

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

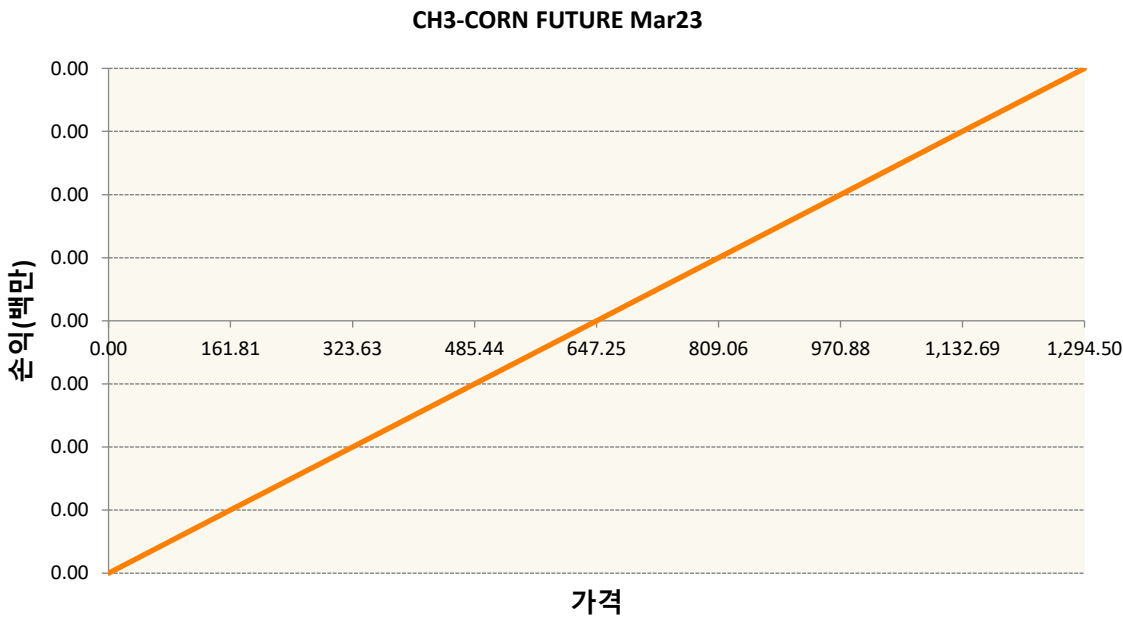
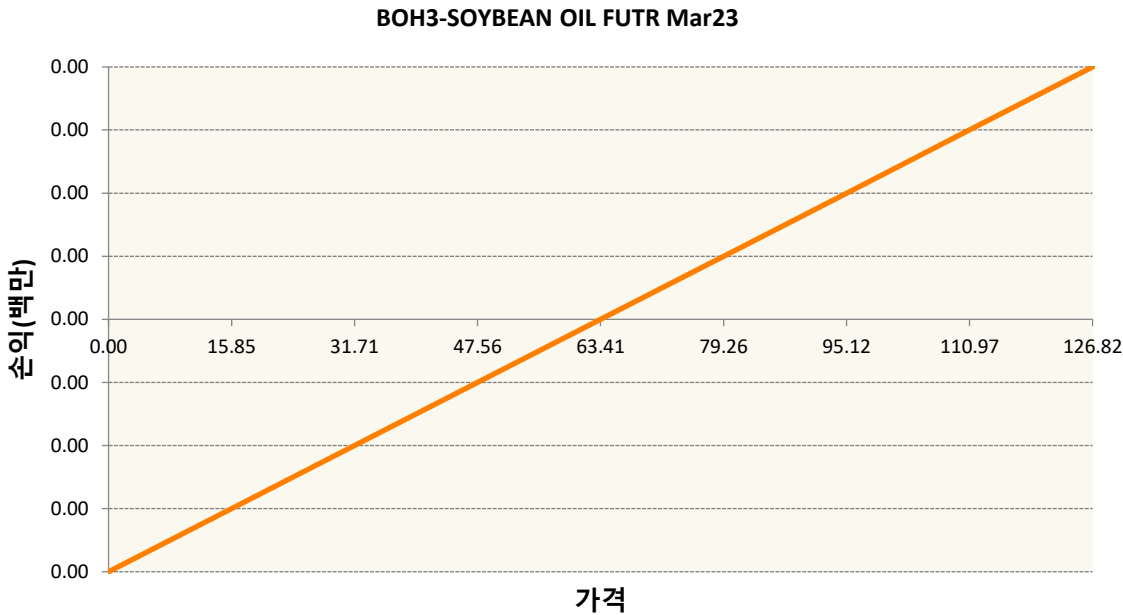
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

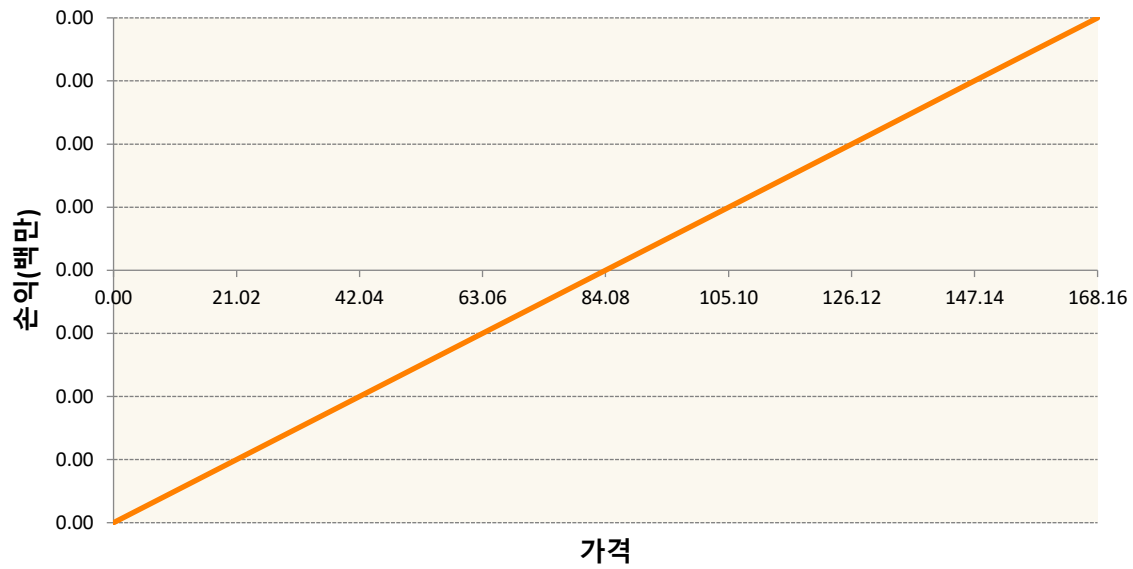
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,289	773	5,516	

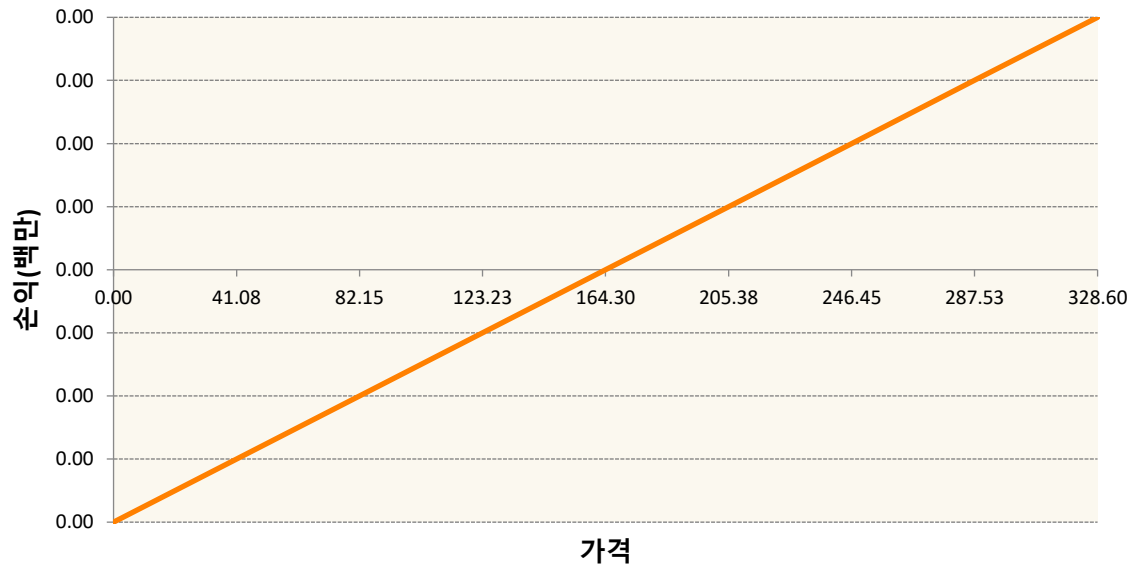
2. 만기시점의 손익구조



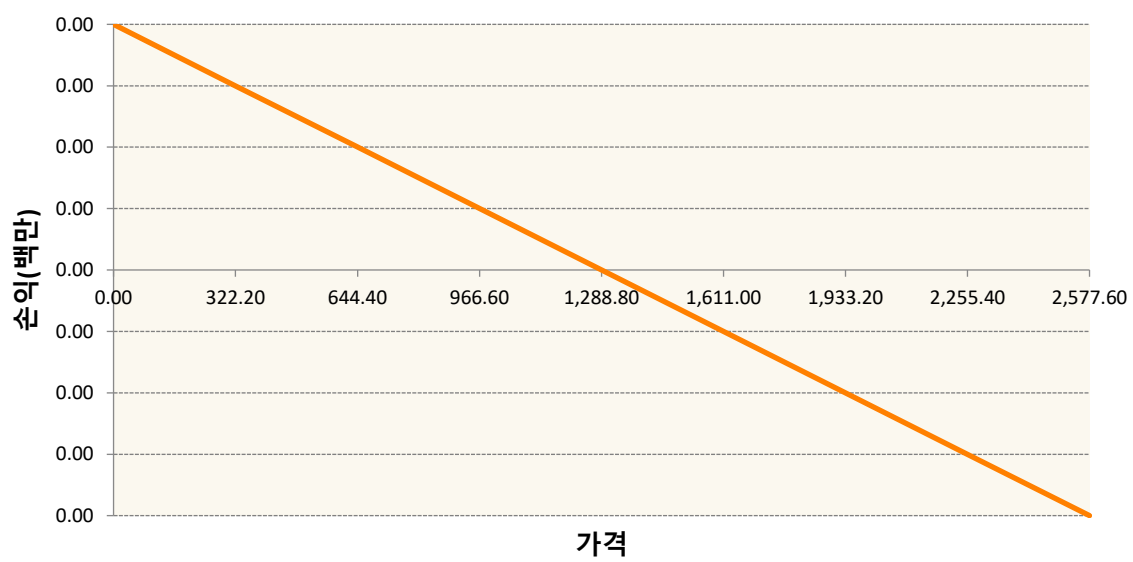
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



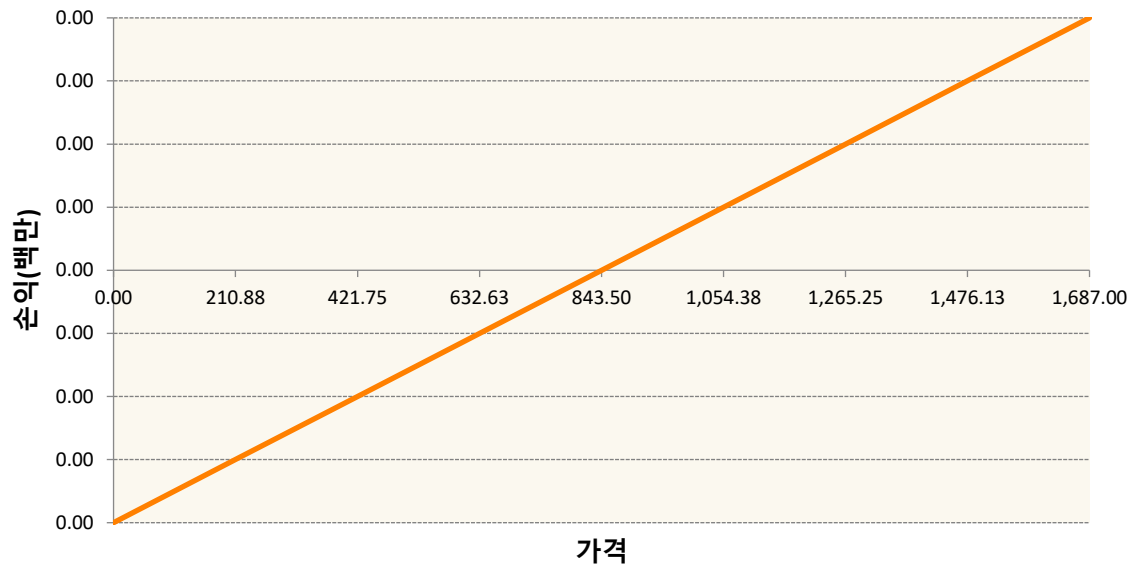
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



