

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

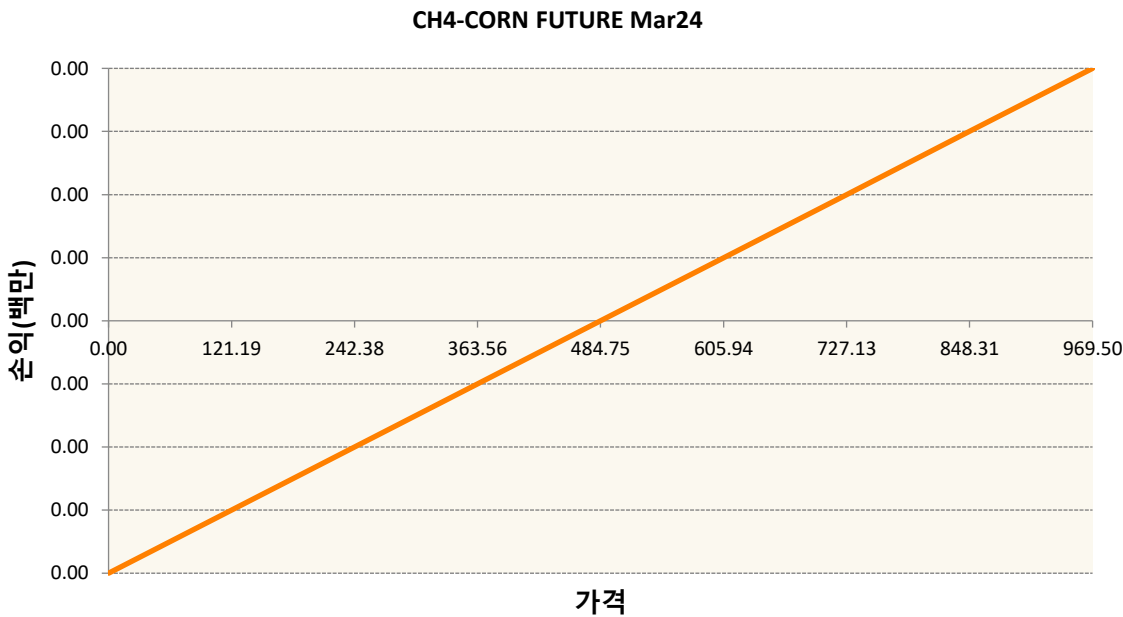
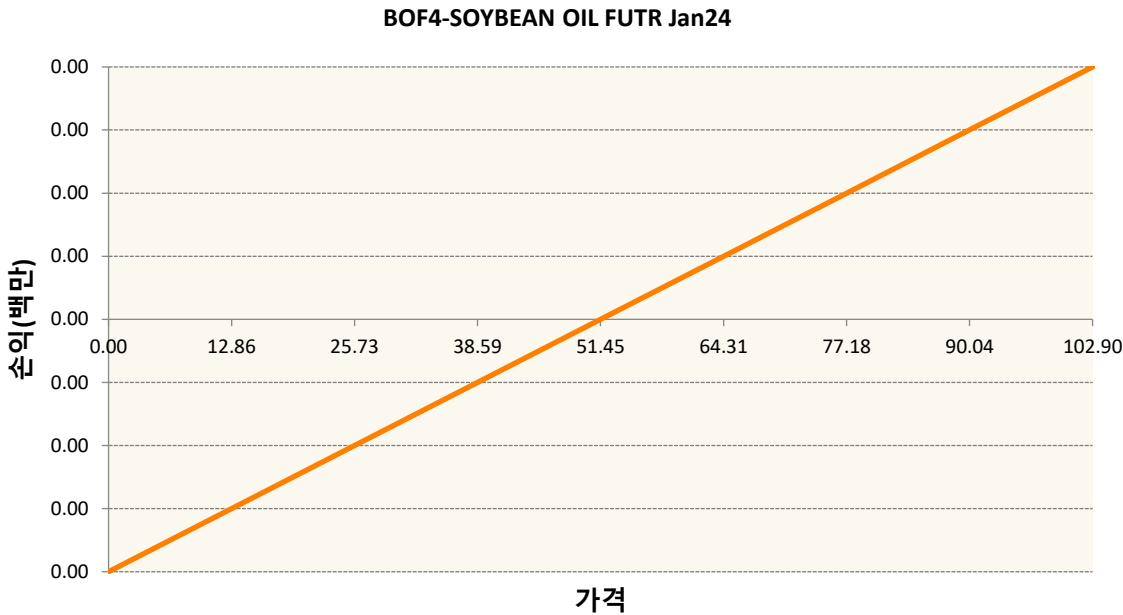
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

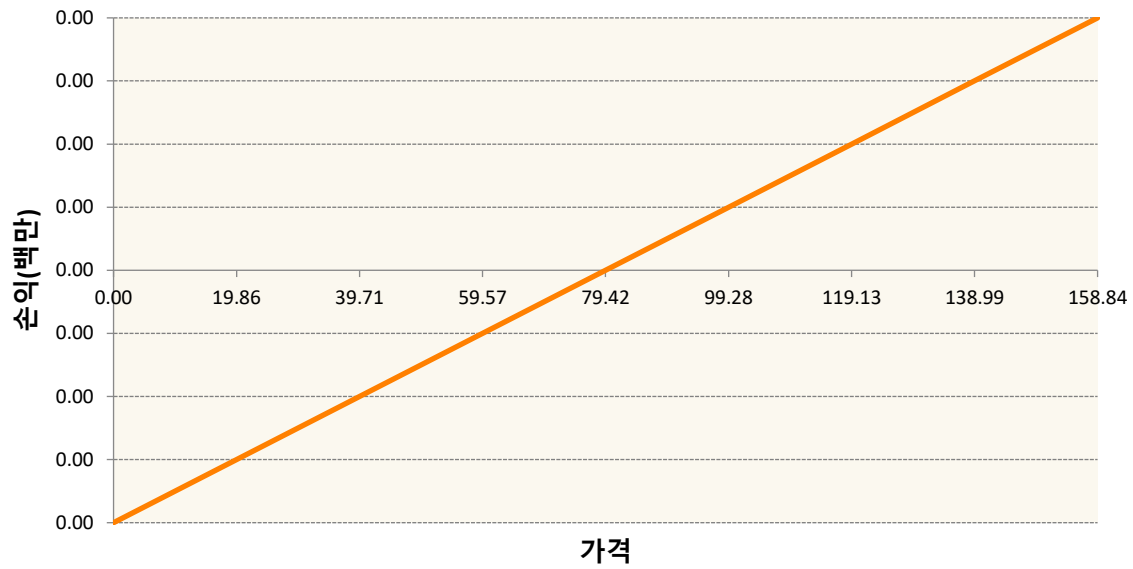
(단위:USD 백만)

| 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   | 4,964 | 0     | 4,964     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 547   | -547      | 장내 |

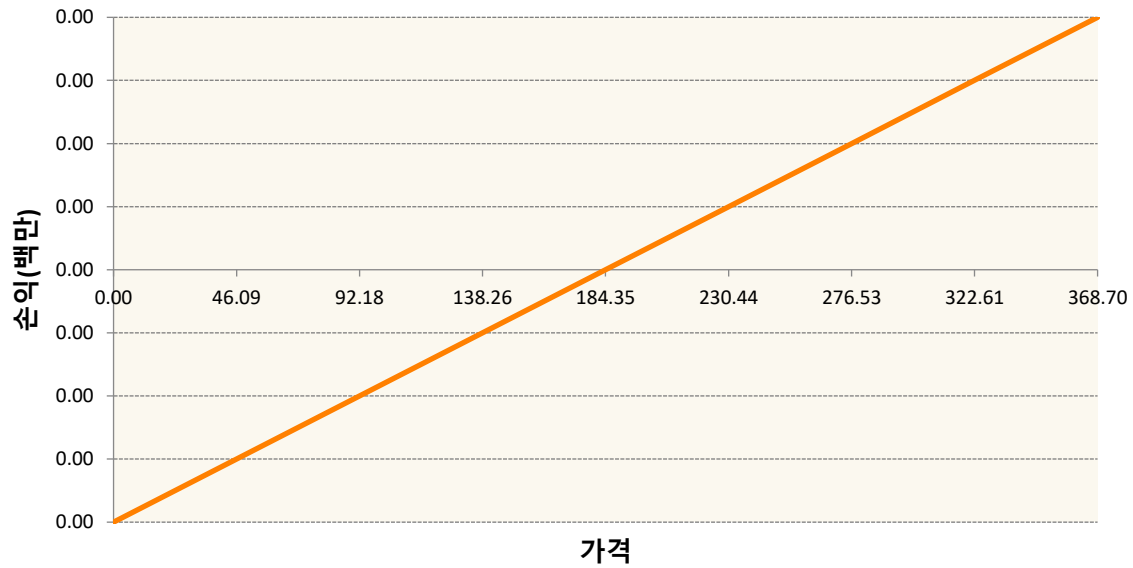
### 2. 만기시점의 손익구조



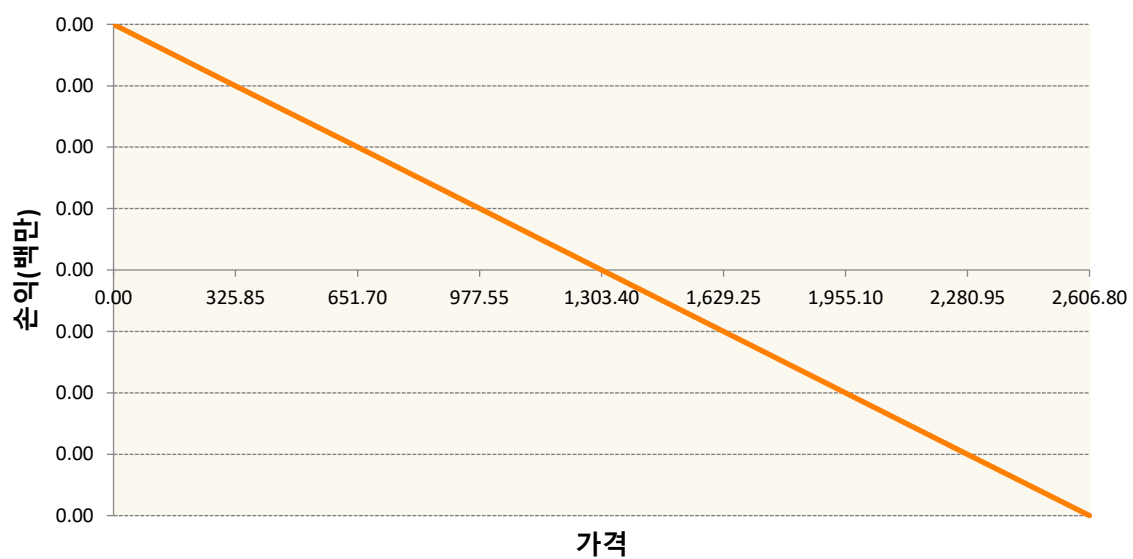
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



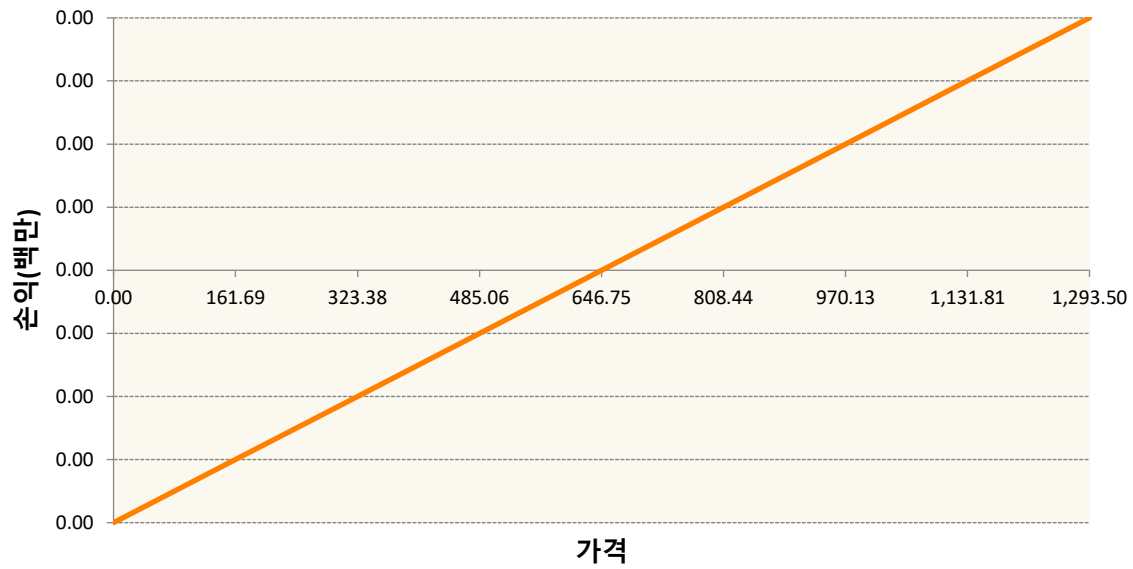
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



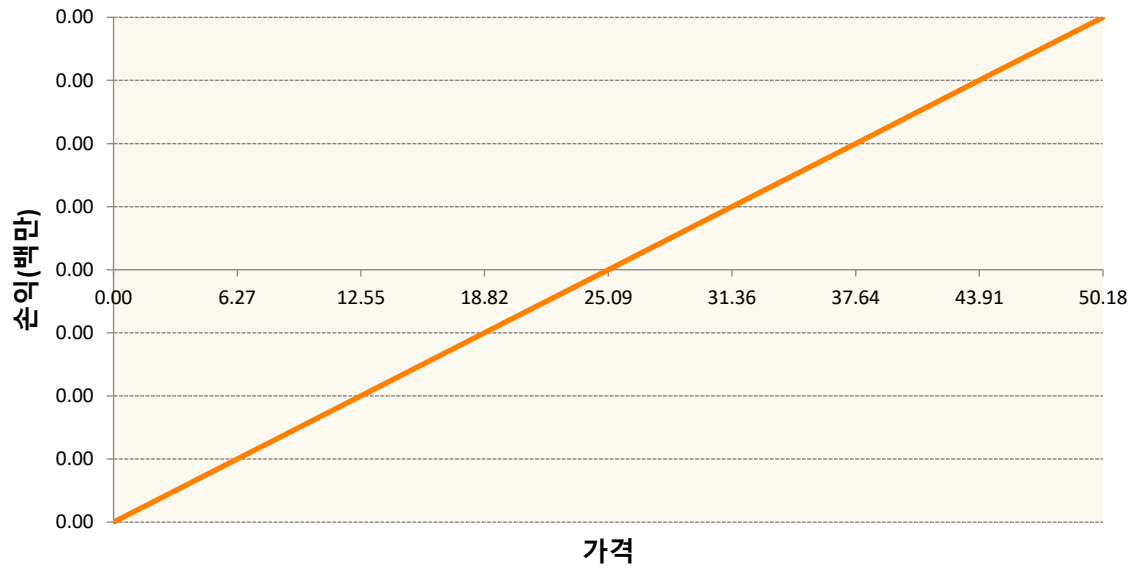
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



