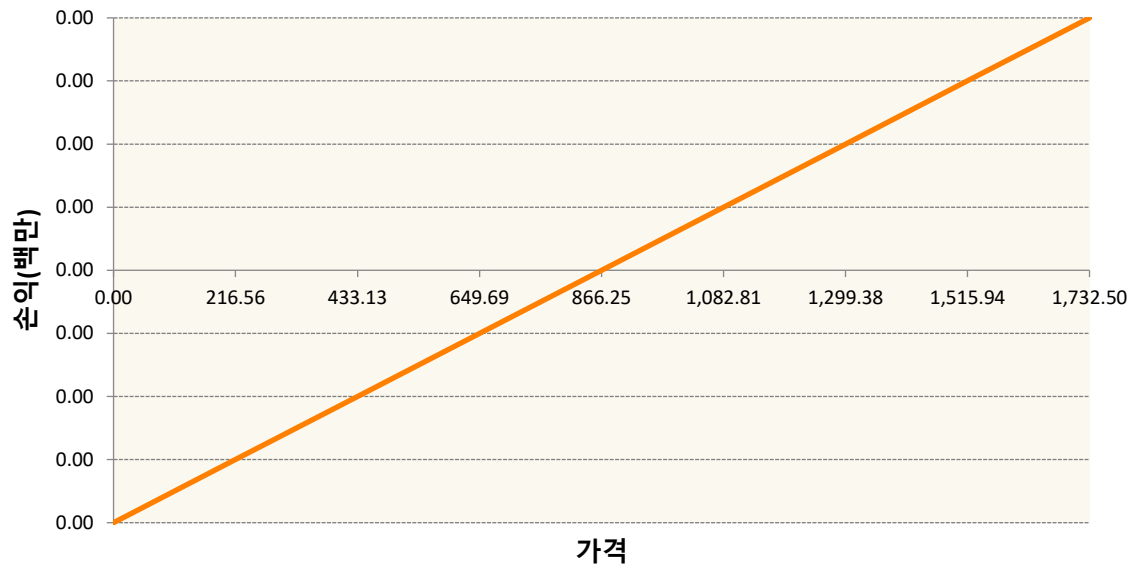
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



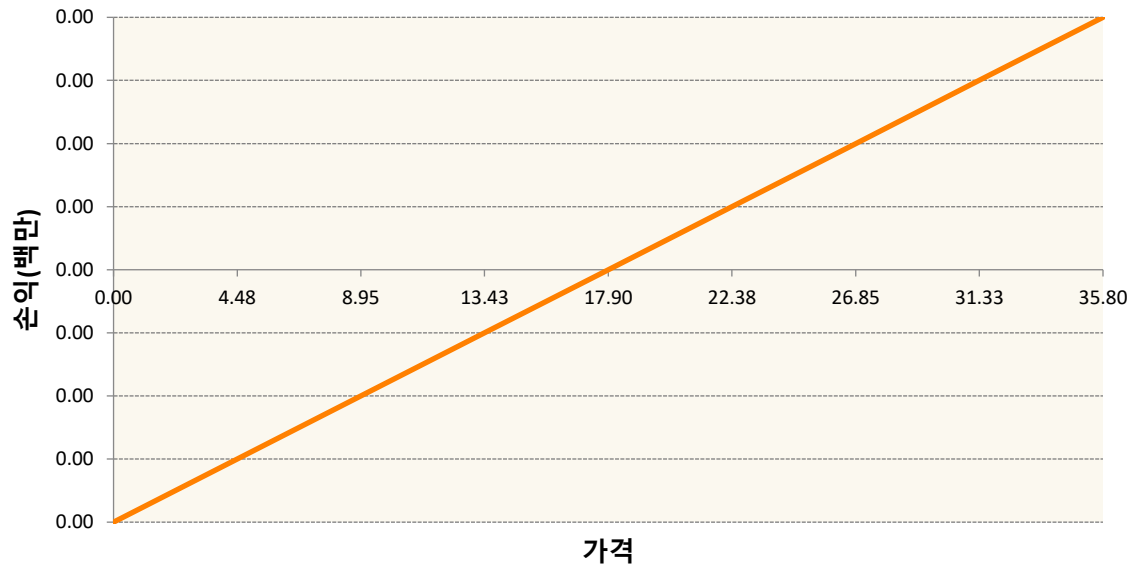
KR4175S90009-2022-09 달러선물



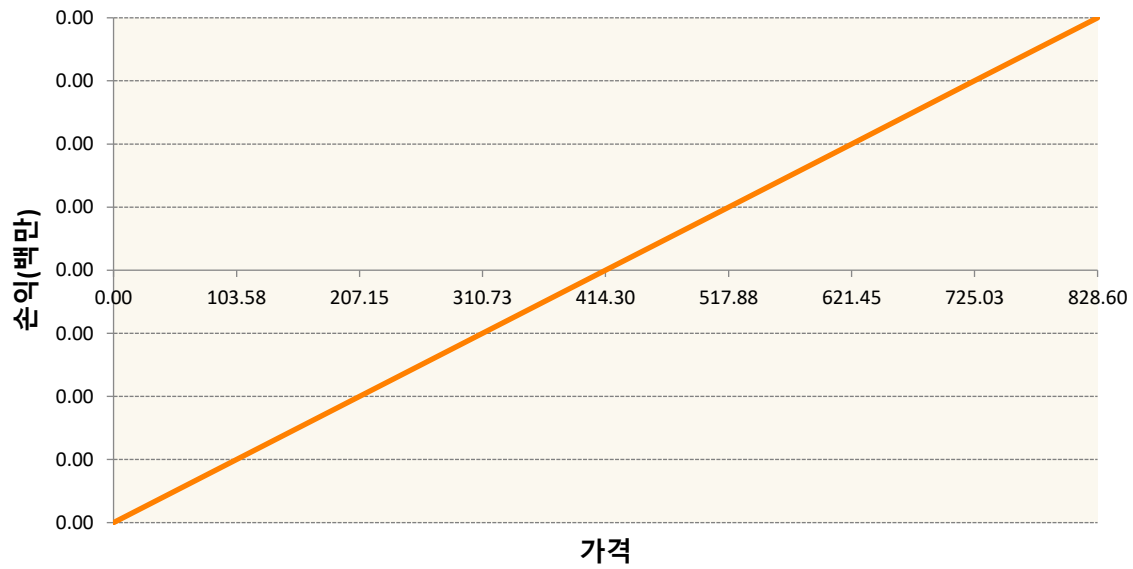
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

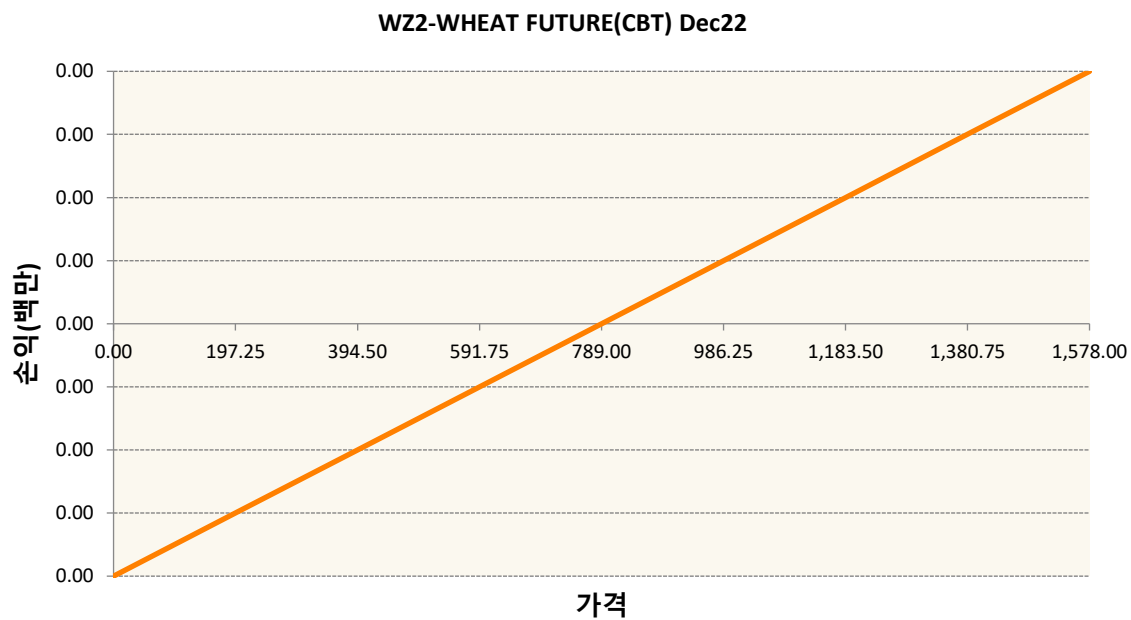
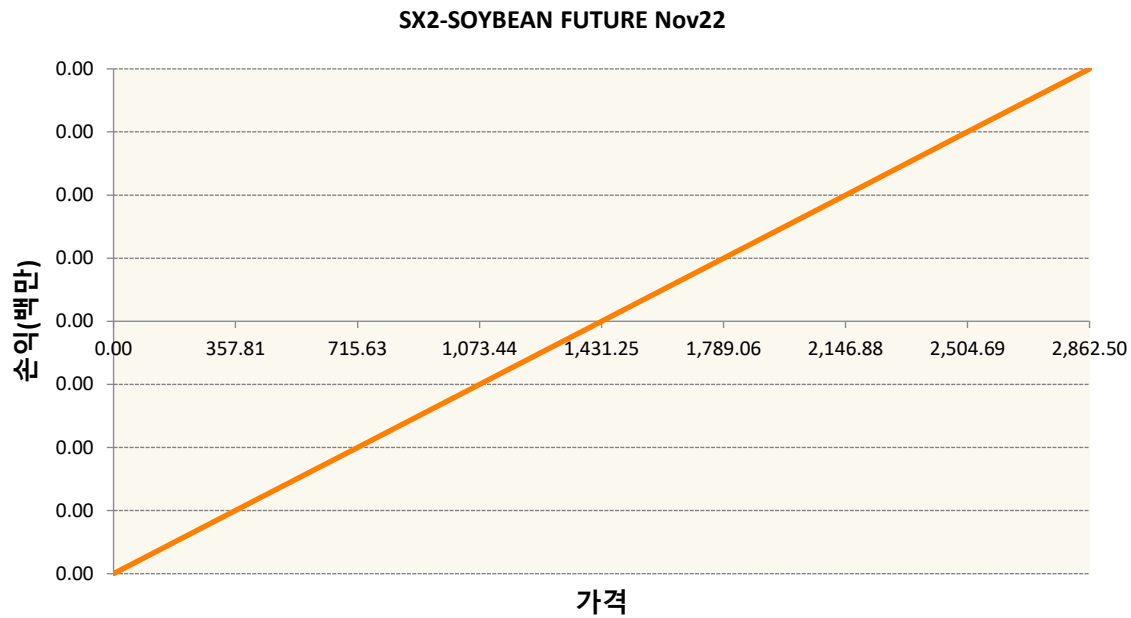


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



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	2022-08-29
기준일	2022-08-26

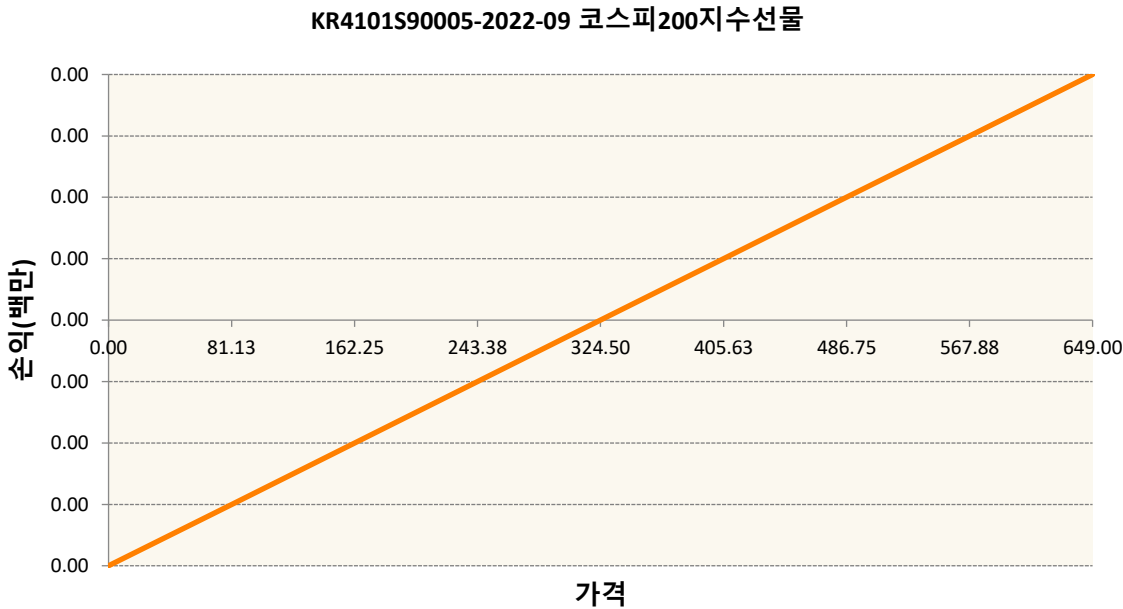
스마트인덱스모

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	1,055	0	1,055	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				84
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-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%	56	56	56	56	56	56	56
8.00%	84	84	84	84	84	84	84