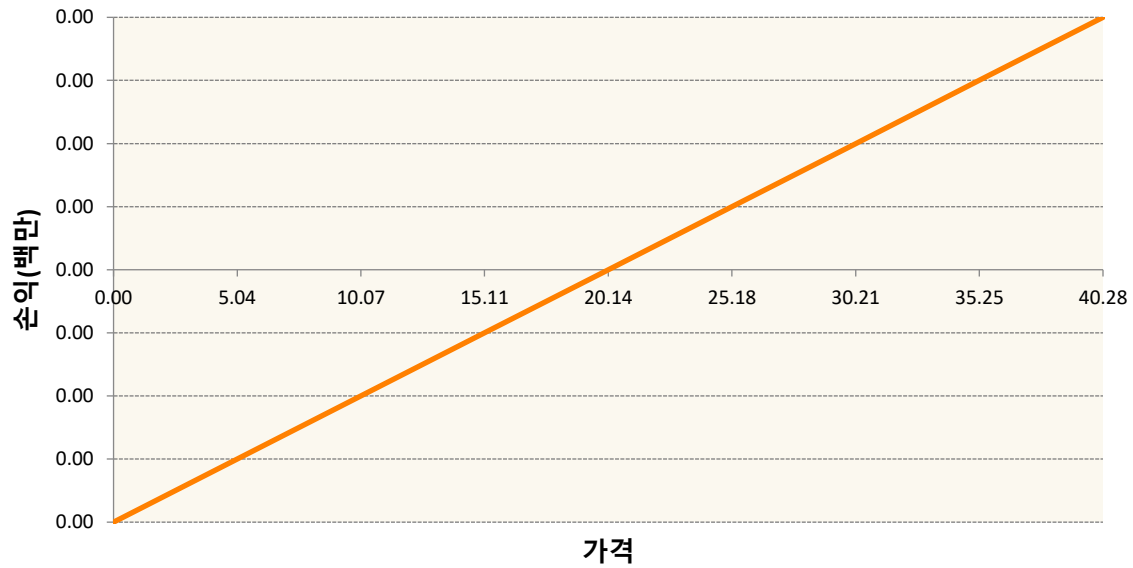
KR4175T10005-2023-01 달러선물



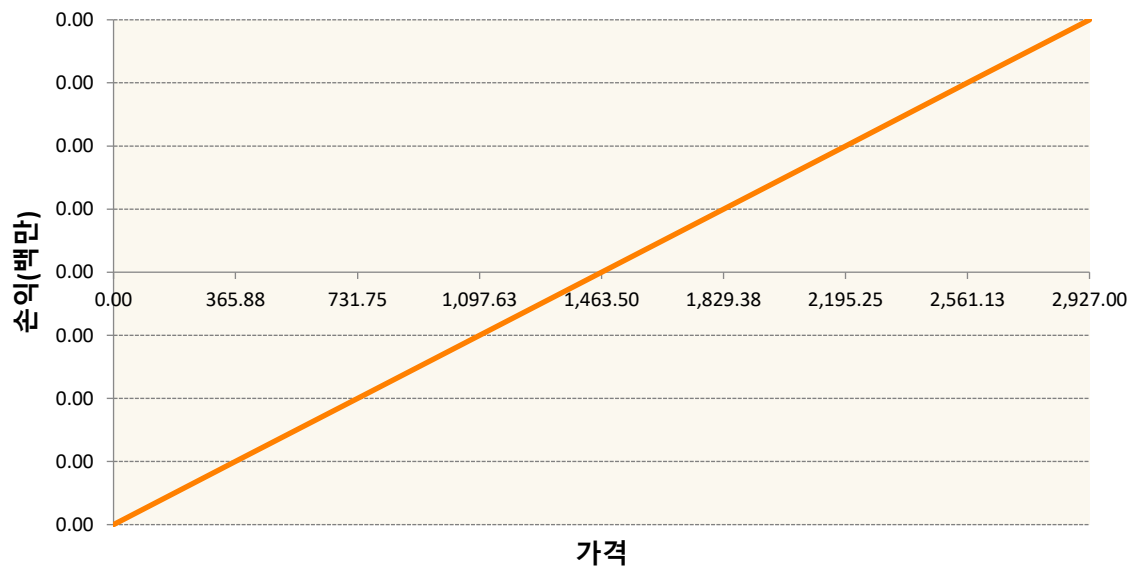
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



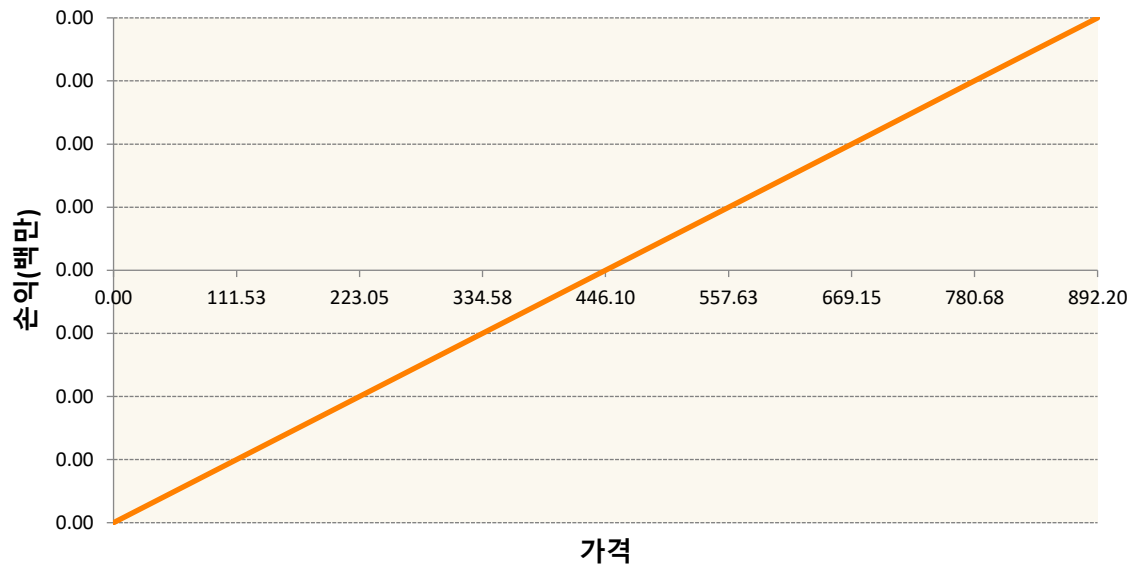
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



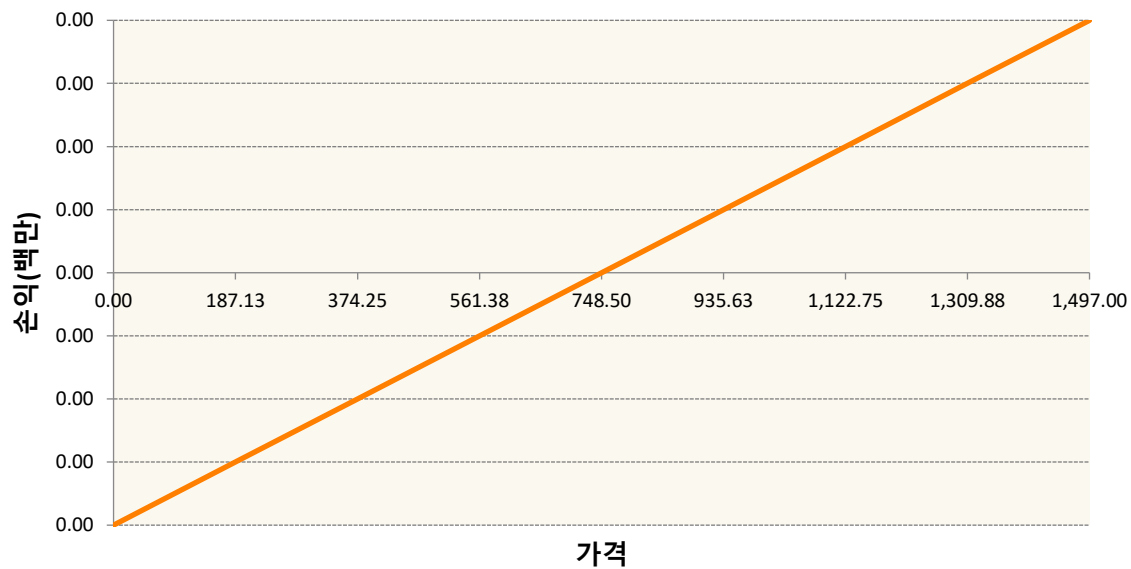
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



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	2022-12-21
기준일	2022-12-20

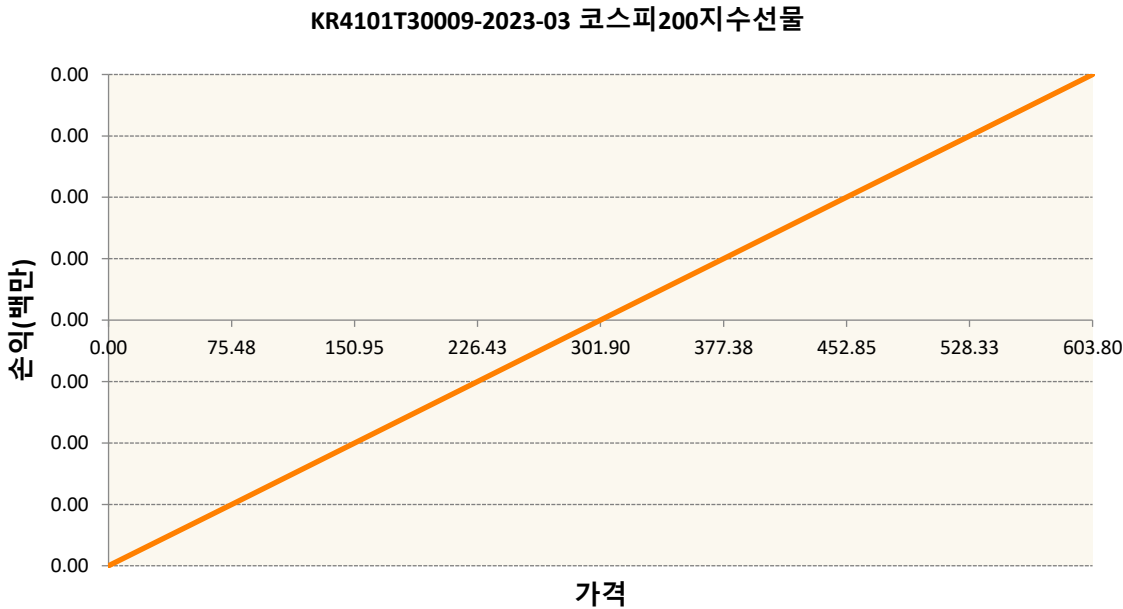
스마트인덱스모

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	1,887	0	1,887	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					152
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
-5.33%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-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%	101	101	101	101	101	101	101
8.00%	152	152	152	152	152	152	152

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

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

338

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

474

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

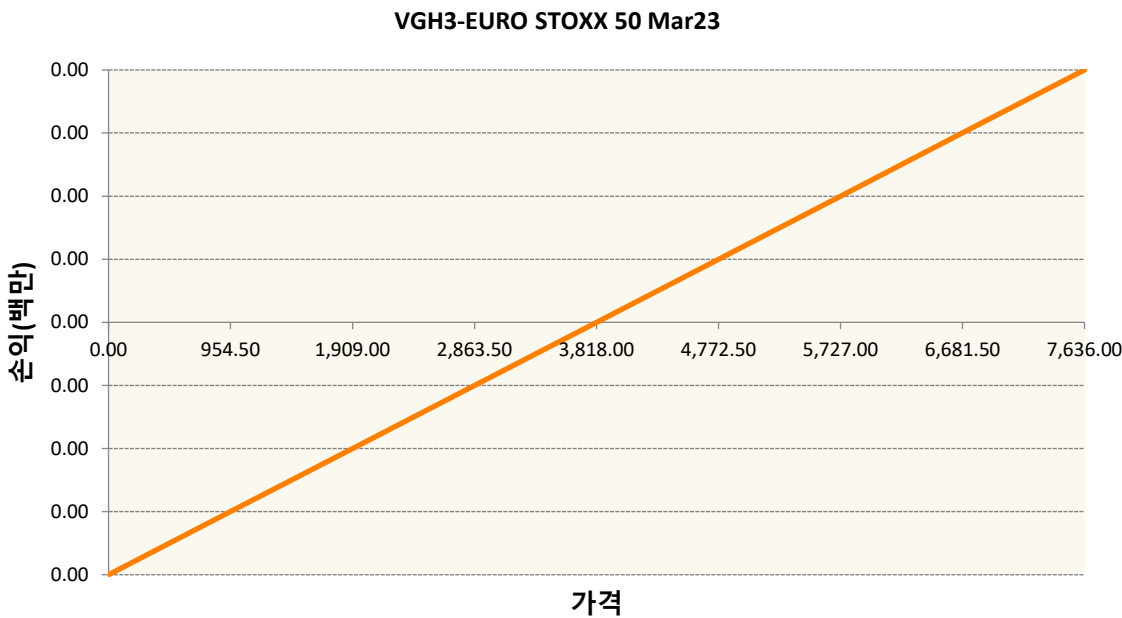
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	478	0	478	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

40

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

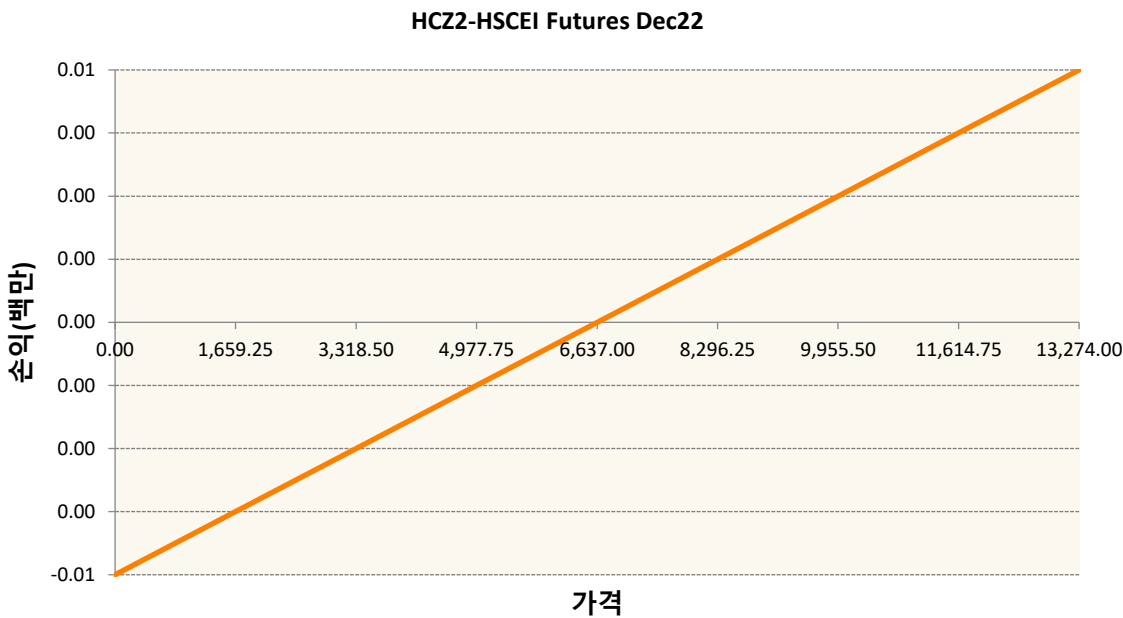
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,348	0	1,348	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ2	HSCEI Futures Dec22	108
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

