

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

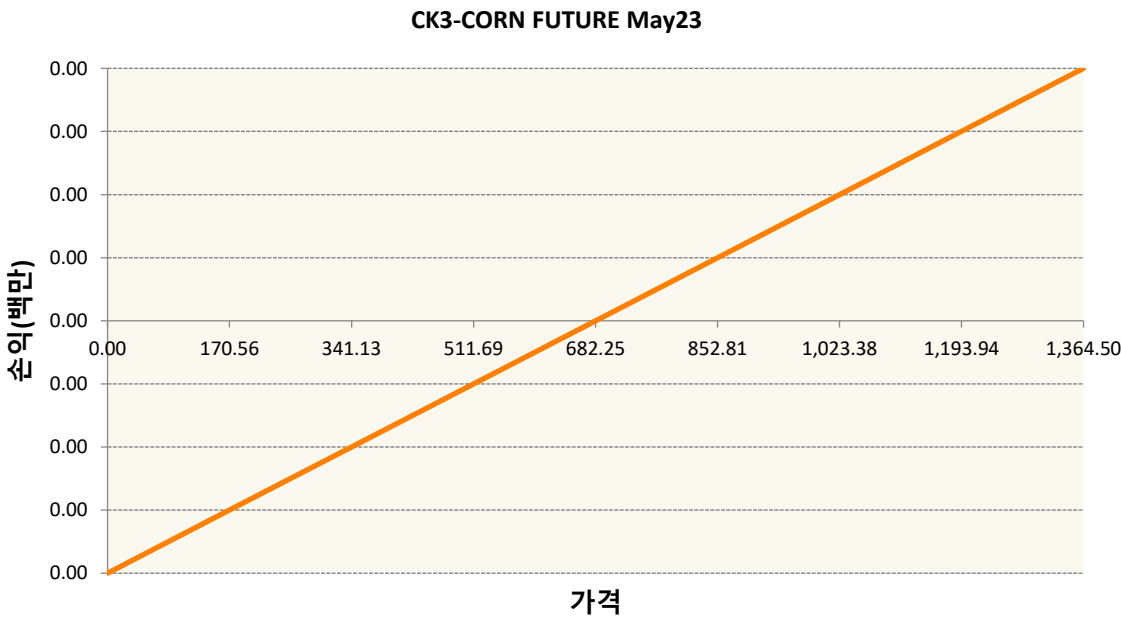
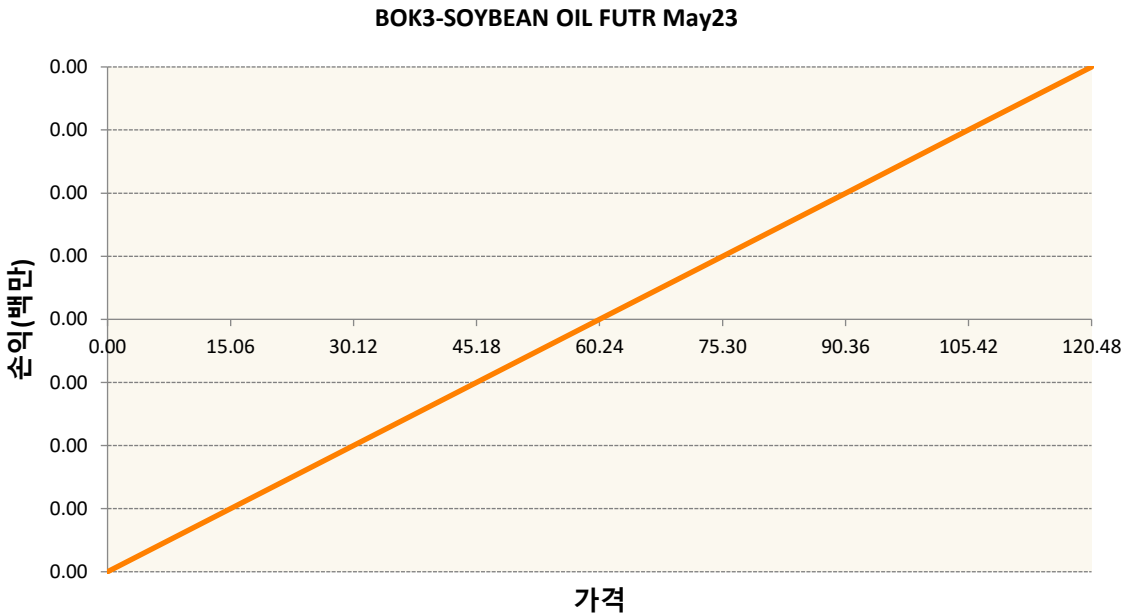
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

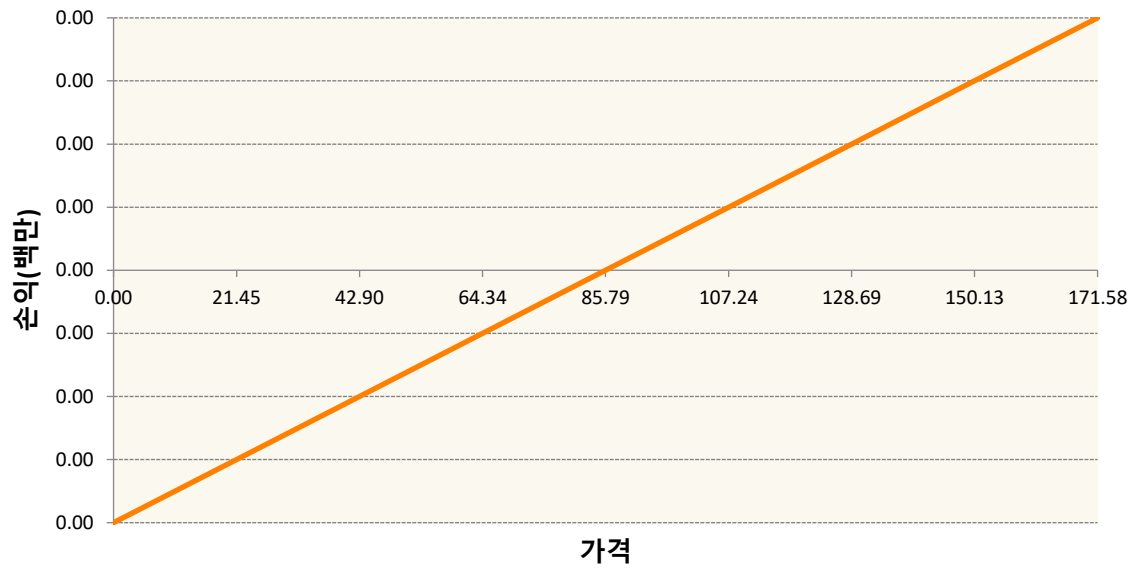
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,163	761	5,401	

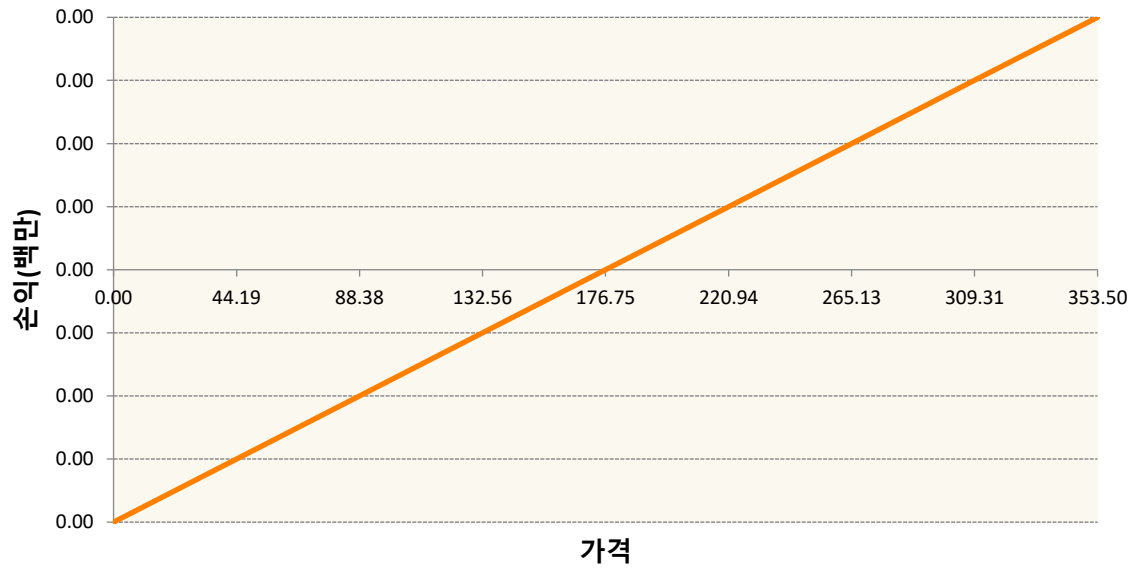
2. 만기시점의 손익구조



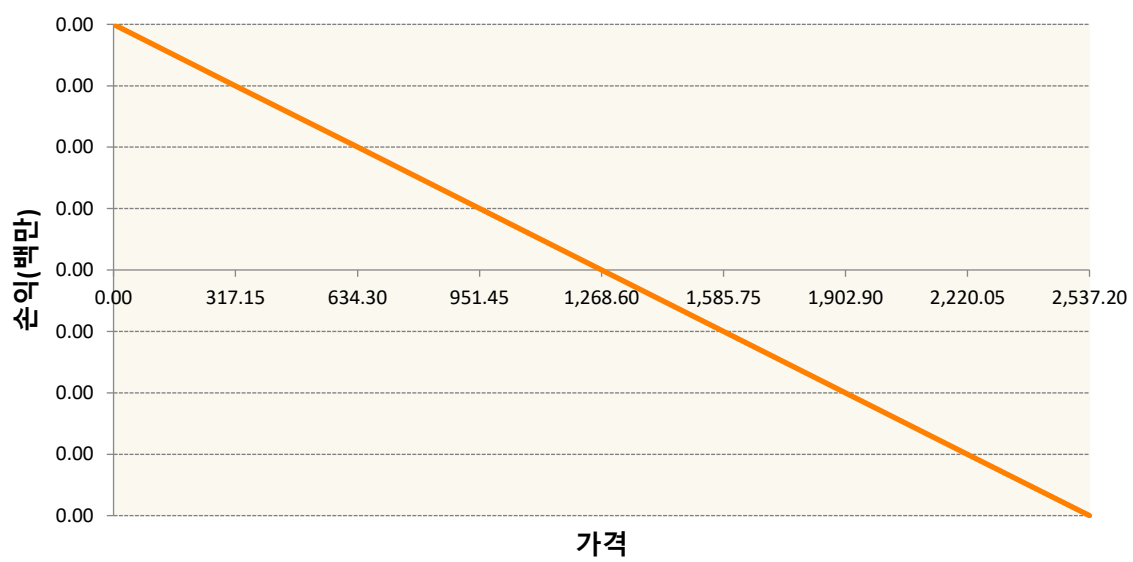
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



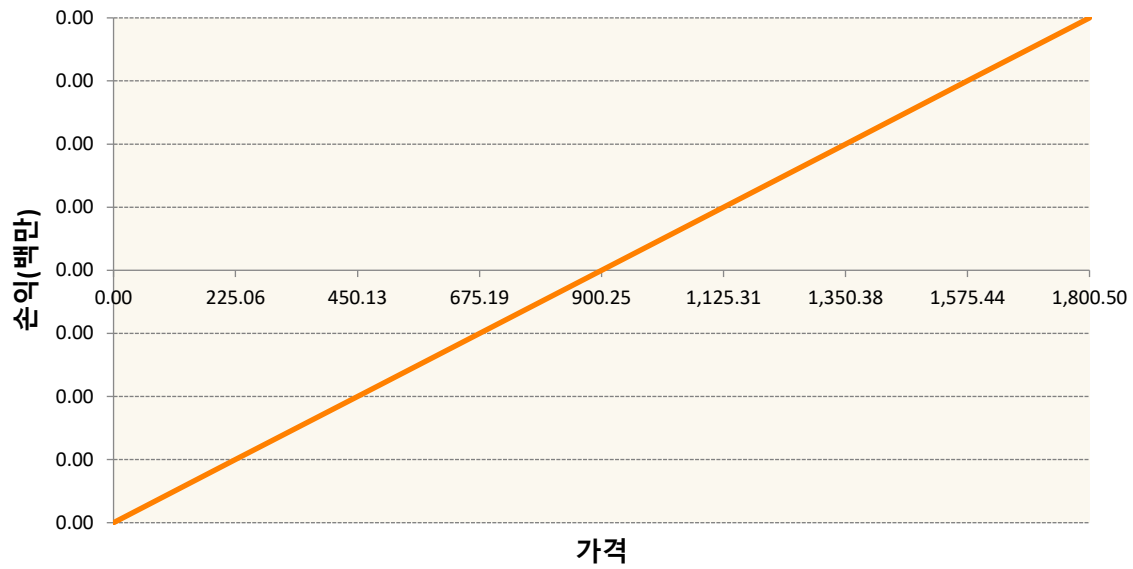
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



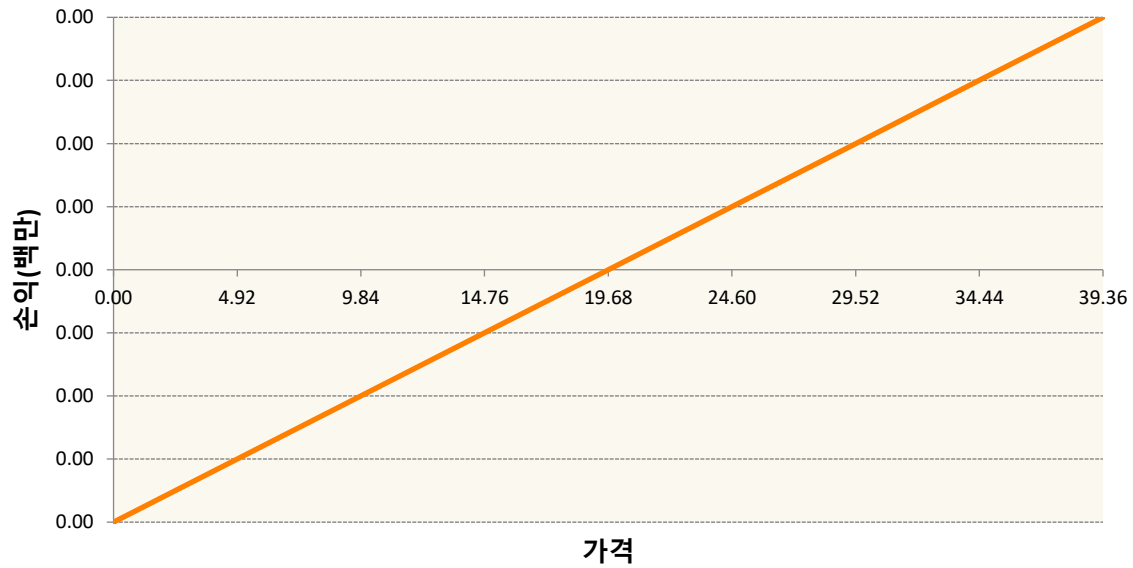
KR4175T20004-2023-02 달러선물



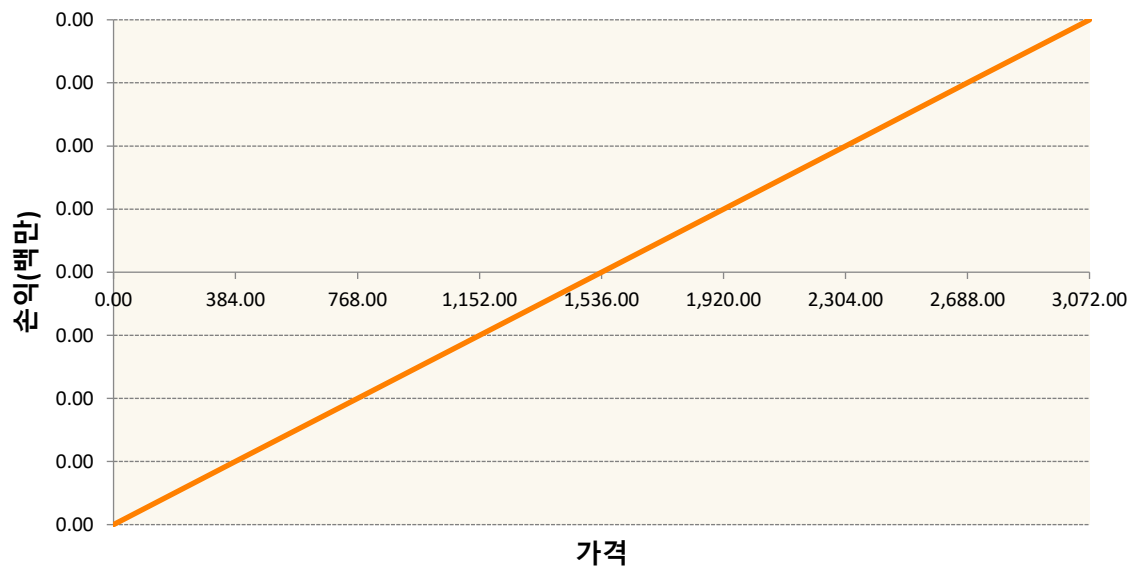
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



