

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

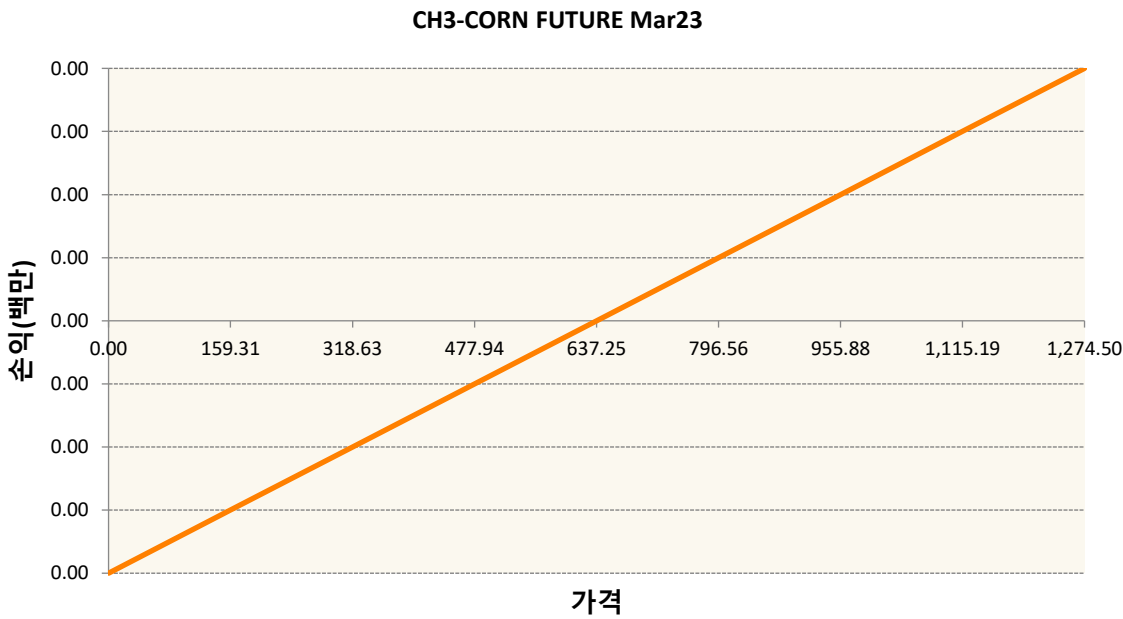
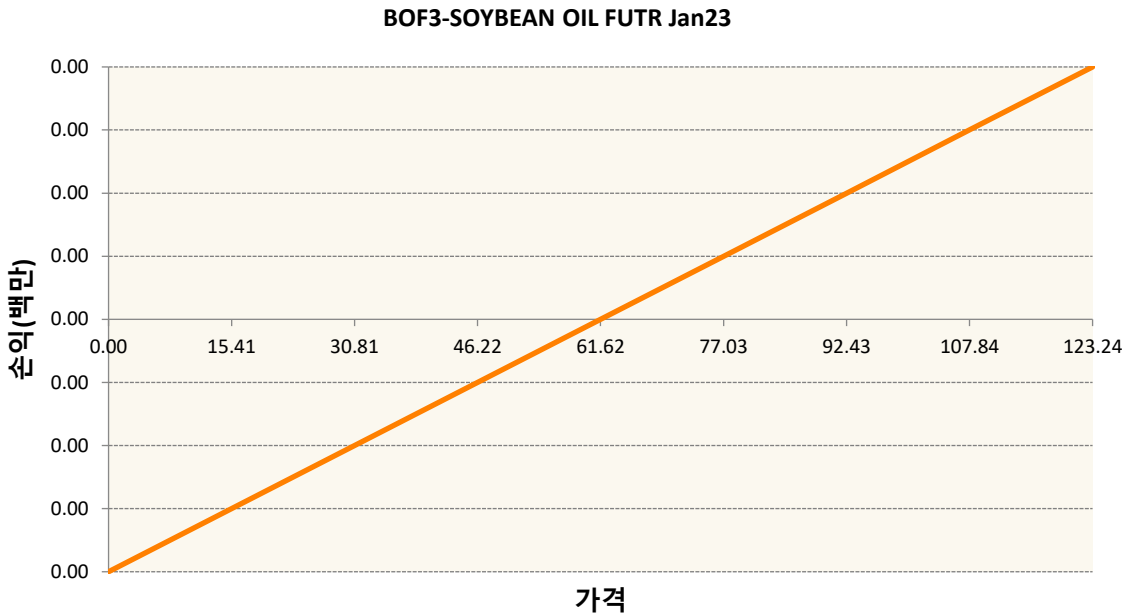
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

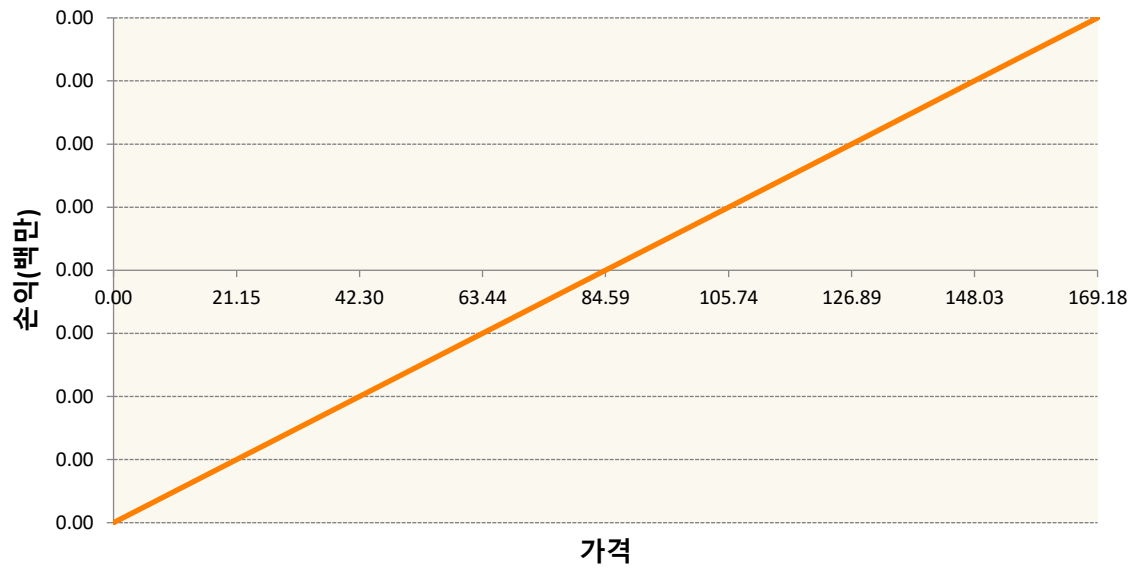
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,465	792	5,673	

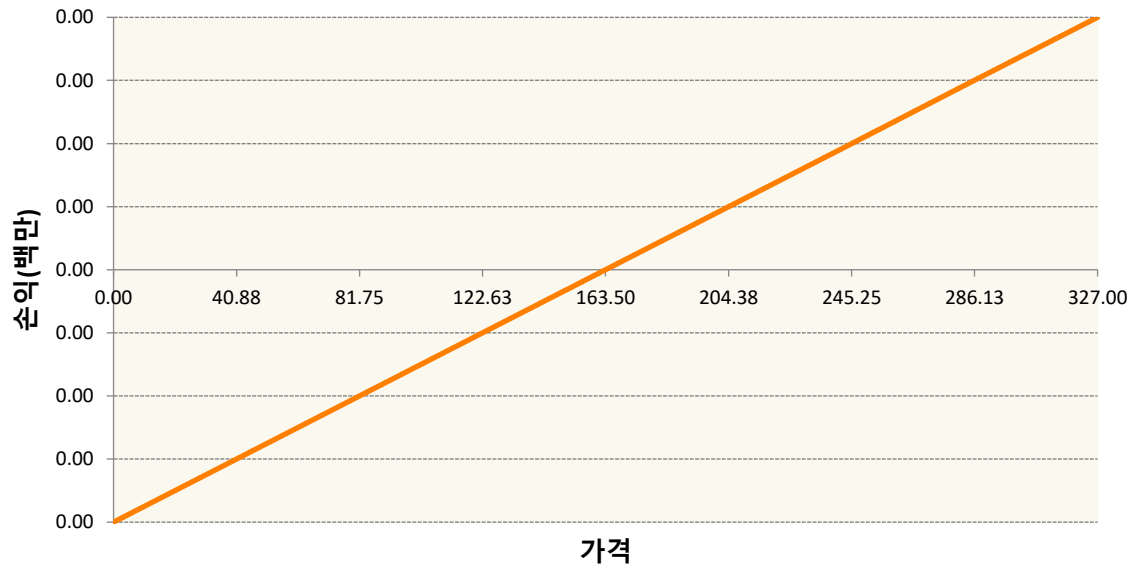
2. 만기시점의 손익구조



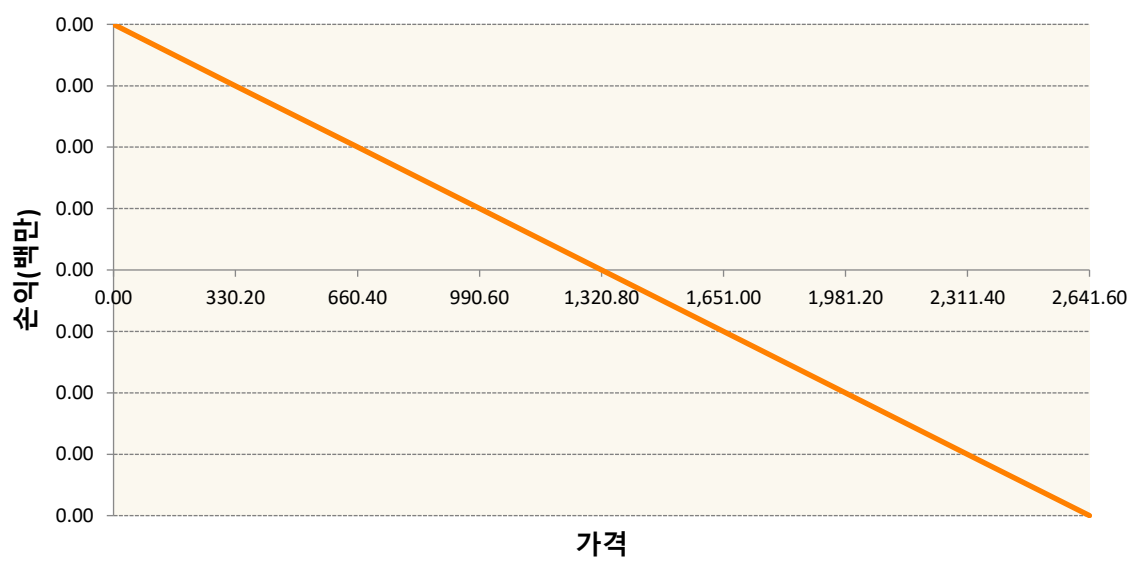
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



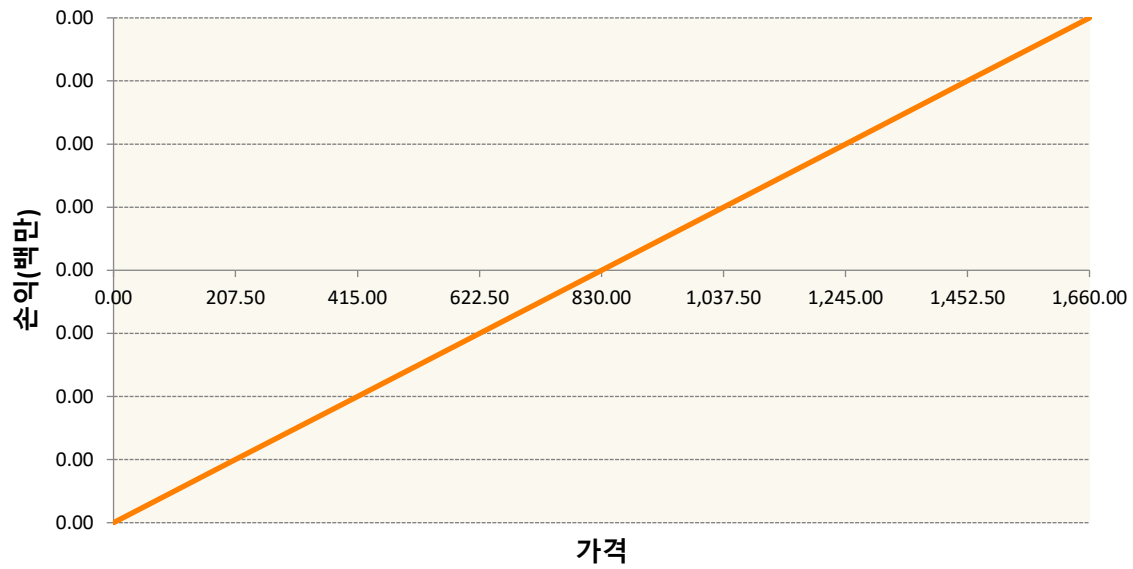
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



