

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

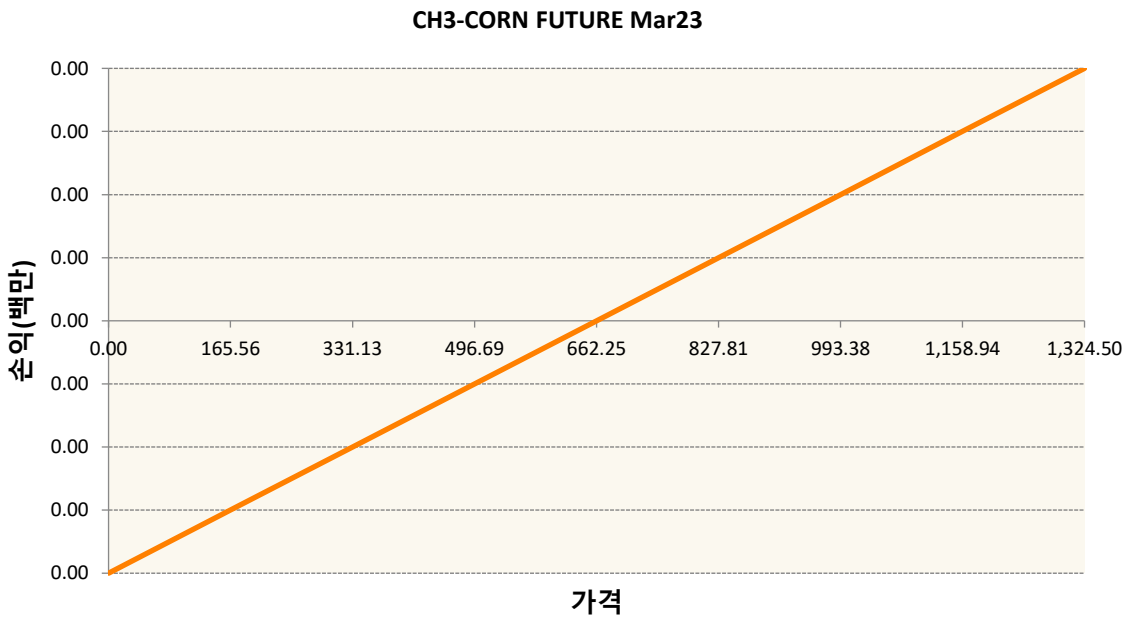
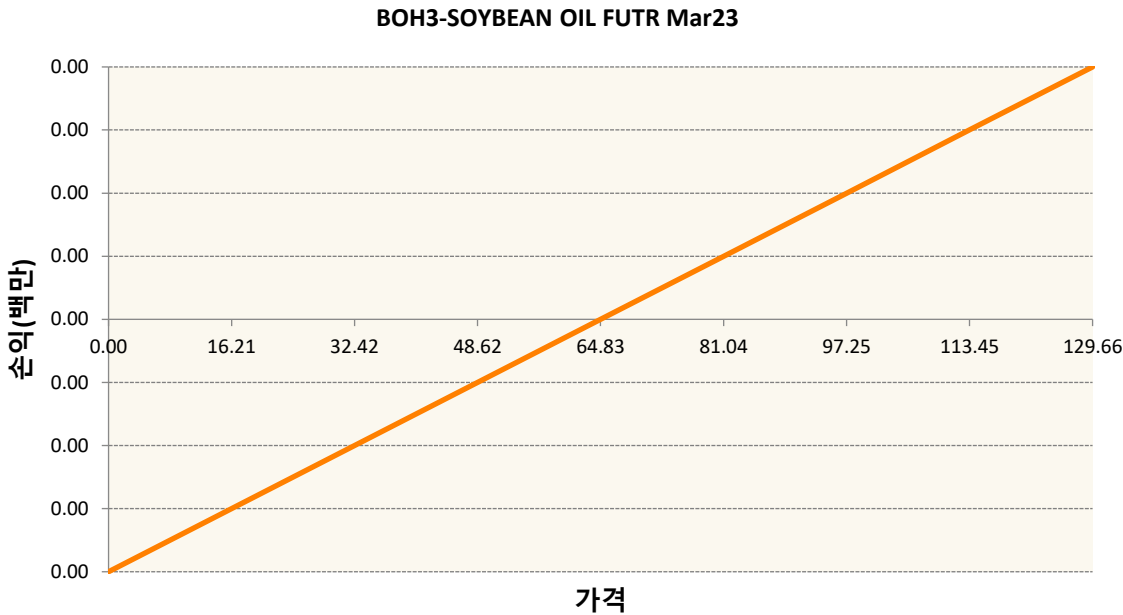
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

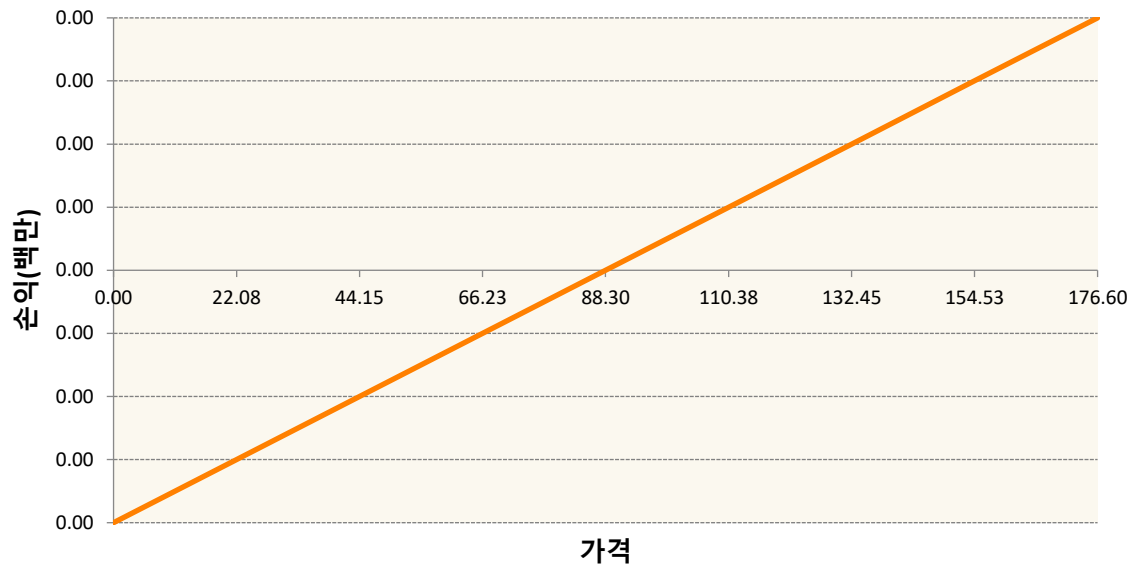
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,428	765	5,663	

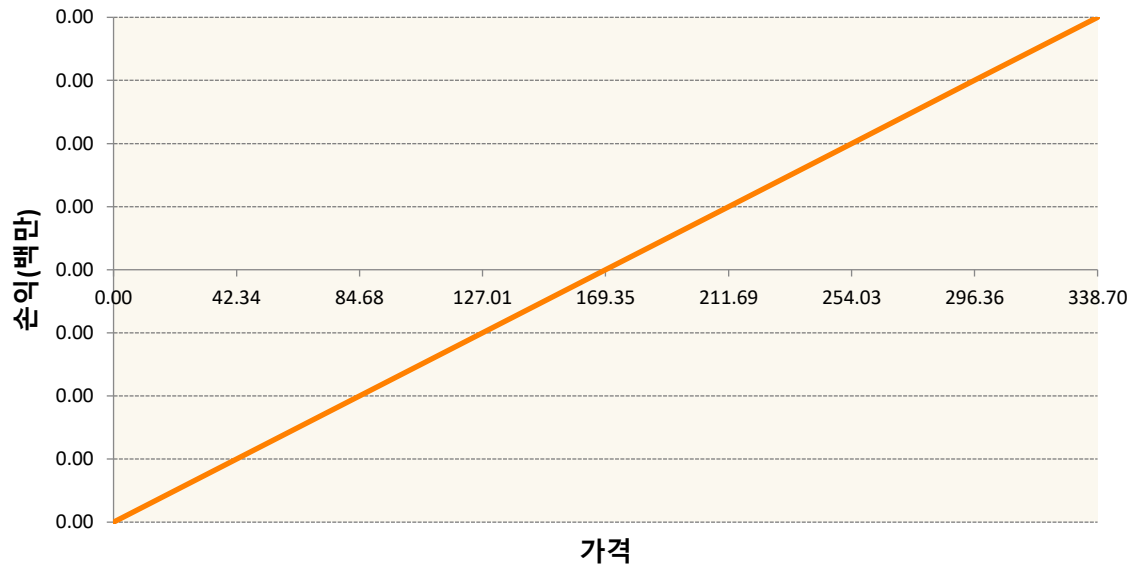
2. 만기시점의 손익구조



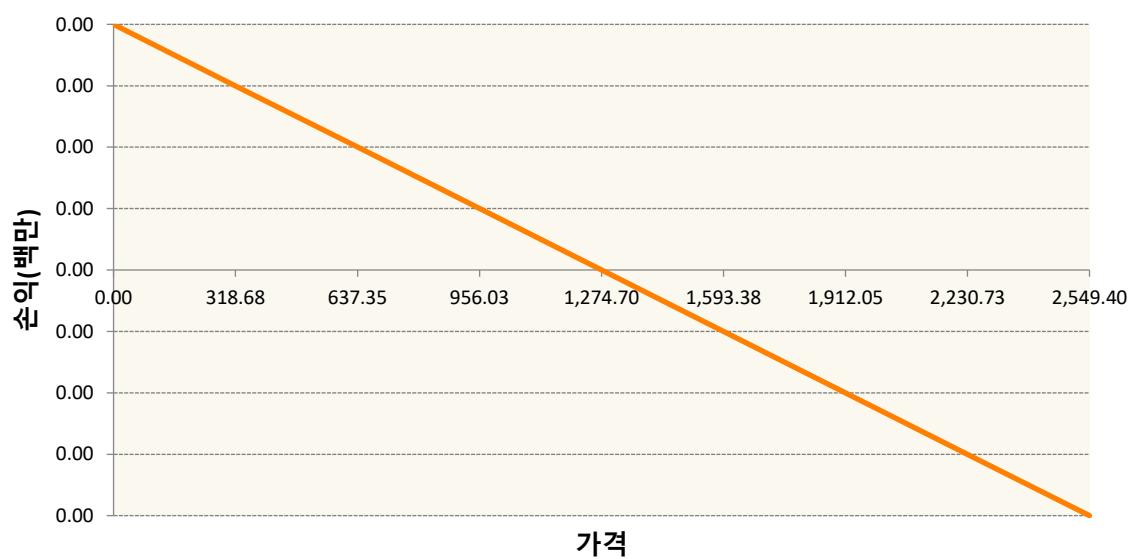
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



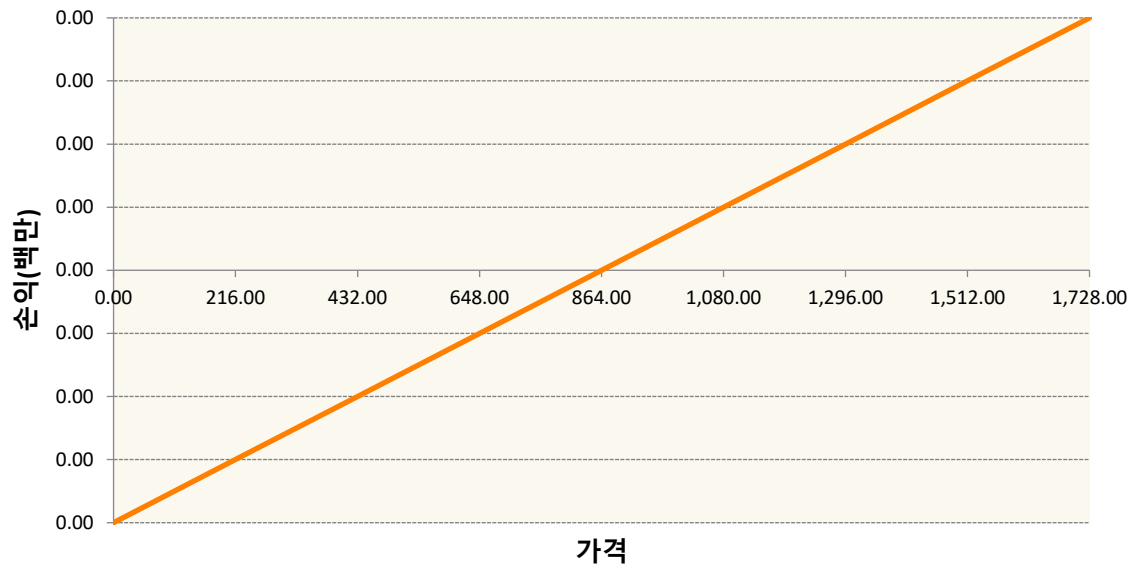
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



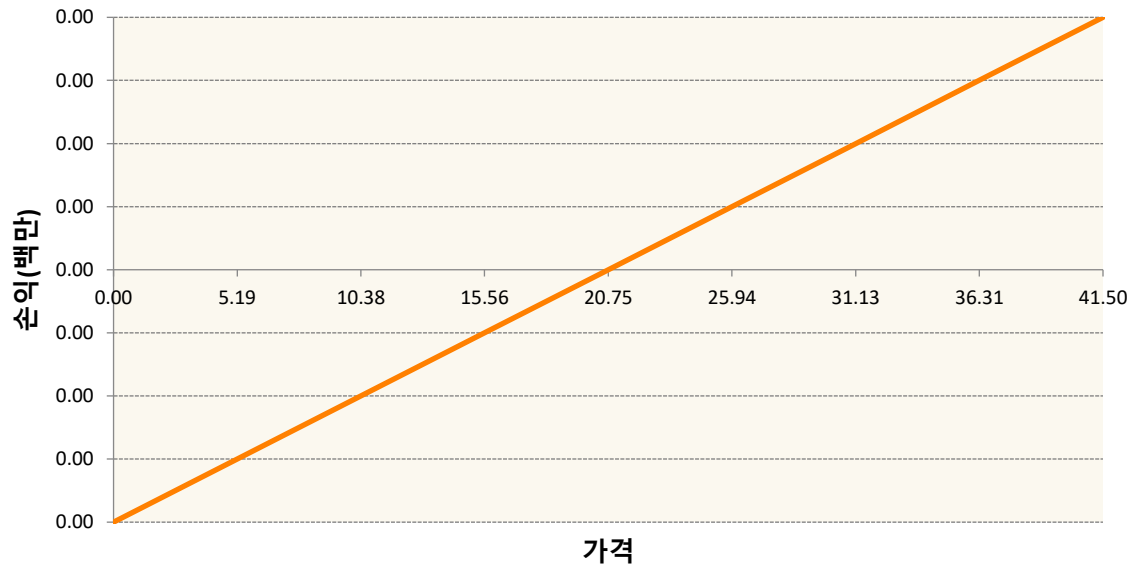
KR4175T10005-2023-01 달러선물



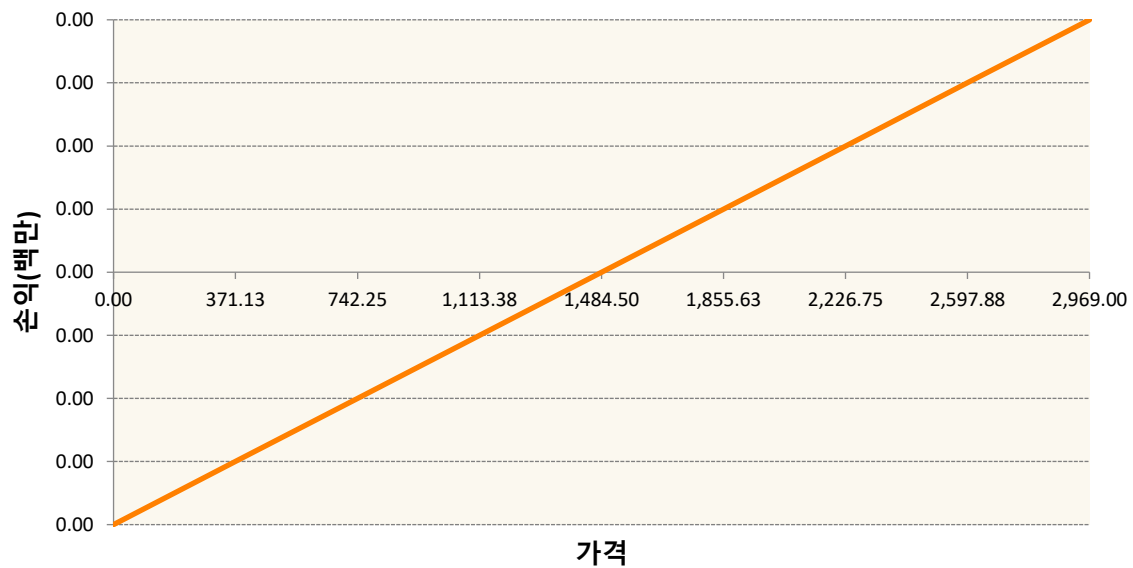
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



