

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

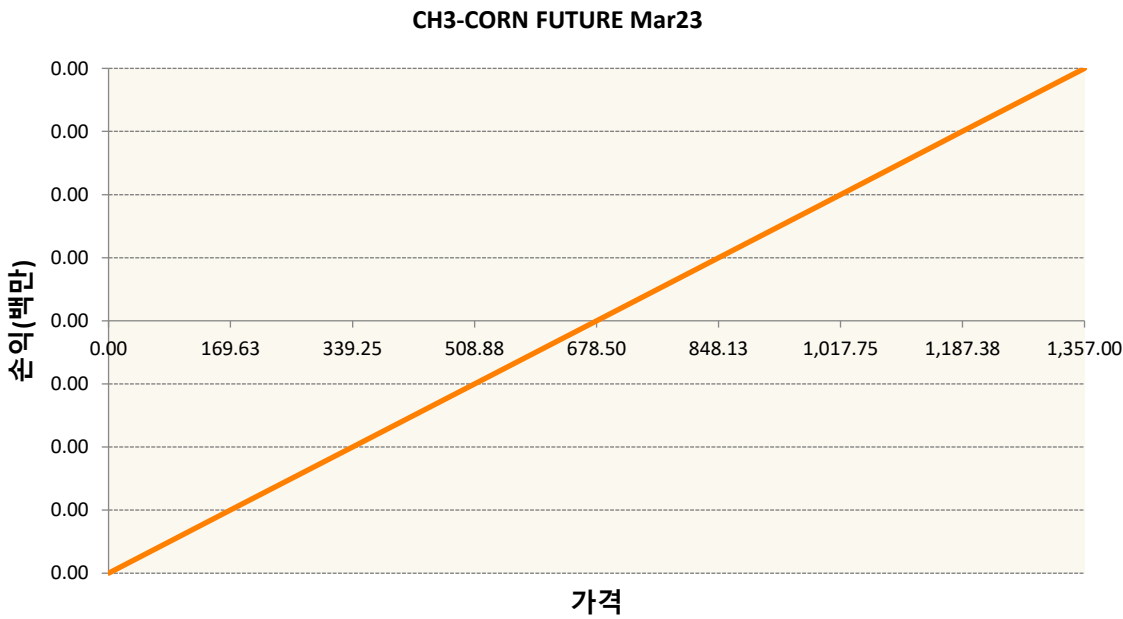
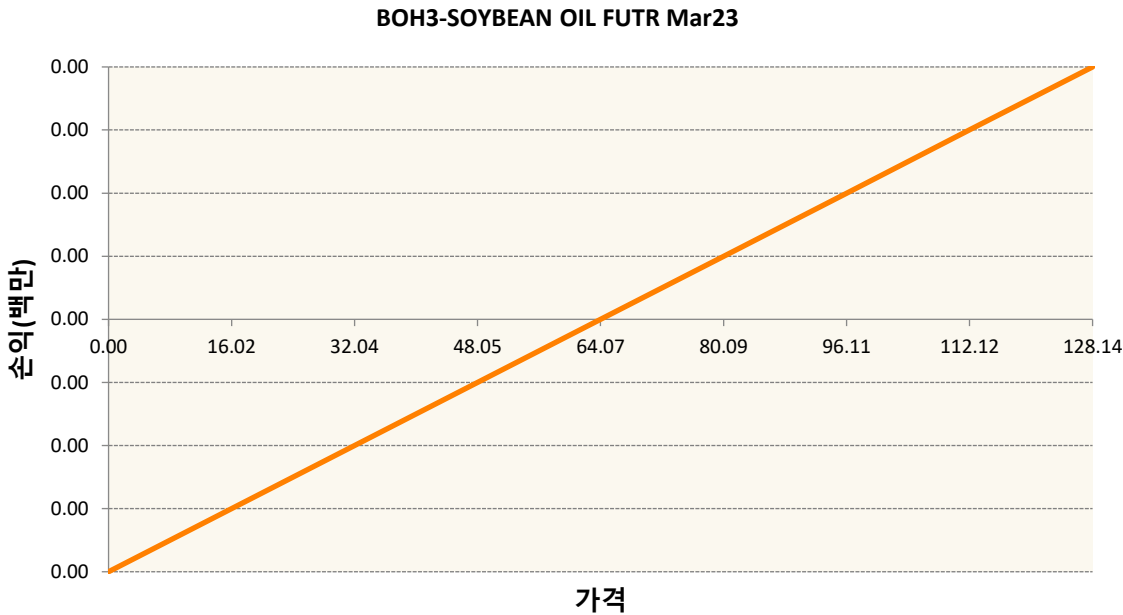
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

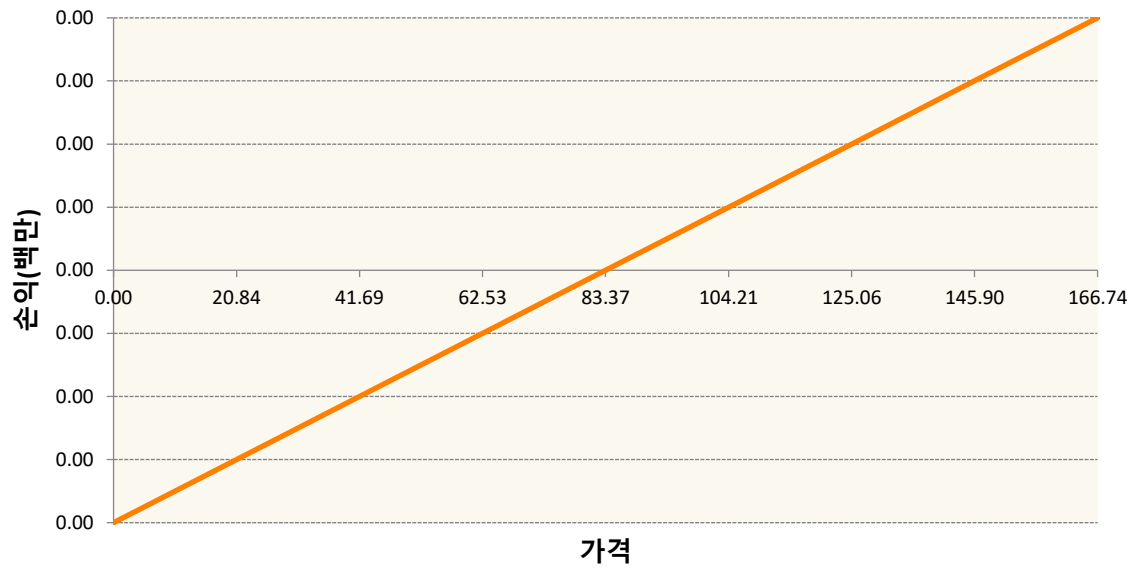
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,607 | 763   | 5,844     |    |

