

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

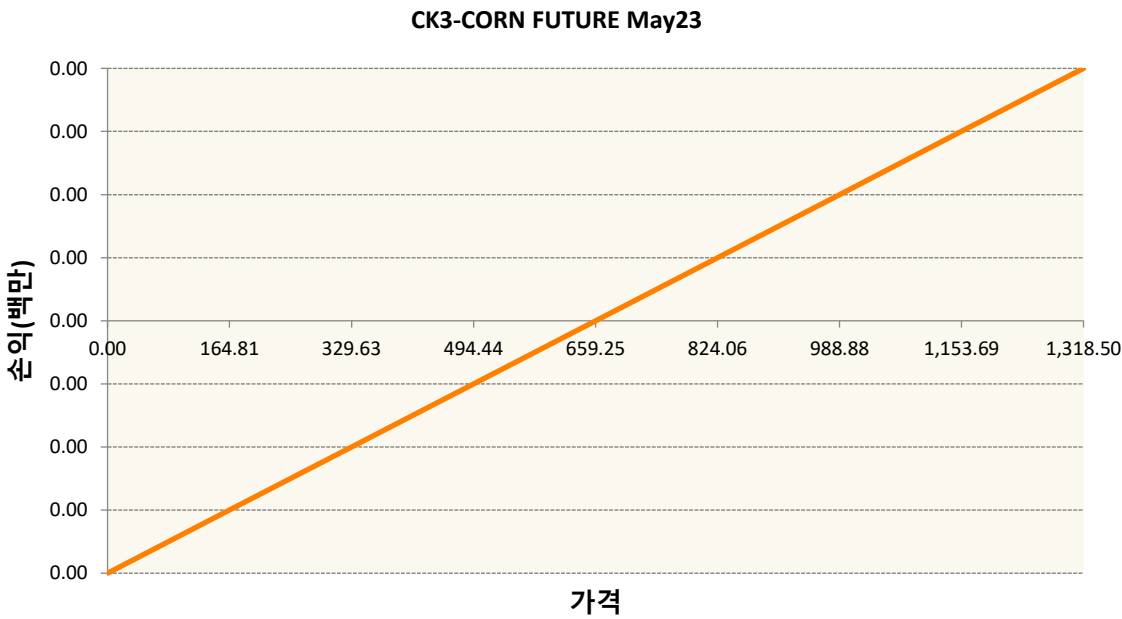
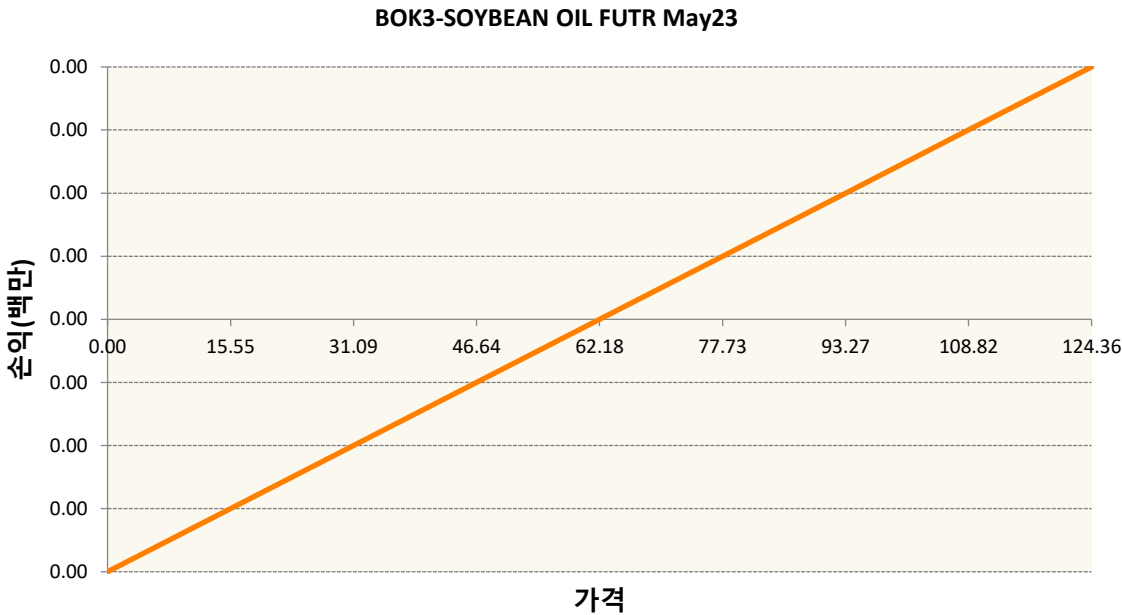
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

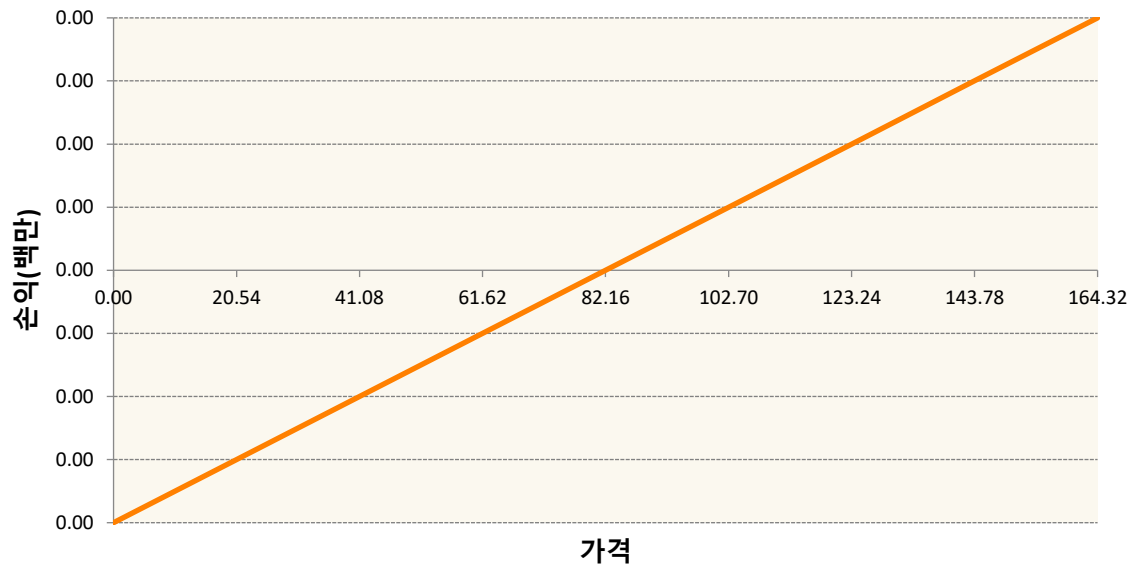
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,959	651	5,307	

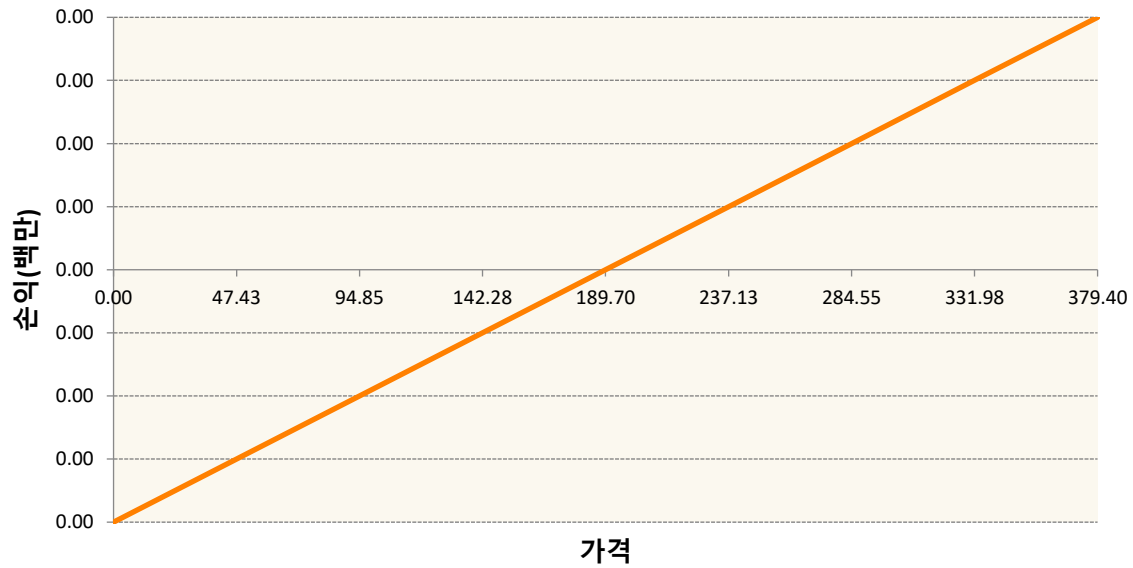
2. 만기시점의 손익구조



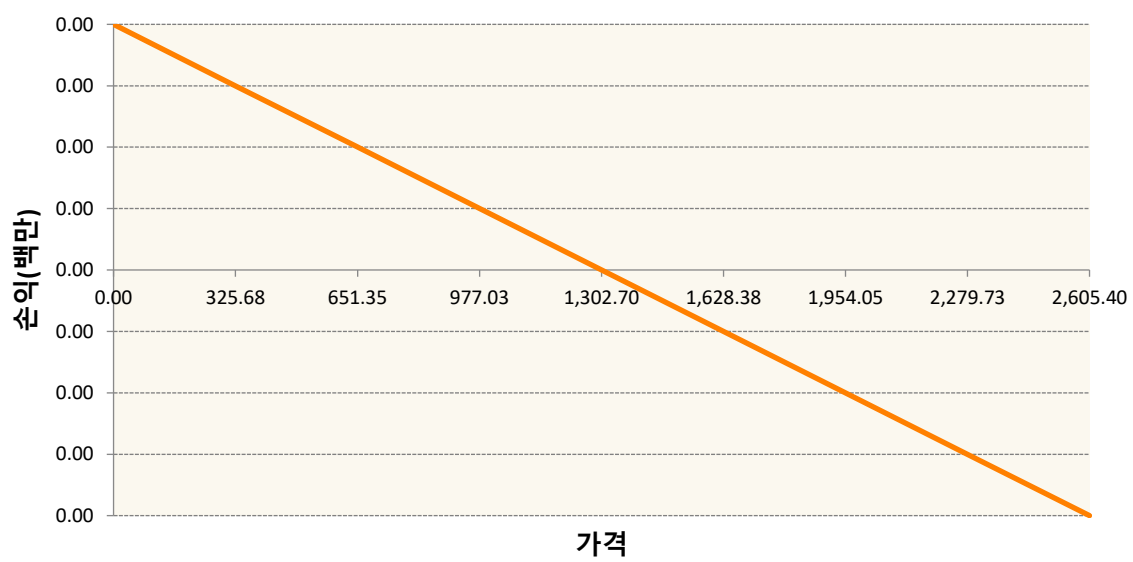
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



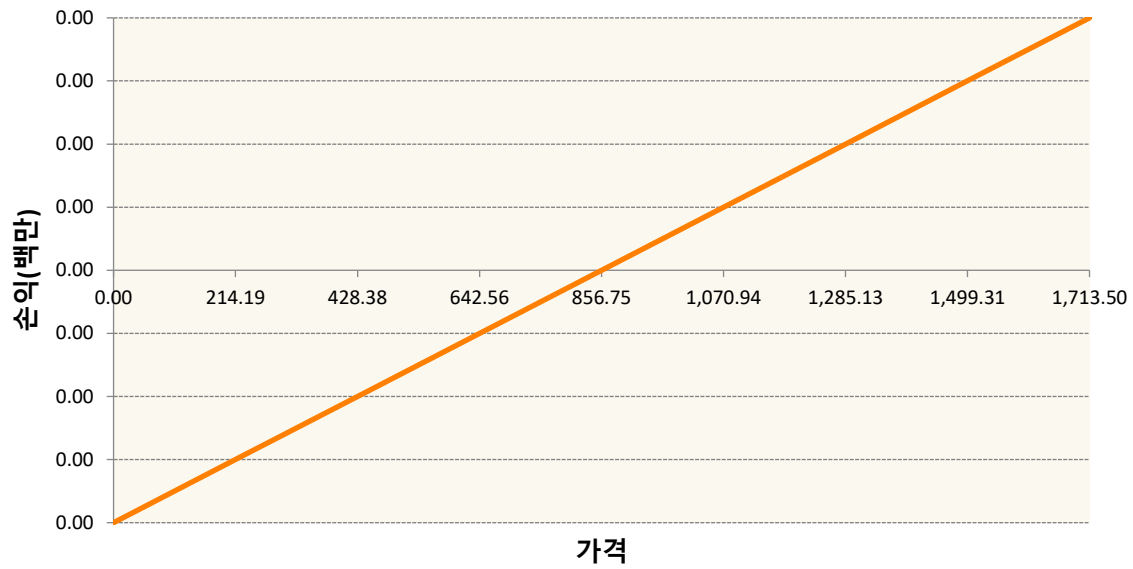
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



