

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

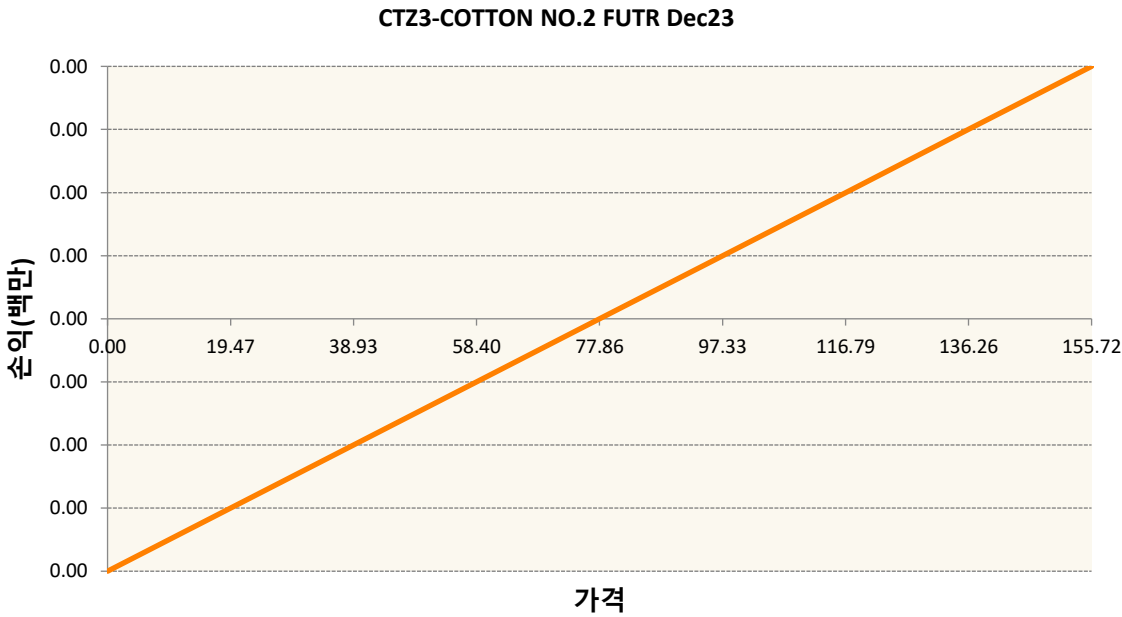
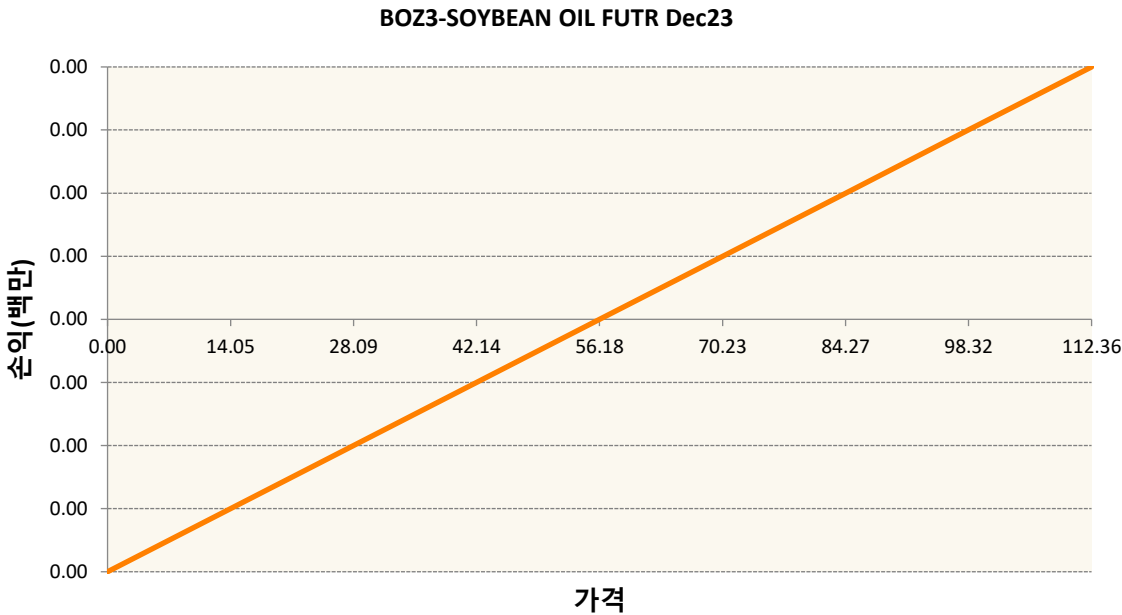
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

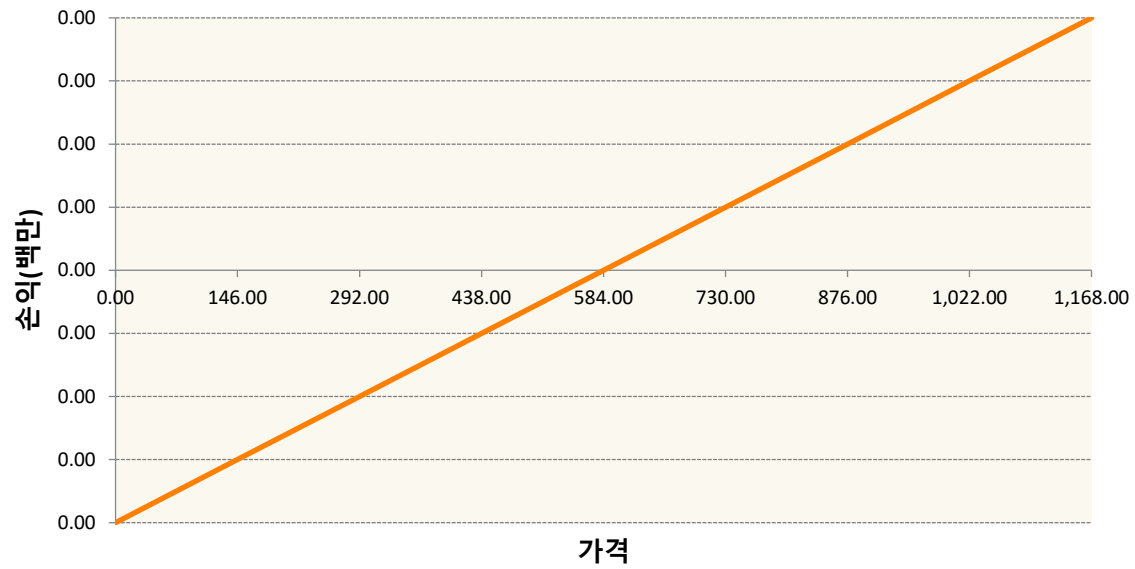
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,383 | 650   | 4,734     |    |

