

공시일 2022-09-16

기준일 2022-09-15

포커스농산물모(채권-파생형)

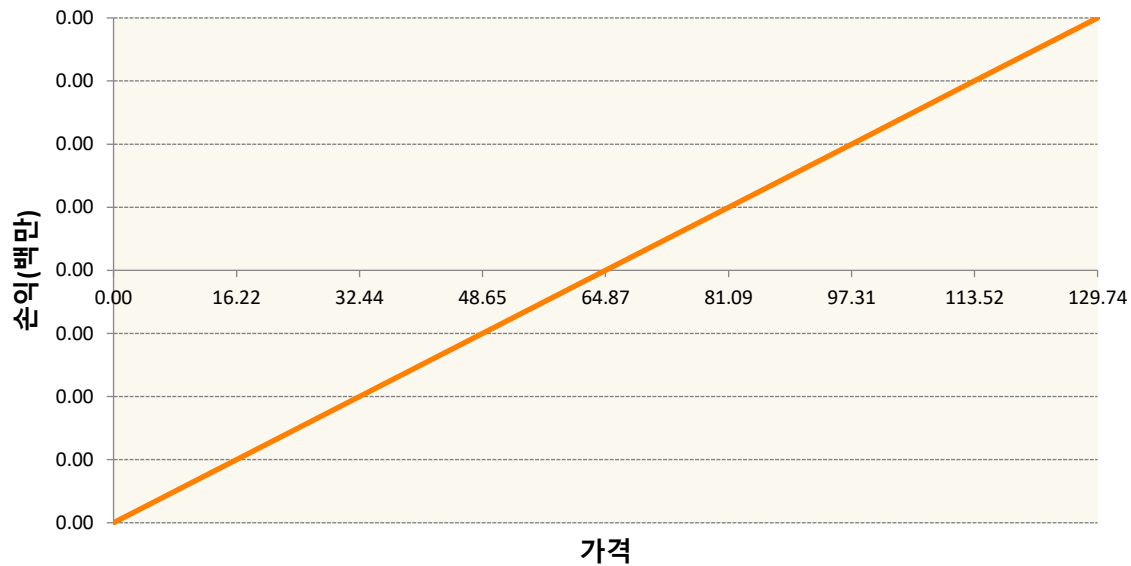
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

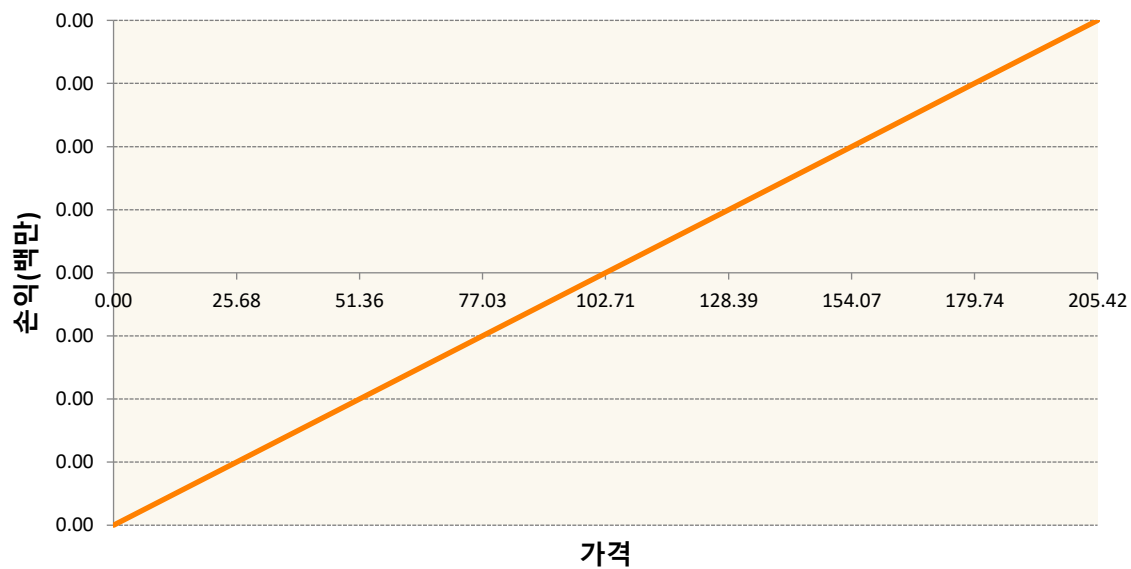
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,916	836	6,080	

2. 만기시점의 손익구조

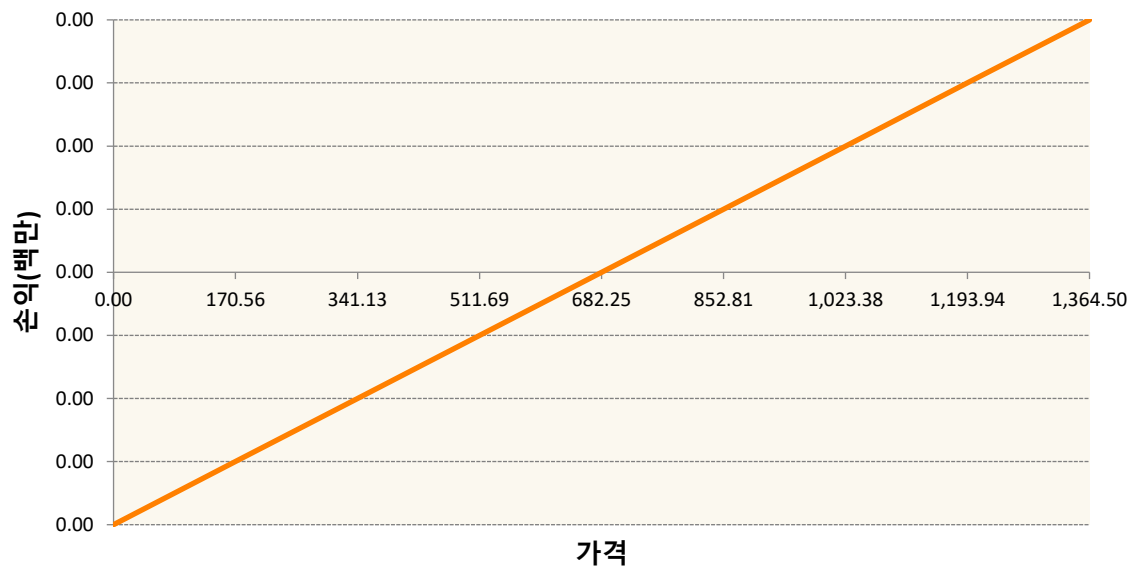
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



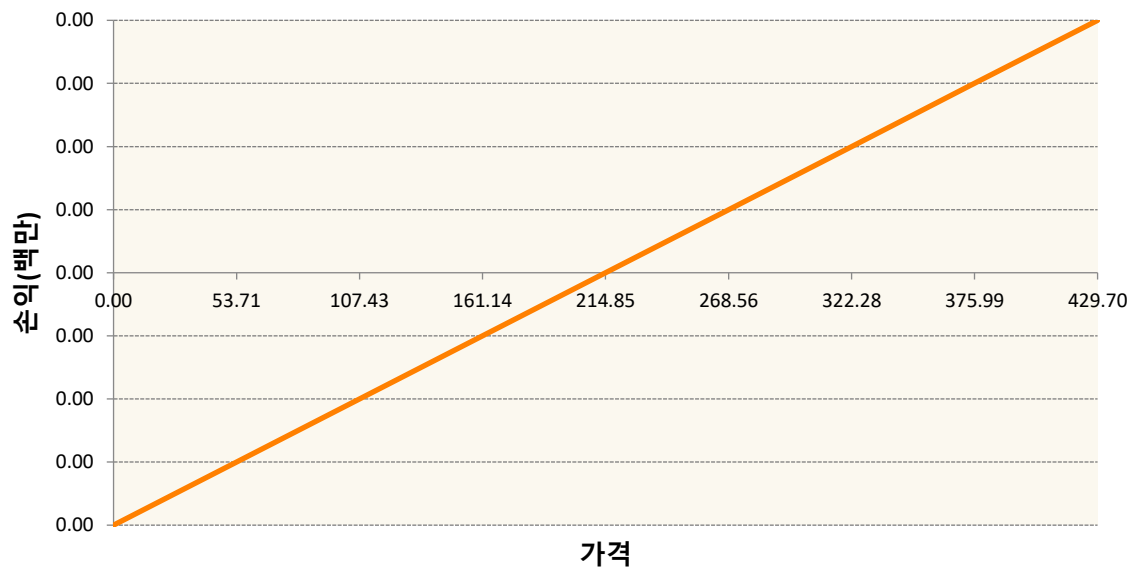
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



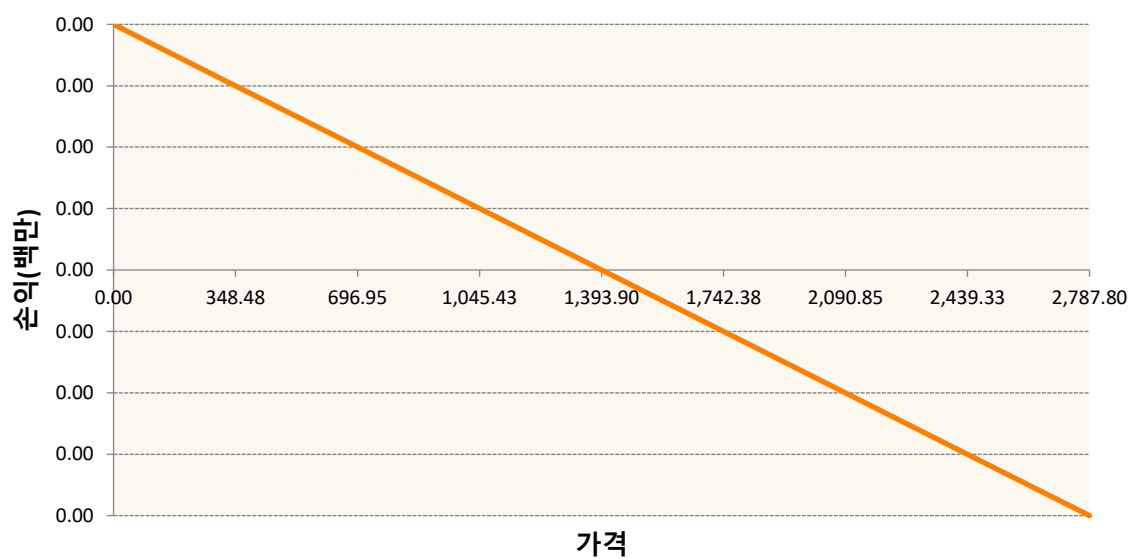
CZ2-CORN FUTURE Dec22



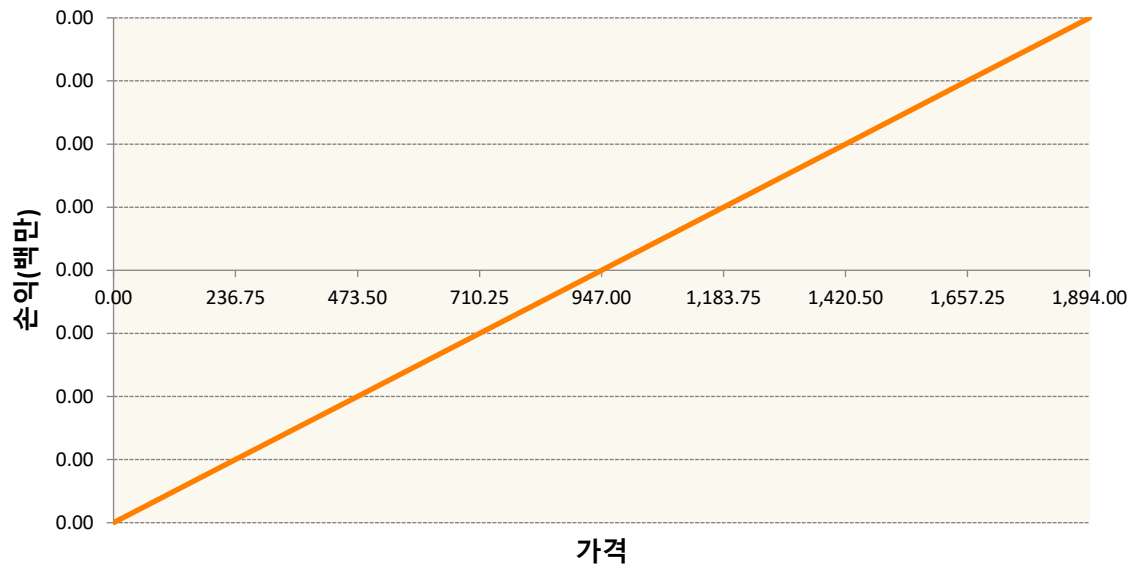
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



