

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

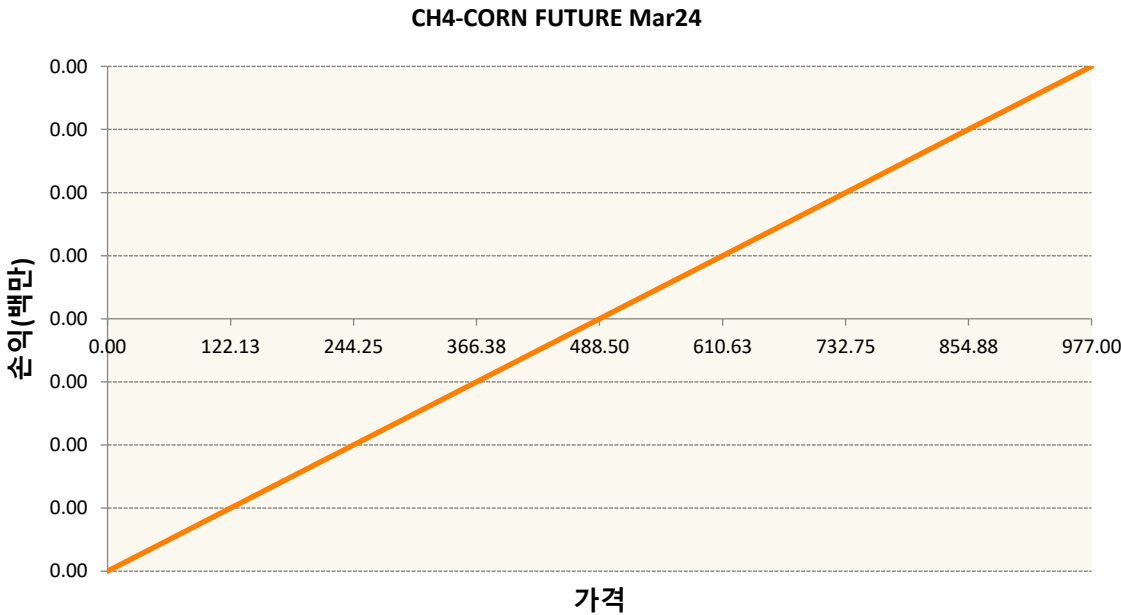
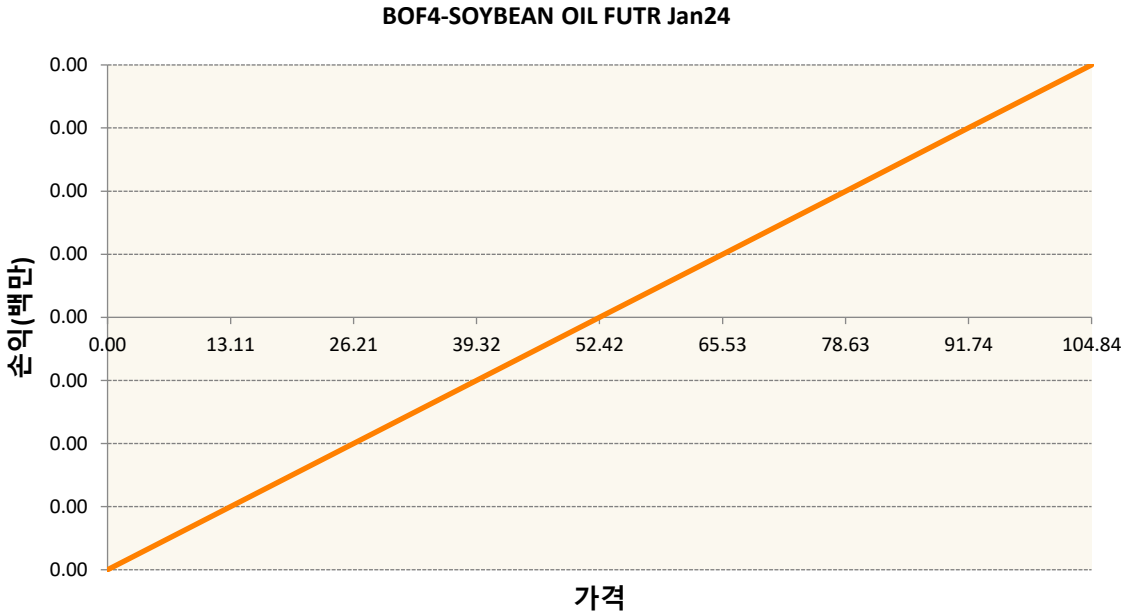
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

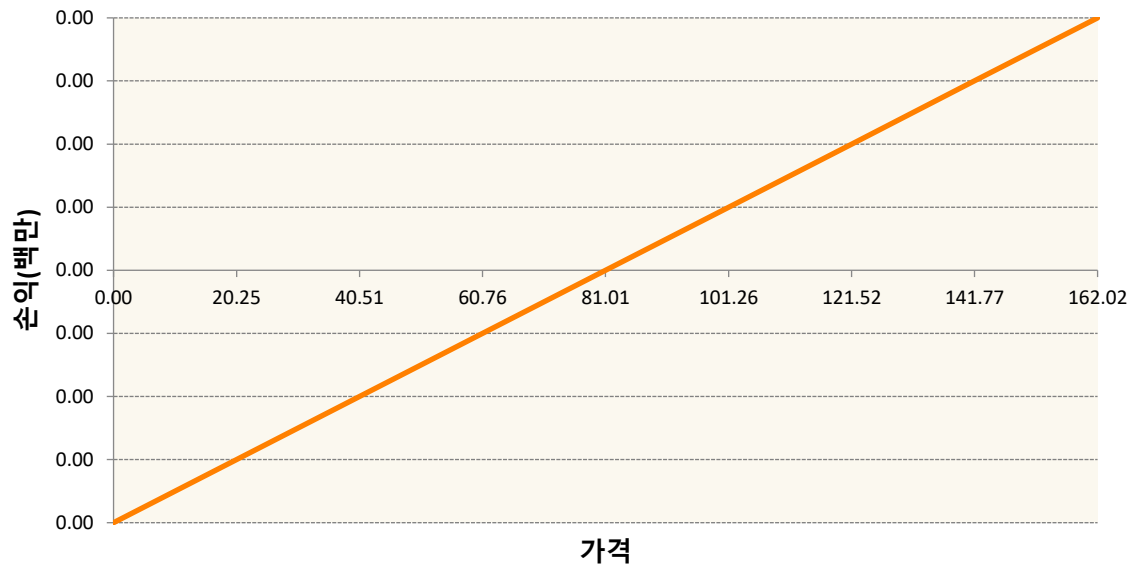
(단위:USD 백만)

| 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   | 4,973 | 0     | 4,973     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 739   | -739      | 장내 |

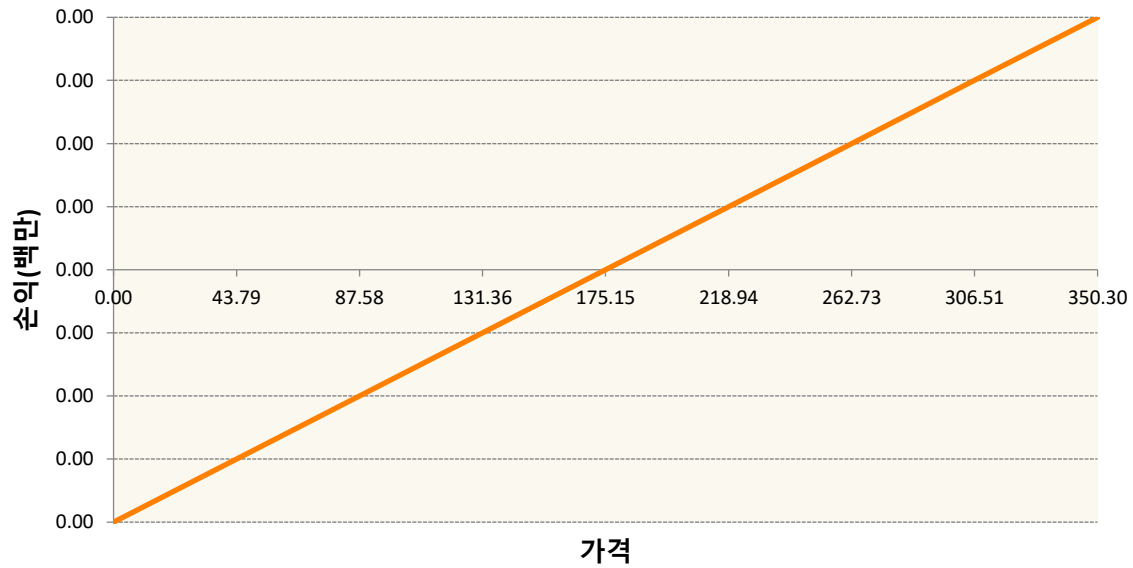
### 2. 만기시점의 손익구조



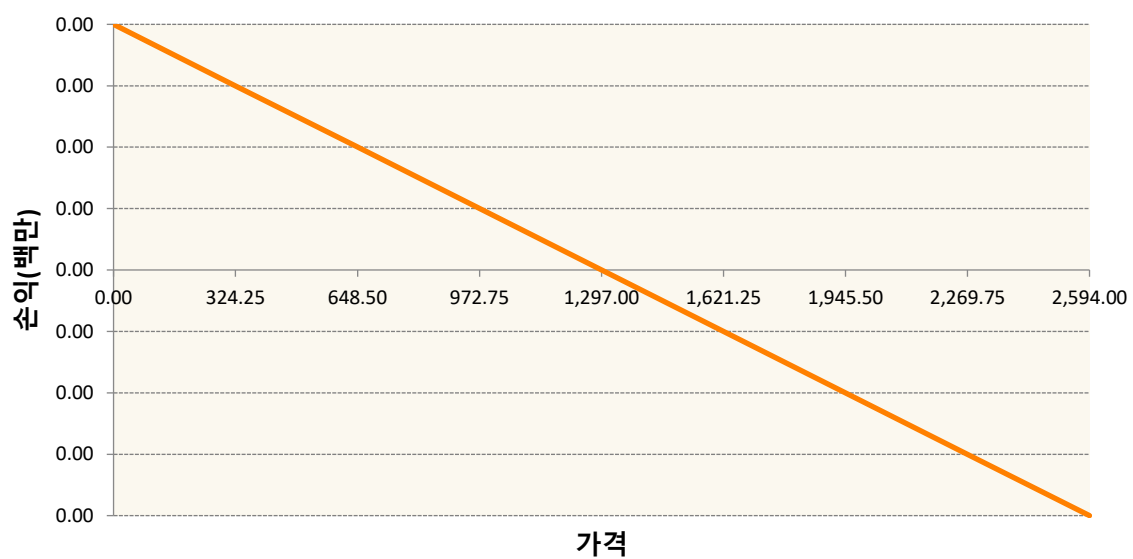
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



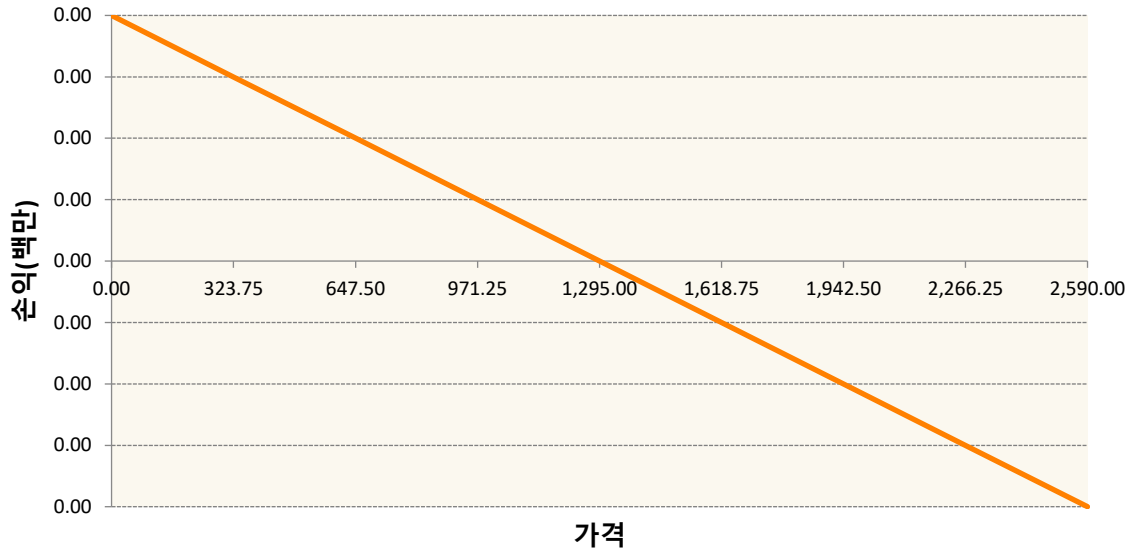
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



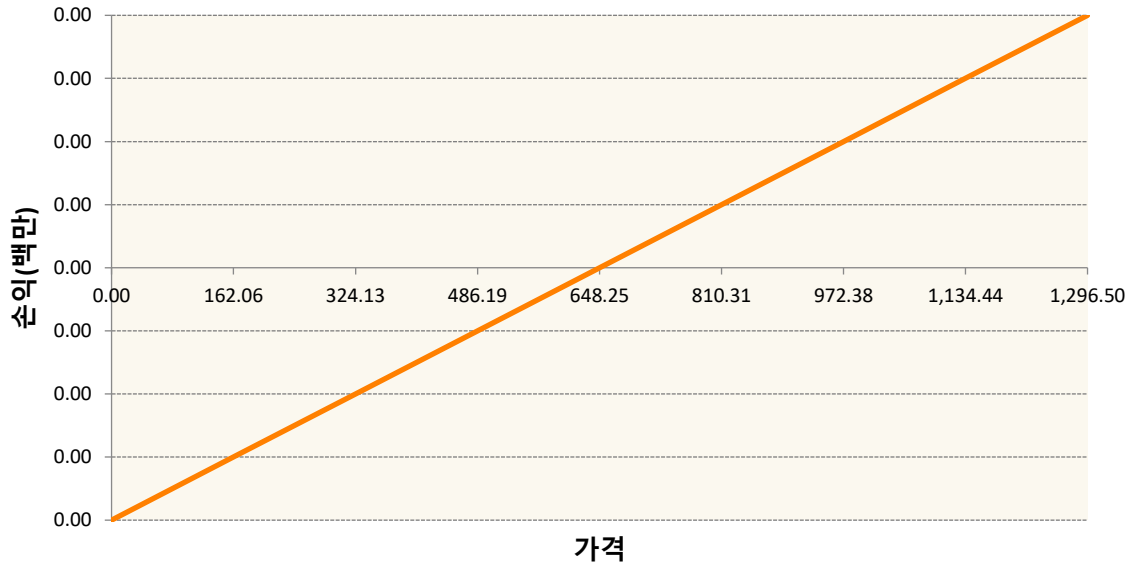
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



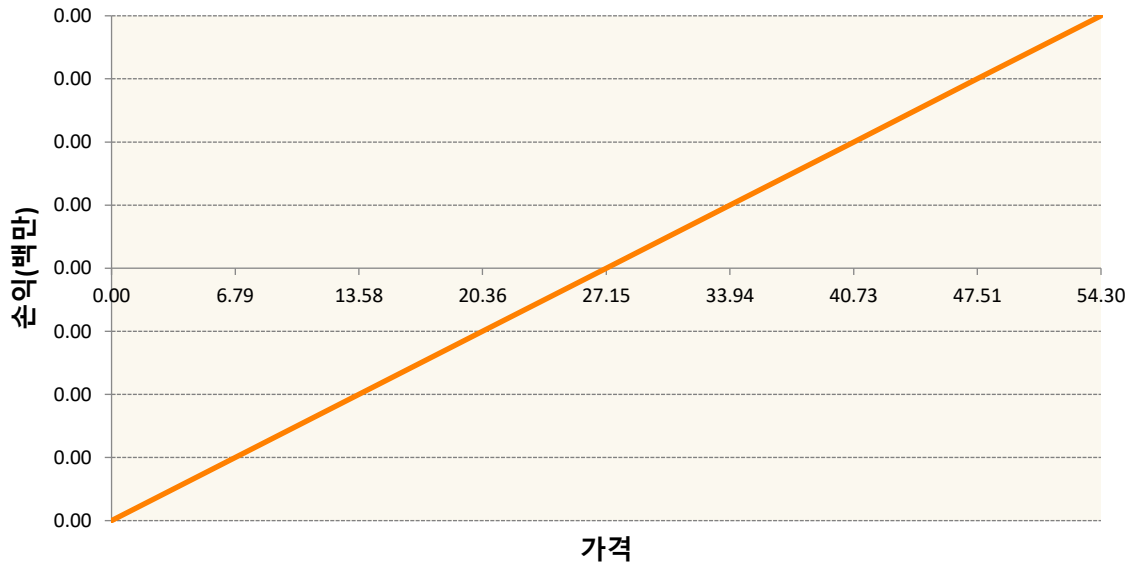
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