145

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

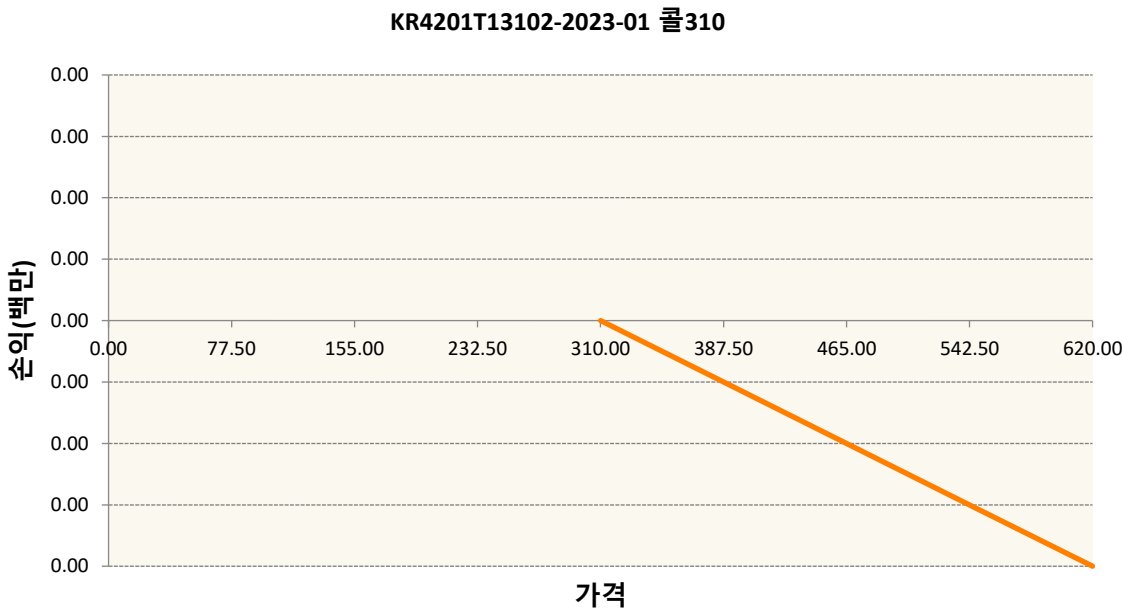
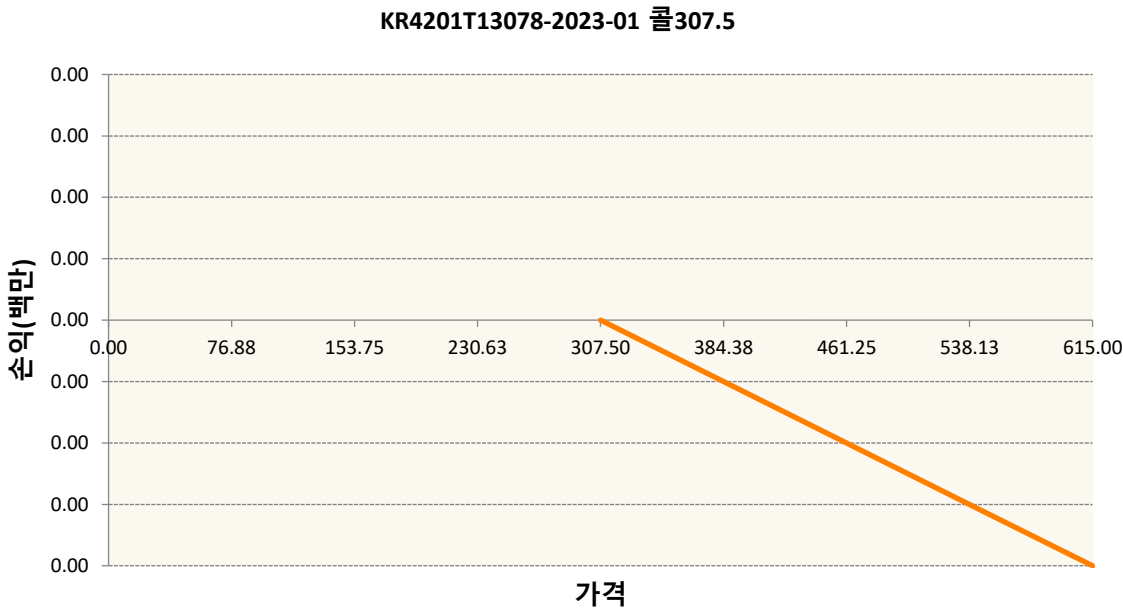
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

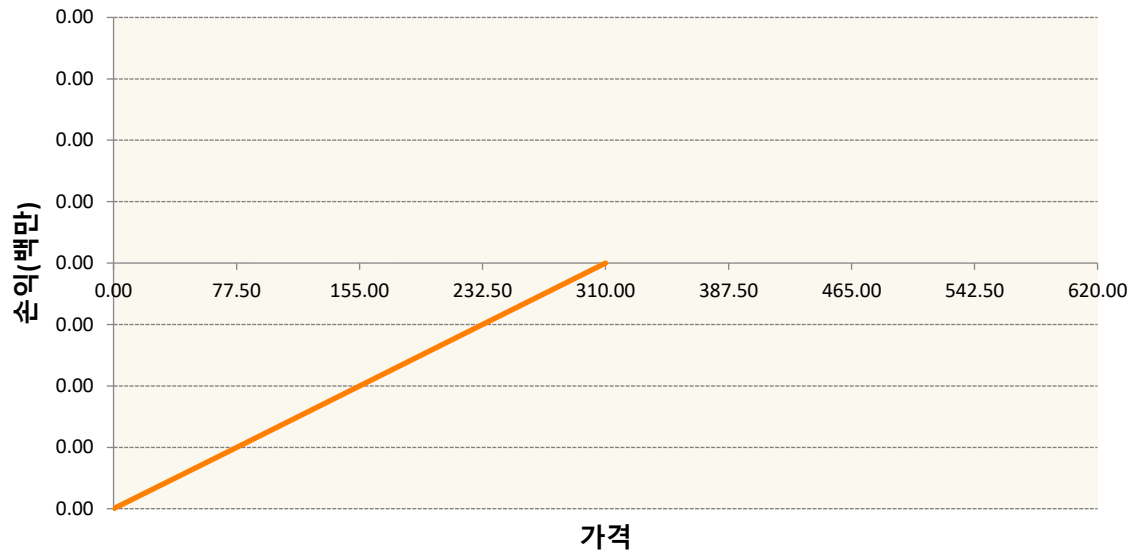
(단위:백만원)

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				2,275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,420	1,322	1,216	1,104	986	864	738
-5.33%	1,204	1,079	950	817	681	542	402
-2.67%	892	746	599	450	300	150	-2
0%	472	315	158	0	-158	-315	-473
2.67%	-58	-216	-375	-534	-693	-852	-1,011
5.33%	-694	-843	-994	-1,147	-1,302	-1,457	-1,613
8.00%	-1,425	-1,556	-1,693	-1,834	-1,979	-2,126	-2,275
KR4201T13102			2023-01 콜310				386
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	232	216	199	180	161	140	119
-5.33%	199	178	156	134	111	87	63
-2.67%	149	125	100	74	48	22	-4
0%	82	55	27	0	-27	-55	-82
2.67%	-5	-33	-61	-89	-117	-145	-173
5.33%	-110	-137	-164	-191	-219	-247	-274
8.00%	-232	-257	-282	-307	-333	-360	-386
KR4301T13100			2023-01 풋310				591
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-425	-448	-474	-501	-530	-560	-591
-5.33%	-219	-249	-281	-314	-348	-382	-417
-2.67%	-36	-72	-109	-146	-184	-222	-260
0%	120	80	40	0	-40	-80	-121

2.67%	248	207	166	125	84	43	2
5.33%	349	310	270	230	189	149	108
8.00%	425	389	353	315	277	238	199

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

(단위:백만원)

2,670

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

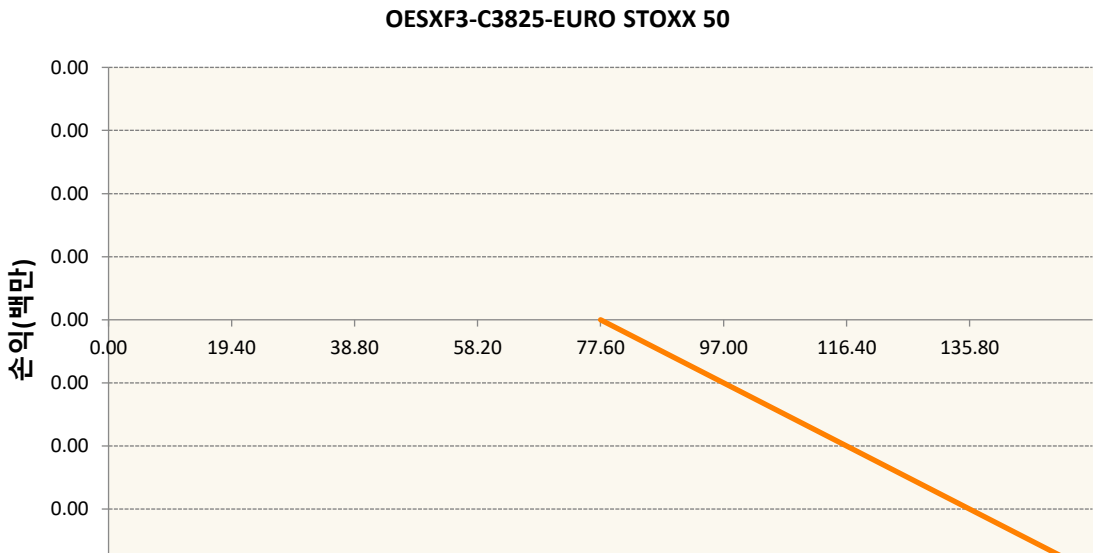
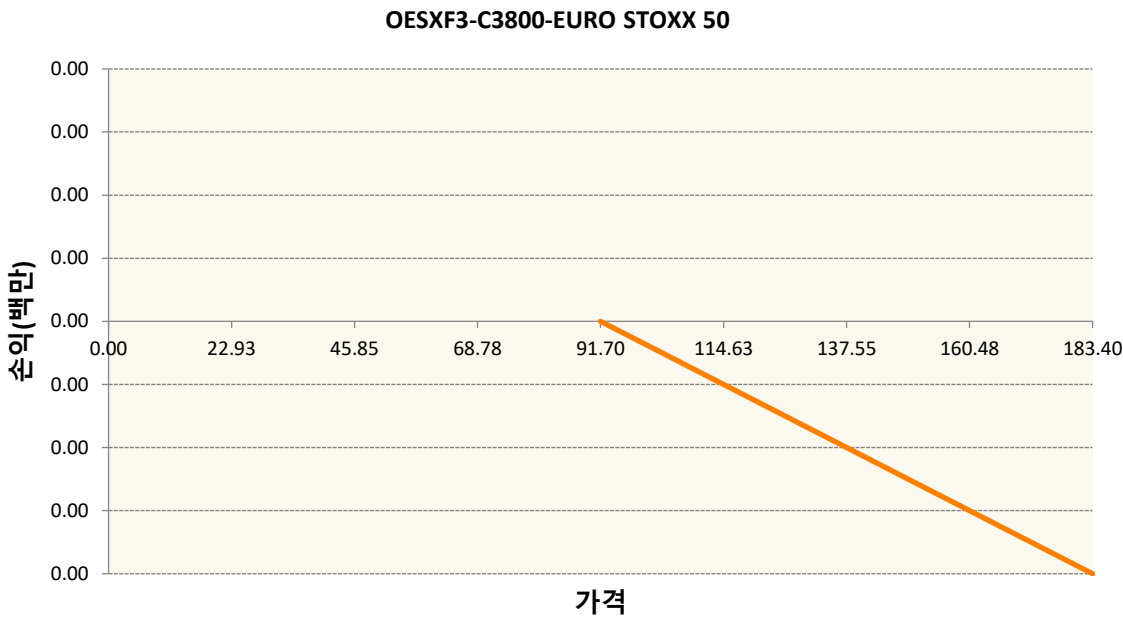
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

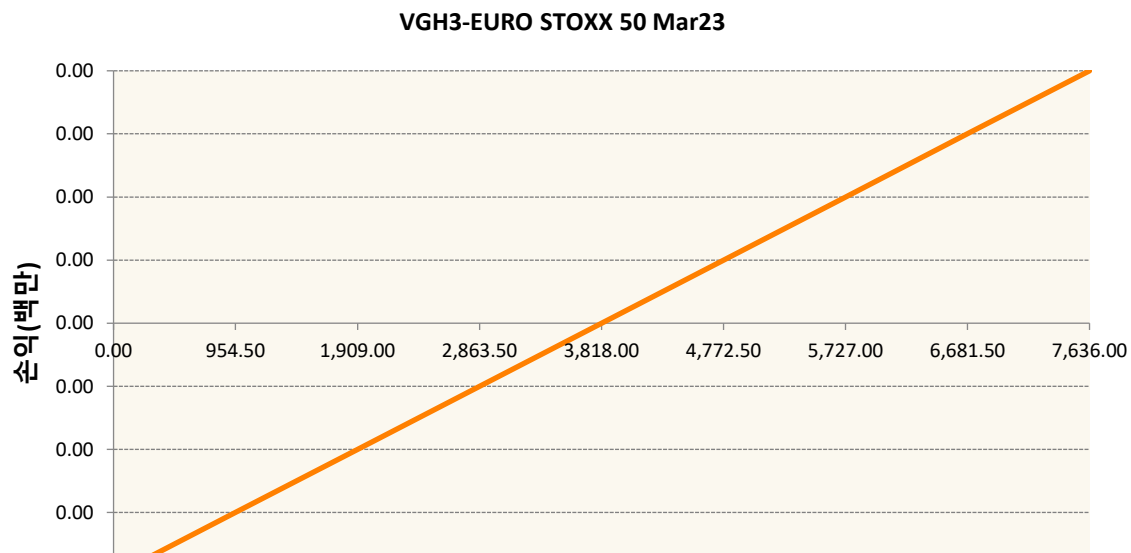
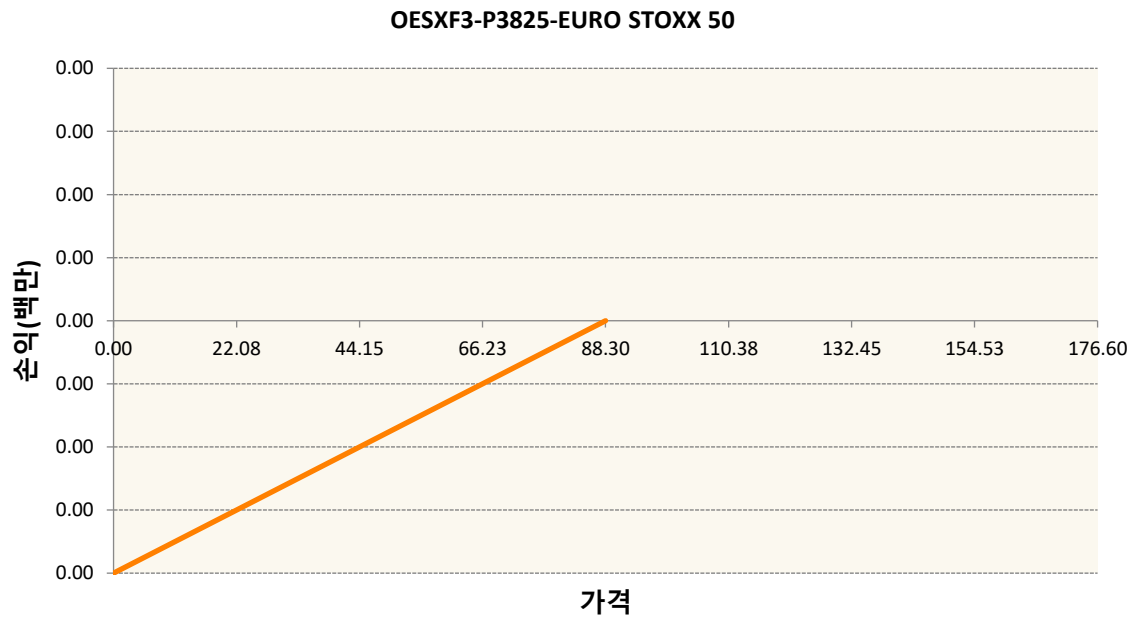
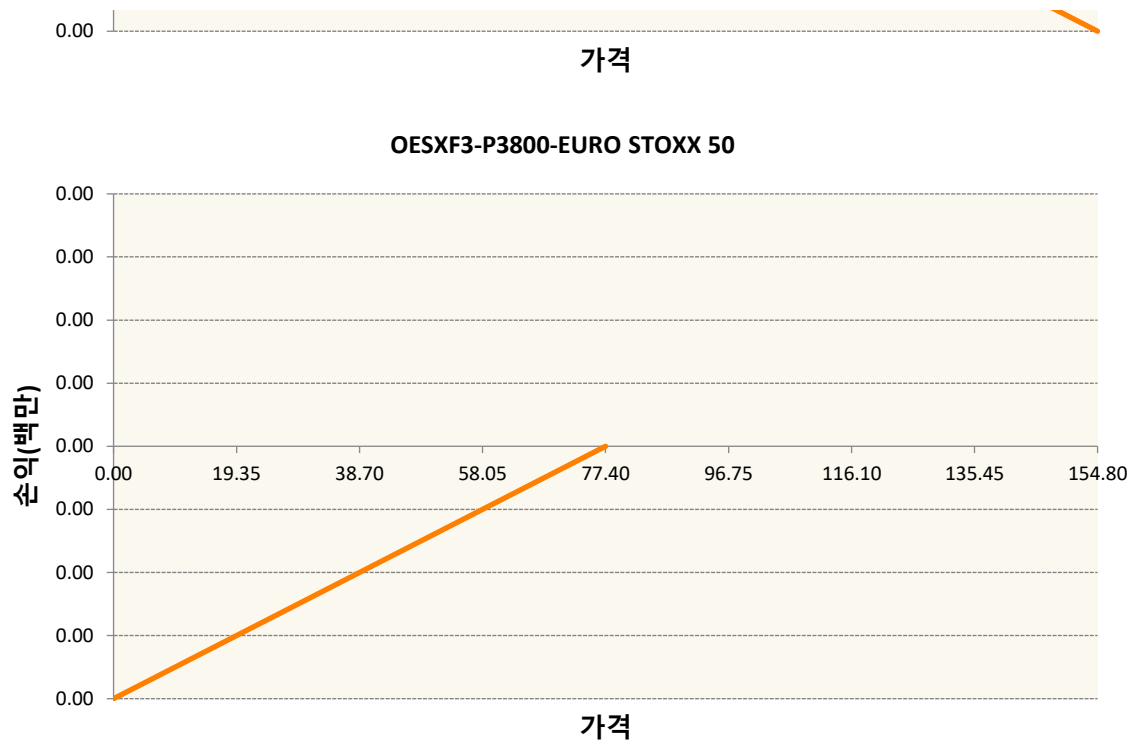
1. 계약금액

