

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

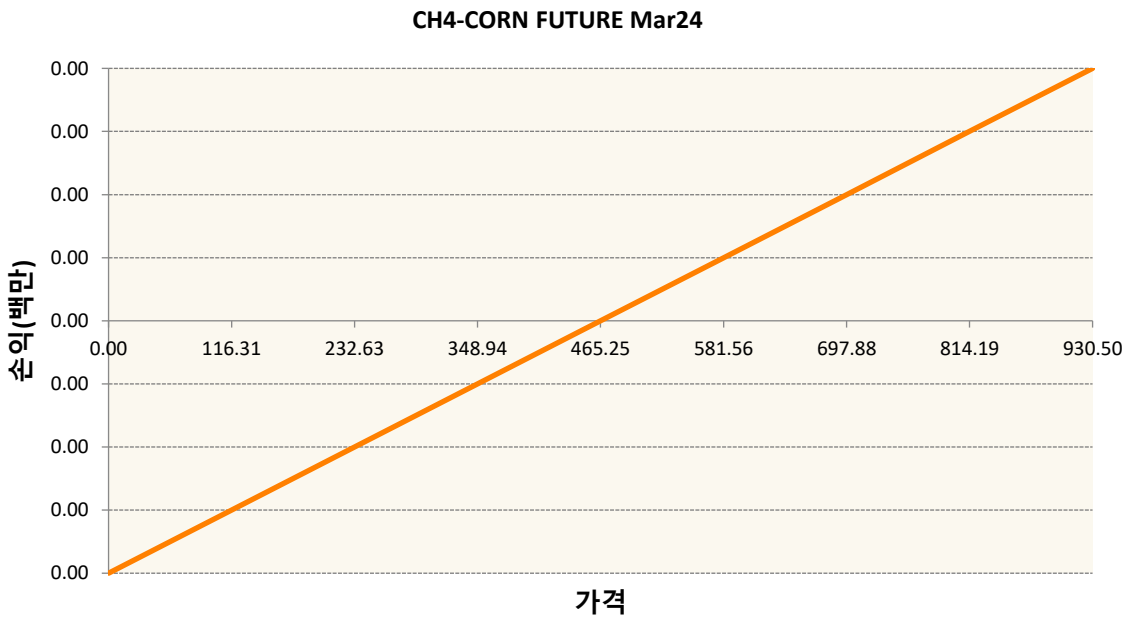
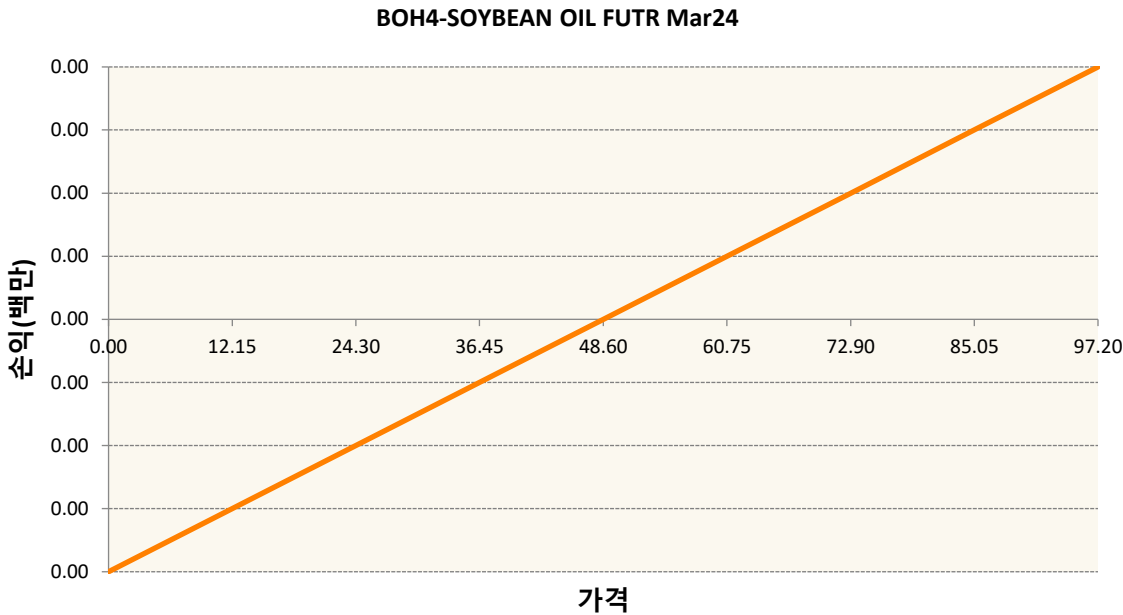
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

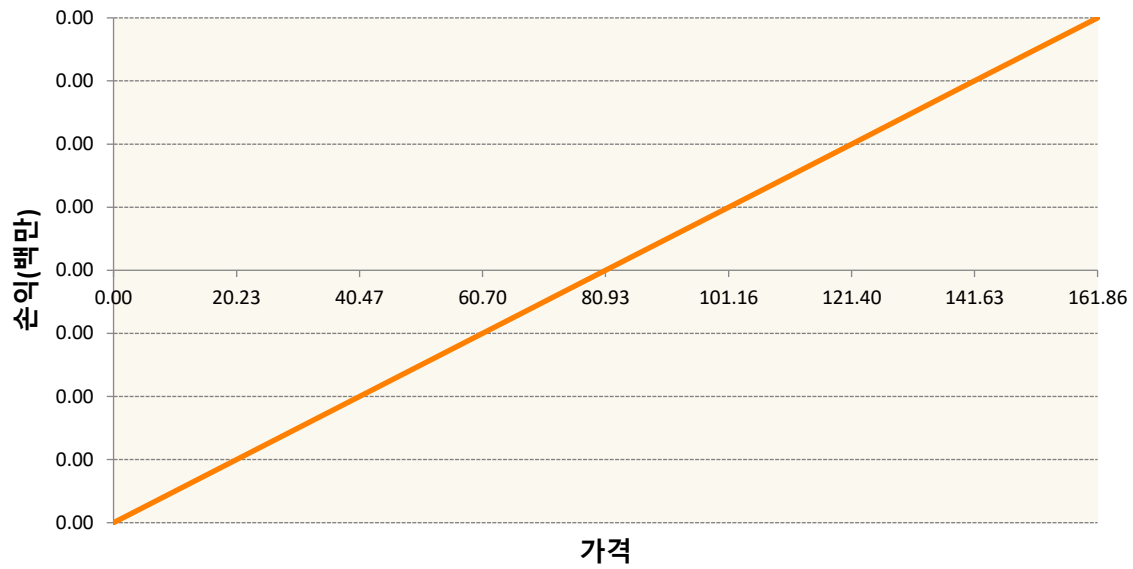
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 52    | 0     | 52        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 4,601 | 0     | 4,601     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 432   | -432      | 장내 |