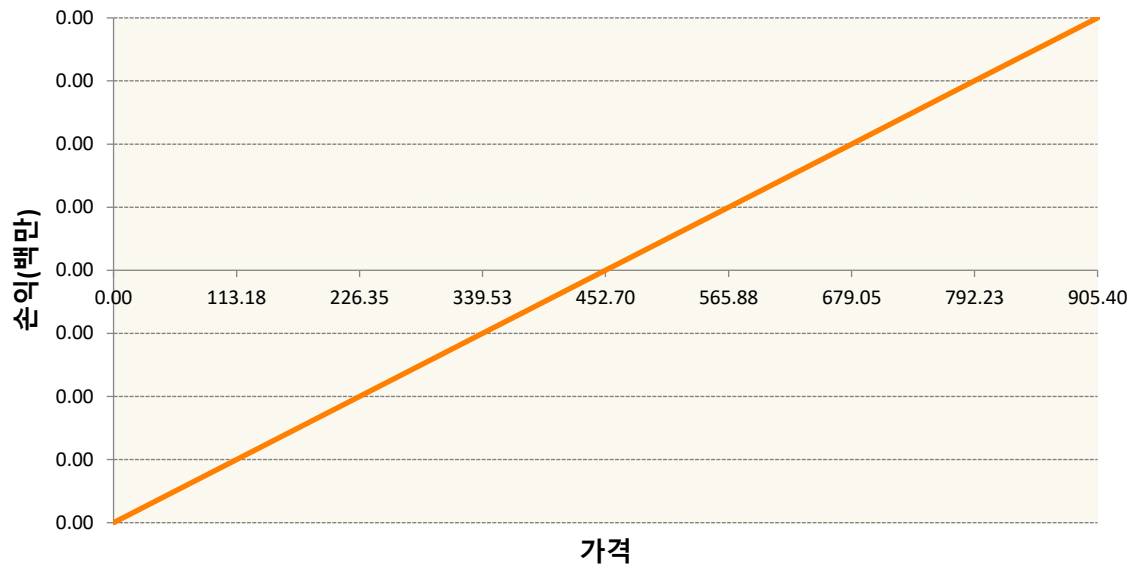
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



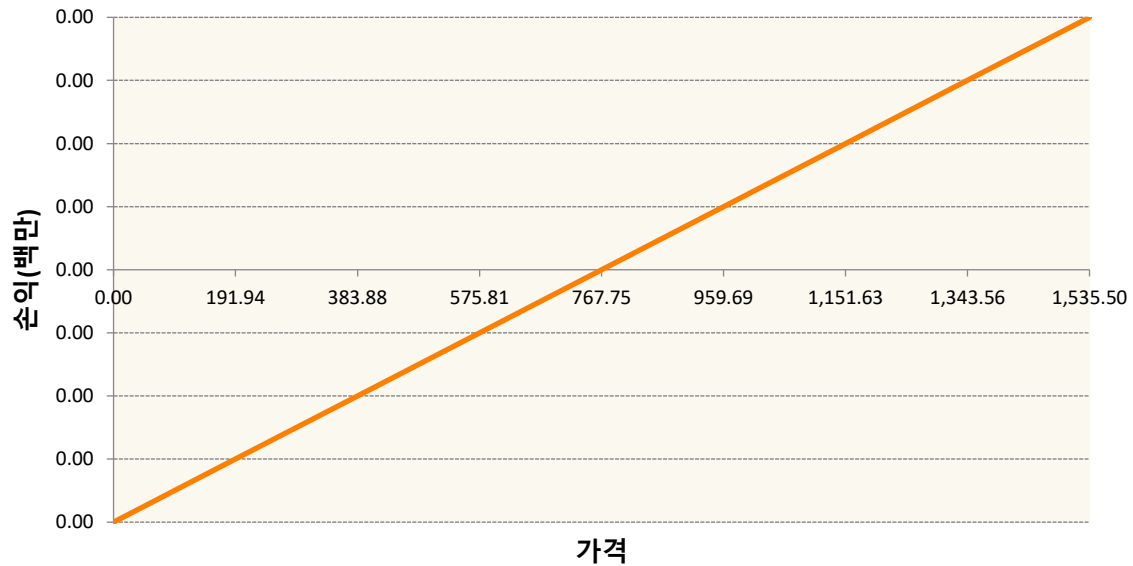
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



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	2022-12-23
기준일	2022-12-22

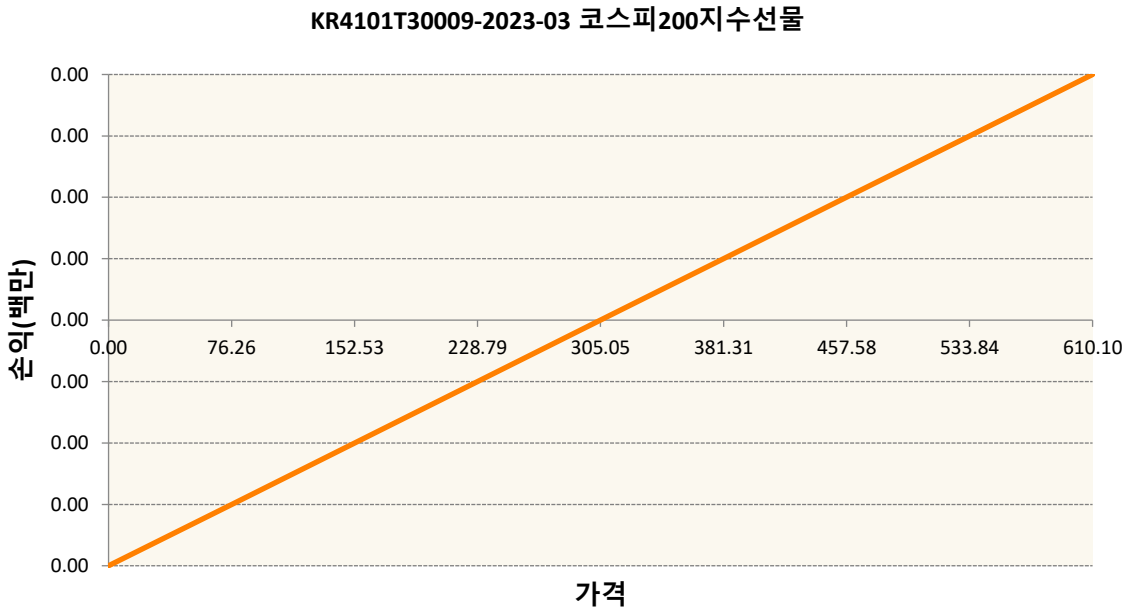
스마트인덱스모

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	1,907	0	1,907	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	2022-12-23
기준일	2022-12-22

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	333
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

466

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

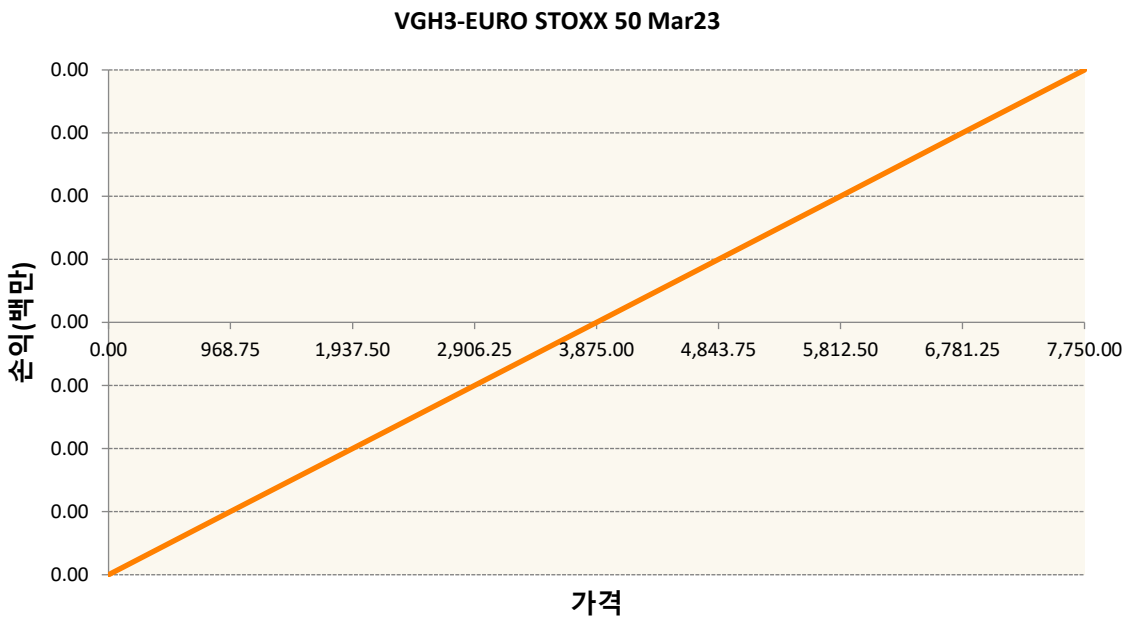
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	537	0	537	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH3	EURO STOXX 50 Mar23	43
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

46

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

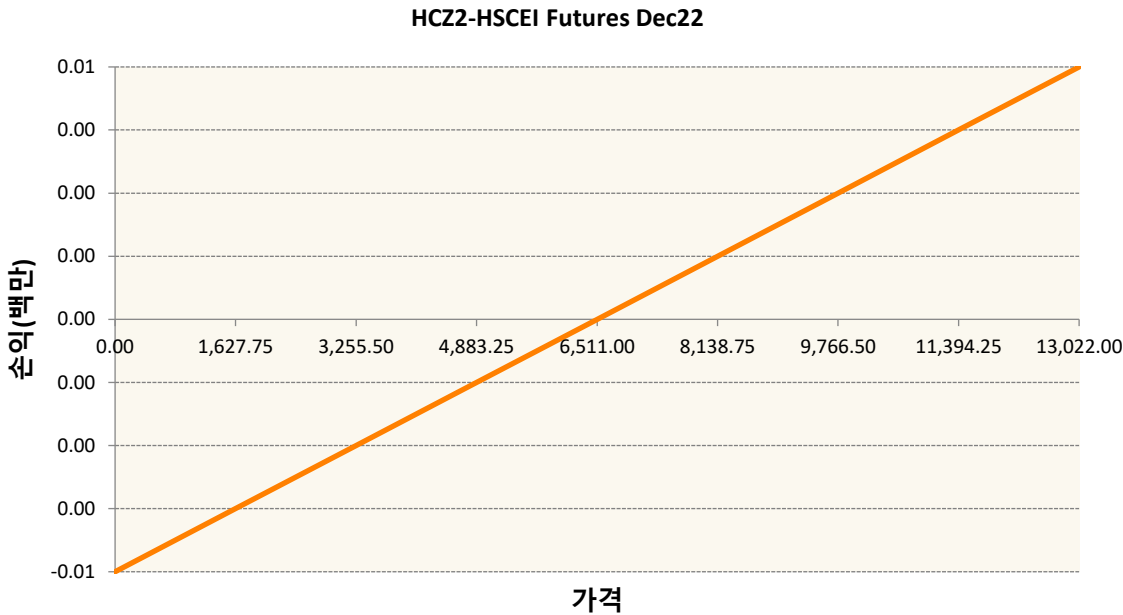
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,321	0	1,321	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ2	HSCEI Futures Dec22	106
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

