

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

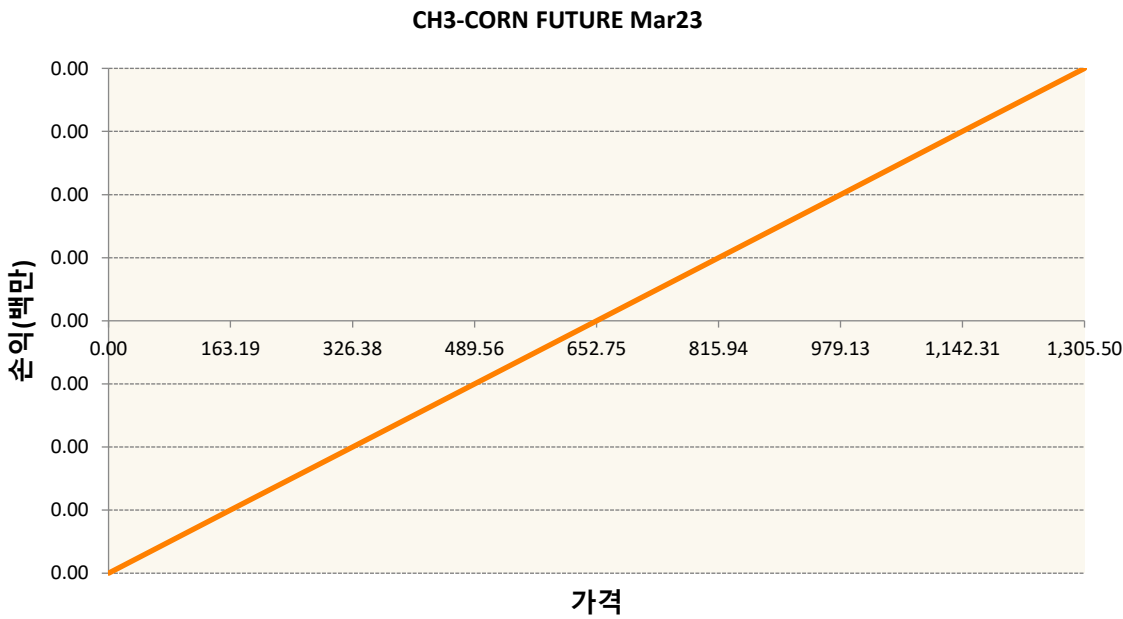
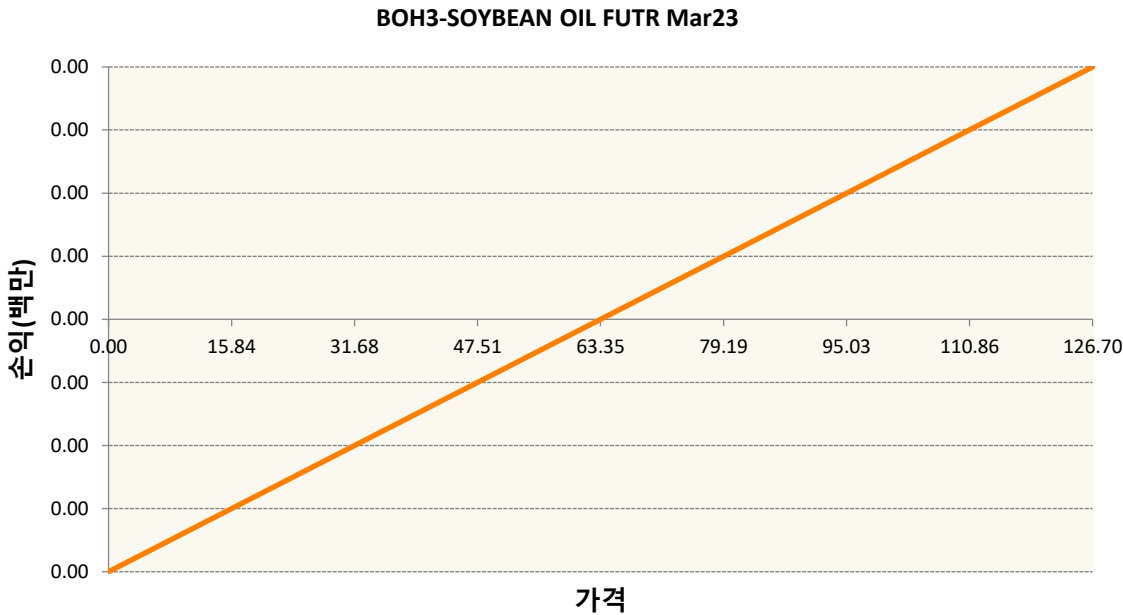
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

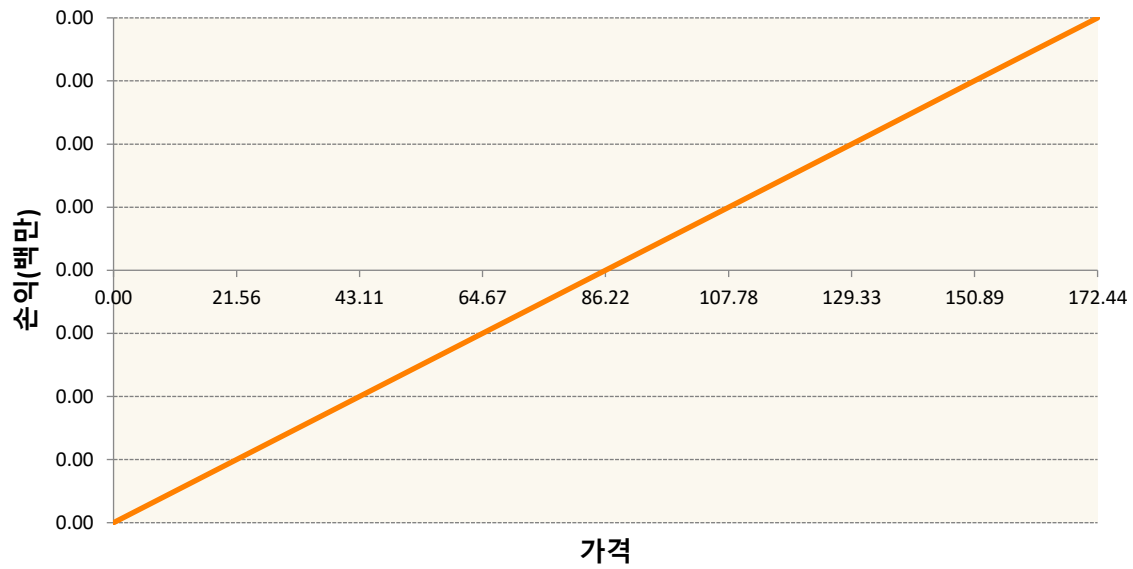
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,506	497	6,009	

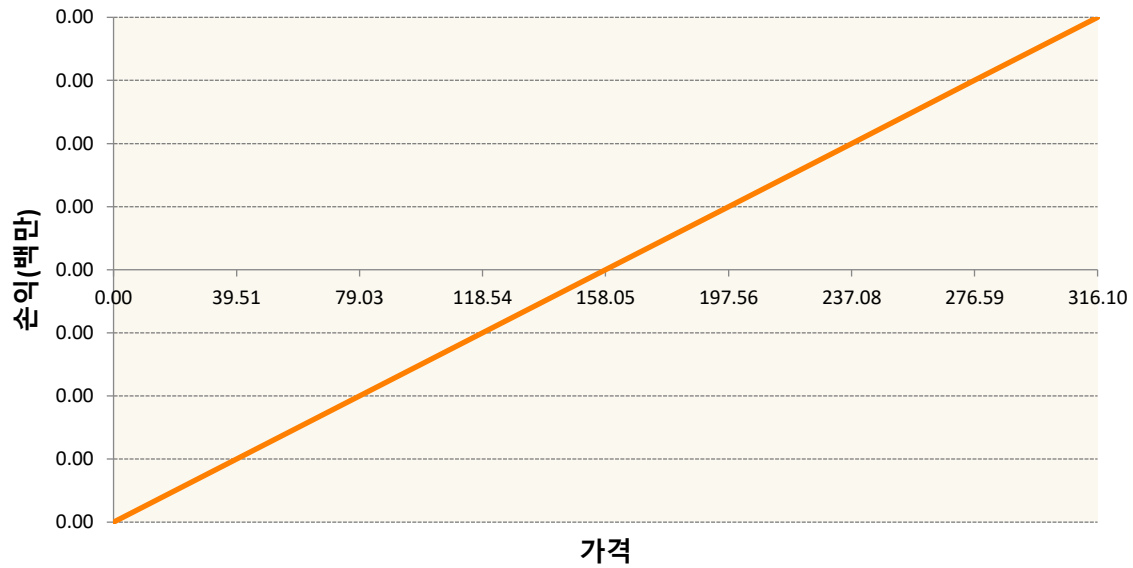
2. 만기시점의 손익구조



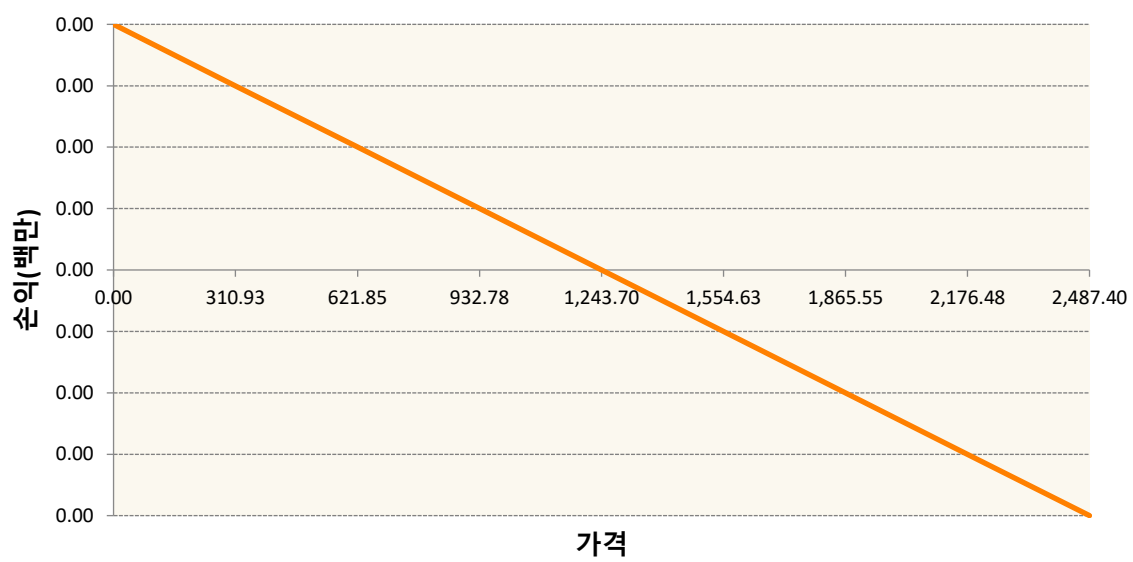
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



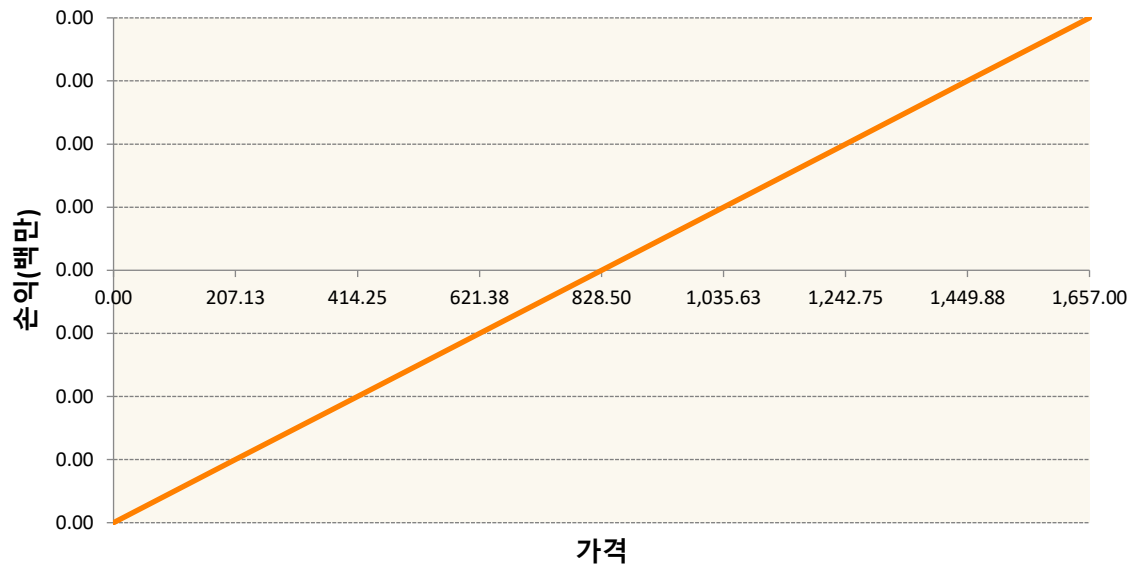
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



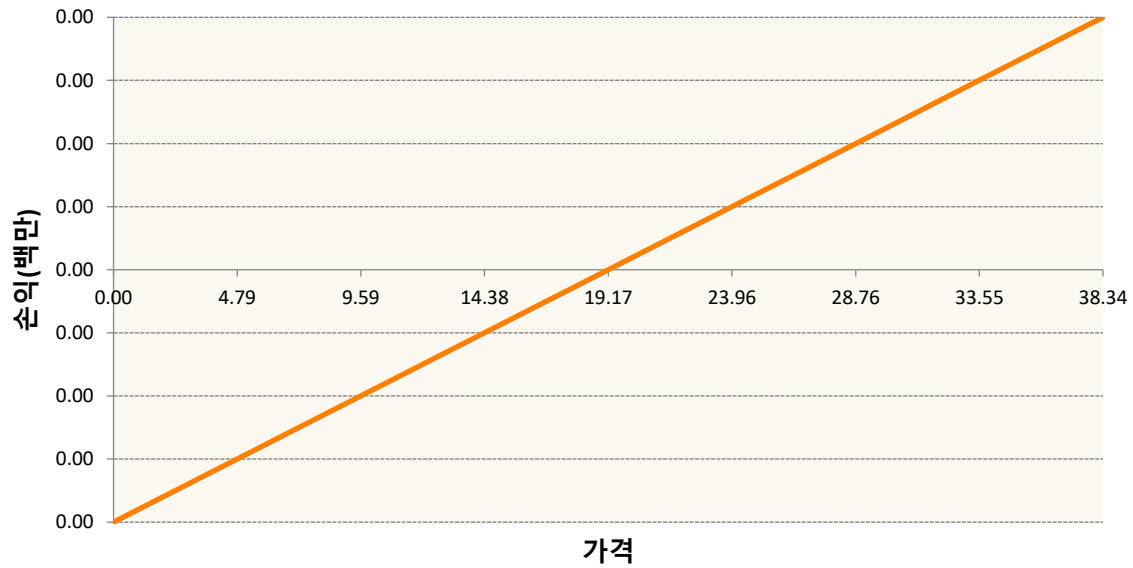
KR4175T10005-2023-01 달러선물



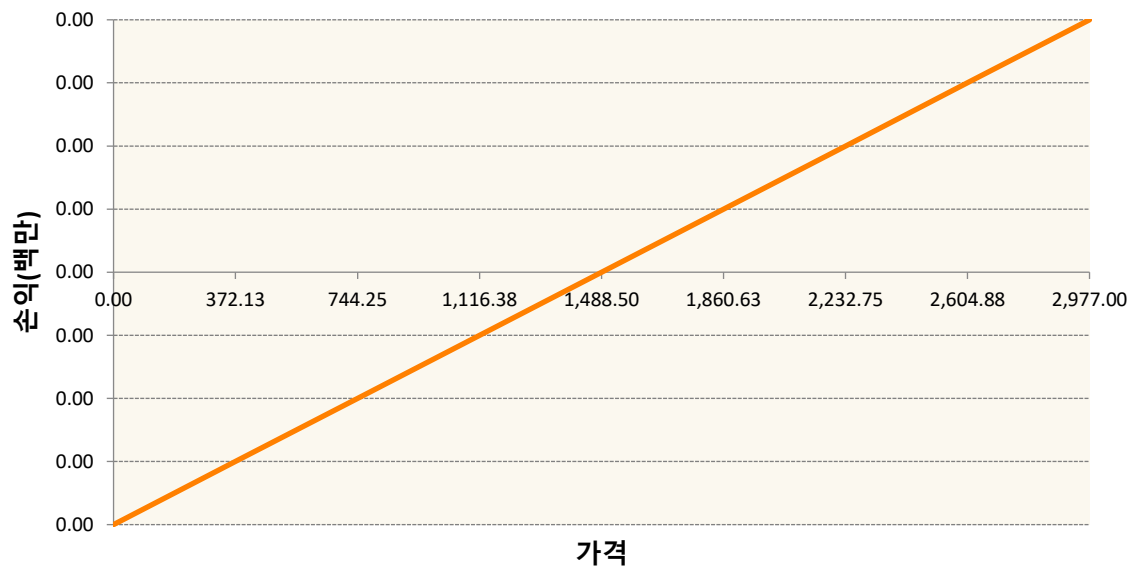
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



