

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

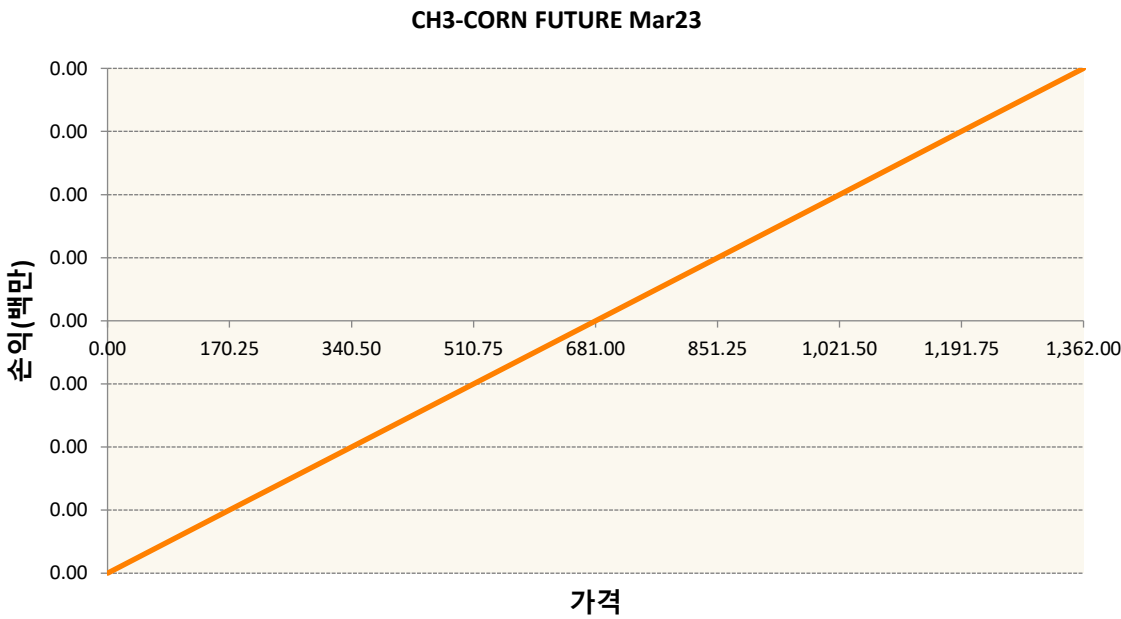
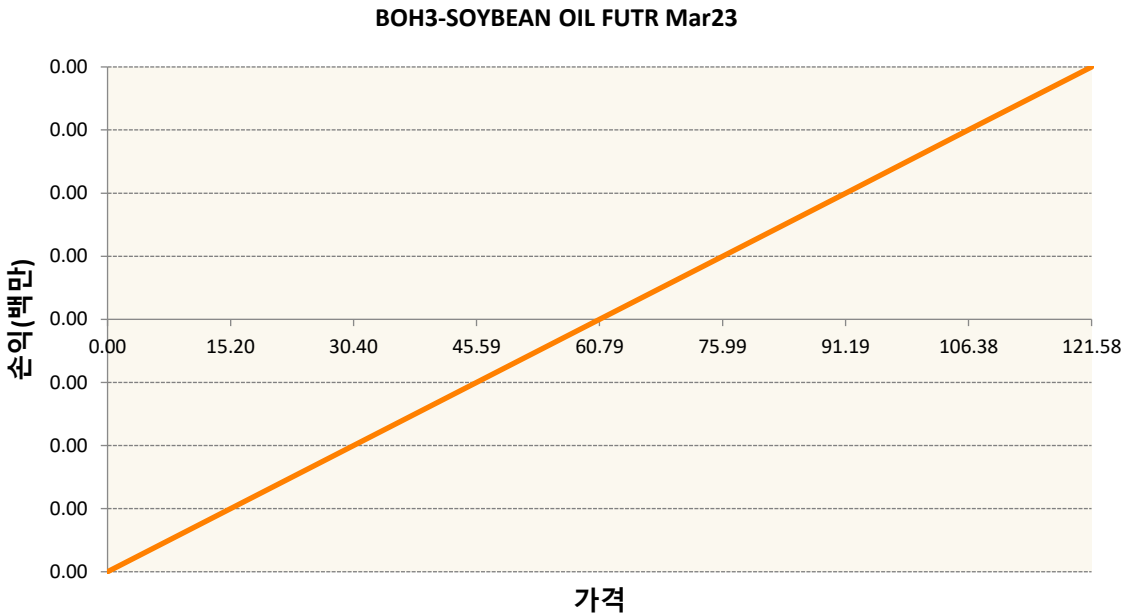
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

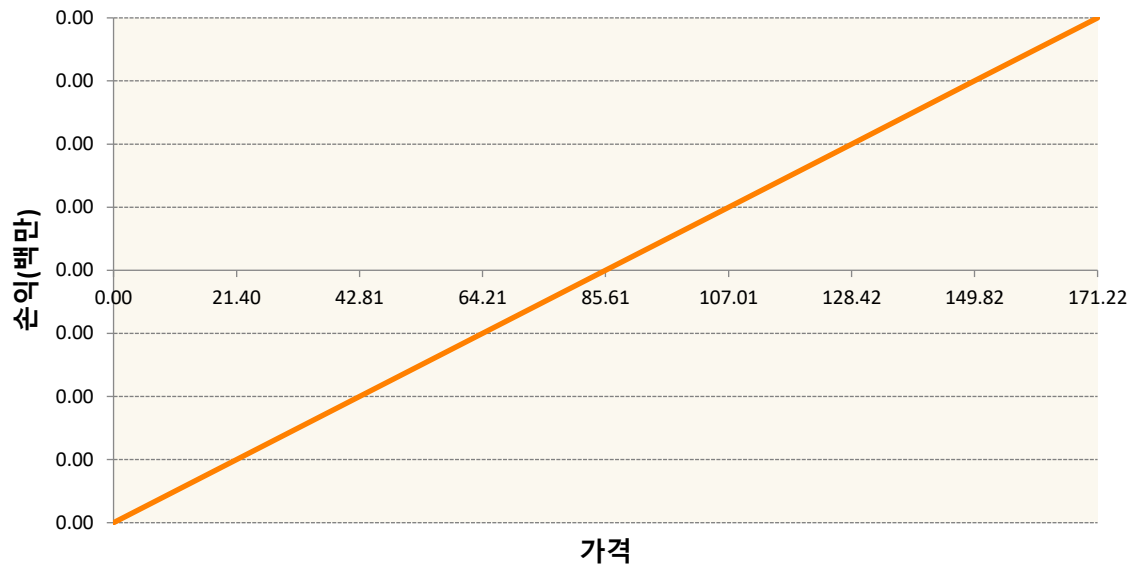
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,728	732	5,996	

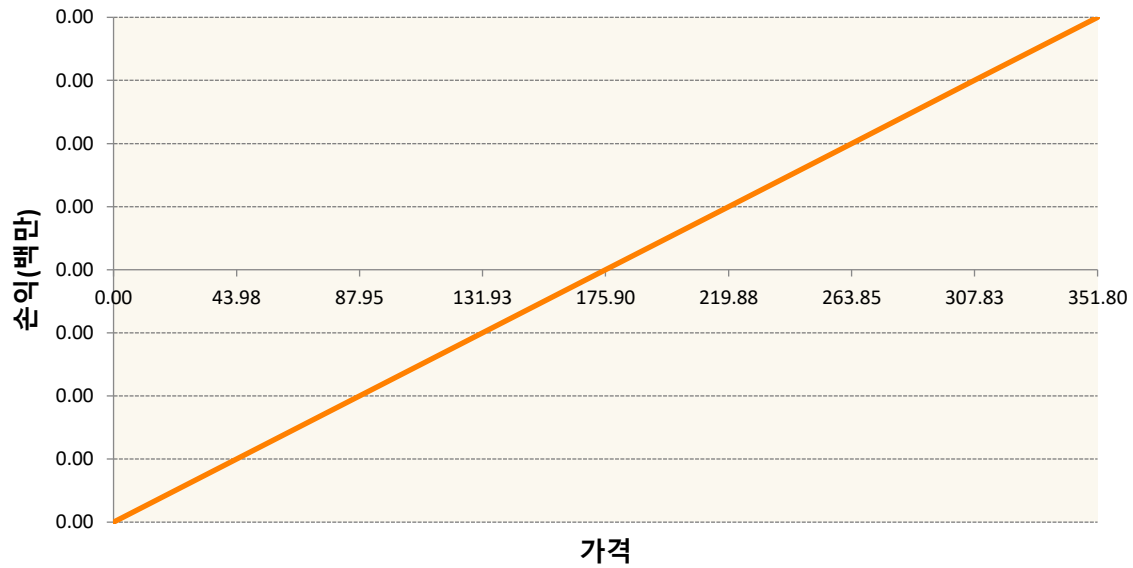
2. 만기시점의 손익구조



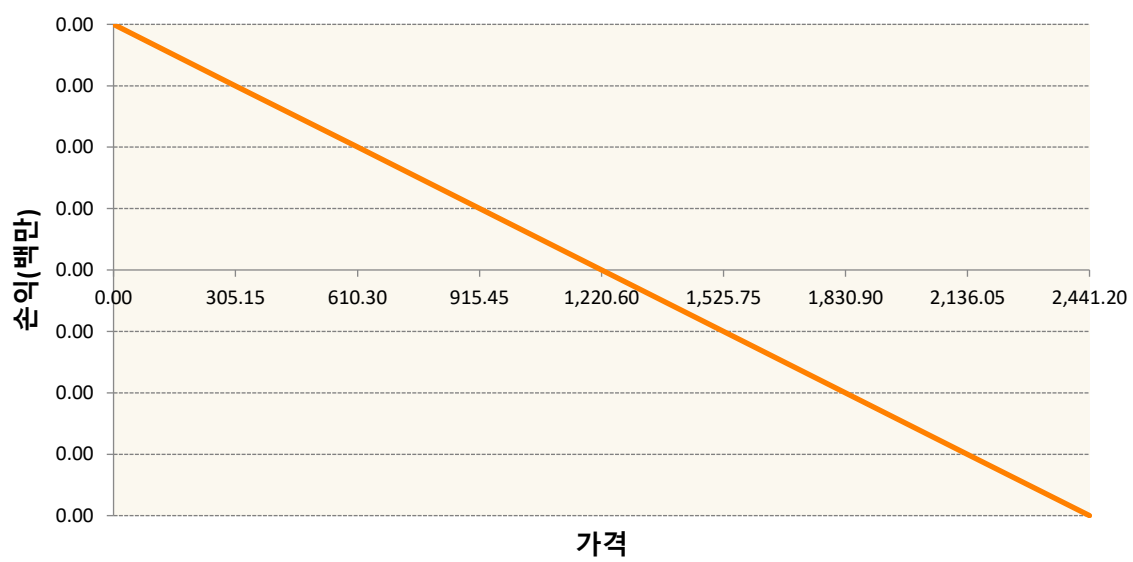
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



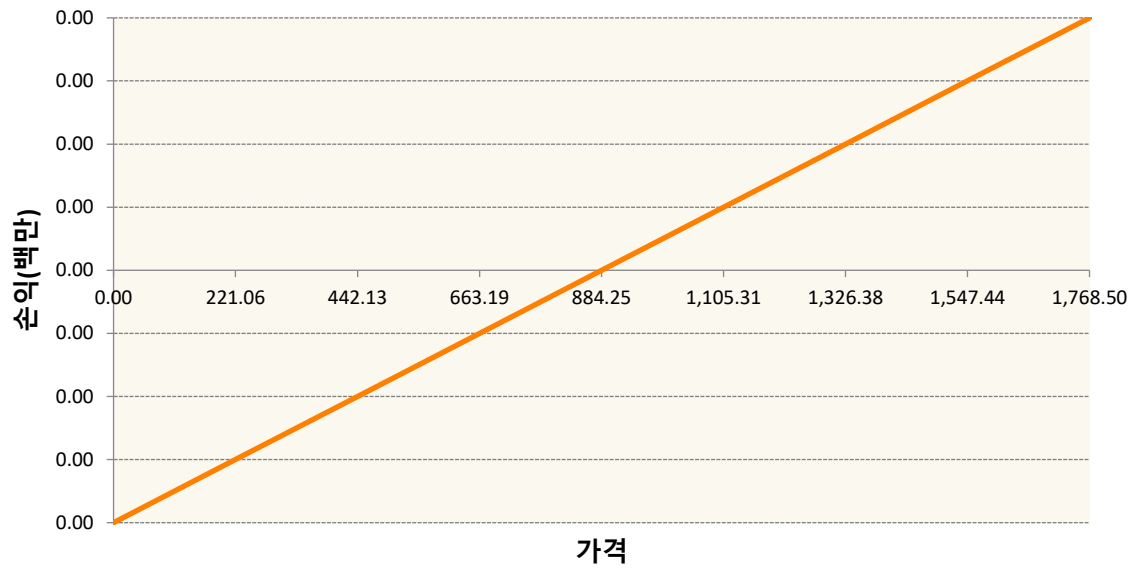
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



