

공시일 2022-09-20

기준일 2022-09-19

포커스농산물모(채권-파생형)

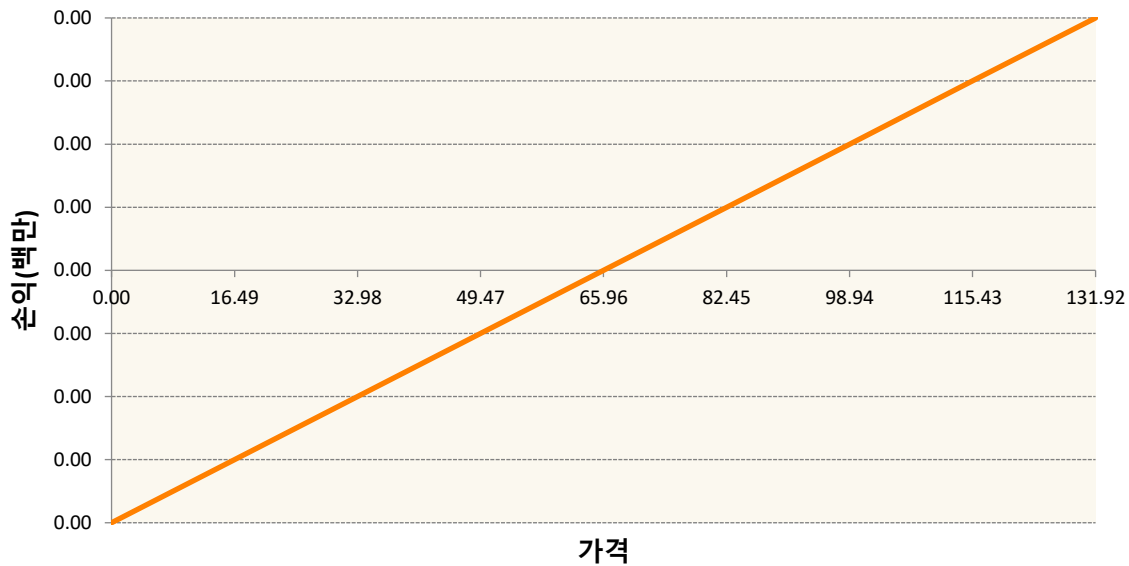
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

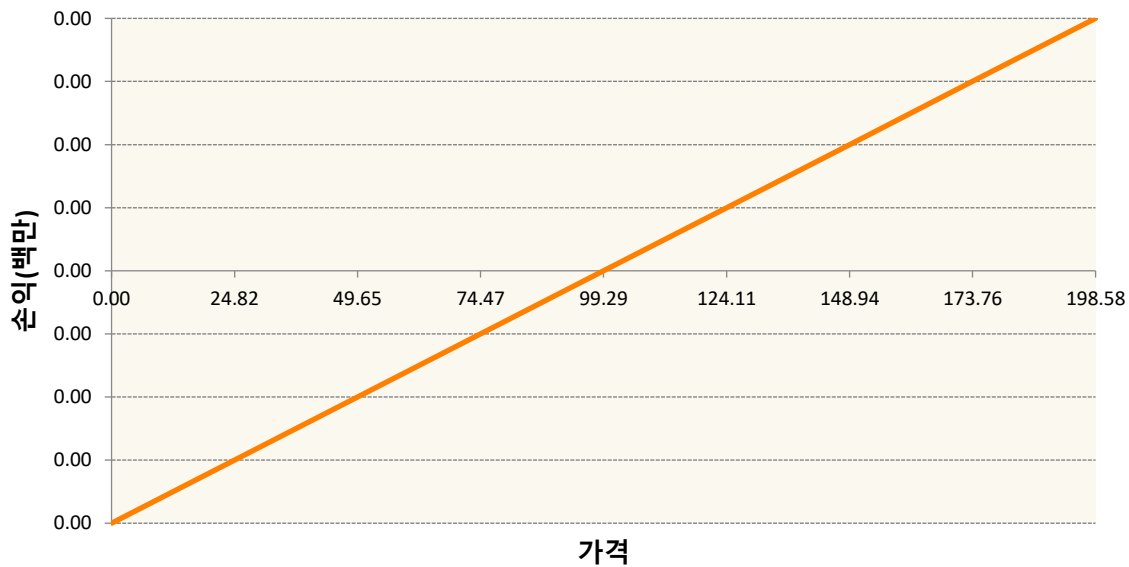
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,762	835	5,926	

