

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

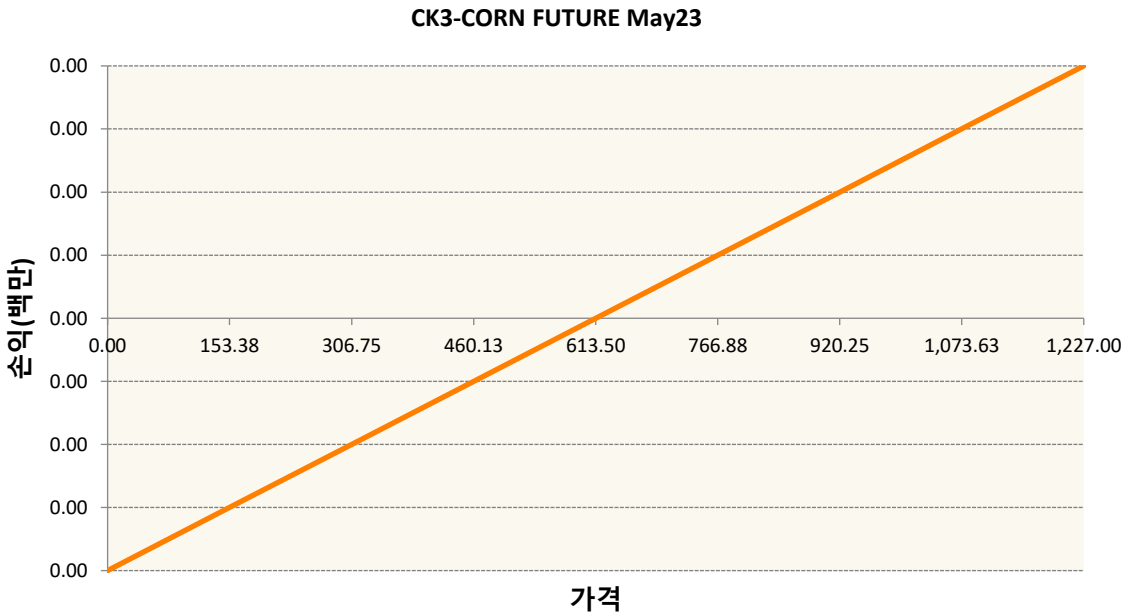
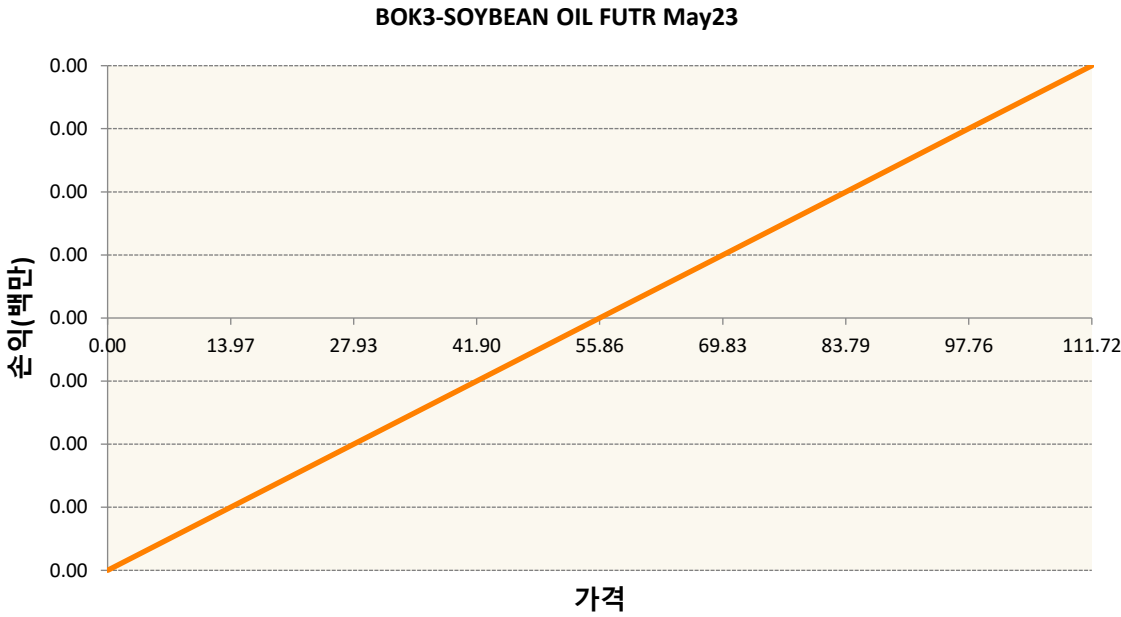
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

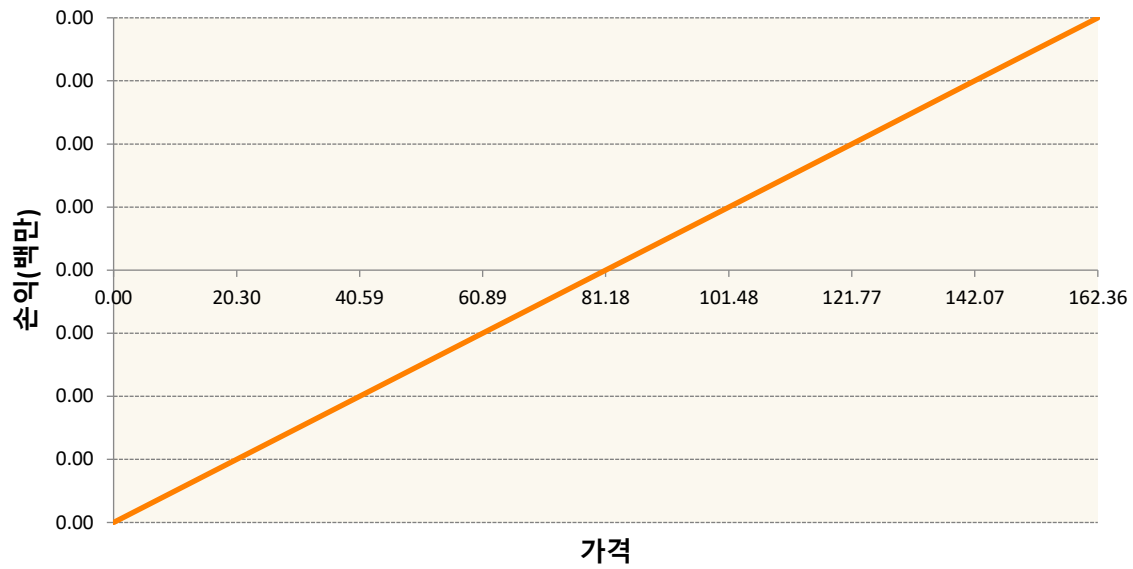
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,546 | 524   | 5,022     |    |

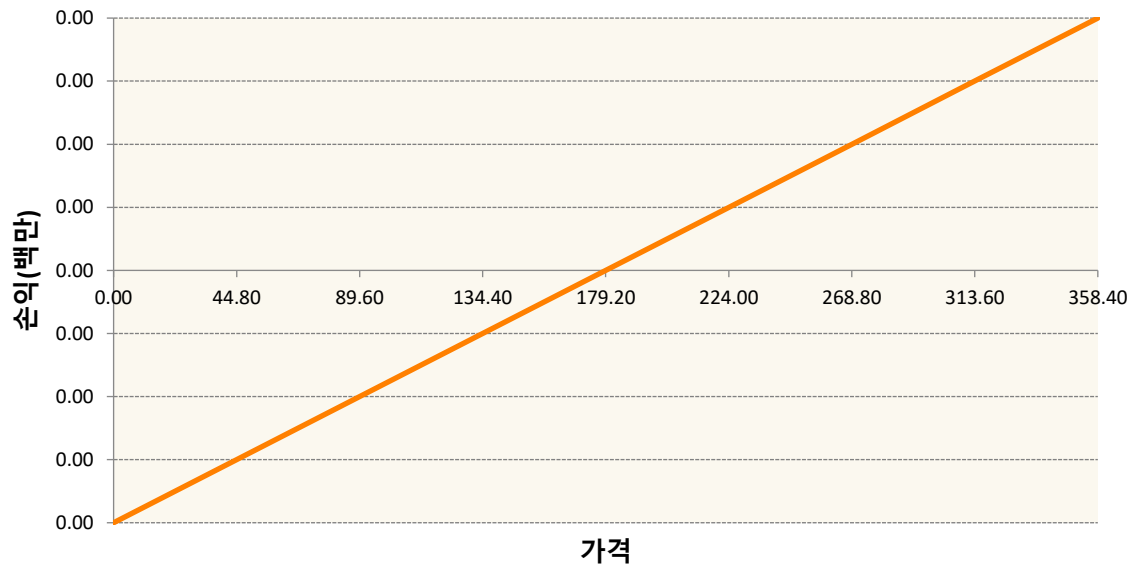
### 2. 만기시점의 손익구조



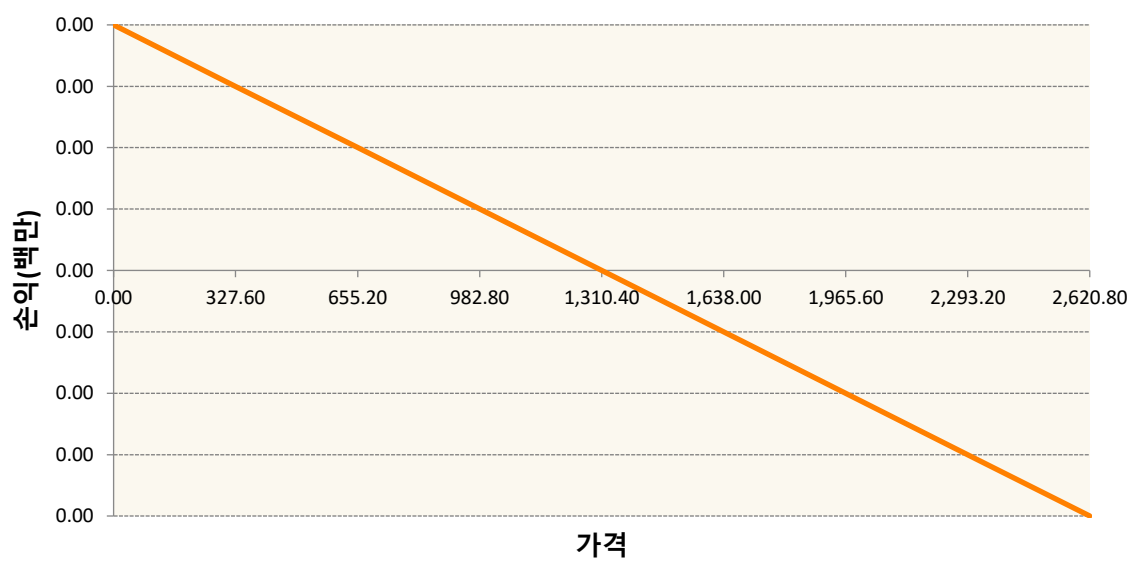
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



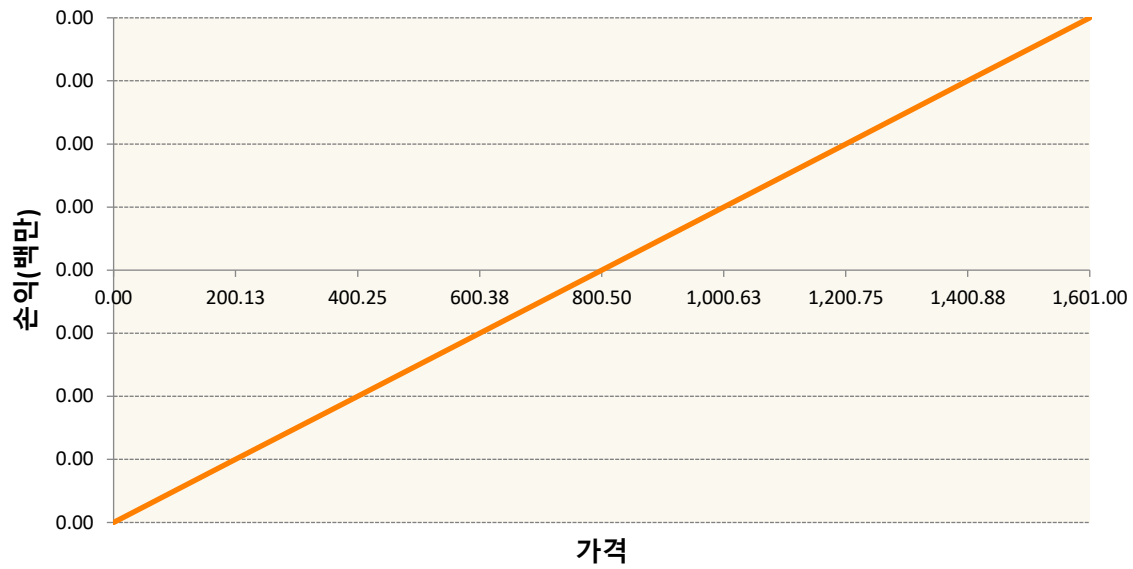
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