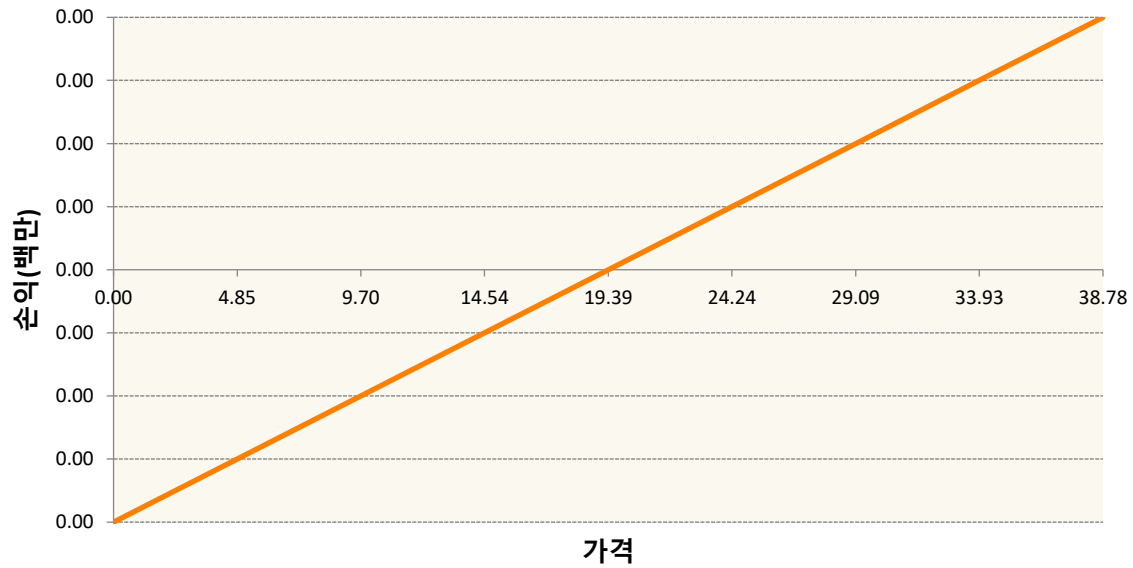
KR4175SC0000-2022-12 달러선물



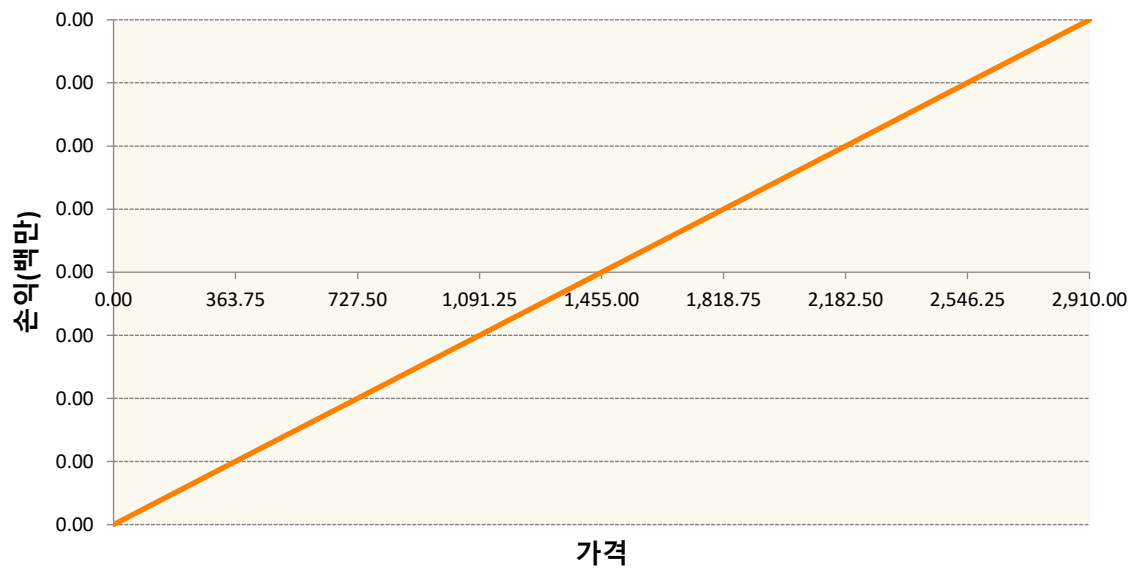
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



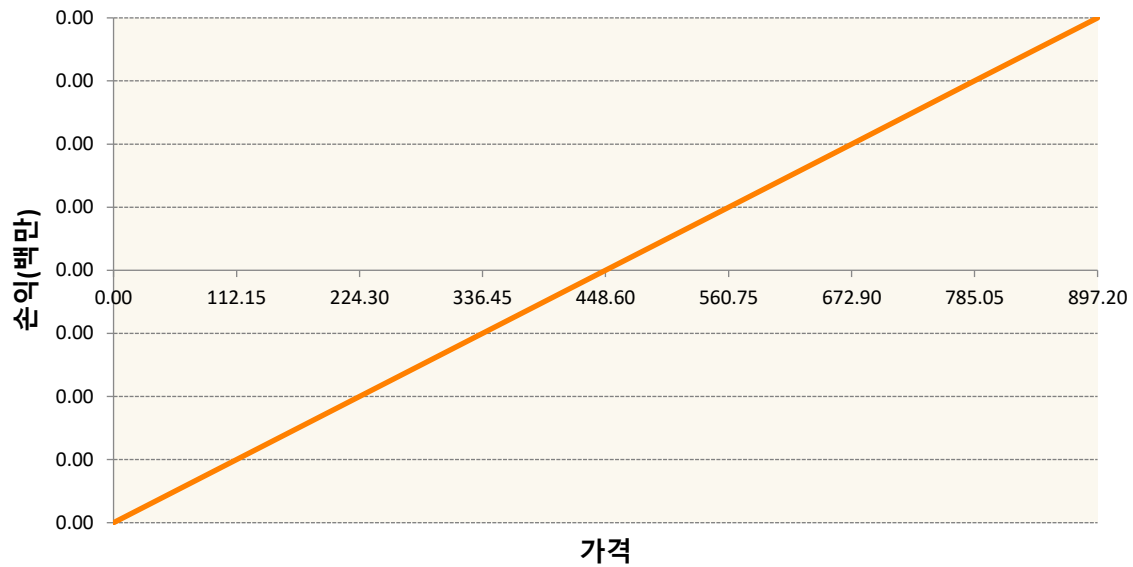
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



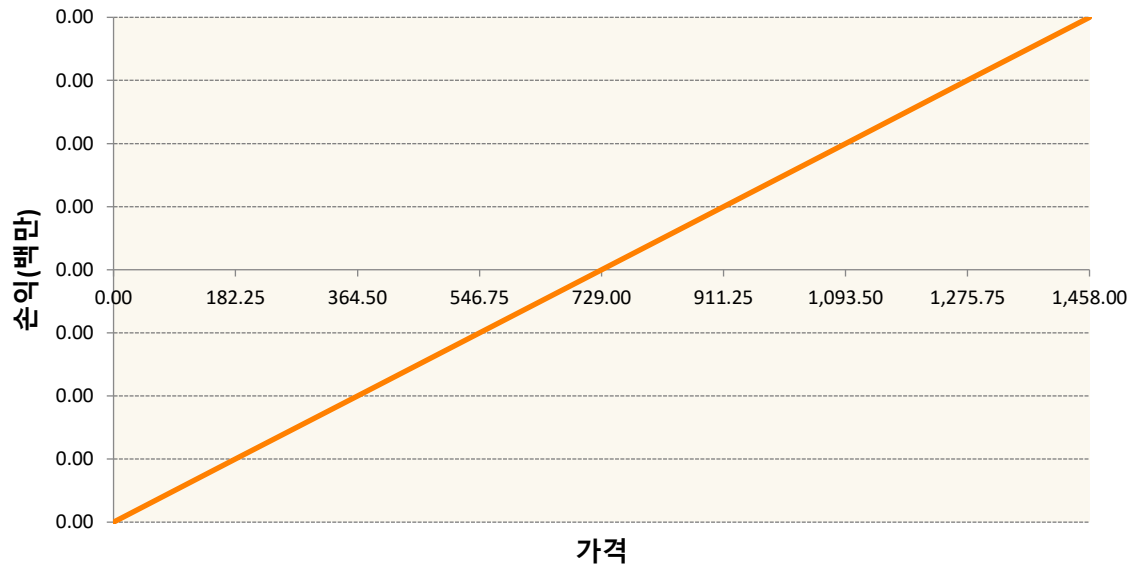
SF3-SOYBEAN FUTURE Jan23



SMF3-SOYBEAN MEAL FUTR Jan23



WH3-WHEAT FUTURE(CBT) Mar23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

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

353

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

495

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

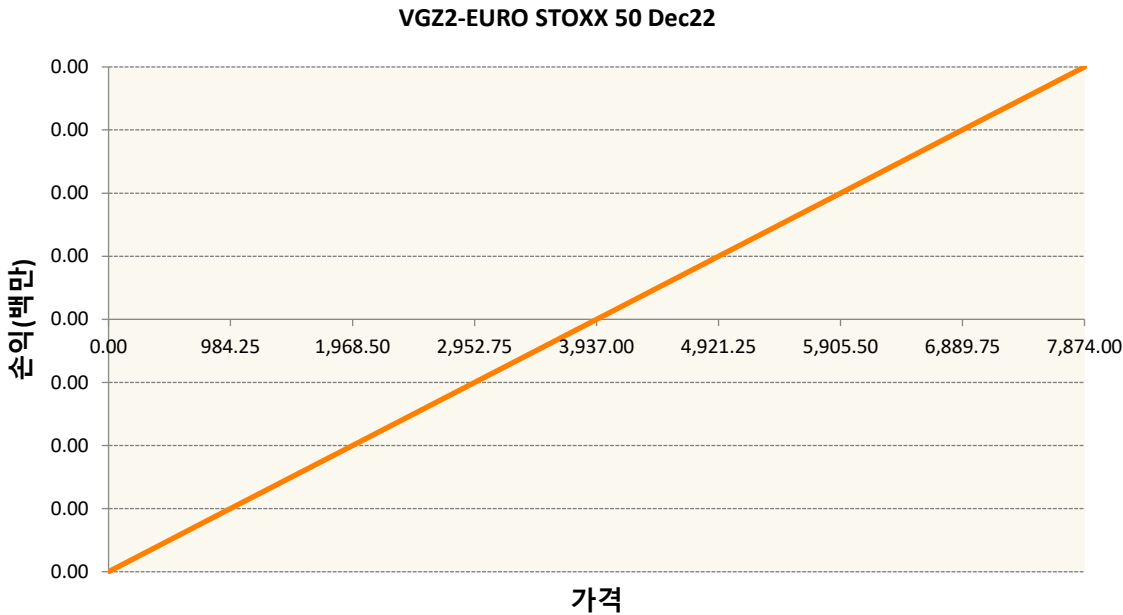
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	545	0	545	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ2	EURO STOXX 50 Dec22	44
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

46

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

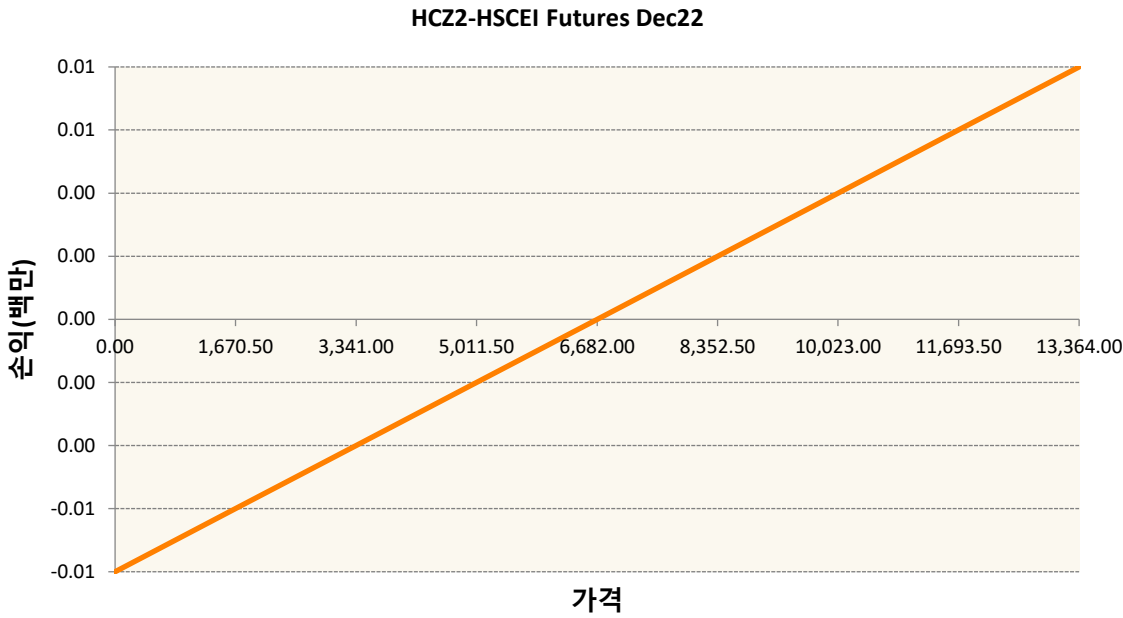
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,304	0	1,304	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ2	HSCEI Futures Dec22	104
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