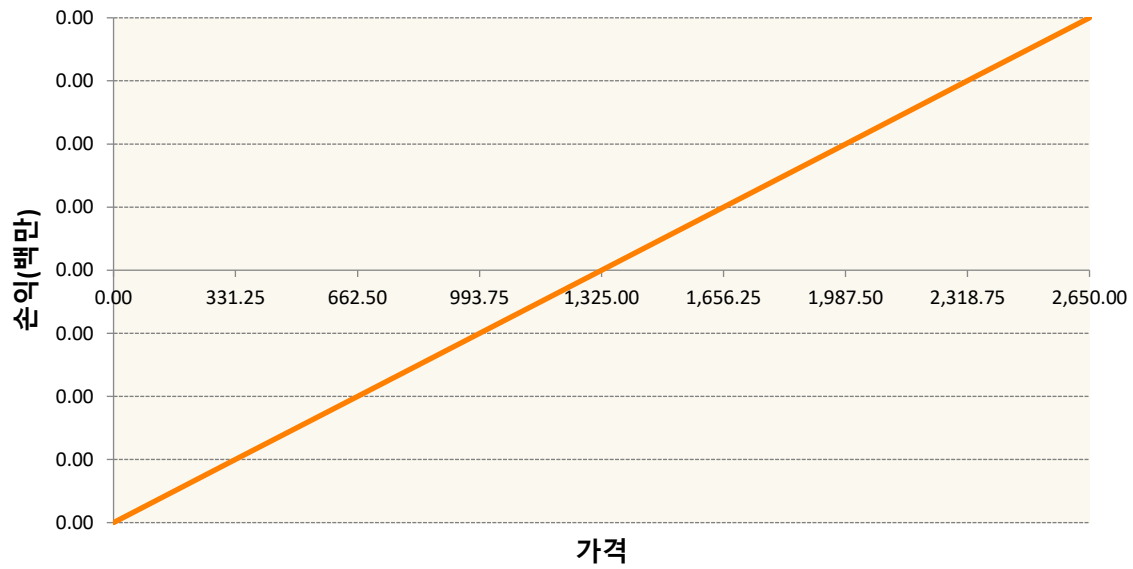
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



SF4-SOYBEAN FUTURE Jan24



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 825.40. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -100.00 to 100.00. The line starts at the origin (0,0) and passes through the point (412.70, 0), indicating the break-even point. The line continues to rise, reaching a profit of 100 million at a price of 825.40.

| 가격     | 손익(백만) |
|--------|--------|
| 0.00   | 0.00   |
| 103.18 | 20.00  |
| 206.35 | 40.00  |
| 309.53 | 60.00  |
| 412.70 | 80.00  |
| 515.88 | 100.00 |
| 619.05 | 120.00 |
| 722.23 | 140.00 |
| 825.40 | 160.00 |

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 1,205.50. The y-axis represents Net Income, ranging from 0.00 to 0.00. A solid blue line shows the relationship, starting at the origin (0, 0) and ending at (1,205.50, 0.00).

| 가격       | 순이익(백만) |
|----------|---------|
| 0.00     | 0.00    |
| 150.69   | 0.00    |
| 301.38   | 0.00    |
| 452.06   | 0.00    |
| 602.75   | 0.00    |
| 753.44   | 0.00    |
| 904.13   | 0.00    |
| 1,054.81 | 0.00    |
| 1,205.50 | 0.00    |

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

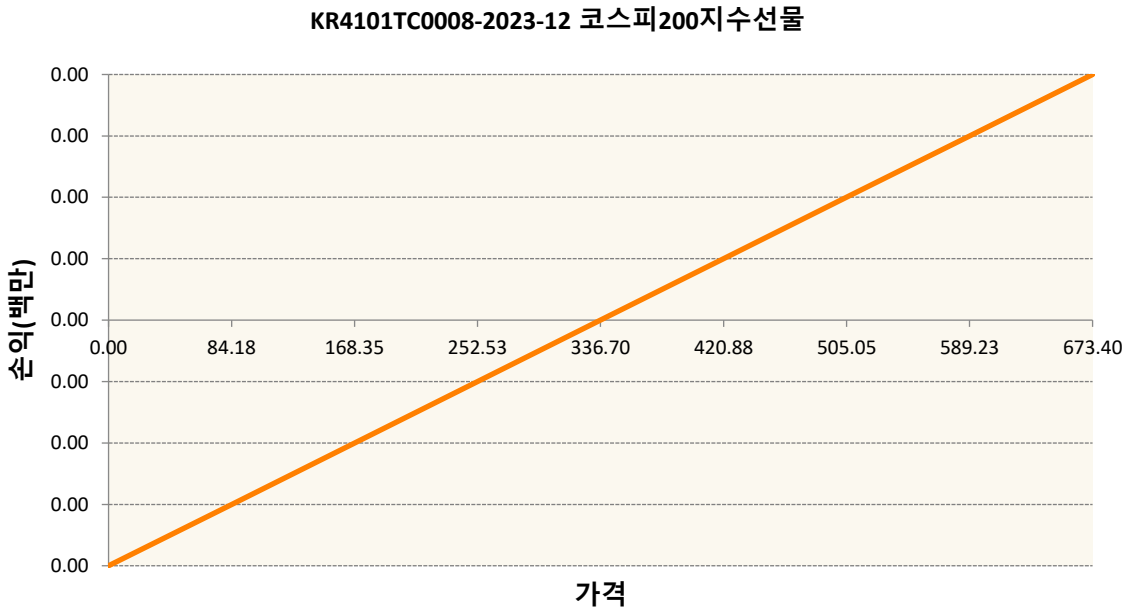
## 스마트인덱스모

### 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   | 1,852 | 0     | 1,852     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 코스피200지수선물 |      |       |        | 148    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -148      | -148    | -148               | -148 | -148  | -148   | -148   |
| -5.33%       | -99       | -99     | -99                | -99  | -99   | -99    | -99    |
| -2.67%       | -49       | -49     | -49                | -49  | -49   | -49    | -49    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 49        | 49      | 49                 | 49   | 49    | 49     | 49     |
| 5.33%        | 99        | 99      | 99                 | 99   | 99    | 99     | 99     |
| 8.00%        | 148       | 148     | 148                | 148  | 148   | 148    | 148    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

## 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 | 317 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 281 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

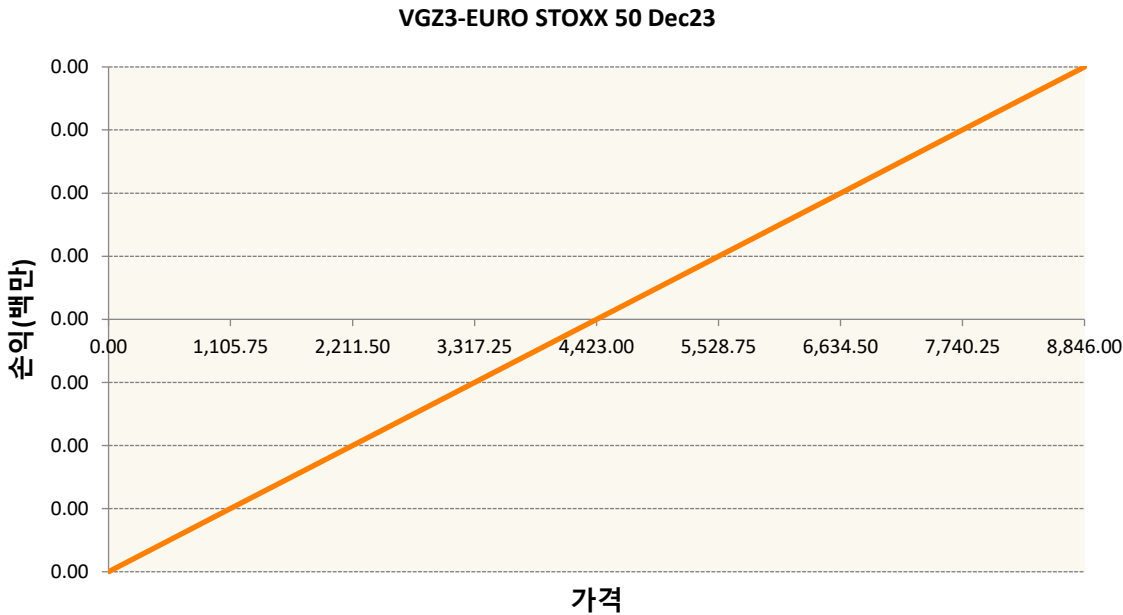
유로인덱스모(주식-파생형)

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   | 943   | 0     | 943       |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 213   | 0     | 213       | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |                     |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------|---------------------|--|----------|
| FXW213D9M EUR/KRW 22-12-23E |                     |  | 17       |
| VGZ3                        | EURO STOXX 50 Dec23 |  | 75       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 72       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

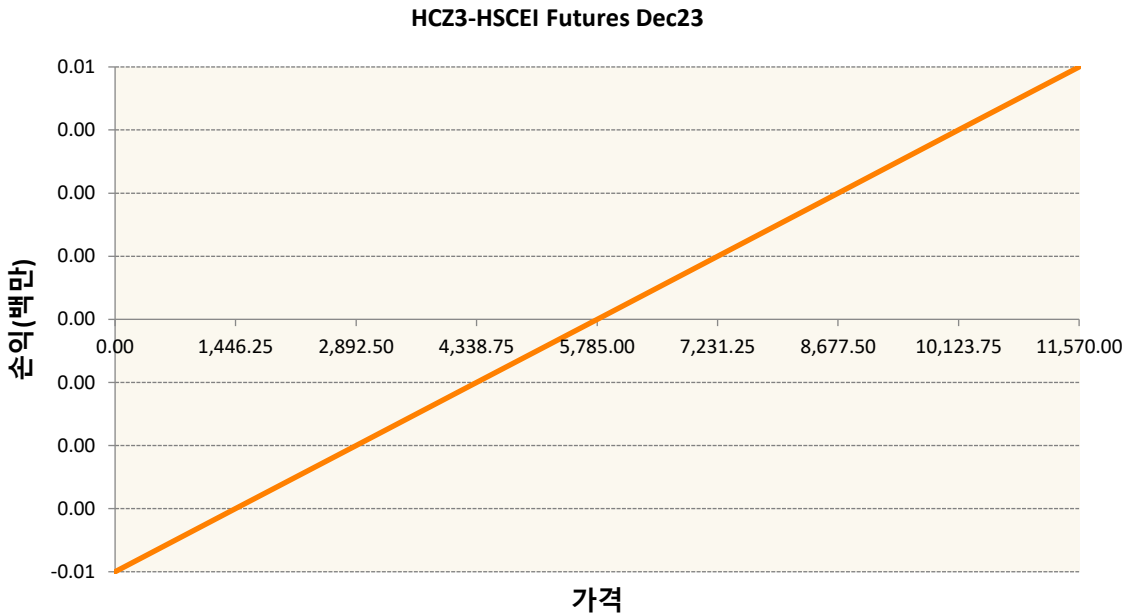
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,104 | 0     | 1,104     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCZ3 | HSCEI Futures Dec23 | 88 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 129 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

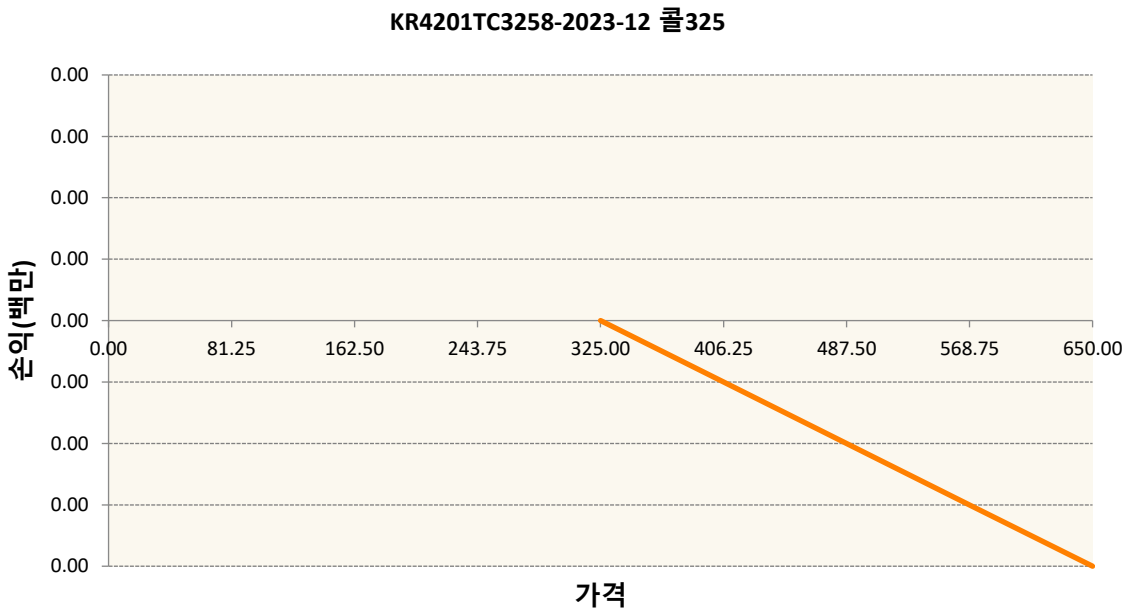
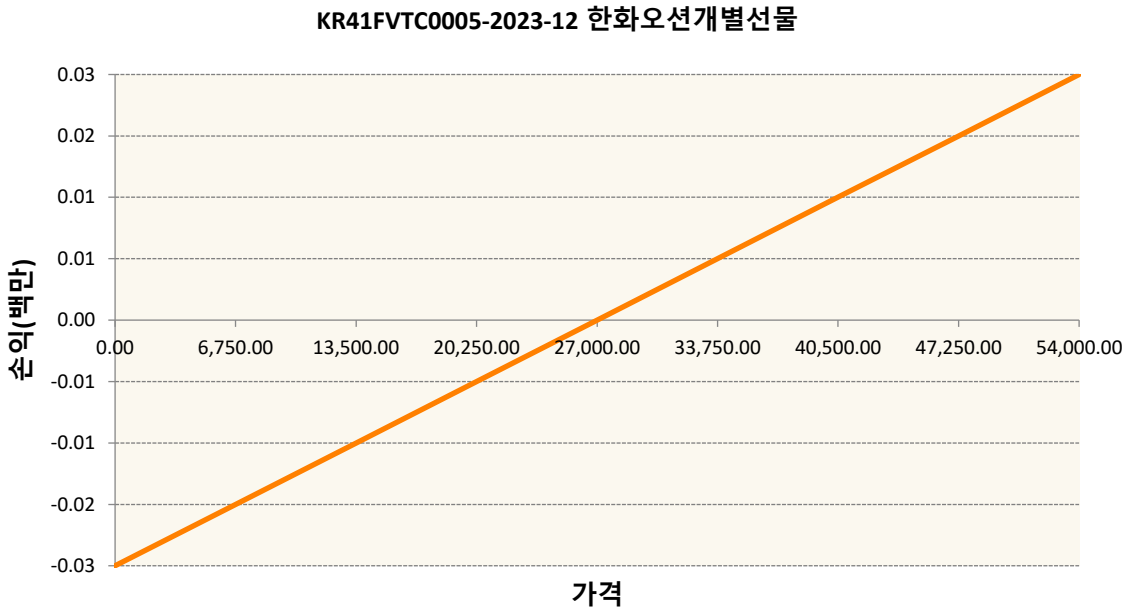
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 34    | 0      | 34        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 50,663 | -50,663   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 655.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line represents the relationship, starting at a price of 327.50 with a profit/loss of 0.00, and ending at a price of 655.00 with a profit/loss of -0.00.

| 가격     | 손익(백만) |
|--------|--------|
| 327.50 | 0.00   |
| 655.00 | -0.00  |

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 650.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at (0, 0) and ends at (325, 0), indicating that profit is zero for all prices in this range.