142

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

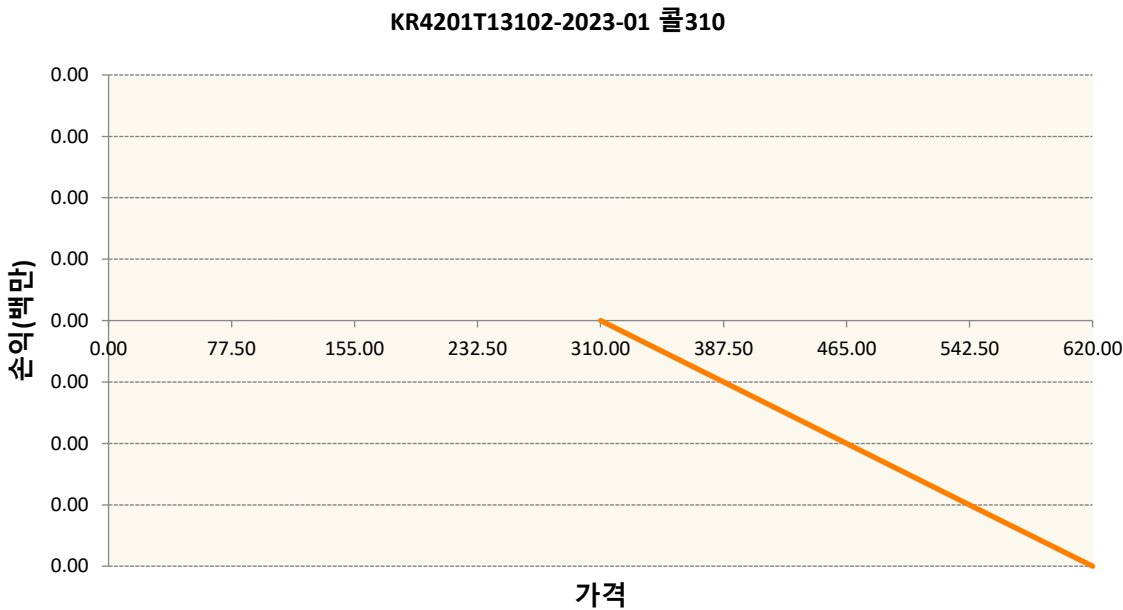
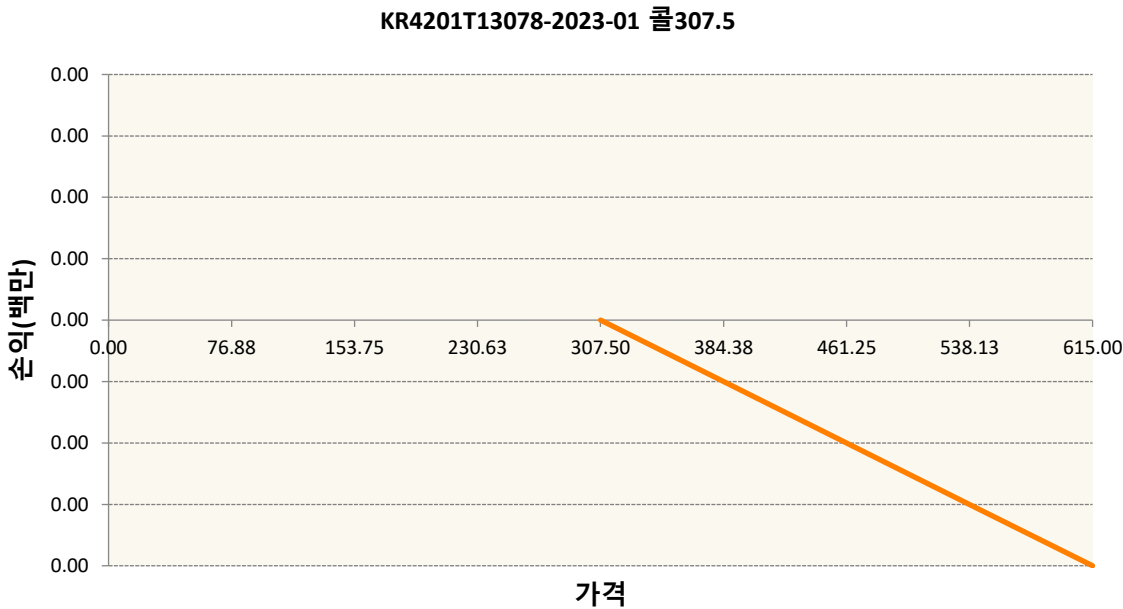
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

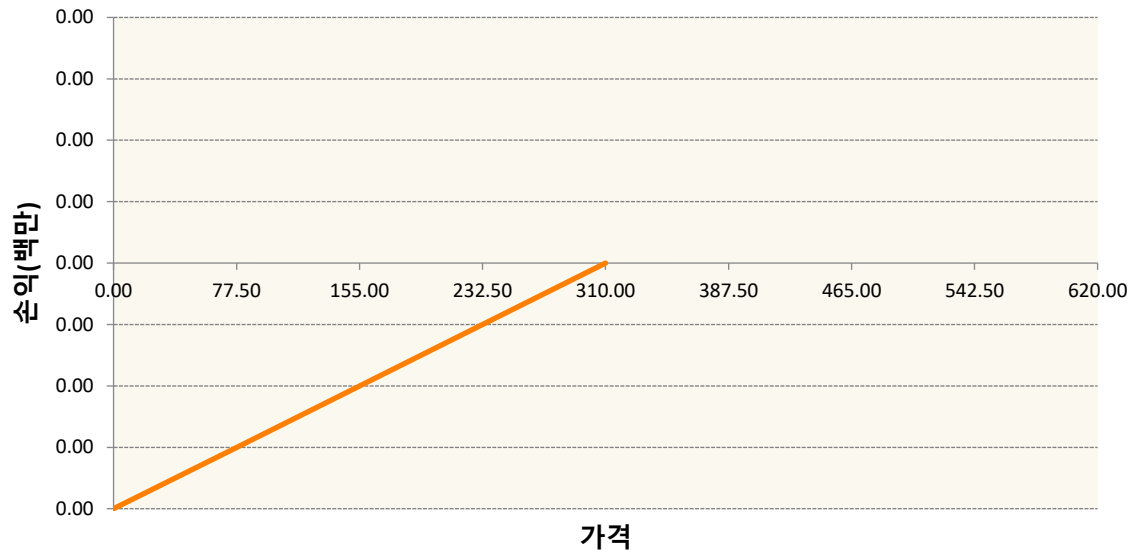
(단위:백만원)

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				2,367
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,513	1,413	1,306	1,194	1,077	957	834
-5.33%	1,270	1,145	1,016	884	750	614	477
-2.67%	921	777	632	487	341	195	48
0%	454	302	151	0	-151	-302	-453
2.67%	-132	-279	-427	-576	-725	-875	-1,026
5.33%	-825	-958	-1,095	-1,235	-1,377	-1,520	-1,665
8.00%	-1,611	-1,724	-1,843	-1,968	-2,098	-2,231	-2,367
KR4201T13102			2023-01 콜310				402
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	247	231	214	195	175	155	134
-5.33%	210	189	167	145	122	99	76
-2.67%	155	130	105	80	55	30	4
0%	79	53	26	0	-26	-53	-79
2.67%	-17	-43	-69	-96	-122	-149	-175
5.33%	-132	-156	-181	-206	-232	-257	-283
8.00%	-264	-285	-307	-330	-354	-378	-402
KR4301T13100			2023-01 풋310				577
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-412	-435	-461	-488	-517	-547	-577
-5.33%	-209	-239	-271	-304	-337	-371	-405
-2.67%	-32	-67	-104	-140	-177	-214	-251
0%	116	77	39	0	-39	-77	-116

2.67%	234	195	156	118	79	40	1
5.33%	323	287	251	214	176	139	101
8.00%	387	356	324	290	256	220	184

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

(단위:백만원)

2,822

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

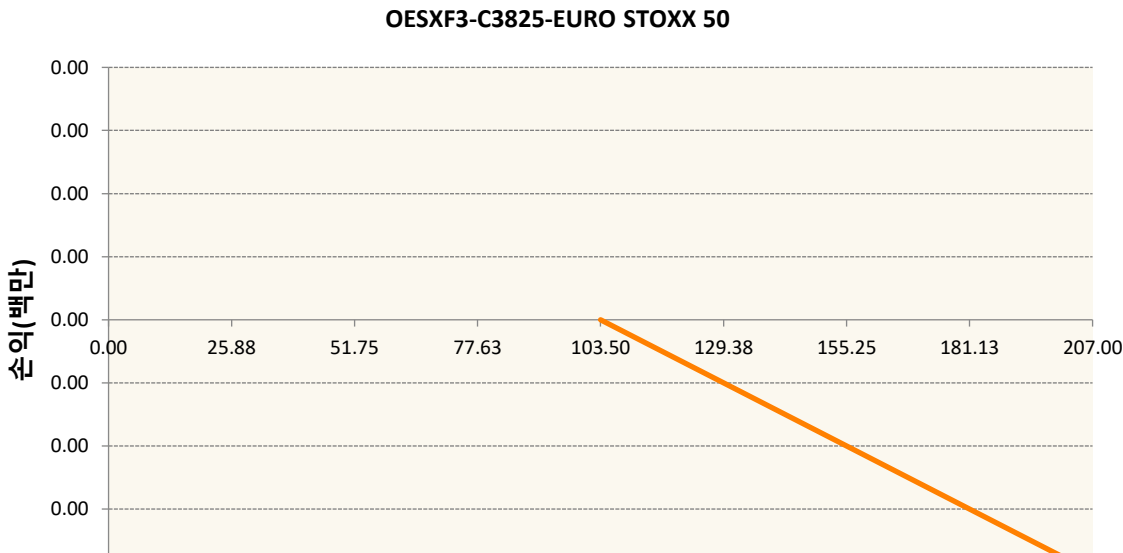
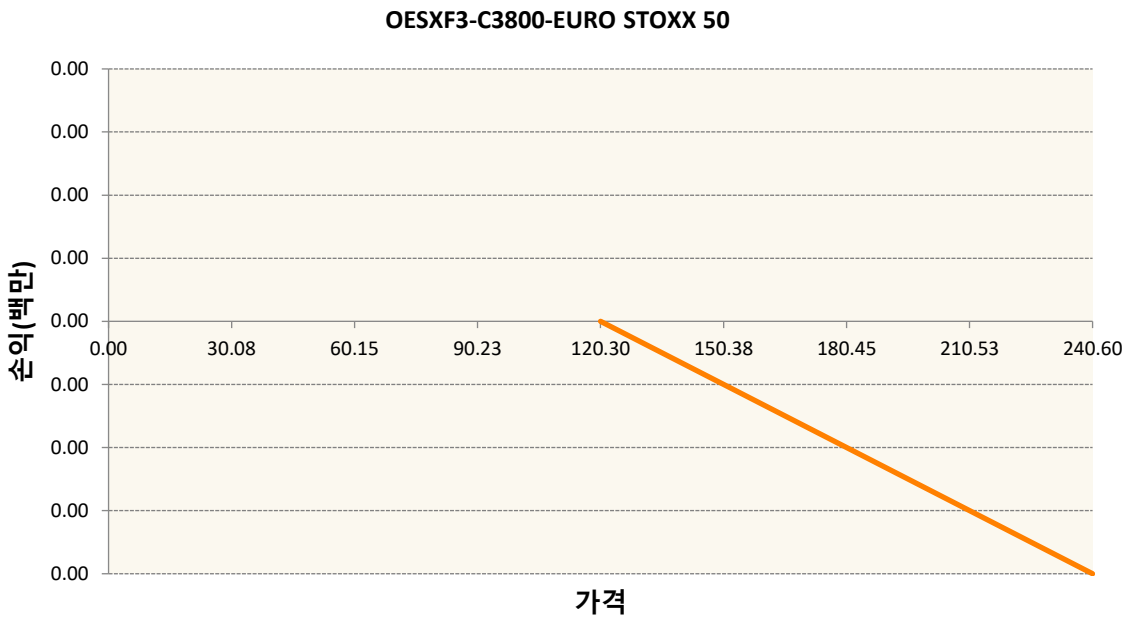
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

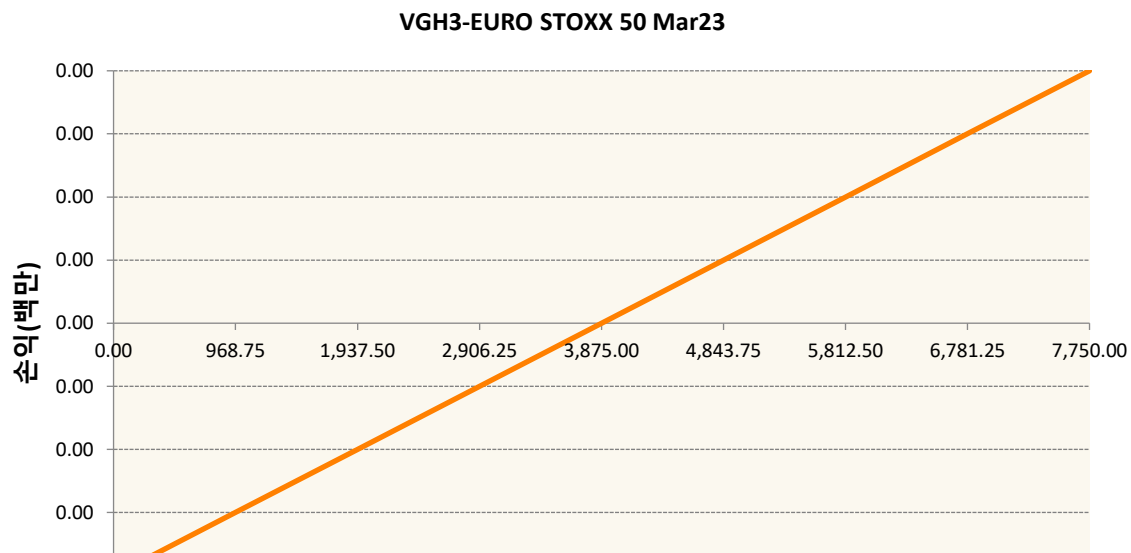
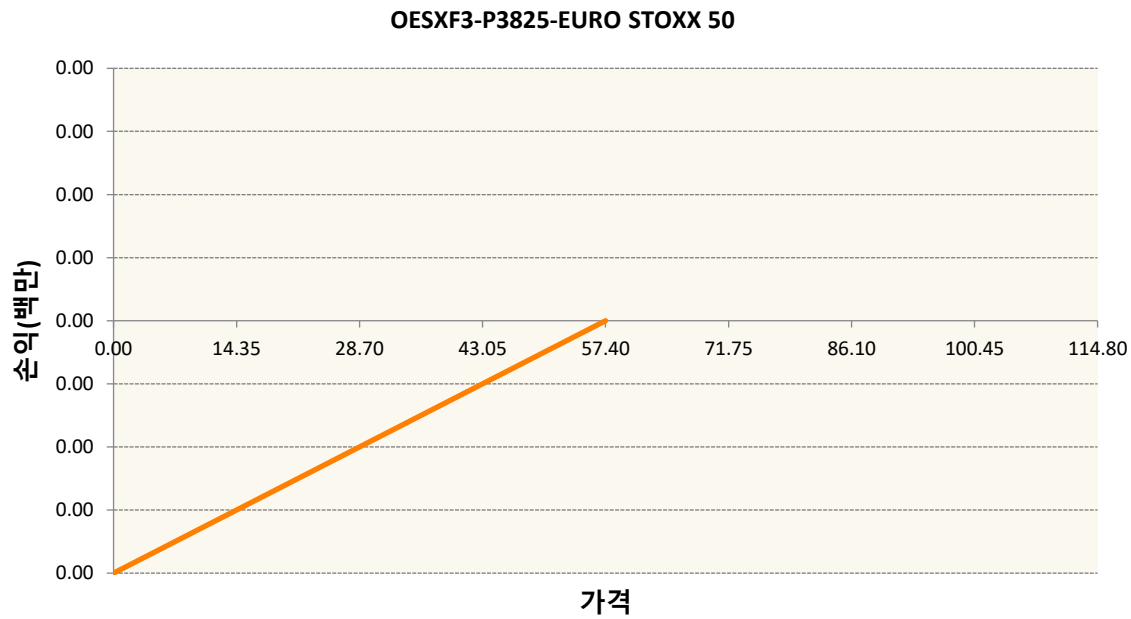
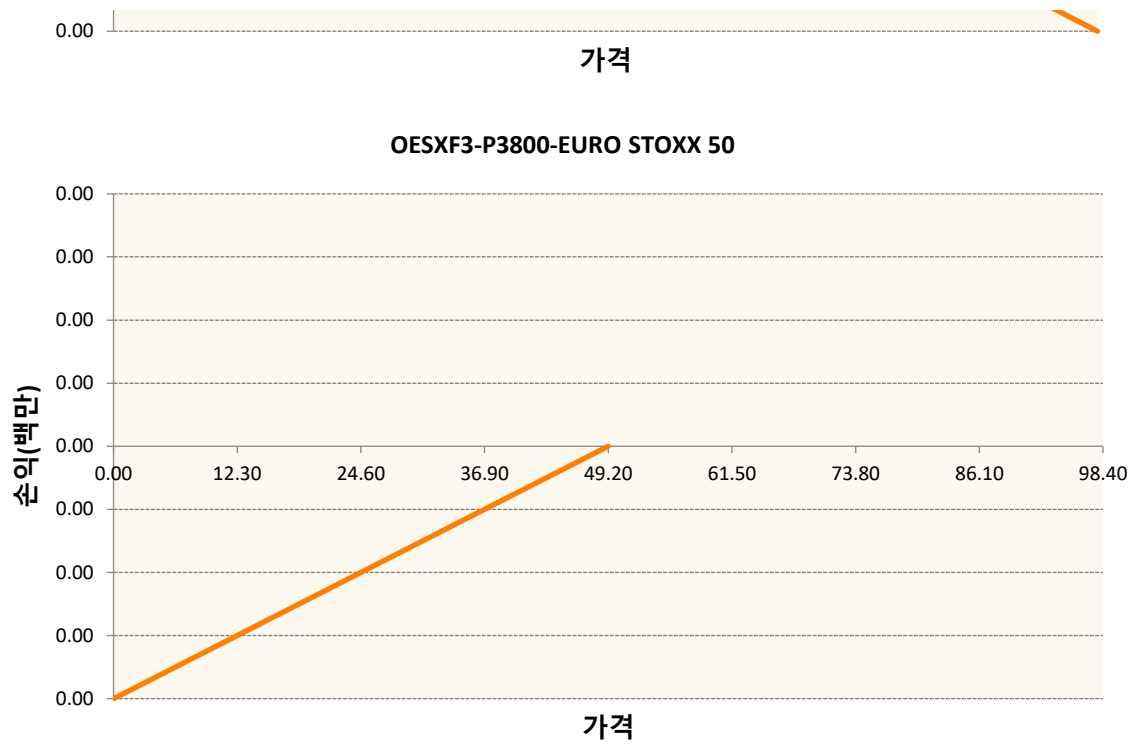
1. 계약금액