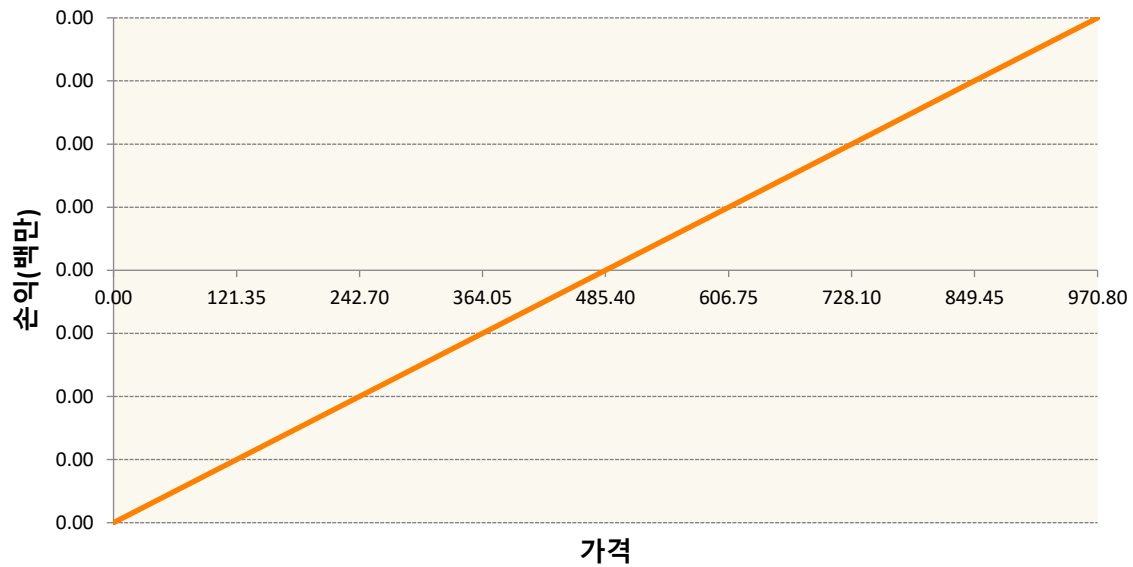
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



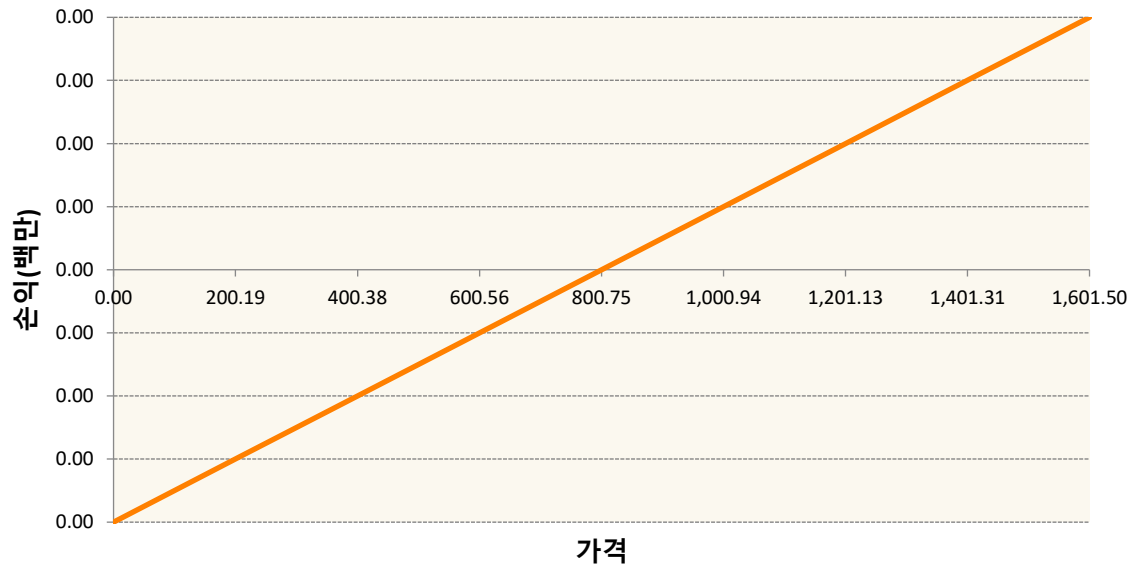
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



SMK3-SOYBEAN MEAL FUTR May23



WK3-WHEAT FUTURE(CBT) May23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

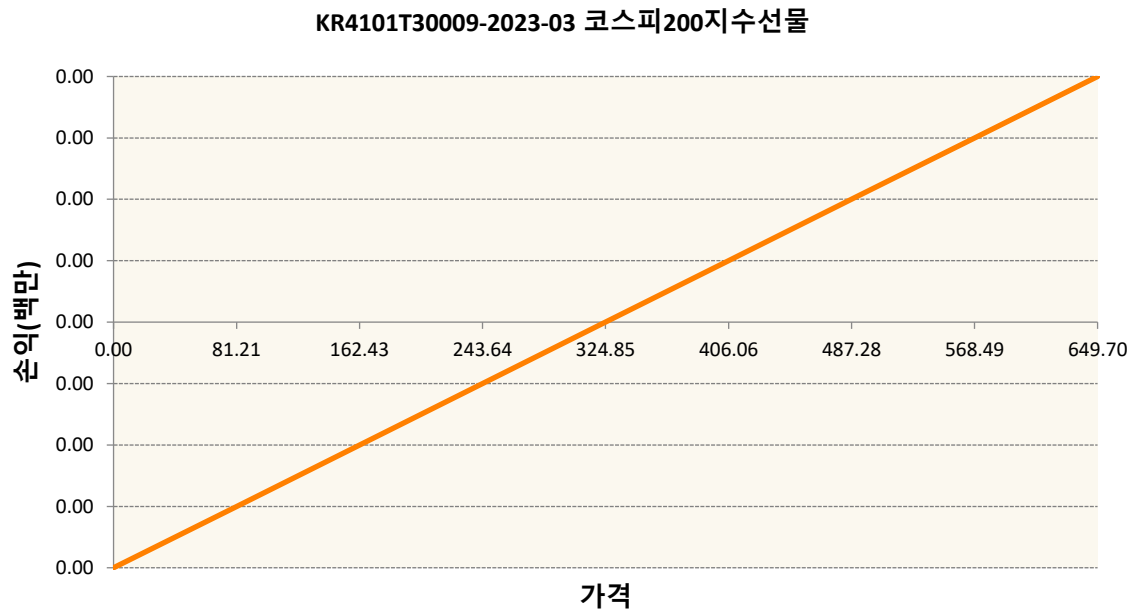
스마트인덱스모

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	2,436	0	2,436	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%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-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%	129	129	129	129	129	129	129
8.00%	194	194	194	194	194	194	194

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

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	371
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

514

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

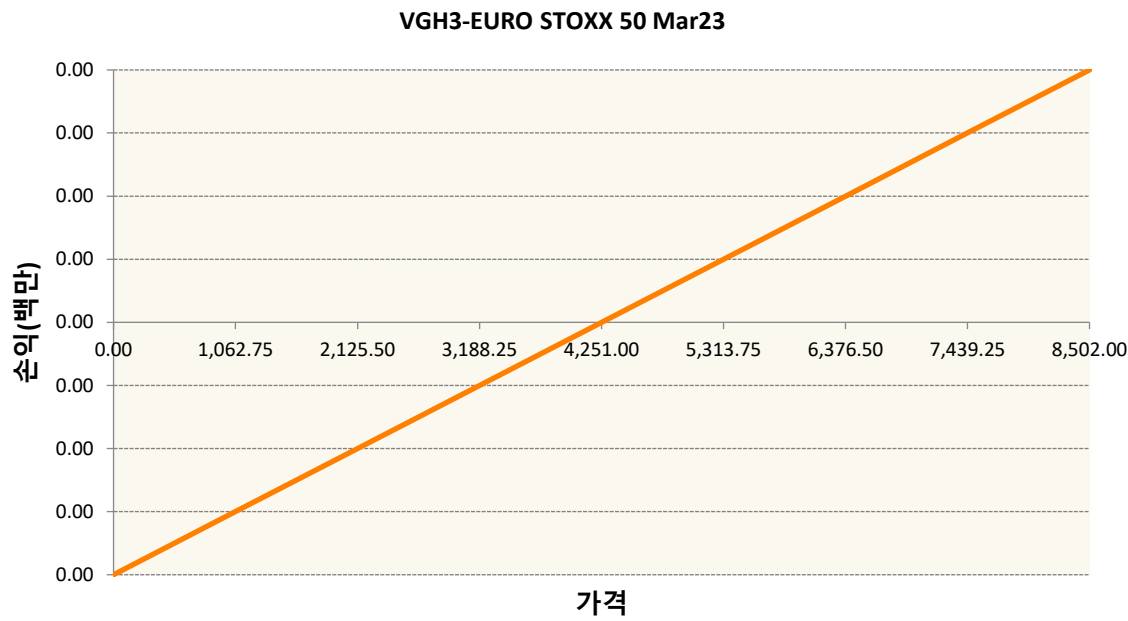
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	412	0	412	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH3	EURO STOXX 50 Mar23	33
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

35

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

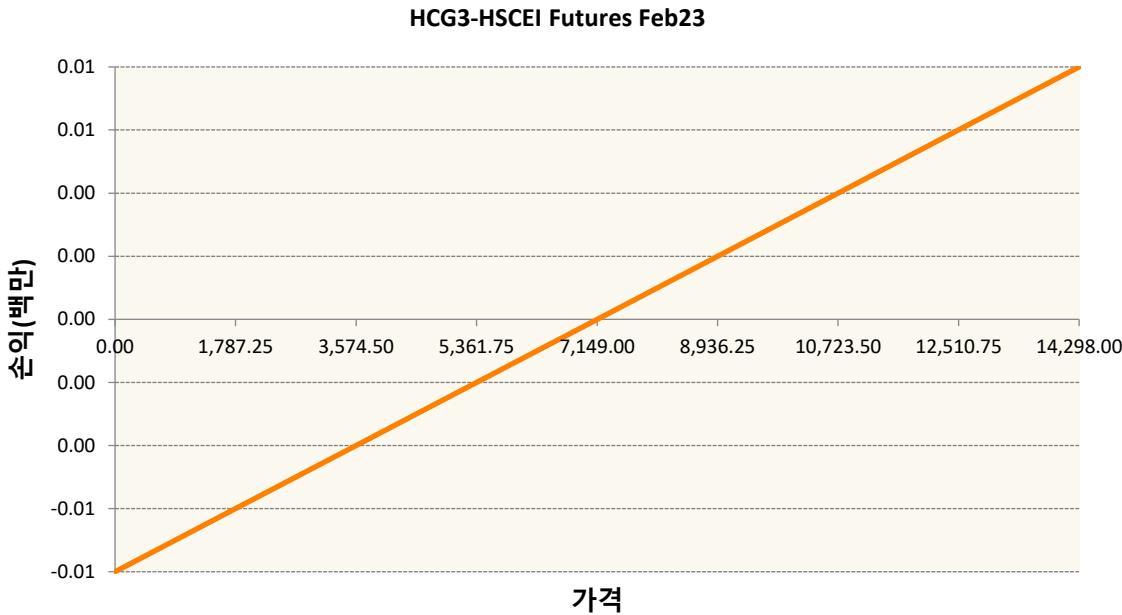
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,346	0	1,346	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG3	HSCEI Futures Feb23	108
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