141

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

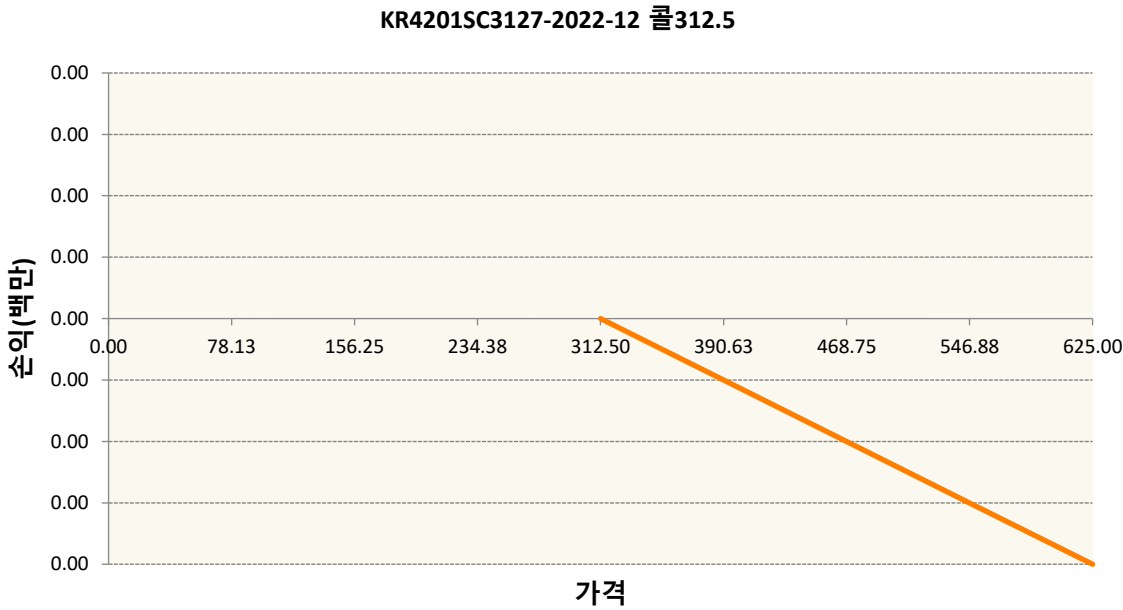
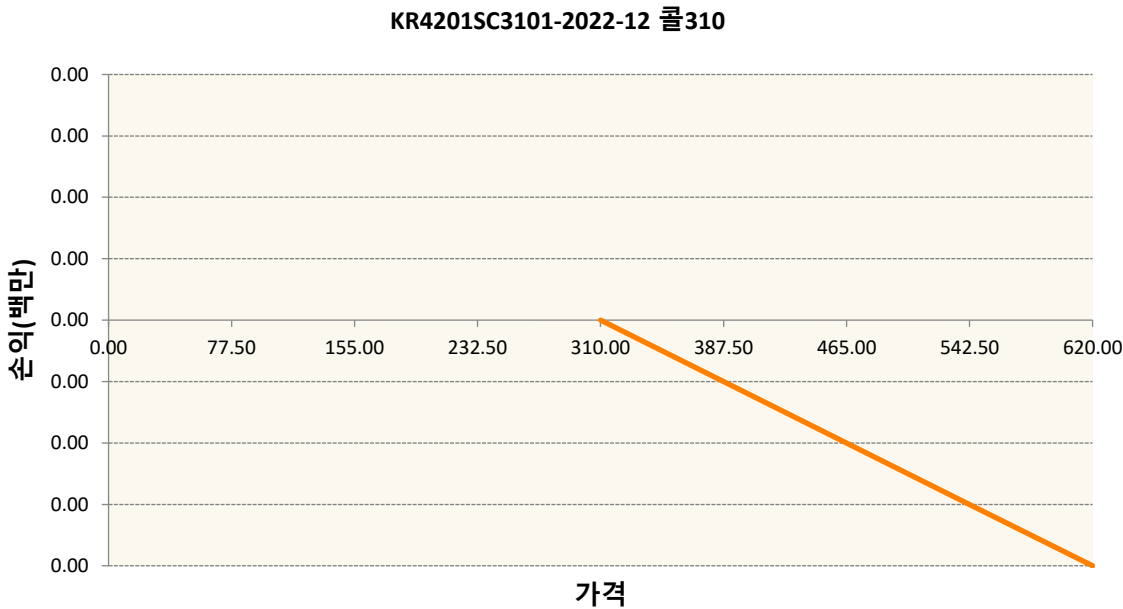
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	54,445	-54,445	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 620.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the origin (0, 0) and ends at (310, 0), indicating that profit is zero at a price of 310 million won.

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
78.13	0.00
156.25	0.00
234.38	0.00
312.50	0.00
390.63	0.00
468.75	0.00
546.88	0.00
625.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201SC3101				2022-12 콜310			1,784
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	217	217	217	217	217	217	216
-5.33%	217	217	216	214	212	209	205
-2.67%	206	199	190	179	168	155	141
0%	69	46	23	0	-23	-47	-70
2.67%	-391	-405	-422	-439	-457	-476	-496
5.33%	-1,066	-1,068	-1,071	-1,076	-1,082	-1,089	-1,098
8.00%	-1,779	-1,779	-1,779	-1,780	-1,781	-1,782	-1,784
KR4201SC3127				2022-12 콜312.5			1,099
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	93	93	93	93	93	93	93
-5.33%	93	93	93	93	92	91	89
-2.67%	91	88	85	80	75	69	62
0%	40	27	14	0	-14	-29	-43
2.67%	-197	-210	-224	-238	-253	-268	-283
5.33%	-620	-623	-627	-632	-638	-646	-654
8.00%	-1,092	-1,093	-1,093	-1,094	-1,095	-1,097	-1,099

KR4301SC3100

2022-12 풋310

222

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222
-5.33%	-139	-139	-140	-140	-140	-140	-141
-2.67%	-59	-59	-60	-62	-63	-64	-66
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	37	36	34	32	30	27	25
5.33%	42	42	41	41	40	39	38
8.00%	42	42	42	42	42	42	42

KR4301SC3126

2022-12 풋312.5

461

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-461	-461	-461	-461	-461	-461	-461
-5.33%	-297	-297	-297	-297	-297	-298	-298
-2.67%	-133	-134	-135	-137	-139	-141	-143
0%	14	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	97	92	87	82	77	72	67
5.33%	115	114	113	111	109	106	103
8.00%	116	116	116	116	116	115	114

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

(단위:백만원)

4,103

공시일 2022-12-08

기준일 2022-12-07

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

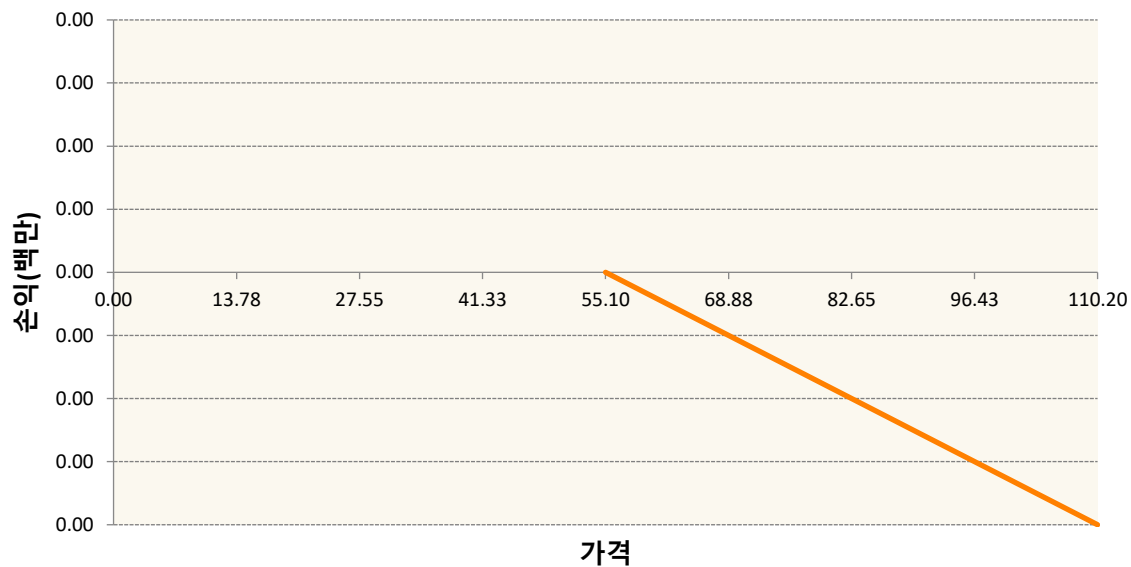
1. 계약금액

(단위:백만원)

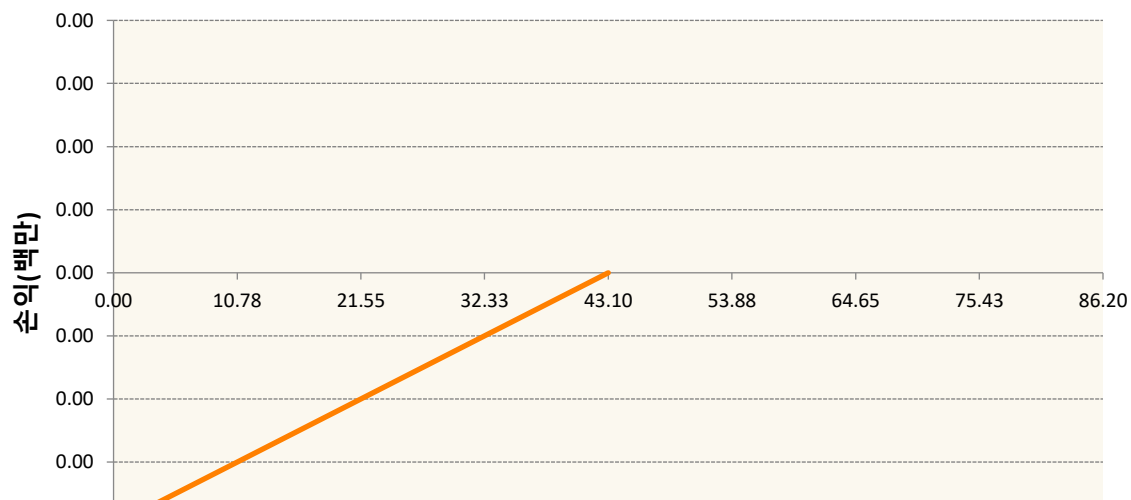
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,103	0	1,103	
누계	유가증권	옵션	0	55	-55	장내
누계	통화	선도	138	2,280	-2,142	장외

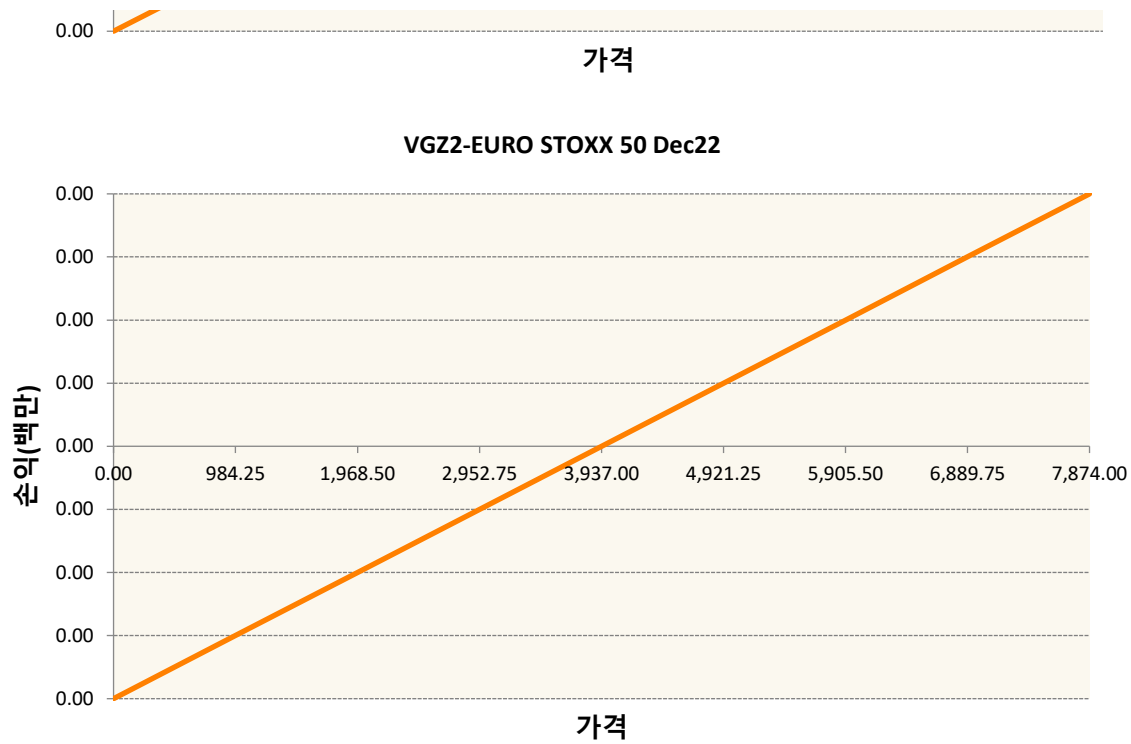
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ2-C3925-EURO STOXX 50



OESXZ2-P3925-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E	55
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E	55
FXW213CBG KRW/EUR 24-02-23E	72
FXW213CBN EUR/KRW 24-02-23E	11
OESXZ2-C39 EURO STOXX 50	3
OESXZ2-P39 EURO STOXX 50	2
VGZ2 EURO STOXX 50 Dec22	88

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

(단위:백만원)

239

공시일 2022-12-08

기준일 2022-12-07

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

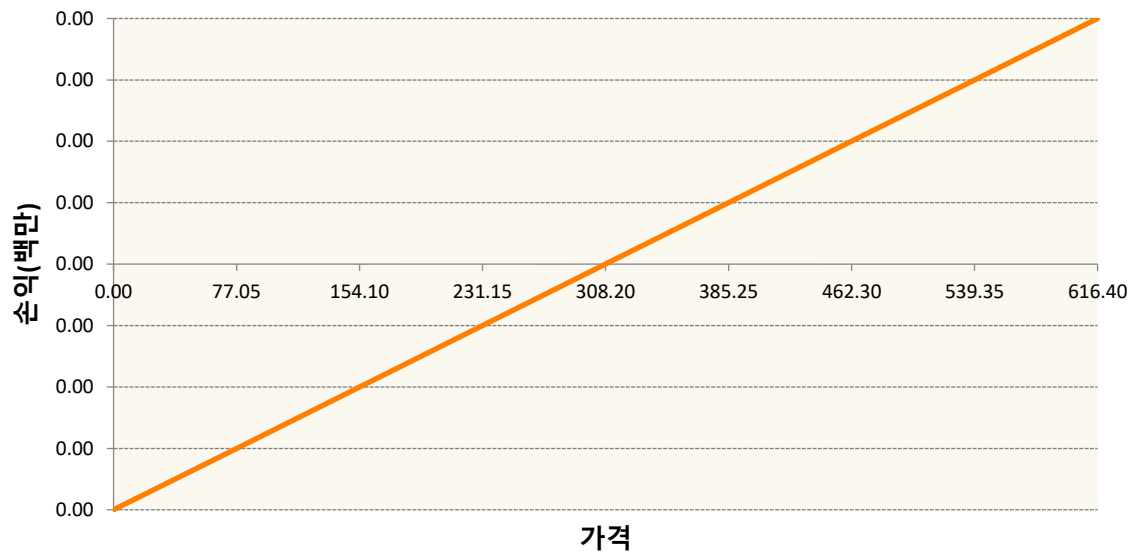
1. 계약금액

(단위:백만원)

