

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

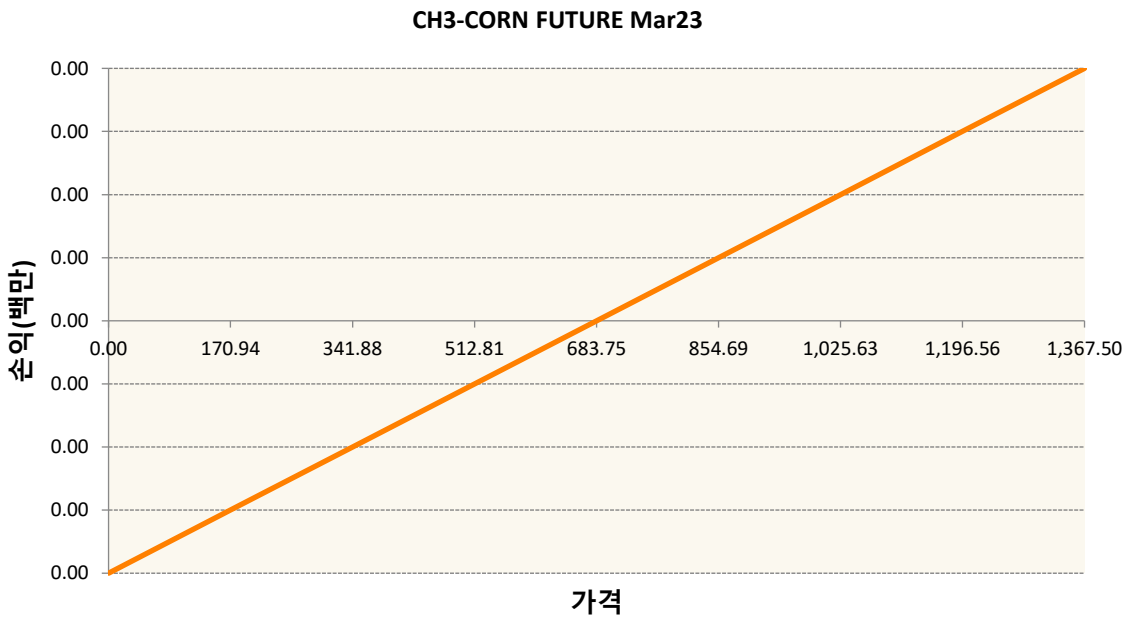
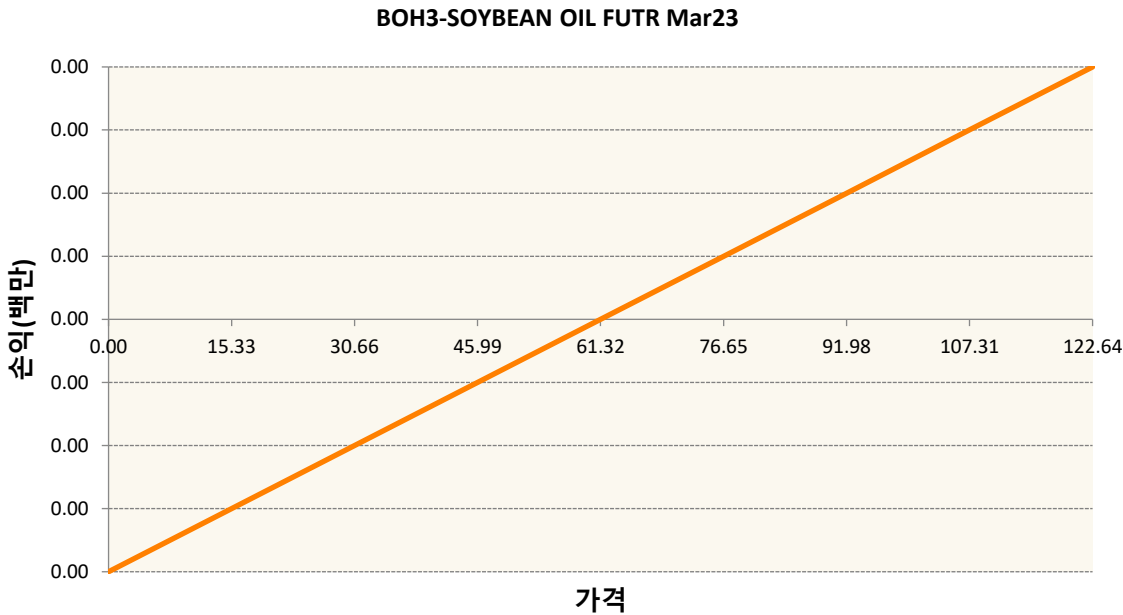
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

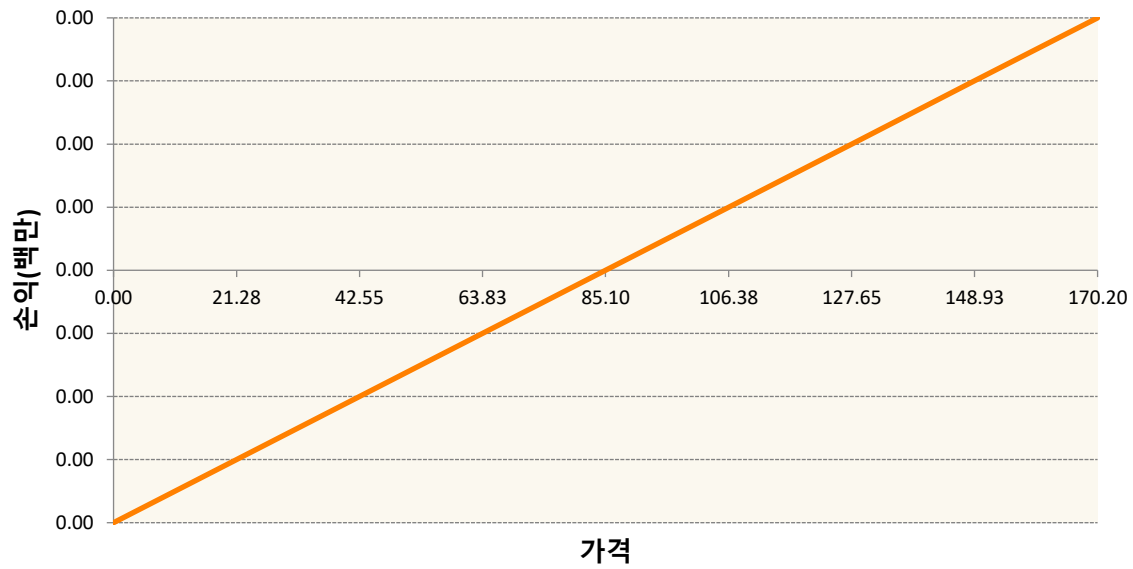
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,722	738	5,984	

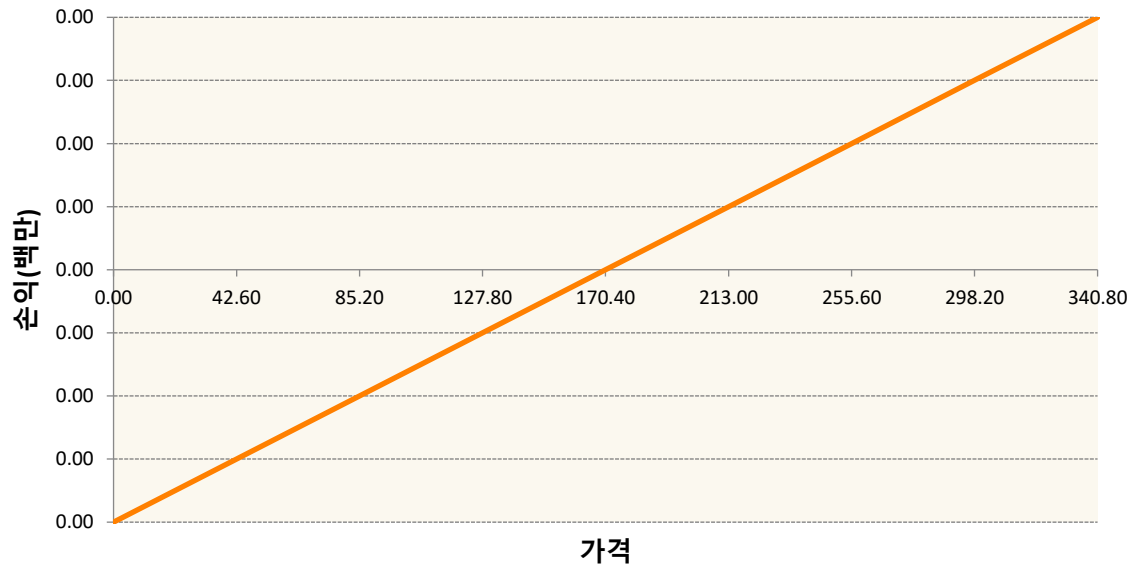
2. 만기시점의 손익구조



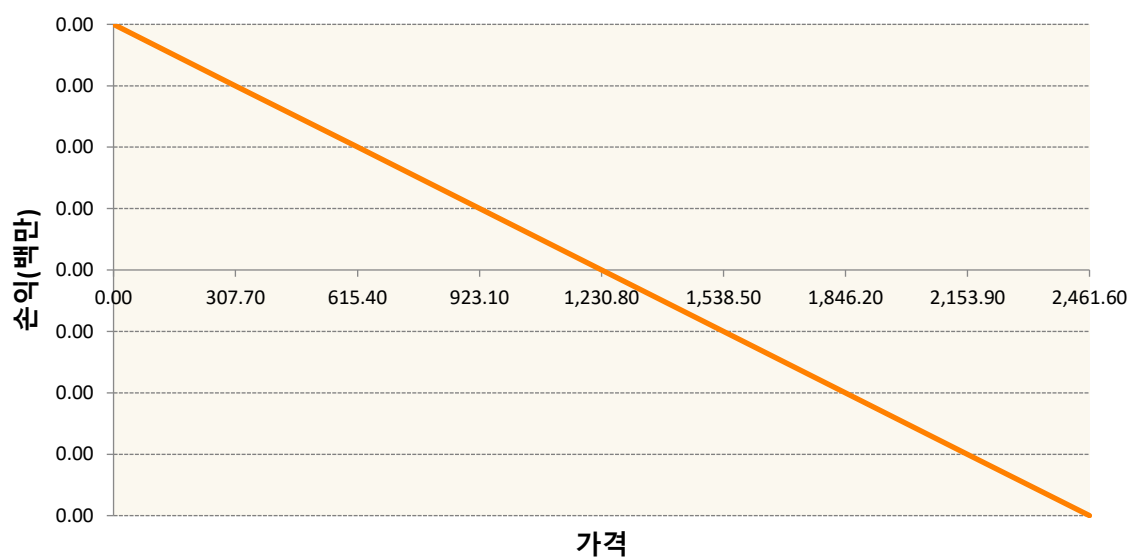
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



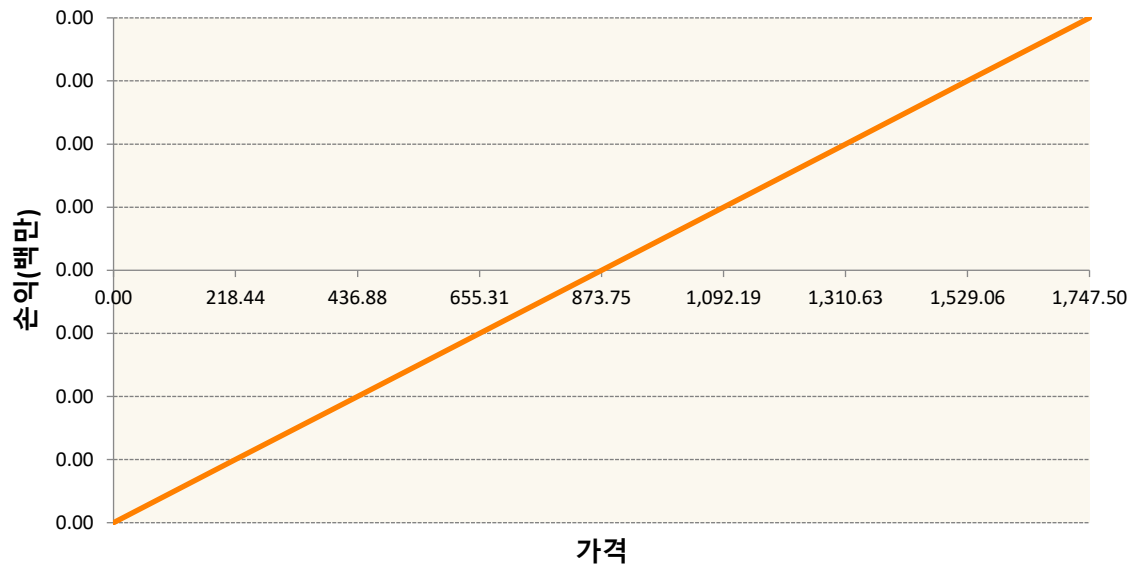
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



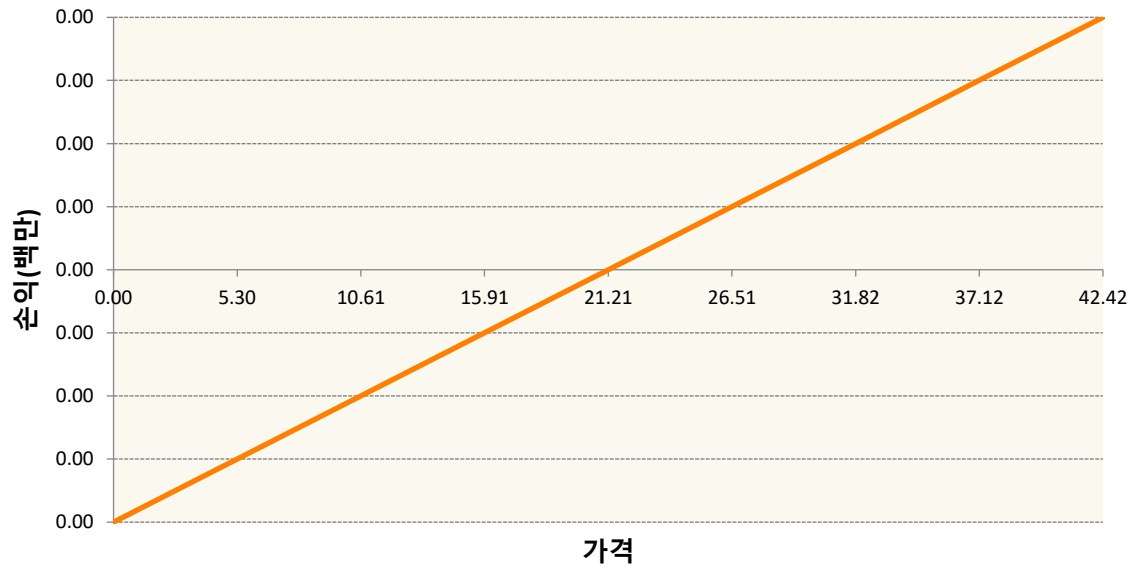
KR4175T20004-2023-02 달러선물



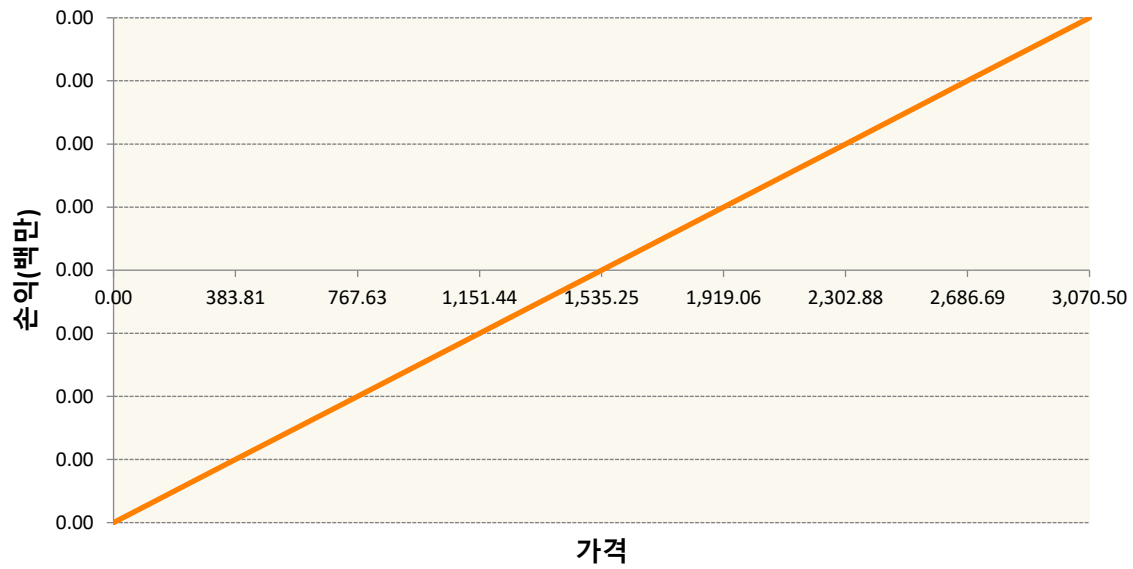
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



