

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

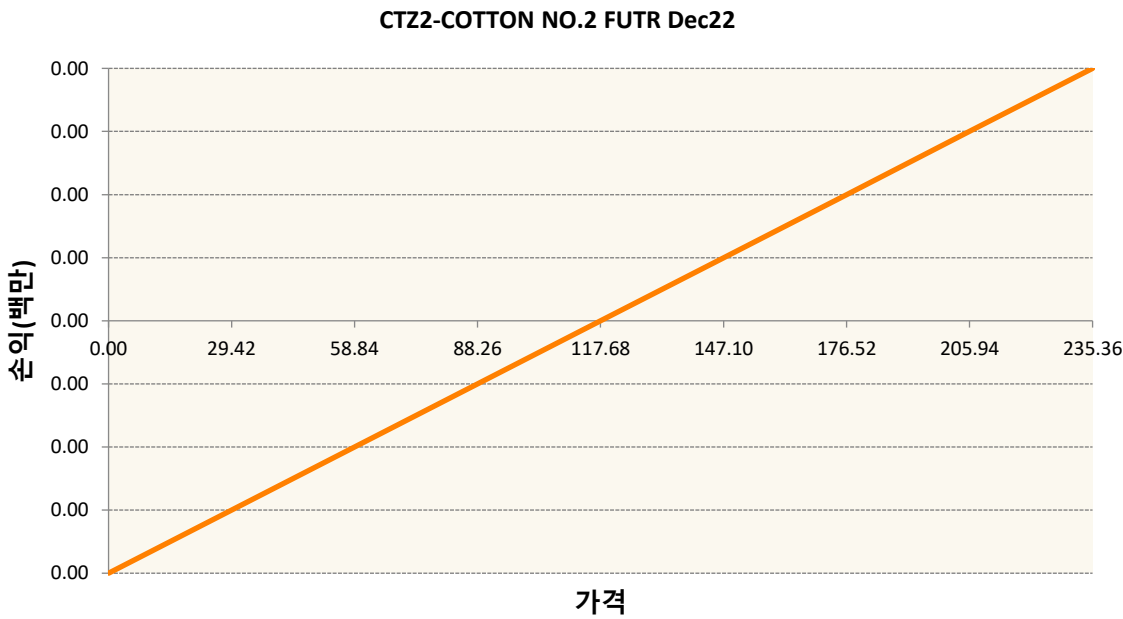
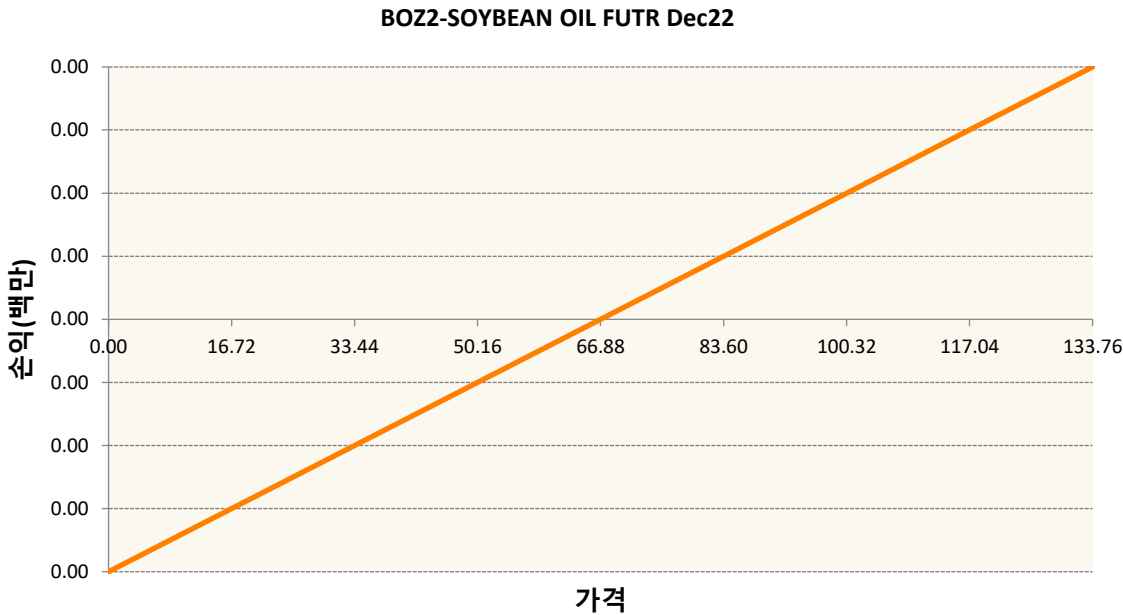
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

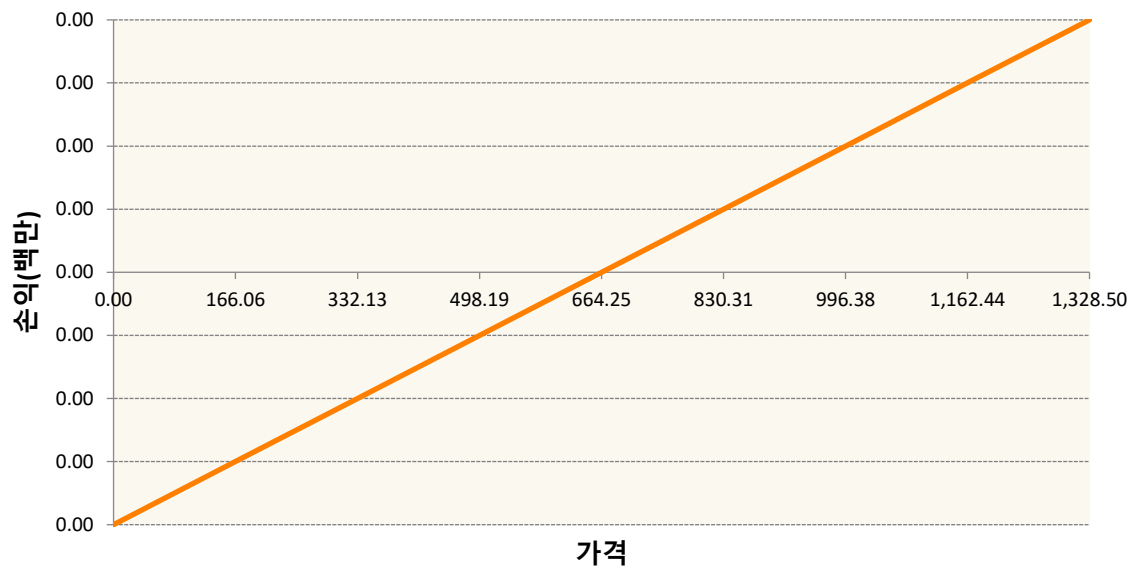
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	7,292	945	6,347	

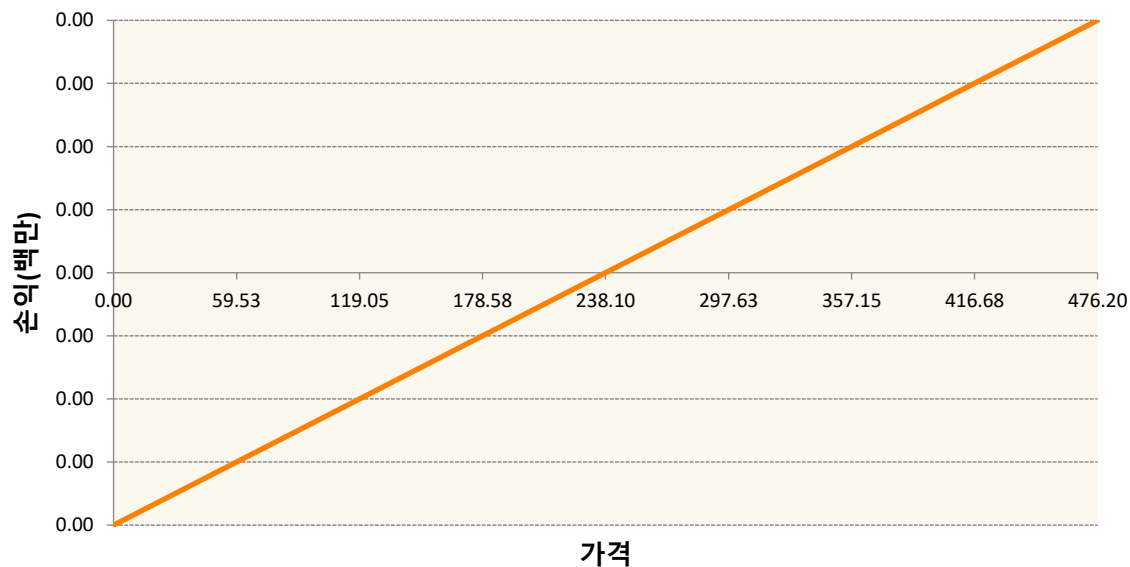
2. 만기시점의 손익구조



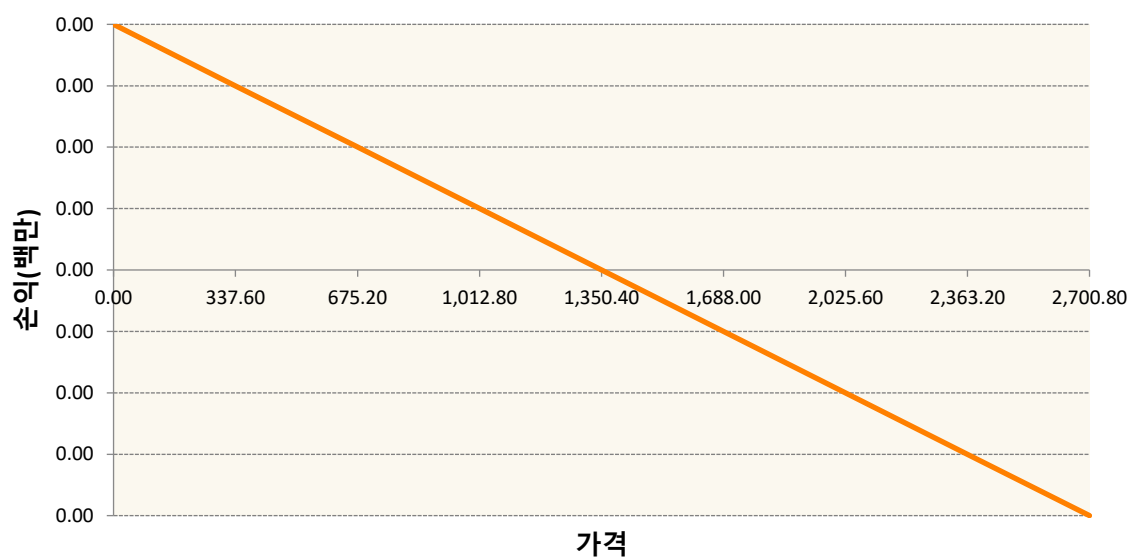
CZ2-CORN FUTURE Dec22



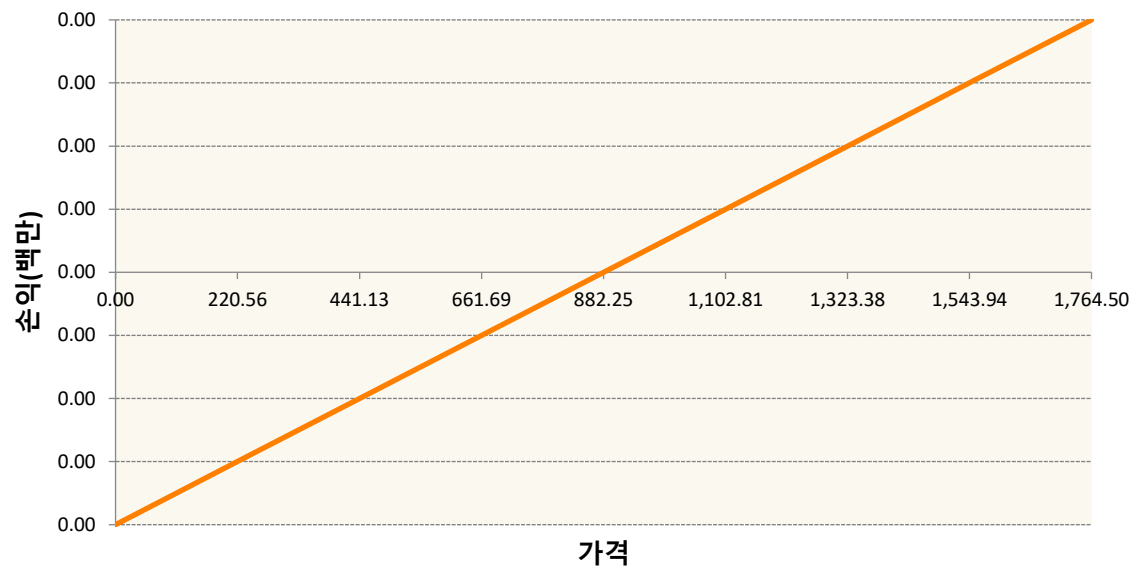
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