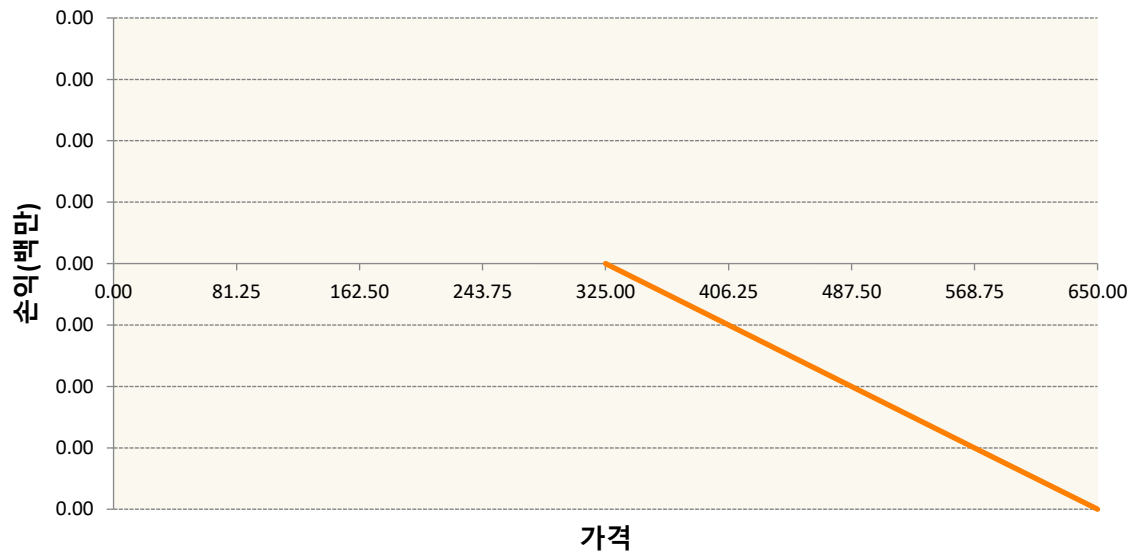
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	385	0	385	장내
누계	유가증권	옵션	311	3,839	-3,528	장내

2. 만기시점의 손익구조

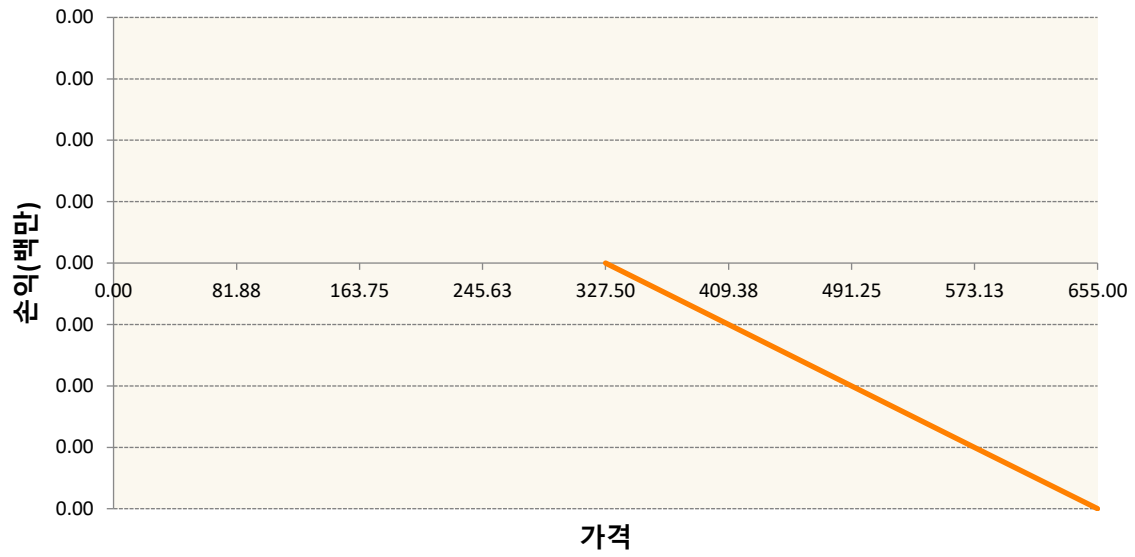
KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



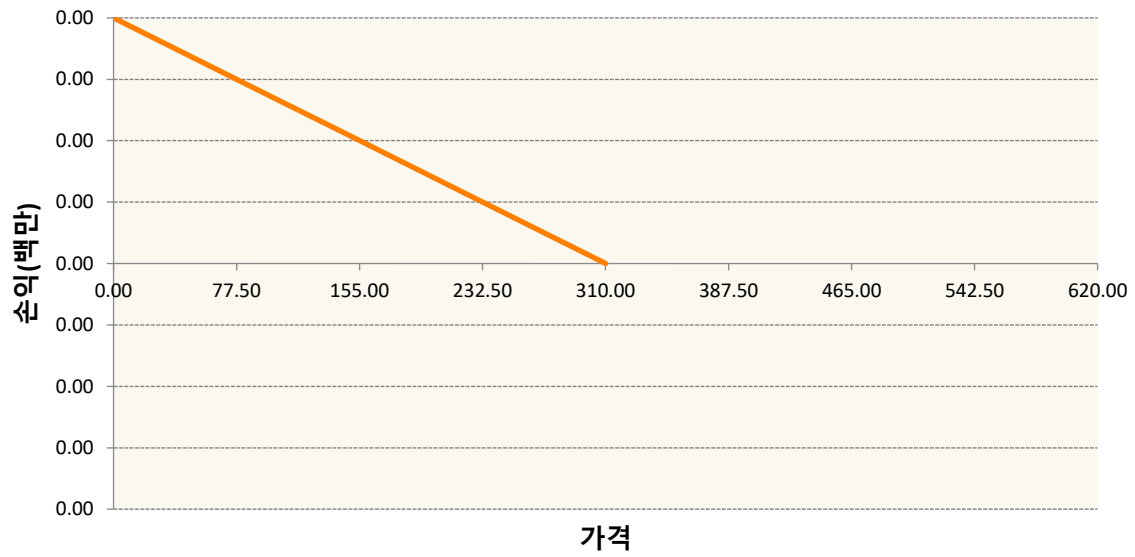
KR4201SC3259-2022-12 콜325



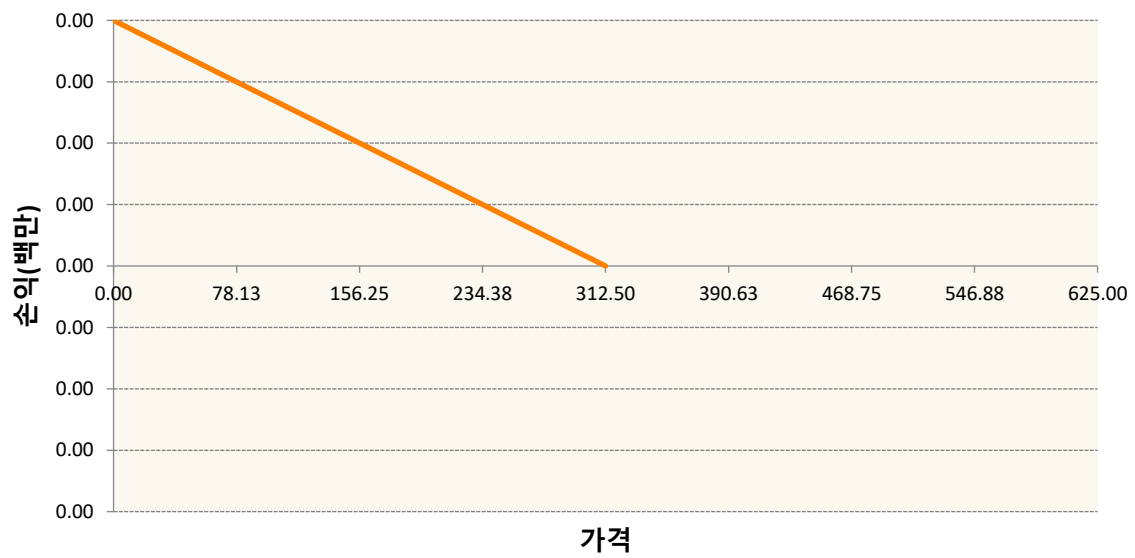
KR4201SC3275-2022-12 콜327.5



KR4301SC3100-2022-12 풋310



KR4301SC3126-2022-12 풋312.5



(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				
KR4201SC3259							2022-12 콜325		35		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0				
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0				
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	-1	-1	-2	-2	-3	-4	-5				
5.33%	-9	-10	-11	-12	-13	-14	-15				
8.00%	-31	-31	-32	-33	-34	-34	-35				
KR4201SC3275							2022-12 콜327.5		61		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0				
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0				
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0				
0%	0	0	0	0	0	-1	-1				
2.67%	-1	-1	-2	-3	-4	-5	-7				
5.33%	-11	-13	-16	-18	-20	-22	-24				
8.00%	-49	-51	-53	-55	-57	-59	-61				
KR4301SC3100							2022-12 풋310		11		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11				
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7				
-2.67%	3	3	3	3	3	3	3				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	-2	-2	-2	-2	-1	-1	-1				
5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2				
8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2				
KR4301SC3126							2022-12 풋312.5		12		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	7	7	7	7	7	7	7
-2.67%	3	3	3	3	3	4	4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

82

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

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	6,849	0	6,849	

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	2022-12-08
기준일	2022-12-07

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	48	-48	
누계	유가증권	수익증권	5,848	0	5,848	

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	2022-12-08
기준일	2022-12-07

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	18,975	0	18,975	
누계	통화	선도	0	18,669	-18,669	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	492
FXW213CAR(KRW/USD 30-01-23E	273
FXW213CBQ(KRW/USD 28-02-23E	676
FXW213CBW(KRW/USD 28-12-22E	37
FXW213CC6(KRW/USD 28-12-22E	16
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

771

공시일 2022-12-08

기준일 2022-12-07

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

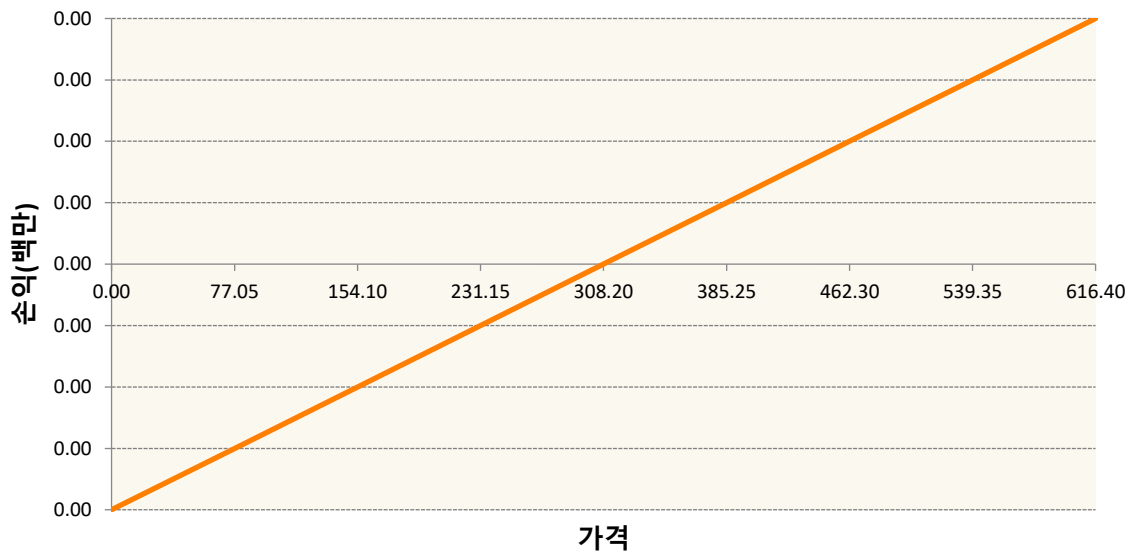
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	462	0	462	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101SC0009-2022-12 코스피200지수선물



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	2022-12-08
기준일	2022-12-07

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	276	276	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9MKRW/EUR 23-12-22E	22
FXW213CBE(EUR/KRW 23-12-22E	22

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

(단위:백만원)