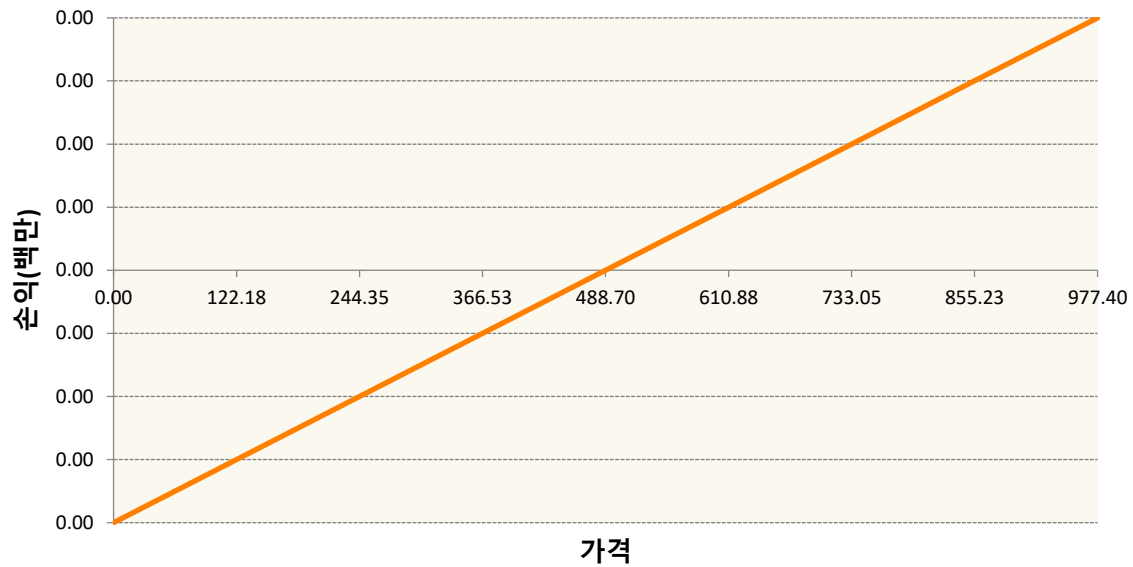
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



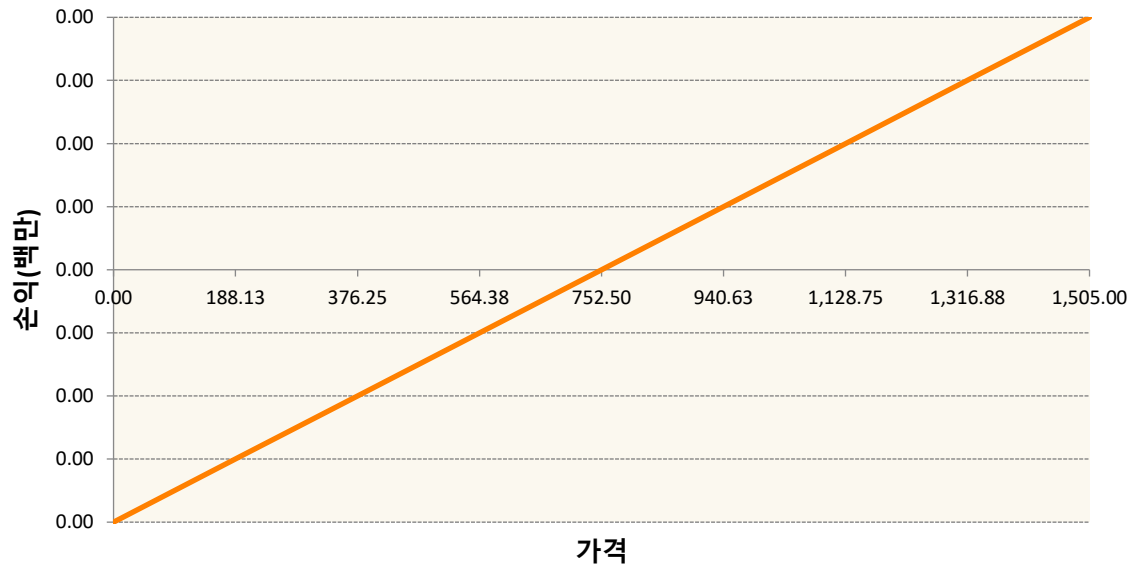
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



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	2023-02-01
기준일	2023-01-31

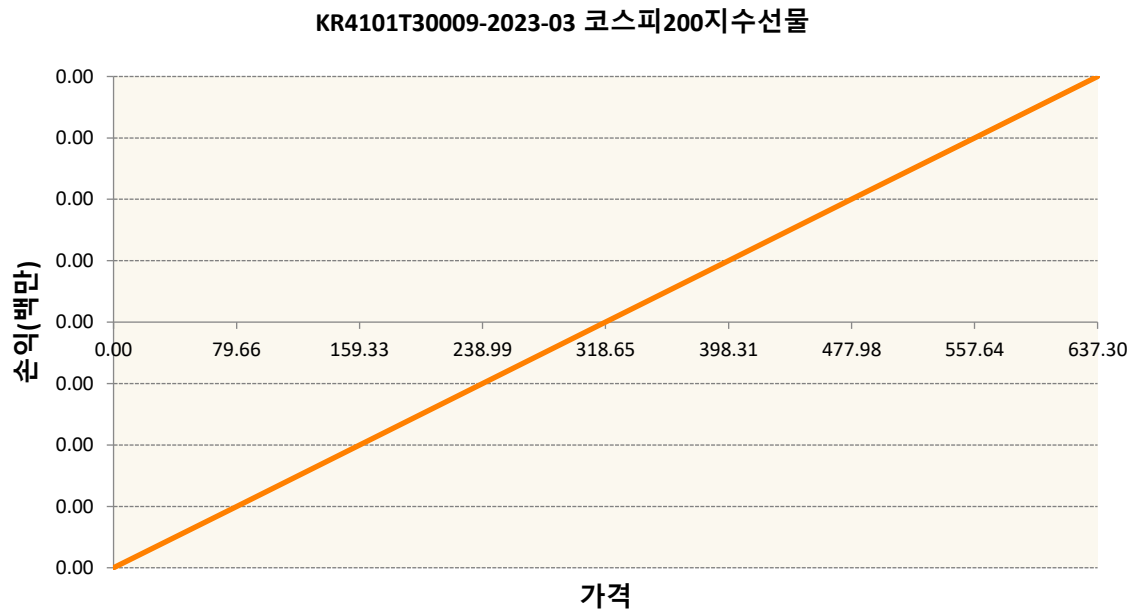
스마트인덱스모

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	2,788	0	2,788	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					222
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222
-5.33%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
-2.67%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	74	74	74	74	74	74	74
5.33%	148	148	148	148	148	148	148
8.00%	222	222	222	222	222	222	222

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

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

369

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

515

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

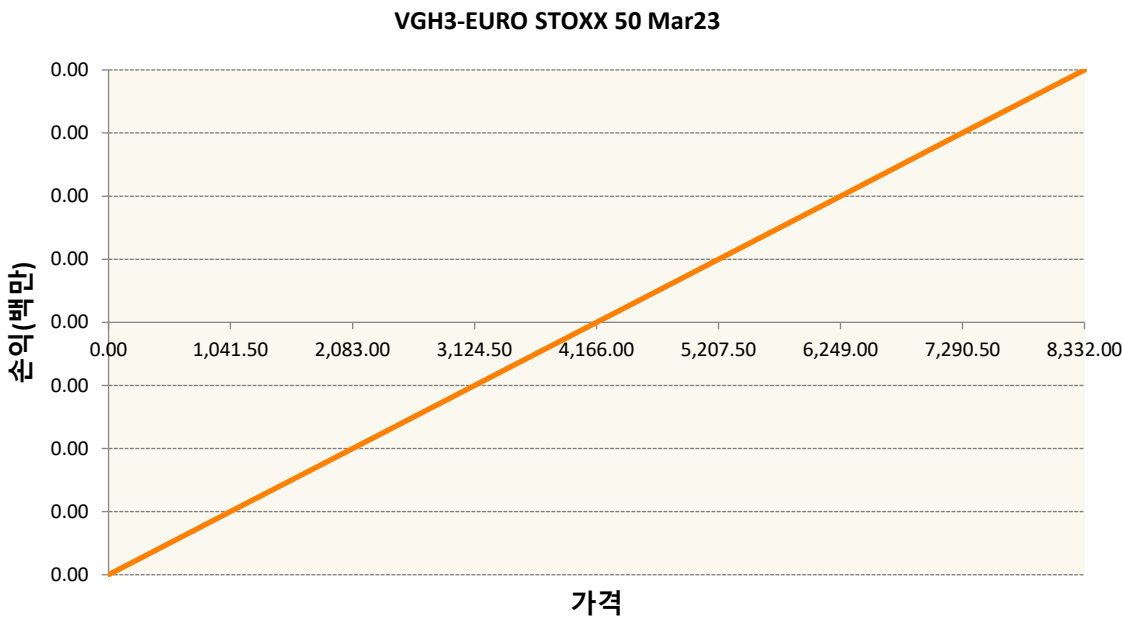
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	519	0	519	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH3	EURO STOXX 50 Mar23	41
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

45

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

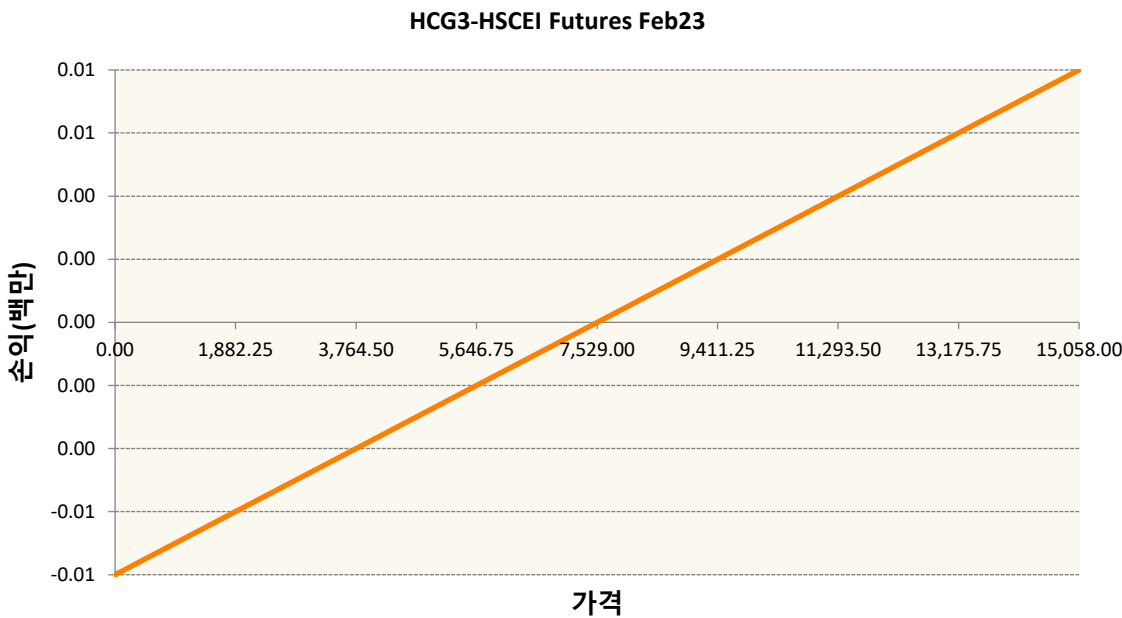
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,657	0	1,657	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG3	HSCEI Futures Feb23	133
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

221

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

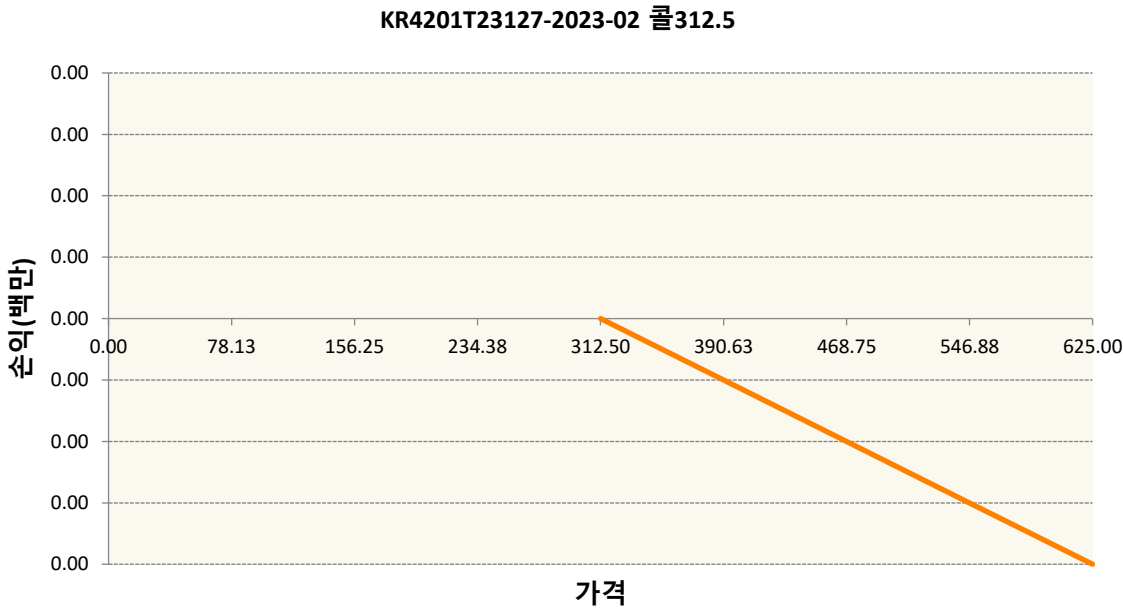
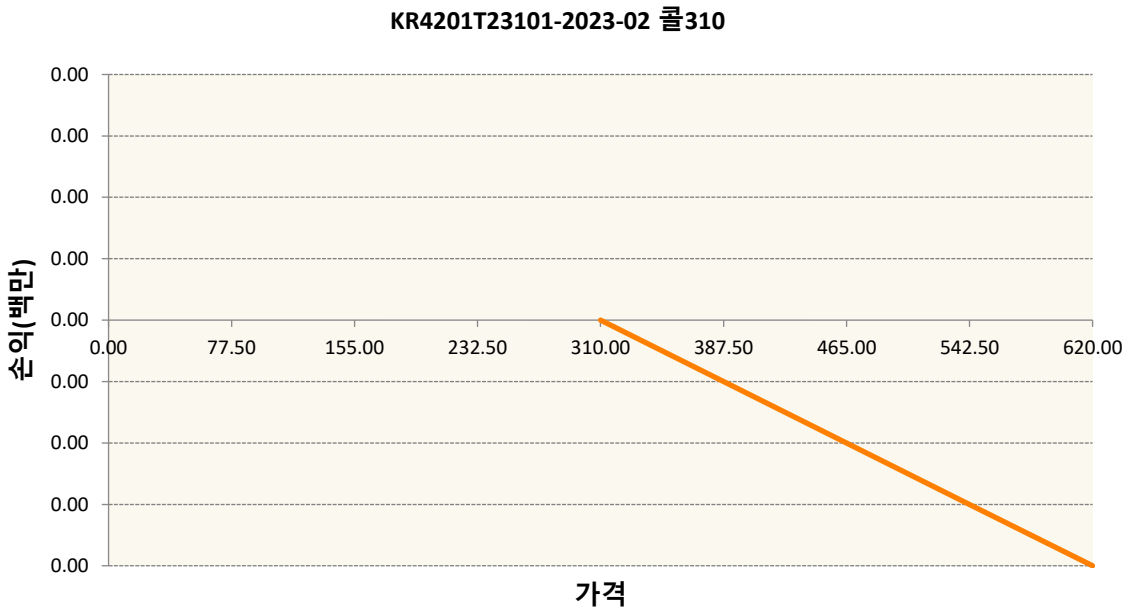
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	469	-469	장내
누계	유가증권	옵션	0	54,686	-54,686	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 million won.