(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	1,077	0	1,077	
누계	유가증권	옵션	0	91	-91	장내
누계	통화	선도	136	2,921	-2,785	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CAD KRW/EUR 23-12-22E		54
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E		54
FXW213CBG KRW/EUR 24-02-23E		71
FXW213CBN EUR/KRW 24-02-23E		11
FXW213CCM KRW/EUR 24-03-23E		54
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		4
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		1
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		2
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		0.44
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		86

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	280

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

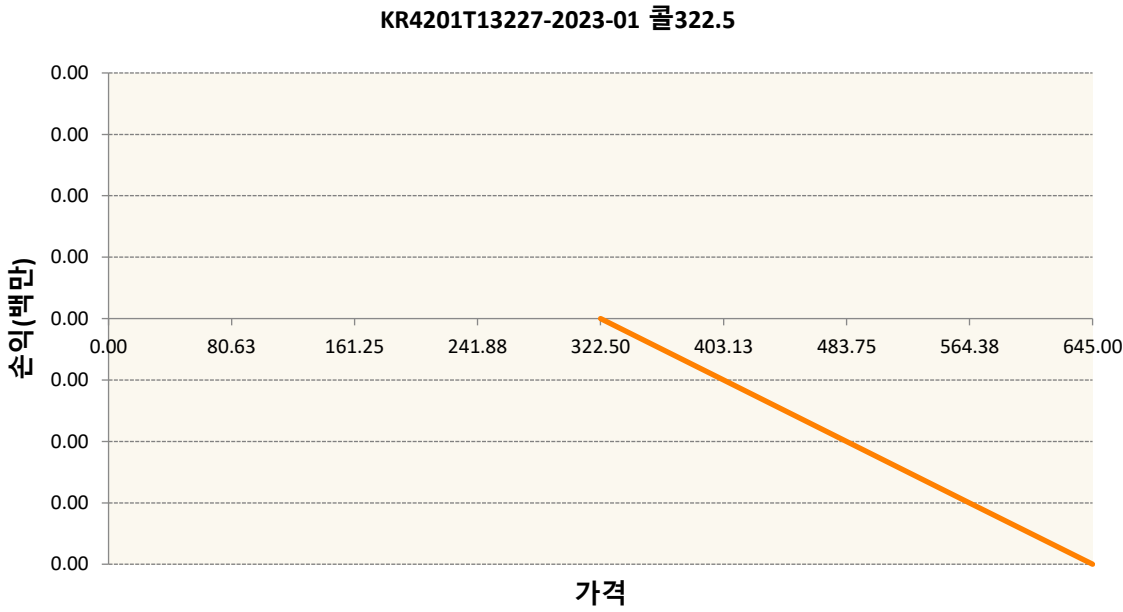
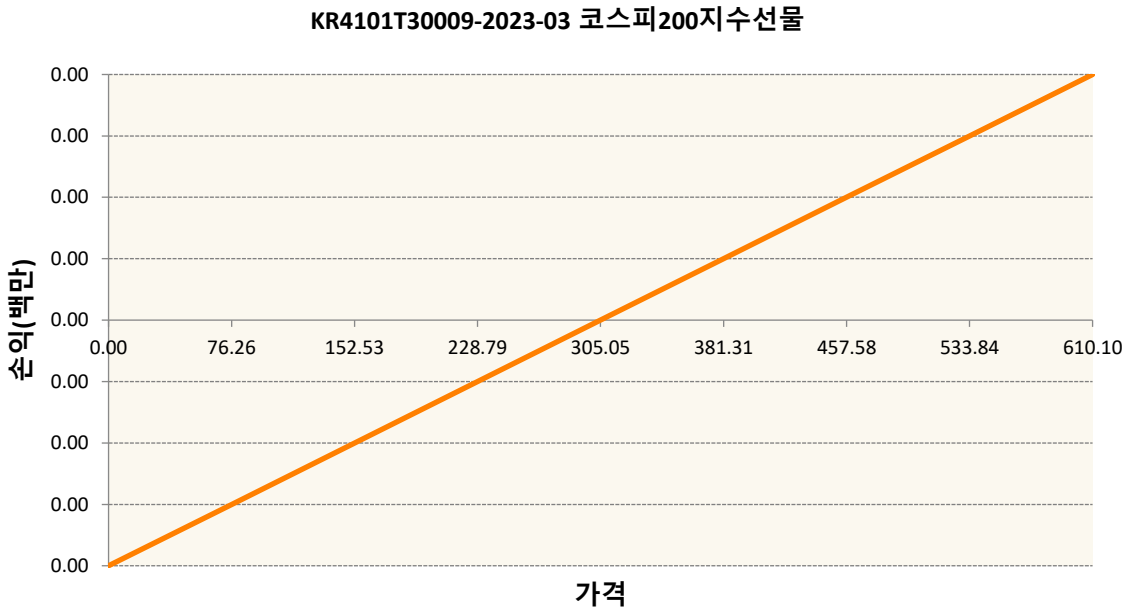
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

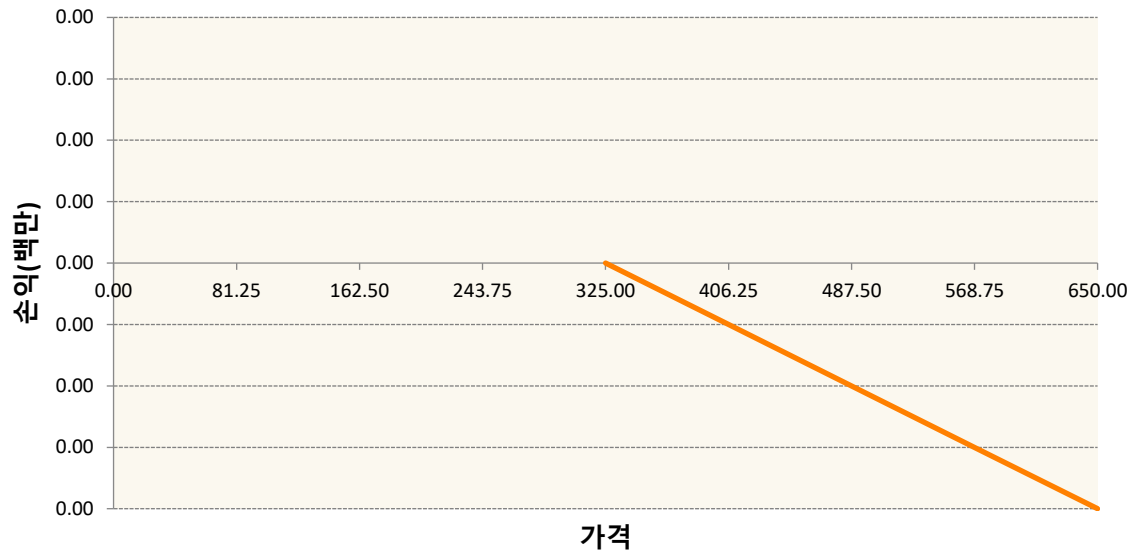
(단위:백만원)

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	381	0	381	장내
누계	유가증권	옵션	78	3,803	-3,726	장내

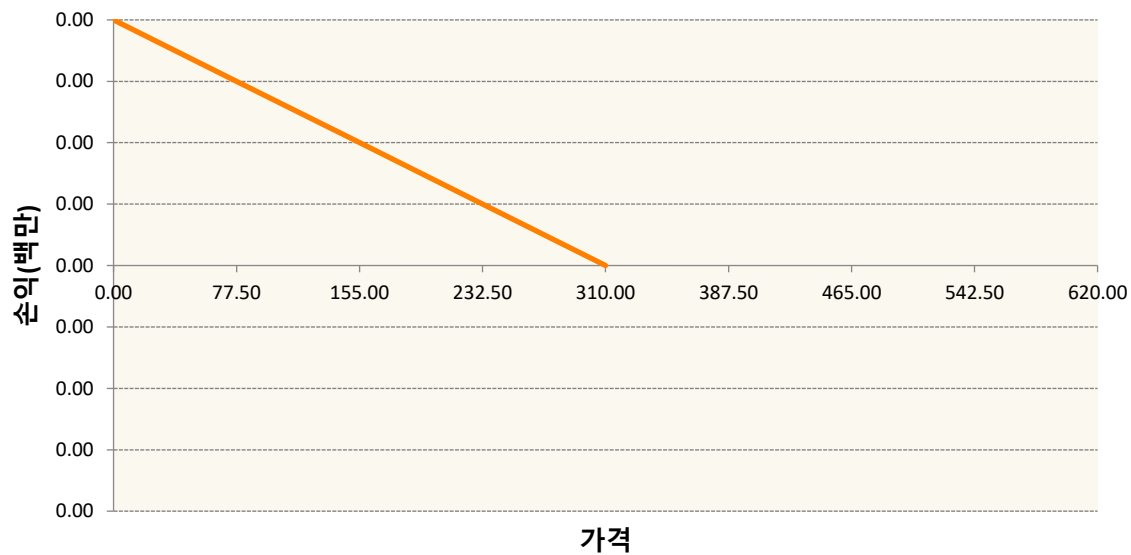
2. 만기시점의 손익구조



KR4201T13250-2023-01 쿨325



KR4301T13100-2023-01 ㄱ310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(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					100
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	50	47	43	39	35	30	25
-5.33%	44	40	35	30	24	19	13
-2.67%	35	29	23	17	10	4	-3
0%	21	14	7	0	-7	-15	-22
2.67%	2	-6	-13	-21	-29	-37	-45
5.33%	-23	-31	-39	-47	-55	-63	-71
8.00%	-53	-61	-69	-77	-84	-92	-100
KR4201T13250 2023-01 콜325							85

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	40	38	35	32	28	24	20
-5.33%	36	33	29	24	20	15	10
-2.67%	29	24	19	14	8	3	-3
0%	18	12	6	0	-6	-13	-19
2.67%	3	-4	-11	-18	-24	-31	-38
5.33%	-18	-25	-32	-39	-46	-53	-60
8.00%	-43	-50	-57	-64	-71	-78	-85

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	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	-1	-1	-1
8.00%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-1

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

(단위:백만원)

177

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

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	6,485	0	6,485	

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	2022-12-23
기준일	2022-12-22

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	5,489	0	5,489	

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	2022-12-23
기준일	2022-12-22

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	18,376	0	18,376	
누계	통화	선도	0	18,537	-18,537	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213C9P(KRW/USD 28-12-22E	475
FXW213CAR(KRW/USD 30-01-23E	264
FXW213CBQ(KRW/USD 28-02-23E	652
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)

783

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

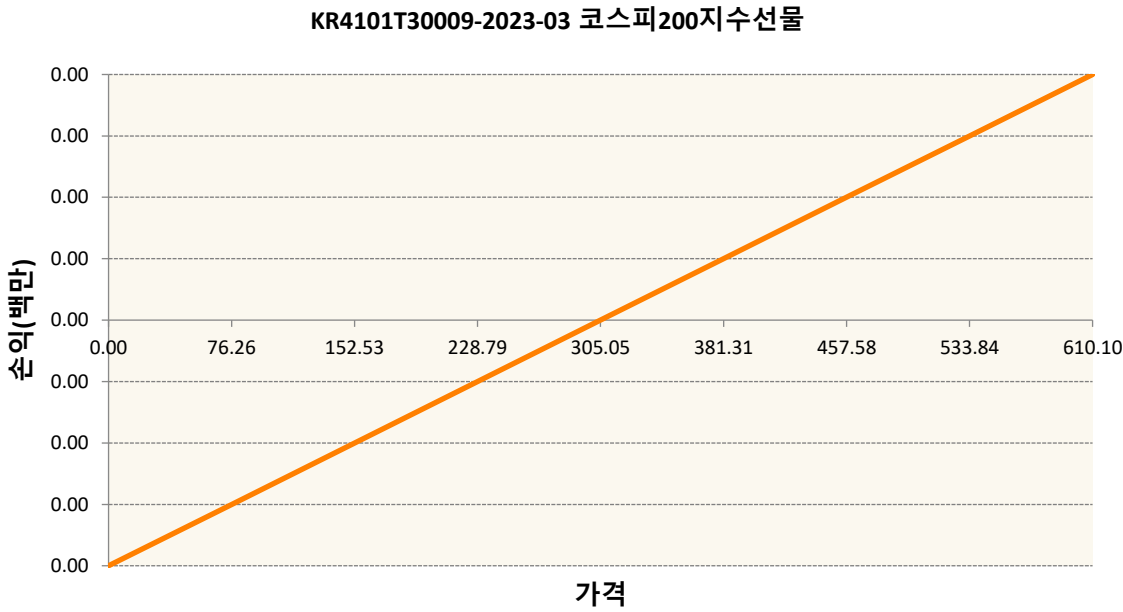
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	763	0	763	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	2022-12-23
기준일	2022-12-22