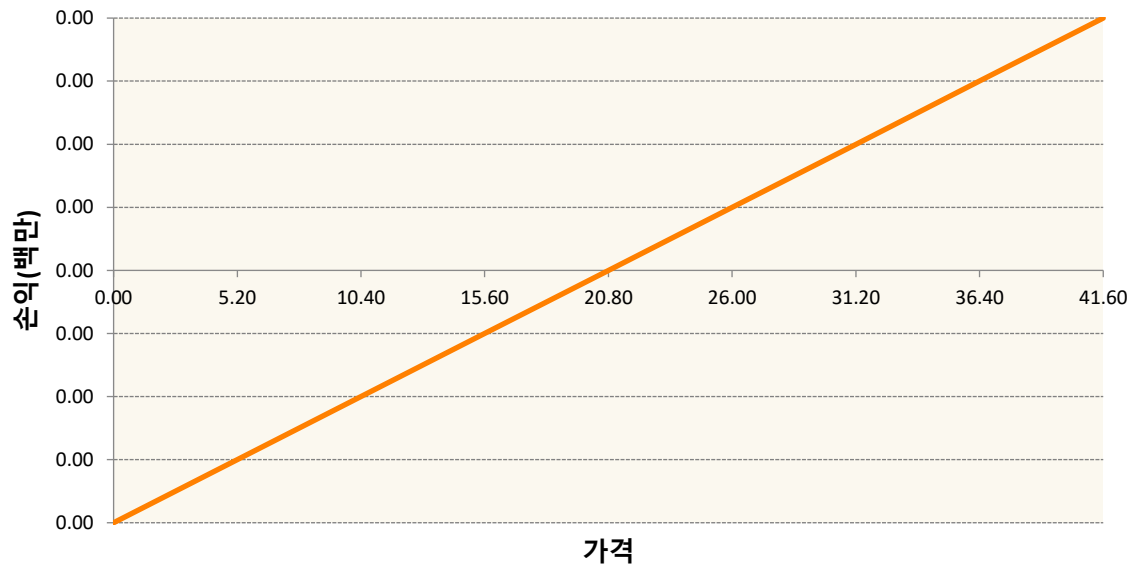
KR4175T30003-2023-03 달러선물



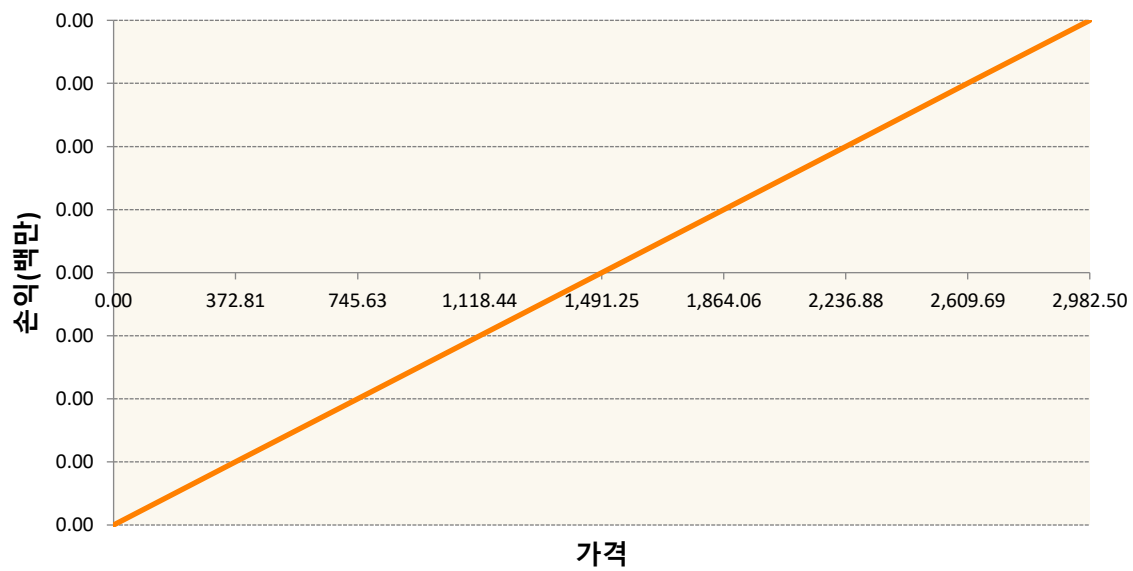
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



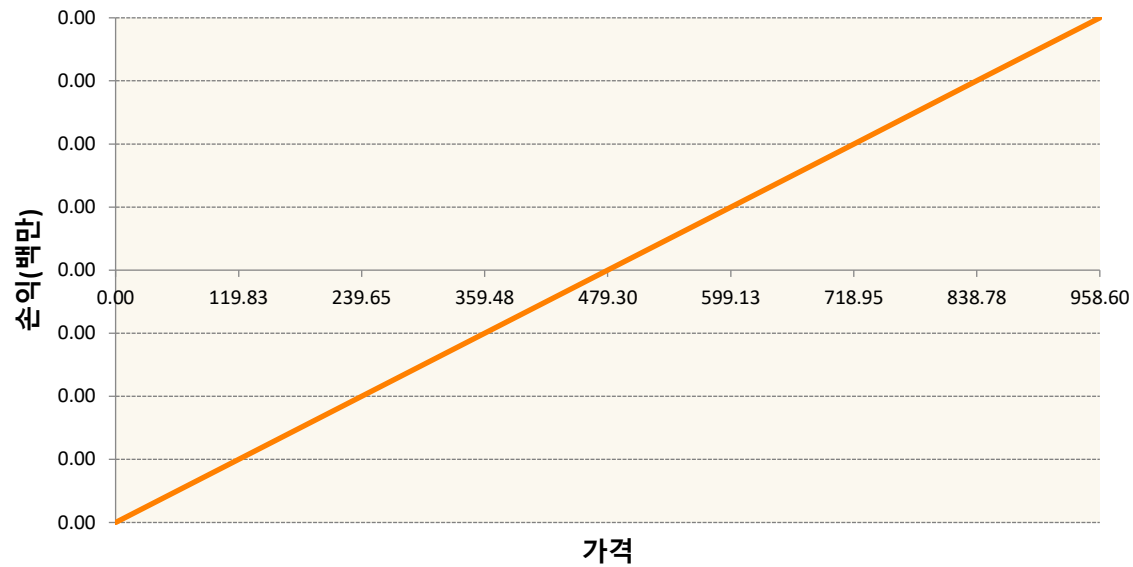
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



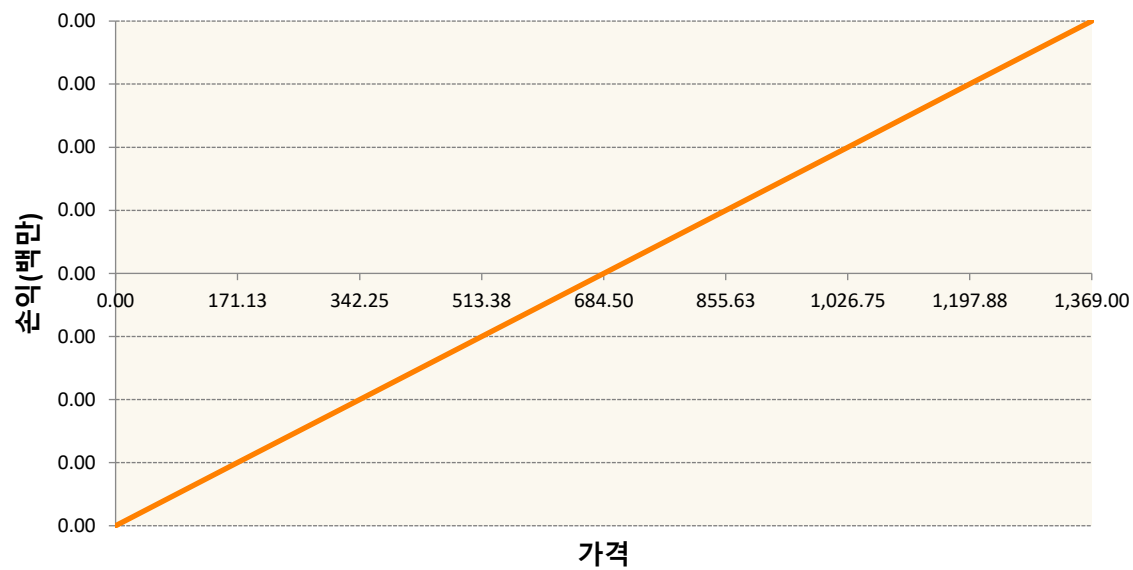
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

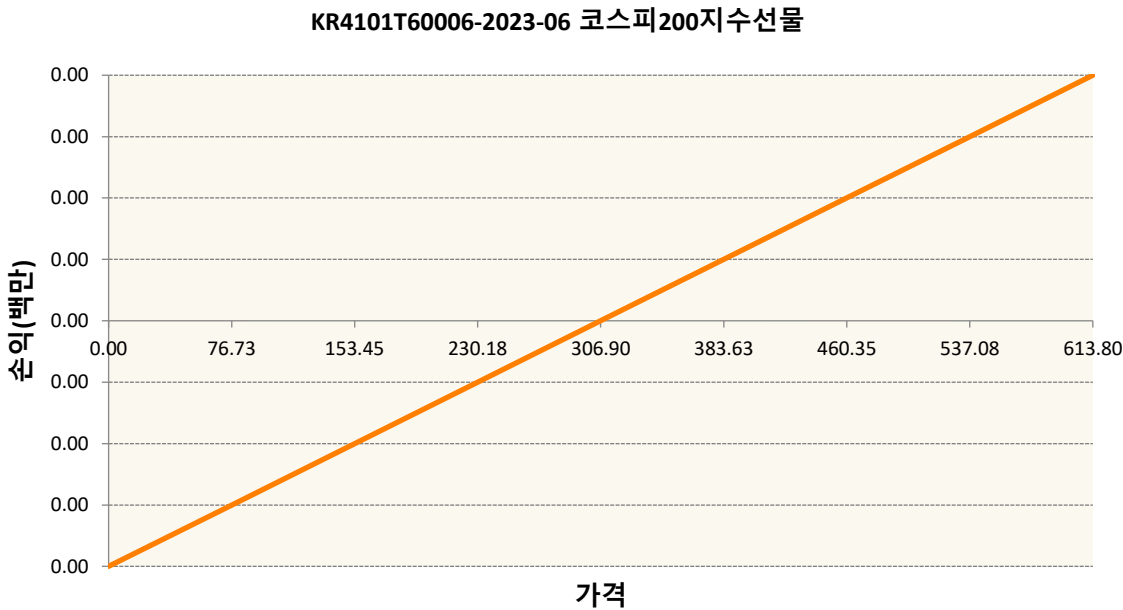
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,455 | 0     | 2,455     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T60006 |           | 2023-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 196    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -196      | -196               | -196   | -196 | -196  | -196   | -196   |
| -5.33%       | -130      | -130               | -130   | -130 | -130  | -130   | -130   |
| -2.67%       | -65       | -65                | -65    | -65  | -65   | -65    | -65    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 65        | 65                 | 65     | 65   | 65    | 65     | 65     |
| 5.33%        | 130       | 130                | 130    | 130  | 130   | 130    | 130    |
| 8.00%        | 196       | 196                | 196    | 196  | 196   | 196    | 196    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

## SOL차이나강소기업CSI500상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 4,470 | 0     | 4,470     | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 4,470 | 0     | 4,470     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래230314

364

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

497

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

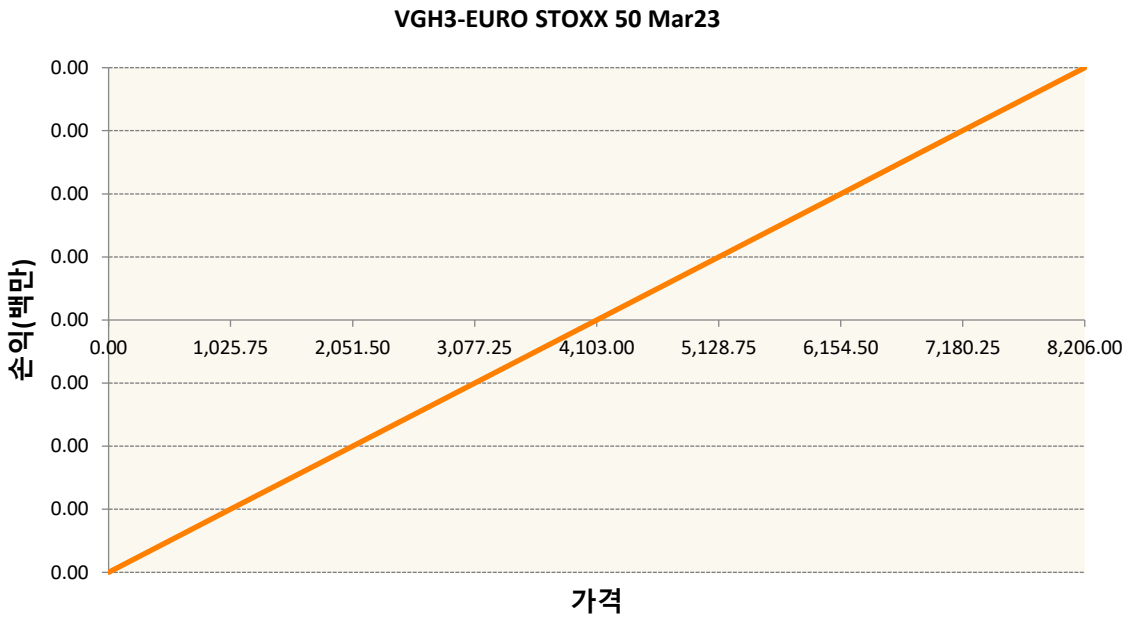
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 455   | 0     | 455       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGH3 | EURO STOXX 50 Mar23 | 36 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 39 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