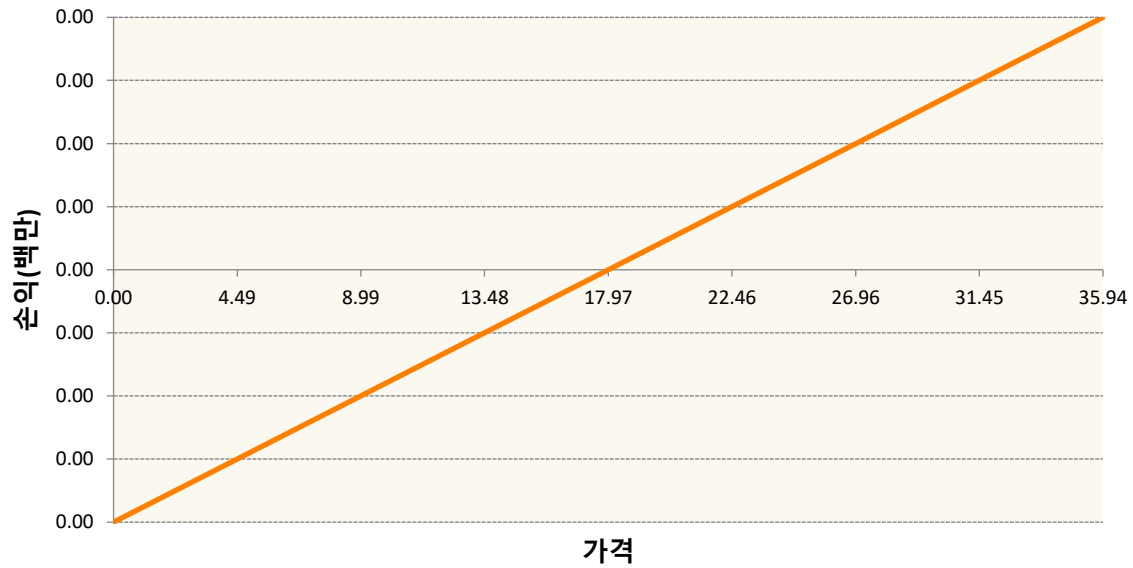
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



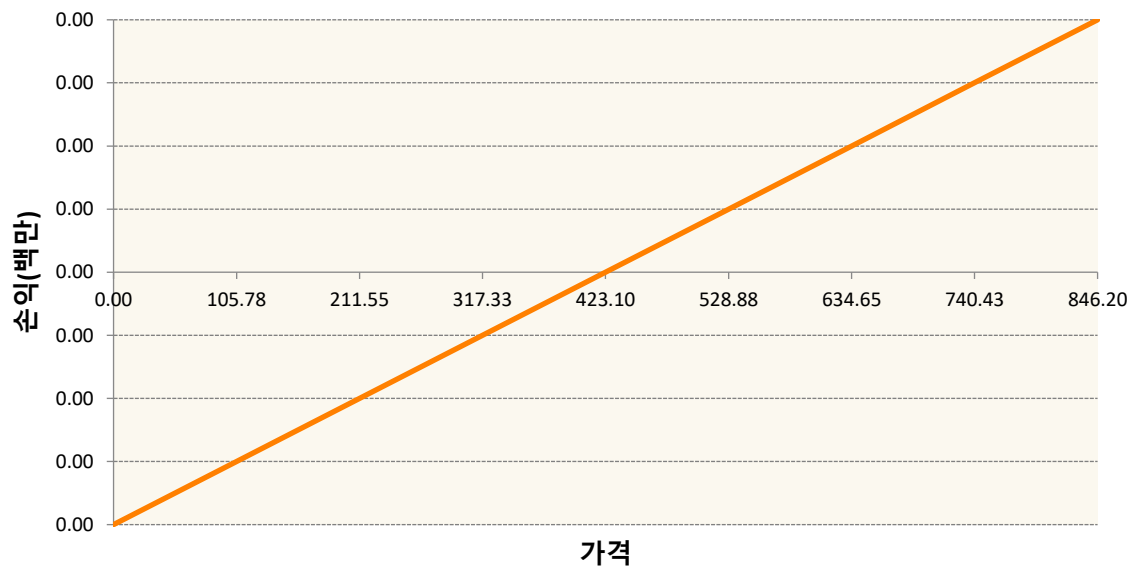
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

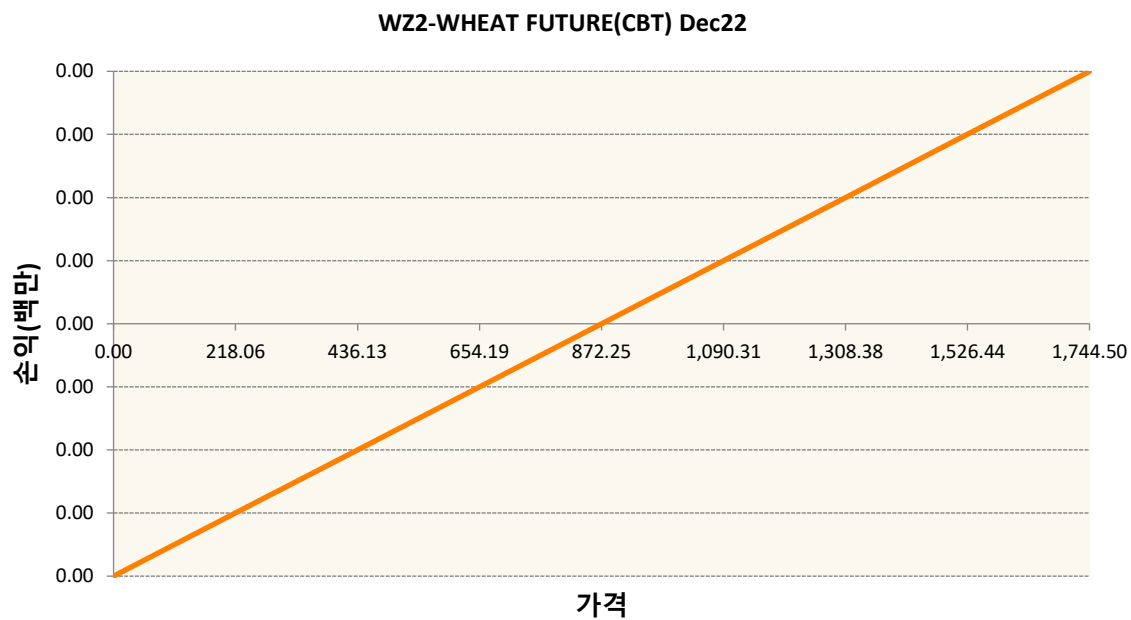
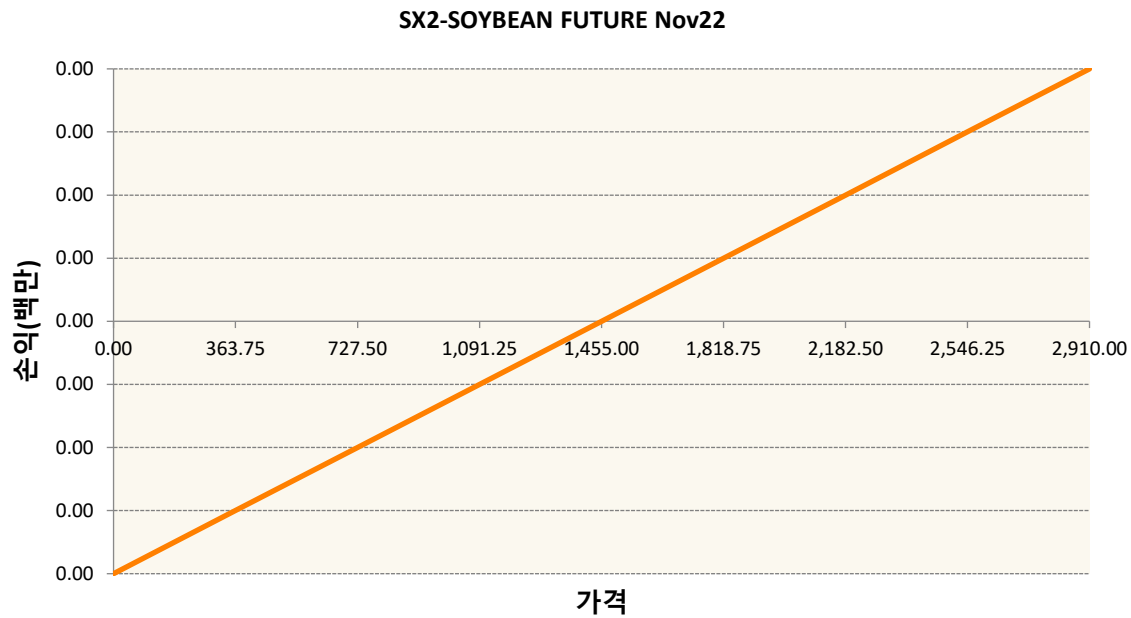


SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



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	2022-09-16
기준일	2022-09-15

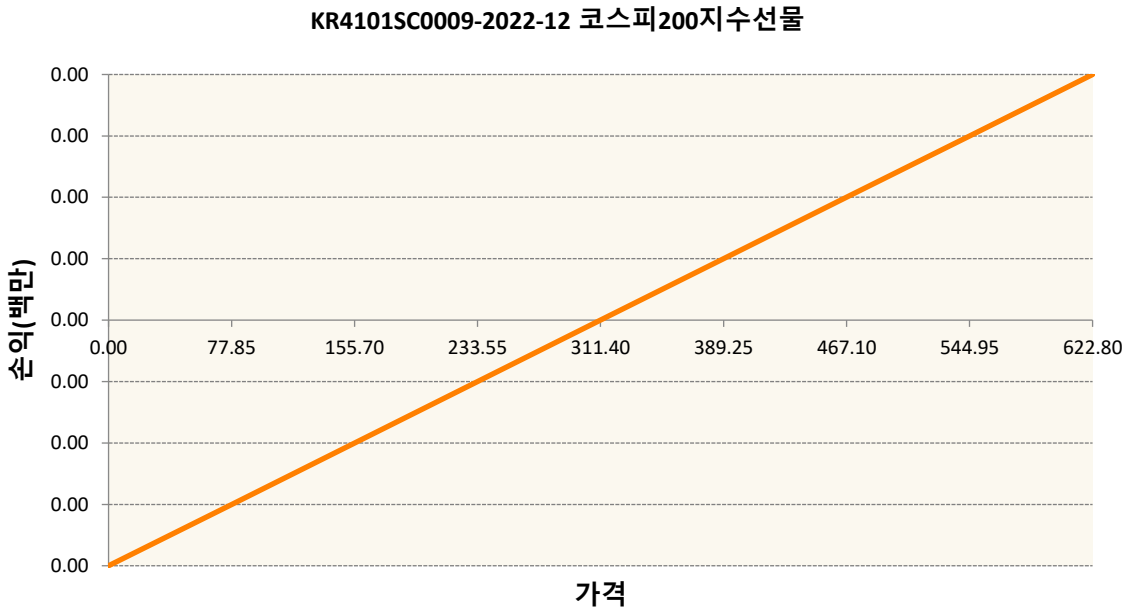
스마트인덱스모

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	623	0	623	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101SC0009			2022-12 코스피200지수선물				50
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	50	50	50	50	50	50	50

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

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	357
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

466

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

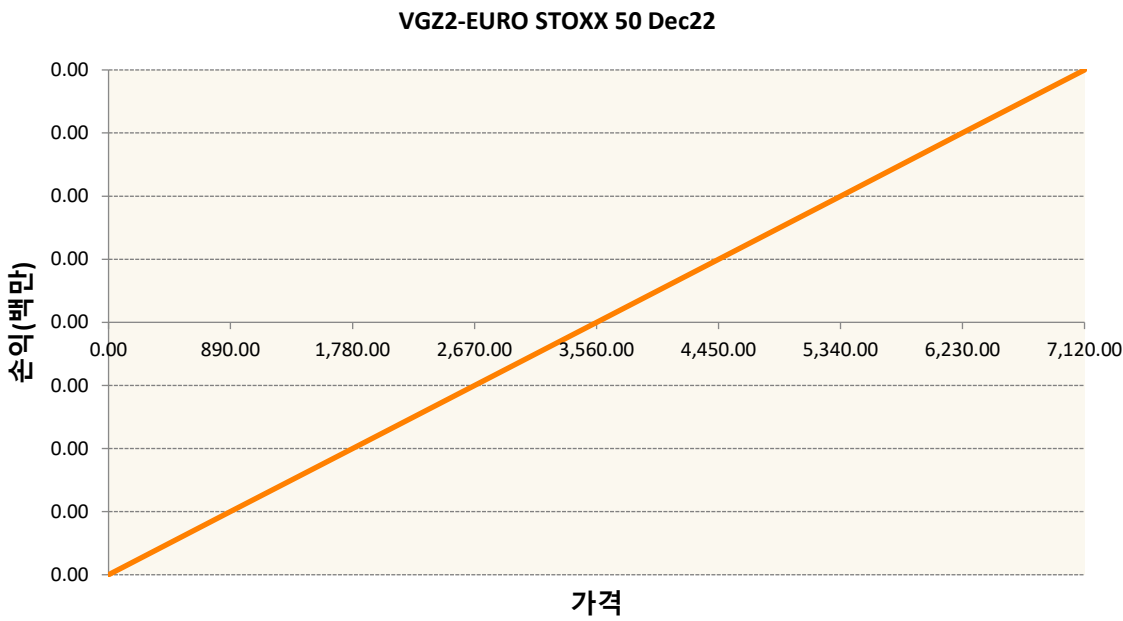
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	544	0	544	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ2	EURO STOXX 50 Dec22	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