(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	1,061	0	1,061	
누계	유가증권	옵션	0	92	-92	장내
누계	통화	선도	137	2,254	-2,117	장외

2. 만기시점의 손익구조





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		71
FXW213CBN EUR/KRW 24-02-23E		11
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		3
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		1
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		3
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		1
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		85

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	239

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

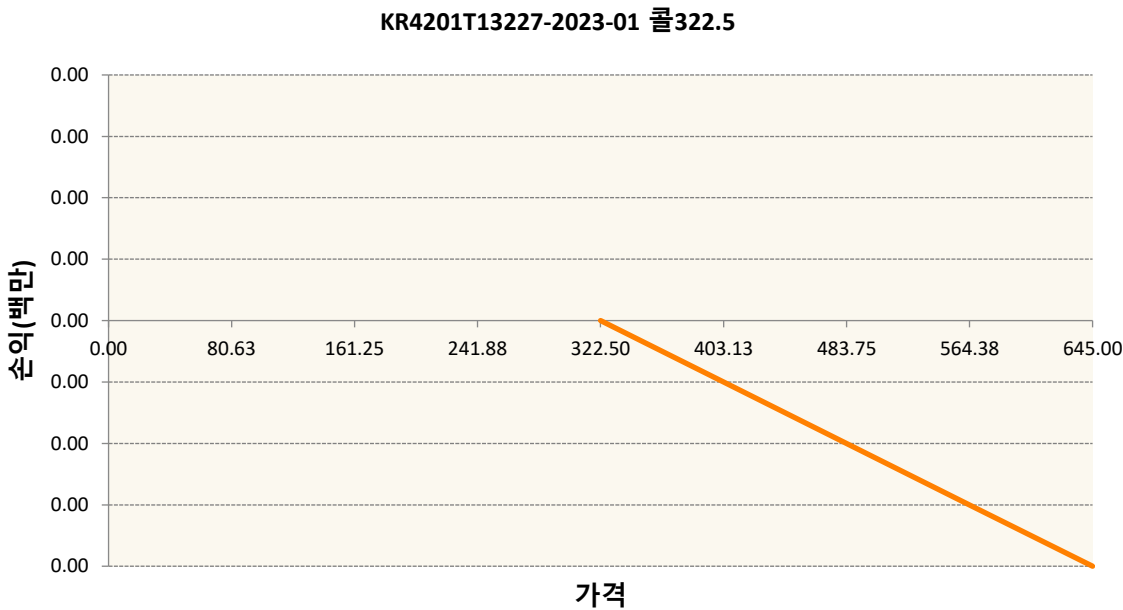
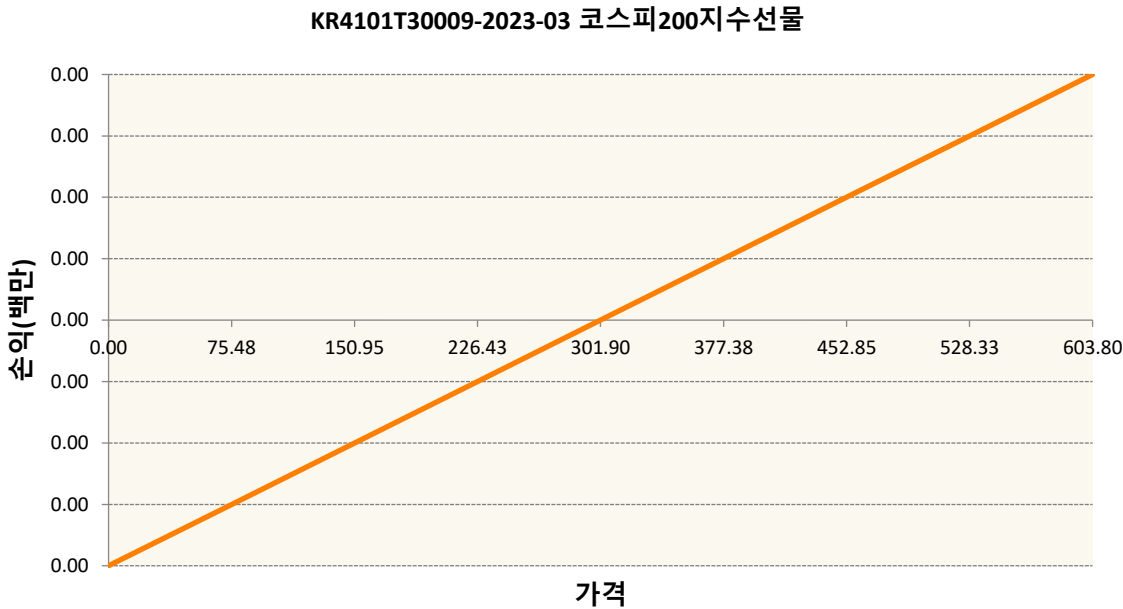
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	377	0	377	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 the profit/loss is zero at these price points.

The graph illustrates the relationship between price (가격) and profit (이익). The x-axis represents price, ranging from 0.00 to 620.00. The y-axis represents profit, ranging from 0.00 to 0.00. A single orange line is plotted, starting at (0, 0) and ending at (310, 0). This indicates that profit is zero for all prices in this range.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	0.00
310.00	0.00

(단위:백만원)

KR4101T30009				2023-03 코스피200지수선물				30
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	
-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%	30	30	30	30	30	30	30	
KR4201T13227				2023-01 콜322.5				96
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	44	40	36	32	27	22
-5.33%	42	38	33	28	22	16	10
-2.67%	34	28	22	16	9	2	-5
0%	21	14	7	0	-7	-15	-23
2.67%	4	-4	-12	-20	-28	-36	-44
5.33%	-18	-26	-35	-43	-52	-60	-68
8.00%	-46	-54	-62	-71	-79	-88	-96
KR4201T13250 2023-01 콜325							82

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	36	33	30	26	22	18
-5.33%	34	31	27	23	18	13	8
-2.67%	28	23	18	13	7	1	-5
0%	18	12	6	0	-6	-13	-20
2.67%	4	-2	-9	-16	-23	-30	-37
5.33%	-14	-21	-29	-36	-43	-51	-58
8.00%	-37	-44	-52	-59	-67	-74	-82

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

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

(단위:백만원)

166

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	69	-69	
누계	유가증권	수익증권	6,546	0	6,546	

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	2022-12-21
기준일	2022-12-20

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	60	-60	
누계	유가증권	수익증권	5,540	0	5,540	

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	2022-12-21
기준일	2022-12-20

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	209	-209	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	18,551	0	18,551	
누계	통화	선도	0	18,731	-18,731	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	480
FXW213CAR(KRW/USD 30-01-23E	267
FXW213CBQ(KRW/USD 28-02-23E	659
FXW213CBW(KRW/USD 28-12-22E	36
FXW213CC6(KRW/USD 28-12-22E	15
FXW213CCK(KRW/USD 30-01-23E	41
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

787

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

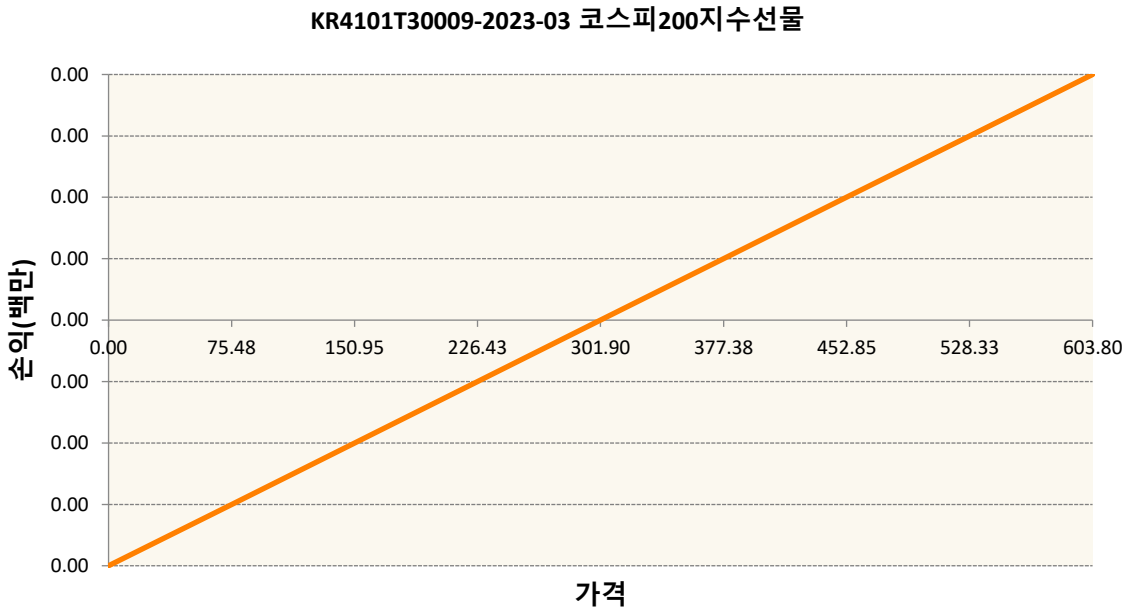
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	755	0	755	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	2022-12-21
기준일	2022-12-20

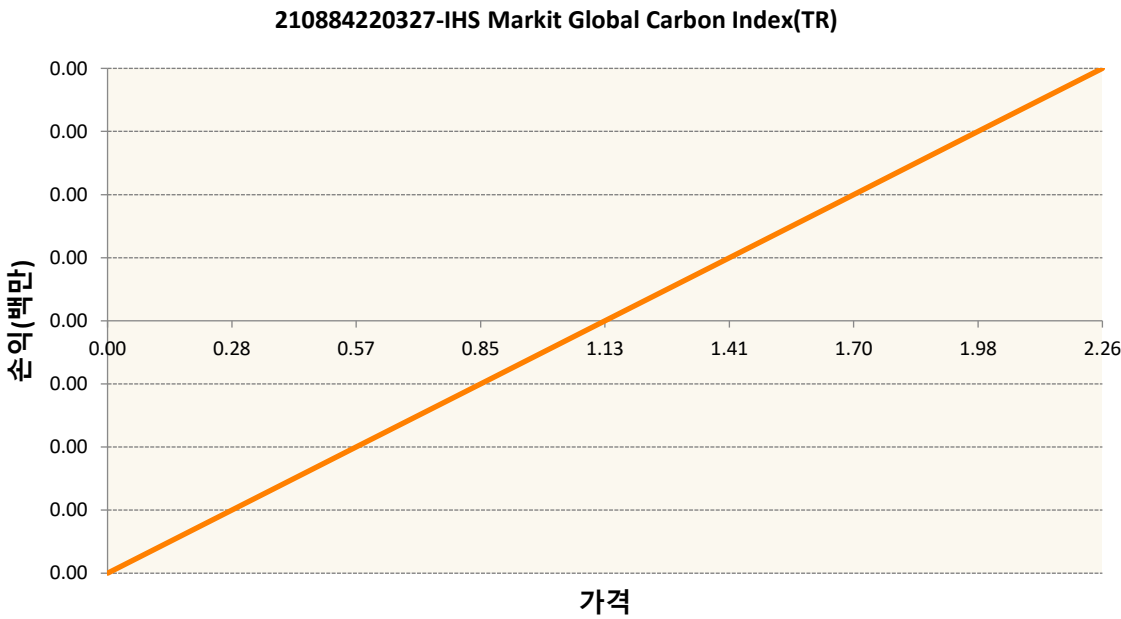
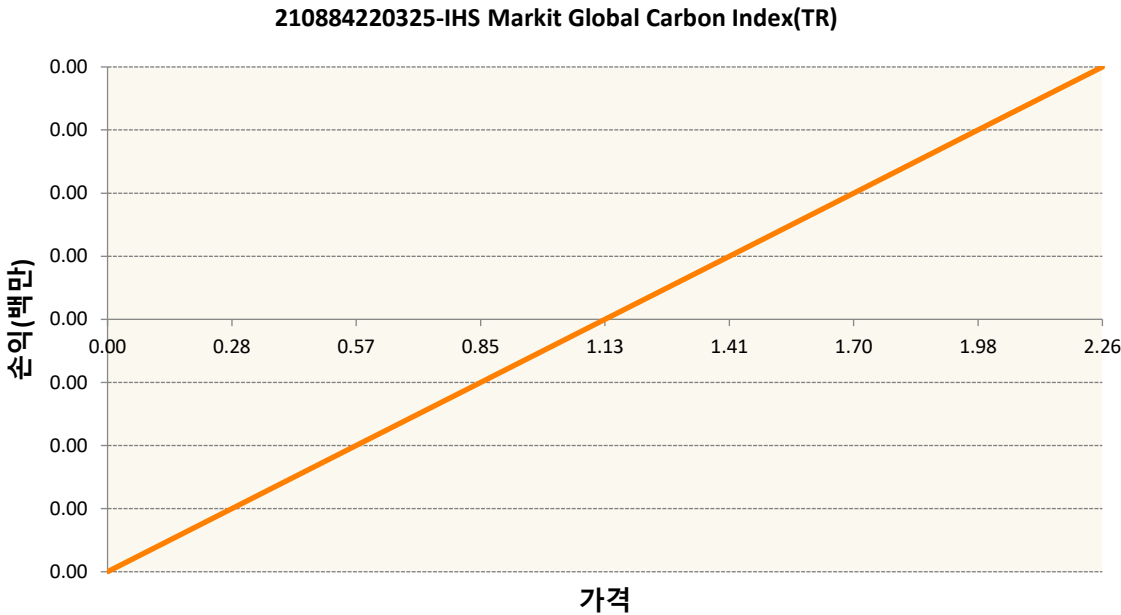
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