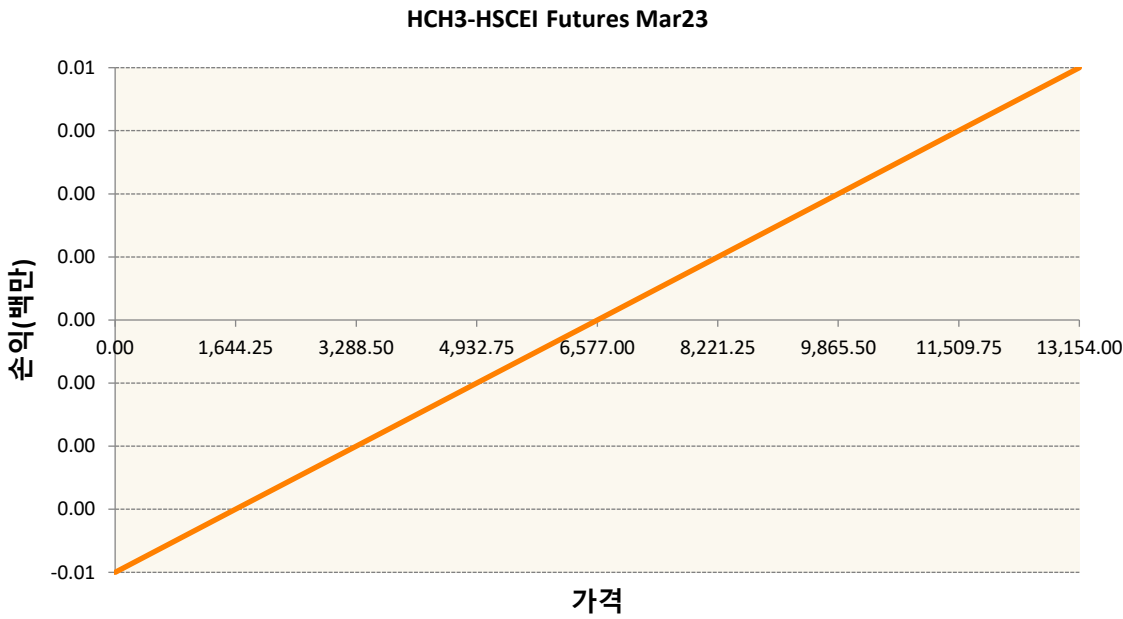
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,147 | 0     | 1,147     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCH3 | HSCEI Futures Mar23 | 92 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 123 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

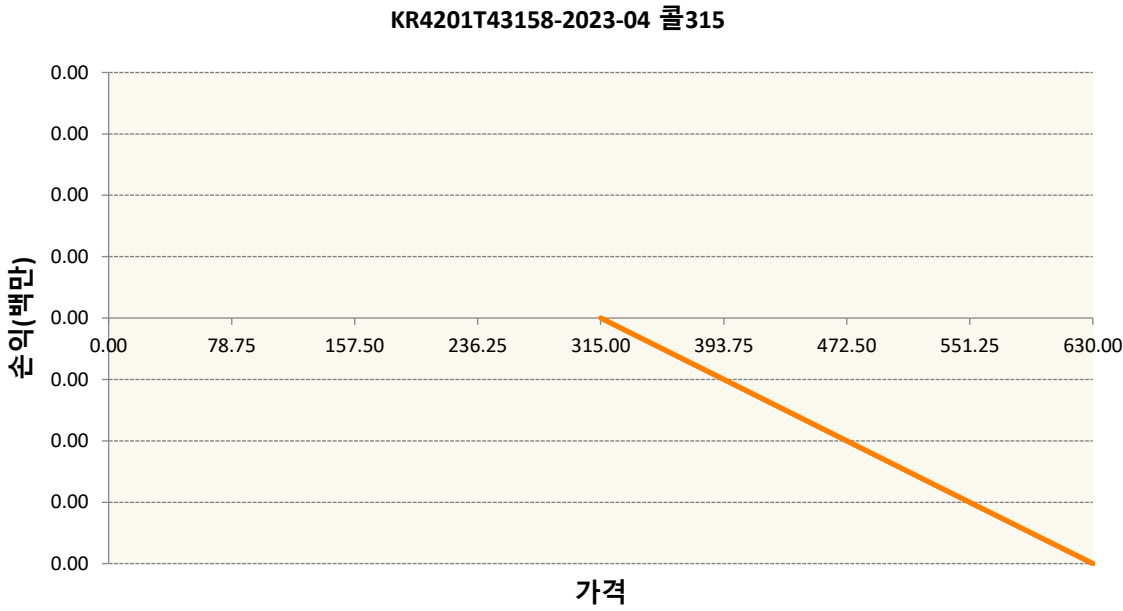
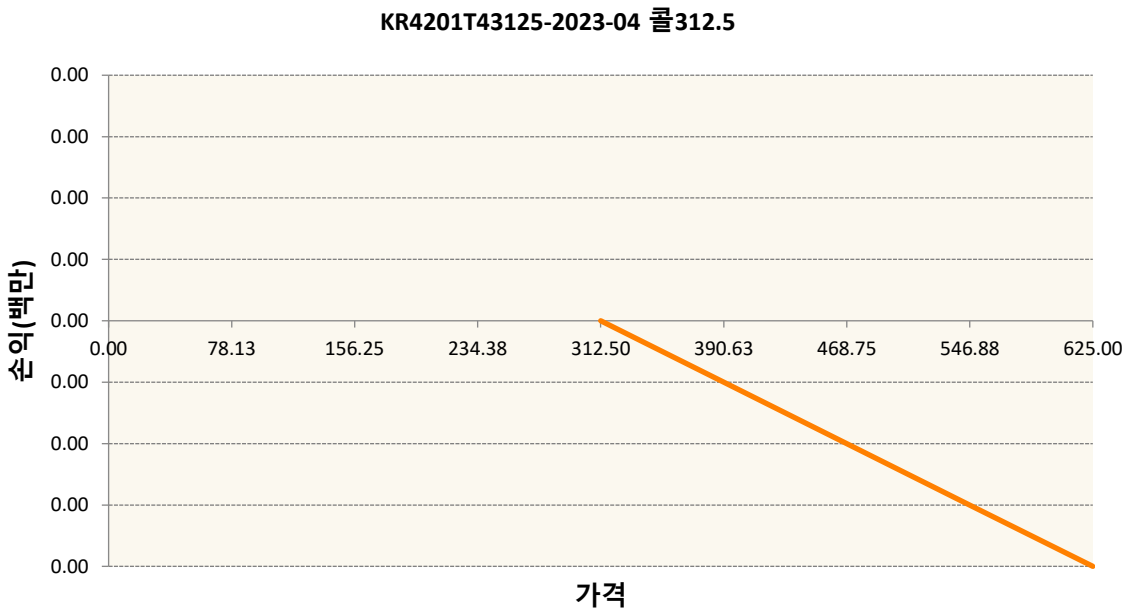
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

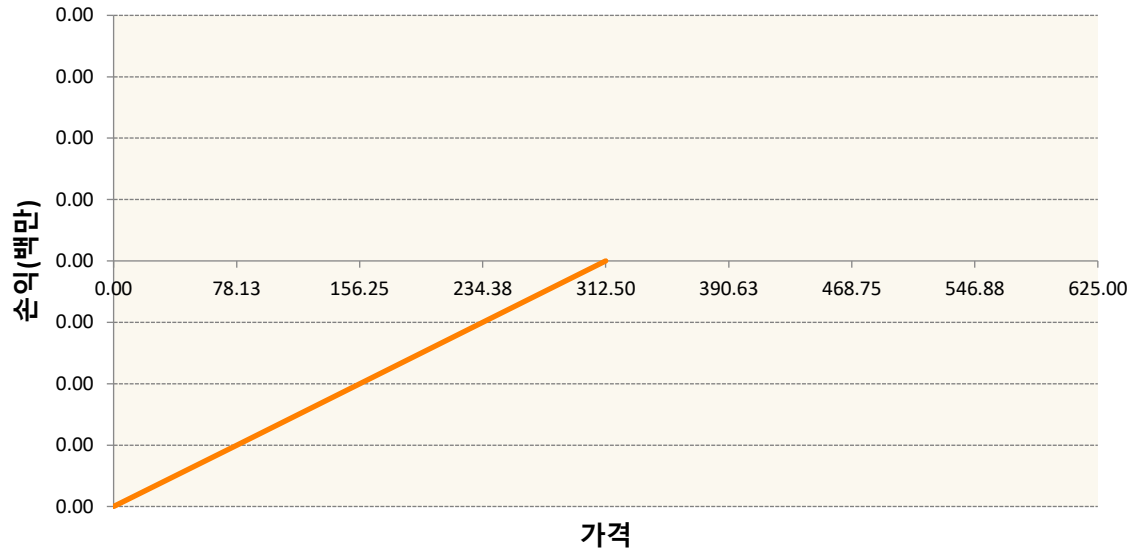
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 55,114 | -55,114   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301T43123-2023-04 풋312.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201T43125 |        | 2023-04 콜312.5 |         |        |        |        |        | 610    |
|--------------|--------|----------------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
|              |        | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |        | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 237    | 230            | 221     | 210    | 198    | 184    | 168    |        |
| -5.33%       | 217    | 203            | 187     | 170    | 152    | 132    | 111    |        |
| -2.67%       | 170    | 149            | 126     | 102    | 78     | 53     | 27     |        |
| 0%           | 84     | 56             | 28      | 0      | -28    | -57    | -86    |        |
| 2.67%        | -52    | -82            | -111    | -141   | -171   | -201   | -230   |        |
| 5.33%        | -239   | -266           | -293    | -321   | -349   | -377   | -406   |        |
| 8.00%        | -469   | -490           | -512    | -535   | -559   | -584   | -610   |        |
| KR4201T43158 |        | 2023-04 콜315   |         |        |        |        |        | 1,714  |
|              |        | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |        | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 598    | 583            | 562     | 536    | 505    | 469    | 429    |        |
| -5.33%       | 555    | 522            | 483     | 439    | 390    | 338    | 282    |        |
| -2.67%       | 448    | 392            | 332     | 268    | 202    | 133    | 62     |        |
| 0%           | 235    | 158            | 80      | 0      | -81    | -162   | -244   |        |
| 2.67%        | -120   | -207           | -294    | -381   | -468   | -555   | -642   |        |
| 5.33%        | -629   | -711           | -794    | -879   | -963   | -1,049 | -1,134 |        |
| 8.00%        | -1,275 | -1,341         | -1,411  | -1,484 | -1,559 | -1,636 | -1,714 |        |
| KR4301T43123 |        | 2023-04 풋312.5 |         |        |        |        |        | 614    |
|              |        | 기초자산의 변동성      |         |        |        |        |        |        |
| 가격           |        | -25.00%        | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -555   | -561           | -569    | -578   | -588   | -600   | -614   |        |
| -5.33%       | -320   | -332           | -345    | -360   | -376   | -392   | -410   |        |
| -2.67%       | -108   | -126           | -145    | -165   | -186   | -207   | -229   |        |
| 0%           | 71     | 48             | 24      | 0      | -24    | -48    | -73    |        |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 208 | 183 | 158 | 132 | 107 | 82  | 56  |
| 5.33% | 301 | 279 | 255 | 232 | 208 | 184 | 159 |
| 8.00% | 358 | 341 | 322 | 302 | 282 | 260 | 238 |

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

(단위:백만원)