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 relationship between price and profit/loss. The x-axis represents '가격' (Price) and the y-axis represents '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions). The line starts at the origin (0,0) and passes through the point (312.50, 0). The area under the line is shaded light orange.

가격	손익 (백만)
0.00	-100.00
78.13	-20.00
156.25	-10.00
234.38	0.00
312.50	10.00
390.63	20.00
468.75	30.00
546.88	40.00
625.00	50.00

(단위:백만원)

KR4201T23101				2023-02 콜310			2,349
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,374	1,320	1,261	1,199	1,133	1,065	995
-5.33%	1,160	1,083	1,005	925	844	762	679
-2.67%	791	703	615	527	438	350	262
0%	253	170	85	0	-86	-172	-259
2.67%	-437	-503	-572	-645	-720	-798	-877
5.33%	-1,239	-1,283	-1,333	-1,388	-1,448	-1,512	-1,578
8.00%	-2,109	-2,134	-2,166	-2,204	-2,247	-2,296	-2,349
KR4201T23127				2023-02 콜312.5			716
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	392	377	361	343	324	303	283
-5.33%	336	314	291	267	242	217	192
-2.67%	236	208	181	153	126	98	71
0%	82	55	28	0	-28	-55	-83
2.67%	-121	-143	-167	-192	-217	-242	-268
5.33%	-363	-379	-397	-416	-436	-458	-480
8.00%	-630	-640	-652	-665	-681	-698	-716
KR4301T23109 2023-02 풋310							257

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-203	-211	-219	-228	-237	-247	-257
-5.33%	-100	-111	-123	-134	-146	-157	-169
-2.67%	-20	-32	-45	-58	-70	-83	-96
0%	36	24	12	0	-12	-25	-37
2.67%	71	61	51	41	30	19	8
5.33%	89	83	76	68	59	50	40
8.00%	98	94	89	84	78	71	63

KR4301T23125 2023-02 풋312.5							271
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-221	-227	-235	-243	-252	-261	-271
-5.33%	-113	-123	-134	-145	-156	-167	-179
-2.67%	-26	-38	-51	-63	-76	-88	-101
0%	38	25	13	0	-13	-25	-38
2.67%	78	68	57	46	34	23	11
5.33%	101	93	85	77	67	57	47
8.00%	112	107	102	96	89	81	73

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

(단위:백만원)

3,447

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

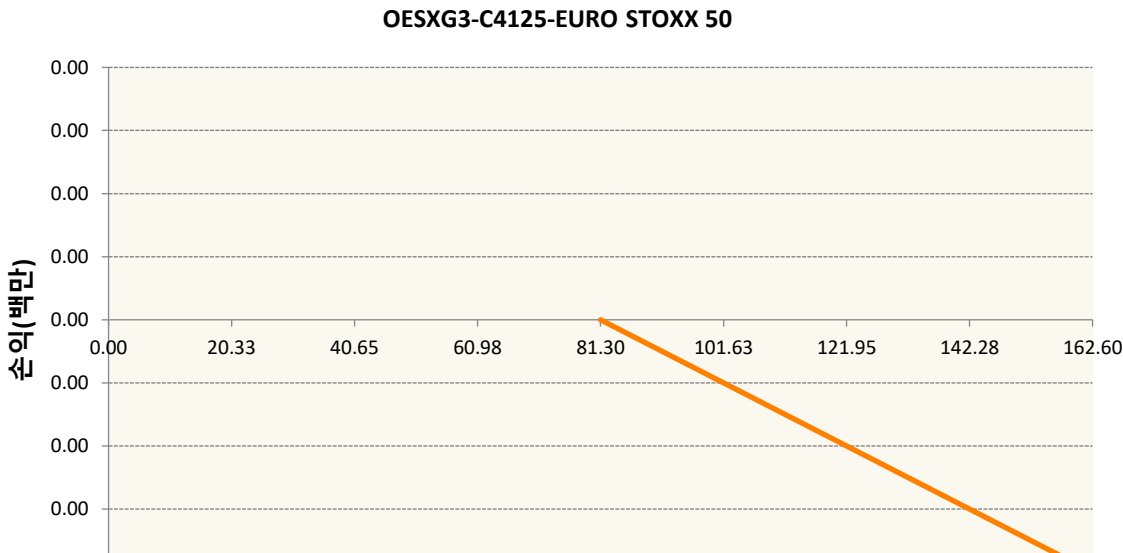
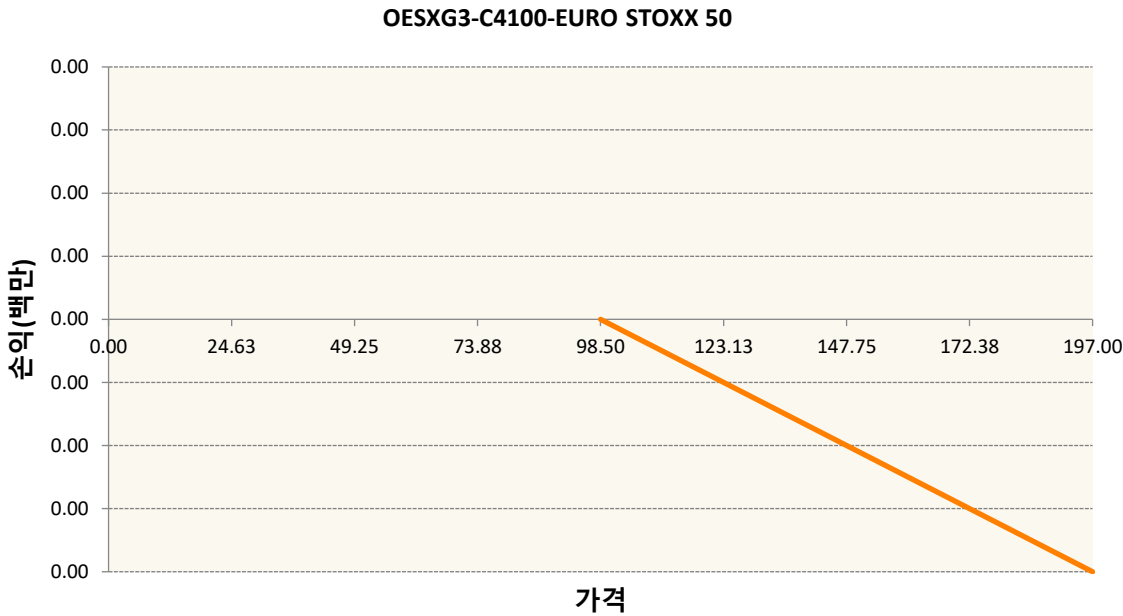
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

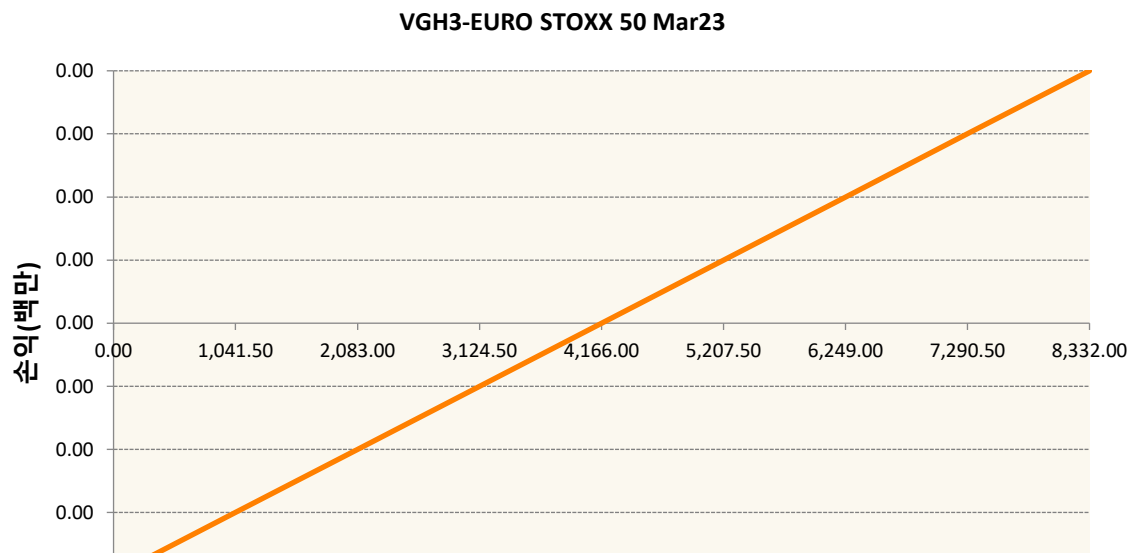
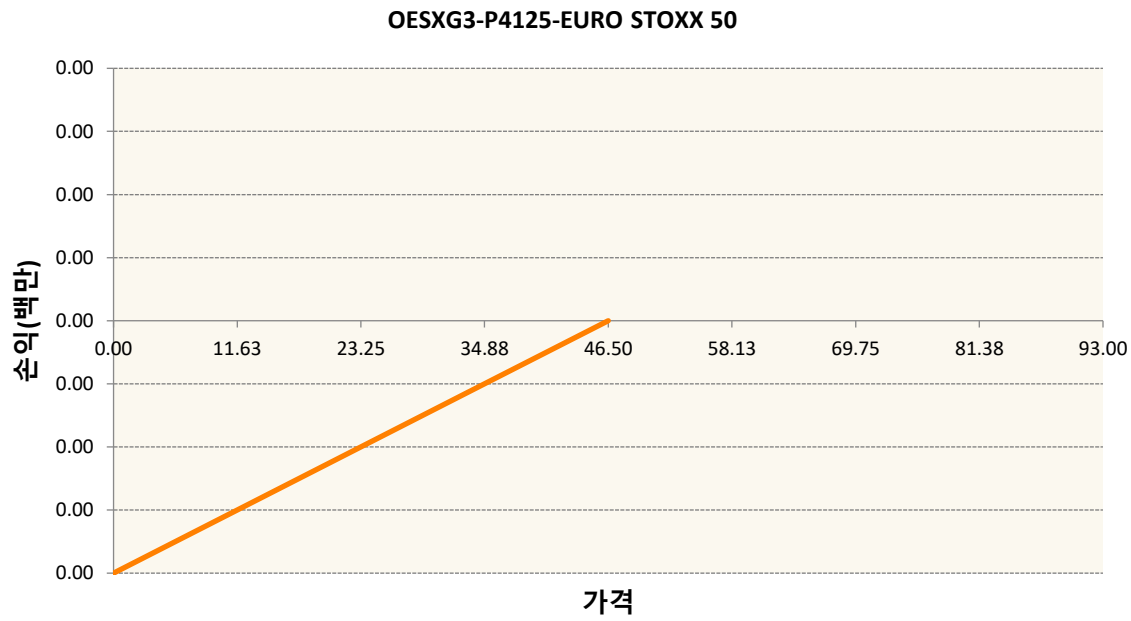
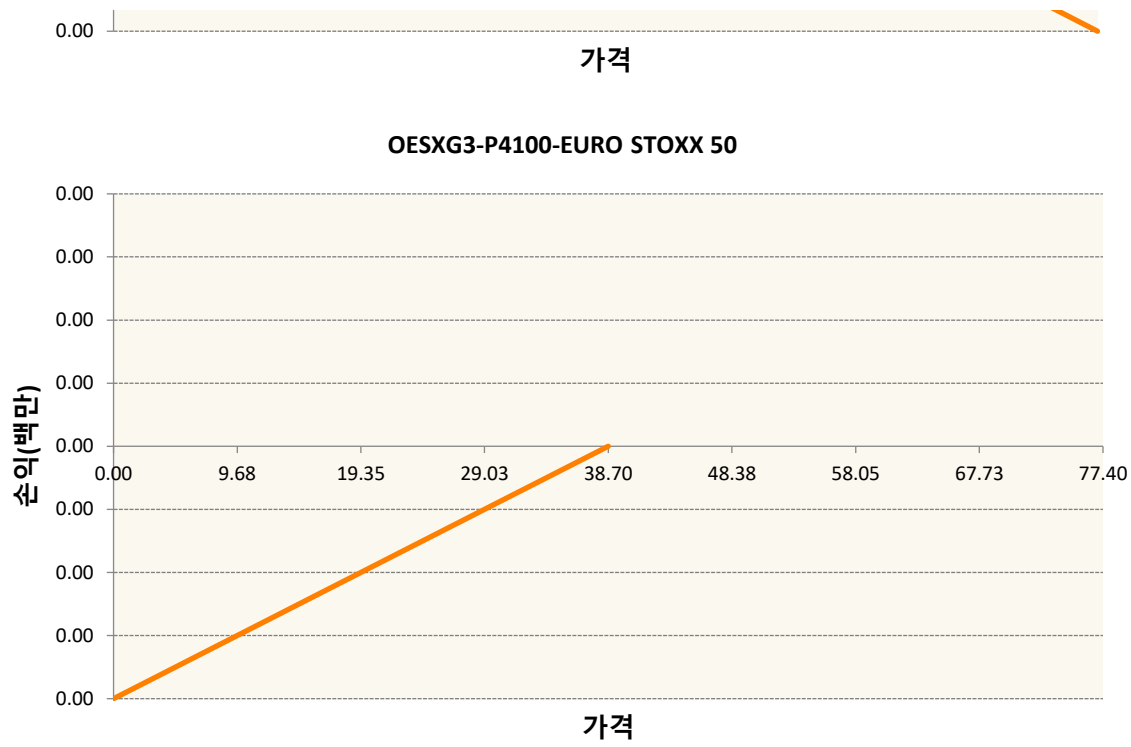
1. 계약금액