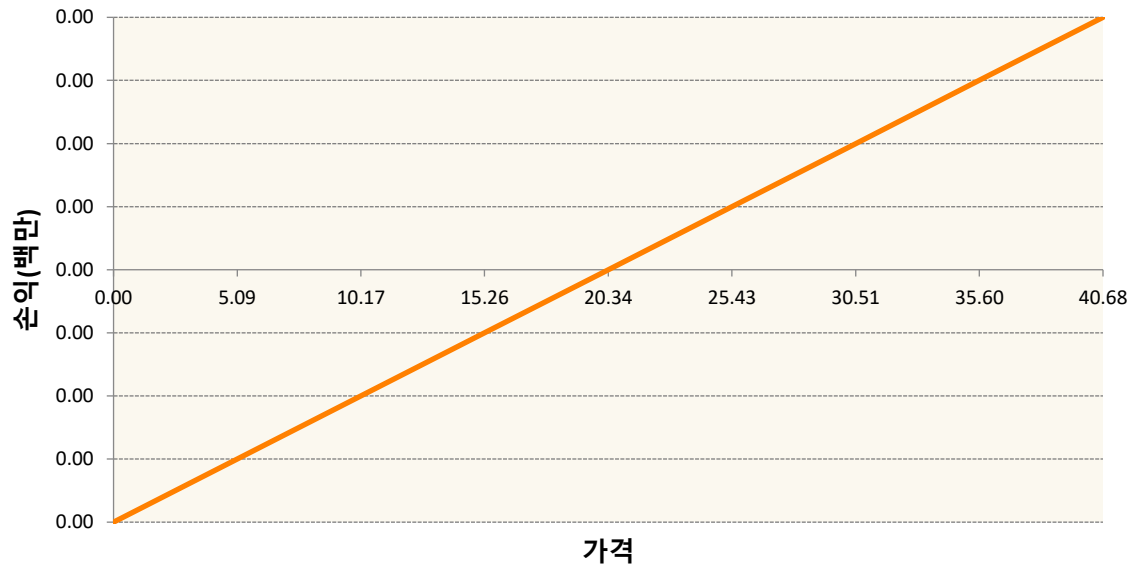
KR4175T30003-2023-03 달러선물



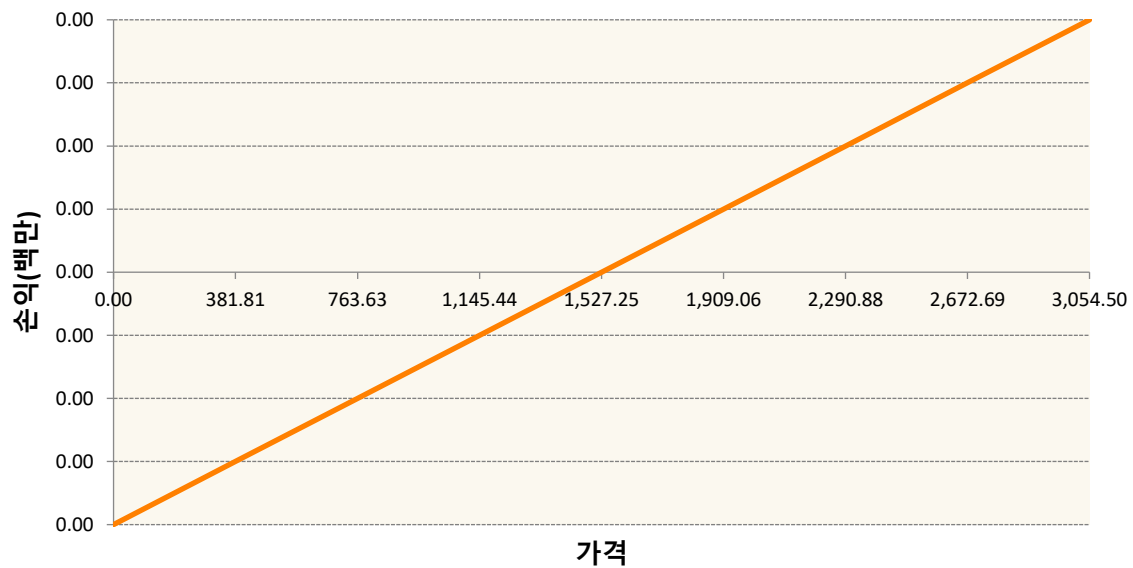
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



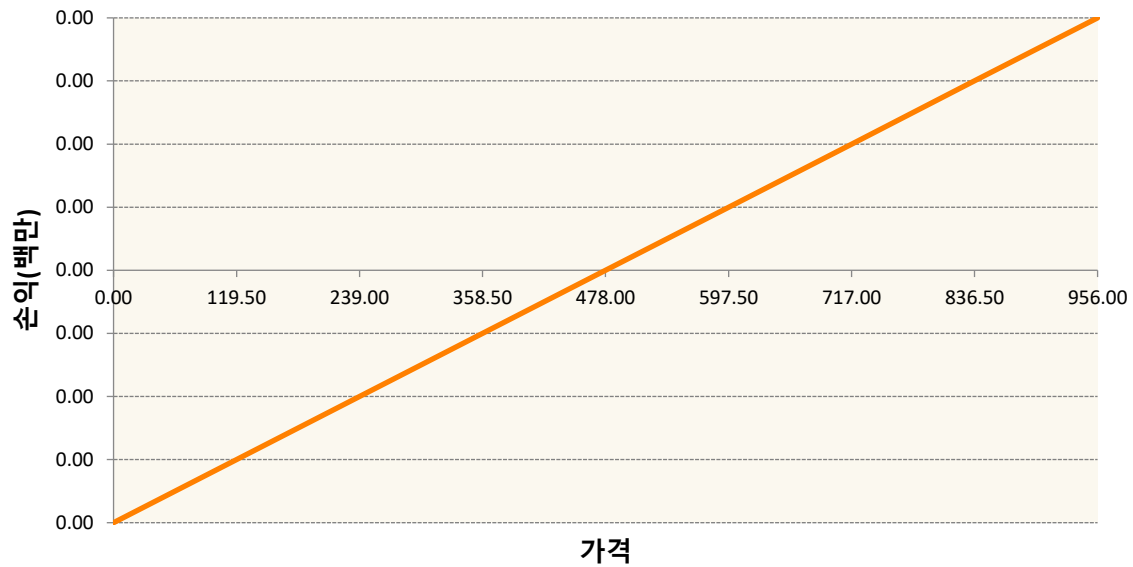
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



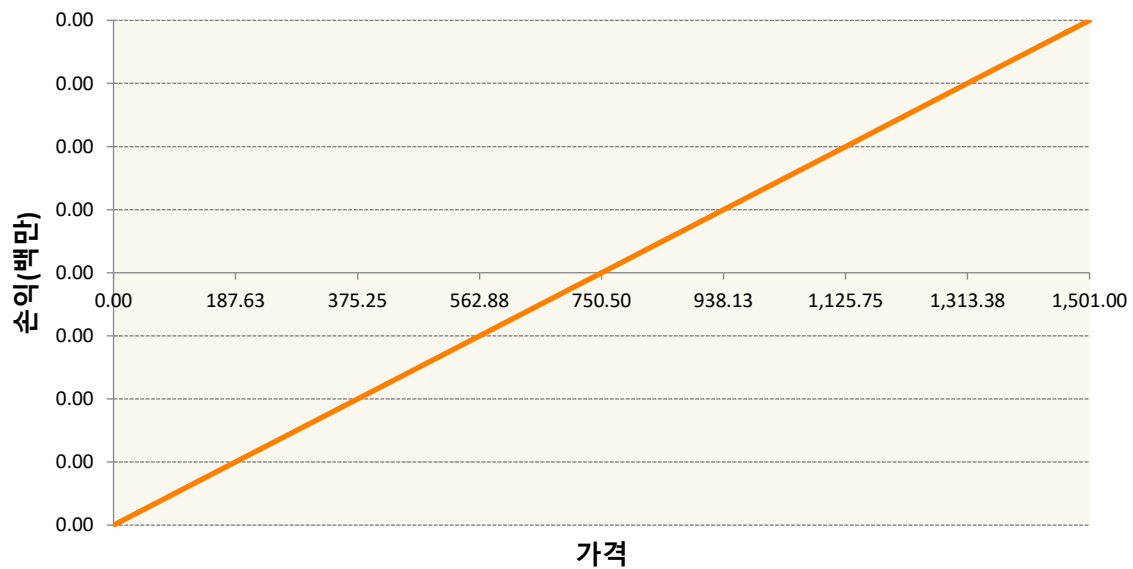
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-02-27
기준일	2023-02-24

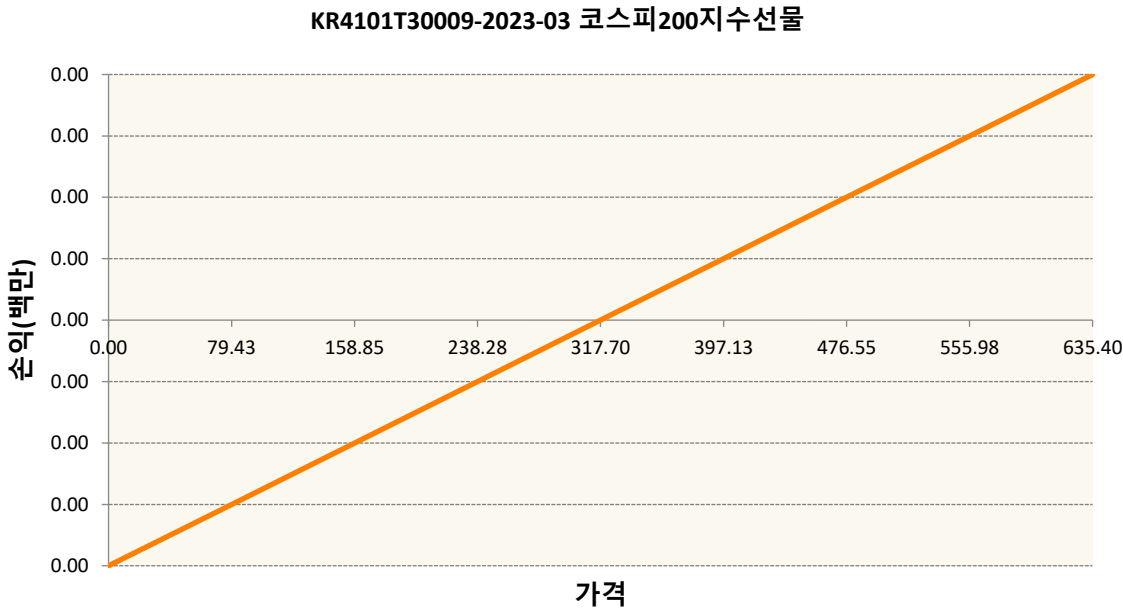
스마트인덱스모

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	2,383	0	2,383	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
-5.33%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	127	127	127	127	127	127	127
8.00%	190	190	190	190	190	190	190

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

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	367
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

509

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

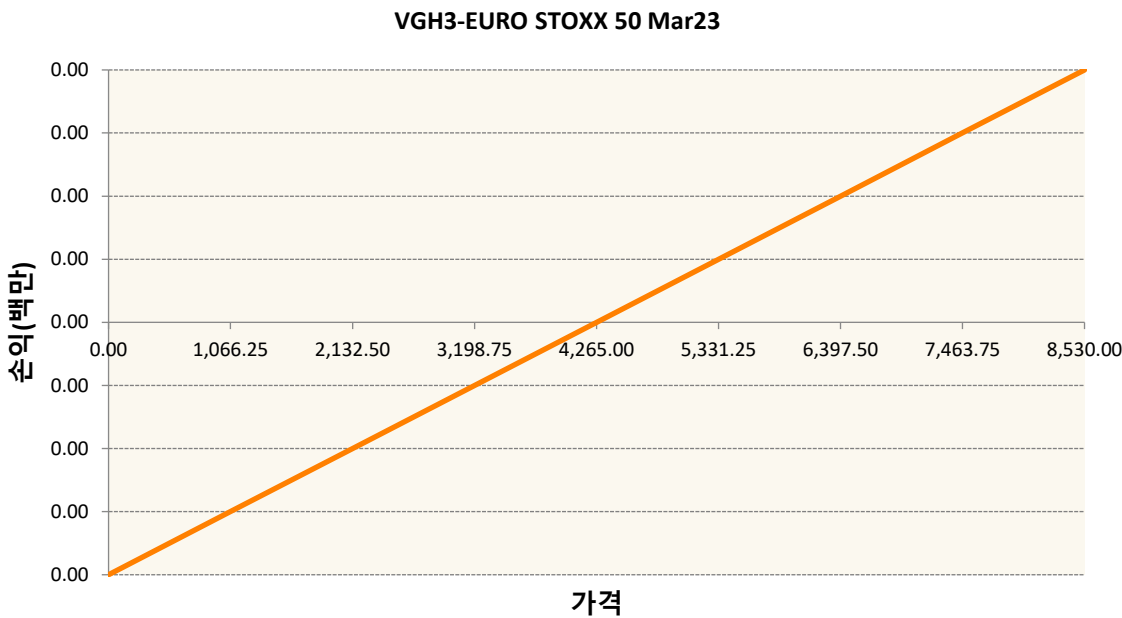
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	531	0	531	

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	2023-02-27
기준일	2023-02-24

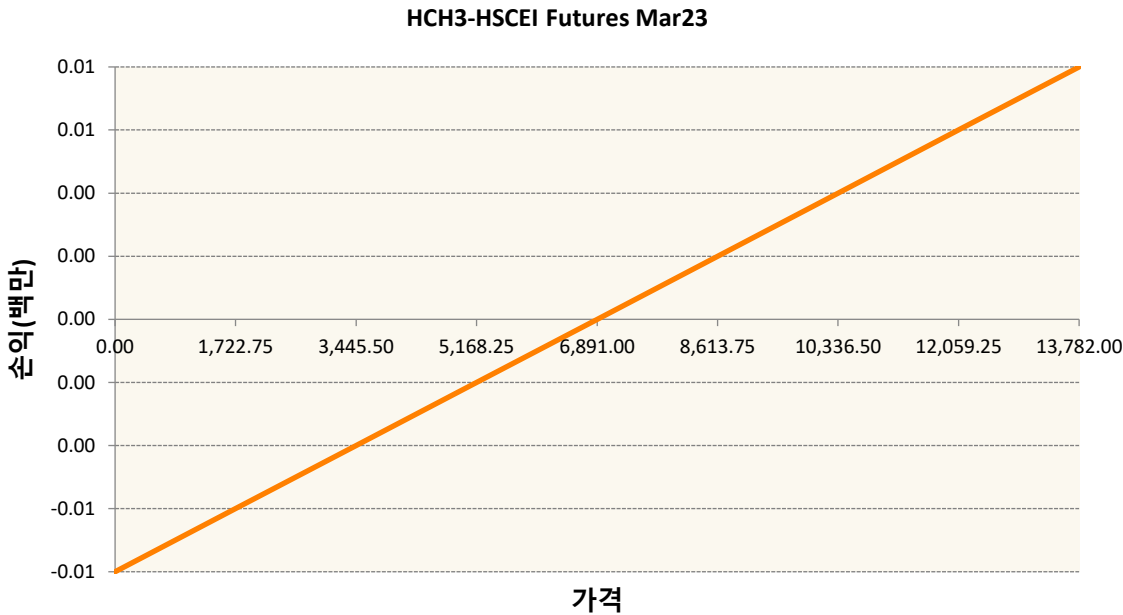
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,203	0	1,203	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH3	HSCEI Futures Mar23	96
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