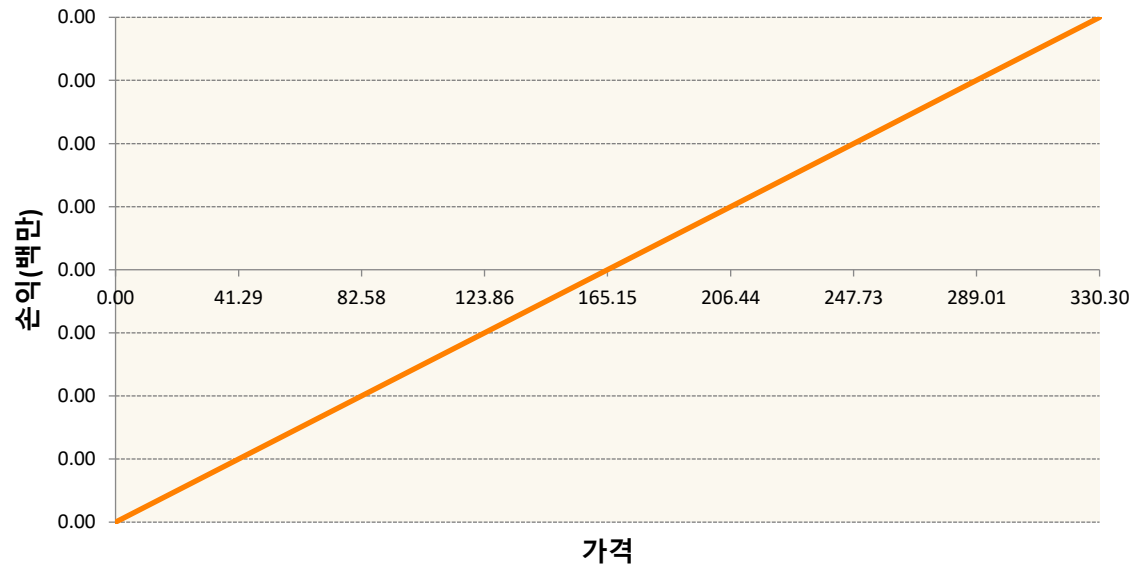
### 2. 만기시점의 손익구조



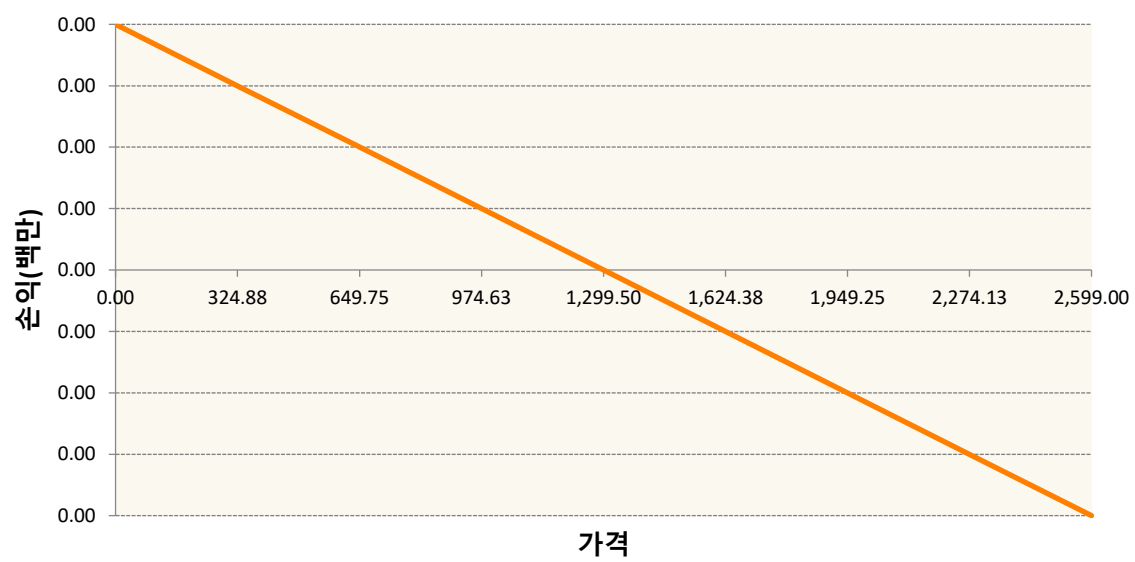
CU3-CORN FUTURE Sep23



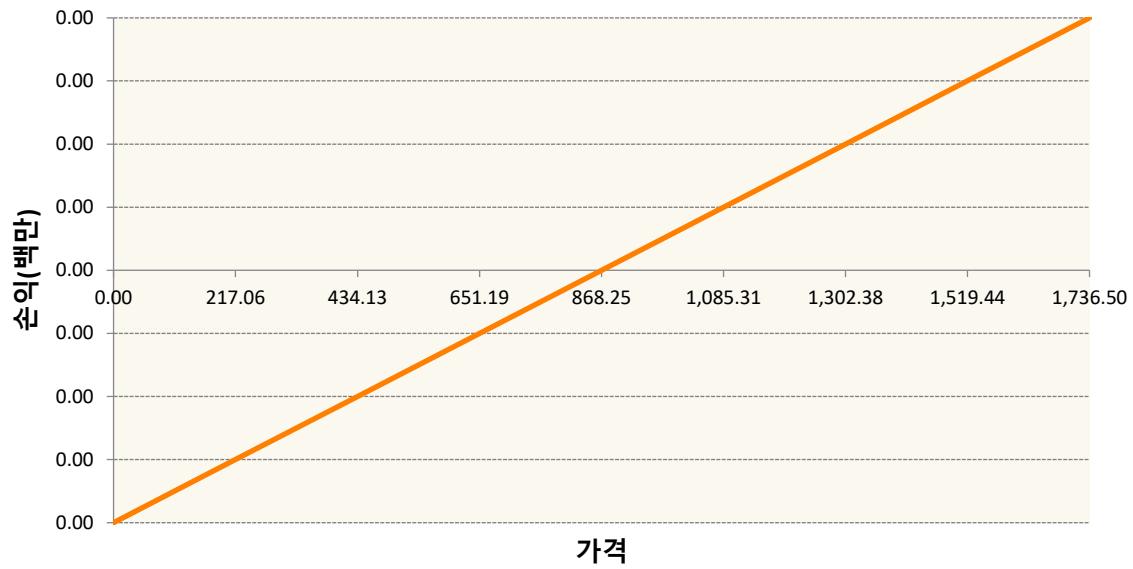
KCU3-COFFEE 'C' FUTURE Sep23



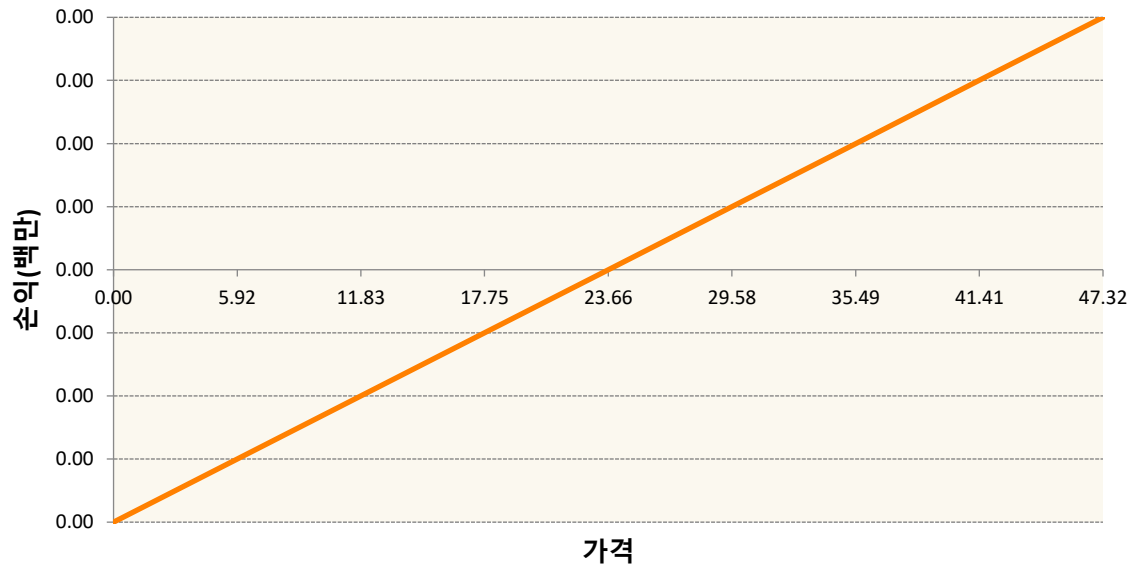
KR4175T70009-2023-07 달러선물



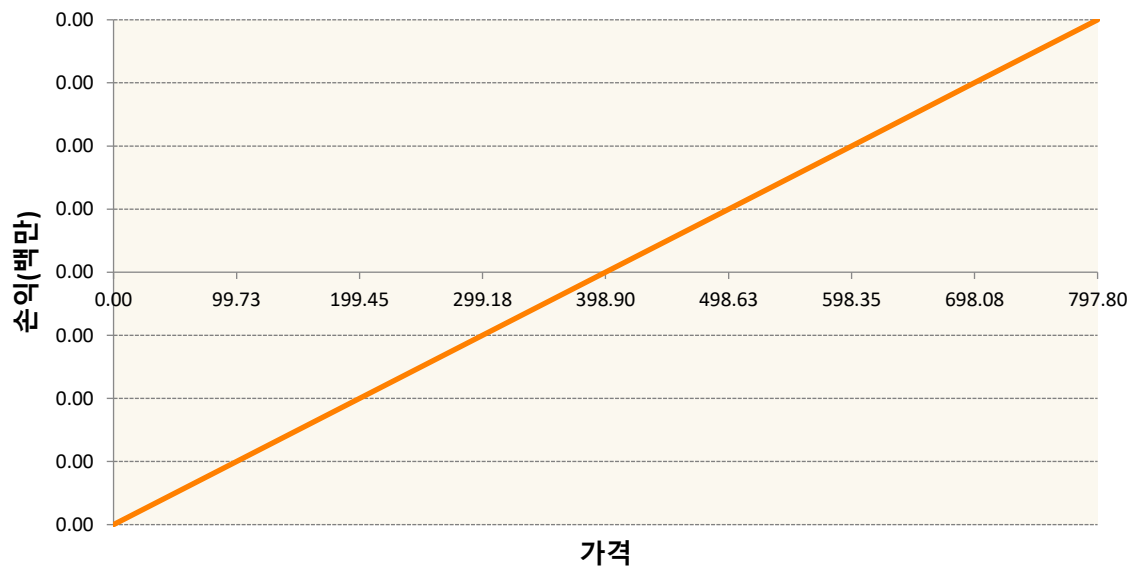
KWU3-KC HRW WHEAT FUT Sep23

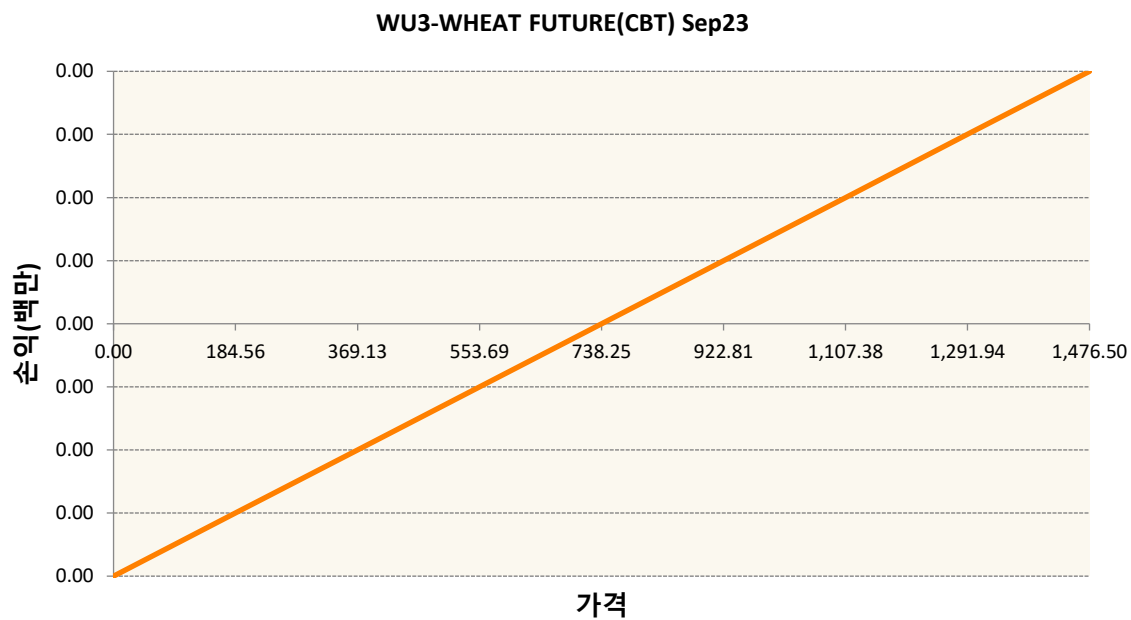
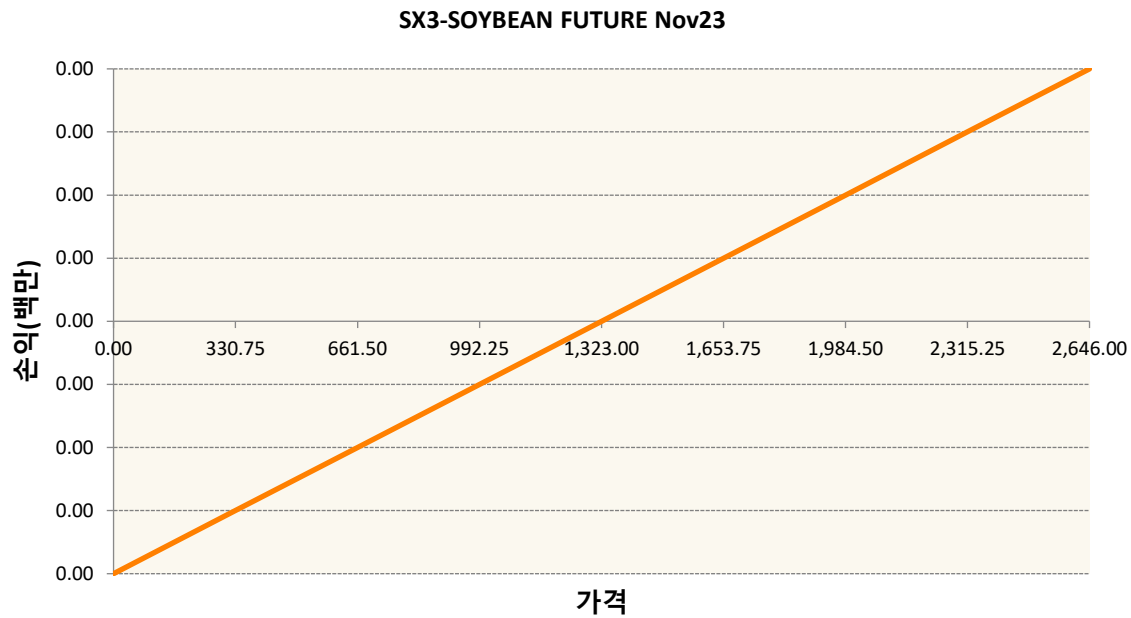