(단위:백만원)

|              |           |                  |        |    |       |        |        |    |
|--------------|-----------|------------------|--------|----|-------|--------|--------|----|
| KR41FVTC0005 |           | 2023-12 한화오션개별선물 |        |    |       |        | 3      |    |
|              | 기초자산의 변동성 |                  |        |    |       |        |        |    |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%          | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |    |
| -8.00%       | -3        | -3               | -3     | -3 | -3    | -3     | -3     | -3 |
| -5.33%       | -2        | -2               | -2     | -2 | -2    | -2     | -2     | -2 |
| -2.67%       | -1        | -1               | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     | -1 |
| 0%           | 0         | 0                | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      | 0  |
| 2.67%        | 1         | 1                | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      | 1  |
| 5.33%        | 2         | 2                | 2      | 2  | 2     | 2      | 2      | 2  |
| 8.00%        | 3         | 3                | 3      | 3  | 3     | 3      | 3      | 3  |
| KR4201TC3258 |           | 2023-12 콜325     |        |    |       |        | 2,958  |    |
|              | 기초자산의 변동성 |                  |        |    |       |        |        |    |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -8.00% | 1,285   | 1,284   | 1,282  | 1,279  | 1,275  | 1,269  | 1,262  |
| -5.33% | 1,244   | 1,228   | 1,210  | 1,191  | 1,170  | 1,149  | 1,126  |
| -2.67% | 875     | 847     | 820    | 792    | 764    | 735    | 707    |
| 0%     | 24      | 18      | 10     | 0      | -12    | -25    | -41    |
| 2.67%  | -964    | -965    | -965   | -966   | -968   | -971   | -974   |
| 5.33%  | -1,961  | -1,961  | -1,961 | -1,961 | -1,961 | -1,961 | -1,962 |
| 8.00%  | -2,958  | -2,958  | -2,958 | -2,958 | -2,958 | -2,958 | -2,958 |

KR4201TC3274

2023-12 콜327.5

461

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 163     | 163     | 163    | 163  | 163   | 162    | 161    |
| -5.33%    | 161     | 159     | 157    | 155  | 153   | 150    | 147    |
| -2.67%    | 123     | 119     | 114    | 110  | 105   | 100    | 96     |
| 0%        | 6       | 5       | 2      | 0    | -3    | -6     | -9     |
| 2.67%     | -147    | -147    | -147   | -148 | -148  | -149   | -150   |
| 5.33%     | -304    | -304    | -304   | -304 | -304  | -304   | -304   |
| 8.00%     | -460    | -460    | -460   | -460 | -460  | -460   | -461   |

KR4301TC3257

2023-12 풋325

419

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -414    | -414    | -414   | -415 | -416  | -418   | -419   |
| -5.33%    | -182    | -186    | -190   | -195 | -200  | -205   | -210   |
| -2.67%    | -30     | -36     | -43    | -50  | -57   | -63    | -70    |
| 0%        | 6       | 4       | 2      | 0    | -3    | -6     | -10    |
| 2.67%     | 8       | 8       | 8      | 7    | 7     | 6      | 5      |
| 5.33%     | 8       | 8       | 8      | 8    | 8     | 8      | 8      |
| 8.00%     | 8       | 8       | 8      | 8    | 8     | 8      | 8      |

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

(단위:백만원)

4,251

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

## 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 | 1,896 | 0     | 1,896     |    |

### 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 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

## 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 | 4,550 | 0     | 4,550     |    |

### 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 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

## 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 | 17,368 | 0      | 17,368    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 16,659 | -16,659   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |                                 |
|-----------------------------|---------------------------------|
| FXW213D9R\KRW/USD 29-12-23E | 506                             |
| FXW213DAT\KRW/USD 31-01-24E | 186                             |
| FXW213DBV\KRW/USD 29-02-24E | 641                             |
| IE00BD8RGM75                | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 693 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

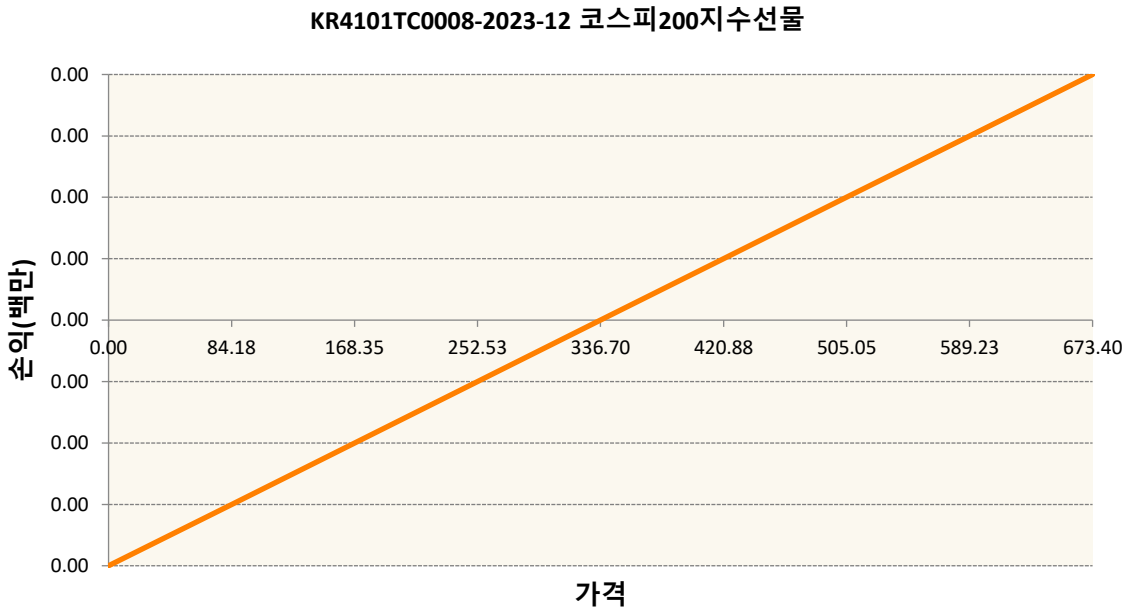
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 673   | 0     | 673       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 코스피200지수선물 |     |       |        | 54     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -54       | -54     | -54                | -54 | -54   | -54    | -54    |
| -5.33%       | -36       | -36     | -36                | -36 | -36   | -36    | -36    |
| -2.67%       | -18       | -18     | -18                | -18 | -18   | -18    | -18    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 18        | 18      | 18                 | 18  | 18    | 18     | 18     |
| 5.33%        | 36        | 36      | 36                 | 36  | 36    | 36     | 36     |
| 8.00%        | 54        | 54      | 54                 | 54  | 54    | 54     | 54     |

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

(단위:백만원)

50

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

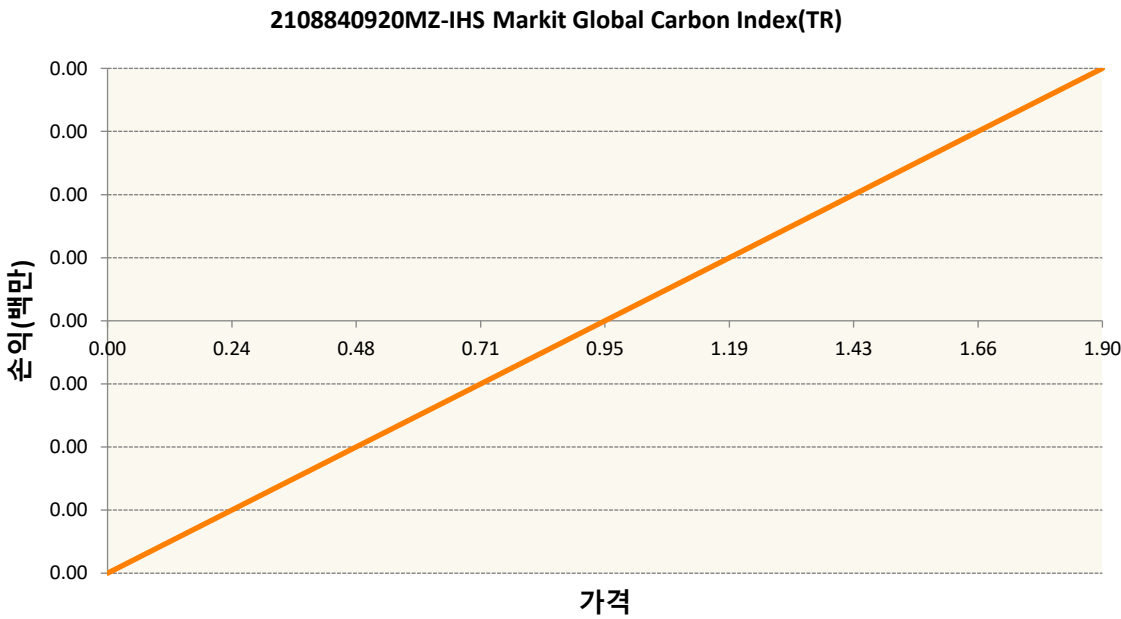
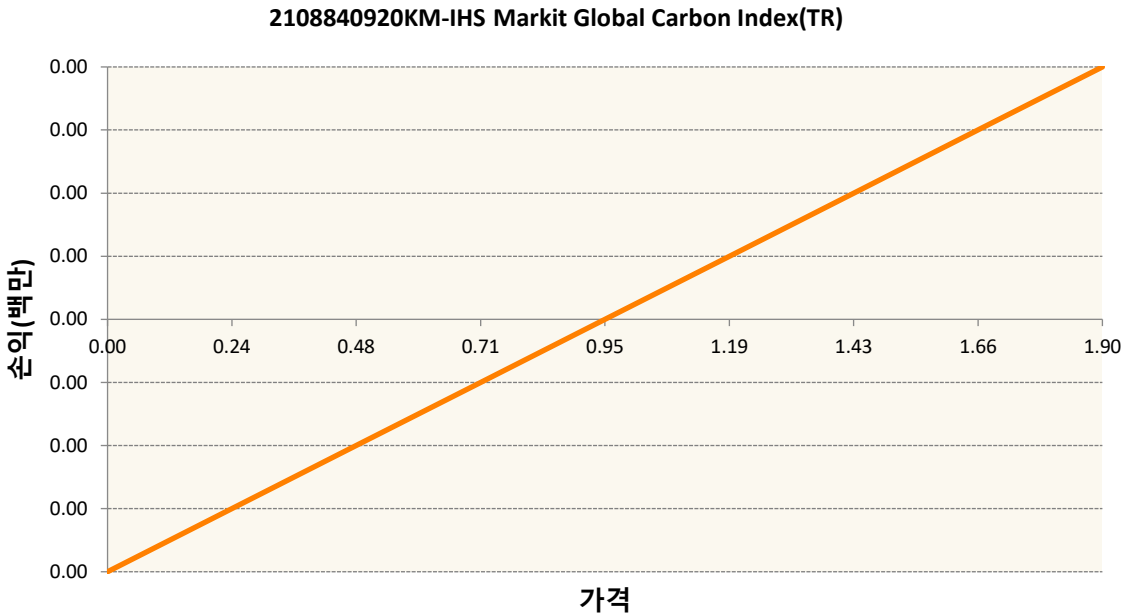
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

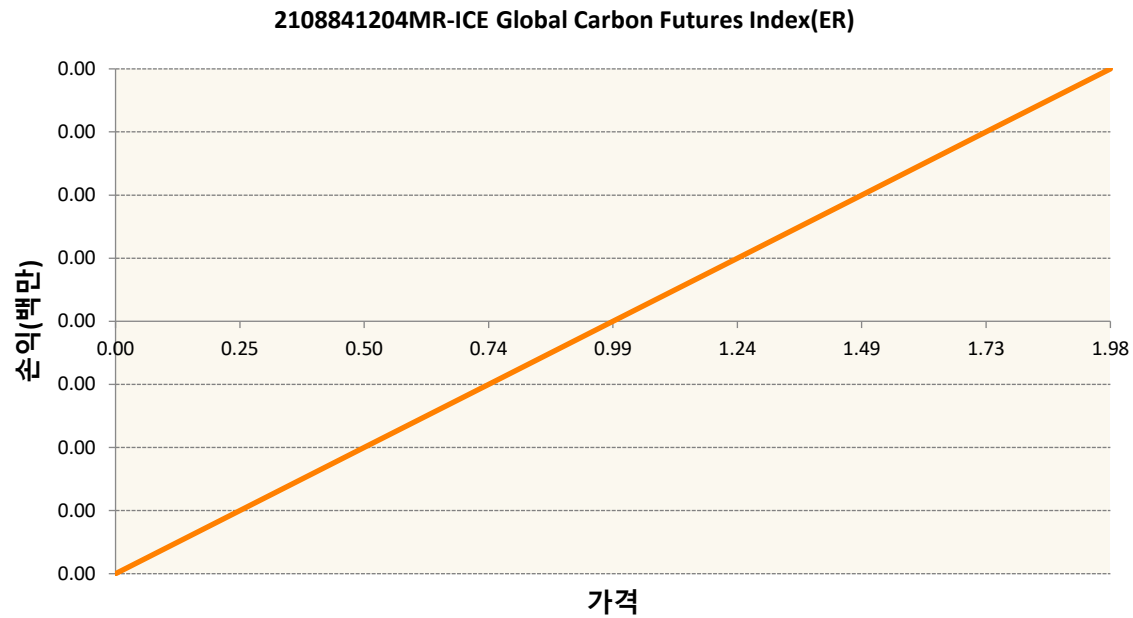
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 4,828  | 0     | 4,828     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 19,201 | 0     | 19,201    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                       |  | (단위:백만원) |
|-------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)   |  | 959      |
| 2108840920IIHS Markit Global Carbon Index(TR)   |  | 192      |
| 2108841204IIICE Global Carbon Futures Index(ER) |  | 384      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,958    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

