

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

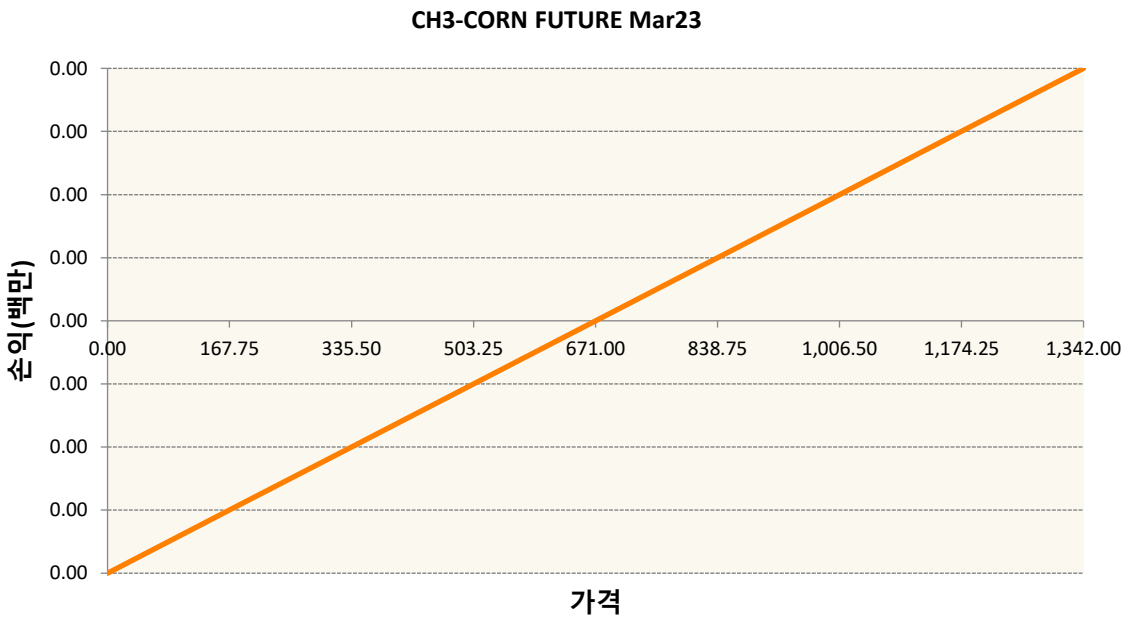
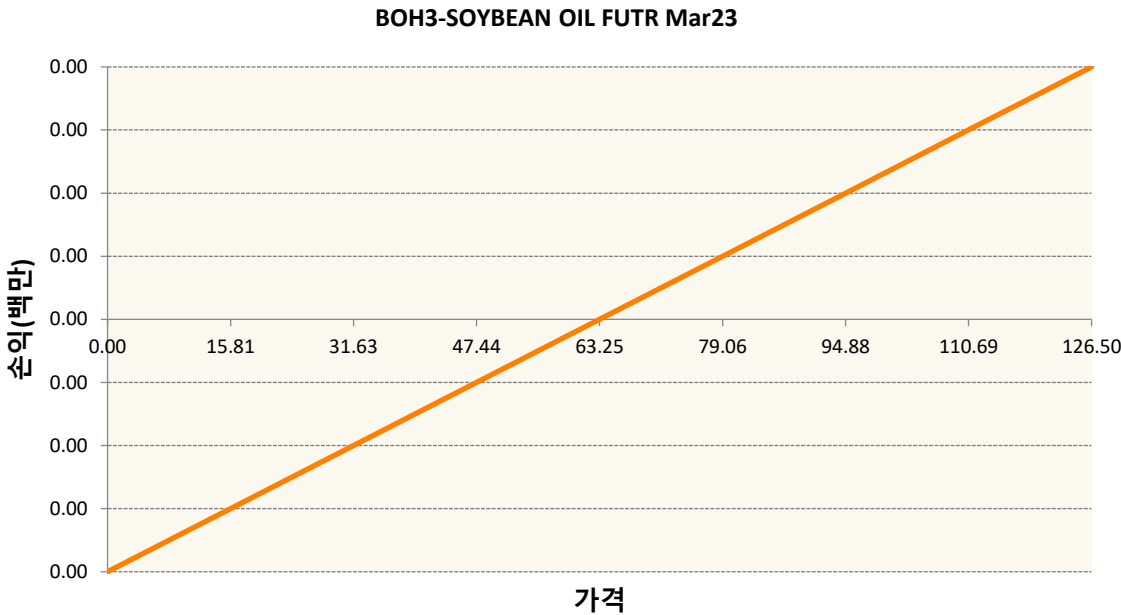
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

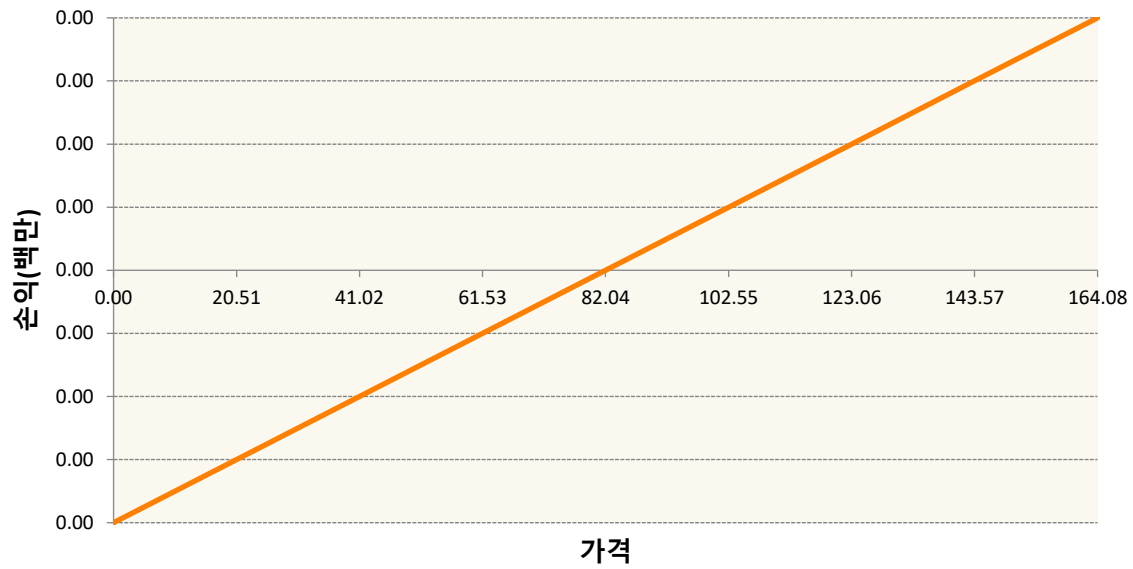
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,530	496	6,034	

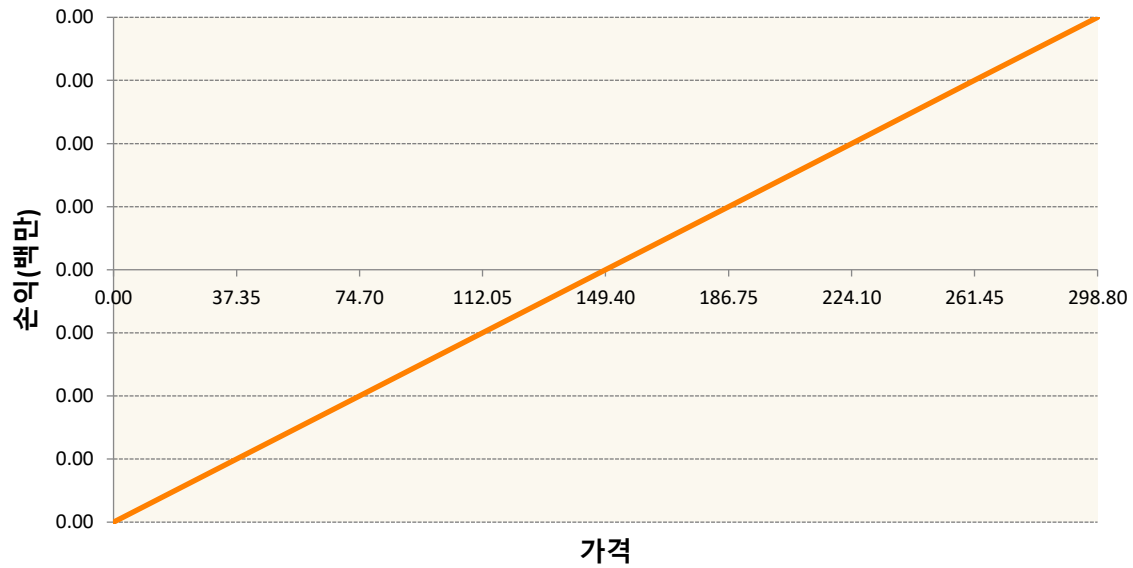
2. 만기시점의 손익구조



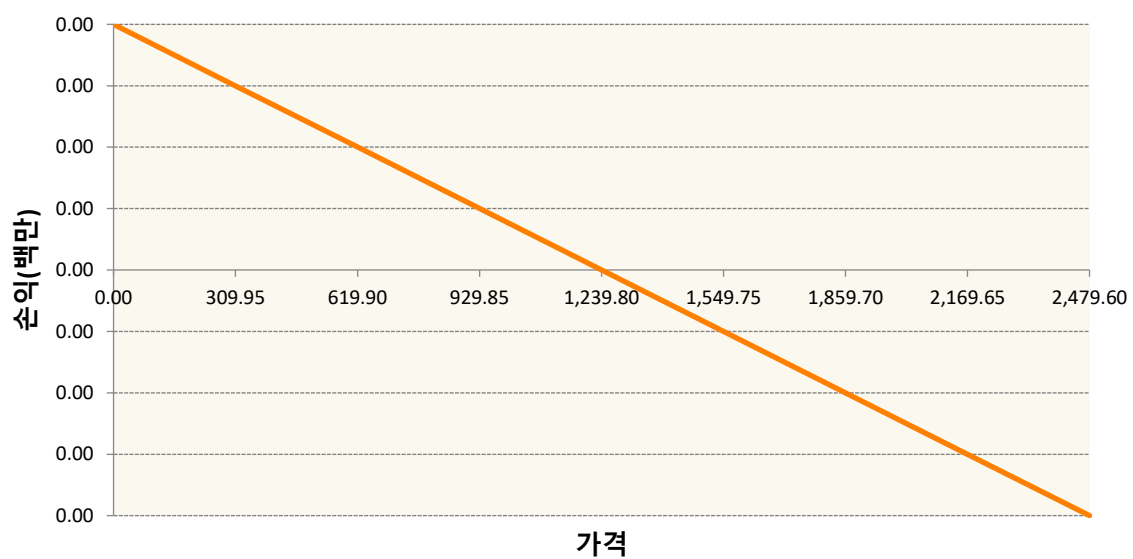
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



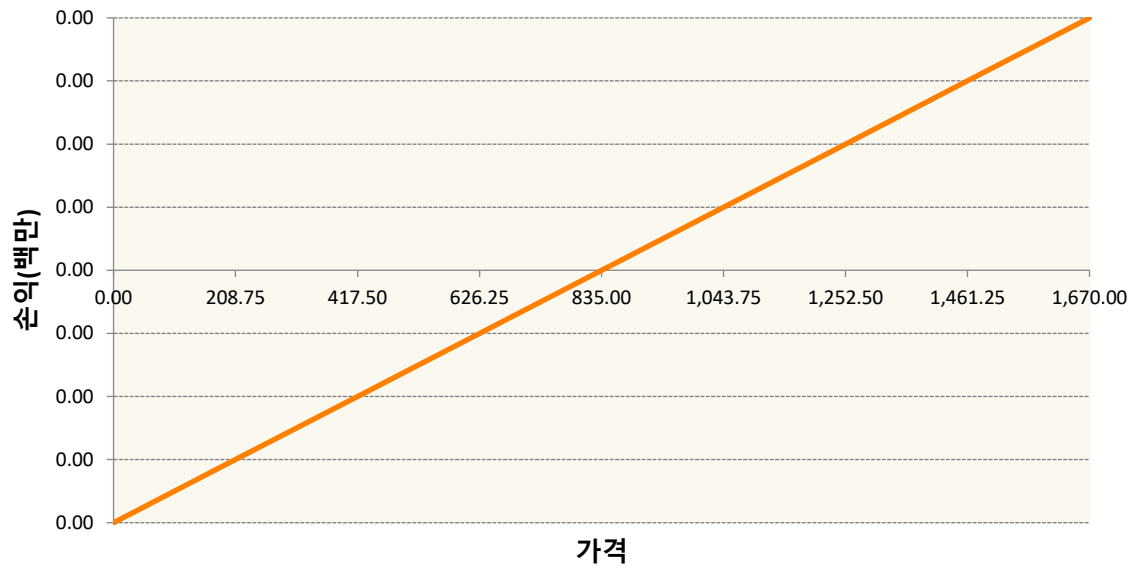
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



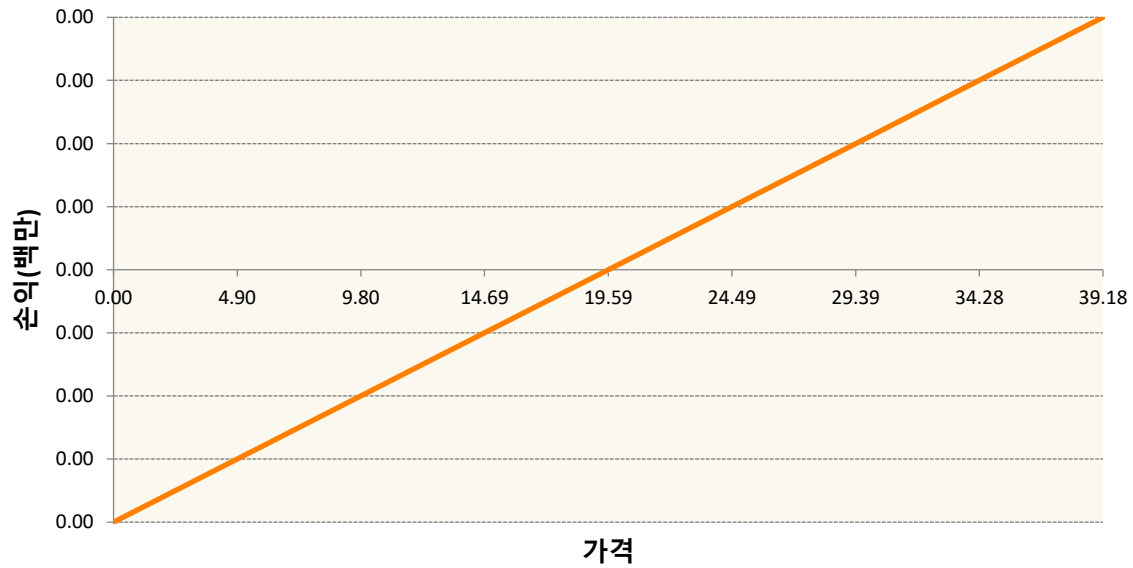
KR4175T20004-2023-02 달러선물



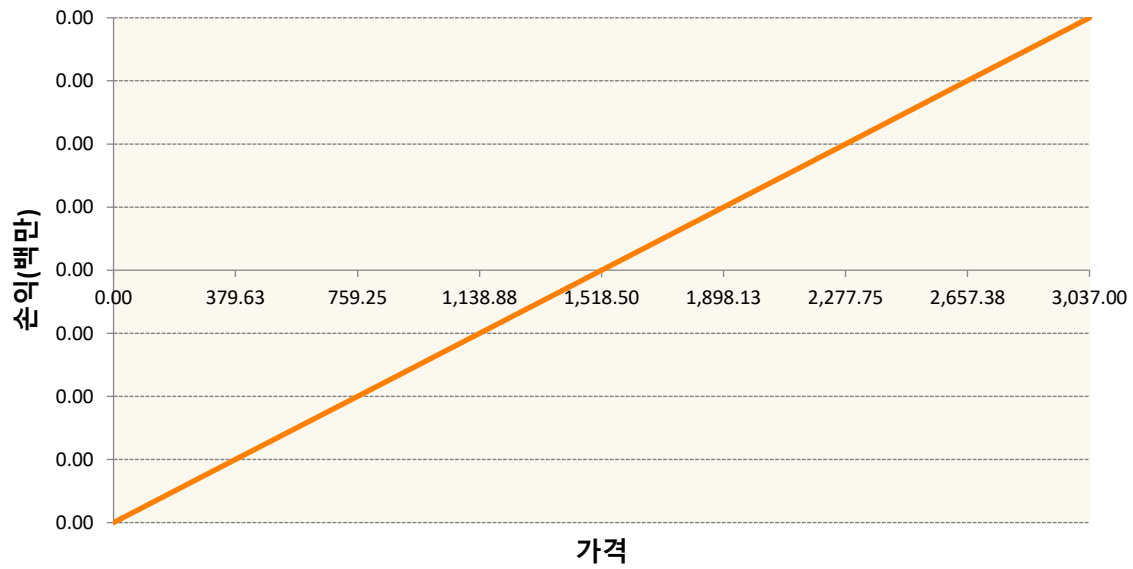
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