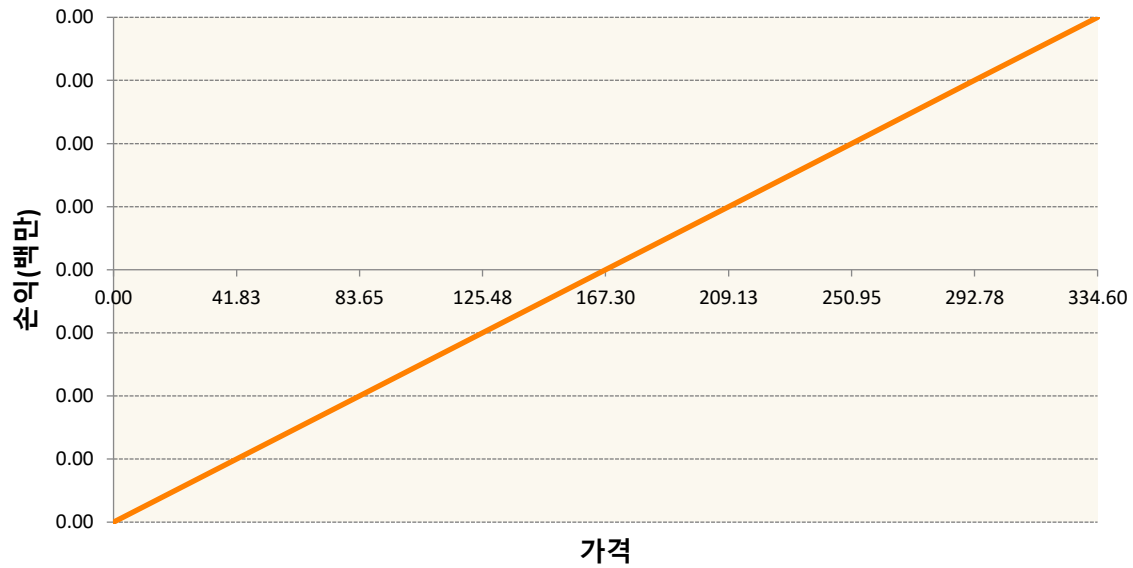
### 2. 만기시점의 손익구조



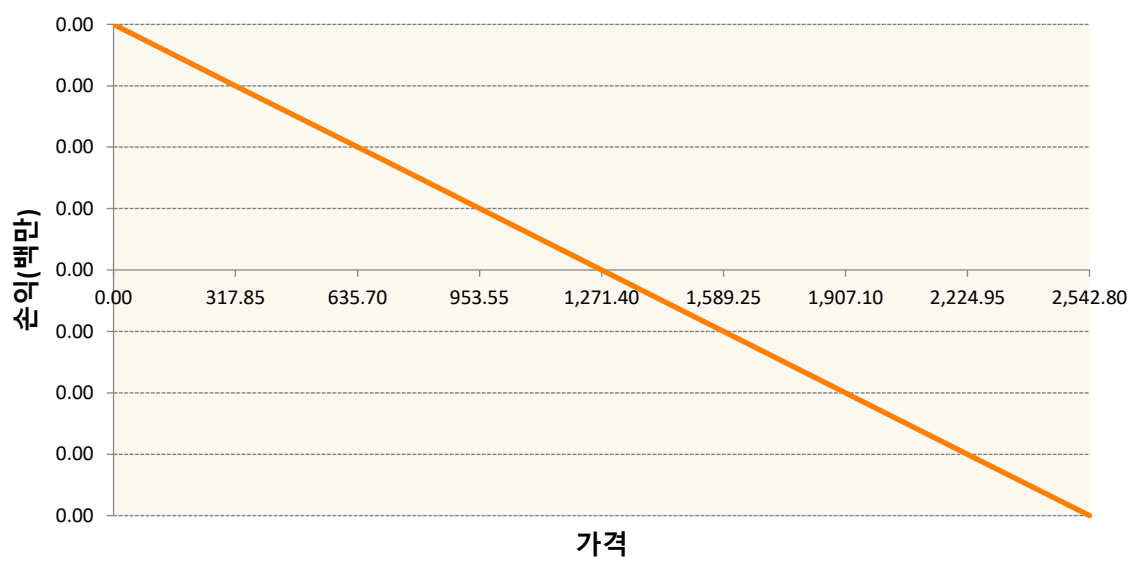
CTH3-COTTON NO.2 FUTR Mar23



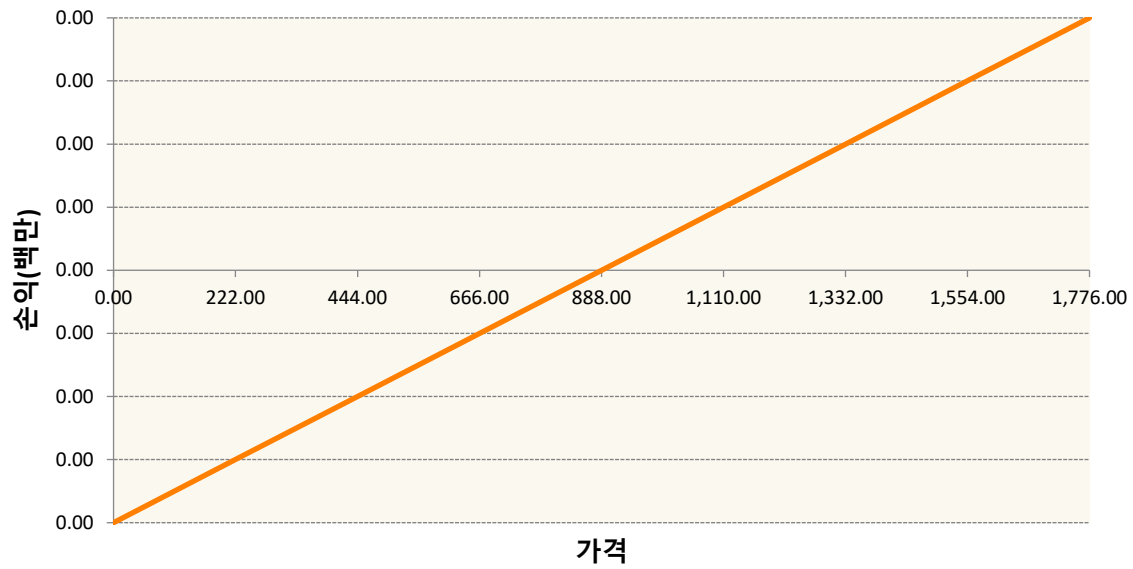
KCH3-COFFEE 'C' FUTURE Mar23



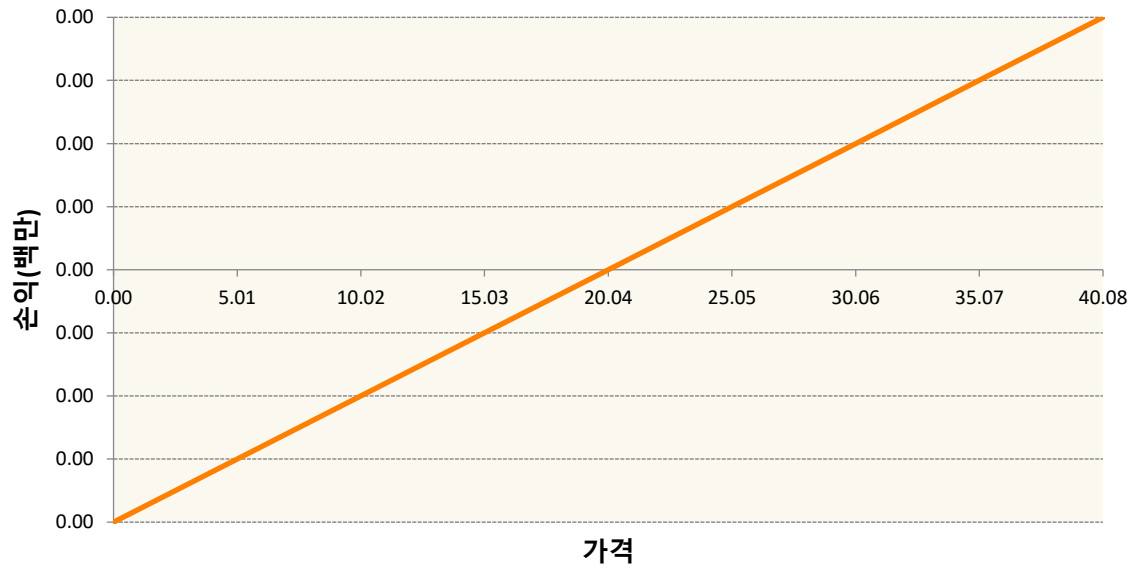
KR4175T10005-2023-01 달러선물



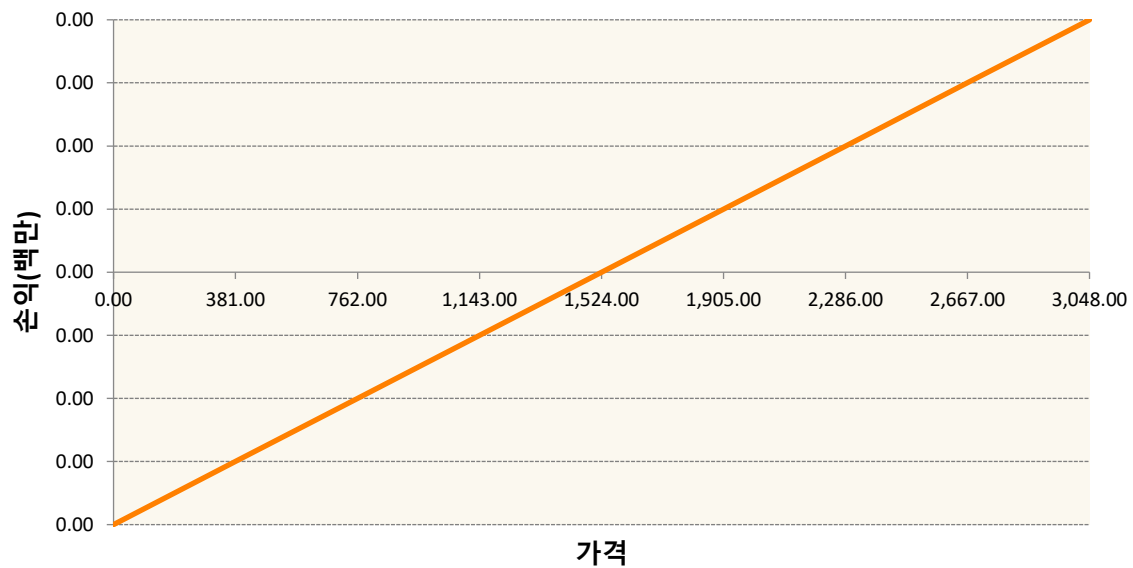
KWH3-KC HRW WHEAT FUT Mar23



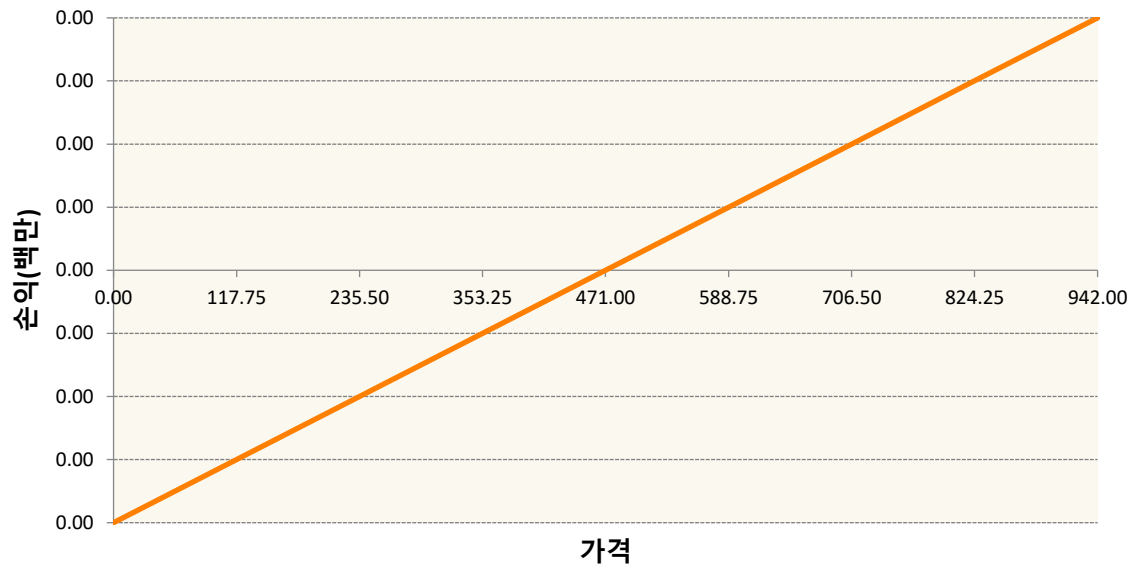
SBH3-Sugar #11 (WORLD) Mar23



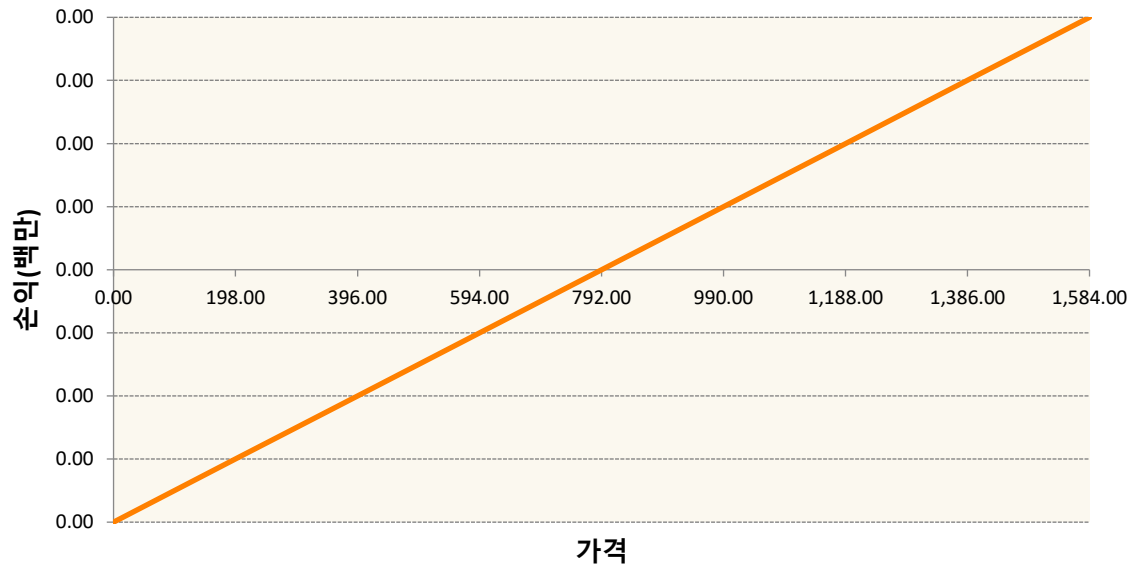
SH3-SOYBEAN FUTURE Mar23



SMH3-SOYBEAN MEAL FUTR Mar23



WH3-WHEAT FUTURE(CBT) Mar23



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

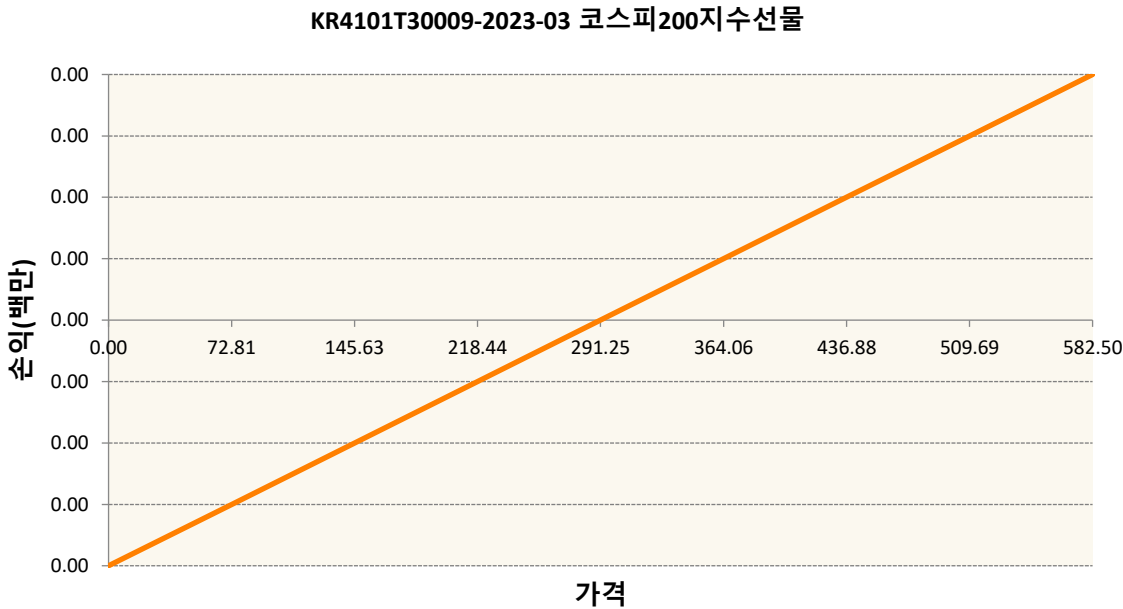
스마트인덱스모

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   | 1,820 | 0     | 1,820     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T30009 |           |         | 2023-03 코스피200지수선물 |      |       |        | 145    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -145      | -145    | -145               | -145 | -145  | -145   | -145   |
| -5.33%       | -97       | -97     | -97                | -97  | -97   | -97    | -97    |
| -2.67%       | -48       | -48     | -48                | -48  | -48   | -48    | -48    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 48        | 48      | 48                 | 48   | 48    | 48     | 48     |
| 5.33%        | 97        | 97      | 97                 | 97   | 97    | 97     | 97     |
| 8.00%        | 145       | 145     | 145                | 145  | 145   | 145    | 145    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

## SMART중국본토중소형CSI500상장

### 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

336

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

470

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

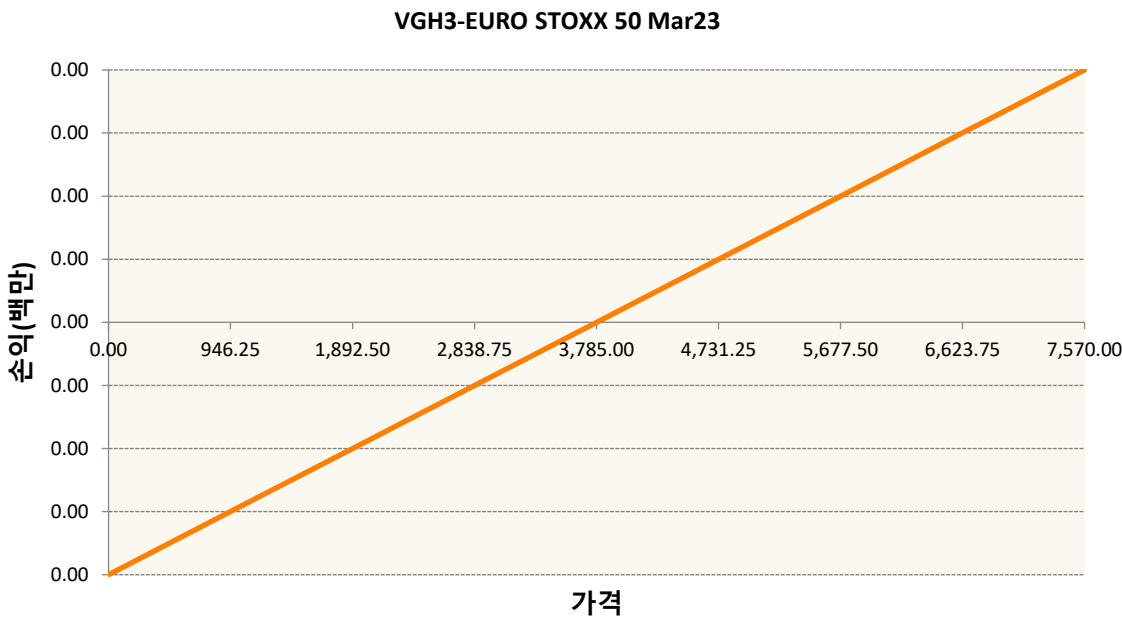
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 525   | 0     | 525       |    |

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 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

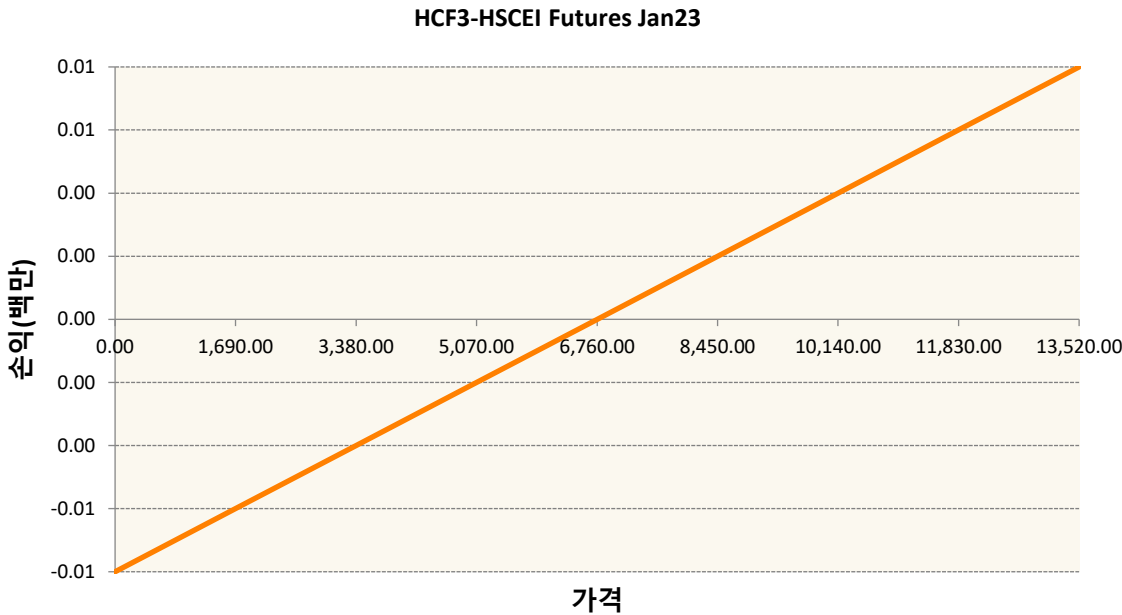
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,535 | 0     | 1,535     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCF3 | HSCEI Futures Jan23 | 123 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 205 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

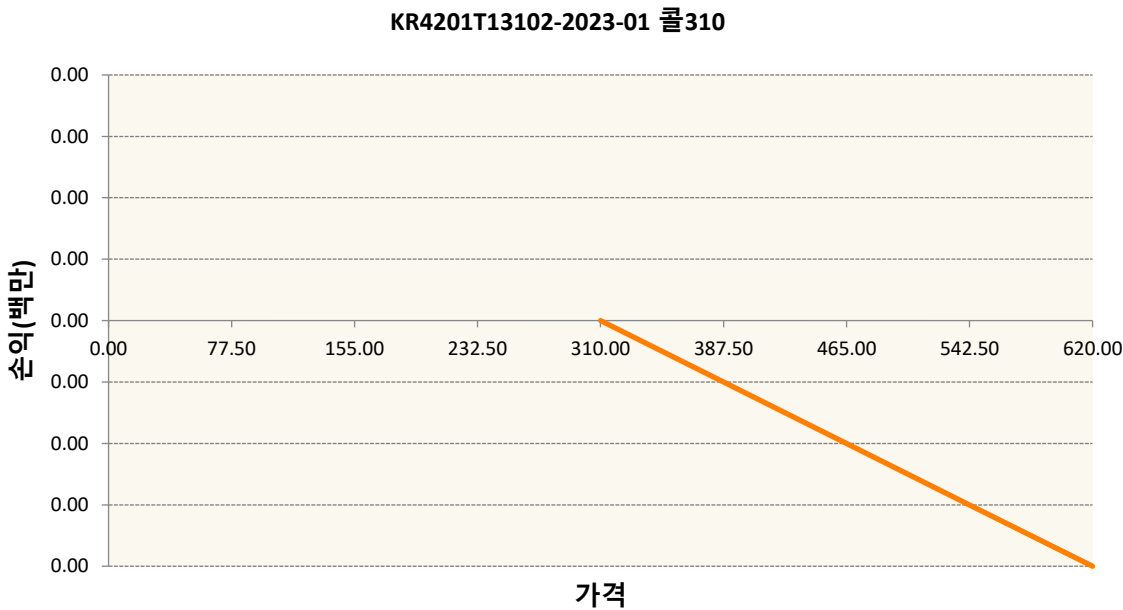
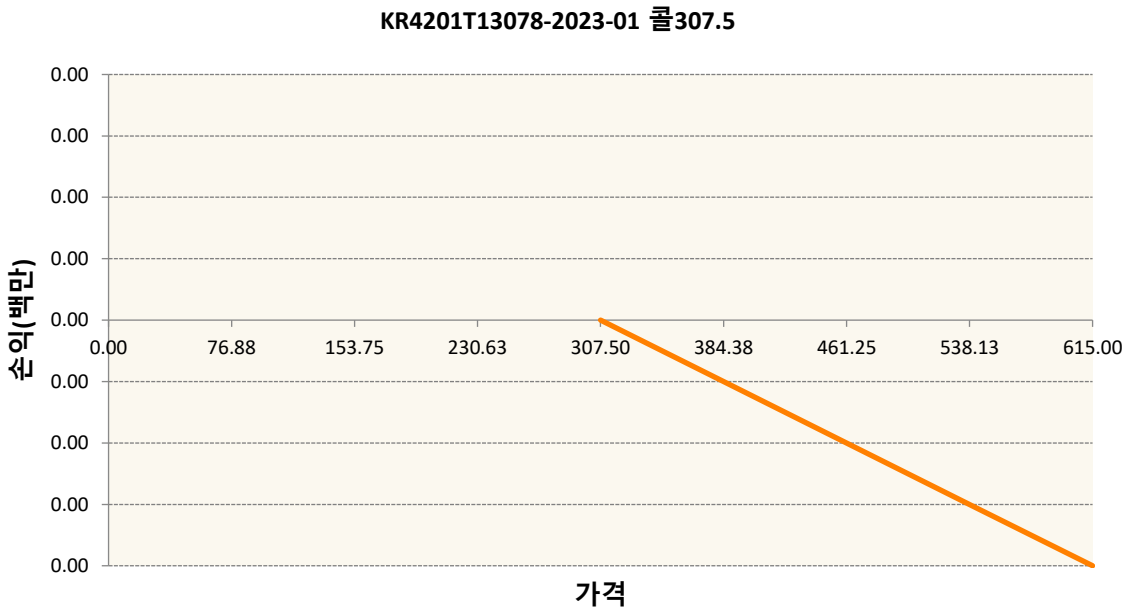
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