45

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

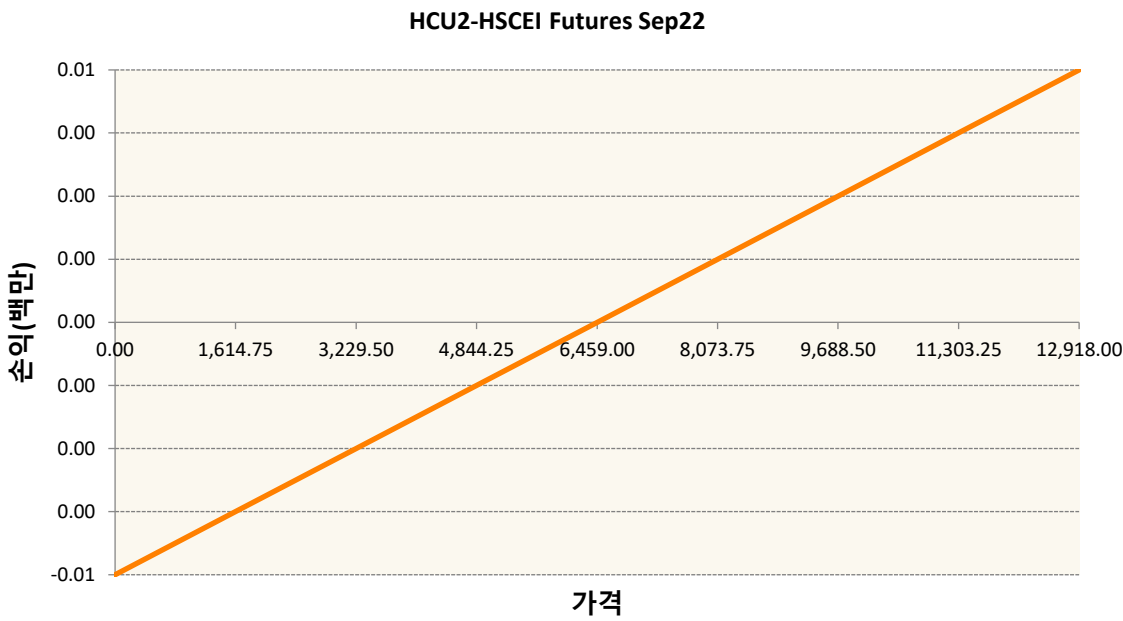
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,051	0	1,051	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU2	HSCEI Futures Sep22	84
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

123

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

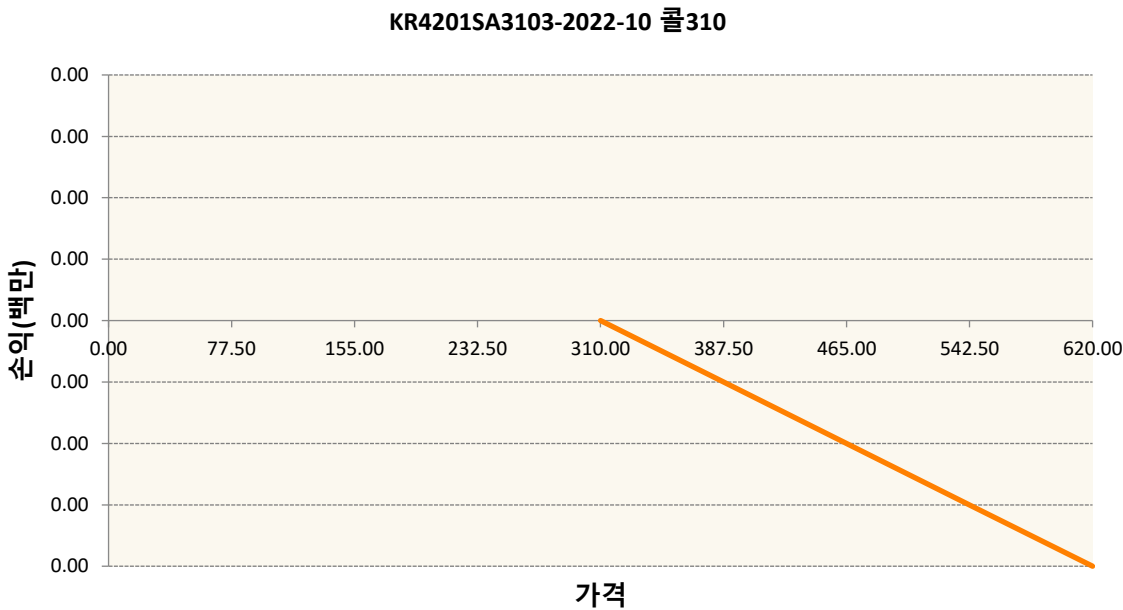
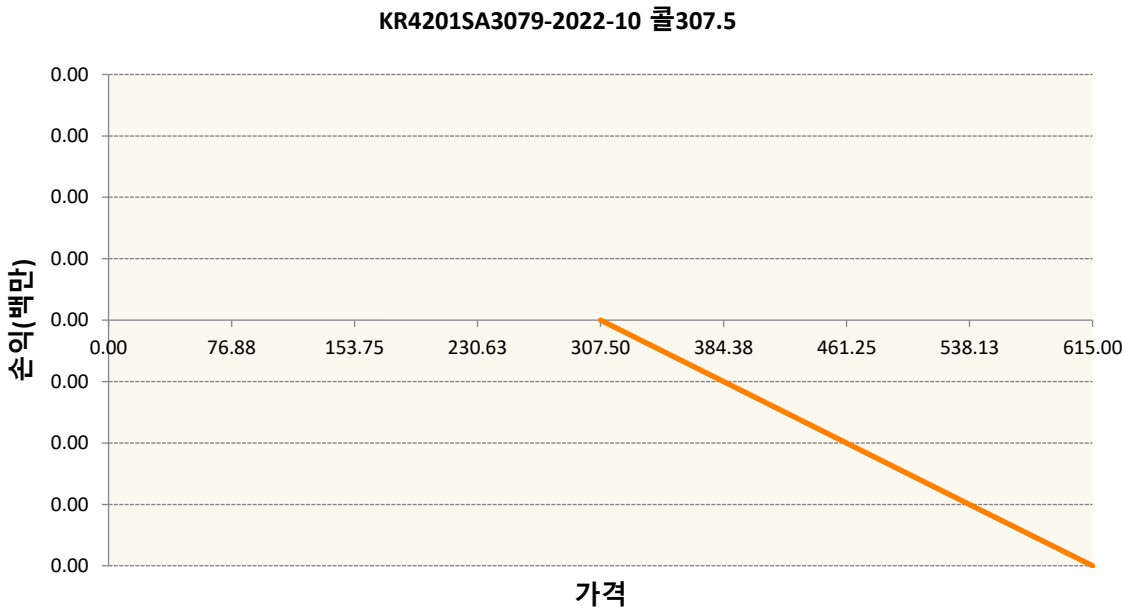
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

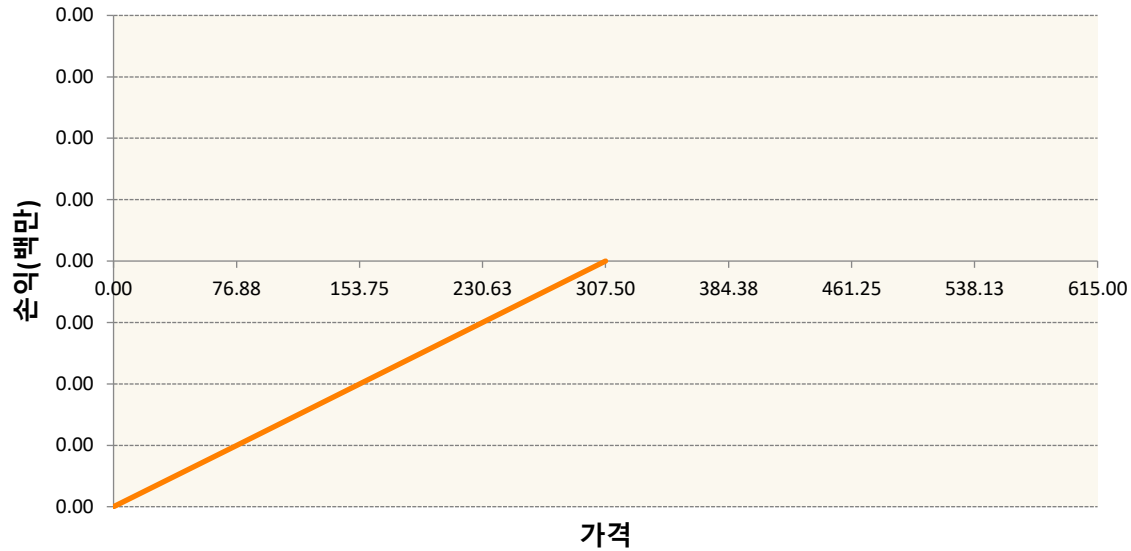
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	56,413	-56,413	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301SA3078-2022-10 풋307.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201SA3079		2022-10 콜307.5						671
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		364	350	334	316	297	277	256
-5.33%		313	292	269	245	221	196	172
-2.67%		223	195	168	141	113	86	58
0%		84	56	28	0	-28	-56	-84
2.67%		-101	-126	-151	-176	-202	-229	-255
5.33%		-325	-343	-363	-384	-406	-429	-452
8.00%		-575	-586	-600	-616	-633	-652	-671
KR4201SA3103		2022-10 콜310						2,261
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		1,147	1,103	1,052	996	936	871	803
-5.33%		1,001	931	857	780	700	618	534
-2.67%		729	638	545	452	358	264	169
0%		297	198	99	0	-99	-198	-297
2.67%		-301	-391	-484	-577	-672	-767	-863
5.33%		-1,041	-1,112	-1,188	-1,267	-1,350	-1,435	-1,522
8.00%		-1,886	-1,934	-1,989	-2,050	-2,116	-2,187	-2,261
KR4301SA3078		2022-10 풋307.5						538
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-438	-451	-466	-483	-500	-519	-538
-5.33%		-227	-247	-268	-290	-312	-335	-358
-2.67%		-52	-78	-103	-128	-153	-179	-204
0%		78	52	26	0	-26	-52	-78

2.67%	165	142	119	95	71	47	22
5.33%	216	199	181	162	141	120	98
8.00%	243	233	220	205	189	172	154

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

(단위:백만원)

3,225

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

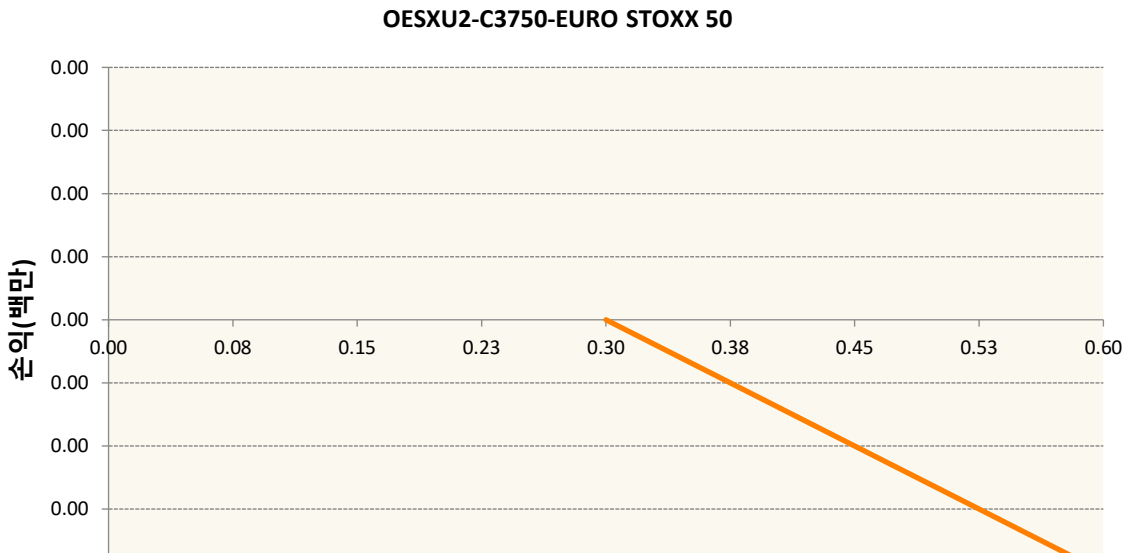
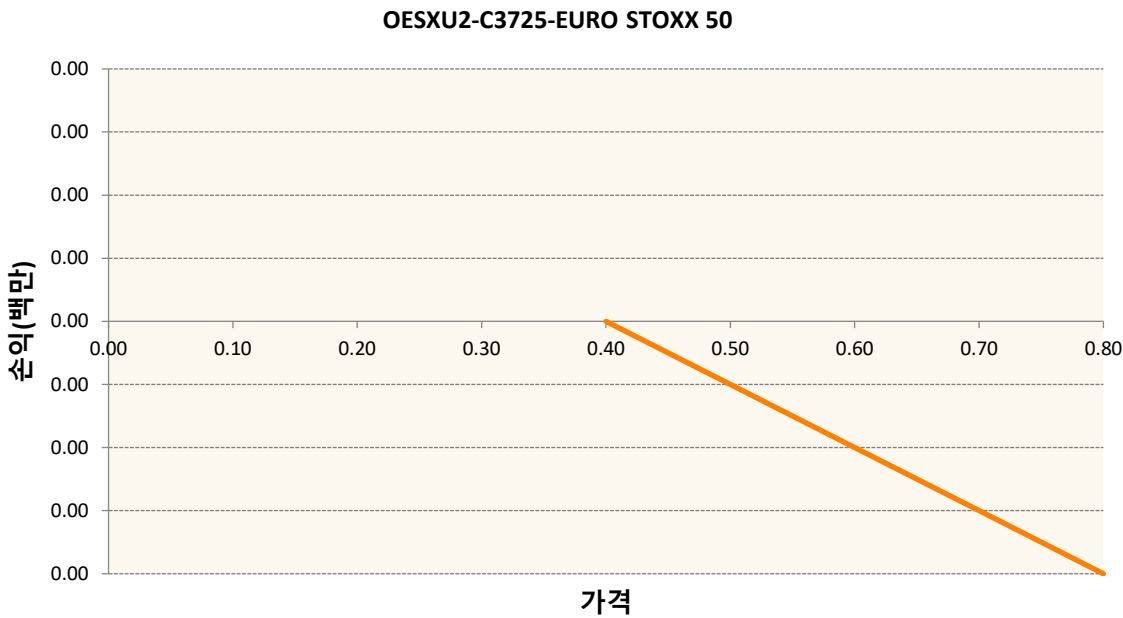
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

