

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

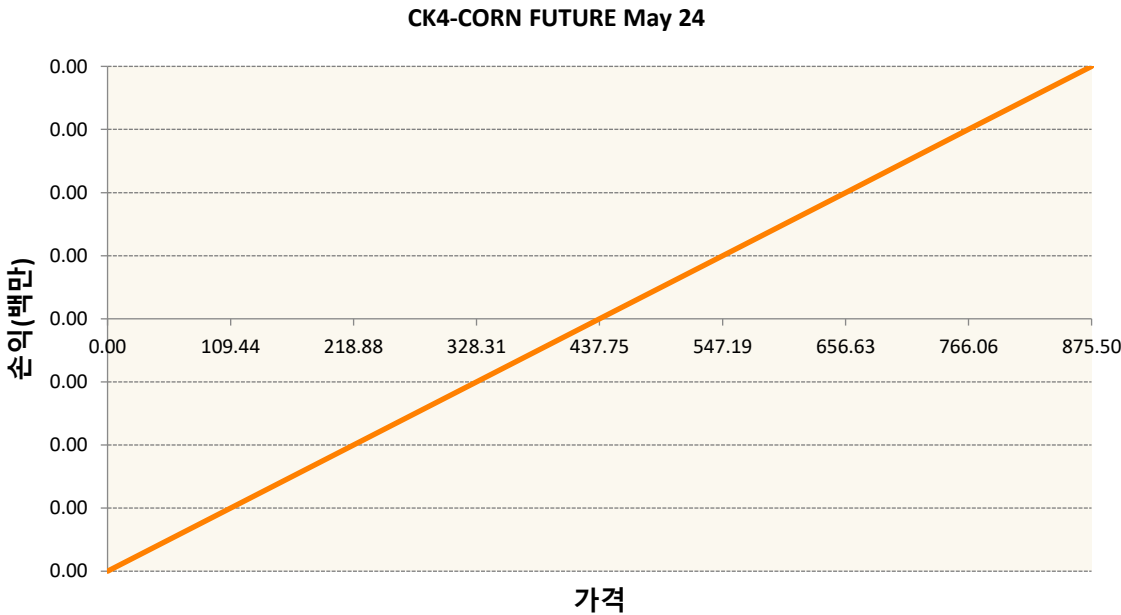
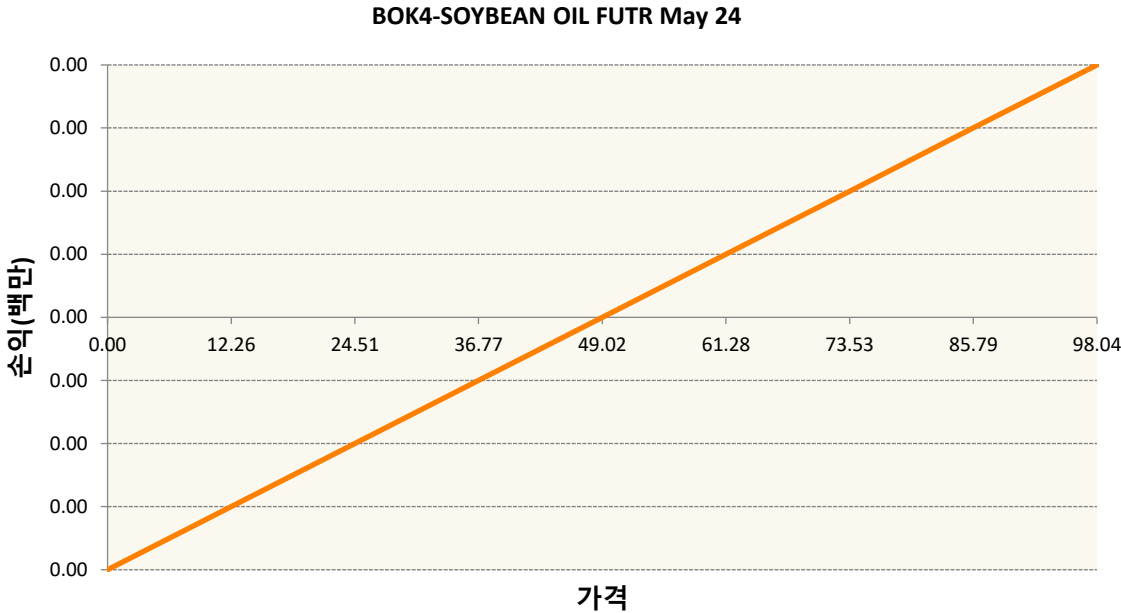
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

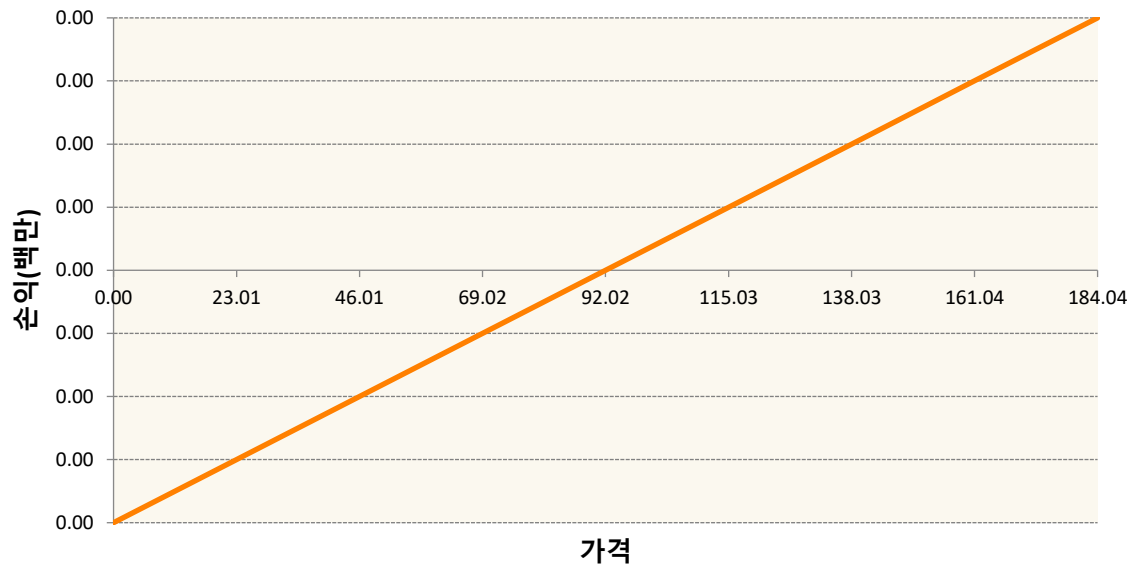
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 27    | -27       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 4,375 | 0     | 4,375     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 562   | -562      | 장내 |

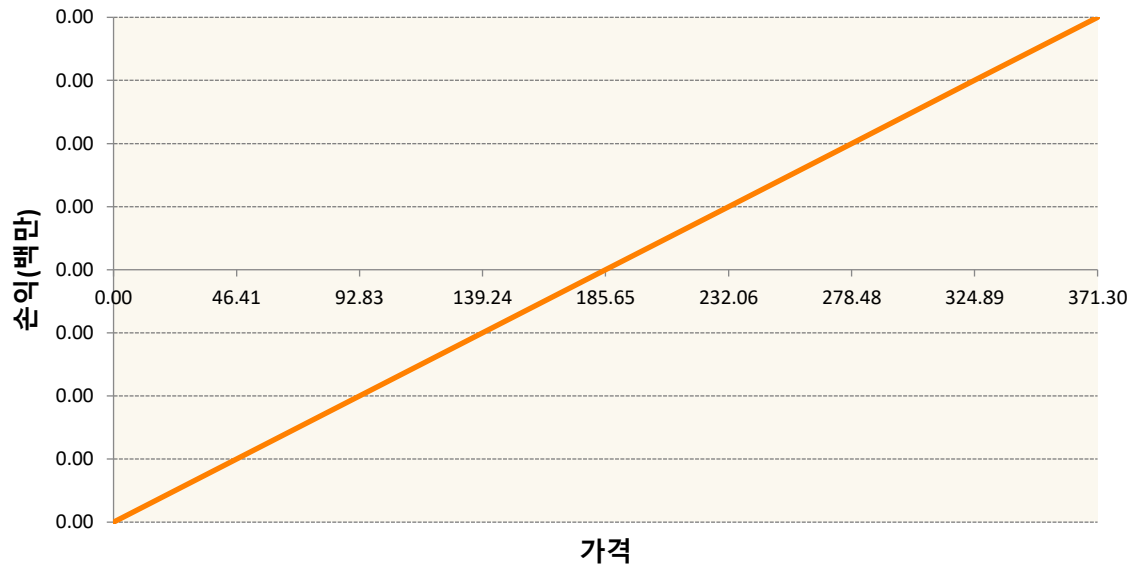
2. 만기시점의 손익구조



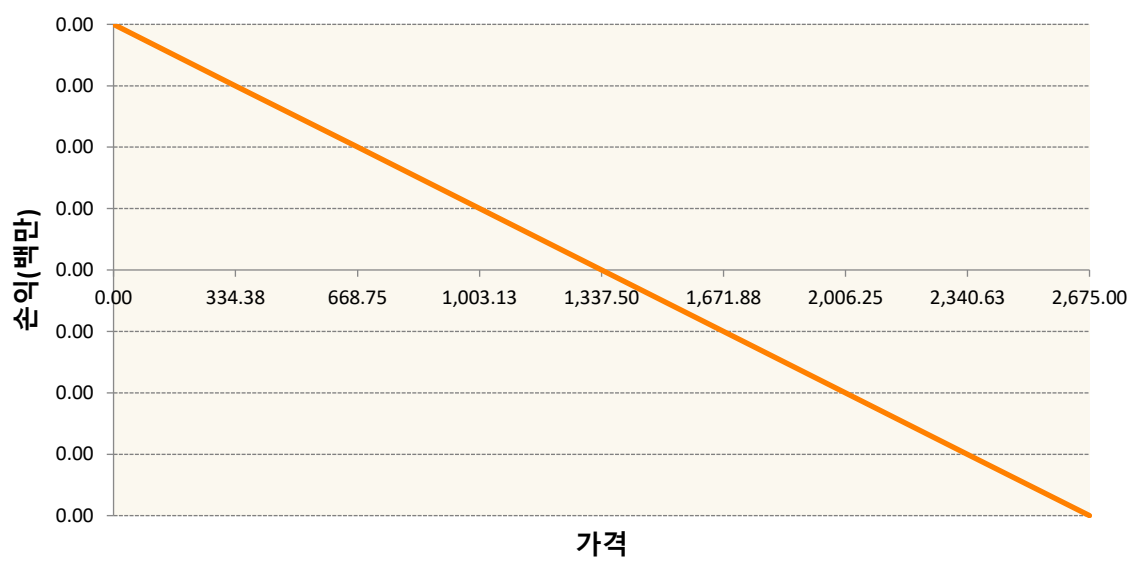
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



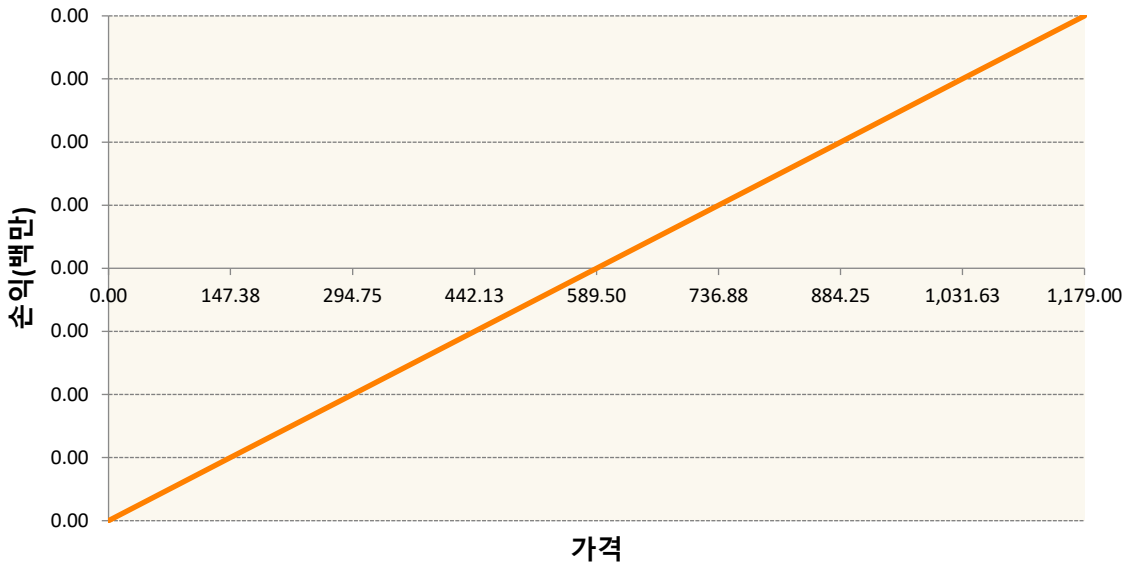
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



