

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

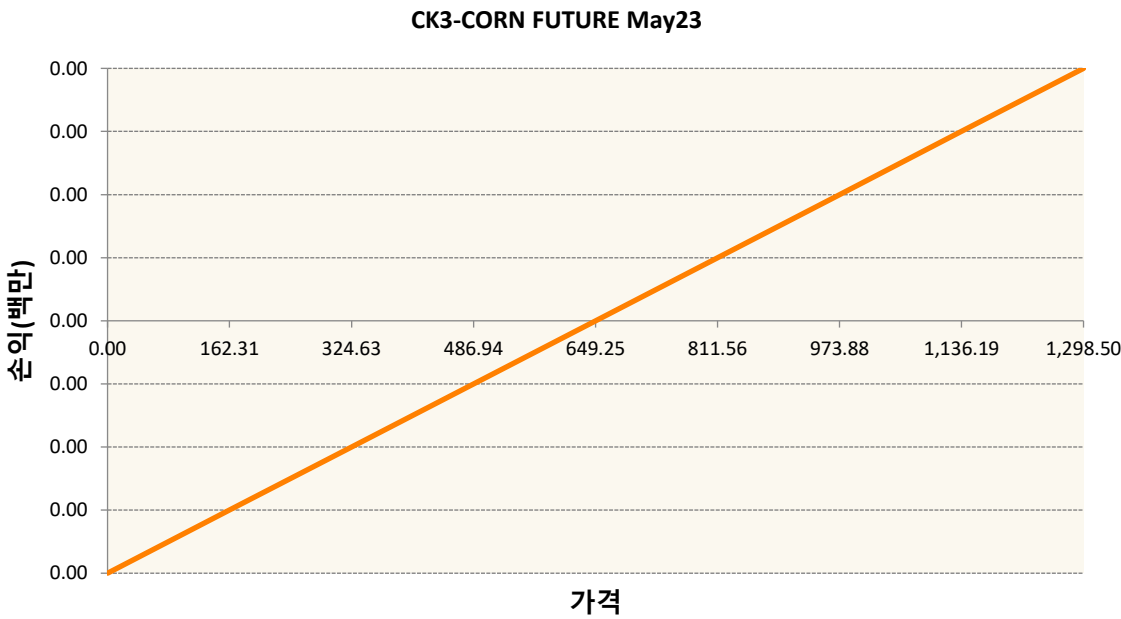
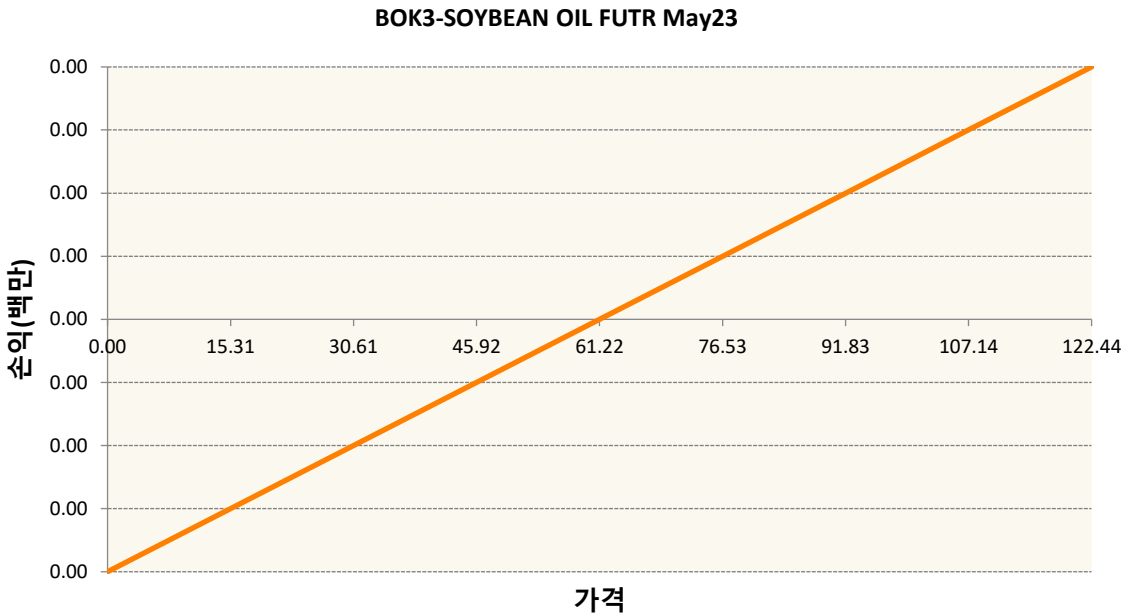
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

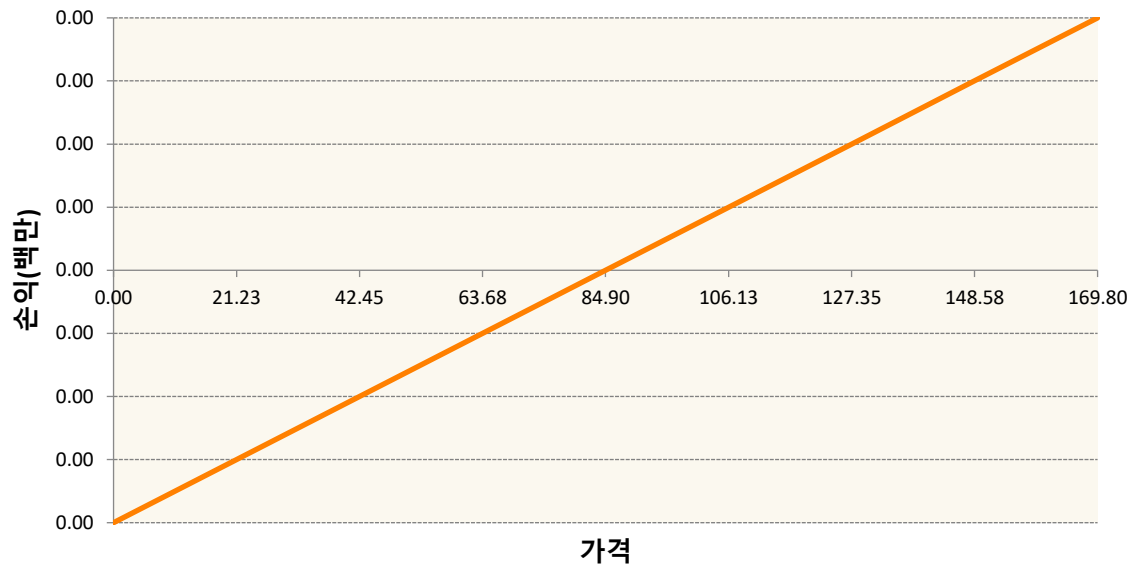
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	5,883	662	5,222	

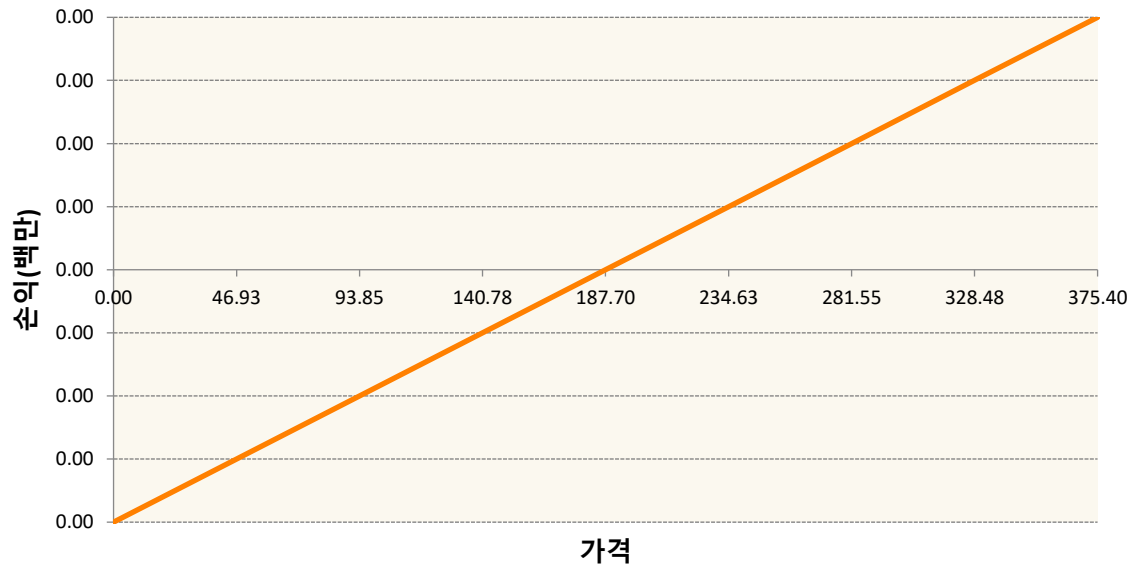
2. 만기시점의 손익구조



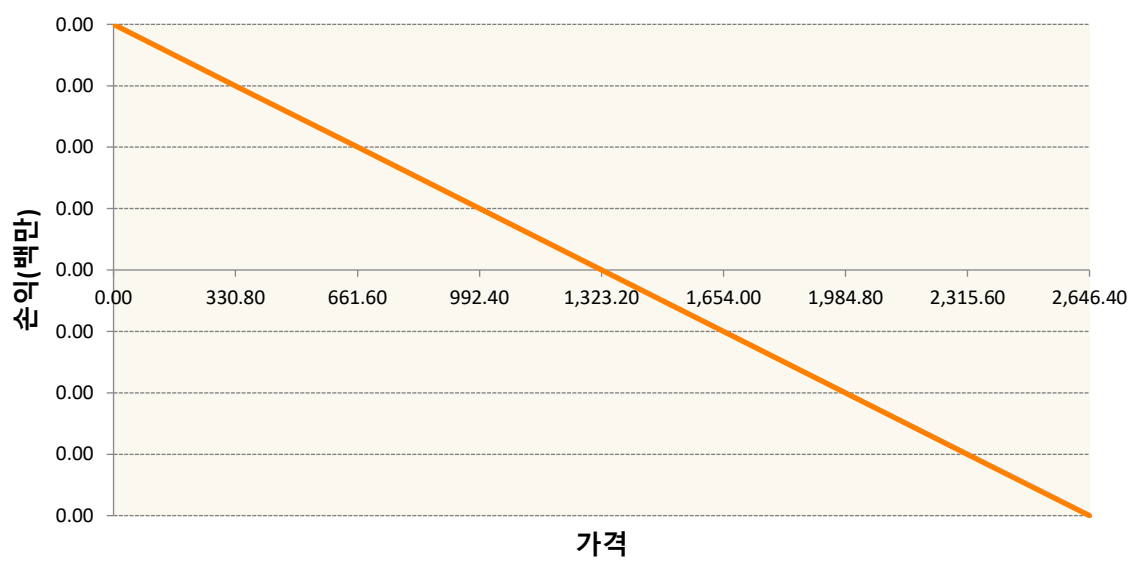
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



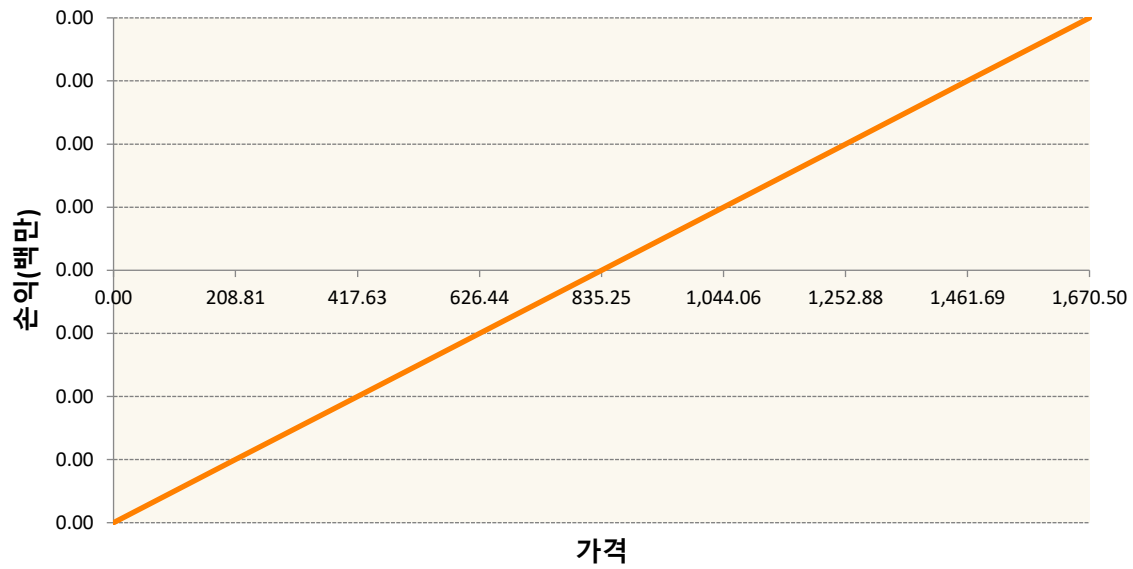
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



