

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

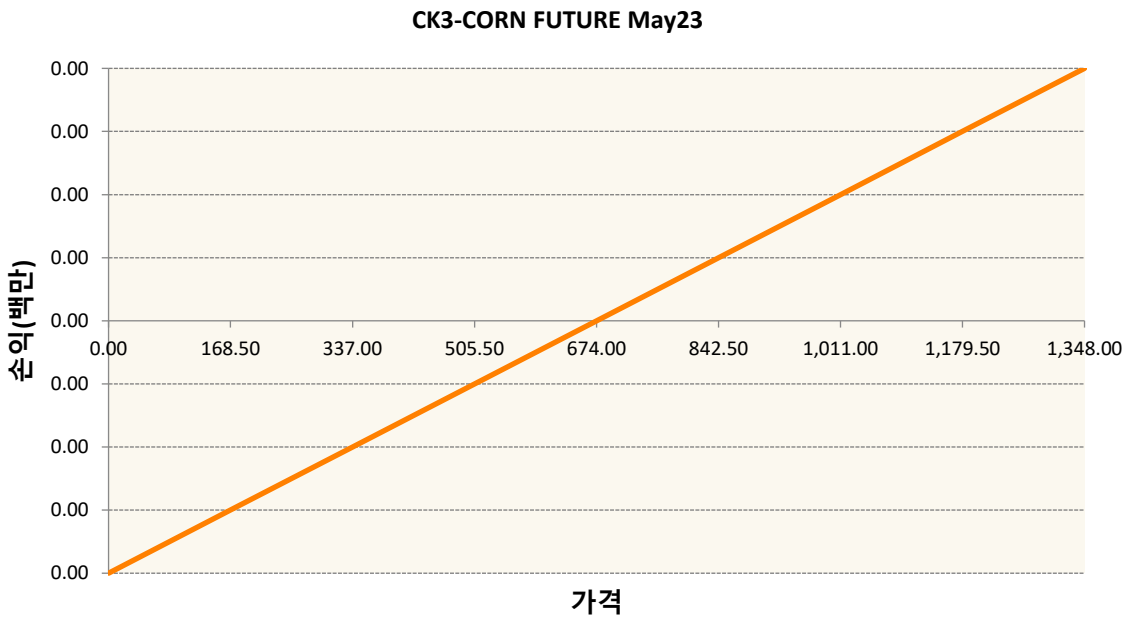
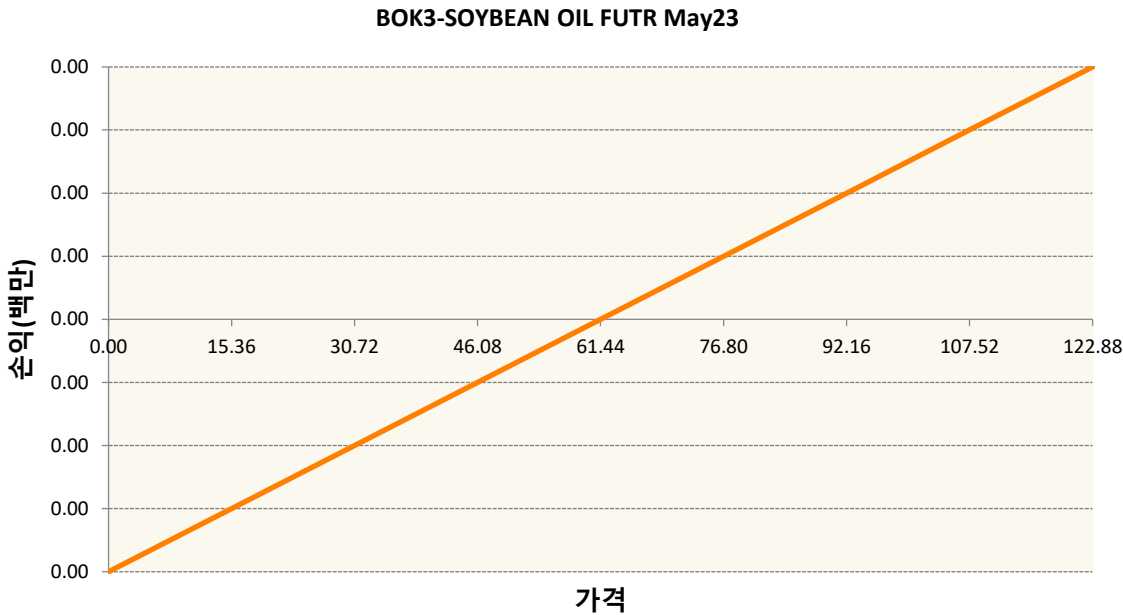
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

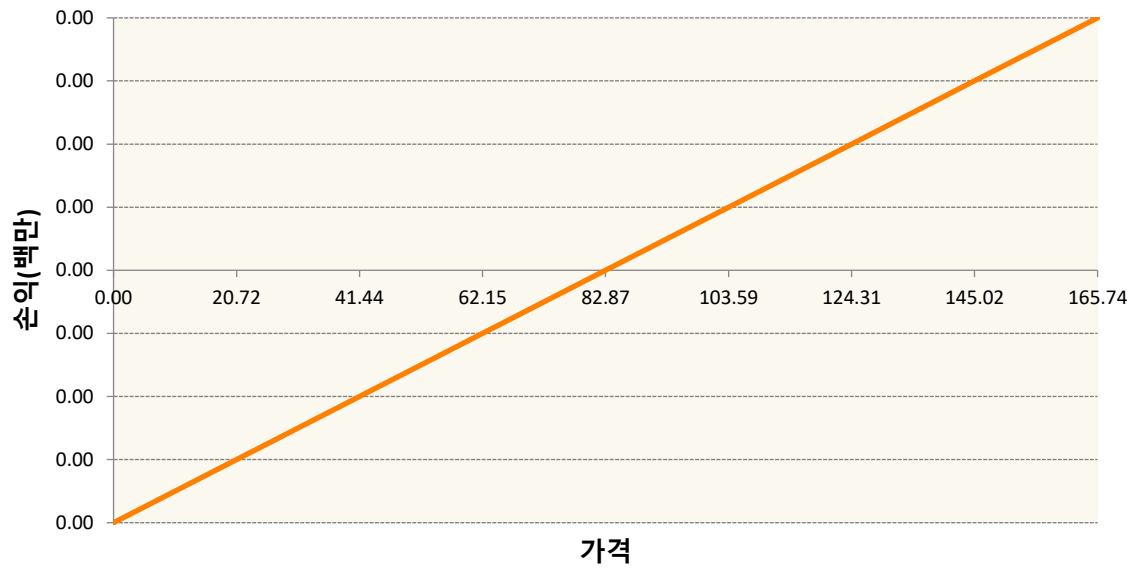
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,102	642	5,460	

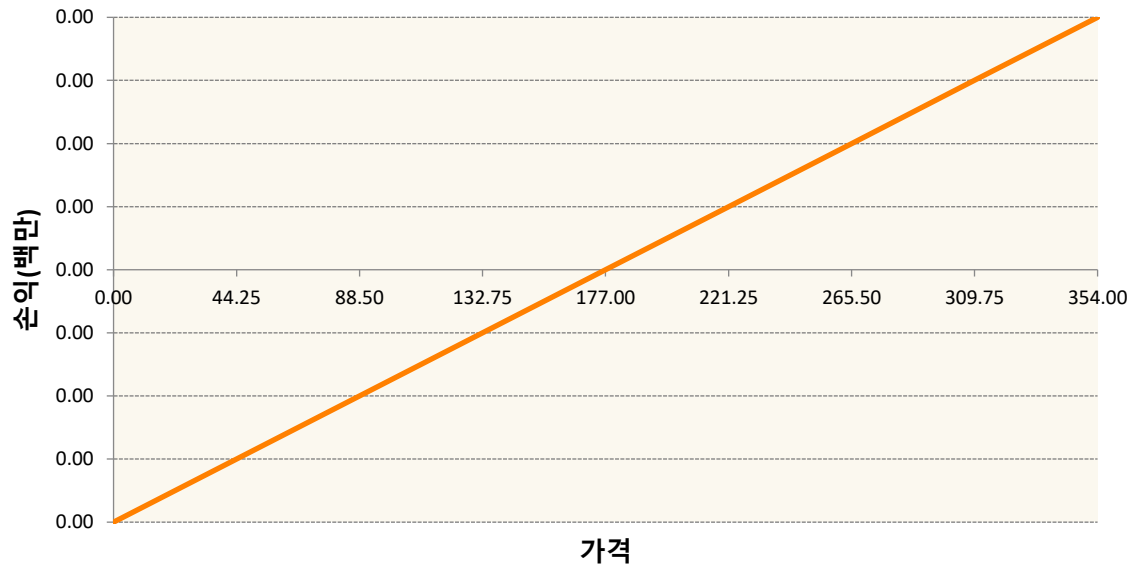
2. 만기시점의 손익구조



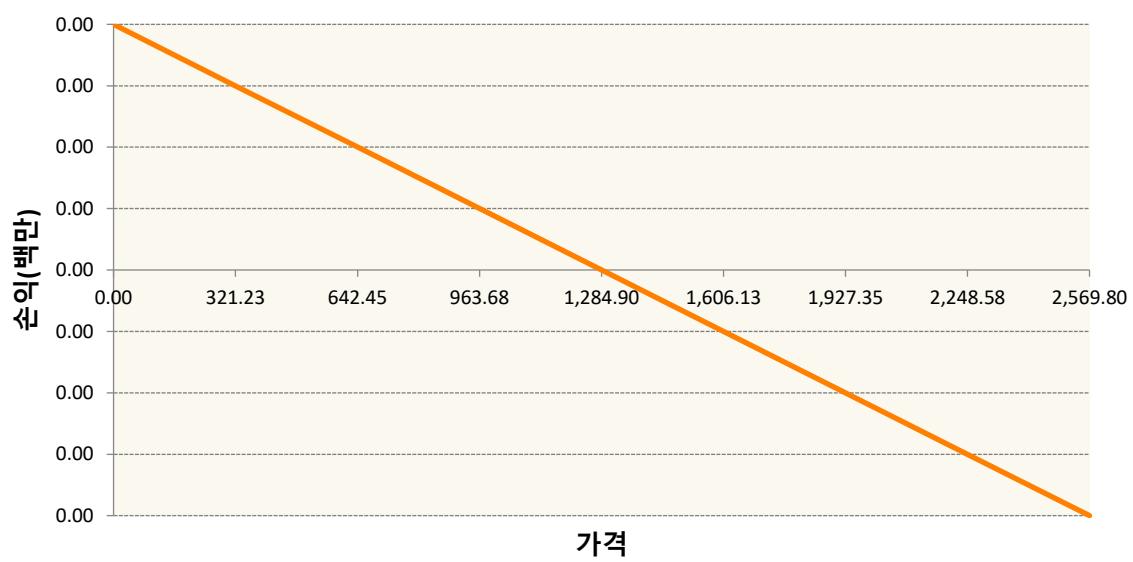
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



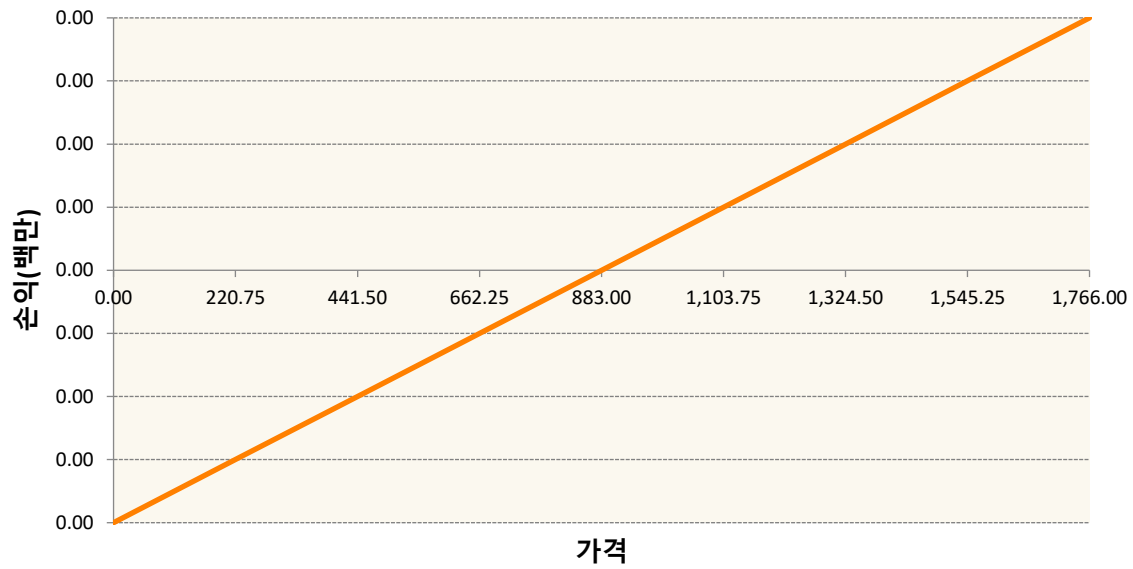
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



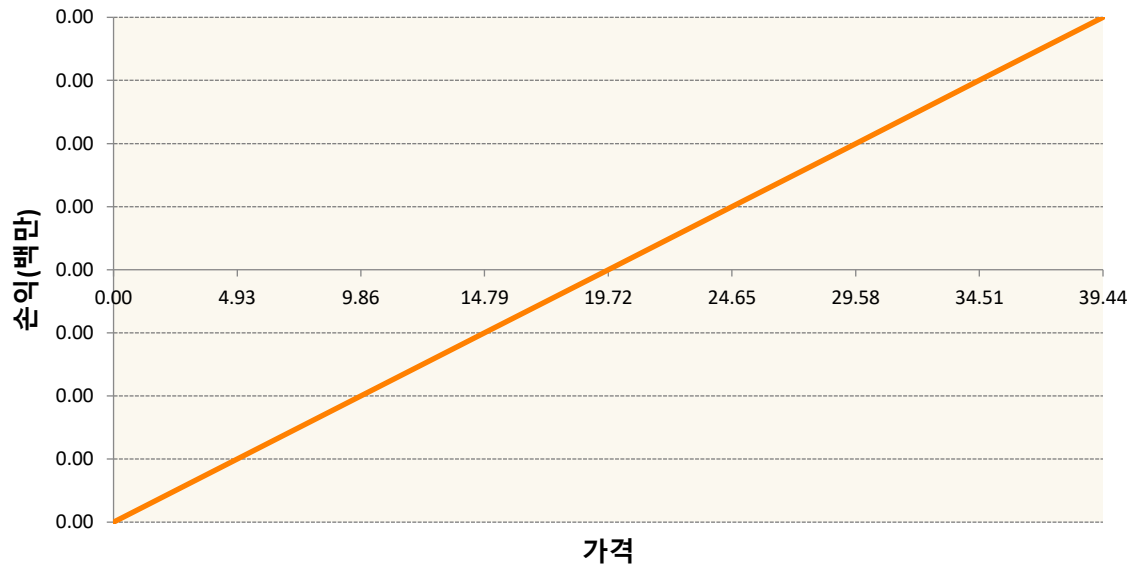
KR4175T30003-2023-03 달러선물



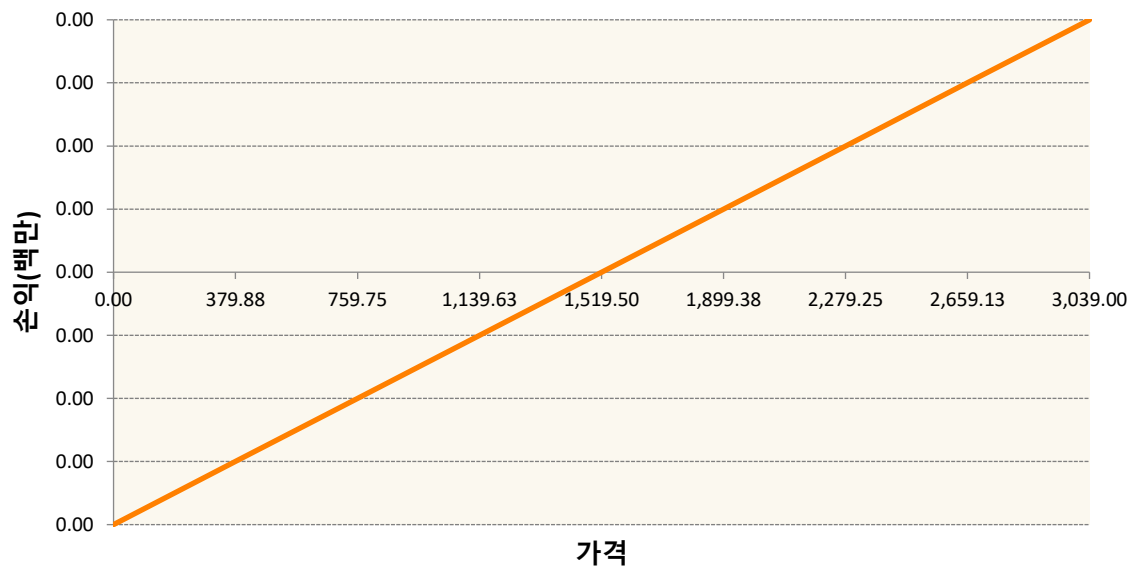
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



