

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

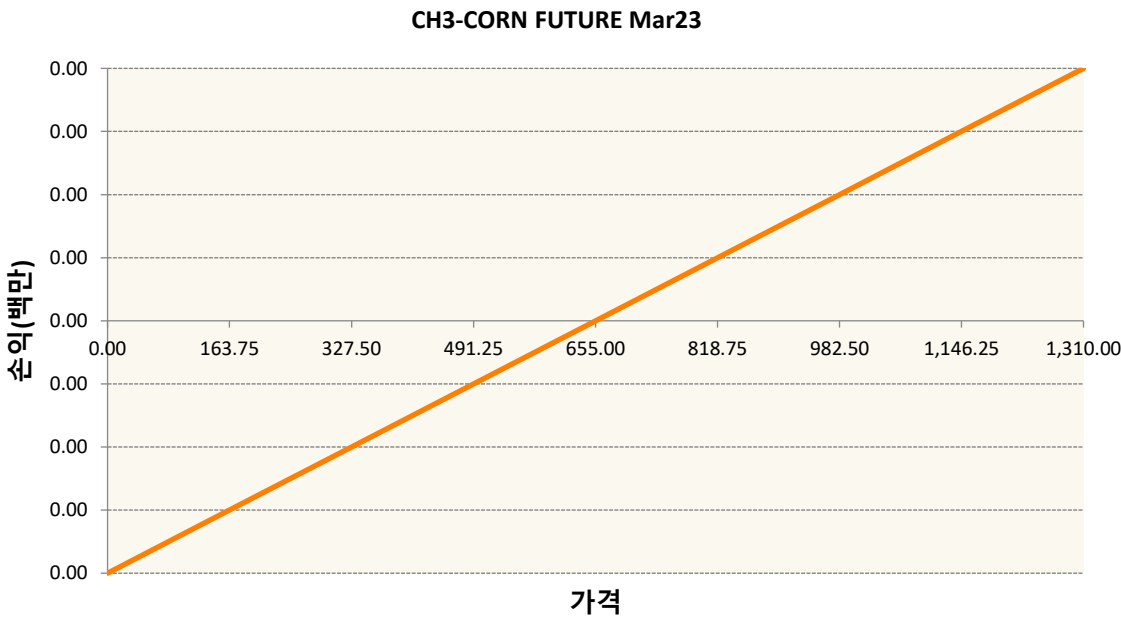
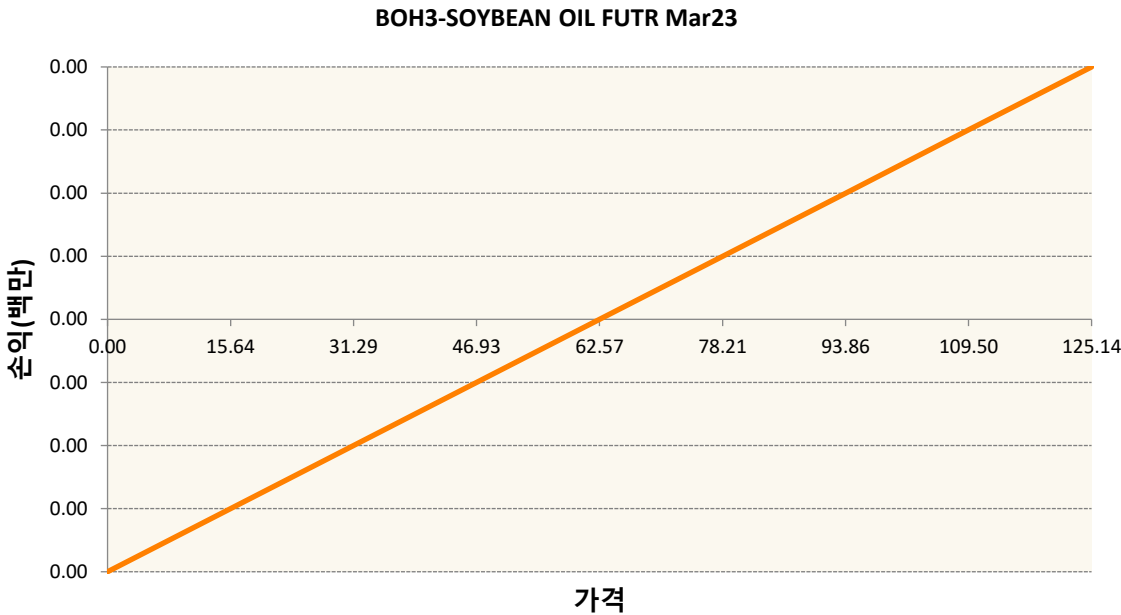
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

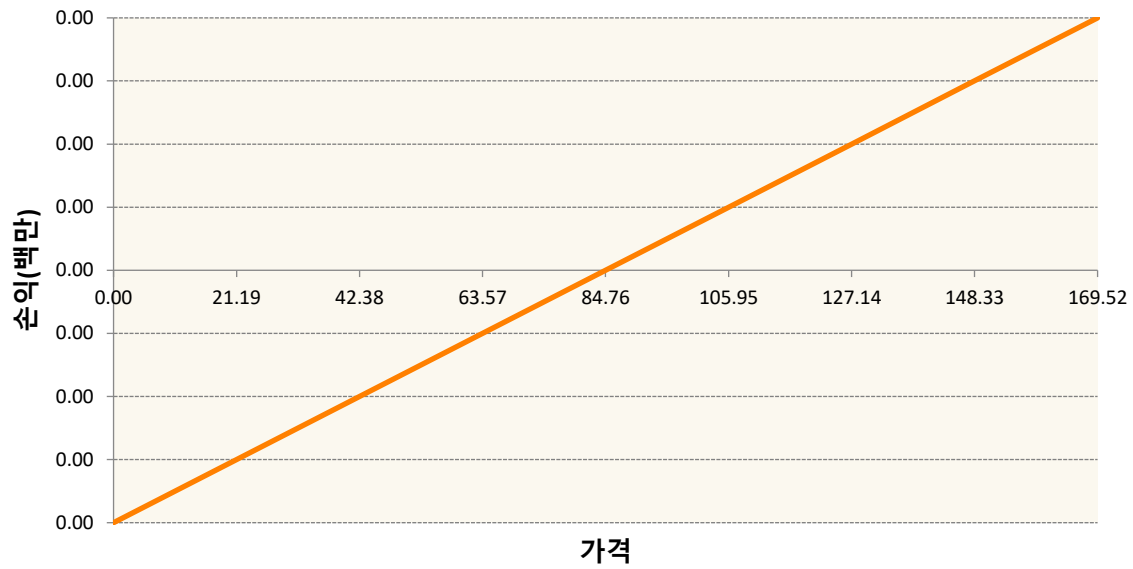
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,484	498	5,986	

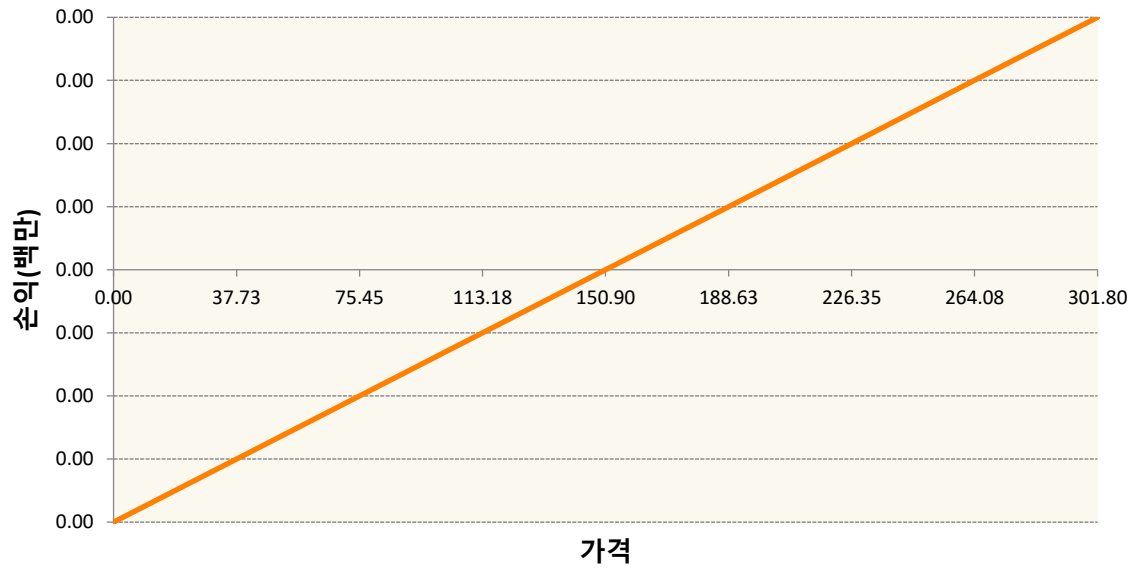
2. 만기시점의 손익구조



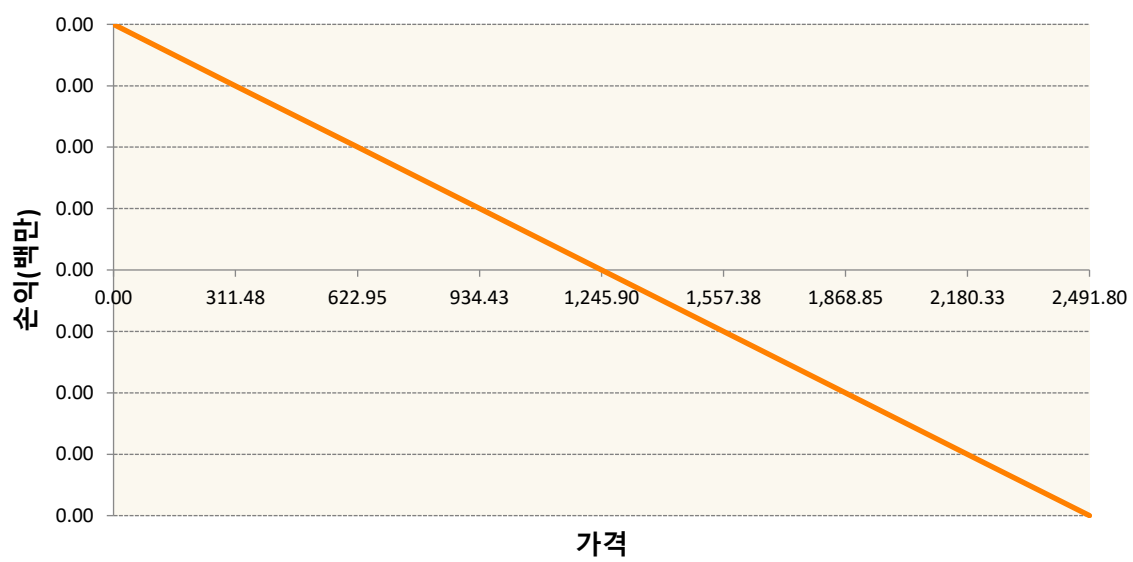
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



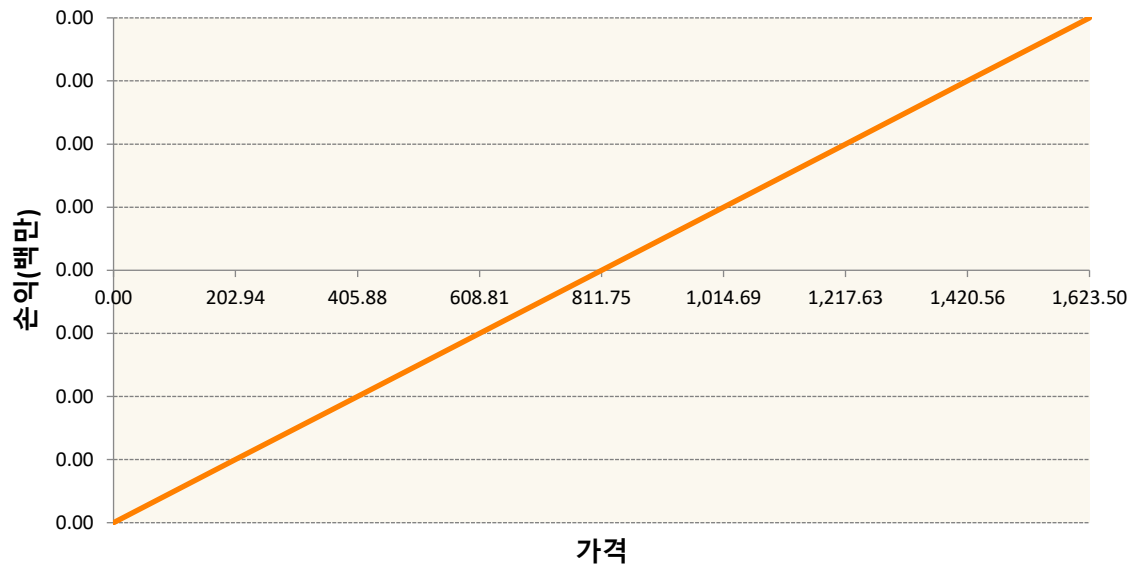
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



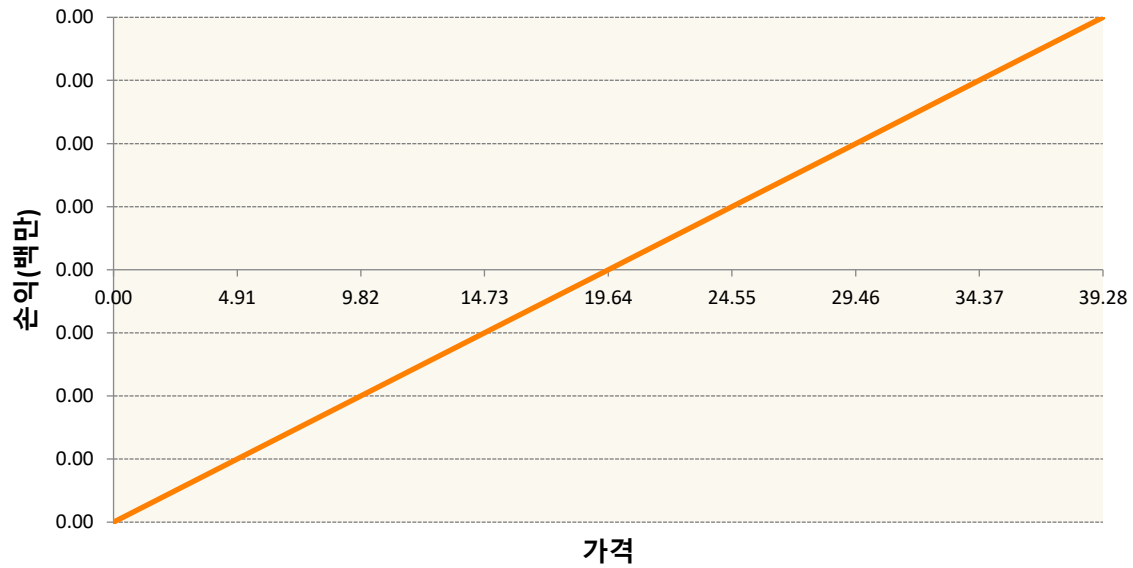
KR4175T10005-2023-01 달러선물



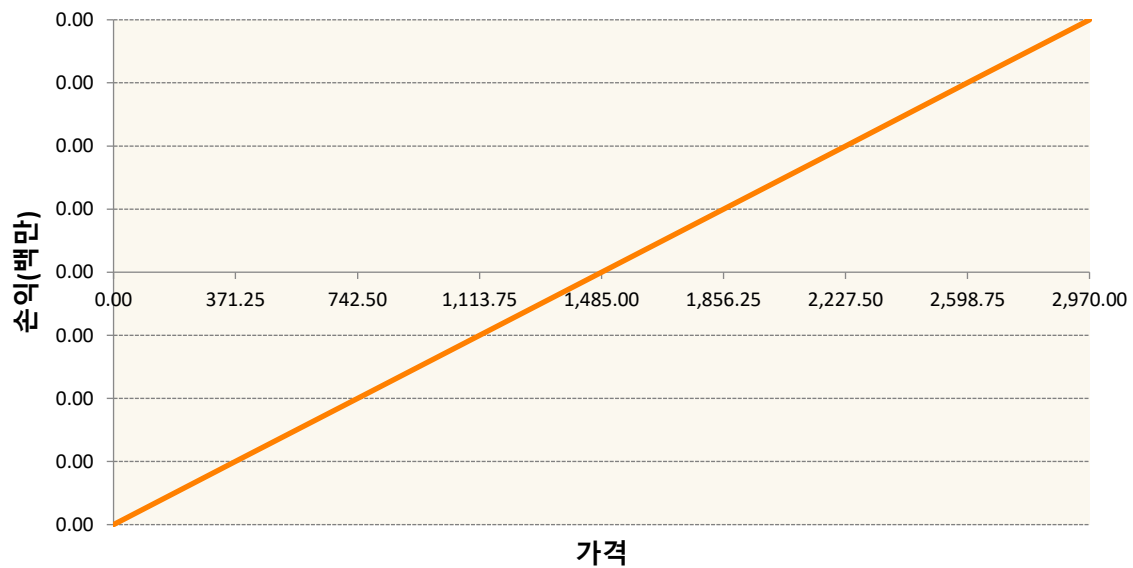
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



