

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

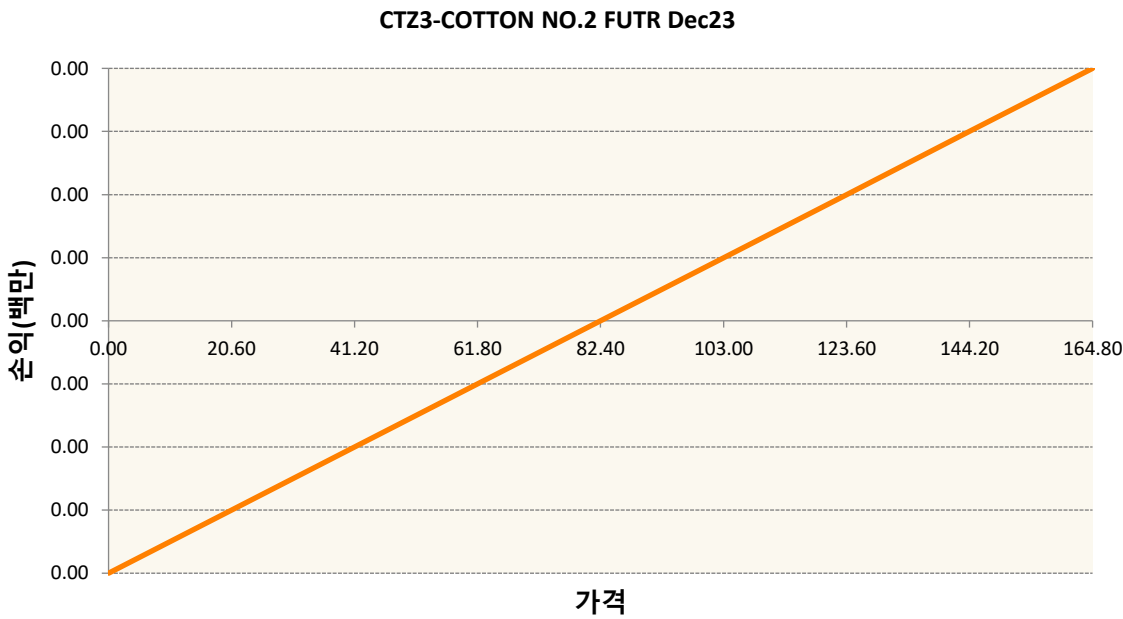
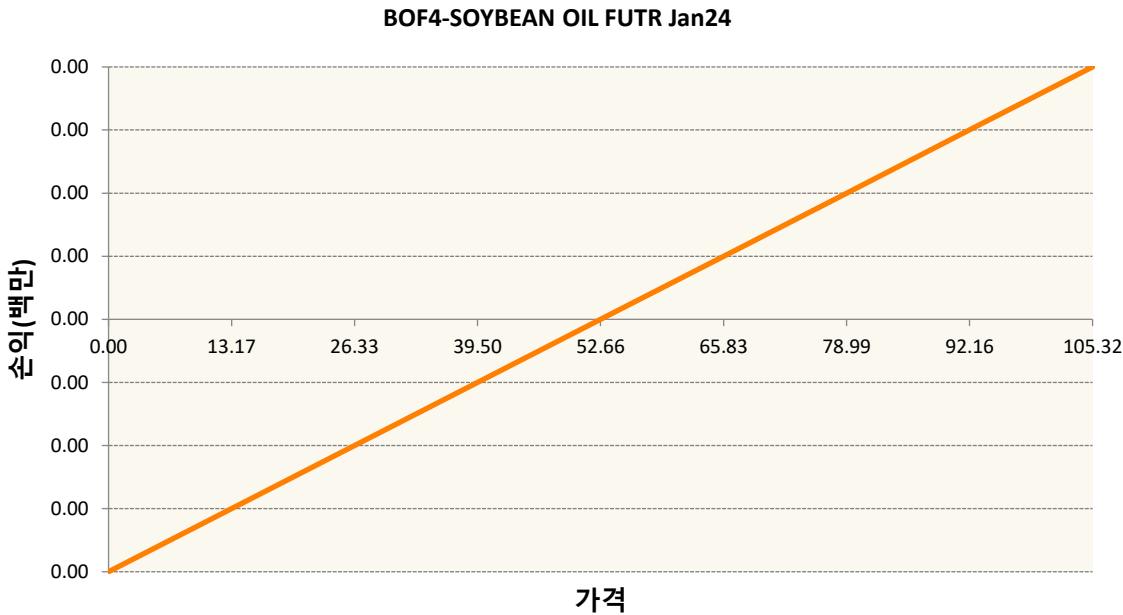
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

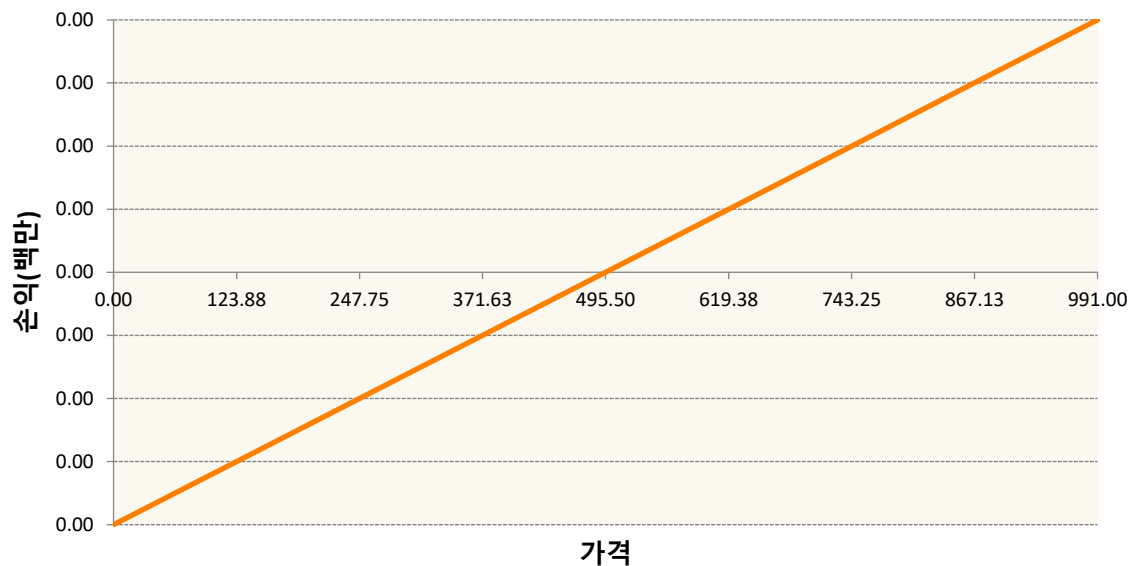
(단위:USD 백만)

| 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   | 4,851 | 0     | 4,851     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 527   | -527      | 장내 |

