

공시일 2022-09-13

기준일 2022-09-08

포커스농산물모(채권-파생형)

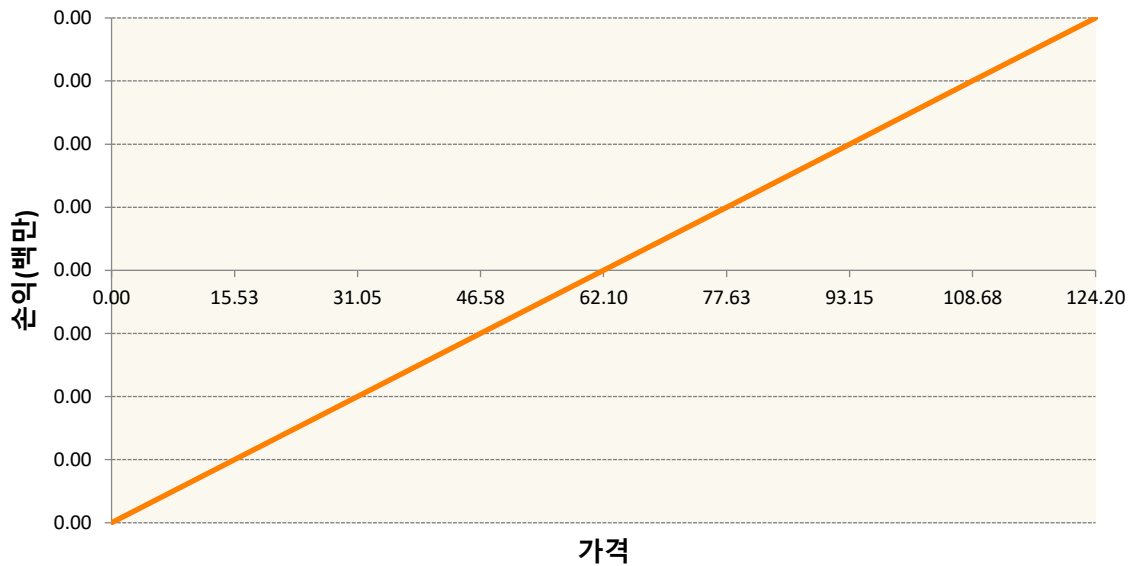
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

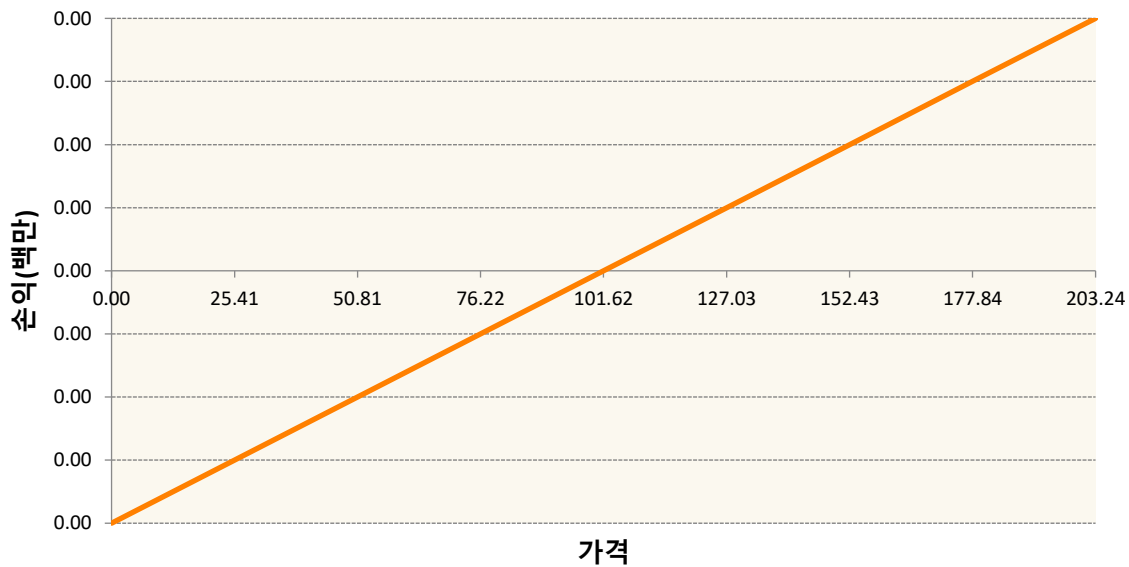
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,864	967	5,897	

2. 만기시점의 손익구조

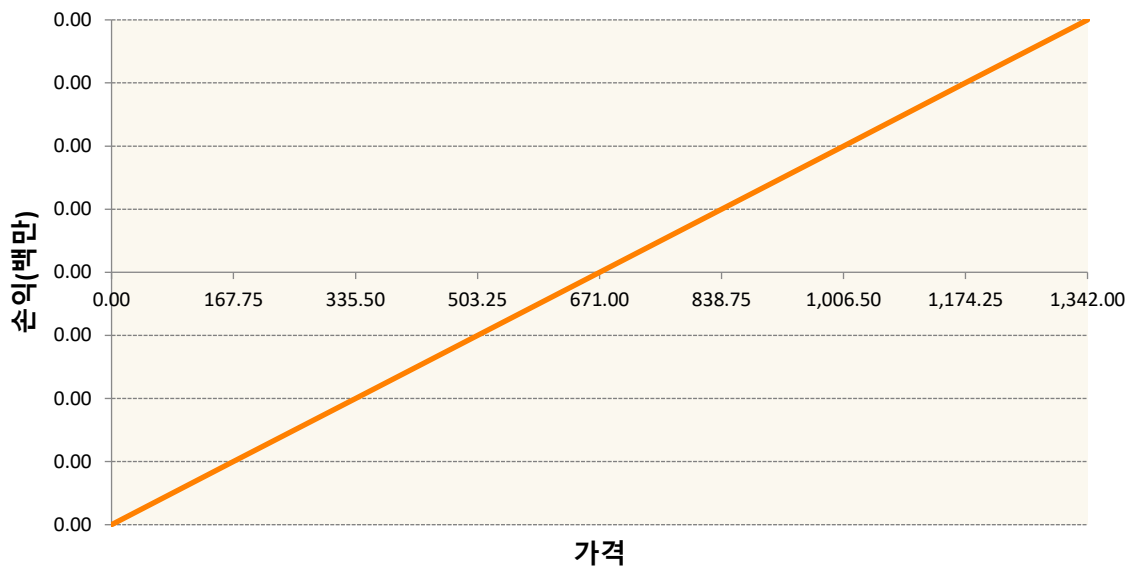
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



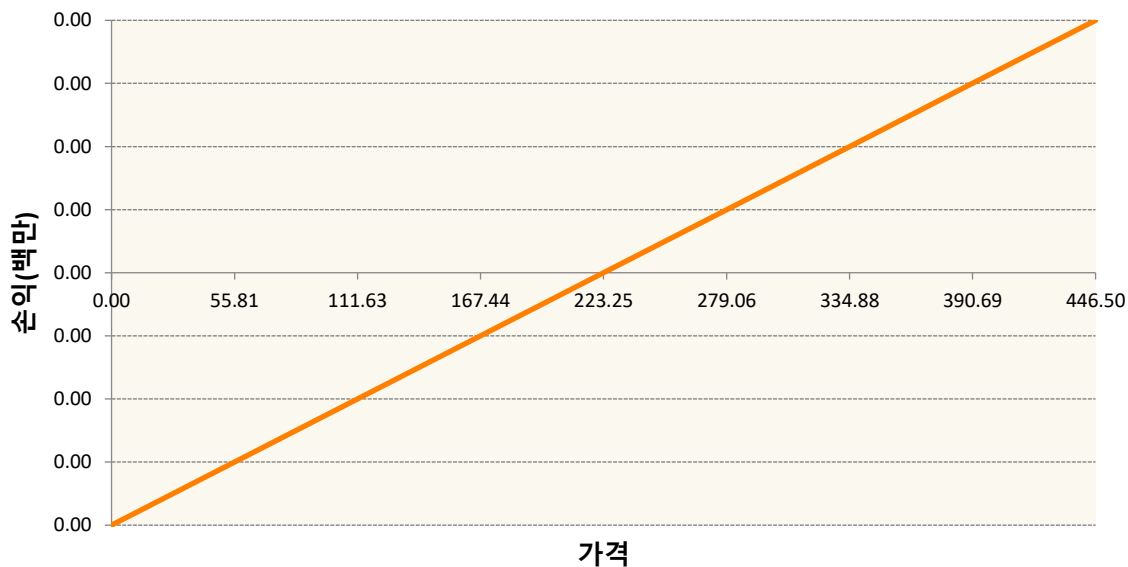
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



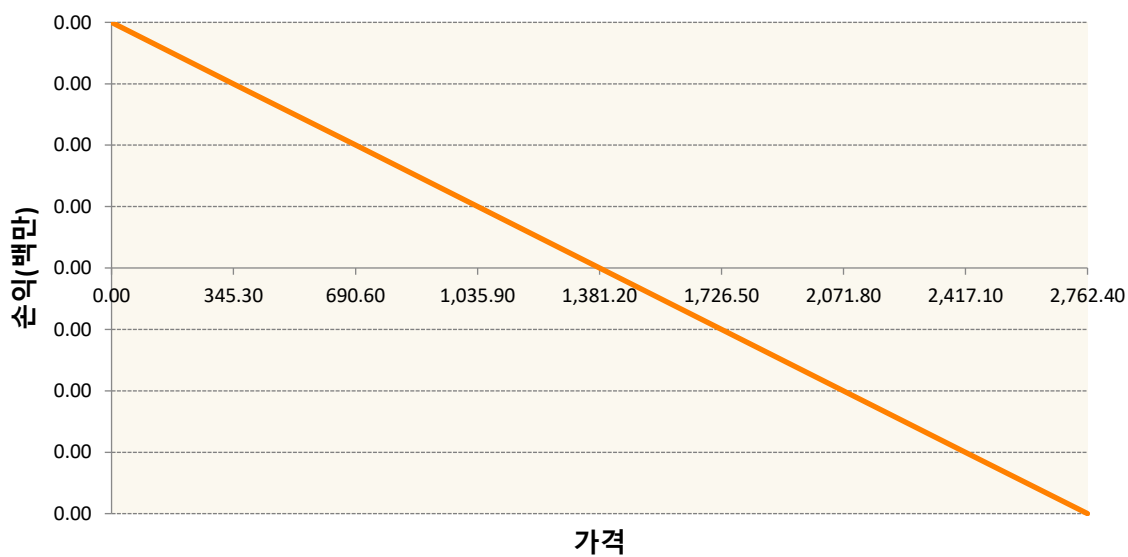
CZ2-CORN FUTURE Dec22



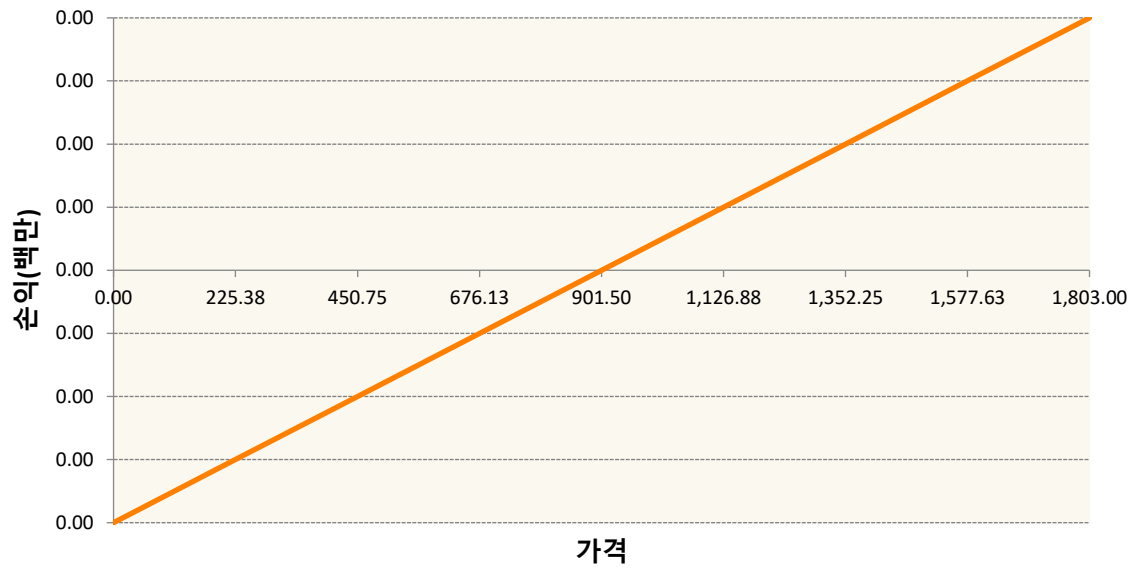
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