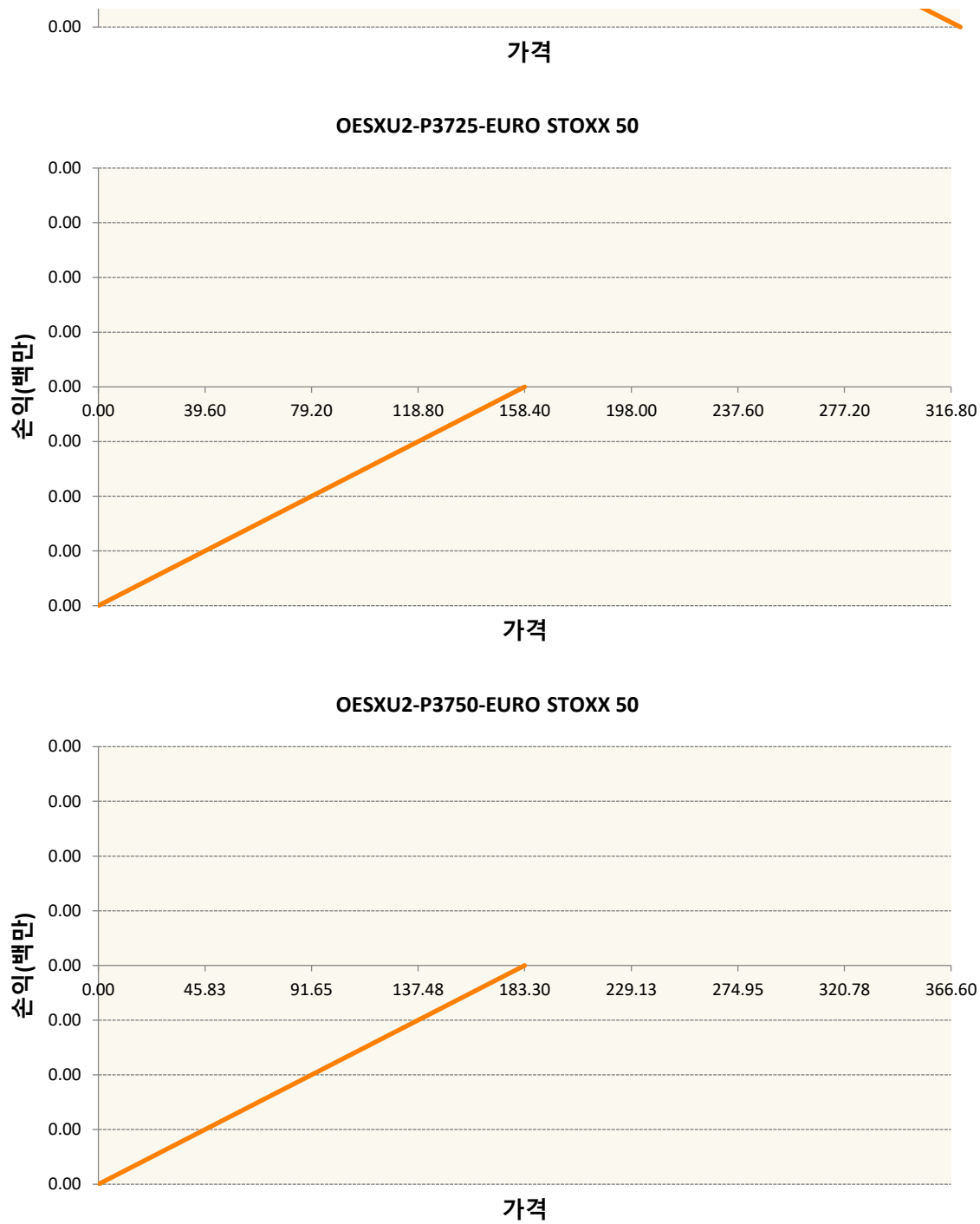
1. 계약금액

(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	23	-23	장내
누계	지수	스왑	4	0	4	장외
누계	통화	선도	0	1,319	-1,319	장외

2. 만기시점의 손익구조





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
0.01
0
1
0.41

공시일 2022-09-16

기준일 2022-09-15

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

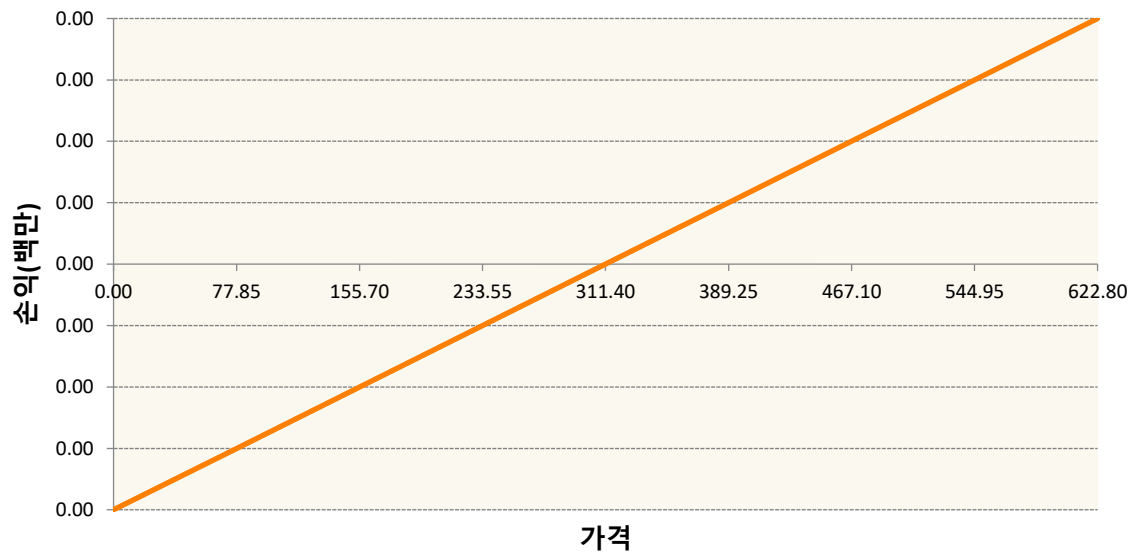
1. 계약금액

(단위:백만원)

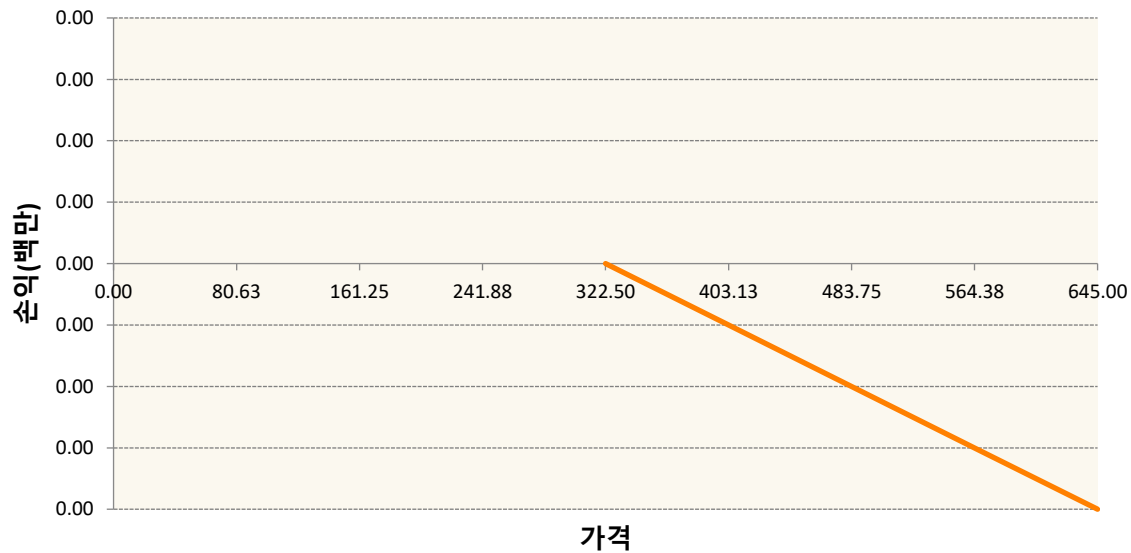
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	389	0	389	장내
누계	유가증권	옵션	386	4,219	-3,834	장내

2. 만기시점의 손익구조

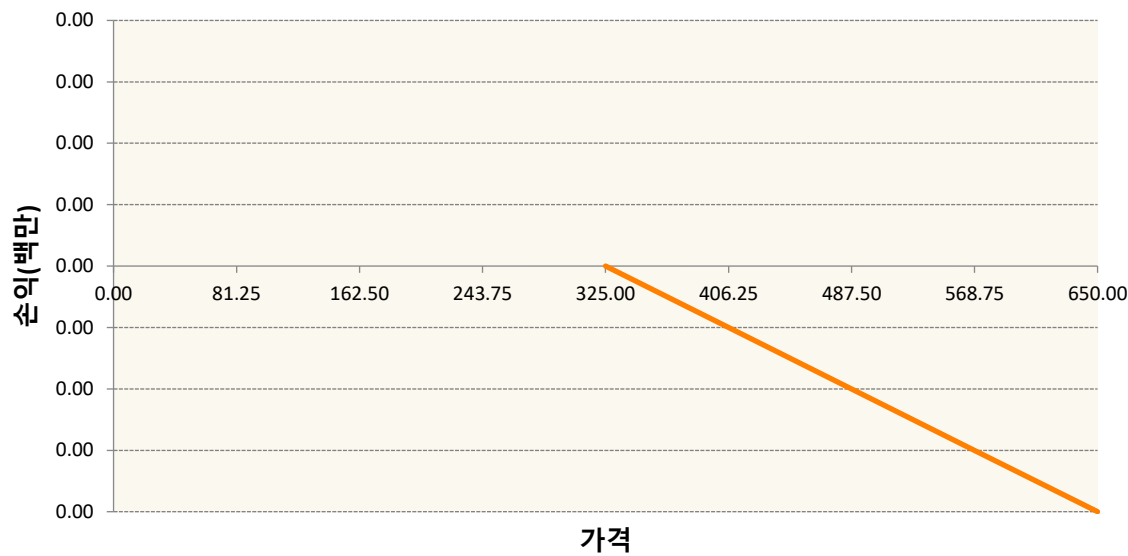
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