2. 만기시점의 손익구조

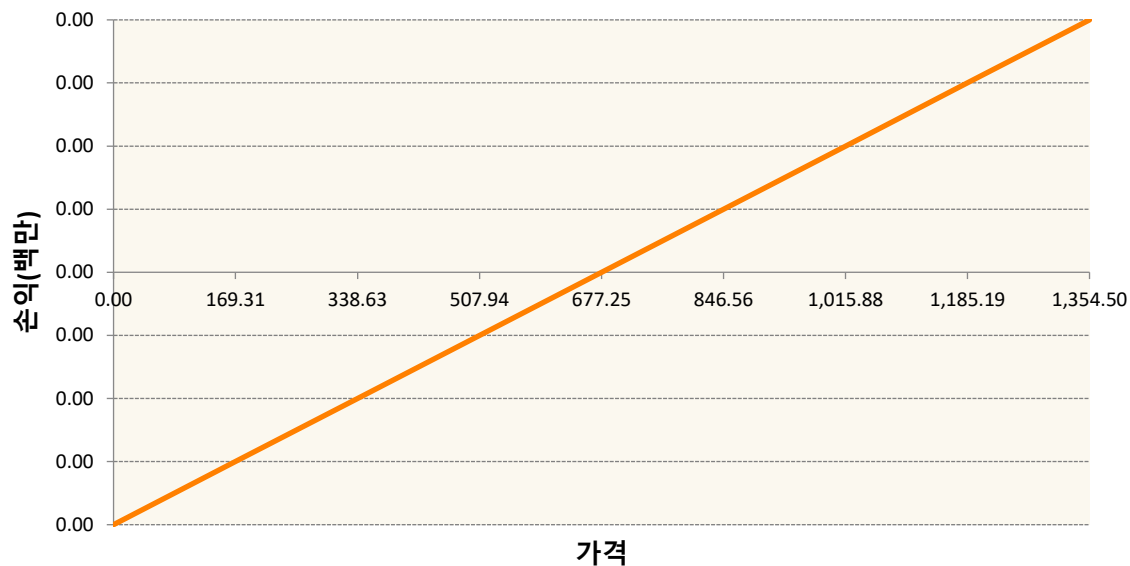
BOZ2-SOYBEAN OIL FUTR Dec22



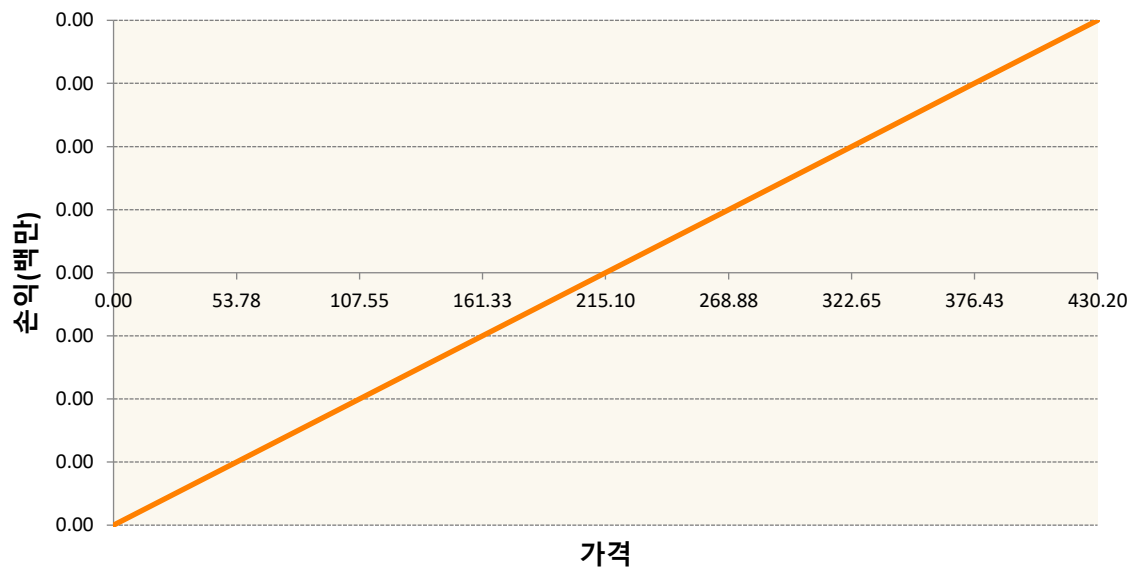
CTZ2-COTTON NO.2 FUTR Dec22



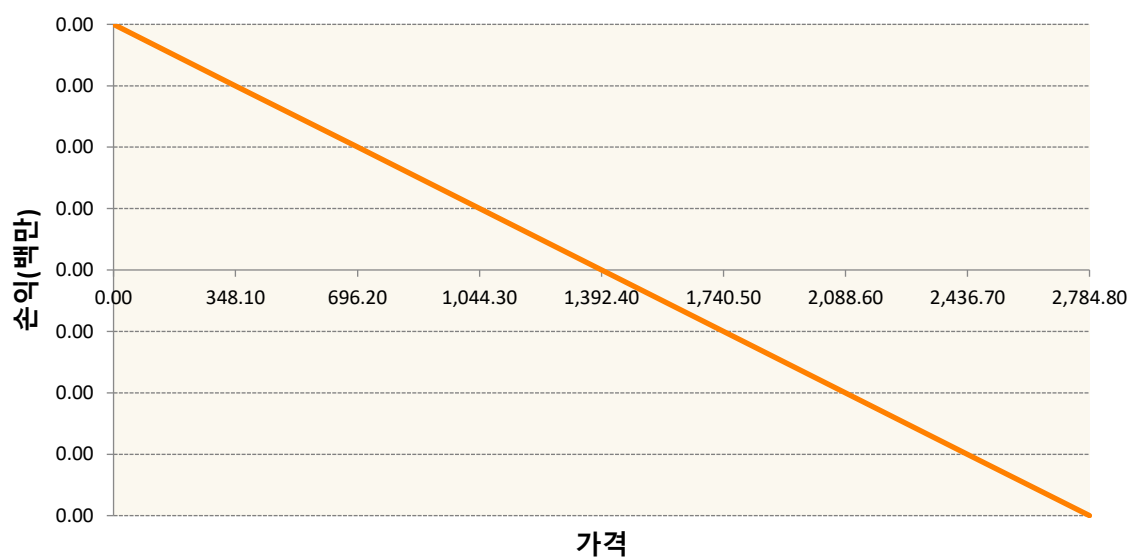
CZ2-CORN FUTURE Dec22



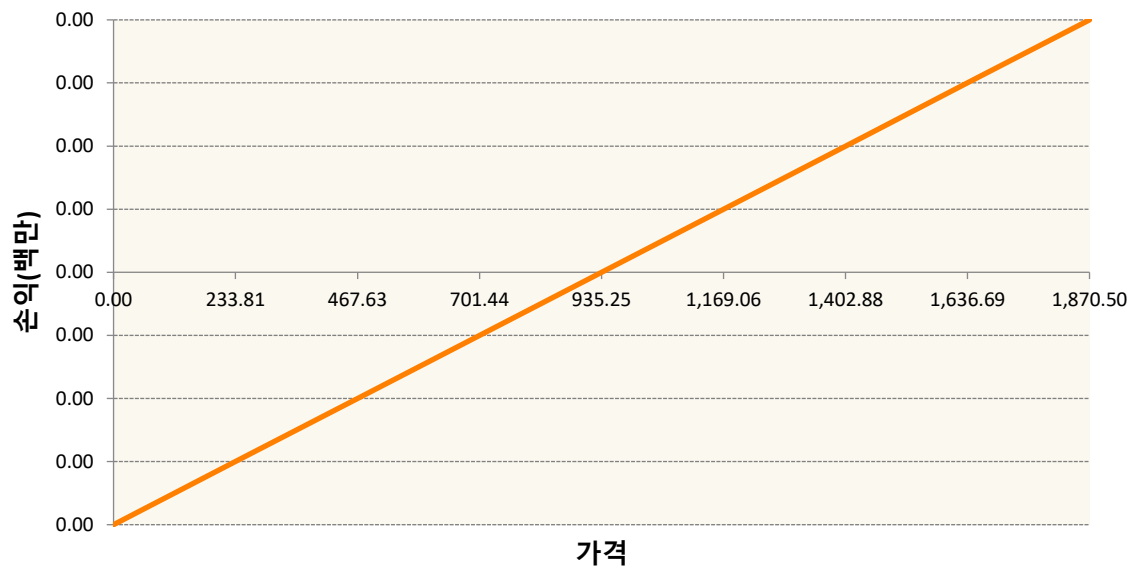
KCZ2-COFFEE 'C' FUTURE Dec22



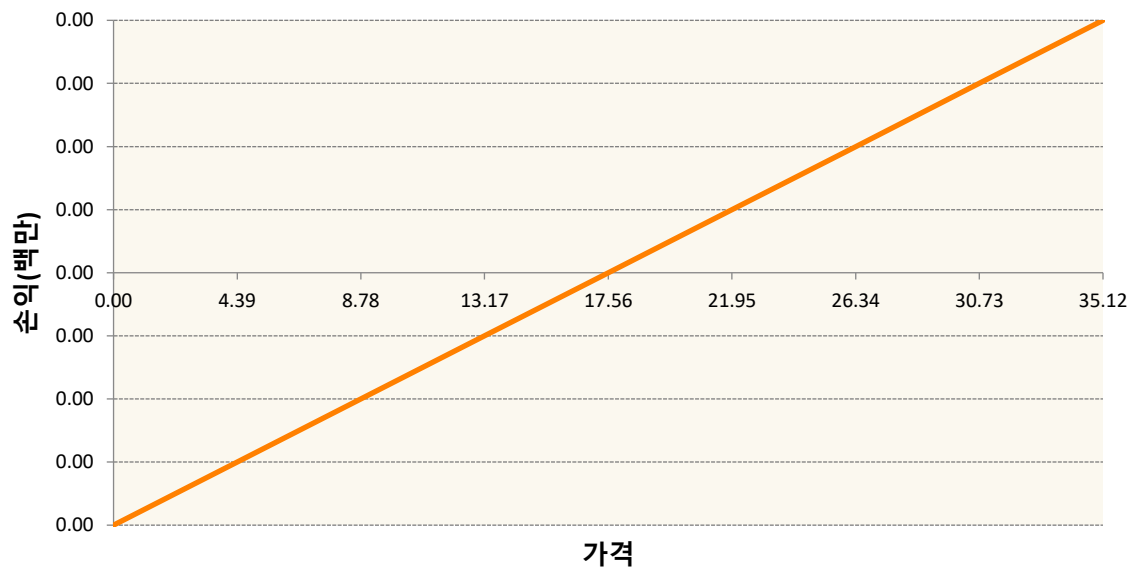
KR4175SA0002-2022-10 달러선물



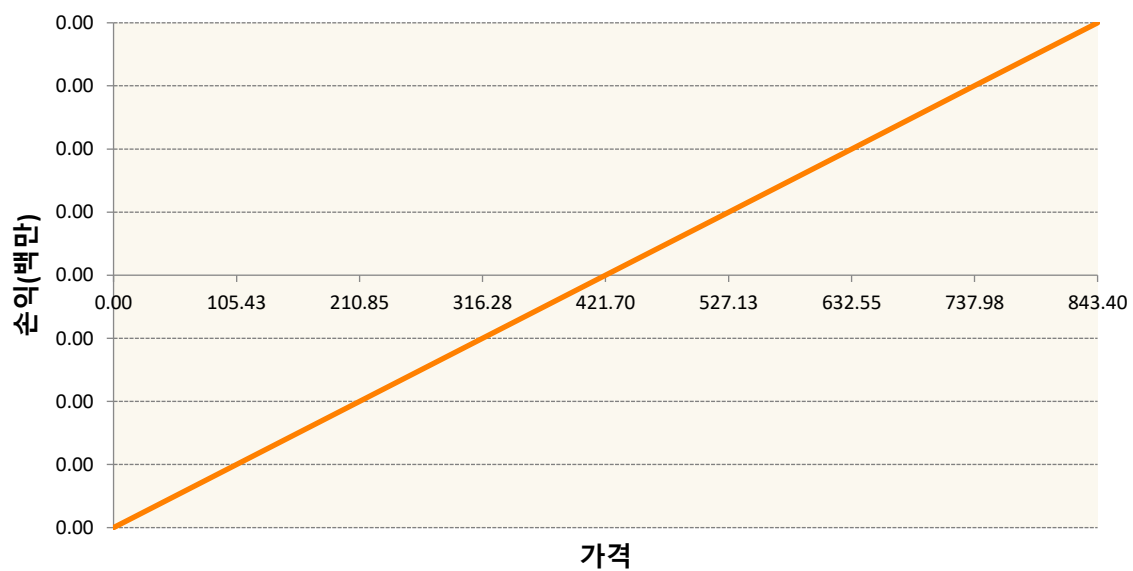
KWZ2-KC HRW WHEAT FUT Dec22

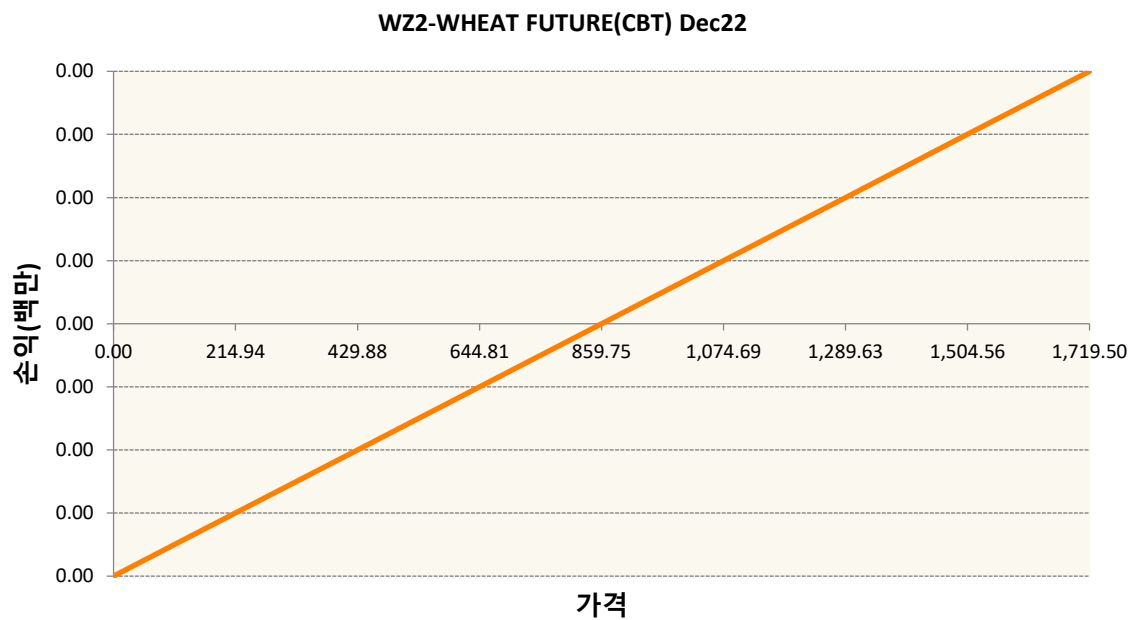
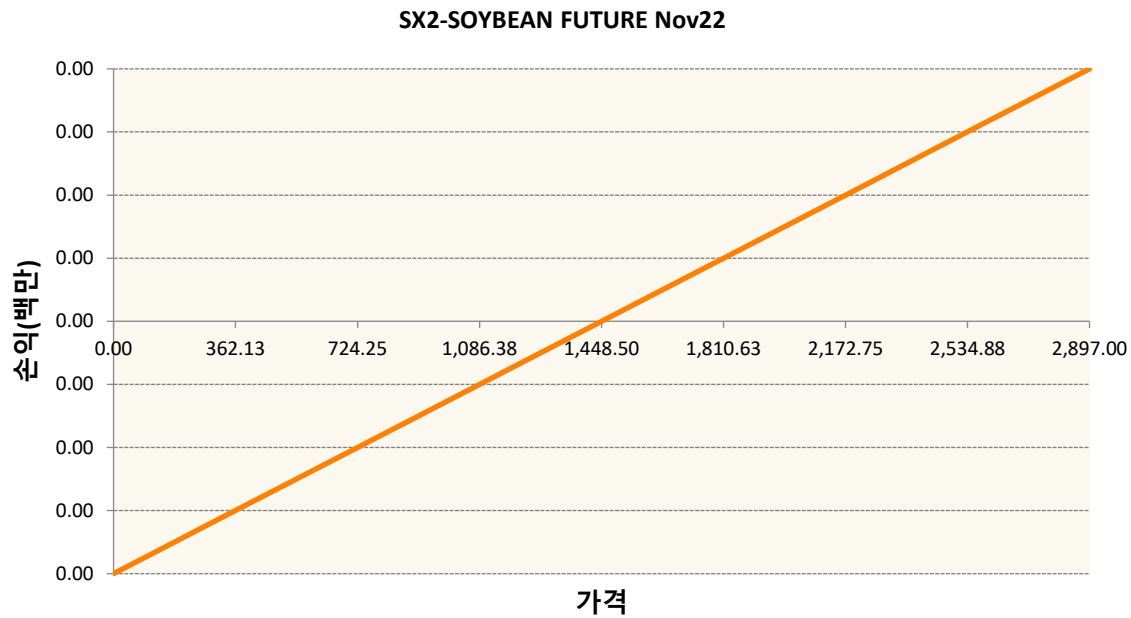


SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



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	2022-09-20
기준일	2022-09-19

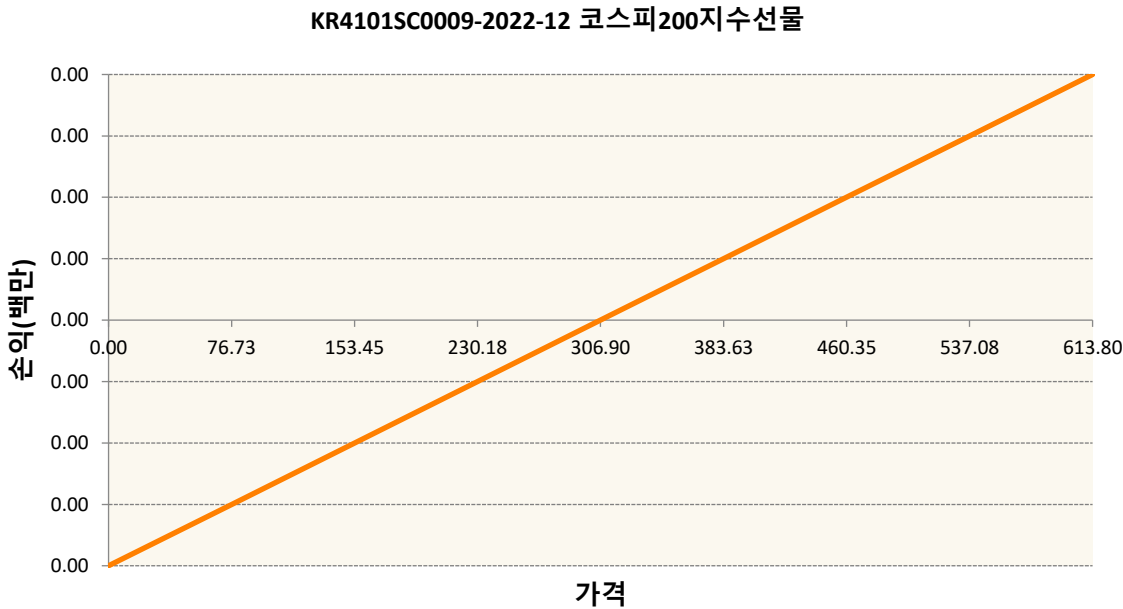
스마트인덱스모

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	614	0	614	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	2022-09-20
기준일	2022-09-19

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	4,450	0	4,450	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래220311	337
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

446

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

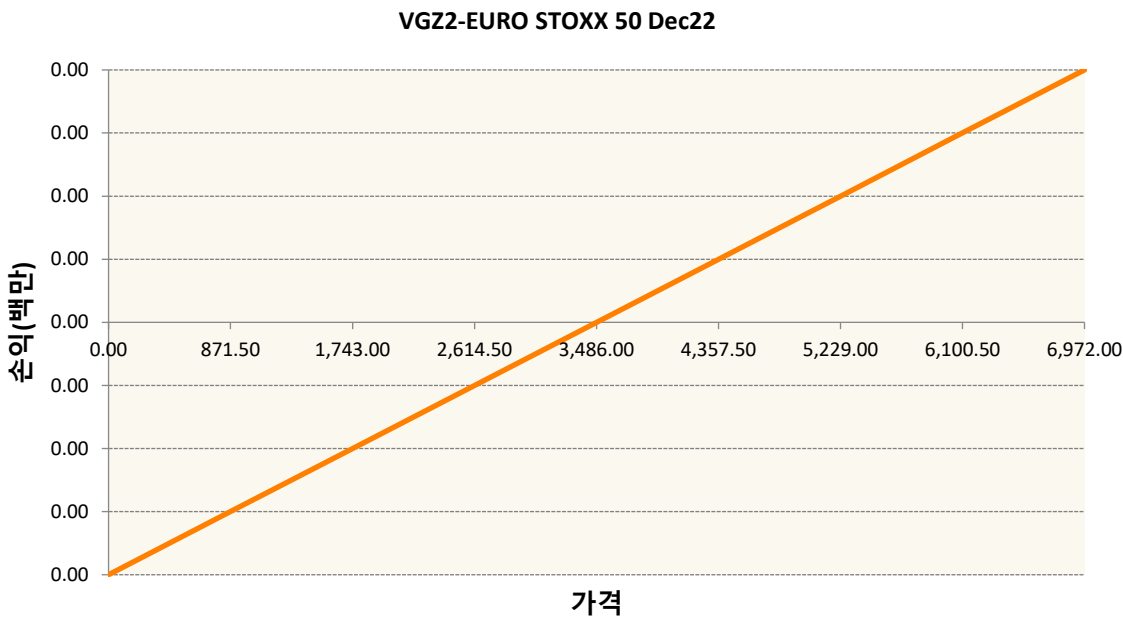
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	532	0	532	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