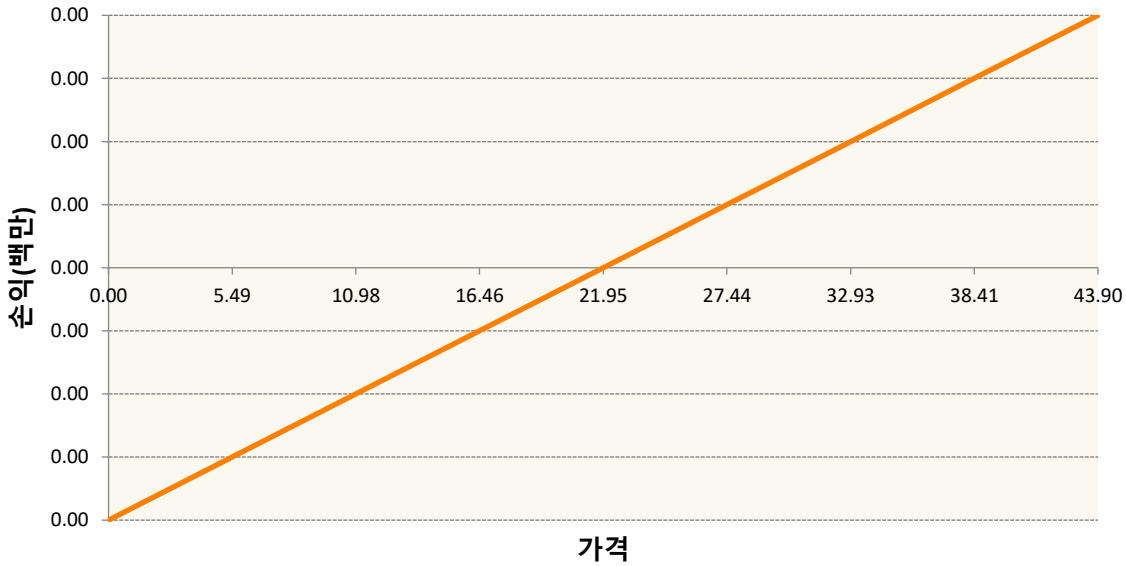
KR4175V40008-2024-04 달러선물



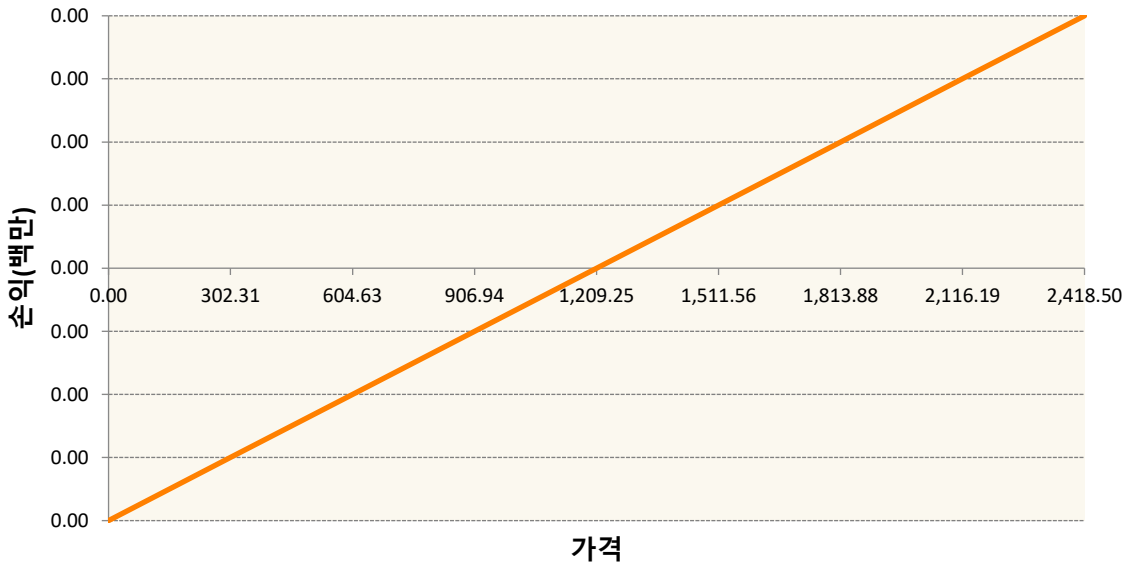
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



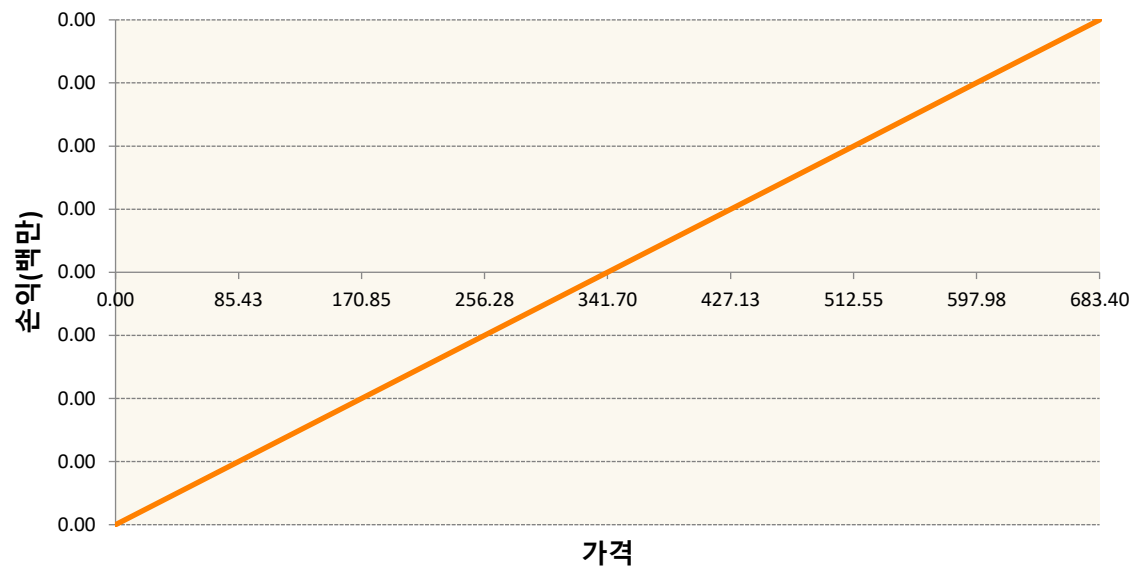
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



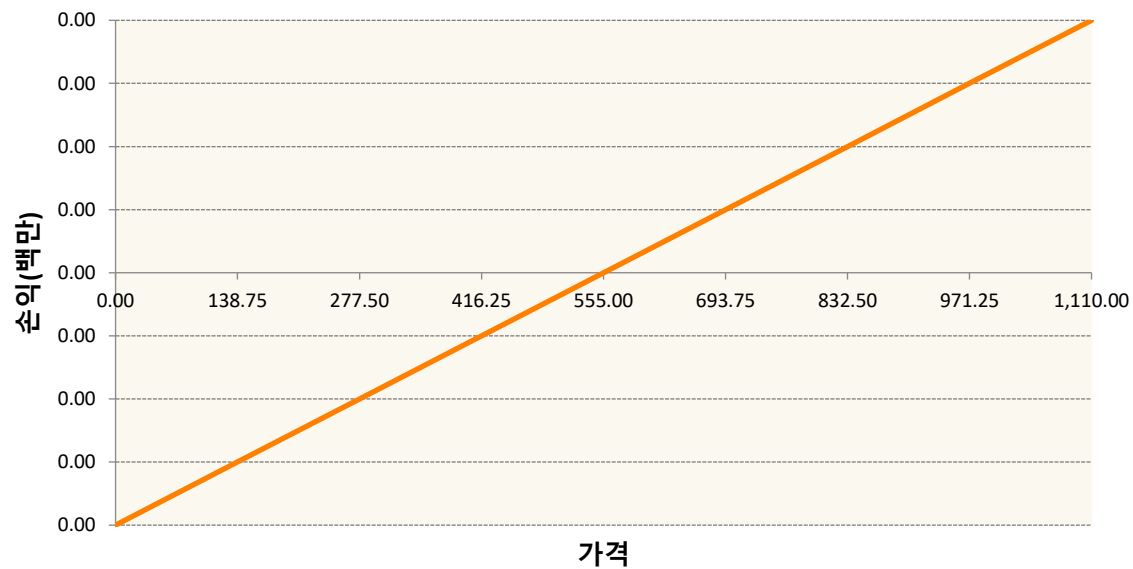
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



SMK4-SOYBEAN MEAL FUTR May 24



WK4-WHEAT FUTURE(CBT) May 24



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

스마트인덱스모

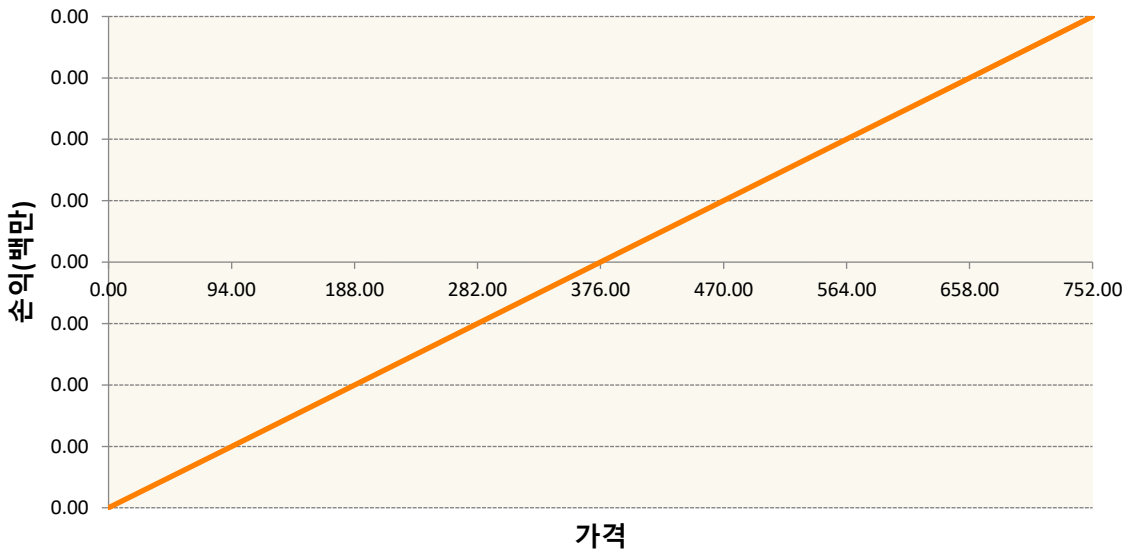
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 188   | -188      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,162 | 0     | 2,162     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           | 2024-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 172    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -172      | -172               | -172   | -172 | -172  | -172   | -172   |
| -5.33%       | -115      | -115               | -115   | -115 | -115  | -115   | -115   |
| -2.67%       | -57       | -57                | -57    | -57  | -57   | -57    | -57    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 57        | 57                 | 57     | 57   | 57    | 57     | 57     |
| 5.33%        | 115       | 115                | 115    | 115  | 115   | 115    | 115    |
| 8.00%        | 172       | 172                | 172    | 172  | 172   | 172    | 172    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

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   | 3,420 | 0     | 3,420     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래231226 | 264 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 306 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

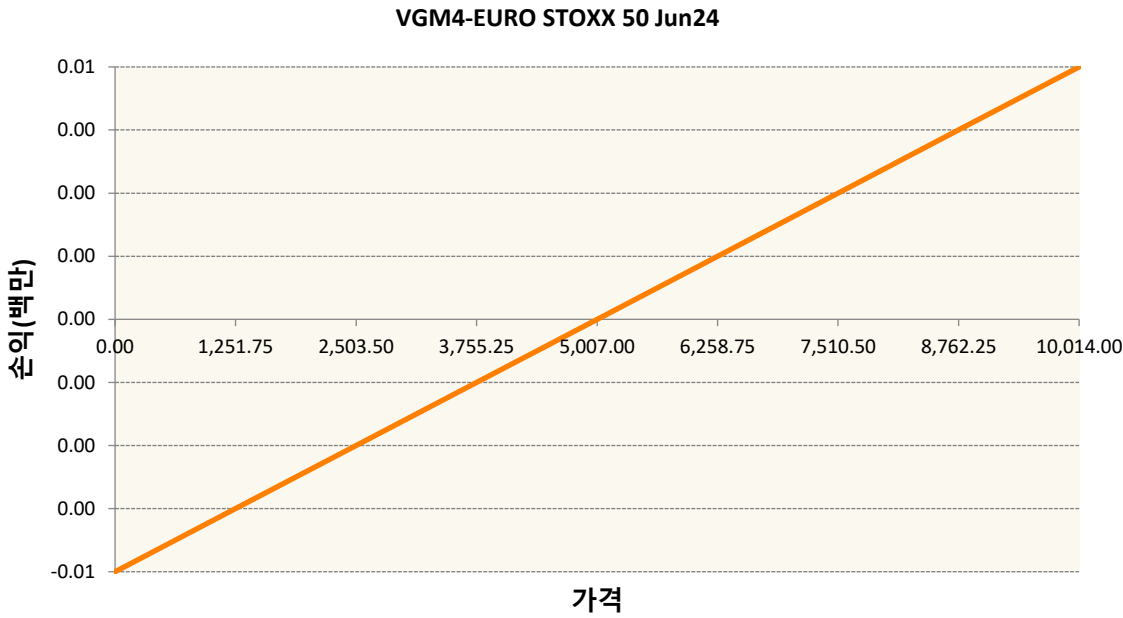
유로인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,005 | 0     | 1,005     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 218   | 0     | 218       | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |    |
|------------------------------|----|
| FXW213E3K( EUR/KRW 21-06-24E | 17 |
| VGM4 EURO STOXX 50 Jun24     | 80 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 67 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

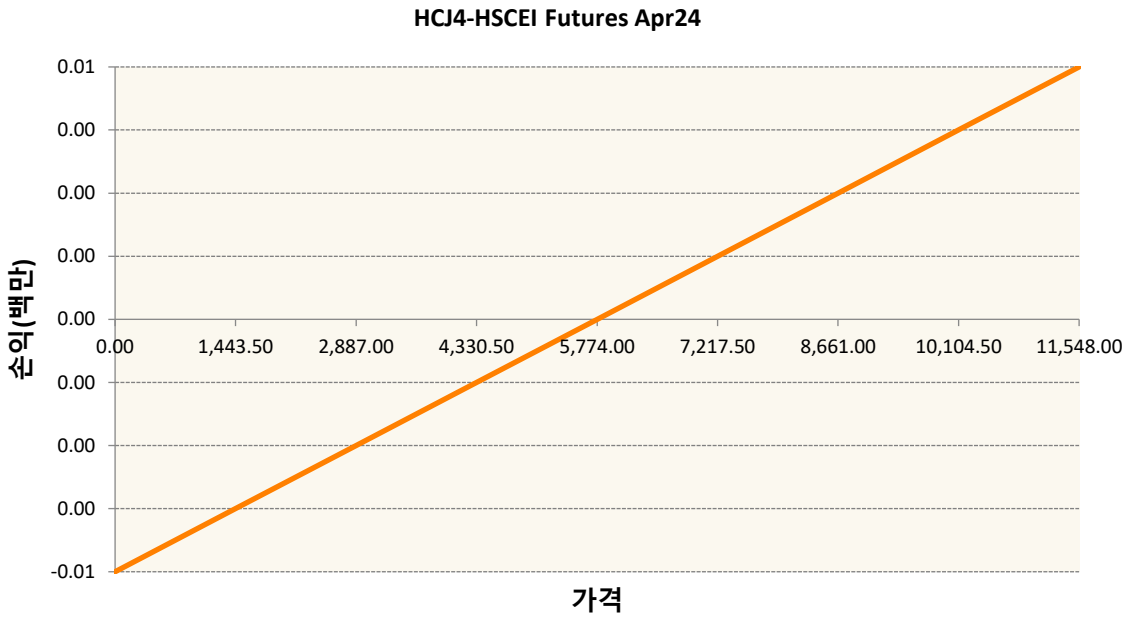
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,186 | 0     | 1,186     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCI4 | HSCEI Futures Apr24 | 95 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

