

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

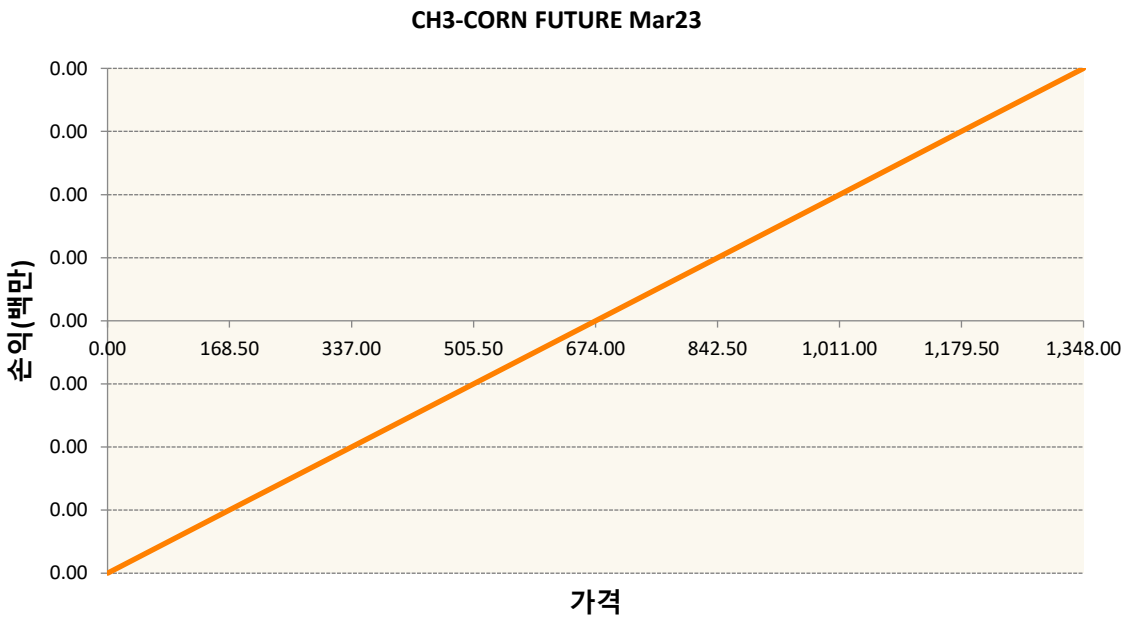
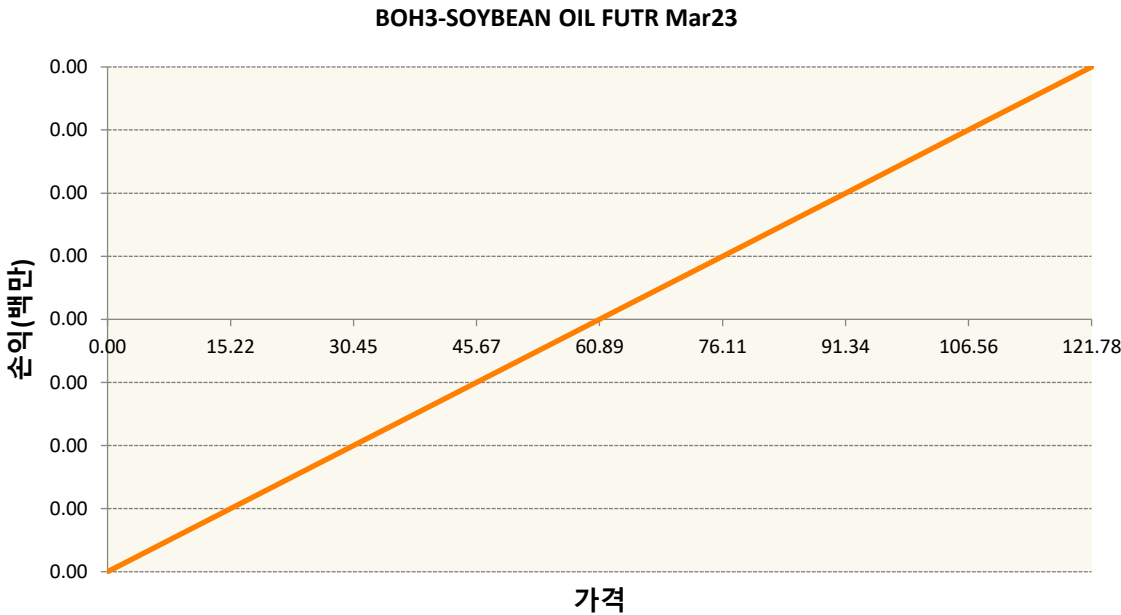
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

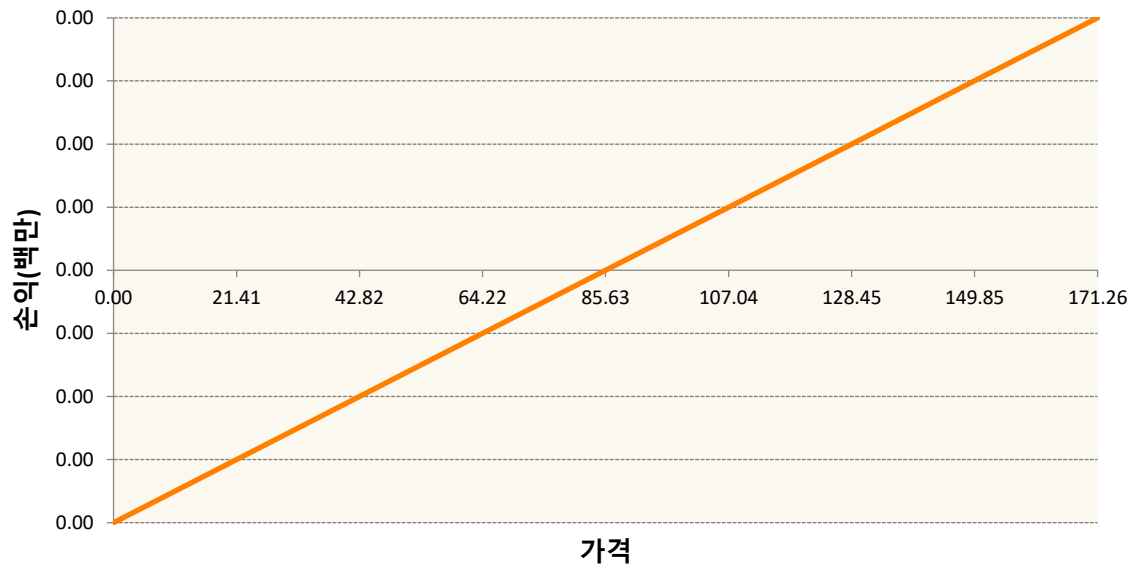
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,409	756	5,653	

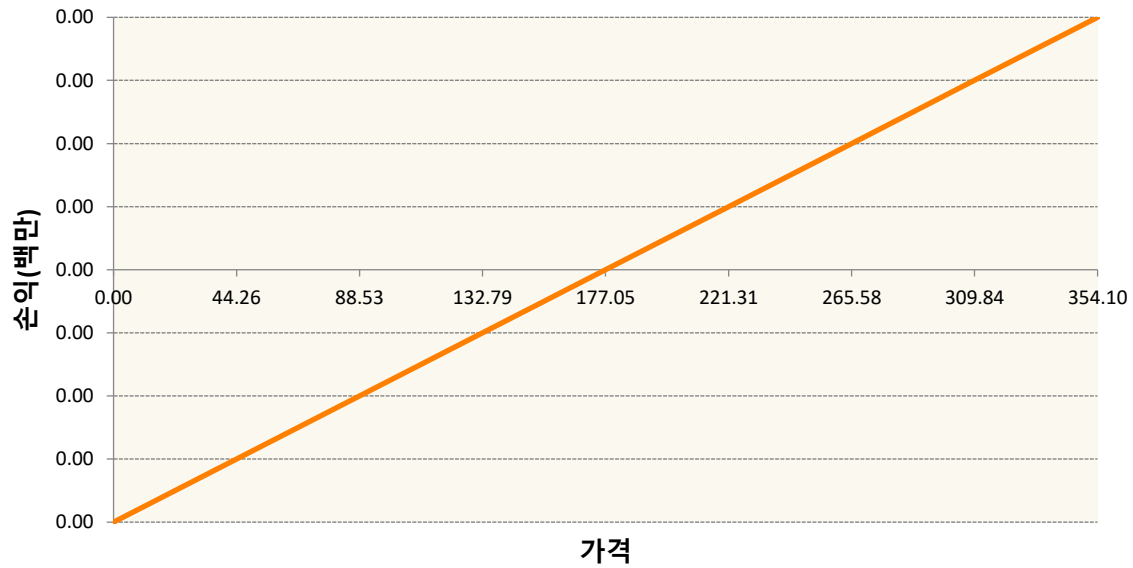
2. 만기시점의 손익구조



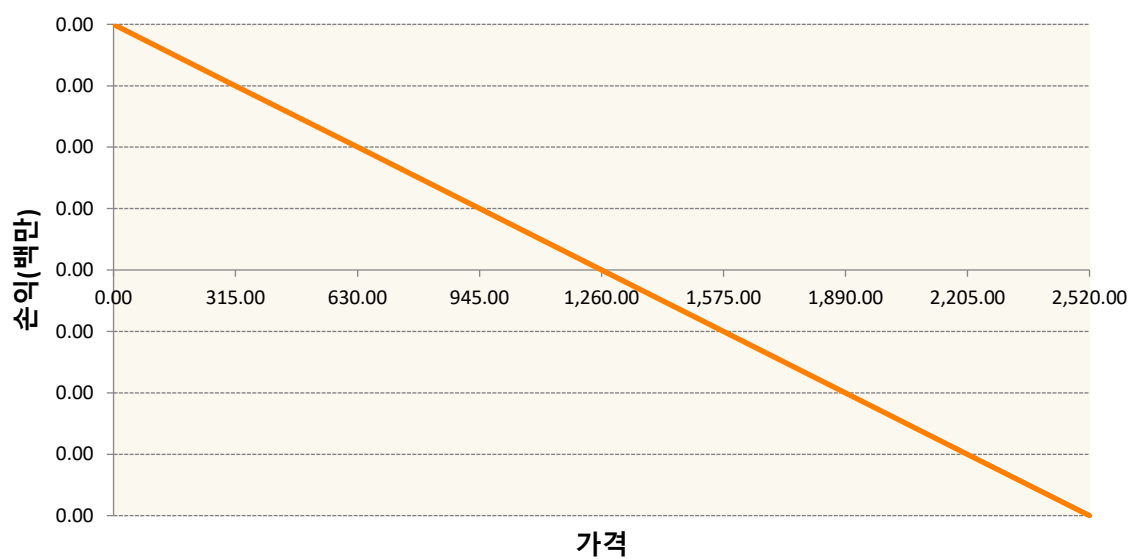
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



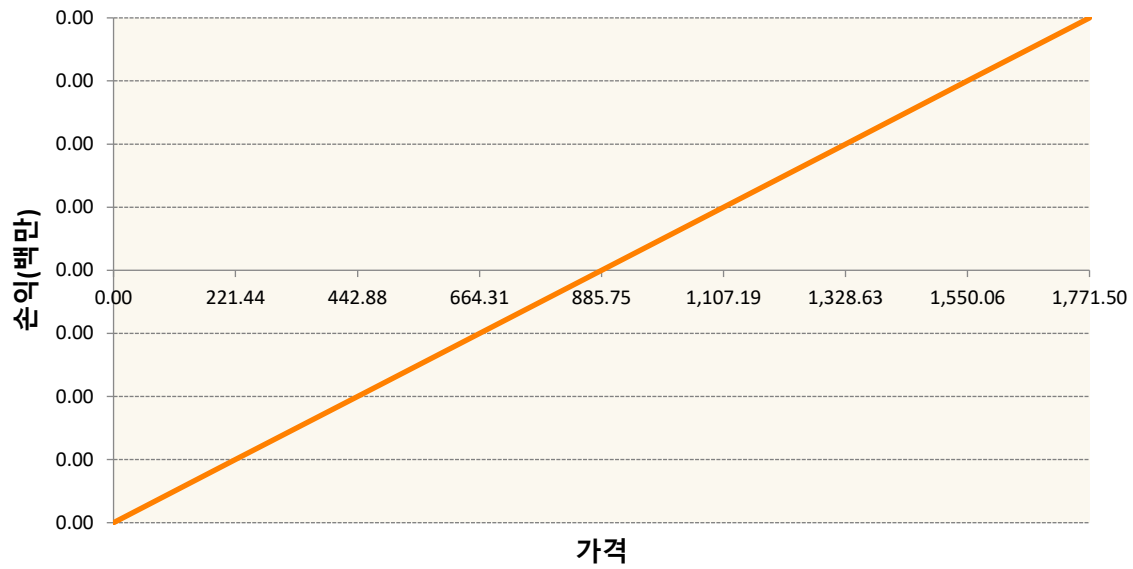
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



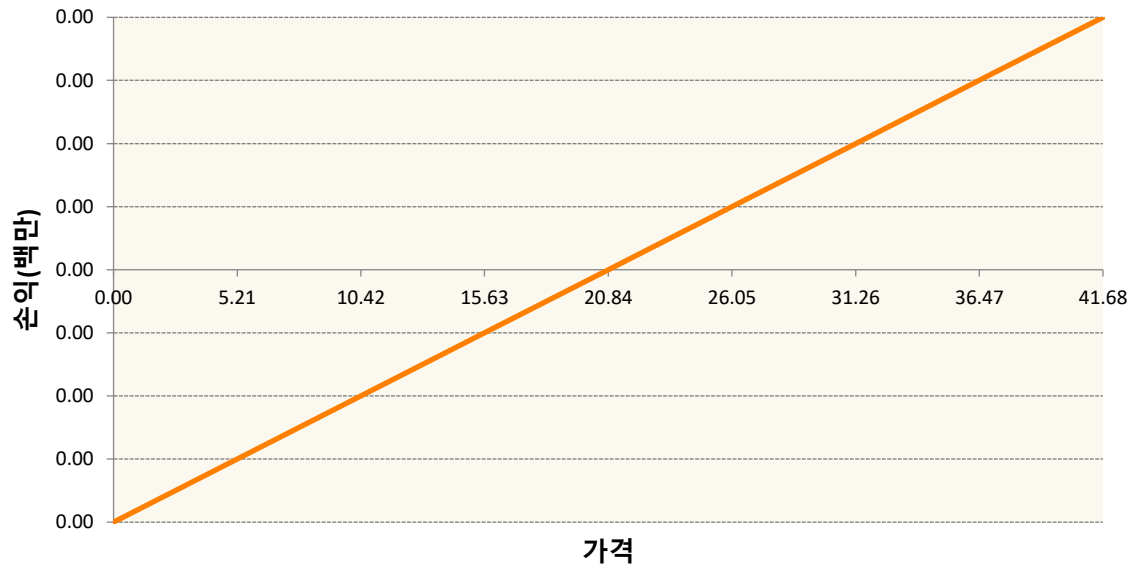
KR4175T20004-2023-02 달러선물



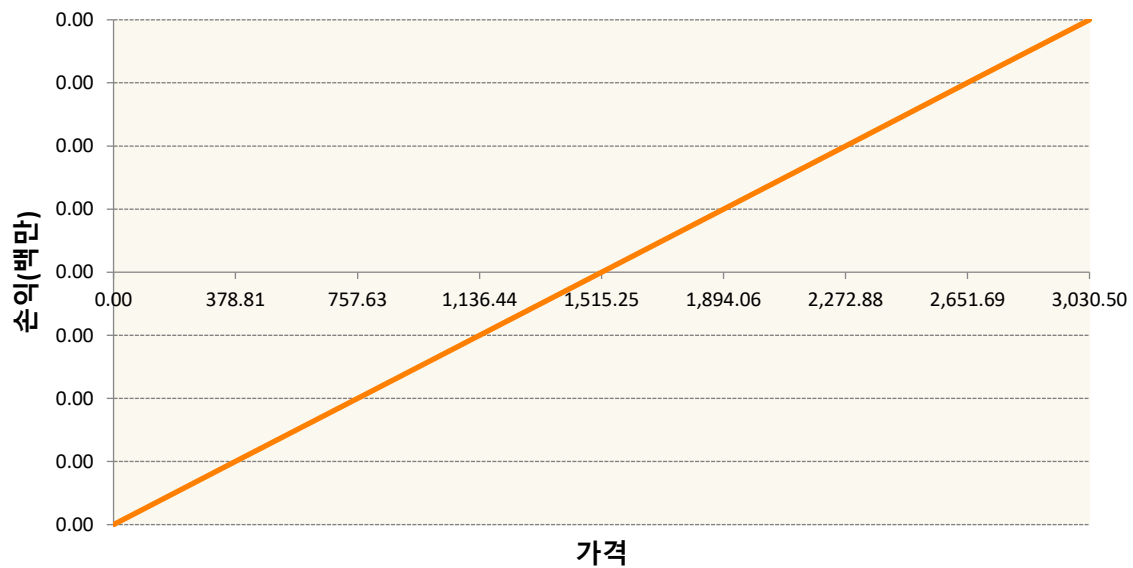
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