44

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

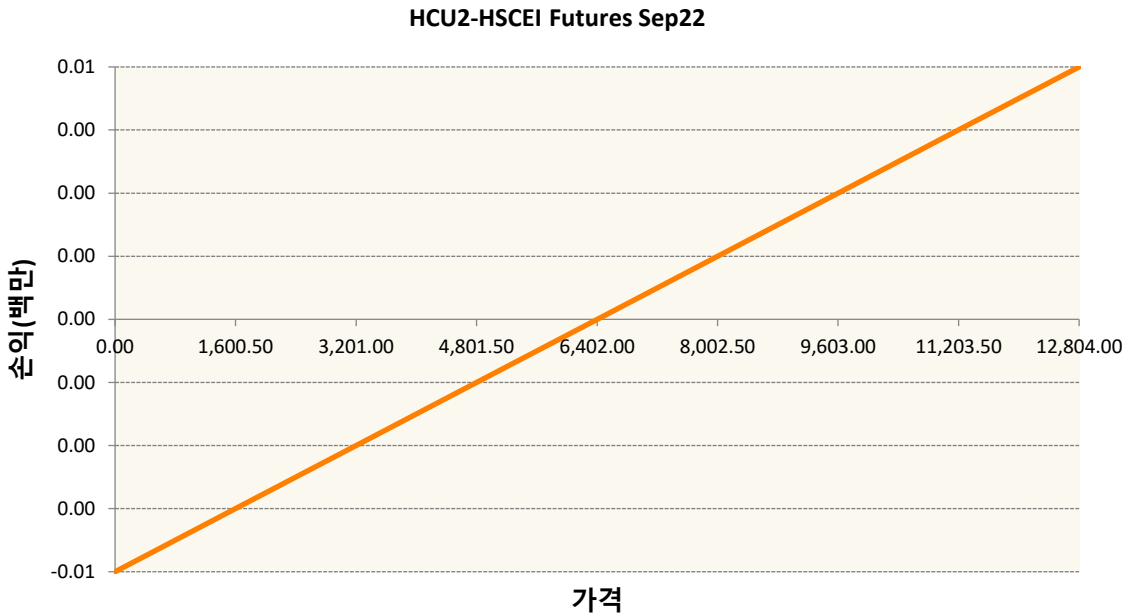
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,041	0	1,041	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU2	HSCEI Futures Sep22	83
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

122

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

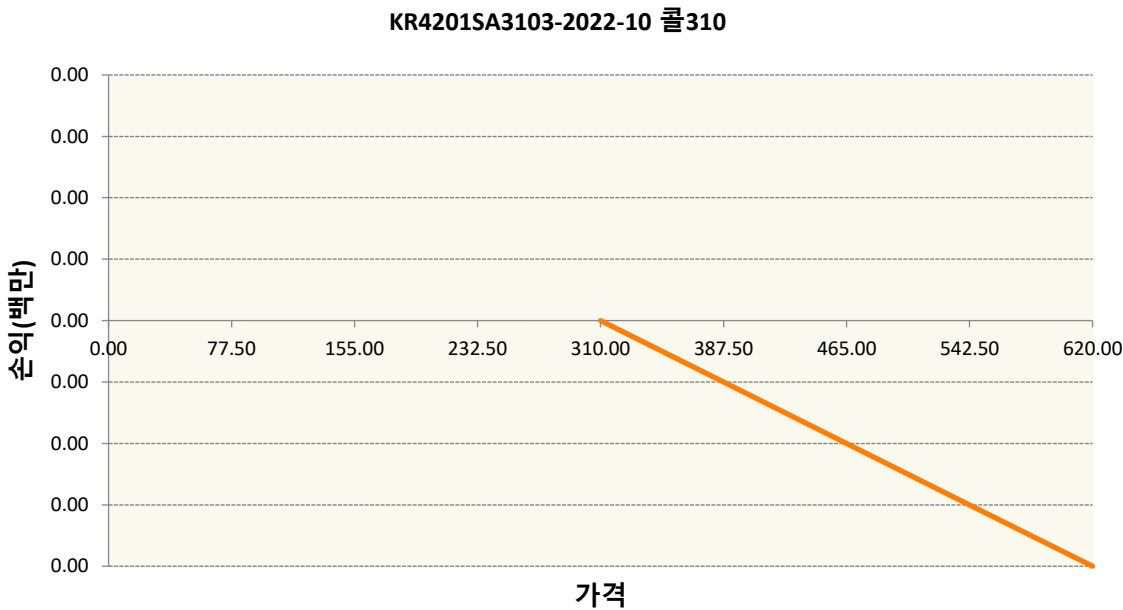
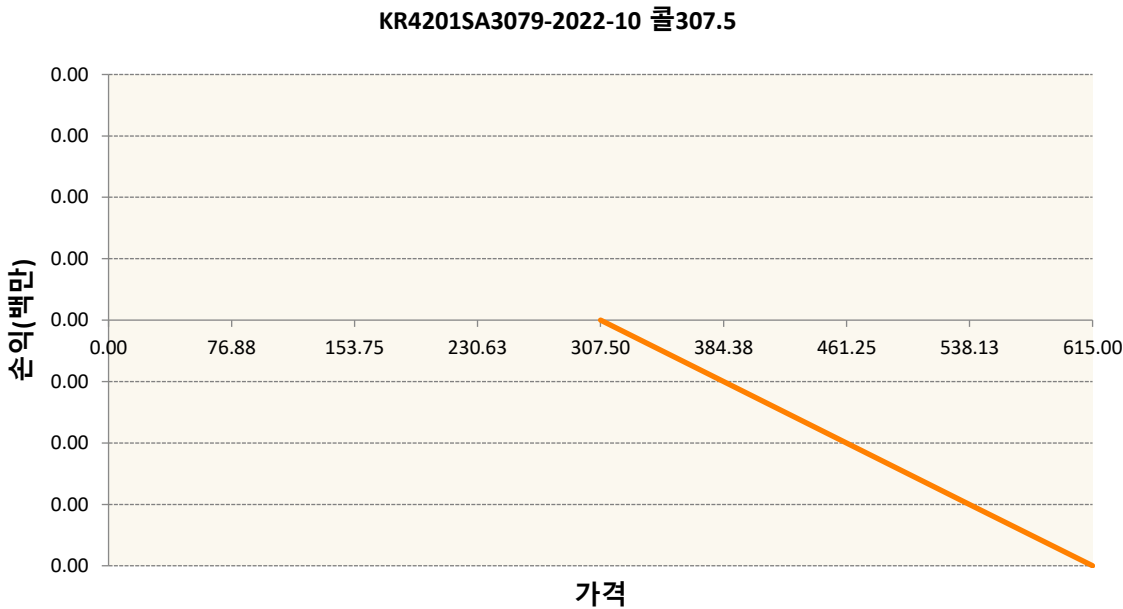
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

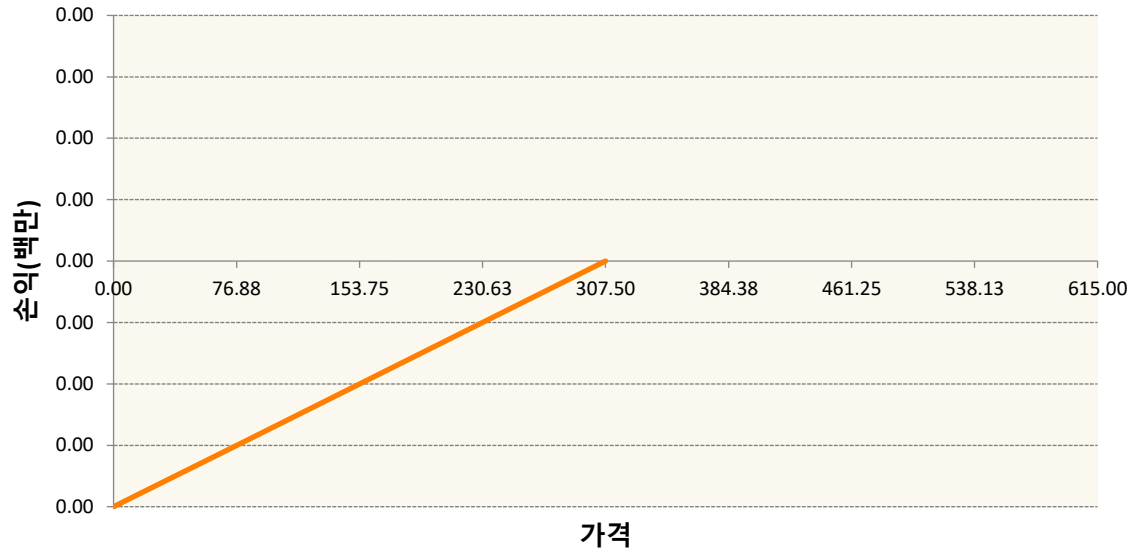
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	57,181	-57,181	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301SA3078-2022-10 풋307.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201SA3079			2022-10 콜307.5				626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	287	278	267	254	240	224	208
-5.33%	255	239	221	202	182	162	140
-2.67%	190	167	143	119	95	70	46
0%	79	53	26	0	-26	-53	-79
2.67%	-82	-107	-132	-157	-183	-208	-234
5.33%	-287	-306	-327	-349	-371	-394	-418
8.00%	-525	-538	-553	-569	-587	-606	-626
KR4201SA3103			2022-10 콜310				2,090
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	884	857	824	785	740	691	638
-5.33%	797	747	691	631	566	499	429
-2.67%	609	534	456	376	295	212	128
0%	274	183	91	0	-92	-183	-275
2.67%	-234	-325	-416	-507	-599	-691	-783
5.33%	-904	-979	-1,058	-1,139	-1,221	-1,306	-1,392
8.00%	-1,700	-1,753	-1,812	-1,876	-1,944	-2,016	-2,090
KR4301SA3078			2022-10 풋307.5				619
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-539	-549	-560	-573	-587	-602	-619
-5.33%	-296	-312	-330	-349	-369	-389	-411
-2.67%	-85	-108	-132	-156	-181	-205	-230
0%	79	53	26	0	-26	-53	-79

2.67%	194	169	144	118	93	67	41
5.33%	264	244	224	202	180	157	133
8.00%	302	289	274	257	239	221	201

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,082

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	4	0	4	장외
누계	통화	선도	0	1,321	-1,321	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY		3
FXW213C7L KRW/EUR 23-09-22E		33
FXW213C8Q KRW/EUR 18-11-22E		72

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	72

공시일 2022-09-20

기준일 2022-09-19

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

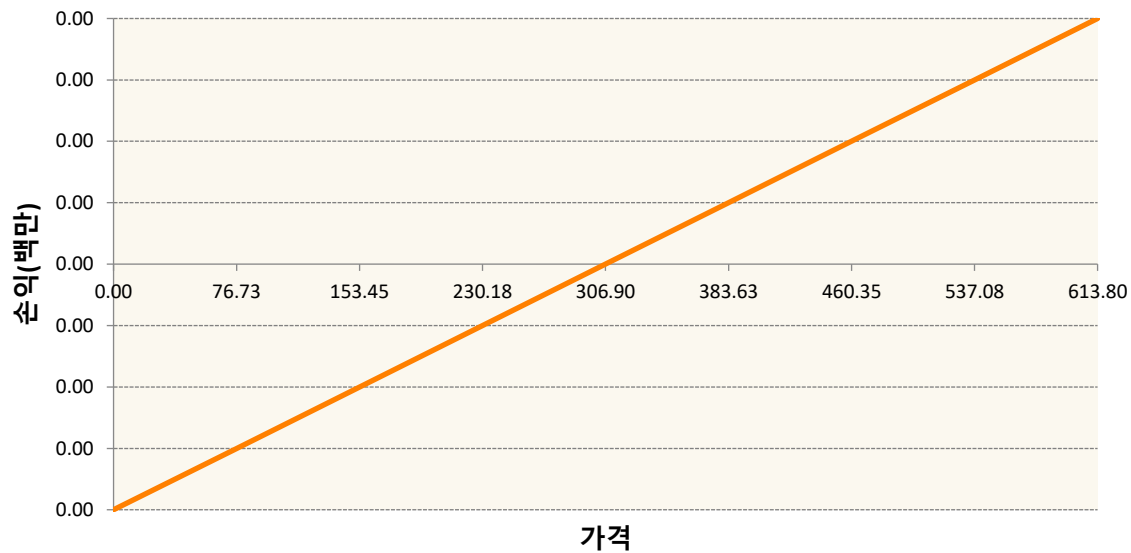
1. 계약금액

(단위:백만원)