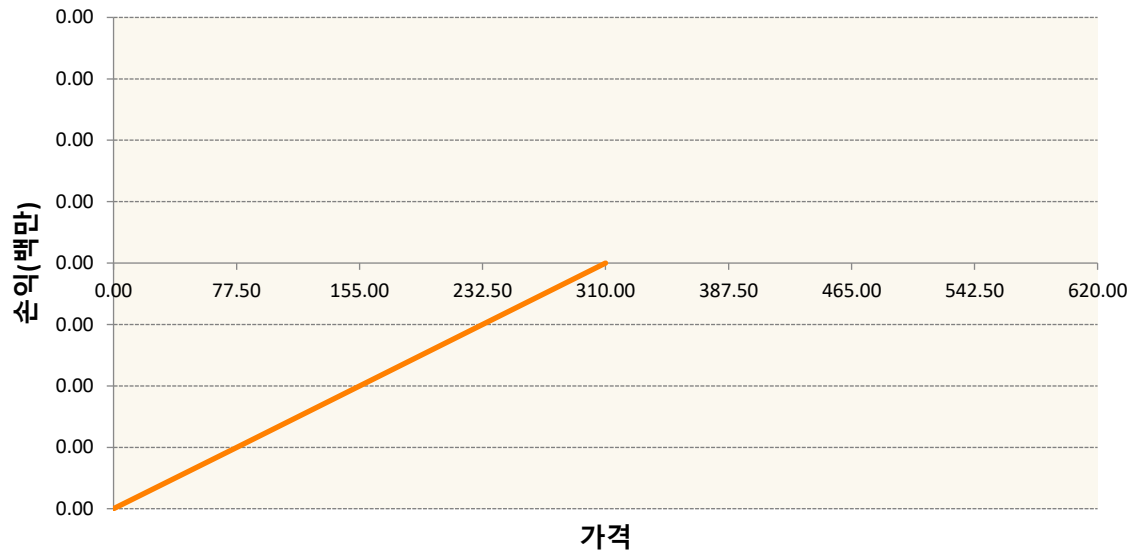
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 55,100 | -55,100   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301T13100-2023-01 풋310



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201T13078 |  | 2023-01 콜307.5 |         |        |        |        |        | 1,548  |
|--------------|--|----------------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
|              |  | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |  | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       |  | 434            | 424     | 409    | 388    | 362    | 330    | 293    |
| -5.33%       |  | 411            | 388     | 358    | 321    | 278    | 230    | 176    |
| -2.67%       |  | 352            | 308     | 257    | 199    | 136    | 69     | -2     |
| 0%           |  | 224            | 154     | 79     | 0      | -82    | -168   | -255   |
| 2.67%        |  | -12            | -106    | -201   | -297   | -395   | -494   | -594   |
| 5.33%        |  | -389           | -495    | -601   | -706   | -813   | -919   | -1,025 |
| 8.00%        |  | -918           | -1,022  | -1,126 | -1,231 | -1,337 | -1,442 | -1,548 |
| KR4201T13102 |  | 2023-01 콜310   |         |        |        |        |        | 258    |
|              |  | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |  | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       |  | 66             | 65      | 62     | 59     | 55     | 50     | 44     |
| -5.33%       |  | 63             | 60      | 55     | 49     | 43     | 35     | 26     |
| -2.67%       |  | 55             | 48      | 40     | 31     | 21     | 10     | -2     |
| 0%           |  | 36             | 25      | 13     | 0      | -14    | -28    | -43    |
| 2.67%        |  | 1              | -15     | -31    | -47    | -64    | -81    | -98    |
| 5.33%        |  | -58            | -76     | -95    | -114   | -132   | -151   | -170   |
| 8.00%        |  | -143           | -162    | -181   | -200   | -220   | -239   | -258   |
| KR4301T13100 |  | 2023-01 풋310   |         |        |        |        |        | 667    |
|              |  | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |  | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       |  | -637           | -639    | -642   | -646   | -652   | -659   | -667   |
| -5.33%       |  | -397           | -402    | -409   | -417   | -426   | -437   | -450   |
| -2.67%       |  | -166           | -175    | -186   | -199   | -214   | -230   | -246   |
| 0%           |  | 51             | 36      | 18     | 0      | -20    | -40    | -61    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 245 | 223 | 200 | 176 | 153 | 128 | 104 |
| 5.33% | 405 | 378 | 352 | 326 | 299 | 273 | 246 |
| 8.00% | 527 | 500 | 473 | 446 | 419 | 392 | 365 |

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

(단위:백만원)

2,049

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

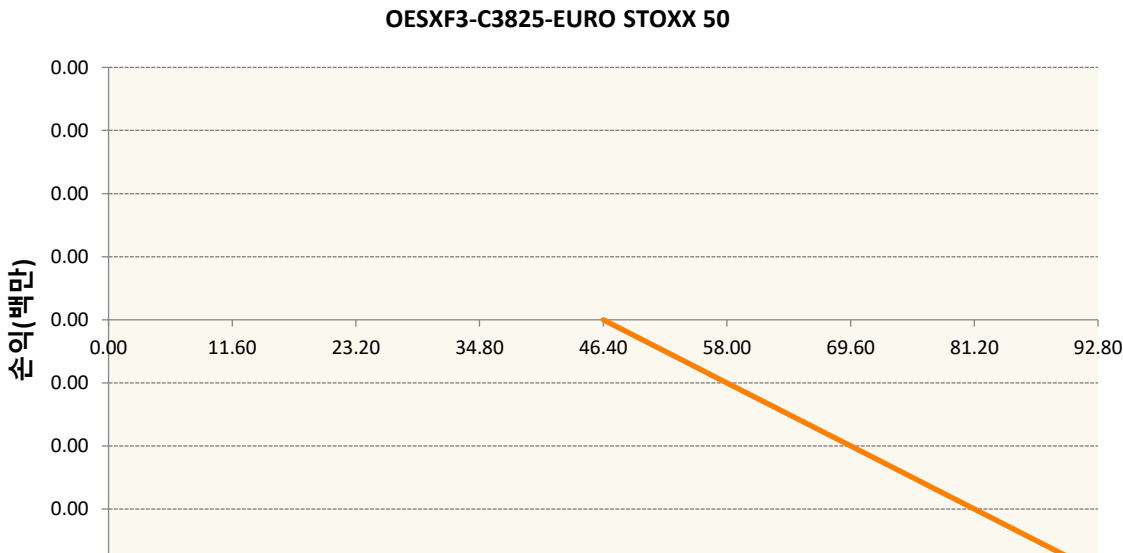
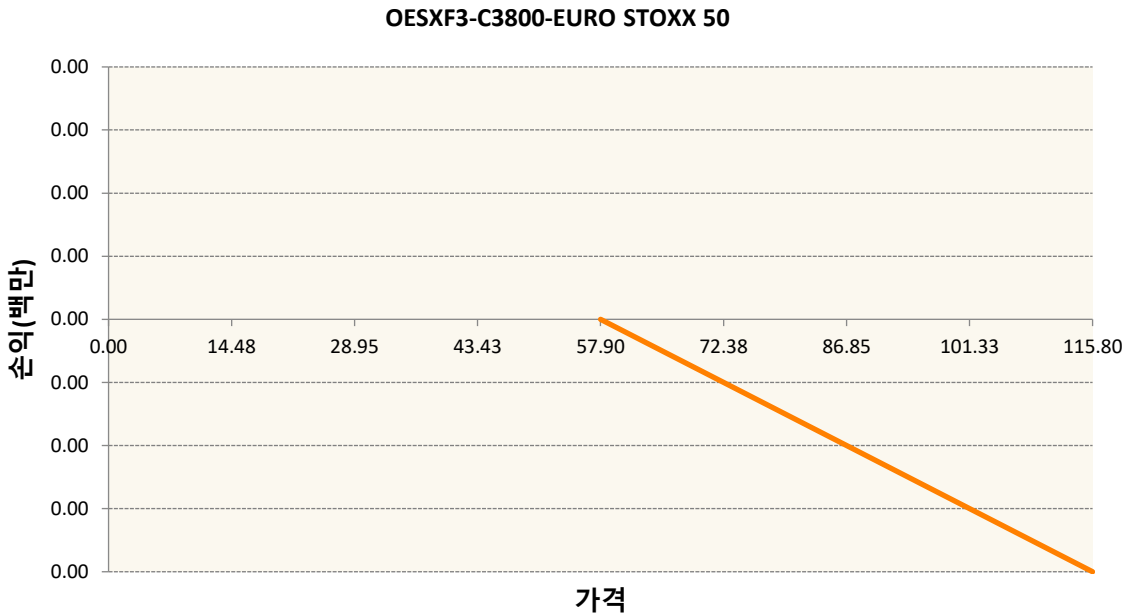
## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

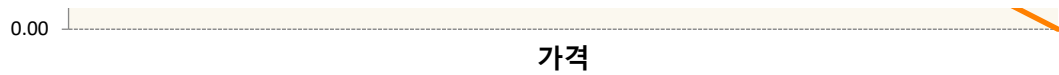
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

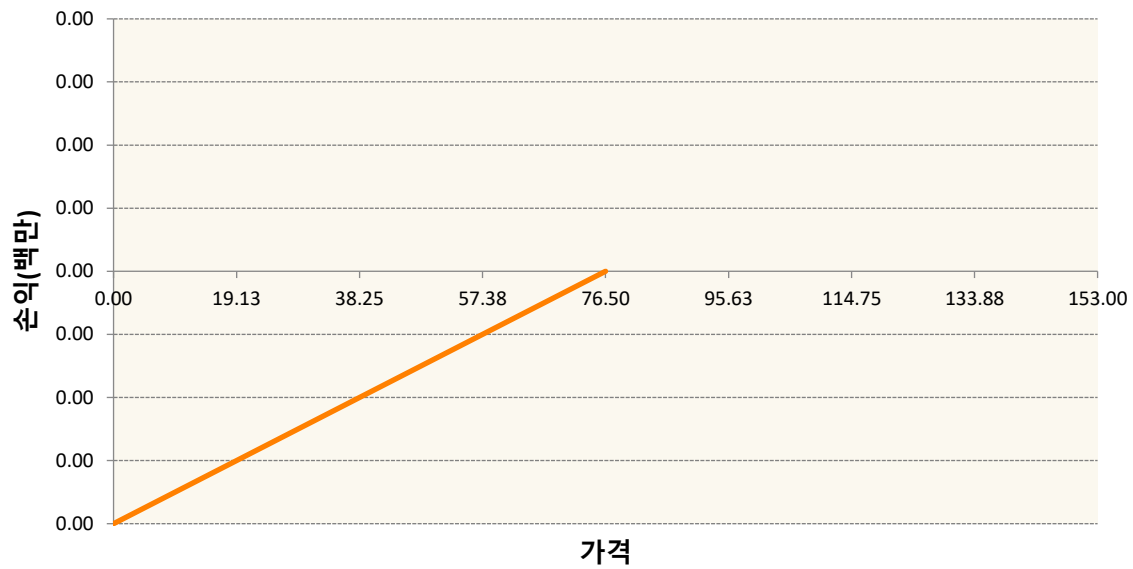
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,053 | 0     | 1,053     |    |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 72    | -72       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 340   | 2,246 | -1,905    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

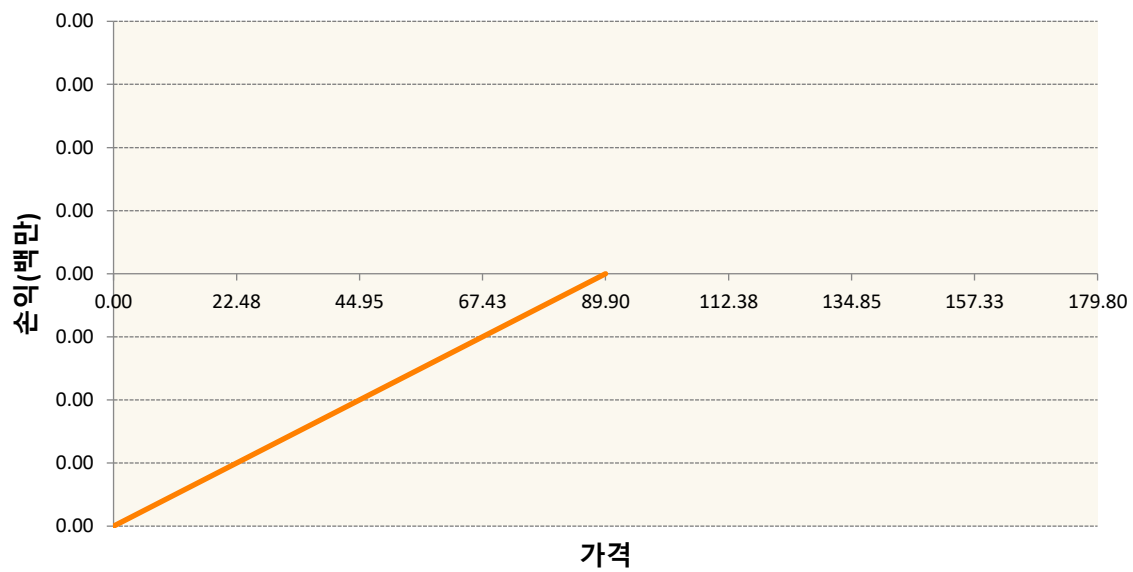




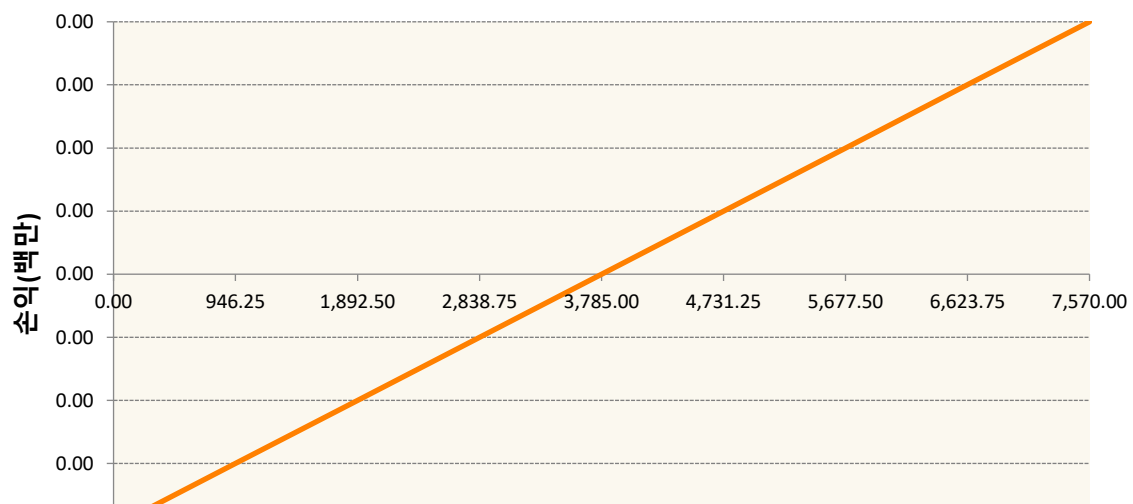
OESXF3-P3800-EURO STOXX 50



OESXF3-P3825-EURO STOXX 50



VGH3-EURO STOXX 50 Mar23



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------|--|----------|
| FXW213CAE(KRW/EUR 27-01-23E |  | 54       |
| FXW213CBG(KRW/EUR 24-02-23E |  | 71       |
| FXW213CBN(EUR/KRW 24-02-23E |  | 11       |
| FXW213CCN(KRW/EUR 24-03-23E |  | 54       |
| FXW213CCP(EUR/KRW 27-01-23E |  | 16       |
| OESXF3-C38(EURO STOXX 50    |  | 2        |
| OESXF3-C38(EURO STOXX 50    |  | 0.35     |
| OESXF3-P38(EURO STOXX 50    |  | 3        |
| OESXF3-P38(EURO STOXX 50    |  | 1        |
| VGH3(EURO STOXX 50 Mar23    |  | 84       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 249      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