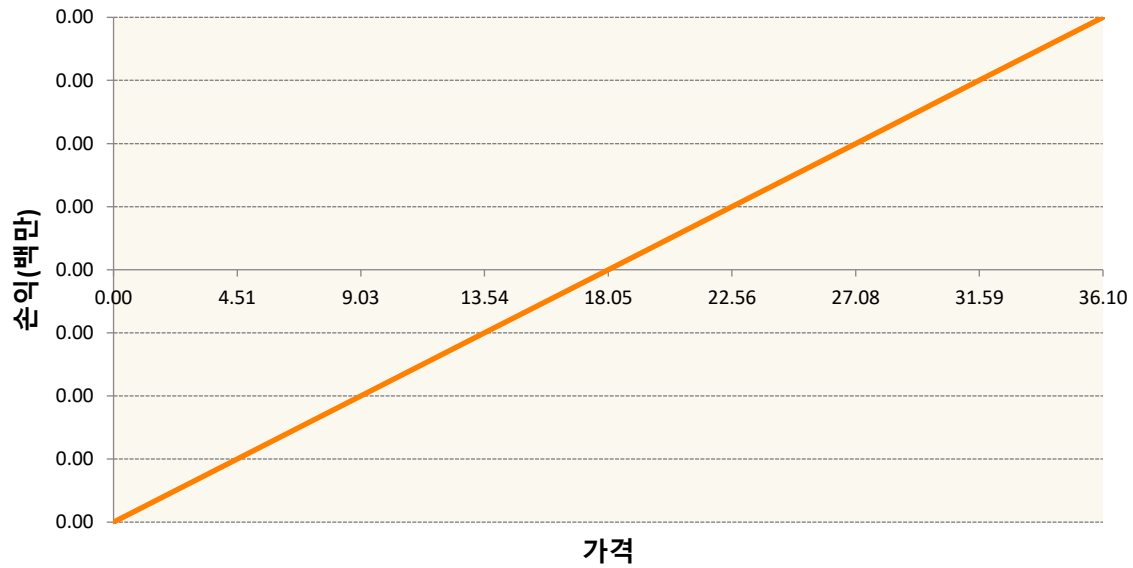
KR4175S90009-2022-09 달러선물



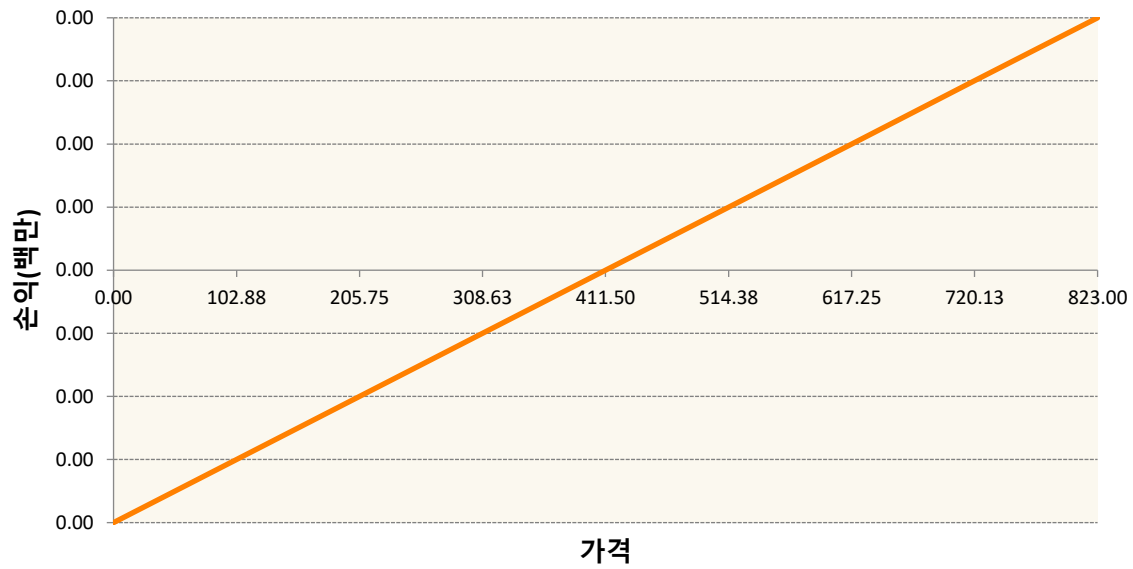
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

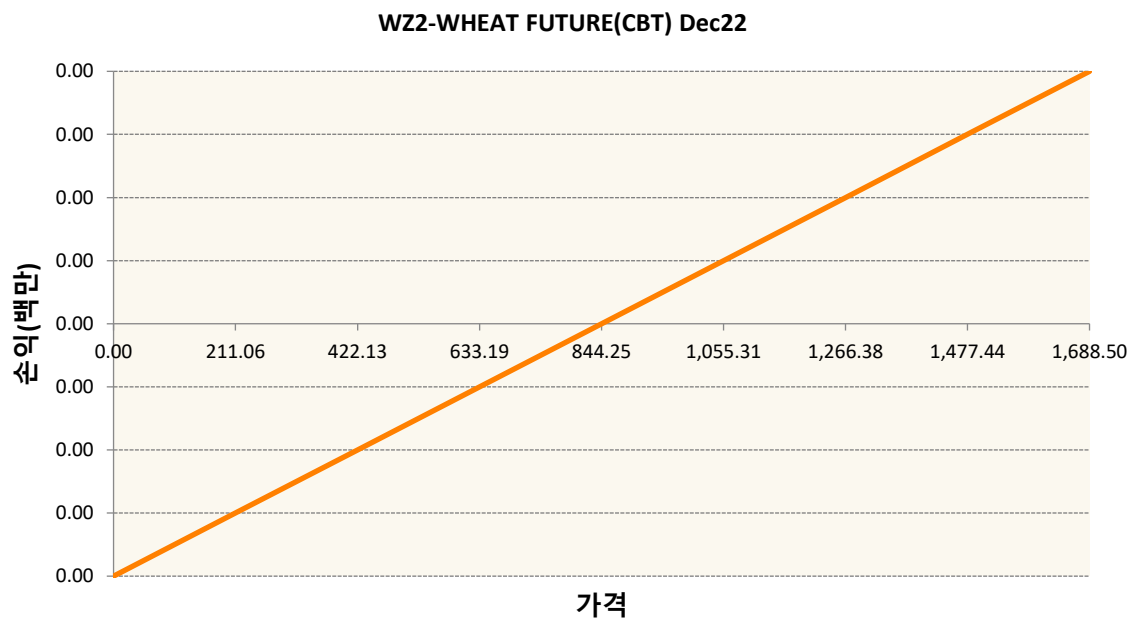
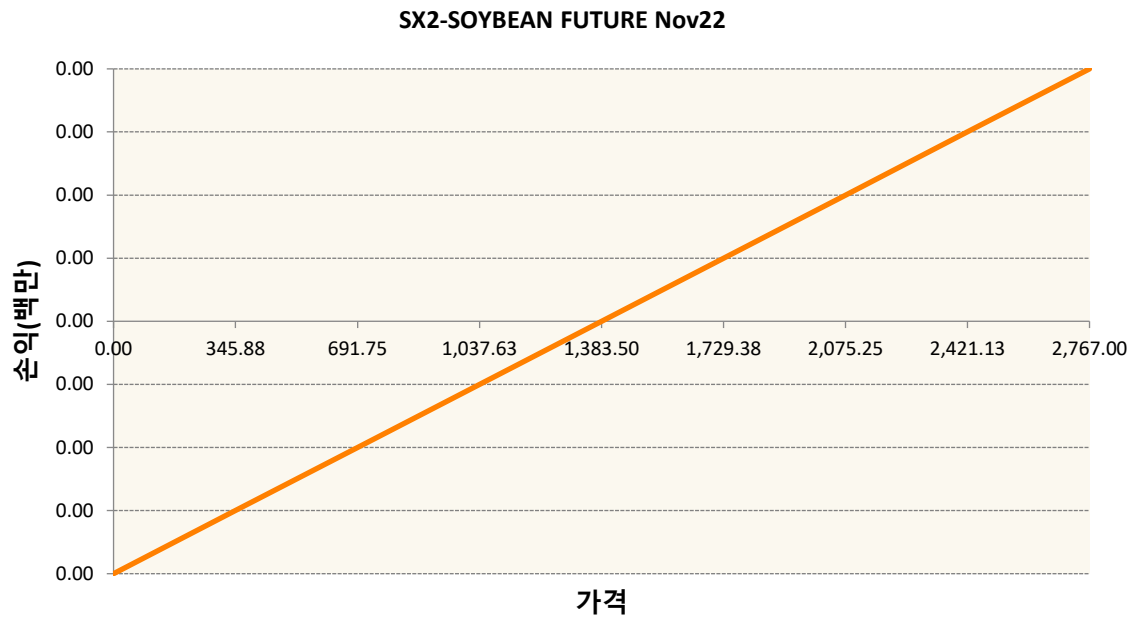


SBV2-Sugar #11 (WORLD) Oct22



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	2022-09-13
기준일	2022-09-08

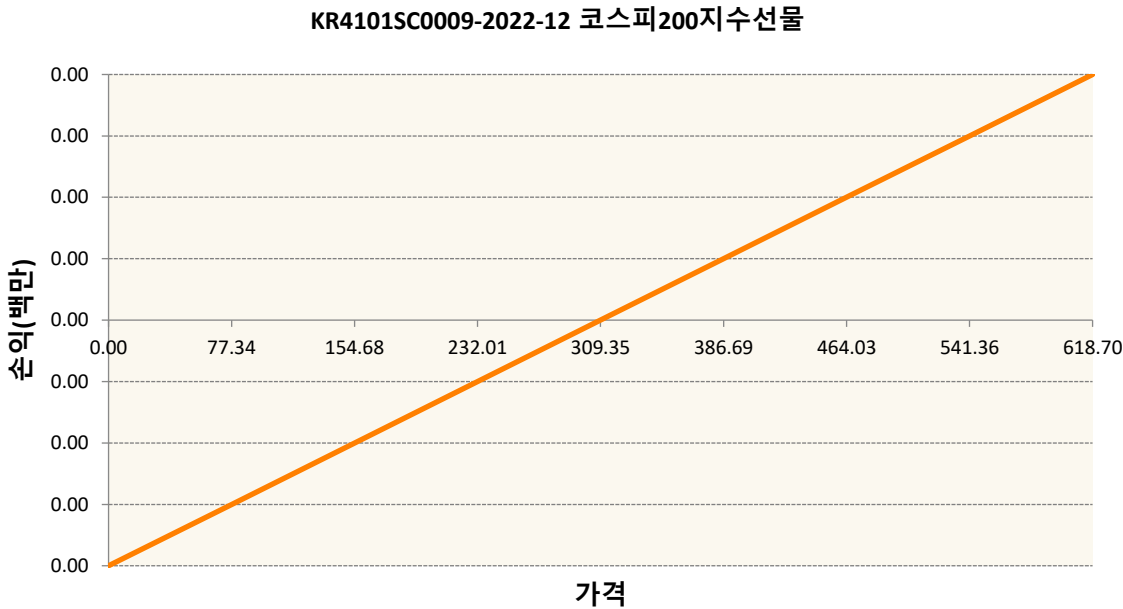
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	619	0	619	장내
누계	유가증권	선물	619	0	619	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				49
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

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

360

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

471

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일 2022-09-13

기준일 2022-09-08

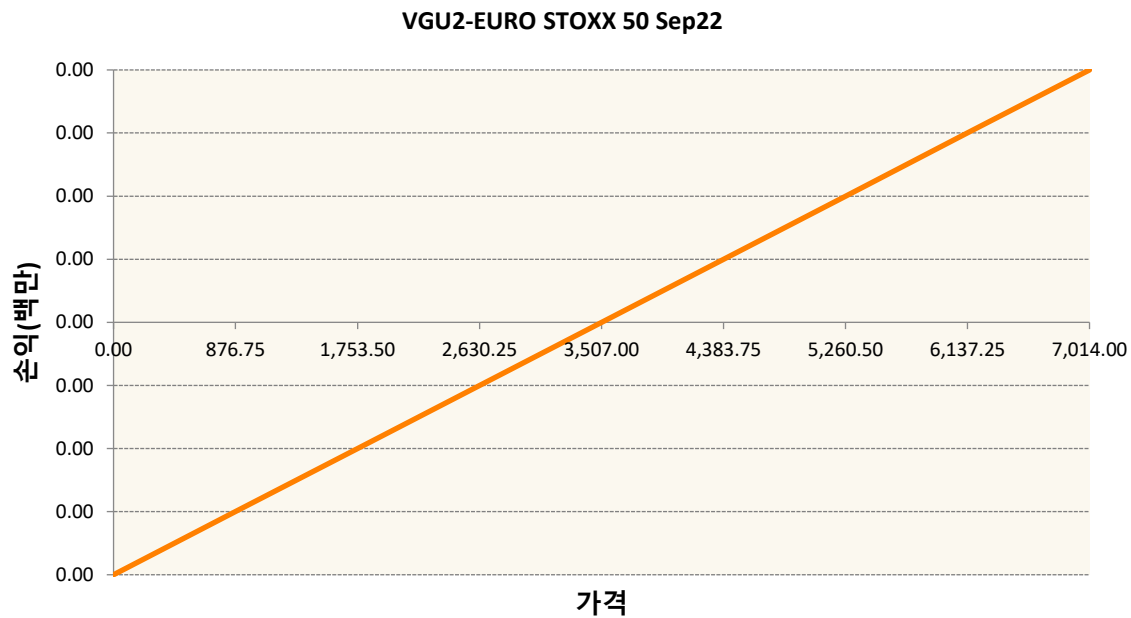
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU2	EURO STOXX 50 Sep22	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