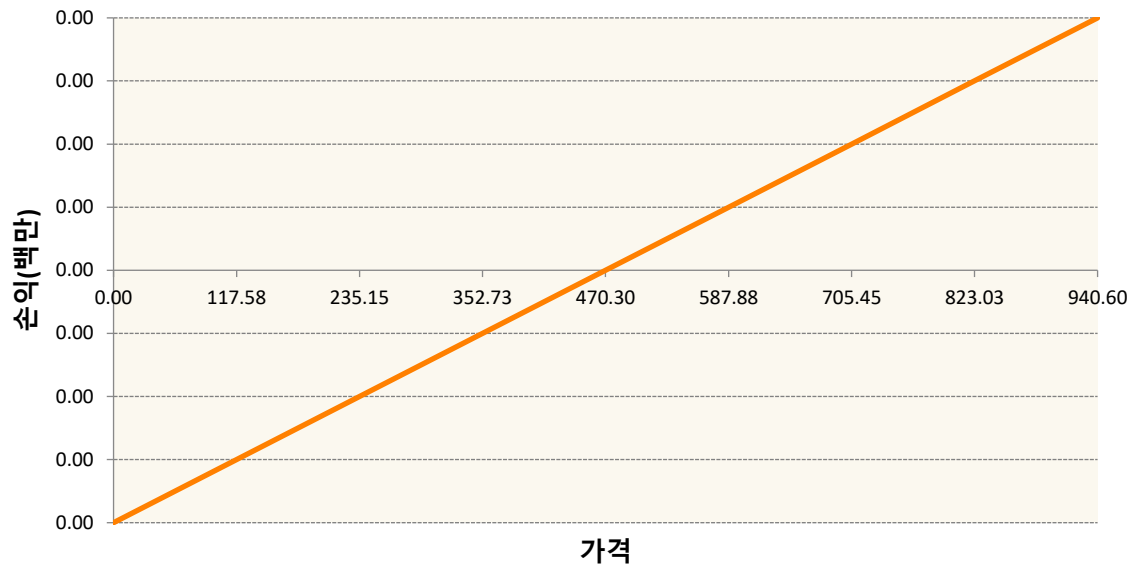
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



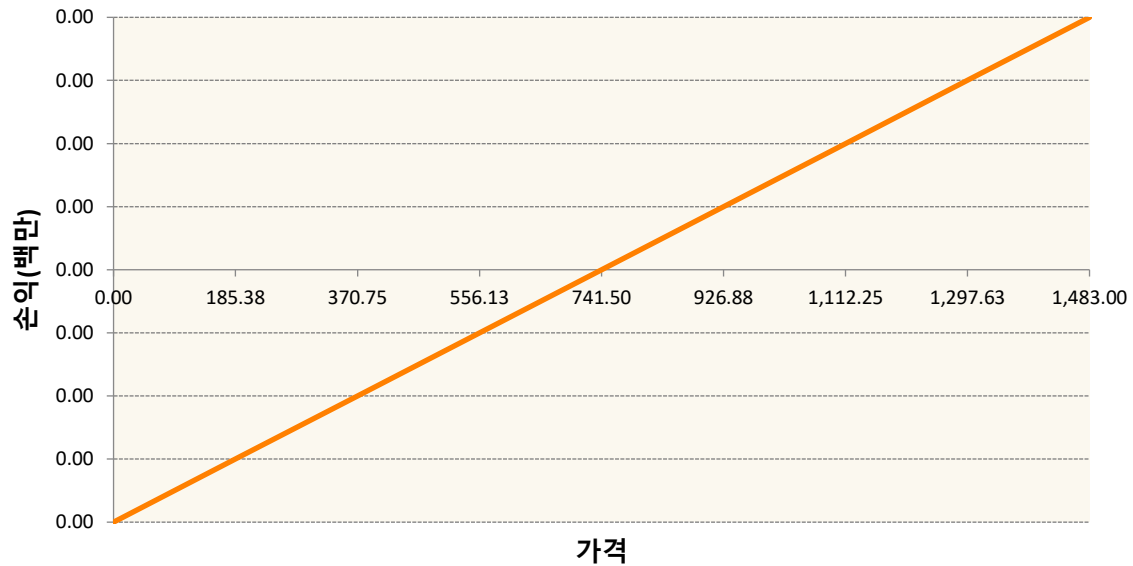
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



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	2023-01-11
기준일	2023-01-10

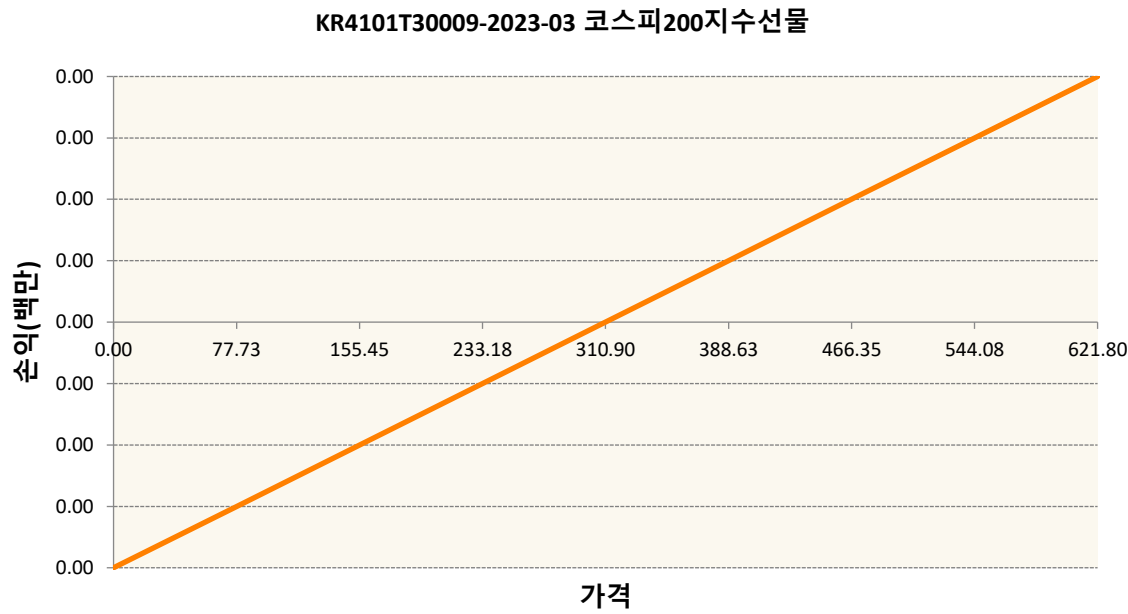
스마트인덱스모

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	1,943	0	1,943	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
-5.33%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	103	103	103	103	103	103	103
8.00%	155	155	155	155	155	155	155

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

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	354
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

499

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

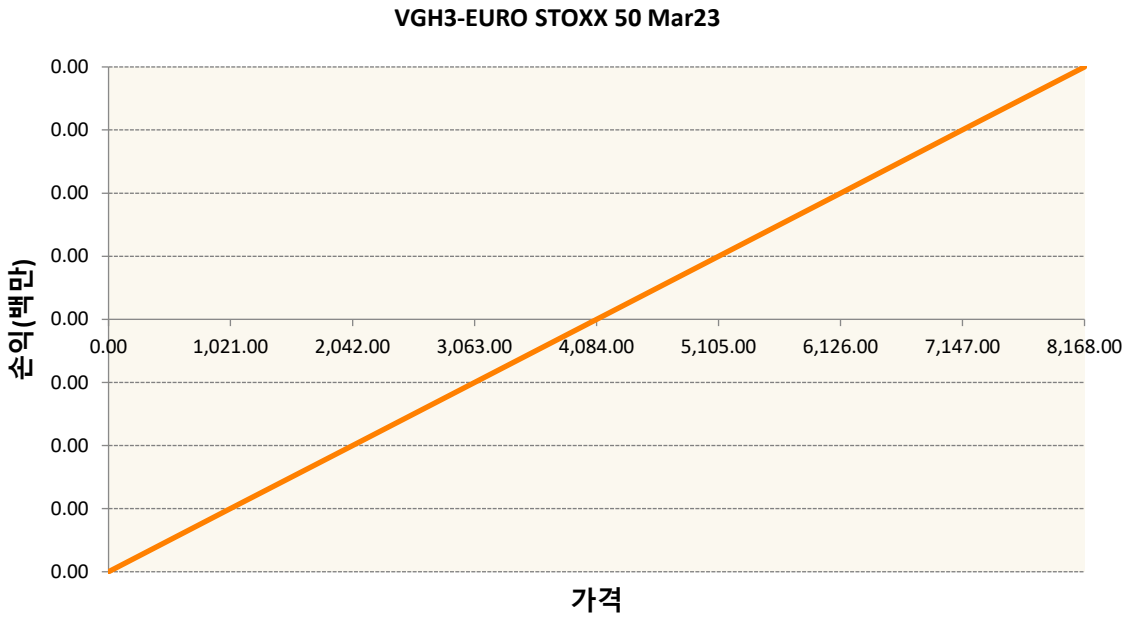
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	565	0	565	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH3	EURO STOXX 50 Mar23	45
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

49

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

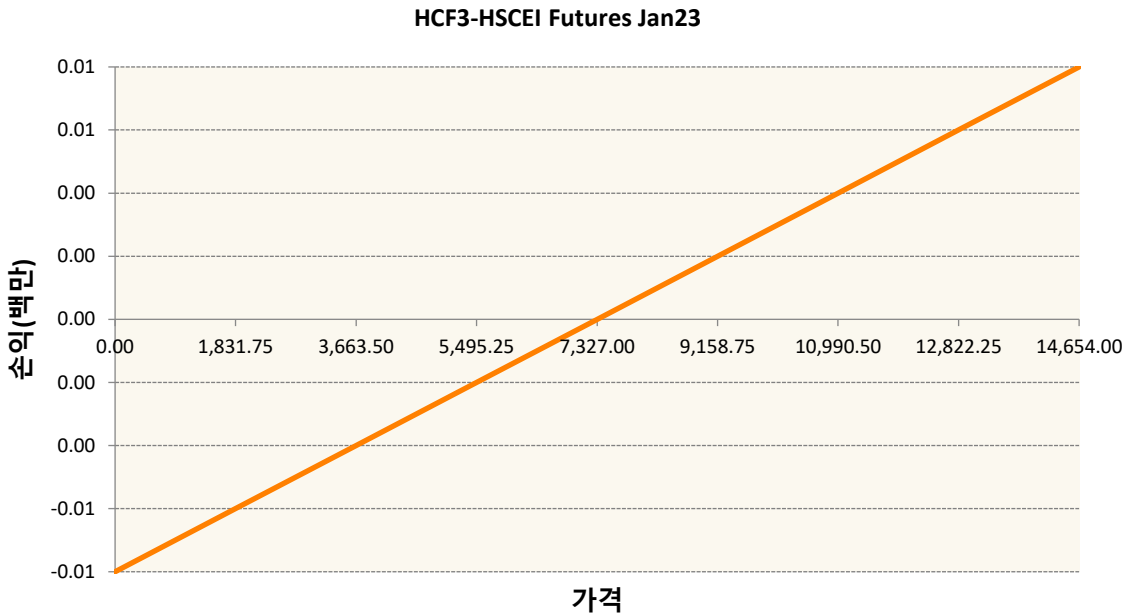
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,662	0	1,662	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF3	HSCEI Futures Jan23	133
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

223

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

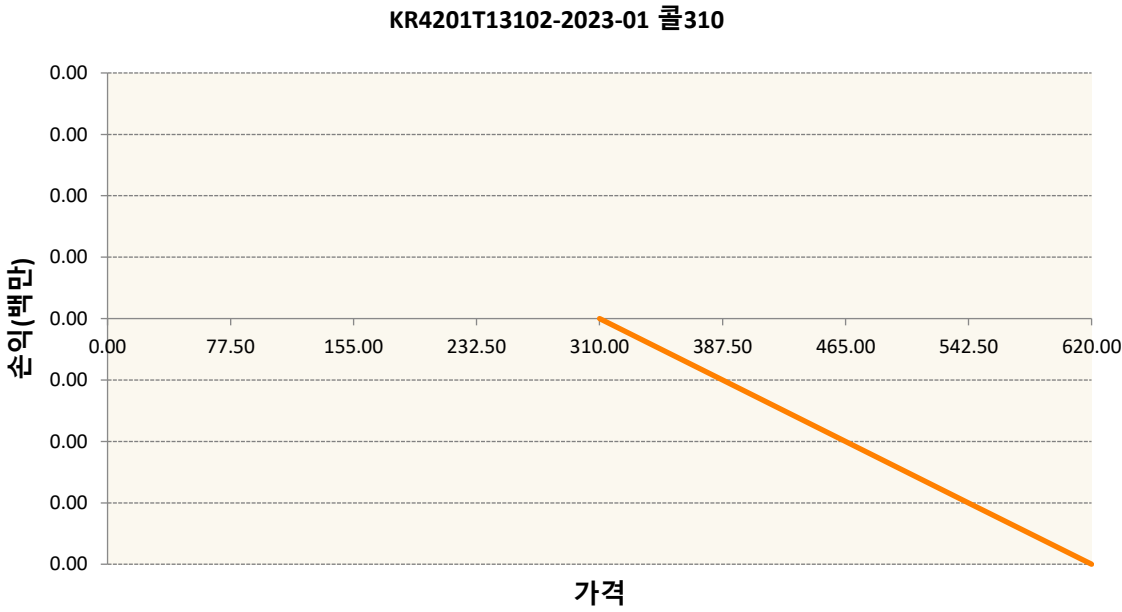
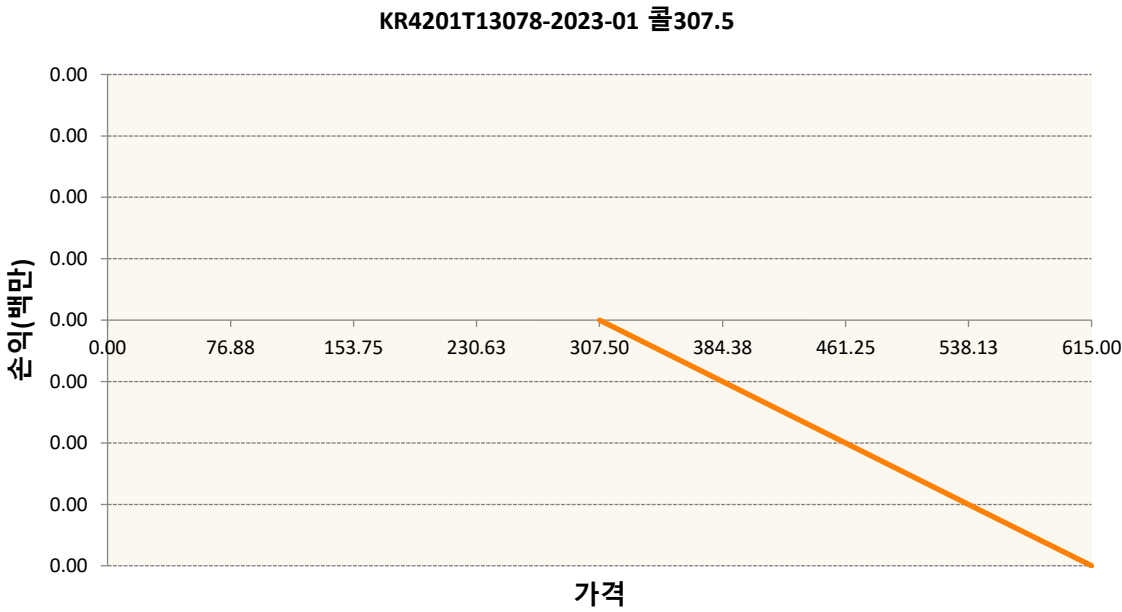
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

