

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

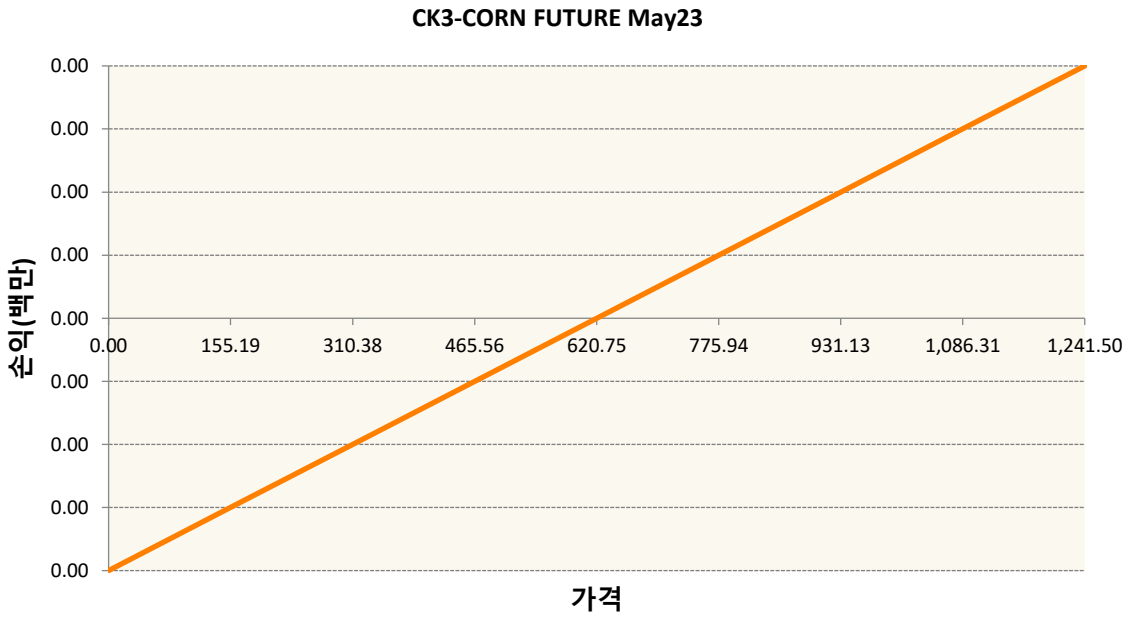
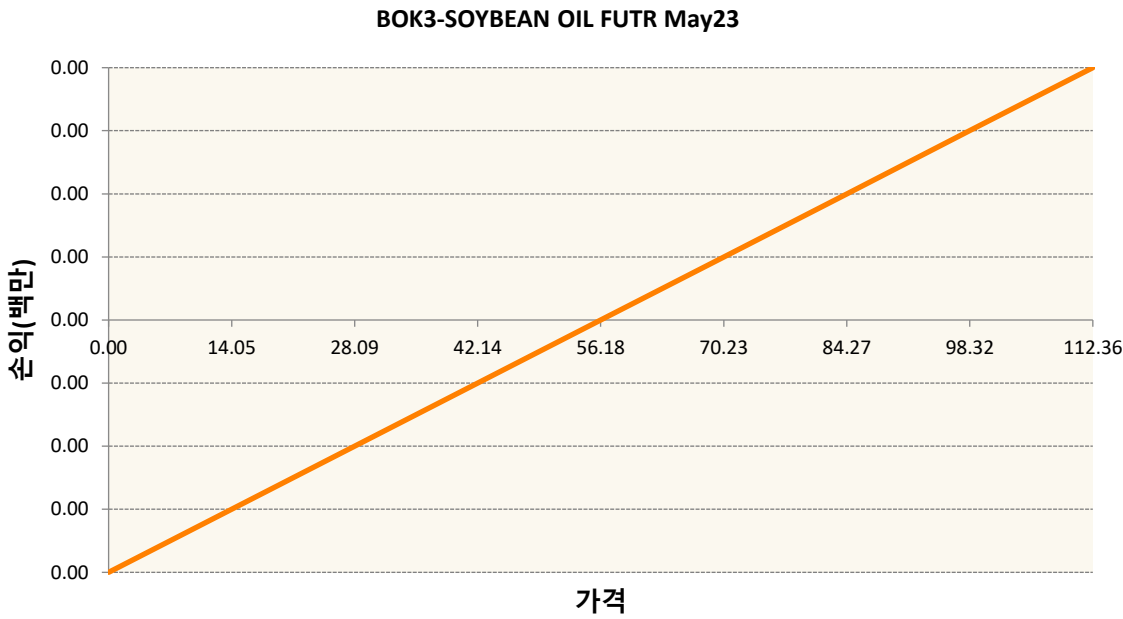
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

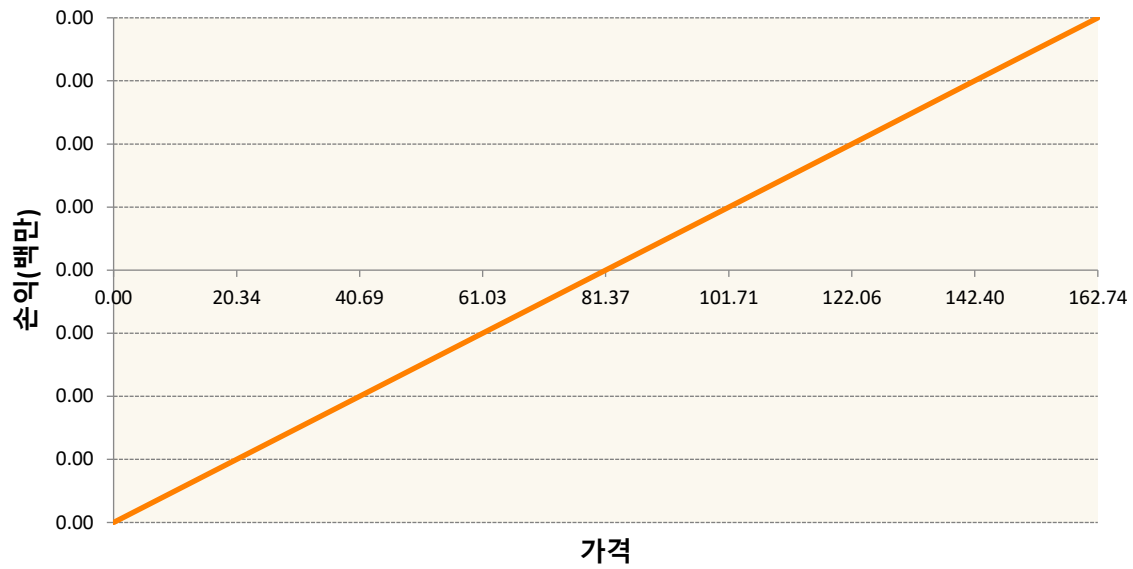
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,565 | 521   | 5,044     |    |