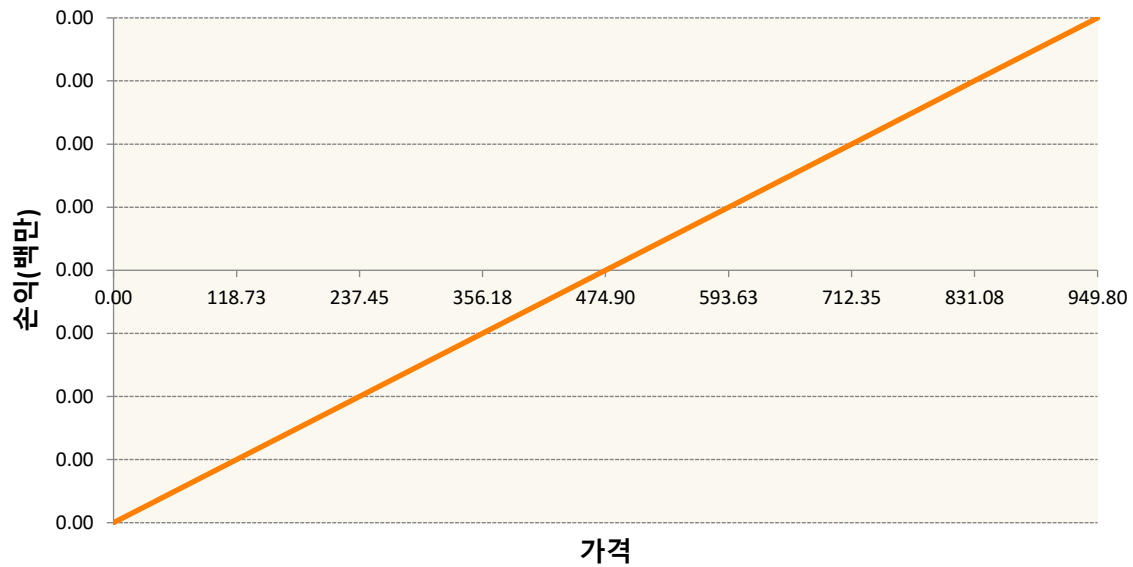
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



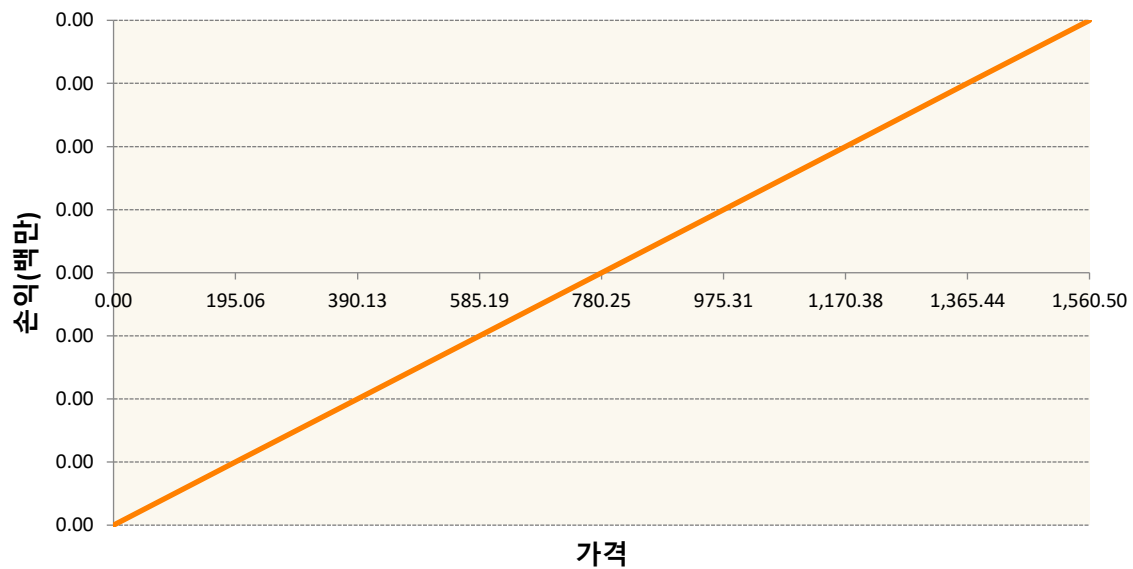
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-02-17
기준일	2023-02-16

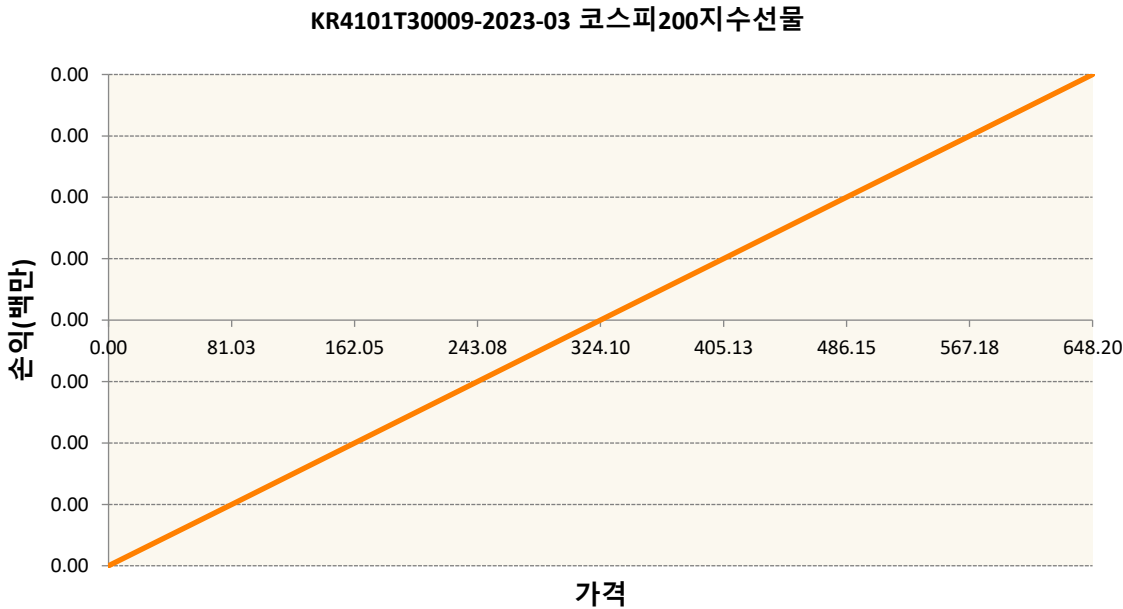
스마트인덱스모

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	2,431	0	2,431	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	2023-02-17
기준일	2023-02-16

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)

512

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

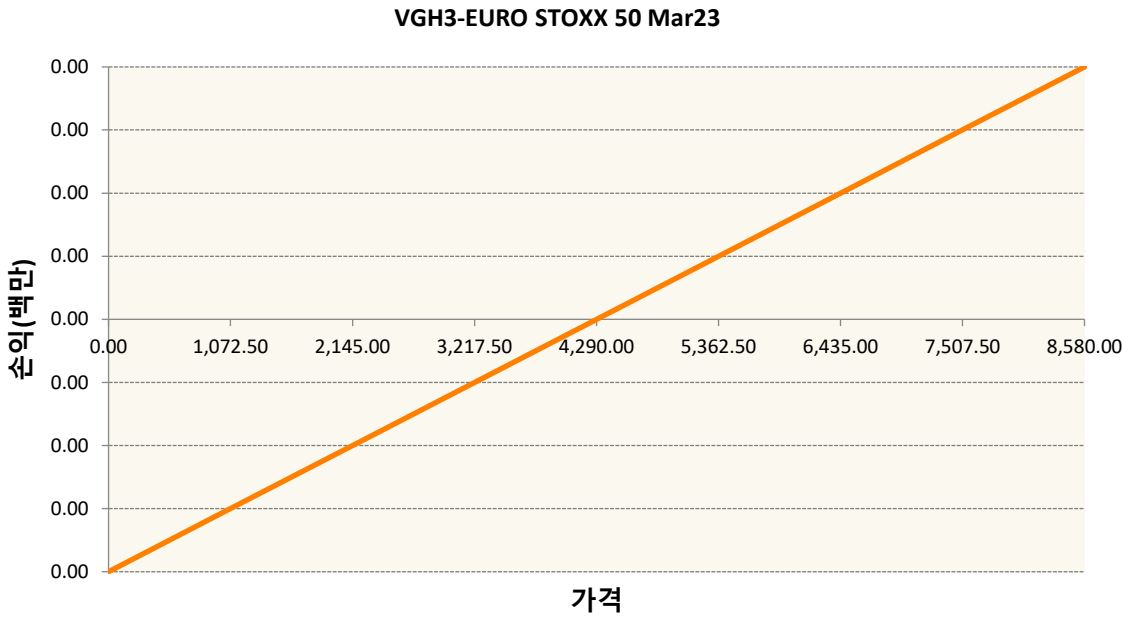
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	416	0	416	

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	2023-02-17
기준일	2023-02-16

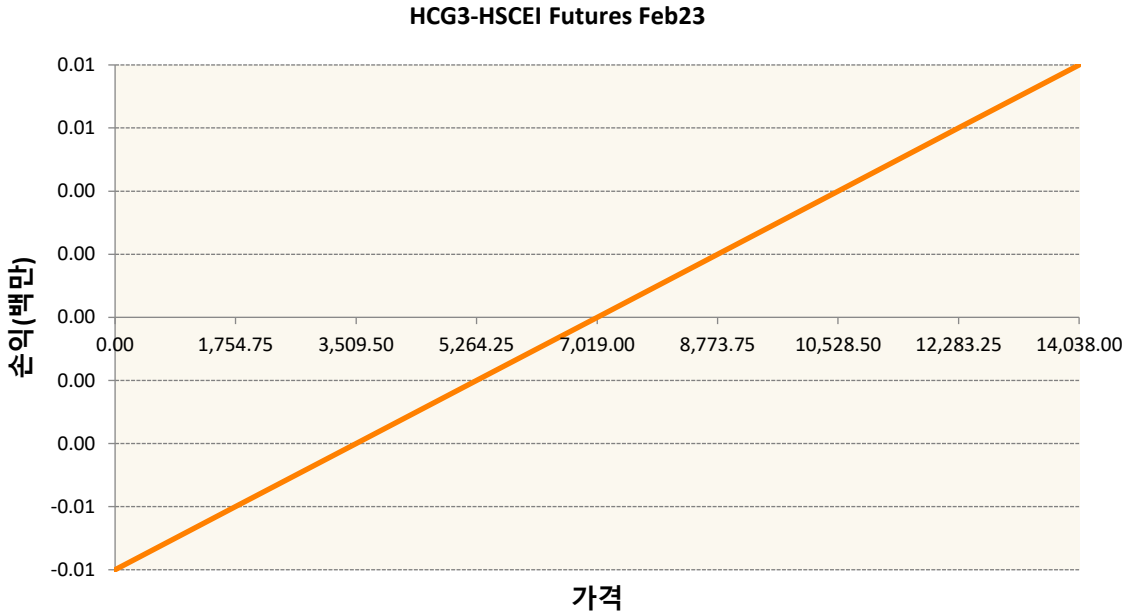
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,209	0	1,209	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG3	HSCEI Futures Feb23	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

162

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

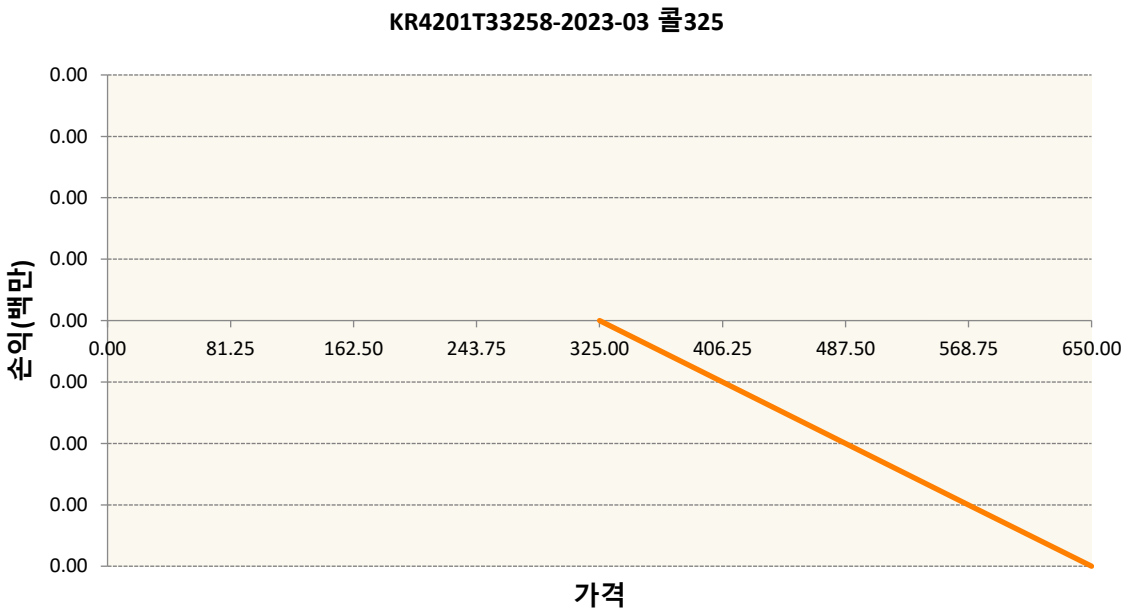
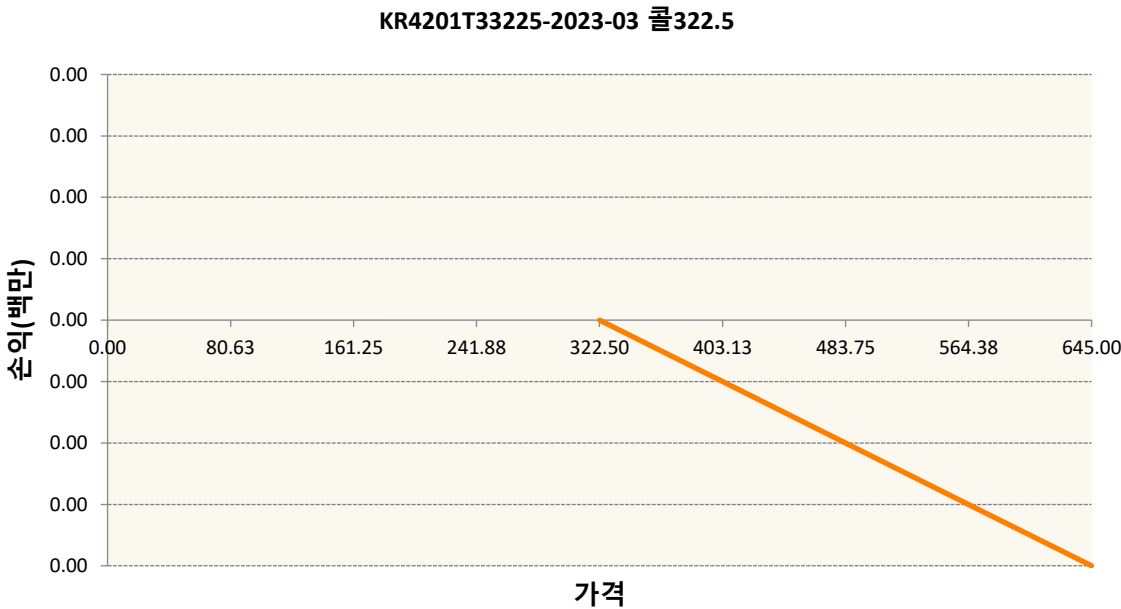
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