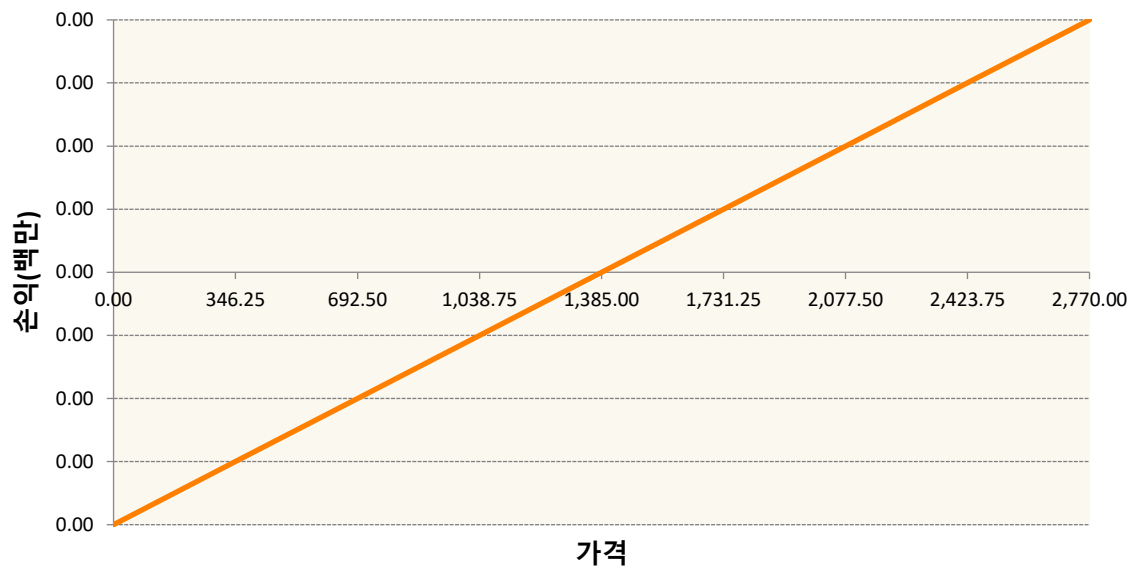
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



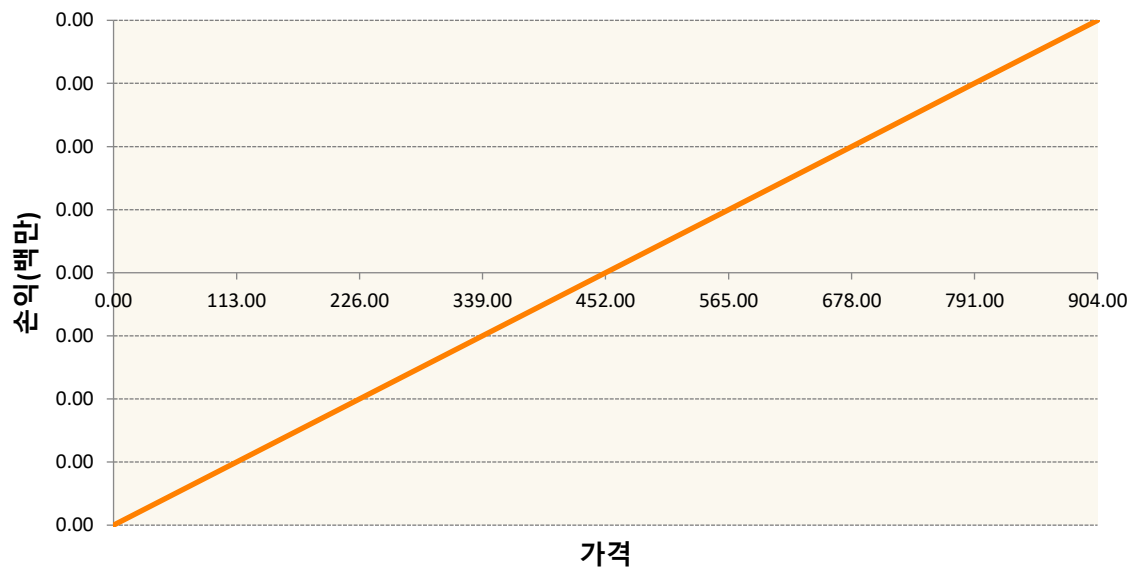
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



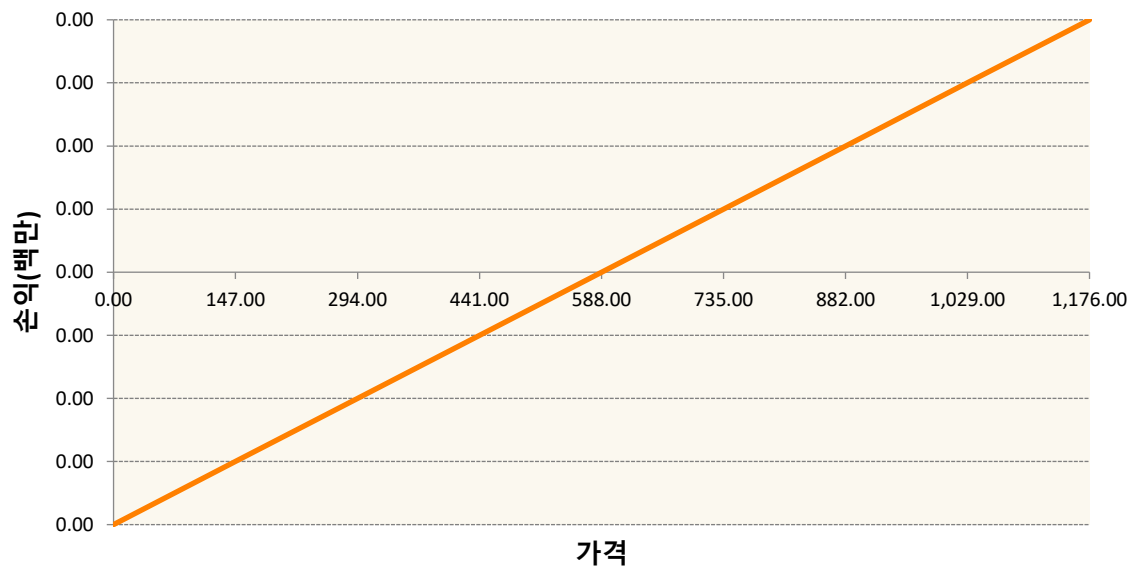
SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



SMF4-SOYBEAN MEAL FUTR Jan24



WH4-WHEAT FUTURE(CBT) Mar24



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

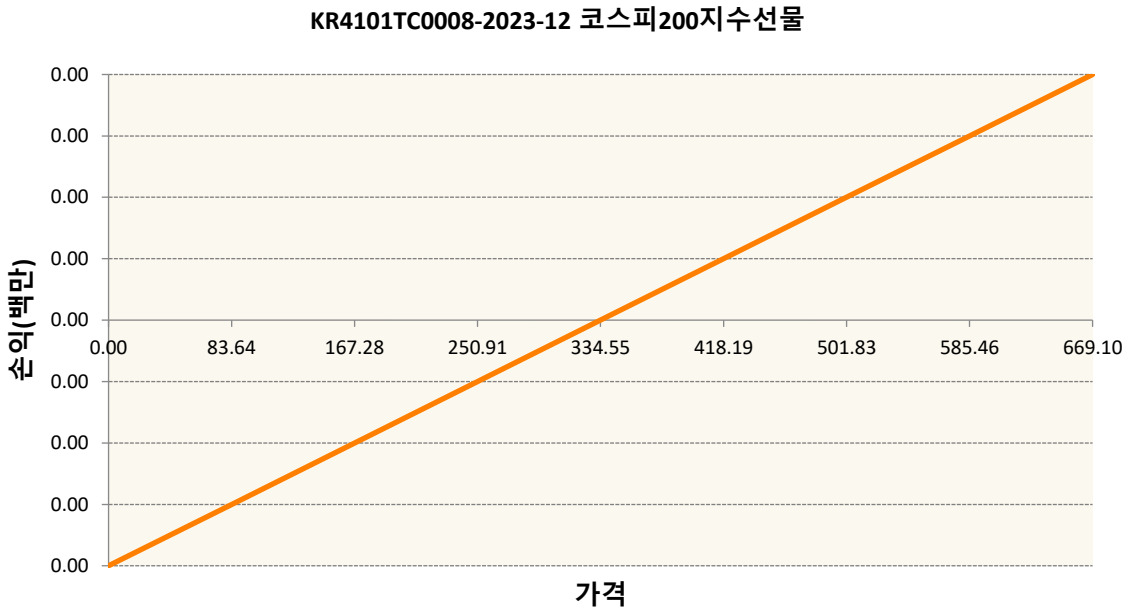
스마트인덱스모

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   | 1,422 | 0     | 1,422     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 코스피200지수선물 |      |       |        | 114    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -114      | -114    | -114               | -114 | -114  | -114   | -114   |
| -5.33%       | -76       | -76     | -76                | -76  | -76   | -76    | -76    |
| -2.67%       | -38       | -38     | -38                | -38  | -38   | -38    | -38    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 38        | 38      | 38                 | 38   | 38    | 38     | 38     |
| 5.33%        | 76        | 76      | 76                 | 76   | 76    | 76     | 76     |
| 8.00%        | 114       | 114     | 114                | 114  | 114   | 114    | 114    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

## 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 | 318 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 285 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

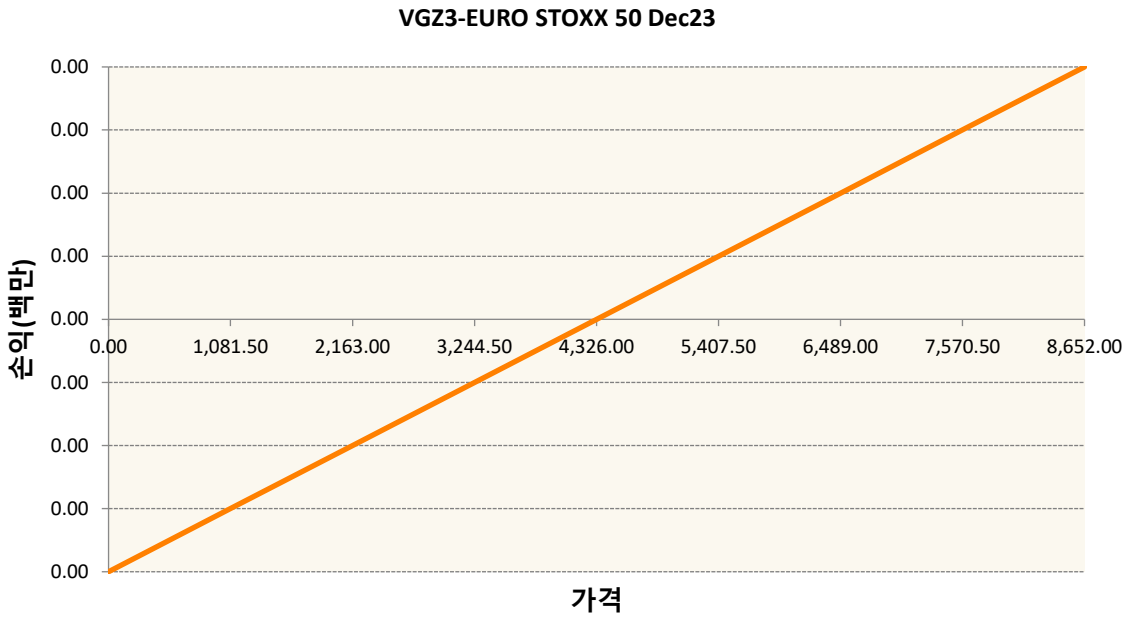
유로인덱스모(주식-파생형)

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   | 984   | 0     | 984       |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 211   | 0     | 211       | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |    |
|-----------------------------|----|
| FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E | 17 |
| VGZ3 EURO STOXX 50 Dec23    | 79 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 76 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

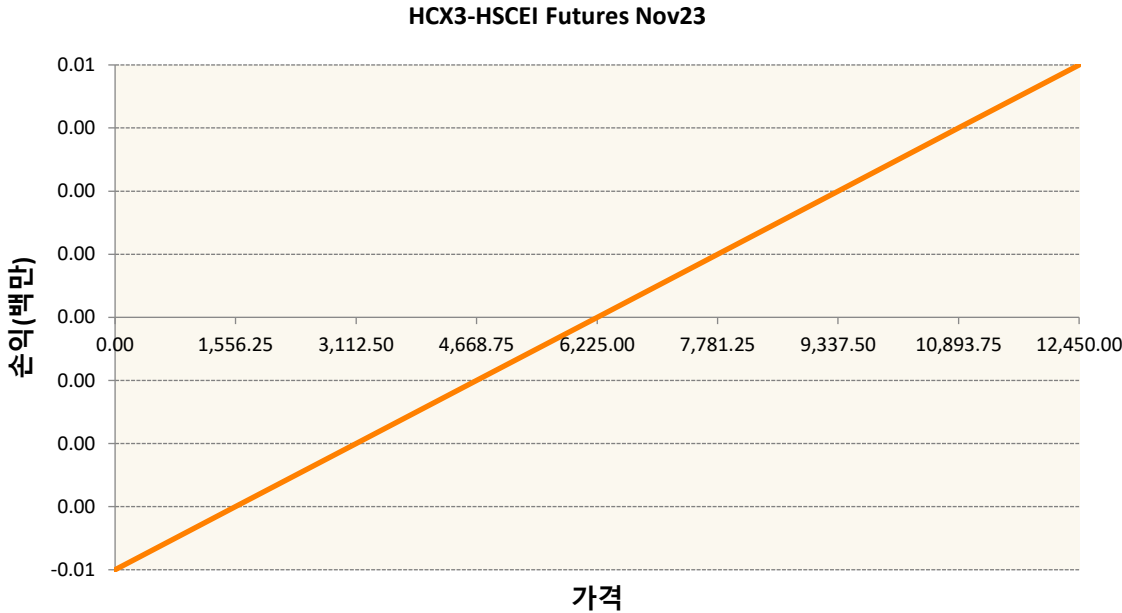
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,282 | 0     | 1,282     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HGX3 | HSCEI Futures Nov23 | 103 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