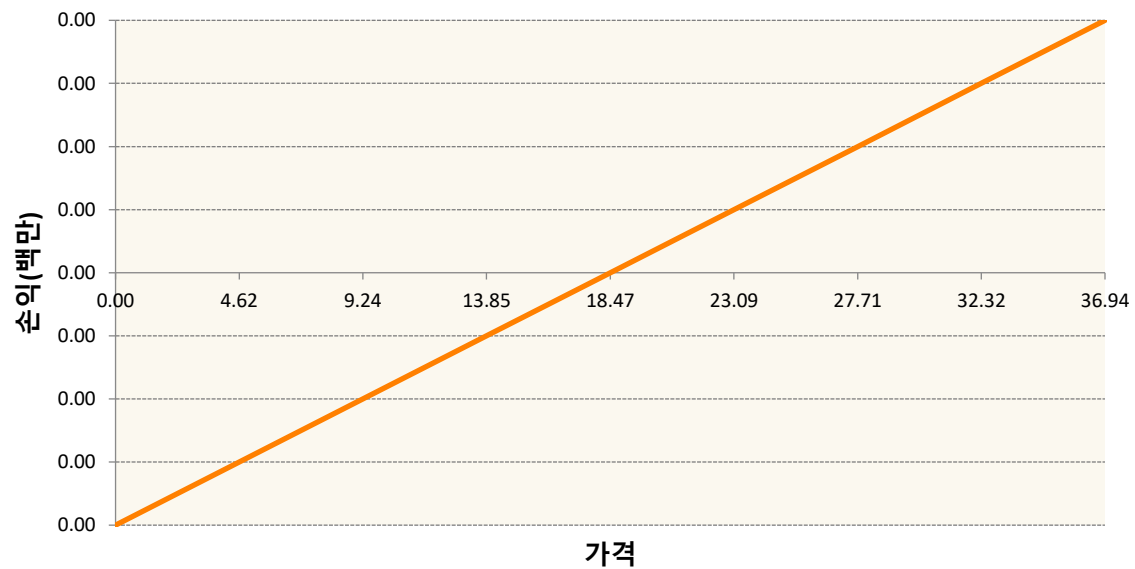
KR4175S90009-2022-09 달러선물



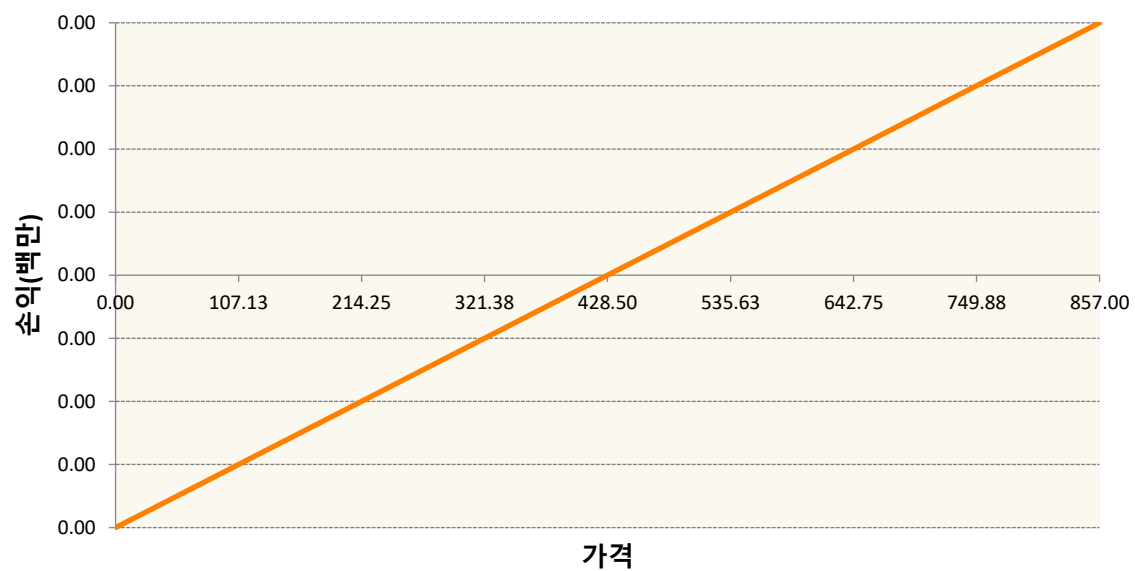
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

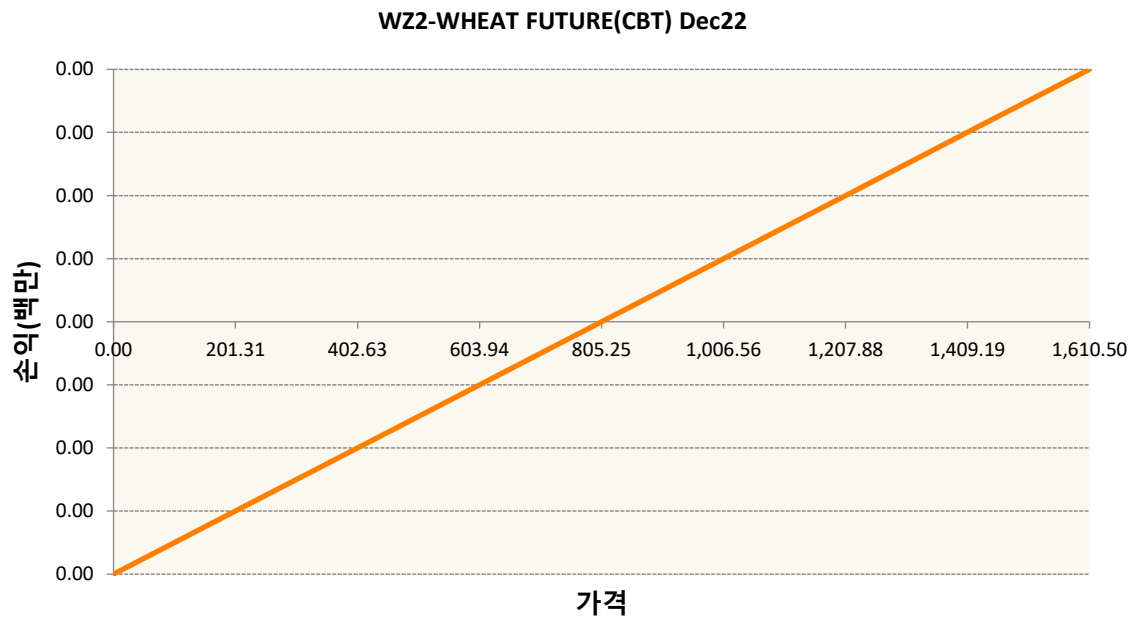
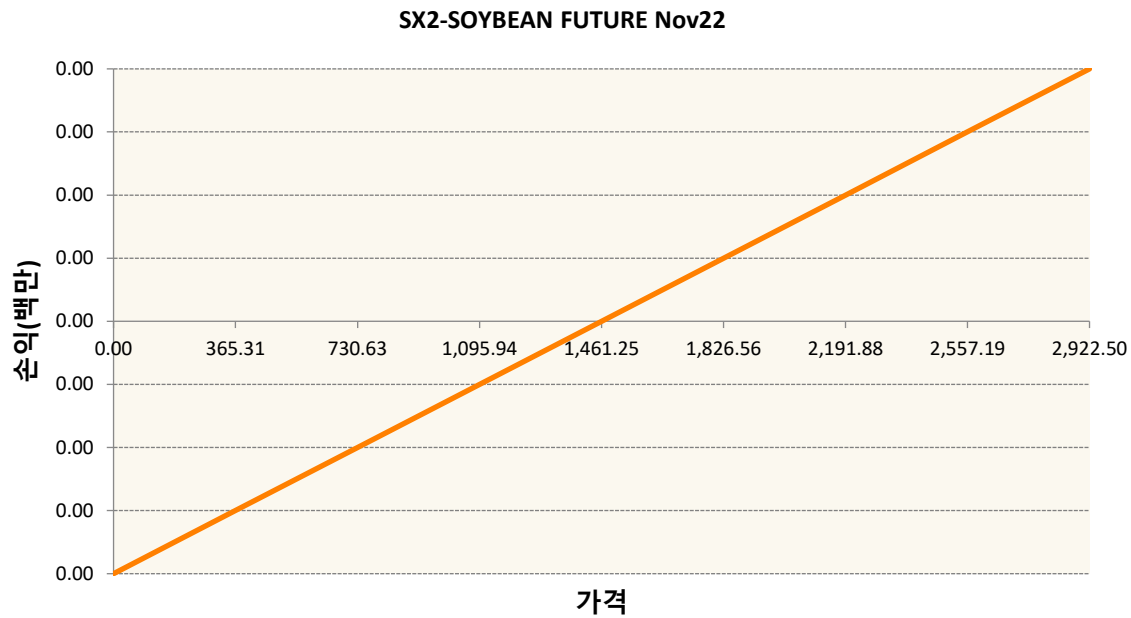


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



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	2022-08-30
기준일	2022-08-29

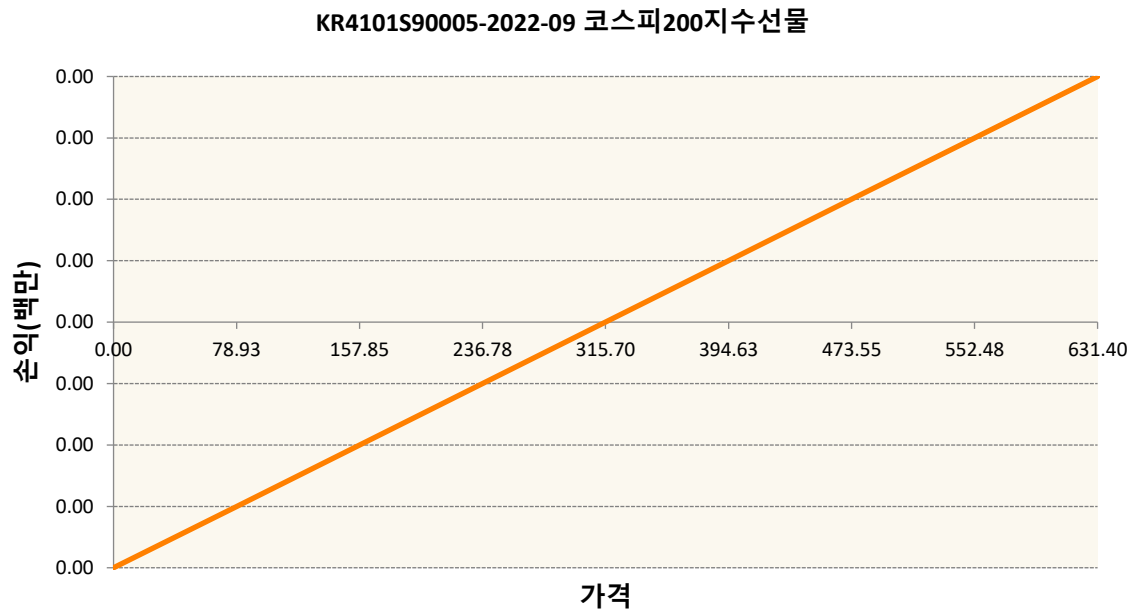
스마트인덱스모

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	1,026	0	1,026	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101S90005			2022-09 코스피200지수선물				82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,602	0	4,602	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래220311	365
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

479

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

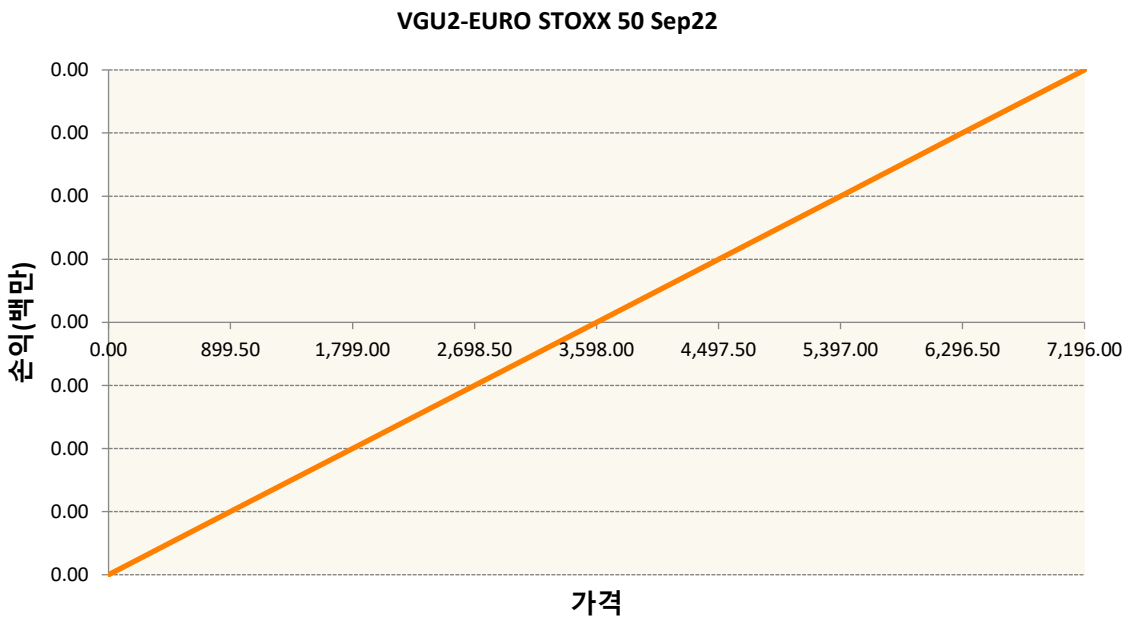
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	583	0	583	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU2	EURO STOXX 50 Sep22	47
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