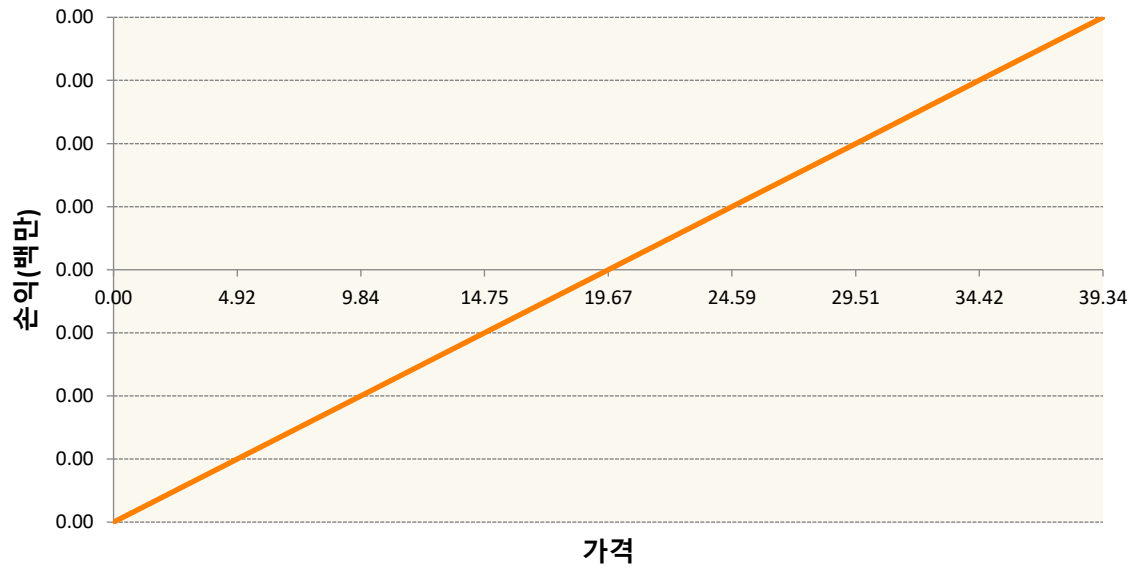
KR4175T30003-2023-03 달러선물



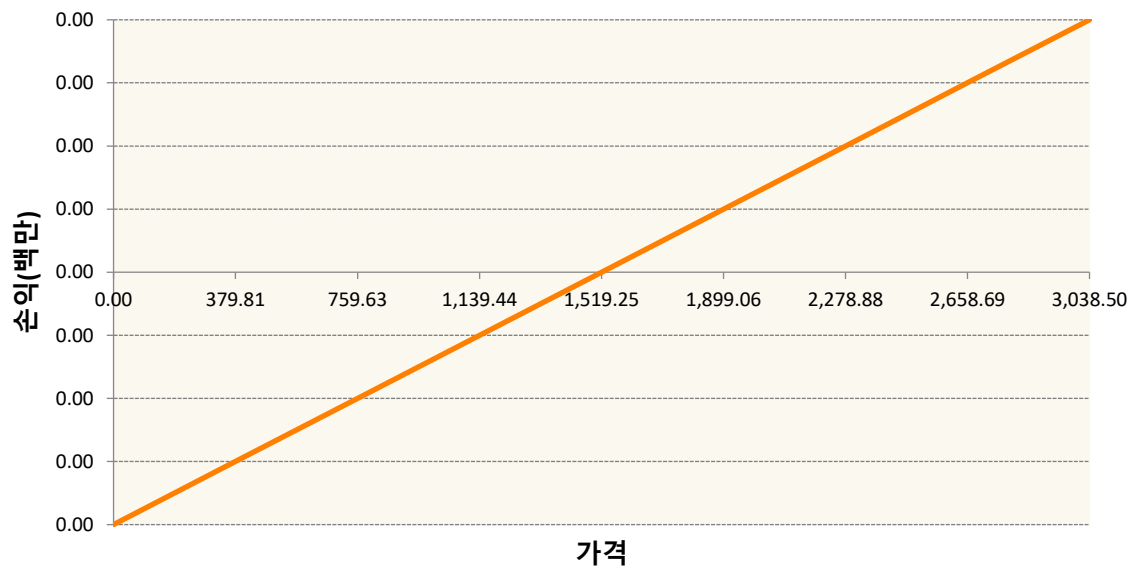
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



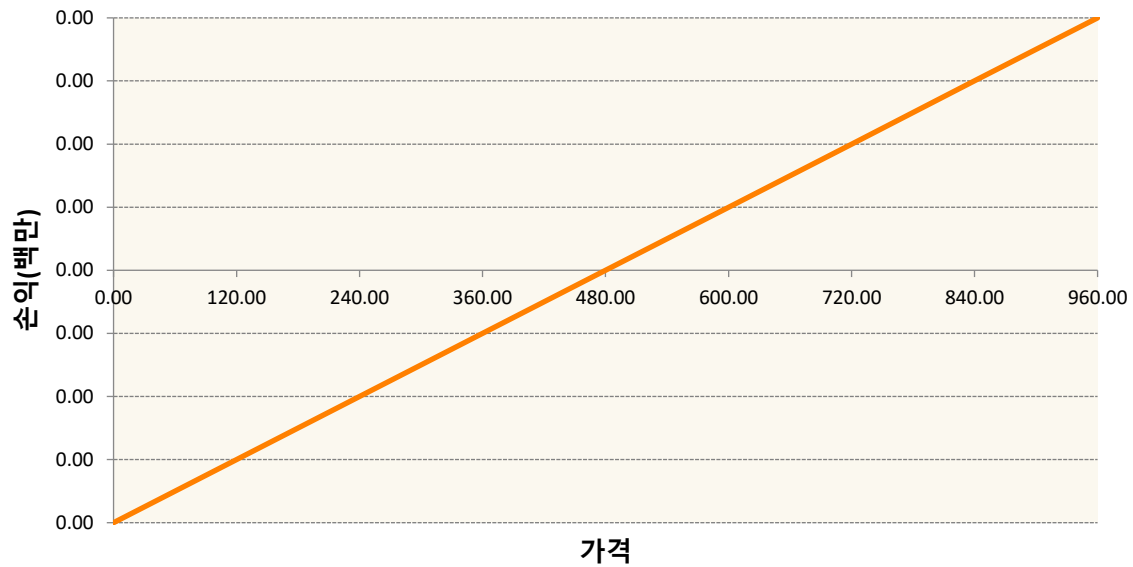
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



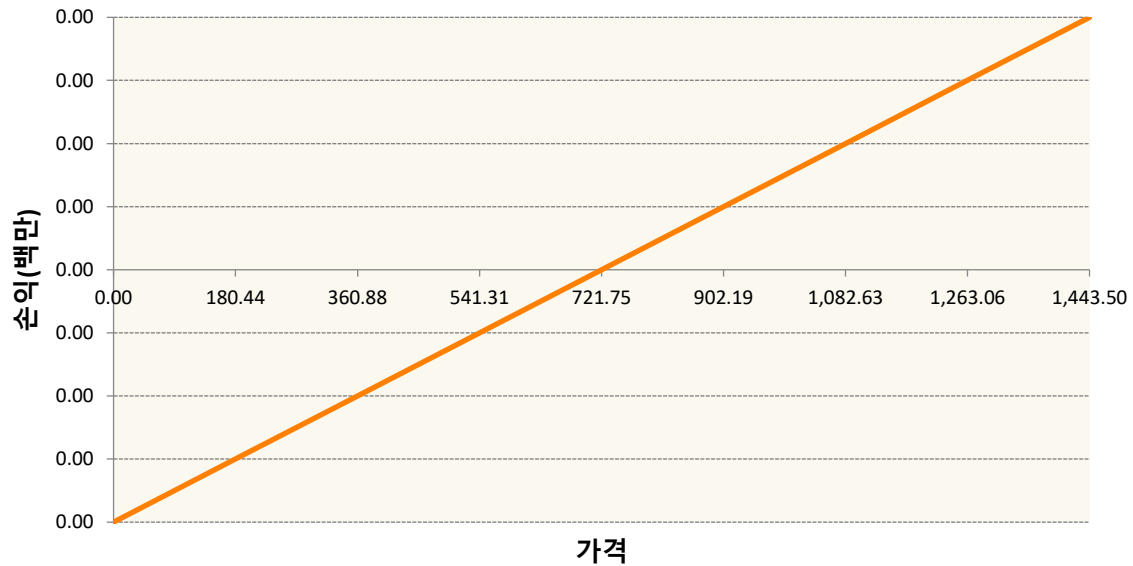
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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	2023-02-28
기준일	2023-02-27

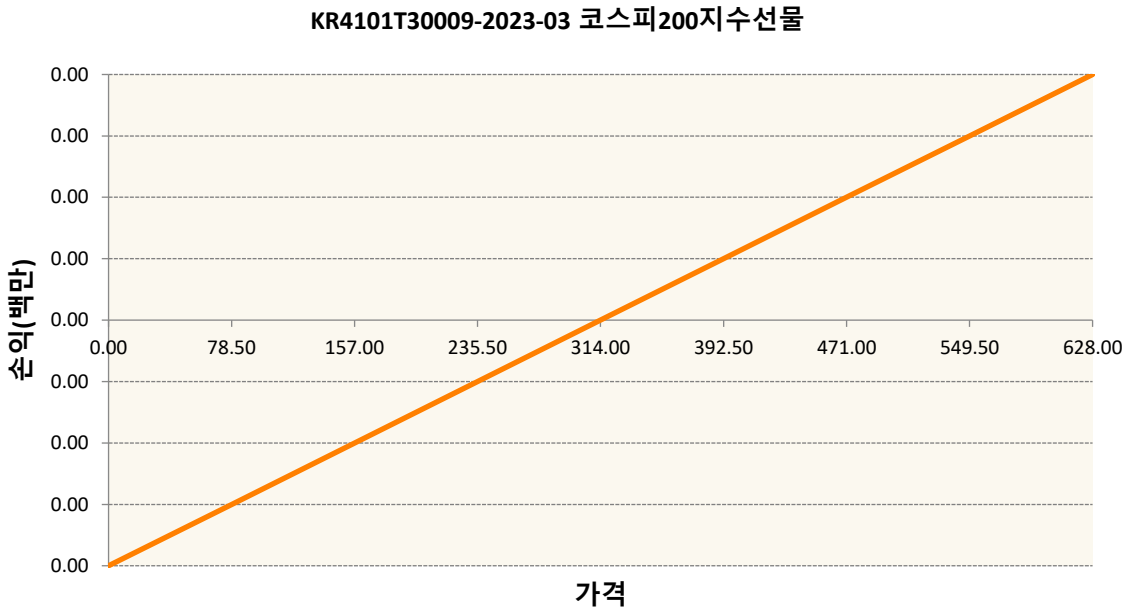
스마트인덱스모

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	2,355	0	2,355	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					188
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
-5.33%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-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%	126	126	126	126	126	126	126
8.00%	188	188	188	188	188	188	188

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

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

364

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

504

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

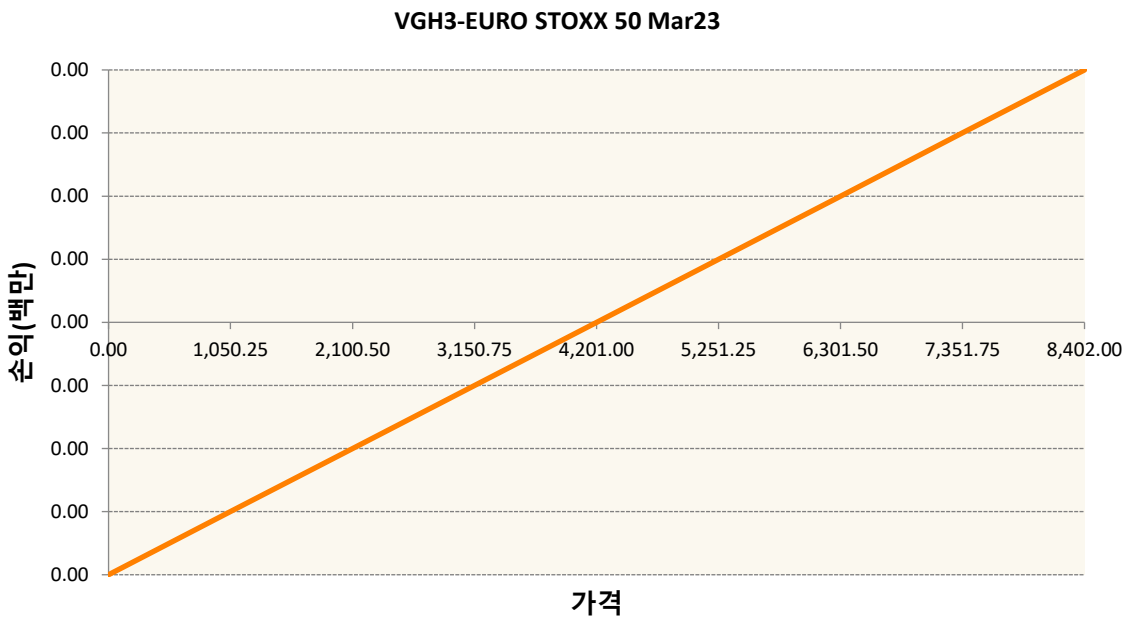
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	523	0	523	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

44

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

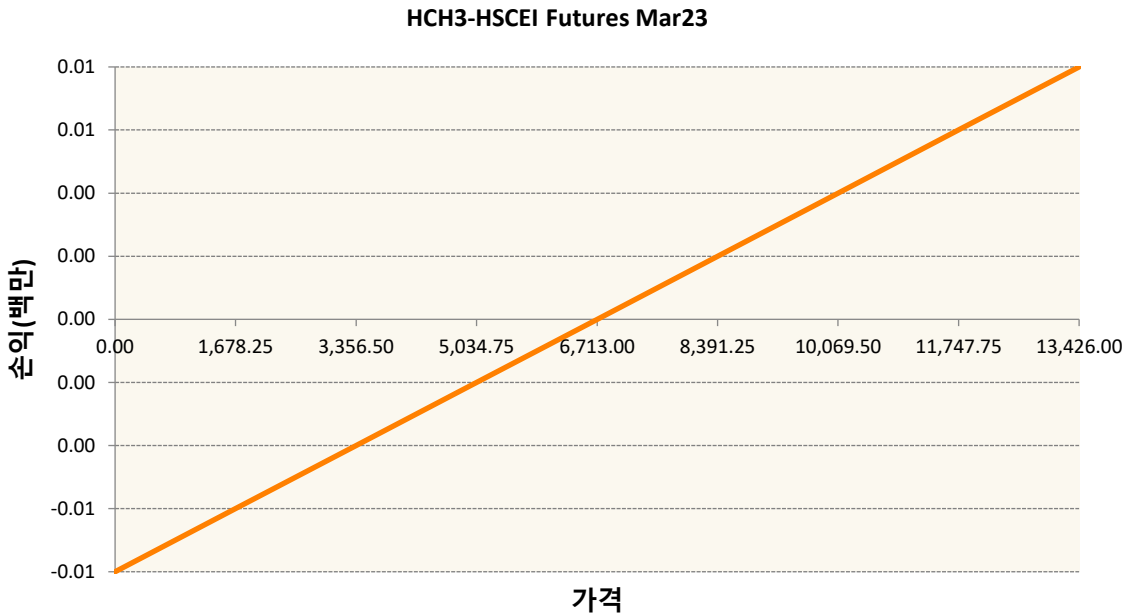
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,171	0	1,171	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH3	HSCEI Futures Mar23	94
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