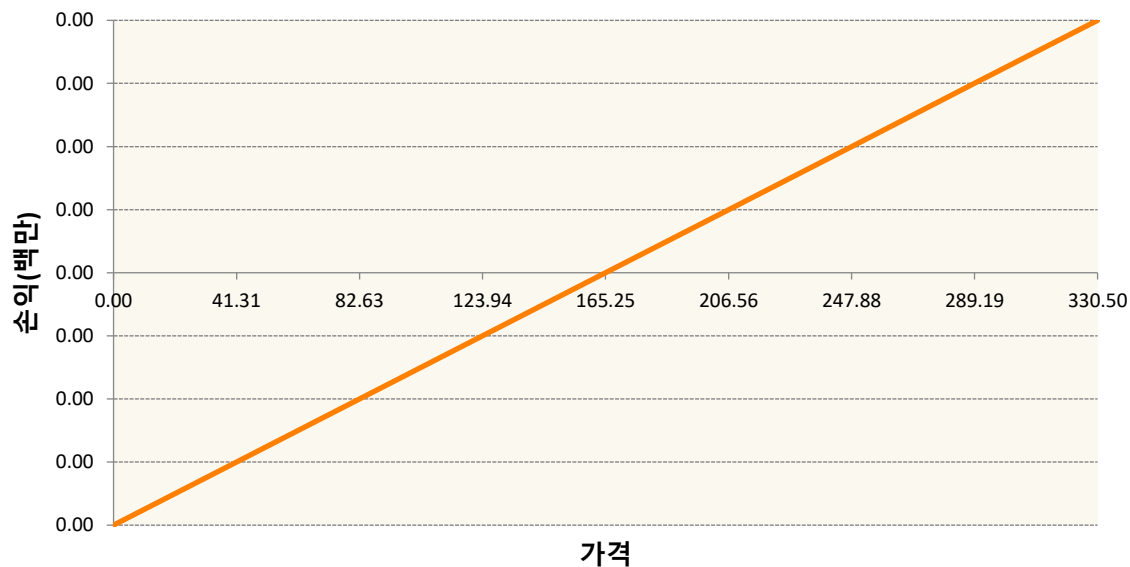
### 2. 만기시점의 손익구조



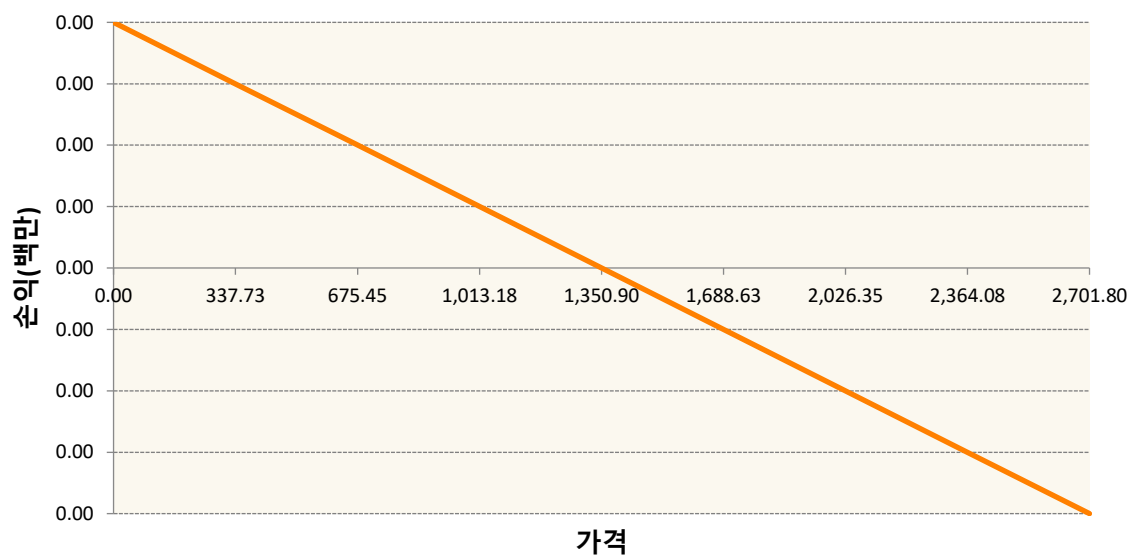
CZ3-CORN FUTURE Dec23



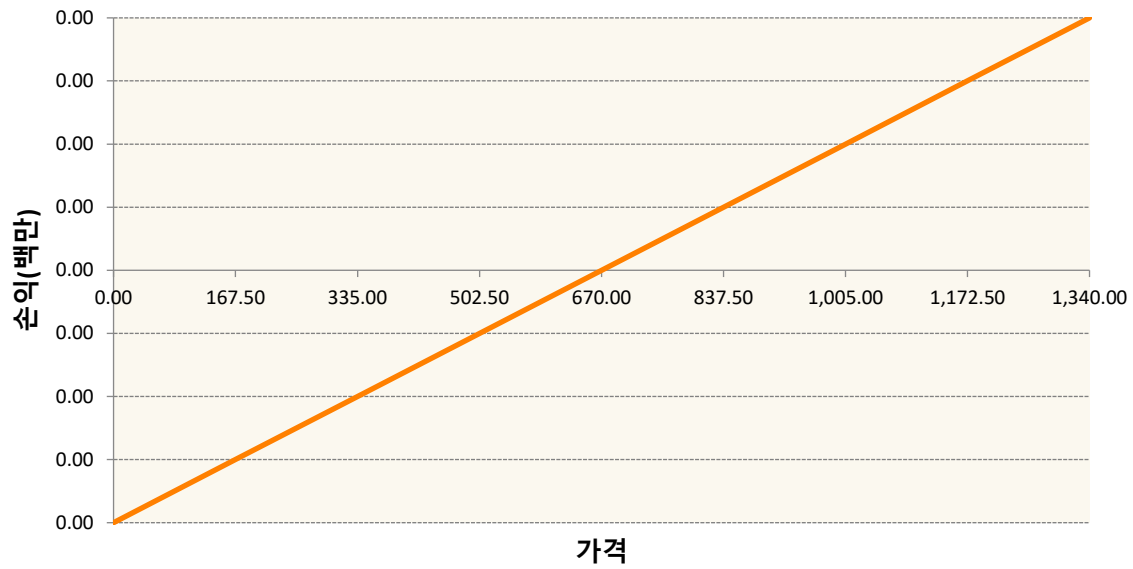
KCZ3-COFFEE 'C' FUTURE DEC23



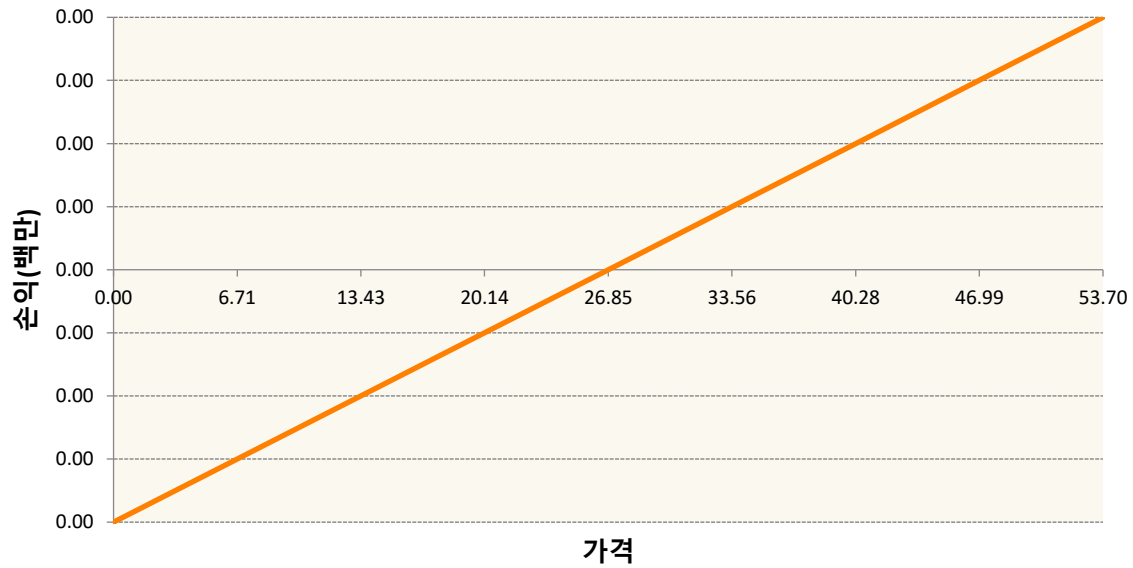
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



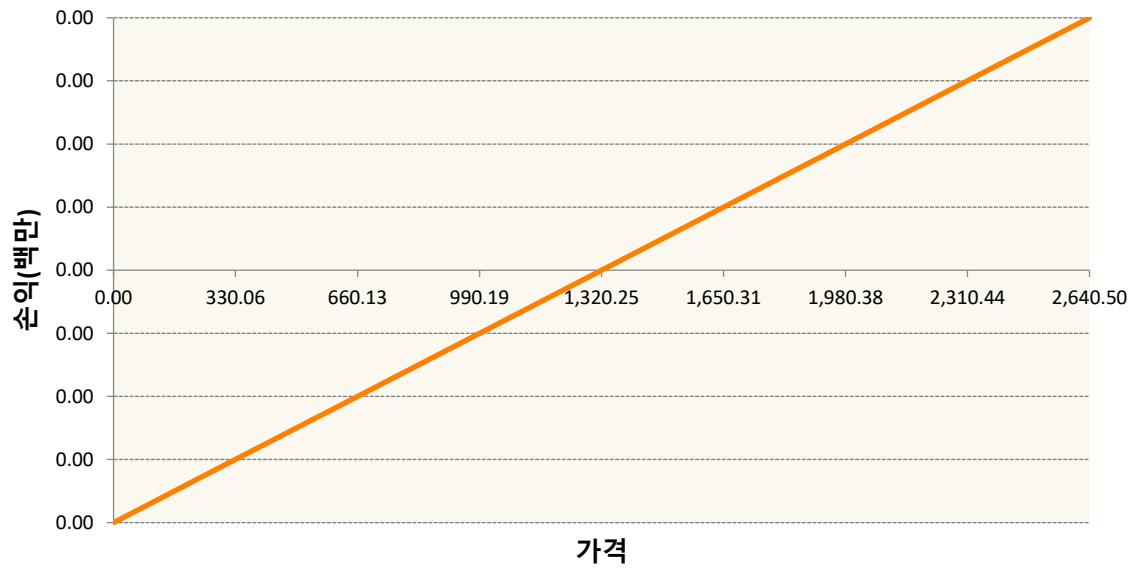
KWZ3-KC HRW WHEAT FUT DEC23



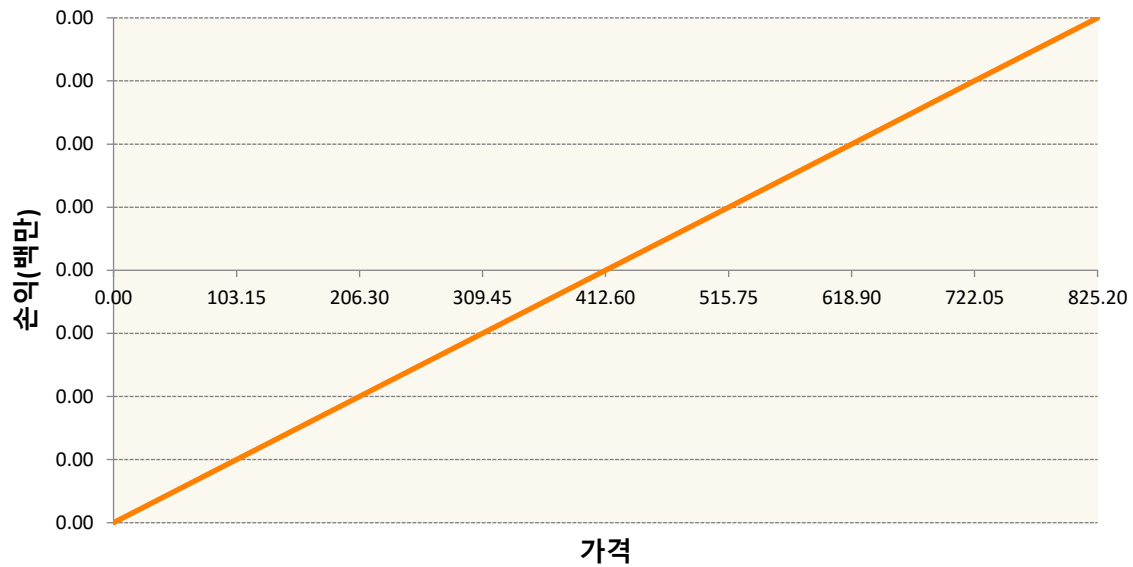
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



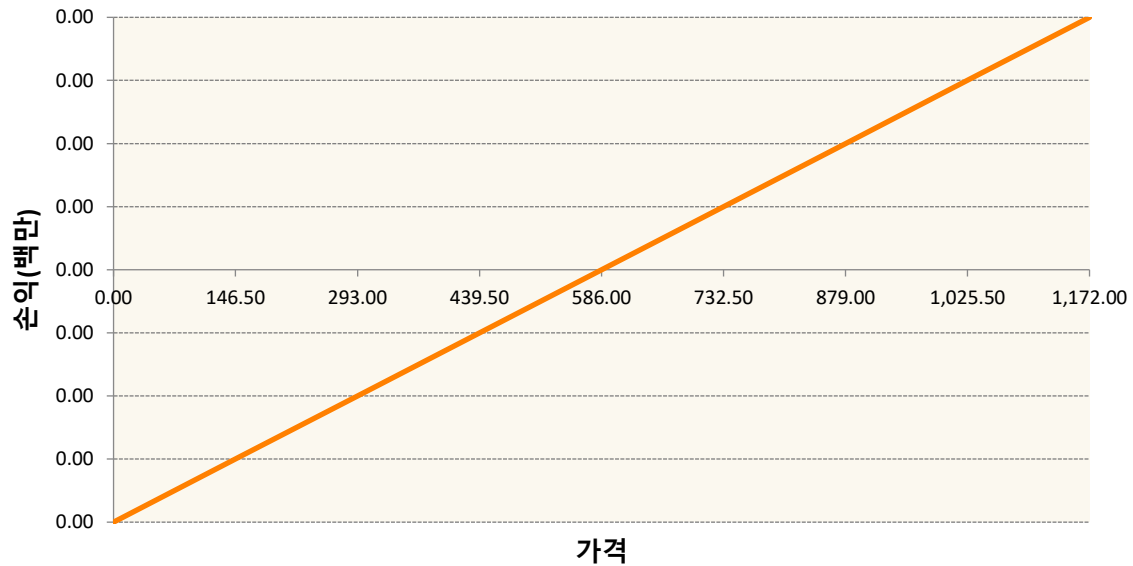
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



SMF4-SOYBEAN MEAL FUTR Jan24



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 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

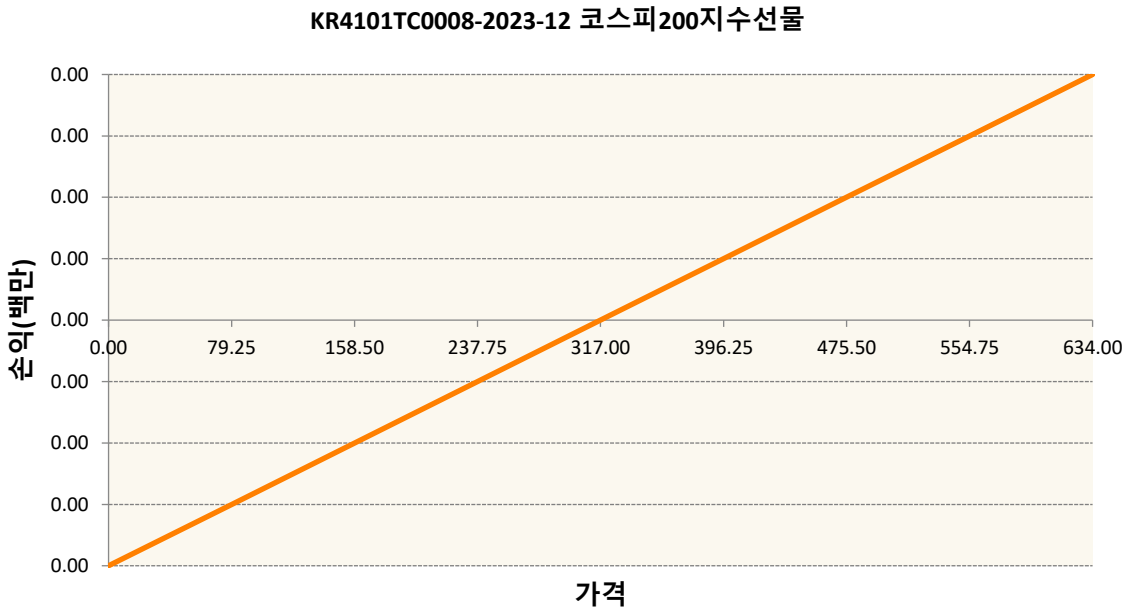
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 159   | 0     | 159       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,347 | 0     | 1,347     | 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%       | -72       | -72     | -72                | -72  | -72   | -72    | -72    |
| -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%        | 72        | 72      | 72                 | 72   | 72    | 72     | 72     |
| 8.00%        | 107       | 107     | 107                | 107  | 107   | 107    | 107    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