43

공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

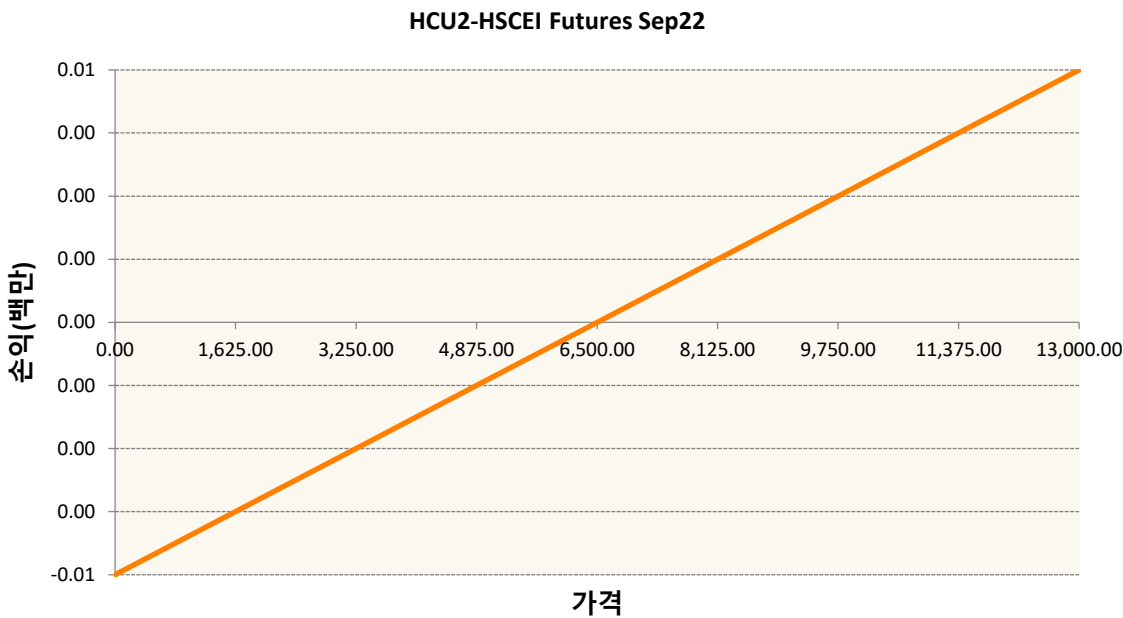
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,114	0	1,114	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU2	HSCEI Futures Sep22	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

130

공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

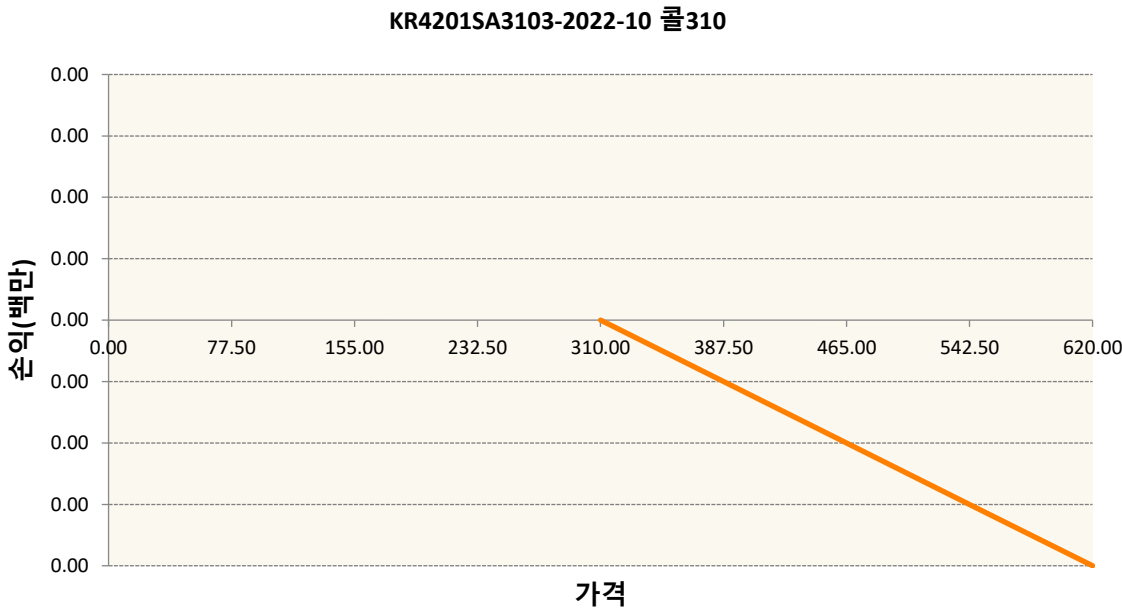
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	37,135	-37,135	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,425	-36,425	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201SA3103			2022-10 콜310				2,206
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,174	1,121	1,060	993	922	846	767
-5.33%	1,017	938	853	766	675	582	487
-2.67%	745	644	541	438	333	228	123
0%	332	222	111	0	-111	-222	-332
2.67%	-228	-334	-441	-549	-657	-767	-876
5.33%	-921	-1,011	-1,104	-1,201	-1,300	-1,401	-1,504
8.00%	-1,720	-1,787	-1,862	-1,942	-2,026	-2,115	-2,206

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

(단위:백만원)

1,982

공시일 2022-09-13

기준일 2022-09-08

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

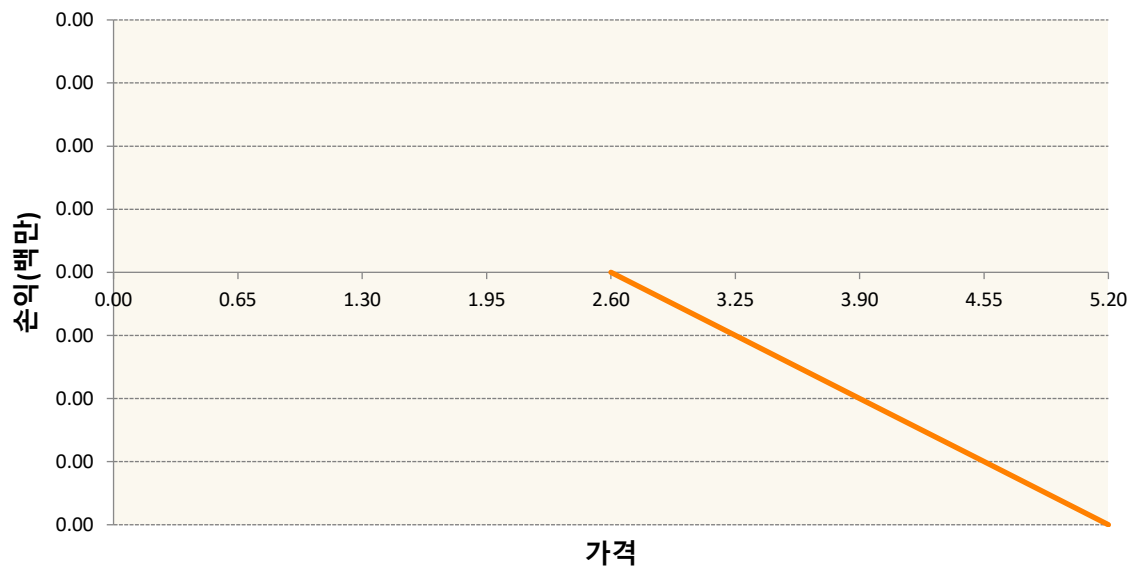
1. 계약금액

(단위:백만원)

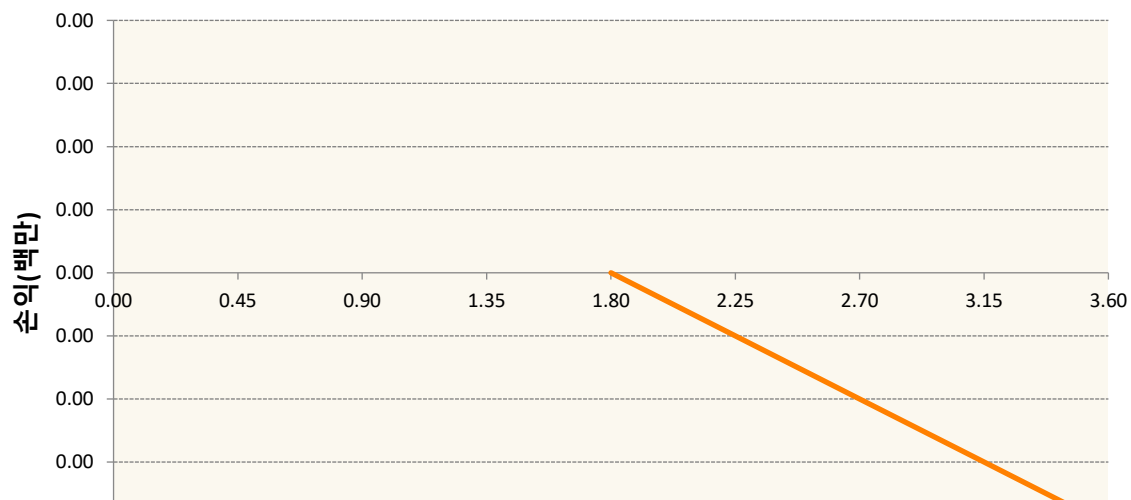
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	옵션	0	38	-38	장내
누계	지수	스왑	4	0	4	장외
누계	통화	선도	0	1,311	-1,311	장외

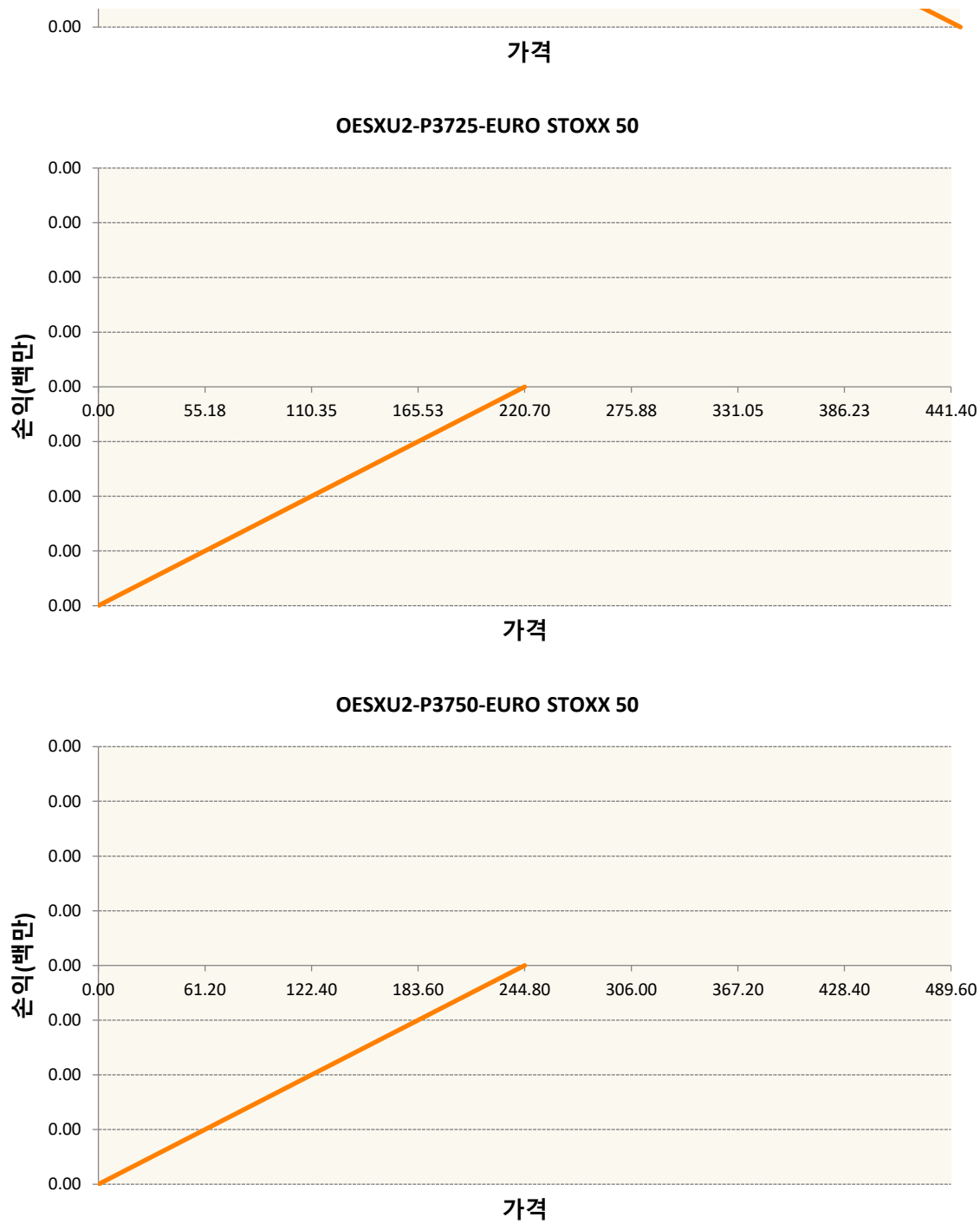
2. 만기시점의 손익구조

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
 OESXU2-C37 EURO STOXX 50
 OESXU2-C37 EURO STOXX 50
 OESXU2-P37 EURO STOXX 50
 OESXU2-P37 EURO STOXX 50

