

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

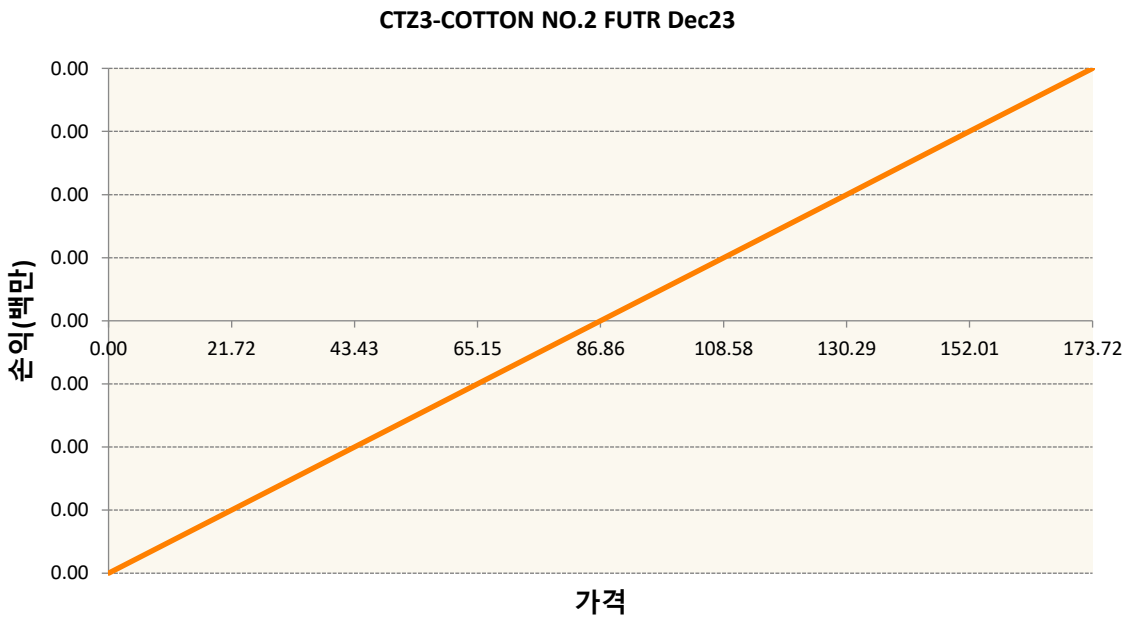
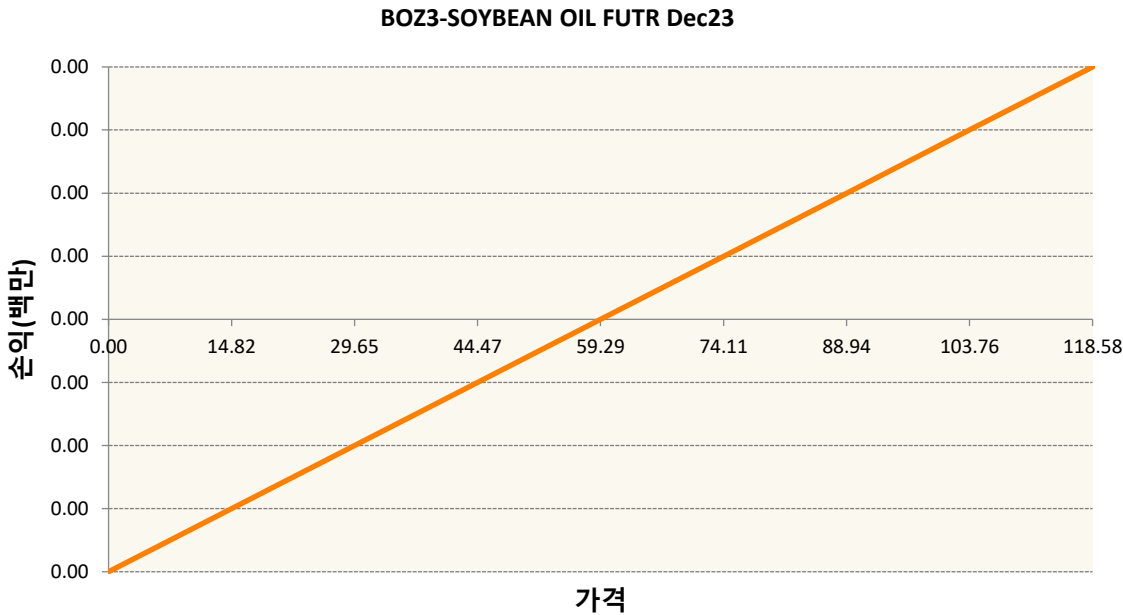
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

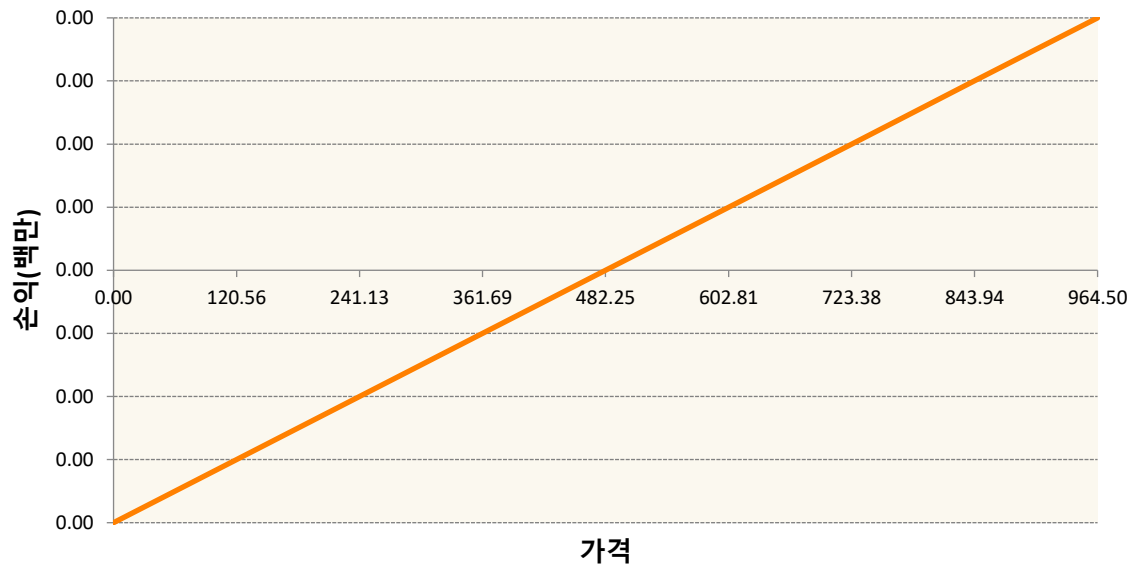
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 4,988 | 0     | 4,988     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 549   | -549      | 장내 |

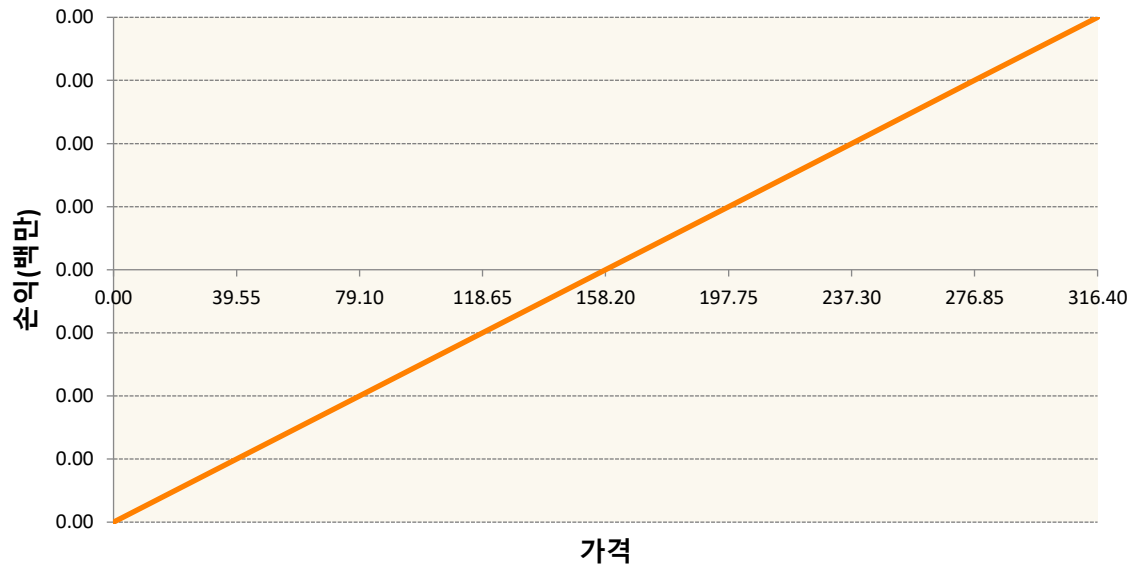
### 2. 만기시점의 손익구조



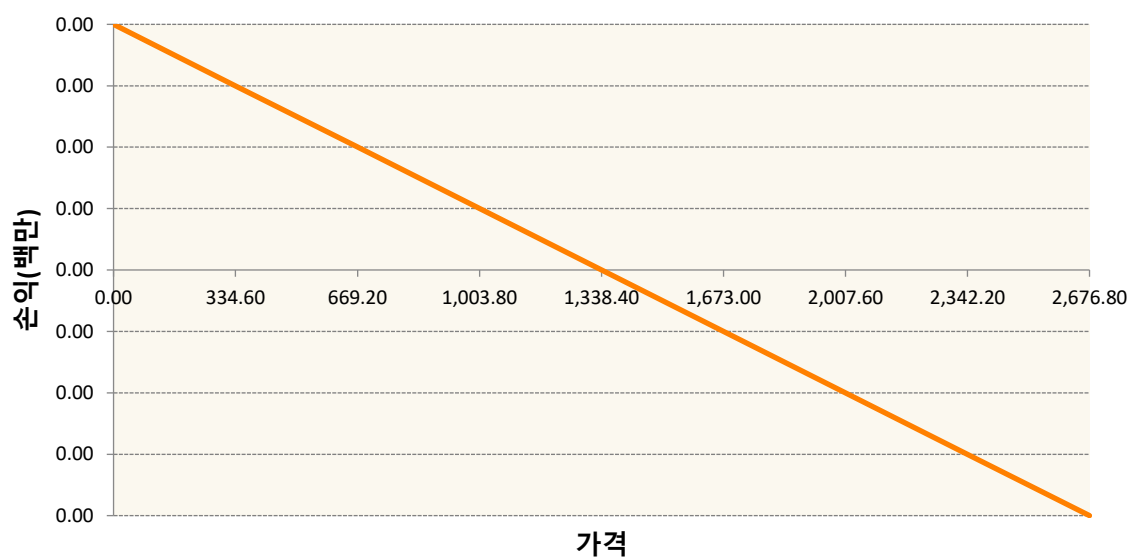
CZ3-CORN FUTURE Dec23



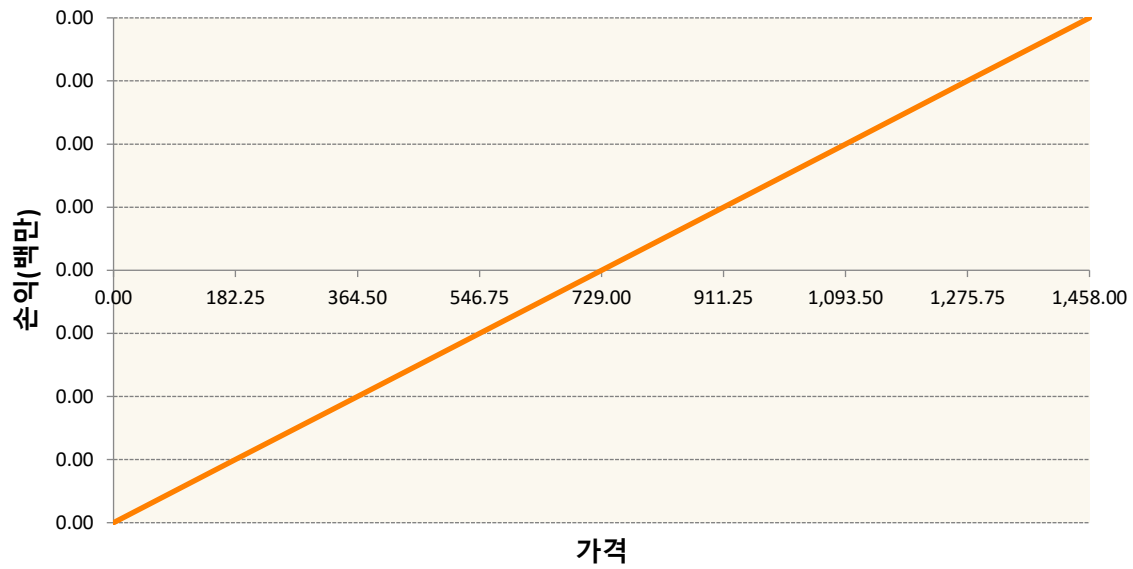
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



