

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

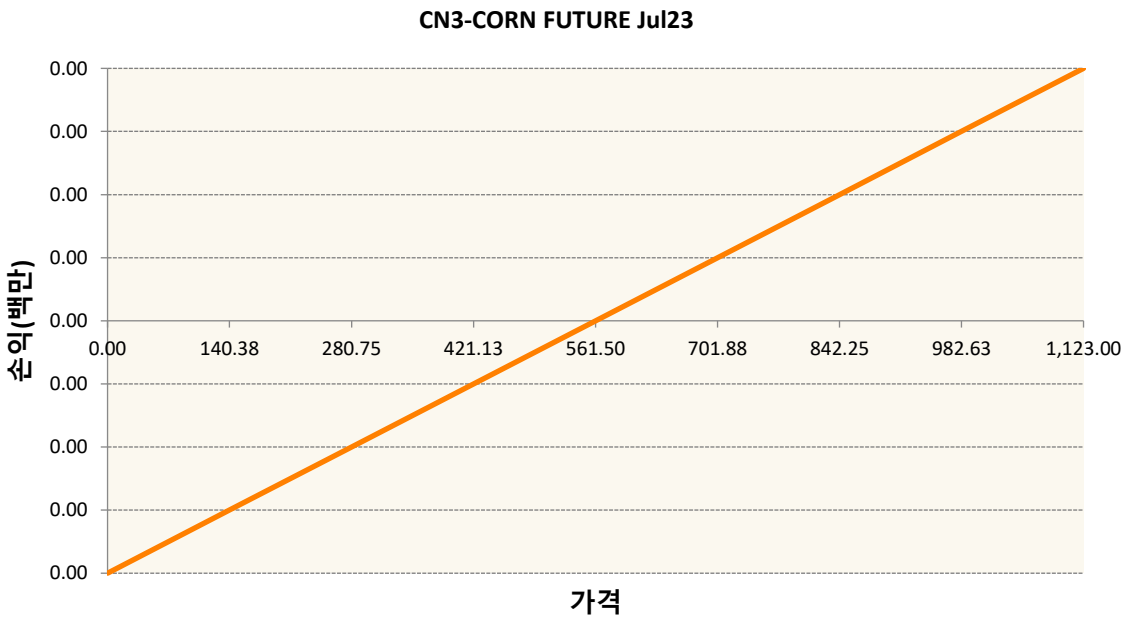
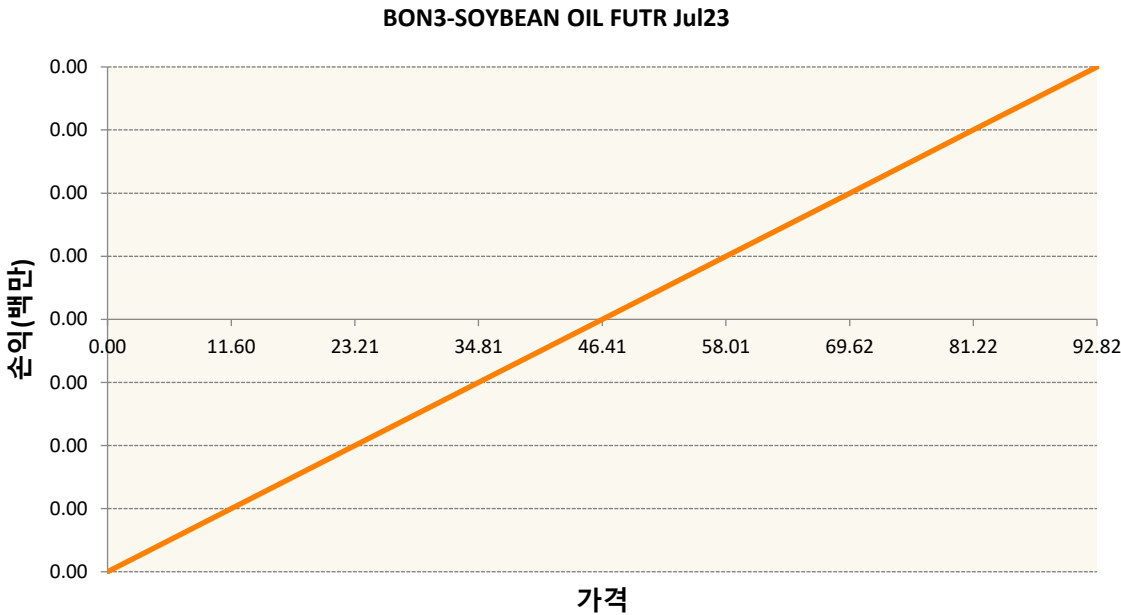
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

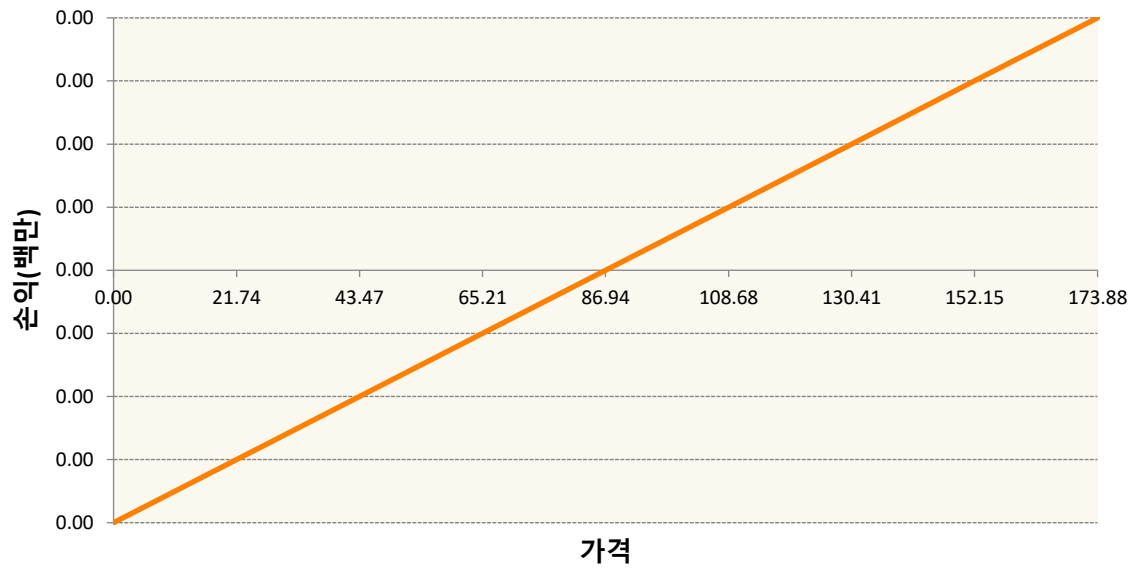
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,221 | 533   | 4,688     |    |