150

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

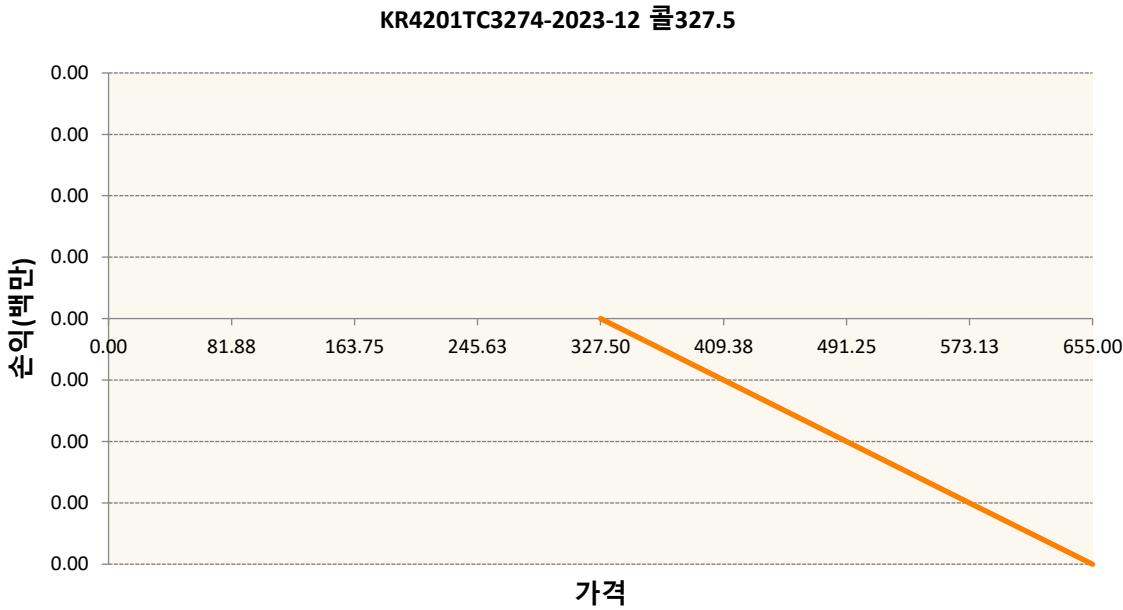
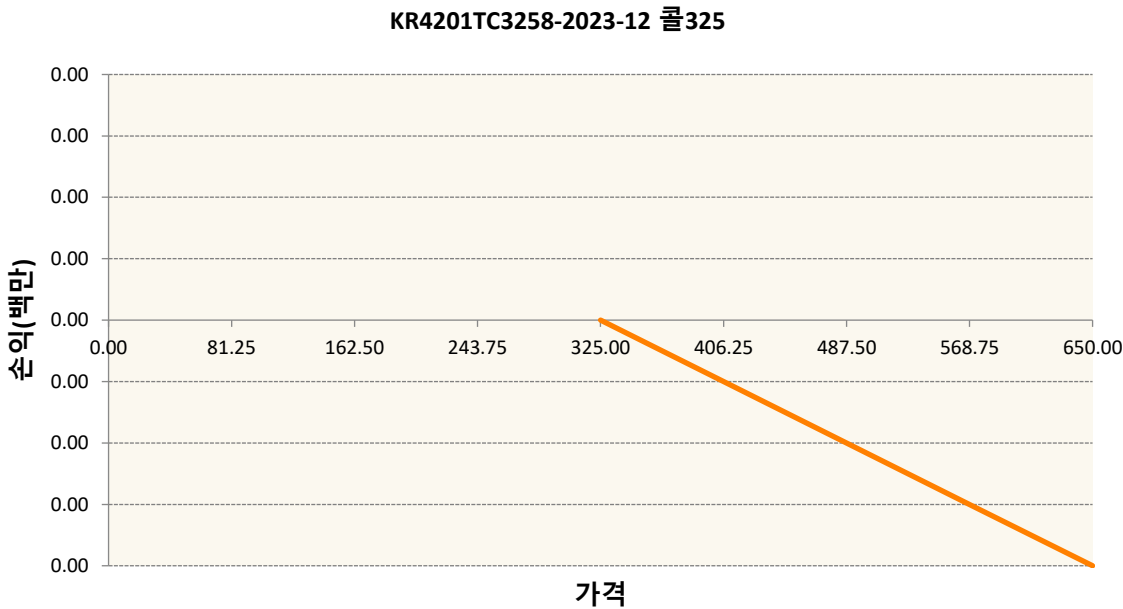
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

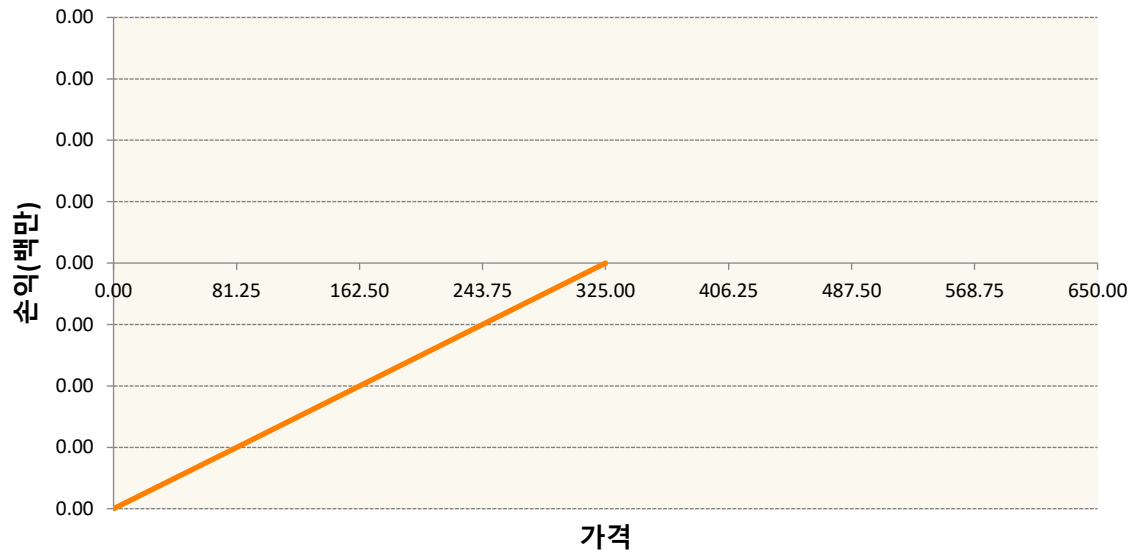
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 51,721 | -51,721   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301TC3257-2023-12 풋325



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201TC3258 |           |         | 2023-12 콜325   |        |        |        | 2,617  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 1,564     | 1,506   | 1,444          | 1,379  | 1,310  | 1,239  | 1,166  |
| -5.33%       | 1,312     | 1,231   | 1,149          | 1,065  | 981    | 896    | 810    |
| -2.67%       | 877       | 787     | 697            | 606    | 516    | 426    | 336    |
| 0%           | 247       | 166     | 84             | 0      | -85    | -171   | -257   |
| 2.67%        | -548      | -606    | -670           | -738   | -809   | -883   | -959   |
| 5.33%        | -1,453    | -1,488  | -1,531         | -1,579 | -1,632 | -1,690 | -1,752 |
| 8.00%        | -2,419    | -2,437  | -2,462         | -2,492 | -2,529 | -2,570 | -2,617 |
| KR4201TC3274 |           |         | 2023-12 콜327.5 |        |        |        | 416    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 233       | 225     | 215            | 206    | 195    | 184    | 173    |
| -5.33%       | 199       | 186     | 173            | 160    | 147    | 134    | 120    |
| -2.67%       | 136       | 122     | 107            | 92     | 77     | 63     | 48     |
| 0%           | 42        | 28      | 14             | 0      | -14    | -29    | -43    |
| 2.67%        | -80       | -91     | -102           | -114   | -127   | -140   | -153   |
| 5.33%        | -223      | -230    | -238           | -247   | -257   | -267   | -278   |
| 8.00%        | -379      | -382    | -387           | -393   | -400   | -407   | -416   |
| KR4301TC3257 |           |         | 2023-12 풋325   |        |        |        | 440    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -400      | -405    | -410           | -417   | -424   | -432   | -440   |
| -5.33%       | -193      | -204    | -215           | -227   | -238   | -250   | -263   |
| -2.67%       | -45       | -59     | -73            | -86    | -100   | -113   | -127   |
| 0%           | 32        | 22      | 11             | 0      | -11    | -23    | -35    |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 2.67% | 59 | 55 | 49 | 43 | 35 | 27 | 19 |
| 5.33% | 65 | 64 | 62 | 59 | 56 | 52 | 47 |
| 8.00% | 66 | 66 | 66 | 65 | 63 | 62 | 59 |

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

(단위:백만원)

3,406

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

## 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 | 1,962 | 0     | 1,962     |    |

### 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 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

## 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 | 4,525 | 0     | 4,525     |    |

### 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 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

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 | 17,094 | 0      | 17,094    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 16,568 | -16,568   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |                                 | (단위:백만원) |
|-----------------------------|---------------------------------|----------|
| FXW213D8W KRW/USD 30-11-23E |                                 | 590      |
| FXW213D9R KRW/USD 29-12-23E |                                 | 503      |
| FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E |                                 | 185      |
| FXW213DB7 KRW/USD 30-11-23E |                                 | 47       |
| IE00BD8RGM75                | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |          |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 711      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

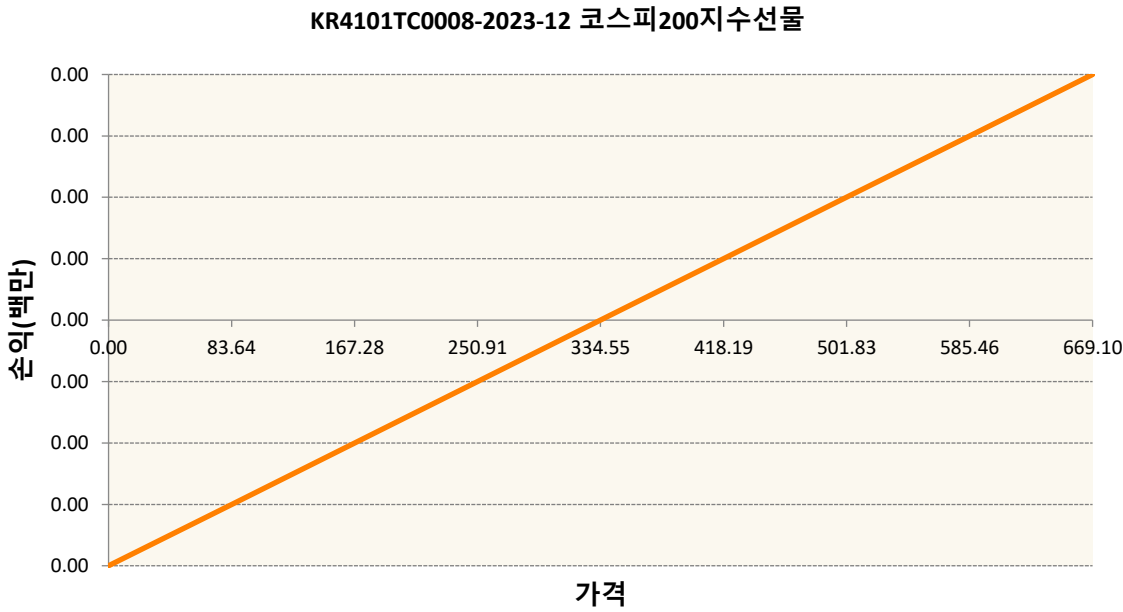
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 502   | 0     | 502       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 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%       | -27       | -27     | -27                | -27 | -27   | -27    | -27    |
| -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%        | 27        | 27      | 27                 | 27  | 27    | 27     | 27     |
| 8.00%        | 40        | 40      | 40                 | 40  | 40    | 40     | 40     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

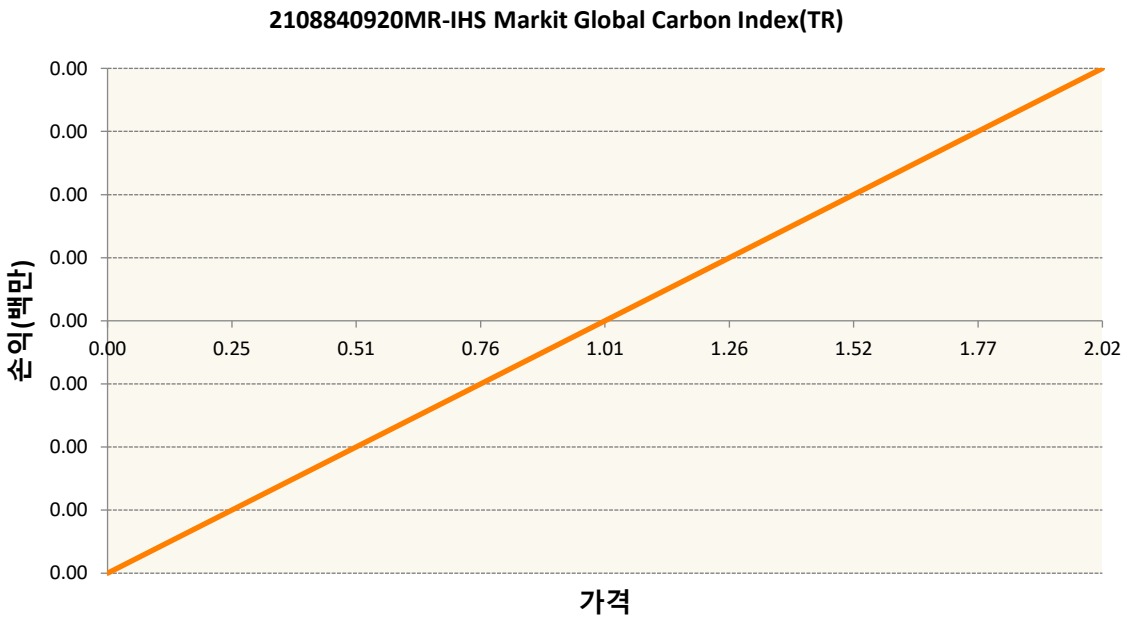
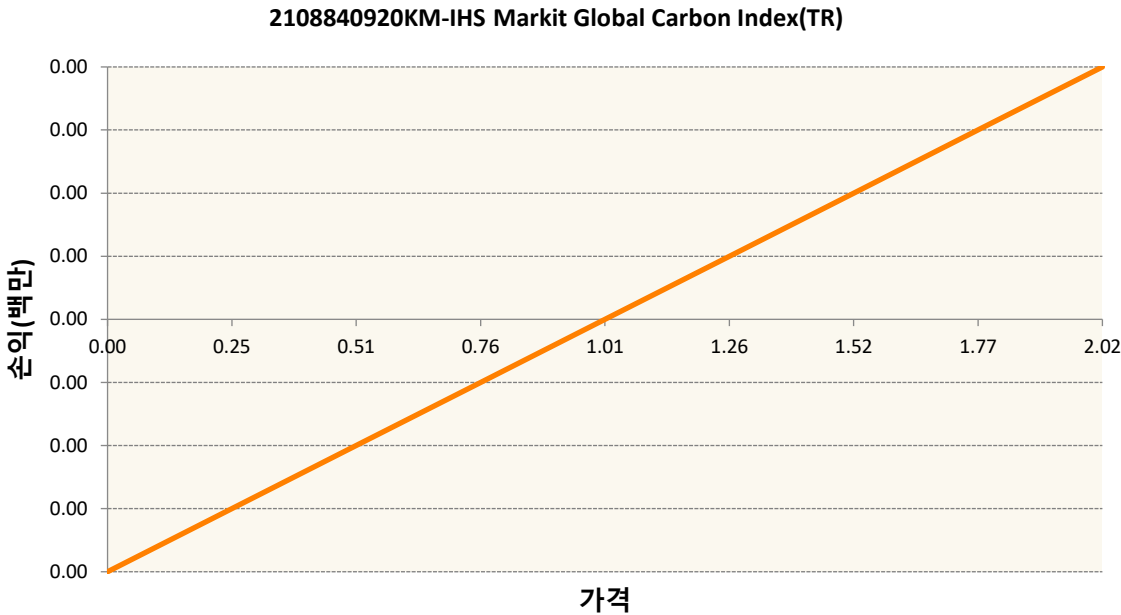
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