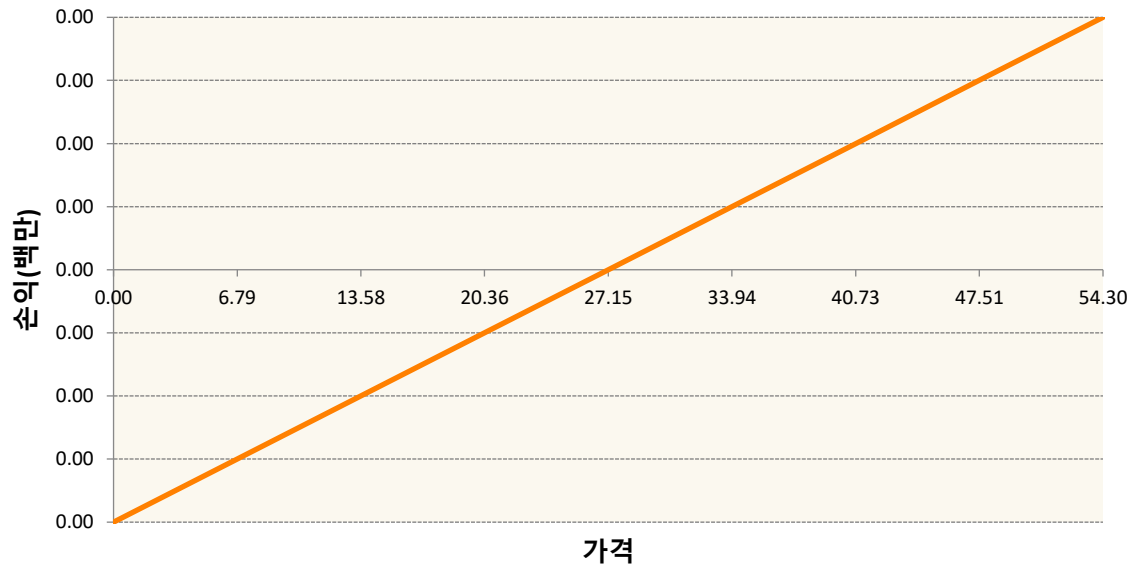
KR4175TA0001-2023-10 달러선물



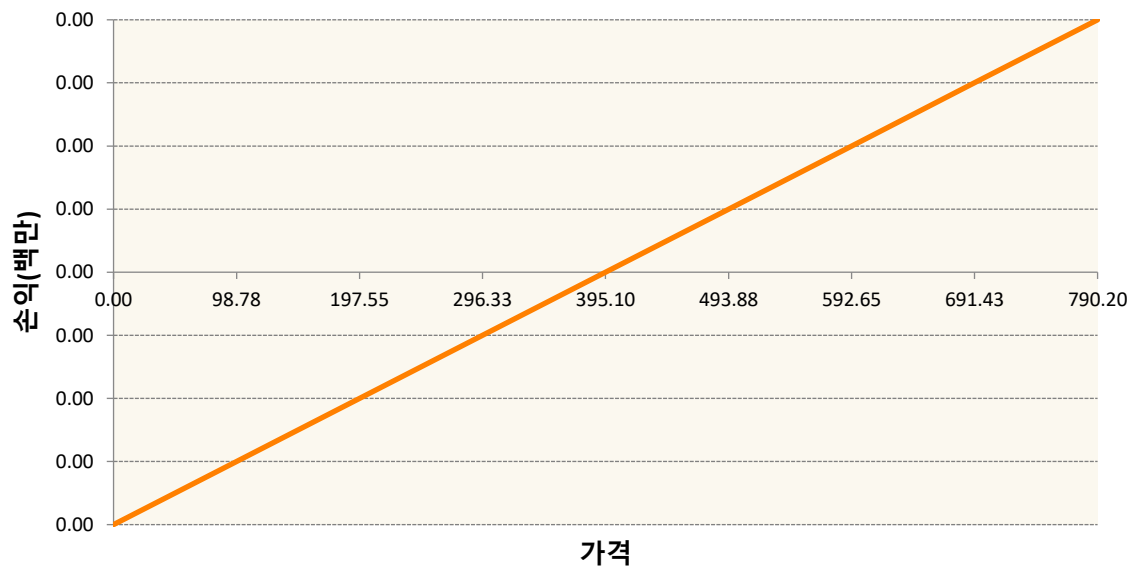
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23



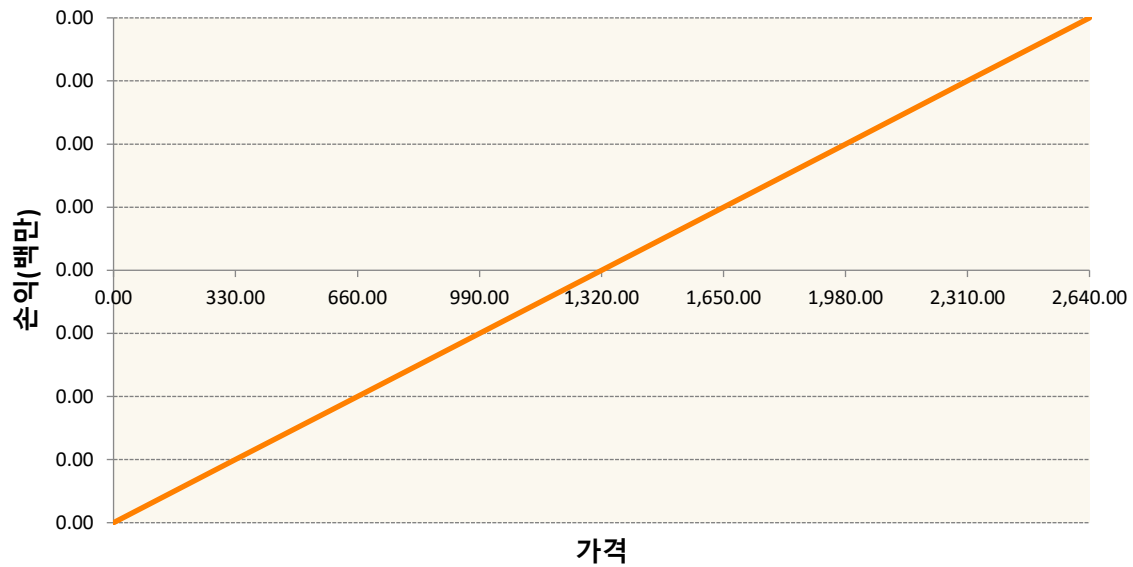
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



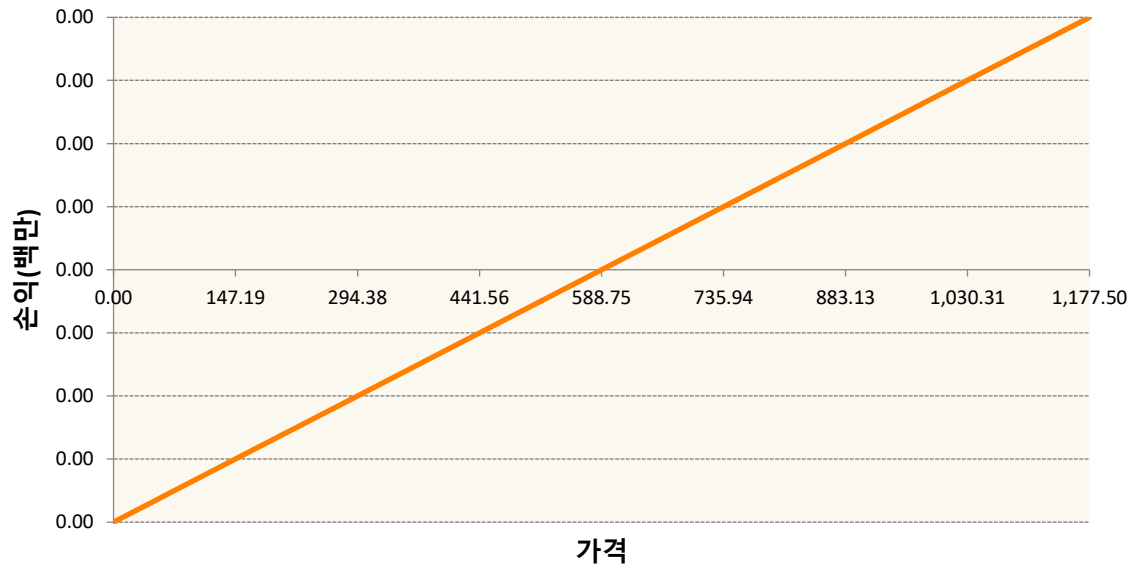
SMZ3-SOYBEAN MEAL FUTR Dec23



SX3-SOYBEAN FUTURE Nov23



WZ3-WHEAT FUTURE(CBT) 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 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

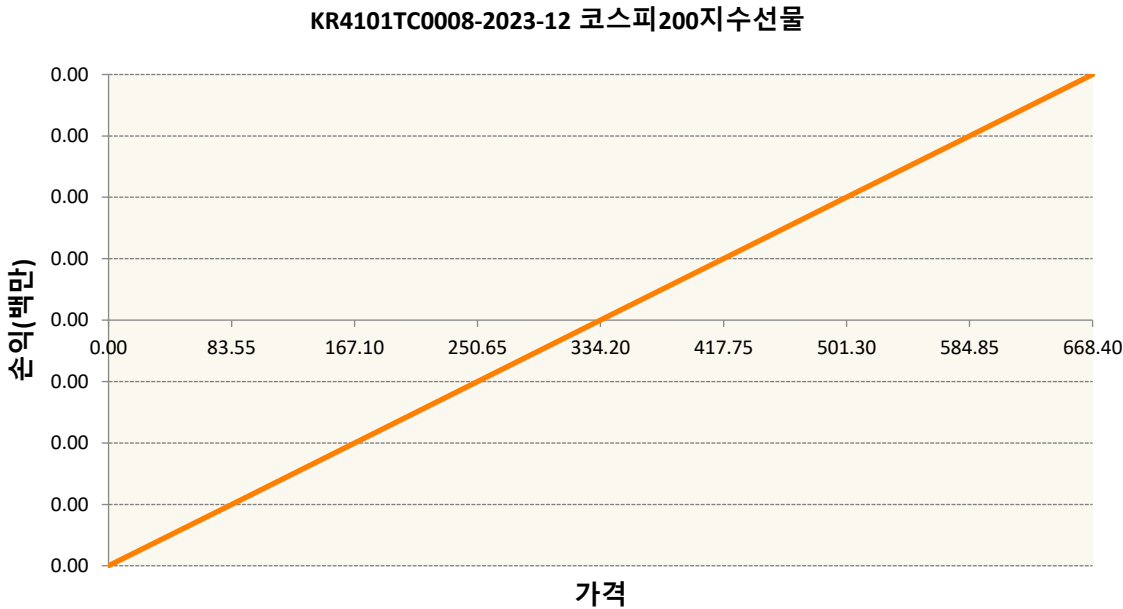
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,170 | 0     | 1,170     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 코스피200지수선물 |     |       |        | 93     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -93       | -93     | -93                | -93 | -93   | -93    | -93    |
| -5.33%       | -62       | -62     | -62                | -62 | -62   | -62    | -62    |
| -2.67%       | -31       | -31     | -31                | -31 | -31   | -31    | -31    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 31        | 31      | 31                 | 31  | 31    | 31     | 31     |
| 5.33%        | 62        | 62      | 62                 | 62  | 62    | 62     | 62     |
| 8.00%        | 93        | 93      | 93                 | 93  | 93    | 93     | 93     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