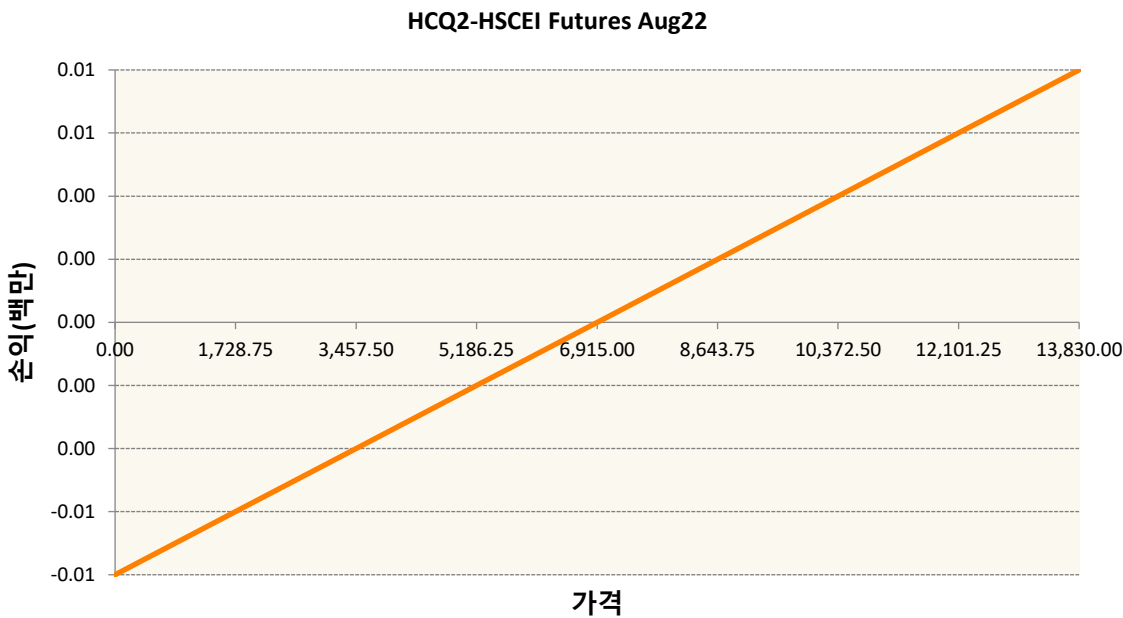
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,156	0	1,156	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ2	HSCEI Futures Aug22	92
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

136

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

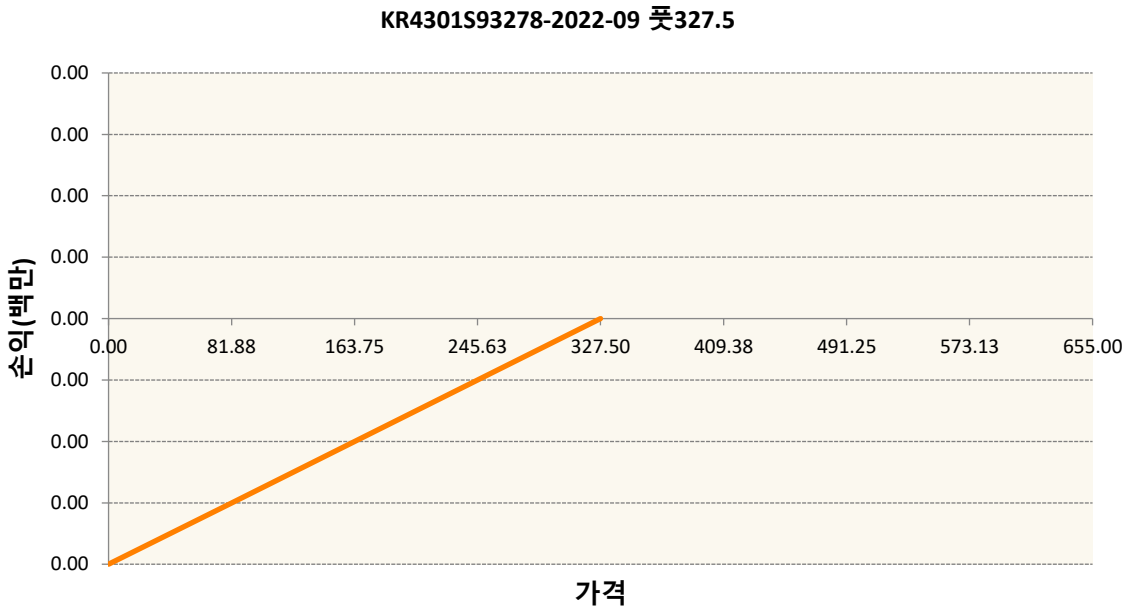
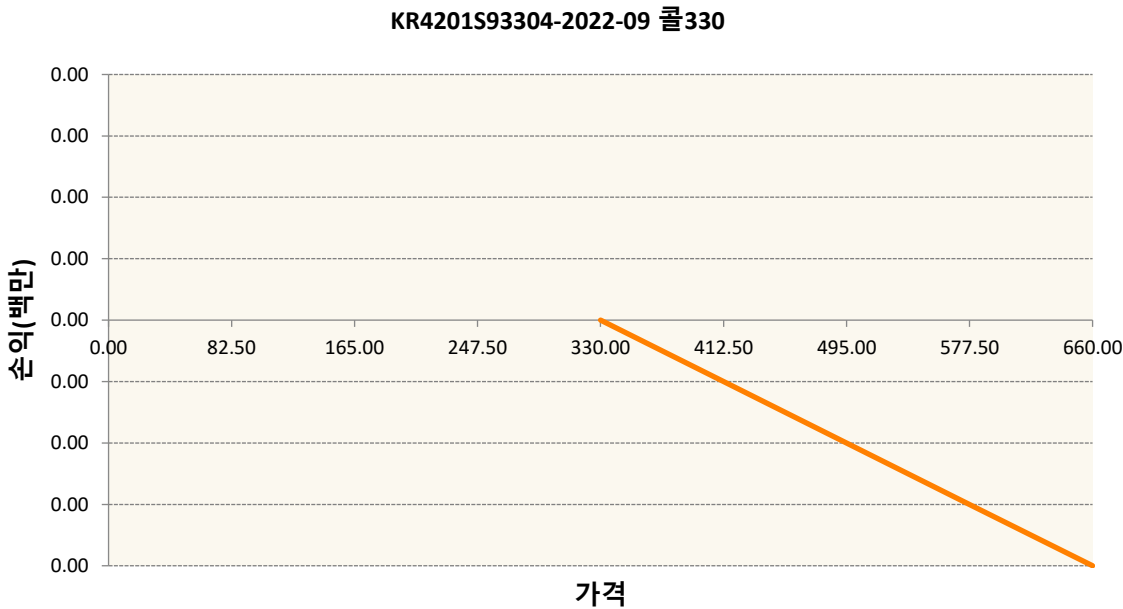
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

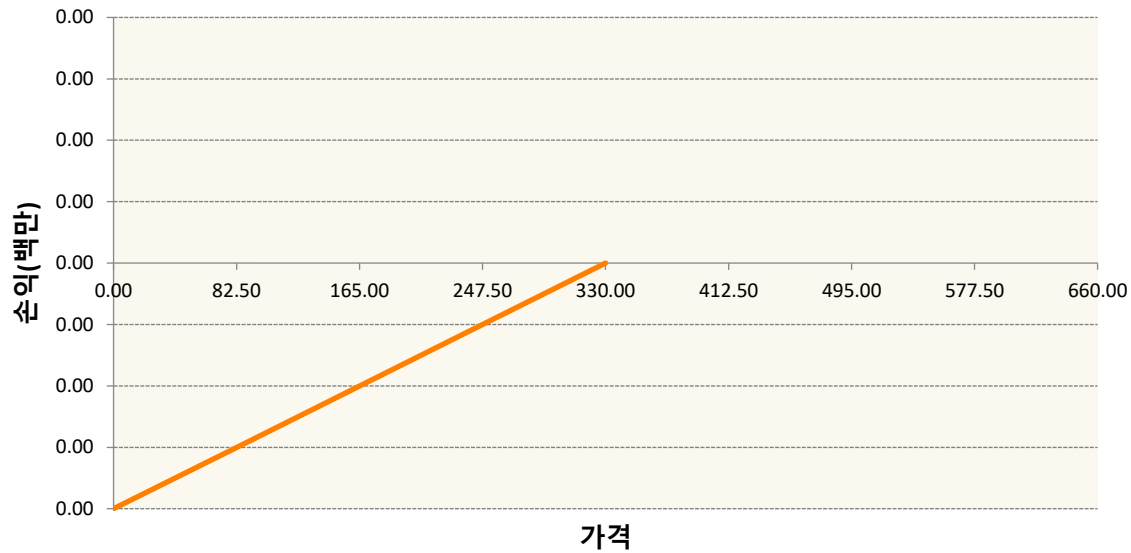
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301S93302-2022-09 풋330



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201S93304			2022-09 콜330				2,070
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	253	252	251	249	246	241	233
-5.33%	251	248	242	233	221	205	186
-2.67%	233	218	197	172	141	107	68
0%	144	101	52	0	-56	-114	-175
2.67%	-143	-217	-292	-367	-443	-520	-597
5.33%	-755	-833	-912	-991	-1,070	-1,150	-1,230
8.00%	-1,696	-1,750	-1,808	-1,870	-1,934	-2,001	-2,070
KR4301S93278			2022-09 풋327.5				146
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-144	-144	-145	-145	-145	-145	-146
-5.33%	-92	-92	-92	-93	-94	-94	-95
-2.67%	-40	-41	-42	-44	-45	-47	-49
0%	7	5	2	0	-3	-5	-8
2.67%	44	41	38	35	31	28	25
5.33%	68	65	62	58	55	52	49
8.00%	78	76	74	72	70	67	65
KR4301S93302			2022-09 풋330				600
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-597	-597	-597	-597	-598	-599	-600
-5.33%	-384	-385	-386	-387	-389	-392	-395
-2.67%	-174	-177	-180	-184	-189	-195	-202
0%	24	17	9	0	-9	-19	-29

2.67%	189	177	164	152	139	126	114
5.33%	300	287	274	261	248	235	221
8.00%	357	348	338	328	317	306	295

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

(단위:백만원)

2,504

공시일 2022-08-30

기준일 2022-08-29

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

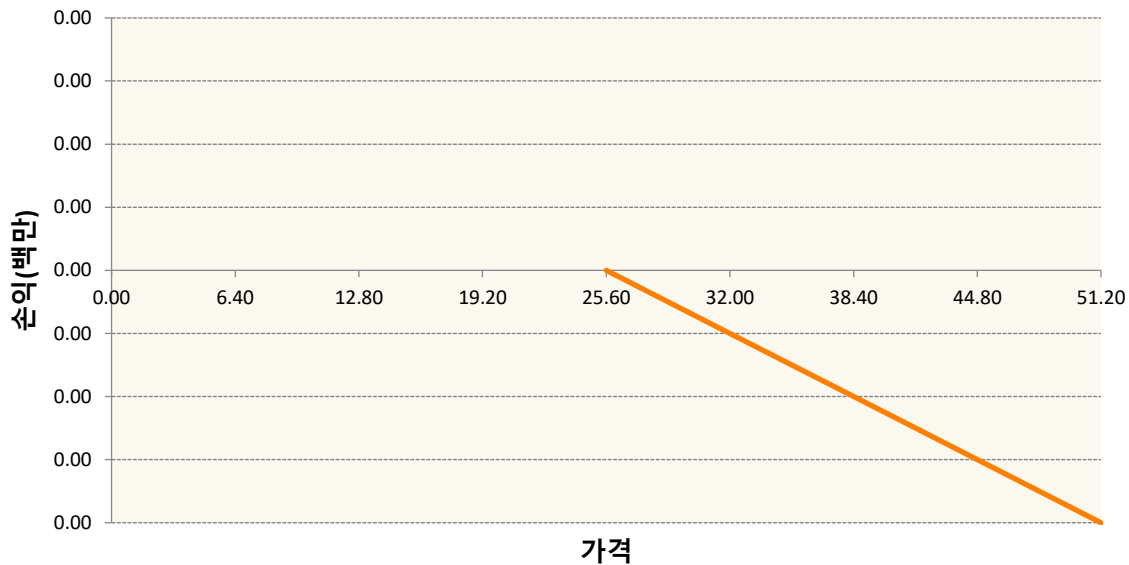
1. 계약금액

(단위:백만원)

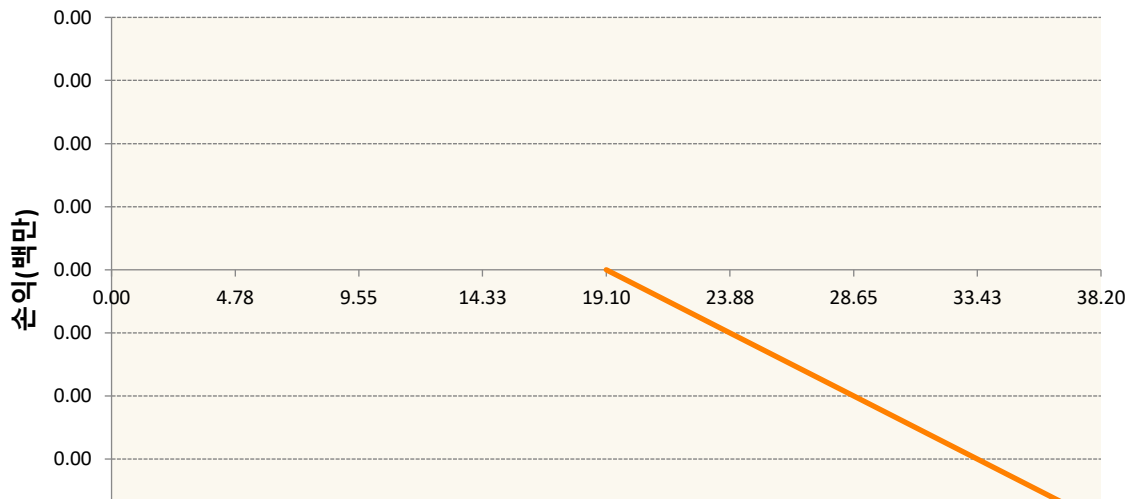
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	37	-37	장내
누계	지수	스왑	4	0	4	장외
누계	통화	선도	0	1,477	-1,477	장외