129

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

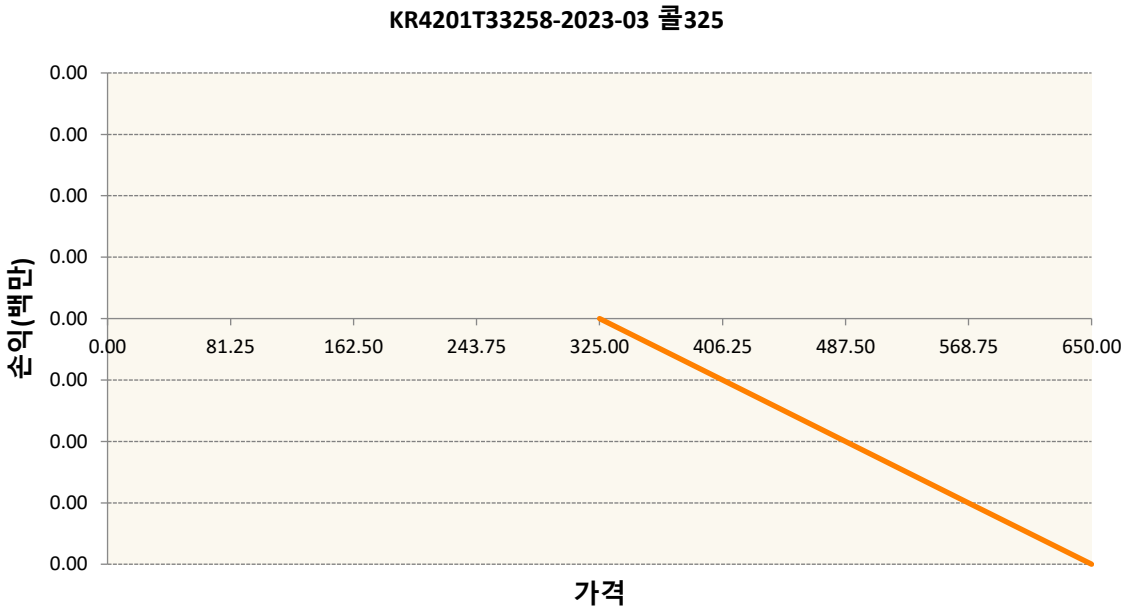
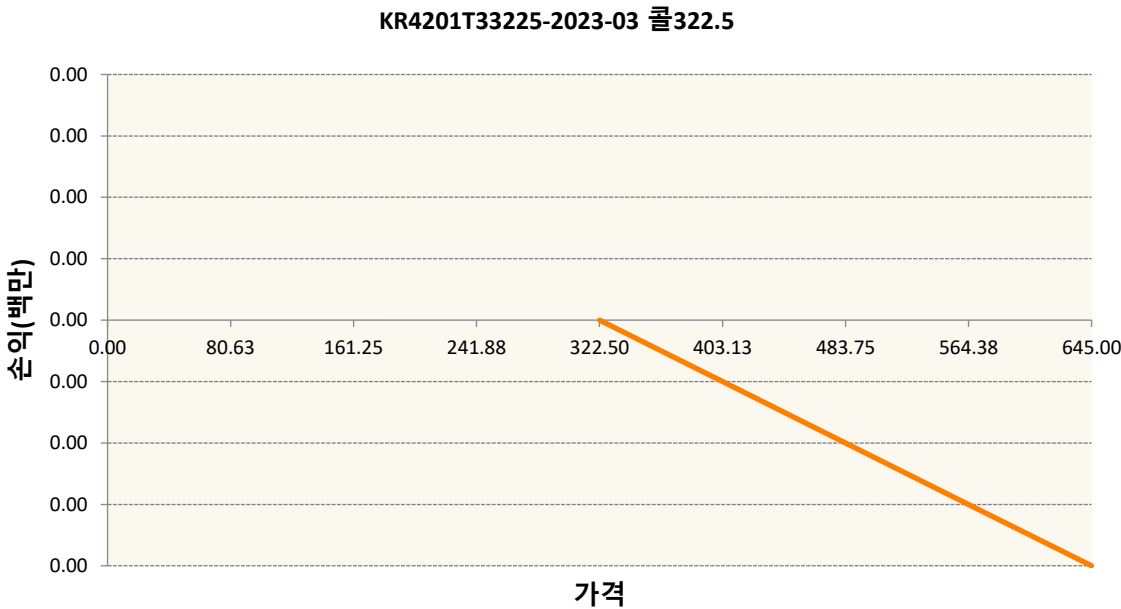
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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 0.00 to 0.00. An orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (322.50, 0.00), indicating that the profit/loss is zero at this price point.

가격	손익(백만)
0.00	0.00
322.50	0.00

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 650.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the origin (0, 0) and increases linearly to the point (325, 0.00). The area under the line is shaded light blue.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
81.25	0.00
162.50	0.00
243.75	0.00
325.00	0.00
406.25	0.00
487.50	0.00
568.75	0.00
650.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201T33225							2023-03 콜322.5		90	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	43	41	39	37	34	31	28			
-5.33%	38	35	32	29	25	21	17			
-2.67%	29	25	21	17	12	8	3			
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15			
2.67%	-6	-11	-16	-21	-26	-31	-36			
5.33%	-33	-38	-42	-47	-52	-57	-61			
8.00%	-65	-69	-73	-77	-81	-86	-90			
KR4201T33258							2023-03 콜325		2,431	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,097	1,051	995	931	859	780	696
-5.33%	981	905	821	729	633	531	425
-2.67%	761	654	541	425	306	185	61
0%	399	267	134	0	-135	-270	-406
2.67%	-133	-274	-415	-556	-697	-838	-979
5.33%	-838	-971	-1,106	-1,242	-1,380	-1,517	-1,656
8.00%	-1,697	-1,810	-1,927	-2,049	-2,174	-2,301	-2,431

KR4301T33223

2023-03 풋322.5

40

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-33	-34	-35	-36	-37	-38	-40
-5.33%	-18	-20	-21	-22	-24	-25	-27
-2.67%	-5	-7	-9	-10	-12	-14	-16
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	14	12	10	8	6	4	2
5.33%	20	19	17	15	13	11	9
8.00%	25	23	21	20	18	16	15

KR4301T33256

2023-03 풋325

591

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-508	-517	-529	-542	-557	-573	-591
-5.33%	-287	-302	-320	-339	-359	-380	-402
-2.67%	-87	-109	-133	-157	-182	-207	-232
0%	83	55	28	0	-28	-56	-84
2.67%	217	188	159	130	101	71	42
5.33%	316	289	261	233	204	176	147
8.00%	383	360	336	310	284	258	231

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

(단위:백만원)

2,731

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

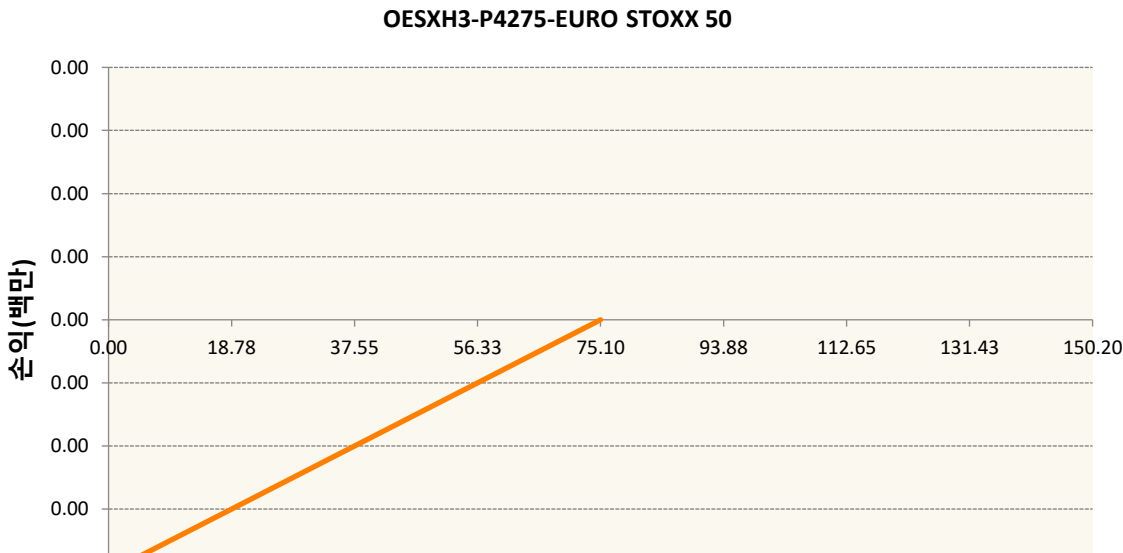
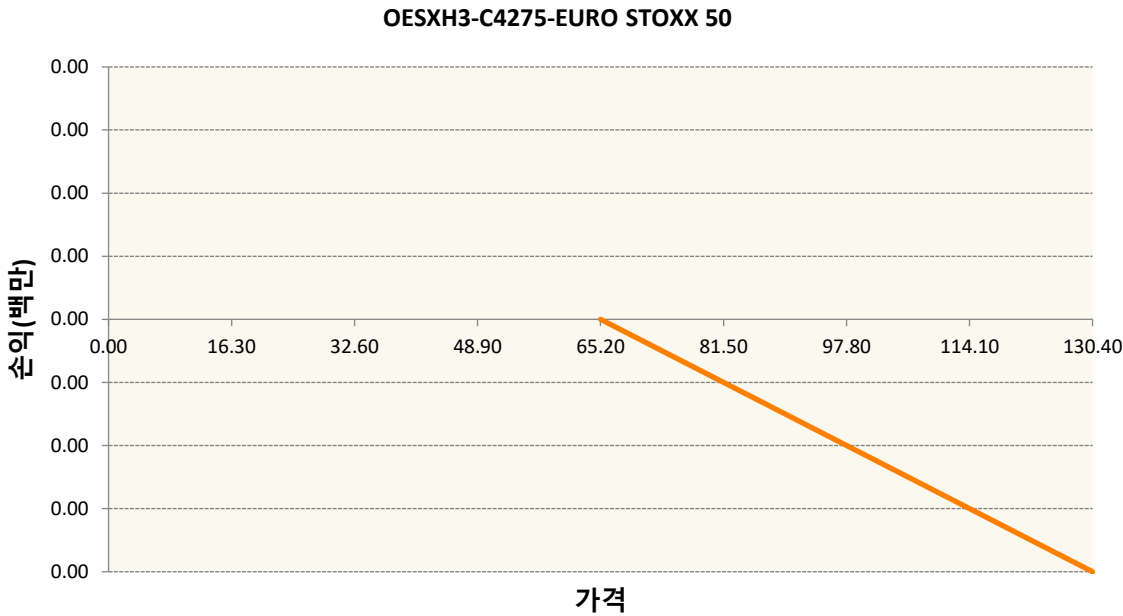
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

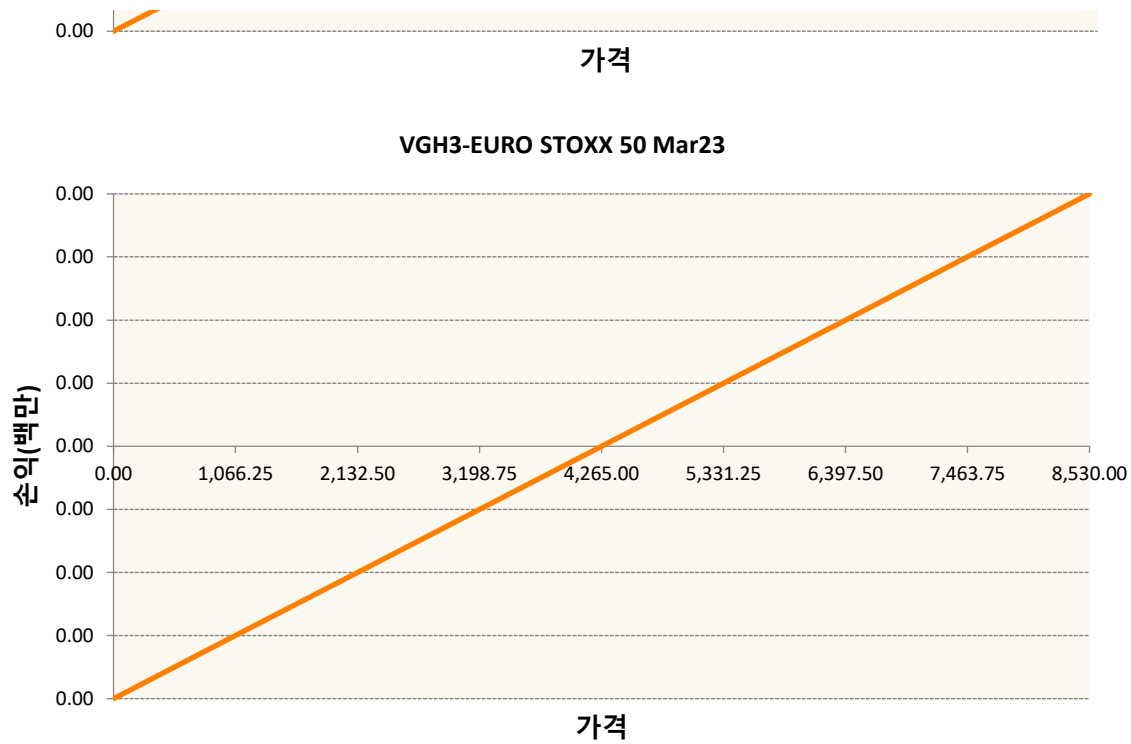
1. 계약금액

(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	1,007	0	1,007	
누계	유가증권	옵션	0	65	-65	장내
누계	통화	선도	0	1,798	-1,798	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213CCM KRW/EUR 24-03-23E		55
FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E		44
FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E		44
OESXH3-C42 EURO STOXX 50		2
OESXH3-P42 EURO STOXX 50		3
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23		81