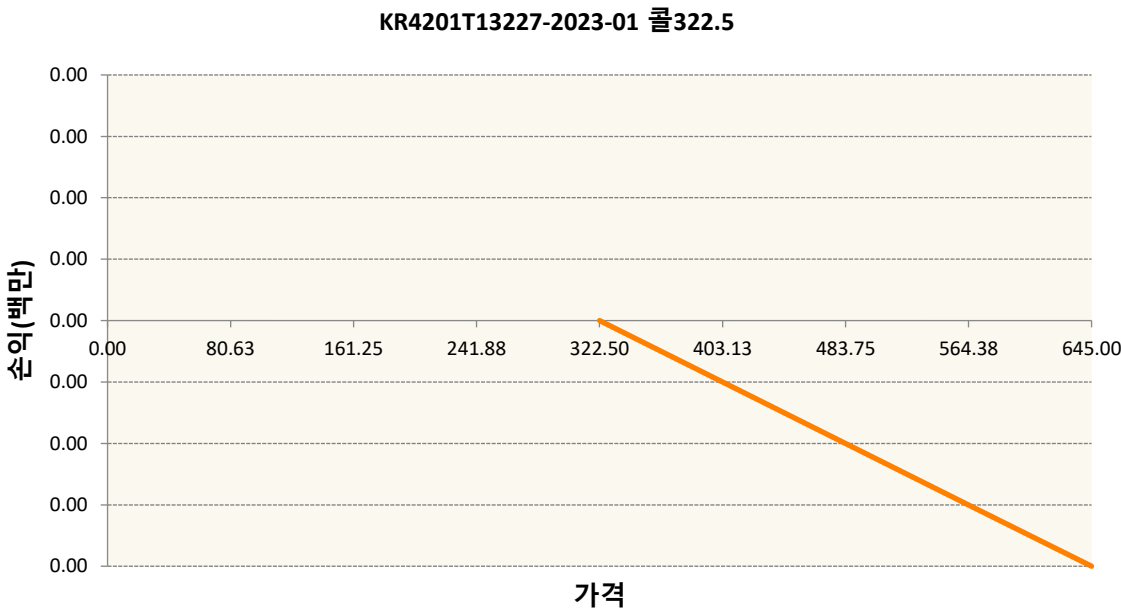
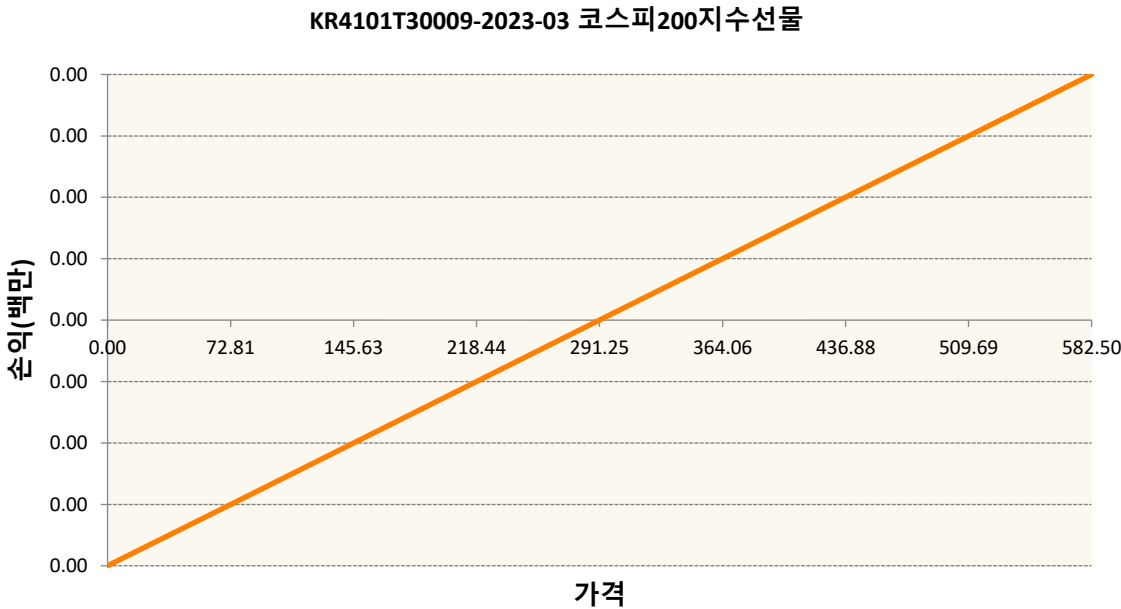
## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

### 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   | 364   | 0     | 364       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 78    | 3,803 | -3,726    | 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 650.00 with major ticks every 81.25 units. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A blue line starts at the point (325.00, 0.00) and extends to the point (650.00, 0.00), indicating that the profit/loss is zero at these price points.

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 620.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at (0, 0) and ends at (310, 0), indicating that profit is zero for all prices in this range.

(단위:백만원)

|              |           |         |        |                    |       |        |        |    |
|--------------|-----------|---------|--------|--------------------|-------|--------|--------|----|
| KR4101T30009 |           |         |        | 2023-03 코스피200지수선물 |       |        |        | 29 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |    |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                 | 8.33% | 16.67% | 25.00% |    |
| -8.00%       | -29       | -29     | -29    | -29                | -29   | -29    | -29    |    |
| -5.33%       | -19       | -19     | -19    | -19                | -19   | -19    | -19    |    |
| -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%        | 19        | 19      | 19     | 19                 | 19    | 19     | 19     |    |
| 8.00%        | 29        | 29      | 29     | 29                 | 29    | 29     | 29     |    |
| KR4201T13227 |           |         |        | 2023-01 콜322.5     |       |        |        | 49 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |    |

| 가격                                             | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|------------------------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| -8.00%                                         | 8       | 8       | 7      | 7   | 7     | 6      | 5      |
| -5.33%                                         | 8       | 7       | 7      | 6   | 5     | 4      | 3      |
| -2.67%                                         | 7       | 6       | 5      | 4   | 2     | 0      | -2     |
| 0%                                             | 5       | 4       | 2      | 0   | -3    | -5     | -8     |
| 2.67%                                          | 2       | -1      | -4     | -7  | -10   | -14    | -18    |
| 5.33%                                          | -5      | -9      | -13    | -18 | -22   | -27    | -31    |
| 8.00%                                          | -18     | -23     | -28    | -33 | -39   | -44    | -49    |
| KR4201T13250                      2023-01 콜325 |         |         |        |     |       |        | 39     |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 6       | 6       | 5      | 5   | 5     | 4      | 4      |
| -5.33%    | 5       | 5       | 5      | 4   | 4     | 3      | 2      |
| -2.67%    | 5       | 5       | 4      | 3   | 2     | 0      | -2     |
| 0%        | 4       | 3       | 2      | 0   | -2    | -4     | -7     |
| 2.67%     | 2       | 0       | -3     | -5  | -8    | -11    | -14    |
| 5.33%     | -4      | -7      | -10    | -14 | -17   | -21    | -25    |
| 8.00%     | -13     | -17     | -22    | -26 | -30   | -35    | -39    |

| KR4301T13100                      2023-01 풋310 |         |         |        |    |       |        | 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      | 4      |
| -2.67%                                         | 1       | 1       | 1      | 2  | 2     | 2      | 2      |
| 0%                                             | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                                          | -2      | -2      | -2     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| 5.33%                                          | -3      | -3      | -3     | -3 | -2    | -2     | -2     |
| 8.00%                                          | -4      | -4      | -4     | -4 | -3    | -3     | -3     |

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

(단위:백만원)

89

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

## 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 | 6,517 | 0     | 6,517     |    |

### 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 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

## 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 | 5,516 | 0     | 5,516     |    |

### 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 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

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 | 18,466 | 0      | 18,466    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 18,675 | -18,675   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |                                 | (단위:백만원) |
|-----------------------------|---------------------------------|----------|
| FXW213CAR\KRW/USD 30-01-23E |                                 | 263      |
| FXW213CBQ\KRW/USD 28-02-23E |                                 | 651      |
| FXW213CCK\KRW/USD 30-01-23E |                                 | 41       |
| FXW213CCS\KRW/USD 28-03-23E |                                 | 540      |
| IE00BD8RGM75                | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |          |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 795      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

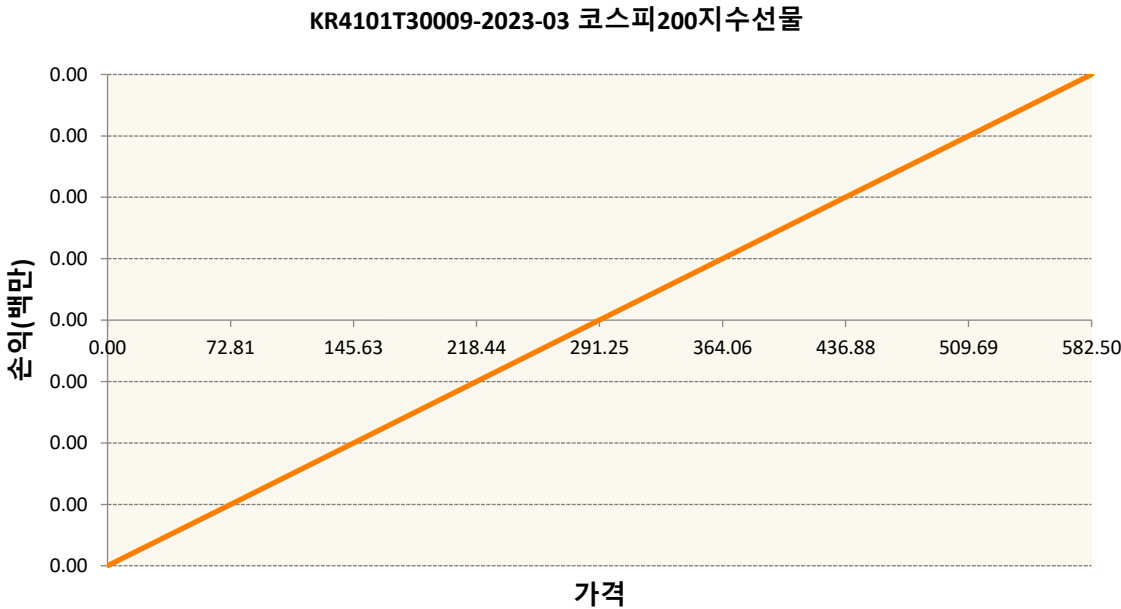
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 728   | 0     | 728       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T30009 |           |         | 2023-03 코스피200지수선물 |     |       |        | 58     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -58       | -58     | -58                | -58 | -58   | -58    | -58    |
| -5.33%       | -39       | -39     | -39                | -39 | -39   | -39    | -39    |
| -2.67%       | -19       | -19     | -19                | -19 | -19   | -19    | -19    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 19        | 19      | 19                 | 19  | 19    | 19     | 19     |
| 5.33%        | 39        | 39      | 39                 | 39  | 39    | 39     | 39     |
| 8.00%        | 58        | 58      | 58                 | 58  | 58    | 58     | 58     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

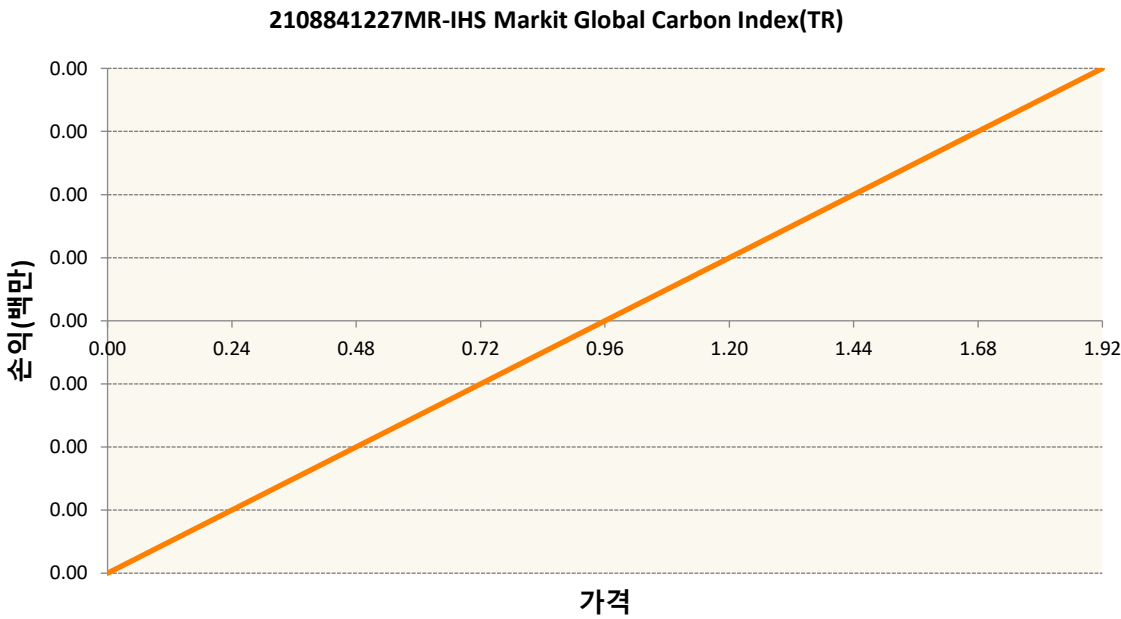
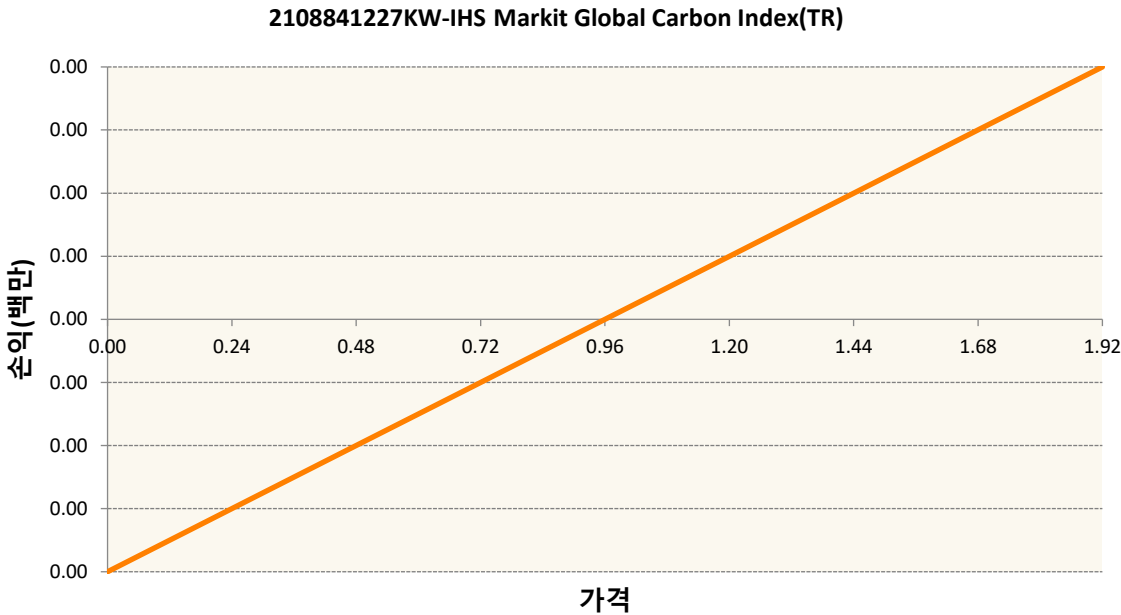
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

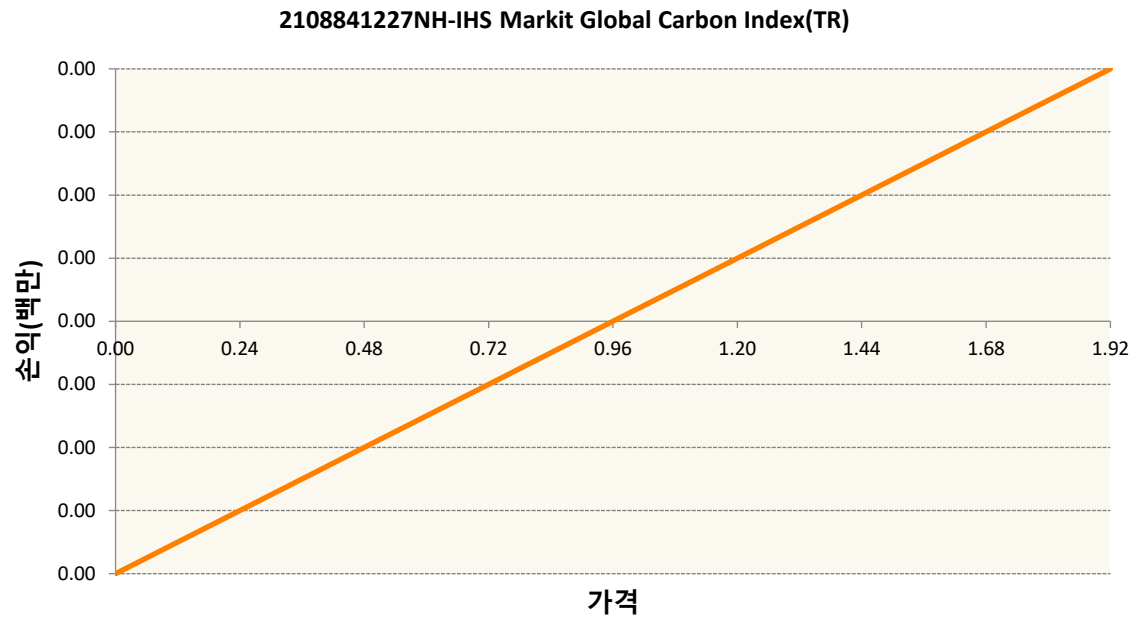
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 23,372 | 0     | 23,372    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                    |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------|--|----------|
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 1,595    |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 188      |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 94       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 3,599    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