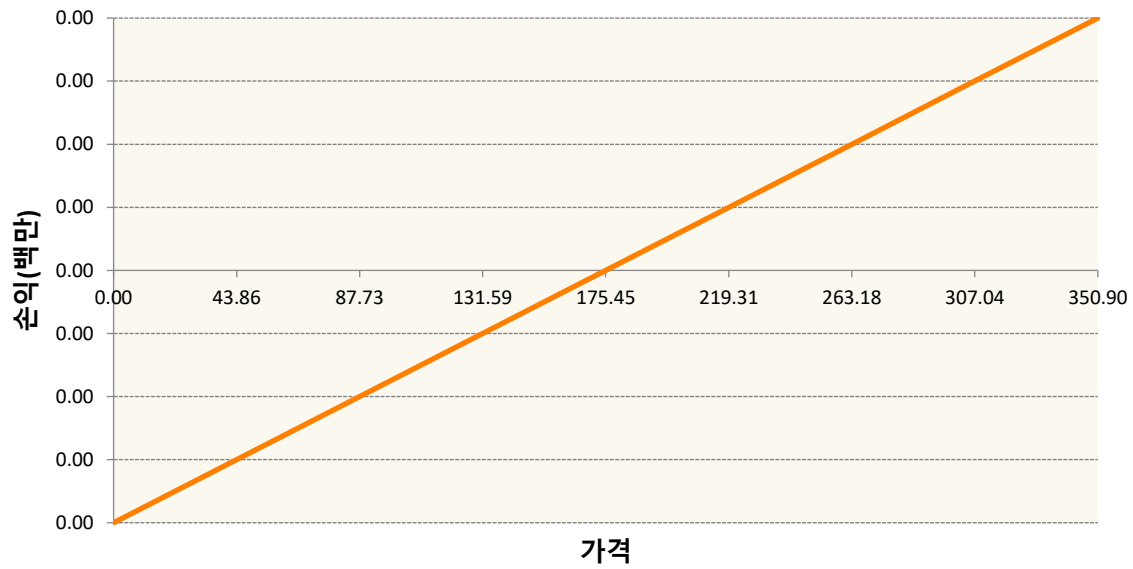
### 2. 만기시점의 손익구조



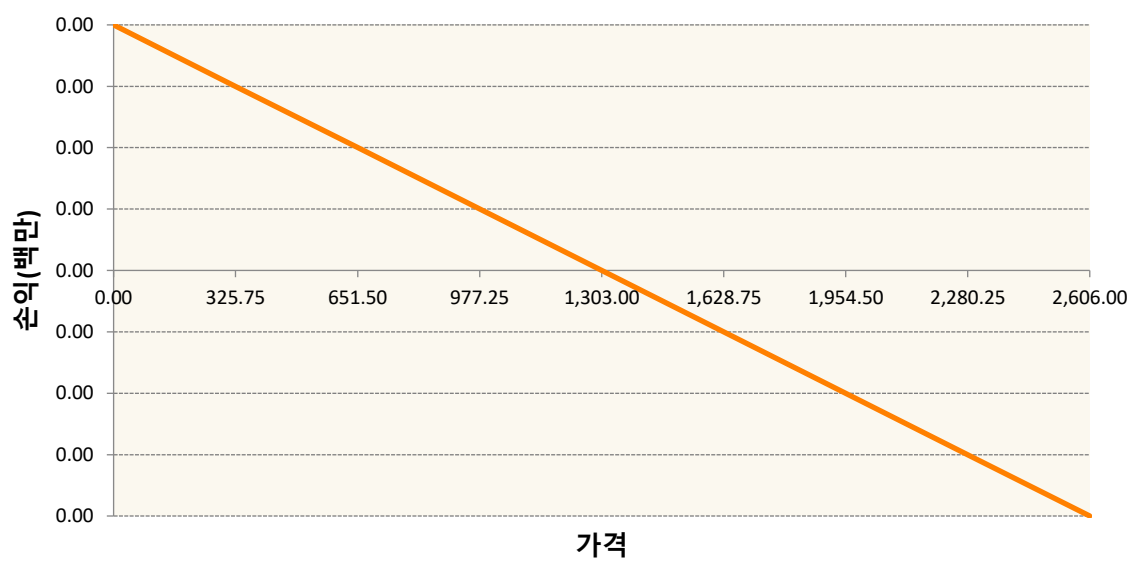
CTK3-COTTON NO.2 FUTR May23



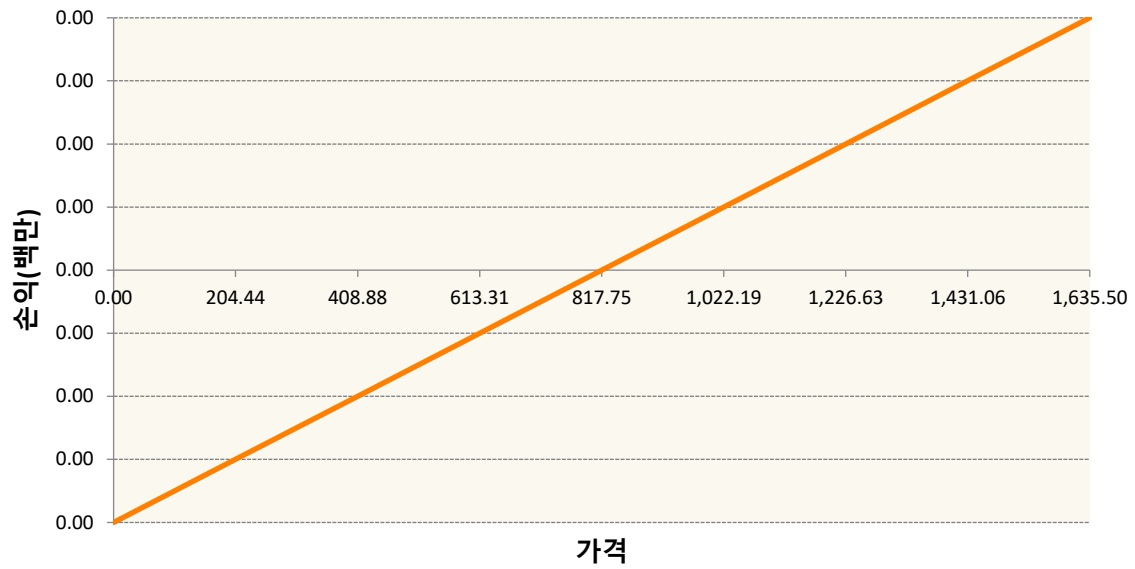
KCK3-COFFEE 'C' FUTURE May23



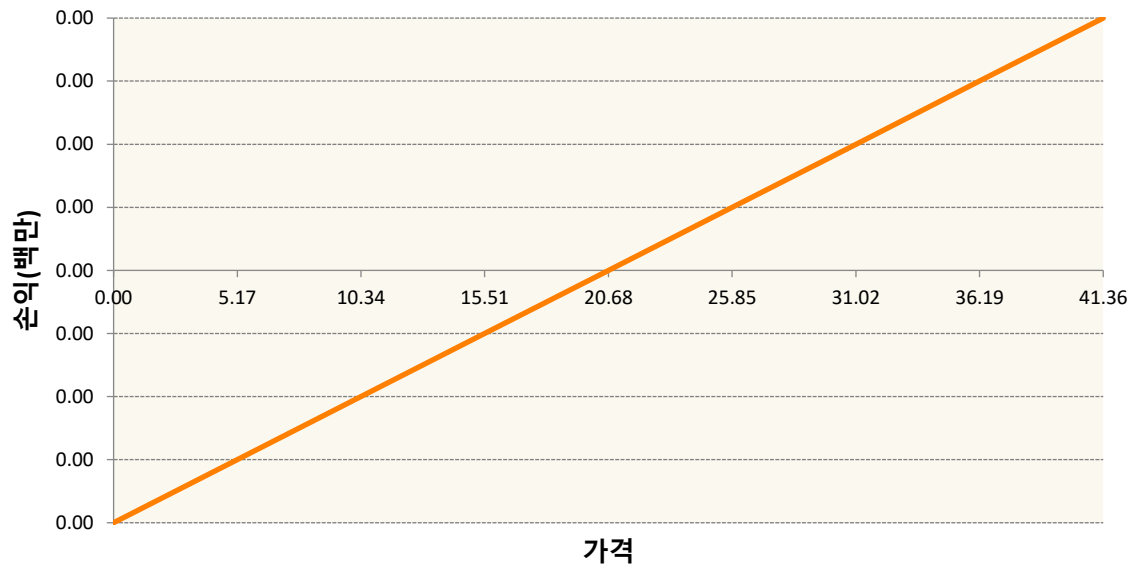
KR4175T30003-2023-03 달러선물



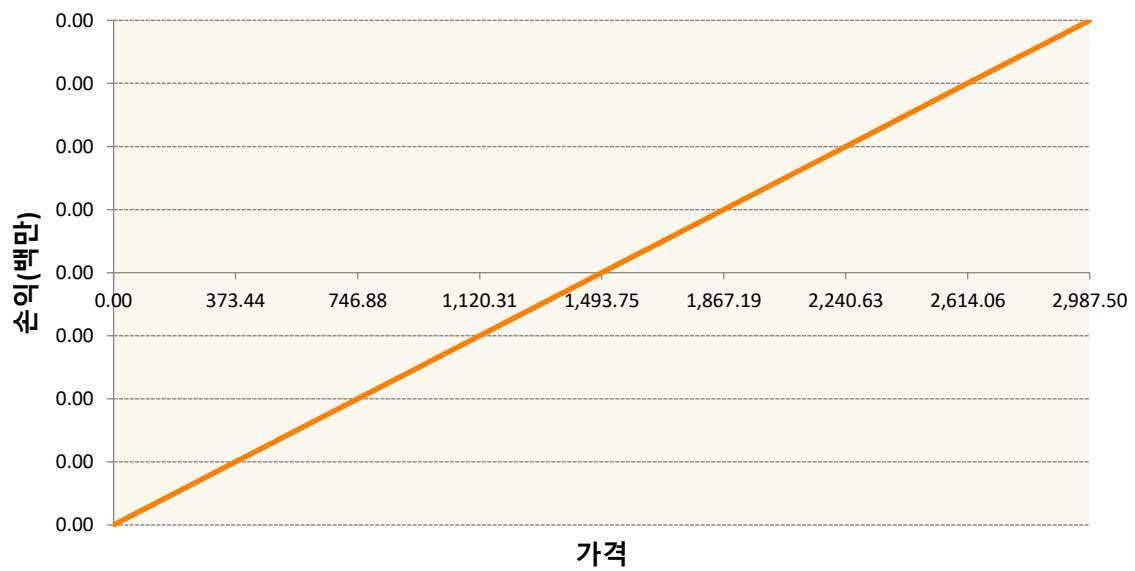
KWK3-KC HRW WHEAT FUT May23



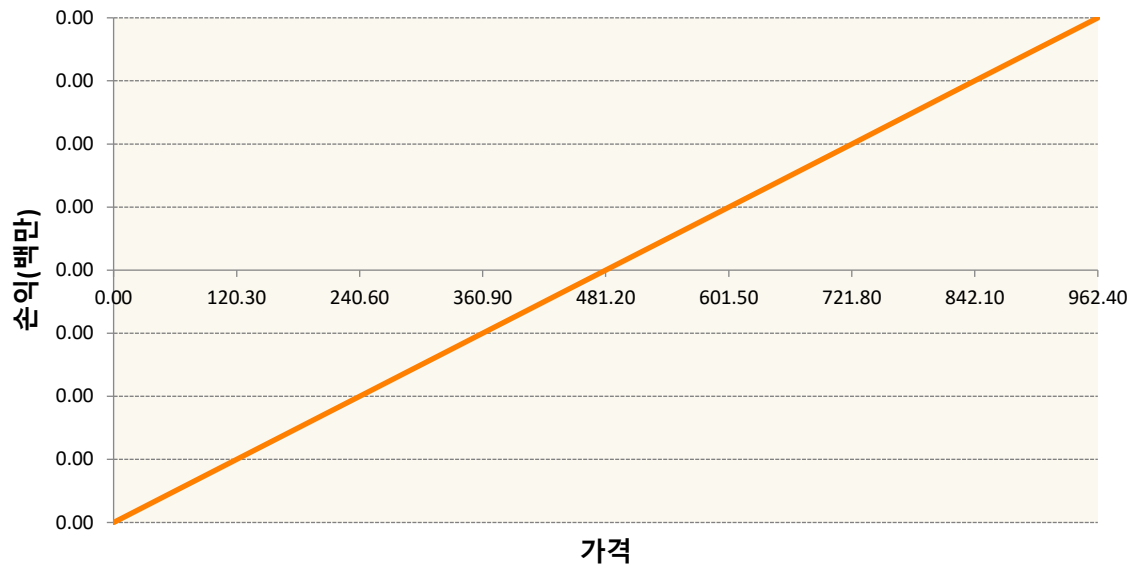
SBK3-Sugar #11 (WORLD) May23



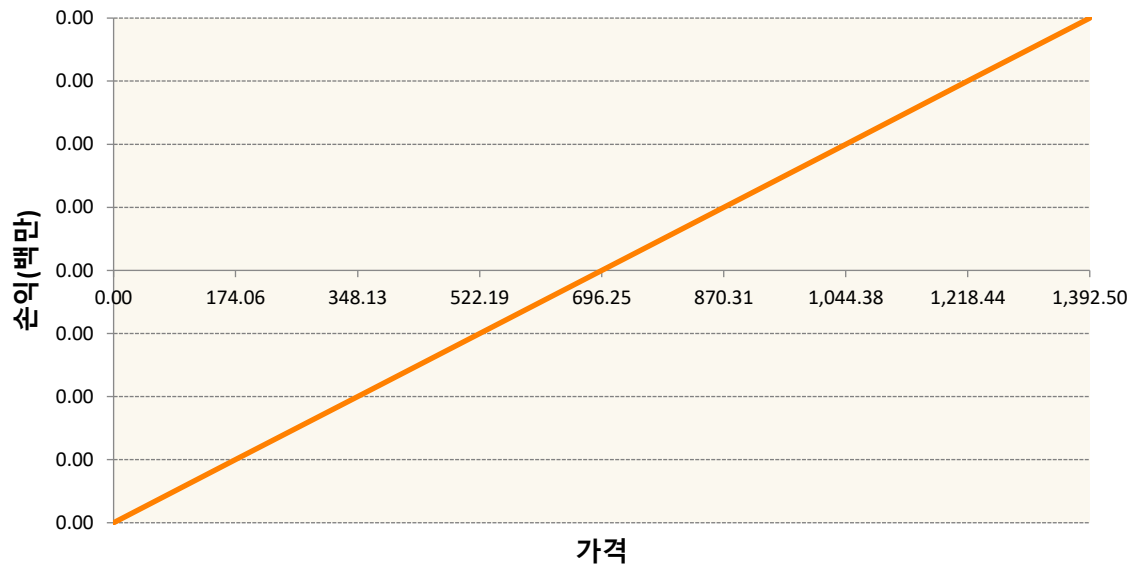
SK3-SOYBEAN FUTURE May23



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 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

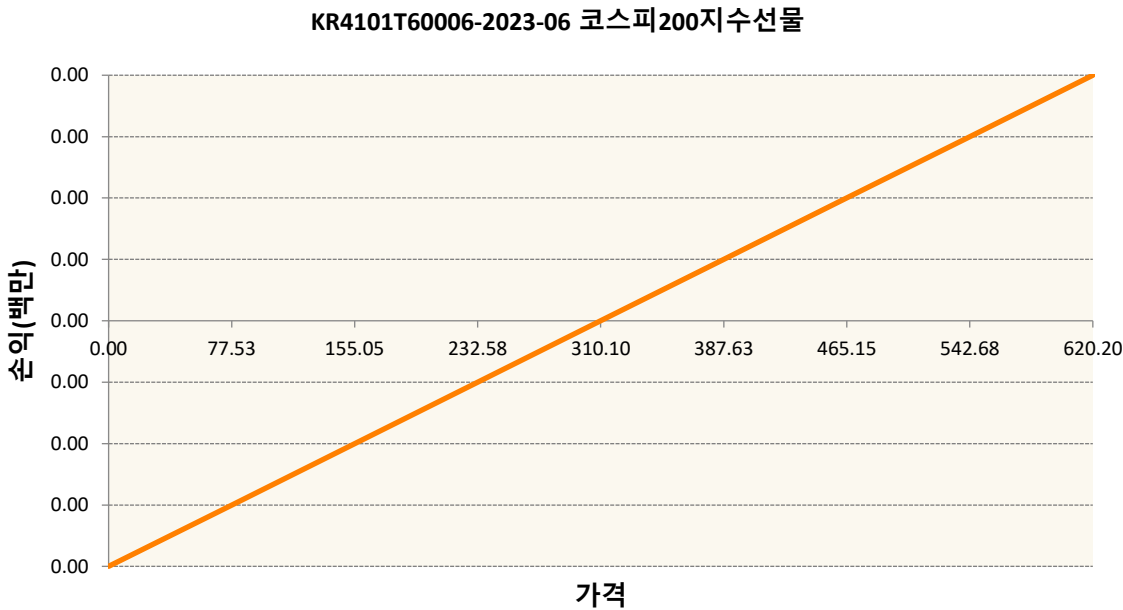
스마트인덱스모

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   | 2,481 | 0     | 2,481     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T60006 |           |         | 2023-06 코스피200지수선물 |      |       |        | 198    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -198      | -198    | -198               | -198 | -198  | -198   | -198   |
| -5.33%       | -132      | -132    | -132               | -132 | -132  | -132   | -132   |
| -2.67%       | -66       | -66     | -66                | -66  | -66   | -66    | -66    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 66        | 66      | 66                 | 66   | 66    | 66     | 66     |
| 5.33%        | 132       | 132     | 132                | 132  | 132   | 132    | 132    |
| 8.00%        | 198       | 198     | 198                | 198  | 198   | 198    | 198    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

## 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   | 4,470 | 0     | 4,470     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래230314 | 362 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 477 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