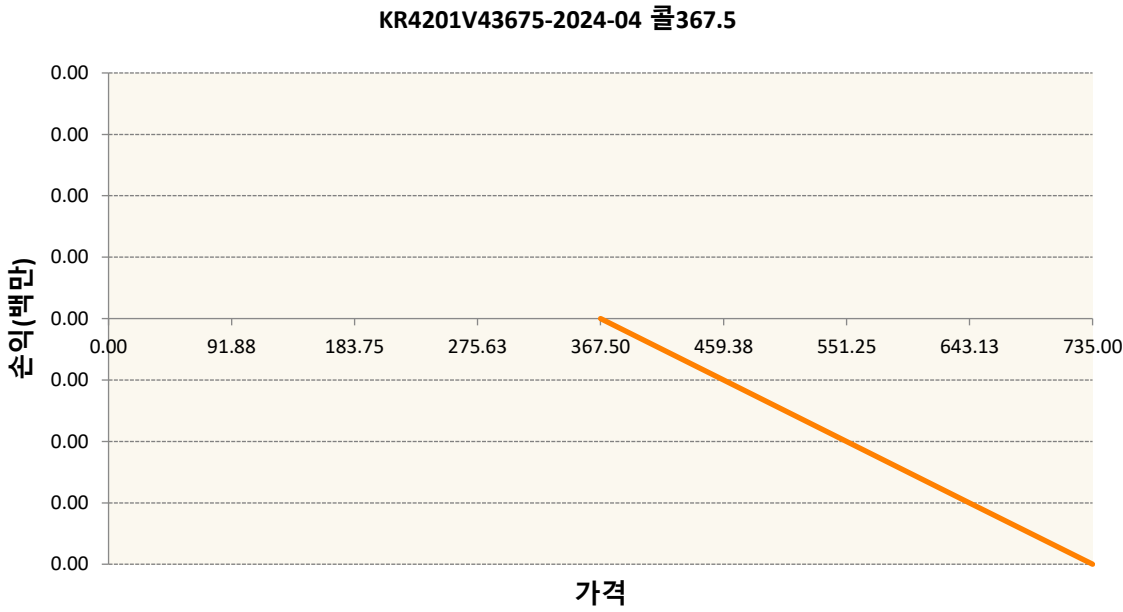
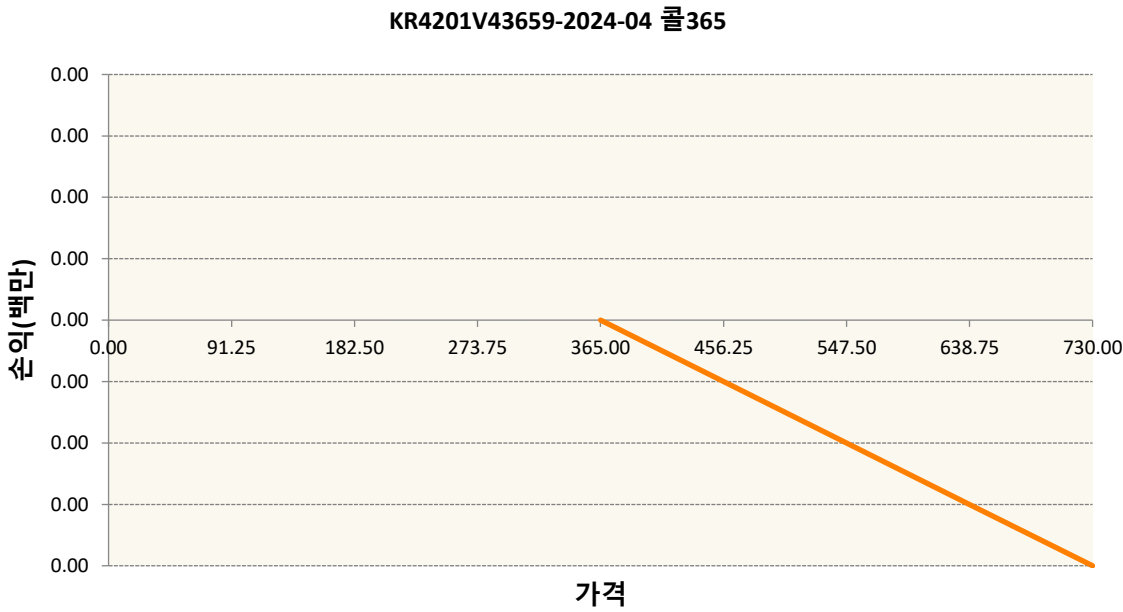
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

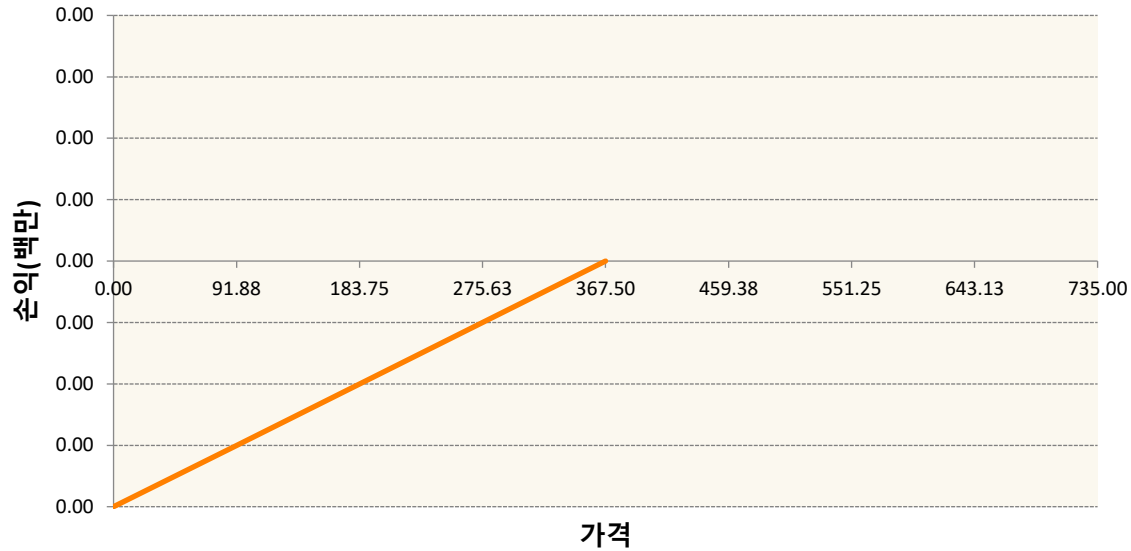
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 445   | 0      | 445       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 47,214 | -47,214   | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V43673-2024-04 풋367.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201V43659 2024-04 콜365 1,078

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |        |        |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 551     | 539     | 525    | 509    | 492    | 473    | 454    |
| -5.33%    | 482     | 460     | 436    | 412    | 387    | 362    | 337    |
| -2.67%    | 328     | 300     | 272    | 244    | 216    | 188    | 160    |
| 0%        | 74      | 50      | 25     | 0      | -26    | -52    | -78    |
| 2.67%     | -262    | -277    | -293   | -311   | -330   | -351   | -372   |
| 5.33%     | -644    | -650    | -659   | -669   | -681   | -695   | -710   |
| 8.00%     | -1,044  | -1,046  | -1,049 | -1,054 | -1,060 | -1,068 | -1,078 |

KR4201V43675 2024-04 콜367.5 1,689

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |        |        |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 792     | 776     | 757    | 734    | 710    | 683    | 655    |
| -5.33%    | 706     | 673     | 638    | 602    | 565    | 526    | 487    |
| -2.67%    | 496     | 452     | 407    | 362    | 317    | 273    | 228    |
| 0%        | 127     | 85      | 43     | 0      | -43    | -87    | -131   |
| 2.67%     | -385    | -412    | -442   | -475   | -509   | -545   | -582   |
| 5.33%     | -984    | -997    | -1,014 | -1,033 | -1,056 | -1,081 | -1,108 |
| 8.00%     | -1,622  | -1,626  | -1,633 | -1,643 | -1,656 | -1,671 | -1,689 |

KR4301V43673 2024-04 풋367.5 467

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -455    | -456    | -457   | -459 | -461  | -464   | -467   |
| -5.33%    | -240    | -244    | -250   | -255 | -262  | -268   | -275   |
| -2.67%    | -67     | -76     | -86    | -96  | -105  | -115   | -125   |
| 0%        | 25      | 17      | 8      | 0    | -9    | -18    | -27    |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 2.67% | 51 | 48 | 45 | 41 | 36 | 31 | 25 |
| 5.33% | 55 | 55 | 54 | 53 | 51 | 49 | 46 |
| 8.00% | 55 | 55 | 55 | 55 | 55 | 54 | 53 |

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

(단위:백만원)

3,342

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

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 | 1,733 | 0     | 1,733     |    |

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 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

## 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 | 4,530 | 0     | 4,530     |    |

### 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 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 수익증권 | 0      | 0      | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0      | 0      | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 수익증권 | 16,037 | 0      | 16,037    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,072  | 16,858 | -15,786   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FXW213DCT KRW/USD 29-03-24E  | 520 |
| FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E  | 250 |
| FXW213E2L0 USD/KRW 29-03-24E | 86  |
| FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E | 579 |
| IE00BD8RGM75                 |     |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

689

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

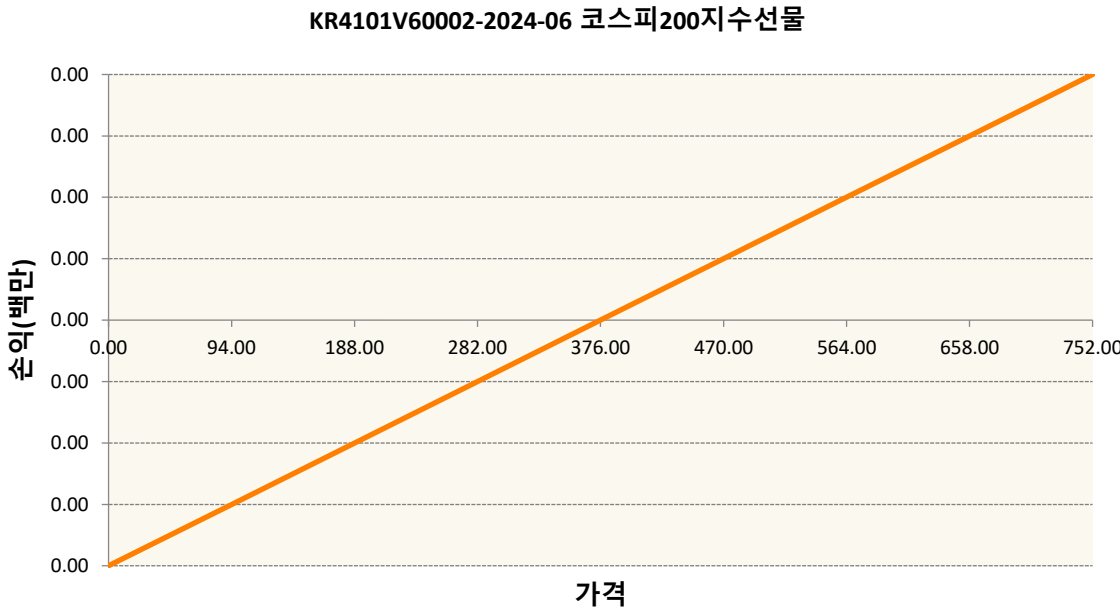
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 94    | -94       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 564   | 0     | 564       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           |         | 2024-06 코스피200지수선물 |     |       |        | 45     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -45       | -45     | -45                | -45 | -45   | -45    | -45    |
| -5.33%       | -30       | -30     | -30                | -30 | -30   | -30    | -30    |
| -2.67%       | -15       | -15     | -15                | -15 | -15   | -15    | -15    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 15        | 15      | 15                 | 15  | 15    | 15     | 15     |
| 5.33%        | 30        | 30      | 30                 | 30  | 30    | 30     | 30     |
| 8.00%        | 45        | 45      | 45                 | 45  | 45    | 45     | 45     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

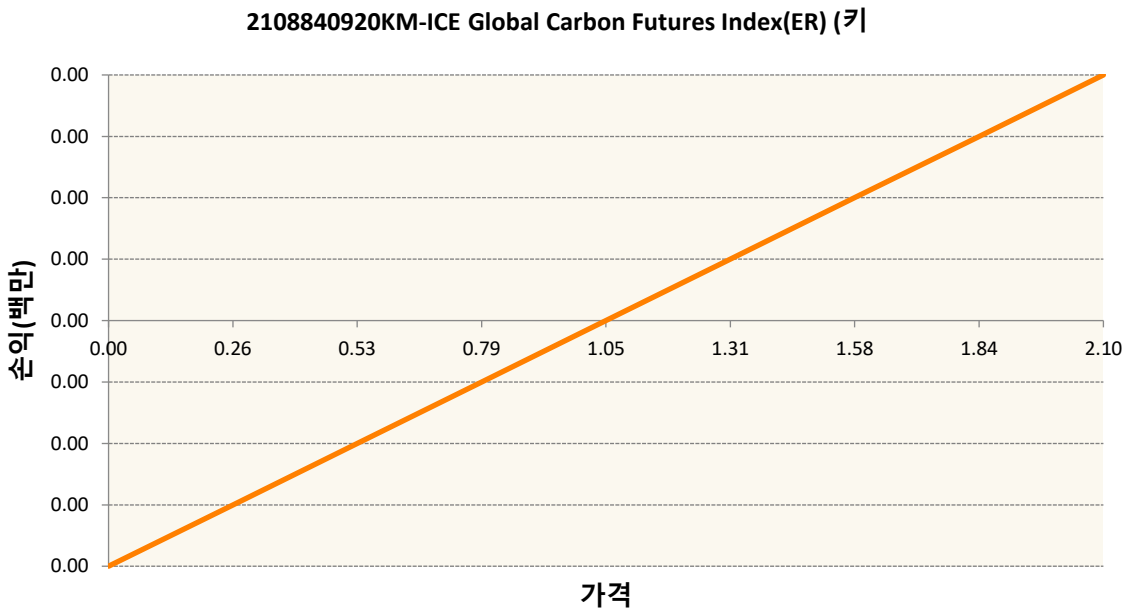
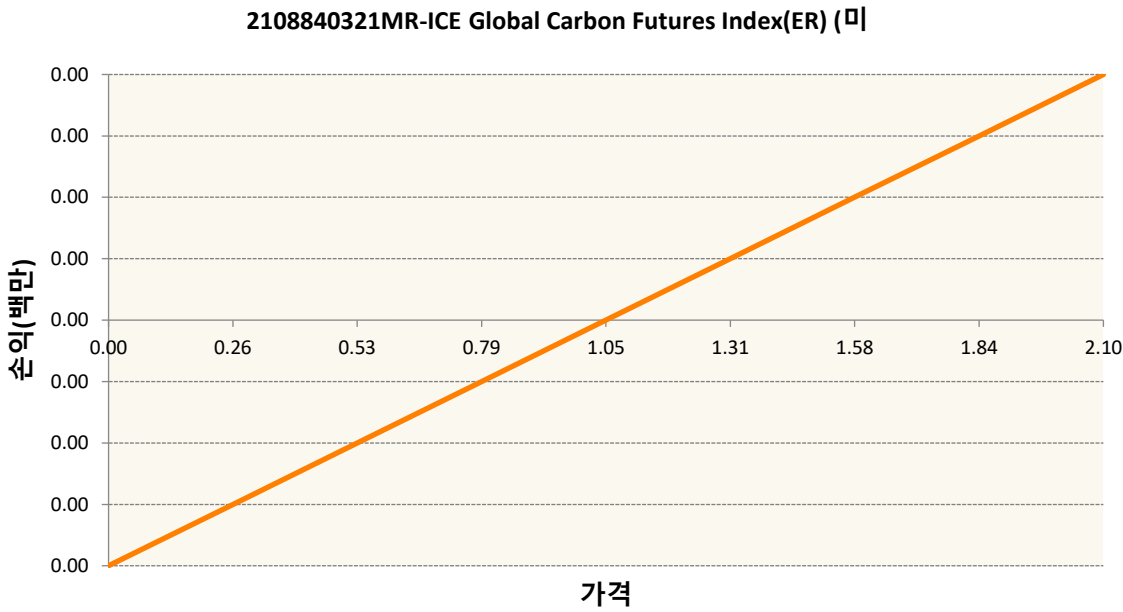
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