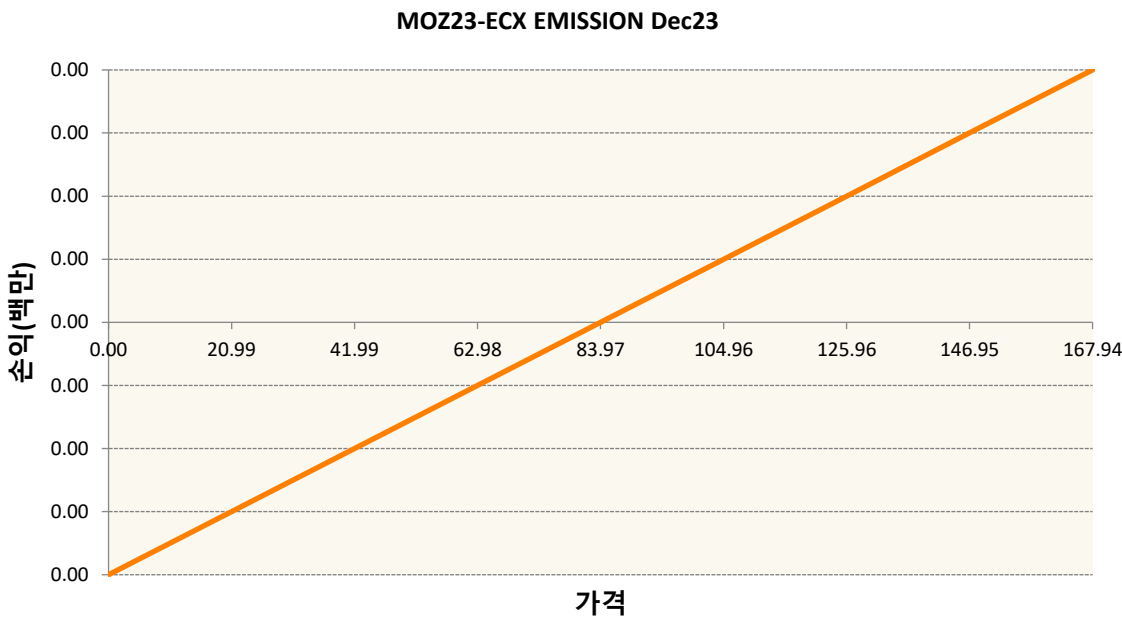
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 12,659 | 0     | 12,659    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 712    | 3,638 | -2,926    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |       |
|-------------------------------|-------|
| FXW213CCPI KRW/EUR 27-01-23E  | 109   |
| FXW213CCPI KRW/EUR 27-01-23E  | 182   |
| FXW213D12I EUR/KRW 27-01-23E  | 57    |
| MOZ23      ECX EMISSION Dec23 | 1,013 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 2,867 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

## 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)  | 4 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)  | 4 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)  | 4 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠) | 4 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 32 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

## 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   | 8,926 | 0     | 8,926     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(키움)  | 7  |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(미래)  | 9  |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220113(NH)  | 7  |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 220714(메리츠) | 10 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 43 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

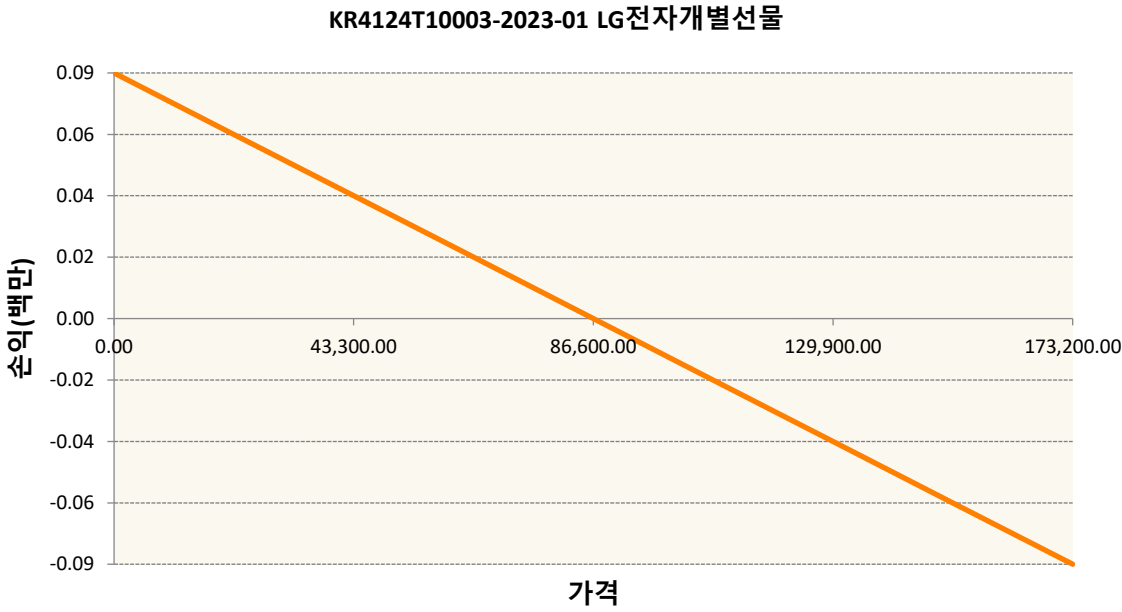
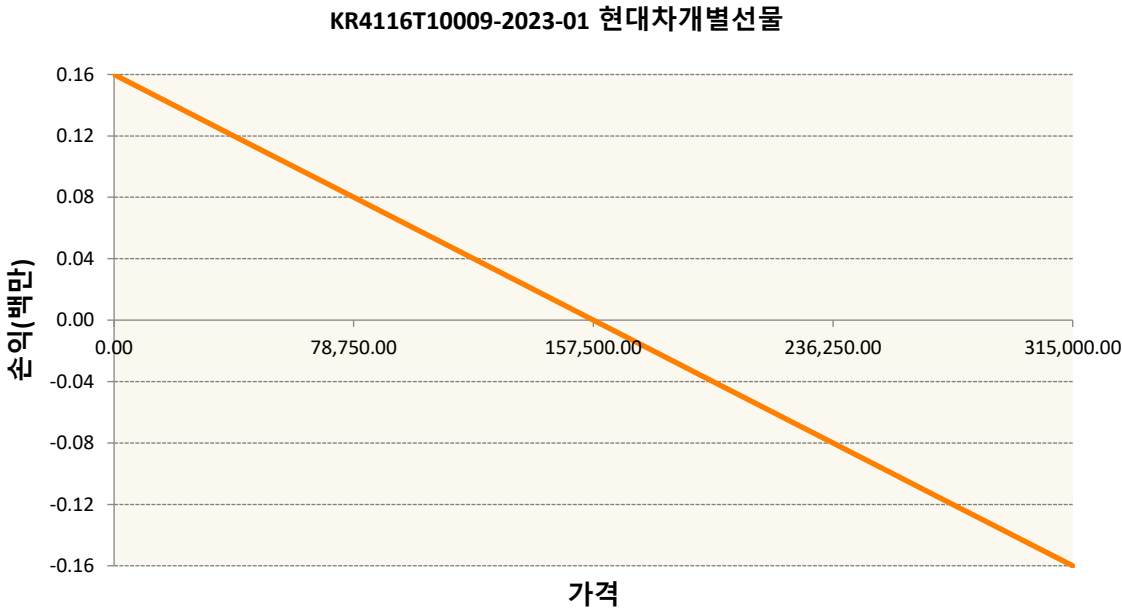
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

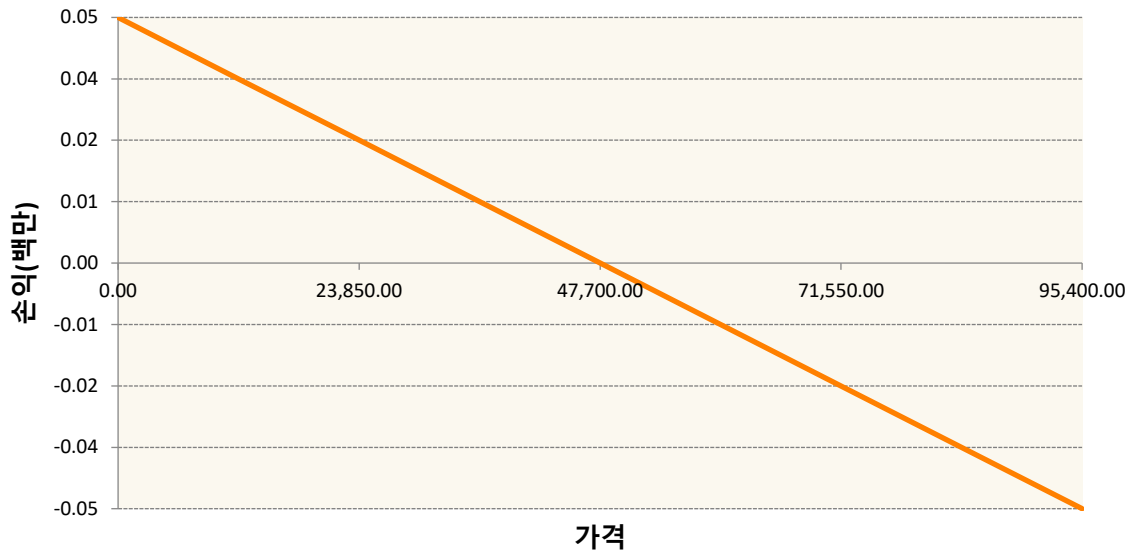
(단위:백만원)

| 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   | 0     | 2,137 | -2,137    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