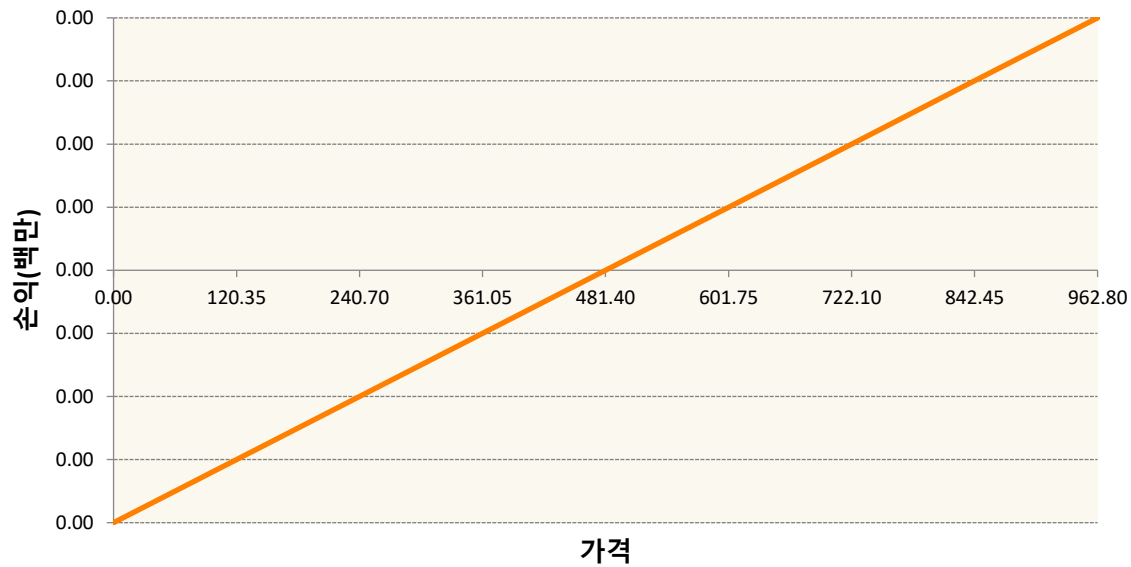
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



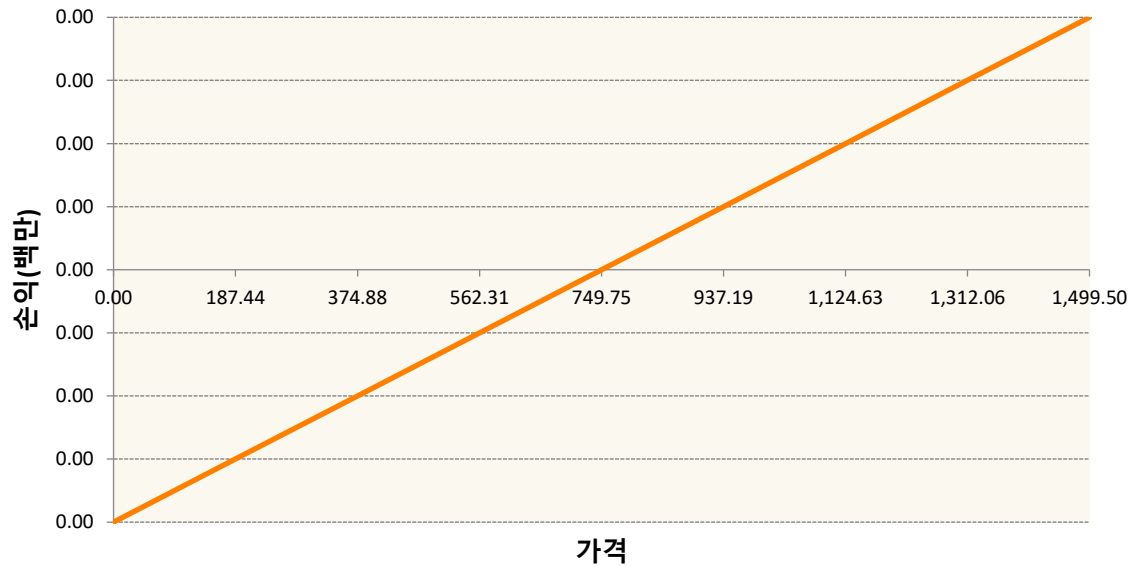
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



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	2023-02-09
기준일	2023-02-08

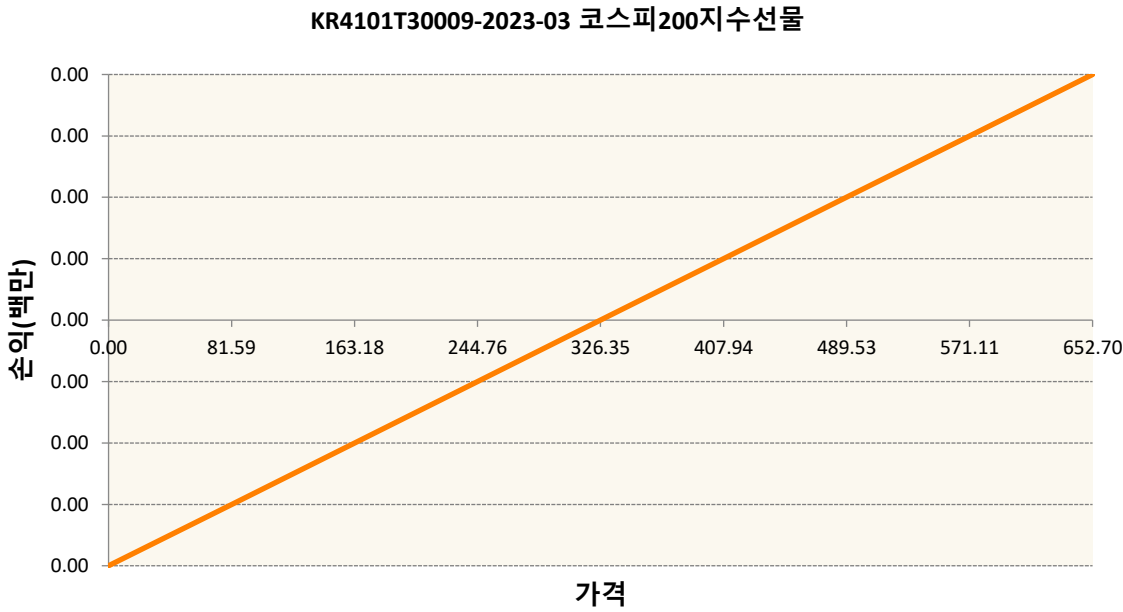
스마트인덱스모

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	2,448	0	2,448	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-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%	195	195	195	195	195	195	195

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

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

370

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

513

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

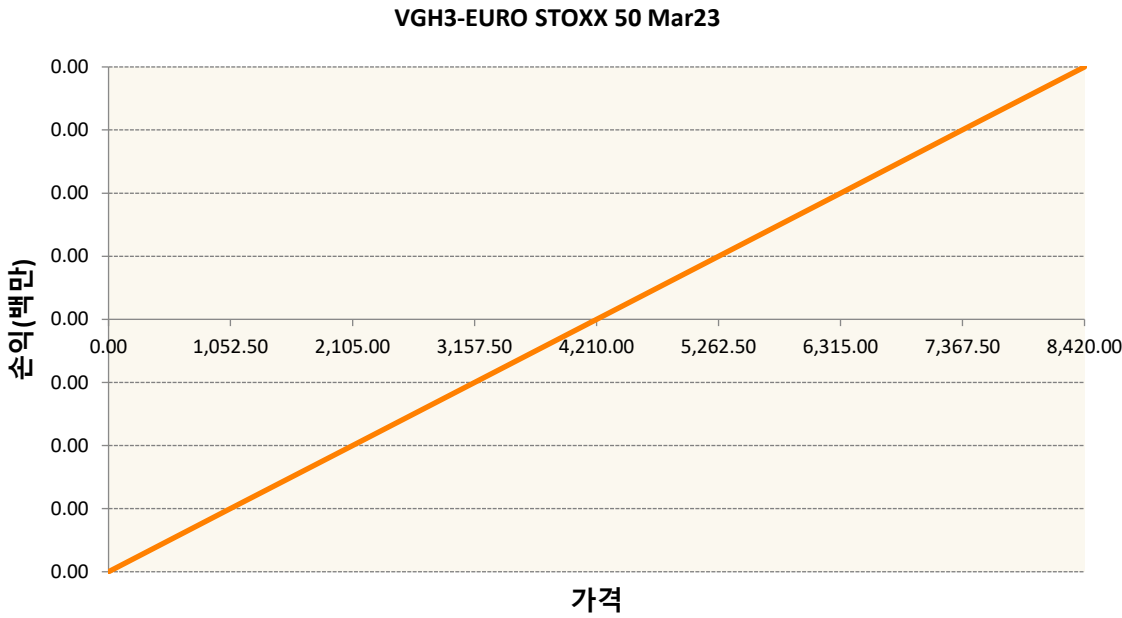
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	466	0	466	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH3	EURO STOXX 50 Mar23	37
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

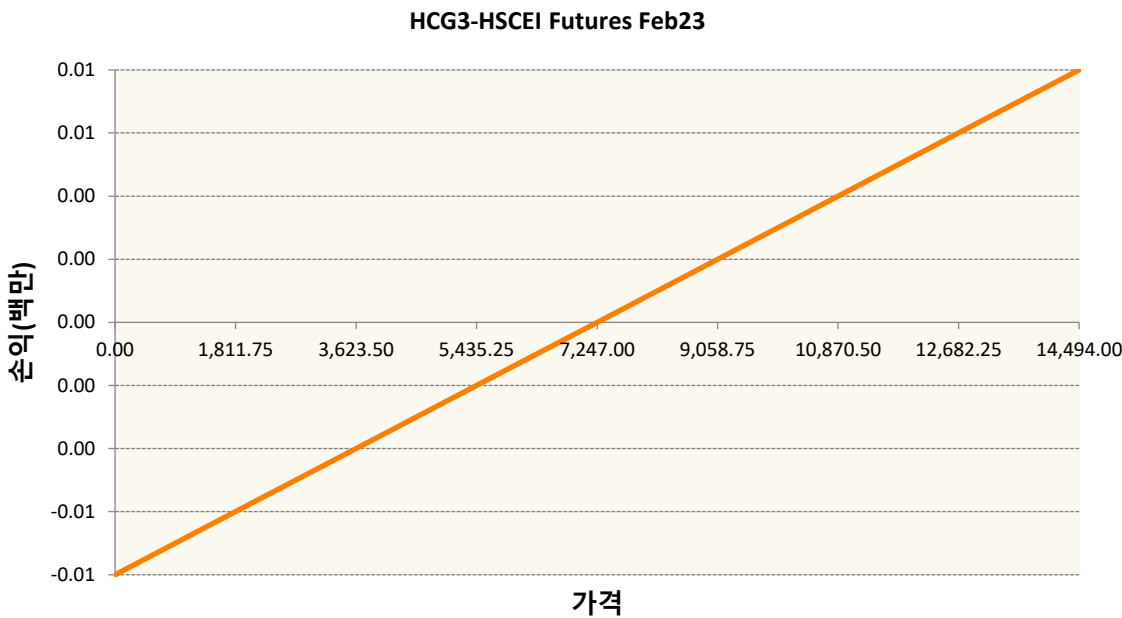
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,536	0	1,536	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG3	HSCEI Futures Feb23	123
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

206

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

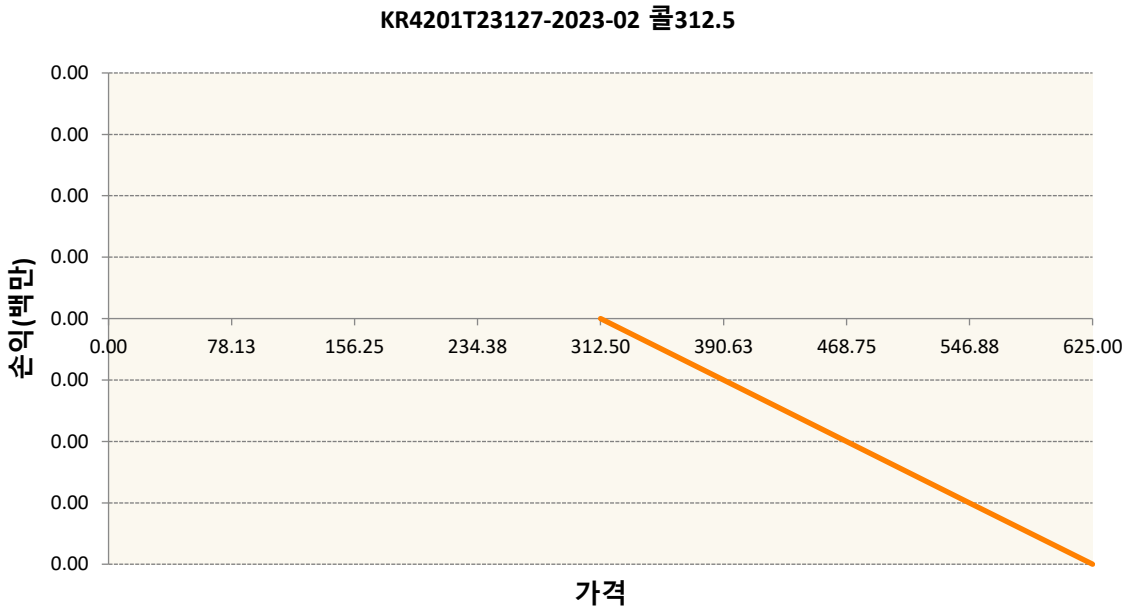
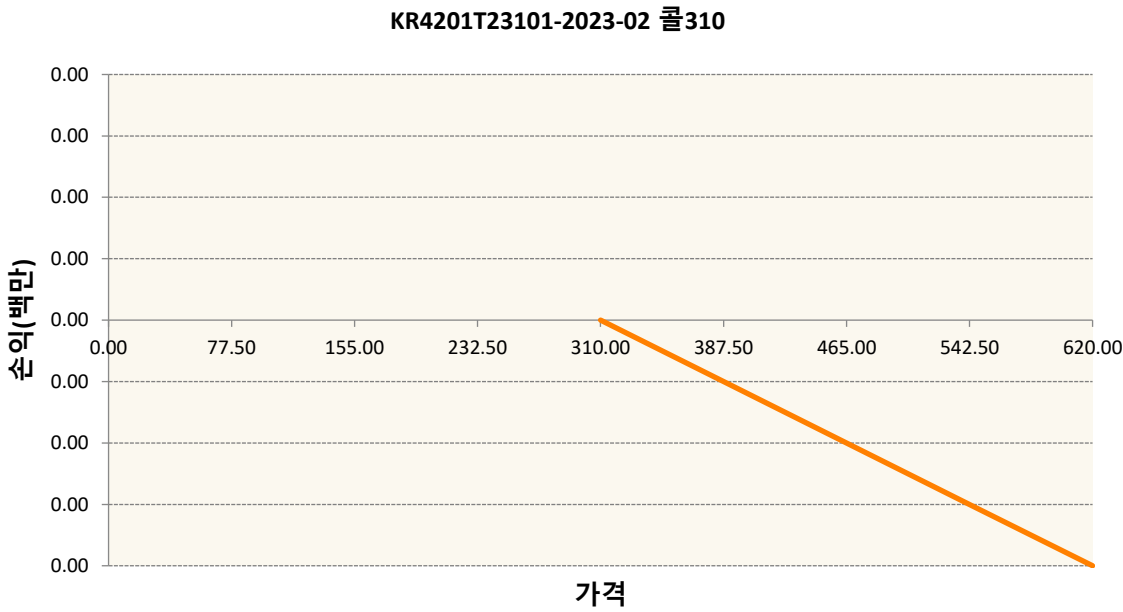
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