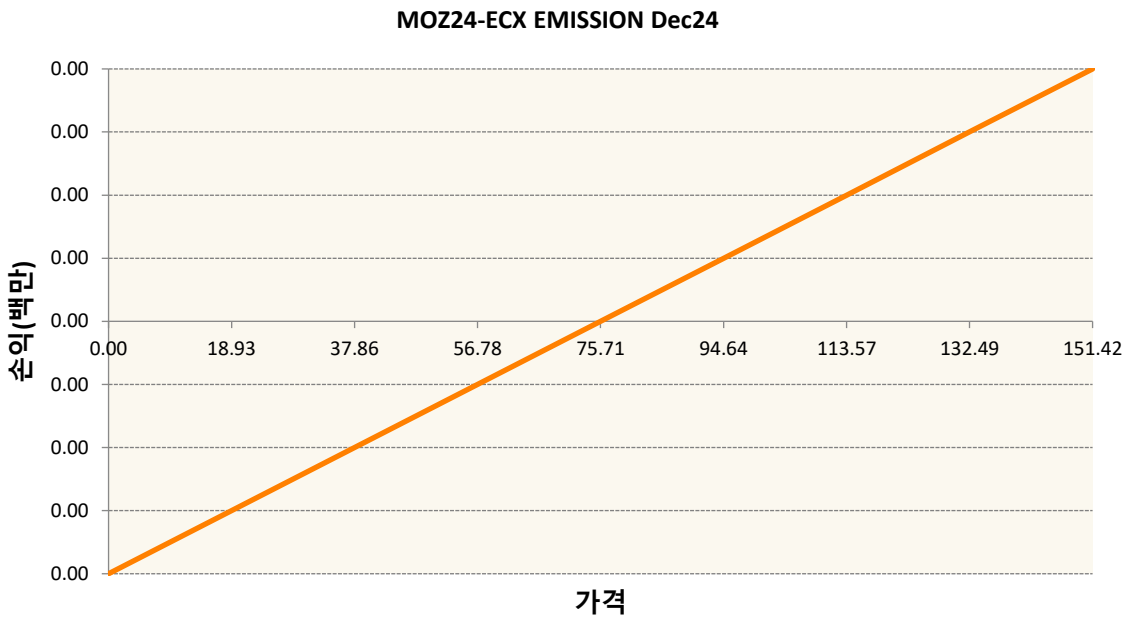
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 8,212 | 0     | 8,212     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 479   | 0     | 479       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,430 | -1,430    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E                        | 114 |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 657 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 5   |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,263 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

## 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)  | 17 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠) | 17 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)  | 11 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)  | 13 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 84 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

## SOL차이나육성산업엑티브상장지

### 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)  | 0.15 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(메리츠) | 0.21 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230116(미래)  | 0.18 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 230427(키움)  | 0.04 |

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

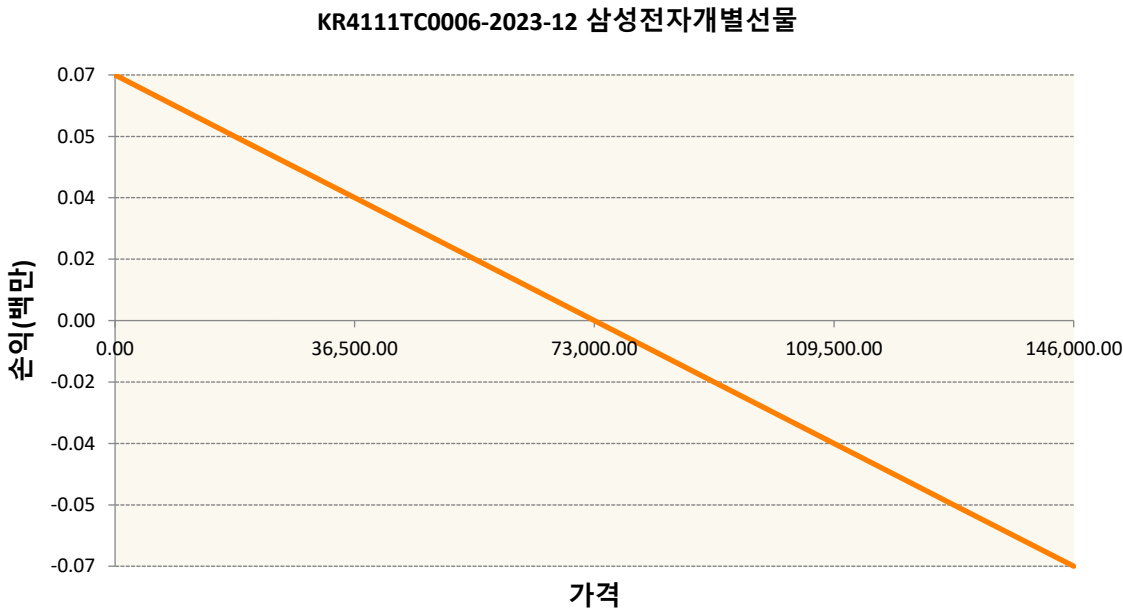
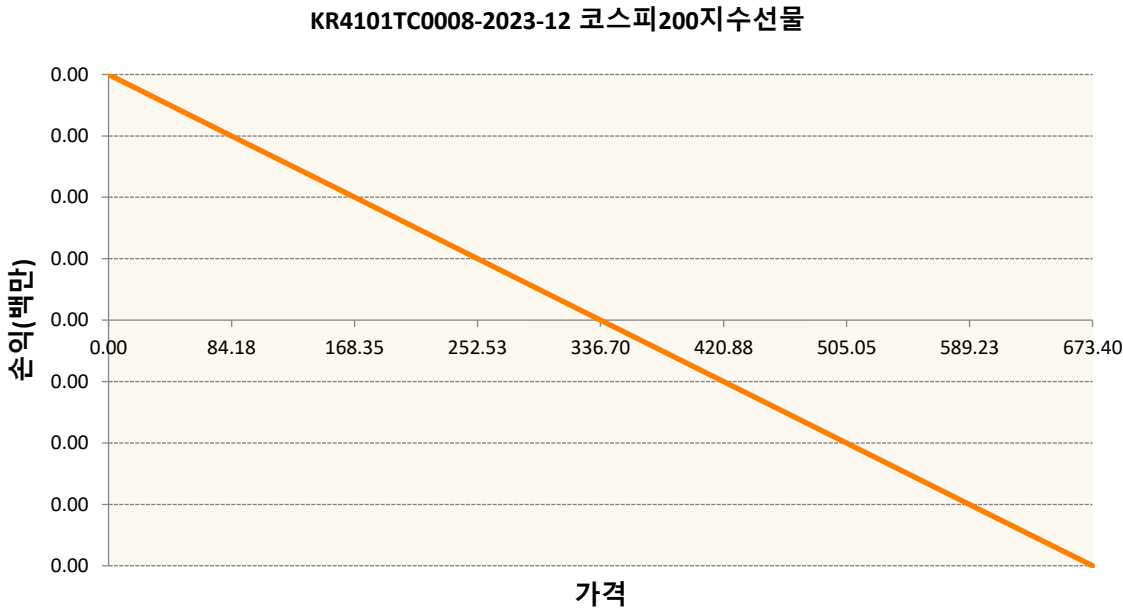
## 에퀴티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

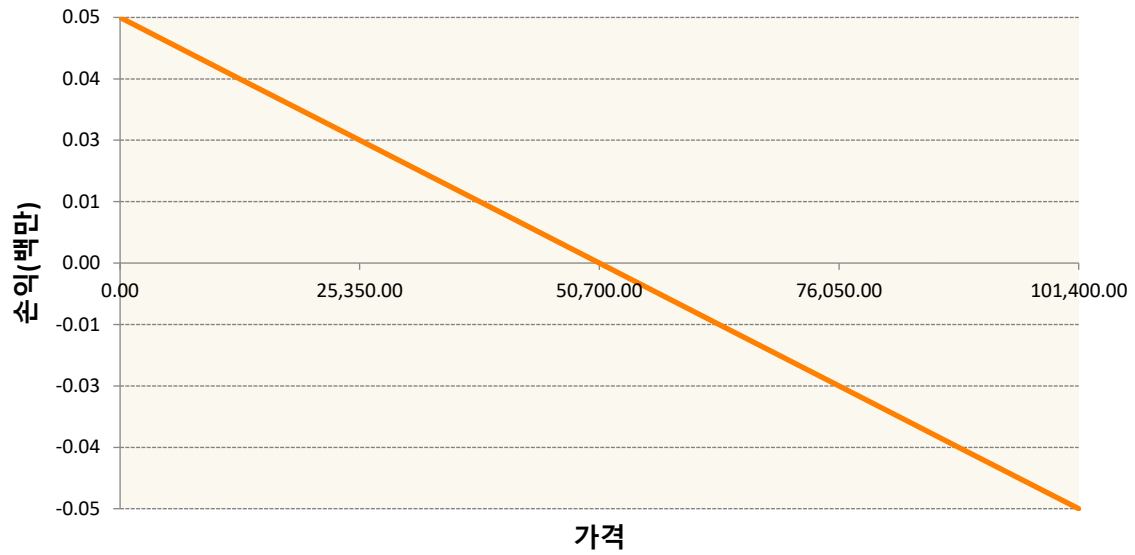
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 453   | -453      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 3,050 | -3,050    | 장내 |