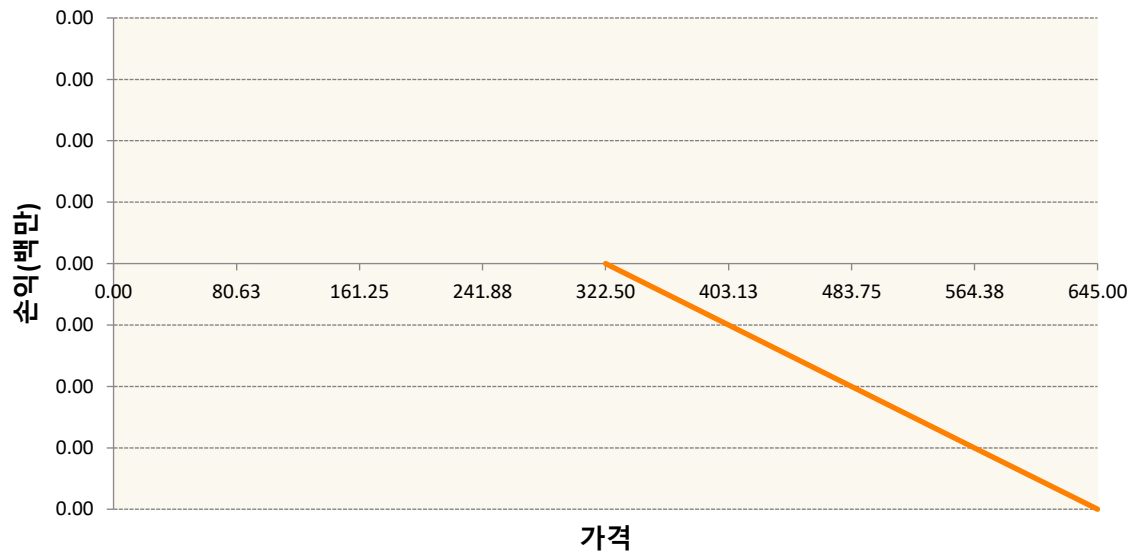
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	384	0	384	장내
누계	유가증권	옵션	386	4,219	-3,834	장내

2. 만기시점의 손익구조

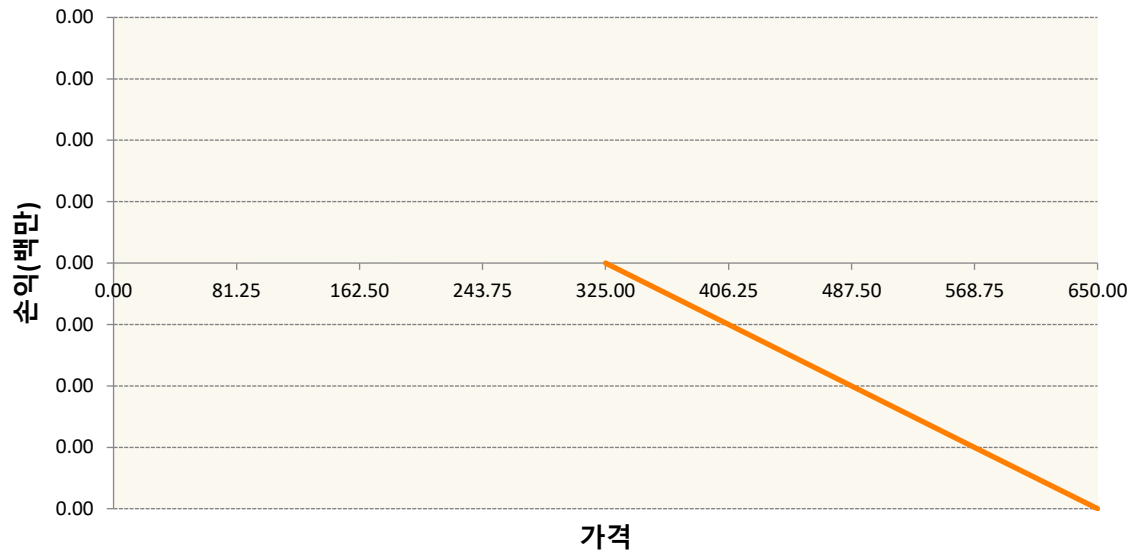
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



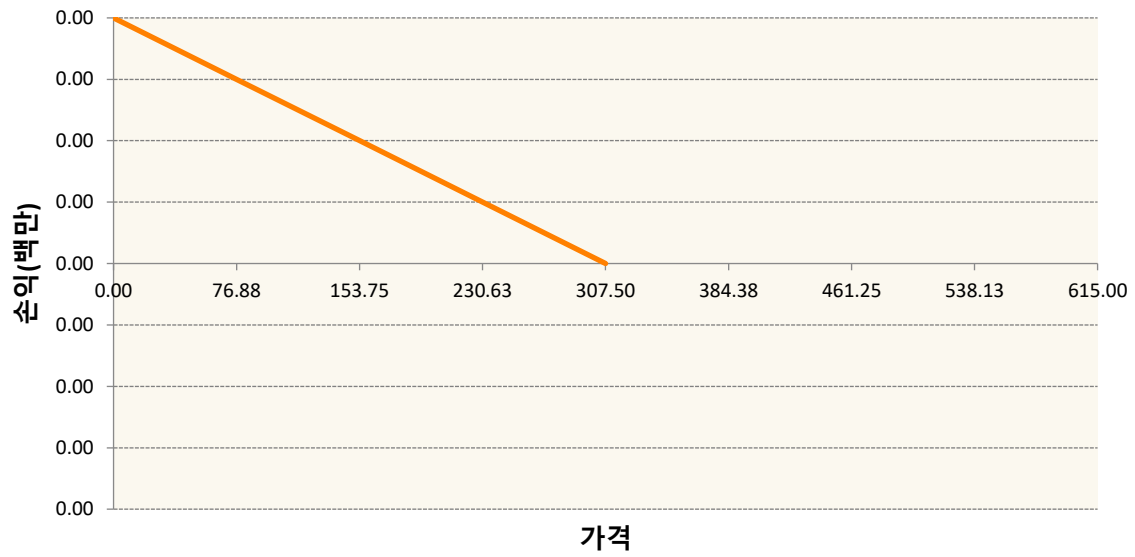
KR4201SA3228-2022-10 콜322.5



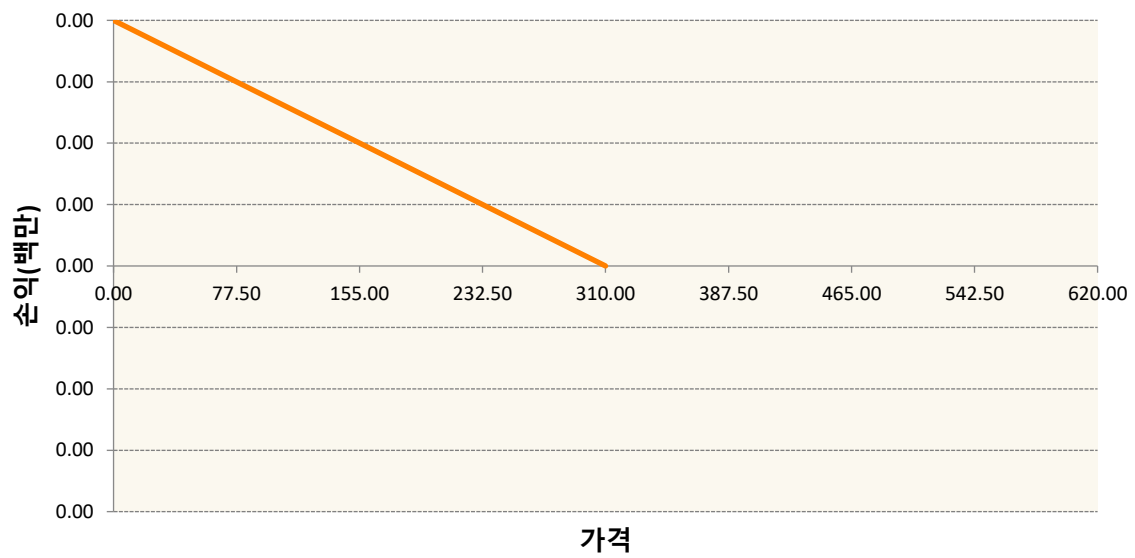
KR4201SA3251-2022-10 콜325



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%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20			
-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%	20	20	20	20	20	20	20			
8.00%	31	31	31	31	31	31	31			
KR4201SA3228							2022-10 콜322.5		31	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	8	8	8	8	7	7	6			
-5.33%	8	7	7	6	6	5	4			
-2.67%	7	6	5	4	3	2	0			
0%	4	3	1	0	-1	-3	-5			
2.67%	-1	-3	-4	-6	-8	-10	-11			
5.33%	-9	-11	-13	-14	-16	-18	-20			
8.00%	-20	-22	-24	-25	-27	-29	-31			
KR4201SA3251							2022-10 콜325		137	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	34	33	32	31	29	27	24			
-5.33%	32	31	29	26	23	19	15			
-2.67%	28	25	21	17	12	6	1			
0%	18	12	6	0	-7	-14	-21			
2.67%	-2	-10	-18	-26	-34	-42	-50			
5.33%	-36	-45	-54	-63	-72	-80	-89			
8.00%	-85	-94	-102	-111	-120	-128	-137			
KR4301SA3078							2022-10 풋307.5		14	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	12	12	12	13	13	13	14			
-5.33%	7	7	7	8	8	9	9			
-2.67%	2	2	3	3	4	5	5			
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2			
2.67%	-4	-4	-3	-3	-2	-1	-1			
5.33%	-6	-5	-5	-4	-4	-3	-3			
8.00%	-7	-6	-6	-6	-5	-5	-4			
KR4301SA3102							2022-10 풋310		10	
	기초자산의 변동성									

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

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

(단위:백만원)

178

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

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	7,625	0	7,625	

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	2022-09-20
기준일	2022-09-19

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	6,492	0	6,492	

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	2022-09-20
기준일	2022-09-19

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	20,067	0	20,067	
누계	통화	선도	766	21,566	-20,799	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
FXW213C9K₩ USD/KRW 27-09-22E		45

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	728

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

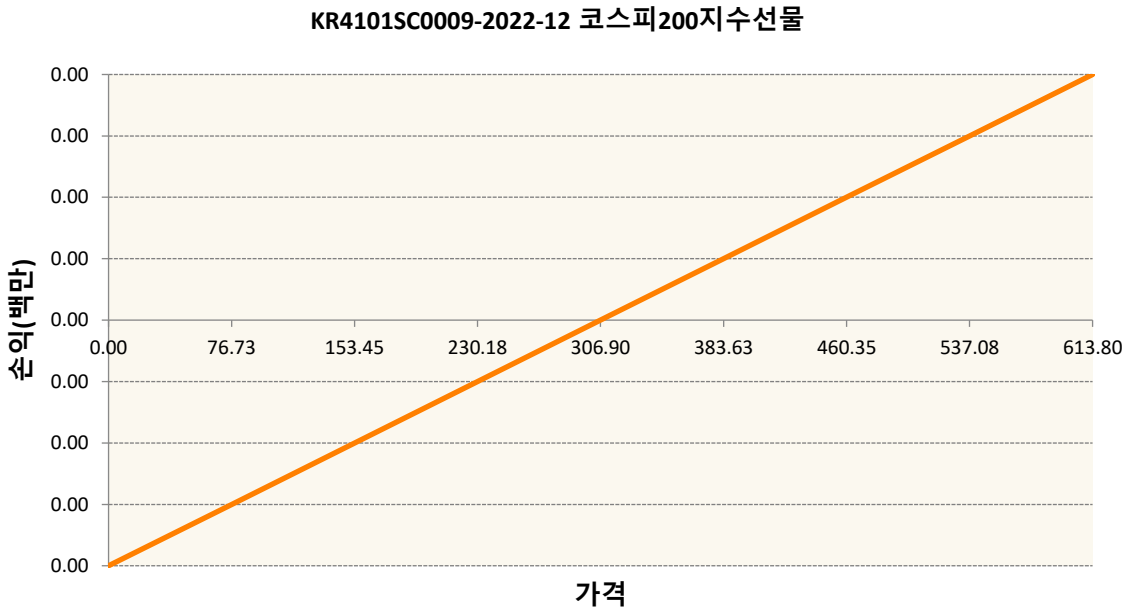
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	384	0	384	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%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-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%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

