

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

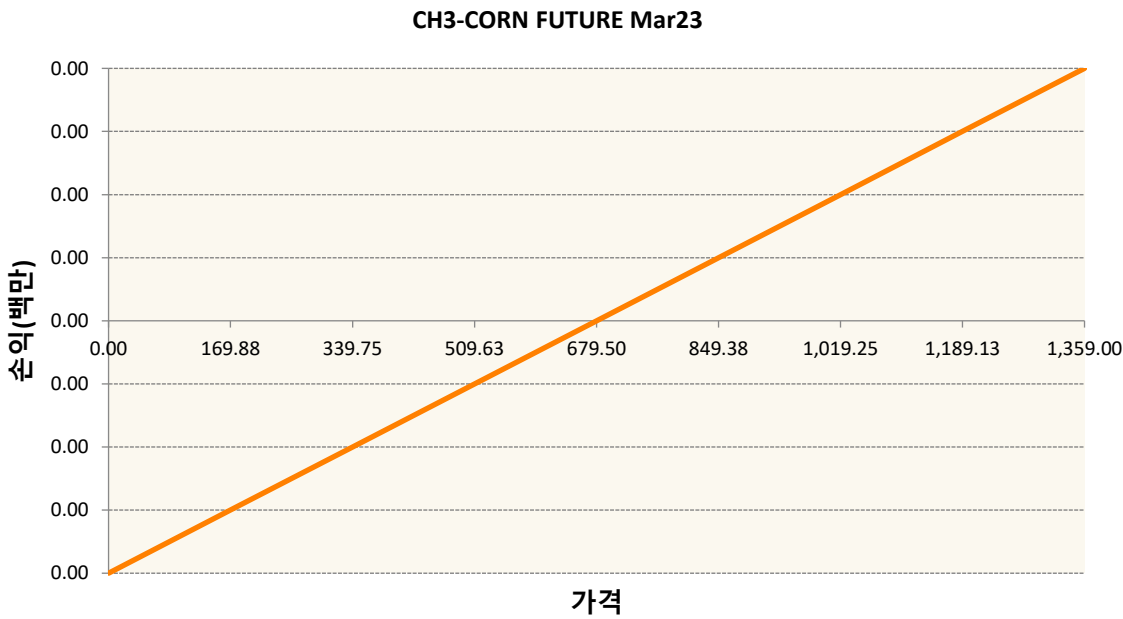
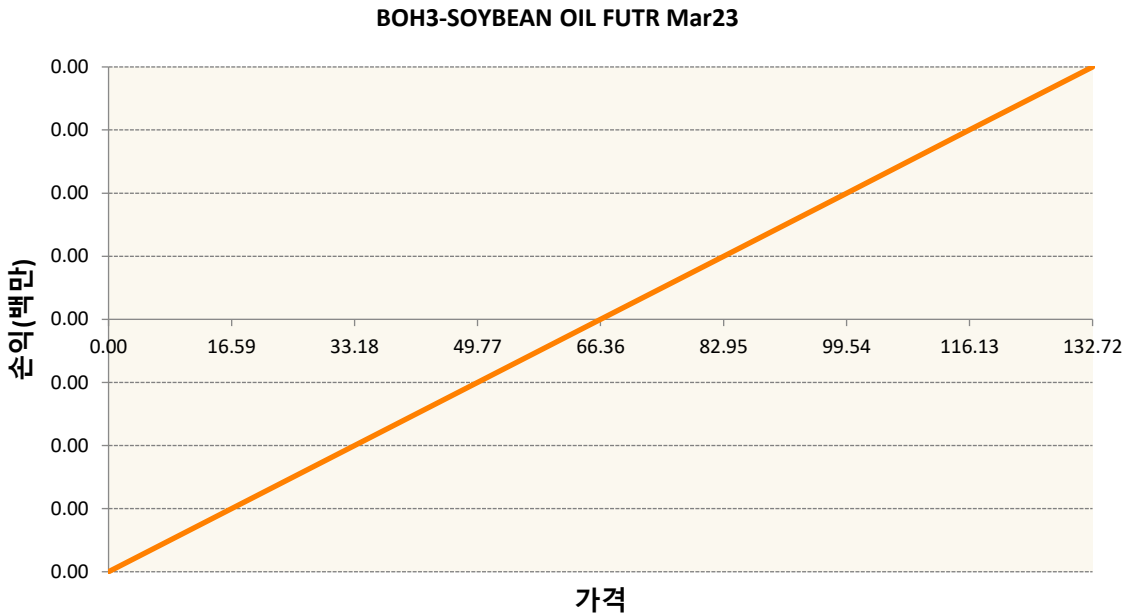
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

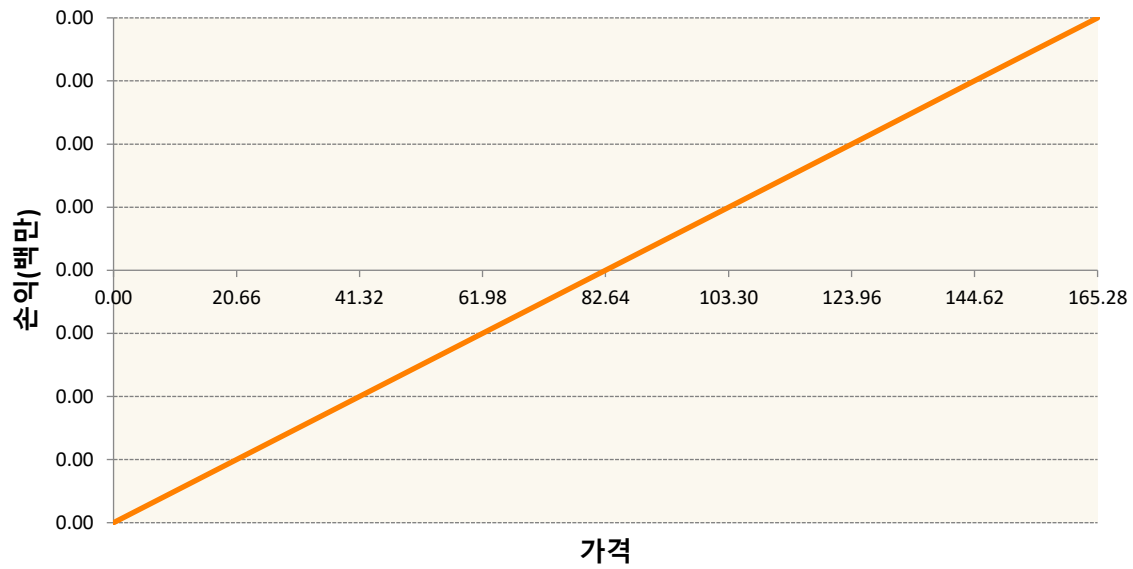
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,593	758	5,834	

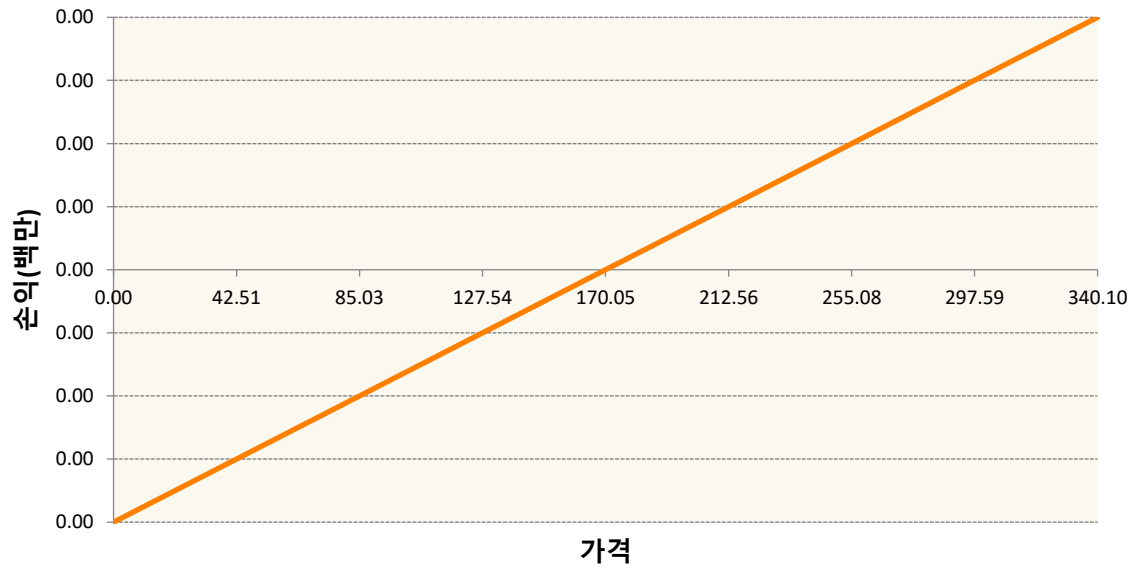
2. 만기시점의 손익구조



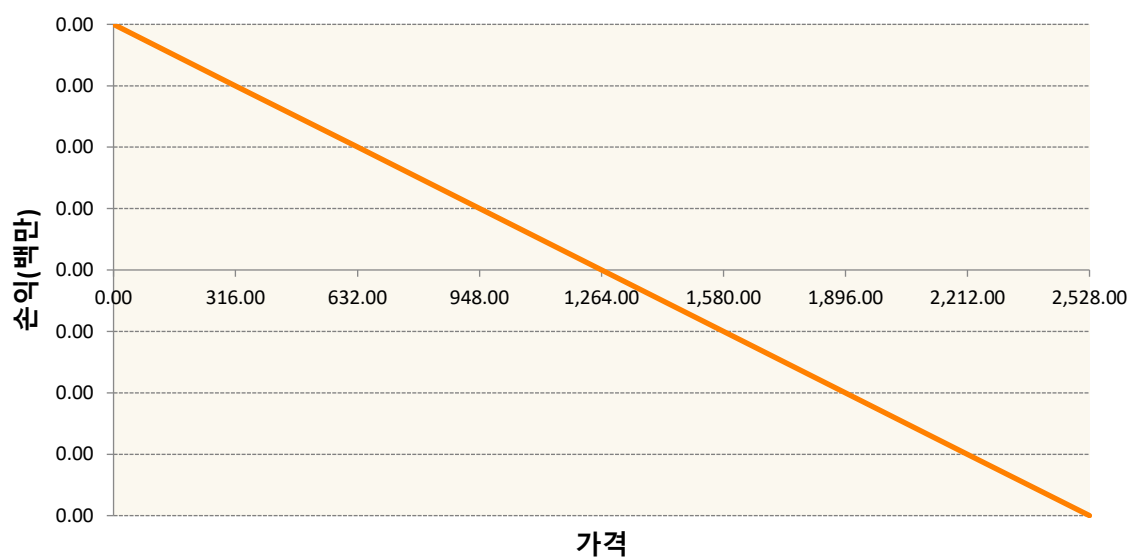
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



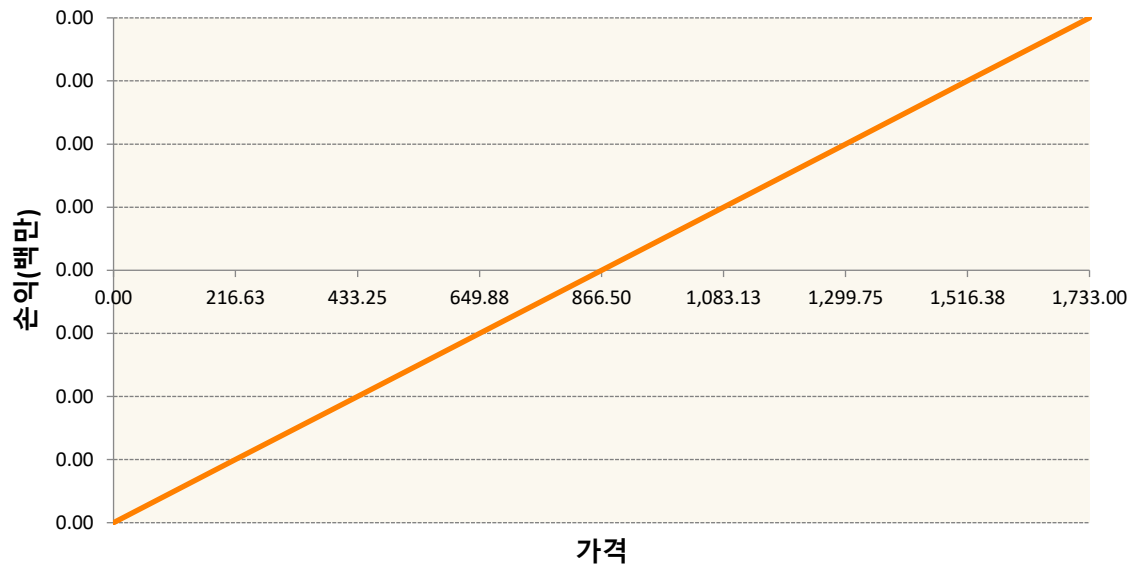
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



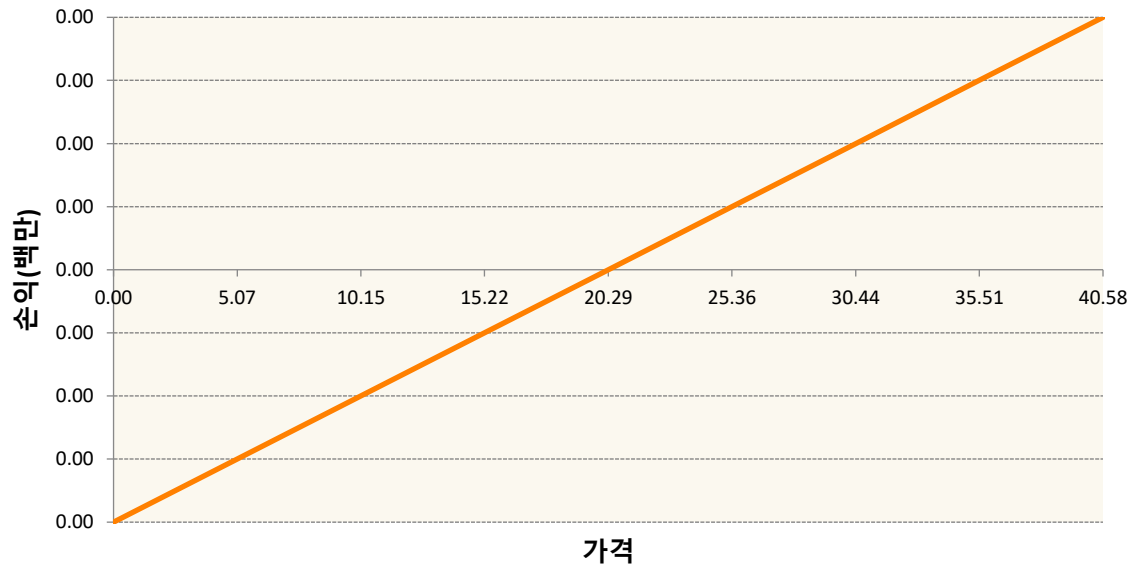
KR4175T10005-2023-01 달러선물



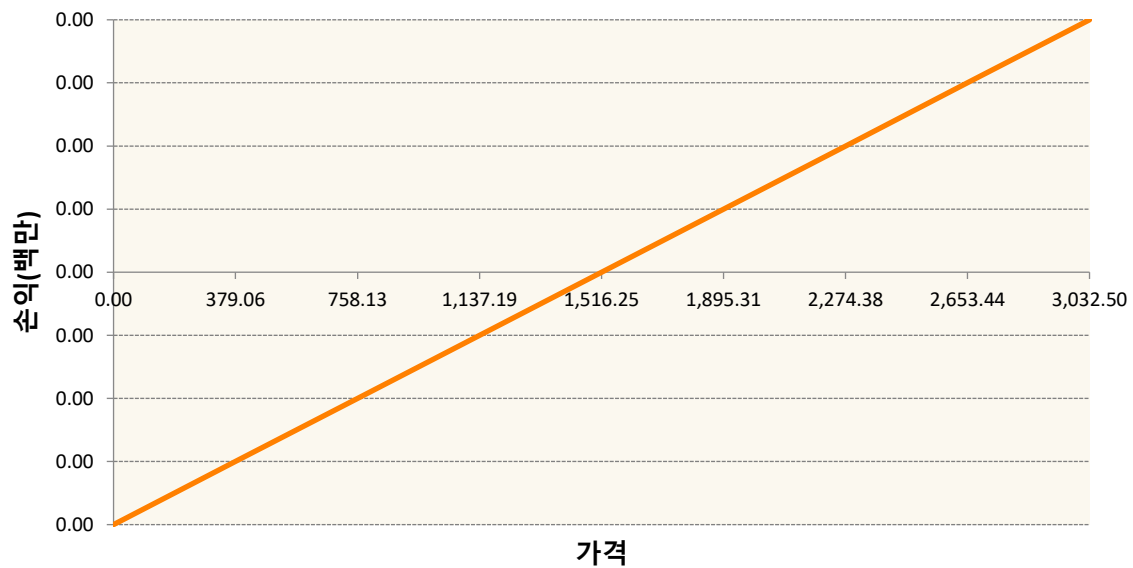
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