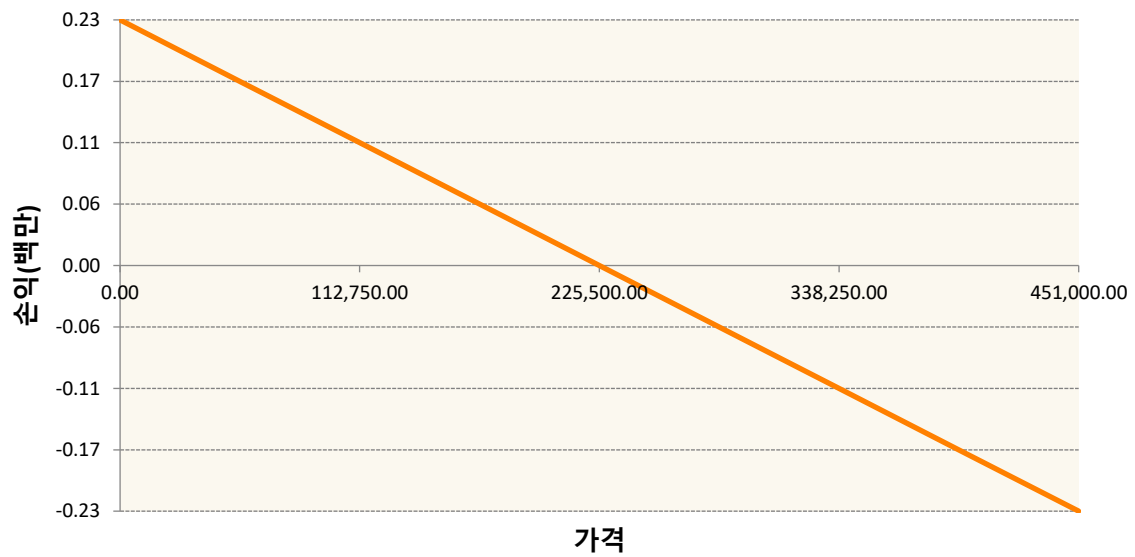
### 2. 만기시점의 손익구조



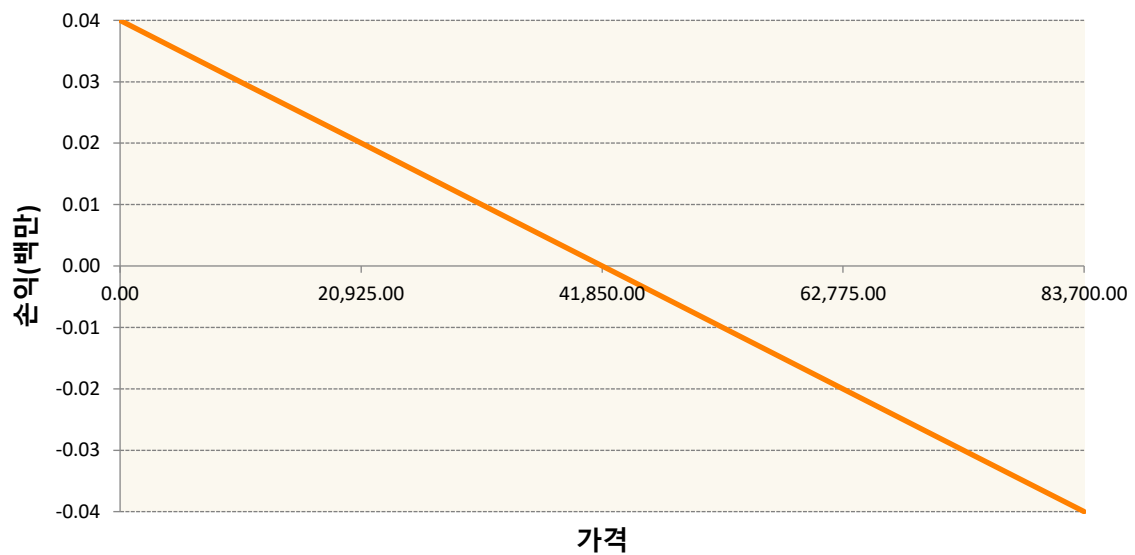
KR4112TC0005-2023-12 SK텔레콤개별선물



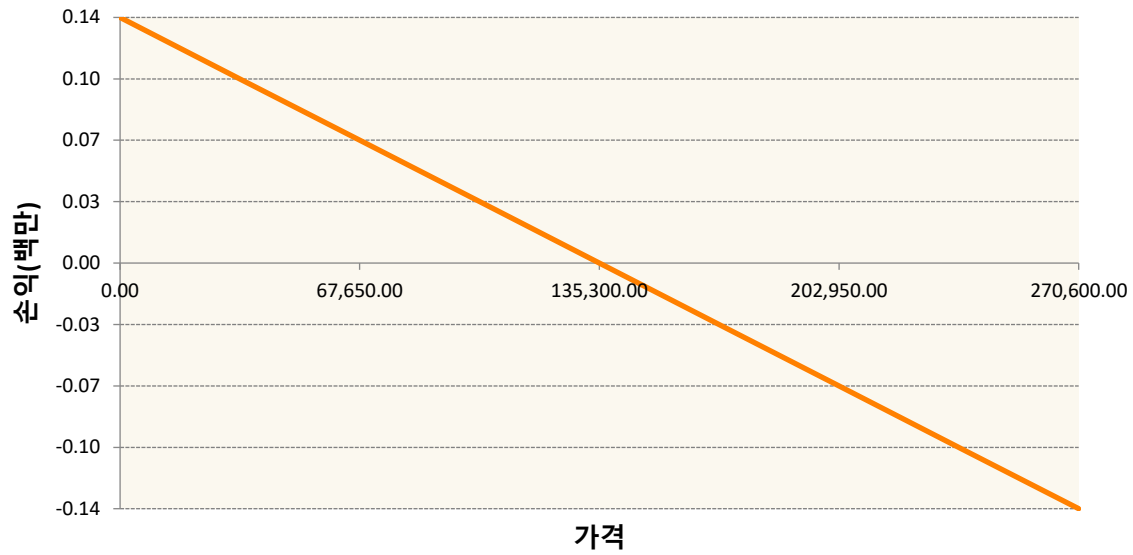
KR4120TC0005-2023-12 현대모비스개별선물



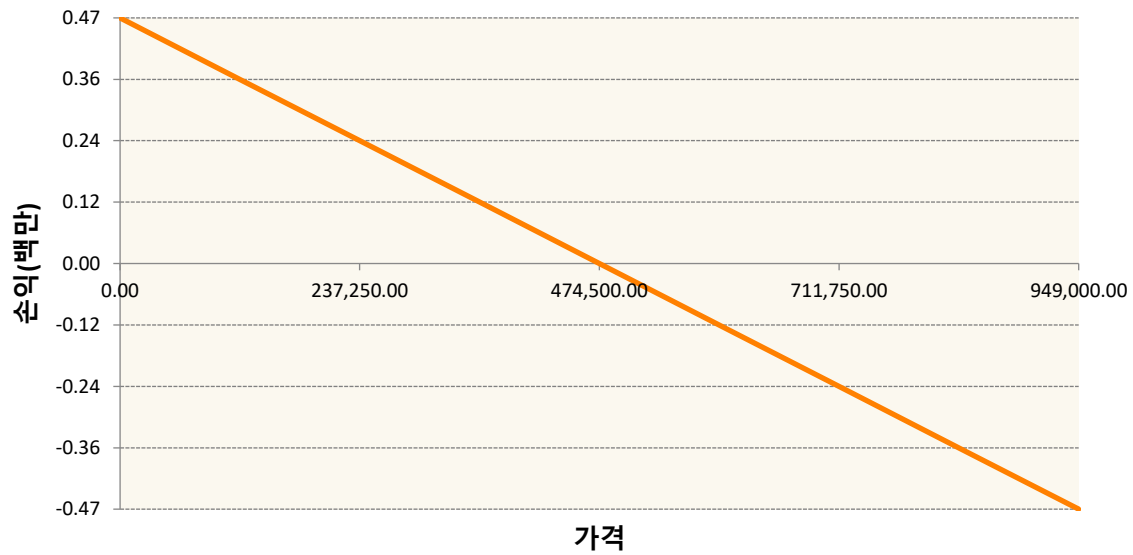
KR4140TC0001-2023-12 하나금융지주개별선물



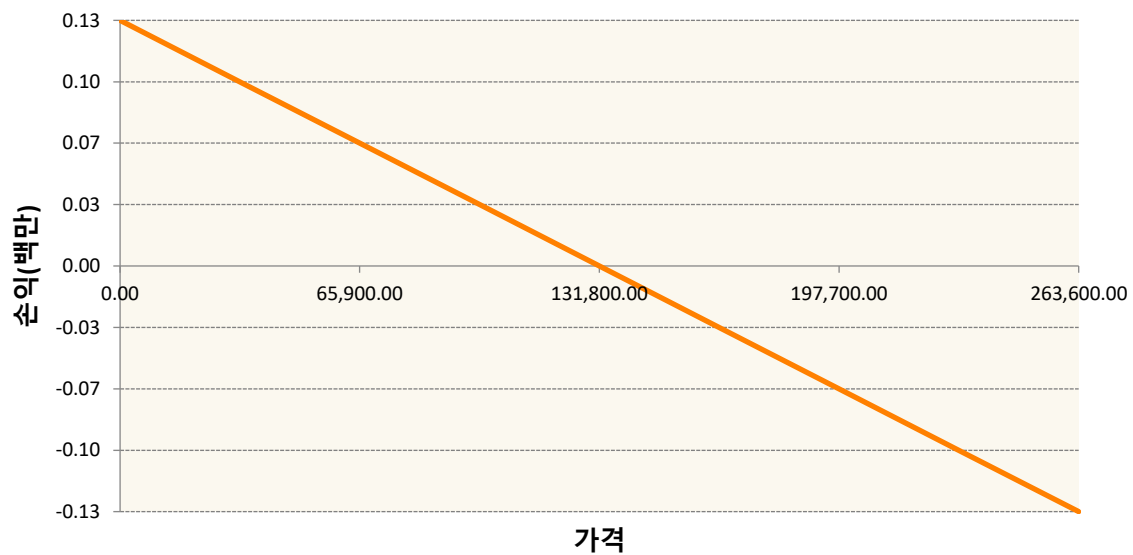
KR4141TC0000-2023-12 SK이노베이션개별선물



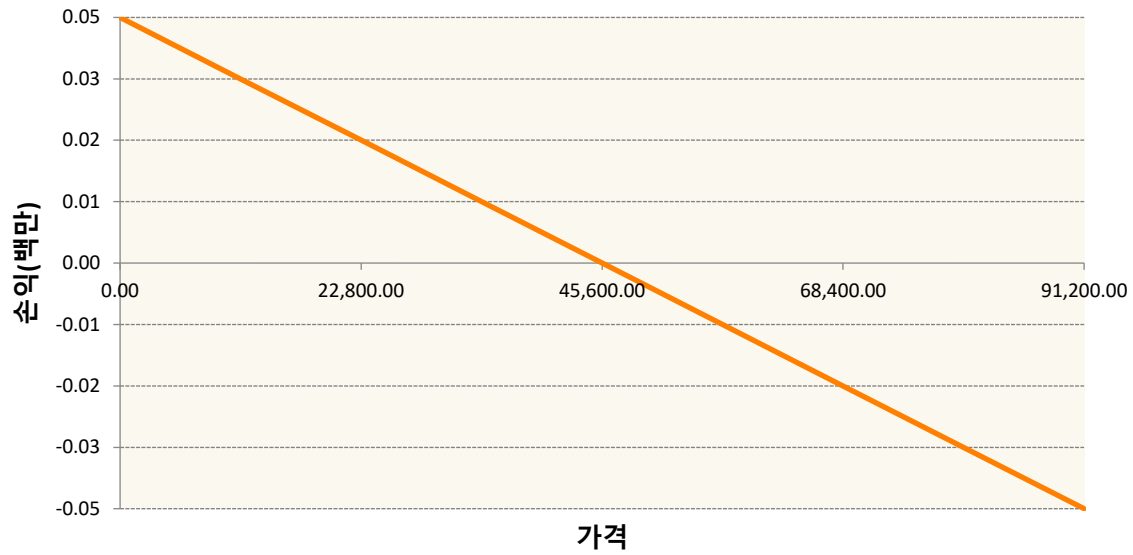
KR4147TC0004-2023-12 LG화학개별선물



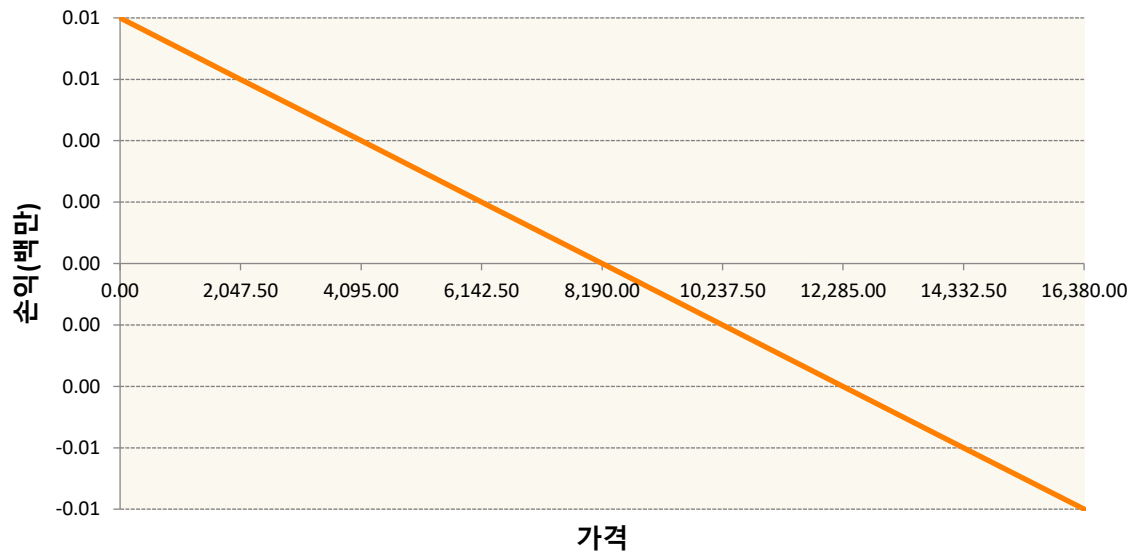
KR4150TC0008-2023-12 SK하이닉스개별선물



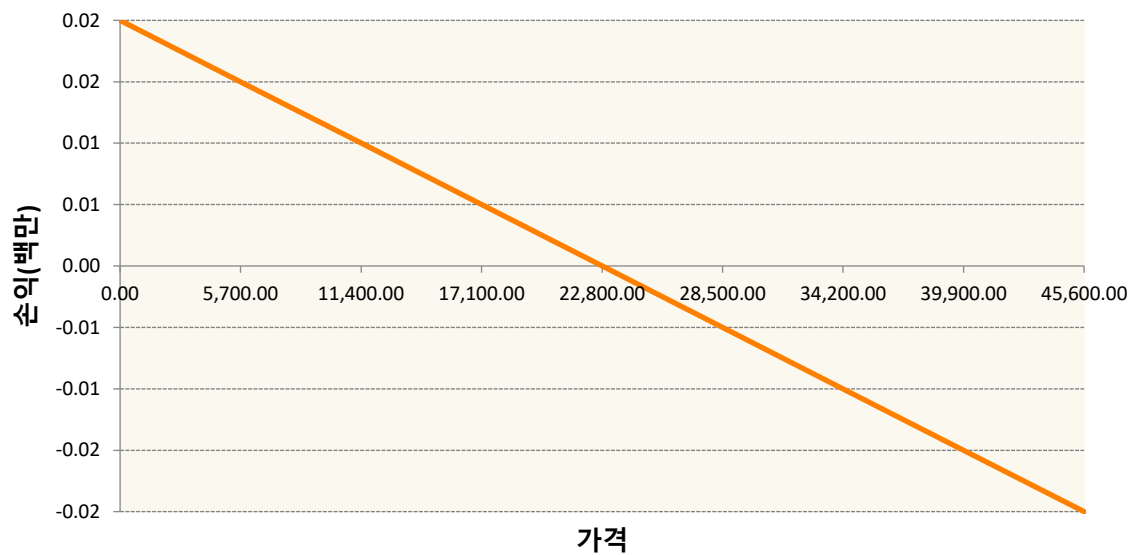
KR4155TC0003-2023-12 한국타이어앤테크놀로지개별선물



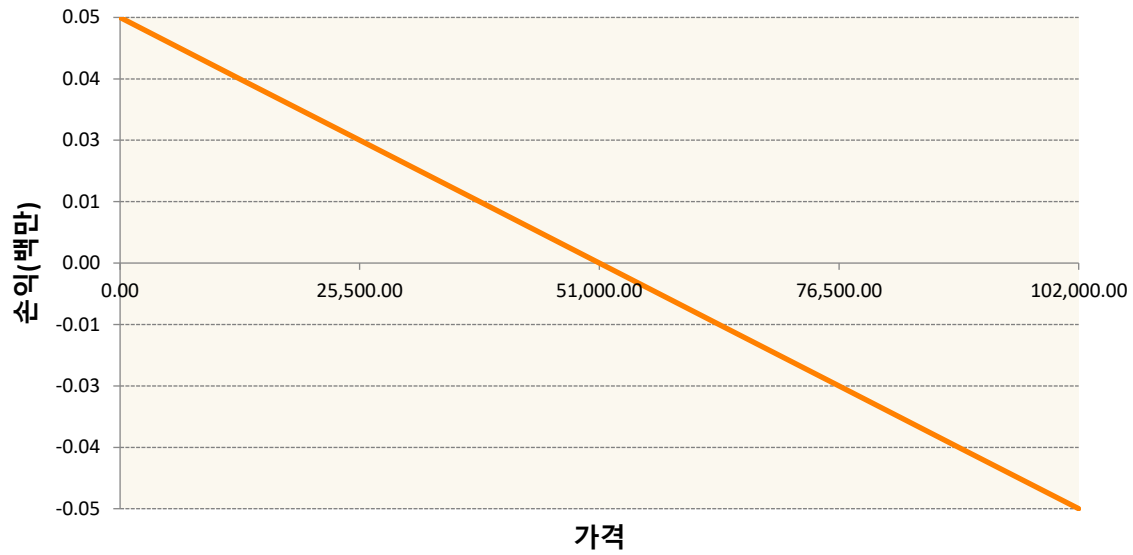
KR41BFTC0009-2023-12 삼성중공업개별선물



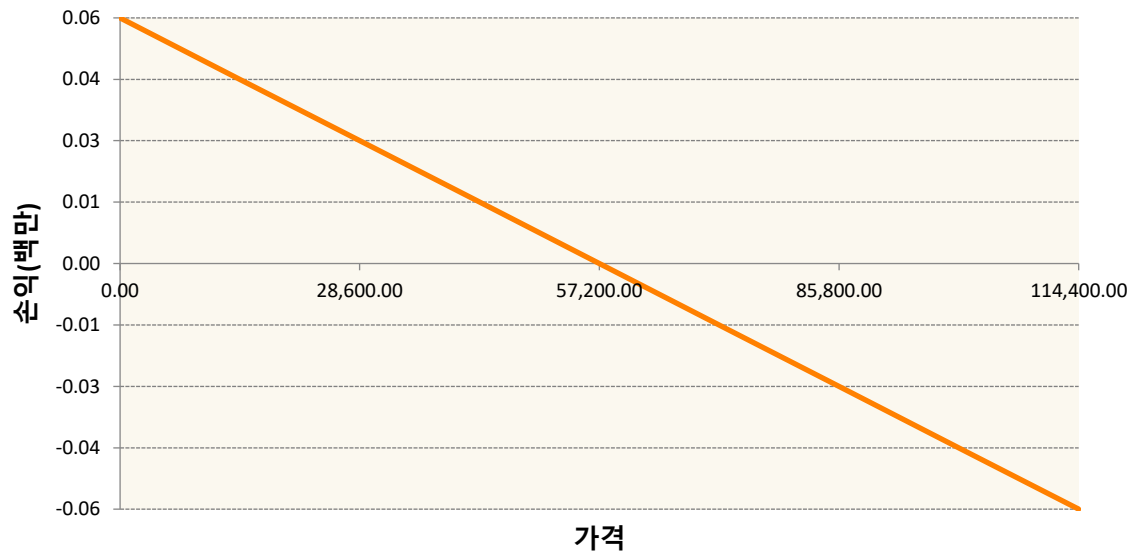
KR41BKTC0002-2023-12 하이트진로개별선물



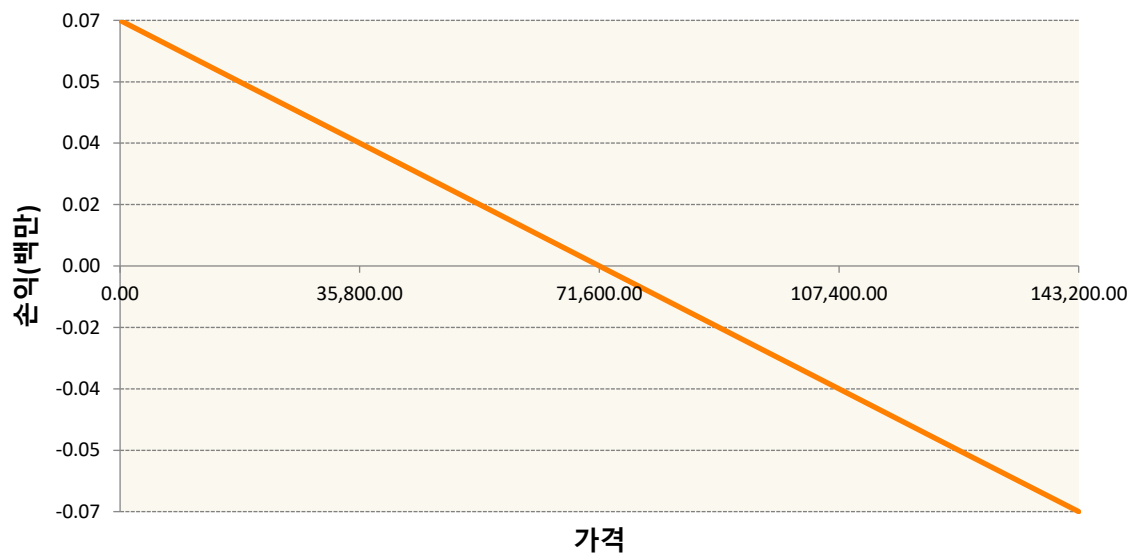
KR41CNTC0008-2023-12 포스코 ICT개별선물



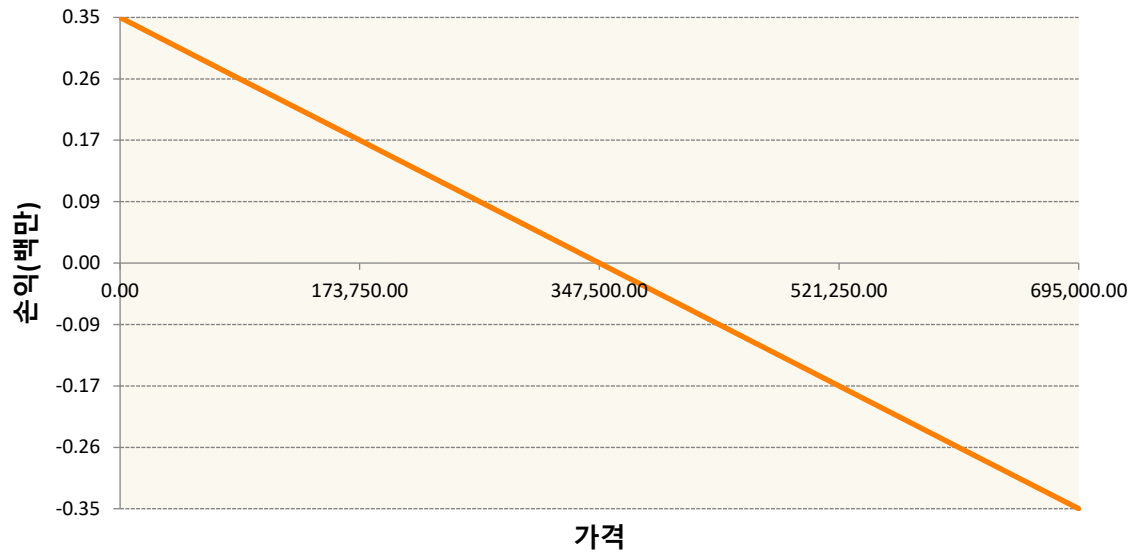
KR41E5TC0004-2023-12 넷마블개별선물



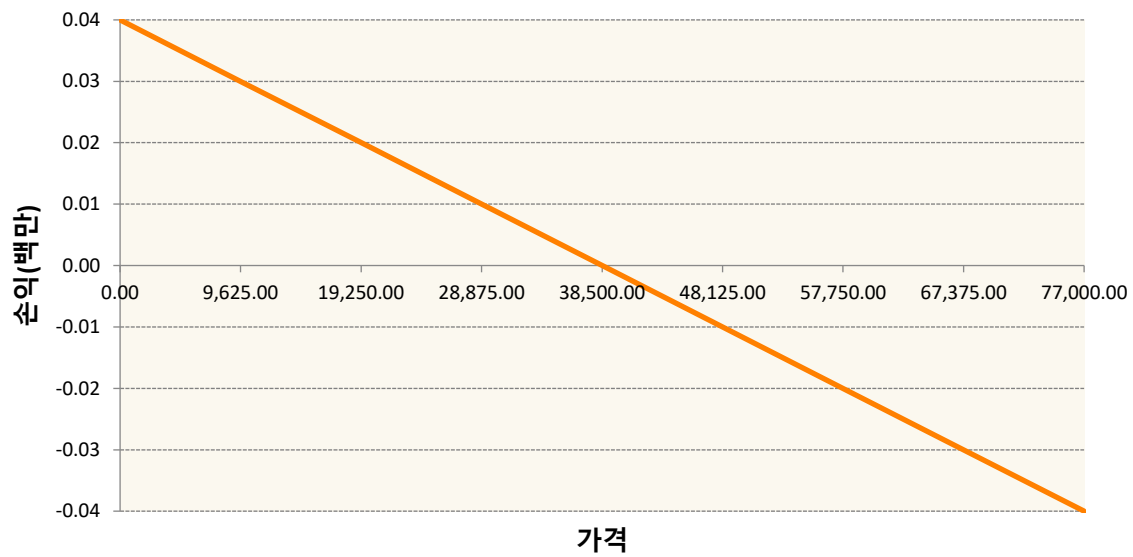
KR41E6TC0003-2023-12 셀트리온헬스케어개별선물



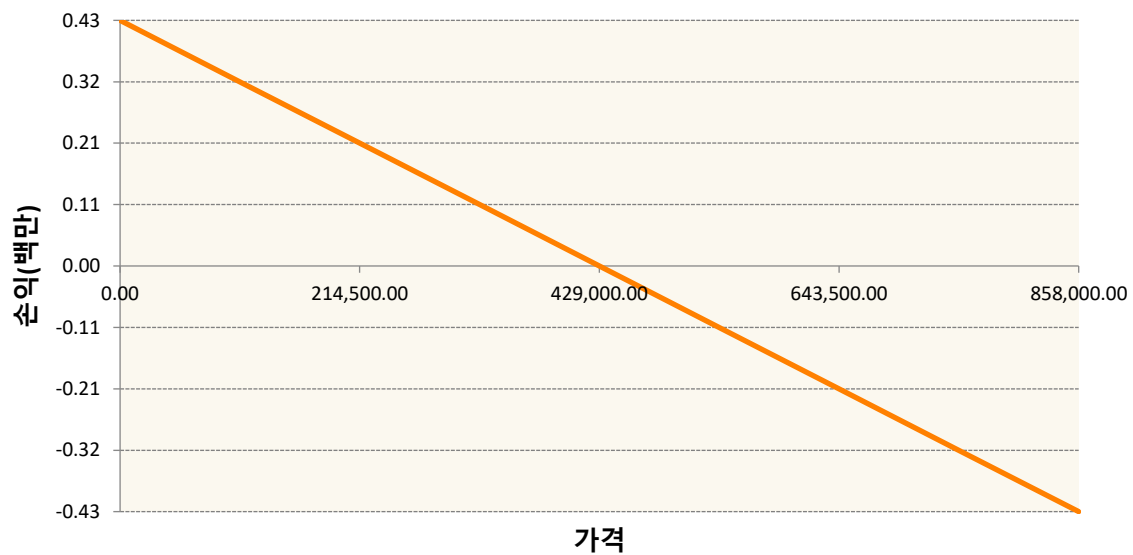
KR41E8TC0001-2023-12 포스코케미칼개별선물



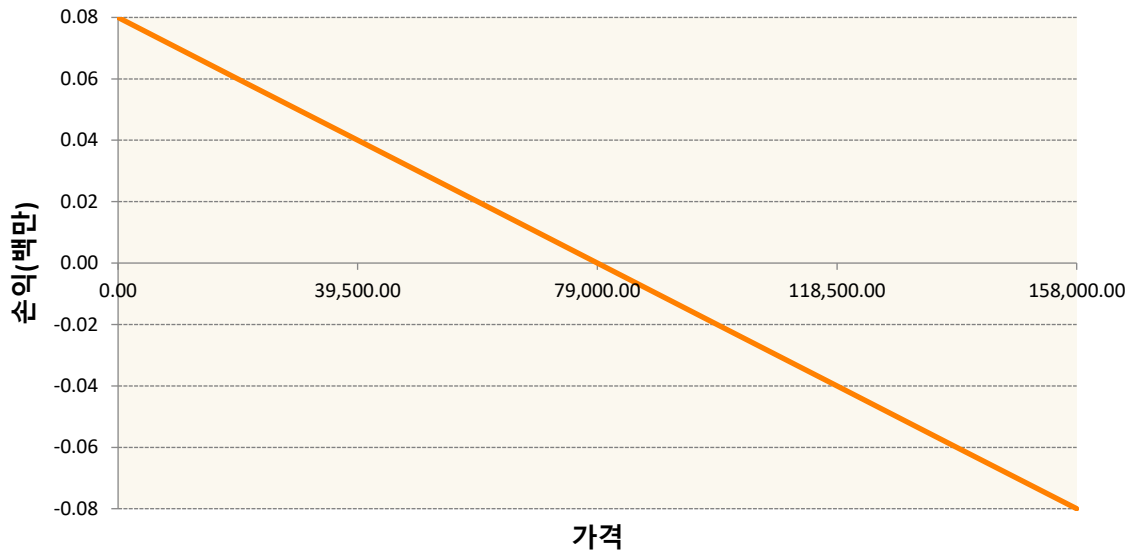
KR41ERTC0002-2023-12 DL이앤씨개별선물



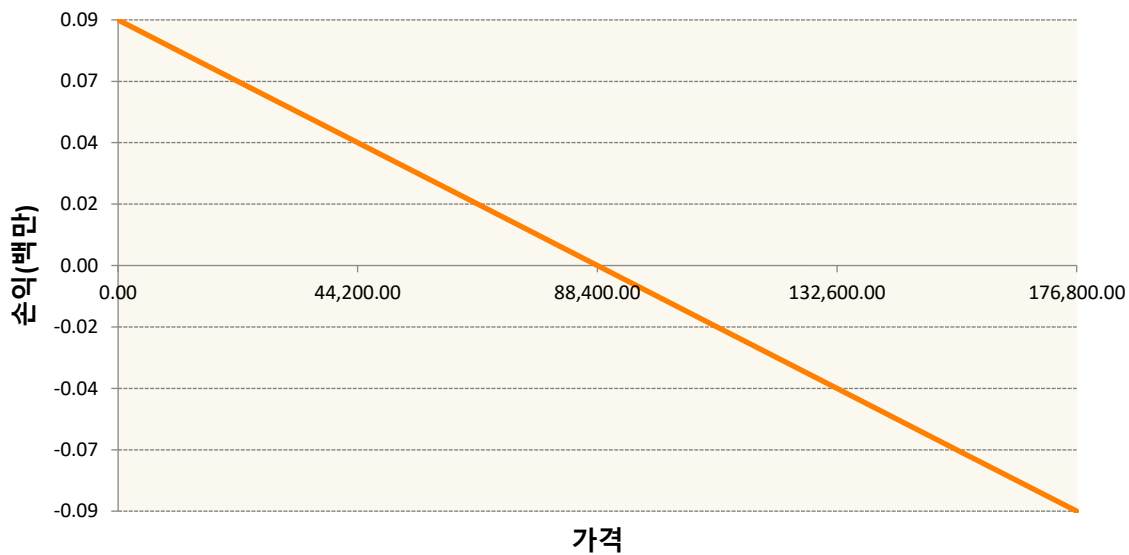
KR41F5TC0001-2023-12 LG에너지솔루션개별선물



KR41FBTC0009-2023-12 SK아이이테크놀로지개별선물



KR41FSTC0000-2023-12 LS개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                    |     |
|------------------------------------|-----|
| KR4101TC00 2023-12 코스피200지수선물      | 162 |
| KR4111TC00 2023-12 삼성전자개별선물        | 19  |
| KR4112TC00 2023-12 SK텔레콤개별선물       | 4   |
| KR4120TC00 2023-12 현대모비스개별선물       | 3   |
| KR4140TC00 2023-12 하나금융지주개별선물      | 2   |
| KR4141TC00 2023-12 SK이노베이션개별선물     | 1   |
| KR4147TC00 2023-12 LG화학개별선물        | 3   |