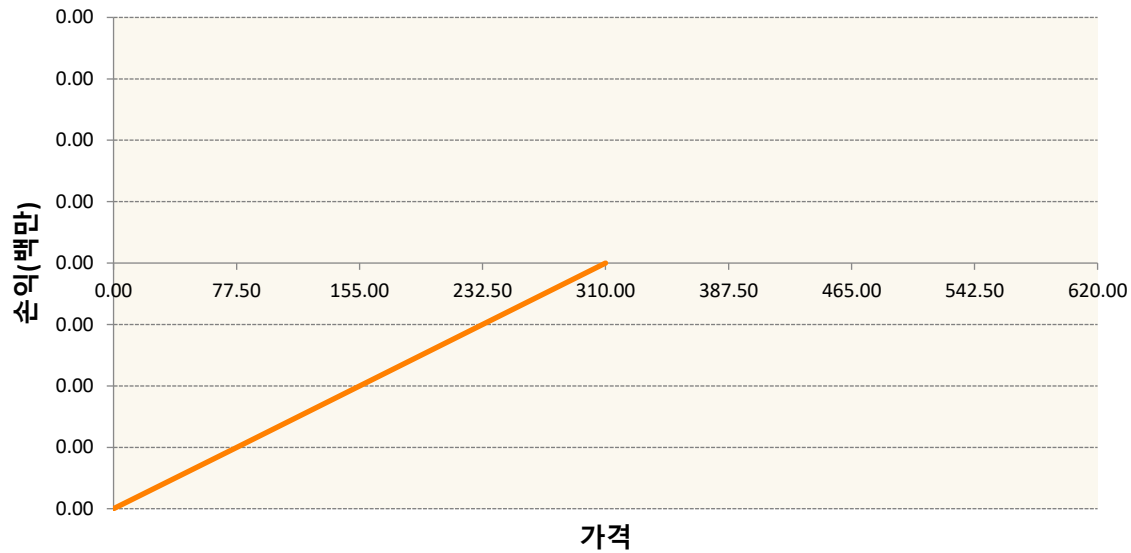
(단위:백만원)

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				2,670
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	714	712	709	705	698	689	678
-5.33%	696	684	668	649	627	603	577
-2.67%	568	531	492	452	411	369	326
0%	140	94	47	0	-47	-94	-142
2.67%	-643	-668	-697	-729	-763	-798	-835
5.33%	-1,618	-1,625	-1,634	-1,647	-1,663	-1,681	-1,702
8.00%	-2,643	-2,644	-2,646	-2,649	-2,654	-2,661	-2,670
KR4201T13102			2023-01 콜310				451
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	98	98	97	96	95	94
-5.33%	97	95	93	91	88	85	81
-2.67%	83	77	72	65	59	52	45
0%	26	17	9	0	-9	-17	-26
2.67%	-96	-102	-109	-116	-123	-130	-137
5.33%	-263	-265	-268	-271	-275	-279	-283
8.00%	-444	-444	-445	-446	-447	-449	-451
KR4301T13100			2023-01 풋310				647
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-641	-641	-642	-642	-643	-645	-647
-5.33%	-383	-385	-388	-391	-395	-400	-406
-2.67%	-143	-150	-159	-167	-177	-186	-196
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36

2.67%	124	115	106	96	86	76	66
5.33%	148	145	141	137	131	125	119
8.00%	151	151	150	149	147	144	141

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

(단위:백만원)

4,210

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

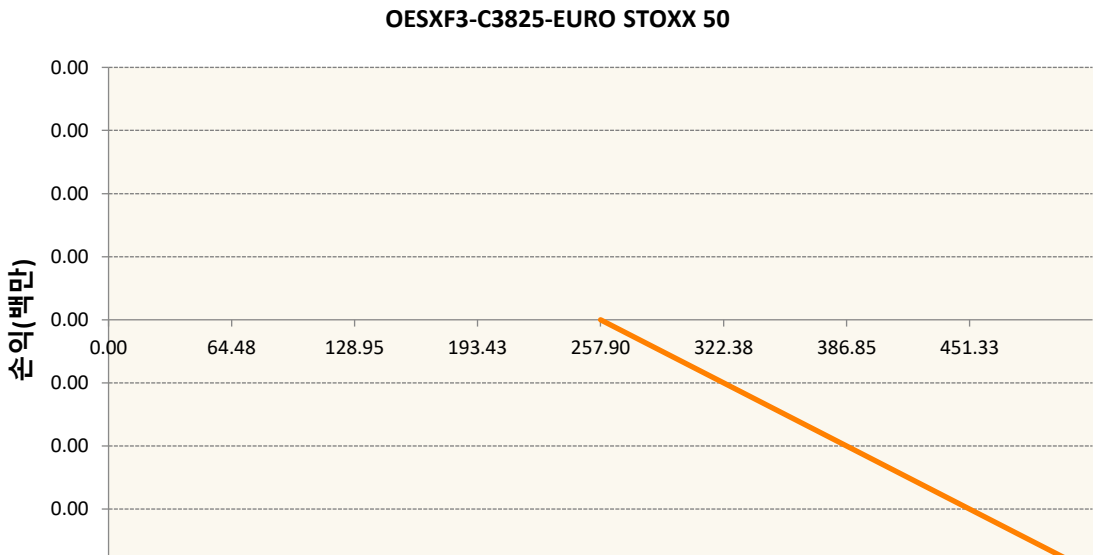
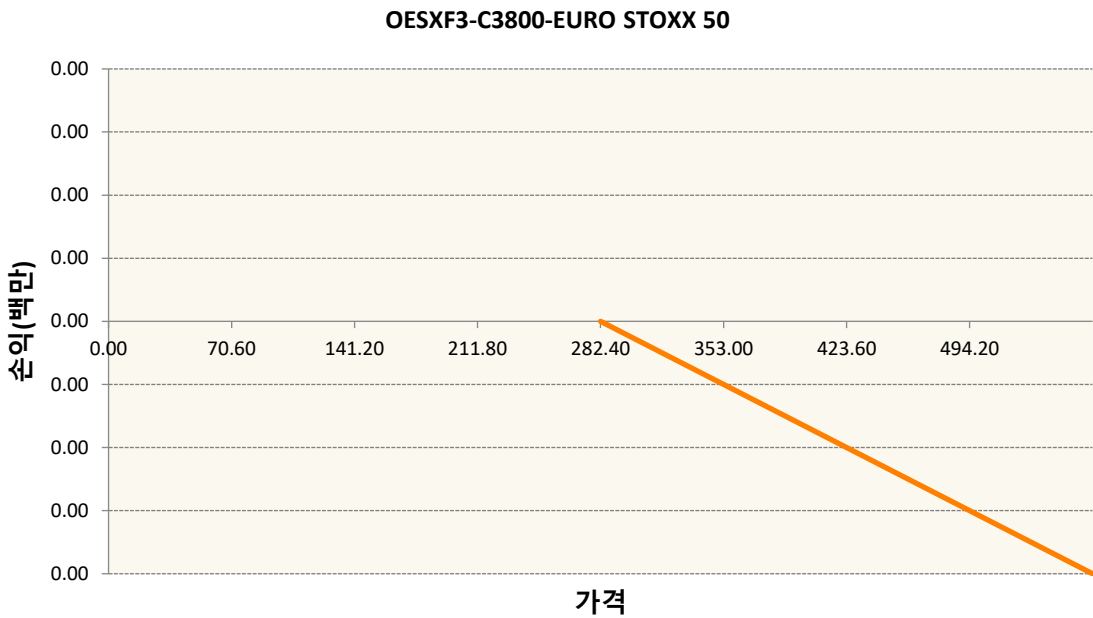
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

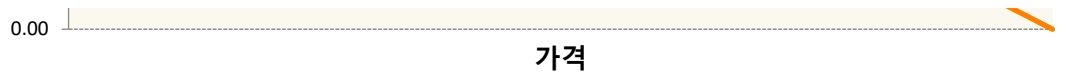
1. 계약금액

(단위:백만원)

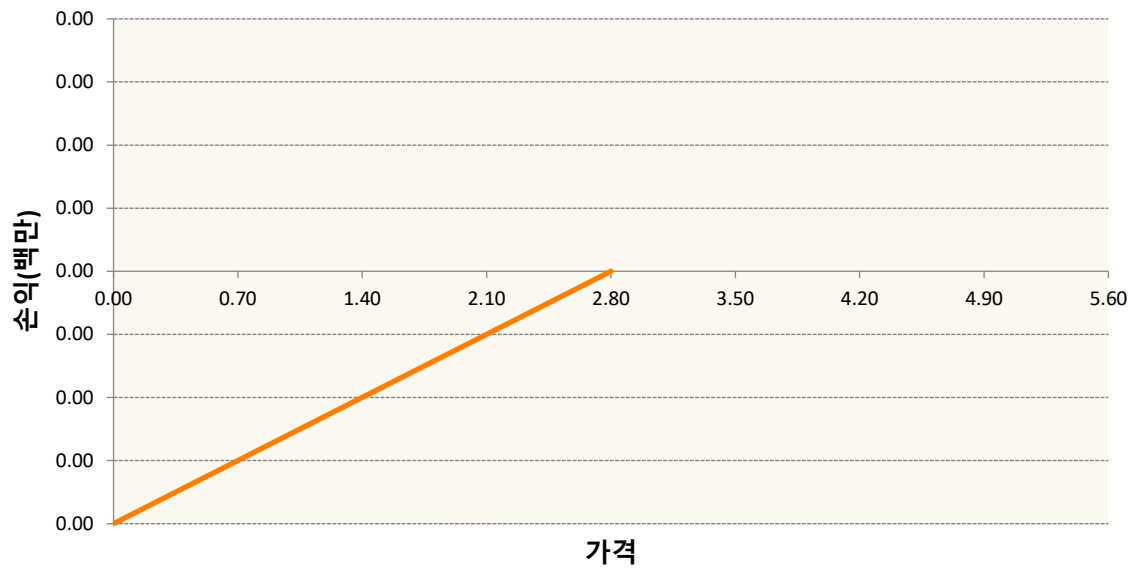
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,133	0	1,133	
누계	유가증권	옵션	0	150	-150	장내
누계	통화	선도	334	2,203	-1,870	장외

2. 만기시점의 손익구조

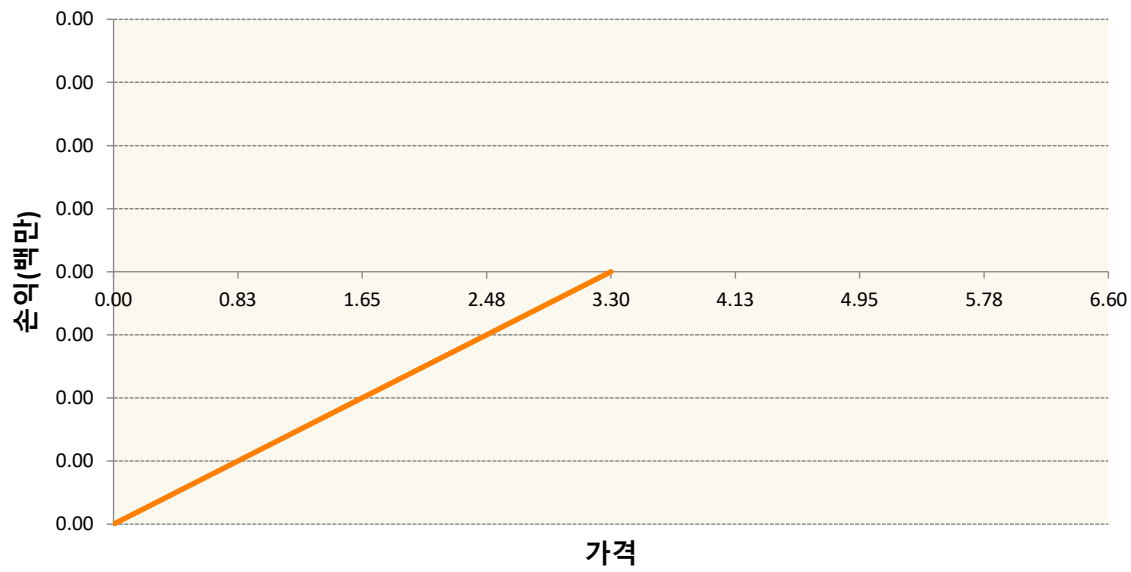




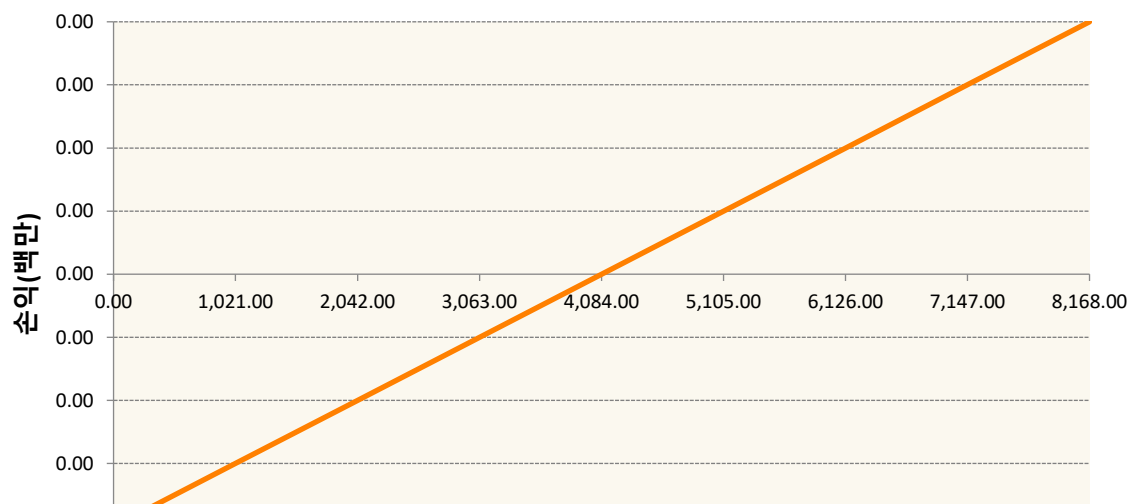
OESXF3-P3800-EURO STOXX 50



OESXF3-P3825-EURO STOXX 50



VGH3-EURO STOXX 50 Mar23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E		53
FXW213CBG(KRW/EUR 24-02-23E		69
FXW213CBN(EUR/KRW 24-02-23E		11
FXW213CCN(KRW/EUR 24-03-23E		53
FXW213CCP(EUR/KRW 27-01-23E		16
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		10
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		2
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		0.09
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		0.02
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		91