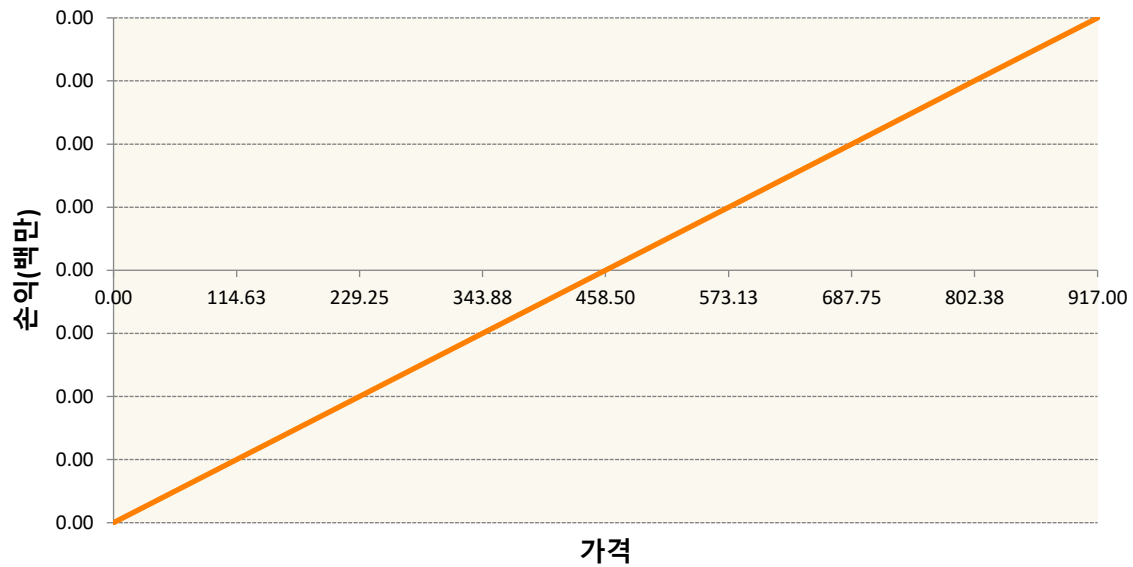
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



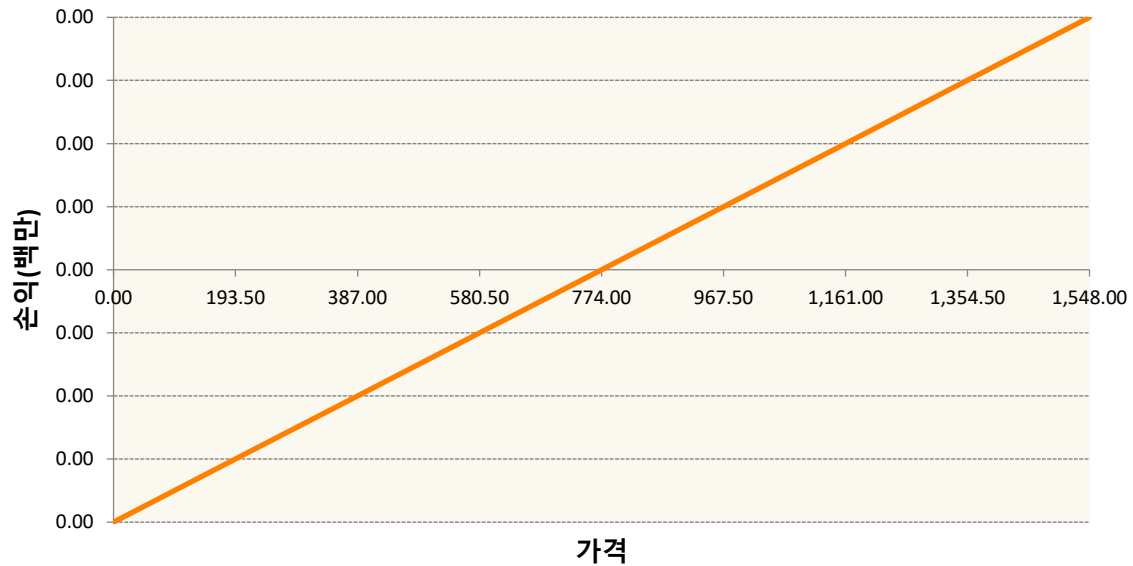
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



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	2023-01-02
기준일	2022-12-30

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	335
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

469

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

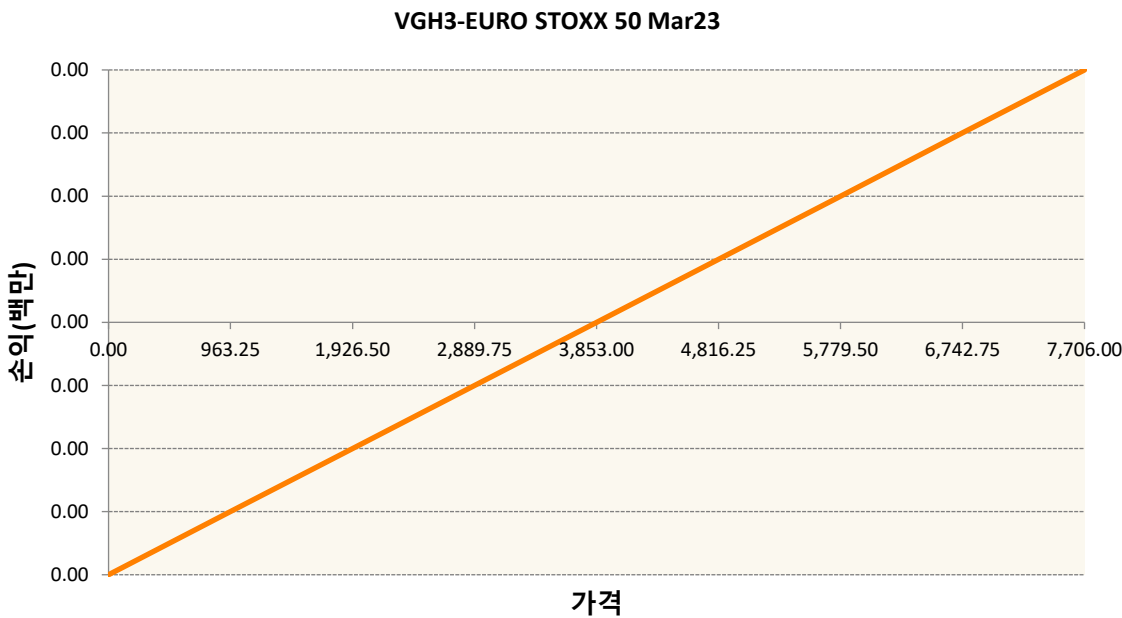
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	535	0	535	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

45

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

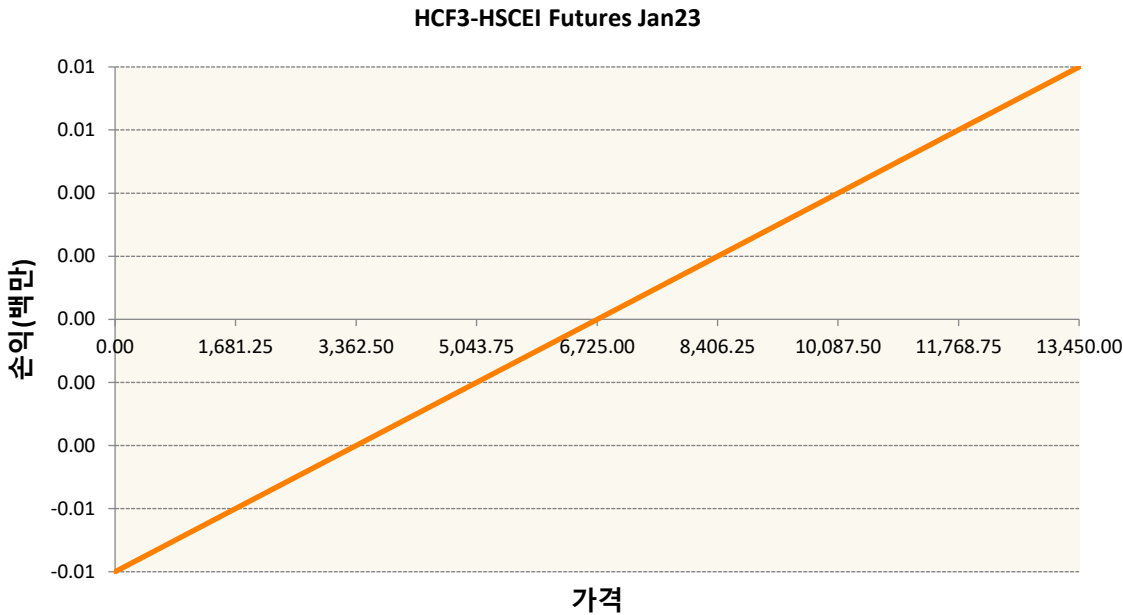
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,527	0	1,527	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF3	HSCEI Futures Jan23	122
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

204

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

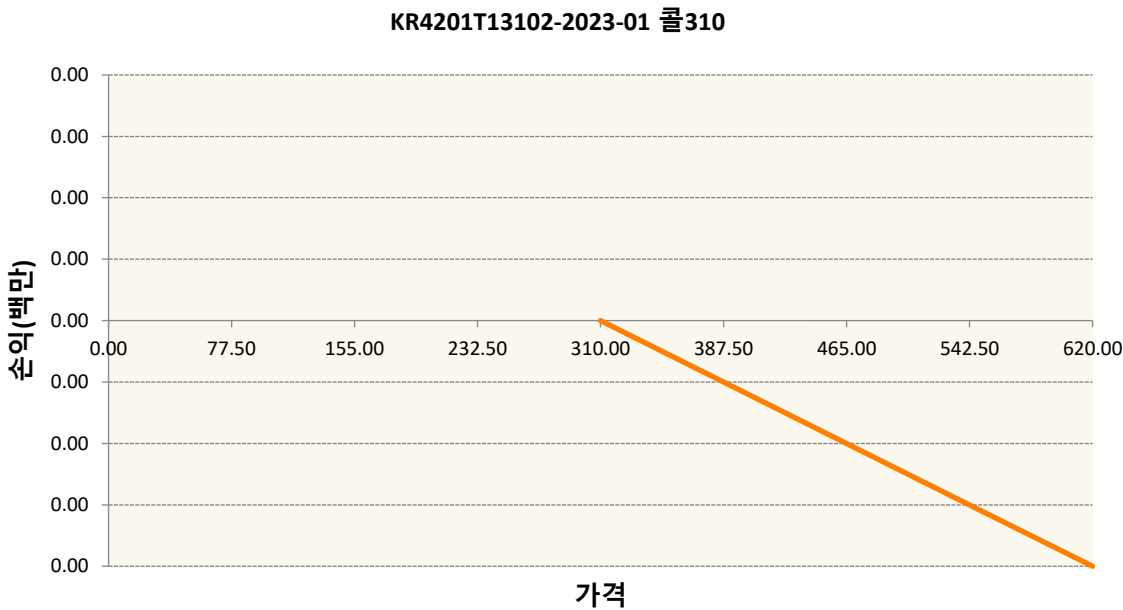
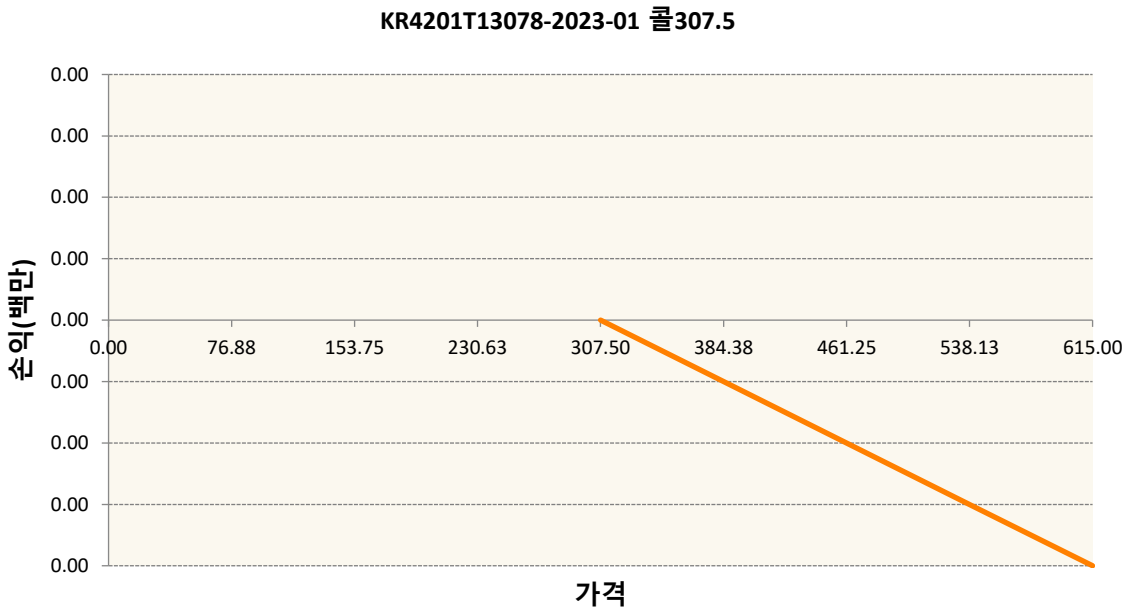
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