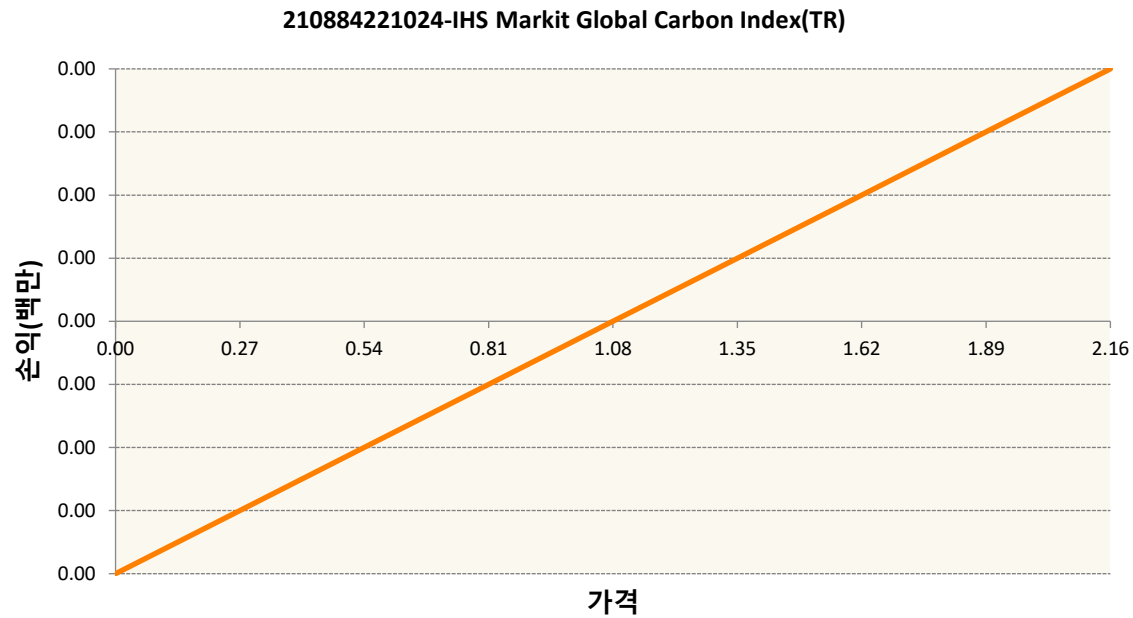
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	30,436	0	30,436	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		195
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		98
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		2,143

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,679

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

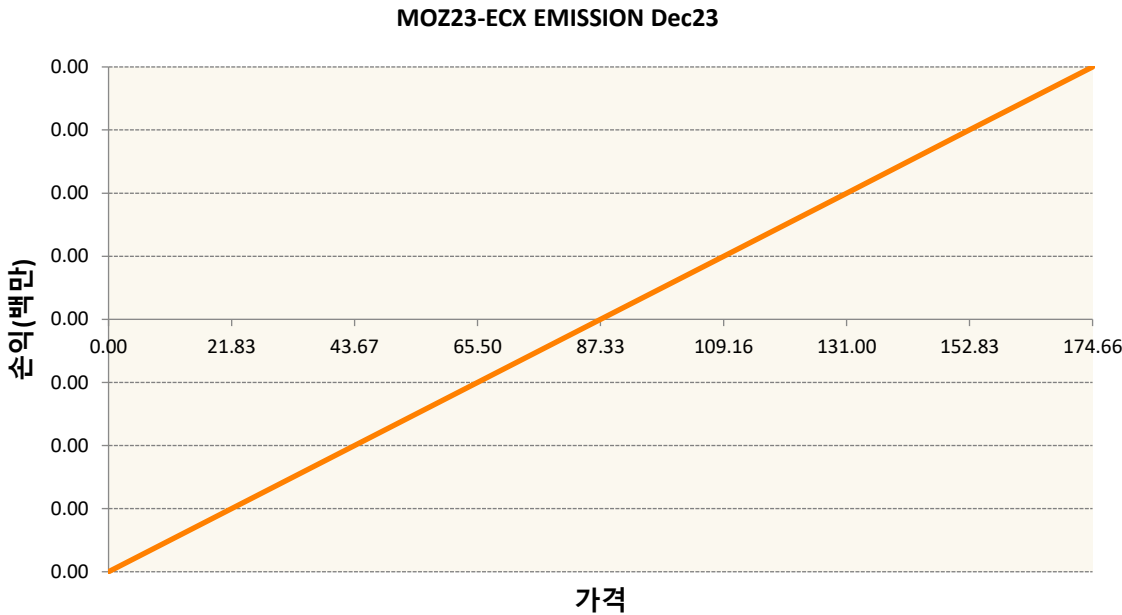
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,049	0	13,049	
누계	통화	선도	0	6,389	-6,389	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CBP(KRW/EUR 23-12-22E	358
FXW213CC1(KRW/EUR 23-12-22E	153
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,044

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

(단위:백만원)

3,059

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

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)	46
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (키움)	46
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (미래)	46
SWCSI00000 신한CSI Index 220323 (메리츠)	46

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

(단위:백만원)

350

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

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)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	11

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

(단위:백만원)

45

공시일 2022-12-21

기준일 2022-12-20

에쿼티알파일반사모혼합자산

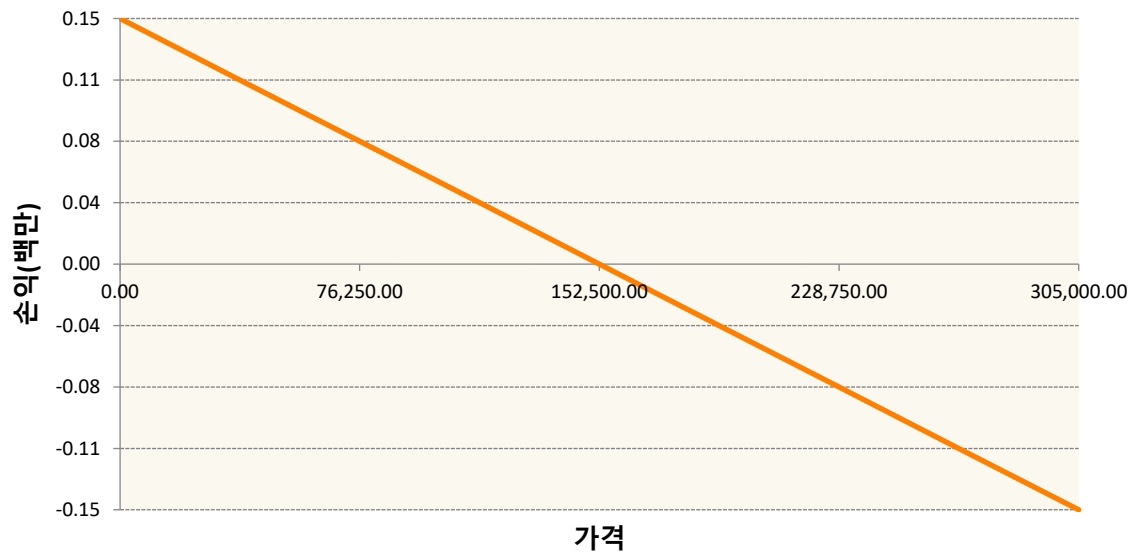
1. 계약금액

(단위:백만원)

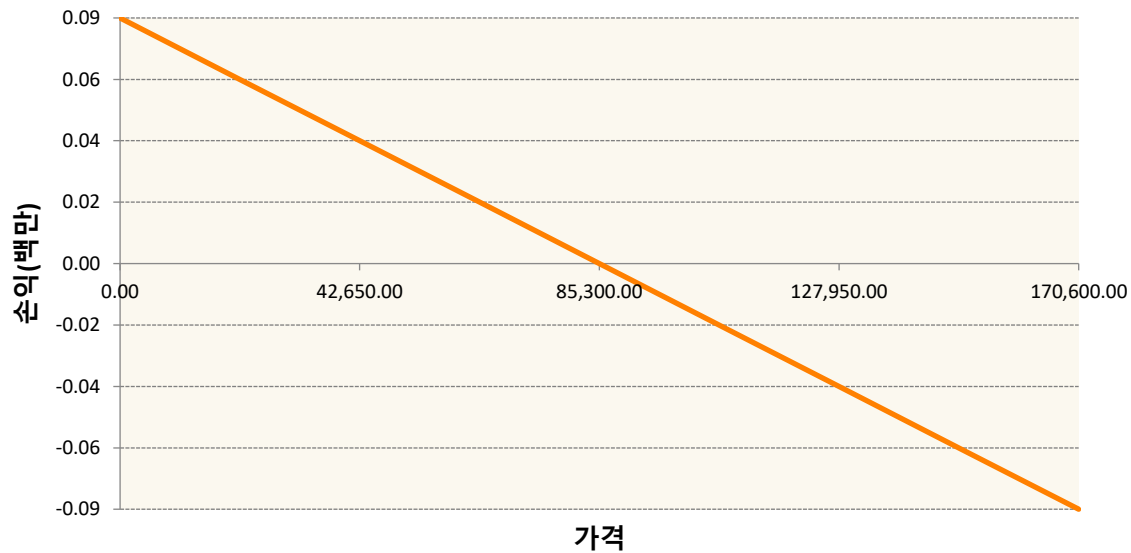
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,068	-1,068	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