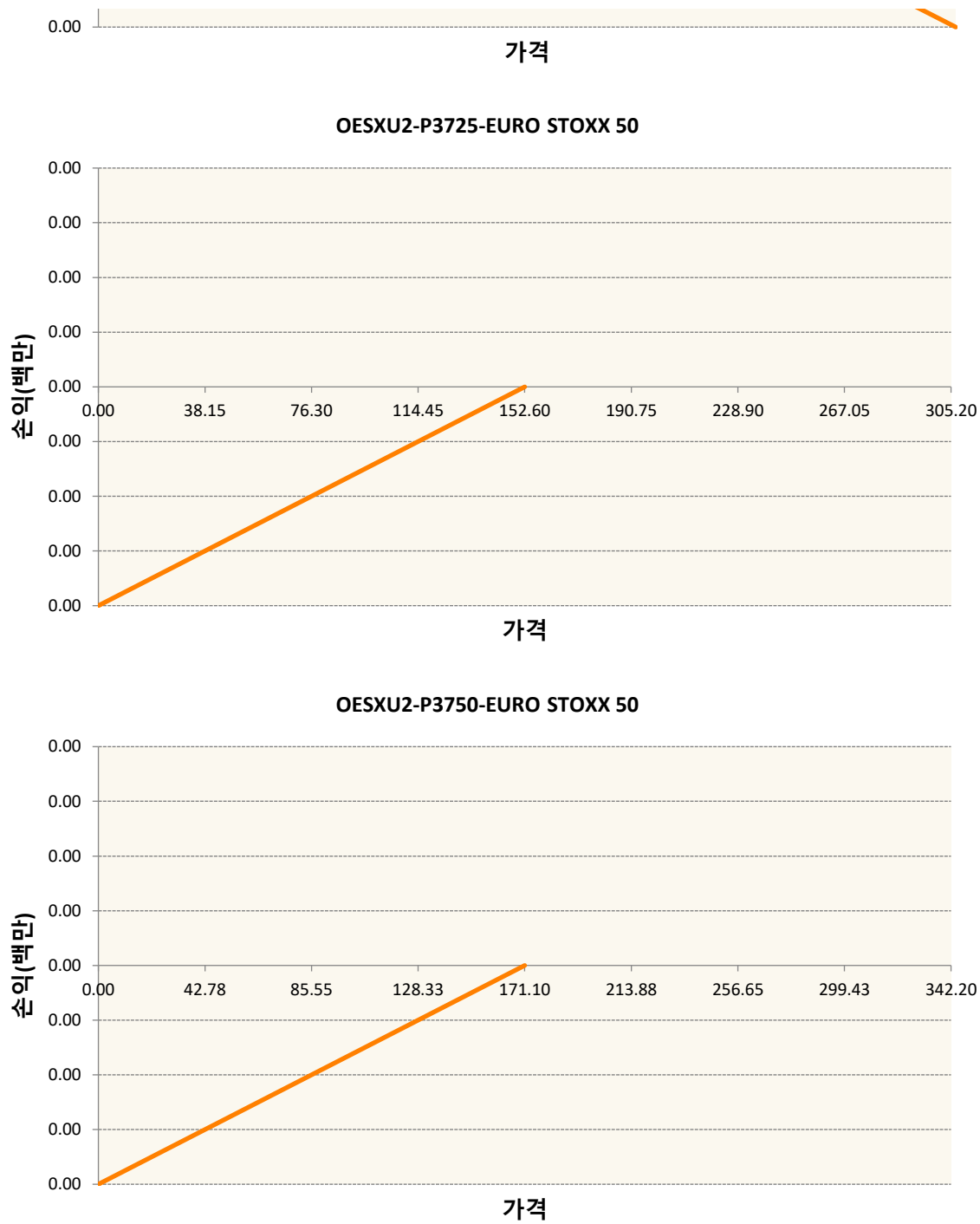
2. 만기시점의 손익구조

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

3
32
70
16
0.36
0.08
2
1

공시일 2022-08-30

기준일 2022-08-29

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

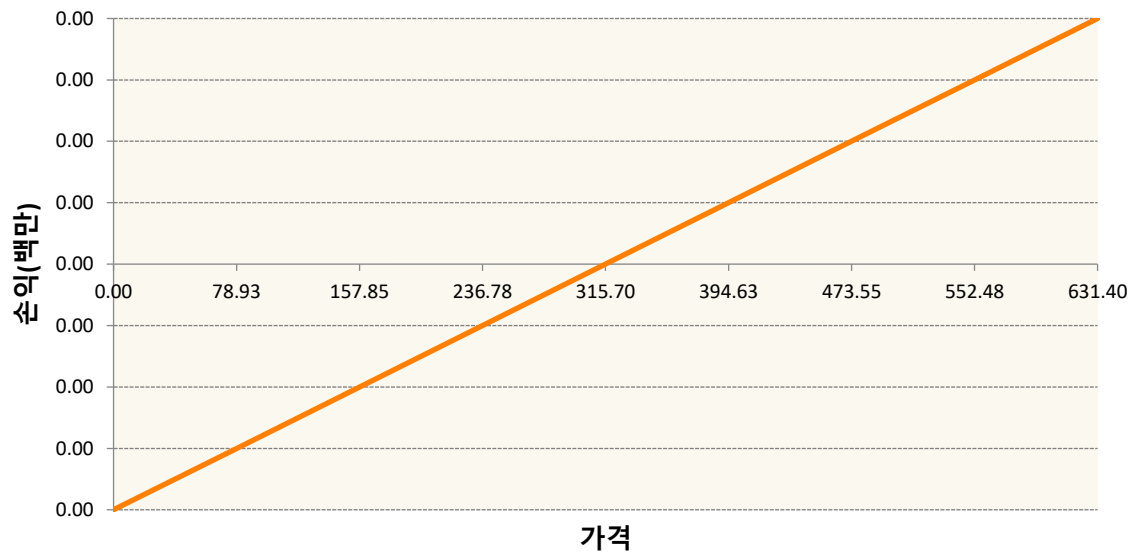
1. 계약금액

(단위:백만원)

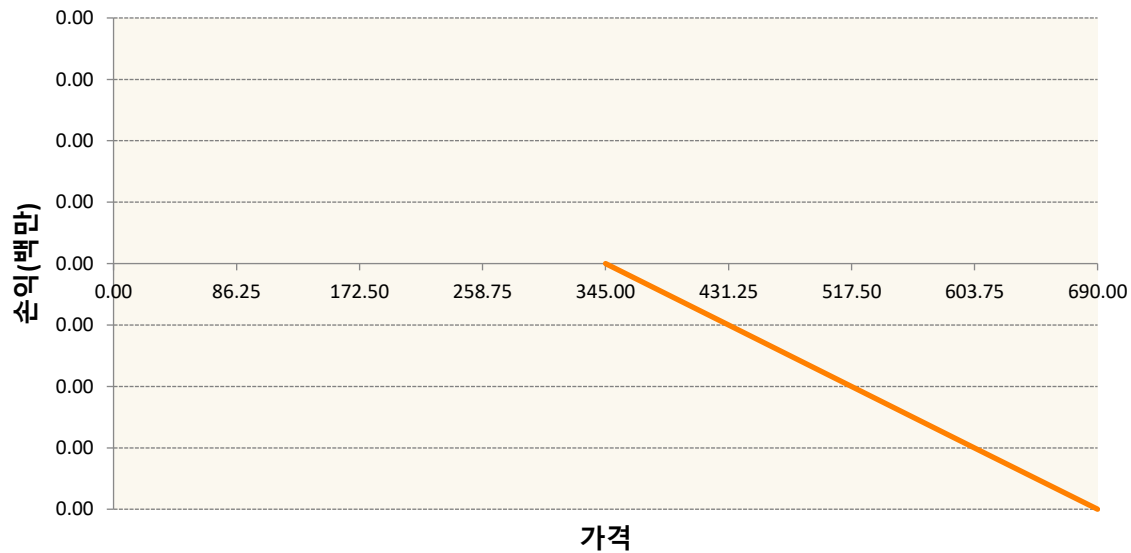
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	395	0	395	장내
누계	유가증권	옵션	329	4,503	-4,174	장내

2. 만기시점의 손익구조

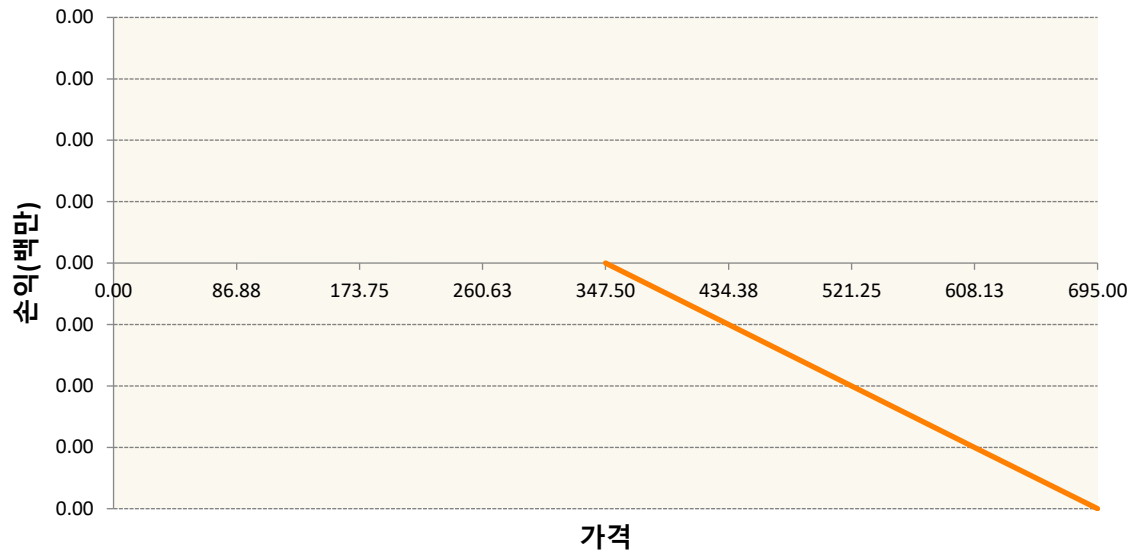
KR4101S90005-2022-09 코스피200지수선물



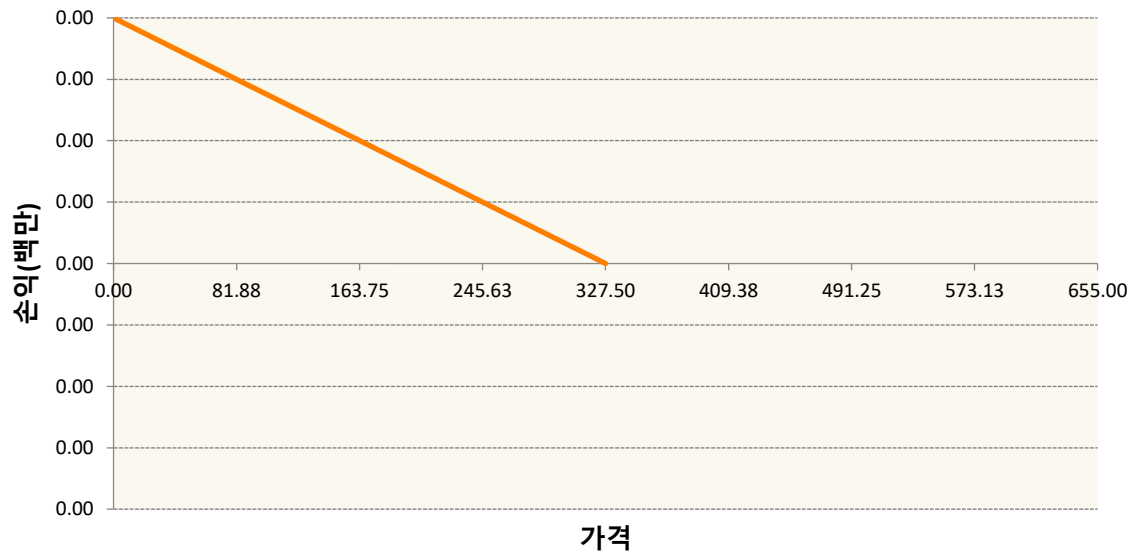
KR4201S93452-2022-09 콜345



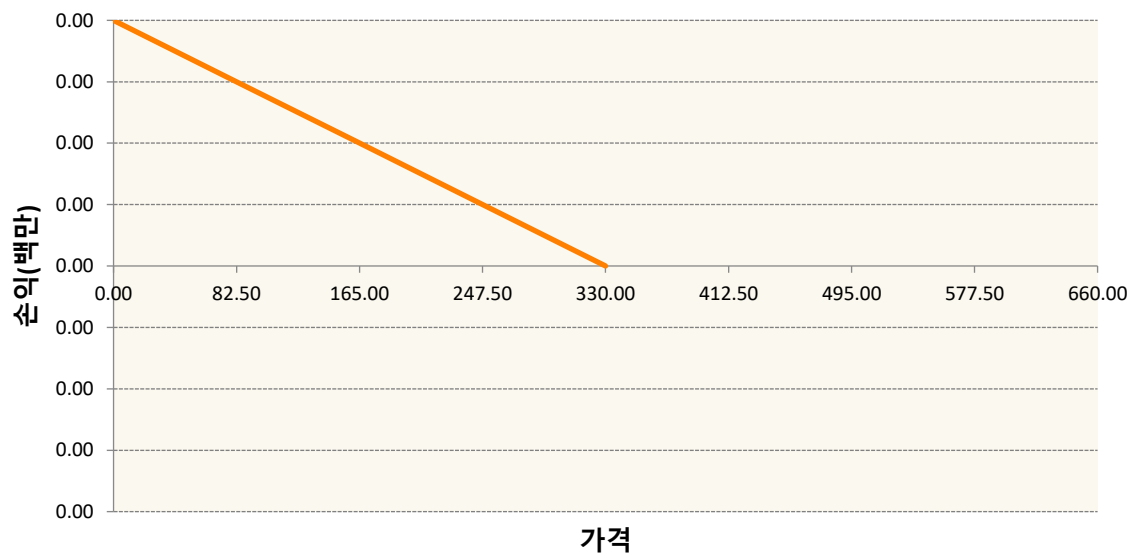
KR4201S93478-2022-09 콜347.5



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			
-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			
KR4201S93452							2022-09 콜345		37	
	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%	1	1	1	1	1	1	0			
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3			
2.67%	0	-1	-2	-3	-5	-7	-8			
5.33%	-5	-7	-9	-12	-14	-17	-19			
8.00%	-19	-22	-25	-28	-31	-34	-37			
KR4201S93478							2022-09 콜347.5		40	
	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%	1	1	1	1	1	1	0			
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3			
2.67%	0	-1	-2	-3	-5	-7	-9			
5.33%	-4	-7	-9	-12	-14	-17	-21			
8.00%	-18	-22	-25	-29	-33	-37	-40			
KR4301S93278							2022-09 풋327.5		6	
	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			
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4			
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	-2	-2	-2	-1	-1	-1	-1			
5.33%	-3	-3	-2	-2	-2	-2	-2			
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3			
KR4301S93302							2022-09 풋330		18	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	18	18	18	18
-5.33%	11	11	11	11	12	12	12
-2.67%	5	5	5	5	6	6	6
0%	-1	0	0	0	0	1	1
2.67%	-6	-5	-5	-5	-4	-4	-3
5.33%	-9	-9	-8	-8	-7	-7	-7
8.00%	-11	-10	-10	-10	-9	-9	-9