32

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

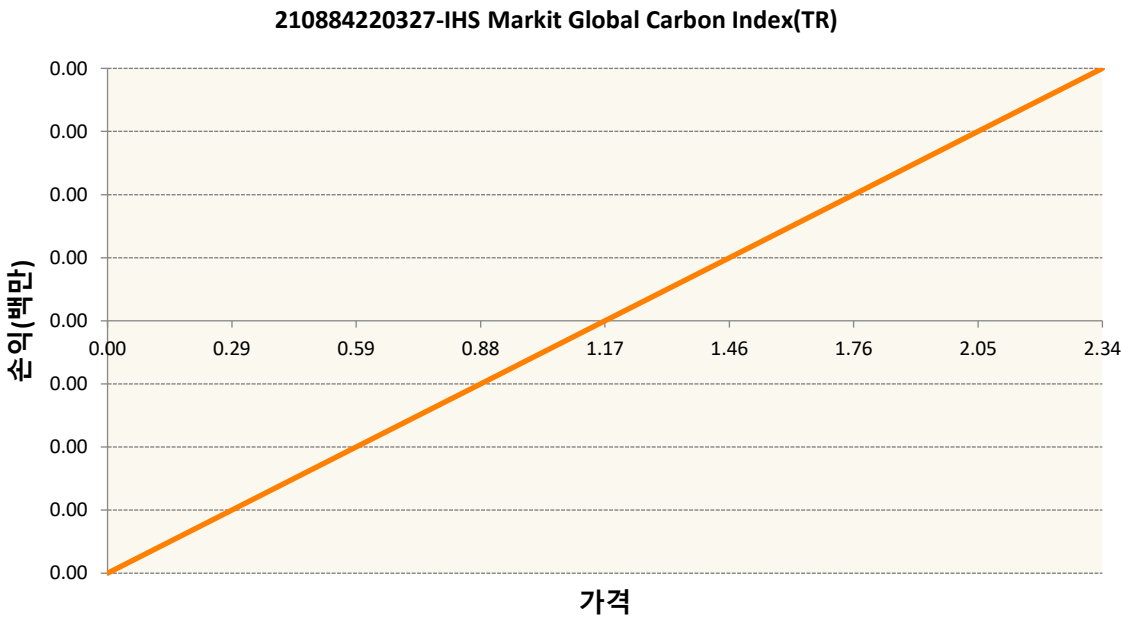
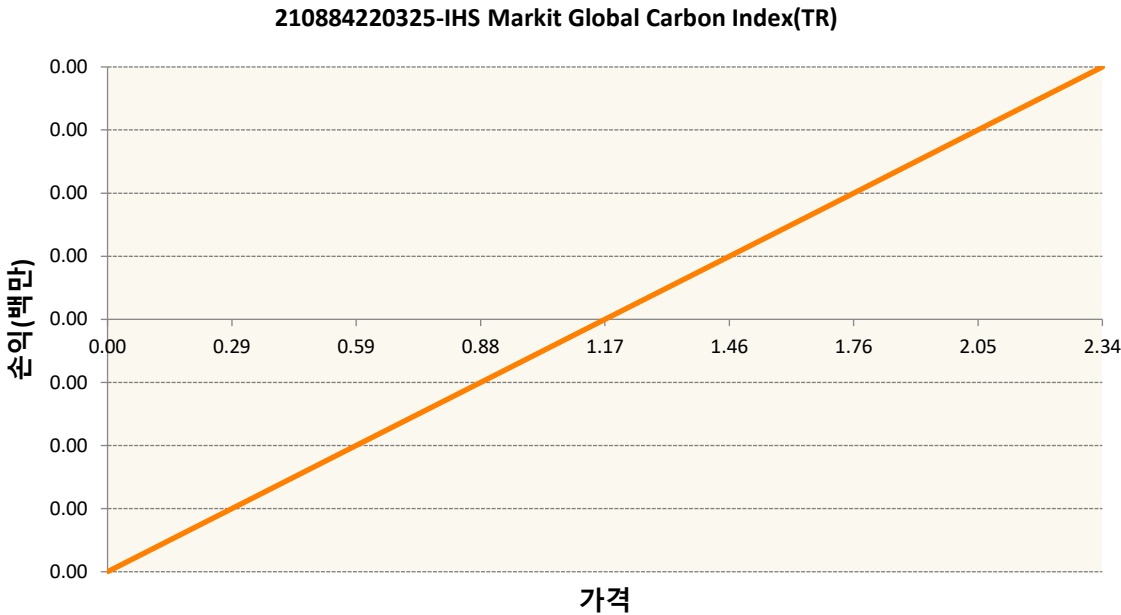
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

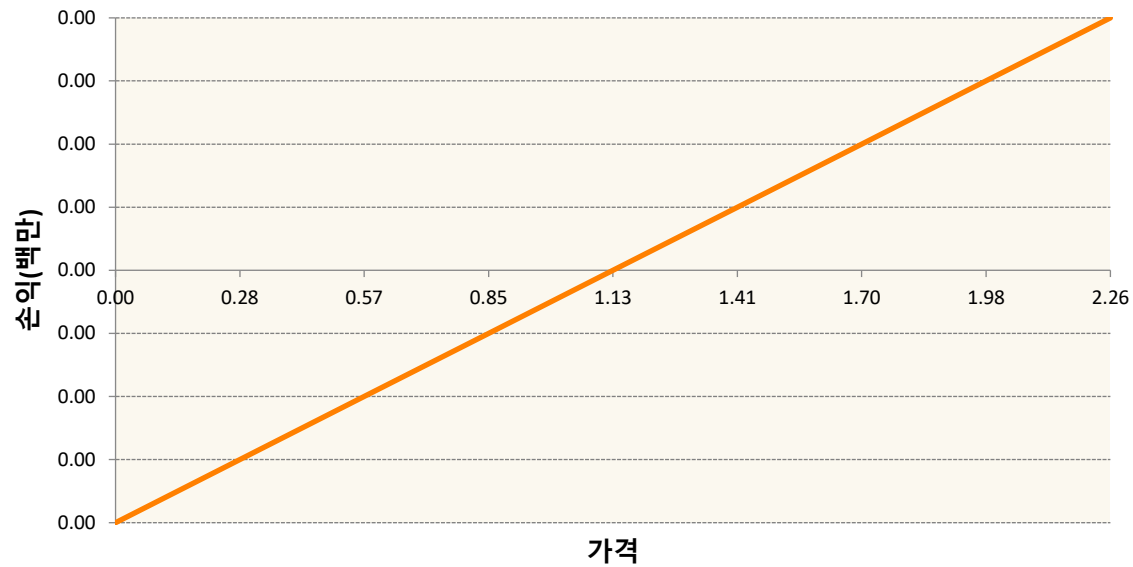
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	31,805	0	31,805	

2. 만기시점의 손익구조



210884221024-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

204

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

102

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

2,235

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

(단위:백만원)

4,895

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

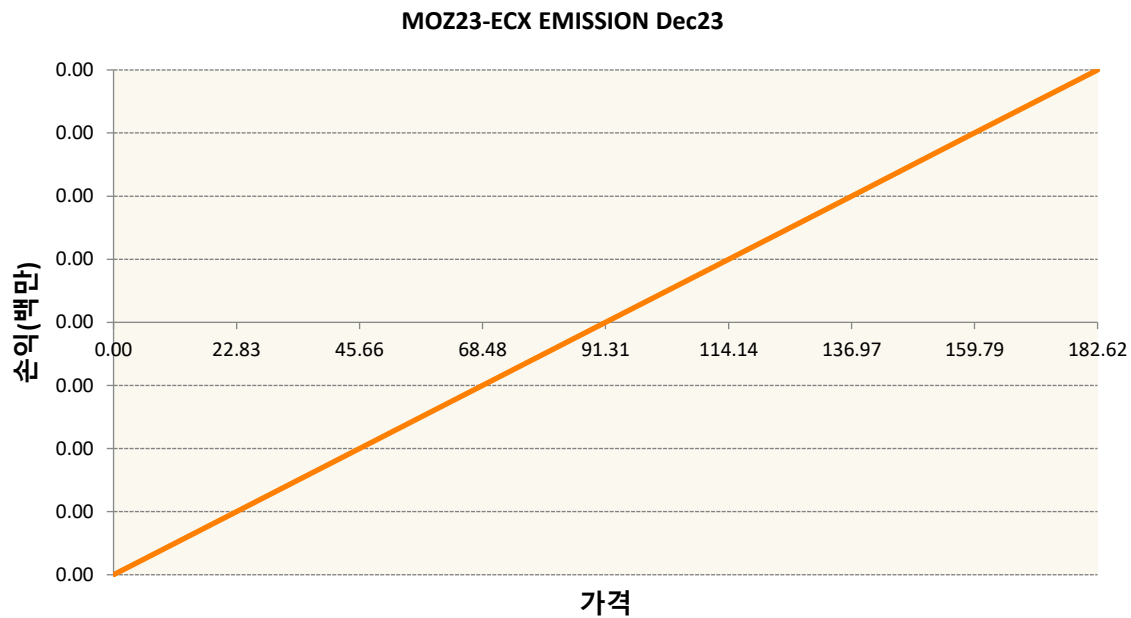
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	16,426	0	16,426	
누계	통화	선도	0	6,463	-6,463	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CBP(KRW/EUR 23-12-22E)	362
FXW213CC1(KRW/EUR 23-12-22E)	155
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,314

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

(단위:백만원)

3,760

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

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	11,500	0	11,500	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (NH)	28
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	28
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	28
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	28

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

(단위:백만원)

218

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

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	8,926	0	8,926	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	5

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

(단위:백만원)

23

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

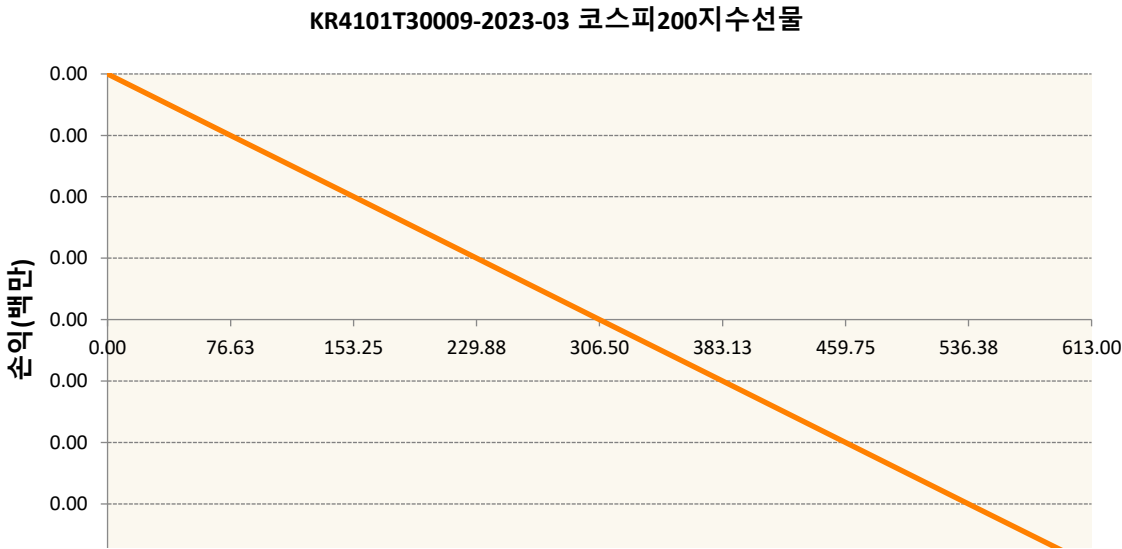
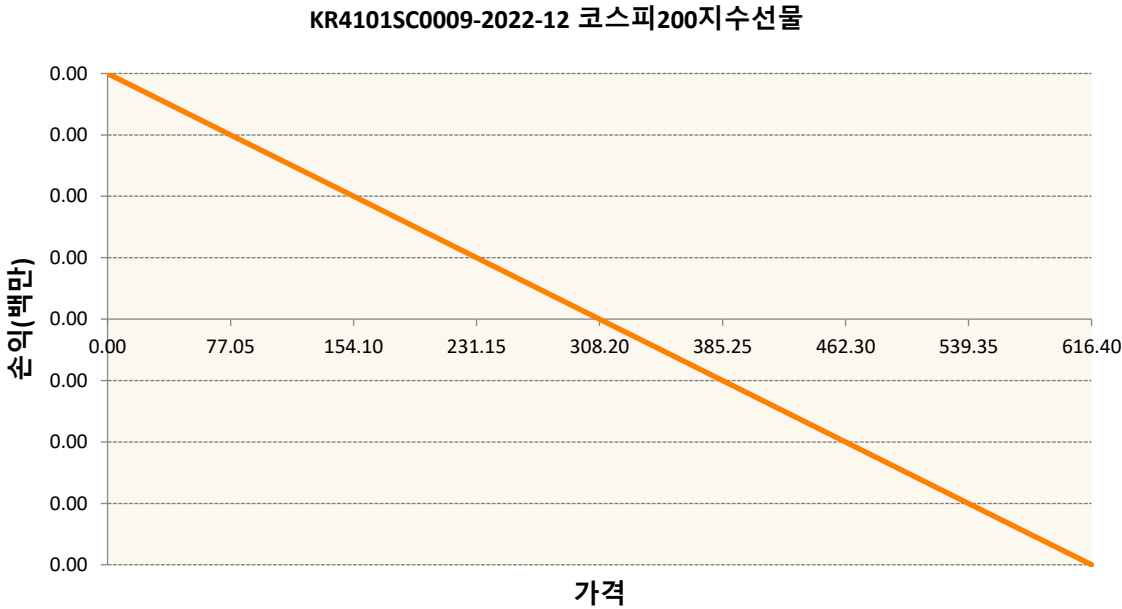
에쿼티알파일반사모혼합자산