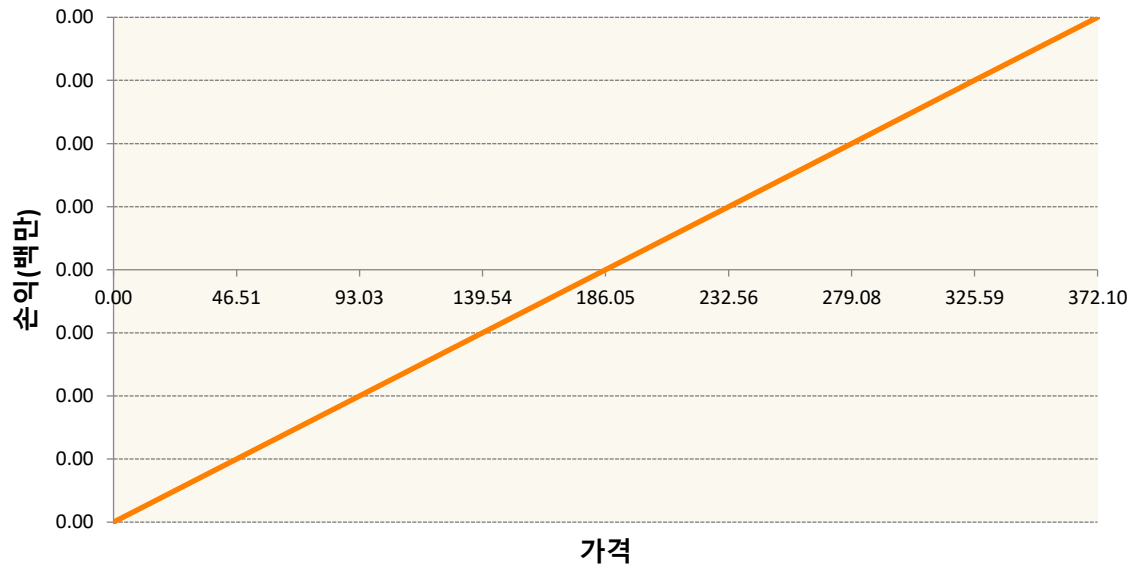
### 2. 만기시점의 손익구조



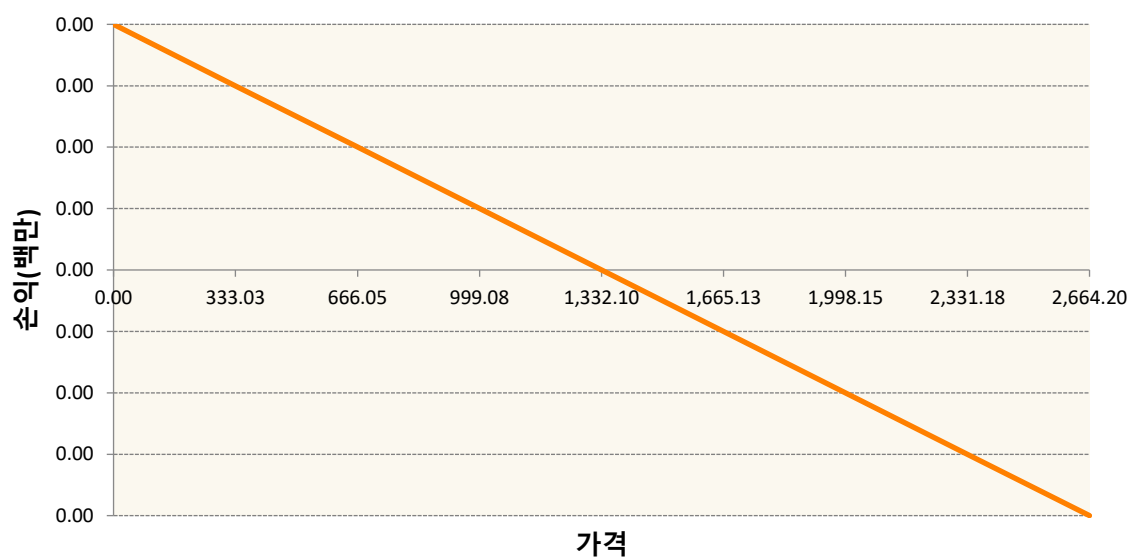
CTN3-COTTON NO.2 FUTR Jul23



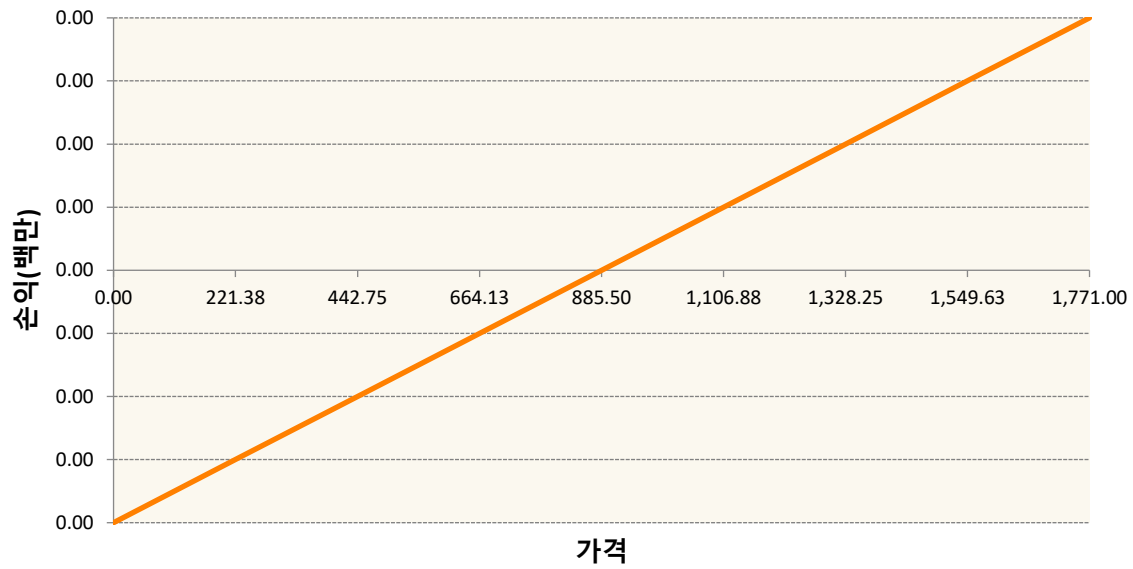
KCN3-COFFEE 'C' FUTURE Jul23



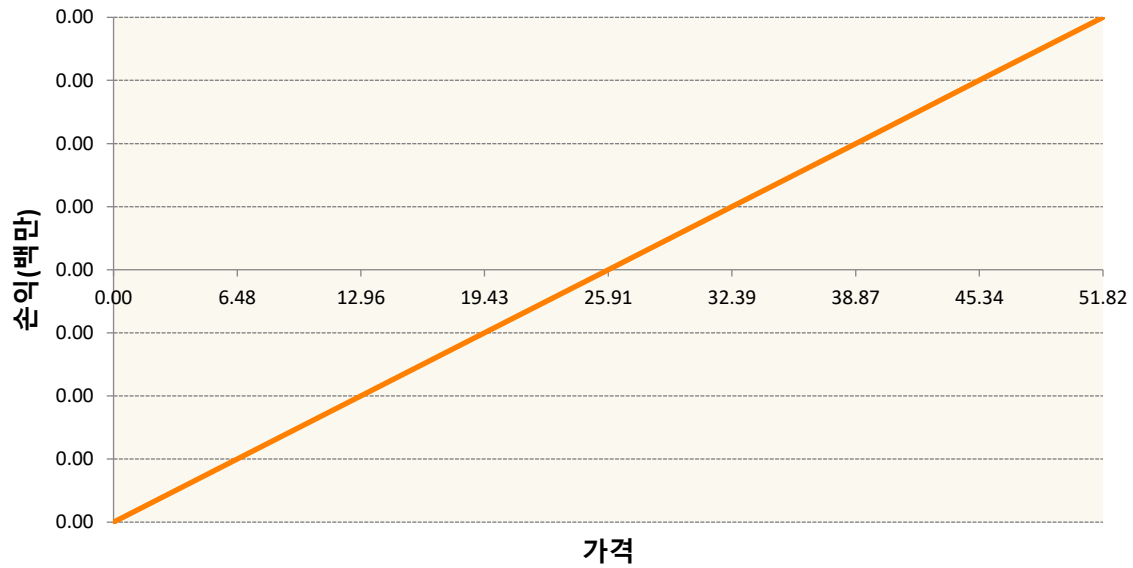
KR4175T60000-2023-06 달러선물



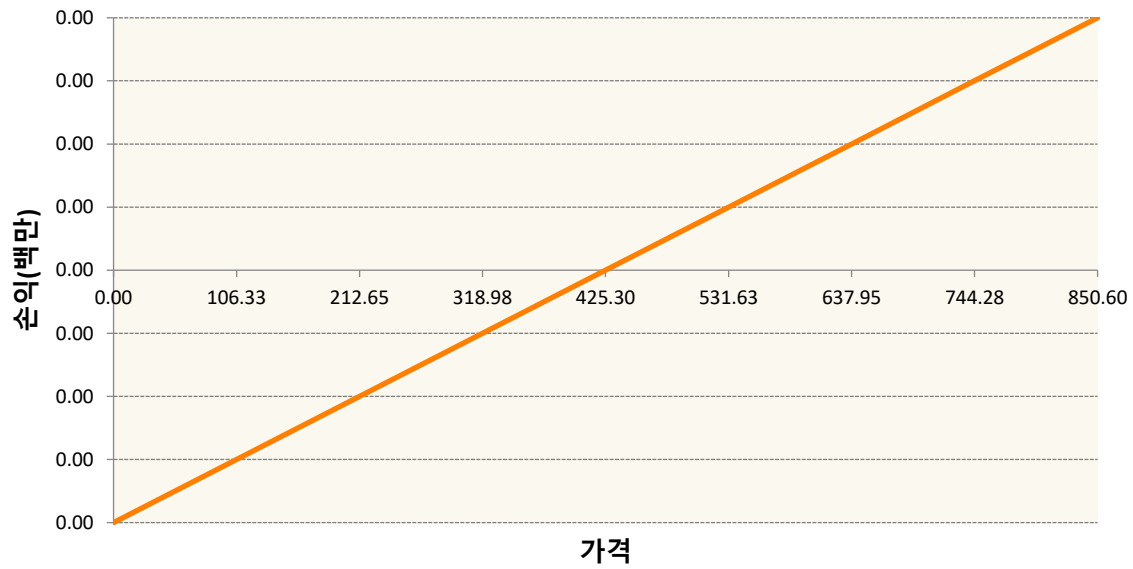
KWN3-KC HRW WHEAT FUT Jul23

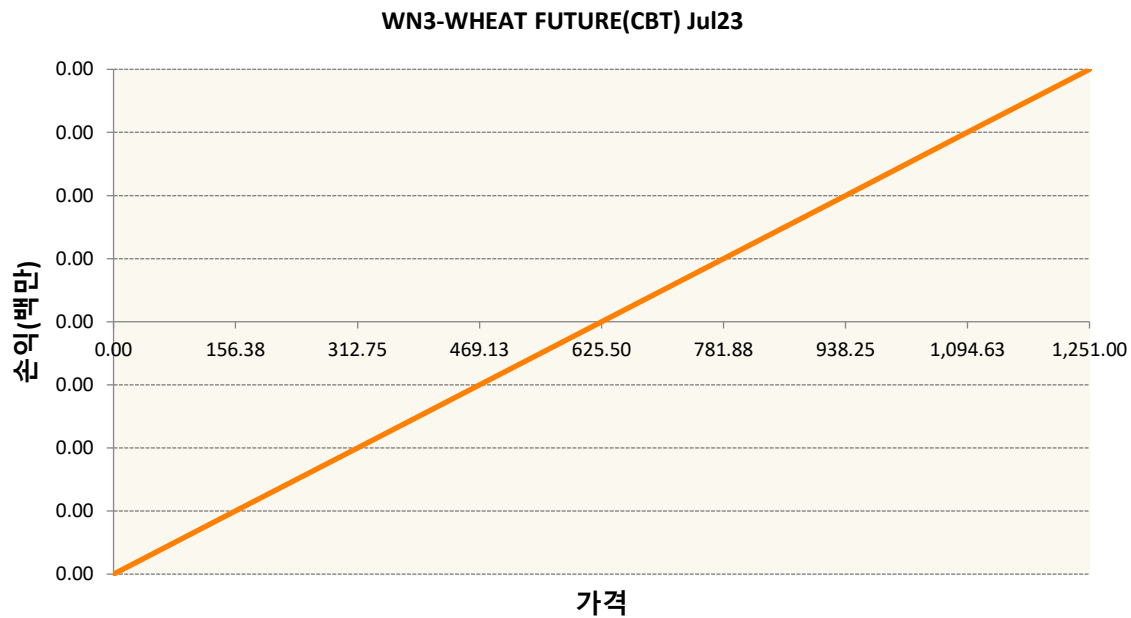
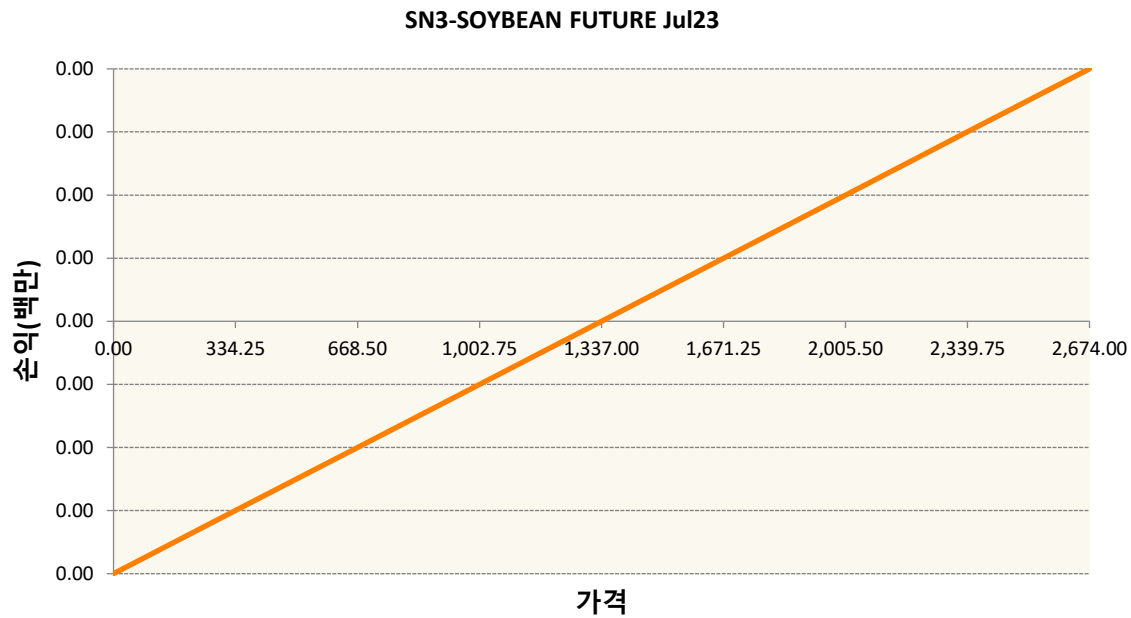