126

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

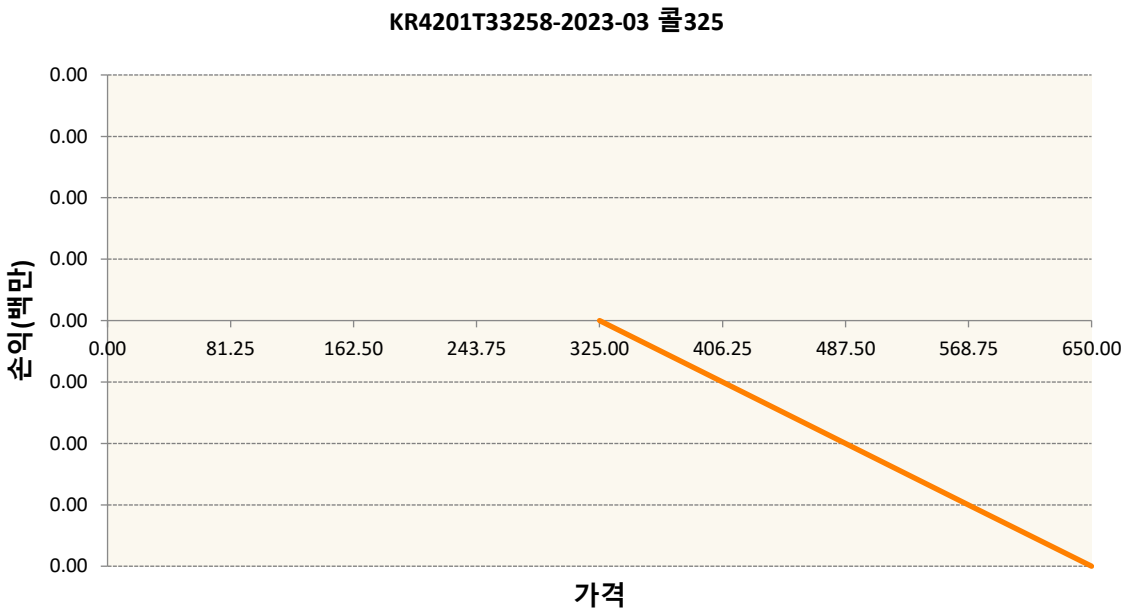
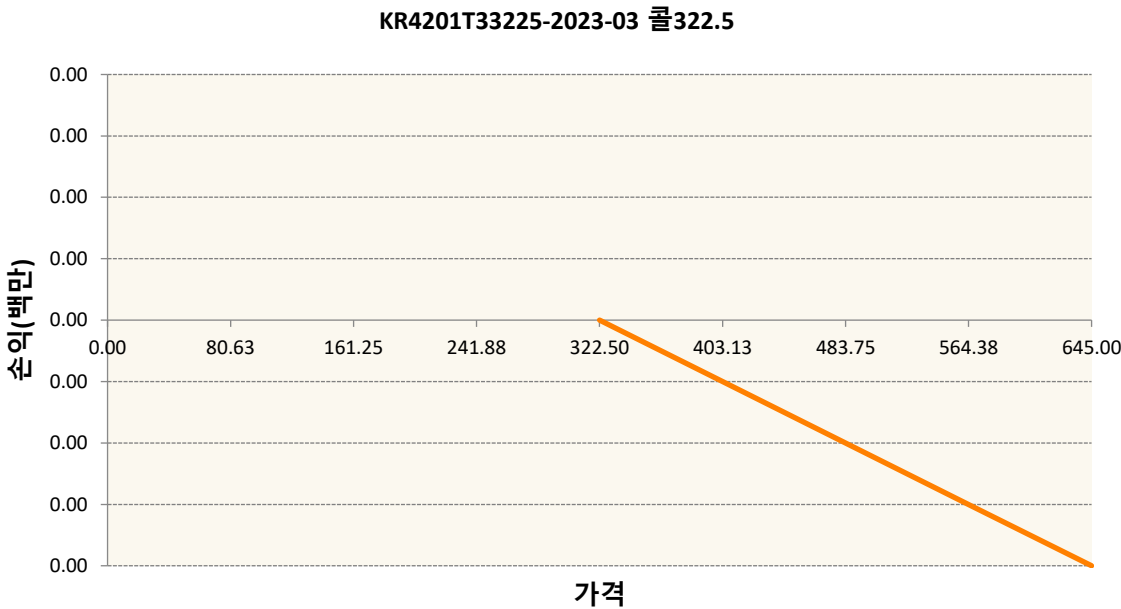
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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

가격 (Price)	손익 (백만) (Profit/Loss in millions)
0.00	0.00
81.25	10.00
162.50	20.00
243.75	30.00
325.00	40.00
406.25	30.00
487.50	20.00
568.75	10.00
650.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201T33225				2023-03 콜322.5				84
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	32	31	30	28	27	25	22	
-5.33%	30	28	25	23	20	17	14	
-2.67%	23	20	17	14	10	7	3	
0%	12	8	4	0	-4	-8	-12	
2.67%	-6	-10	-15	-19	-23	-28	-32	
5.33%	-31	-35	-39	-43	-47	-52	-56	
8.00%	-62	-65	-68	-72	-76	-80	-84	
KR4201T33258				2023-03 콜325				2,232
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	796	773	743	704	659	607	549
-5.33%	736	689	634	572	503	428	349
-2.67%	596	519	435	346	253	157	58
0%	326	220	111	0	-112	-226	-341
2.67%	-119	-241	-364	-487	-610	-733	-856
5.33%	-756	-877	-998	-1,120	-1,242	-1,365	-1,488
8.00%	-1,574	-1,676	-1,782	-1,892	-2,003	-2,117	-2,232
KR4301T33223 2023-03 풋322.5							41

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-38	-38	-39	-40	-40	-41
-5.33%	-22	-22	-23	-24	-25	-27	-28
-2.67%	-7	-9	-10	-11	-13	-14	-16
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	14	13	11	9	7	6	4
5.33%	21	20	18	16	15	13	11
8.00%	26	24	23	21	20	18	17

KR4301T33256 2023-03 풋325							614
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-563	-568	-574	-582	-591	-602	-614
-5.33%	-333	-342	-354	-367	-381	-397	-413
-2.67%	-119	-135	-152	-171	-190	-210	-231
0%	67	46	23	0	-23	-47	-71
2.67%	218	193	167	142	116	91	65
5.33%	329	304	279	253	228	203	177
8.00%	402	381	359	336	313	289	266

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

(단위:백만원)

2,597

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

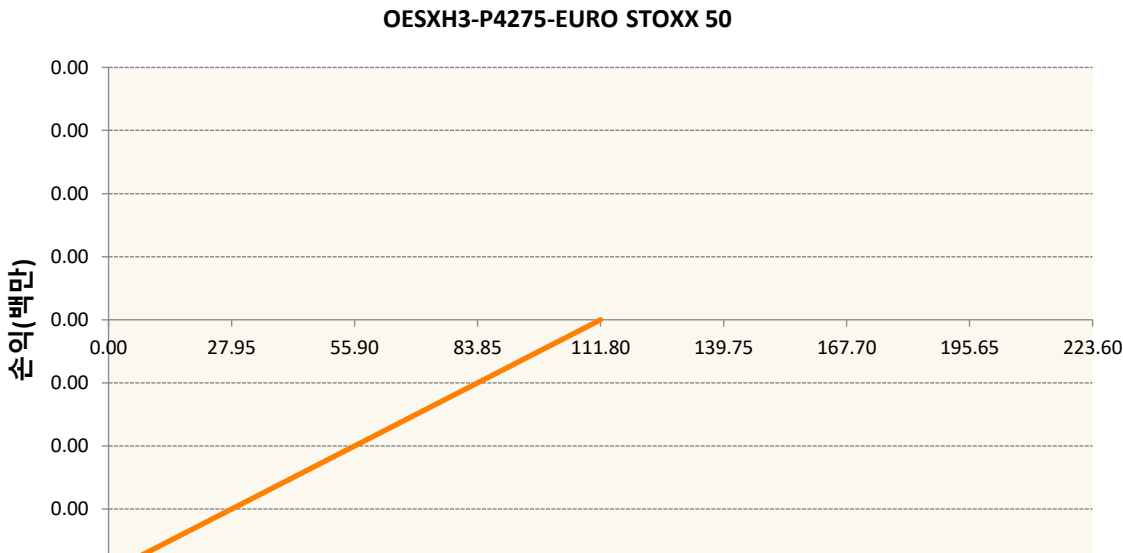
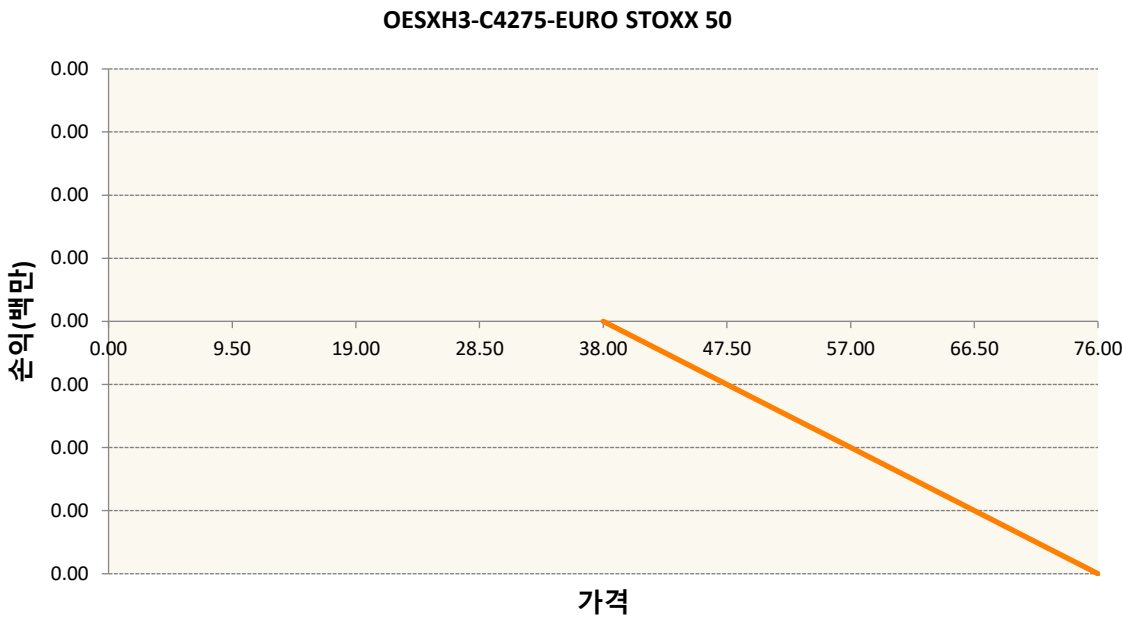
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

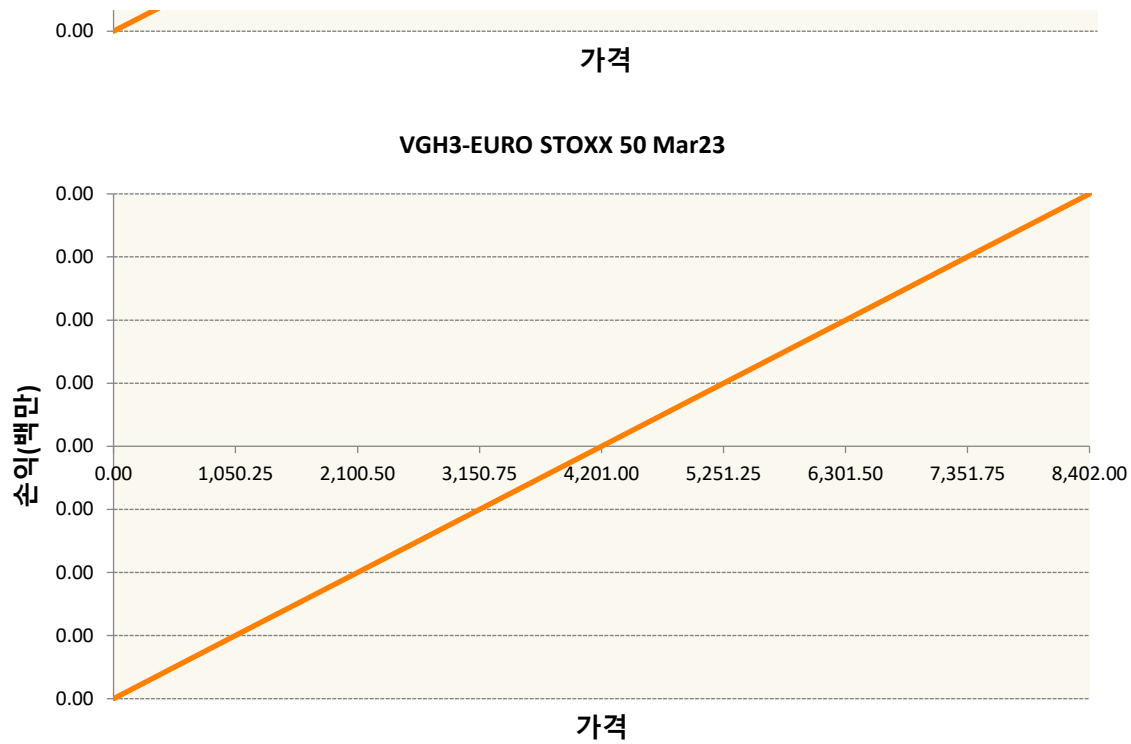
1. 계약금액

(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	992	0	992	
누계	유가증권	옵션	0	69	-69	장내
누계	통화	선도	0	1,812	-1,812	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213CCM KRW/EUR 24-03-23E	56
FXW213D1R KRW/EUR 28-04-23E	45
FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E	45
OESXH3-C42 EURO STOXX 50	1
OESXH3-P42 EURO STOXX 50	4
VGH3 EURO STOXX 50 Mar23	79

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

(단위:백만원)