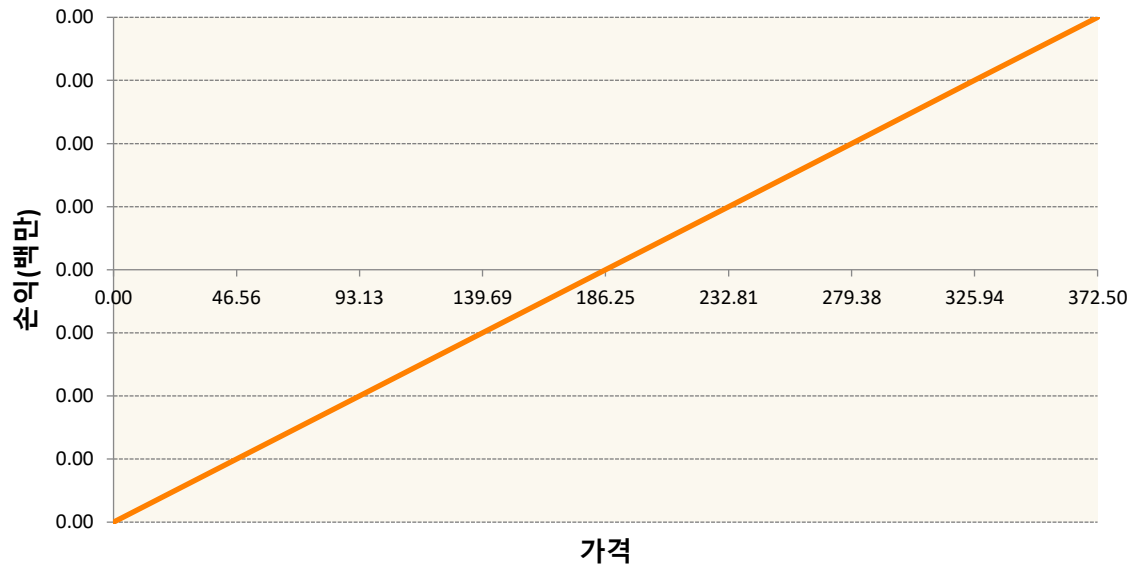
2. 만기시점의 손익구조



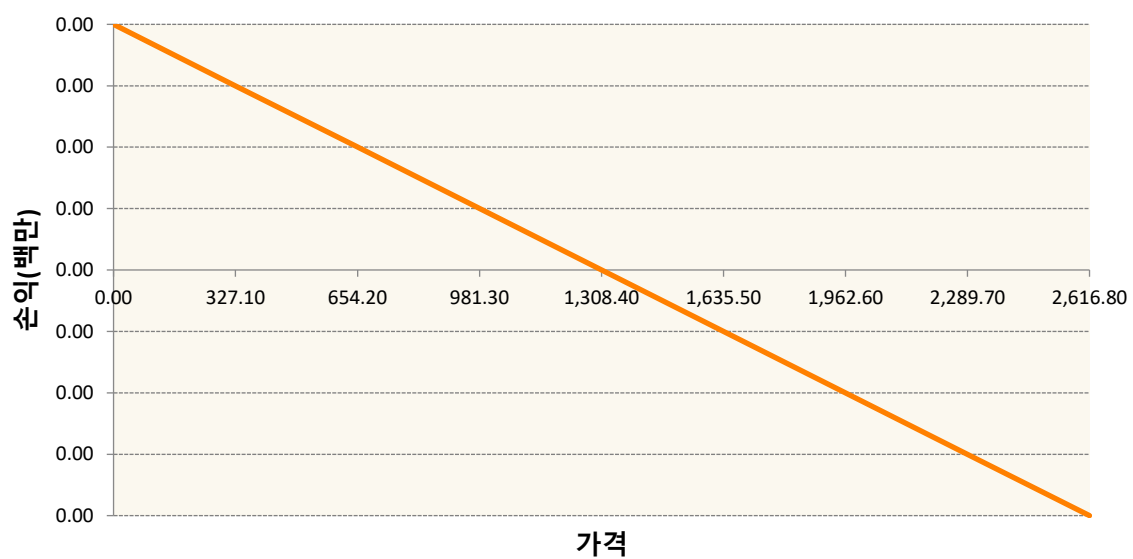
CTH4-COTTON NO.2 FUTR Mar24



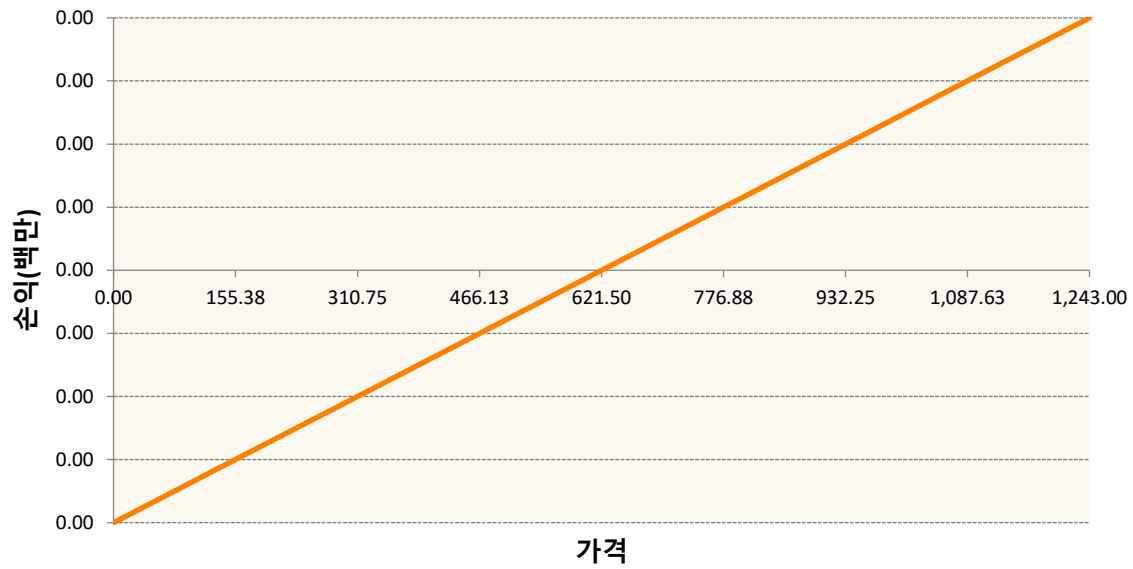
KCH4-COFFEE 'C' FUTURE Mar24



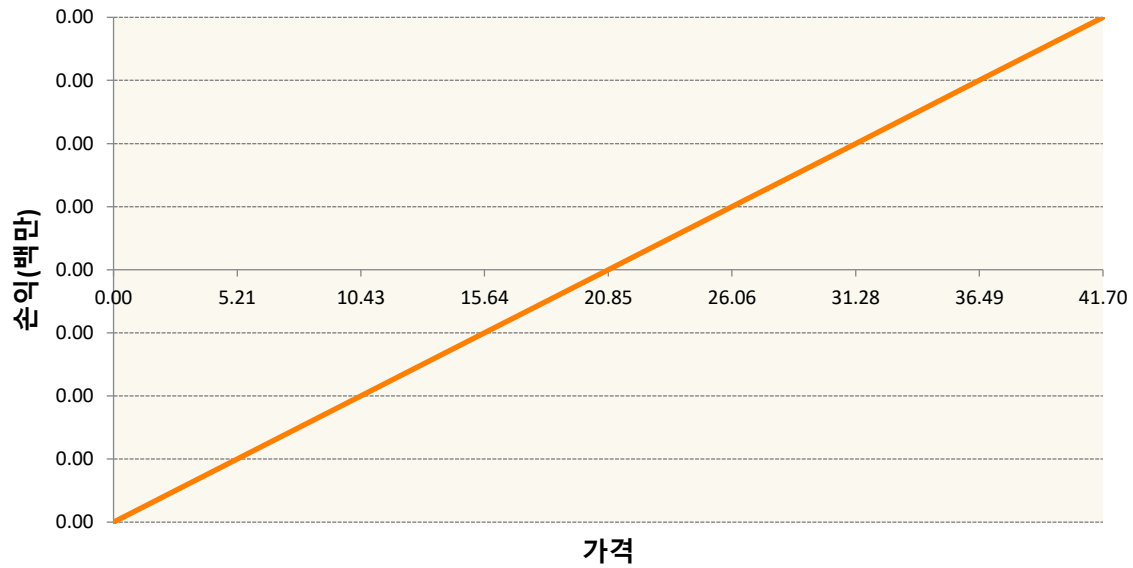
KR4175V10001-2024-01 달러선물



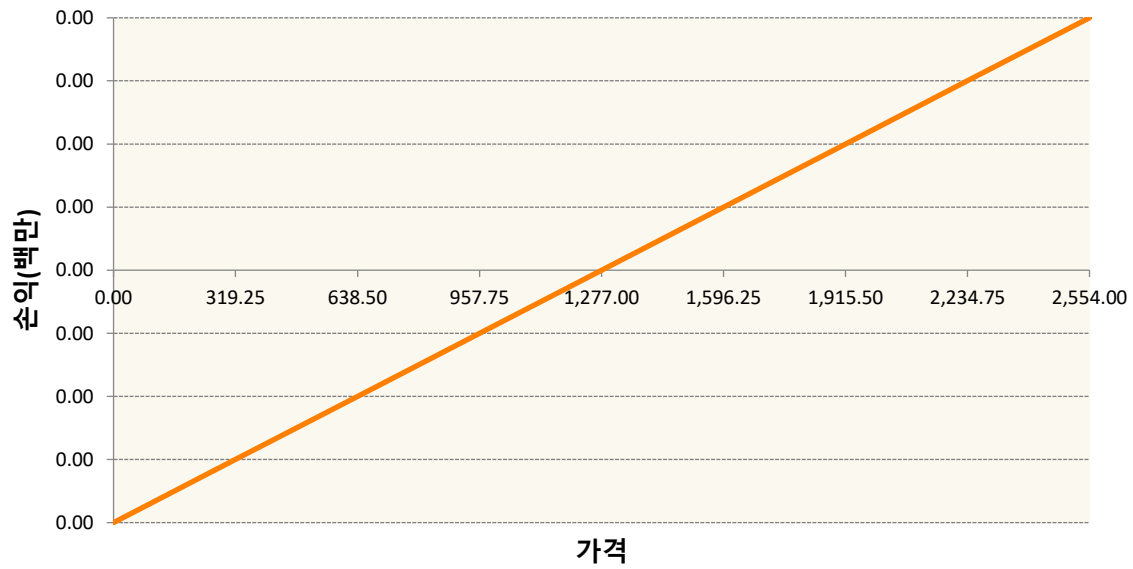
KWH4-KC HRW WHEAT FUT Mar24



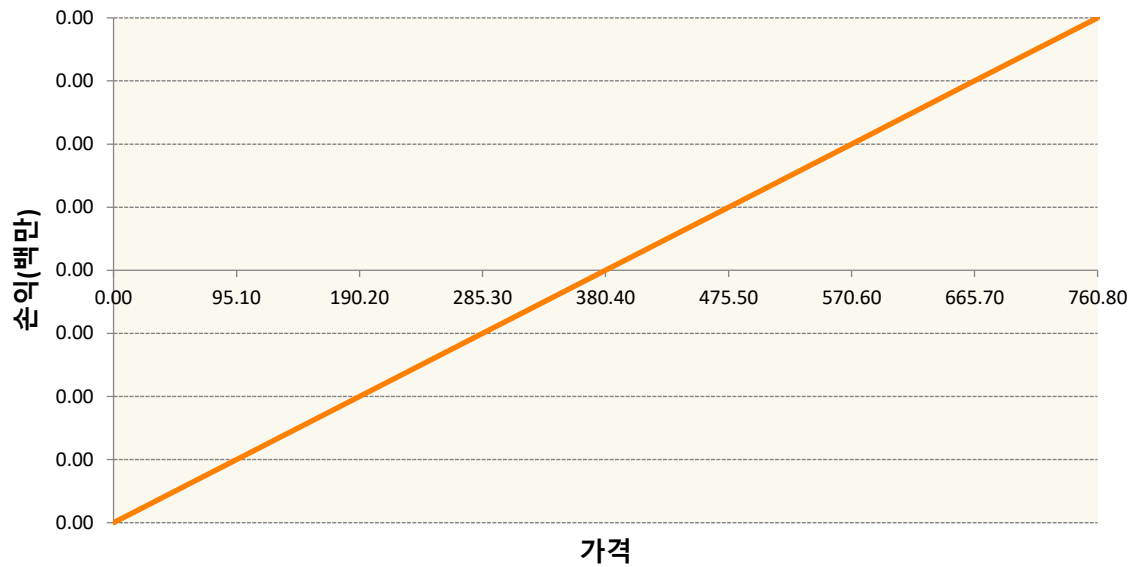
SBH4-Sugar #11 (WORLD) Mar24



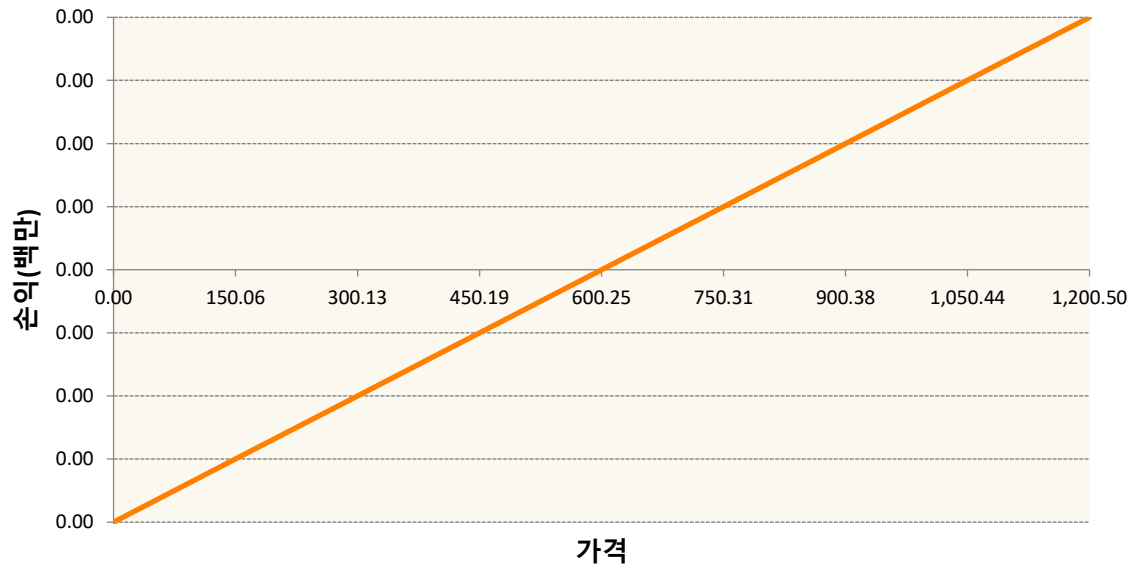
SH4-SOYBEAN FUTURE Mar24



SMH4-SOYBEAN MEAL FUTR Mar24



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 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

스마트인덱스모

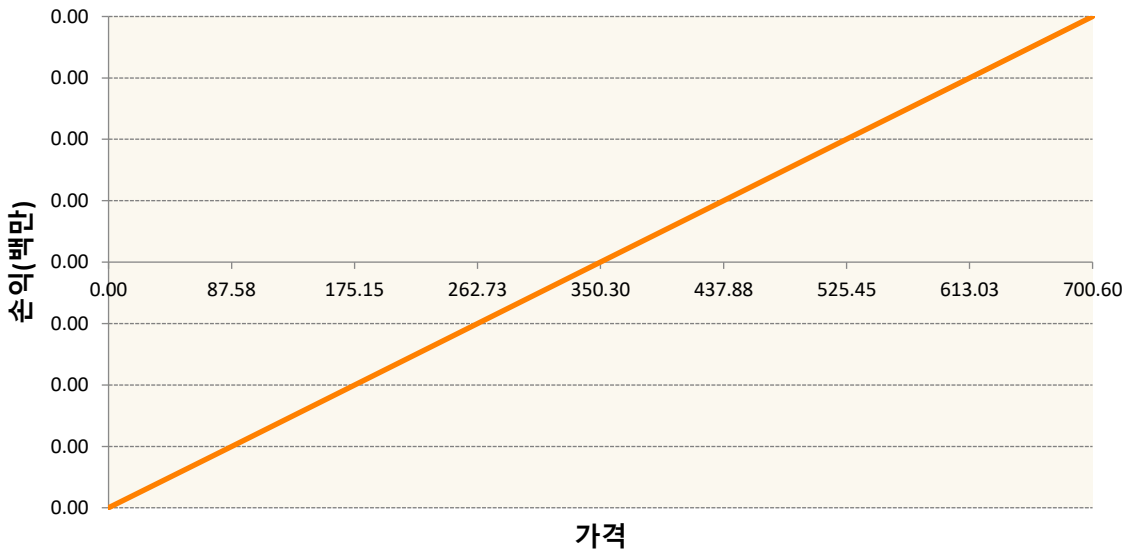
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 175   | -175      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,138 | 0     | 1,138     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V30005-2024-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V30005 |           |         | 2024-03 코스피200지수선물 |     |       |        | 90     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -90       | -90     | -90                | -90 | -90   | -90    | -90    |
| -5.33%       | -60       | -60     | -60                | -60 | -60   | -60    | -60    |
| -2.67%       | -30       | -30     | -30                | -30 | -30   | -30    | -30    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 30        | 30      | 30                 | 30  | 30    | 30     | 30     |
| 5.33%        | 60        | 60      | 60                 | 60  | 60    | 60     | 60     |
| 8.00%        | 90        | 90      | 90                 | 90  | 90    | 90     | 90     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

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   | 3,779 | 0     | 3,779     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래231226 | 306 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 270 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

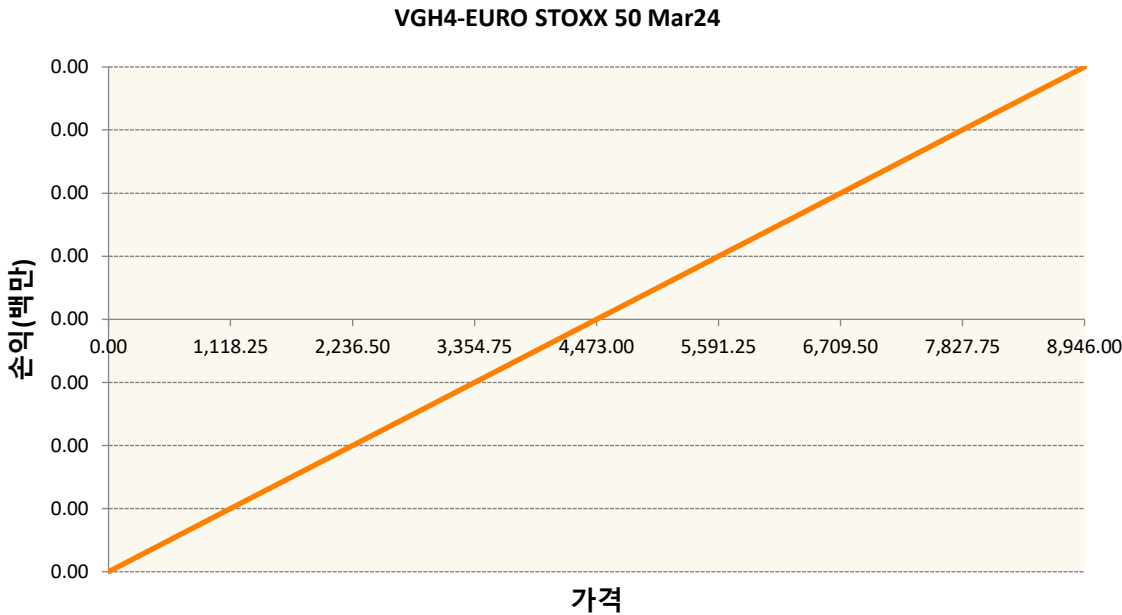
|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

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   | 955   | 0     | 955       |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 215   | 0     | 215       | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                     |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|---------------------|--|----------|
| FXW213DCL                 | EUR/KRW 22-03-24E   |  | 17       |
| VGH4                      | EURO STOXX 50 Mar24 |  | 76       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 71       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

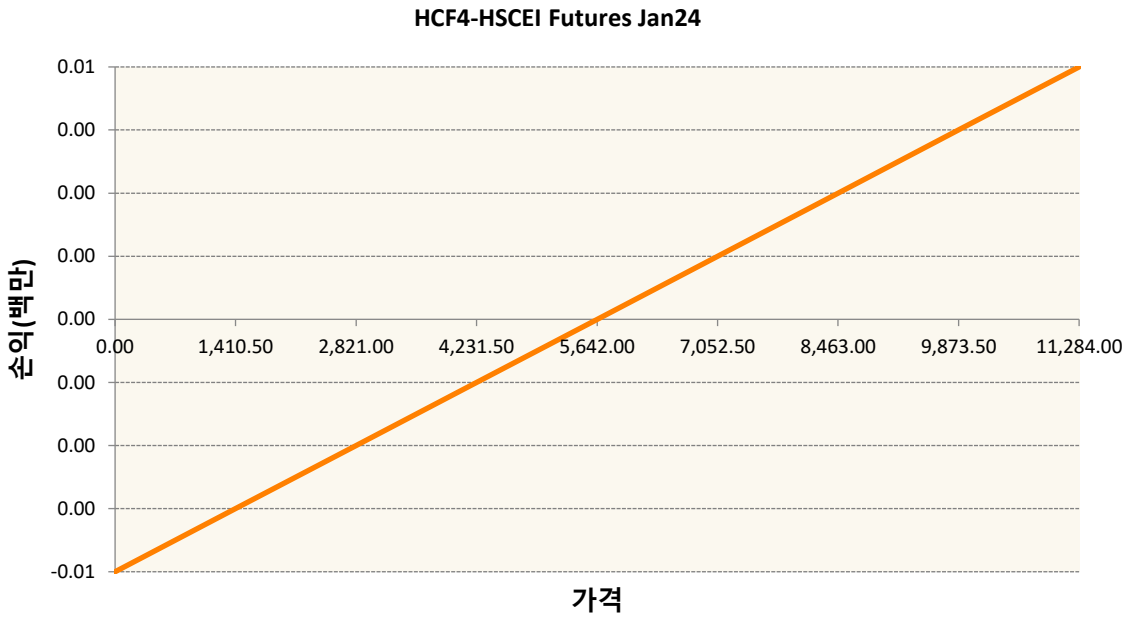
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,122 | 0     | 1,122     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCF4 | HSCEI Futures Jan24 | 90 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 130 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