SBN3-Sugar #11 (WORLD) Jul23



SMN3-SOYBEAN MEAL FUTR Jul23





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

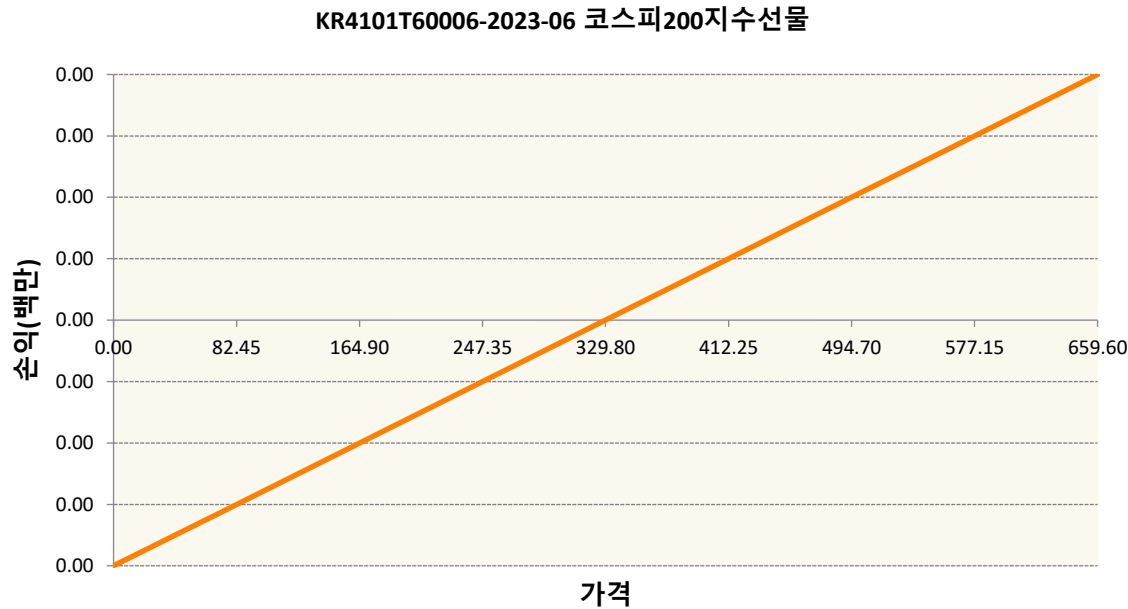
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 82    | -82       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,803 | 0     | 2,803     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T60006 |           | 2023-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 224    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -224      | -224               | -224   | -224 | -224  | -224   | -224   |
| -5.33%       | -150      | -150               | -150   | -150 | -150  | -150   | -150   |
| -2.67%       | -75       | -75                | -75    | -75  | -75   | -75    | -75    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 75        | 75                 | 75     | 75   | 75    | 75     | 75     |
| 5.33%        | 150       | 150                | 150    | 150  | 150   | 150    | 150    |
| 8.00%        | 224       | 224                | 224    | 224  | 224   | 224    | 224    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

## 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

352

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

602

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

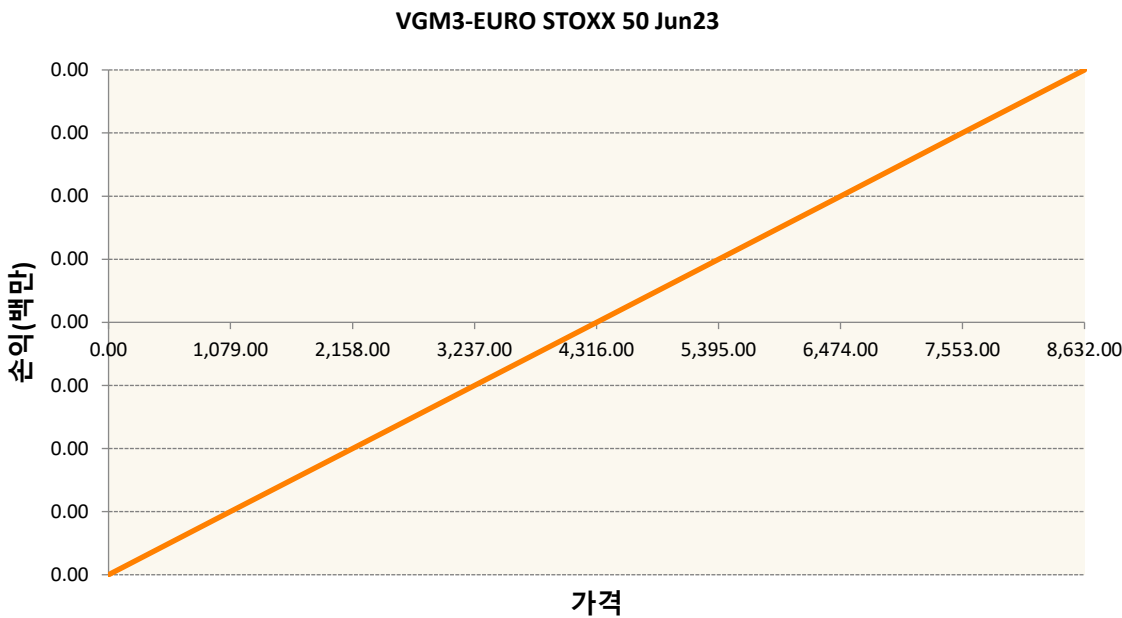
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 425   | 0     | 425       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM3      EURO STOXX 50 Jun23

34

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

(단위:백만원)

58

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

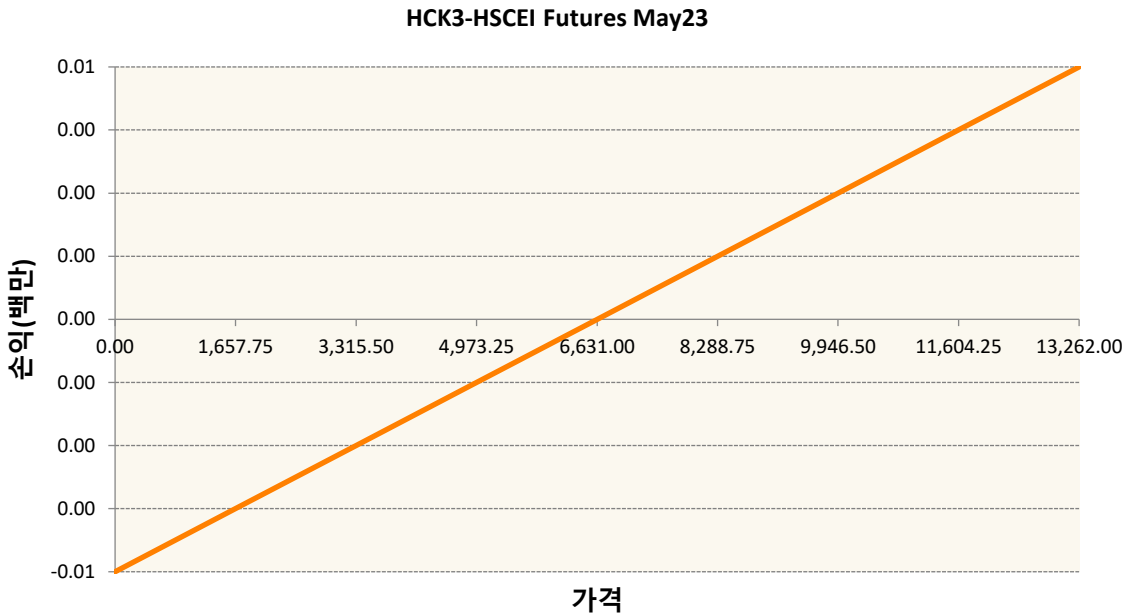
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 846   | 0     | 846       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCK3 | HSCEI Futures May23 | 68 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

116

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

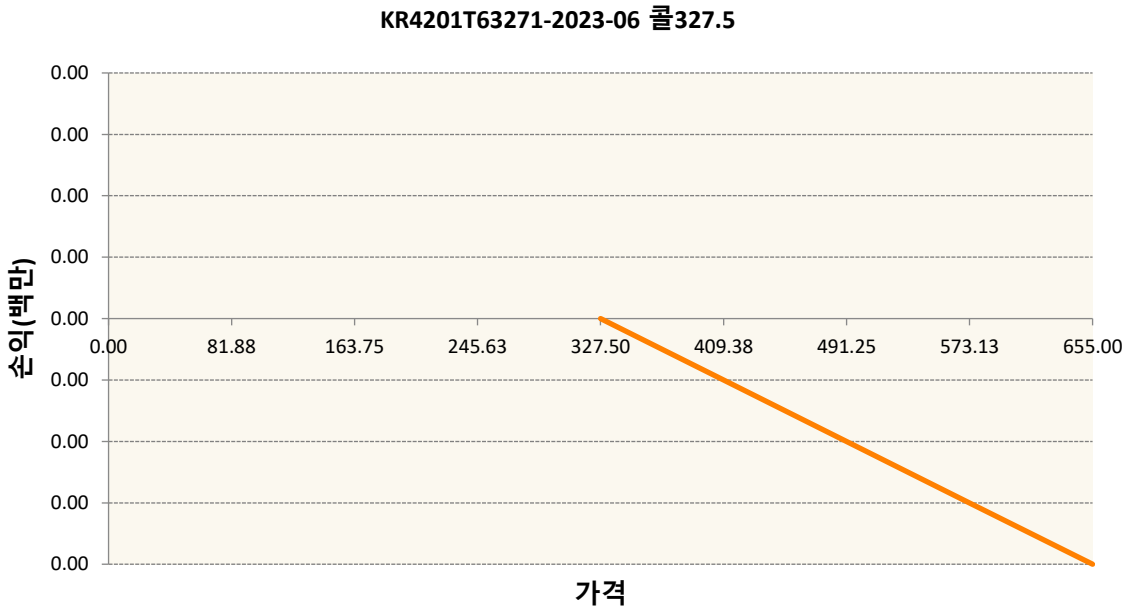
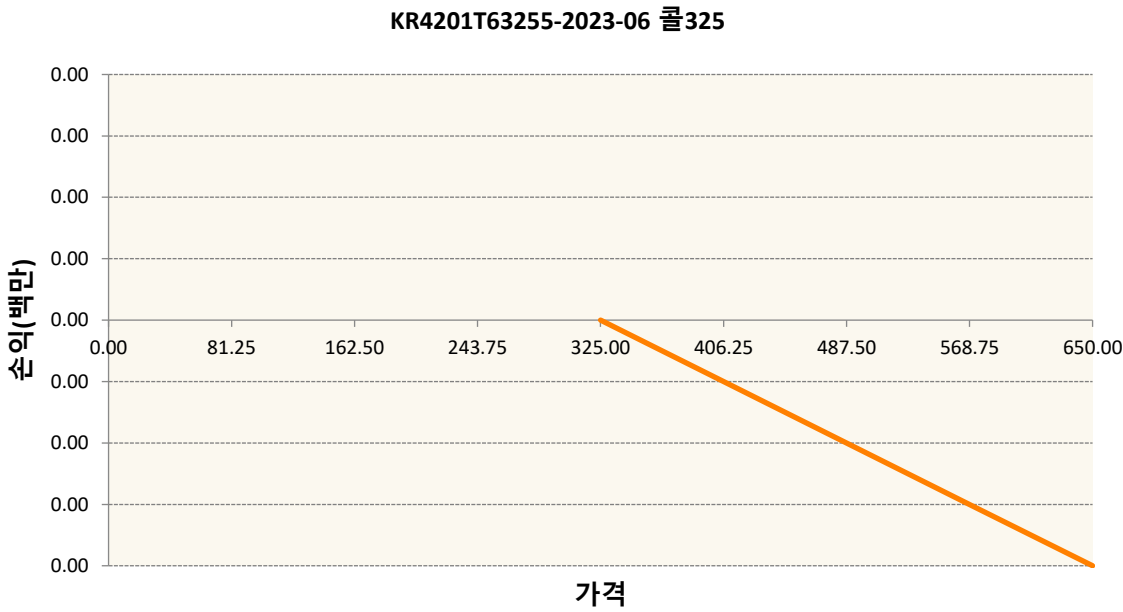
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