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	262

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

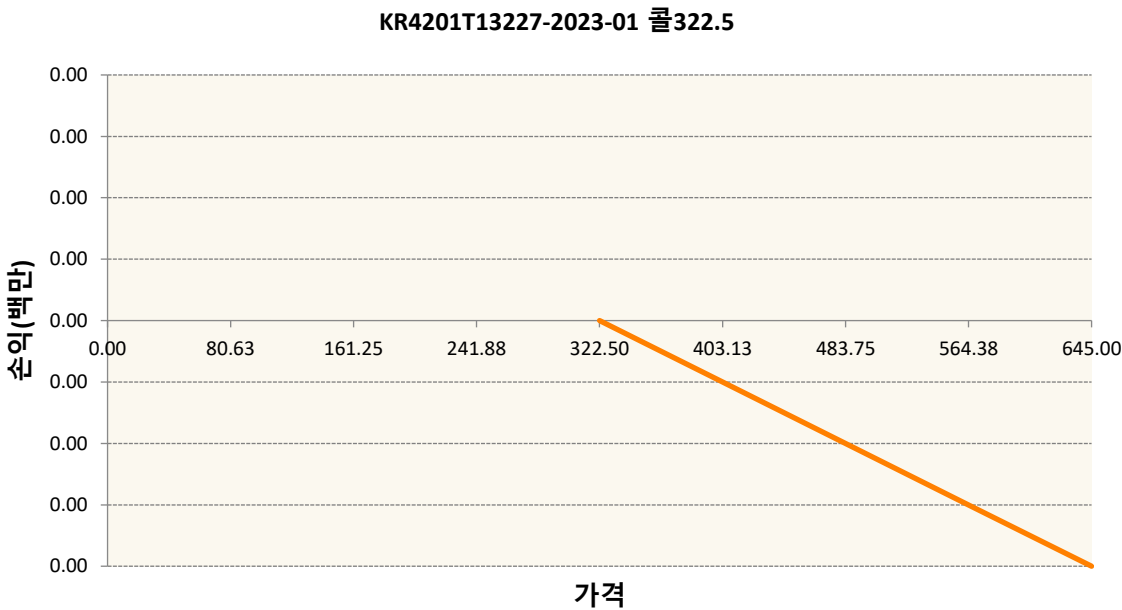
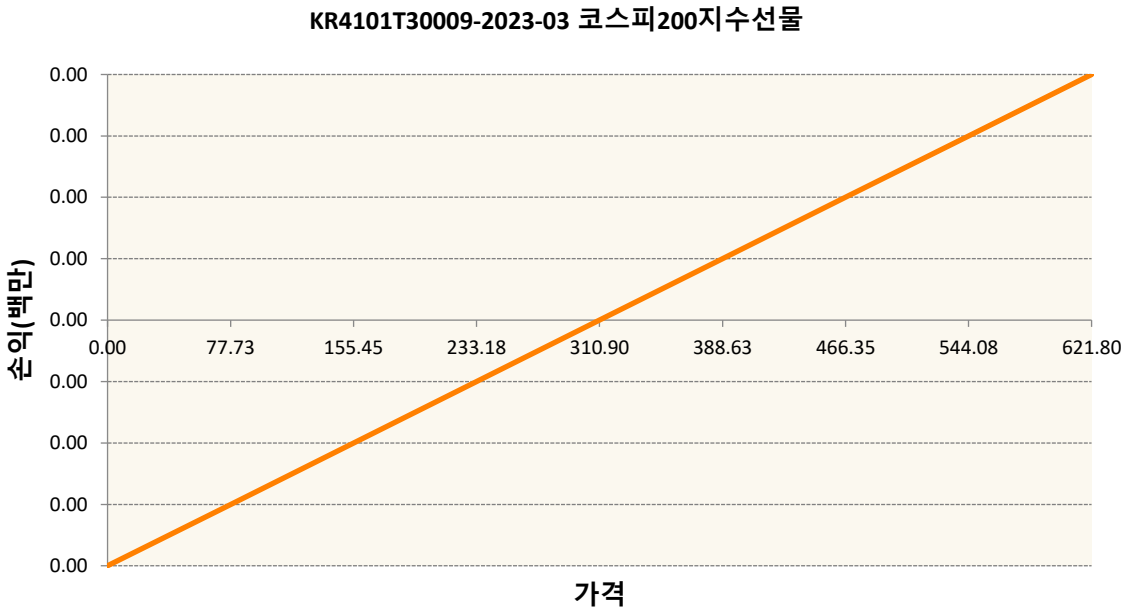
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	389	0	389	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 and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 620.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A 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%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31
KR4201T13227		2023-01 콜322.5					81
	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%	5	5	5	5	5	5	4
-2.67%	5	5	5	4	4	3	2
0%	3	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	-6	-8	-10	-12	-15	-17	-19
5.33%	-31	-33	-35	-38	-40	-43	-45
8.00%	-72	-73	-74	-76	-77	-79	-81
KR4201T13250 2023-01 콜325							63

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	3	3	3	2	2	2	1
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-3	-5	-6	-8	-10	-12	-14
5.33%	-20	-22	-25	-27	-29	-31	-34
8.00%	-53	-54	-56	-57	-59	-61	-63

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

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

(단위:백만원)

143

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

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	6,430	0	6,430	

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	2023-01-11
기준일	2023-01-10

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	5,442	0	5,442	

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	2023-01-11
기준일	2023-01-10

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	18,219	0	18,219	
누계	통화	선도	0	18,266	-18,266	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CAR\KRW/USD 30-01-23E		257
FXW213CBQ\KRW/USD 28-02-23E		636
FXW213CCK\KRW/USD 30-01-23E		40
FXW213CCS\KRW/USD 28-03-23E		528
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

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

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

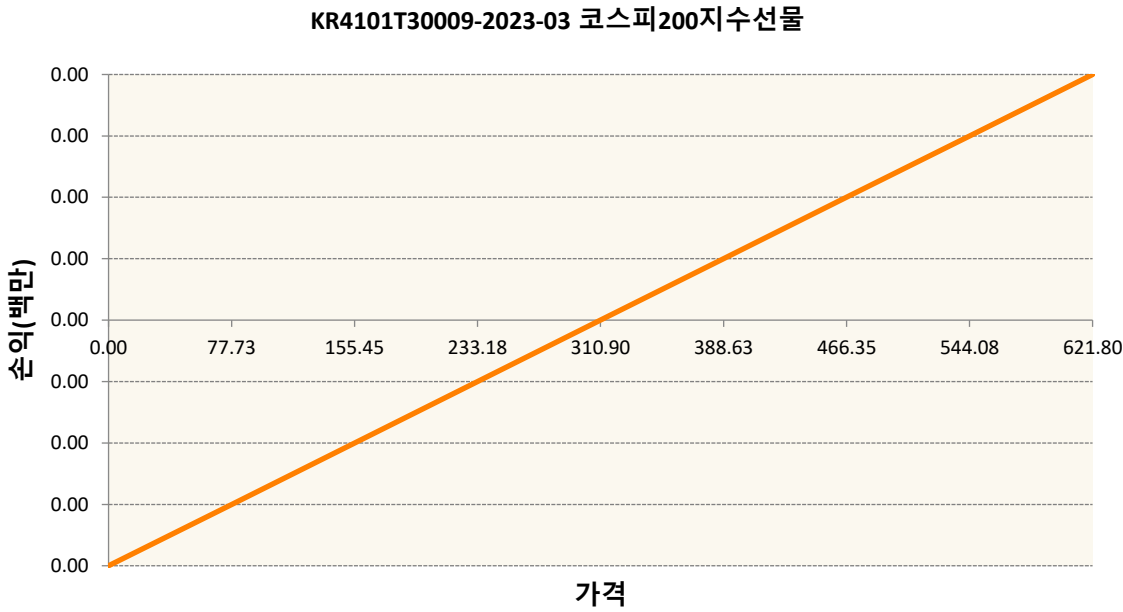
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	777	0	777	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				62
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

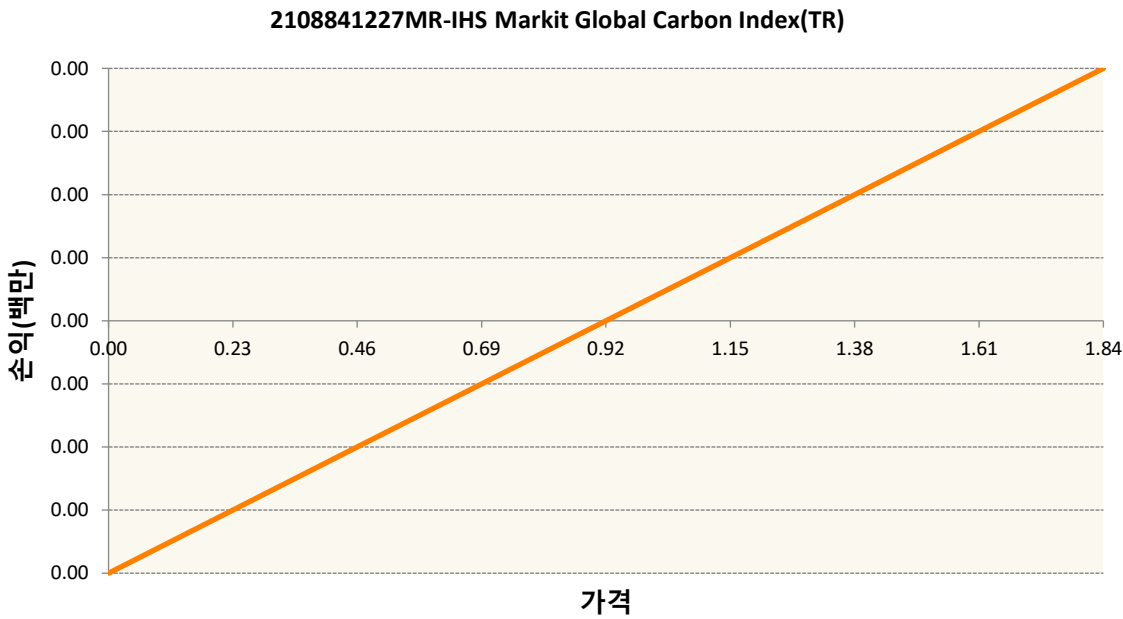
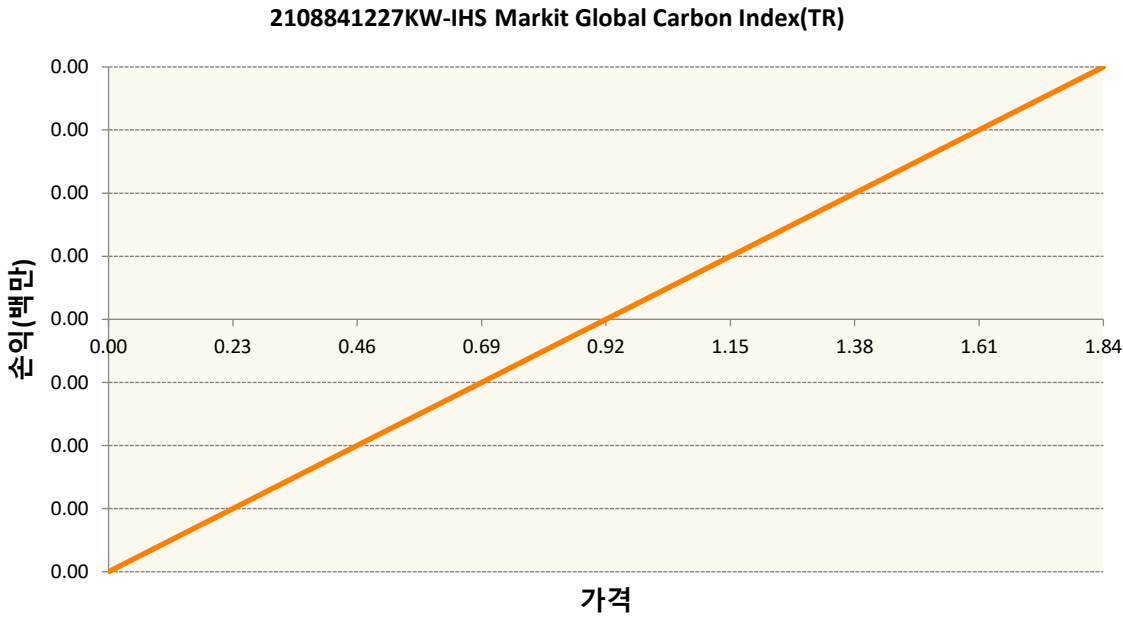
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

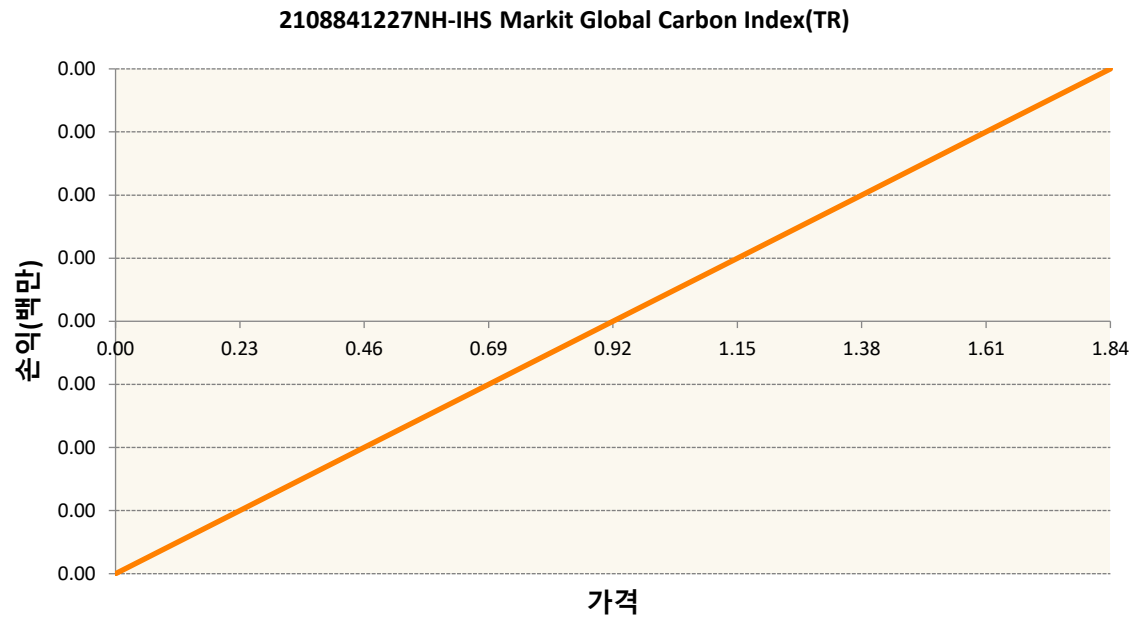
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	22,398	0	22,398	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,523
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		179
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		90