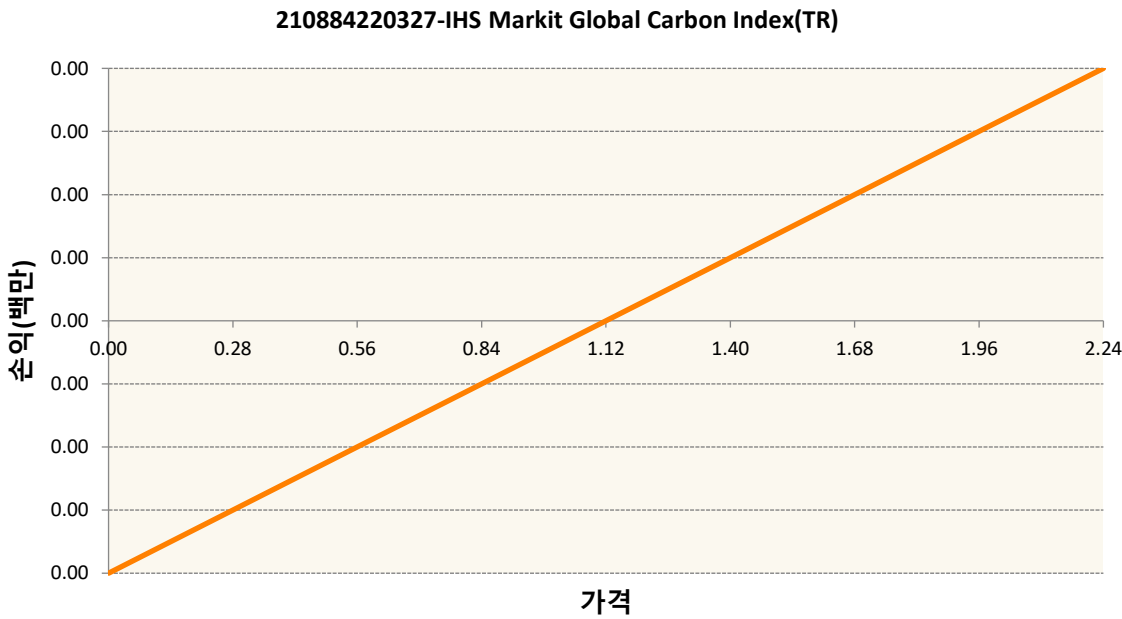
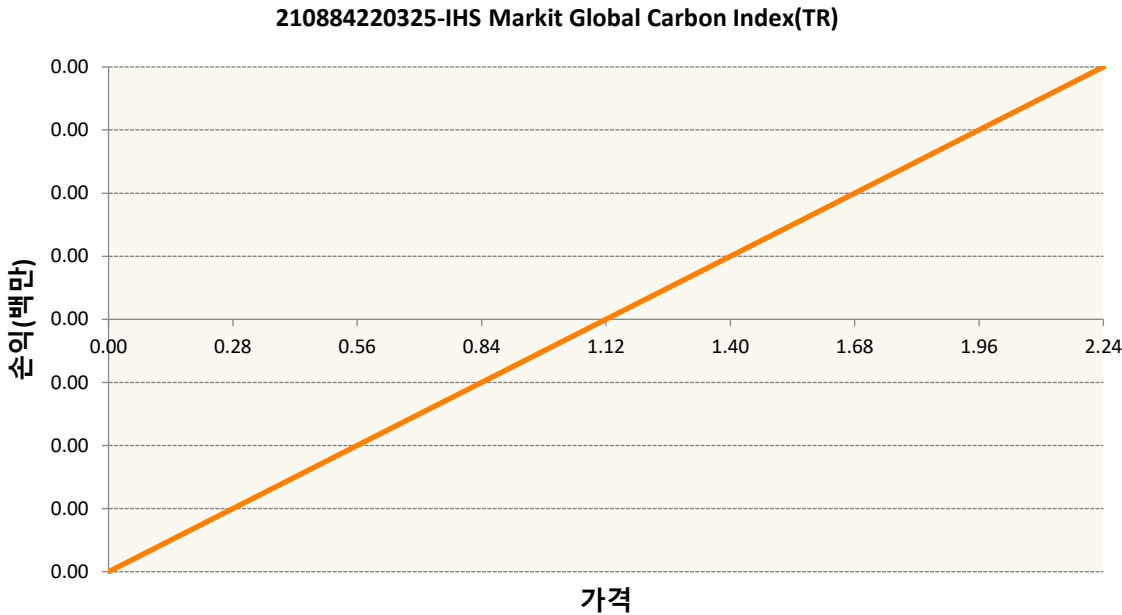
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

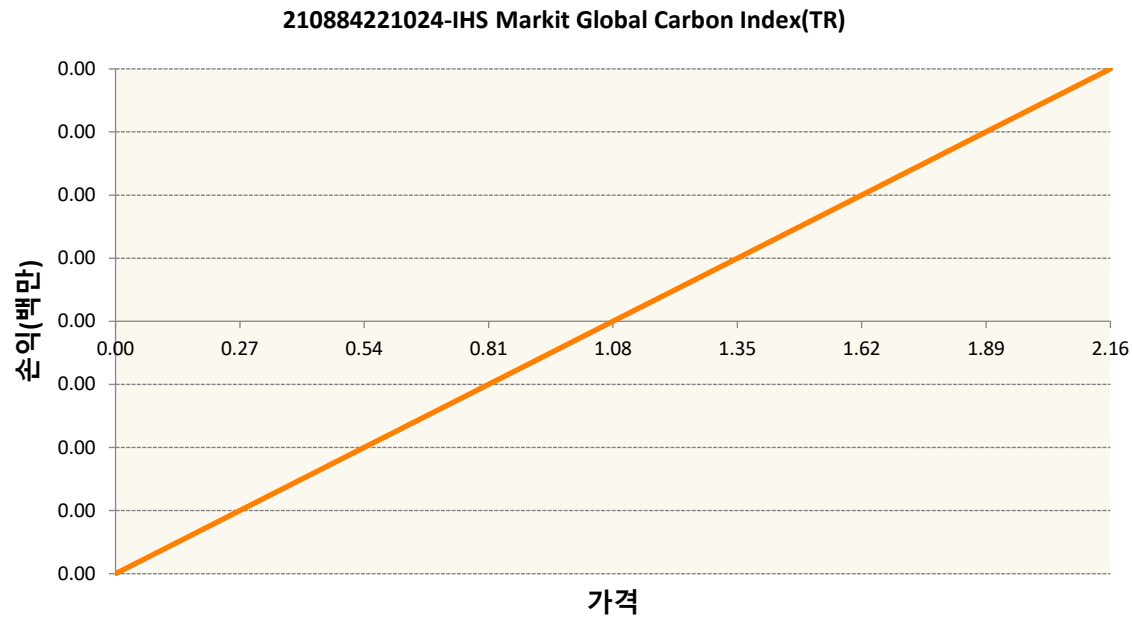
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	30,403	0	30,403	

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)		97
2.1088E+11 IHS Markit Global Carbon Index(TR)		2,134

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		4,663

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

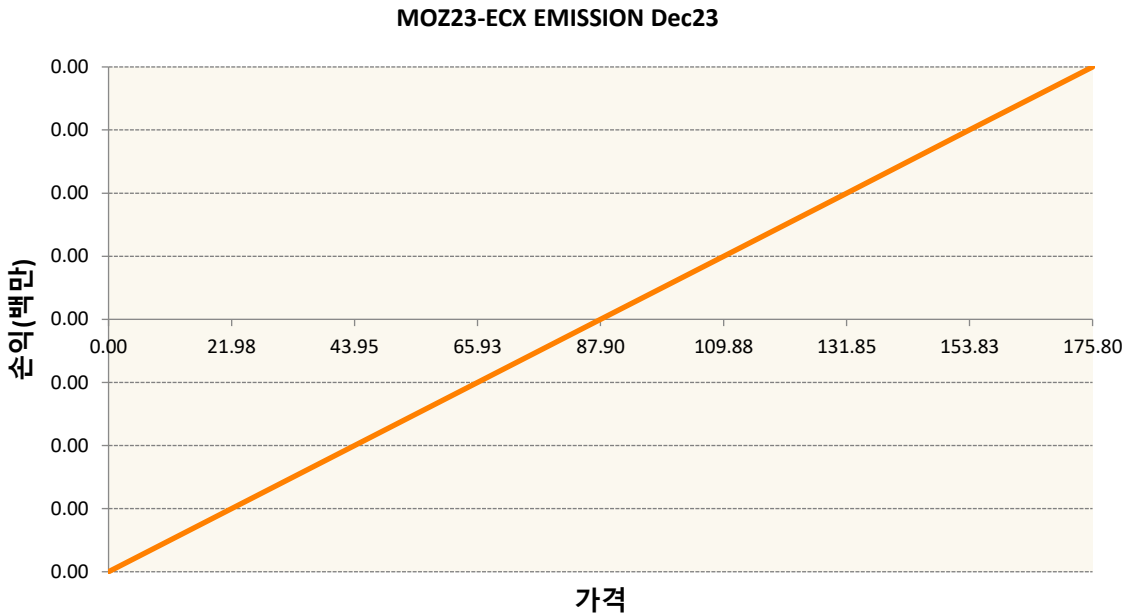
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	13,126	0	13,126	
누계	통화	선도	0	6,355	-6,355	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CBP(KRW/EUR 23-12-22E	356
FXW213CC1(KRW/EUR 23-12-22E	152
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,050

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

(단위:백만원)

3,080

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	9,319	0	9,319	장외
누계	지수	스왑	9,319	0	9,319	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (NH)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	6

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

(단위:백만원)

46

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

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)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	16

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

(단위:백만원)

68

공시일 2022-12-23

기준일 2022-12-22

에쿼티알파일반사모혼합자산

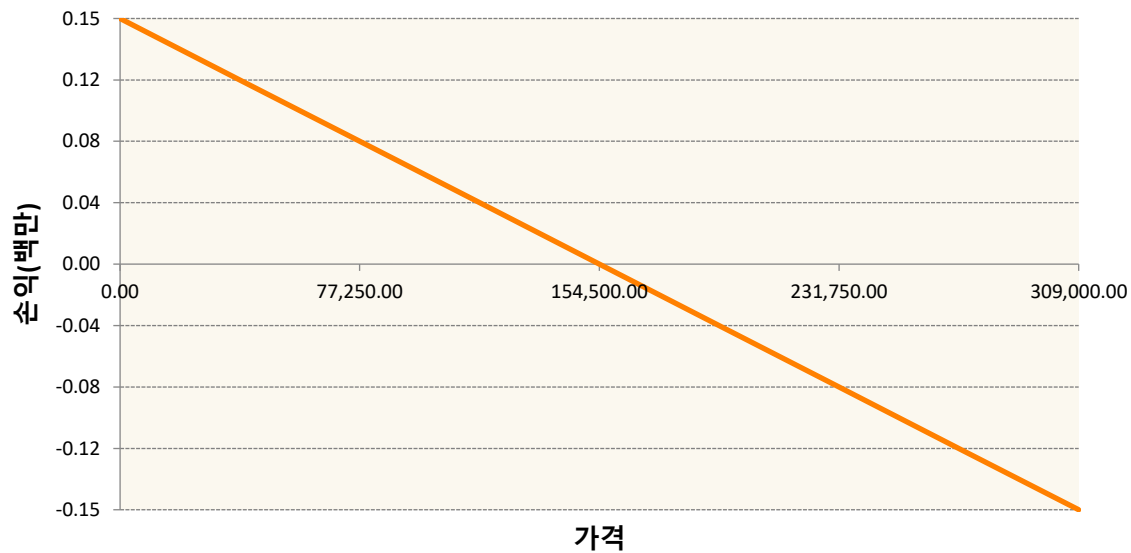
1. 계약금액

(단위:백만원)

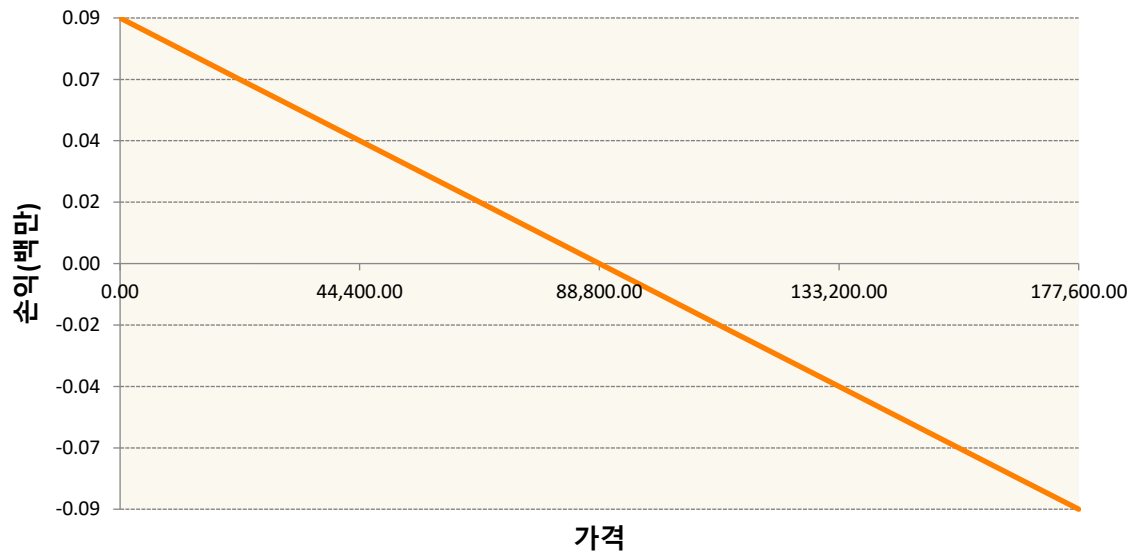
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	1,076	-1,076	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