(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	982	0	982	
누계	유가증권	옵션	0	64	-64	장내
누계	통화	선도	134	2,070	-1,936	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CBG KRW/EUR 24-02-23E		69
FXW213CBN EUR/KRW 24-02-23E		11
FXW213CCM KRW/EUR 24-03-23E		53
FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E		43
OESXG3-C41 EURO STOXX 50		1
OESXG3-C41 EURO STOXX 50		3
OESXG3-P41 EURO STOXX 50		0.33
OESXG3-P41 EURO STOXX 50		1
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		79

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	222

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

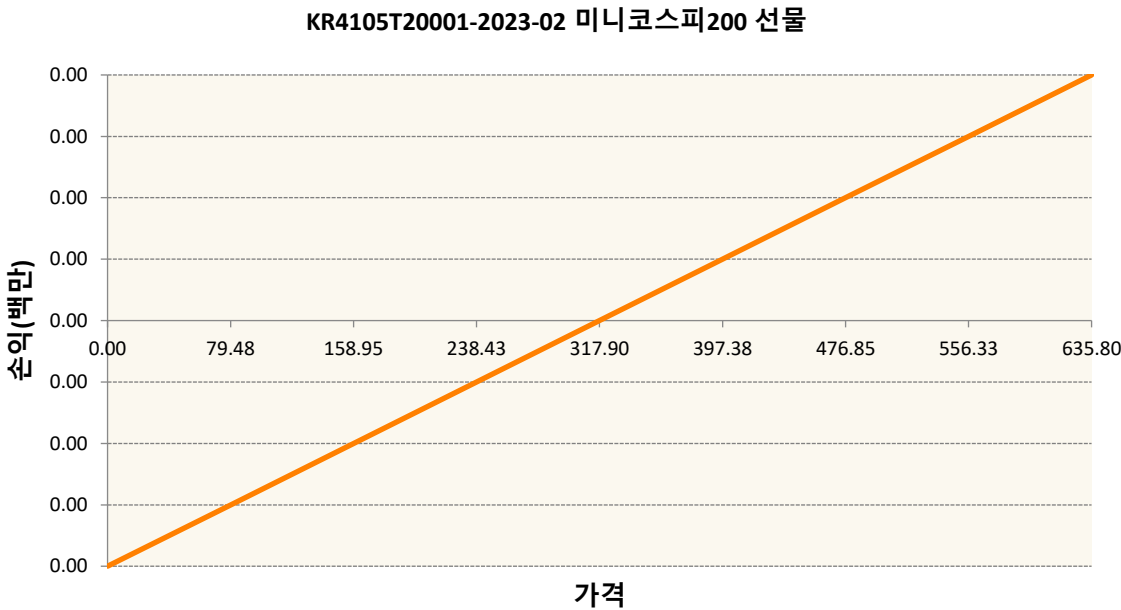
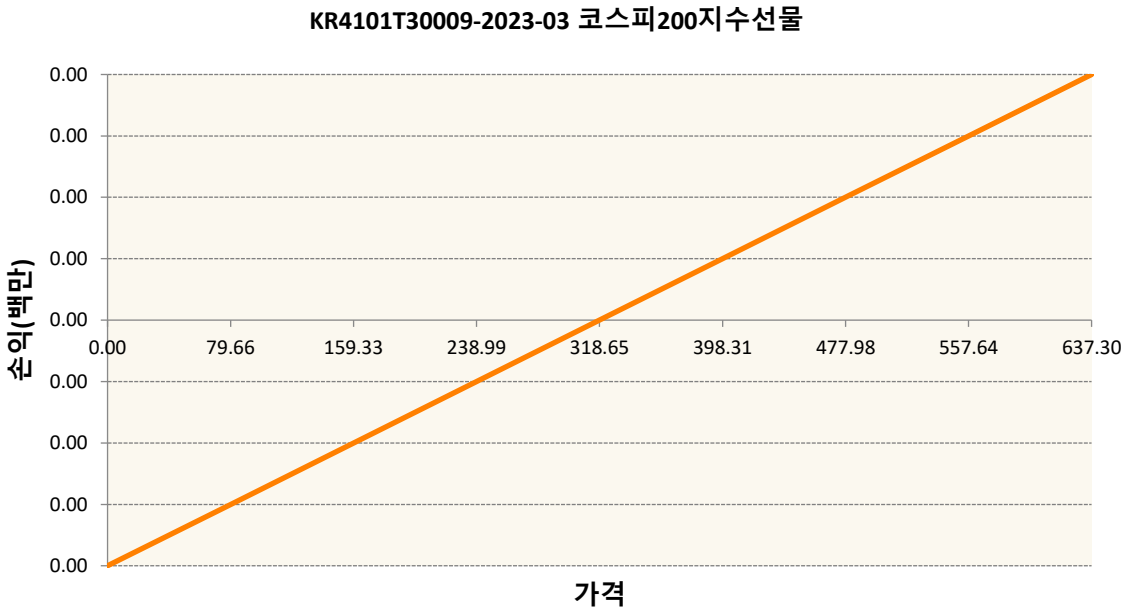
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

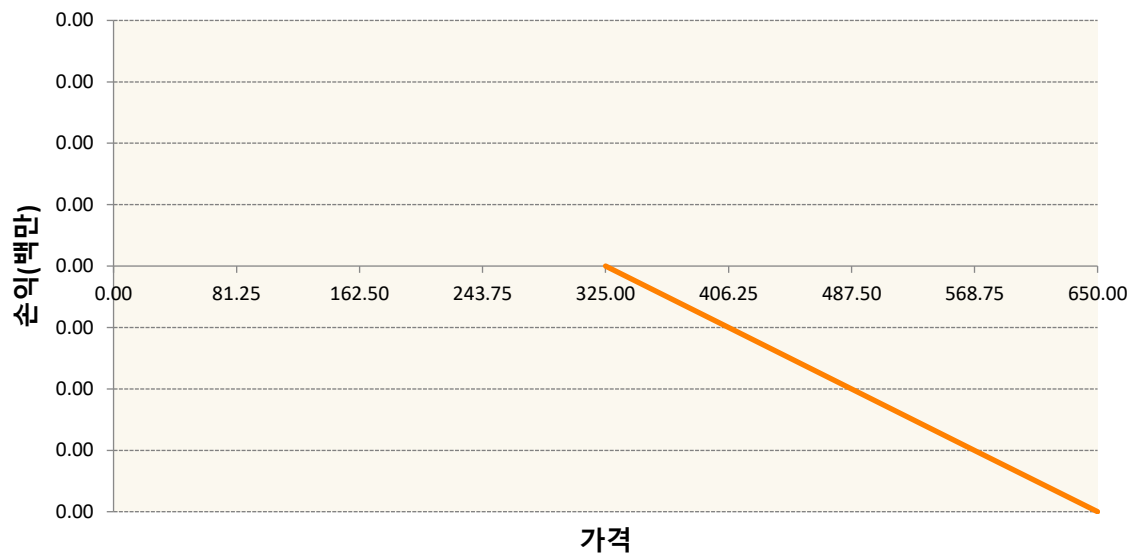
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	79	-79	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	637	0	637	장내
누계	유가증권	옵션	156	3,915	-3,759	장내

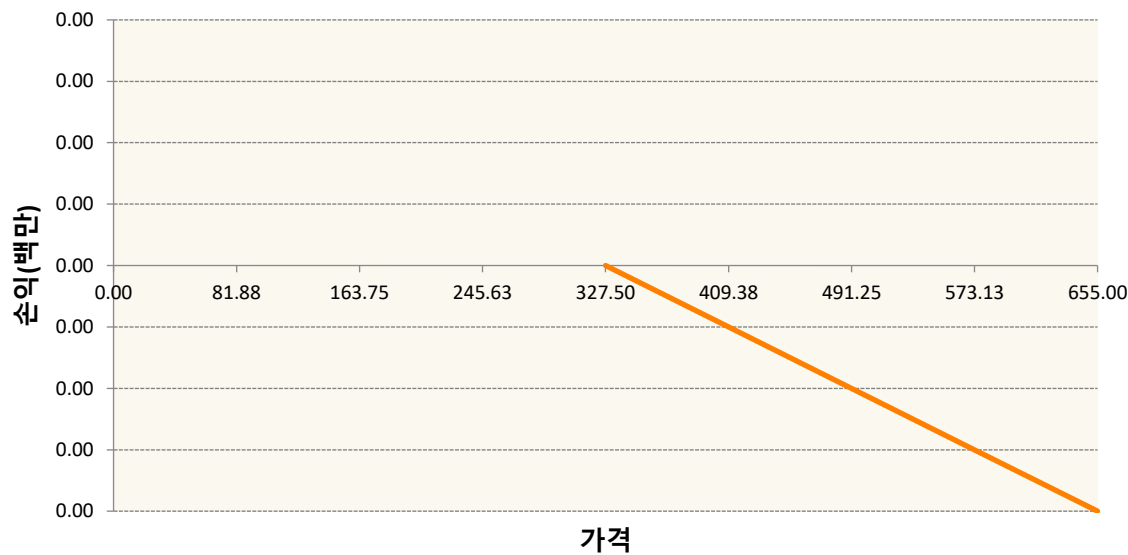
2. 만기시점의 손익구조



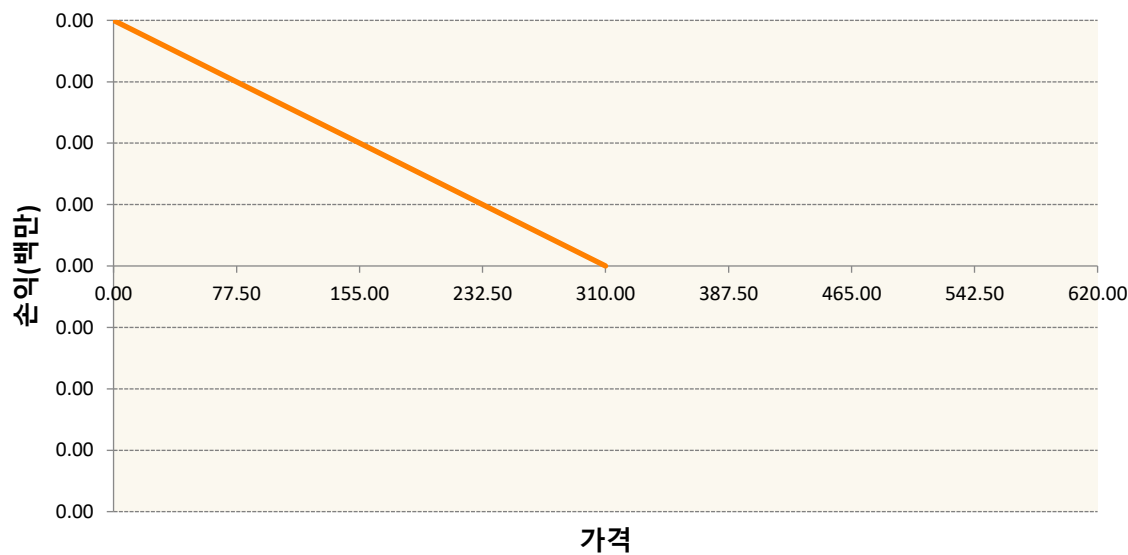
KR4201T23259-2023-02 콜325



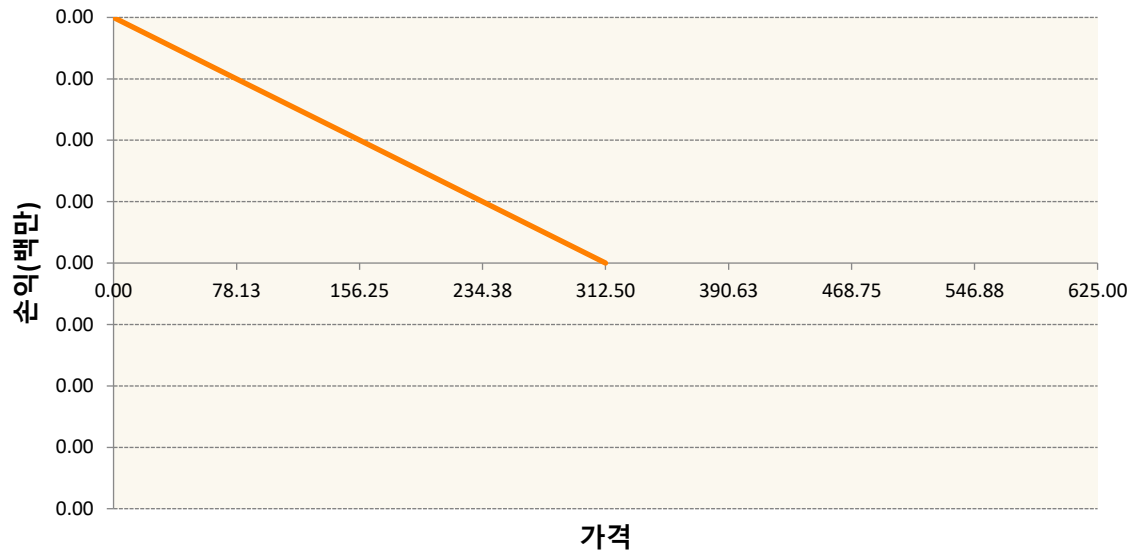
KR4201T23275-2023-02 콜327.5



KR4301T23109-2023-02 풋310



KR4301T23125-2023-02 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				32
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	32	32	32	32	32	32	32
KR4105T20001			2023-02 미니코스피200 선물				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
KR4201T23259			2023-02 콜325				103
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	39	37	36	34	32	30	27
-5.33%	35	33	31	28	25	22	18
-2.67%	28	25	21	17	13	9	4
0%	14	9	5	0	-5	-10	-14

2.67%	-8	-13	-18	-23	-29	-34	-39
5.33%	-39	-44	-49	-54	-58	-63	-68
8.00%	-78	-82	-86	-90	-94	-98	-103
KR4201T23275 2023-02 콜327.5							98
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	33	32	30	28	26	24
-5.33%	31	29	27	25	22	19	16
-2.67%	25	22	19	15	11	7	3
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14
2.67%	-6	-11	-16	-21	-27	-32	-37
5.33%	-35	-40	-45	-50	-55	-60	-65
8.00%	-72	-75	-80	-84	-88	-93	-98
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	4	4	4	4
-5.33%	2	2	2	2	2	2	3
-2.67%	0	1	1	1	1	1	2
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	0	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-1	-1	-1	-1	-1	-1
KR4301T23125 2023-02 풋312.5							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	3	3
-2.67%	0	1	1	1	1	1	2
0%	-1	0	0	0	0	0	1
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	0	0
5.33%	-2	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-2	-2	-2	-2	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

219

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

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	6,681	0	6,681	

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	2023-02-01
기준일	2023-01-31

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	5,573	0	5,573	

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	2023-02-01
기준일	2023-01-31

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	18,929	0	18,929	
누계	통화	선도	0	19,002	-19,002	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CBQ KRW/USD 28-02-23E	630
FXW213CCS(KRW/USD 28-03-23E	522
FXW213D1S(KRW/USD 28-04-23E	294
FXW213D1T(KRW/USD 28-02-23E	74
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