2,619

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

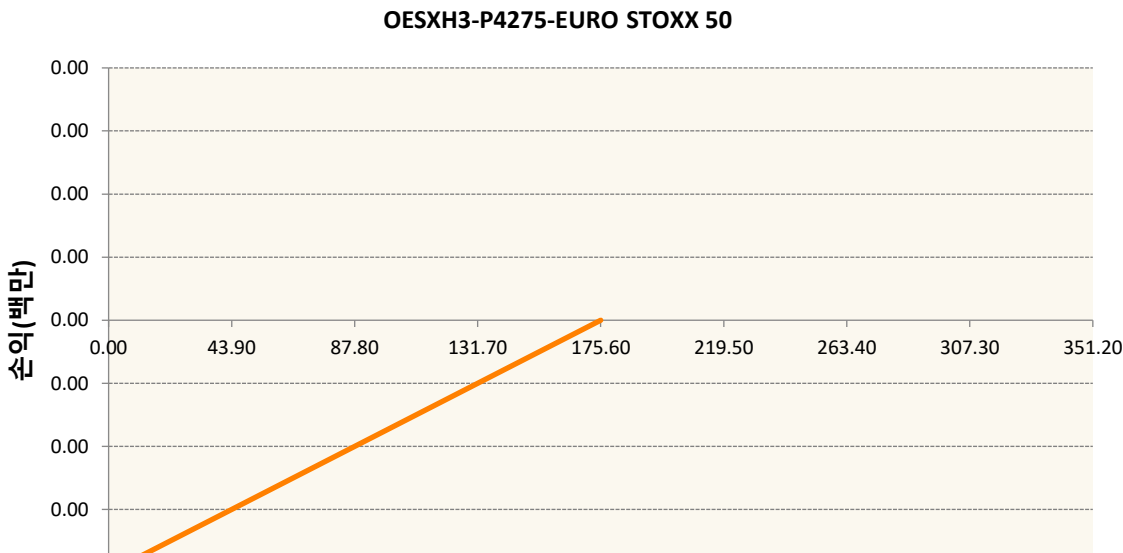
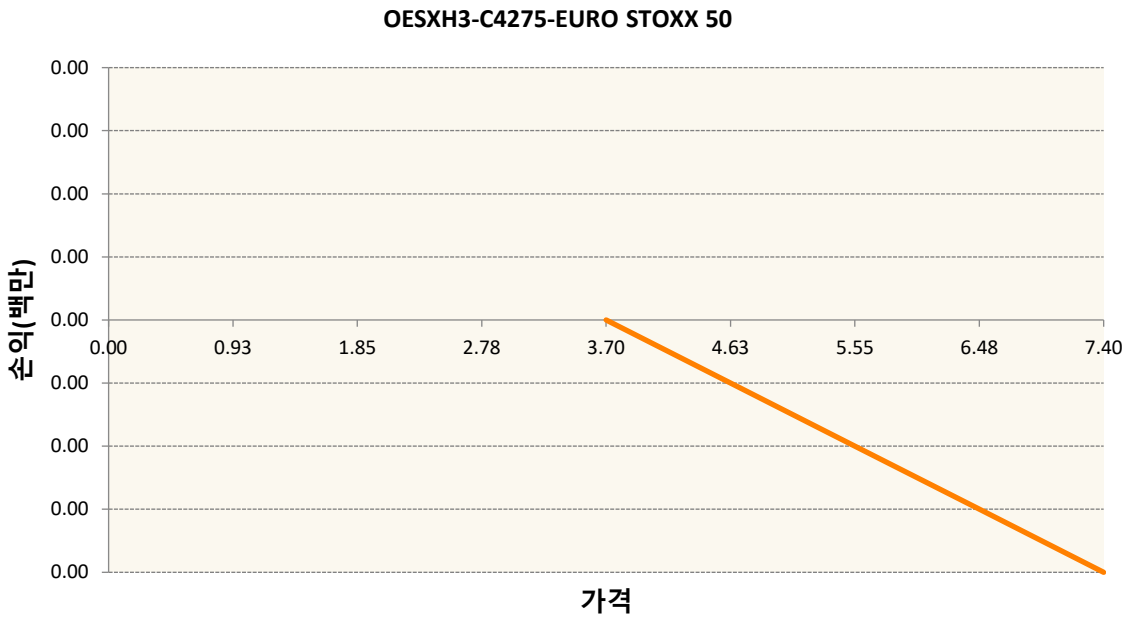
유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

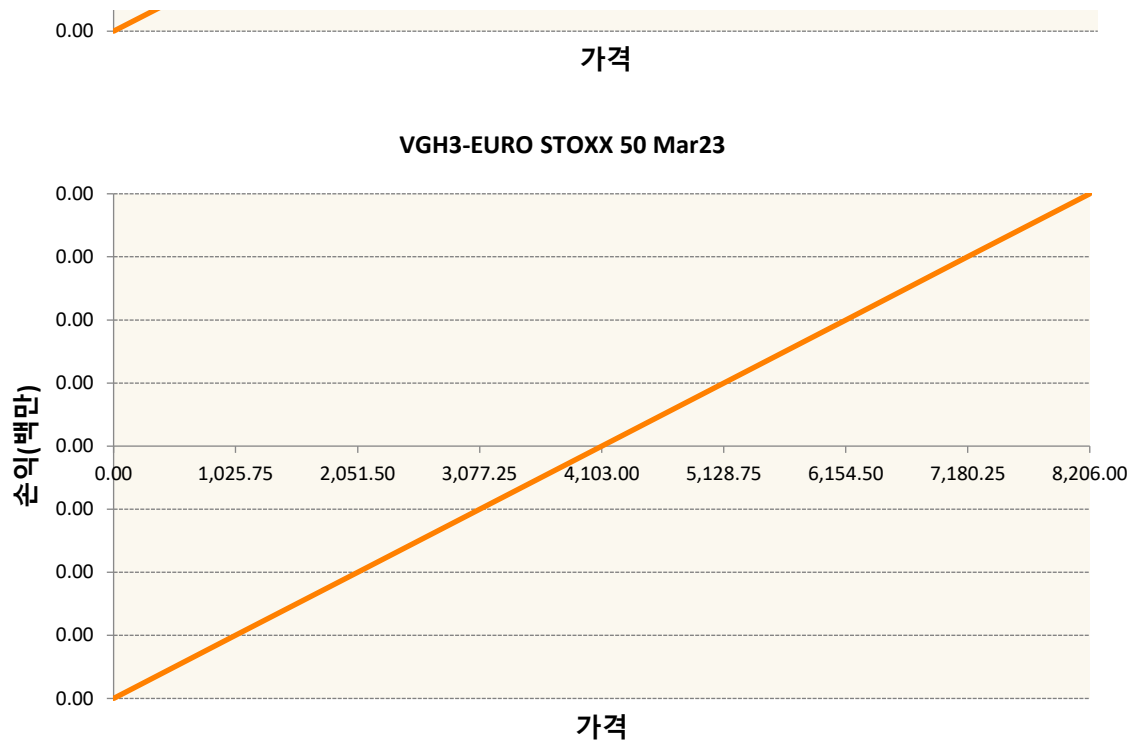
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 912   | 0     | 912       |    |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 71    | -71       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,823 | -1,823    | 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    | 0.13 |
| OESXH3-P42 EURO STOXX 50    | 6    |
| VGH3 EURO STOXX 50 Mar23    | 73   |

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

(단위:백만원)

195

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

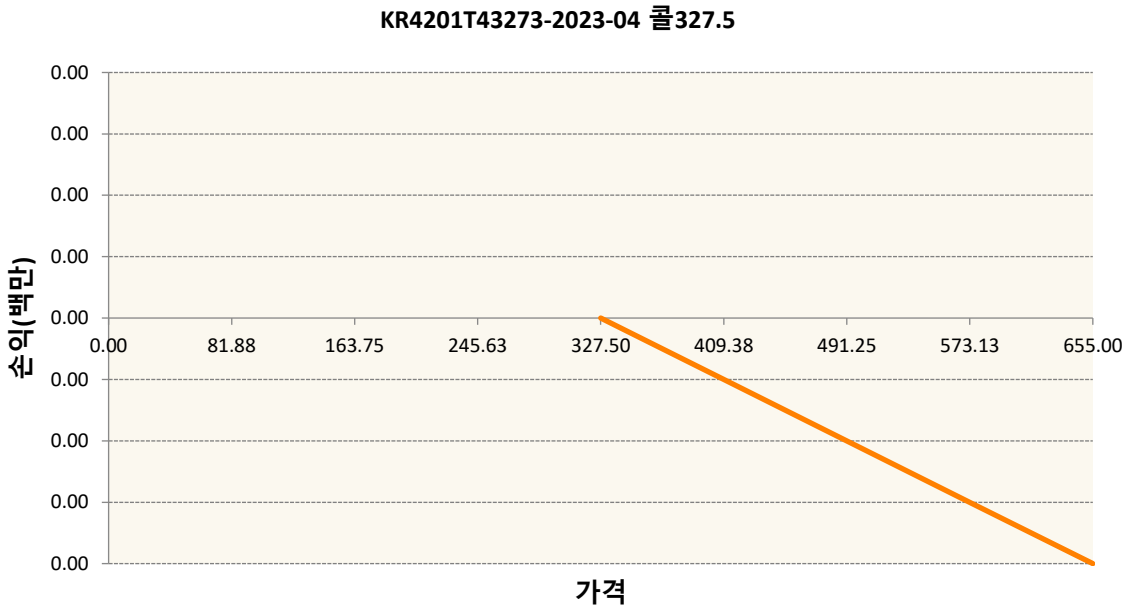
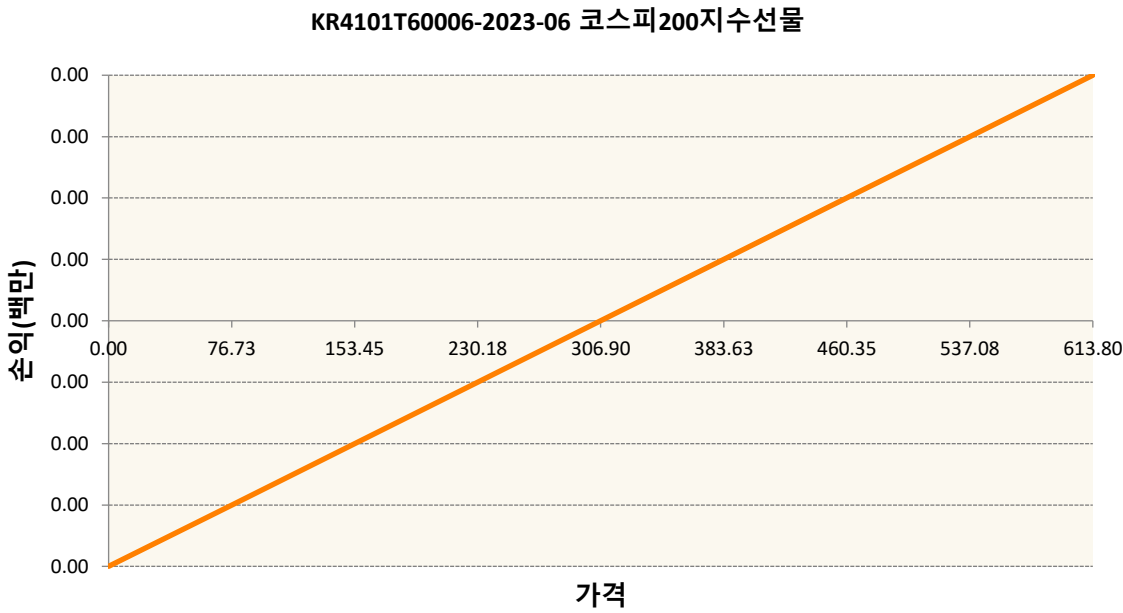
## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

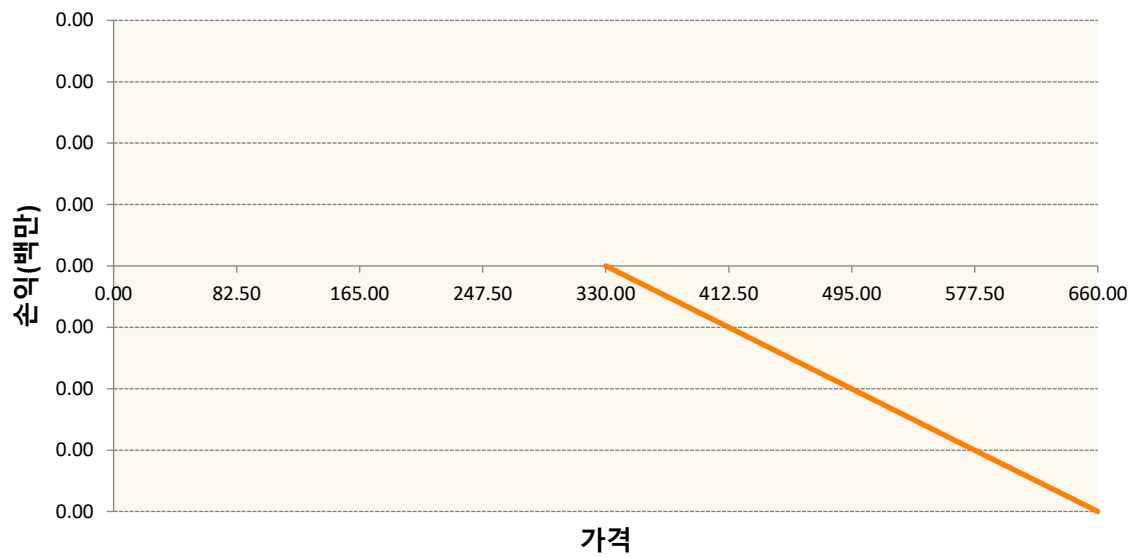
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 384   | 0     | 384       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 157   | 3,874 | -3,718    | 장내 |