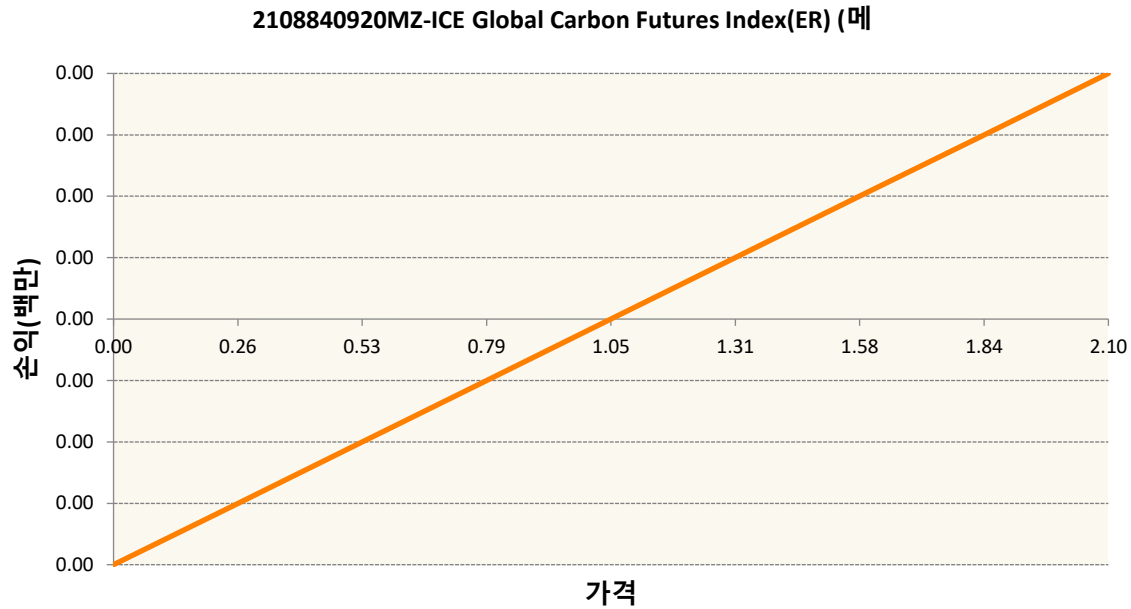
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 19,362 | 0     | 19,362    |    |

2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 457      |
| 2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키 |  | 914      |
| 2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 183      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,817    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

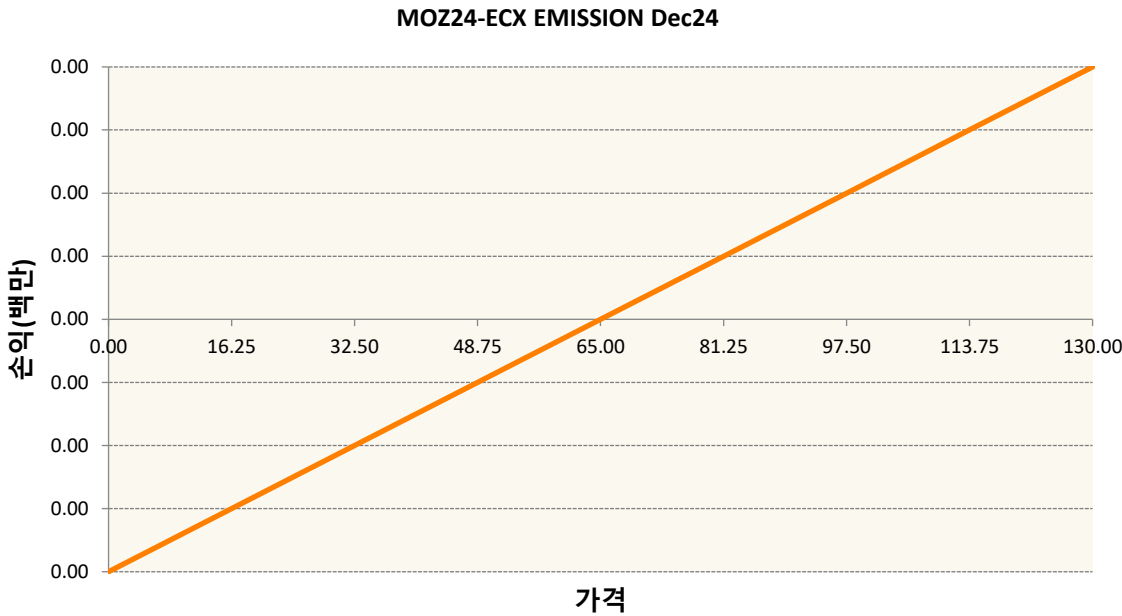
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 9,730 | 0     | 9,730     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 331   | 0     | 331       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 4,831 | -4,831    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E                       | 180 |
| FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E                       | 61  |
| FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E                       | 145 |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 778 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 2   |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,580 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

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   | 4,948 | 0     | 4,948     | 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)  | 4 |

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

(단위:백만원)

30

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

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   | 6,101 | 0     | 6,101     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |   |
|-----------------------------------------|---|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(미래)  | 6 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(NH)  | 5 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(메리츠) | 7 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 1 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 22 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

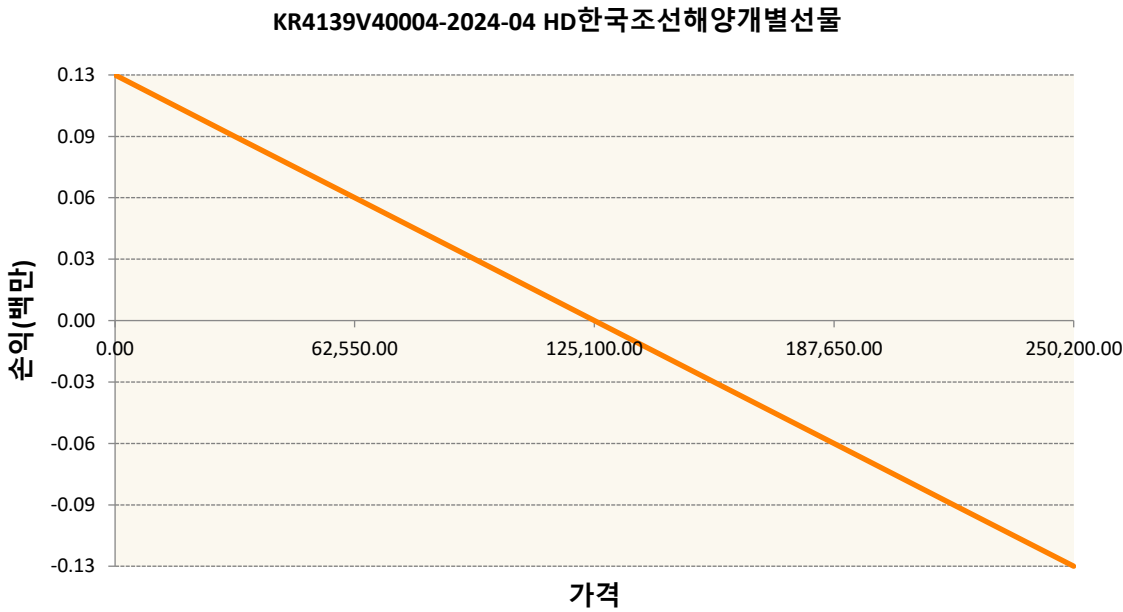
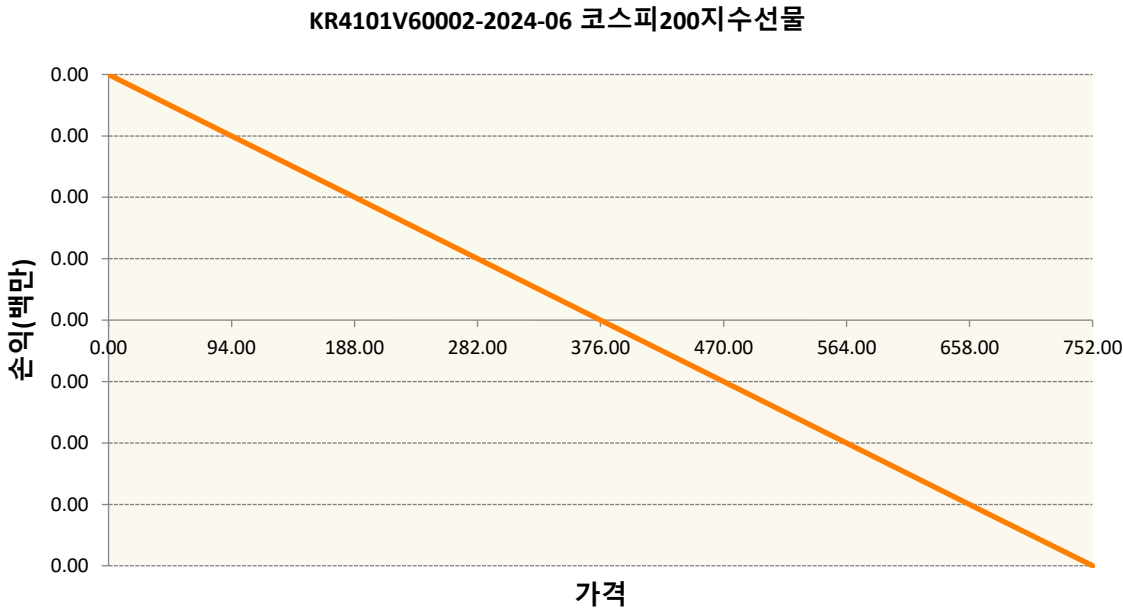
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

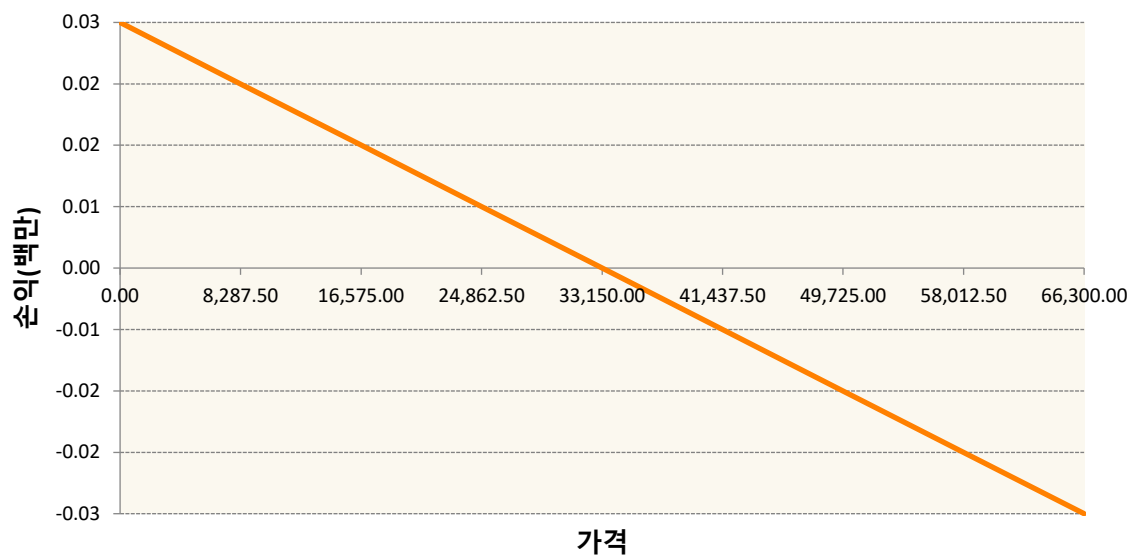
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 10    | 102   | -92       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 24    | 872   | -848      | 장내 |