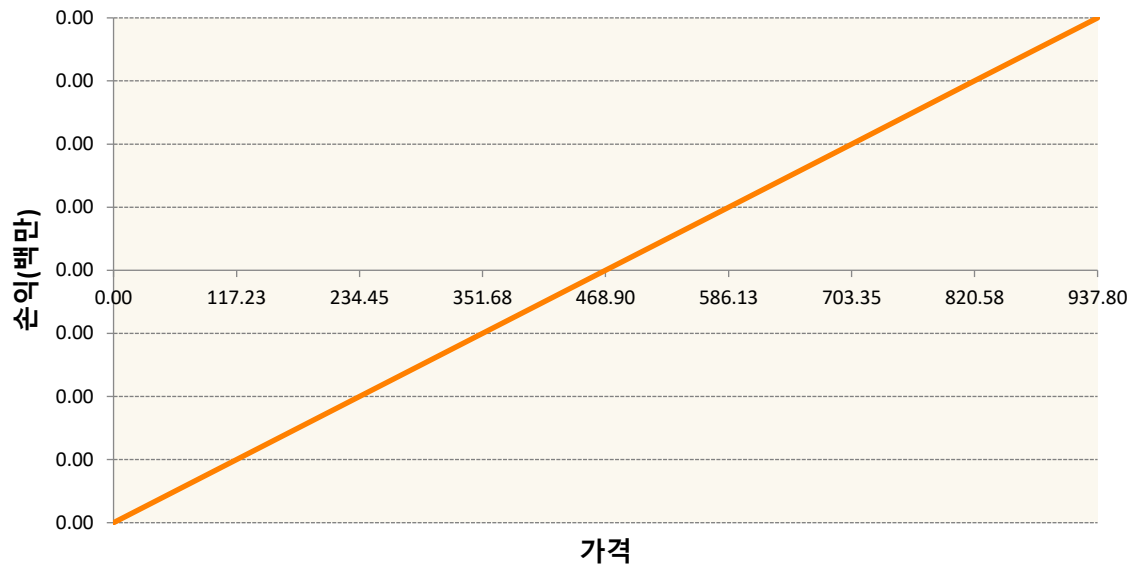
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



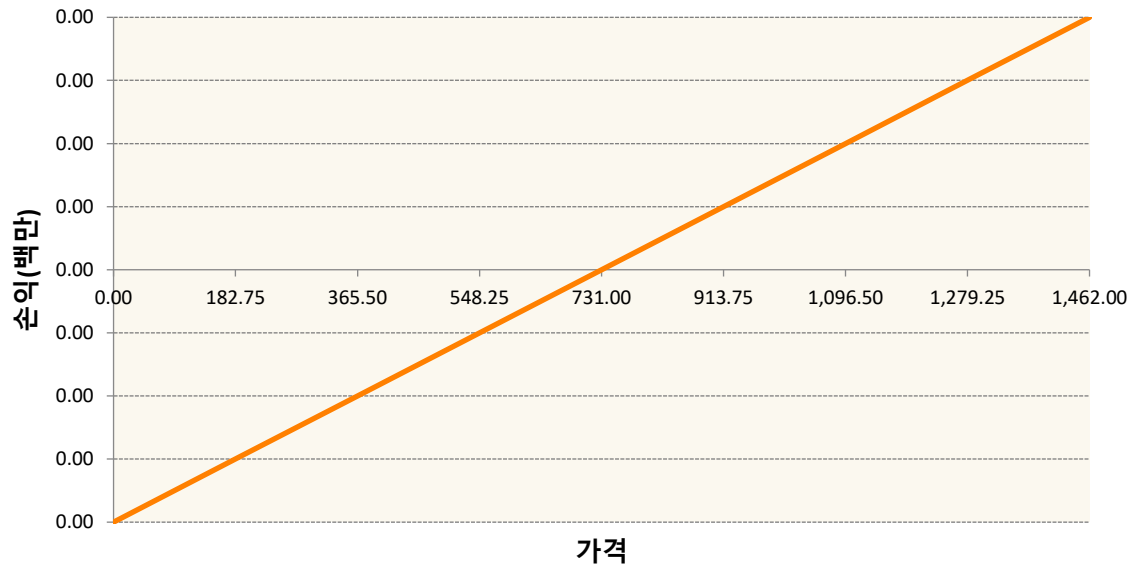
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



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	2023-01-12
기준일	2023-01-11

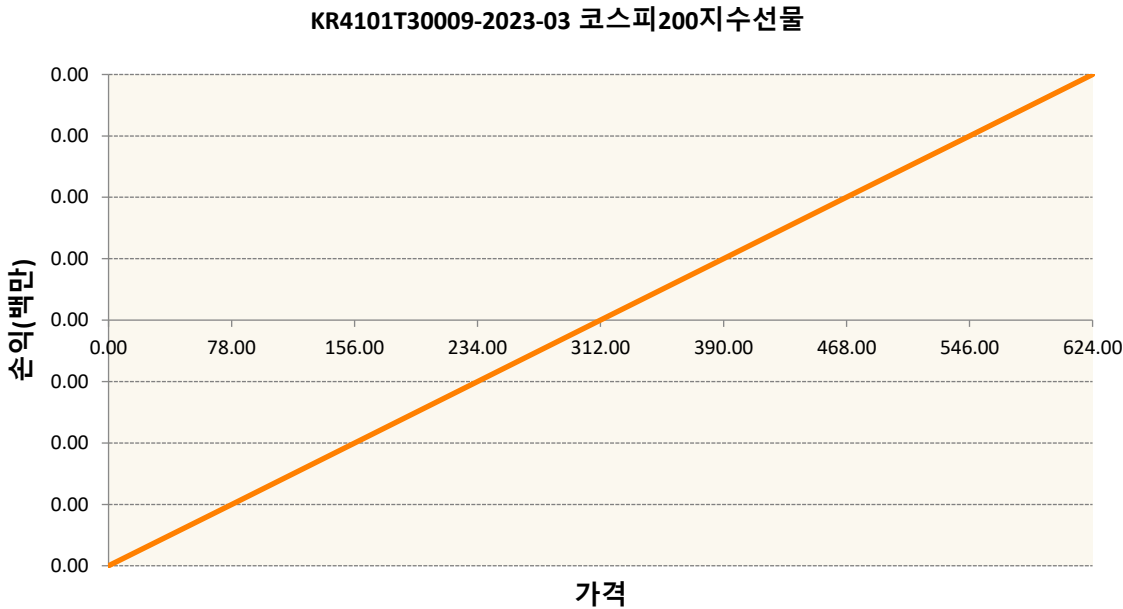
스마트인덱스모

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	1,950	0	1,950	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	2023-01-12
기준일	2023-01-11

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

355

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

500

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

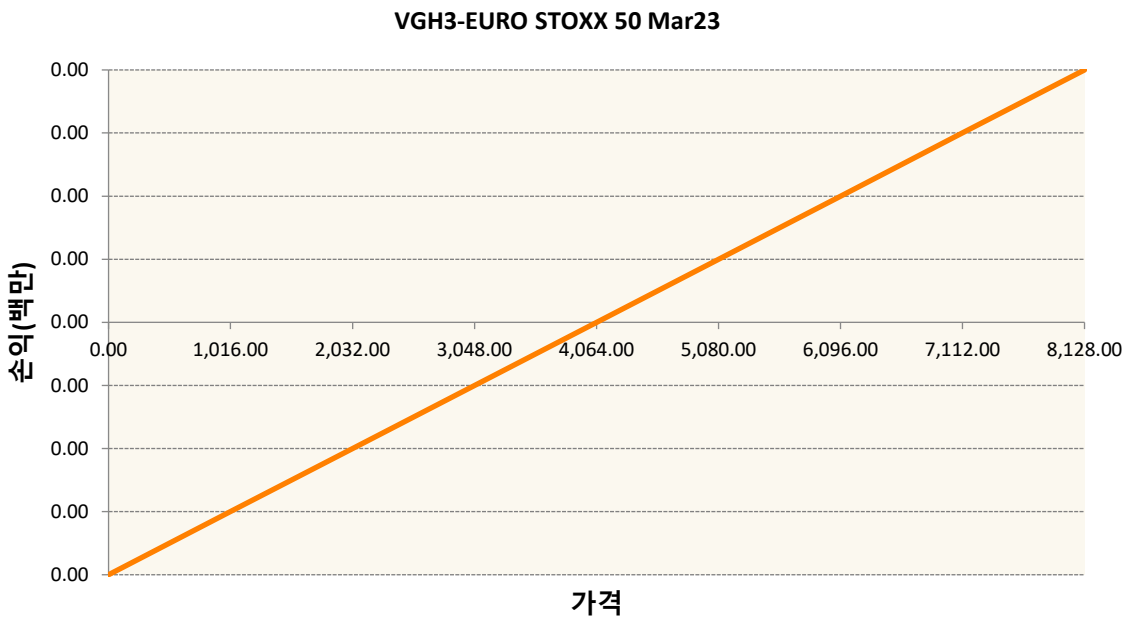
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

48

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

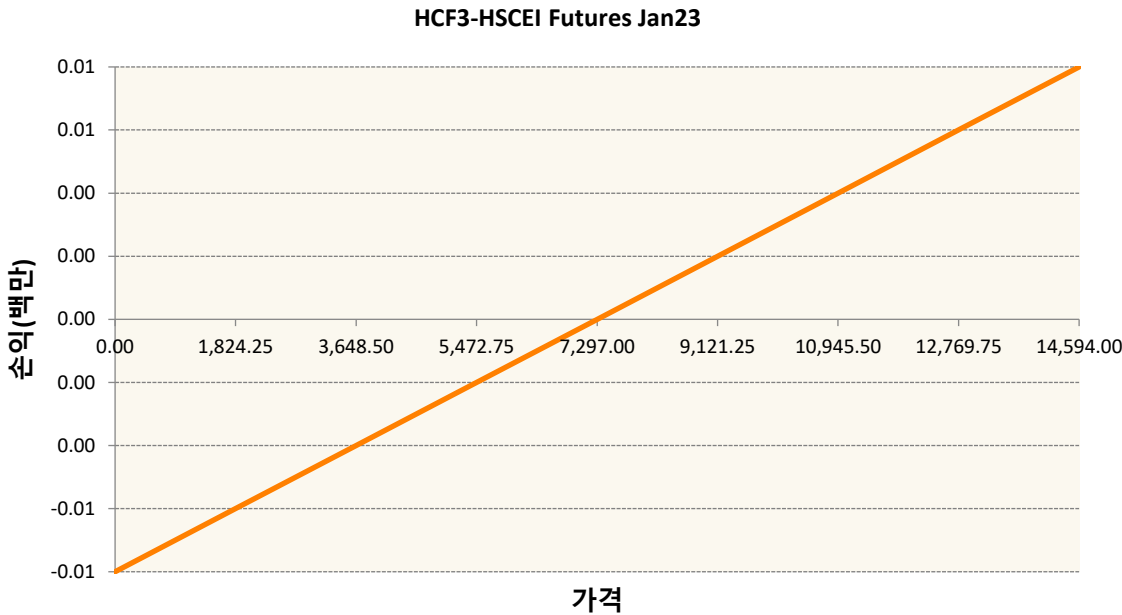
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,656	0	1,656	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF3	HSCEI Futures Jan23	132
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