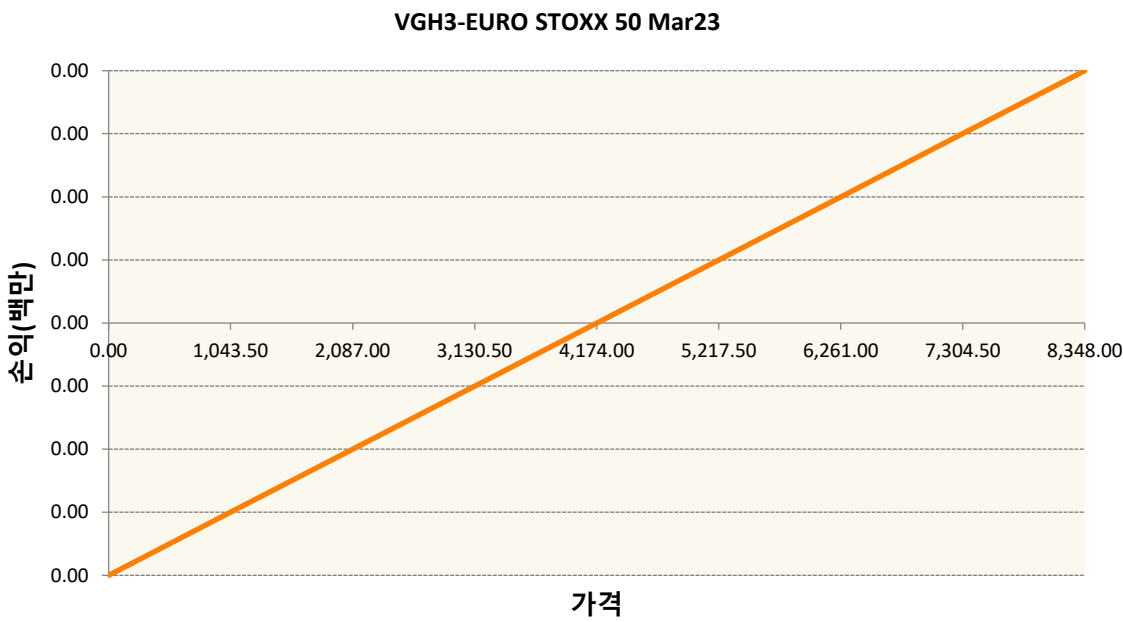
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 463   | 0     | 463       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGH3 | EURO STOXX 50 Mar23 | 37 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

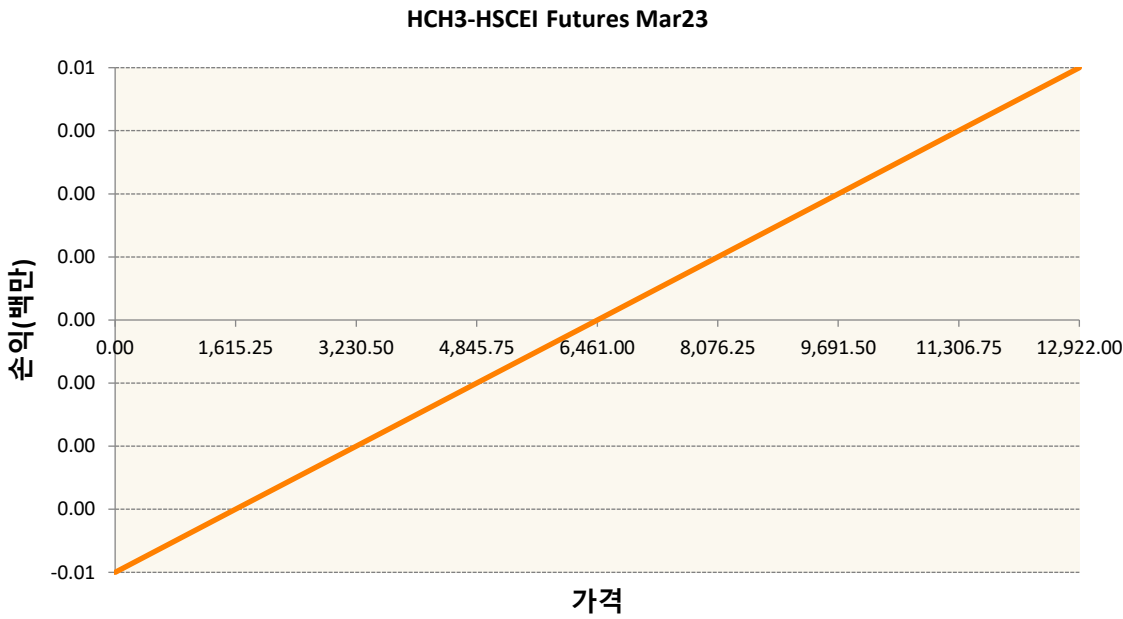
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCH3 | HSCEI Futures Mar23 | 90 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

121

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

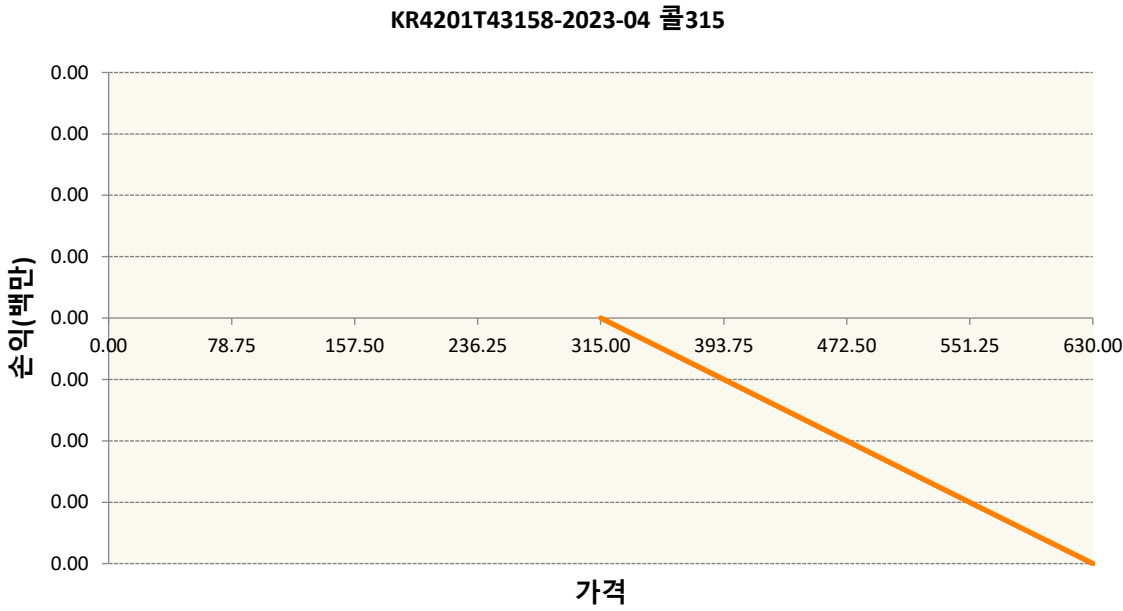
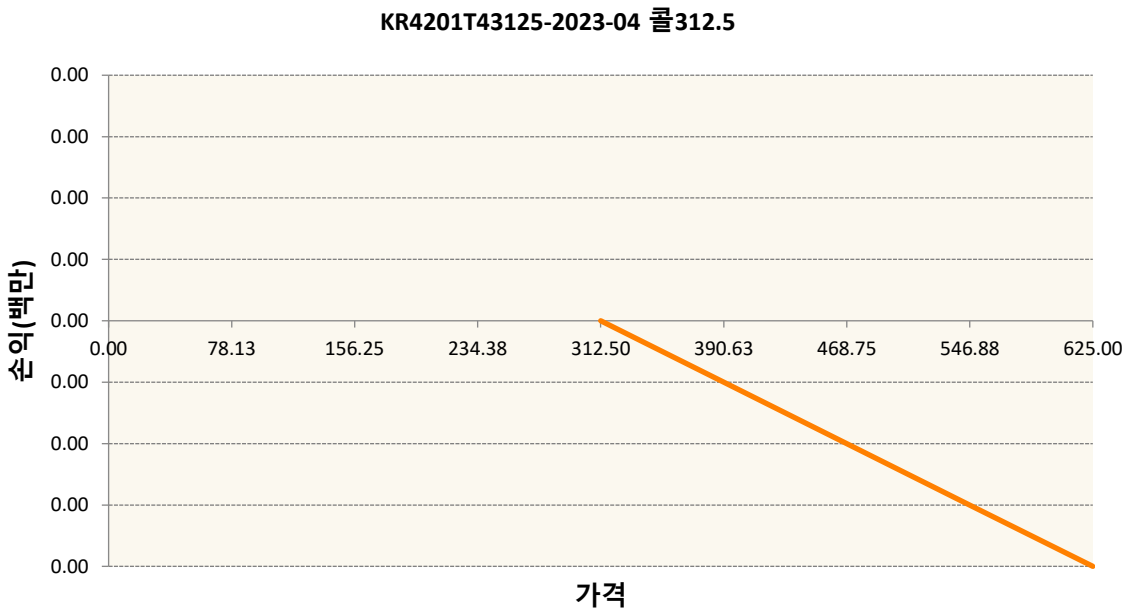
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

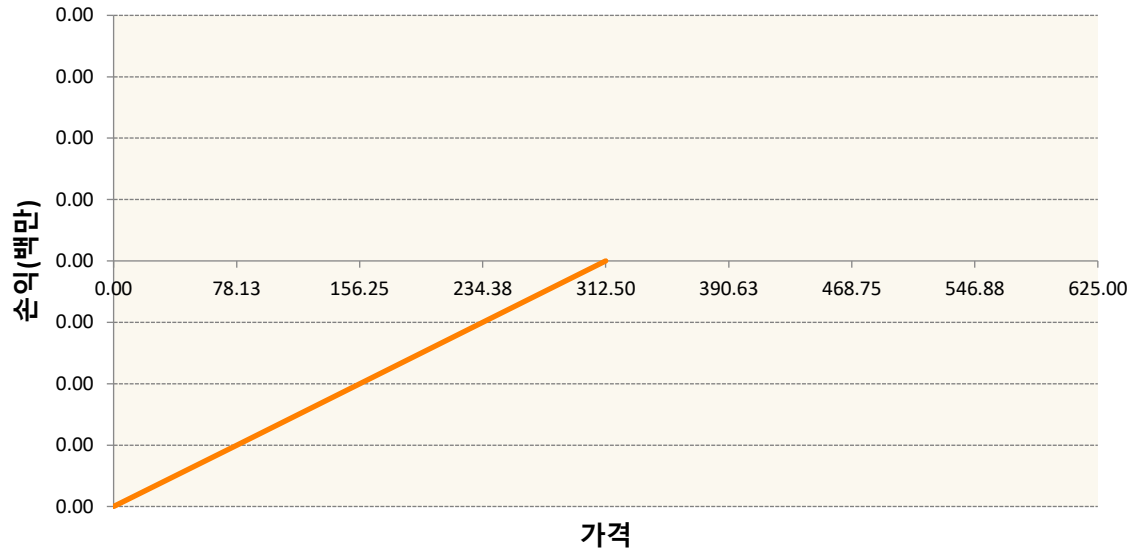
(단위:백만원)

| 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 |        |        |        | 657    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 270       | 263     | 253            | 242    | 229    | 215    | 199    |
| -5.33%       | 245       | 230     | 214            | 196    | 177    | 157    | 136    |
| -2.67%       | 188       | 165     | 142            | 118    | 93     | 68     | 43     |
| 0%           | 83        | 55      | 28             | 0      | -28    | -55    | -83    |
| 2.67%        | -78       | -105    | -133           | -160   | -188   | -215   | -243   |
| 5.33%        | -291      | -313    | -336           | -360   | -385   | -410   | -436   |
| 8.00%        | -544      | -559    | -576           | -595   | -614   | -635   | -657   |
| KR4201T43158 |           |         | 2023-04 콜315   |        |        |        | 1,855  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 684       | 668     | 645            | 618    | 586    | 550    | 510    |
| -5.33%       | 630       | 594     | 553            | 507    | 457    | 403    | 347    |
| -2.67%       | 497       | 437     | 375            | 309    | 242    | 173    | 102    |
| 0%           | 235       | 157     | 79             | 0      | -79    | -159   | -238   |
| 2.67%        | -190      | -271    | -353           | -435   | -517   | -599   | -681   |
| 5.33%        | -777      | -847    | -919           | -994   | -1,069 | -1,146 | -1,223 |
| 8.00%        | -1,496    | -1,546  | -1,601         | -1,660 | -1,722 | -1,788 | -1,855 |
| KR4301T43123 |           |         | 2023-04 풋312.5 |        |        |        | 596    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -536      | -542    | -550           | -560   | -571   | -583   | -596   |
| -5.33%       | -302      | -315    | -329           | -344   | -360   | -377   | -395   |
| -2.67%       | -96       | -115    | -135           | -155   | -176   | -197   | -219   |
| 0%           | 70        | 47      | 23             | 0      | -23    | -47    | -70    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 189 | 166 | 143 | 119 | 96  | 72  | 49  |
| 5.33% | 263 | 244 | 225 | 204 | 183 | 162 | 140 |
| 8.00% | 303 | 290 | 276 | 260 | 243 | 226 | 207 |