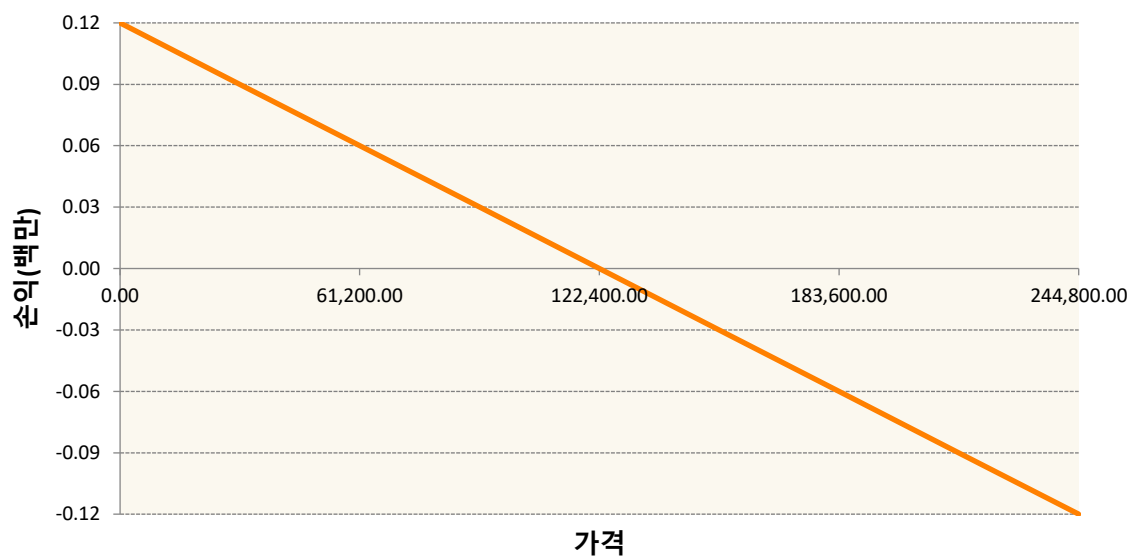
2. 만기시점의 손익구조



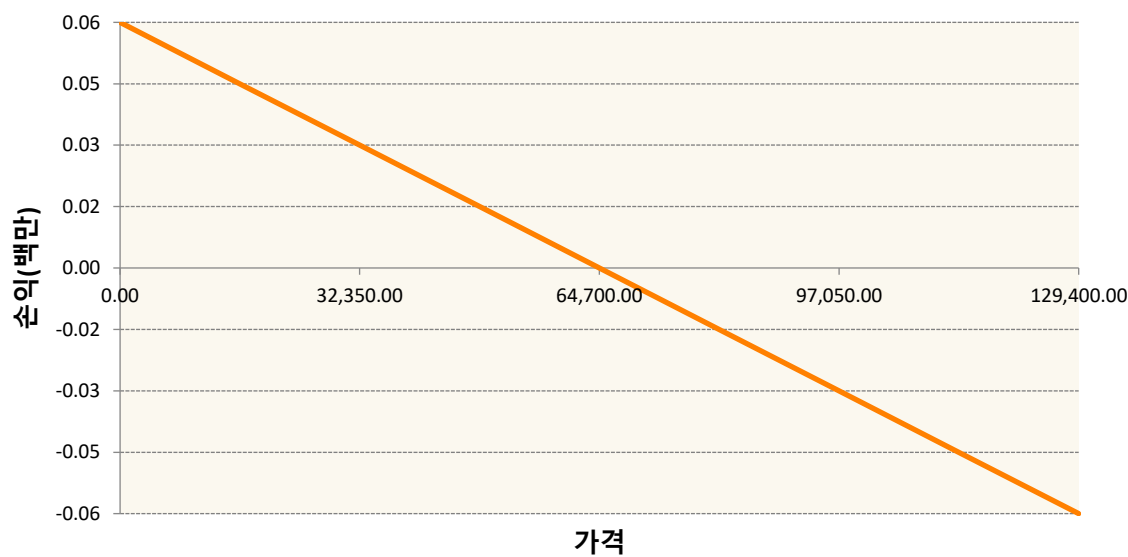
KR41BNV40005-2024-04 현대건설개별선물



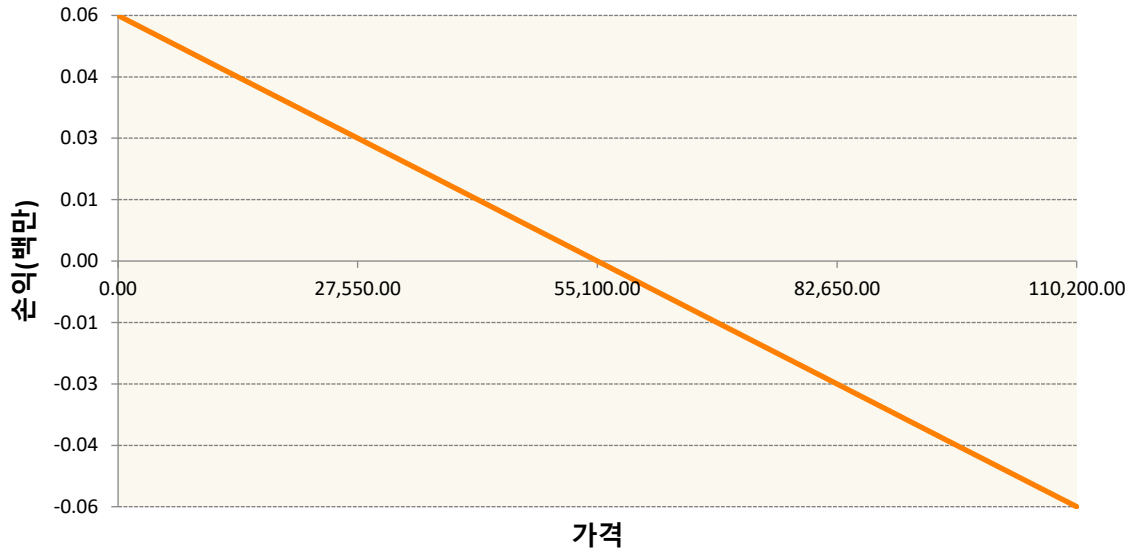
KR41C6V40000-2024-04 아모레퍼시픽개별선물



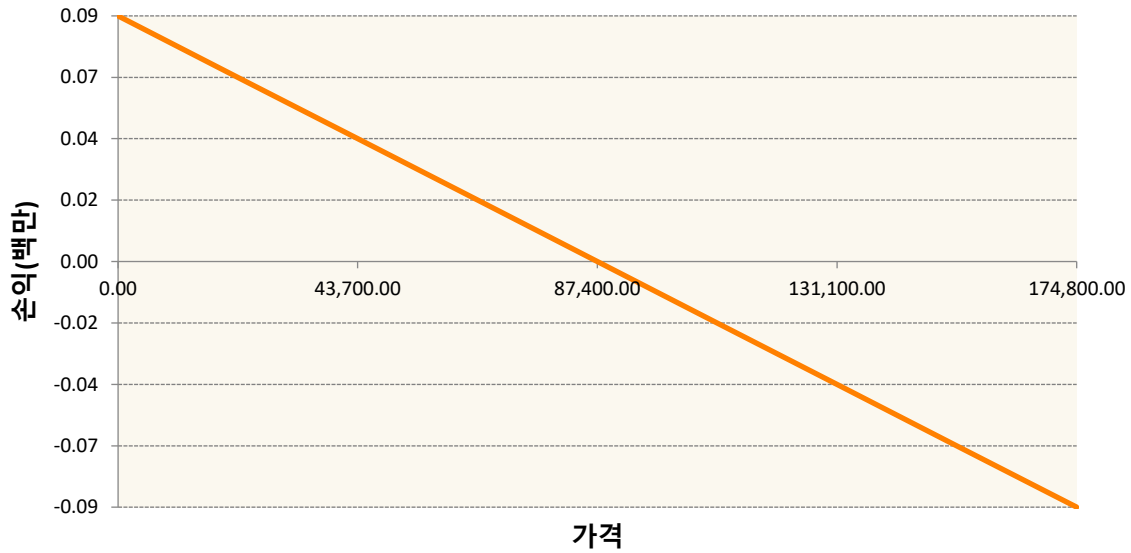
KR41CDV40004-2024-04 현대미포조선개별선물



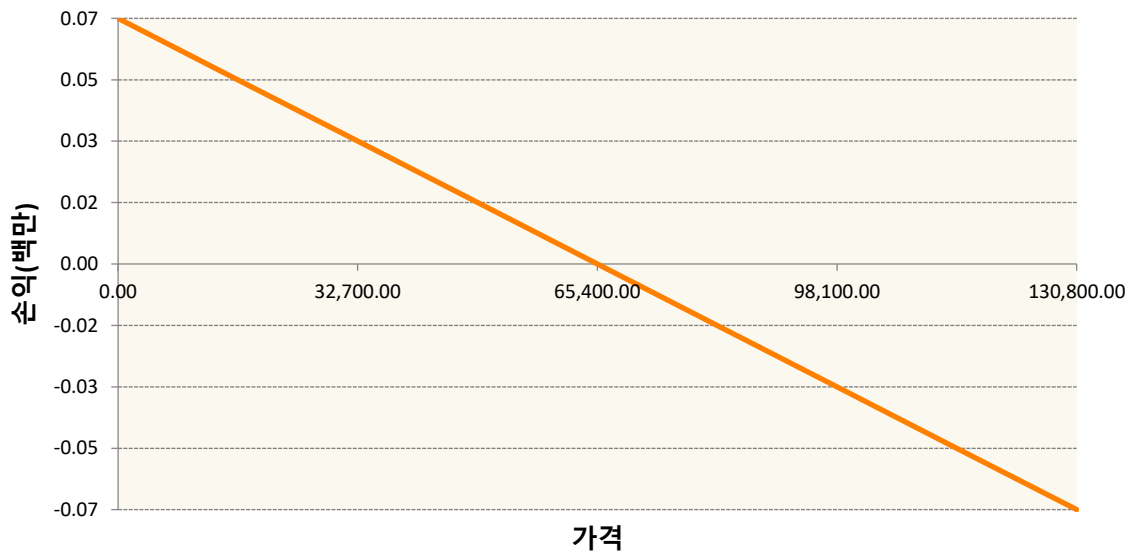
KR41CFV40009-2024-04 카카오개별선물



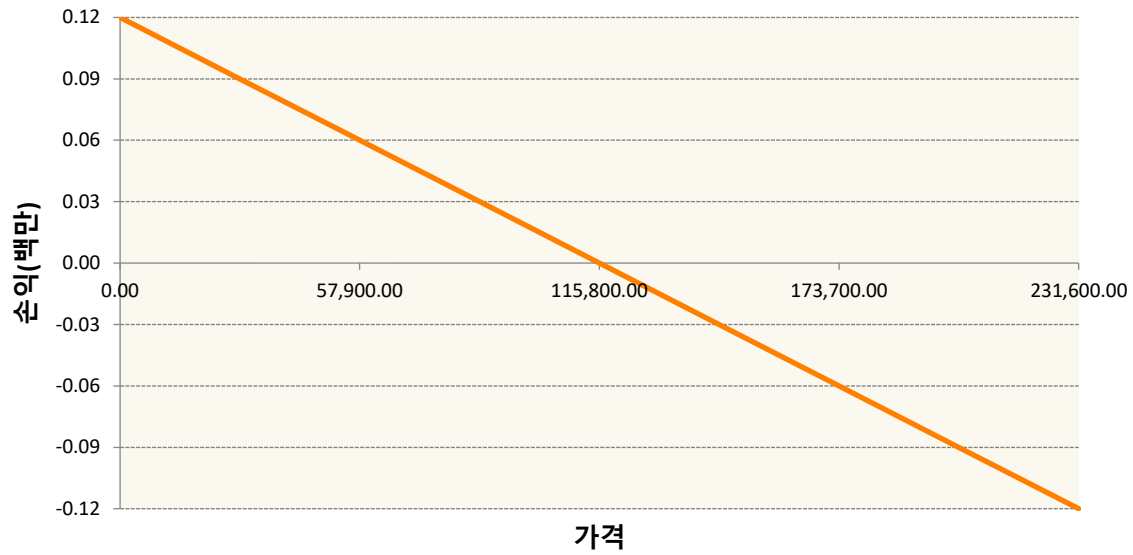
KR41E4V40003-2024-04 에스엠개별선물



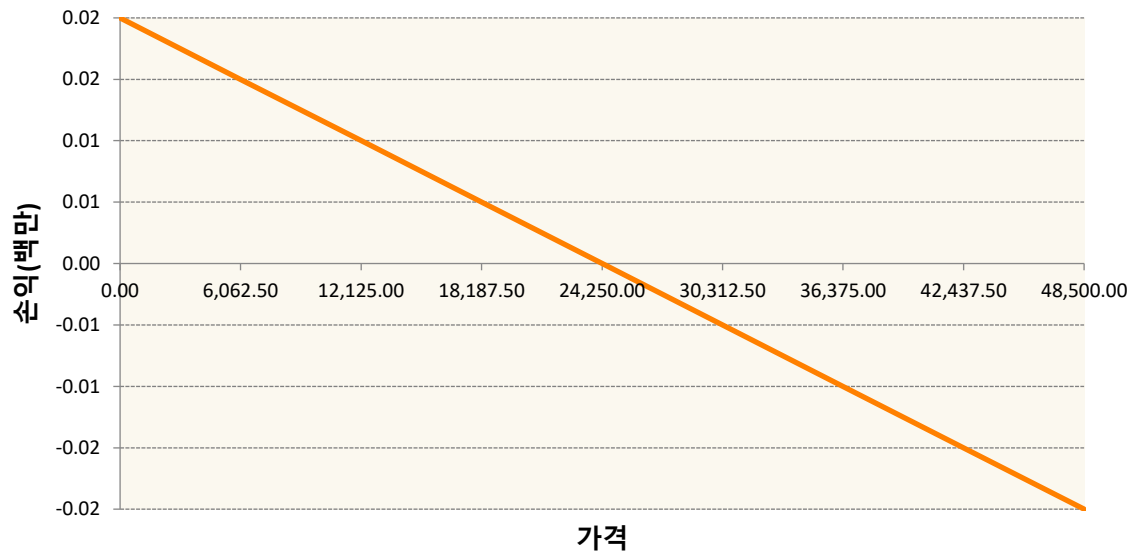
KR41E5V40000-2024-04 넷마블개별선물



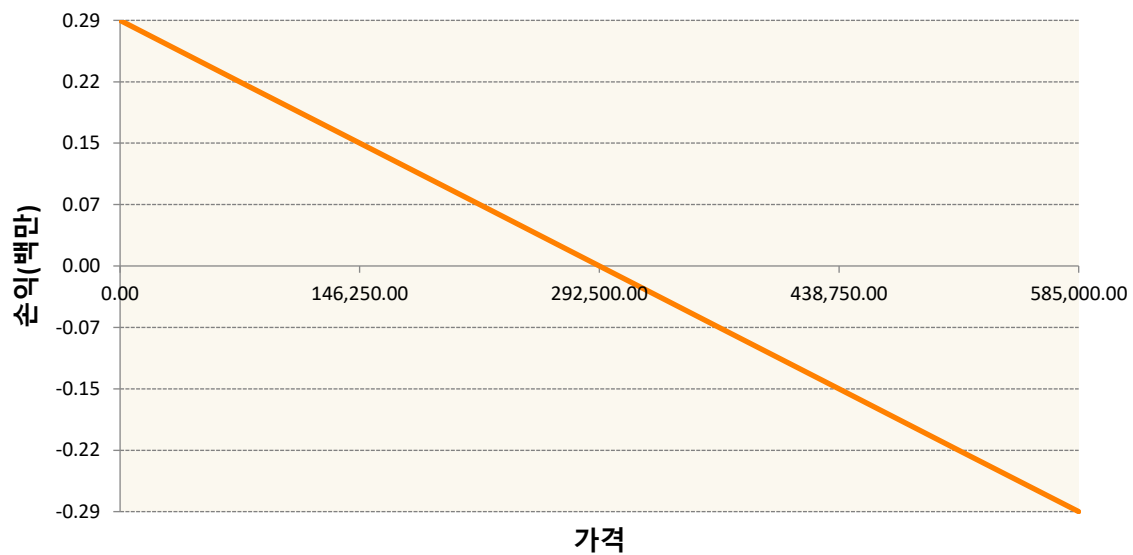
KR41EJV40007-2024-04 SKC개별선물



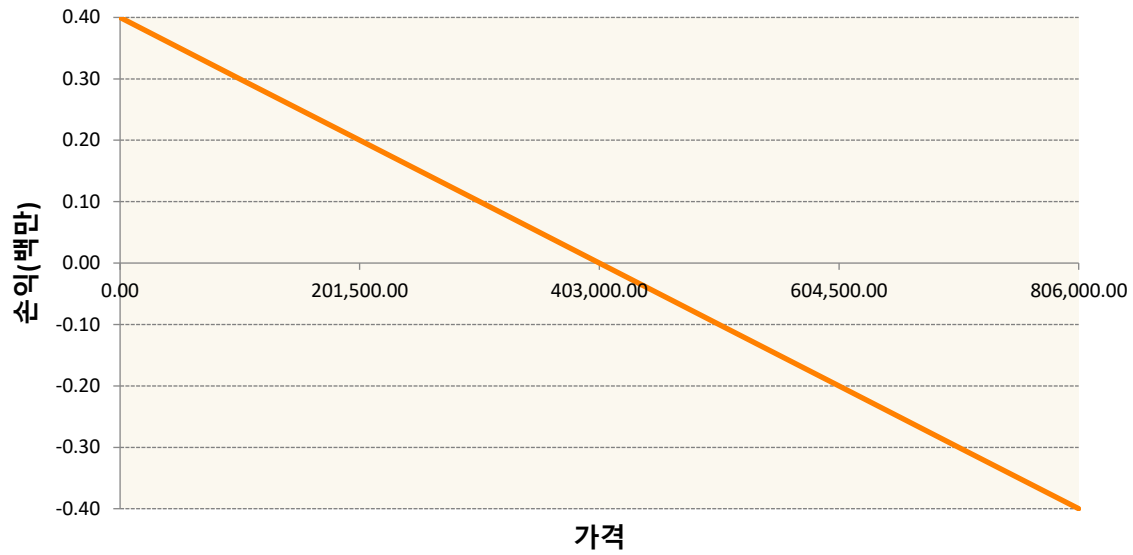
KR41ETV40006-2024-04 삼성엔지니어링개별선물



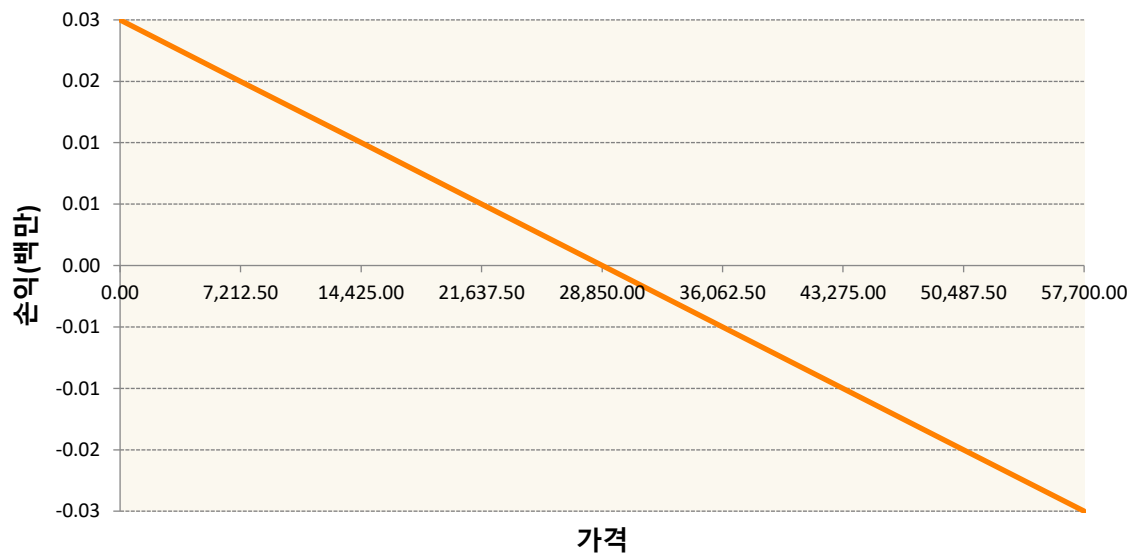
KR41EYV40006-2024-04 에코프로비엠개별선물



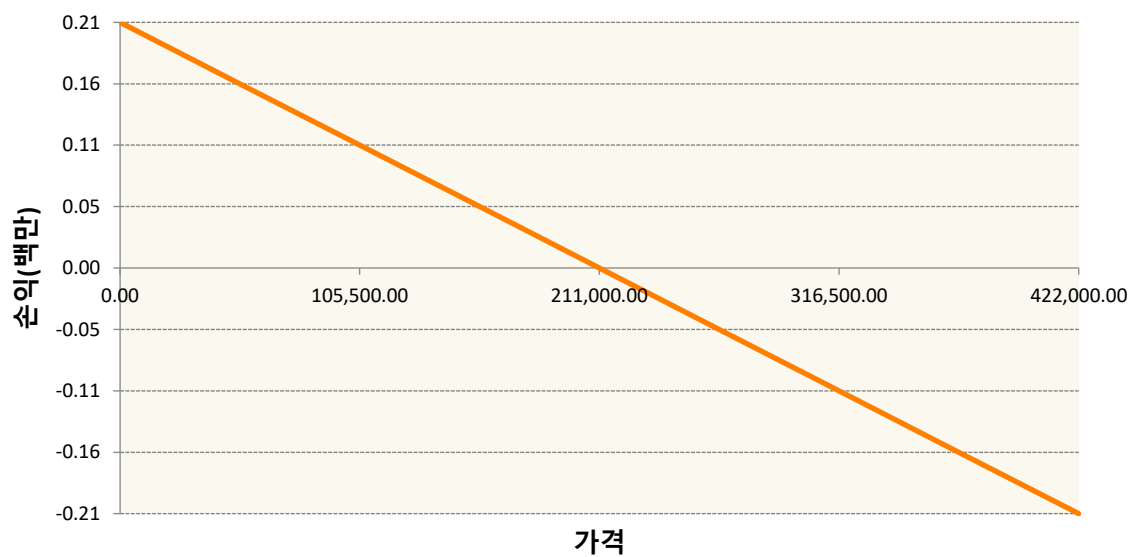
KR41F5V40009-2024-04 LG에너지솔루션개별선물



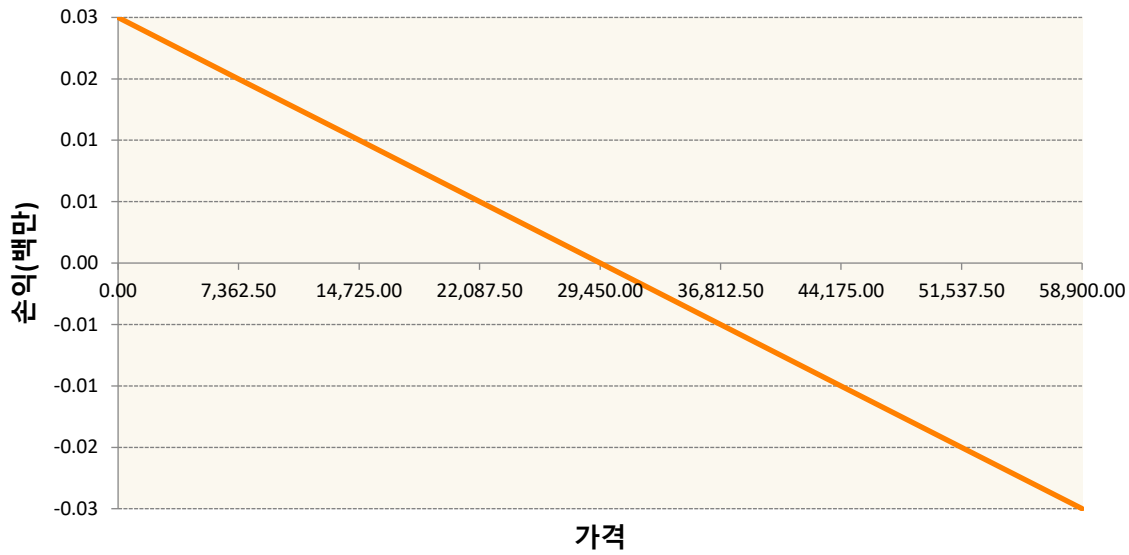
KR41F6V40007-2024-04 카카오뱅크개별선물



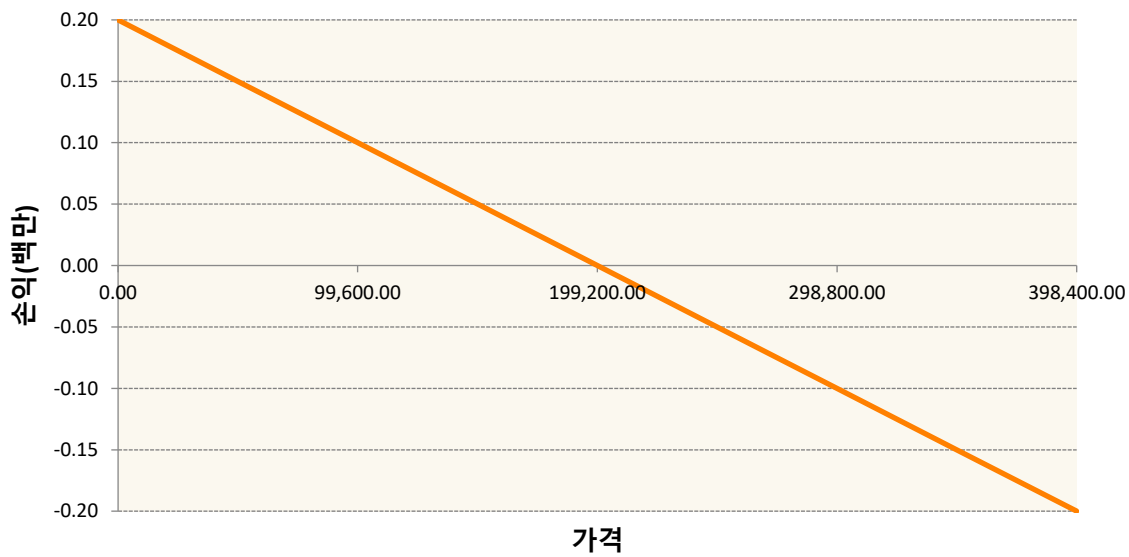
KR41FCV40009-2024-04 하이브개별선물



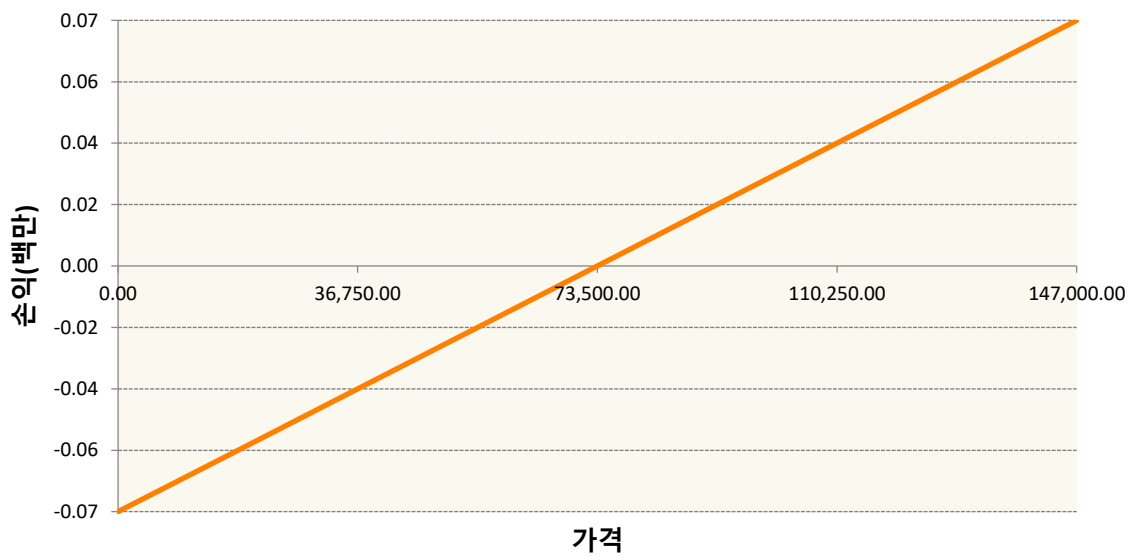
KR41FVV40009-2024-04 한화오션개별선물



KR41G4V40001-2024-04 한솔케미칼개별선물



KR41G9V40000-2024-04 레고캠바이오개별선물



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)       | (단위:백만원) |
|---------------------------------|----------|
| KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물   | 45       |
| KR4139V400 2024-04 HD한국조선해양개별선물 | 1        |
| KR41BNV400( 2024-04 현대건설개별선물    | 0.27     |
| KR41C6V400 2024-04 아모레퍼시픽개별선물   | 13       |
| KR41CDV400( 2024-04 현대미포조선개별선물  | 1        |
| KR41CFV400 2024-04 카카오개별선물      | 0.44     |