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	200

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

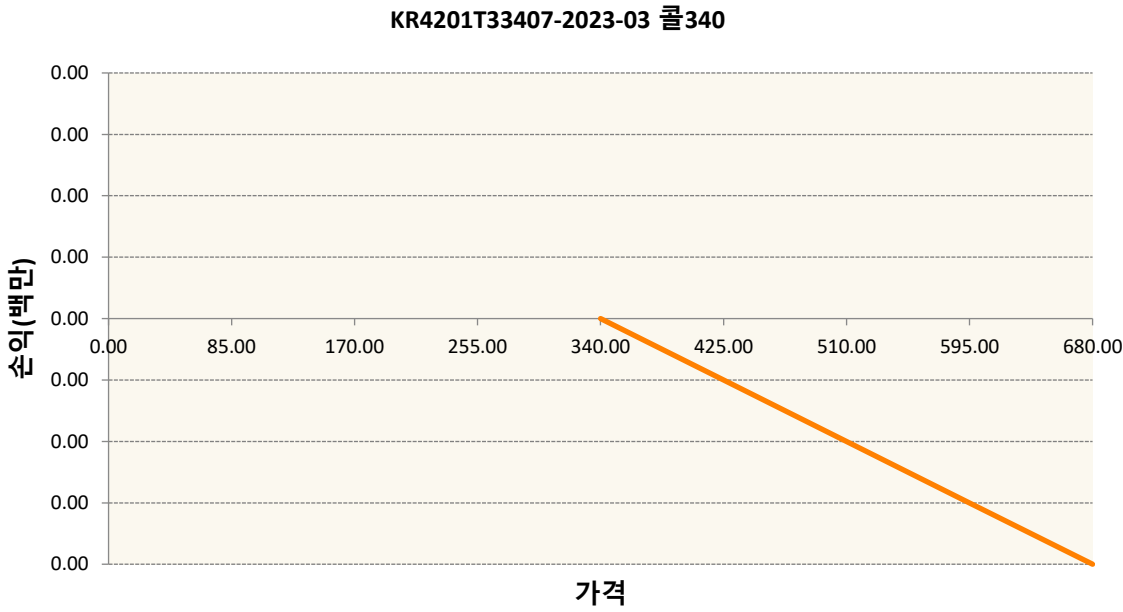
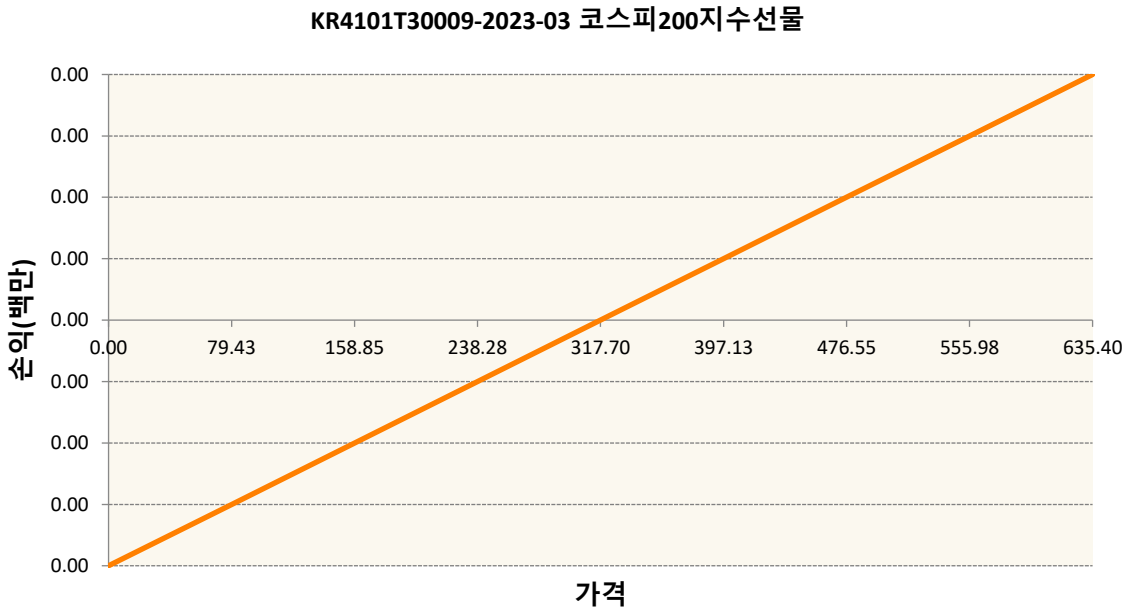
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

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	397	0	397	장내
누계	유가증권	옵션	163	4,009	-3,846	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 685.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the point (342.50, 0.00) and ends at the point (685.00, -0.00), indicating a negative slope.

가격	손익(백만)
342.50	0.00
685.00	-0.00

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
325.00	0.00

(단위:백만원)

KR4101T30009				2023-03 코스피200지수선물				32
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	11	11	11	11	11	11	11	
5.33%	21	21	21	21	21	21	21	
8.00%	32	32	32	32	32	32	32	
KR4201T33407							2023-03 콜340	82
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	24	23	21	20	17	15
-5.33%	23	22	20	17	15	12	8
-2.67%	20	17	14	11	7	3	-2
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	1	-4	-10	-15	-21	-27	-33
5.33%	-17	-23	-29	-36	-42	-49	-55
8.00%	-42	-49	-55	-62	-69	-75	-82

KR4201T33423

2023-03 콜342.5

68

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	18	18	17	15	14	12
-5.33%	18	17	15	14	11	9	6
-2.67%	16	14	11	8	5	2	-2
0%	11	7	4	0	-4	-8	-13
2.67%	2	-3	-7	-12	-17	-22	-27
5.33%	-12	-18	-23	-29	-35	-40	-46
8.00%	-33	-39	-45	-51	-56	-62	-68

KR4301T33256

2023-03 풋325

10

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

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

(단위:백만원)

151

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

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	6,882	0	6,882	

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	2023-02-27
기준일	2023-02-24

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	5,612	0	5,612	

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	2023-02-27
기준일	2023-02-24

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	19,500	0	19,500	
누계	통화	선도	196	28,921	-28,725	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213CBQ KRW/USD 28-02-23E		667
FXW213CCS(KRW/USD 28-03-23E		553
FXW213D1S(KRW/USD 28-04-23E		312
FXW213D1T(KRW/USD 28-02-23E		78
FXW213D2F(USD/KRW 28-02-23E		16
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		704

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

(단위:백만원)

1,307

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

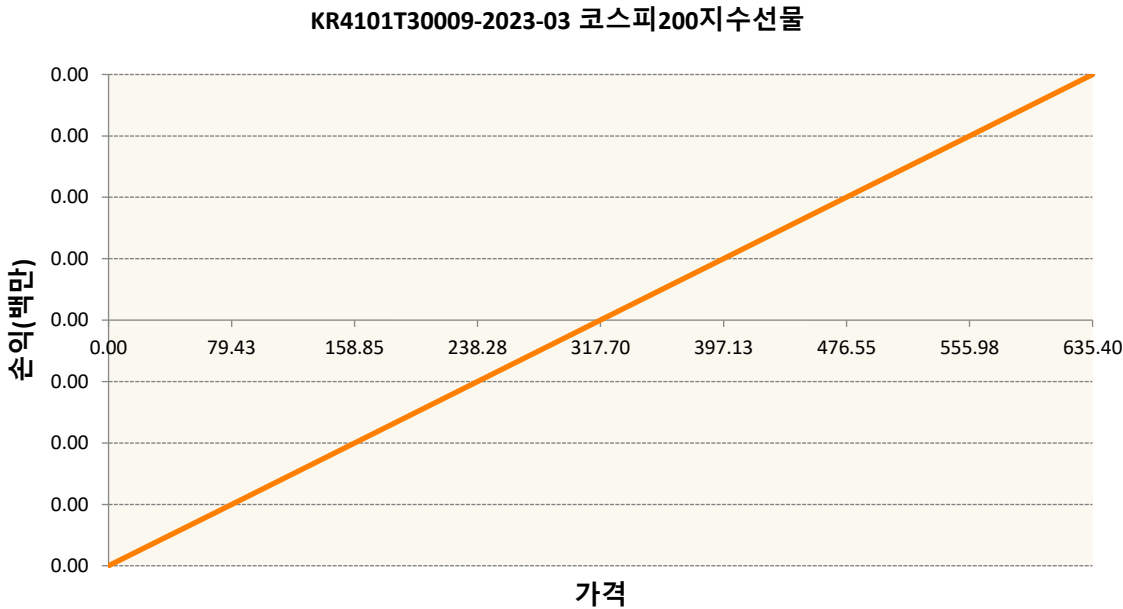
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,350	0	1,350	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	108	108	108	108	108	108	108

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

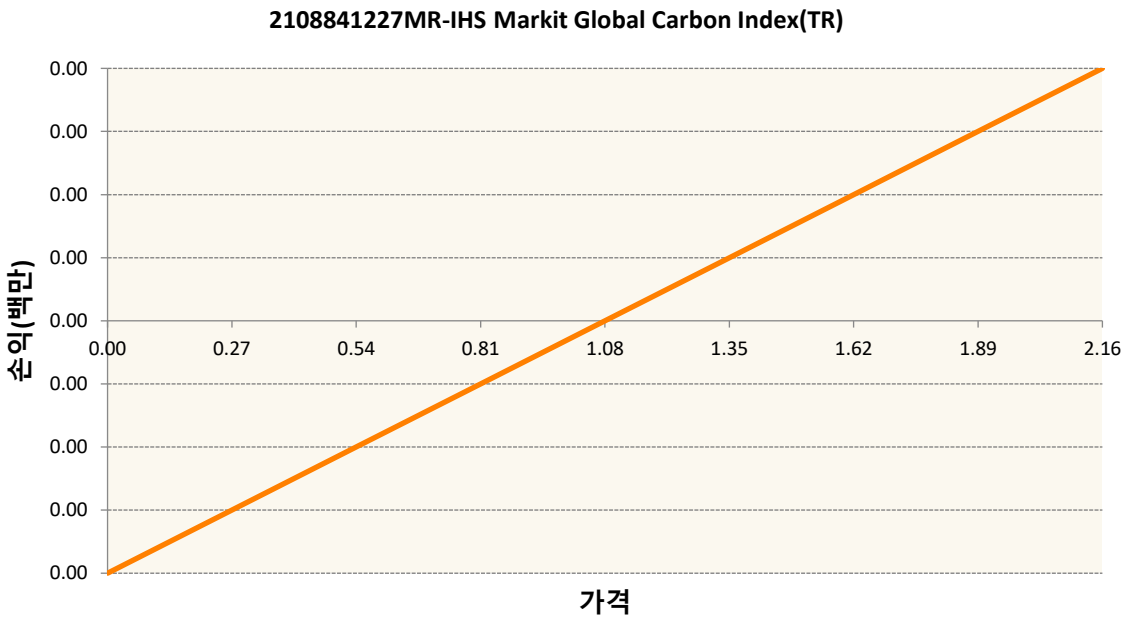
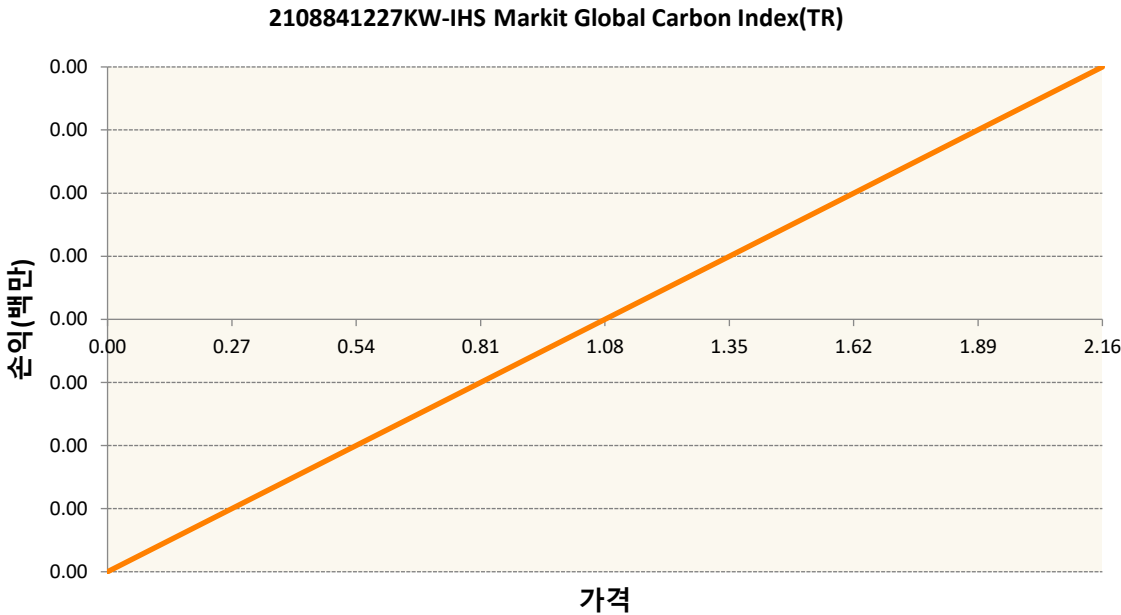
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