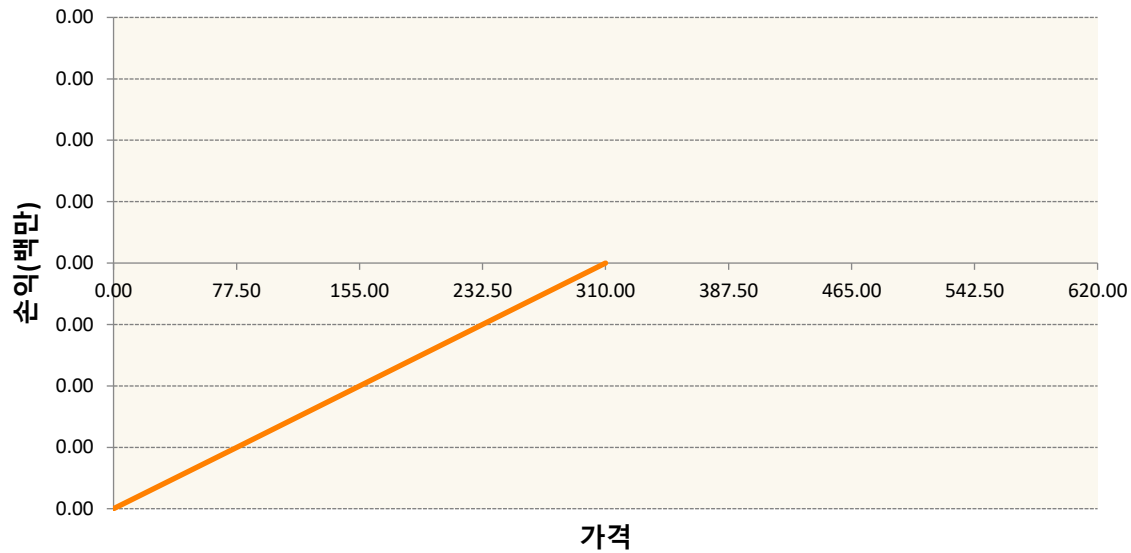
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	55,100	-55,100	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301T13100-2023-01 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201T13078			2023-01 콜307.5				1,688
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	603	582	553	517	474	424	369
-5.33%	558	518	469	413	350	282	209
-2.67%	462	397	325	247	163	76	-15
0%	286	194	99	0	-102	-206	-311
2.67%	-2	-113	-226	-341	-456	-571	-687
5.33%	-420	-541	-662	-783	-904	-1,025	-1,146
8.00%	-973	-1,091	-1,209	-1,328	-1,447	-1,567	-1,688
KR4201T13102			2023-01 콜310				285
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	91	87	81	74	66	57
-5.33%	88	82	74	65	55	44	32
-2.67%	74	64	52	39	25	11	-5
0%	48	33	17	0	-17	-35	-53
2.67%	3	-16	-36	-55	-75	-96	-116
5.33%	-64	-85	-107	-128	-150	-171	-193
8.00%	-155	-176	-198	-219	-241	-263	-285
KR4301T13100			2023-01 풋310				652
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-599	-604	-610	-618	-628	-639	-652
-5.33%	-364	-373	-383	-396	-411	-427	-444
-2.67%	-139	-154	-170	-189	-208	-229	-251
0%	67	46	24	0	-25	-50	-76

2.67%	249	222	194	166	138	109	80
5.33%	398	368	338	307	277	246	216
8.00%	514	484	453	422	392	361	330

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

(단위:백만원)

2,156

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

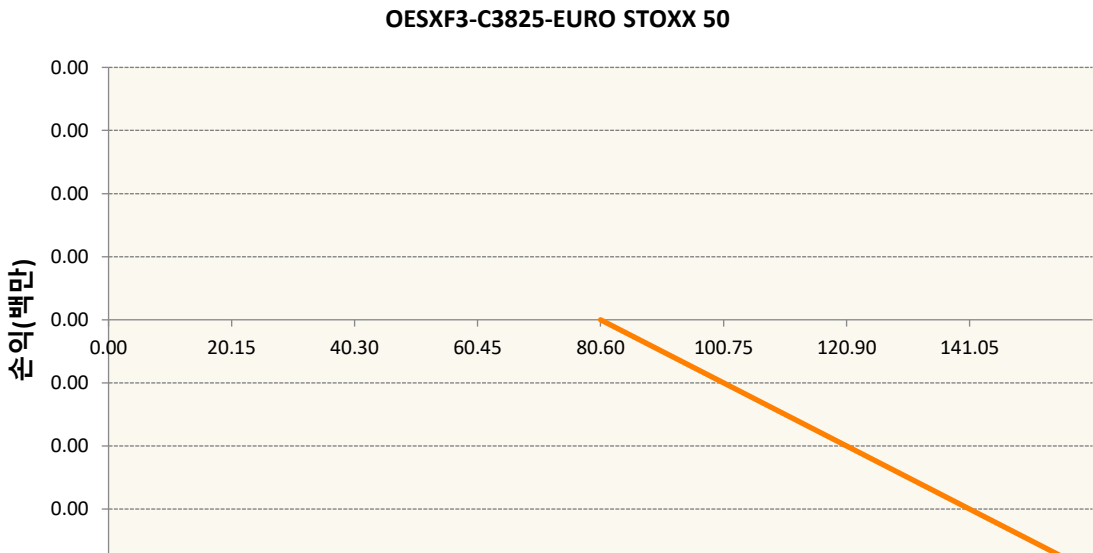
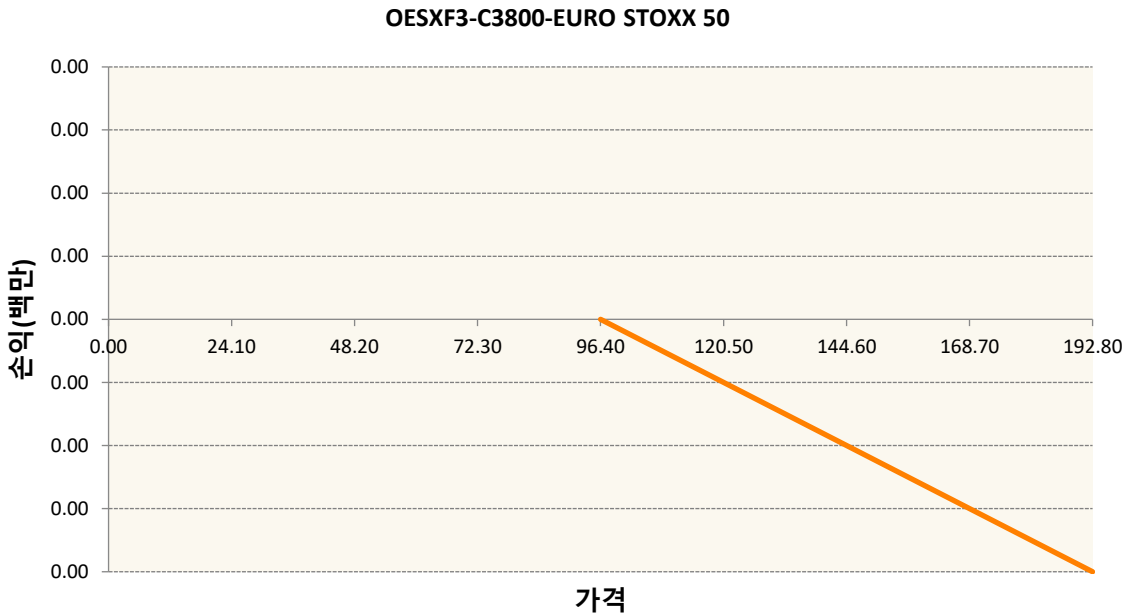
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

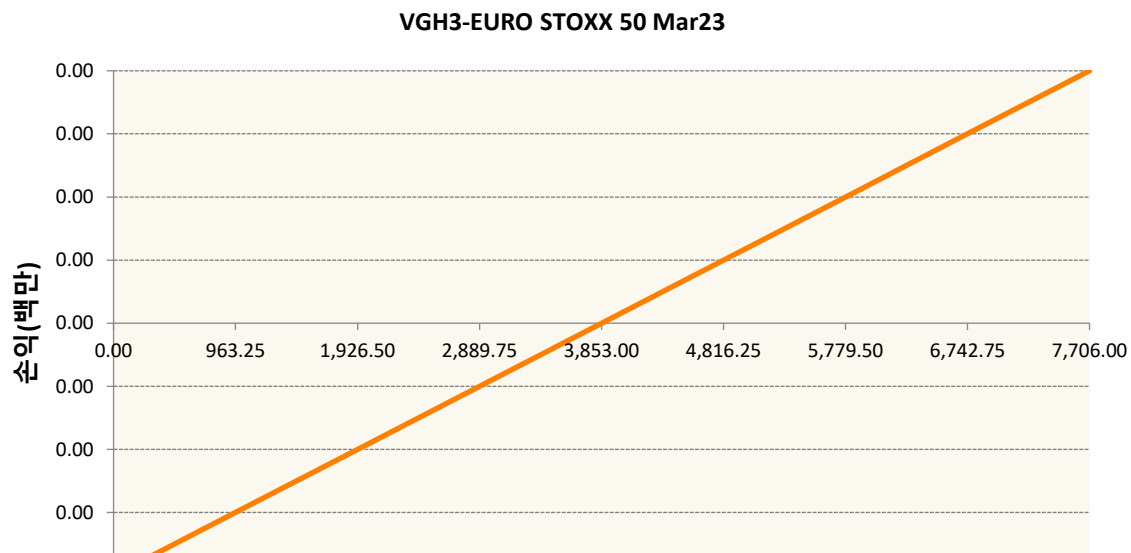
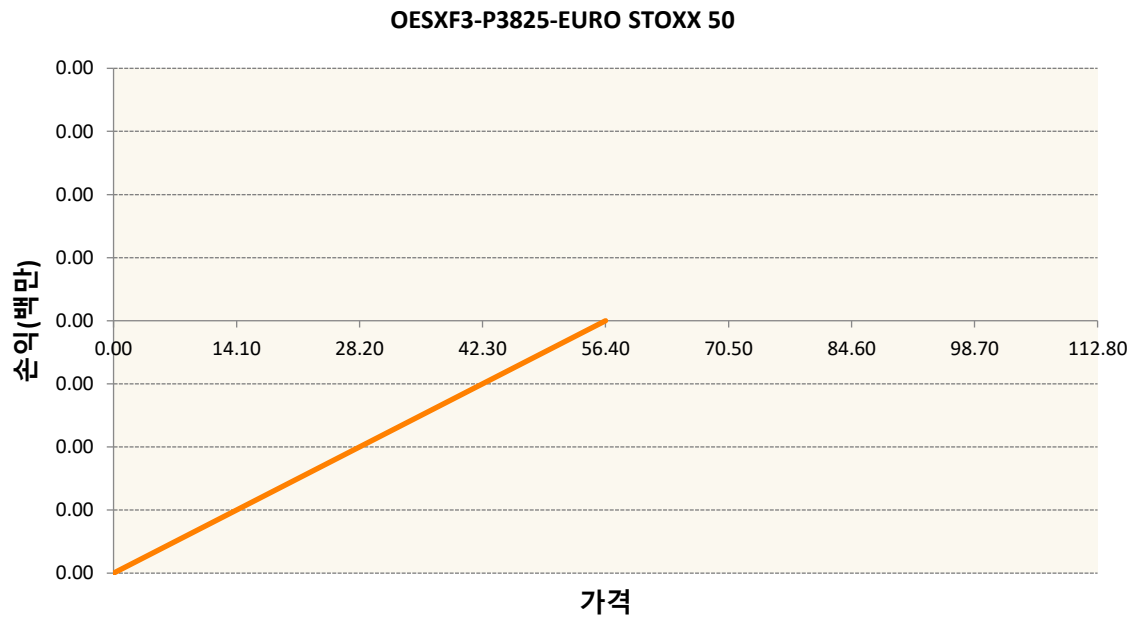
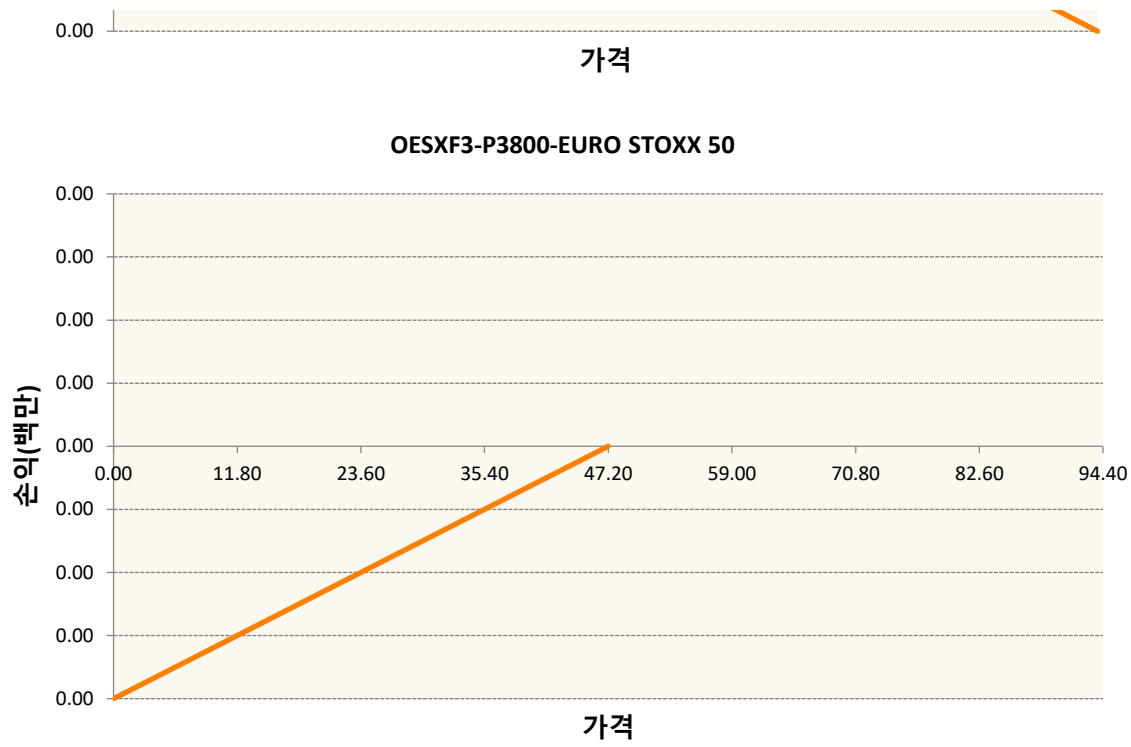
1. 계약금액

(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	1,071	0	1,071	
누계	유가증권	옵션	0	76	-76	장내
누계	통화	선도	336	2,220	-1,884	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E		54
FXW213CBG(KRW/EUR 24-02-23E		70
FXW213CBN(EUR/KRW 24-02-23E		11
FXW213CCN(KRW/EUR 24-03-23E		54
FXW213CCP(EUR/KRW 27-01-23E		16
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		3
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		1
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		2
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		0.42
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		86