## 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   | 3,903 | 0     | 3,903     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래230314 | 301 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 283 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

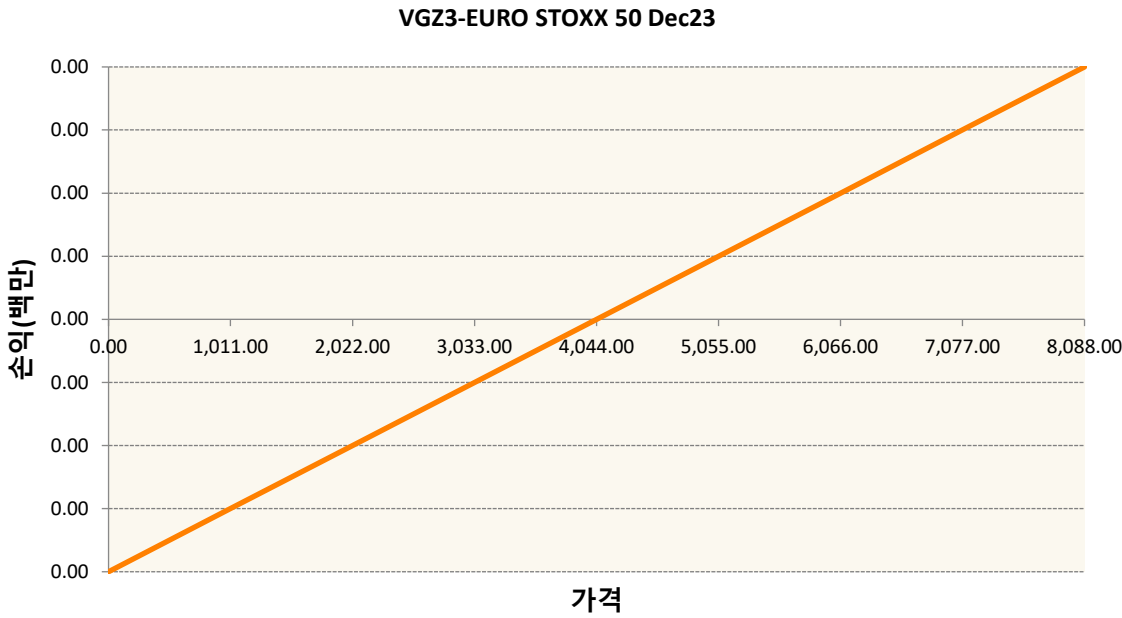
유로인덱스모(주식-파생형)

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   | 920   | 0     | 920       |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 215   | 0     | 215       | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |    |
|-----------------------------|----|
| FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E | 17 |
| VGZ3 EURO STOXX 50 Dec23    | 74 |

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

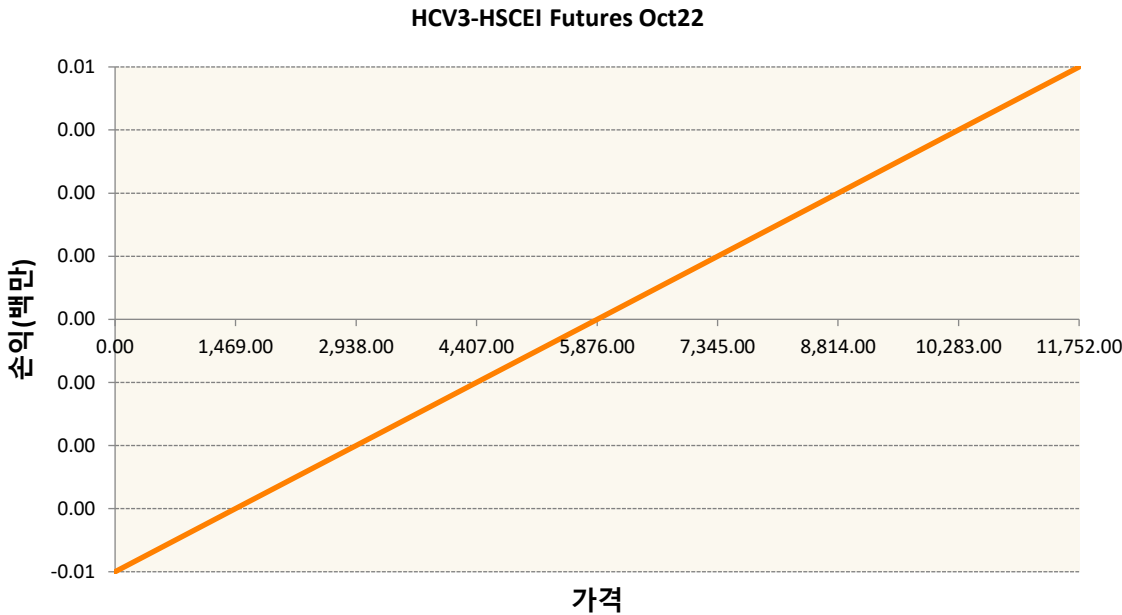
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,064 | 0     | 1,064     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCV3 | HSCEI Futures Oct22 | 85 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 126 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

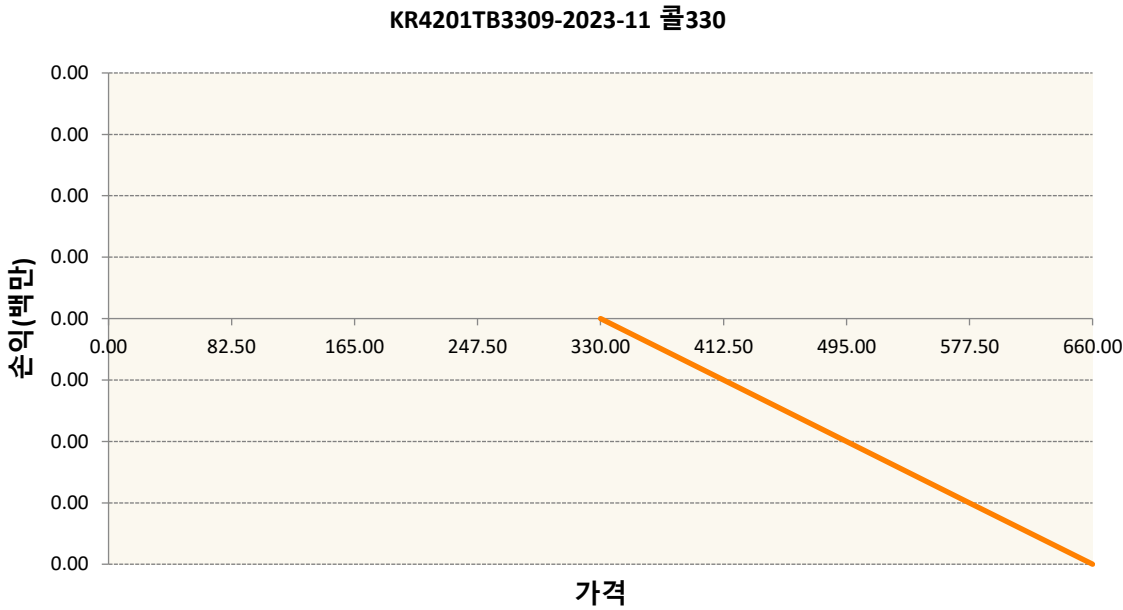
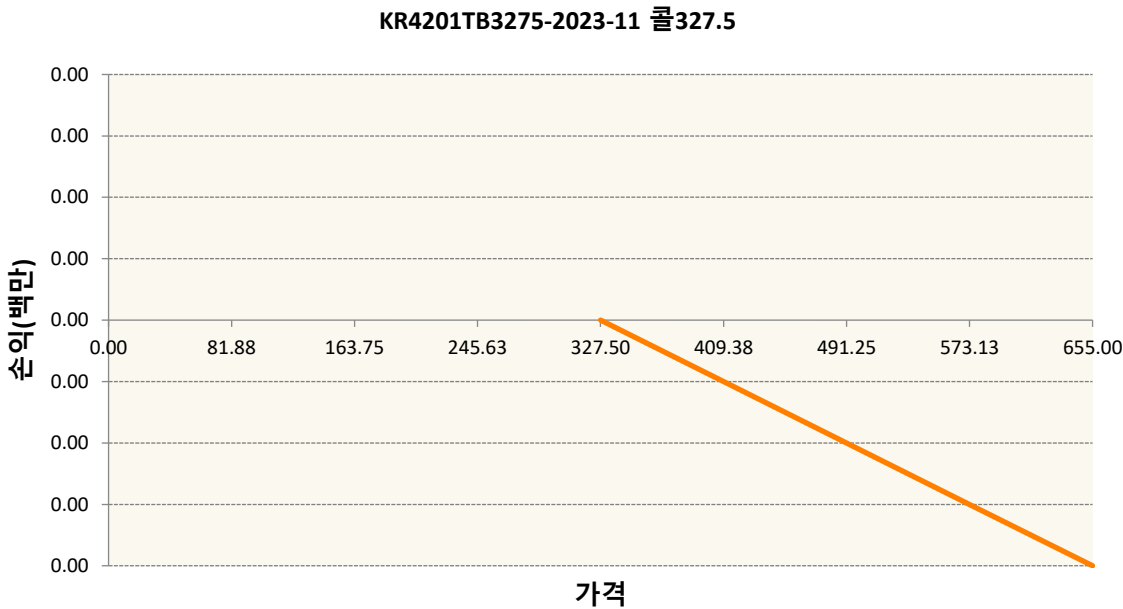
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

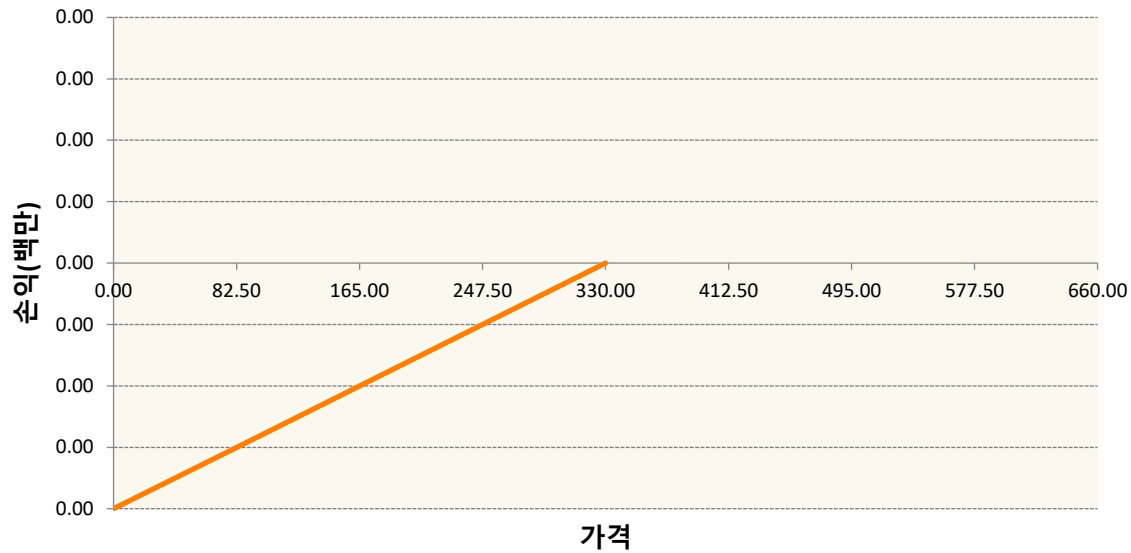
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 52,778 | -52,778   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301TB3308-2023-11 풋330