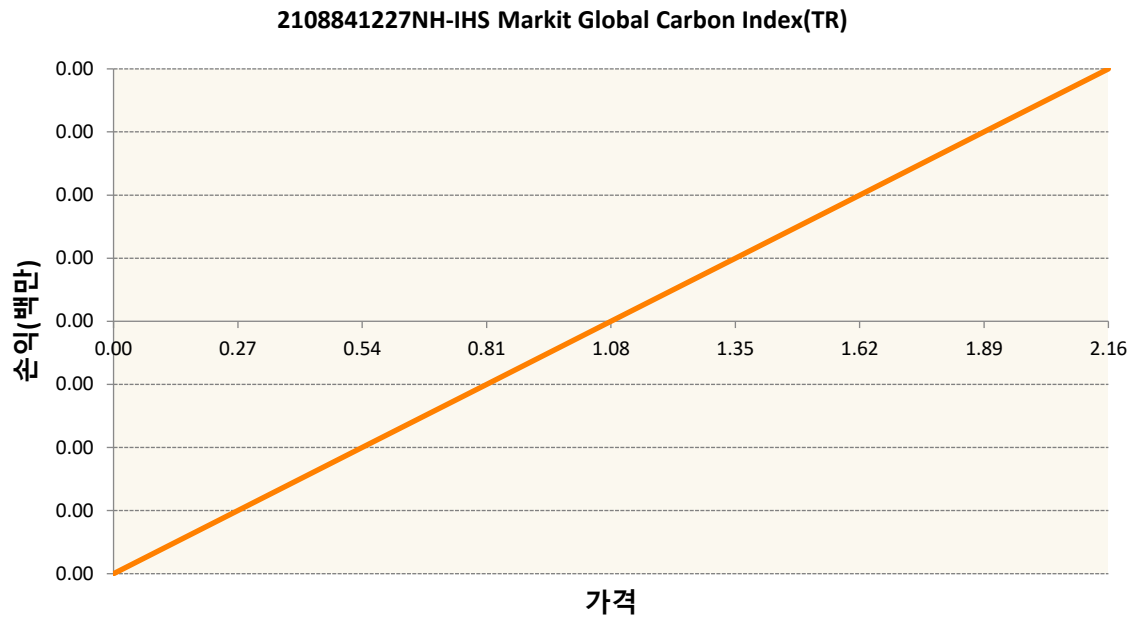
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	26,294	0	26,294	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,783
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		210
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		105

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		4,041

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

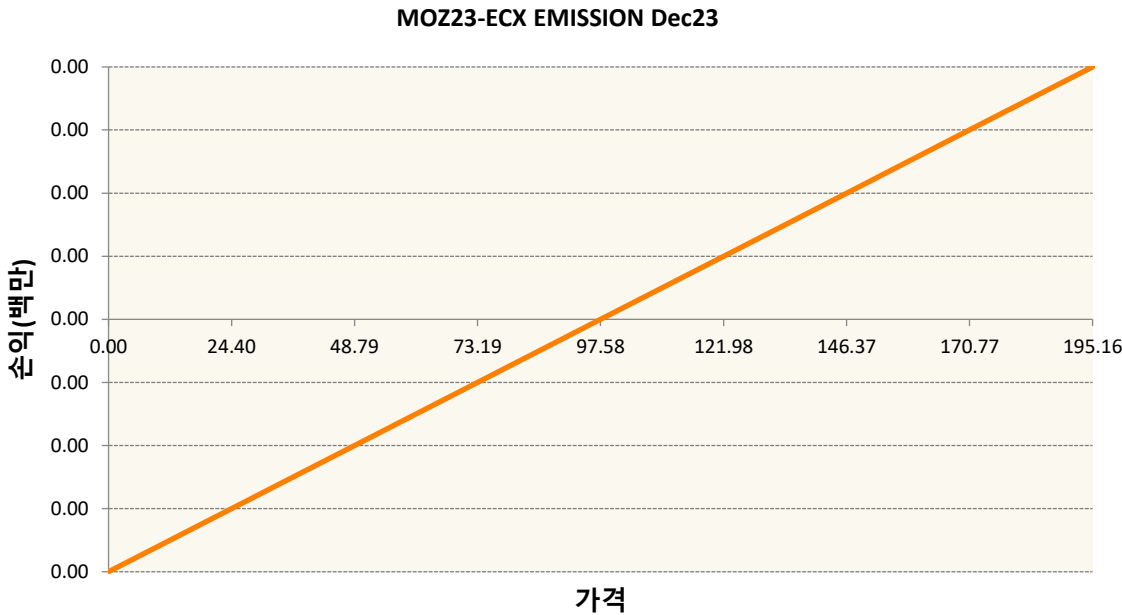
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,221	0	10,221	
누계	통화	선도	0	3,596	-3,596	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	144
FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	144
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	818

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

(단위:백만원)

2,334

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

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)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠)	19

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

(단위:백만원)

138

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

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)	7
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)

30

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

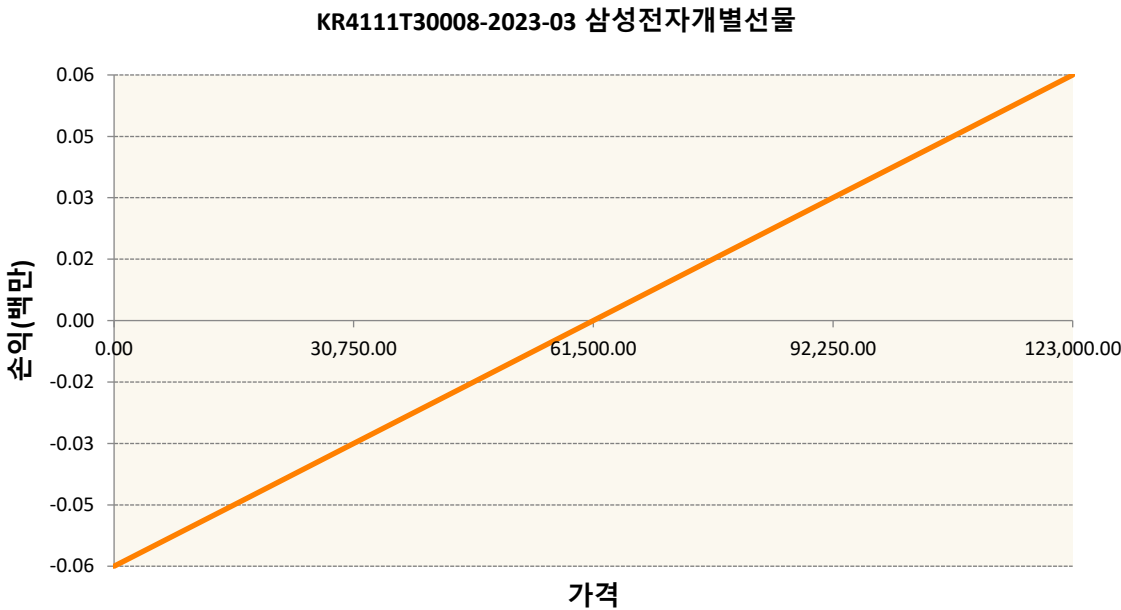
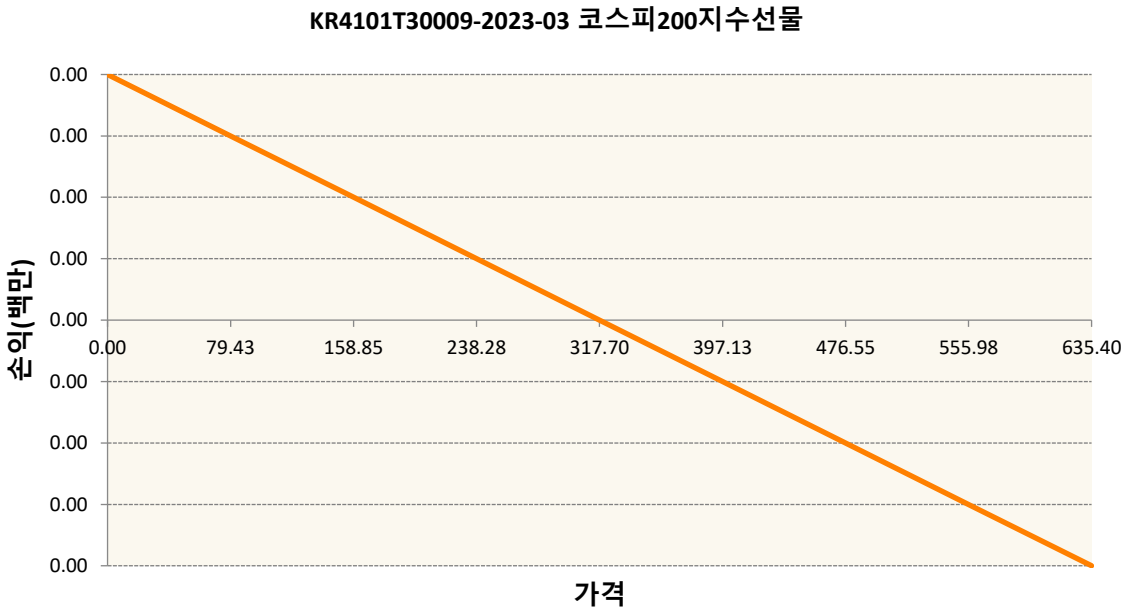
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

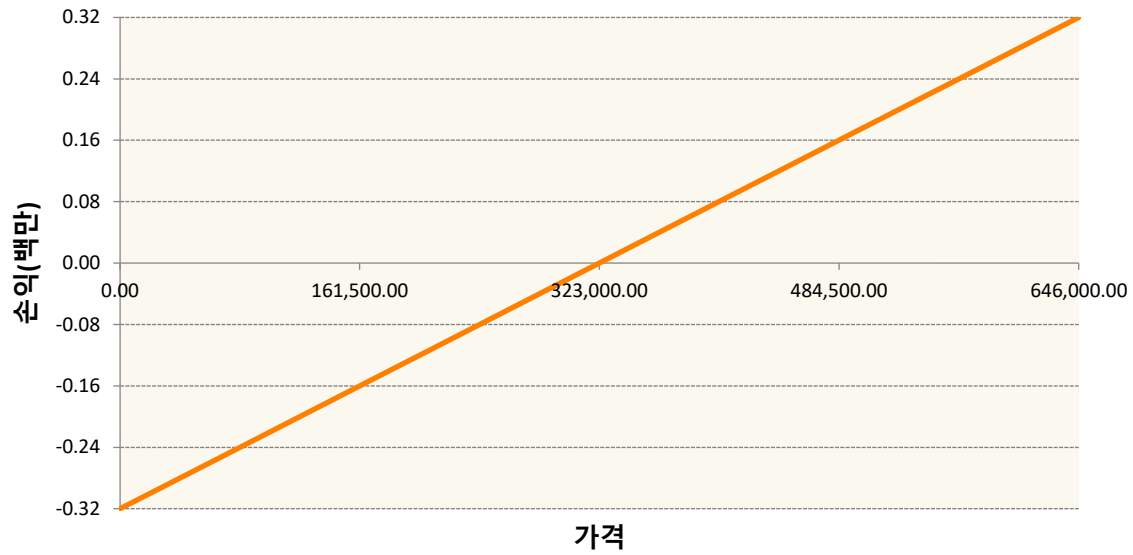
(단위:백만원)

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	1,069	4,195	-3,126	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