200

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

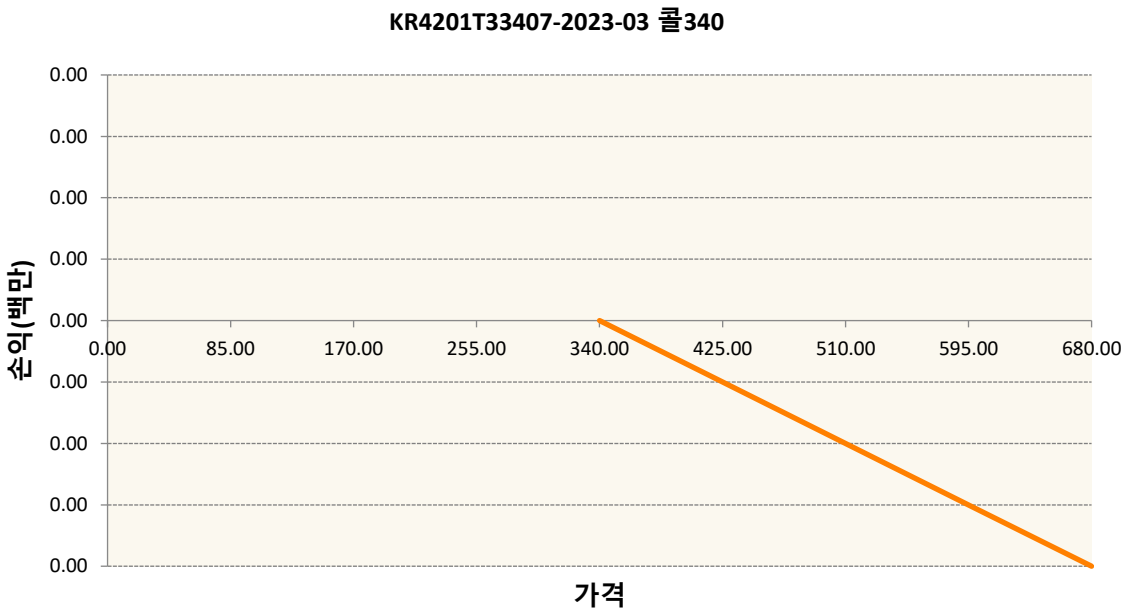
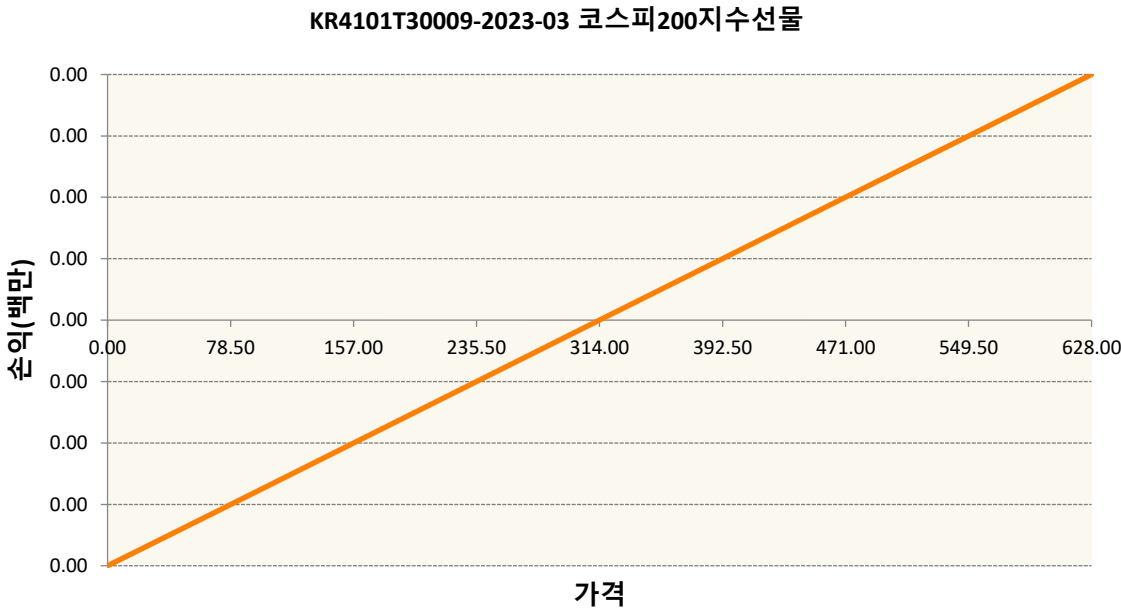
리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

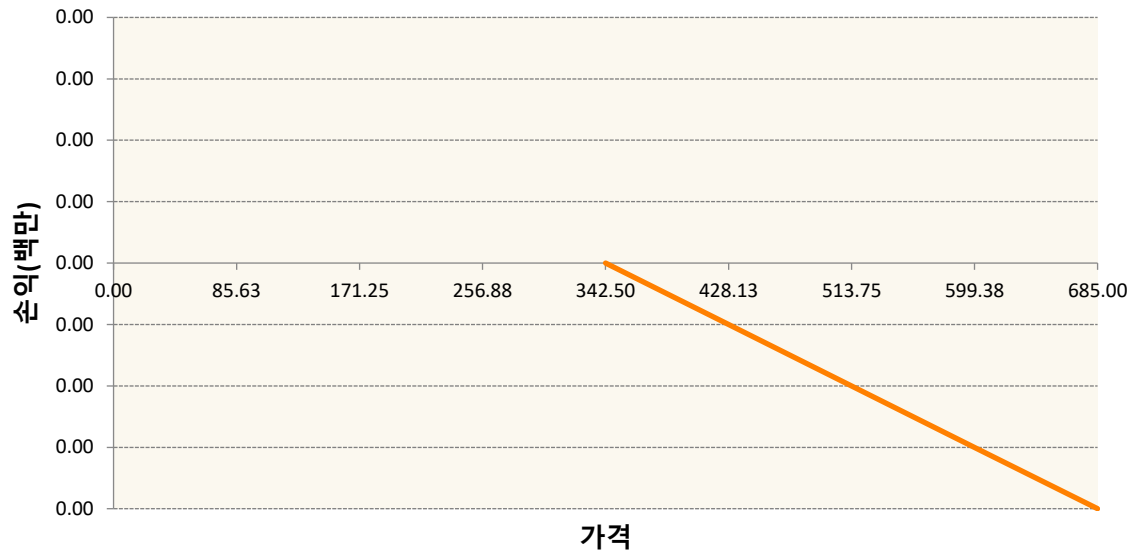
1. 계약금액

(단위:백만원)

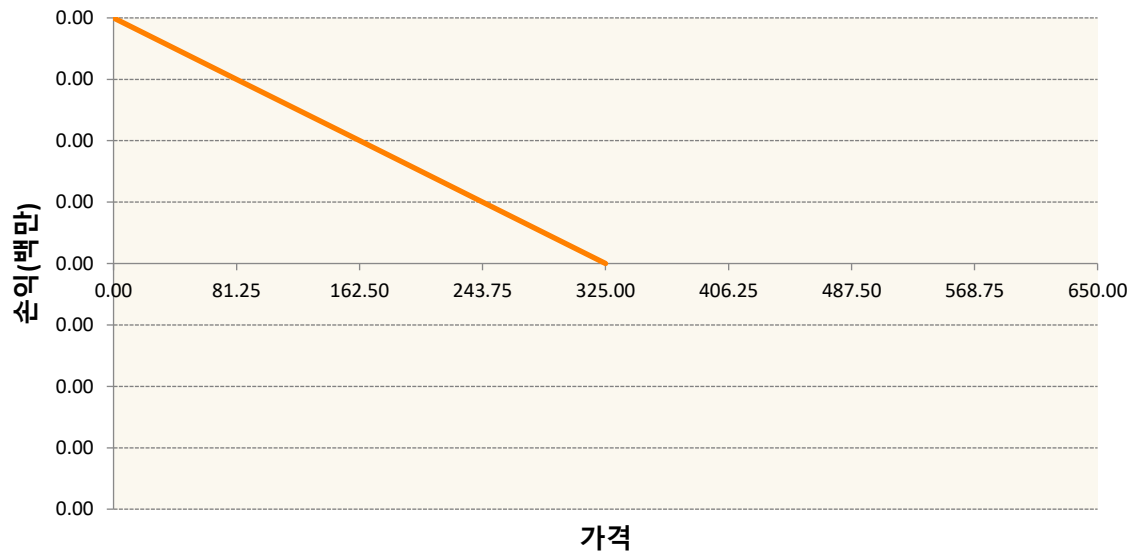
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	393	0	393	장내
누계	유가증권	옵션	163	4,009	-3,846	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4201T33423-2023-03 **콜**342.5

KR4301T33256-2023-03 쪽325



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					31
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31
KR4201T33407		2023-03 콜340					69
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	15	14	14	13	13	11	10
-5.33%	14	14	13	11	10	8	6
-2.67%	13	11	9	7	5	2	-1
0%	9	6	3	0	-4	-7	-12
2.67%	1	-3	-7	-12	-16	-21	-26
5.33%	-13	-18	-23	-29	-34	-40	-45
8.00%	-35	-41	-46	-52	-58	-64	-69
KR4201T33423 2023-03 콜342.5							57

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	10	9	9	7
-5.33%	11	10	10	9	7	6	4
-2.67%	10	9	7	6	4	1	-1
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	1	-2	-5	-9	-13	-17	-21
5.33%	-9	-14	-18	-23	-27	-32	-37
8.00%	-26	-31	-37	-42	-47	-52	-57

KR4301T33256 2023-03 풋325							11
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10	10	10	10	10	10	11
-5.33%	6	6	6	6	7	7	7
-2.67%	2	2	3	3	3	4	4
0%	-1	-1	0	0	0	1	1
2.67%	-4	-3	-3	-2	-2	-2	-1
5.33%	-6	-5	-5	-4	-4	-3	-3
8.00%	-7	-7	-6	-6	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

129

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

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	7,065	0	7,065	

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	2023-02-28
기준일	2023-02-27

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	5,762	0	5,762	

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	2023-02-28
기준일	2023-02-27

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	20,020	0	20,020	
누계	통화	선도	198	29,324	-29,126	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	
FXW213CBQ KRW/USD 28-02-23E		676
FXW213CCS(KRW/USD 28-03-23E		561
FXW213D1S(KRW/USD 28-04-23E		316
FXW213D1T(KRW/USD 28-02-23E		79
FXW213D2F(USD/KRW 28-02-23E		16
FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E		713

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

(단위:백만원)

1,325

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

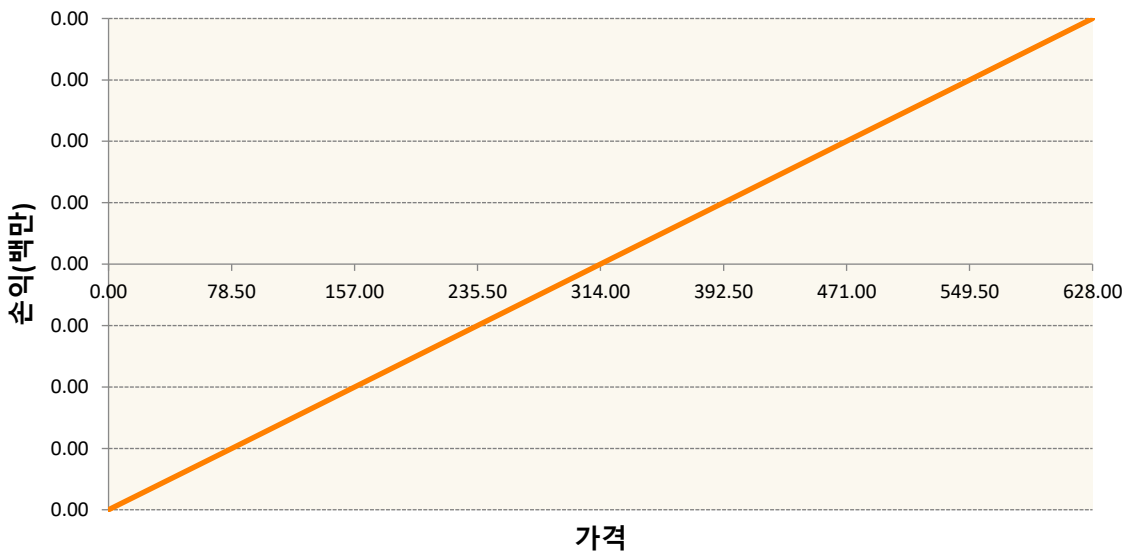
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,335	0	1,335	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T30009-2023-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009		2023-03 코스피200지수선물					107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-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%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

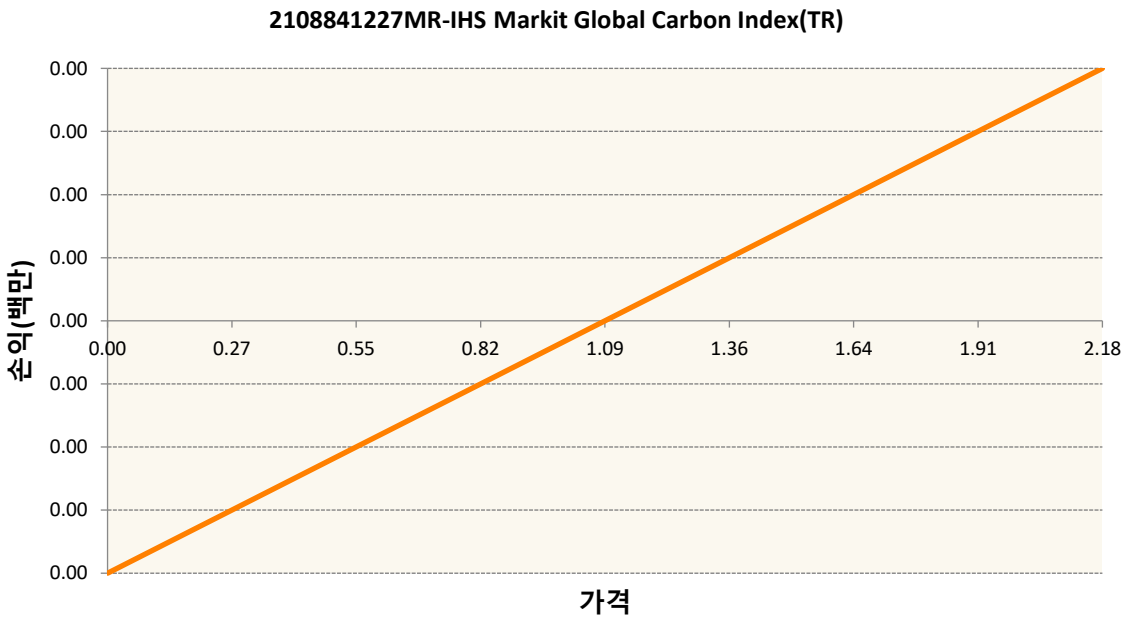
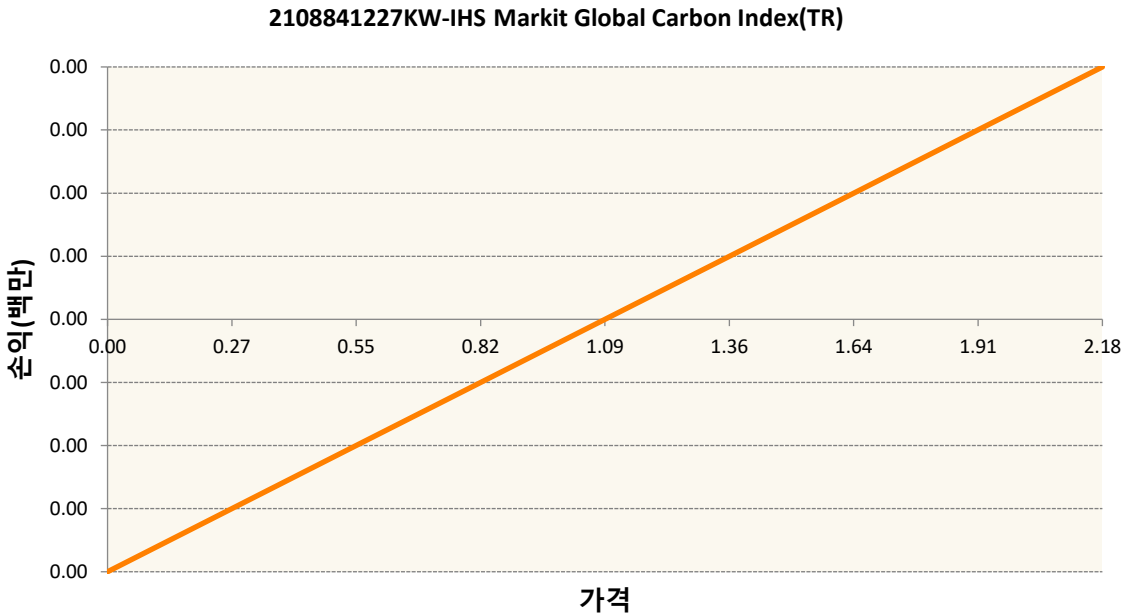
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