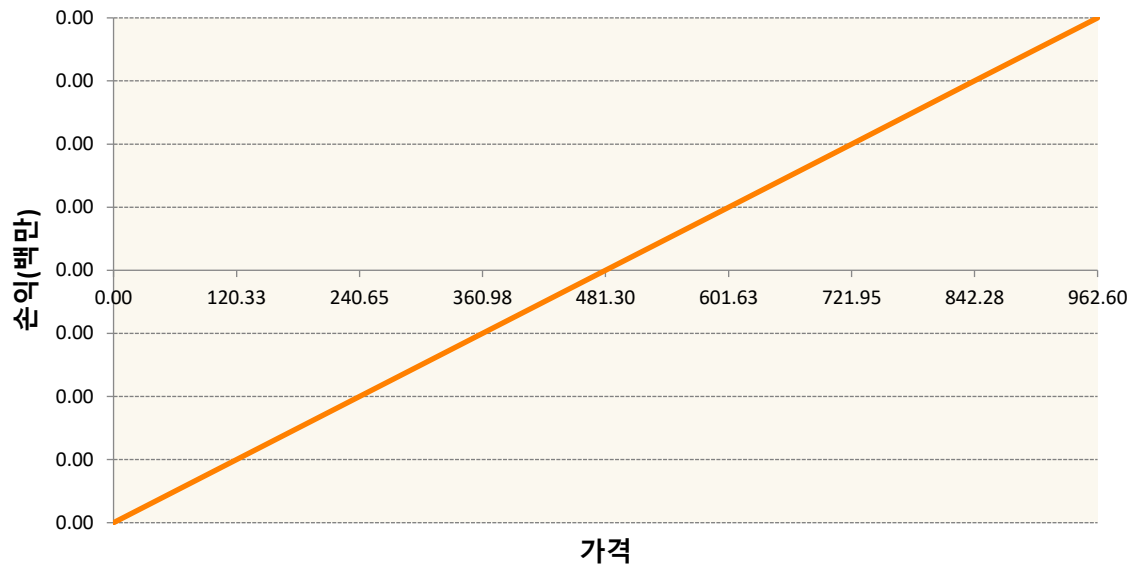
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



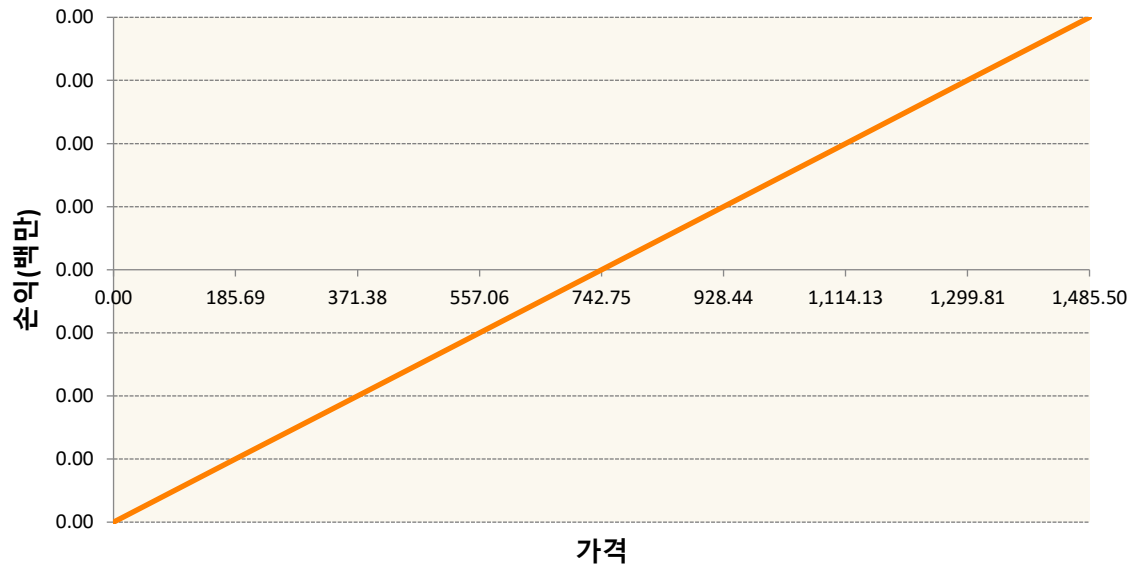
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



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	2023-01-16
기준일	2023-01-13

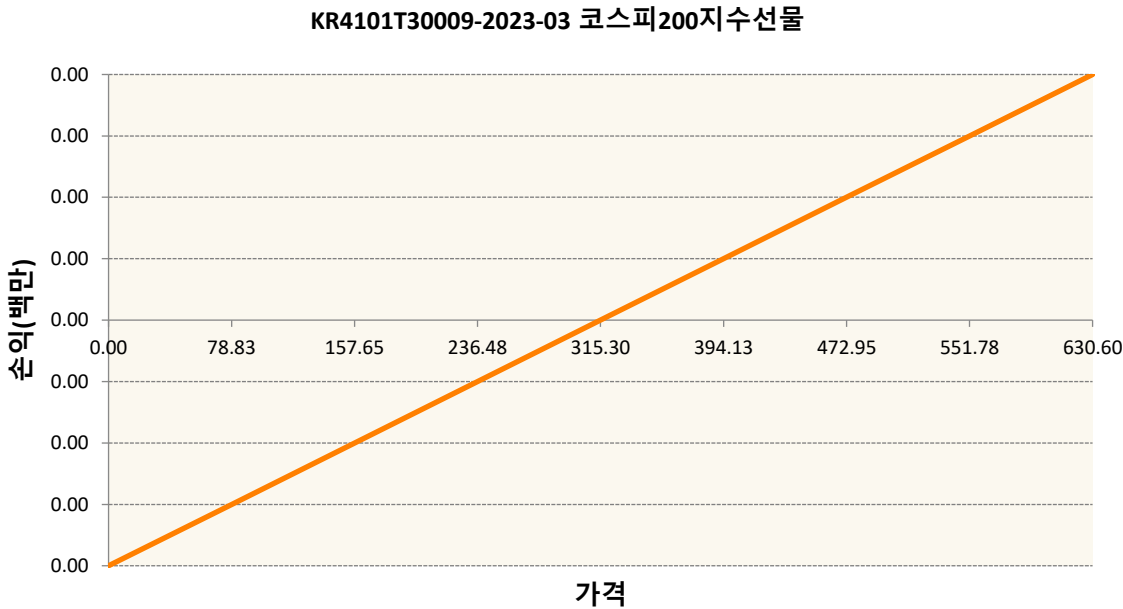
스마트인덱스모

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	1,971	0	1,971	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-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%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	157	157	157	157	157	157	157

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

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	2023-01-16
기준일	2023-01-13

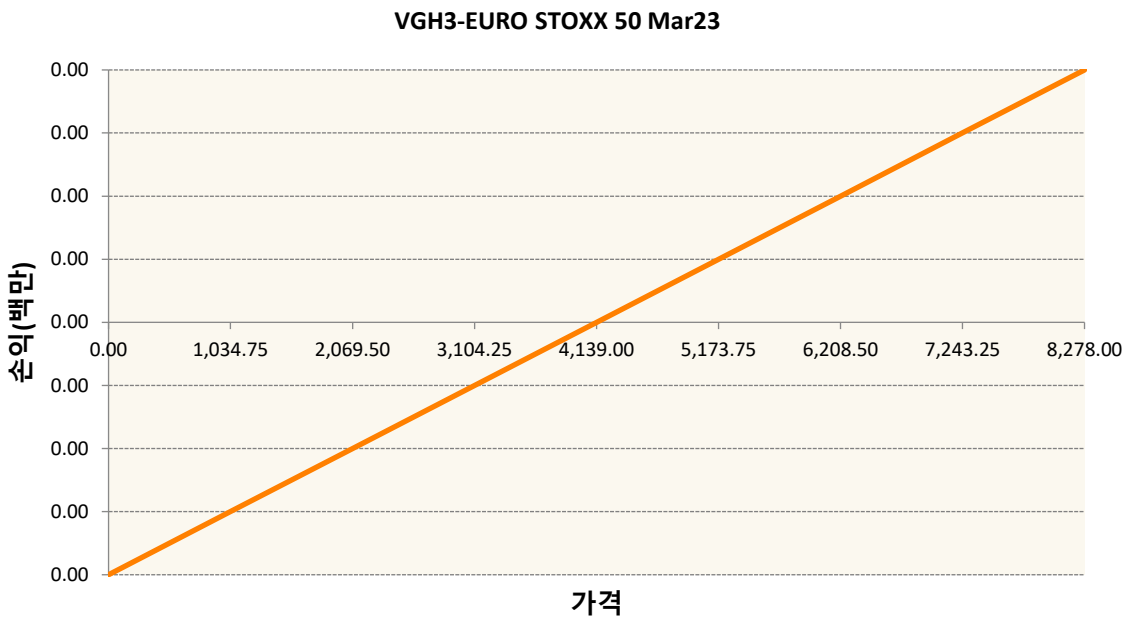
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	573	0	573	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH3	EURO STOXX 50 Mar23	46
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

49

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

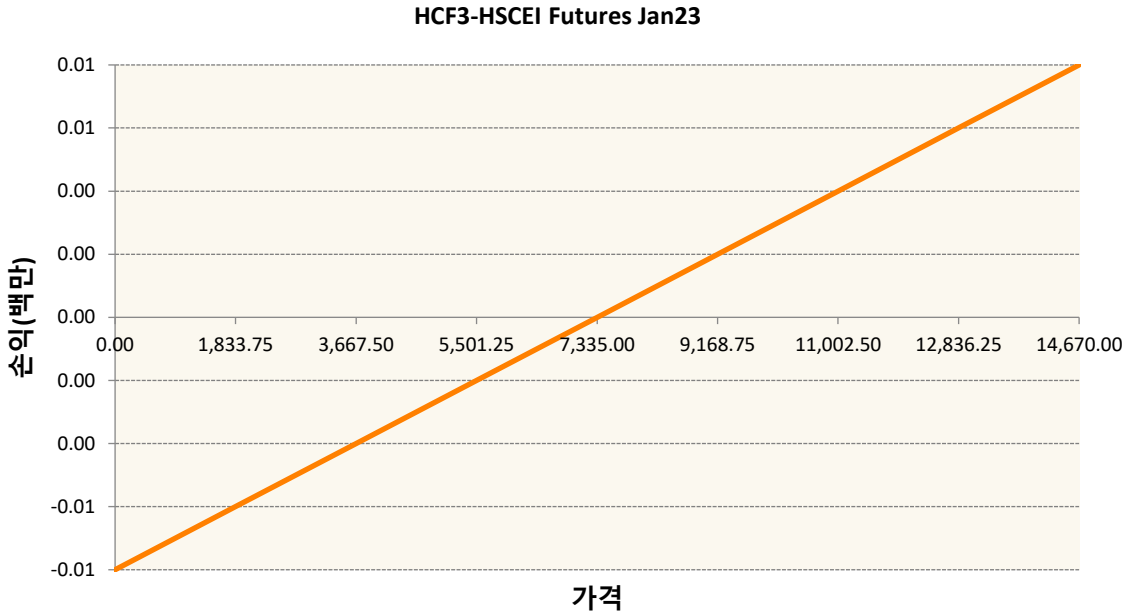
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,664	0	1,664	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	2023-01-16
기준일	2023-01-13

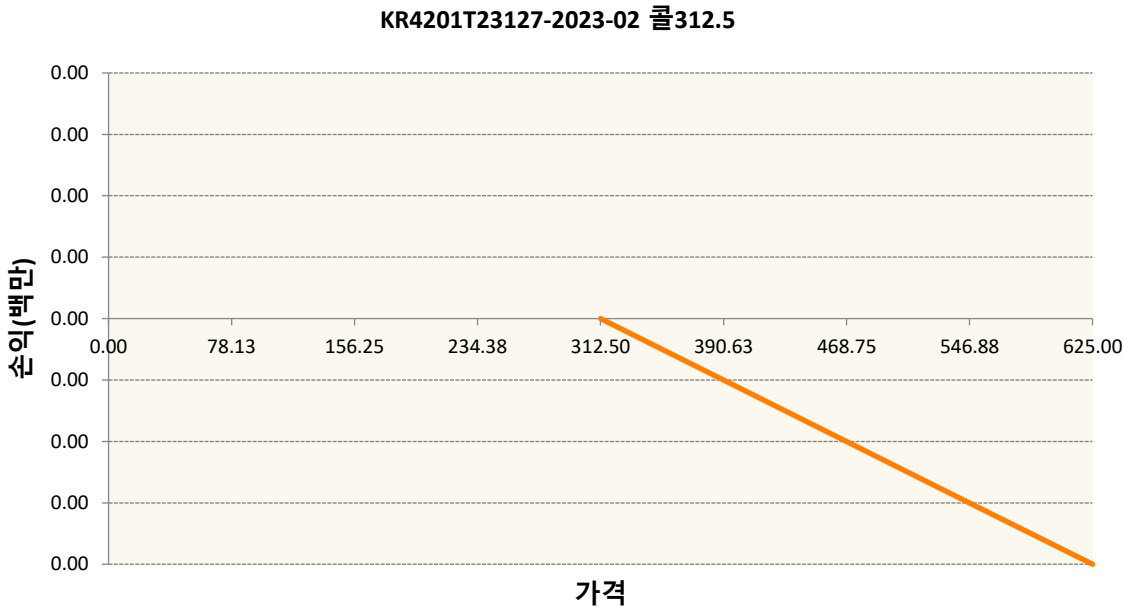
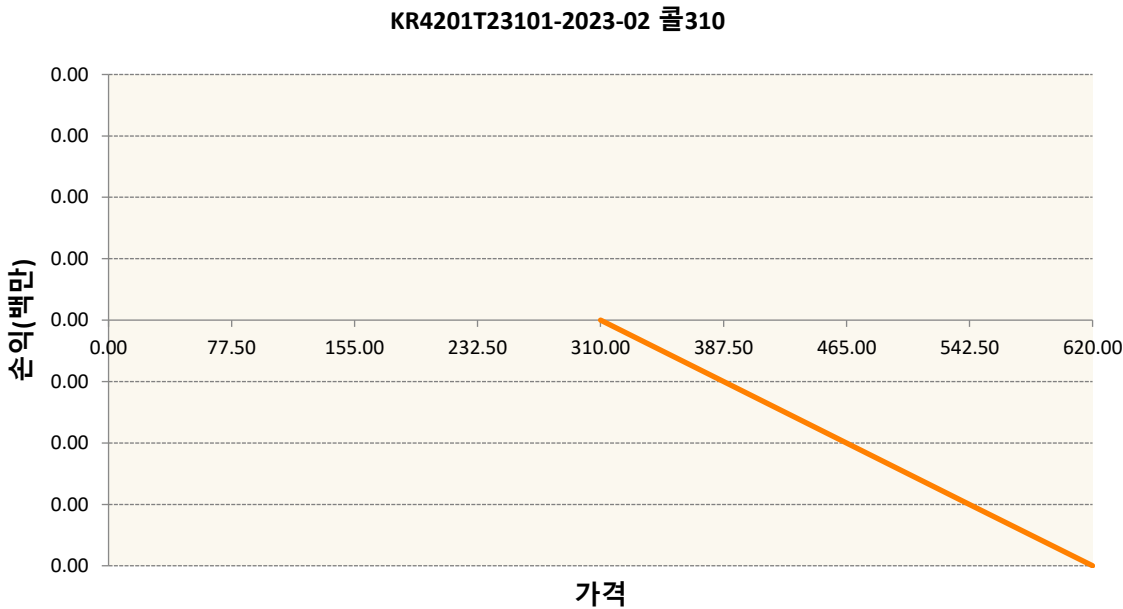
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	21,101	-21,101	장내
누계	유가증권	옵션	0	55,384	-55,384	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph displays a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 620.00 with major ticks every 77.50 units. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A single orange line is plotted, starting at the origin (0, 0) and ending at (310, 0). This indicates that the profit is zero for all prices in the range from 0 to 310.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
77.50	0.00
155.00	0.00
232.50	0.00
310.00	0.00