3
33
72
0.04
0.01
2
1

공시일 2022-09-13

기준일 2022-09-08

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

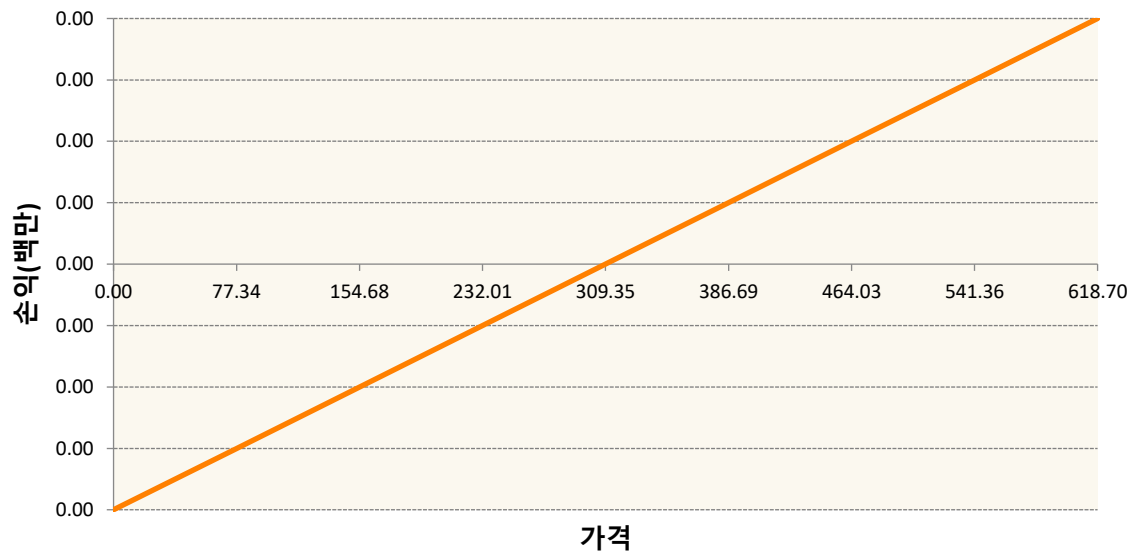
1. 계약금액

(단위:백만원)

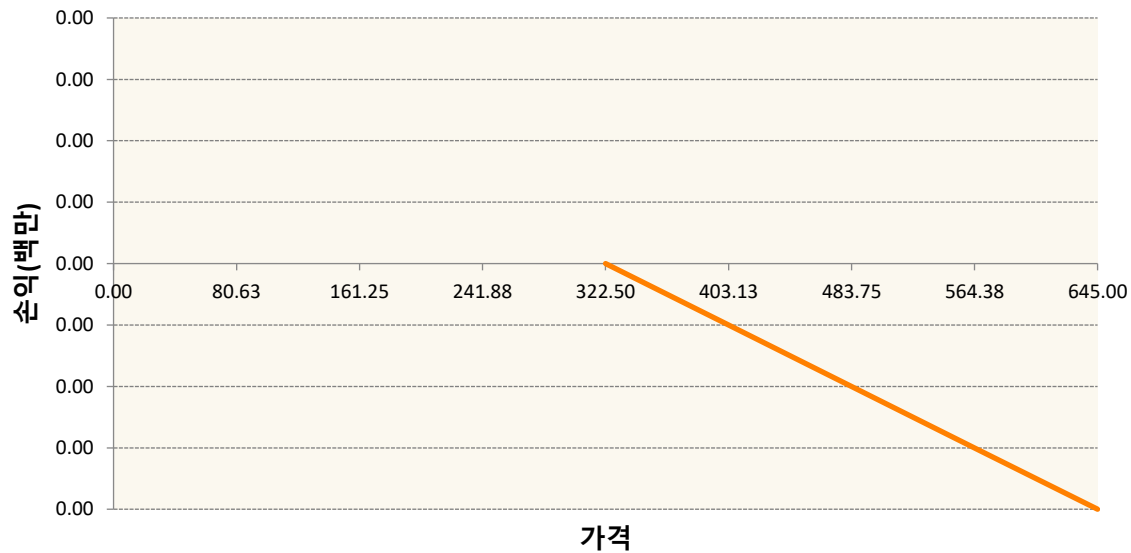
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	387	0	387	장내
신규	유가증권	옵션	377	4,315	-3,938	장내
누계	유가증권	선물	387	0	387	장내
누계	유가증권	옵션	386	4,301	-3,915	장내

2. 만기시점의 손익구조

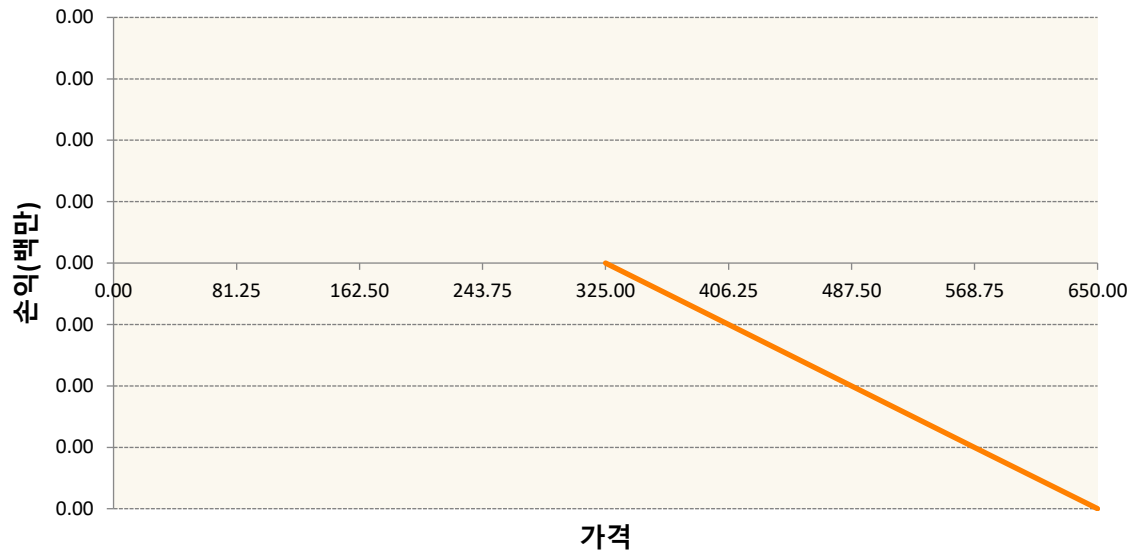
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



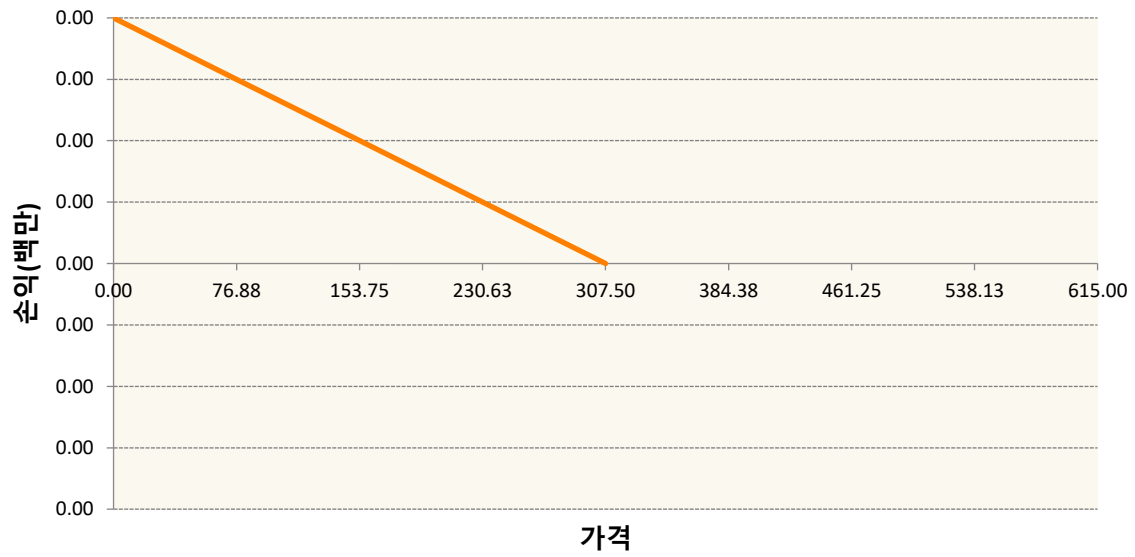
KR4201SA3228-2022-10 콜322.5



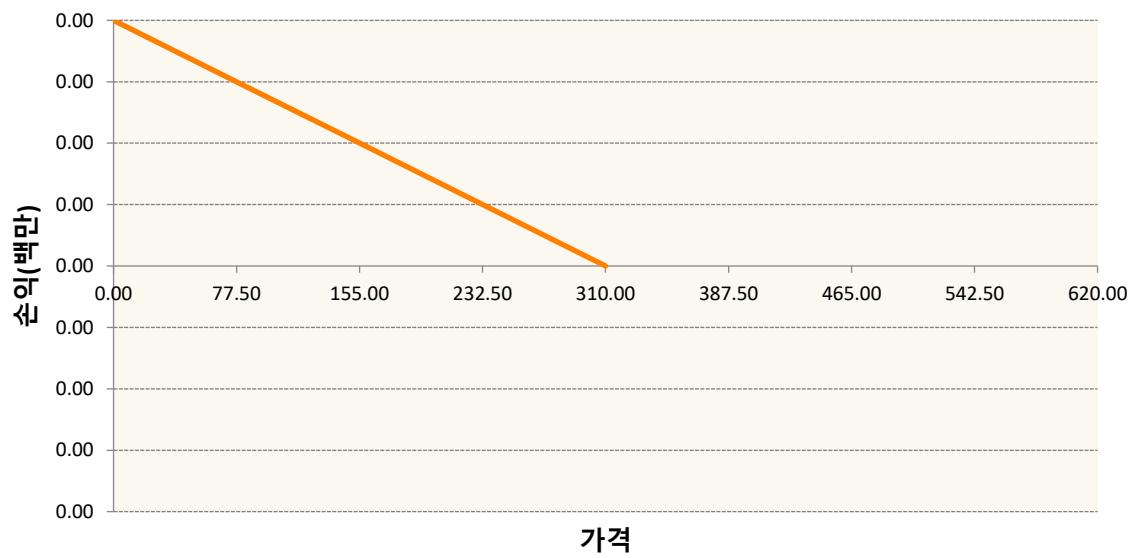
KR4201SA3251-2022-10 콜325



KR4301SA3078-2022-10 풋307.5



KR4301SA3102-2022-10 풋310



(단위:백만원)