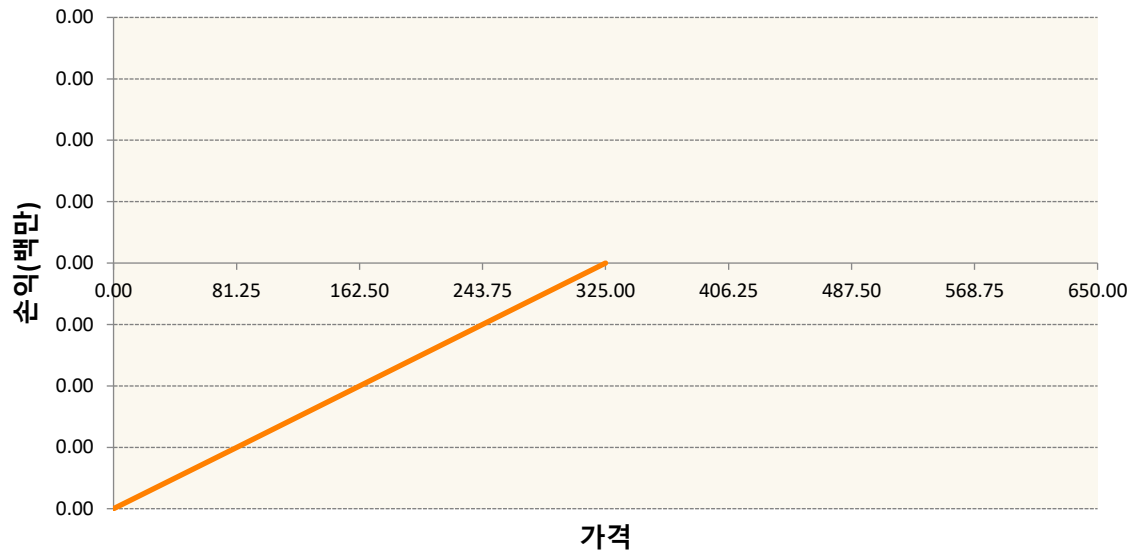
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 54,728 | -54,728   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301T63253-2023-06 풋325



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4201T63255 |           |         | 2023-06 콜325   |        |        |        | 2,698  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 1,203     | 1,179   | 1,151          | 1,117  | 1,080  | 1,039  | 994    |
| -5.33%       | 1,081     | 1,031   | 978            | 921    | 863    | 802    | 740    |
| -2.67%       | 775       | 704     | 632            | 559    | 487    | 414    | 341    |
| 0%           | 214       | 143     | 72             | 0      | -72    | -145   | -218   |
| 2.67%        | -586      | -636    | -689           | -746   | -805   | -866   | -929   |
| 5.33%        | -1,543    | -1,568  | -1,599         | -1,635 | -1,675 | -1,720 | -1,767 |
| 8.00%        | -2,573    | -2,583  | -2,597         | -2,616 | -2,639 | -2,666 | -2,698 |
| KR4201T63271 |           |         | 2023-06 콜327.5 |        |        |        | 403    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 162       | 159     | 155            | 151    | 146    | 141    | 134    |
| -5.33%       | 148       | 141     | 134            | 126    | 118    | 109    | 100    |
| -2.67%       | 110       | 99      | 89             | 78     | 67     | 56     | 45     |
| 0%           | 35        | 23      | 12             | 0      | -12    | -23    | -35    |
| 2.67%        | -80       | -89     | -98            | -108   | -118   | -128   | -138   |
| 5.33%        | -222      | -227    | -233           | -240   | -247   | -255   | -263   |
| 8.00%        | -380      | -382    | -385           | -388   | -393   | -398   | -403   |
| KR4301T63253 |           |         | 2023-06 풋325   |        |        |        | 517    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -468      | -473    | -480           | -488   | -497   | -507   | -517   |
| -5.33%       | -246      | -258    | -270           | -284   | -298   | -312   | -326   |
| -2.67%       | -68       | -85     | -102           | -119   | -136   | -153   | -170   |
| 0%           | 50        | 34      | 17             | 0      | -17    | -34    | -51    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 112 | 101 | 88  | 75  | 61  | 46  | 31  |
| 5.33% | 137 | 131 | 124 | 116 | 106 | 96  | 85  |
| 8.00% | 145 | 143 | 140 | 135 | 130 | 123 | 116 |

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

(단위:백만원)

3,692

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 578   | 578   | 0         | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |    |
|-----------------------------|----|
| FXW213D2N KRW/EUR 26-05-23E | 46 |
| FXW213D4K EUR/KRW 26-05-23E | 46 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 75 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

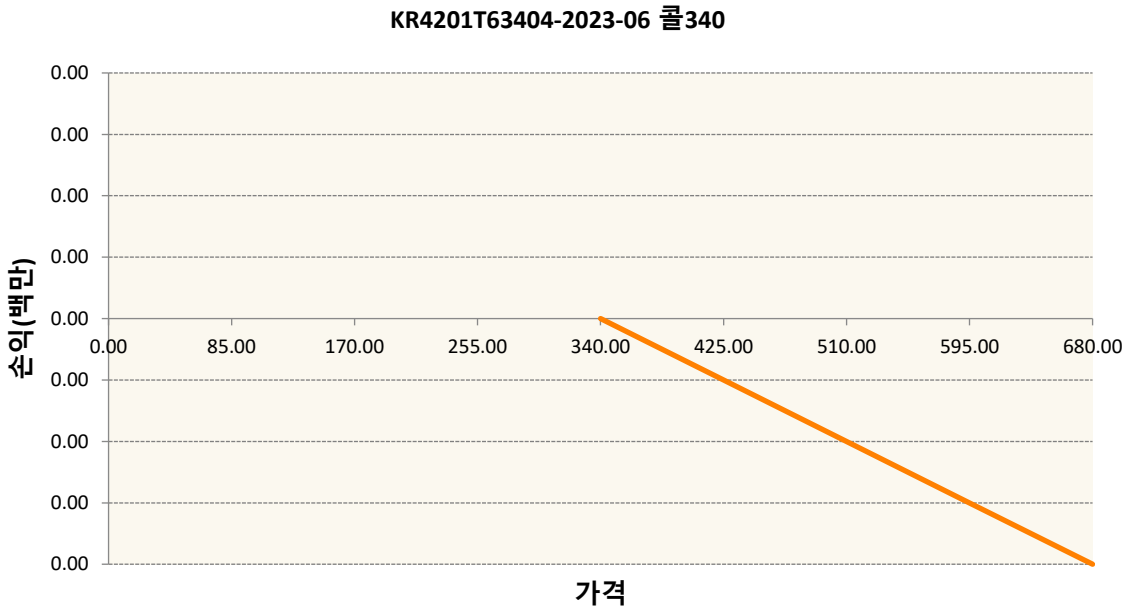
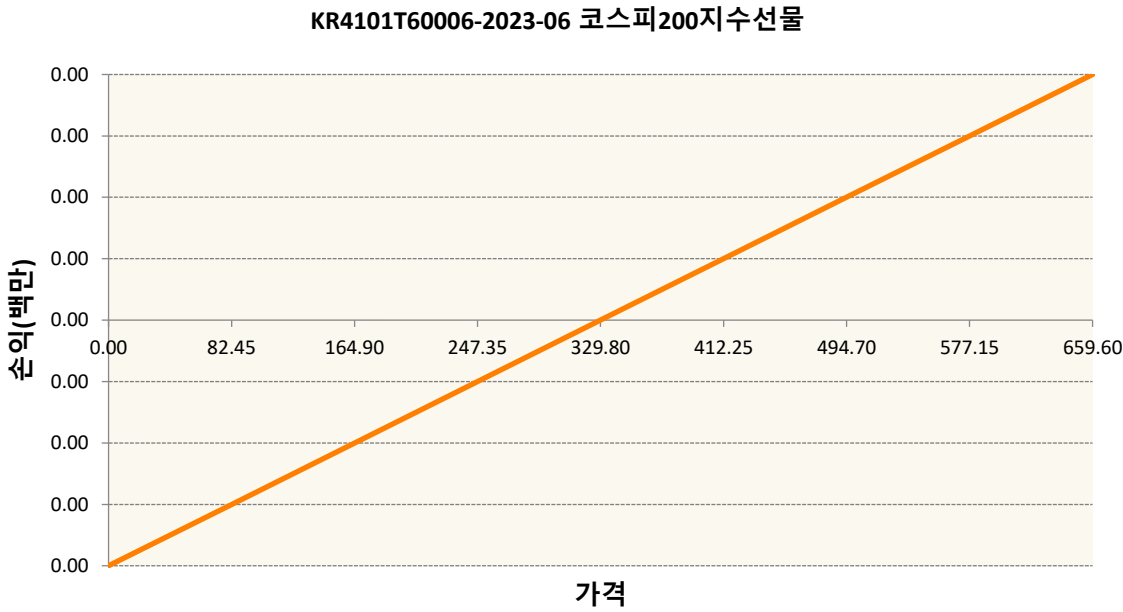
## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

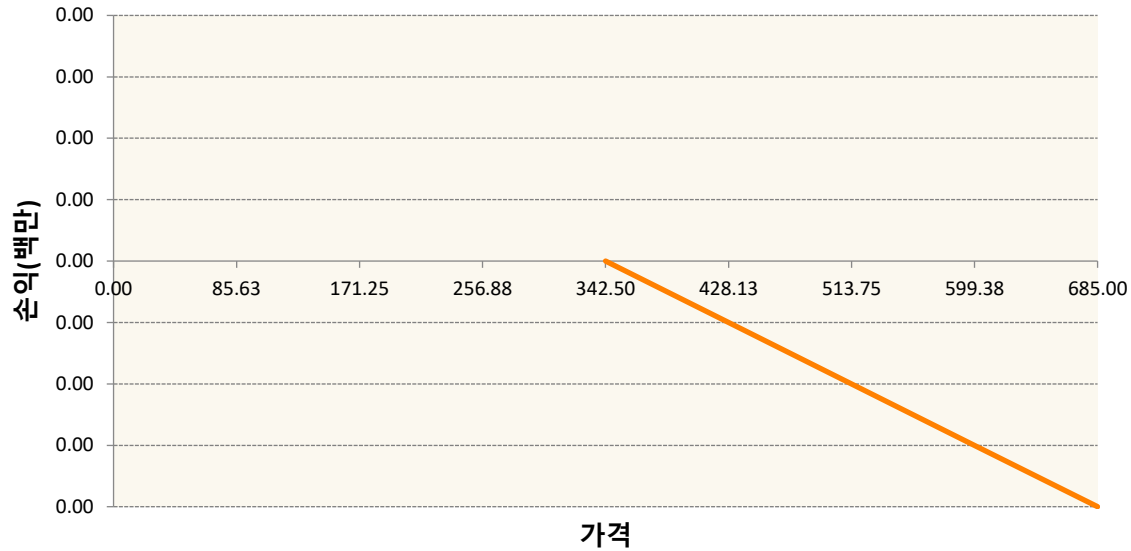
(단위:백만원)

| 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   | 495   | 0     | 495       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 3,672 | -3,672    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4201T63420-2023-06 콜342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|              |           |                    |        |     |       |        |        |
|--------------|-----------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
| KR4101T60006 |           | 2023-06 코스피200지수선물 |        |     |       |        | 40     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -40       | -40                | -40    | -40 | -40   | -40    | -40    |
| -5.33%       | -26       | -26                | -26    | -26 | -26   | -26    | -26    |
| -2.67%       | -13       | -13                | -13    | -13 | -13   | -13    | -13    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 13        | 13                 | 13     | 13  | 13    | 13     | 13     |
| 5.33%        | 26        | 26                 | 26     | 26  | 26    | 26     | 26     |
| 8.00%        | 40        | 40                 | 40     | 40  | 40    | 40     | 40     |
| KR4201T63404 |           | 2023-06 콜340       |        |     |       |        | 66     |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 15        | 14                 | 14     | 14  | 14    | 13     | 12     |
| -5.33%       | 14        | 14                 | 13     | 12  | 11    | 10     | 9      |
| -2.67%       | 12        | 11                 | 10     | 8   | 7     | 5      | 3      |
| 0%           | 6         | 4                  | 2      | 0   | -2    | -5     | -7     |
| 2.67%        | -6        | -9                 | -11    | -14 | -17   | -19    | -22    |
| 5.33%        | -27       | -30                | -32    | -34 | -37   | -39    | -42    |
| 8.00%        | -55       | -57                | -58    | -60 | -62   | -64    | -66    |
| KR4201T63420 |           | 2023-06 콜342.5     |        |     |       |        | 104    |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 20        | 20                 | 20     | 19  | 19    | 18     | 17     |
| -5.33%       | 20        | 19                 | 18     | 17  | 16    | 15     | 13     |
| -2.67%       | 17        | 16                 | 14     | 12  | 9     | 7      | 4      |
| 0%           | 10        | 7                  | 3      | 0   | -4    | -7     | -11    |

|       |     |     |     |     |     |      |      |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|------|------|
| 2.67% | -8  | -12 | -17 | -21 | -25 | -29  | -34  |
| 5.33% | -39 | -44 | -48 | -52 | -56 | -61  | -65  |
| 8.00% | -84 | -87 | -90 | -93 | -97 | -101 | -104 |