공시일 2022-09-20

기준일 2022-09-19

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

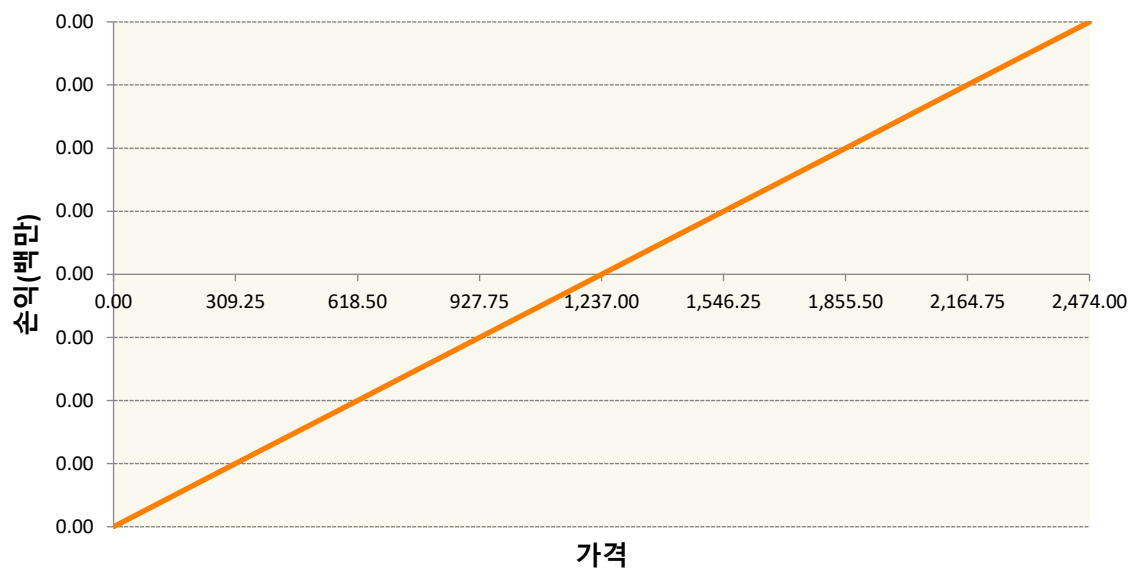
1. 계약금액

(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	566	0	566	
누계	유가증권	스왑	1,712	0	1,712	장외
누계	통화	선도	0	1,182	-1,182	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCV2-VN30 Index Future OCT22



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
VNCV2 VN30 Index Future OCT22	45

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

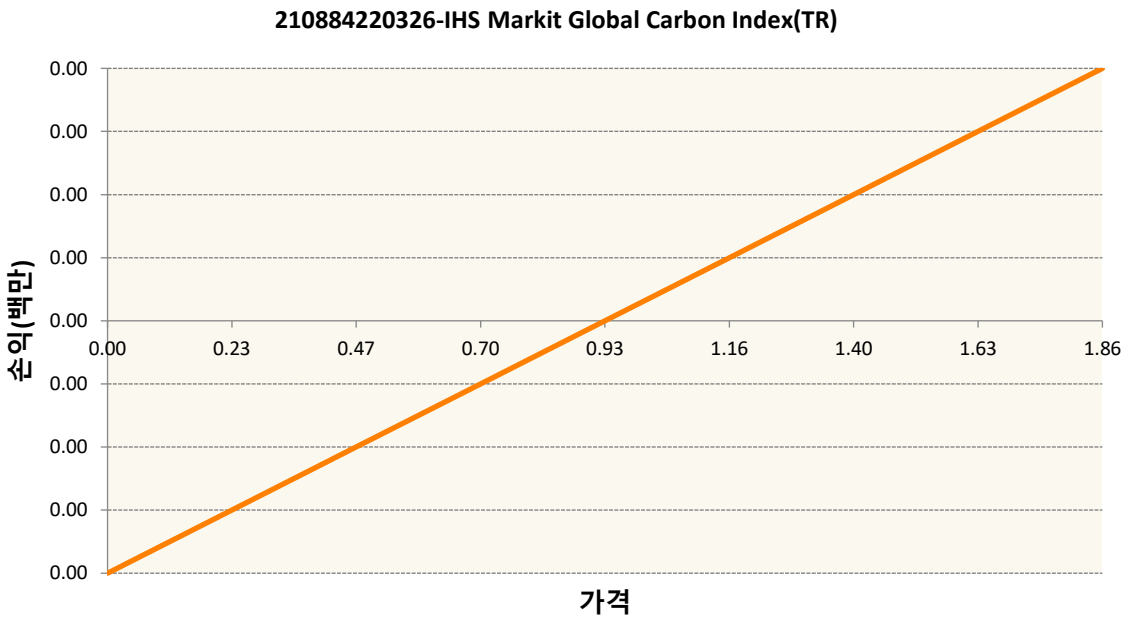
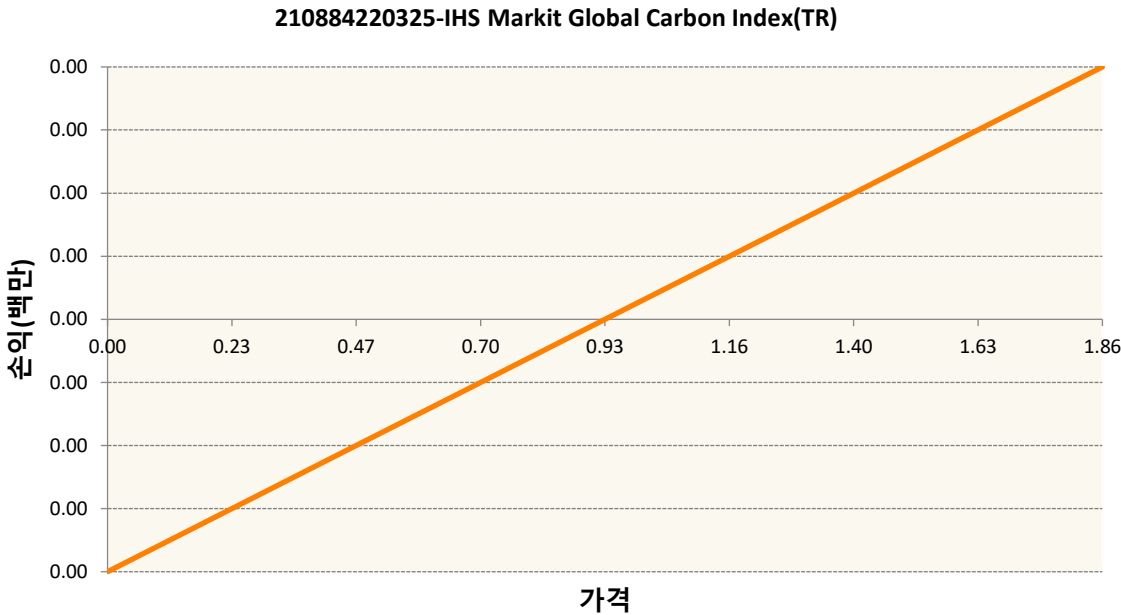
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

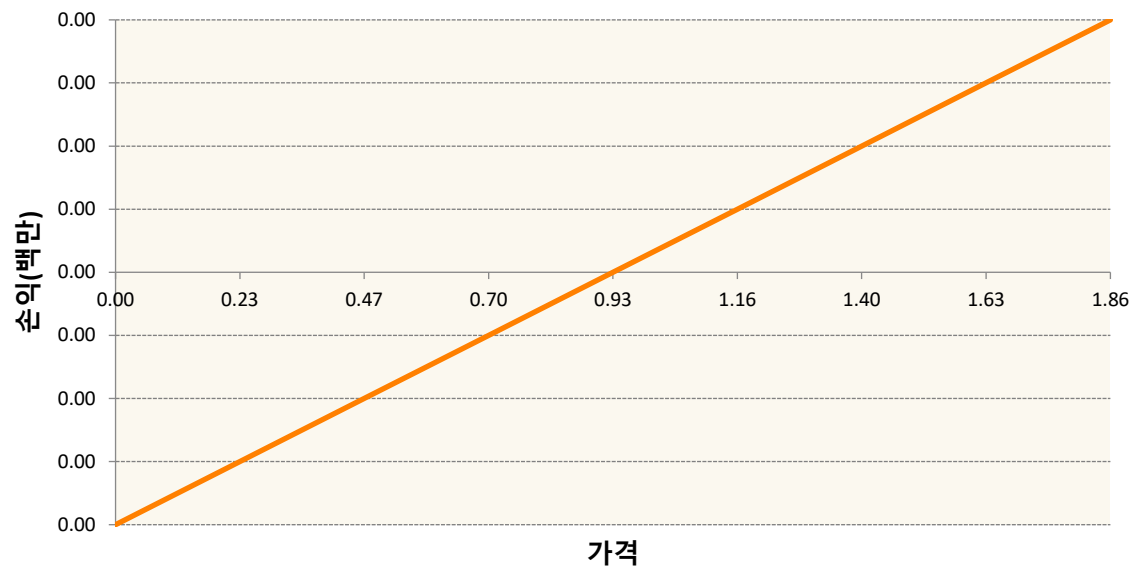
(단위:백만원)

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

188
2,712
94

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

(단위:백만원)

5,717

공시일 2022-09-20

기준일 2022-09-19

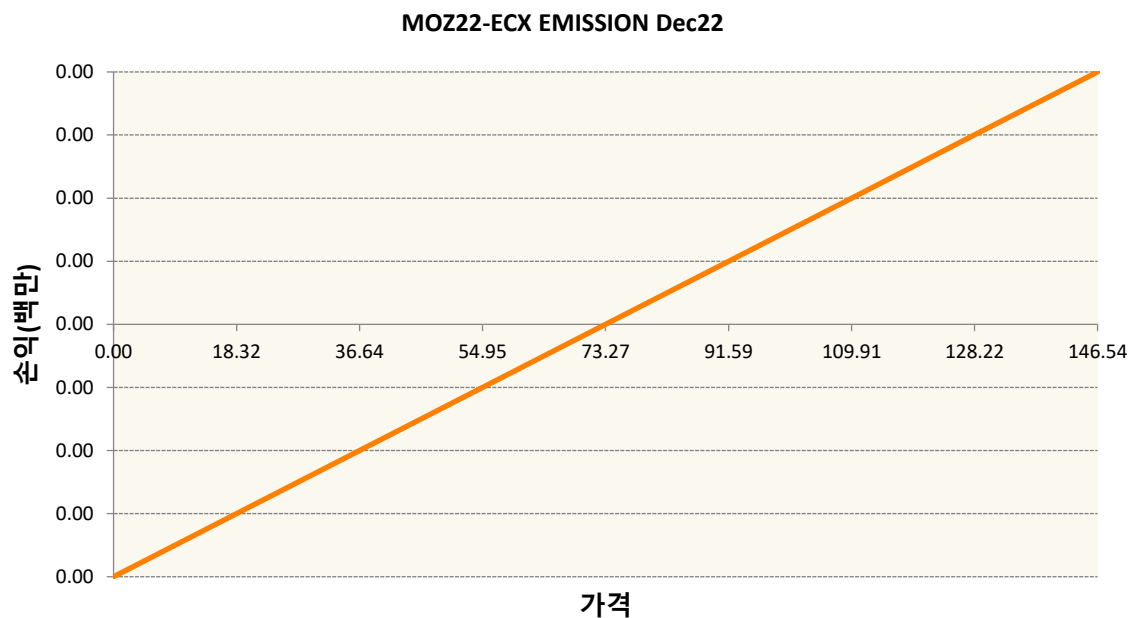
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,464	0	12,464	
누계	통화	선도	0	5,229	-5,229	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C8S KRW/EUR 27-09-22E

418

MOZ22 ECX EMISSION Dec22

997

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

(단위:백만원)

2,801

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

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)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	7

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

(단위:백만원)

56

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

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)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	8

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

(단위:백만원)

33

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

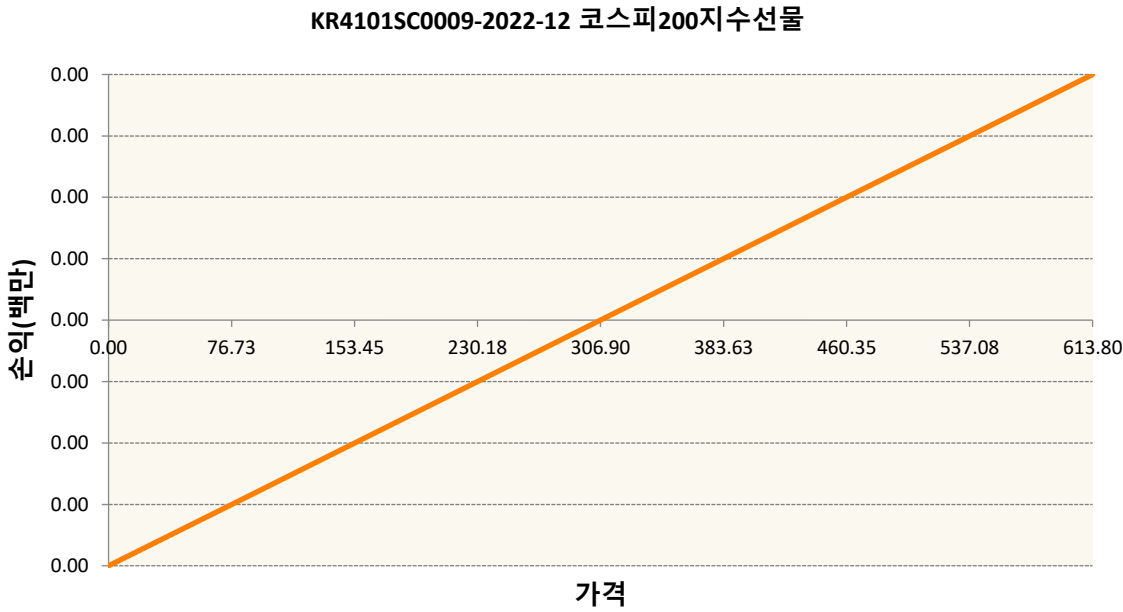
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	921	0	921	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	2
KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물	74

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

(단위:백만원)