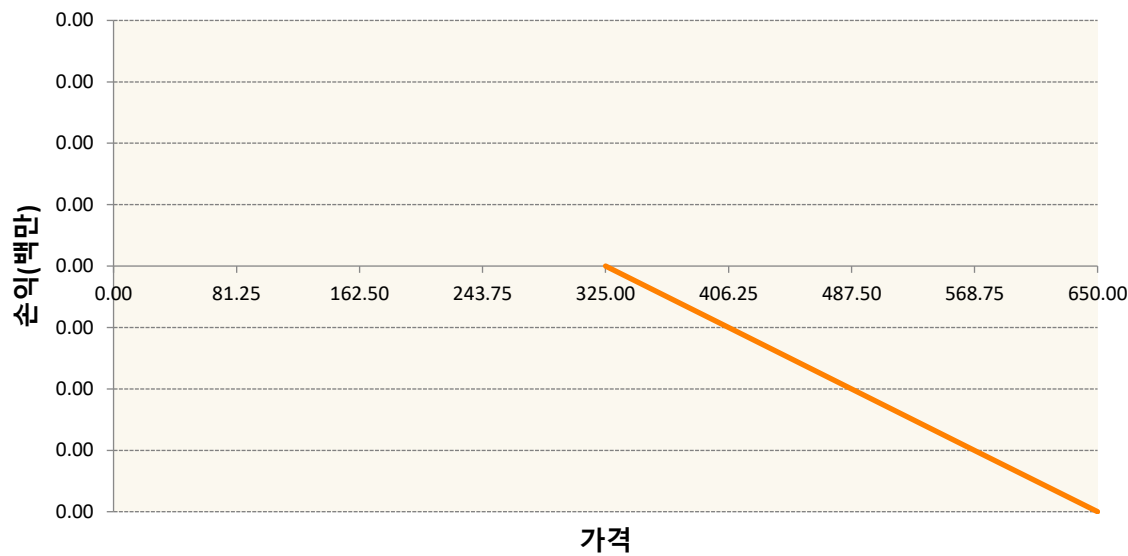
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	6,037	6,799	-762	장내
누계	유가증권	옵션	0	54,993	-54,993	장내

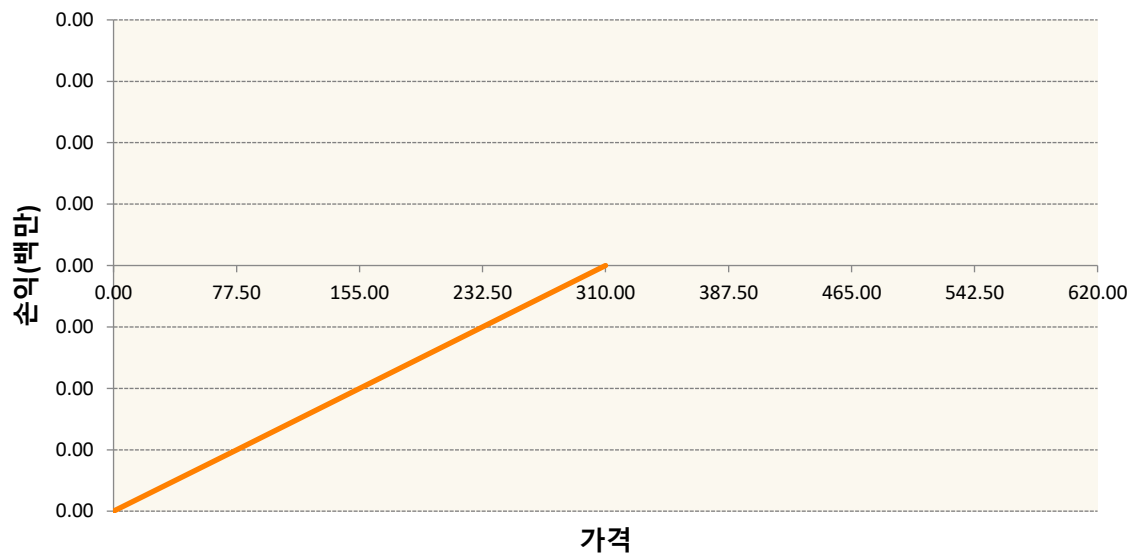
2. 만기시점의 손익구조



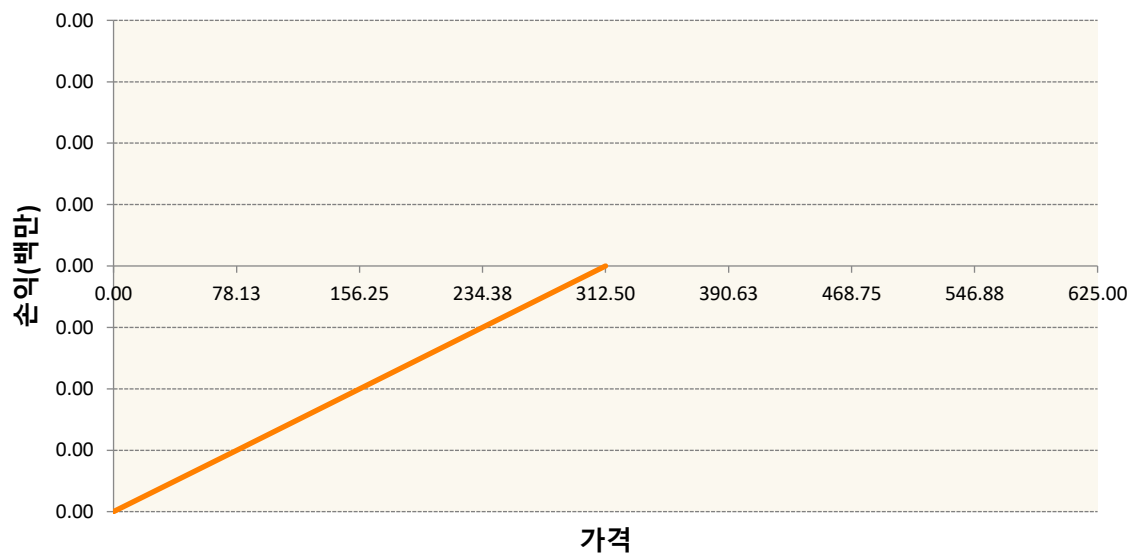
KR4201T33258-2023-03 콜325



KR4301T23109-2023-02 풋310



KR4301T23125-2023-02 풋312.5



(단위:백만원)

KR4201T23101							2023-02 콜310	2,323
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,400	1,394	1,386	1,377	1,367	1,355	1,342	
-5.33%	1,262	1,239	1,216	1,193	1,170	1,146	1,123	
-2.67%	751	738	723	707	689	671	653	
0%	7	6	3	0	-5	-10	-18	
2.67%	-769	-769	-769	-769	-770	-771	-772	
5.33%	-1,546	-1,546	-1,546	-1,546	-1,546	-1,546	-1,546	
8.00%	-2,323	-2,323	-2,323	-2,323	-2,323	-2,323	-2,323	
KR4201T23127							2023-02 콜312.5	892
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	459	458	456	454	452	448	445	
-5.33%	431	423	415	408	399	391	383	
-2.67%	278	270	263	255	247	238	230	
0%	5	4	2	0	-3	-6	-10	
2.67%	-293	-293	-293	-293	-294	-294	-295	
5.33%	-592	-592	-592	-592	-592	-592	-593	
8.00%	-892	-892	-892	-892	-892	-892	-892	
KR4201T33258							2023-03 콜325	427
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	295	273	249	224	199	173	147	
-5.33%	245	218	191	163	135	107	78	
-2.67%	178	148	118	89	59	29	-1	
0%	92	61	31	0	-31	-61	-92	
2.67%	-11	-41	-72	-102	-132	-163	-194	
5.33%	-131	-159	-188	-217	-246	-276	-306	
8.00%	-266	-290	-316	-343	-370	-398	-427	
KR4301T23109							2023-02 풋310	174
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-164	-165	-166	-168	-170	-172	-174	
-5.33%	-51	-55	-59	-64	-68	-72	-76	
-2.67%	-5	-7	-10	-12	-15	-19	-22	
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3	
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	
8.00%	1	1	1	1	1	1	1	
KR4301T23125							2023-02 풋312.5	207
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-201	-201	-202	-203	-204	-206	-207
-5.33%	-77	-80	-84	-87	-91	-95	-99
-2.67%	-10	-13	-17	-20	-24	-28	-32
0%	2	2	1	0	-1	-3	-5
2.67%	3	3	3	3	3	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

4,030

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

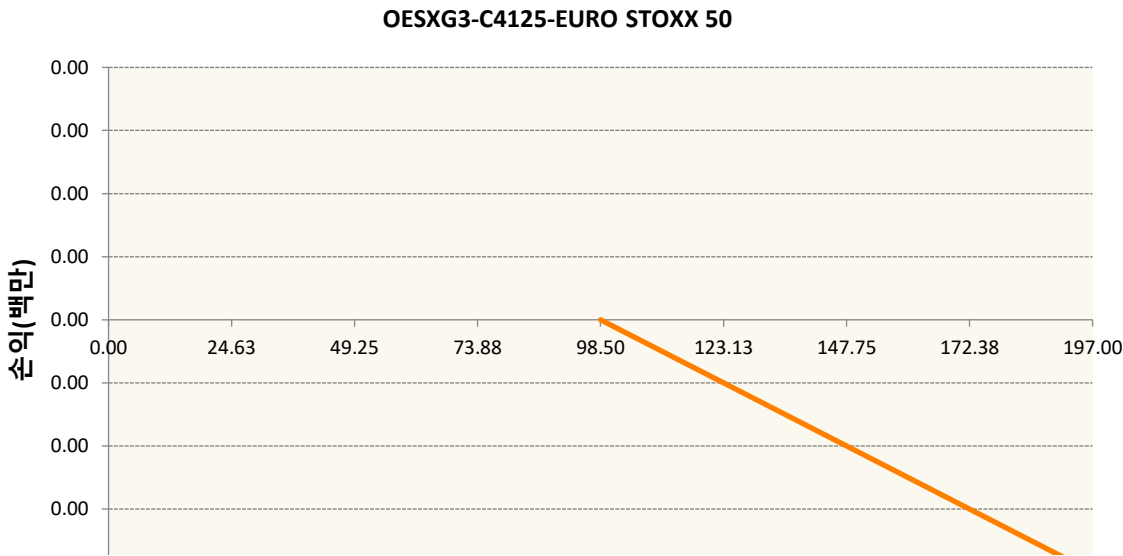
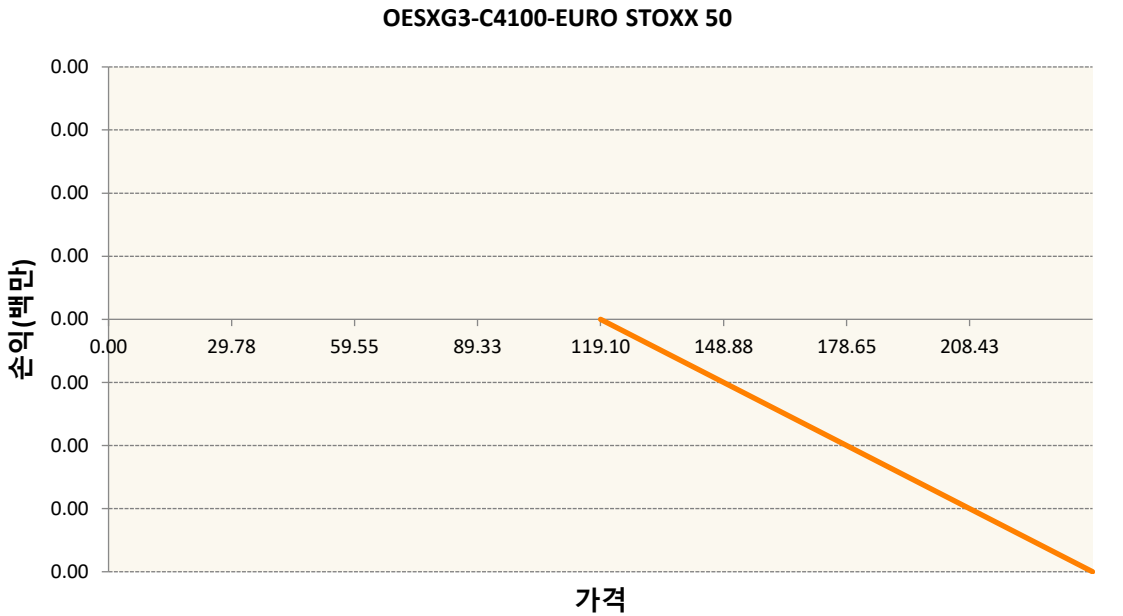
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