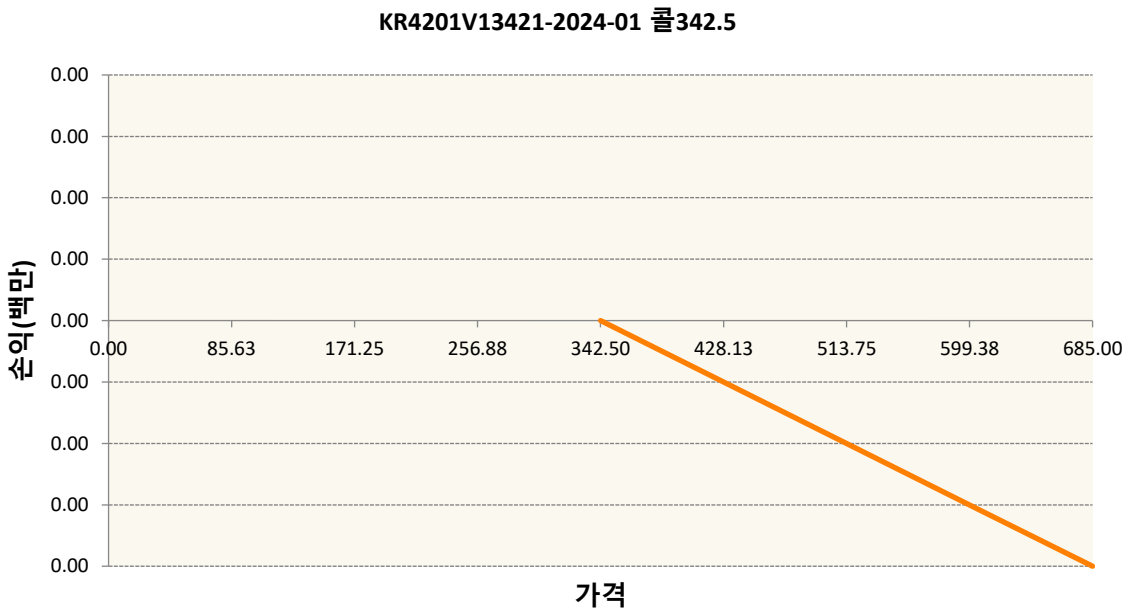
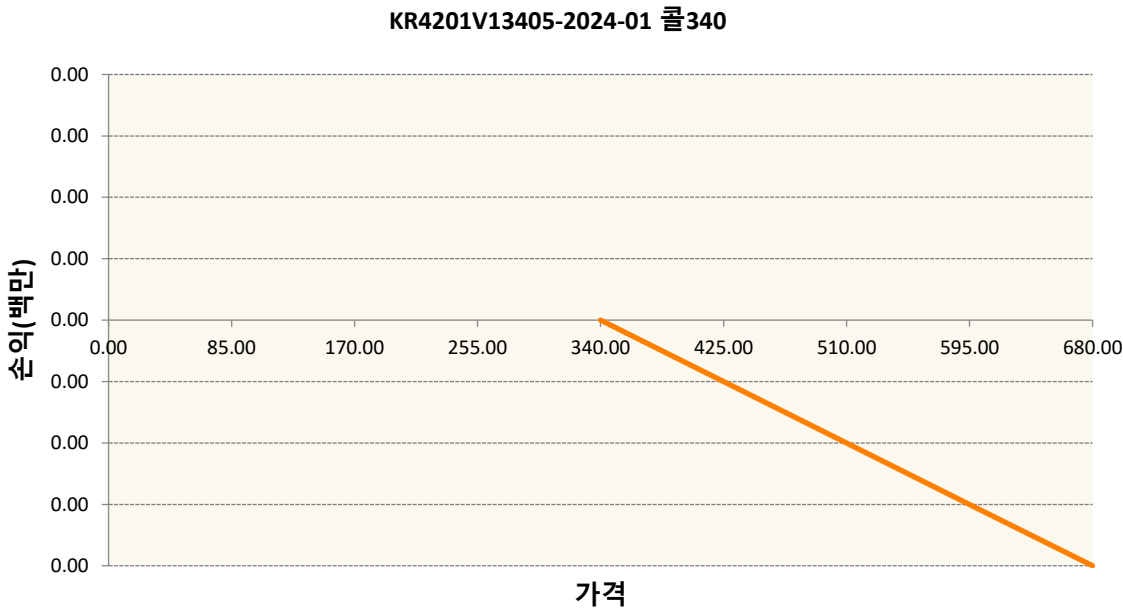
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

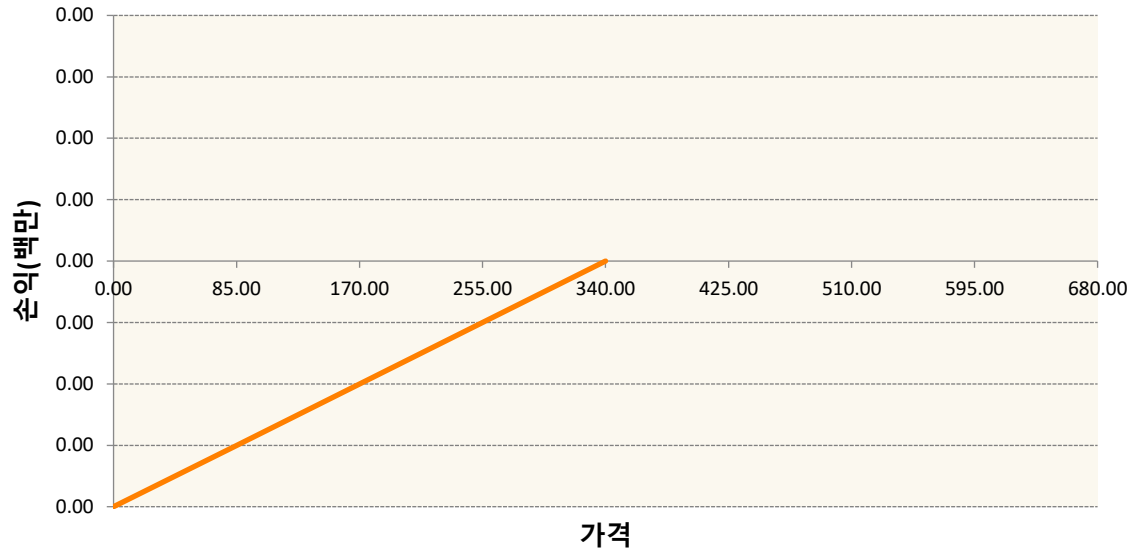
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 49,150 | -49,150   | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V13403-2024-01 풋340



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201V13405 |           |         | 2024-01 콜340   |        |        |        | 1,114  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 435       | 433     | 430            | 426    | 420    | 414    | 407    |
| -5.33%       | 411       | 401     | 390            | 378    | 365    | 351    | 337    |
| -2.67%       | 299       | 281     | 263            | 245    | 227    | 209    | 191    |
| 0%           | 42        | 29      | 15             | 0      | -15    | -31    | -47    |
| 2.67%        | -318      | -322    | -328           | -335   | -343   | -352   | -362   |
| 5.33%        | -711      | -712    | -713           | -715   | -718   | -722   | -726   |
| 8.00%        | -1,110    | -1,110  | -1,110         | -1,111 | -1,111 | -1,112 | -1,114 |
| KR4201V13421 |           |         | 2024-01 콜342.5 |        |        |        | 1,915  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 639       | 637     | 633            | 628    | 621    | 612    | 602    |
| -5.33%       | 614       | 600     | 585            | 567    | 548    | 527    | 505    |
| -2.67%       | 470       | 440     | 410            | 379    | 349    | 318    | 287    |
| 0%           | 85        | 58      | 29             | 0      | -30    | -60    | -90    |
| 2.67%        | -514      | -526    | -540           | -556   | -573   | -593   | -614   |
| 5.33%        | -1,201    | -1,203  | -1,207         | -1,212 | -1,219 | -1,228 | -1,238 |
| 8.00%        | -1,905    | -1,905  | -1,905         | -1,906 | -1,908 | -1,911 | -1,915 |
| KR4301V13403 |           |         | 2024-01 풋340   |        |        |        | 474    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -471      | -471    | -471           | -472   | -472   | -473   | -474   |
| -5.33%       | -243      | -245    | -247           | -251   | -254   | -258   | -262   |
| -2.67%       | -59       | -66     | -73            | -80    | -87    | -94    | -102   |
| 0%           | 12        | 9       | 5              | 0      | -5     | -10    | -15    |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 2.67% | 21 | 20 | 20 | 19 | 18 | 16 | 14 |
| 5.33% | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 20 | 20 |
| 8.00% | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 |

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

(단위:백만원)

3,880

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

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 | 1,957 | 0     | 1,957     |    |

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 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

## 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 | 4,539 | 0     | 4,539     |    |

### 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 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

## 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 | 17,710 | 0      | 17,710    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 17,456 | -17,456   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| FXW213DAT KRW/USD 31-01-24E | 187 |
| FXW213DBV KRW/USD 29-02-24E | 643 |
| FXW213DCB KRW/USD 31-01-24E | 26  |
| FXW213DCS KRW/USD 31-01-24E | 31  |
| FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E | 508 |
| IE00BD8RGM75                |     |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 726 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

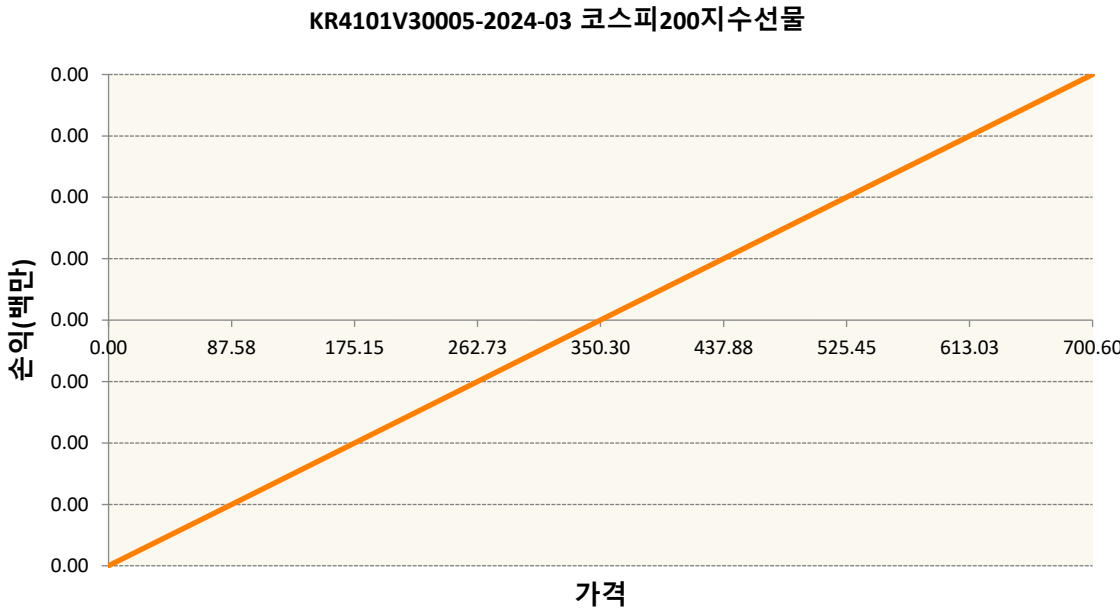
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 88    | -88       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 438   | 0     | 438       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V30005 |           |         | 2024-03 코스피200지수선물 |     |       |        | 35     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -35       | -35     | -35                | -35 | -35   | -35    | -35    |
| -5.33%       | -23       | -23     | -23                | -23 | -23   | -23    | -23    |
| -2.67%       | -12       | -12     | -12                | -12 | -12   | -12    | -12    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 12        | 12      | 12                 | 12  | 12    | 12     | 12     |
| 5.33%        | 23        | 23      | 23                 | 23  | 23    | 23     | 23     |
| 8.00%        | 35        | 35      | 35                 | 35  | 35    | 35     | 35     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

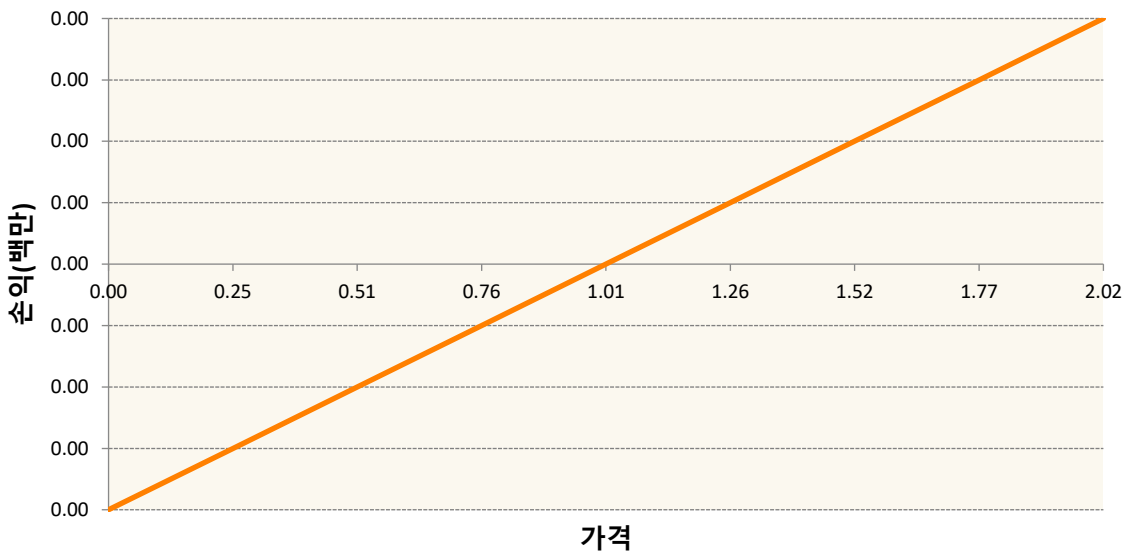
1. 계약금액

(단위:백만원)