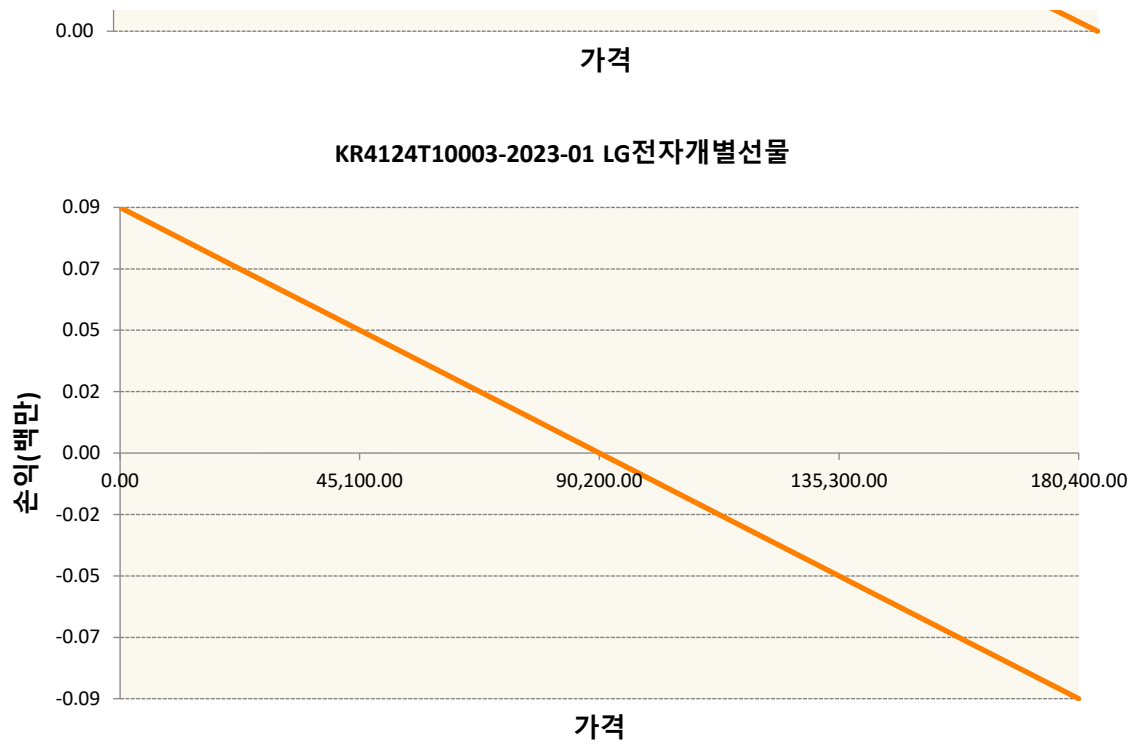
1. 계약금액

(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
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	2,309	-2,309	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	0	39	-39	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101SC00 2022-12 코스피200지수선물		154
KR4101T300 2023-03 코스피200지수선물		31
KR4124T100 2023-01 LG전자개별선물		3
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		0.13
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602		0.22

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		208

공시일 2022-12-08

기준일 2022-12-07

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

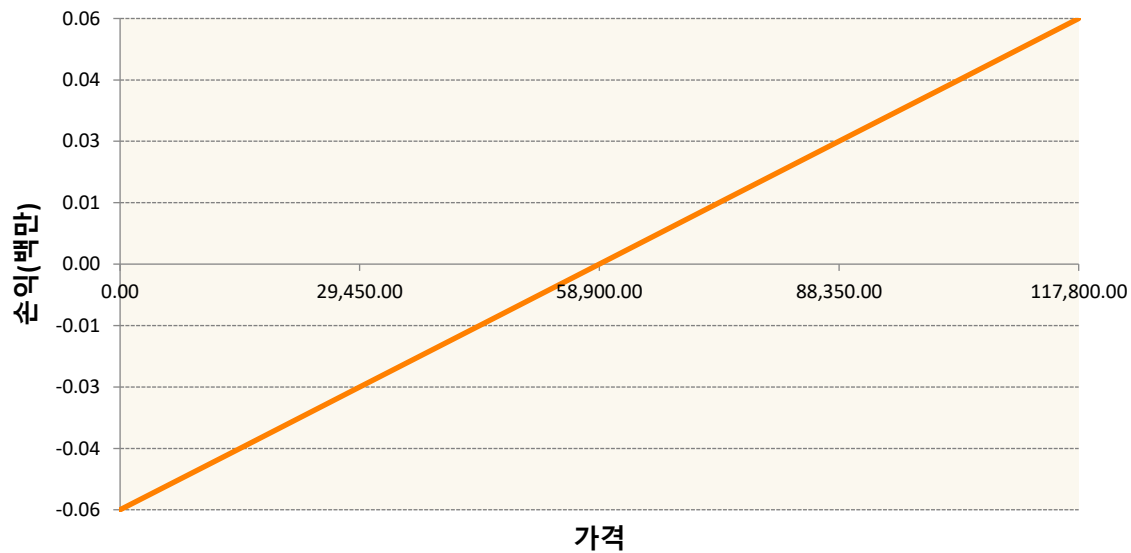
1. 계약금액

(단위:백만원)

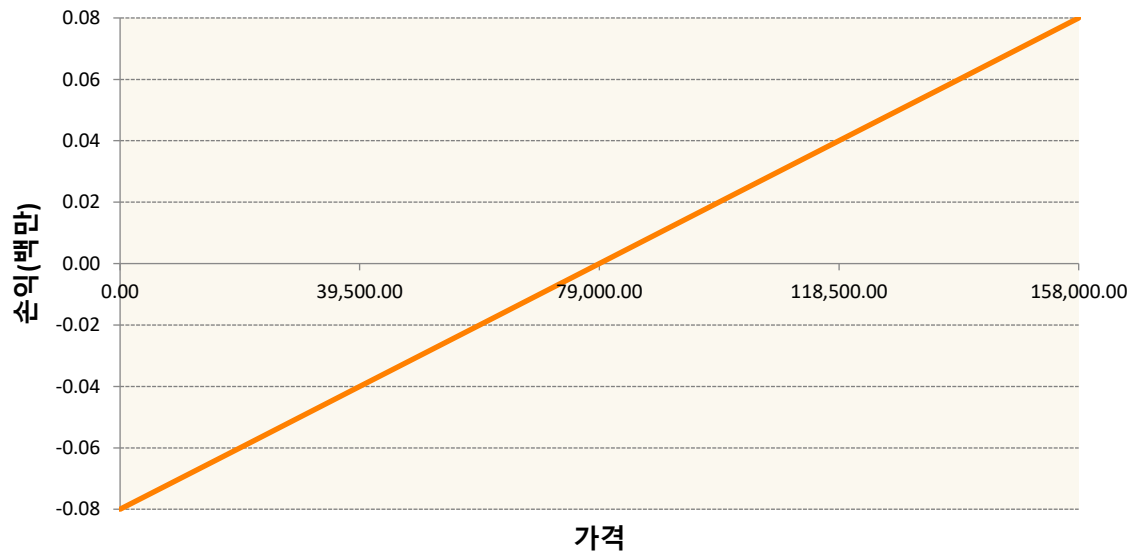
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	141	0	141	장내
누계	유가증권	선물	142	0	142	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111T10000-2023-01 삼성전자개별선물



KR4150T10008-2023-01 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111T10000		2023-01 삼성전자개별선물					8
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-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%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	8	8	8	8	8	8	8
KR4150T10008		2023-01 SK하이닉스개별선물					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

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

13

공시일 2022-12-08

기준일 2022-12-07

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

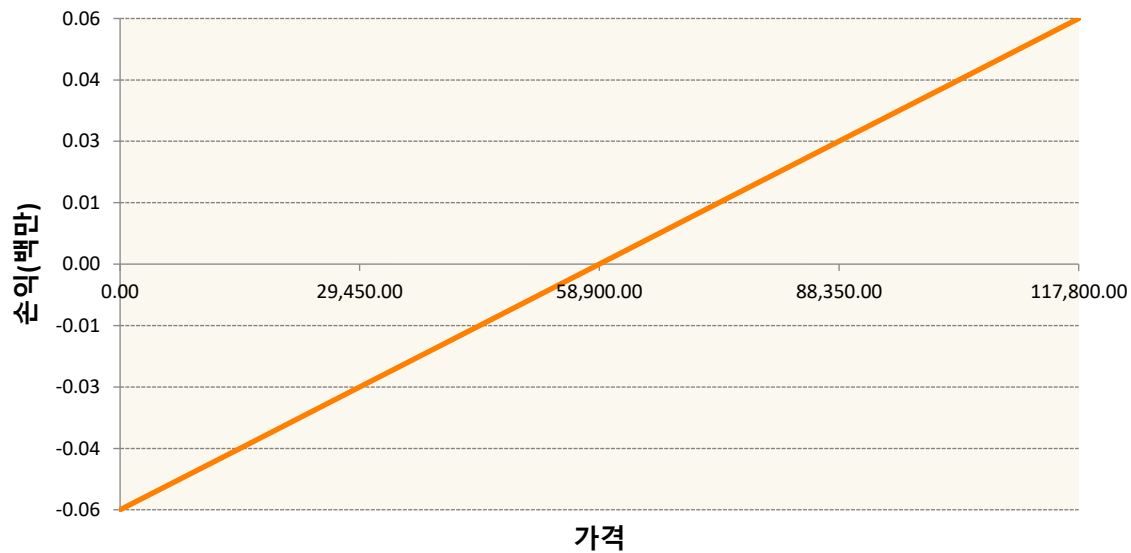
1. 계약금액

(단위:백만원)

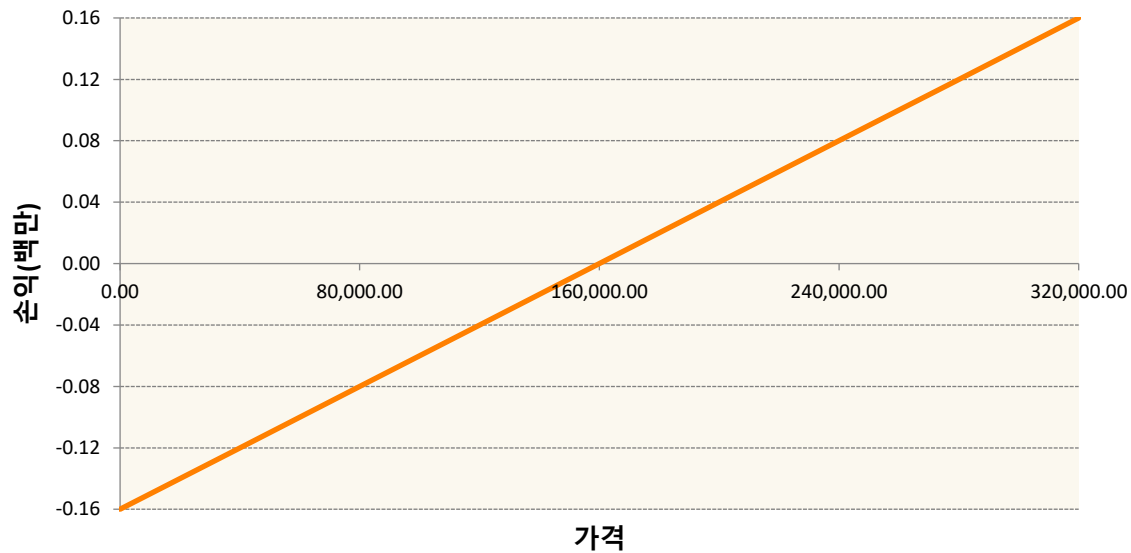
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	292	0	292	장내