222

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

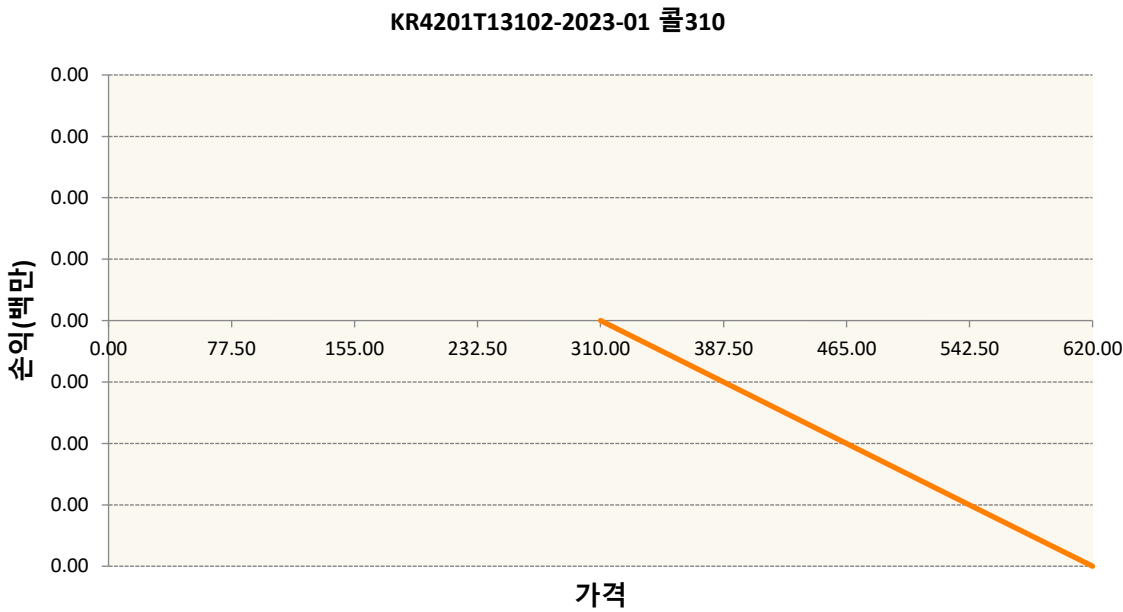
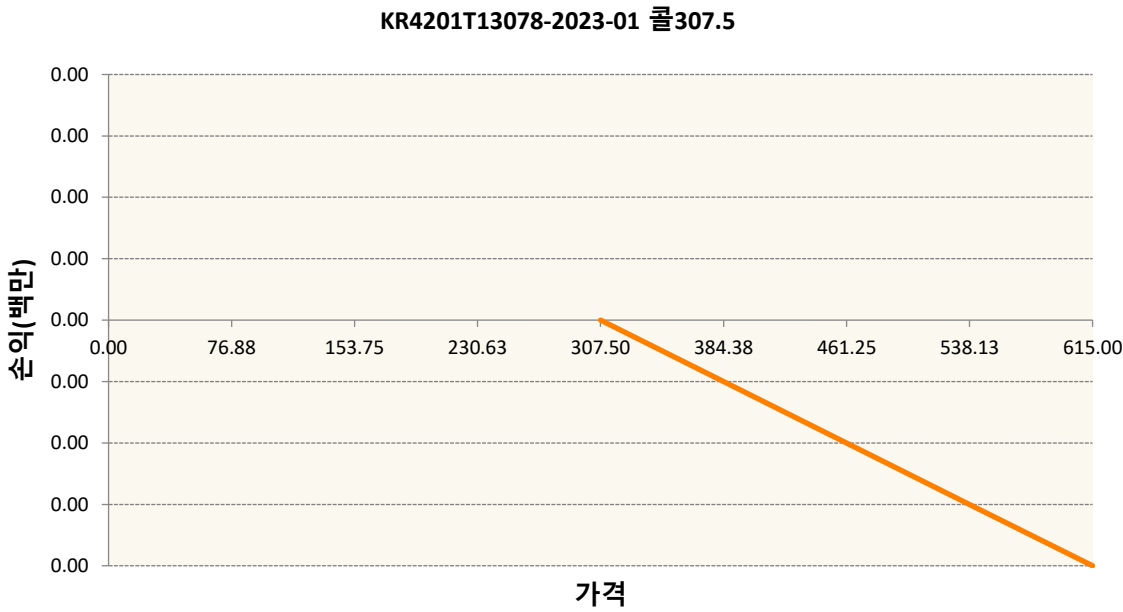
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

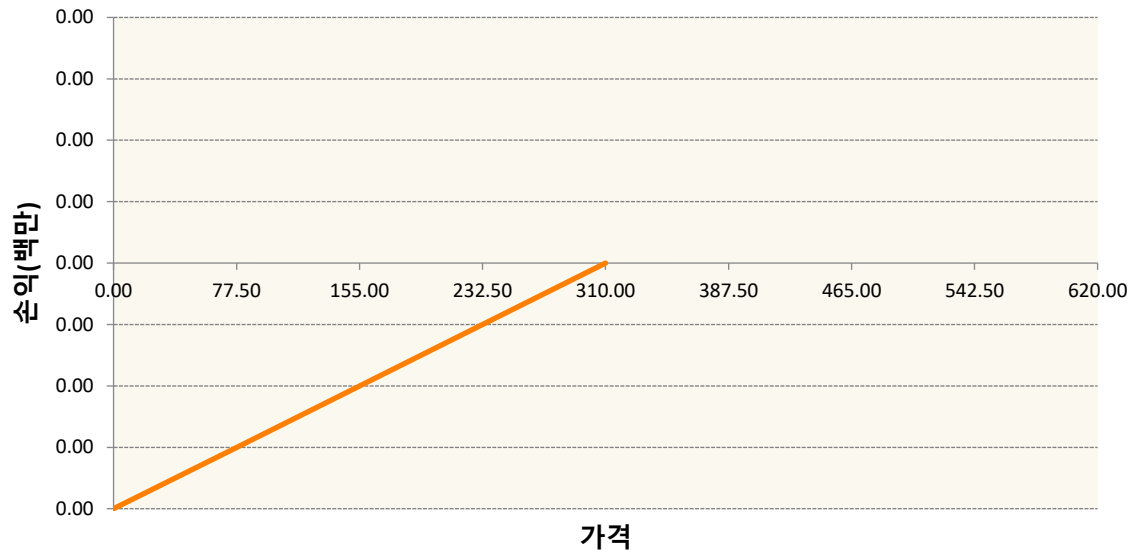
(단위:백만원)

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				2,855
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	612	612	612	612	611	609	607
-5.33%	610	607	602	595	587	577	565
-2.67%	536	512	488	461	434	406	378
0%	93	63	32	0	-32	-64	-97
2.67%	-795	-803	-813	-826	-840	-857	-875
5.33%	-1,818	-1,819	-1,820	-1,822	-1,825	-1,829	-1,834
8.00%	-2,853	-2,853	-2,853	-2,853	-2,853	-2,854	-2,855
KR4201T13102			2023-01 콜310				485
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	77	77	77	77	77
-5.33%	77	77	76	76	75	74	72
-2.67%	71	68	65	61	58	53	49
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-121	-124	-127	-130	-134	-138	-142
5.33%	-300	-300	-301	-301	-302	-304	-305
8.00%	-484	-484	-484	-484	-484	-485	-485
KR4301T13100			2023-01 풋310				674
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-673	-673	-673	-673	-673	-673	-674
-5.33%	-413	-413	-413	-414	-416	-417	-419
-2.67%	-160	-164	-169	-174	-179	-185	-191
0%	26	17	9	0	-9	-17	-26

2.67%	89	86	82	77	72	66	60
5.33%	97	96	96	95	93	91	89
8.00%	97	97	97	97	96	96	96

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

(단위:백만원)

4,921

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

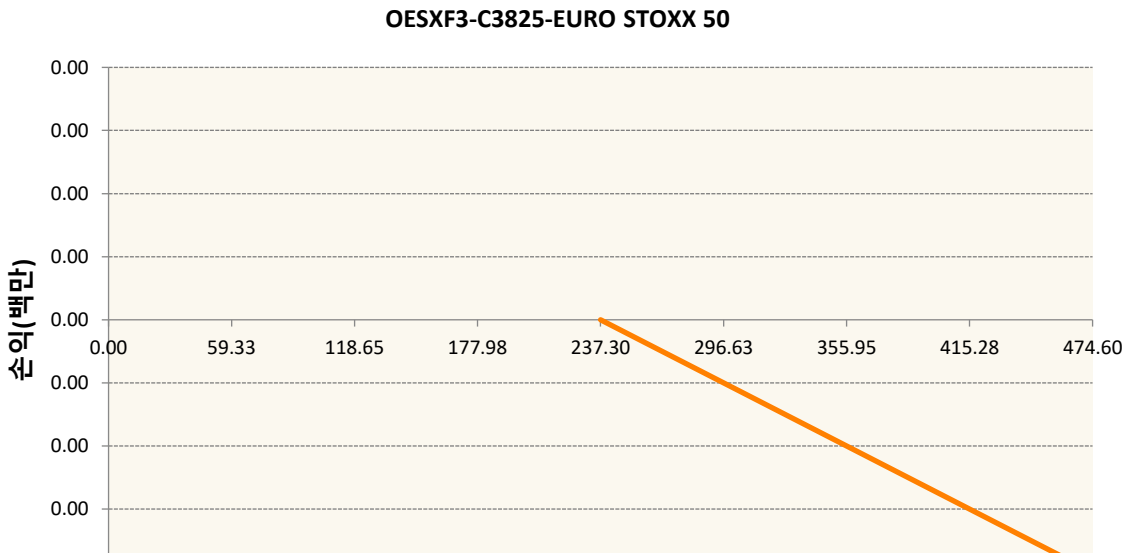
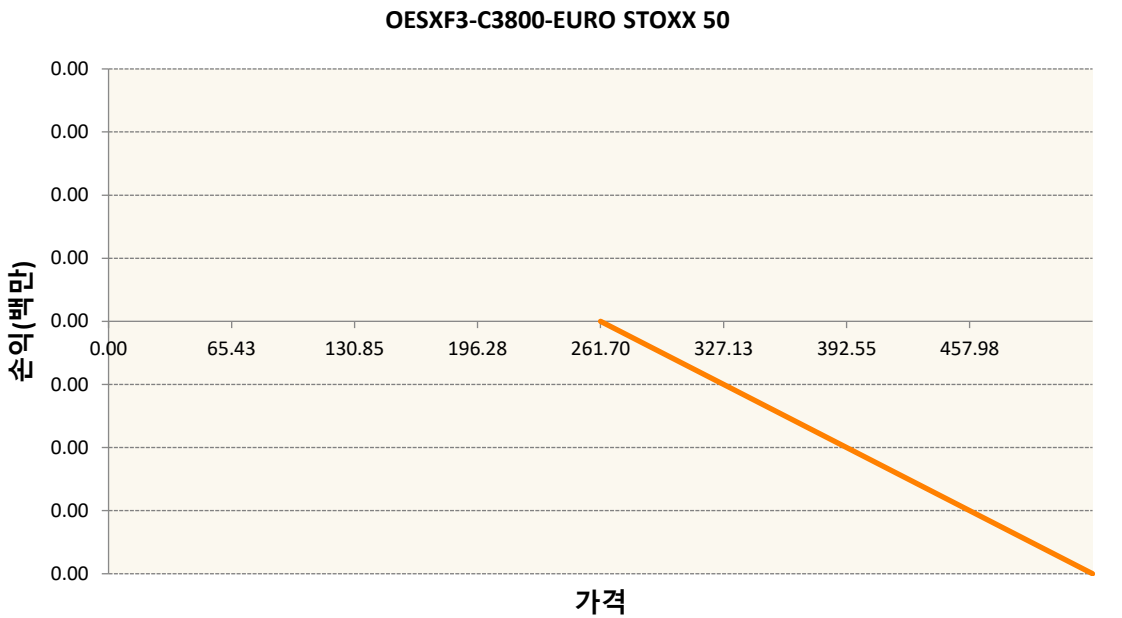
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

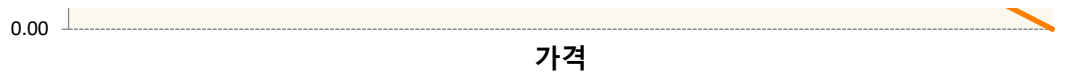
1. 계약금액

(단위:백만원)

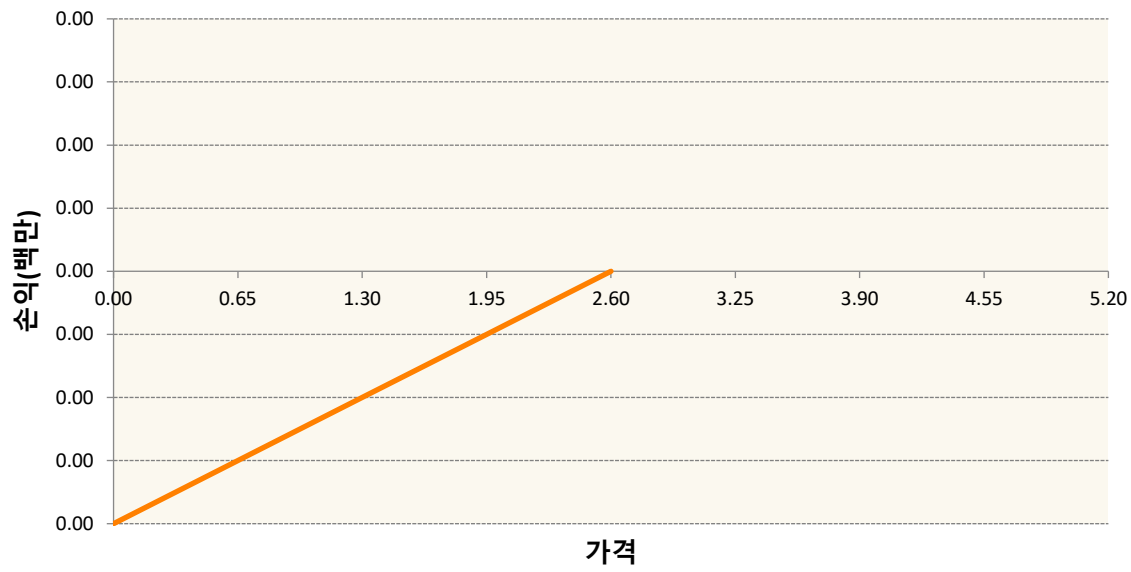
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,128	0	1,128	
누계	유가증권	옵션	0	139	-139	장내
누계	통화	선도	335	2,211	-1,876	장외

2. 만기시점의 손익구조

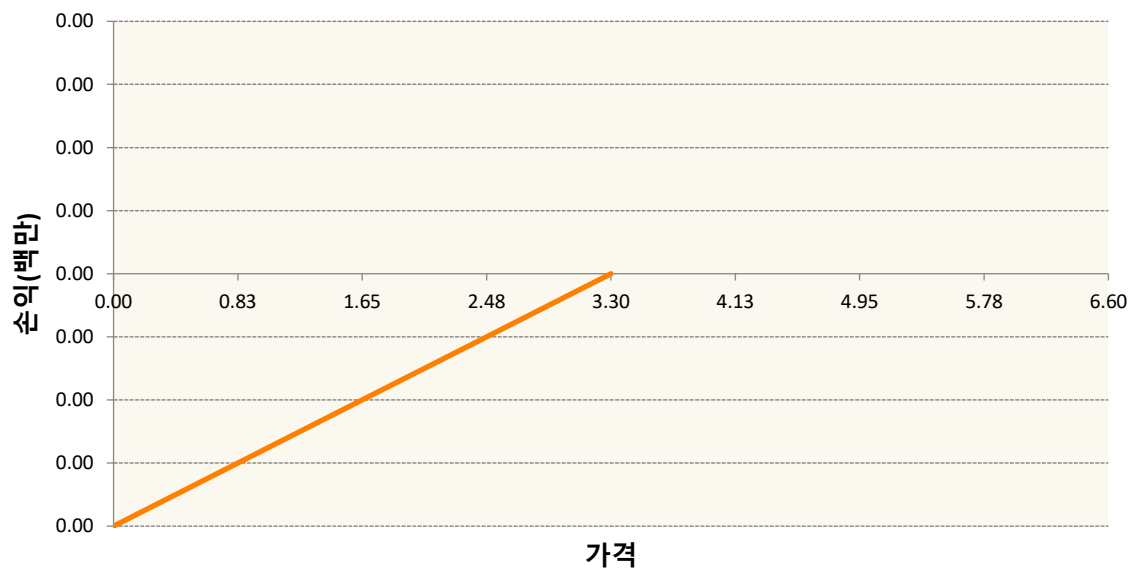




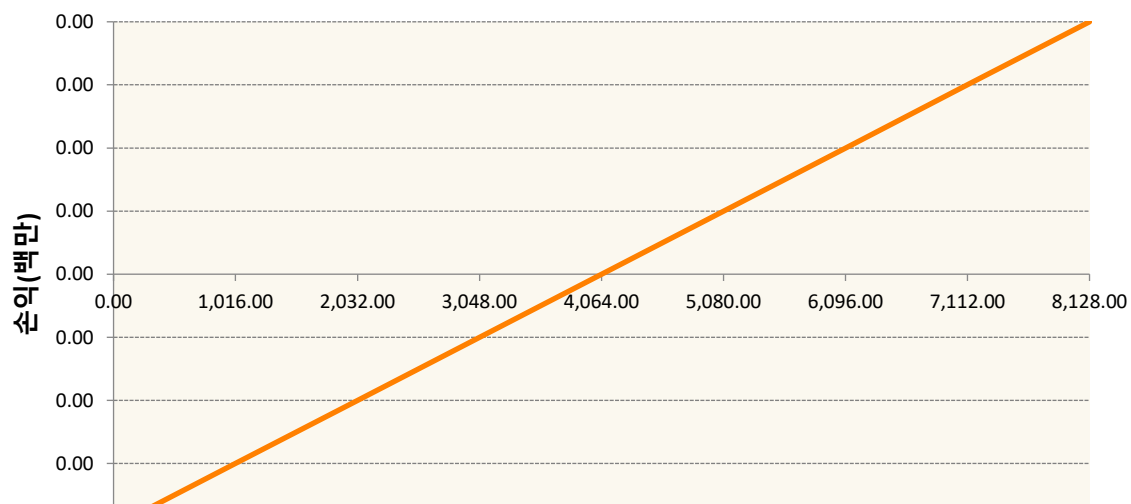
OESXF3-P3800-EURO STOXX 50



OESXF3-P3825-EURO STOXX 50



VGH3-EURO STOXX 50 Mar23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E		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		9
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		2
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		0.08
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		0.02
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		90