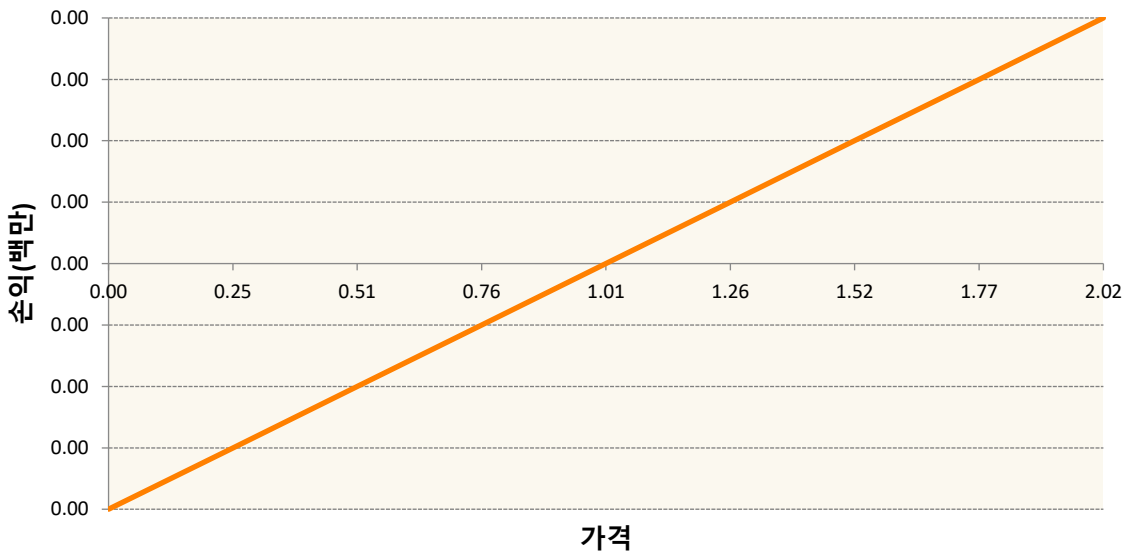
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 20,069 | 0     | 20,069    |    |

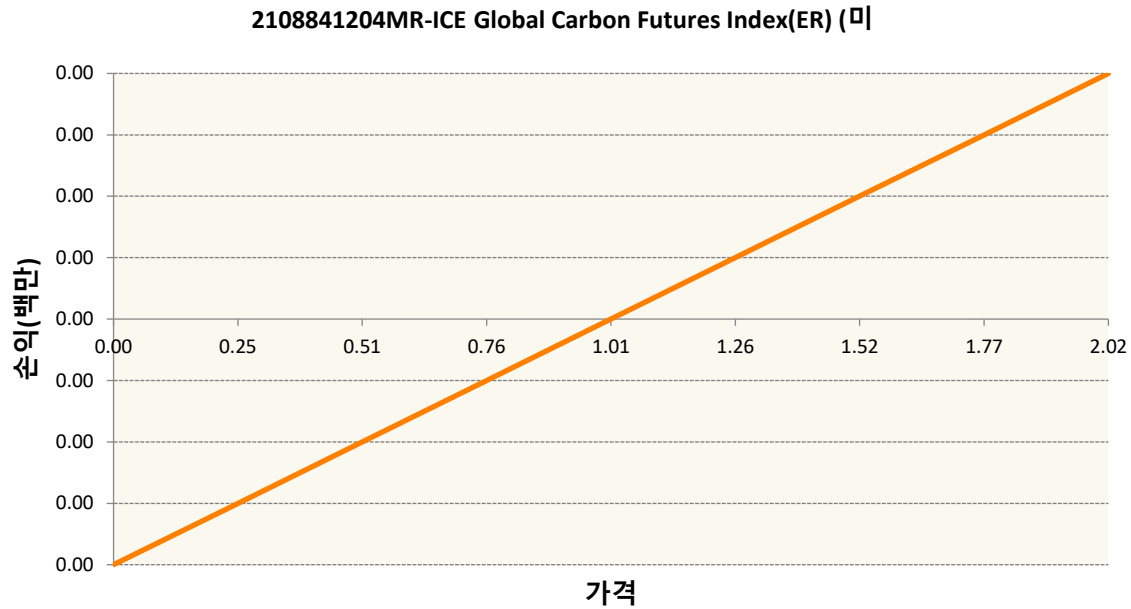
2. 만기시점의 손익구조

2108840920KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키



2108840920MZ-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                        |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키 |  | 1,006    |
| 2108840920ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 201      |
| 2108841204ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 402      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 2,055    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

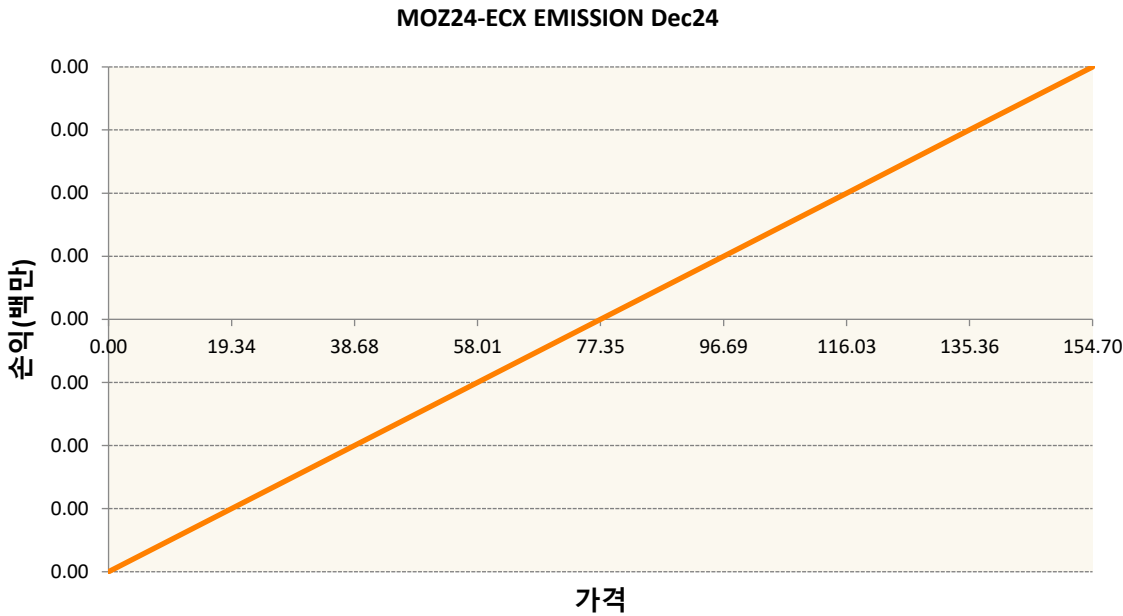
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 9,489 | 0     | 9,489     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 424   | 0     | 424       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,407 | -2,407    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |      |
|----------------------------------------------------|------|
| FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E                        | 15   |
| FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E                        | 62   |
| FXW213DCS KRW/EUR 31-01-24E                        | 115  |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 759  |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 0.24 |

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

(단위:백만원)

1,503

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

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   | 4,370 | 0     | 4,370     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                     |    |
|-------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (미래)  | 10 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠) | 10 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)  | 7  |
| SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)  | 7  |

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

(단위:백만원)

48

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

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   | 6,244 | 0     | 6,244     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |   |
|-----------------------------------------|---|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(미래)  | 3 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(NH)  | 2 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(메리츠) | 3 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 1 |

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

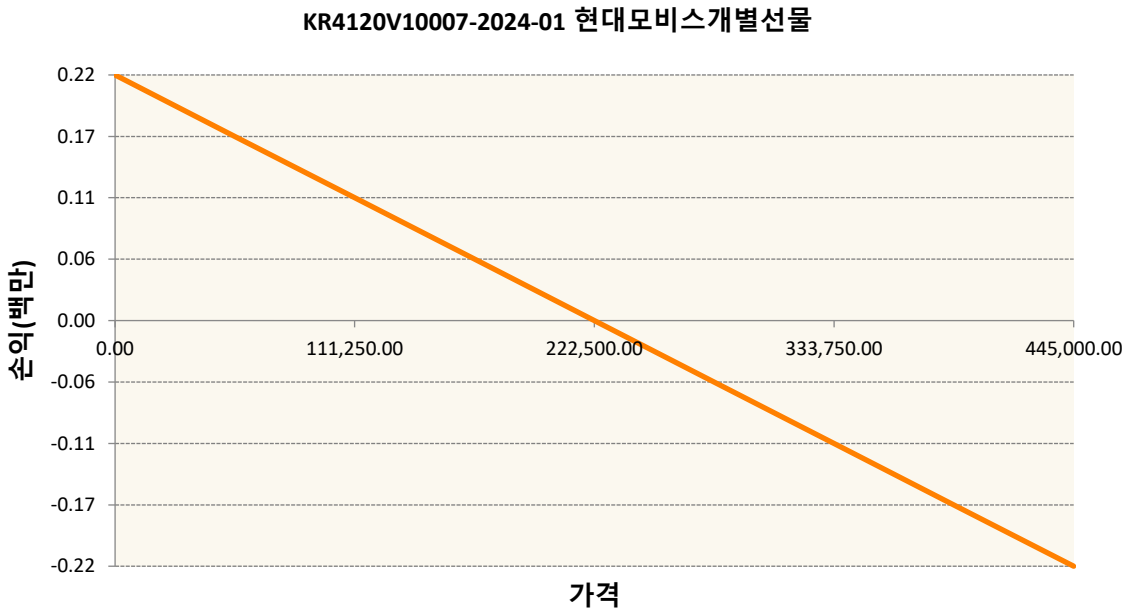
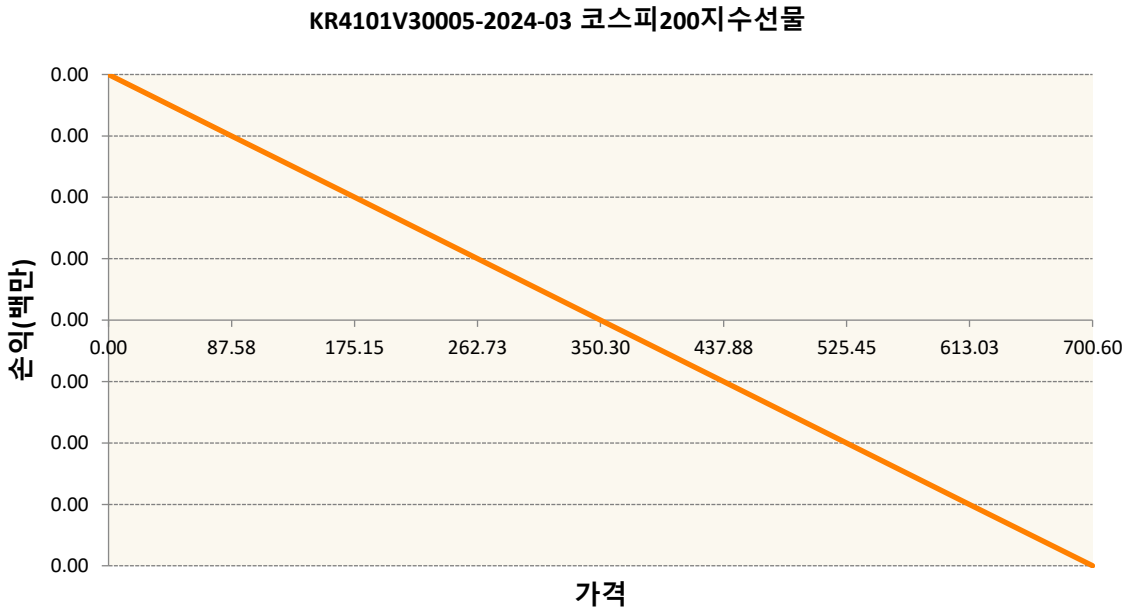
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

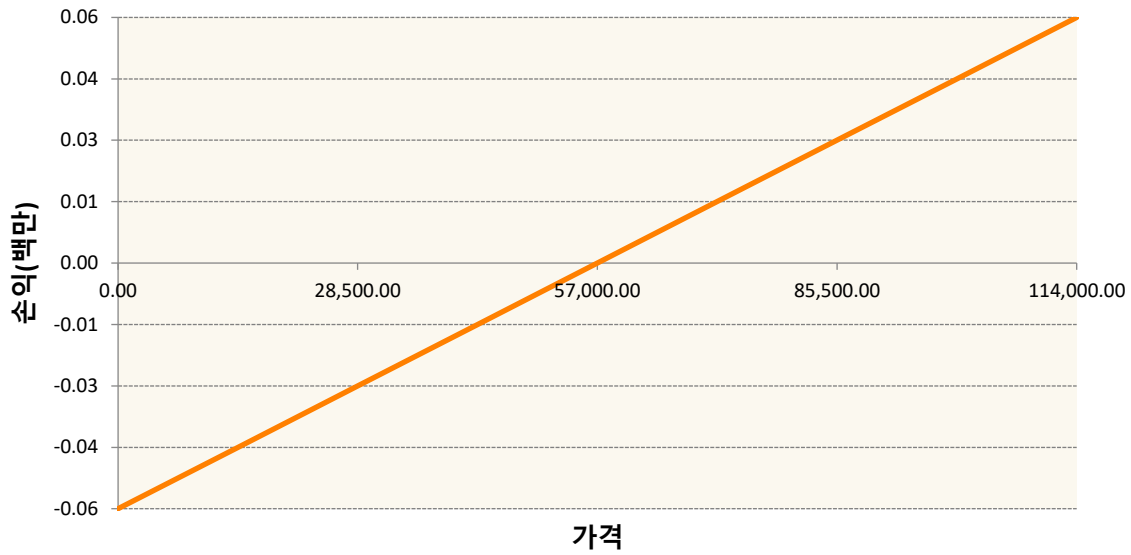
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 15    | 17    | -2        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 28    | 1,460 | -1,433    | 장내 |