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201TB3275 |           |         | 2023-11 콜327.5 |      |        |        | 1,071  |
|--------------|-----------|---------|----------------|------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |      |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%   | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 108       | 108     | 108            | 107  | 106    | 105    | 103    |
| -5.33%       | 107       | 107     | 105            | 103  | 99     | 94     | 87     |
| -2.67%       | 102       | 96      | 89             | 79   | 68     | 54     | 39     |
| 0%           | 61        | 43      | 22             | 0    | -24    | -49    | -75    |
| 2.67%        | -91       | -123    | -156           | -189 | -222   | -256   | -289   |
| 5.33%        | -430      | -461    | -493           | -525 | -558   | -591   | -624   |
| 8.00%        | -941      | -958    | -977           | -998 | -1,021 | -1,046 | -1,071 |
| KR4201TB3309 |           |         | 2023-11 콜330   |      |        |        | 731    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |      |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%   | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 59        | 59      | 59             | 58   | 58     | 57     | 56     |
| -5.33%       | 59        | 58      | 58             | 56   | 54     | 51     | 48     |
| -2.67%       | 56        | 54      | 50             | 44   | 38     | 29     | 20     |
| 0%           | 37        | 27      | 14             | 0    | -15    | -32    | -50    |
| 2.67%        | -46       | -69     | -92            | -116 | -140   | -164   | -188   |
| 5.33%        | -260      | -285    | -311           | -337 | -363   | -389   | -415   |
| 8.00%        | -615      | -631    | -649           | -668 | -688   | -709   | -731   |
| KR4301TB3308 |           |         | 2023-11 풋330   |      |        |        | 691    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |      |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%   | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -689      | -689    | -689           | -689 | -690   | -690   | -691   |
| -5.33%       | -450      | -450    | -450           | -451 | -452   | -453   | -455   |
| -2.67%       | -211      | -213    | -215           | -217 | -221   | -225   | -230   |
| 0%           | 19        | 13      | 7              | 0    | -8     | -16    | -25    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0     | 93    | -93       |    |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 1,909 | 0     | 1,909     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

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 | 4,468 | 0     | 4,468     |    |

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 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

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 | 16,802 | 0      | 16,802    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 474    | 17,632 | -17,158   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| FXW213D7T(KRW/USD 31-10-23E | 269 |
| FXW213D8W KRW/USD 30-11-23E | 616 |
| FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E | 525 |
| FXW213DA5 USD/KRW 31-10-23E | 38  |
| IE00BD8RGM75                |     |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

792

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

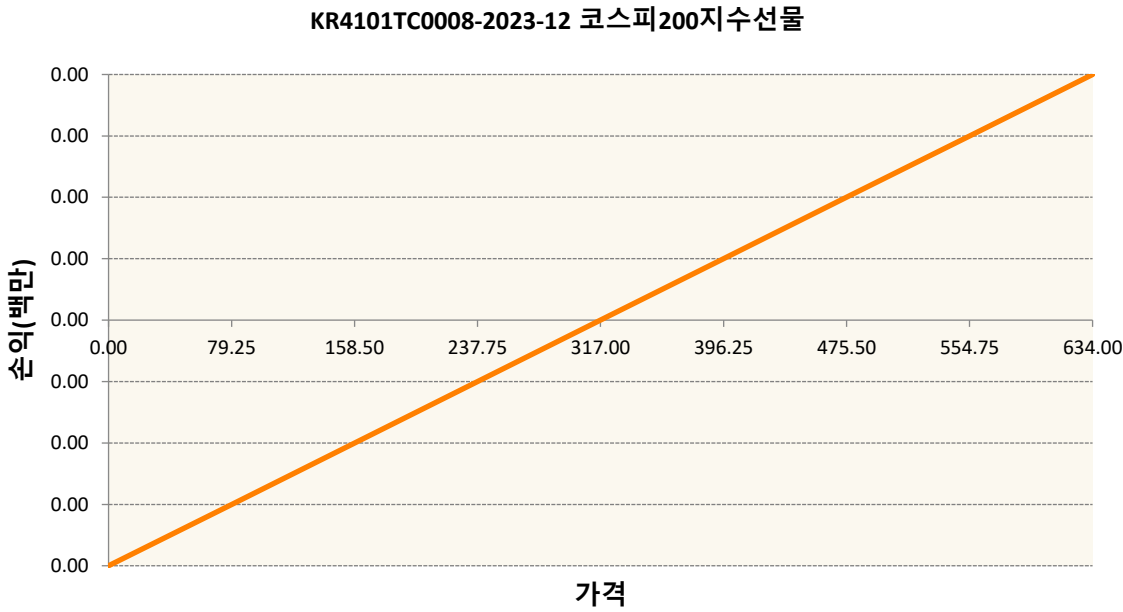
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 634   | 0     | 634       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |         |                    |     |       |        |        |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 코스피200지수선물 |     |       |        | 50     |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -50       | -50     | -50                | -50 | -50   | -50    | -50    |
| -5.33%       | -34       | -34     | -34                | -34 | -34   | -34    | -34    |
| -2.67%       | -17       | -17     | -17                | -17 | -17   | -17    | -17    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 17        | 17      | 17                 | 17  | 17    | 17     | 17     |
| 5.33%        | 34        | 34      | 34                 | 34  | 34    | 34     | 34     |
| 8.00%        | 50        | 50      | 50                 | 50  | 50    | 50     | 50     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

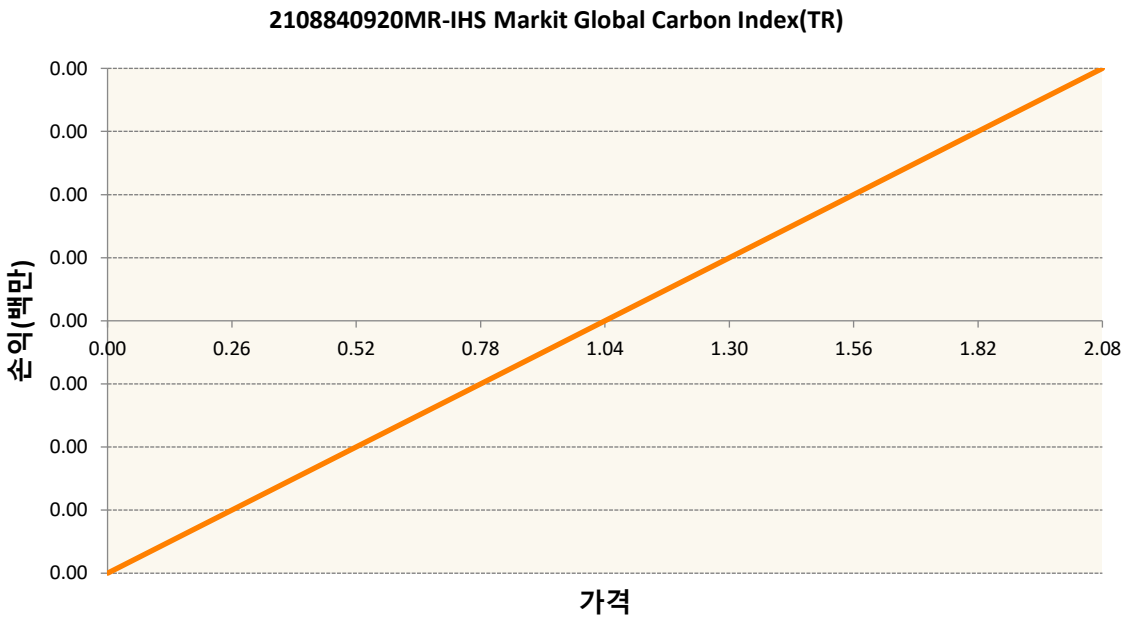
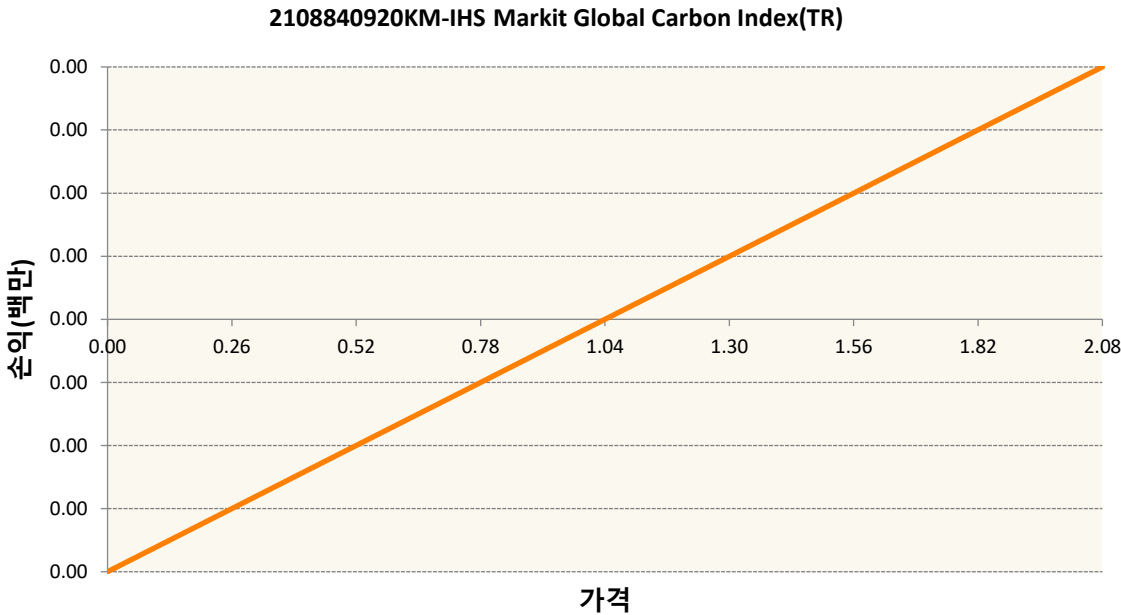
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