86

공시일 2022-09-20

기준일 2022-09-19

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

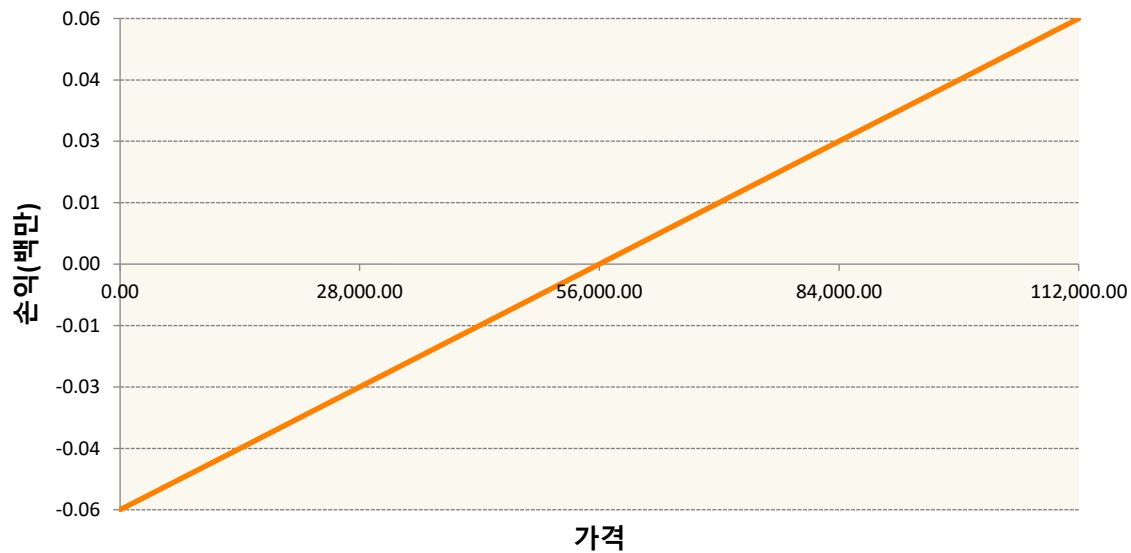
1. 계약금액

(단위:백만원)

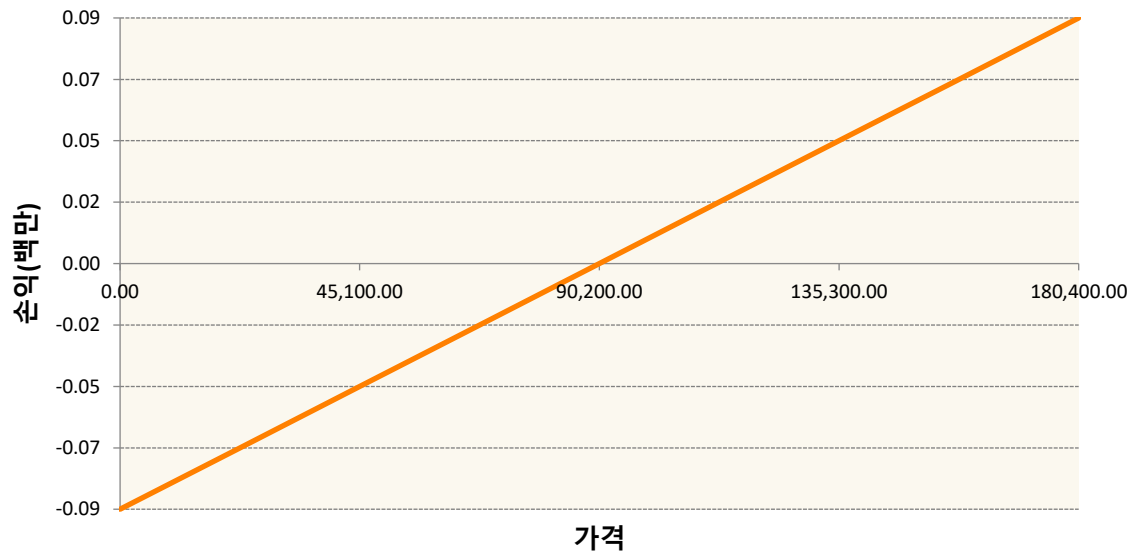
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	796	0	796	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



KR4150SA0001-2022-10 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111SA0009		2022-10 삼성전자개별선물					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
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)

75

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

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 2022-09-20

기준일 2022-09-19

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

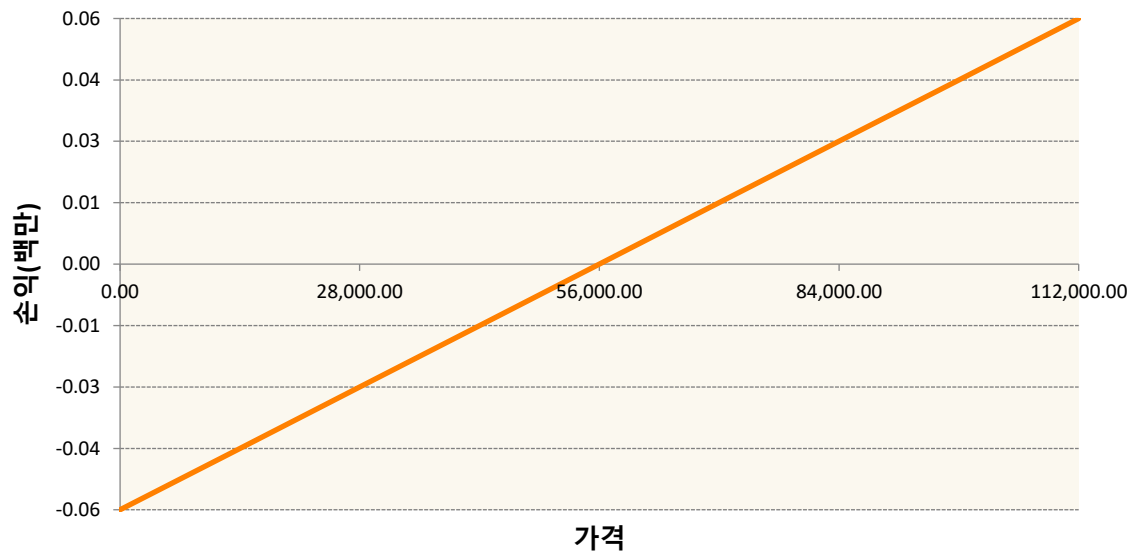
1. 계약금액

(단위:백만원)

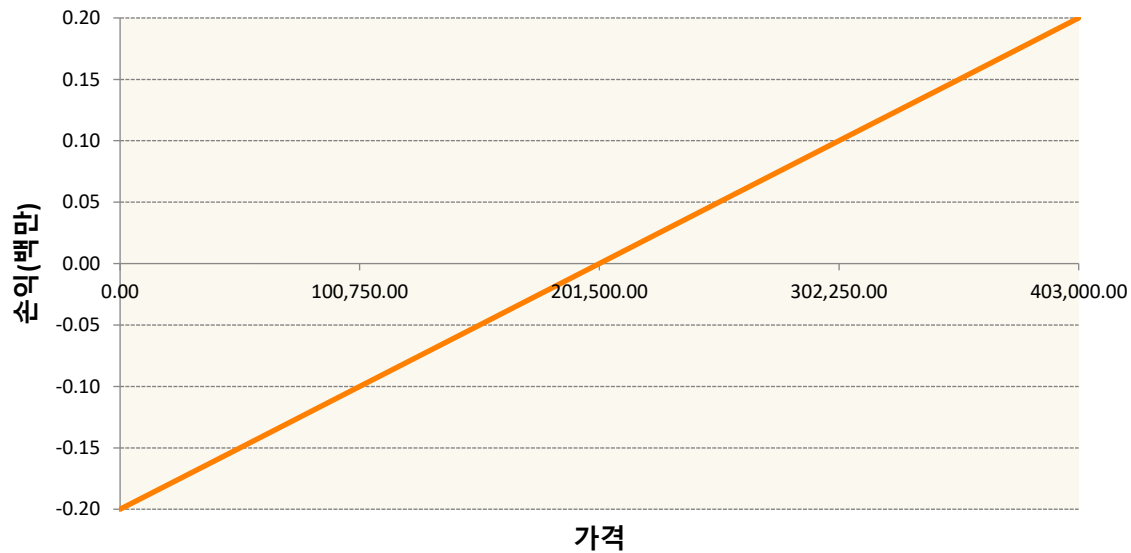
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	287	0	287	장내

2. 만기시점의 손익구조

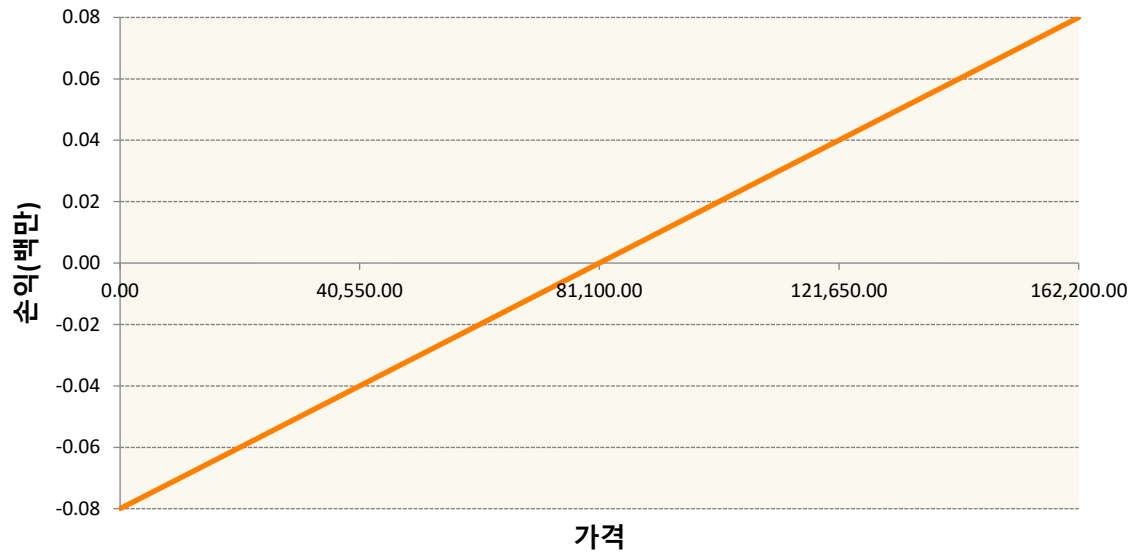
KR4111SA0009-2022-10 삼성전자개별선물



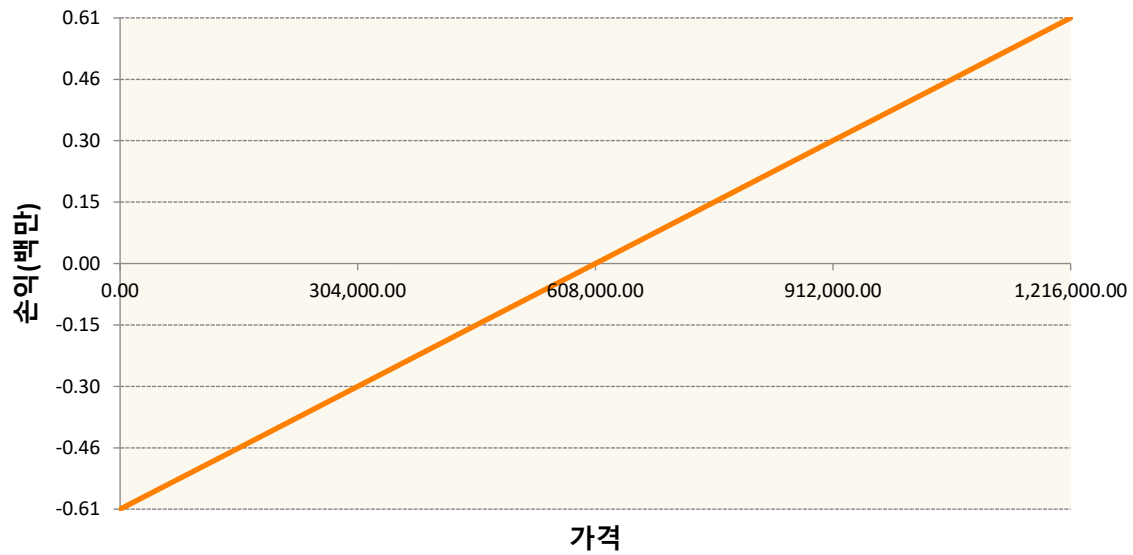
KR4116SA0004-2022-10 현대차개별선물



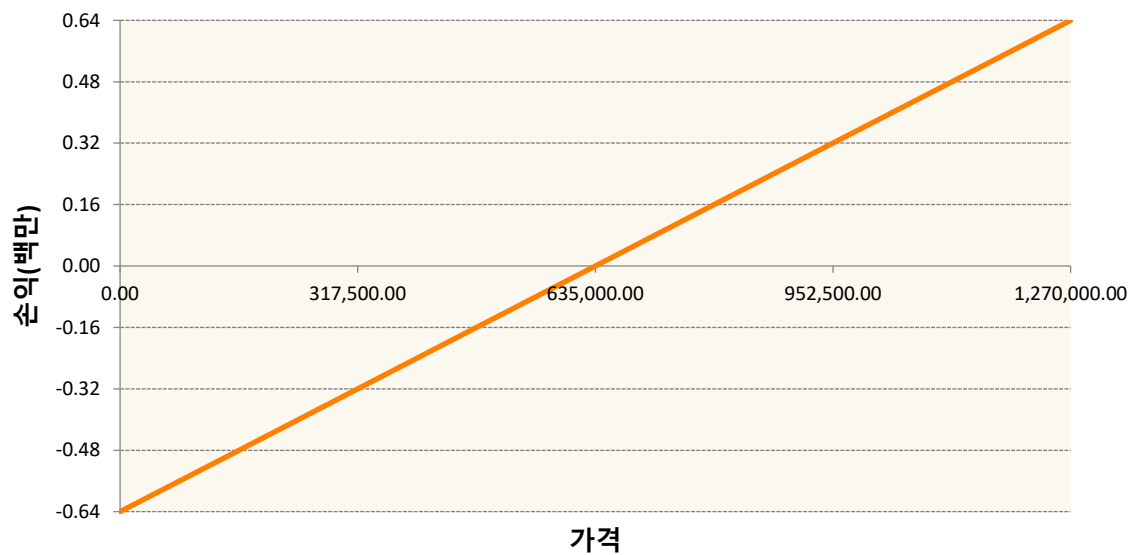
KR4119SA0001-2022-10 기아개별선물



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		
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3		
-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%	3	3	3	3	3	3	3		
8.00%	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		
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3		
-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%	3	3	3	3	3	3	3		
8.00%	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		
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2		
-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%	2	2	2	2	2	2	2		
8.00%	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		
-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		
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 2022-09-20