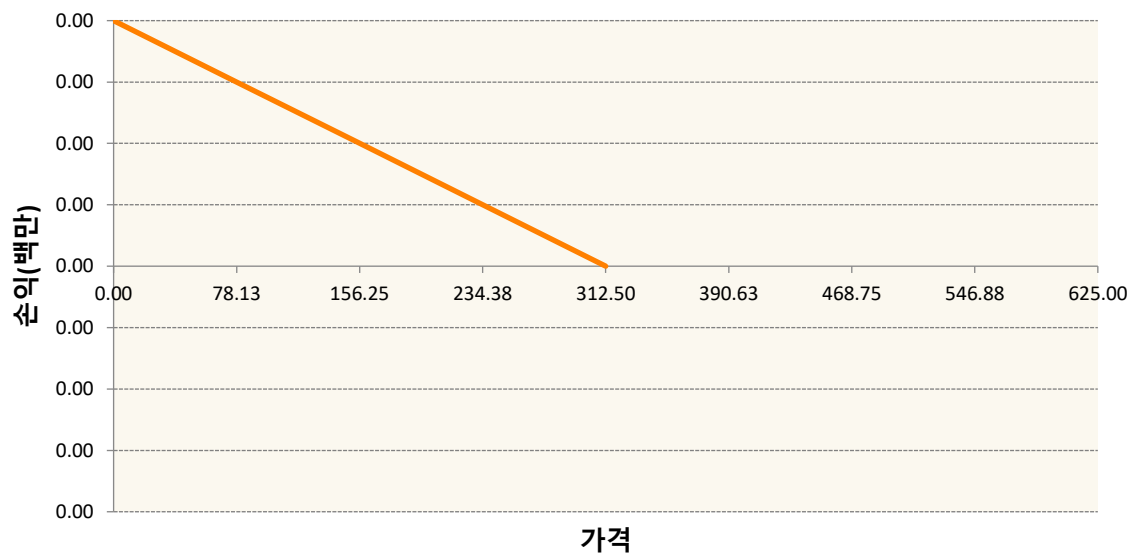
### 2. 만기시점의 손익구조



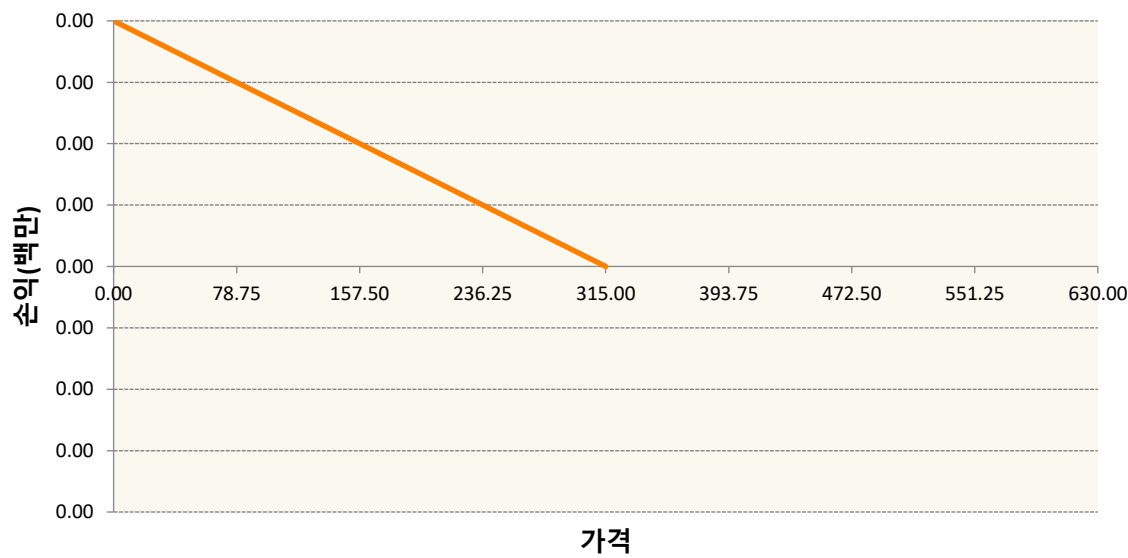
KR4201T43307-2023-04 콜330



KR4301T43123-2023-04 풋312.5



KR4301T43156-2023-04 풋315



(단위:백만원)

|              |           |                    |        |     |       |        |        |
|--------------|-----------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
| KR4101T60006 |           | 2023-06 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%       | -20       | -20                | -20    | -20 | -20   | -20    | -20    |
| -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%        | 20        | 20                 | 20     | 20  | 20    | 20     | 20     |
| 8.00%        | 31        | 31                 | 31     | 31  | 31    | 31     | 31     |
| KR4201T43273 |           | 2023-04 콜327.5     |        |     |       |        | 15     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 3         | 3                  | 3      | 3   | 3     | 3      | 2      |
| -5.33%       | 3         | 3                  | 3      | 3   | 2     | 2      | 1      |
| -2.67%       | 3         | 2                  | 2      | 2   | 1     | 1      | 0      |
| 0%           | 2         | 1                  | 1      | 0   | -1    | -1     | -2     |
| 2.67%        | 0         | -1                 | -2     | -3  | -4    | -4     | -5     |
| 5.33%        | -3        | -4                 | -5     | -6  | -7    | -8     | -10    |
| 8.00%        | -8        | -9                 | -10    | -11 | -13   | -14    | -15    |
| KR4201T43307 |           | 2023-04 콜330       |        |     |       |        | 113    |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 22        | 22                 | 21     | 21  | 19    | 18     | 16     |
| -5.33%       | 22        | 21                 | 19     | 18  | 15    | 13     | 10     |
| -2.67%       | 19        | 17                 | 15     | 11  | 8     | 3      | -1     |
| 0%           | 14        | 10                 | 5      | 0   | -6    | -11    | -18    |
| 2.67%        | 1         | -5                 | -12    | -19 | -26   | -34    | -41    |
| 5.33%        | -23       | -31                | -39    | -47 | -56   | -64    | -73    |
| 8.00%        | -60       | -69                | -78    | -87 | -95   | -104   | -113   |
| KR4301T43123 |           | 2023-04 풋312.5     |        |     |       |        | 5      |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 4         | 5                  | 5      | 5   | 5     | 5      | 5      |
| -5.33%       | 3         | 3                  | 3      | 3   | 3     | 3      | 3      |
| -2.67%       | 1         | 1                  | 1      | 1   | 1     | 2      | 2      |
| 0%           | -1        | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 1      |
| 2.67%        | -2        | -1                 | -1     | -1  | -1    | -1     | 0      |
| 5.33%        | -2        | -2                 | -2     | -2  | -2    | -1     | -1     |
| 8.00%        | -3        | -3                 | -3     | -2  | -2    | -2     | -2     |
| KR4301T43156 |           | 2023-04 풋315       |        |     |       |        | 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% | 1       | 1       | 1      | 1  | 2     | 2      | 2      |
| 0%     | -1      | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 1      |
| 2.67%  | -2      | -2      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| 5.33%  | -3      | -2      | -2     | -2 | -2    | -2     | -1     |
| 8.00%  | -3      | -3      | -3     | -3 | -2    | -2     | -2     |

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

(단위:백만원)

131

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 6,909 | 0     | 6,909     |    |

### 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 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 5,515 | 0     | 5,515     |    |

### 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 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0      | 0      | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 19,575 | 0      | 19,575    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 19,699 | -19,699   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    |                                 | (단위:백만원) |
|------------------------------|---------------------------------|----------|
| FXW213CCSI KRW/USD 28-03-23E |                                 | 556      |
| FXW213D1SI KRW/USD 28-04-23E |                                 | 313      |
| FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E  |                                 | 707      |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |          |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 905      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

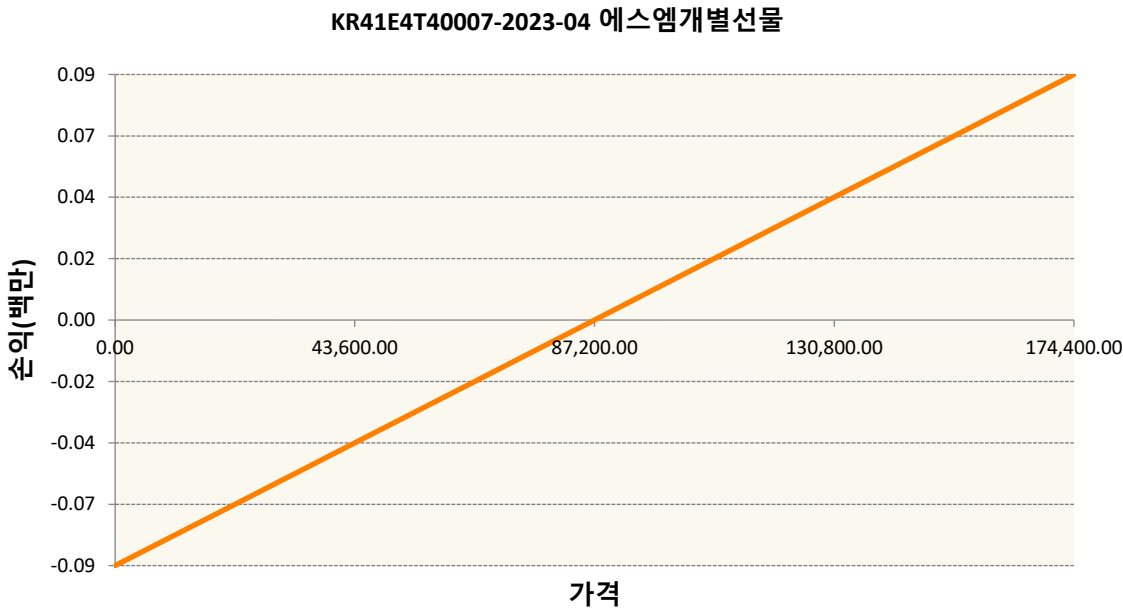
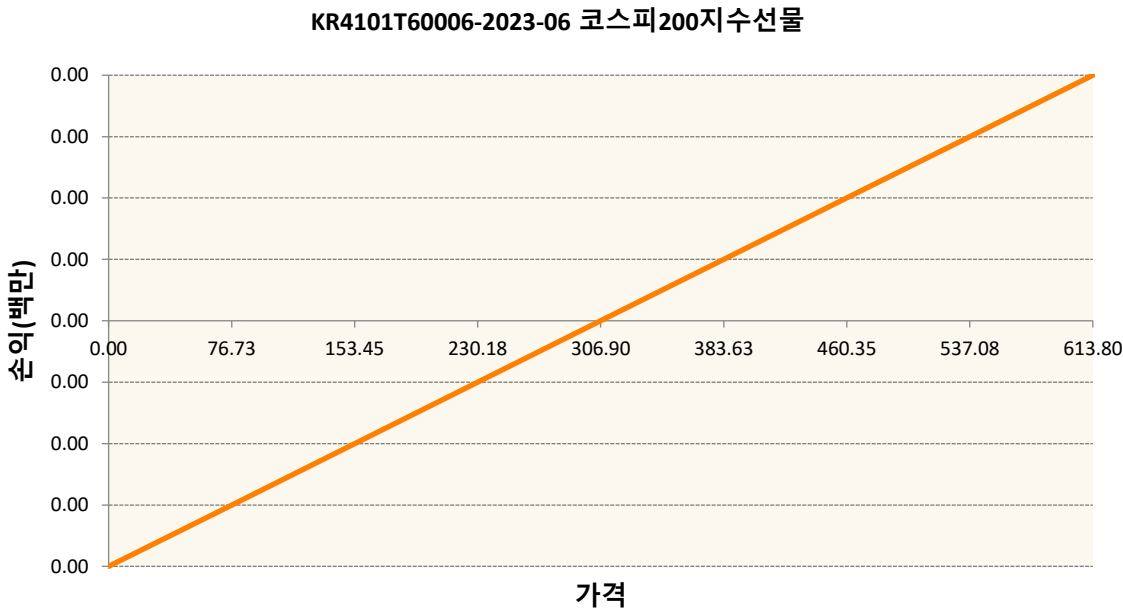
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,319 | 0     | 1,319     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



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

| KR4101T60006 |           | 2023-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 104    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -104      | -104               | -104   | -104 | -104  | -104   | -104   |
| -5.33%       | -69       | -69                | -69    | -69  | -69   | -69    | -69    |
| -2.67%       | -35       | -35                | -35    | -35  | -35   | -35    | -35    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 35        | 35                 | 35     | 35   | 35    | 35     | 35     |
| 5.33%        | 69        | 69                 | 69     | 69   | 69    | 69     | 69     |
| 8.00%        | 104       | 104                | 104    | 104  | 104   | 104    | 104    |
| KR41E4T40007 |           | 2023-04 에스엠개별선물    |        |      |       |        | 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)

