

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

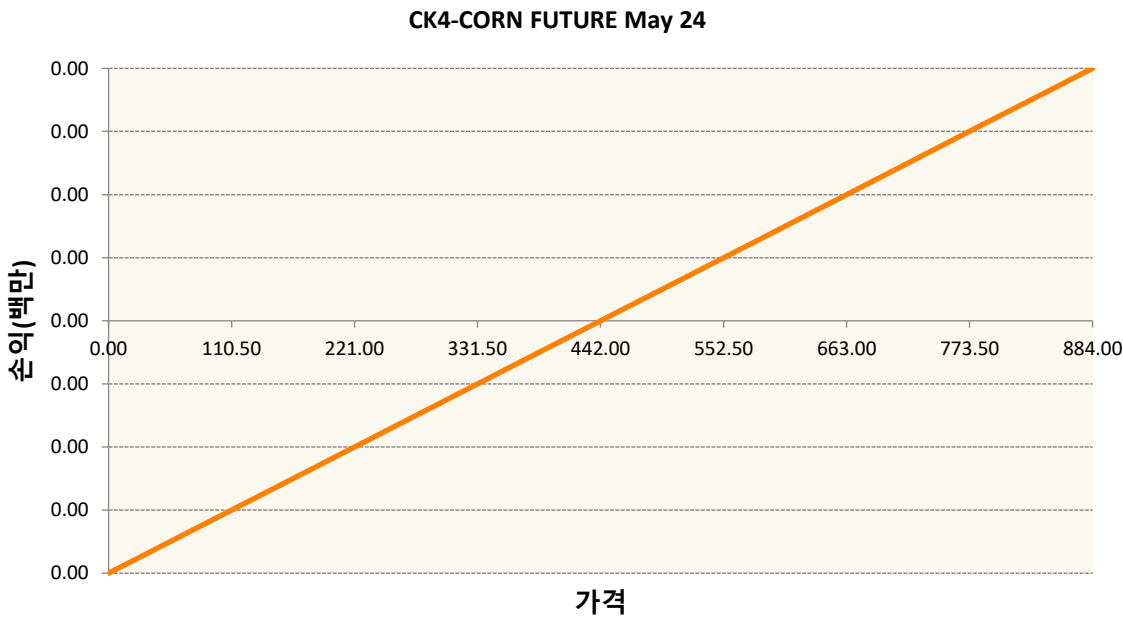
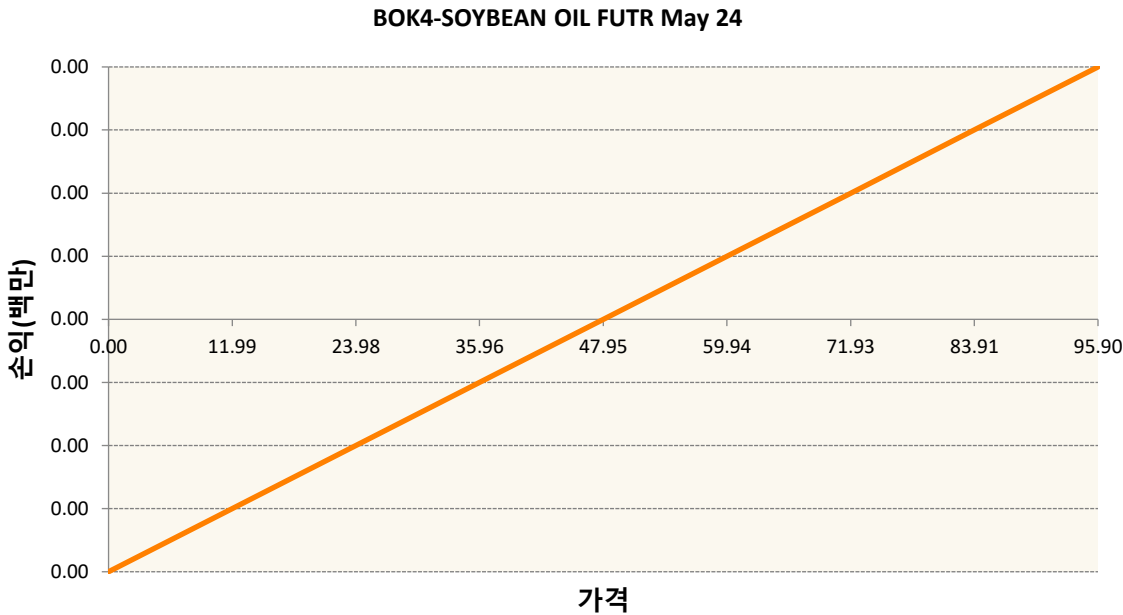
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

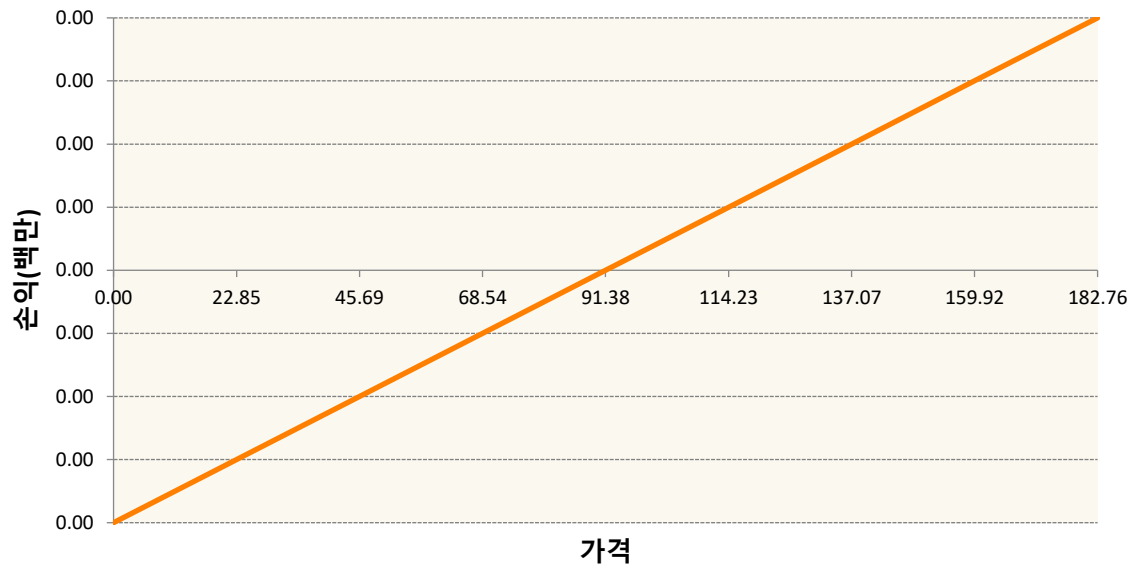
(단위:USD 백만)

| 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   | 4,339 | 0     | 4,339     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 525   | -525      | 장내 |