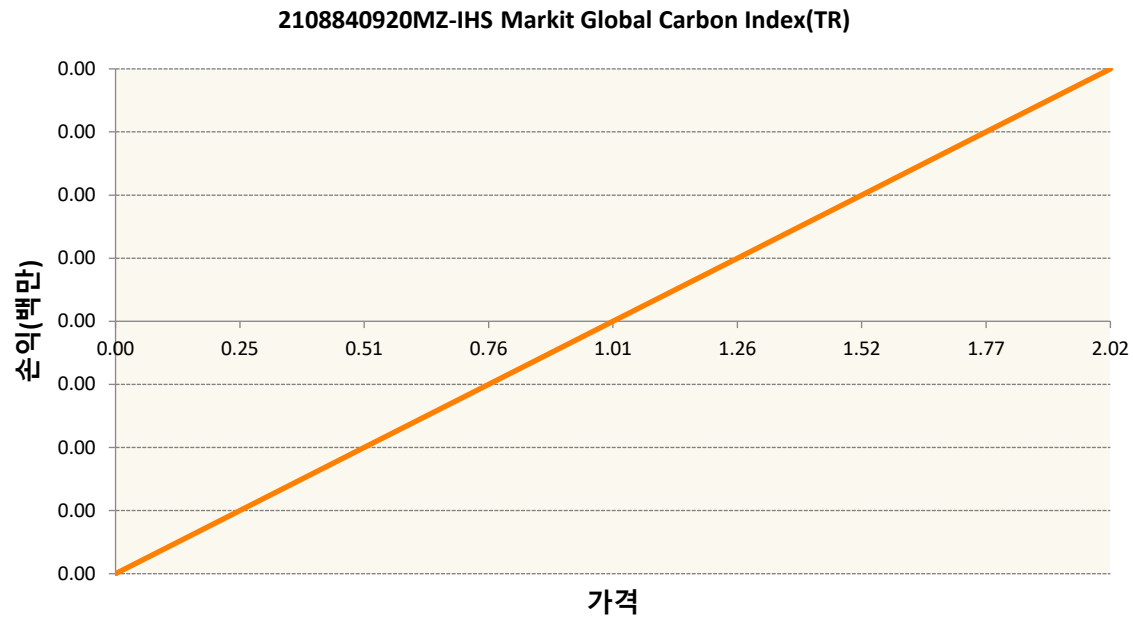
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 17,887 | 0     | 17,887    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                    |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------|--|----------|
| 2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 1,019    |
| 2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 204      |
| 2108840920IHS Markit Global Carbon Index(TR) |  | 204      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 1,833    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

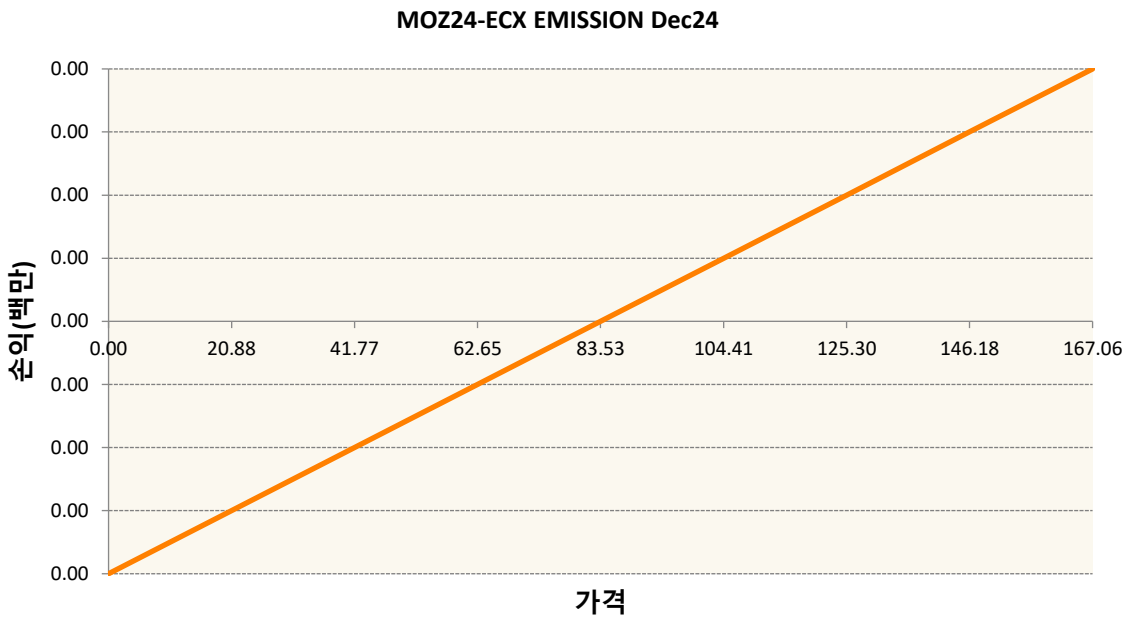
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 9,063 | 0     | 9,063     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 479   | 0     | 479       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,434 | -1,434    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E                        | 115 |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 725 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 2   |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,383 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

## 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)  | 6 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠) | 6 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)  | 4 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)  | 5 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 32 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

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)  | 2 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(메리츠) | 3 |
| 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)

|    |
|----|
| 10 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

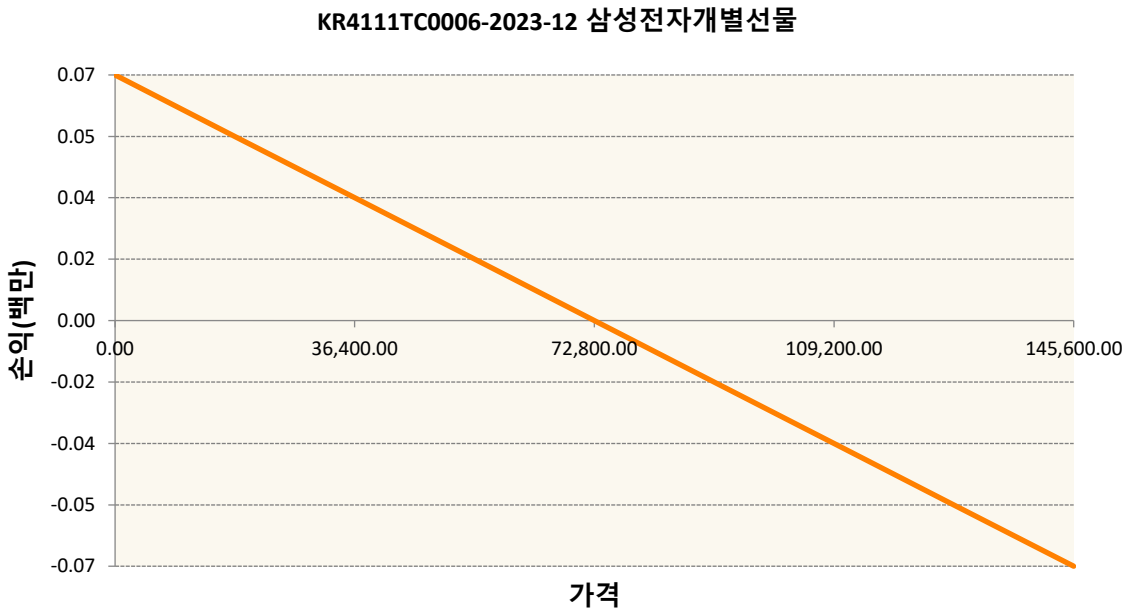
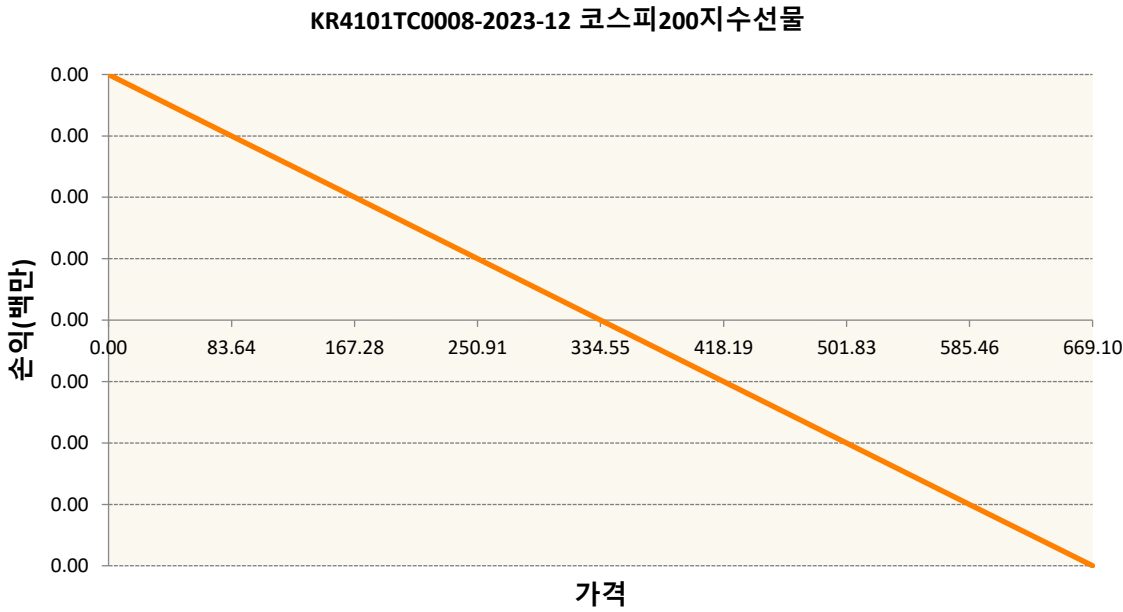
## 에퀴티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

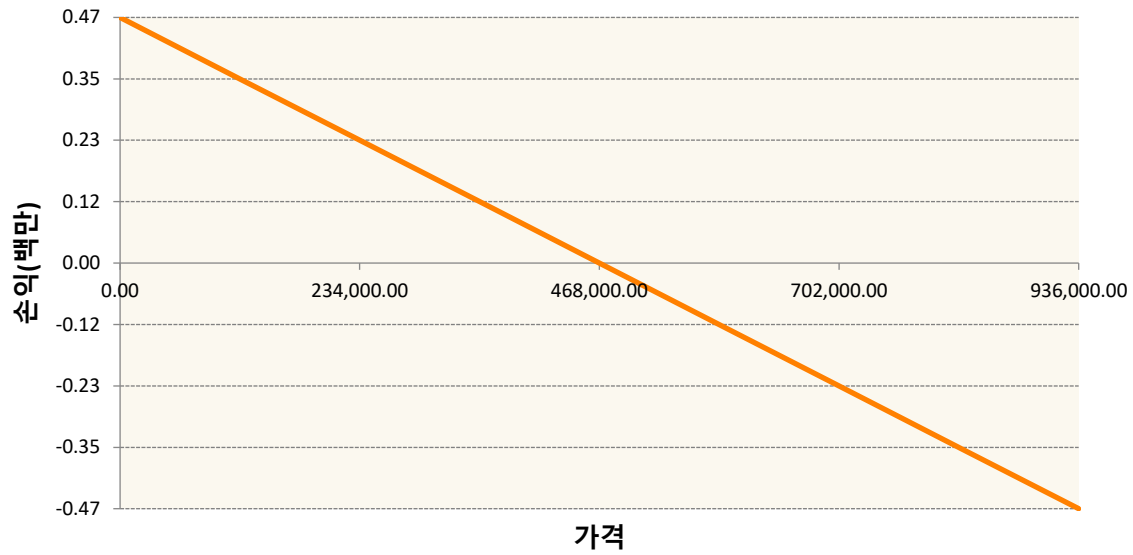
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 16    | 28    | -11       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 66    | 2,737 | -2,671    | 장내 |

