

공시일 2022-12-19
기준일 2022-12-16

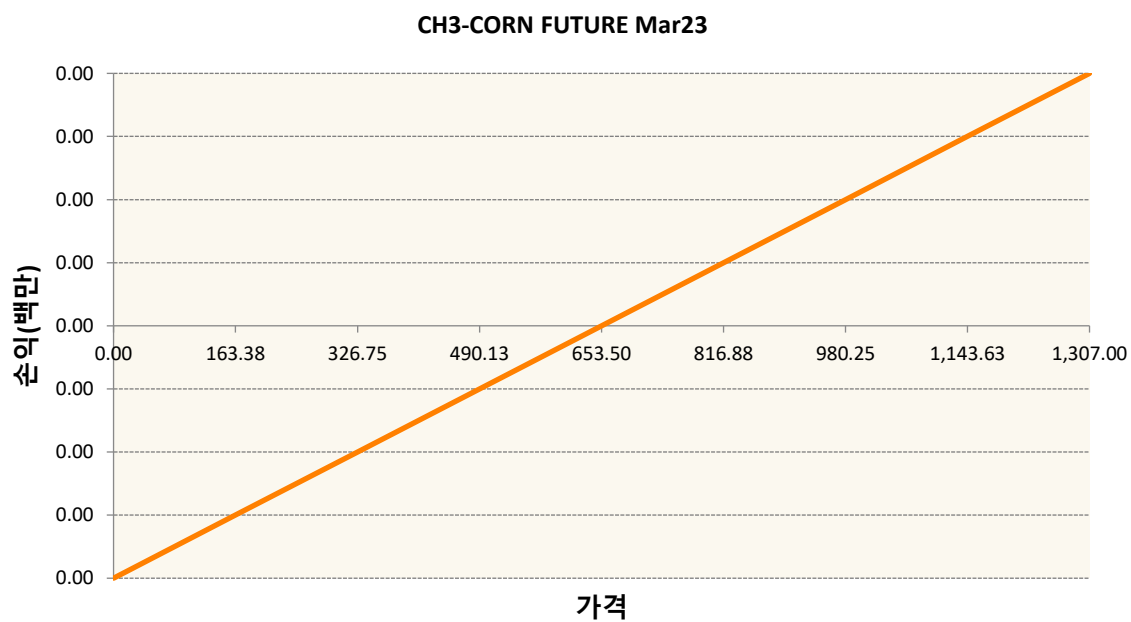
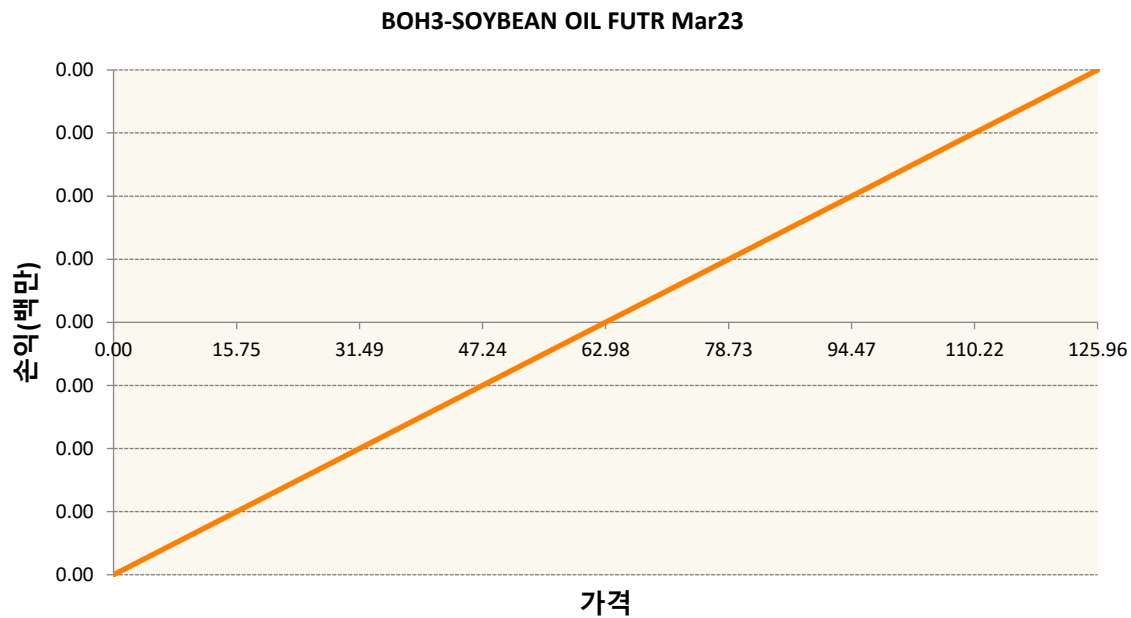
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

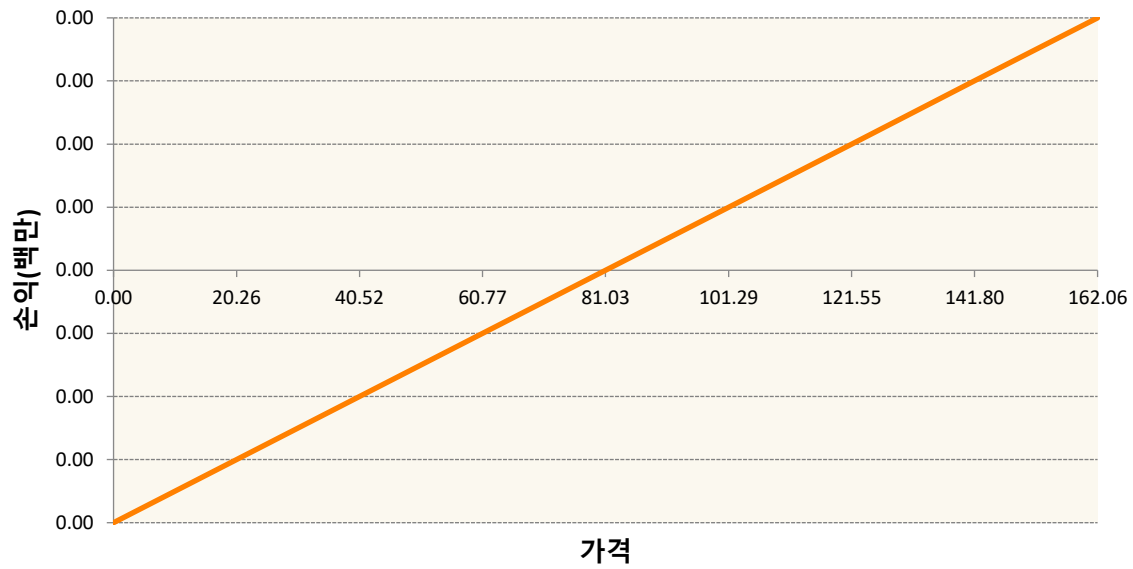
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,338	783	5,555	

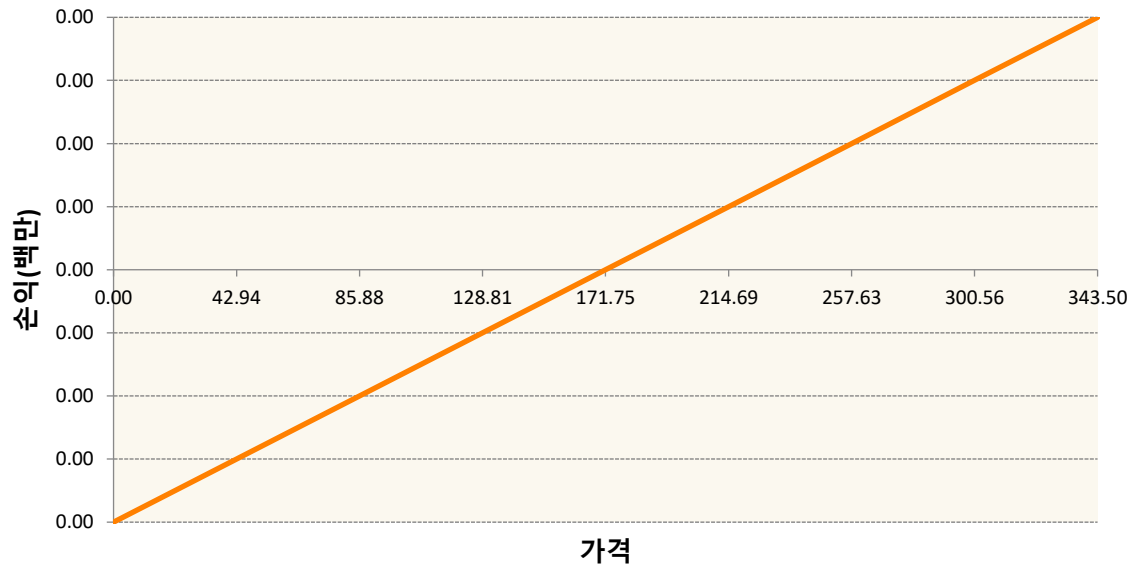
2. 만기시점의 손익구조



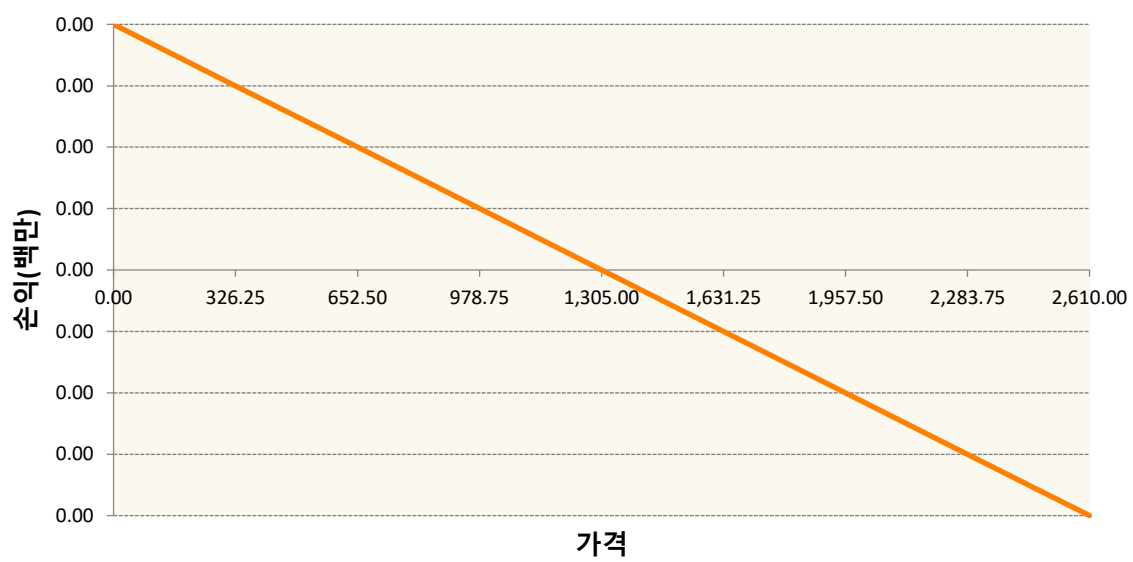
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



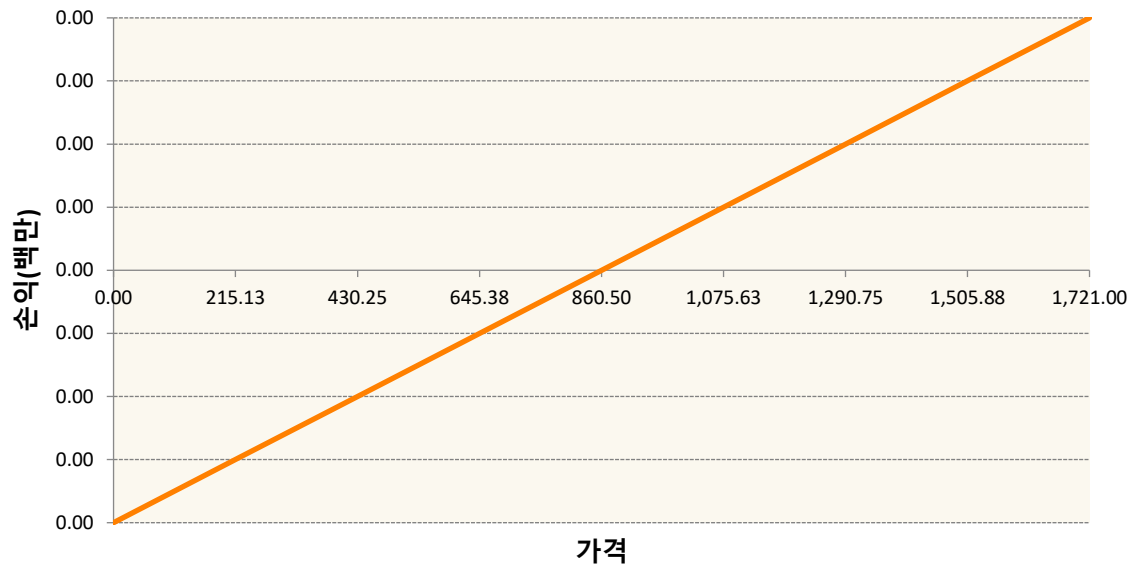
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