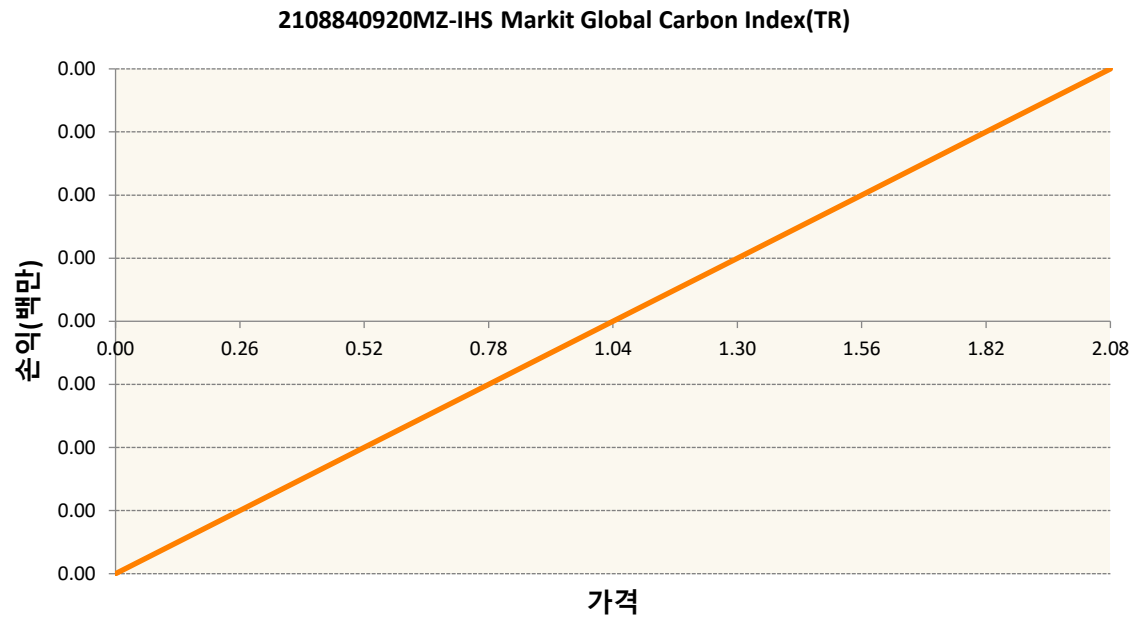
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 18,419 | 0     | 18,419    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                    |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------|--|----------|
| 2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 1,048    |
| 2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 210      |
| 2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 210      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,948    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

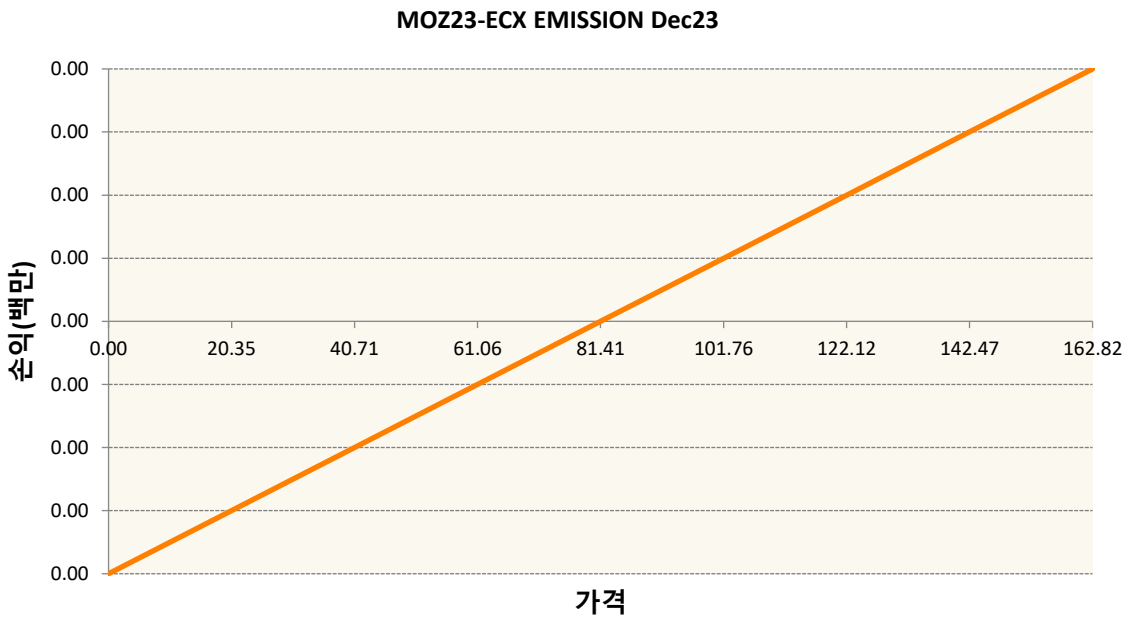
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 9,048 | 0     | 9,048     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 479   | 0     | 479       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,835 | -1,835    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213D9R\KRW/EUR 31-10-23E                        | 147 |
| MOZ23 ECX EMISSION Dec23                           | 724 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 1   |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,435 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

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   | 5,380 | 0     | 5,380     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                     |   |
|-------------------------------------|---|
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)  | 3 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠) | 3 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)  | 2 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)  | 3 |

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

## 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   | 6,424 | 0     | 6,424     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |      |
|-----------------------------------------|------|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(NH)  | 1    |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(메리츠) | 2    |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(미래)  | 1    |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230427(키움)  | 0.33 |

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

(단위:백만원)

|   |
|---|
| 5 |
|---|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

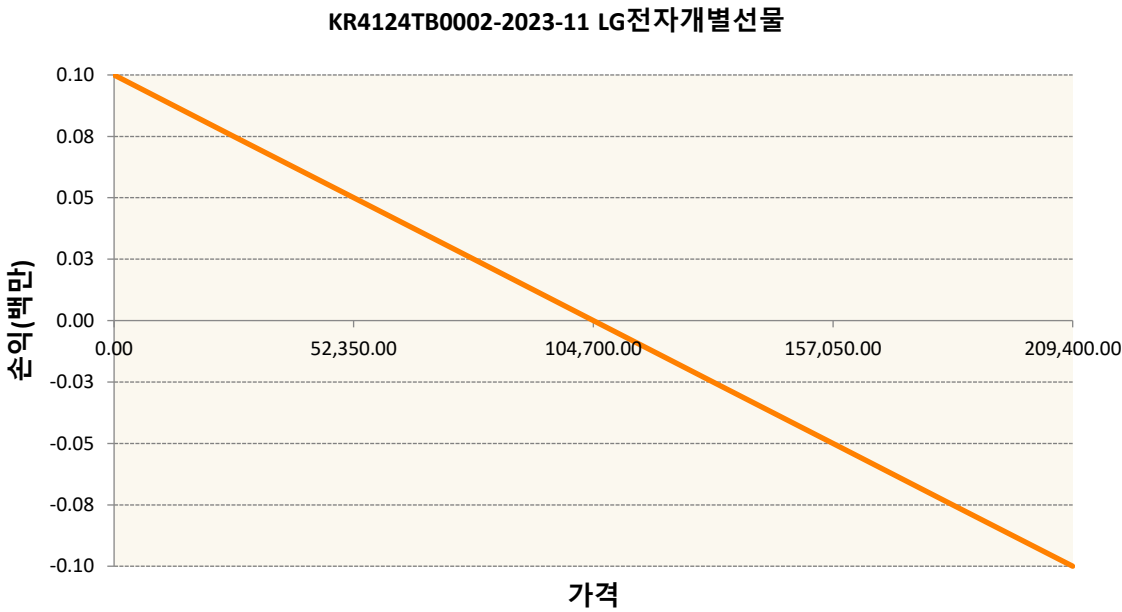
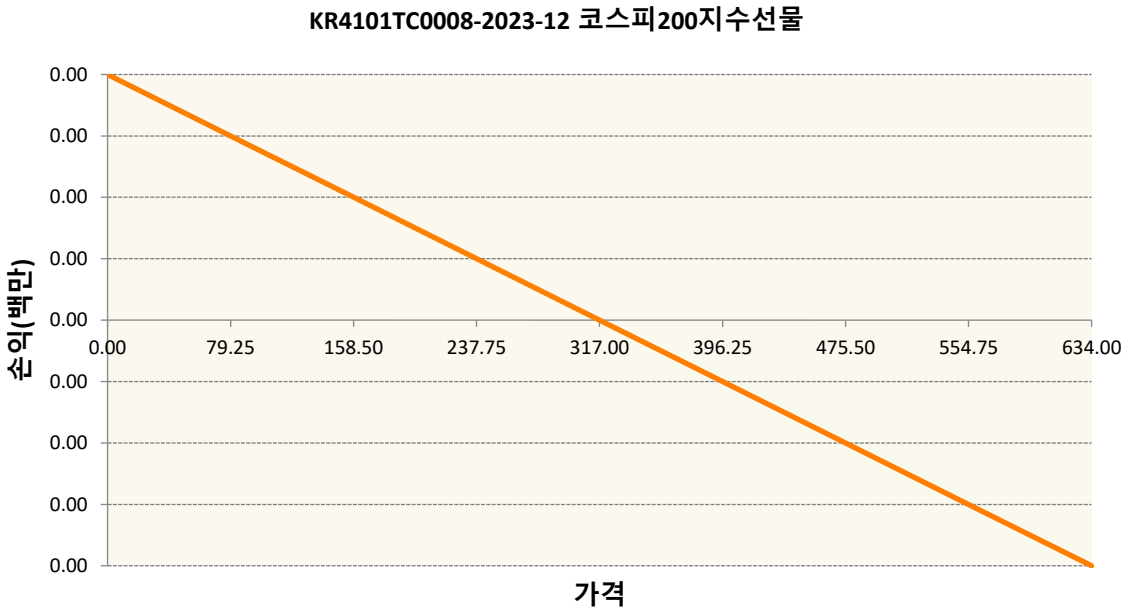
## 에퀴티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

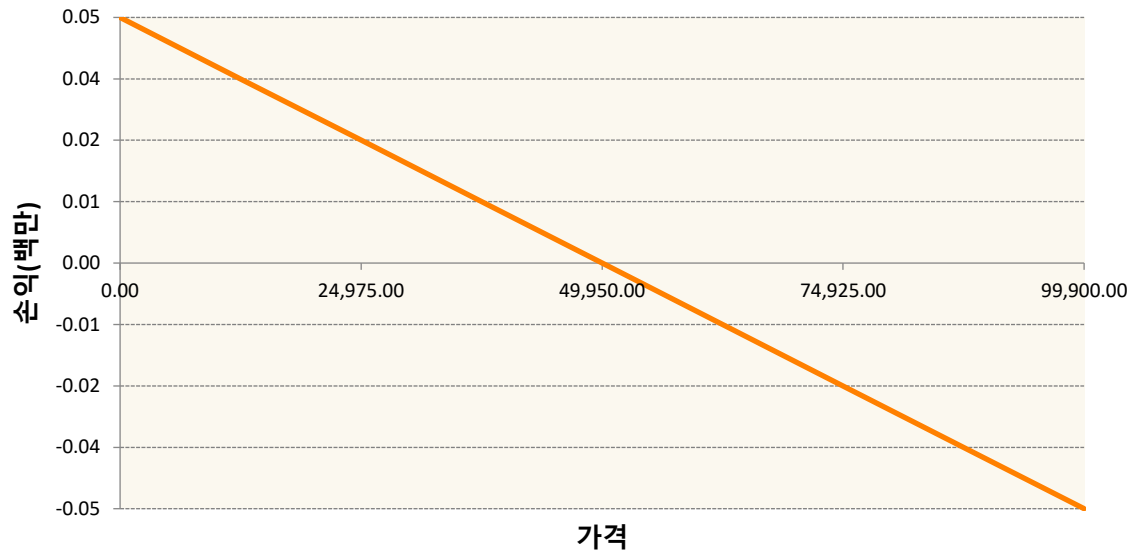
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 2,902 | -2,902    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### KR41CNTB0009-2023-11 포스코DX개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물  
 KR4124TB00 2023-11 LG전자개별선물  
 KR41CNTB00 2023-11 포스코DX개별선물

|     |
|-----|
| 216 |
| 13  |
| 4   |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 238 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