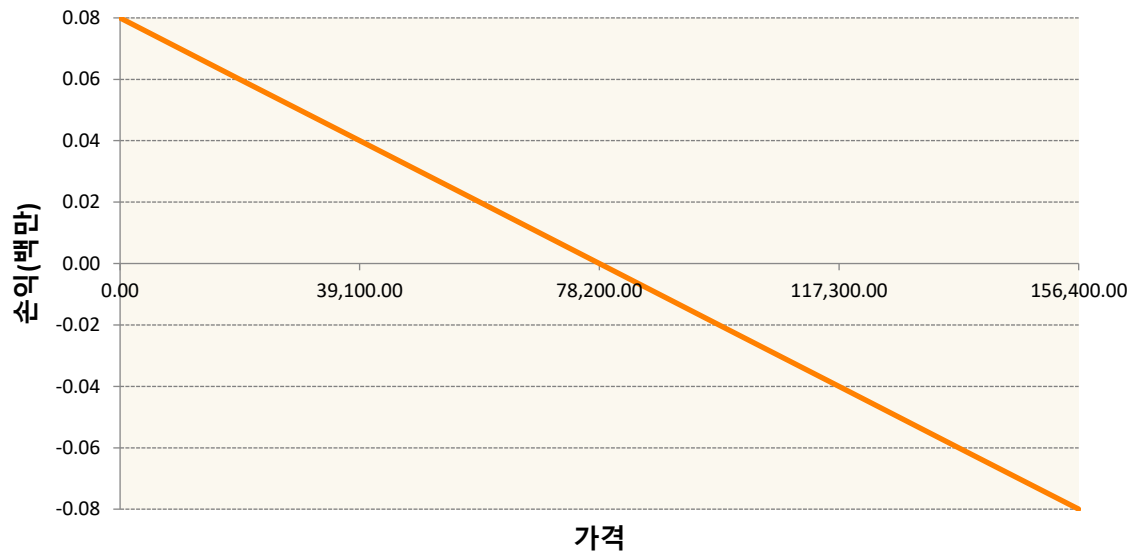
### 2. 만기시점의 손익구조



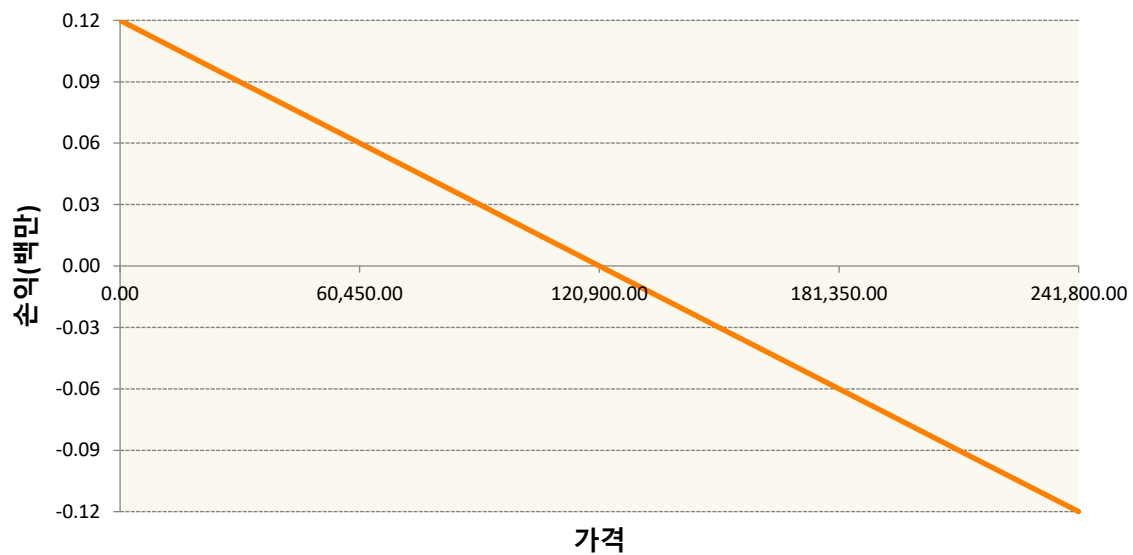
KR4113TC0004-2023-12 POSCO개별선물



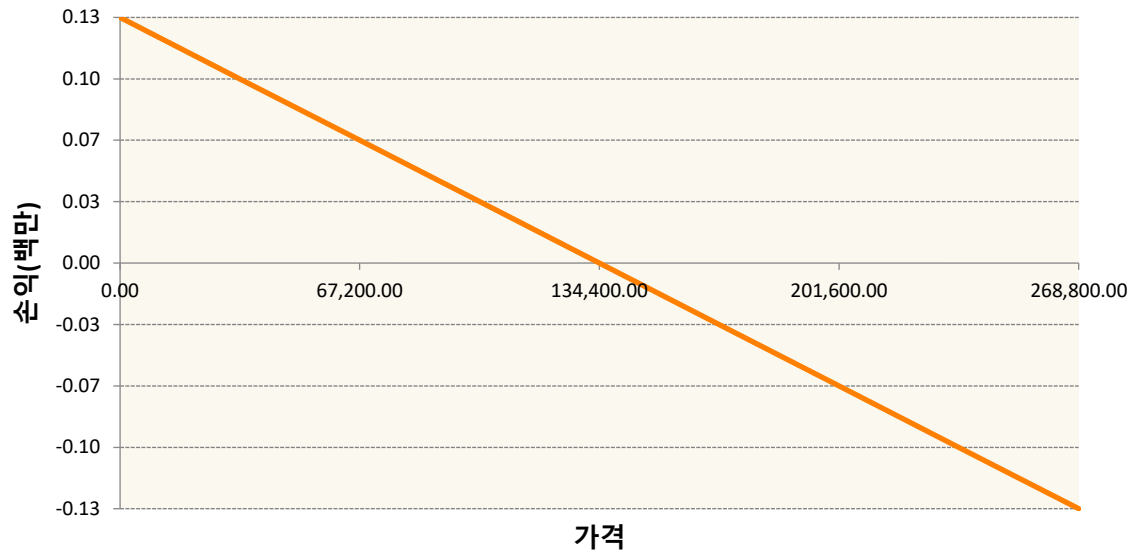
KR4154TC0004-2023-12 이마트개별선물



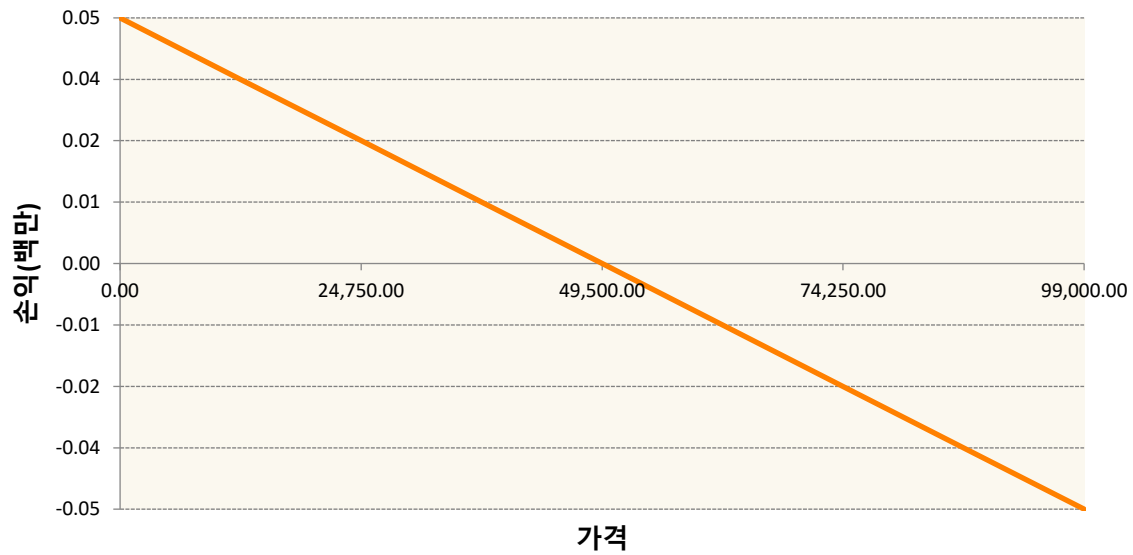
KR41BHTC0007-2023-12 한화에어로스페이스개별선물



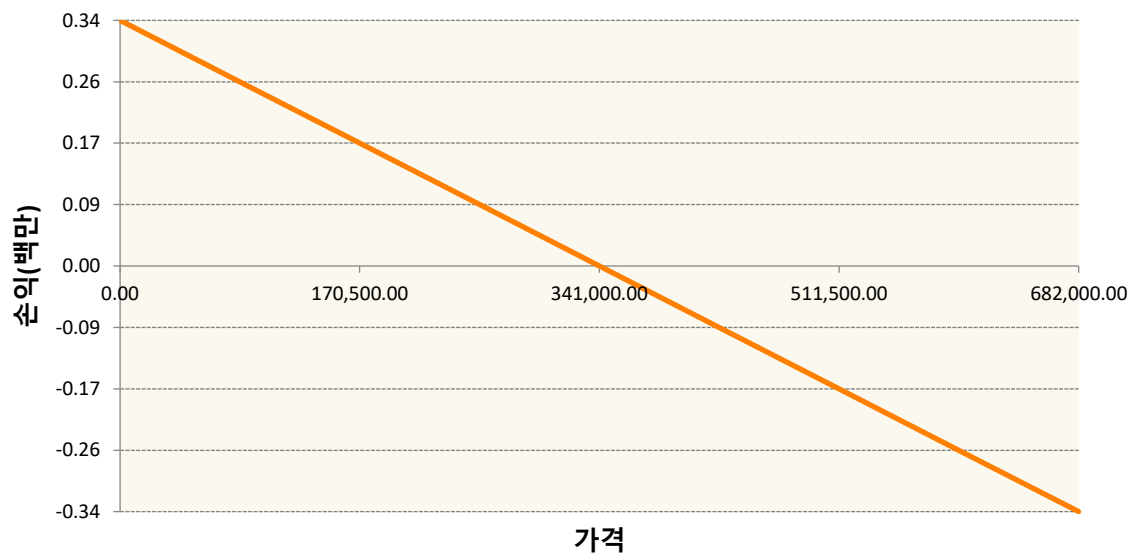
KR41C6TC0007-2023-12 아모레퍼시픽개별선물



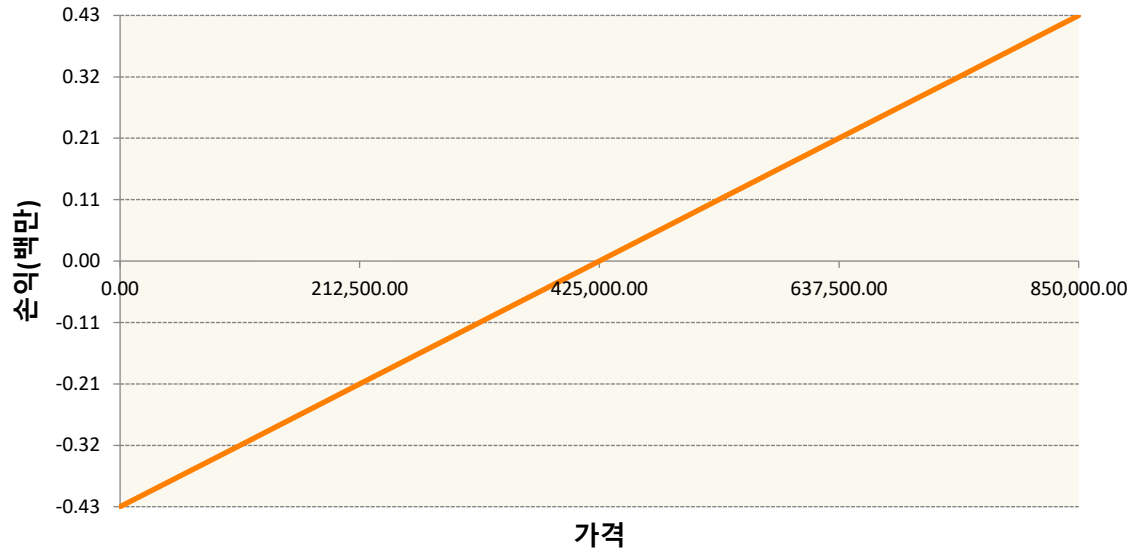
KR41CNTC0008-2023-12 포스코 ICT개별선물



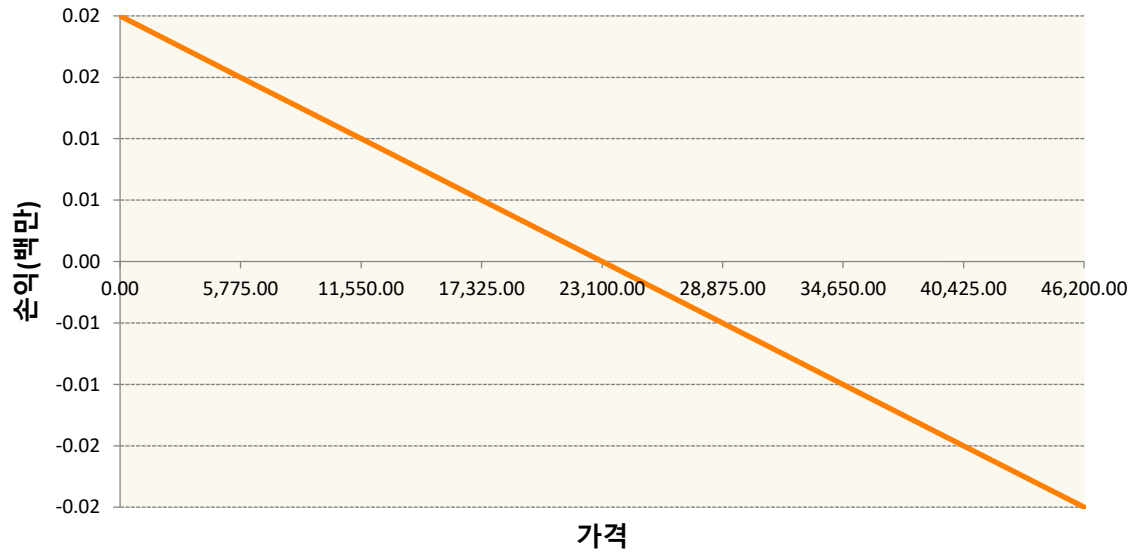
KR41CRTC0004-2023-12 LG생활건강개별선물



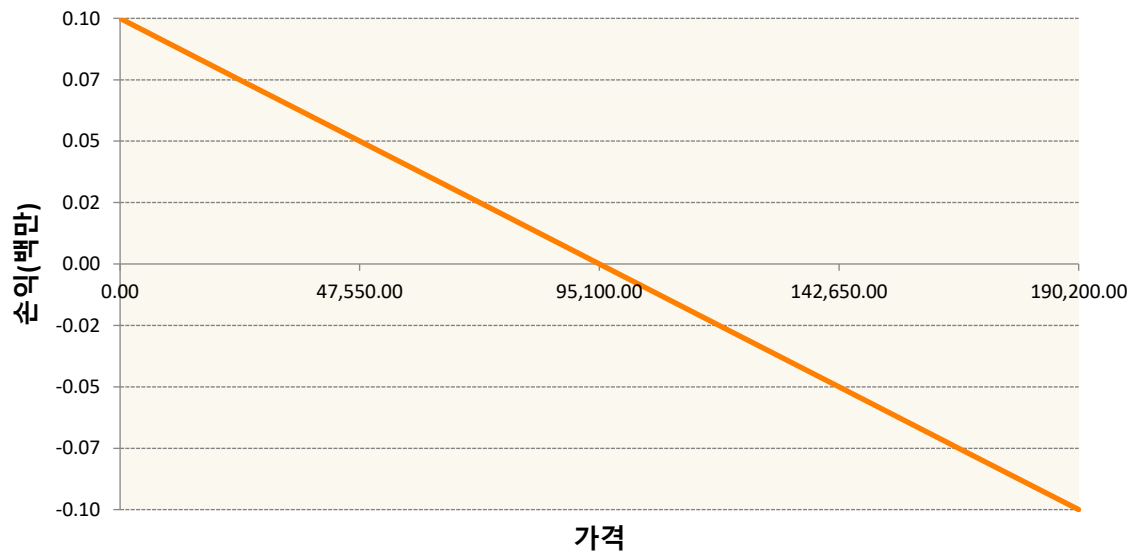
KR41DATC0002-2023-12 농심개별선물



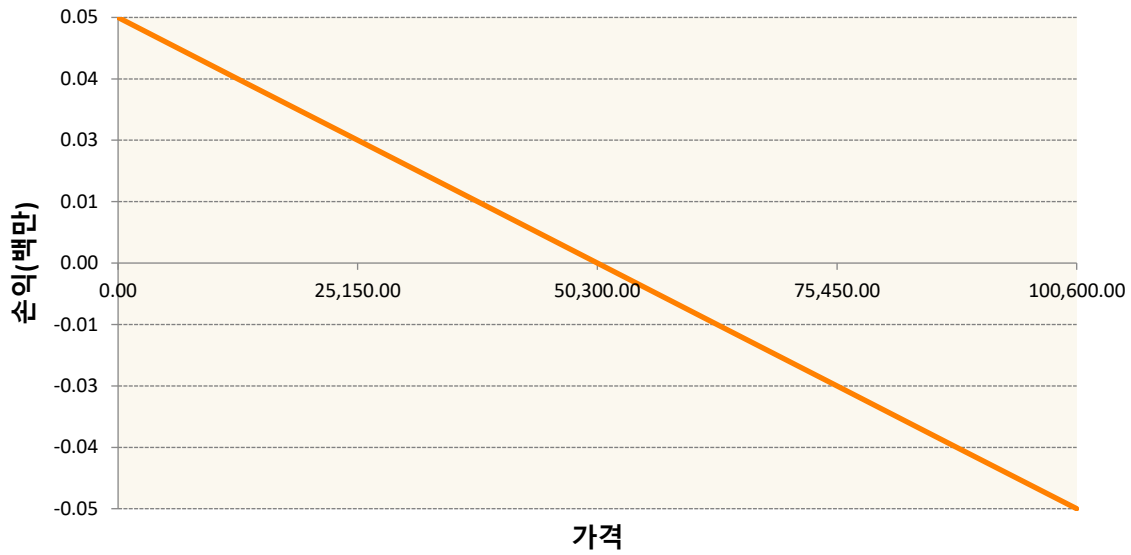
KR41DZTC0003-2023-12 한세실업개별선물



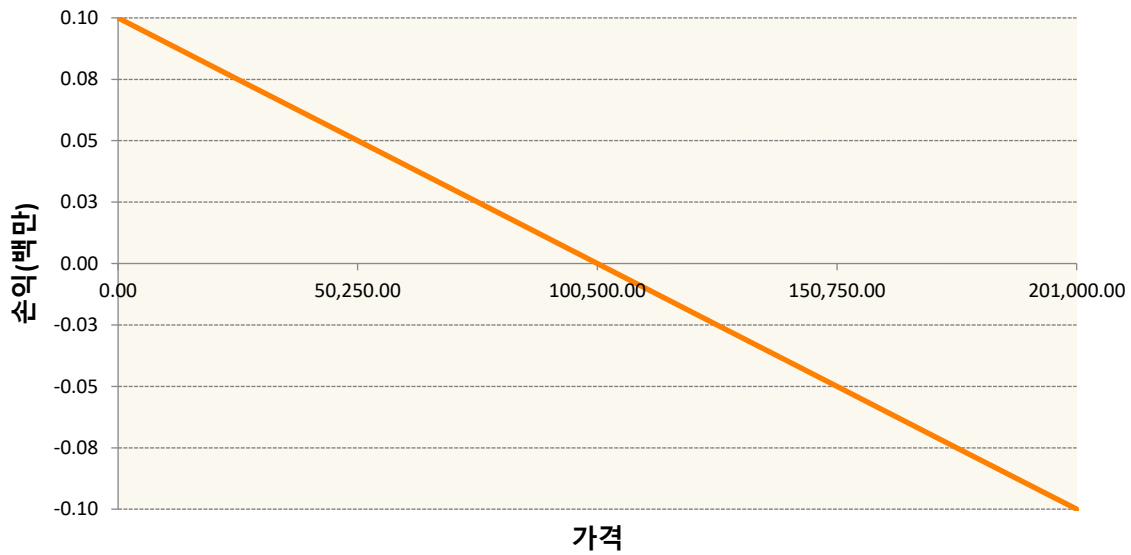
KR41E4TC0005-2023-12 에스엠개별선물



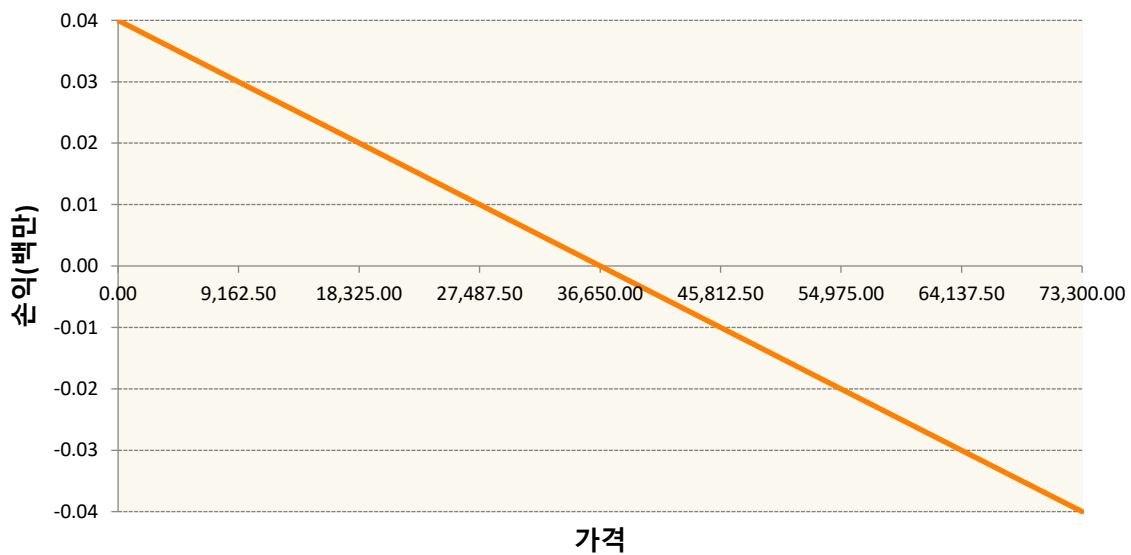
KR41E5TC0004-2023-12 넷마블개별선물



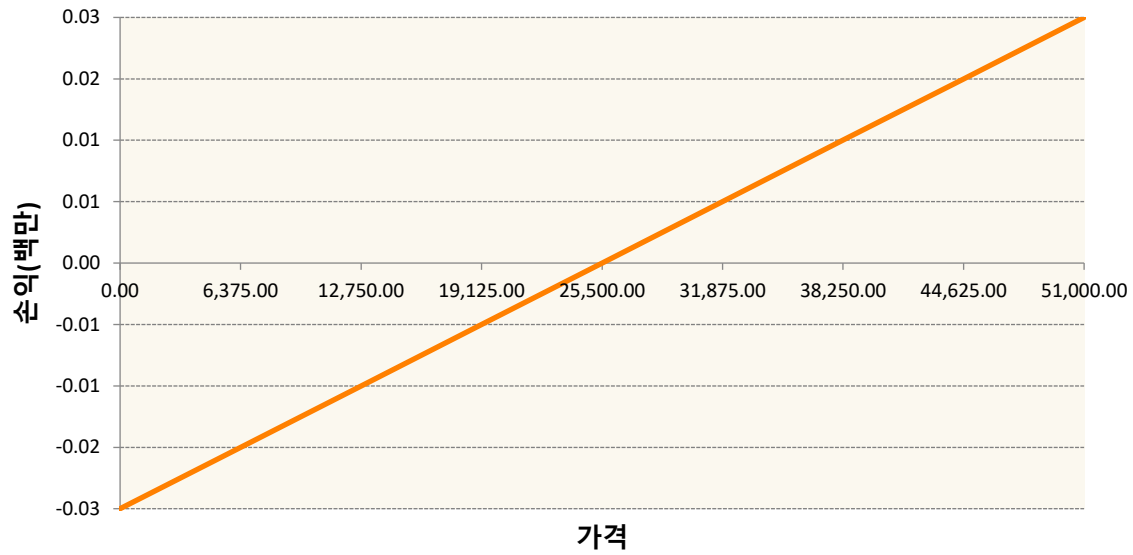
KR41EFTC0006-2023-12 JYP Ent.개별선물



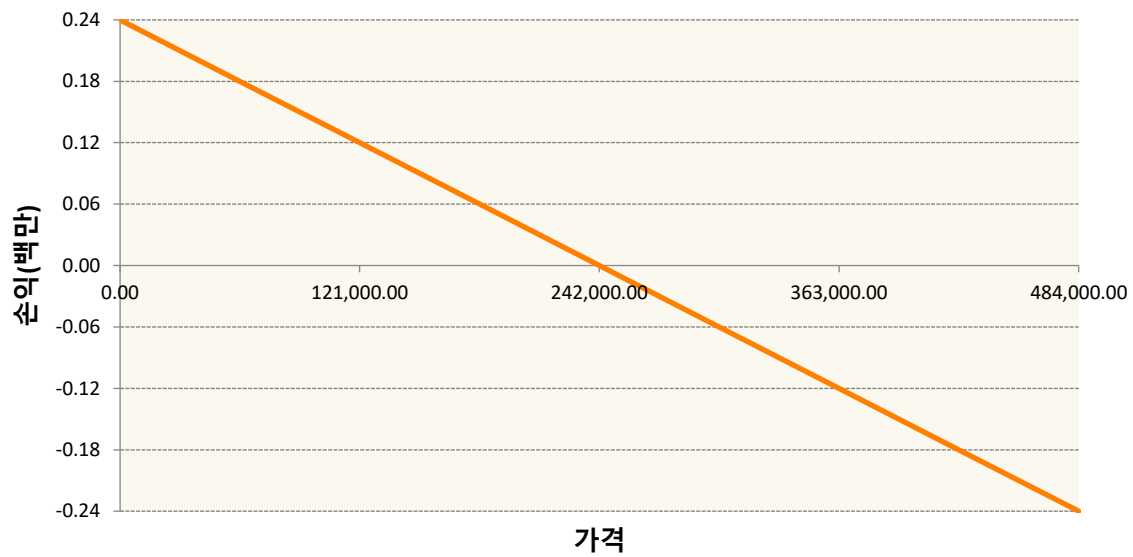
KR41ERTC0002-2023-12 DL이앤씨개별선물



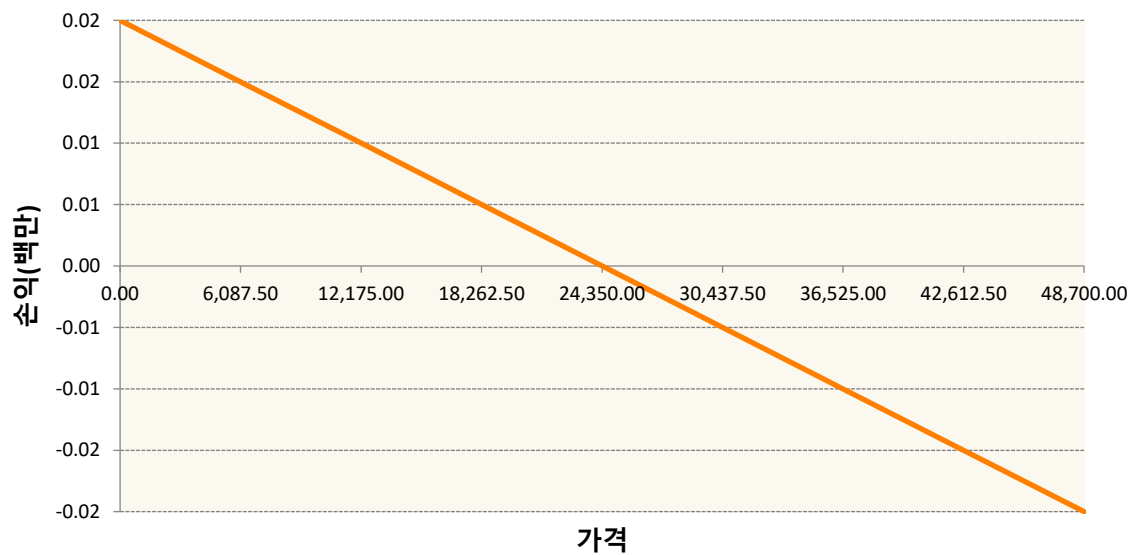
KR41ETTC0000-2023-12 삼성엔지니어링개별선물



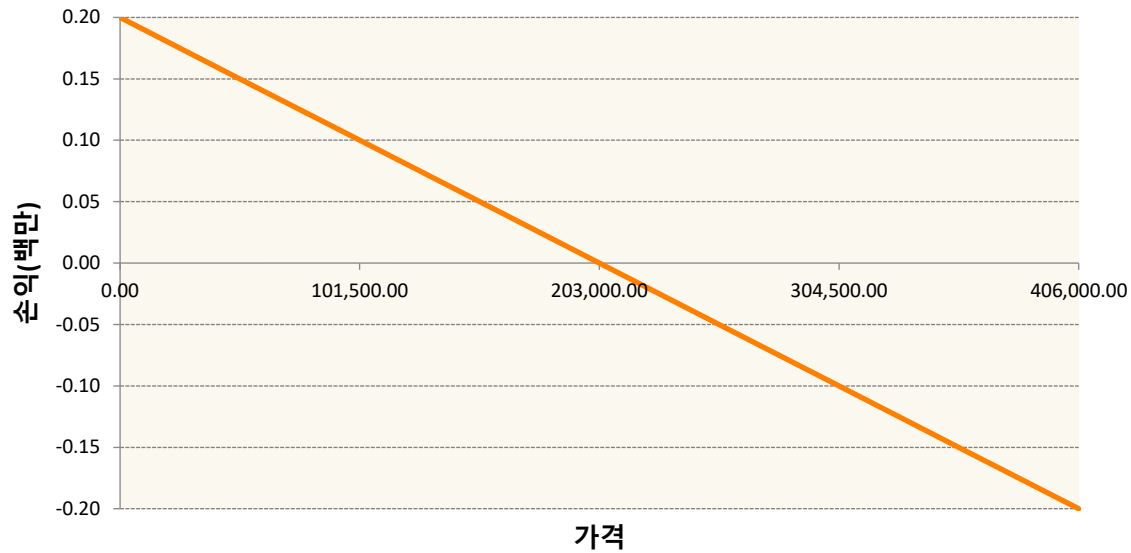
KR41EYTC0003-2023-12 에코프로비엠개별선물



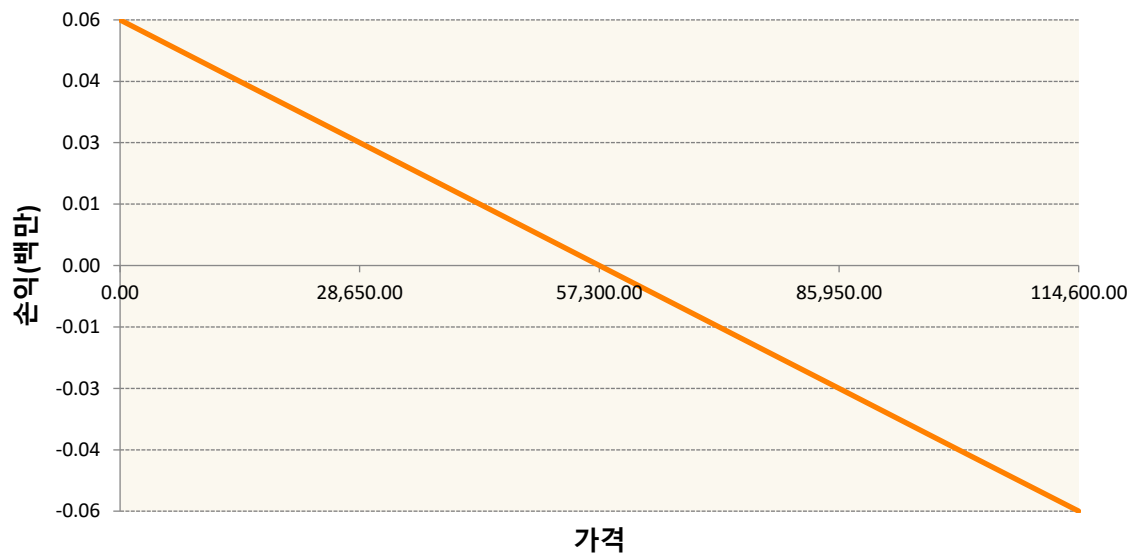
KR41F6TC0000-2023-12 카카오뱅크개별선물



KR41F8TC0008-2023-12 크래프톤개별선물



KR41FNTC0005-2023-12 위메이드개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                  |     |
|----------------------------------|-----|
| KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물    | 174 |
| KR4111TC00 2023-12 삼성전자개별선물      | 2   |
| KR4113TC00 2023-12 POSCO개별선물     | 5   |
| KR4154TC00 2023-12 이마트개별선물       | 1   |
| KR41BHTC00 2023-12 한화에어로스페이스개별선물 | 5   |
| KR41C6TC00 2023-12 아모레퍼시픽개별선물    | 2   |
| KR41CNTC00 2023-12 포스코 ICT개별선물   | 2   |
| KR41CRTC00 2023-12 LG생활건강개별선물    | 2   |