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

(단위:백만원)

87

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	8,107	0	8,107	

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	2022-08-30
기준일	2022-08-29

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	6,808	0	6,808	

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	2022-08-30
기준일	2022-08-29

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	21,237	0	21,237	
누계	통화	선도	0	20,897	-20,897	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C6P* KRW/USD 27-09-22E		605
FXW213C7R* KRW/USD 27-10-22E		463
FXW213C8R* KRW/USD 28-11-22E		604

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	657

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

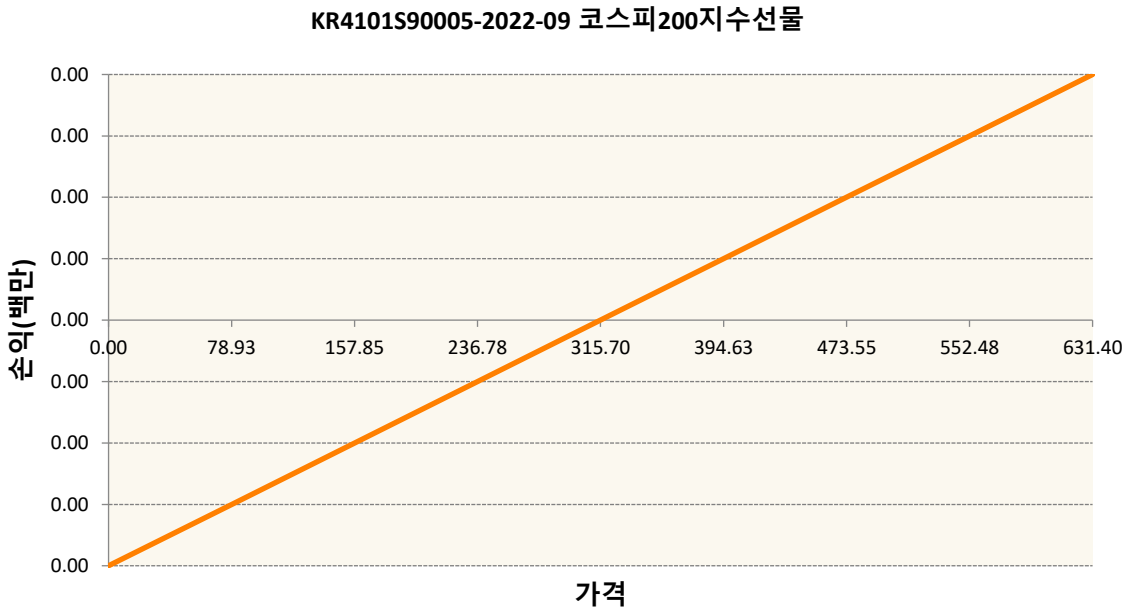
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	395	0	395	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%	-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 2022-08-30

기준일 2022-08-29

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

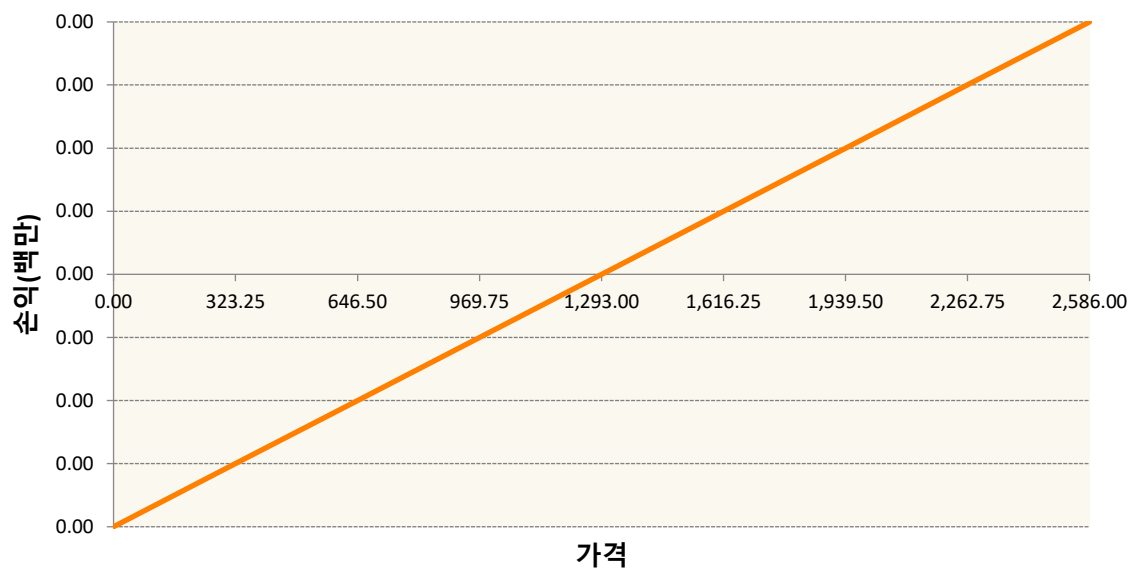
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	828	0	828	
누계	유가증권	스왑	1,652	0	1,652	장외
누계	통화	선도	0	1,141	-1,141	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCU2-VN30 Index Future SEP22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	132
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	66

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

(단위:백만원)

259

공시일 2022-08-30

기준일 2022-08-29

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

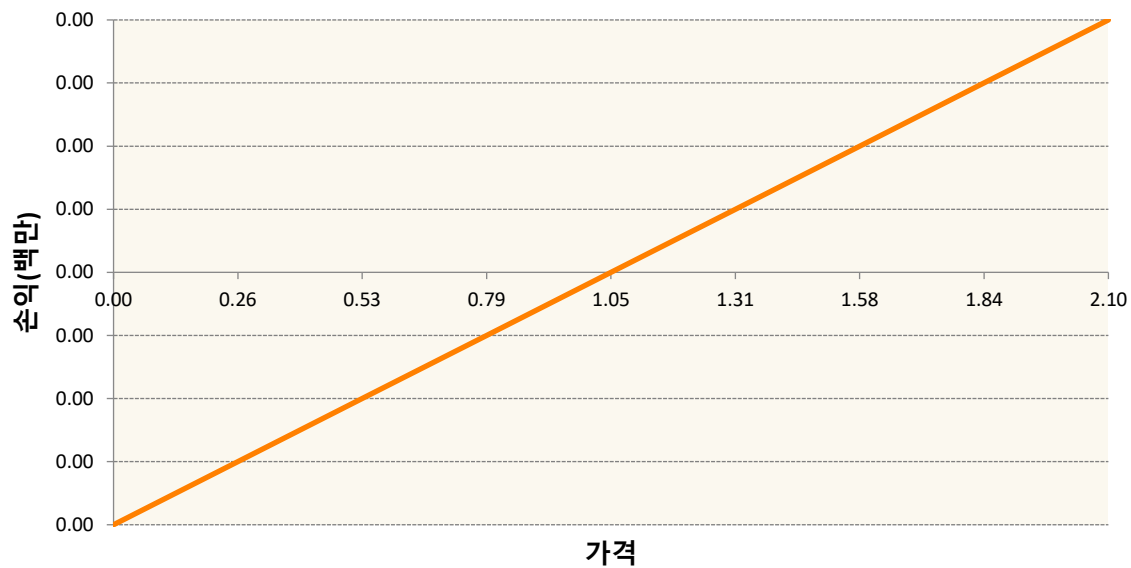
1. 계약금액

(단위:백만원)

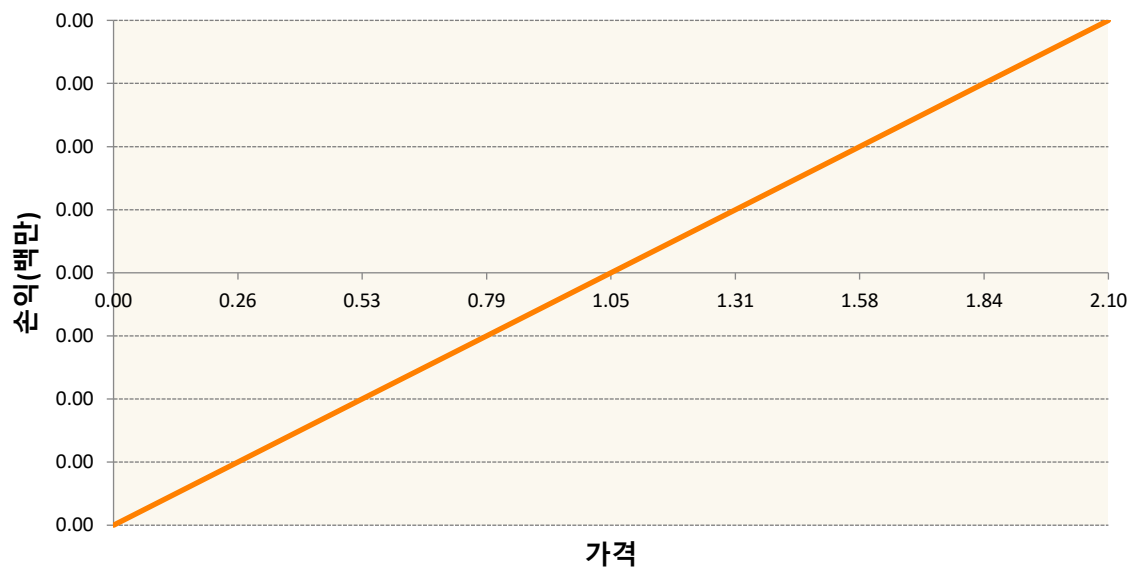
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	42,051	0	42,051	

2. 만기시점의 손익구조

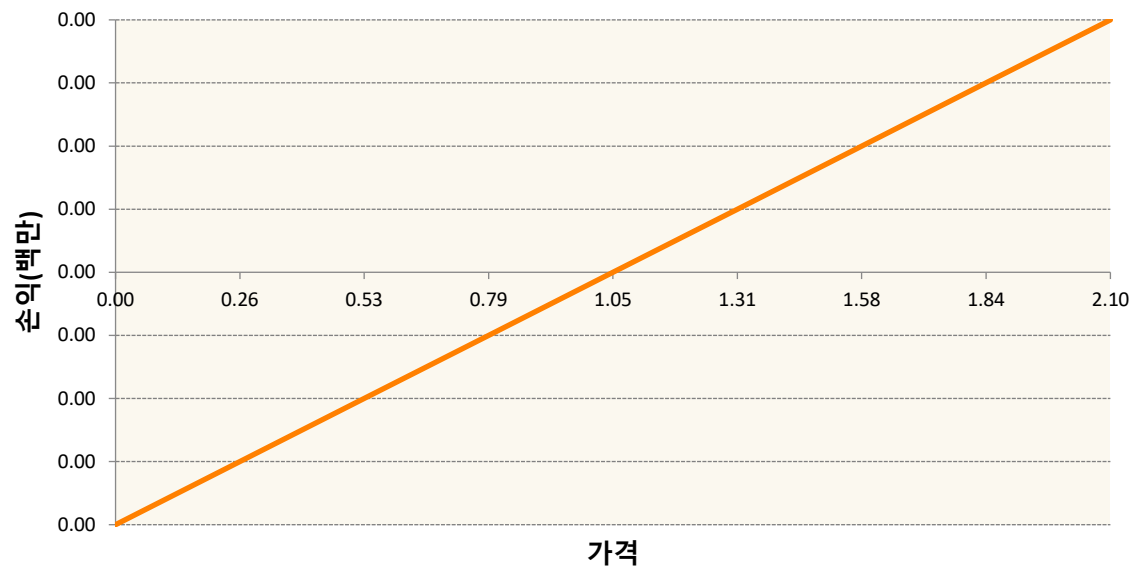
210884220325-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220326-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



210884220327-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

210

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

3,041

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

105

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

(단위:백만원)