114

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

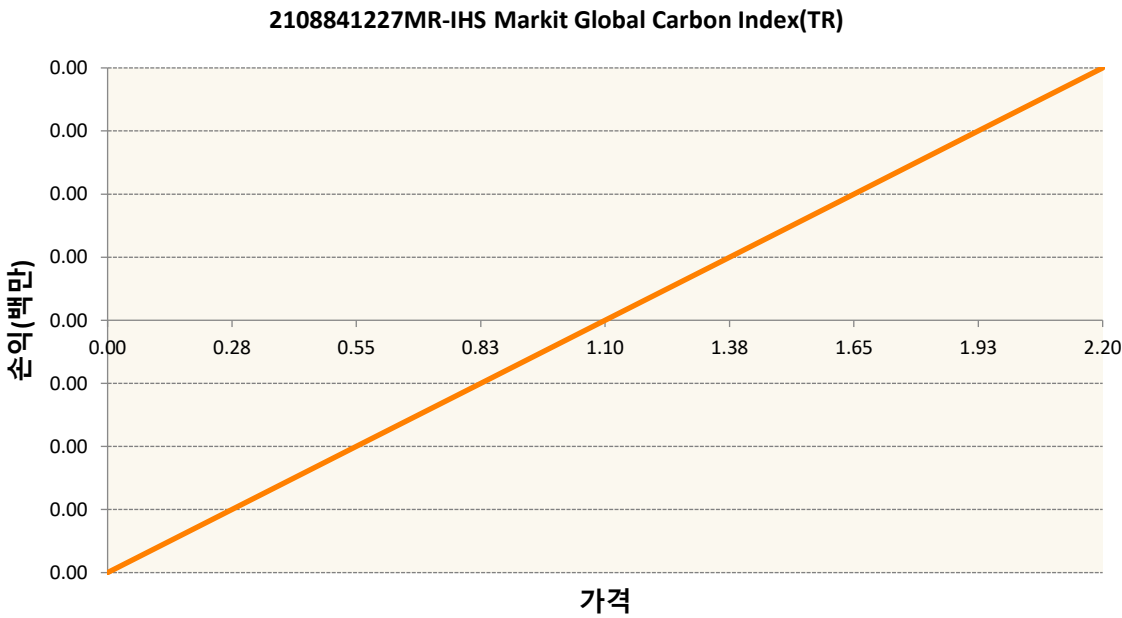
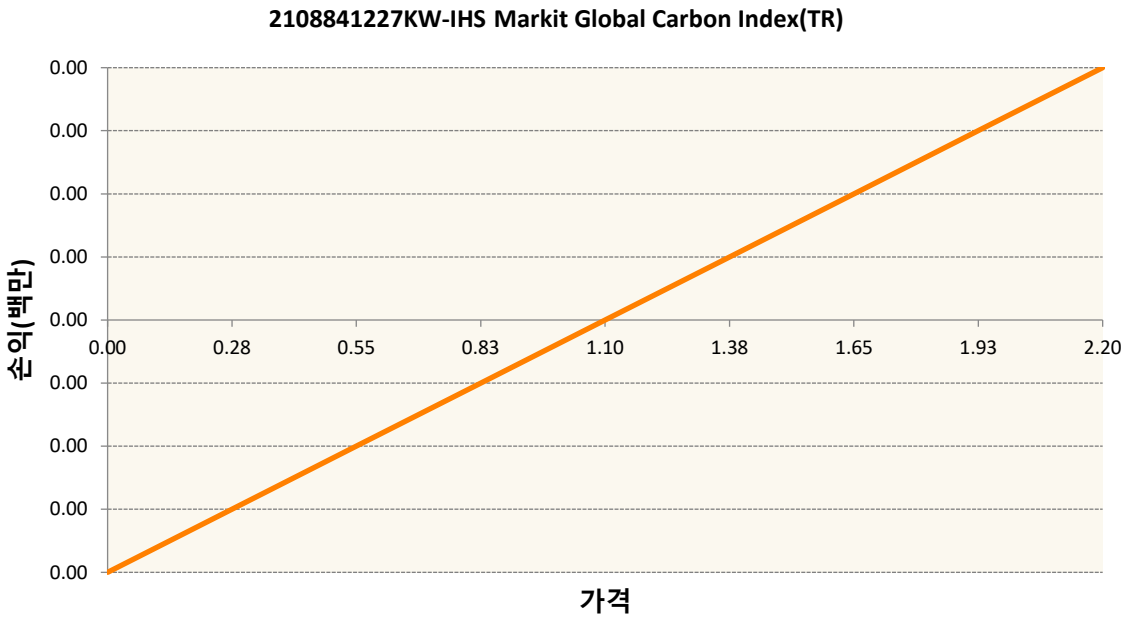
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

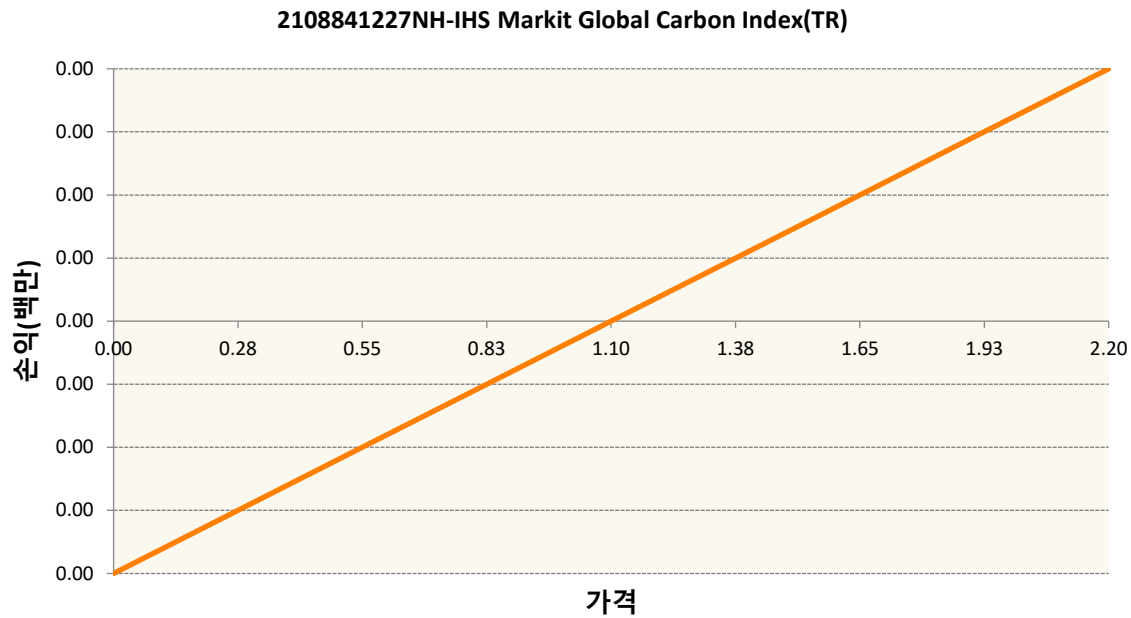
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 26,781 | 0     | 26,781    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                    |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------|--|----------|
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 1,816    |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 214      |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 107      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 4,056    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

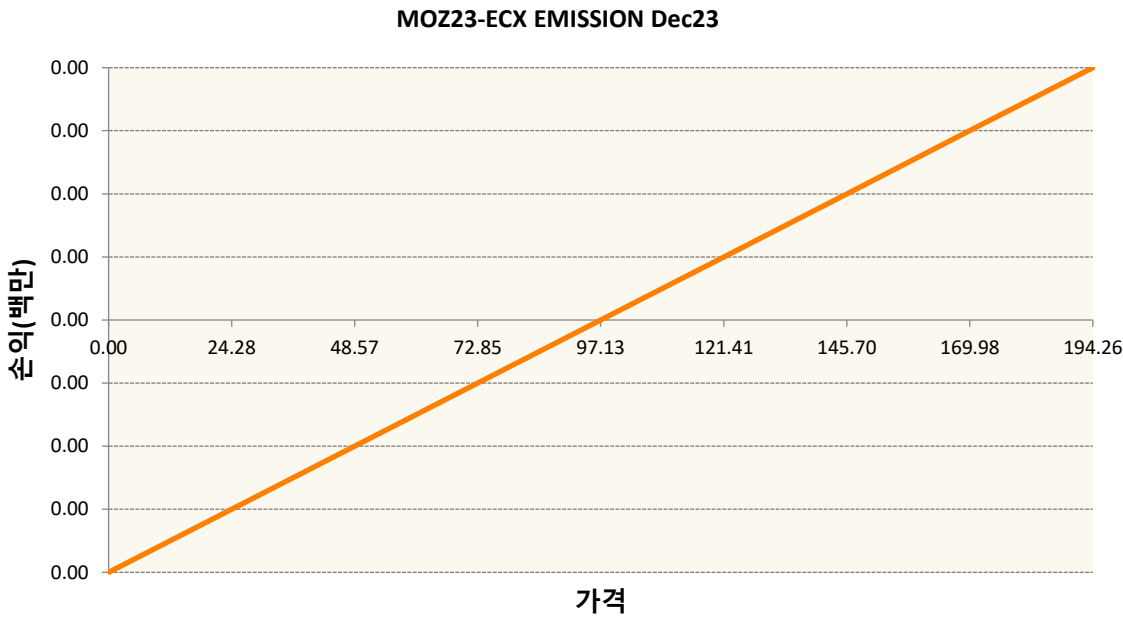
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 10,068 | 0     | 10,068    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 561    | 4,246 | -3,685    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E  | 146 |
| FXW213D2Q KRW/EUR 31-03-23E  | 146 |
| FXW213D36I EUR/KRW 31-03-23E | 45  |
| FXW213D39I KRW/EUR 31-03-23E | 48  |
| MOZ23 ECX EMISSION Dec23     | 805 |

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

(단위:백만원)

2,358

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)           |  | (단위:백만원) |
|-------------------------------------|--|----------|
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (NH)  |  | 12       |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)  |  | 12       |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)  |  | 12       |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠) |  | 12       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 82       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

## SOL차이나육성산업액티브상장지

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 8,619 | 0     | 8,619     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(NH)  | 8  |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(메리츠) | 11 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(미래)  | 10 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(키움)  | 8  |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 45 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

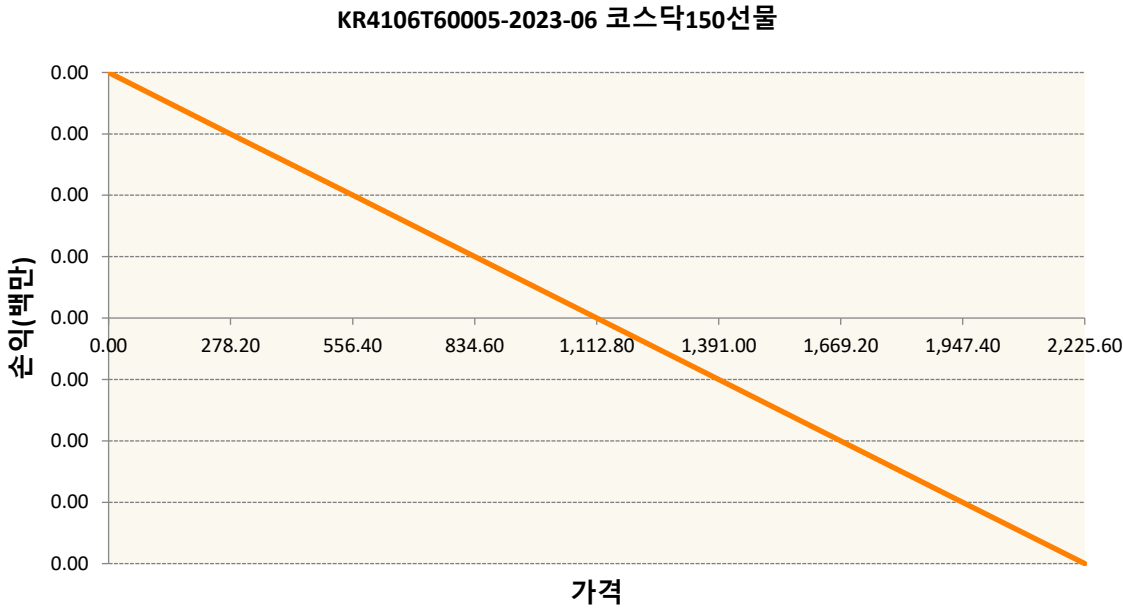
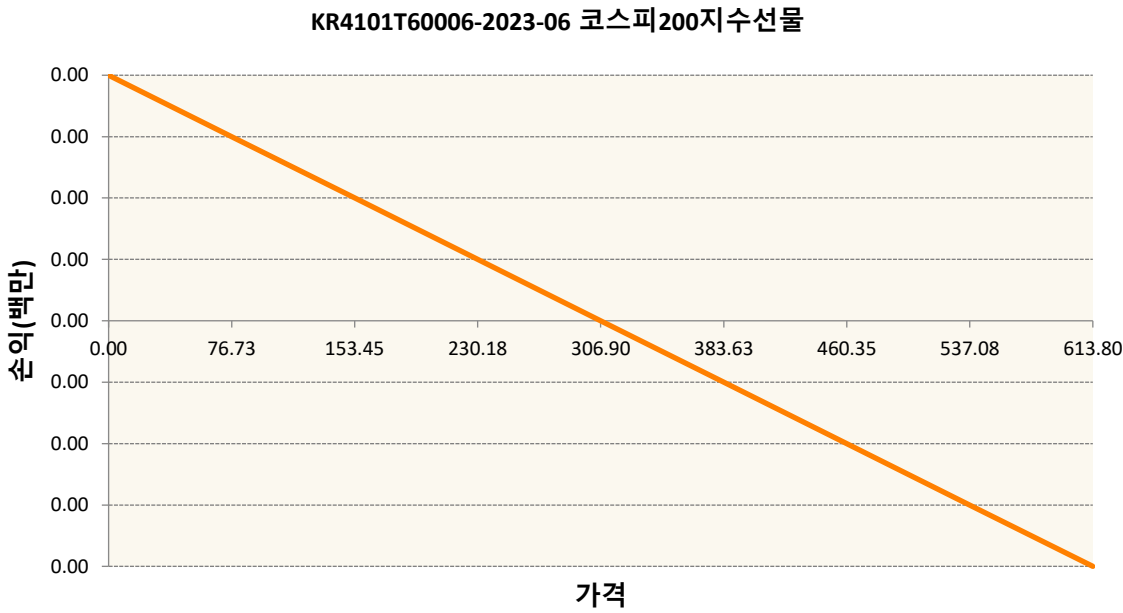
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