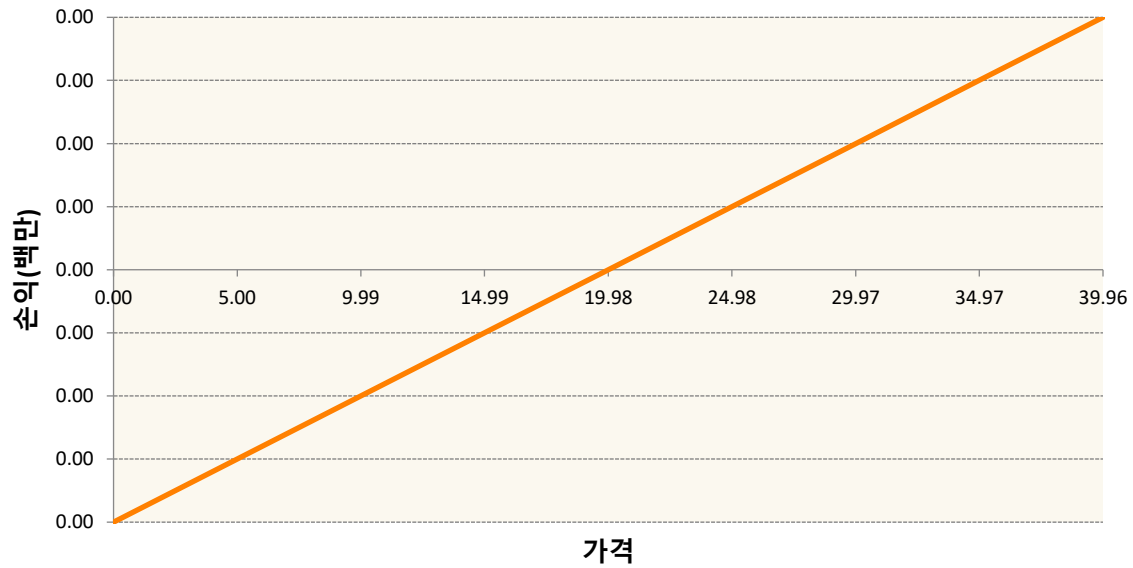
KR4175T10005-2023-01 달러선물



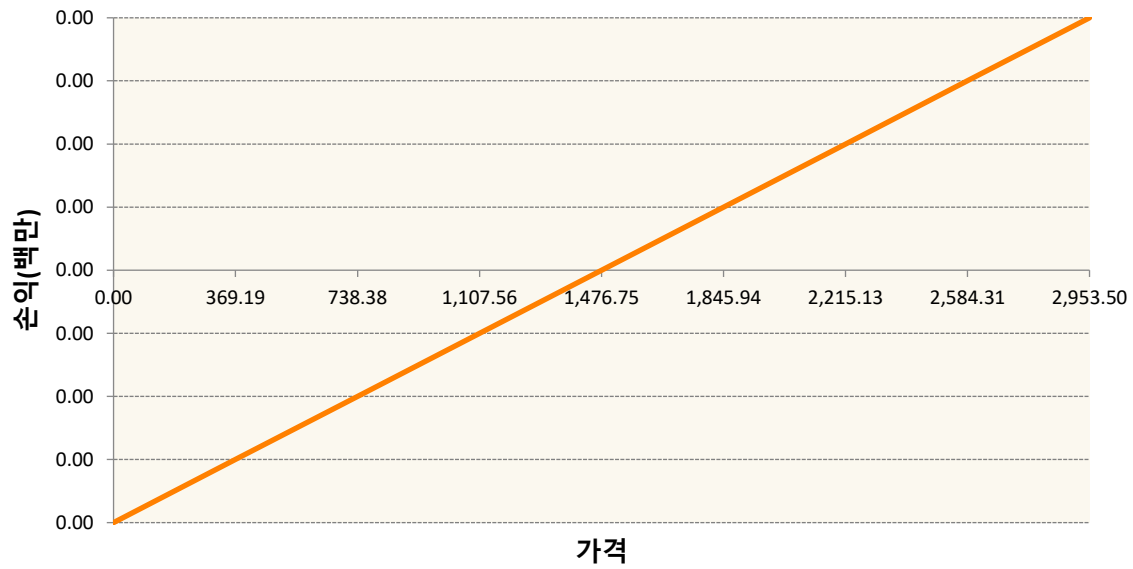
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



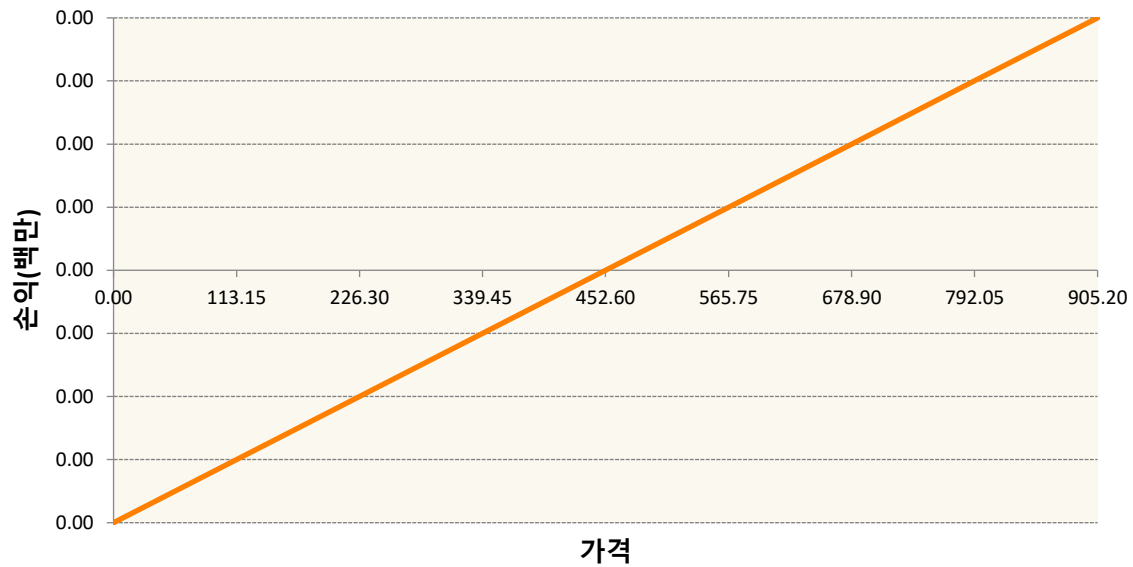
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



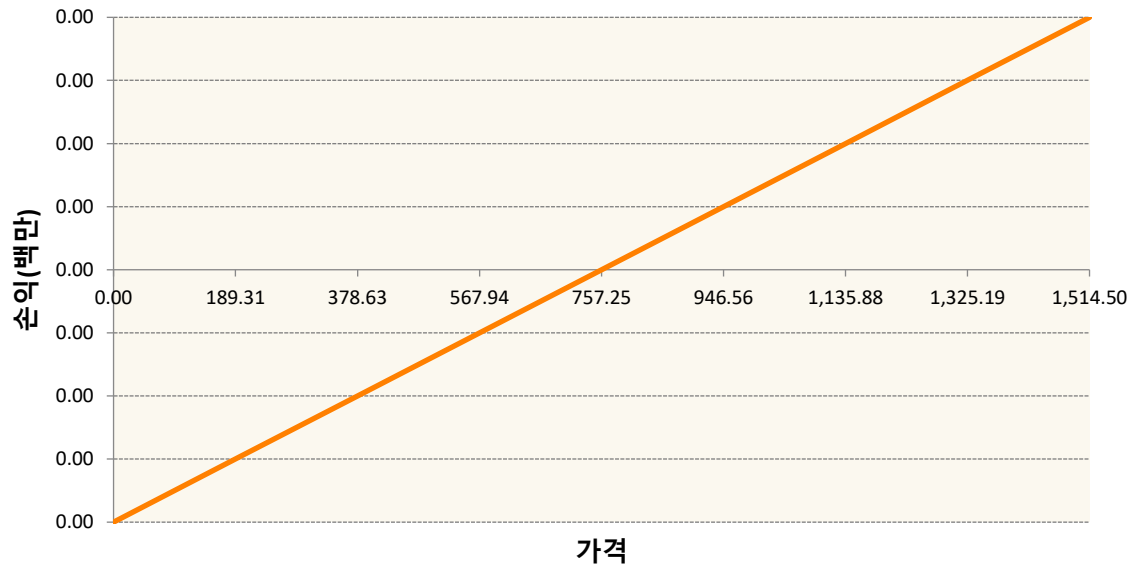
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



SMH3-SOYBEAN MEAL FUTR Mar23



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	2022-12-19
기준일	2022-12-16

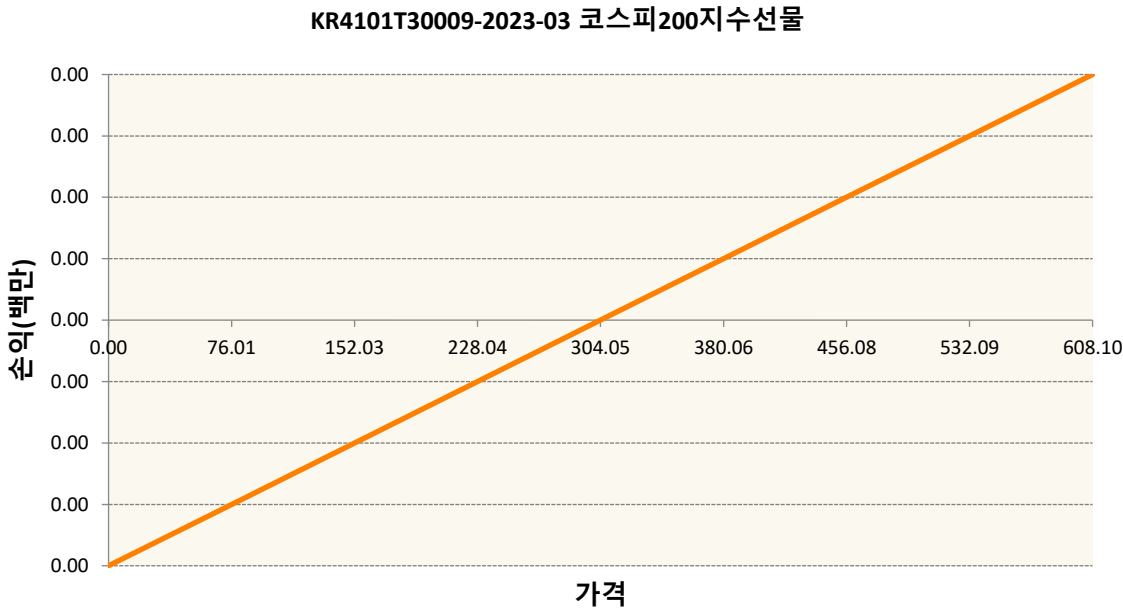
스마트인덱스모

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	1,900	0	1,900	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				154
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
-5.33%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102
-2.67%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	51	51	51	51	51	51	51
5.33%	102	102	102	102	102	102	102
8.00%	154	154	154	154	154	154	154

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

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	4,420	0	4,420	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래220311

348

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

486

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

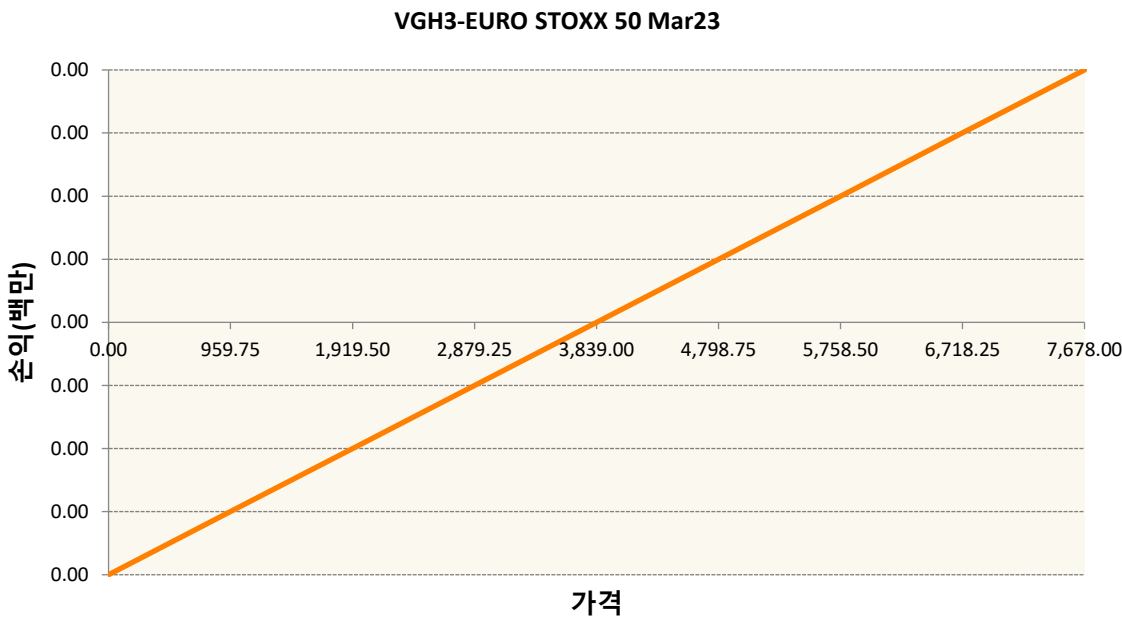
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	480	0	480	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH3	EURO STOXX 50 Mar23	38
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

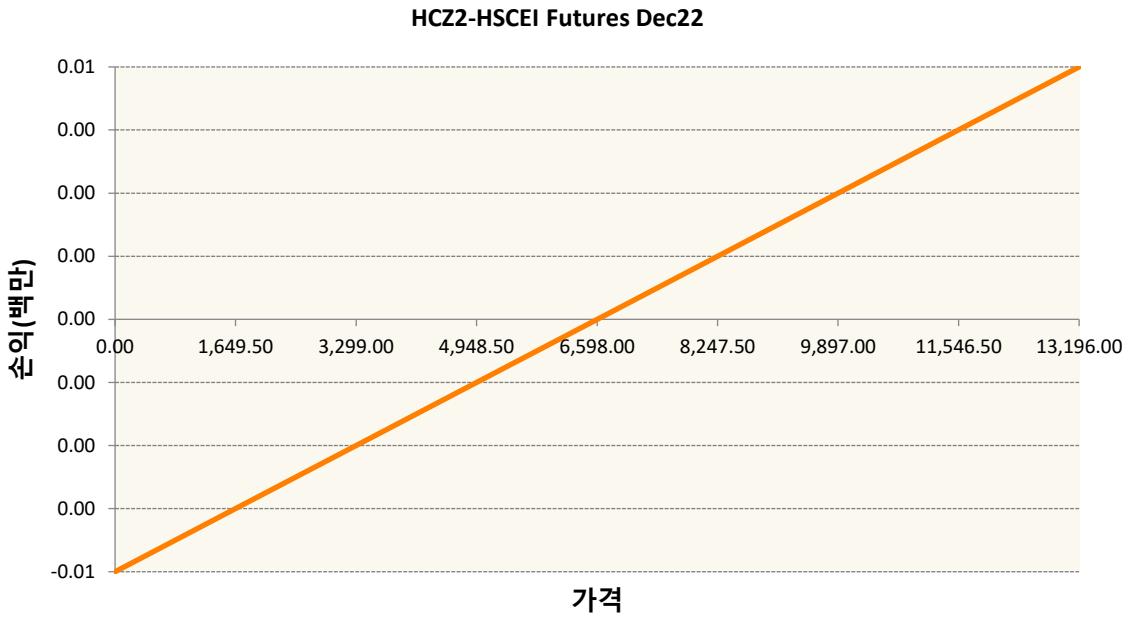
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,342	0	1,342	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ2	HSCEI Futures Dec22	107
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