6,194

공시일 2022-08-30

기준일 2022-08-29

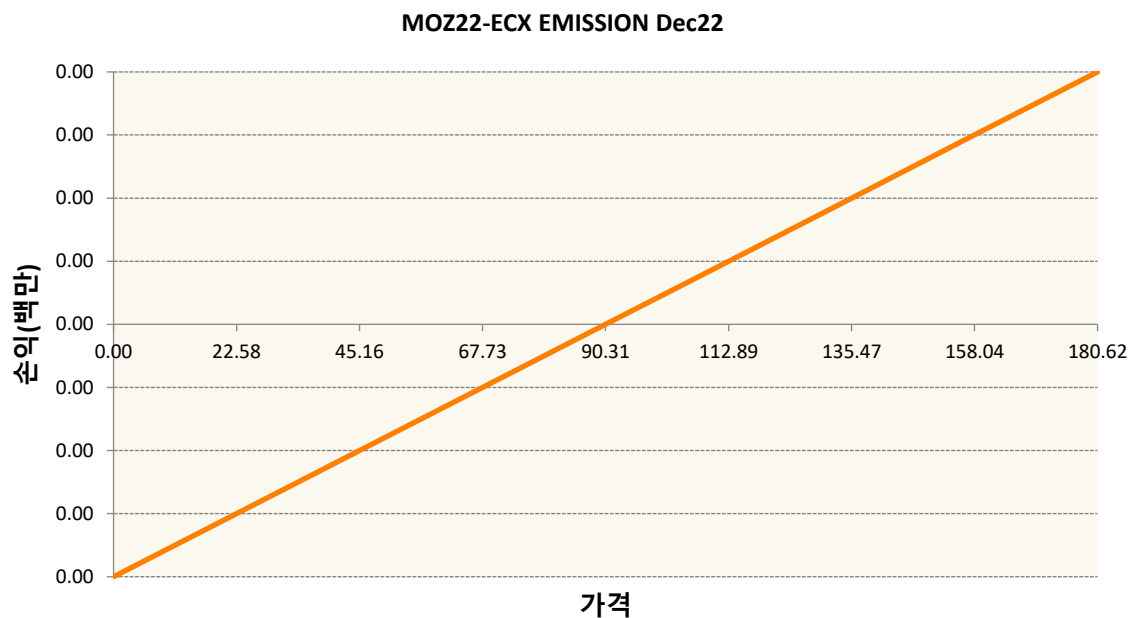
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	12,258	0	12,258	
누계	통화	선도	0	5,047	-5,047	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8S KRW/EUR 27-09-22E

404

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

981

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

(단위:백만원)

2,653

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	11,616	0	11,616	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	18

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

(단위:백만원)

136

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	9,881	0	9,881	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	0.4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	0.47
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	0.4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	1

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

(단위:백만원)

2

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

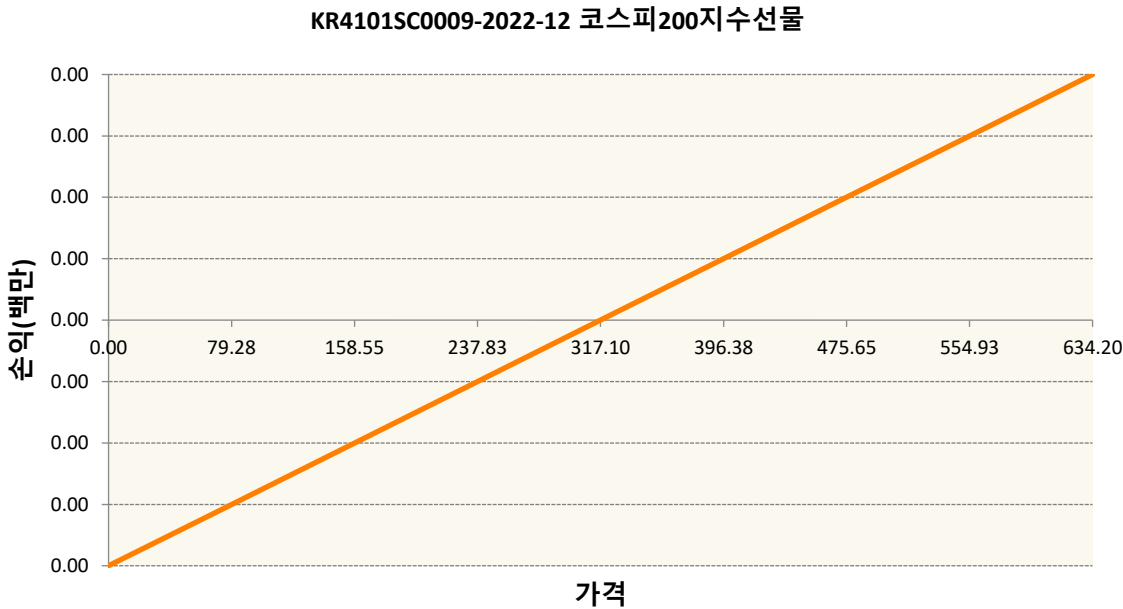
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	951	0	951	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	76

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

(단위:백만원)

82

공시일 2022-08-30

기준일 2022-08-29

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

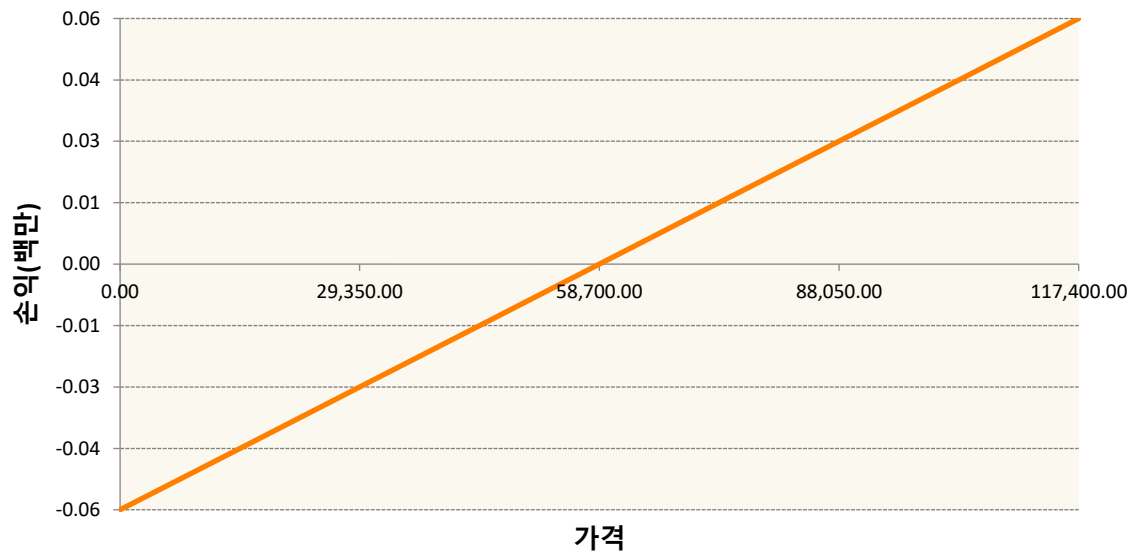
1. 계약금액

(단위:백만원)

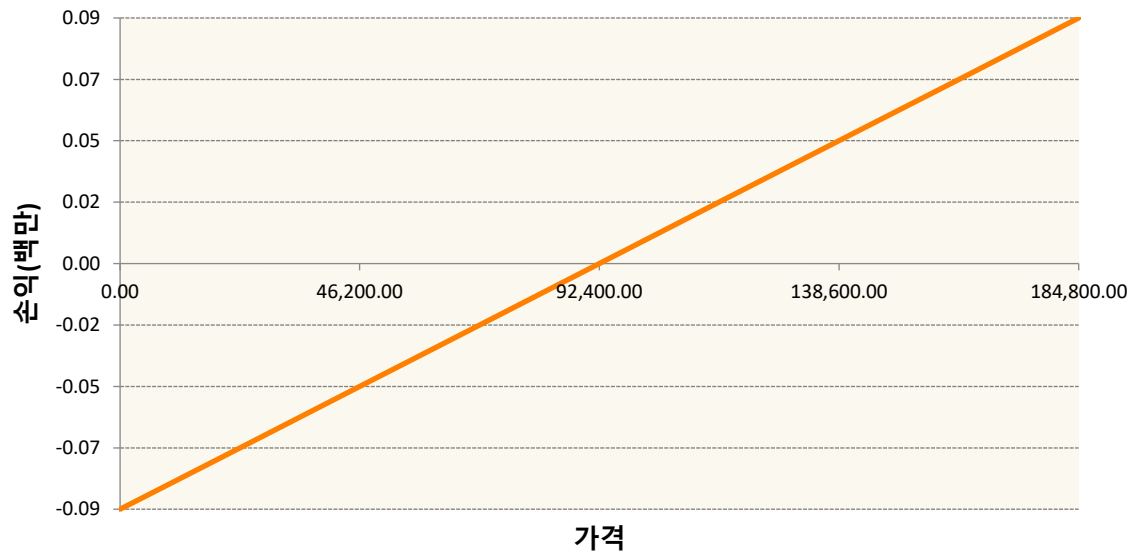
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	825	0	825	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111S90004-2022-09 삼성전자개별선물



KR4150S90002-2022-09 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111S90004		2022-09 삼성전자개별선물					34
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-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%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34
KR4150S90002		2022-09 SK하이닉스개별선물					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

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

75

공시일	2022-08-30
기준일	2022-08-29

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 2022-08-30

기준일 2022-08-29

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

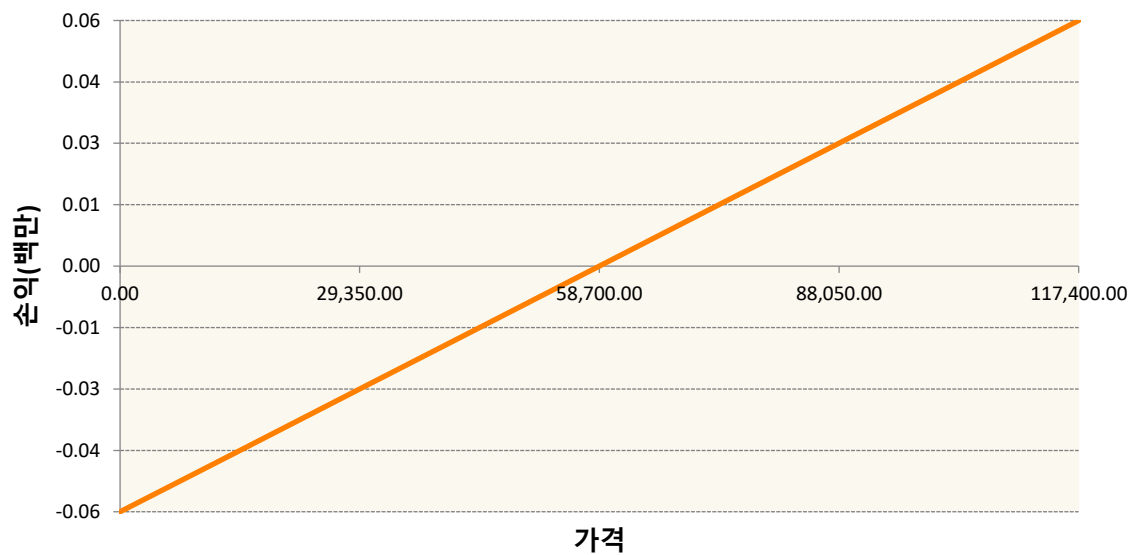
1. 계약금액

(단위:백만원)

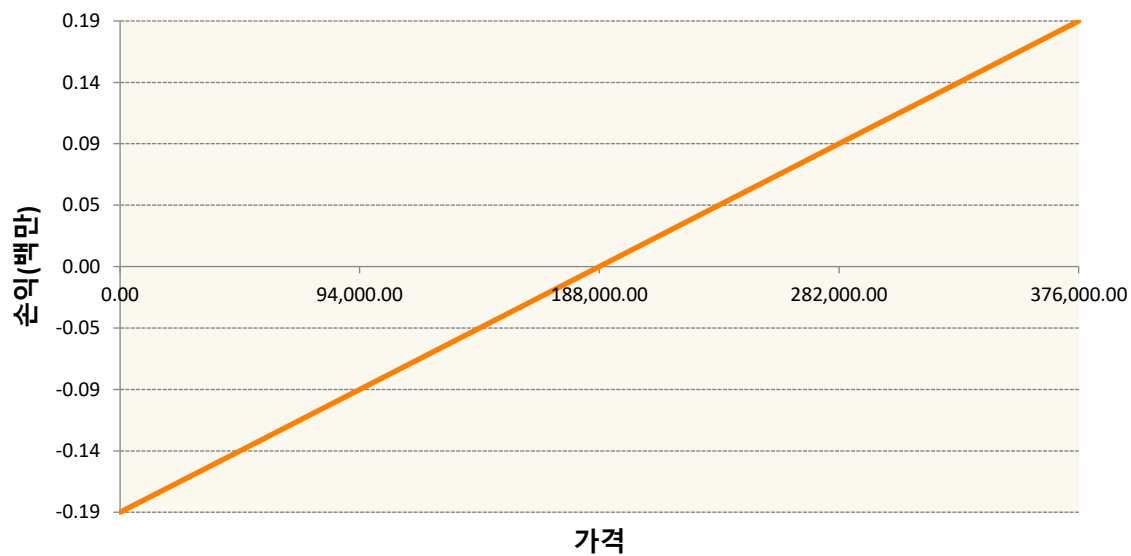
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	277	0	277	장내