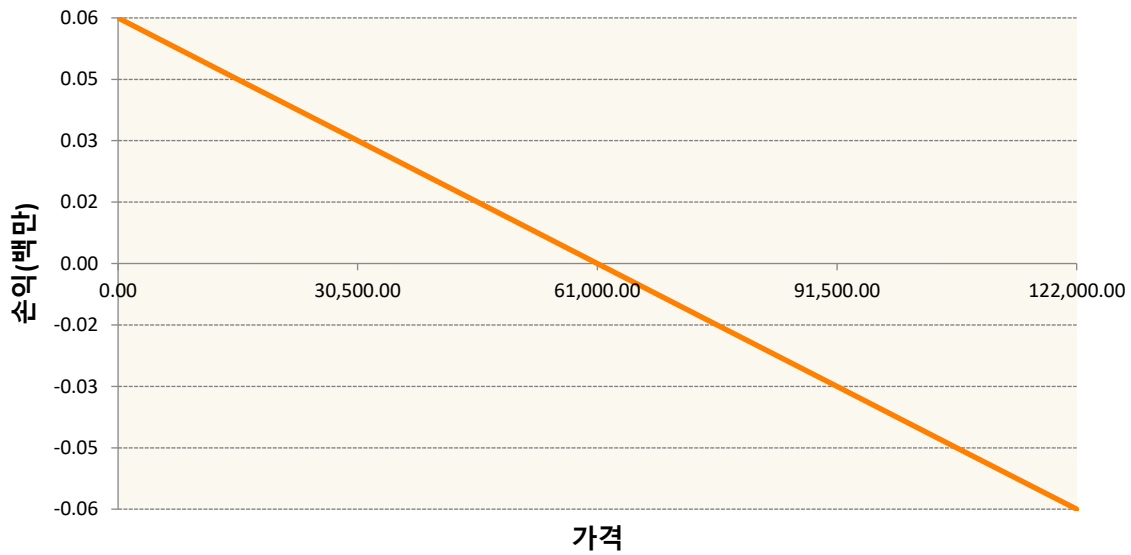
2. 만기시점의 손익구조



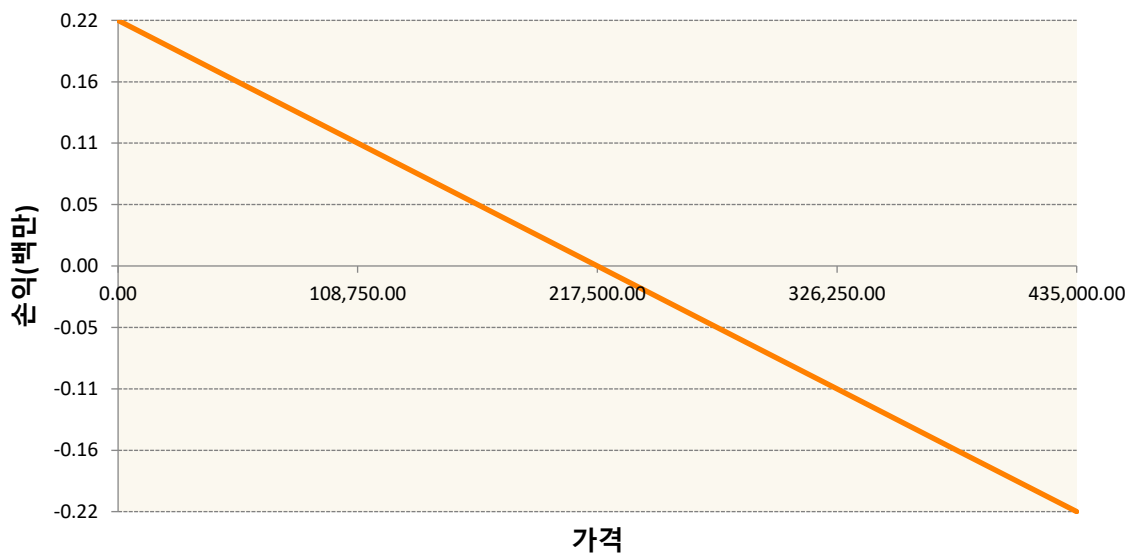
KR41CFV10002-2024-01 카카오개별선물



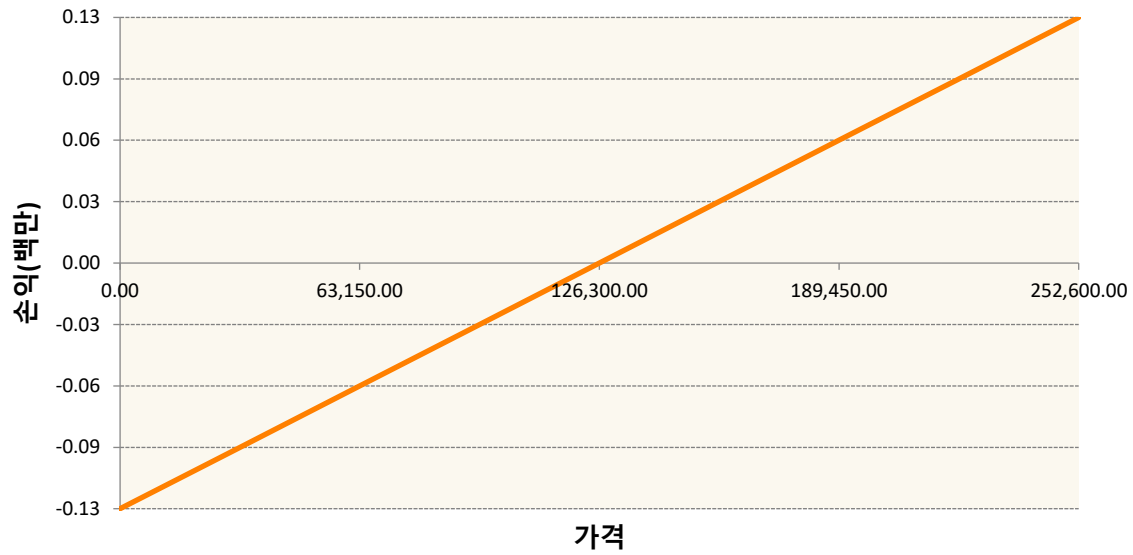
KR41CNV10006-2024-01 포스코DX개별선물



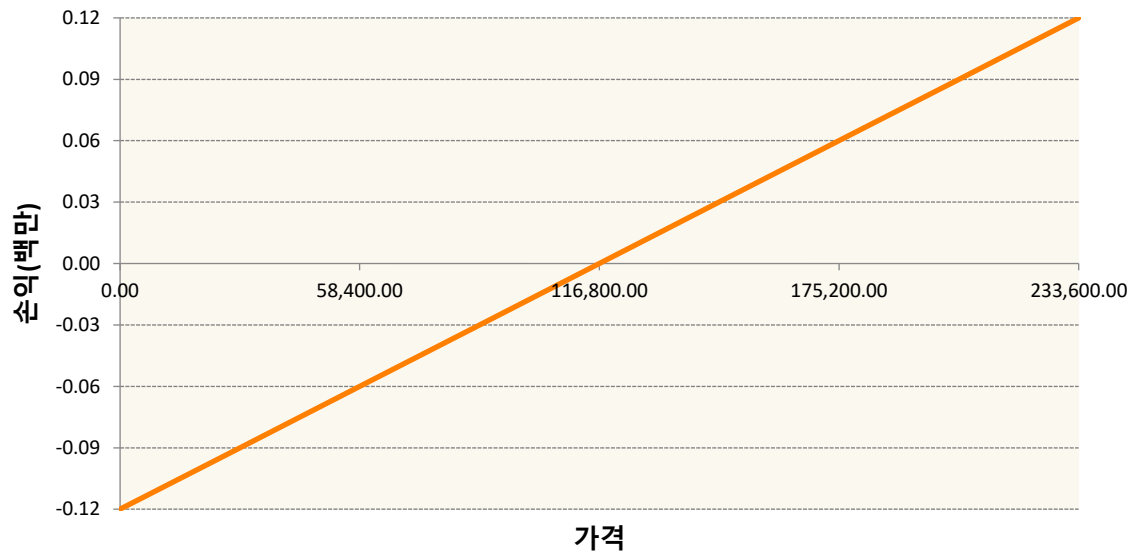
KR41CPV10001-2024-01 셀트리온개별선물



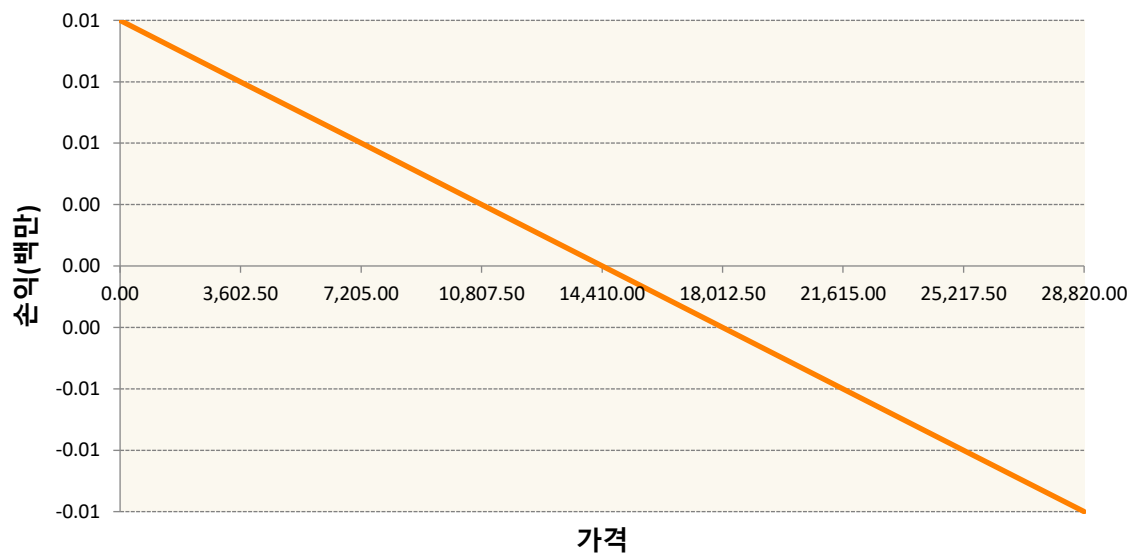
KR41DBV10009-2024-01 LIG넥스원개별선물



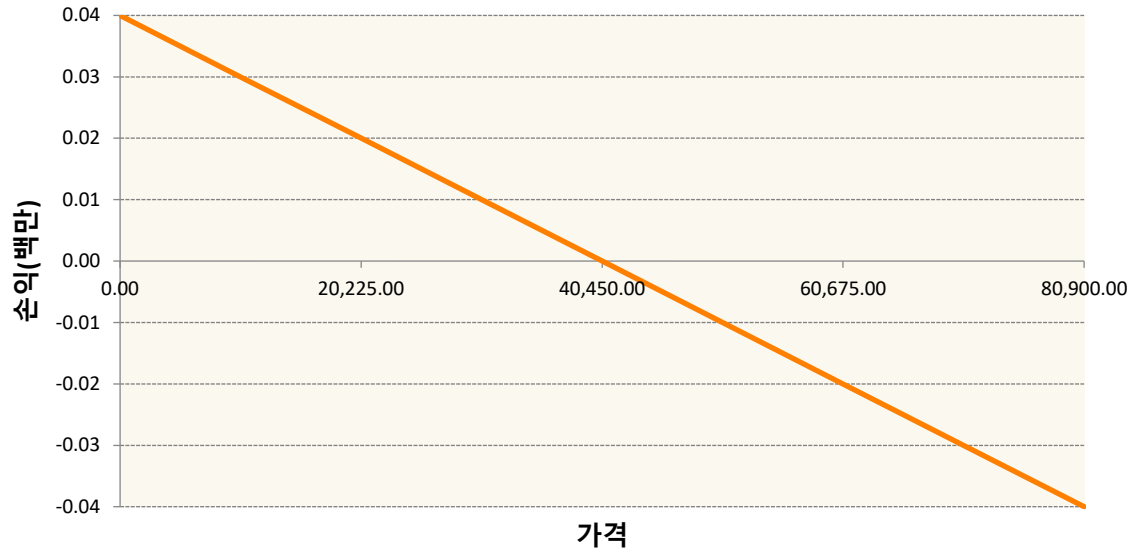
KR41DKV10000-2024-01 코스맥스개별선물



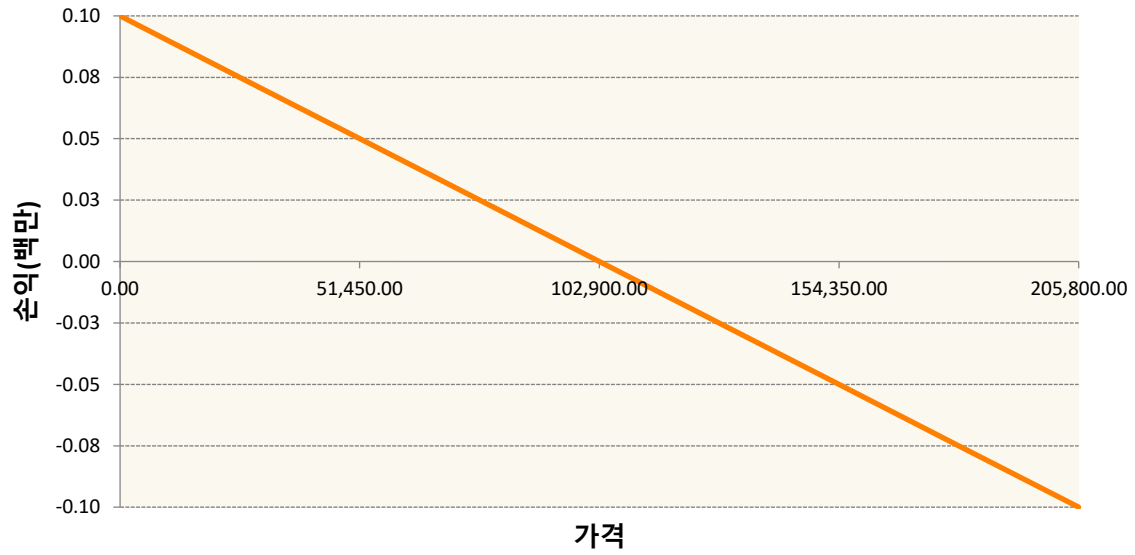
KR41ECV10005-2024-01 HDC현대산업개발개별선물



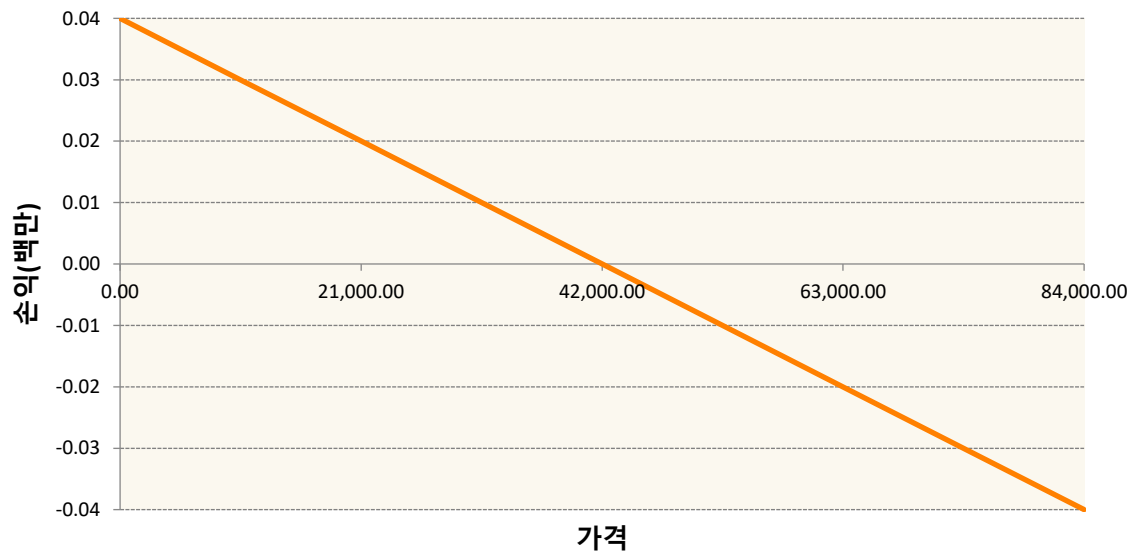
KR41EEV10001-2024-01 한울바이오파마개별선물



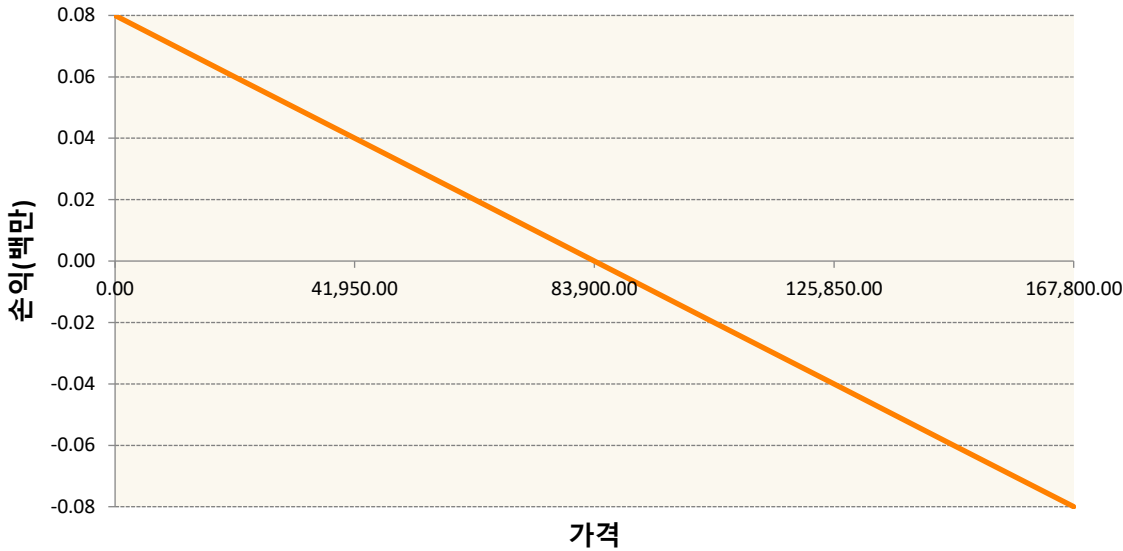
KR41EFV10008-2024-01 JYP Ent.개별선물



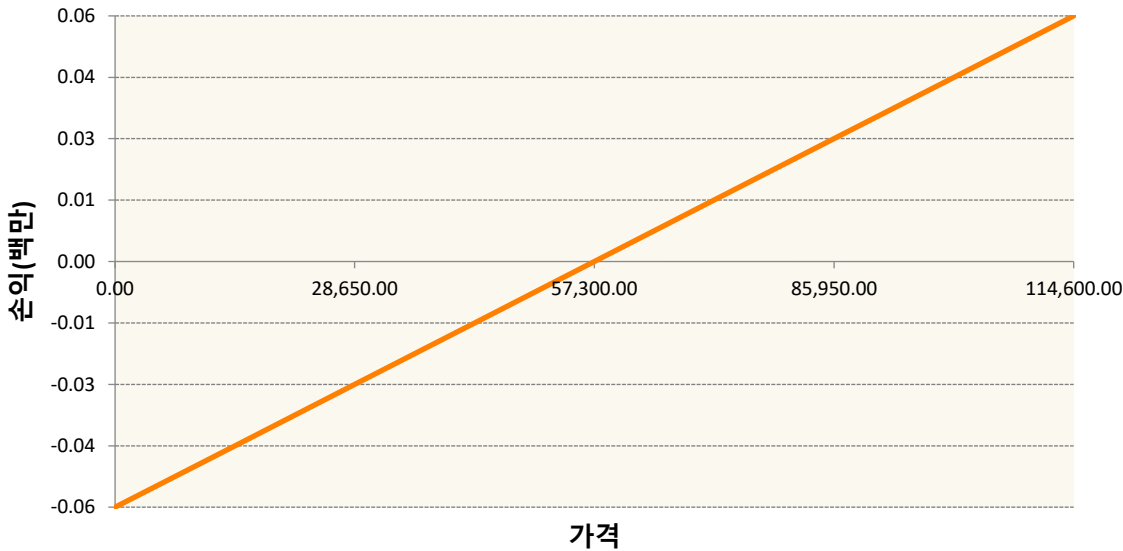
KR41ENV10002-2024-01 동진세미캠개별선물



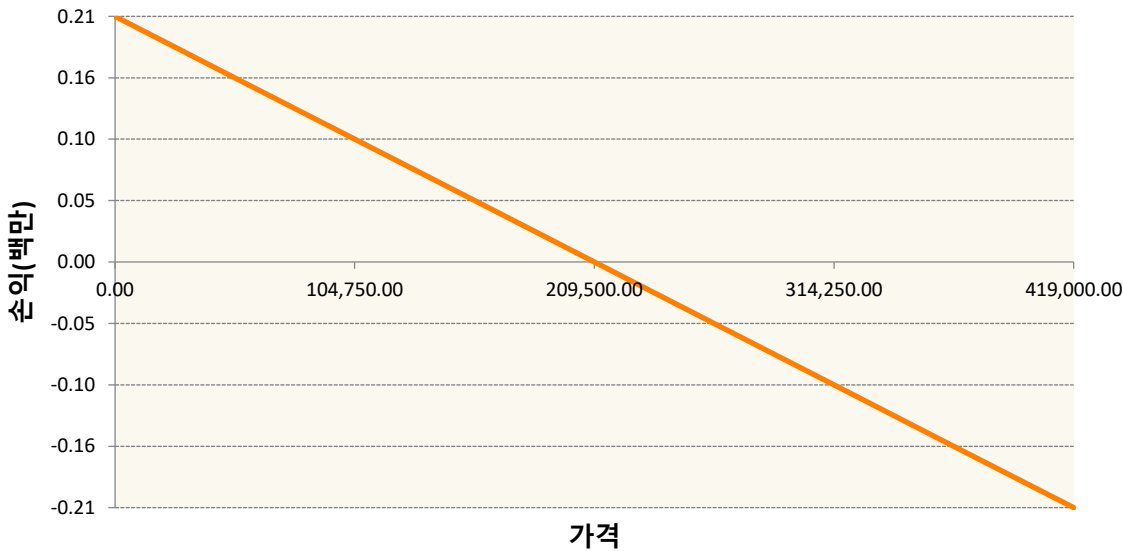
KR41FBV10004-2024-01 SK아이이테크놀로지개별선물



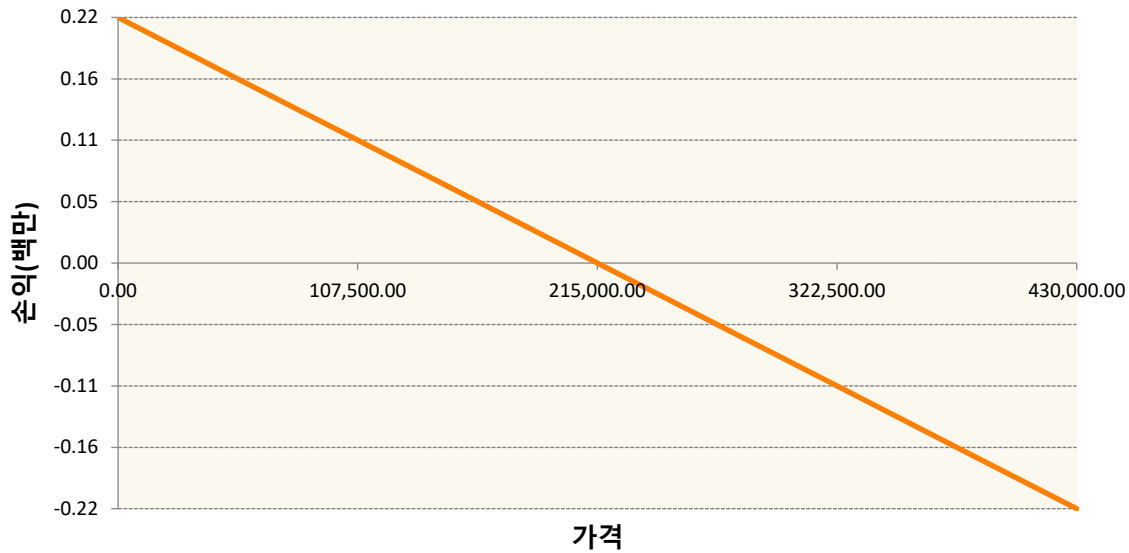
KR41FKV10005-2024-01 메리츠금융지주개별선물



KR41FMV10001-2024-01 엘앤에프개별선물



### KR41G4V10004-2024-01 한솔케미칼개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                   |      |
|-----------------------------------|------|
| KR4101V300 2024-03 코스피200지수선물     | 98   |
| KR4120V100 2024-01 현대모비스개별선물      | 2    |
| KR41CFV100 2024-01 카카오개별선물        | 0.36 |
| KR41CNV100 2024-01 포스코DX개별선물      | 8    |
| KR41CPV100 2024-01 셀트리온개별선물       | 4    |
| KR41DBV100 2024-01 LG넥스원개별선물      | 2    |
| KR41DKV100 2024-01 코스맥스개별선물       | 0.28 |
| KR41ECV100 2024-01 HDC현대산업개발개별선물  | 1    |