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

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	368
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

483

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

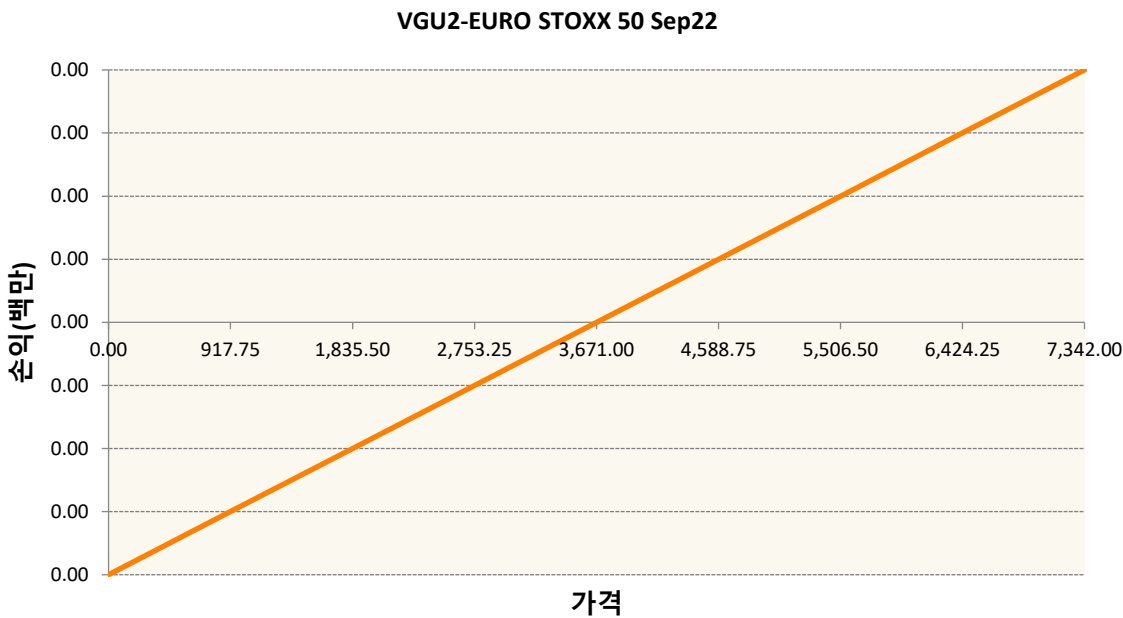
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	594	0	594	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU2	EURO STOXX 50 Sep22	48
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

48

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

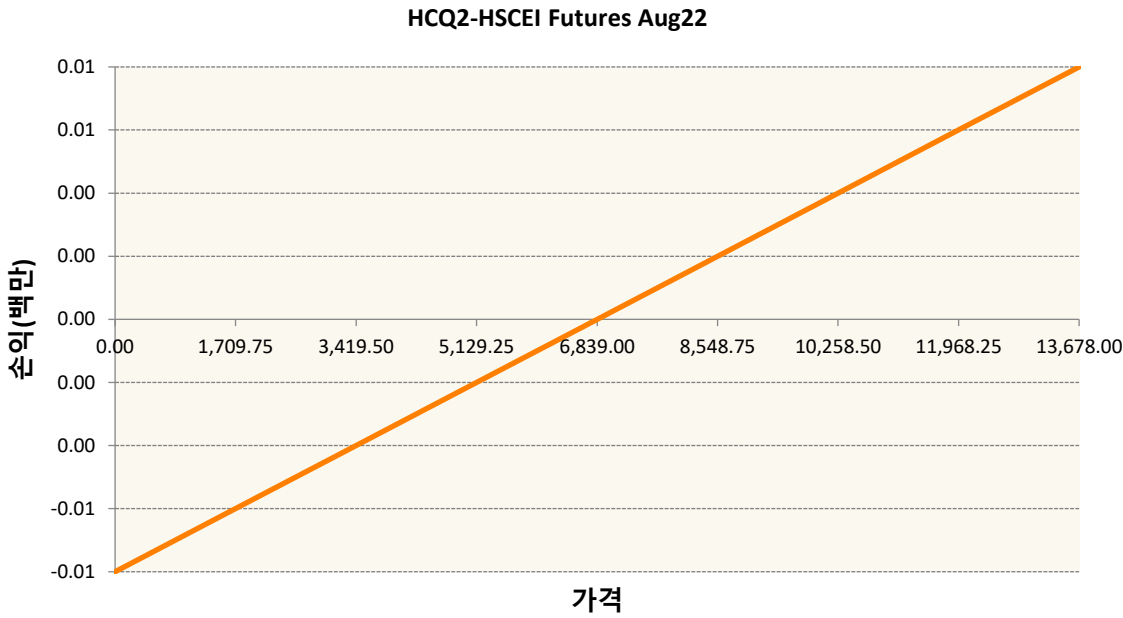
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,143	0	1,143	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ2	HSCEI Futures Aug22	91
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

134

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

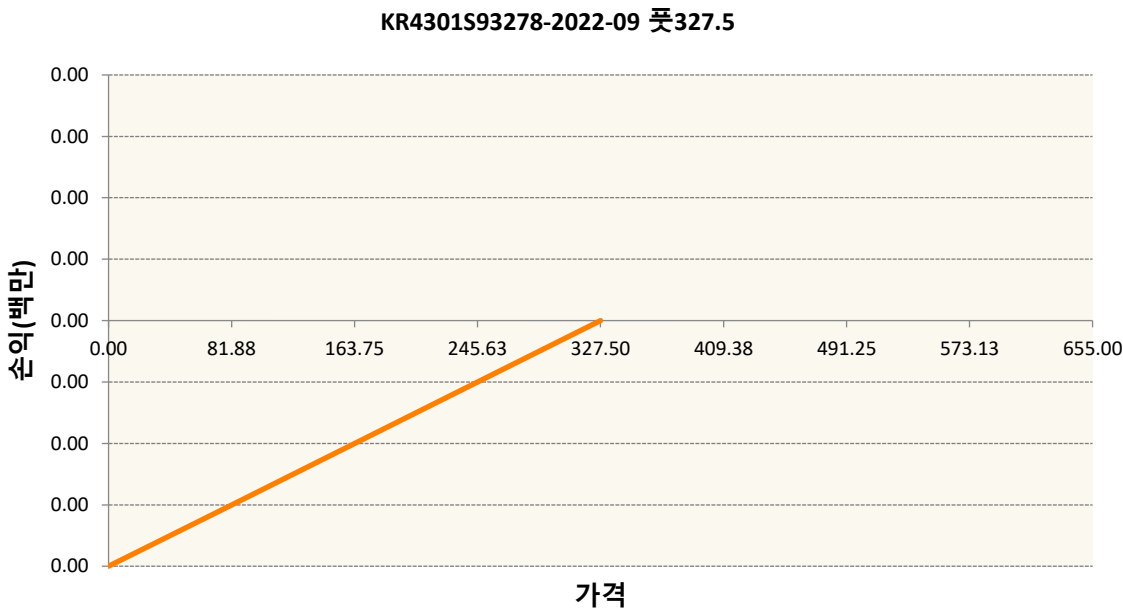
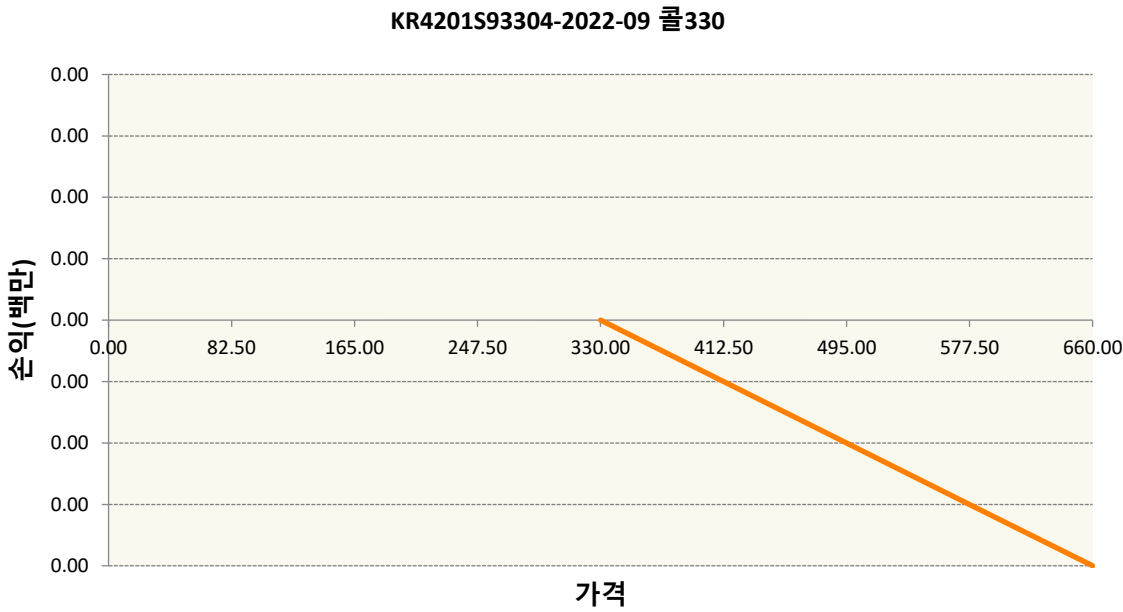
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

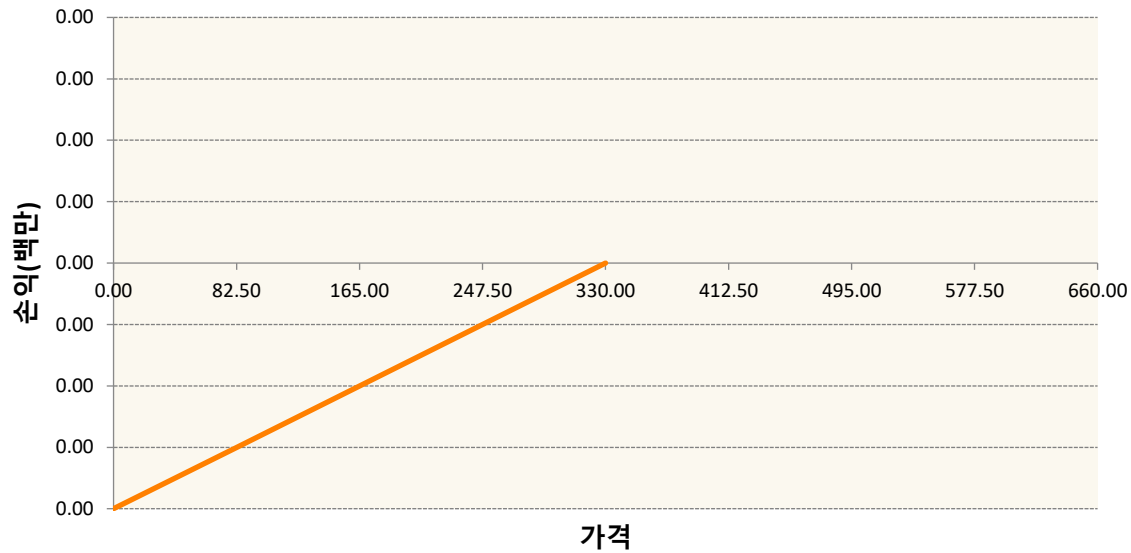
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	60,539	-60,539	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S93302-2022-09 풋330