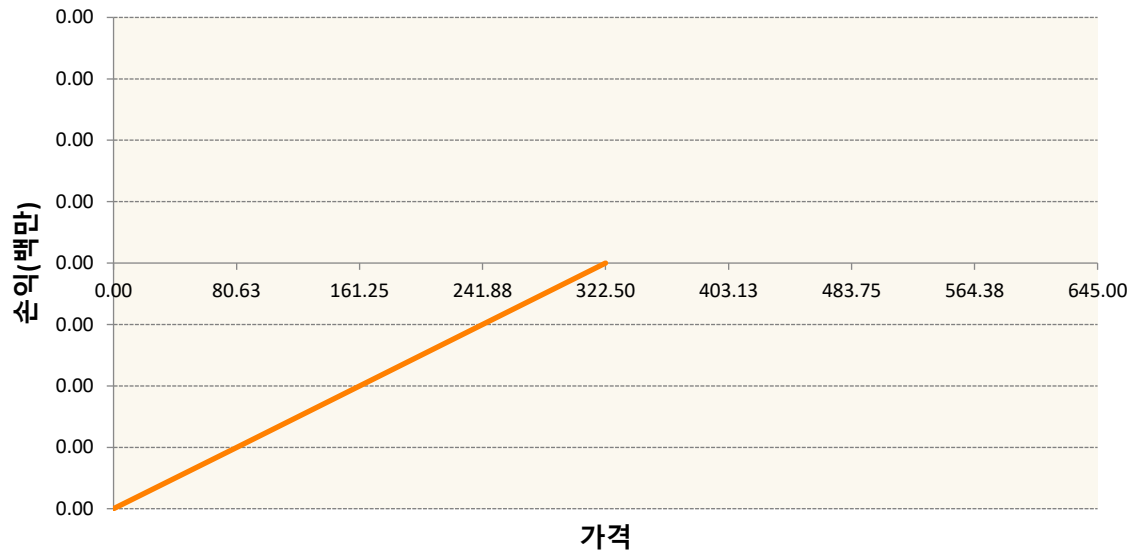
(단위:백만원)

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

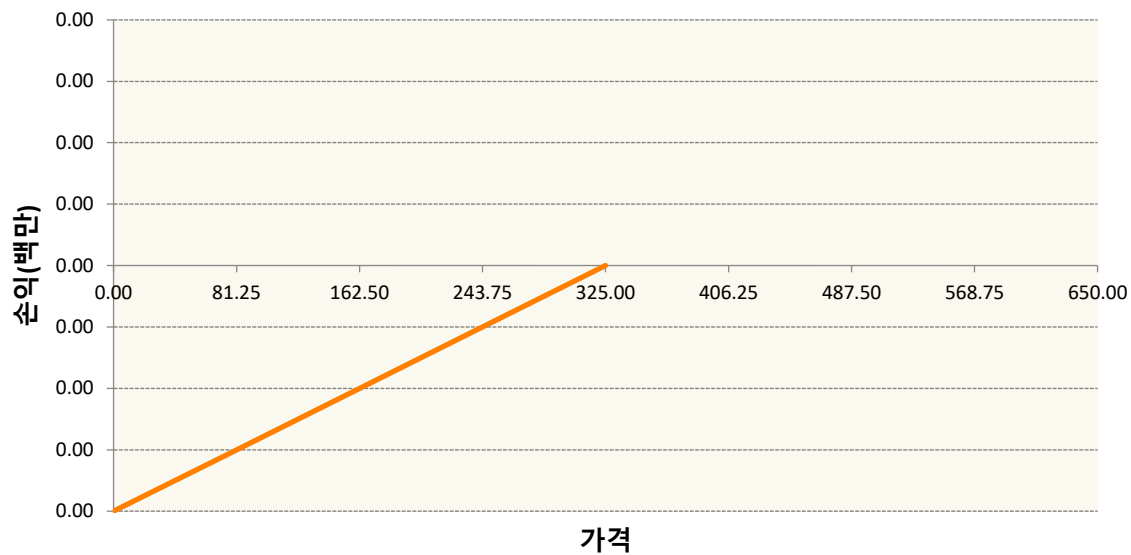
2. 만기시점의 손익구조



KR4301T33223-2023-03 푼322.5



KR4301T33256-2023-03 受325



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201T33225							2023-03 콜322.5		103	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	66	62	58	53	48	43	37			
-5.33%	56	50	45	39	33	28	22			
-2.67%	40	34	28	21	15	9	3			
0%	19	13	6	0	-6	-13	-19			
2.67%	-7	-13	-19	-25	-32	-38	-44			
5.33%	-38	-43	-49	-54	-60	-66	-72			
8.00%	-72	-76	-81	-86	-92	-97	-103			
KR4201T33258							2023-03 콜325		2,803	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,751	1,638	1,517	1,388	1,254	1,114	972
-5.33%	1,478	1,334	1,184	1,031	876	717	557
-2.67%	1,077	910	740	570	399	228	56
0%	534	356	178	0	-178	-356	-534
2.67%	-152	-327	-502	-678	-855	-1,033	-1,211
5.33%	-972	-1,130	-1,293	-1,459	-1,627	-1,797	-1,969
8.00%	-1,906	-2,040	-2,182	-2,331	-2,485	-2,642	-2,803
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	-23	-26
-2.67%	-1	-4	-6	-9	-11	-14	-16
0%	8	5	3	0	-3	-5	-8
2.67%	14	12	10	7	5	2	0
5.33%	19	17	15	13	11	8	6
8.00%	23	21	19	17	15	13	11

KR4301T33256 2023-03 풋325							550
---	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-388	-412	-437	-464	-491	-520	-550
-5.33%	-195	-224	-255	-287	-319	-352	-385
-2.67%	-27	-62	-97	-132	-168	-203	-239
0%	111	74	37	0	-37	-74	-111
2.67%	219	183	146	110	73	36	0
5.33%	299	267	233	199	164	128	93
8.00%	356	328	299	268	236	204	170

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

(단위:백만원)

2,947

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

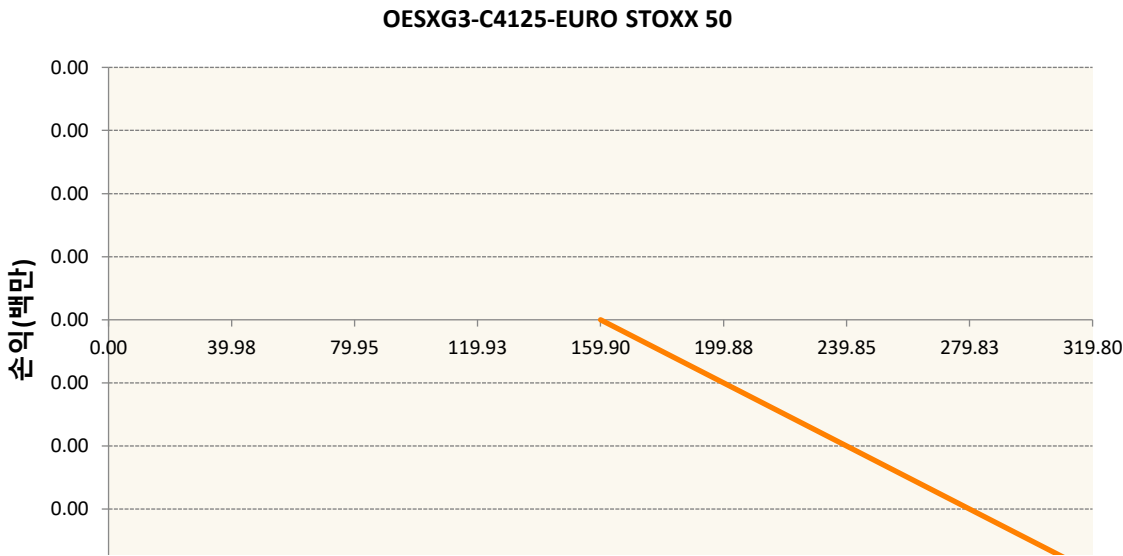
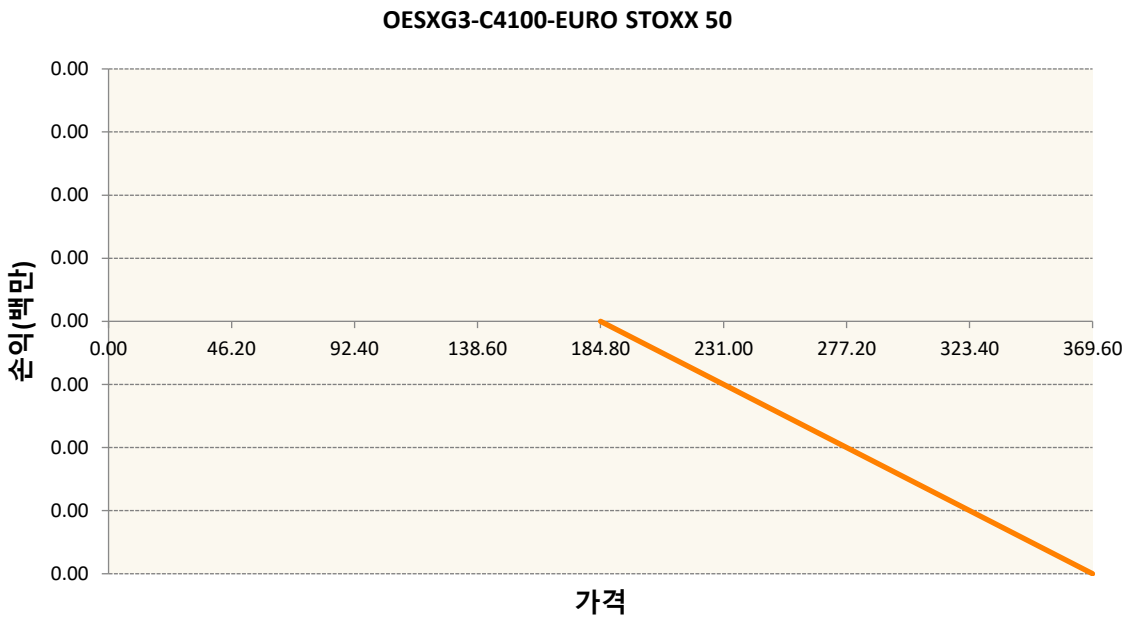
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

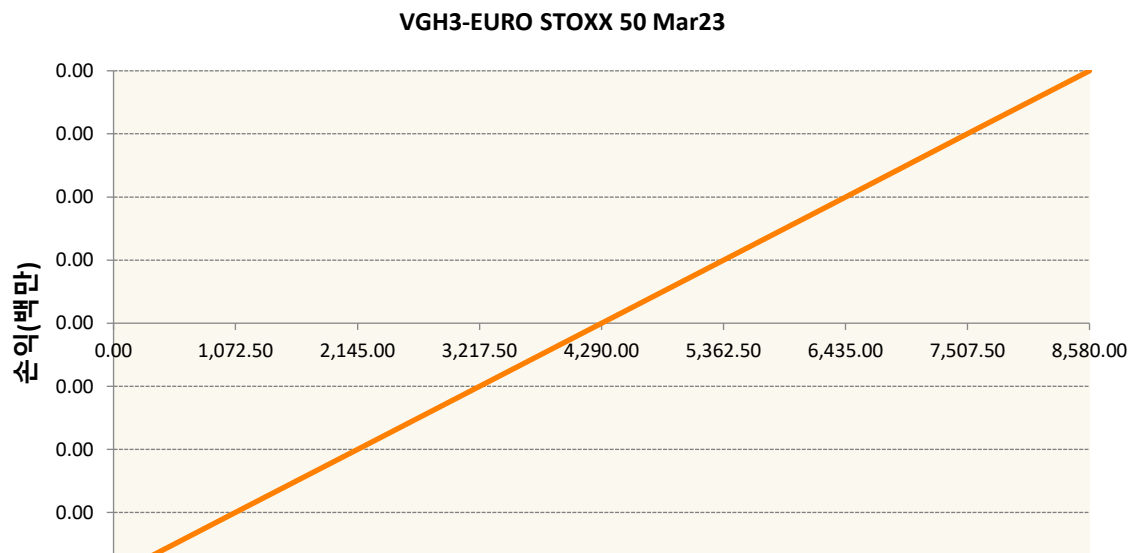
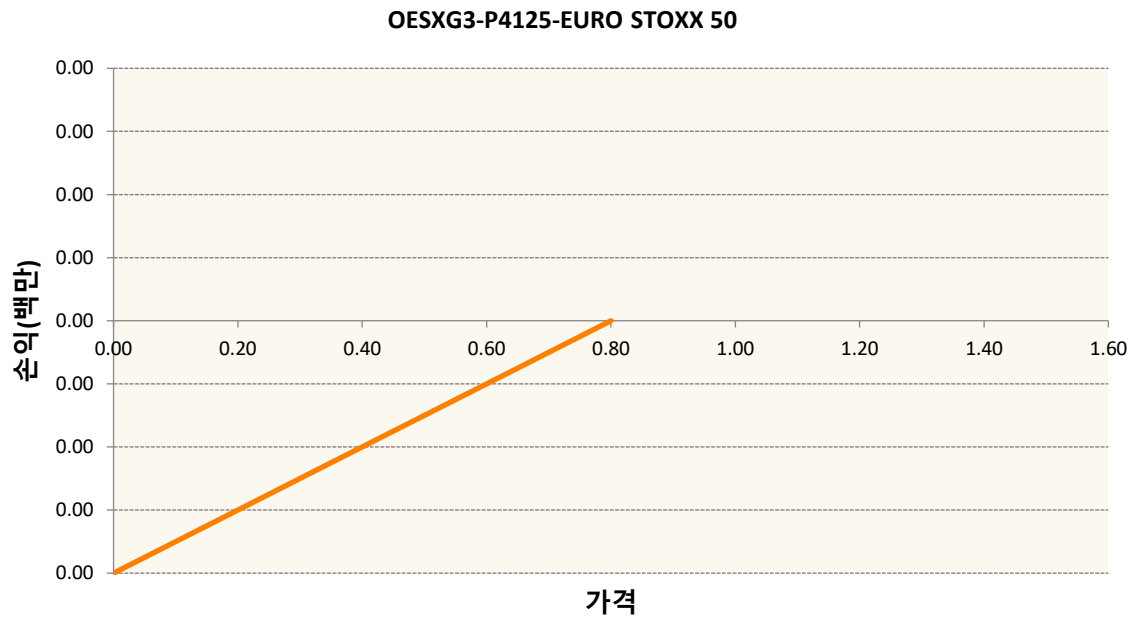
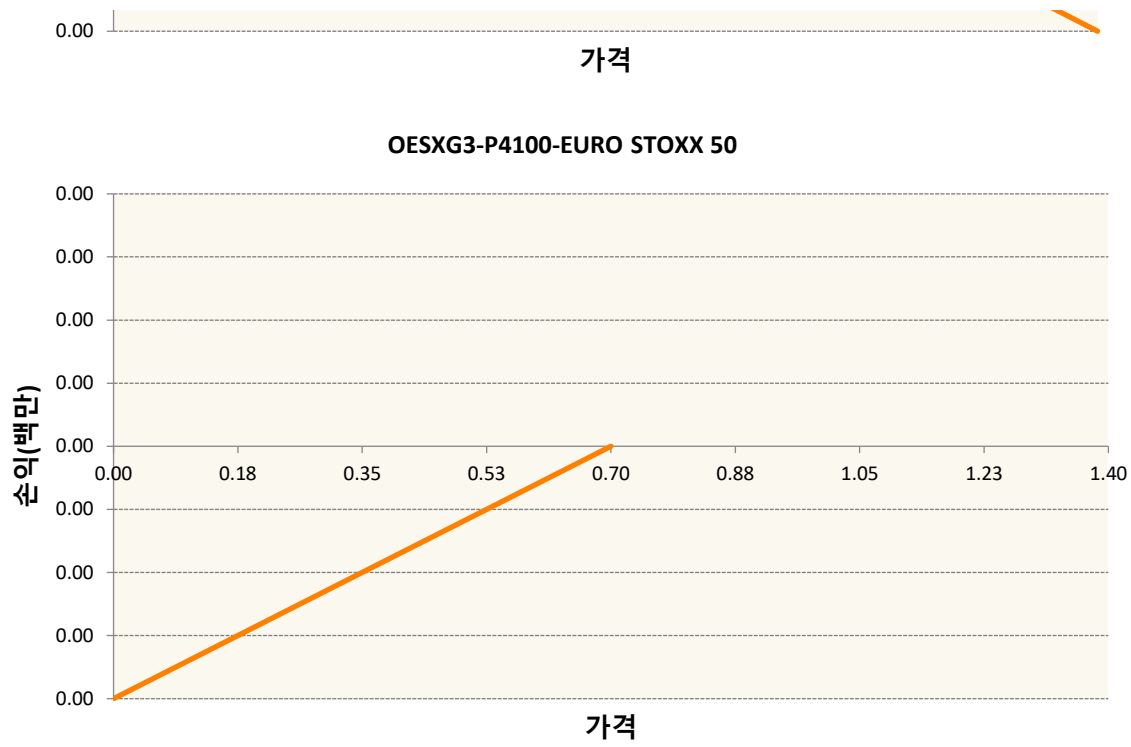
1. 계약금액