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

(단위:백만원)

2,865

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

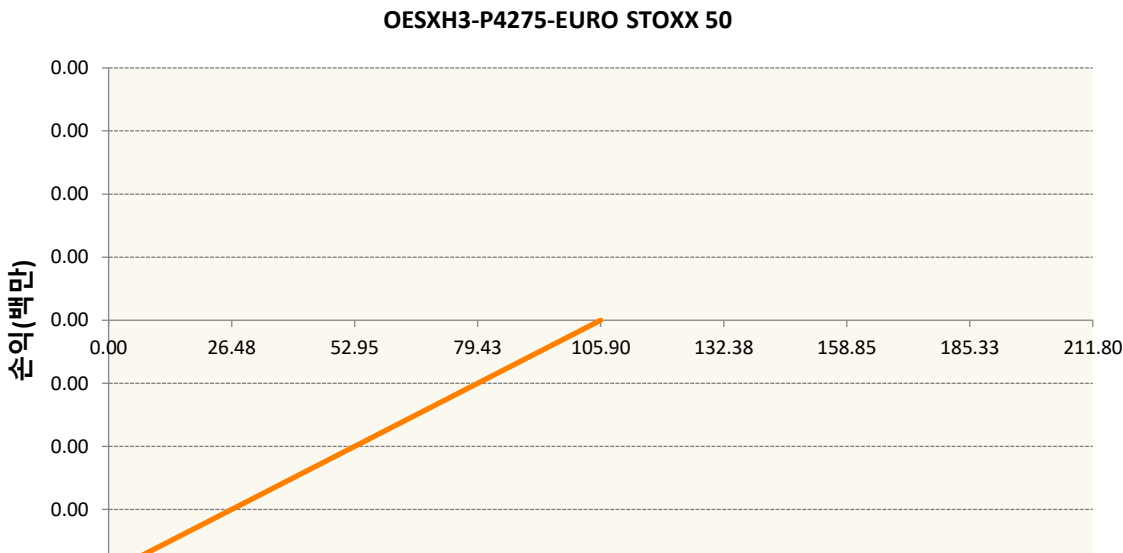
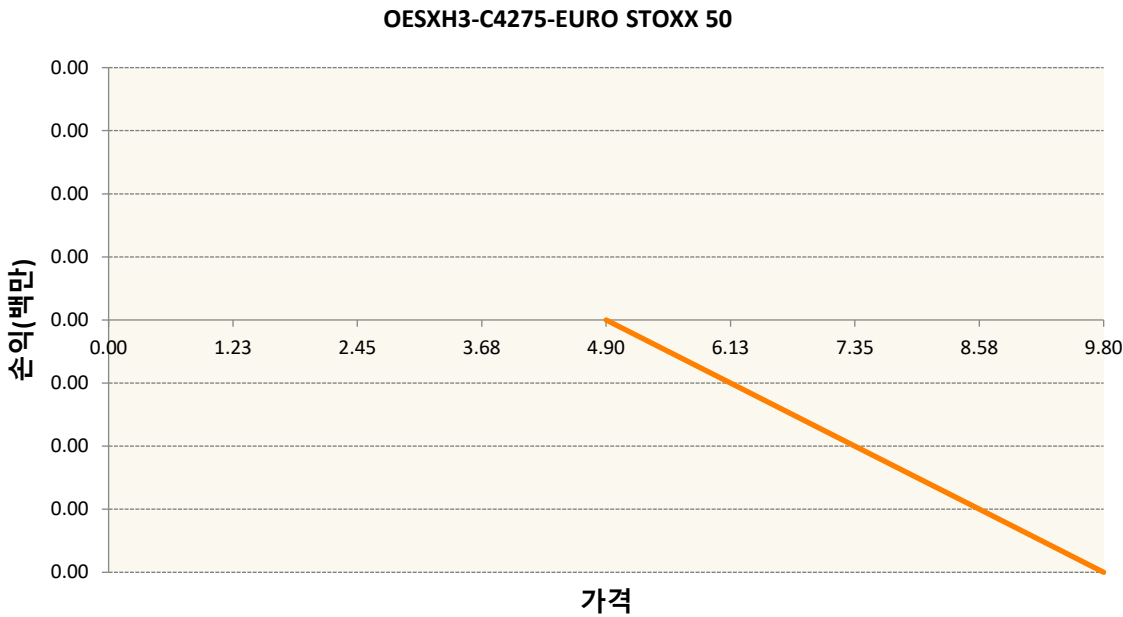
## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

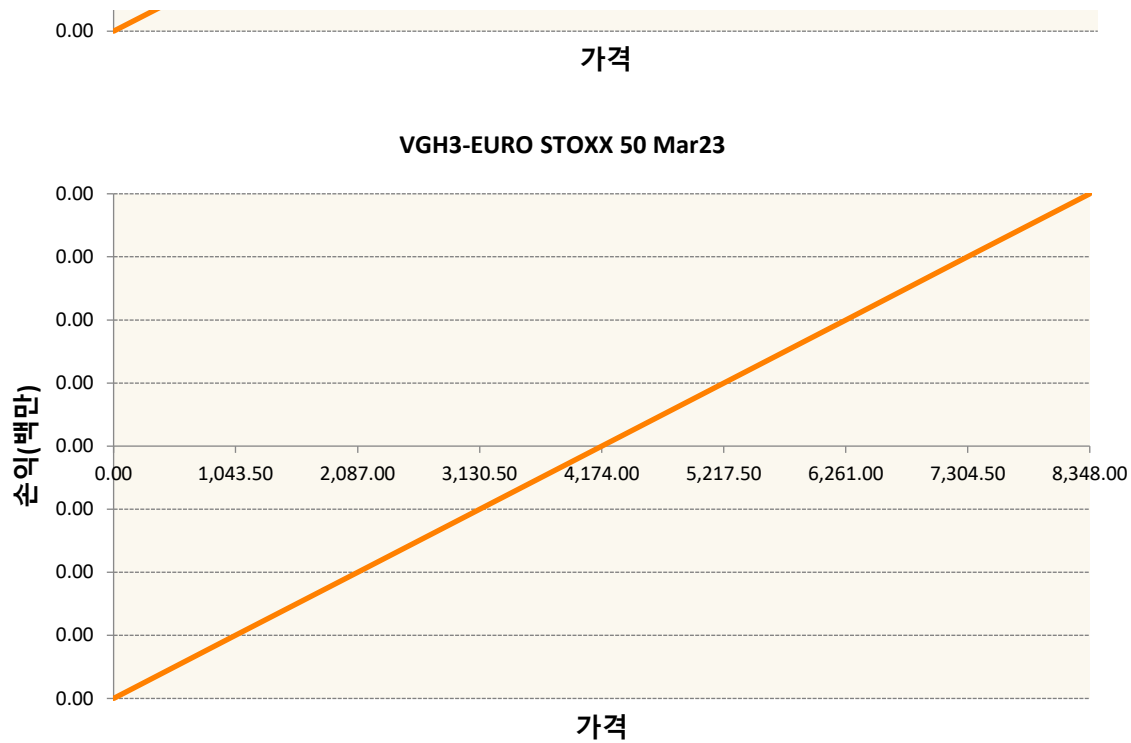
### 1. 계약금액

(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   | 928   | 0     | 928       |    |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 44    | -44       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,820 | -1,820    | 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    | 0.18 |
| OESXH3-P42 EURO STOXX 50    | 3    |
| VGH3 EURO STOXX 50 Mar23    | 74   |

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

(단위:백만원)

194

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

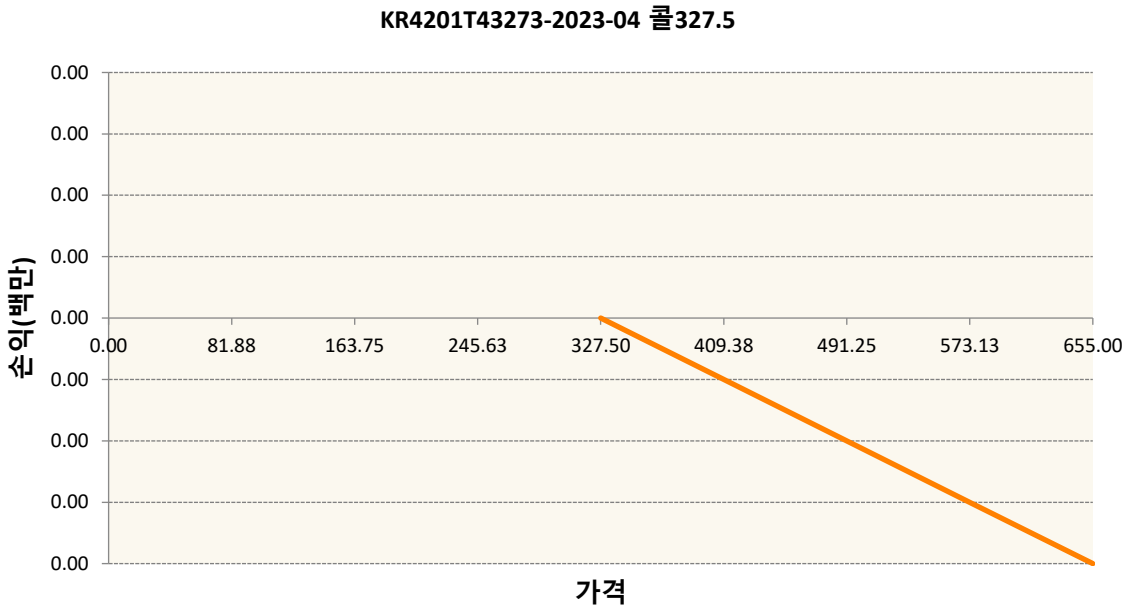
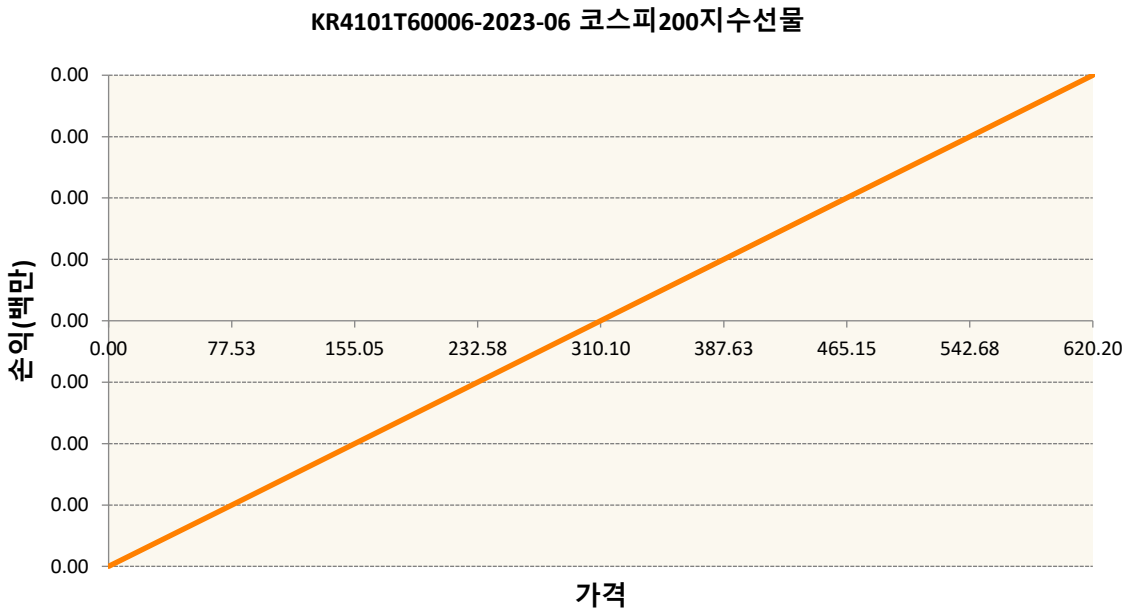
## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