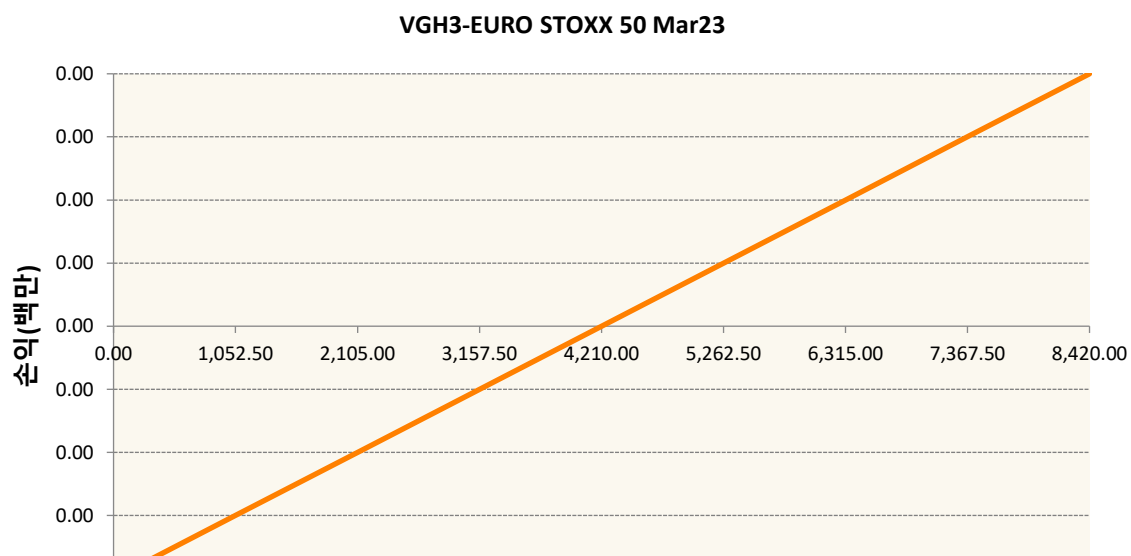
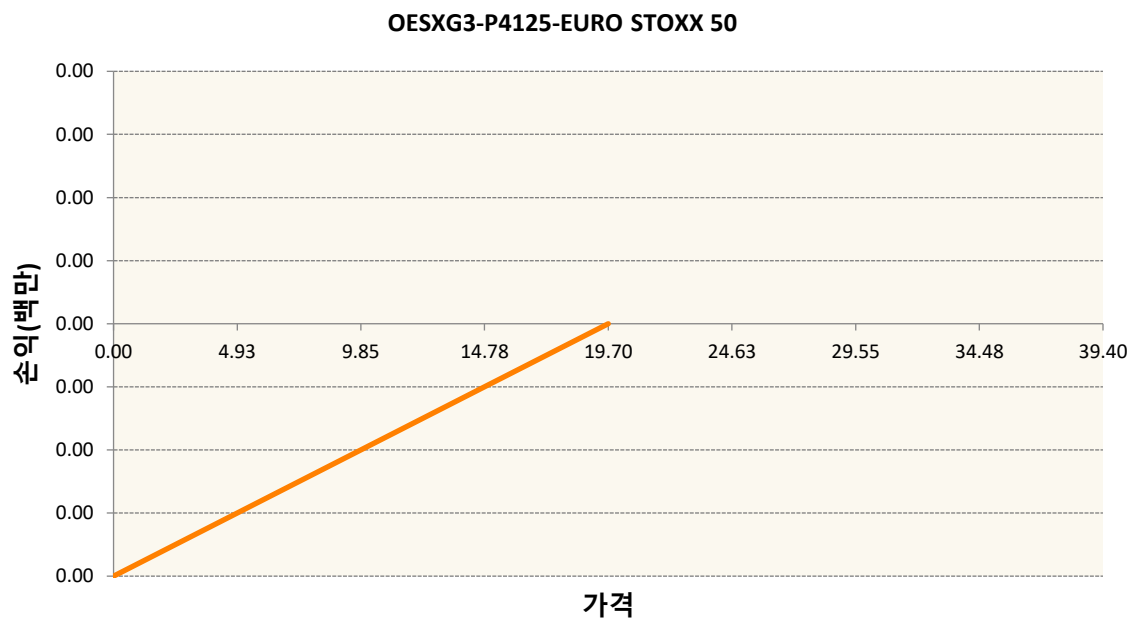
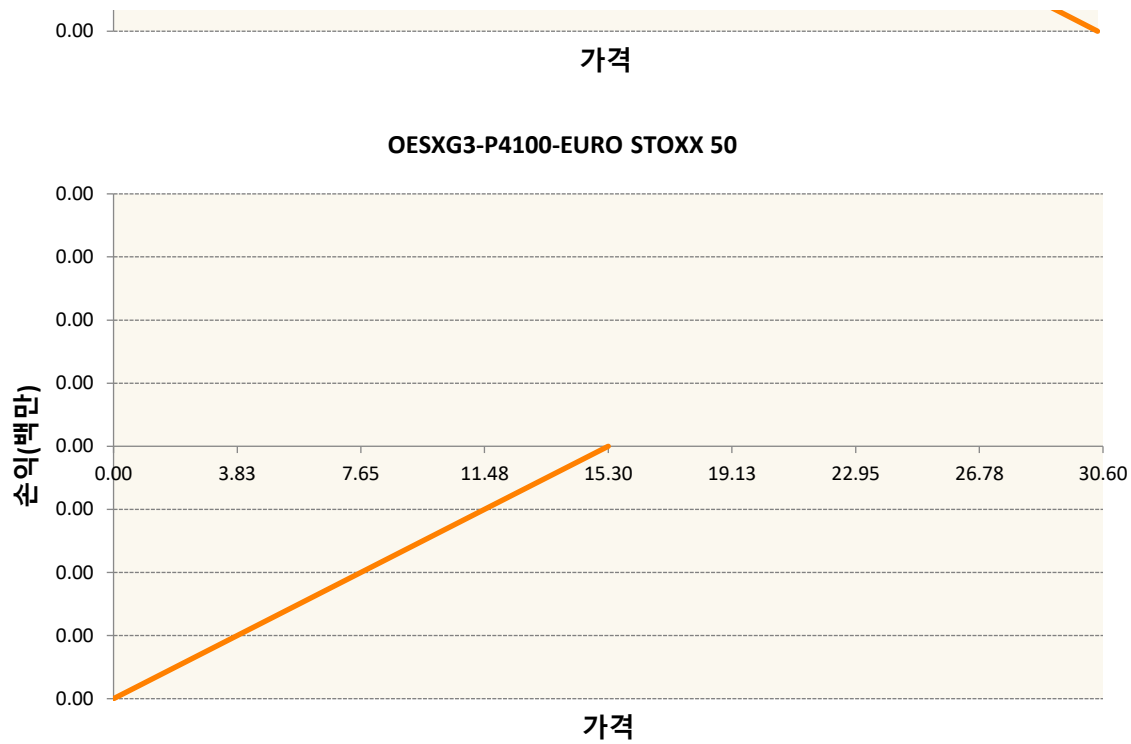
1. 계약금액

(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	993	0	993	
누계	유가증권	옵션	0	60	-60	장내
누계	통화	선도	135	2,097	-1,961	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		0.13
OESXG3-P41 EURO STOXX 50		1
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		79

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	225

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

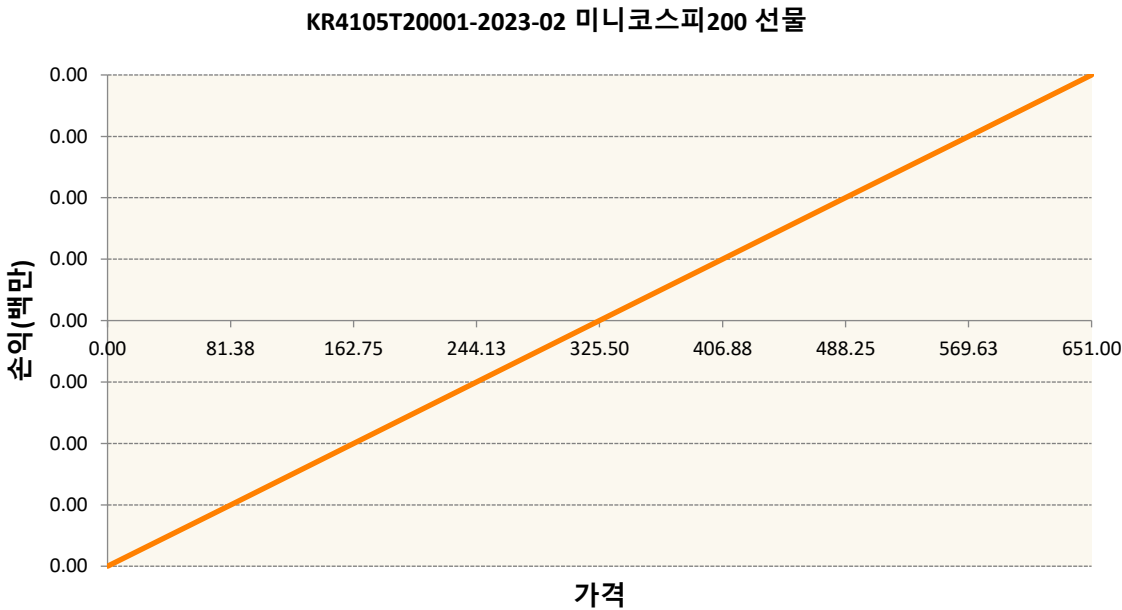
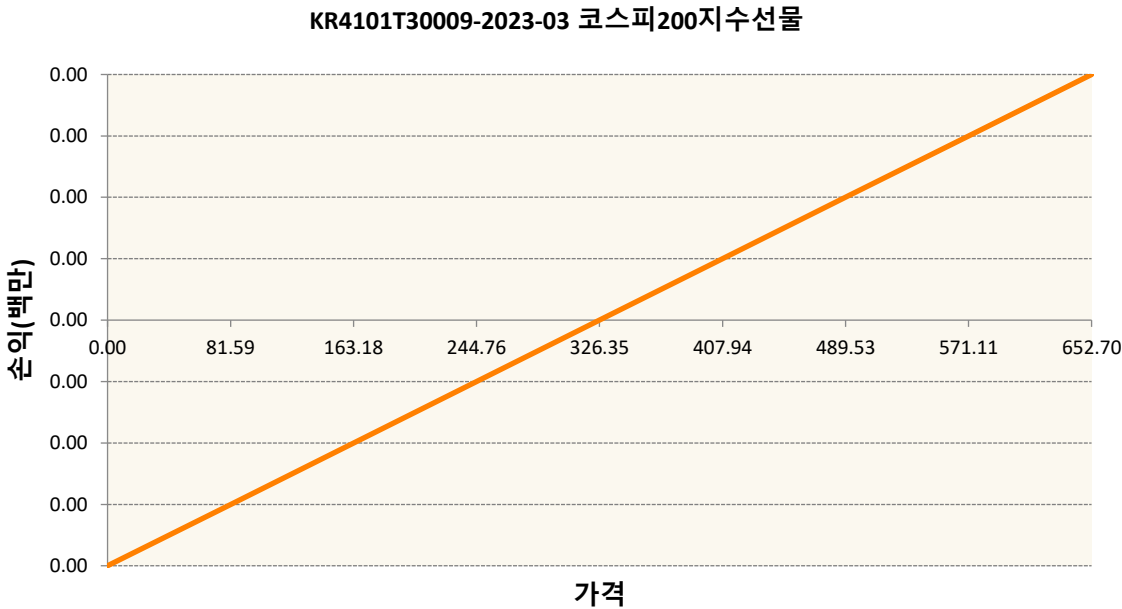
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

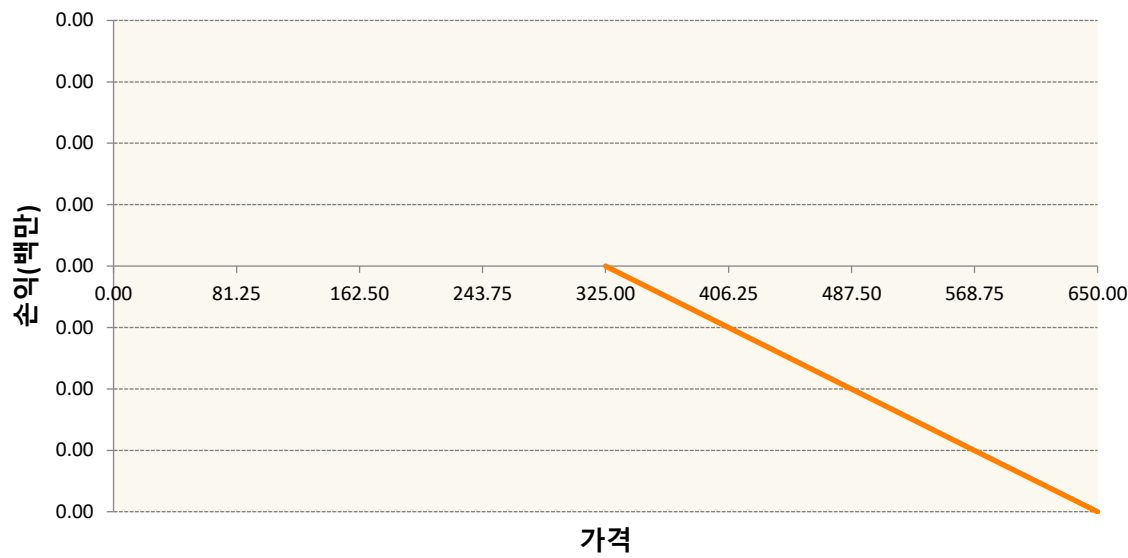
(단위:백만원)

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	733	0	733	장내
누계	유가증권	옵션	156	3,915	-3,759	장내

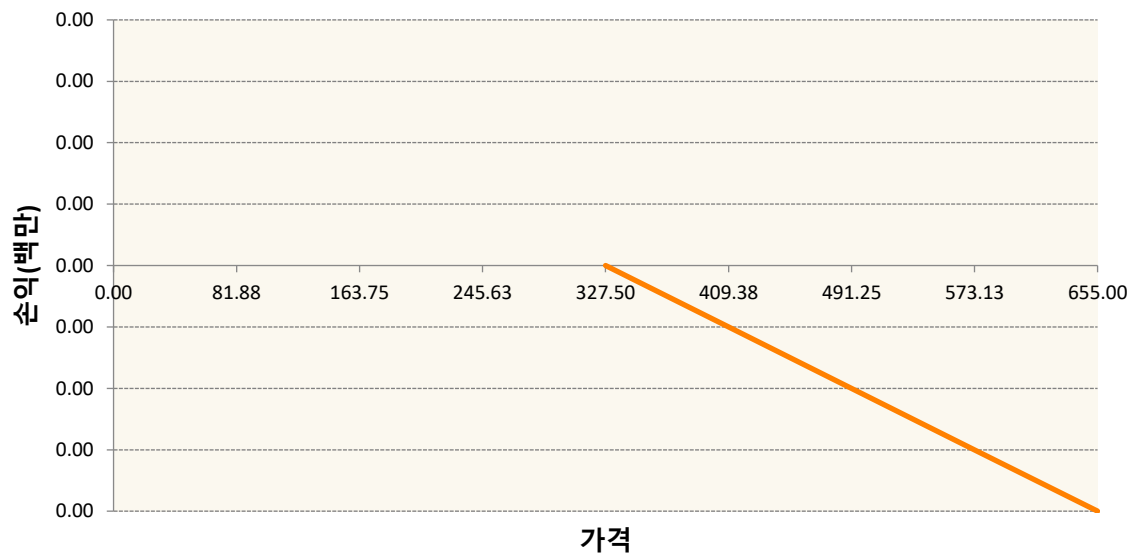
2. 만기시점의 손익구조



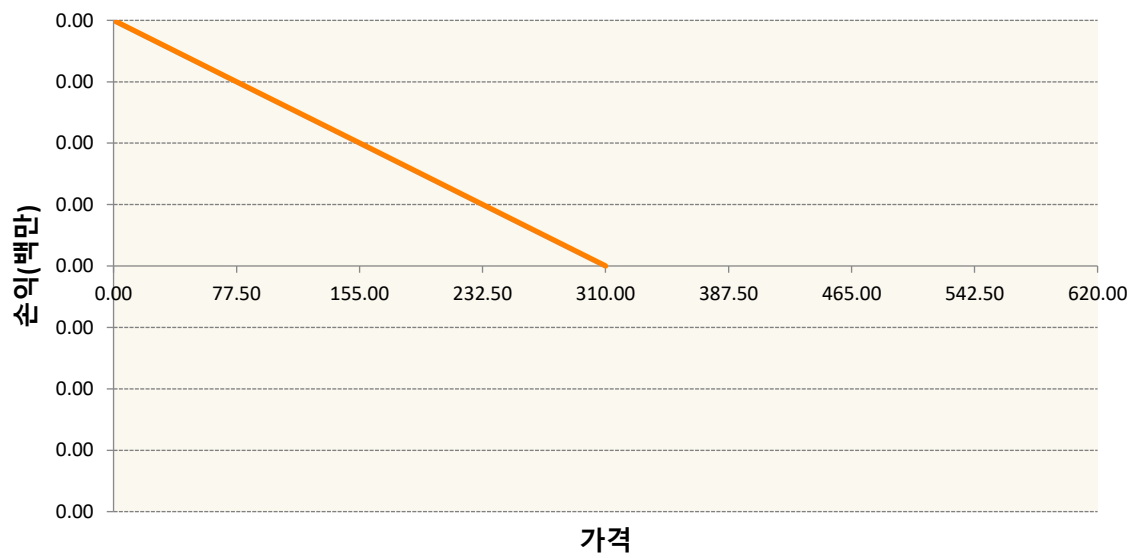
KR4201T23259-2023-02 콜325



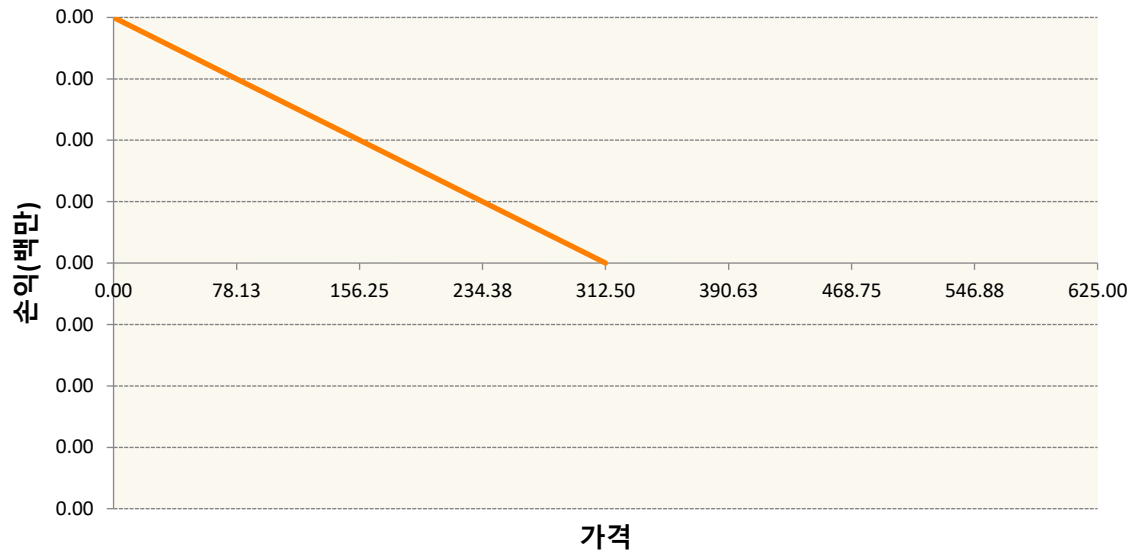
KR4201T23275-2023-02 콜327.5



KR4301T23109-2023-02 풋310



KR4301T23125-2023-02 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					33
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33
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					138
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22
-5.33%	22	22	22	22	22	21	21
-2.67%	20	20	19	18	17	16	14
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5