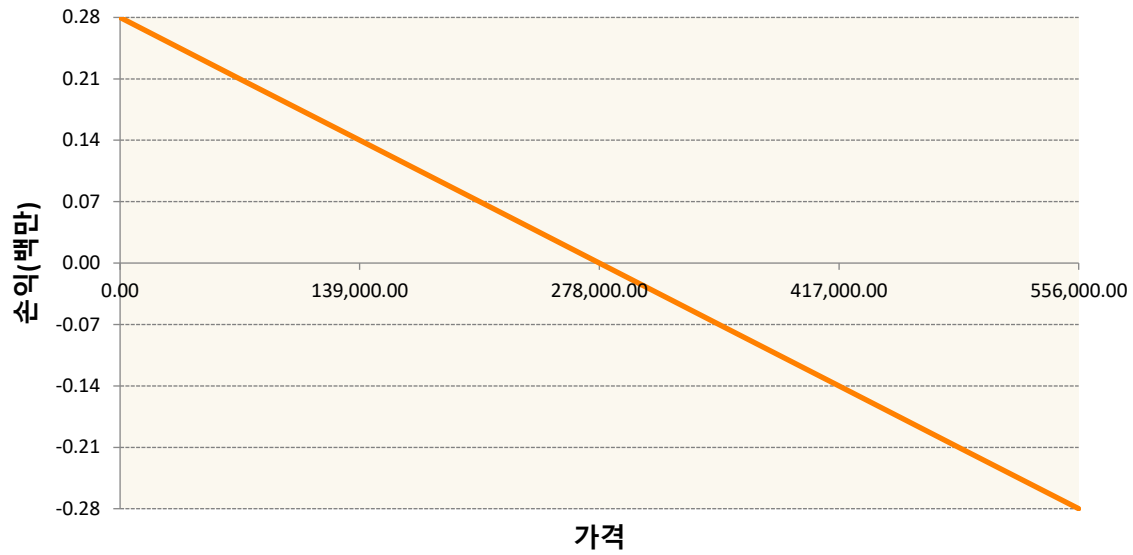
KR4116T10009-2023-01 현대차개별선물



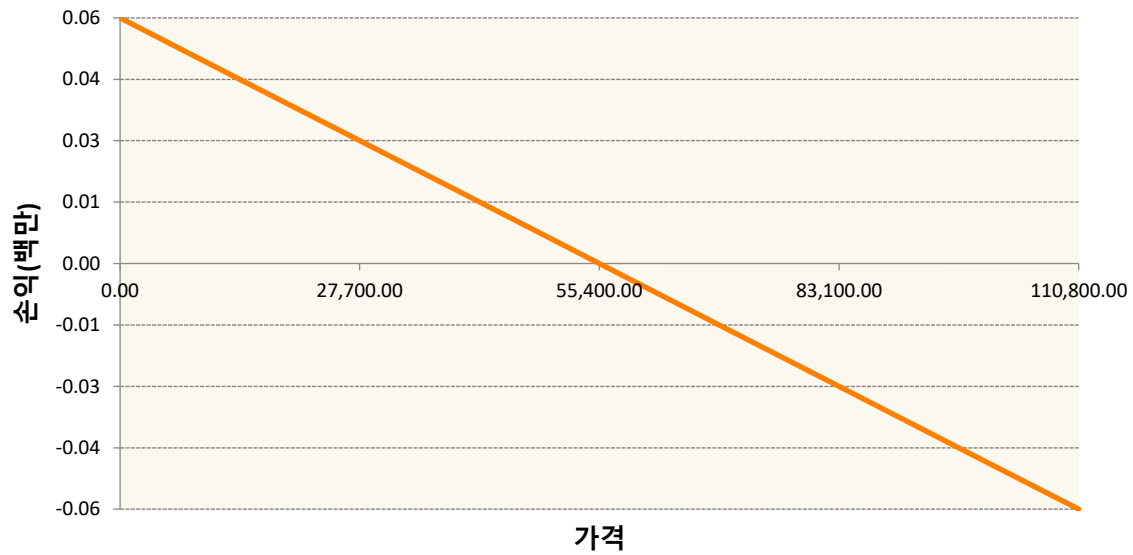
KR4124T10003-2023-01 LG전자개별선물



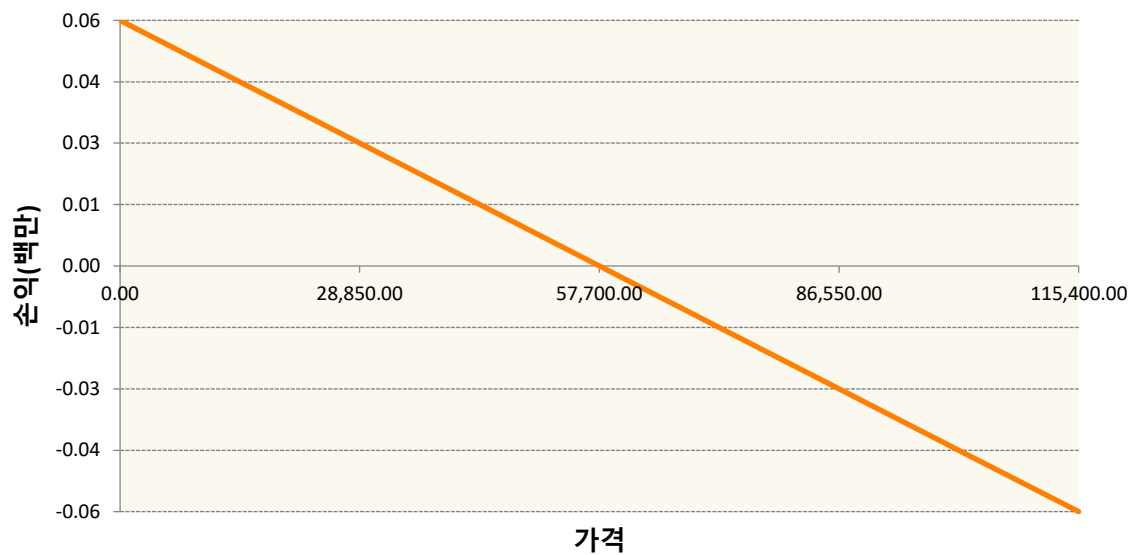
KR41BYT10009-2023-01 LG이노텍개별선물



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		27
KR41F7T100 2023-01 카카오페이개별선물		9
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		0.14
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602		0.15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	205

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

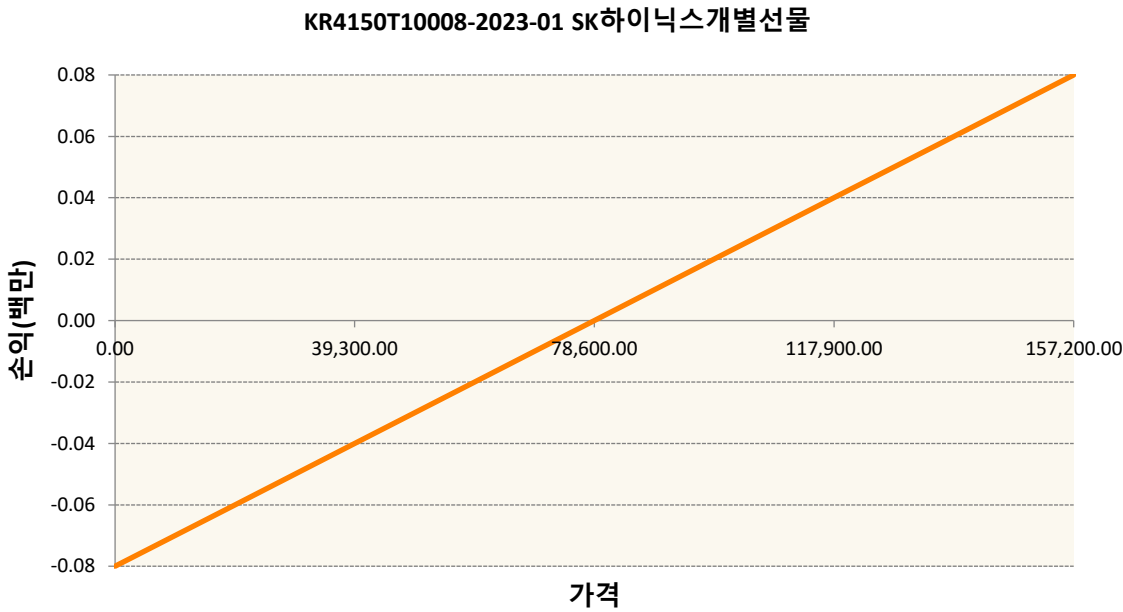
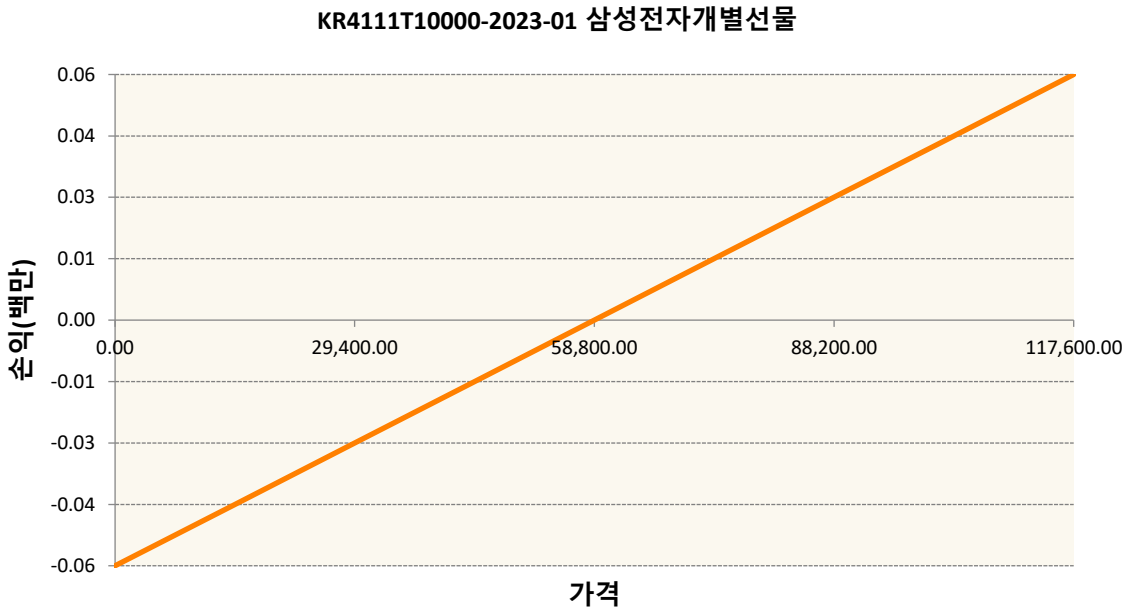
신한SOL한국형글로벌반도체액티

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)

14

공시일	2022-12-23
기준일	2022-12-22

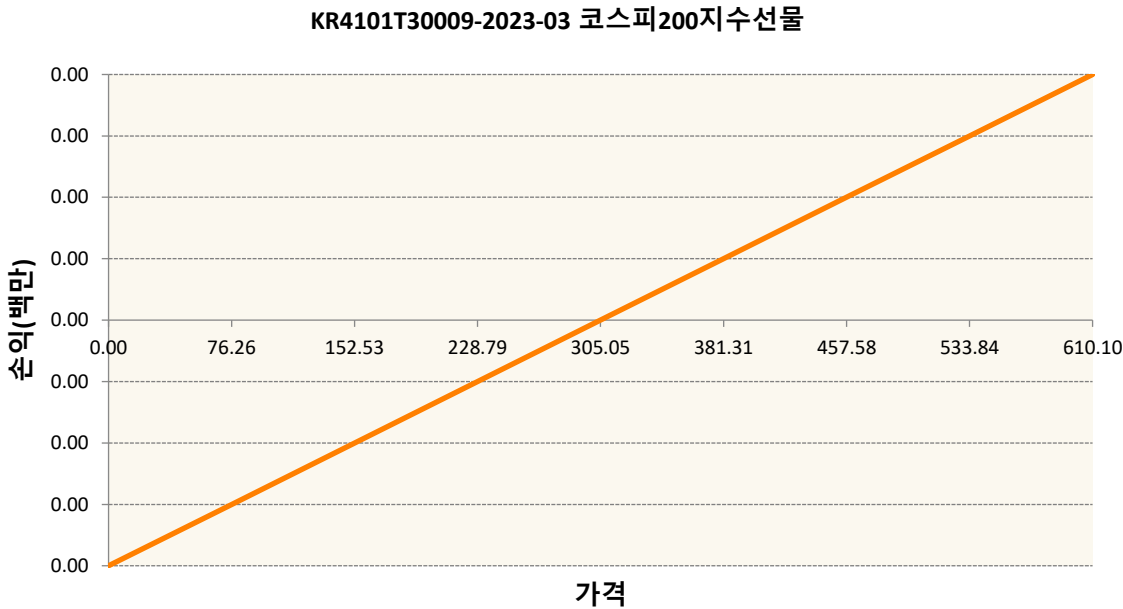
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,288	0	2,288	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 2022-12-23

기준일 2022-12-22

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

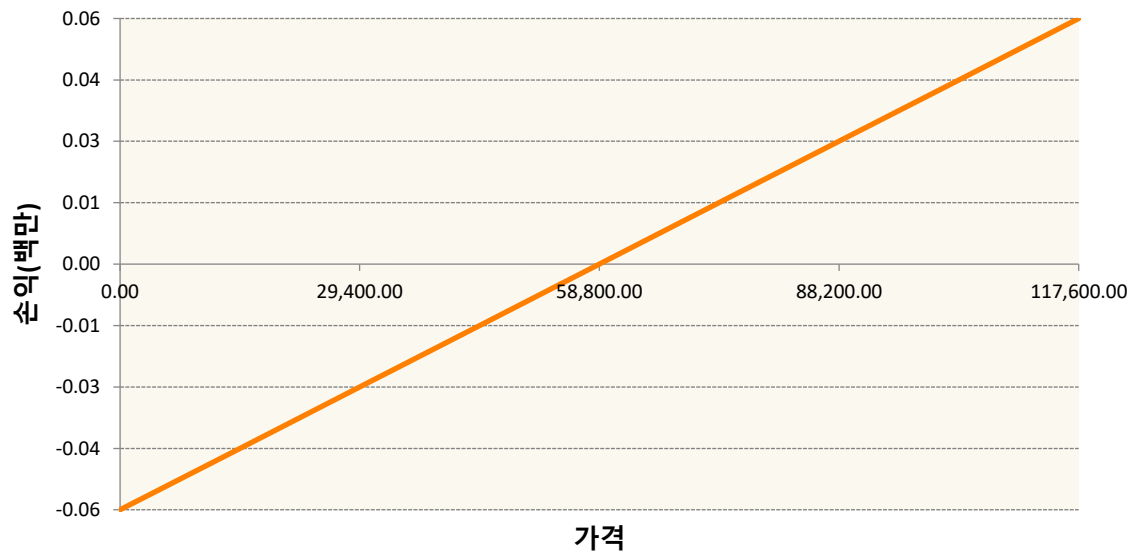
1. 계약금액

(단위:백만원)

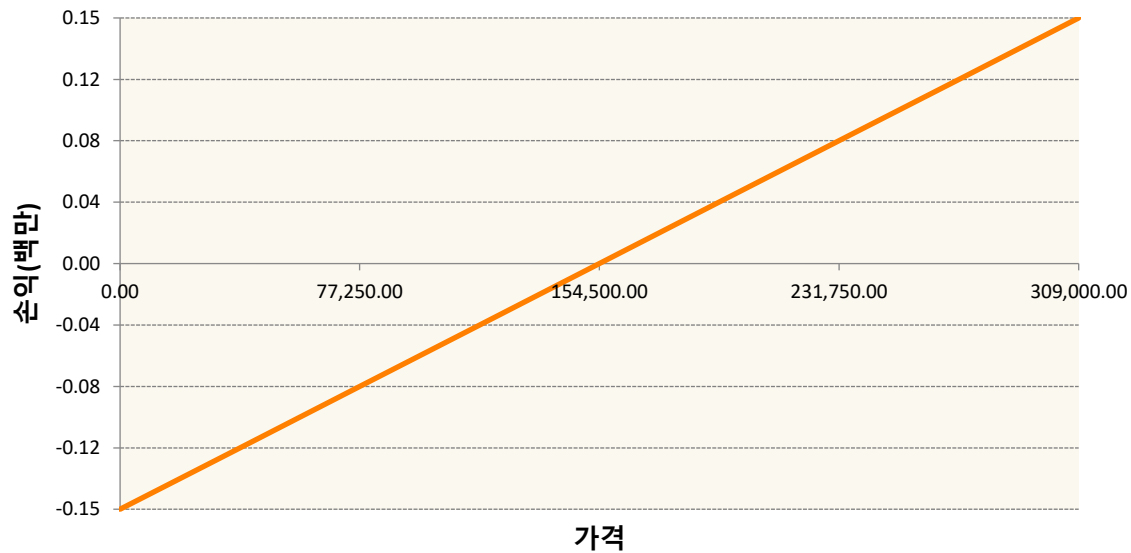
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	227	0	227	장내