180

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

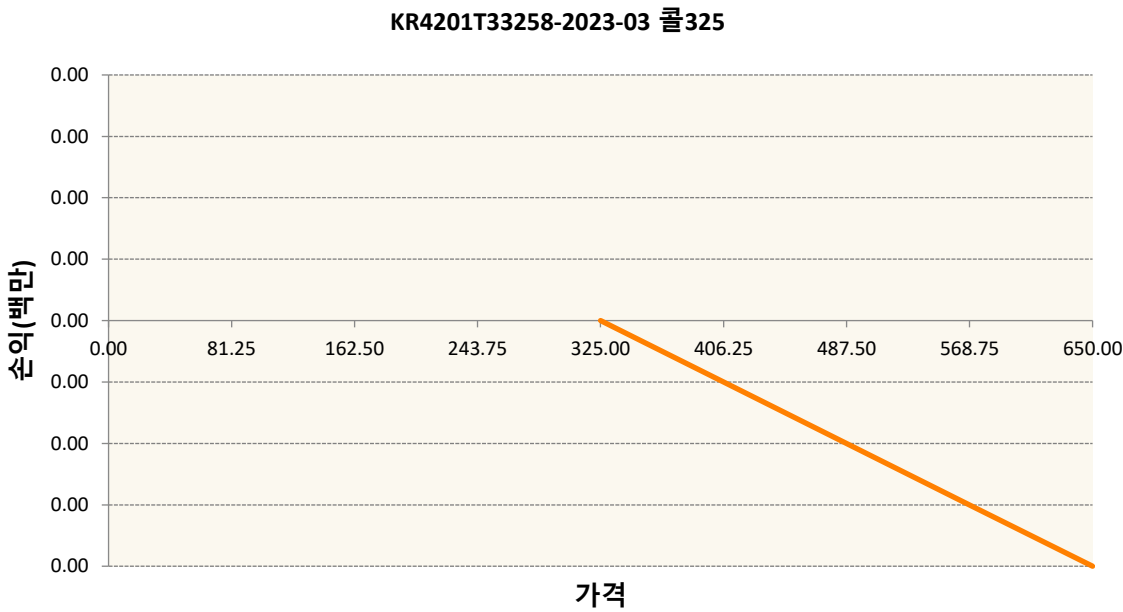
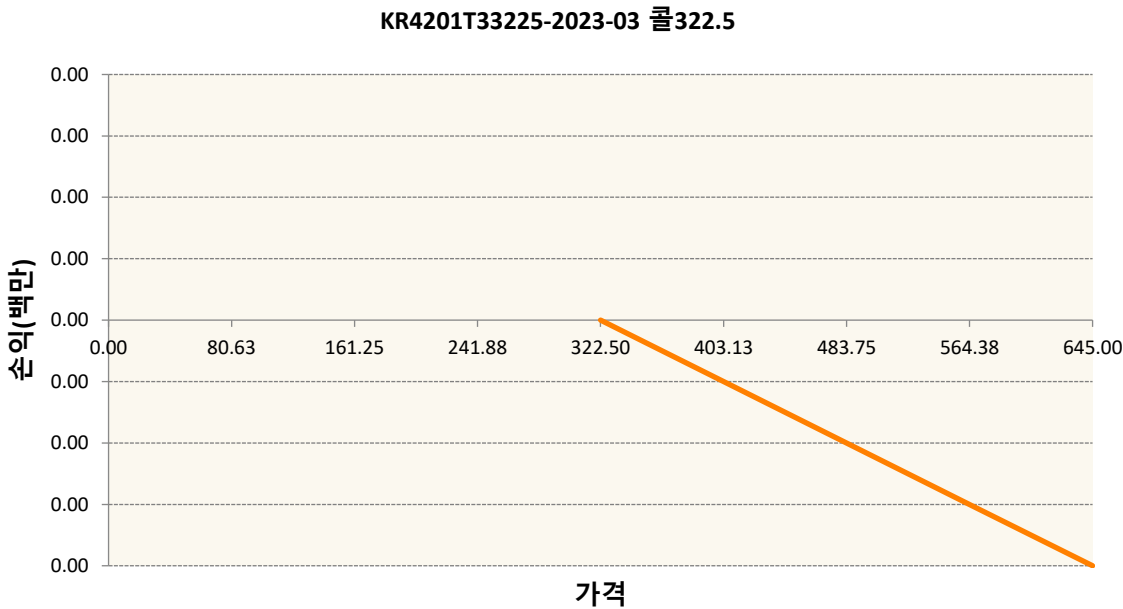
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	57,183	-57,183	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 645.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -100.00 to 100.00. An orange line starts at the origin (0,0) and extends to the point (322.50, 0), indicating that the profit/loss is zero at this price point.

가격 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
0.00	-100.00
80.63	-80.00
161.25	-60.00
241.88	-40.00
322.50	-20.00
403.13	0.00
483.75	20.00
564.38	40.00
645.00	60.00

The graph illustrates the relationship between price and profit/loss. The x-axis represents price ('가격') from 0.00 to 650.00. The y-axis represents profit/loss ('손익 (백만)') from -10.00 to 10.00. An orange line starts at the origin (0,0) and reaches a profit of 2 million at a price of 325.00.

가격	손익 (백만)
0.00	0.00
325.00	2.00

(단위:백만원)

KR4201T33225							2023-03 콜322.5		102	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	67	63	58	53	47	42	36			
-5.33%	56	51	45	39	33	27	21			
-2.67%	41	34	28	21	15	8	2			
0%	20	13	7	0	-7	-13	-20			
2.67%	-5	-12	-18	-25	-32	-38	-45			
5.33%	-35	-41	-47	-53	-60	-66	-72			
8.00%	-69	-74	-79	-85	-90	-96	-102			
KR4201T33258							2023-03 콜325		2,798	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,782	1,660	1,530	1,392	1,249	1,101	950
-5.33%	1,501	1,348	1,191	1,029	865	698	529
-2.67%	1,099	923	745	567	387	207	26
0%	562	374	187	0	-187	-374	-561
2.67%	-112	-297	-483	-669	-856	-1,043	-1,231
5.33%	-913	-1,084	-1,258	-1,435	-1,615	-1,796	-1,978
8.00%	-1,826	-1,973	-2,129	-2,290	-2,456	-2,625	-2,798
KR4301T33223 2023-03 풋322.5							37

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-27	-29	-31	-33	-35	-37
-5.33%	-12	-14	-17	-19	-21	-24	-26
-2.67%	-1	-4	-6	-9	-11	-14	-16
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	15	12	10	7	5	2	-1
5.33%	20	18	16	13	11	8	6
8.00%	24	22	20	18	16	13	11

KR4301T33256 2023-03 풋325							553
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-380	-406	-433	-461	-491	-521	-553
-5.33%	-189	-220	-253	-286	-321	-355	-390
-2.67%	-22	-59	-95	-132	-170	-207	-244
0%	116	78	39	0	-39	-78	-116
2.67%	227	188	150	111	73	34	-5
5.33%	310	275	239	202	165	128	90
8.00%	371	341	309	275	241	206	170

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

(단위:백만원)

2,899

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

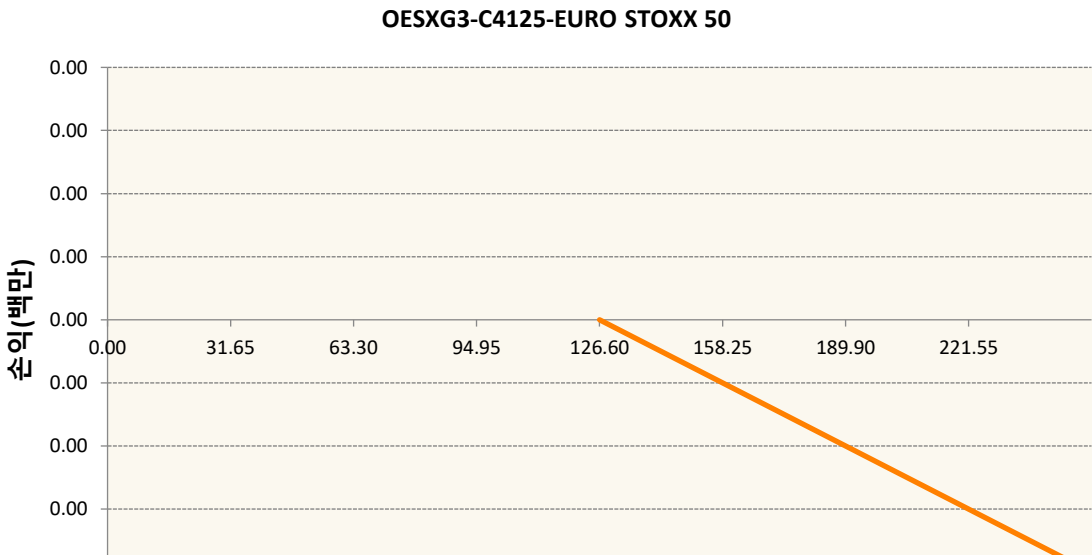
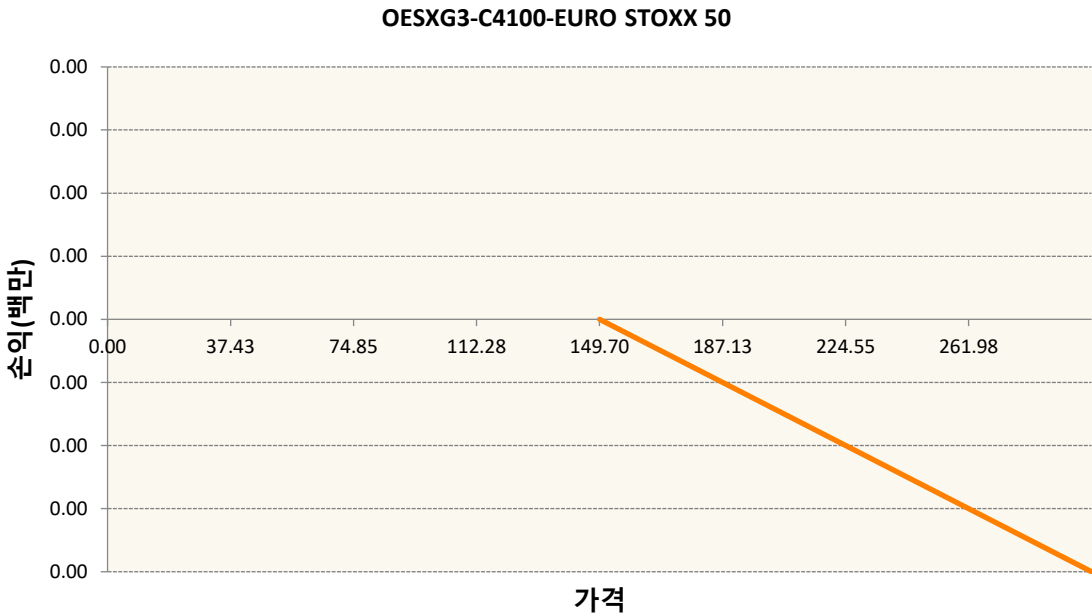
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

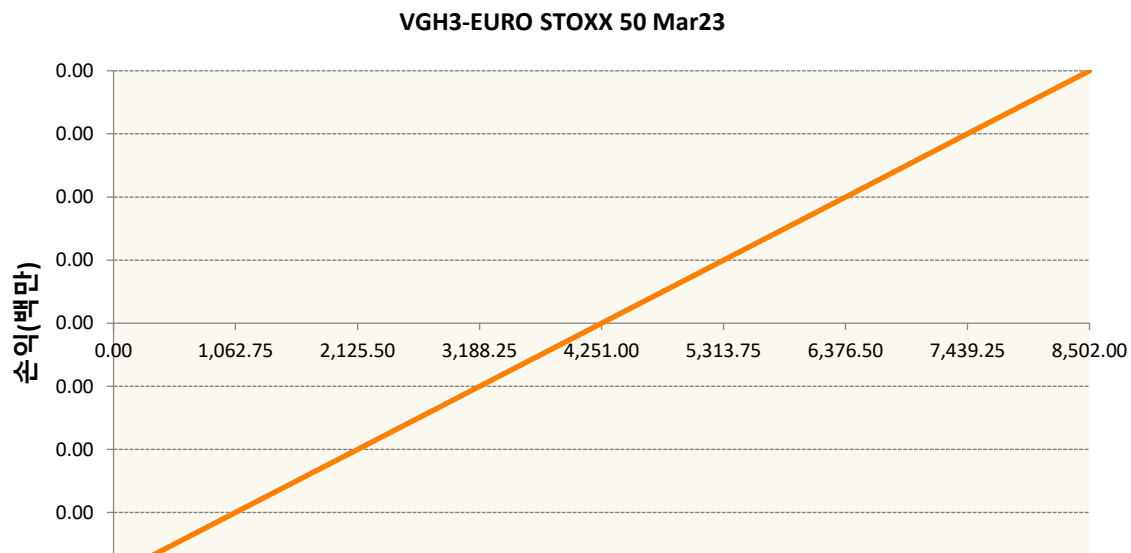
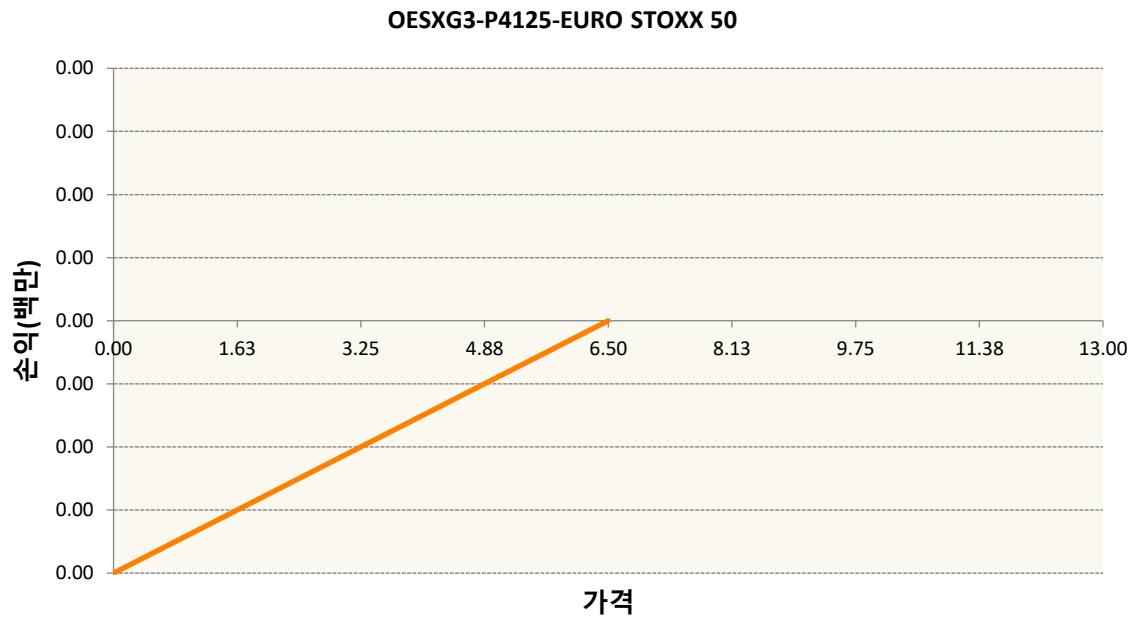
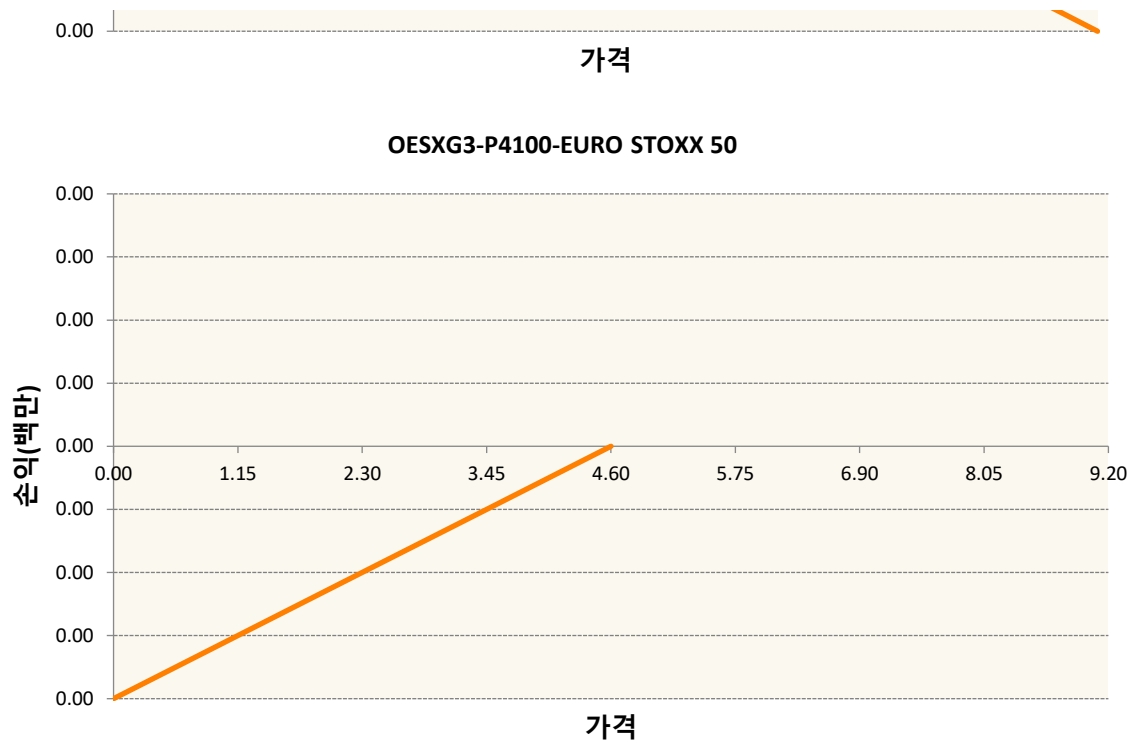
1. 계약금액