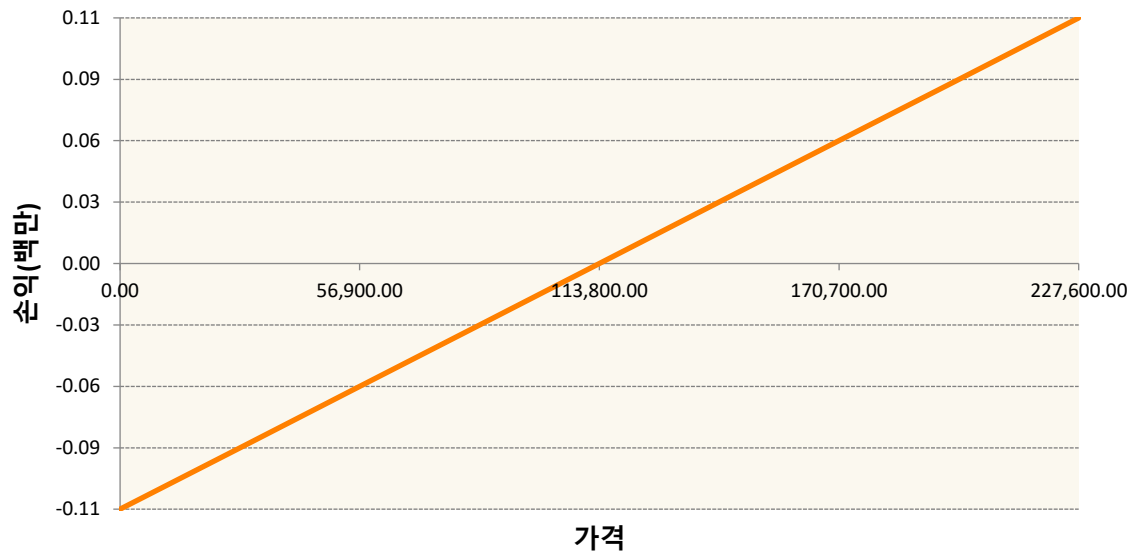
2. 만기시점의 손익구조



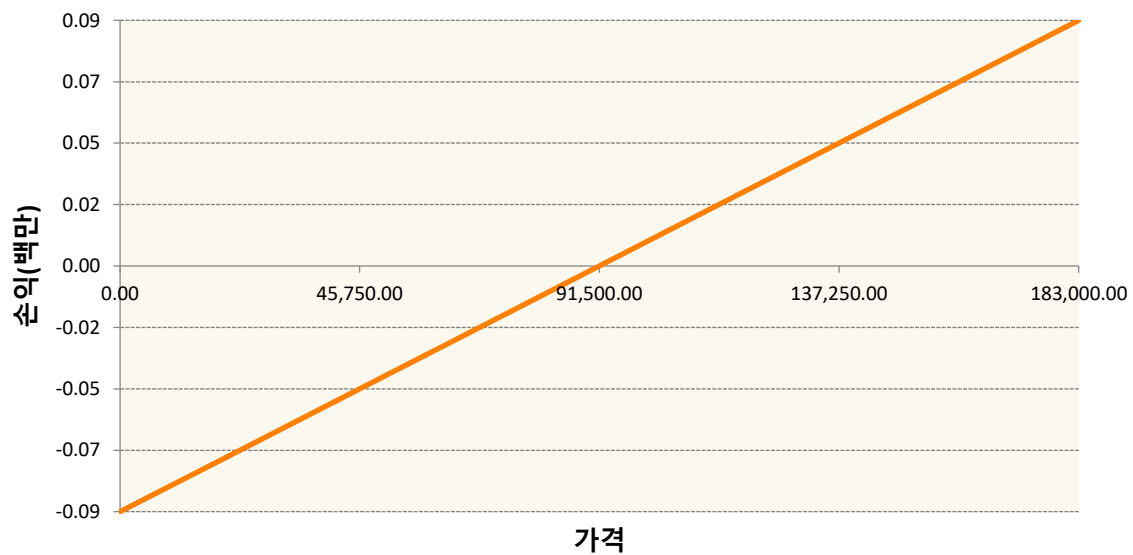
KR4113T30004-2023-03 POSCO개별선물



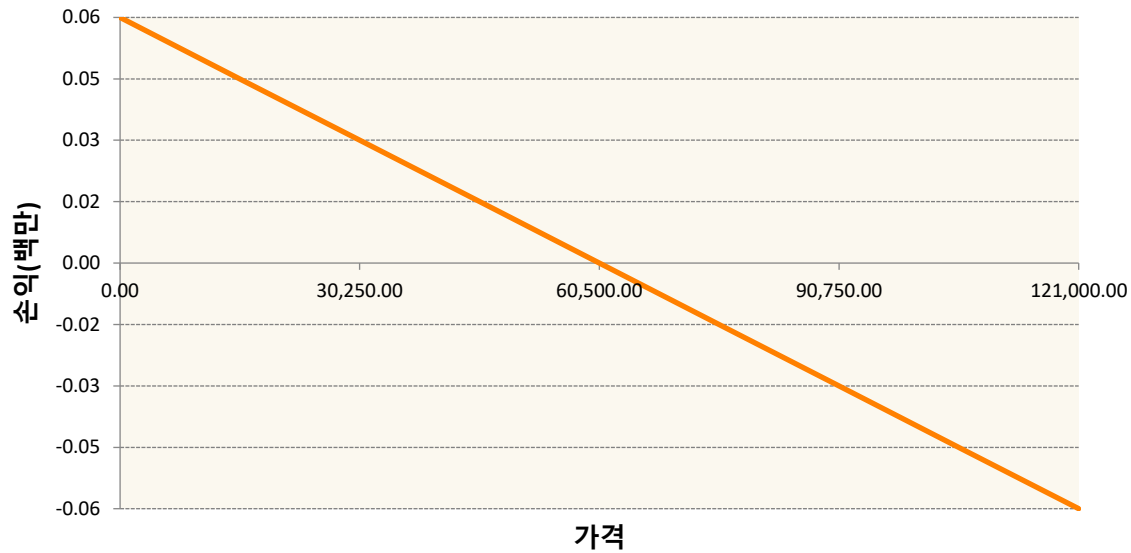
KR4124T30001-2023-03 LG전자개별선물



KR4150T30006-2023-03 SK하이닉스개별선물



KR41F7T30000-2023-03 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	0.12
KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	0.03
KR4101T300 2023-03 코스피200지수선물	318
KR4111T300 2023-03 삼성전자개별선물	10
KR4113T300 2023-03 POSCO개별선물	47
KR4124T300 2023-03 LG전자개별선물	18
KR4150T300 2023-03 SK하이닉스개별선물	11
KR41F7T300 2023-03 카카오페이개별선물	18

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

(단위:백만원)

576

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

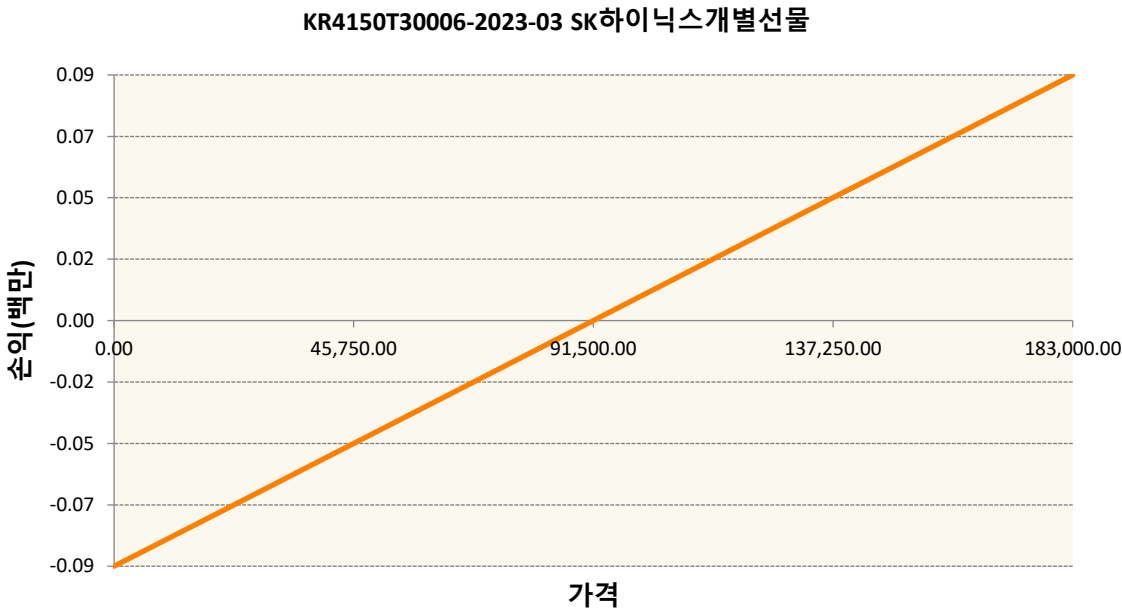
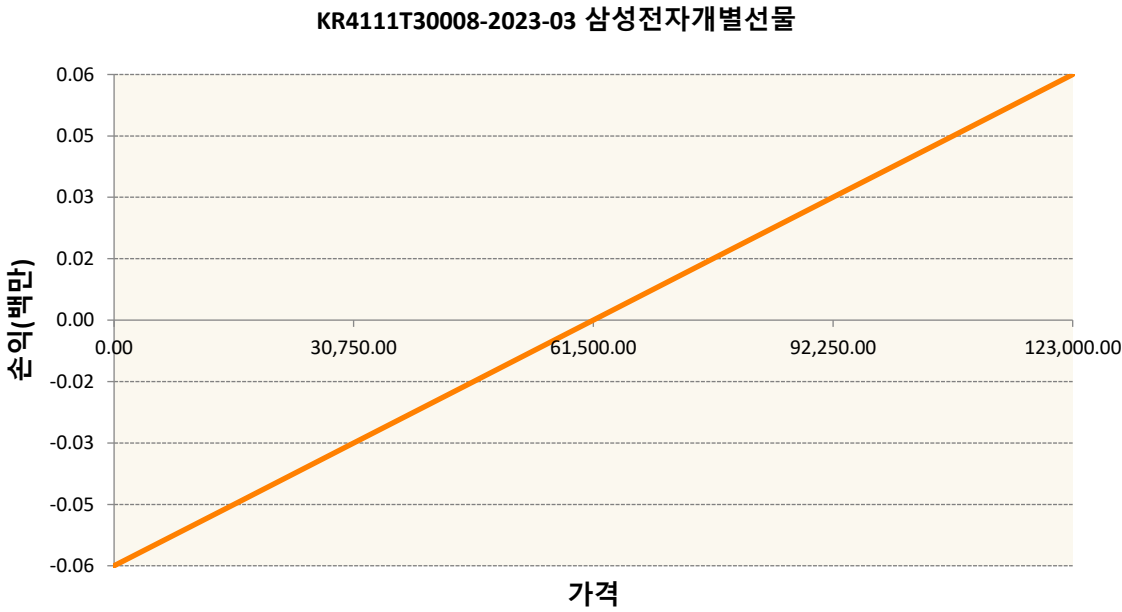
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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	153	0	153	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)

15

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

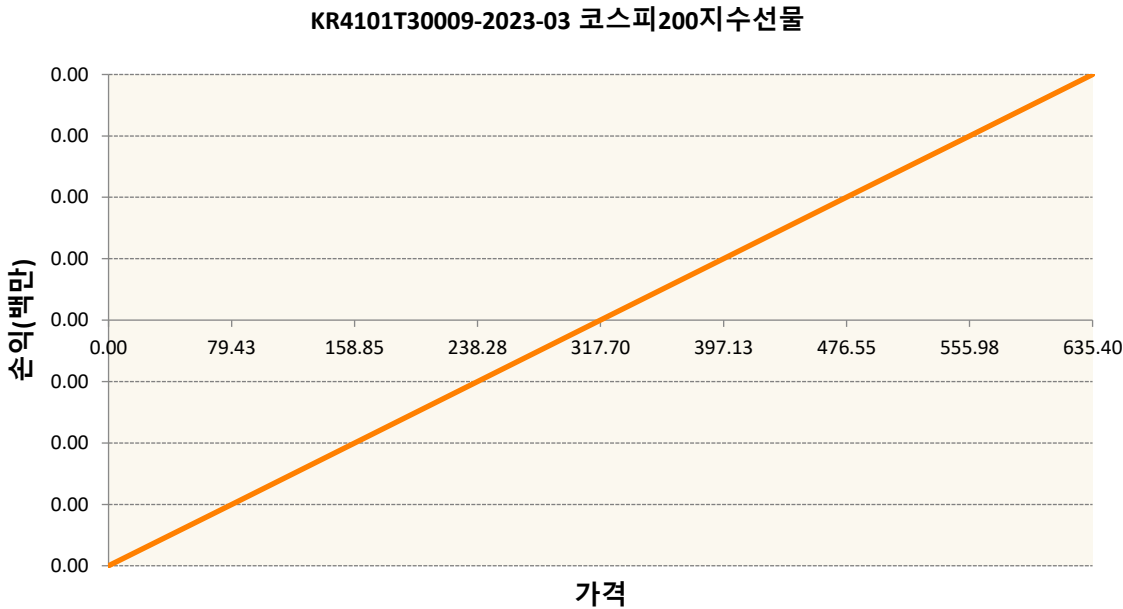
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	159	0	159	장내
누계	유가증권	선물	2,939	0	2,939	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	235	235	235	235	235	235	235

공시일 2023-02-27

기준일 2023-02-24

SOL한국형글로벌전기차&2차전지

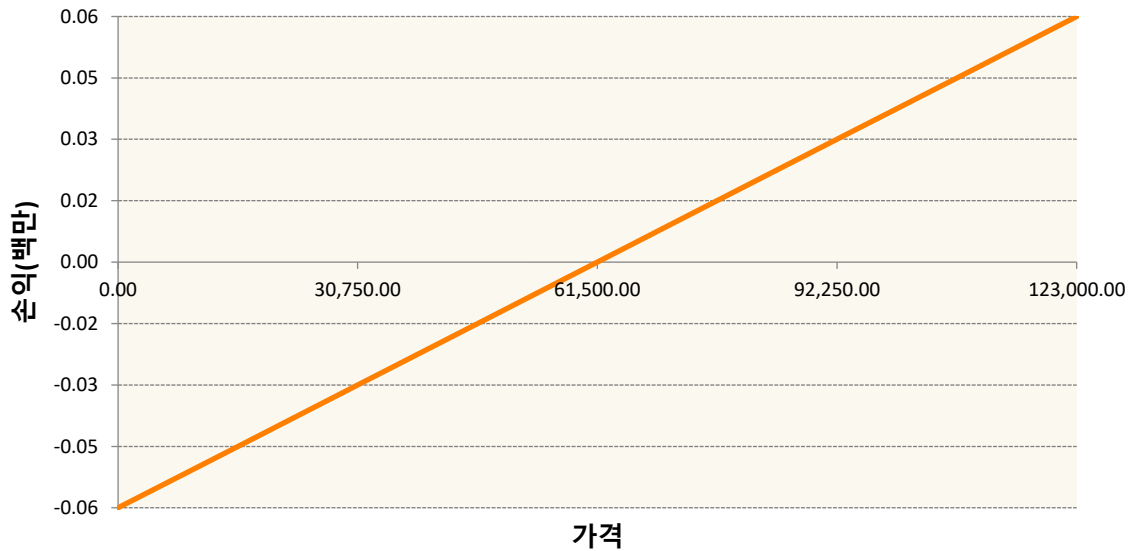
1. 계약금액

(단위:백만원)

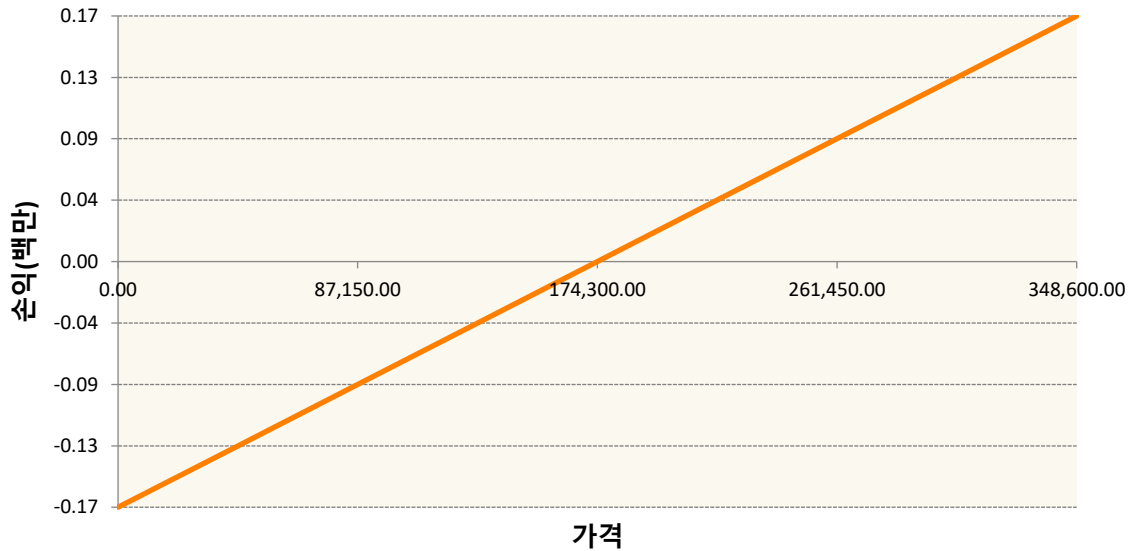
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	244	0	244	장내