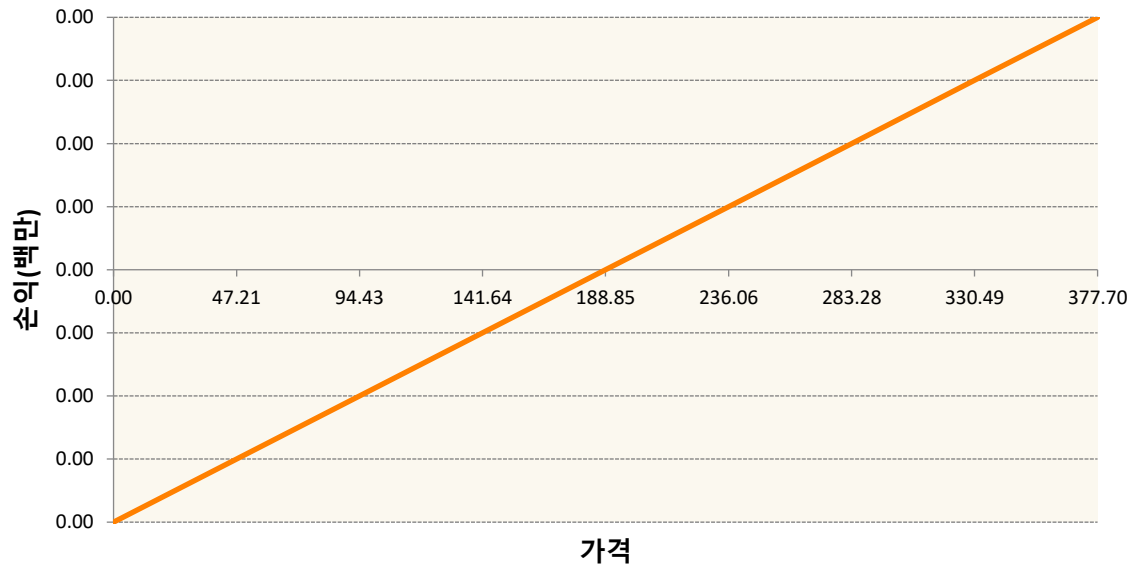
2. 만기시점의 손익구조



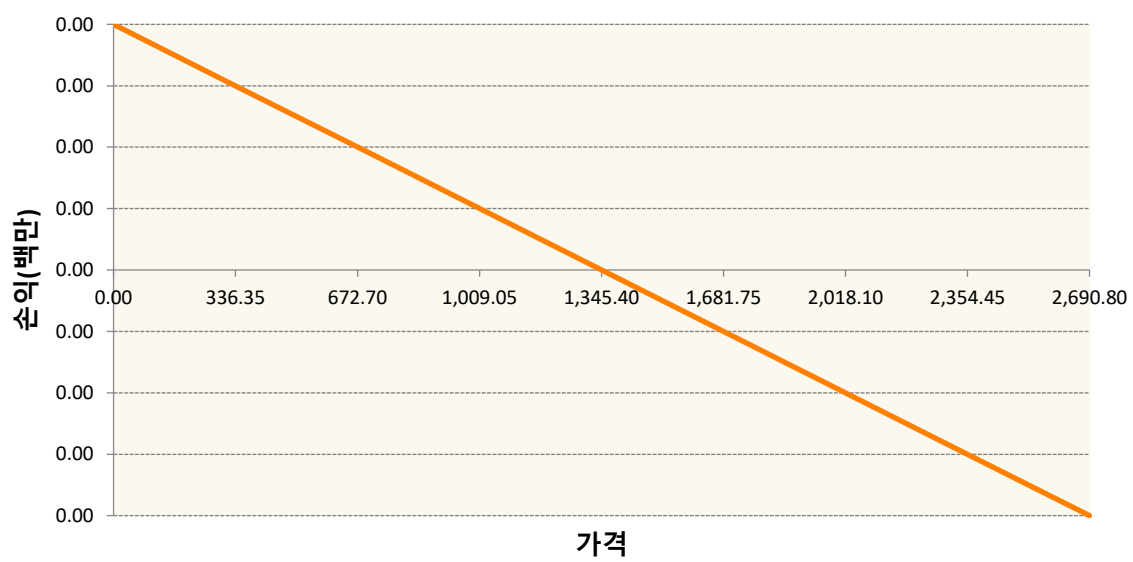
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



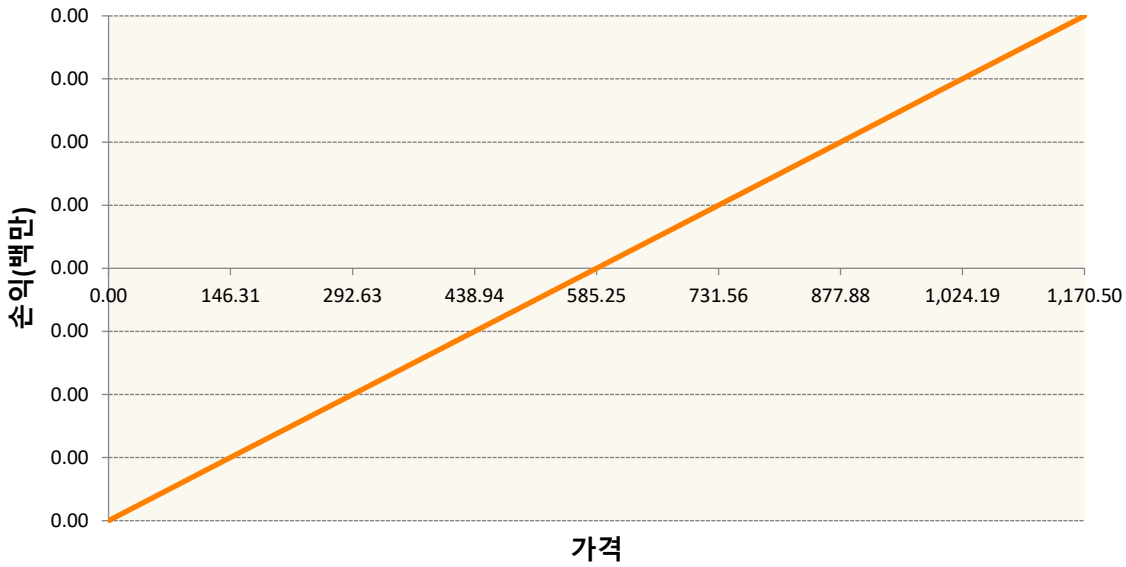
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



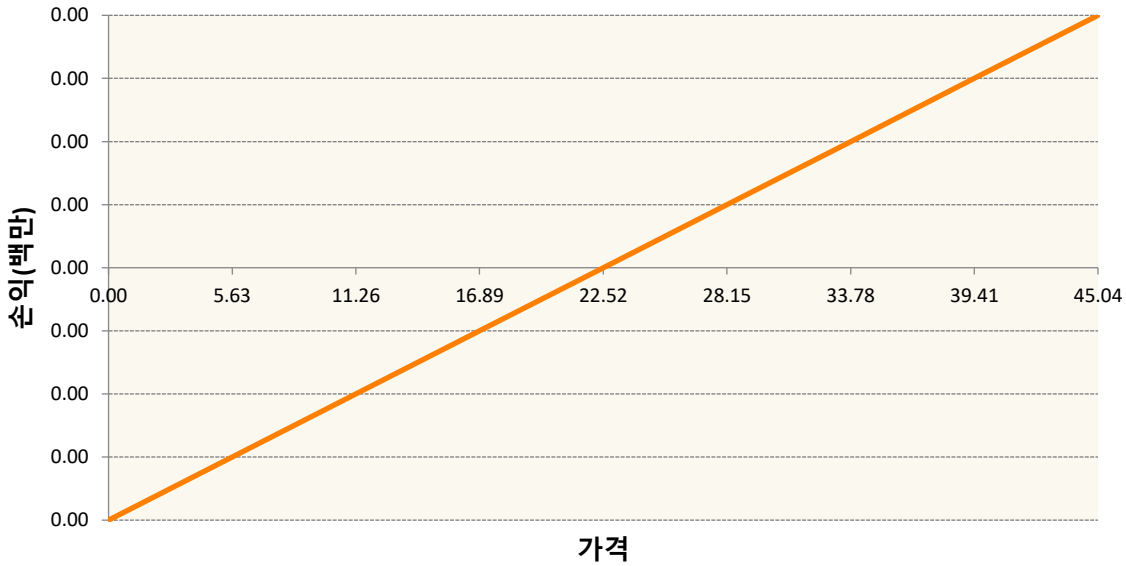
KR4175V40008-2024-04 달러선물



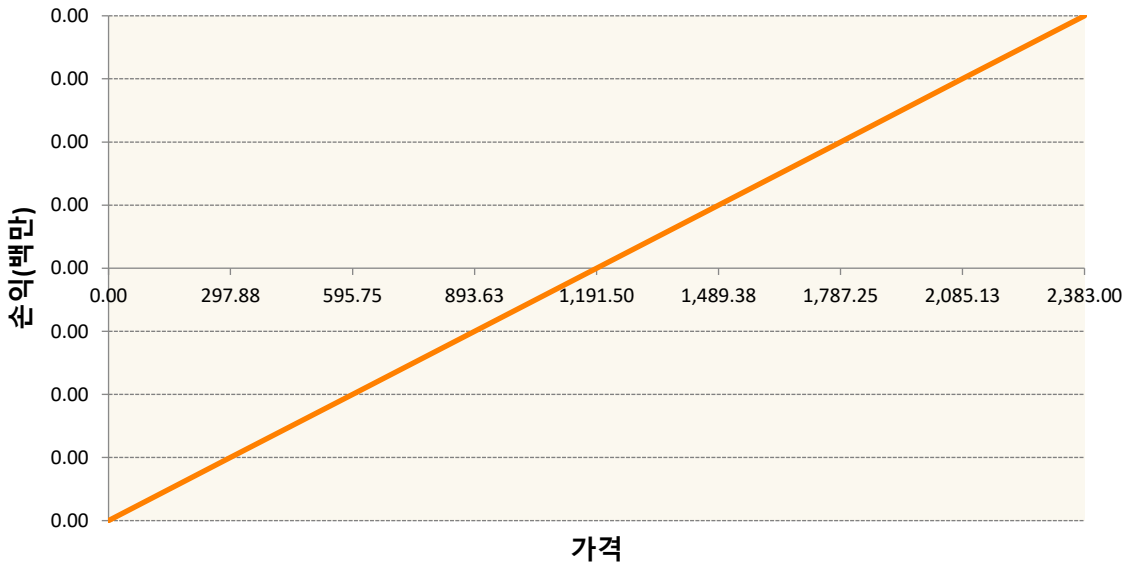
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



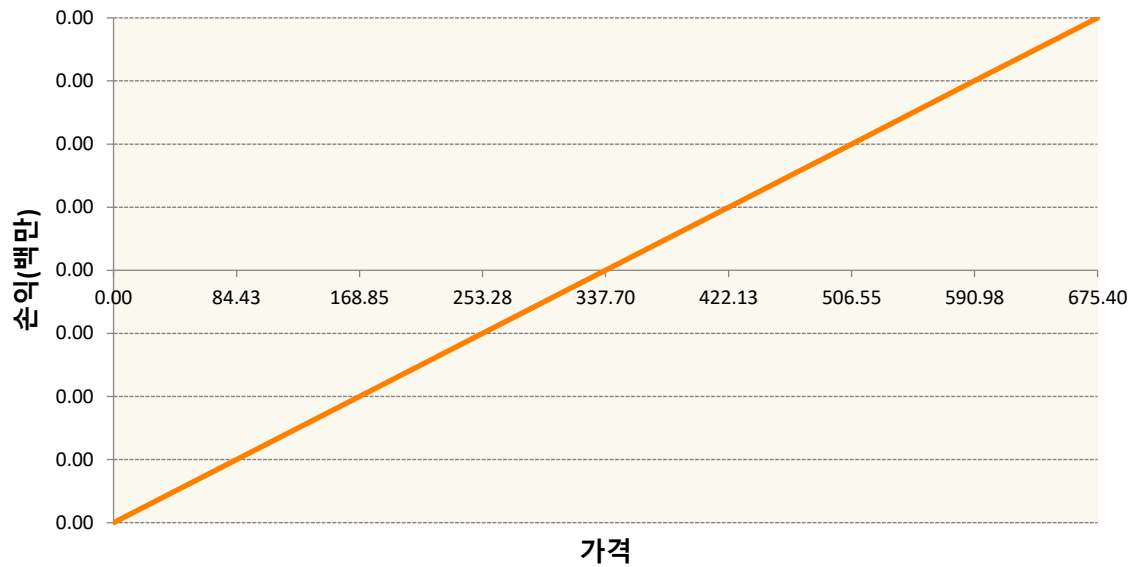
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