(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	1,003	0	1,003	
누계	유가증권	옵션	0	69	-69	장내
누계	통화	선도	136	2,113	-1,977	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CBG KRW/EUR 24-02-23E		71
FXW213CBN EUR/KRW 24-02-23E		11
FXW213CCM KRW/EUR 24-03-23E		55
FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E		44
OESXG3-C41 EURO STOXX 50		1
OESXG3-C41 EURO STOXX 50		4
OESXG3-P41 EURO STOXX 50		0.04
OESXG3-P41 EURO STOXX 50		0.19
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		80

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	228

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

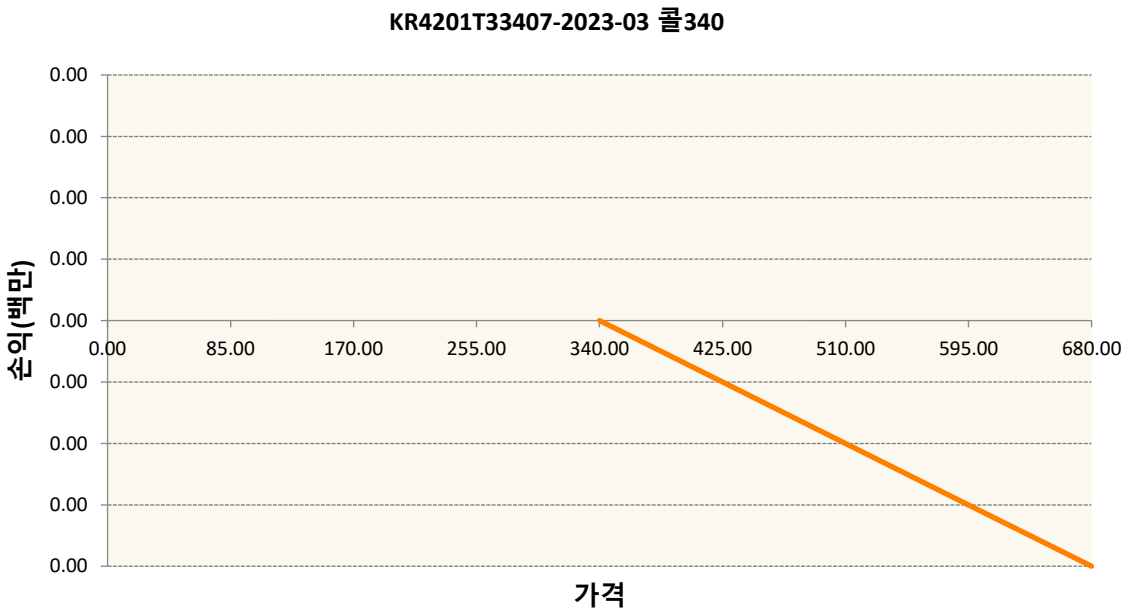
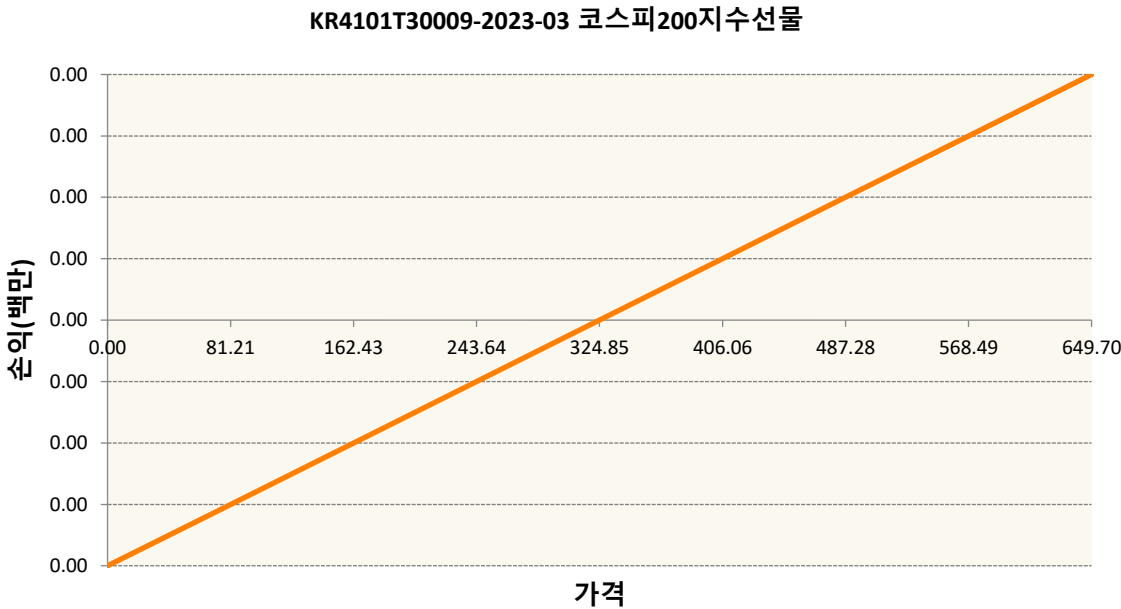
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

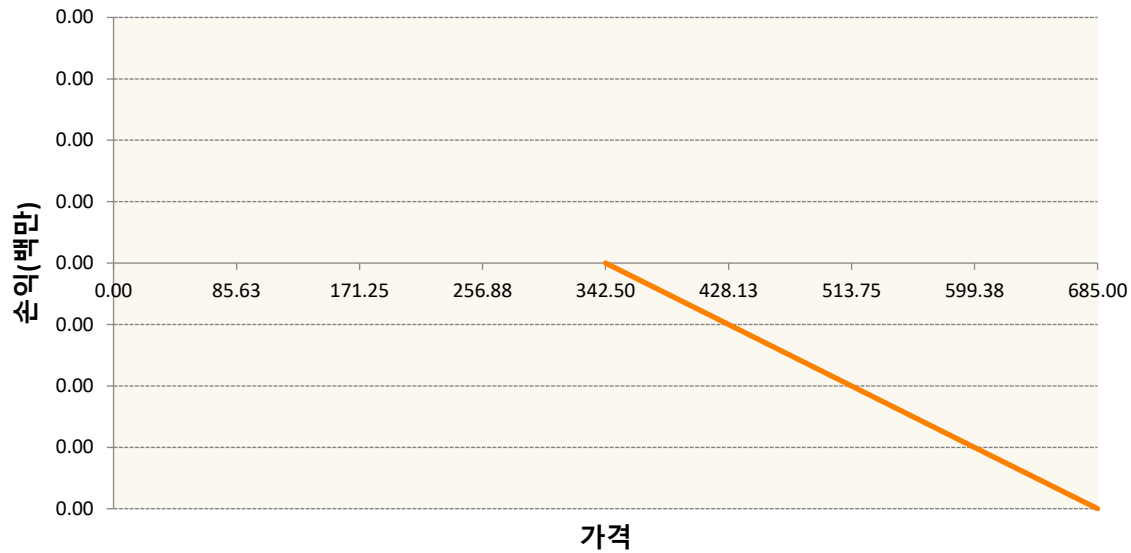
1. 계약금액

(단위:백만원)

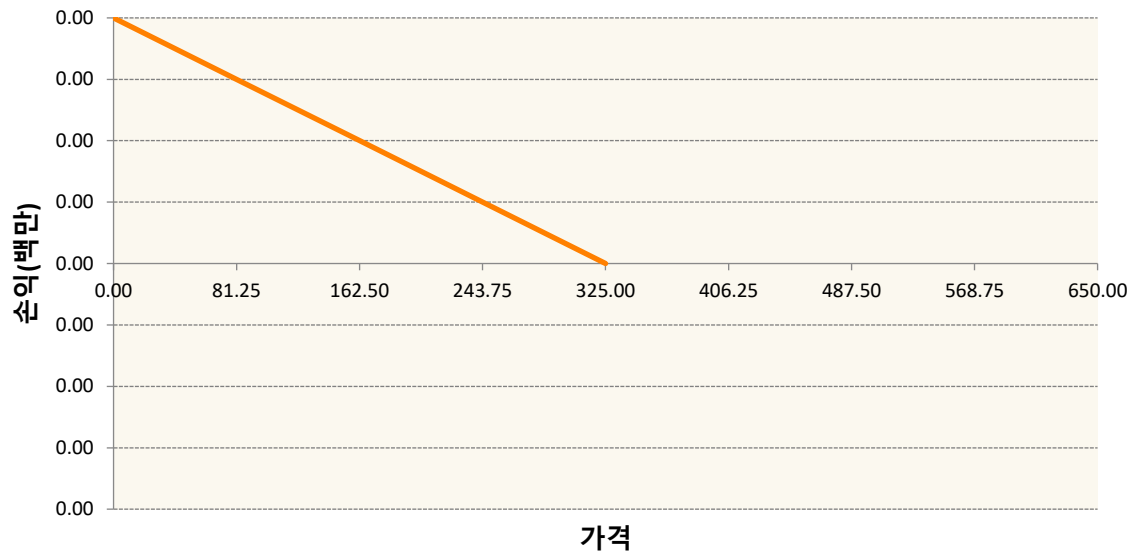
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	406	0	406	장내
누계	유가증권	옵션	163	4,009	-3,846	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4201T33423-2023-03 **콜**342.5

KR4301T33256-2023-03 쪽325



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	
KR4201T33407				2023-03 콜340				106
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	50	46	42	37	32	26
-5.33%	47	43	37	32	26	19	13
-2.67%	38	31	25	18	11	3	-4
0%	23	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	3	-5	-14	-22	-31	-39	-48
5.33%	-22	-31	-40	-49	-58	-66	-75
8.00%	-54	-62	-71	-80	-88	-97	-106

KR4201T33423

2023-03 콜342.5

90

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	44	41	38	34	30	26	21
-5.33%	39	35	31	26	21	15	10
-2.67%	31	26	21	15	9	2	-4
0%	20	13	7	0	-7	-14	-21
2.67%	4	-4	-11	-18	-26	-33	-41
5.33%	-17	-25	-33	-41	-48	-56	-64
8.00%	-44	-51	-59	-67	-75	-82	-90

KR4301T33256

2023-03 풋325

10

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	8	8	9	10
-5.33%	3	4	4	5	6	6	7
-2.67%	0	1	2	2	3	4	4
0%	-2	-1	-1	0	1	1	2
2.67%	-4	-3	-3	-2	-1	-1	0
5.33%	-5	-5	-4	-3	-3	-2	-2
8.00%	-6	-6	-5	-5	-4	-4	-3

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

(단위:백만원)

188

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

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	6,829	0	6,829	

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	2023-02-15
기준일	2023-02-14

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	5,628	0	5,628	

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	2023-02-15
기준일	2023-02-14

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	19,349	0	19,349	
누계	통화	선도	0	19,580	-19,580	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213CBQ KRW/USD 28-02-23E		649
FXW213CCS(KRW/USD 28-03-23E		538
FXW213D1S(KRW/USD 28-04-23E		303
FXW213D1T(KRW/USD 28-02-23E		76

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

(단위:백만원)

870

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

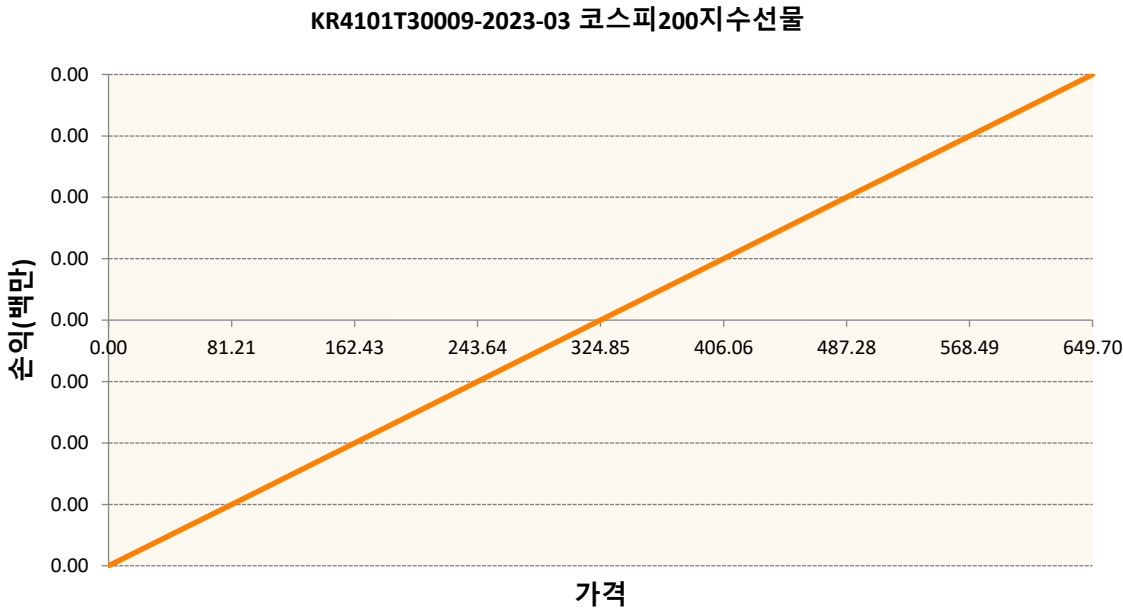
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,381	0	1,381	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				110
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-5.33%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-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%	73	73	73	73	73	73	73
8.00%	110	110	110	110	110	110	110