822

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

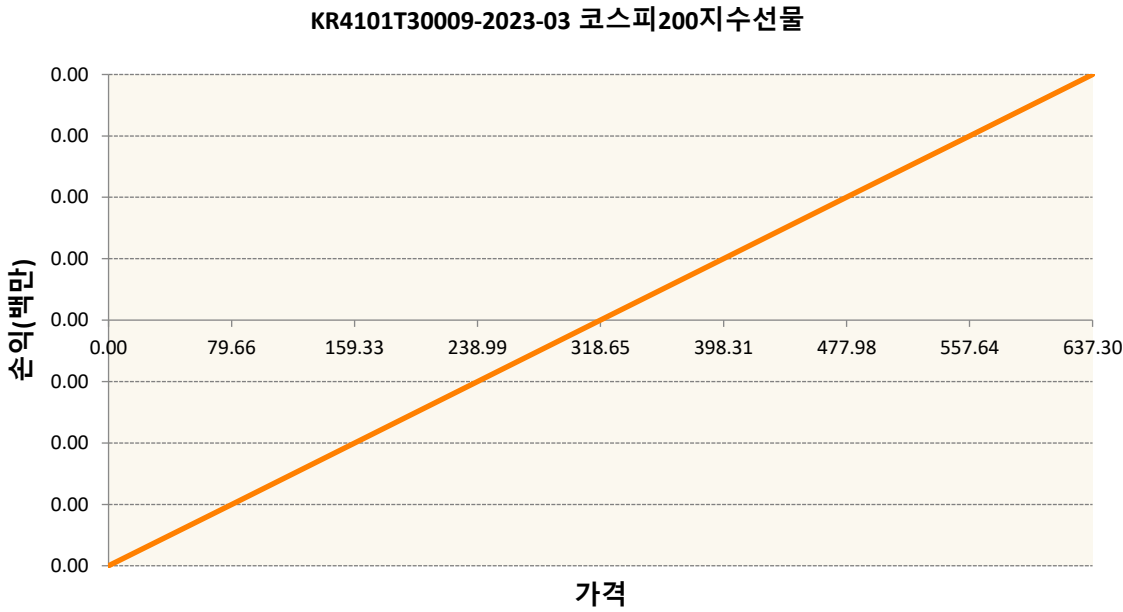
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	159	0	159	장내
누계	유가증권	선물	1,036	0	1,036	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

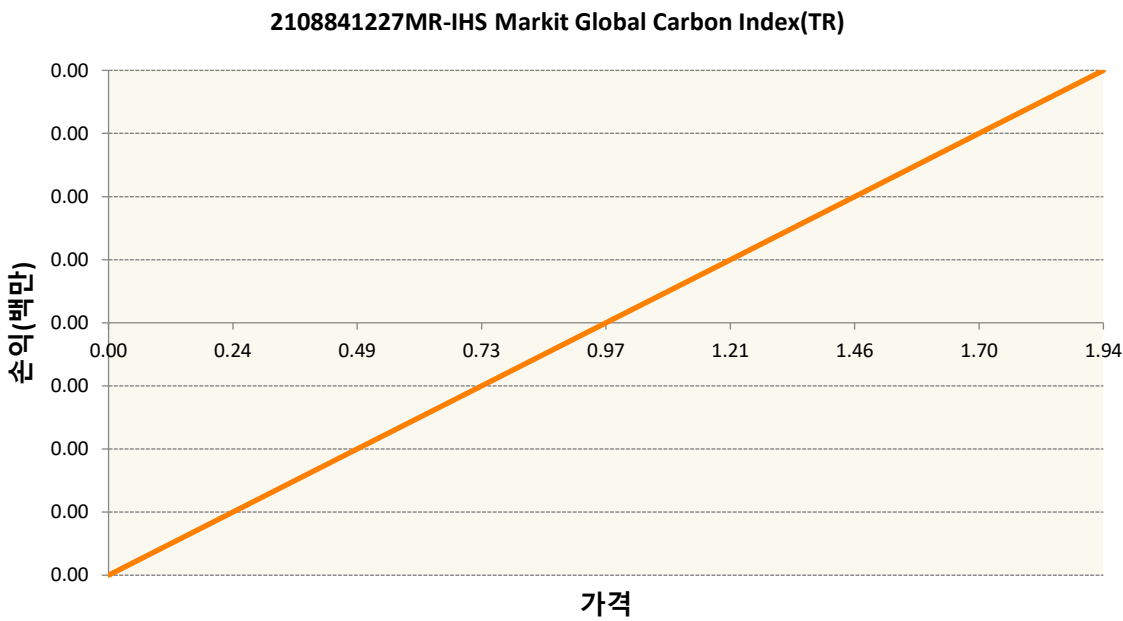
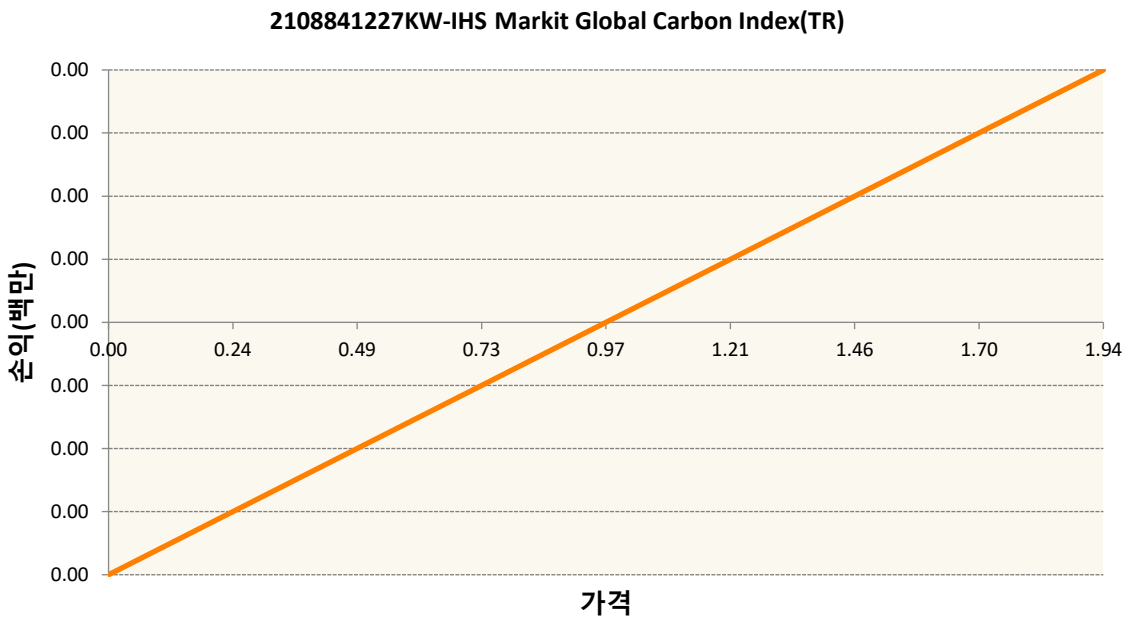
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

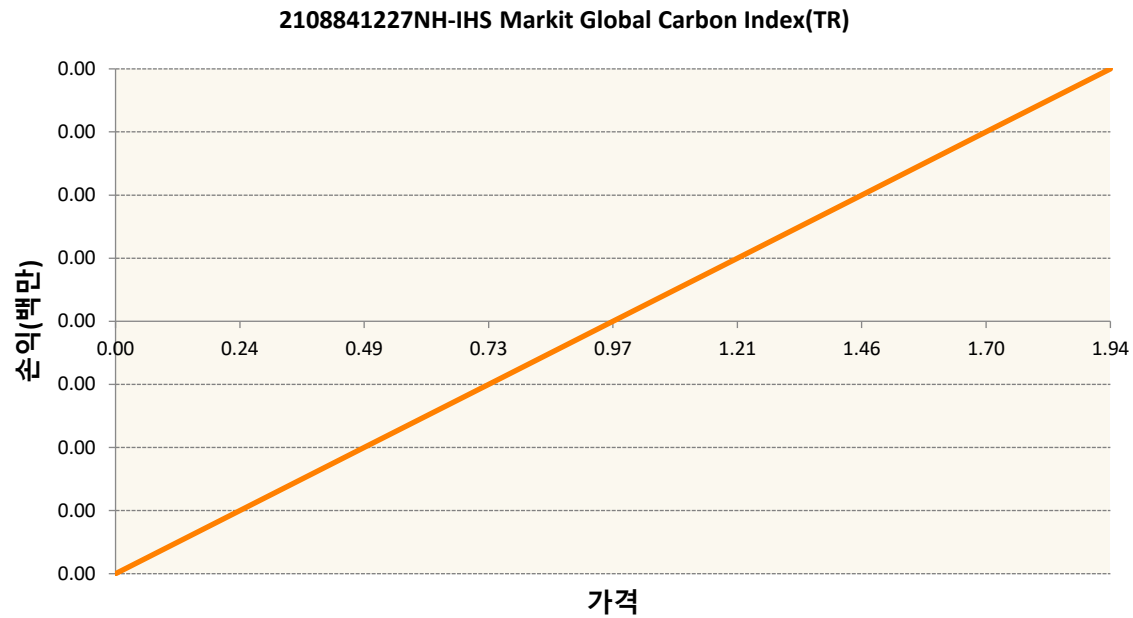
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	23,616	0	23,616	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,609
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		189
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		95

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,637

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

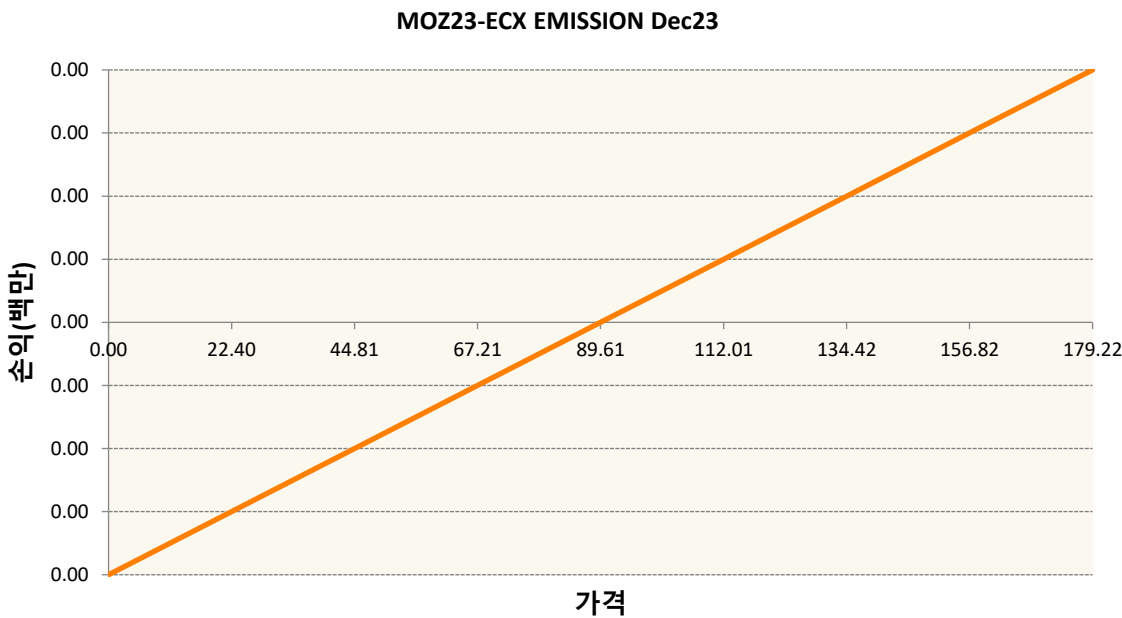
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	13,709	0	13,709	
누계	통화	선도	0	4,568	-4,568	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	107
FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	195
FXW213D1X(KRW/EUR 24-02-23E	64
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,097

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

(단위:백만원)

3,133

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

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)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	20

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

(단위:백만원)

145

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

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	8,619	0	8,619	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(NH)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	7

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

(단위:백만원)

39

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

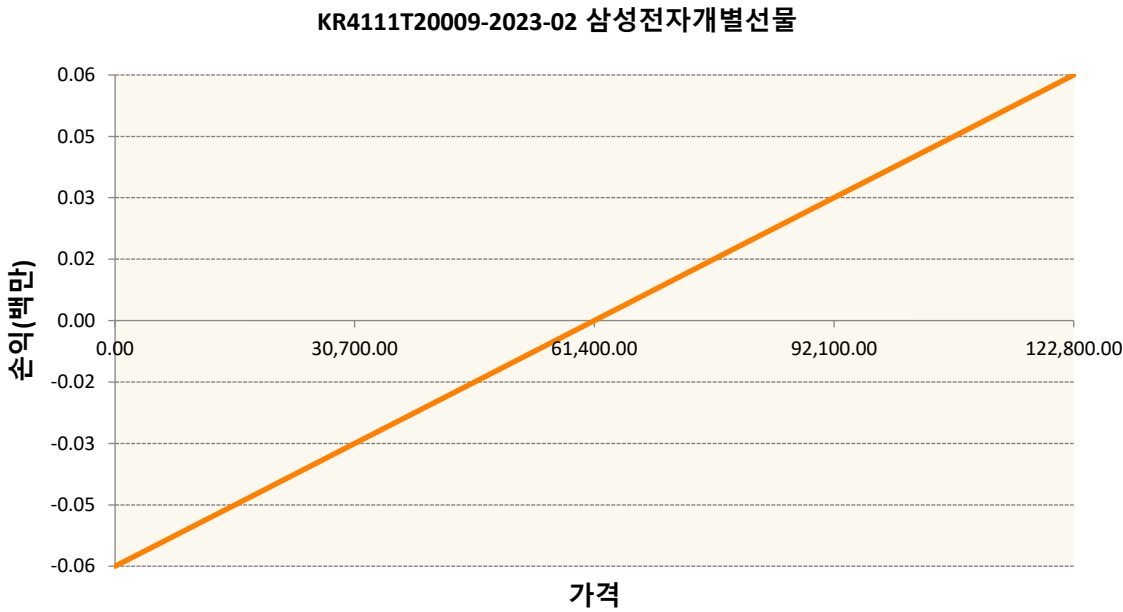
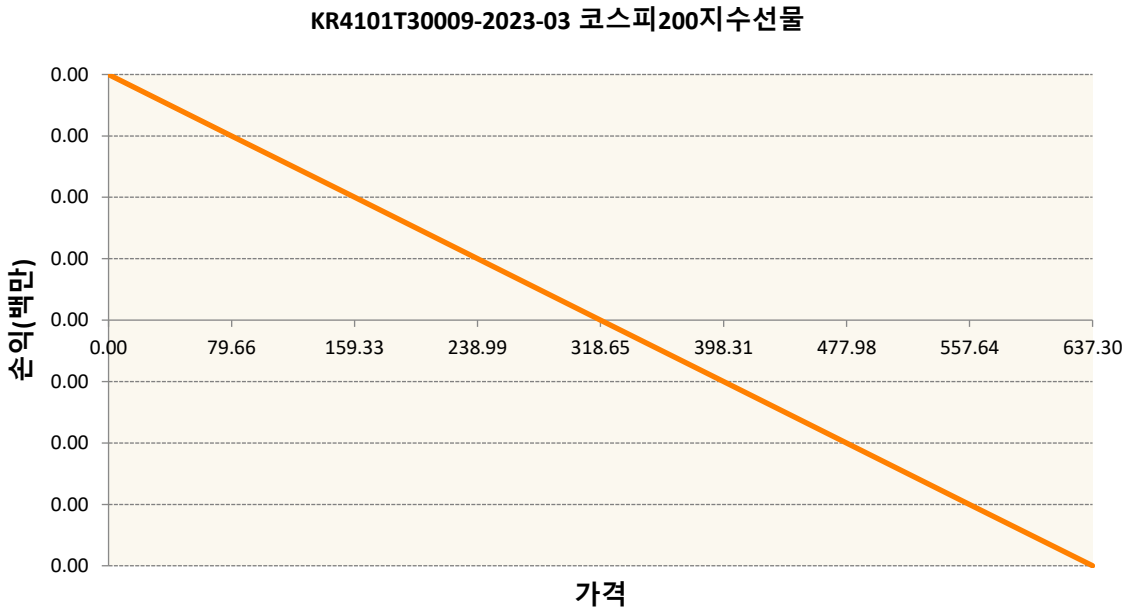
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