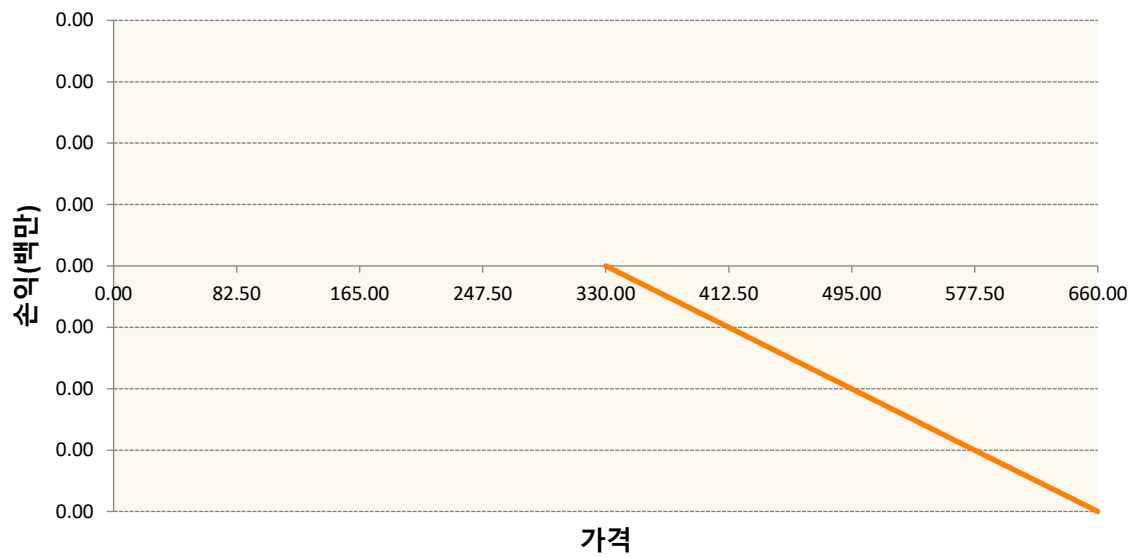
(단위:백만원)

| 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   | 388   | 0     | 388       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 157   | 3,874 | -3,718    | 장내 |

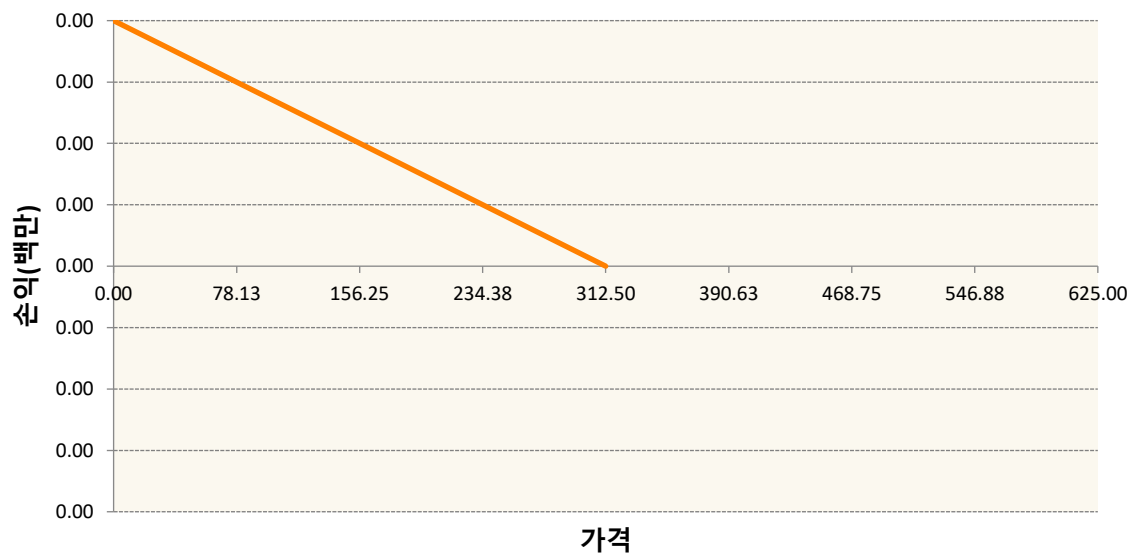
### 2. 만기시점의 손익구조



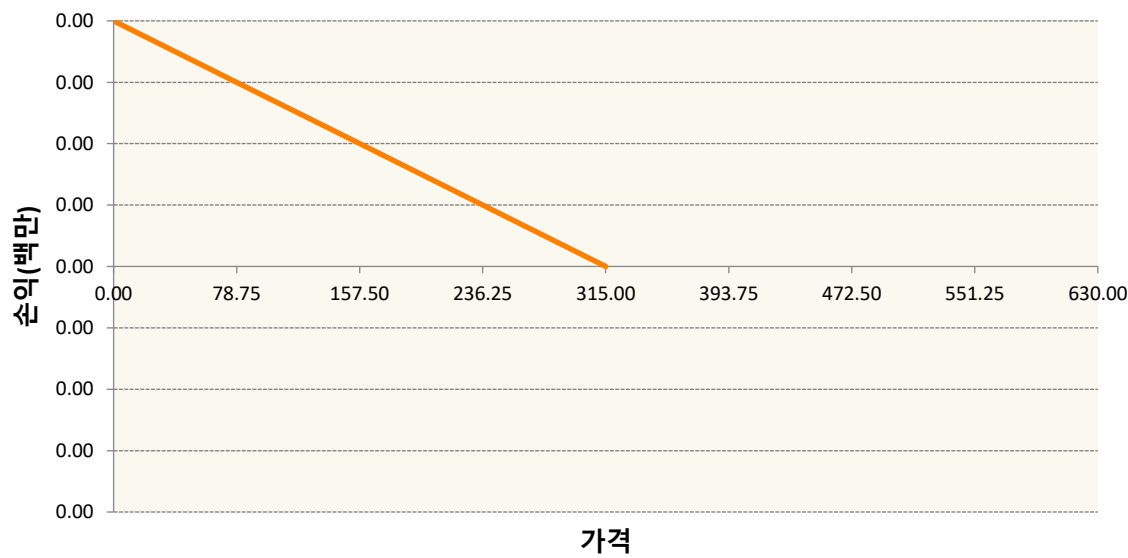
KR4201T43307-2023-04 콜330



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%       | -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     |
| KR4201T43273 |           | 2023-04 콜327.5     |        |     |       |        | 16     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 4         | 4                  | 4      | 3   | 3     | 3      | 3      |
| -5.33%       | 4         | 3                  | 3      | 3   | 3     | 2      | 2      |
| -2.67%       | 3         | 3                  | 2      | 2   | 1     | 1      | 0      |
| 0%           | 2         | 1                  | 1      | 0   | -1    | -2     | -2     |
| 2.67%        | 0         | -1                 | -2     | -3  | -4    | -5     | -6     |
| 5.33%        | -4        | -5                 | -6     | -7  | -8    | -9     | -10    |
| 8.00%        | -10       | -11                | -12    | -13 | -14   | -15    | -16    |
| KR4201T43307 |           | 2023-04 콜330       |        |     |       |        | 124    |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 25        | 25                 | 24     | 23  | 22    | 21     | 19     |
| -5.33%       | 24        | 23                 | 22     | 20  | 18    | 15     | 12     |
| -2.67%       | 22        | 19                 | 17     | 13  | 9     | 5      | 0      |
| 0%           | 14        | 10                 | 5      | 0   | -6    | -12    | -18    |
| 2.67%        | -1        | -8                 | -15    | -22 | -29   | -37    | -44    |
| 5.33%        | -30       | -38                | -47    | -55 | -63   | -71    | -79    |
| 8.00%        | -75       | -83                | -91    | -99 | -108  | -116   | -124   |
| 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         | 4                  | 4      | 5   | 5     | 5      | 5      |
| -5.33%       | 2         | 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  | -1    | -1     | -1     |
| 8.00%        | -2        | -2                 | -2     | -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  | 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      | -2     | -2 | -2    | -2     | -2     |

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

(단위:백만원)

145

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

## 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 | 6,888 | 0     | 6,888     |    |

### 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 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

## 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 | 5,499 | 0     | 5,499     |    |

### 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 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

## 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 | 19,518 | 0      | 19,518    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 19,588 | -19,588   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |                                 |
|------------------------------|---------------------------------|
| FXW213CCSI KRW/USD 28-03-23E | 553                             |
| FXW213D1SI KRW/USD 28-04-23E | 311                             |
| FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E  | 703                             |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 900 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

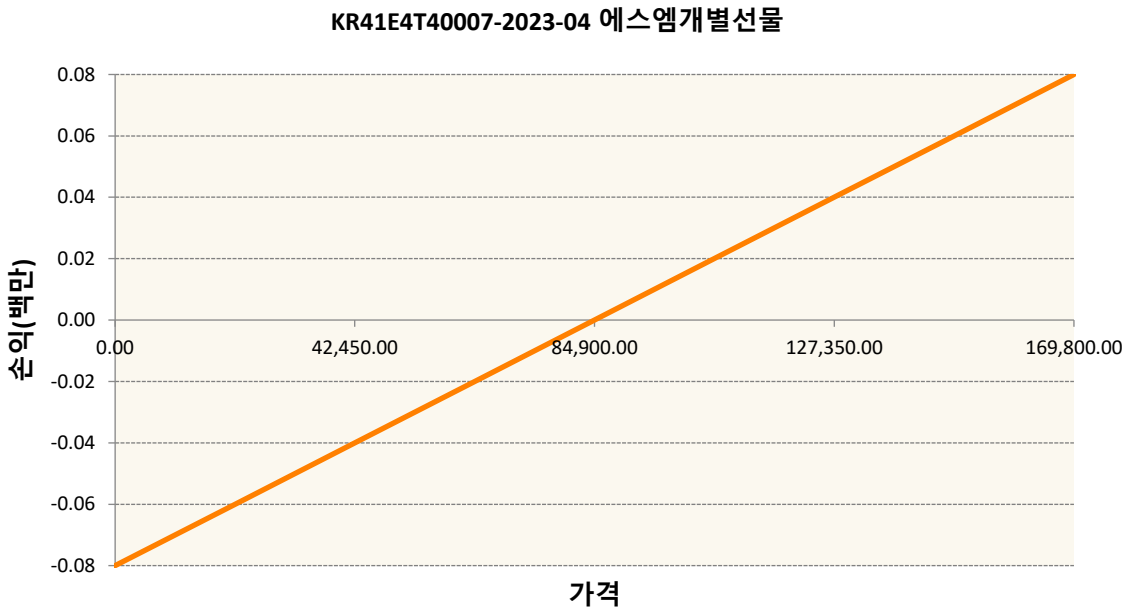
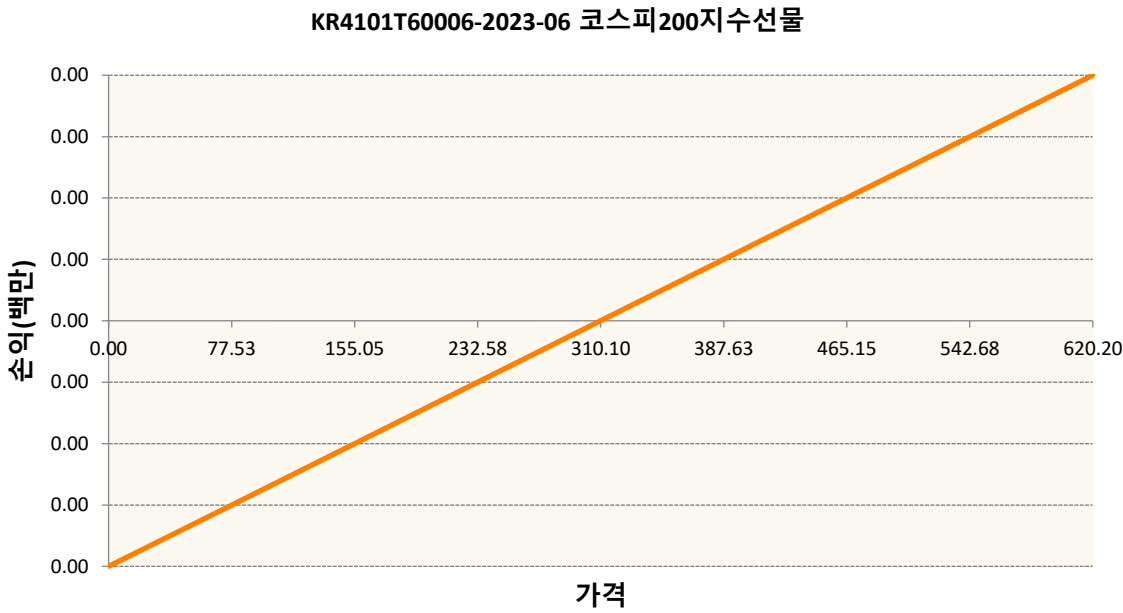
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,332 | 0     | 1,332     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



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

| KR4101T60006 |           | 2023-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 105    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -105      | -105               | -105   | -105 | -105  | -105   | -105   |
| -5.33%       | -70       | -70                | -70    | -70  | -70   | -70    | -70    |
| -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%        | 70        | 70                 | 70     | 70   | 70    | 70     | 70     |
| 8.00%        | 105       | 105                | 105    | 105  | 105   | 105    | 105    |
| 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)