2. 만기시점의 손익구조

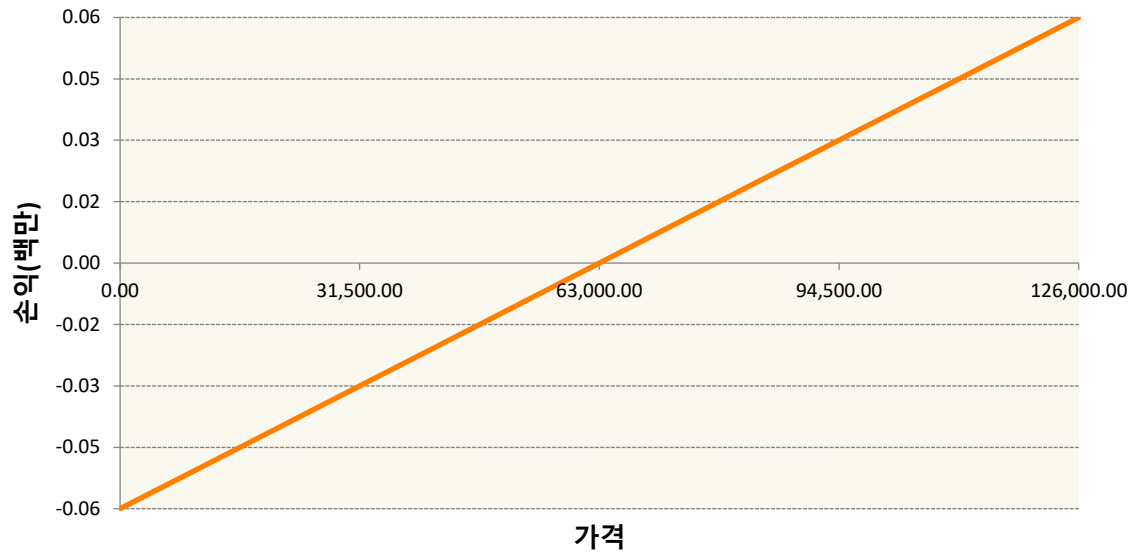
KR4111T10000-2023-01 삼성전자개별선물



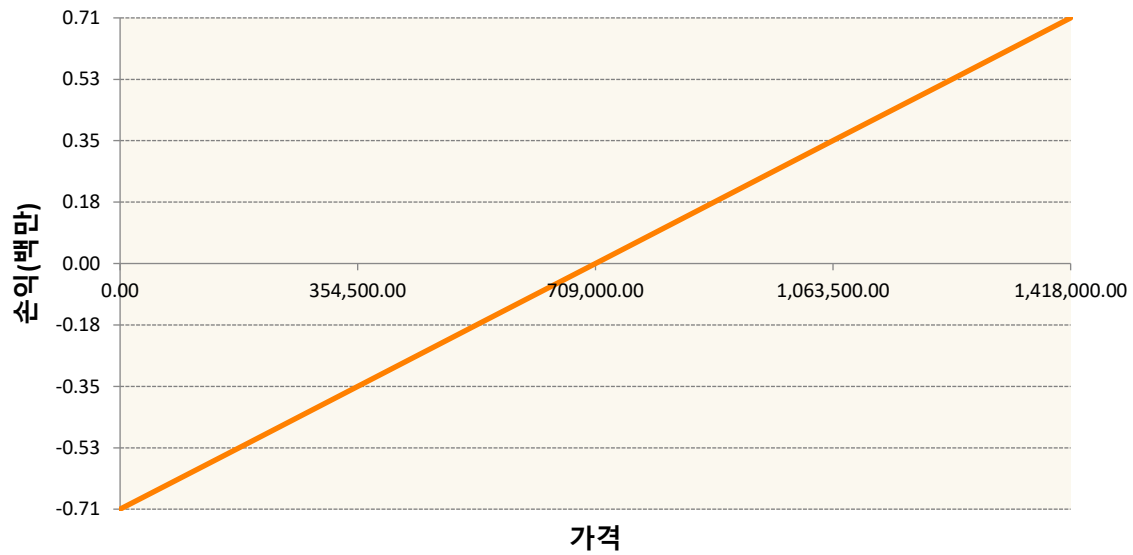
KR4116T10009-2023-01 현대차개별선물



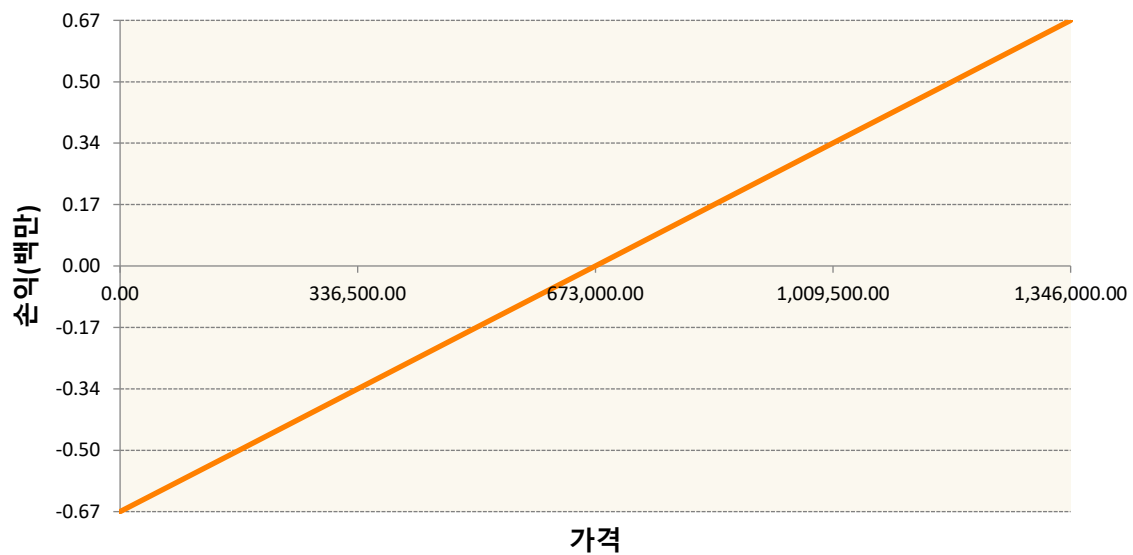
KR4119T10003-2023-01 기아개별선물



KR4122T10007-2023-01 삼성SDI개별선물



KR4147T10004-2023-01 LG화학개별선물



(단위:백만원)

KR4111T10000							2023-01 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	
KR4116T10009							2023-01 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%	-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%	4	4	4	4	4	4	4	4	
KR4119T10003							2023-01 기아개별선물		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	-2	
-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%	2	2	2	2	2	2	2	2	
KR4122T10007							2023-01 삼성SDI개별선물		11
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	4	4	4	4	4	4	4	4	
5.33%	8	8	8	8	8	8	8	8	
8.00%	11	11	11	11	11	11	11	11	
KR4147T10004							2023-01 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)

27

공시일 2022-12-08

기준일 2022-12-07

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

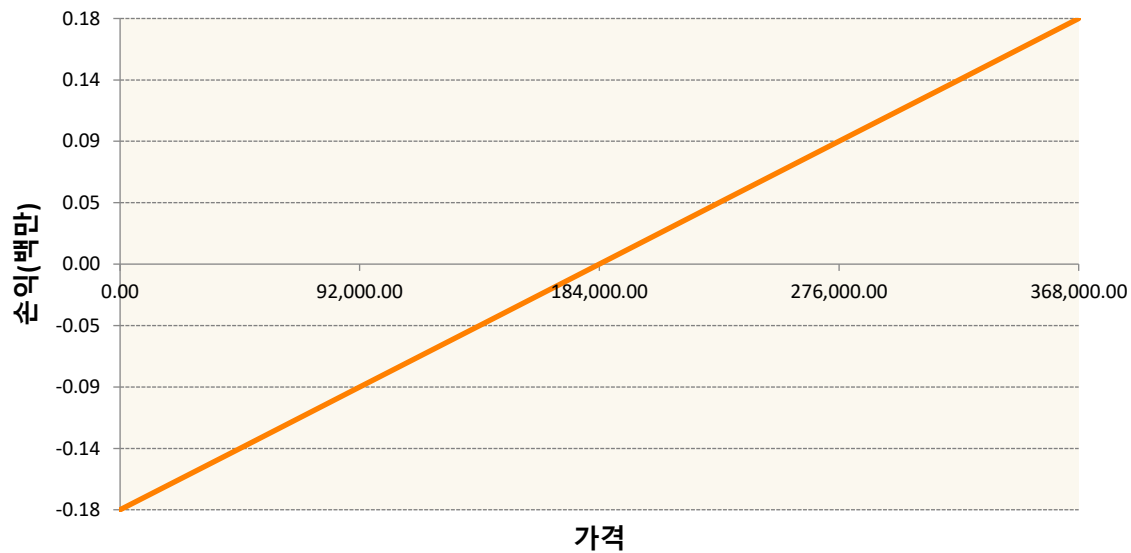
1. 계약금액

(단위:백만원)

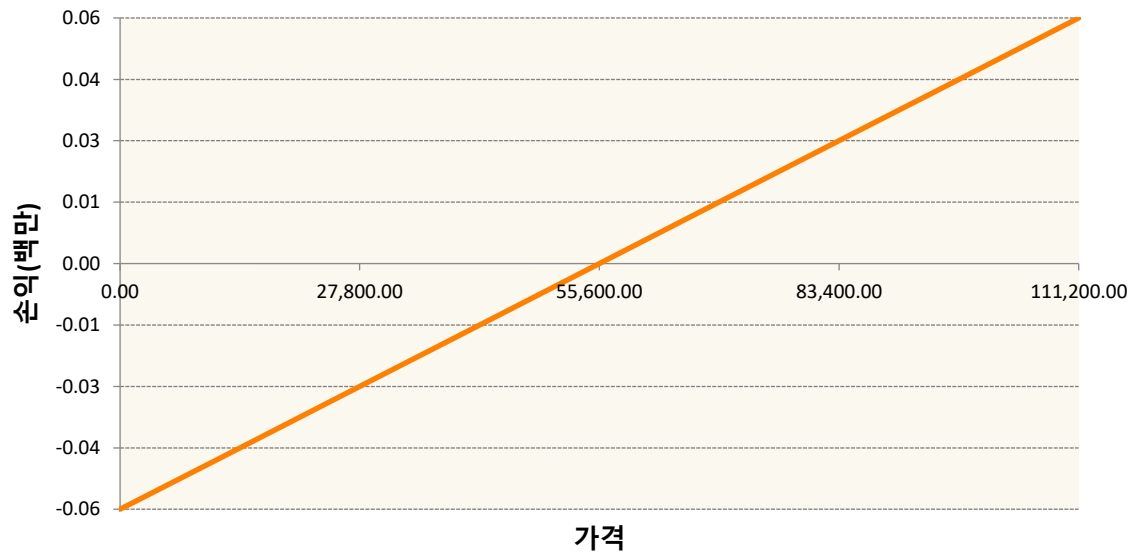
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	51	0	51	장내
누계	유가증권	선물	114	0	114	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156SC0003-2022-12 NAVER개별선물



KR41CFT10006-2023-01 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156SC0003		2022-12 NAVER개별선물					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
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-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%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR41CFT10006		2023-01 카카오개별선물					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

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

18

공시일	2022-12-08
기준일	2022-12-07

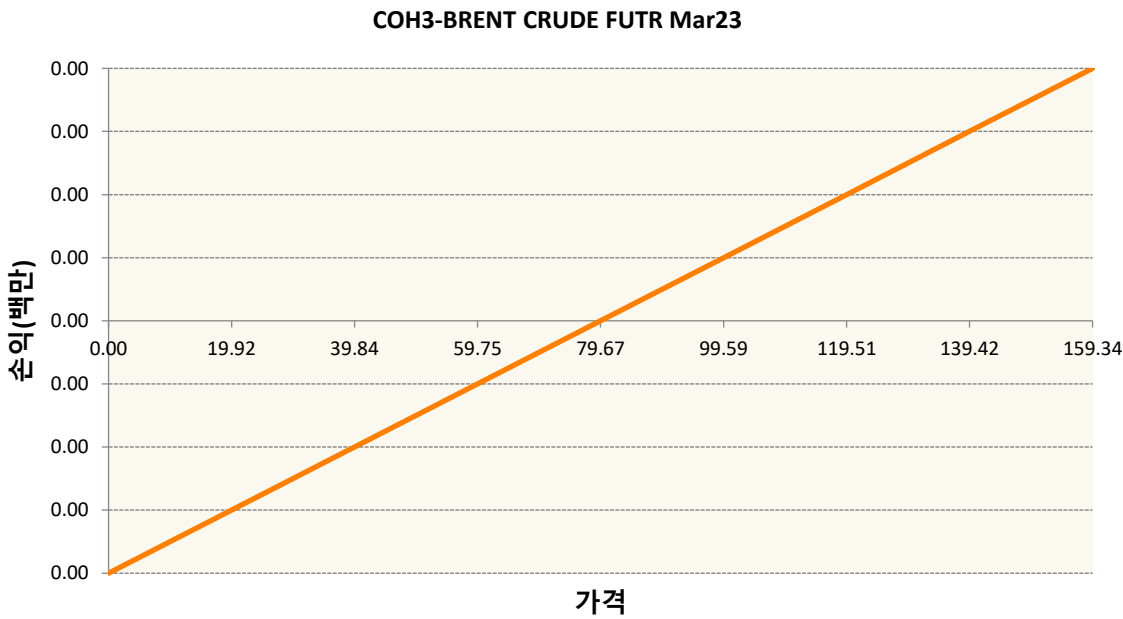
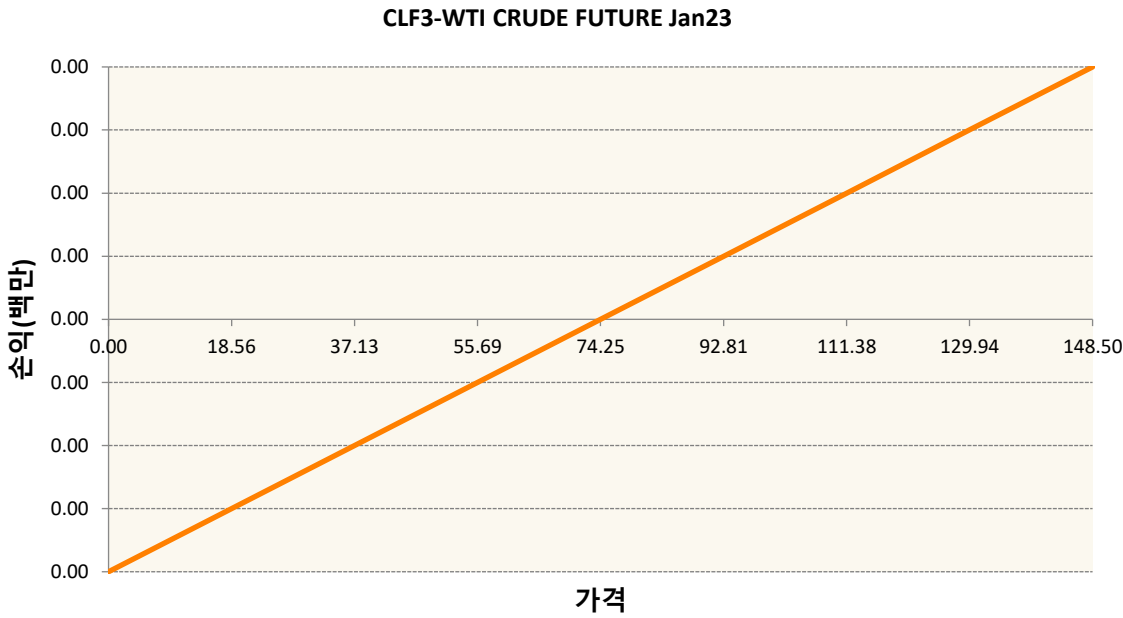
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

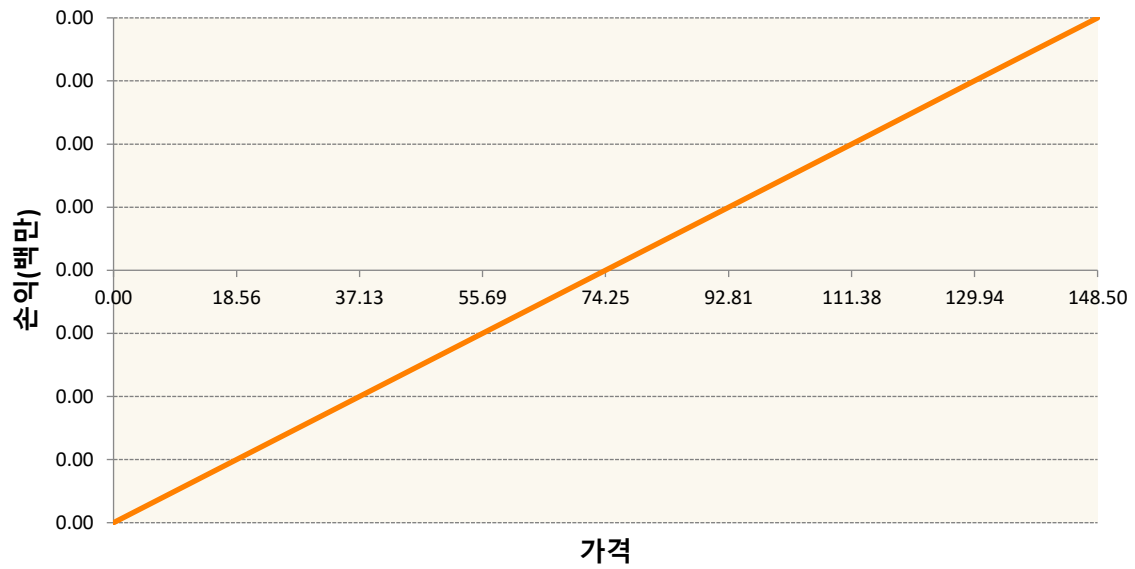
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	선물	유가증권	214	0	214	
누계	유가증권	선물	1,394	198	1,196	