2. 만기시점의 손익구조

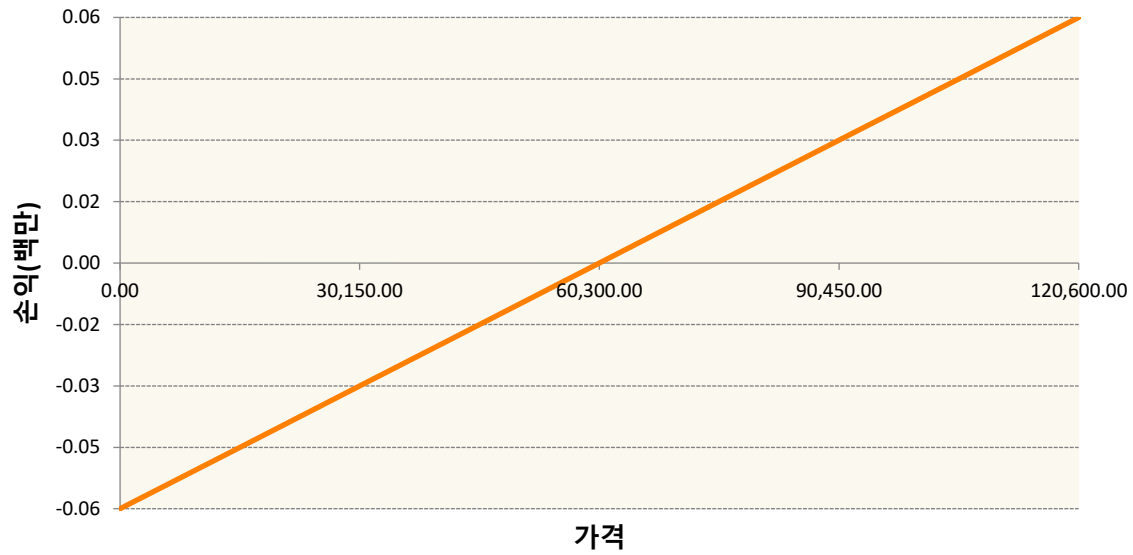
KR4111T10000-2023-01 삼성전자개별선물



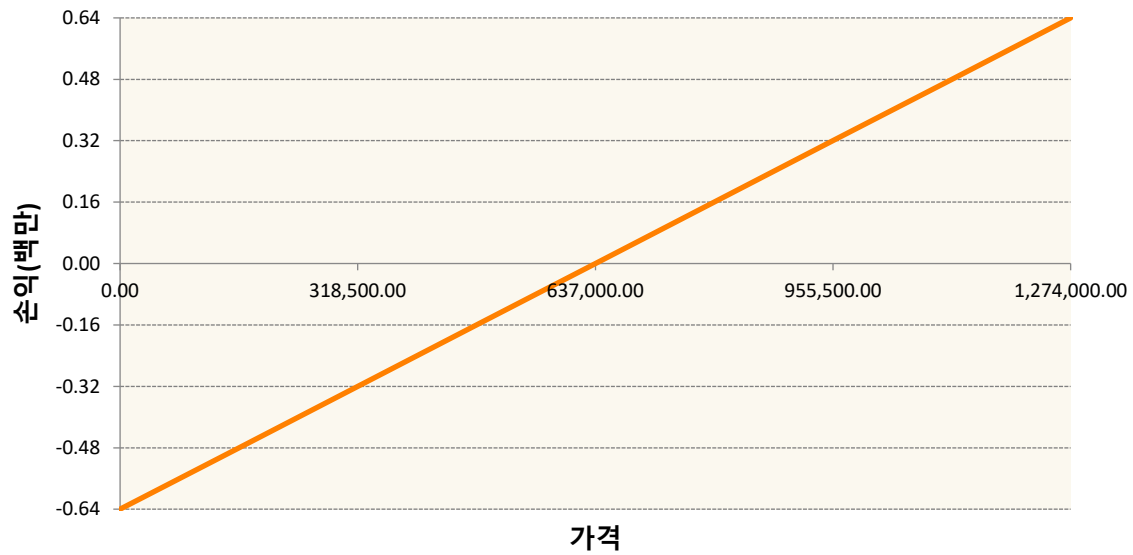
KR4116T10009-2023-01 현대차개별선물



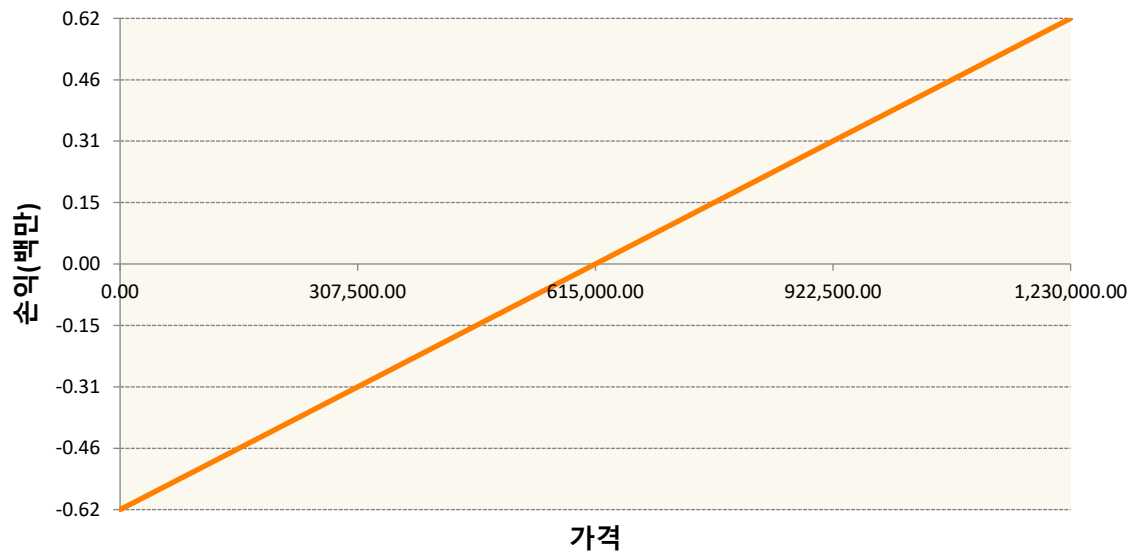
KR4119T10003-2023-01 기아개별선물



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		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 2022-12-23

기준일 2022-12-22

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

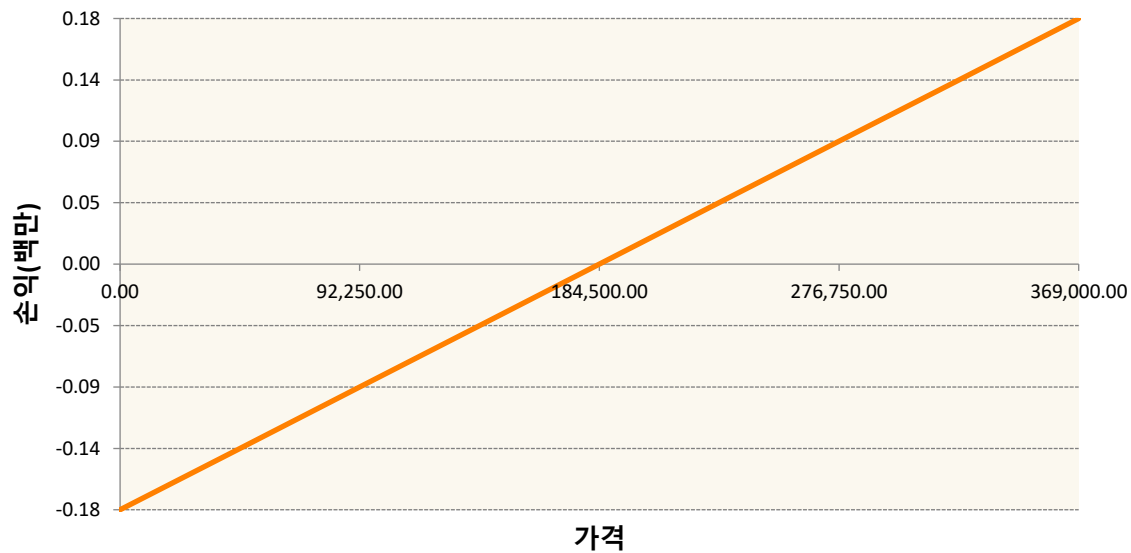
1. 계약금액

(단위:백만원)

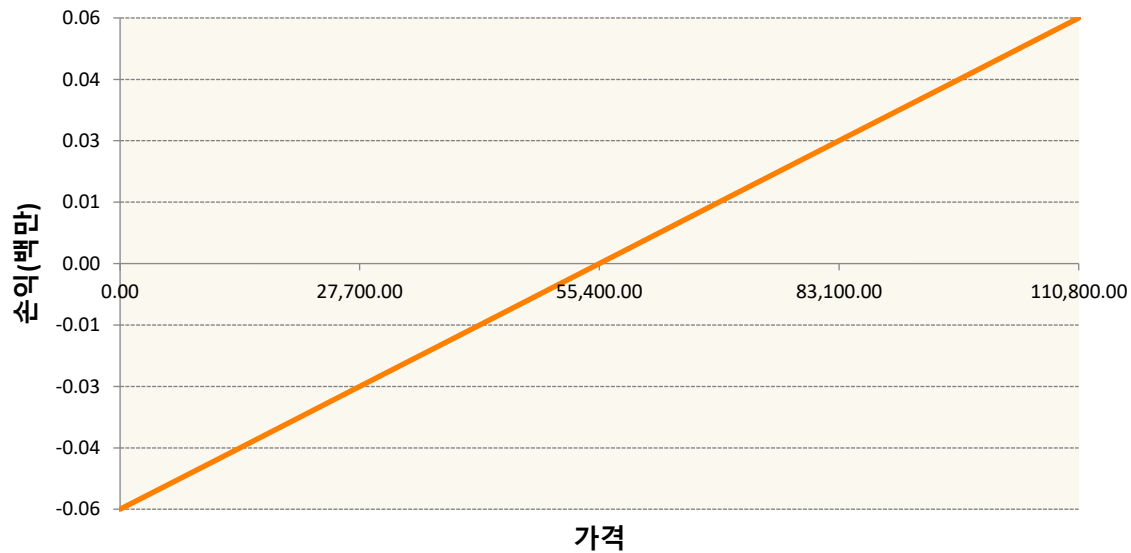
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	114	0	114	장내

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	2022-12-23
기준일	2022-12-22

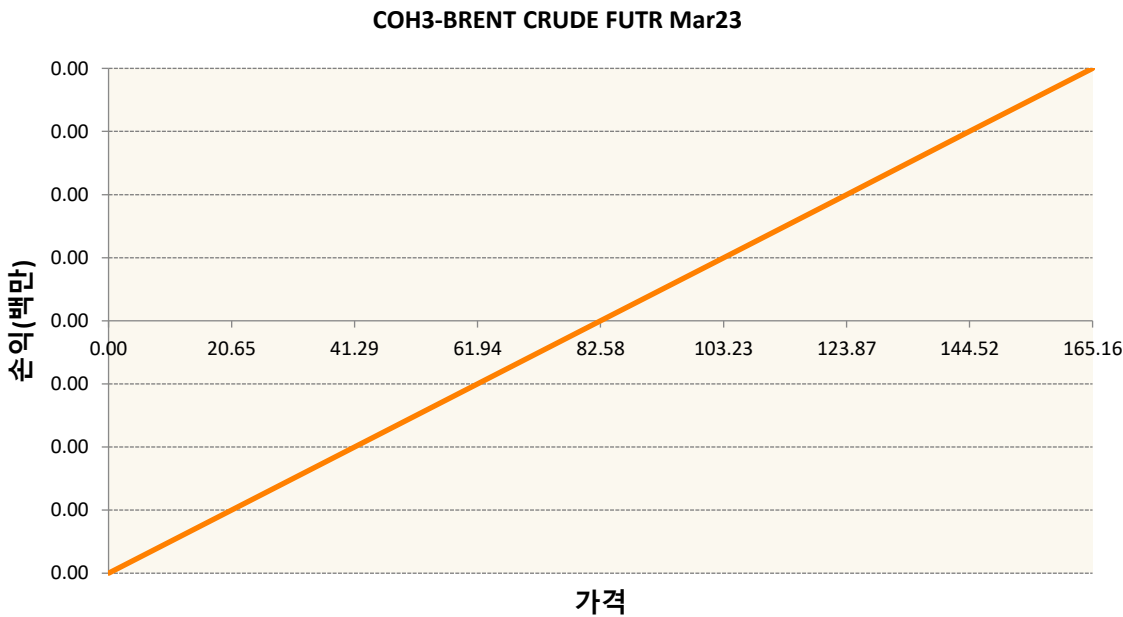
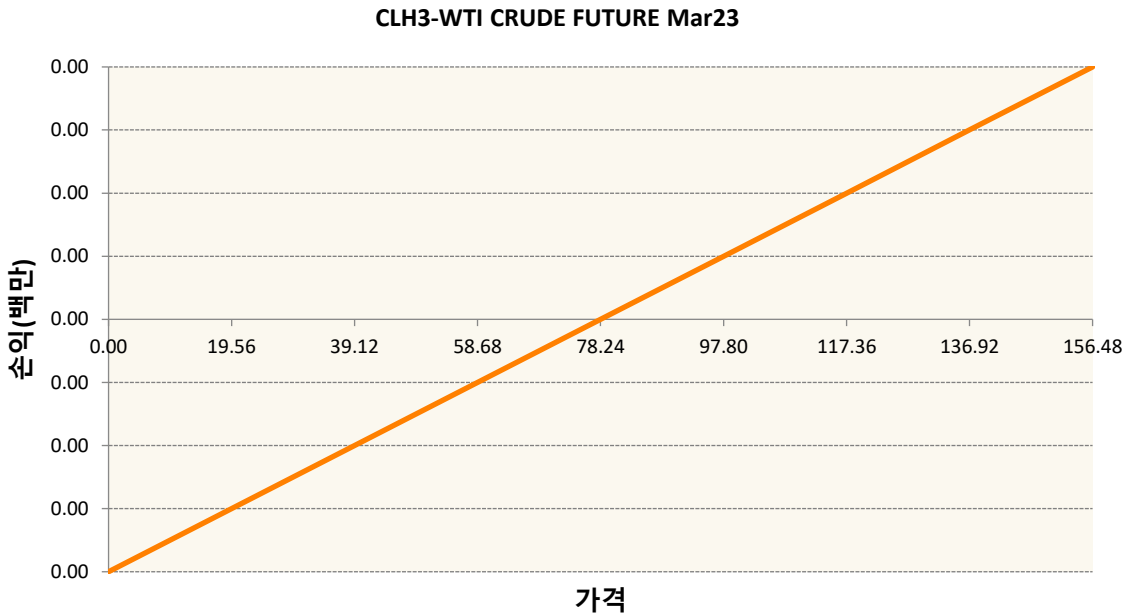
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