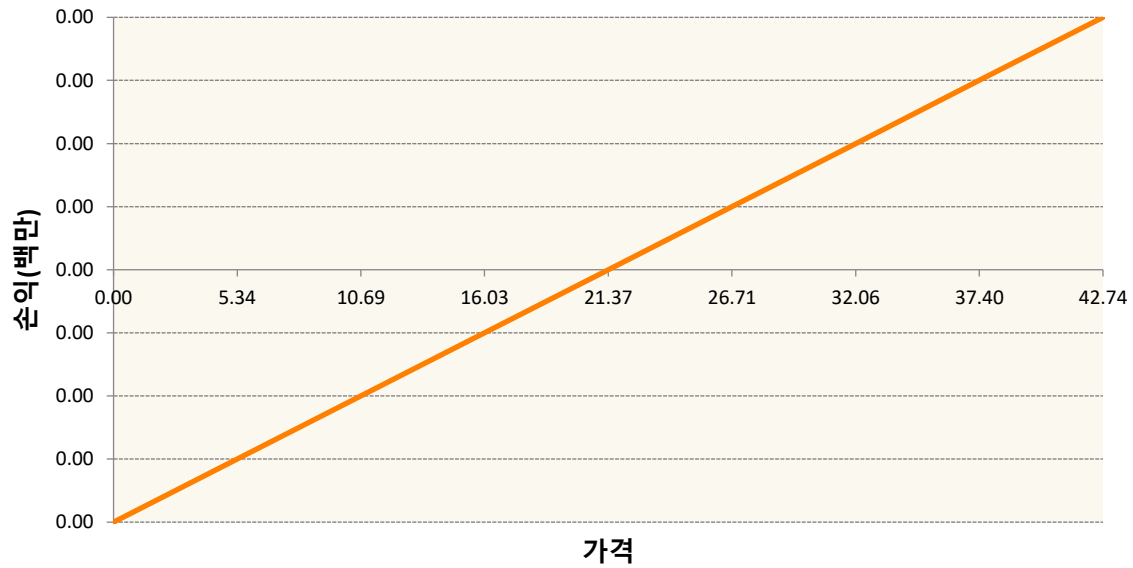
KR4175T20004-2023-02 달러선물



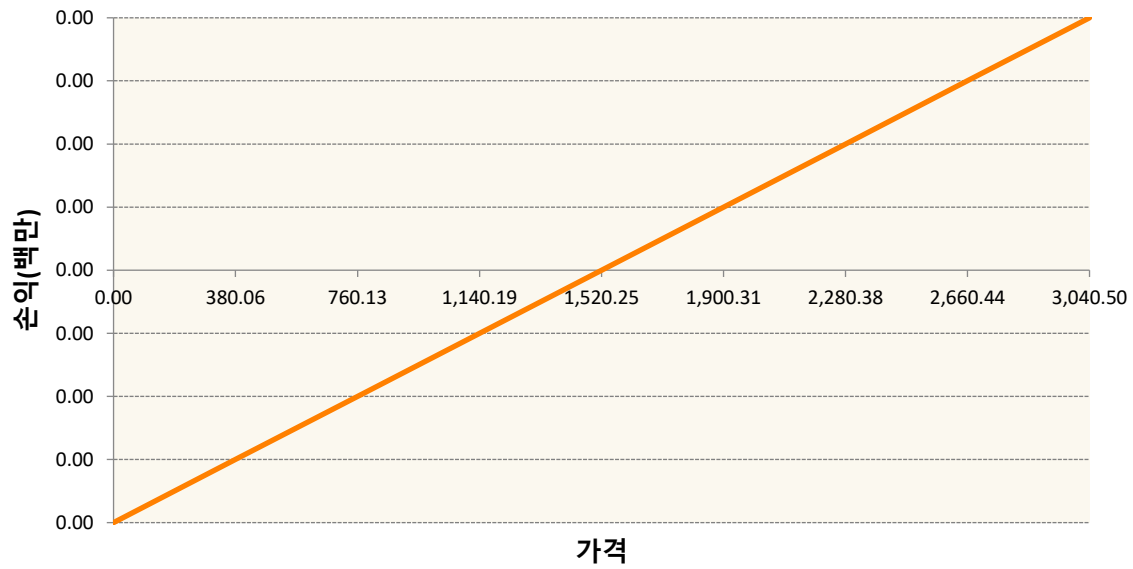
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



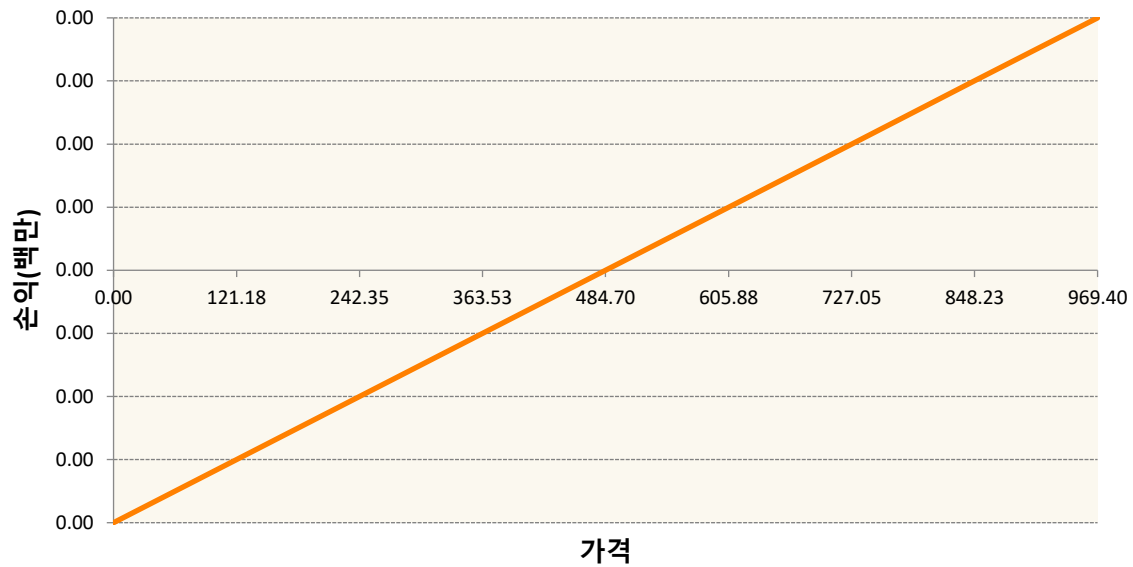
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



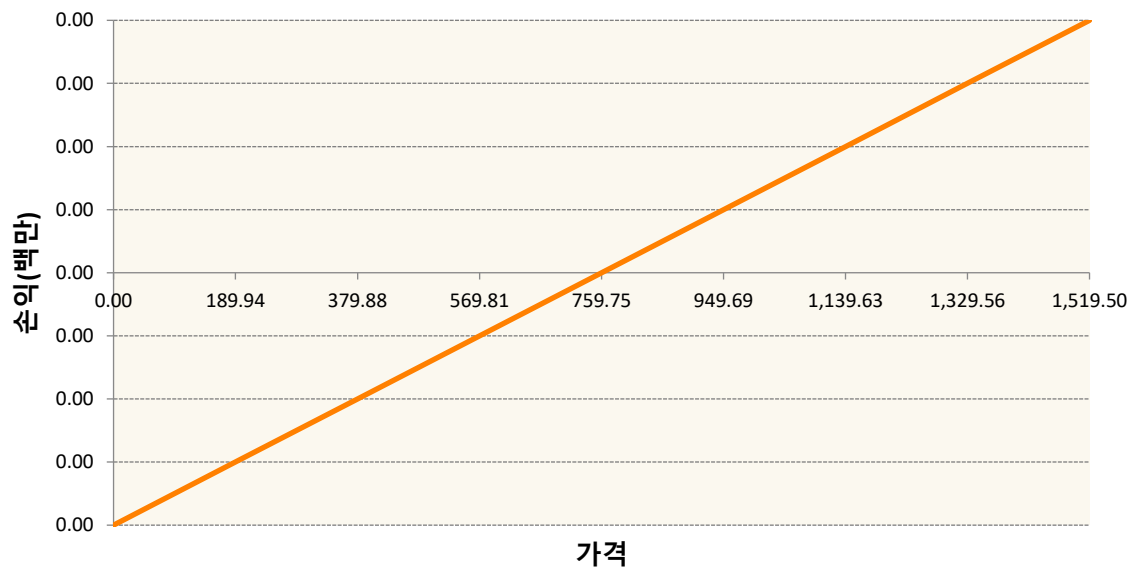
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



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	2023-02-03
기준일	2023-02-02

스마트인덱스모

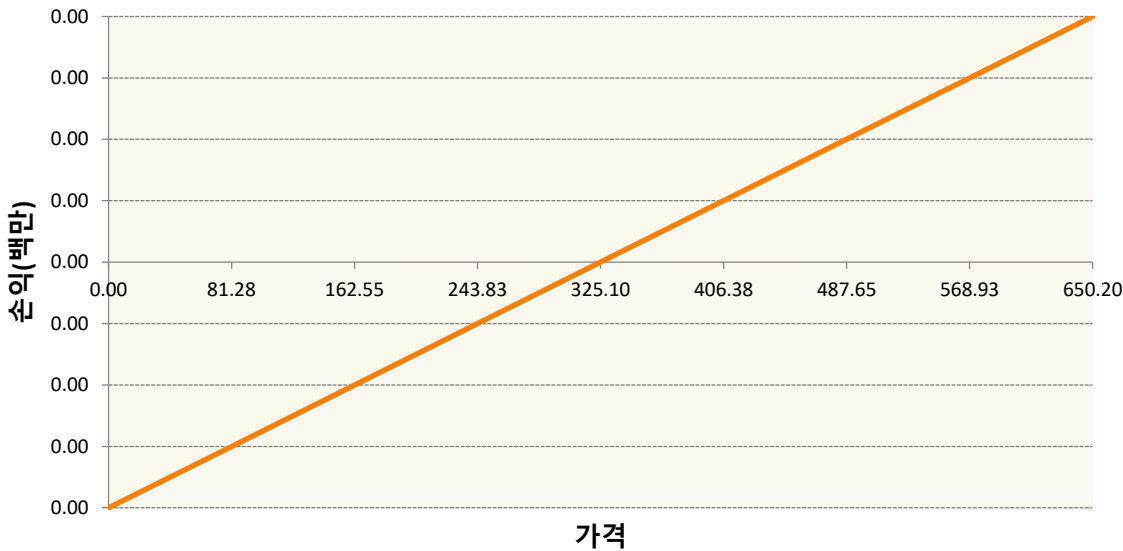
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,845	0	2,845	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T30009-2023-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					227
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-227	-227	-227	-227	-227	-227	-227
-5.33%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
-2.67%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	76	76	76	76	76	76	76
5.33%	151	151	151	151	151	151	151
8.00%	227	227	227	227	227	227	227

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

(단위:백만원)

251

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

SOL차이나강소기업CSI500상장

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	374
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

518

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

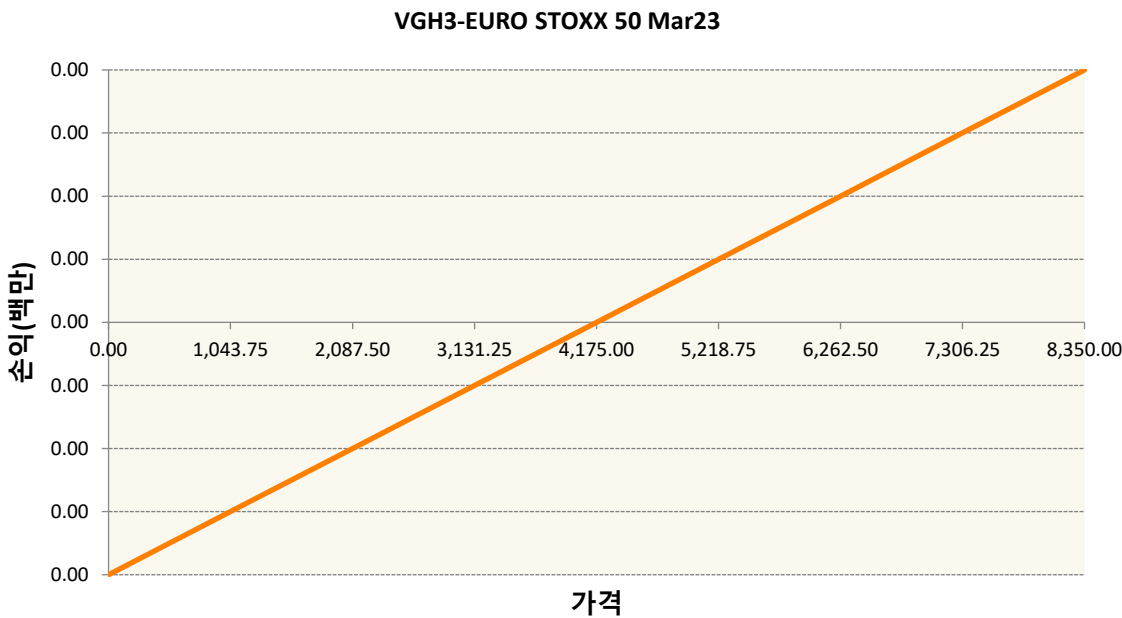
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	520	0	520	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH3	EURO STOXX 50 Mar23	42
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

45

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

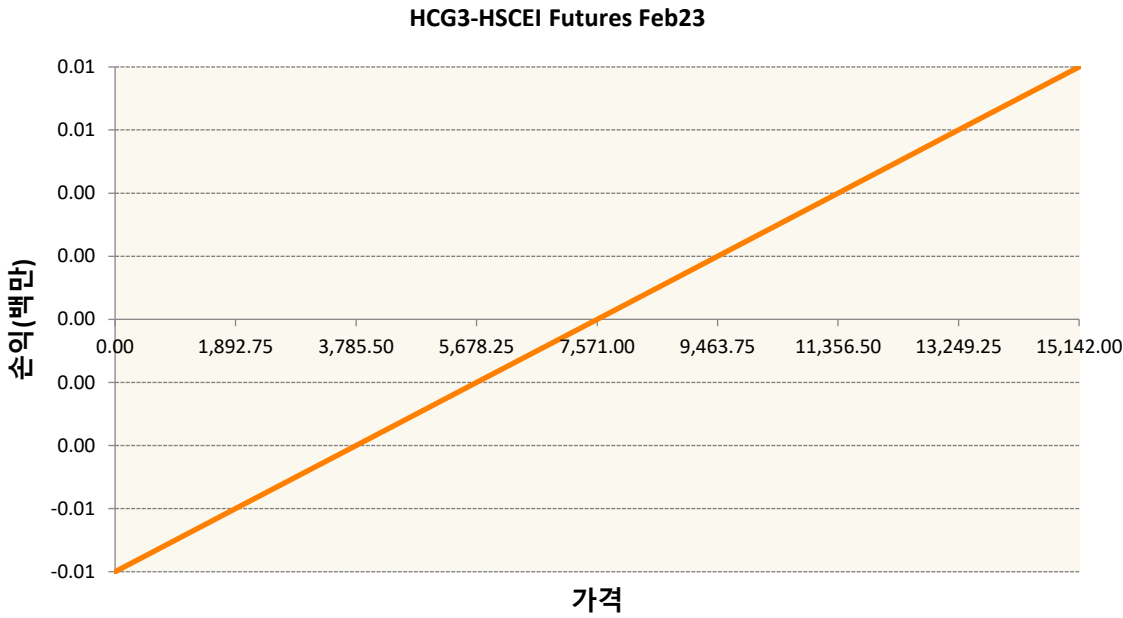
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,667	0	1,667	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