2. 만기시점의 손익구조

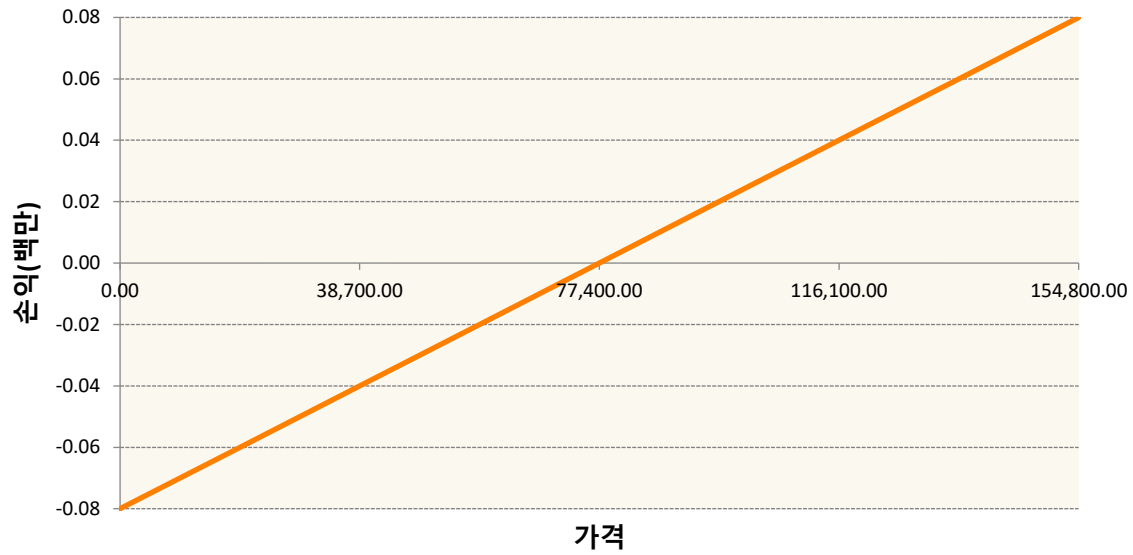
KR4111S90004-2022-09 삼성전자개별선물



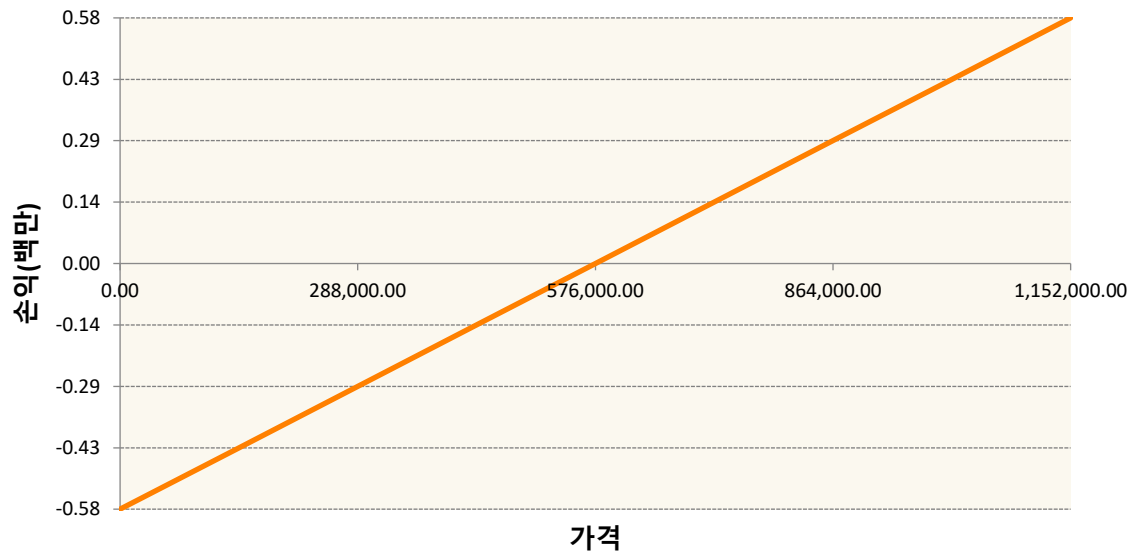
KR4116S90003-2022-09 현대차개별선물



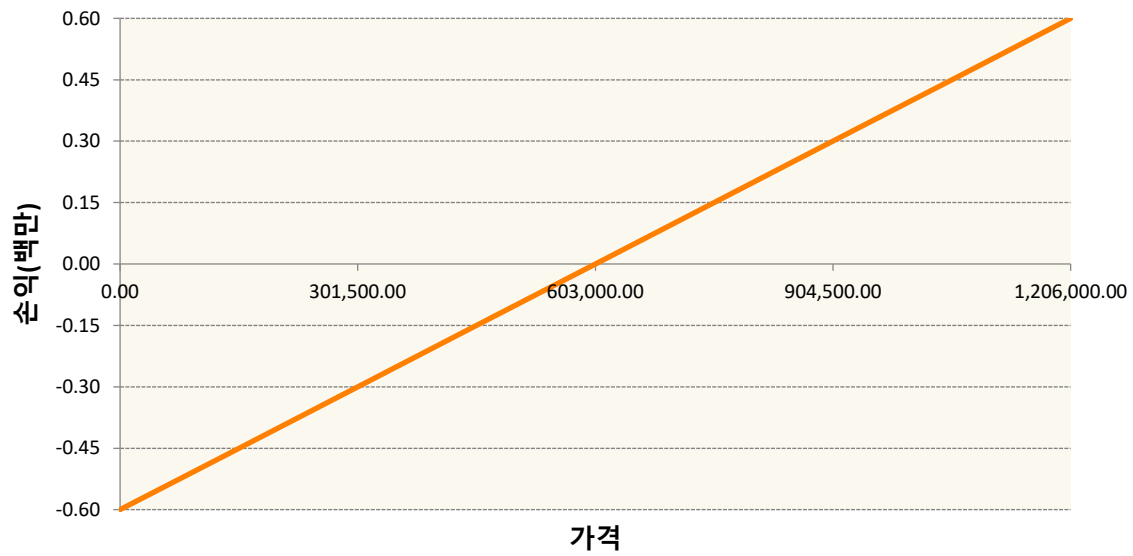
KR4119S90007-2022-09 기아개별선물



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 2022-08-30

기준일 2022-08-29

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

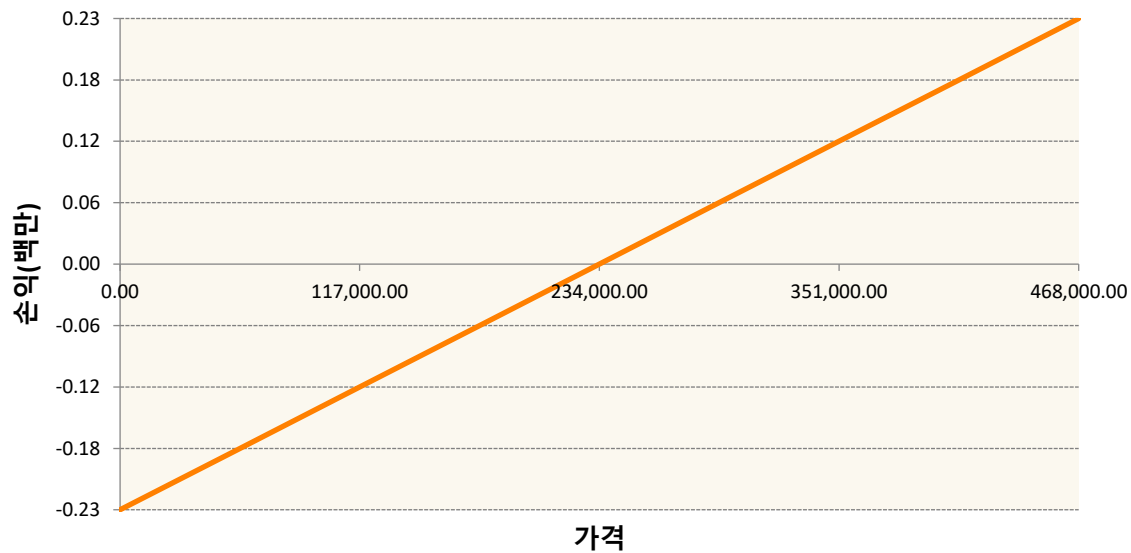
1. 계약금액

(단위:백만원)

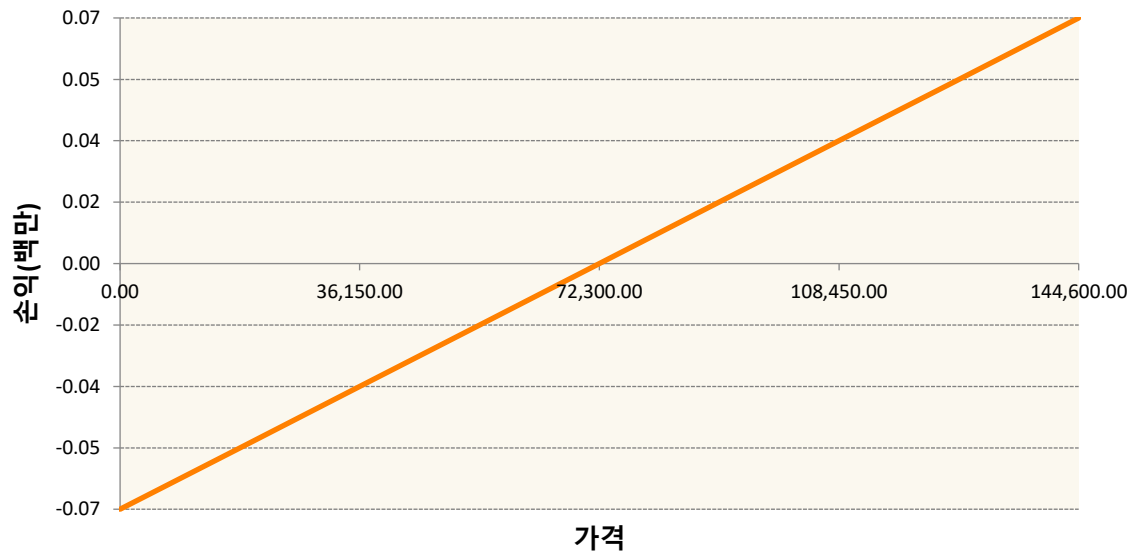
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	204	0	204	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156S90009-2022-09 NAVER개별선물



KR41CFS90000-2022-09 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156S90009		2022-09 NAVER개별선물					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
-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%	9	9	9	9	9	9	9

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)

29

공시일 2022-08-30

기준일 2022-08-29

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

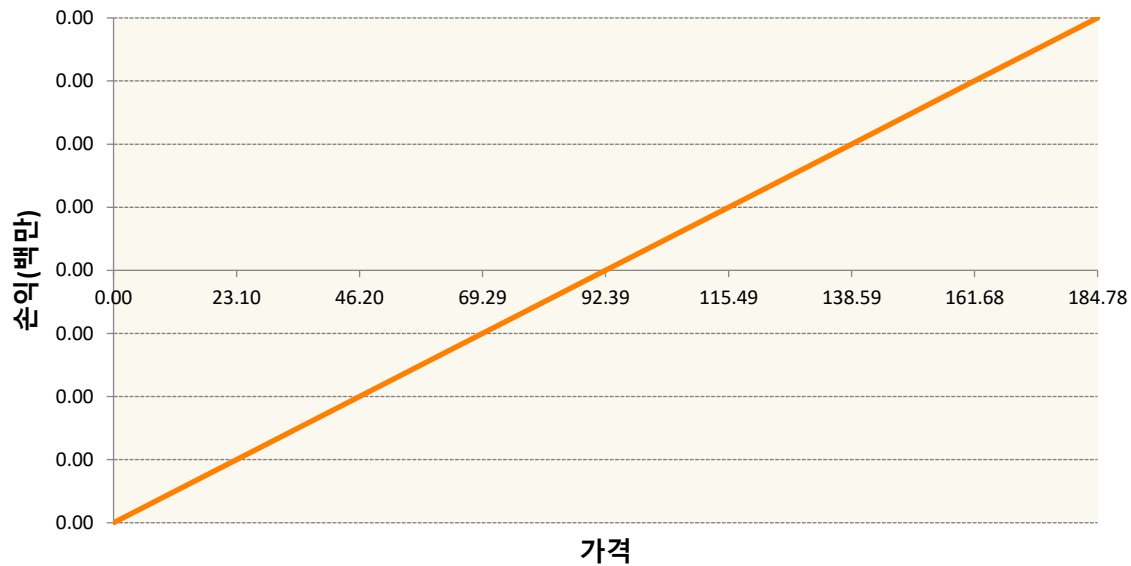
1. 계약금액

(단위:백만원)

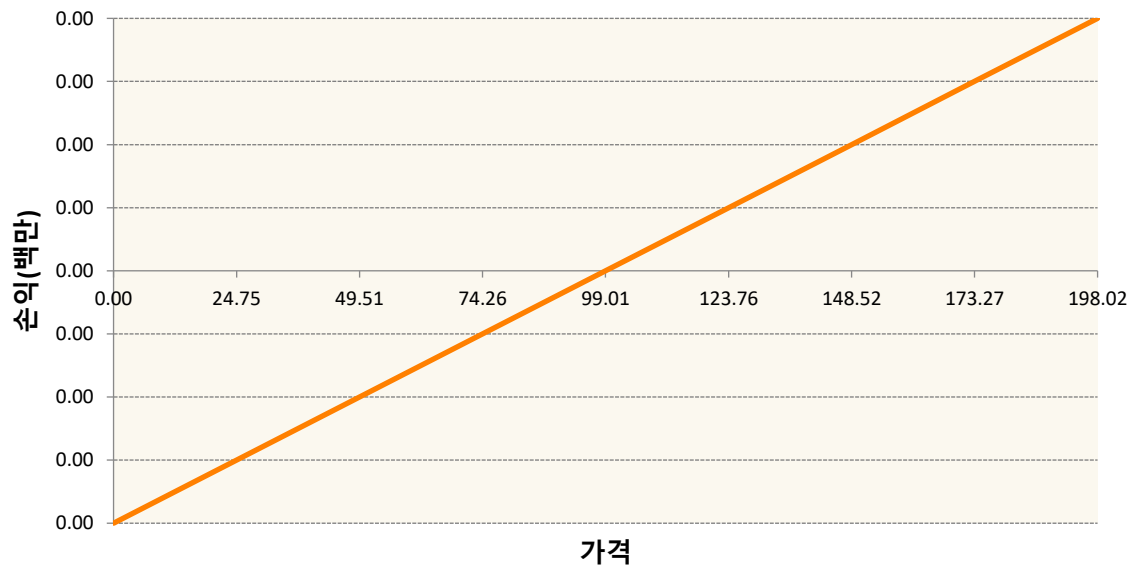
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,170	432	1,738	