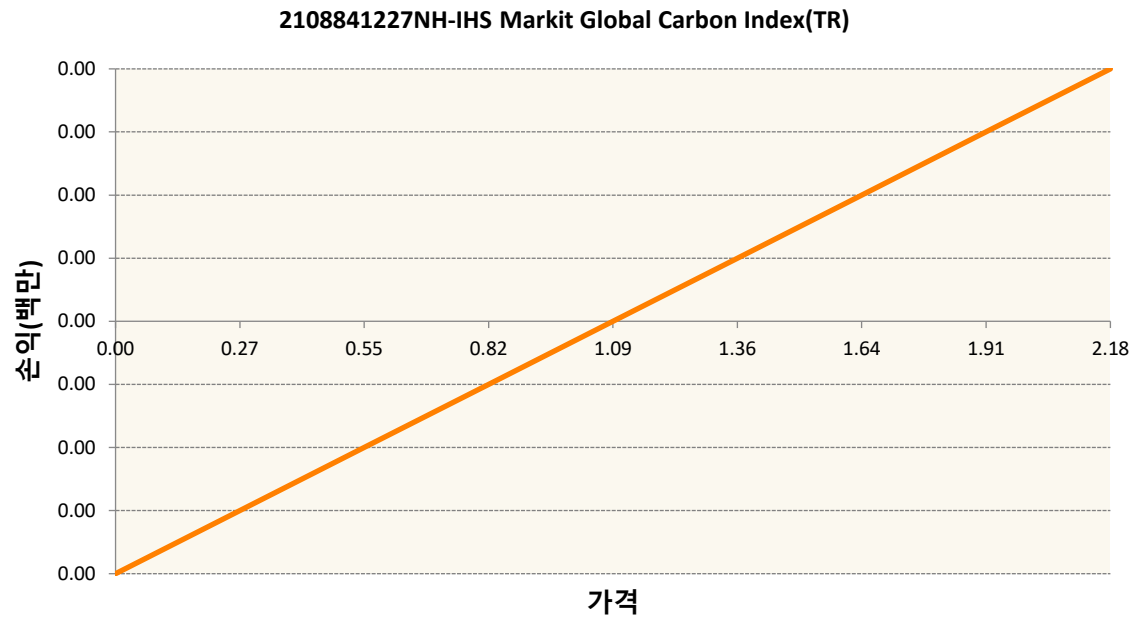
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	26,537	0	26,537	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		1,798
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		212
2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR)		106

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		4,075

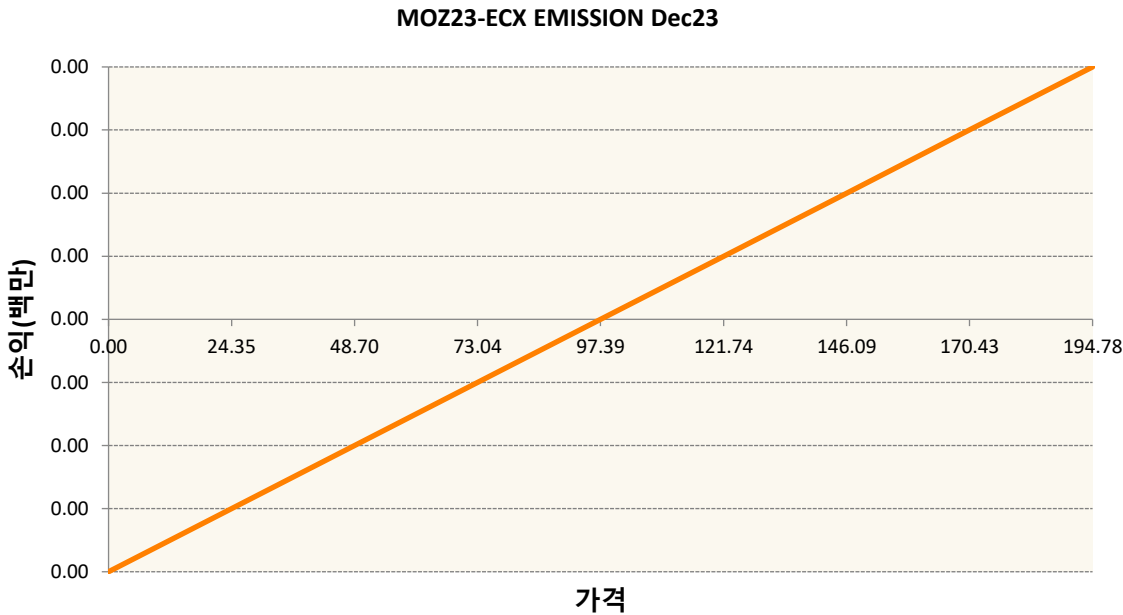
공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

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	10,216	0	10,216	
누계	통화	선도	0	3,624	-3,624	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	145
FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E	145
MOZ23 ECX EMISSION Dec23	817

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

2,334

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

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)

124

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

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)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(메리츠)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(미래)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 230116(키움)	6

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

(단위:백만원)

35

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

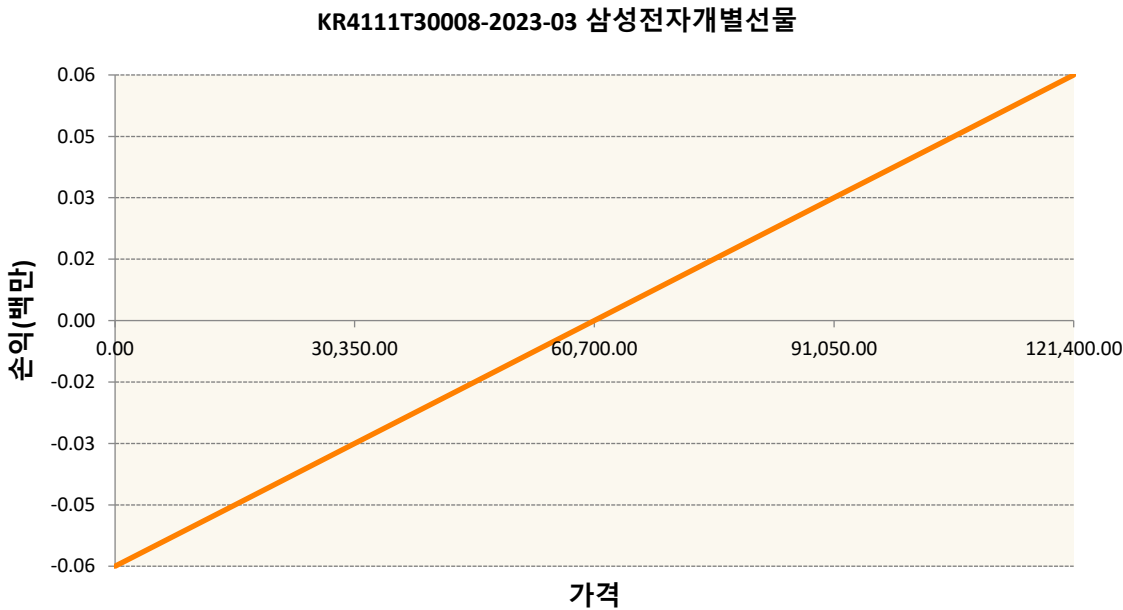
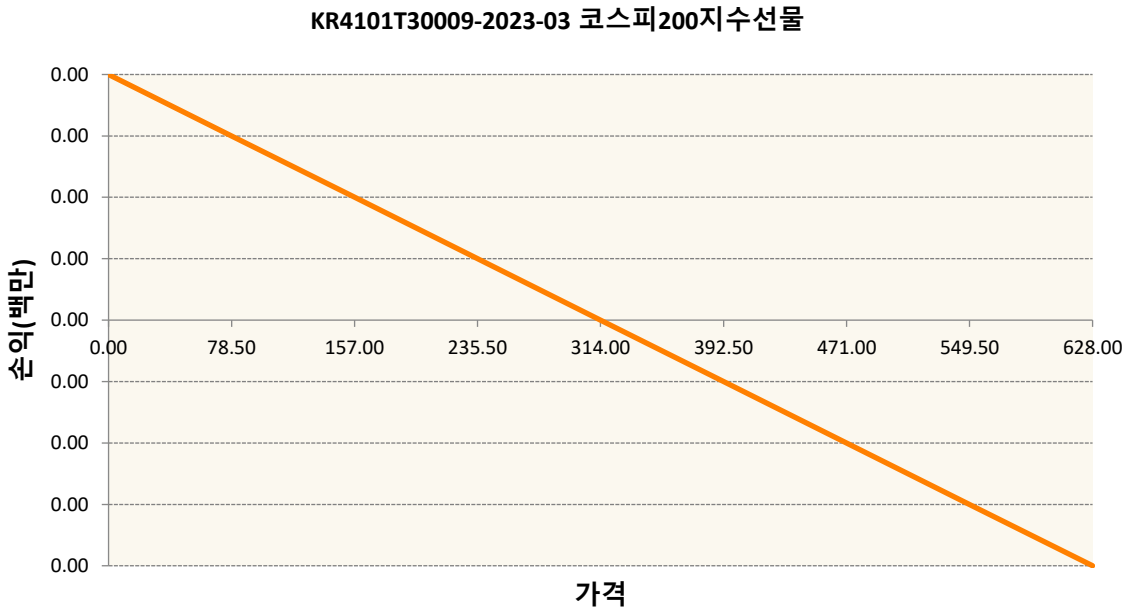
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

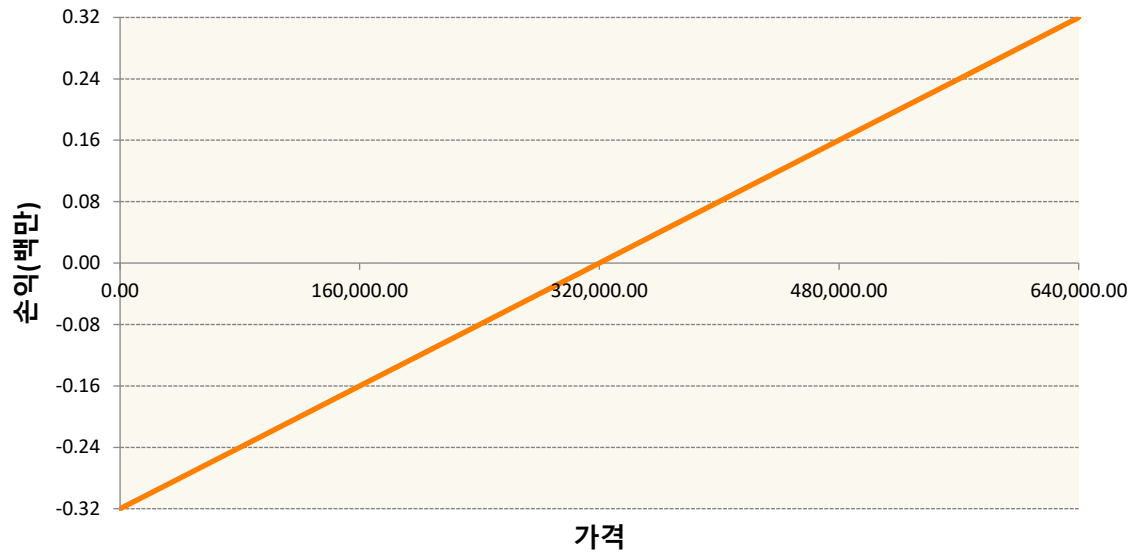
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	391	65	327	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,058	3,822	-2,764	장내
누계	유가증권	스왑	0	0	0	장외