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S93304			2022-09 콜330				2,721
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	667	662	654	642	626	605	580
-5.33%	644	624	599	567	530	489	443
-2.67%	542	492	438	378	315	249	181
0%	246	165	83	0	-84	-169	-254
2.67%	-355	-444	-532	-621	-710	-799	-888
5.33%	-1,276	-1,343	-1,413	-1,486	-1,562	-1,640	-1,720
8.00%	-2,424	-2,459	-2,501	-2,549	-2,603	-2,660	-2,721
KR4301S93278			2022-09 풋327.5				133
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-129	-129	-129	-130	-131	-132	-133
-5.33%	-76	-77	-78	-80	-82	-84	-86
-2.67%	-28	-30	-33	-36	-39	-42	-45
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	36	32	29	25	22	18	15
5.33%	49	46	44	41	38	35	32
8.00%	54	52	51	49	47	45	43
KR4301S93302			2022-09 풋330				557
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-543	-544	-545	-547	-550	-553	-557
-5.33%	-329	-332	-336	-342	-348	-355	-362
-2.67%	-128	-136	-145	-155	-166	-177	-188
0%	41	27	14	0	-14	-28	-42

2.67%	159	144	130	115	100	85	70
5.33%	224	213	201	189	176	163	150
8.00%	251	245	238	230	221	212	202

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

(단위:백만원)

3,314

공시일 2022-08-29

기준일 2022-08-26

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

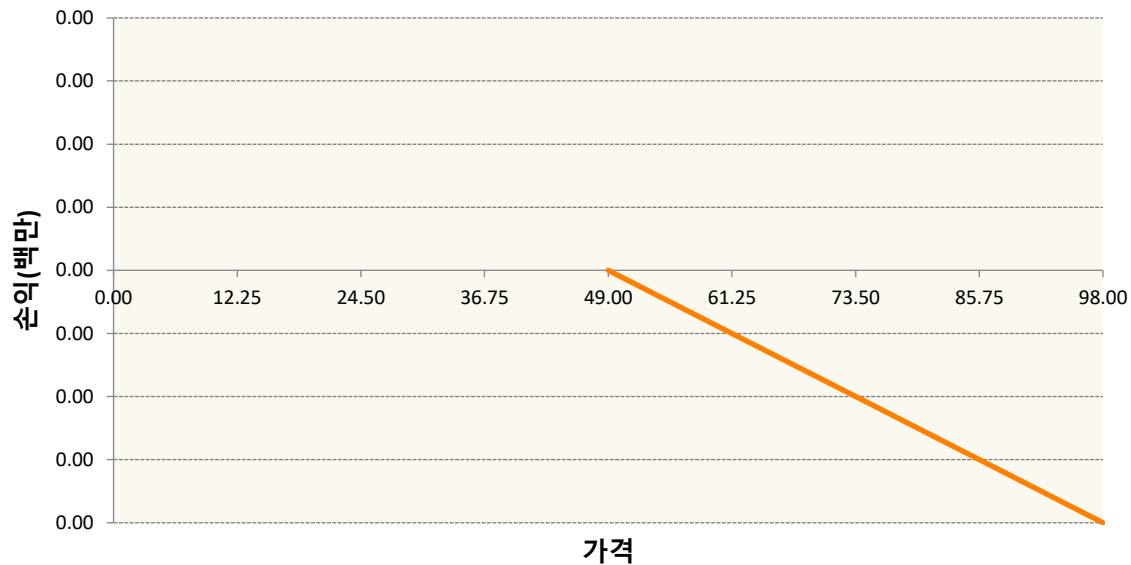
1. 계약금액

(단위:백만원)

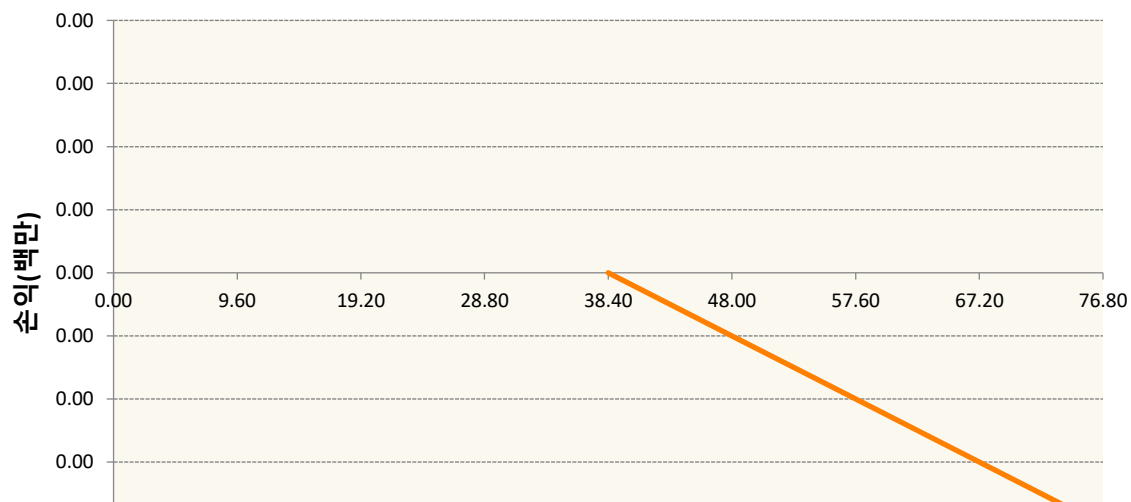
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	32	-32	장내
누계	지수	스왑	3	0	3	장외
누계	통화	선도	0	1,459	-1,459	장외

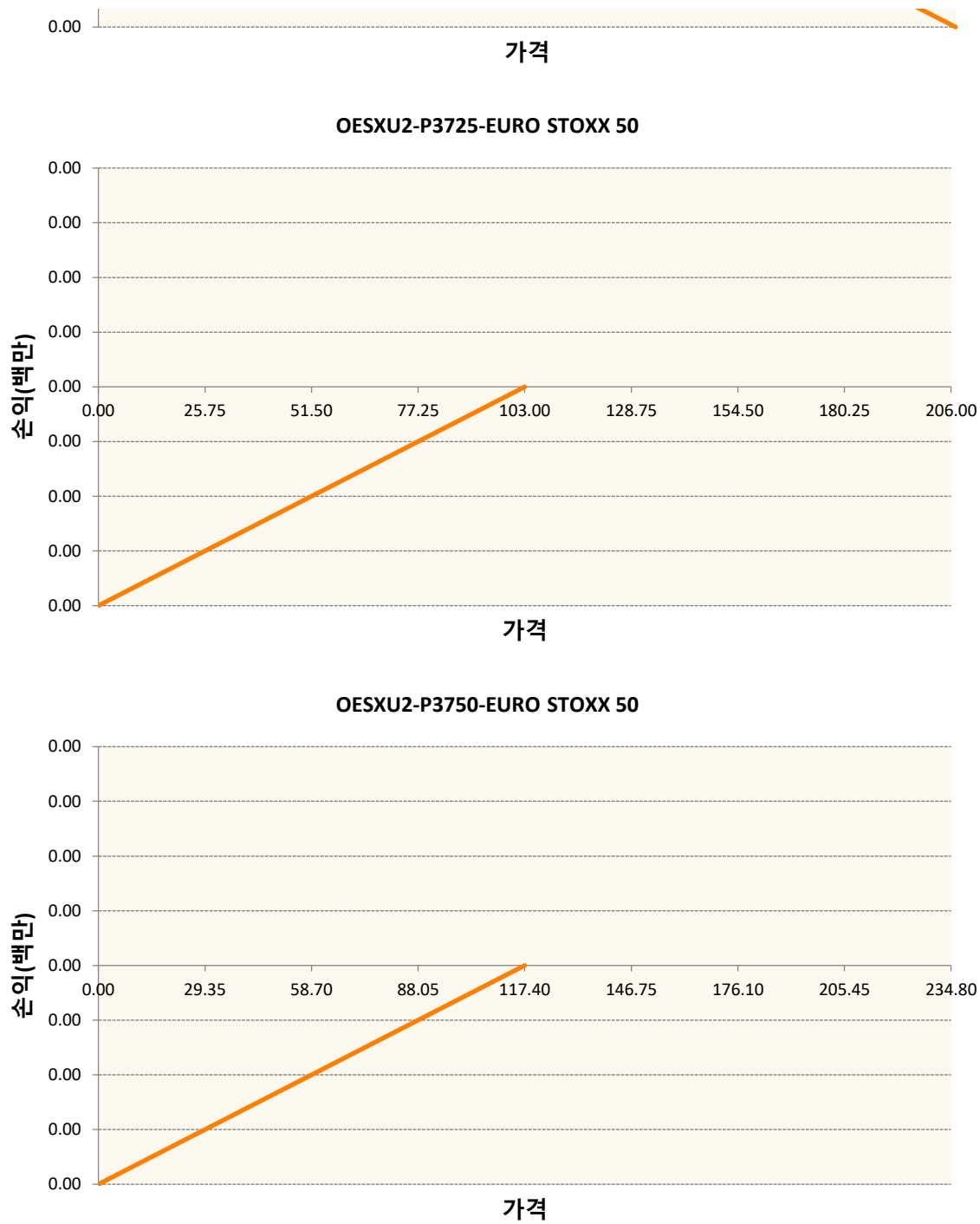
2. 만기시점의 손익구조

OESXU2-C3725-EURO STOXX 50



OESXU2-C3750-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY
 FXW213C7L KRW/EUR 23-09-22E
 FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E
 FXW213C8R KRW/EUR 06-09-22E
 OESXU2-C37 EURO STOXX 50
 OESXU2-C37 EURO STOXX 50
 OESXU2-P37 EURO STOXX 50
 OESXU2-P37 EURO STOXX 50

7
32
69
16
1
0.16
1
0.37

공시일 2022-08-29

기준일 2022-08-26

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

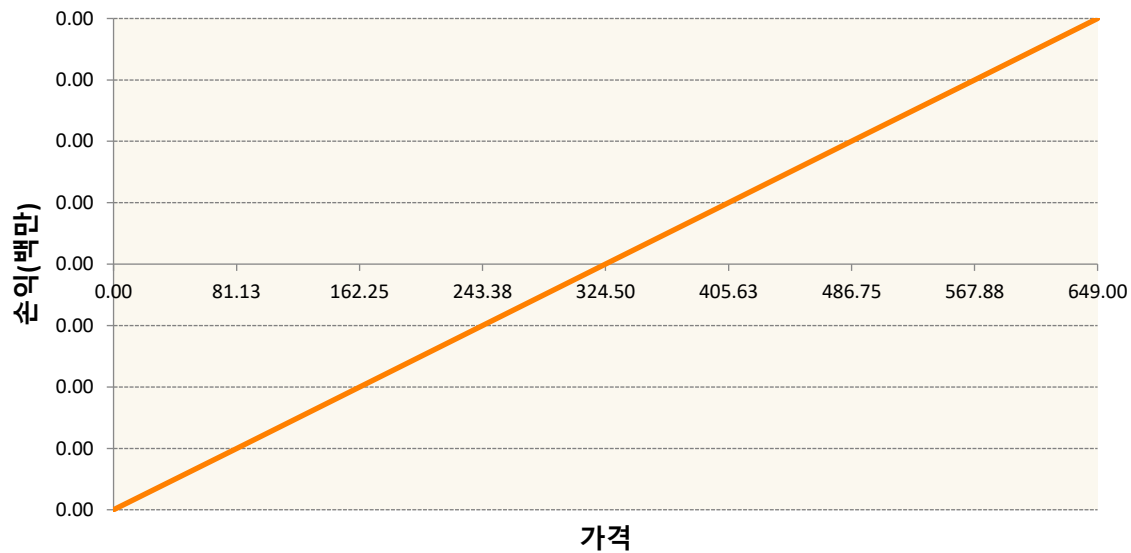
1. 계약금액

(단위:백만원)

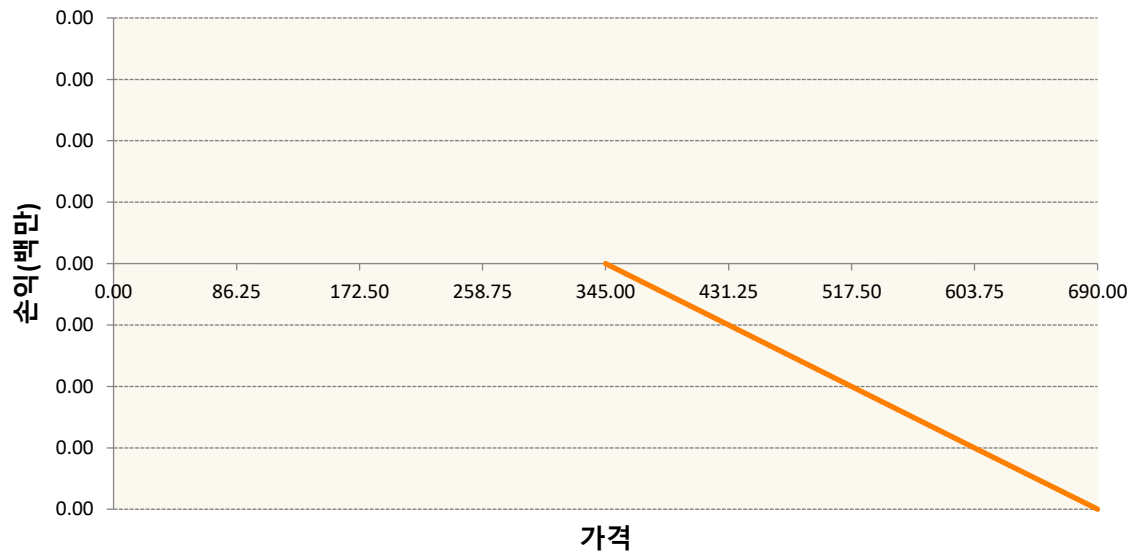
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	406	0	406	장내
누계	유가증권	옵션	329	4,503	-4,174	장내