The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions). The blue line represents the profit function, which starts at the origin (0, 0) and increases linearly to a maximum profit of 0.00 million at a price of 312.50. The area under the curve is shaded light blue.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
78.13	0.00
156.25	0.00
234.38	0.00
312.50	0.00
390.63	0.00
468.75	0.00
546.88	0.00
625.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201T23101		2023-02 콜310					2,299
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,648	1,522	1,391	1,257	1,120	981	839
-5.33%	1,354	1,208	1,060	911	761	610	459
-2.67%	965	808	650	492	334	176	18
0%	480	320	160	0	-160	-320	-480
2.67%	-99	-252	-406	-562	-719	-877	-1,035
5.33%	-761	-900	-1,043	-1,189	-1,339	-1,490	-1,643
8.00%	-1,495	-1,615	-1,742	-1,875	-2,013	-2,154	-2,299
KR4201T23127		2023-02 콜312.5					706
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	492	454	415	374	332	289	246
-5.33%	408	363	318	272	226	179	132
-2.67%	295	246	197	147	98	49	-1
0%	152	101	51	0	-51	-101	-151
2.67%	-21	-70	-120	-170	-220	-270	-320
5.33%	-221	-266	-312	-360	-408	-456	-505
8.00%	-444	-484	-526	-569	-614	-660	-706
KR4301T23109 2023-02 풋310							276

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-162	-180	-199	-218	-237	-257	-276
-5.33%	-72	-93	-114	-135	-156	-177	-199
-2.67%	4	-18	-40	-62	-84	-107	-129
0%	68	45	23	0	-23	-45	-68
2.67%	118	96	74	52	30	8	-14
5.33%	156	136	116	96	75	53	32
8.00%	184	167	149	130	111	91	71

KR4301T23125 2023-02 풋312.5							284
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-173	-190	-208	-226	-245	-265	-284
-5.33%	-80	-100	-120	-141	-162	-183	-204
-2.67%	1	-21	-43	-65	-87	-110	-132
0%	68	45	23	0	-23	-45	-68
2.67%	122	100	78	55	33	10	-12
5.33%	164	143	123	101	80	58	36
8.00%	195	177	158	139	119	98	77

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

(단위:백만원)

2,921

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

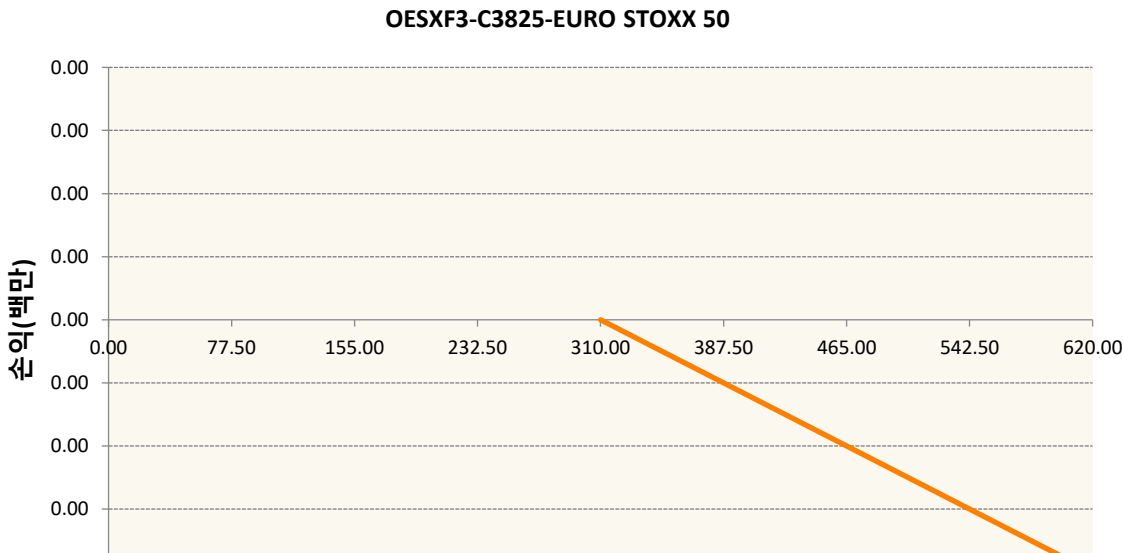
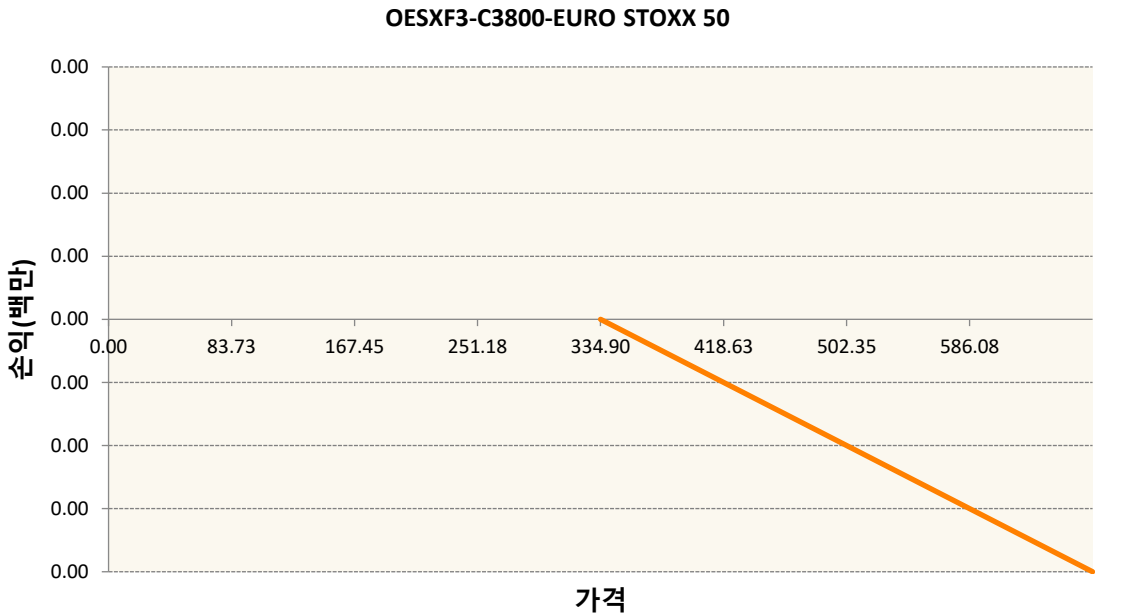
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

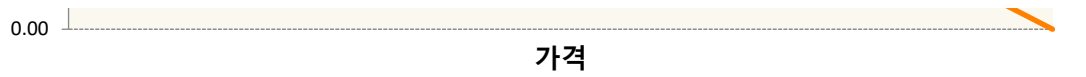
1. 계약금액

(단위:백만원)

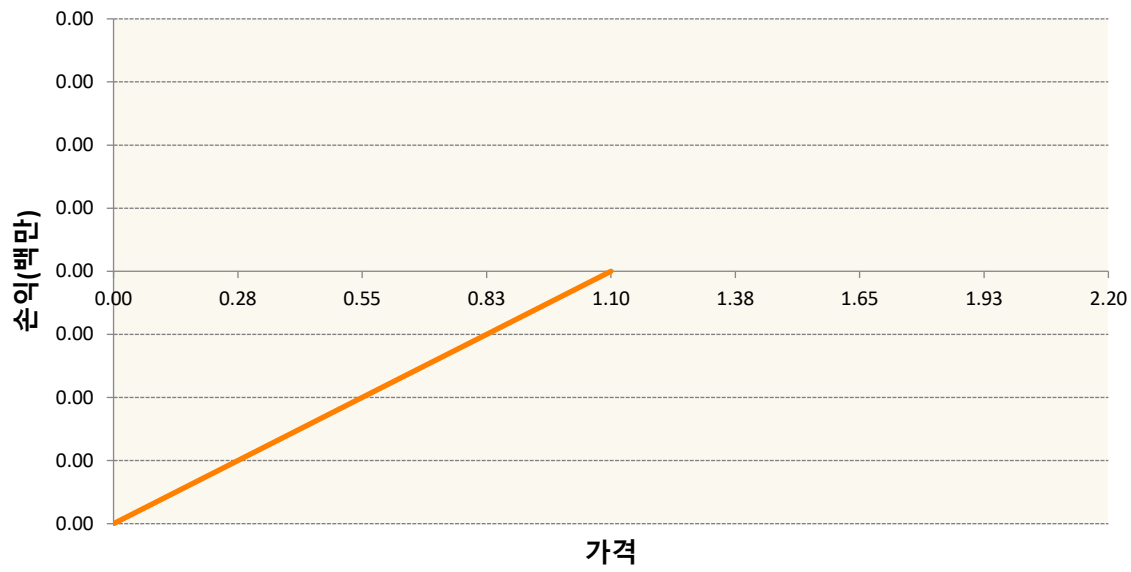
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,148	0	1,148	
누계	유가증권	옵션	0	179	-179	장내
누계	통화	선도	337	2,222	-1,885	장외

2. 만기시점의 손익구조

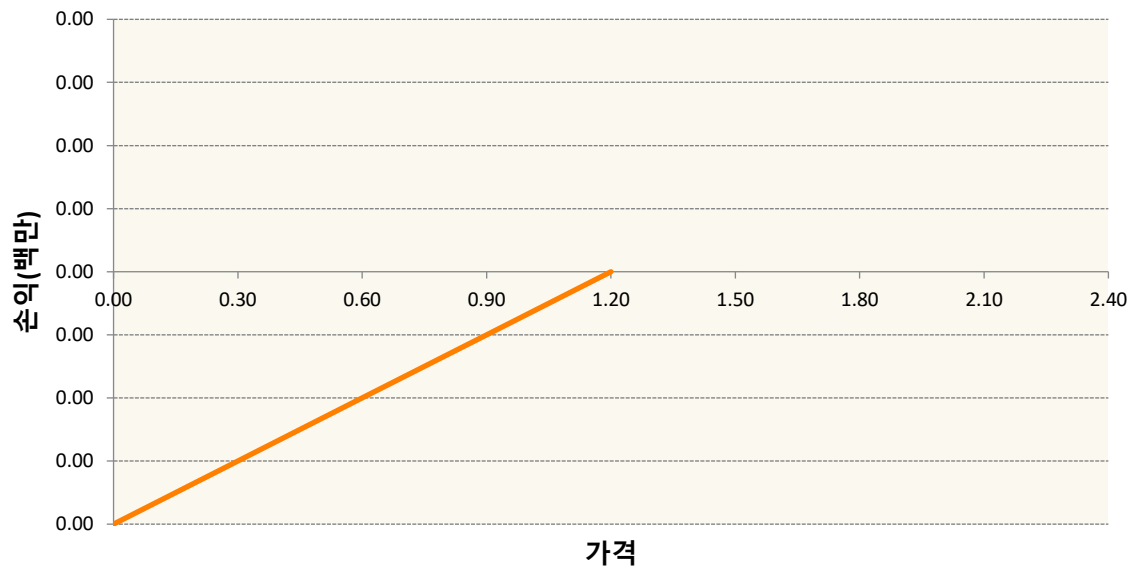




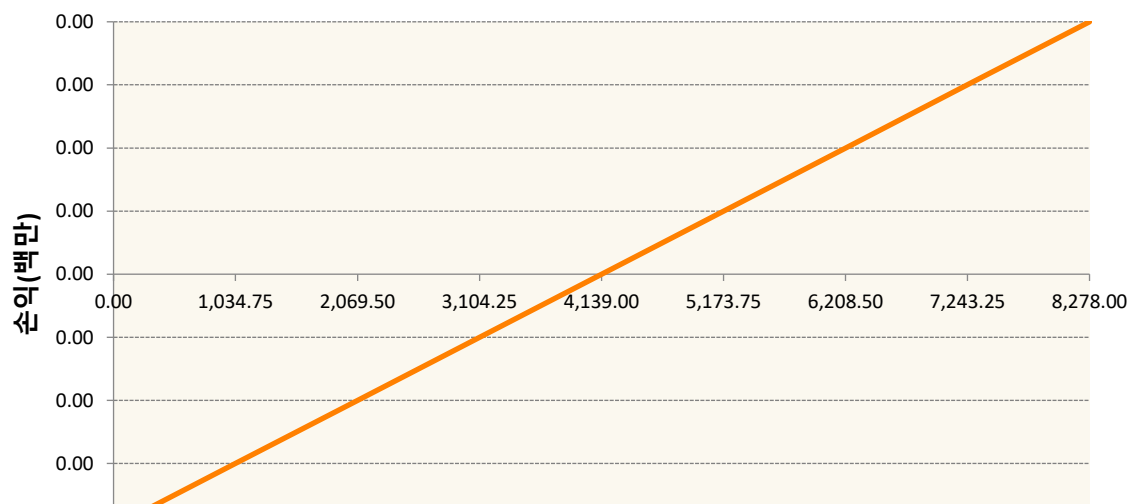
OESXF3-P3800-EURO STOXX 50



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		12
OESXF3-C38 EURO STOXX 50		2
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		0.03
OESXF3-P38(EURO STOXX 50		0.01
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		92