SBV3-Sugar #11 (WORLD) Oct23



SMZ3-SOYBEAN MEAL FUTR Dec23





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

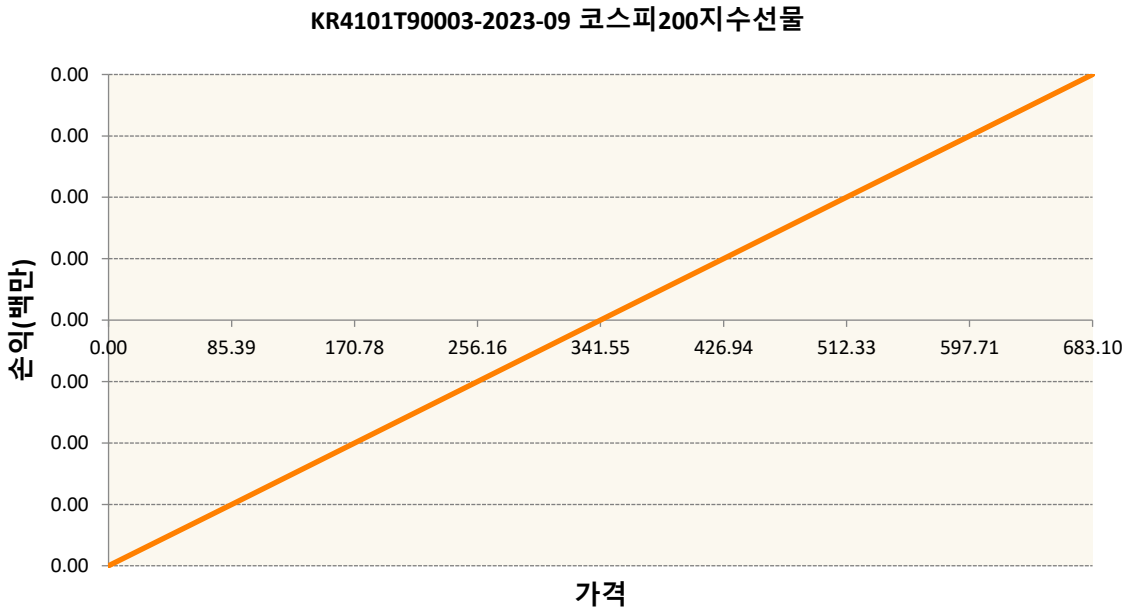
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 427   | 0     | 427       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T90003 |           |         | 2023-09 코스피200지수선물 |     |       |        | 34     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -34       | -34     | -34                | -34 | -34   | -34    | -34    |
| -5.33%       | -23       | -23     | -23                | -23 | -23   | -23    | -23    |
| -2.67%       | -11       | -11     | -11                | -11 | -11   | -11    | -11    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 11        | 11      | 11                 | 11  | 11    | 11     | 11     |
| 5.33%        | 23        | 23      | 23                 | 23  | 23    | 23     | 23     |
| 8.00%        | 34        | 34      | 34                 | 34  | 34    | 34     | 34     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

## SOL차이나강소기업CSI500상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 4,215 | 0     | 4,215     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래230314 | 330 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 533 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

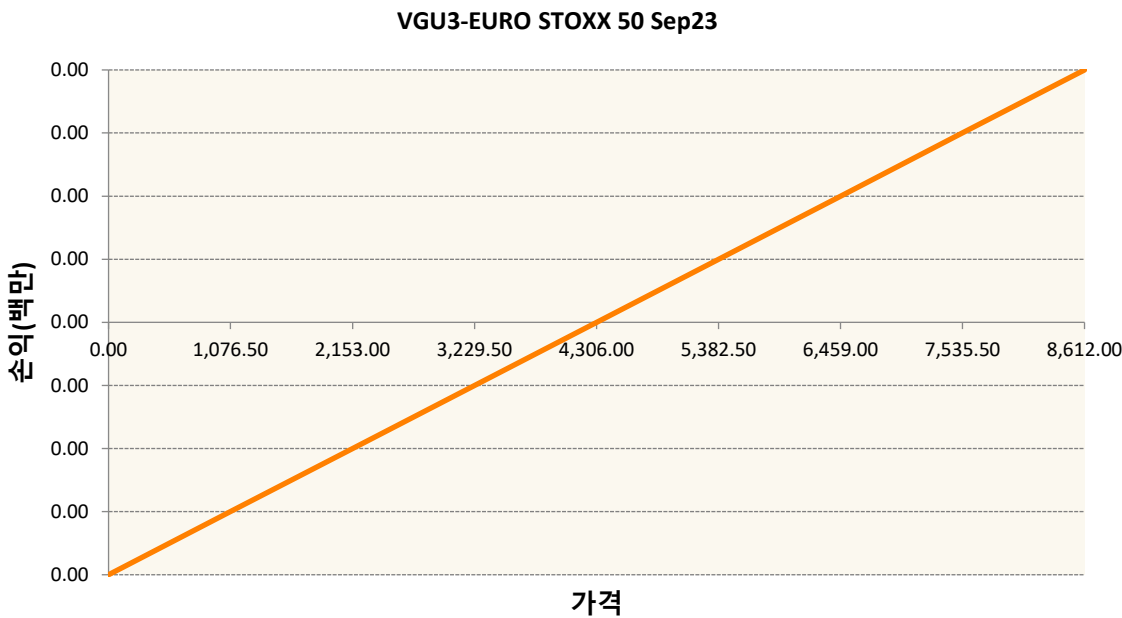
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 415   | 0     | 415       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGU3 | EURO STOXX 50 Sep23 | 33 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 54 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

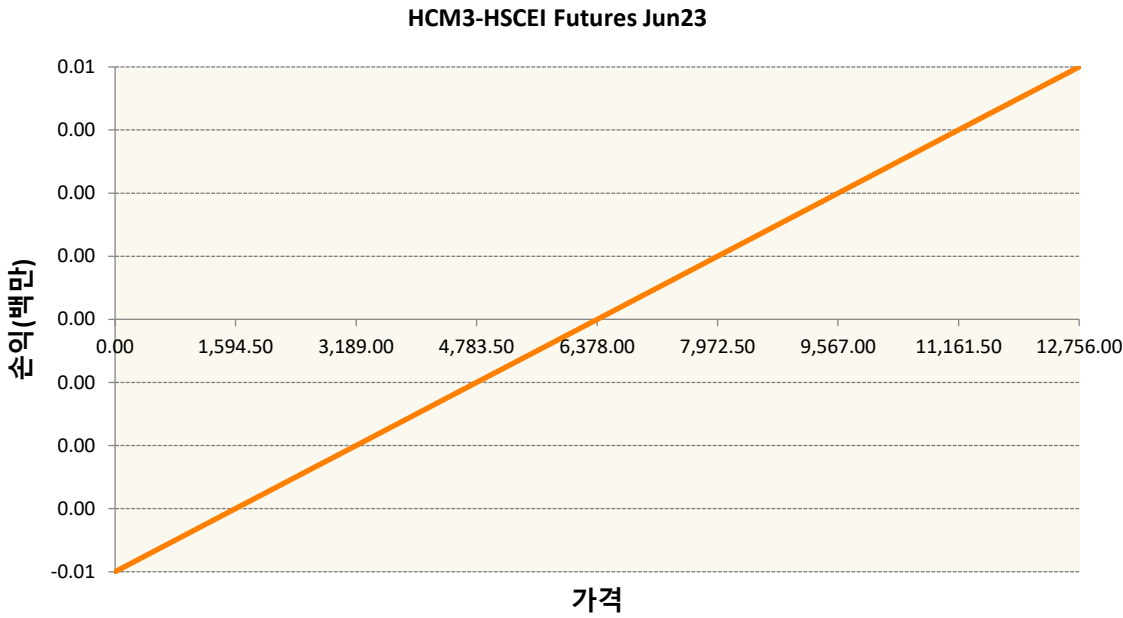
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCM3 | HSCEI Futures Jun23 | 86 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 138 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

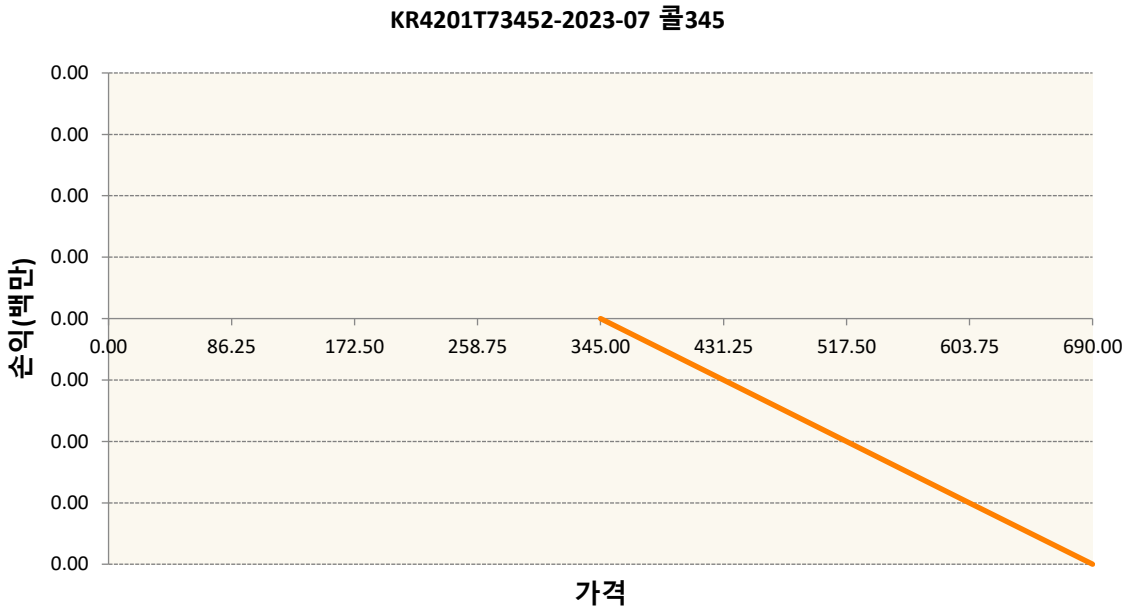
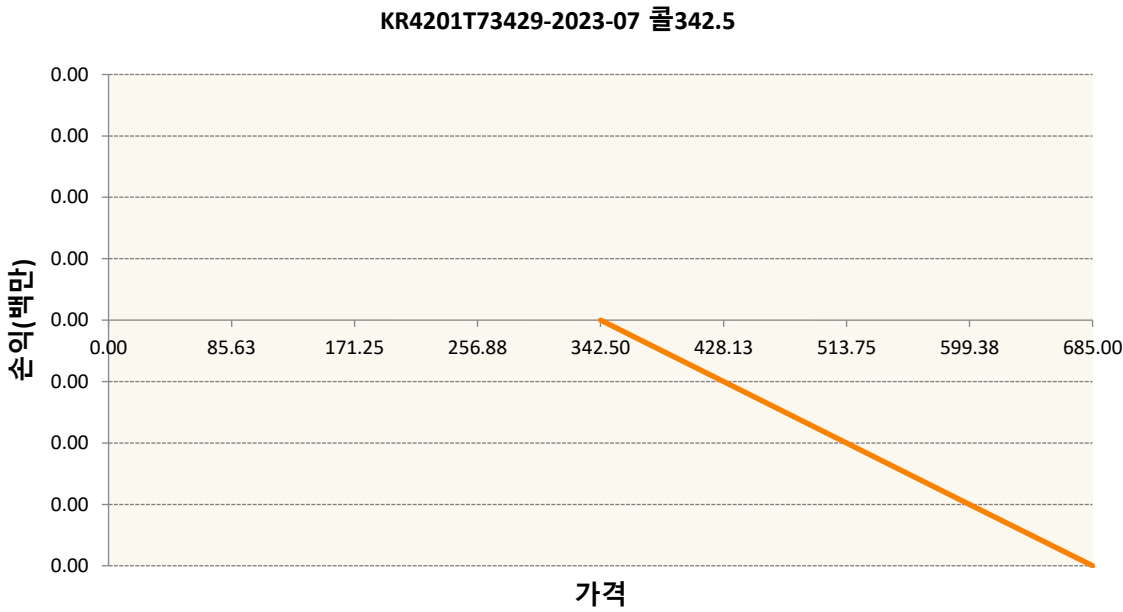
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