(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	1,012	0	1,012	
누계	유가증권	옵션	0	78	-78	장내
누계	통화	선도	344	2,251	-1,907	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
FXW213D2F(EUR/KRW 24-02-23E	5
FXW213D2G EUR/KRW 24-02-23E	11
FXW213D2G KRW/EUR 21-02-23E	10
OESXG3-C41 EURO STOXX 50	2
OESXG3-C41 EURO STOXX 50	5
OESXG3-P41 EURO STOXX 50	0.01
OESXG3-P41 EURO STOXX 50	0.02
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23	81

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

(단위:백만원)

250

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

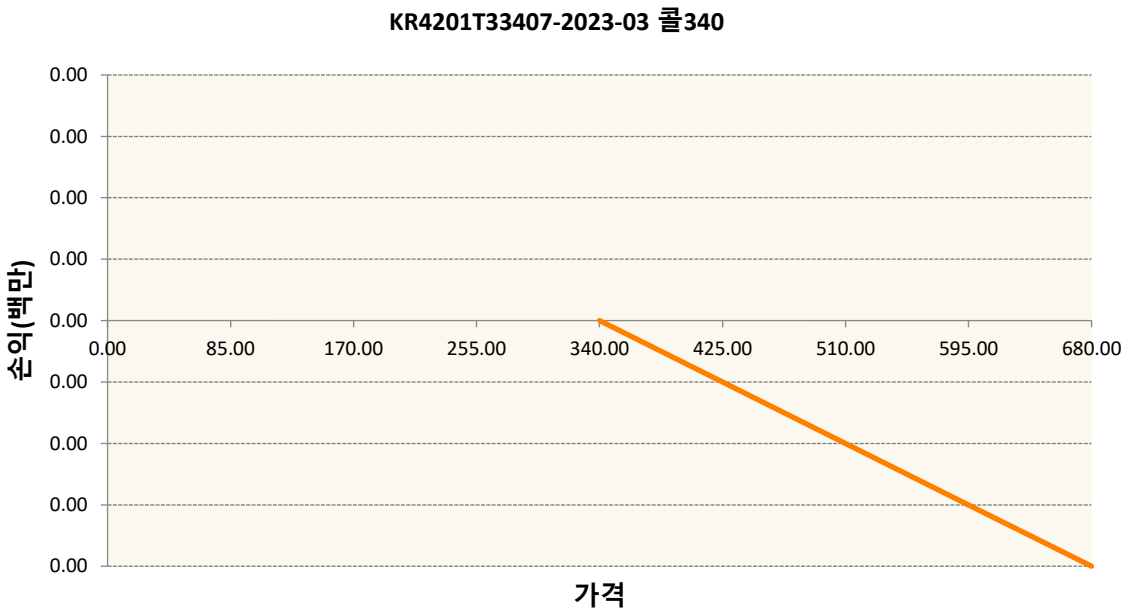
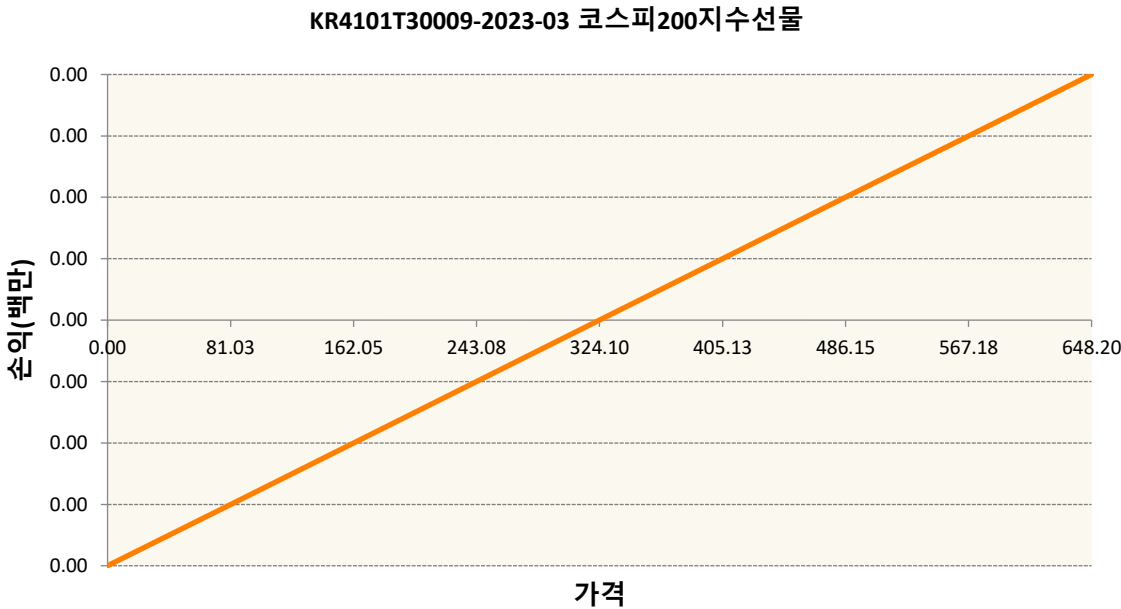
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

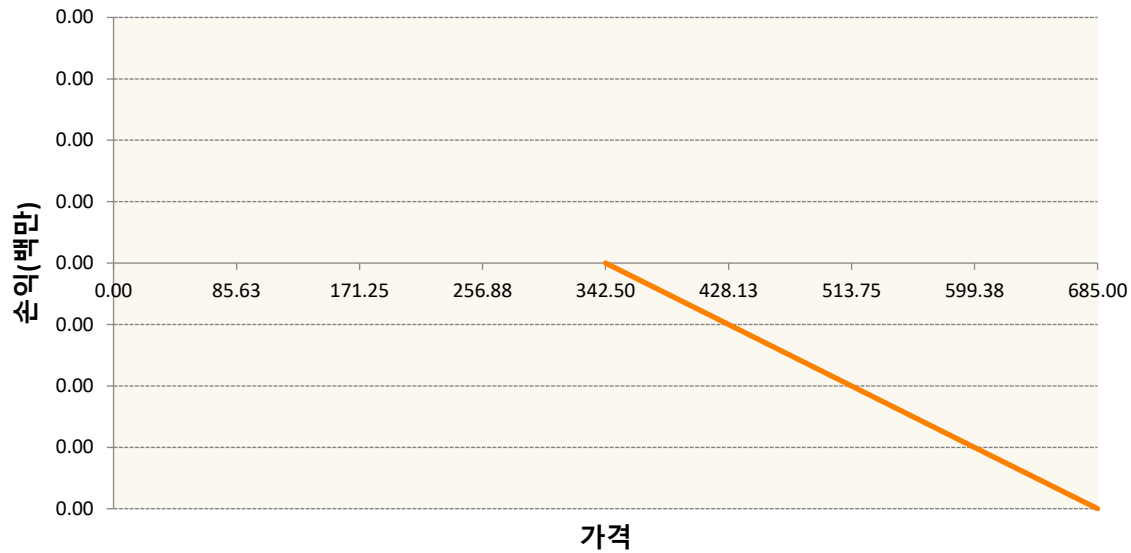
(단위:백만원)

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	405	0	405	장내
누계	유가증권	옵션	163	4,009	-3,846	장내

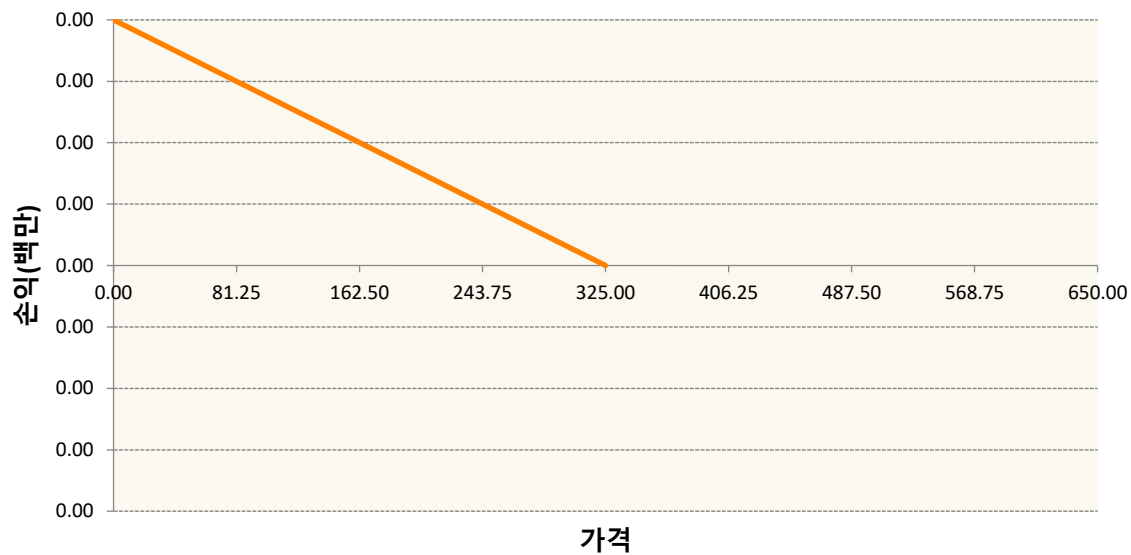
2. 만기시점의 손익구조



KR4201T33423-2023-03 콜342.5



KR4301T33256-2023-03 受325



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				105
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	51	48	45	41	36	31	26
-5.33%	45	41	36	31	25	19	13
-2.67%	36	30	24	18	11	4	-3
0%	22	15	7	0	-8	-15	-23
2.67%	2	-6	-14	-22	-30	-38	-47
5.33%	-24	-32	-41	-49	-57	-66	-74
8.00%	-56	-64	-72	-80	-89	-97	-105
KR4201T33423 2023-03 콜342.5							89

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	42	39	36	33	29	25	21
-5.33%	37	34	30	25	21	16	10
-2.67%	30	25	20	14	9	3	-3
0%	19	13	6	0	-7	-13	-20
2.67%	3	-4	-11	-18	-25	-33	-40
5.33%	-19	-26	-33	-41	-48	-56	-63
8.00%	-45	-53	-60	-67	-75	-82	-89

KR4301T33256 2023-03 풋325							9
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	8	8	8	9	9
-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)

189

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

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	6,894	0	6,894	

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	2023-02-17
기준일	2023-02-16

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	5,681	0	5,681	

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	2023-02-17
기준일	2023-02-16

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	19,533	0	19,533	
누계	통화	선도	193	19,818	-19,625	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213CBQ KRW/USD 28-02-23E		657
FXW213CCS(KRW/USD 28-03-23E		545
FXW213D1S(KRW/USD 28-04-23E		307
FXW213D1T(KRW/USD 28-02-23E		77
FXW213D2F(USD/KRW 28-02-23E		15

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

(단위:백만원)

892

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

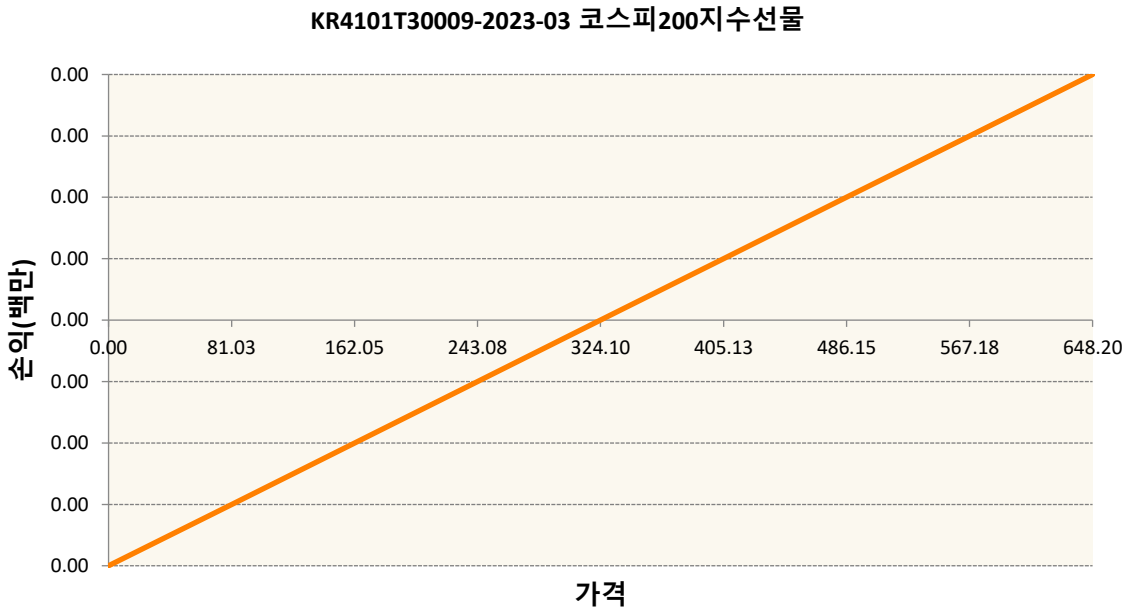
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,377	0	1,377	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	2023-02-17
기준일	2023-02-16