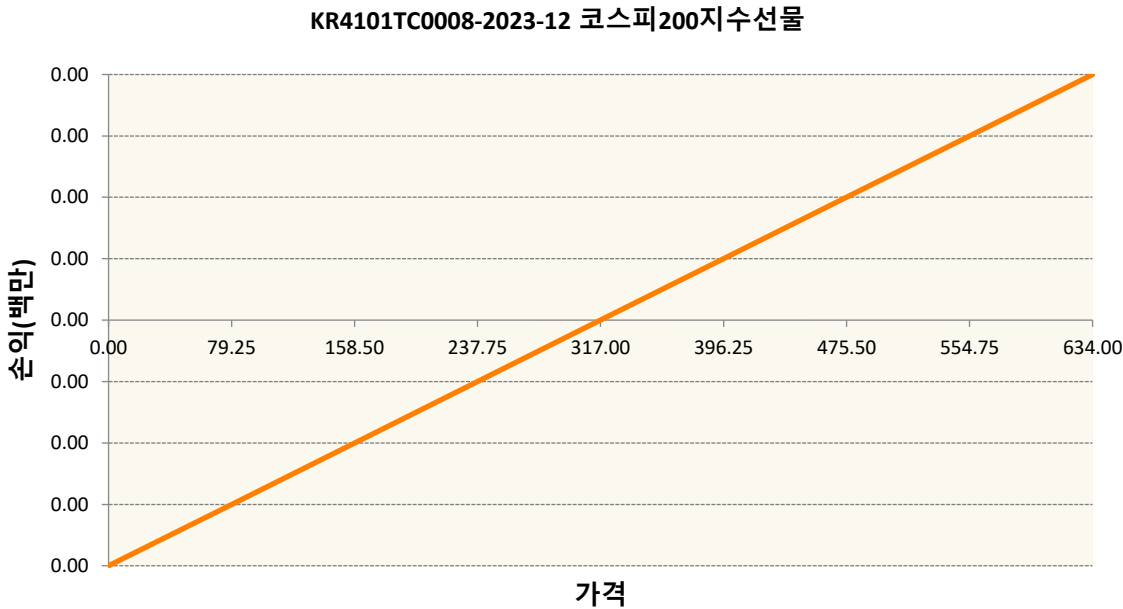
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 159   | 0     | 159       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 7,529 | 0     | 7,529     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 코스피200지수선물 |      |       |        | 599    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -599      | -599    | -599               | -599 | -599  | -599   | -599   |
| -5.33%       | -400      | -400    | -400               | -400 | -400  | -400   | -400   |
| -2.67%       | -200      | -200    | -200               | -200 | -200  | -200   | -200   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 200       | 200     | 200                | 200  | 200   | 200    | 200    |
| 5.33%        | 400       | 400     | 400                | 400  | 400   | 400    | 400    |
| 8.00%        | 599       | 599     | 599                | 599  | 599   | 599    | 599    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

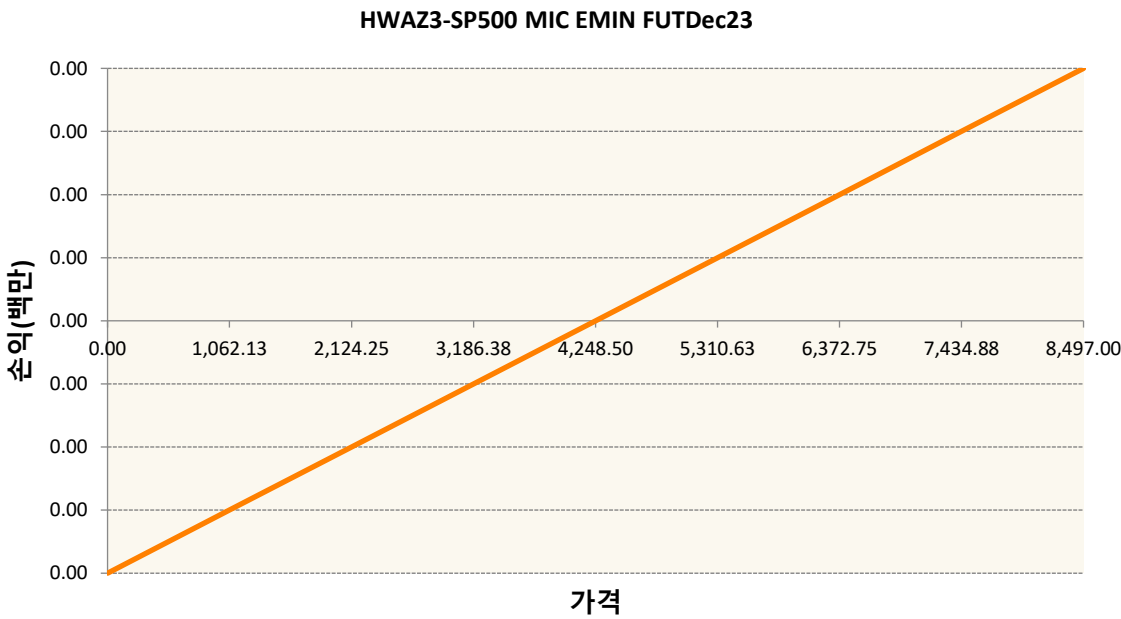
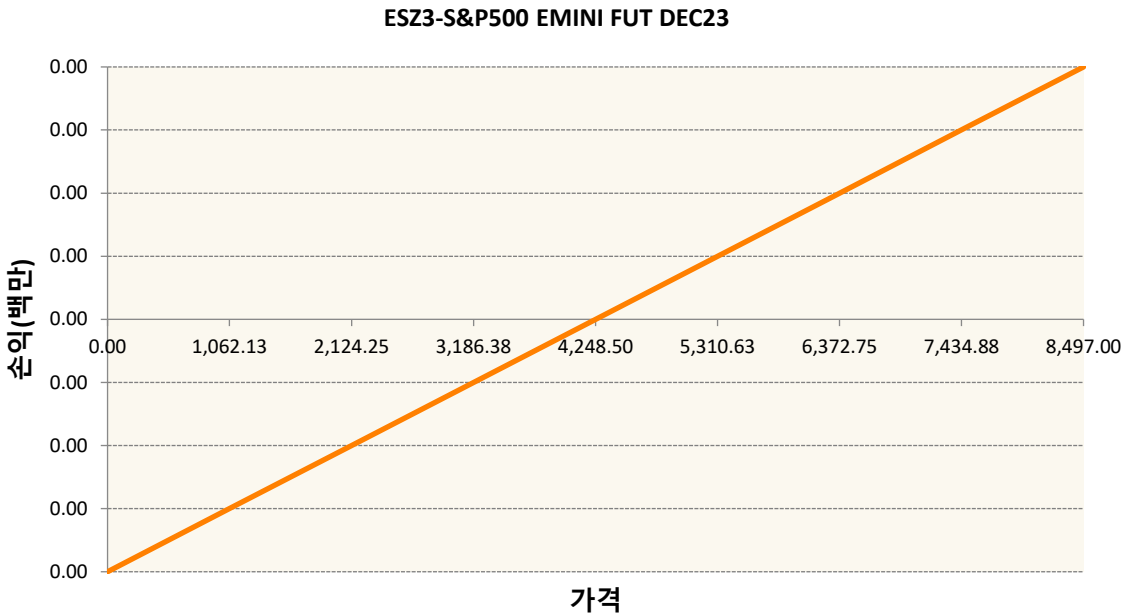
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 288   | 0     | 288       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,671 | 0     | 1,671     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| ESZ3                      | S&P500 EMINI FUT DEC23  | 23       |
| HWAZ3                     | SP500 MIC EMIN FUTDec23 | 134      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원)   |
|----------------------------------------|------------|
|                                        | <b>144</b> |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

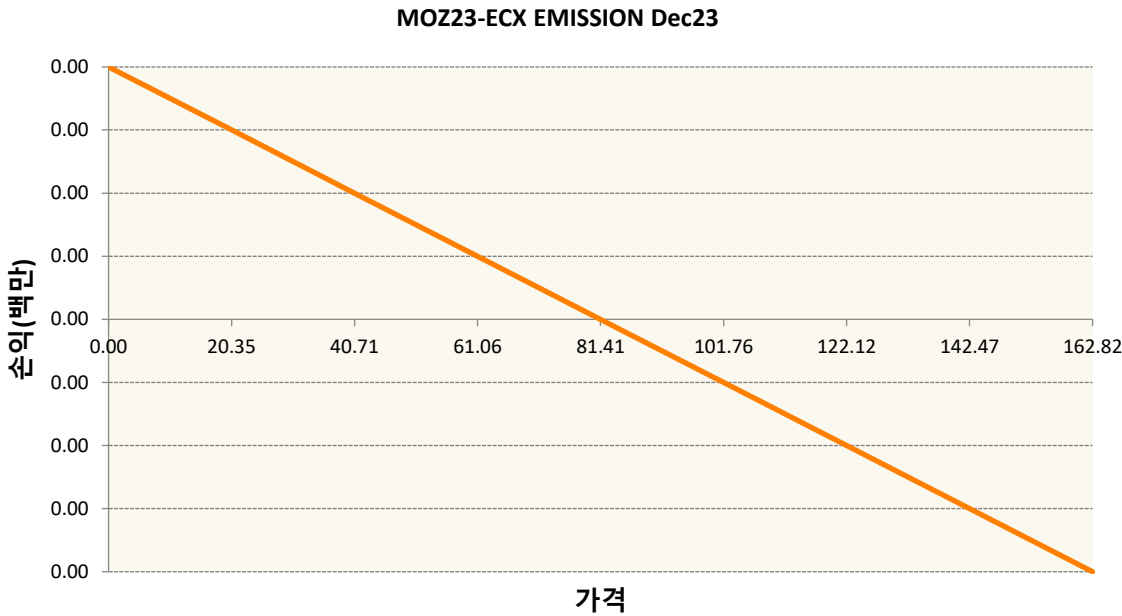
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 9,040 | -9,040    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 479   | 0     | 479       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,781 | -1,781    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213D9R\KRW/EUR 31-10-23E                        | 142 |
| MOZ23      ECX EMISSION Dec23                      | 723 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 1   |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,431 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