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	249

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

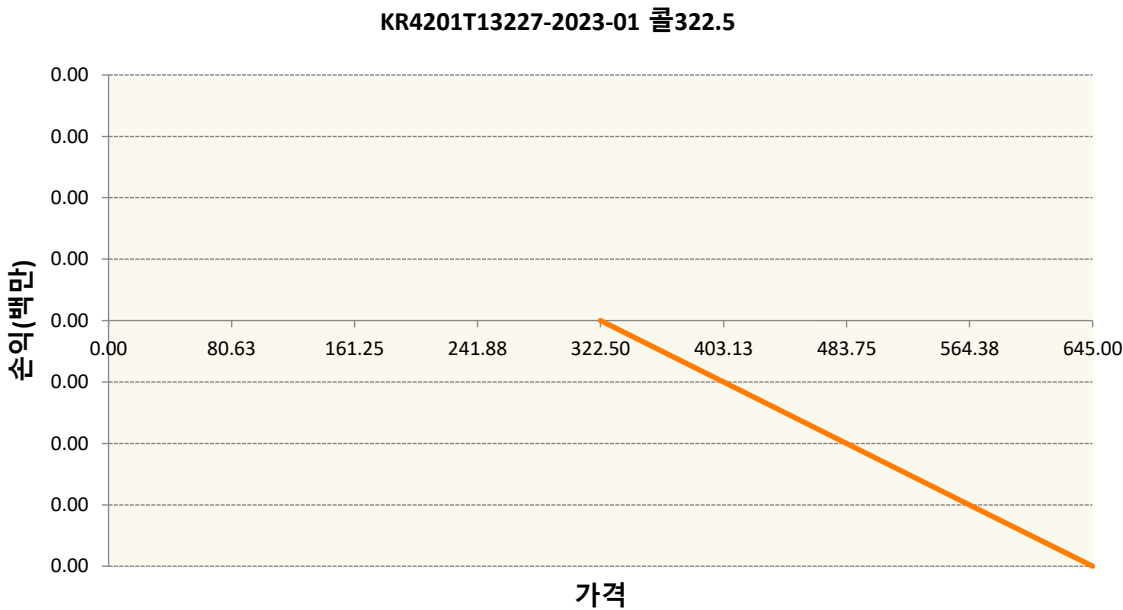
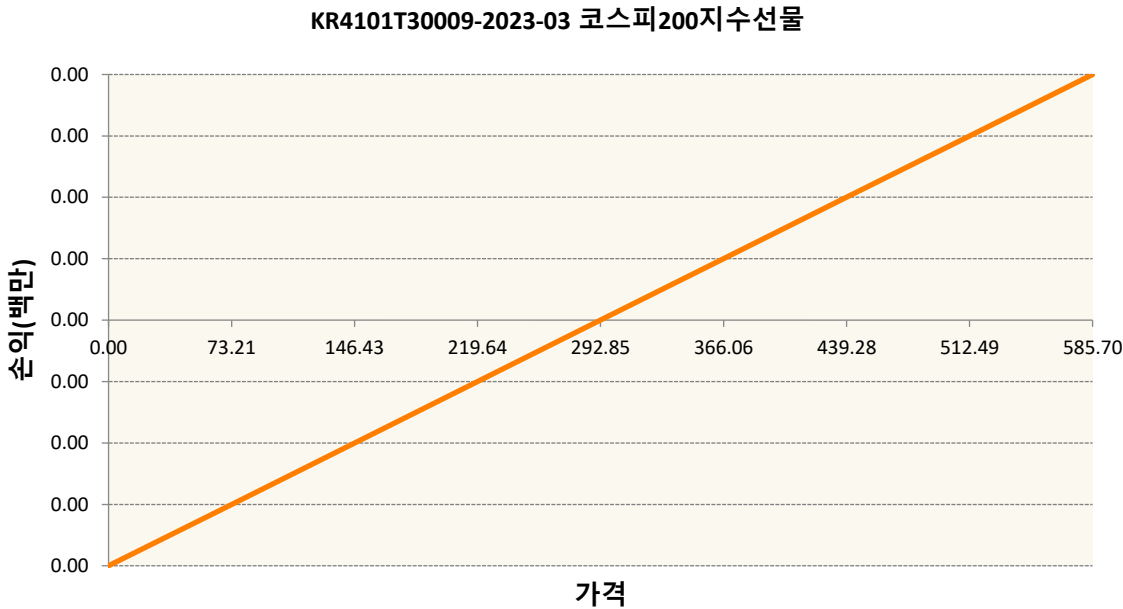
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

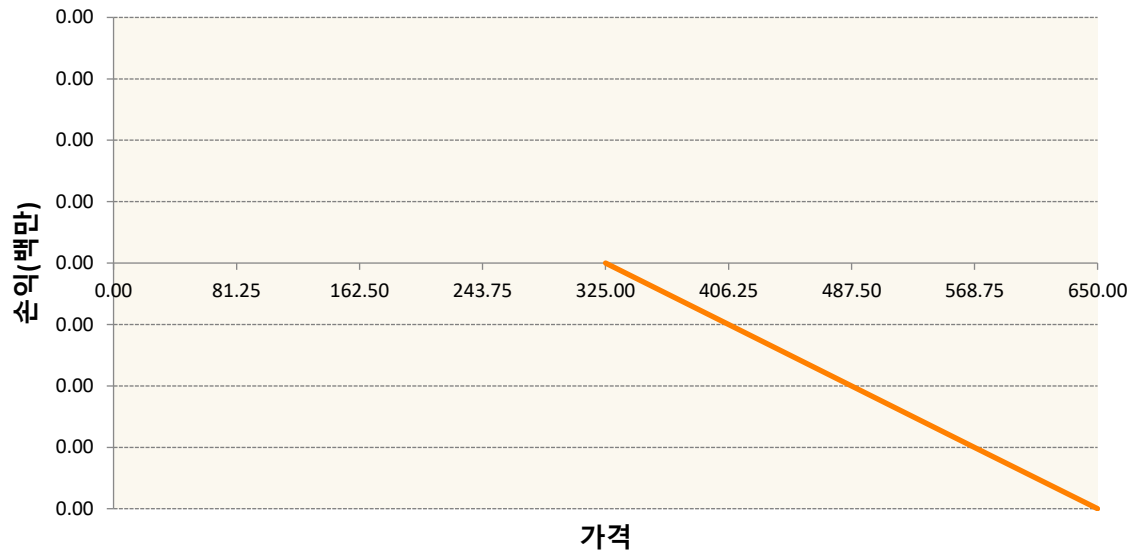
(단위:백만원)

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	366	0	366	장내
누계	유가증권	옵션	78	3,803	-3,726	장내

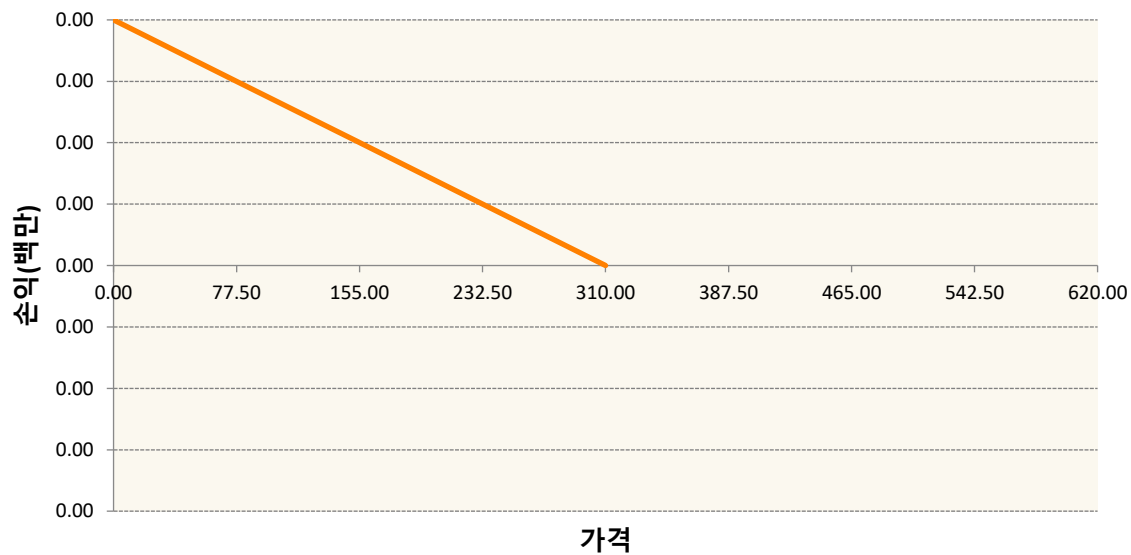
2. 만기시점의 손익구조



KR4201T13250-2023-01 쿨325



KR4301T13100-2023-01 ㄸ310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					29
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-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%	19	19	19	19	19	19	19
8.00%	29	29	29	29	29	29	29
KR4201T13227		2023-01 콜322.5					58
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	12	12	11	9	8
-5.33%	13	12	11	10	8	6	4
-2.67%	11	10	8	6	3	1	-3
0%	9	6	3	0	-4	-7	-11
2.67%	3	-1	-5	-9	-14	-19	-23
5.33%	-7	-12	-17	-22	-28	-33	-39
8.00%	-22	-28	-34	-40	-46	-52	-58

KR4201T13250

2023-01 콜325

48

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	9	9	8	7	6
-5.33%	10	9	8	7	6	4	3
-2.67%	9	8	6	5	3	0	-2
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	3	0	-4	-7	-11	-15	-19
5.33%	-5	-9	-13	-18	-22	-27	-32
8.00%	-17	-22	-27	-32	-37	-43	-48

KR4301T13100

2023-01 풋310

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	4
-2.67%	1	1	1	1	2	2	2
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-2	-2	-2	-1	-1	-1	-1
5.33%	-3	-3	-3	-2	-2	-2	-2
8.00%	-4	-4	-4	-3	-3	-3	-3

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

(단위:백만원)

103

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

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	6,455	0	6,455	

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	2023-01-02
기준일	2022-12-30

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	5,463	0	5,463	

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	2023-01-02
기준일	2022-12-30

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	18,290	0	18,290	
누계	통화	선도	0	18,557	-18,557	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CAR\KRW/USD 30-01-23E		261
FXW213CBQ\KRW/USD 28-02-23E		646
FXW213CCK\KRW/USD 30-01-23E		40
FXW213CCS\KRW/USD 28-03-23E		536
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	790

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

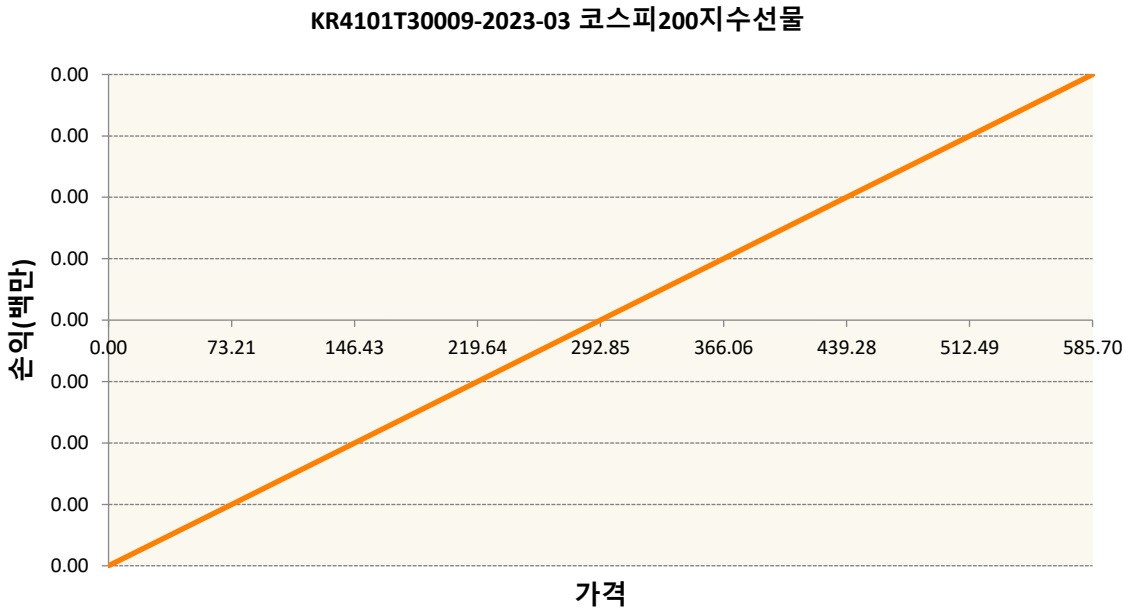
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	732	0	732	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				58
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	58	58	58	58	58	58	58

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

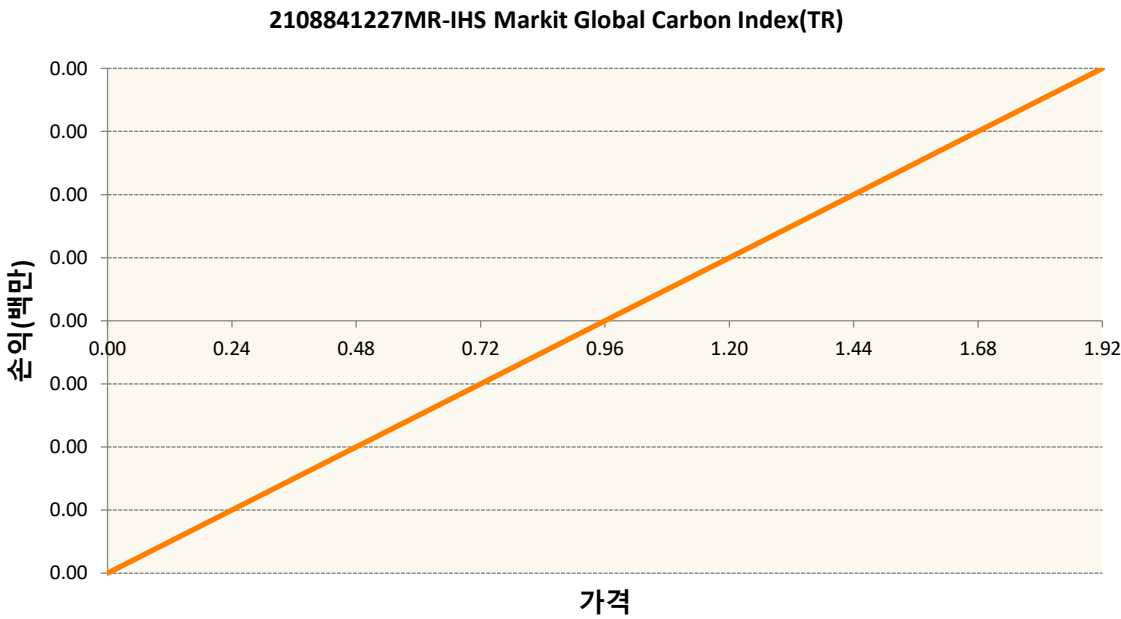
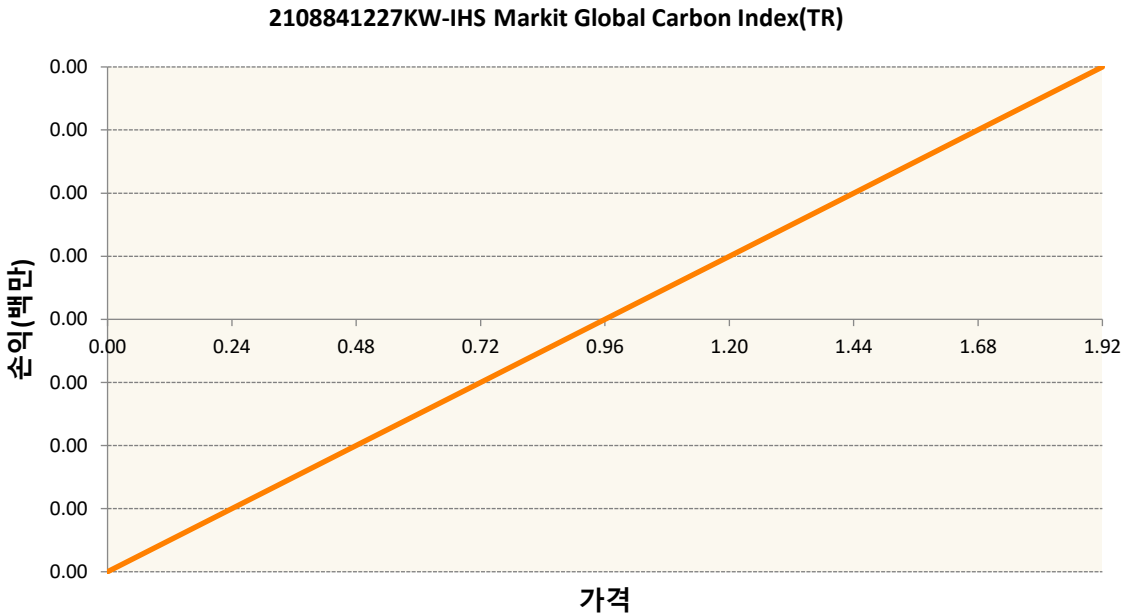
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