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	268

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

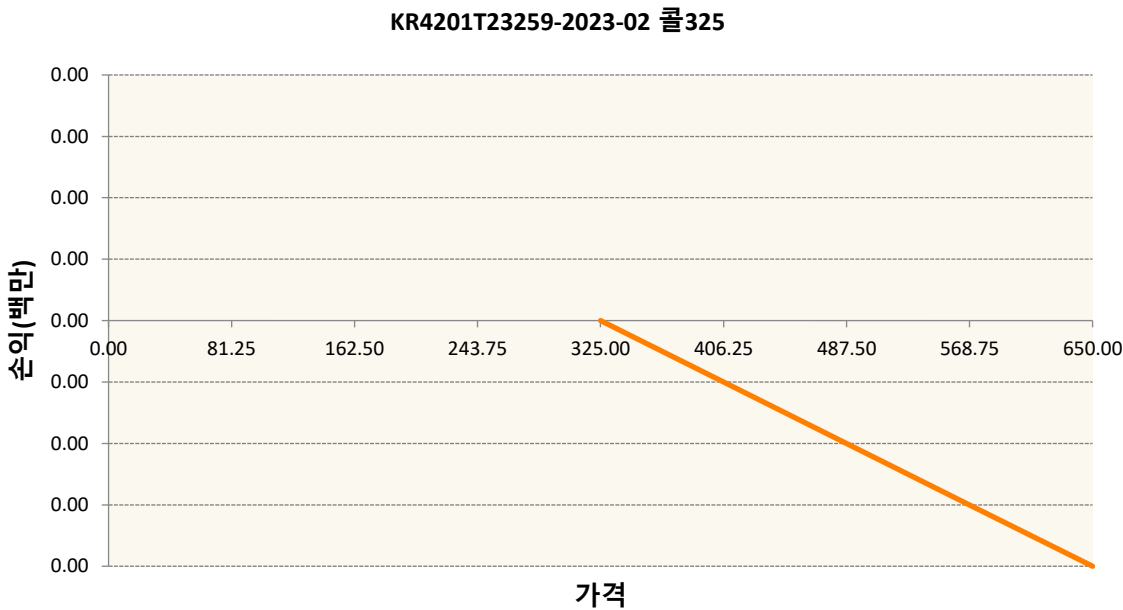
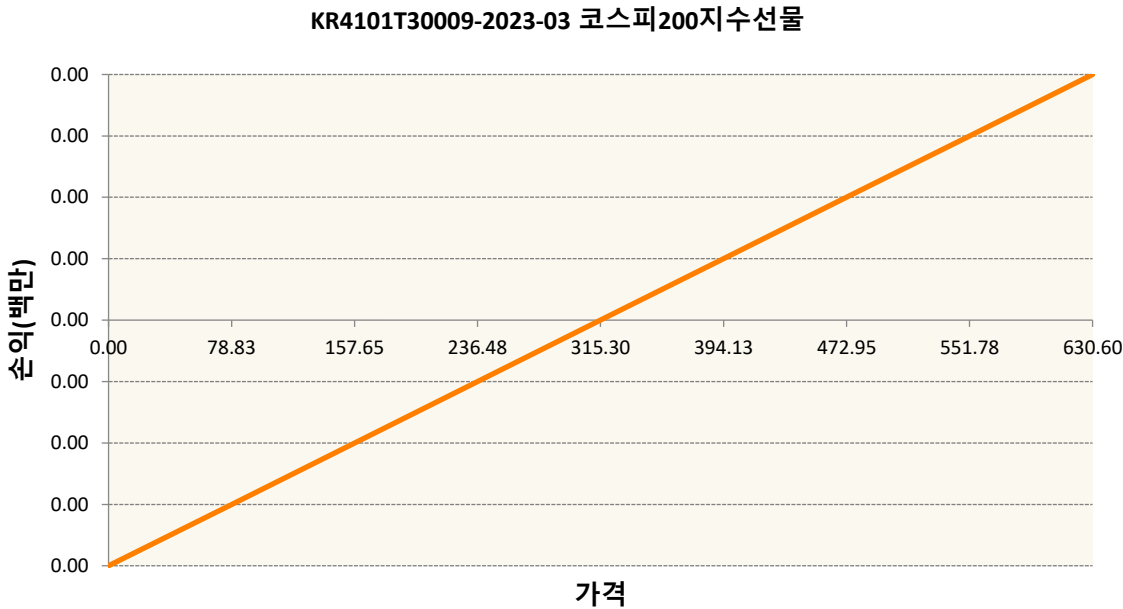
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

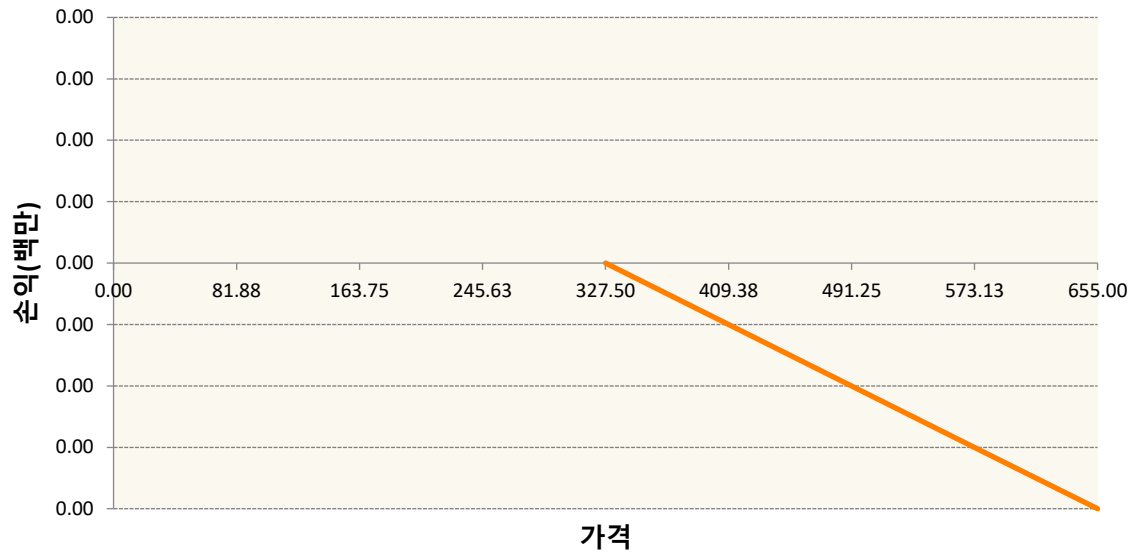
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	897	899	-2	장내
누계	유가증권	선물	394	0	394	장내
누계	유가증권	옵션	156	3,915	-3,759	장내

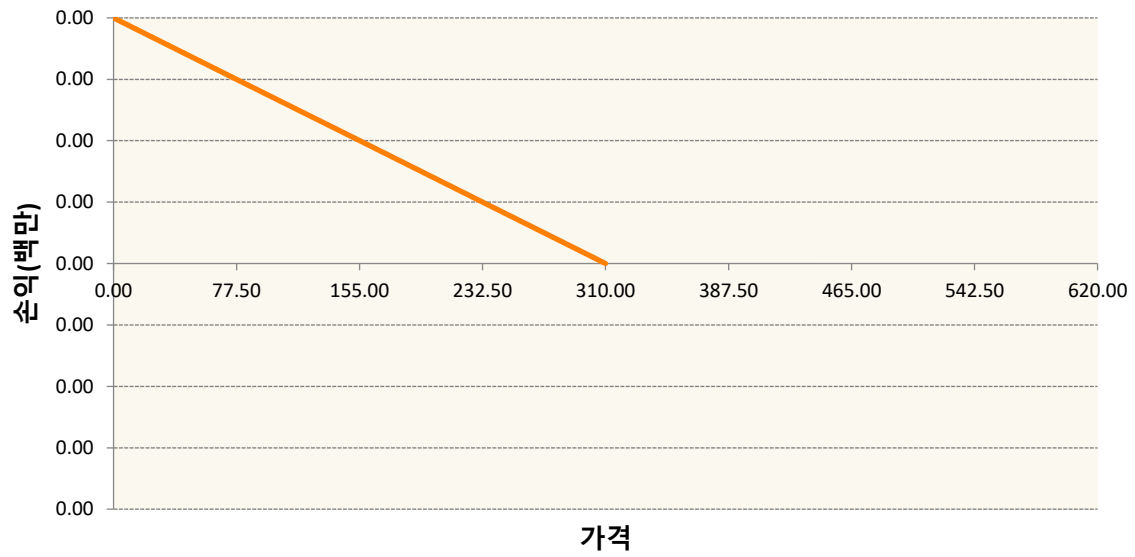
2. 만기시점의 손익구조



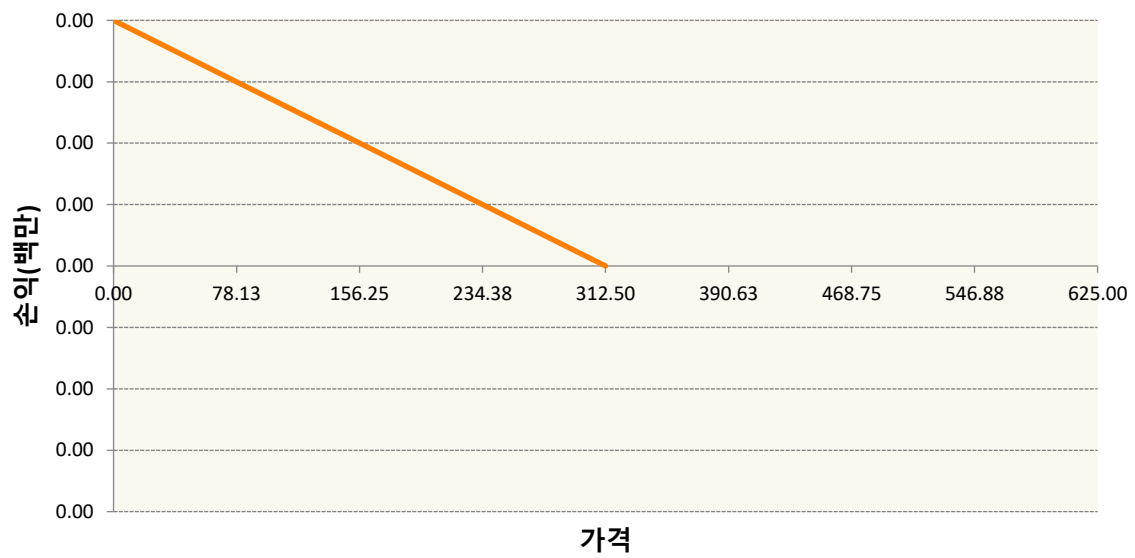
KR4201T23275-2023-02 콜327.5



KR4301T23109-2023-02 풋310



KR4301T23125-2023-02 풋312.5



(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
KR4201T23259			2023-02 콜325				108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	64	59	54	48	42	36	29
-5.33%	55	49	43	36	29	21	14
-2.67%	43	35	28	20	12	4	-4
0%	25	17	9	0	-9	-17	-26
2.67%	3	-6	-15	-23	-32	-41	-50
5.33%	-24	-33	-42	-51	-60	-69	-78
8.00%	-56	-64	-73	-81	-90	-99	-108
KR4201T23275			2023-02 콜327.5				105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	56	51	46	40	33	27
-5.33%	53	47	40	34	27	20	12
-2.67%	41	34	26	19	11	3	-5
0%	25	17	8	0	-9	-17	-26
2.67%	4	-5	-13	-22	-31	-40	-49
5.33%	-21	-30	-39	-48	-58	-67	-76
8.00%	-52	-60	-69	-78	-87	-96	-105
KR4301T23109			2023-02 풋310				4
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	4	4	4
-5.33%	1	1	2	2	2	3	3
-2.67%	0	0	1	1	1	2	2
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-2	-2	-1	-1	0	0	0
5.33%	-2	-2	-2	-2	-1	-1	-1
8.00%	-3	-3	-2	-2	-2	-1	-1
KR4301T23125			2023-02 풋312.5				5
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	4	4	4	5
-5.33%	1	2	2	2	3	3	3
-2.67%	0	0	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)

201

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

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	6,507	0	6,507	

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	2023-01-16
기준일	2023-01-13

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	5,508	0	5,508	

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	2023-01-16
기준일	2023-01-13

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	18,439	0	18,439	
누계	통화	선도	0	18,216	-18,216	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CAR\ KRW/USD 30-01-23E		257
FXW213CBQ KRW/USD 28-02-23E		635
FXW213CCK\ KRW/USD 30-01-23E		40
FXW213CCS\ KRW/USD 28-03-23E		526
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	789

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

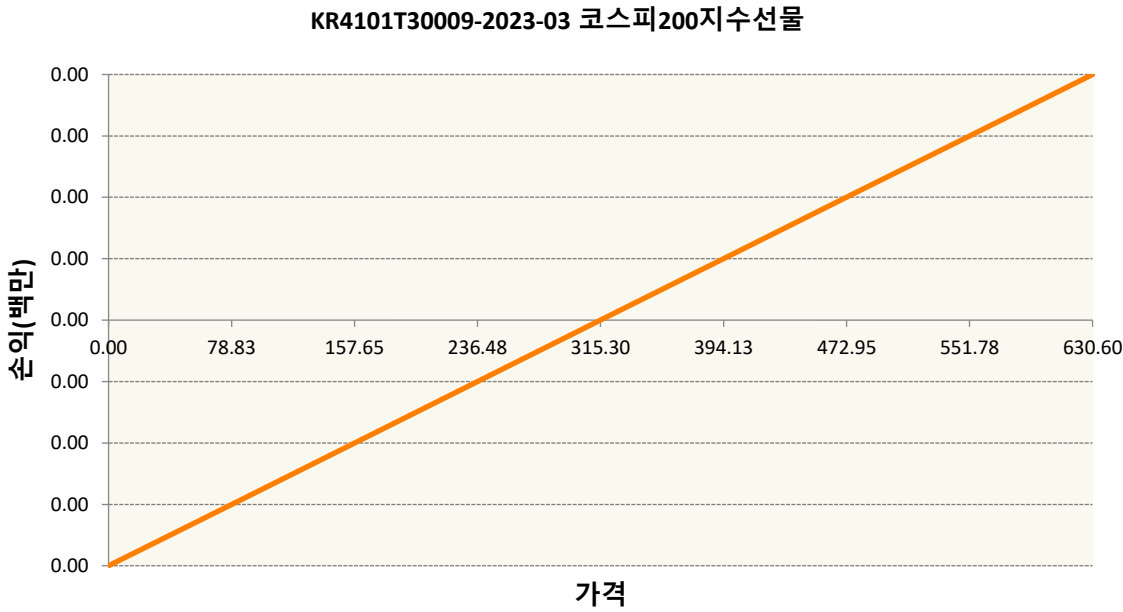
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	788	0	788	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-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%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	63	63	63	63	63	63	63

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

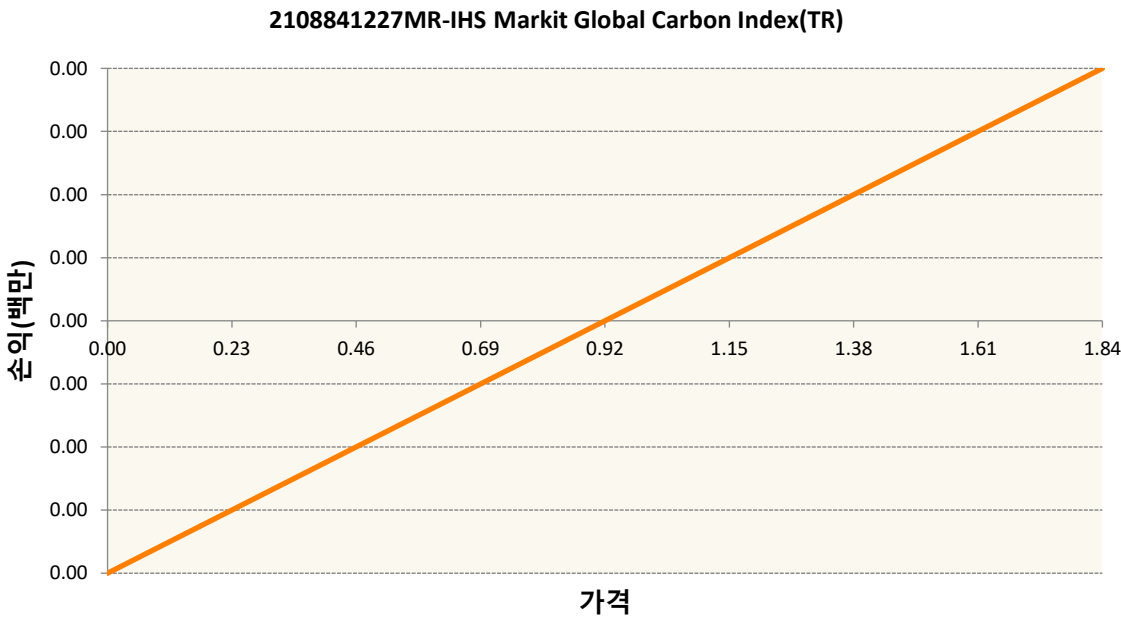
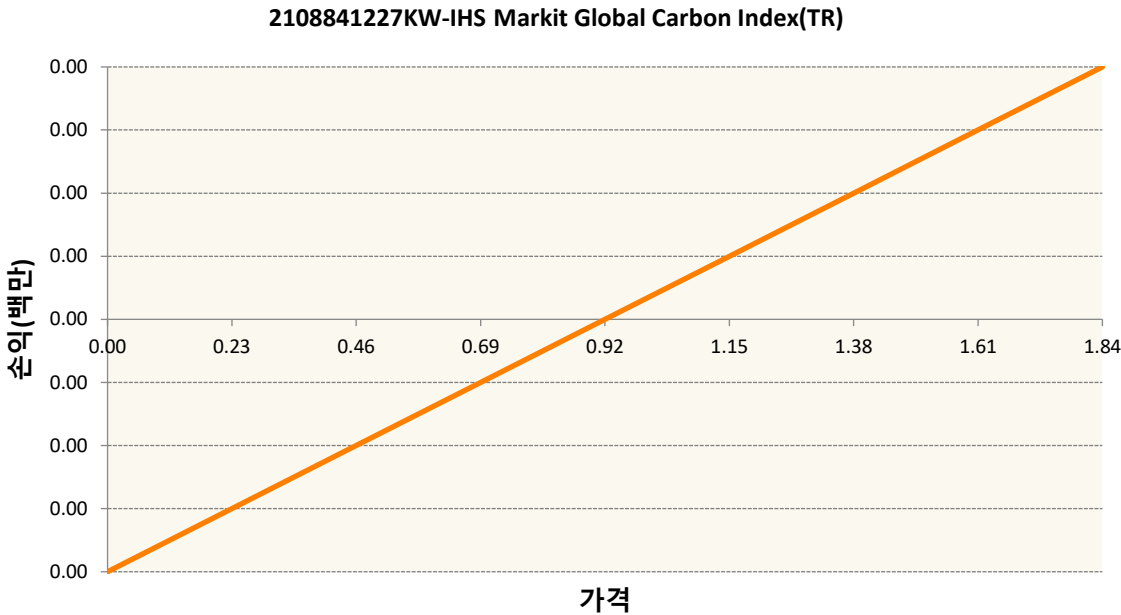
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