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

(단위:백만원)

191

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

## 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 | 6,815 | 0     | 6,815     |    |

### 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 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

## 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 | 4,979 | 0     | 4,979     |    |

### 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 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

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 | 18,962 | 0      | 18,962    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 667    | 19,313 | -18,645   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    |                                 | (단위:백만원) |
|------------------------------|---------------------------------|----------|
| FXW213D2Q KRW/USD 31-05-23E  |                                 | 719      |
| FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E  |                                 | 518      |
| FXW213D4S( KRW/USD 31-07-23E |                                 | 265      |
| FXW213D52( USD/KRW 31-05-23E |                                 | 53       |
| FXW213D5A KRW/USD 31-05-23E  |                                 | 43       |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |          |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 3,520    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

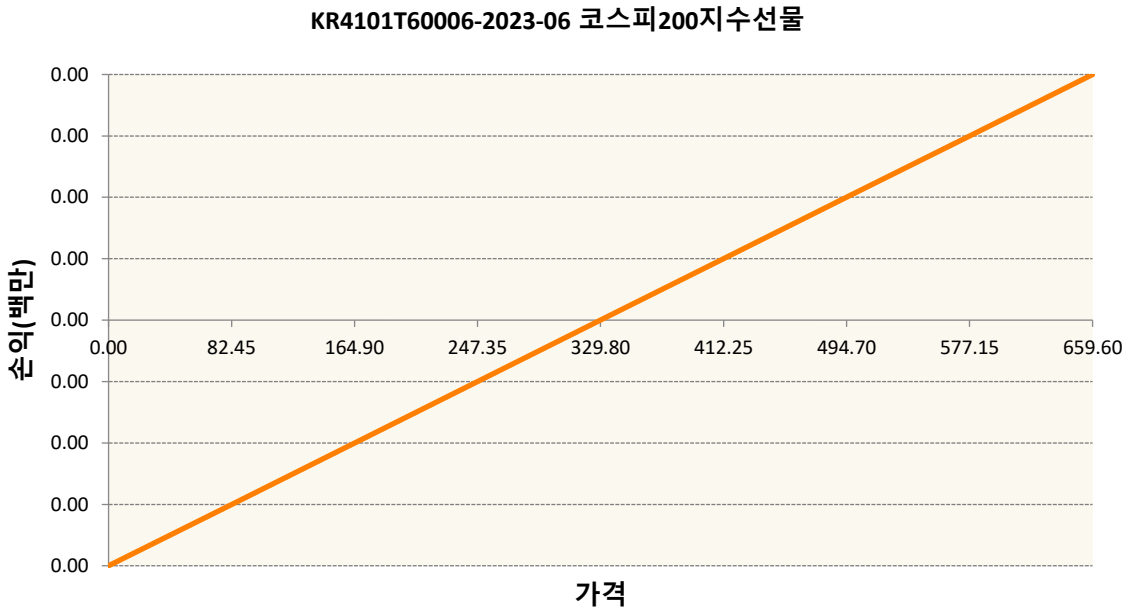
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 165   | -165      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,072 | 0     | 1,072     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T60006 |           |         | 2023-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 86     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -86       | -86     | -86                | -86 | -86   | -86    | -86    |
| -5.33%       | -57       | -57     | -57                | -57 | -57   | -57    | -57    |
| -2.67%       | -29       | -29     | -29                | -29 | -29   | -29    | -29    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 29        | 29      | 29                 | 29  | 29    | 29     | 29     |
| 5.33%        | 57        | 57      | 57                 | 57  | 57    | 57     | 57     |
| 8.00%        | 86        | 86      | 86                 | 86  | 86    | 86     | 86     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

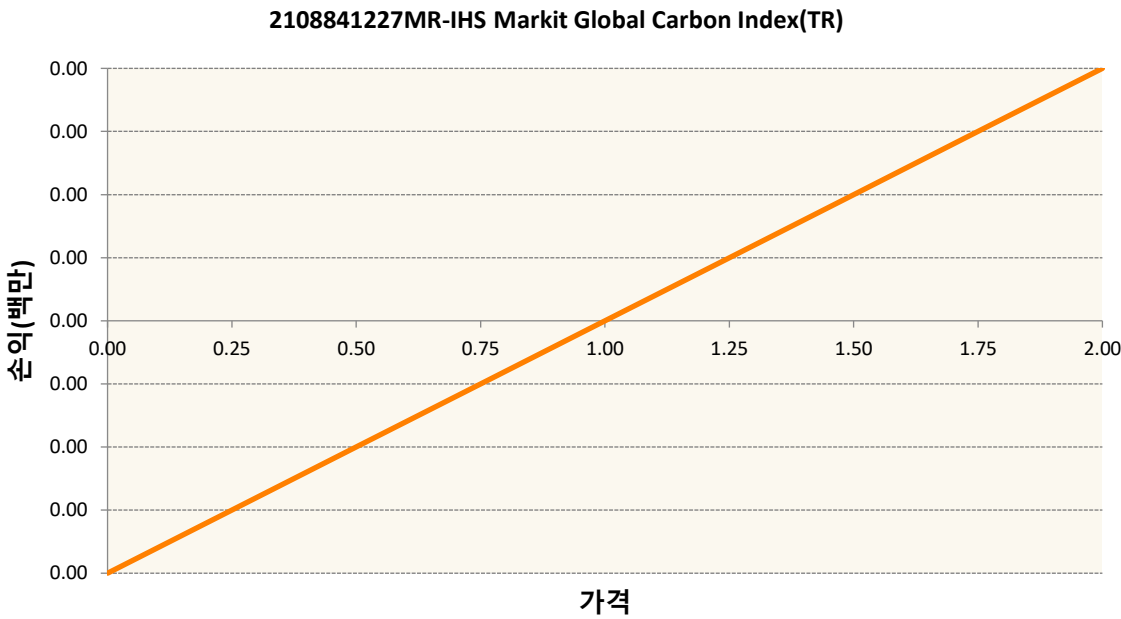
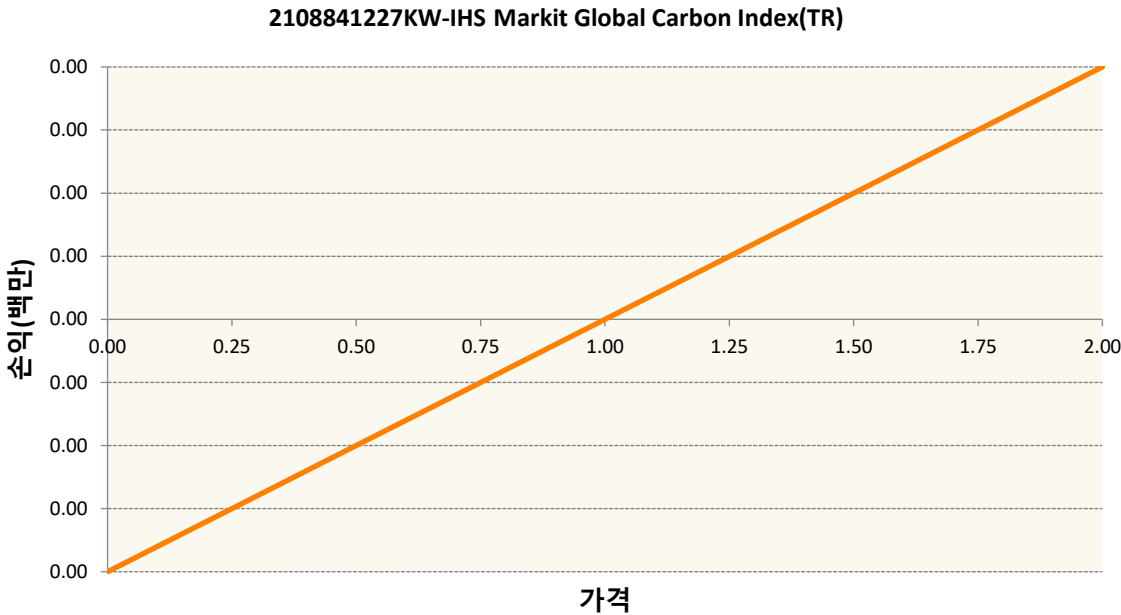
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

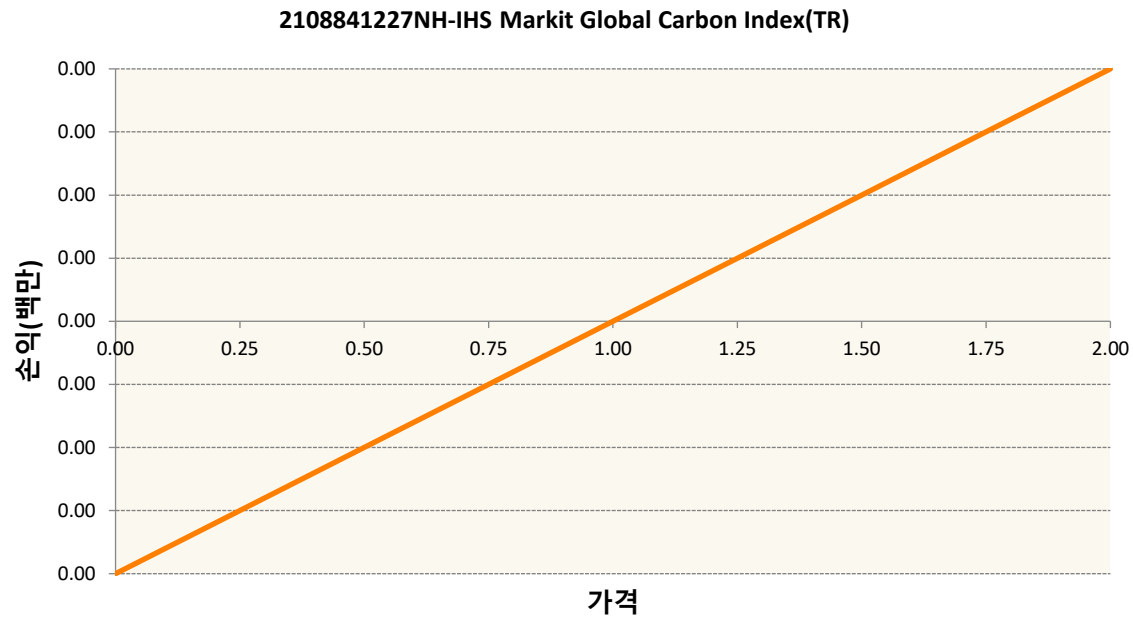
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 25,784 | 0     | 25,784    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                    |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------|--|----------|
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 1,752    |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 206      |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 103      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 3,520    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