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

315

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

315

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

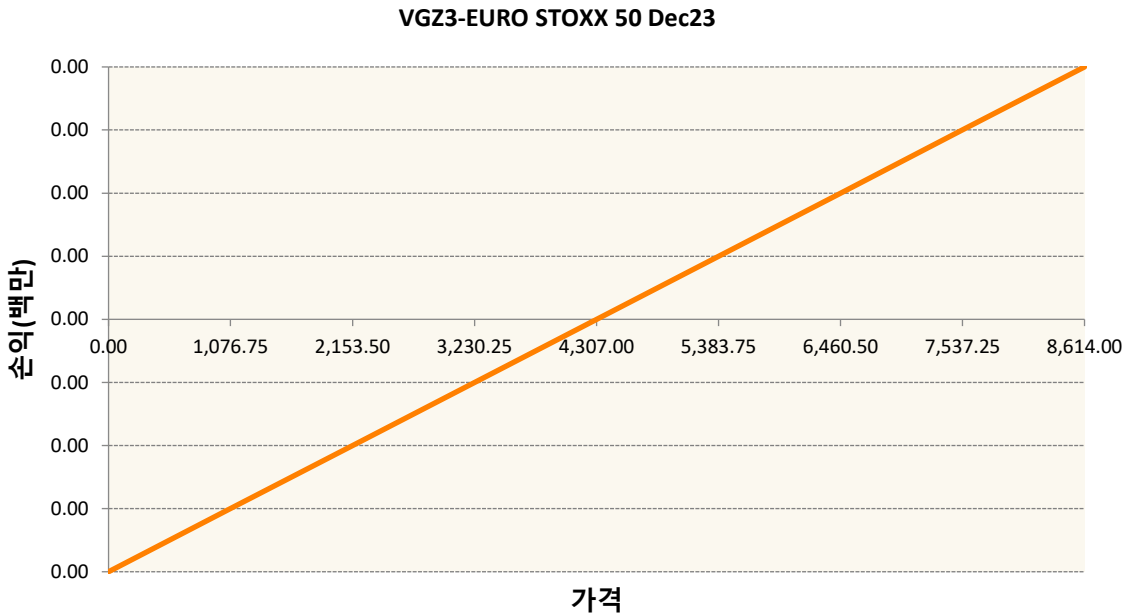
유로인덱스모(주식-파생형)

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   | 980   | 0     | 980       |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 214   | 0     | 214       | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |                     |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------|---------------------|--|----------|
| FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E |                     |  | 17       |
| VGZ3                        | EURO STOXX 50 Dec23 |  | 78       |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

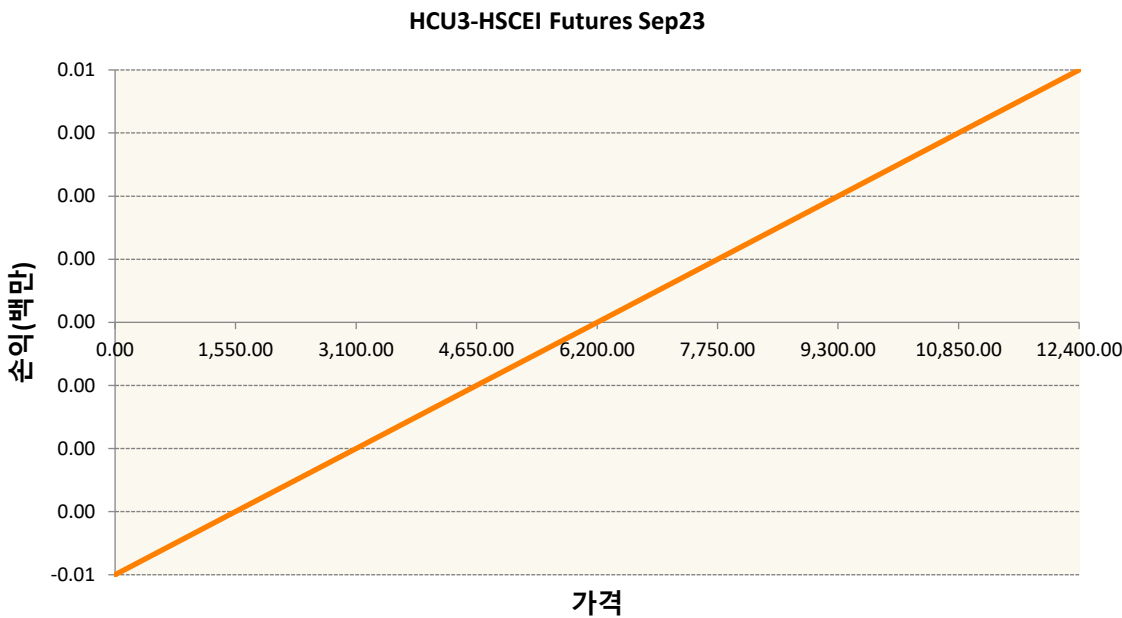
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,149 | 0     | 1,149     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCU3 | HSCEI Futures Sep23 | 92 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

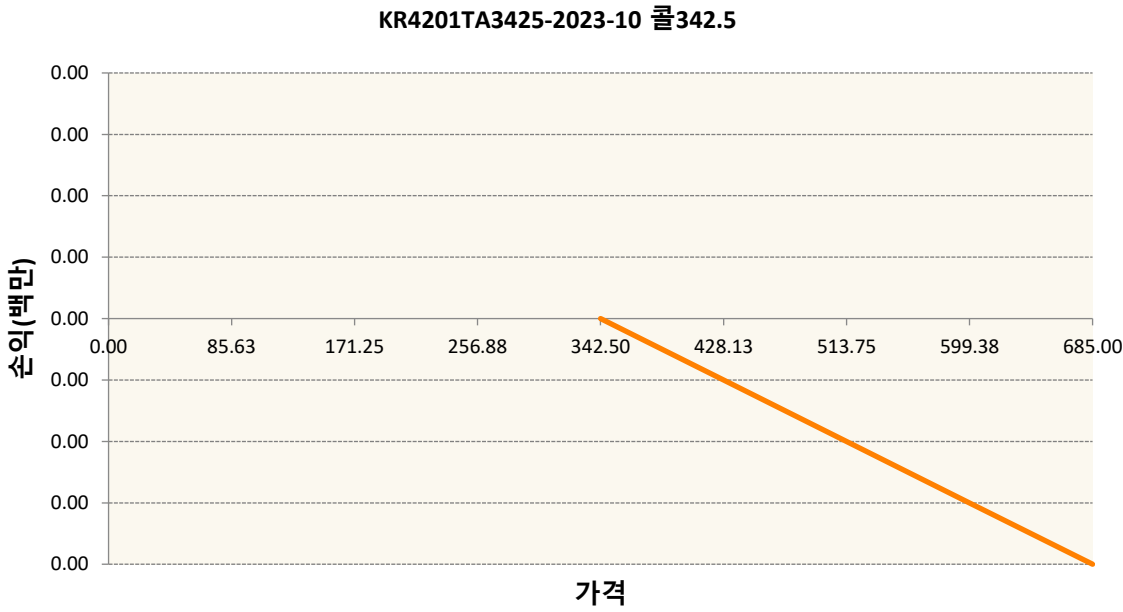
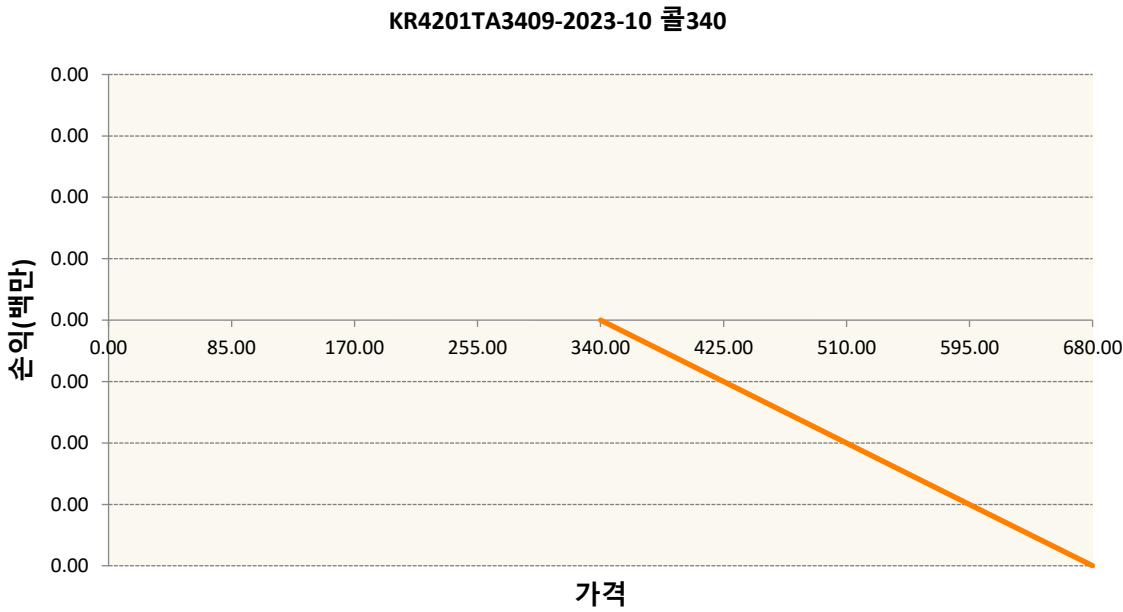
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

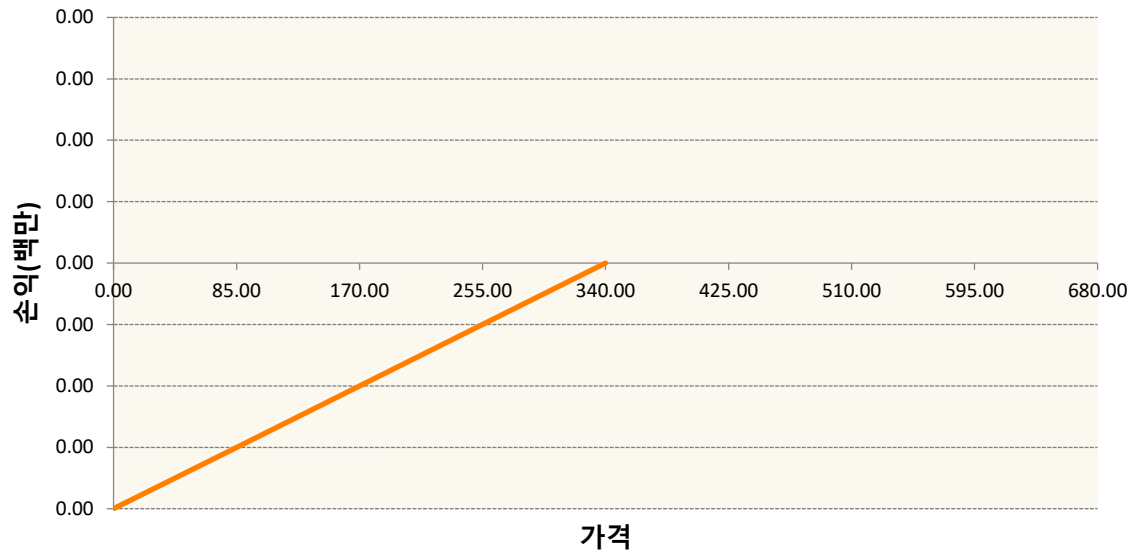
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 53,908 | -53,908   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301TA3408-2023-10 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201TA3409 |           | 2023-10 콜340   |        |        |        |        | 1,023  |
|--------------|-----------|----------------|--------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 239       | 238            | 235    | 231    | 225    | 218    | 209    |
| -5.33%       | 232       | 225            | 216    | 205    | 192    | 177    | 161    |
| -2.67%       | 197       | 179            | 159    | 138    | 115    | 91     | 66     |
| 0%           | 91        | 61             | 31     | 0      | -31    | -63    | -94    |
| 2.67%        | -130      | -164           | -197   | -231   | -264   | -297   | -331   |
| 5.33%        | -476      | -501           | -528   | -556   | -585   | -614   | -644   |
| 8.00%        | -910      | -924           | -940   | -958   | -978   | -1,000 | -1,023 |
| KR4201TA3425 |           | 2023-10 콜342.5 |        |        |        |        | 1,279  |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 94        | 94             | 94     | 94     | 94     | 94     | 93     |
| -5.33%       | 94        | 94             | 93     | 93     | 91     | 89     | 86     |
| -2.67%       | 91        | 88             | 84     | 78     | 70     | 61     | 50     |
| 0%           | 52        | 36             | 19     | 0      | -20    | -41    | -63    |
| 2.67%        | -147      | -175           | -203   | -231   | -258   | -286   | -314   |
| 5.33%        | -606      | -623           | -643   | -663   | -685   | -707   | -730   |
| 8.00%        | -1,227    | -1,231         | -1,238 | -1,245 | -1,255 | -1,266 | -1,279 |
| KR4301TA3408 |           | 2023-10 풋340   |        |        |        |        | 657    |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -657      | -657           | -657   | -657   | -657   | -657   | -657   |
| -5.33%       | -422      | -422           | -422   | -423   | -424   | -425   | -426   |
| -2.67%       | -189      | -191           | -193   | -196   | -200   | -204   | -209   |
| 0%           | 23        | 15             | 8      | 0      | -8     | -16    | -25    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 163 | 153 | 144 | 134 | 125 | 115 | 105 |
| 5.33% | 214 | 210 | 205 | 199 | 192 | 186 | 179 |
| 8.00% | 223 | 222 | 221 | 219 | 217 | 214 | 210 |

|                                        |  |  |  |  |  |          |
|----------------------------------------|--|--|--|--|--|----------|
| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  |  |  |  | (단위:백만원) |
|                                        |  |  |  |  |  | 2,898    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