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

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

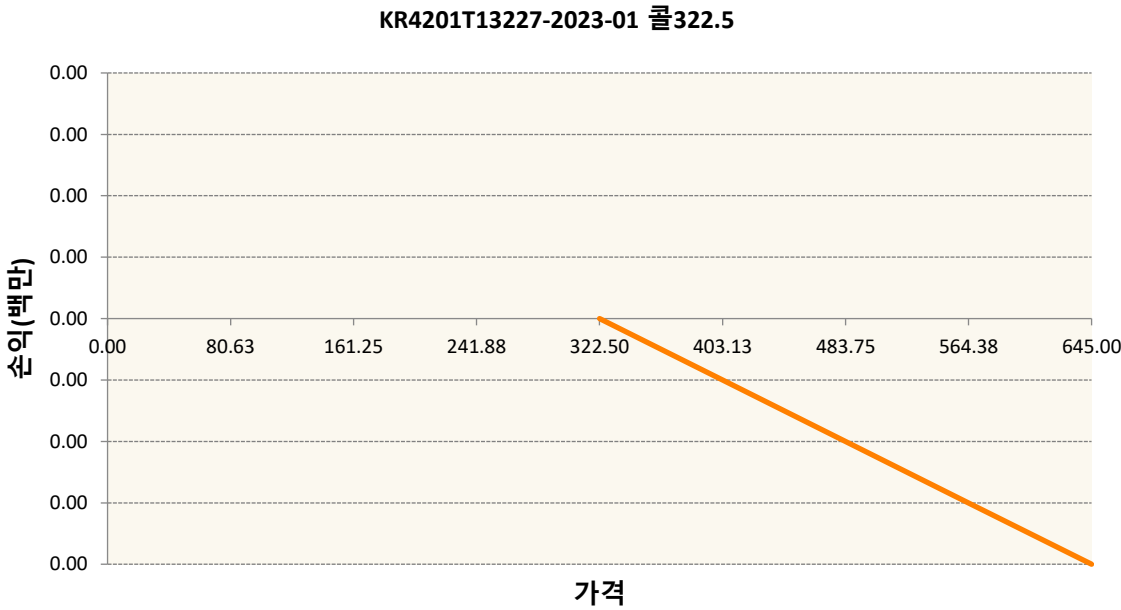
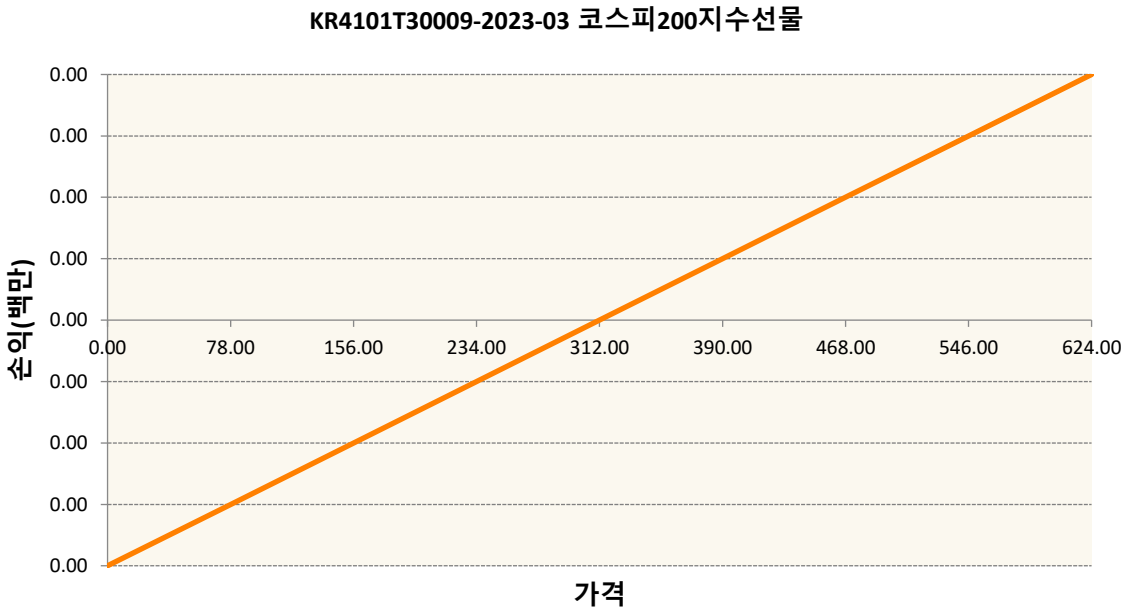
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	390	0	390	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 is plotted, starting at (0, 0) and ending at (310, 0). This indicates that the 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					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					82
	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
-5.33%	2	2	2	2	2	2	2
-2.67%	2	2	2	2	1	1	1
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-5	-6	-8	-10	-11	-13	-14
5.33%	-32	-33	-35	-36	-38	-40	-41
8.00%	-78	-79	-79	-80	-80	-81	-82
KR4201T13250 2023-01 콜325							61

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
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	1	1	1	1	1	1	0
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	-2	-3	-4	-5	-7	-8	-9
5.33%	-19	-21	-22	-24	-25	-27	-29
8.00%	-56	-57	-58	-58	-59	-60	-61

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	0
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)

124

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

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	6,474	0	6,474	

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	2023-01-12
기준일	2023-01-11

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	5,479	0	5,479	

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	2023-01-12
기준일	2023-01-11

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	18,344	0	18,344	
누계	통화	선도	0	18,288	-18,288	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CAR\KRW/USD 30-01-23E	258
FXW213CBQ\KRW/USD 28-02-23E	637
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)

792

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

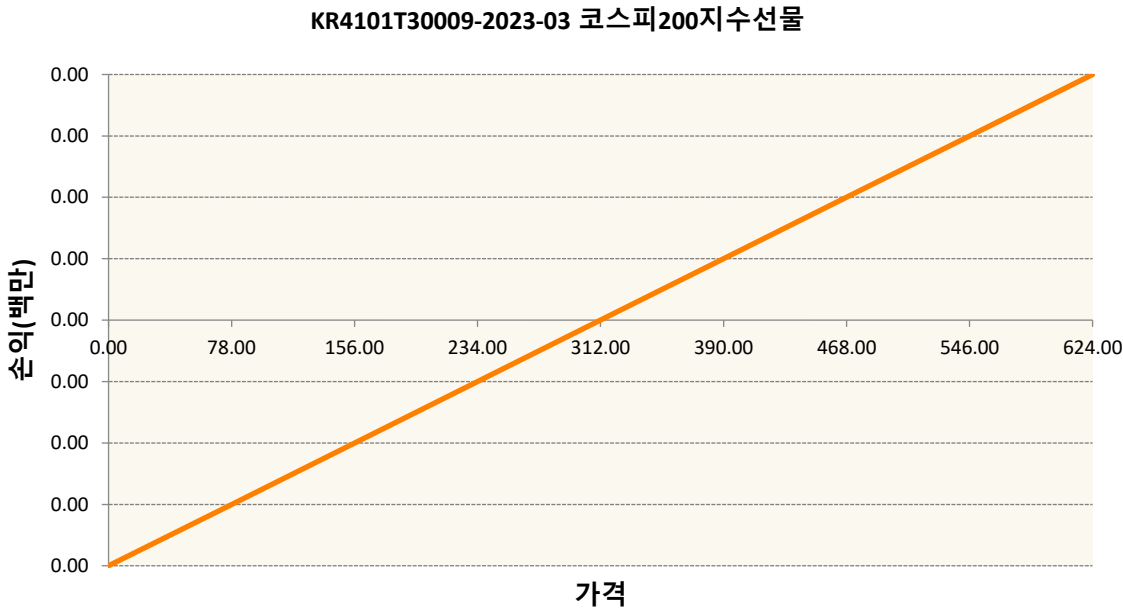
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	780	0	780	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	2023-01-12
기준일	2023-01-11

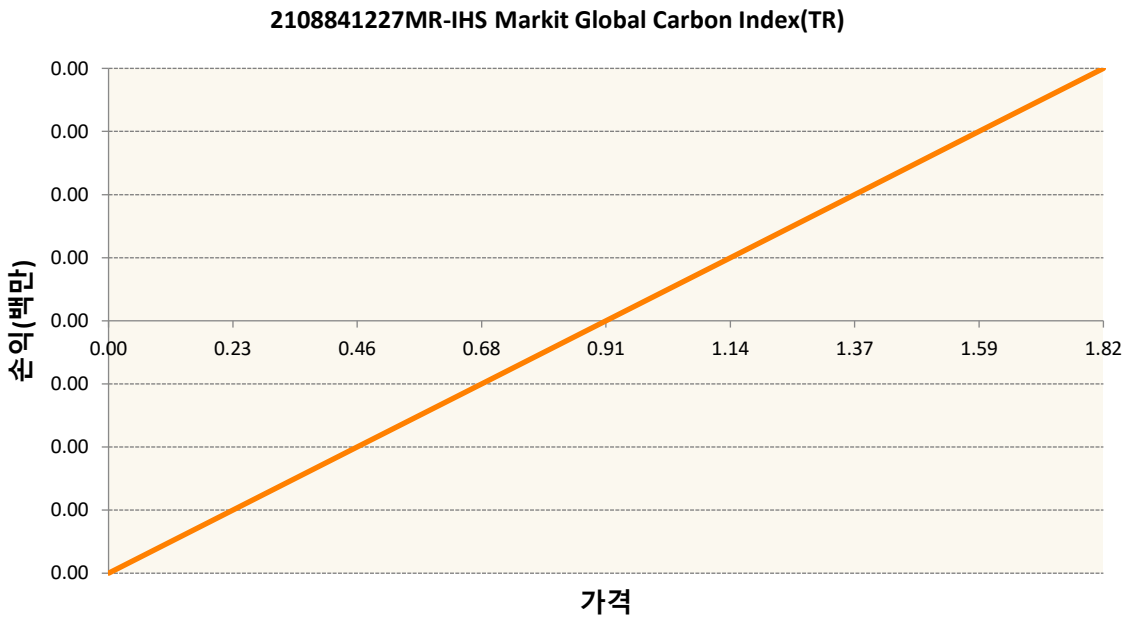
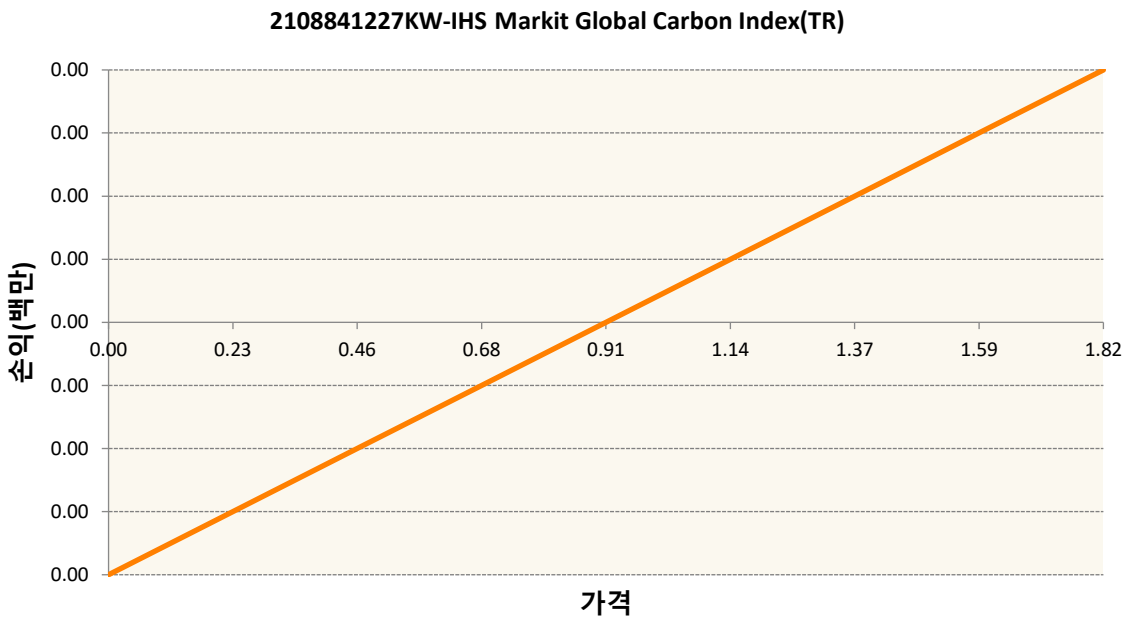
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

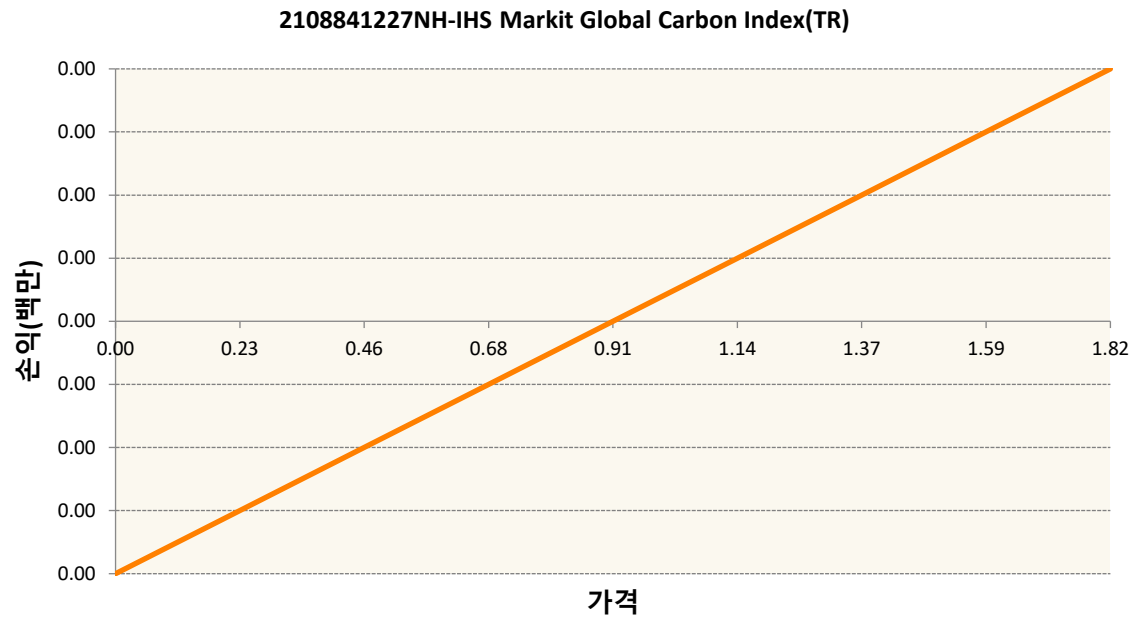
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	22,155	0	22,155	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,510
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		178
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		89