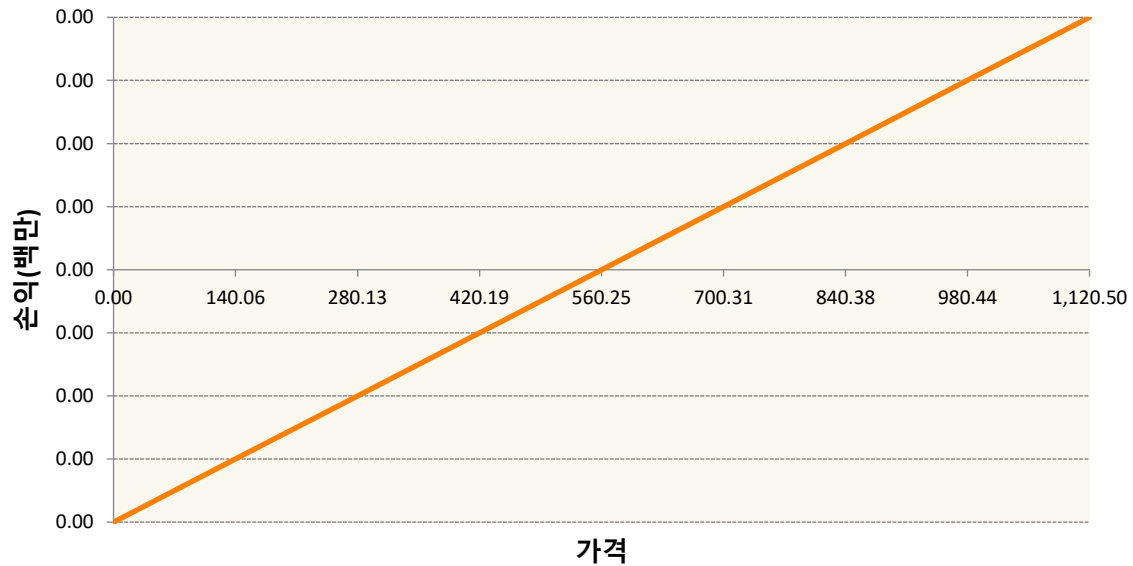
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



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 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

스마트인덱스모

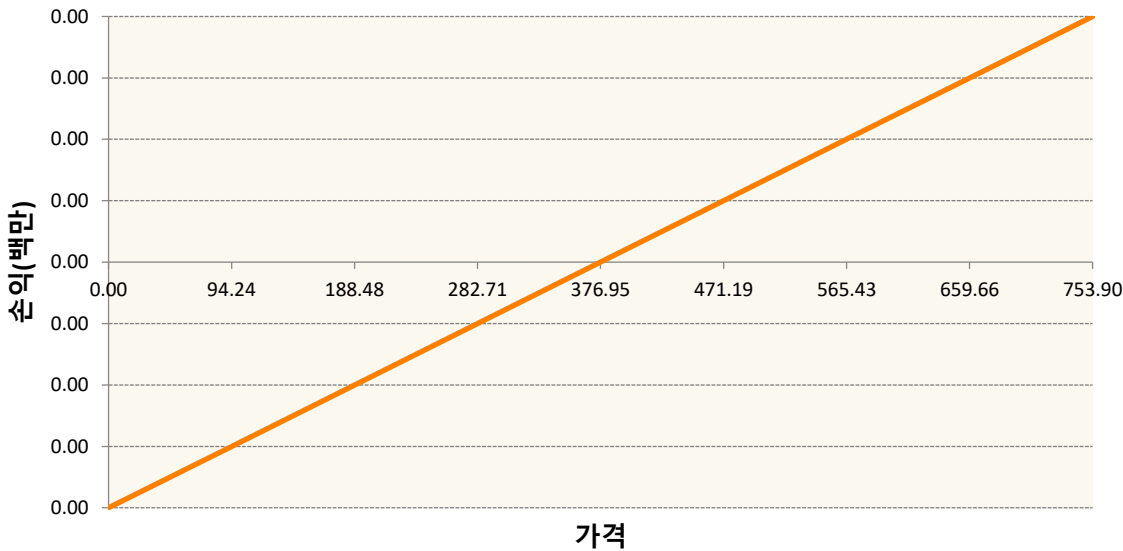
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,696 | 0     | 1,696     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           | 2024-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 135    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -135      | -135               | -135   | -135 | -135  | -135   | -135   |
| -5.33%       | -90       | -90                | -90    | -90  | -90   | -90    | -90    |
| -2.67%       | -45       | -45                | -45    | -45  | -45   | -45    | -45    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 45        | 45                 | 45     | 45   | 45    | 45     | 45     |
| 5.33%        | 90        | 90                 | 90     | 90   | 90    | 90     | 90     |
| 8.00%        | 135       | 135                | 135    | 135  | 135   | 135    | 135    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

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 | 260 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 303 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

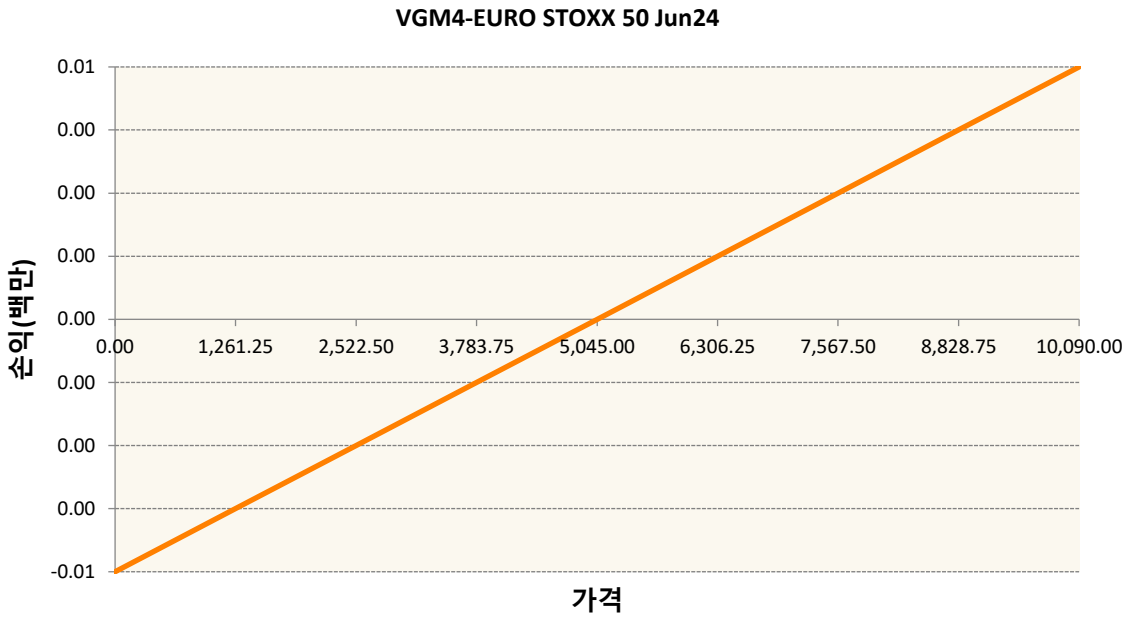
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,013 | 0     | 1,013     |    |
| 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     | 81 |

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

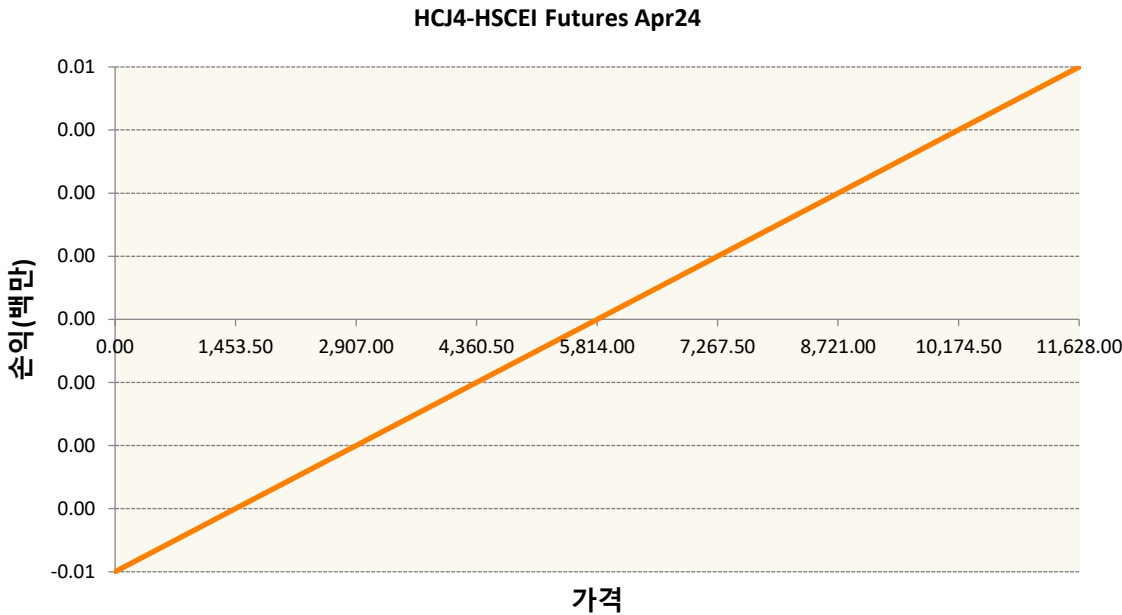
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,195 | 0     | 1,195     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| HCI4 | HSCEI Futures Apr24 | 96 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