| KR4150TC00 2023-12 SK하이닉스개별선물      | 18  |
| KR4155TC00 2023-12 한국타이어앤테크놀로지개별선물 | 2   |
| KR41BFTC00 2023-12 삼성중공업개별선물       | 2   |
| KR41BKTC00 2023-12 하이트진로개별선물       | 5   |
| KR41CNTC00 2023-12 포스코 ICT개별선물     | 1   |

|                                   |   |
|-----------------------------------|---|
| KR41E5TC00 2023-12 넷마블개별선물        | 7 |
| KR41E6TC00 2023-12 셀트리온헬스케어개별선물   | 2 |
| KR41E8TC00 2023-12 포스코케미칼개별선물     | 4 |
| KR41ERTC00 2023-12 DL이앤씨개별선물      | 4 |
| KR41F5TC00 2023-12 LG에너지솔루션개별선물   | 2 |
| KR41FBTC00 2023-12 SK아이이테크놀로지개별선물 | 1 |
| KR41FSTC00 2023-12 LS개별선물         | 1 |

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

(단위:백만원)

309

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

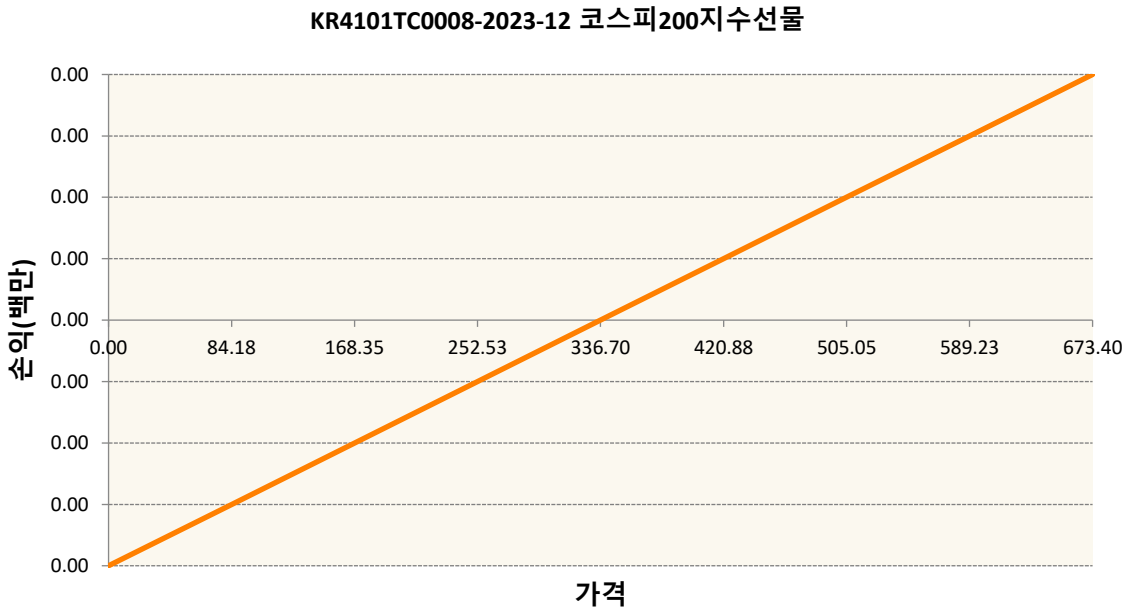
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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   | 4,377 | 0     | 4,377     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101TC0008 |           |         | 2023-12 코스피200지수선물 |      |       |        | 350    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -350      | -350    | -350               | -350 | -350  | -350   | -350   |
| -5.33%       | -233      | -233    | -233               | -233 | -233  | -233   | -233   |
| -2.67%       | -117      | -117    | -117               | -117 | -117  | -117   | -117   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 117       | 117     | 117                | 117  | 117   | 117    | 117    |
| 5.33%        | 233       | 233     | 233                | 233  | 233   | 233    | 233    |
| 8.00%        | 350       | 350     | 350                | 350  | 350   | 350    | 350    |