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,436

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

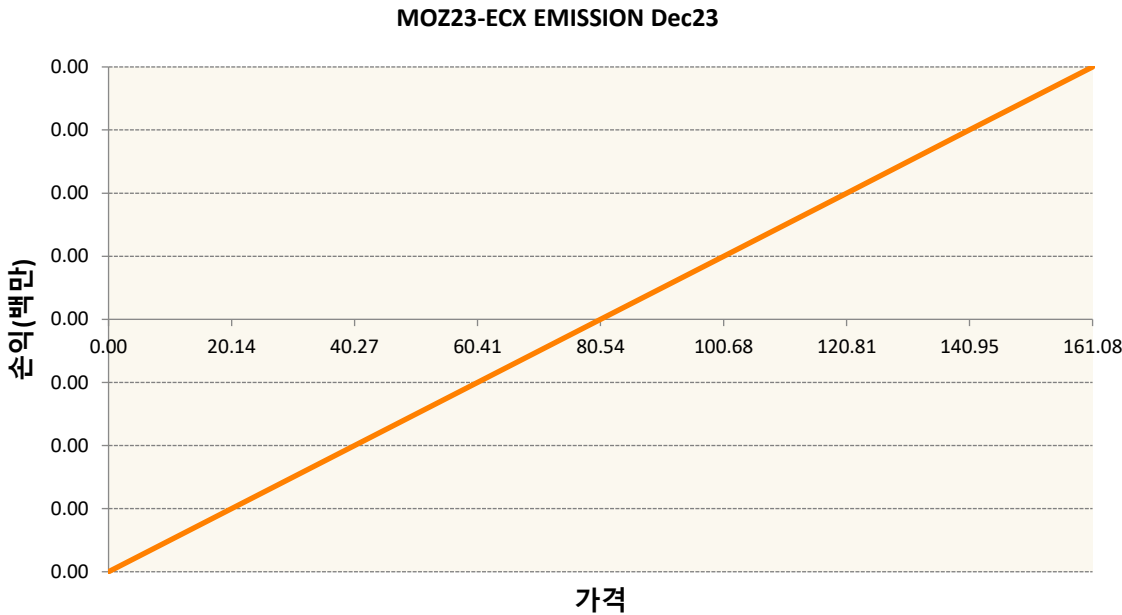
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,357	0	12,357	
누계	통화	선도	701	3,581	-2,880	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	989

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

(단위:백만원)

2,813

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

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)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	16

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

(단위:백만원)

124

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

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)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)	5

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

(단위:백만원)

19

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

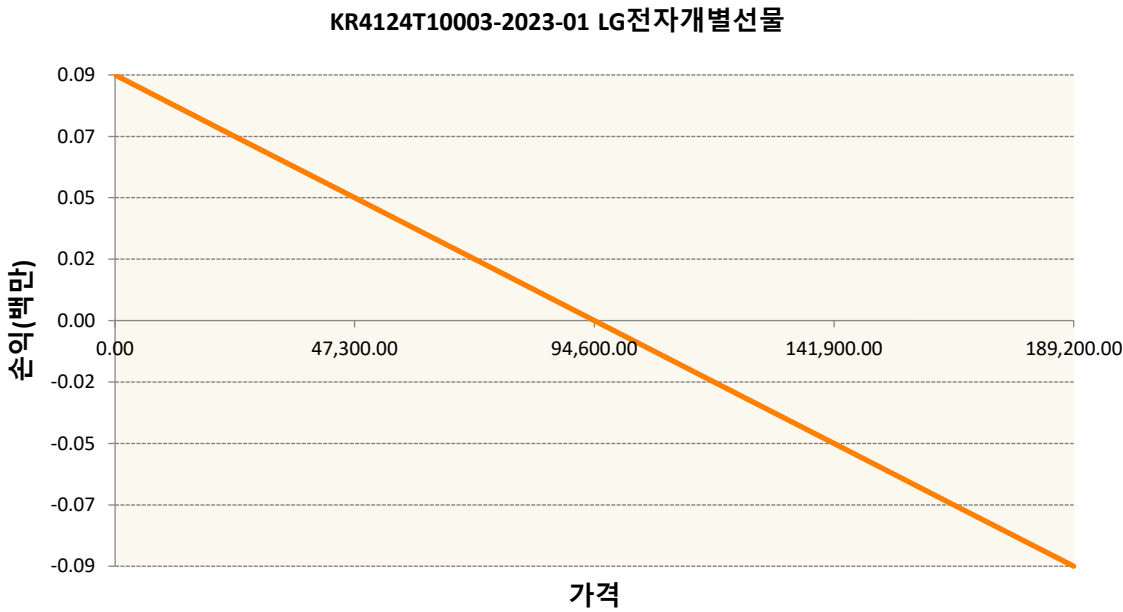
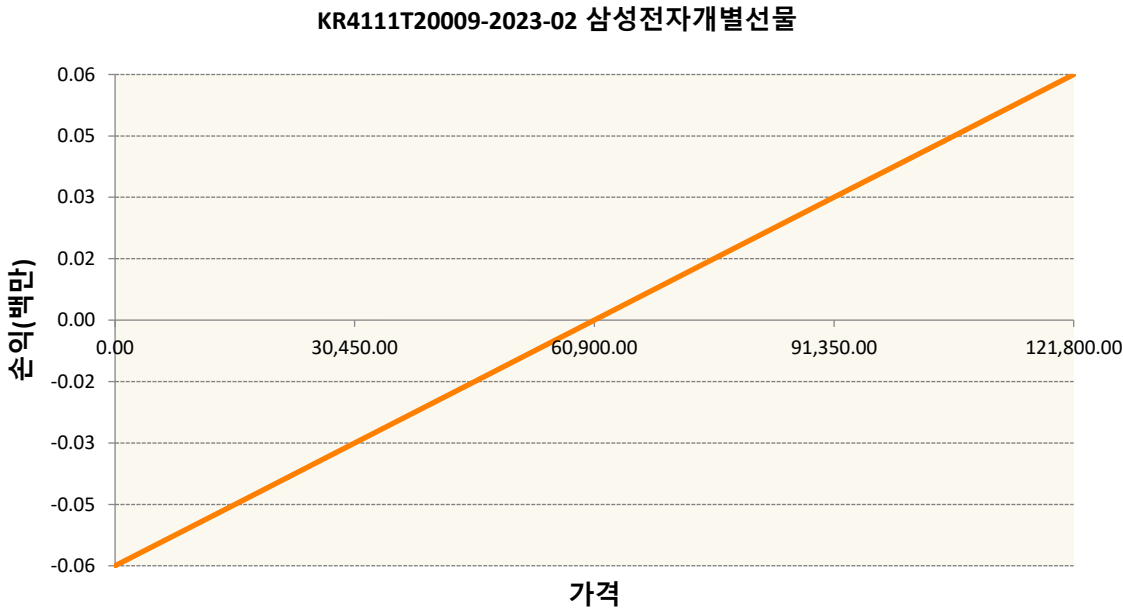
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

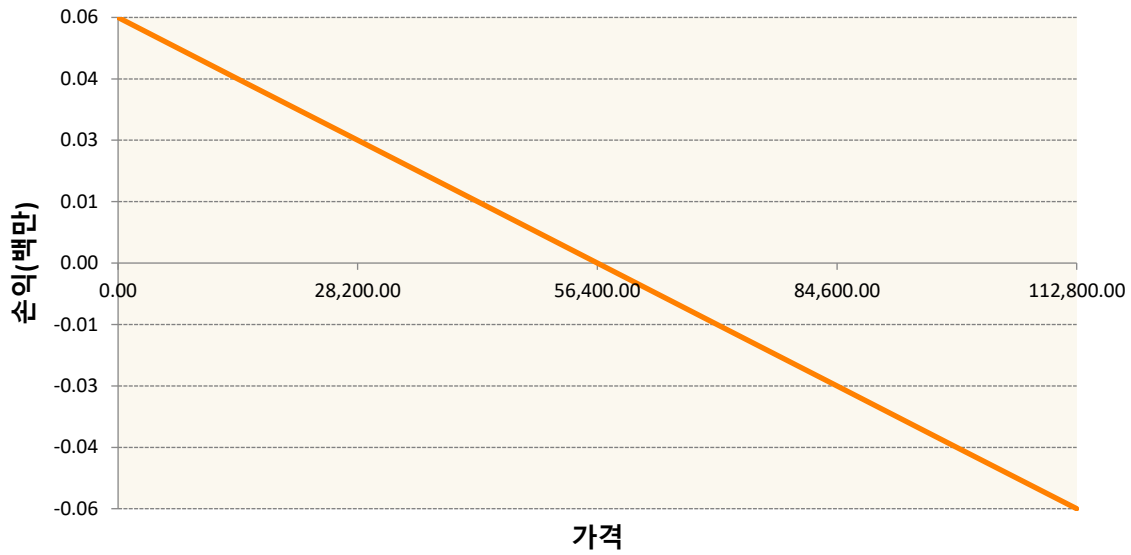
(단위:백만원)

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	765	932	-167	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