2.67%	-35	-36	-36	-37	-38	-39	-41
5.33%	-86	-86	-86	-86	-87	-87	-87
8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138

KR4201T23275 2023-02 콜327.5 130

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	15	15	15	15	15	15
-5.33%	15	15	15	15	15	15	14
-2.67%	14	14	13	13	12	11	10
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	-29	-30	-31	-32	-33	-35	-36
5.33%	-78	-78	-78	-79	-79	-80	-80
8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130

KR4301T23109 2023-02 풋310 3

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	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%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301T23125 2023-02 풋312.5 3

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3	3	3	3	3	3	3
-5.33%	1	1	1	1	1	2	2
-2.67%	0	0	0	0	0	0	1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

365

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

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	6,866	0	6,866	

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	2023-02-09
기준일	2023-02-08

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	5,728	0	5,728	

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	2023-02-09
기준일	2023-02-08

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	19,456	0	19,456	
누계	통화	선도	0	19,437	-19,437	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CBQ KRW/USD 28-02-23E		644
FXW213CCS(KRW/USD 28-03-23E		534
FXW213D1S(KRW/USD 28-04-23E		301
FXW213D1T(KRW/USD 28-02-23E		76
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	860

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

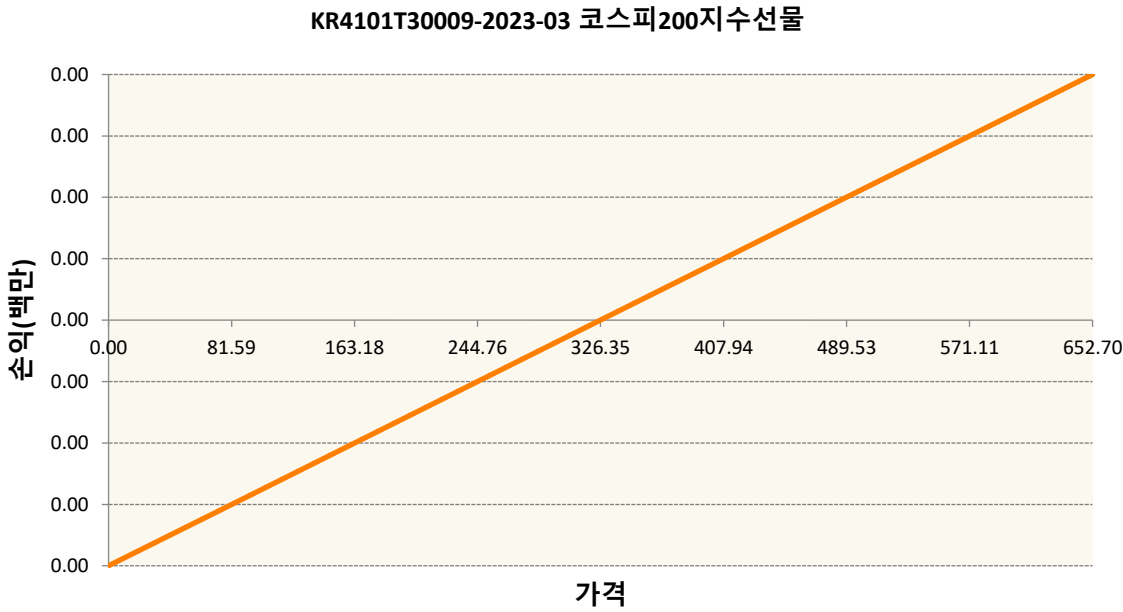
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,387	0	1,387	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					111
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	111	111	111	111	111	111	111

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

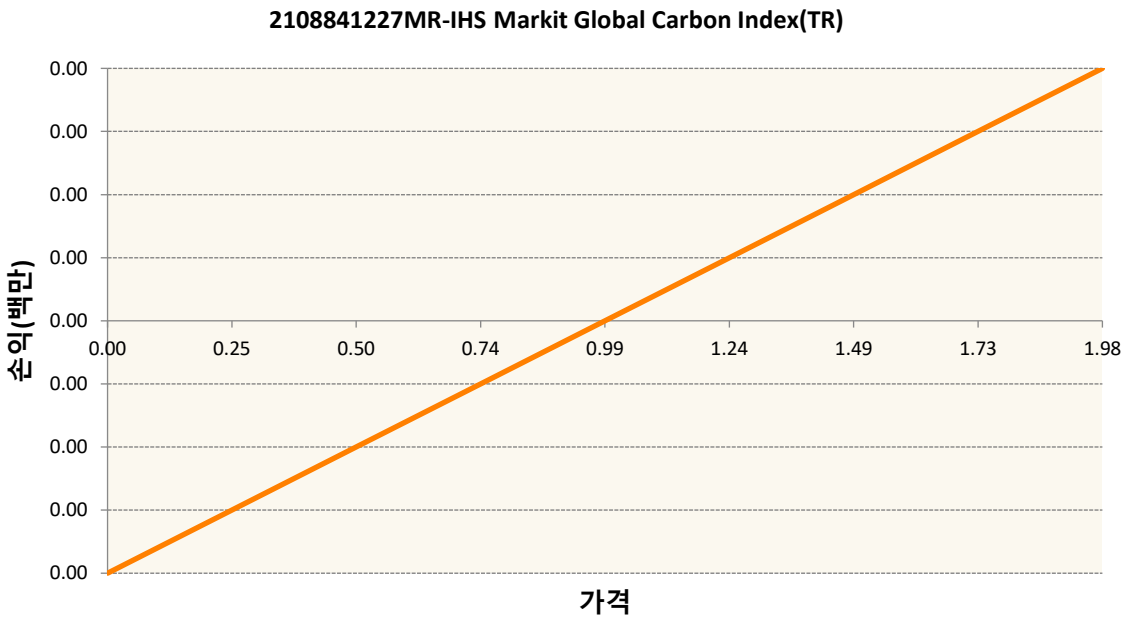
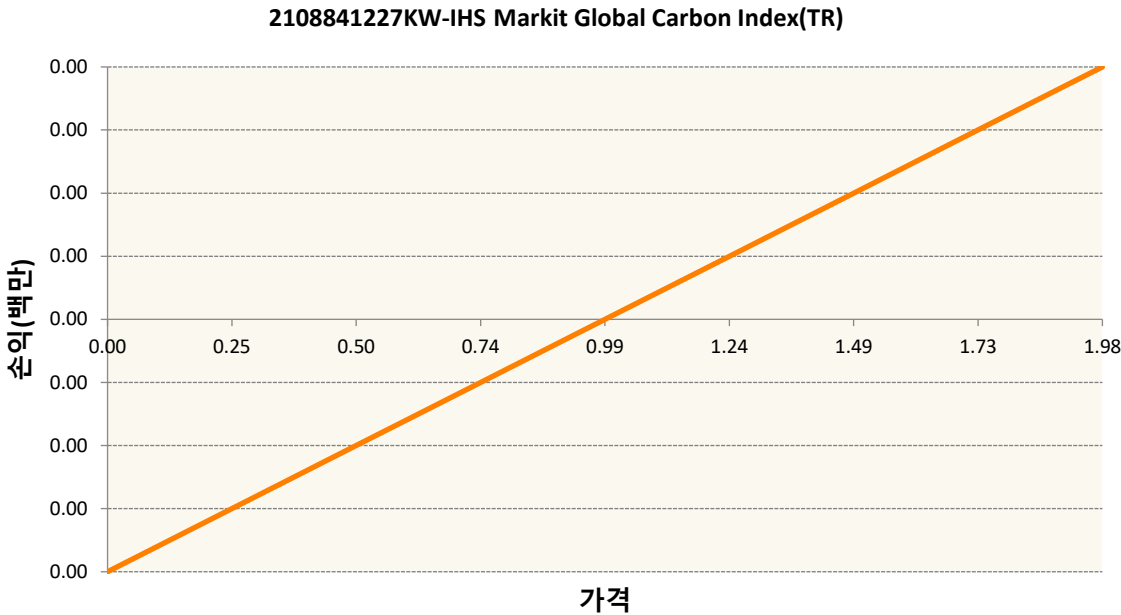
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

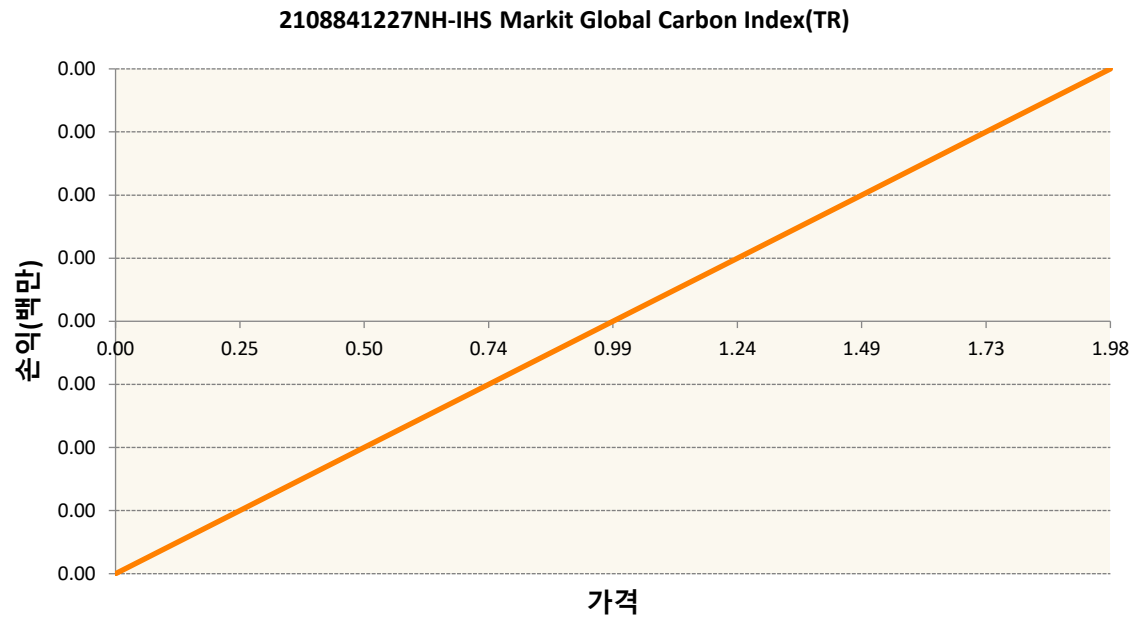
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,103	0	24,103	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,646
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		194
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		97

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,718

공시일 2023-02-09

기준일 2023-02-08

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

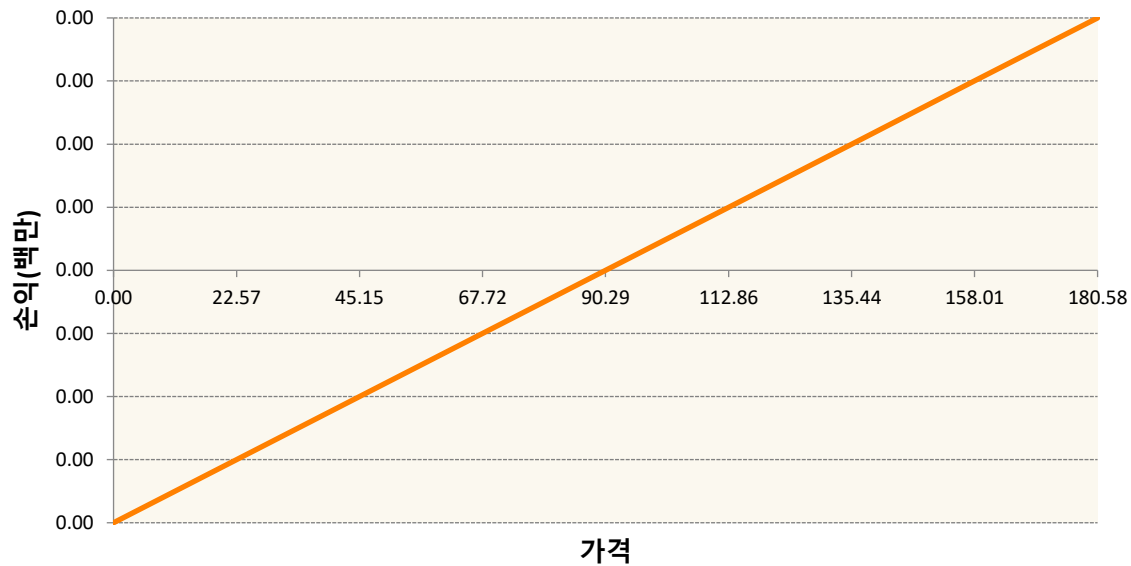
1. 계약금액

(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	13,711	0	13,711	
누계	통화	선도	692	5,570	-4,877	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ23-ECX EMISSION Dec23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	108
FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	197
FXW213D1X(KRW/EUR 24-02-23E	65
FXW213D22(KRW/EUR 24-02-23E	75
FXW213D27(EUR/KRW 24-02-23E	55
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,097

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

(단위:백만원)

3,246

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

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)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	17

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

(단위:백만원)

123

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

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)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	8

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

(단위:백만원)

44

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

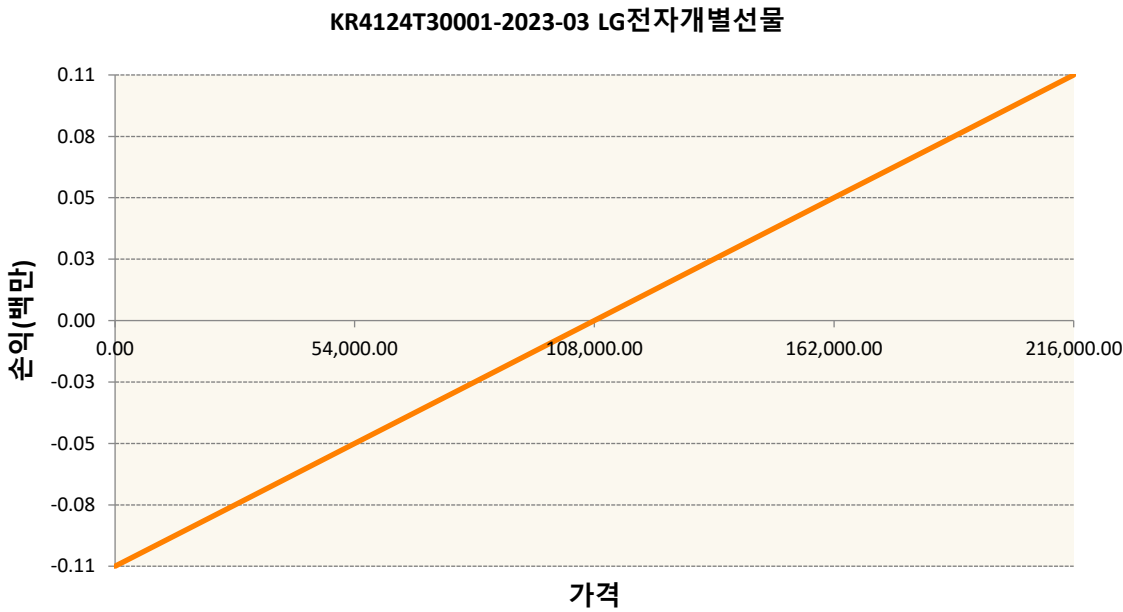
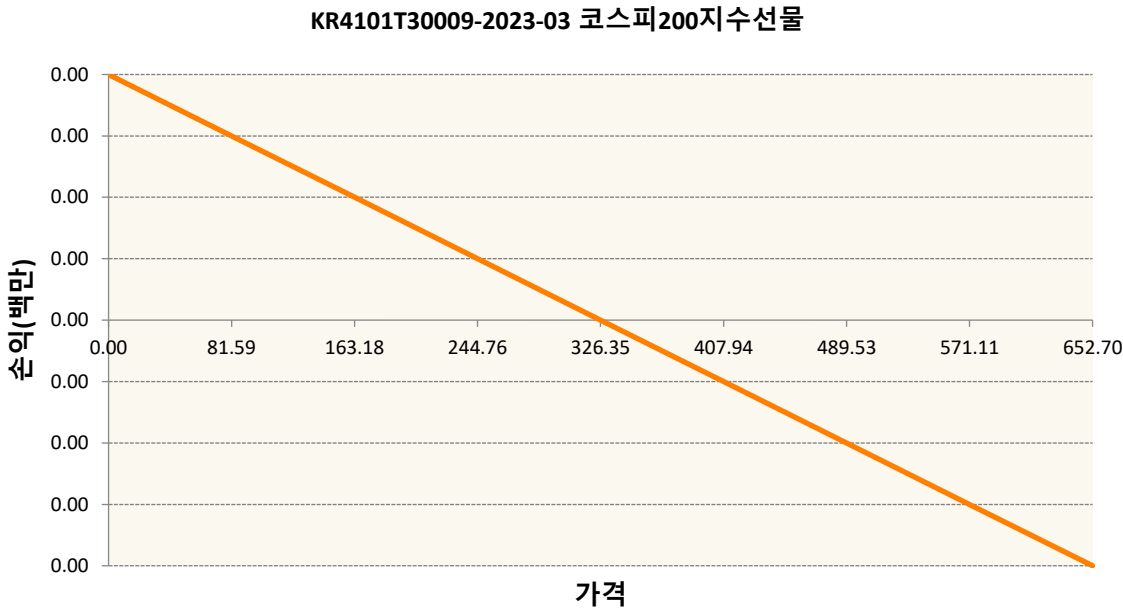
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