223

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

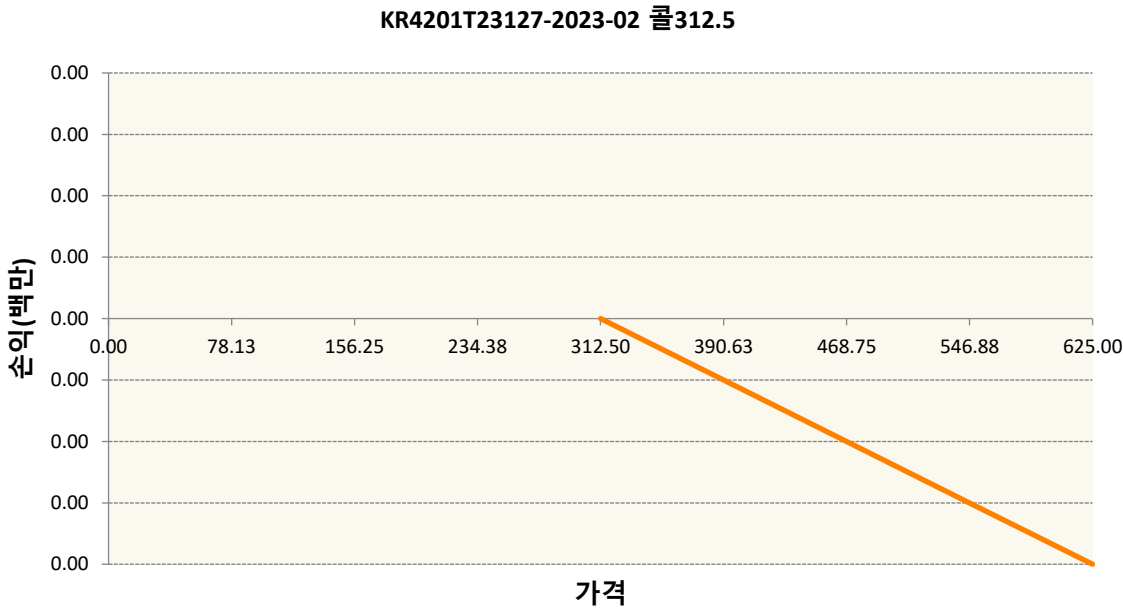
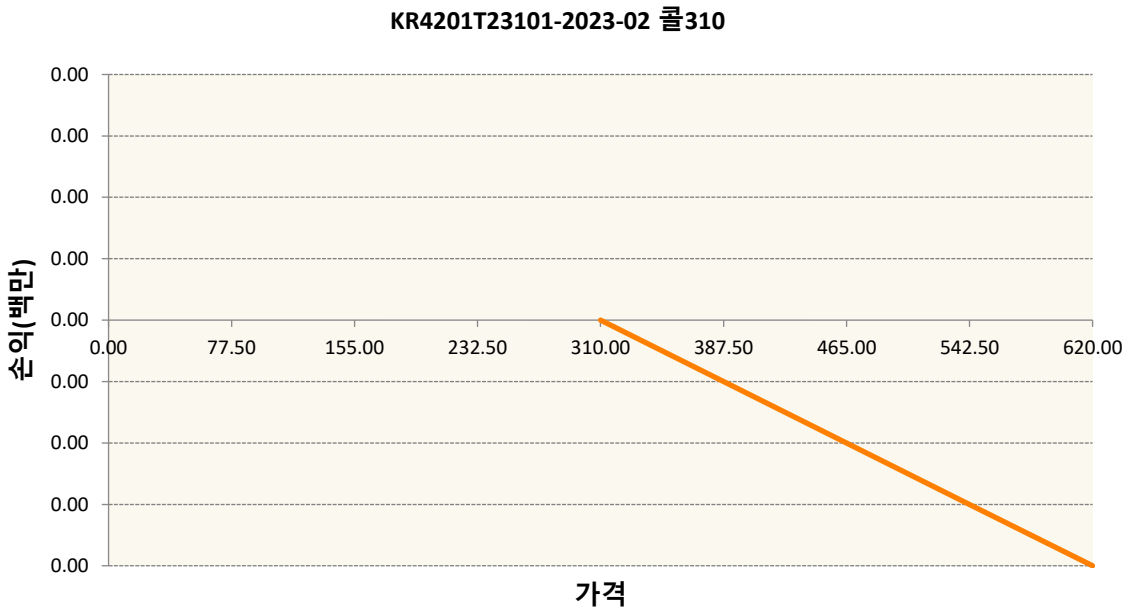
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	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.

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

가격	순이익 (백만)
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					2,585
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,695	1,636	1,574	1,510	1,444	1,377	1,309
-5.33%	1,385	1,309	1,232	1,156	1,079	1,003	926
-2.67%	876	801	726	650	573	497	420
0%	181	124	63	0	-66	-133	-202
2.67%	-645	-680	-721	-766	-816	-869	-925
5.33%	-1,546	-1,563	-1,586	-1,614	-1,647	-1,685	-1,726
8.00%	-2,480	-2,486	-2,497	-2,513	-2,532	-2,556	-2,585
KR4201T23127		2023-02 콜312.5					794
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	487	471	453	434	415	395	375
-5.33%	406	383	360	336	313	289	265
-2.67%	264	240	216	191	167	142	118
0%	62	42	22	0	-22	-44	-67
2.67%	-186	-199	-214	-230	-248	-266	-285
5.33%	-463	-470	-479	-489	-501	-515	-529
8.00%	-754	-757	-761	-767	-774	-783	-794
KR4301T23109 2023-02 풋310							221

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-165	-174	-183	-192	-201	-211	-221
-5.33%	-74	-85	-96	-106	-117	-128	-139
-2.67%	-11	-21	-32	-43	-54	-65	-76
0%	26	18	9	0	-9	-19	-29
2.67%	44	39	33	26	19	12	4
5.33%	51	48	45	41	36	31	25
8.00%	53	52	50	48	45	42	38

KR4301T23125 2023-02 풋312.5							237
-----------------------------	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-186	-193	-201	-210	-219	-228	-237
-5.33%	-87	-97	-108	-119	-129	-140	-151
-2.67%	-15	-26	-38	-49	-60	-71	-82
0%	29	19	10	0	-10	-20	-31
2.67%	51	45	38	31	23	15	6
5.33%	61	57	53	49	43	37	30
8.00%	64	63	61	58	54	50	46

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

(단위:백만원)

3,831

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

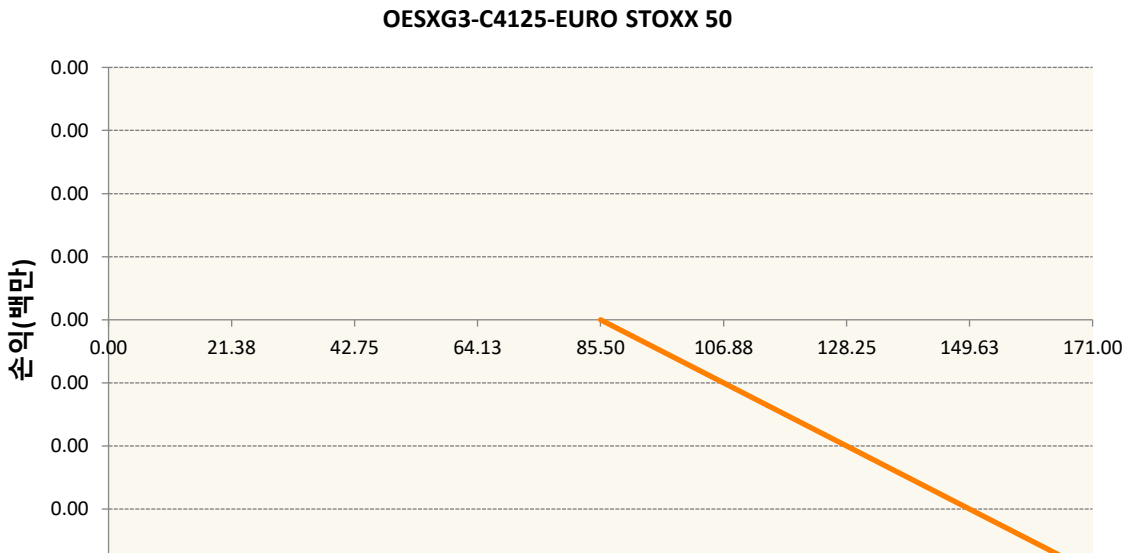
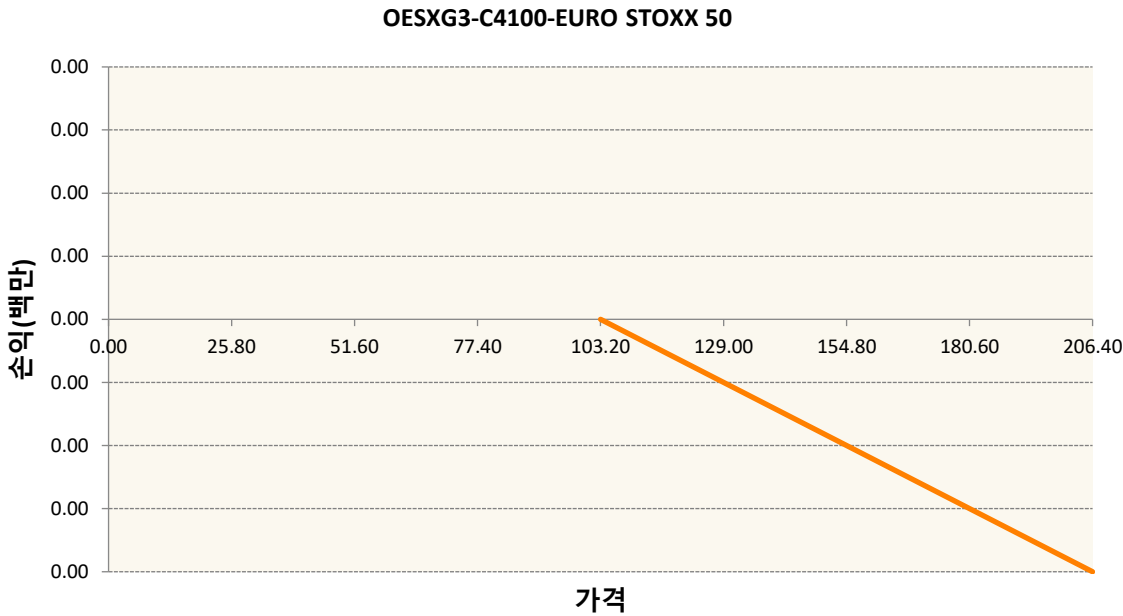
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

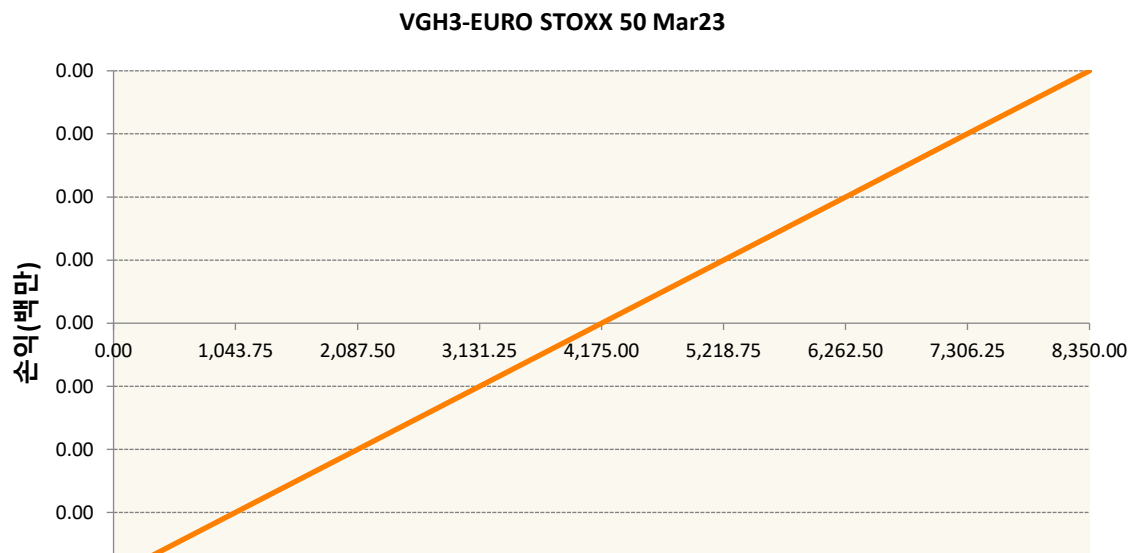
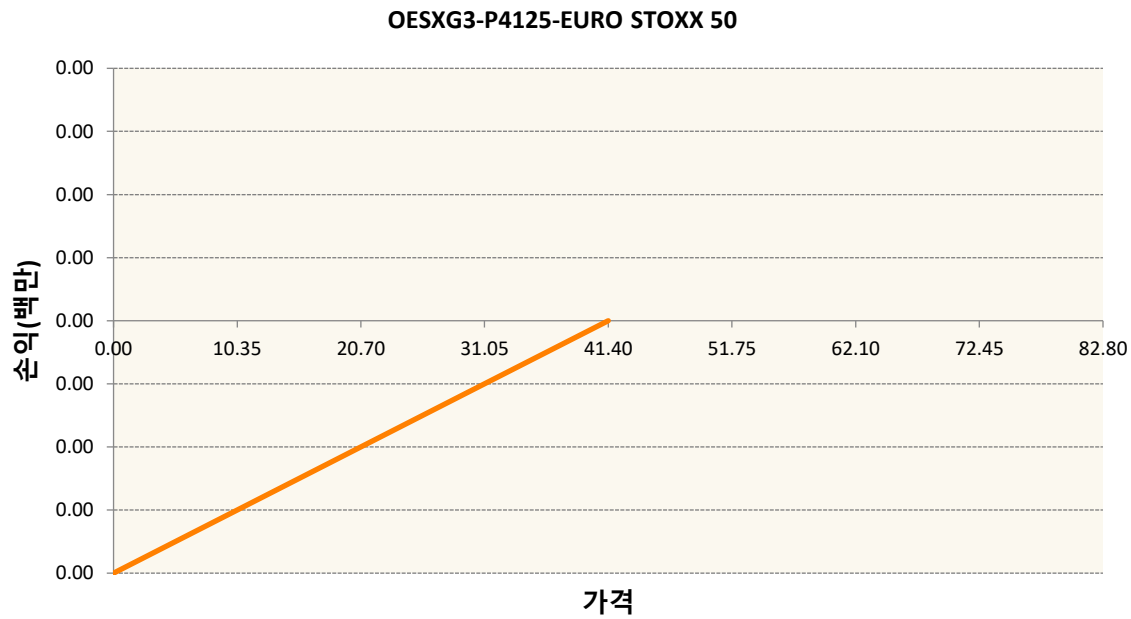
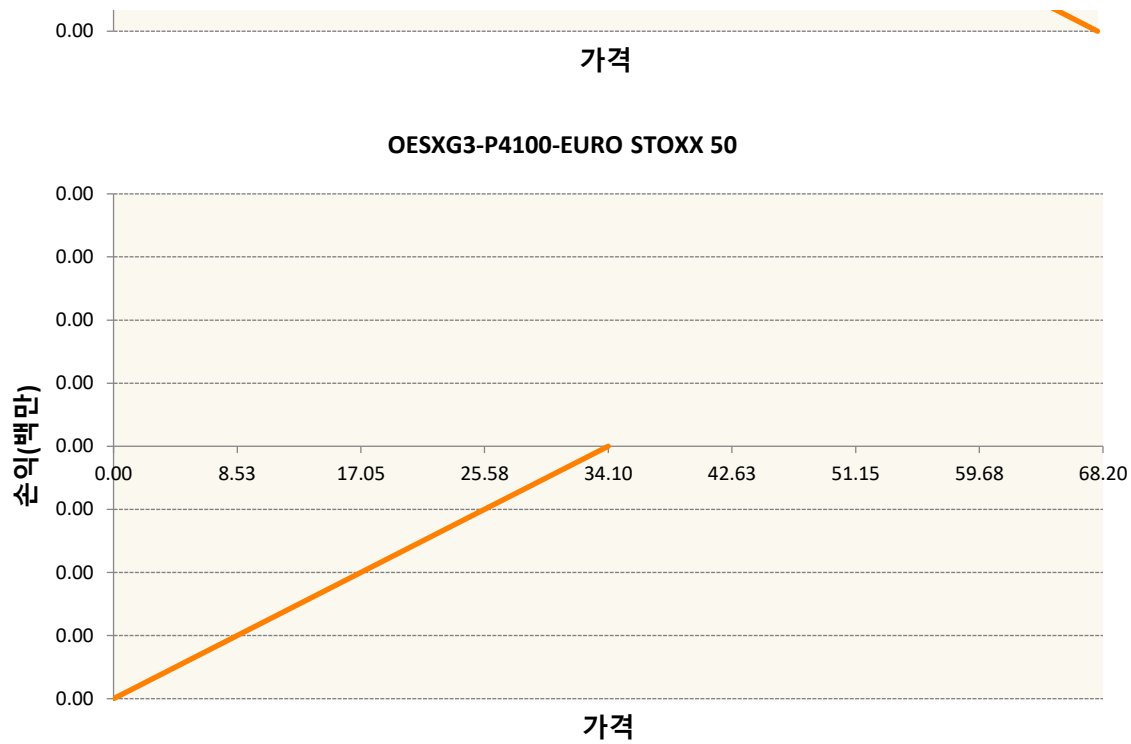
1. 계약금액