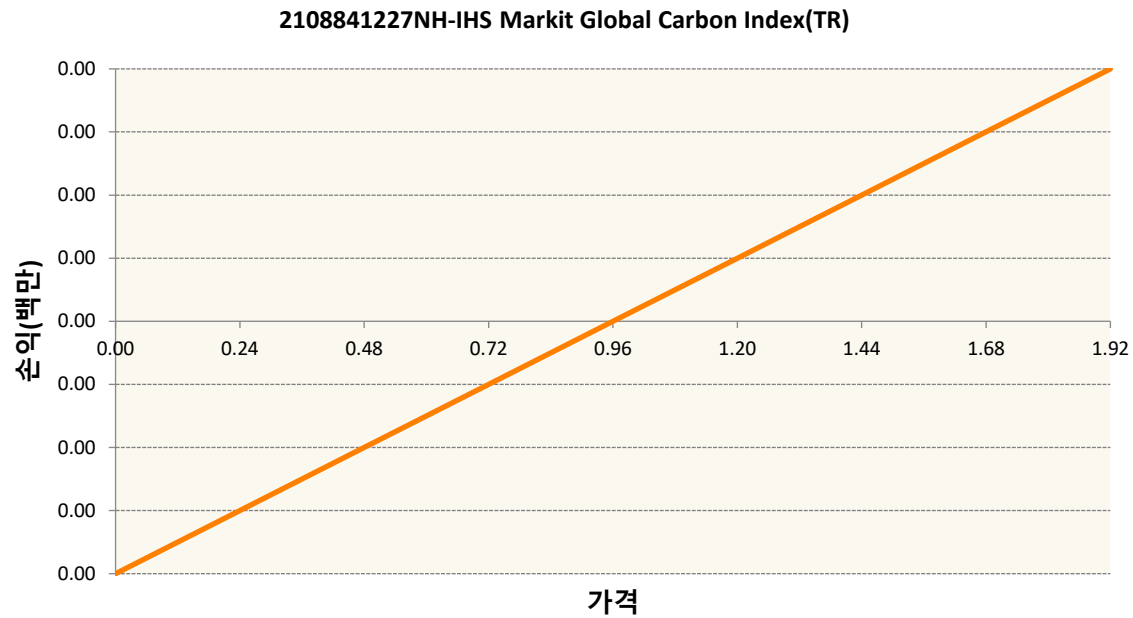
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	23,372	0	23,372	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,596
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		188
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		94

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,603

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

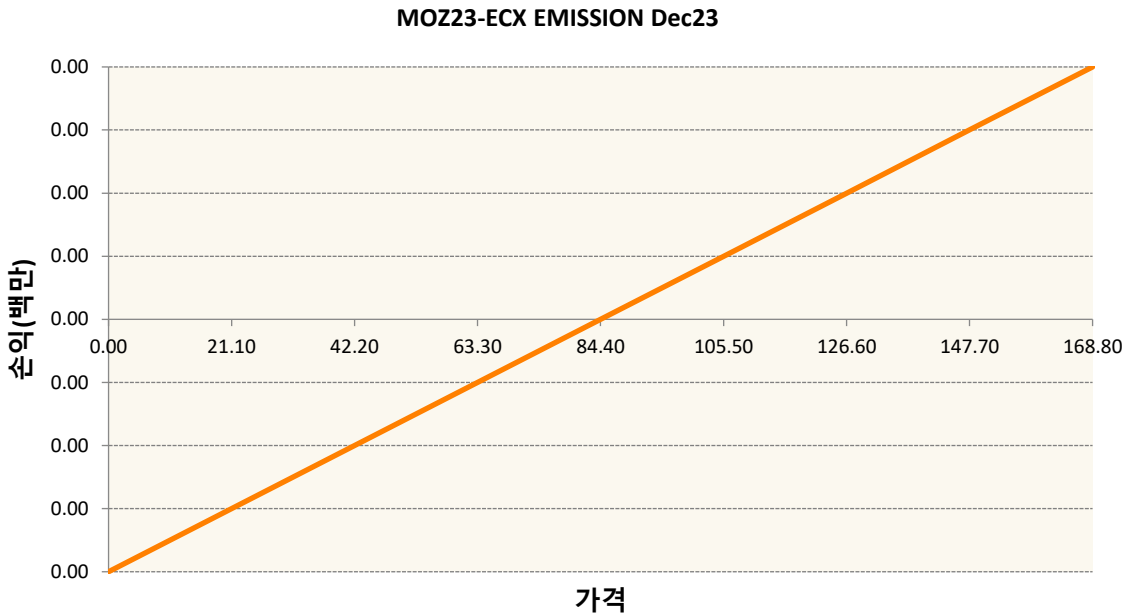
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	12,955	0	12,955	
누계	통화	선도	0	3,597	-3,597	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CCPI KRW/EUR 27-01-23E	108
FXW213CCPI KRW/EUR 27-01-23E	180
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,036

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

(단위:백만원)

2,886

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

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	9,319	0	9,319	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (NH)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	1

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

(단위:백만원)

10

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

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)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	14

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

(단위:백만원)

59

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

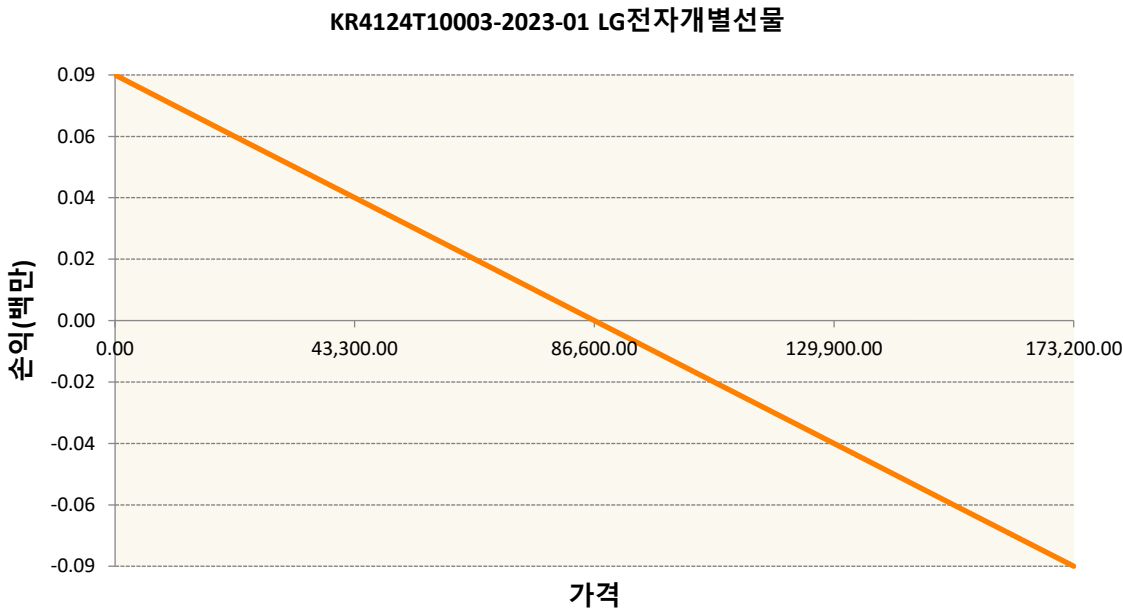
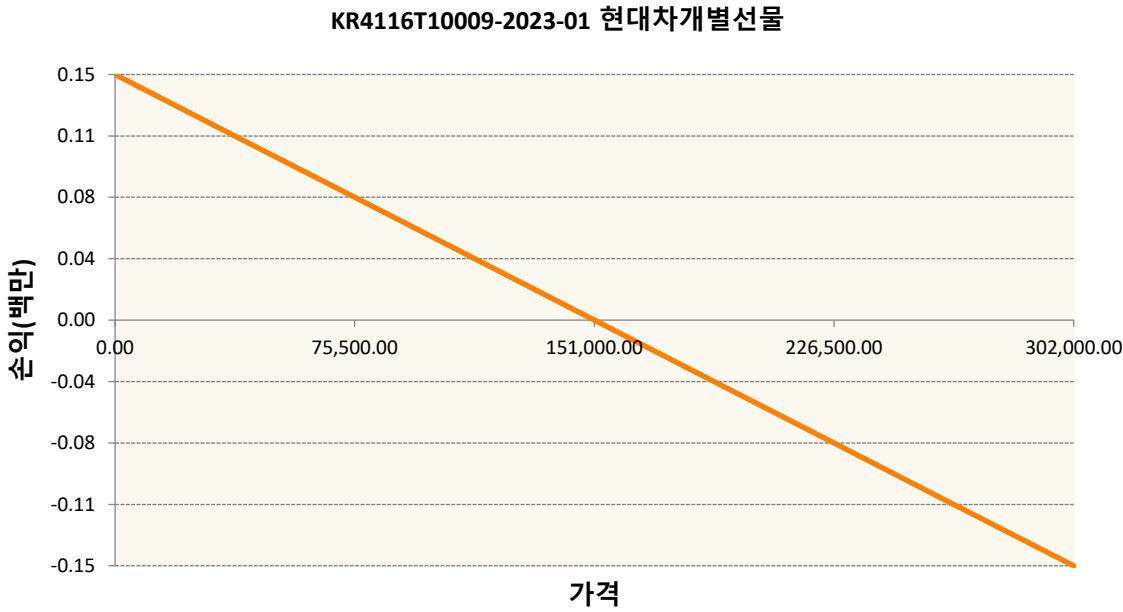
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

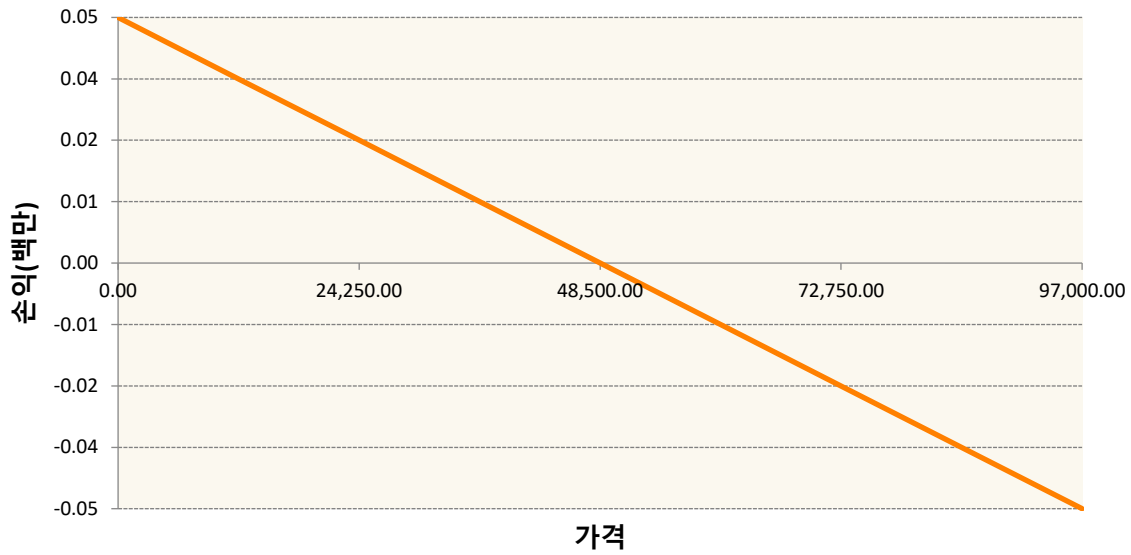
(단위:백만원)

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	2,122	-2,122	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