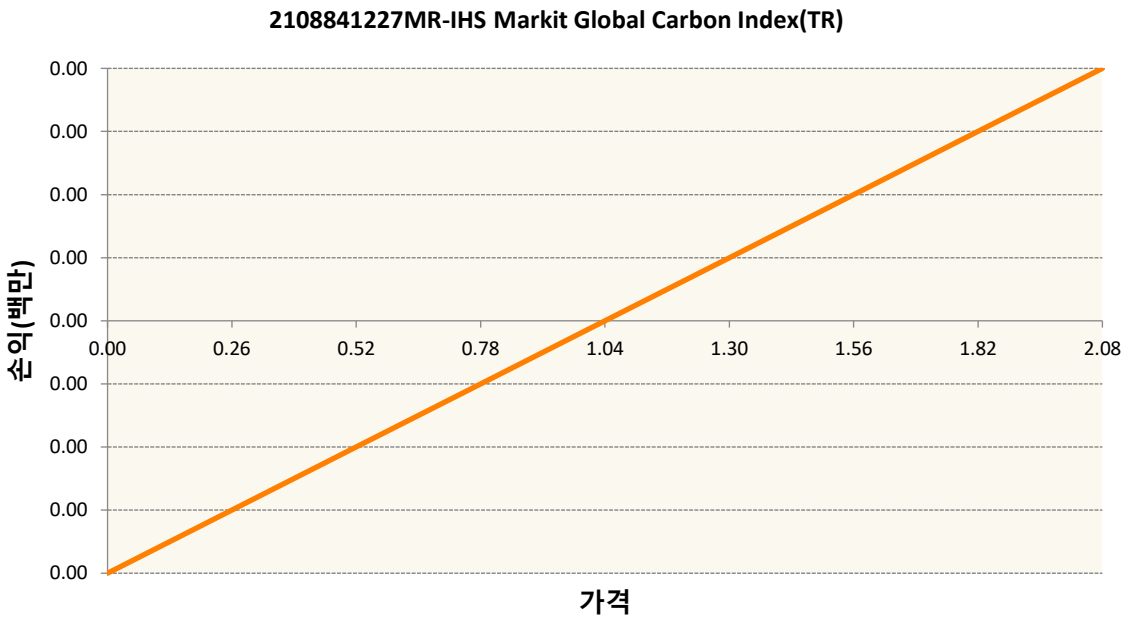
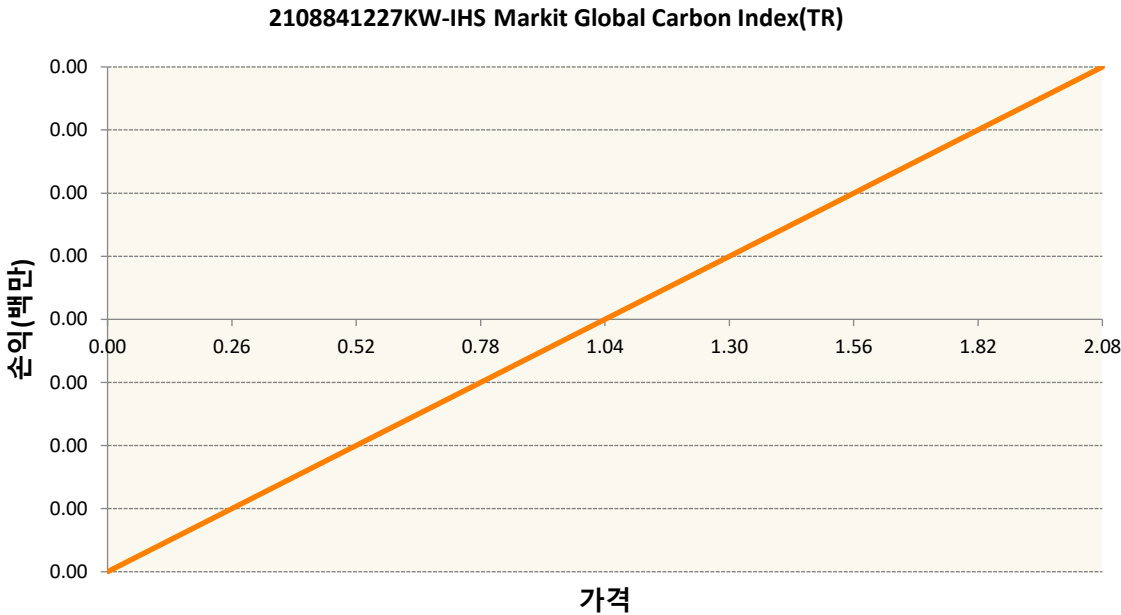
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

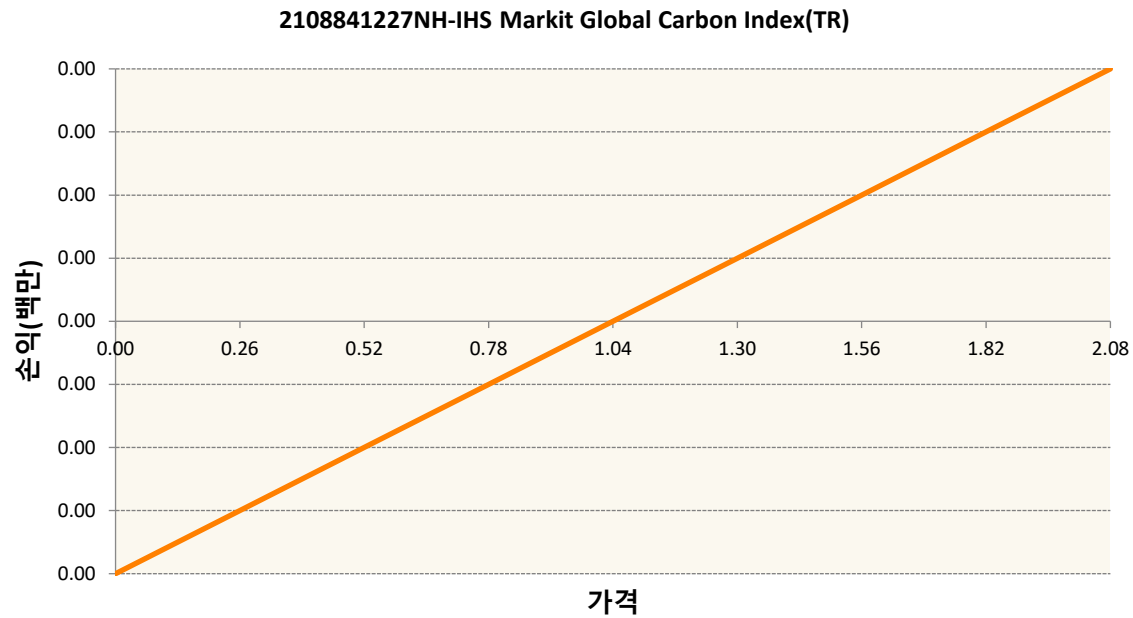
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	25,320	0	25,320	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,720
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		202
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		3,881

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

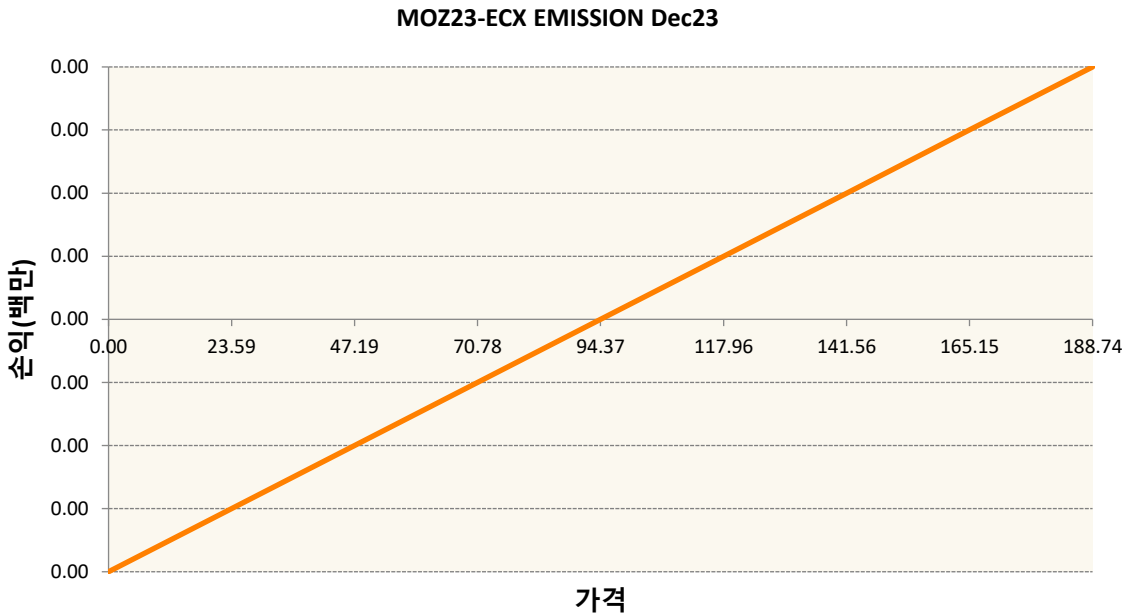
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,874	0	9,874	
누계	통화	선도	704	5,661	-4,957	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	110
FXW213D1L(KRW/EUR 24-02-23E	201
FXW213D1X(KRW/EUR 24-02-23E	66
FXW213D22(KRW/EUR 24-02-23E	77
FXW213D27(EUR/KRW 24-02-23E	56
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	790

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

(단위:백만원)

2,446

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

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)

117

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

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)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	9

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

(단위:백만원)

54

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

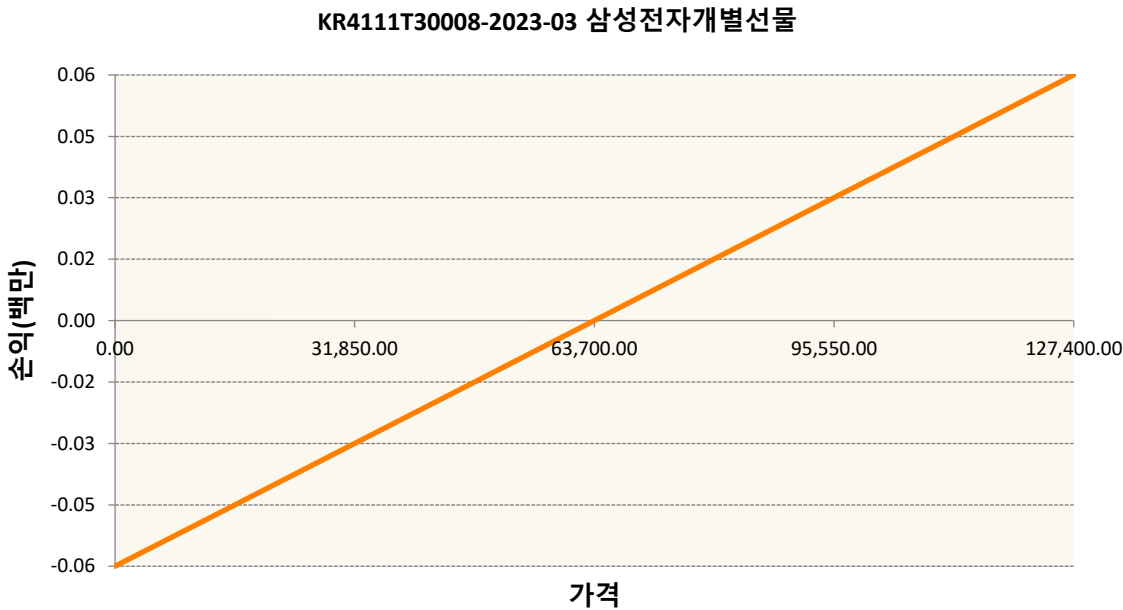
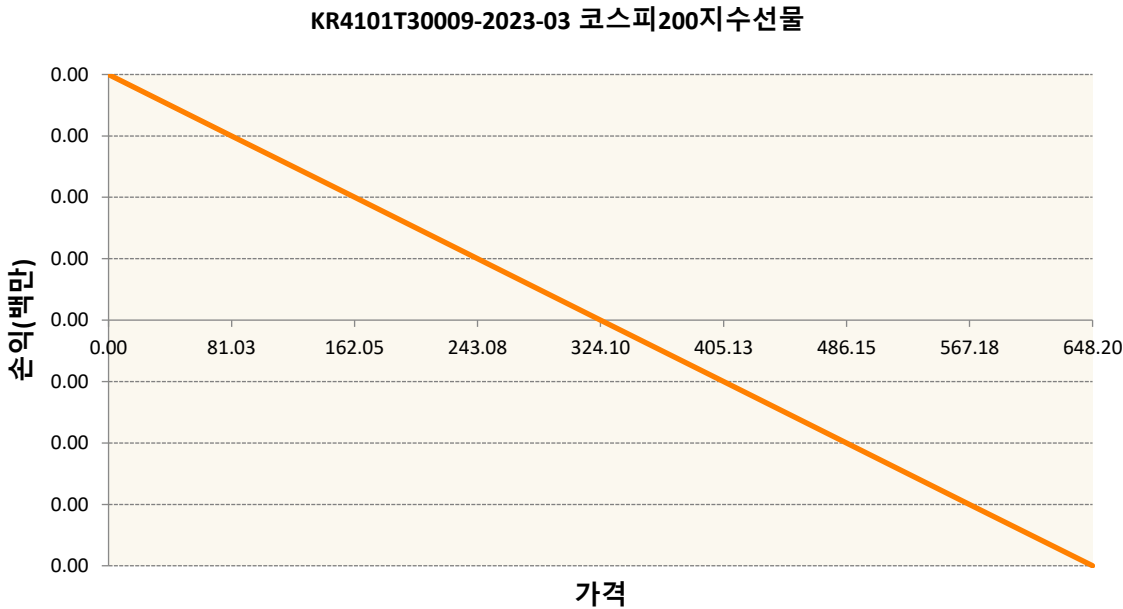
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