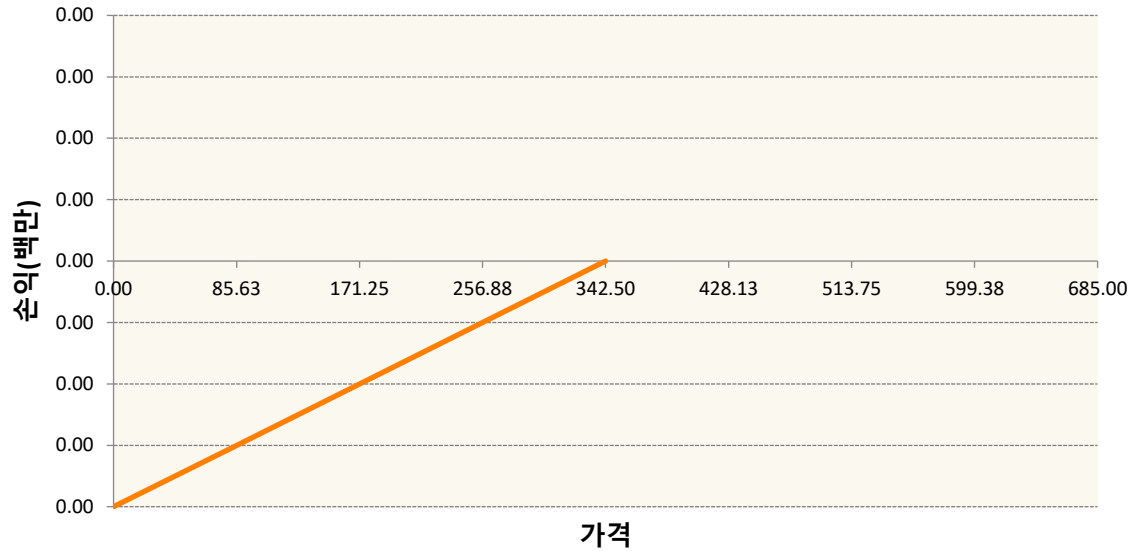
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 54,840 | -54,840   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301T73427-2023-07 풋342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201T73429 |           |         | 2023-07 콜342.5 |        |        |        | 2,433  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 645       | 641     | 635            | 626    | 614    | 598    | 580    |
| -5.33%       | 622       | 605     | 583            | 558    | 529    | 496    | 461    |
| -2.67%       | 511       | 468     | 422            | 374    | 324    | 273    | 220    |
| 0%           | 187       | 125     | 62             | 0      | -63    | -125   | -188   |
| 2.67%        | -434      | -489    | -545           | -603   | -662   | -721   | -781   |
| 5.33%        | -1,305    | -1,335  | -1,370         | -1,409 | -1,451 | -1,496 | -1,542 |
| 8.00%        | -2,306    | -2,317  | -2,333         | -2,352 | -2,376 | -2,403 | -2,433 |
| KR4201T73452 |           |         | 2023-07 콜345   |        |        |        | 315    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 75        | 75      | 74             | 73     | 72     | 70     | 68     |
| -5.33%       | 73        | 71      | 69             | 66     | 62     | 58     | 53     |
| -2.67%       | 62        | 56      | 51             | 44     | 38     | 31     | 24     |
| 0%           | 26        | 17      | 9              | 0      | -9     | -17    | -26    |
| 2.67%        | -48       | -57     | -66            | -74    | -83    | -92    | -101   |
| 5.33%        | -159      | -165    | -171           | -177   | -184   | -191   | -199   |
| 8.00%        | -292      | -295    | -298           | -301   | -306   | -310   | -315   |
| KR4301T73427 |           |         | 2023-07 풋342.5 |        |        |        | 611    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -596      | -597    | -598           | -600   | -603   | -607   | -611   |
| -5.33%       | -352      | -356    | -361           | -367   | -374   | -382   | -390   |
| -2.67%       | -129      | -139    | -150           | -161   | -173   | -185   | -197   |
| 0%           | 44        | 29      | 15             | 0      | -15    | -30    | -44    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 147 | 134 | 121 | 107 | 93  | 79  | 65  |
| 5.33% | 191 | 183 | 175 | 166 | 156 | 146 | 135 |
| 8.00% | 204 | 201 | 197 | 193 | 187 | 181 | 174 |

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

(단위:백만원)

3,446

공시일 2023-06-28

기준일 2023-06-27

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

### 1. 계약금액

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 2. 만기시점의 손익구조

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 6,459 | 0     | 6,459     |    |

### 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 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 4,804 | 0     | 4,804     |    |

### 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 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0      | 0      | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 18,714 | 0      | 18,714    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 25,648 | -25,648   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    | (단위:백만원)                        |
|------------------------------|---------------------------------|
| FXW213D3Q KRW/USD 28-06-23E  | 505                             |
| FXW213D4S( KRW/USD 31-07-23E | 258                             |
| FXW213D5S( KRW/USD 31-08-23E | 680                             |
| FXW213D6D KRW/USD 28-06-23E  | 62                              |
| FXW213D6S( KRW/USD 27-09-23E | 546                             |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 3,591    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

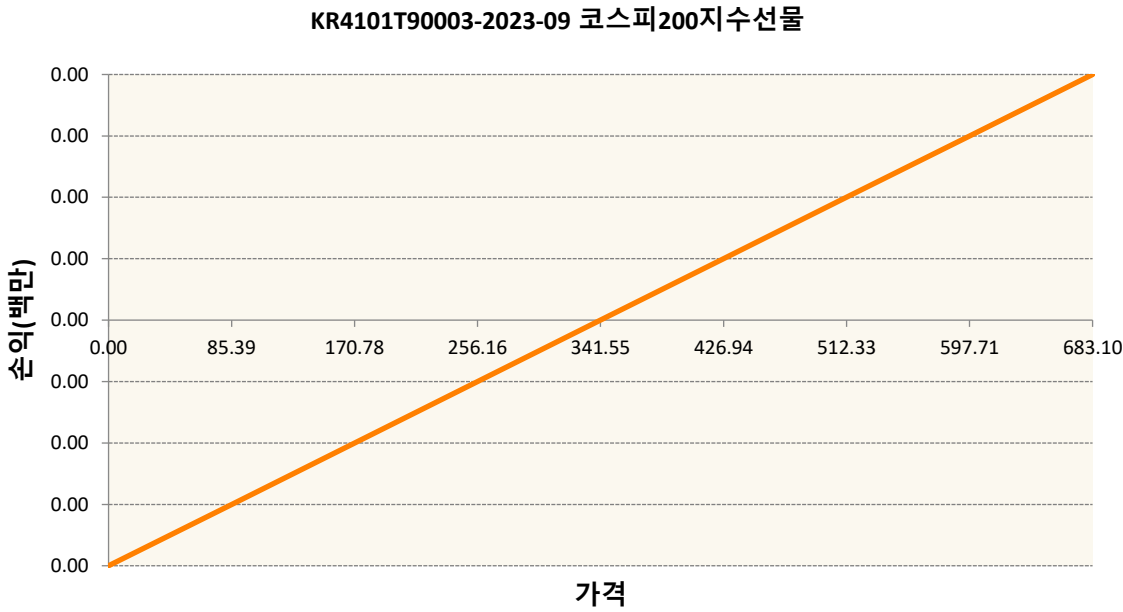
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 598   | 0     | 598       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T90003 |           |         | 2023-09 코스피200지수선물 |     |       |        | 48     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -48       | -48     | -48                | -48 | -48   | -48    | -48    |
| -5.33%       | -32       | -32     | -32                | -32 | -32   | -32    | -32    |
| -2.67%       | -16       | -16     | -16                | -16 | -16   | -16    | -16    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 16        | 16      | 16                 | 16  | 16    | 16     | 16     |
| 5.33%        | 32        | 32      | 32                 | 32  | 32    | 32     | 32     |
| 8.00%        | 48        | 48      | 48                 | 48  | 48    | 48     | 48     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

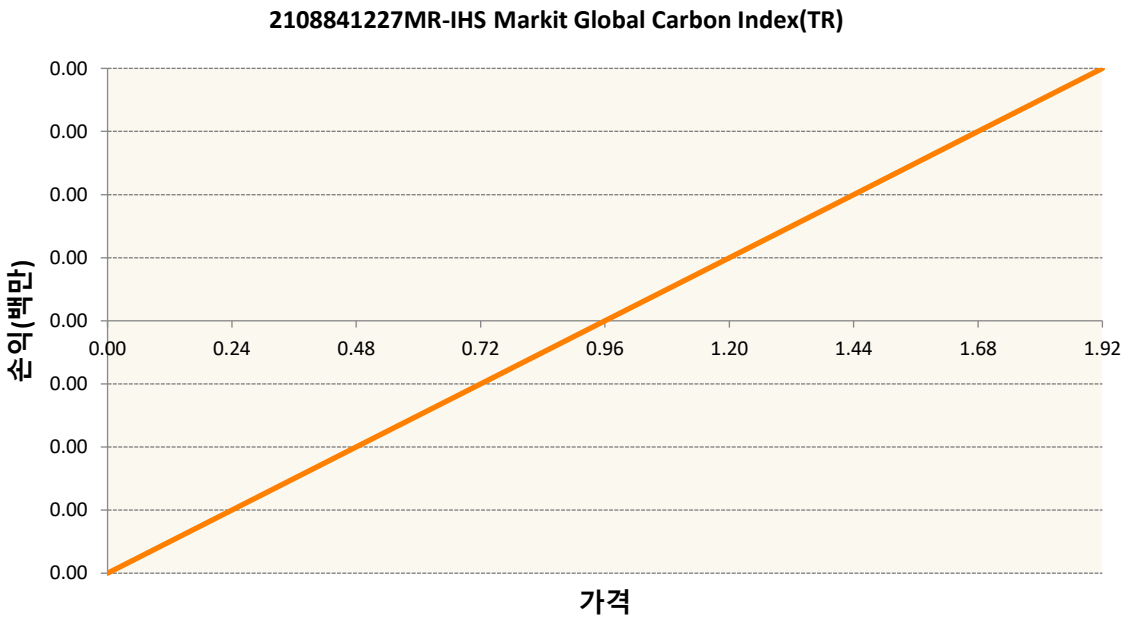
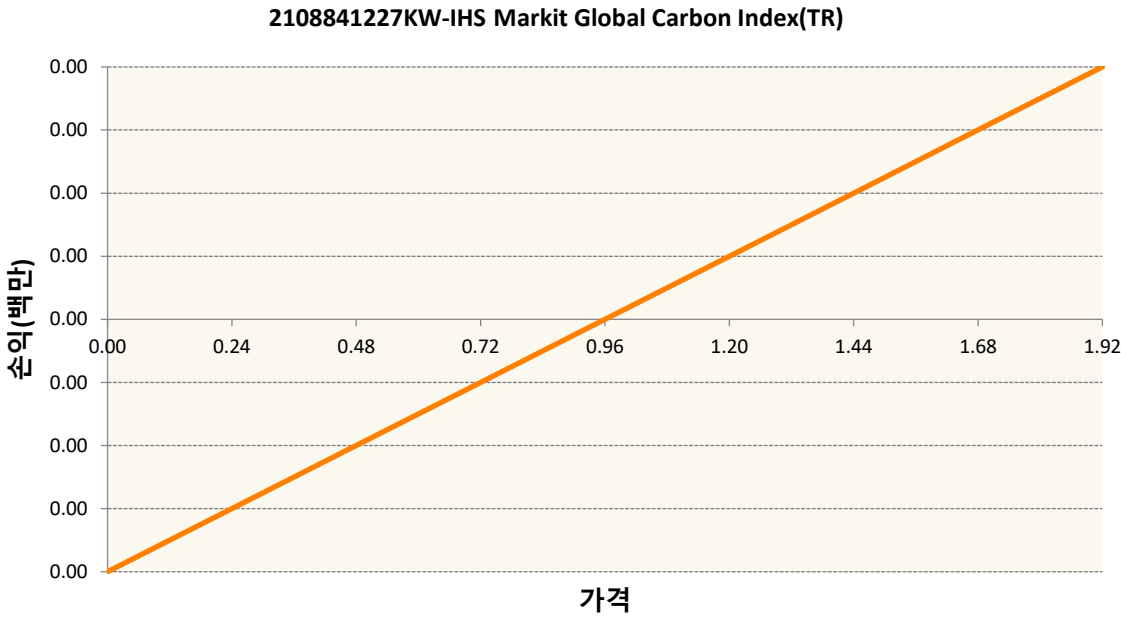
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