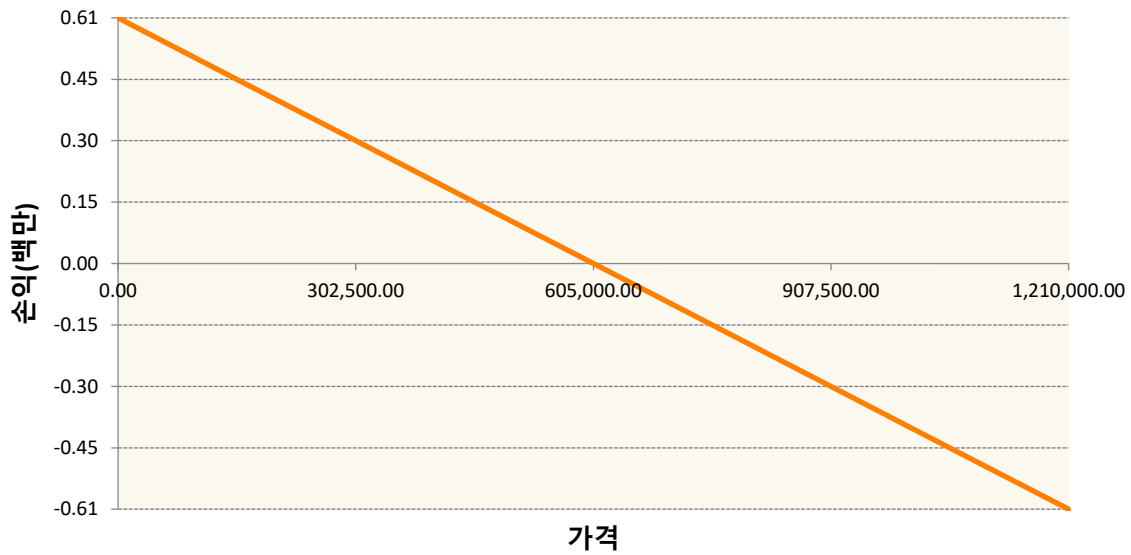
### 2. 만기시점의 손익구조



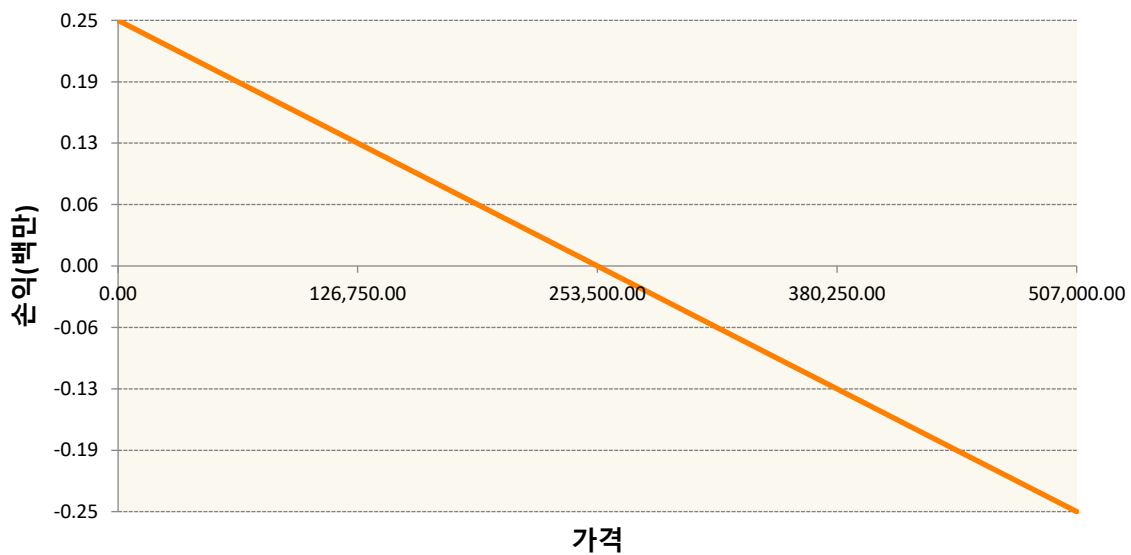
KR4146T10006-2023-01 KB금융개별선물



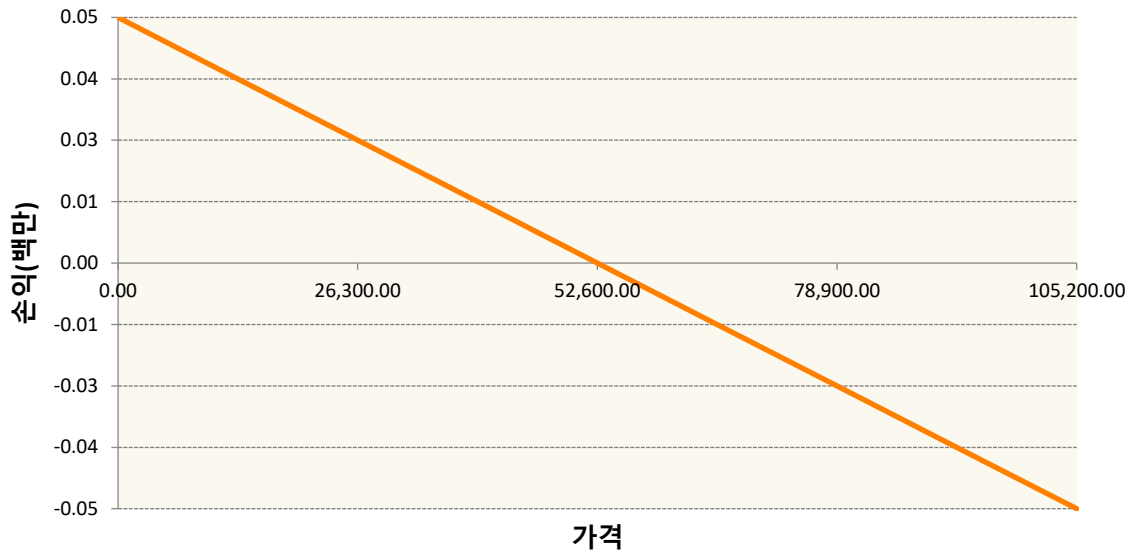
KR4147T10004-2023-01 LG화학개별선물



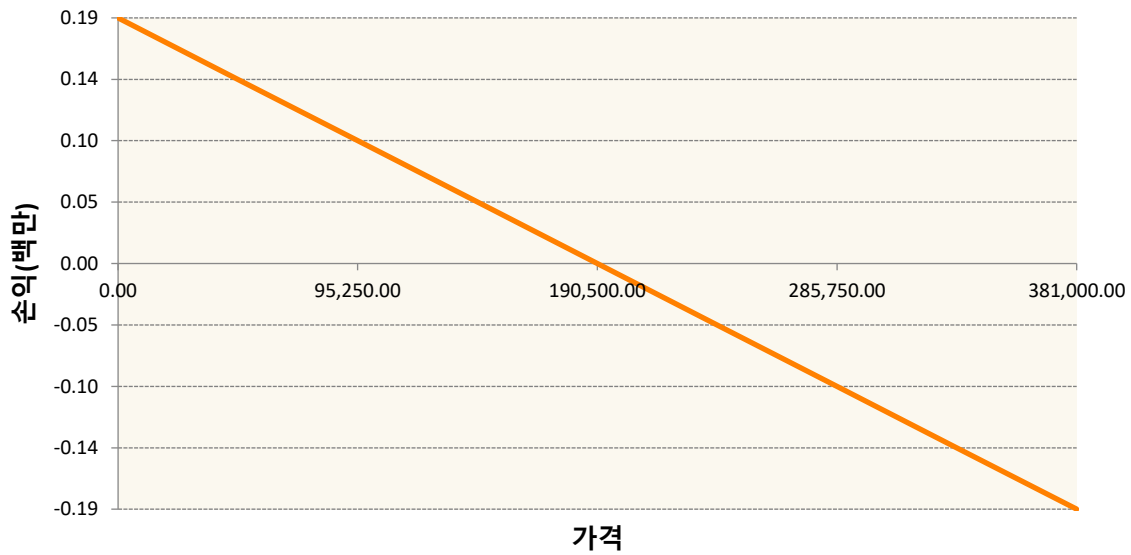
KR41BYT10009-2023-01 LG이노텍개별선물



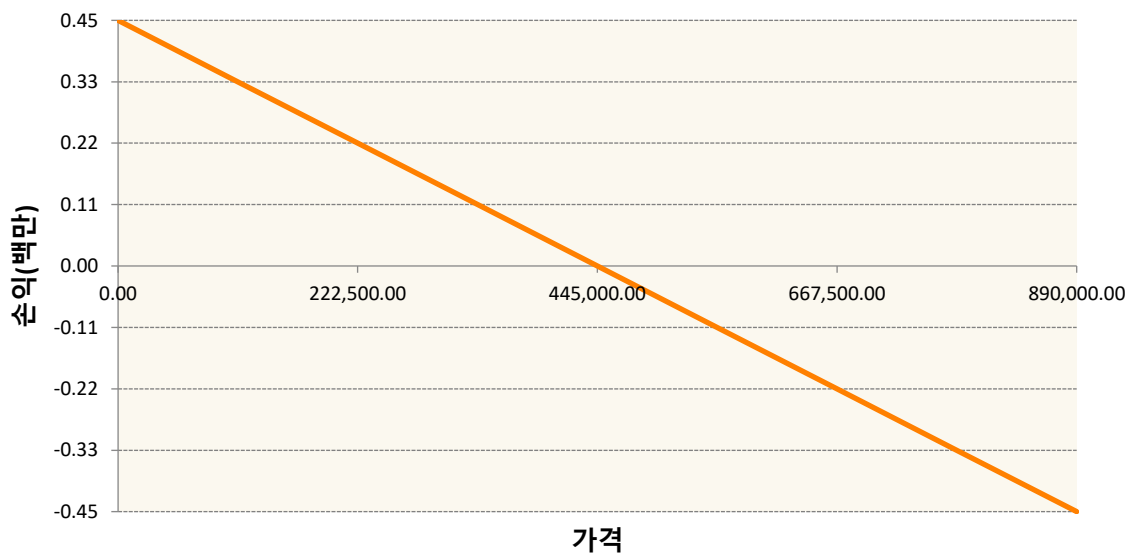
KR41CFT10006-2023-01 카카오개별선물



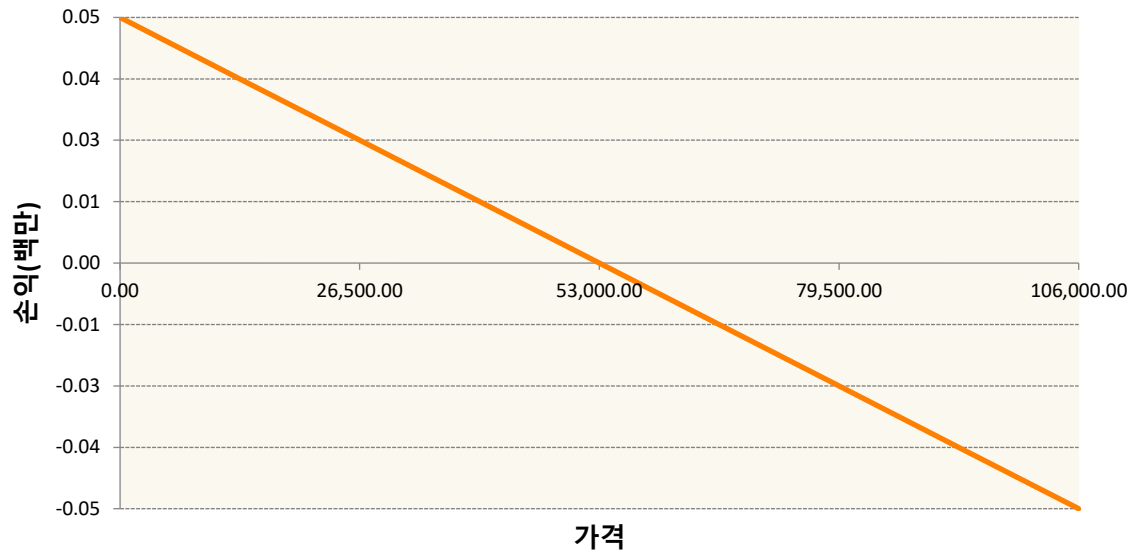
KR41E8T10001-2023-01 포스코케미칼개별선물



KR41F5T10006-2023-01 LG에너지솔루션개별선물



### KR41F7T10002-2023-01 카카오페이개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                      |      |
|--------------------------------------|------|
| KR4116T100 2023-01 현대차개별선물           | 19   |
| KR4124T100 2023-01 LG전자개별선물          | 26   |
| KR4146T100 2023-01 KB금융개별선물          | 27   |
| KR4147T100 2023-01 LG화학개별선물          | 15   |
| KR41BYT100 2023-01 LG이노텍개별선물         | 10   |
| KR41CFT100 2023-01 카카오개별선물           | 29   |
| KR41E8T100 2023-01 포스코케미칼개별선물        | 15   |
| KR41F5T100 2023-01 LG에너지솔루션개별선물      | 21   |
| KR41F7T100 2023-01 카카오페이개별선물         | 8    |
| KRS0003135 SWAP_MICROSOFT CP_0429    | 0.04 |
| KRS0003224 SWAP_FIRST TRUST ECL_0602 | 0.03 |

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

(단위:백만원)

392

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

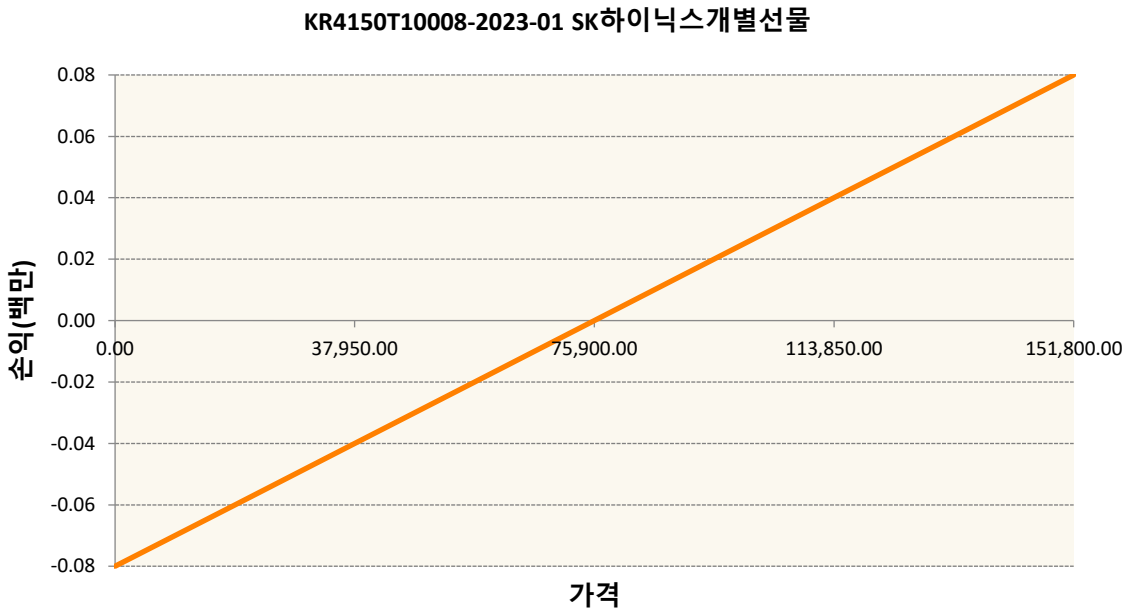
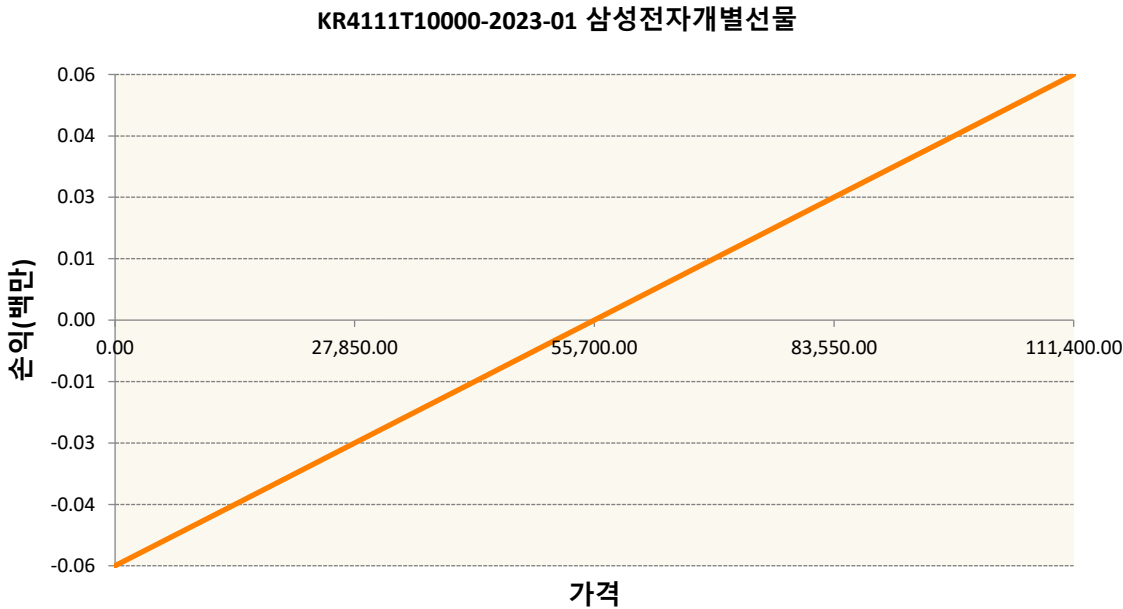
신한SOL한국형글로벌반도체엑티

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   | 135   | 0     | 135       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

| KR4111T10000 |           | 2023-01 삼성전자개별선물   |        |    |       |        | 7      |
|--------------|-----------|--------------------|--------|----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |    |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -7        | -7                 | -7     | -7 | -7    | -7     | -7     |
| -5.33%       | -5        | -5                 | -5     | -5 | -5    | -5     | -5     |
| -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%        | 5         | 5                  | 5      | 5  | 5     | 5      | 5      |
| 8.00%        | 7         | 7                  | 7      | 7  | 7     | 7      | 7      |
| KR4150T10008 |           | 2023-01 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%       | -2        | -2                 | -2     | -2 | -2    | -2     | -2     |
| -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%        | 2         | 2                  | 2      | 2  | 2     | 2      | 2      |
| 8.00%        | 4         | 4                  | 4      | 4  | 4     | 4      | 4      |

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

13

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

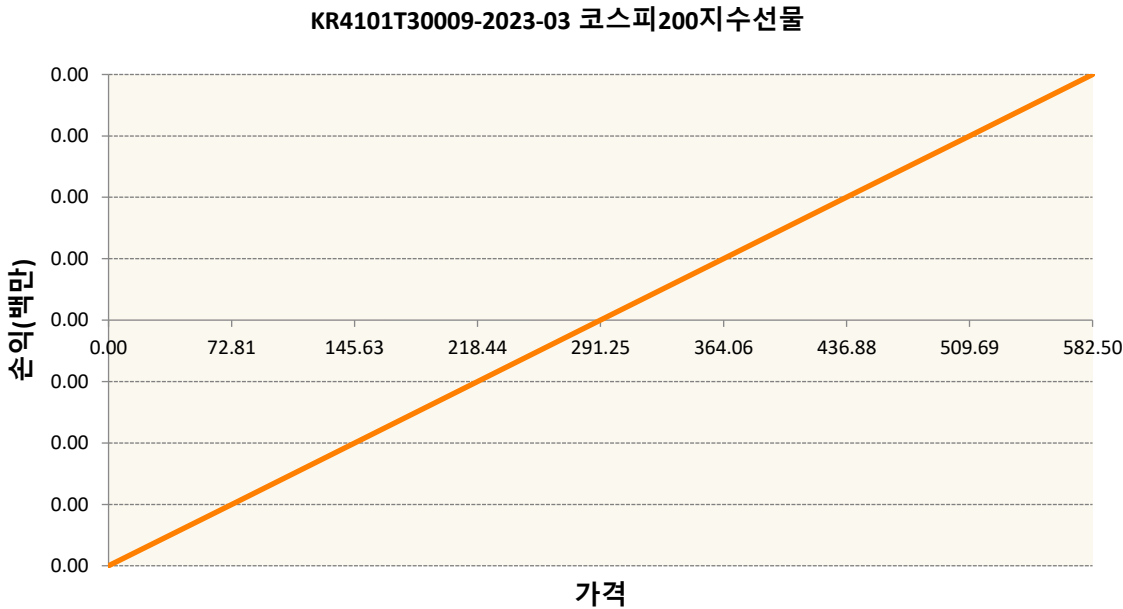
코리아인텍스(주식-파생형)(종)

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   | 1,675 | 0     | 1,675     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T30009 |           |         | 2023-03 코스피200지수선물 |      |       |        | 133    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -133      | -133    | -133               | -133 | -133  | -133   | -133   |
| -5.33%       | -89       | -89     | -89                | -89  | -89   | -89    | -89    |
| -2.67%       | -44       | -44     | -44                | -44  | -44   | -44    | -44    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 44        | 44      | 44                 | 44   | 44    | 44     | 44     |
| 5.33%        | 89        | 89      | 89                 | 89   | 89    | 89     | 89     |
| 8.00%        | 133       | 133     | 133                | 133  | 133   | 133    | 133    |



공시일 2023-01-03

기준일 2023-01-02

## SOL한국형글로벌전기차&2차전지

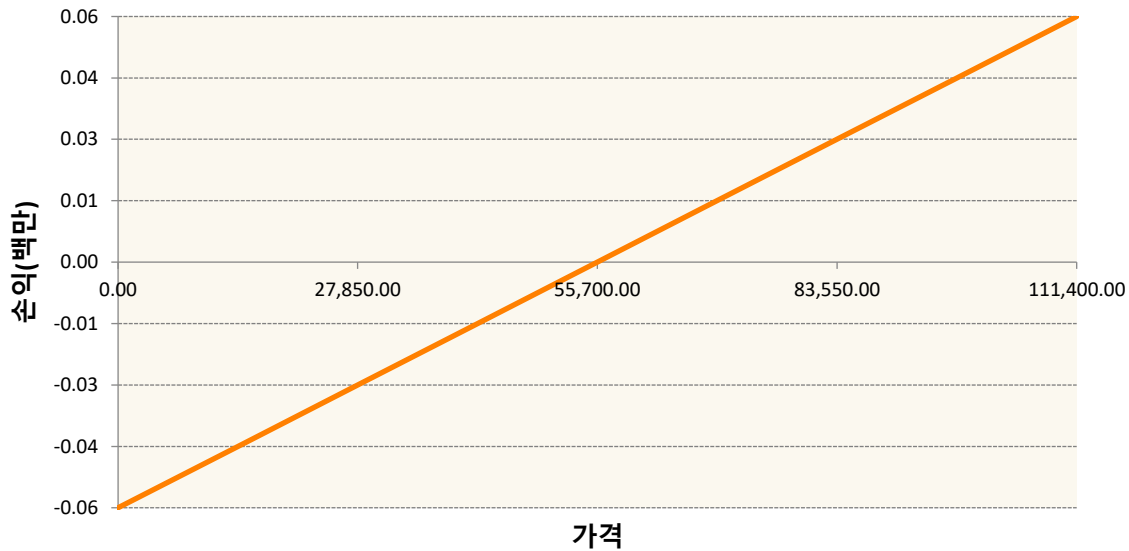
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

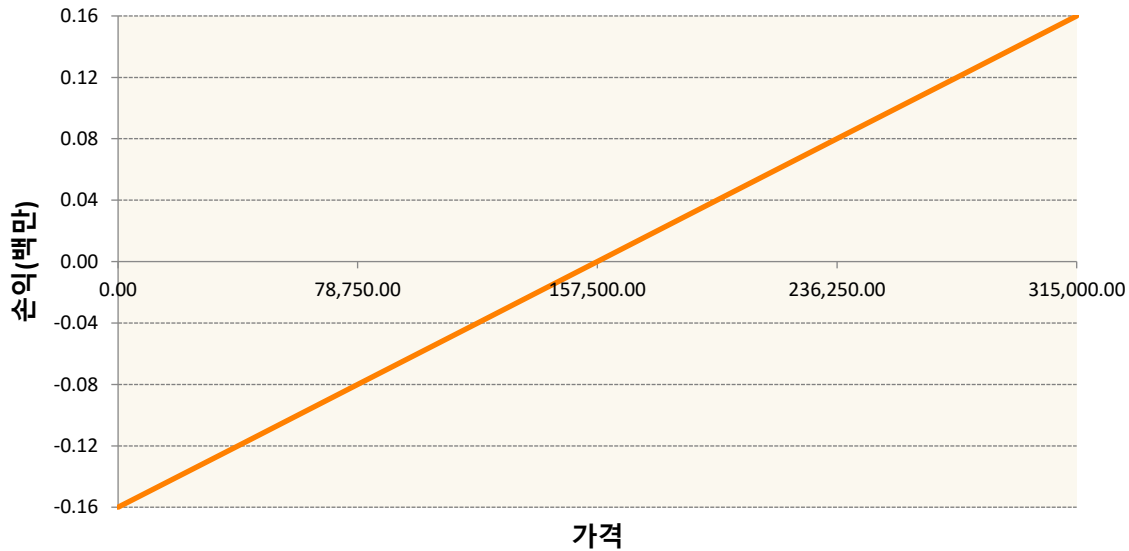
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 217   | 0     | 217       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