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,464

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

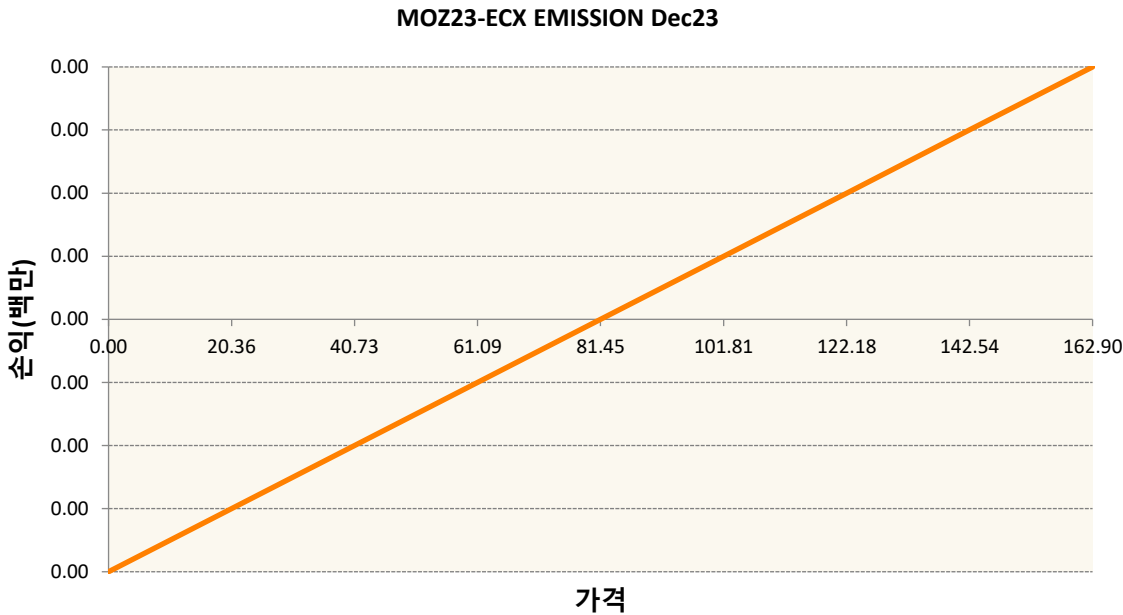
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,383	0	12,383	
누계	통화	선도	698	3,569	-2,871	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CCPI KRW/EUR 27-01-23E	107
FXW213CCPI KRW/EUR 27-01-23E	179
FXW213D12I EUR/KRW 27-01-23E	56
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	991

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

(단위:백만원)

2,818

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

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)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	15

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

(단위:백만원)

113

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

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

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

(단위:백만원)

22

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

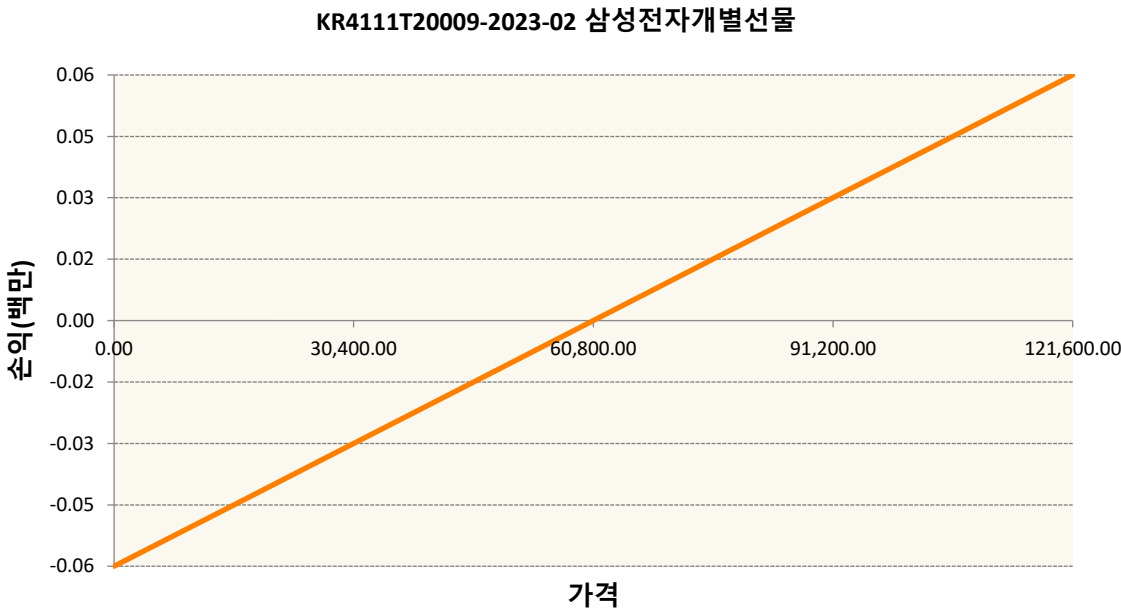
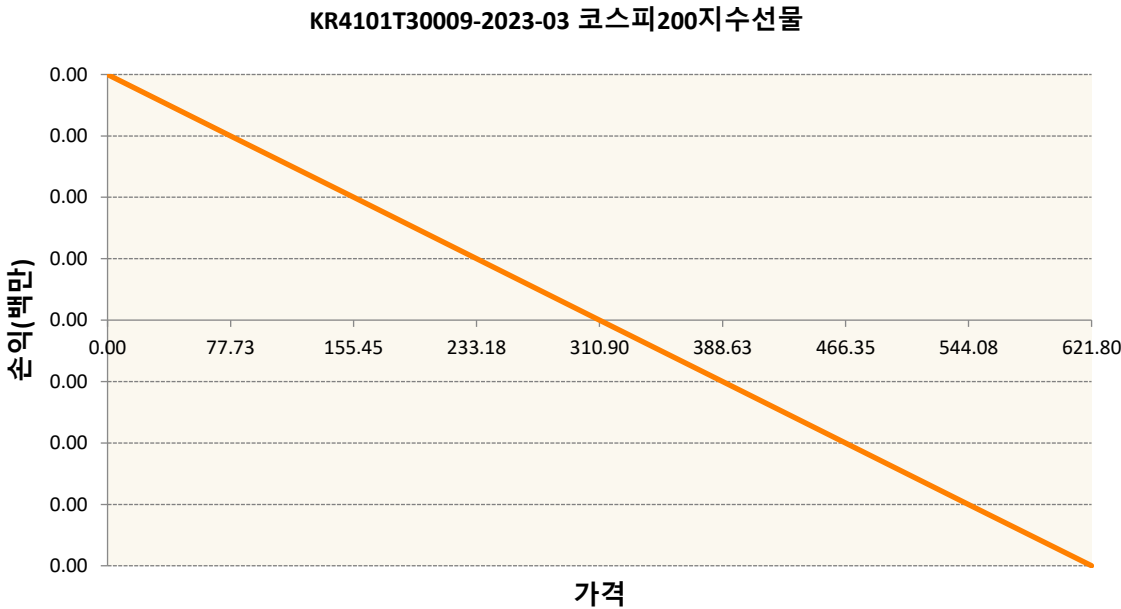
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

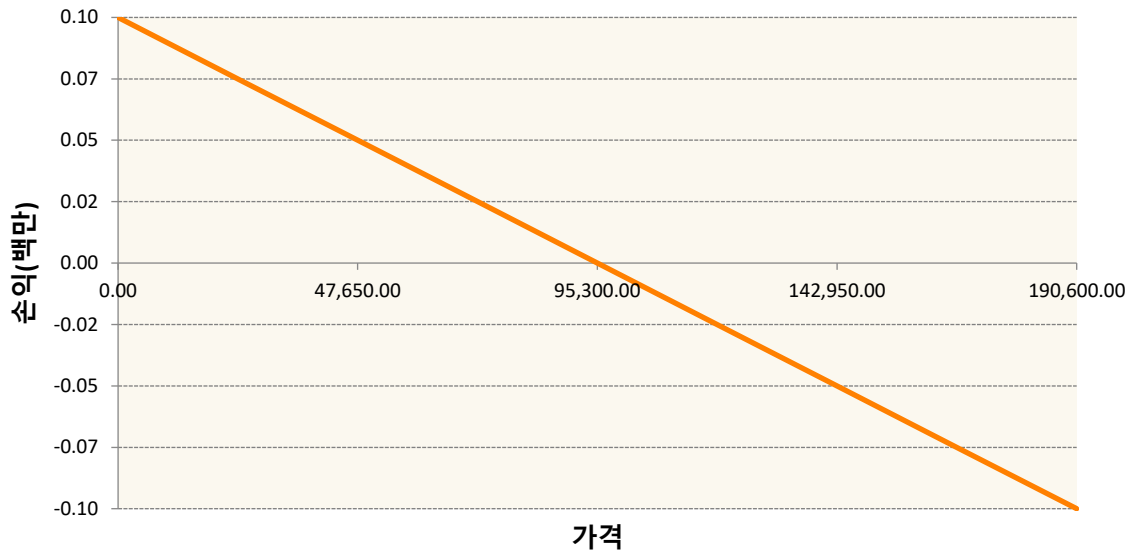
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,169	776	393	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	642	1,318	-676	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