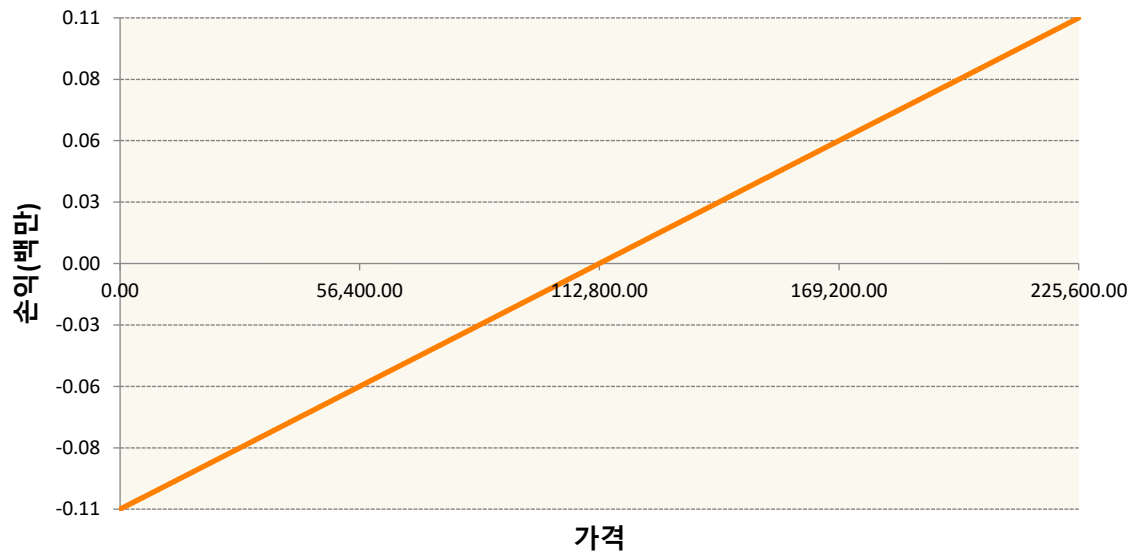
2. 만기시점의 손익구조



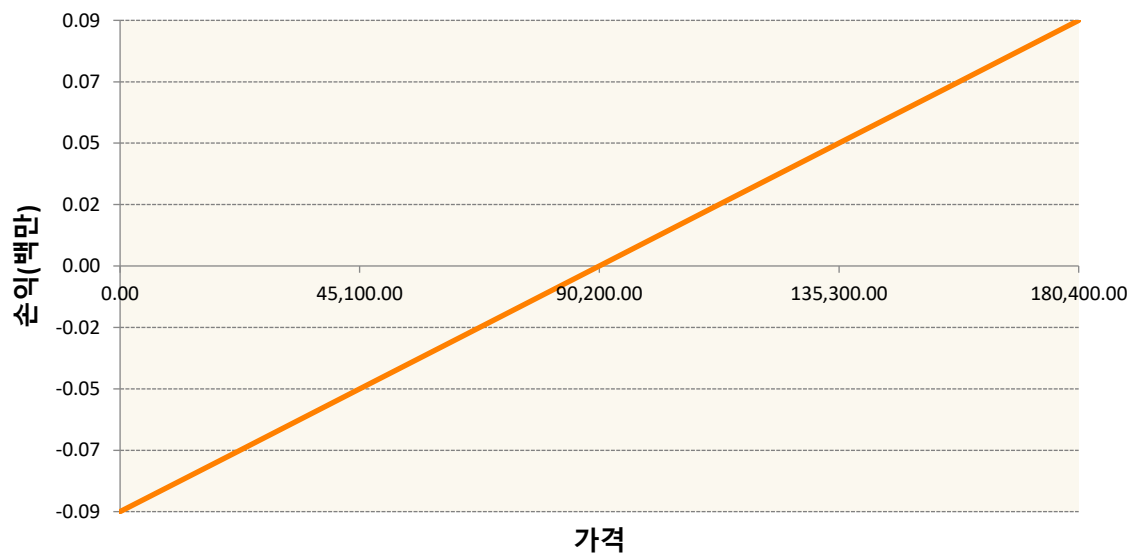
KR4113T30004-2023-03 POSCO개별선물



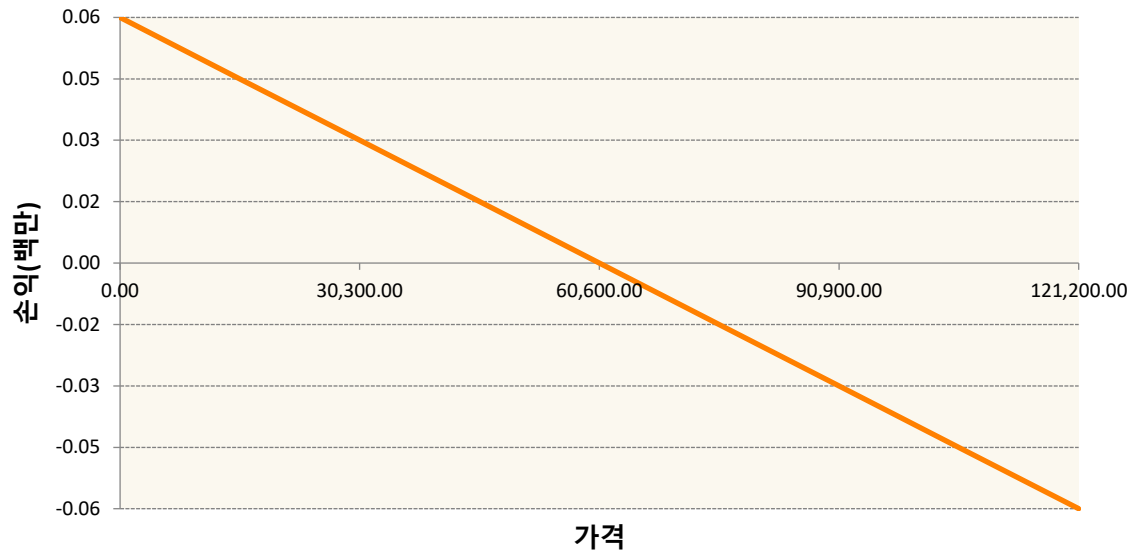
KR4124T30001-2023-03 LG전자개별선물



KR4150T30006-2023-03 SK하이닉스개별선물



KR41F7T30000-2023-03 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221	0.34
KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221	0.25
KR4101T300 2023-03 코스피200지수선물	283
KR4111T300 2023-03 삼성전자개별선물	10
KR4113T300 2023-03 POSCO개별선물	46
KR4124T300 2023-03 LG전자개별선물	18
KR4150T300 2023-03 SK하이닉스개별선물	11
KR41F7T300 2023-03 카카오페이개별선물	23

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

(단위:백만원)

555

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

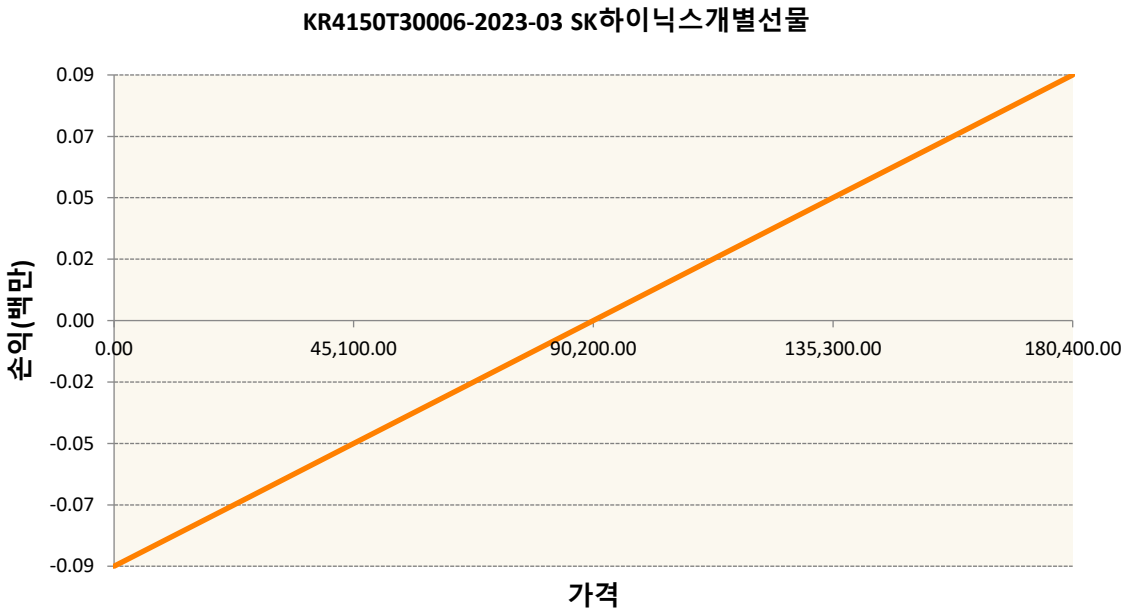
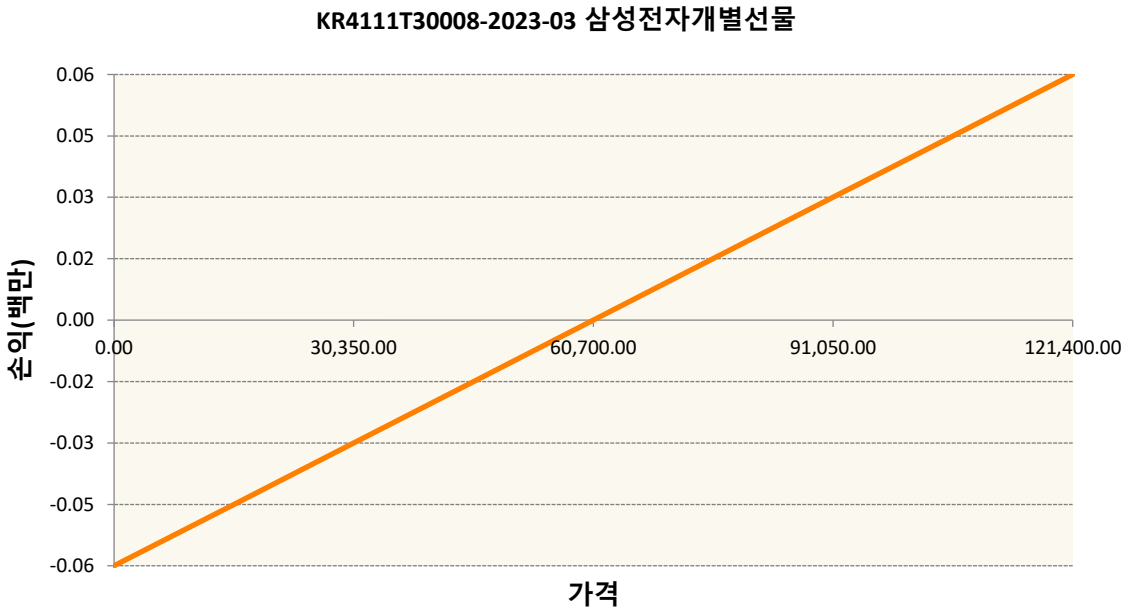
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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	151	0	151	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	2023-02-28
기준일	2023-02-27

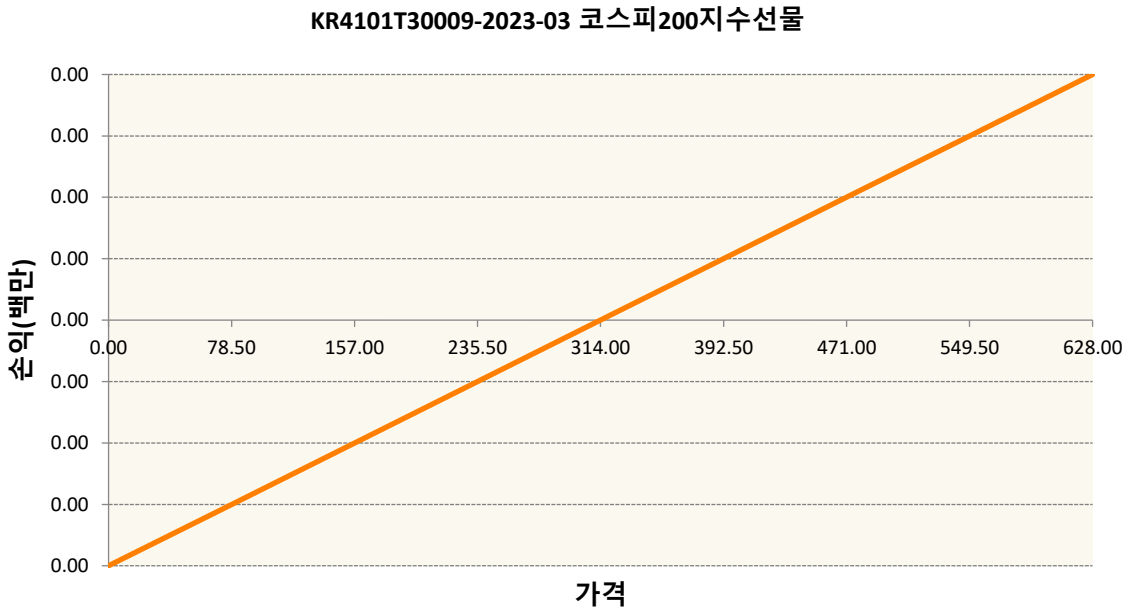
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	79	0	79	장내
누계	유가증권	선물	2,983	0	2,983	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101T30009			2023-03 코스피200지수선물				239
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
-5.33%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-2.67%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	80	80	80	80	80	80	80
5.33%	159	159	159	159	159	159	159
8.00%	239	239	239	239	239	239	239

공시일	2023-02-28
기준일	2023-02-27

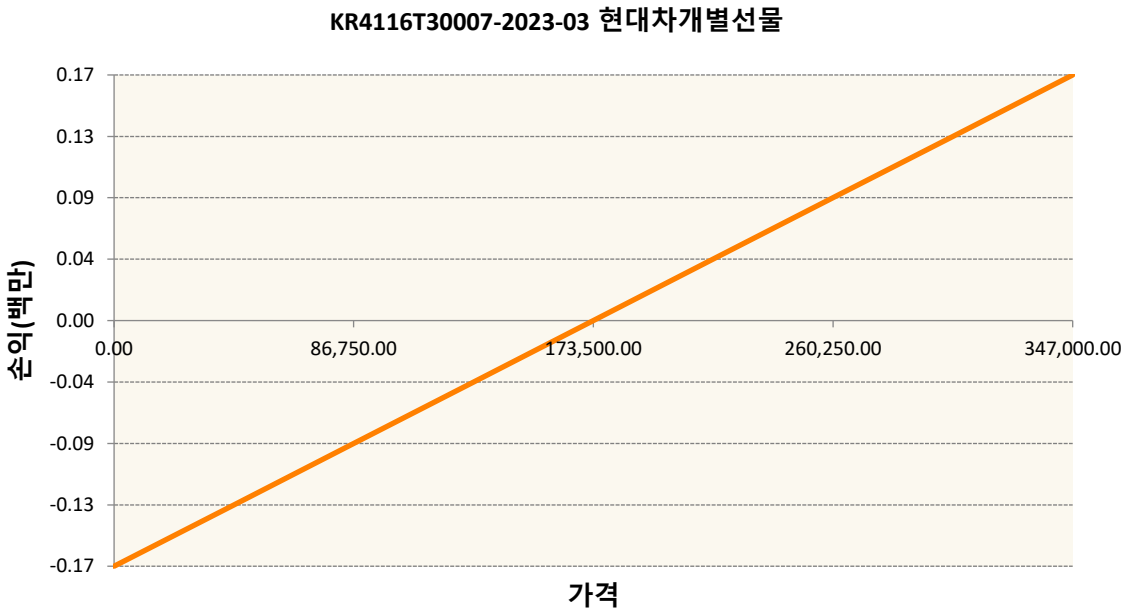
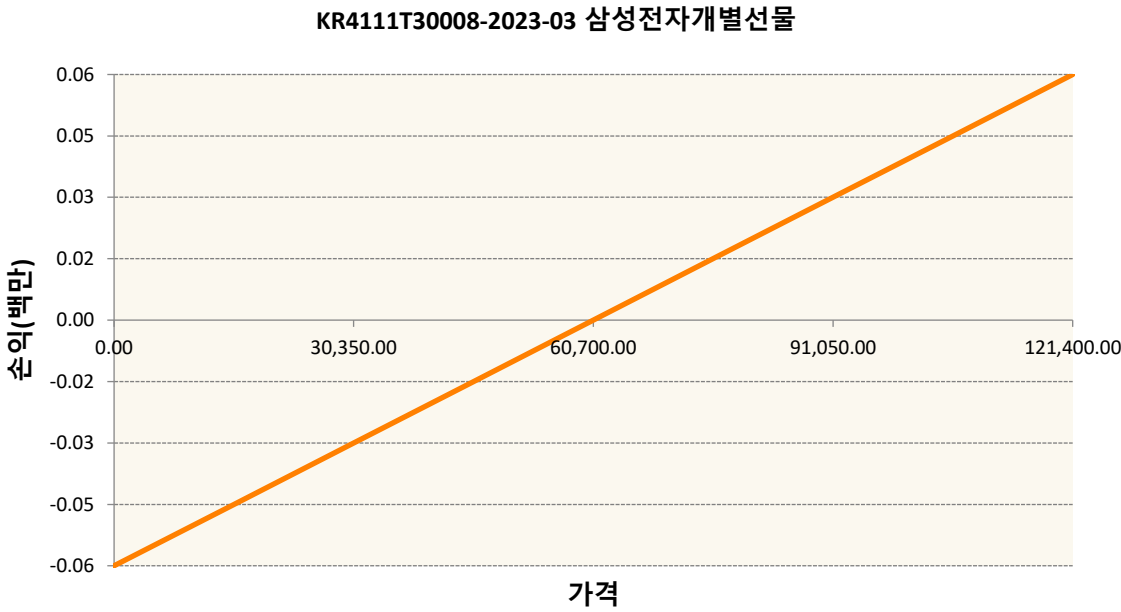
SOL한국형글로벌전기차&2차전지