116

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

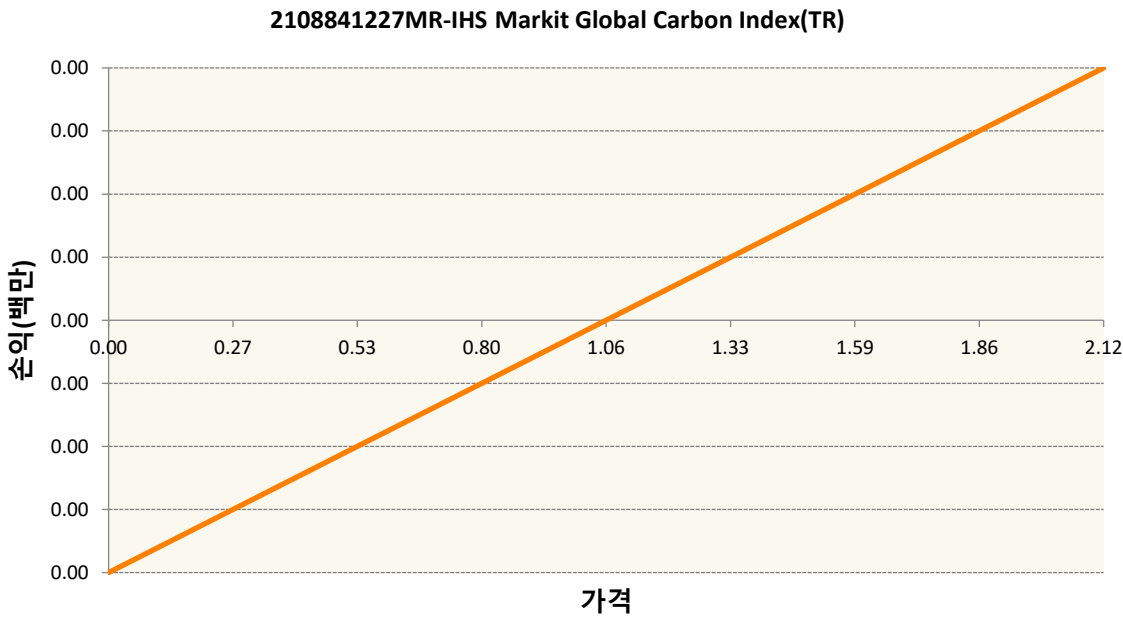
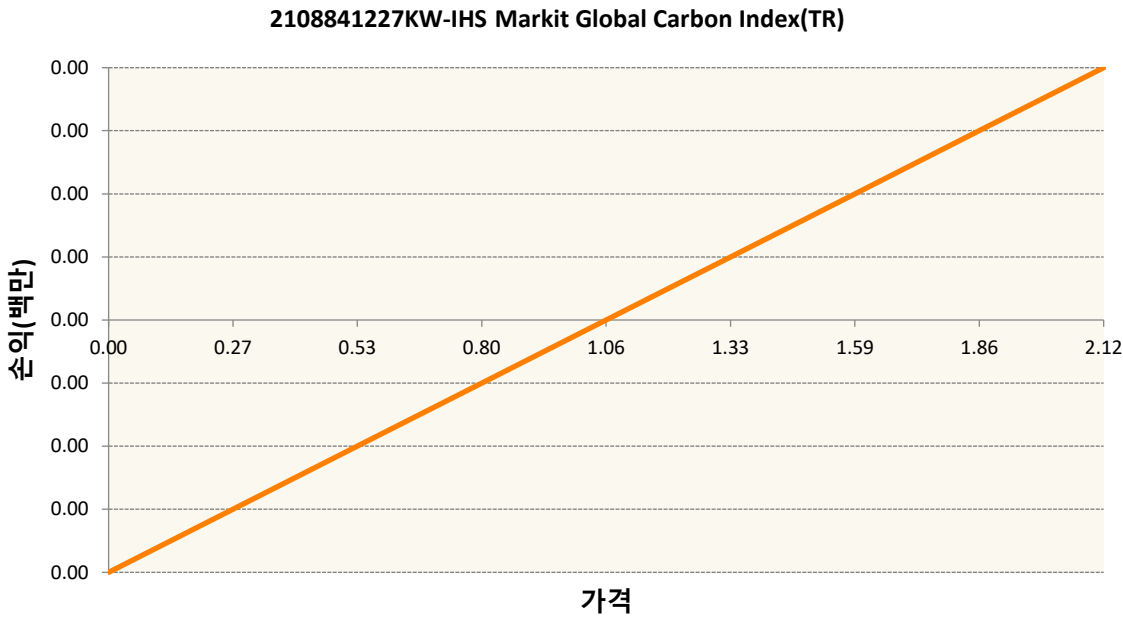
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

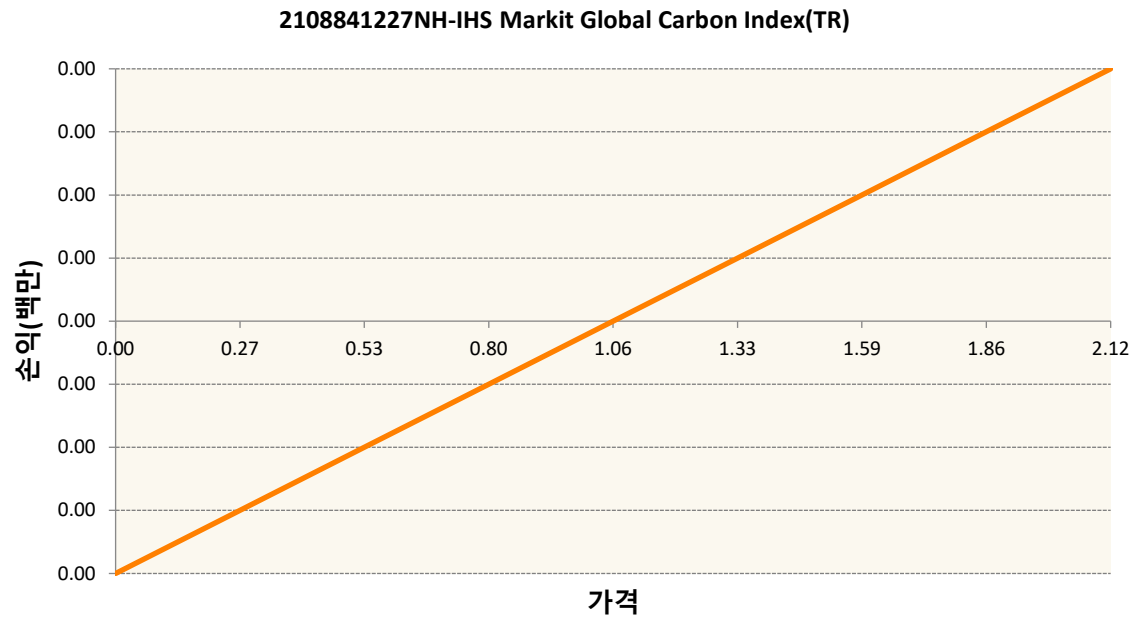
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 25,807 | 0     | 25,807    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                    |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------|--|----------|
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 1,753    |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 206      |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 103      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 3,922    |

공시일 2023-03-16

기준일 2023-03-15

## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

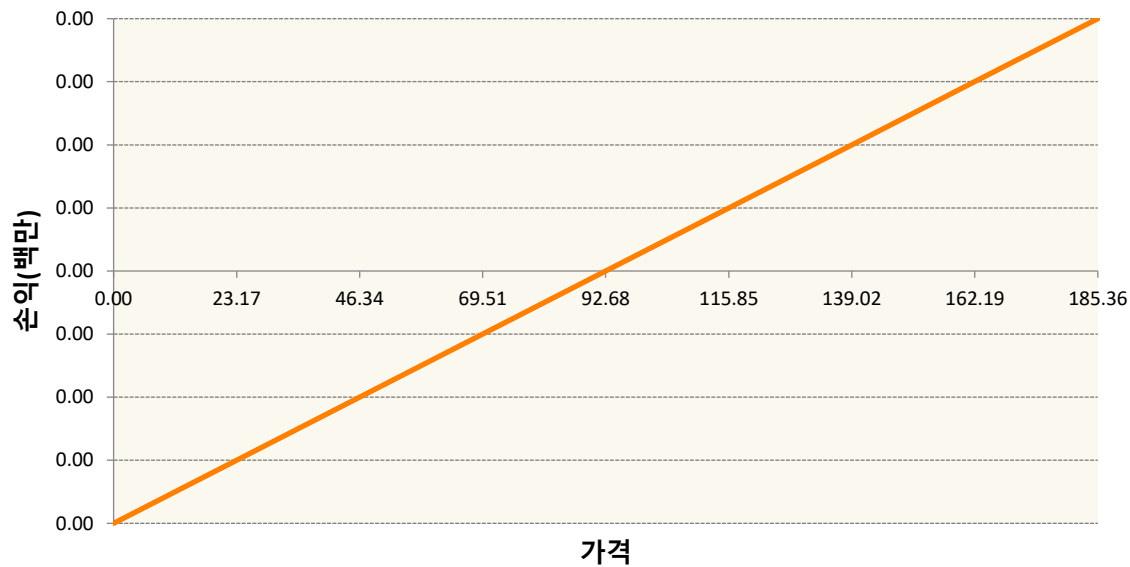
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 9,597 | 0     | 9,597     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,103 | 4,238 | -3,135    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

MOZ23-ECX EMISSION Dec23



### 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  |
| FXW213D3F( EUR/KRW 31-03-23E | 43  |
| MOZ23 ECX EMISSION Dec23     | 768 |

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

(단위:백만원)

2,299

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

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)  | 6 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)  | 6 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)  | 6 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠) | 6 |

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

## SOL차이나육성산업액티브상장지

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(NH)  | 9  |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(메리츠) | 13 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(미래)  | 11 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(키움)  | 9  |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 50 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

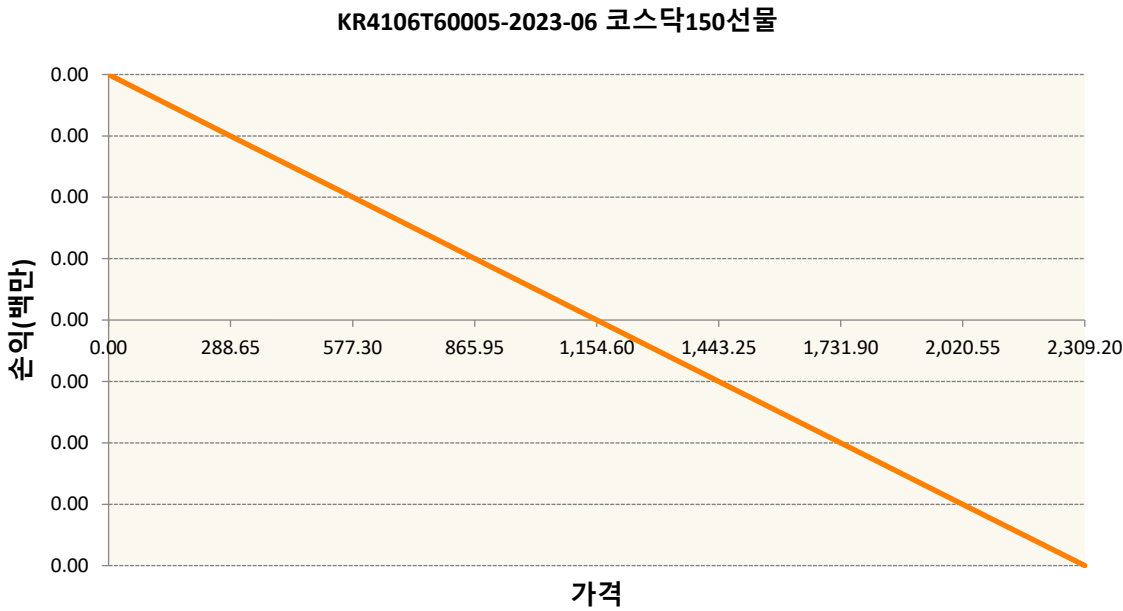
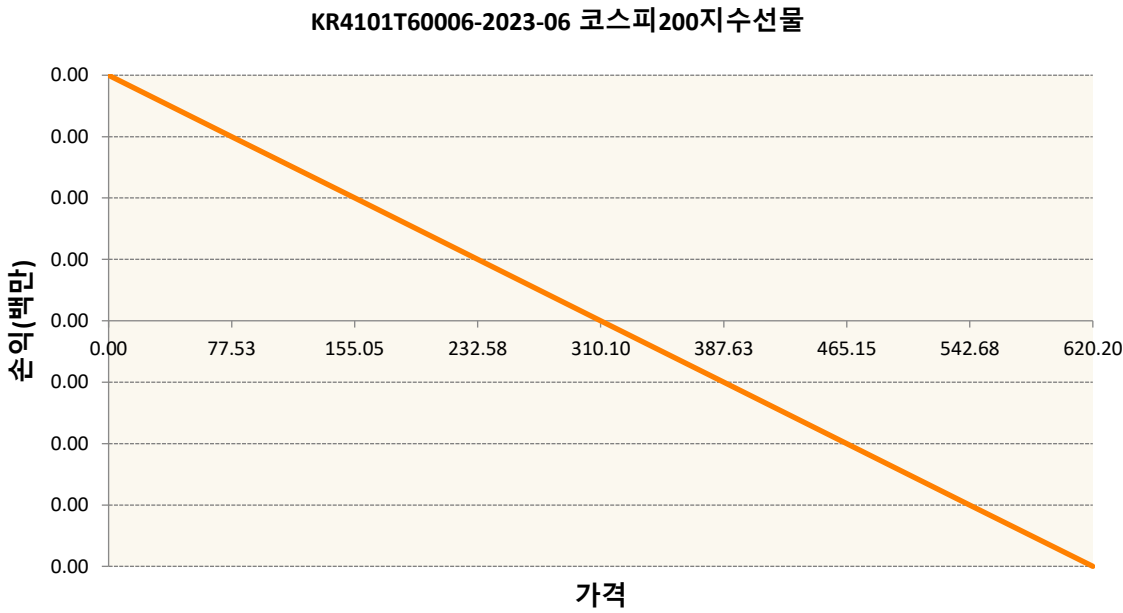
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