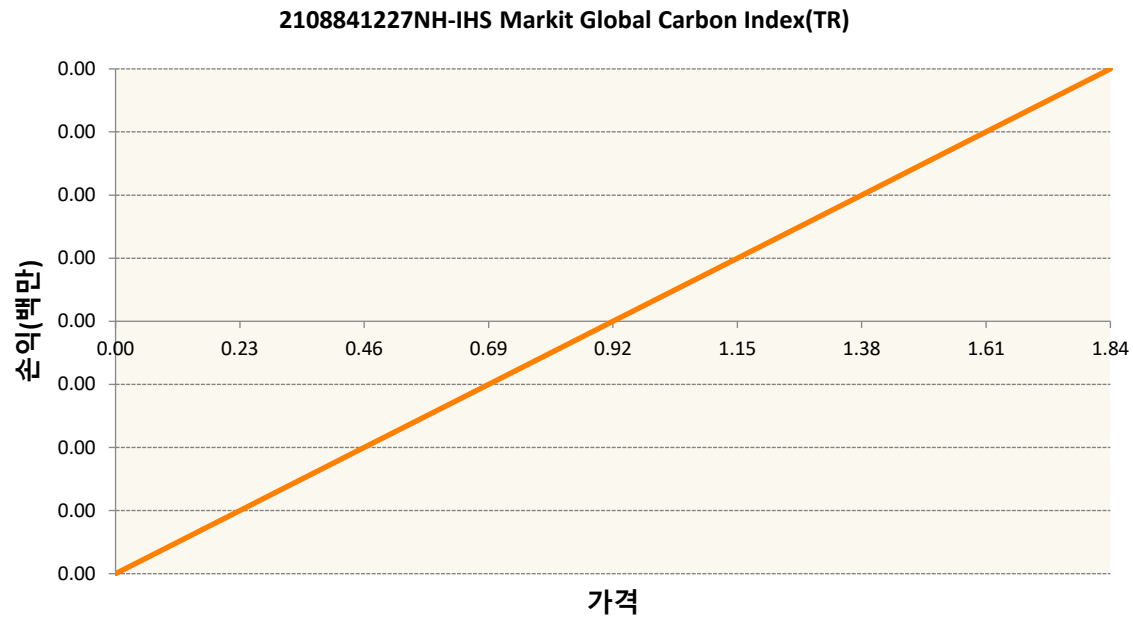
1. 계약금액

(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)		1,516
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		178
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		89

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,450

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

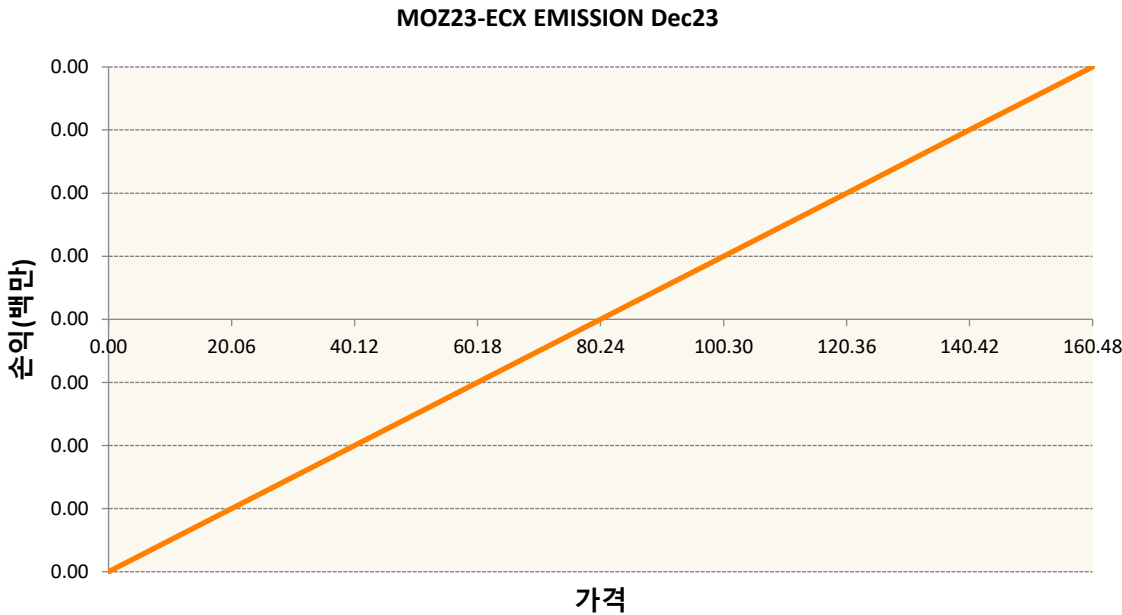
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	12,314	0	12,314	
누계	통화	선도	704	3,600	-2,895	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CCPI KRW/EUR 27-01-23E	108
FXW213CCPI KRW/EUR 27-01-23E	180
FXW213D12I EUR/KRW 27-01-23E	56
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	985

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

(단위:백만원)

2,806

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

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)

111

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8,926	0	8,926	장외
누계	통화	선도	1	0	1	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213D1C USD/KRW 19-01-23E		0.05
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(키움)		5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(미래)		6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220113(NH)		5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 220714(메리츠)		8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	31

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

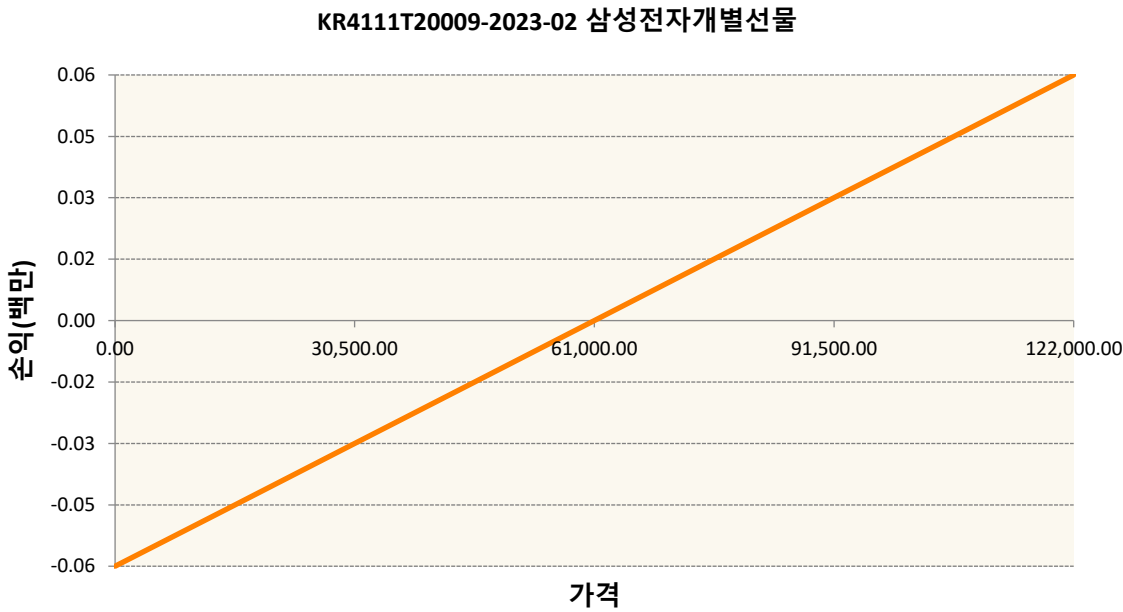
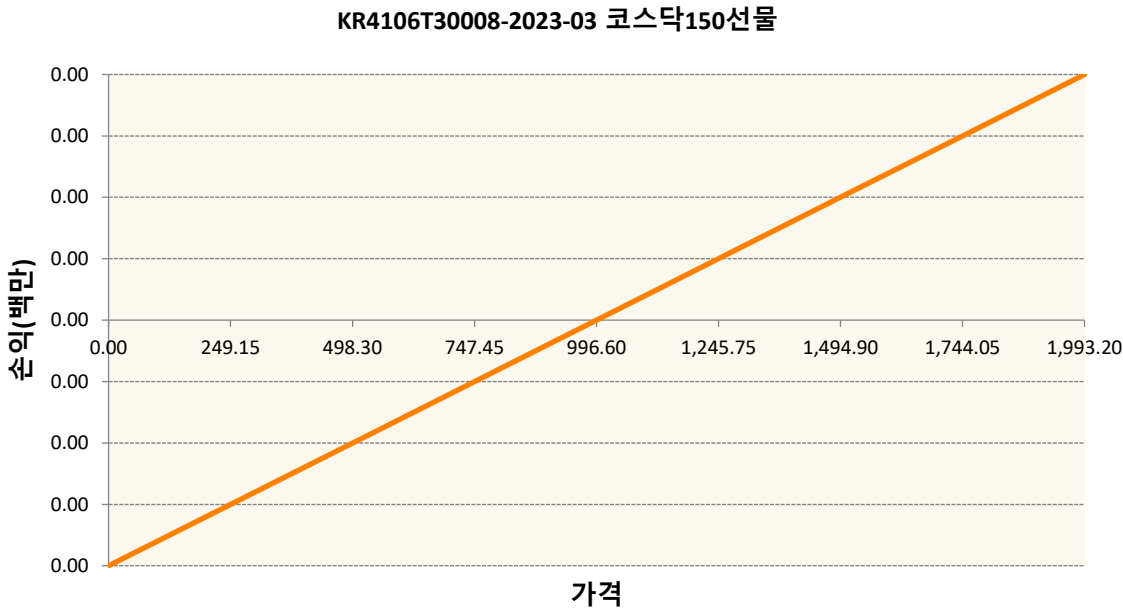
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

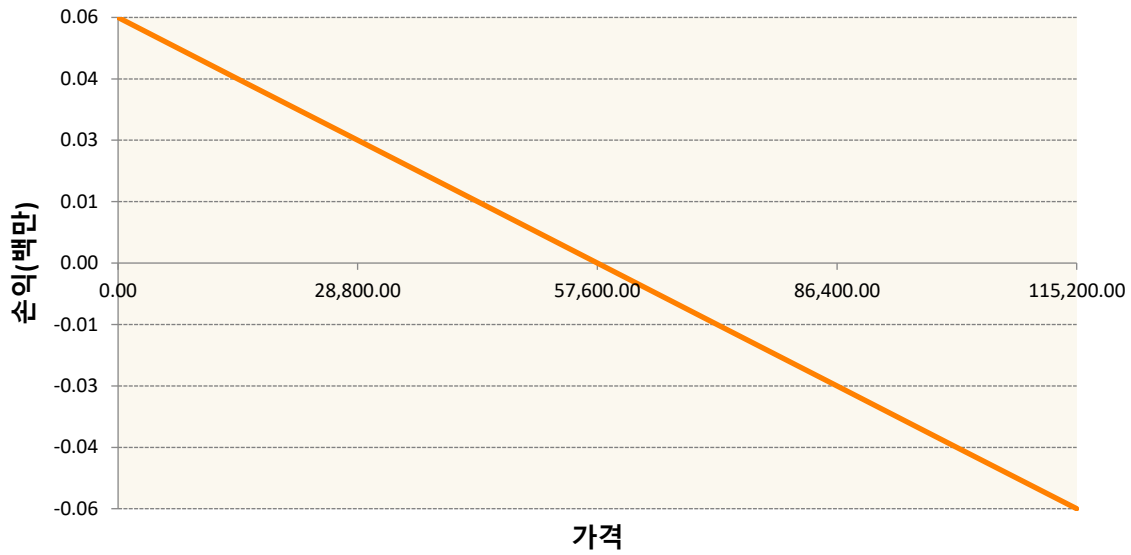
(단위:백만원)

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	617	1,013	-396	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