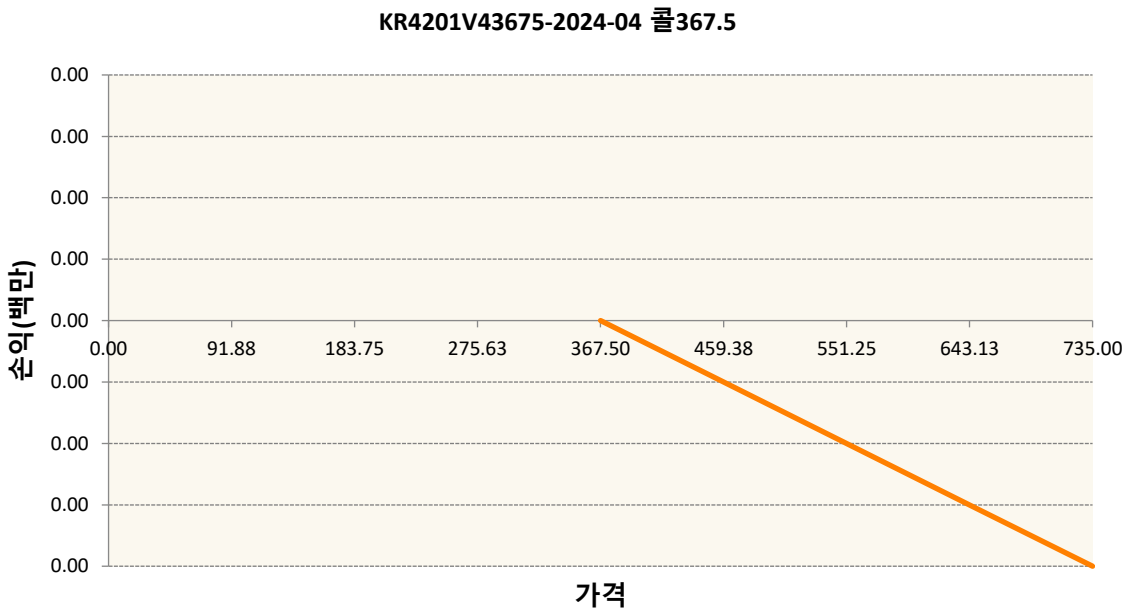
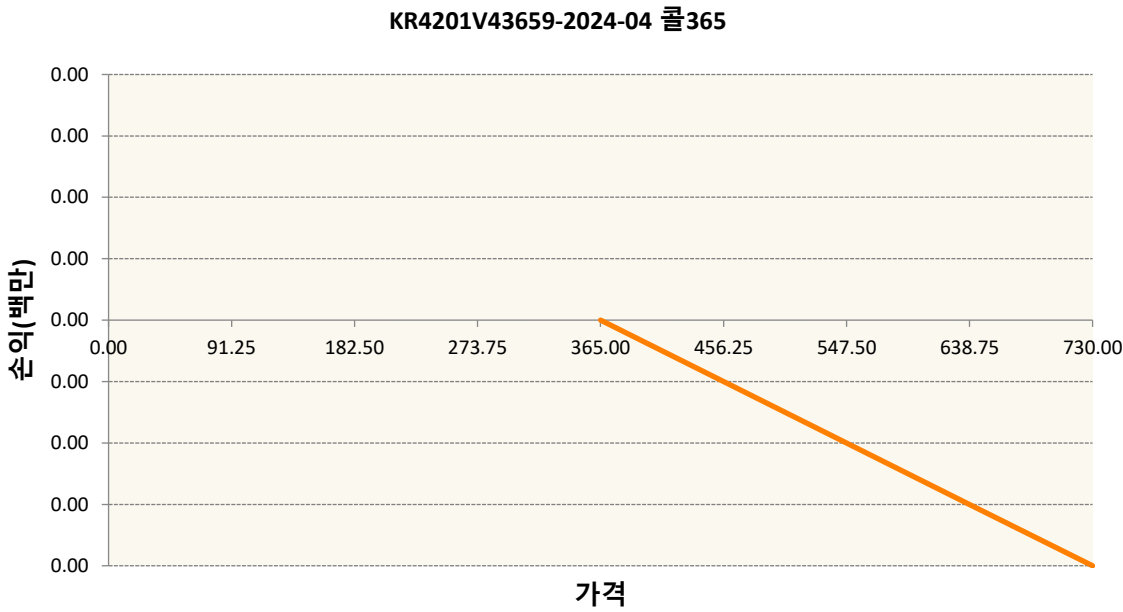
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

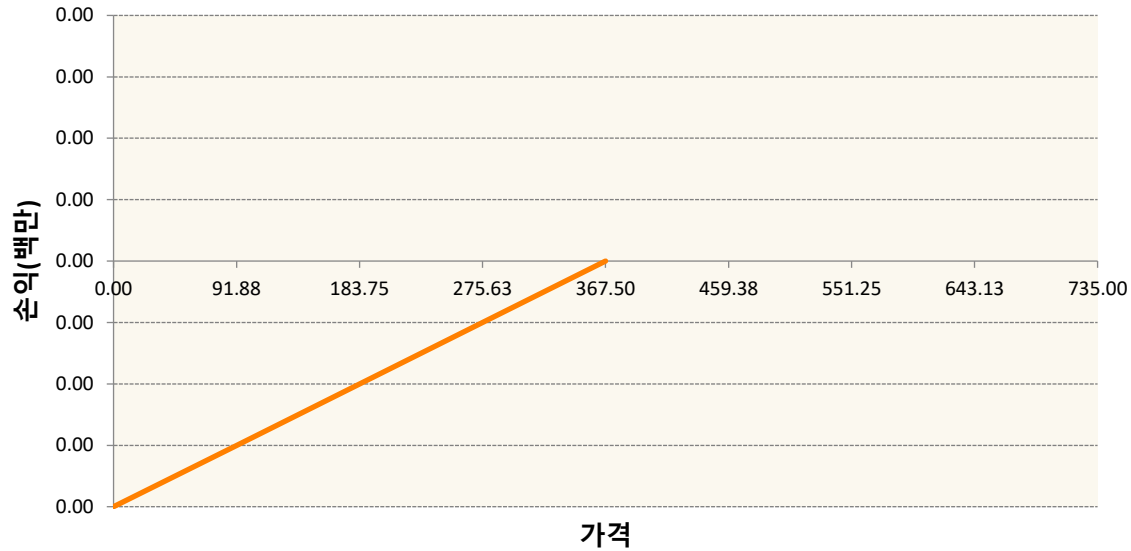
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301V43673-2024-04 풋367.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201V43659 |           |         | 2024-04 콜365   |        |        |        | 1,170  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 451       | 450     | 448            | 446    | 442    | 438    | 434    |
| -5.33%       | 433       | 425     | 416            | 406    | 396    | 385    | 373    |
| -2.67%       | 316       | 301     | 285            | 270    | 255    | 239    | 224    |
| 0%           | 29        | 20      | 11             | 0      | -11    | -23    | -35    |
| 2.67%        | -357      | -358    | -361           | -364   | -368   | -373   | -379   |
| 5.33%        | -762      | -762    | -762           | -763   | -764   | -765   | -767   |
| 8.00%        | -1,169    | -1,169  | -1,169         | -1,169 | -1,169 | -1,169 | -1,170 |
| KR4201V43675 |           |         | 2024-04 콜367.5 |        |        |        | 1,842  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 601       | 600     | 598            | 596    | 592    | 587    | 581    |
| -5.33%       | 585       | 576     | 565            | 553    | 539    | 524    | 508    |
| -2.67%       | 454       | 430     | 406            | 382    | 357    | 333    | 308    |
| 0%           | 58        | 40      | 20             | 0      | -21    | -43    | -65    |
| 2.67%        | -538      | -542    | -549           | -556   | -566   | -577   | -589   |
| 5.33%        | -1,187    | -1,187  | -1,188         | -1,189 | -1,192 | -1,195 | -1,199 |
| 8.00%        | -1,840    | -1,840  | -1,840         | -1,841 | -1,841 | -1,841 | -1,842 |
| KR4301V43673 |           |         | 2024-04 풋367.5 |        |        |        | 474    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -468      | -468    | -468           | -469   | -471   | -472   | -474   |
| -5.33%       | -248      | -251    | -255           | -259   | -264   | -269   | -275   |
| -2.67%       | -69       | -77     | -85            | -94    | -102   | -110   | -119   |
| 0%           | 20        | 14      | 7              | 0      | -7     | -15    | -22    |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 2.67% | 40 | 38 | 36 | 34 | 30 | 27 | 22 |
| 5.33% | 42 | 42 | 41 | 41 | 40 | 39 | 37 |
| 8.00% | 42 | 42 | 42 | 42 | 42 | 41 | 41 |

|                                        |          |
|----------------------------------------|----------|
| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|                                        | 4,004    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