(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	984	0	984	
누계	유가증권	옵션	0	64	-64	장내
누계	통화	선도	134	2,082	-1,948	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CBG KRW/EUR 24-02-23E	70
FXW213CBN EUR/KRW 24-02-23E	11
FXW213CCM KRW/EUR 24-03-23E	54
FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E	43
OESXG3-C41 EURO STOXX 50	1
OESXG3-C41 EURO STOXX 50	3
OESXG3-P41 EURO STOXX 50	0.29
OESXG3-P41 EURO STOXX 50	1
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23	79

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

(단위:백만원)

223

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

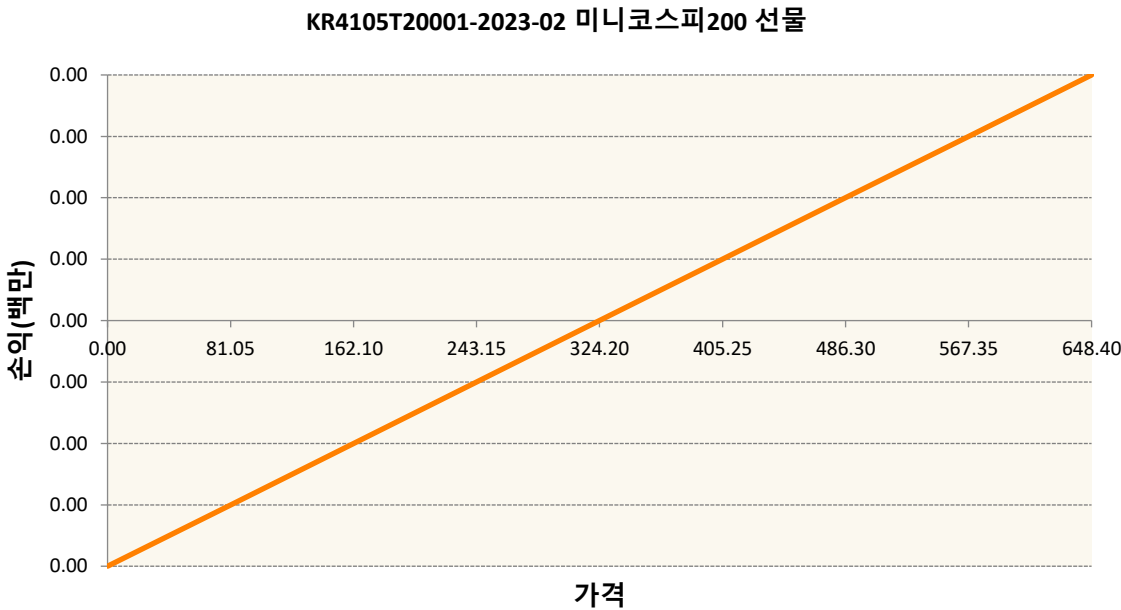
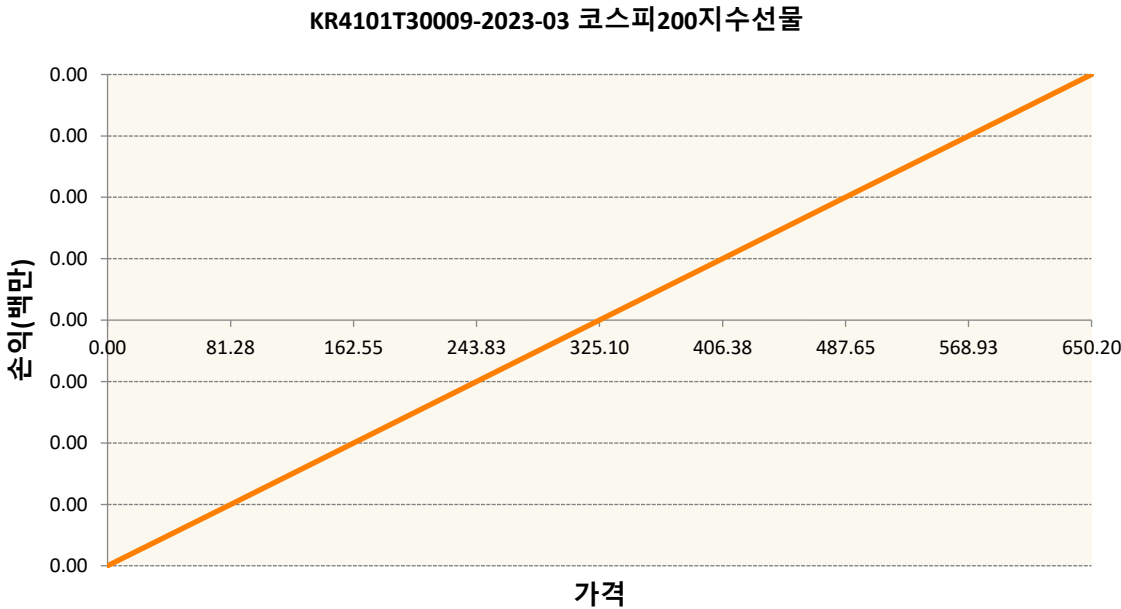
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

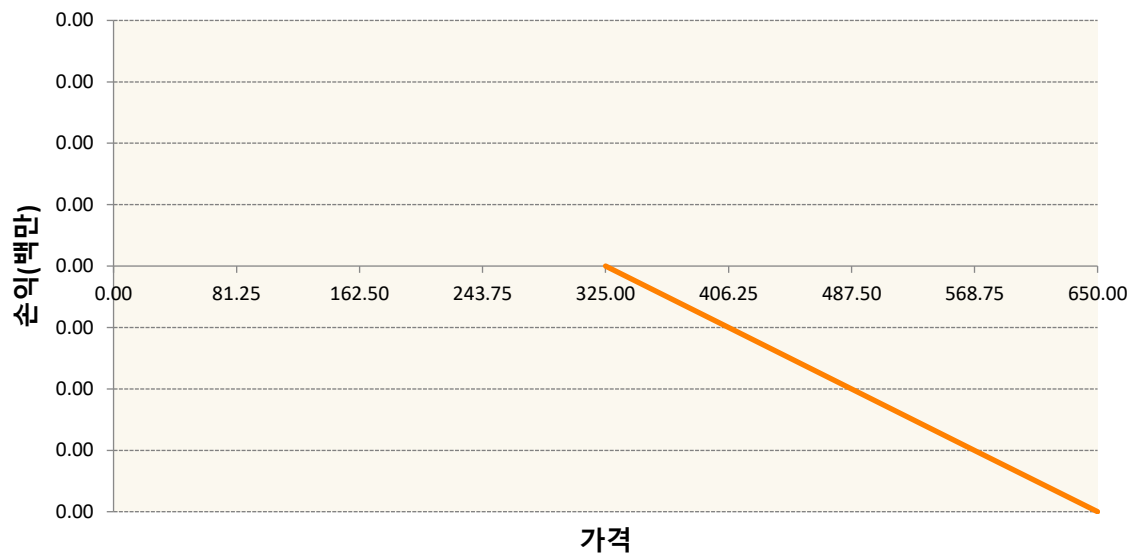
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	81	0	81	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	731	0	731	장내
누계	유가증권	옵션	156	3,915	-3,759	장내

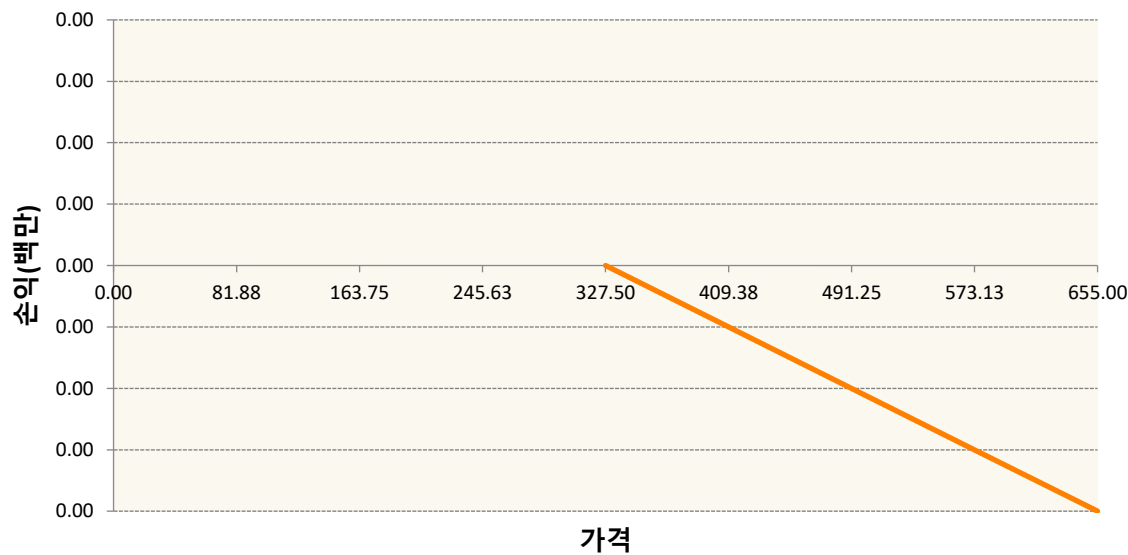
2. 만기시점의 손익구조



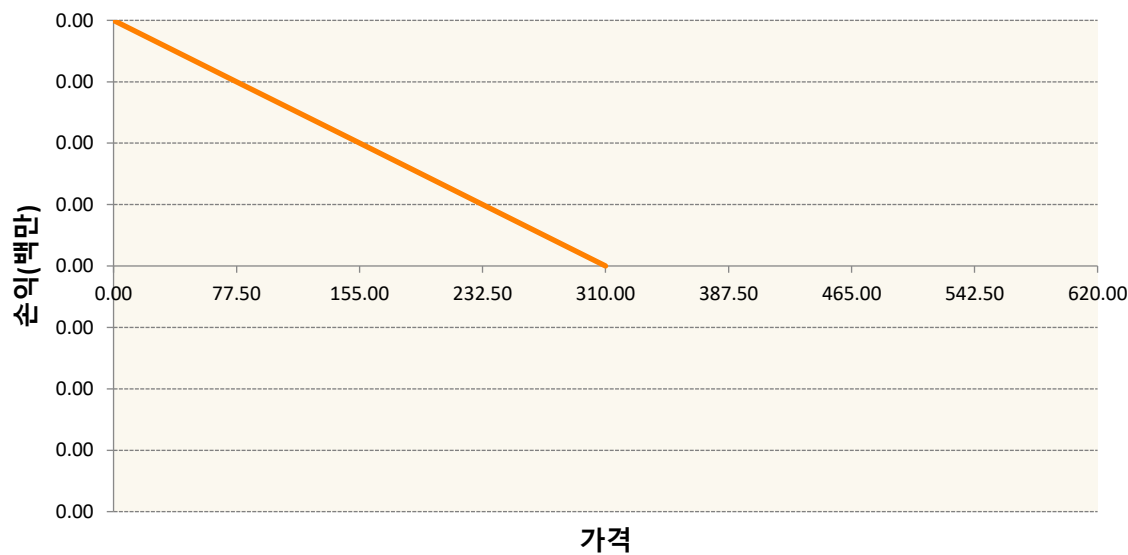
KR4201T23259-2023-02 콜325



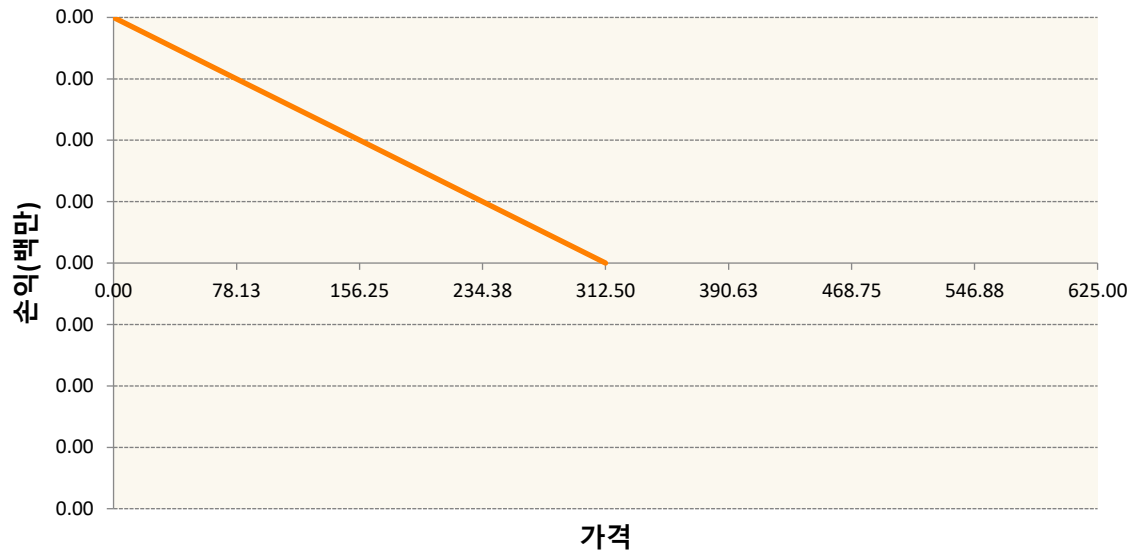
KR4201T23275-2023-02 콜327.5



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%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-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%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	32	32	32	32	32	32	32
KR4105T20001		2023-02 미니코스피200 선물					5
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR4201T23259		2023-02 콜325					118
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	49	47	46	44	42	40	37
-5.33%	44	42	39	36	33	30	26
-2.67%	33	30	26	22	18	14	10
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13

2.67%	-17	-21	-25	-30	-34	-38	-43
5.33%	-57	-60	-63	-66	-70	-74	-78
8.00%	-103	-104	-107	-109	-112	-115	-118