| KR41EEV100 2024-01 한올바이오파마개별선물    | 0.06 |
| KR41EFV100 2024-01 JYP Ent.개별선물   | 2    |
| KR41ENV100 2024-01 동진세미캠개별선물      | 1    |
| KR41FBV100 2024-01 SK아이이테크놀로지개별선물 | 0.34 |
| KR41FKV100 2024-01 메리츠금융지주개별선물    | 0.05 |
| KR41FMV100 2024-01 엘앤에프개별선물       | 1    |
| KR41G4V100 2024-01 한솔케미칼개별선물      | 1    |

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

(단위:백만원)

148

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

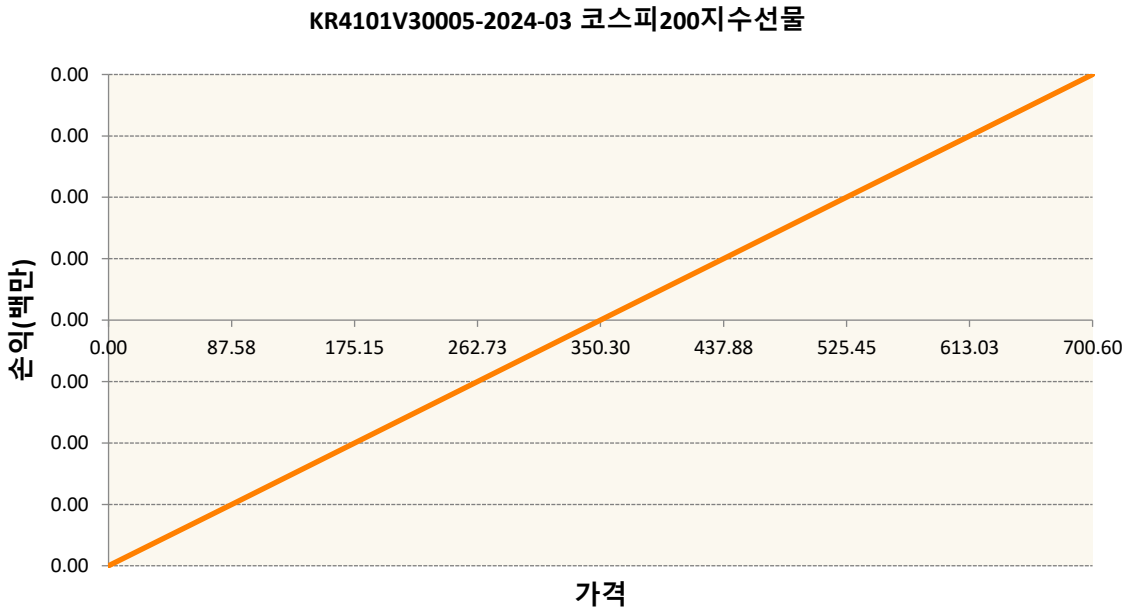
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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   | 3,153 | 0     | 3,153     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V30005 |           | 2024-03 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 251    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -251      | -251               | -251   | -251 | -251  | -251   | -251   |
| -5.33%       | -167      | -167               | -167   | -167 | -167  | -167   | -167   |
| -2.67%       | -84       | -84                | -84    | -84  | -84   | -84    | -84    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 84        | 84                 | 84     | 84   | 84    | 84     | 84     |
| 5.33%        | 167       | 167                | 167    | 167  | 167   | 167    | 167    |
| 8.00%        | 251       | 251                | 251    | 251  | 251   | 251    | 251    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