KR4101SC0009							2022-12 코스피200지수선물		31	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31			
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21			
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	10	10	10	10	10	10	10			
5.33%	21	21	21	21	21	21	21			
8.00%	31	31	31	31	31	31	31			
KR4201SA3228							2022-10 콜322.5		35	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	13	13	12	11	11	10	8			
-5.33%	12	11	10	9	8	6	5			
-2.67%	10	8	7	5	4	2	0			
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6			
2.67%	-1	-3	-5	-7	-10	-12	-14			
5.33%	-10	-12	-15	-17	-19	-21	-23			
8.00%	-22	-24	-26	-28	-30	-32	-35			
KR4201SA3251							2022-10 콜325		161	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	58	56	53	50	46	41	36			
-5.33%	53	50	45	40	34	28	21			
-2.67%	44	38	31	24	16	8	0			
0%	26	18	9	0	-9	-19	-28			
2.67%	-2	-12	-23	-33	-44	-54	-65			
5.33%	-44	-54	-65	-76	-87	-98	-109			
8.00%	-98	-108	-119	-129	-140	-150	-161			
KR4301SA3078							2022-10 풋307.5		13	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	10	11	11	12	12	13	13			
-5.33%	5	6	6	7	8	8	9			
-2.67%	1	2	2	3	4	5	5			
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2			
2.67%	-4	-4	-3	-2	-2	-1	0			
5.33%	-6	-5	-5	-4	-4	-3	-2			
8.00%	-7	-6	-6	-6	-5	-5	-4			
KR4301SA3102							2022-10 풋310		9	
기초자산의 변동성										

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

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

(단위:백만원)

202

공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

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	7,851	0	7,851	

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	2022-09-13
기준일	2022-09-08

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	6,705	0	6,705	

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	2022-09-13
기준일	2022-09-08

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	20,768	0	20,768	
누계	통화	선도	207	21,368	-21,161	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C6P₩ KRW/USD 27-09-22E		619
FXW213C7R₩ KRW/USD 27-10-22E		473
FXW213C8R₩ KRW/USD 28-11-22E		617
FXW213C96₩ USD/KRW 27-09-22E		17

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

(단위:백만원)

695

공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

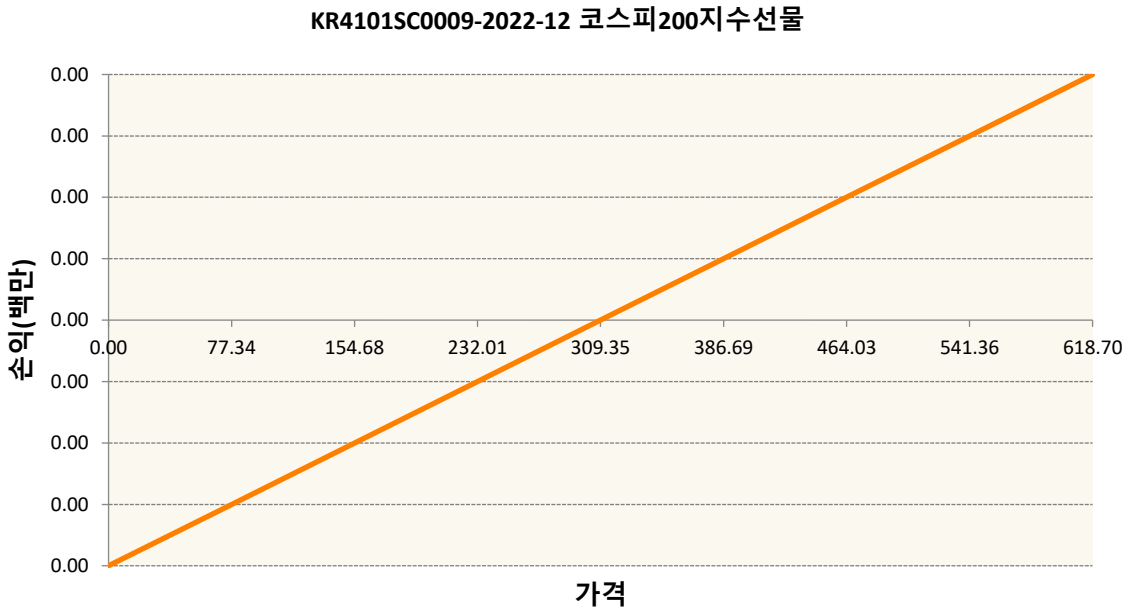
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	464	0	464	장내
누계	유가증권	선물	464	0	464	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				37
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-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%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

공시일 2022-09-13

기준일 2022-09-08

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

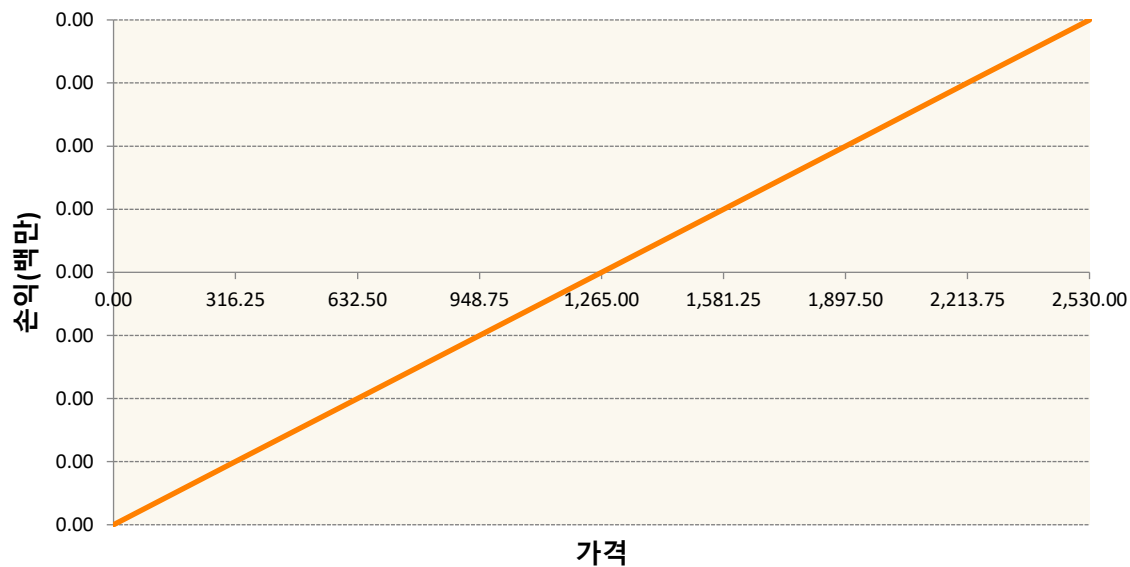
1. 계약금액

(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	652	0	652	
누계	유가증권	스왑	1,699	0	1,699	장외
누계	통화	선도	0	1,173	-1,173	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCU2-VN30 Index Future SEP22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	136
FXW213C6N KRW/EUR 23-09-22E	28
FXW213C7L KRW/EUR 21-10-22E	19
FXW213C84 KRW/EUR 21-10-22E	6
FXW213C8P KRW/EUR 18-11-22E	11
FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E	31
VNCU2 VN30 Index Future SEP22	52

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

(단위:백만원)

252

공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

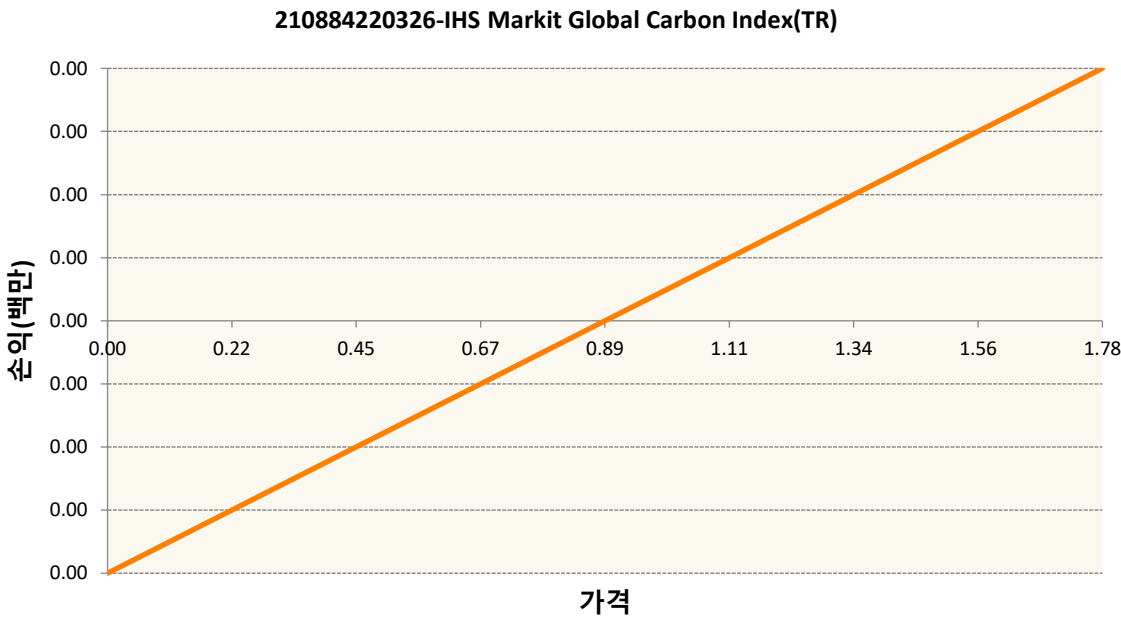
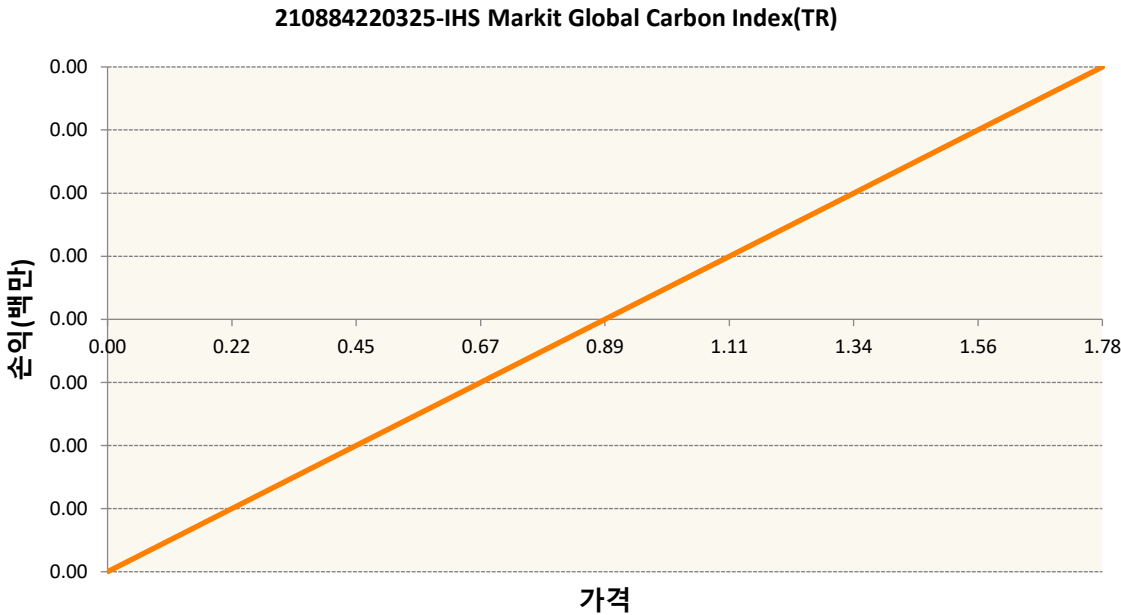
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

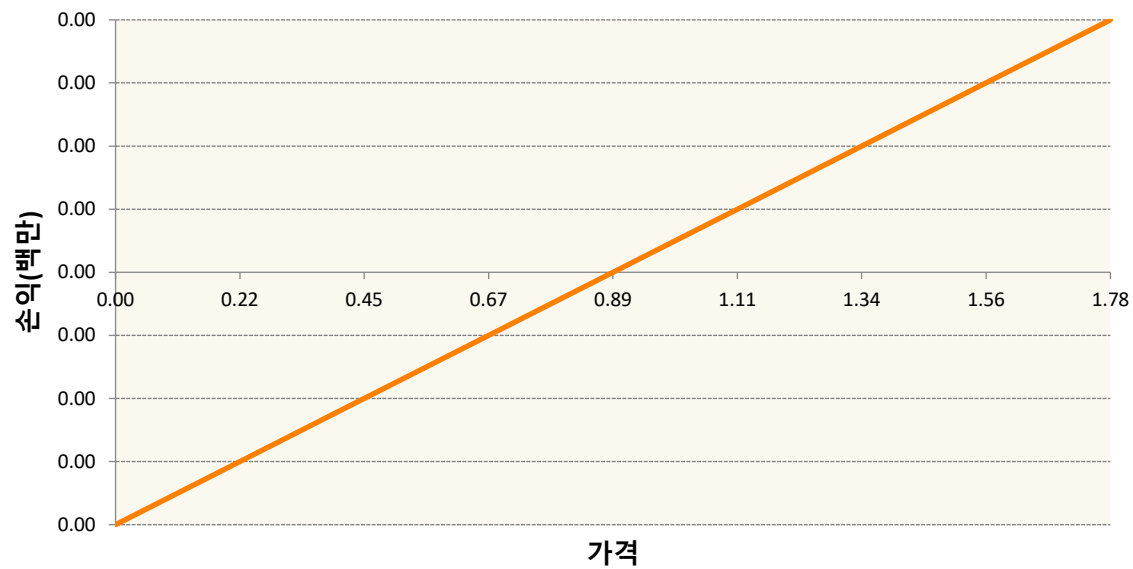
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	35,643	0	35,643	