기준일 2022-09-19

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

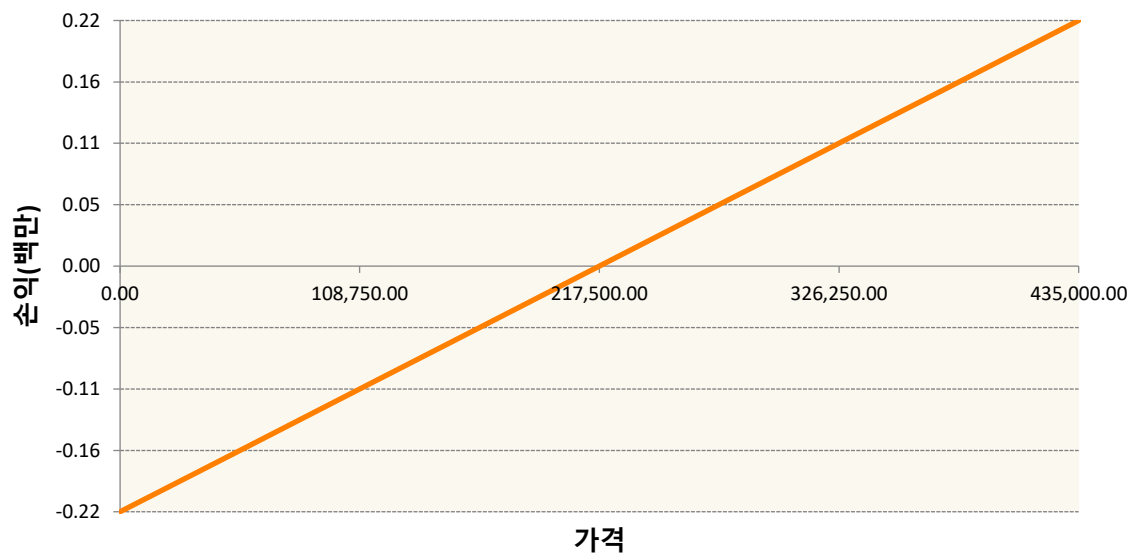
1. 계약금액

(단위:백만원)

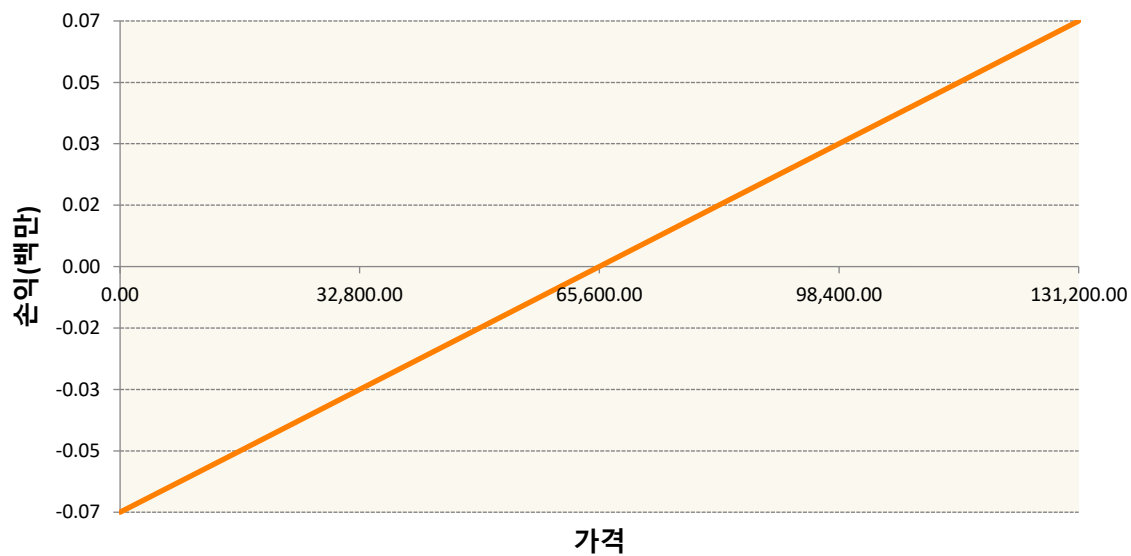
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	187	0	187	장내

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)

27

공시일	2022-09-20
기준일	2022-09-19

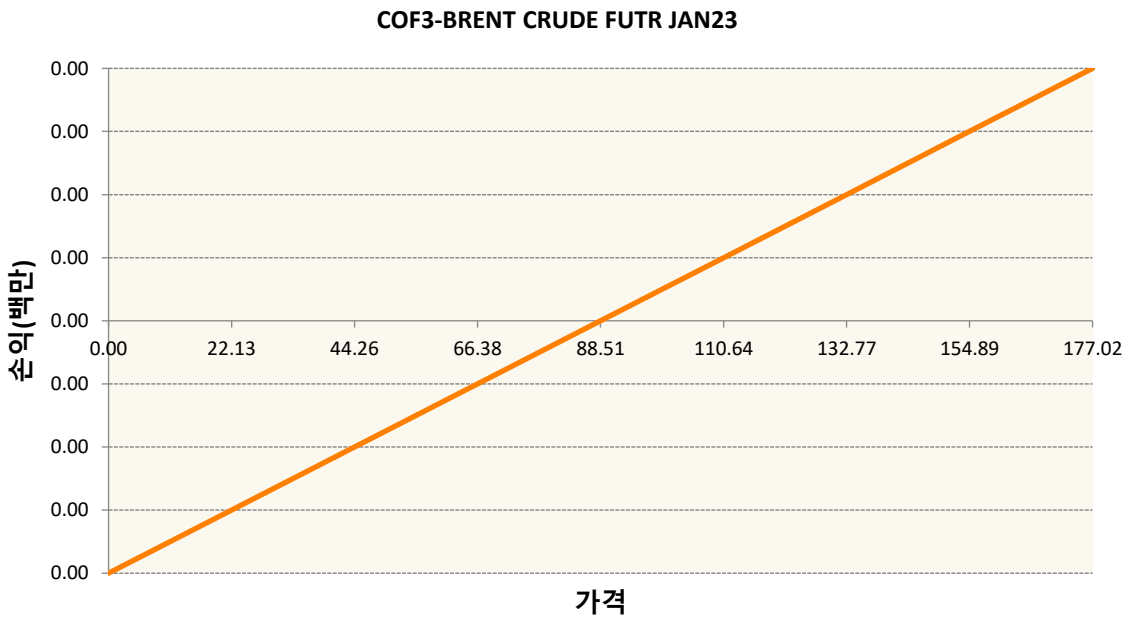
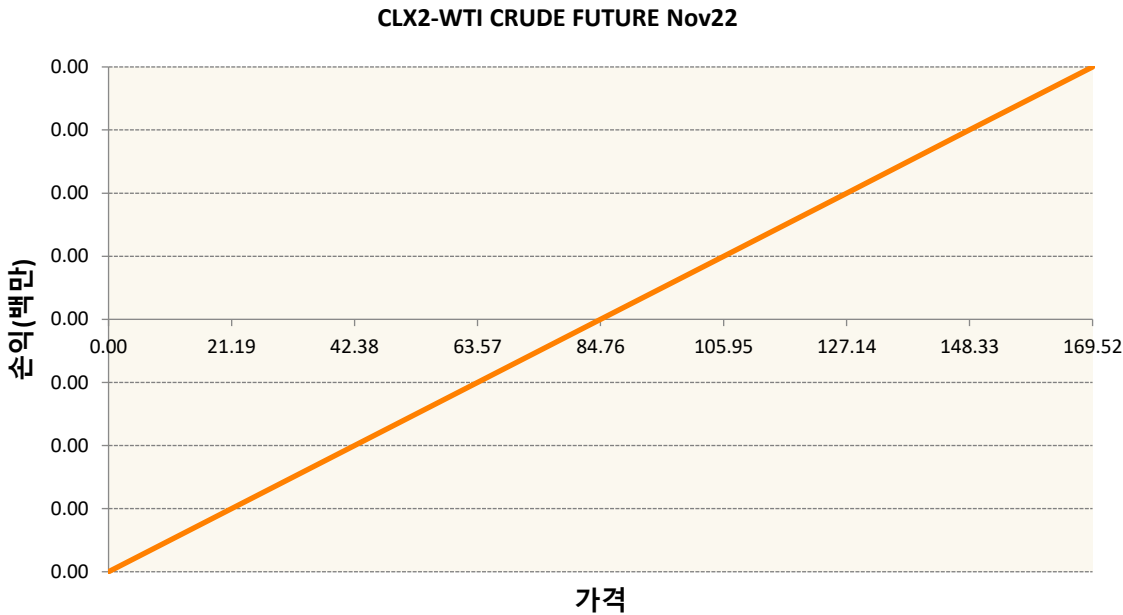
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

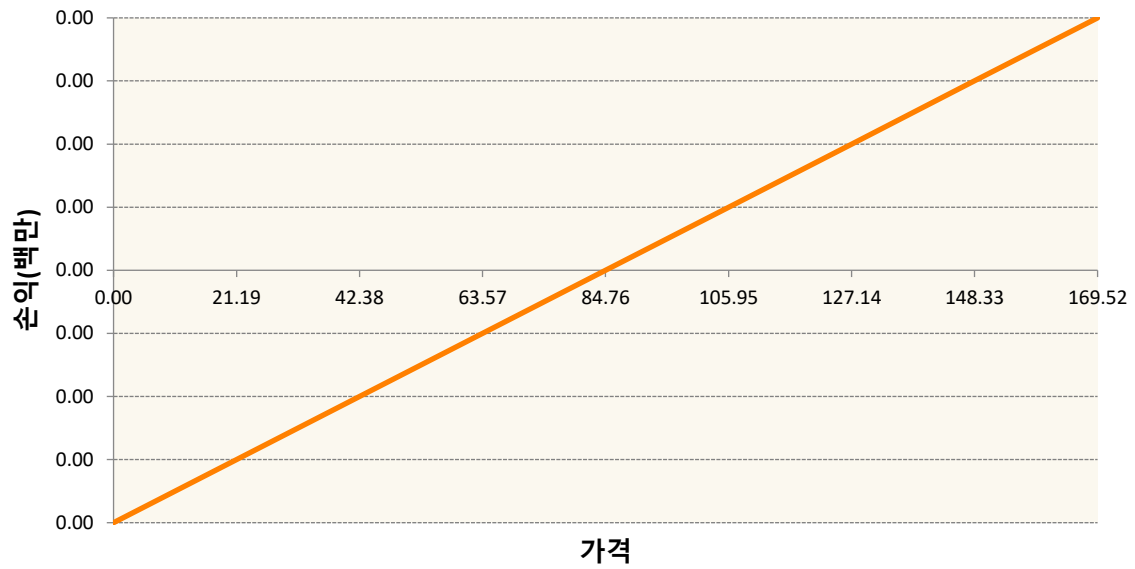
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,802	209	1,594	