145

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

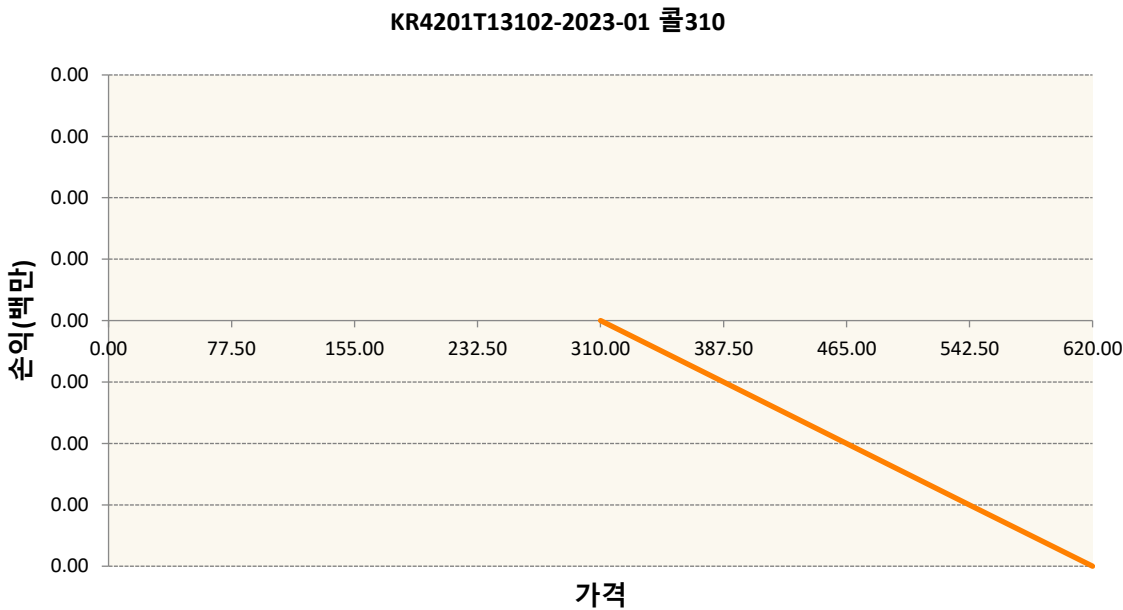
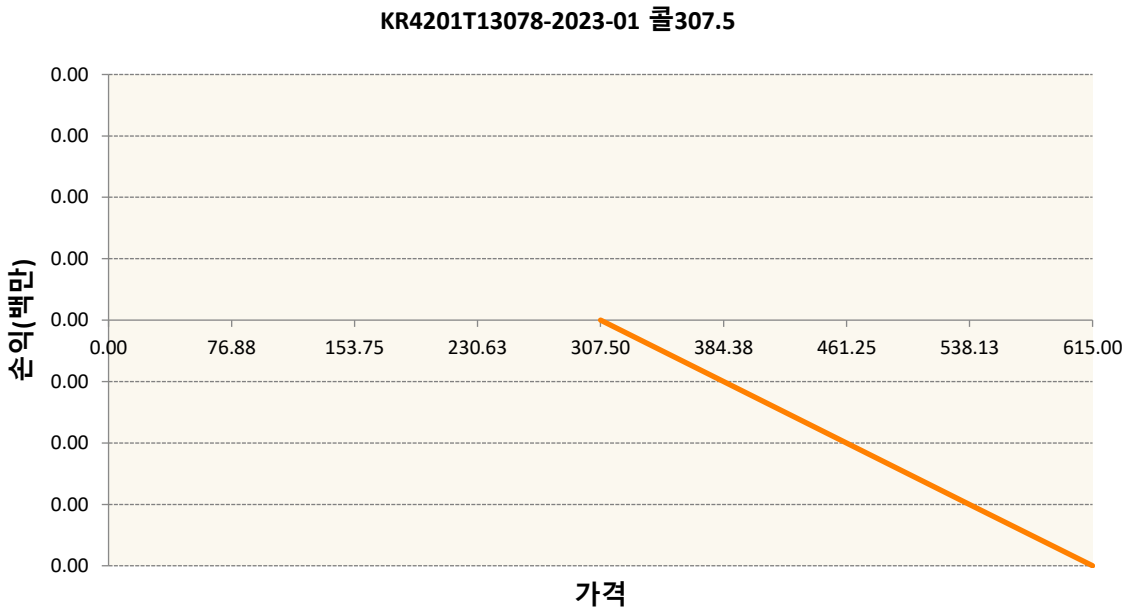
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

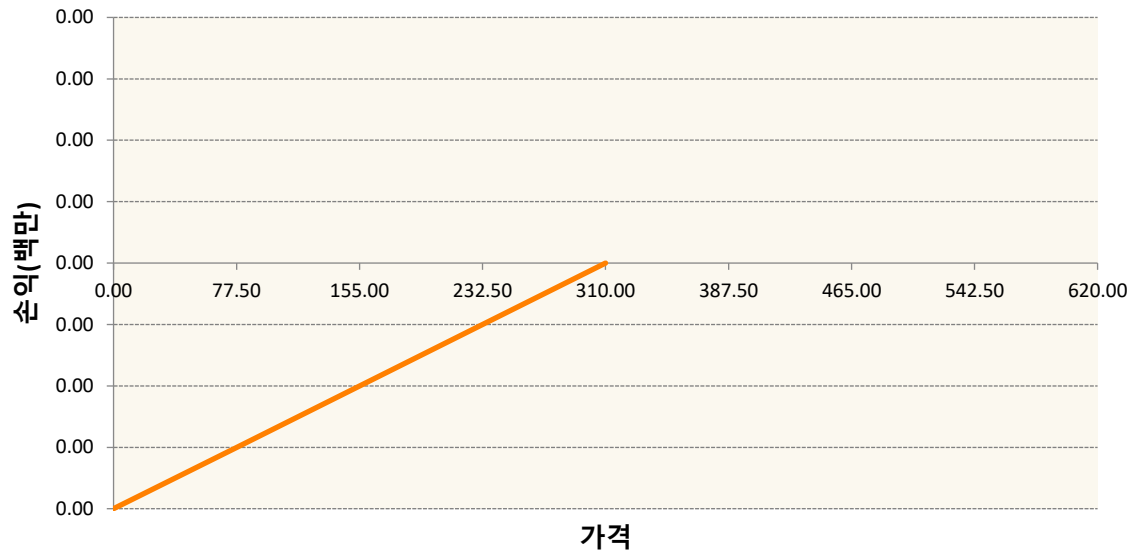
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	54,329	-54,329	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T13100-2023-01 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T13078				2023-01 콜307.5			2,405
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,639	1,515	1,385	1,250	1,111	968	823
-5.33%	1,365	1,217	1,066	912	757	599	441
-2.67%	992	828	662	496	329	162	-5
0%	515	344	172	0	-172	-343	-515
2.67%	-66	-234	-404	-574	-745	-916	-1,087
5.33%	-743	-899	-1,059	-1,221	-1,386	-1,552	-1,719
8.00%	-1,504	-1,642	-1,786	-1,936	-2,089	-2,246	-2,405
KR4201T13102				2023-01 콜310			410
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	271	251	229	206	183	158	133
-5.33%	228	203	177	151	124	97	70
-2.67%	168	140	111	82	54	25	-4
0%	90	60	30	0	-30	-60	-90
2.67%	-6	-36	-66	-96	-126	-156	-187
5.33%	-119	-147	-176	-205	-234	-264	-294
8.00%	-247	-273	-299	-326	-354	-382	-410
KR4301T13100				2023-01 풋310			578
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-377	-407	-438	-472	-506	-542	-578
-5.33%	-182	-219	-256	-295	-334	-373	-413
-2.67%	-12	-53	-95	-137	-179	-222	-264
0%	132	88	44	0	-44	-88	-132

2.67%	249	205	161	117	73	29	-16
5.33%	342	300	258	215	172	129	86
8.00%	412	374	336	296	255	214	172

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

2,763

공시일 2022-12-19

기준일 2022-12-16

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

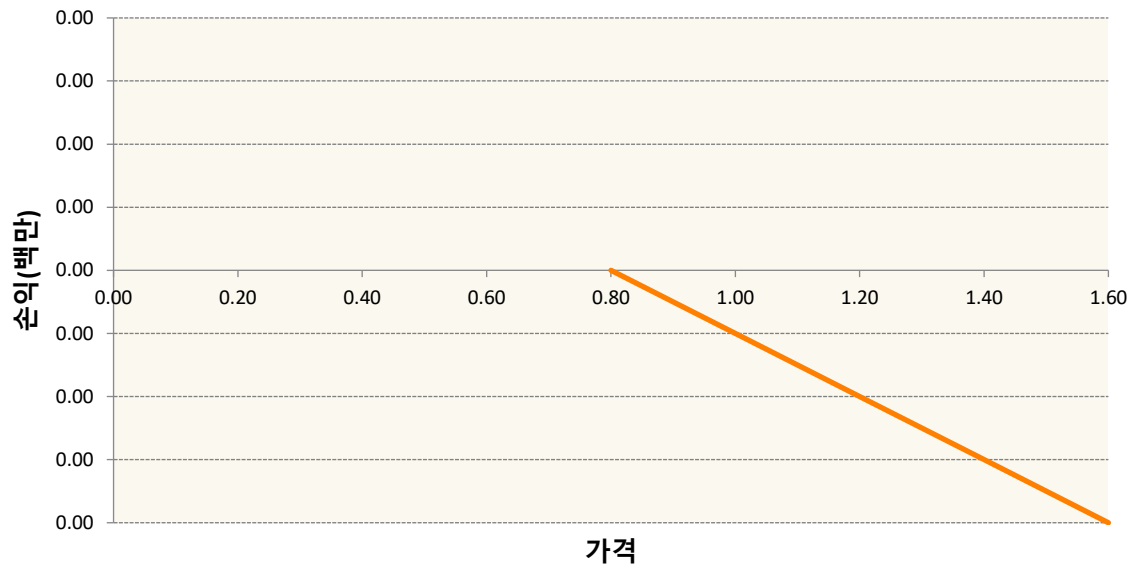
1. 계약금액

(단위:백만원)

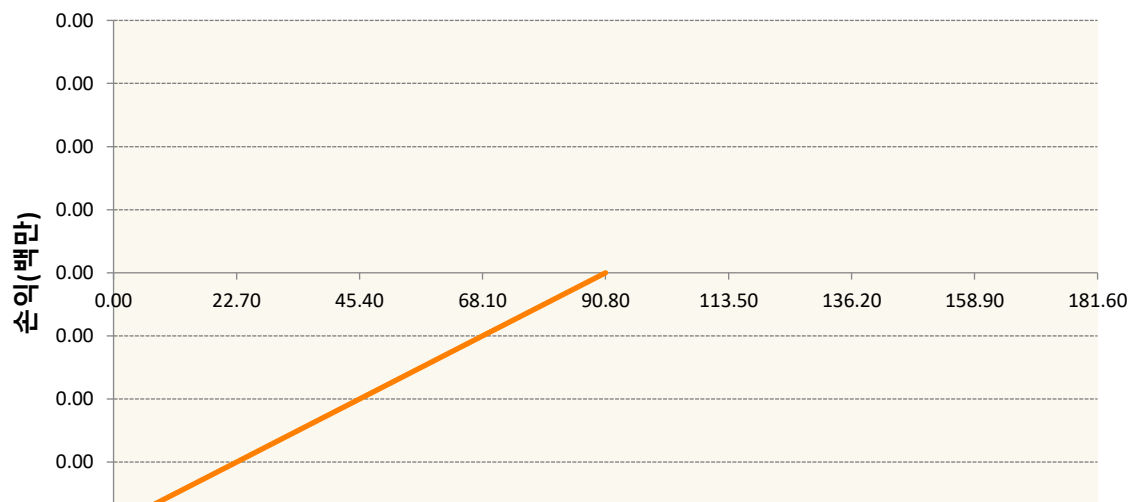
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,066	0	1,066	
누계	유가증권	옵션	0	48	-48	장내
누계	통화	선도	139	2,295	-2,156	장외

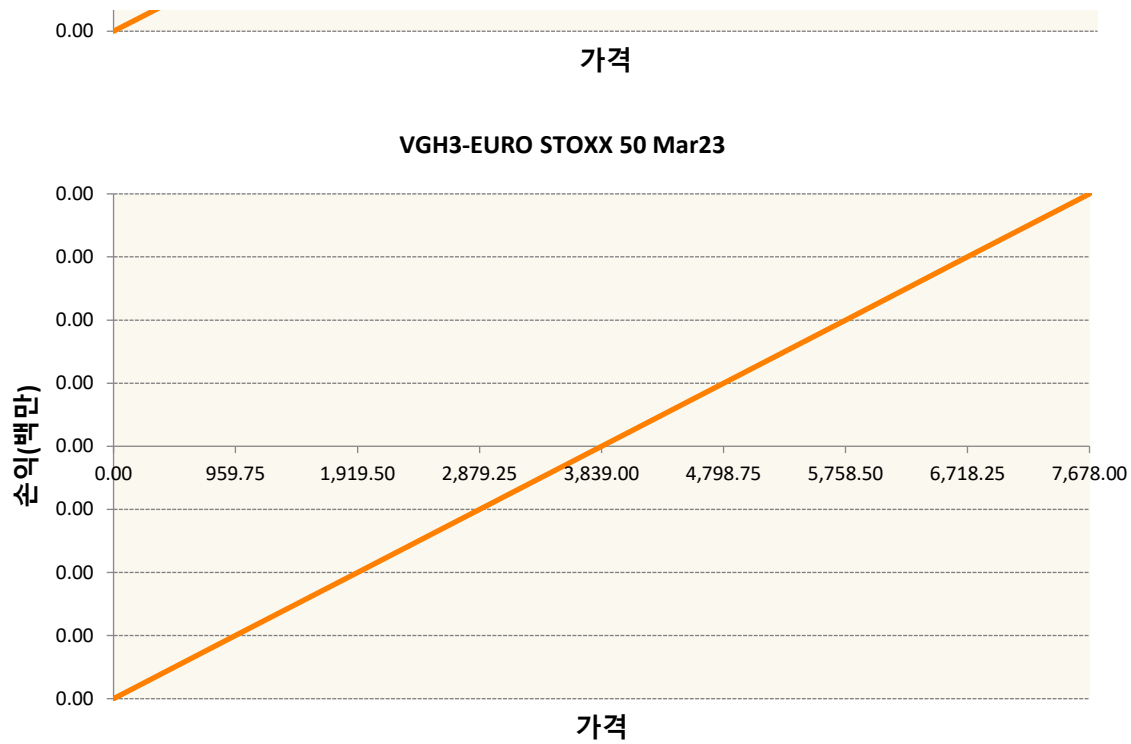
2. 만기시점의 손익구조

OESXZ2-C3925-EURO STOXX 50



OESXZ2-P3925-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E	56
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E	56
FXW213CBG KRW/EUR 24-02-23E	72
FXW213CBN EUR/KRW 24-02-23E	11
OESXZ2-C39 EURO STOXX 50	0.04
OESXZ2-P39 EURO STOXX 50	4
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23	85