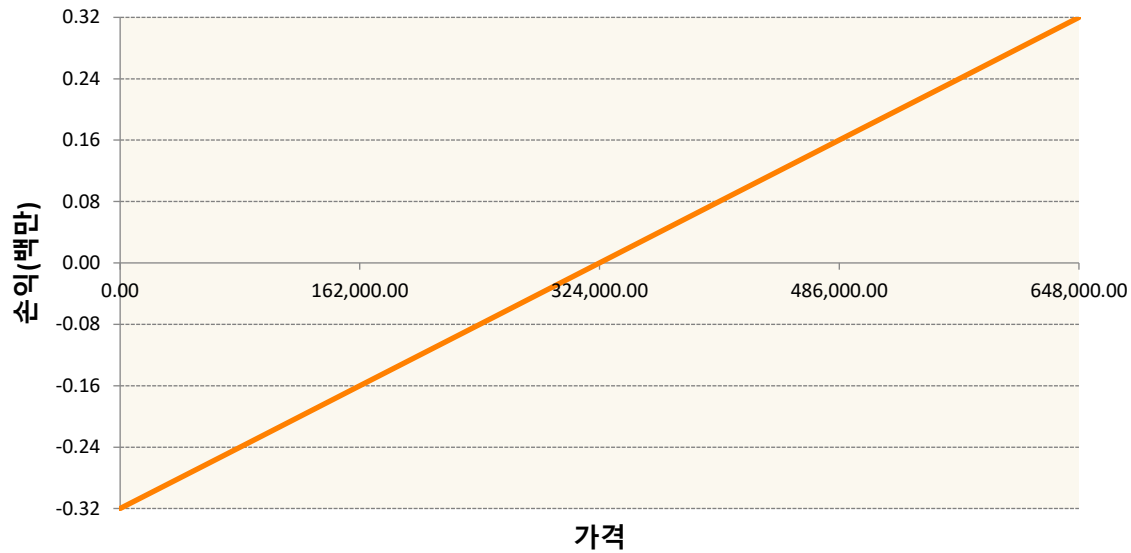
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 548   | 0     | 548       | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 324   | 3,601 | -3,277    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### KR4113T40003-2023-04 POSCO홀딩스개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                      |      |
|--------------------------------------|------|
| KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물        | 155  |
| KR4106T600 2023-06 코스닥150선물          | 133  |
| KR4113T400 2023-04 POSCO홀딩스개별선물      | 26   |
| KRS0004054 SWAP_MICROSOFT CP_0221    | 0.07 |
| KRS0004054 SWAP_FIRST TRUST ECL_0221 | 0.45 |
| KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308     | 1    |

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

(단위:백만원)

449

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

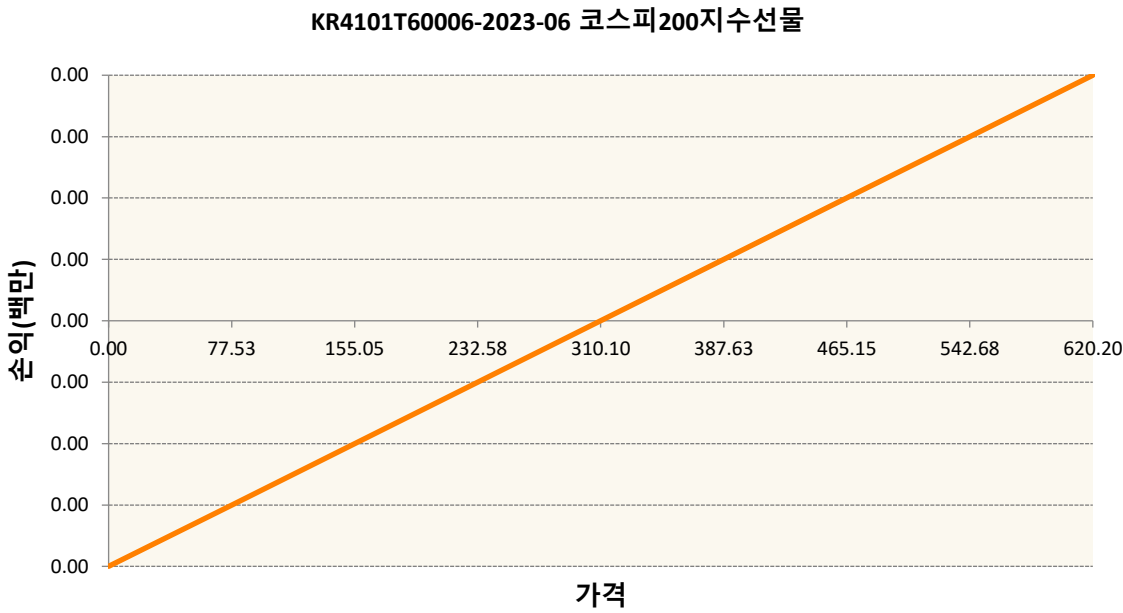
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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   | 2,946 | 0     | 2,946     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T60006 |           | 2023-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 235    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -235      | -235               | -235   | -235 | -235  | -235   | -235   |
| -5.33%       | -157      | -157               | -157   | -157 | -157  | -157   | -157   |
| -2.67%       | -78       | -78                | -78    | -78  | -78   | -78    | -78    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 78        | 78                 | 78     | 78   | 78    | 78     | 78     |
| 5.33%        | 157       | 157                | 157    | 157  | 157   | 157    | 157    |
| 8.00%        | 235       | 235                | 235    | 235  | 235   | 235    | 235    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-03-16 |
| 기준일 | 2023-03-15 |

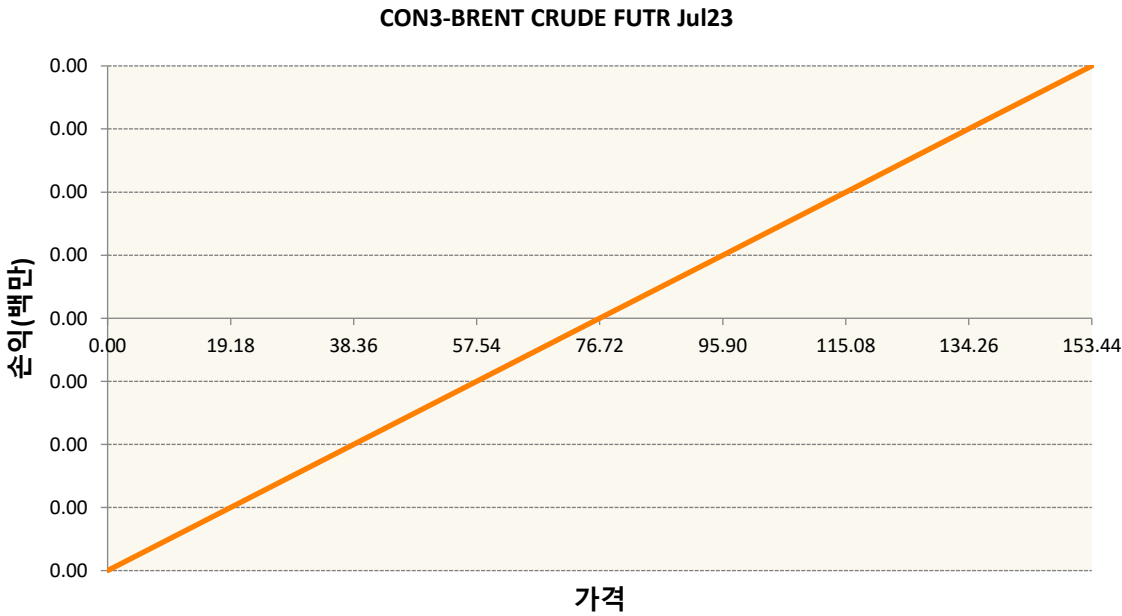
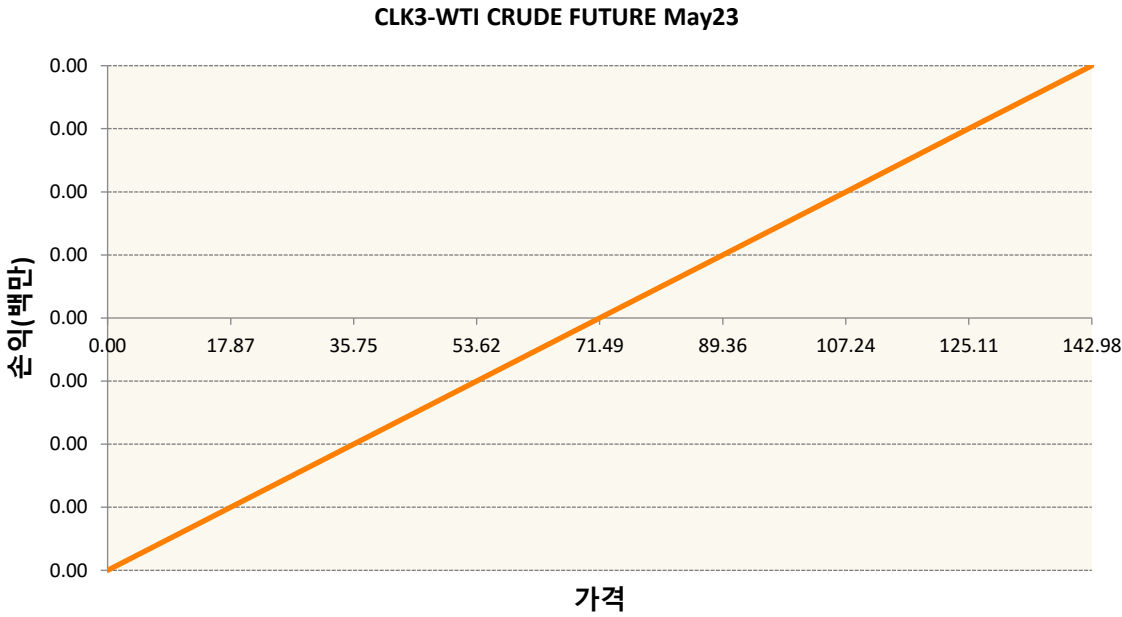
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