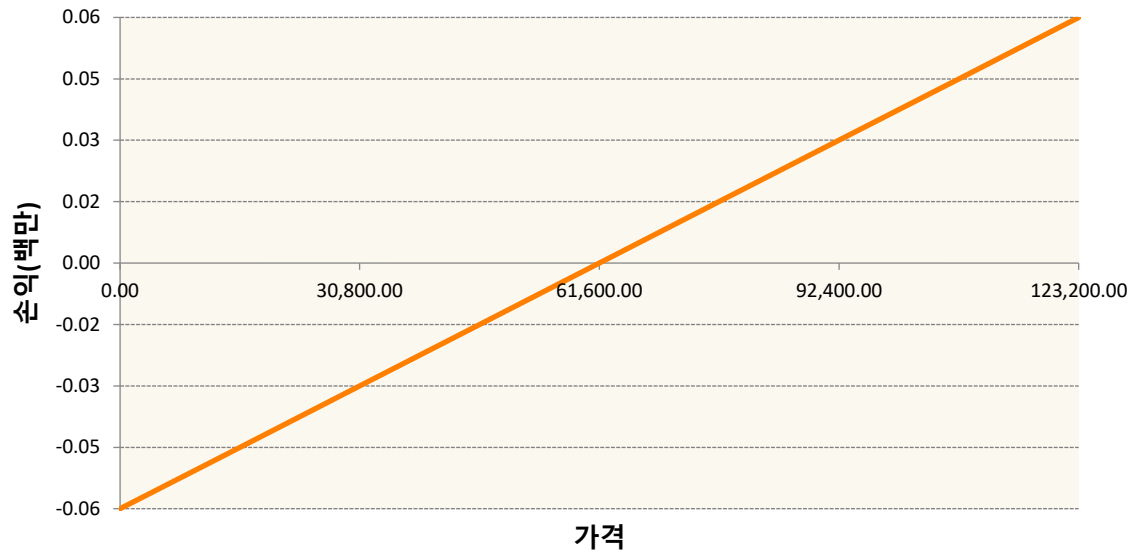
KR4111T10000-2023-01 삼성전자개별선물



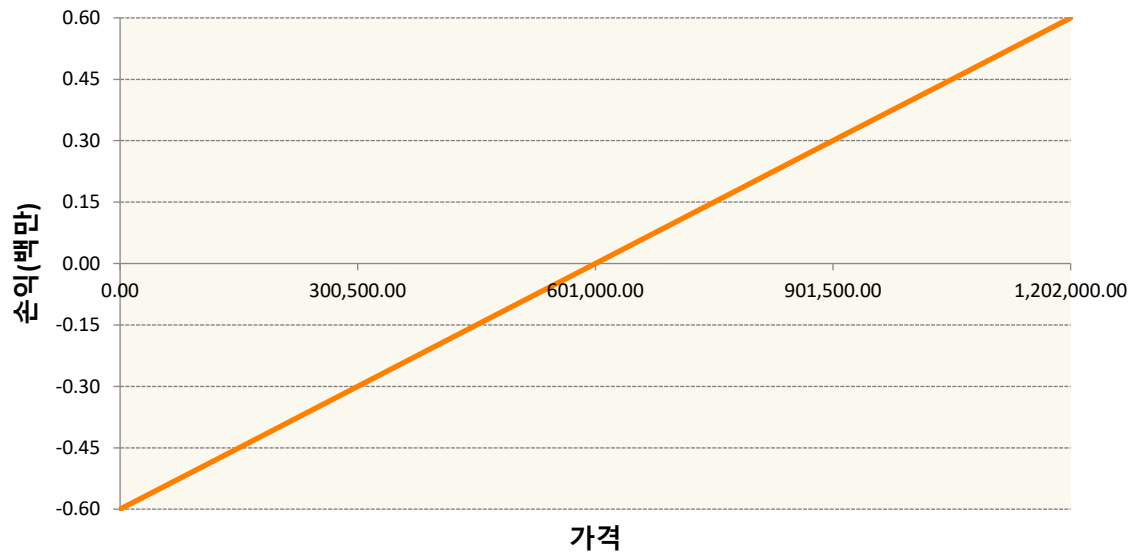
KR4116T10009-2023-01 현대차개별선물



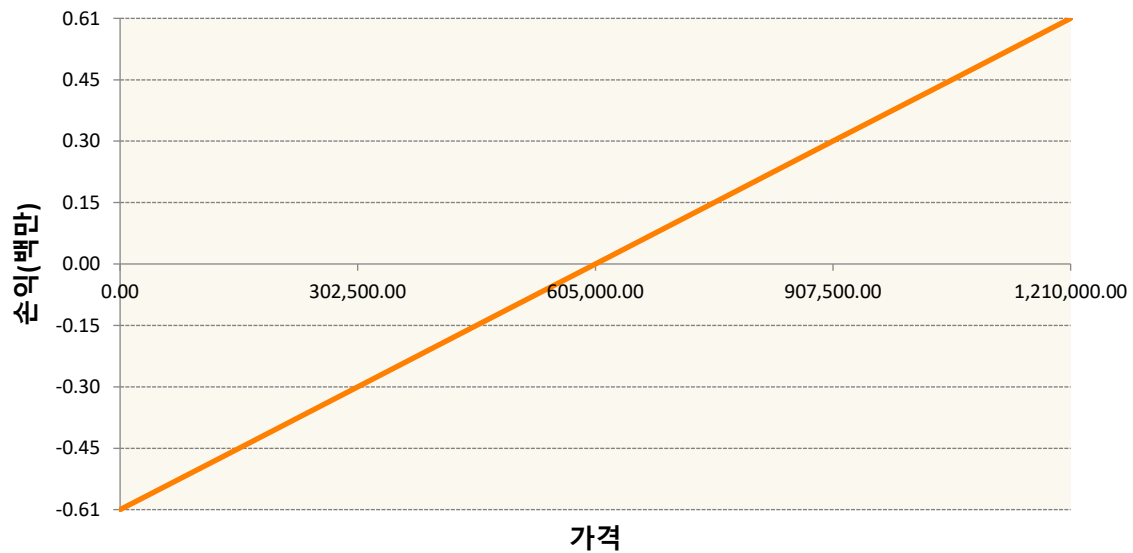
KR4119T10003-2023-01 기아개별선물



KR4122T10007-2023-01 삼성SDI개별선물



KR4147T10004-2023-01 LG화학개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|              |           |                   |        |     |       |        |        |     |
|--------------|-----------|-------------------|--------|-----|-------|--------|--------|-----|
| KR4111T10000 |           | 2023-01 삼성전자개별선물  |        |     |       |        |        | 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     | -4  |
| -5.33%       | -3        | -3                | -3     | -3  | -3    | -3     | -3     | -3  |
| -2.67%       | -1        | -1                | -1     | -1  | -1    | -1     | -1     | -1  |
| 0%           | 0         | 0                 | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      | 0   |
| 2.67%        | 1         | 1                 | 1      | 1   | 1     | 1      | 1      | 1   |
| 5.33%        | 3         | 3                 | 3      | 3   | 3     | 3      | 3      | 3   |
| 8.00%        | 4         | 4                 | 4      | 4   | 4     | 4      | 4      | 4   |
|              |           |                   |        |     |       |        |        |     |
| KR4119T10003 |           | 2023-01 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%       | 0         | 0                 | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      | 0   |
| -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%        | 0         | 0                 | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      | 0   |
| 8.00%        | 1         | 1                 | 1      | 1   | 1     | 1      | 1      | 1   |
| KR4122T10007 |           | 2023-01 삼성SDI개별선물 |        |     |       |        |        | 10  |
|              | 기초자산의 변동성 |                   |        |     |       |        |        |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%           | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%       | -10       | -10               | -10    | -10 | -10   | -10    | -10    | -10 |
| -5.33%       | -6        | -6                | -6     | -6  | -6    | -6     | -6     | -6  |
| -2.67%       | -3        | -3                | -3     | -3  | -3    | -3     | -3     | -3  |
| 0%           | 0         | 0                 | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      | 0   |
| 2.67%        | 3         | 3                 | 3      | 3   | 3     | 3      | 3      | 3   |
| 5.33%        | 6         | 6                 | 6      | 6   | 6     | 6      | 6      | 6   |
| 8.00%        | 10        | 10                | 10     | 10  | 10    | 10     | 10     | 10  |
|              |           |                   |        |     |       |        |        |     |

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

18

공시일 2023-01-03

기준일 2023-01-02

## SOL한국형글로벌플랫폼&메타버스

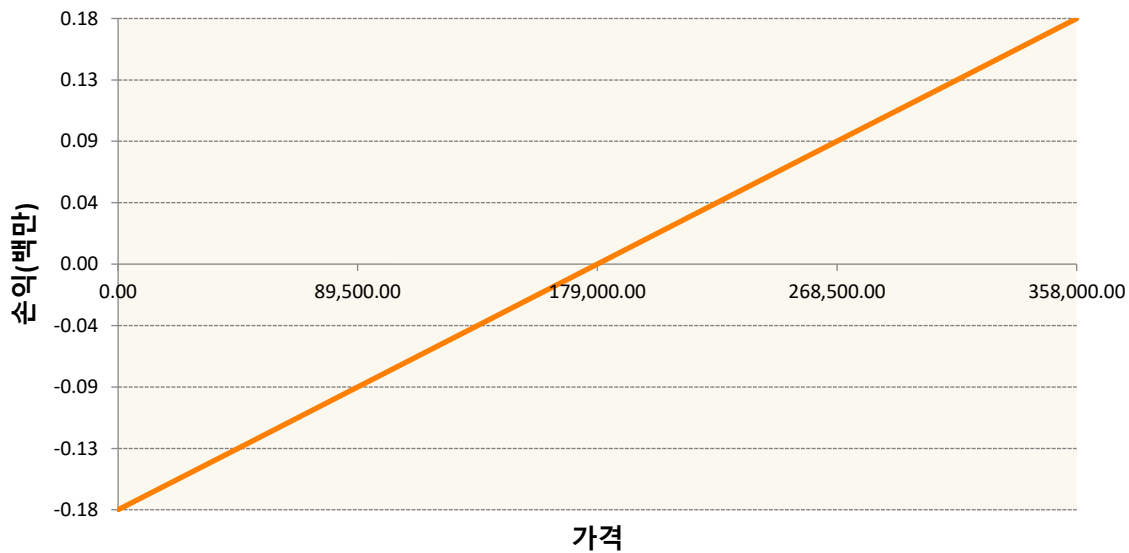
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

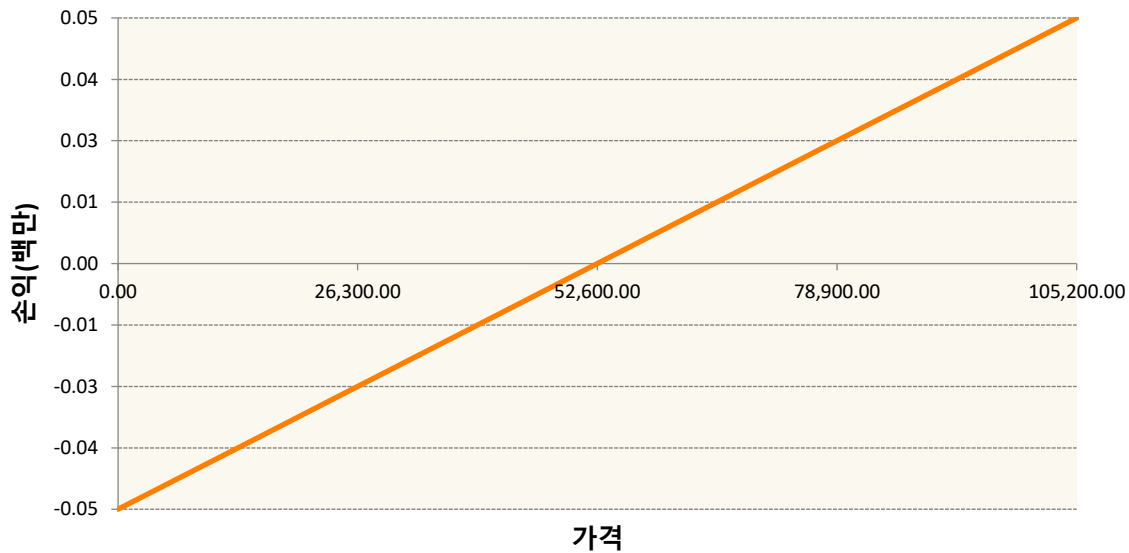
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 110   | 0     | 110       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4156T10005-2023-01 NAVER개별선물



KR41CFT10006-2023-01 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4156T10005 |           | 2023-01 NAVER개별선물 |        |    |       |        |        | 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)

7

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-01-03 |
| 기준일 | 2023-01-02 |

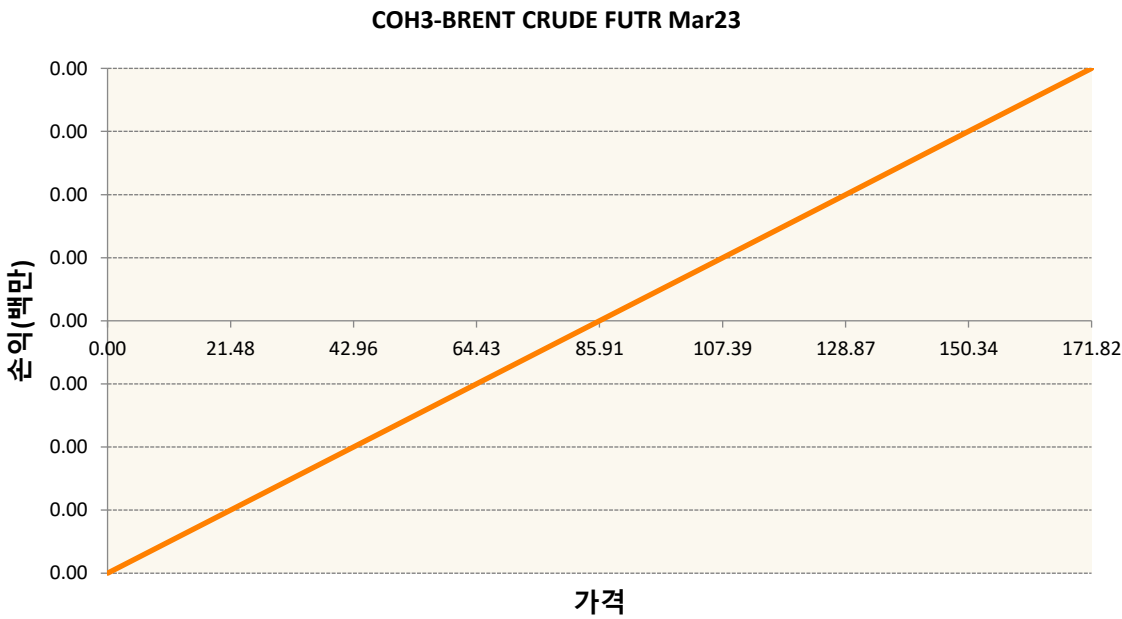
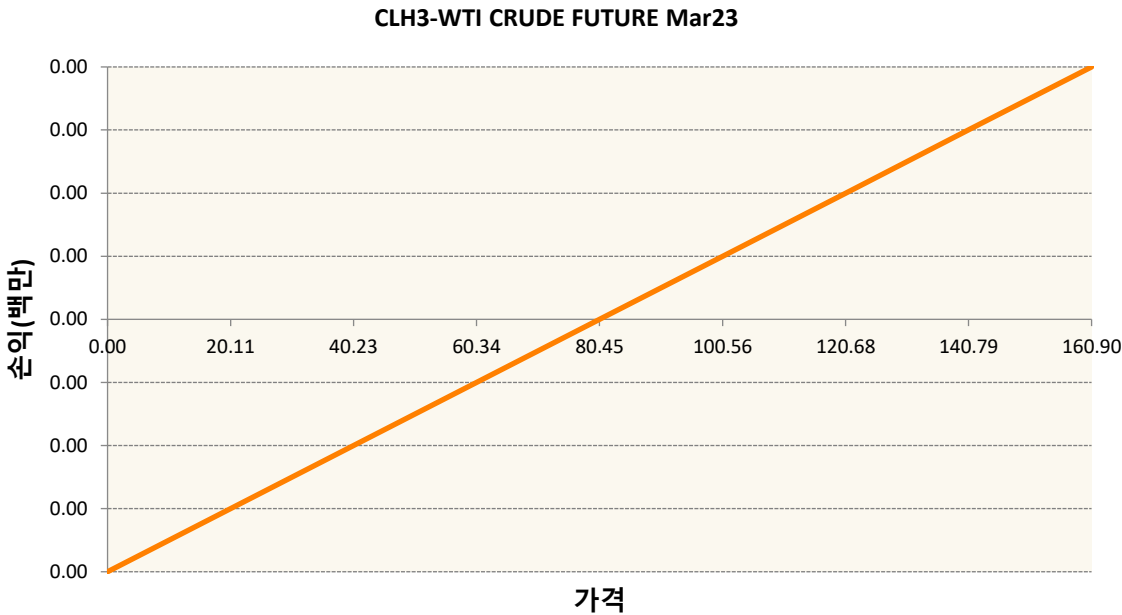
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