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

(단위:백만원)

238

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

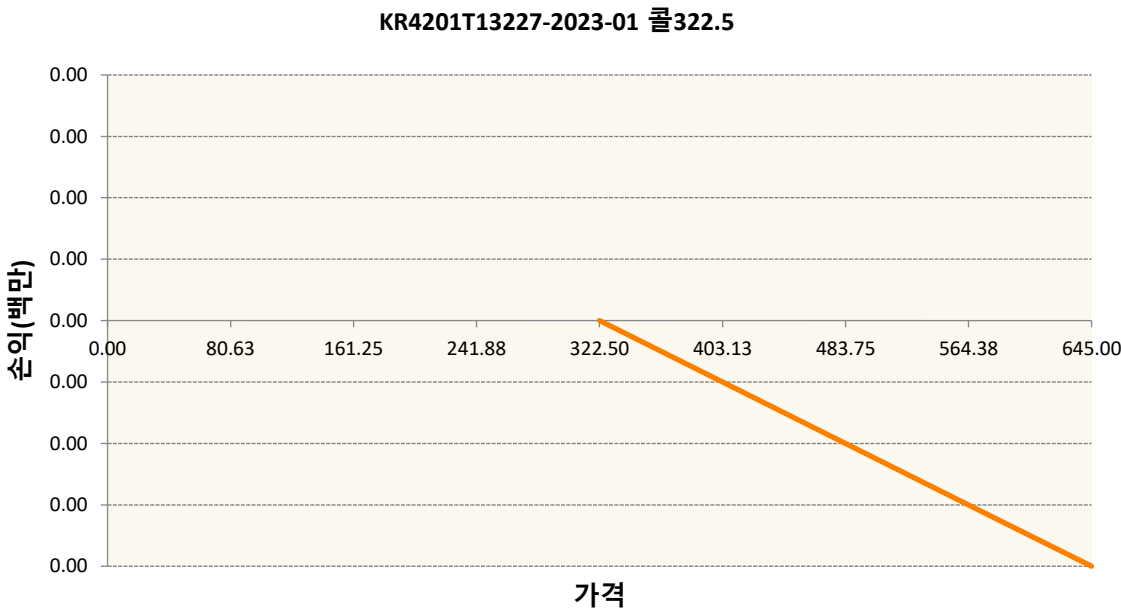
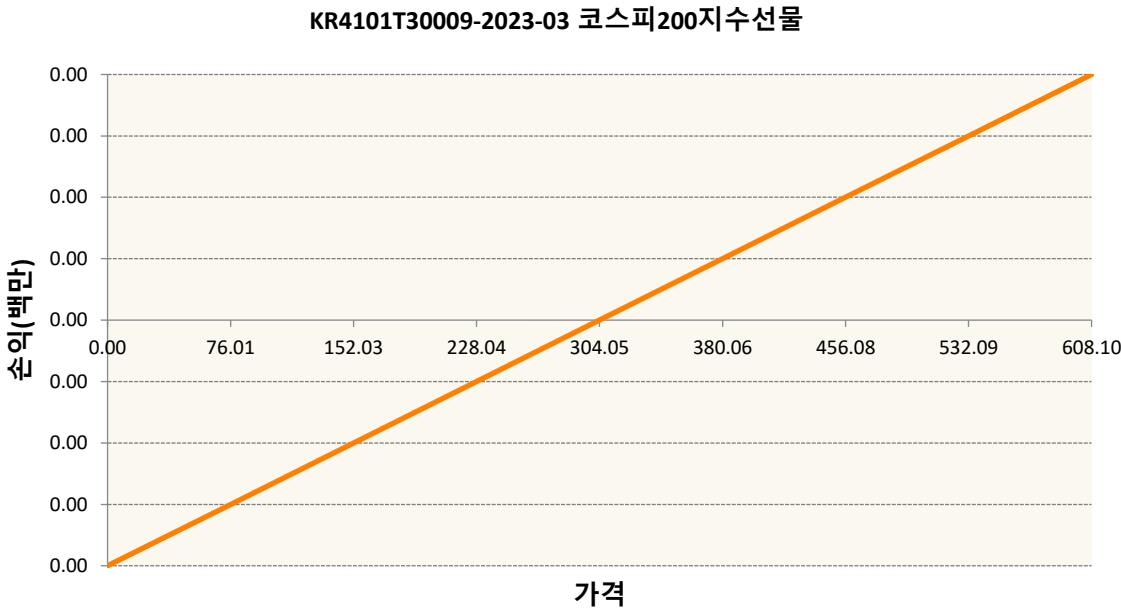
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	380	0	380	장내
누계	유가증권	옵션	78	3,803	-3,726	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 650.00 with major ticks every 81.25 units. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A blue line starts at the point (325.00, 0.00) and extends to the point (650.00, 0.00), indicating that profit/loss is zero at these price points.

The graph illustrates the relationship between price (가격) and profit (이익). The x-axis (가격) ranges from 0.00 to 620.00, and the y-axis (이익) ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at (0, 0) and ends at (310, 0), indicating that profit is zero for all prices in this range.

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 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
KR4201T13227		2023-01 콜322.5					105
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	54	49	44	38	32	26
-5.33%	51	45	39	33	26	19	12
-2.67%	40	33	26	18	11	3	-5
0%	25	17	8	0	-8	-17	-26
2.67%	5	-4	-13	-22	-31	-40	-49
5.33%	-21	-30	-39	-48	-57	-66	-75
8.00%	-51	-60	-69	-78	-87	-96	-105
KR4201T13250 2023-01 콜325							90

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	48	44	41	36	31	26	21
-5.33%	42	38	33	27	21	15	9
-2.67%	34	28	22	15	8	2	-5
0%	21	14	7	0	-7	-15	-22
2.67%	5	-3	-11	-18	-26	-34	-42
5.33%	-16	-24	-32	-40	-48	-56	-64
8.00%	-41	-49	-57	-65	-73	-81	-90

KR4301T13100 2023-01 풋310							5
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	4	4	4	5
-5.33%	1	2	2	2	3	3	3
-2.67%	0	0	1	1	1	2	2
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-1	-1	-1	0	0
5.33%	-3	-2	-2	-2	-1	-1	-1
8.00%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-1

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

(단위:백만원)

180

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	87	-87	
누계	유가증권	수익증권	6,826	0	6,826	

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	2022-12-19
기준일	2022-12-16

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	93	-93	
누계	유가증권	수익증권	5,810	0	5,810	

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	2022-12-19
기준일	2022-12-16

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	19,153	0	19,153	
누계	통화	선도	0	18,439	-18,439	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	486
FXW213CAR(KRW/USD 30-01-23E	270
FXW213CBQ(KRW/USD 28-02-23E	667
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	2022-12-19
기준일	2022-12-16

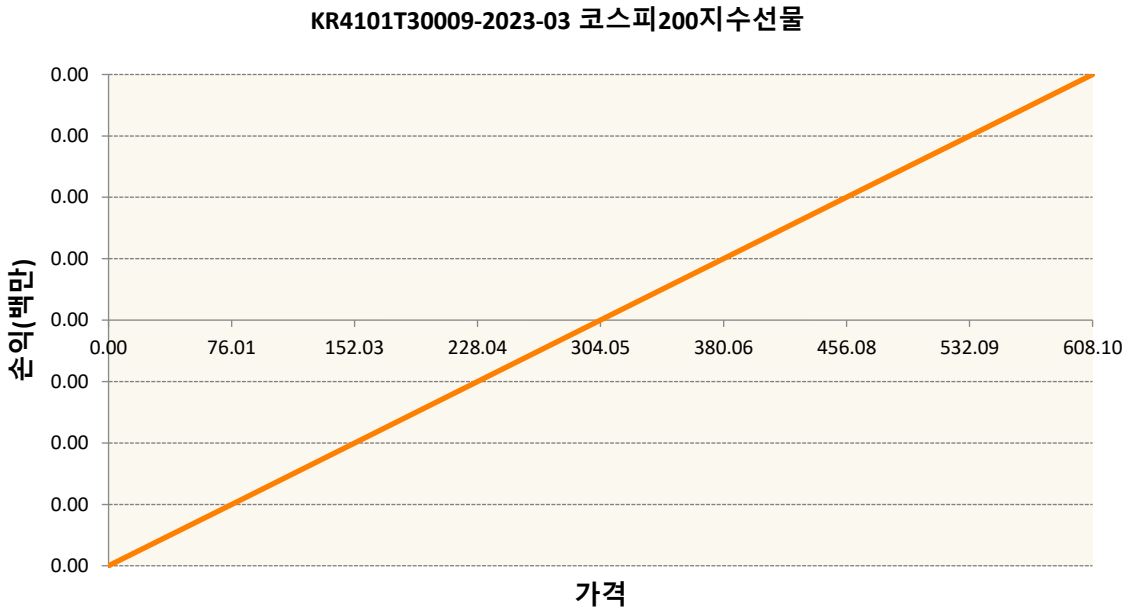
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	760	0	760	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				61
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	61	61	61	61	61	61	61

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

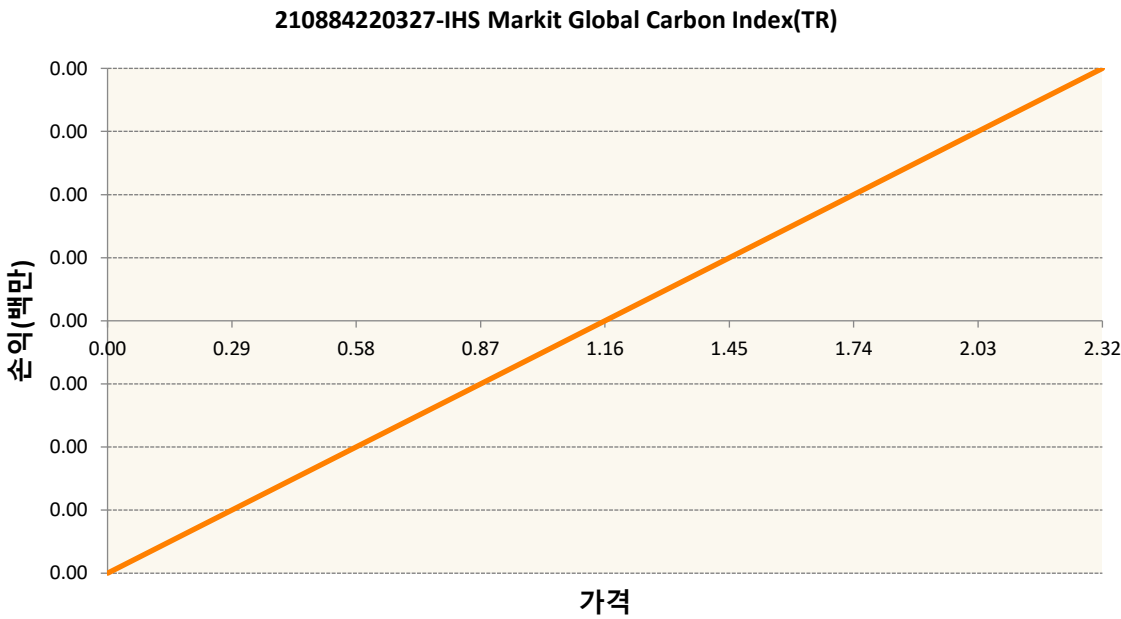
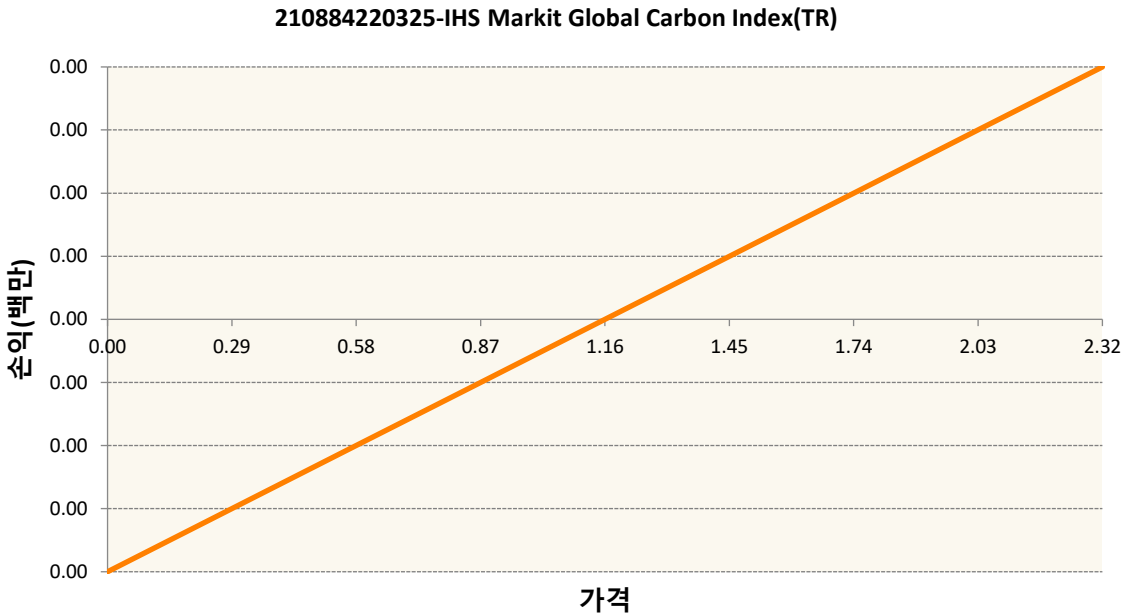
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