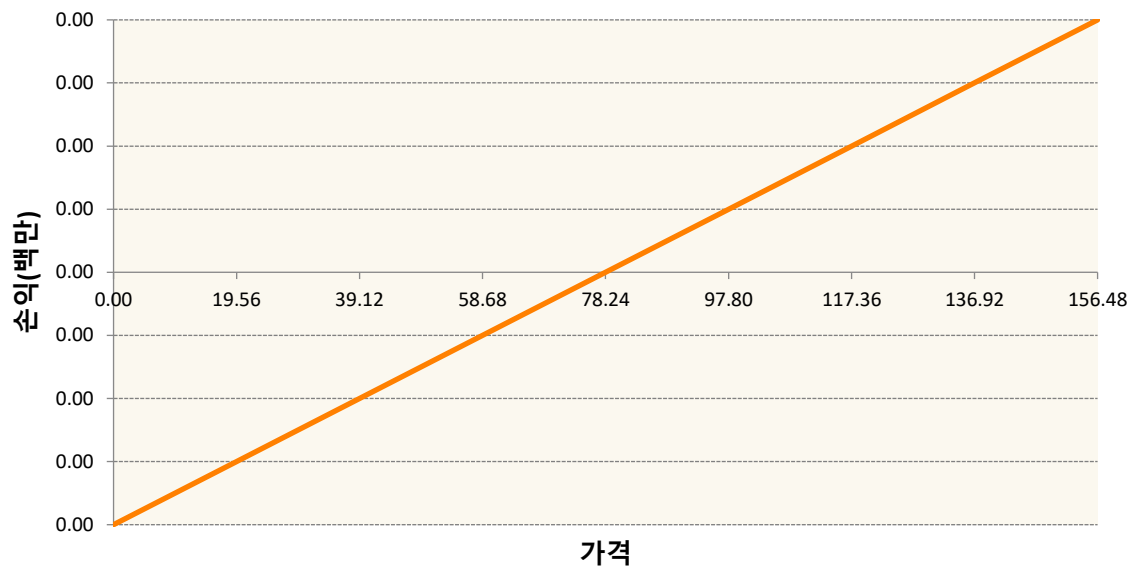
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,779	319	1,461	

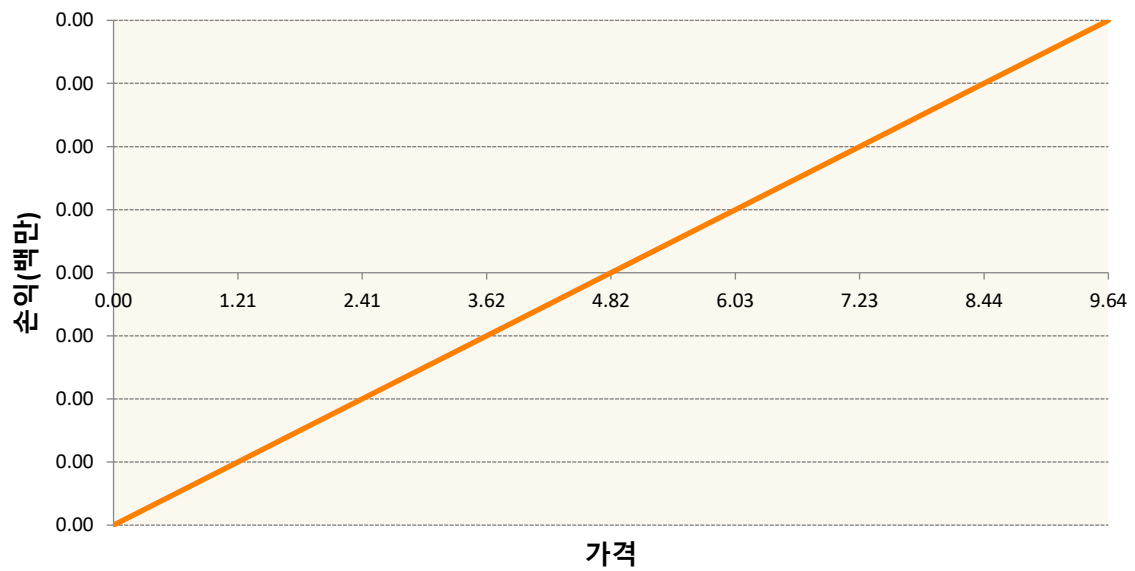
2. 만기시점의 손익구조



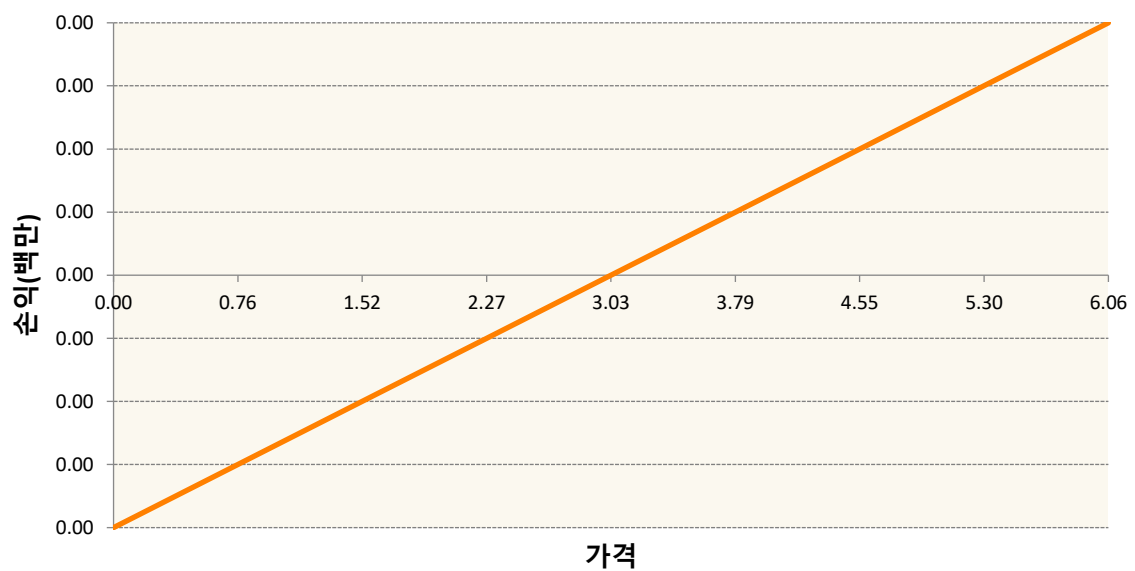
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



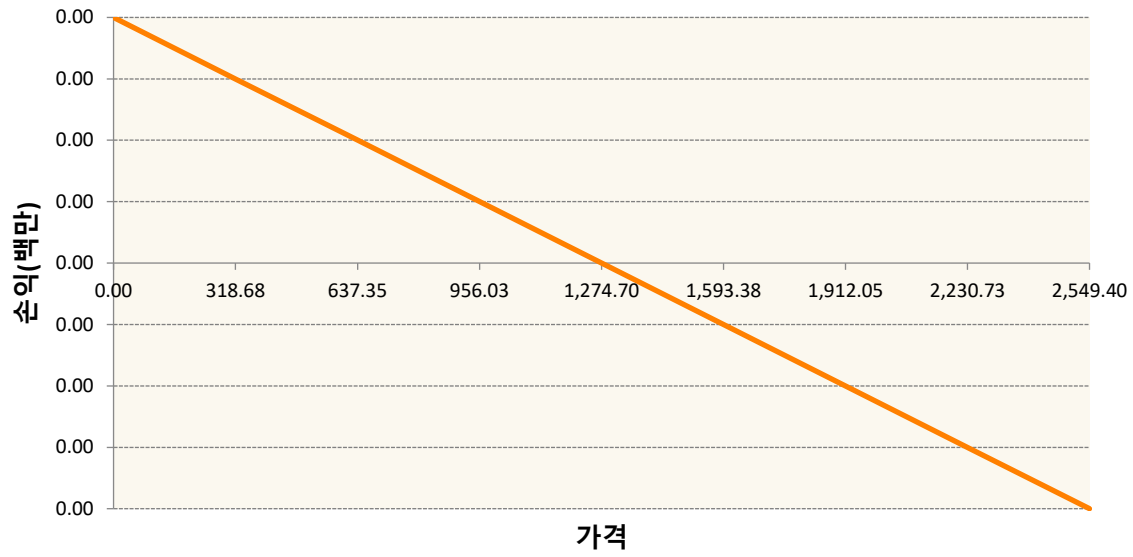
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



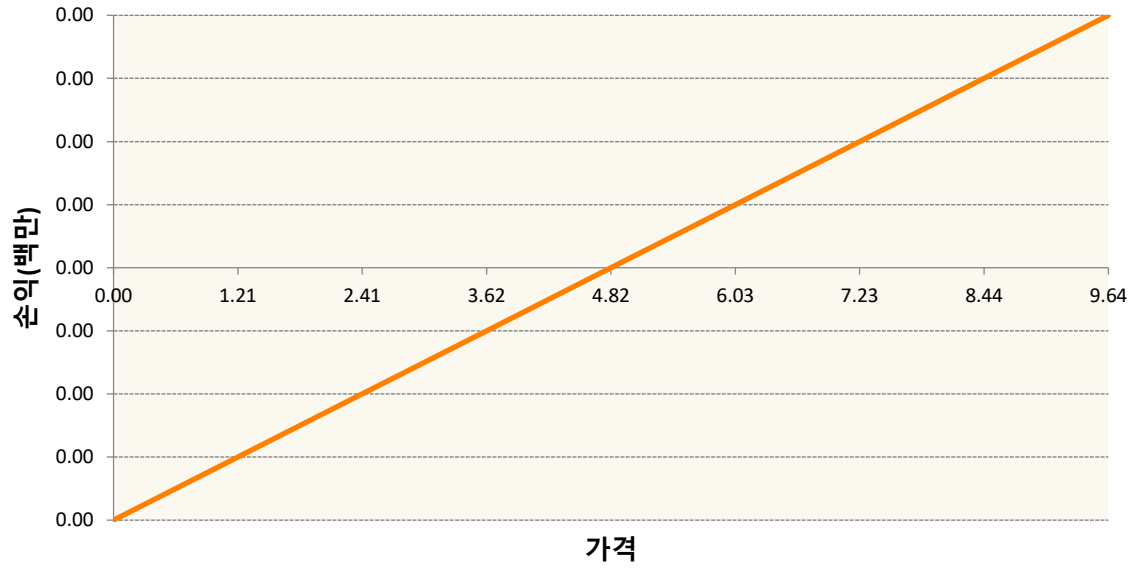
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



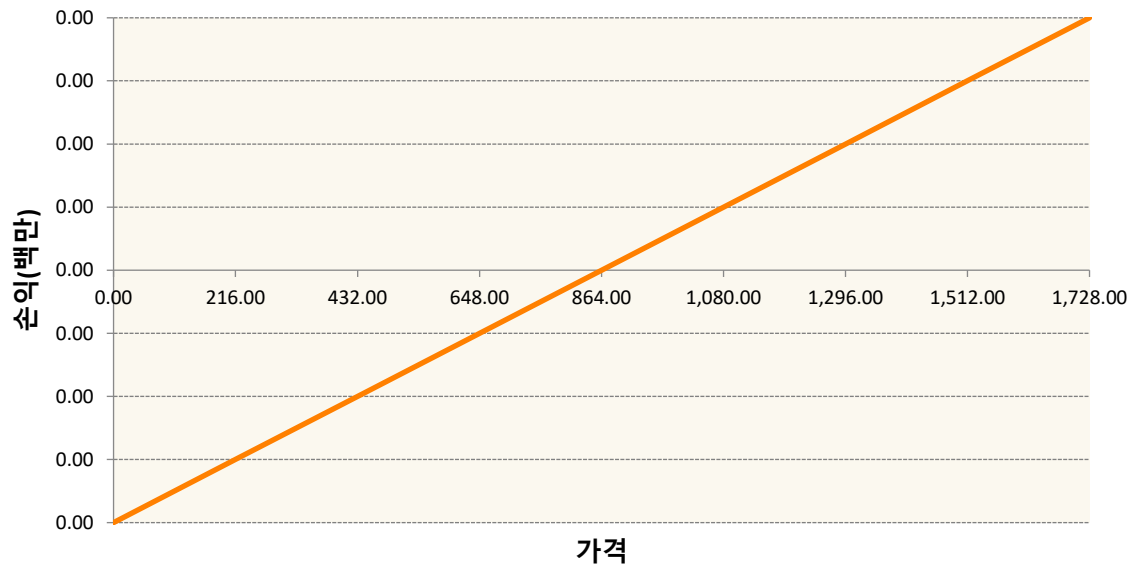
KR4175T10005-2023-01 달러선물

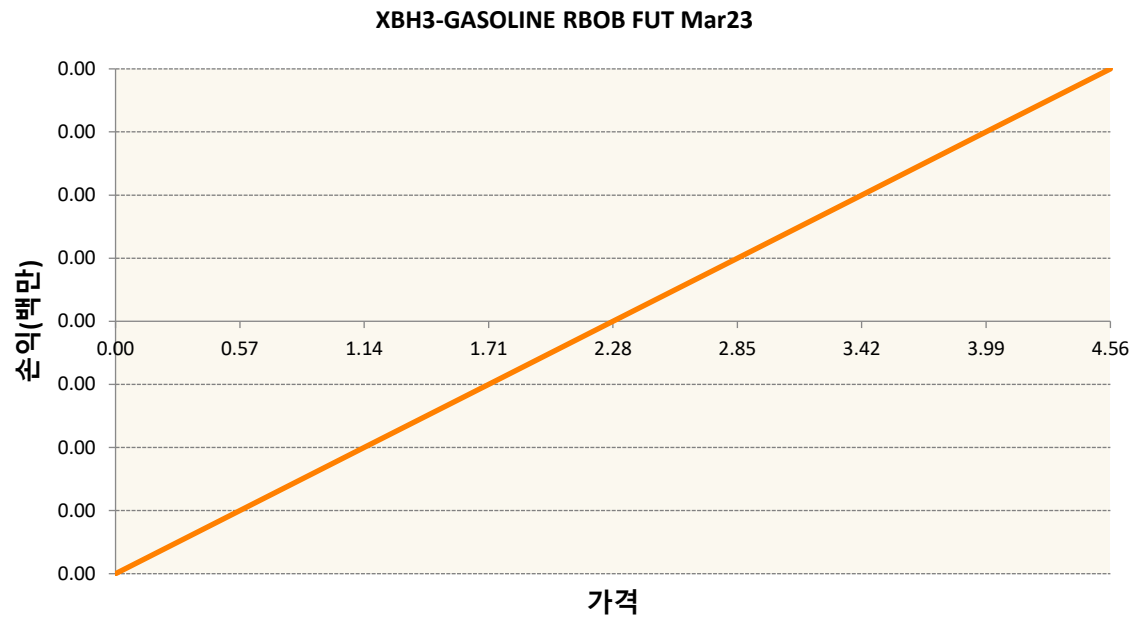


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	24
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	35
ECH3	E-mini Crude Oil Mar23	4
EOH3	E-MINI NATURAL GAS Mar23	1
HOH3	NY Harb ULSD Fut Mar23	13
KR4175T100 2023-01 달러선물		25
NGH23	NATURAL GAS FUTR Mar23	46
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	9
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	10

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