| KR41E4V400 2024-04 에스엠개별선물      | 0.21     |
| KR41E5V400 2024-04 넷마블개별선물      | 1        |
| KR41EJV400( 2024-04 SKC개별선물     | 2        |
| KR41ETV400 2024-04 삼성엔지니어링개별선물  | 0.04     |
| KR41EYV400 2024-04 에코프로비엠개별선물   | 1        |
| KR41F5V400 2024-04 LG에너지솔루션개별선물 | 2        |
| KR41F6V400 2024-04 카카오뱅크개별선물    | 1        |
| KR41FCV400 2024-04 하이브개별선물      | 1        |
| KR41FVV400 2024-04 한화오션개별선물     | 1        |
| KR41G4V400( 2024-04 한솔케미칼개별선물   | 0.16     |
| KR41G9V400( 2024-04 레고캠바이오개별선물  | 2        |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

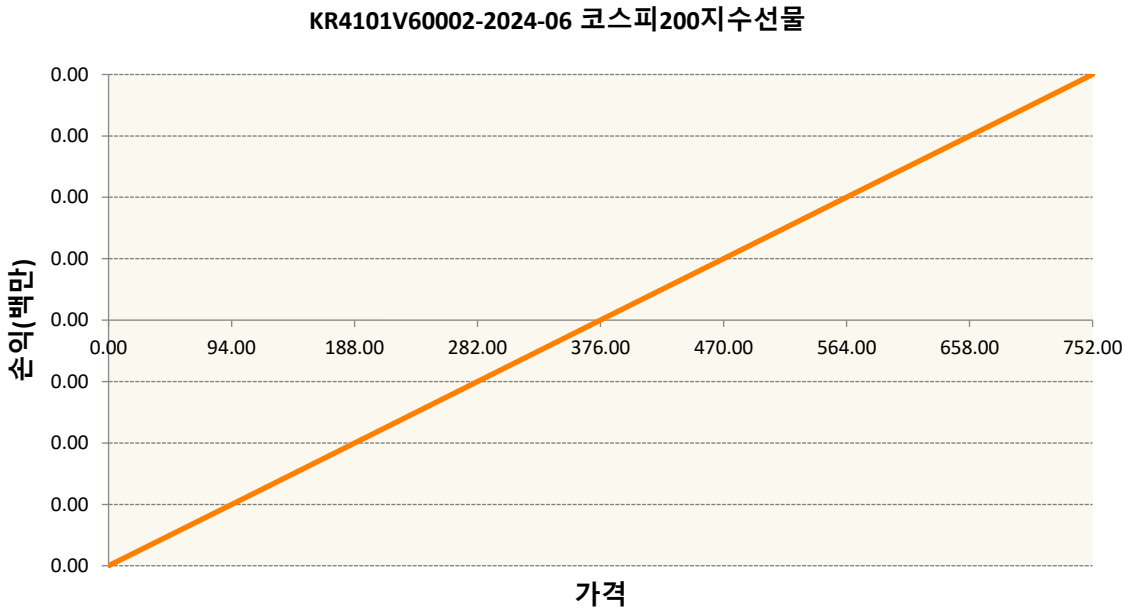
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 376   | -376      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,760 | 0     | 3,760     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           | 2024-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 300    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -300      | -300               | -300   | -300 | -300  | -300   | -300   |
| -5.33%       | -200      | -200               | -200   | -200 | -200  | -200   | -200   |
| -2.67%       | -100      | -100               | -100   | -100 | -100  | -100   | -100   |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 100       | 100                | 100    | 100  | 100   | 100    | 100    |
| 5.33%        | 200       | 200                | 200    | 200  | 200   | 200    | 200    |
| 8.00%        | 300       | 300                | 300    | 300  | 300   | 300    | 300    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