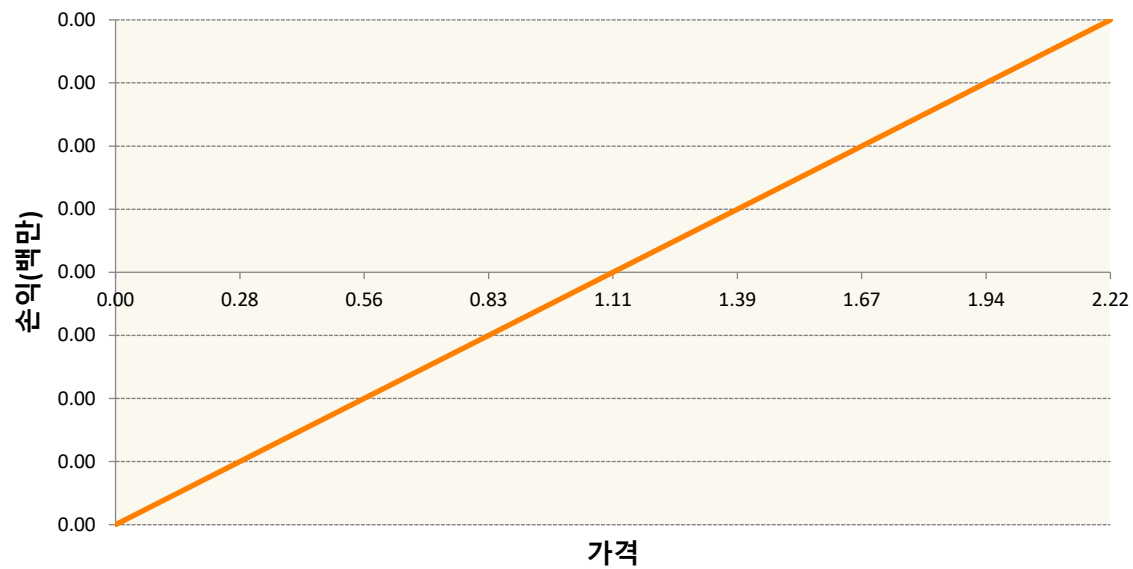
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	31,277	0	31,277	

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)

201

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

101

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

2,205

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

(단위:백만원)

4,812

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

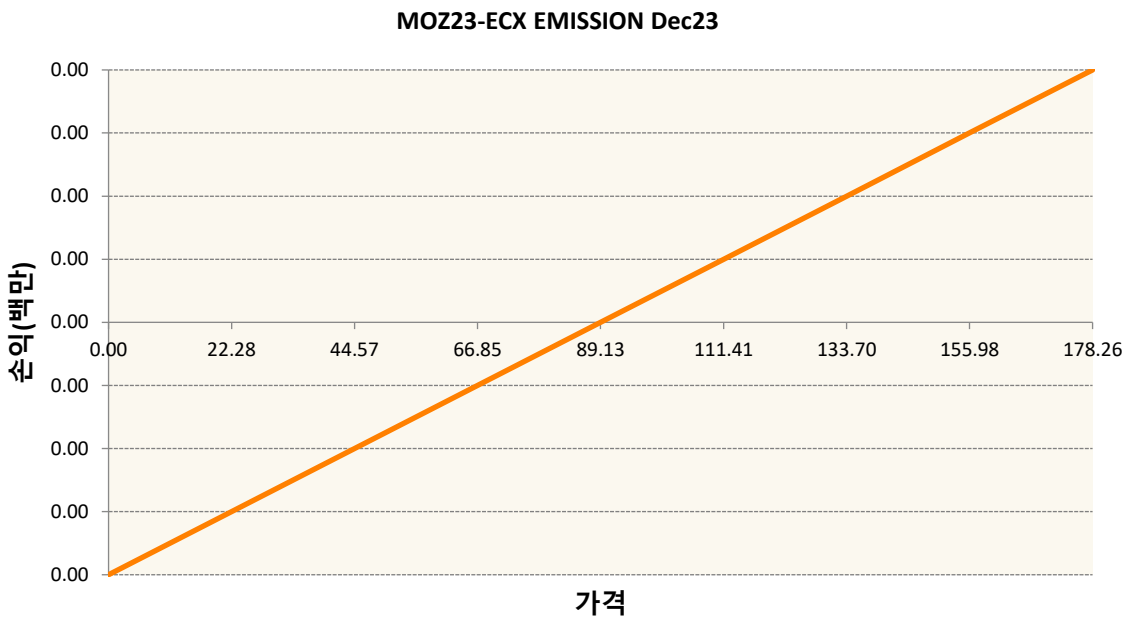
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,347	0	13,347	
누계	통화	선도	0	6,505	-6,505	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CBP(KRW/EUR 23-12-22E	365
FXW213CC1(KRW/EUR 23-12-22E	156
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,068

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

(단위:백만원)

3,127

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

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)	37
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	37
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	37
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	37

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

(단위:백만원)

284

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

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	8,926	0	8,926	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)	0.08
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	0.09
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	0.08
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	0.11

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

(단위:백만원)

0

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

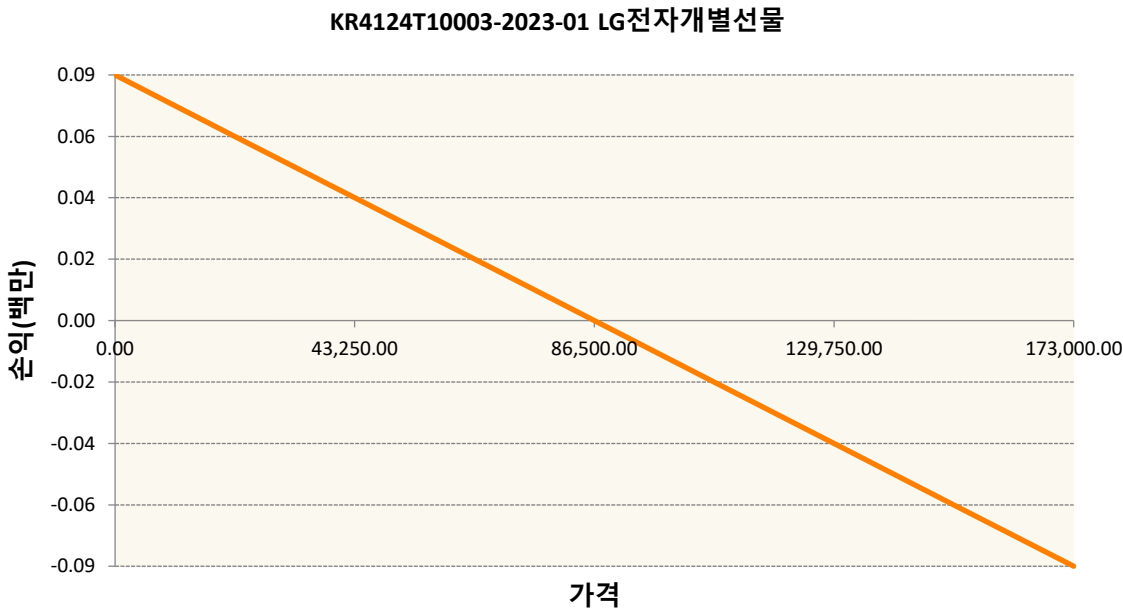
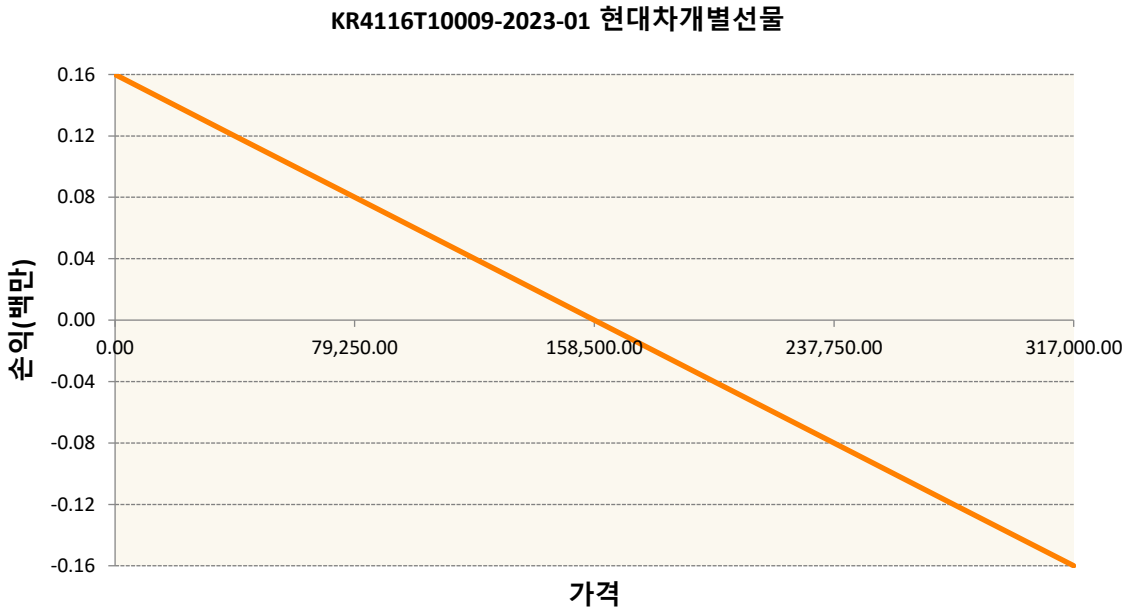
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

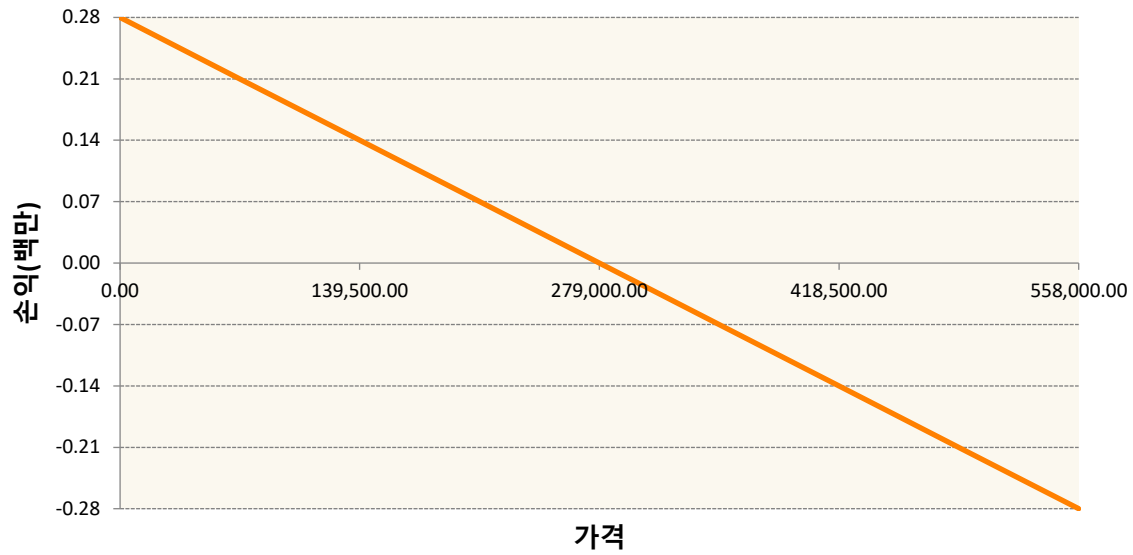
(단위:백만원)

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	0	837	-837	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

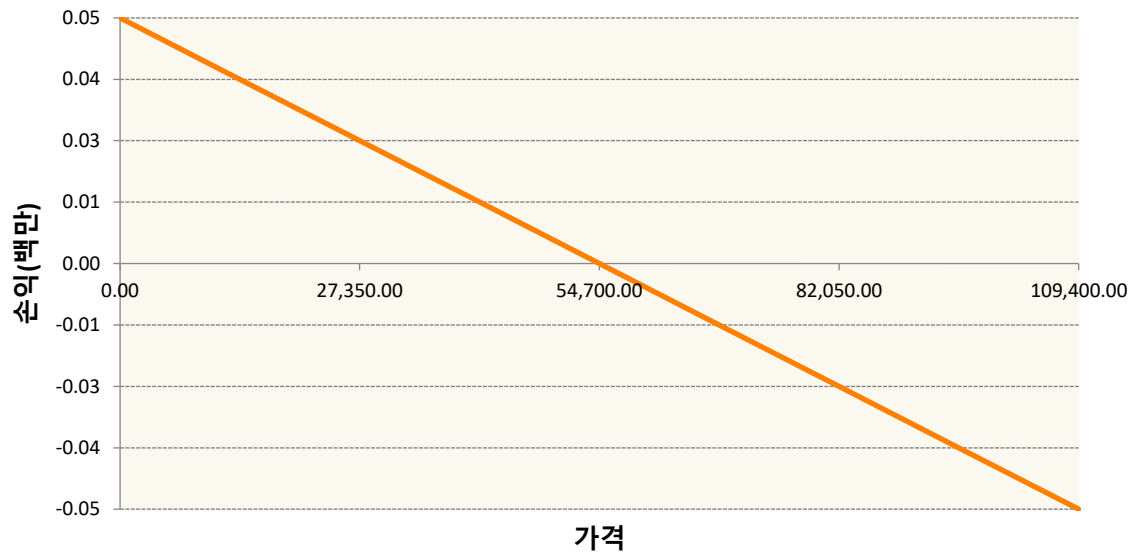
2. 만기시점의 손익구조



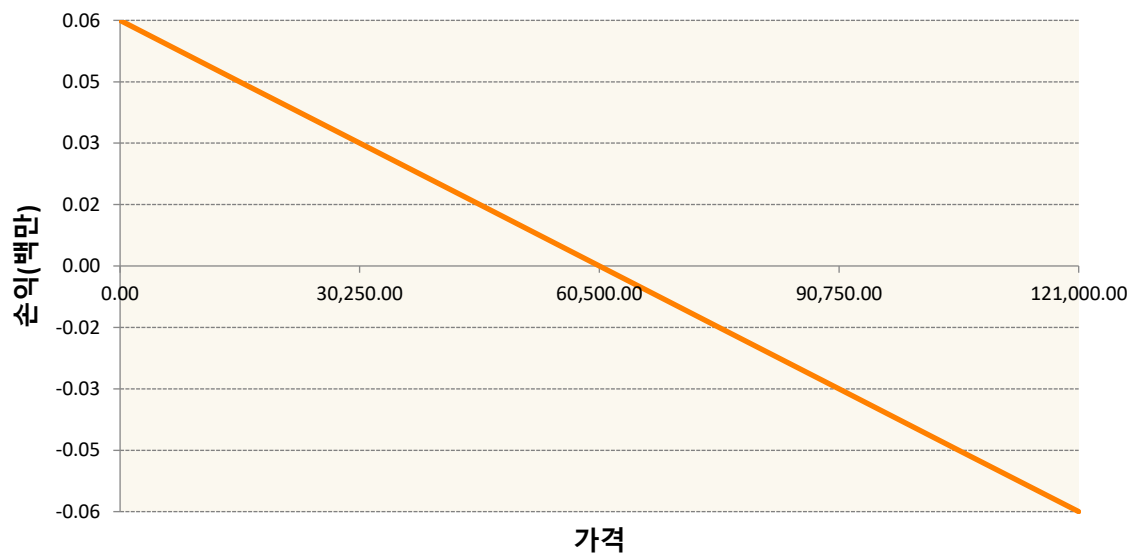
KR41BYT10009-2023-01 LG이노텍개별선물



KR41CFT10006-2023-01 카카오개별선물



KR41F7T10002-2023-01 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4116T100 2023-01 현대차개별선물		8
KR4124T100 2023-01 LG전자개별선물		20
KR41BYT100 2023-01 LG이노텍개별선물		11
KR41CFT100 2023-01 카카오개별선물		18
KR41F7T100 2023-01 카카오페이개별선물		10
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		0.26
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602		0.31