2. 만기시점의 손익구조

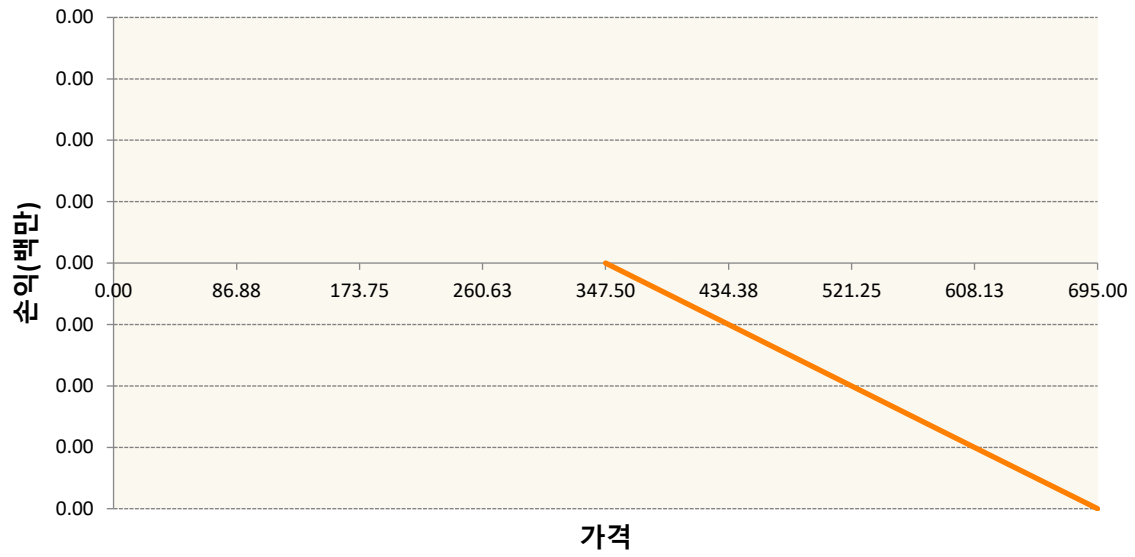
KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



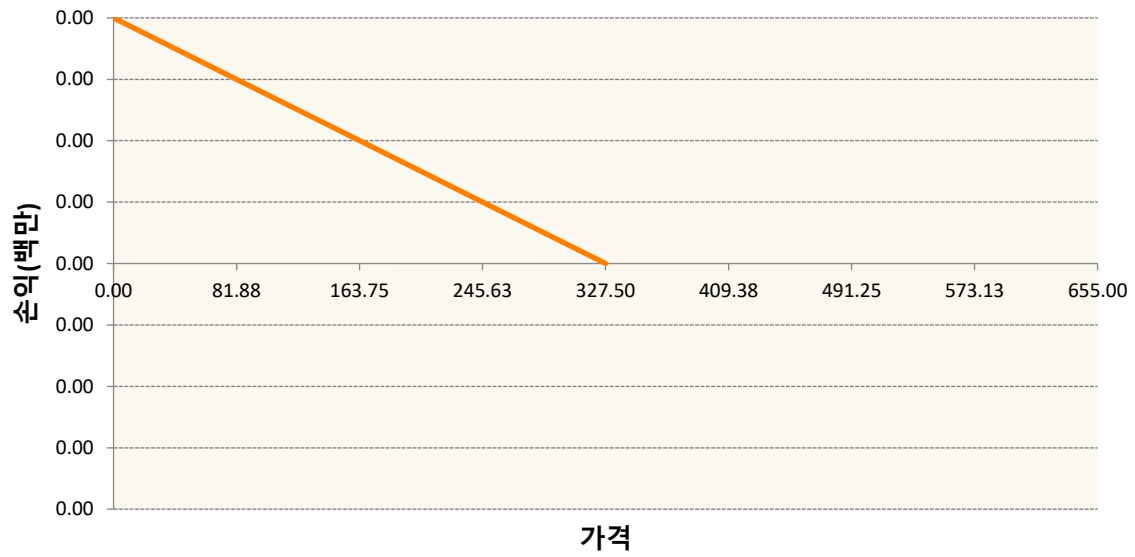
KR4201S93452-2022-09 콜345



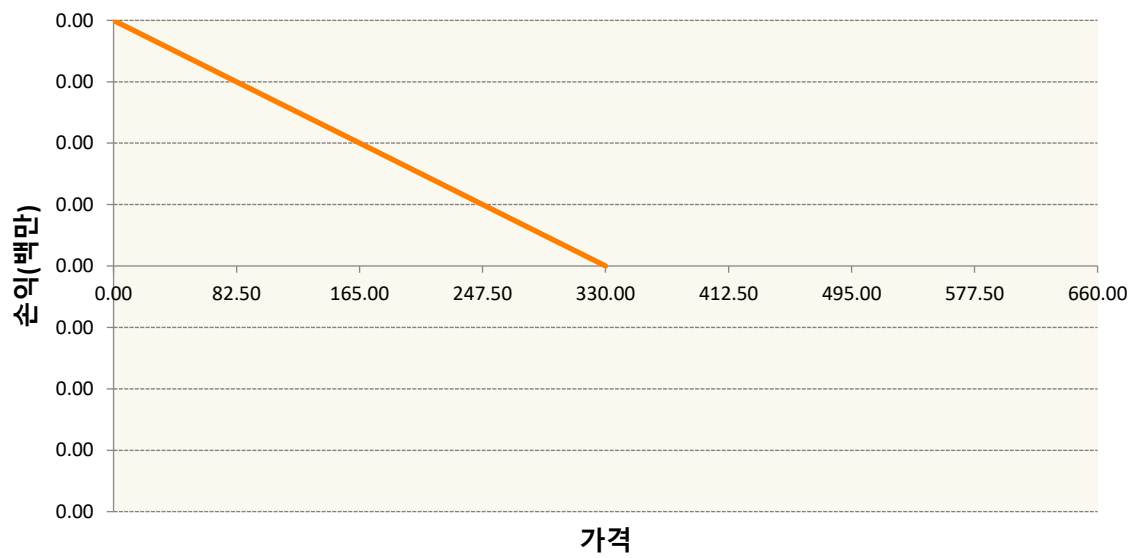
KR4201S93478-2022-09 콜347.5



KR4301S93278-2022-09 풋327.5



KR4301S93302-2022-09 풋330



(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%	-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%	32	32	32	32	32	32	32	32
KR4201S93452				2022-09 콜345				63
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	6	6	6	6	5	5	5	4
-2.67%	6	5	5	4	3	2	2	1
0%	4	3	2	0	-2	-4	-4	-6
2.67%	-2	-4	-7	-9	-12	-15	-15	-18
5.33%	-16	-19	-23	-26	-30	-33	-33	-37
8.00%	-42	-45	-49	-52	-56	-59	-59	-63
KR4201S93478				2022-09 콜347.5				71
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6	5
-5.33%	6	6	6	5	5	5	5	4
-2.67%	6	5	5	4	3	2	2	1
0%	4	3	2	0	-2	-4	-4	-7
2.67%	-1	-4	-7	-10	-13	-16	-16	-20
5.33%	-16	-20	-24	-28	-32	-37	-37	-41
8.00%	-44	-49	-53	-57	-62	-66	-66	-71
KR4301S93278				2022-09 풋327.5				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%	1	1	1	1	2	2	2	2
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	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
KR4301S93302				2022-09 풋330				17
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	16	17
-5.33%	10	10	10	10	10	11	11
-2.67%	4	4	4	5	5	5	6
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-5	-4	-4	-3	-3	-3	-2
5.33%	-7	-6	-6	-6	-5	-5	-4
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-6	-6

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

(단위:백만원)

138

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	129	-129	
누계	유가증권	수익증권	7,902	0	7,902	

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	2022-08-29
기준일	2022-08-26

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	6,636	0	6,636	

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	2022-08-29
기준일	2022-08-26

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	20,699	0	20,699	
누계	통화	선도	932	29,242	-28,310	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C6P·KRW/USD 29-08-22E		595
FXW213C6P·KRW/USD 27-09-22E		596
FXW213C7R·KRW/USD 27-10-22E		456
FXW213C8G·KRW/USD 29-08-22E		96
FXW213C8P·USD/KRW 29-08-22E		37
FXW213C8Q USD/KRW 29-08-22E		37
FXW213C8R·KRW/USD 28-11-22E		595

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

(단위:백만원)

948

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

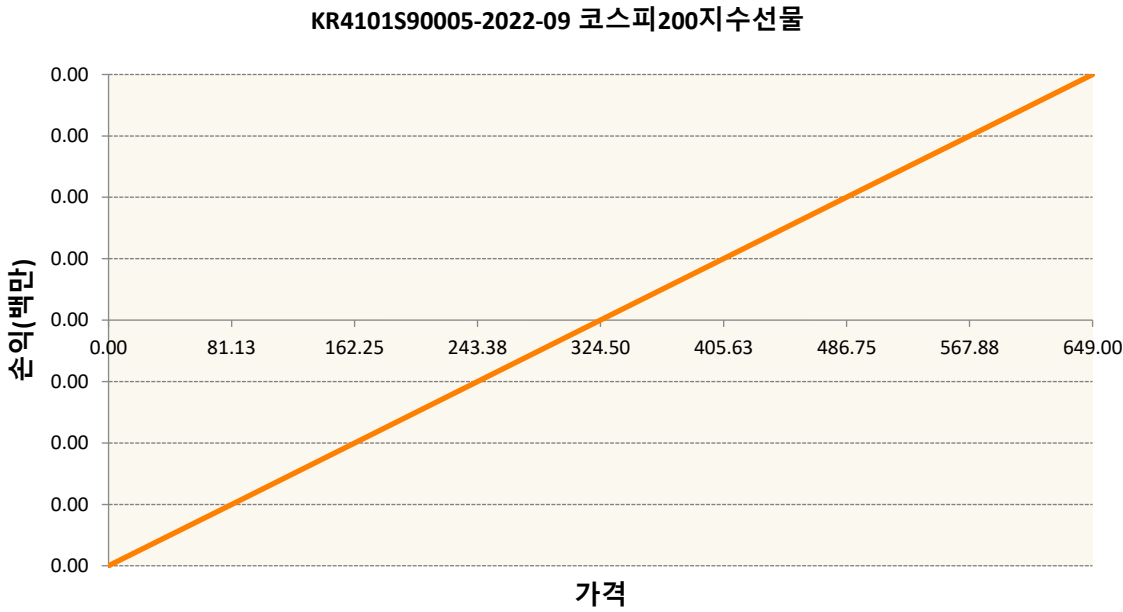
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	406	0	406	장내

2. 만기시점의 손익구조



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%	-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%	32	32	32	32	32	32	32