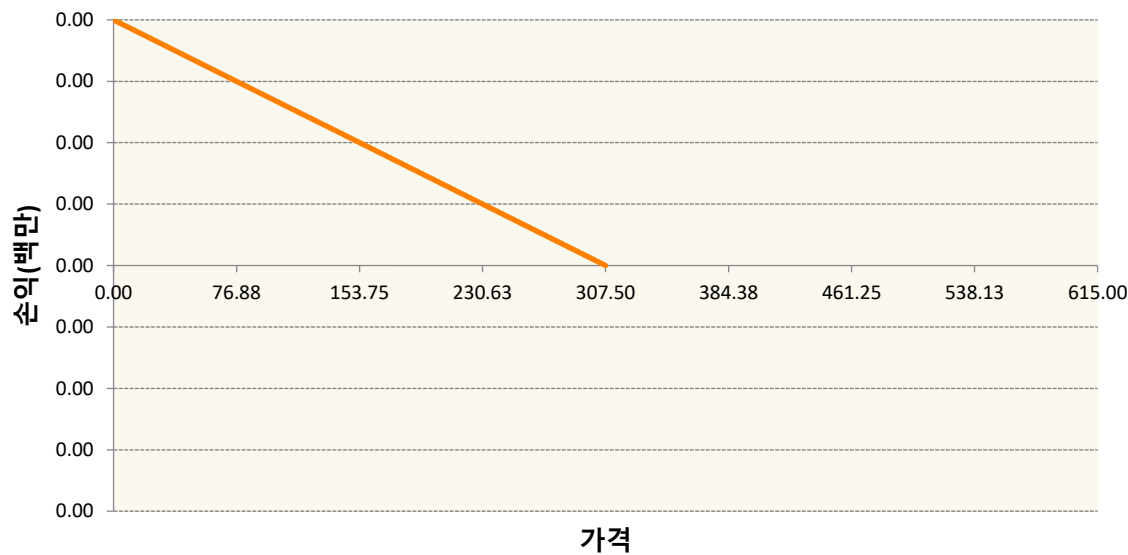
KR4201SA3228-2022-10 콜322.5



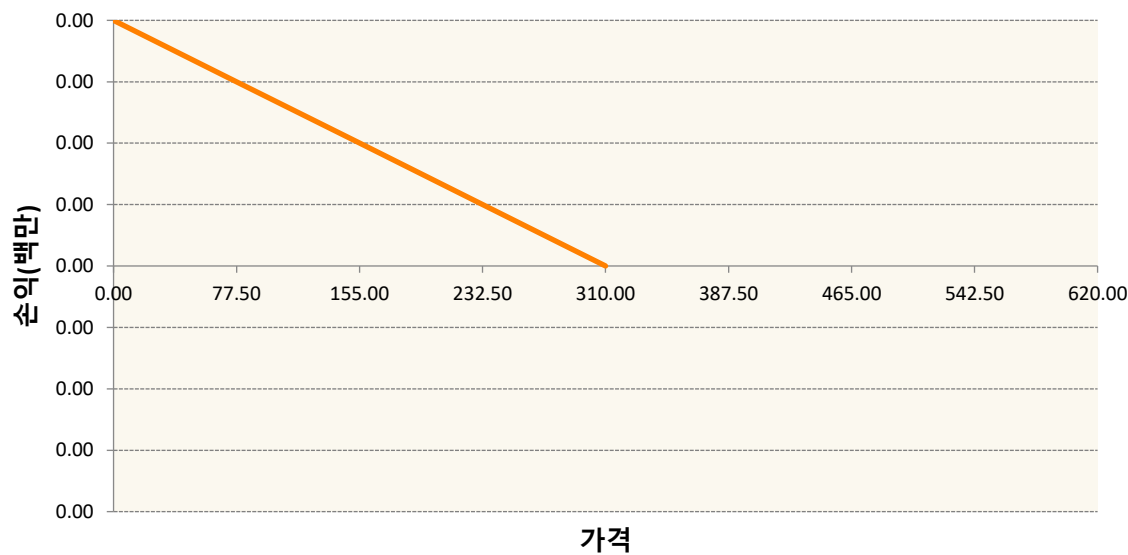
KR4201SA3251-2022-10 콜325



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%	12	12	11	11	10	9	8			
-5.33%	11	11	10	9	8	7	5			
-2.67%	9	8	7	5	4	2	1			
0%	5	3	2	0	-2	-4	-5			
2.67%	-2	-4	-6	-8	-9	-11	-13			
5.33%	-12	-13	-15	-17	-19	-21	-23			
8.00%	-24	-26	-28	-29	-31	-33	-35			
KR4201SA3251							2022-10 콜325		158	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	50	49	47	45	42	39	35			
-5.33%	47	44	41	37	32	27	22			
-2.67%	39	34	29	23	16	9	2			
0%	23	16	8	0	-8	-16	-25			
2.67%	-5	-14	-24	-33	-42	-51	-60			
5.33%	-48	-57	-67	-76	-86	-95	-105			
8.00%	-105	-113	-122	-131	-140	-149	-158			
KR4301SA3078							2022-10 풋307.5		13	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	11	11	11	12	12	12	13			
-5.33%	5	6	6	7	7	8	9			
-2.67%	1	2	2	3	4	4	5			
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2			
2.67%	-4	-3	-3	-2	-2	-1	-1			
5.33%	-5	-5	-4	-4	-3	-3	-2			
8.00%	-6	-6	-5	-5	-5	-4	-4			
KR4301SA3102							2022-10 풋310		9	
	기초자산의 변동성									

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

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

(단위:백만원)

204

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	83	-83	
누계	유가증권	수익증권	7,816	0	7,816	

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	2022-09-16
기준일	2022-09-15

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	6,747	0	6,747	

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	2022-09-16
기준일	2022-09-15

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	20,570	0	20,570	
누계	통화	선도	209	21,568	-21,358	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213C6P₩ KRW/USD 27-09-22E		624
FXW213C7R₩ KRW/USD 27-10-22E		478
FXW213C8R₩ KRW/USD 28-11-22E		623
FXW213C96₩ USD/KRW 27-09-22E		17

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	713

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

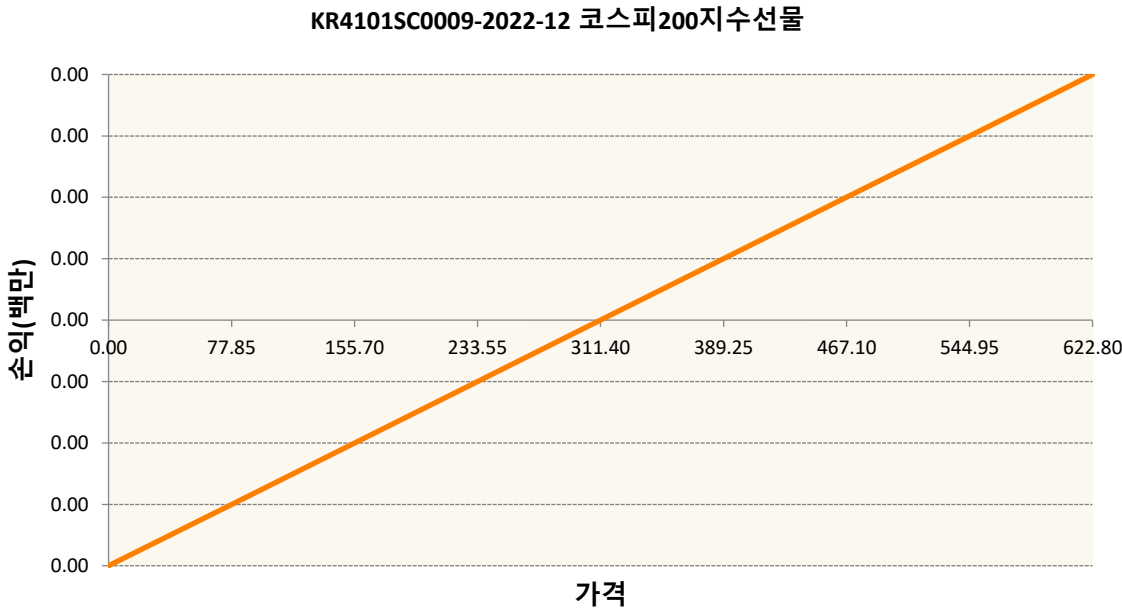
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	389	0	389	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(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

공시일 2022-09-16

기준일 2022-09-15

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

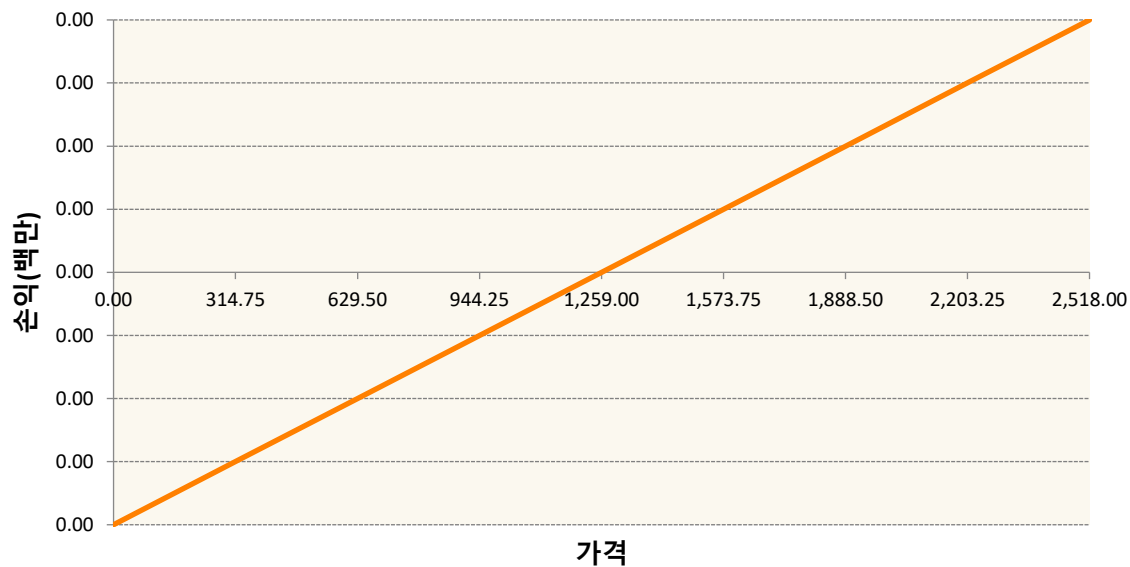
1. 계약금액

(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	549	0	549	
누계	유가증권	스왑	1,709	0	1,709	장외
누계	통화	선도	0	1,180	-1,180	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCU2-VN30 Index Future SEP22



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.5504E+11 VN30TR Index(EUR)	137
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	44

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

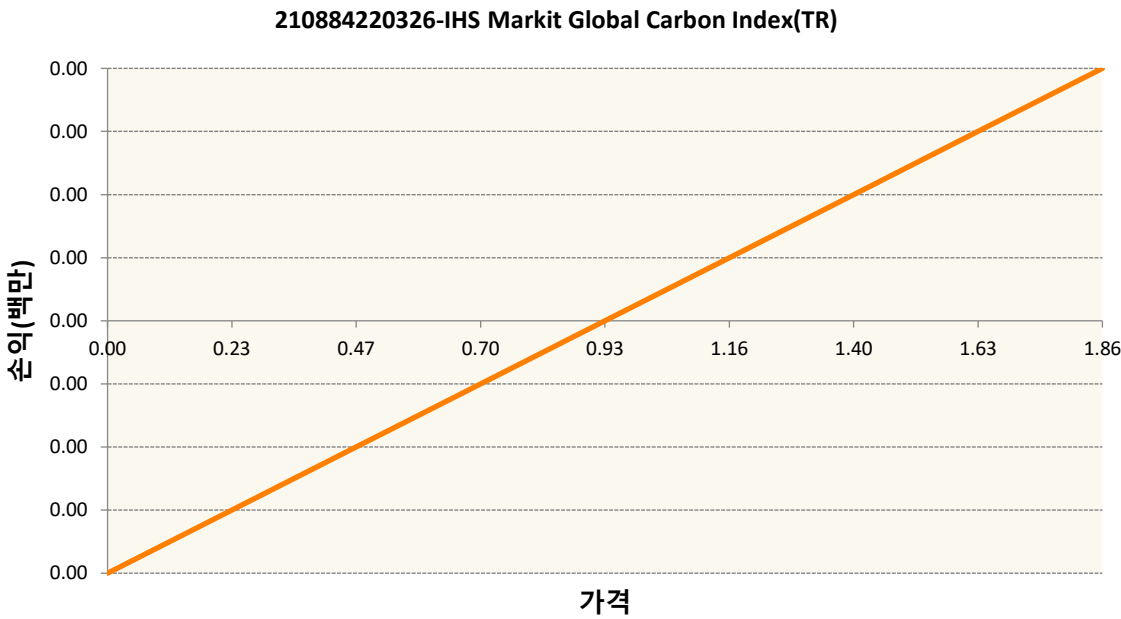
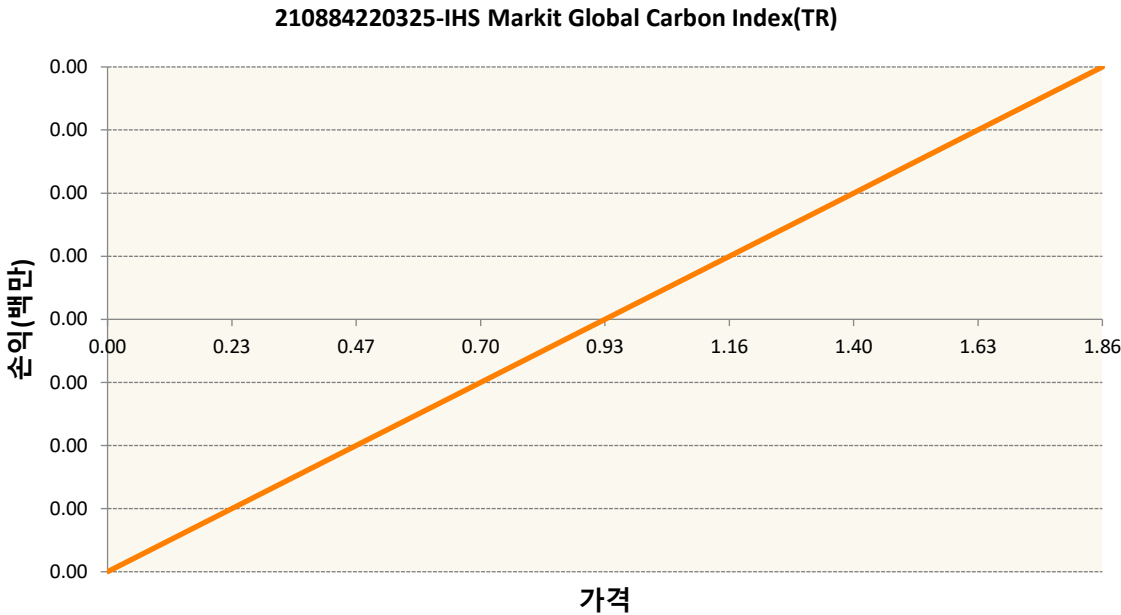
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