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

(단위:백만원)

326

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

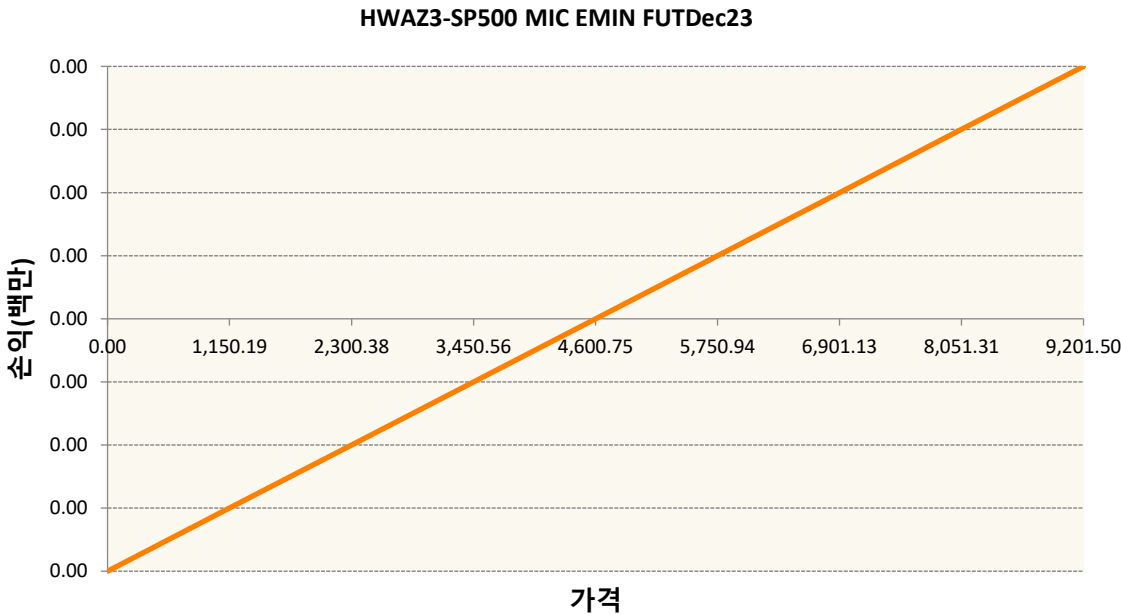
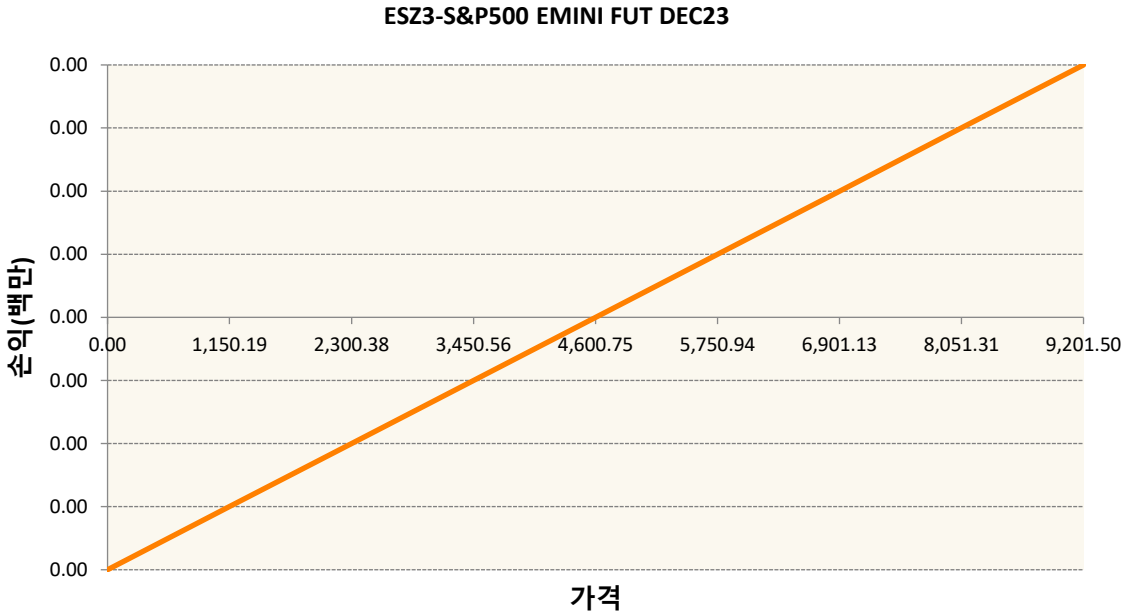
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 311   | 0     | 311       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,881 | 0     | 1,881     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| ESZ3                      | S&P500 EMINI FUT DEC23  | 25       |
| HWAZ3                     | SP500 MIC EMIN FUTDec23 | 150      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 149      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

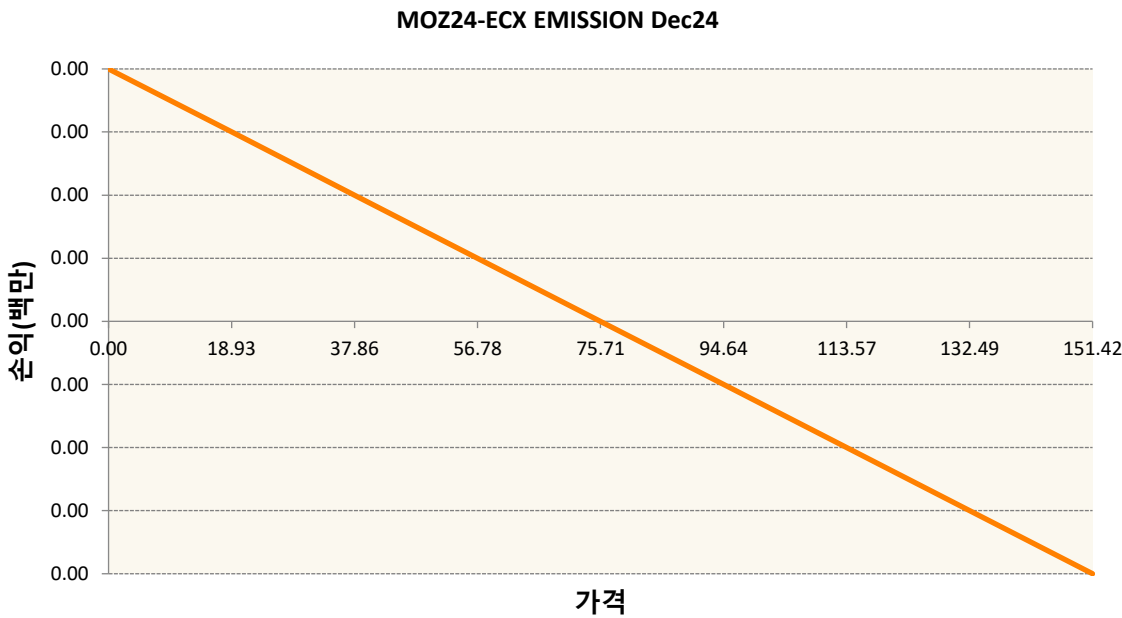
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 6,177 | -6,177    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 479   | 0     | 479       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,718 | -1,718    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E                        | 7   |
| FXW213DBV KRW/EUR 28-12-23E                        | 130 |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 494 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 5   |

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

(단위:백만원)

987

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

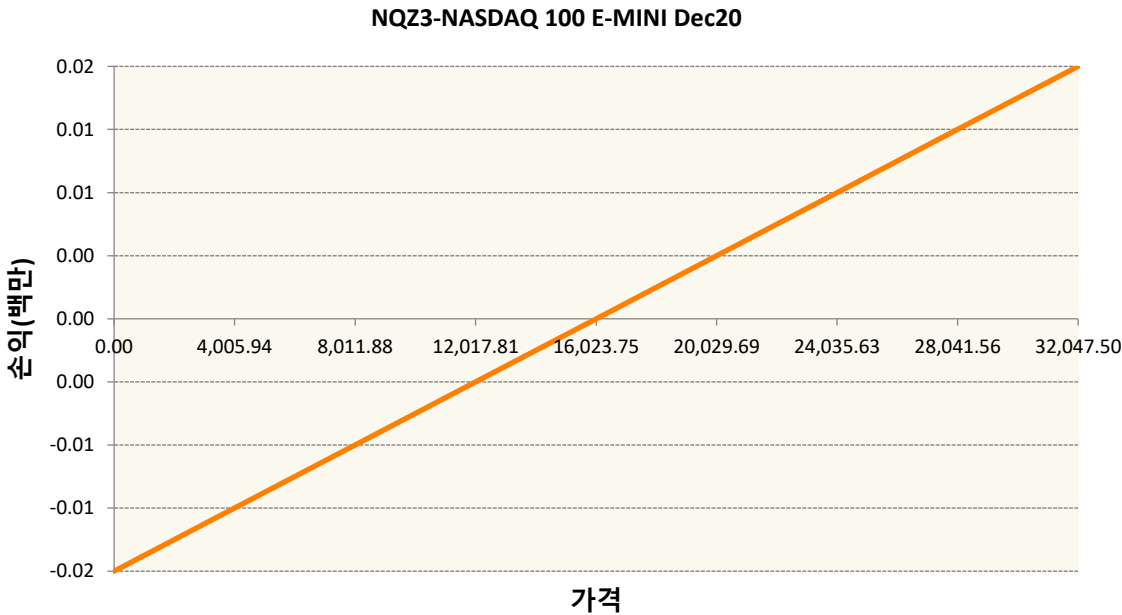
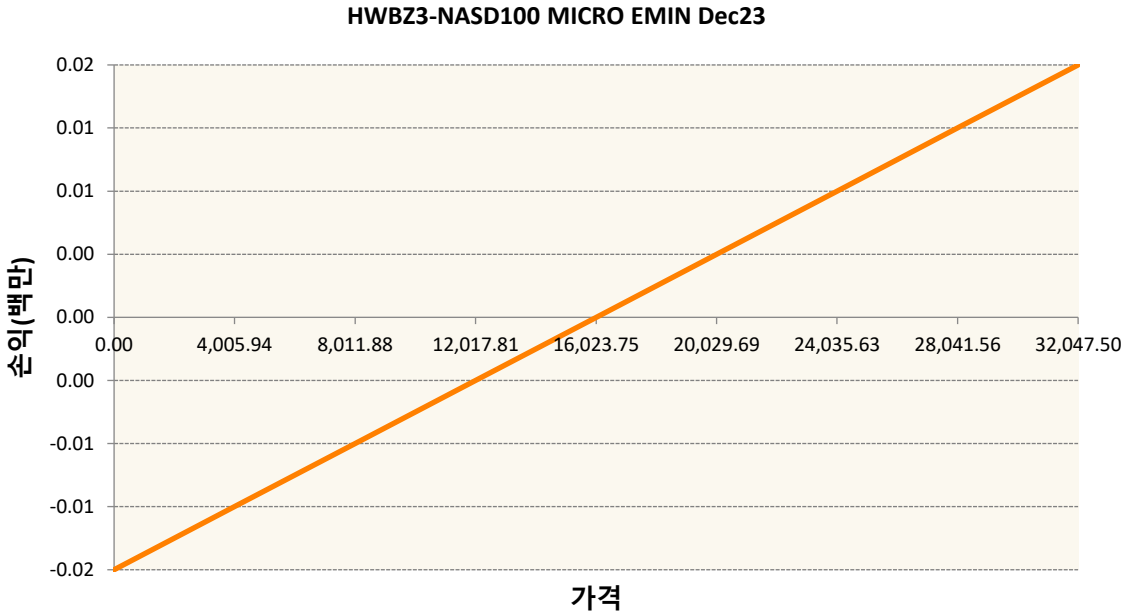
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 432   | 0     | 432       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,594 | 0     | 1,594     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| HWBZ3                     | NASD100 MICRO EMIN Dec23 | 128      |
| NQZ3                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  | 35       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 148      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2023-12-05 |
| 기준일 | 2023-12-04 |

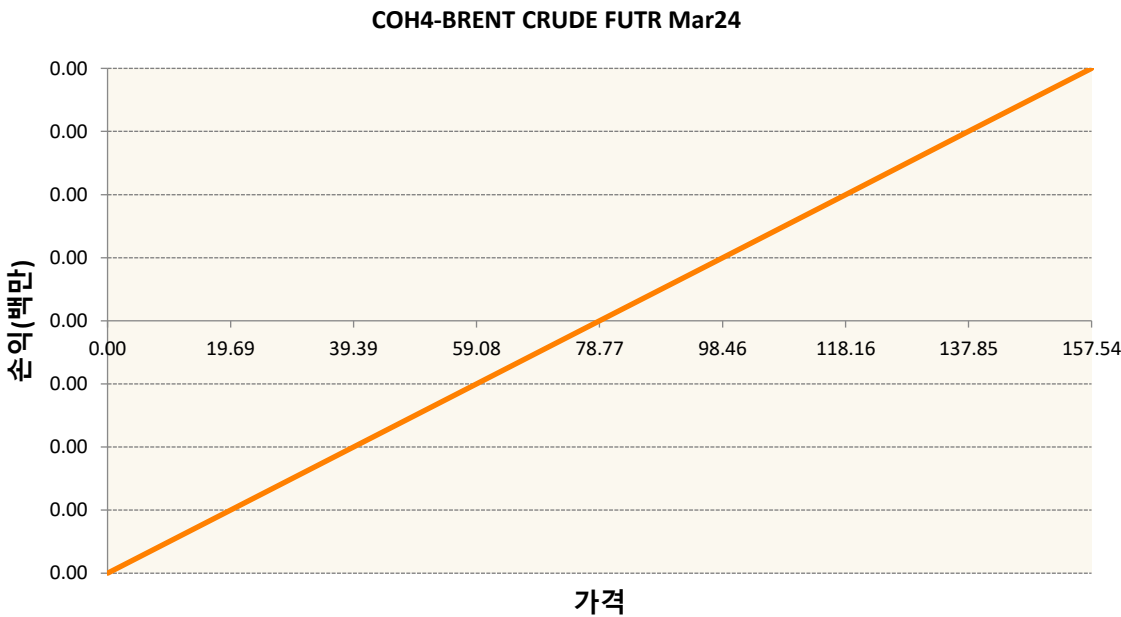
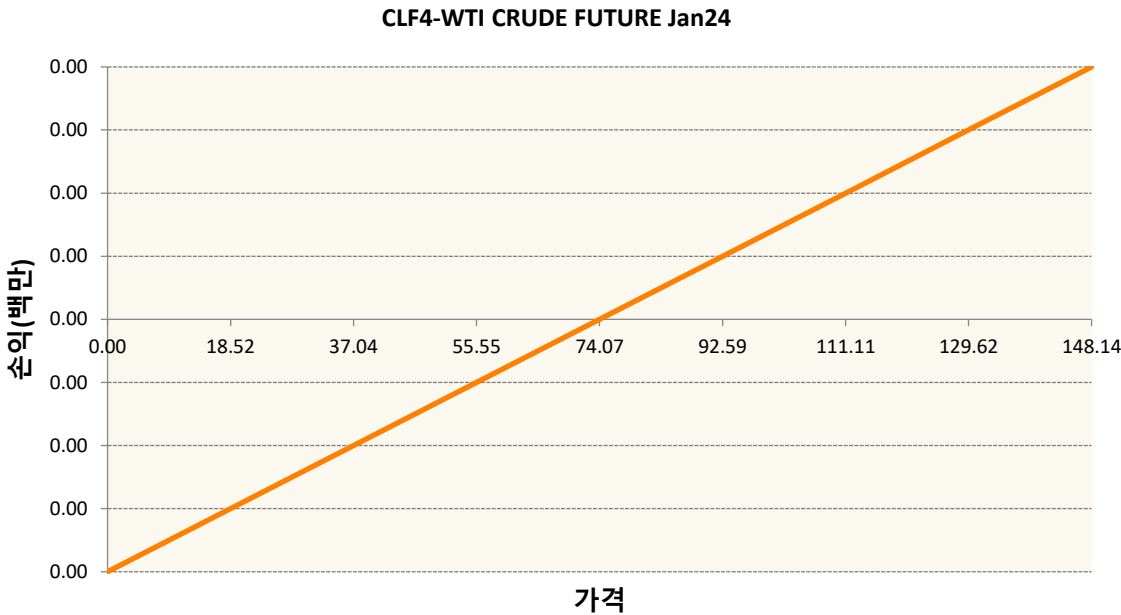
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