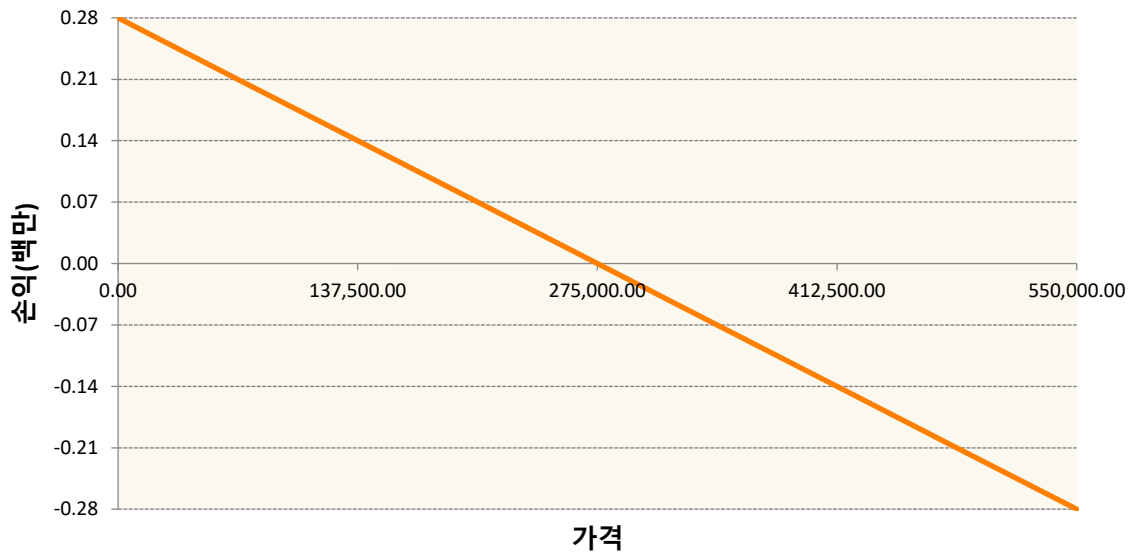
2. 만기시점의 손익구조



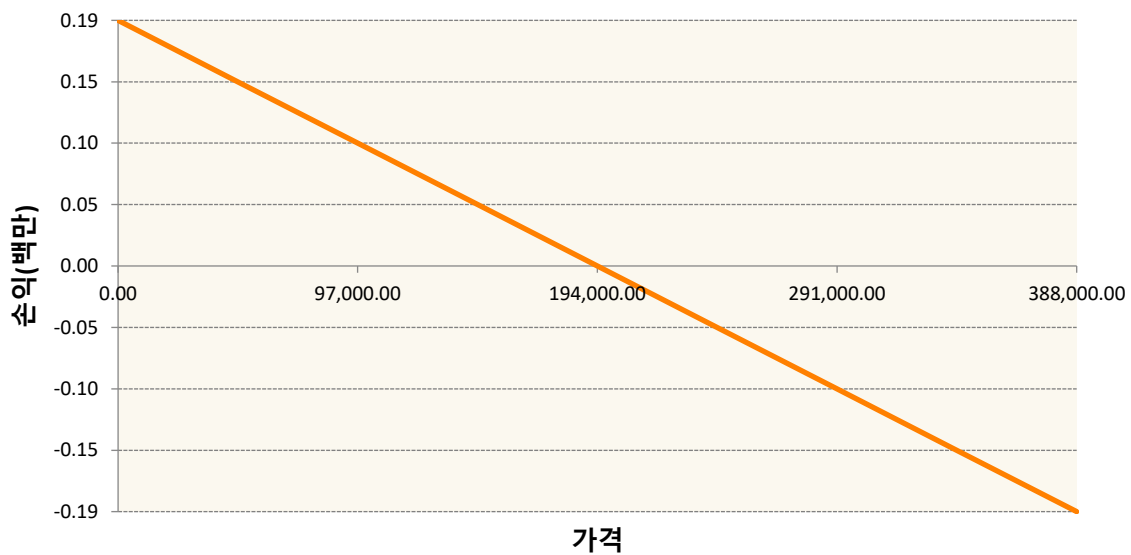
KR4146T20005-2023-02 KB금융개별선물



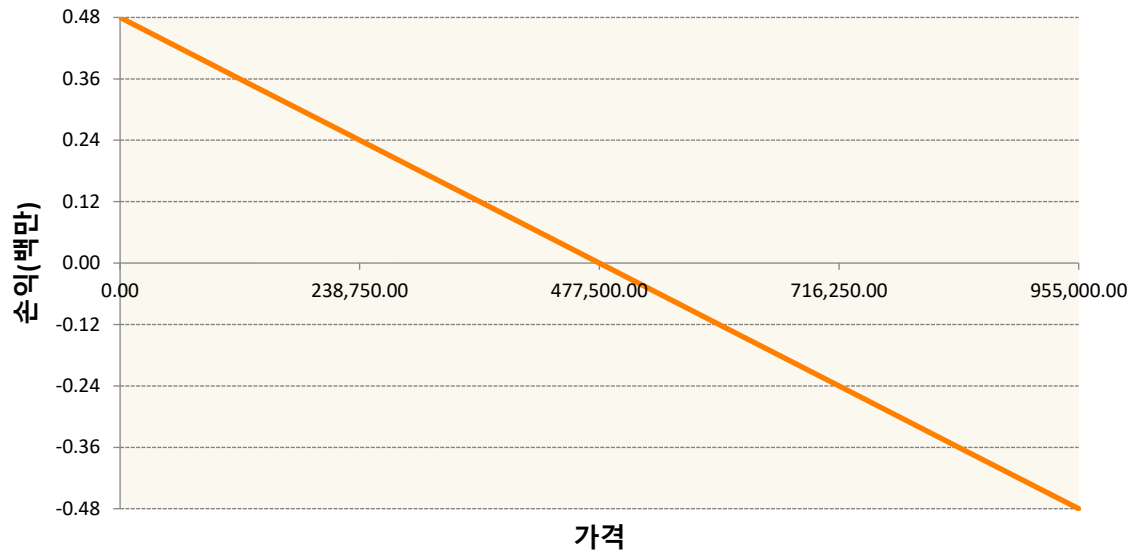
KR41BYT20008-2023-02 LG이노텍개별선물



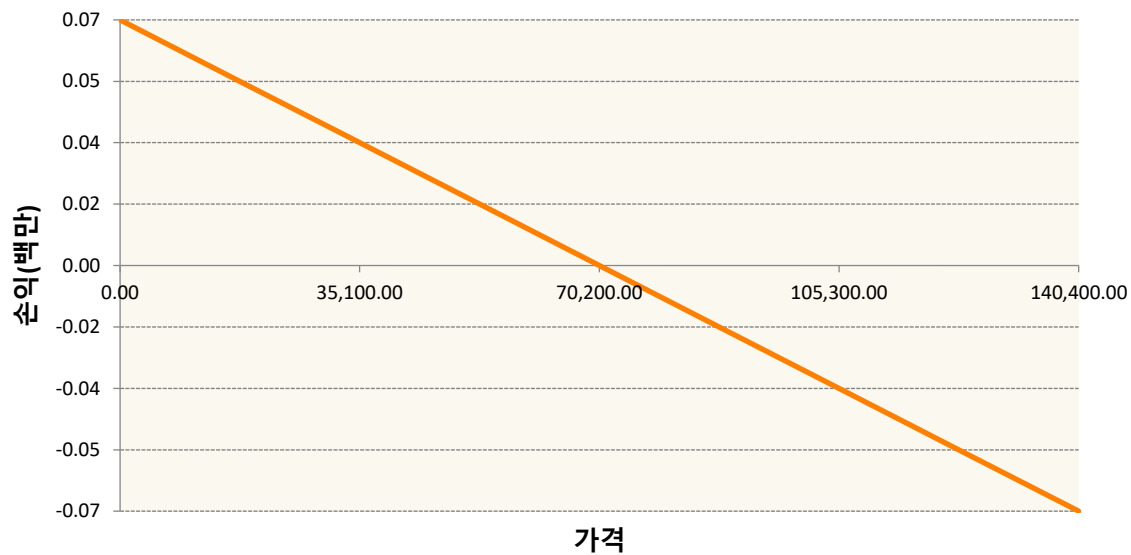
KR41E8T20000-2023-02 포스코케미칼개별선물



KR41F5T20005-2023-02 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7T20001-2023-02 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4106T300 2023-03 코스닥150선물	13
KR4111T200 2023-02 삼성전자개별선물	37
KR4146T200 2023-02 KB금융개별선물	23
KR41BYT200 2023-02 LG이노텍개별선물	20
KR41E8T200 2023-02 포스코케미칼개별선물	16
KR41F5T200 2023-02 LG에너지솔루션개별선물	11
KR41F7T200 2023-02 카카오페이개별선물	11
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.1
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.1

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

(단위:백만원)

280

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

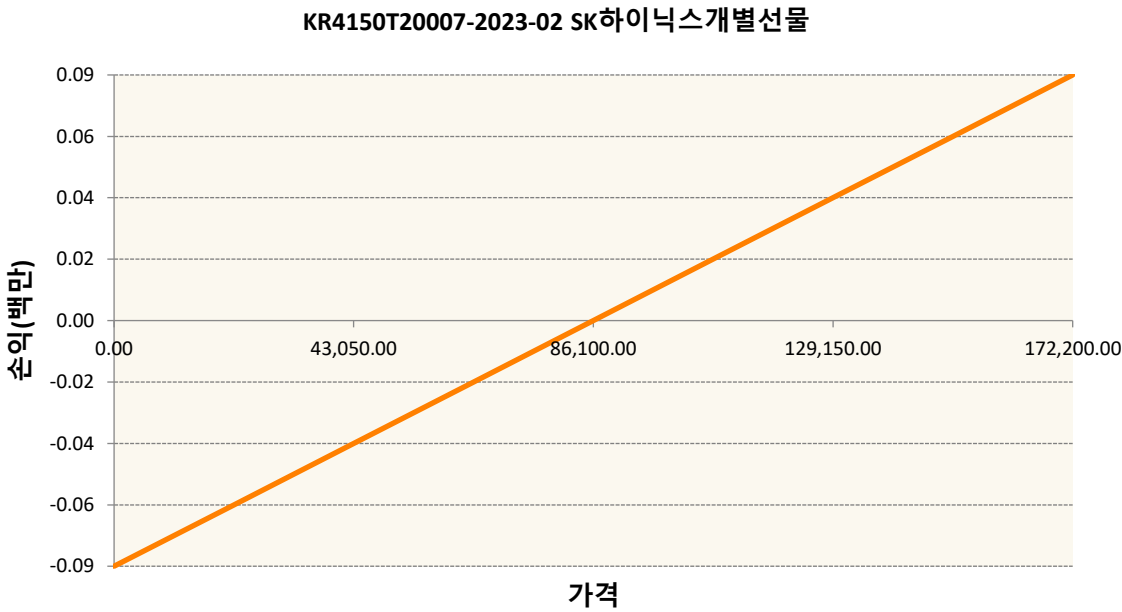
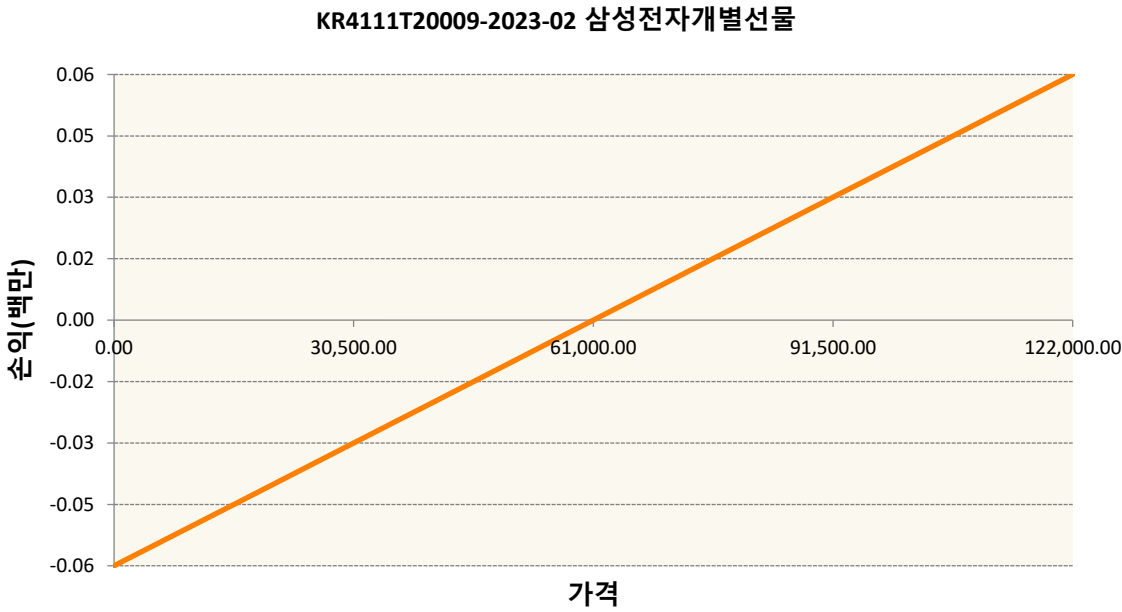
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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)

KR4150T20007 2023-02 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)

5

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

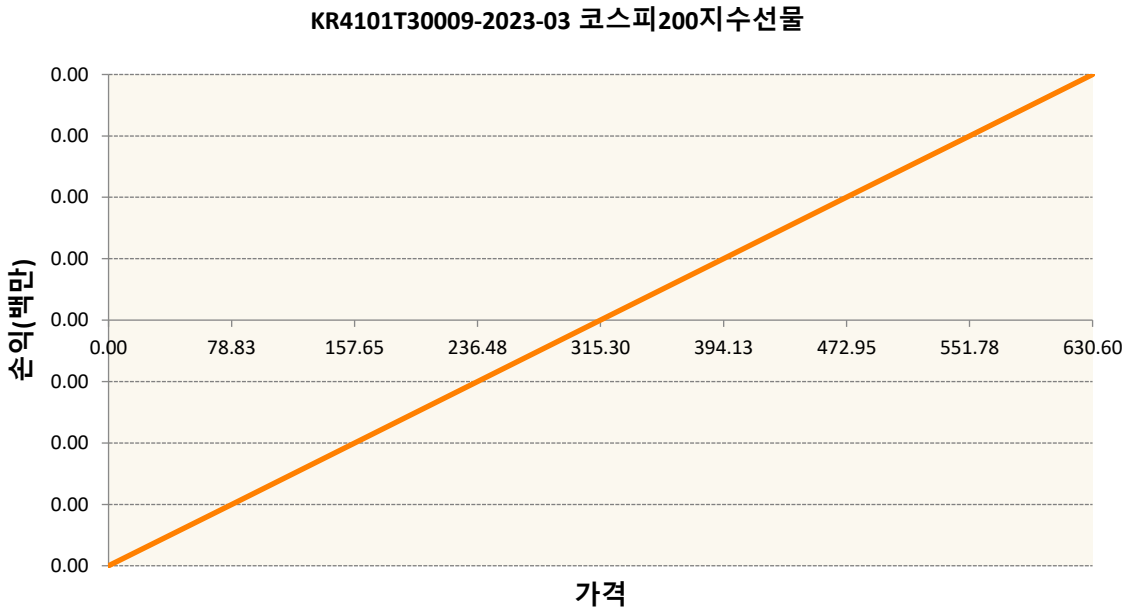
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	1,734	0	1,734	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				138
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	92	92	92	92	92	92	92
8.00%	138	138	138	138	138	138	138

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

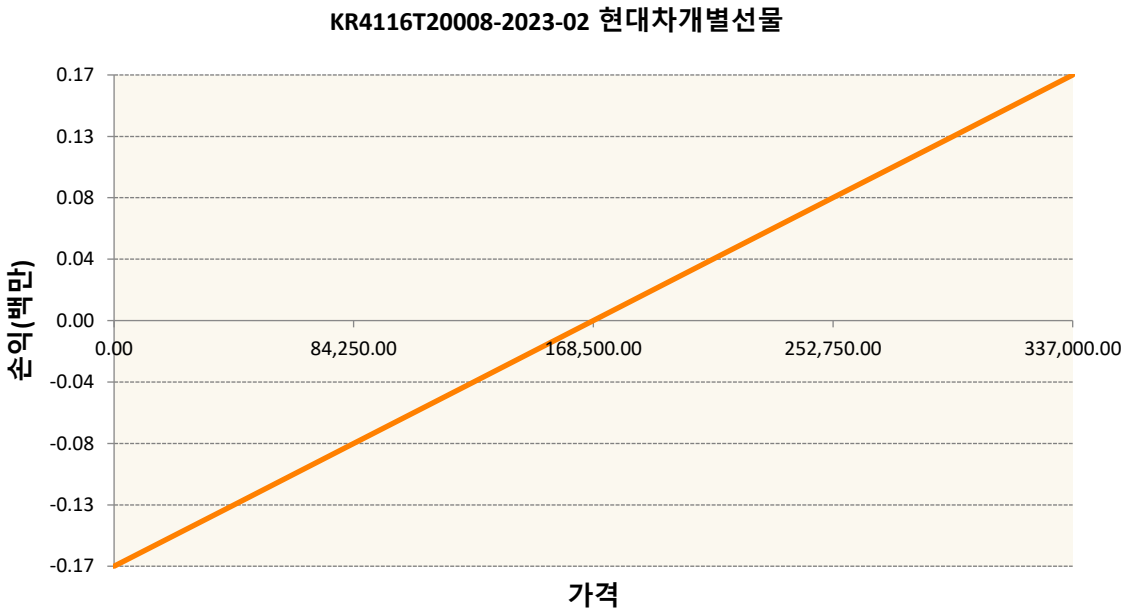
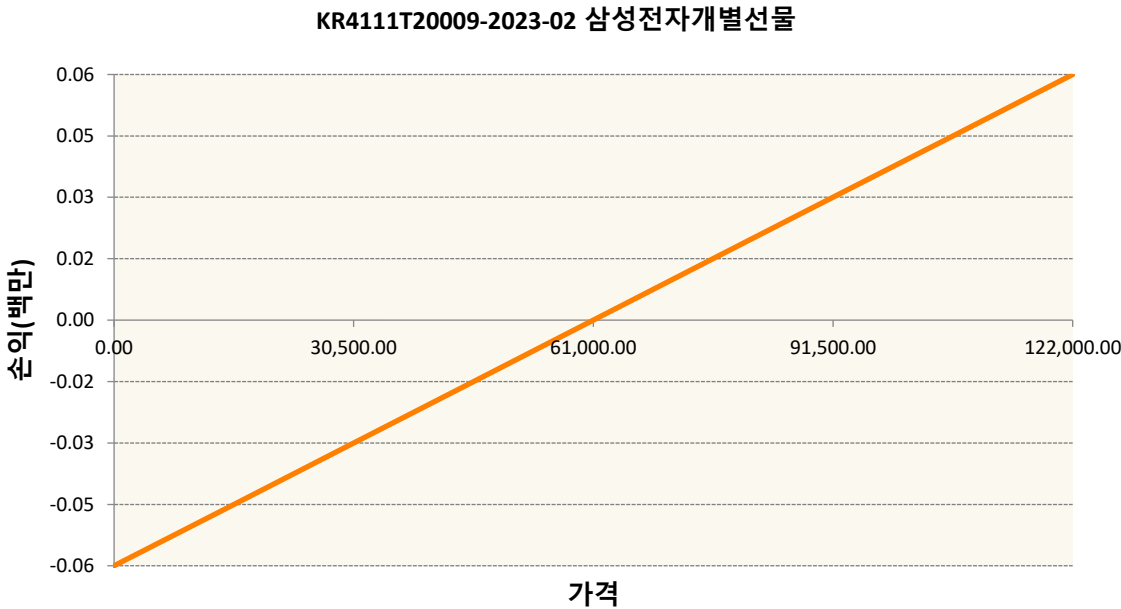
SOL한국형글로벌전기차&2차전지