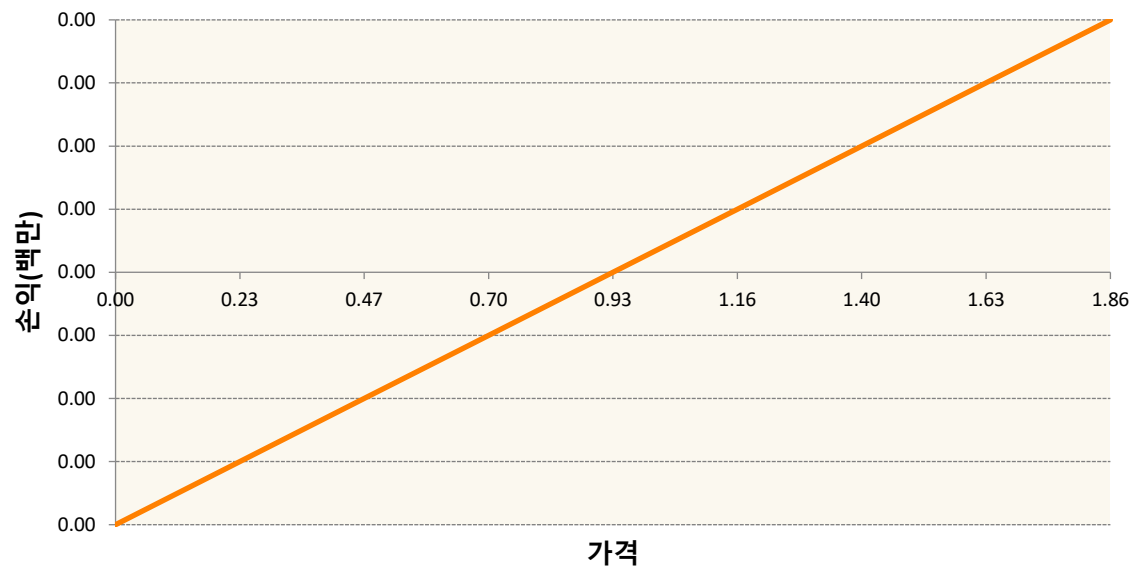
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	37,245	0	37,245	

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)

186

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

2,685

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

93

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

(단위:백만원)

5,660

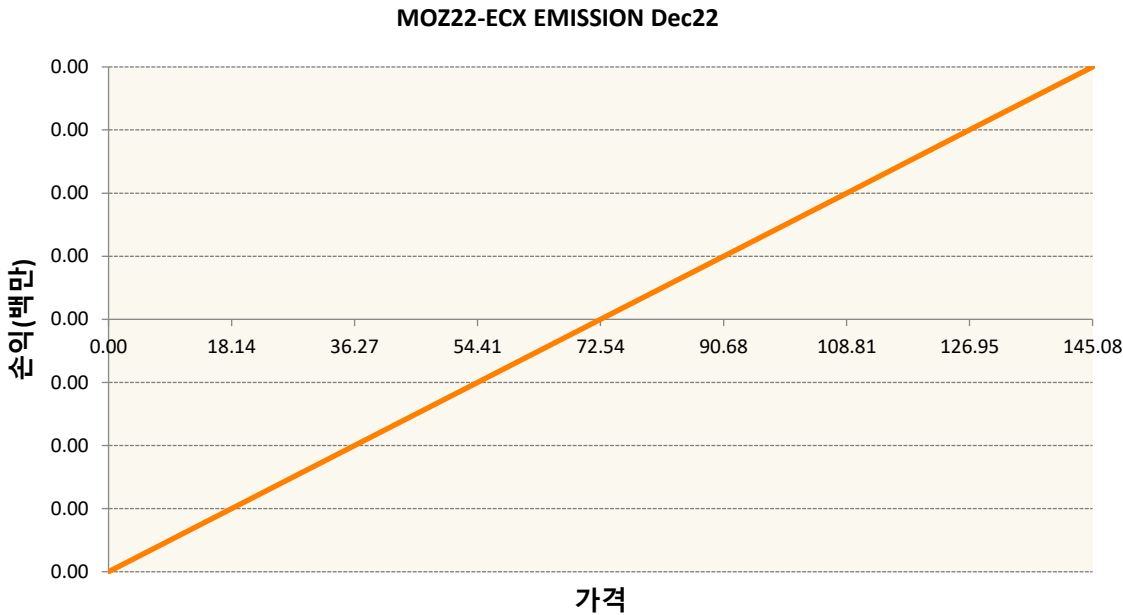
공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

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	12,336	0	12,336	
누계	통화	선도	0	5,220	-5,220	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213C8S	KRW/EUR 27-09-22E		418
MOZ22	ECX EMISSION Dec22		987

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,774

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

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)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	13

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

(단위:백만원)

98

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

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)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	2

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

(단위:백만원)

6

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

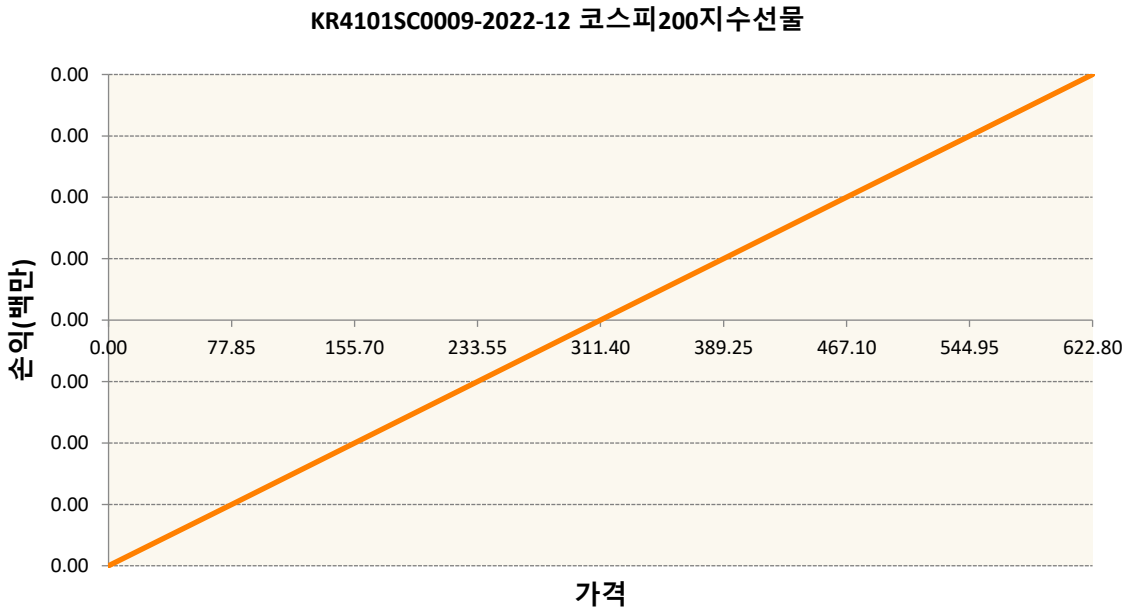
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	934	0	934	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	2
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	1
KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물	75

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

(단위:백만원)

86

공시일 2022-09-16

기준일 2022-09-15

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

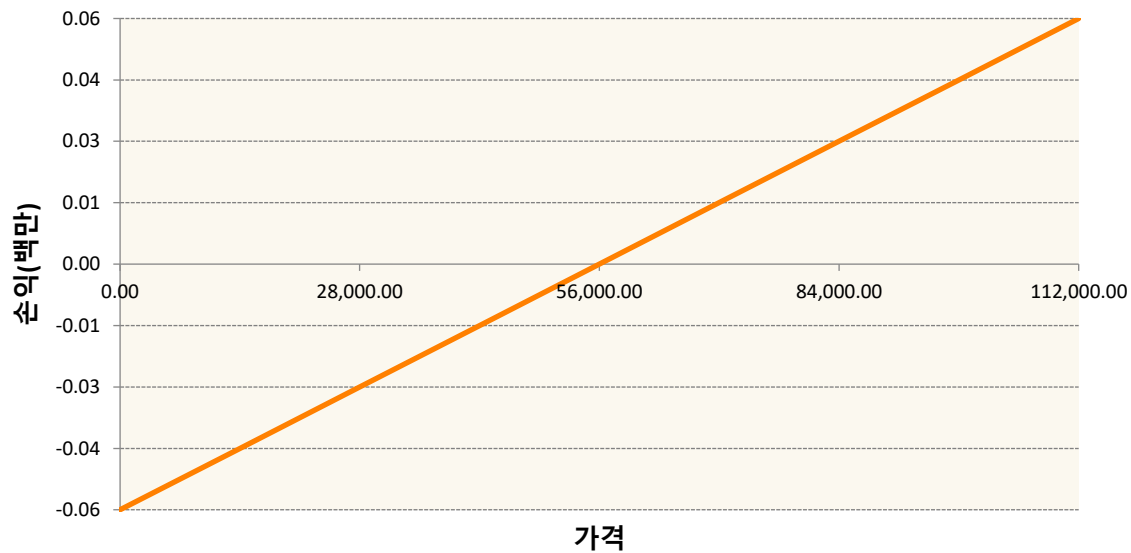
1. 계약금액

(단위:백만원)

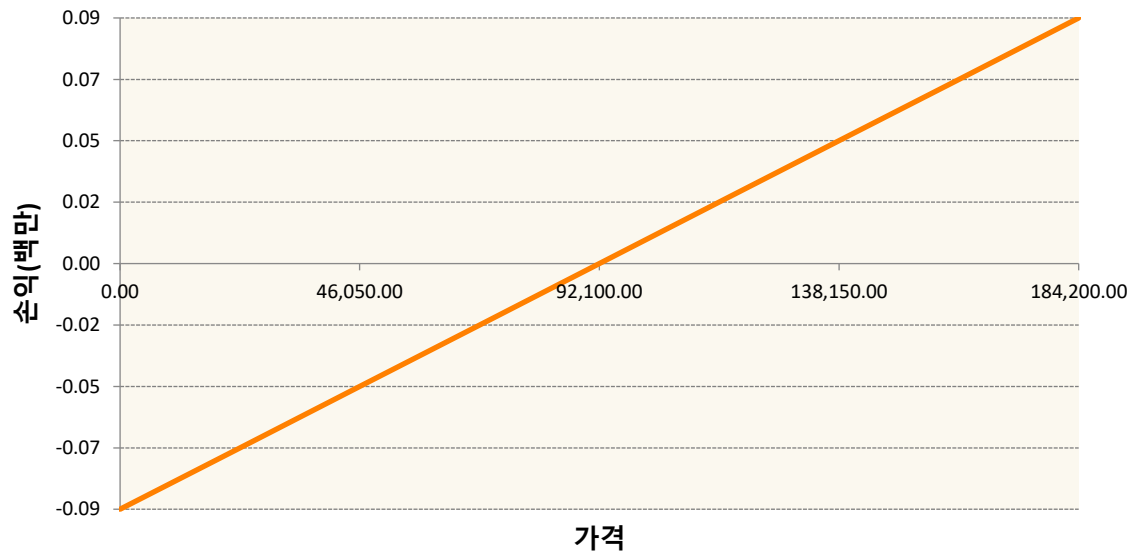
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	805	0	805	장내

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%	-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
KR4150SA0001		2022-10 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)

76

공시일	2022-09-16
기준일	2022-09-15

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 2022-09-16

기준일 2022-09-15

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

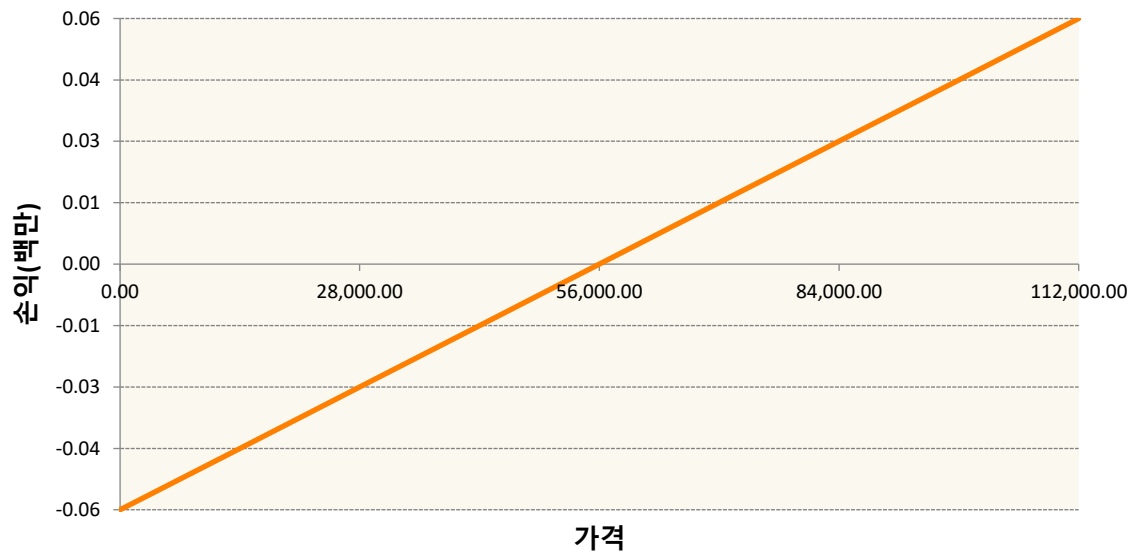
1. 계약금액

(단위:백만원)