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)

178

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

2,572

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

89

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

(단위:백만원)

5,356

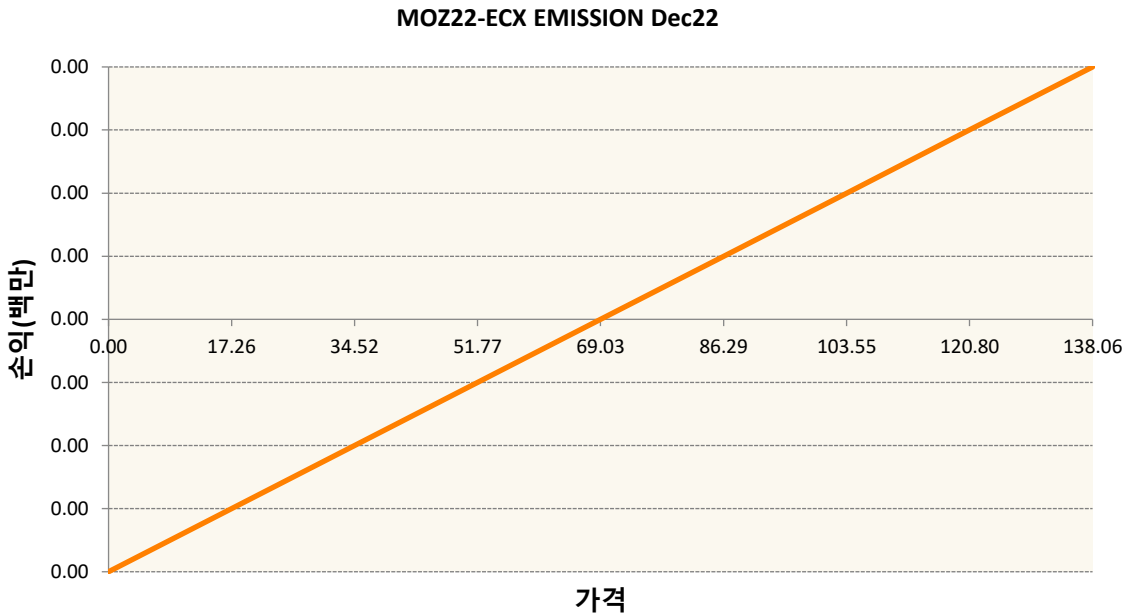
공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

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	10,673	0	10,673	
누계	통화	선도	0	5,191	-5,191	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213C8S	KRW/EUR 27-09-22E		415
MOZ22	ECX EMISSION Dec22		854

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,398

공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

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)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	21

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

(단위:백만원)

160

공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

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

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

(단위:백만원)

18

공시일	2022-09-13
기준일	2022-09-08

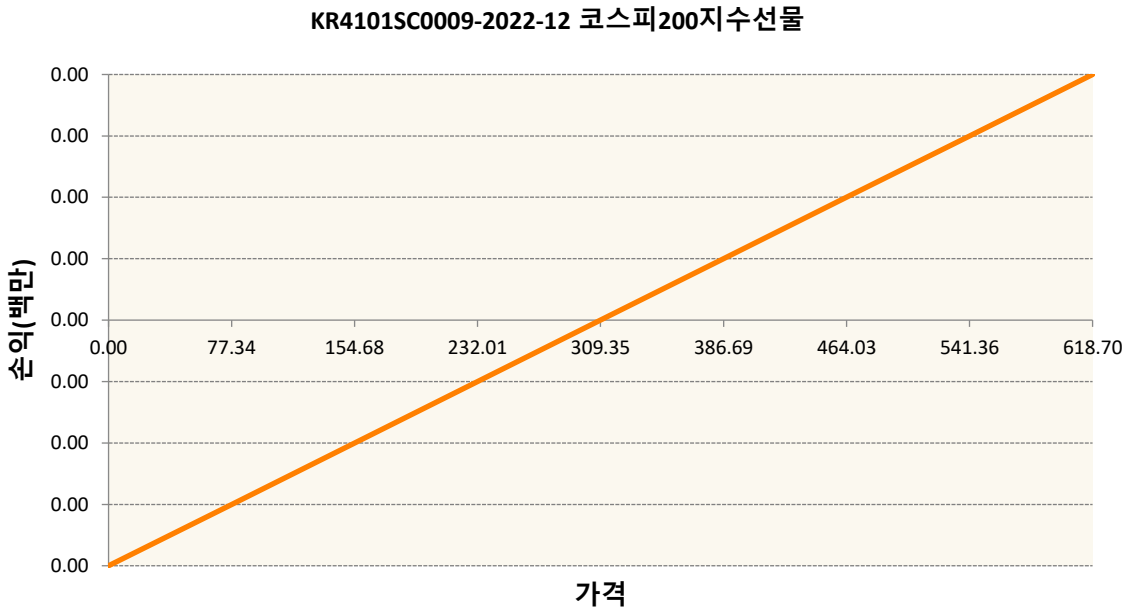
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	928	0	928	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	2
KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물	74

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

(단위:백만원)

83

공시일 2022-09-13

기준일 2022-09-08

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

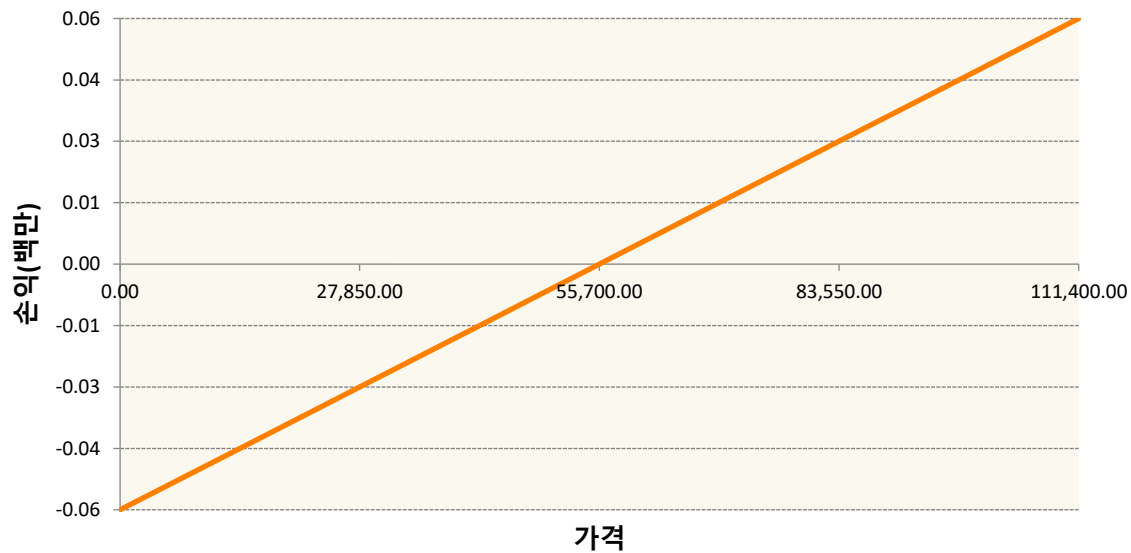
1. 계약금액

(단위:백만원)

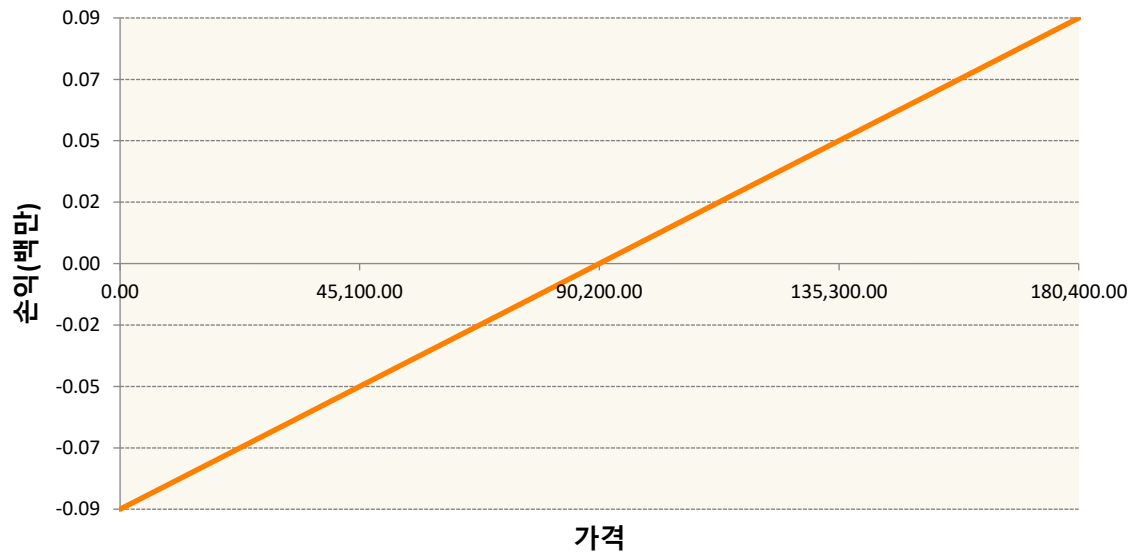
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	800	0	800	장내
누계	유가증권	선물	794	0	794	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



KR4150SA0001-2022-10 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SA0009		2022-10 삼성전자개별선물					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
KR4150SA0001		2022-10 SK하이닉스개별선물					31
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

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

72

공시일 2022-09-13

기준일 2022-09-08

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 2022-09-13

기준일 2022-09-08

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

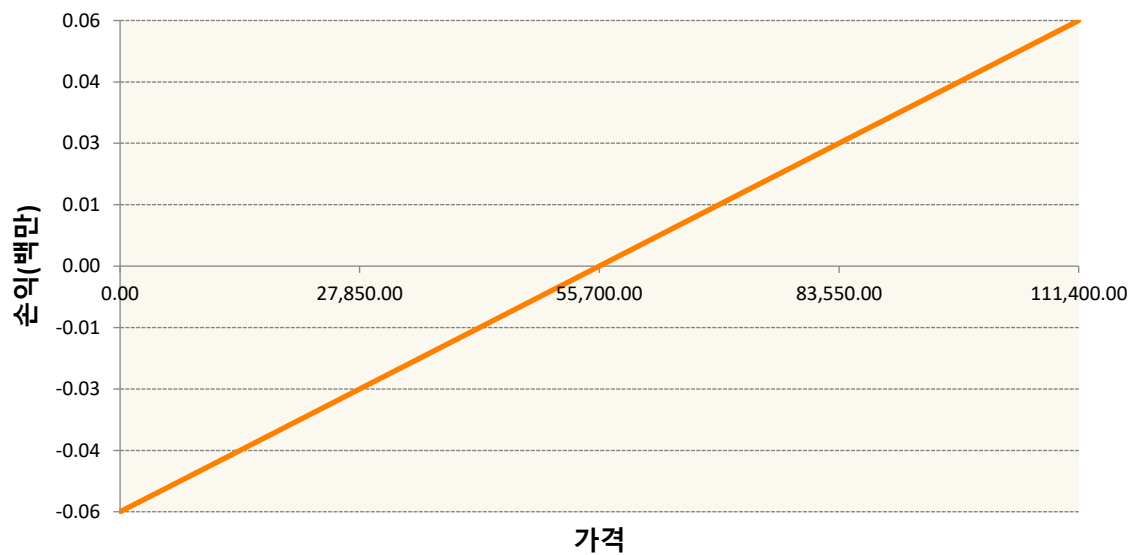
1. 계약금액

(단위:백만원)