2. 만기시점의 손익구조

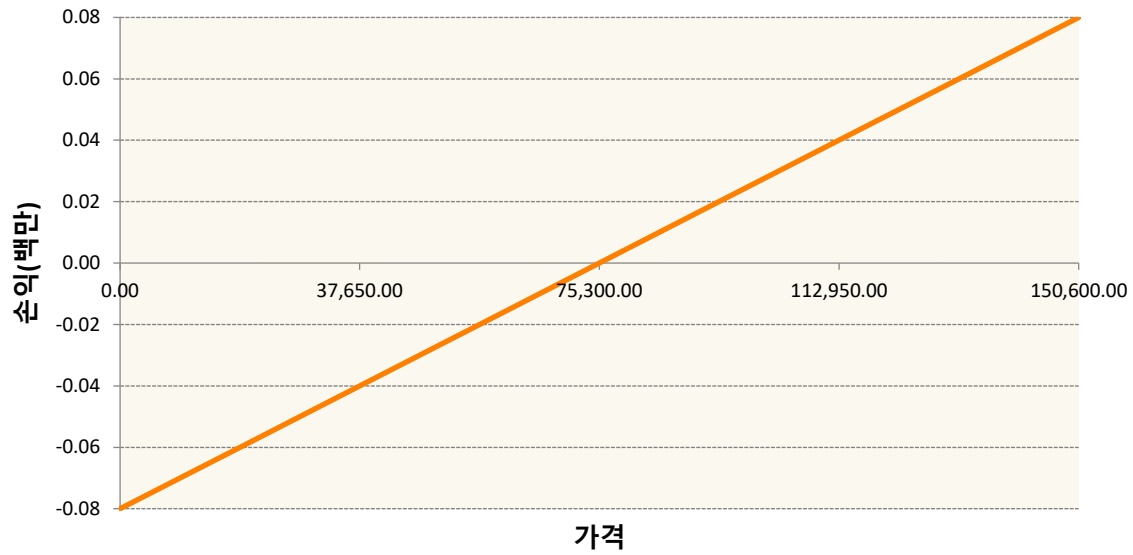
KR4111T30008-2023-03 삼성전자개별선물



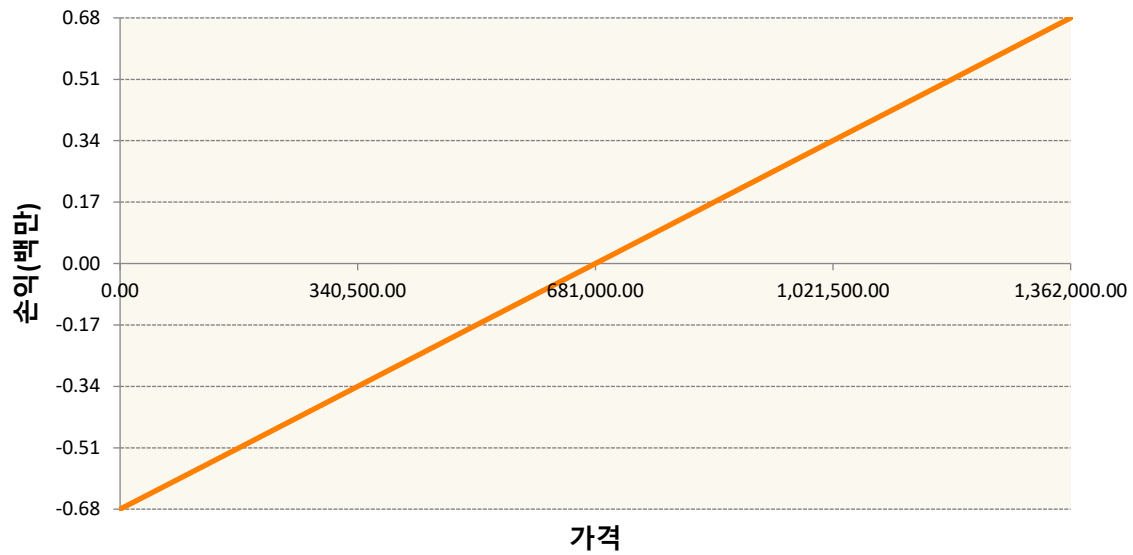
KR4116T30007-2023-03 현대차개별선물



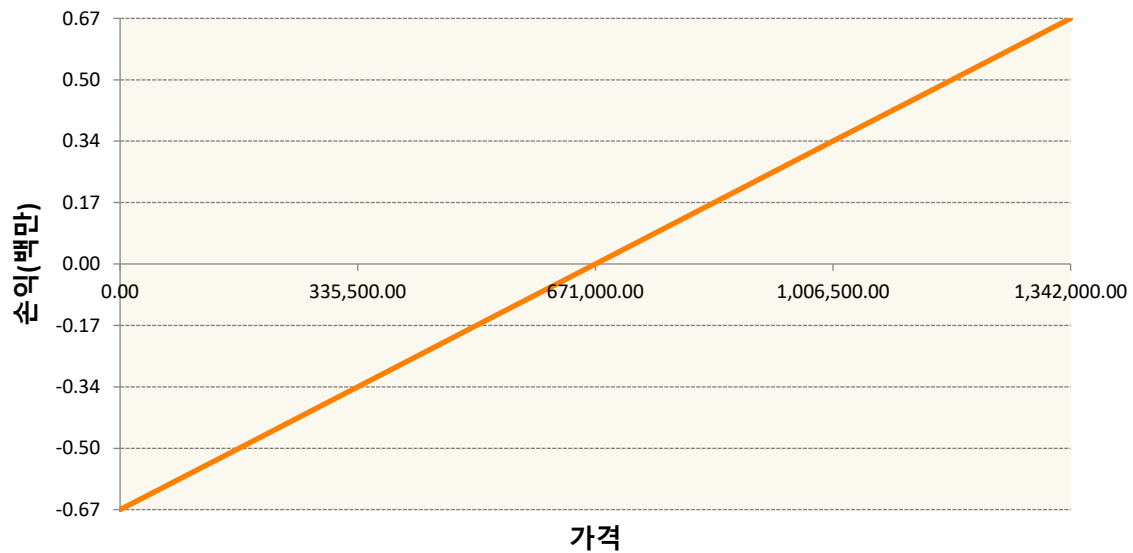
KR4119T30001-2023-03 기아개별선물



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		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	-11	
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
-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%	7	7	7	7	7	7	7	7	
8.00%	11	11	11	11	11	11	11	11	
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)

22

공시일 2023-02-27

기준일 2023-02-24

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

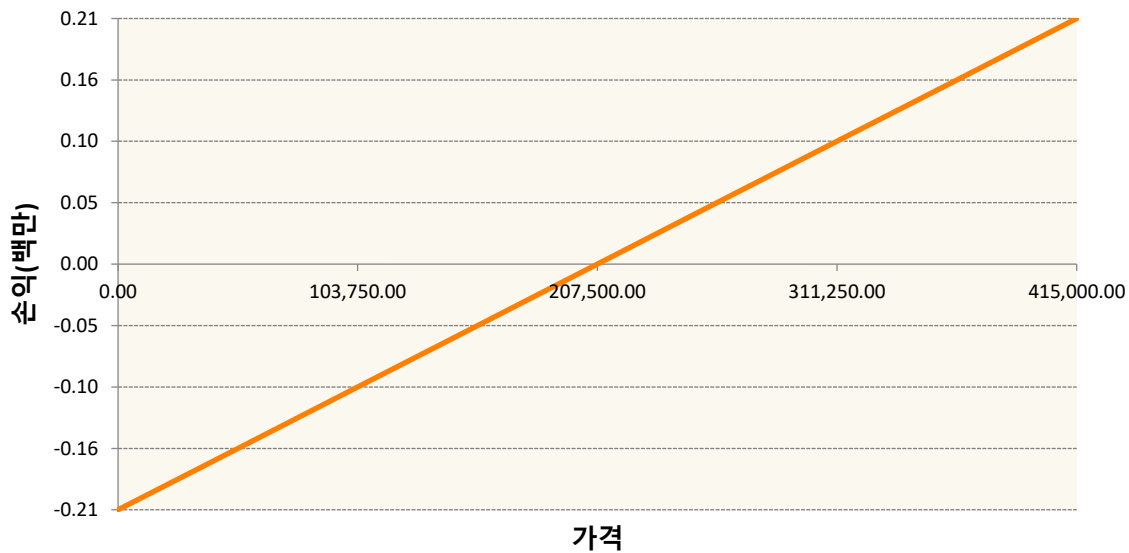
1. 계약금액

(단위:백만원)

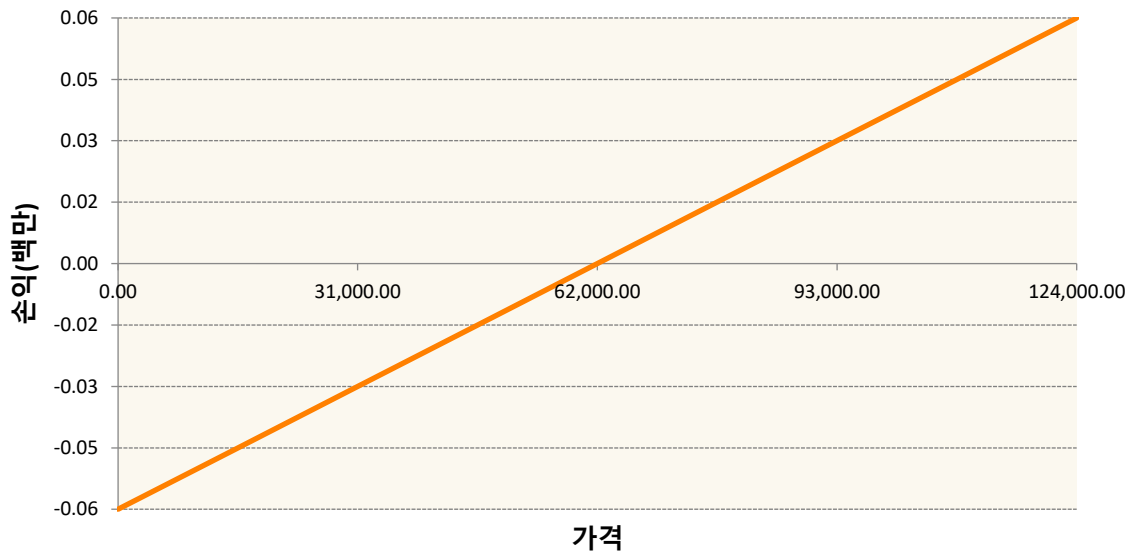
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	128	0	128	장내

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					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)

21

공시일	2023-02-27
기준일	2023-02-24

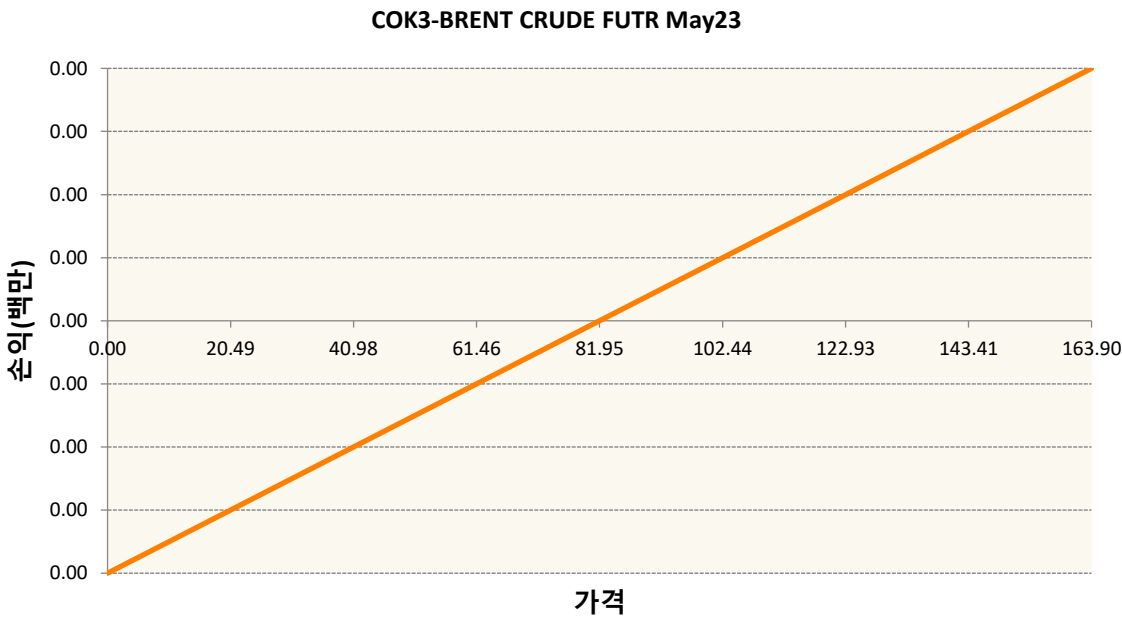
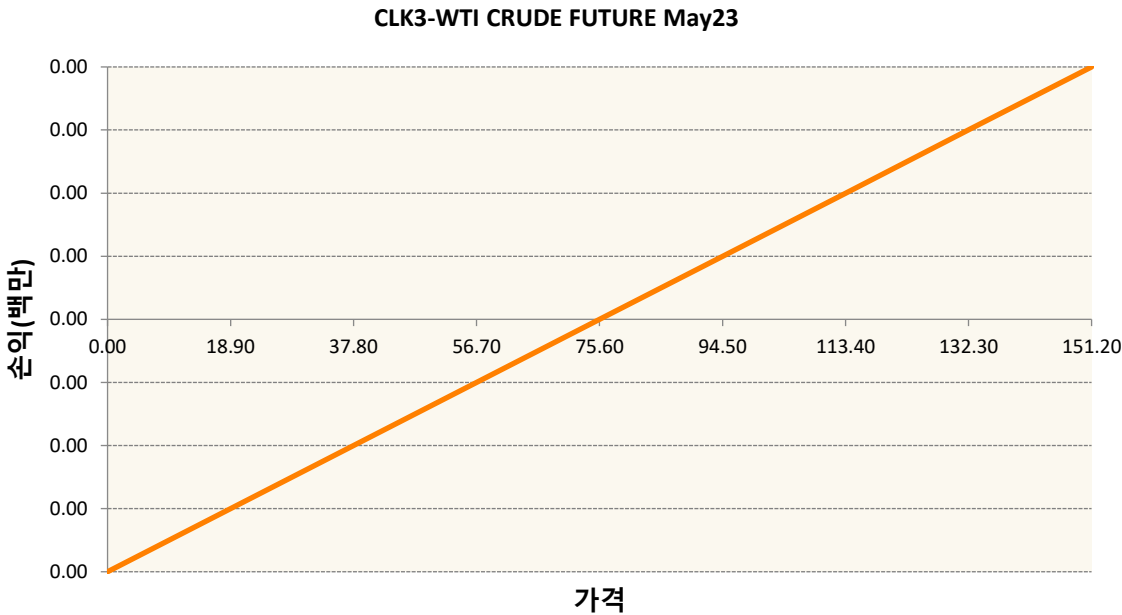
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