공시일 2022-08-29

기준일 2022-08-26

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

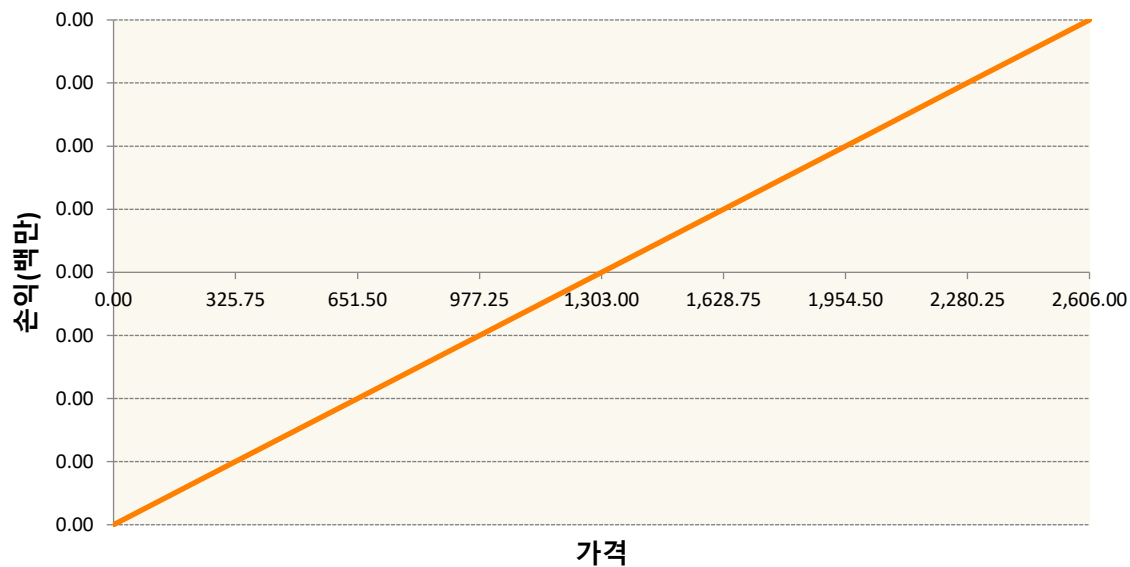
1. 계약금액

(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	842	0	842	
누계	유가증권	스왑	1,632	0	1,632	장외
누계	통화	선도	0	1,127	-1,127	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCU2-VN30 Index Future SEP22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	131
FXW213C6N KRW/EUR 23-09-22E	27
FXW213C7L KRW/EUR 21-10-22E	18
FXW213C84 KRW/EUR 21-10-22E	5
FXW213C8P KRW/EUR 18-11-22E	11
FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E	30
VNCU2 VN30 Index Future SEP22	67

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

(단위:백만원)

258

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

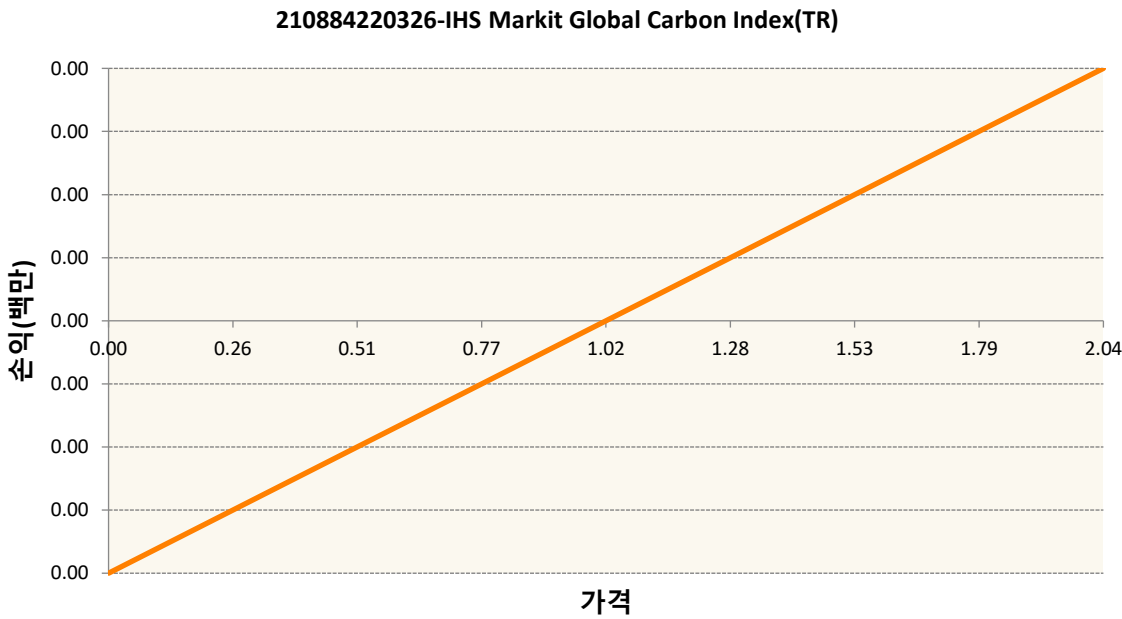
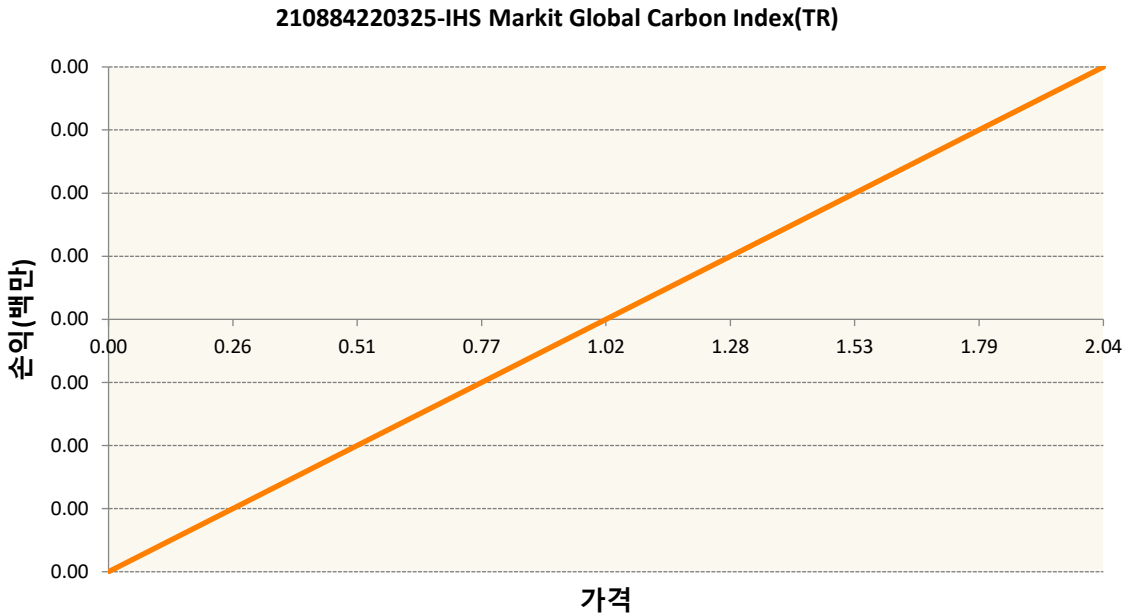
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

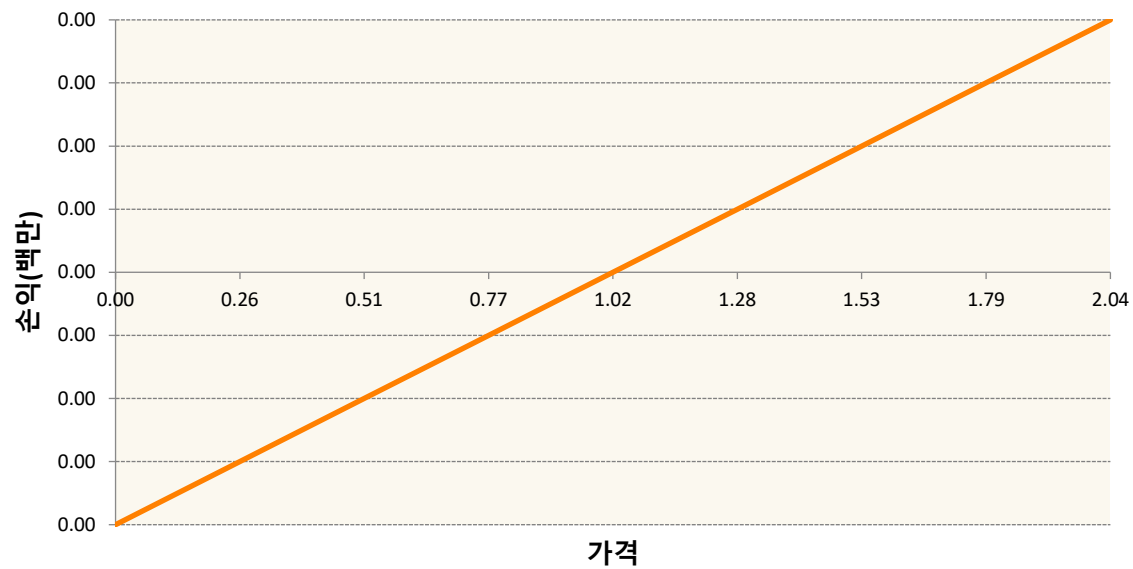
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	40,849	0	40,849	

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)

205

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

2,966

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

103

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

(단위:백만원)

6,051

공시일 2022-08-29

기준일 2022-08-26

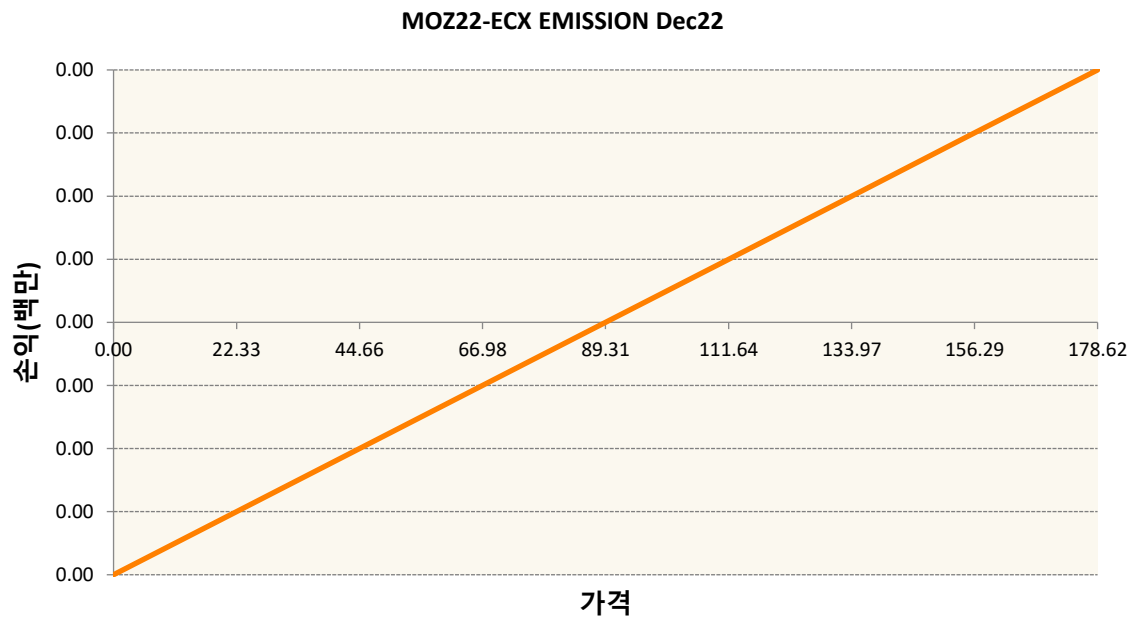
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,095	0	12,095	
누계	통화	선도	0	4,986	-4,986	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8S KRW/EUR 27-09-22E

399

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

968

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

(단위:백만원)

2,617

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

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)

151

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

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)	0.2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	0.23
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	0.2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	0.28

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

(단위:백만원)

1

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

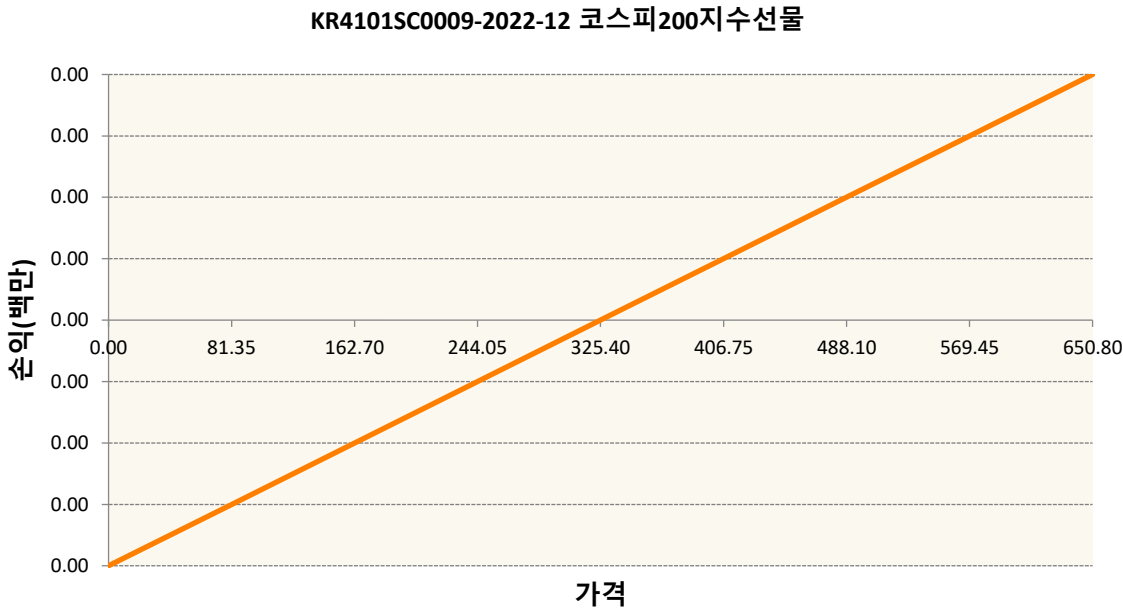
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	976	0	976	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.43
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.26
KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물	78