1. 계약금액

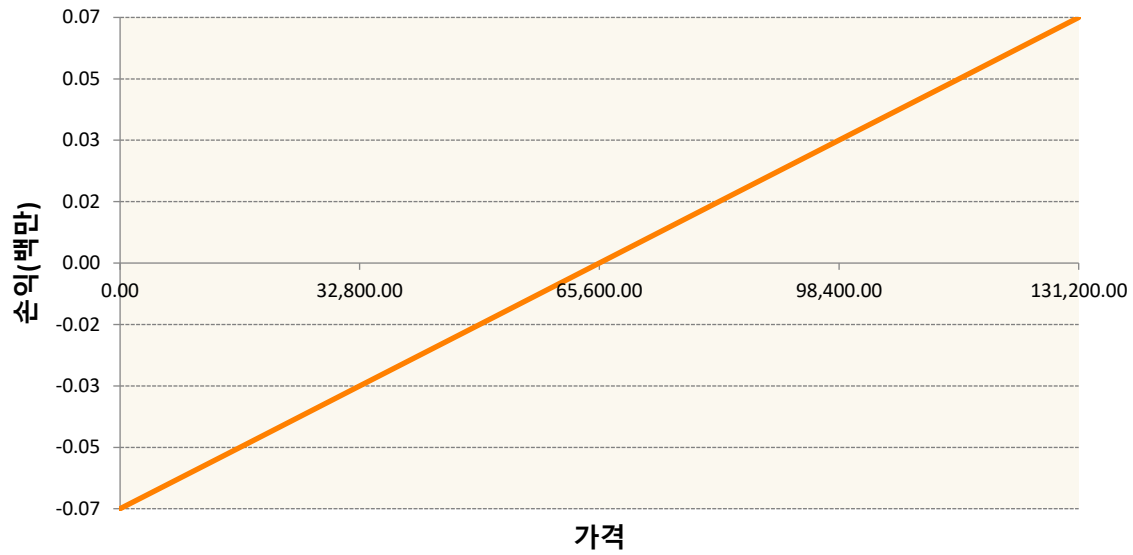
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	232	0	232	장내

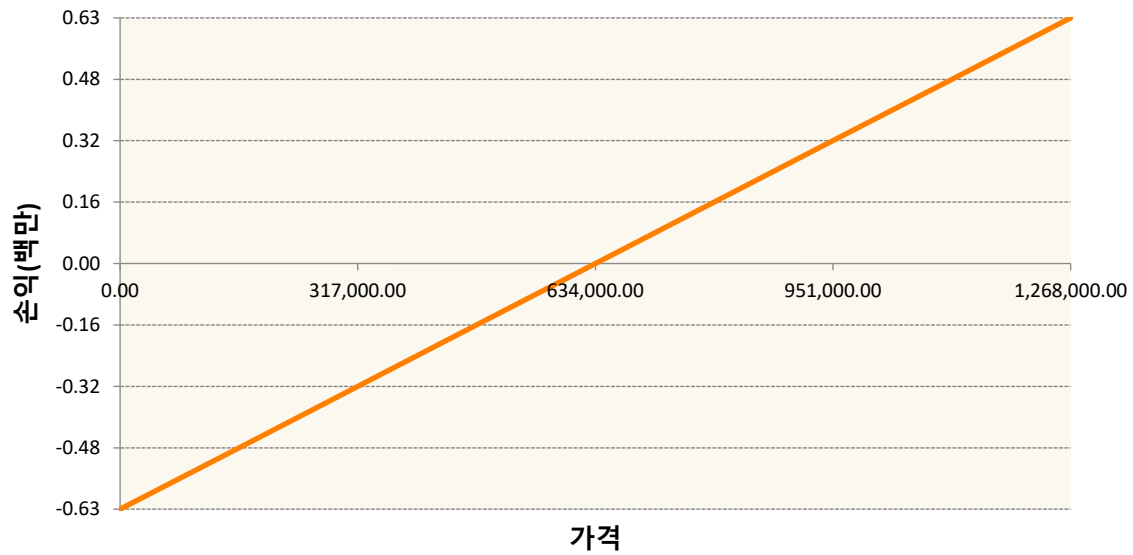
2. 만기시점의 손익구조



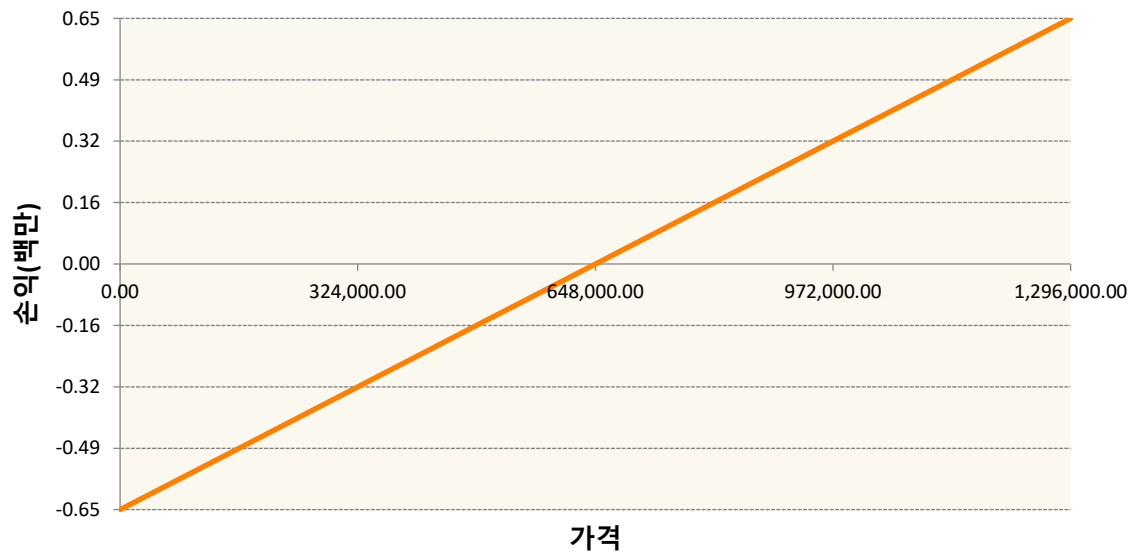
KR4119T20002-2023-02 기아개별선물



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 2023-01-16

기준일 2023-01-13

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

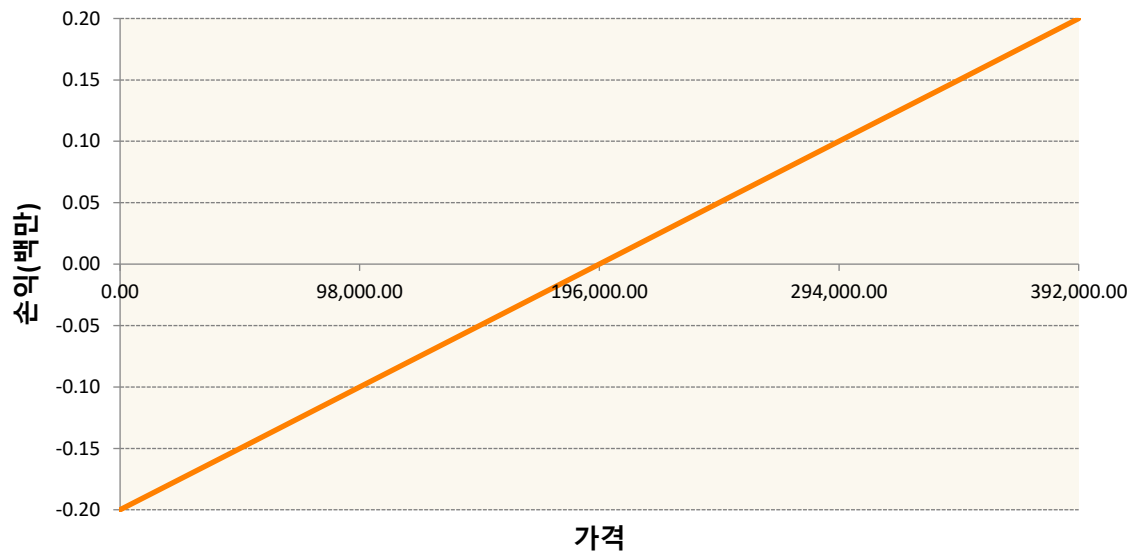
1. 계약금액

(단위:백만원)

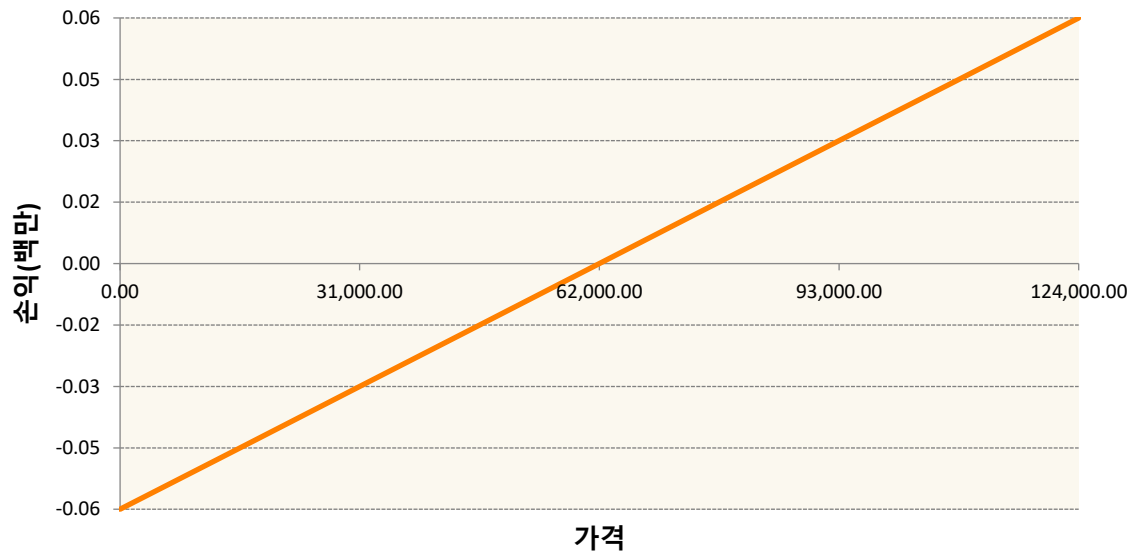
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	124	0	124	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156T20004-2023-02 NAVER개별선물



KR41CFT20005-2023-02 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR41CFT20005							2023-02 카카오개별선물		
									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	

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

(단위:백만원)

13

공시일	2023-01-16
기준일	2023-01-13

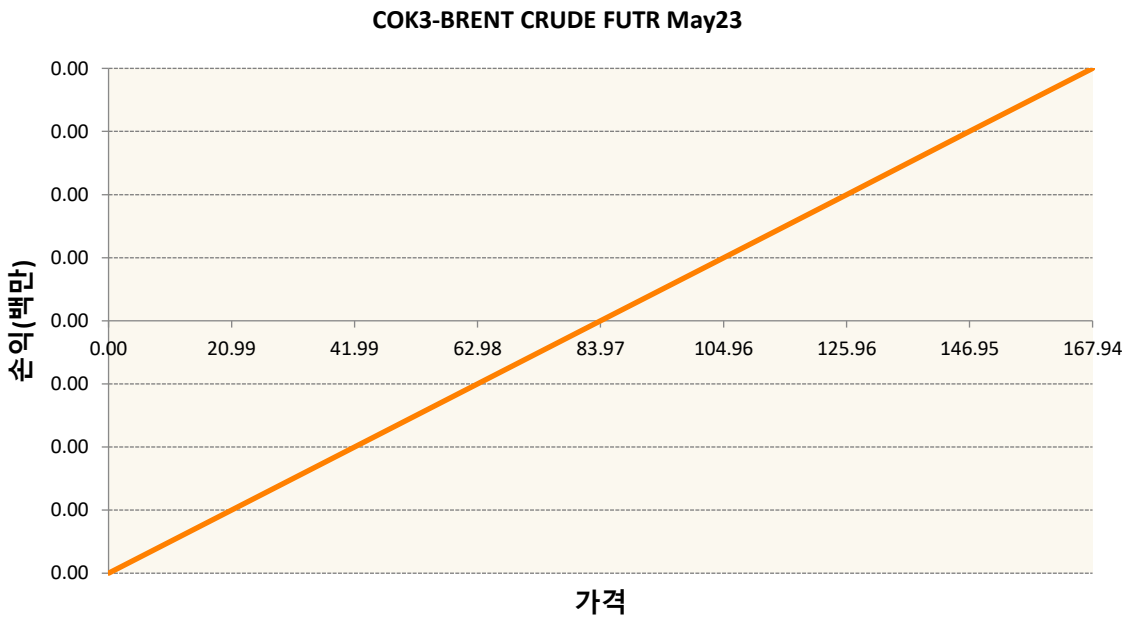
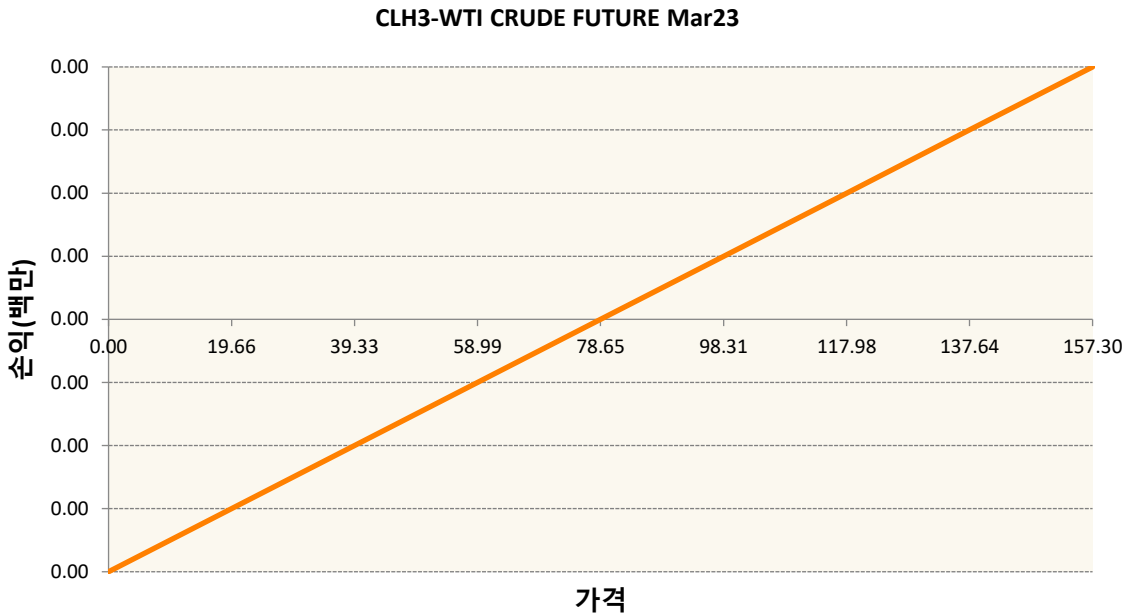
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