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 | 1,749 | 0     | 1,749     |    |

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 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

## 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 | 4,571 | 0     | 4,571     |    |

### 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 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

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 | 15,911 | 0      | 15,911    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 15,607 | -15,607   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |                                 |
|------------------------------|---------------------------------|
| FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E  | 252                             |
| FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E | 582                             |
| FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E | 415                             |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

590

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

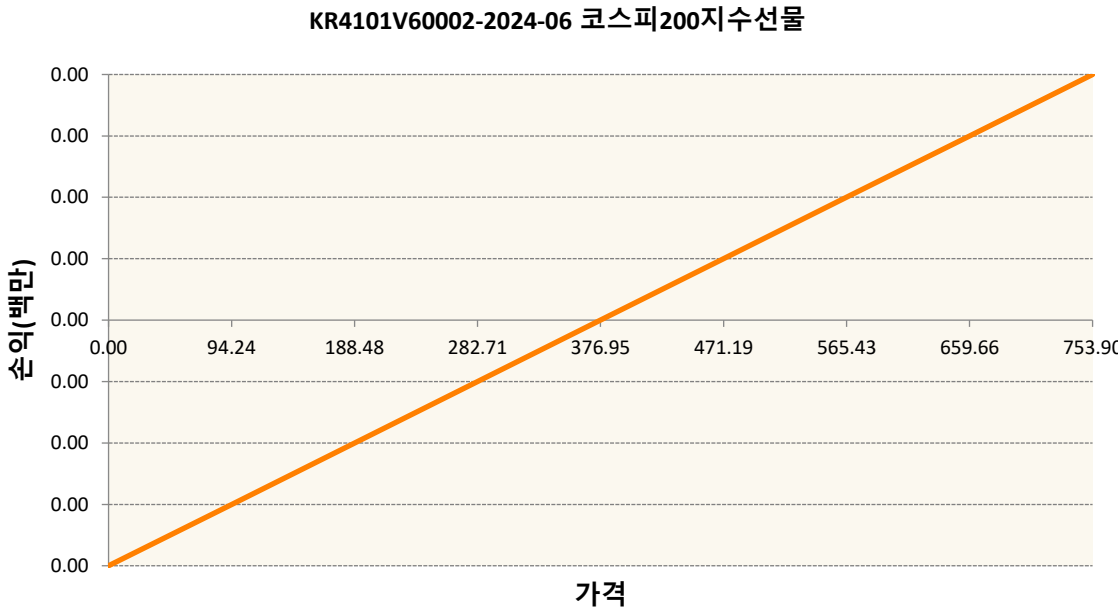
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 565   | 0     | 565       | 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 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

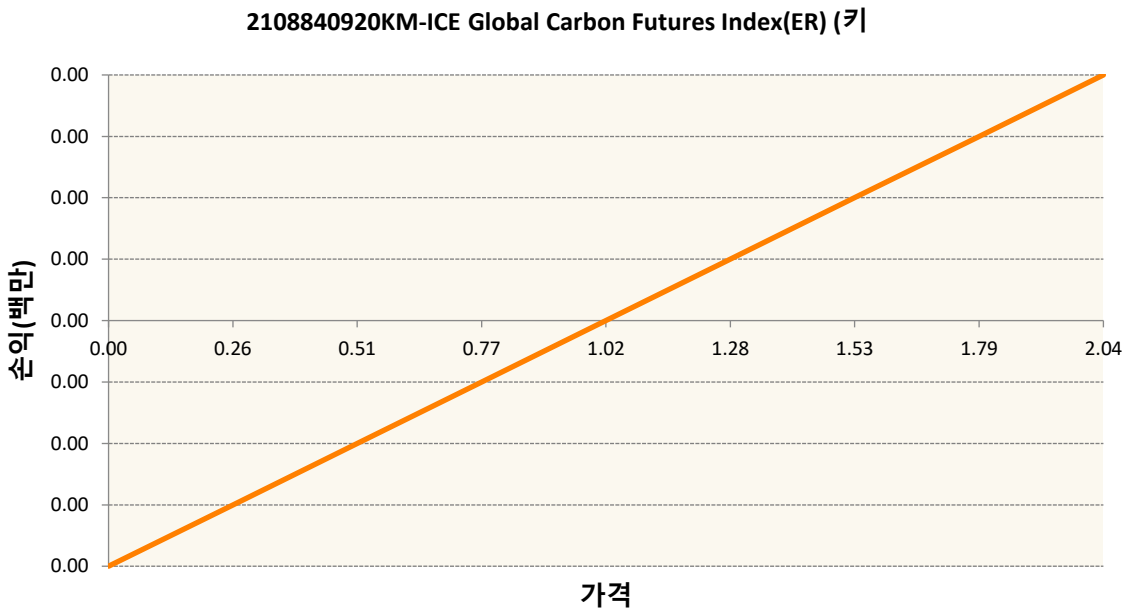
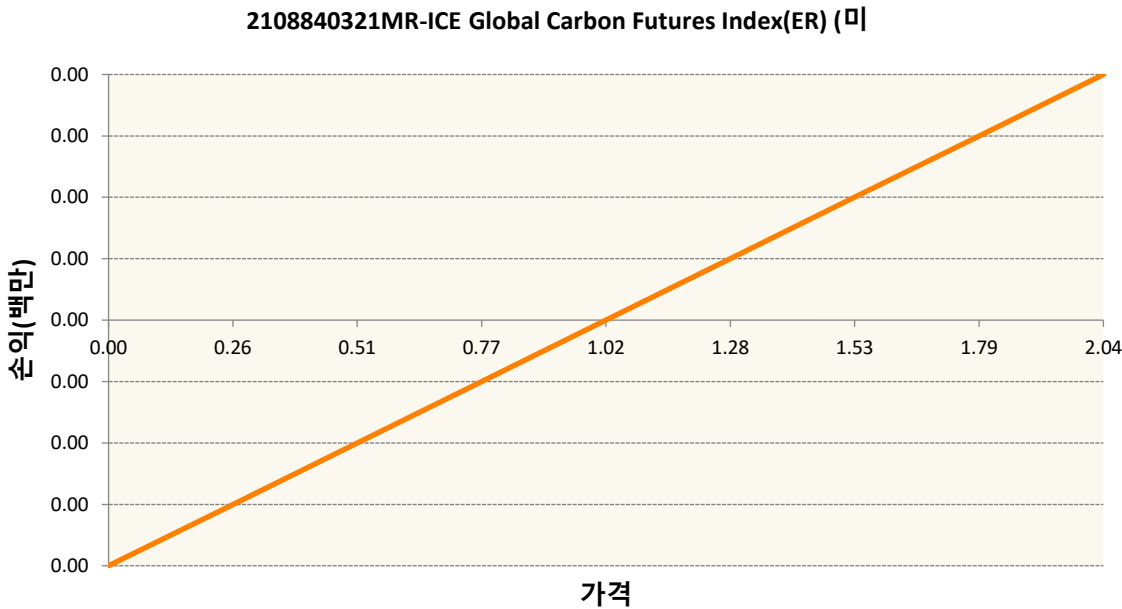
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

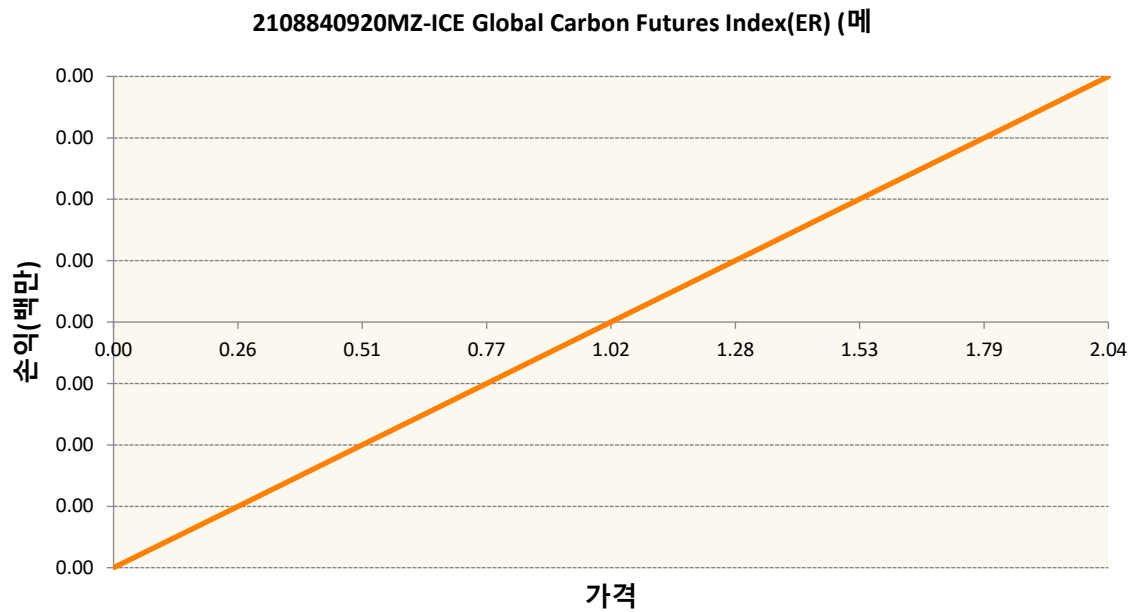
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 18,809 | 0     | 18,809    |    |