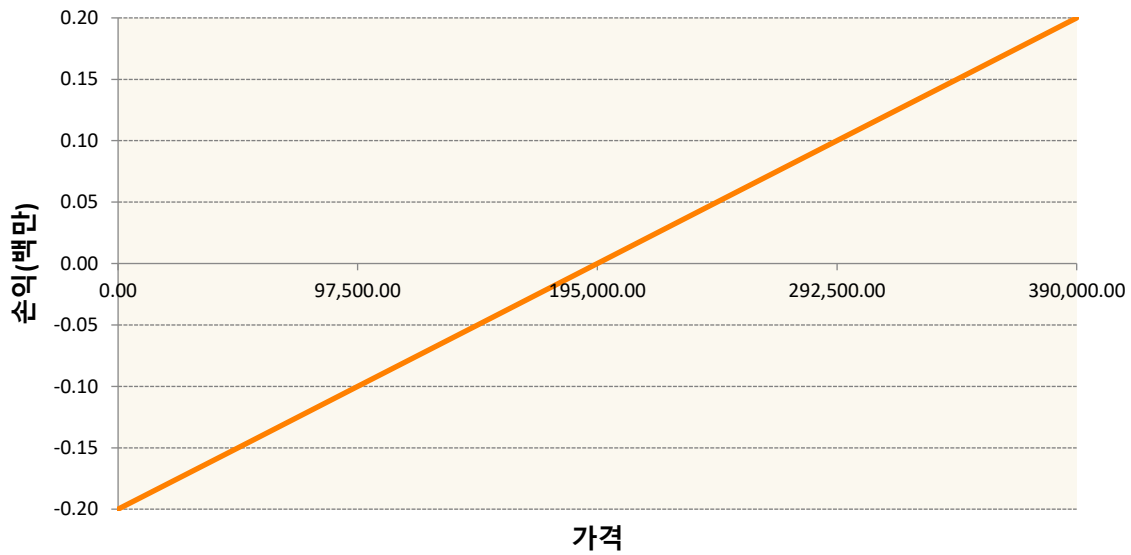
2. 만기시점의 손익구조



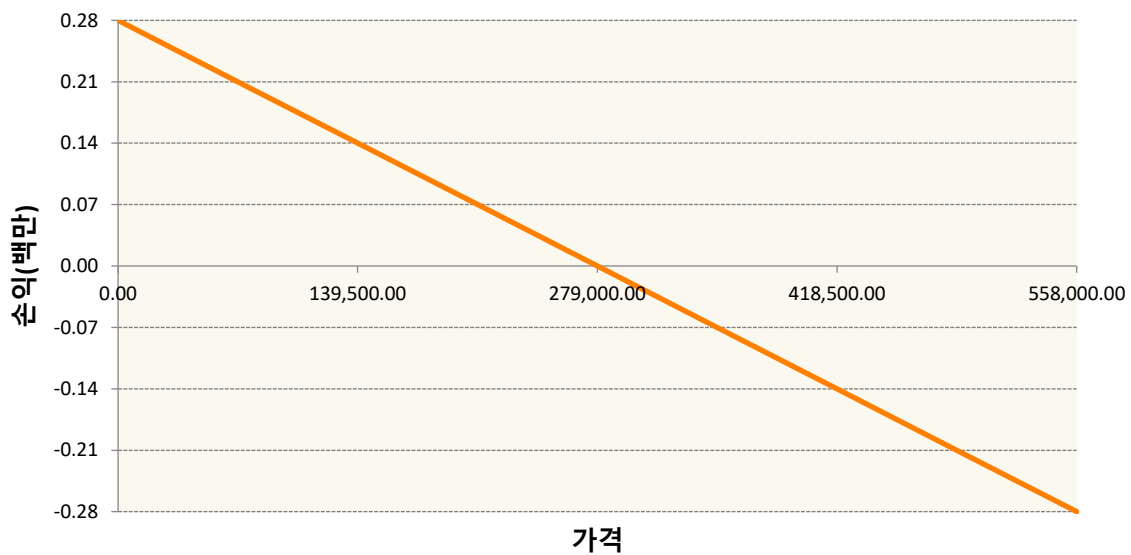
KR4146T10006-2023-01 KB금융개별선물



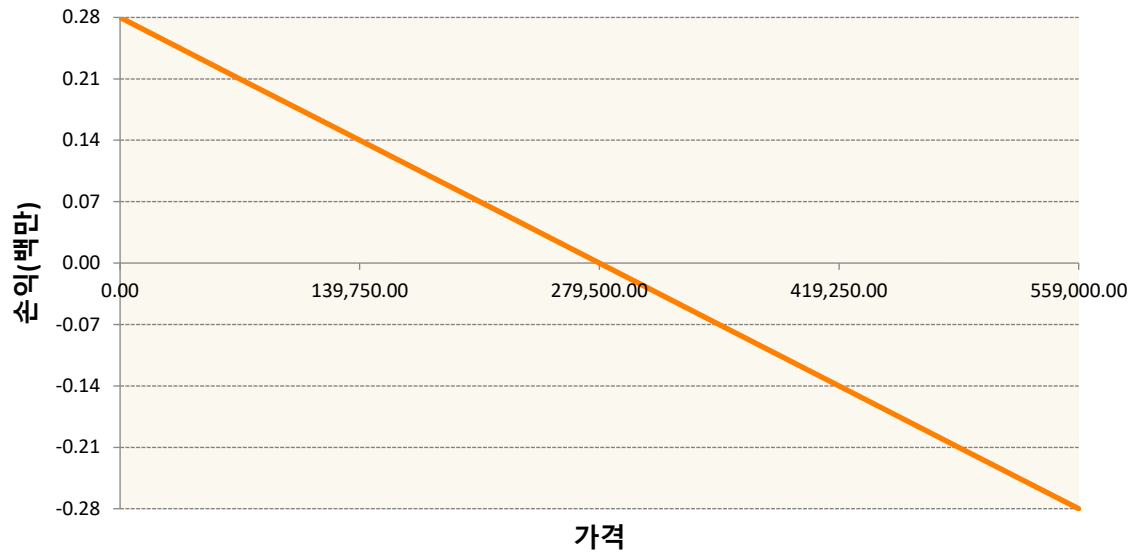
KR4156T20004-2023-02 NAVER개별선물



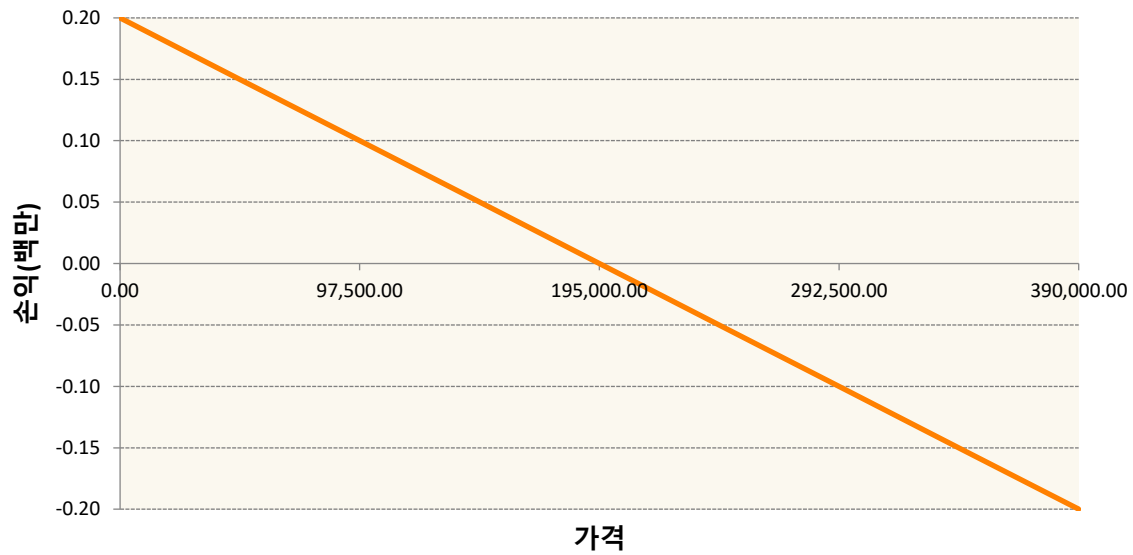
KR41BYT10009-2023-01 LG이노텍개별선물



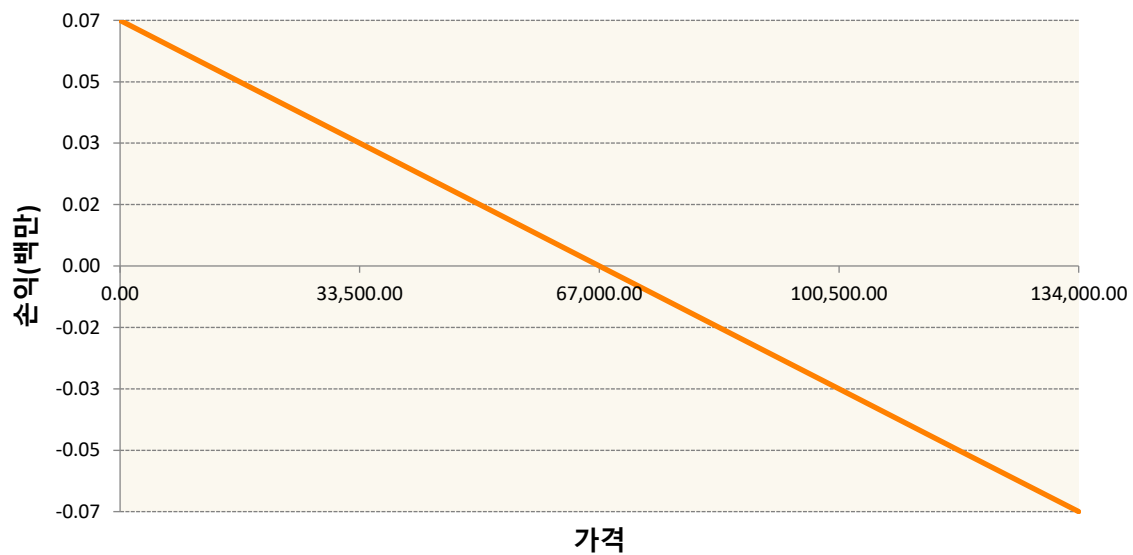
KR41BYT20008-2023-02 LG이노텍개별선물



KR41E8T10001-2023-01 포스코케미칼개별선물



KR41F7T10002-2023-01 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111T200 2023-02 삼성전자개별선물	49
KR4124T100 2023-01 LG전자개별선물	20
KR4146T100 2023-01 KB금융개별선물	10
KR4156T200 2023-02 NAVER개별선물	12
KR41BYT100 2023-01 LG이노텍개별선물	11
KR41BYT200 2023-02 LG이노텍개별선물	7
KR41E8T100 2023-01 포스코케미칼개별선물	16
KR41F7T100 2023-01 카카오페이개별선물	11
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.43
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.17

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

287

공시일 2023-01-12

기준일 2023-01-11

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

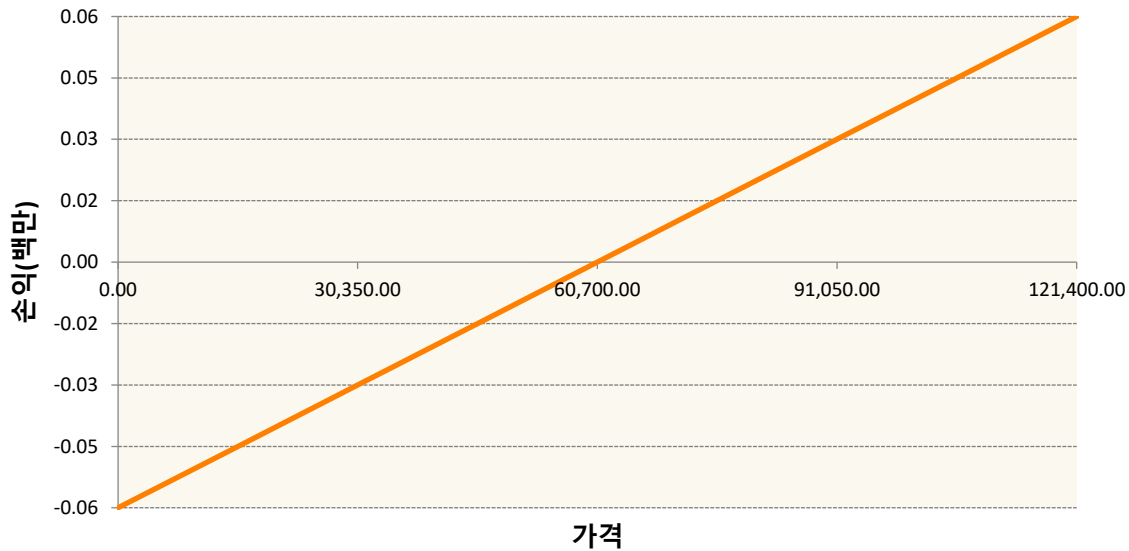
1. 계약금액

(단위:백만원)

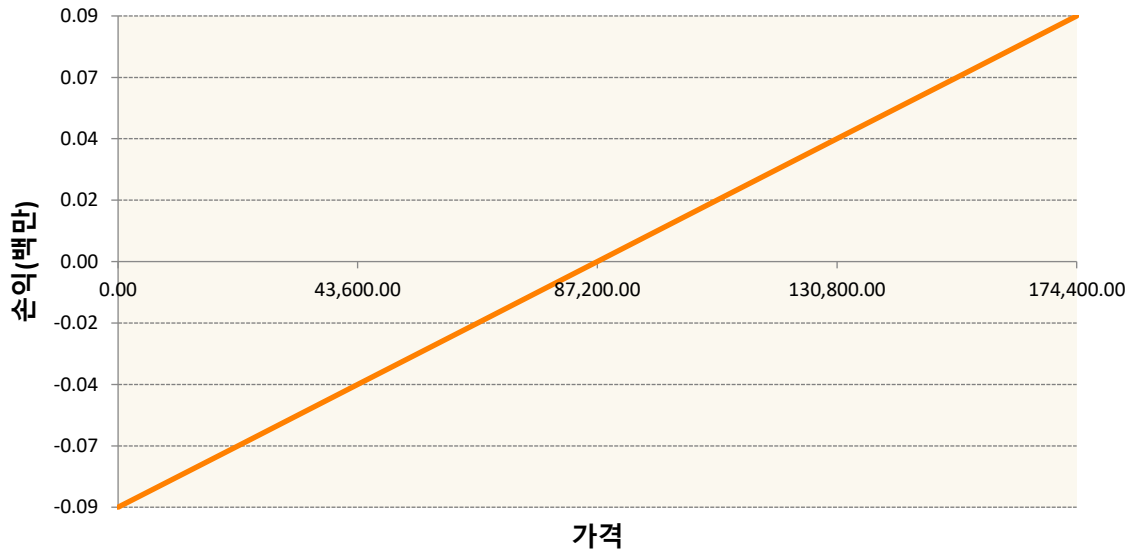
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	149	0	149	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111T10000-2023-01 삼성전자개별선물



KR4150T10008-2023-01 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111T10000		2023-01 삼성전자개별선물					8
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	8	8	8	8	8	8	8
KR4150T10008		2023-01 SK하이닉스개별선물					4
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

15

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

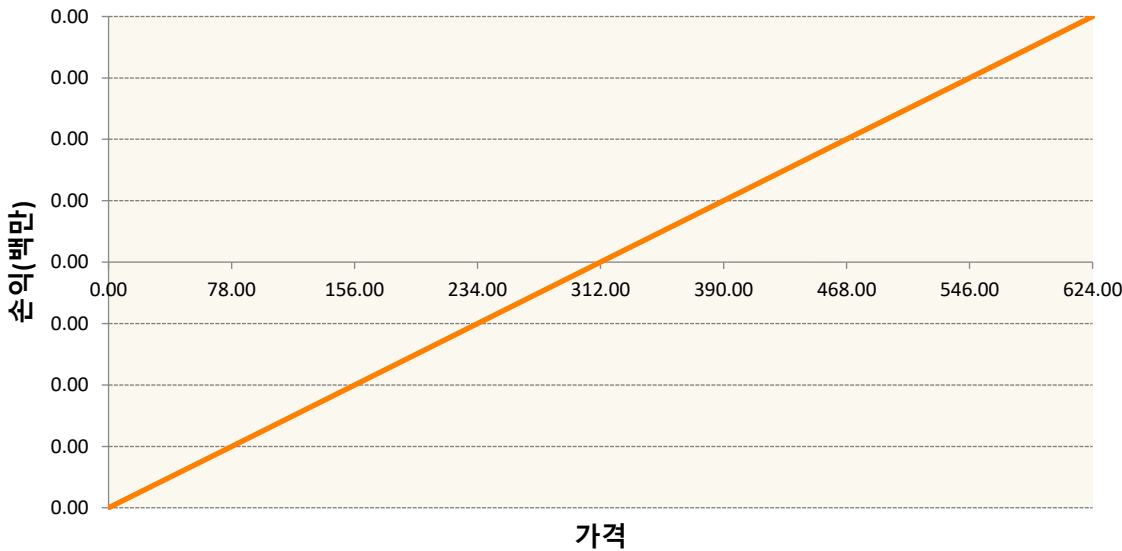
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,794	0	1,794	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T30009-2023-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				143
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	48	48	48	48	48	48	48
5.33%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	143	143	143	143	143	143	143

공시일 2023-01-12

기준일 2023-01-11

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

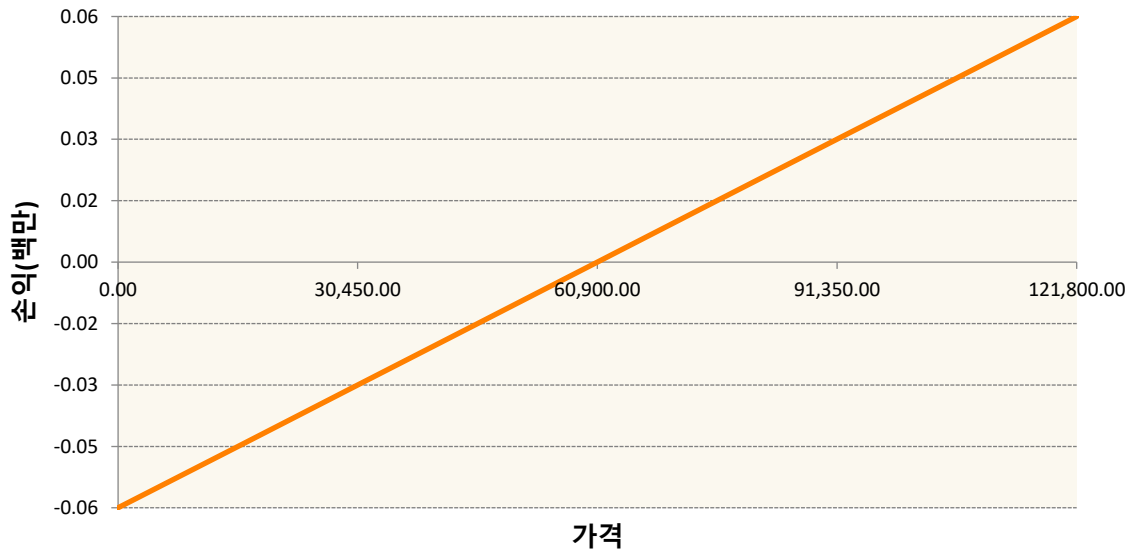
1. 계약금액

(단위:백만원)

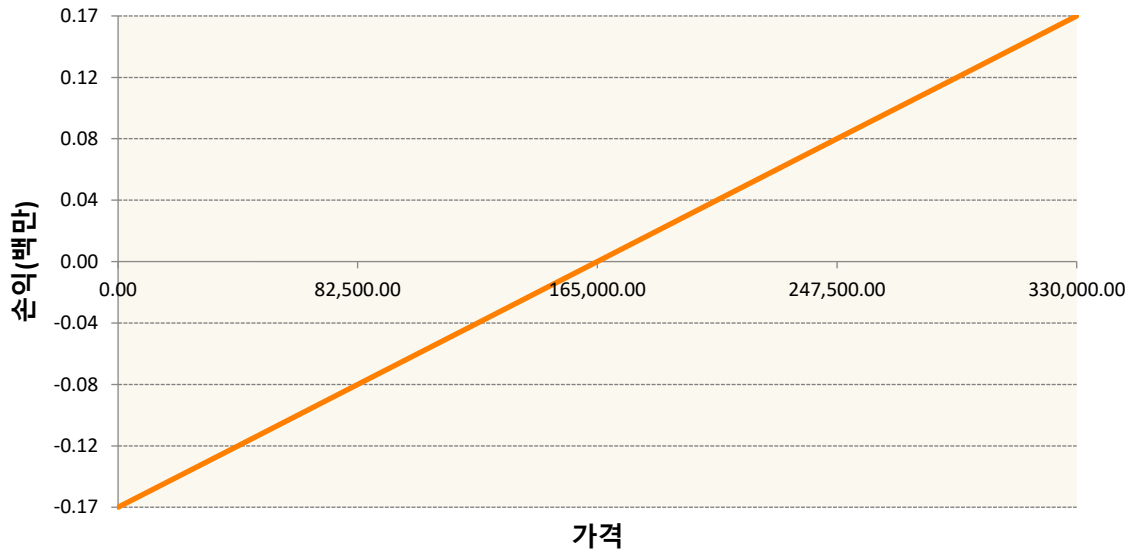
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	168	0	168	장내
누계	유가증권	선물	229	0	229	장내