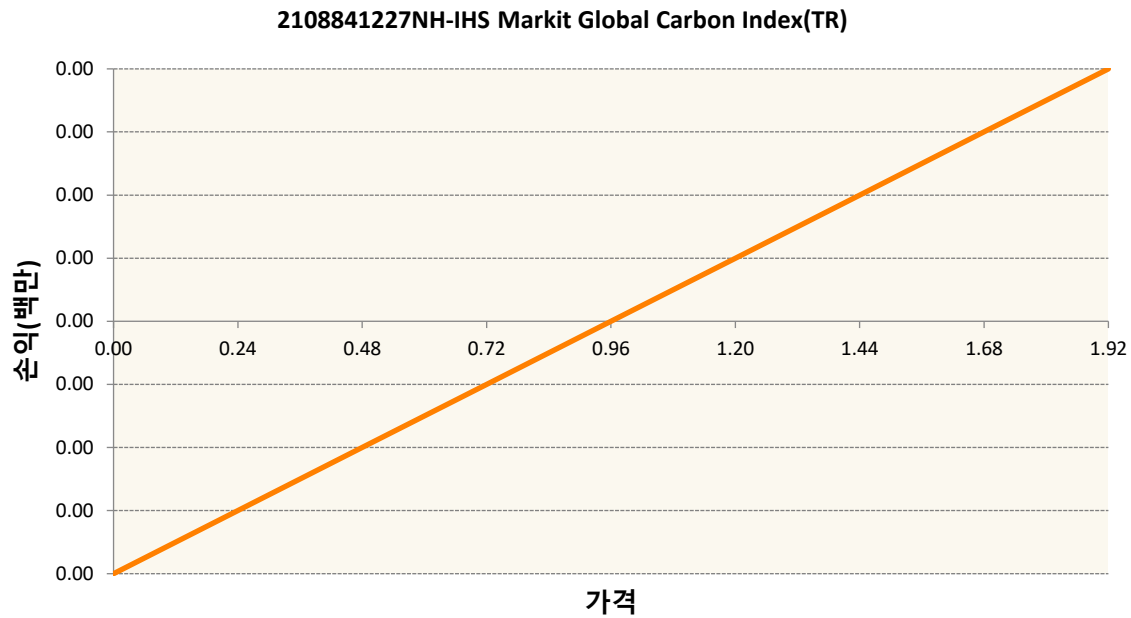
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 25,222 | 0     | 25,222    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                    |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------|--|----------|
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 1,720    |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 202      |
| 2108841227IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 101      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 3,267    |

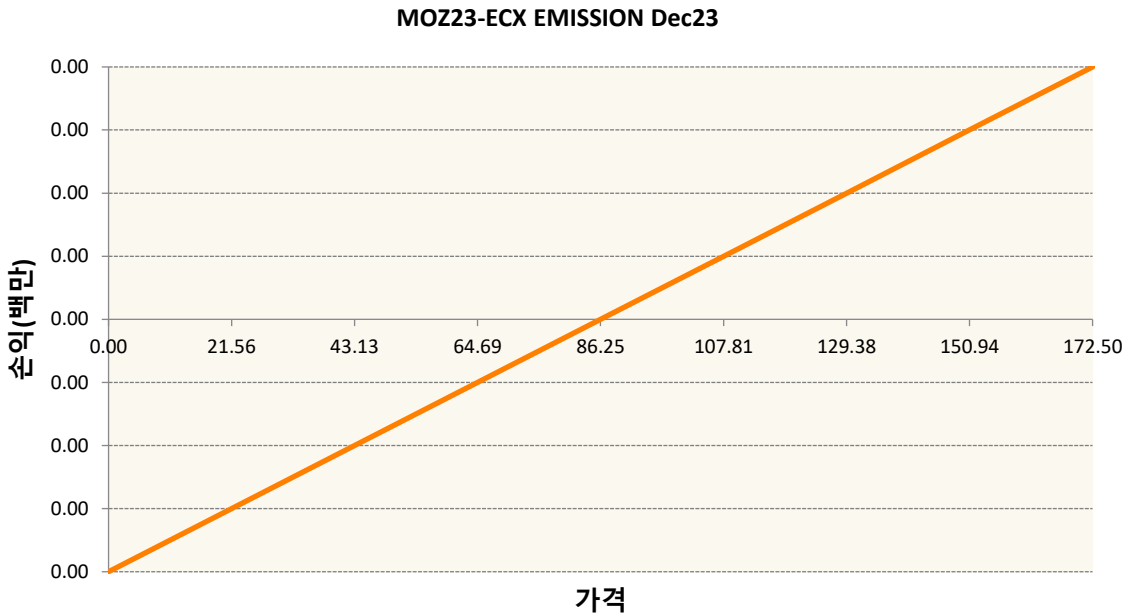
|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액 (단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,720 | 0     | 8,720     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 569   | 3,024 | -2,456    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------|--|----------|
| FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E |  | 40       |
| FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E |  | 45       |
| FXW213D5S(KRW/EUR 30-06-23E |  | 68       |
| FXW213D6D KRW/EUR 30-06-23E |  | 42       |
| FXW213D6F(KRW/EUR 30-06-23E |  | 47       |
| FXW213D6S(EUR/KRW 30-06-23E |  | 45       |
| MOZ23 ECX EMISSION Dec23    |  | 698      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,356    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 7,901 | 0     | 7,901     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                     |     |
|-------------------------------------|-----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (NH)  | 0.1 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)  | 0.1 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)  | 0.1 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠) | 0.1 |

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

(단위:백만원)

|   |
|---|
| 1 |
|---|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

## SOL차이나육성산업액티브상장지

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 7,540 | 0     | 7,540     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |   |
|-----------------------------------------|---|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(NH)  | 3 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(메리츠) | 4 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(미래)  | 3 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230427(키움)  | 1 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 16 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

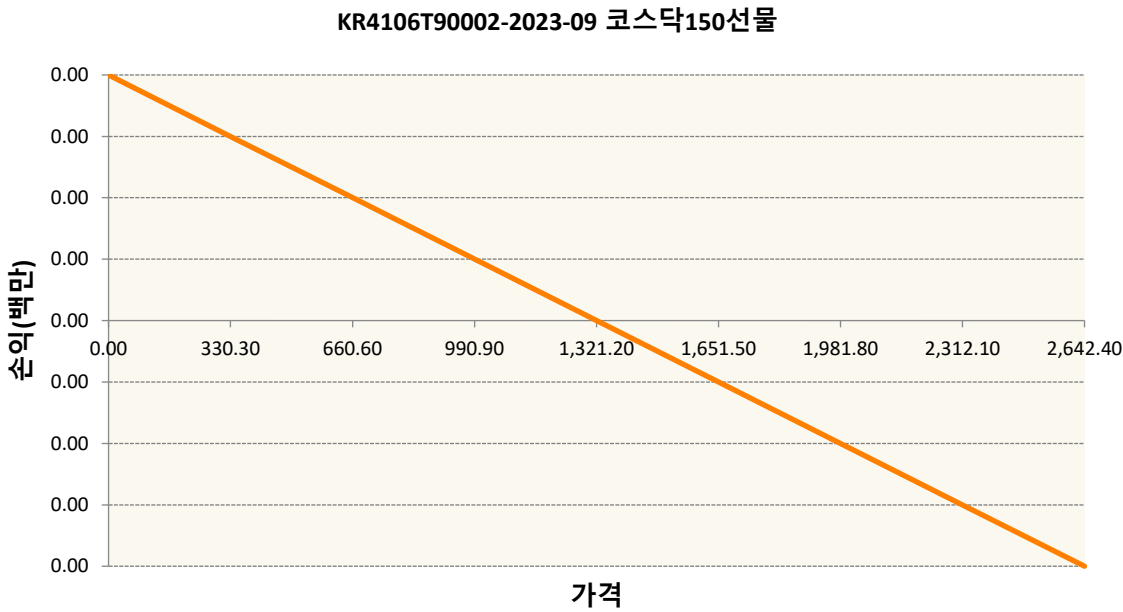
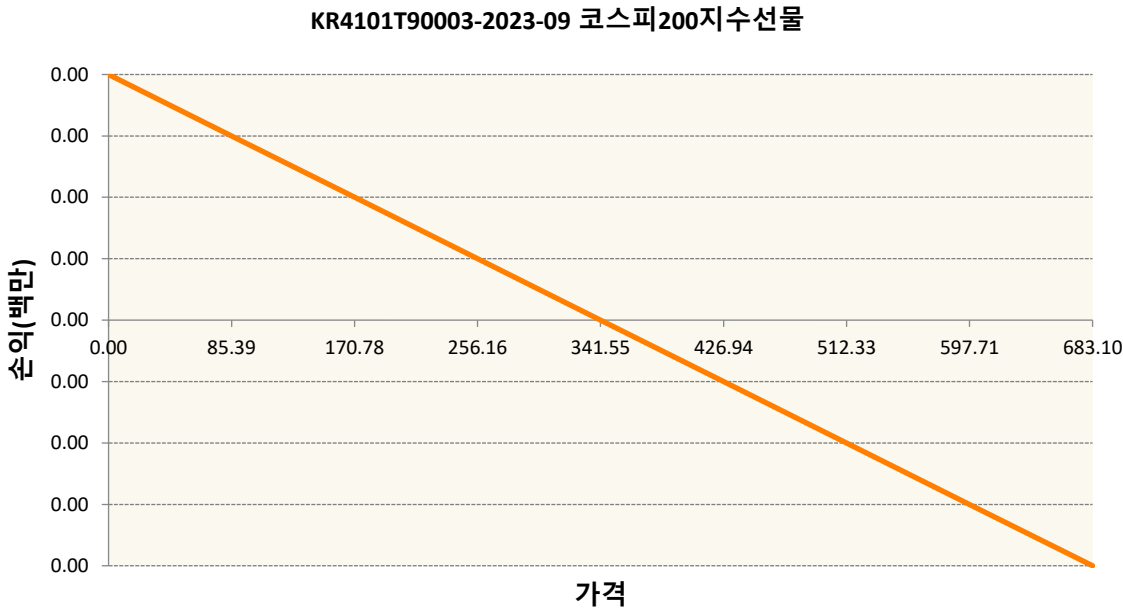
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