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

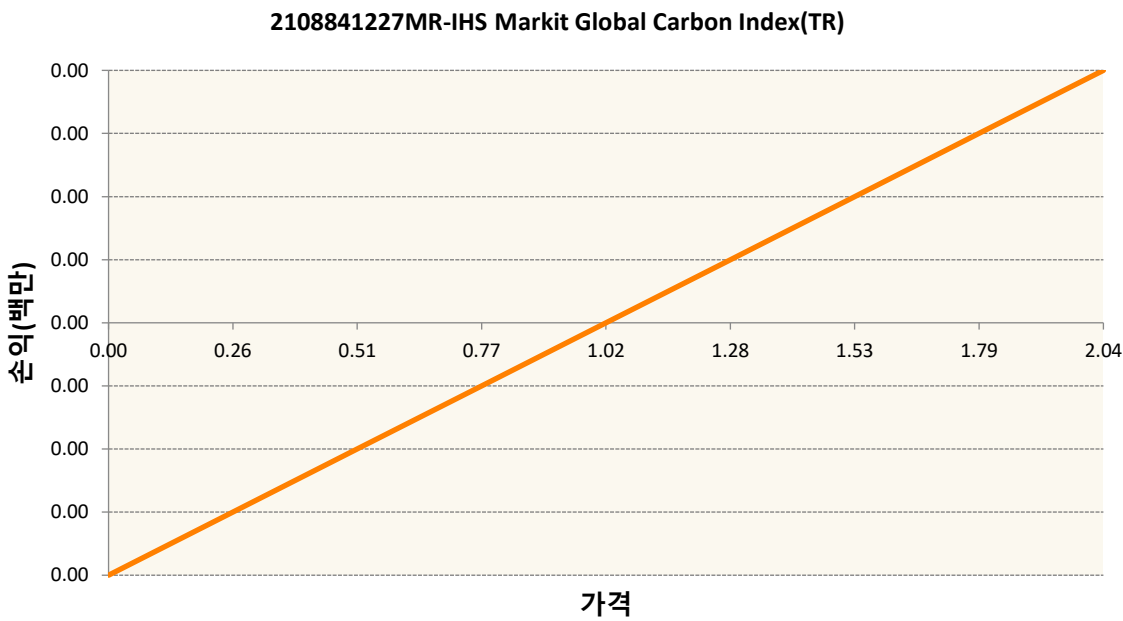
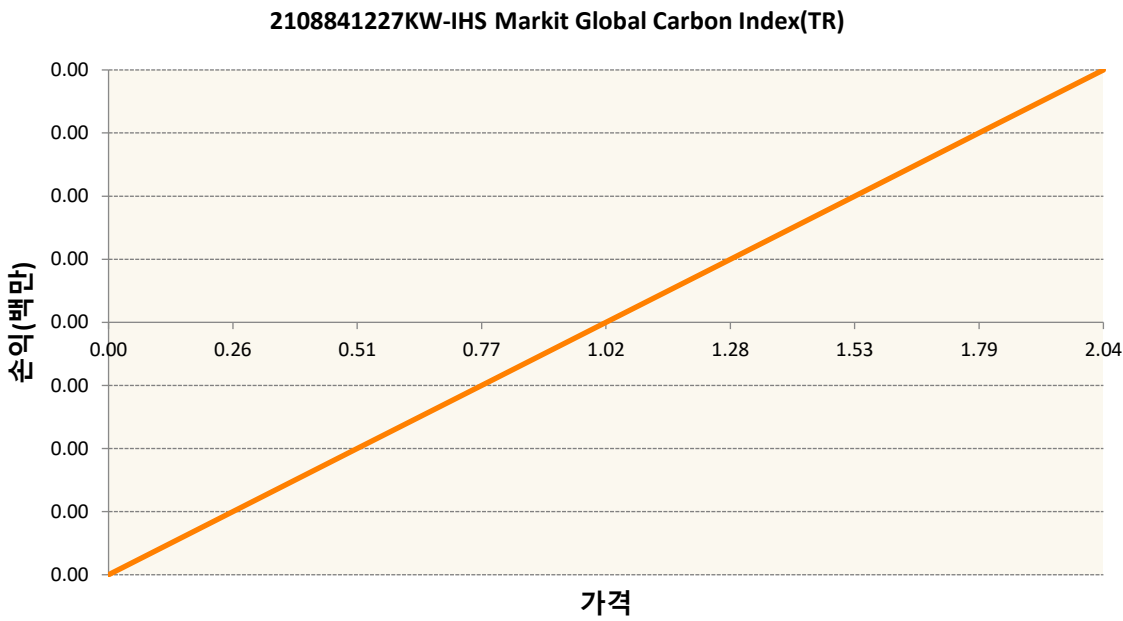
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

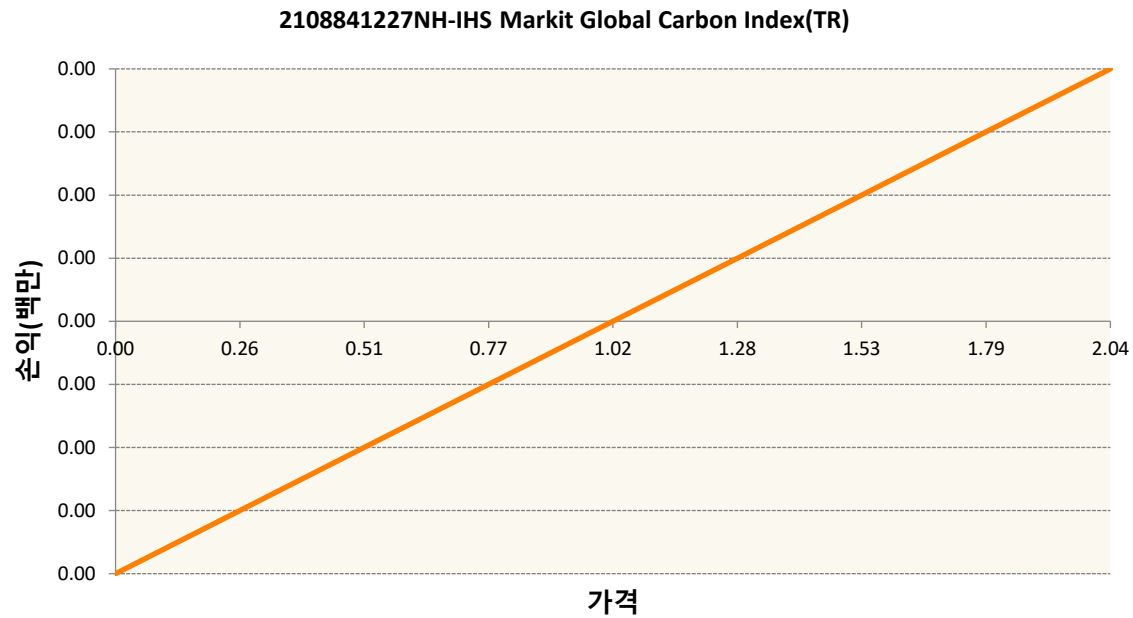
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	24,833	0	24,833	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)

1,681

2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)

198

2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)

99

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

(단위:백만원)

3,798

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

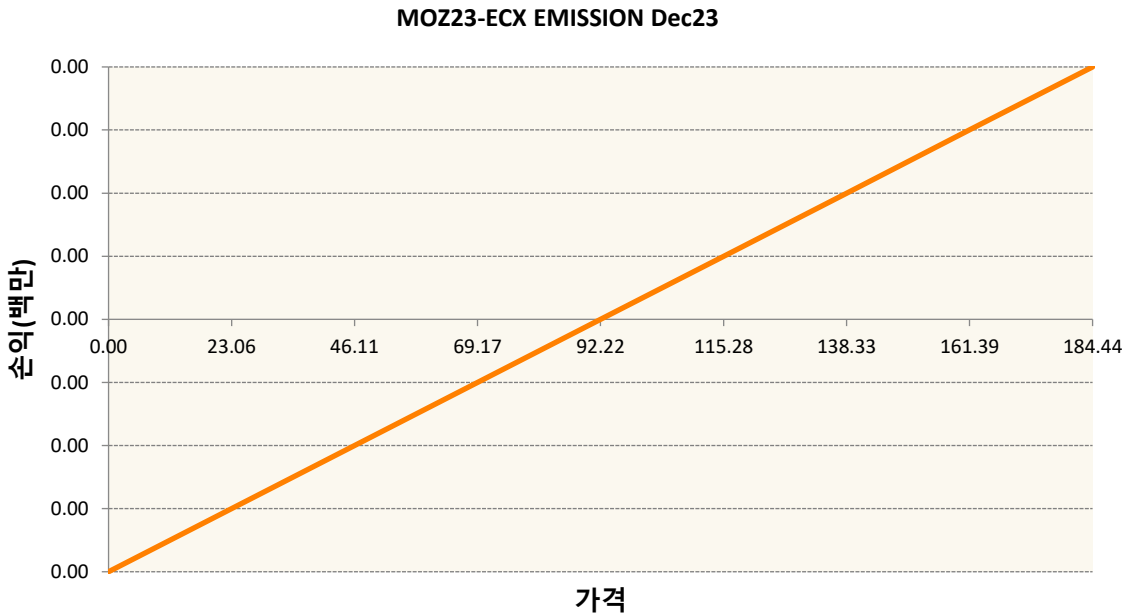
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	14,017	0	14,017	
누계	통화	선도	698	5,613	-4,915	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	109
FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	199
FXW213D1X(KRW/EUR 24-02-23E	65
FXW213D22(KRW/EUR 24-02-23E	76
FXW213D27(EUR/KRW 24-02-23E	56
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	1,121

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

(단위:백만원)

3,312

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	9,319	0	9,319	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

116

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	9

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

(단위:백만원)

49

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

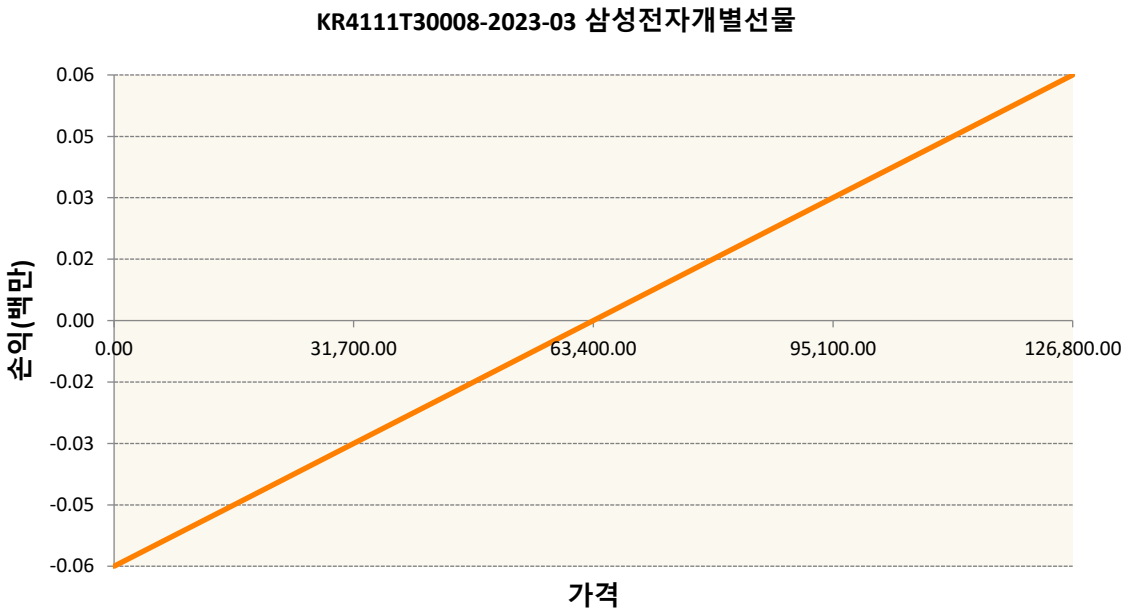
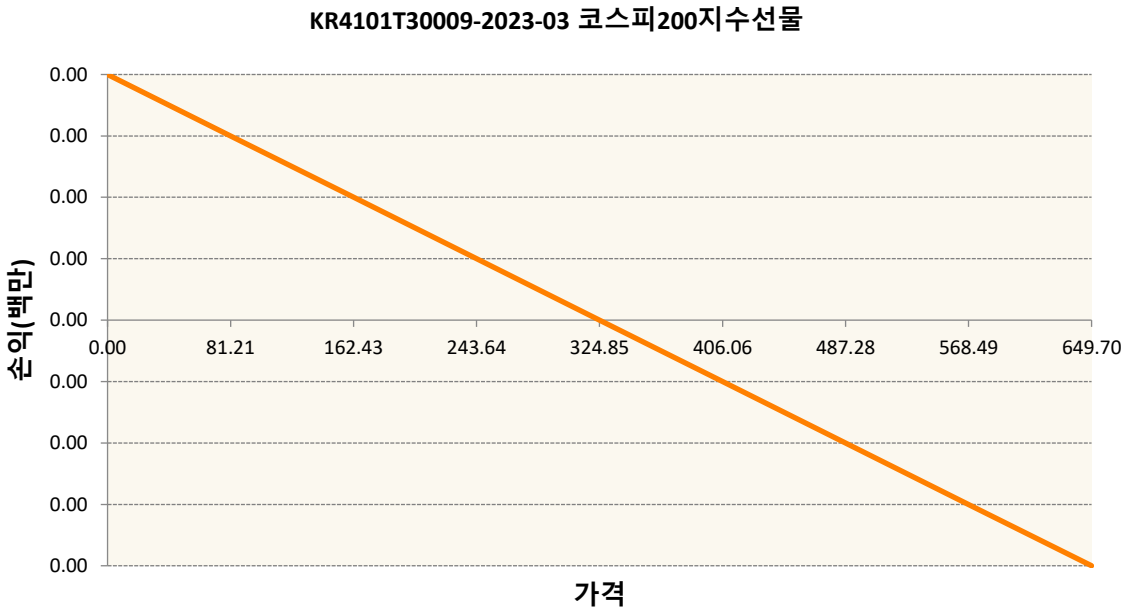
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

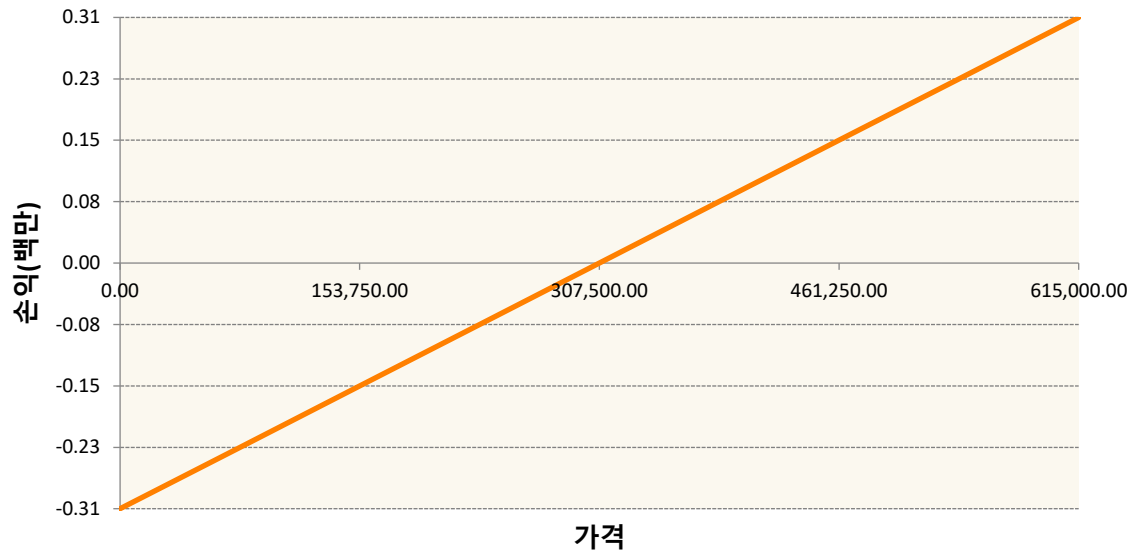
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	320	56	264	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	928	1,278	-350	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