2. 만기시점의 손익구조

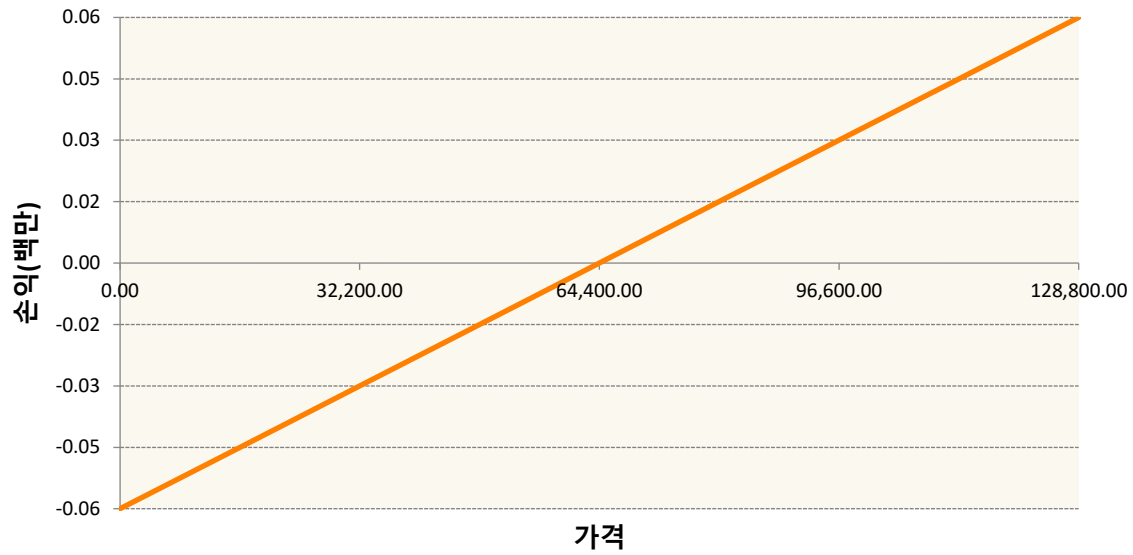
KR4111T20009-2023-02 삼성전자개별선물



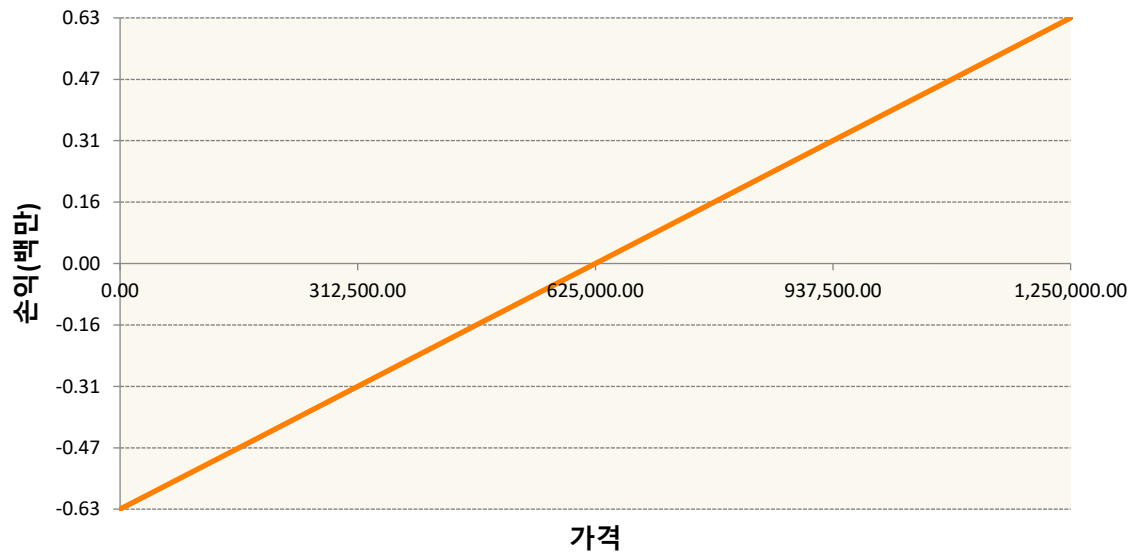
KR4116T20008-2023-02 현대차개별선물



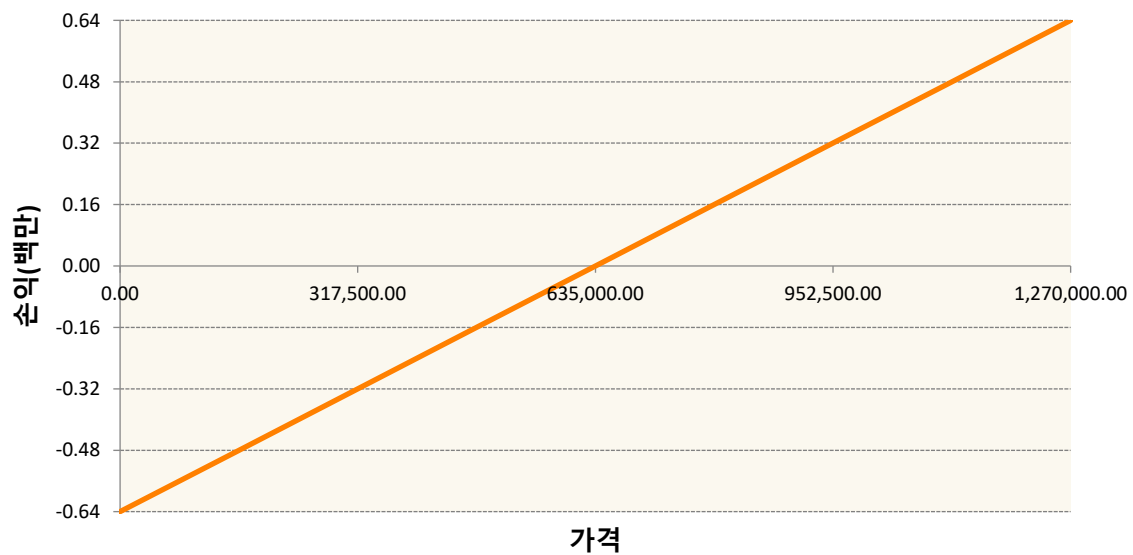
KR4119T20002-2023-02 기아개별선물



KR4122T20006-2023-02 삼성SDI개별선물



KR4147T20003-2023-02 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4116T20008 2023-02 현대차개별선물							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
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
KR4119T20002 2023-02 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
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
KR4122T20006 2023-02 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
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-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%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
KR4147T20003 2023-02 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
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-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%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

공시일 2023-01-12

기준일 2023-01-11

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

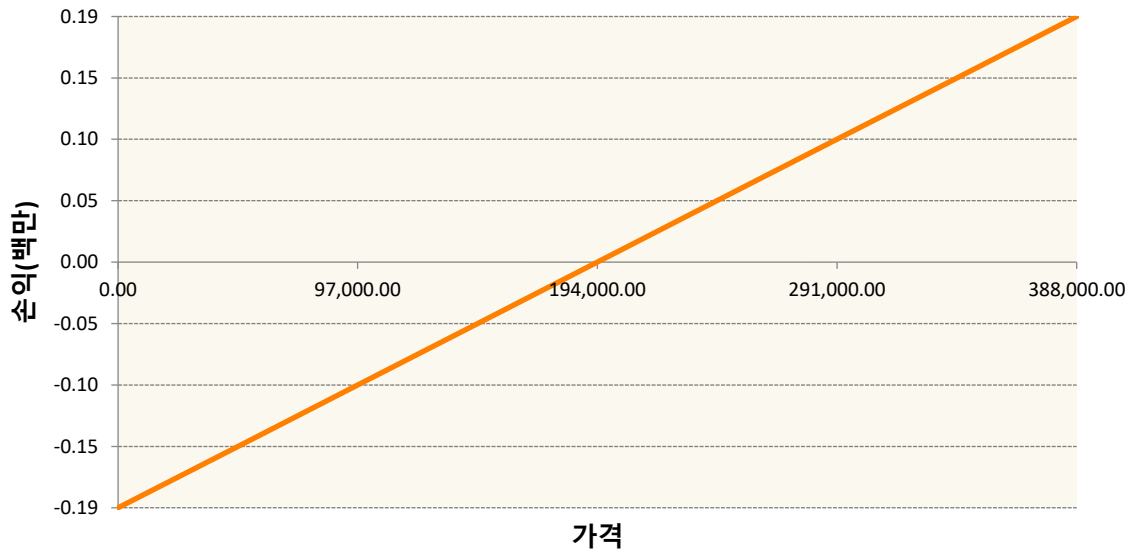
1. 계약금액

(단위:백만원)

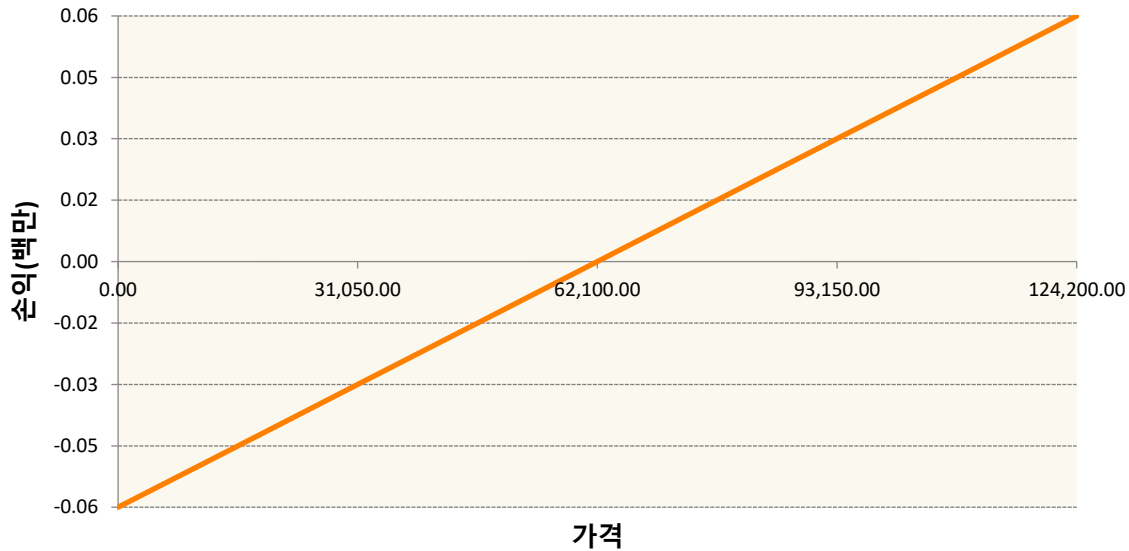
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	124	0	124	장내

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
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-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%	4	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5	5

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

8

공시일	2023-01-12
기준일	2023-01-11

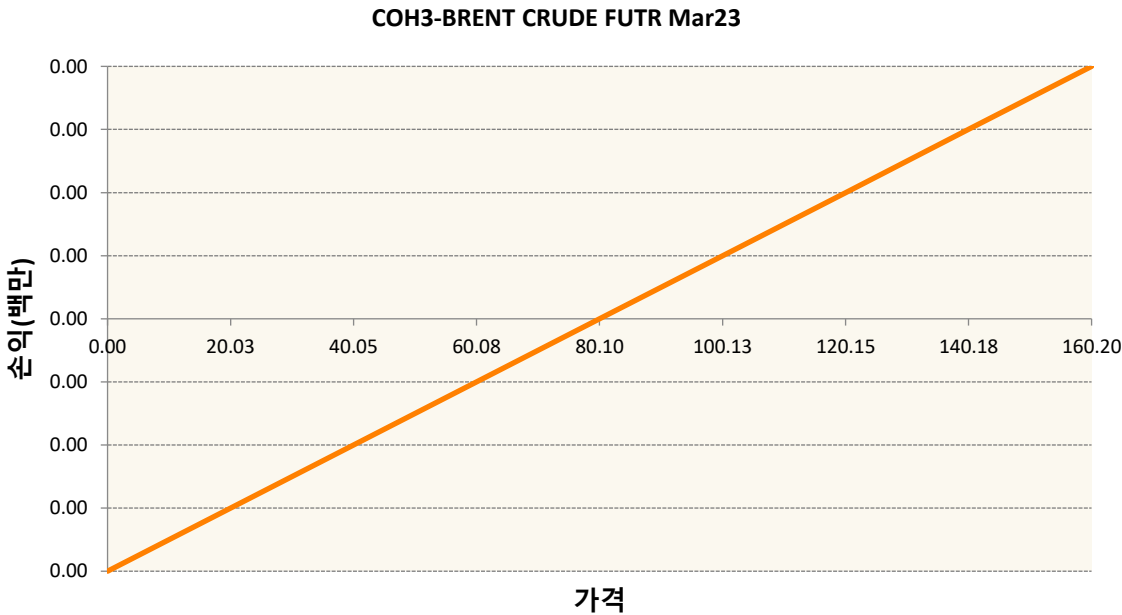
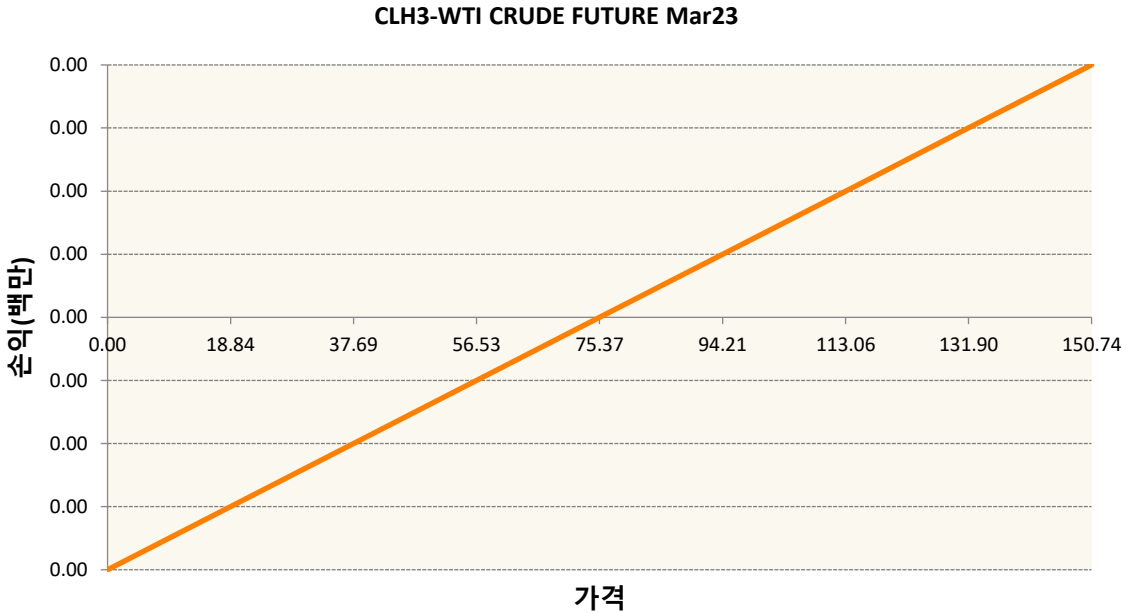
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