KR4201T23275 2023-02 콜327.5 113

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	42	41	40	39	37	35	33
-5.33%	39	37	35	32	29	26	23
-2.67%	30	27	23	19	16	12	8
0%	13	9	4	0	-4	-9	-13
2.67%	-14	-19	-23	-27	-32	-36	-41
5.33%	-51	-55	-58	-62	-66	-70	-74
8.00%	-96	-98	-100	-103	-106	-109	-113

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

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

(단위:백만원)

264

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

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	6,610	0	6,610	

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	2023-02-03
기준일	2023-02-02

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	5,514	0	5,514	

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	2023-02-03
기준일	2023-02-02

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	18,729	0	18,729	
누계	통화	선도	0	18,823	-18,823	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CBQ KRW/USD 28-02-23E		624
FXW213CCSI KRW/USD 28-03-23E		517
FXW213D1SI KRW/USD 28-04-23E		291
FXW213D1TI KRW/USD 28-02-23E		73
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	813

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

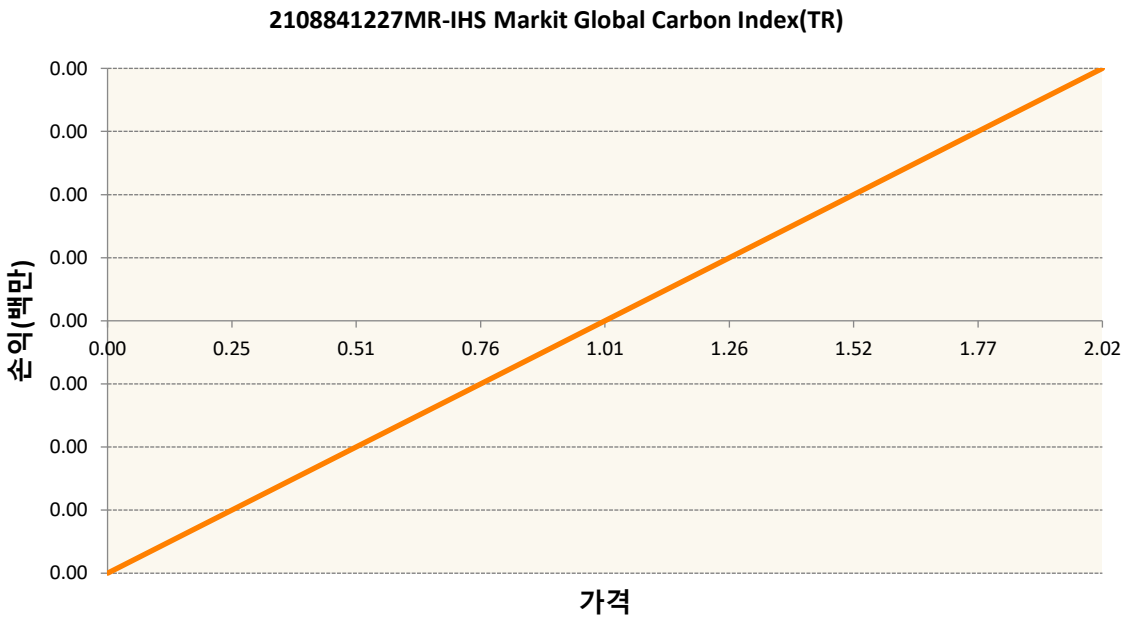
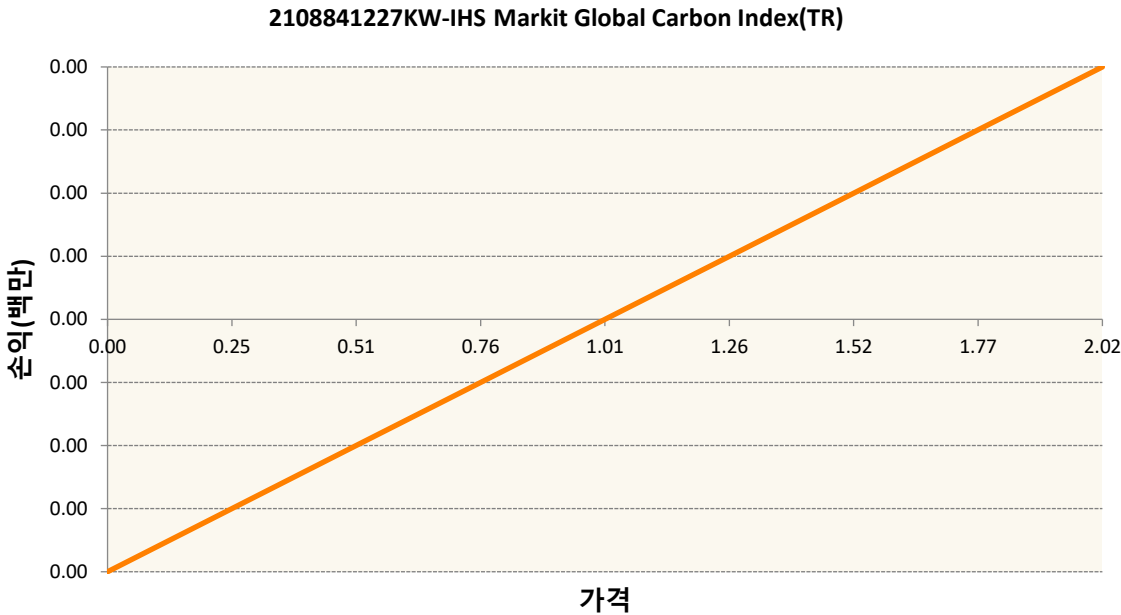
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

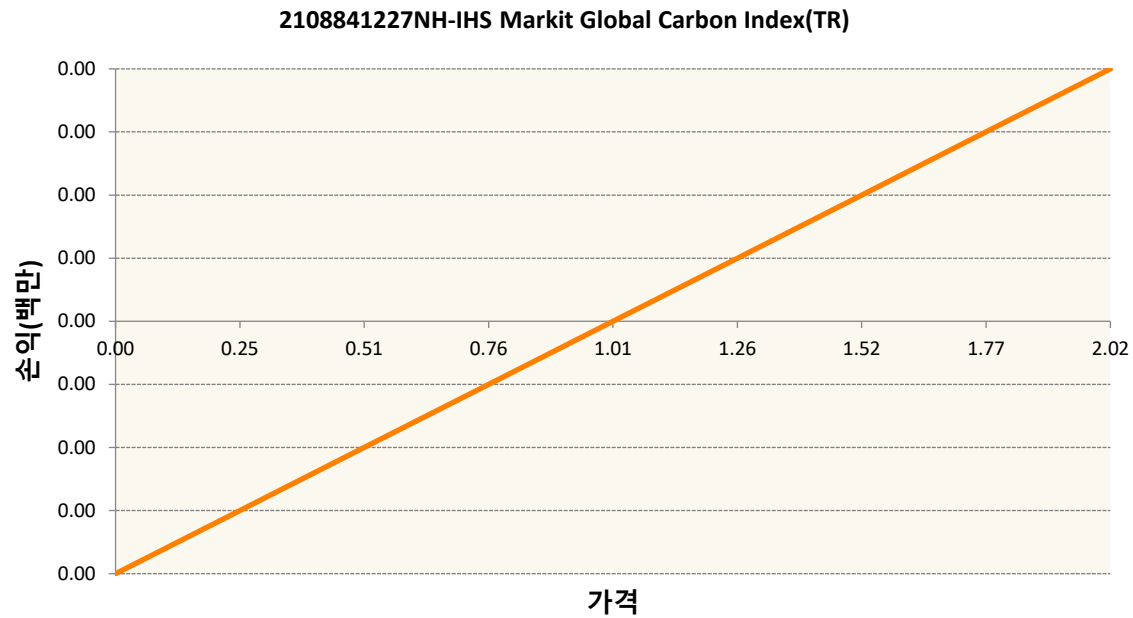
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,590	0	24,590	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,665
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		196
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,761

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

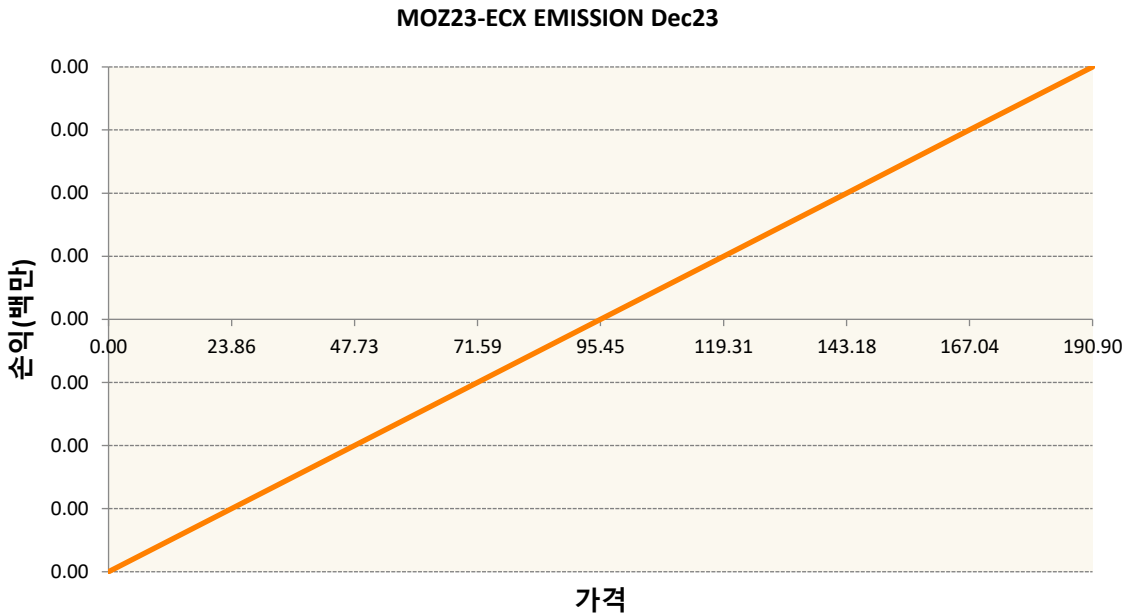
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	14,598	0	14,598	
누계	통화	선도	0	5,530	-5,530	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	107
FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	196
FXW213D1X(KRW/EUR 24-02-23E	64
FXW213D22(KRW/EUR 24-02-23E	75
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,168

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

(단위:백만원)

3,383

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

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)

143

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

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)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	5

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

(단위:백만원)

31

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

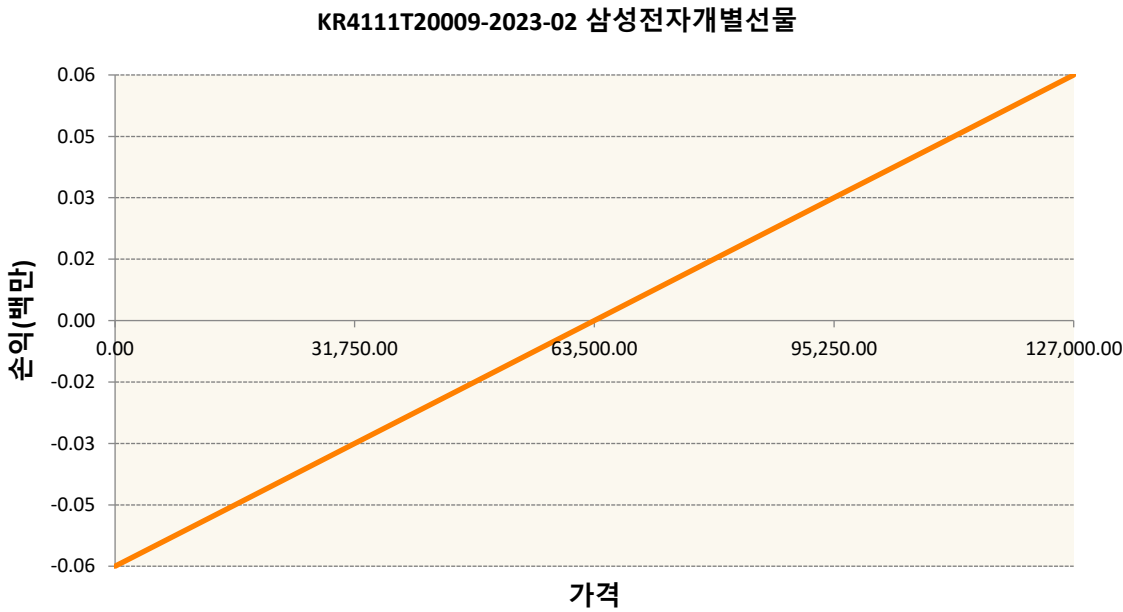
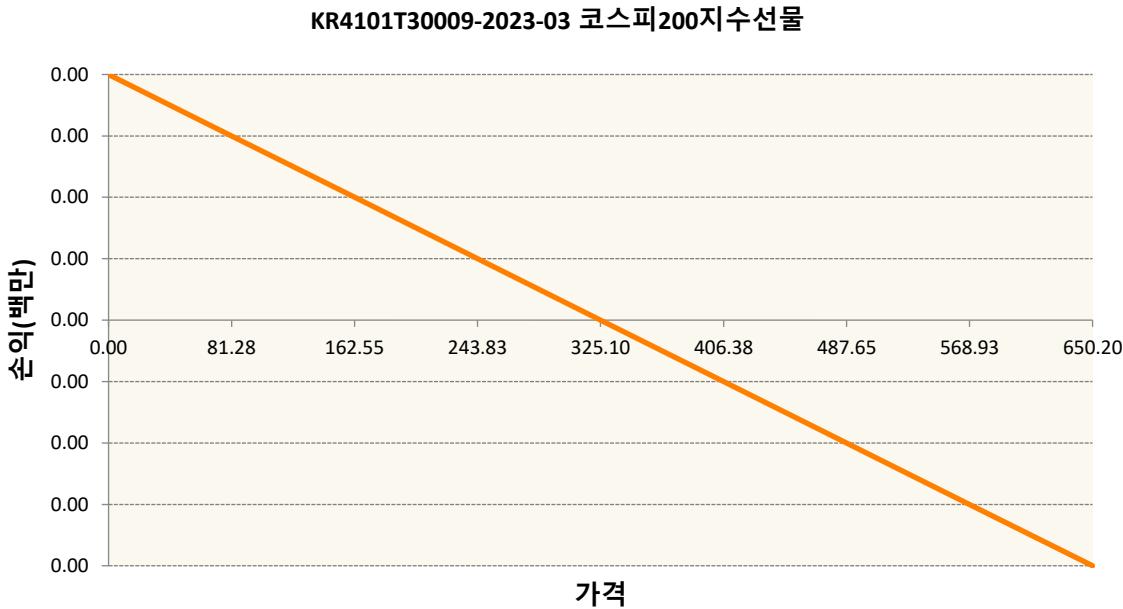
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