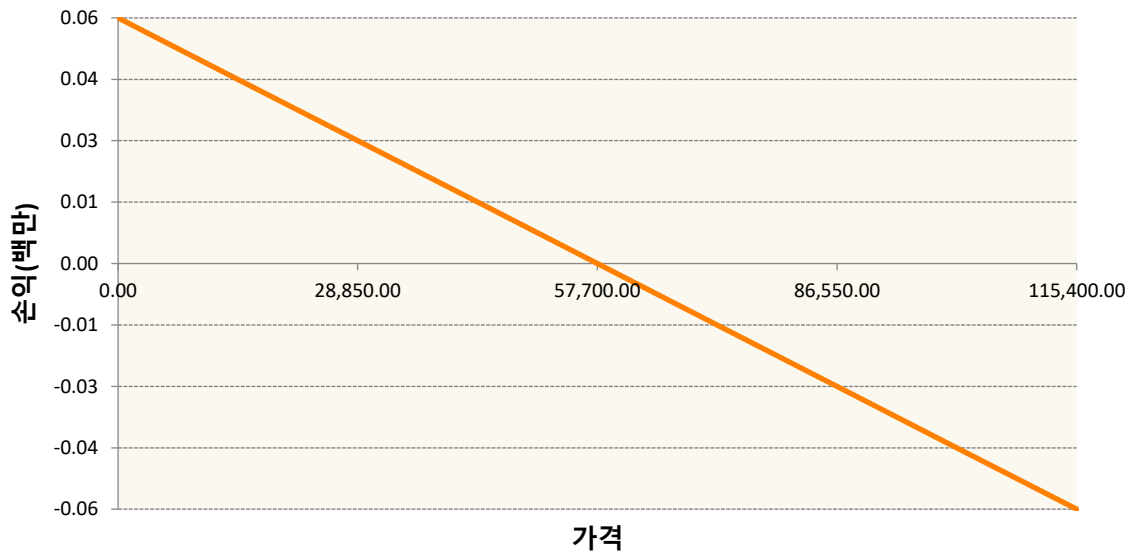
2. 만기시점의 손익구조



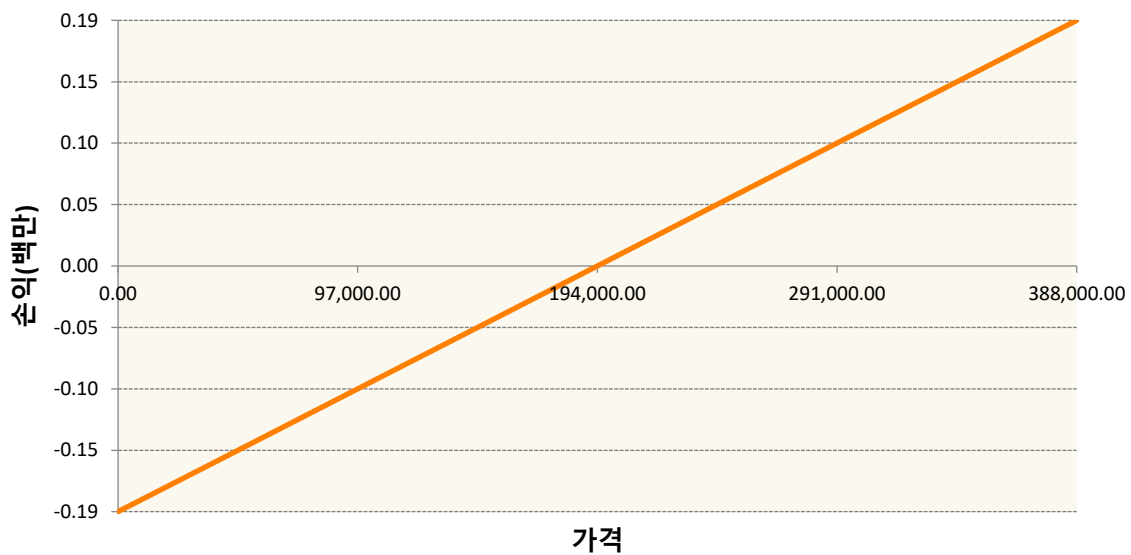
KR4124T10003-2023-01 LG전자개별선물



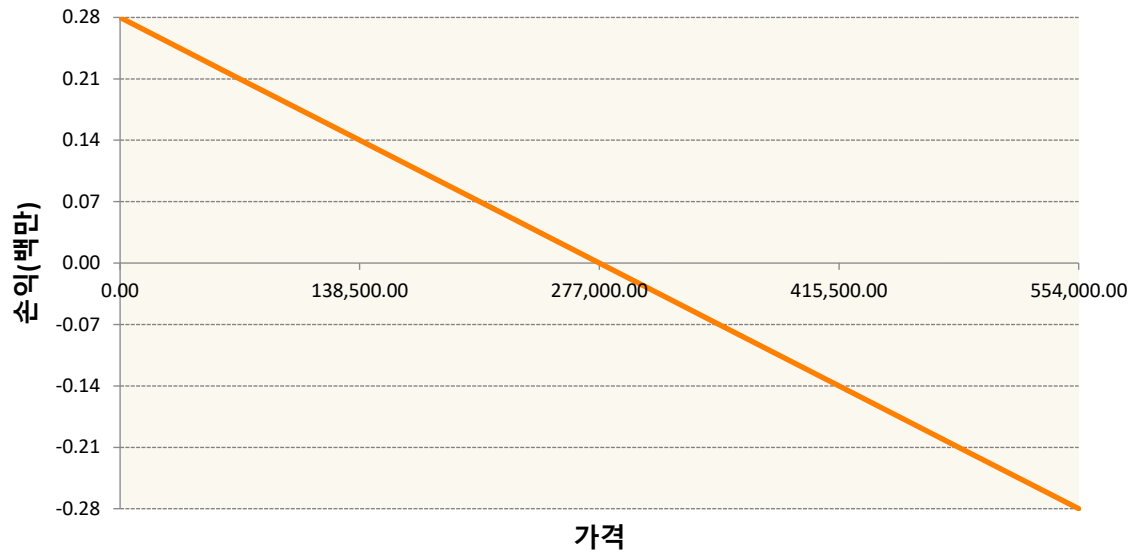
KR4146T10006-2023-01 KB금융개별선물



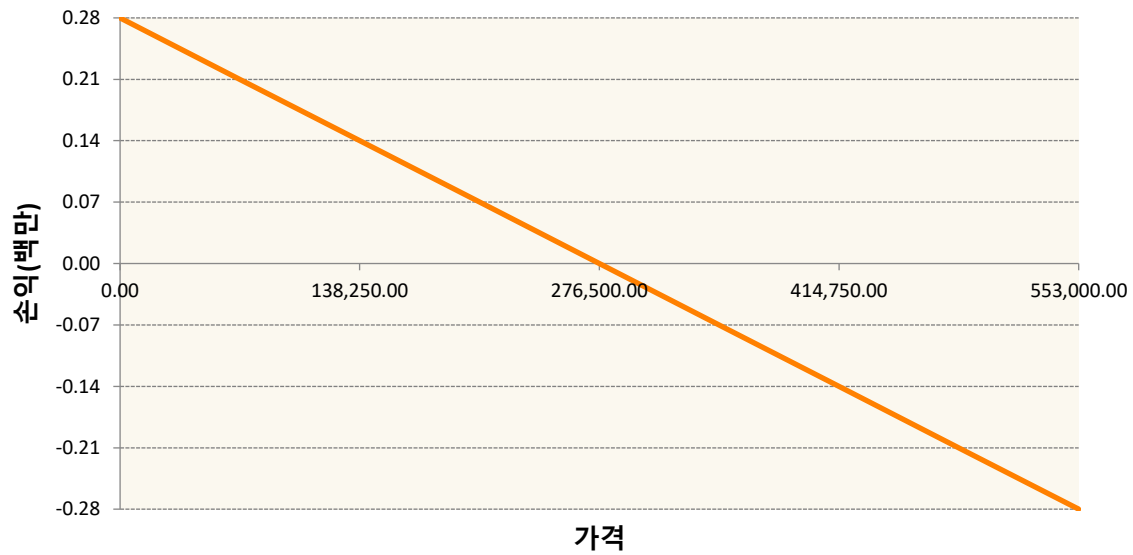
KR4156T20004-2023-02 NAVER개별선물



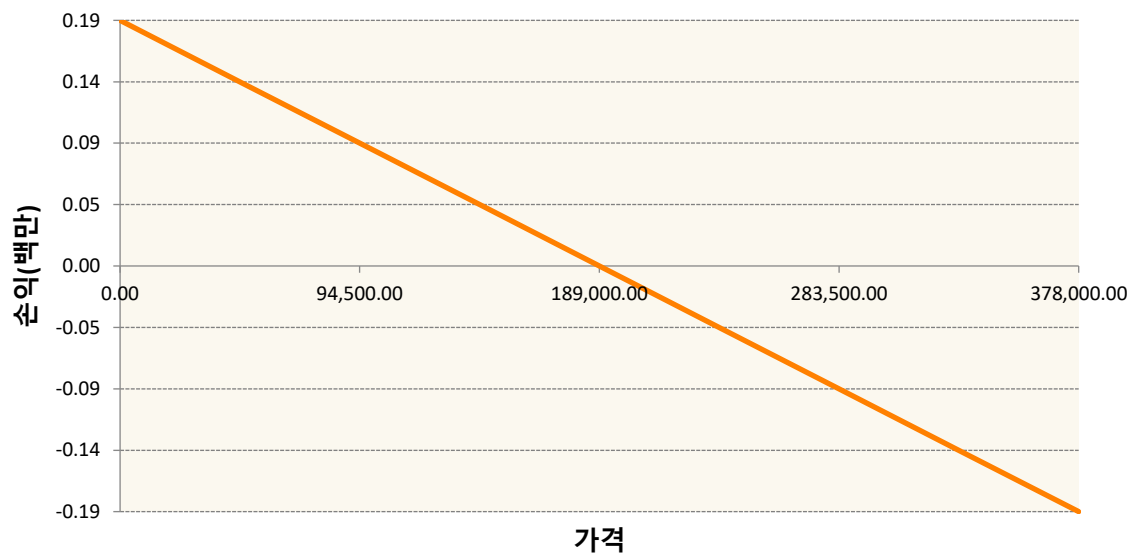
KR41BYT10009-2023-01 LG이노텍개별선물



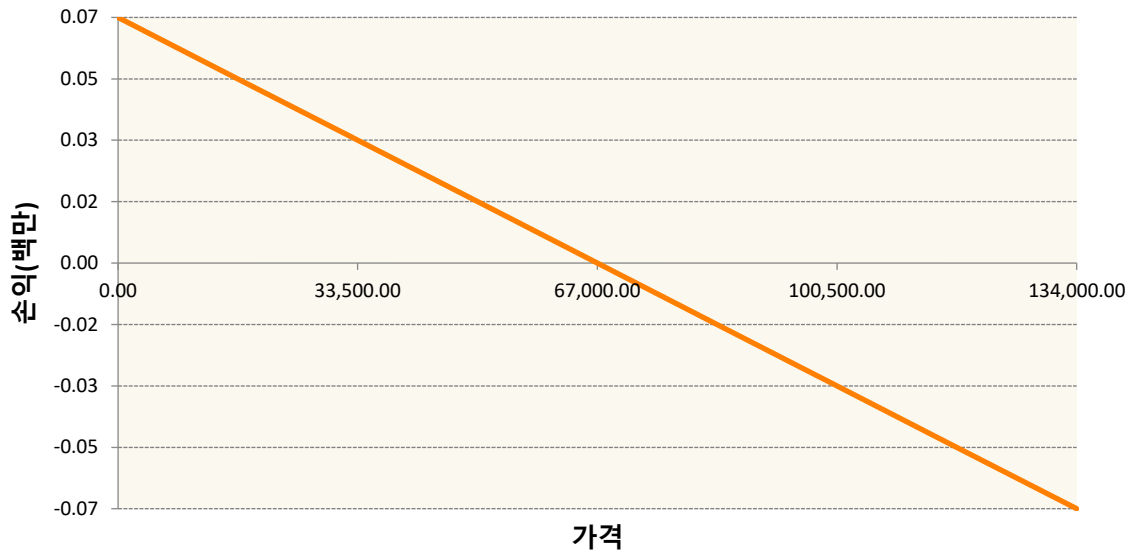
KR41BYT20008-2023-02 LG이노텍개별선물



KR41E8T10001-2023-01 포스코케미칼개별선물



KR41F7T10002-2023-01 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T300 2023-03 코스피200지수선물	31
KR4111T200 2023-02 삼성전자개별선물	39
KR4124T100 2023-01 LG전자개별선물	21
KR4146T100 2023-01 KB금융개별선물	10
KR4156T200 2023-02 NAVER개별선물	12
KR41BYT100 2023-01 LG이노텍개별선물	11
KR41BYT200 2023-02 LG이노텍개별선물	7
KR41E8T100 2023-01 포스코케미칼개별선물	15
KR41F7T100 2023-01 카카오페이개별선물	11
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.49
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.17

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

(단위:백만원)

308

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

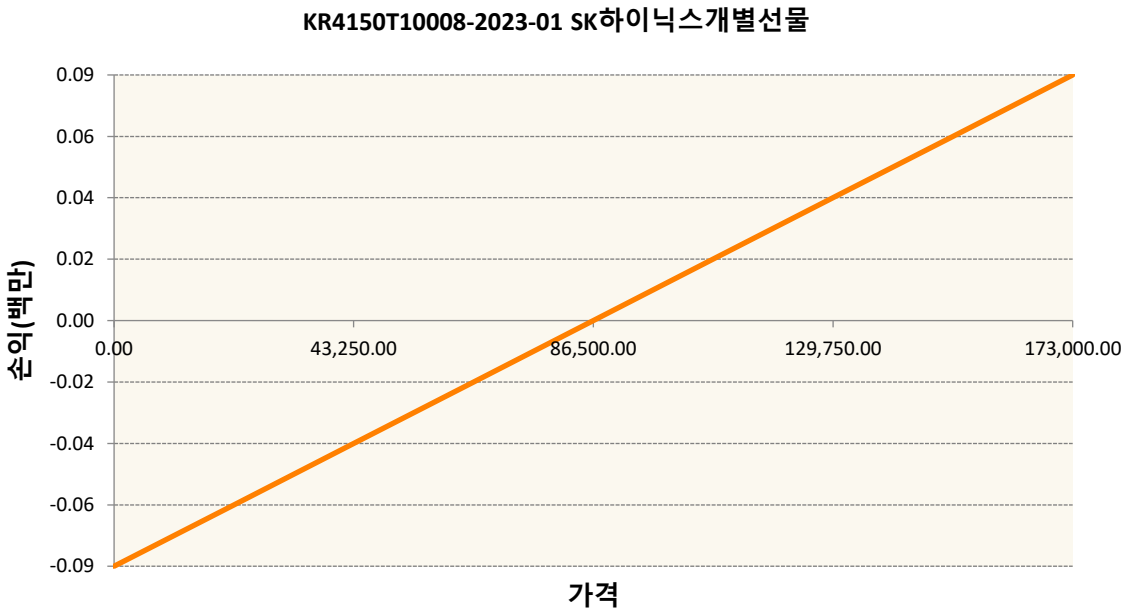
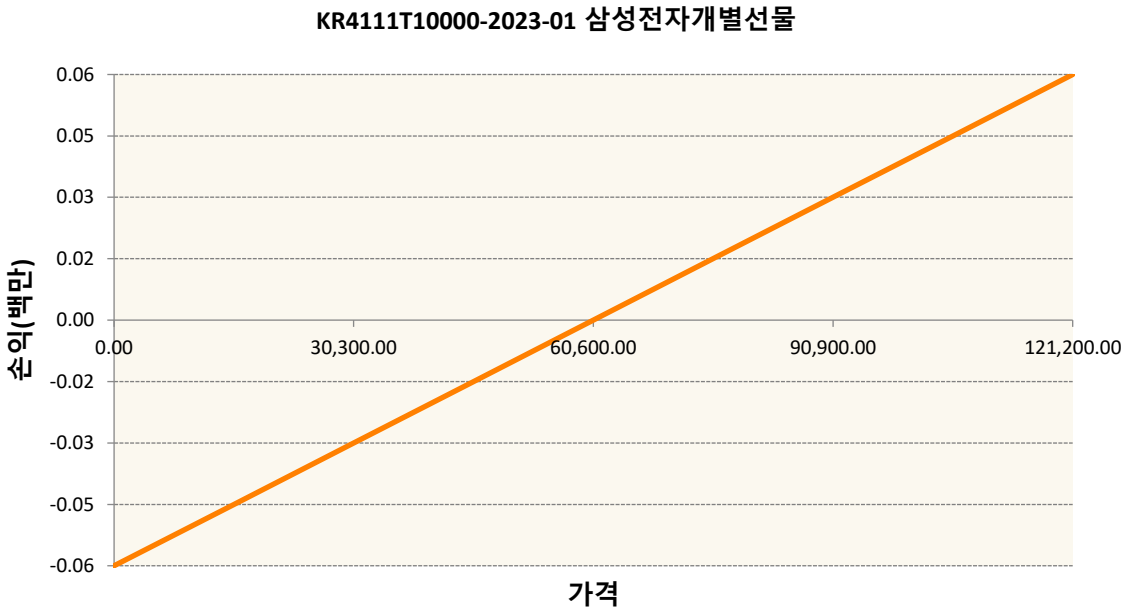
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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	149	0	149	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)

15

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

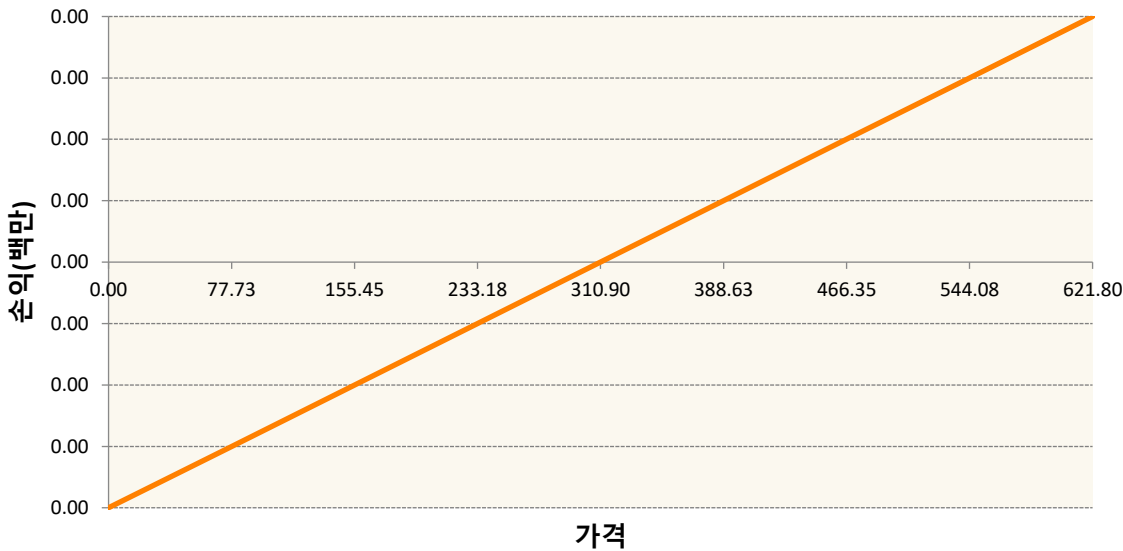
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,788	0	1,788	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T30009-2023-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				142
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	47	47	47	47	47	47	47
5.33%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	142	142	142	142	142	142	142

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

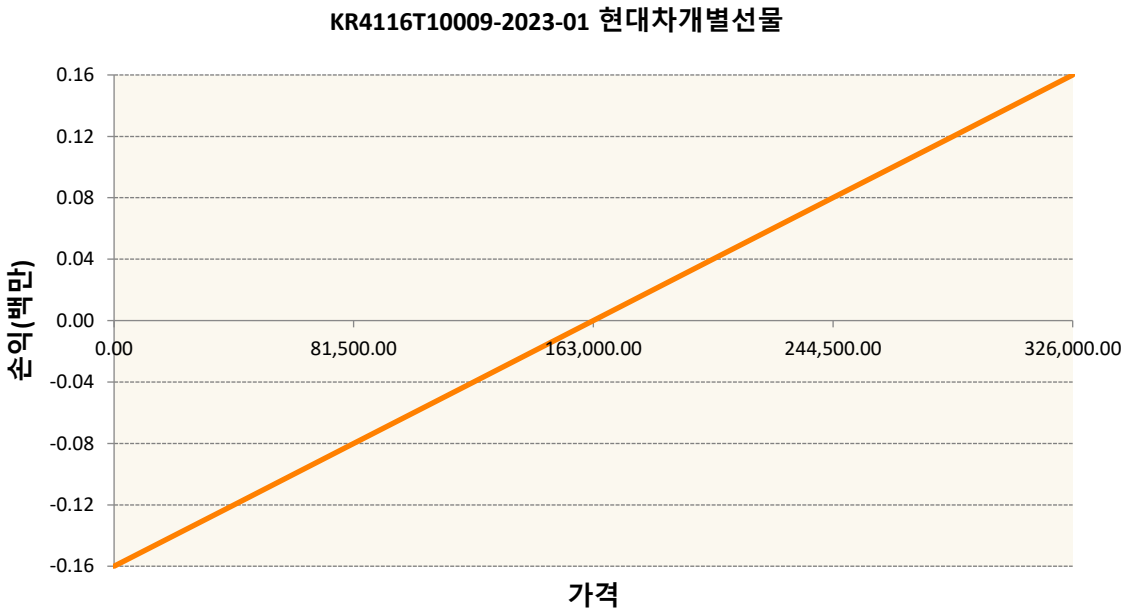
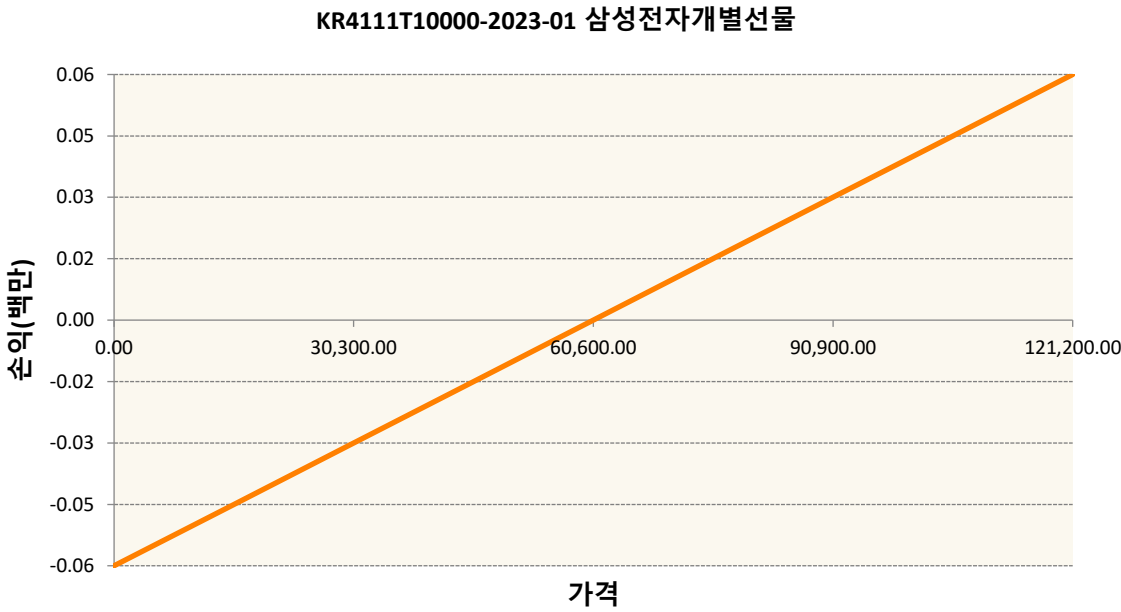
SOL한국형글로벌전기차&2차전지