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

(단위:백만원)

81

공시일 2022-08-29

기준일 2022-08-26

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

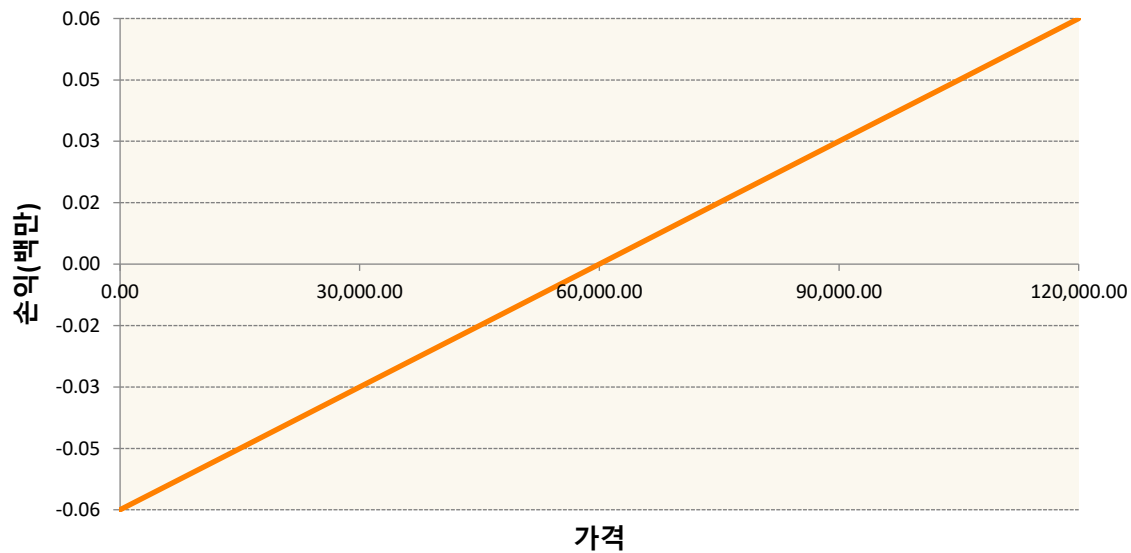
1. 계약금액

(단위:백만원)

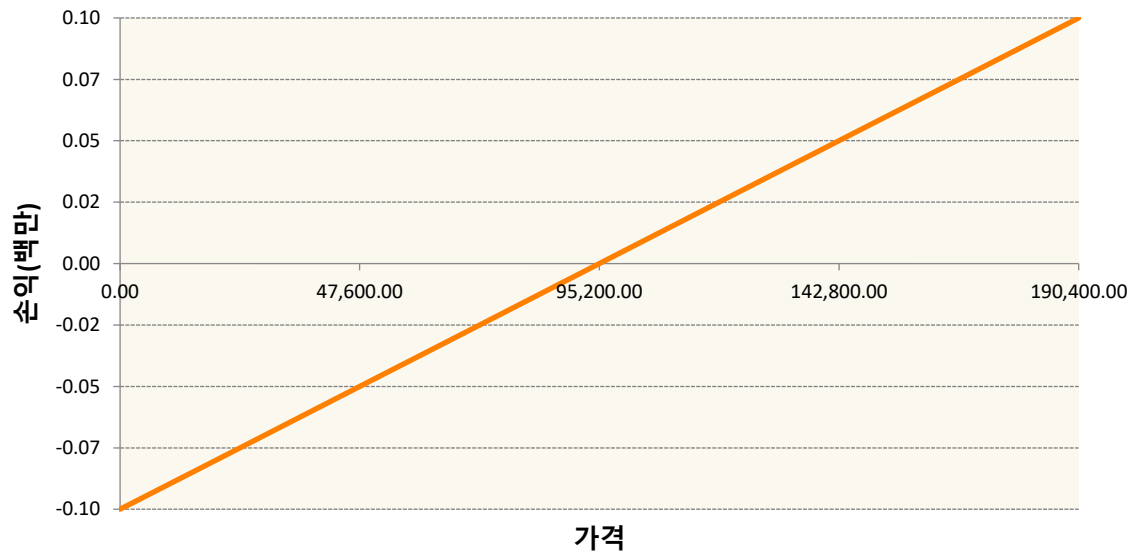
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	847	0	847	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S90004-2022-09 삼성전자개별선물



KR4150S90002-2022-09 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S90004		2022-09 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
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)

77

공시일	2022-08-29
기준일	2022-08-26

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 2022-08-29

기준일 2022-08-26

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

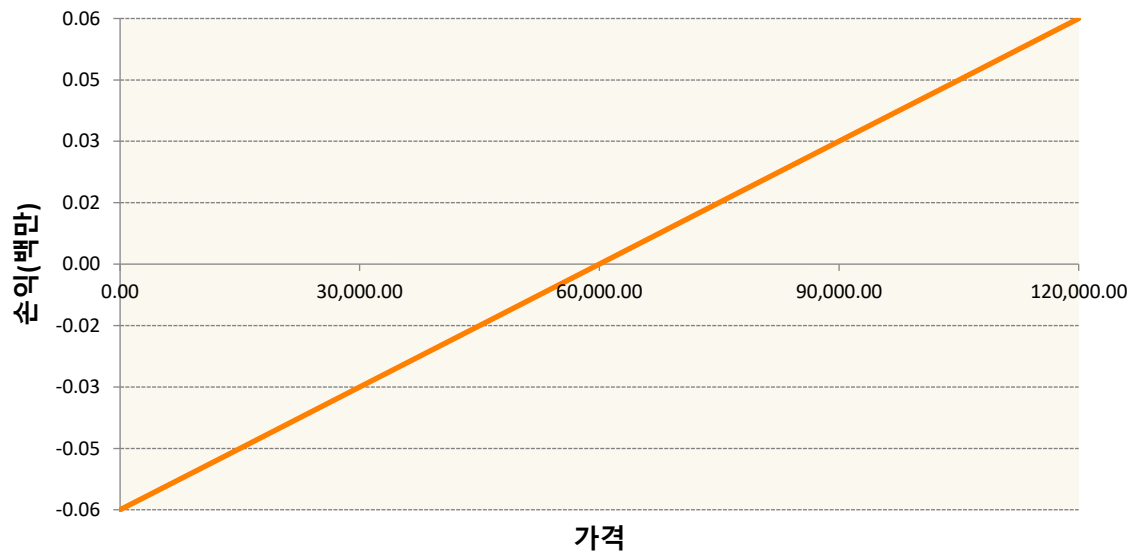
1. 계약금액

(단위:백만원)

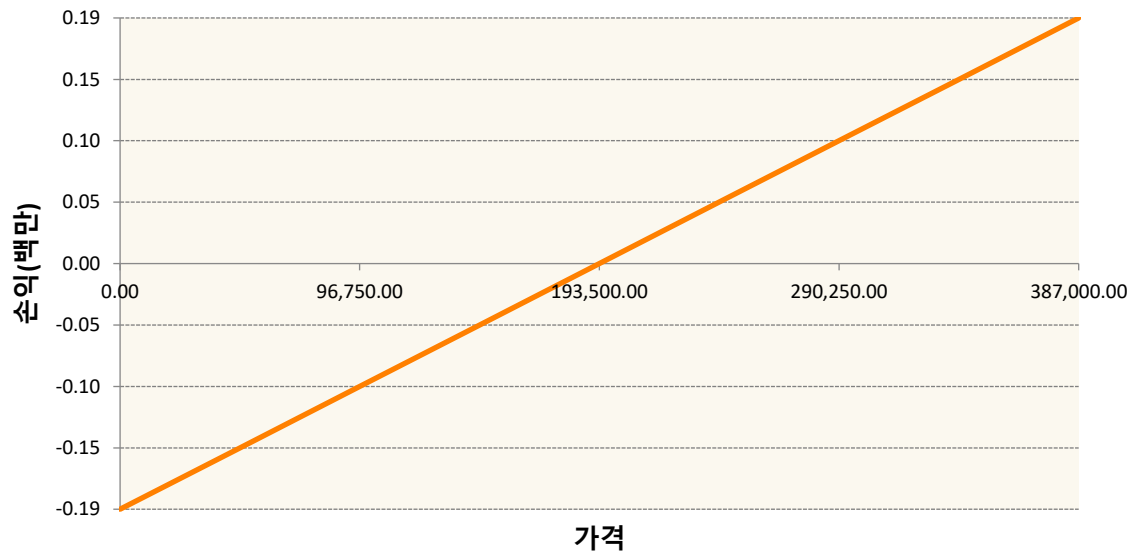
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	283	0	283	장내