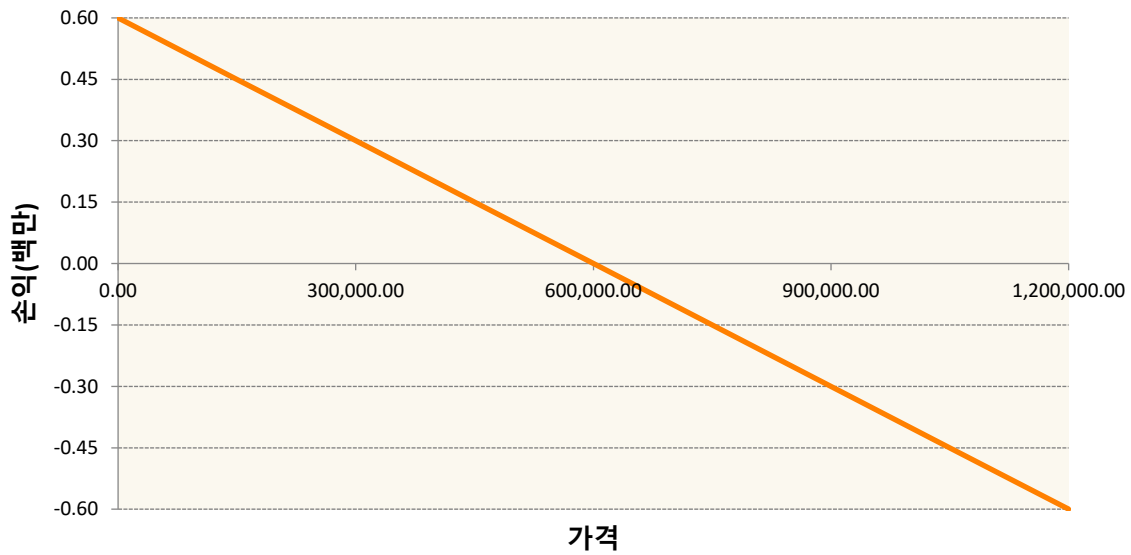
2. 만기시점의 손익구조



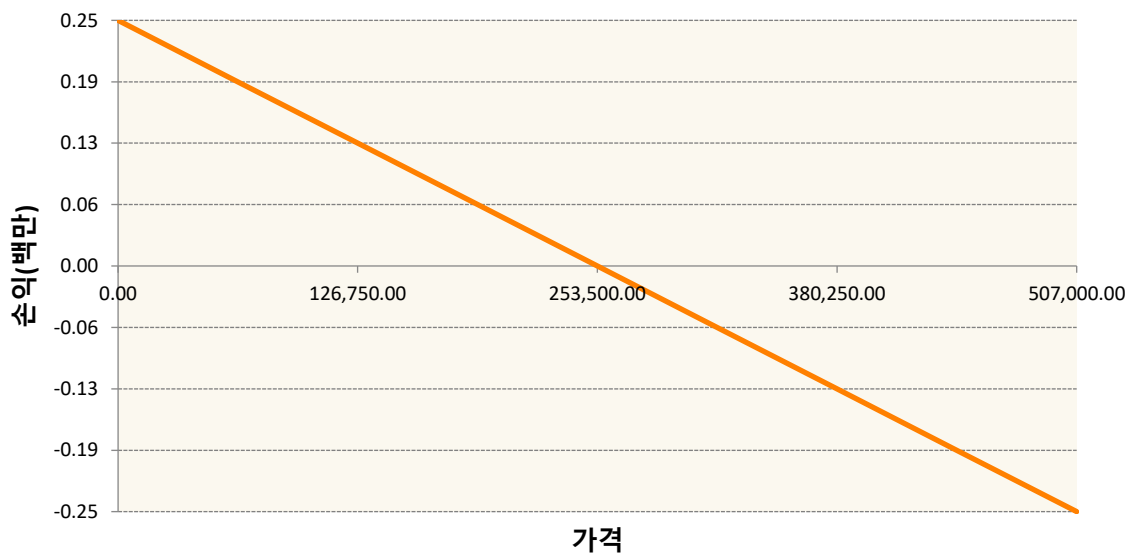
KR4146T10006-2023-01 KB금융개별선물



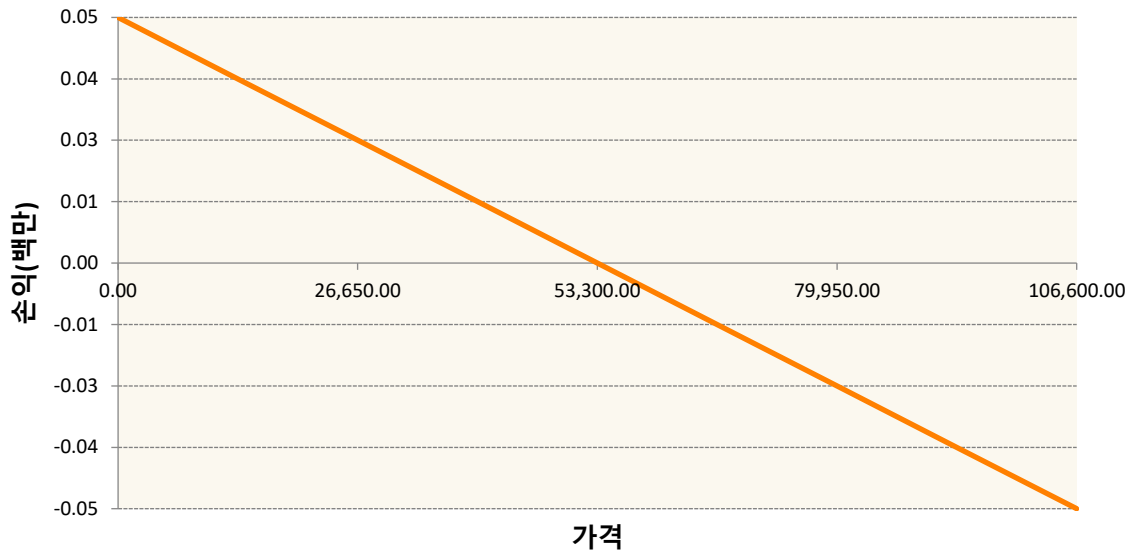
KR4147T10004-2023-01 LG화학개별선물



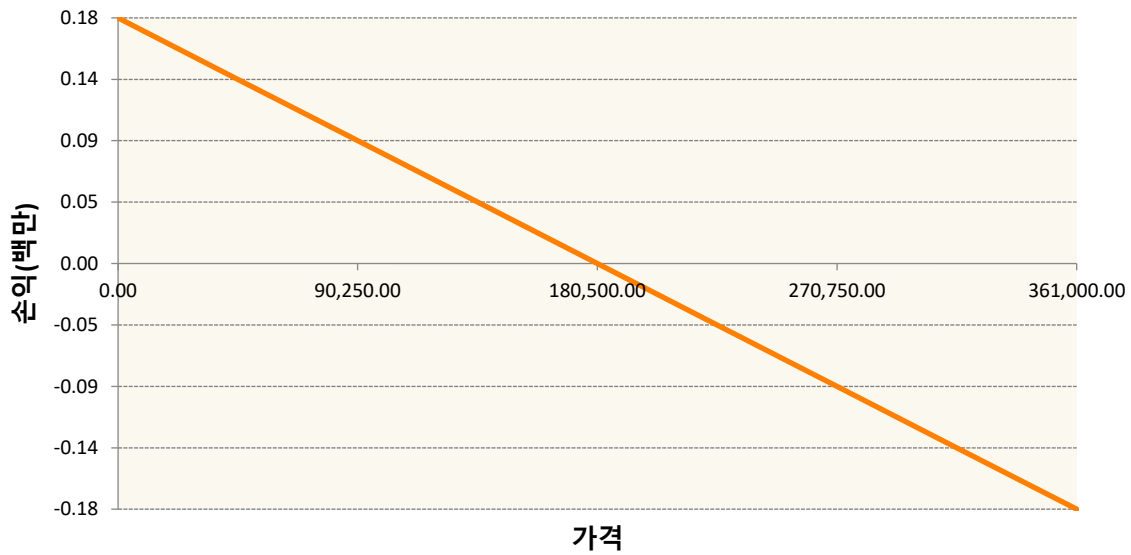
KR41BYT10009-2023-01 LG이노텍개별선물



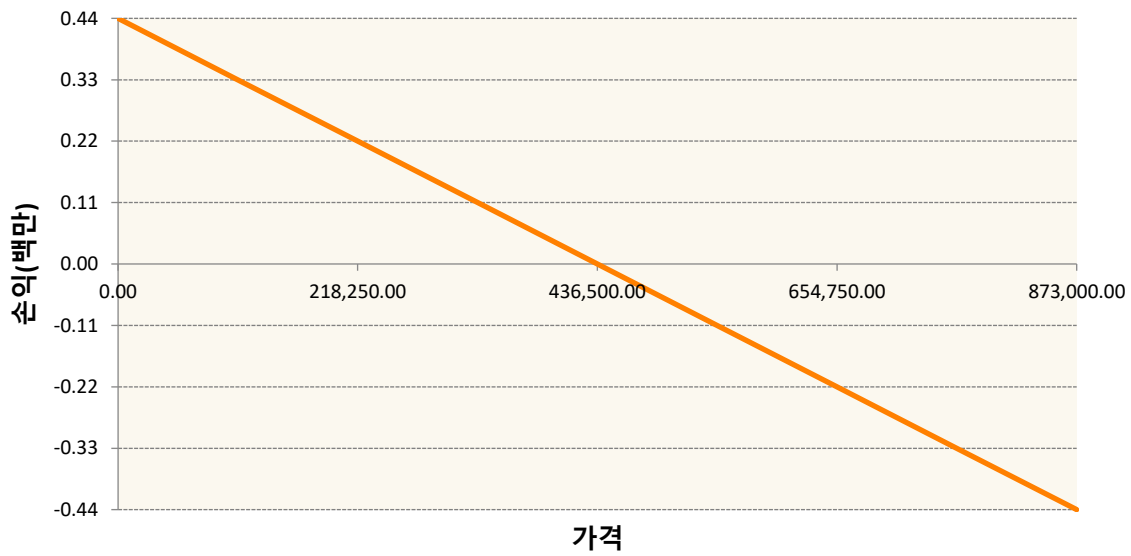
KR41CFT10006-2023-01 카카오개별선물



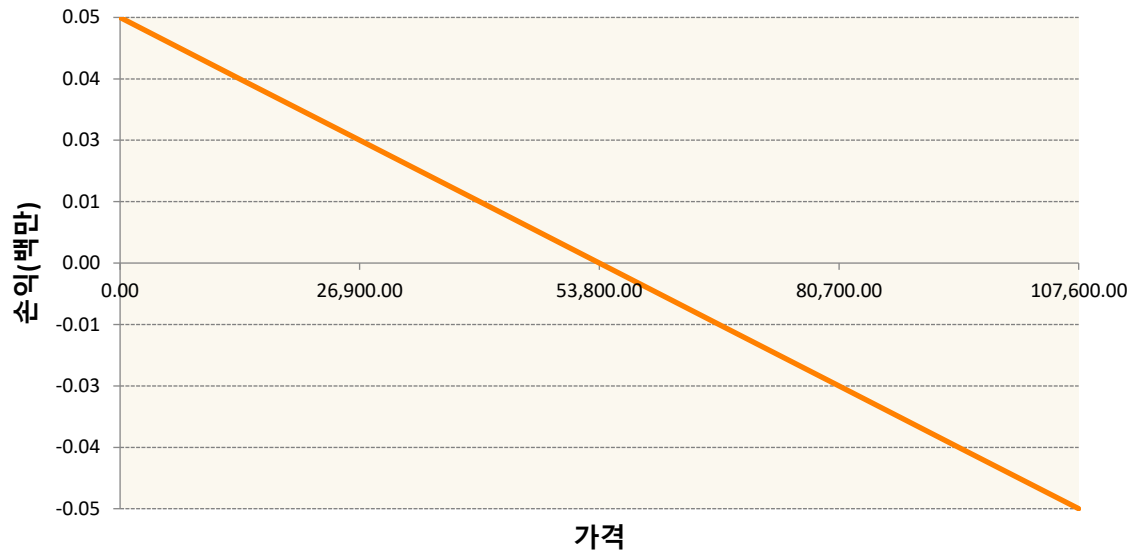
KR41E8T10001-2023-01 포스코케미칼개별선물



KR41F5T10006-2023-01 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7T10002-2023-01 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4116T100 2023-01 현대차개별선물	18
KR4124T100 2023-01 LG전자개별선물	26
KR4146T100 2023-01 KB금융개별선물	27
KR4147T100 2023-01 LG화학개별선물	14
KR41BYT100 2023-01 LG이노텍개별선물	10
KR41CFT100 2023-01 카카오개별선물	30
KR41E8T100 2023-01 포스코케미칼개별선물	14
KR41F5T100 2023-01 LG에너지솔루션개별선물	21
KR41F7T100 2023-01 카카오페이개별선물	9
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.01
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.01

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

(단위:백만원)

389

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

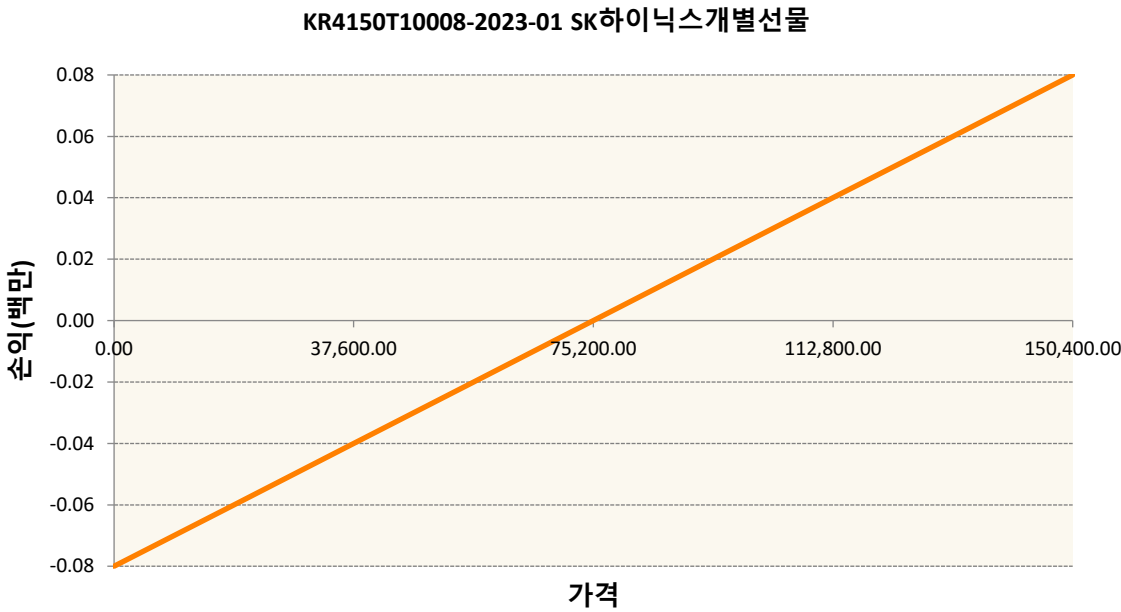
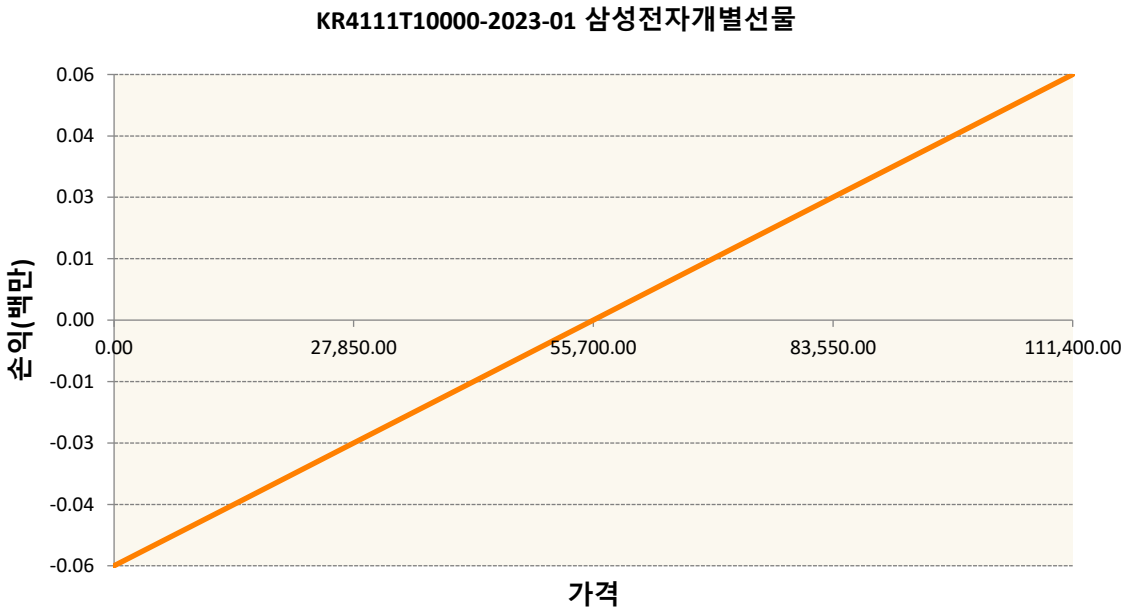
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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	134	0	134	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111T10000		2023-01 삼성전자개별선물					7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-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%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	7
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%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

13

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

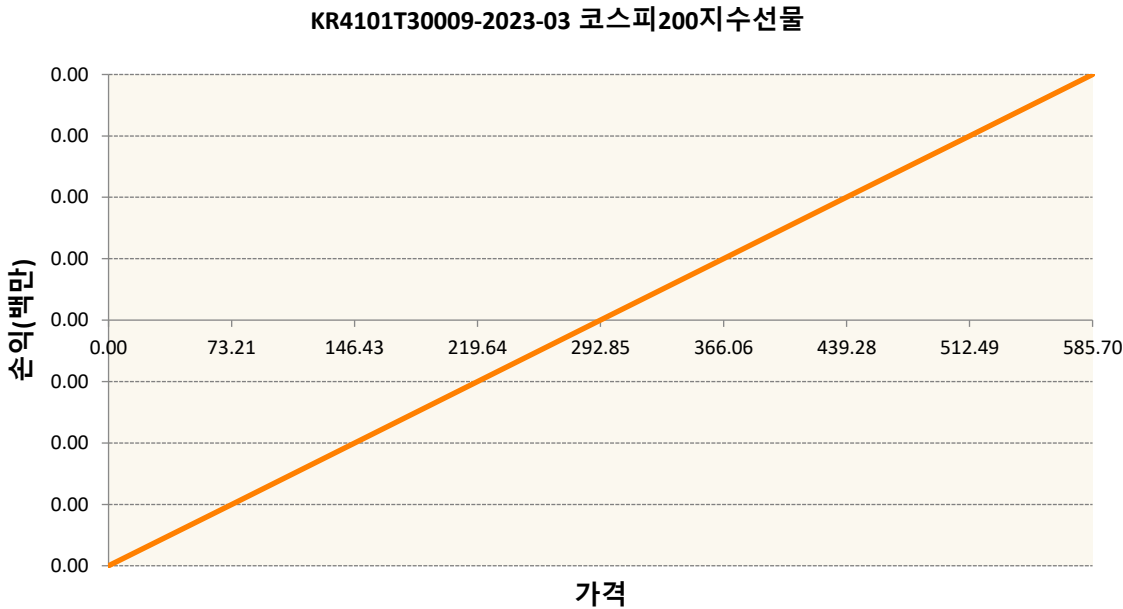
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	1,684	0	1,684	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				134
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
-5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	89	89	89	89	89	89	89
8.00%	134	134	134	134	134	134	134