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 | 2,081 | 0     | 2,081     |    |

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 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 67    | -67       |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 4,645 | 0     | 4,645     |    |

### 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 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

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 | 17,735 | 0      | 17,735    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 536    | 17,985 | -17,450   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |                                 | (단위:백만원) |
|-----------------------------|---------------------------------|----------|
| FXW213D6S(KRW/USD 27-09-23E |                                 | 563      |
| FXW213D7T(KRW/USD 31-10-23E |                                 | 266      |
| FXW213D8W(KRW/USD 30-11-23E |                                 | 610      |
| FXW213D98(USD/KRW 27-09-23E |                                 | 43       |
| IE00BD8RGM75                | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |          |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 834      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

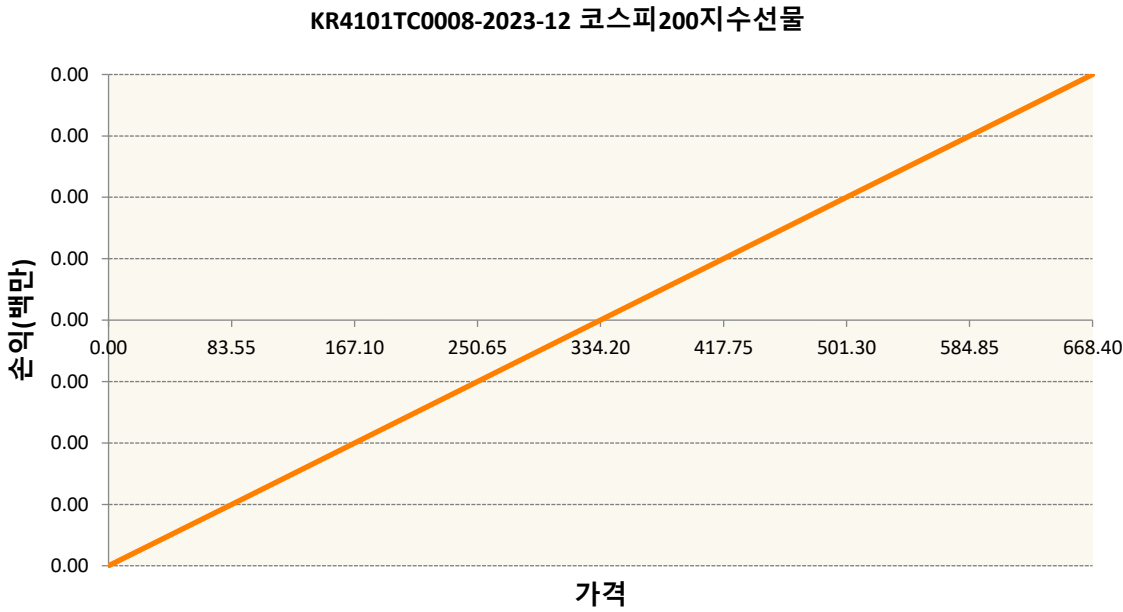
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 585   | 0     | 585       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |         |                    |     |       |        |        |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 코스피200지수선물 |     |       |        | 47     |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -47       | -47     | -47                | -47 | -47   | -47    | -47    |
| -5.33%       | -31       | -31     | -31                | -31 | -31   | -31    | -31    |
| -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%        | 31        | 31      | 31                 | 31  | 31    | 31     | 31     |
| 8.00%        | 47        | 47      | 47                 | 47  | 47    | 47     | 47     |



공시일 2023-09-22

기준일 2023-09-21

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

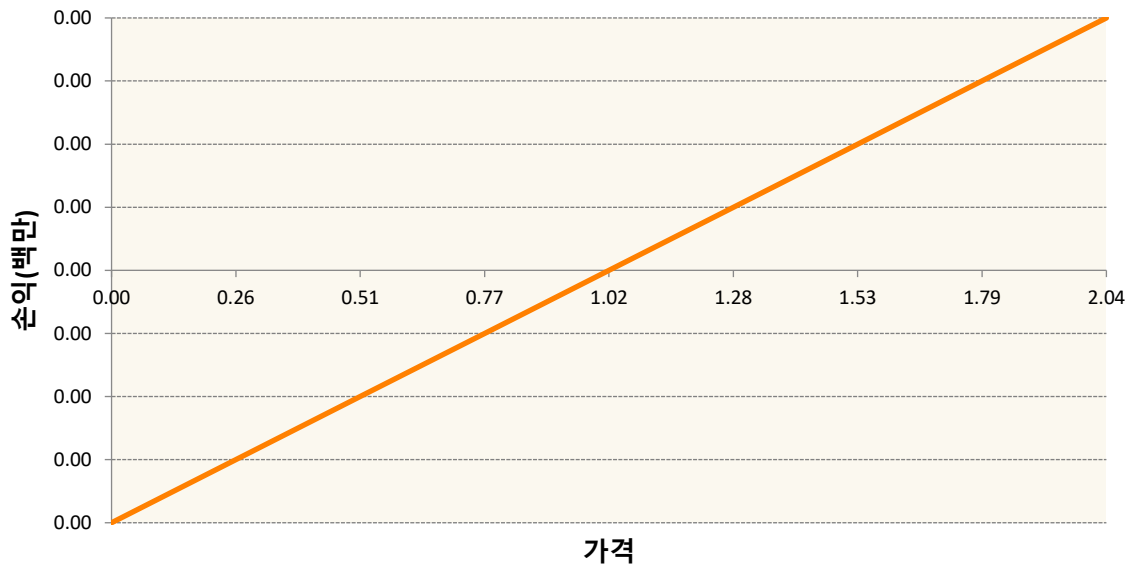
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

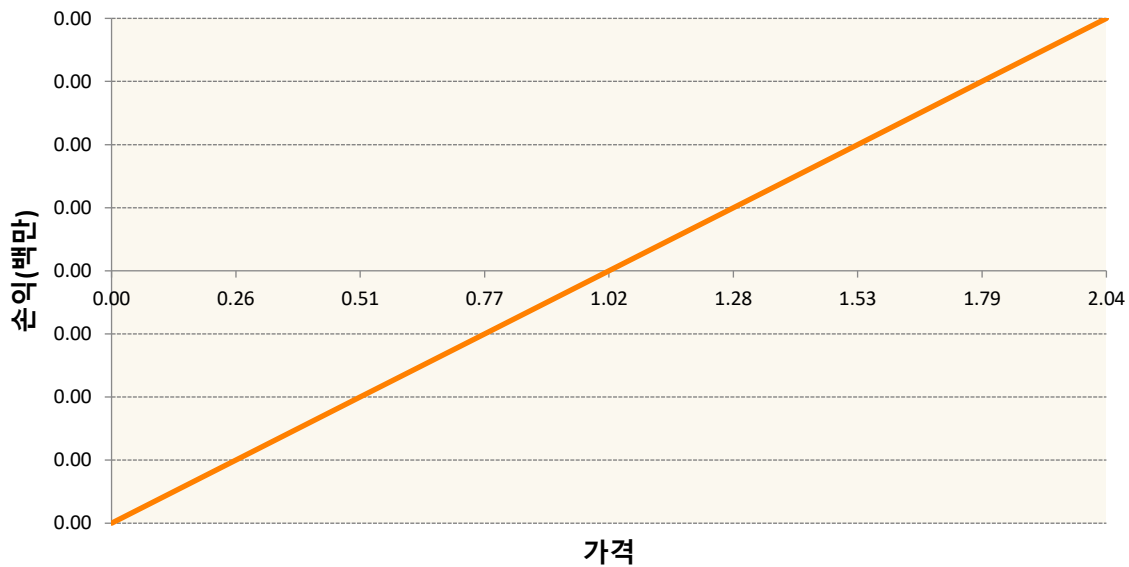
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 18,065 | 0     | 18,065    |    |

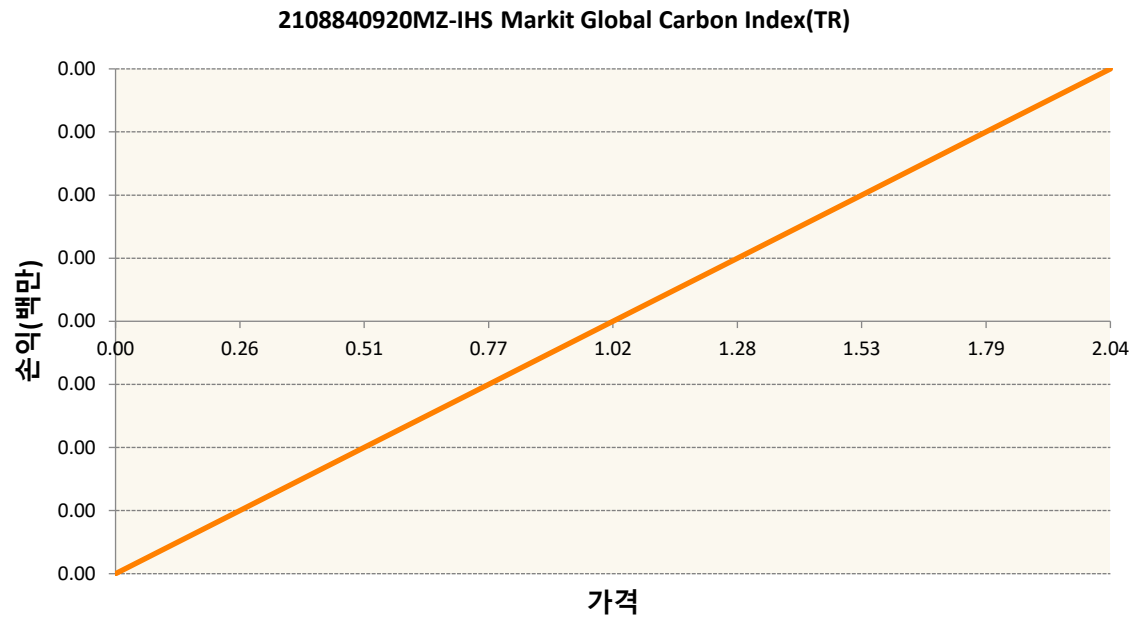
### 2. 만기시점의 손익구조

2108840920KM-IHS Markit Global Carbon Index(TR)



2108840920MR-IHS Markit Global Carbon Index(TR)





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                    |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------|--|----------|
| 2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 1,034    |
| 2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 207      |
| 2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 207      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 2,026    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