2. 만기시점의 손익구조

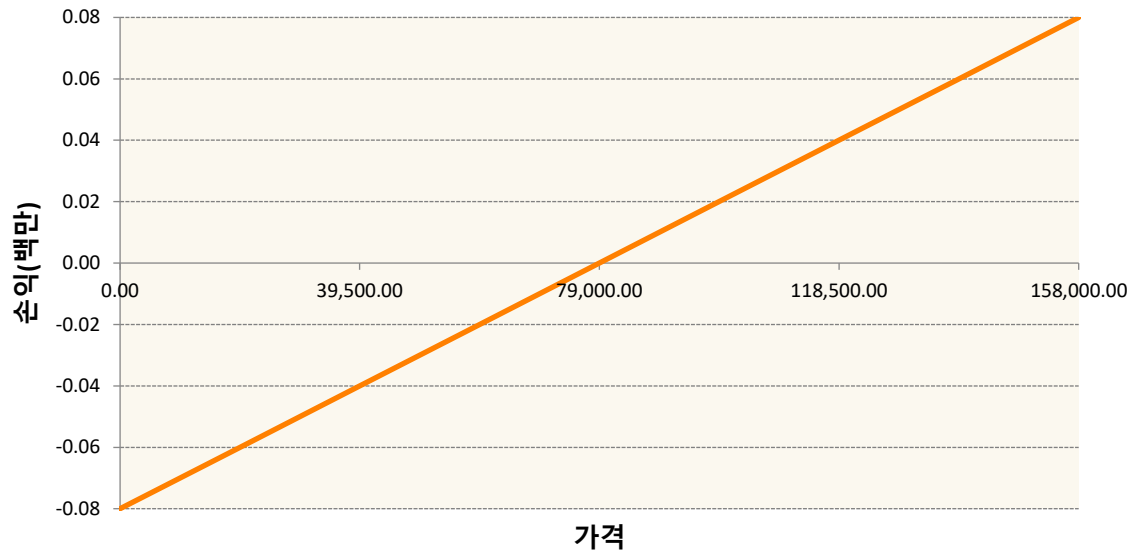
KR4111S90004-2022-09 삼성전자개별선물



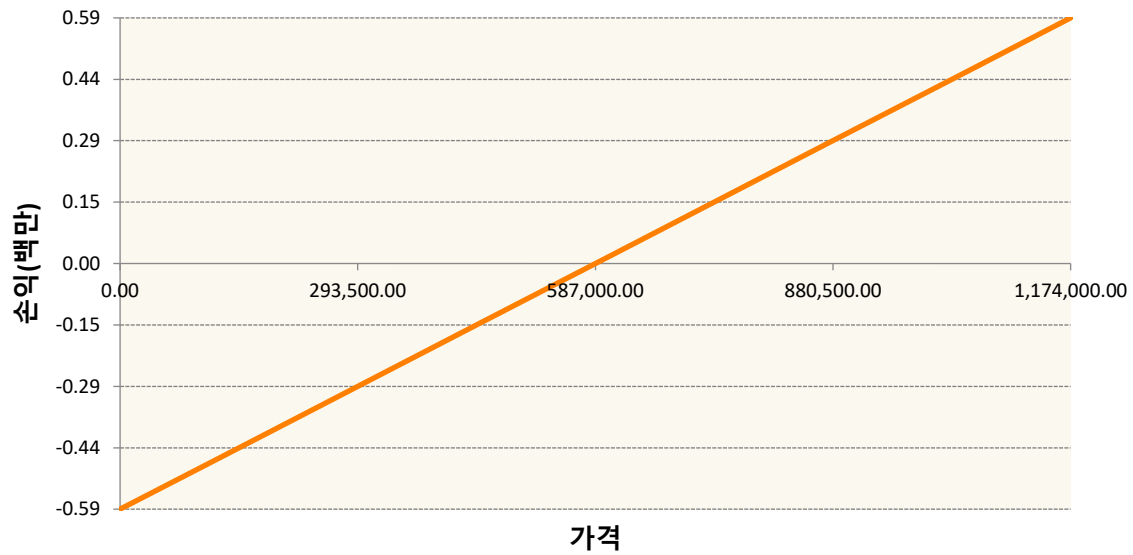
KR4116S90003-2022-09 현대차개별선물



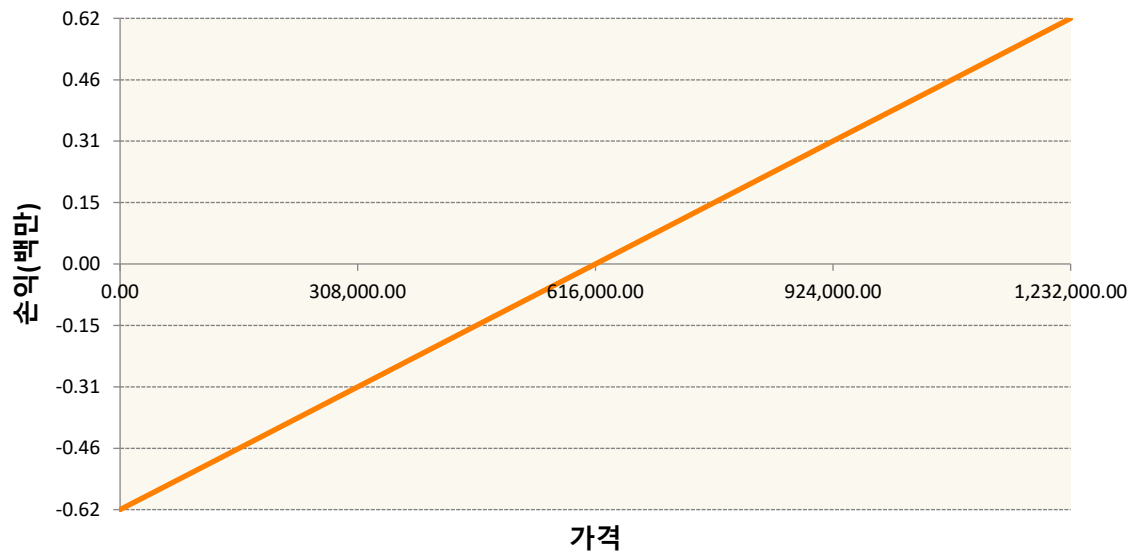
KR4119S90007-2022-09 기아개별선물



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		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	
KR4147S90008							2022-09 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)

25

공시일 2022-08-29

기준일 2022-08-26

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

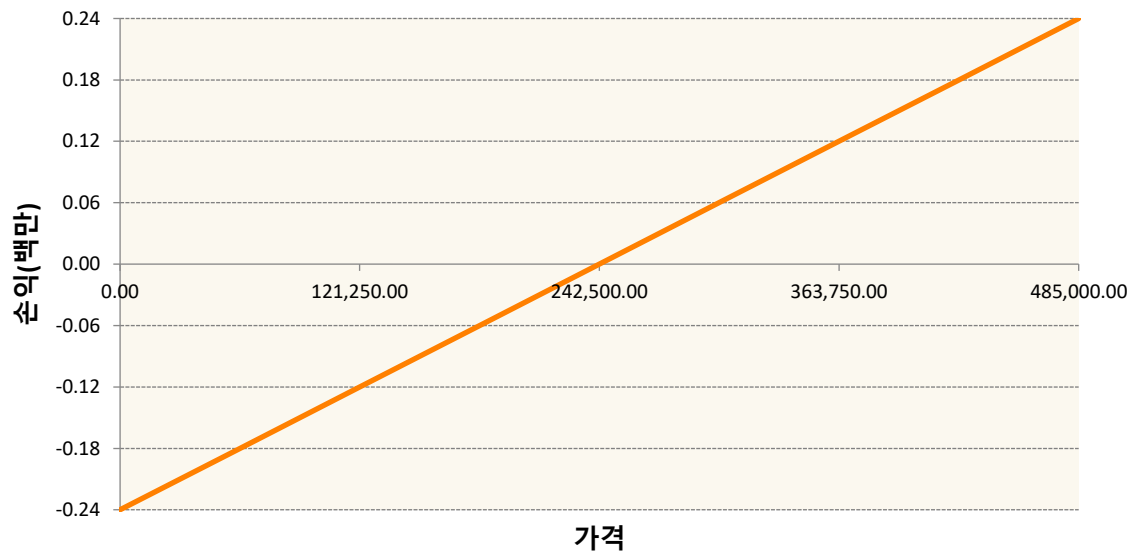
1. 계약금액

(단위:백만원)

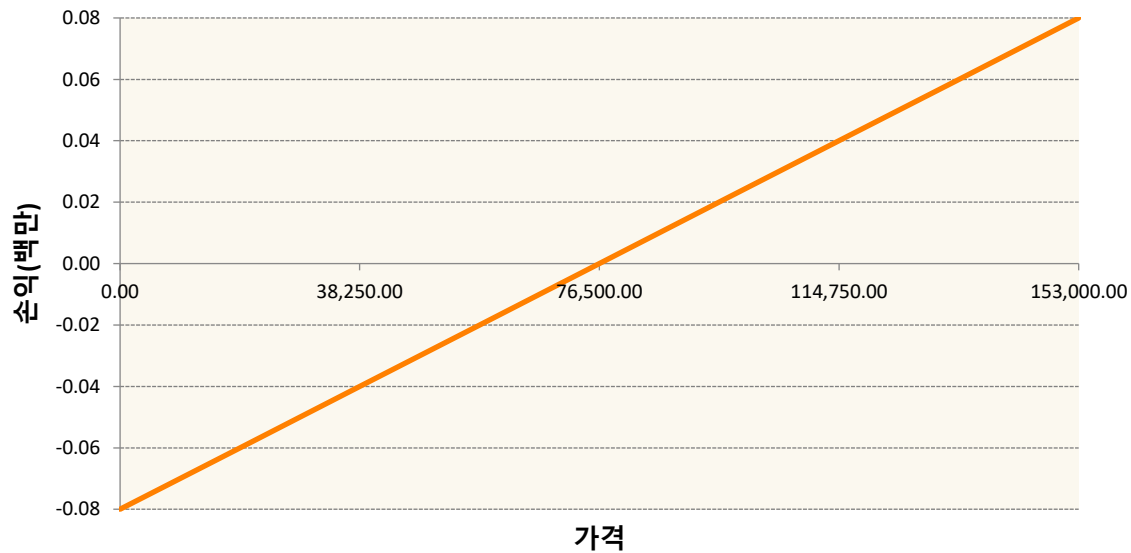
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	213	0	213	장내

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%	-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
KR41CFS90000		2022-09 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)

30

공시일 2022-08-29

기준일 2022-08-26

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

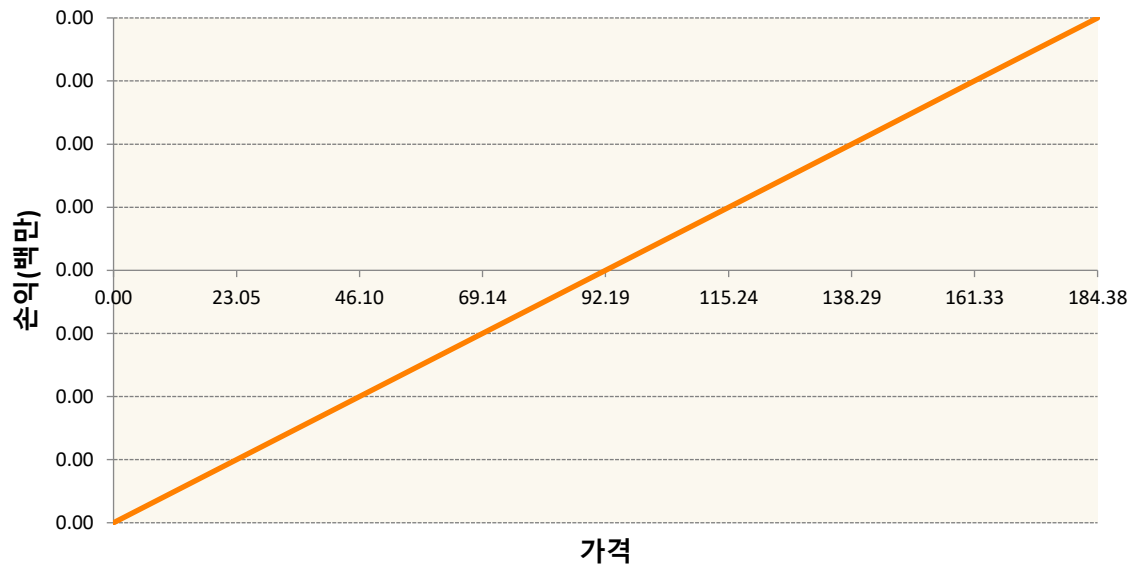
1. 계약금액

(단위:백만원)

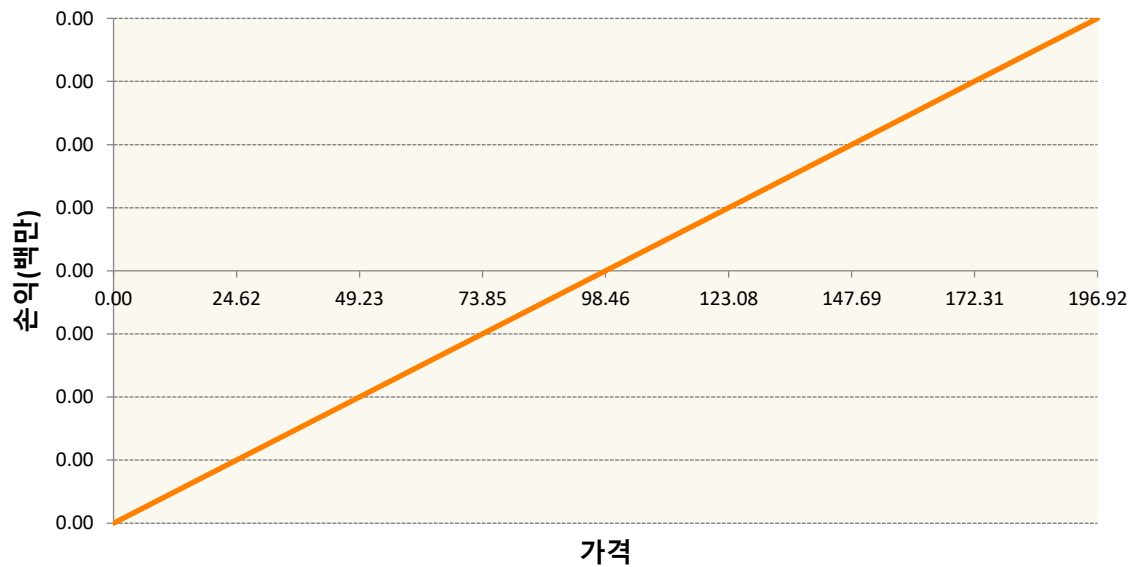
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,168	426	1,742	