| KR41DATC00 2023-12 농심개별선물        | 3   |
| KR41DZTC00 2023-12 한세실업개별선물      | 2   |
| KR41E4TC00 2023-12 에스엠개별선물       | 6   |
| KR41E5TC00 2023-12 넷마블개별선물       | 1   |

|                                 |   |
|---------------------------------|---|
| KR41EFTC00 2023-12 JYP Ent.개별선물 | 2 |
| KR41ERTC00 2023-12 DL이앤씨개별선물    | 2 |
| KR41ETTC00 2023-12 삼성엔지니어링개별선물  | 2 |
| KR41EYTC00 2023-12 에코프로비엠개별선물   | 4 |
| KR41F6TC00 2023-12 카카오뱅크개별선물    | 1 |
| KR41F8TC00 2023-12 크래프톤개별선물     | 4 |
| KR41FNTC00 2023-12 위메이드개별선물     | 3 |

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

(단위:백만원)

305

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

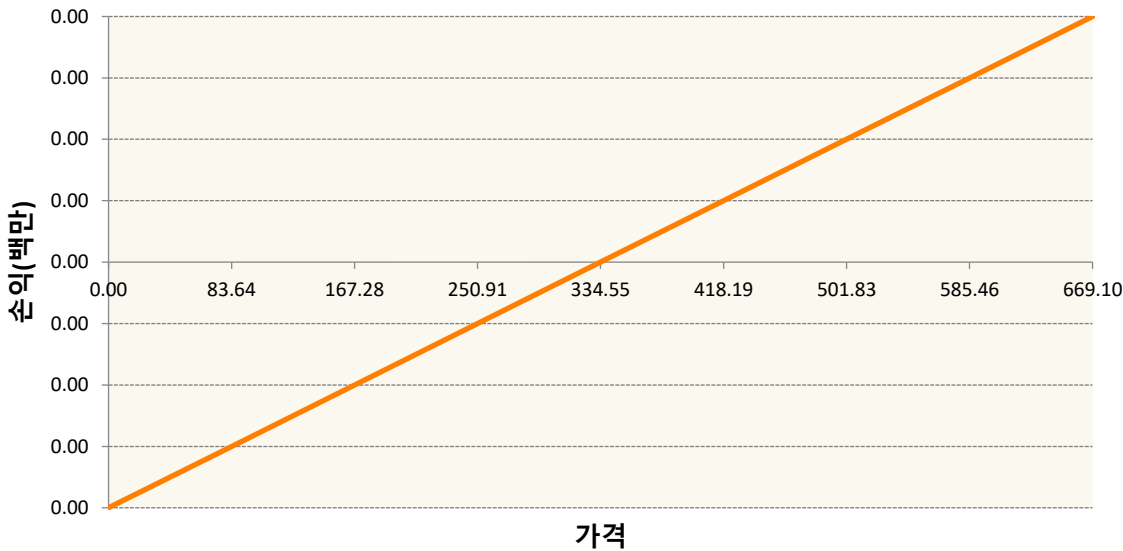
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 502   | 0     | 502       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,262 | 0     | 3,262     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101TC0008-2023-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101TC0008 |           | 2023-12 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 261    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -261      | -261               | -261   | -261 | -261  | -261   | -261   |
| -5.33%       | -174      | -174               | -174   | -174 | -174  | -174   | -174   |
| -2.67%       | -87       | -87                | -87    | -87  | -87   | -87    | -87    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 87        | 87                 | 87     | 87   | 87    | 87     | 87     |
| 5.33%        | 174       | 174                | 174    | 174  | 174   | 174    | 174    |
| 8.00%        | 261       | 261                | 261    | 261  | 261   | 261    | 261    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