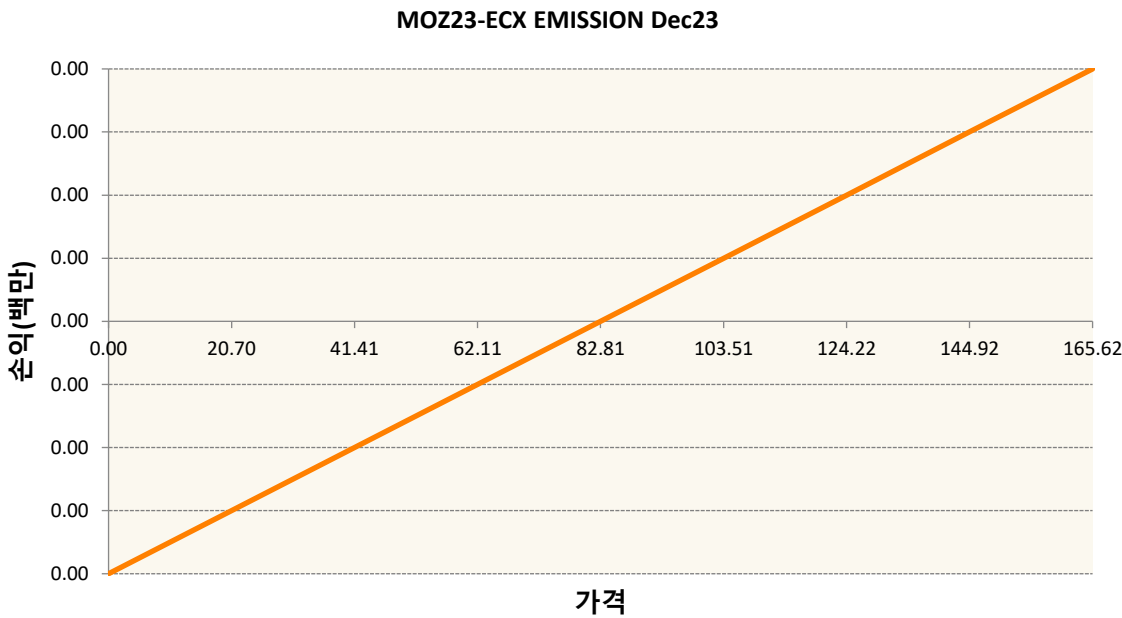
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,032 | 0     | 8,032     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 479   | 0     | 479       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,947 | -1,947    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |      |
|----------------------------------------------------|------|
| FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E                        | 5    |
| FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E                        | 151  |
| MOZ23 ECX EMISSION Dec23                           | 643  |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 0.49 |

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

(단위:백만원)

1,333

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 1,469 | -1,469    | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 6,432 | 0     | 6,432     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                     |   |
|-------------------------------------|---|
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (NH)  | 1 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (키움)  | 1 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)  | 1 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠) | 1 |

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

(단위:백만원)

|   |
|---|
| 4 |
|---|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

## 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)  | 24 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(메리츠) | 33 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(미래)  | 28 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230427(키움)  | 7  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 110 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

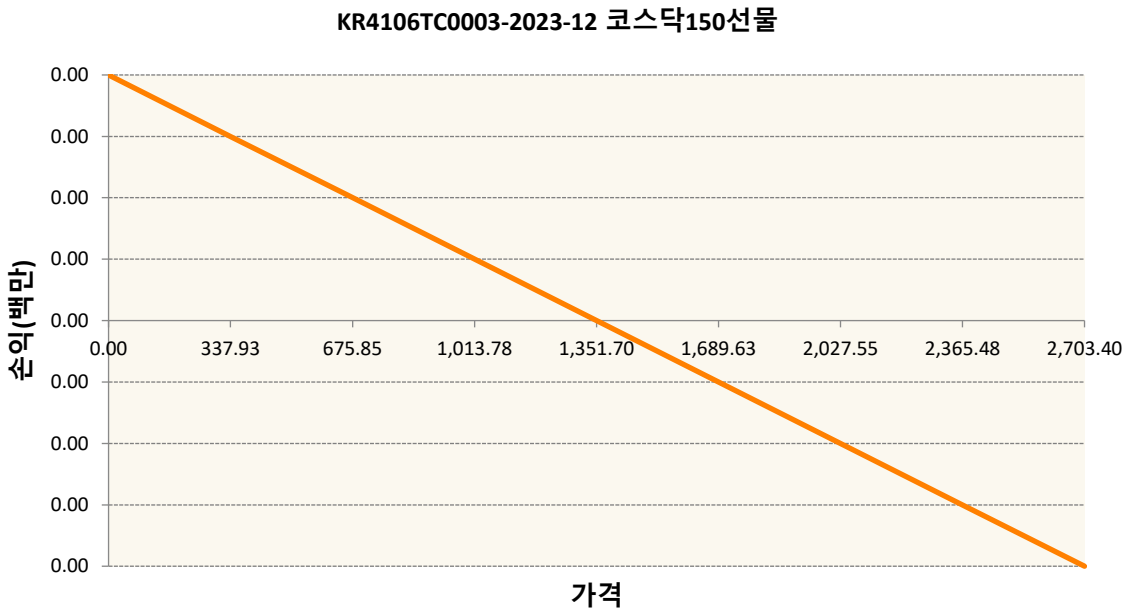
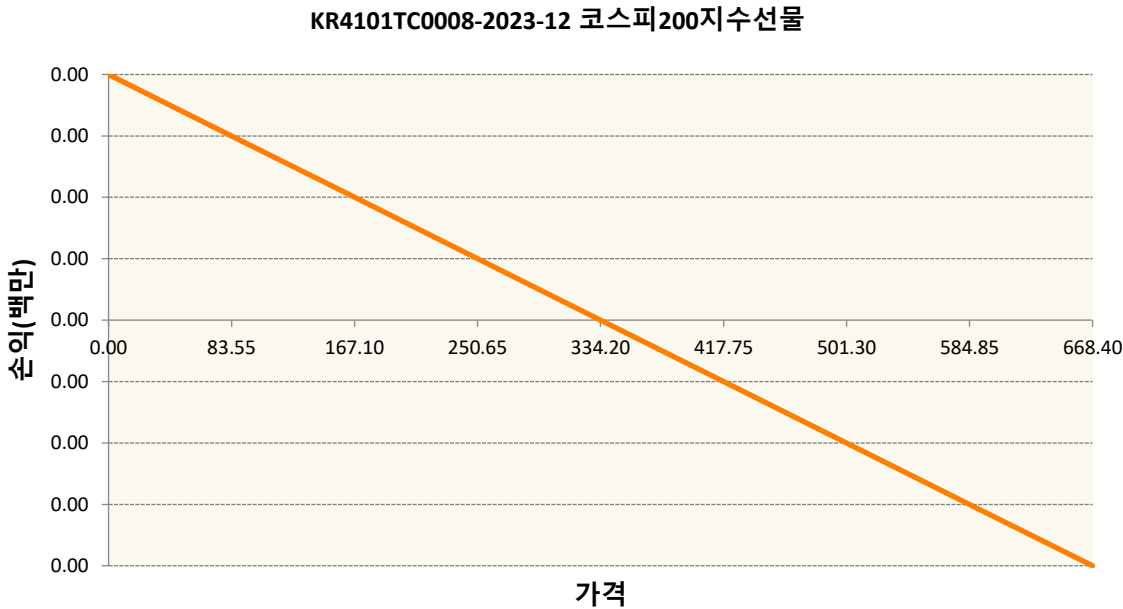
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

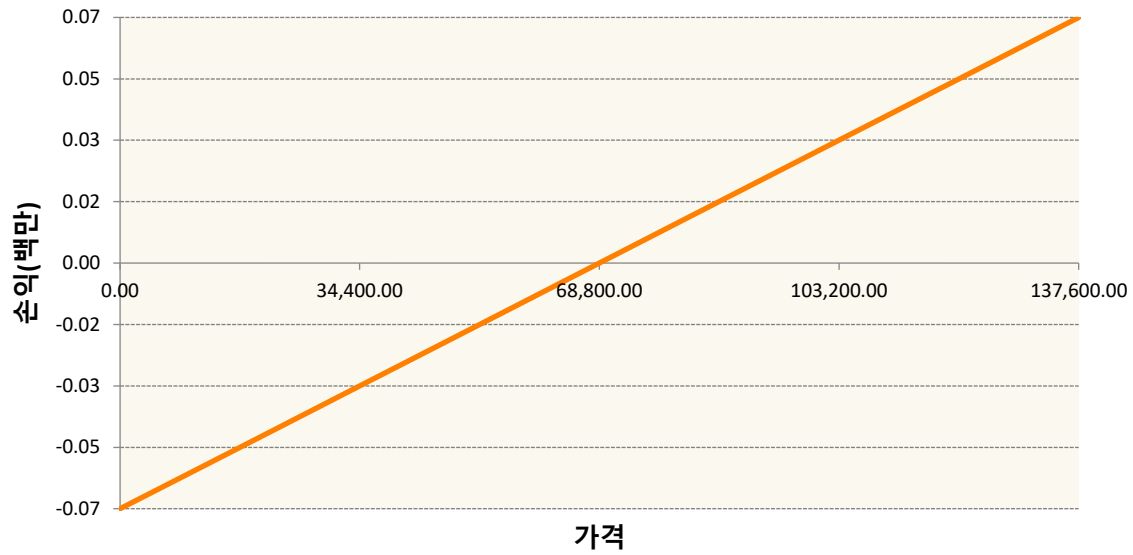
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 845   | -845      | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | ELS  | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,986 | 4,047 | -2,061    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | ELS  | 0     | 0     | 0         | 장외 |