1. 계약금액

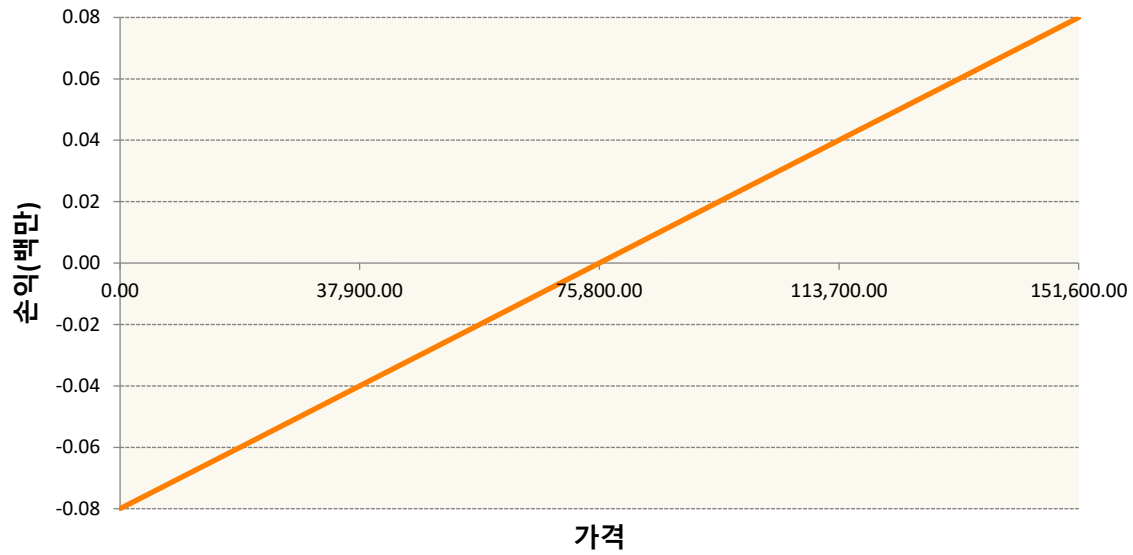
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	242	0	242	장내

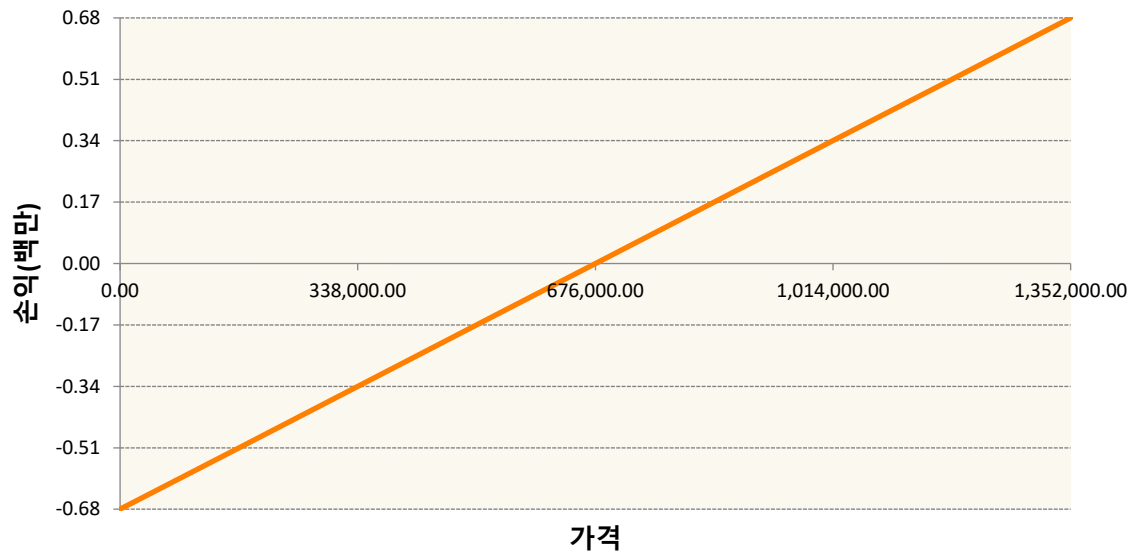
2. 만기시점의 손익구조



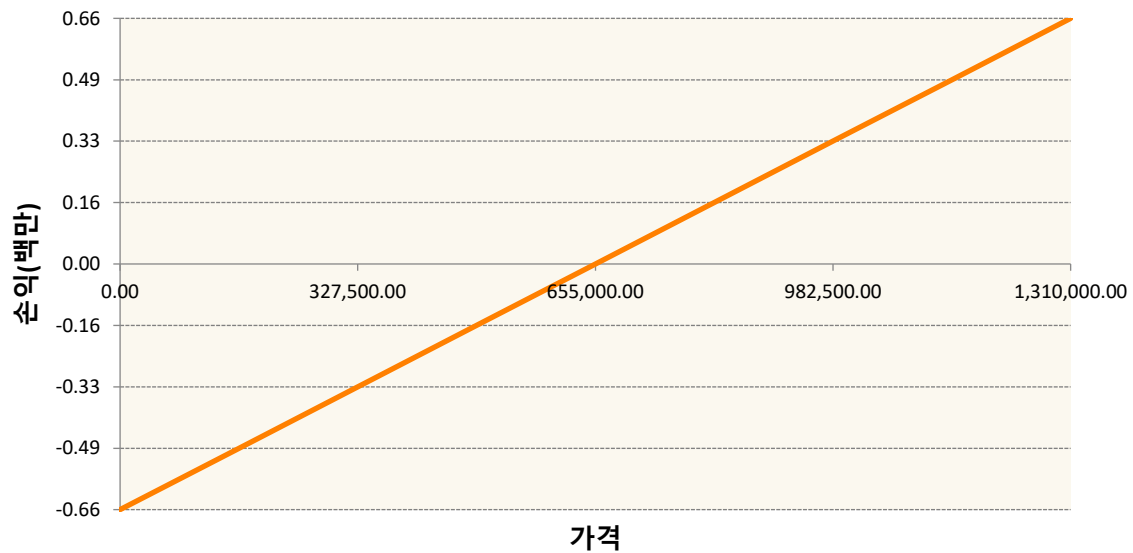
KR4119T30001-2023-03 기아개별선물



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		11
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
-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%	7	7	7	7	7	7	7	
8.00%	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 2023-02-28

기준일 2023-02-27

SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

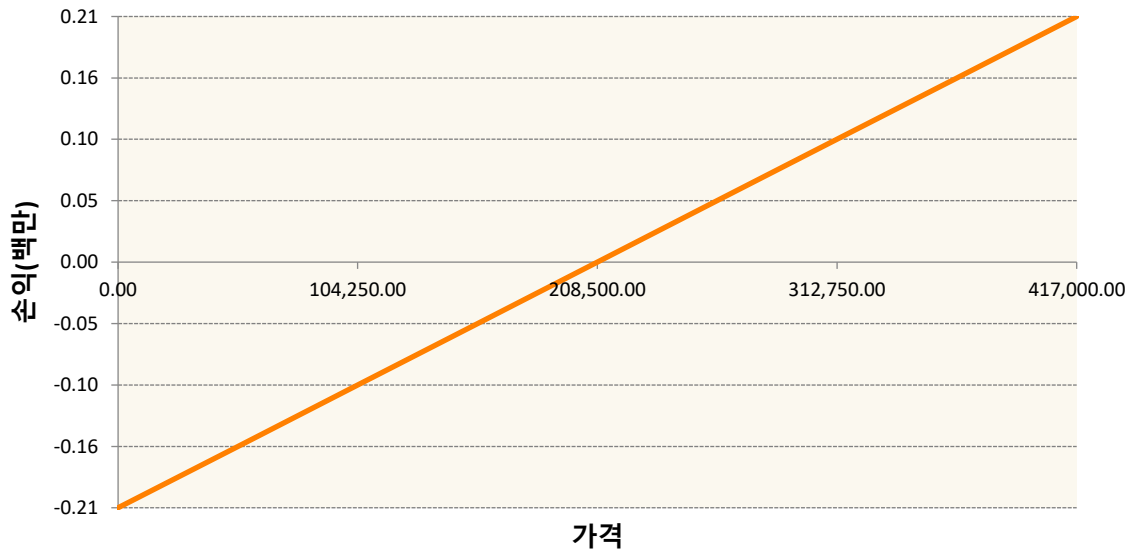
1. 계약금액

(단위:백만원)

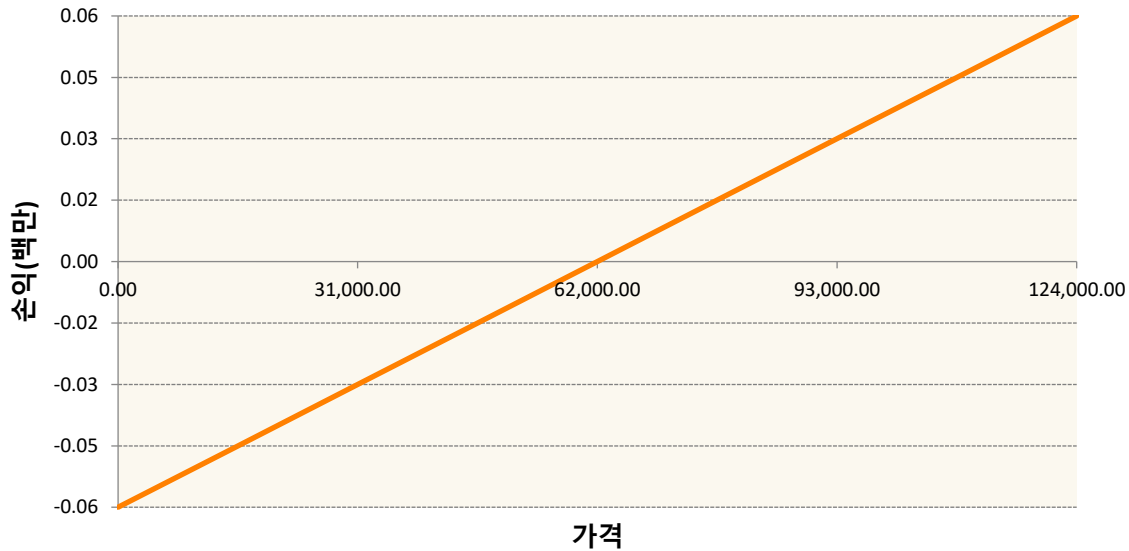
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	129	0	129	장내

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	2023-02-28
기준일	2023-02-27

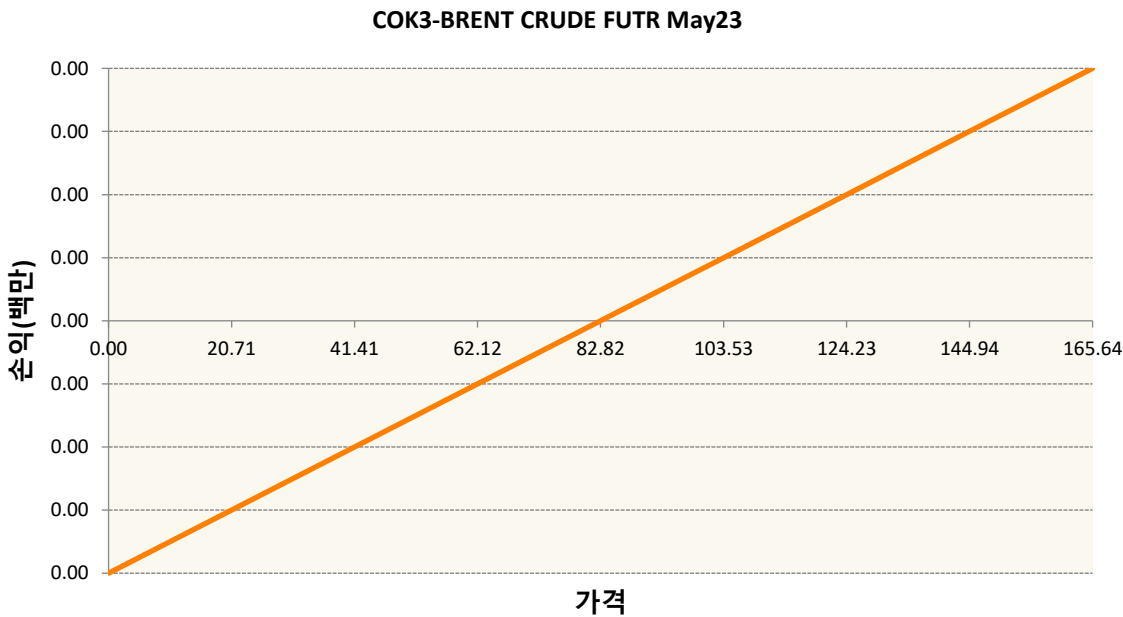
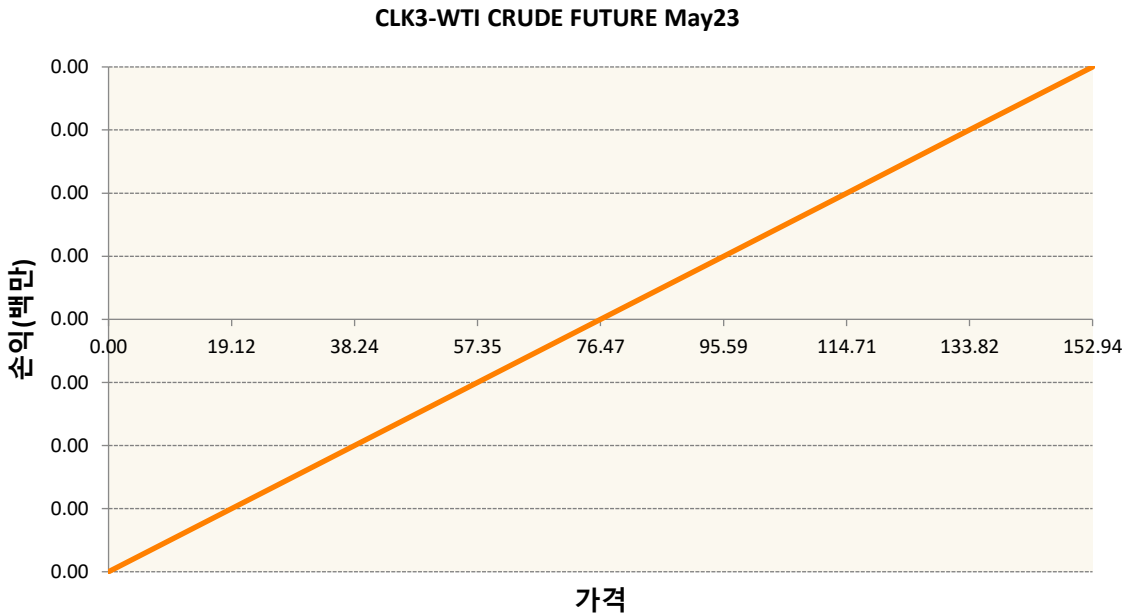
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