공시일	2023-01-02
기준일	2022-12-30

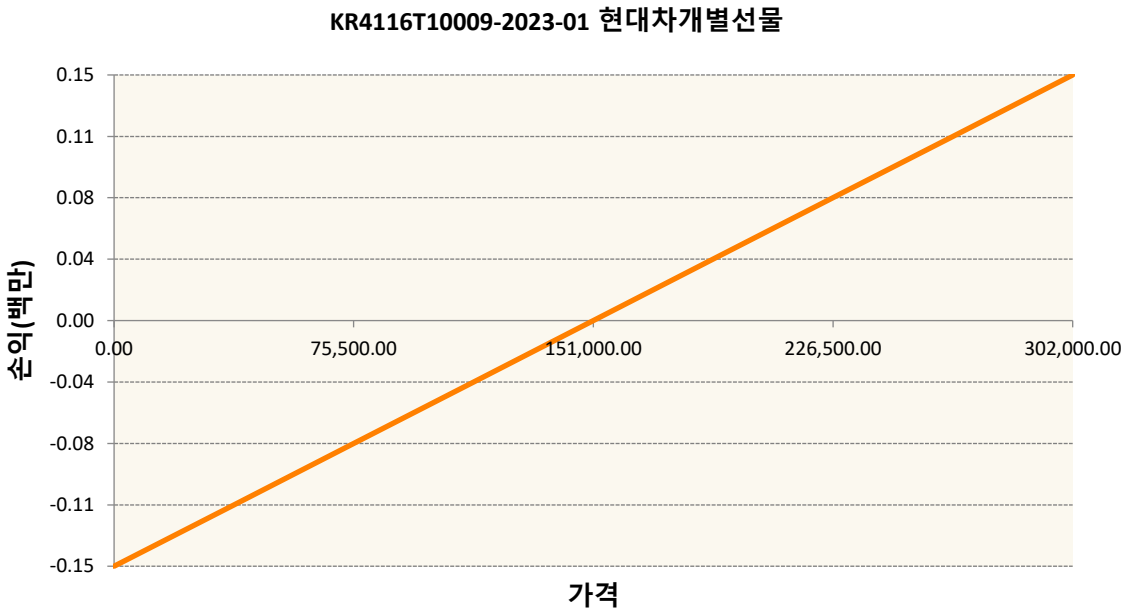
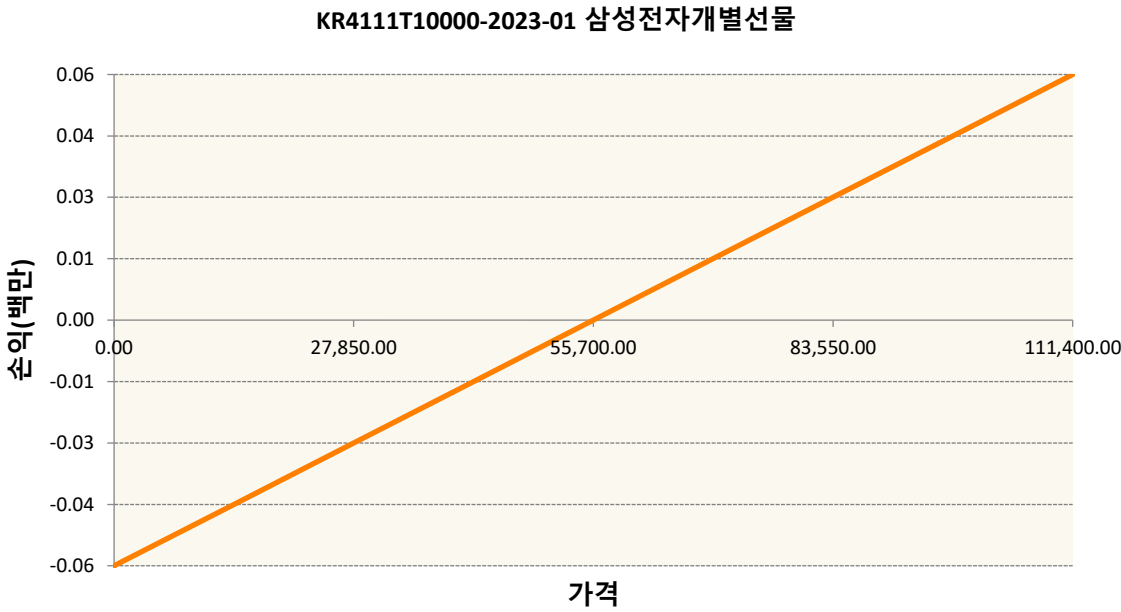
SOL한국형글로벌전기차&2차전지

1. 계약금액

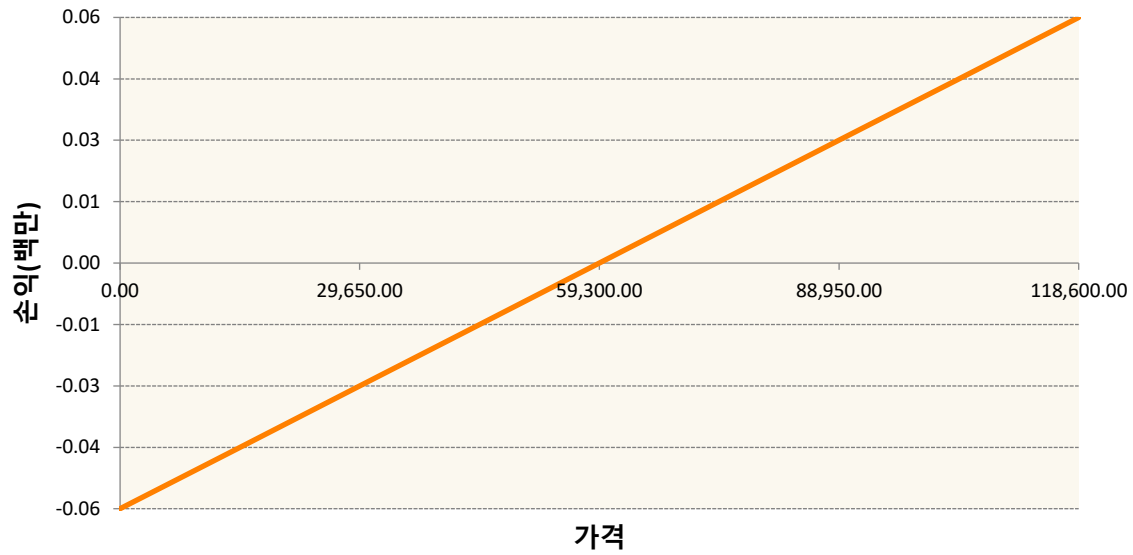
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	214	0	214	장내

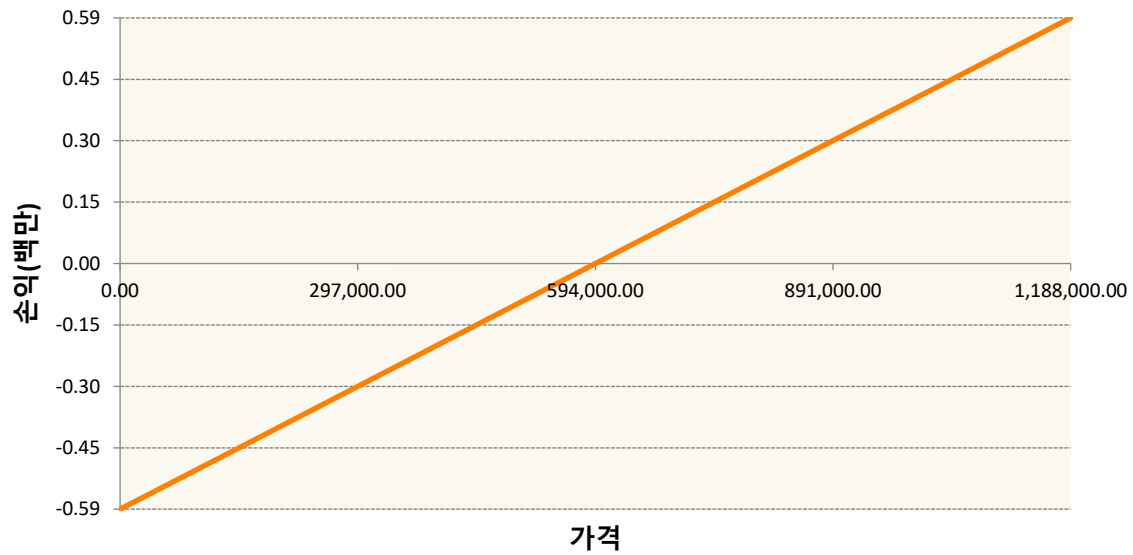
2. 만기시점의 손익구조



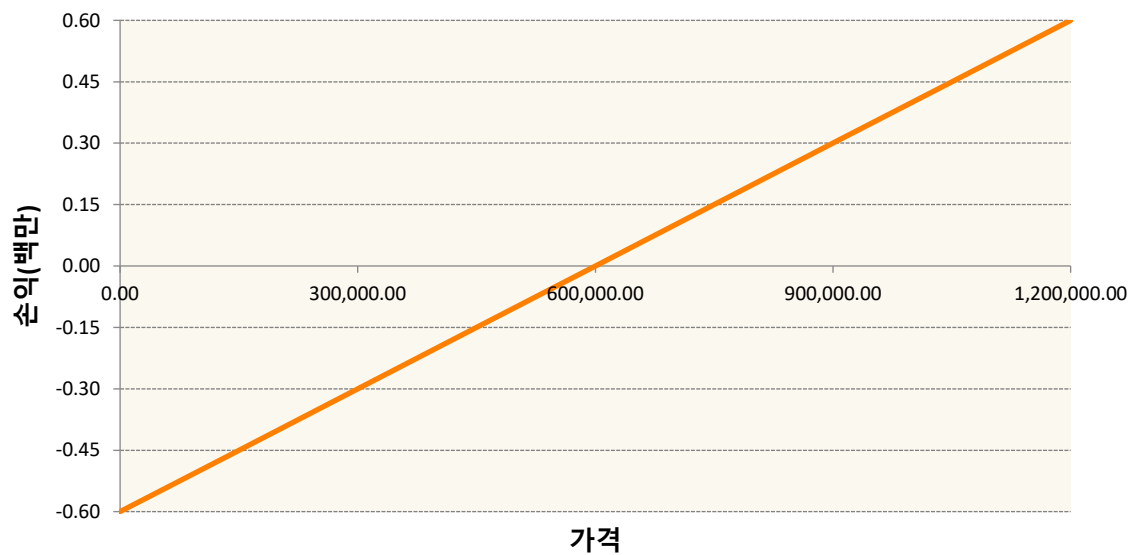
KR4119T10003-2023-01 기아개별선물



KR4122T10007-2023-01 삼성SDI개별선물



KR4147T10004-2023-01 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111T10000		2023-01 삼성전자개별선물						4
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-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%	3	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4	4
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						9
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-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%	6	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9	9

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

18

공시일 2023-01-02

기준일 2022-12-30

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

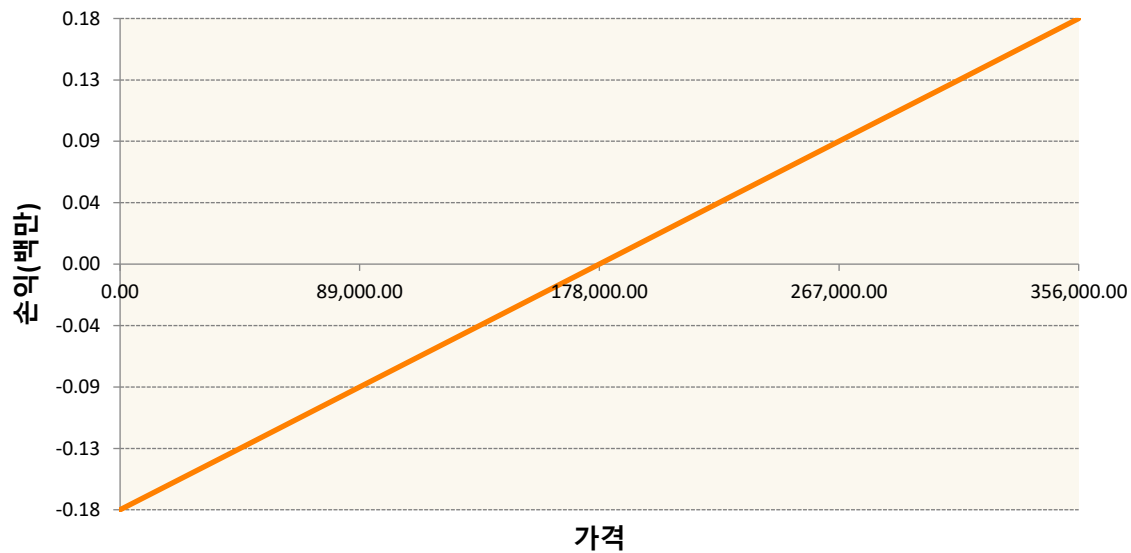
1. 계약금액

(단위:백만원)

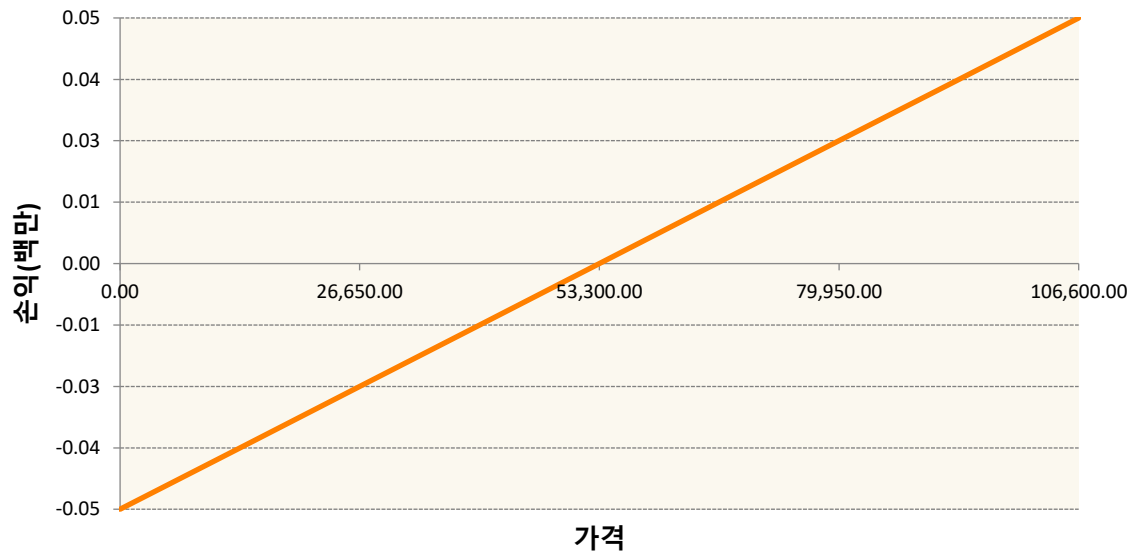
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	110	0	110	장내