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	166

공시일 2022-12-19

기준일 2022-12-16

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

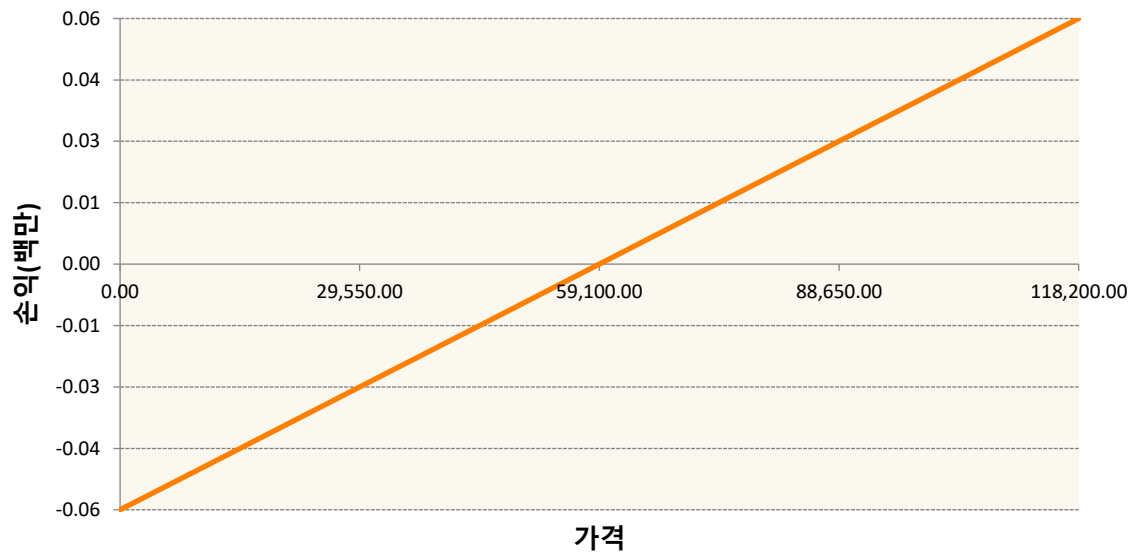
1. 계약금액

(단위:백만원)

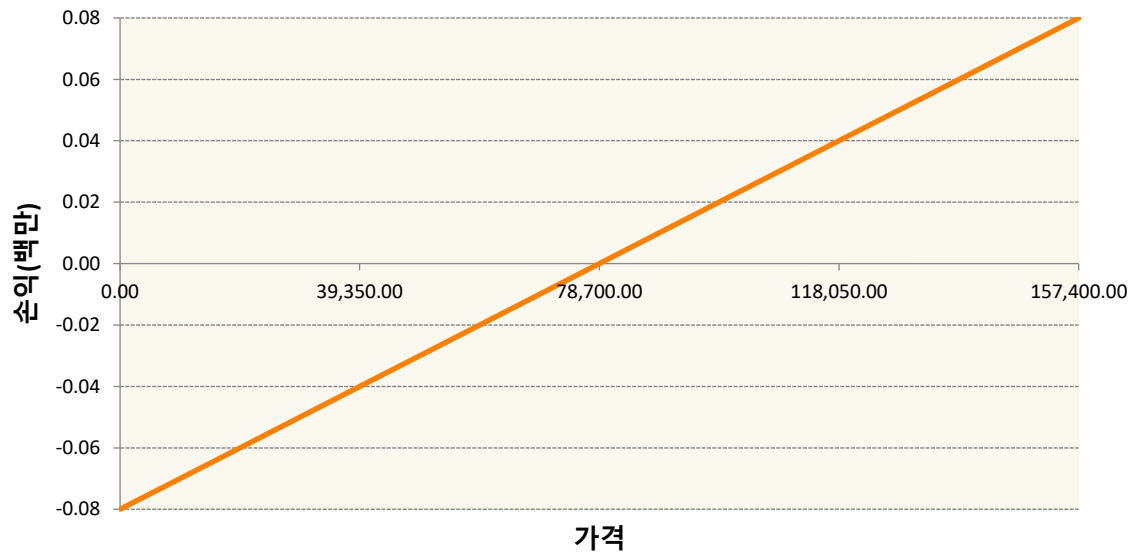
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	142	0	142	장내

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)

14

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

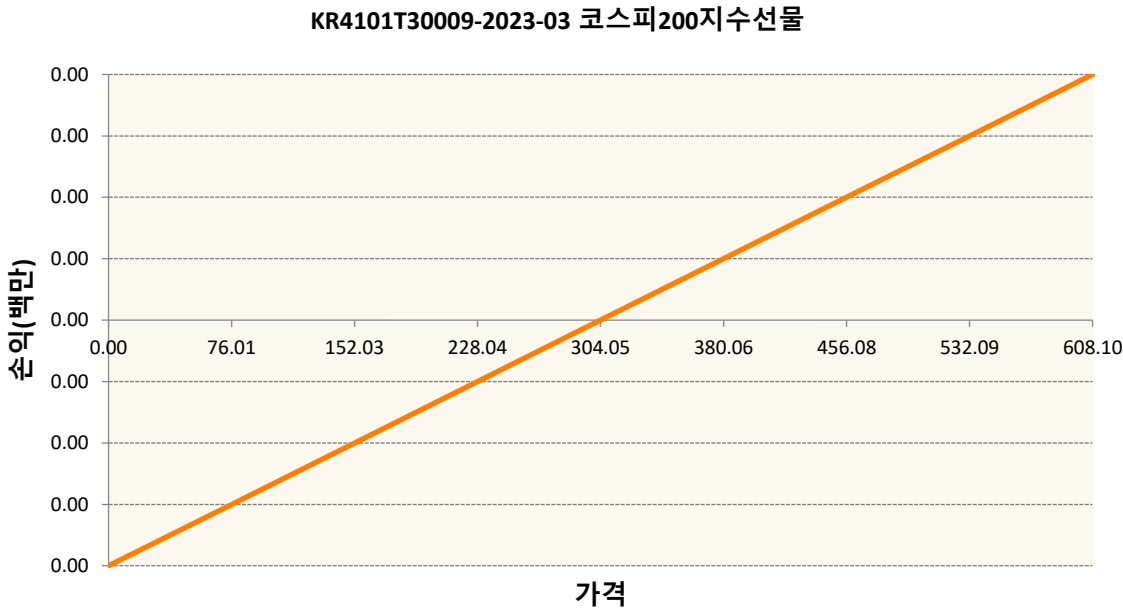
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,280	0	2,280	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				184
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-5.33%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-2.67%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	61	61	61	61	61	61	61
5.33%	123	123	123	123	123	123	123
8.00%	184	184	184	184	184	184	184

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

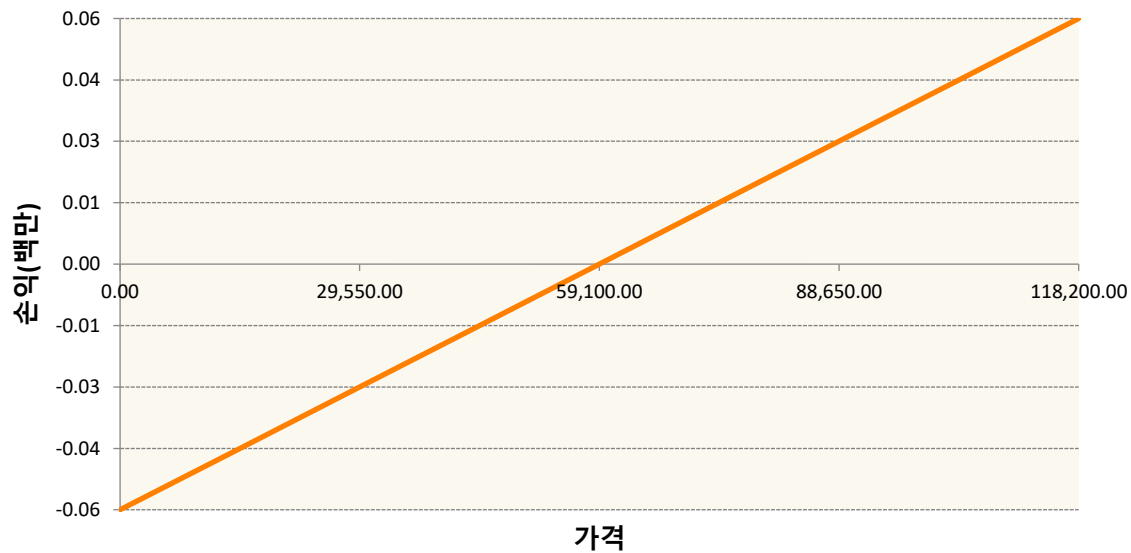
1. 계약금액

(단위:백만원)

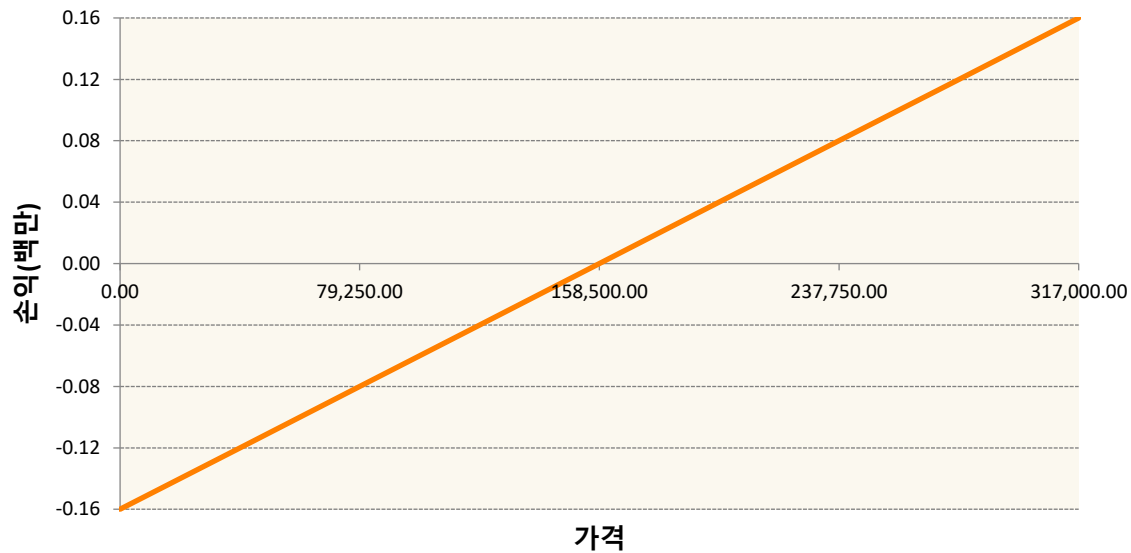
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	233	0	233	장내