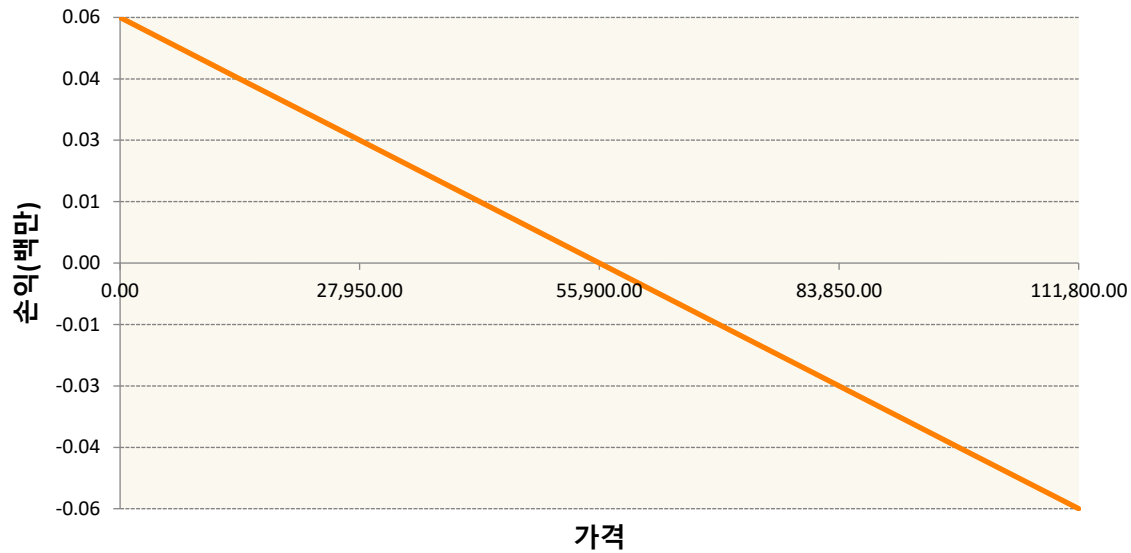
(단위:백만원)

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	108	1,217	-1,109	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

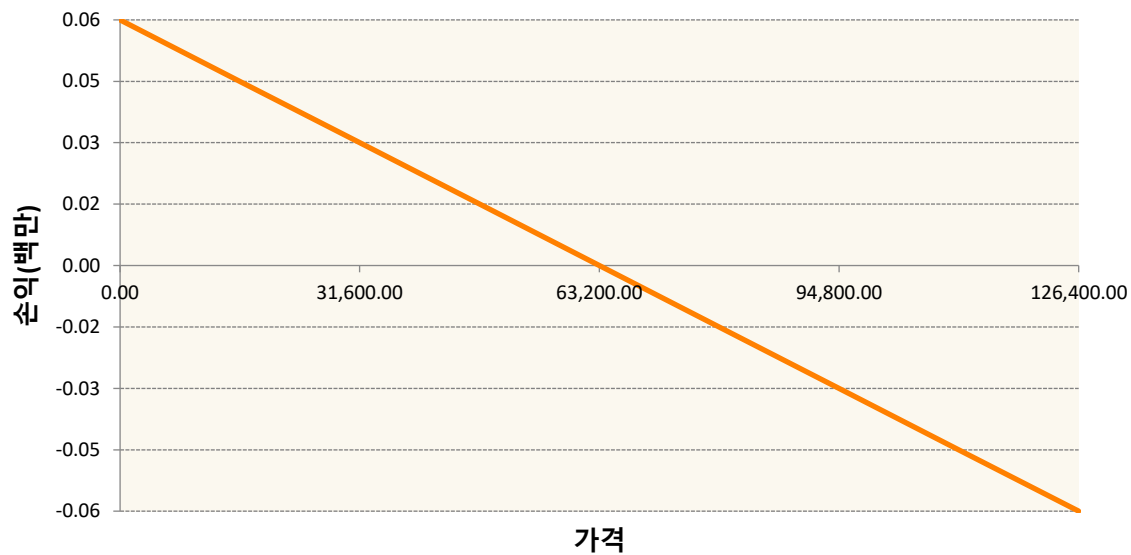
2. 만기시점의 손익구조



KR4146T20005-2023-02 KB금융개별선물



KR41F7T20001-2023-02 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T300 2023-03 코스피200지수선물	65
KR4124T300 2023-03 LG전자개별선물	9
KR4146T200 2023-02 KB금융개별선물	13
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)

192

공시일 2023-02-09

기준일 2023-02-08

신한SOL한국형글로벌반도체엑티

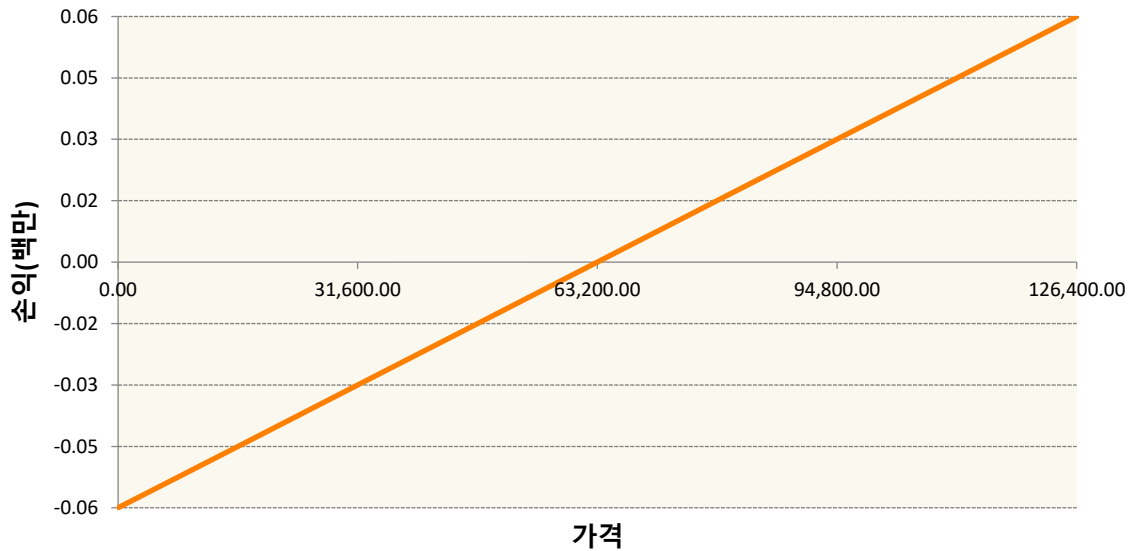
1. 계약금액

(단위:백만원)

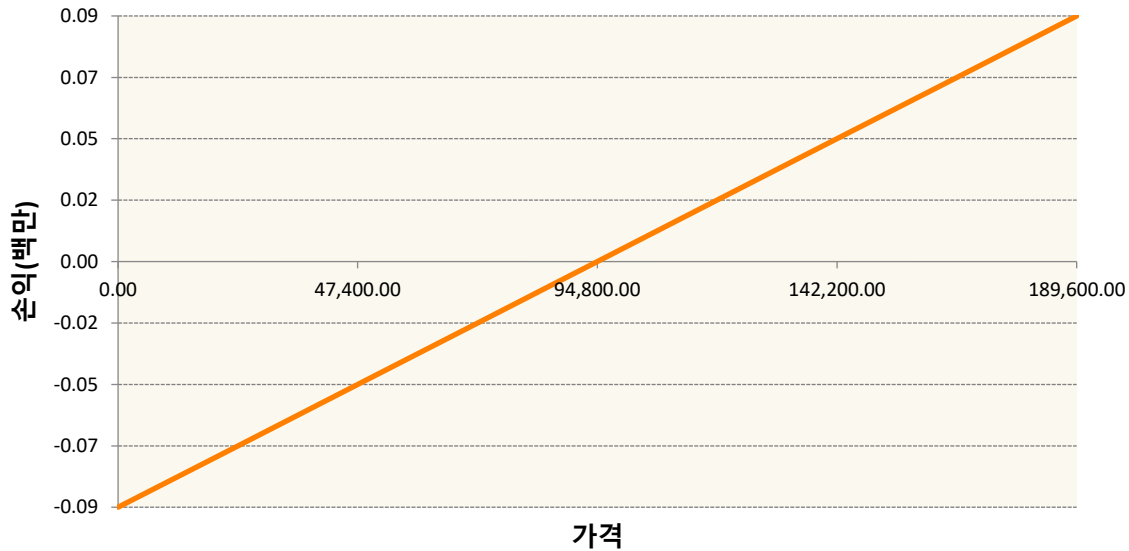
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	157	0	157	장내
누계	유가증권	선물	158	0	158	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4111T30008-2023-03 삼성전자개별선물



KR4150T30006-2023-03 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4111T30008		2023-03 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
KR4150T30006		2023-03 SK하이닉스개별선물					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)

16

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

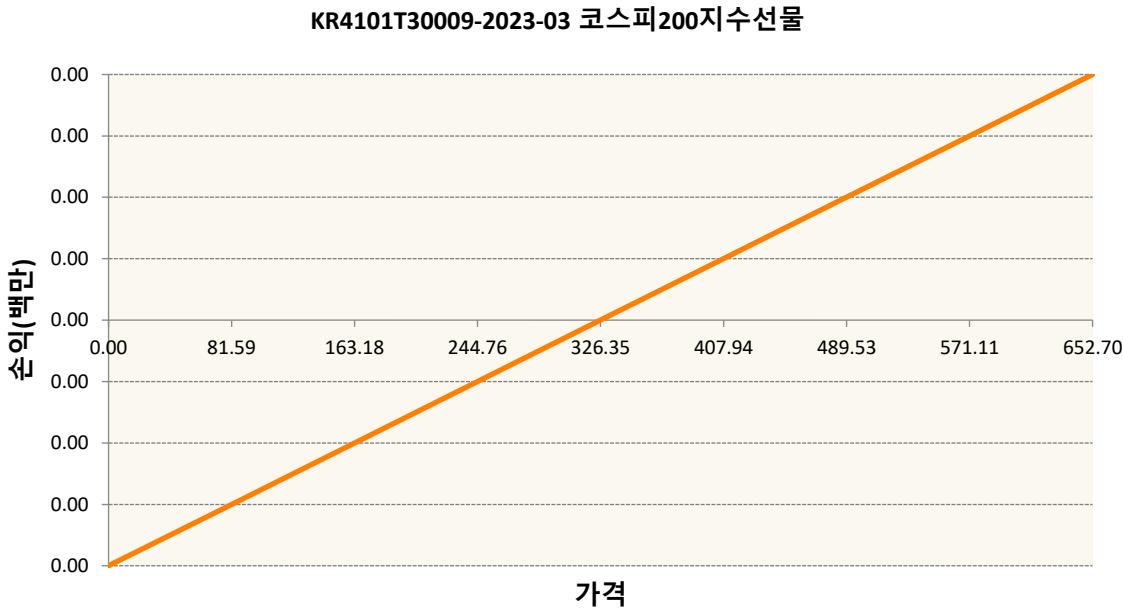
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,448	0	2,448	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				195
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-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%	195	195	195	195	195	195	195

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

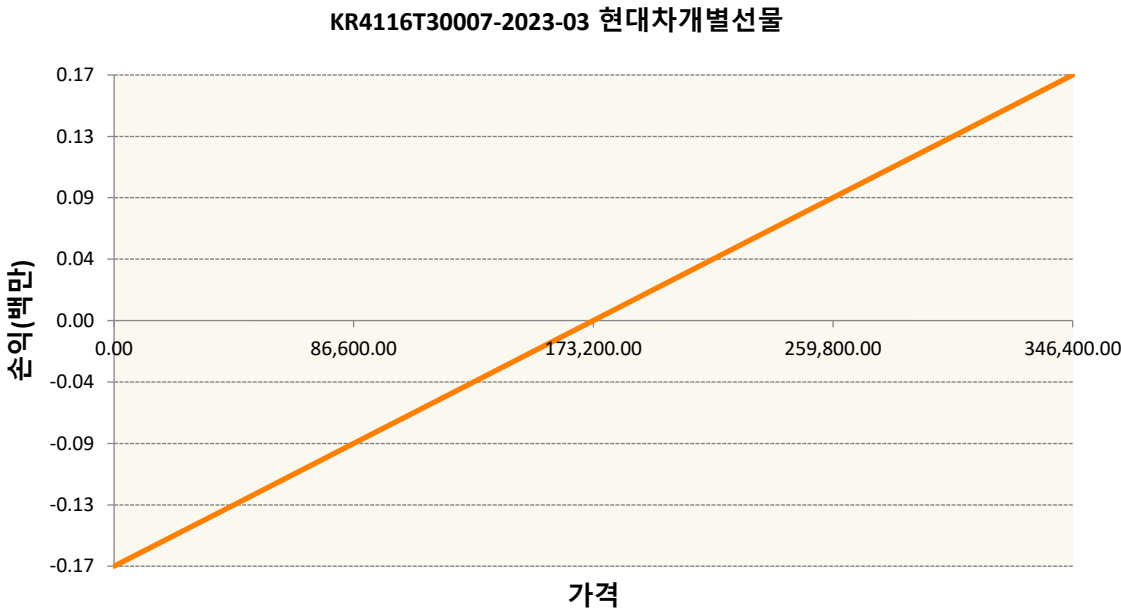
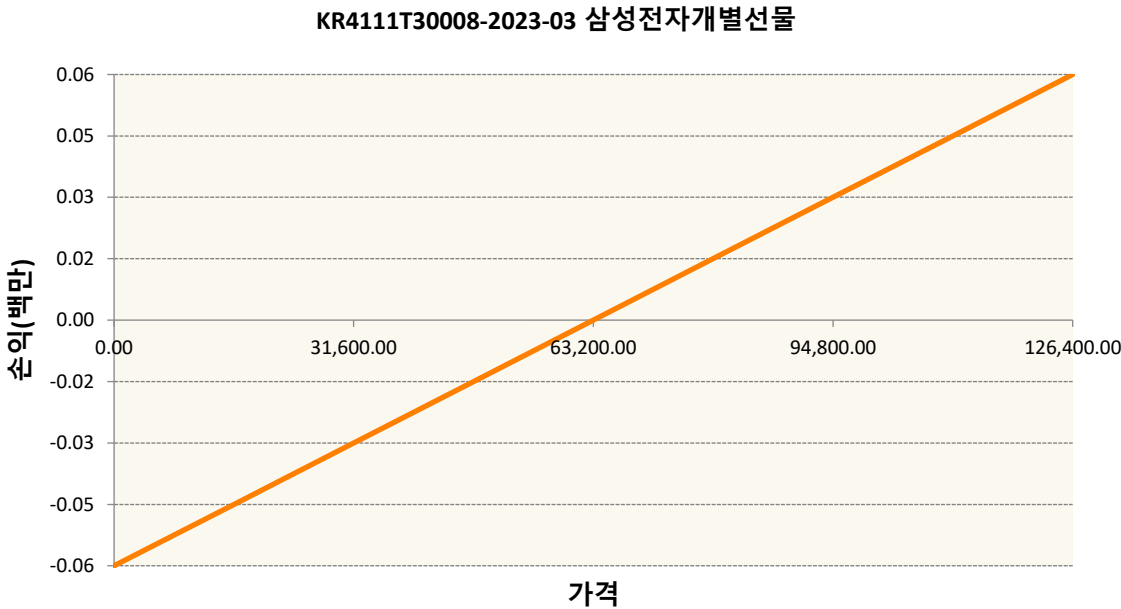
SOL한국형글로벌전기차&2차전지