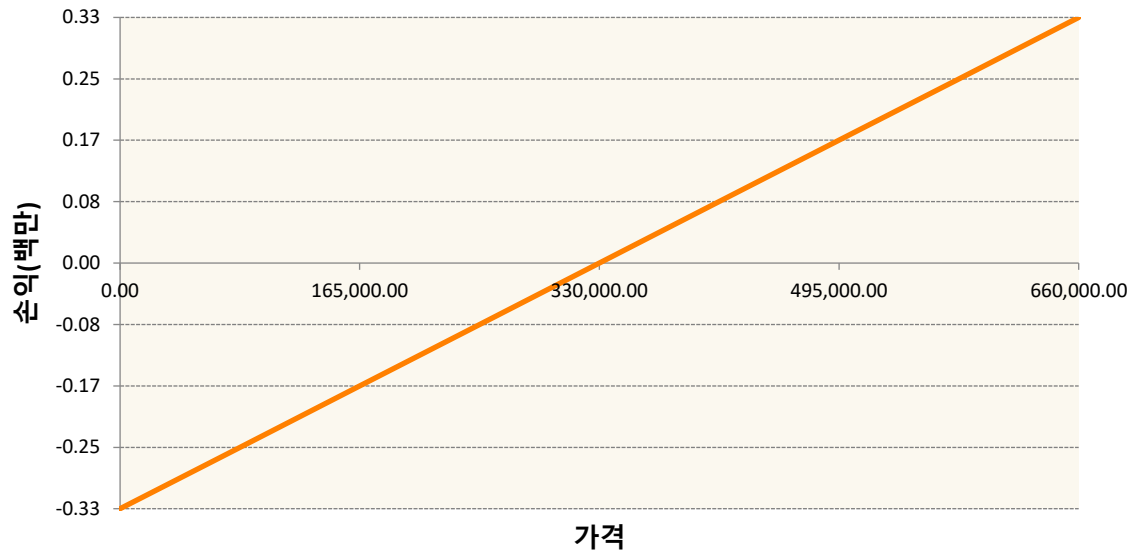
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	357	0	357	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,181	2,486	-1,305	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

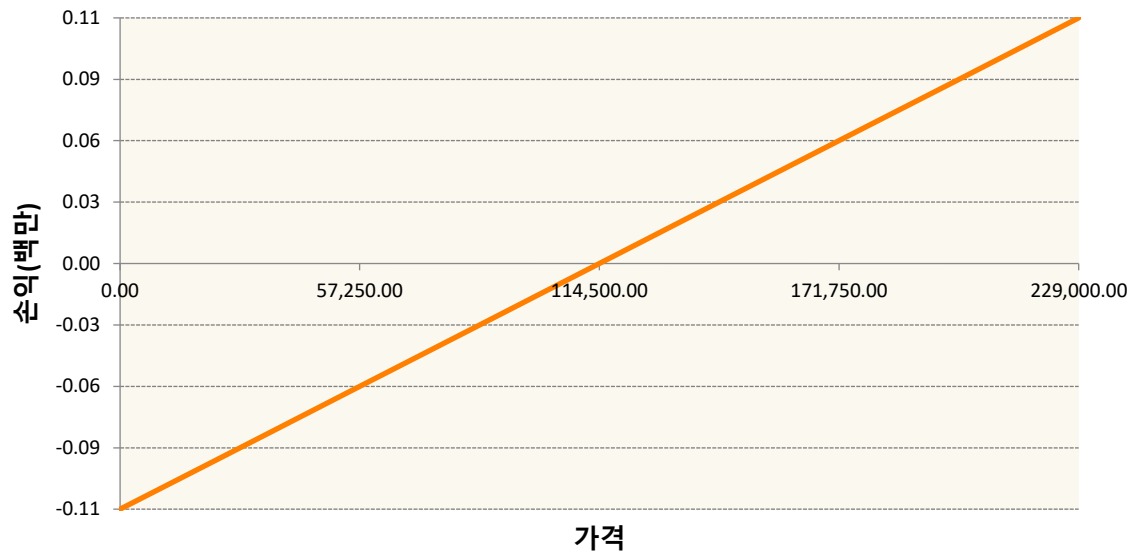
2. 만기시점의 손익구조



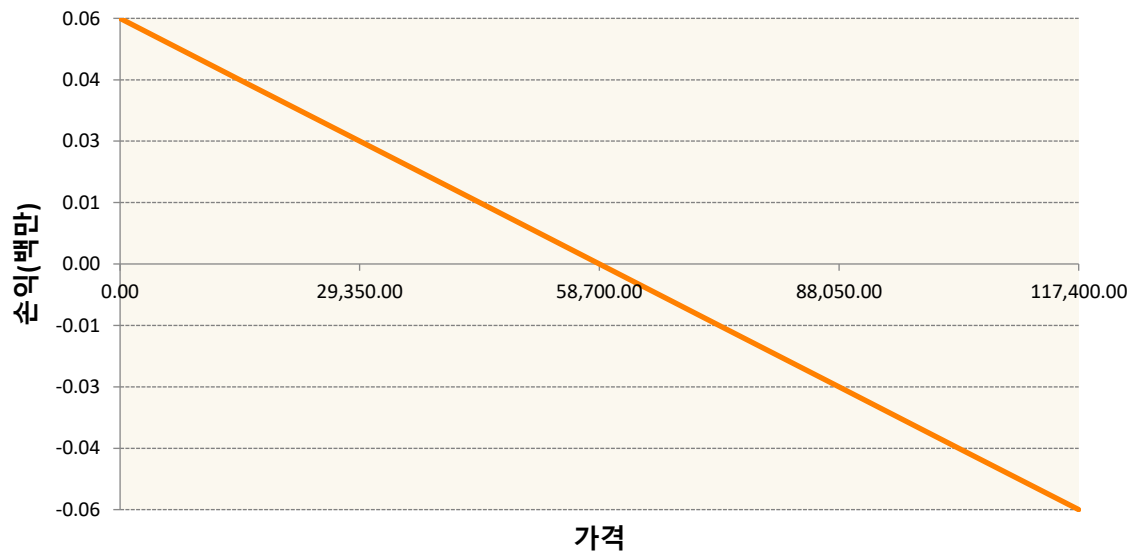
KR4113T30004-2023-03 POSCO개별선물



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		181
KR4111T300 2023-03 삼성전자개별선물		10
KR4113T300 2023-03 POSCO개별선물		48
KR4124T300 2023-03 LG전자개별선물		37
KR41F7T300 2023-03 카카오페이개별선물		17

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	445

공시일	2023-02-17
기준일	2023-02-16

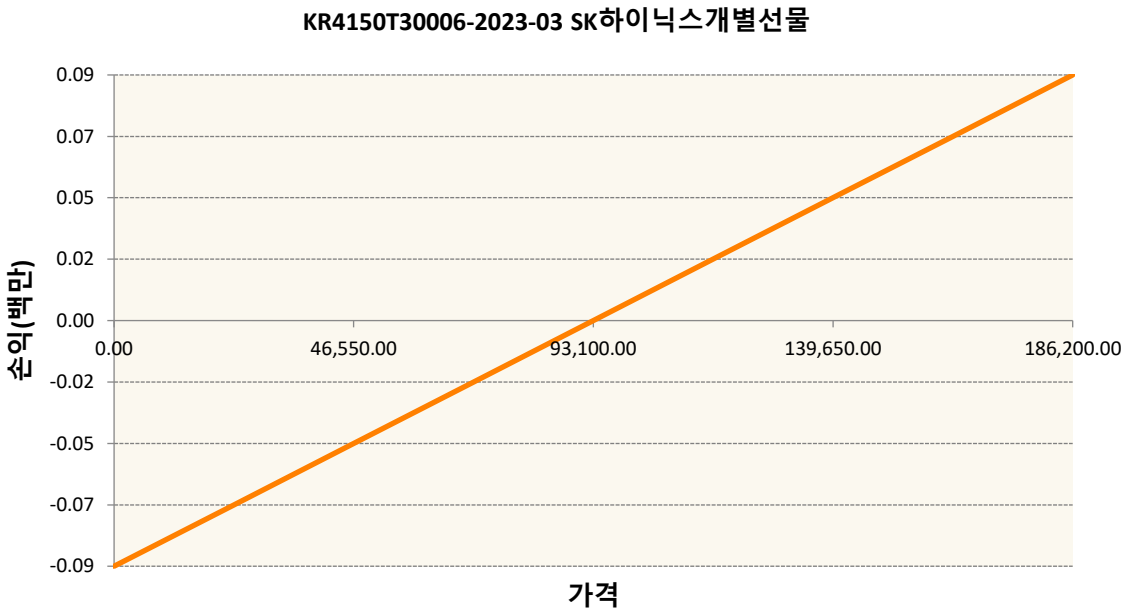
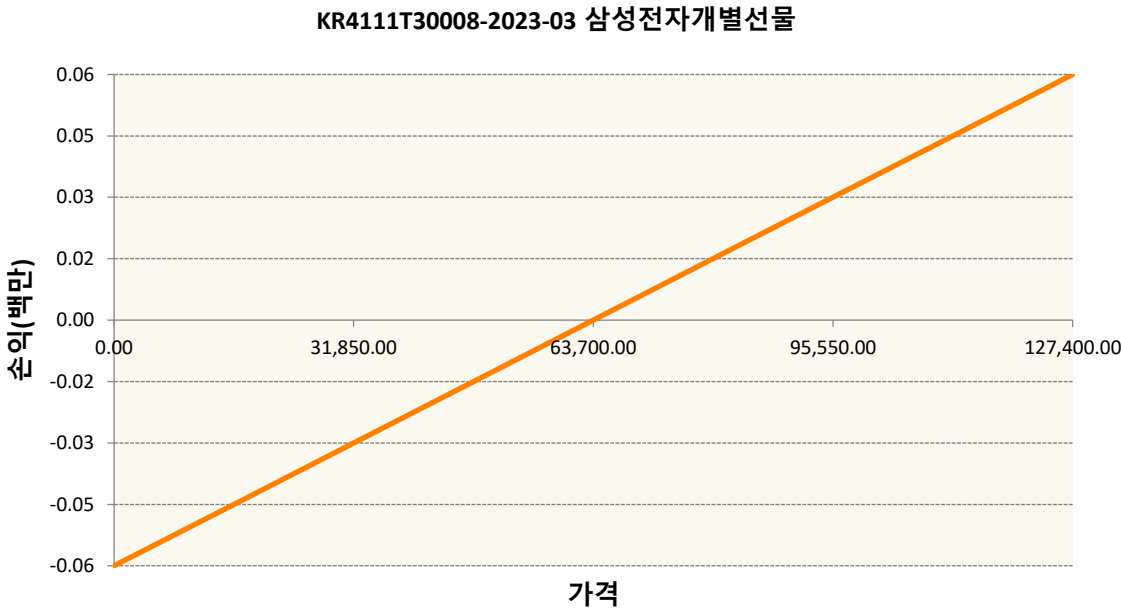
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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)

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	2023-02-17
기준일	2023-02-16

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

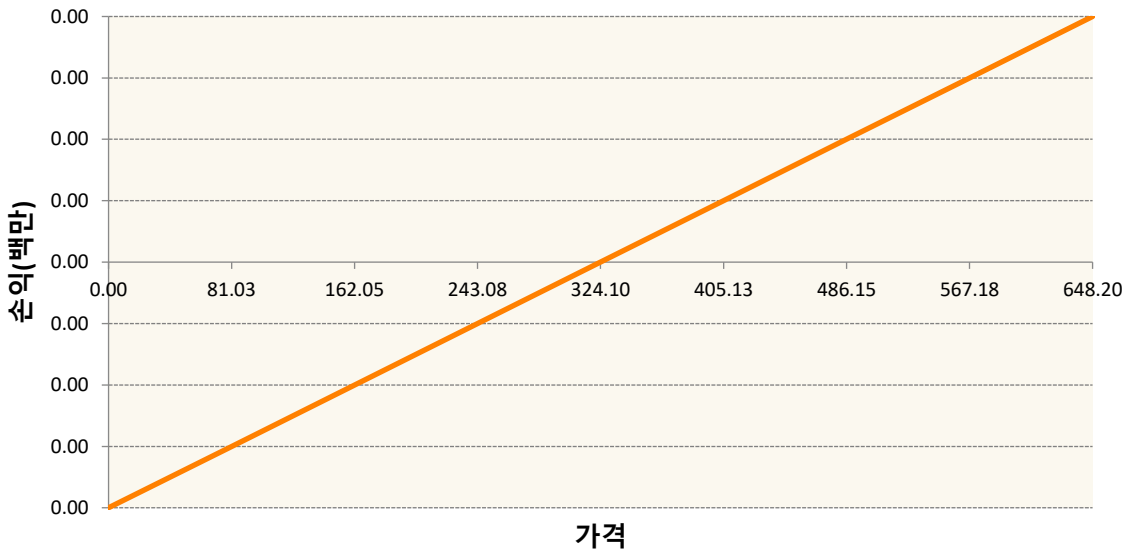
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,593	0	2,593	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T30009-2023-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					207
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-5.33%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	69	69	69	69	69	69	69
5.33%	138	138	138	138	138	138	138
8.00%	207	207	207	207	207	207	207

공시일 2023-02-17

기준일 2023-02-16

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

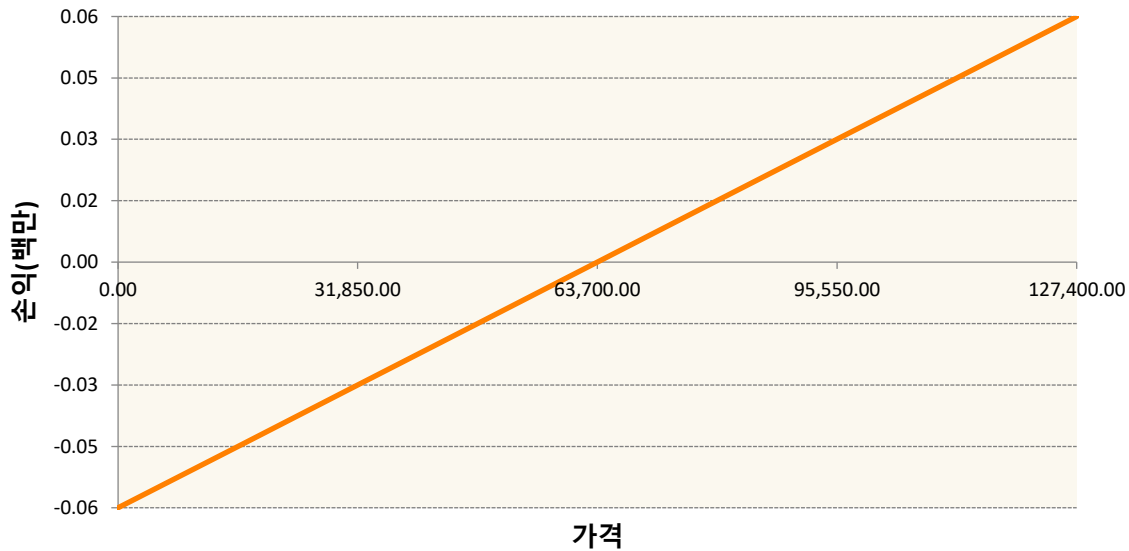
1. 계약금액

(단위:백만원)

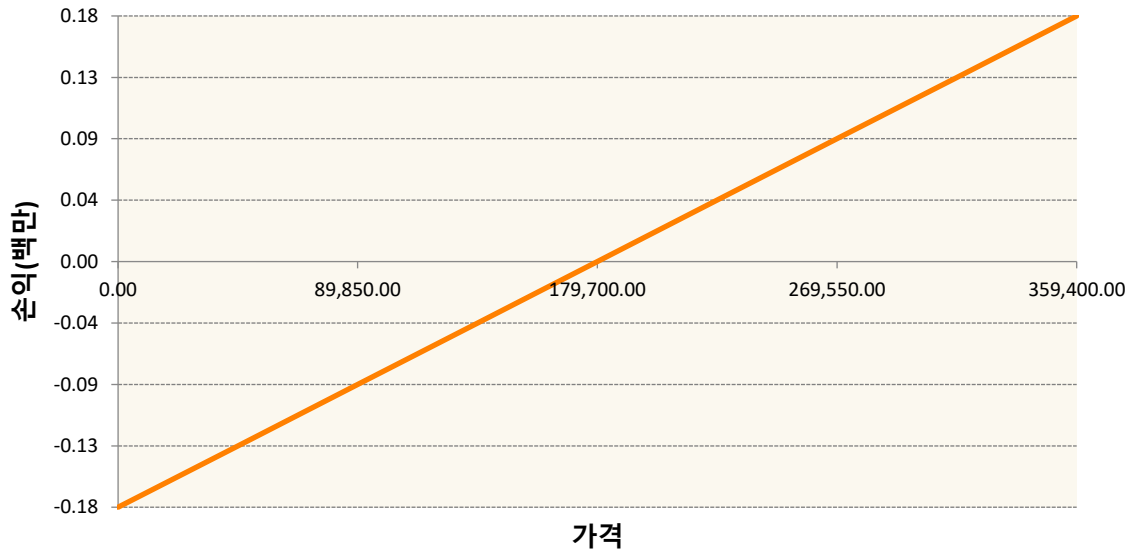
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	259	0	259	장내