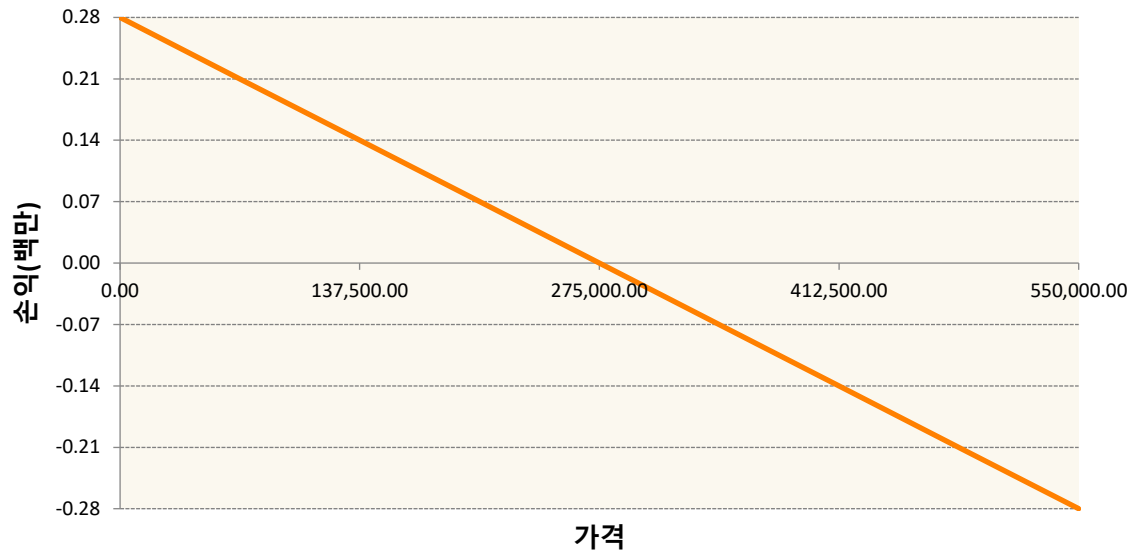
KR4116T10009-2023-01 현대차개별선물



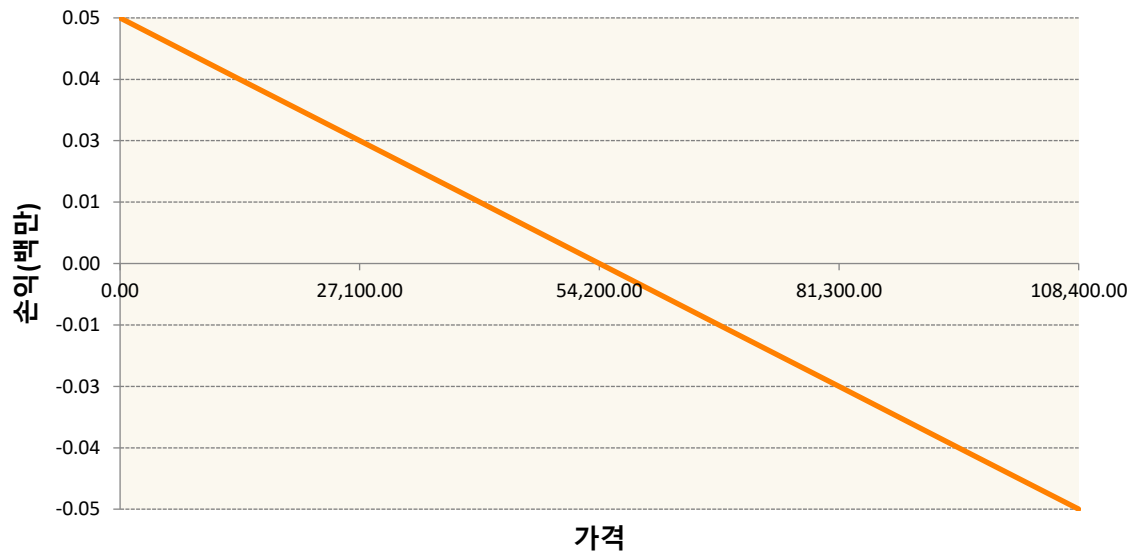
KR4124T10003-2023-01 LG전자개별선물



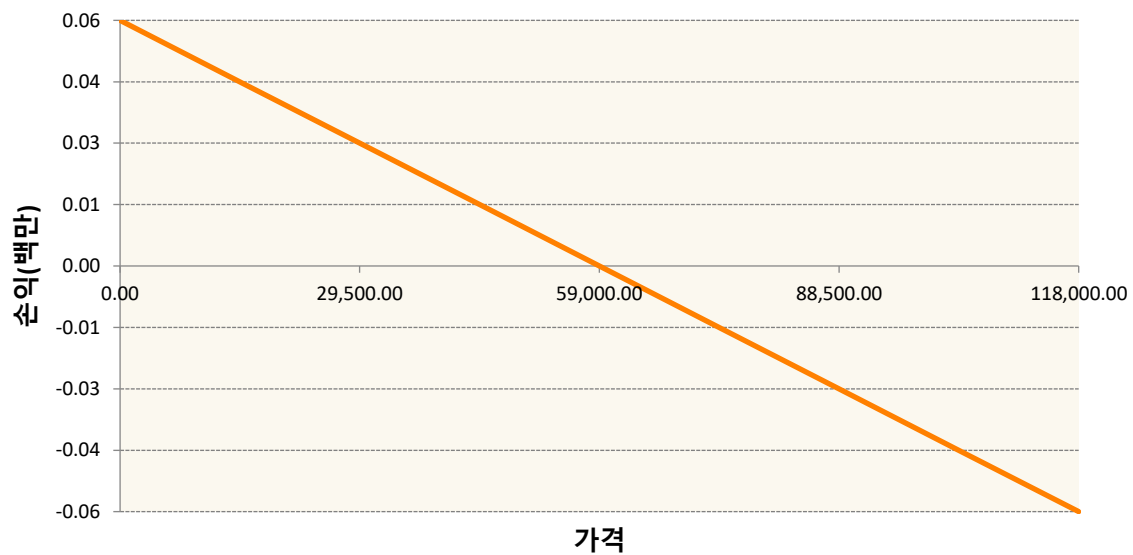
KR41BYT10009-2023-01 LG이노텍개별선물



KR41CFT10006-2023-01 카카오개별선물



KR41F7T10002-2023-01 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4116T100 2023-01 현대차개별선물		12
KR4124T100 2023-01 LG전자개별선물		27
KR41BYT100 2023-01 LG이노텍개별선물		11
KR41CFT100 2023-01 카카오개별선물		26
KR41F7T100 2023-01 카카오페이개별선물		9
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		0
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602		0

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	203

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

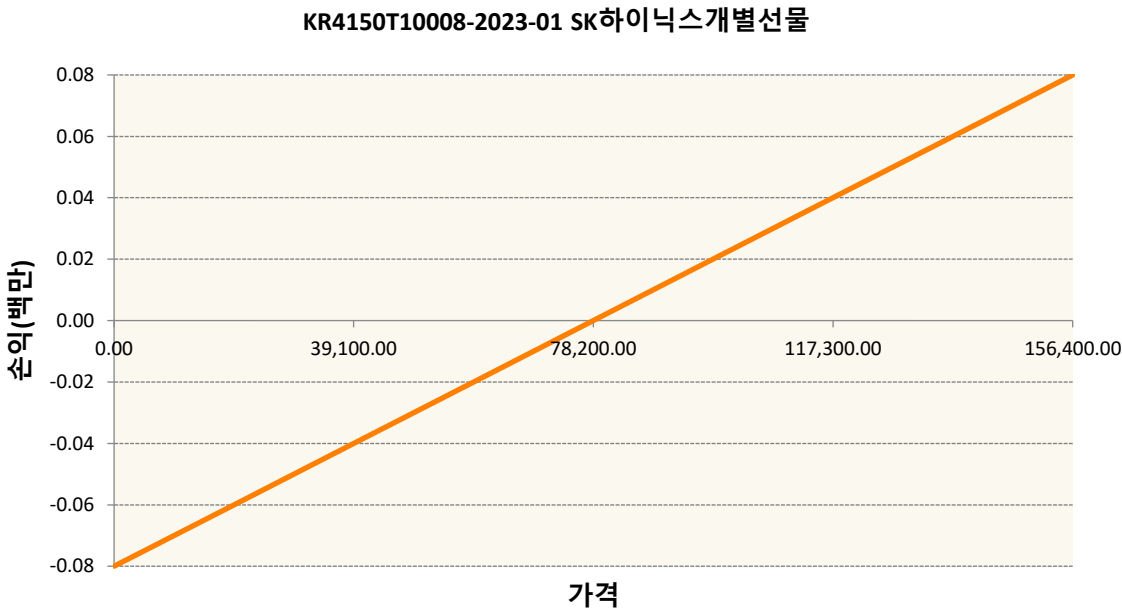
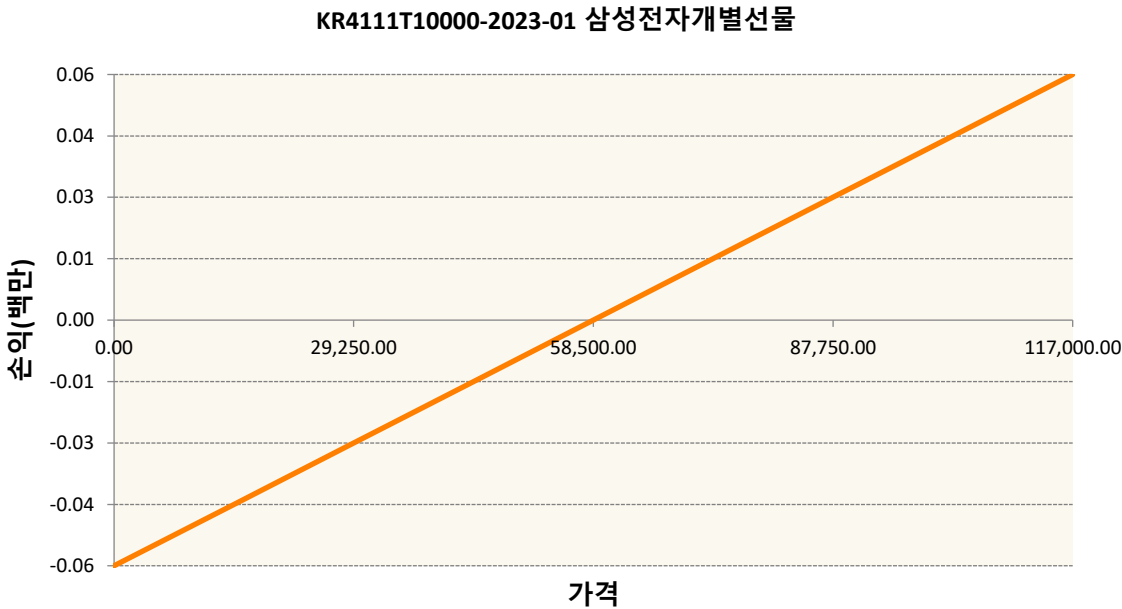
신한SOL한국형글로벌반도체액티

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	141	0	141	장내

2. 만기시점의 손익구조



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	2022-12-21
기준일	2022-12-20

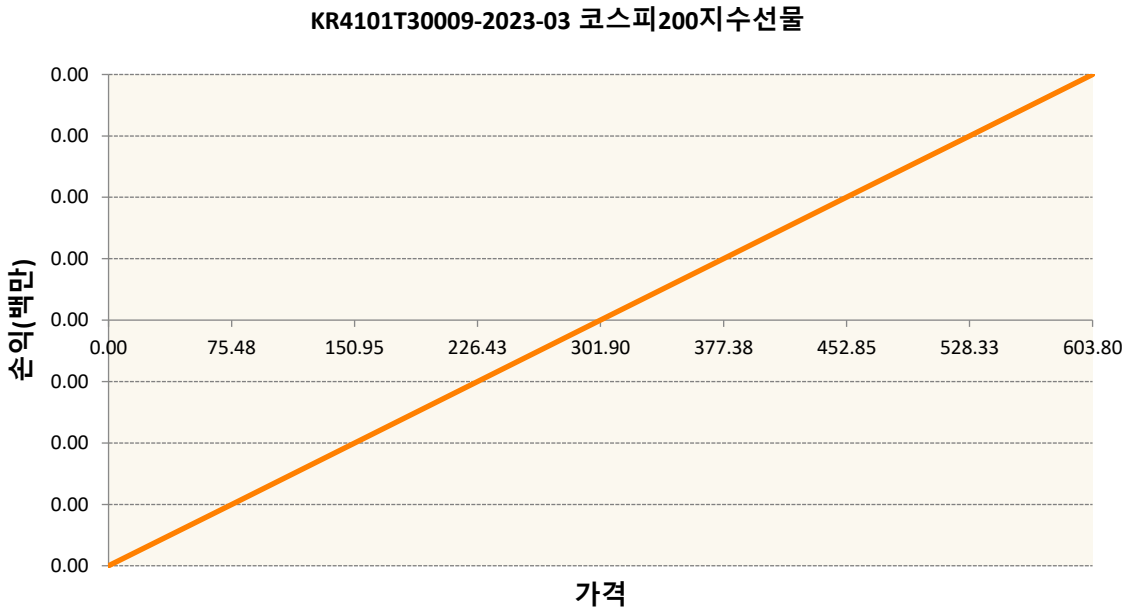
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,264	0	2,264	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				182
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-5.33%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-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%	122	122	122	122	122	122	122
8.00%	182	182	182	182	182	182	182

공시일	2022-12-21
기준일	2022-12-20

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

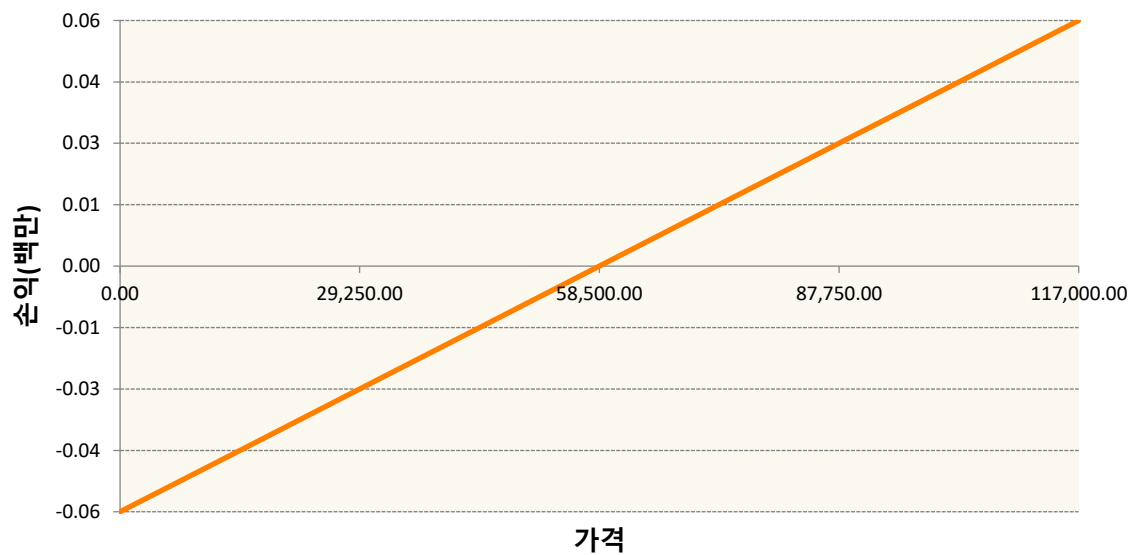
1. 계약금액

(단위:백만원)

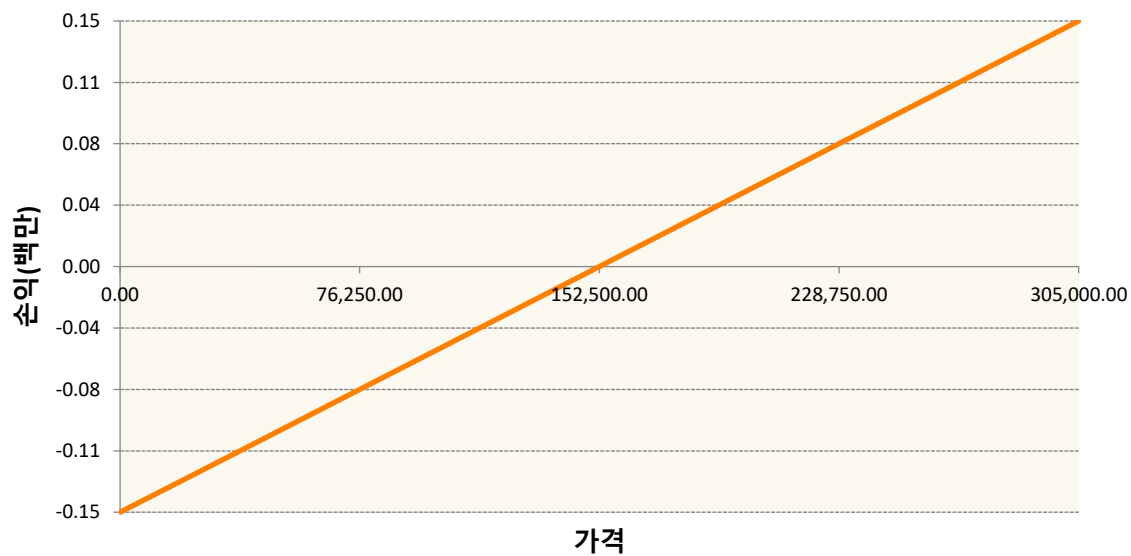
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	228	0	228	장내