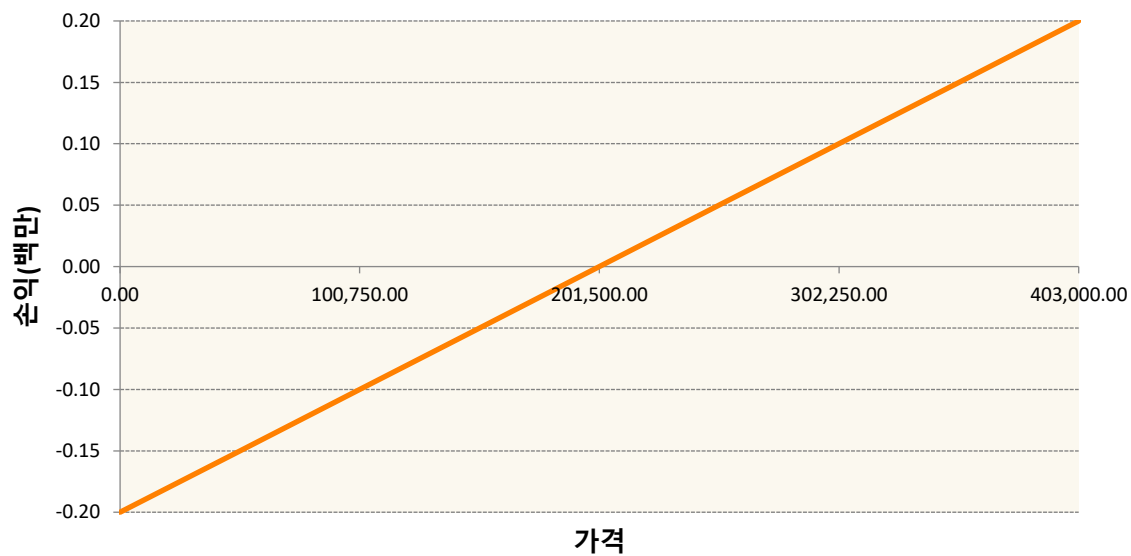
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	280	0	280	장내

2. 만기시점의 손익구조

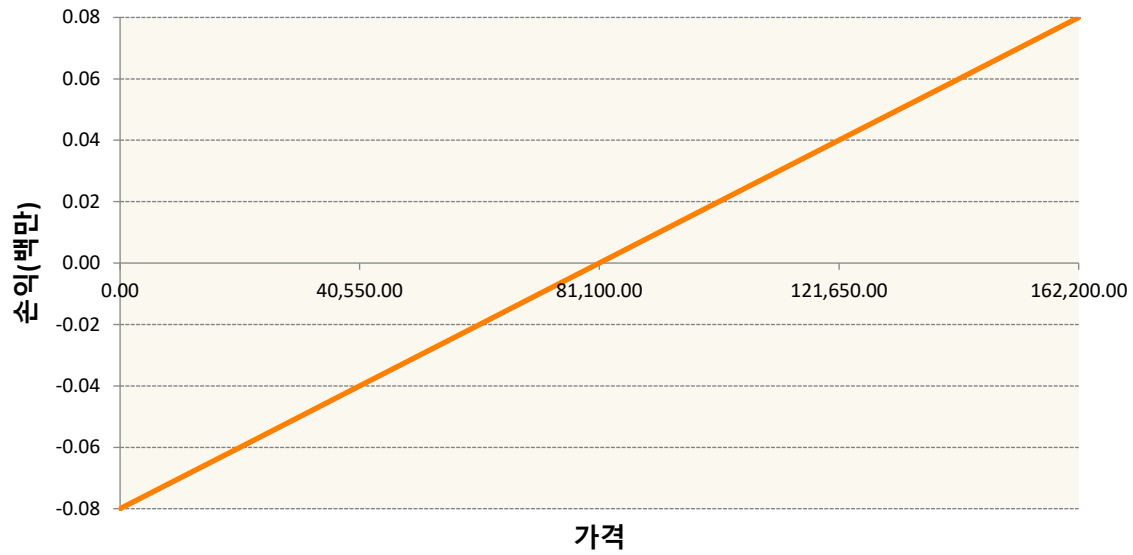
KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



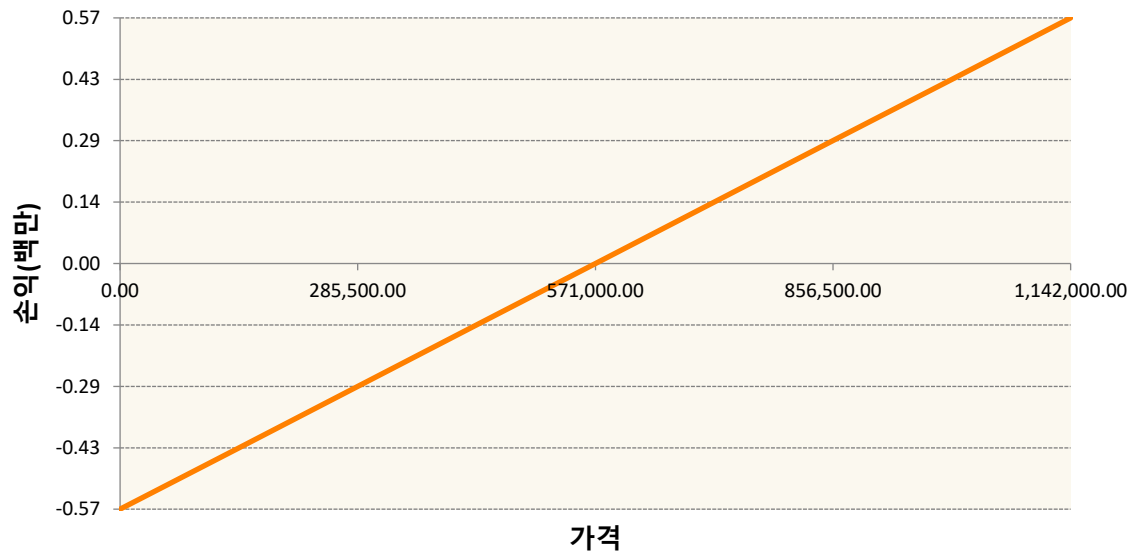
KR4116SA0004-2022-10 현대차개별선물



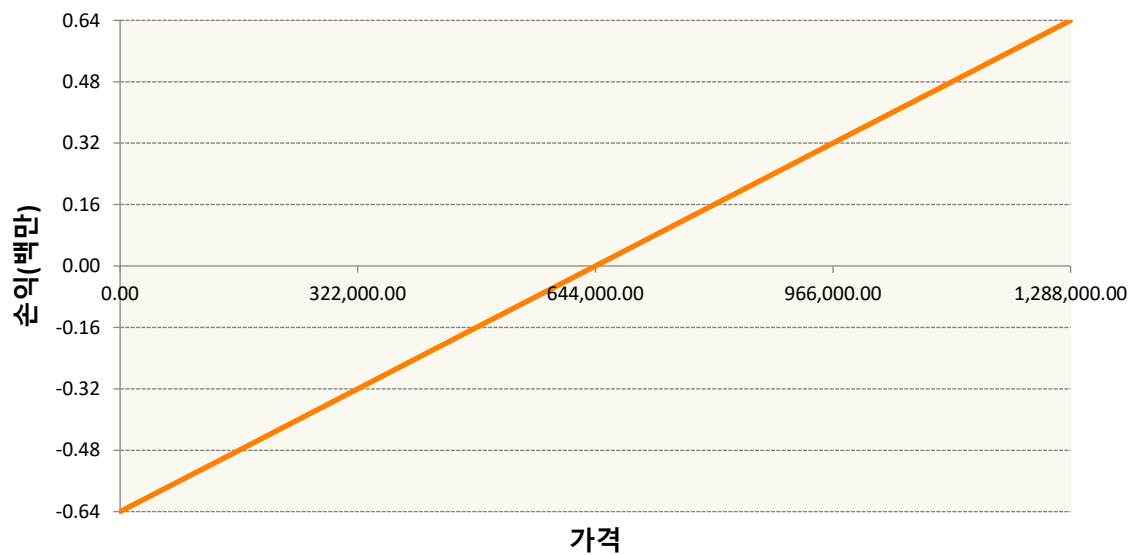
KR4119SA0001-2022-10 기아개별선물



KR4122SA0006-2022-10 삼성SDI개별선물



KR4147SA0007-2022-10 LG화학개별선물



(단위:백만원)

KR4111SA0009							2022-10 삼성전자개별선물		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	
KR4116SA0004							2022-10 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	
KR4119SA0001							2022-10 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	
KR4122SA0006							2022-10 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	
KR4147SA0007							2022-10 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)

25

공시일 2022-09-13

기준일 2022-09-08

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

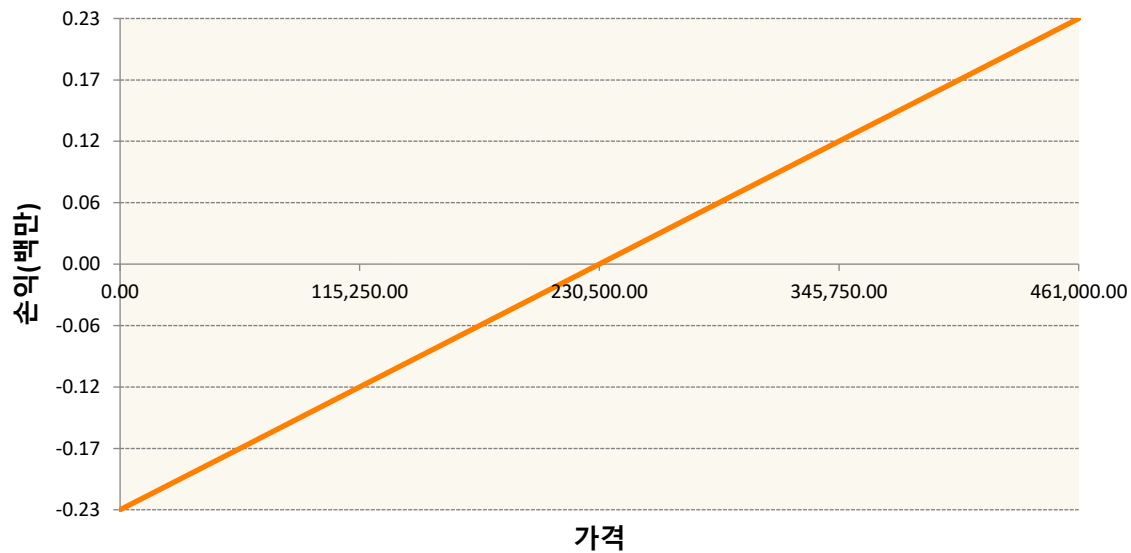
1. 계약금액

(단위:백만원)

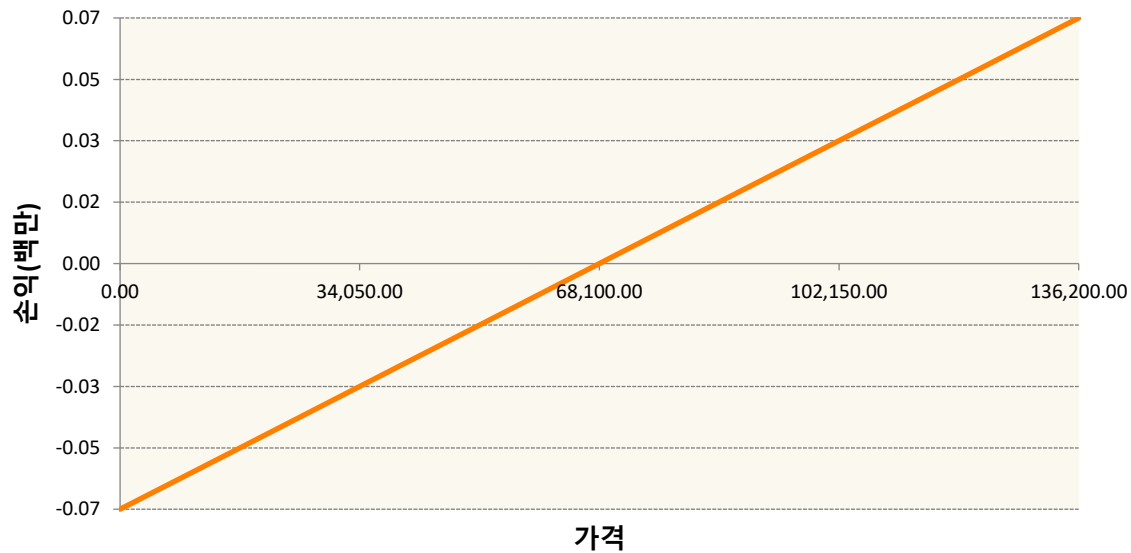
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	199	0	199	장내
누계	유가증권	선물	197	0	197	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156SA0005-2022-10 NAVER개별선물



KR41CFSA0001-2022-10 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156SA0005		2022-10 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
KR41CFSA0001		2022-10 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%	-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	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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