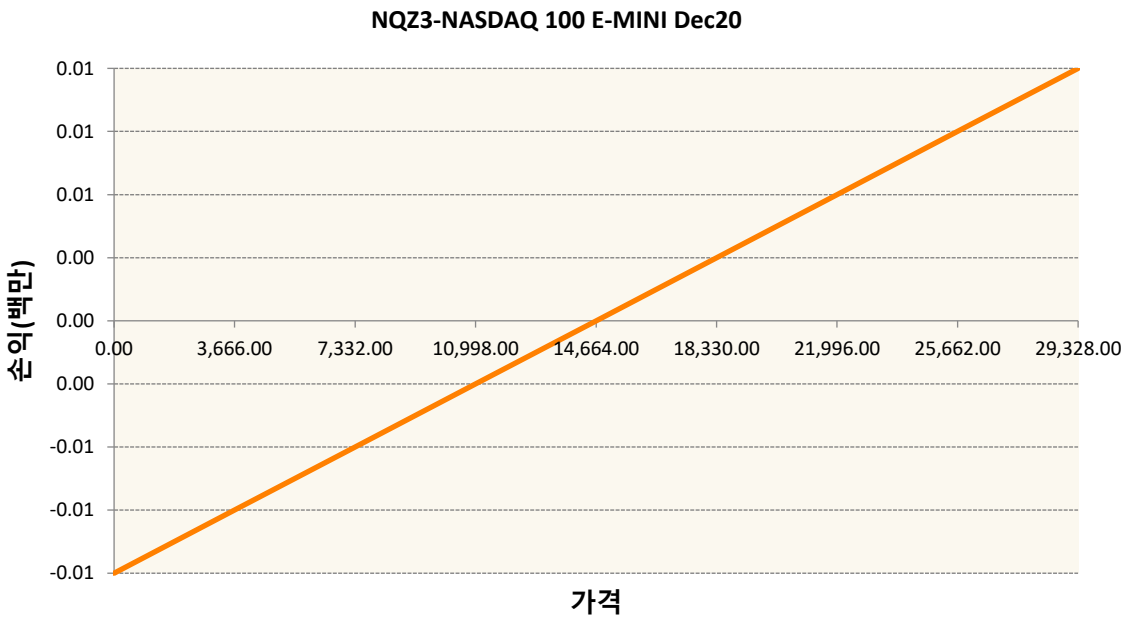
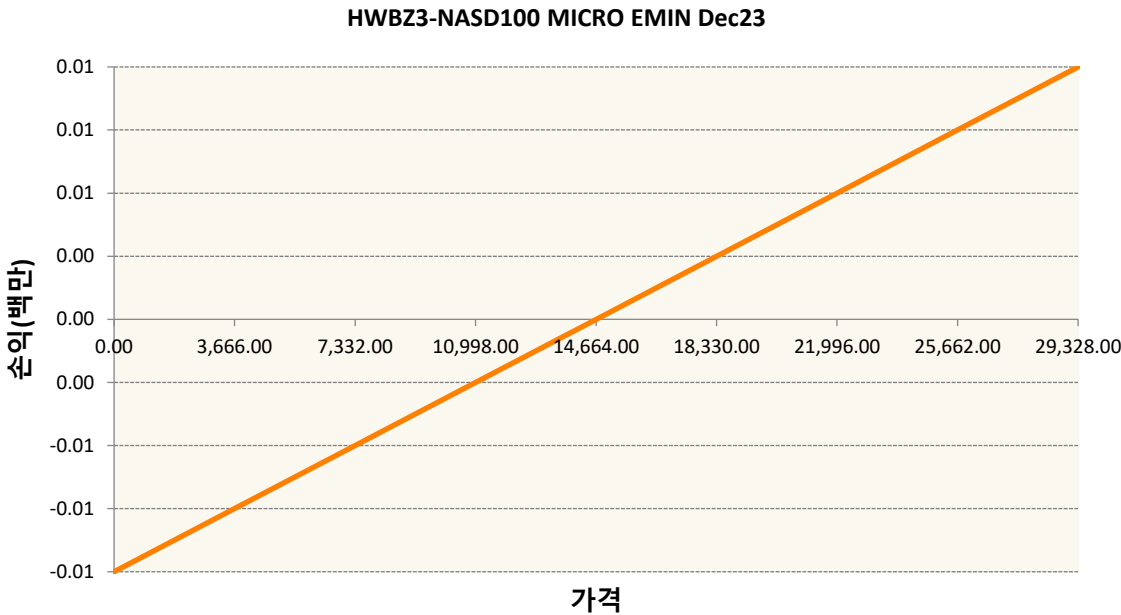
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 397   | 0     | 397       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,524 | 0     | 1,524     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| HWBZ3                     | NASD100 MICRO EMIN Dec23 | 122      |
| NQZ3                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  | 32       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 151      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-10-24 |
| 기준일 | 2023-10-23 |

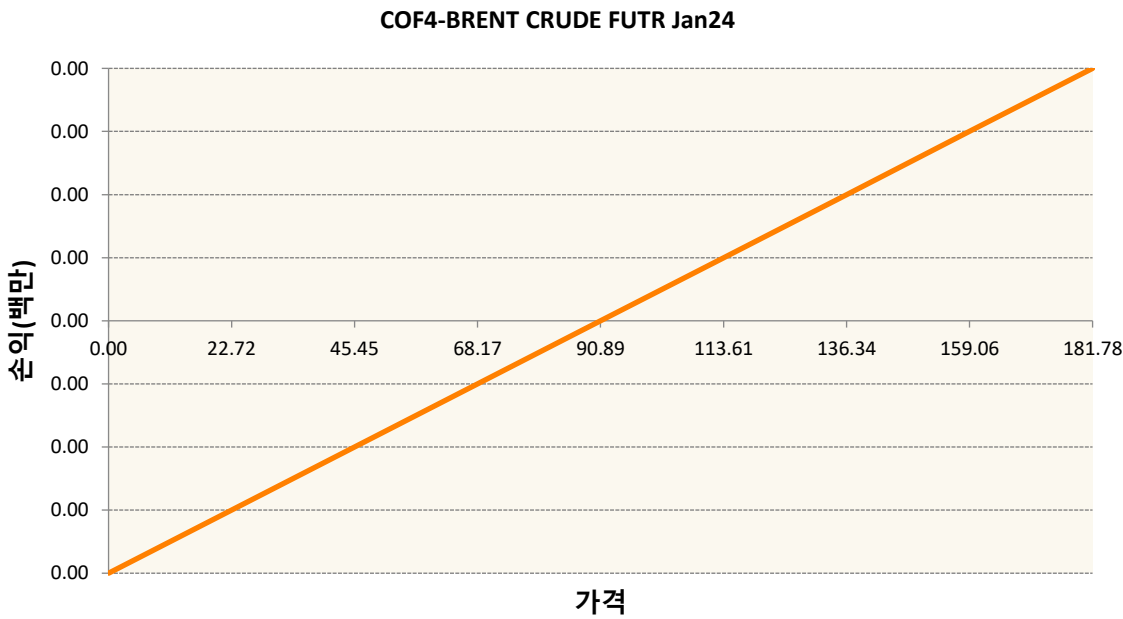
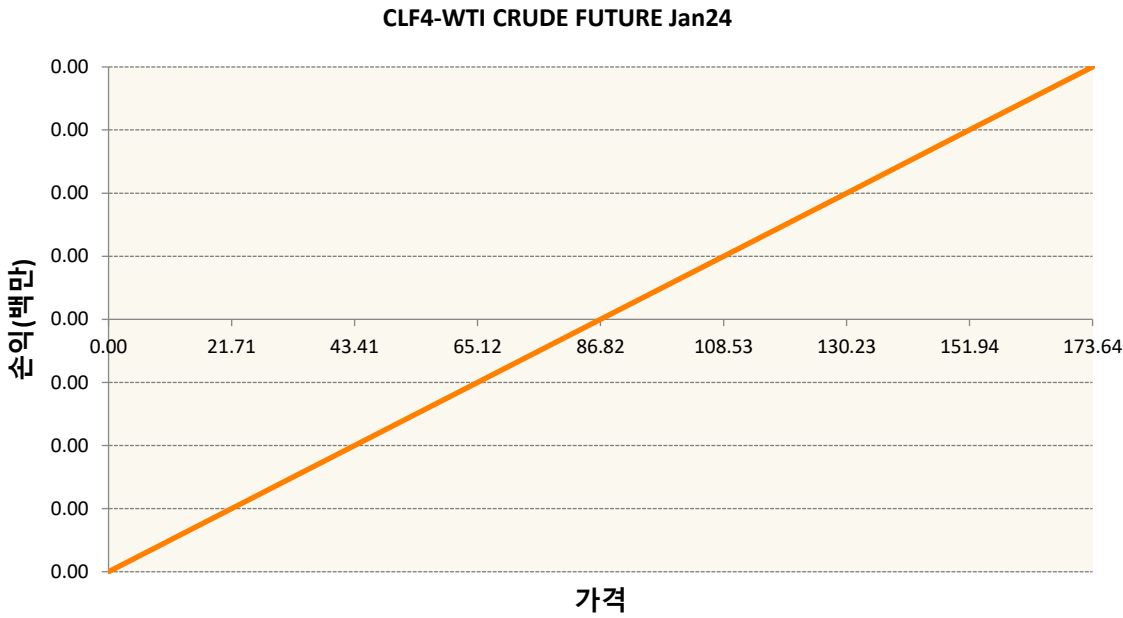
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

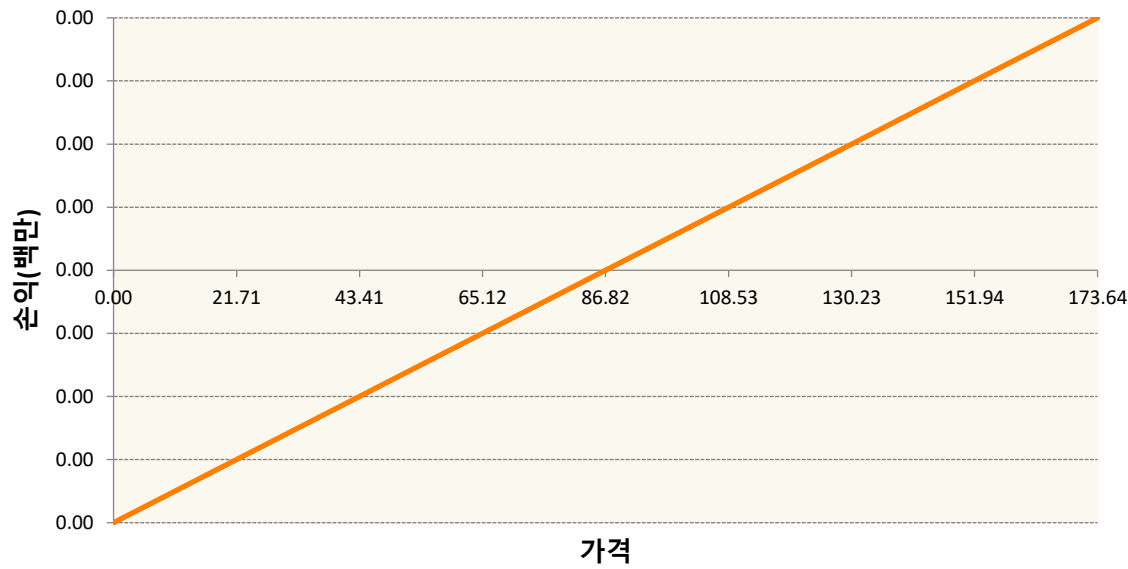
(단위:백만원)

| 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   | 1,554 | 0     | 1,554     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 230   | -230      | 장내 |