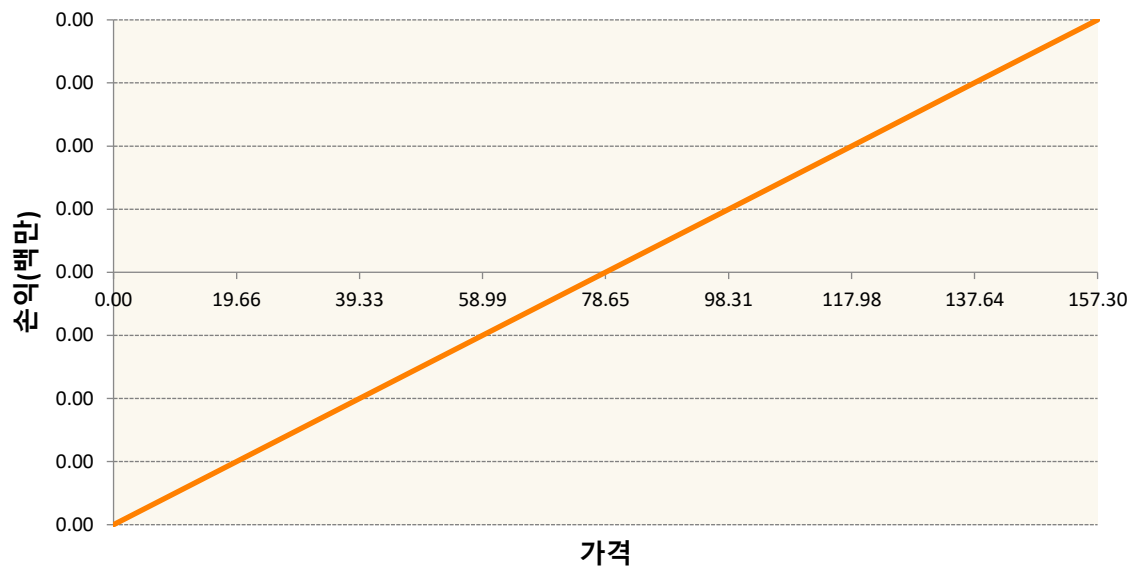
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,810	273	1,537	

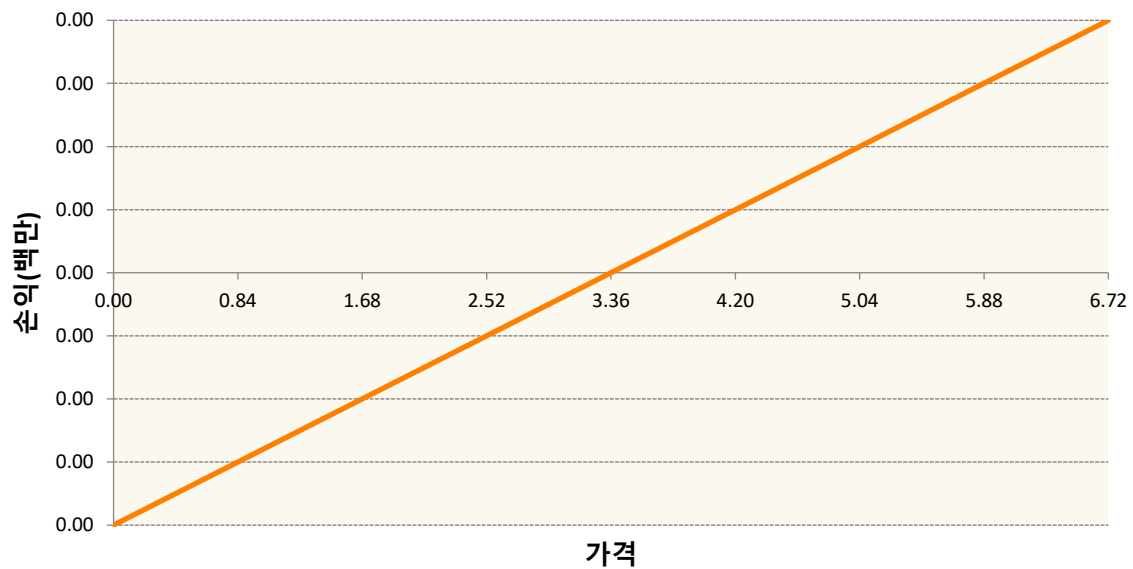
2. 만기시점의 손익구조



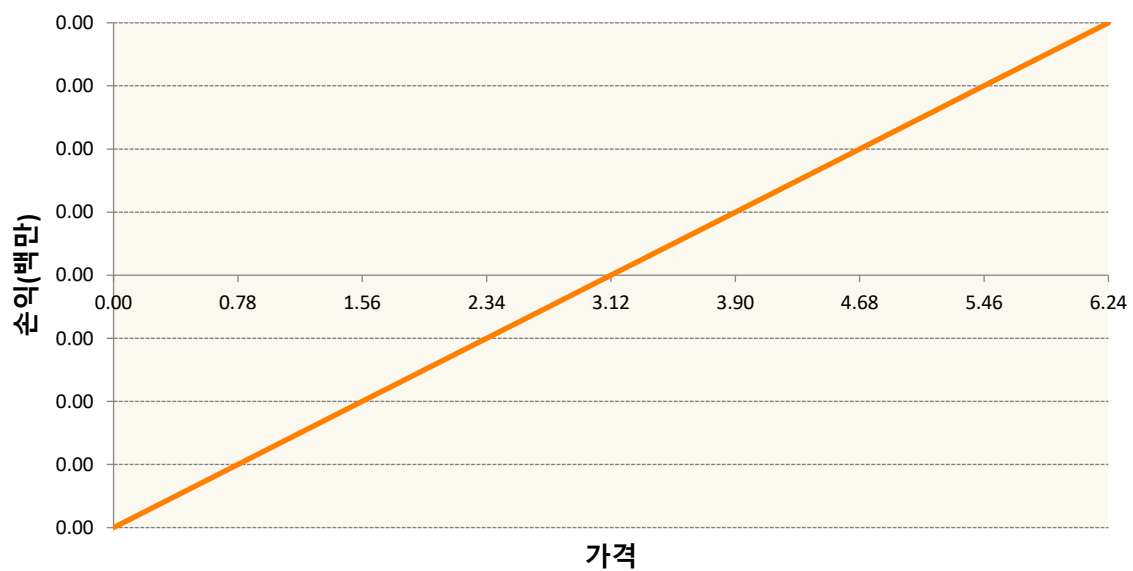
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



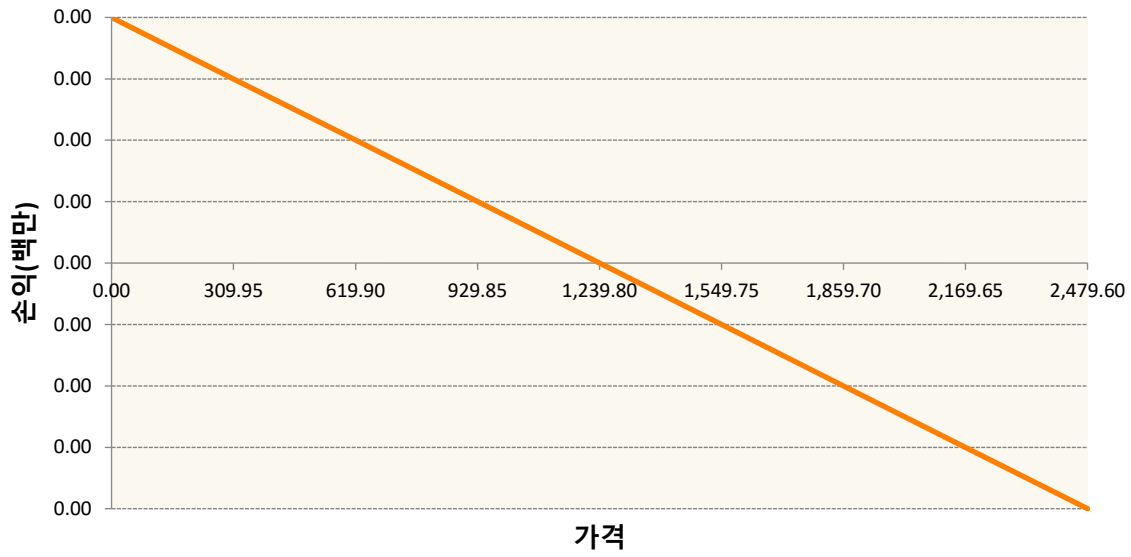
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



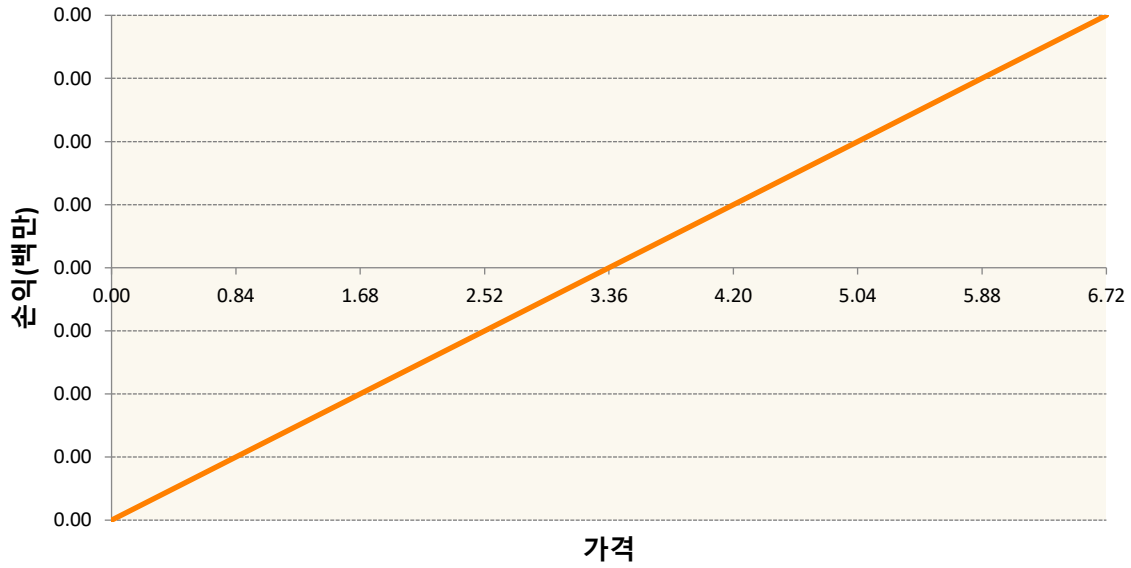
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



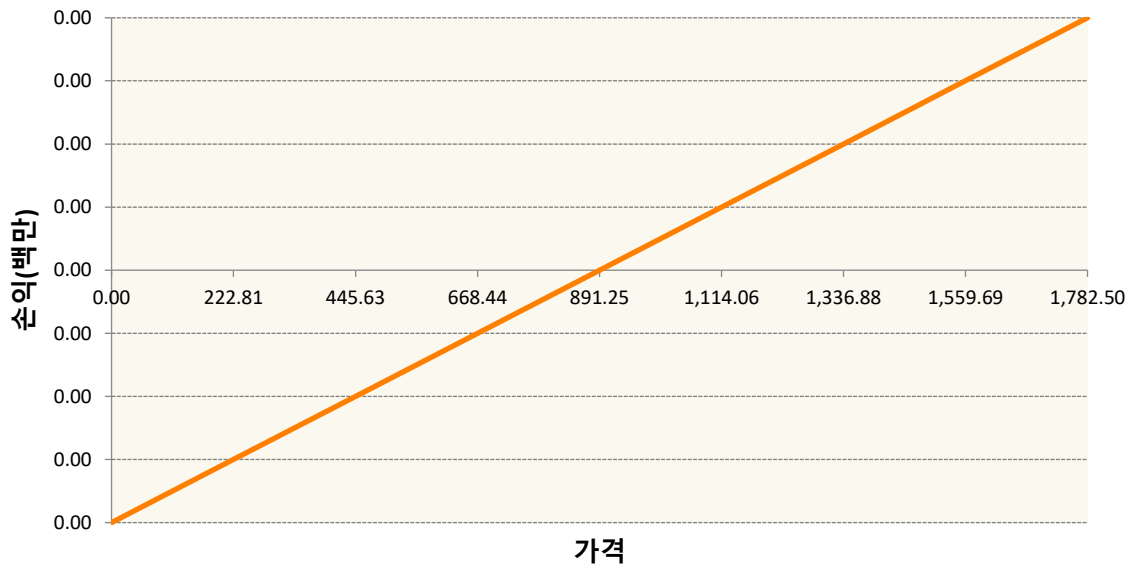
KR4175T20004-2023-02 달러선물

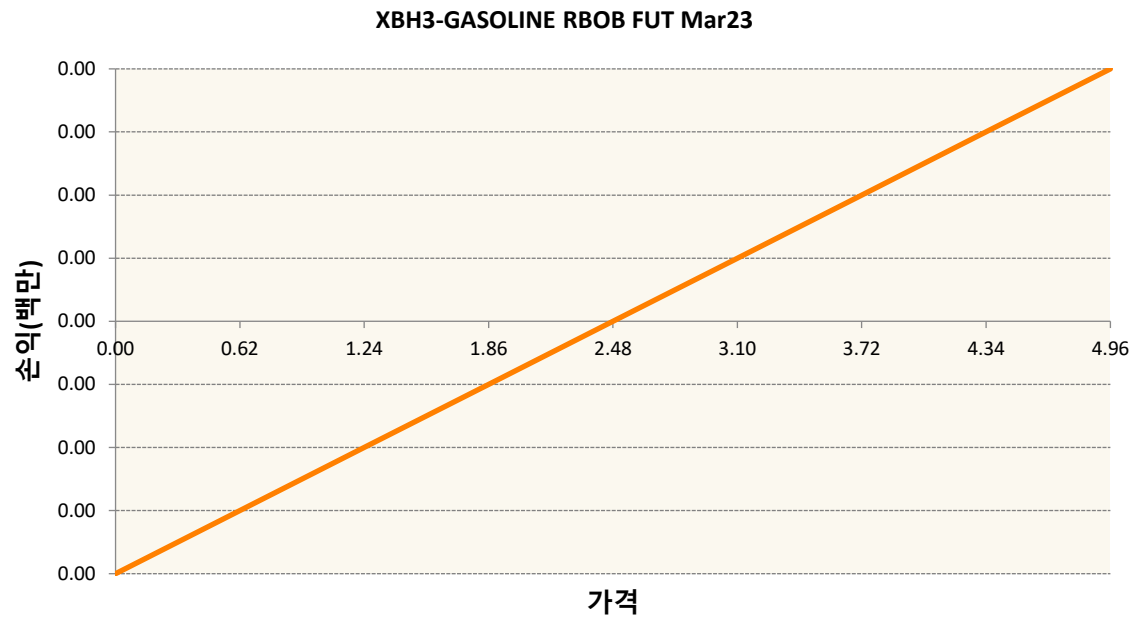


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	25
COK3	BRENT CRUDE FUTR May23	33
ECH3	E-mini Crude Oil Mar23	8
EOH3	E-MINI NATURAL GAS Mar23	3
HOH3	NY Harb ULSD Fut Mar23	14
KR4175T200 2023-02 달러선물		22
NGH23	NATURAL GAS FUTR Mar23	33
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	18
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	468