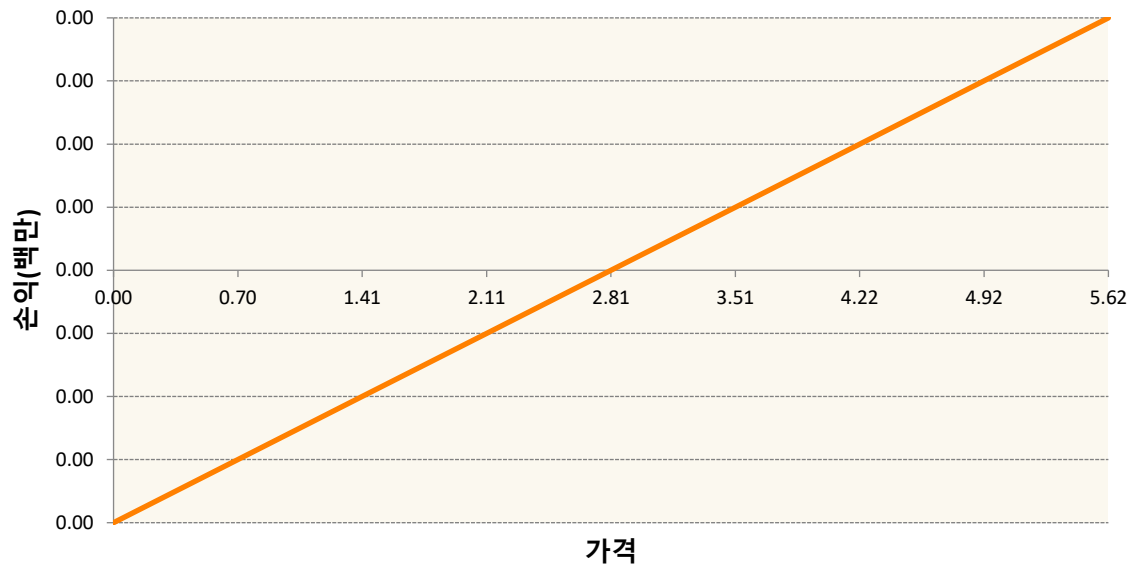
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 13    | 0     | 13        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,241 | 0     | 1,241     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 130   | -130      | 장내 |

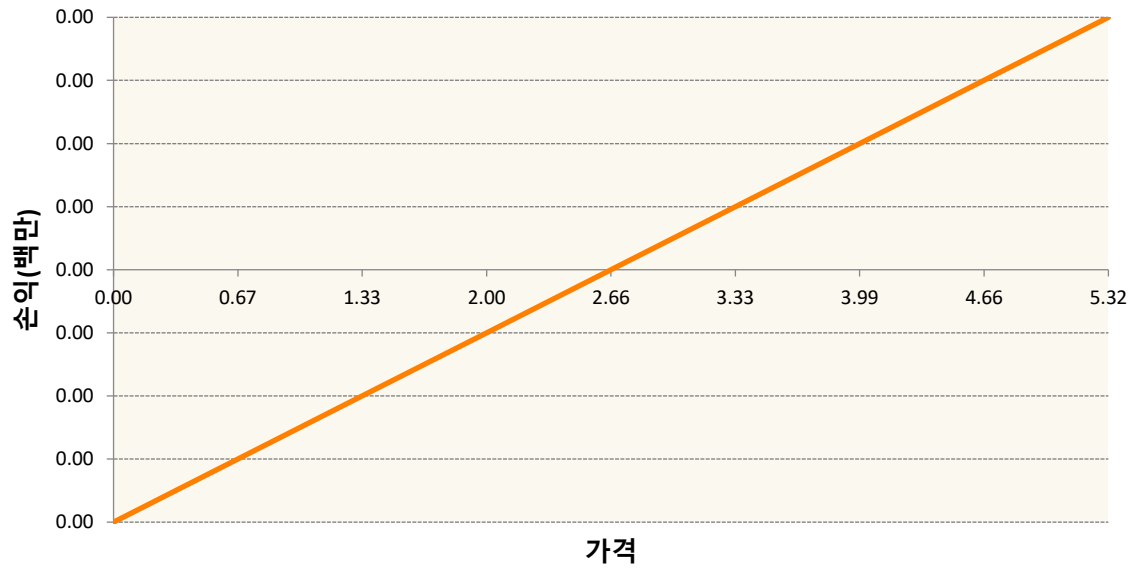
### 2. 만기시점의 손익구조



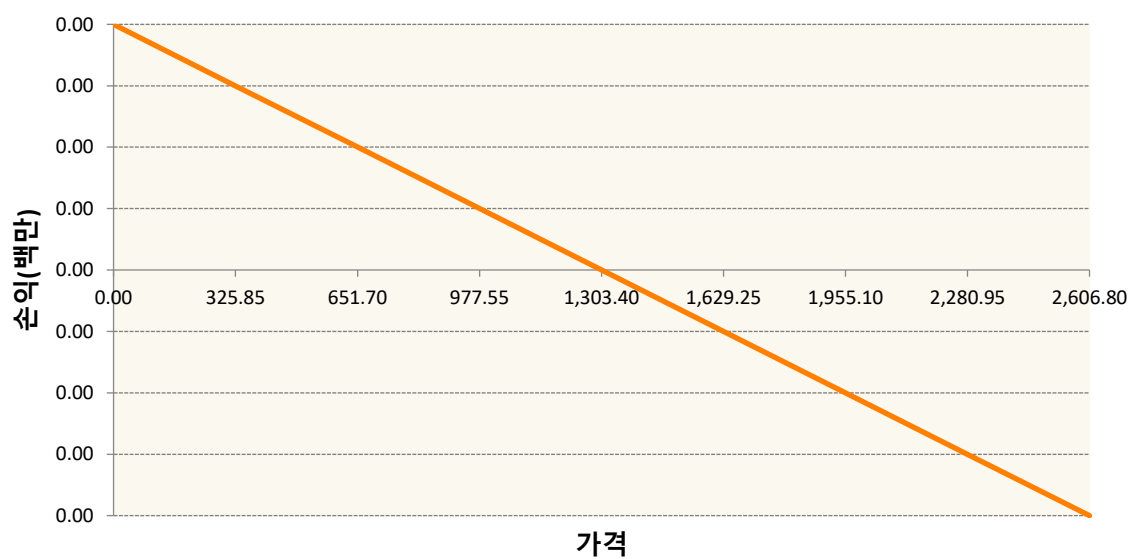
EOF4-E-MINI NATURAL GAS Jan24



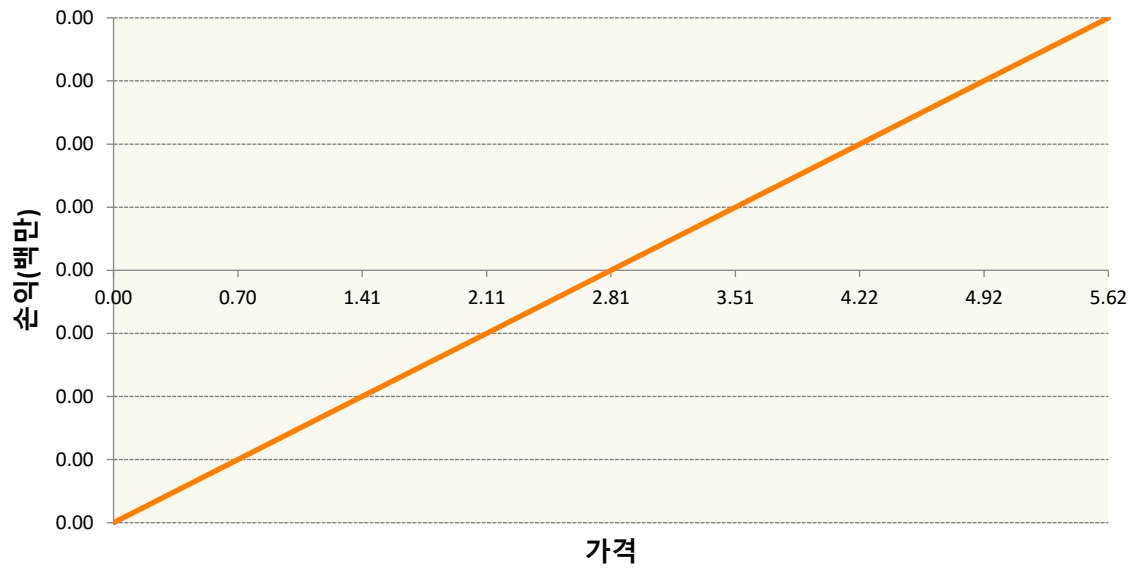
HOF4-NY Harb ULSD Fut Jan24



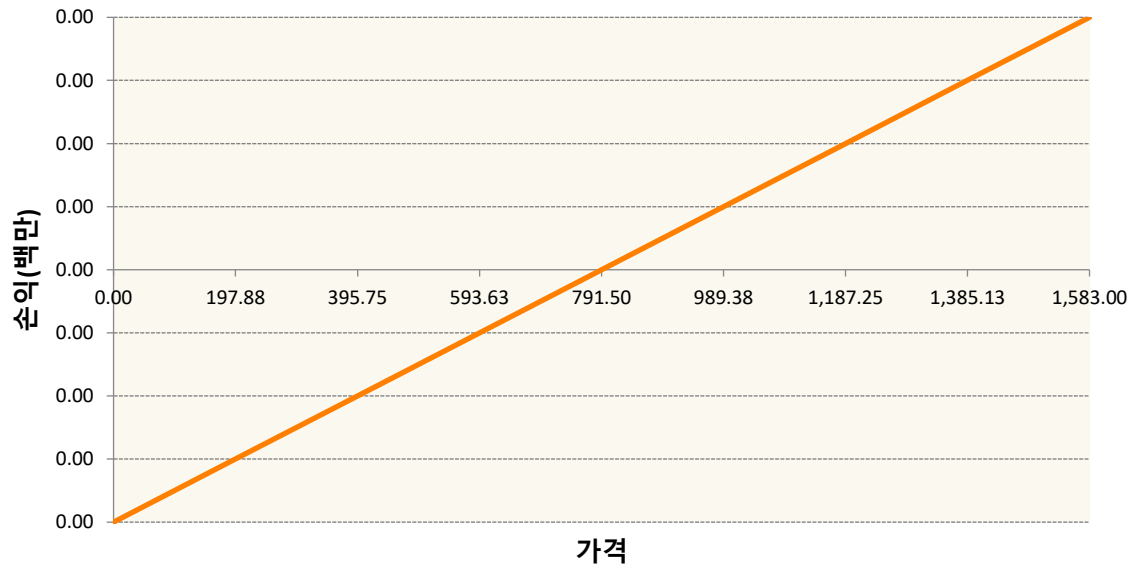
KR4175TC0009-2023-12 달러선물



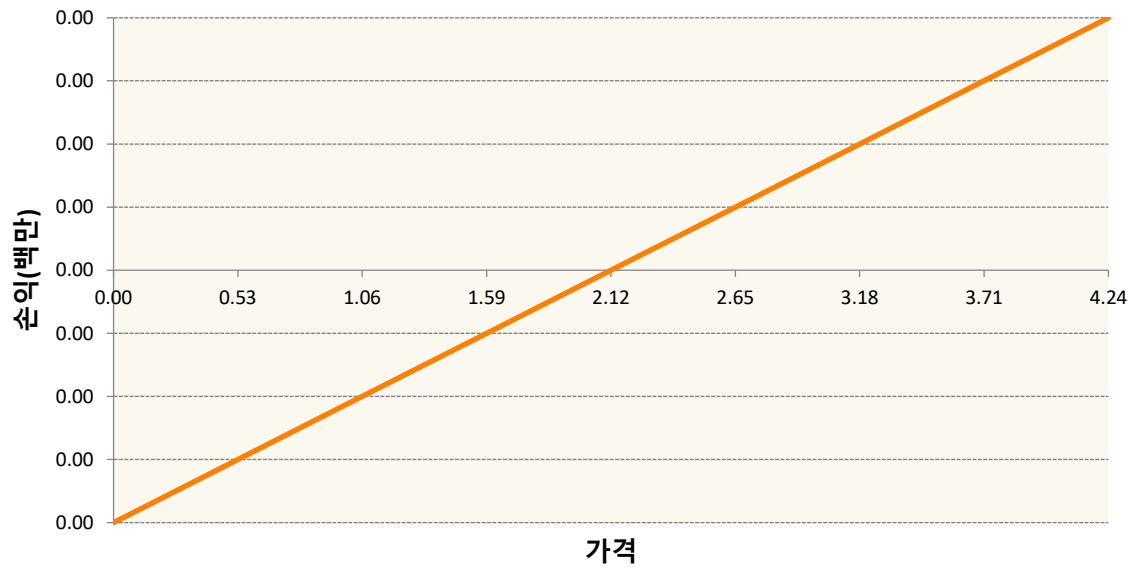
NGF24-NATURAL GAS FUTR Jan24



QSF4-Low Su Gasoil G Jan24



XBF4-GASOLINE RBOB FUT Jan24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|            |                          |    |
|------------|--------------------------|----|
| CLF4       | WTI CRUDE FUTURE Jan24   | 24 |
| COH4       | BRENT CRUDE FUTR Mar24   | 25 |
| EOF4       | E-MINI NATURAL GAS Jan24 | 2  |
| HOF4       | NY Harb ULSD Fut Jan24   | 12 |
| KR4175TC00 | 2023-12 달러선물             | 10 |
| NGF24      | NATURAL GAS FUTR Jan24   | 18 |
| QSF4       | Low Su Gasoil G Jan24    | 8  |
| XBF4       | GASOLINE RBOB FUT Jan24  | 10 |

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

245