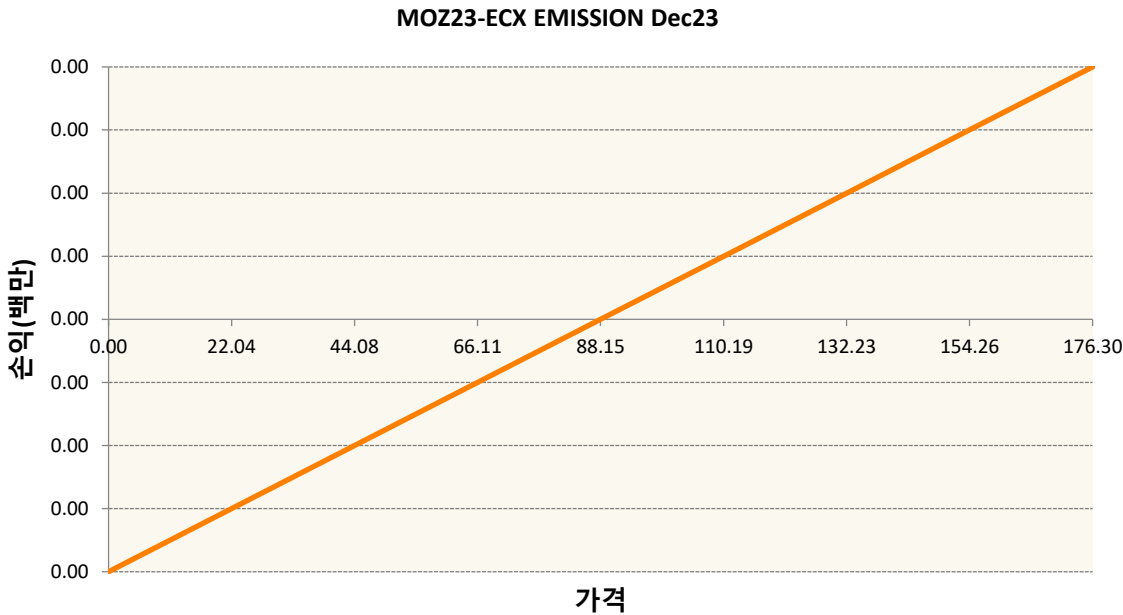
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 8,802 | 0     | 8,802     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,166 | -2,166    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| FXW213D4S( KRW/EUR 31-05-23E  | 58  |
| FXW213D4S( KRW/EUR 31-05-23E  | 58  |
| FXW213D4S( KRW/EUR 31-05-23E  | 58  |
| MOZ23      ECX EMISSION Dec23 | 704 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,343 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

## 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   | 9,237 | 0     | 9,237     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                     |   |
|-------------------------------------|---|
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (NH)  | 8 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (키움)  | 9 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (미래)  | 9 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 221222 (메리츠) | 9 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 60 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

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   | 8,143 | 0     | 8,143     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)      |   |
|-----------------------------------------|---|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(NH)  | 4 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(메리츠) | 6 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(미래)  | 5 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230427(키움)  | 3 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원) |
|-------------------------------------------------|
| 32                                              |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

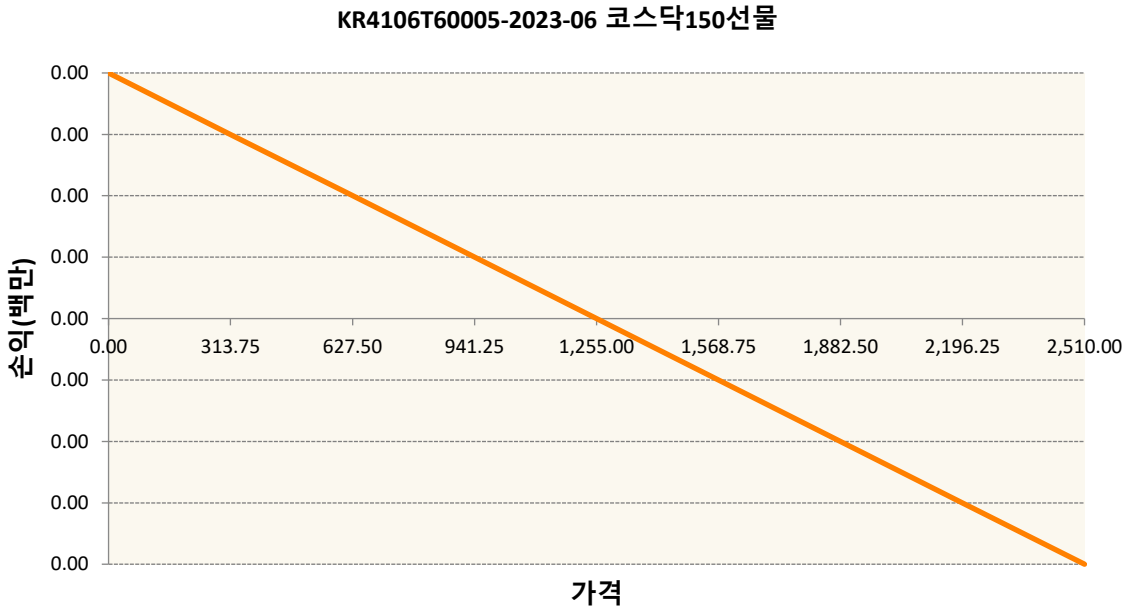
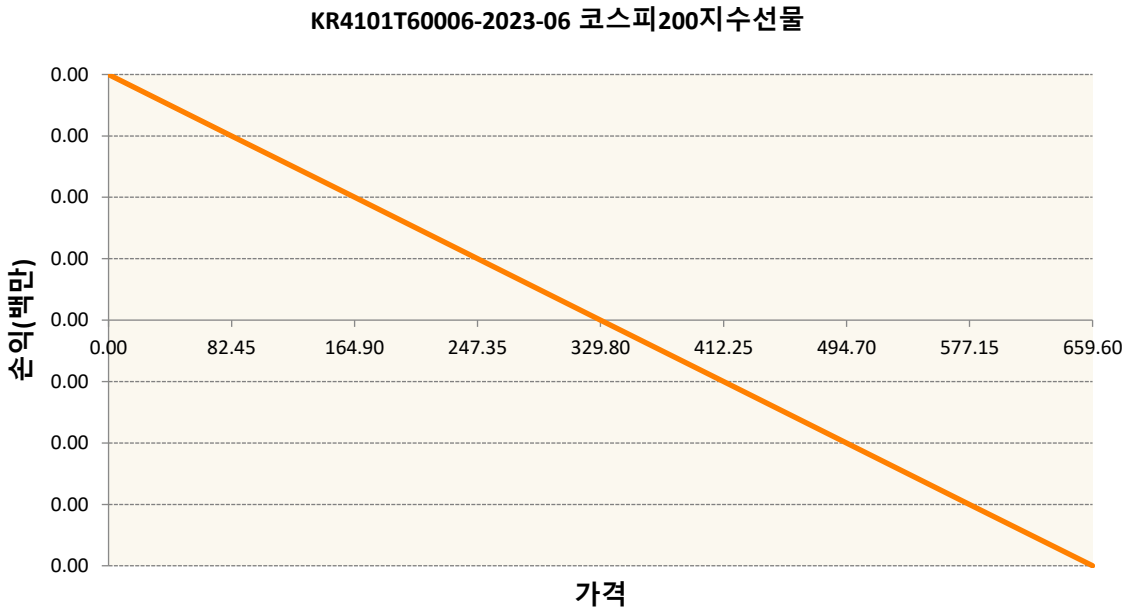
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

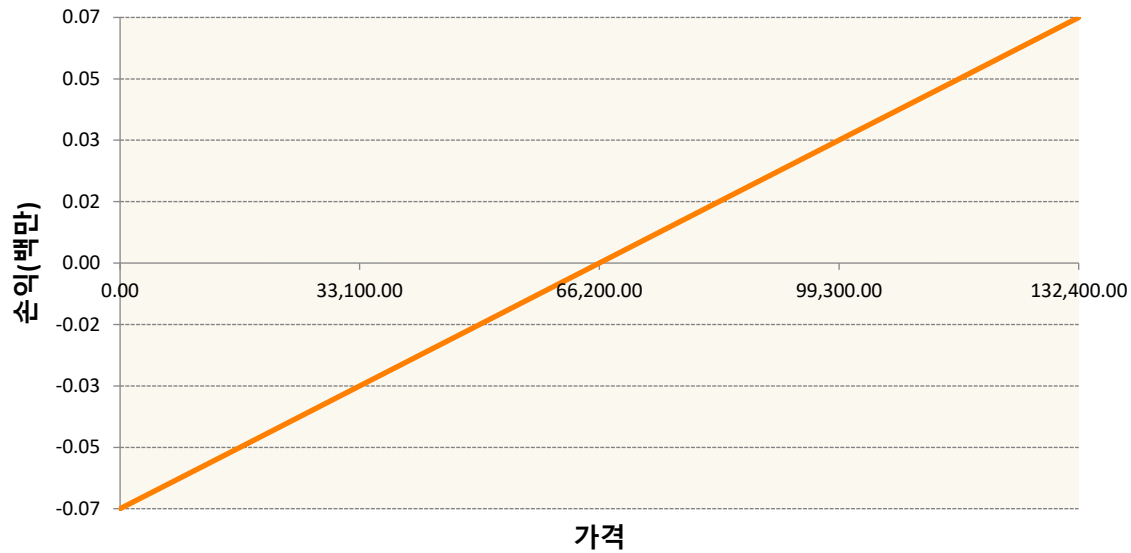
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,099 | 3,502 | -2,403    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

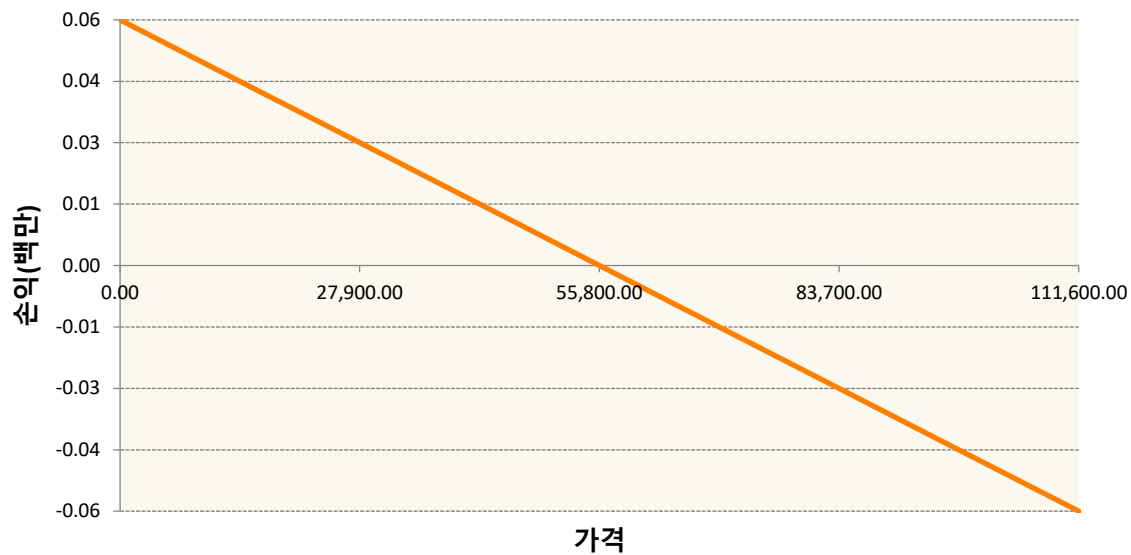
### 2. 만기시점의 손익구조



KR4111T60005-2023-06 삼성전자개별선물



KR41F7T60007-2023-06 카카오페이개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| KR4101T600 2023-06 코스피200지수선물         | 178 |
| KR4106T600 2023-06 코스닥150선물           | 95  |
| KR4111T600 2023-06 삼성전자개별선물           | 88  |
| KR41F7T600 2023-06 카카오페이개별선물          | 7   |
| KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308      | 1   |
| KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413 | 1   |

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

(단위:백만원)