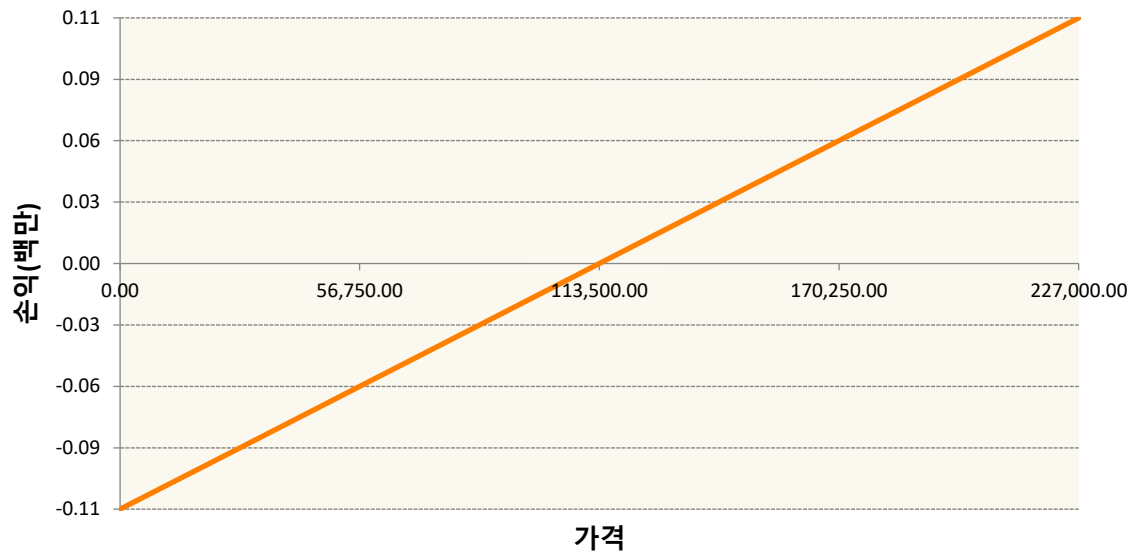
2. 만기시점의 손익구조



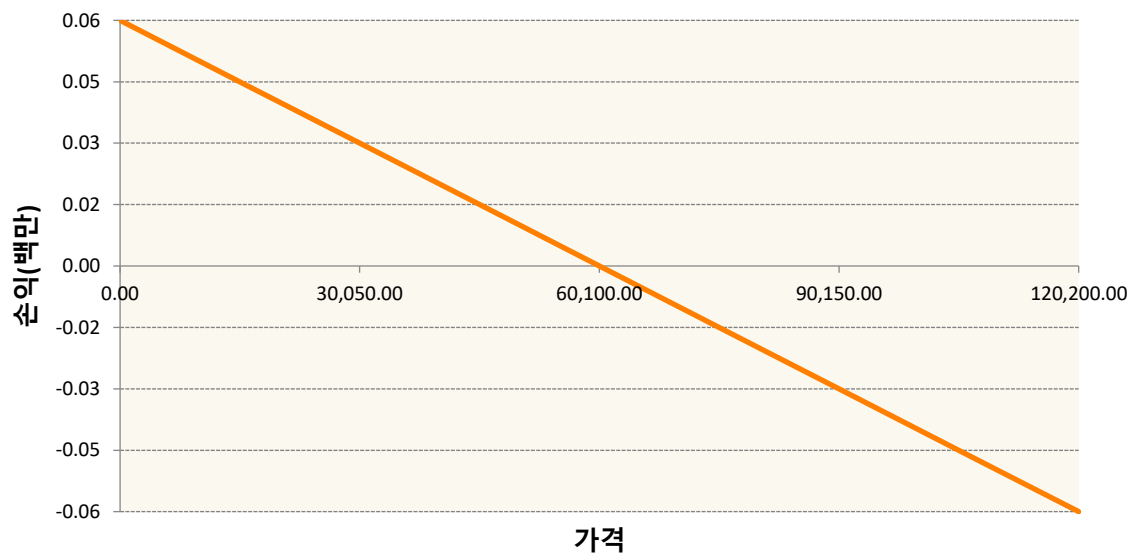
KR4113T30004-2023-03 POSCO개별선물



KR4124T30001-2023-03 LG전자개별선물



KR41F7T30000-2023-03 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429		1
KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602		1
KR4101T300 2023-03 코스피200지수선물		84
KR4111T300 2023-03 삼성전자개별선물		25
KR4113T300 2023-03 POSCO개별선물		44
KR4124T300 2023-03 LG전자개별선물		5
KR41F7T300 2023-03 카카오페이개별선물		18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	290

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

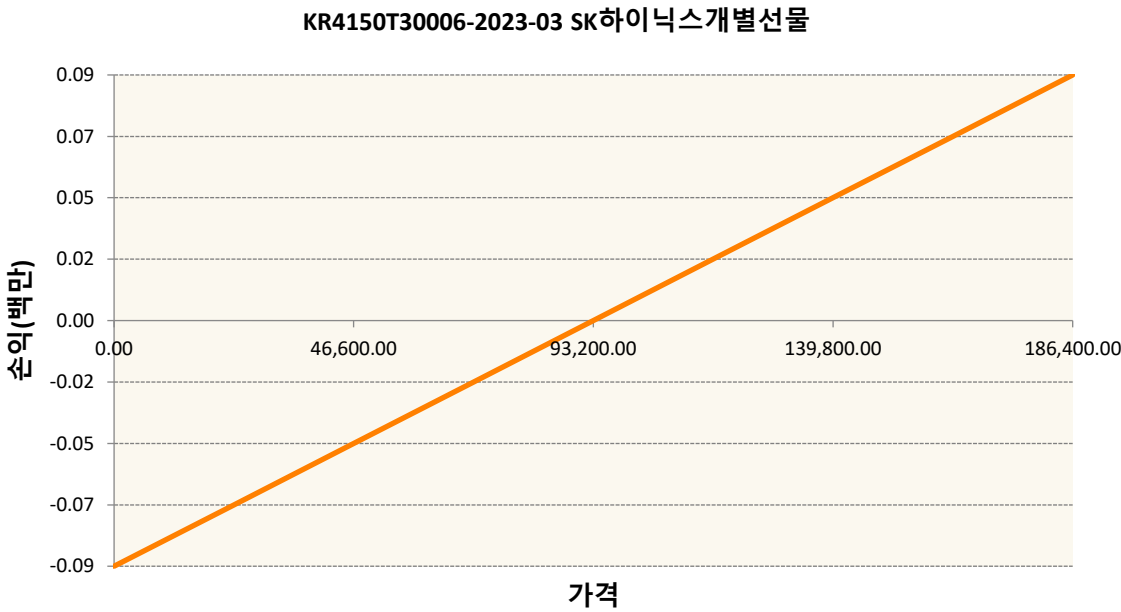
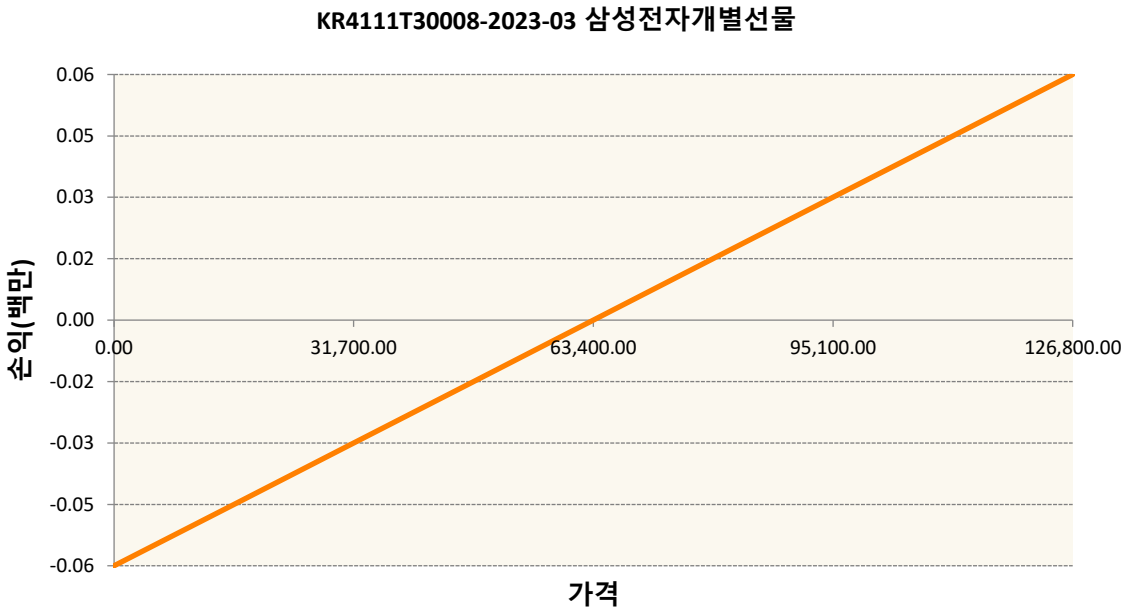
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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	157	0	157	장내

2. 만기시점의 손익구조



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				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)

16

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

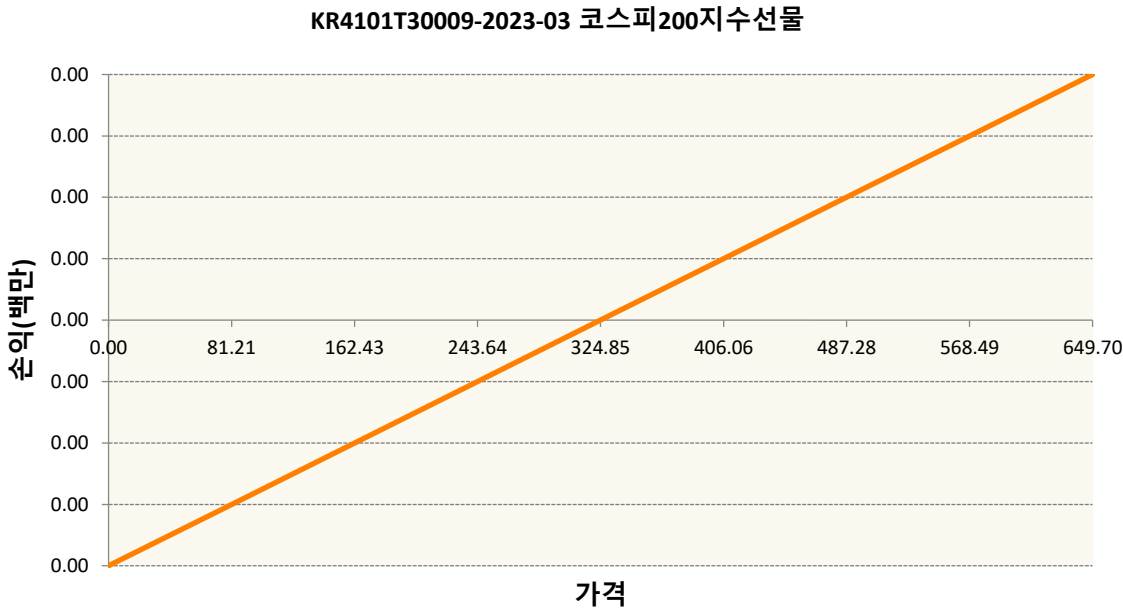
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	2,436	0	2,436	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%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-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%	129	129	129	129	129	129	129
8.00%	194	194	194	194	194	194	194

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

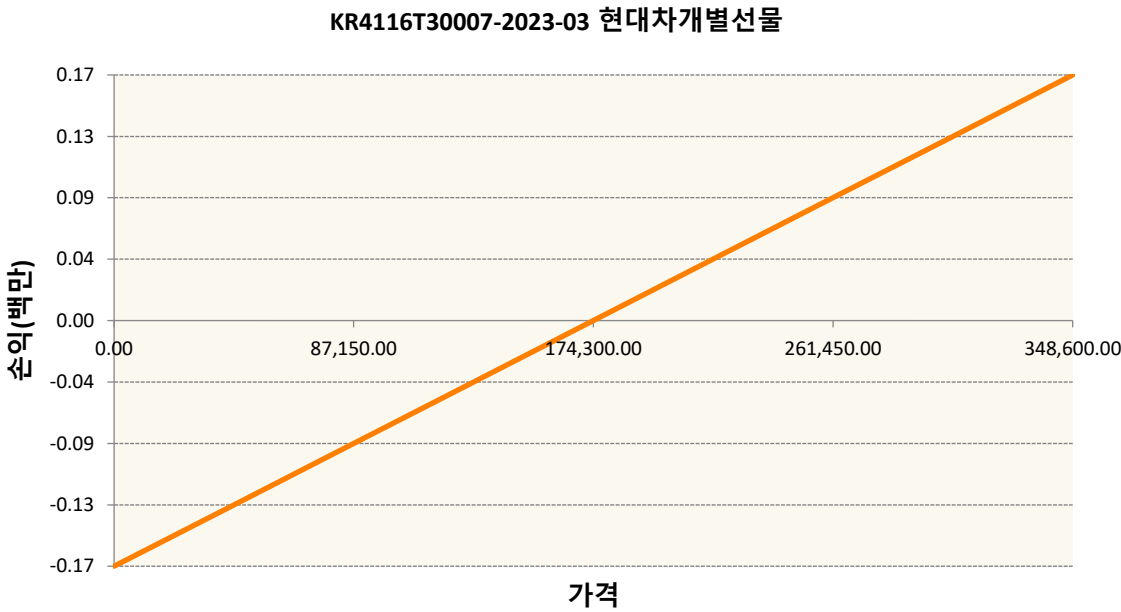
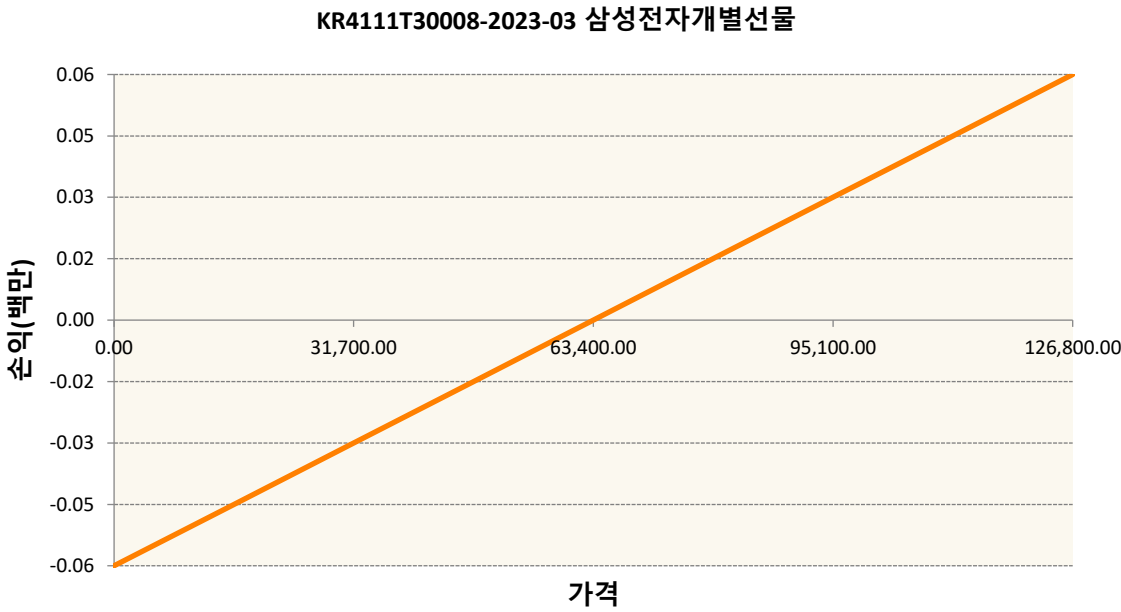
SOL한국형글로벌전기차&2차전지