2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 445      |
| 2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키 |  | 889      |
| 2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 178      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 1,775    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

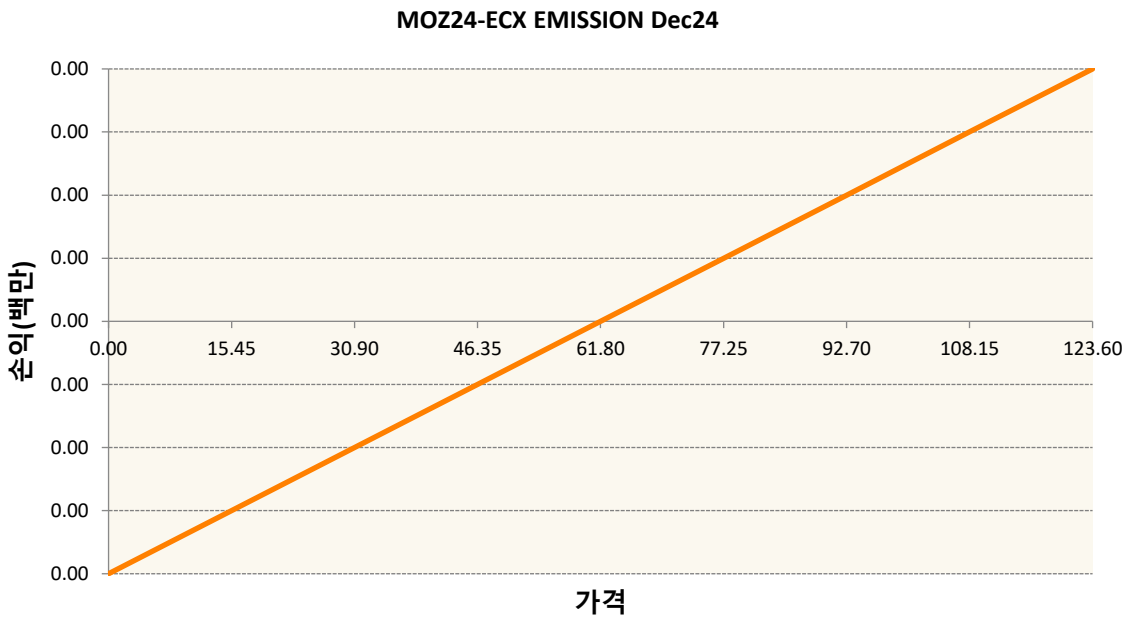
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 9,240 | 0     | 9,240     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 331   | 0     | 331       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,576 | -2,576    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |      |
|----------------------------------------------------|------|
| FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E                       | 61   |
| FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E                       | 145  |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 739  |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 0.41 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,402 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

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)  | 7 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠) | 7 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)  | 5 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)  | 5 |

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

(단위:백만원)

33

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

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)  | 9  |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(NH)  | 7  |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(메리츠) | 10 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 2  |

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

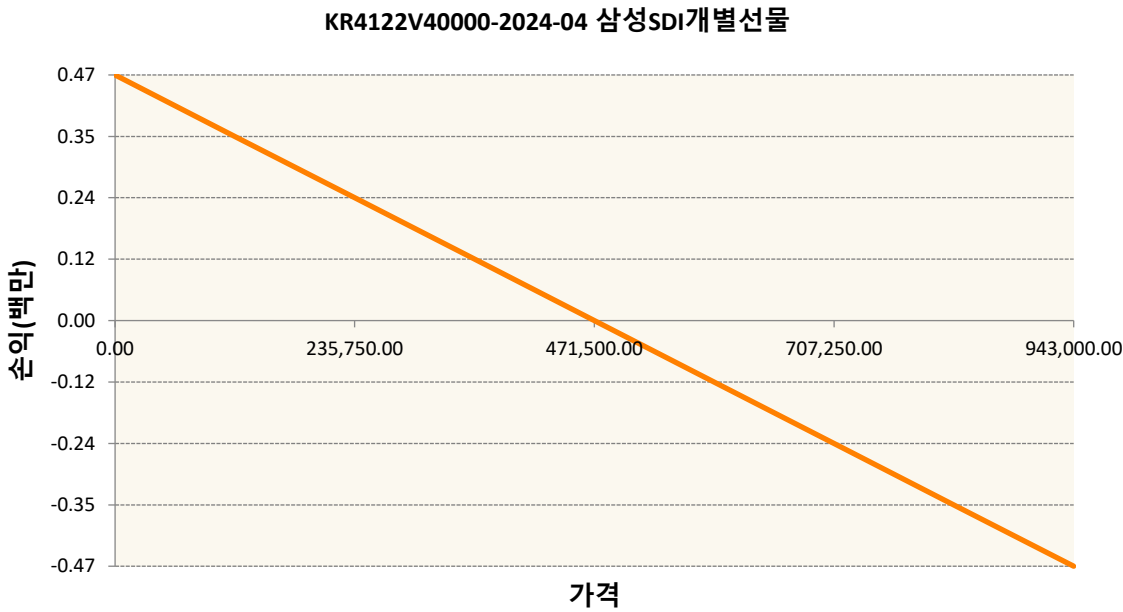
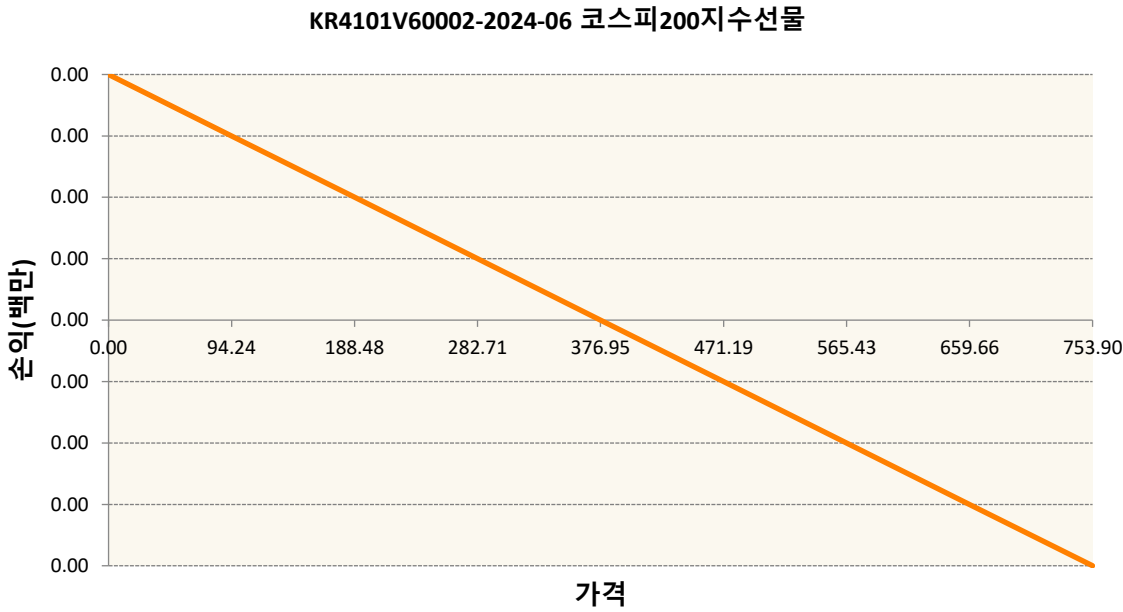
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

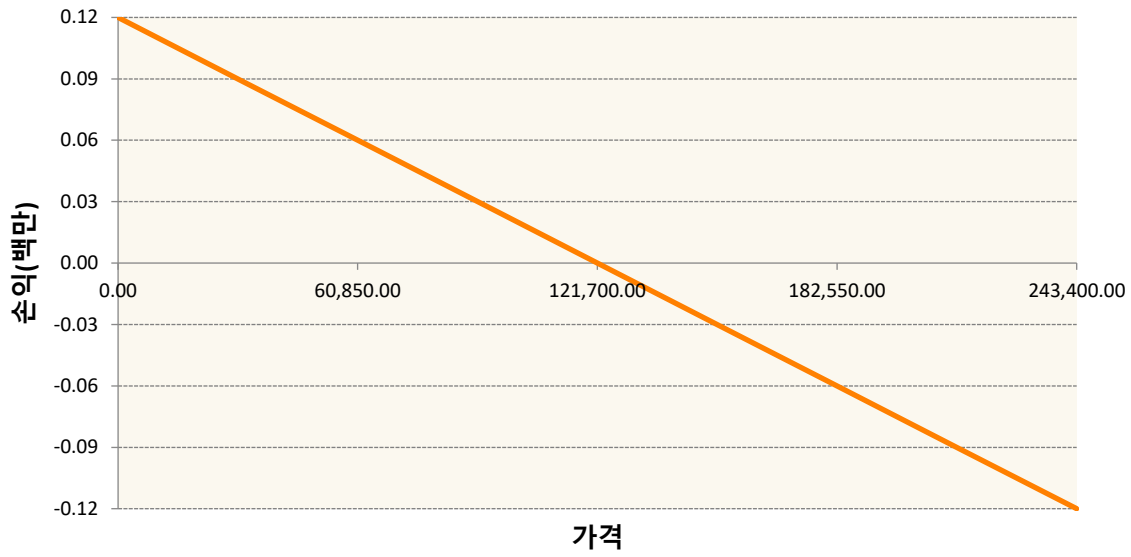
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 12    | 46    | -34       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 25    | 1,049 | -1,024    | 장내 |