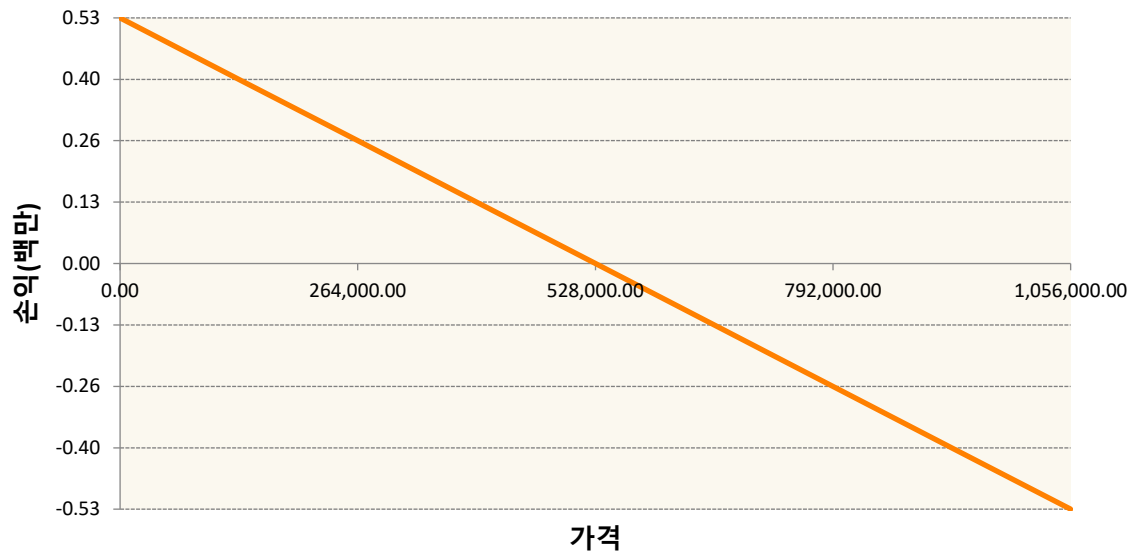
### 2. 만기시점의 손익구조



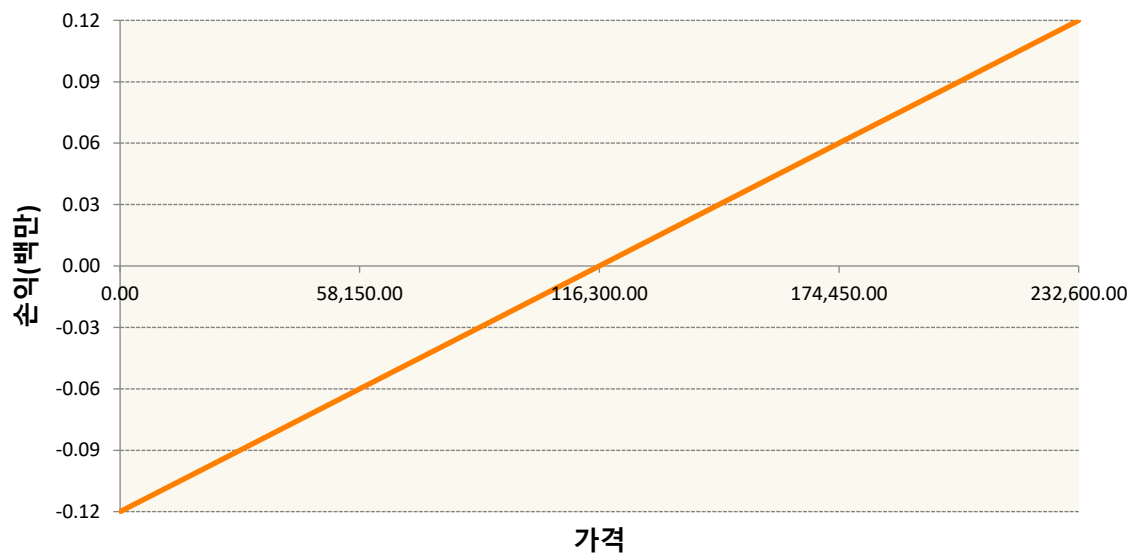
KR4111TA0008-2023-10 삼성전자개별선물



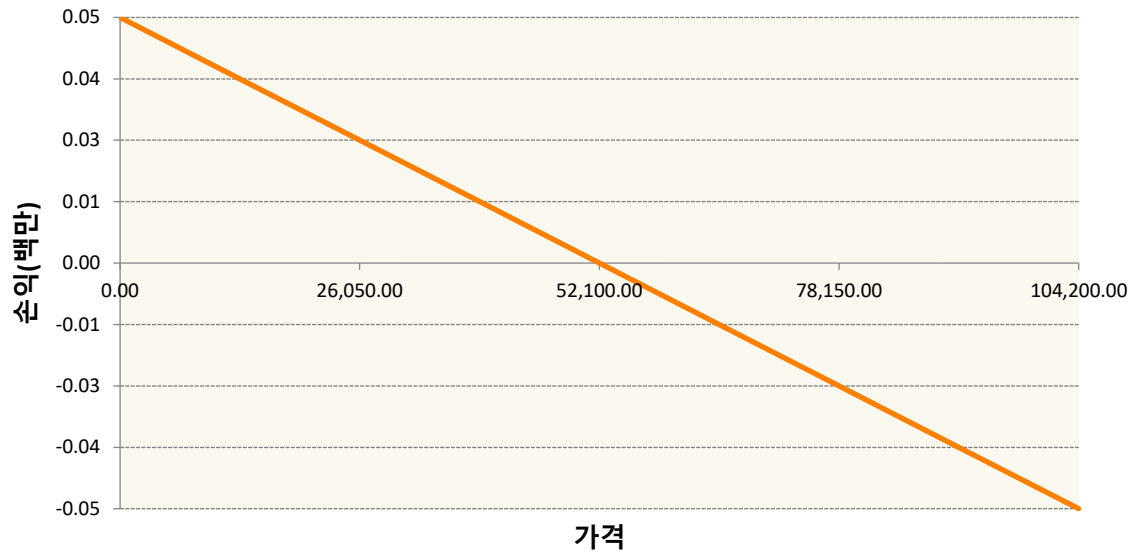
KR4147TA0006-2023-10 LG화학개별선물



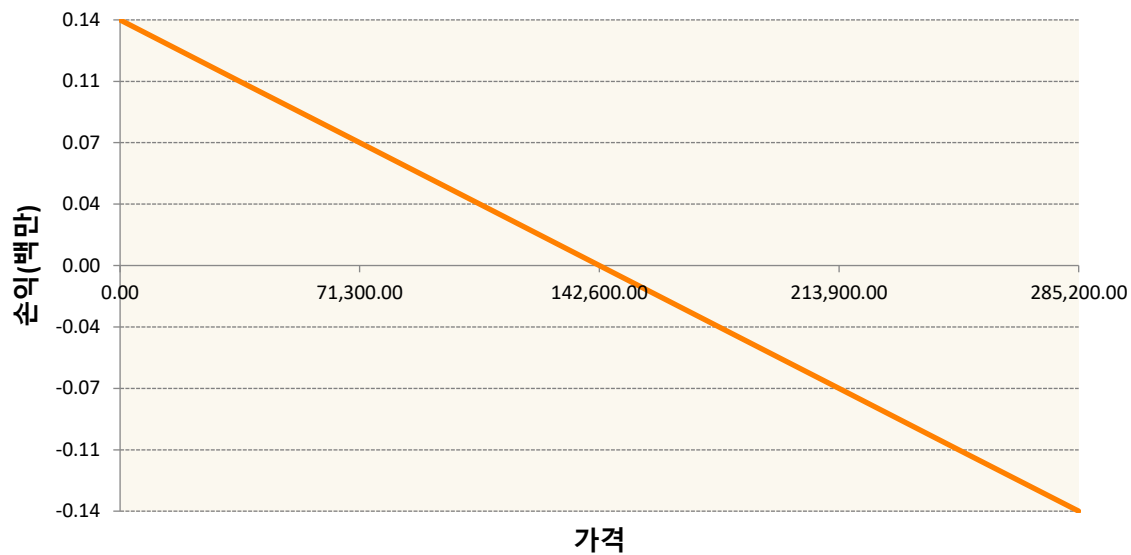
KR4150TA0000-2023-10 SK하이닉스개별선물



KR41CNTA0000-2023-10 포스코DX개별선물



KR41CPTA0008-2023-10 셀트리온개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |      |
|-------------------------------|------|
| KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물 | 267  |
| KR4106TC00 2023-12 코스닥150선물   | 25   |
| KR4111TA00 2023-10 삼성전자개별선물   | 134  |
| KR4147TA00 2023-10 LG화학개별선물   | 13   |
| KR4150TA00 2023-10 SK하이닉스개별선물 | 25   |
| KR41CNTA00( 2023-10 포스코DX개별선물 | 5    |
| KR41CPTA00 2023-10 셀트리온개별선물   | 13   |
| KRS0004572 ELWKB금융_주식스왑       | 0.03 |

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

(단위:백만원)



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

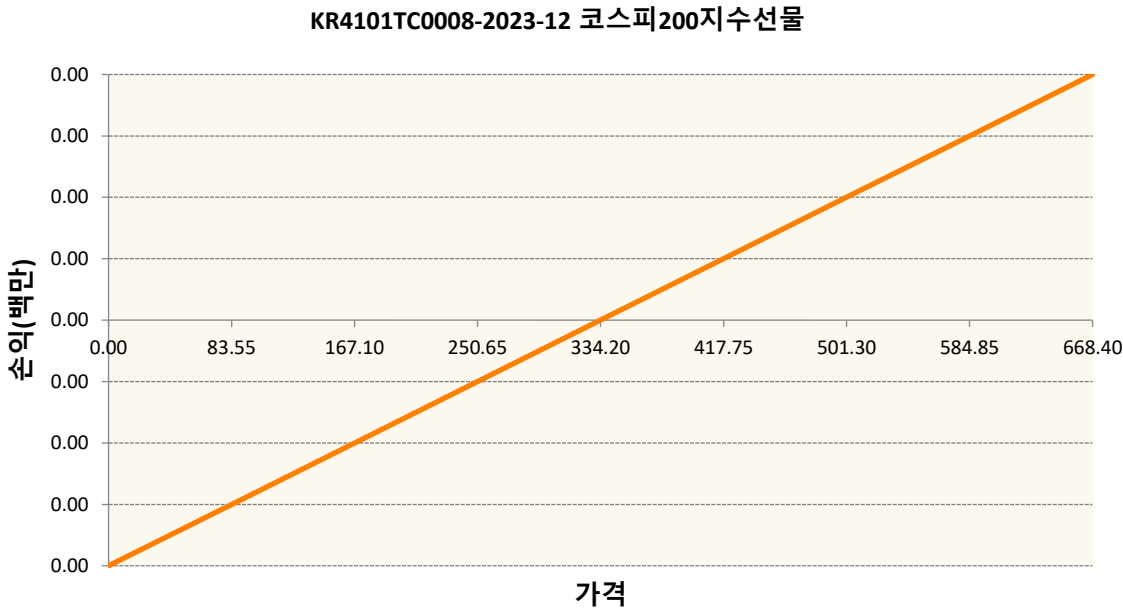
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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   | 1,337 | 0     | 1,337     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 코스피200지수선물 |      |       |        | 107    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -107      | -107    | -107               | -107 | -107  | -107   | -107   |
| -5.33%       | -71       | -71     | -71                | -71  | -71   | -71    | -71    |
| -2.67%       | -36       | -36     | -36                | -36  | -36   | -36    | -36    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 36        | 36      | 36                 | 36   | 36    | 36     | 36     |
| 5.33%        | 71        | 71      | 71                 | 71   | 71    | 71     | 71     |
| 8.00%        | 107       | 107     | 107                | 107  | 107   | 107    | 107    |

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

(단위:백만원)

100

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

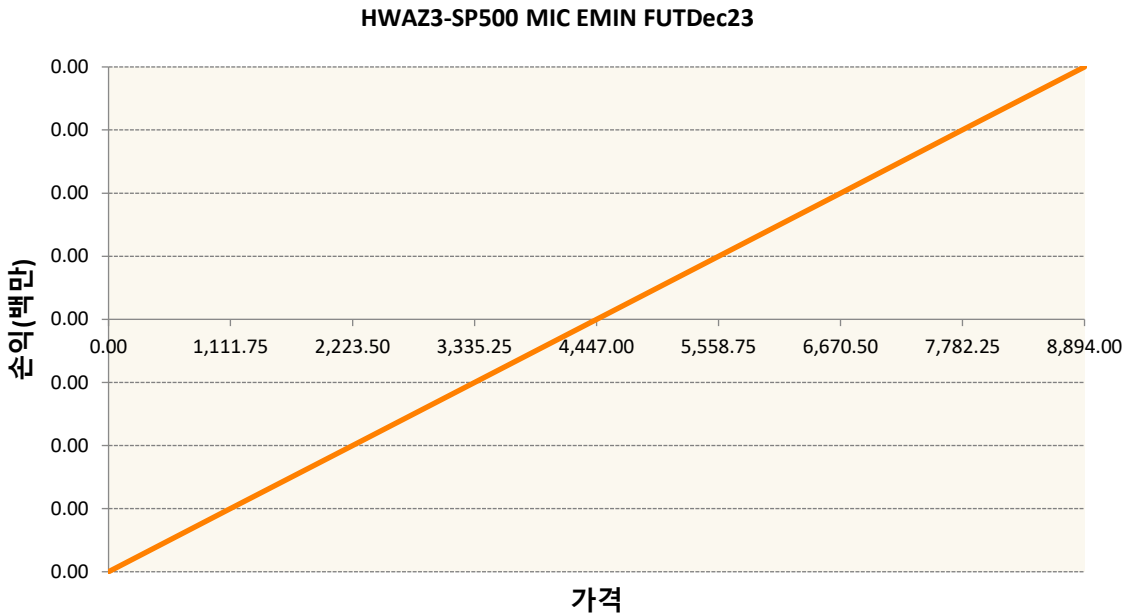
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,061 | 0     | 1,061     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |    |
|-------|-------------------------|----|
| HWAZ3 | SP500 MIC EMIN FUTDec23 | 85 |
|-------|-------------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 85 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