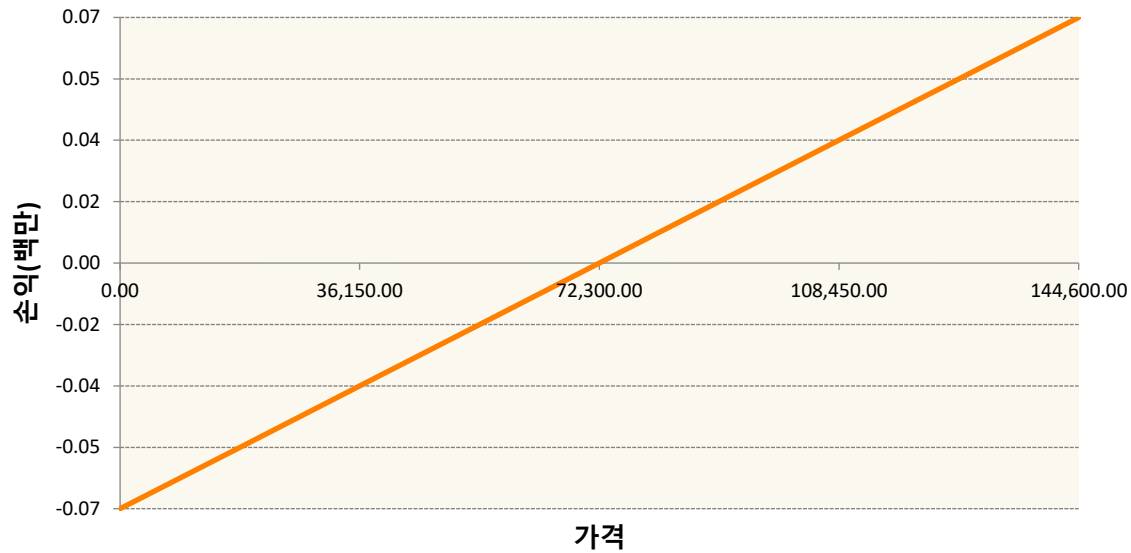
(단위:백만원)

| 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   | 389   | 3,165 | -2,776    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |

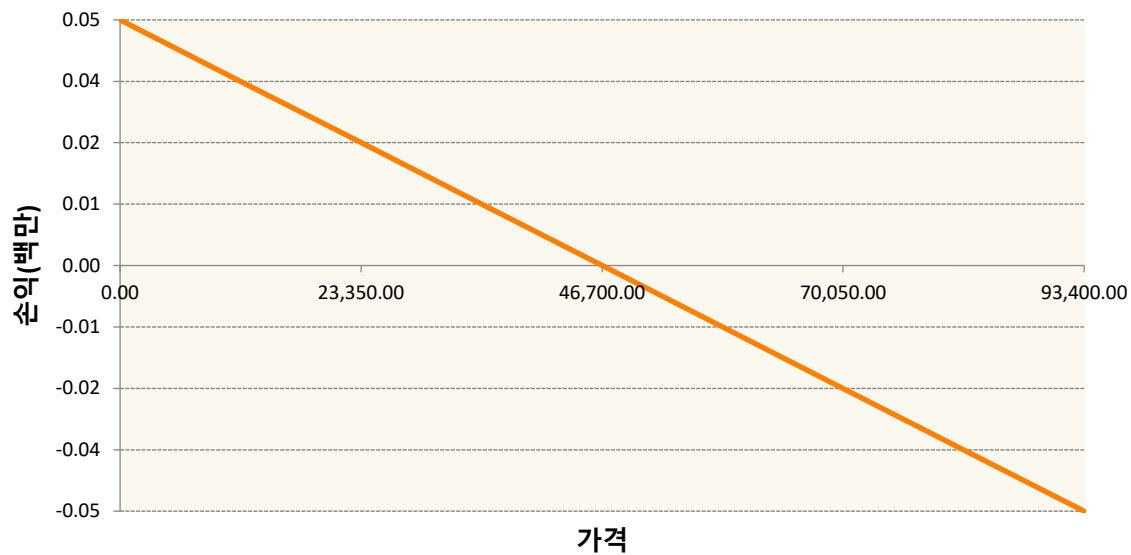
### 2. 만기시점의 손익구조



KR4111T70004-2023-07 삼성전자개별선물



KR41F7T70006-2023-07 카카오페이개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |      |
|---------------------------------------|------|
| KR4101T900 2023-09 코스피200지수선물         | 137  |
| KR4106T900 2023-09 코스닥150선물           | 111  |
| KR4111T700 2023-07 삼성전자개별선물           | 31   |
| KR41F7T700 2023-07 카카오페이개별선물          | 6    |
| KRS0004099 SWAP_MICRON TECH_0308      | 0.48 |
| KRS0004212 SWAP_SPDR S&P BIOTECH_0413 | 1    |

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

(단위:백만원)

461

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

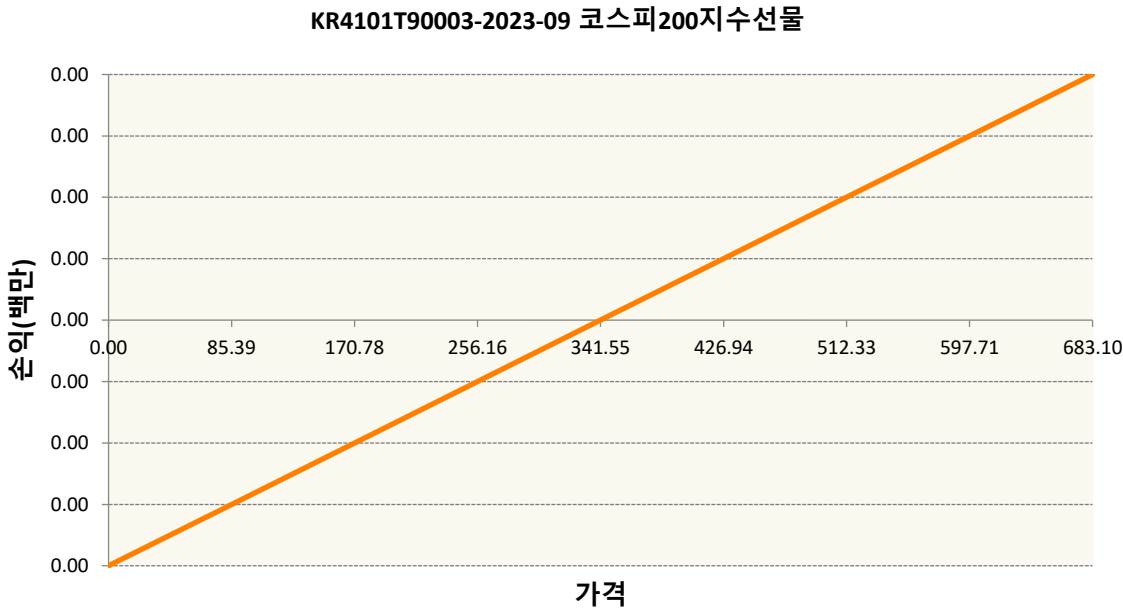
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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   | 256   | 0     | 256       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101T90003 |           |         | 2023-09 코스피200지수선물 |     |       |        | 20     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -20       | -20     | -20                | -20 | -20   | -20    | -20    |
| -5.33%       | -14       | -14     | -14                | -14 | -14   | -14    | -14    |
| -2.67%       | -7        | -7      | -7                 | -7  | -7    | -7     | -7     |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 7         | 7       | 7                  | 7   | 7     | 7      | 7      |
| 5.33%        | 14        | 14      | 14                 | 14  | 14    | 14     | 14     |
| 8.00%        | 20        | 20      | 20                 | 20  | 20    | 20     | 20     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

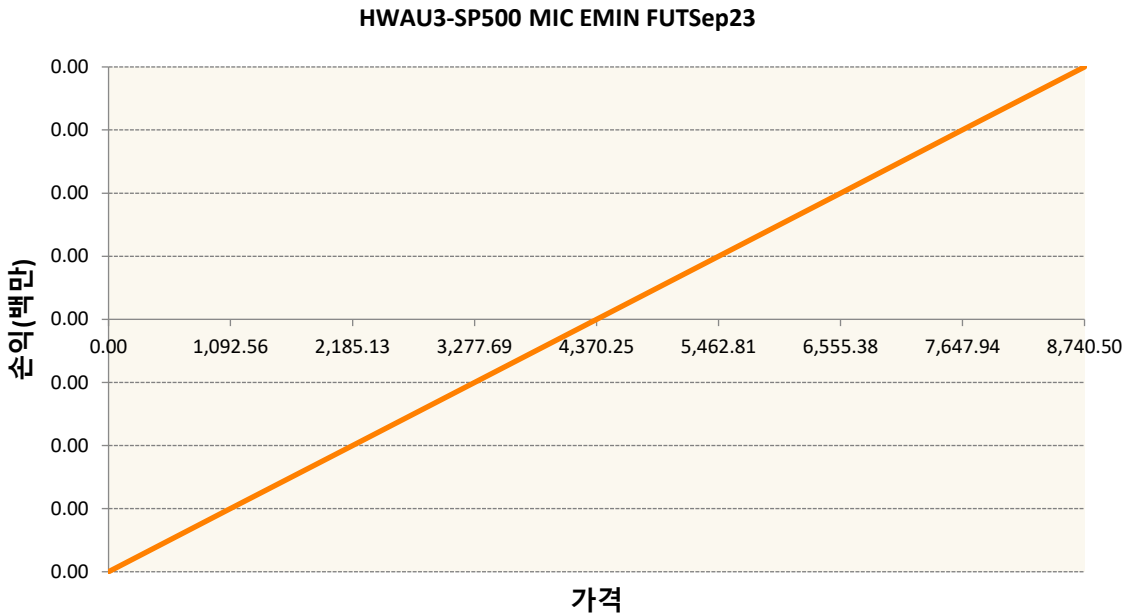
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 839   | 0     | 839       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |    |
|-------|-------------------------|----|
| HWAU3 | SP500 MIC EMIN FUTSep23 | 67 |
|-------|-------------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 108 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