2. 만기시점의 손익구조

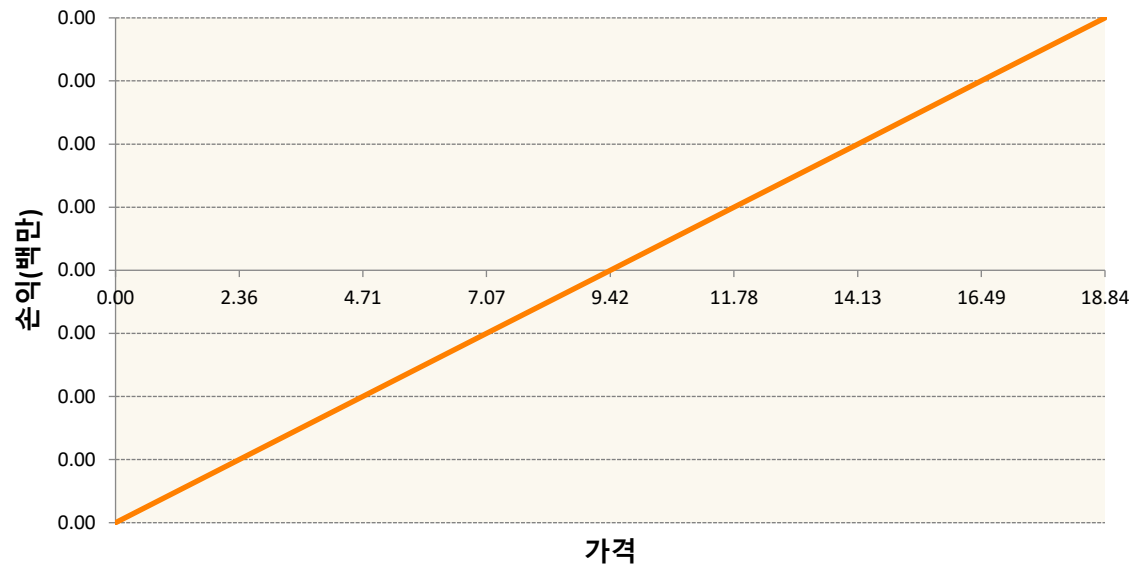
CLX2-WTI CRUDE FUTURE Nov22



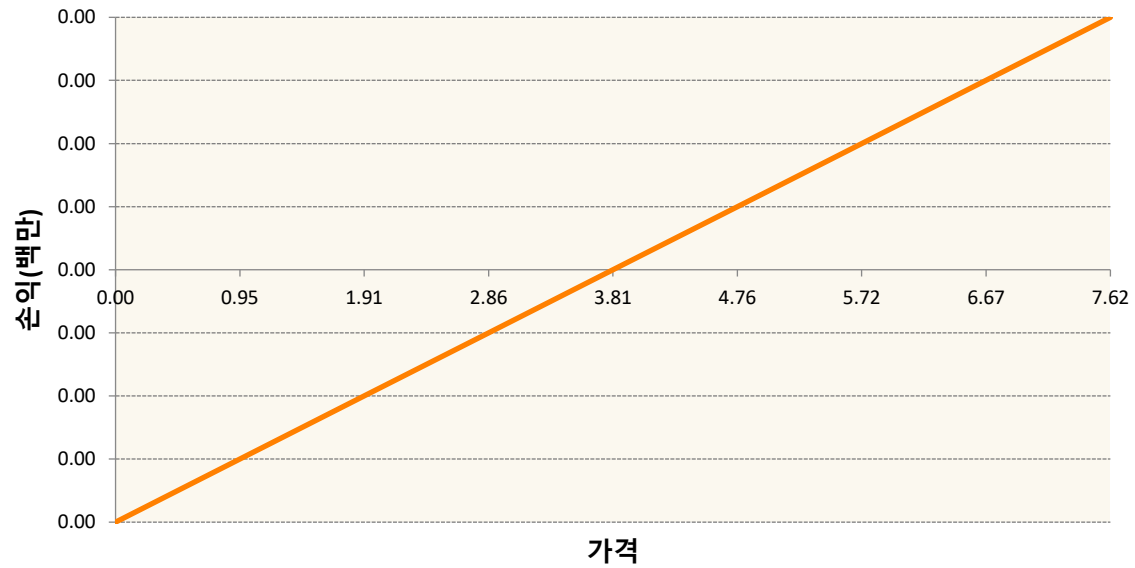
COX2-BRENT CRUDE FUTR Nov22



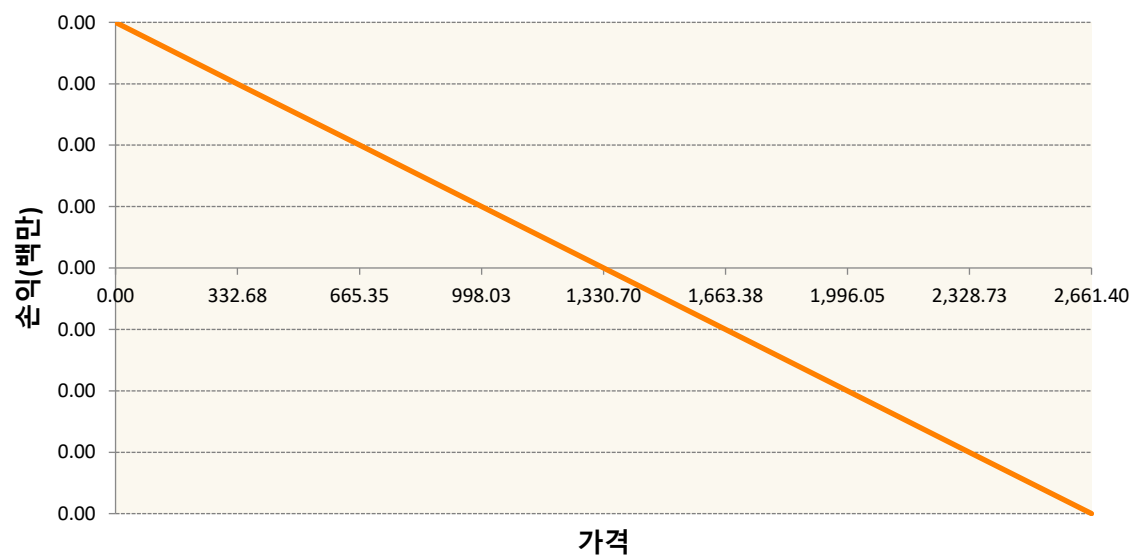
EOX2-E-MINI NATURAL GAS Nov22



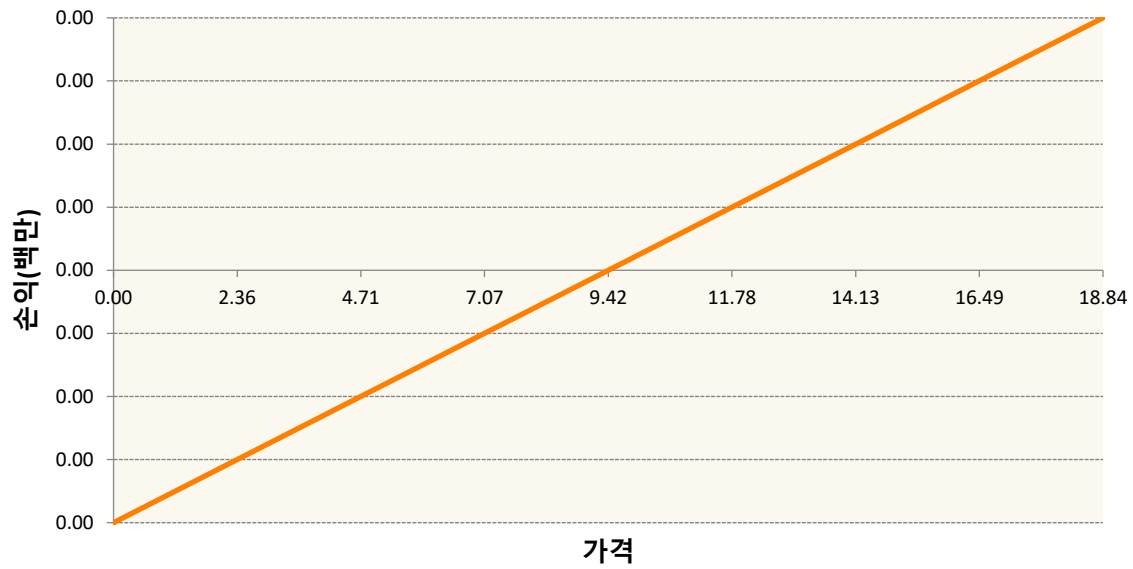
HOX2-NY Harb ULSD Fut Nov22



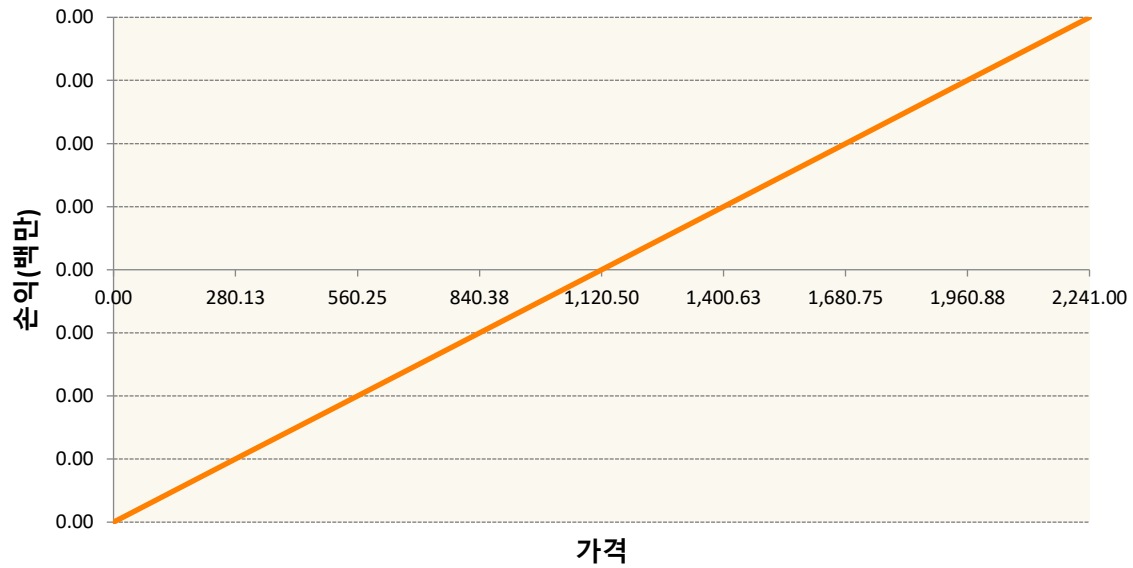
KR4175S90009-2022-09 달러선물



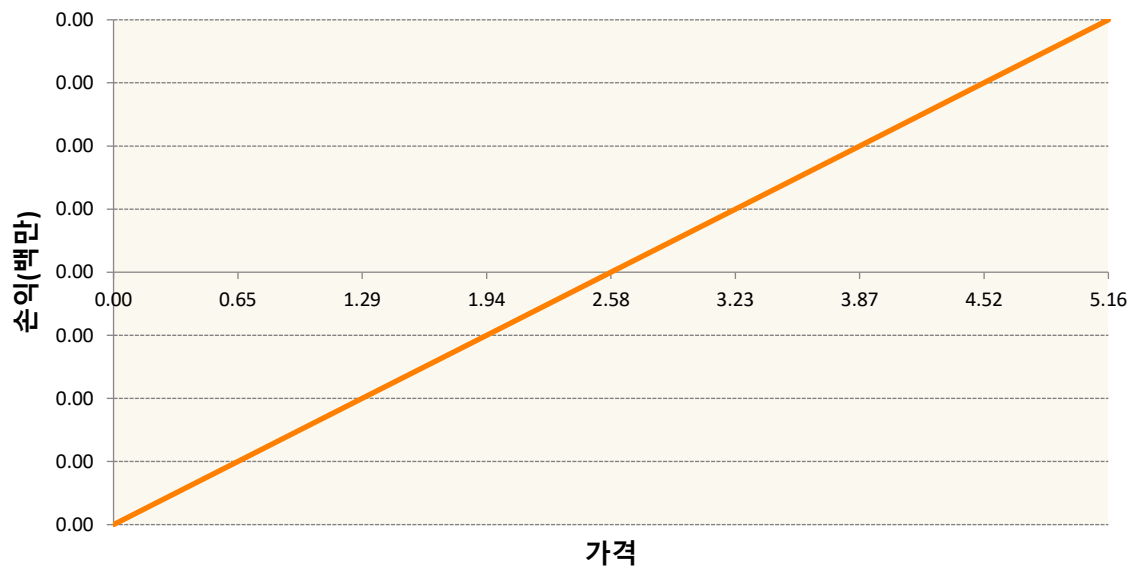
NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QX22-Low Su Gasoil G Nov22



XB22-GASOLINE RBOB FUT Nov22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLX2	WTI CRUDE FUTURE Nov22	29
COX2	BRENT CRUDE FUTR Nov22	31
EOX2	E-MINI NATURAL GAS Nov22	5
HOX2	NY Harb ULSD Fut Nov22	17
KR4175S900	2022-09 달러선물	34
NGX22	NATURAL GAS FUTR Nov22	69
QSX2	Low Su Gasoil G Nov22	12
XBX2	GASOLINE RBOB FUT Nov22	11

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

564