2. 만기시점의 손익구조

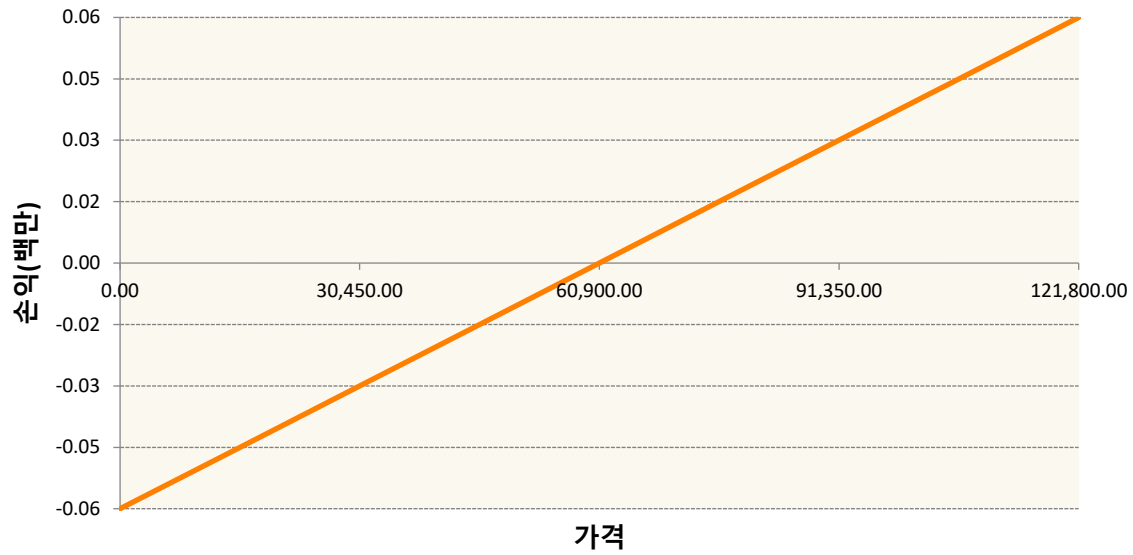
KR4111T10000-2023-01 삼성전자개별선물



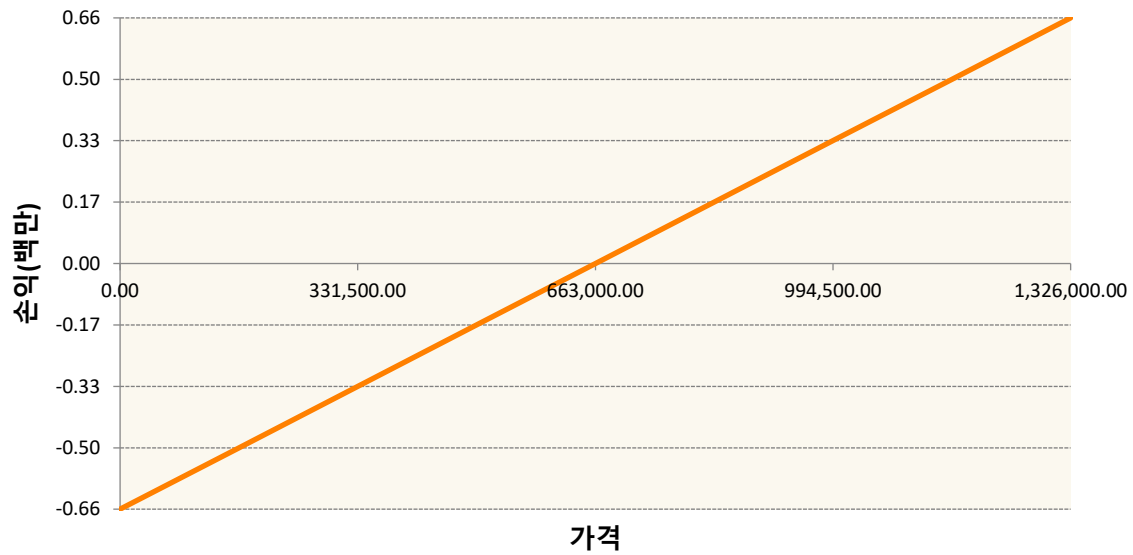
KR4116T10009-2023-01 현대차개별선물



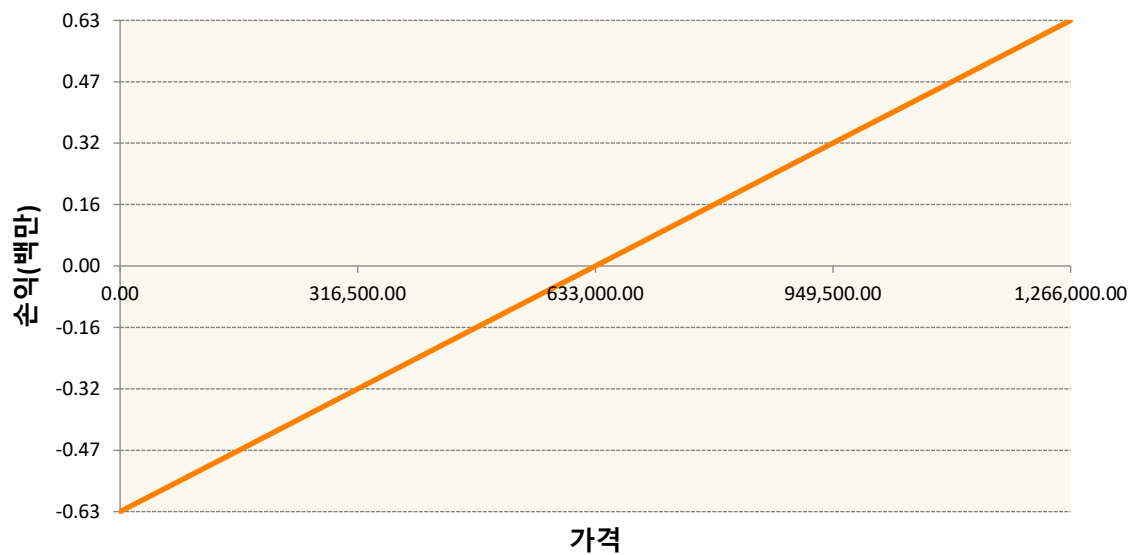
KR4119T10003-2023-01 기아개별선물



KR4122T10007-2023-01 삼성SDI개별선물



KR4147T10004-2023-01 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(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		
KR4119T10003								2023-01 기아개별선물		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	-1		
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1		
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0		
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	1		
8.00%	1	1	1	1	1	1	1	1		
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%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7		
-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%	7	7	7	7	7	7	7	7		
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	-2		
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1		
-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%	1	1	1	1	1	1	1	1		
8.00%	2	2	2	2	2	2	2	2		

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

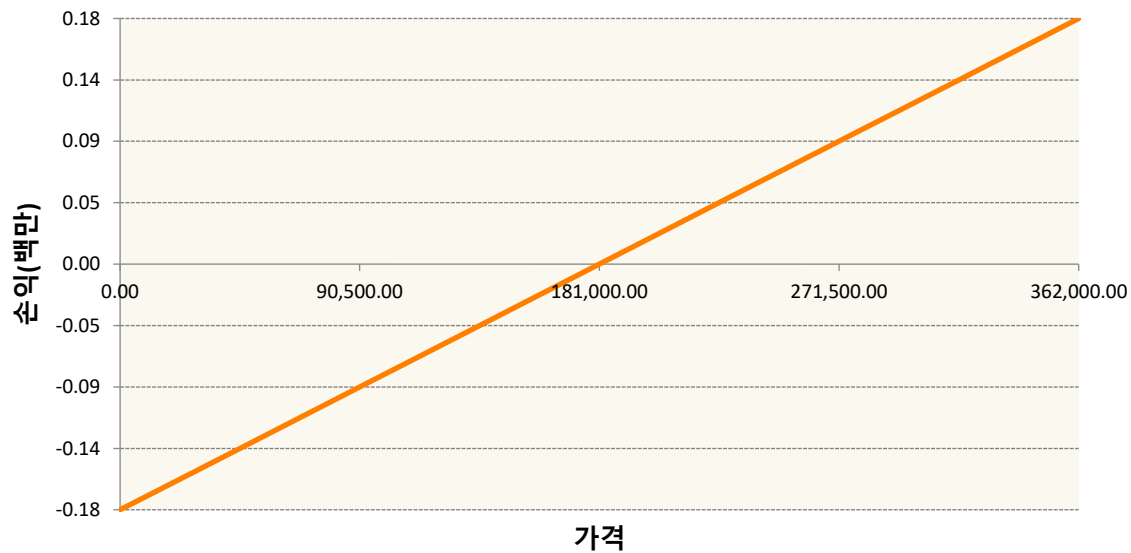
1. 계약금액

(단위:백만원)

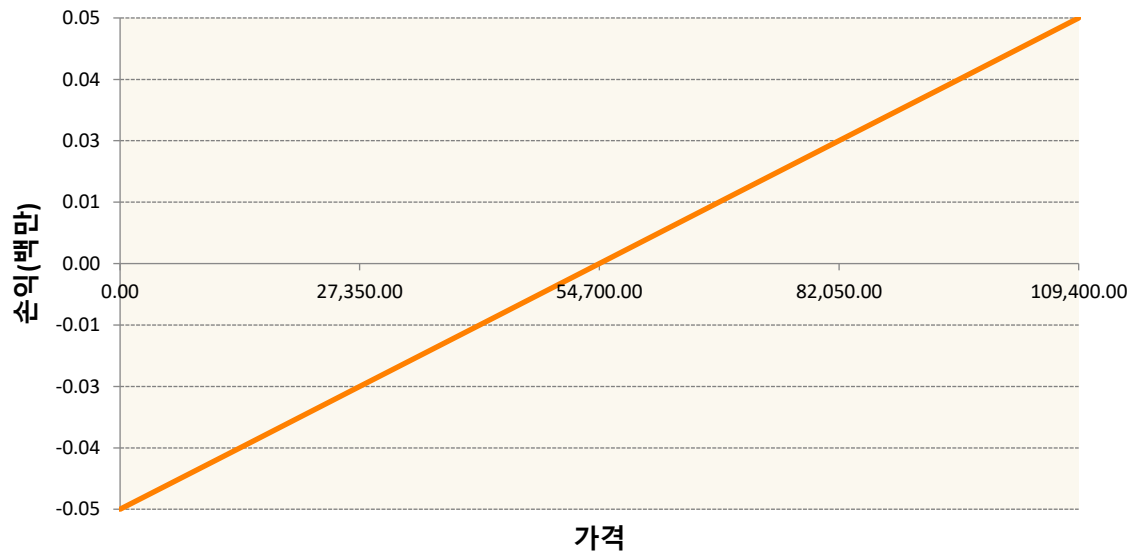
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	113	0	113	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156T10005-2023-01 NAVER개별선물



KR41CFT10006-2023-01 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156T10005		2023-01 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	

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

7

공시일	2022-12-19
기준일	2022-12-16

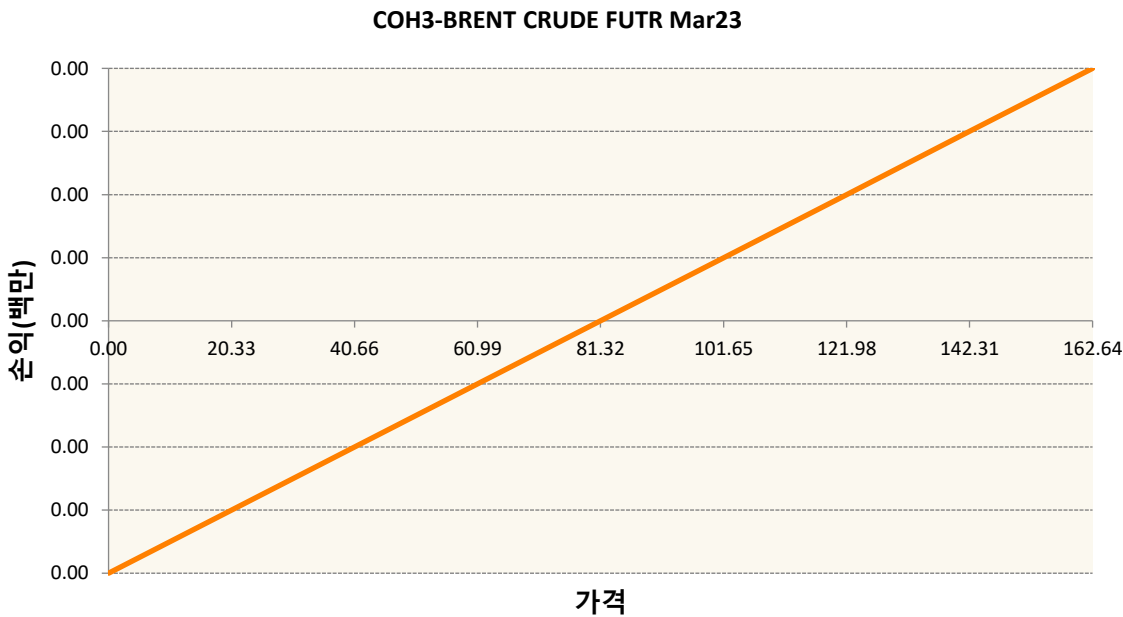
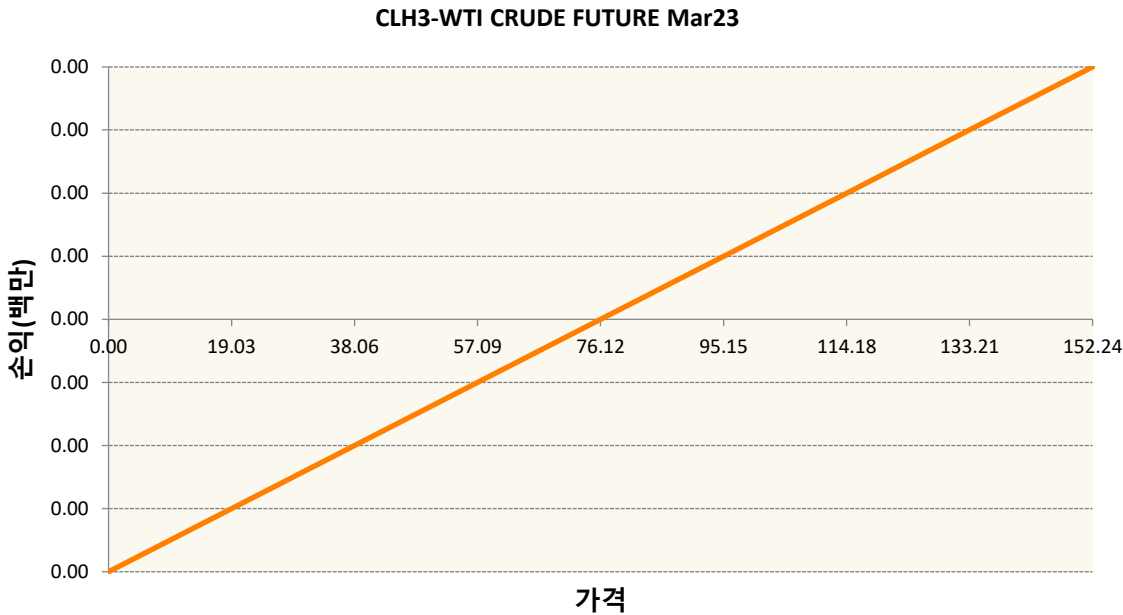
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