631

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

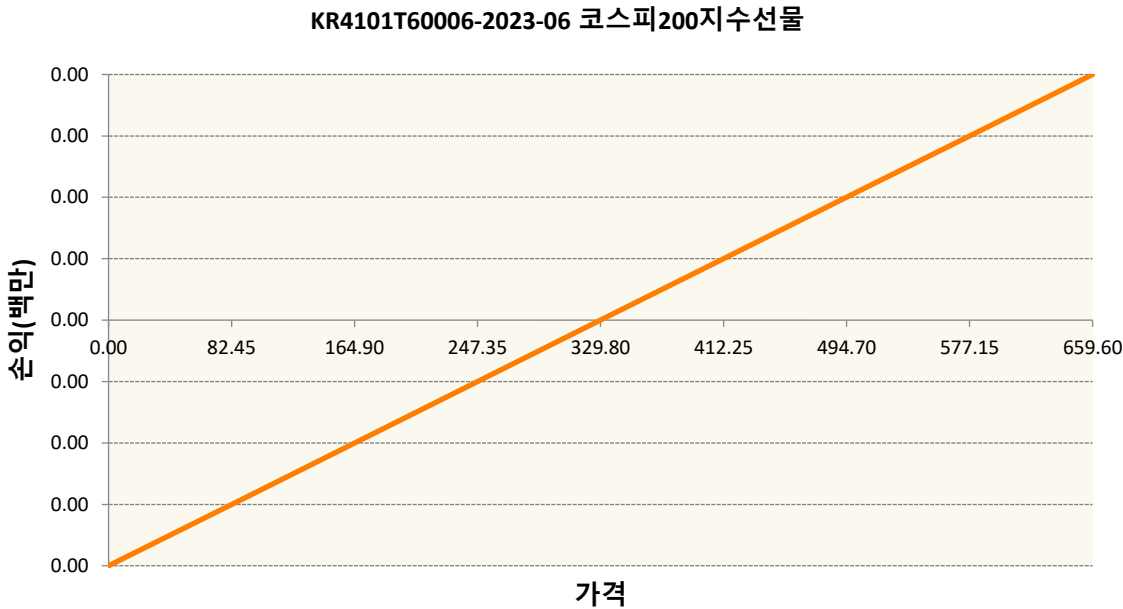
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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   | 660   | 0     | 660       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T60006 |           |         | 2023-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 53     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -53       | -53     | -53                | -53 | -53   | -53    | -53    |
| -5.33%       | -35       | -35     | -35                | -35 | -35   | -35    | -35    |
| -2.67%       | -18       | -18     | -18                | -18 | -18   | -18    | -18    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 18        | 18      | 18                 | 18  | 18    | 18     | 18     |
| 5.33%        | 35        | 35      | 35                 | 35  | 35    | 35     | 35     |
| 8.00%        | 53        | 53      | 53                 | 53  | 53    | 53     | 53     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-05-19 |
| 기준일 | 2023-05-18 |

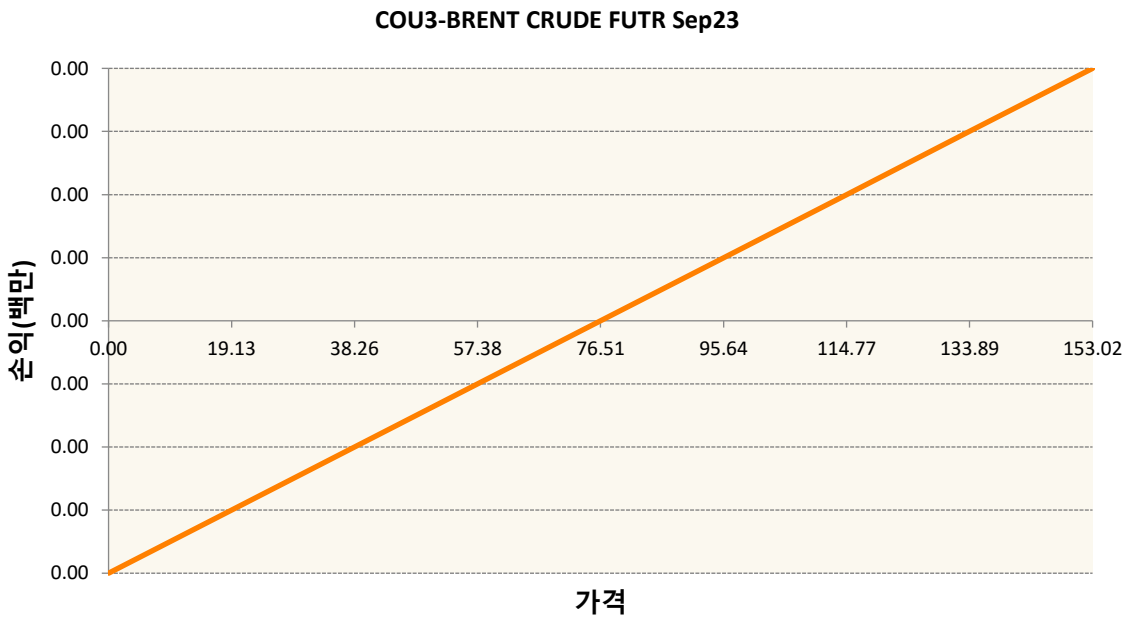
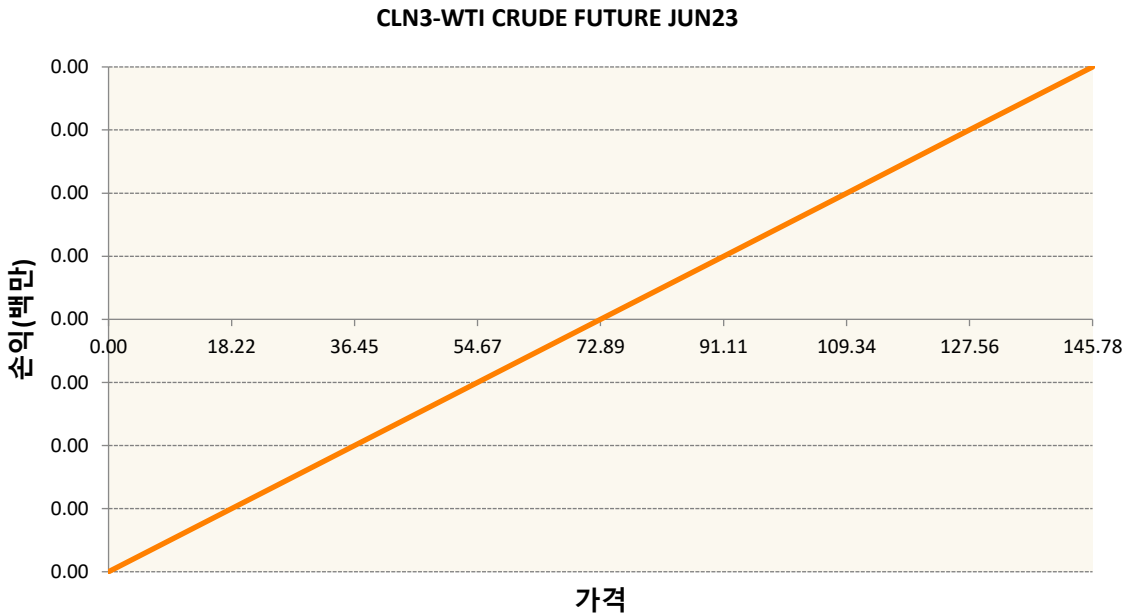
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

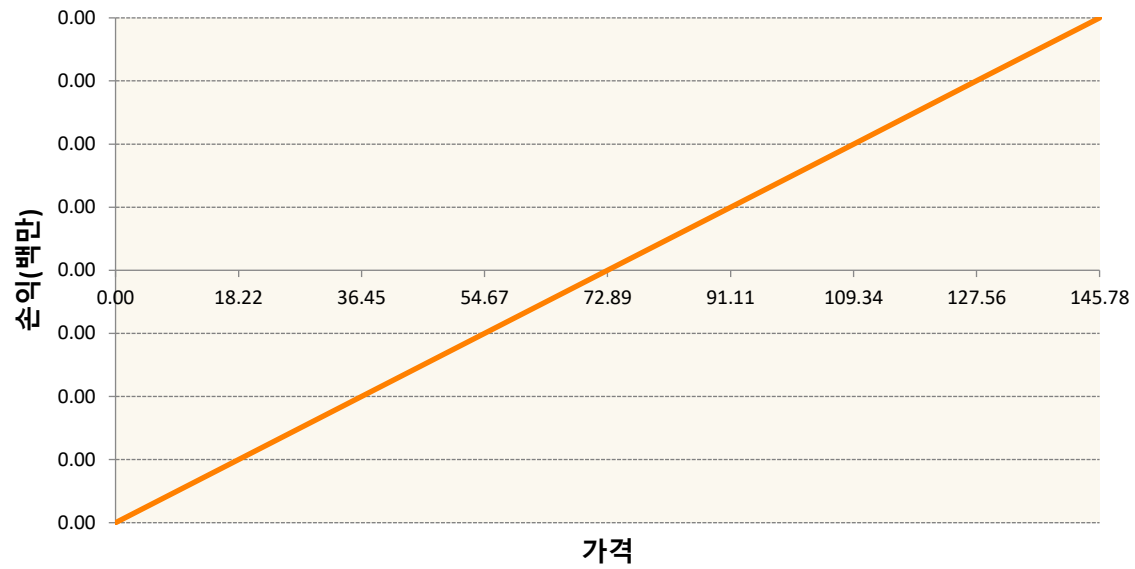
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,312 | 160   | 1,152     |    |