1. 계약금액

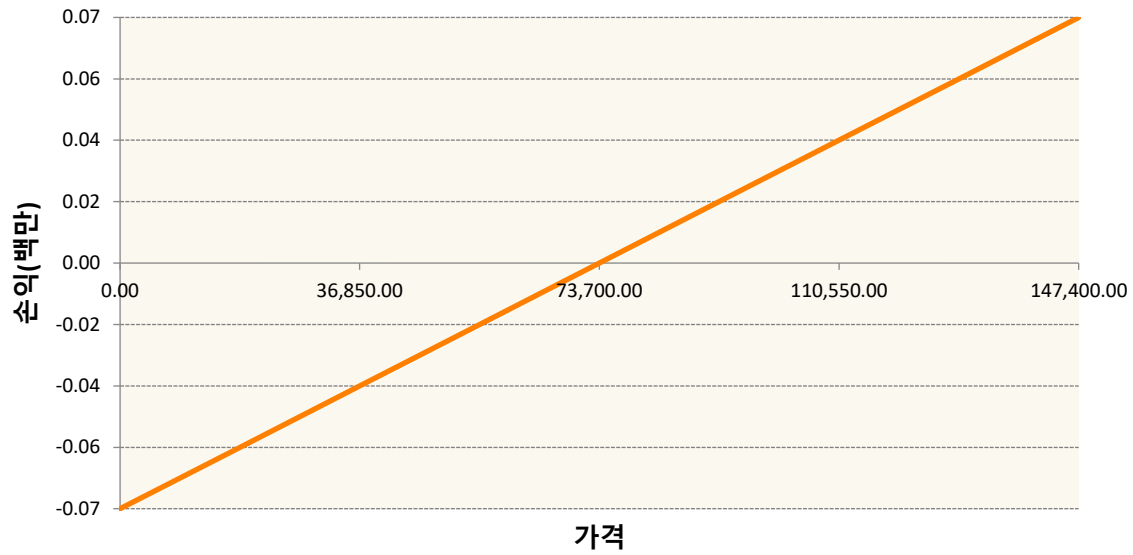
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	258	0	258	장내

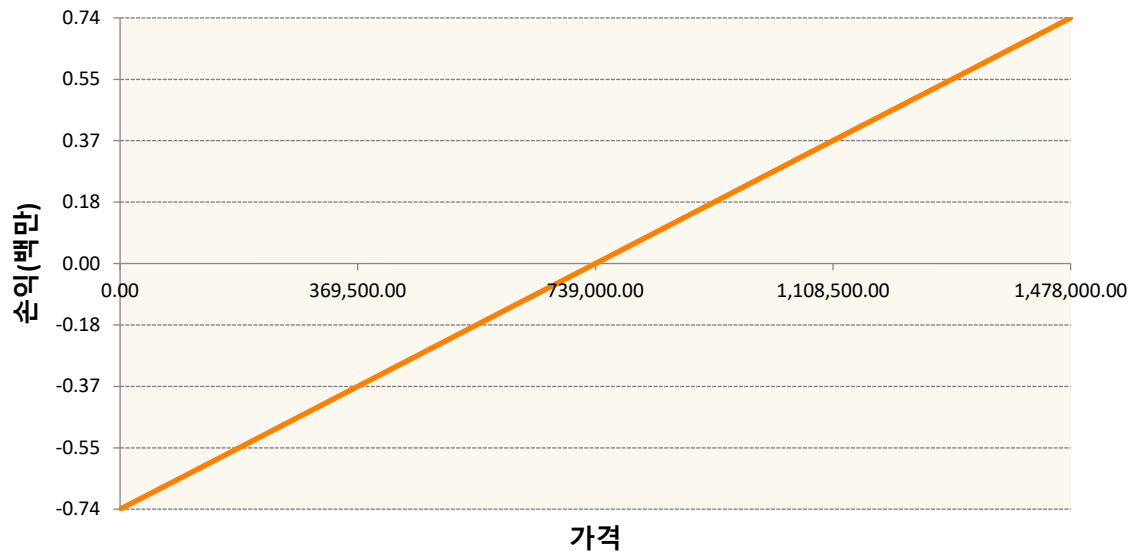
2. 만기시점의 손익구조



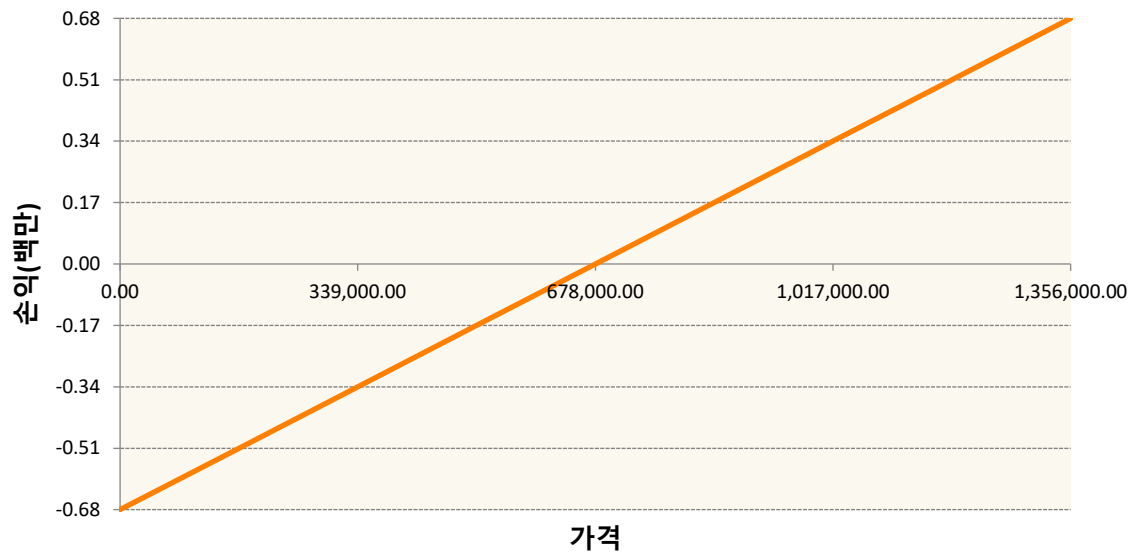
KR4119T30001-2023-03 기아개별선물



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	
-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	
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	-1	
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0	
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	1	
8.00%	1	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	-1	
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0	
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	1	
8.00%	1	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	-12	
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	4	4	4	4	4	4	4	4	
5.33%	8	8	8	8	8	8	8	8	
8.00%	12	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	2023-02-15
기준일	2023-02-14

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

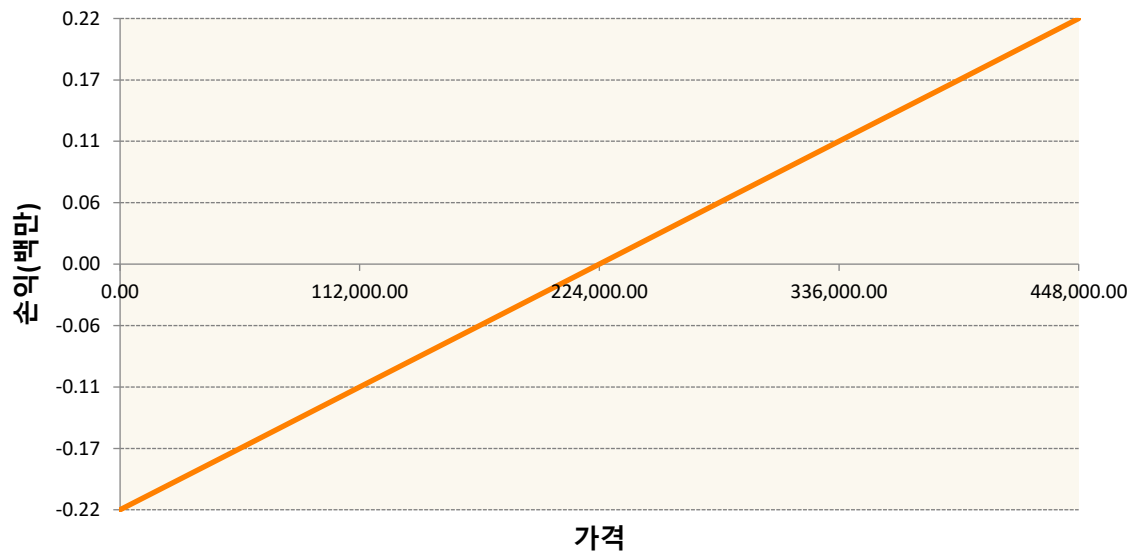
1. 계약금액

(단위:백만원)

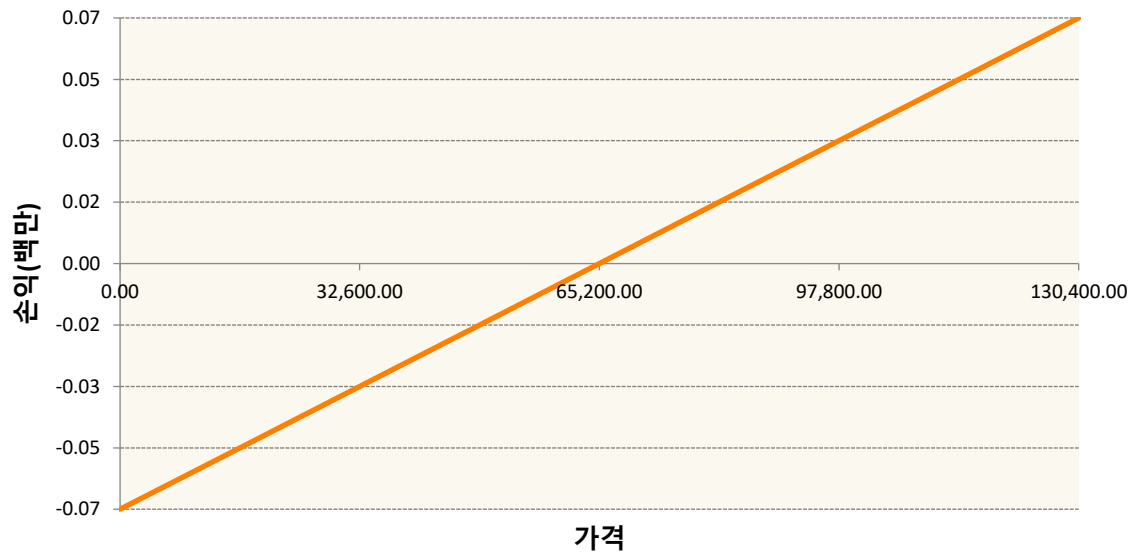
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	137	0	137	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4156T30003-2023-03 NAVER개별선물



KR41CFT30004-2023-03 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4156T30003		2023-03 NAVER개별선물					6
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-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%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	6	6	6	6	6	6	6
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
-5.33%	-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)

22

공시일	2023-02-15
기준일	2023-02-14

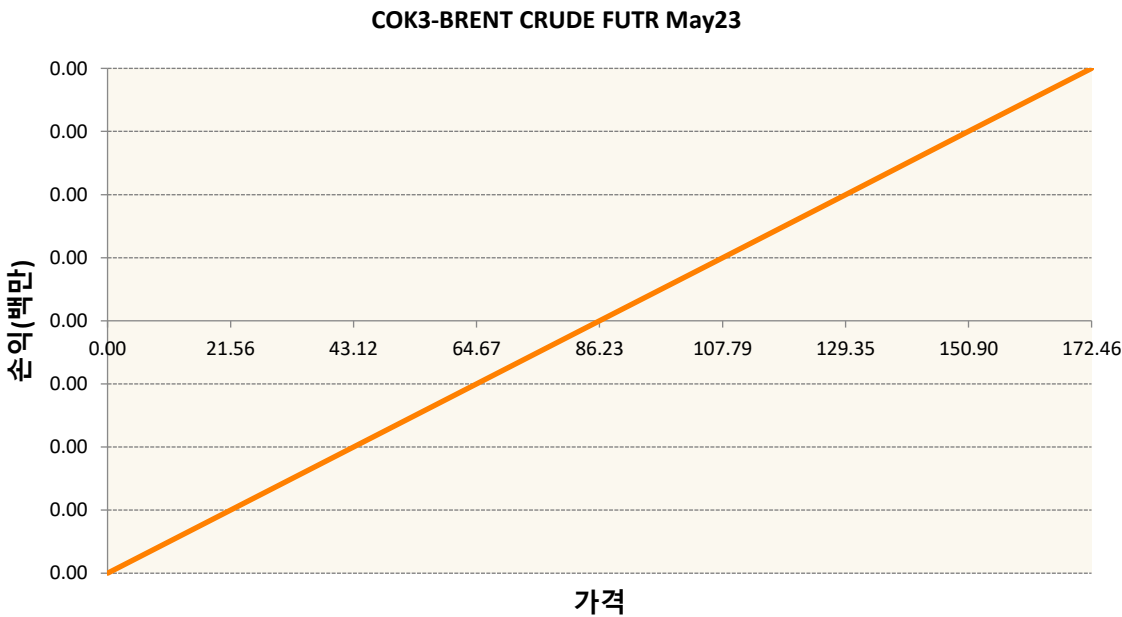
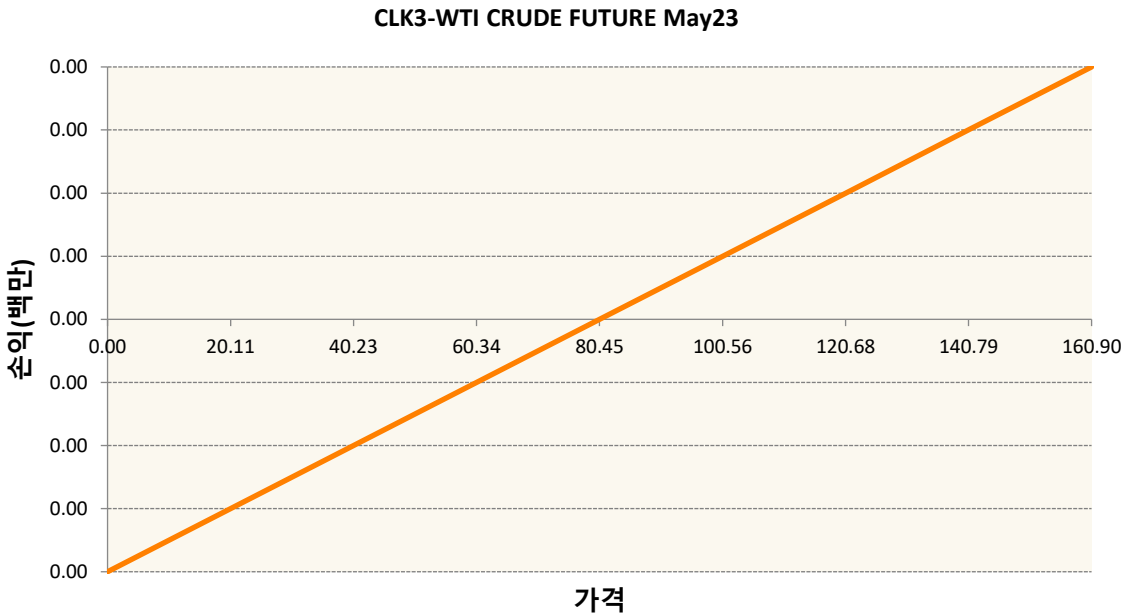
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