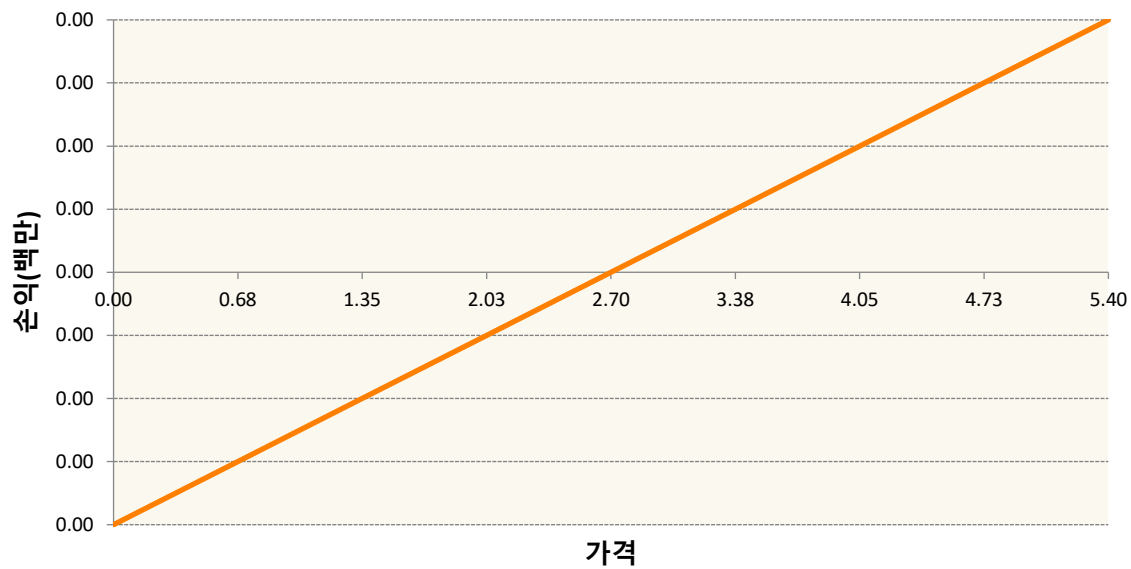
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,659	238	1,421	

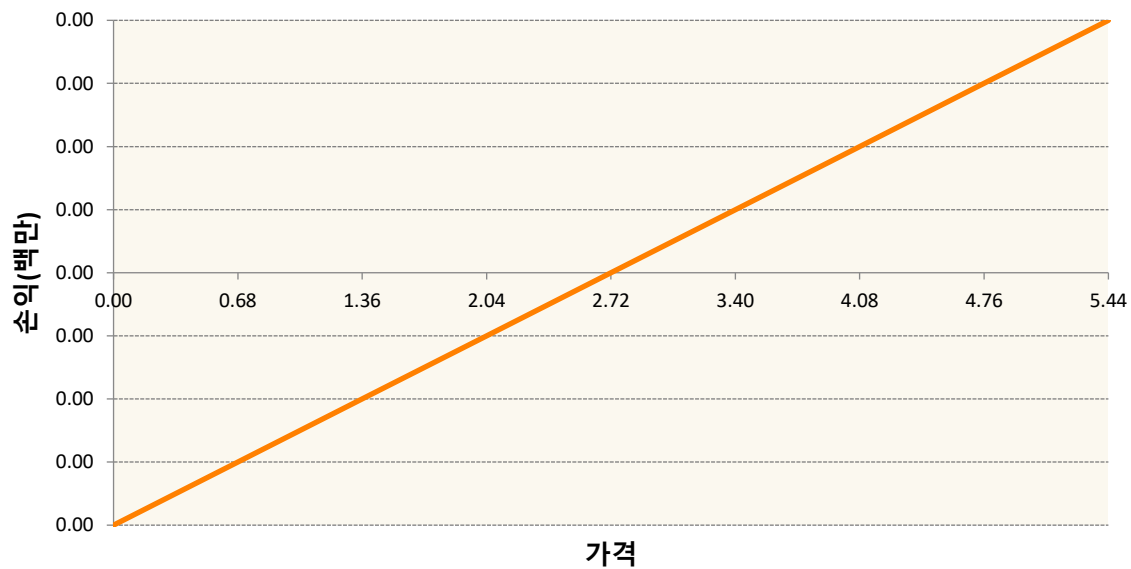
2. 만기시점의 손익구조



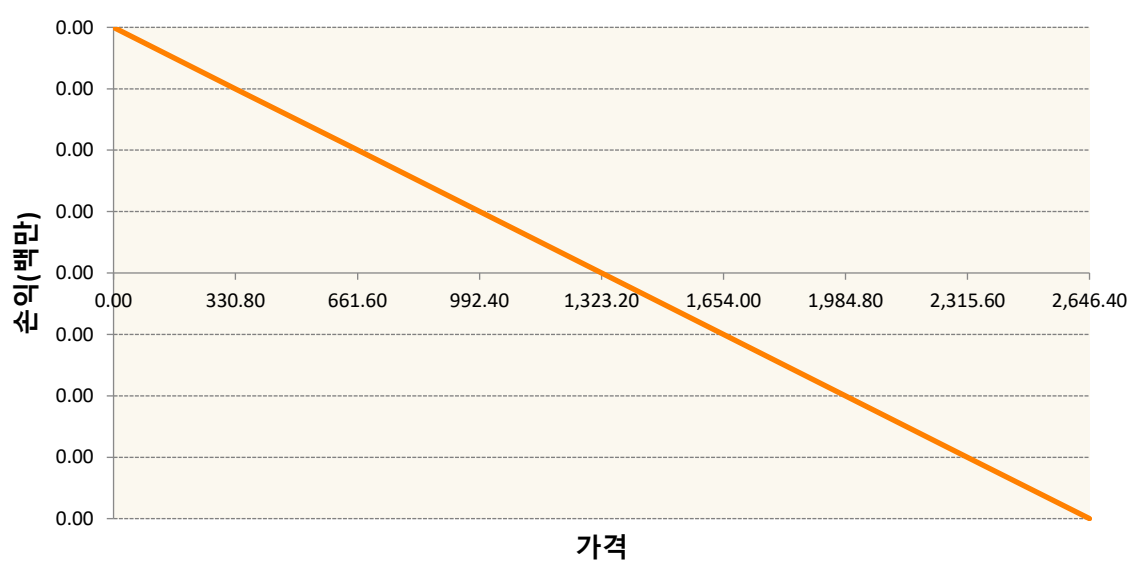
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



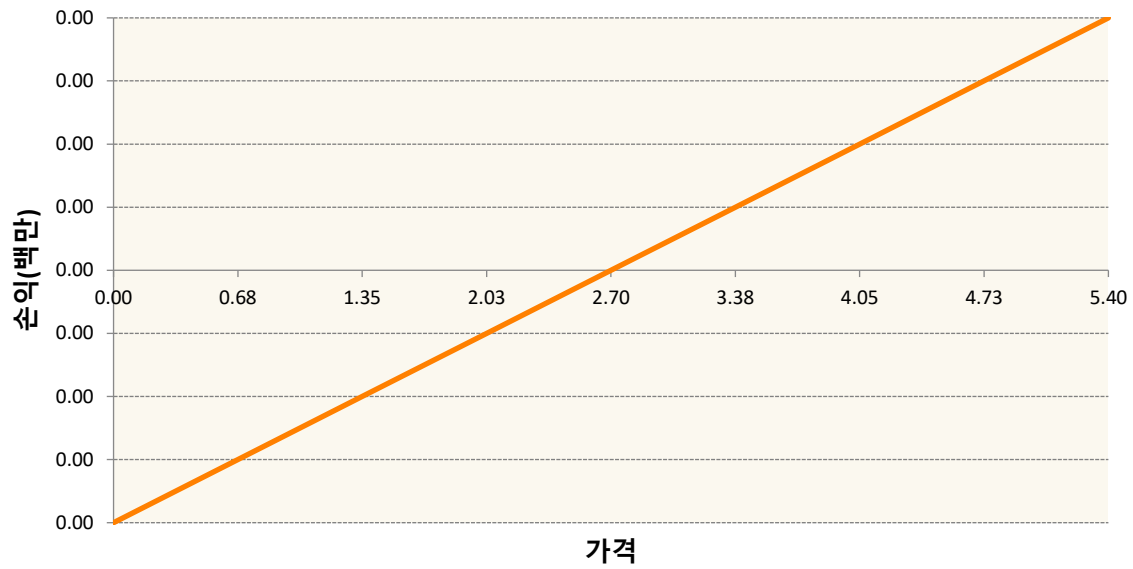
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



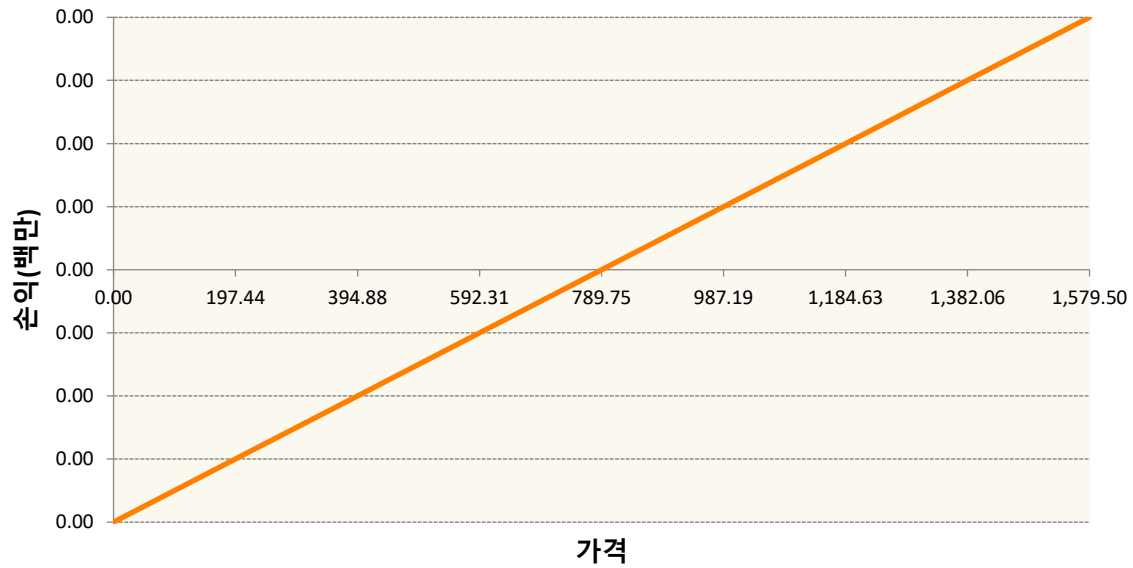
KR4175T30003-2023-03 달러선물



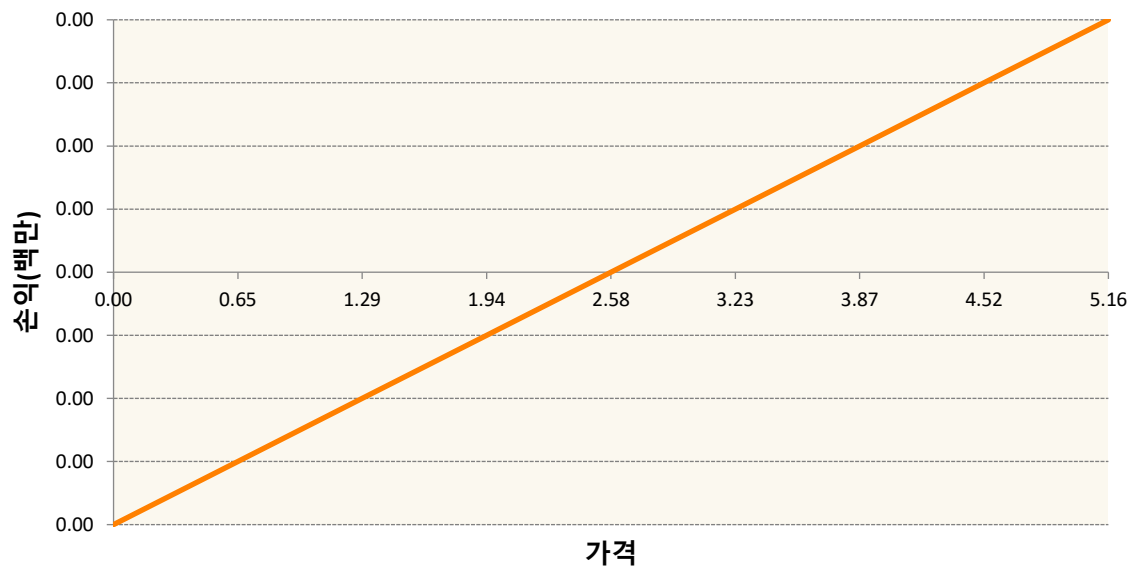
NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



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	12
KR4175T300	2023-03 달러선물	19
NGK23	NATURAL GAS FUTR May23	28
QSK3	Low Su Gasoil G May23	16
XBK3	GASOLINE RBOB FUT May23	11

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

434