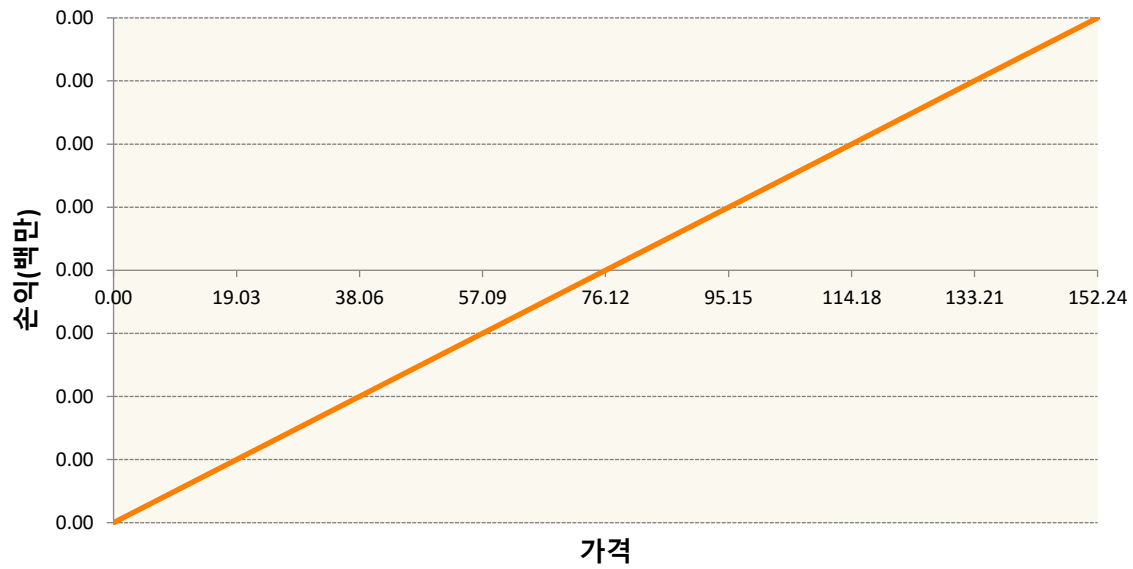
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,849	392	1,457	

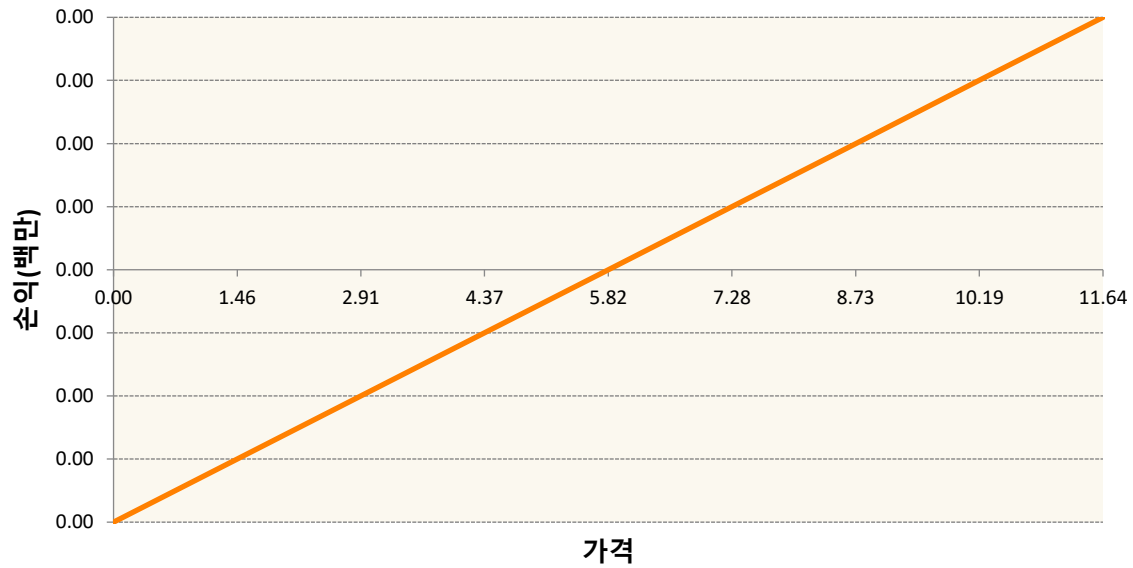
2. 만기시점의 손익구조



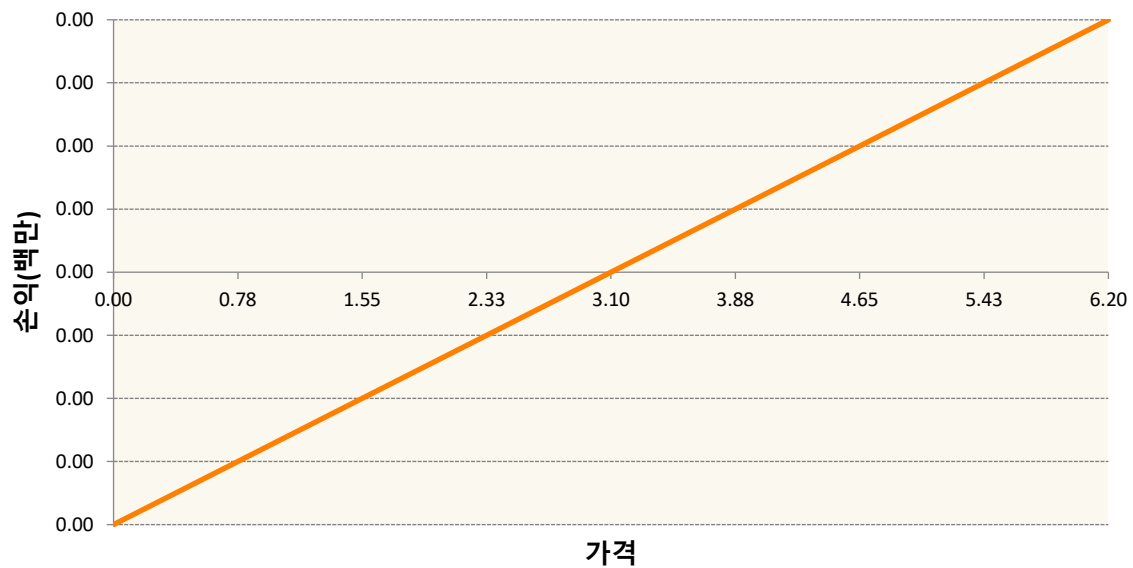
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



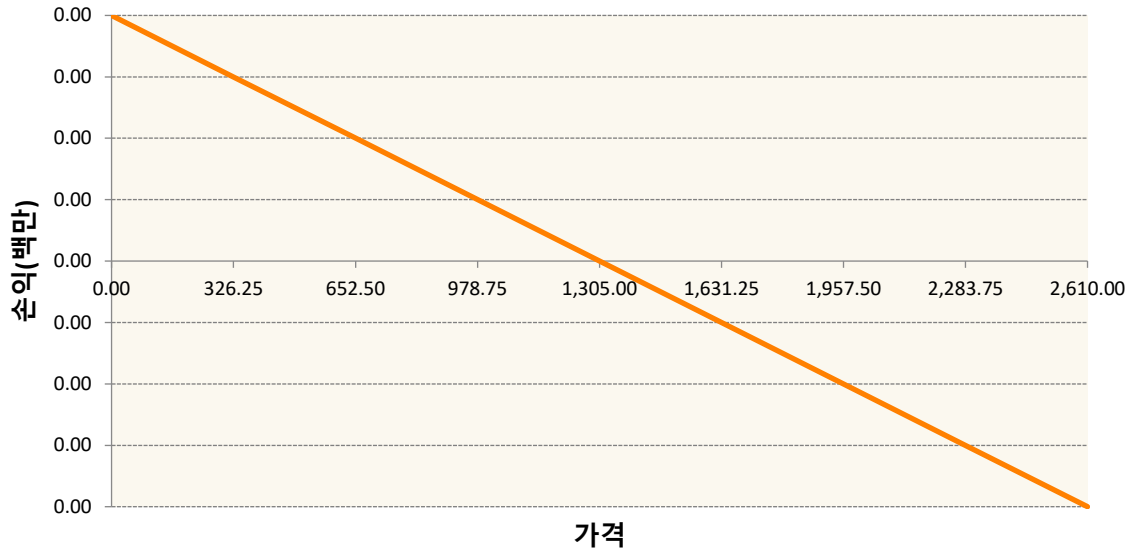
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



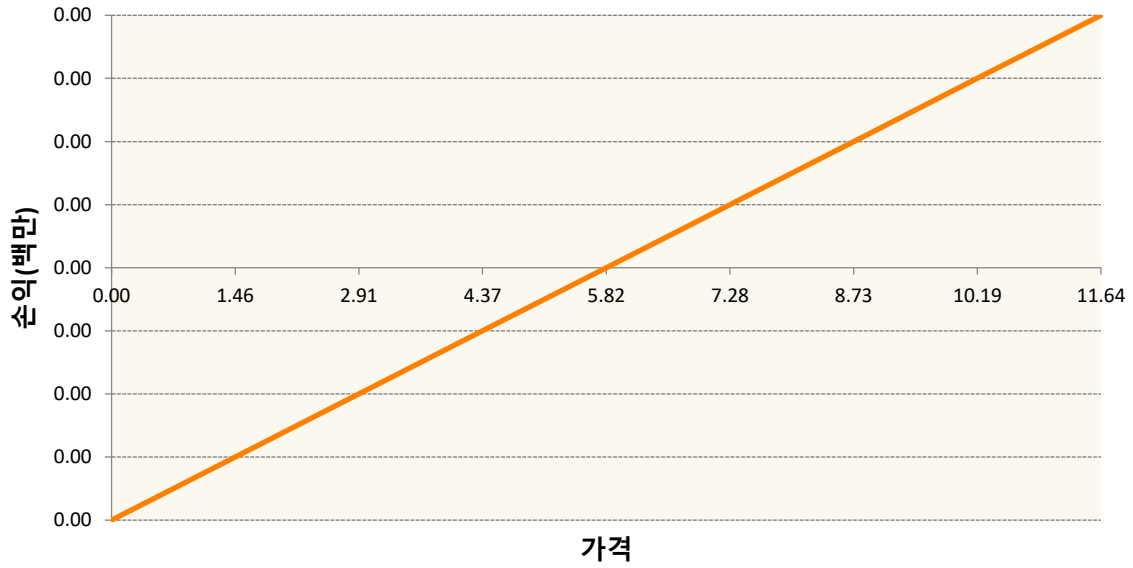
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



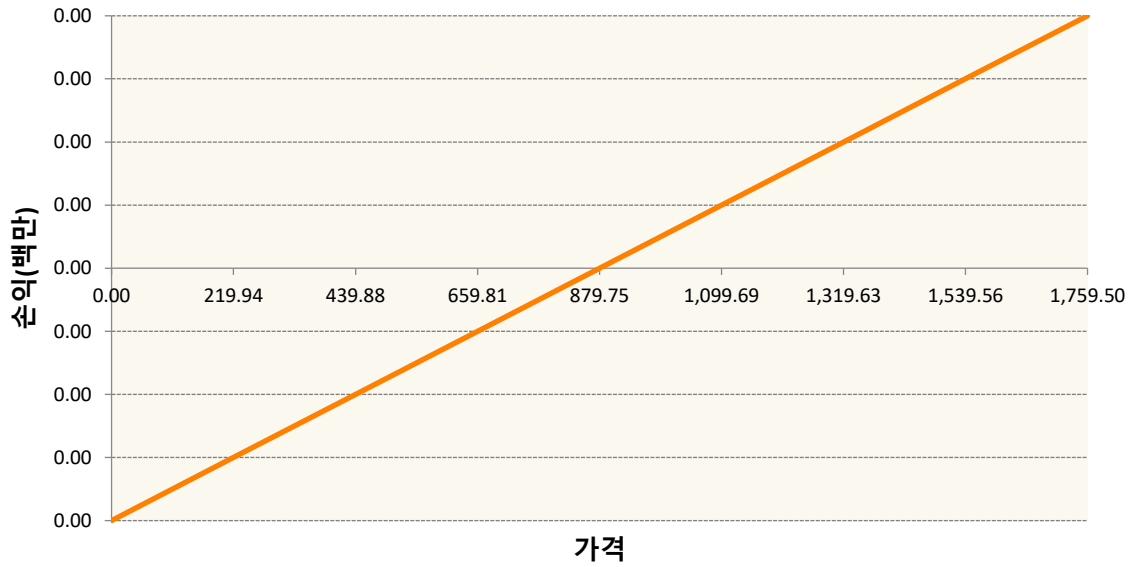
KR4175T10005-2023-01 달러선물

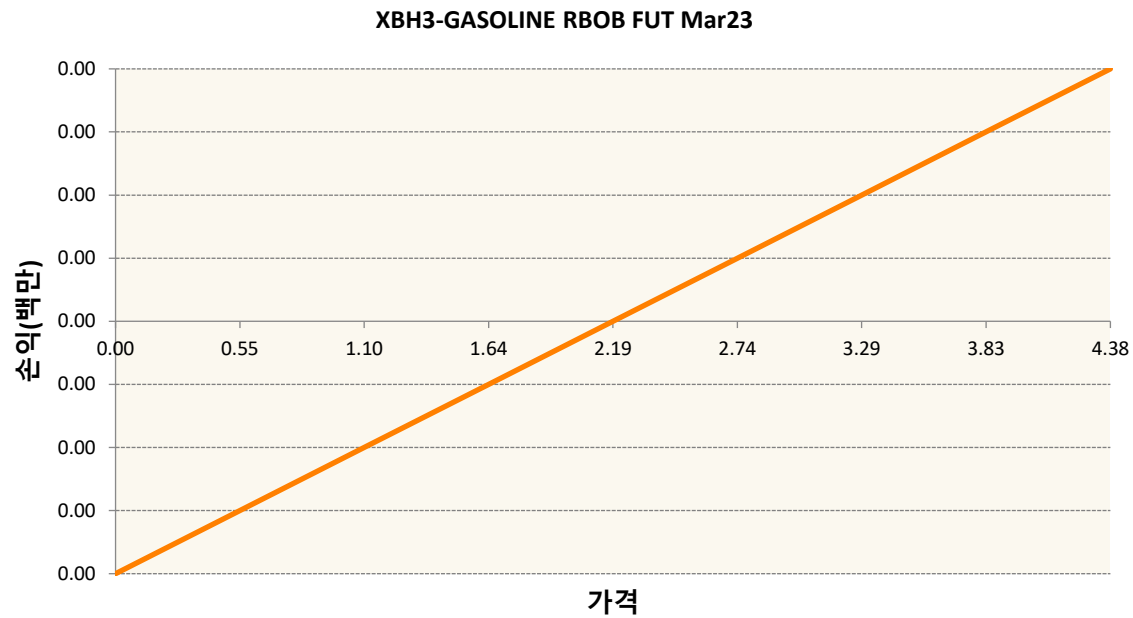


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	24
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	26
ECH3	E-mini Crude Oil Mar23	8
EOH3	E-MINI NATURAL GAS Mar23	3
HOH3	NY Harb ULSD Fut Mar23	14
KR4175T100 2023-01 달러선물		31
NGH23	NATURAL GAS FUTR Mar23	55
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	9
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	513