1. 계약금액

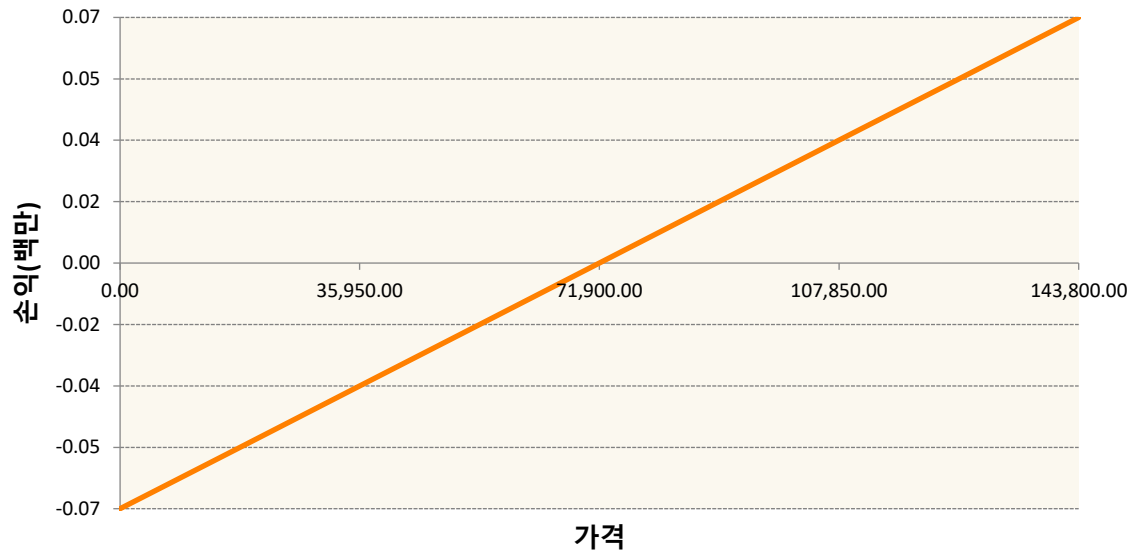
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	256	0	256	장내
누계	유가증권	선물	256	0	256	장내

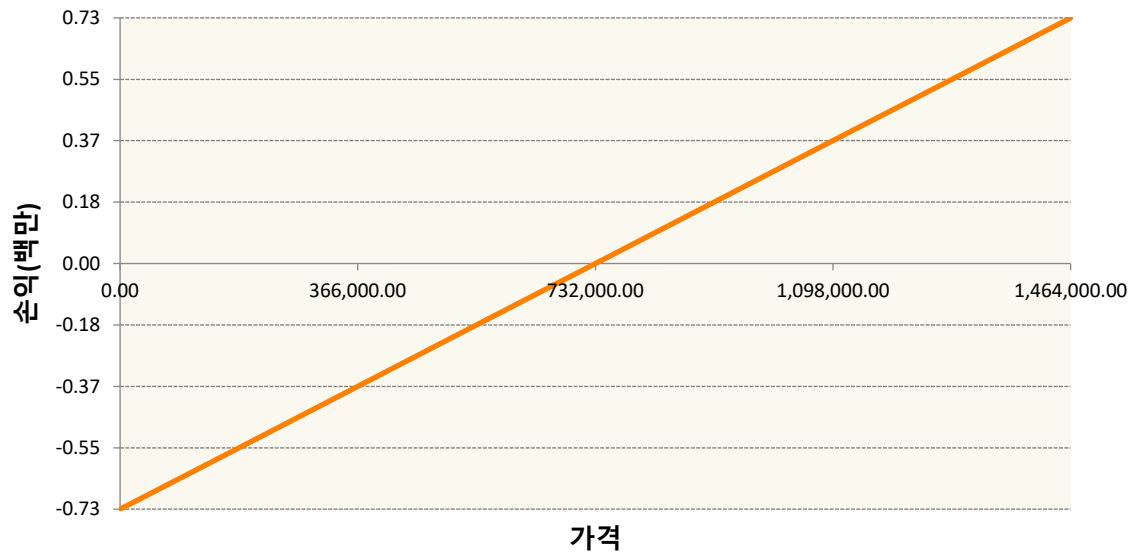
2. 만기시점의 손익구조



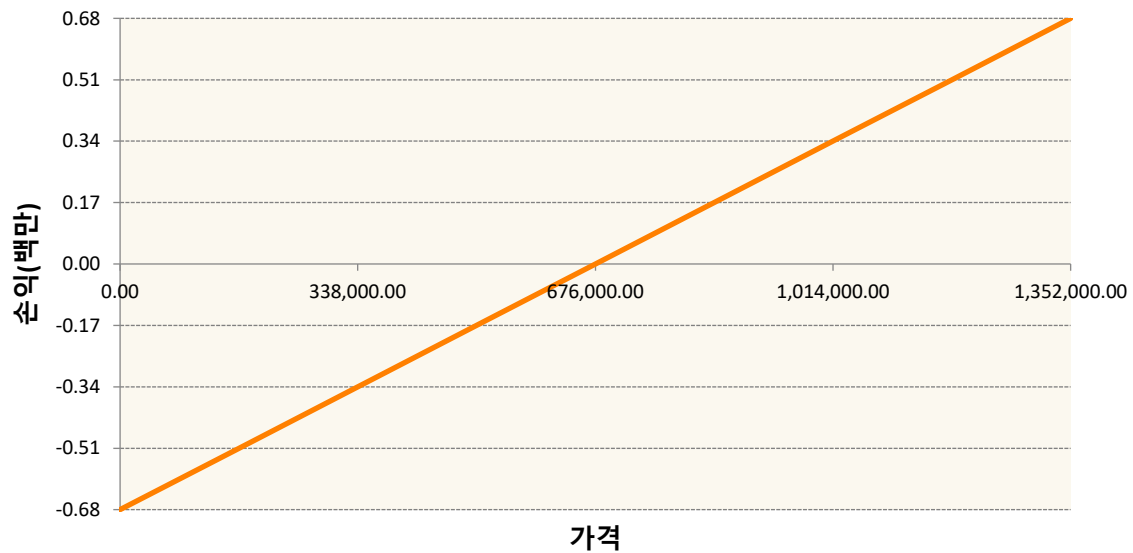
KR4119T30001-2023-03 기아개별선물



KR4122T30005-2023-03 삼성SDI개별선물



KR4147T30002-2023-03 LG화학개별선물



(단위:백만원)

KR4111T30008		2023-03 삼성전자개별선물					5
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-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
KR4116T30007		2023-03 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
KR4119T30001		2023-03 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
KR4122T30005		2023-03 삼성SDI개별선물					12
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-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%	12	12	12	12	12	12	12
KR4147T30002		2023-03 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

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

(단위:백만원)

24

공시일 2023-02-09

기준일 2023-02-08

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

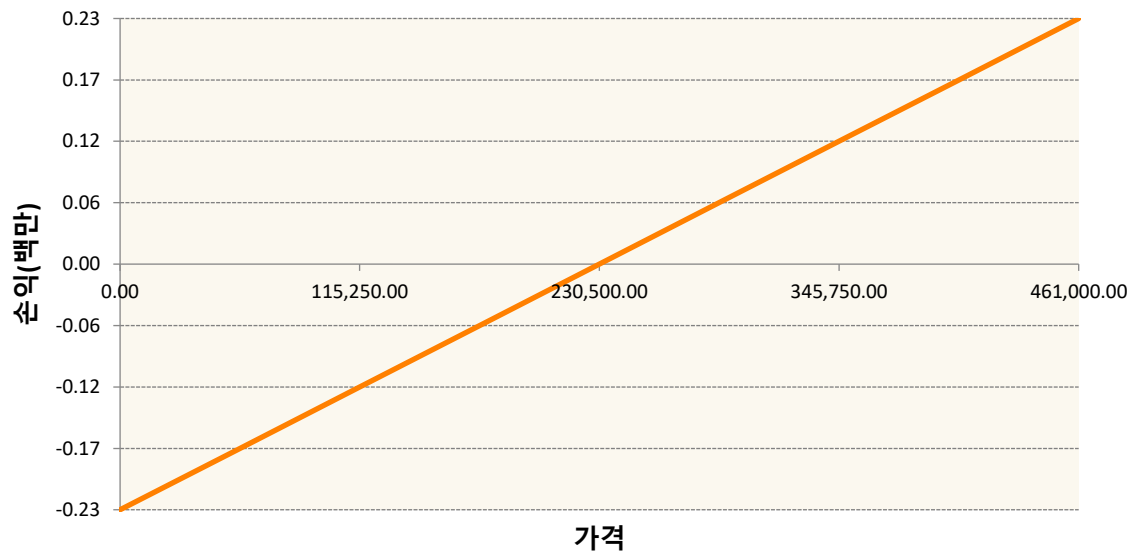
1. 계약금액

(단위:백만원)

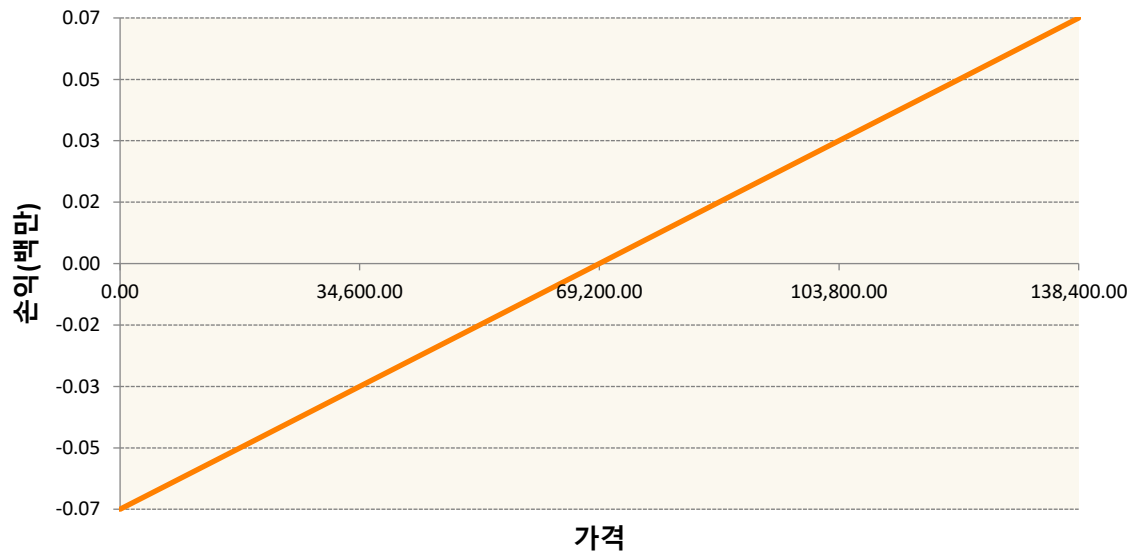
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	62	0	62	장내
누계	유가증권	선물	143	0	143	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156T20004-2023-02 NAVER개별선물



KR41CFT30004-2023-03 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR41CFT30004							2023-03 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	
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2	
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3	
8.00%	5	5	5	5	5	5	5	5	

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

(단위:백만원)

14

공시일	2023-02-09
기준일	2023-02-08

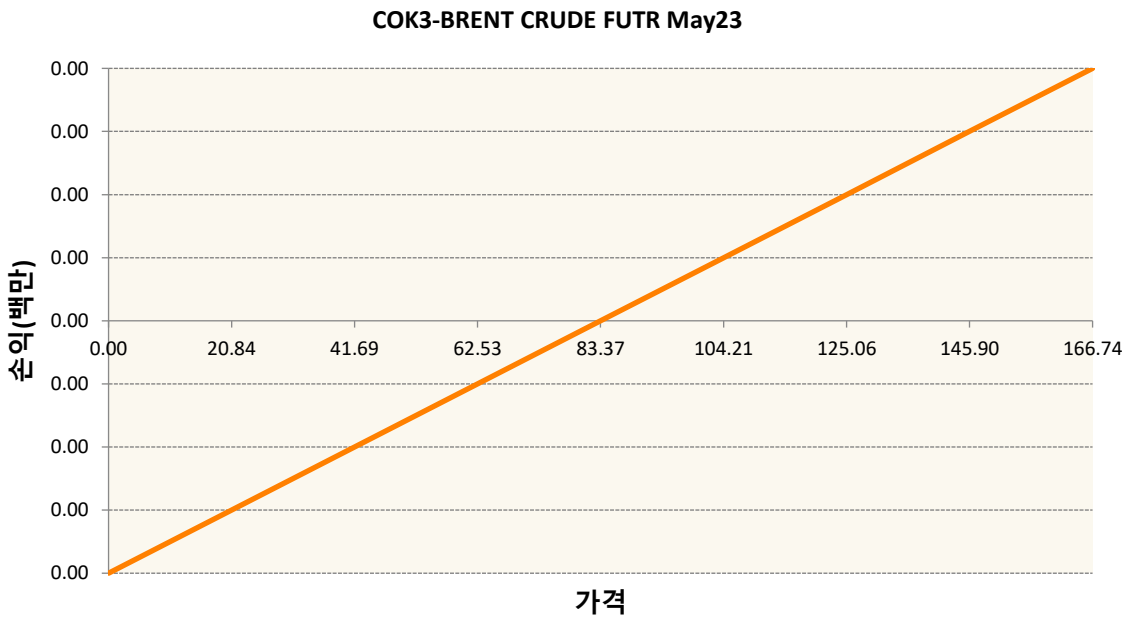
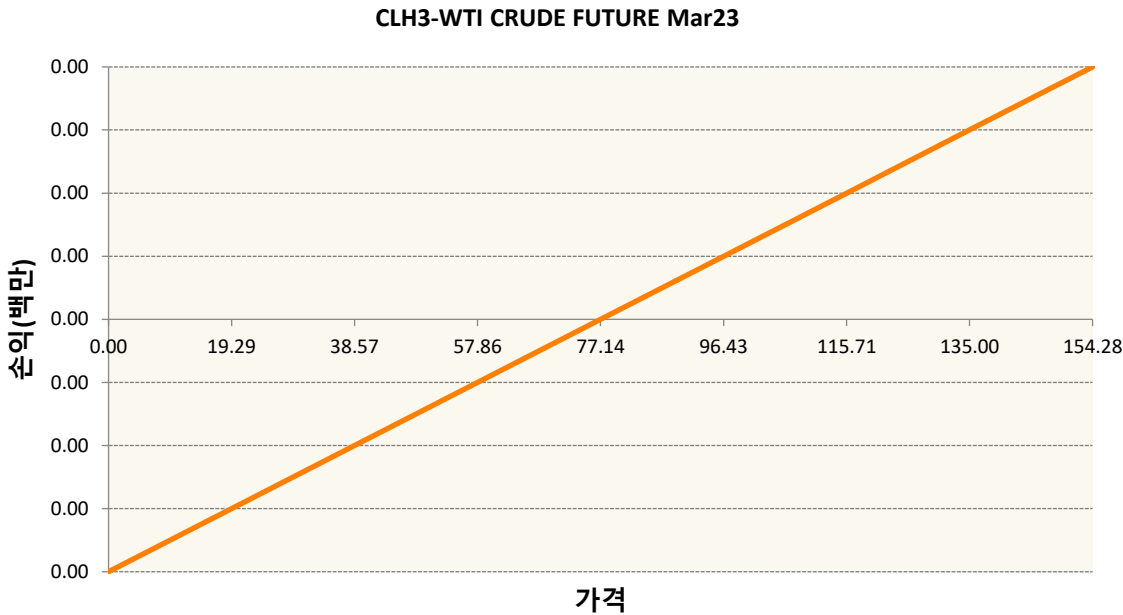
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