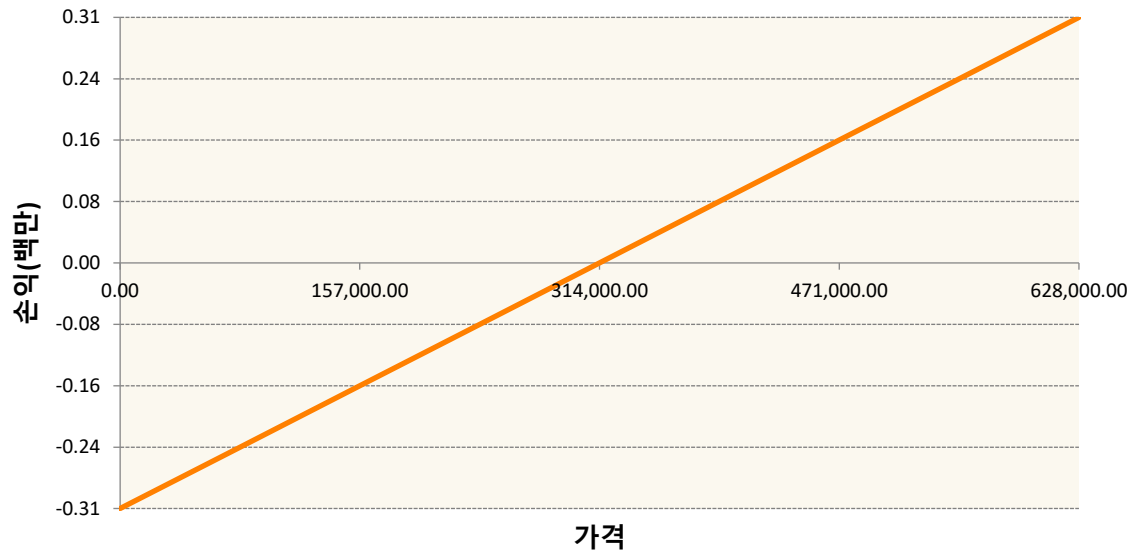
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 154   | 384   | -230      | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 476   | 3,637 | -3,162    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

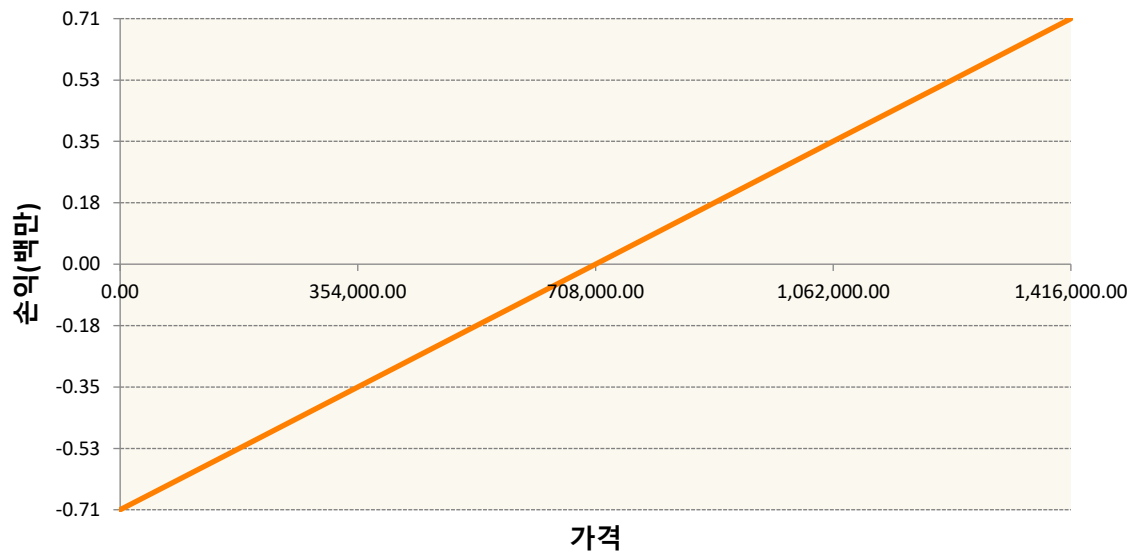
### 2. 만기시점의 손익구조



KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



KR4147T40001-2023-04 LG화학개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                      |      |
|--------------------------------------|------|
| KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물        | 184  |
| KR4106T600 2023-06 코스닥150선물          | 107  |
| KR4113T400 2023-04 POSCO홀딩스개별선물      | 13   |
| KR4147T400 2023-04 LG화학개별선물          | 25   |
| KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221    | 0.18 |
| KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221 | 1    |
| KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308     | 1    |

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

(단위:백만원)

472

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

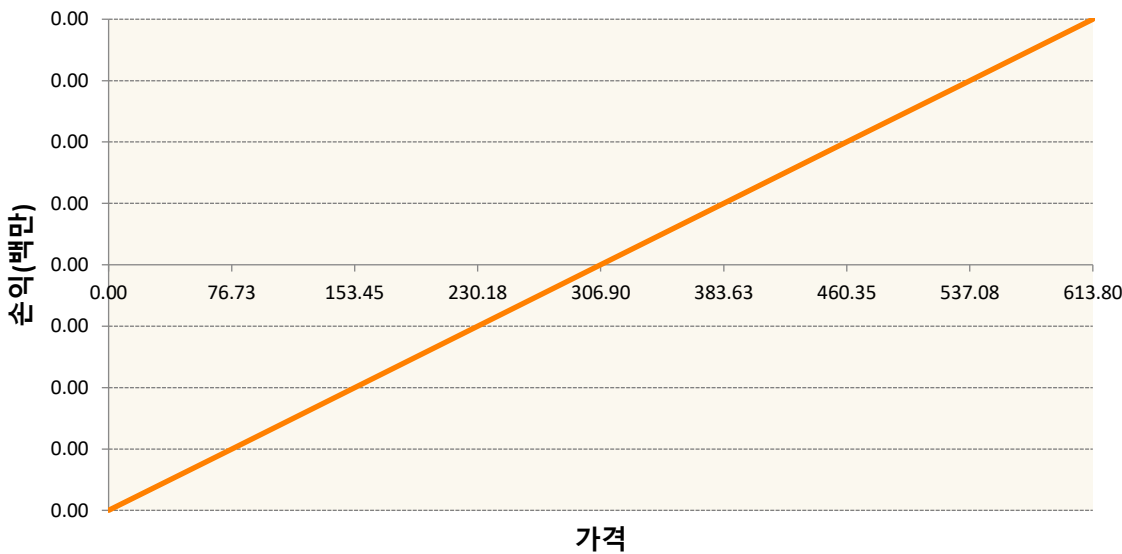
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,916 | 0     | 2,916     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101T60006-2023-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T60006 |           |         | 2023-06 코스피200지수선물 |      |       |        | 232    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -232      | -232    | -232               | -232 | -232  | -232   | -232   |
| -5.33%       | -155      | -155    | -155               | -155 | -155  | -155   | -155   |
| -2.67%       | -77       | -77     | -77                | -77  | -77   | -77    | -77    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 77        | 77      | 77                 | 77   | 77    | 77     | 77     |
| 5.33%        | 155       | 155     | 155                | 155  | 155   | 155    | 155    |
| 8.00%        | 232       | 232     | 232                | 232  | 232   | 232    | 232    |

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

(단위:백만원)

251

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-15 |
| 기준일 | 2023-03-14 |

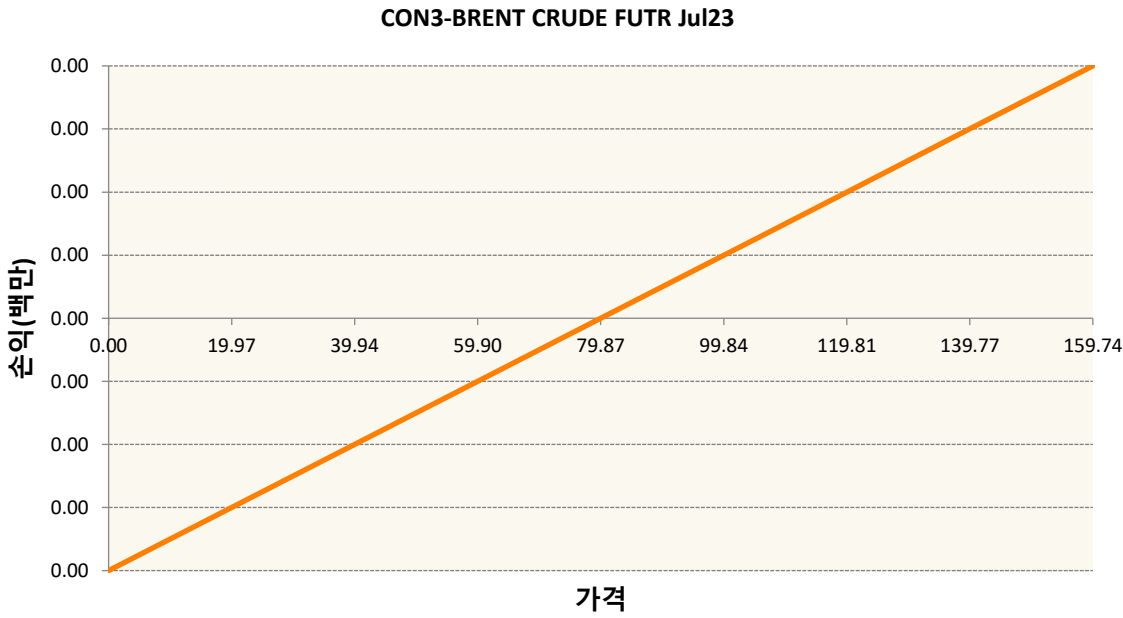
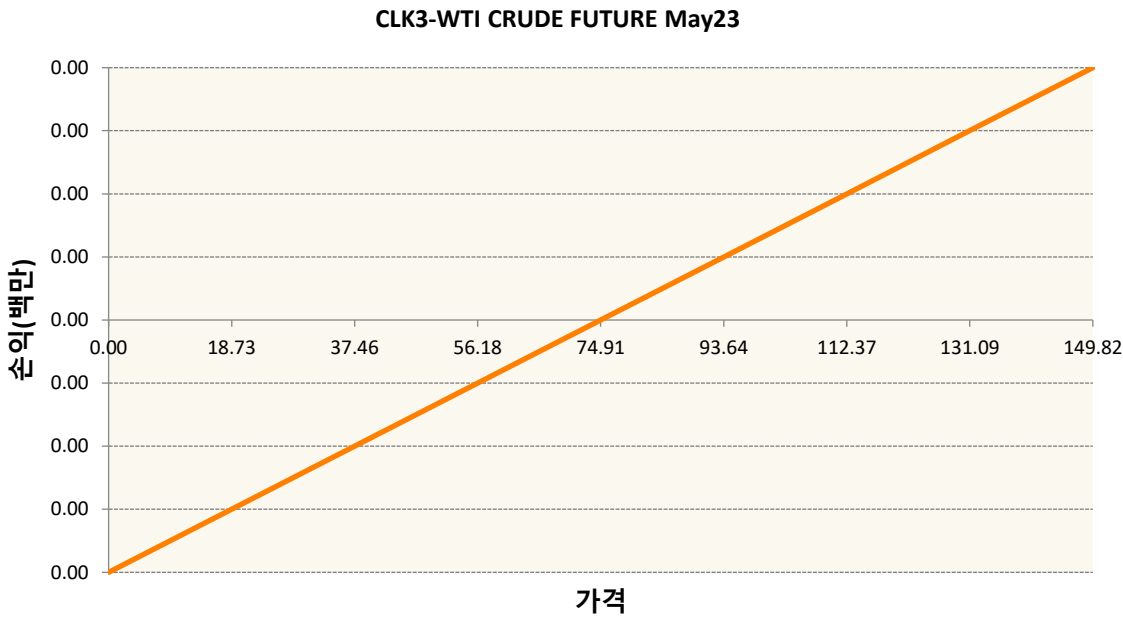
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