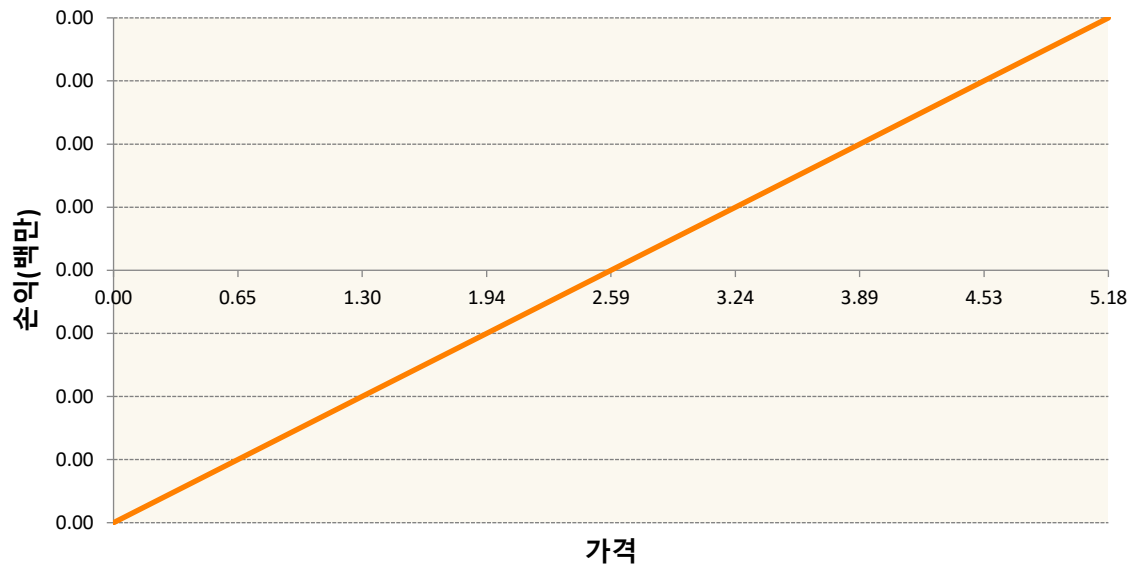
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,626	234	1,392	

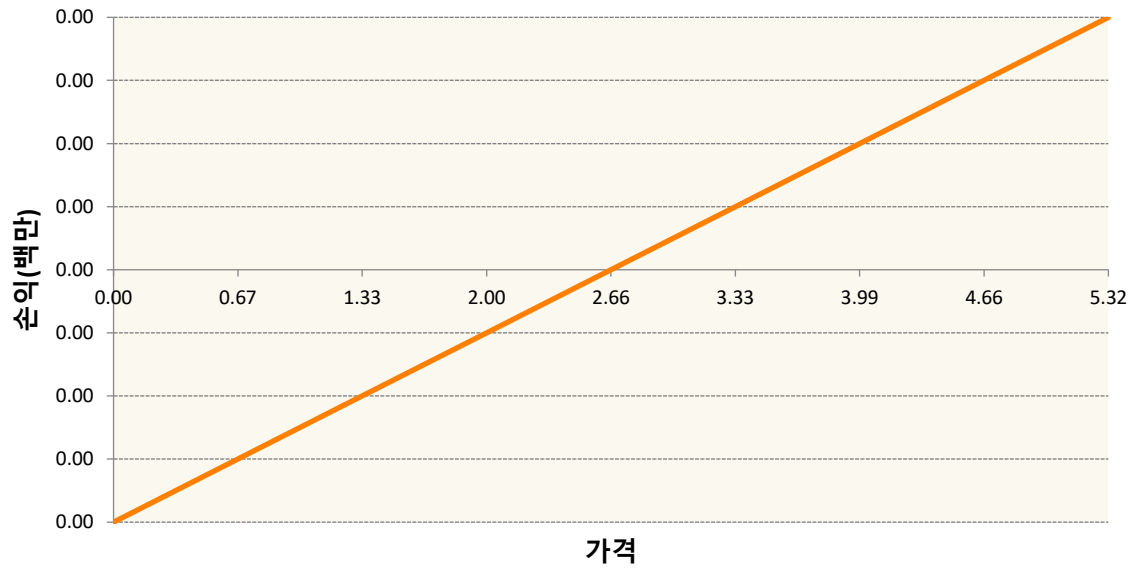
2. 만기시점의 손익구조



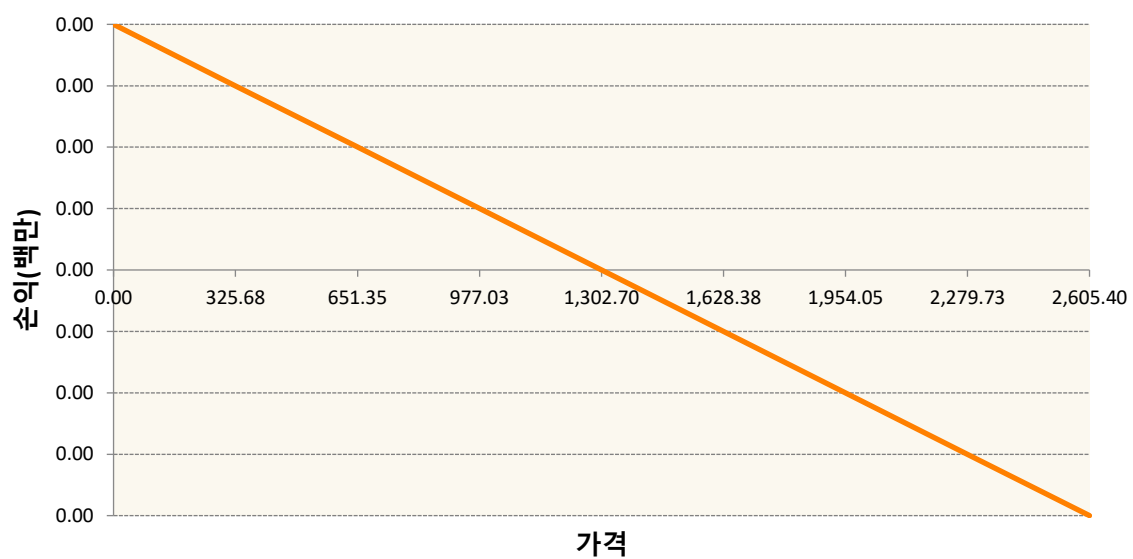
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



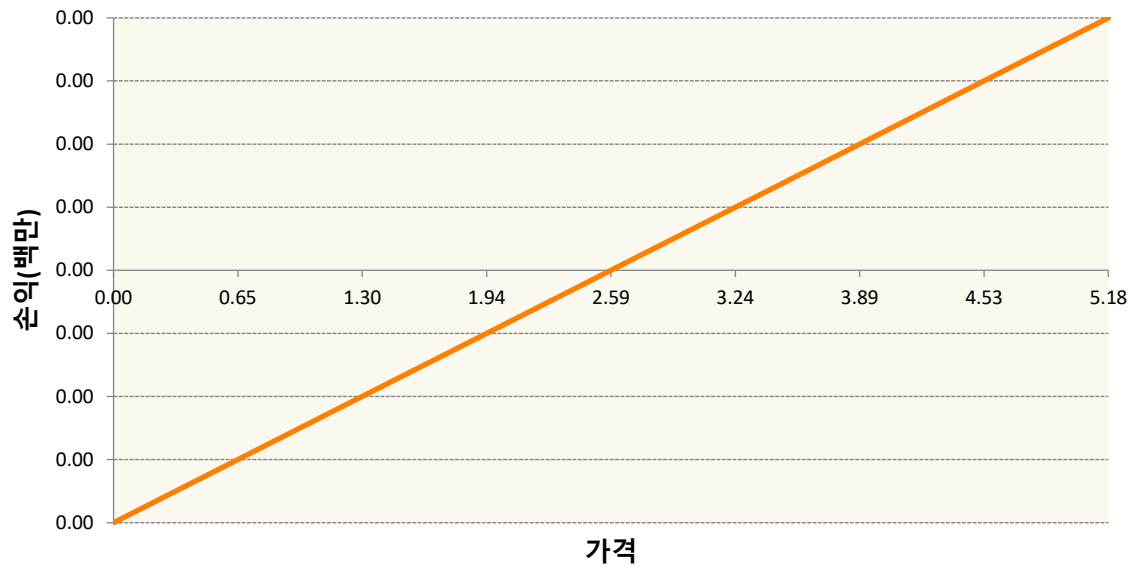
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



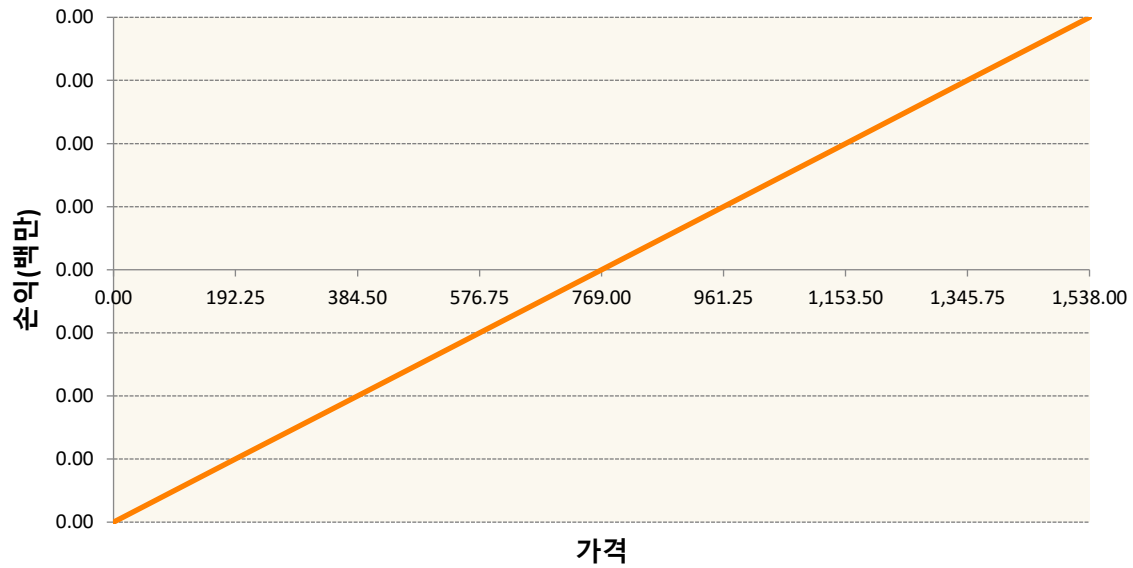
KR4175T30003-2023-03 달러선물



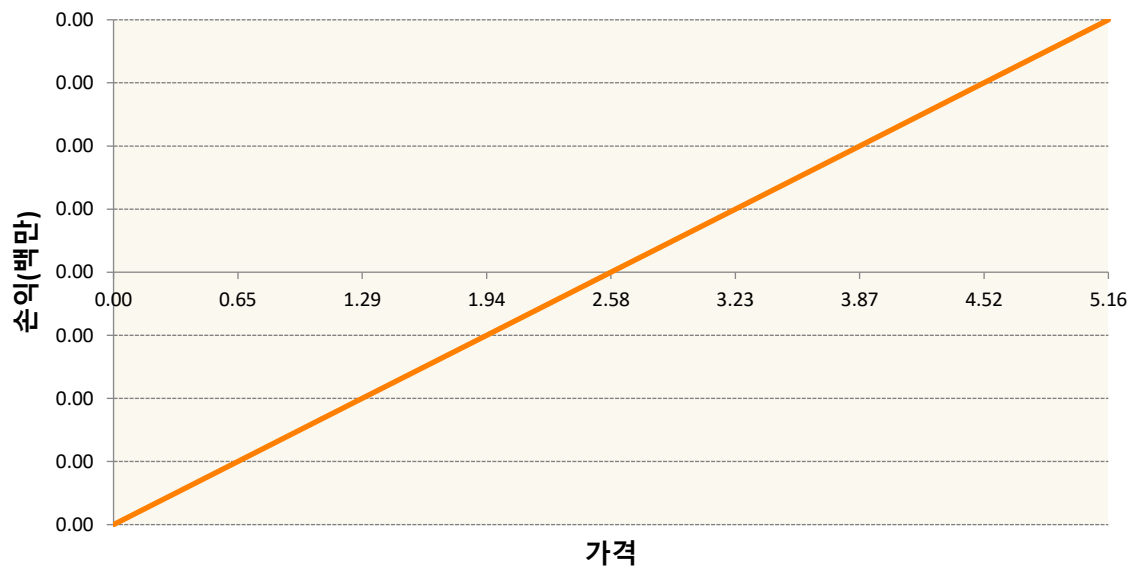
NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23



XBK3-GASOLINE RBOB FUT May23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK3	WTI CRUDE FUTURE May23	31
COK3	BRENT CRUDE FUTR May23	33
EOK3	E-MINI NATURAL GAS May23	2
HOK3	NY Harb ULSD Fut May23	11
KR4175T300	2023-03 달러선물	19
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23	26
QSK3	Low Su Gasoil G May23	16
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	11

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

424