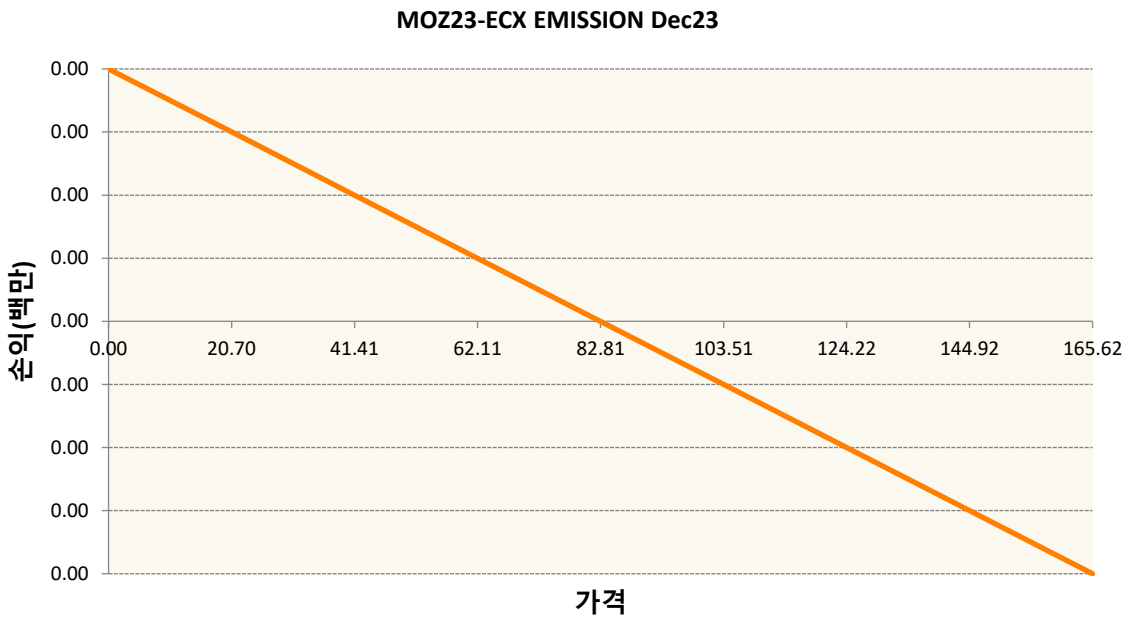
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 9,077 | -9,077    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 479   | 0     | 479       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,863 | -1,863    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |      |
|----------------------------------------------------|------|
| FXW213D8W KRW/EUR 27-09-23E                        | 149  |
| MOZ23 ECX EMISSION Dec23                           | 726  |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 0.46 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,486 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

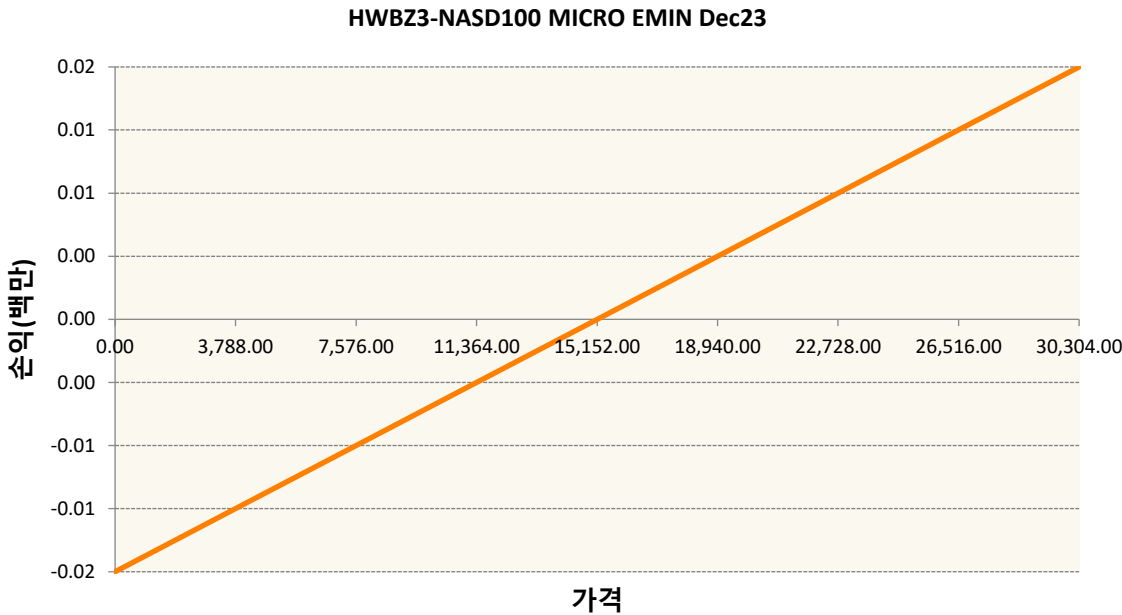
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,044 | 0     | 1,044     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBZ3 NASD100 MICRO EMIN Dec23

84

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

(단위:백만원)

83

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-09-22 |
| 기준일 | 2023-09-21 |

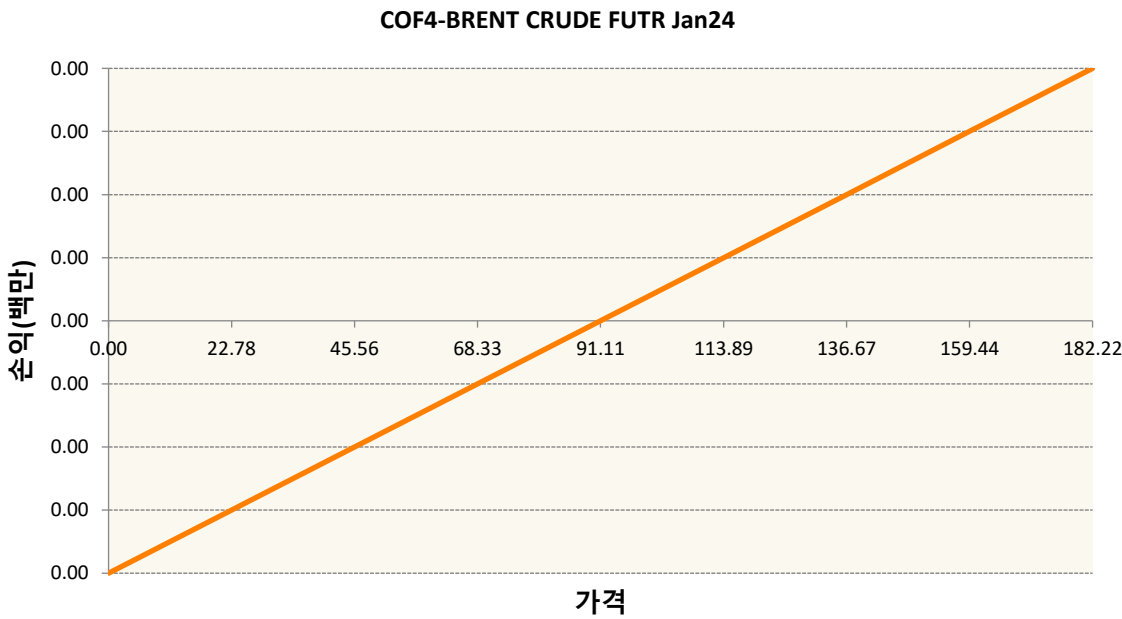
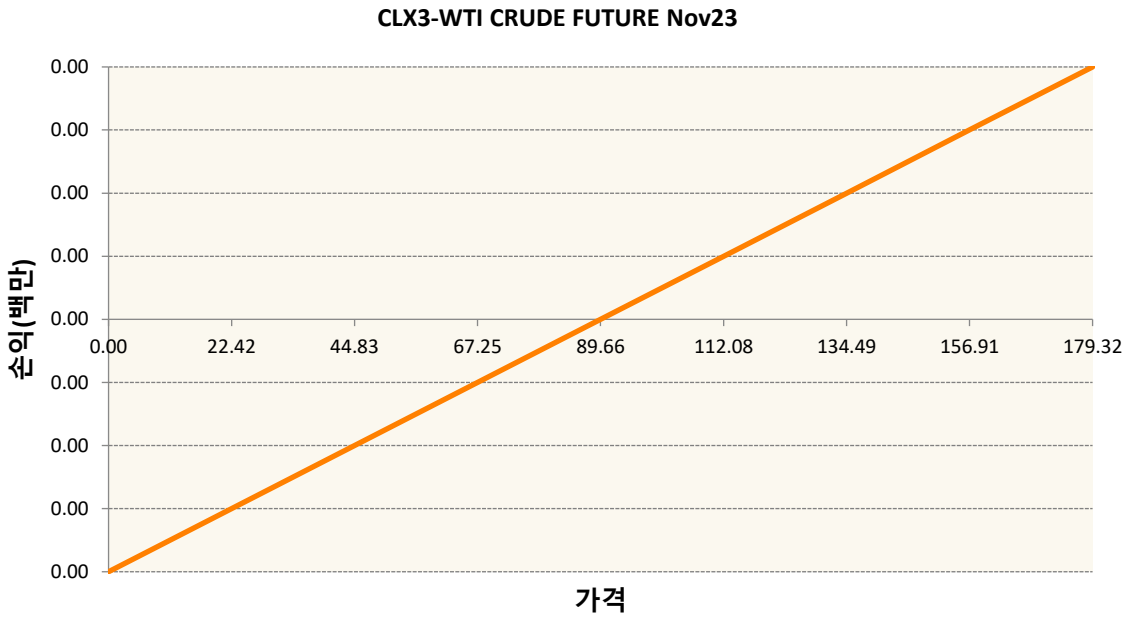
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

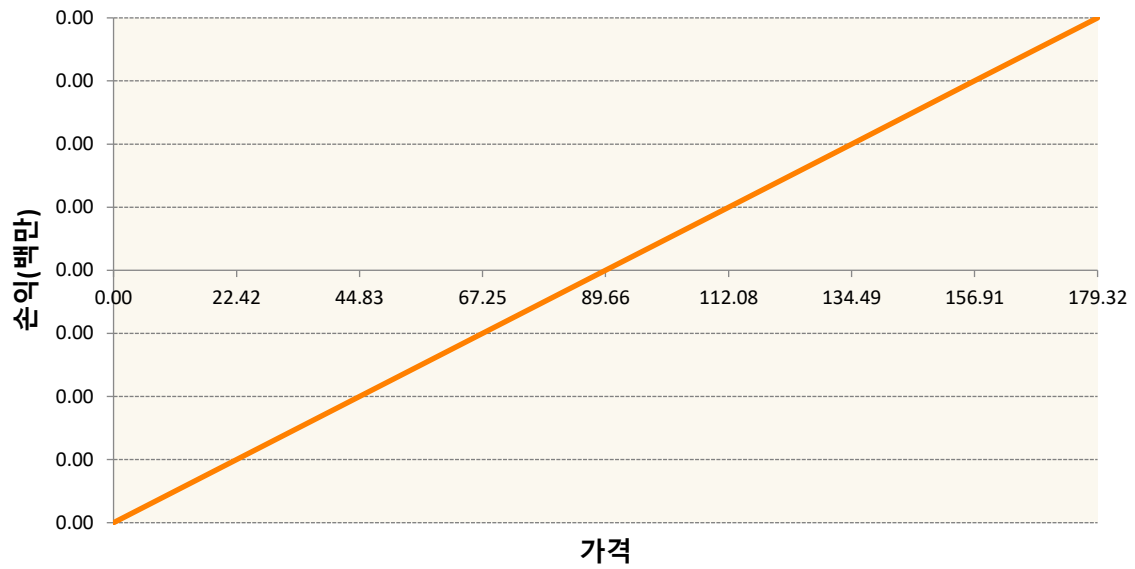
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,547 | 0     | 1,547     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 254   | -254      | 장내 |