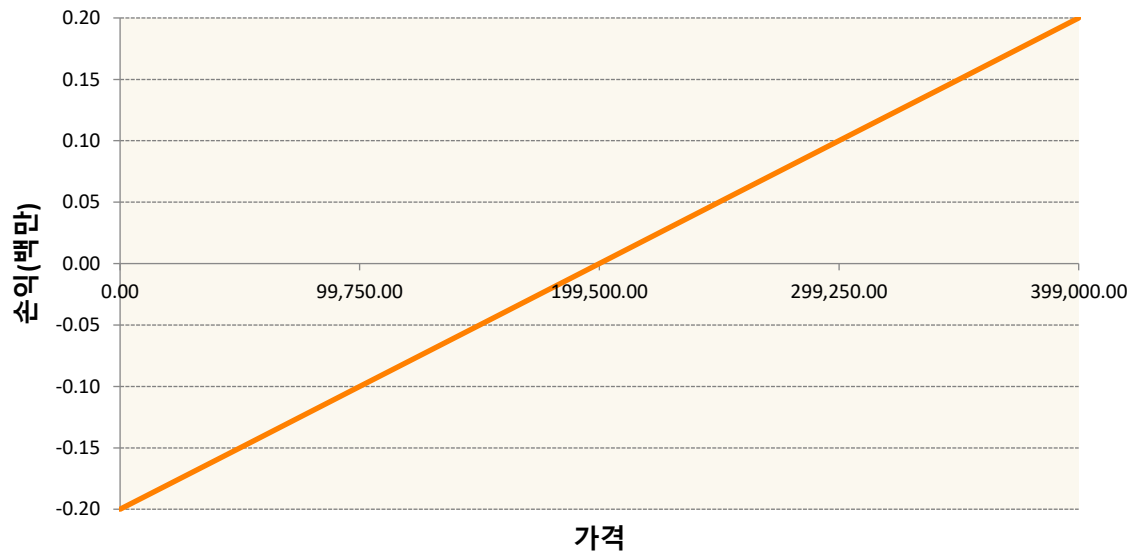
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	288	0	288	장내

2. 만기시점의 손익구조

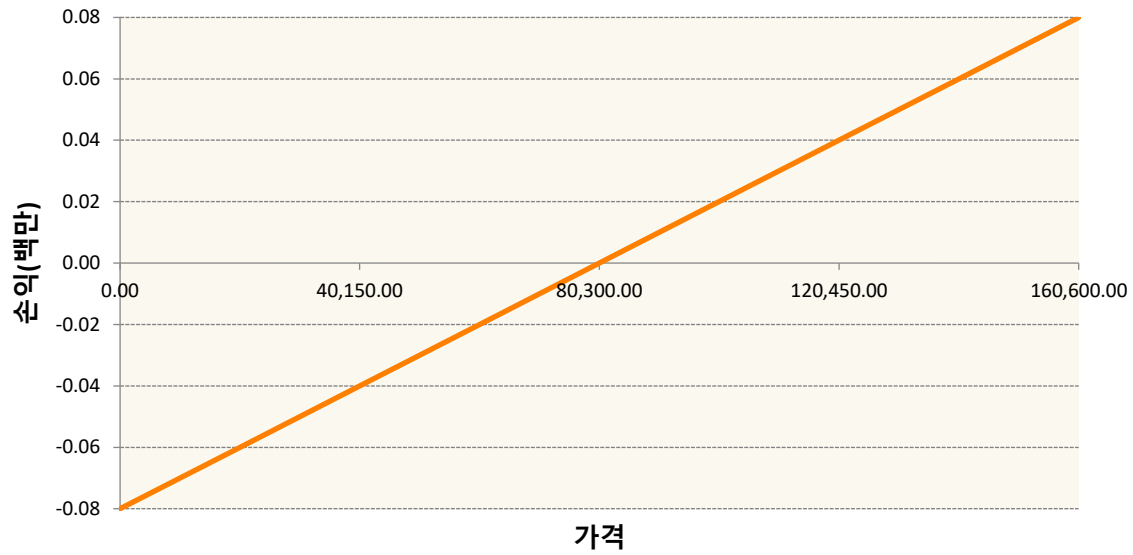
KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



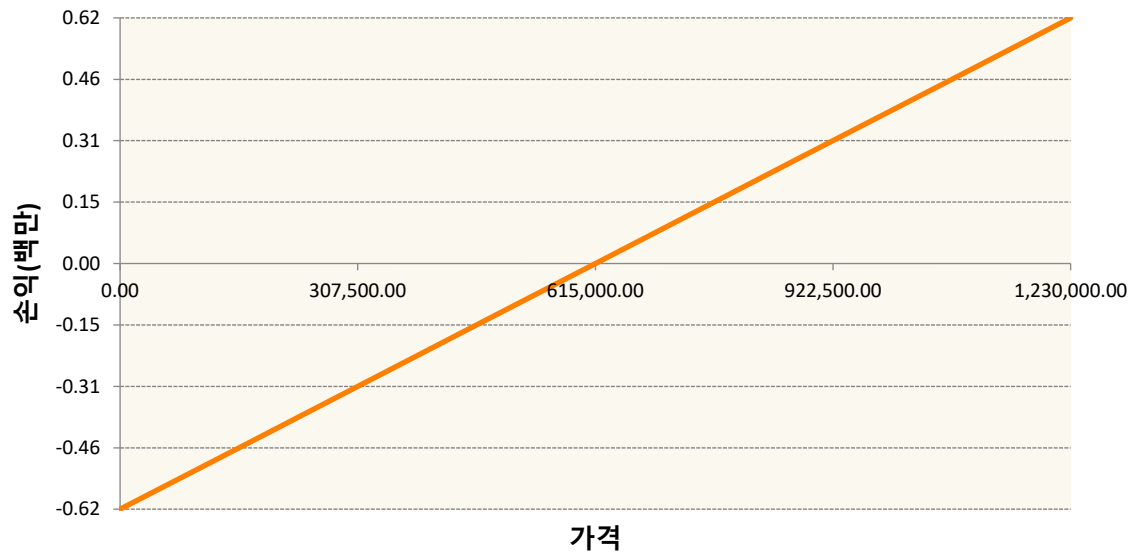
KR4116SA0004-2022-10 현대차개별선물



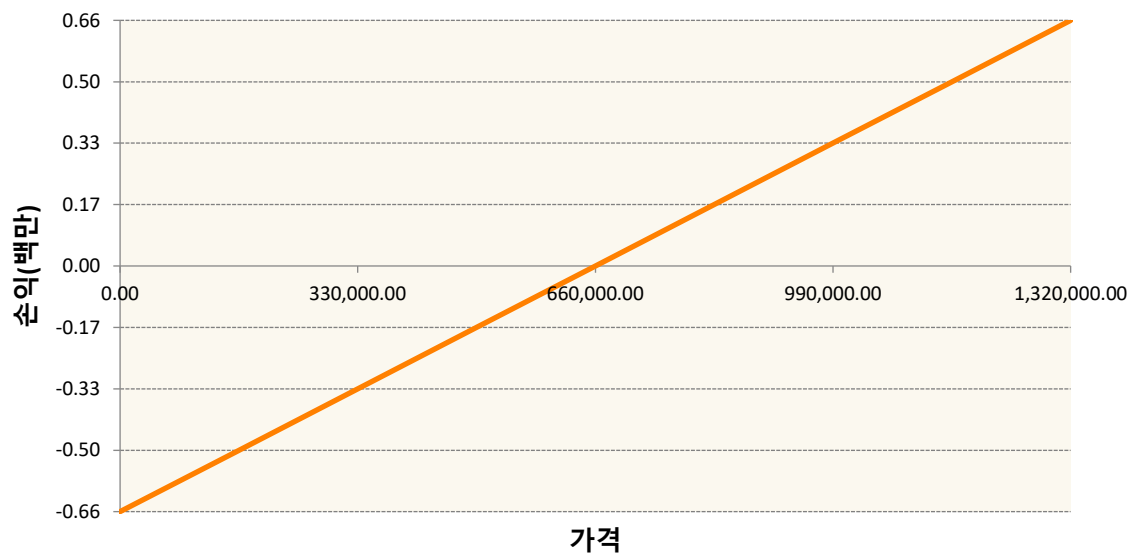
KR4119SA0001-2022-10 기아개별선물



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		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	
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)

26

공시일 2022-09-16

기준일 2022-09-15

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

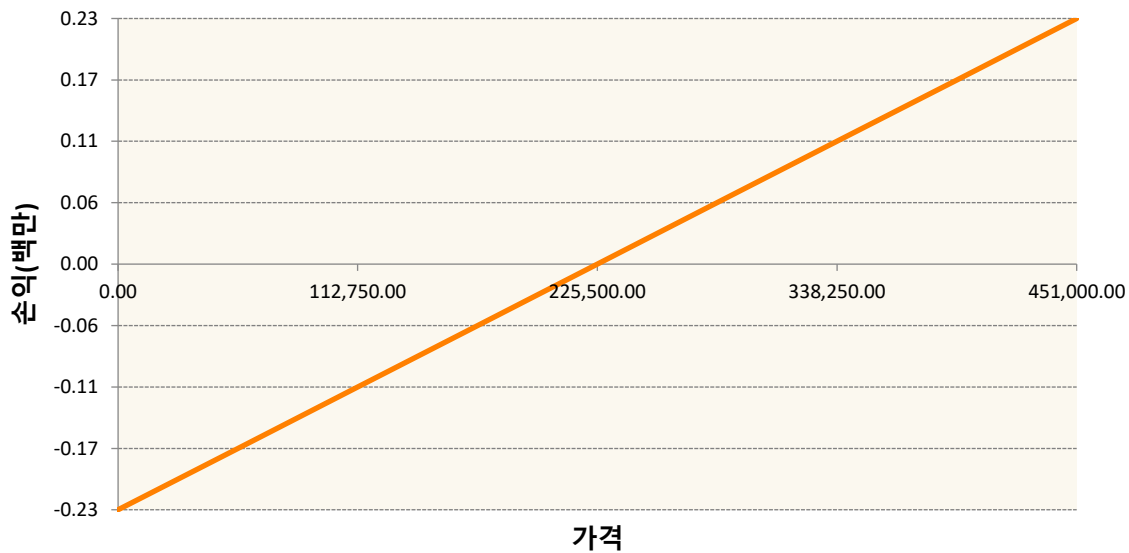
1. 계약금액

(단위:백만원)

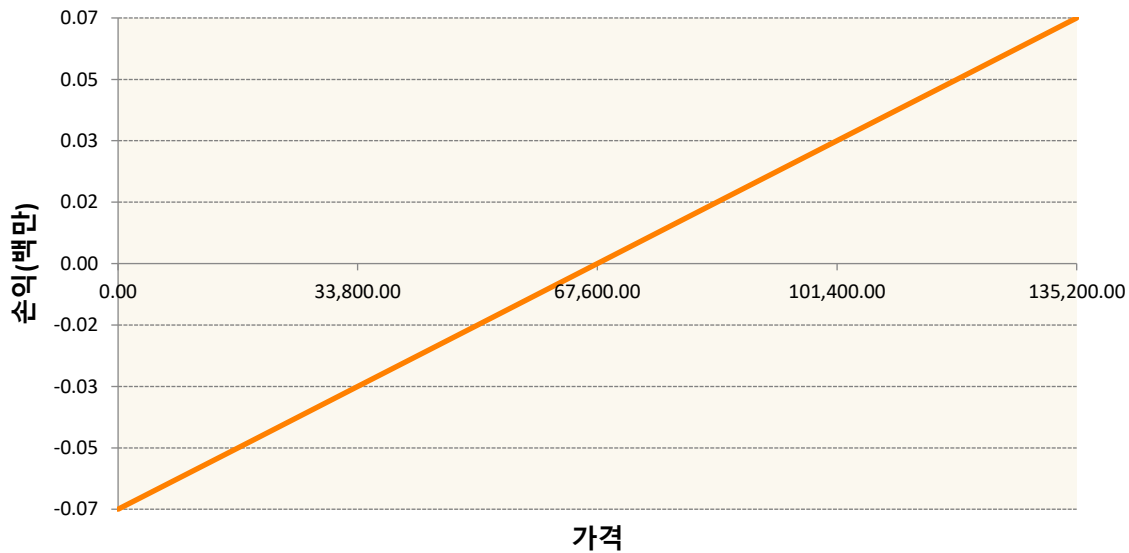
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	194	0	194	장내

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					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	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

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

28

공시일 2022-09-16

기준일 2022-09-15

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

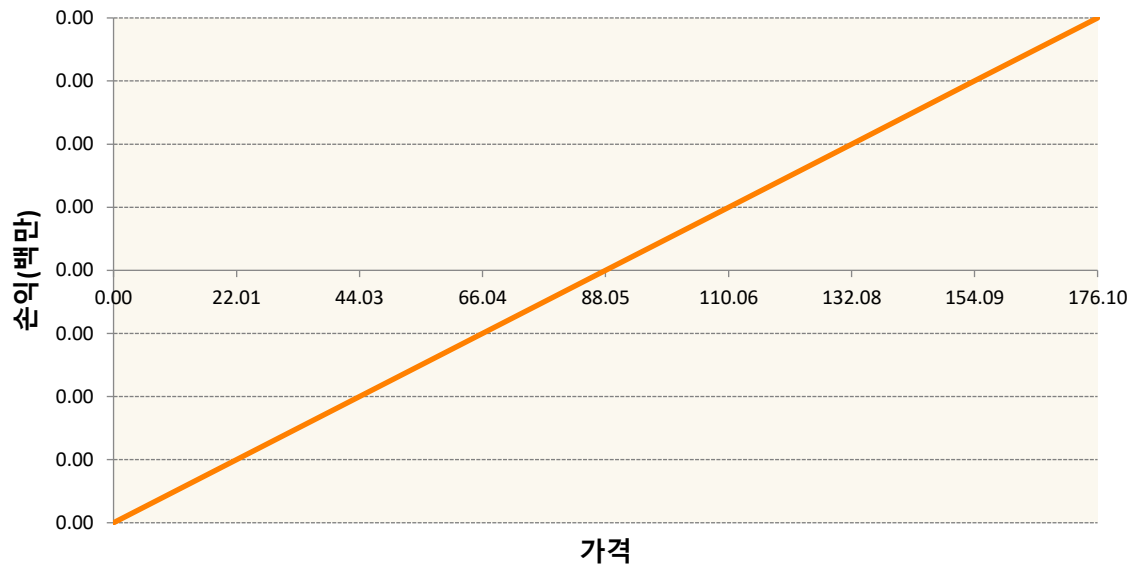
1. 계약금액

(단위:백만원)