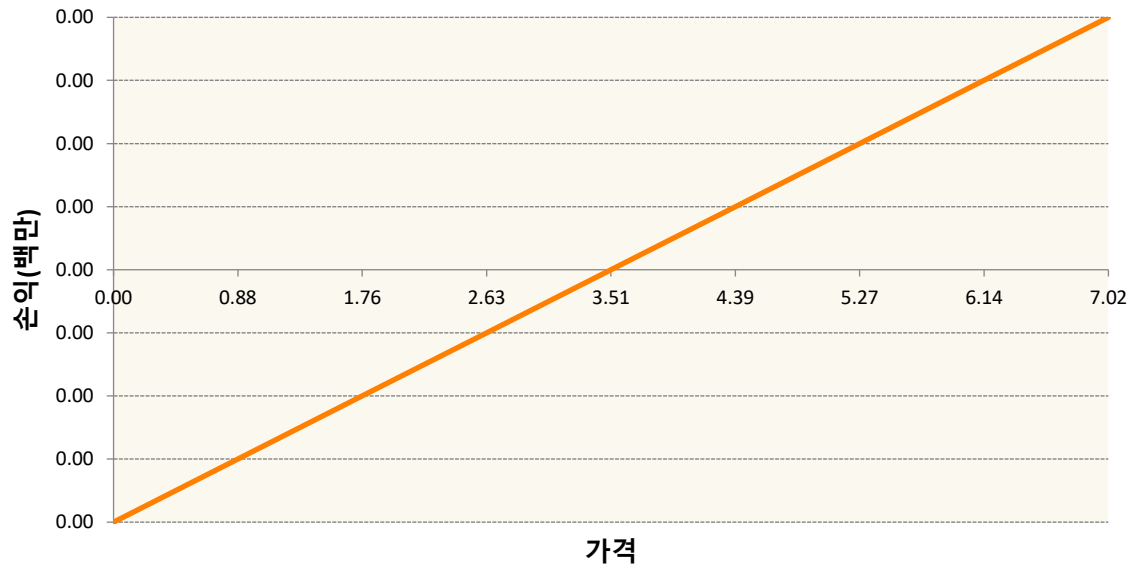
### 2. 만기시점의 손익구조



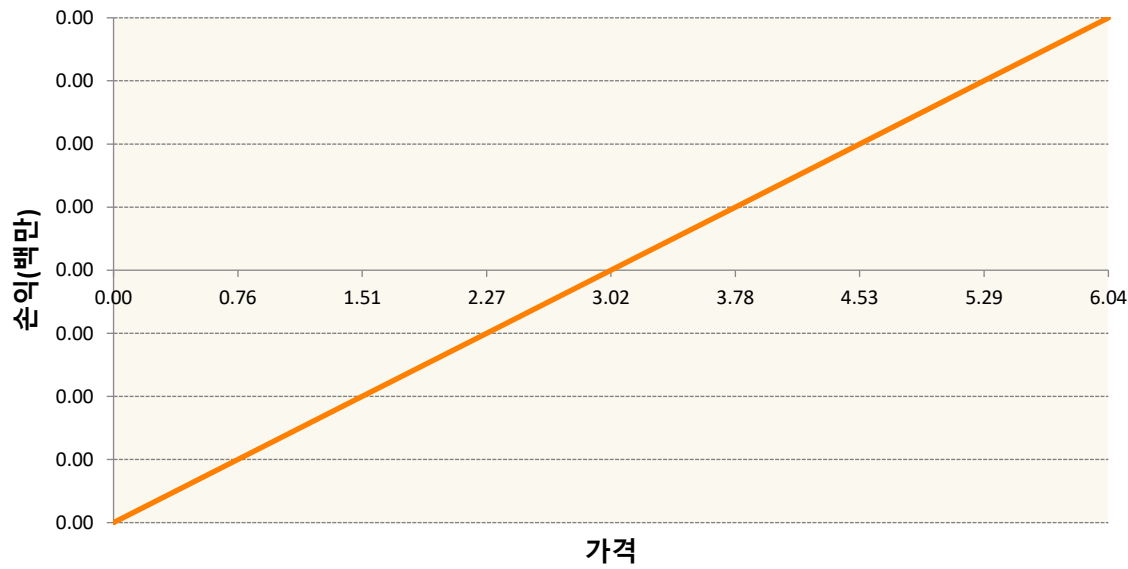
ECF4-E-MINI CRUDE OIL Jan24



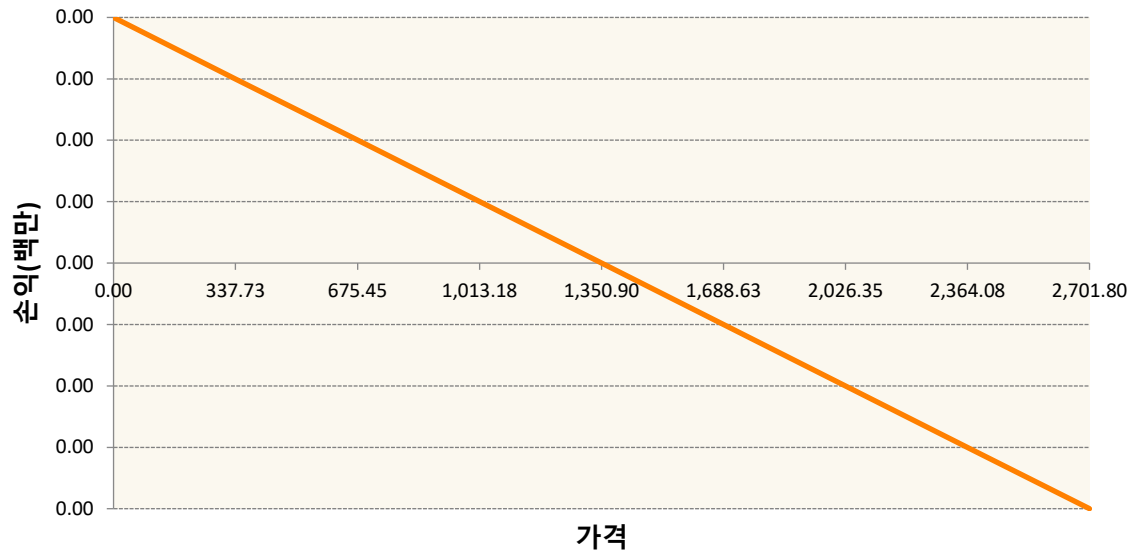
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



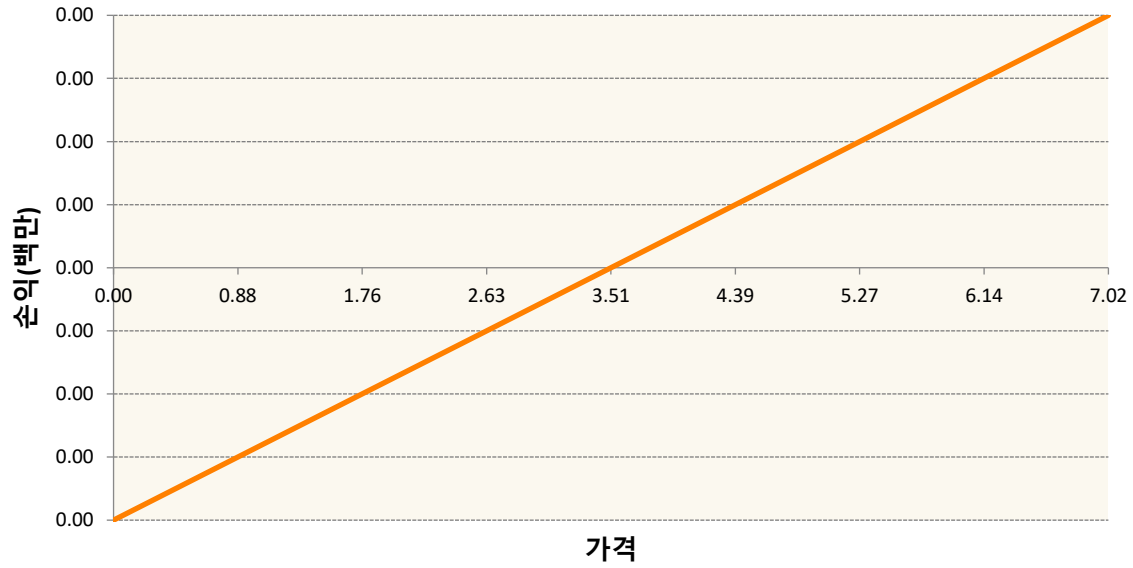
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



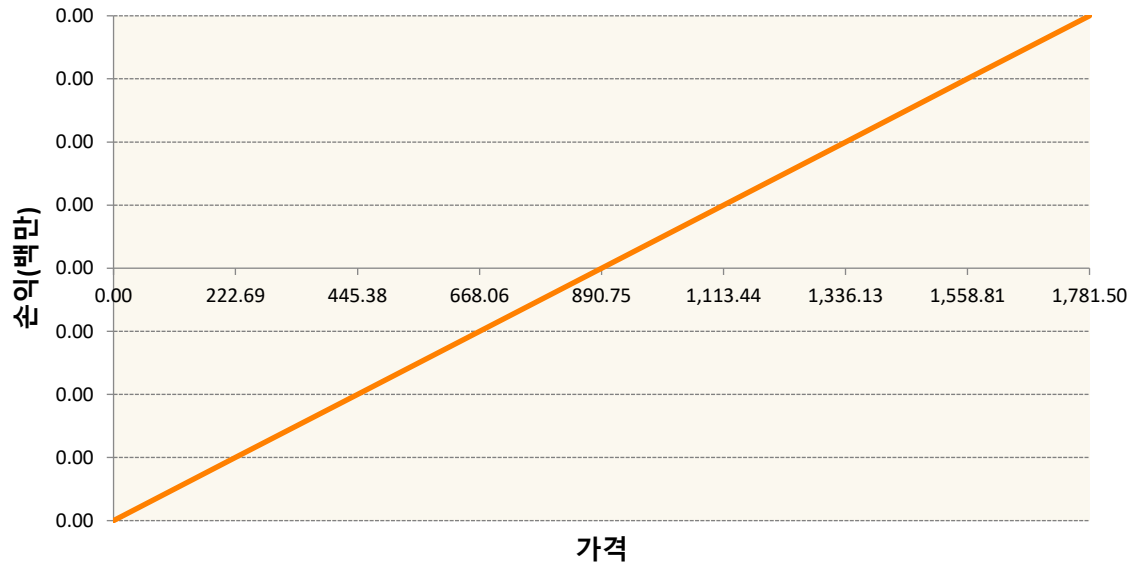
KR4175TB0000-2023-11 달러선물

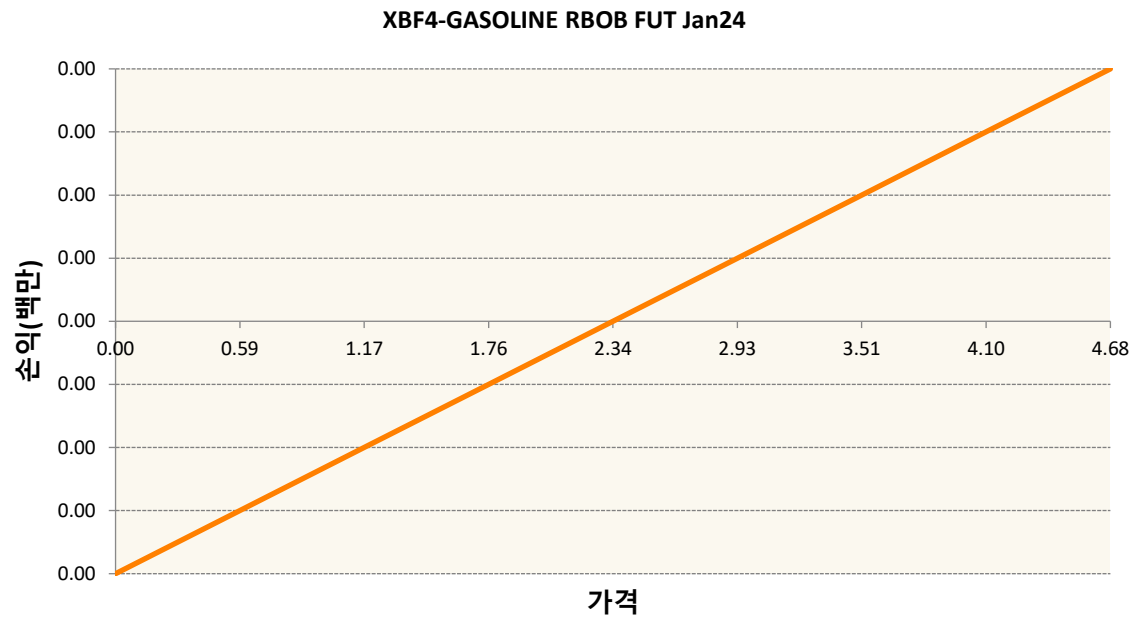


NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| CLF4                      | WTI CRUDE FUTURE Jan24   | 28       |
| COF4                      | BRENT CRUDE FUTR Jan24   | 29       |
| ECF4                      | E-MINI CRUDE OIL Jan24   | 5        |
| EOF4                      | E-MINI NATURAL GAS Jan24 | 3        |
| HOF4                      | NY Harb ULSD Fut Jan24   | 14       |
| KR4175TB00 2023-11 달러선물   |                          | 18       |
| NGF24                     | NATURAL GAS FUTR Jan24   | 26       |
| QSF4                      | Low Su Gasoil G Jan24    | 10       |
| XBF4                      | GASOLINE RBOB FUT Jan24  | 11       |

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