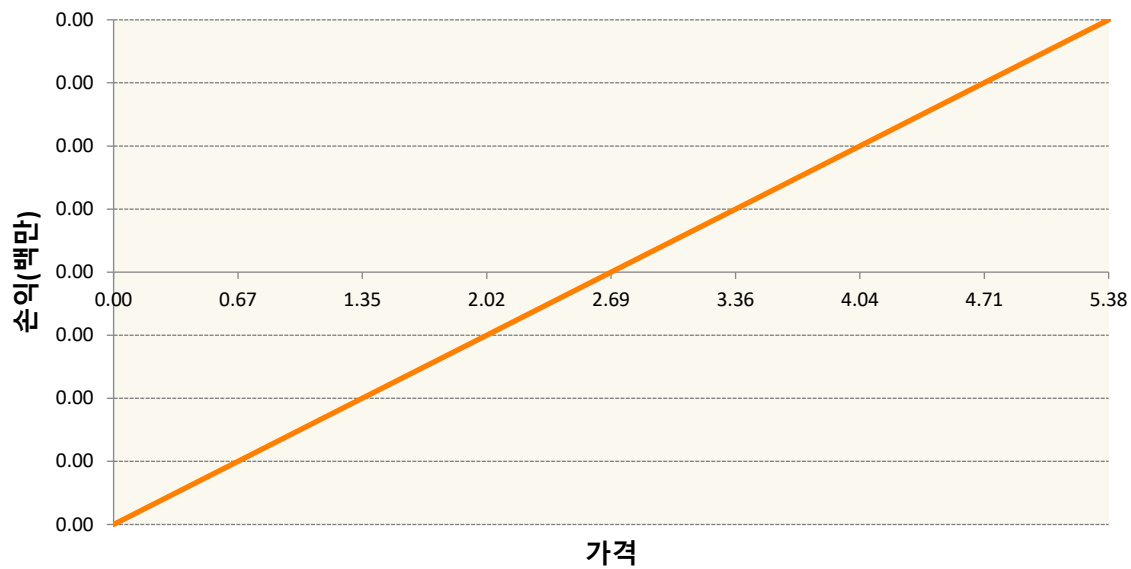
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,616 | 261   | 1,356     |    |

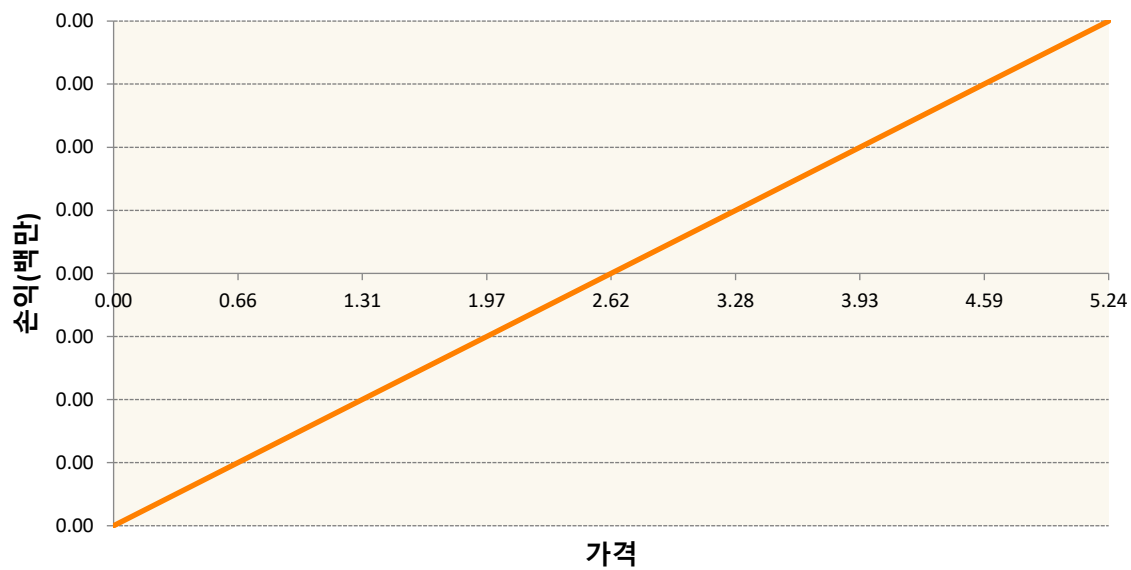
### 2. 만기시점의 손익구조



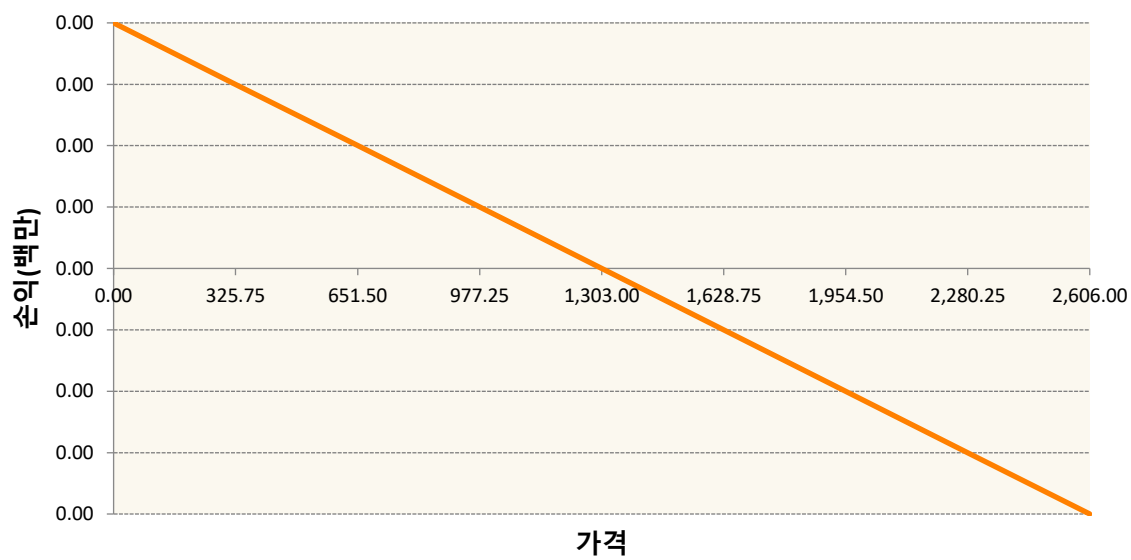
EOK3-E-MINI NATURAL GAS May23



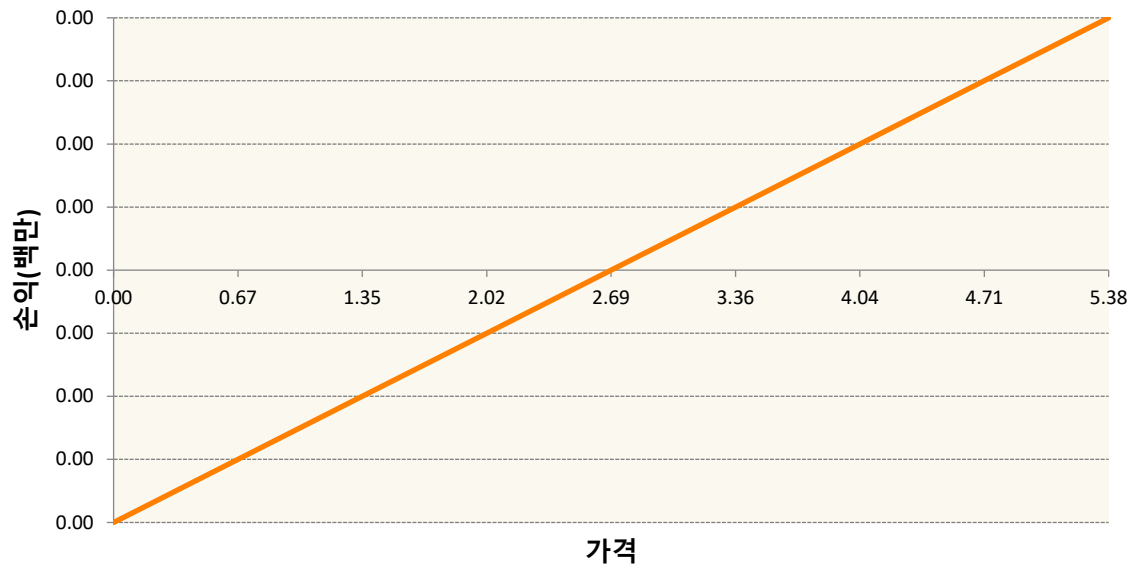
HOK3-NY Harb ULSD Fut May23



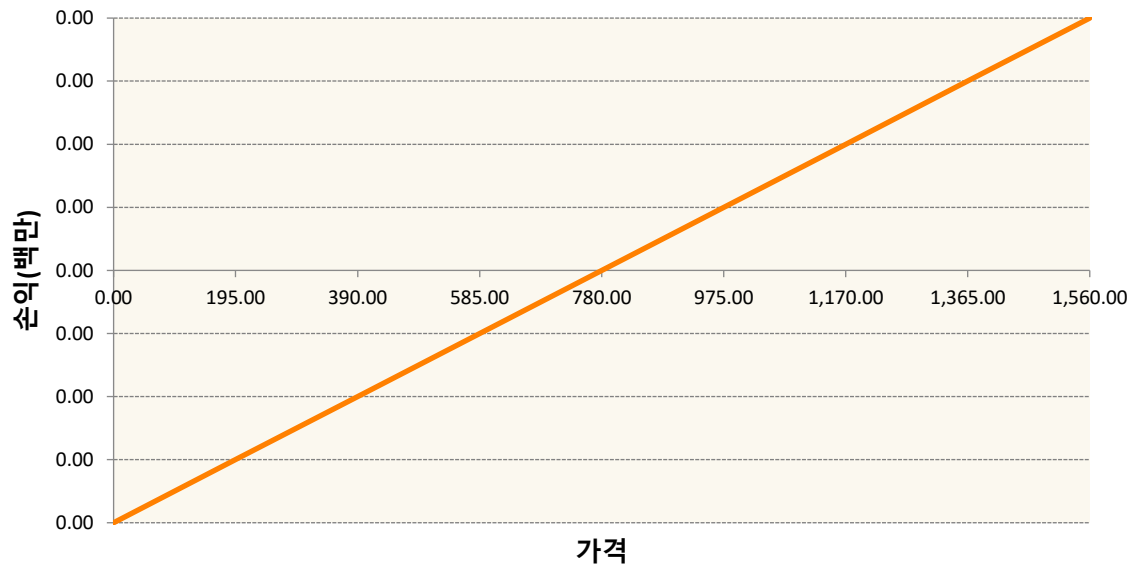
KR4175T30003-2023-03 달러선물



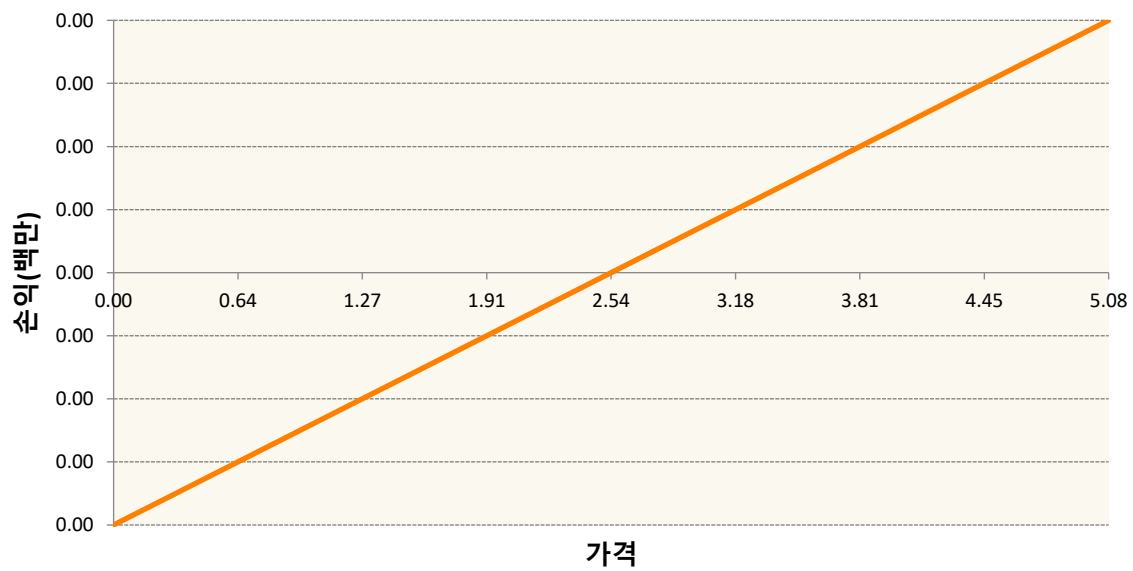
NGK23-NATURAL GAS FUTR May23



QSK3-Low Su Gasoil G May23



XBK3-GASOLINE RBOB FUT May23



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|            |                          |    |
|------------|--------------------------|----|
| CLK3       | WTI CRUDE FUTURE May23   | 29 |
| CON3       | BRENT CRUDE FUTR Jul23   | 33 |
| EOK3       | E-MINI NATURAL GAS May23 | 2  |
| HOK3       | NY Harb ULSD Fut May23   | 11 |
| KR4175T300 | 2023-03 달러선물             | 21 |
| NGK23      | NATURAL GAS FUTR May23   | 27 |
| QSK3       | Low Su Gasoil G May23    | 16 |
| XBK3       | GASOLINE RBOB FUT May23  | 11 |

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

406