2. 만기시점의 손익구조

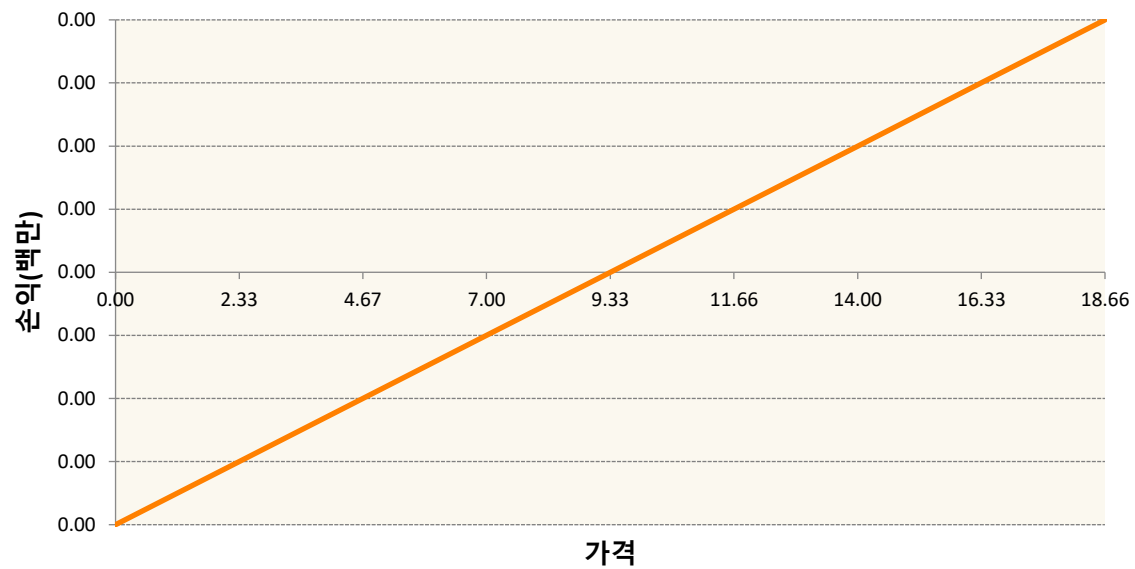
CLX2-WTI CRUDE FUTURE Nov22



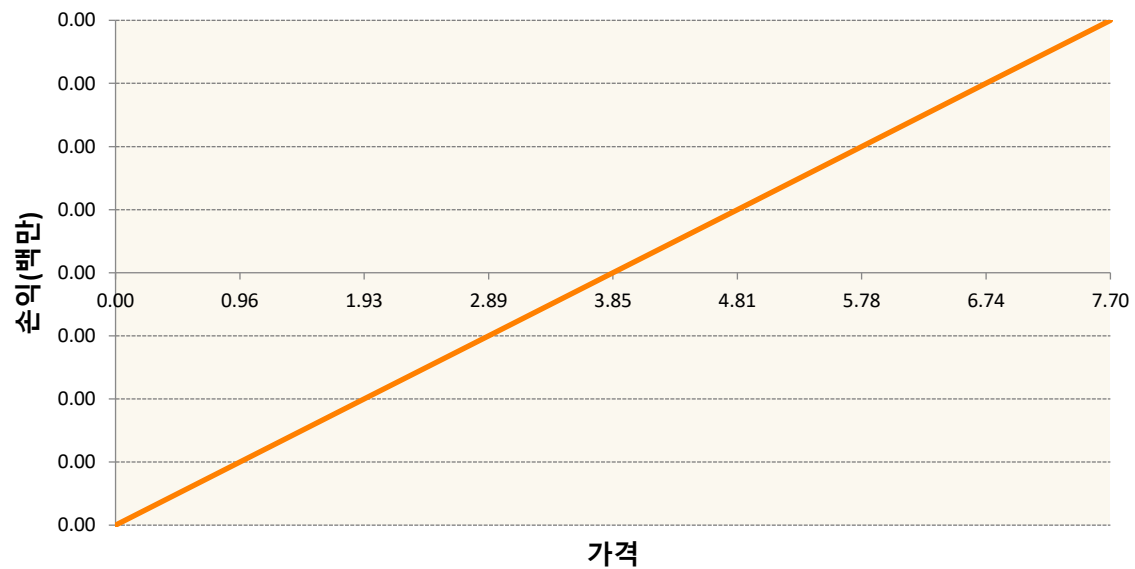
COX2-BRENT CRUDE FUTR Nov22



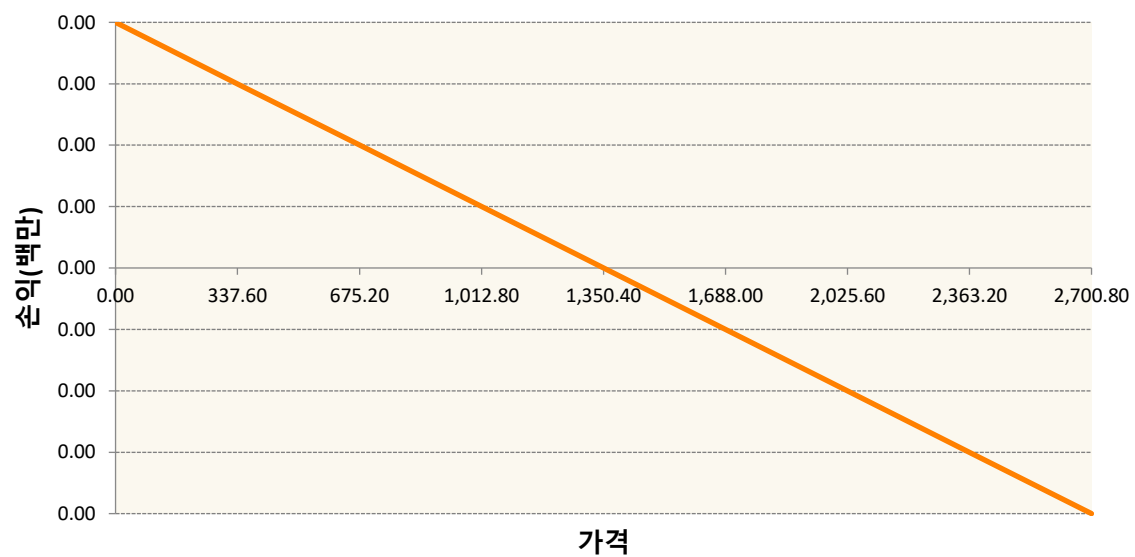
EOX2-E-MINI NATURAL GAS Nov22



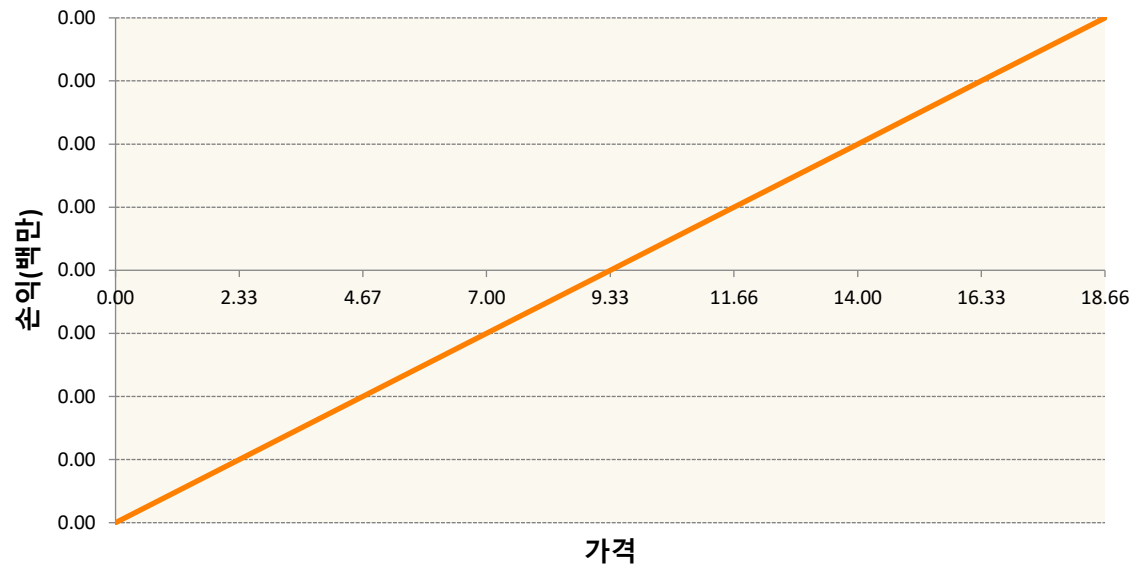
HOX2-NY Harb ULSD Fut Nov22



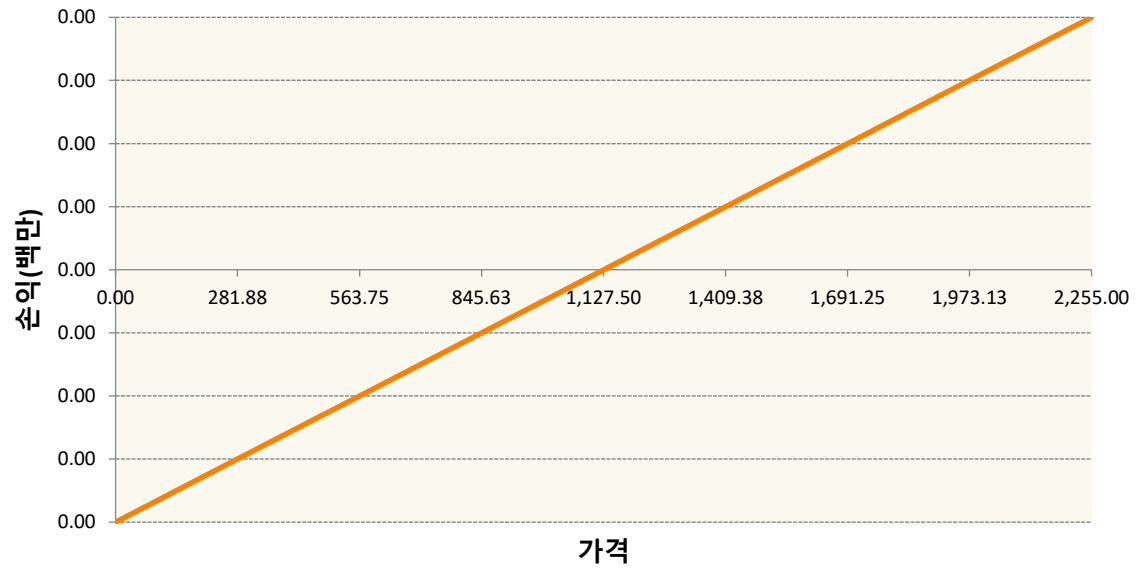
KR4175S90009-2022-09 달러선물



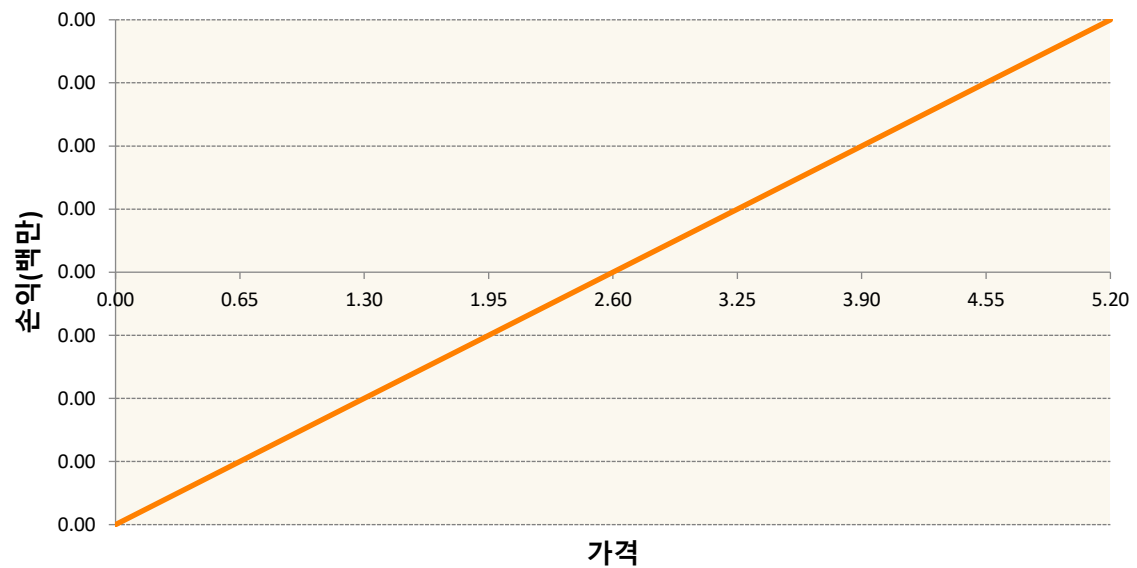
NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QSX2-Low Su Gasoil G Nov22



XBX2-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	35
NGX22	NATURAL GAS FUTR Nov22	68
QSX2	Low Su Gasoil G Nov22	12
XBX2	GASOLINE RBOB FUT Nov22	11

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

564