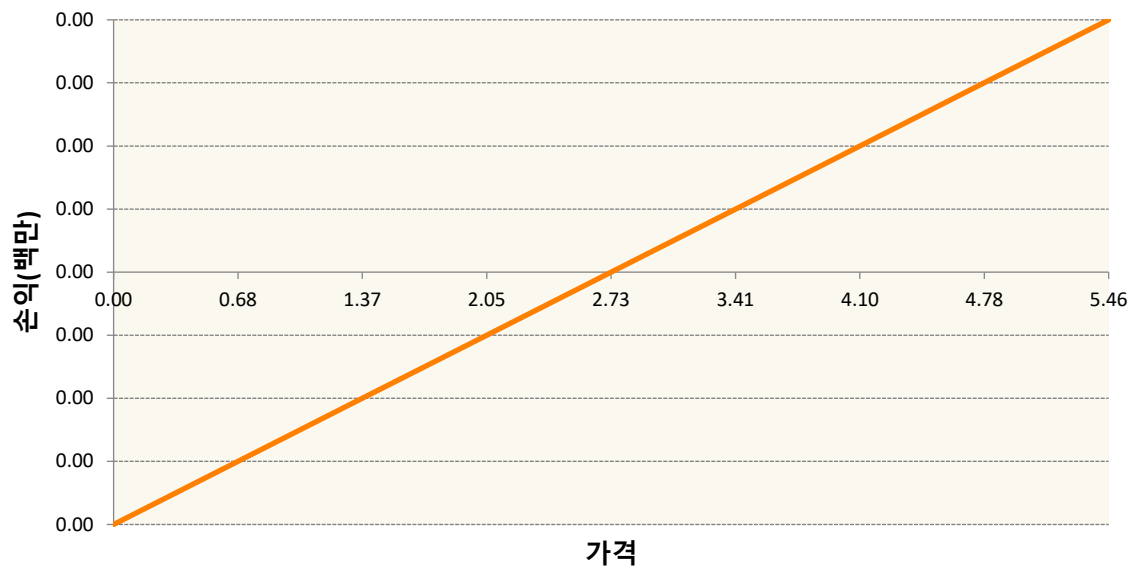
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,662 | 328   | 1,335     |    |

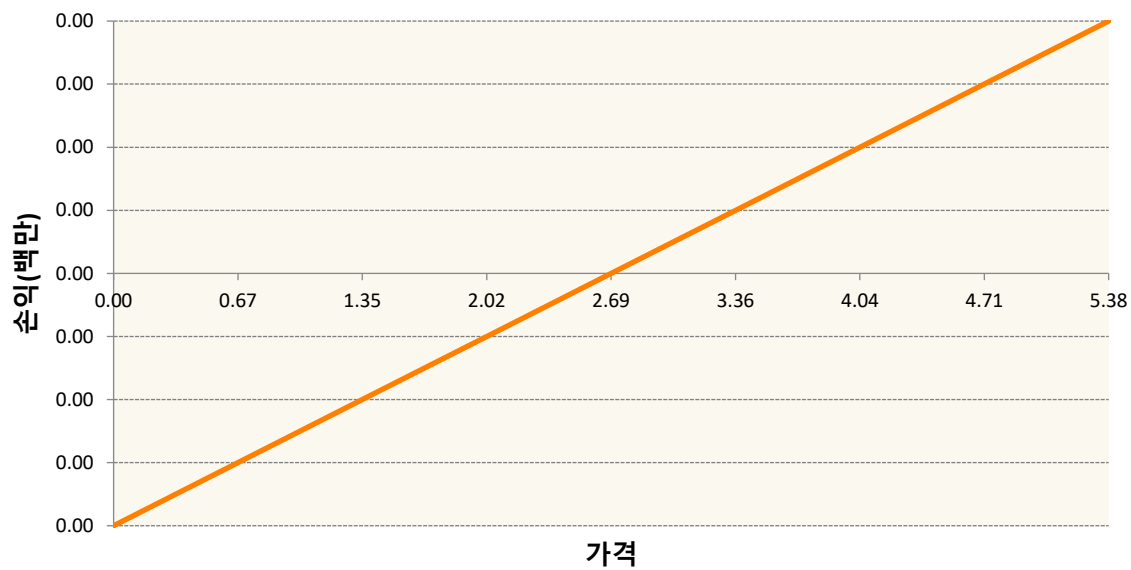
### 2. 만기시점의 손익구조



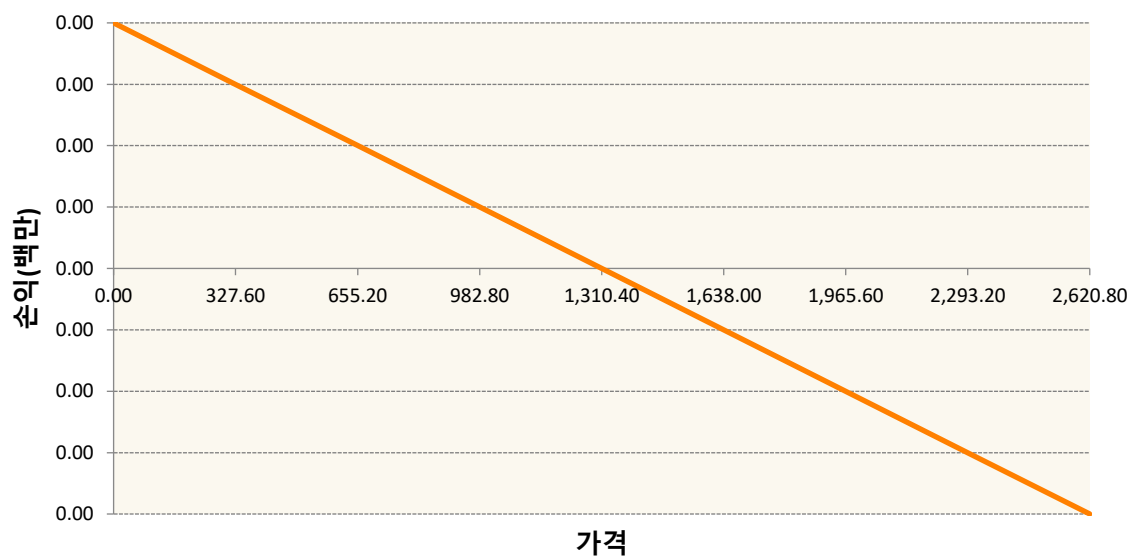
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



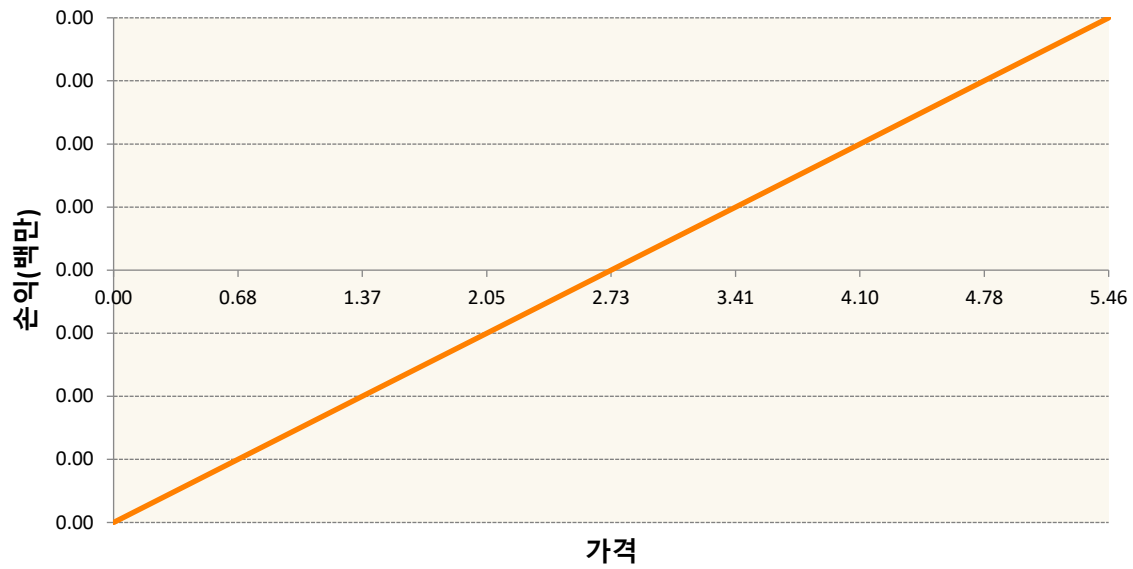
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



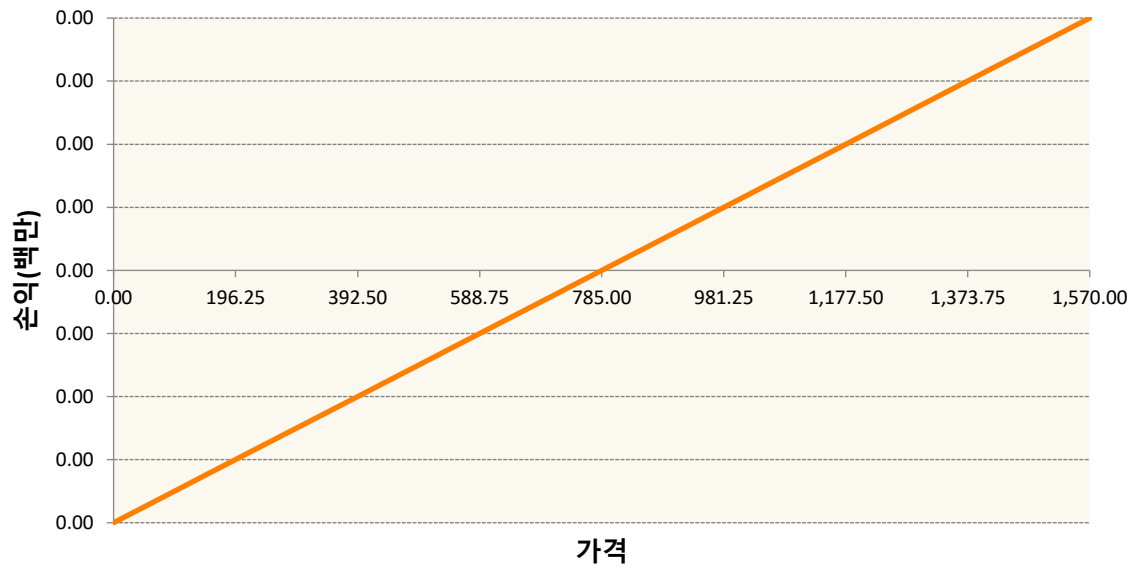
KR4175T30003-2023-03 달러선물



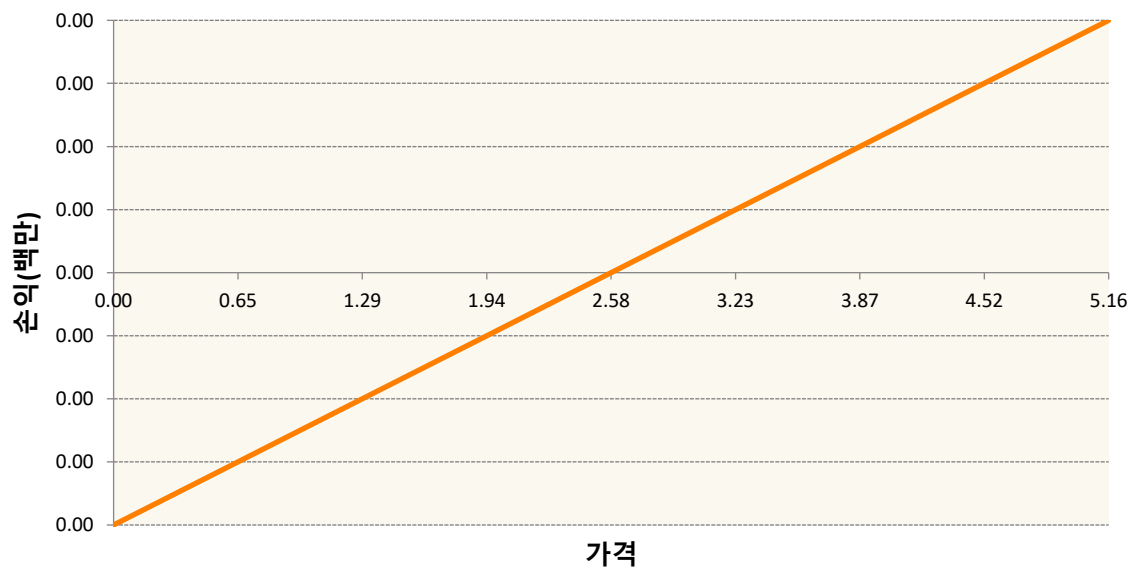
NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23



XBK3-GASOLINE RBOB FUT May23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|            |                          |    |
|------------|--------------------------|----|
| CLK3       | WTI CRUDE FUTURE May23   | 31 |
| CON3       | BRENT CRUDE FUTR Jul23   | 34 |
| EOK3       | E-MINI NATURAL GAS May23 | 2  |
| HOK3       | NY Harb ULSD Fut May23   | 12 |
| KR4175T300 | 2023-03 달러선물             | 26 |
| 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)

420