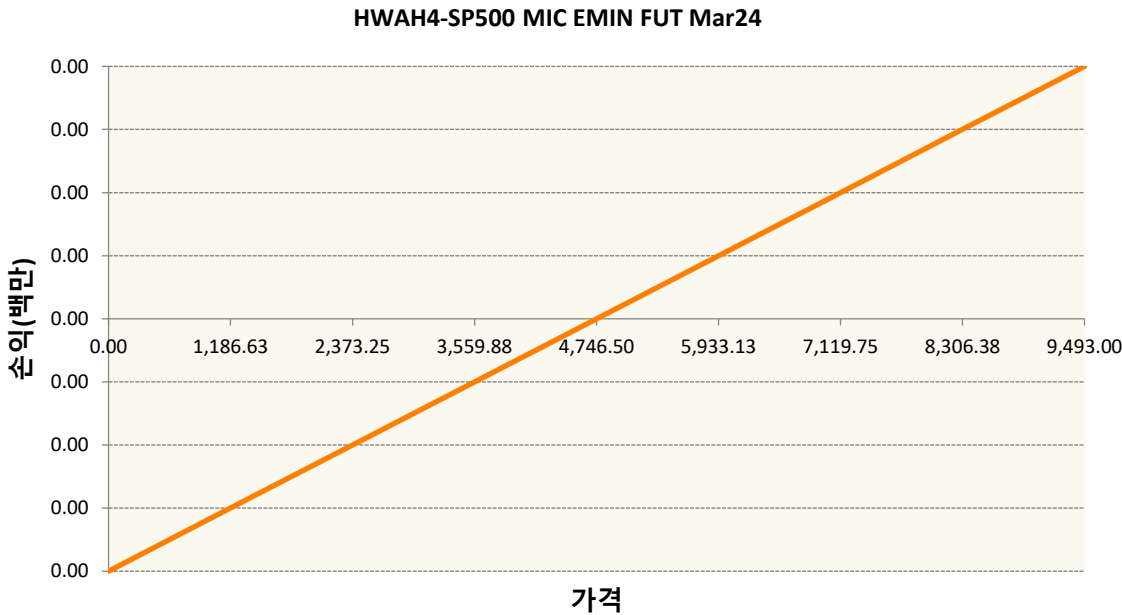
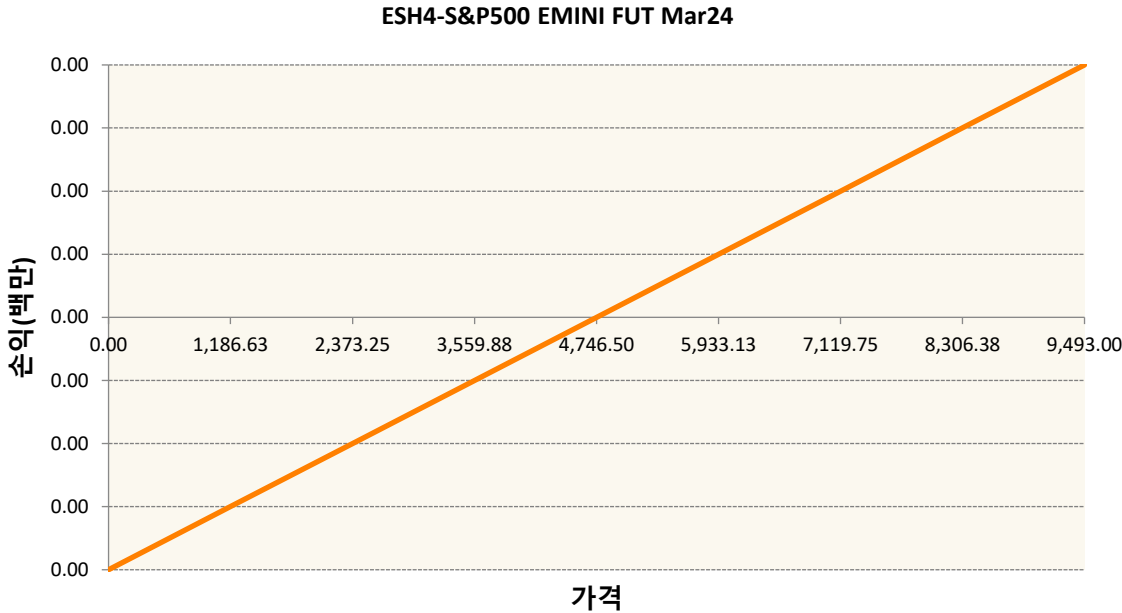
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 924   | 0     | 924       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,708 | 0     | 2,708     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESH4                      | S&P500 EMINI FUT Mar24   | 74       |
| HWAH4                     | SP500 MIC EMIN FUT Mar24 | 217      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 242      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

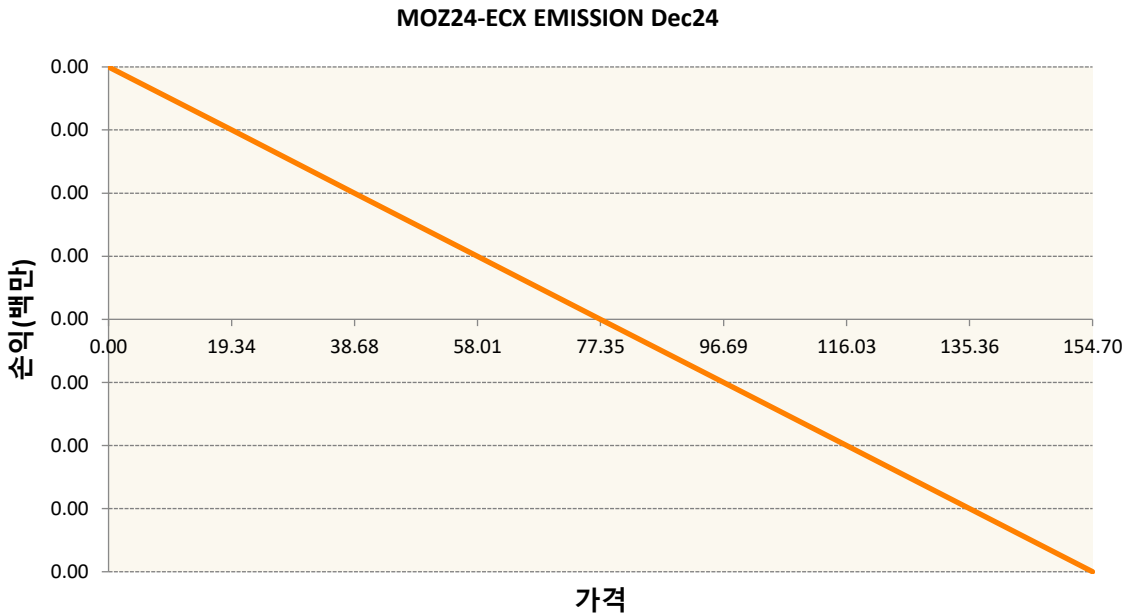
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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     | 5,396 | -5,396    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 424   | 0     | 424       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,333 | -1,333    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |      |
|----------------------------------------------------|------|
| FXW213DCS₩ KRW/EUR 31-01-24E                       | 107  |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 432  |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 0.22 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 853 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

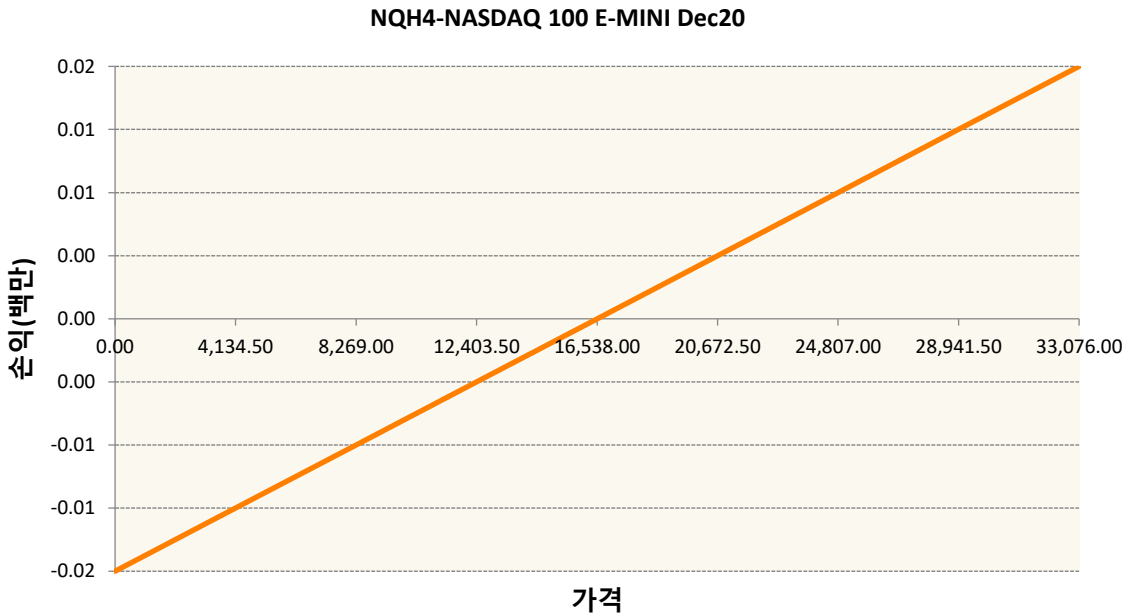
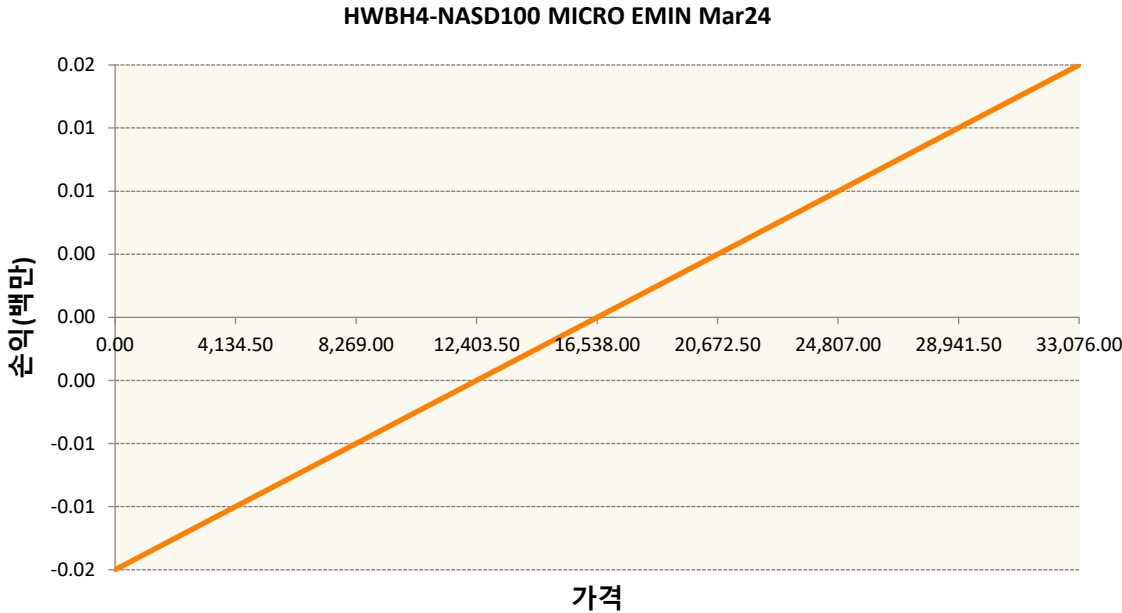
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 852   | 0     | 852       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,867 | 0     | 1,867     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBH4                     | NASD100 MICRO EMIN Mar24 |  | 149      |
| NQH4                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 68       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 200      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 9,549  | 0     | 9,549     | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 14,539 | 0     | 14,539    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |     |
|-----------------------------------------------------|-----|
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 162 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 162 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 81  |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 526 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 243 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 814 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-01-05 |
| 기준일 | 2024-01-04 |

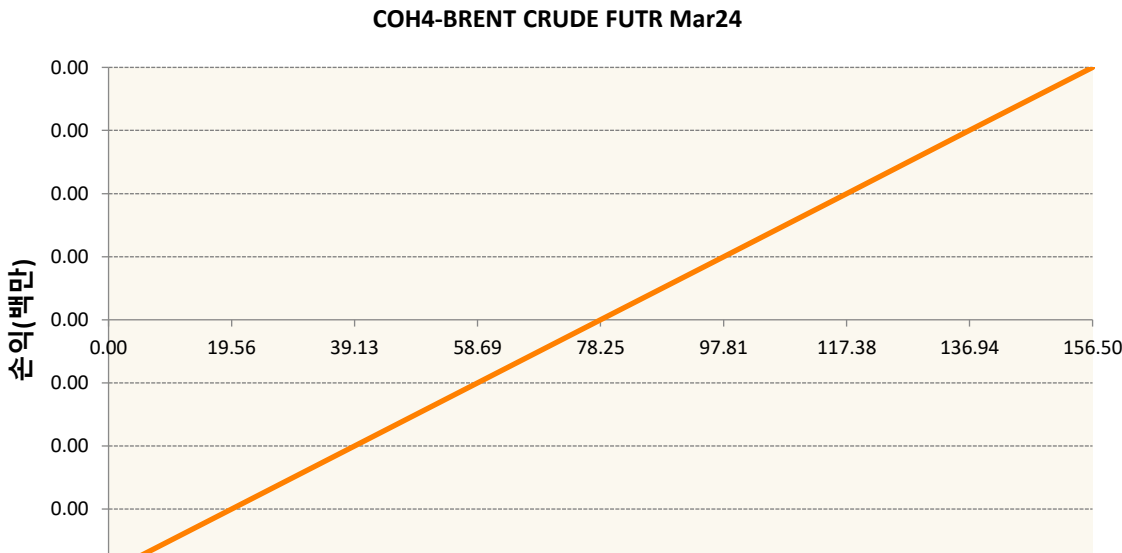
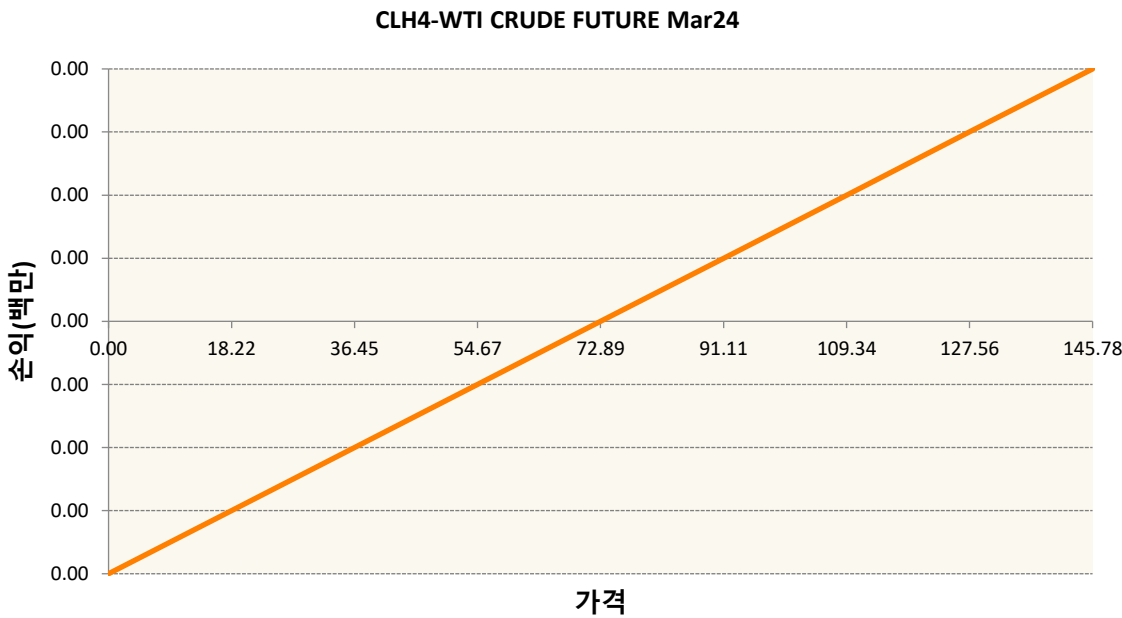
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