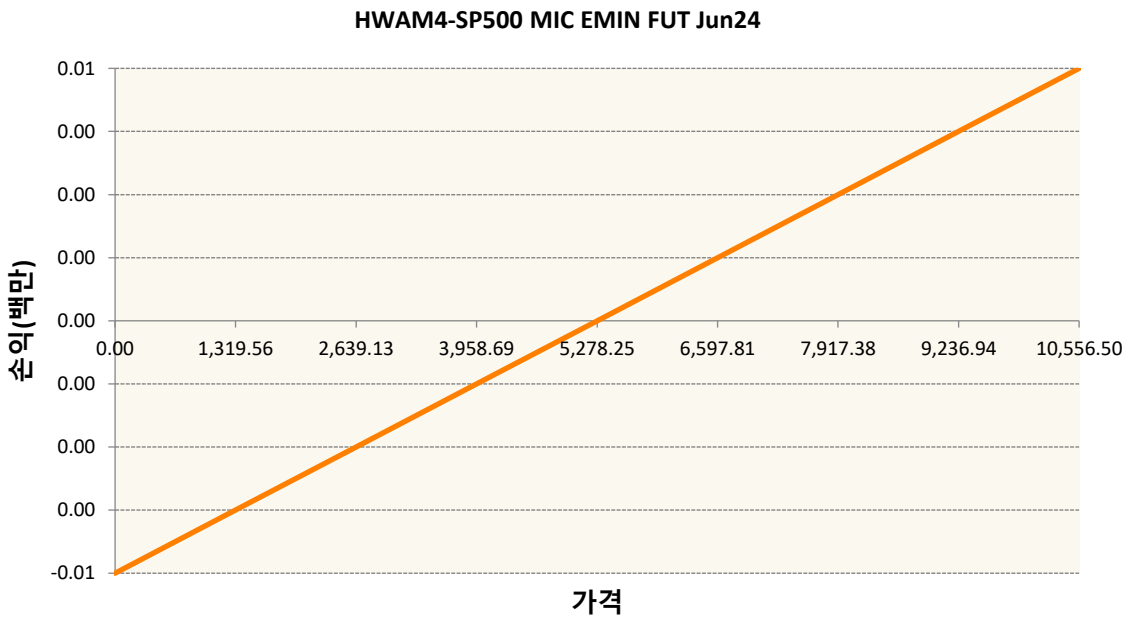
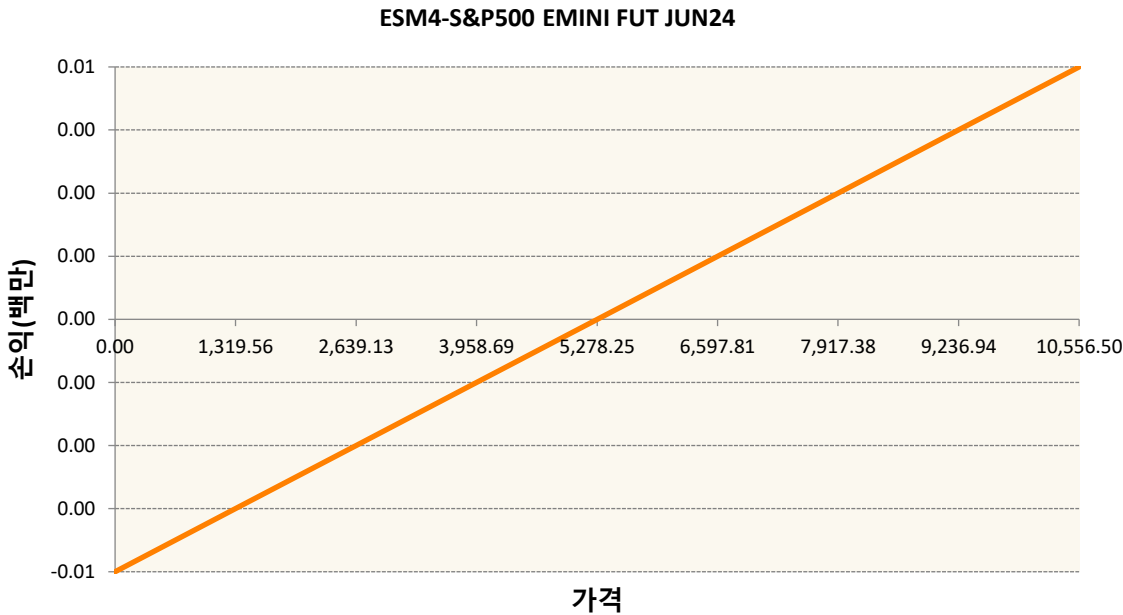
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 4,179 | 0     | 4,179     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,704 | 0     | 1,704     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESM4                      | S&P500 EMINI FUT JUN24   | 334      |
| HWAM4                     | SP500 MIC EMIN FUT Jun24 | 136      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 340      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

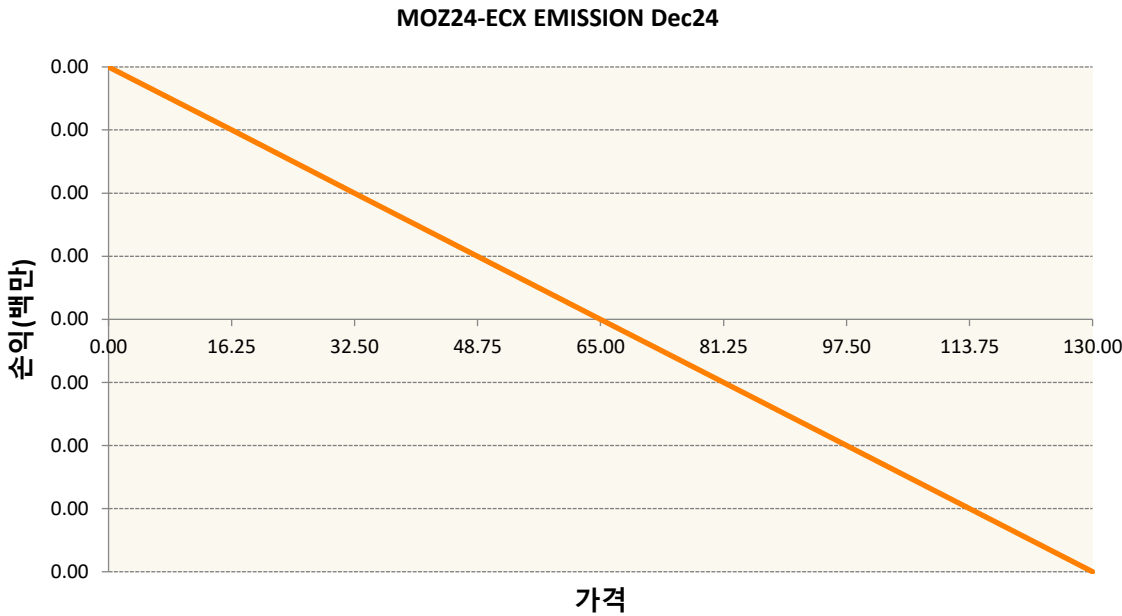
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 4,638 | -4,638    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 331   | 0     | 331       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,194 | 4,003 | -2,809    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E                       | 84  |
| FXW213E2TC KRW/EUR 28-03-24E                       | 148 |
| FXW213E3C( EUR/KRW 28-03-24E                       | 96  |
| FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E                       | 88  |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 371 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 2   |

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

(단위:백만원)



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

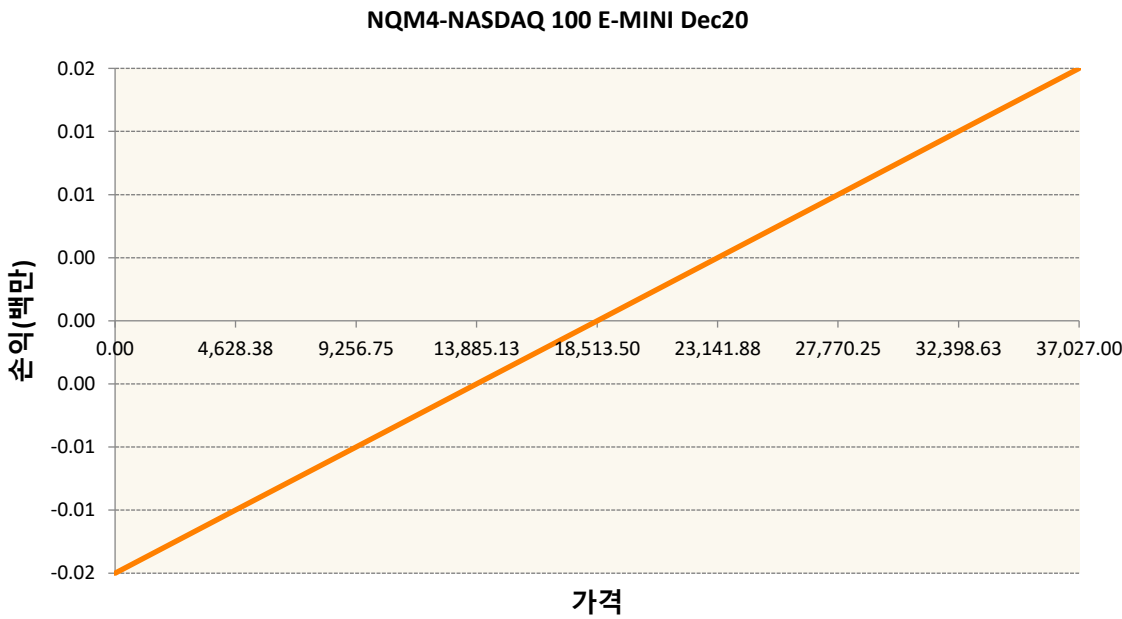
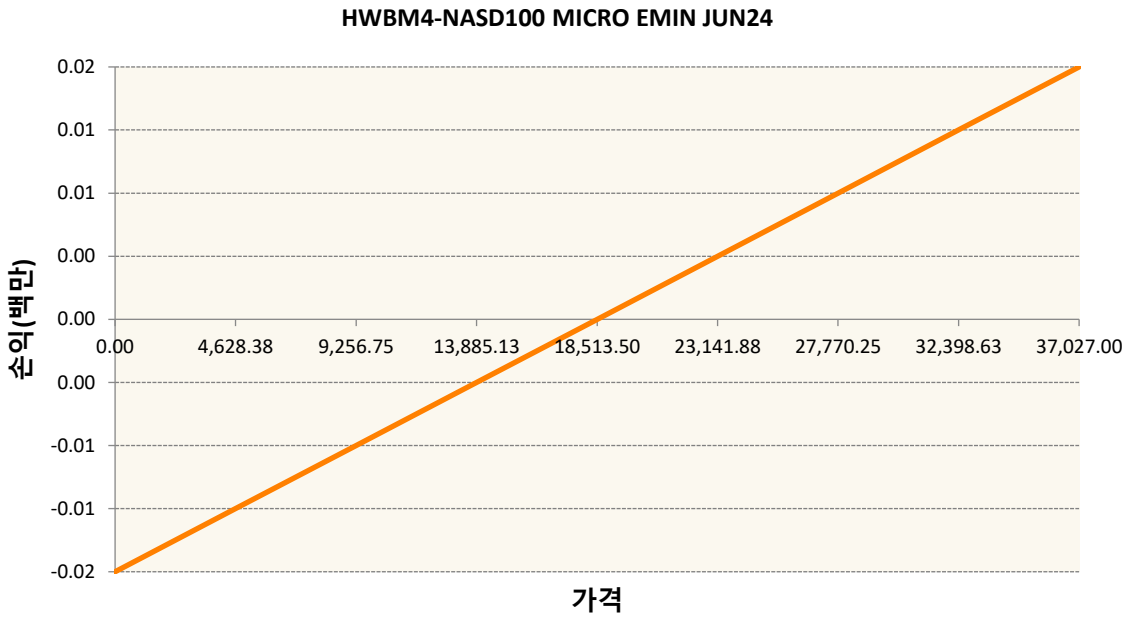
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 2,447 | 0     | 2,447     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,390 | 0     | 2,390     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBM4                     | NASD100 MICRO EMIN JUN24 |  | 191      |
| NQM4                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 196      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 332      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액 (단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 5,555   | 0     | 5,555     | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 103,858 | 0     | 103,858   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|----------|
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 481      |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 1,394    |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 6,033    |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 442      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 5,247    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-03-27 |
| 기준일 | 2024-03-26 |

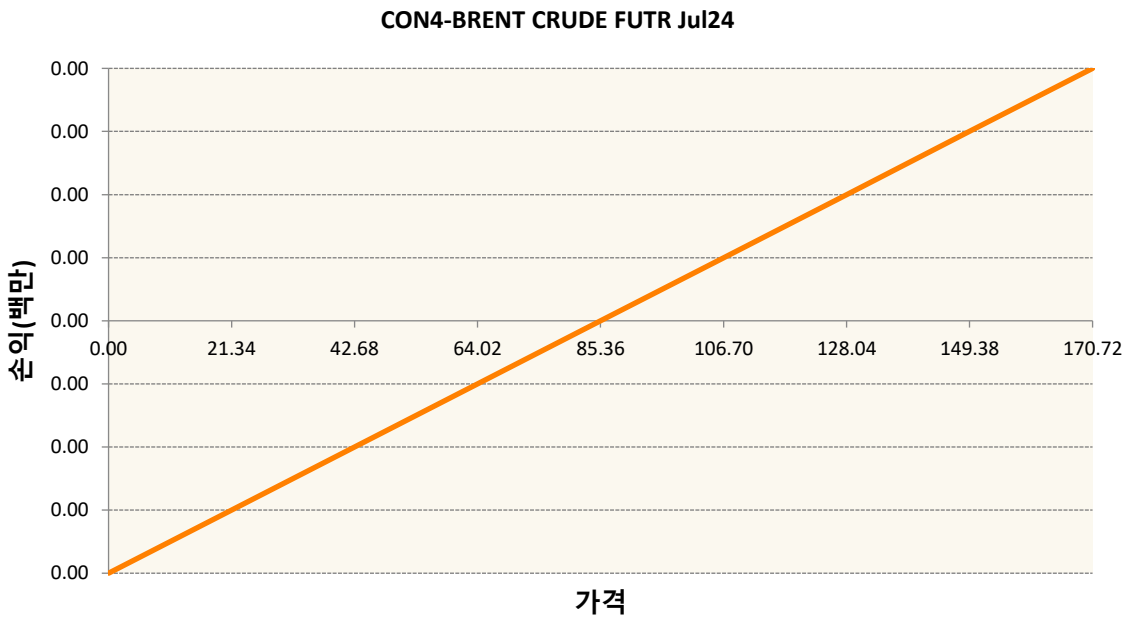
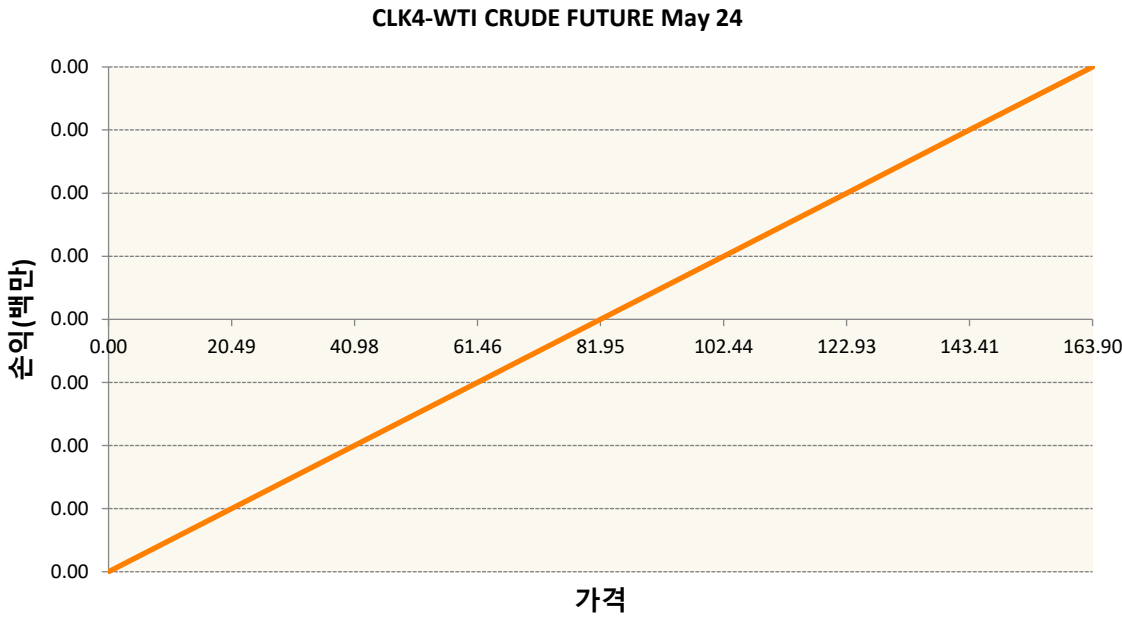
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