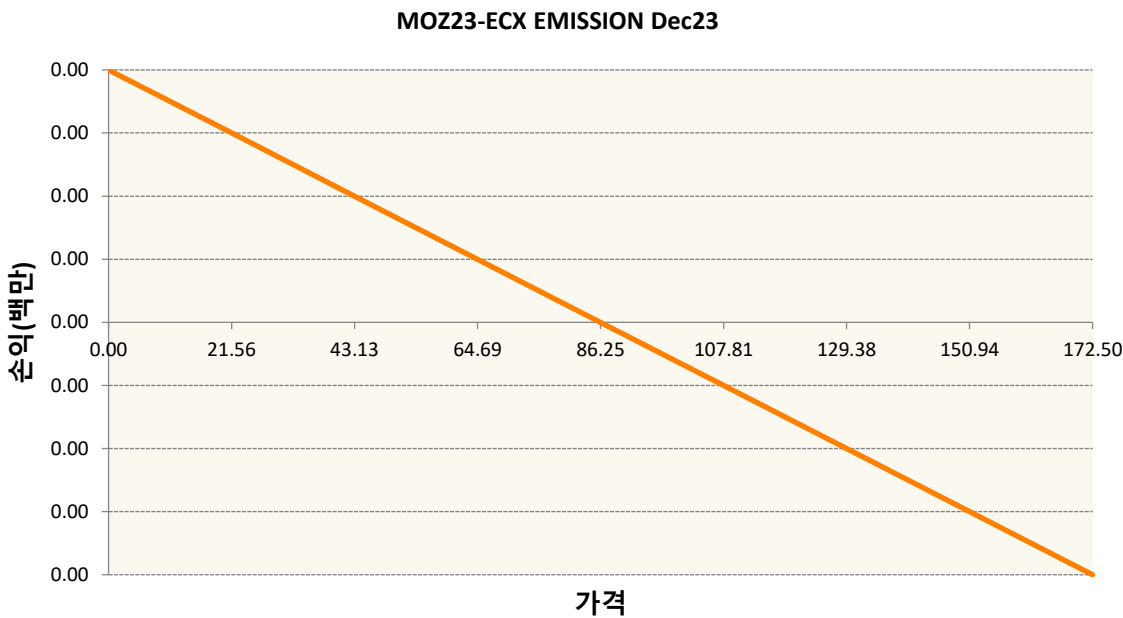
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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   | 0     | 9,087 | -9,087    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,274 | -2,274    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| FXW213D6E(KRW/EUR 30-06-23E)  | 182 |
| MOZ23      ECX EMISSION Dec23 | 727 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,319 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-06-28 |
| 기준일 | 2023-06-27 |

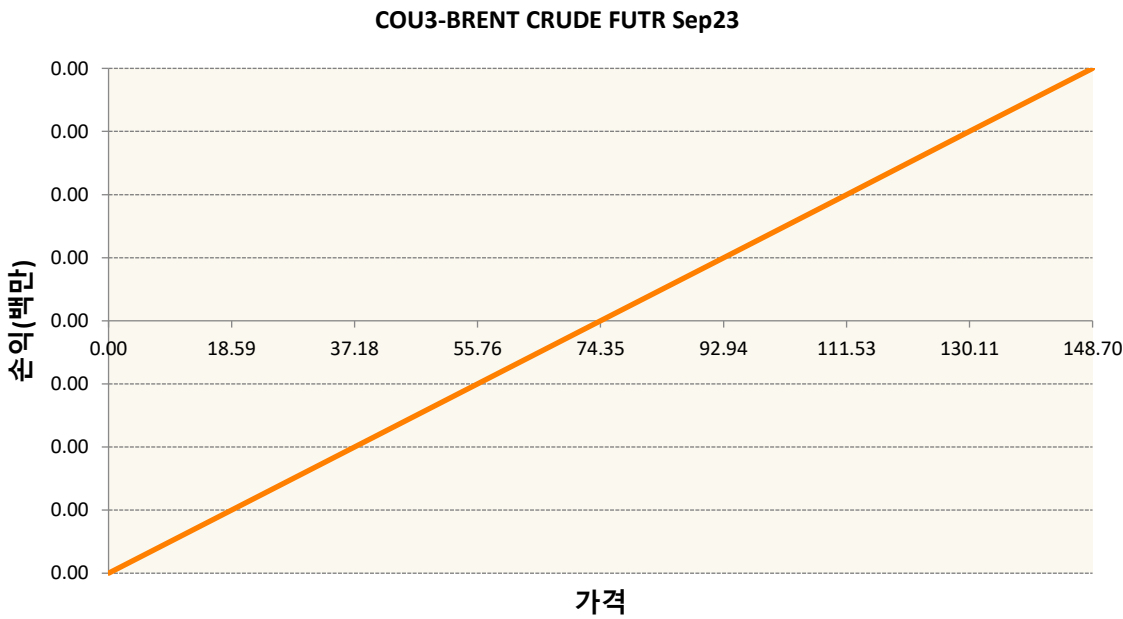
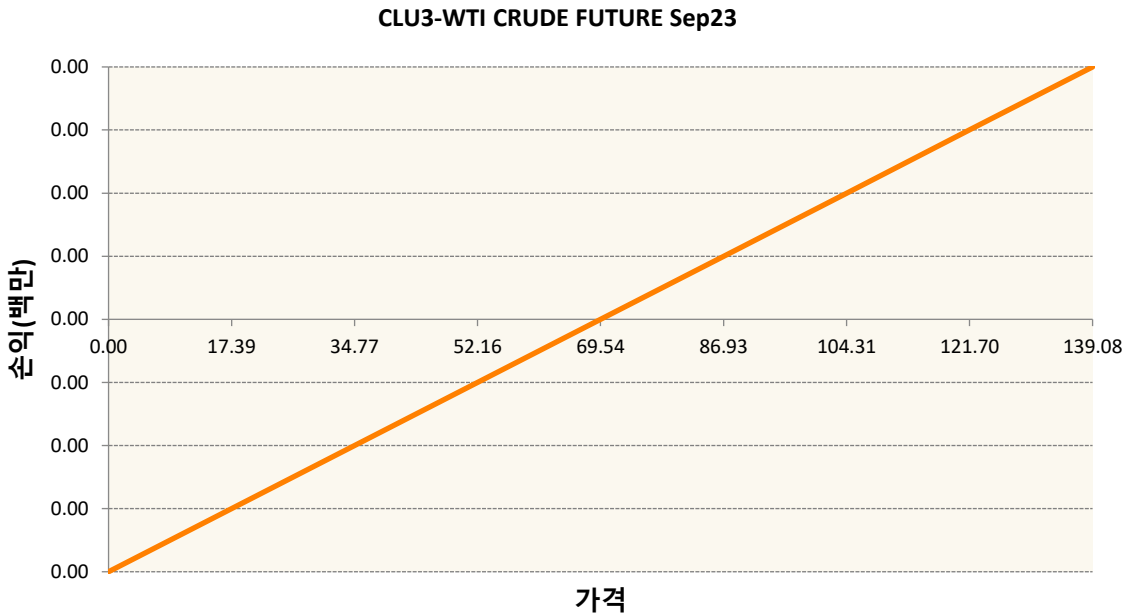
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

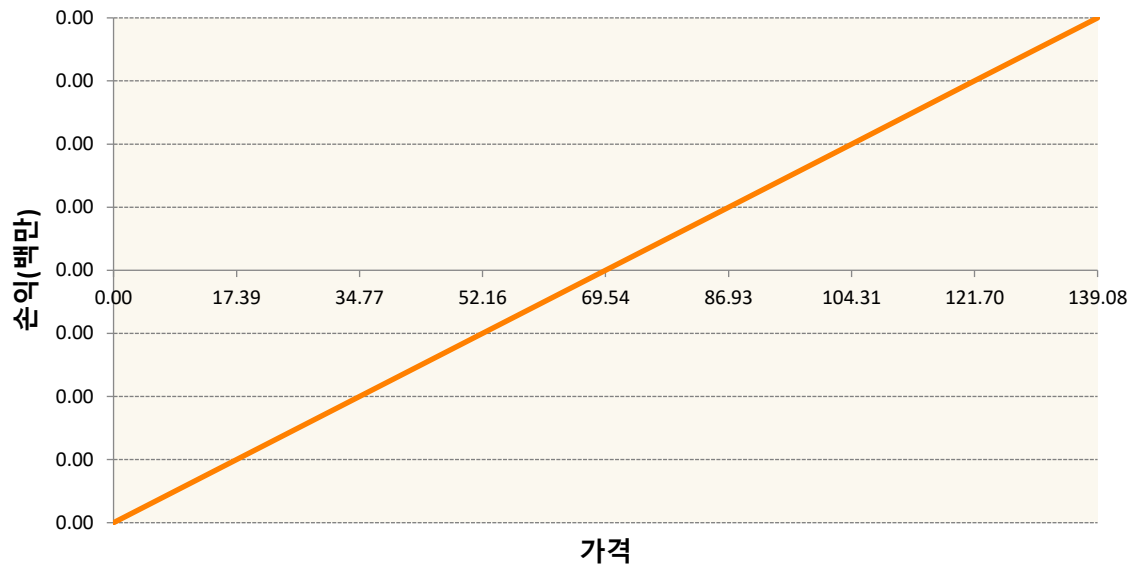
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,291 | 195   | 1,096     |    |