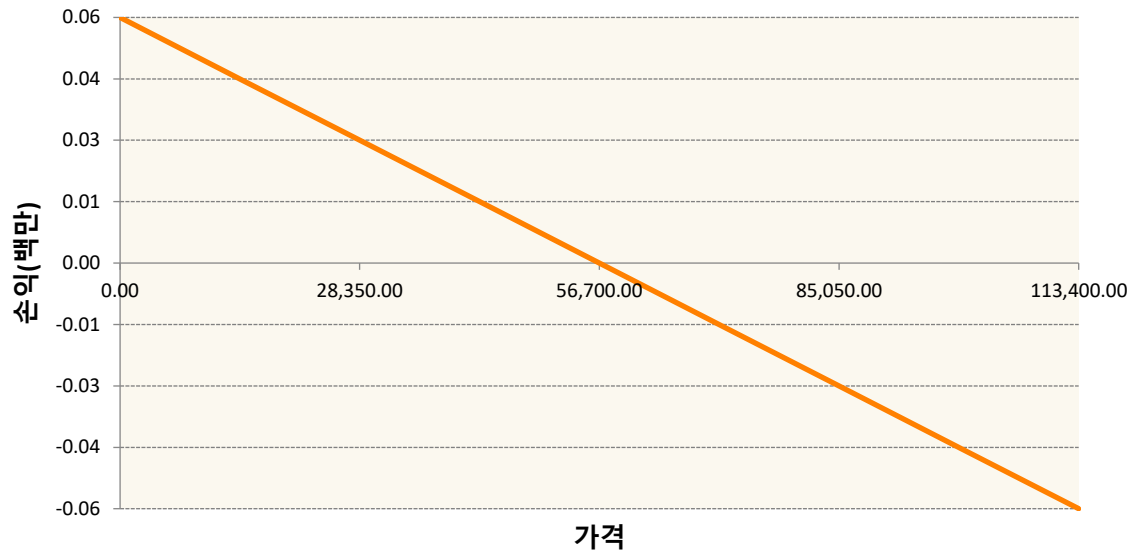
(단위:백만원)

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	476	1,378	-902	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

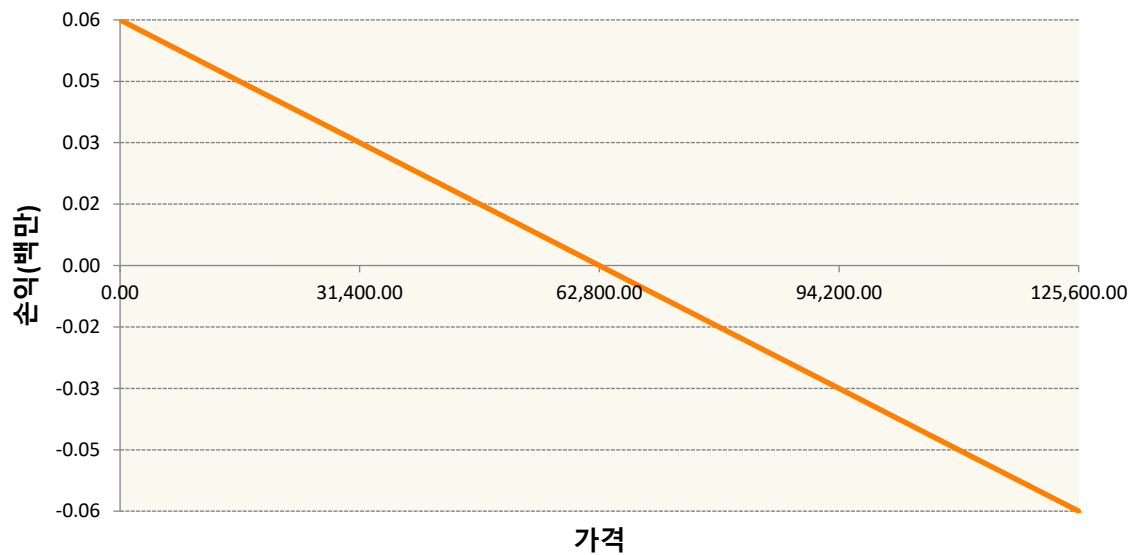
2. 만기시점의 손익구조



KR4146T20005-2023-02 KB금융개별선물



KR41F7T20001-2023-02 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T300 2023-03 코스피200지수선물	78
KR4111T200 2023-02 삼성전자개별선물	38
KR4146T200 2023-02 KB금융개별선물	14
KR41F7T200 2023-02 카카오페이개별선물	19
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429	1
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602	1

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

(단위:백만원)

239

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

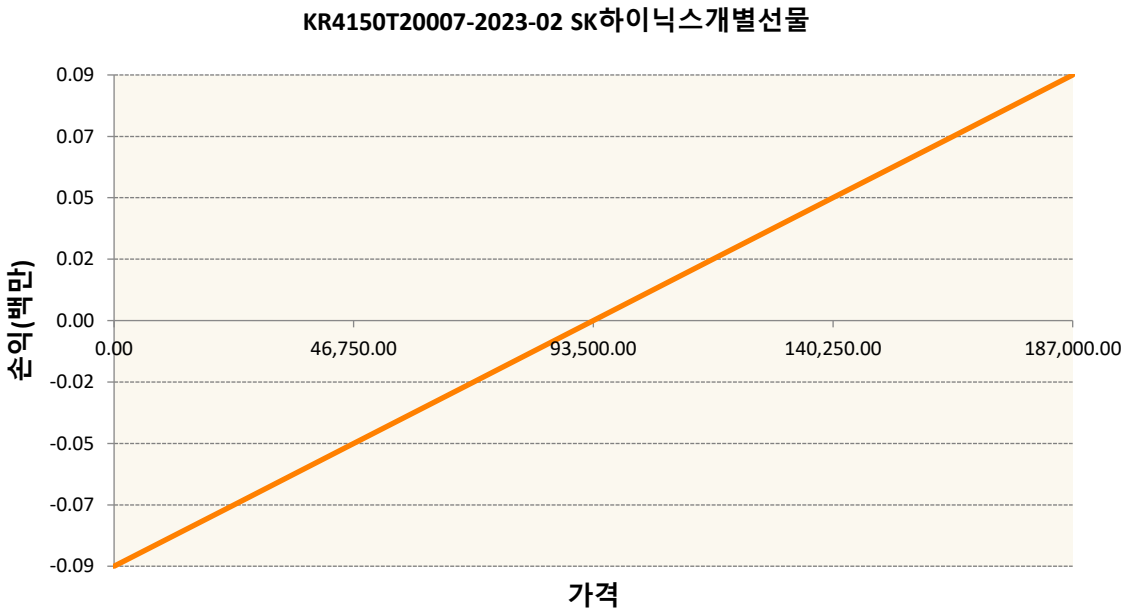
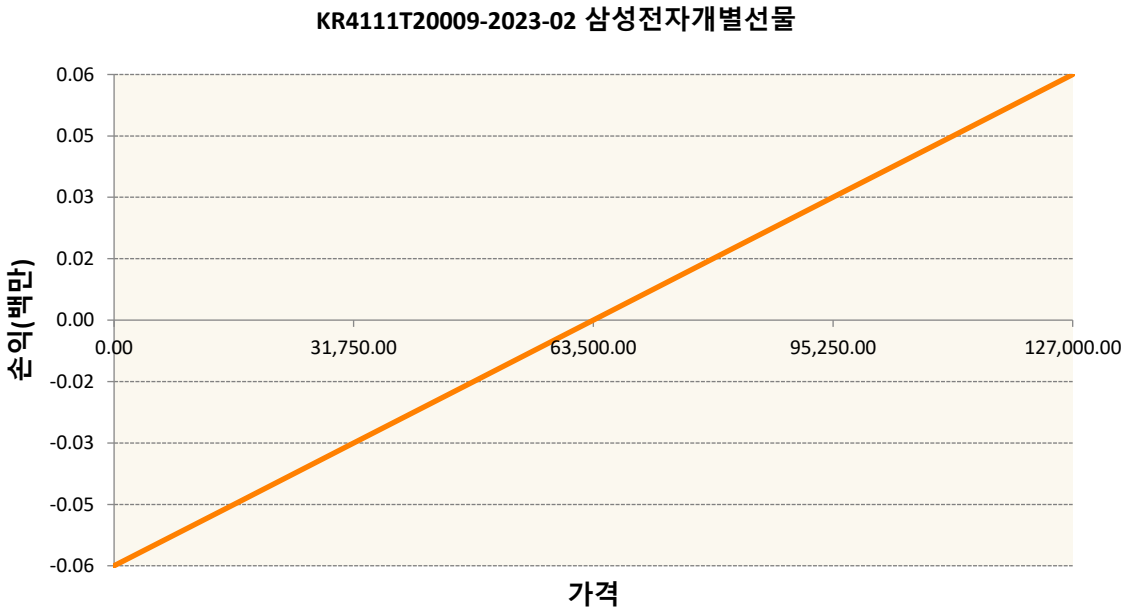
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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	158	0	158	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	2023-02-03
기준일	2023-02-02

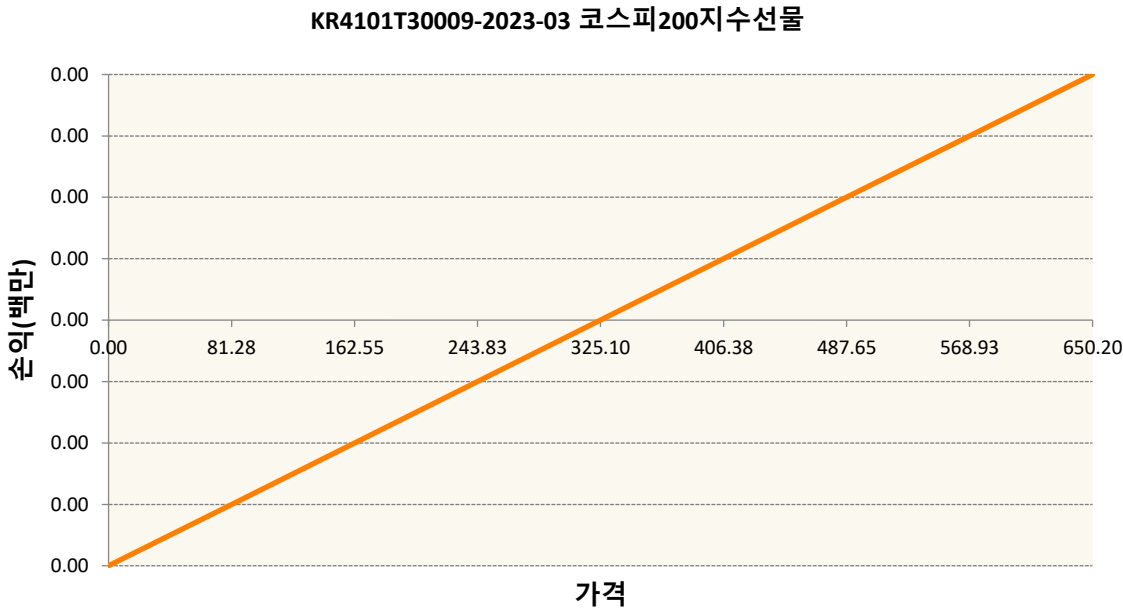
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	408	0	408	장내
누계	유가증권	선물	2,438	0	2,438	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				194
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	130	130	130	130	130	130	130
8.00%	194	194	194	194	194	194	194

공시일 2023-02-03

기준일 2023-02-02

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

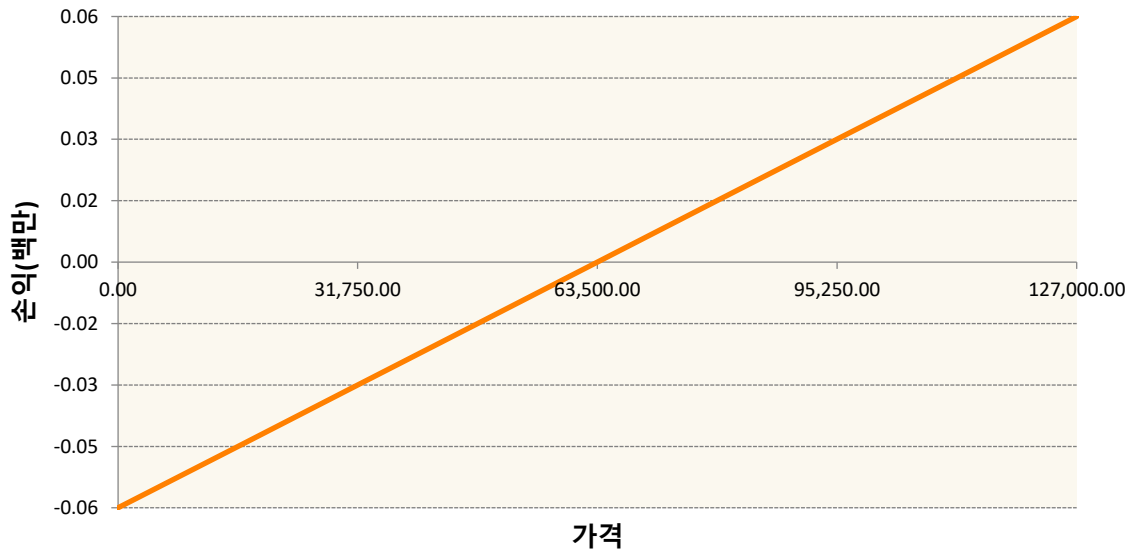
1. 계약금액

(단위:백만원)

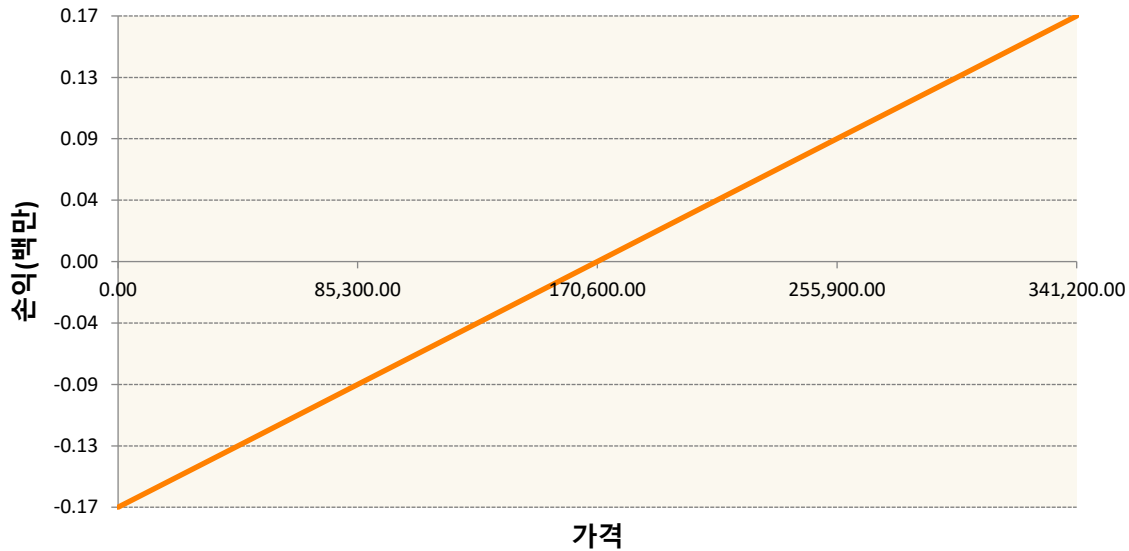
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	253	0	253	장내