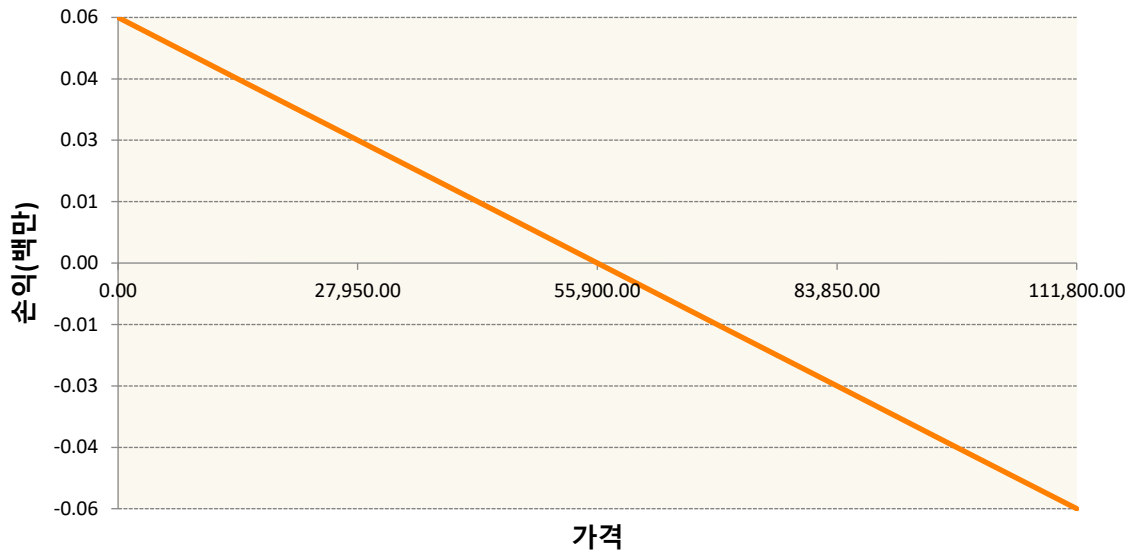
(단위:백만원)

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	461	1,347	-887	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

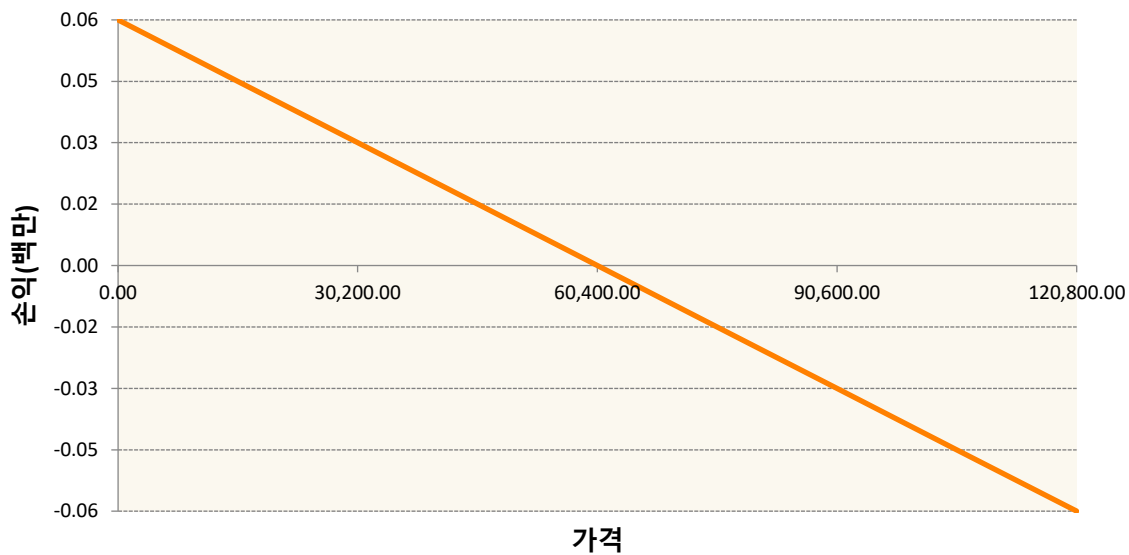
2. 만기시점의 손익구조



KR4146T20005-2023-02 KB금융개별선물



KR41F7T20001-2023-02 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T300 2023-03 코스피200지수선물	76
KR4111T200 2023-02 삼성전자개별선물	37
KR4146T200 2023-02 KB금융개별선물	13
KR41F7T200 2023-02 카카오페이개별선물	18
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	0.22
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	0.36

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

(단위:백만원)

232

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

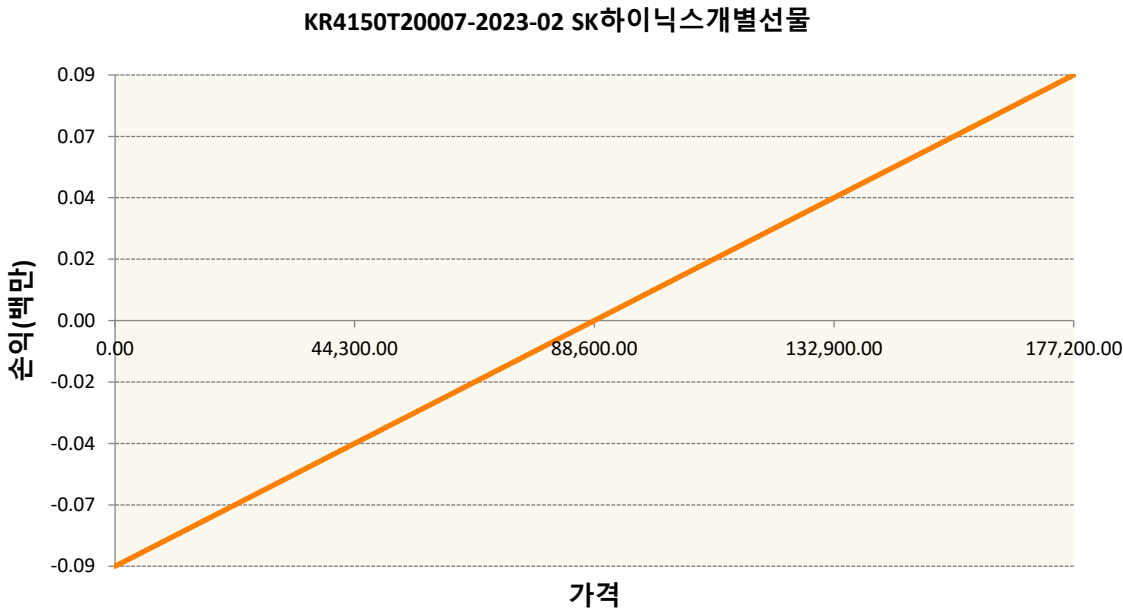
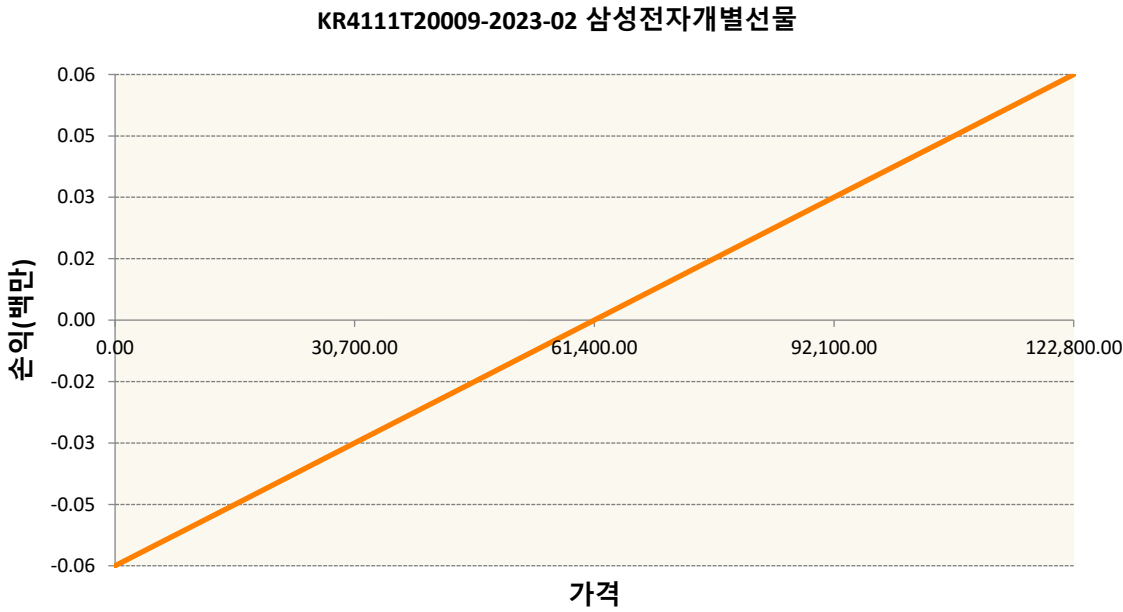
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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	151	0	151	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	-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)

6

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

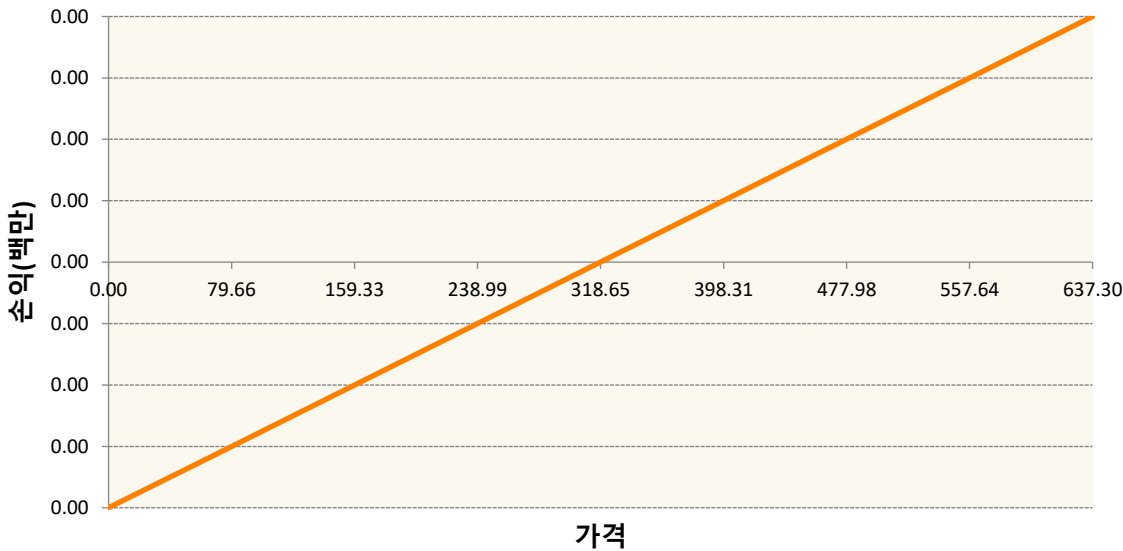
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	398	0	398	장내
누계	유가증권	선물	2,151	0	2,151	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T30009-2023-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					171
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	57	57	57	57	57	57	57
5.33%	114	114	114	114	114	114	114
8.00%	171	171	171	171	171	171	171

공시일 2023-02-01

기준일 2023-01-31

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

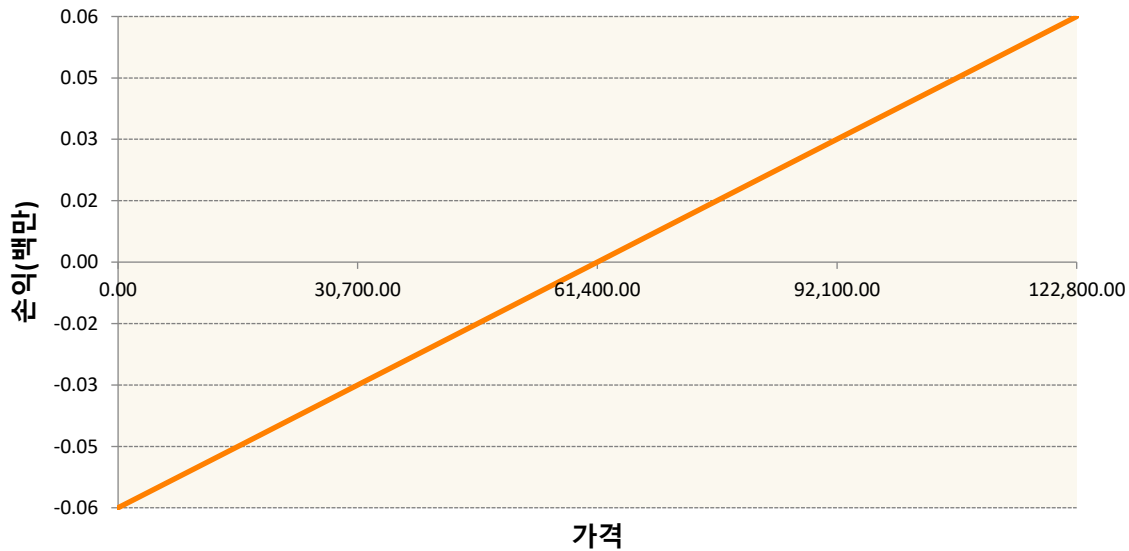
1. 계약금액

(단위:백만원)

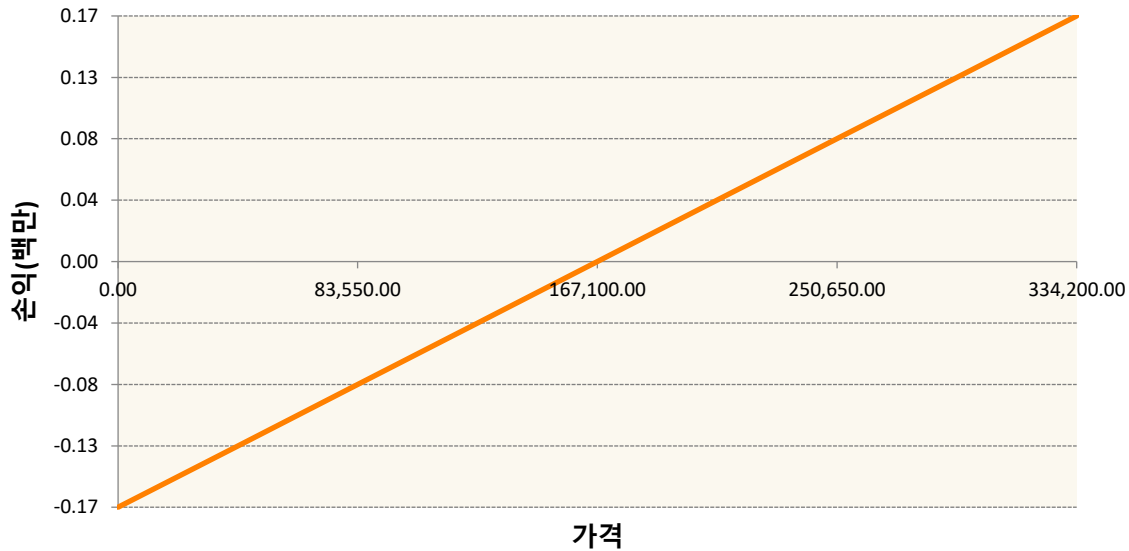
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	244	0	244	장내