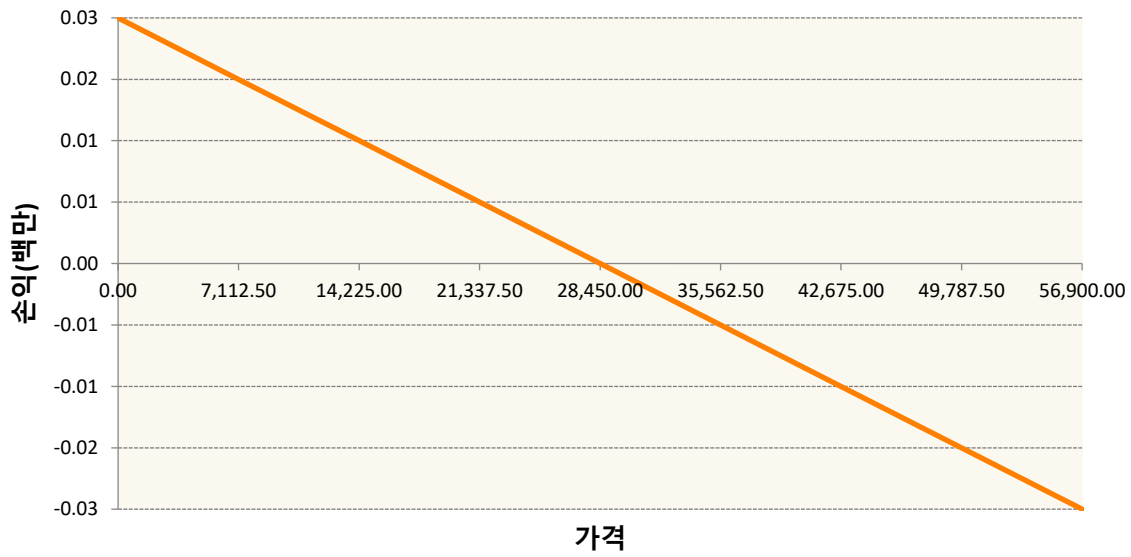
2. 만기시점의 손익구조



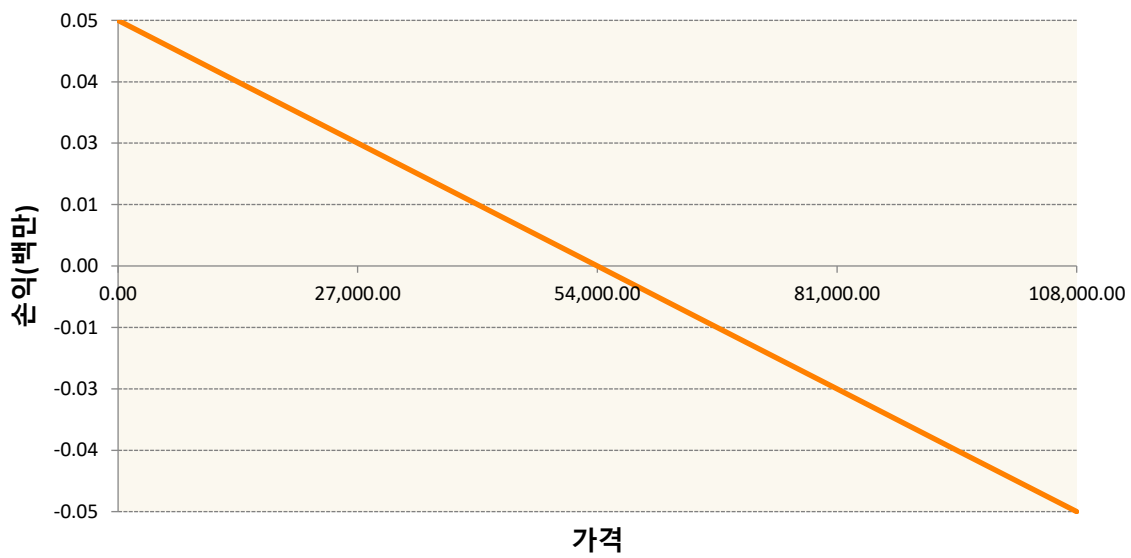
KR41C6V40000-2024-04 아모레퍼시픽개별선물



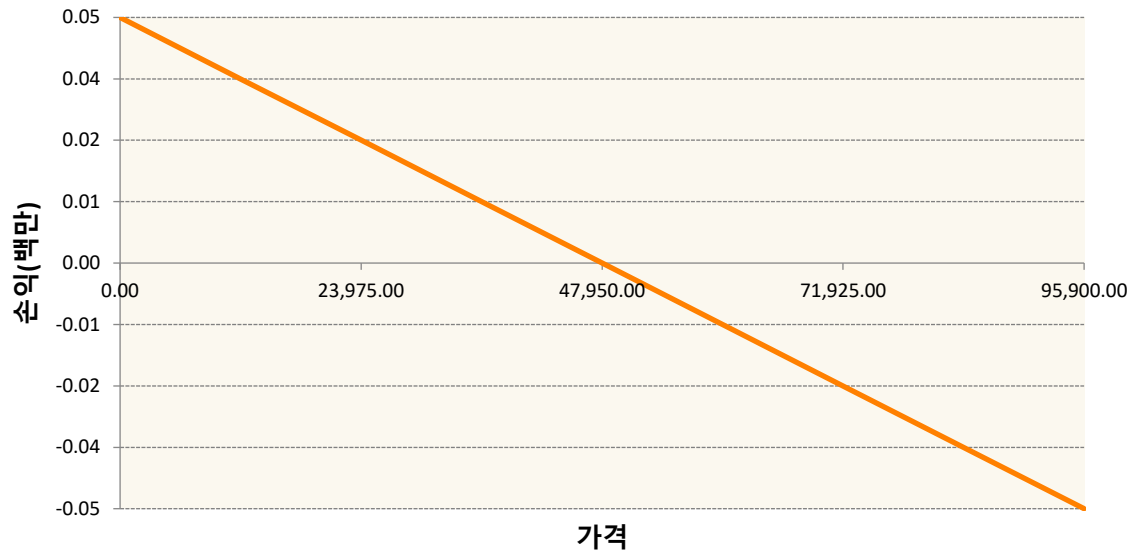
KR41CBV40008-2024-04 한화솔루션개별선물



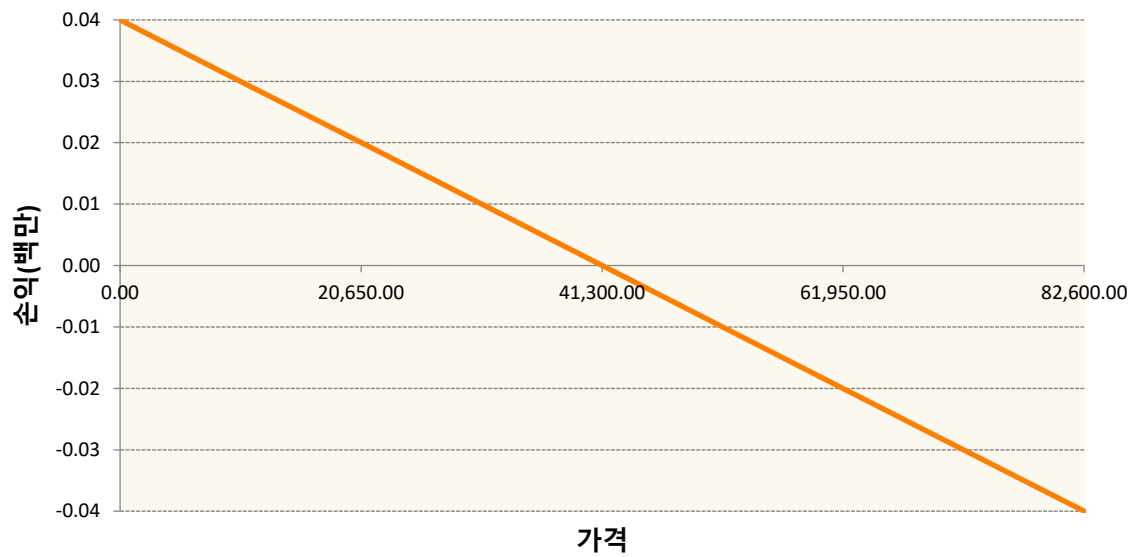
KR41CFV40009-2024-04 카카오개별선물



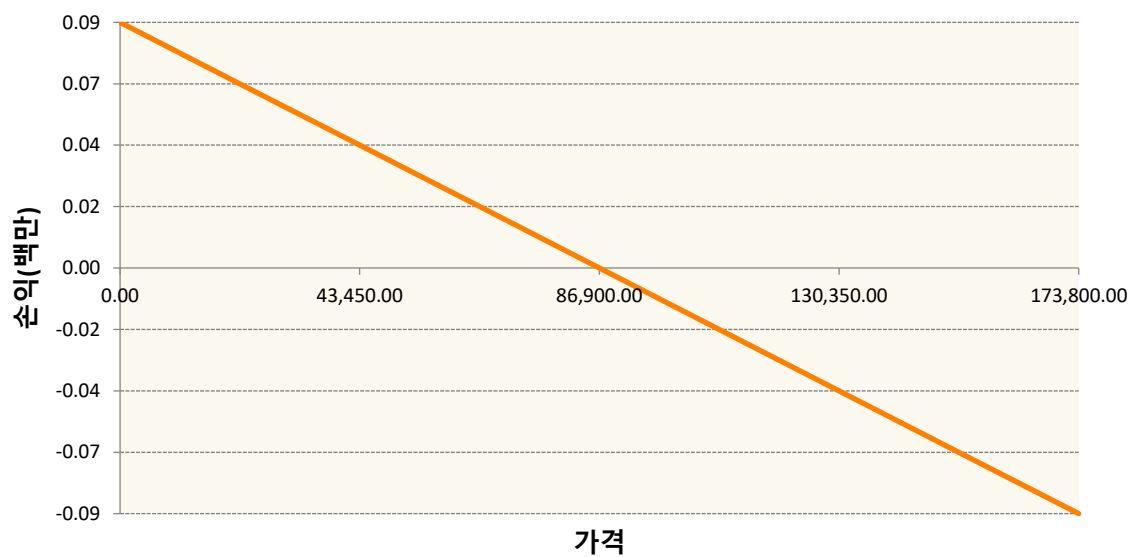