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	2023-01-02
기준일	2022-12-30

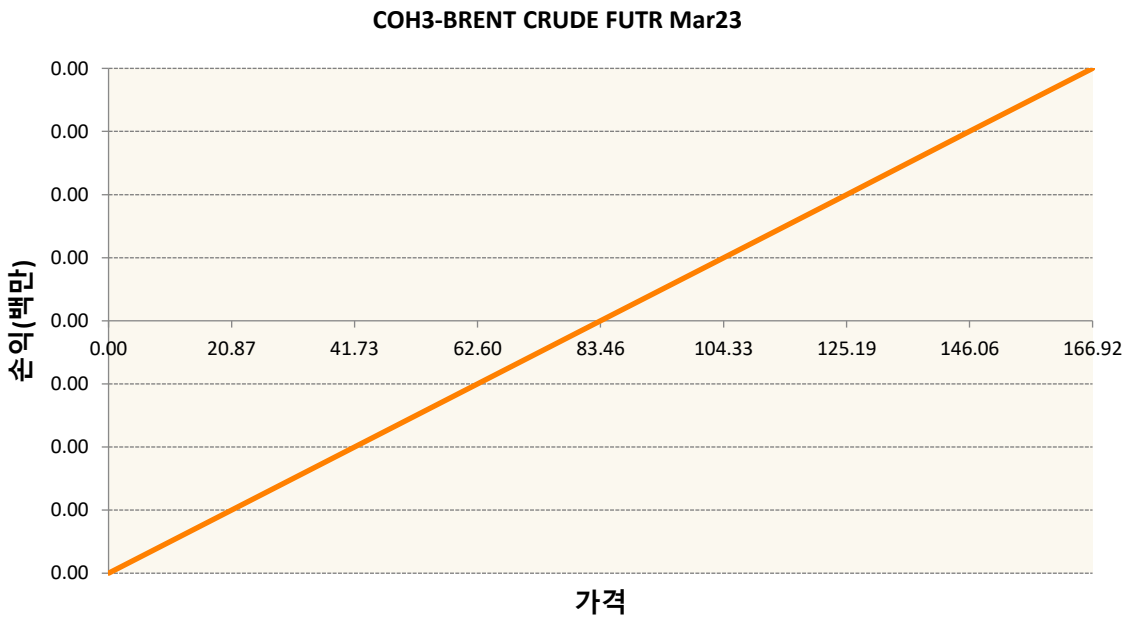
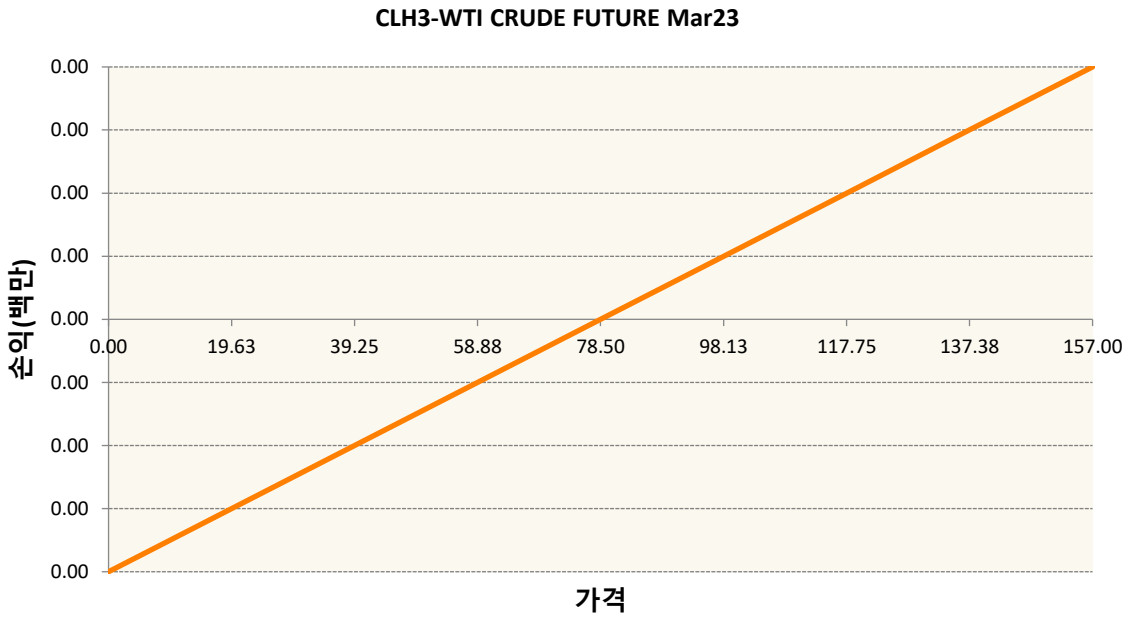
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

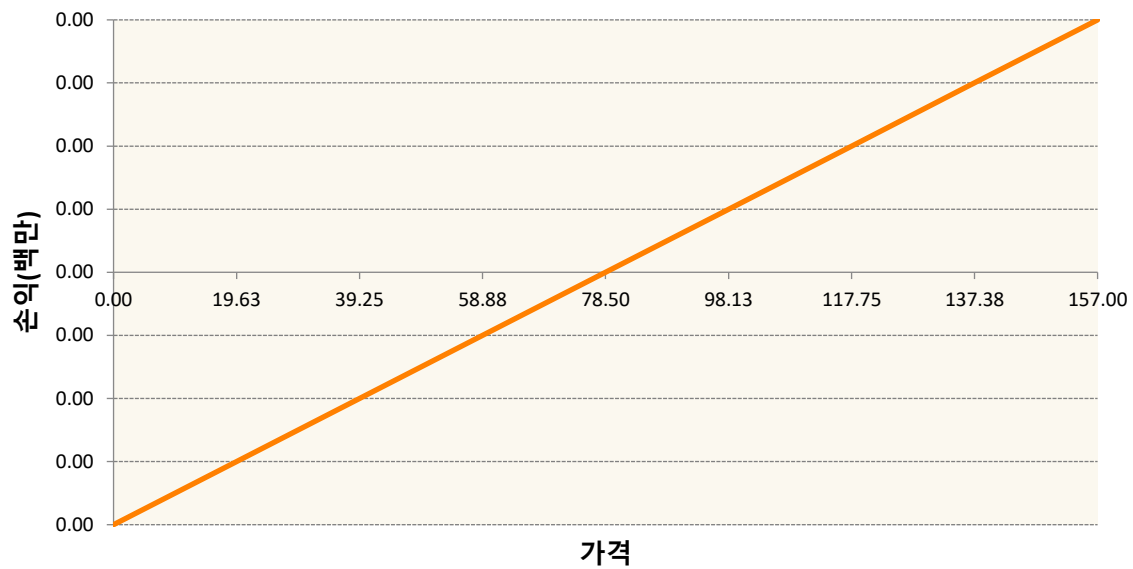
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,717	253	1,464	

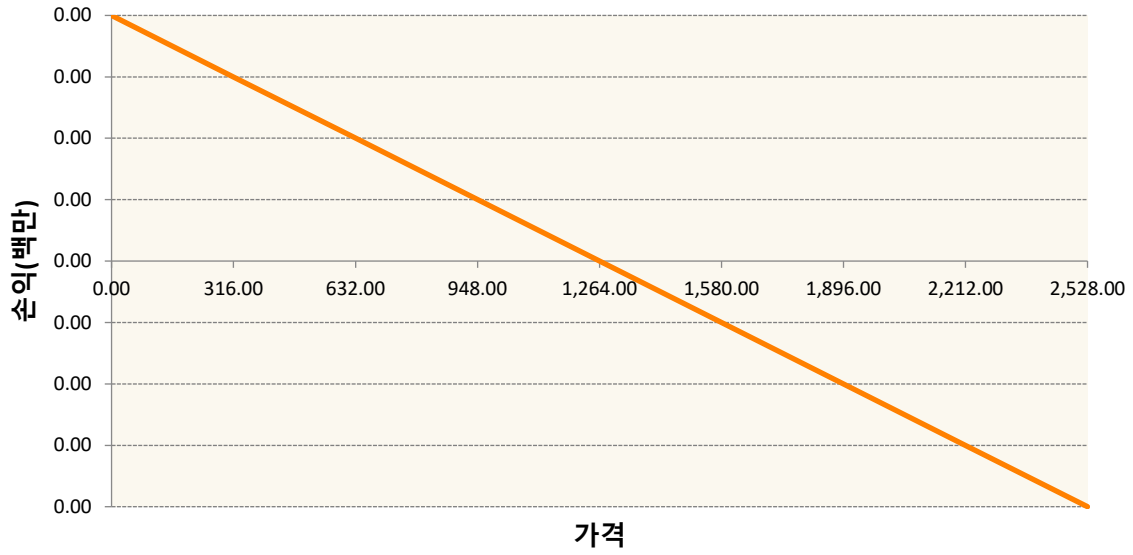
2. 만기시점의 손익구조



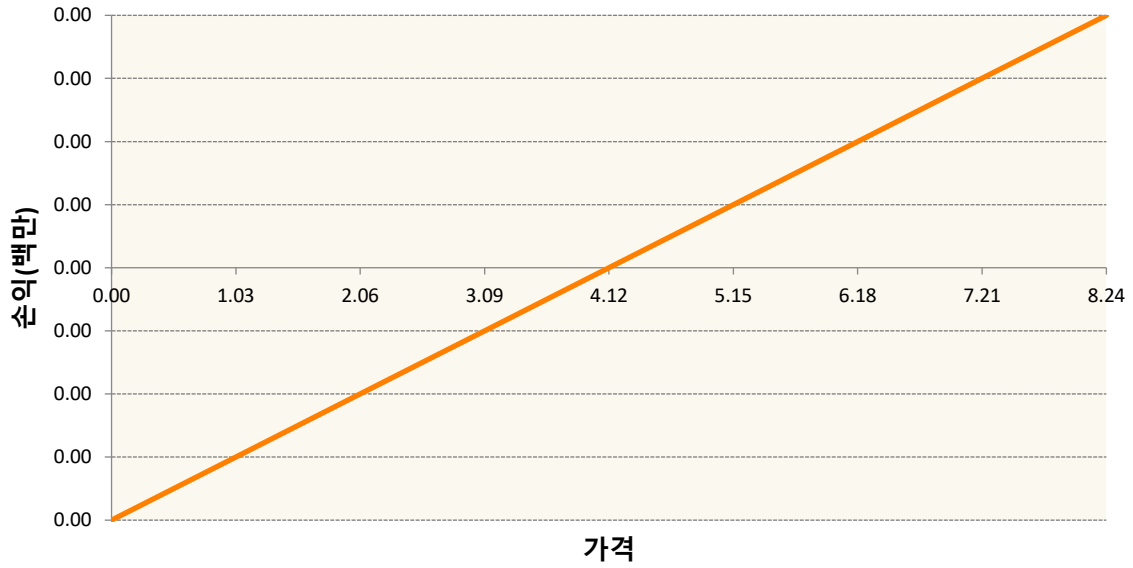
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



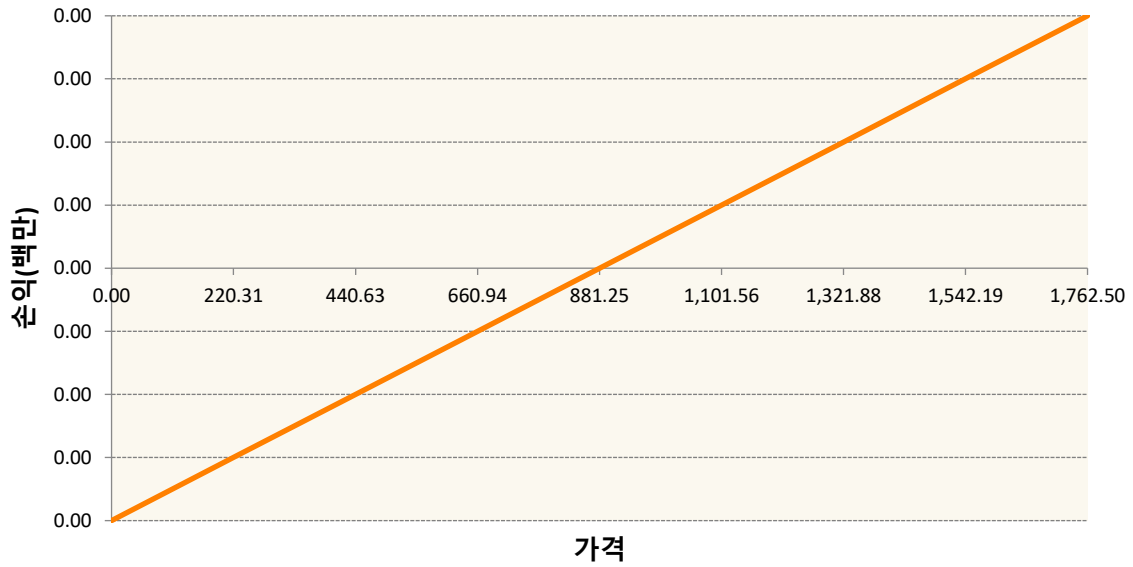
KR4175T10005-2023-01 달러선물

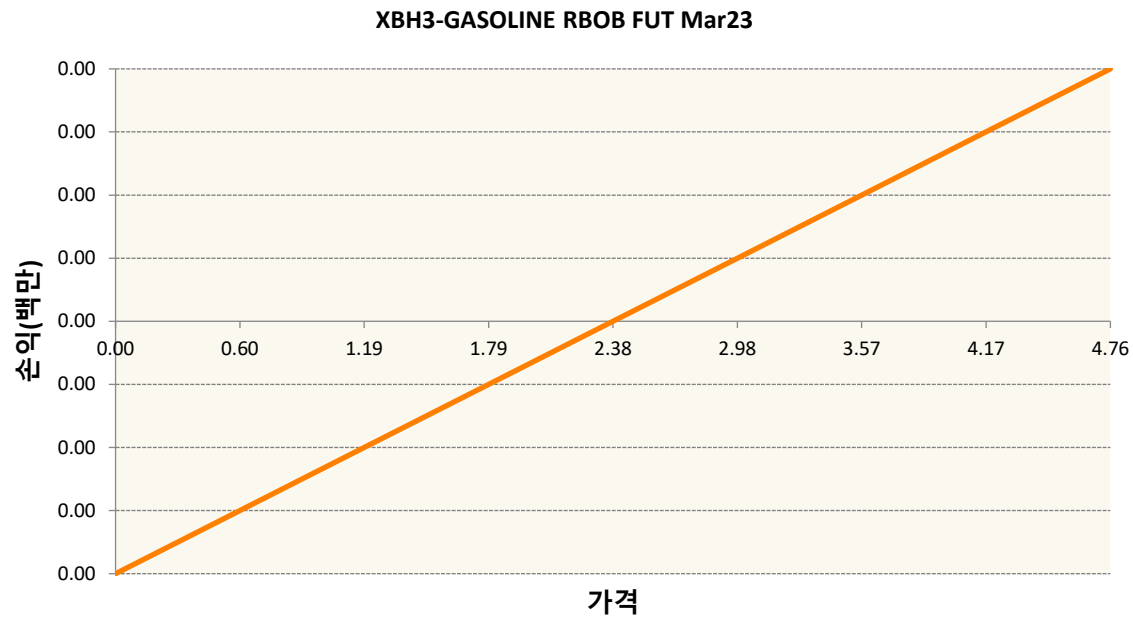


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	25
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	14
KR4175T100 2023-01 달러선물		20
NGH23	NATURAL GAS FUTR Mar23	39
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	9
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	456