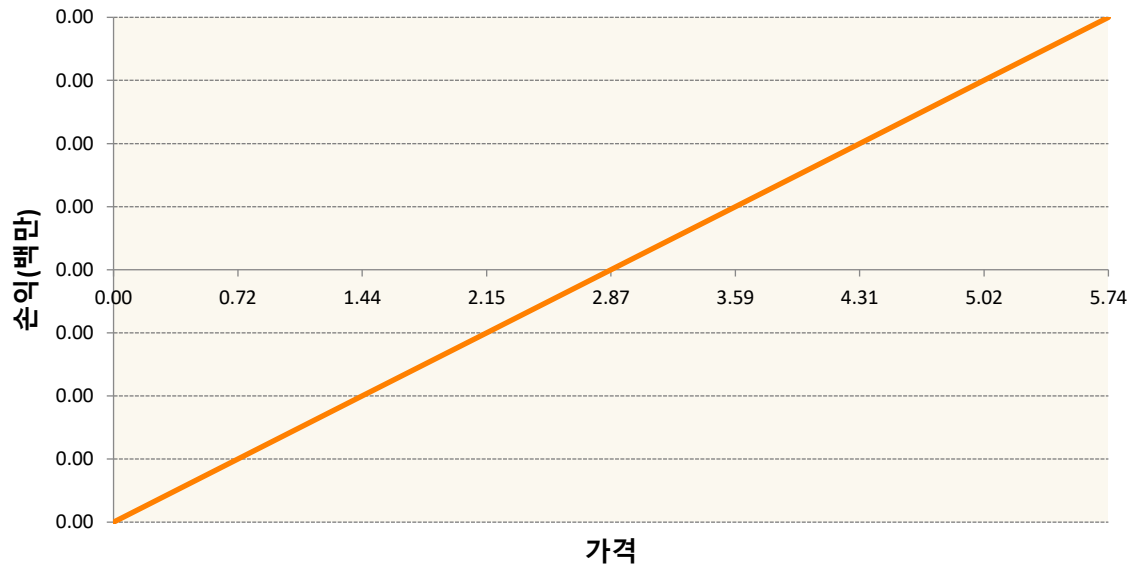
### 2. 만기시점의 손익구조



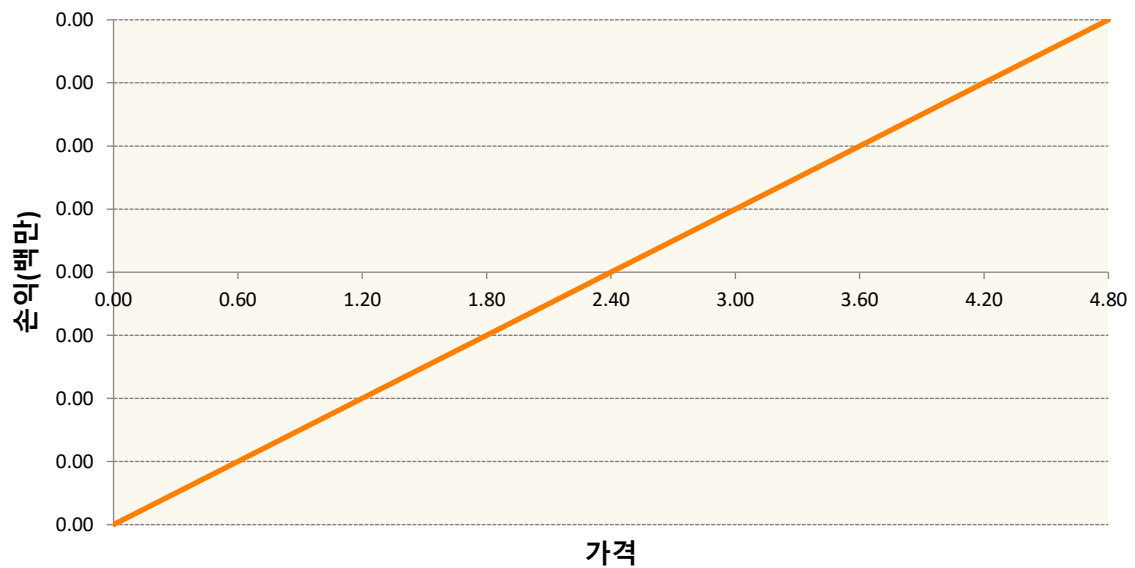
ECU3-E-mini Crude Oil Sep23



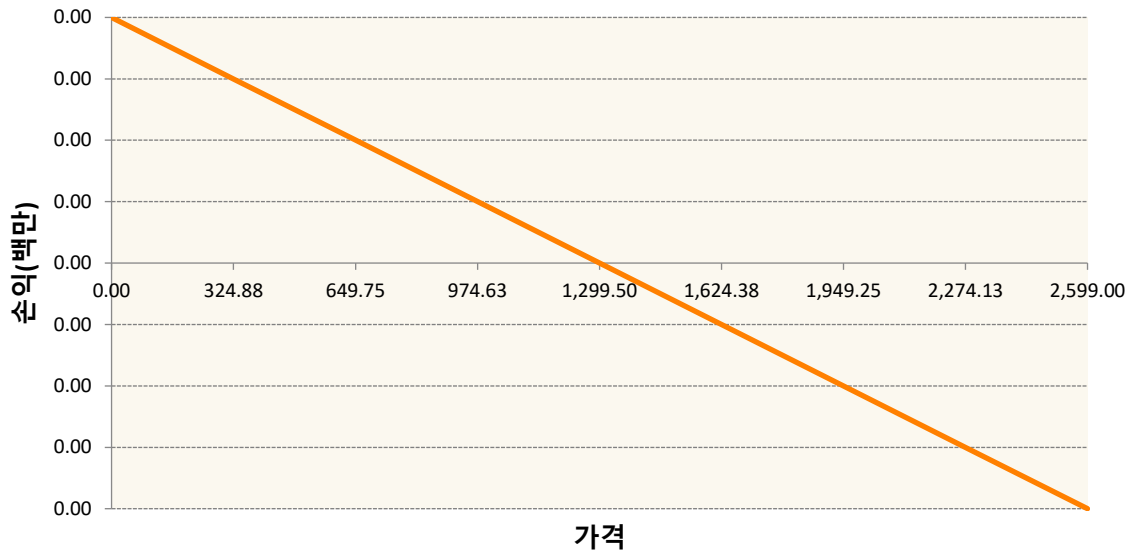
EOU3-E-MINI NATURAL GAS Sep23



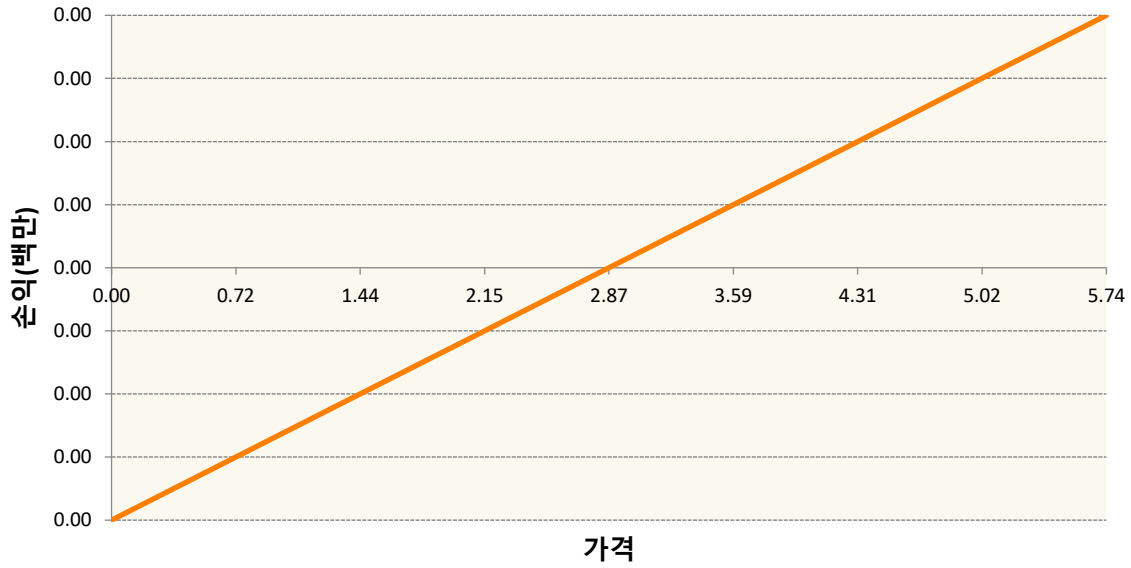
HOU3-NY Harb ULSD Fut Sep23



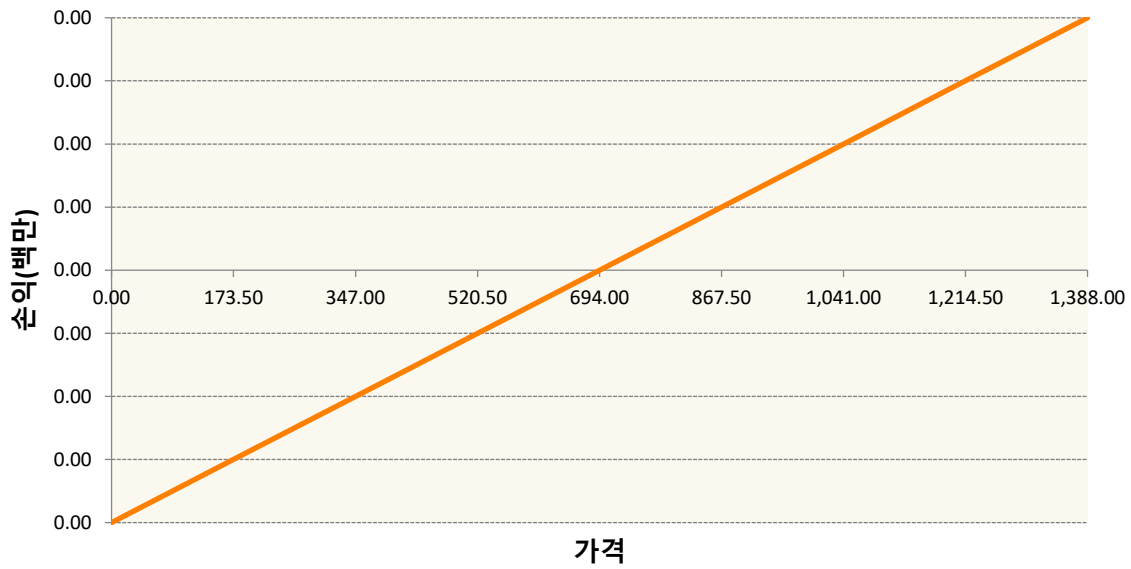
KR4175T70009-2023-07 달러선물

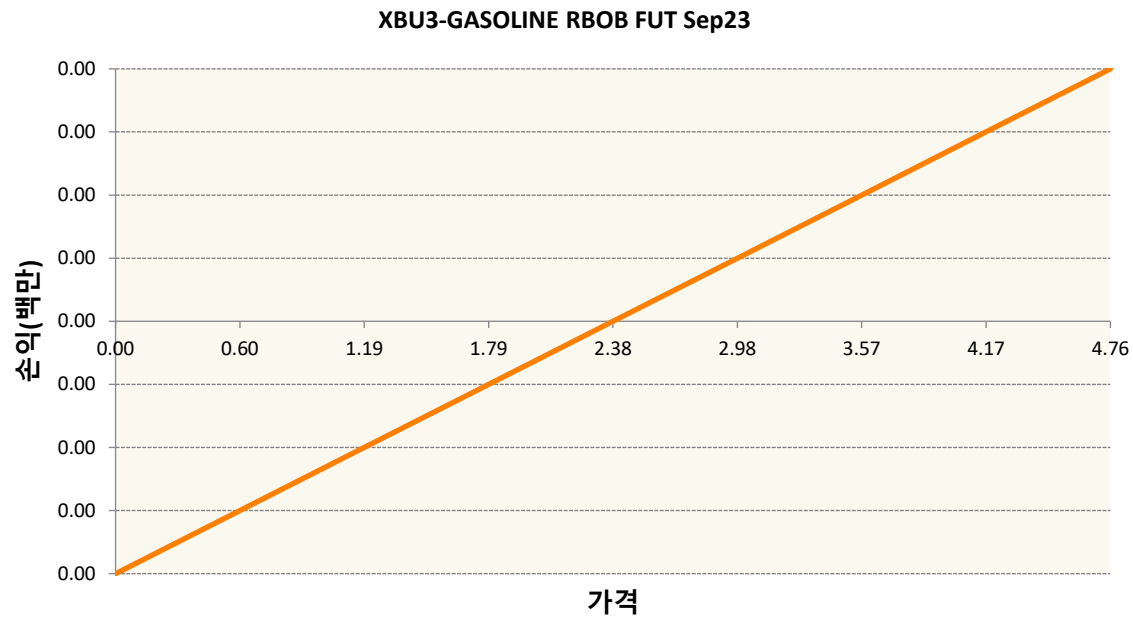


NGU23-NATURAL GAS FUTR Sep23



QSU3-Low Su Gasoil G Sep23





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| CLU3                      | WTI CRUDE FUTURE Sep23   | 21       |
| COU3                      | BRENT CRUDE FUTR Sep23   | 24       |
| ECU3                      | E-mini Crude Oil Sep23   | 4        |
| EOU3                      | E-MINI NATURAL GAS Sep23 | 3        |
| HOU3                      | NY Harb ULSD Fut Sep23   | 10       |
| KR4175T700 2023-07 달러선물   |                          | 16       |
| NGU23                     | NATURAL GAS FUTR Sep23   | 24       |
| QSU3                      | Low Su Gasoil G Sep23    | 7        |
| XBU3                      | GASOLINE RBOB FUT Sep23  | 10       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 192      |