2. 만기시점의 손익구조

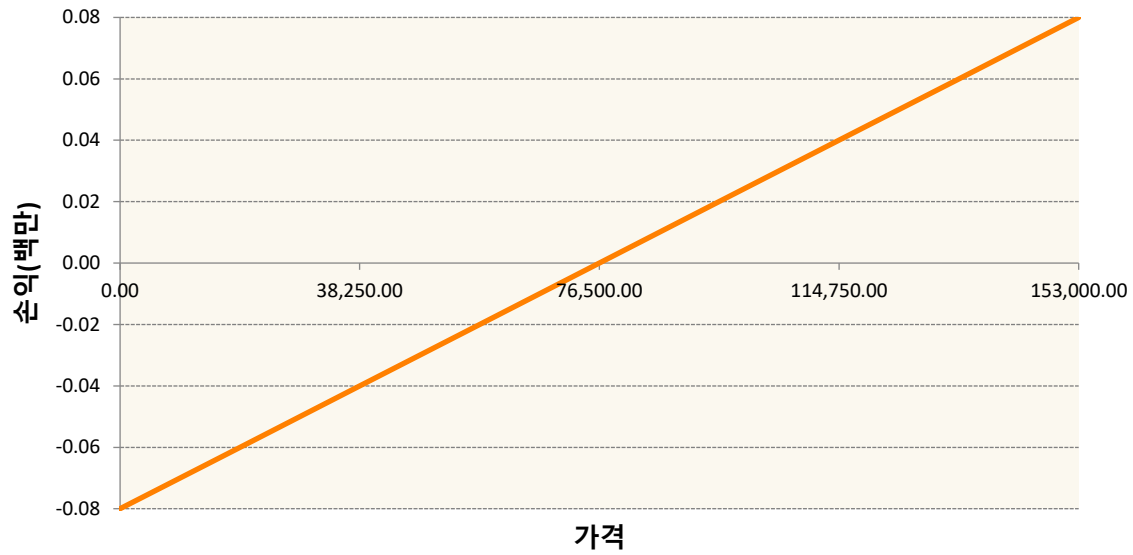
KR4111T30008-2023-03 삼성전자개별선물



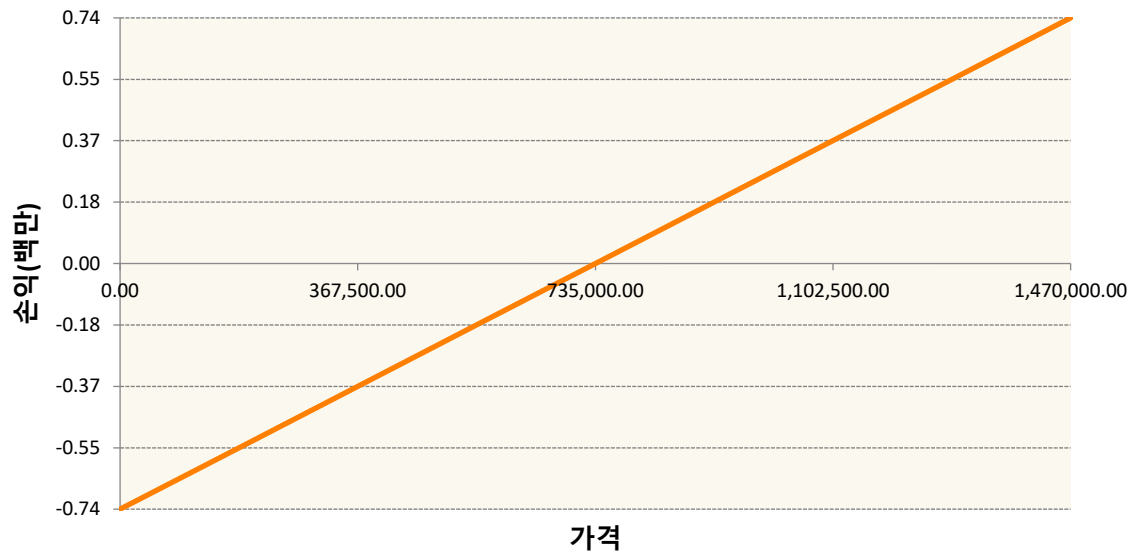
KR4116T30007-2023-03 현대차개별선물



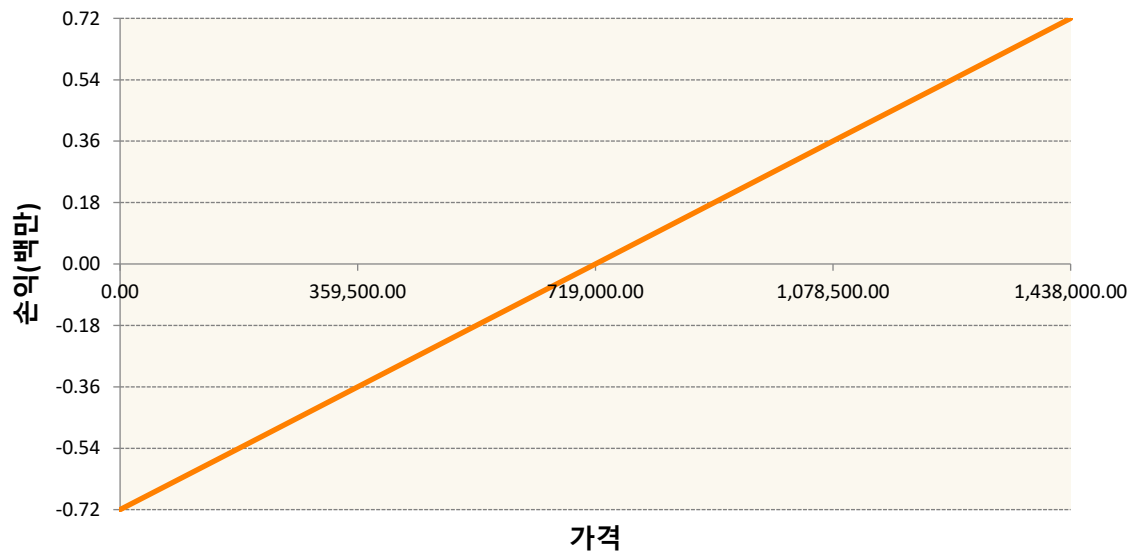
KR4119T30001-2023-03 기아개별선물



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 2023-02-17

기준일 2023-02-16

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

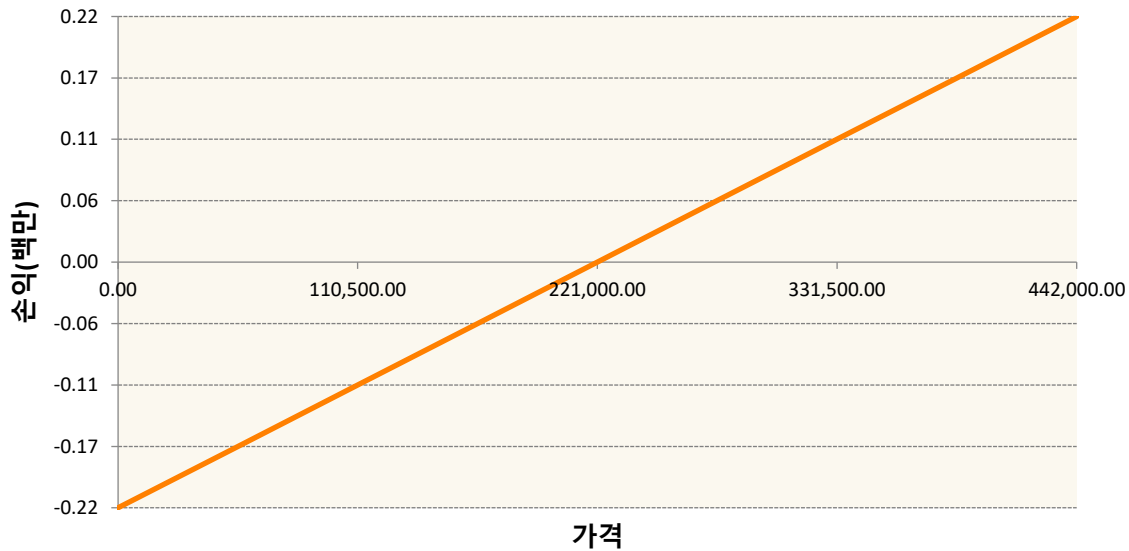
1. 계약금액

(단위:백만원)

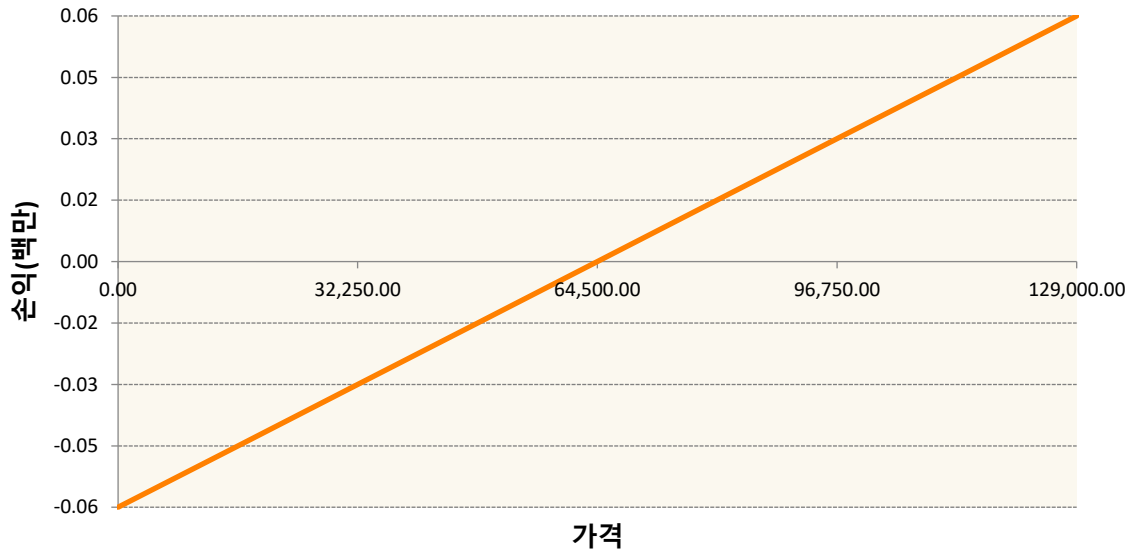
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	135	0	135	장내

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	2023-02-17
기준일	2023-02-16

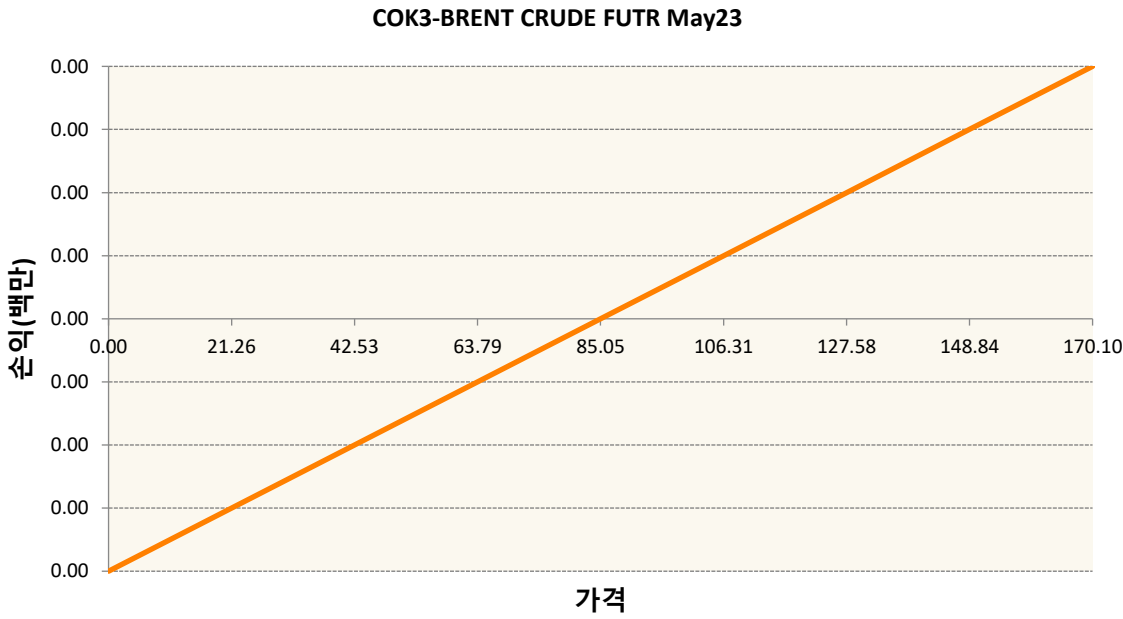
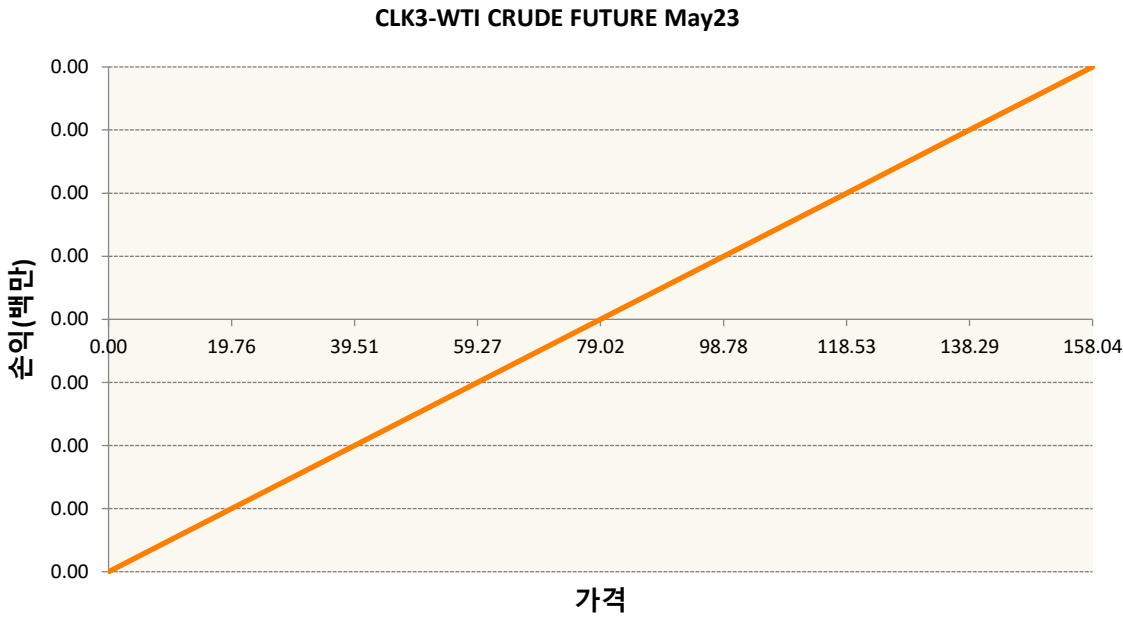
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