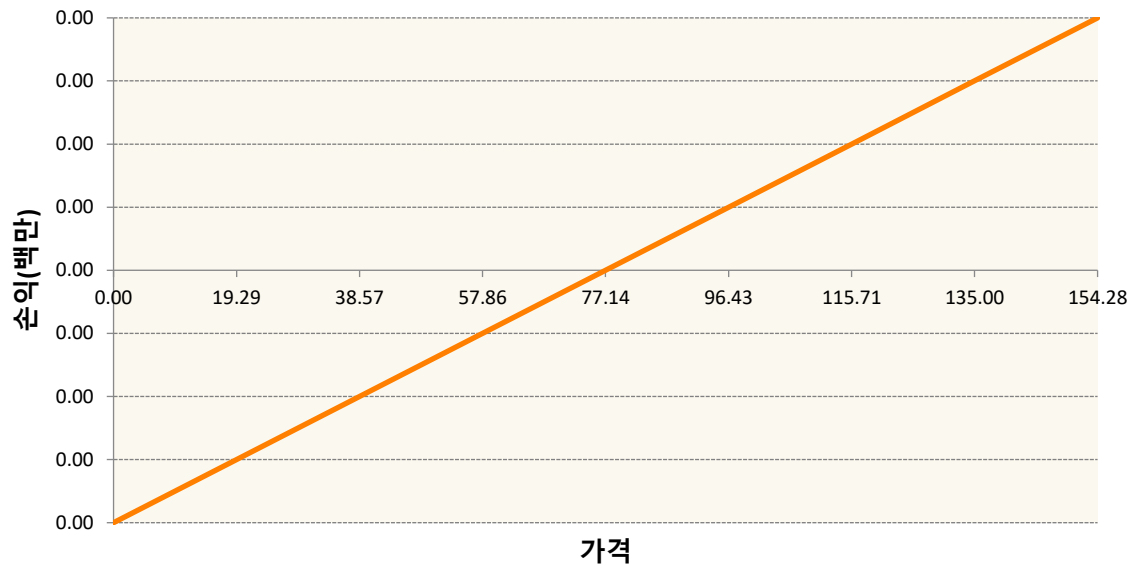
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,755	340	1,415	

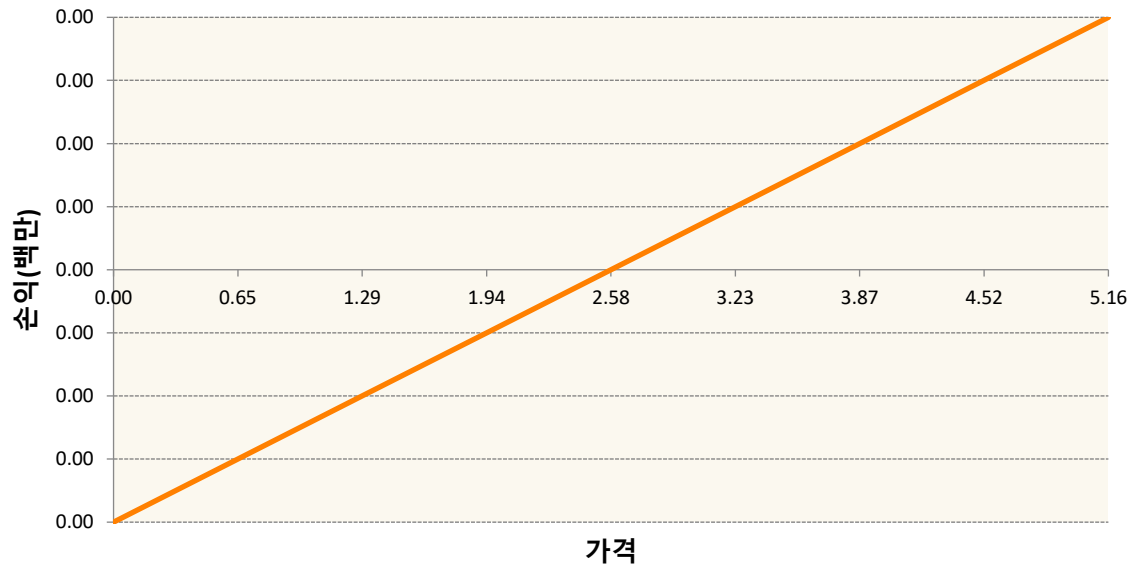
2. 만기시점의 손익구조



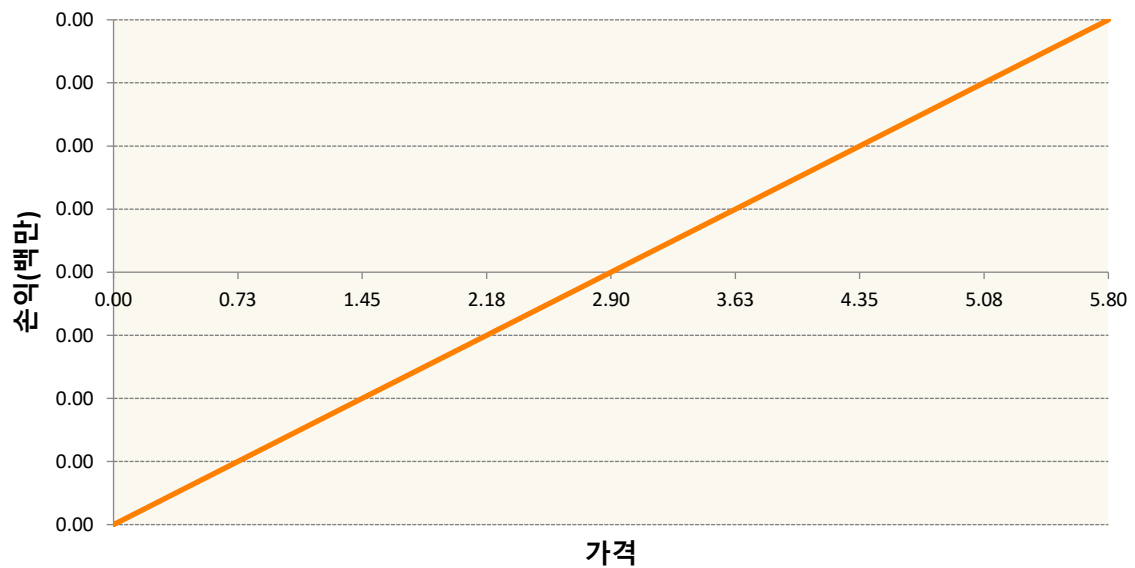
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



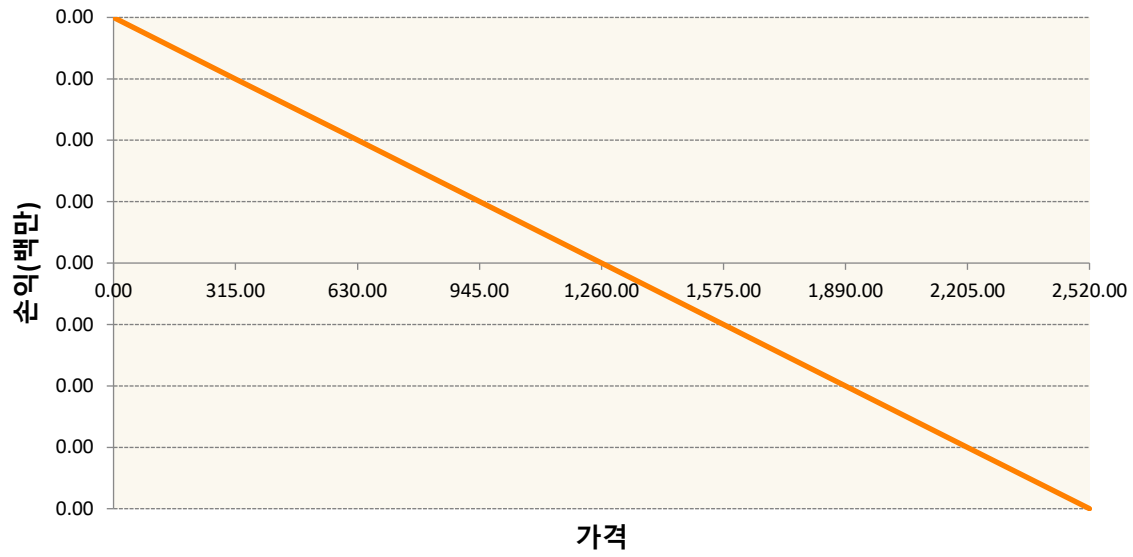
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



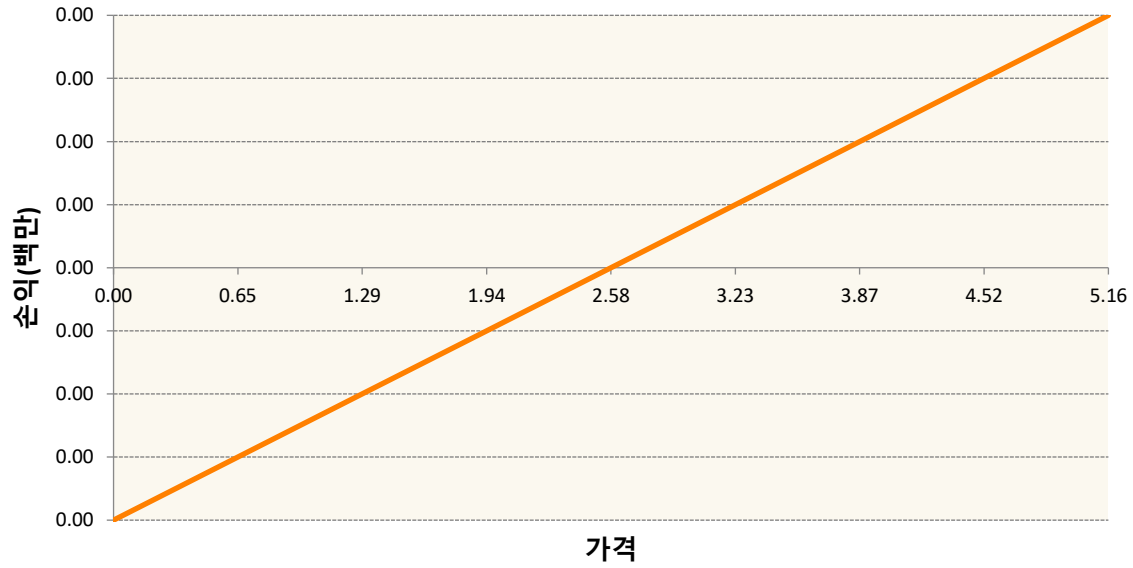
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



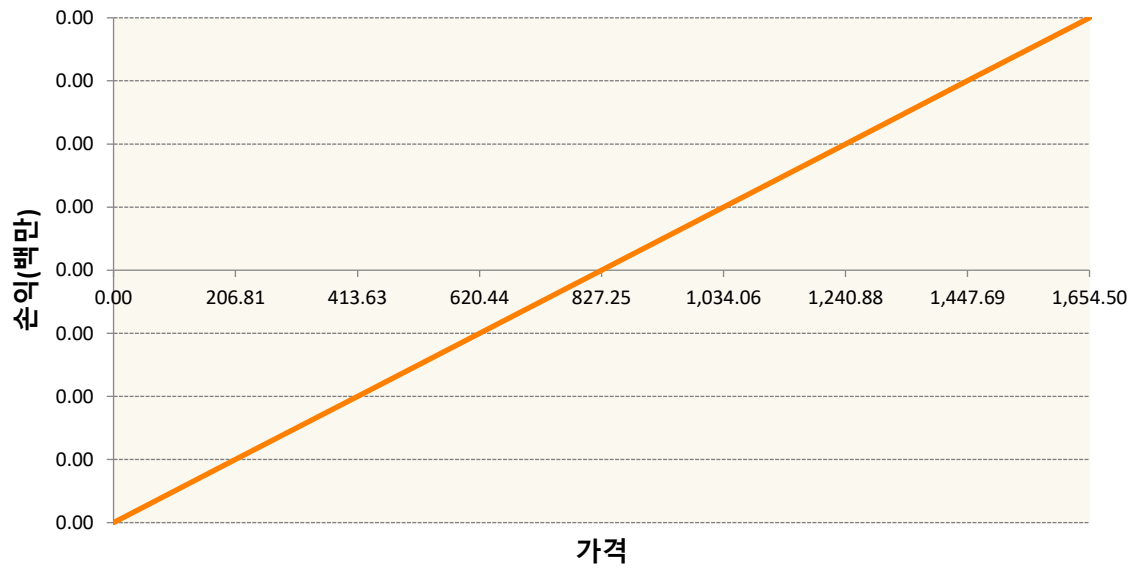
KR4175T20004-2023-02 달러선물

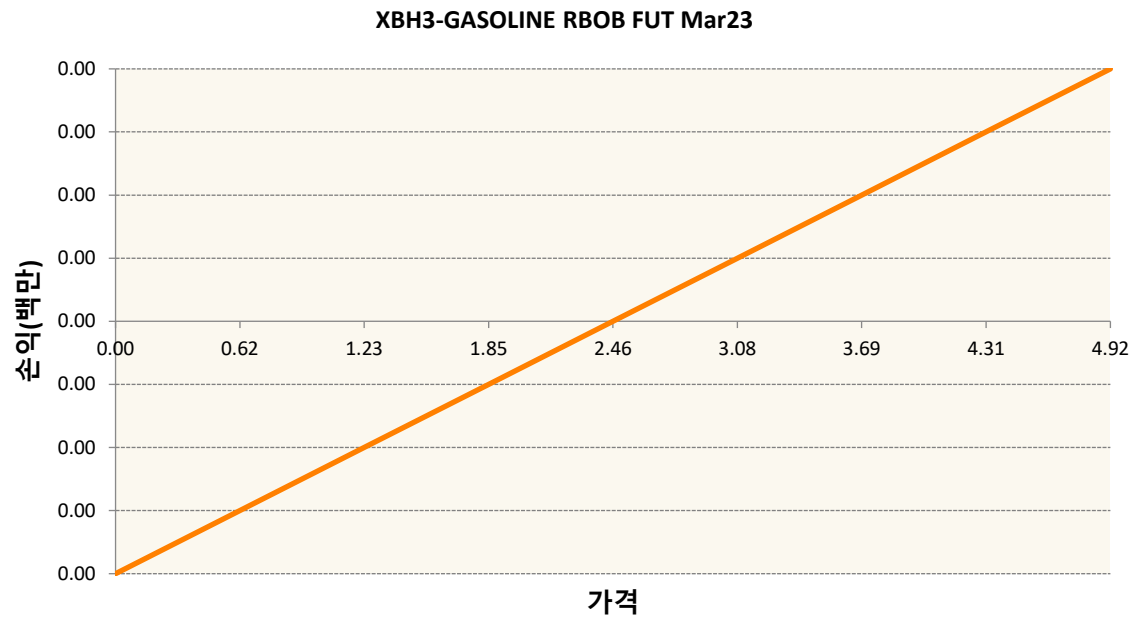


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH3	WTI CRUDE FUTURE Mar23	32
COK3	BRENT CRUDE FUTR May23	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		27
NGH23	NATURAL GAS FUTR Mar23	28
QSH3	Low Su Gasoil G Mar23	17
XBH3	GASOLINE RBOB FUT Mar23	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	459