2. 만기시점의 손익구조

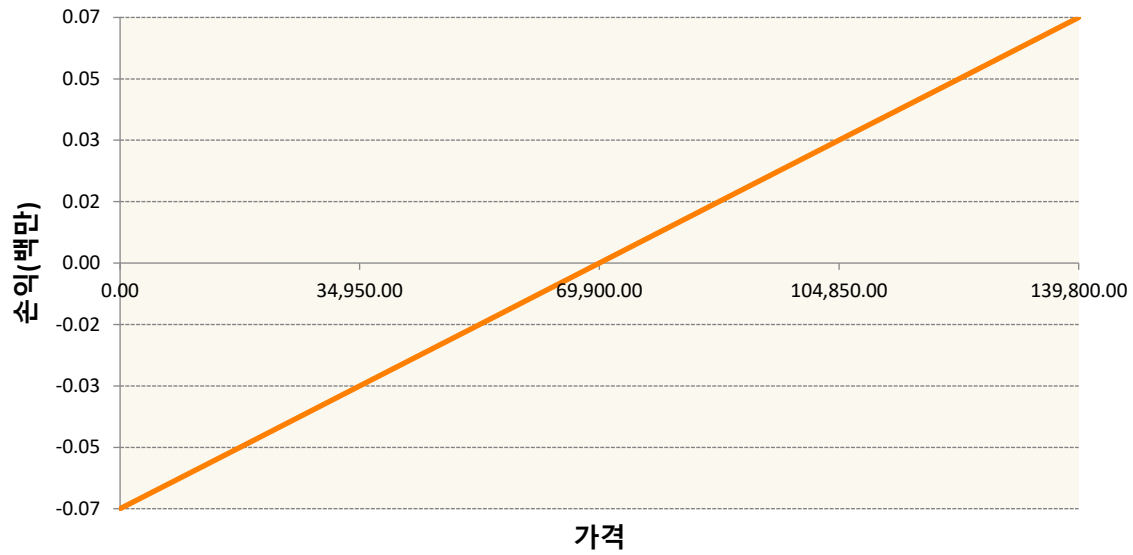
KR4111T20009-2023-02 삼성전자개별선물



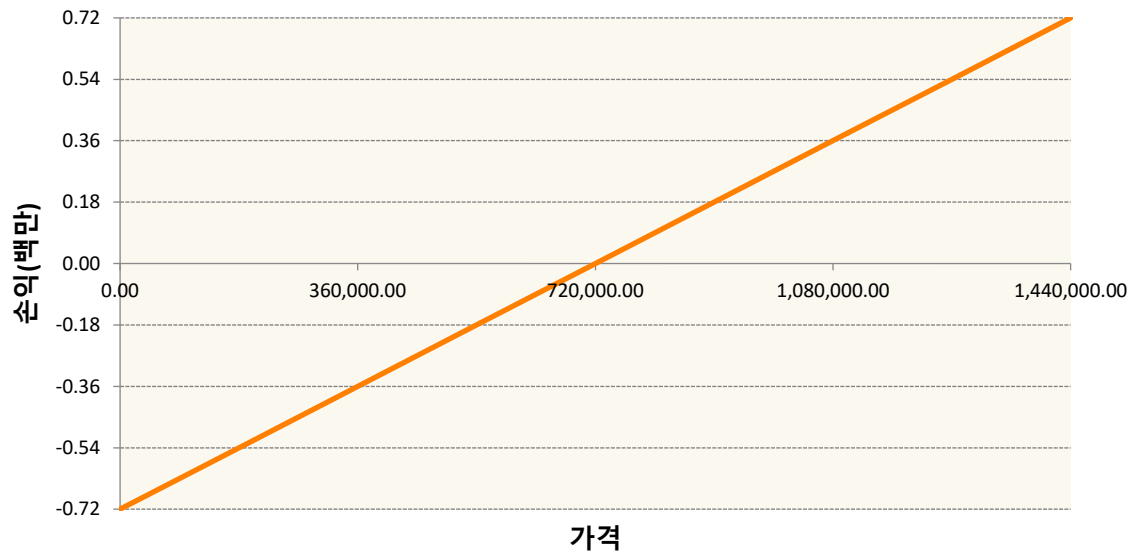
KR4116T20008-2023-02 현대차개별선물



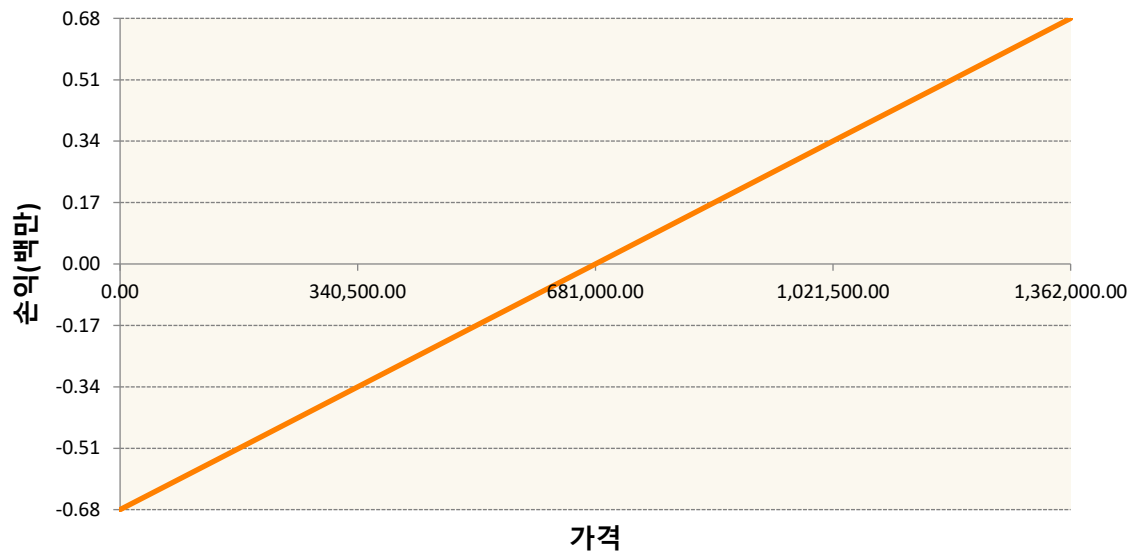
KR4119T20002-2023-02 기아개별선물



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%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-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%	8	8	8	8	8	8	8
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 2023-02-03

기준일 2023-02-02

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

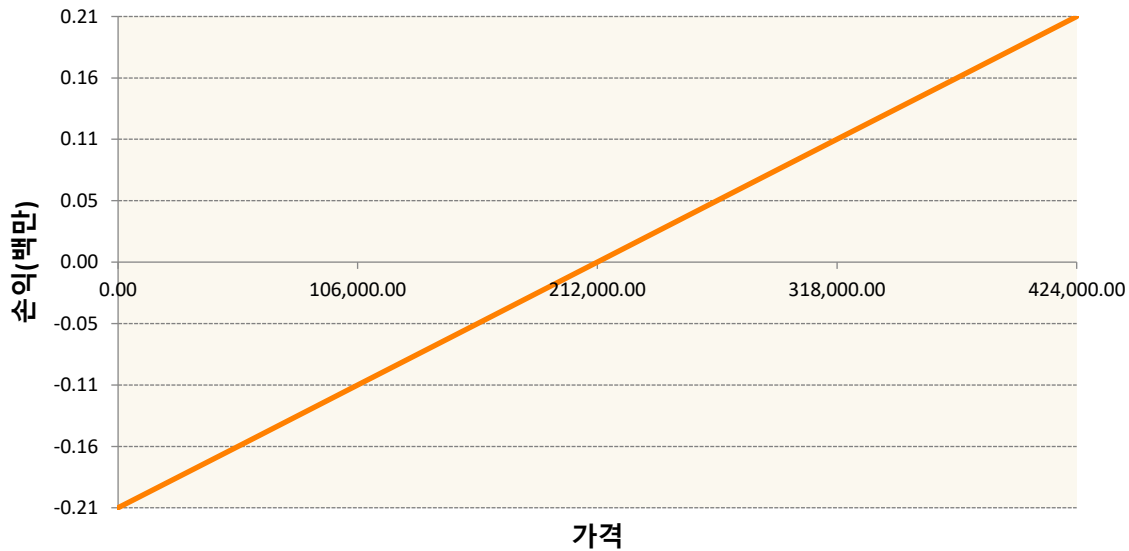
1. 계약금액

(단위:백만원)

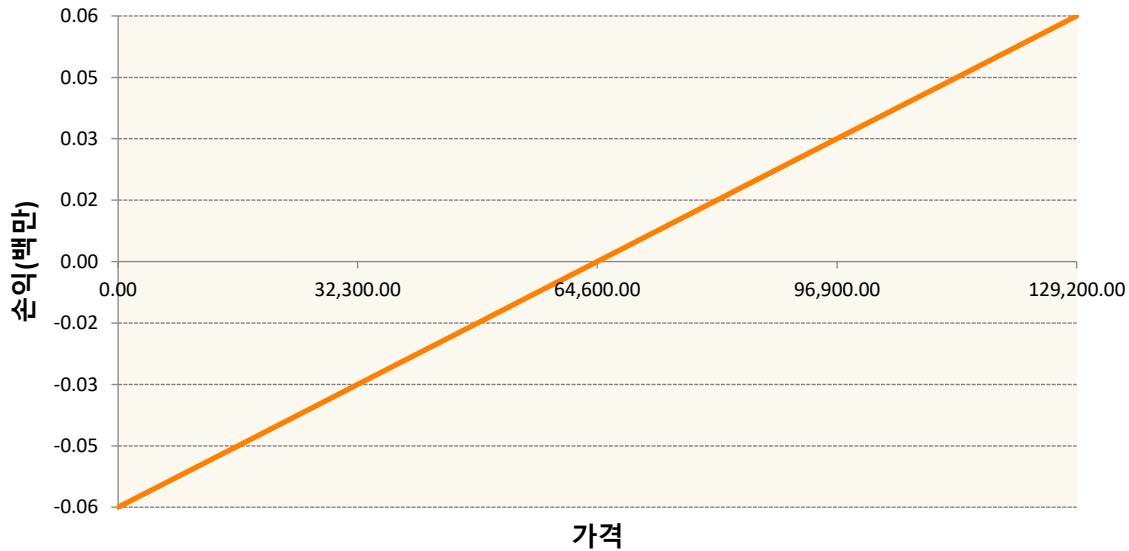
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	132	0	132	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156T20004-2023-02 NAVER개별선물



KR41CFT20005-2023-02 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR41CFT20005 2023-02 카카오개별선물							
							5
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

13

공시일	2023-02-03
기준일	2023-02-02

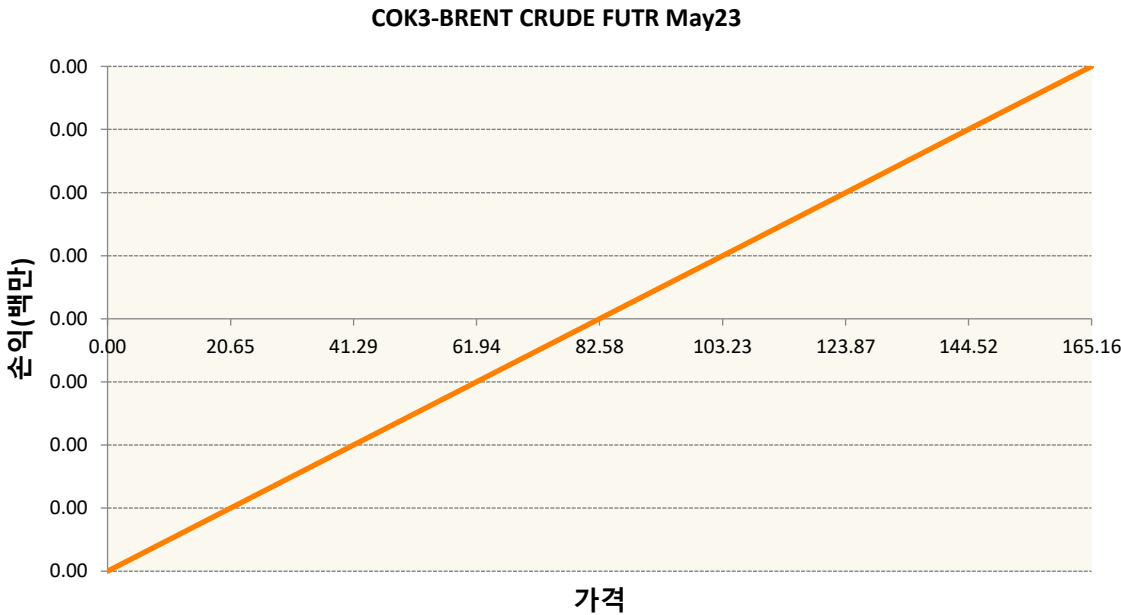
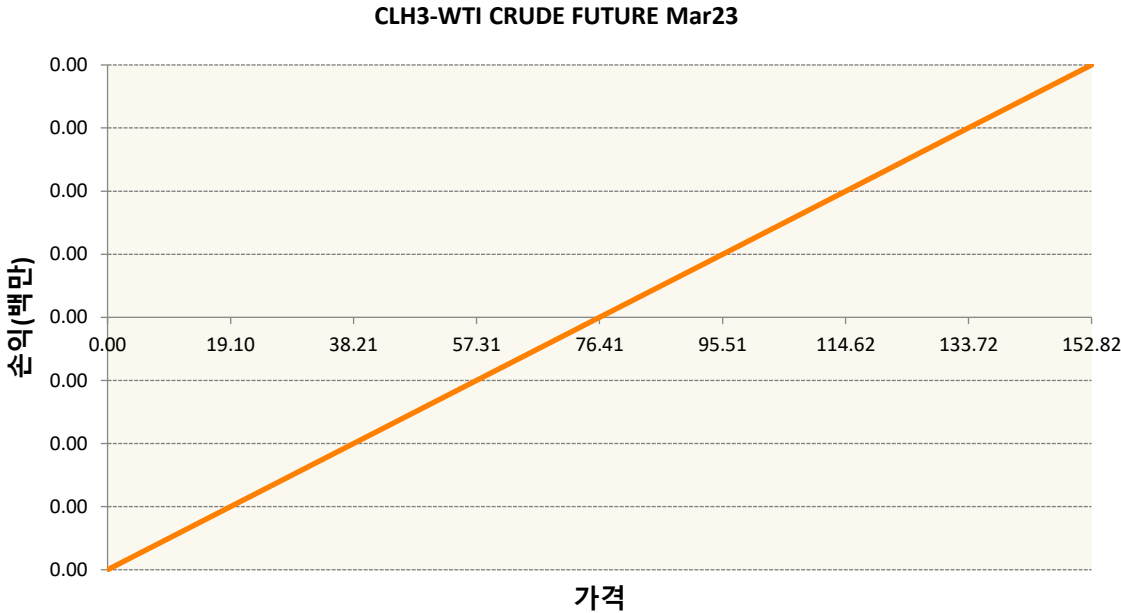
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