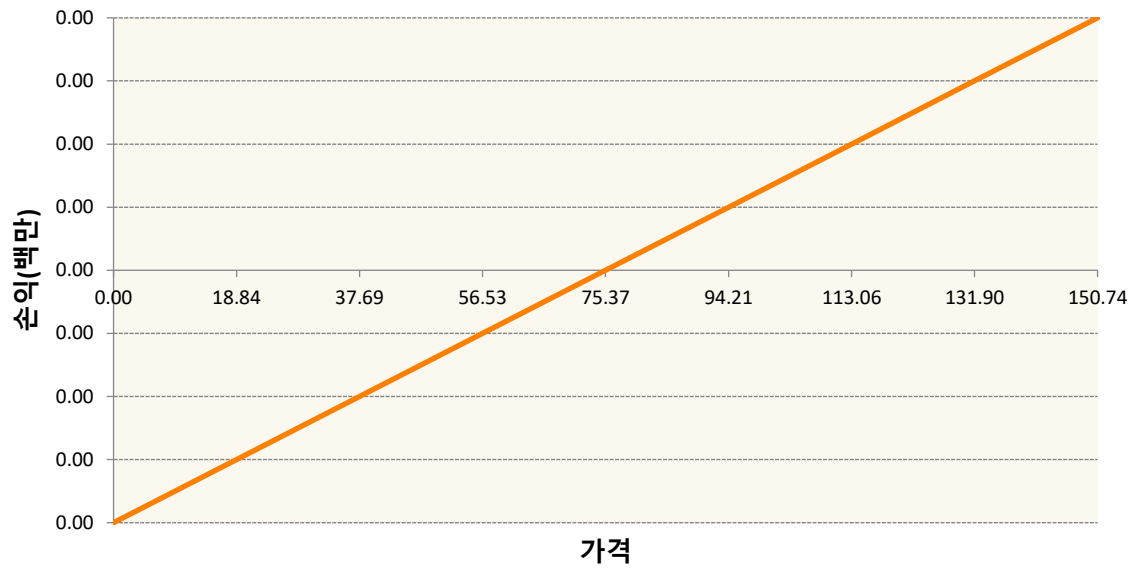
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,754	212	1,543	

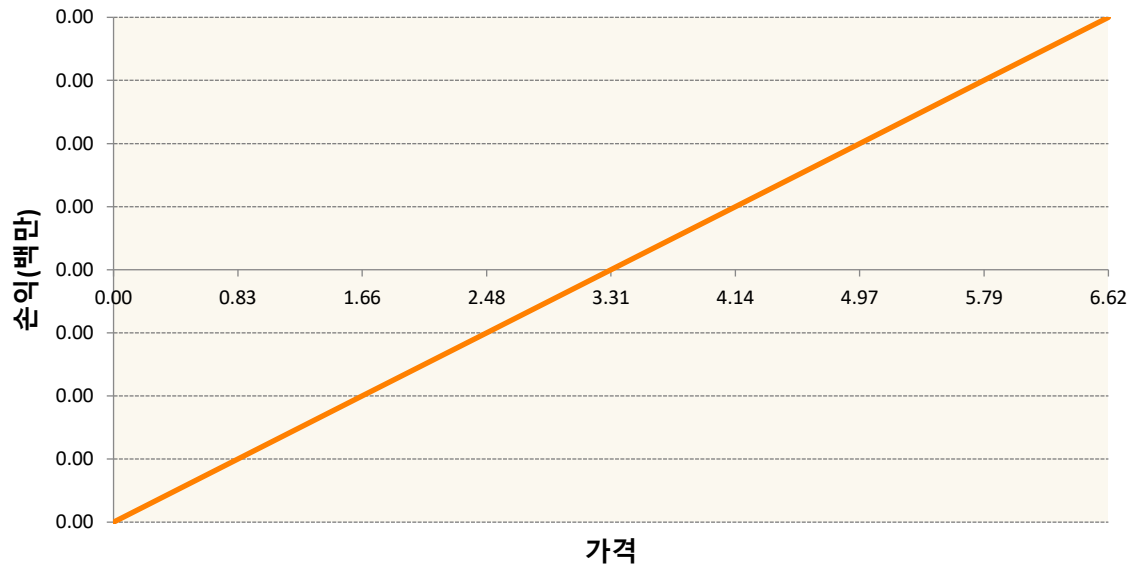
2. 만기시점의 손익구조



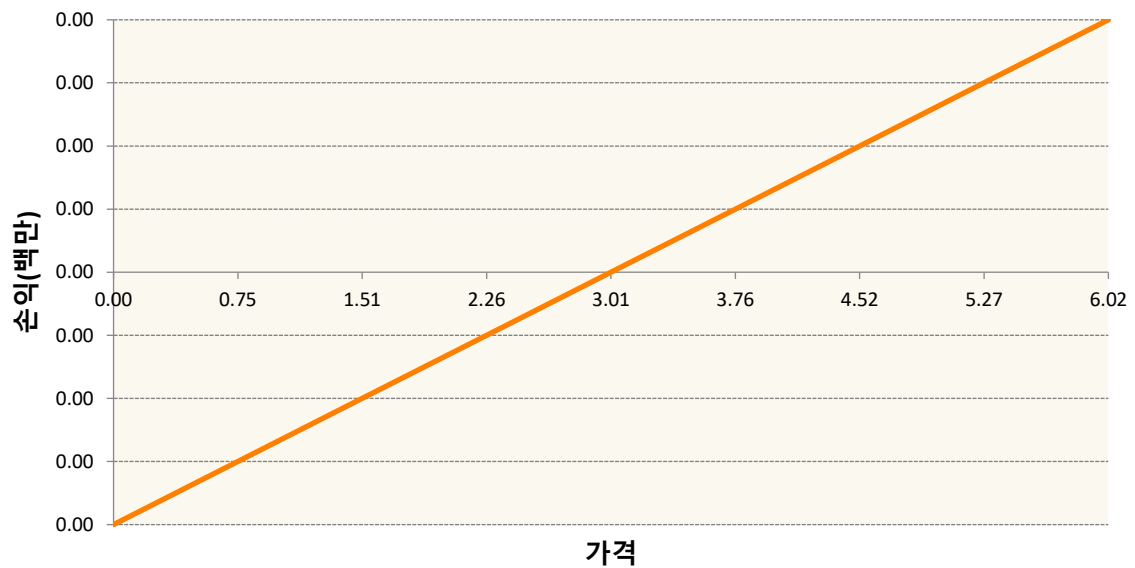
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



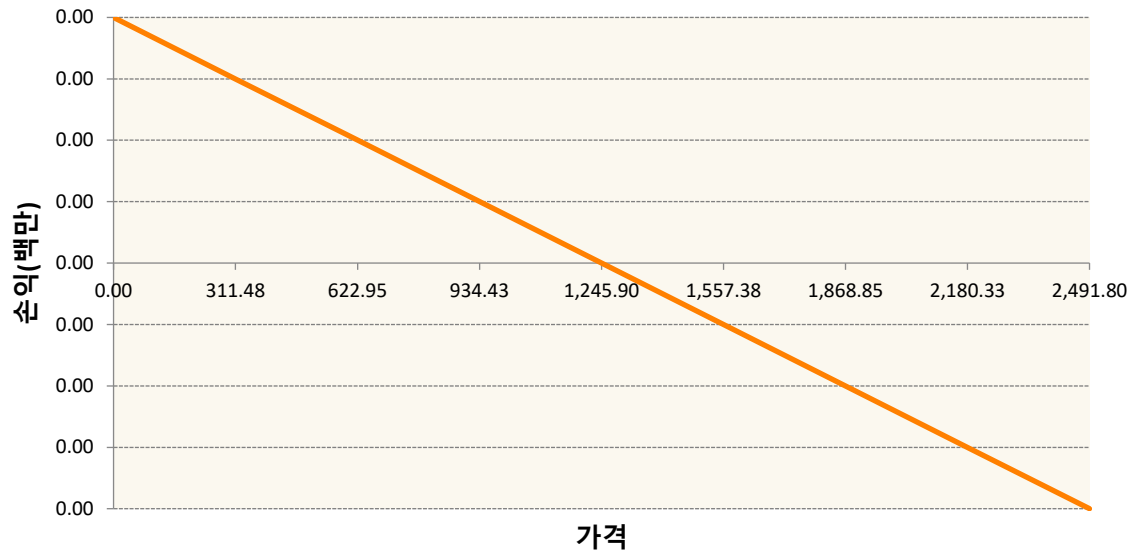
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



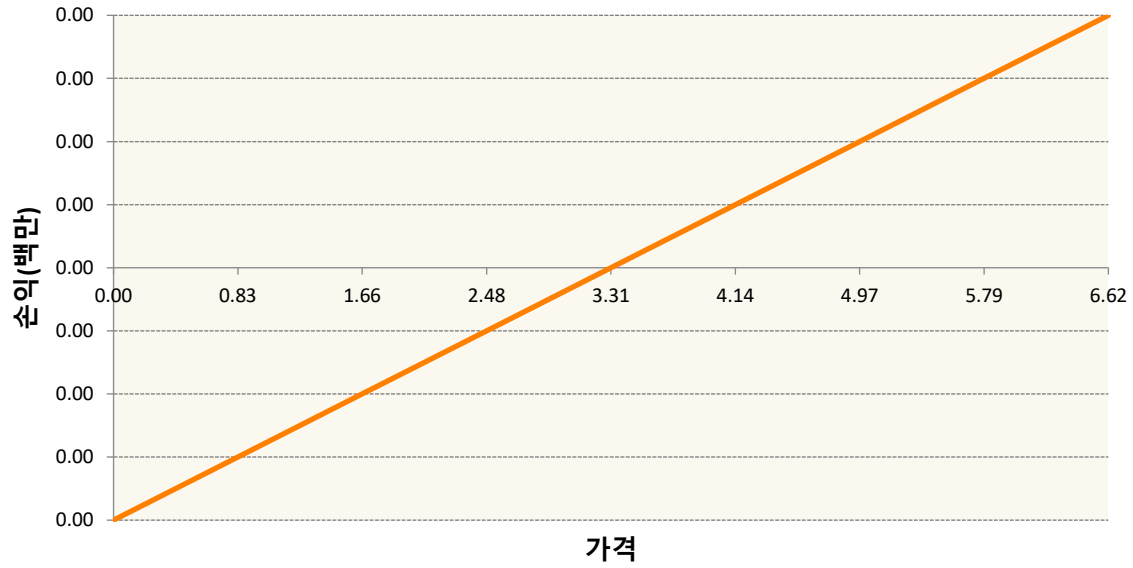
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



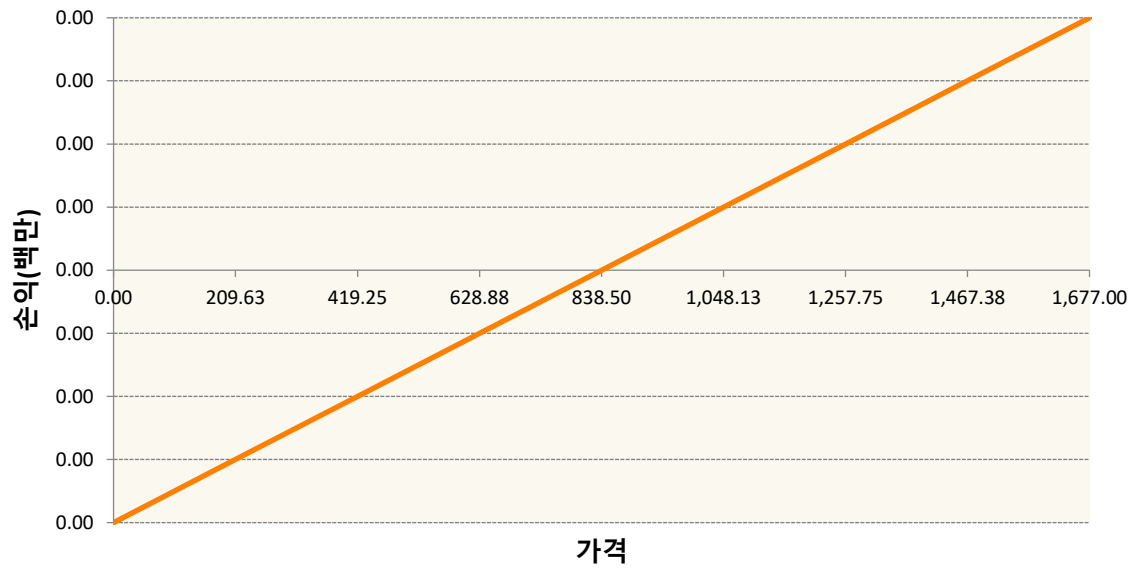
KR4175T10005-2023-01 달러선물

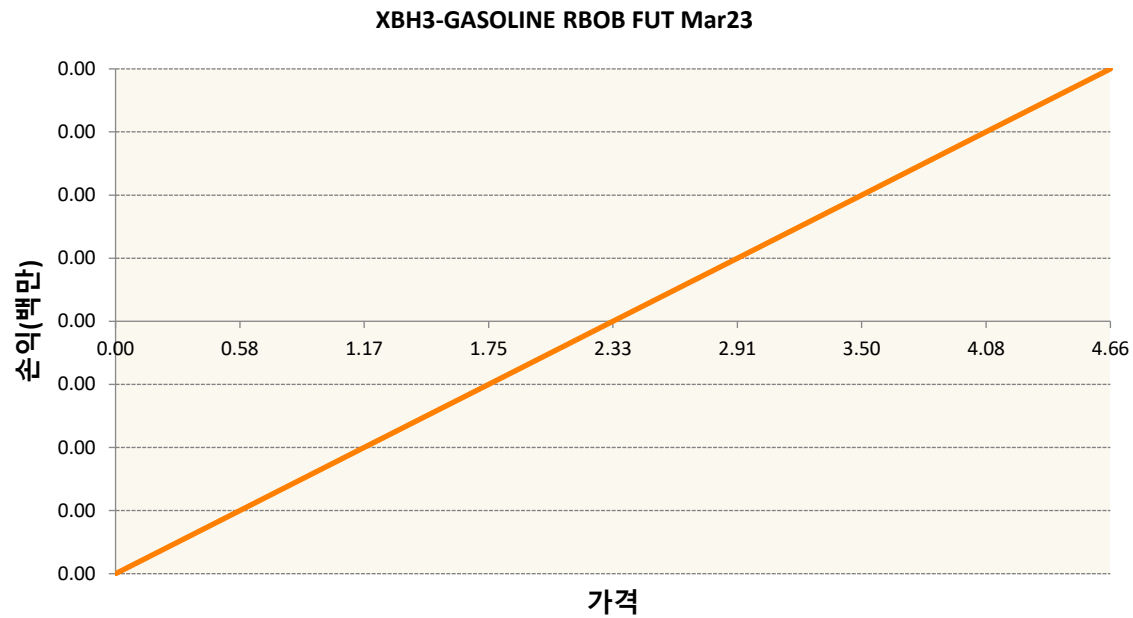


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	24
COH3	BRENT CRUDE FUTR Mar23	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	32
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	17
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	452