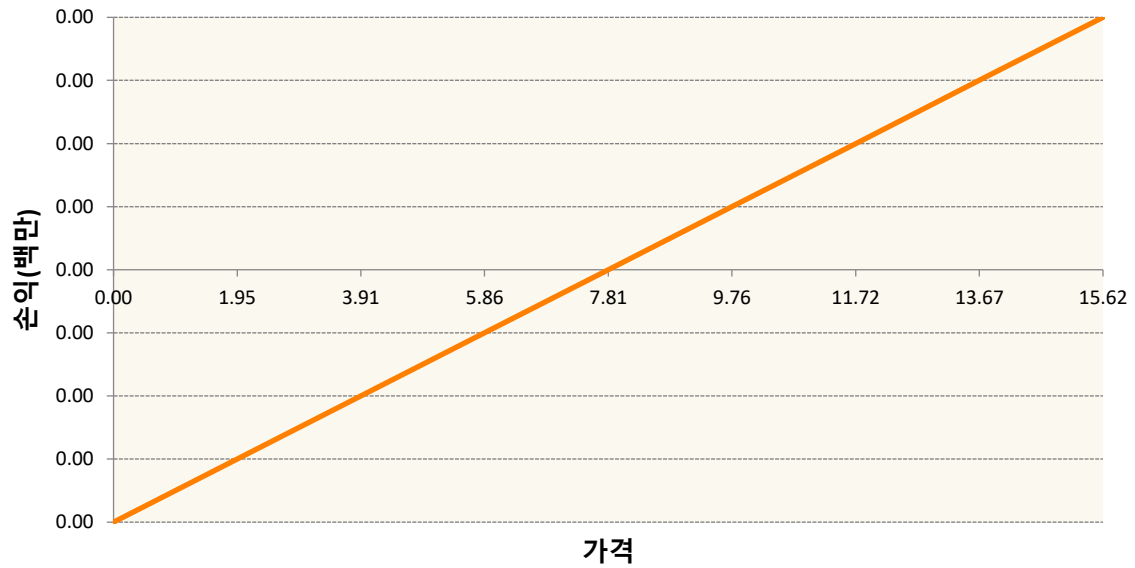
2. 만기시점의 손익구조



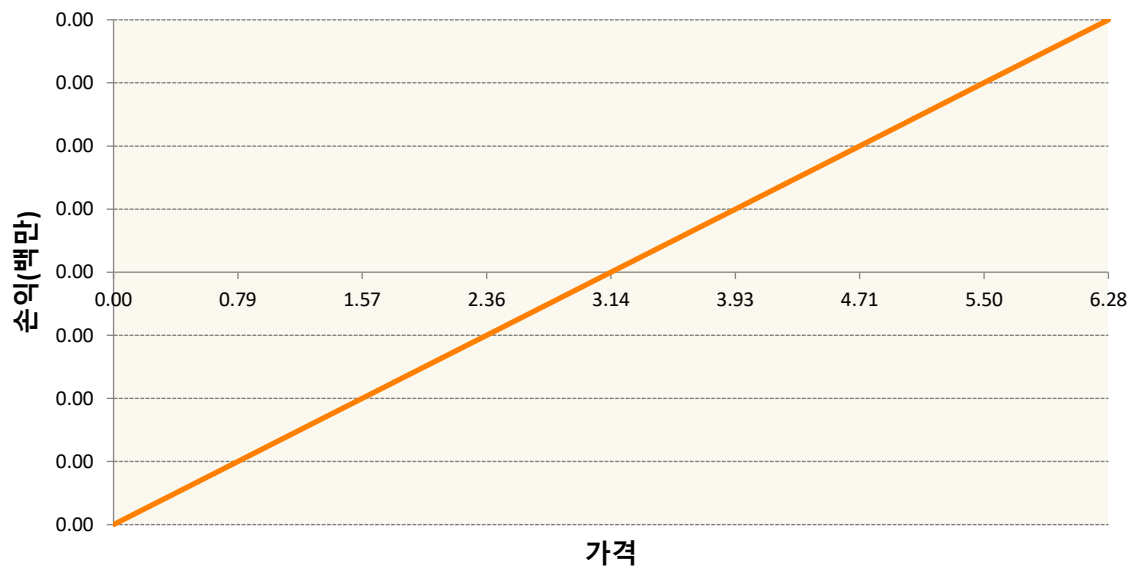
ECX2-E-MINI CRUDE OIL Nov22



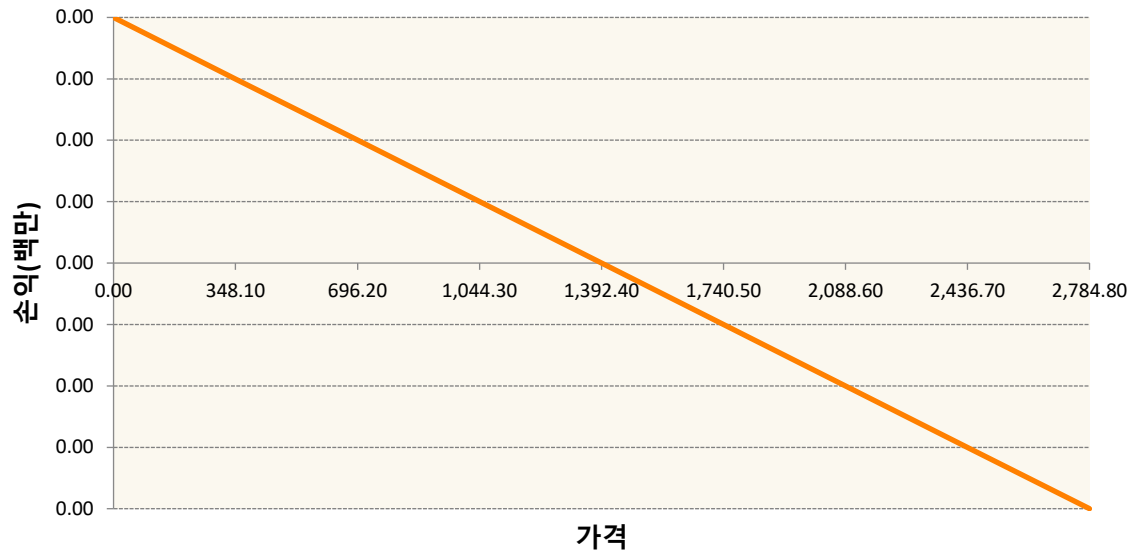
EOX2-E-MINI NATURAL GAS Nov22



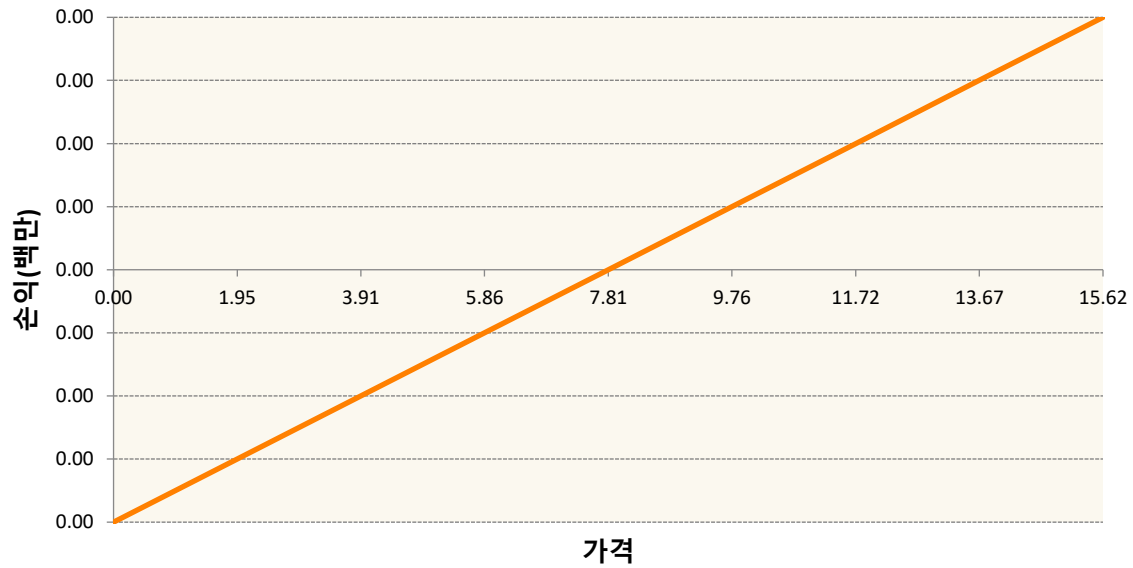
HOX2-NY Harb ULSD Fut Nov22



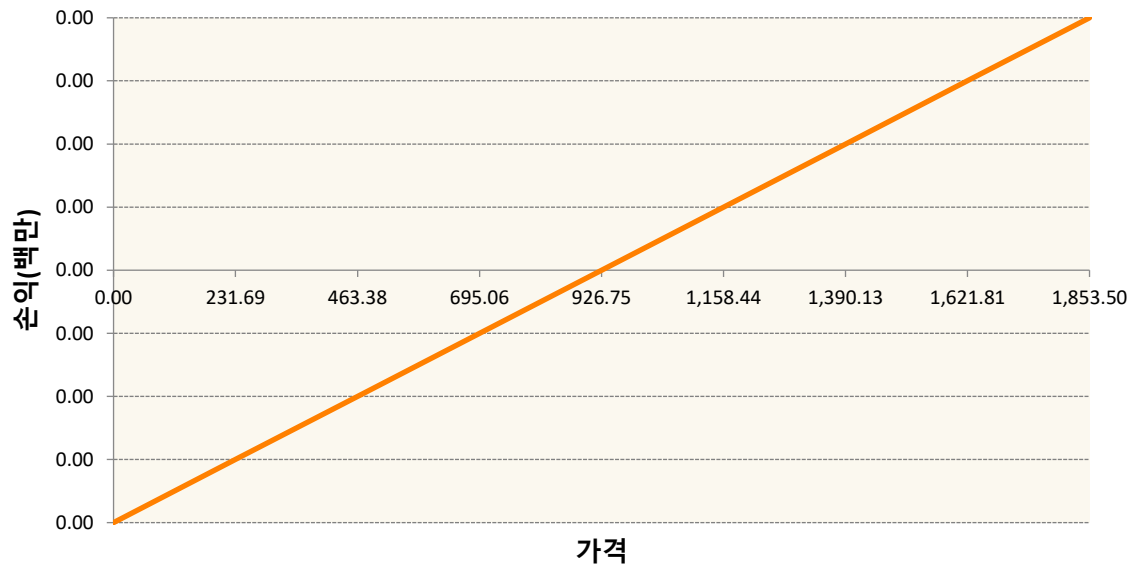
KR4175SA0002-2022-10 달러선물

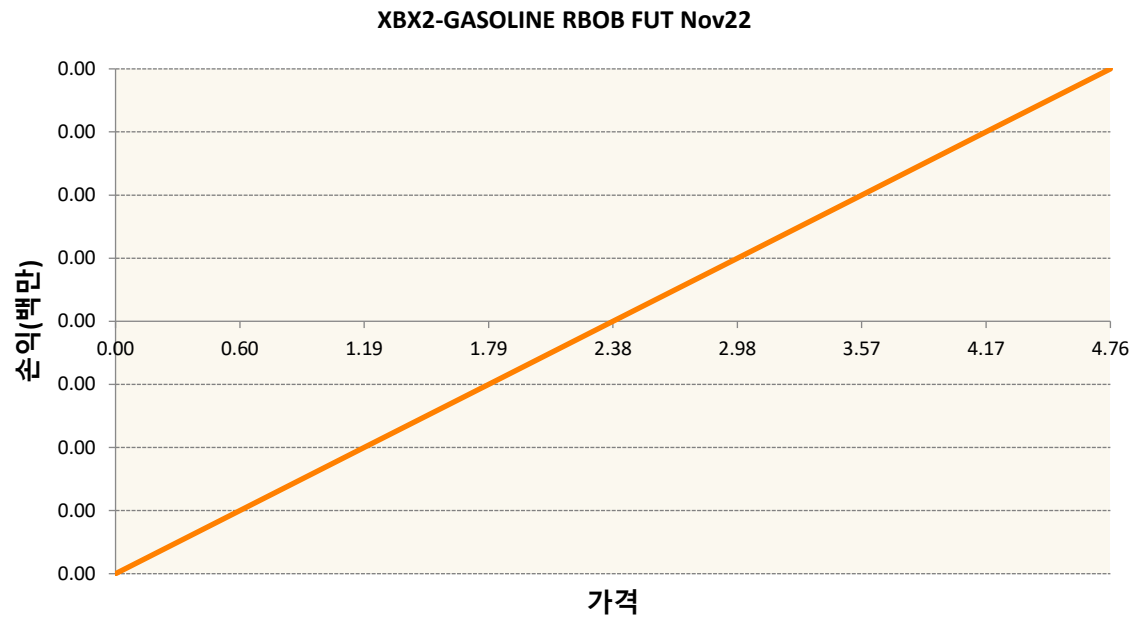


NGX22-NATURAL GAS FUTR Nov22



QSX2-Low Su Gasoil G Nov22





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLX2	WTI CRUDE FUTURE Nov22	18
COF3	BRENT CRUDE FUTR JAN23	30
ECX2	E-MINI CRUDE OIL Nov22	5
EOX2	E-MINI NATURAL GAS Nov22	2
HOX2	NY Harb ULSD Fut Nov22	14
KR4175SA00 2022-10 달러선물		17
NGX22	NATURAL GAS FUTR Nov22	57
QSX2	Low Su Gasoil G Nov22	10
XBX2	GASOLINE RBOB FUT Nov22	10

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