1. 계약금액

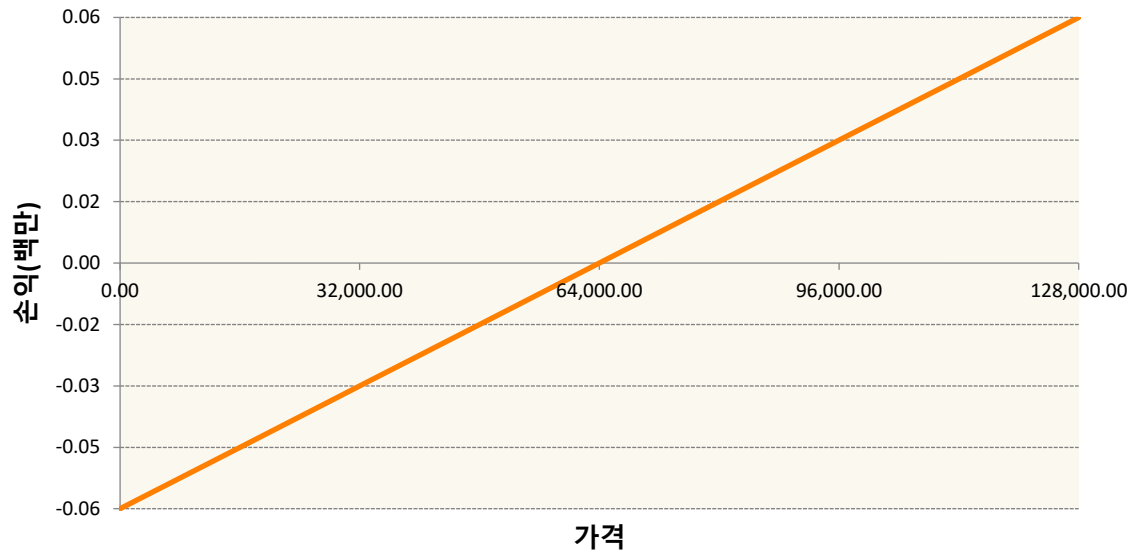
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	225	0	225	장내

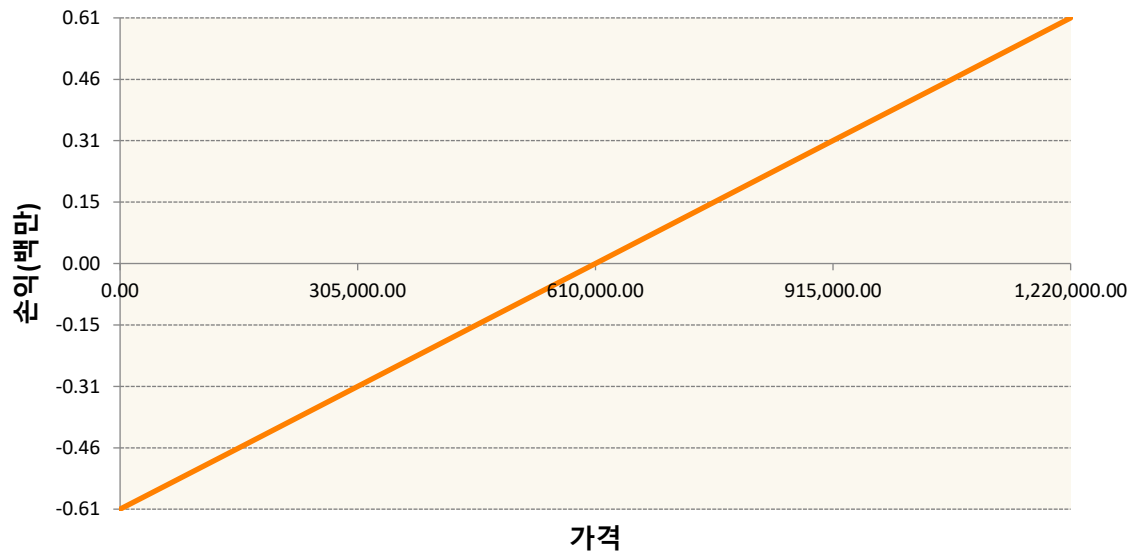
2. 만기시점의 손익구조



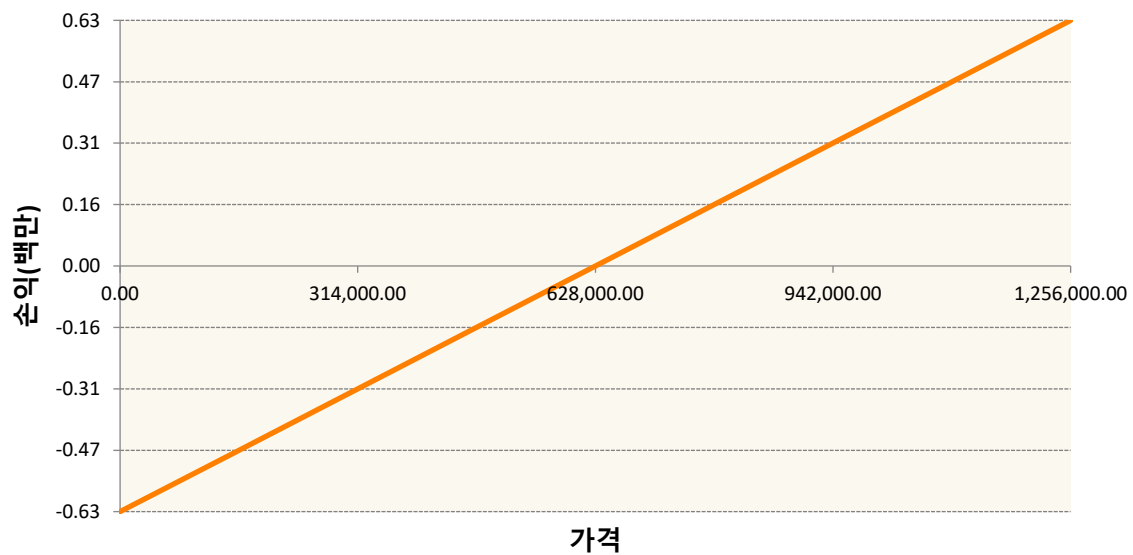
KR4119T10003-2023-01 기아개별선물



KR4122T10007-2023-01 삼성SDI개별선물



KR4147T10004-2023-01 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111T10000		2023-01 삼성전자개별선물						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

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

18

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

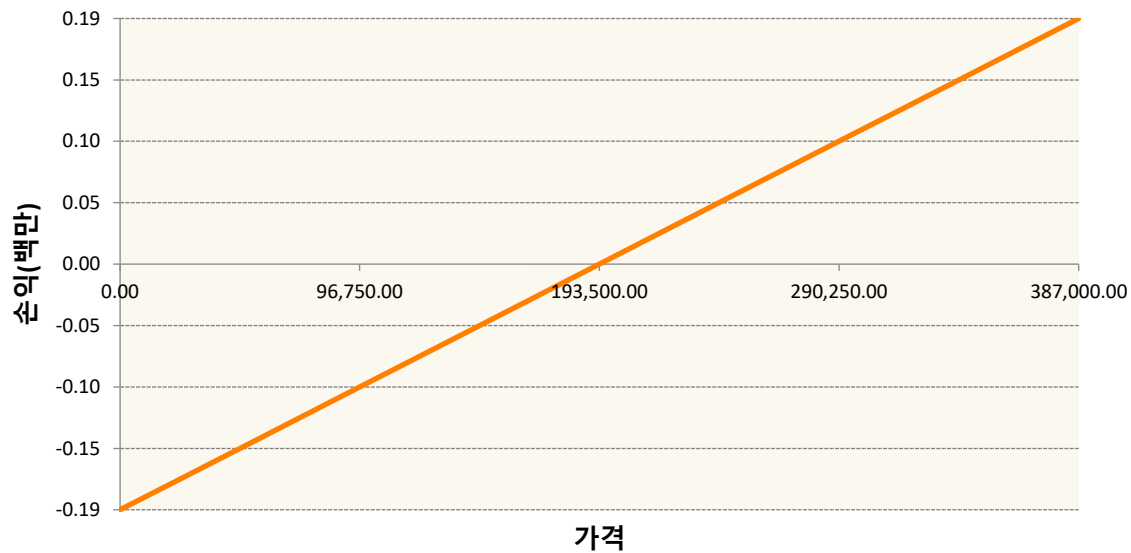
1. 계약금액

(단위:백만원)

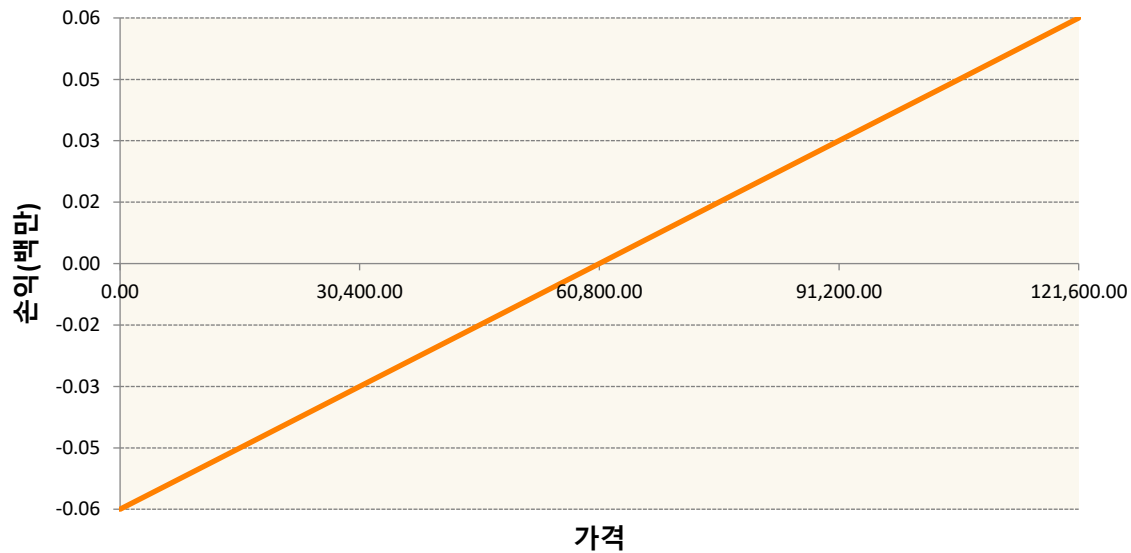
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	122	0	122	장내

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%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-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%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

8

공시일	2023-01-11
기준일	2023-01-10

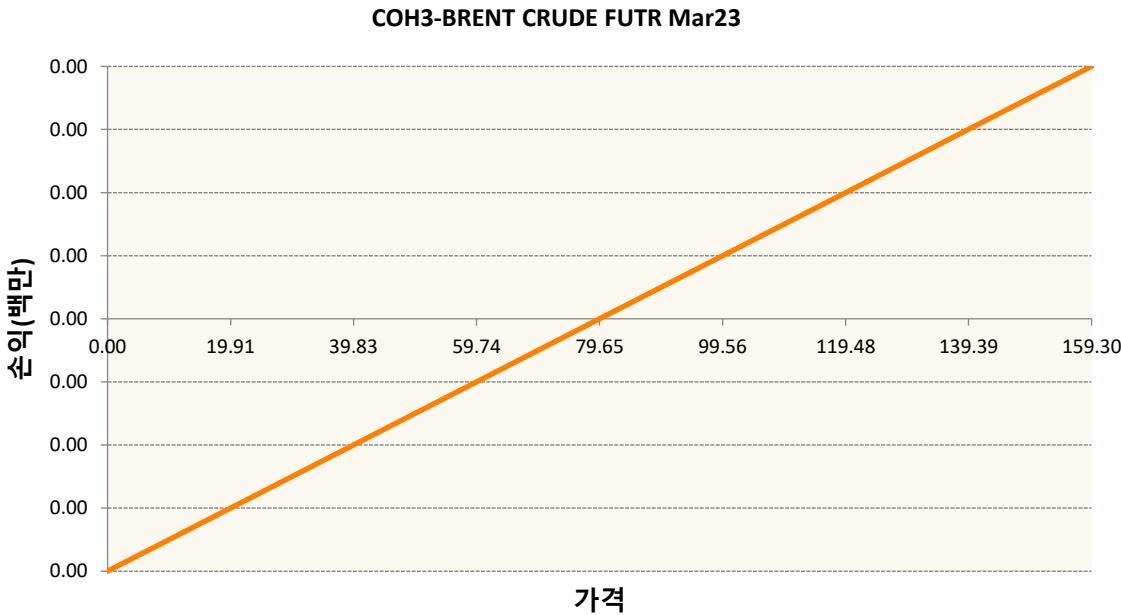
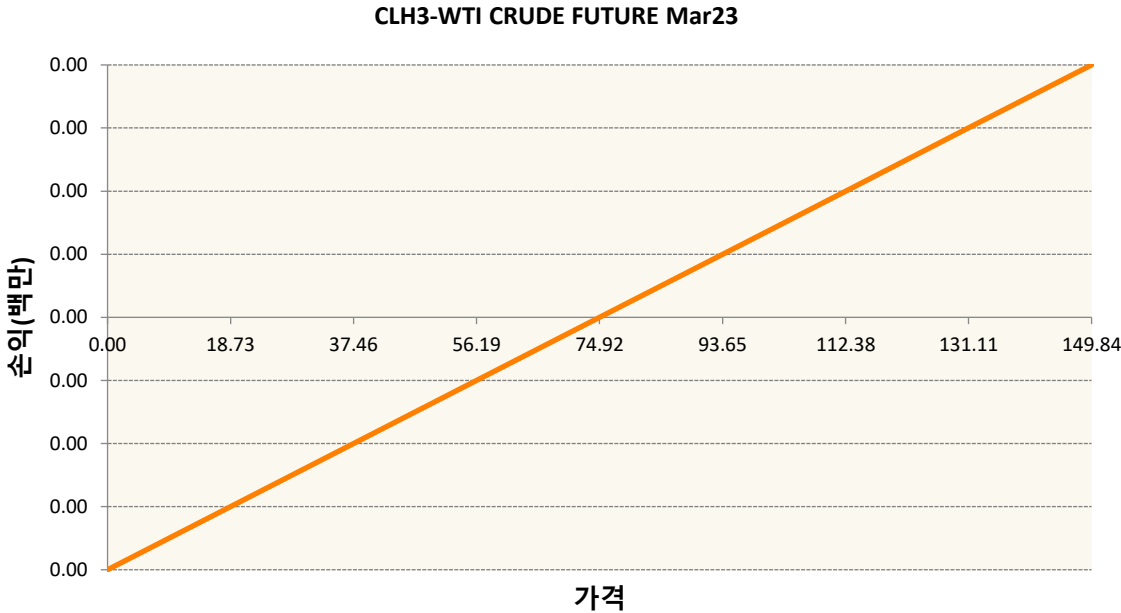
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