28

공시일 2022-09-13

기준일 2022-09-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

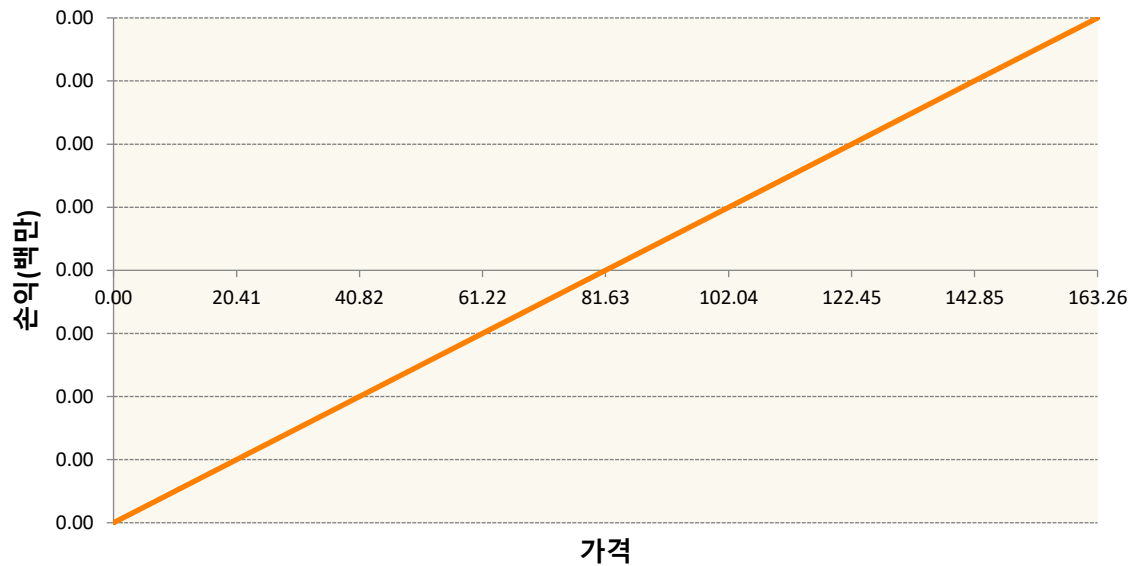
1. 계약금액

(단위:백만원)

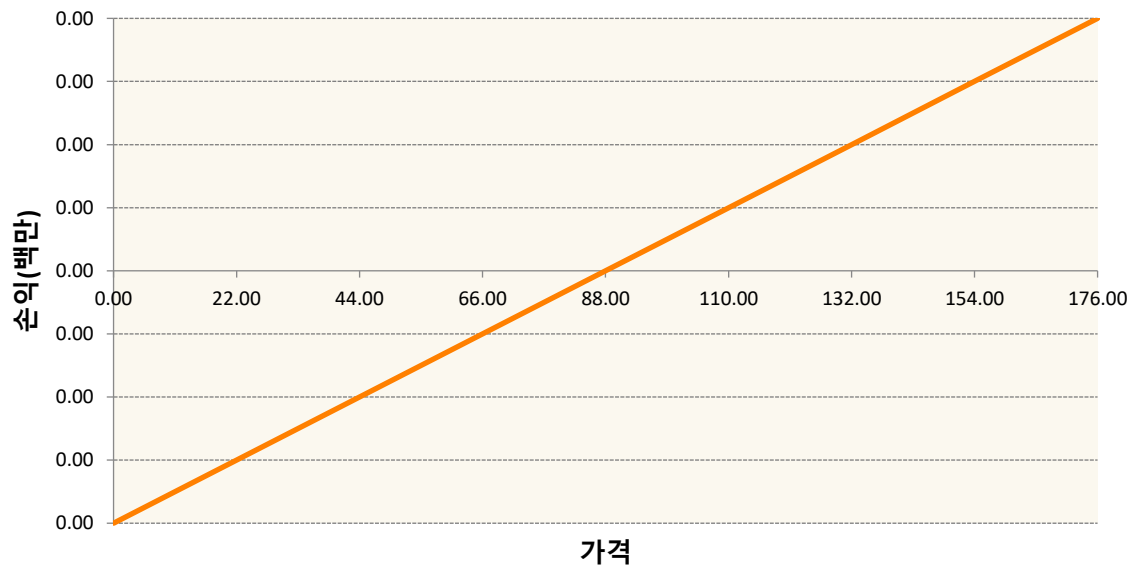
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,805	345	1,460	

2. 만기시점의 손익구조

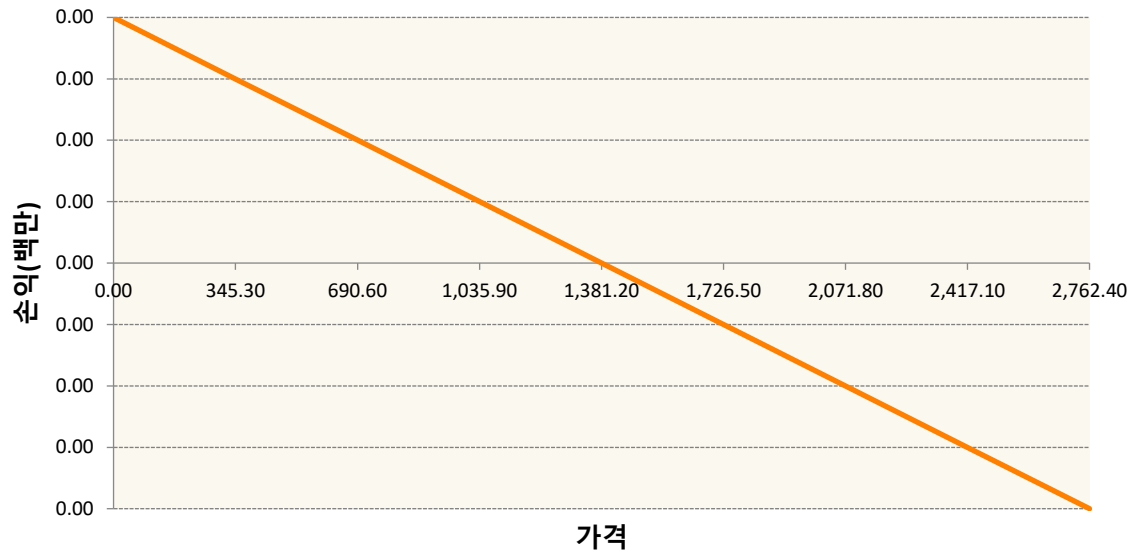
CLX2-WTI CRUDE FUTURE Nov22



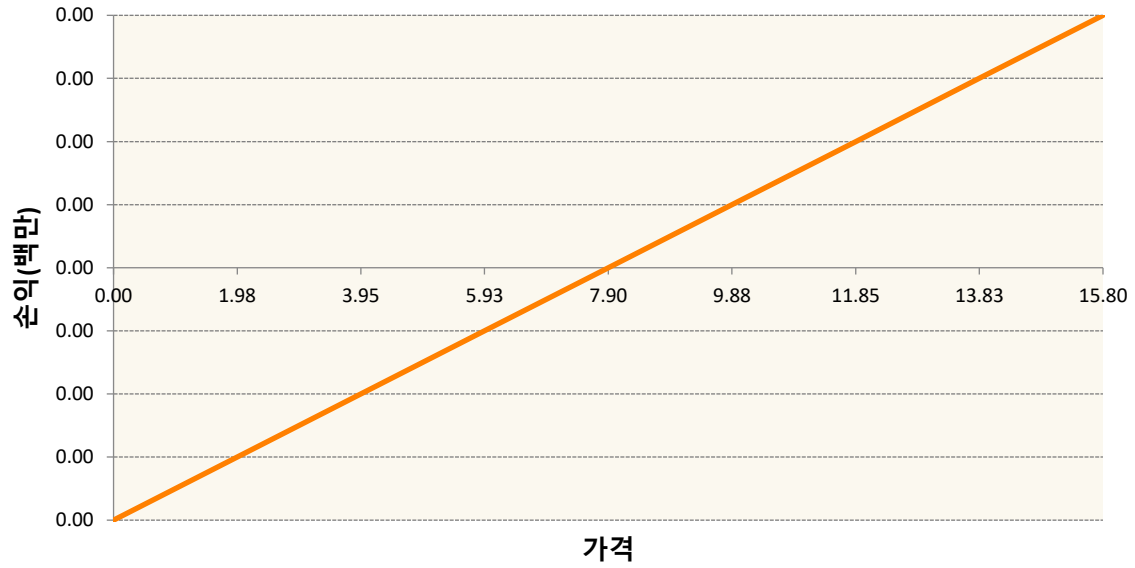
COX2-BRENT CRUDE FUTR Nov22



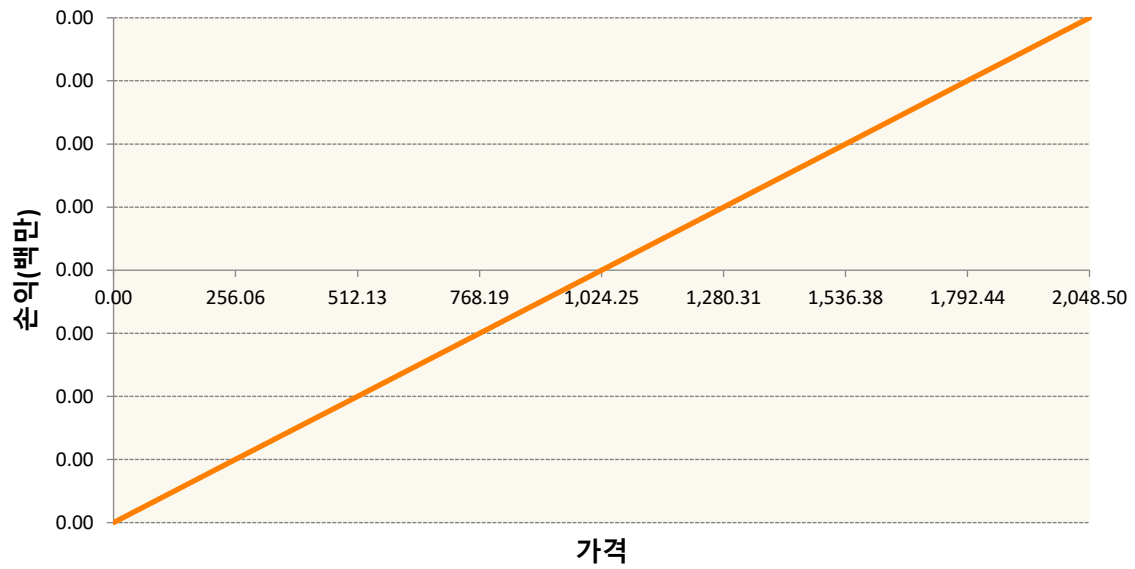
KR4175S90009-2022-09 달러선물

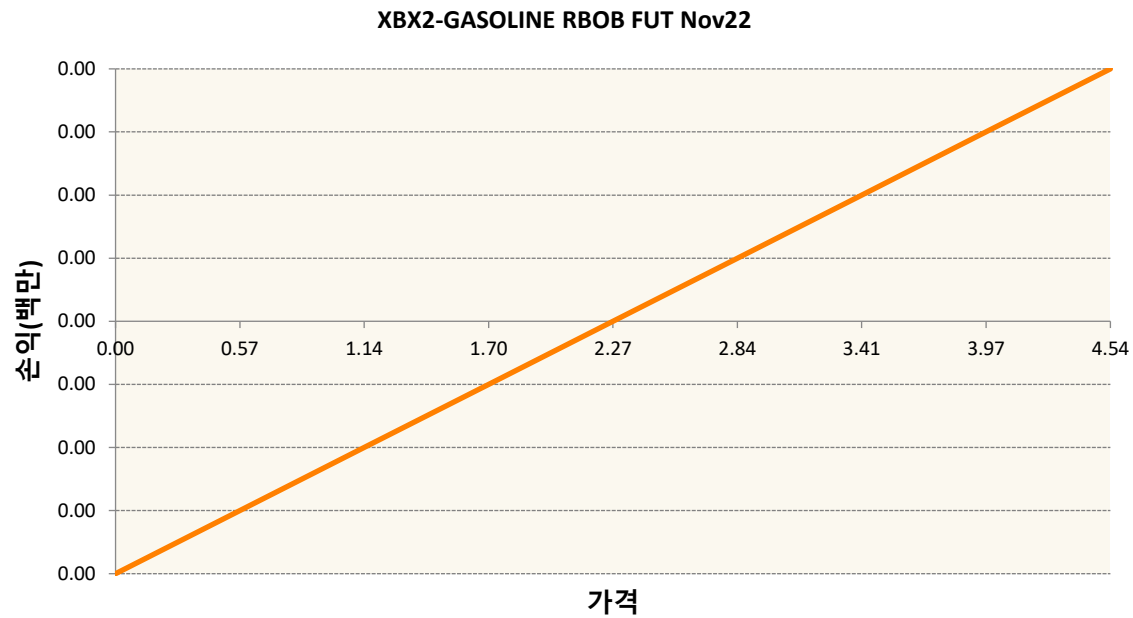


NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QSX2-Low Su Gasoil G Nov22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX2	WTI CRUDE FUTURE Nov22	17
COX2	BRENT CRUDE FUTR Nov22	28
ECX2	E-MINI CRUDE OIL Nov22	4
EOX2	E-MINI NATURAL GAS Nov22	2
HOX2	NY Harb ULSD Fut Nov22	15
KR4175S900 2022-09 달러선물		28
NGX22	NATURAL GAS FUTR Nov22	57
QSX2	Low Su Gasoil G Nov22	11
XBX2	GASOLINE RBOB FUT Nov22	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	468