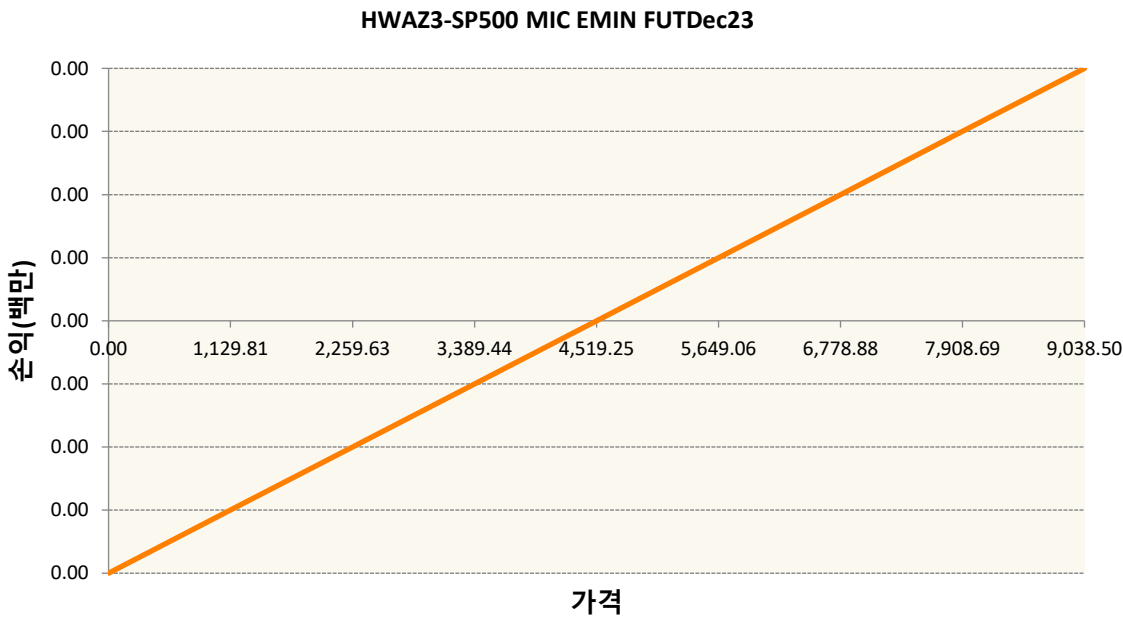
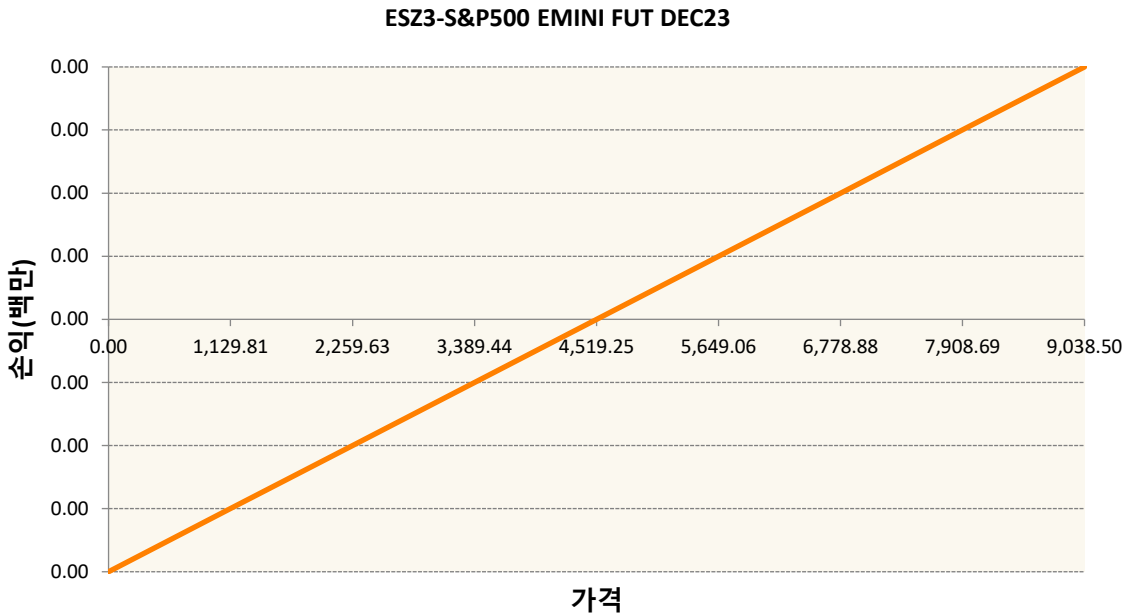
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 306   | 0     | 306       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,381 | 0     | 1,381     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| ESZ3                      | S&P500 EMINI FUT DEC23  | 24       |
| HWAZ3                     | SP500 MIC EMIN FUTDec23 | 110      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 119      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

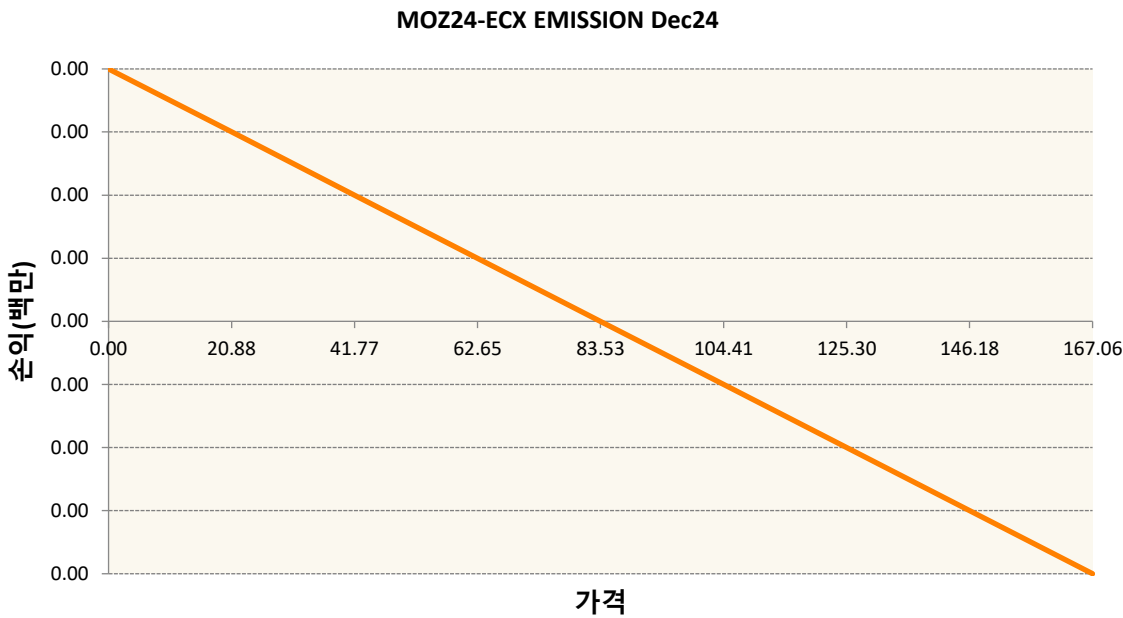
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 4,713 | -4,713    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 479   | 0     | 479       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,213 | -2,213    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E                        | 49  |
| FXW213DAT KRW/EUR 30-11-23E                        | 129 |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 377 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 2   |

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

(단위:백만원)

801

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

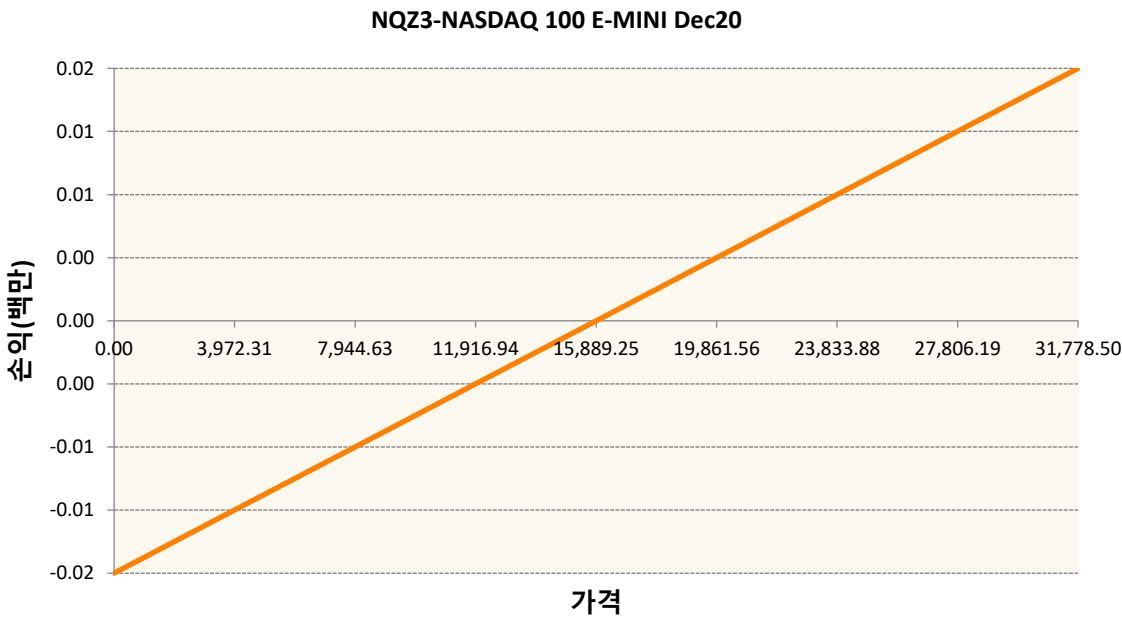
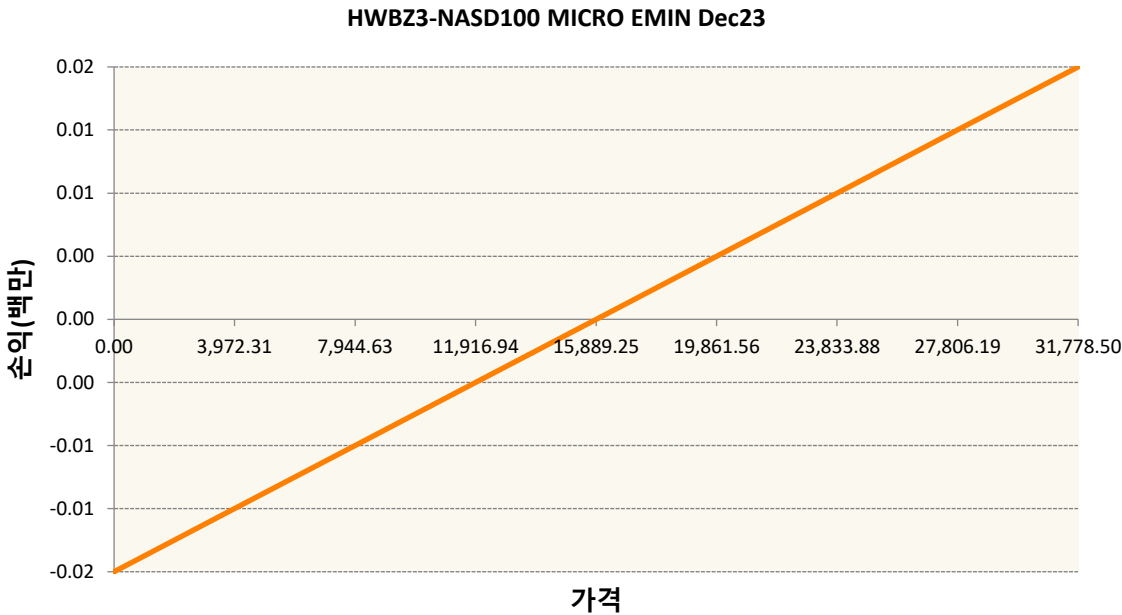
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 429   | 0     | 429       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 923   | 0     | 923       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| HWBZ3                     | NASD100 MICRO EMIN Dec23 | 74       |
| NQZ3                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  | 34       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 106      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-11-17 |
| 기준일 | 2023-11-16 |

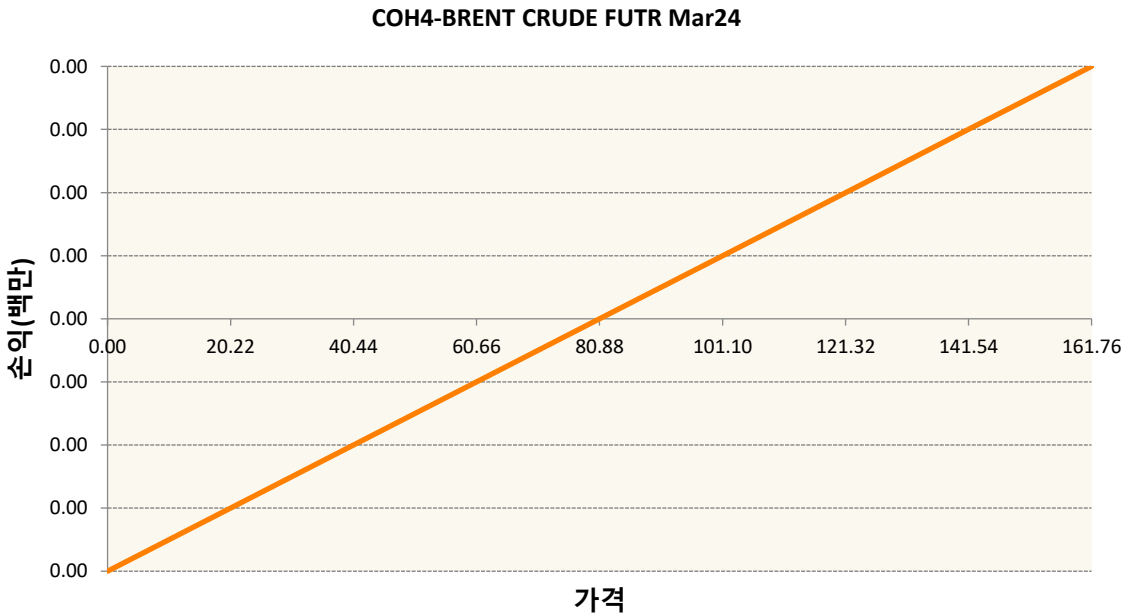
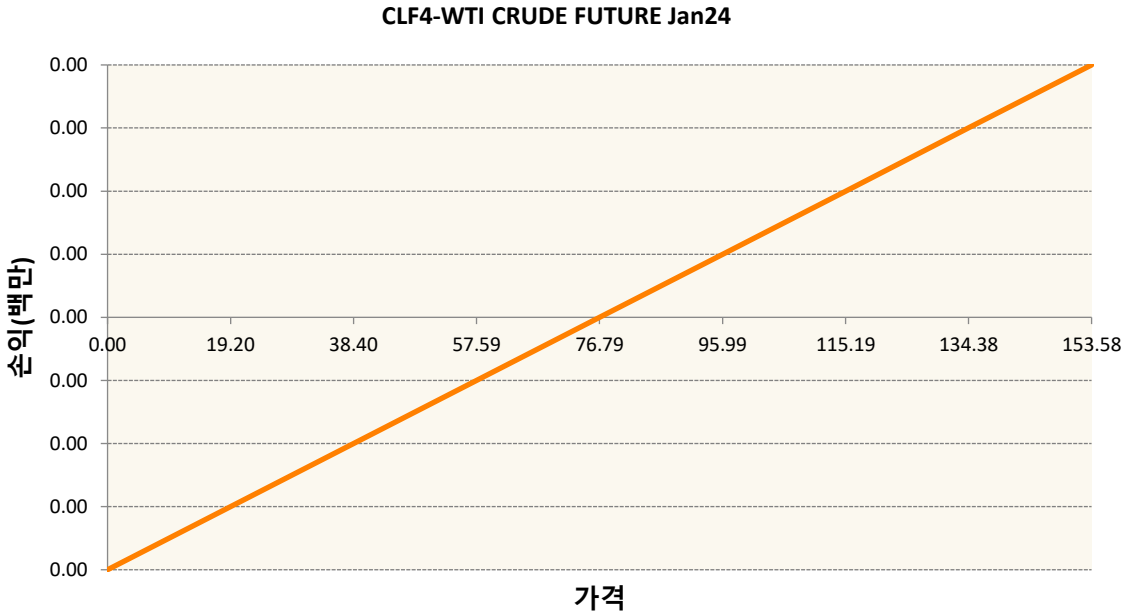
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