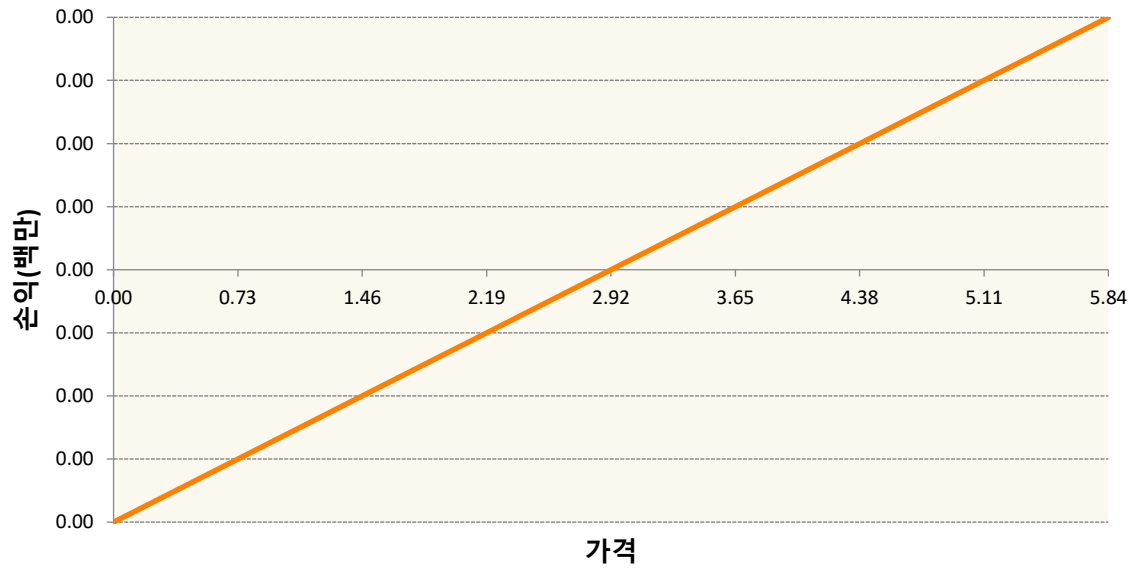
### 2. 만기시점의 손익구조



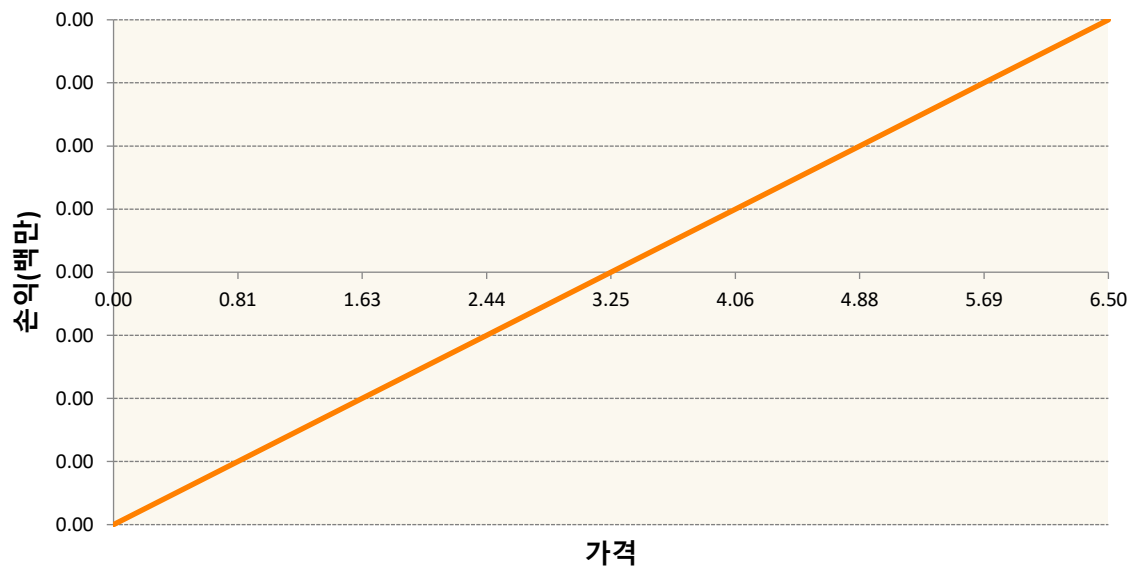
ECX3-E-MINI CRUDE OIL Nov23



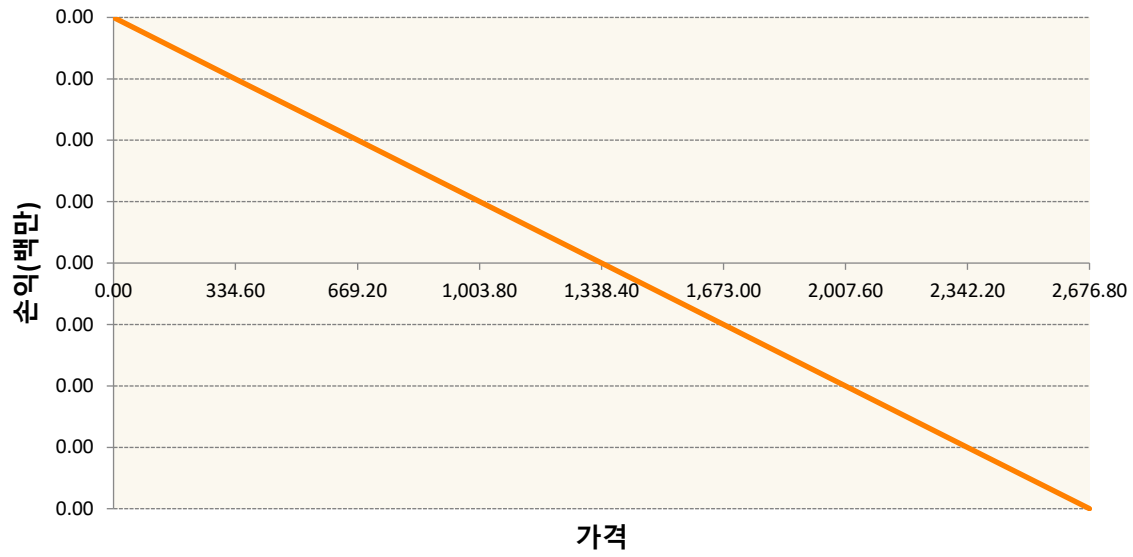
EOX3-E-MINI NATURAL GAS Nov23



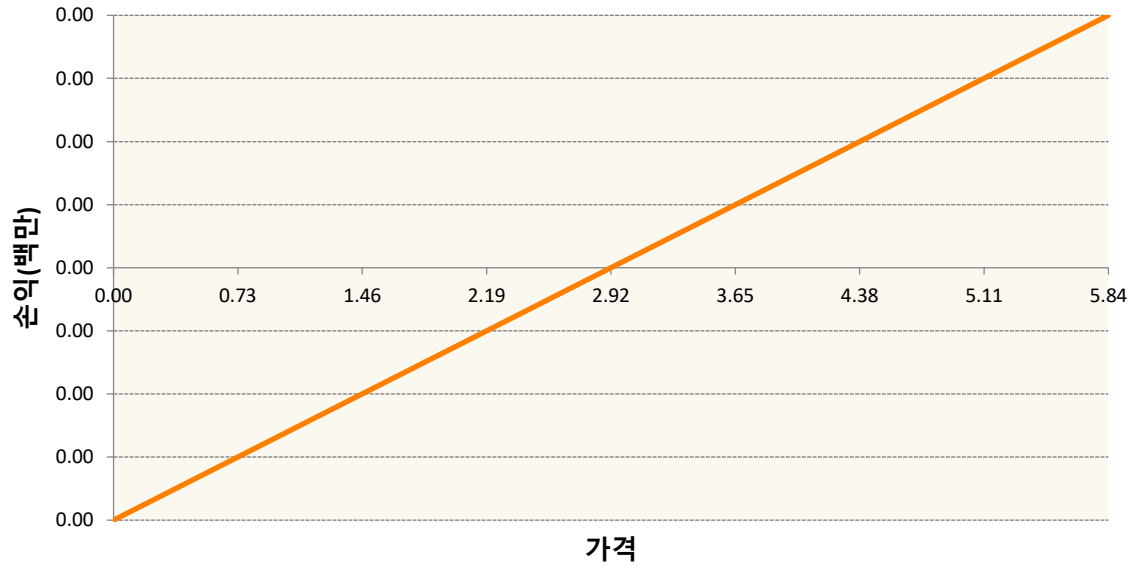
HOX3-NY Harb ULSD Fut Nov23



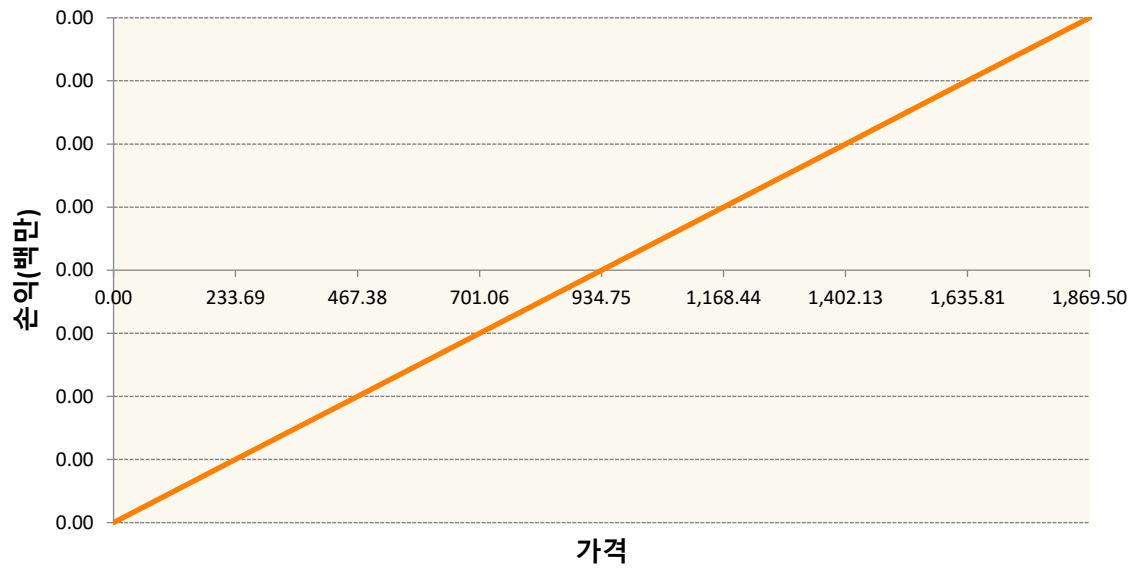
KR4175TA0001-2023-10 달러선물

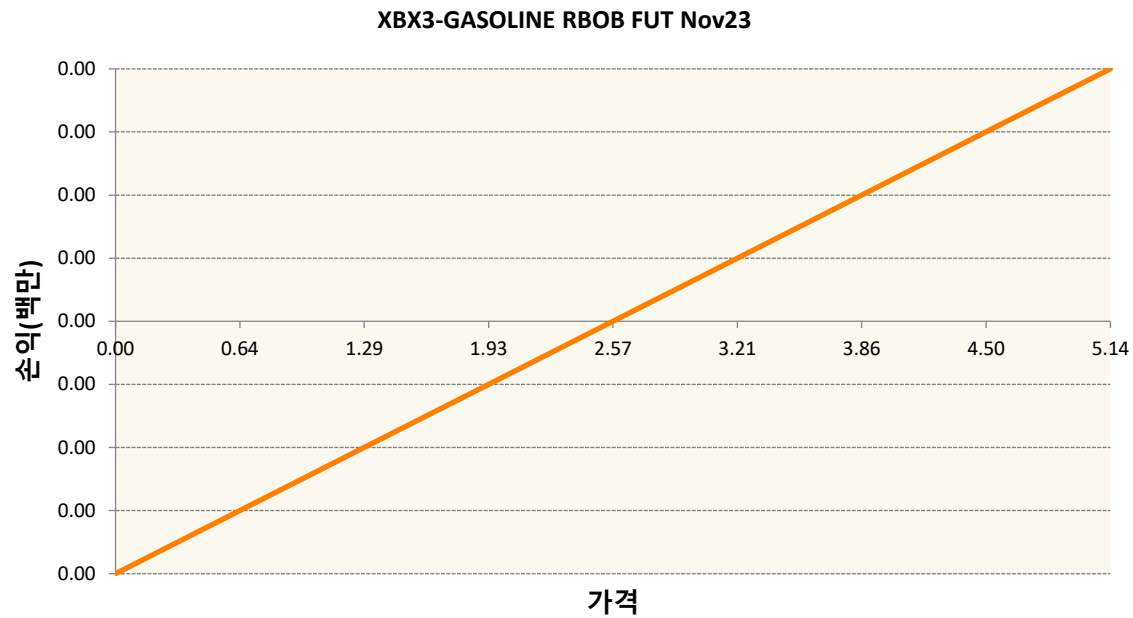


NGX23-NATURAL GAS FUTR Nov23



QX3-Low Su Gasoil G Nov23





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| CLX3                      | WTI CRUDE FUTURE Nov23   | 28       |
| COF4                      | BRENT CRUDE FUTR Jan24   | 29       |
| ECX3                      | E-MINI CRUDE OIL Nov23   | 5        |
| EOX3                      | E-MINI NATURAL GAS Nov23 | 2        |
| HOX3                      | NY Harb ULSD Fut Nov23   | 14       |
| KR4175TA00 2023-10 달러선물   |                          | 20       |
| NGX23                     | NATURAL GAS FUTR Nov23   | 25       |
| QSX3                      | Low Su Gasoil G Nov23    | 10       |
| XBX3                      | GASOLINE RBOB FUT Nov23  | 11       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 319      |