2. 만기시점의 손익구조

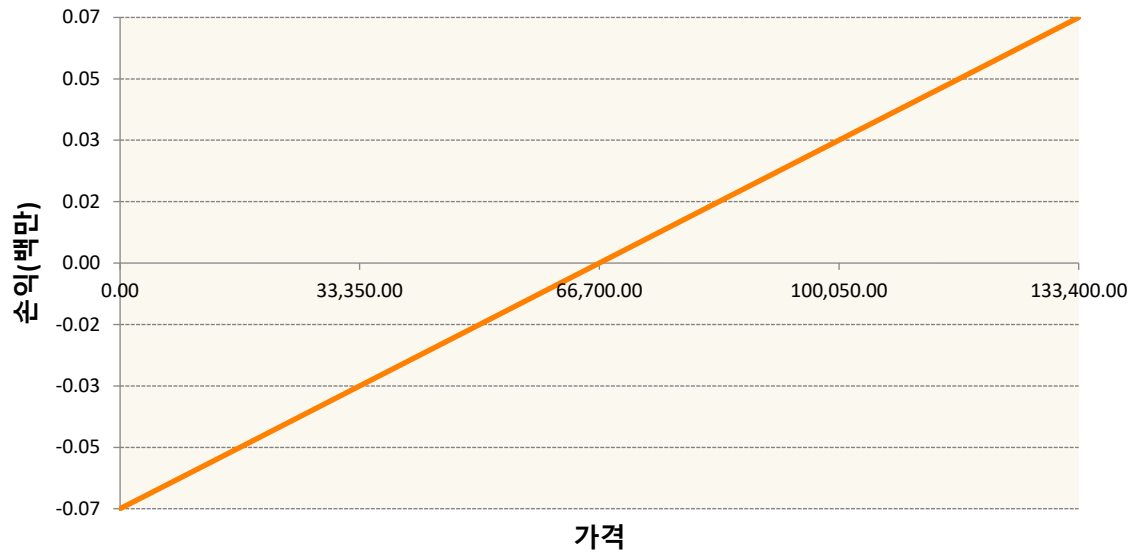
KR4111T20009-2023-02 삼성전자개별선물



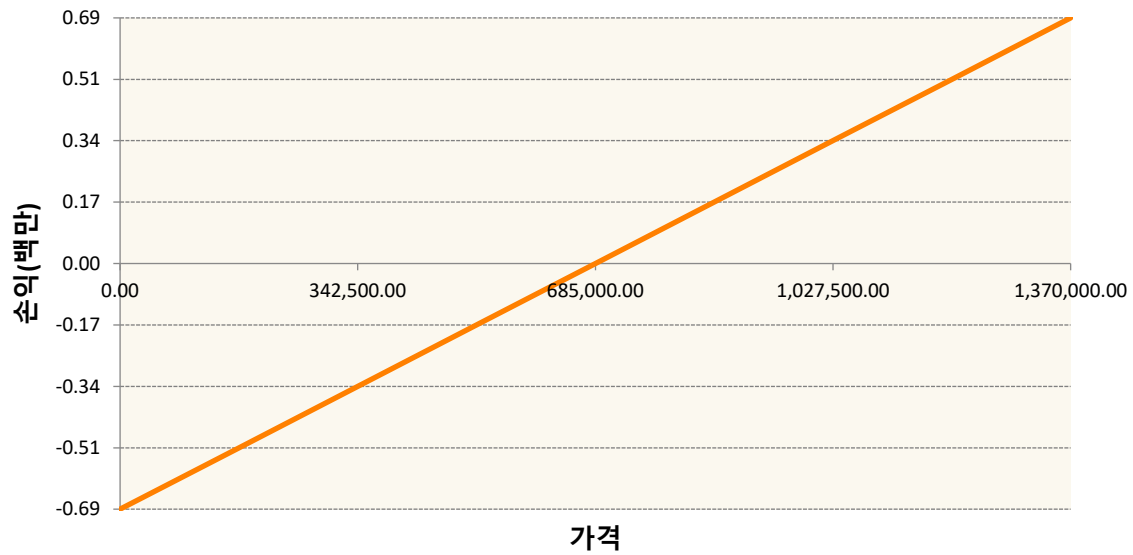
KR4116T20008-2023-02 현대차개별선물



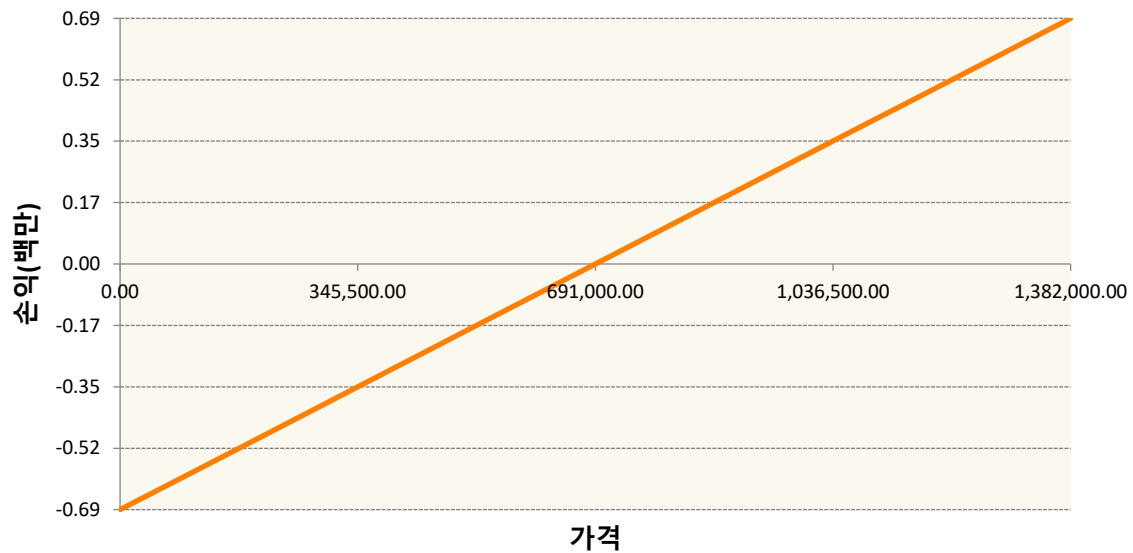
KR4119T20002-2023-02 기아개별선물



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							11
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
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 2023-02-01

기준일 2023-01-31

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

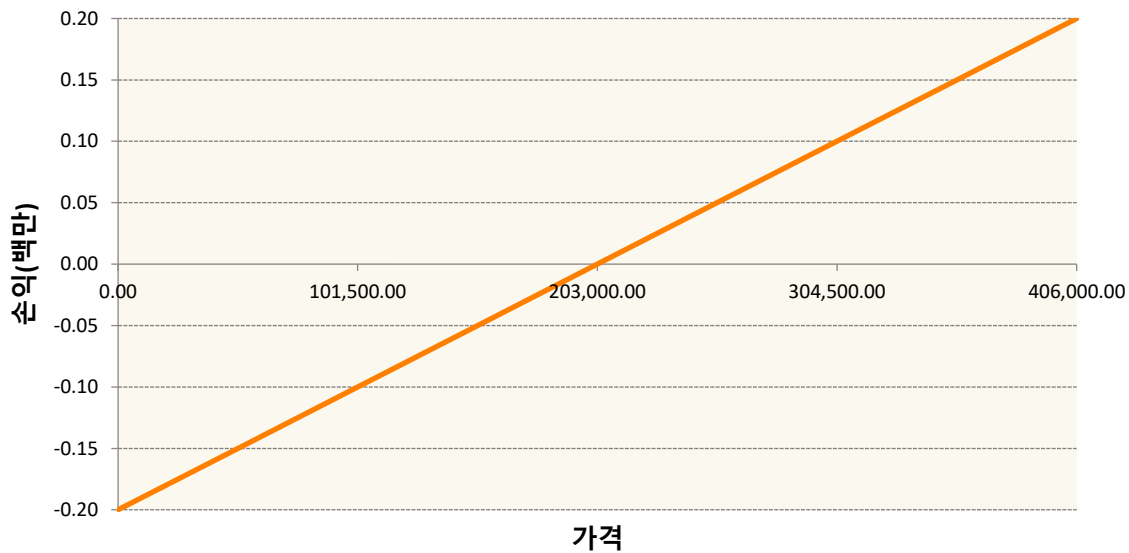
1. 계약금액

(단위:백만원)

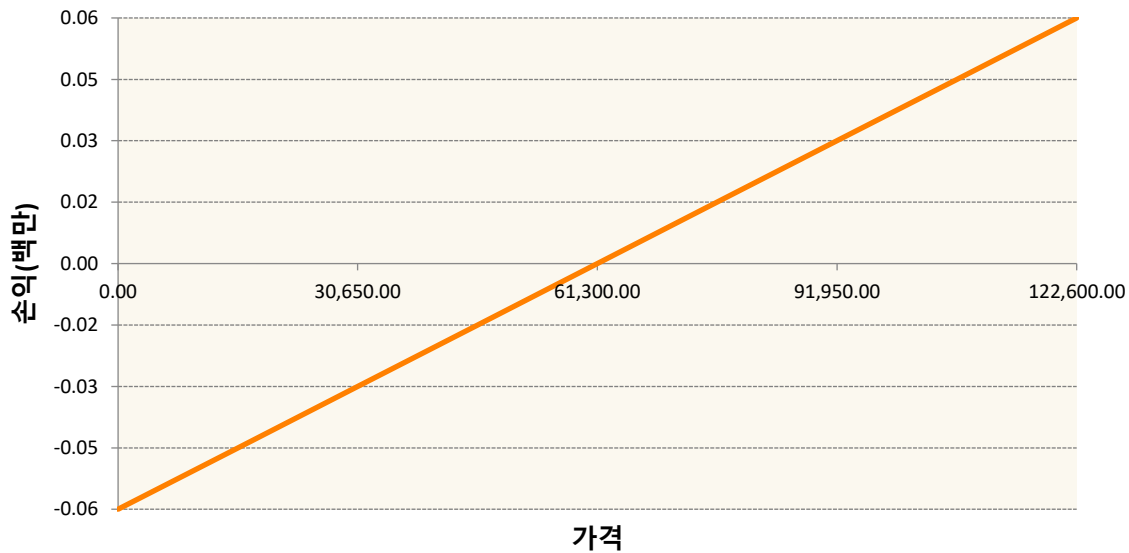
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	126	0	126	장내

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
-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)

12

공시일	2023-02-01
기준일	2023-01-31

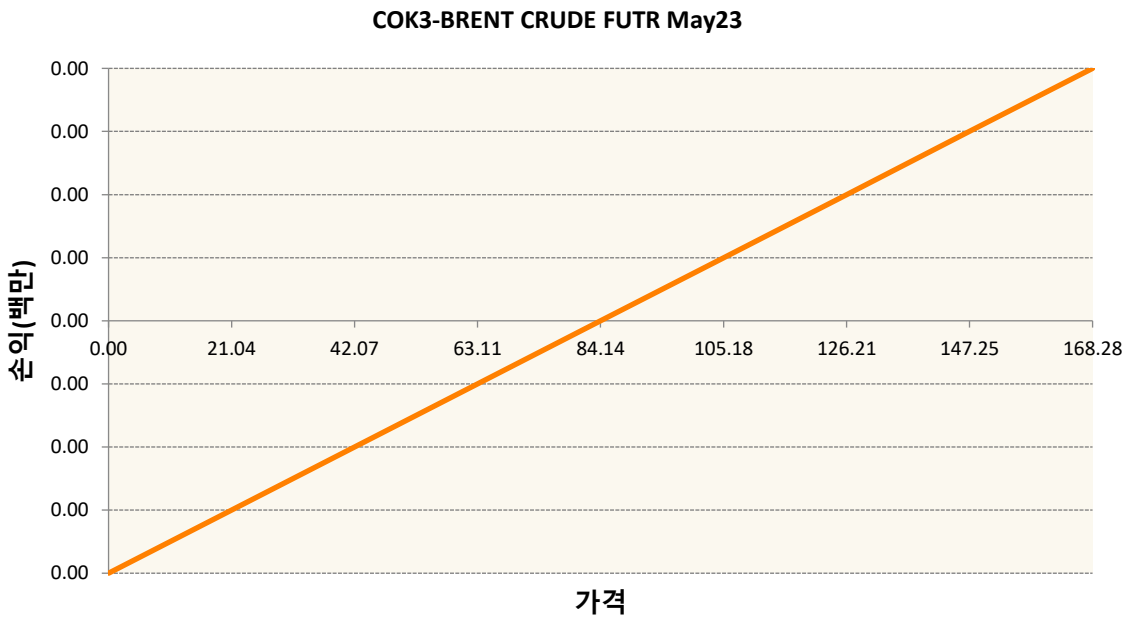
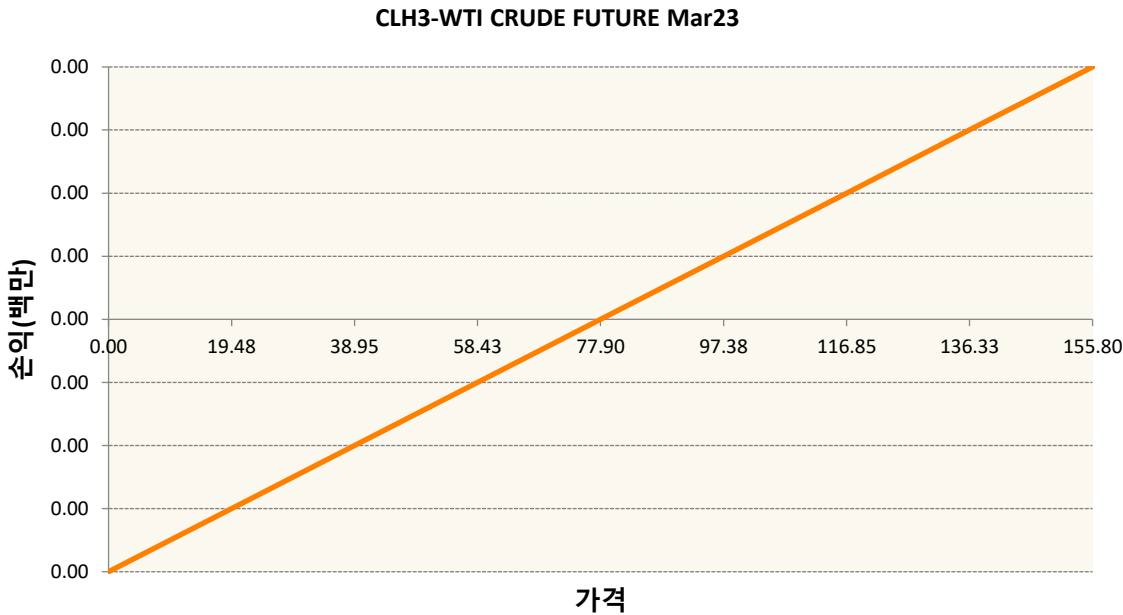
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