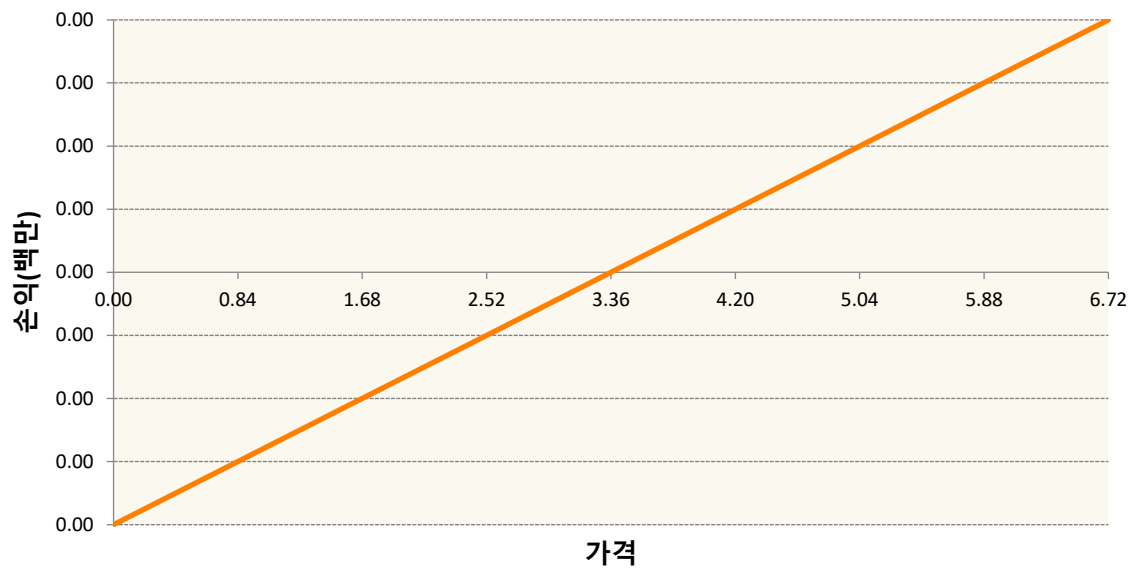
(단위:백만원)

| 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   | 1,343 | 0     | 1,343     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 195   | -195      | 장내 |

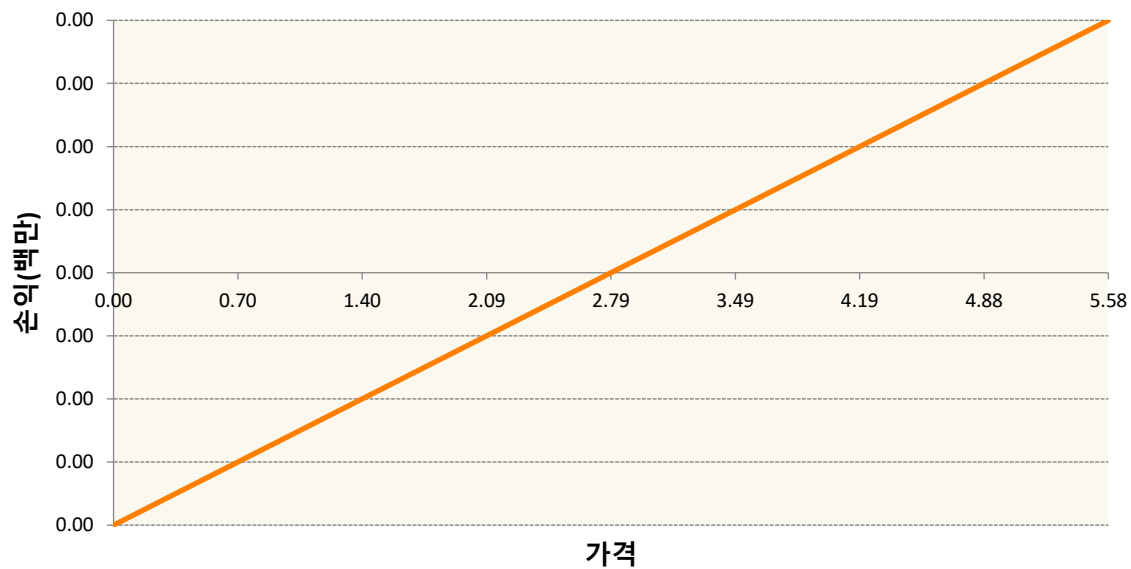
### 2. 만기시점의 손익구조



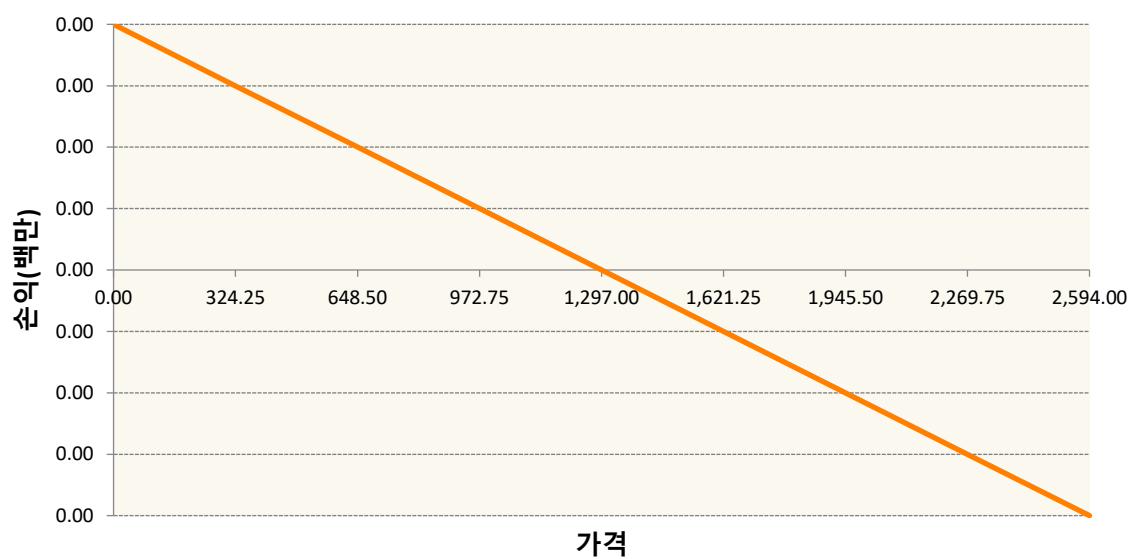
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



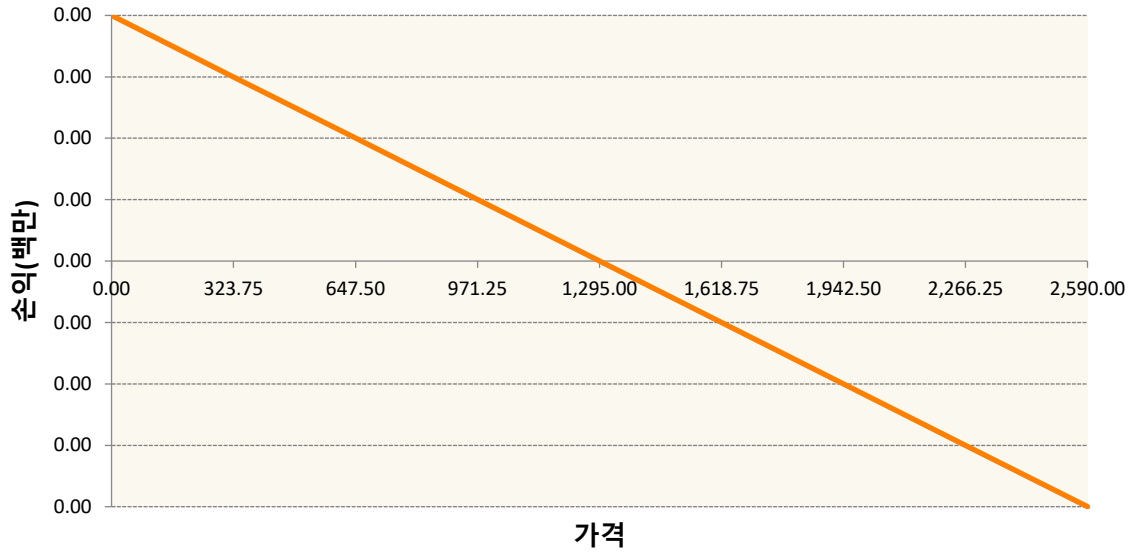
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



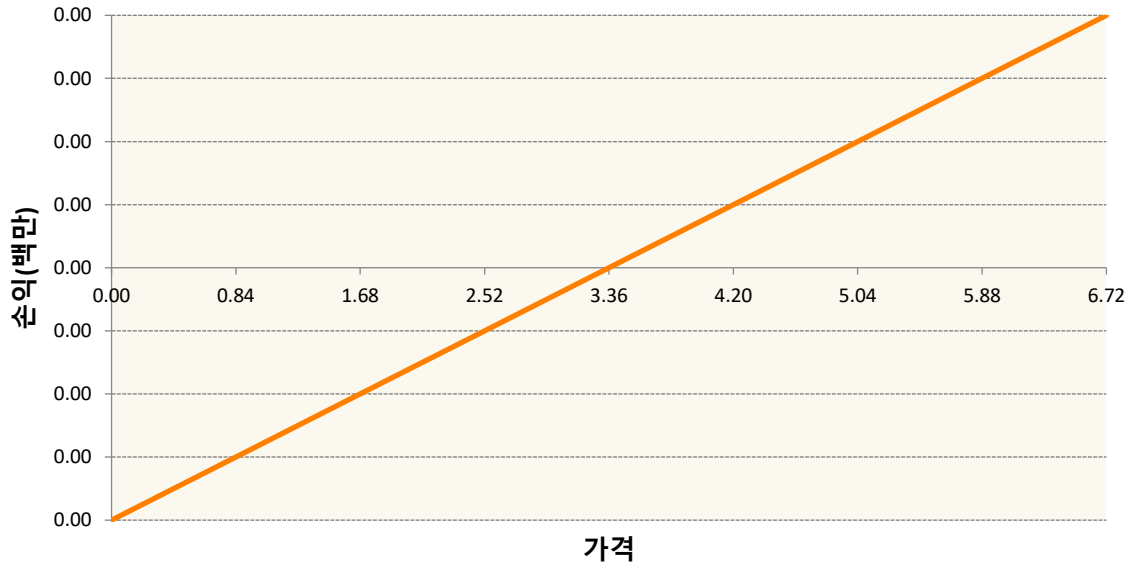
KR4175TB0000-2023-11 달러선물



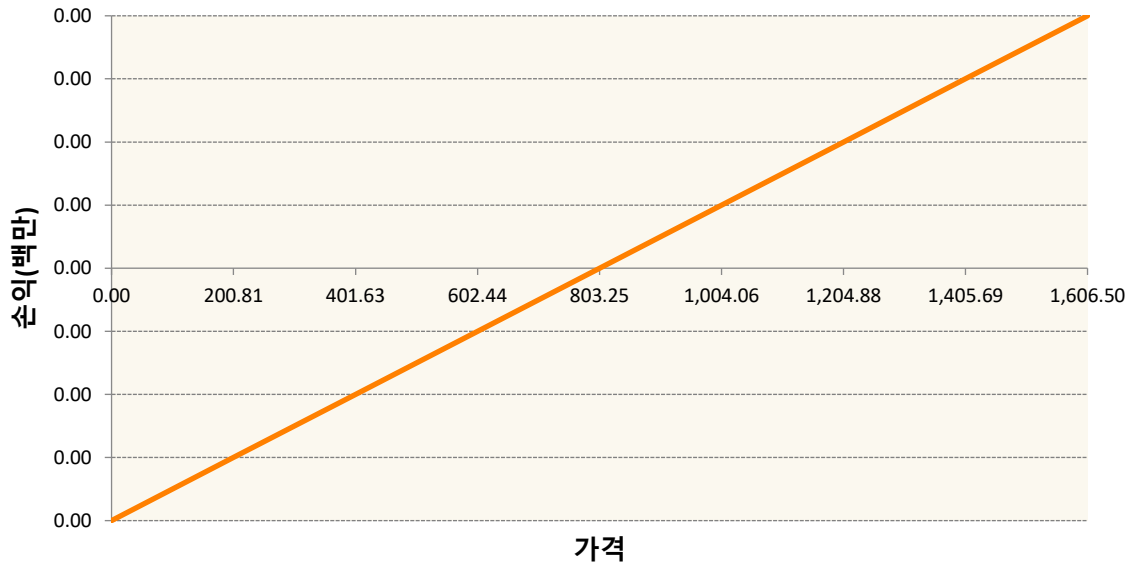
KR4175TC0009-2023-12 달러선물

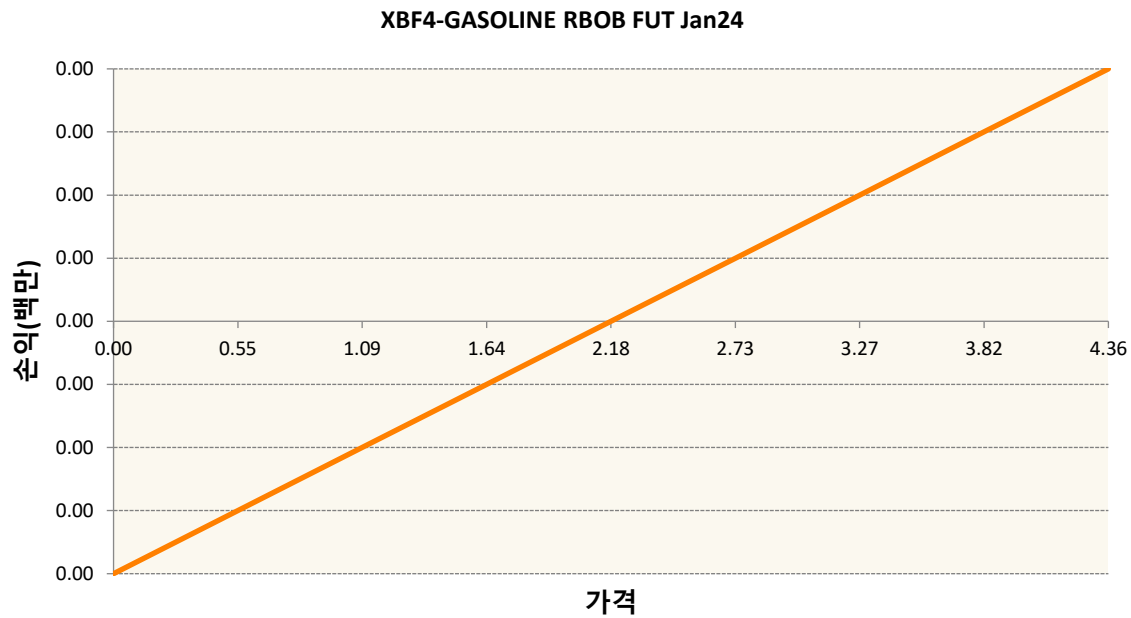


NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| CLF4                      | WTI CRUDE FUTURE Jan24   | 25       |
| COH4                      | BRENT CRUDE FUTR Mar24   | 26       |
| EOF4                      | E-MINI NATURAL GAS Jan24 | 4        |
| HOF4                      | NY Harb ULSD Fut Jan24   | 13       |
| KR4175TB00 2023-11 달러선물   |                          | 13       |
| KR4175TC00 2023-12 달러선물   |                          | 2        |
| NGF24                     | NATURAL GAS FUTR Jan24   | 22       |
| QSF4                      | Low Su Gasoil G Jan24    | 9        |
| XBF4                      | GASOLINE RBOB FUT Jan24  | 10       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 276      |