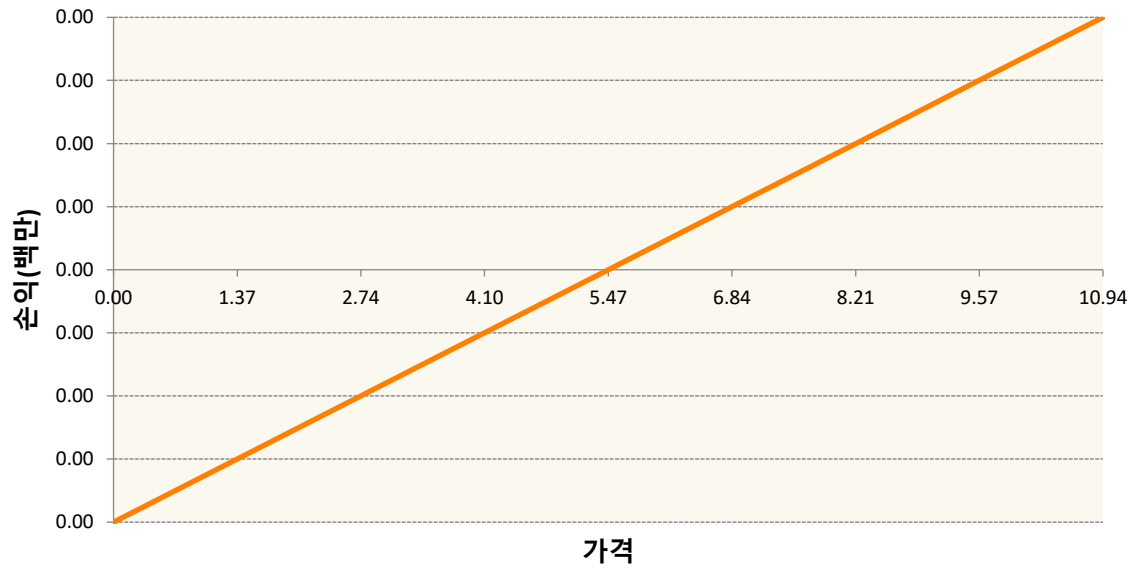
2. 만기시점의 손익구조



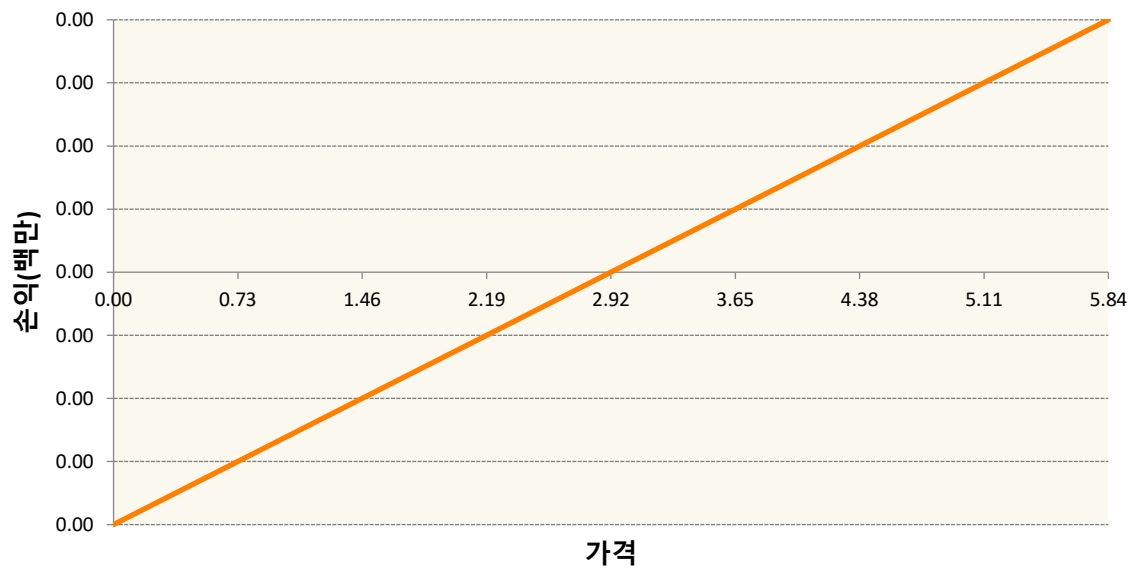
ECF3-E-mini Crude Oil Jan23



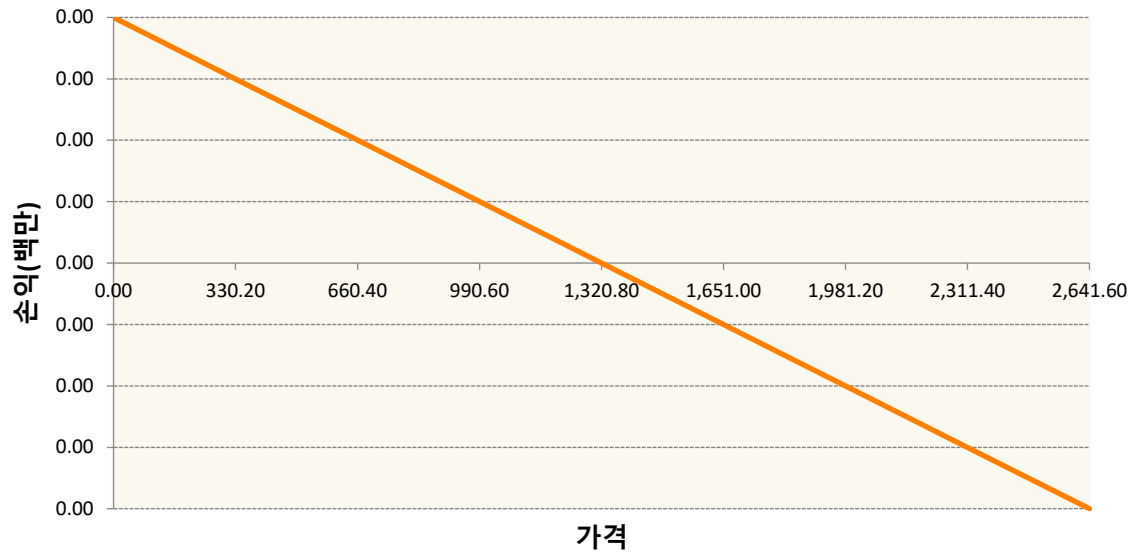
EOF3-E-MINI NATURAL GAS Jan23



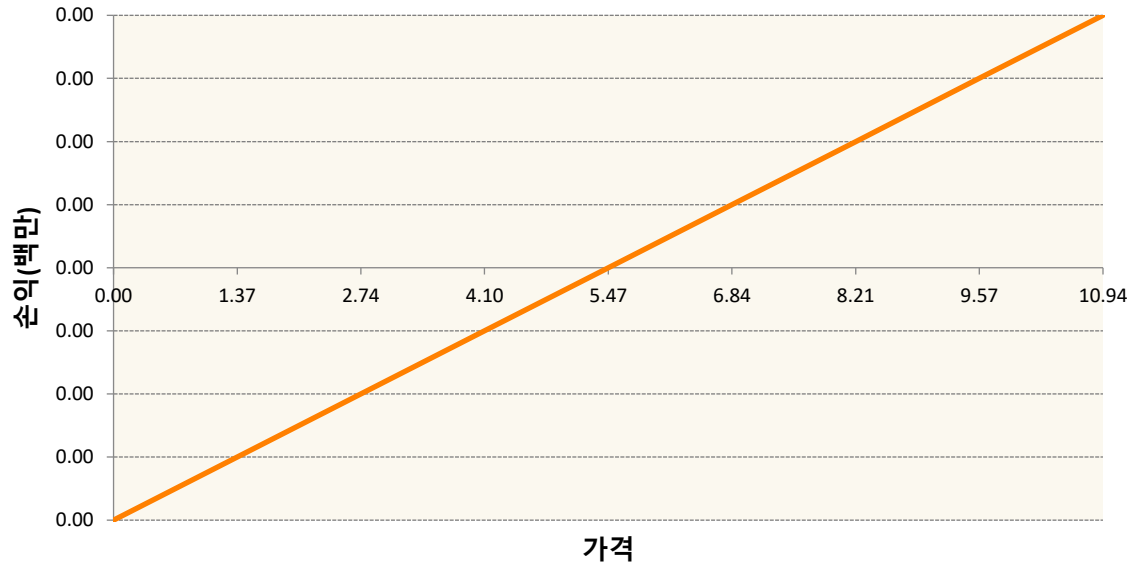
HOF3-NY Harb ULSD Fut Jan23



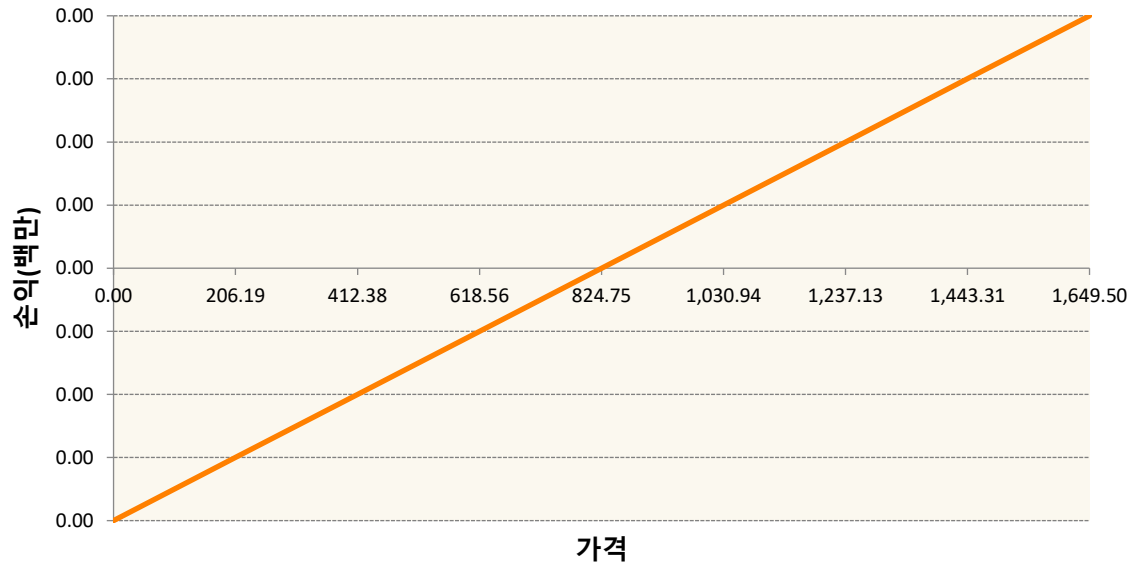
KR4175SC0000-2022-12 달러선물

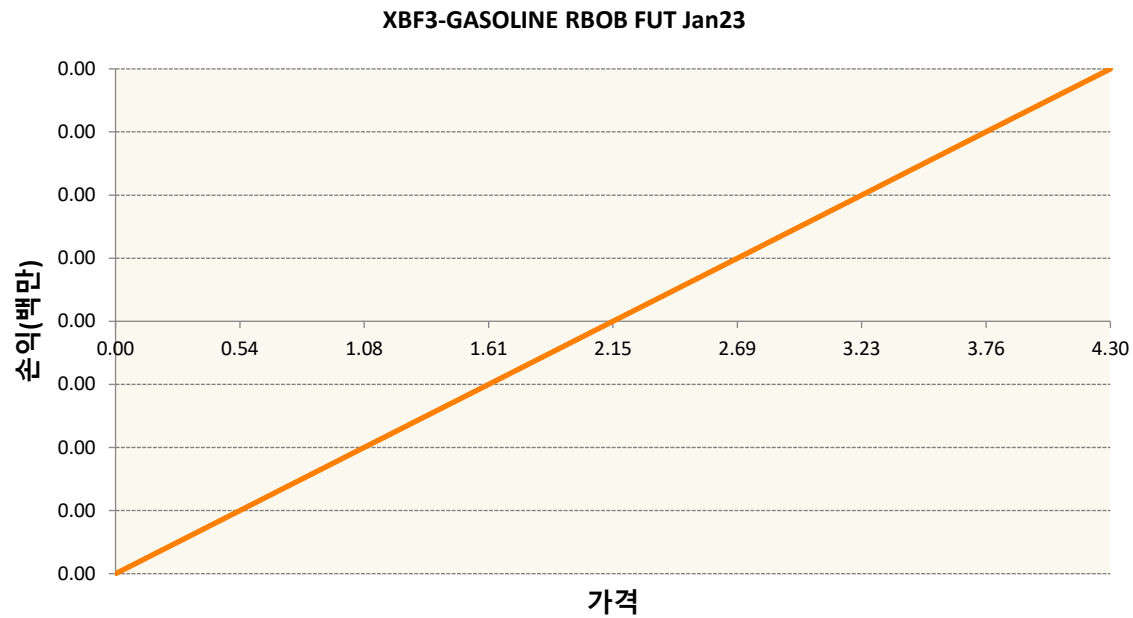


NGF23-NATURAL GAS FUTR Jan23



QSF3-Low Su Gasoil G Jan23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLF3	WTI CRUDE FUTURE Jan23	17
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	25
ECF3	E-mini Crude Oil Jan23	8
EOF3	E-MINI NATURAL GAS Jan23	6
HOF3	NY Harb ULSD Fut Jan23	14
KR4175SC00 2022-12 달러선물		16
NGF23	NATURAL GAS FUTR Jan23	38
QSF3	Low Su Gasoil G Jan23	10
XBF3	GASOLINE RBOB FUT Jan23	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	423