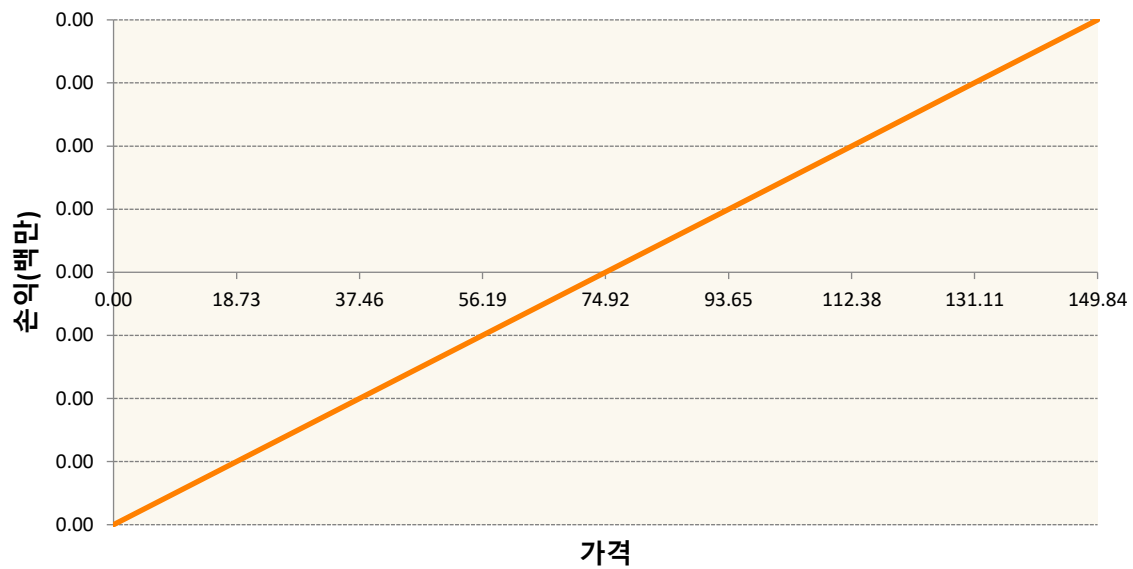
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,774	211	1,563	

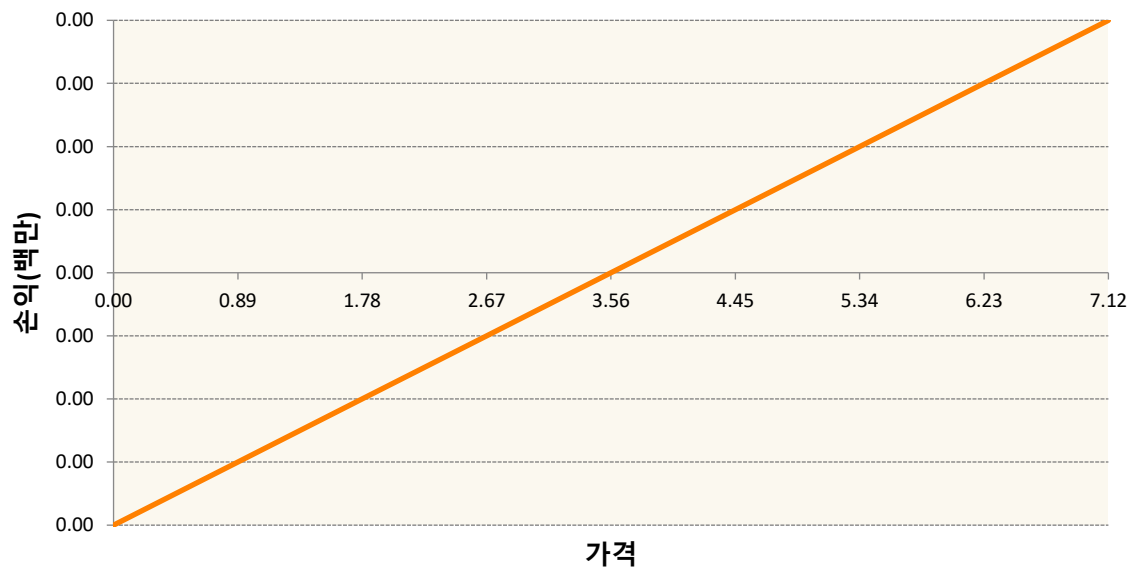
2. 만기시점의 손익구조



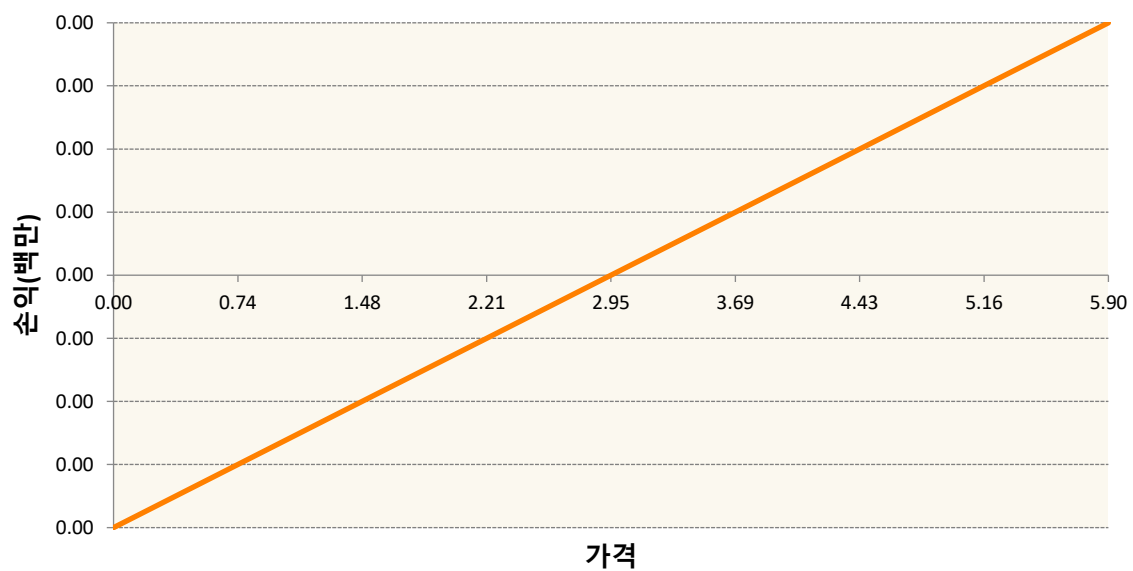
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



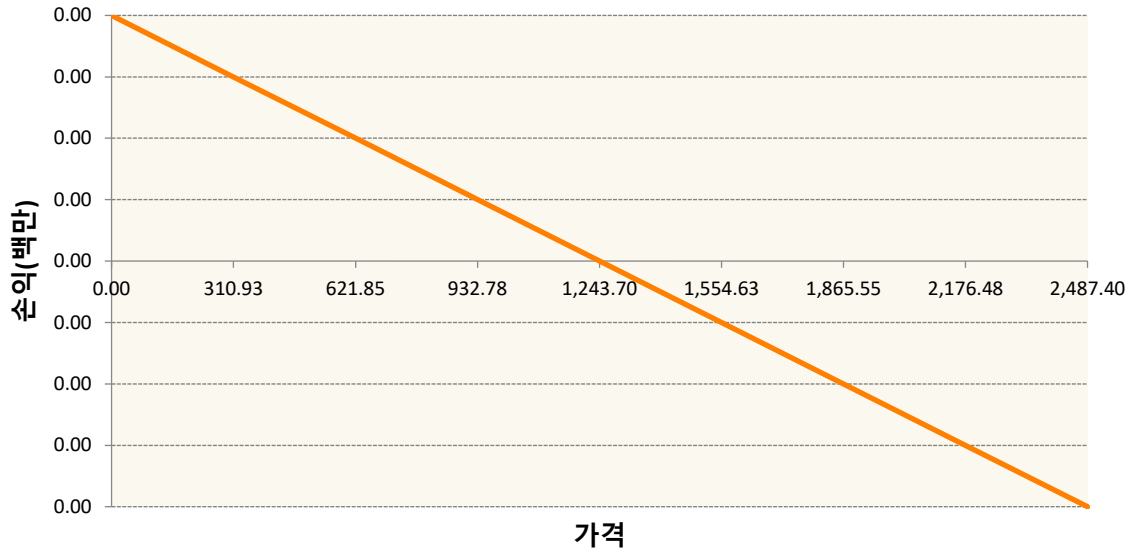
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



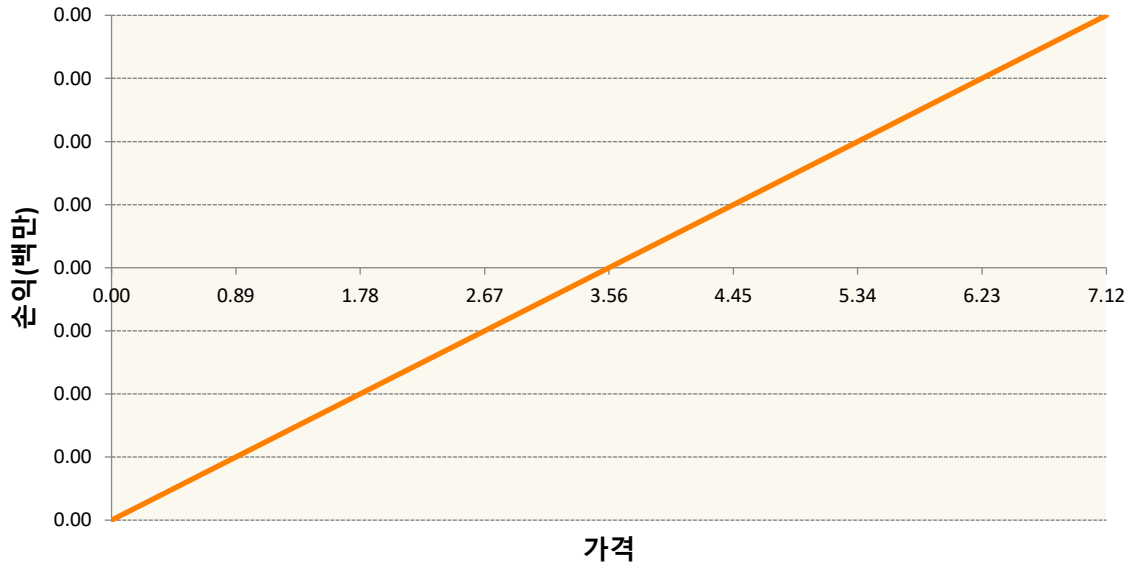
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



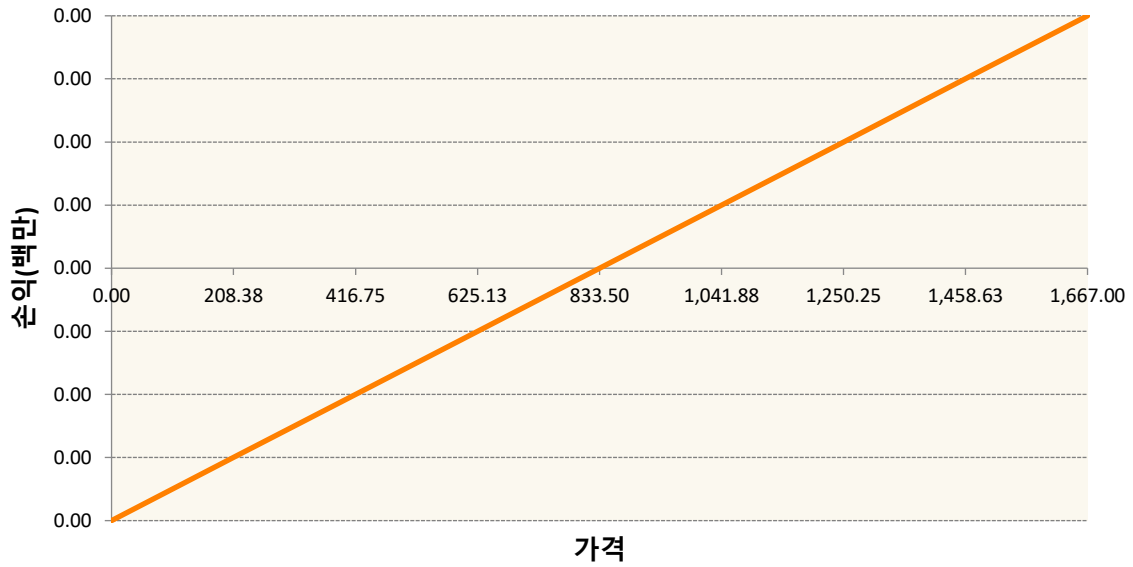
KR4175T10005-2023-01 달러선물

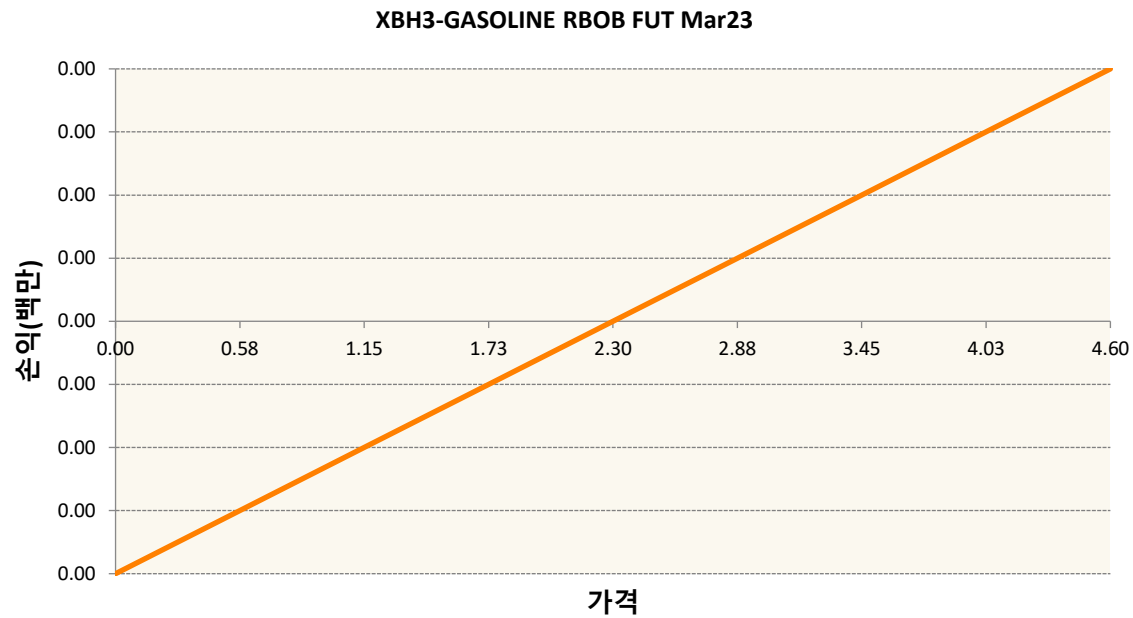


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	23
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	34
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		17
NGH23	NATURAL GAS FUTR Mar23	34
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	17
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	461