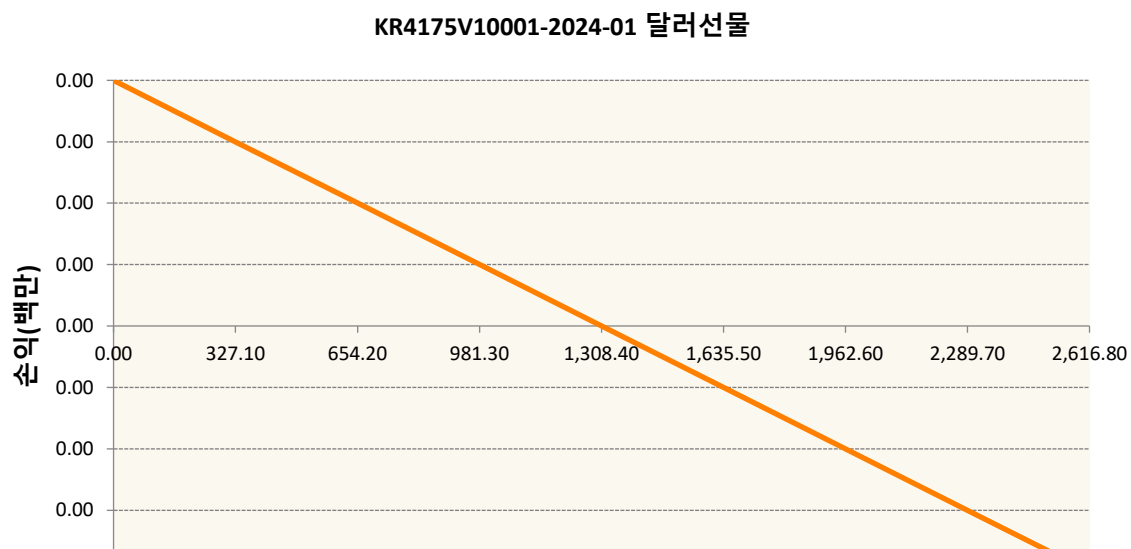
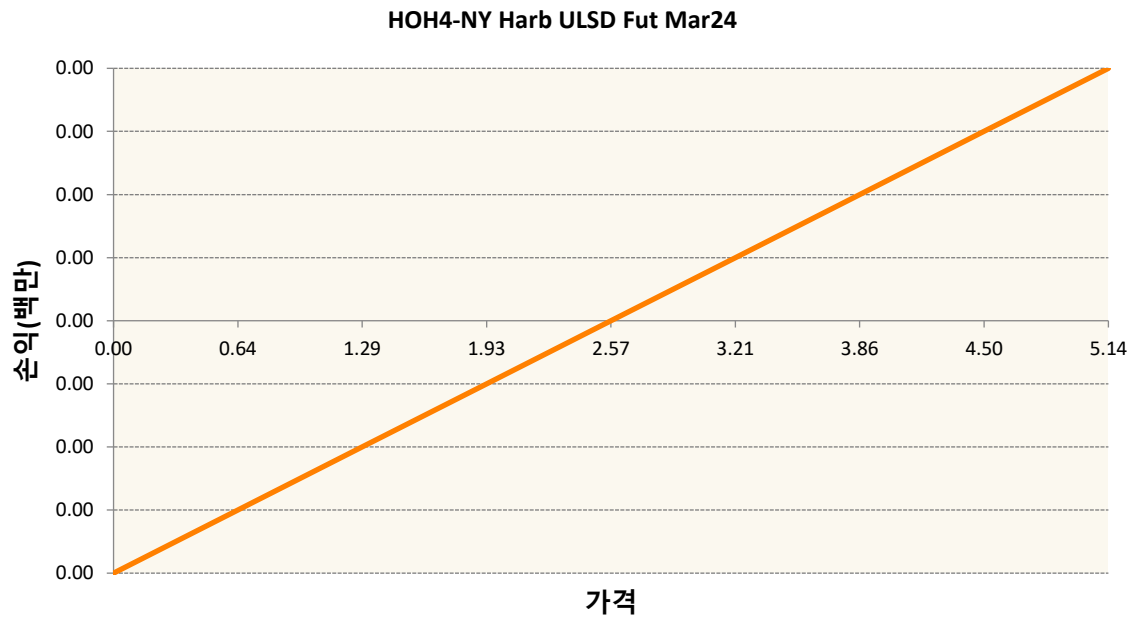
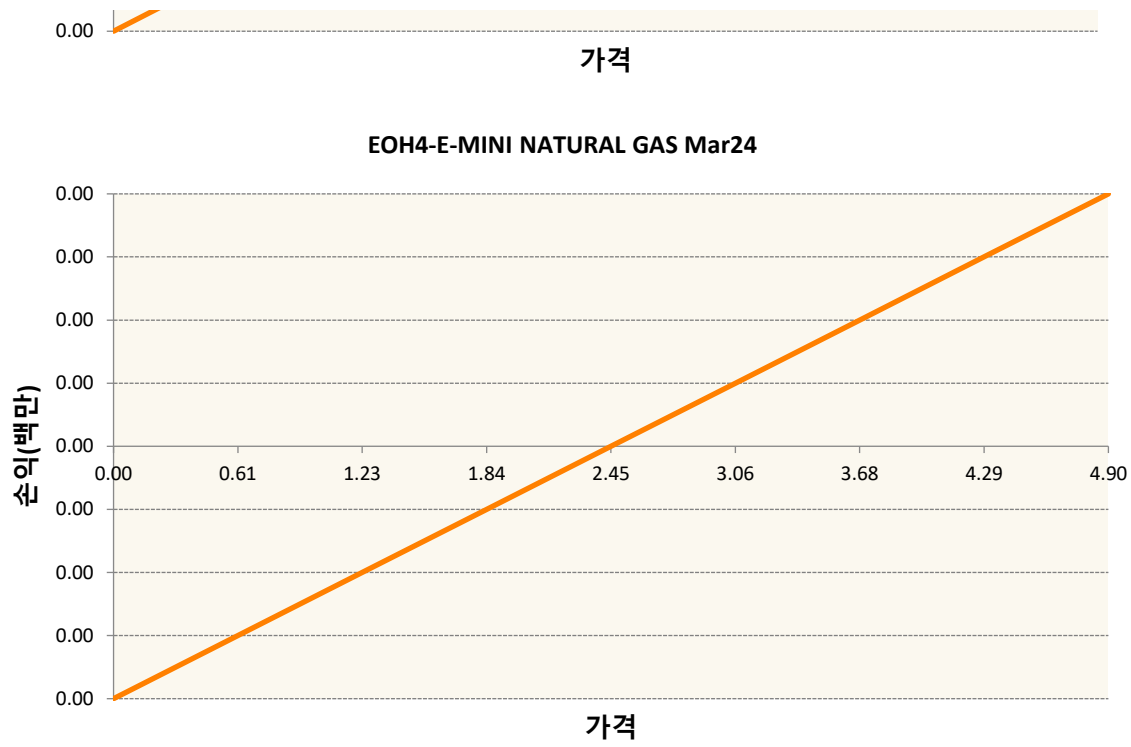
1. 계약금액

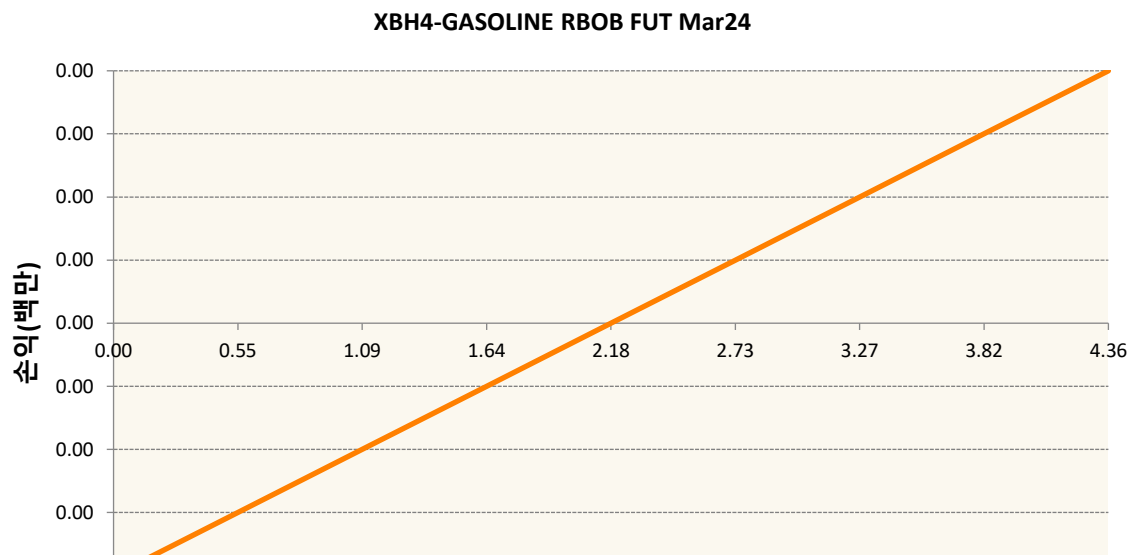
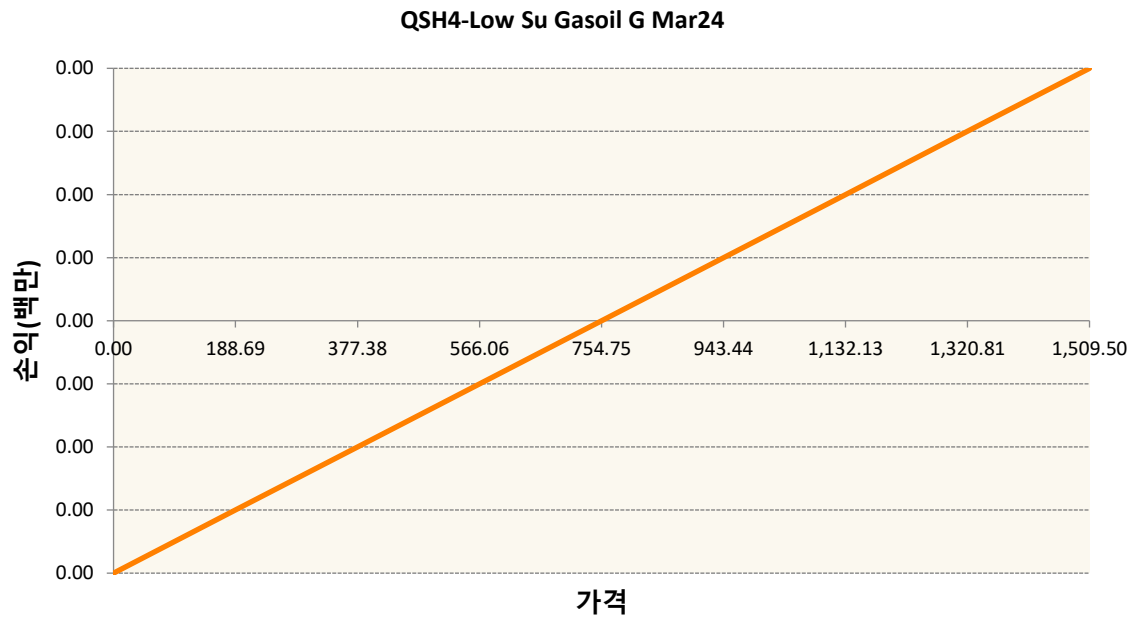
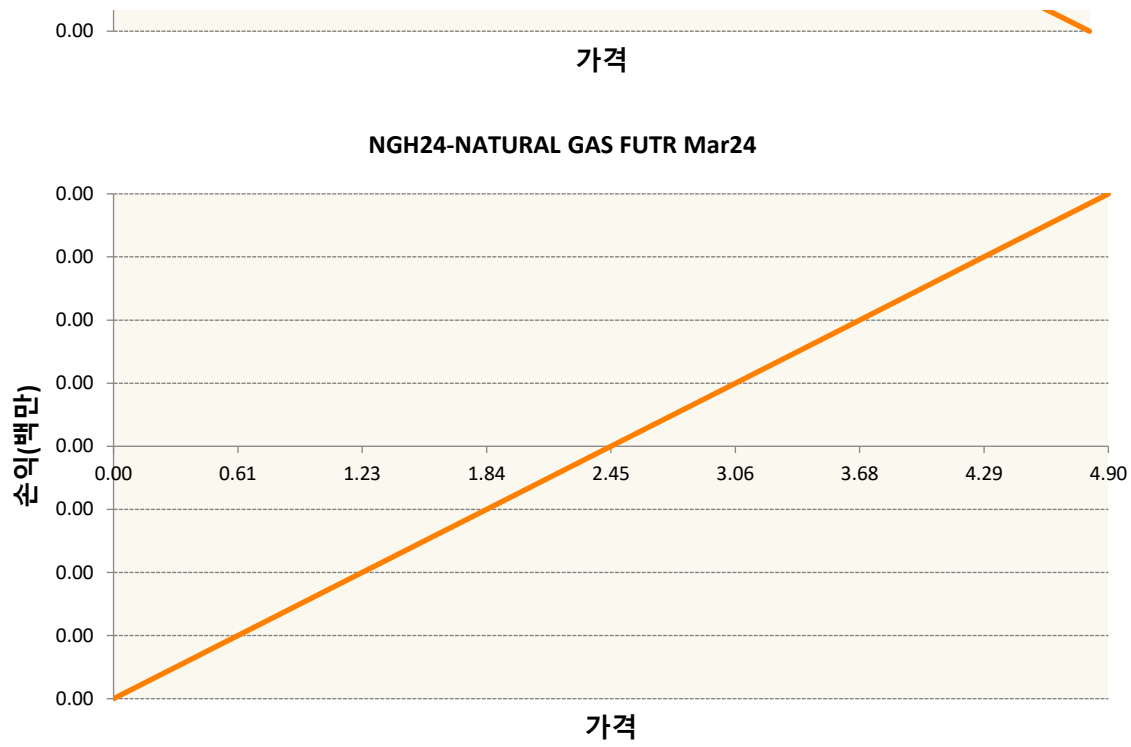
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 선물   | 유가증권 | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 선물   | 유가증권 | 287   | 0     | 287       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 887   | 0     | 887       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 157   | -157      | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조







| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| CLH4                      | WTI CRUDE FUTURE Mar24   | 23       |
| COH4                      | BRENT CRUDE FUTR Mar24   | 25       |
| EOH4                      | E-MINI NATURAL GAS Mar24 | 2        |
| HOH4                      | NY Harb ULSD Fut Mar24   | 11       |
| KR4175V100 2024-01 달러선물   |                          | 13       |
| NGH24                     | NATURAL GAS FUTR Mar24   | 15       |
| QSH4                      | Low Su Gasoil G Mar24    | 8        |
| XBH4                      | GASOLINE RBOB FUT Mar24  | 10       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 226      |