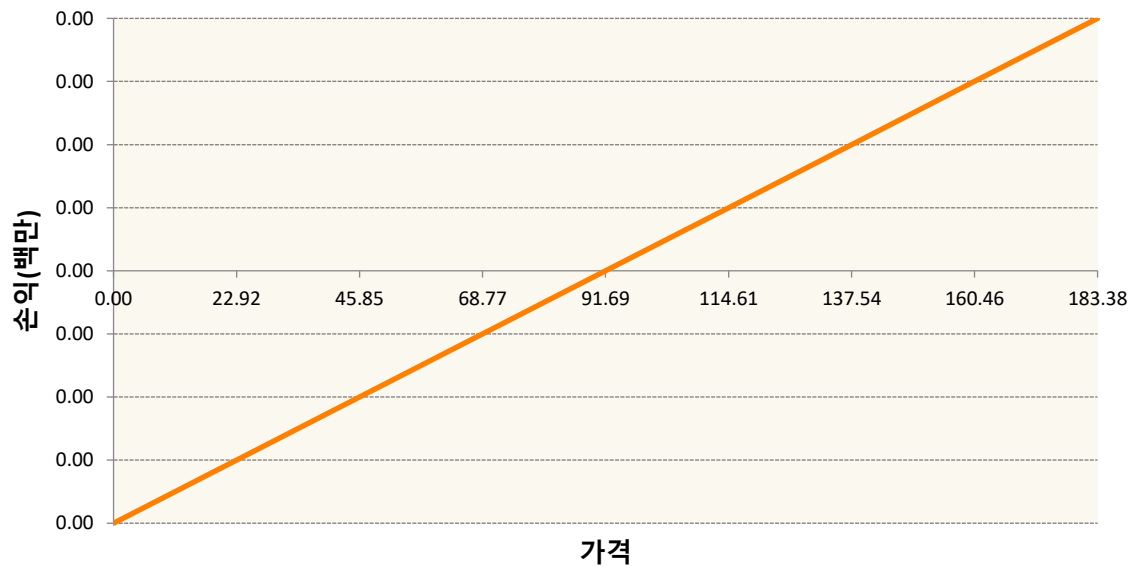
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,988	307	1,681	

2. 만기시점의 손익구조

CLX2-WTI CRUDE FUTURE Nov22



COF3-BRENT CRUDE FUTR JAN23



The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Revenue (수익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 176.10 with major ticks every 22.01. The y-axis represents Revenue in millions, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid blue line starts at the origin (0,0) and extends linearly to the point (176.10, 0.00).

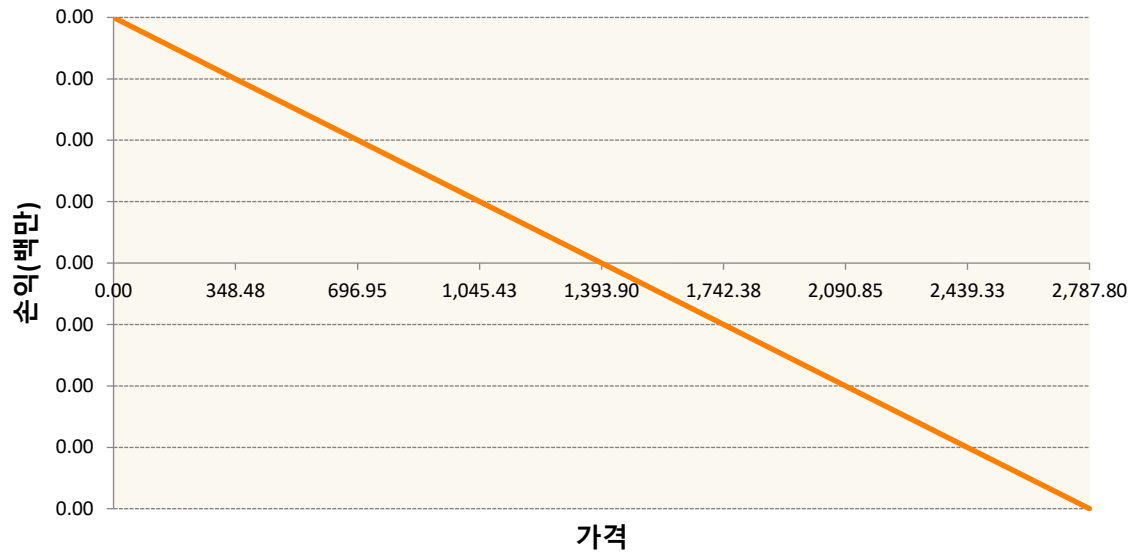
The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 18.34. The y-axis, labeled '순이익(백만원)' (Net Income in 100 million won), ranges from 0.00 to 1.00. A solid blue line represents the linear function, starting at the origin (0,0) and ending at (18.34, 1.00).

가격 (Price)	순이익 (Net Income in 100 million won)
0.00	0.00
2.29	0.05
4.59	0.10
6.88	0.15
9.17	0.20
11.46	0.25
13.76	0.30
16.05	0.35
18.34	0.40

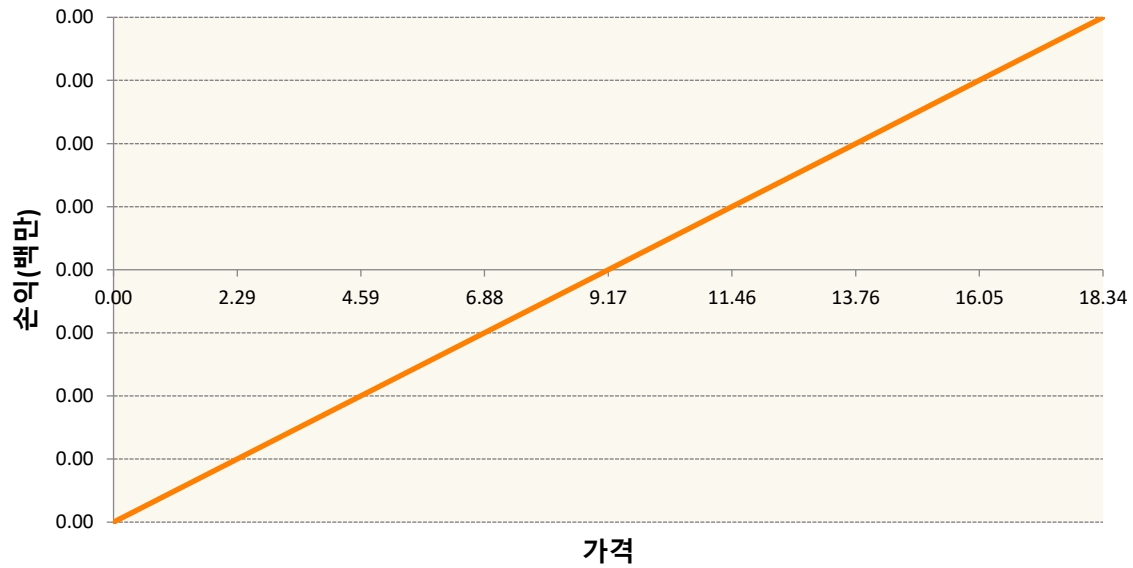
The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 6.68 with major ticks every 0.84. The y-axis represents Net Income, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid orange line starts at the origin (0.00, 0.00) and extends to the point (6.68, 0.00).

가격	순이익(백만)
0.00	0.00
0.84	0.00
1.67	0.00
2.51	0.00
3.34	0.00
4.18	0.00
5.01	0.00
5.85	0.00
6.68	0.00

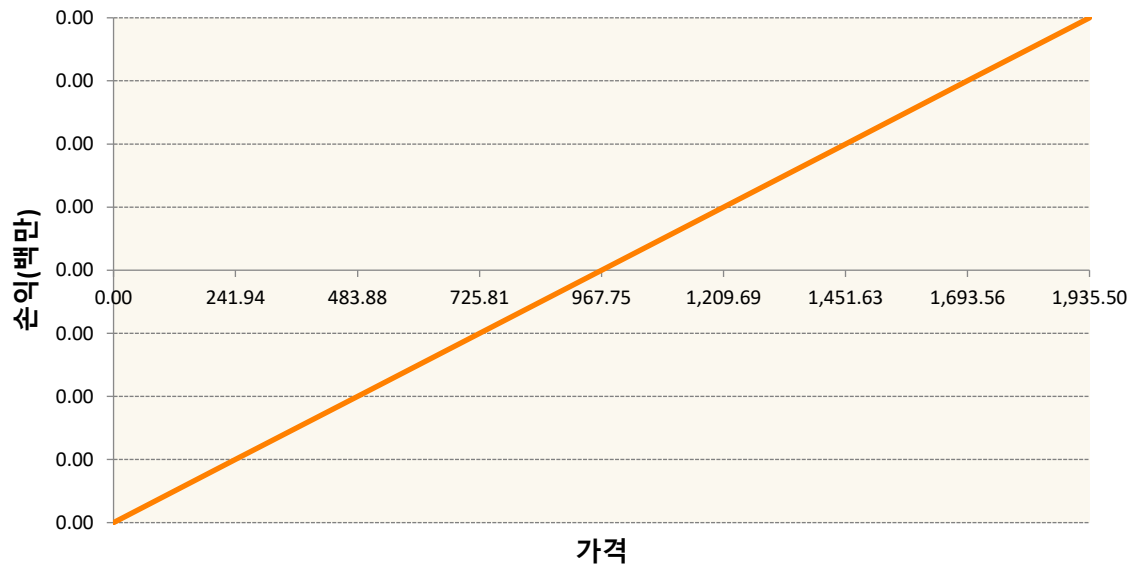
KR4175SA0002-2022-10 달러선물

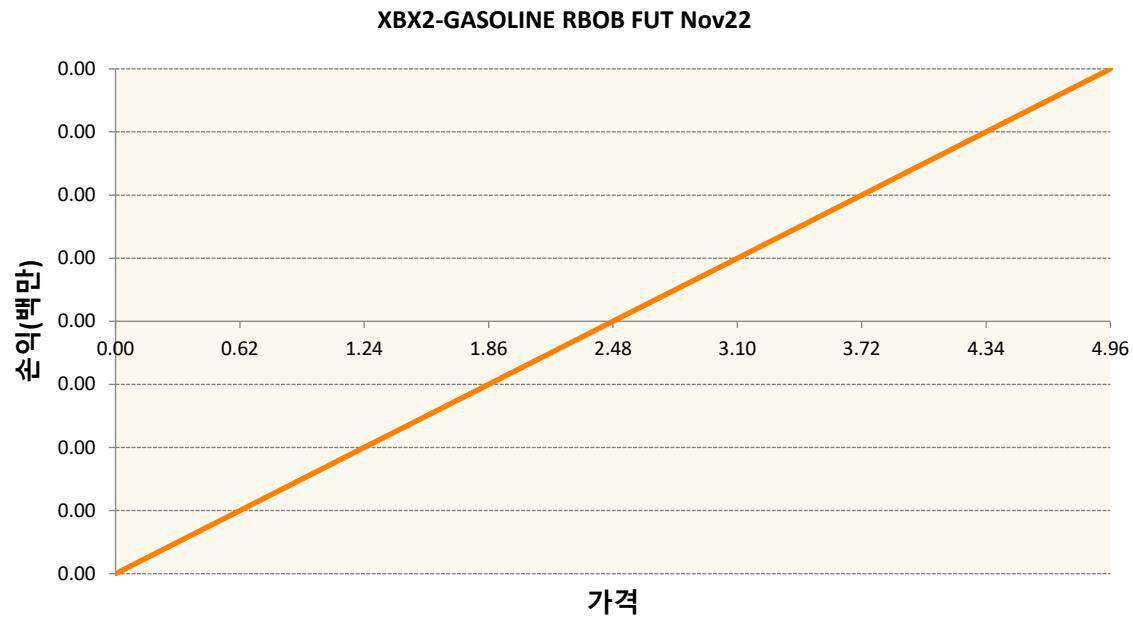


NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QSX2-Low Su Gasoil G Nov22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX2	WTI CRUDE FUTURE Nov22	18
COF3	BRENT CRUDE FUTR JAN23	31
ECX2	E-MINI CRUDE OIL Nov22	5
EOX2	E-MINI NATURAL GAS Nov22	2
HOX2	NY Harb ULSD Fut Nov22	15
KR4175SA00 2022-10 달러선물		25
NGX22	NATURAL GAS FUTR Nov22	67
QSX2	Low Su Gasoil G Nov22	10
XBX2	GASOLINE RBOB FUT Nov22	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	523