2. 만기시점의 손익구조

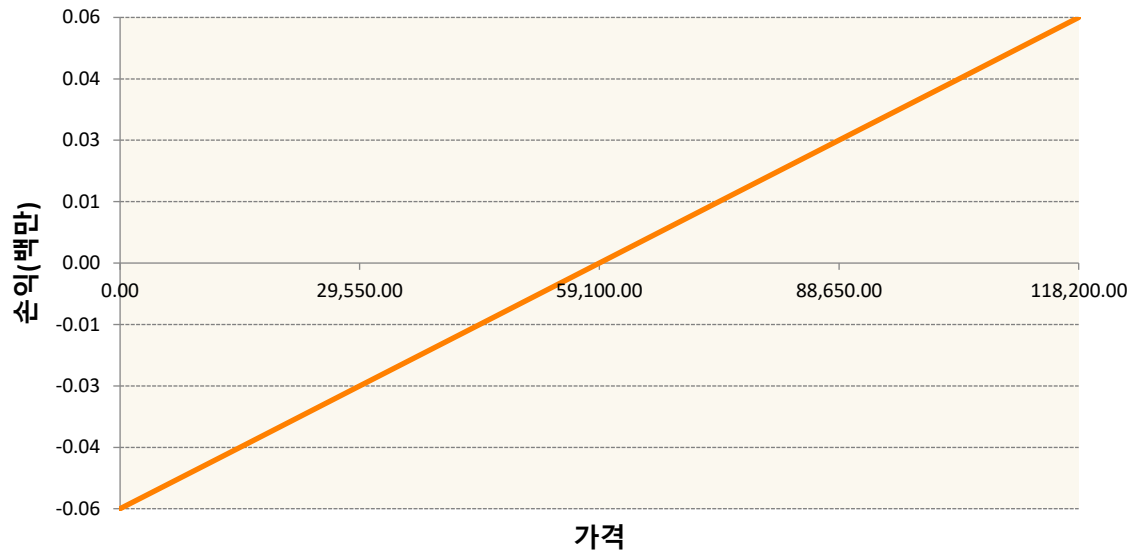
KR4111T10000-2023-01 삼성전자개별선물



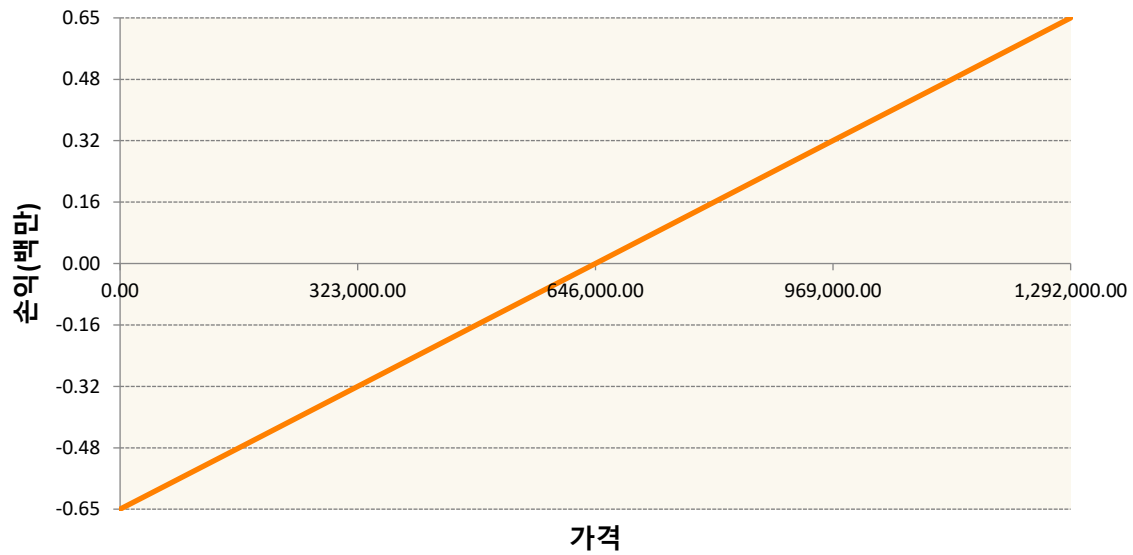
KR4116T10009-2023-01 현대차개별선물



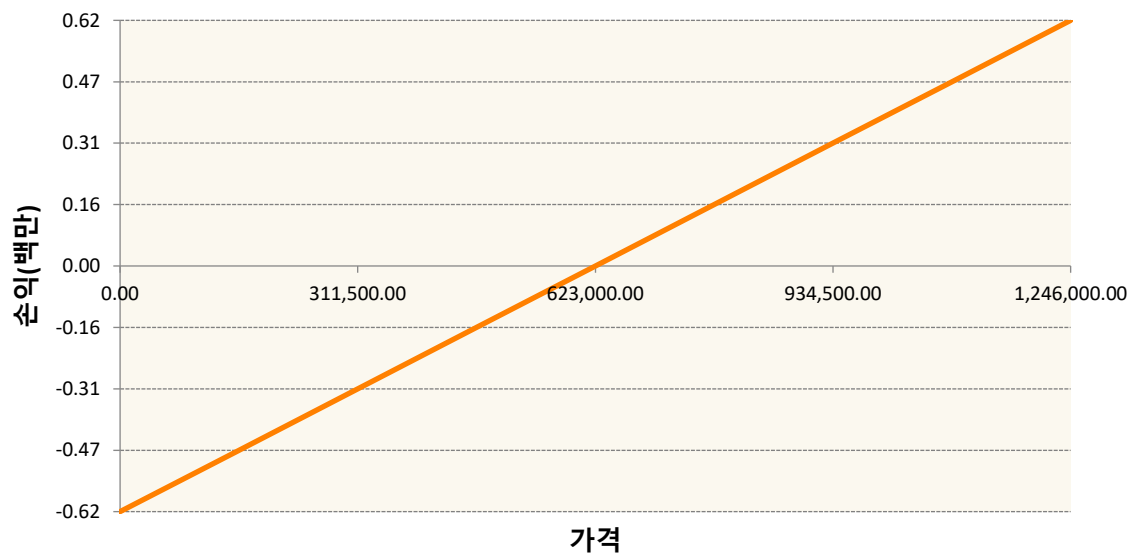
KR4119T10003-2023-01 기아개별선물



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%	0	0	0	0	0	0	0	0		
-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%	0	0	0	0	0	0	0	0		
8.00%	1	1	1	1	1	1	1	1		
KR4122T10007								2023-01 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		
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	2022-12-21
기준일	2022-12-20

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

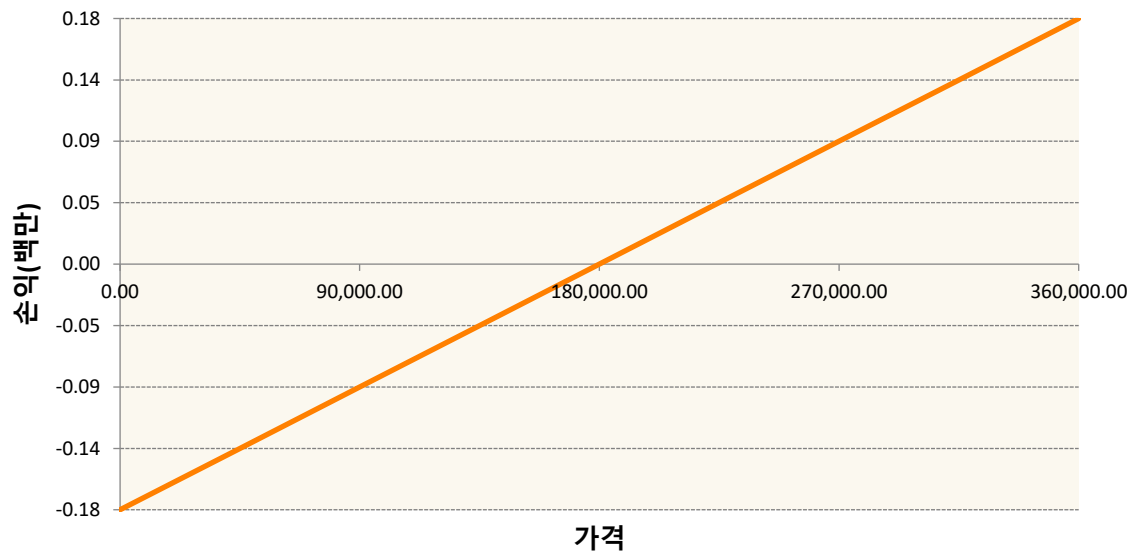
1. 계약금액

(단위:백만원)

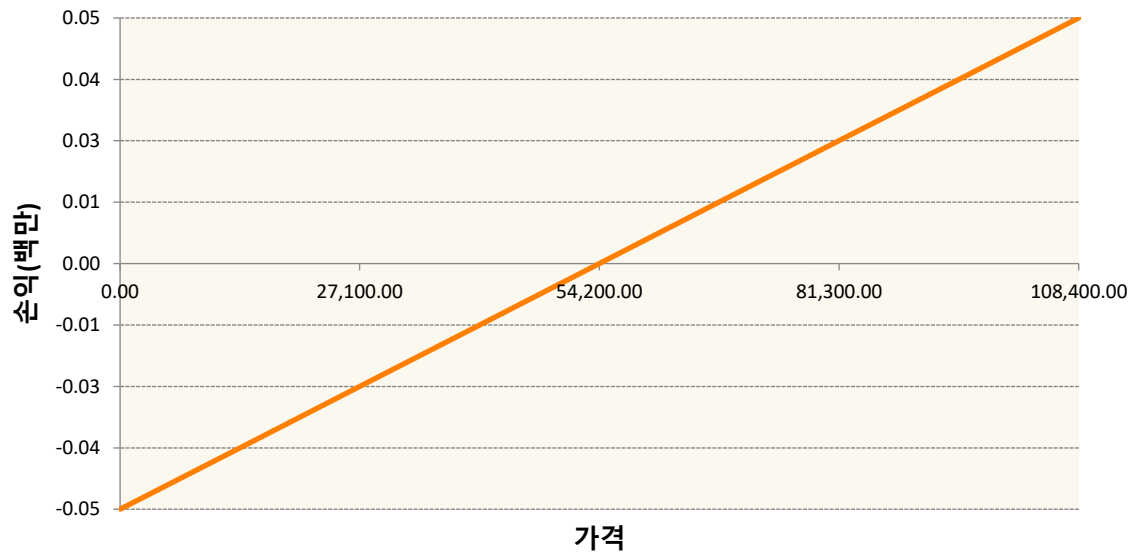
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	112	0	112	장내

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	2022-12-21
기준일	2022-12-20

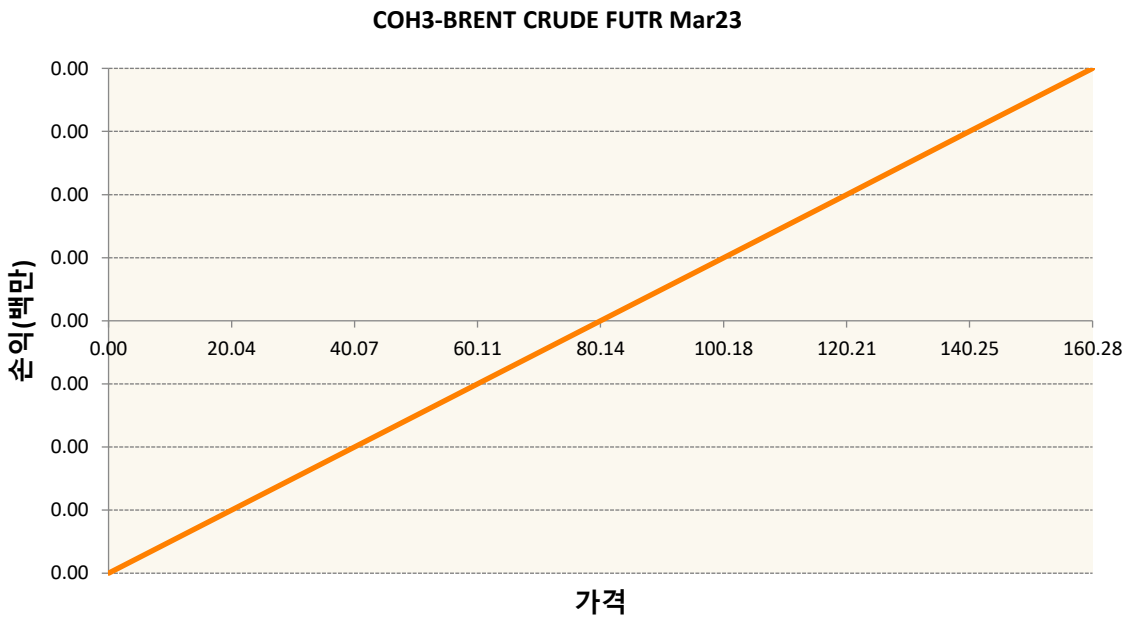
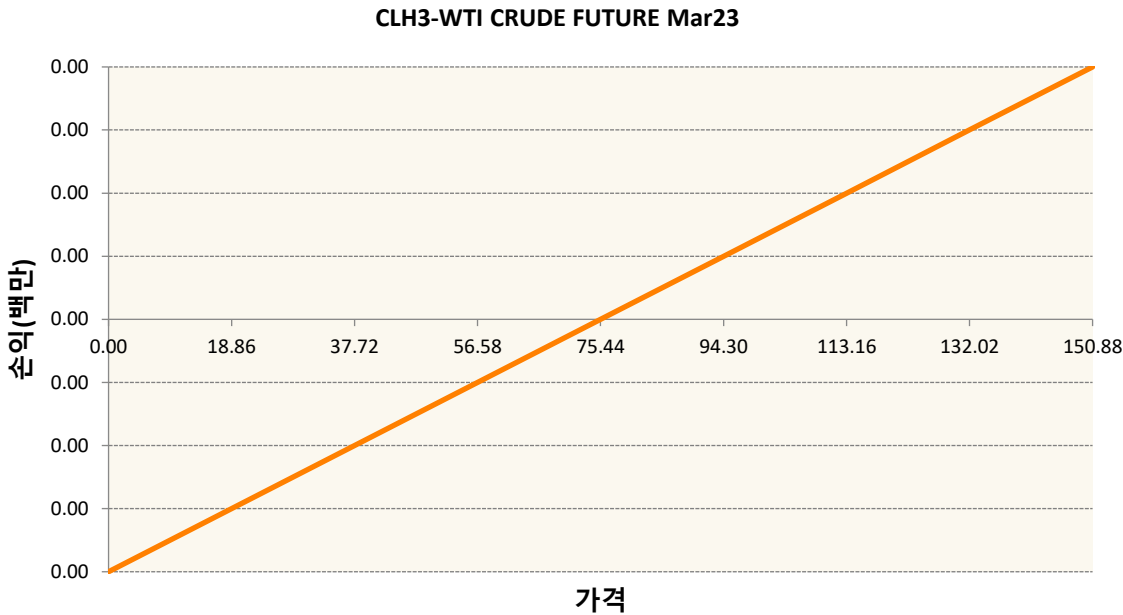
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