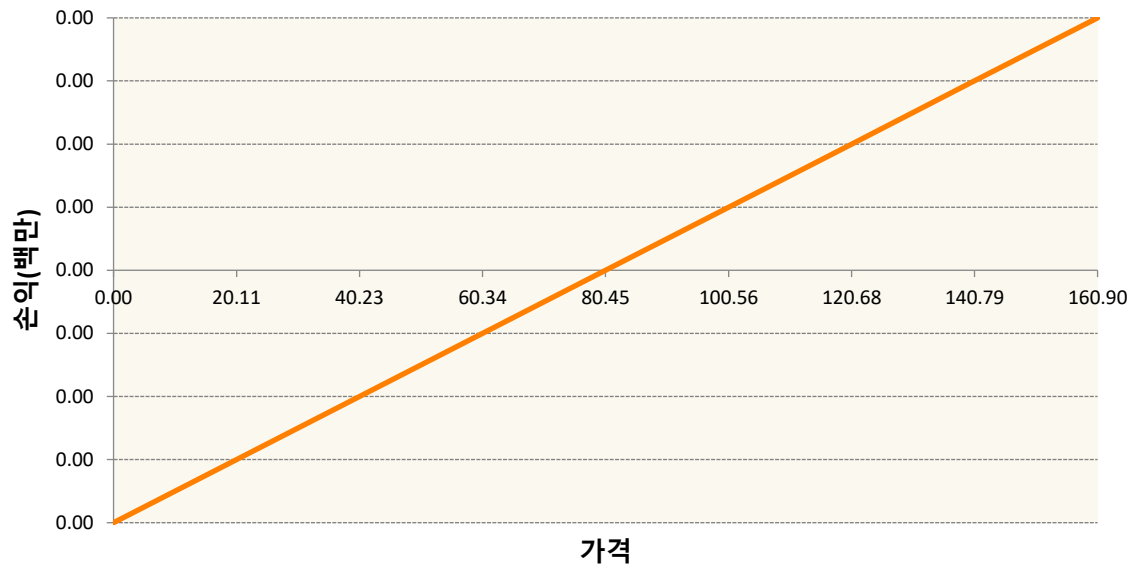
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,744 | 254   | 1,489     |    |

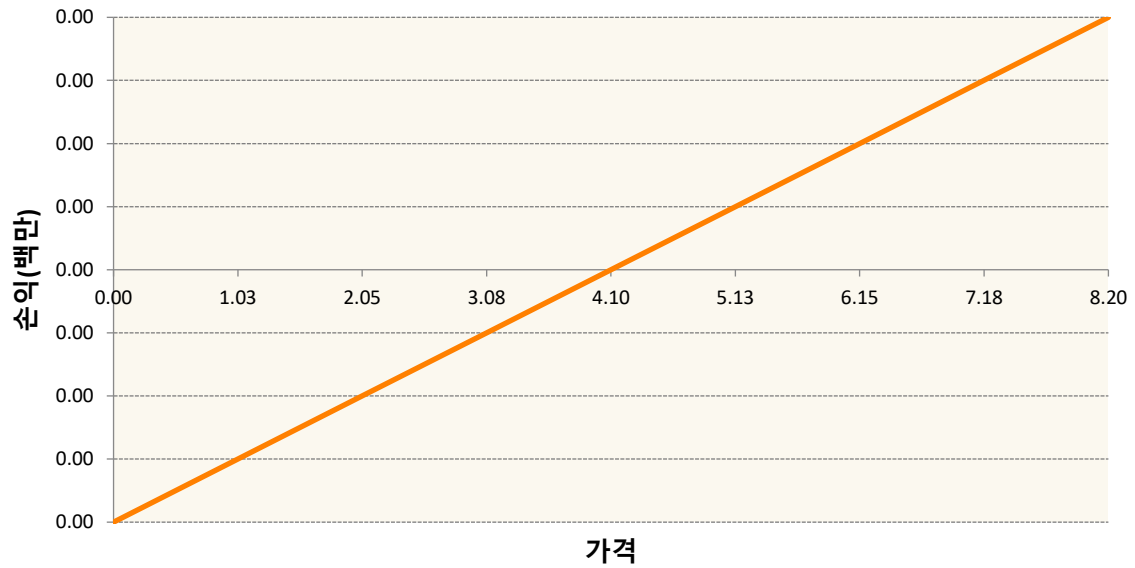
### 2. 만기시점의 손익구조



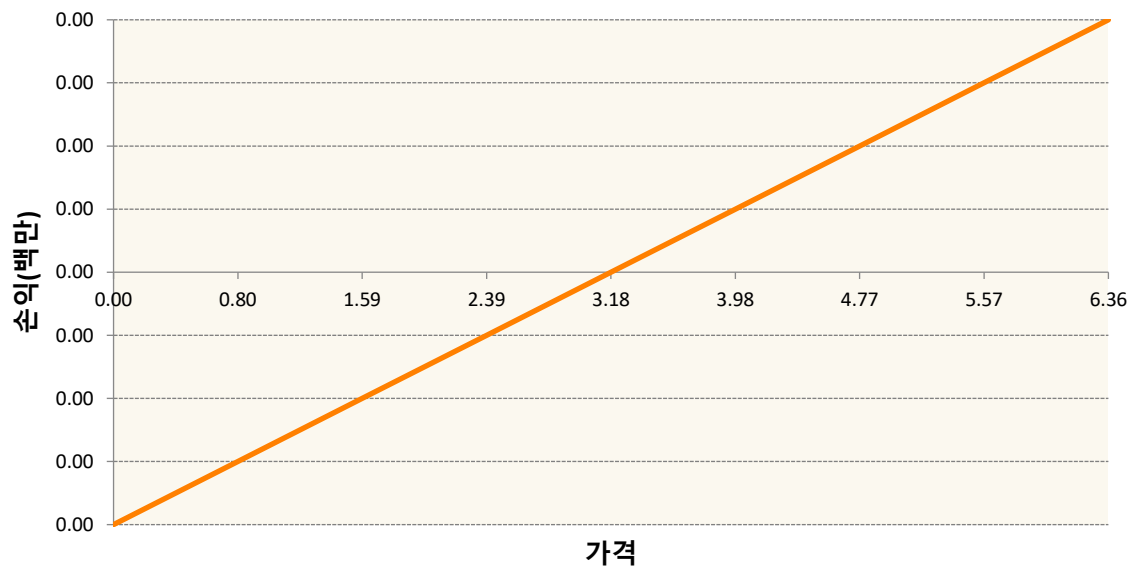
ECH3-E-mini Crude Oil Mar23



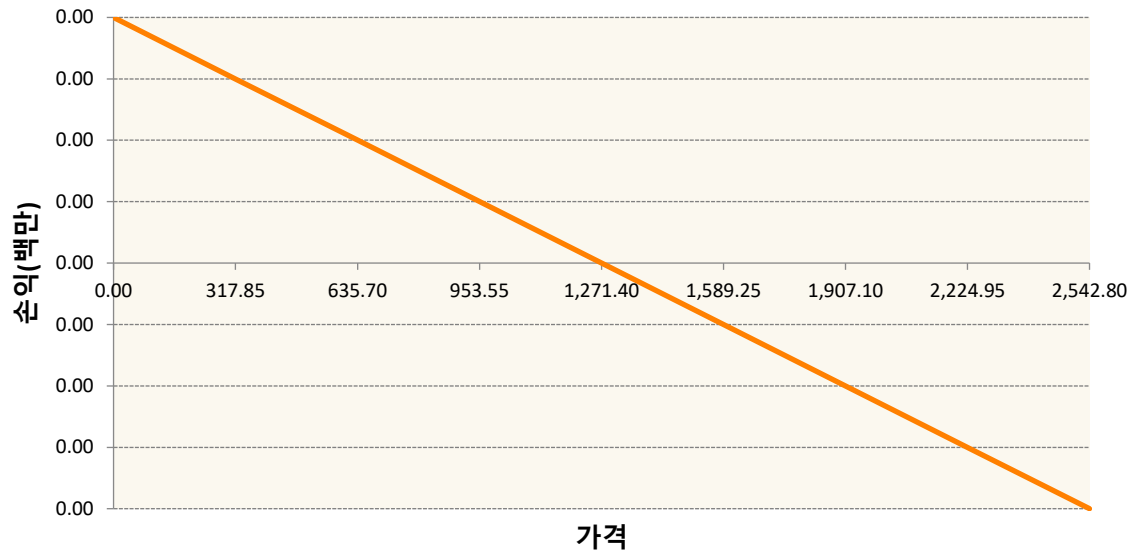
EOH3-E-MINI NATURAL GAS Mar23



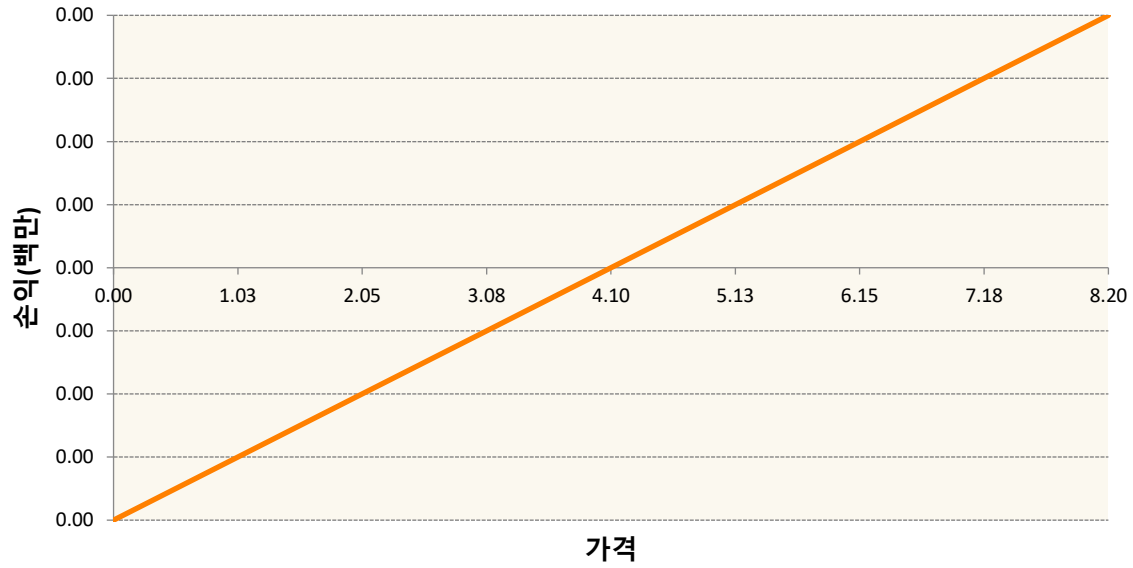
HOH3-NY Harb ULSD Fut Mar23



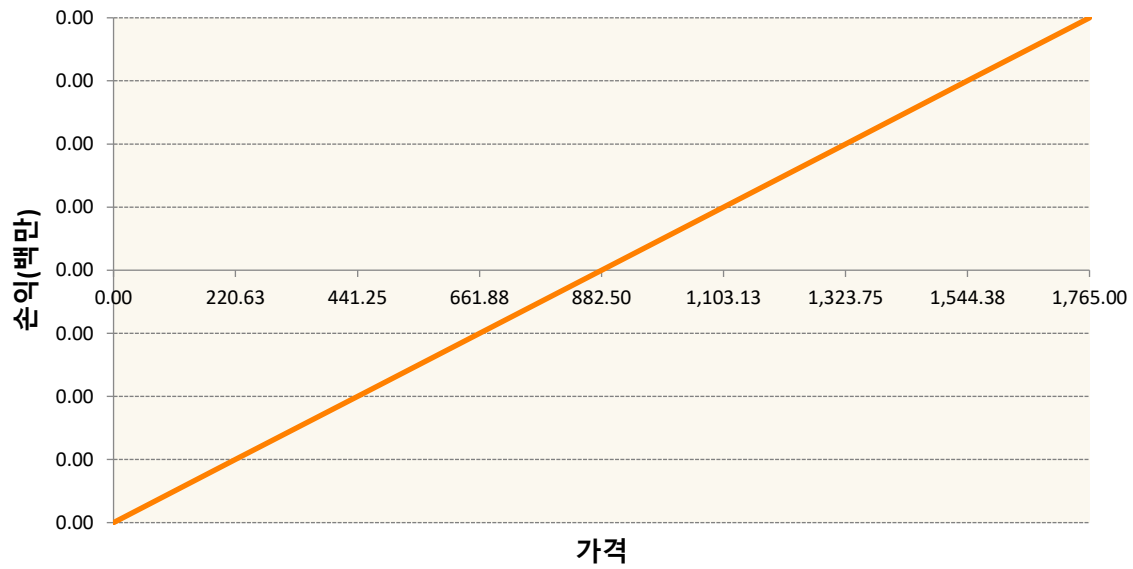
KR4175T10005-2023-01 달러선물

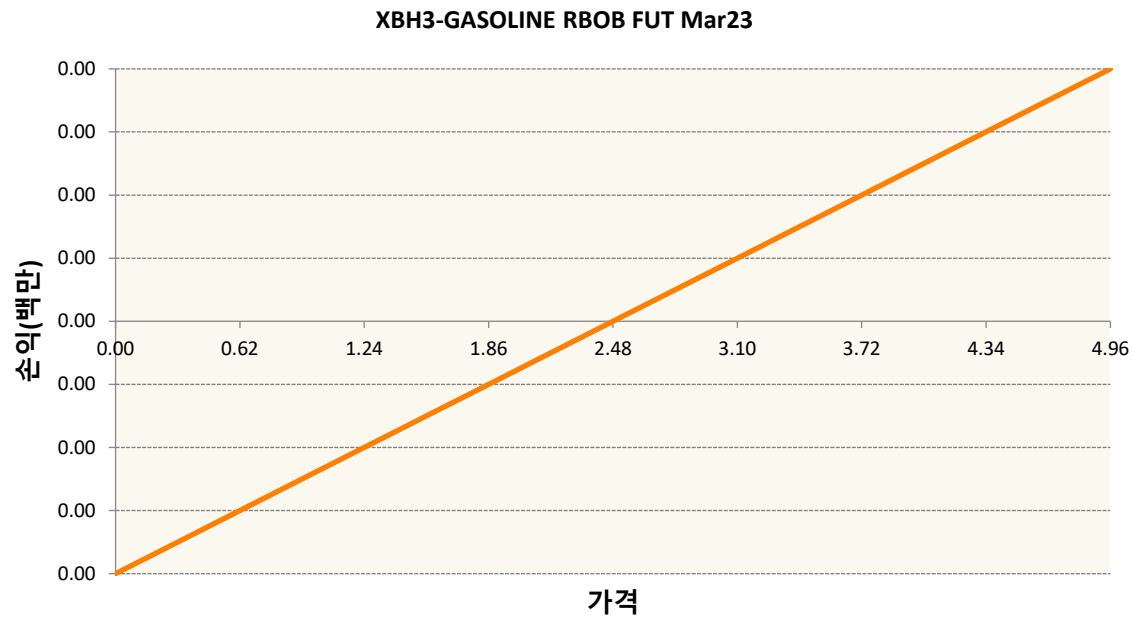


NGH23-NATURAL GAS FUTR Mar23



QSH3-Low Su Gasoil G Mar23





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| CLH3                      | WTI CRUDE FUTURE Mar23   | 25       |
| COH3                      | BRENT CRUDE FUTR Mar23   | 36       |
| ECH3                      | E-mini Crude Oil Mar23   | 4        |
| EOH3                      | E-MINI NATURAL GAS Mar23 | 1        |
| HOH3                      | NY Harb ULSD Fut Mar23   | 14       |
| KR4175T100 2023-01 달러선물   |                          | 20       |
| NGH23                     | NATURAL GAS FUTR Mar23   | 39       |
| QSH3                      | Low Su Gasoil G Mar23    | 9        |
| XBH3                      | GASOLINE RBOB FUT Mar23  | 11       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 462      |