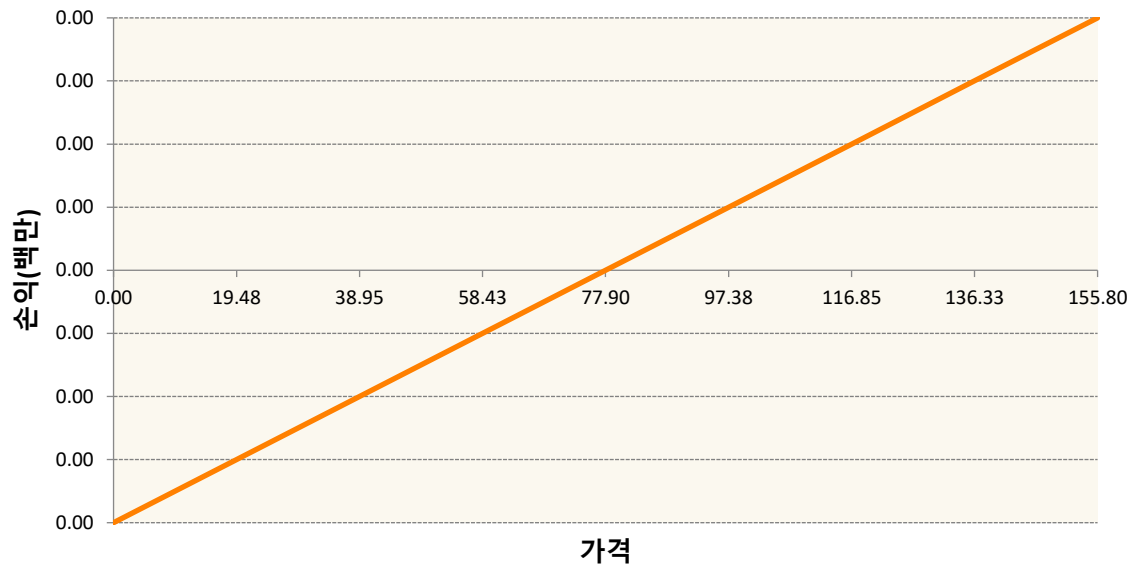
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,810	271	1,539	

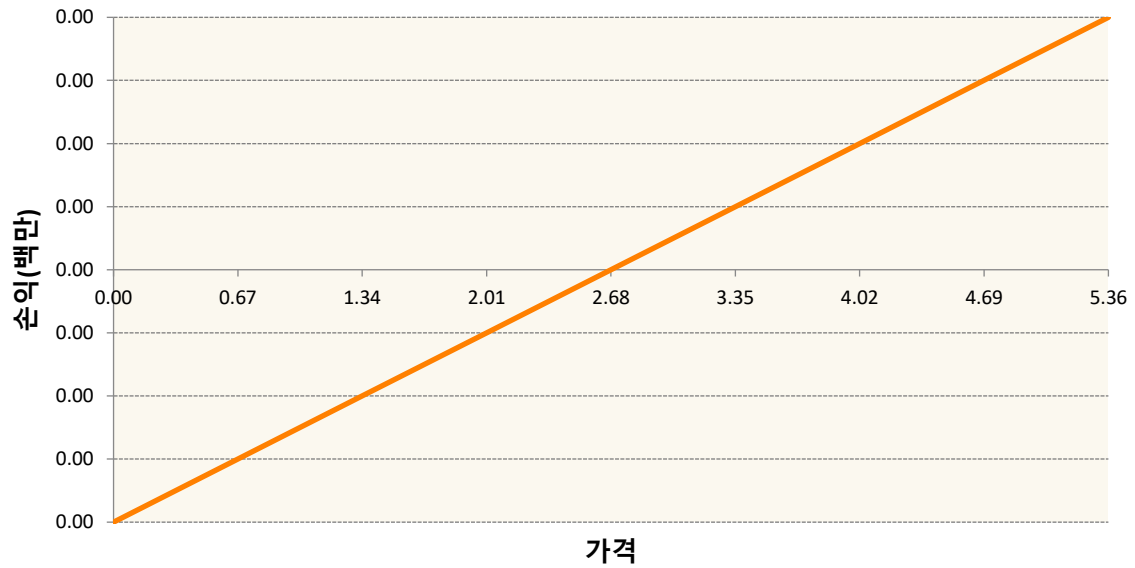
2. 만기시점의 손익구조



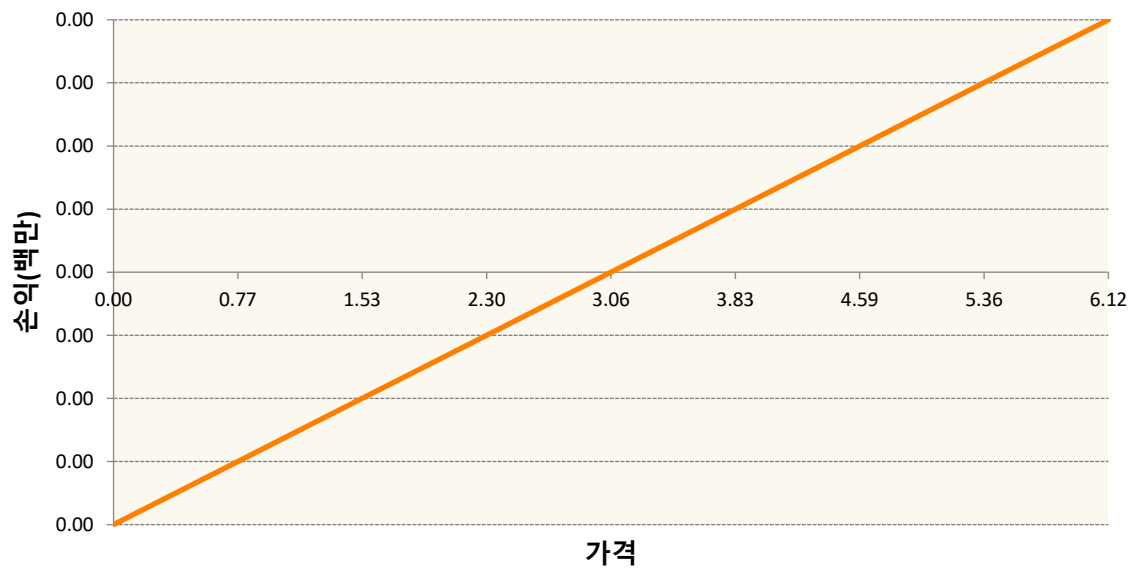
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



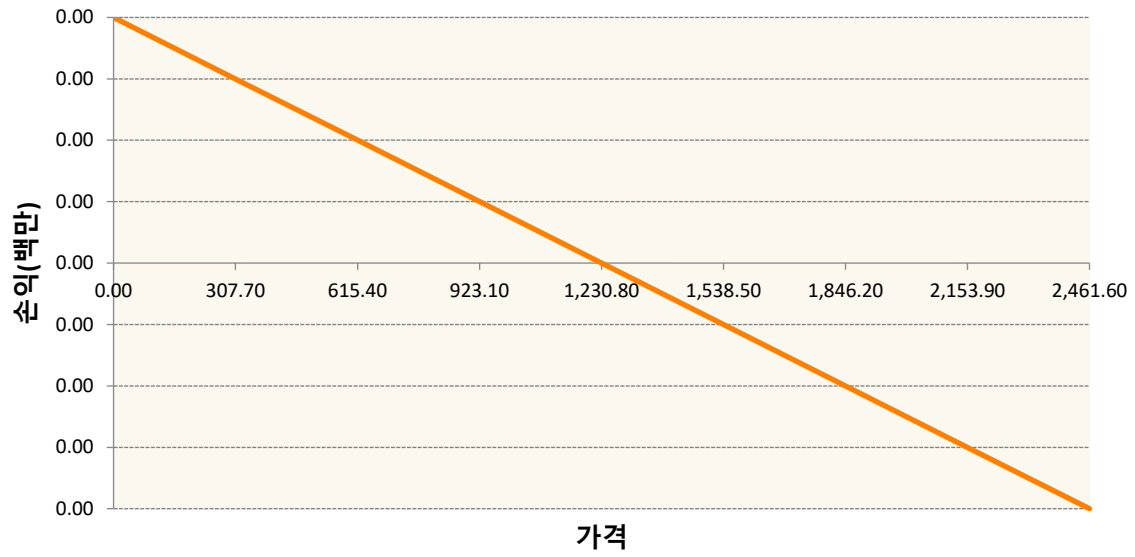
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



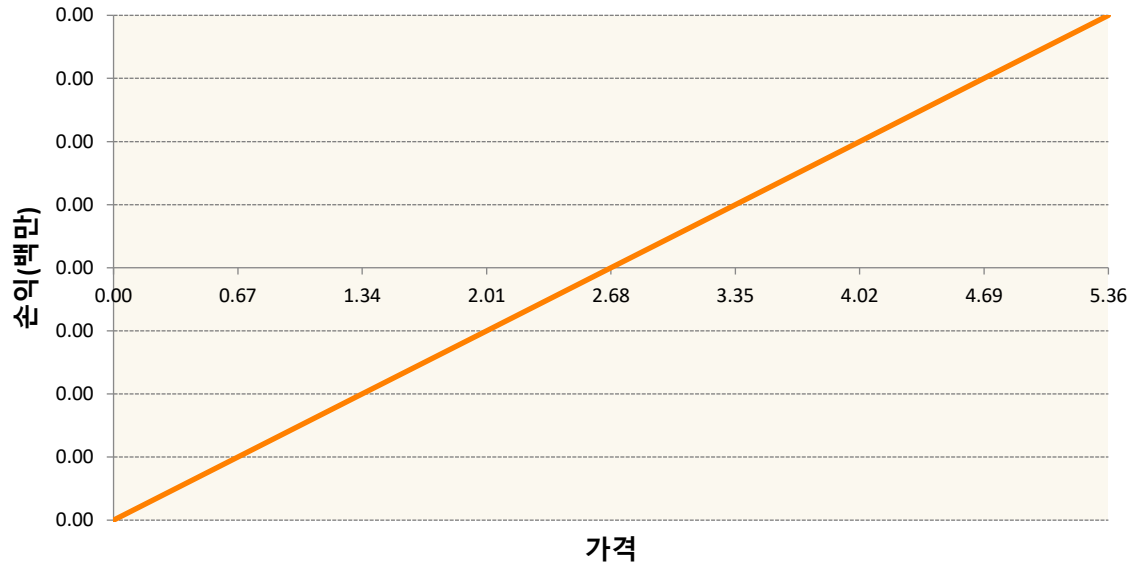
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



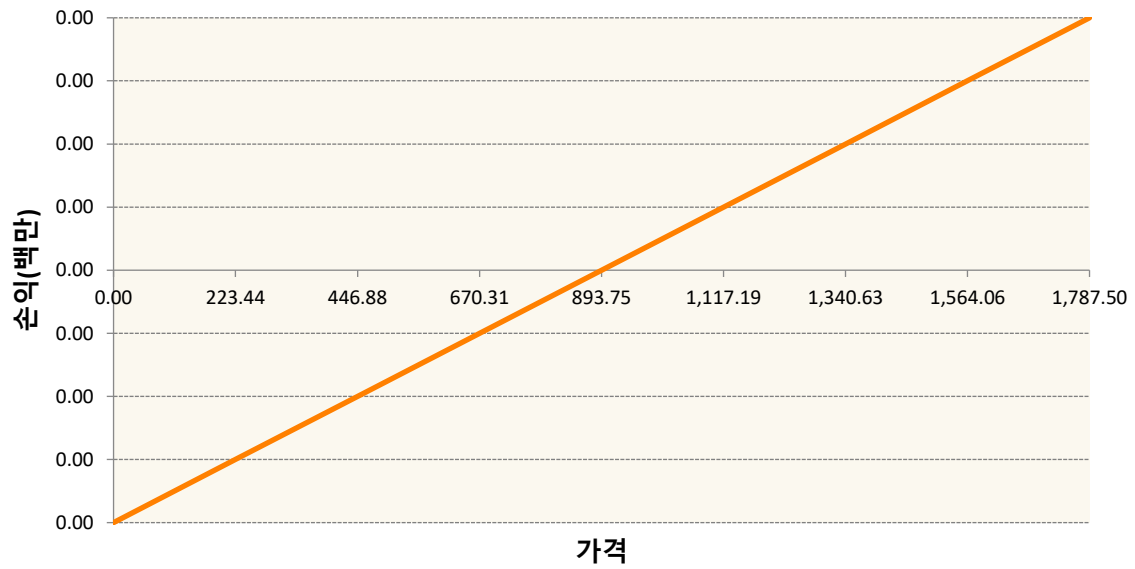
KR4175T20004-2023-02 달러선물

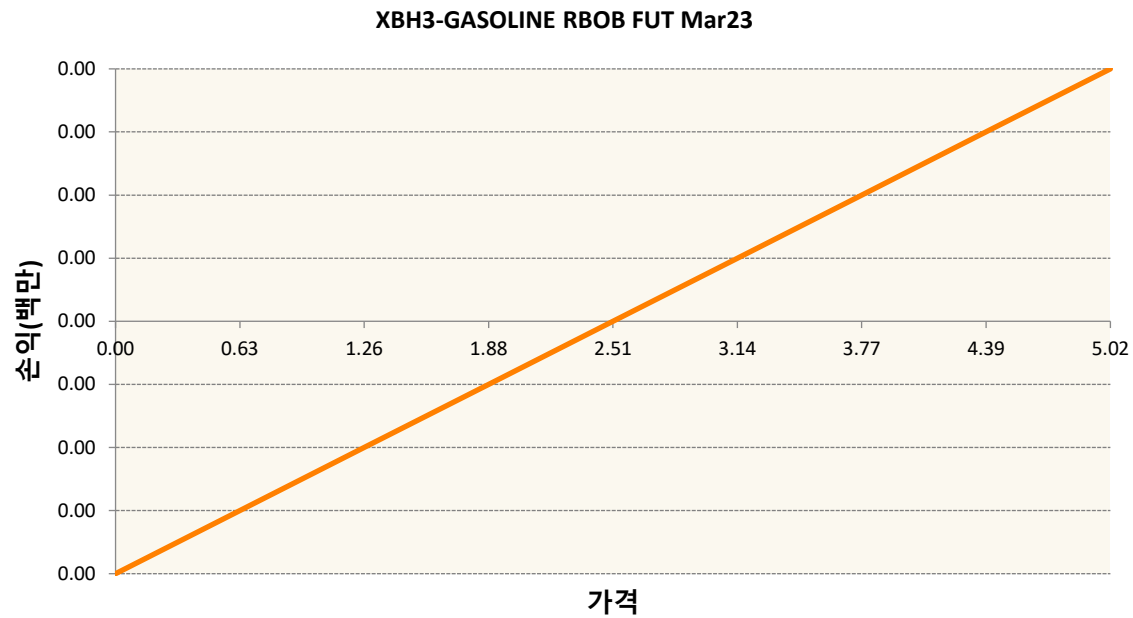


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	32
COK3	BRENT CRUDE FUTR May23	34
ECH3	E-mini Crude Oil Mar23	4
EOH3	E-MINI NATURAL GAS Mar23	3
HOH3	NY Harb ULSD Fut Mar23	13
KR4175T200 2023-02 달러선물		22
NGH23	NATURAL GAS FUTR Mar23	29
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	18
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	469