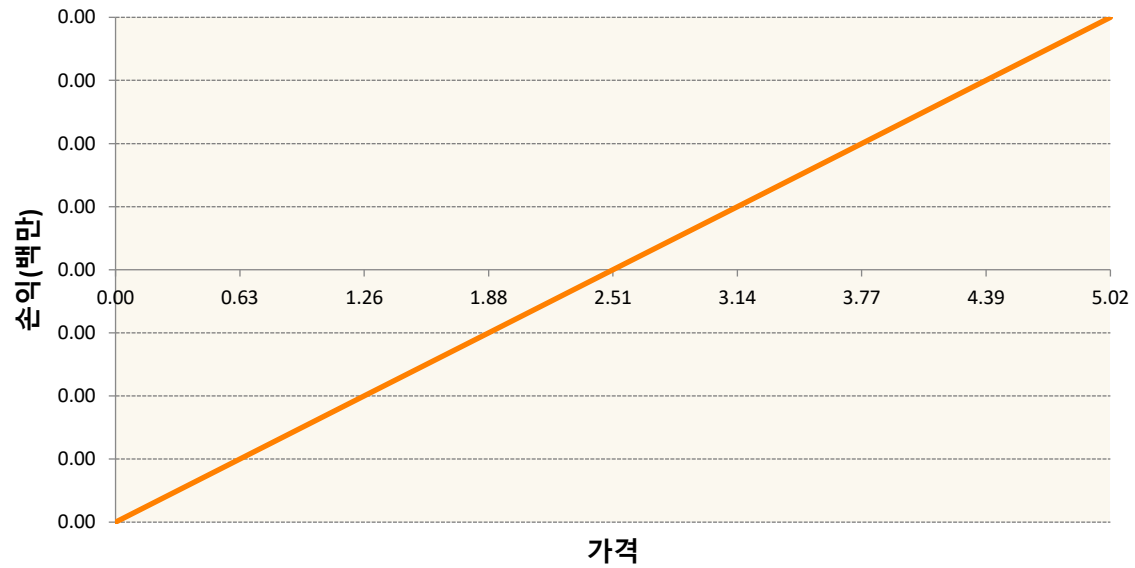
### 2. 만기시점의 손익구조



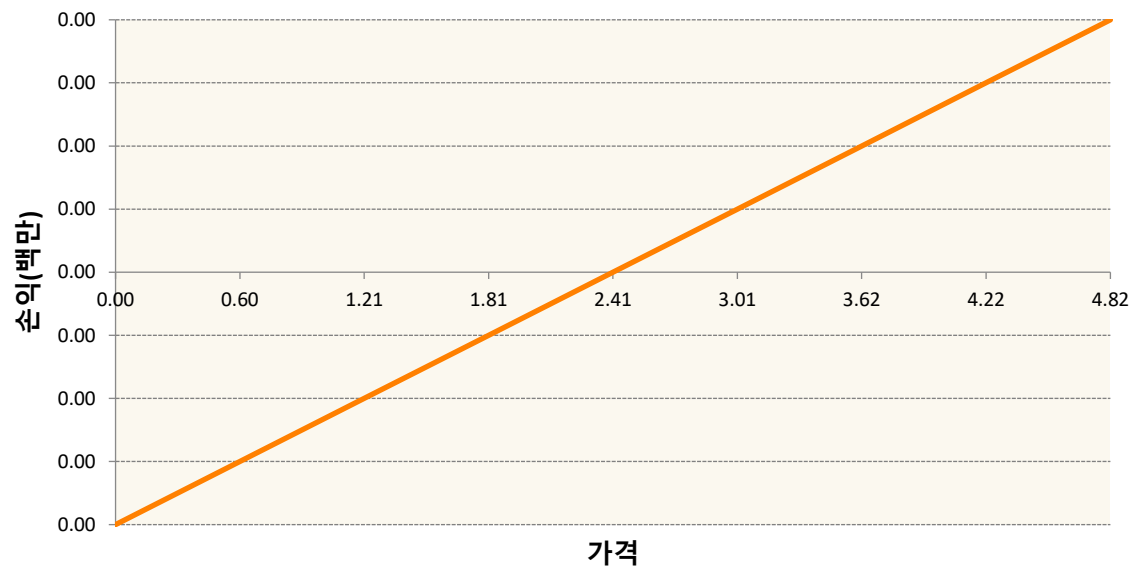
ECN3-E-mini Crude Oil Jul23



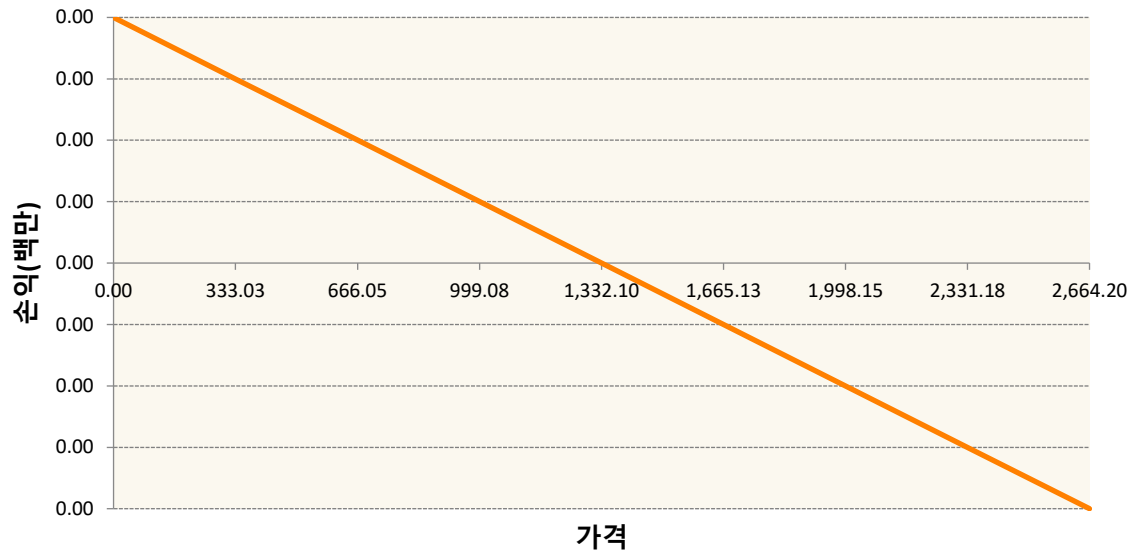
EON3-E-MINI NATURAL GAS Jul23



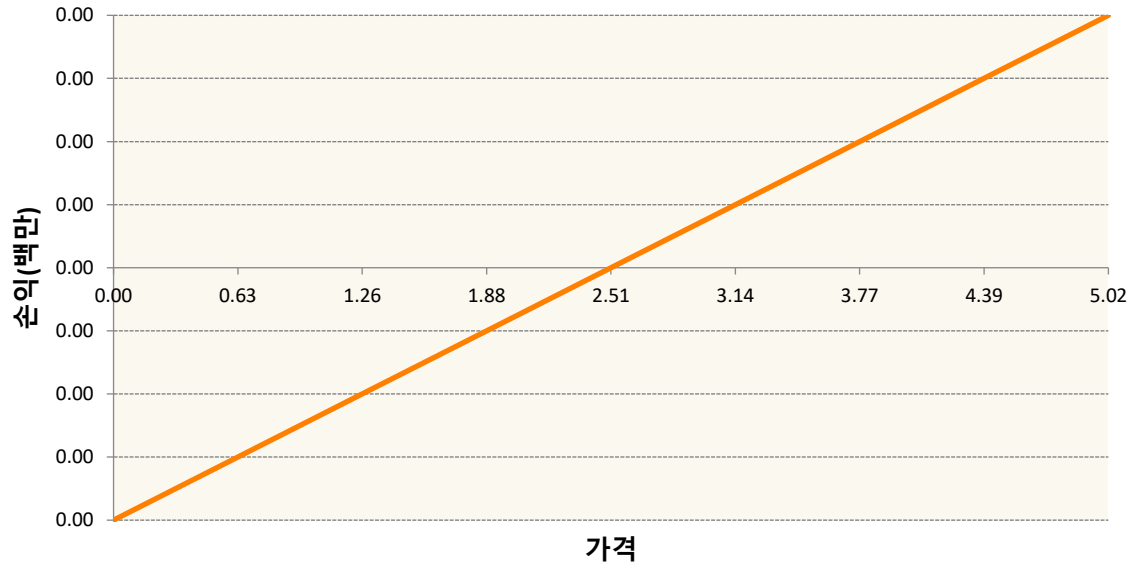
HON3-NY Harb ULSD Fut Jul23



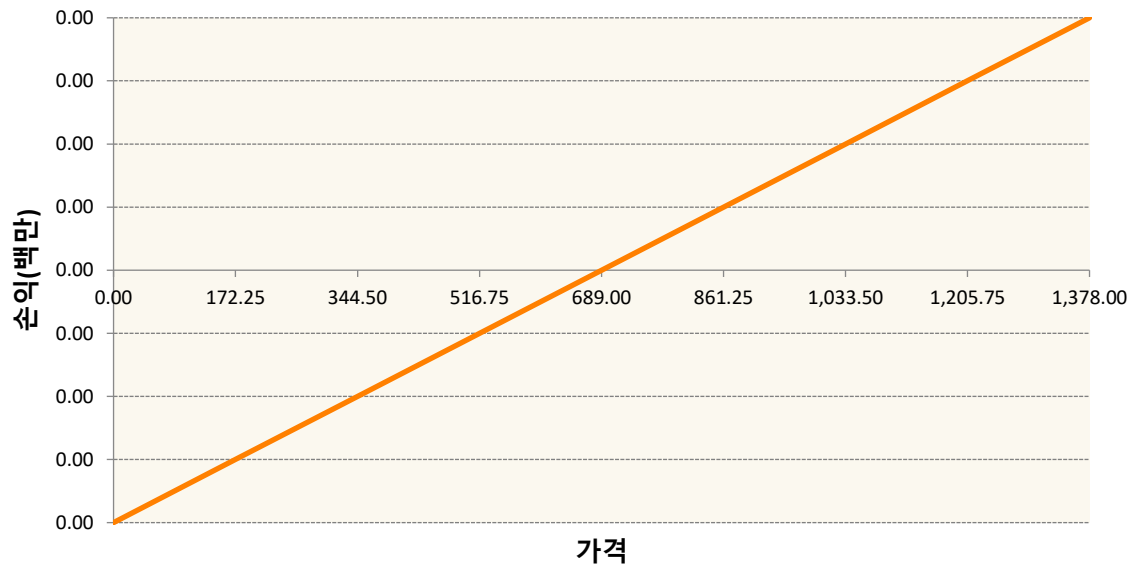
KR4175T60000-2023-06 달러선물

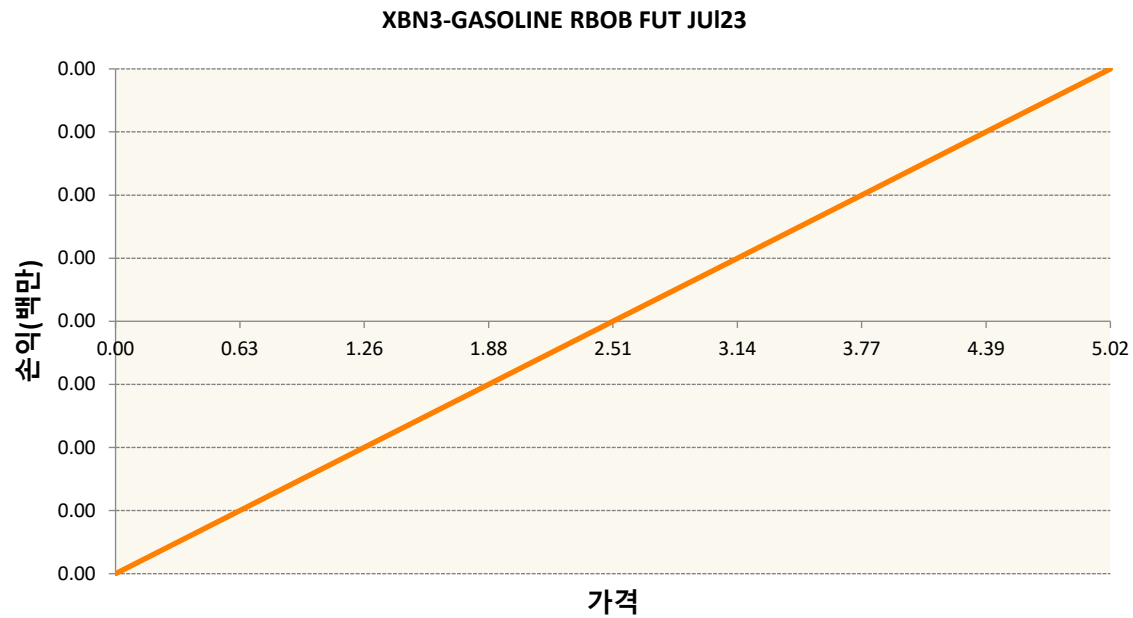


NGN23-NATURAL GAS FUTR JUL23



QSN3-Low Su Gasoil G JUL23





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| CLN3                      | WTI CRUDE FUTURE JUN23   | 23       |
| COU3                      | BRENT CRUDE FUTR Sep23   | 24       |
| ECN3                      | E-mini Crude Oil JUL23   | 4        |
| EON3                      | E-MINI NATURAL GAS JUL23 | 1        |
| HON3                      | NY Harb ULSD Fut Jul23   | 11       |
| KR4175T600 2023-06 달러선물   |                          | 13       |
| NGN23                     | NATURAL GAS FUTR JUL23   | 24       |
| QSN3                      | Low Su Gasoil G JUL23    | 7        |
| XBN3                      | GASOLINE RBOB FUT JUL23  | 11       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 201      |