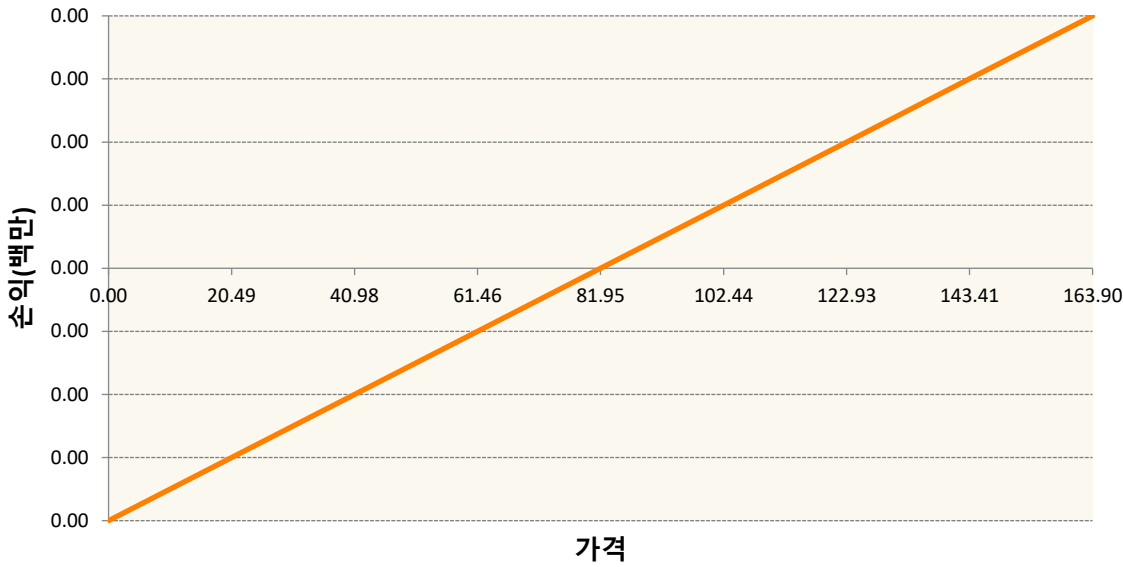
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 13    | -13       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,188 | 0     | 1,188     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 227   | -227      | 장내 |

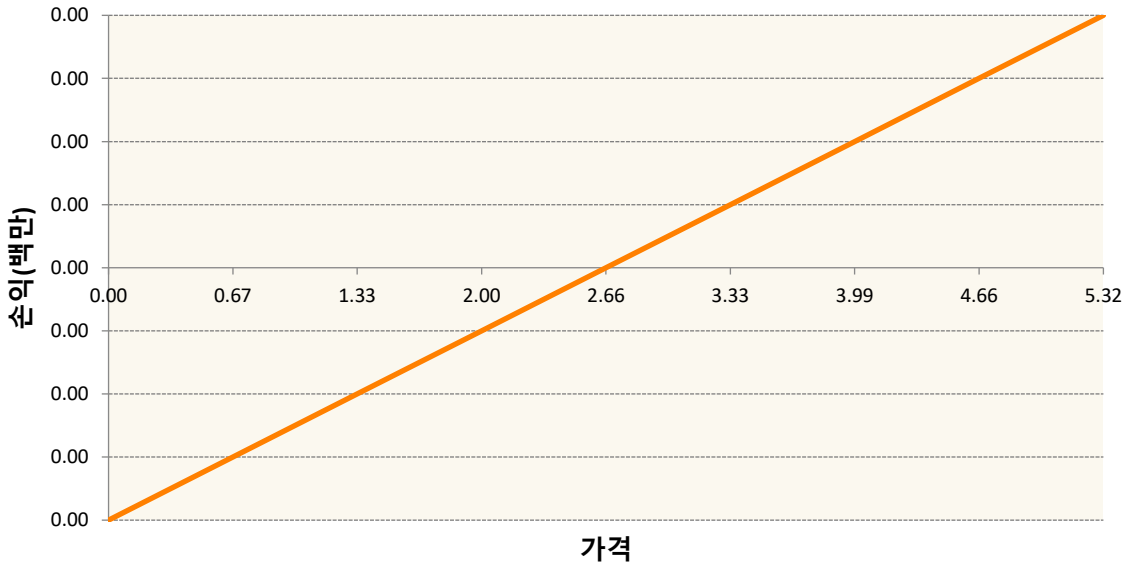
2. 만기시점의 손익구조



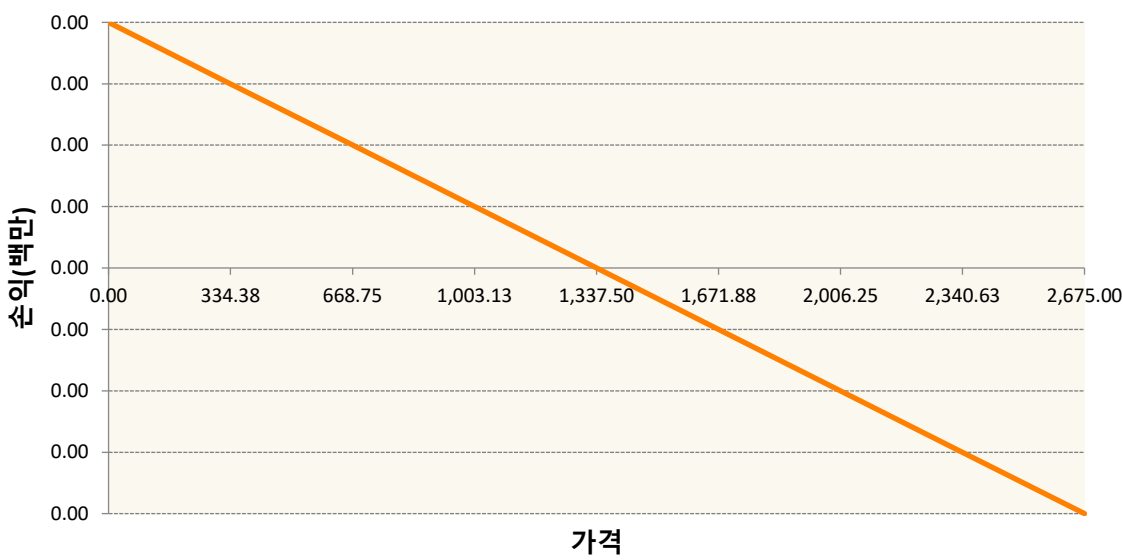
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



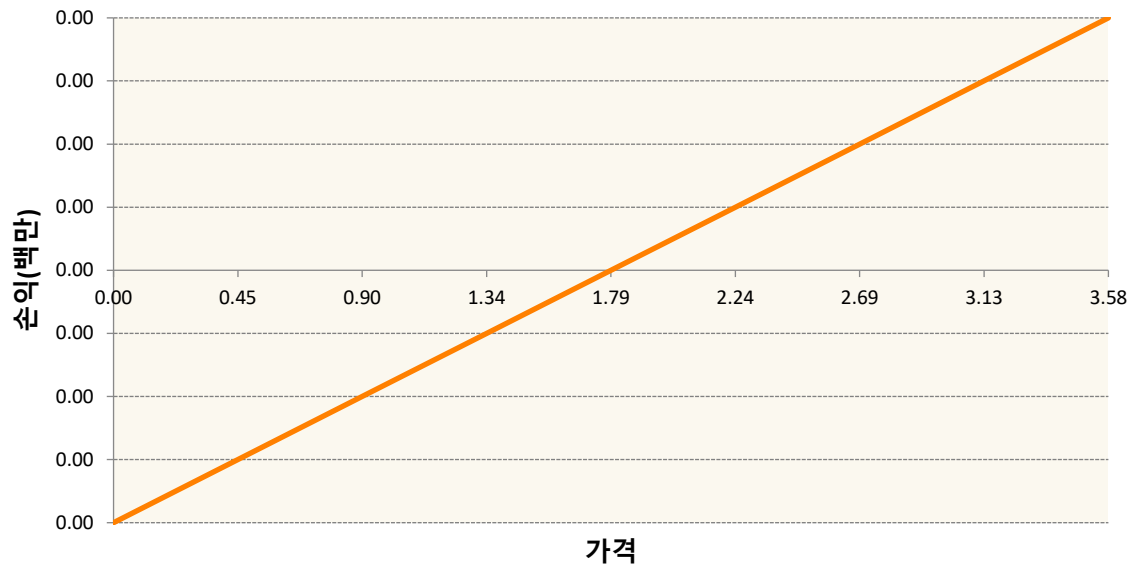
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



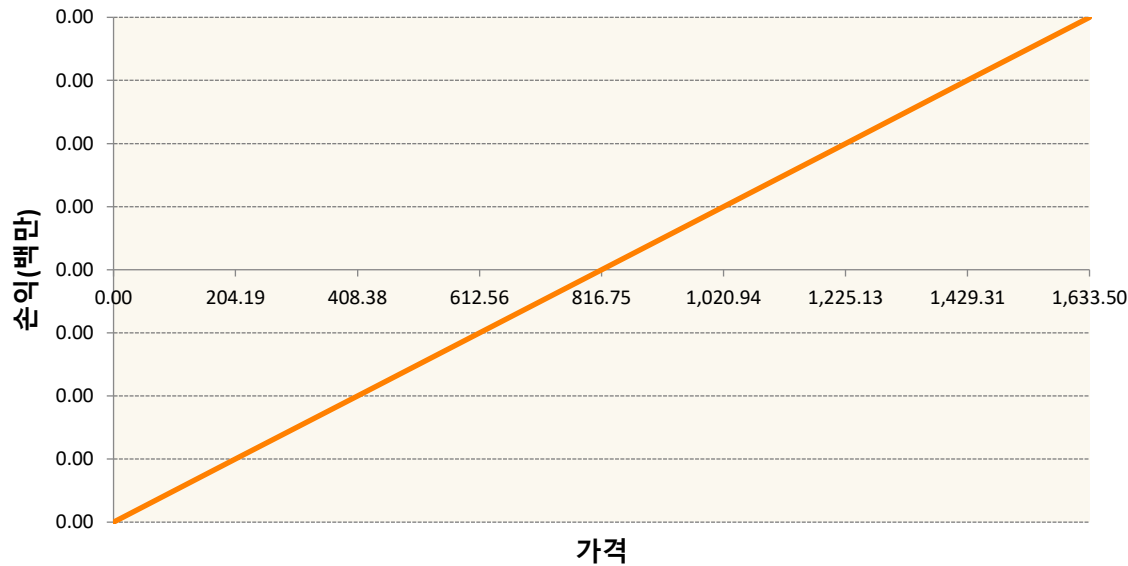
KR4175V40008-2024-04 달러선물



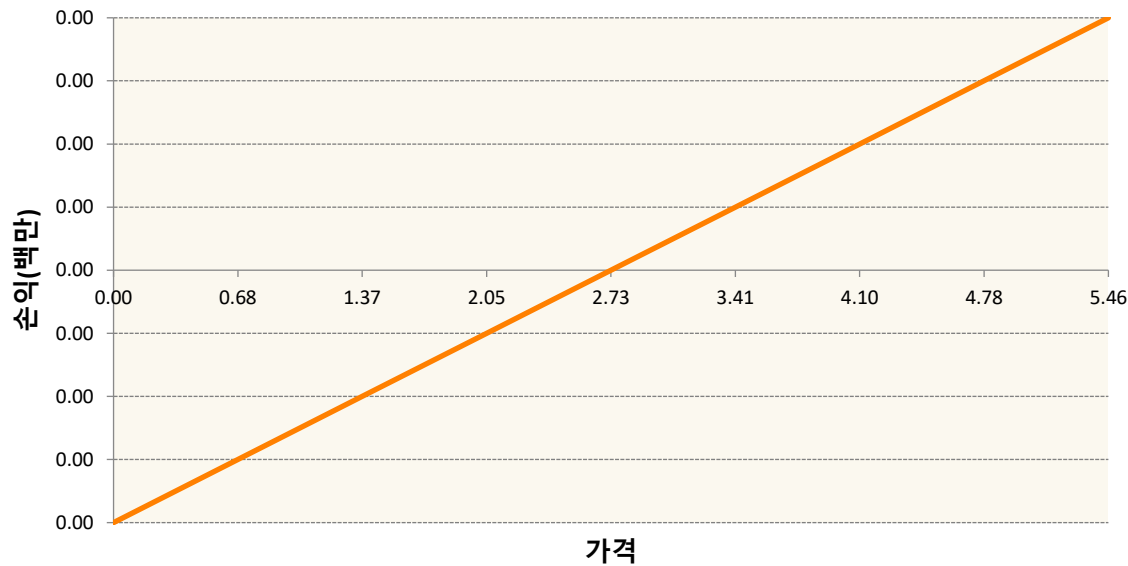
NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



QSK4-Low Su Gasoil G May 24



XBK4-GASOLINE RBOB FUT May 24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|                         |                          |    |
|-------------------------|--------------------------|----|
| CLK4                    | WTI CRUDE FUTURE May 24  | 18 |
| CON4                    | BRENT CRUDE FUTR Jul24   | 27 |
| ECK4                    | E-mini Crude Oil May 24  | 4  |
| HOK4                    | NY Harb ULSD Fut May 24  | 12 |
| KR4175V400 2024-04 달러선물 |                          | 18 |
| NGK24                   | NATURAL GAS FUTR May 24  | 13 |
| QSK4                    | Low Su Gasoil G May 24   | 9  |
| XBK4                    | GASOLINE RBOB FUT May 24 | 12 |

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

214