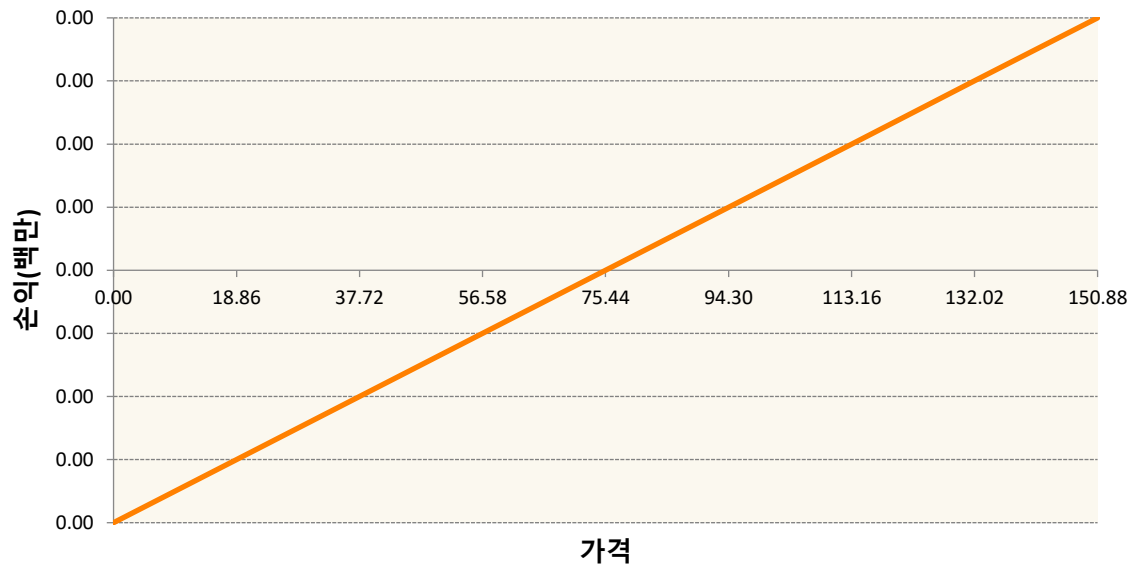
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,758	322	1,436	

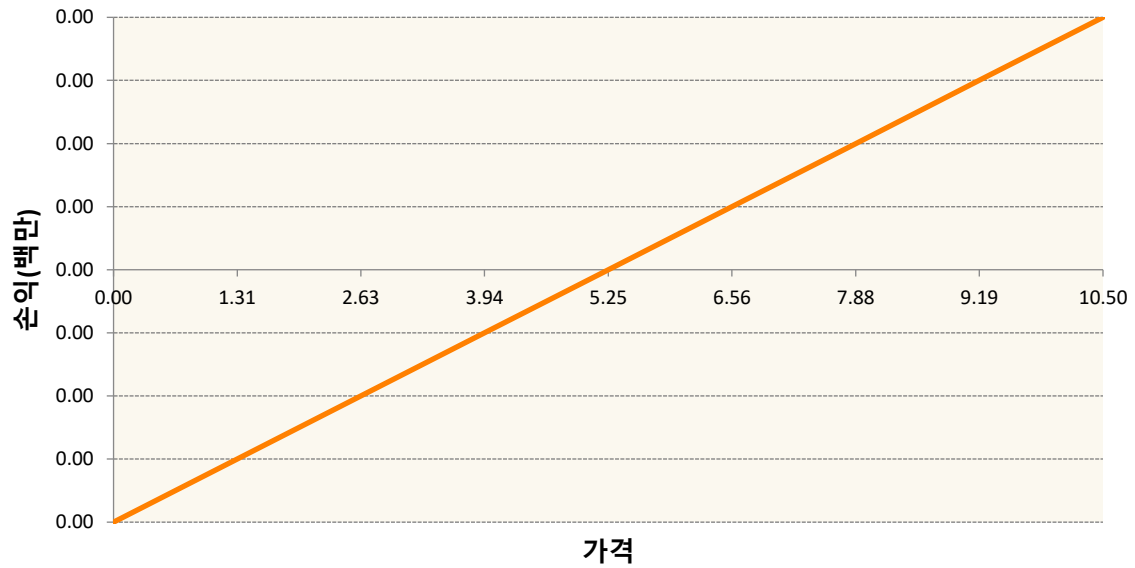
2. 만기시점의 손익구조



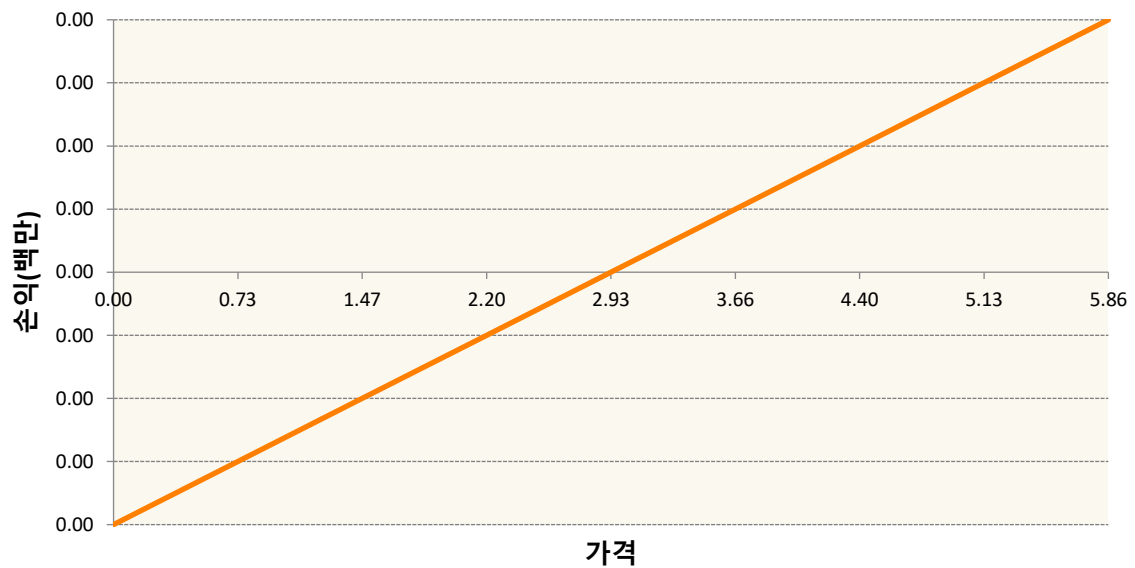
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



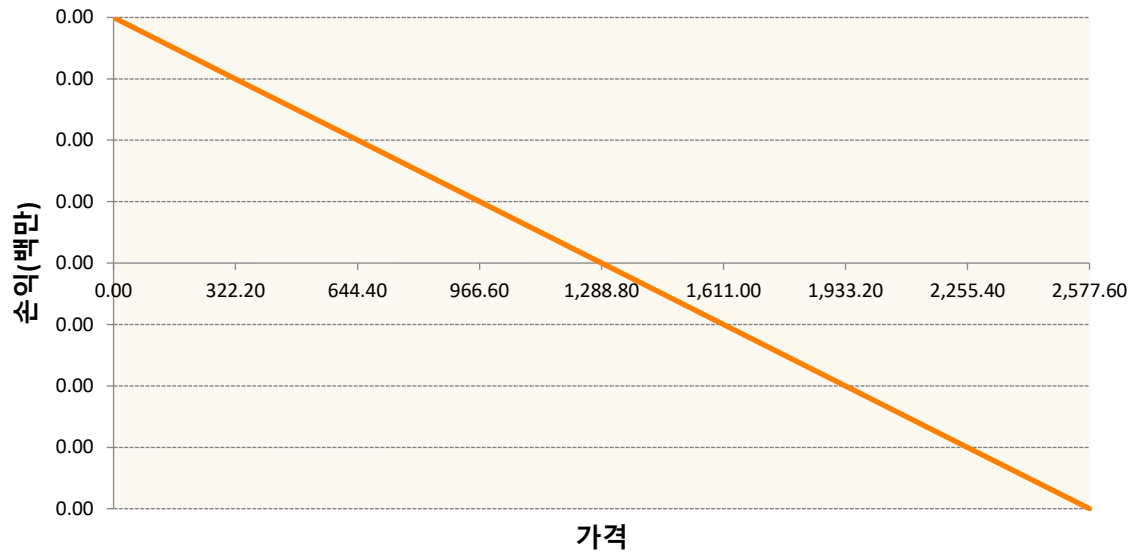
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



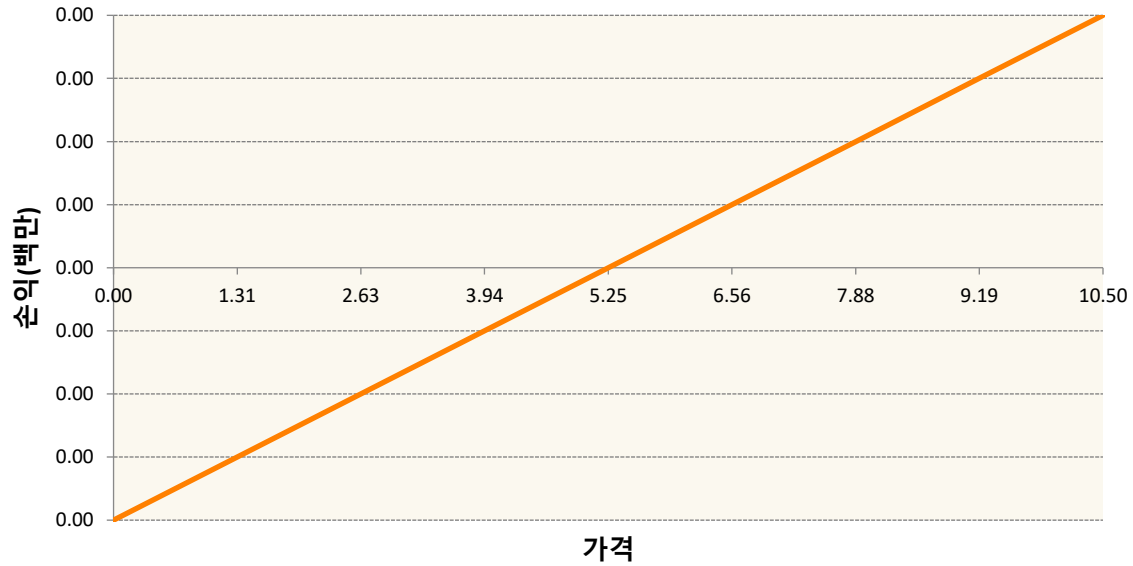
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



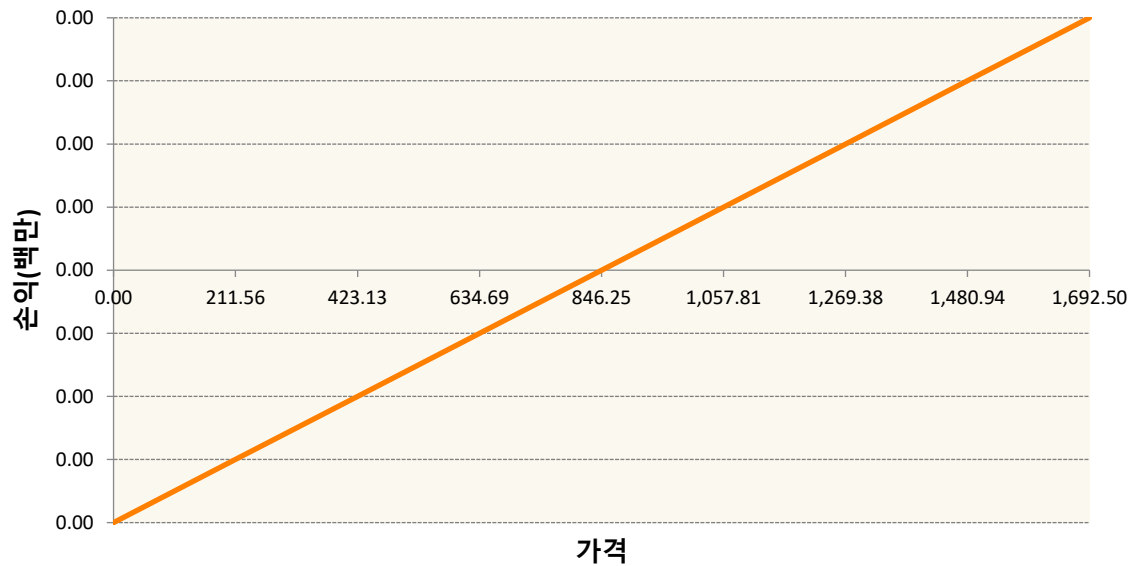
KR4175T10005-2023-01 달러선물

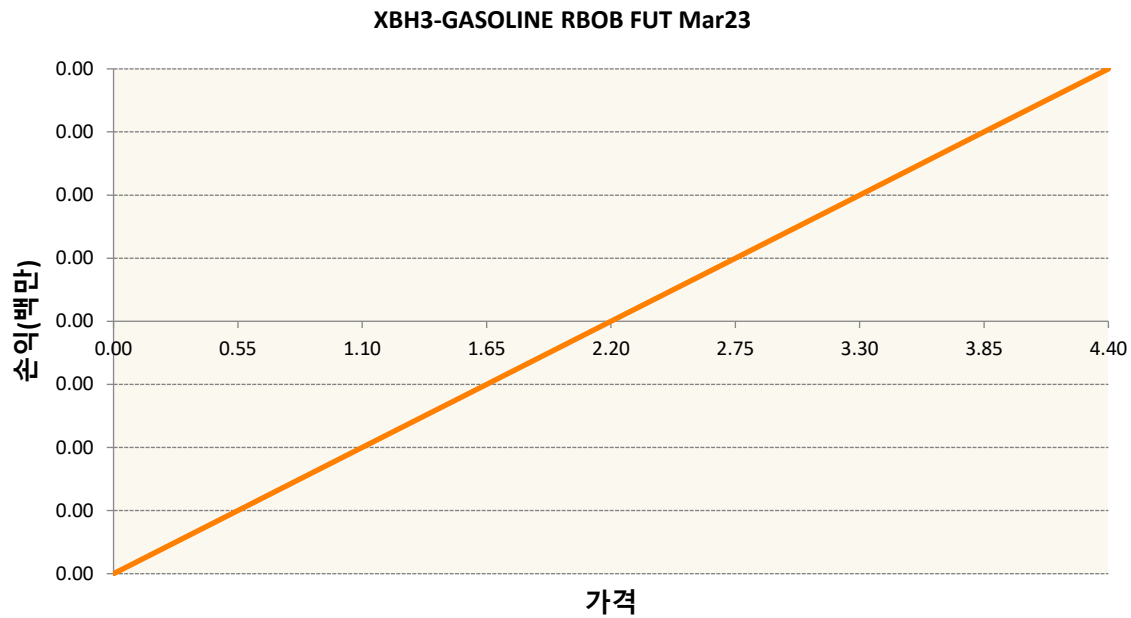


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	24
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	25
ECH3	E-mini Crude Oil Mar23	8
EOH3	E-MINI NATURAL GAS Mar23	3
HOH3	NY Harb ULSD Fut Mar23	13
KR4175T100 2023-01 달러선물		26
NGH23	NATURAL GAS FUTR Mar23	50
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	9
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	483