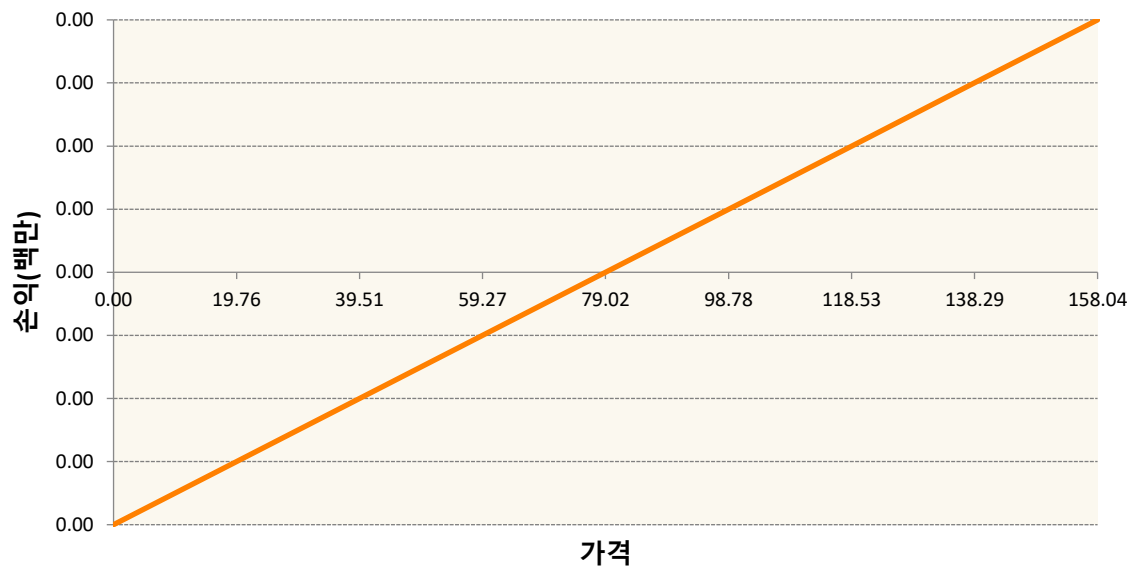
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,732	347	1,385	

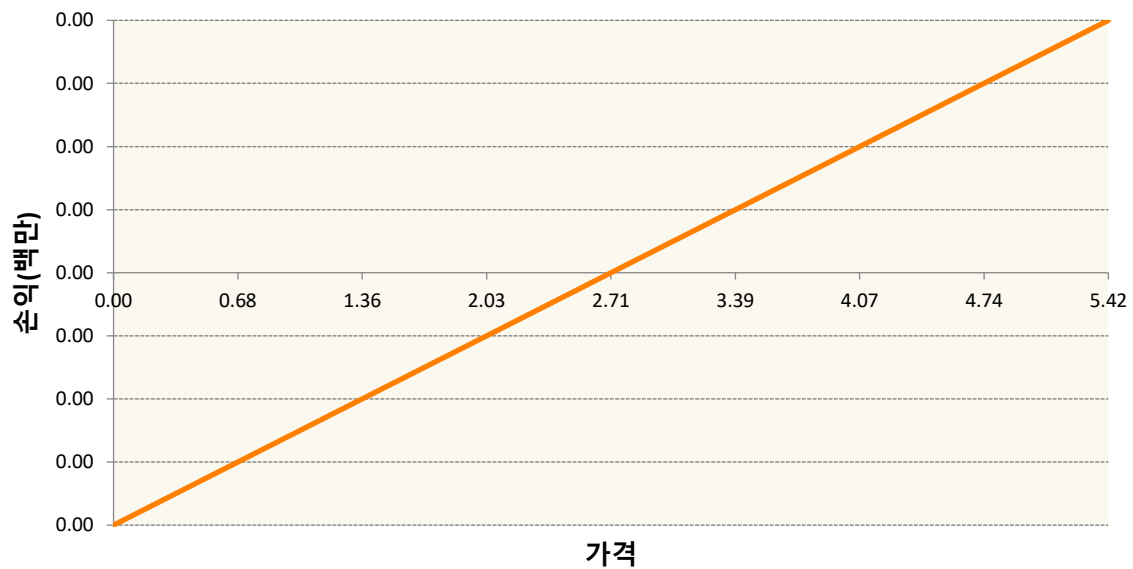
2. 만기시점의 손익구조



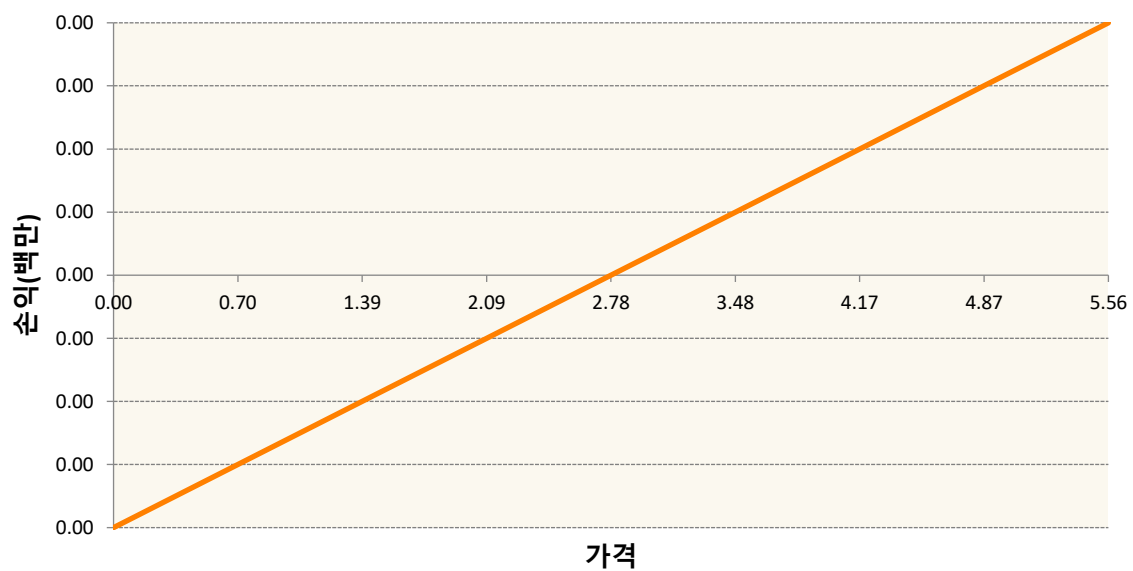
ECK3-E-mini Crude Oil May23



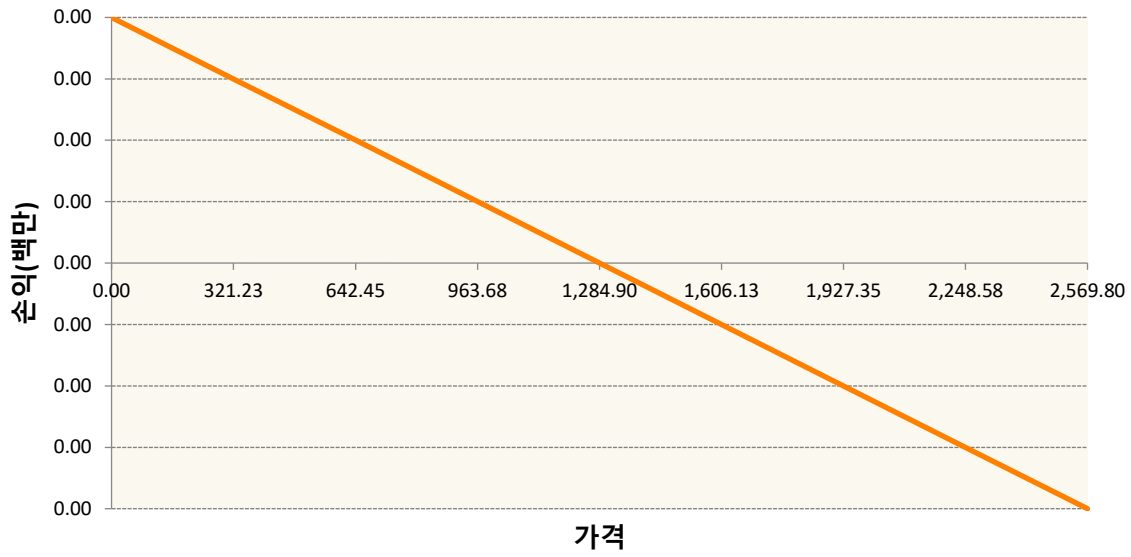
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



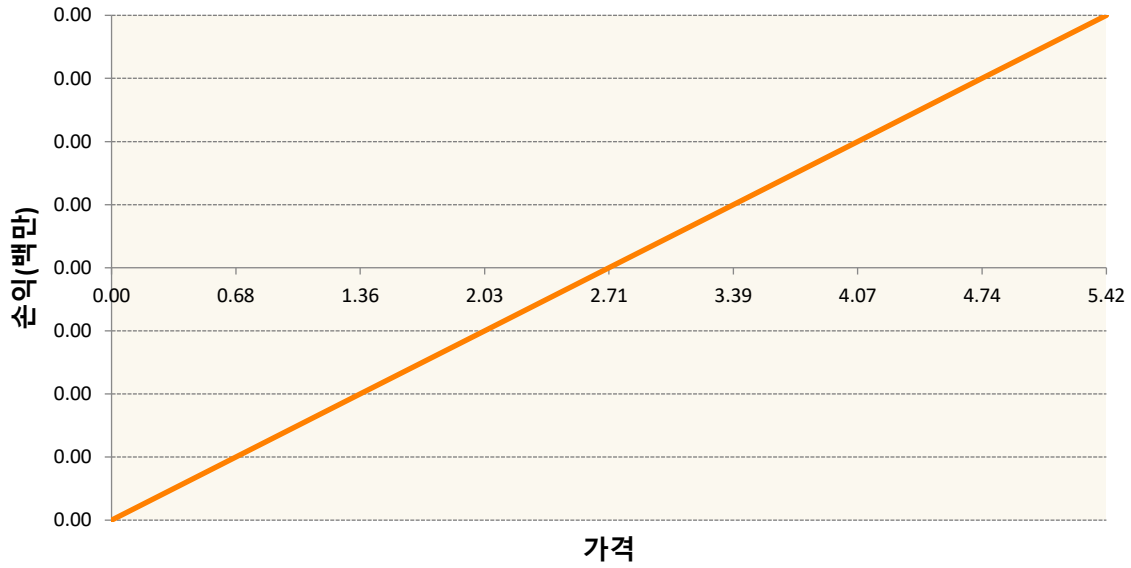
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



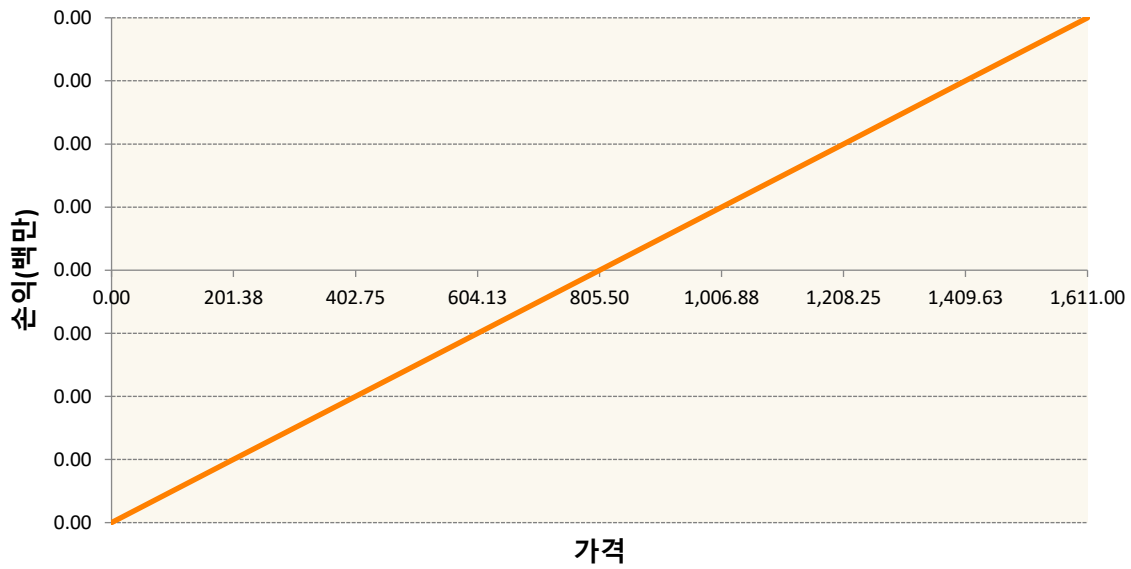
KR4175T30003-2023-03 달러선물

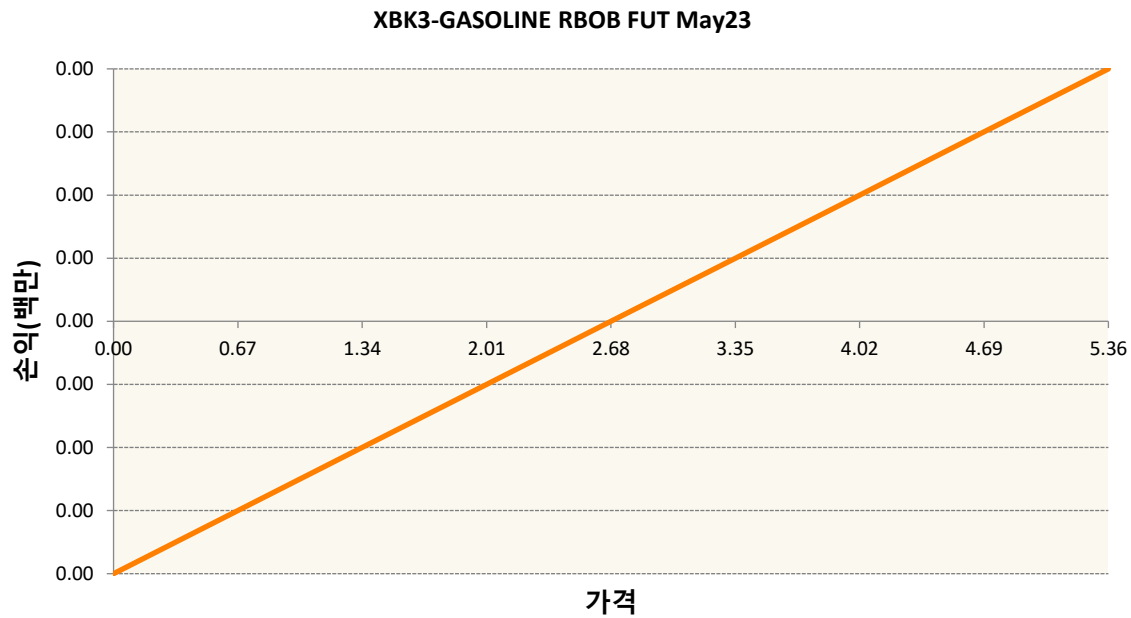


NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLK3	WTI CRUDE FUTURE May23	32
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
KR4175T300	2023-03 달러선물	28
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23	28
QSK3	Low Su Gasoil G May23	16
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	12

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