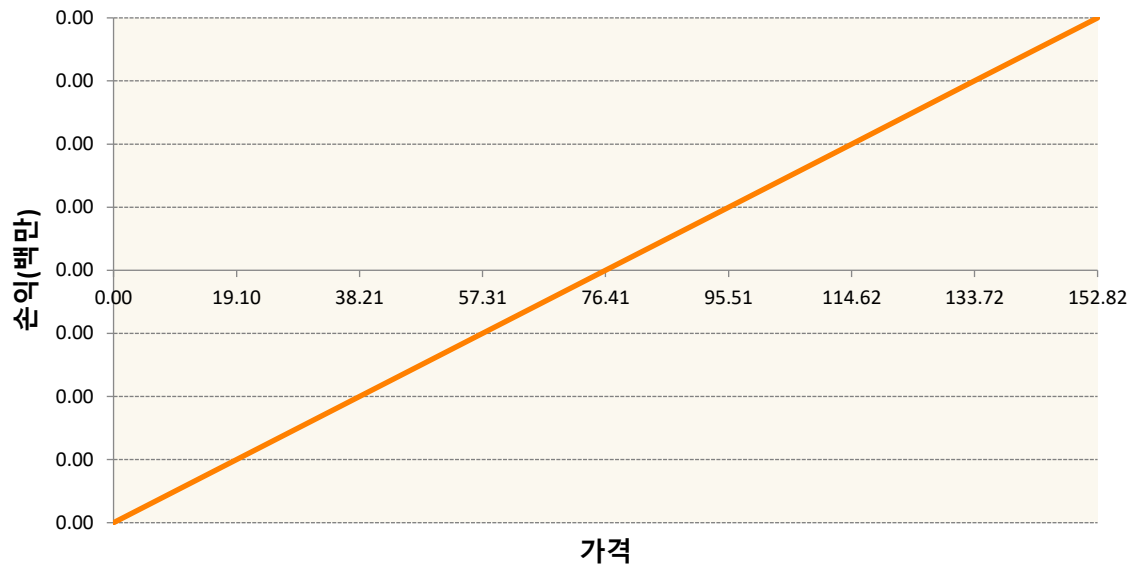
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,754	208	1,546	

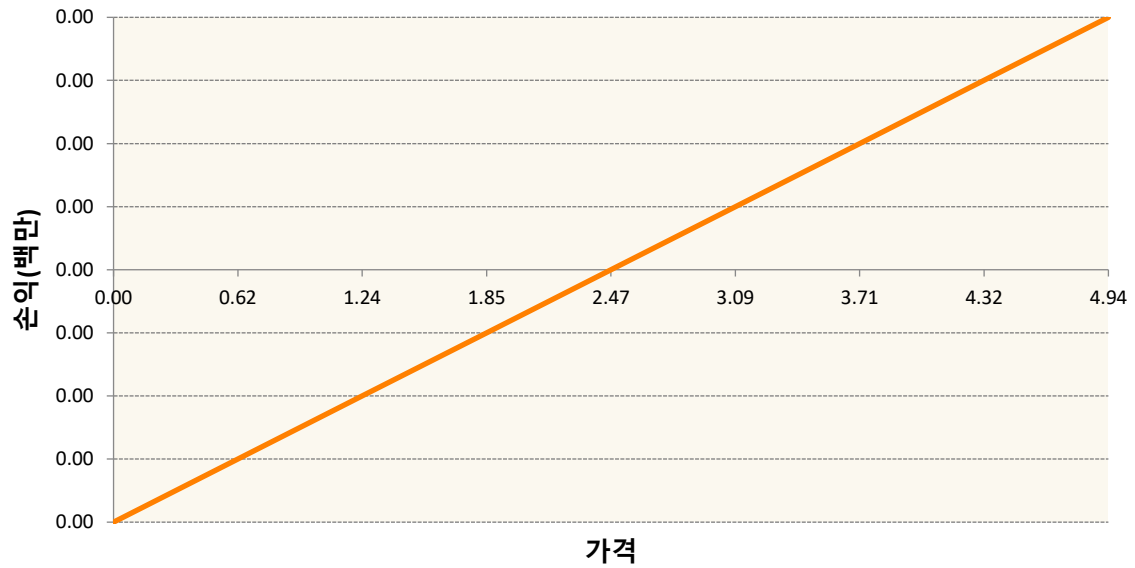
2. 만기시점의 손익구조



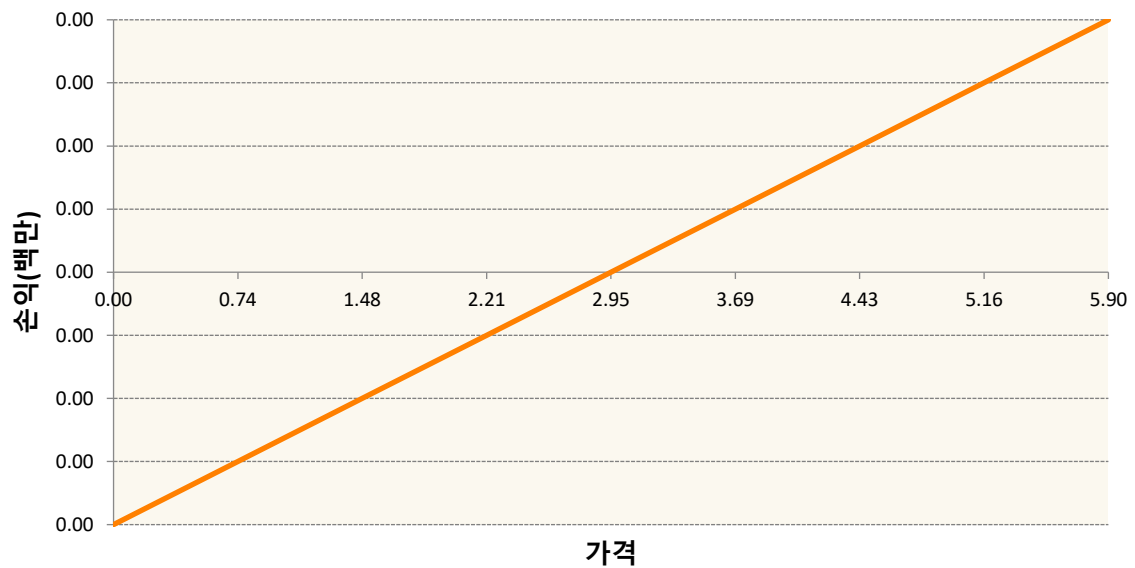
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



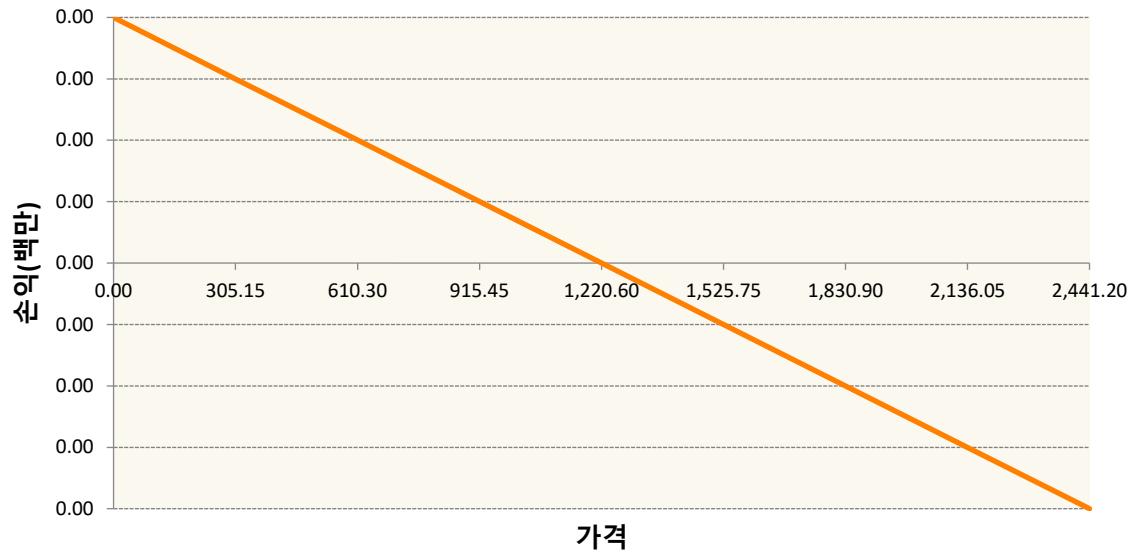
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



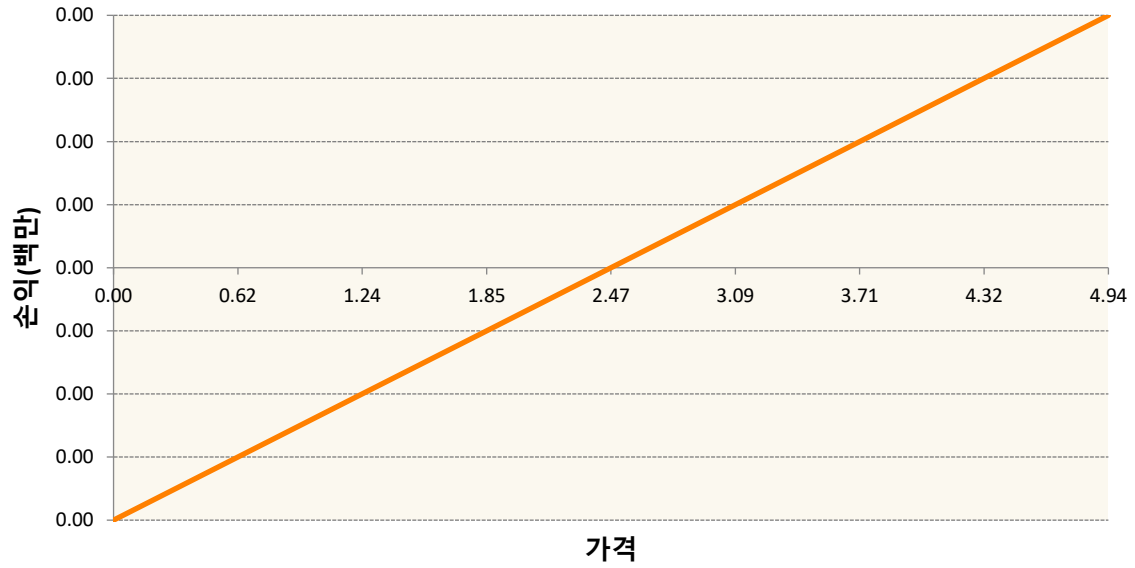
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



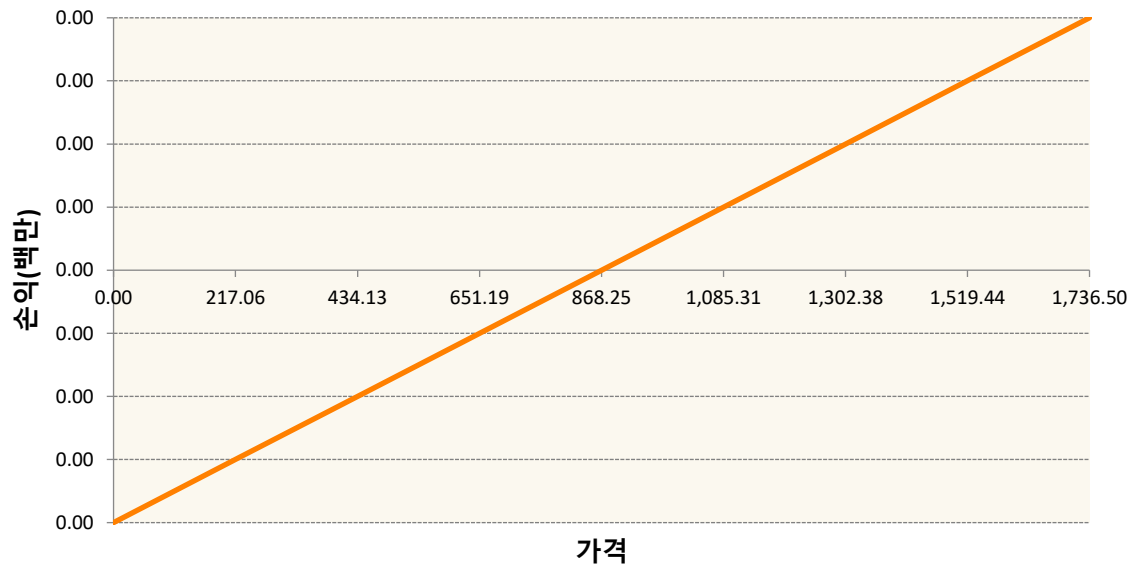
KR4175T20004-2023-02 달러선물

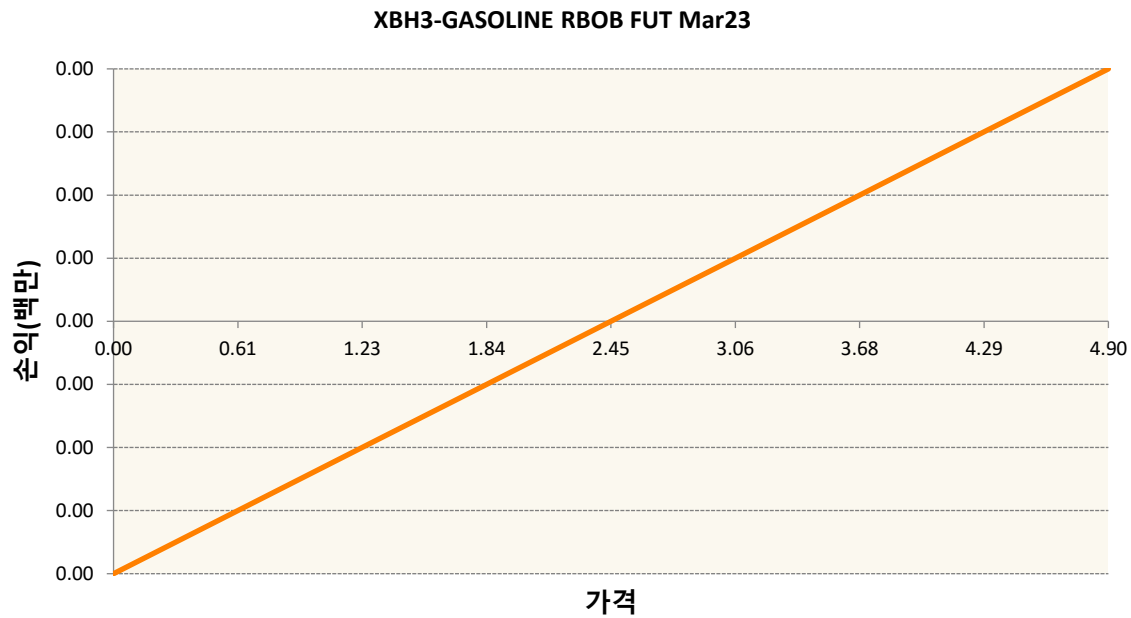


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	31
COK3	BRENT CRUDE FUTR May23	33
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		17
NGH23	NATURAL GAS FUTR Mar23	28
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	18
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	451