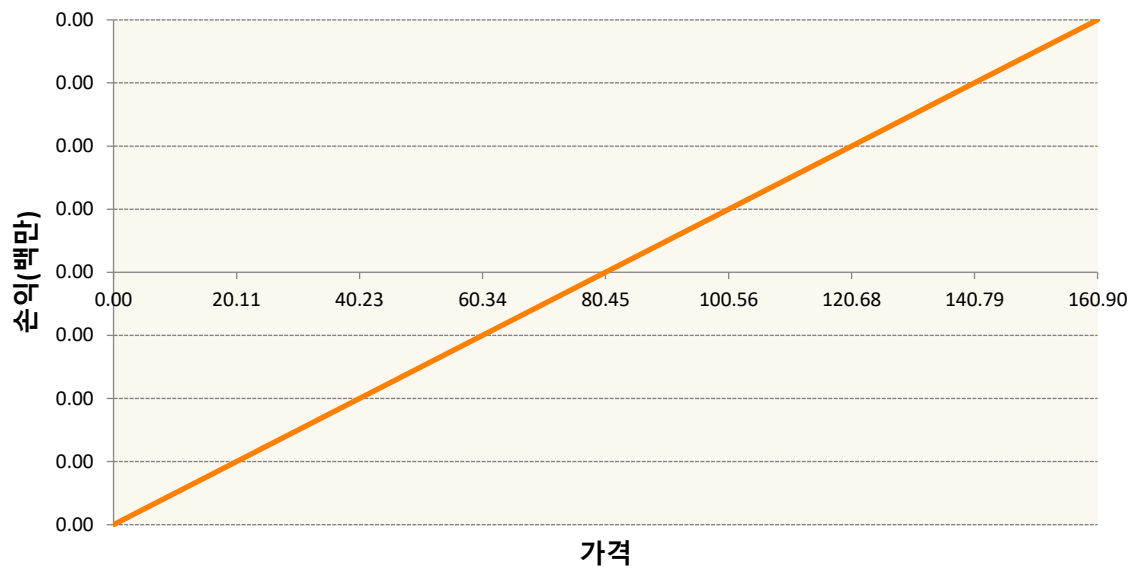
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,750	343	1,408	

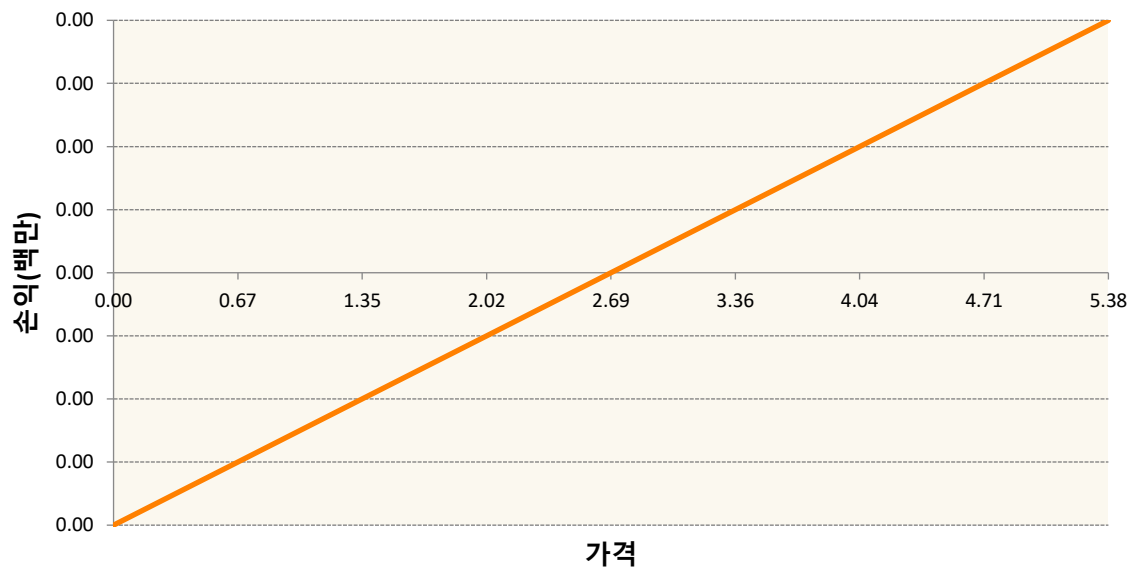
2. 만기시점의 손익구조



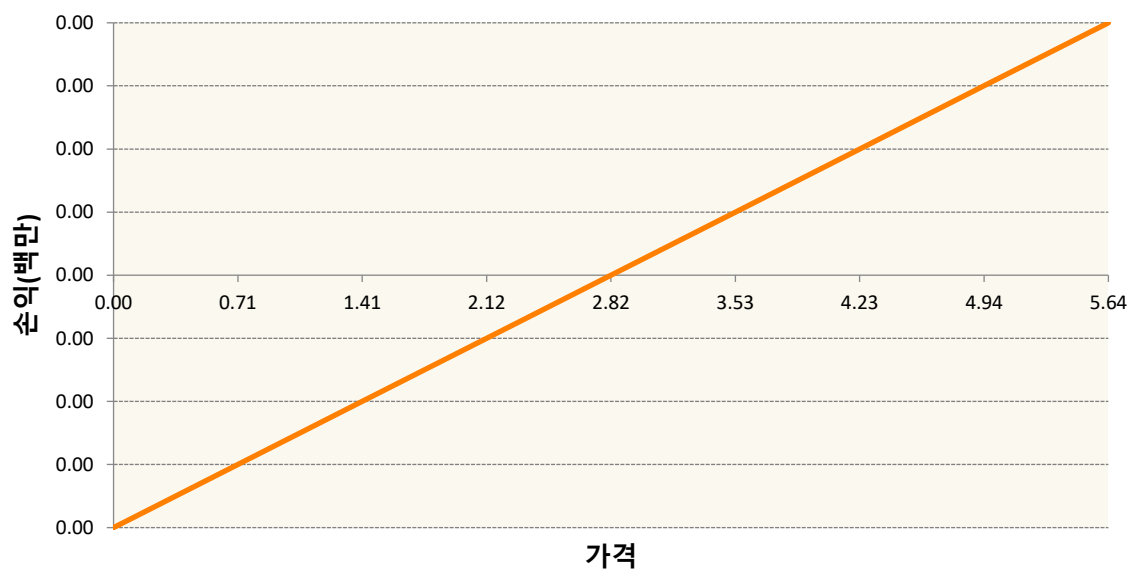
ECK3-E-mini Crude Oil May23



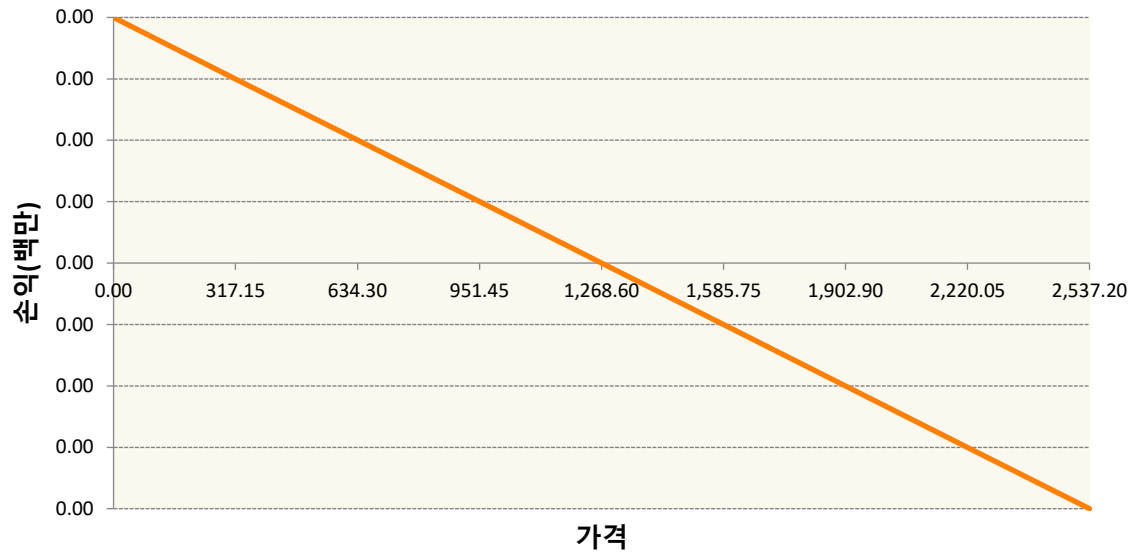
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



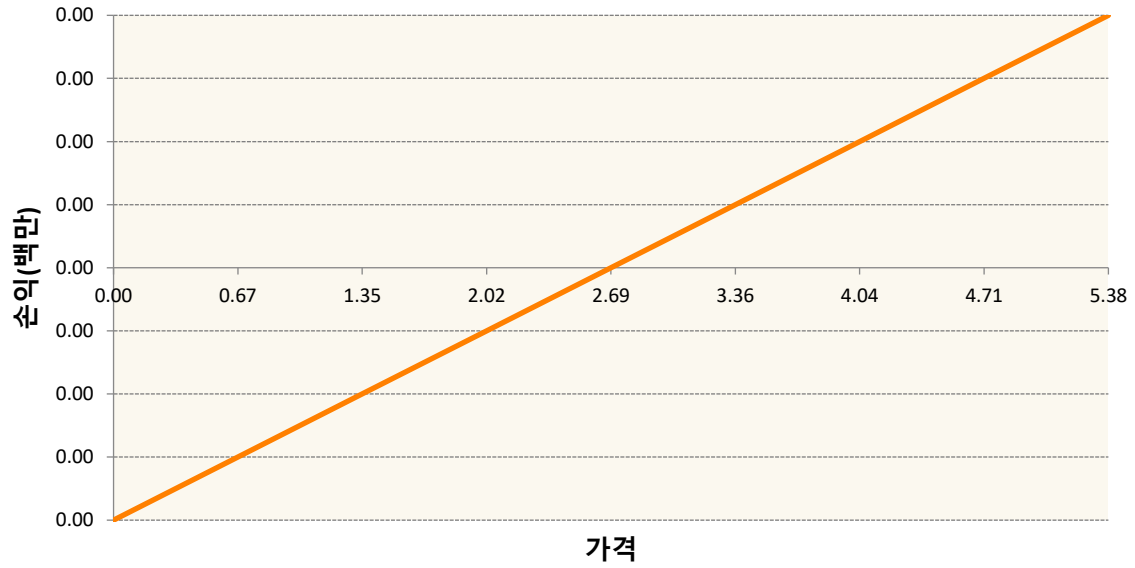
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



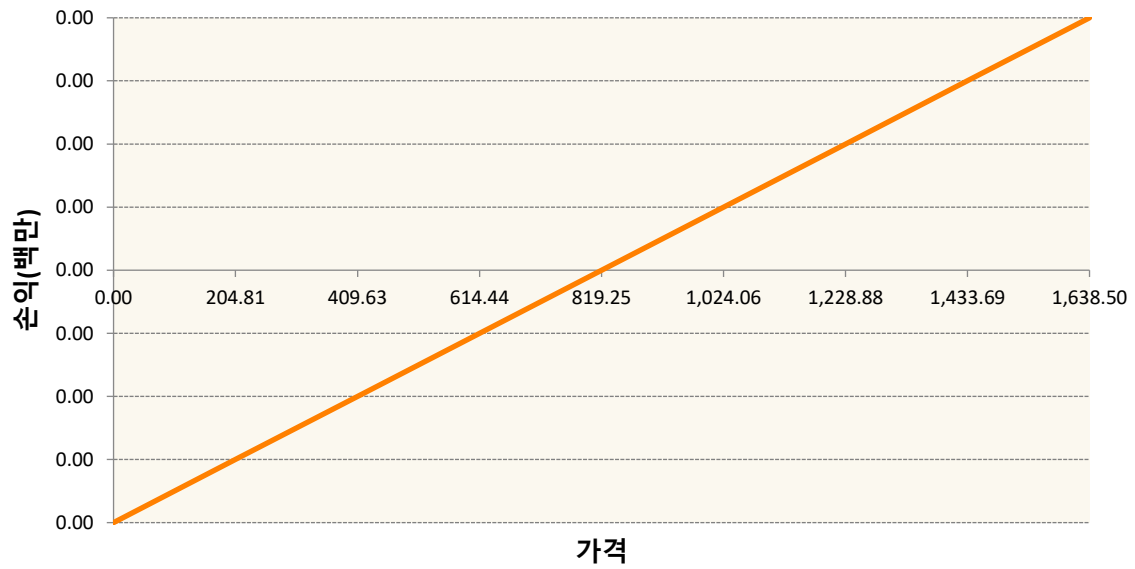
KR4175T20004-2023-02 달러선물

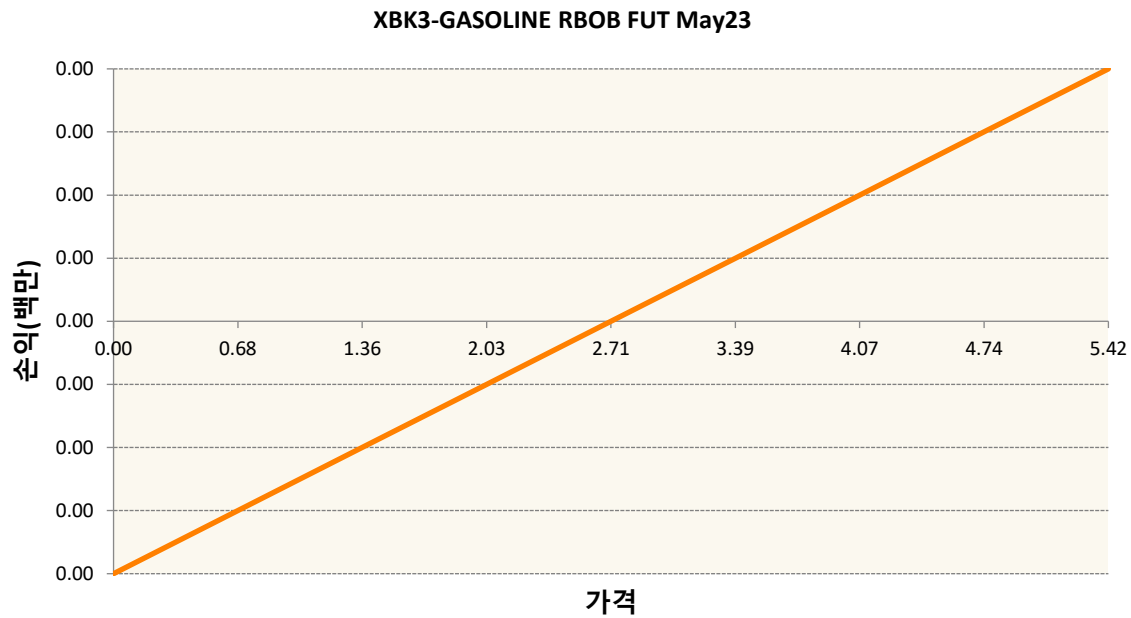


NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK3	WTI CRUDE FUTURE May23		33
COK3	BRENT CRUDE FUTR May23		34
ECK3	E-mini Crude Oil May23		4
EOK3	E-MINI NATURAL GAS May23		1
HOK3	NY Harb ULSD Fut May23		12
KR4175T200 2023-02 달러선물			27
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23		27
QSK3	Low Su Gasoil G May23		17
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23		12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	454