KR41CNV40003-2024-04 포스코DX개별선물



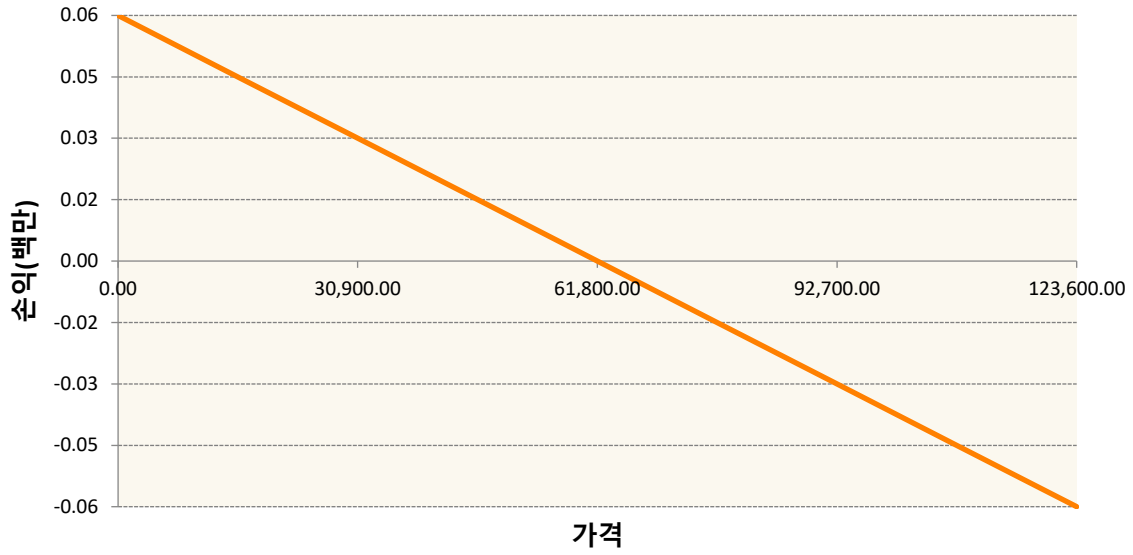
KR41E0V40001-2024-04 원익IPS개별선물



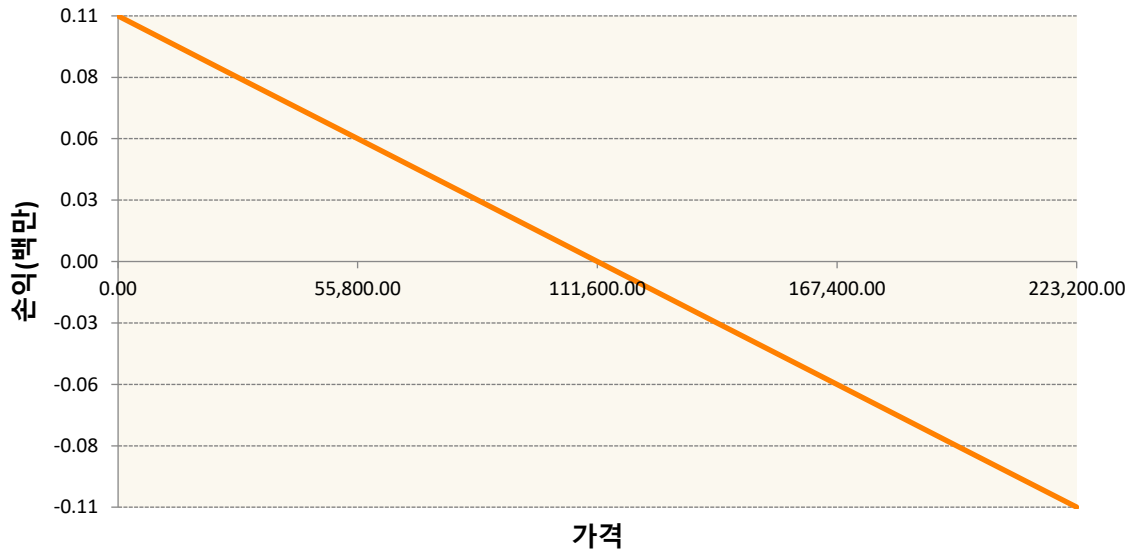
KR41E4V40003-2024-04 에스엠개별선물



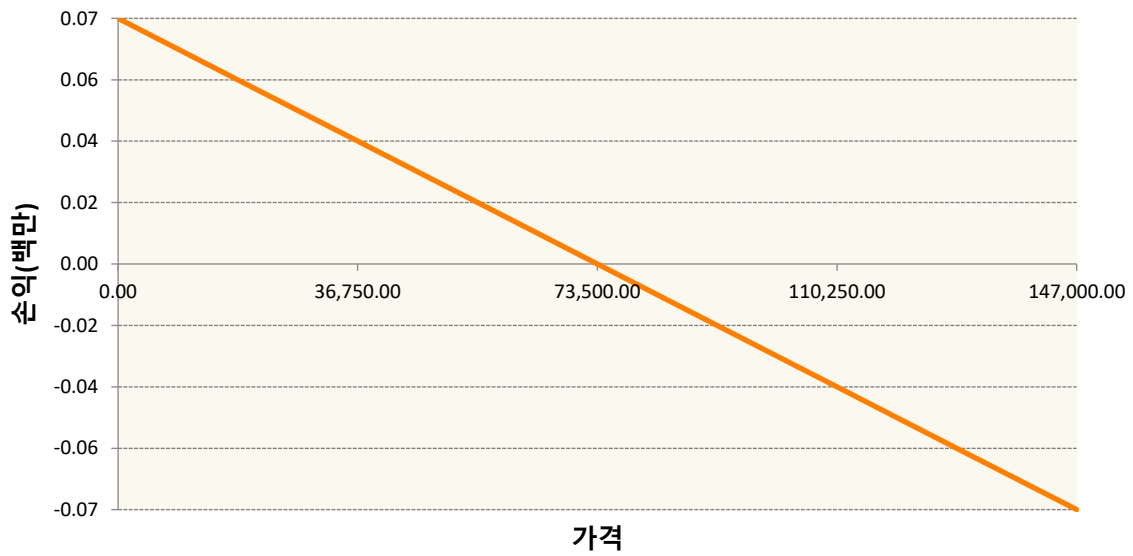
KR41E5V40000-2024-04 넷마블개별선물



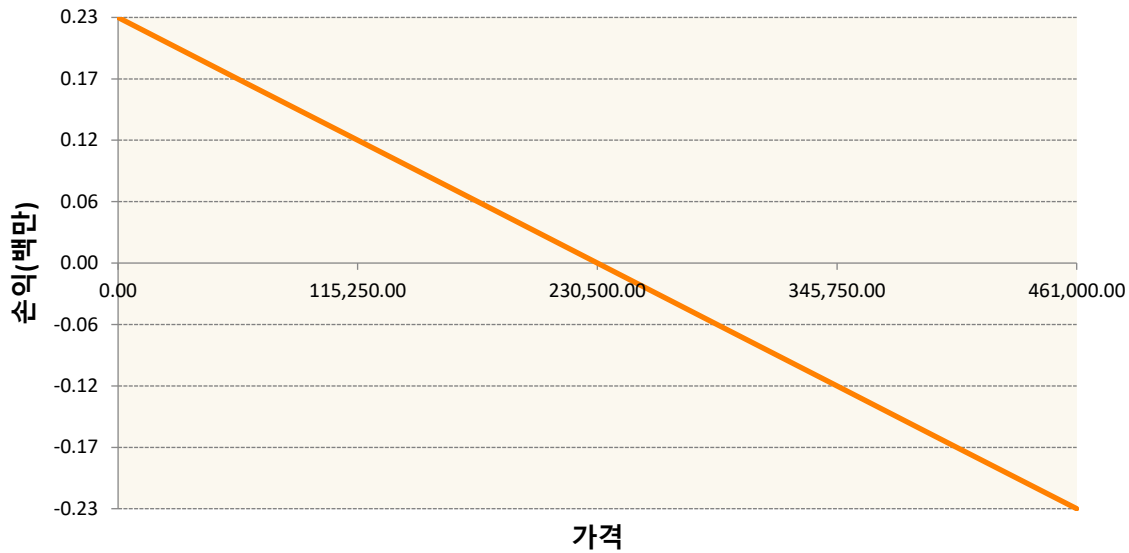
KR41EJV40007-2024-04 SKC개별선물



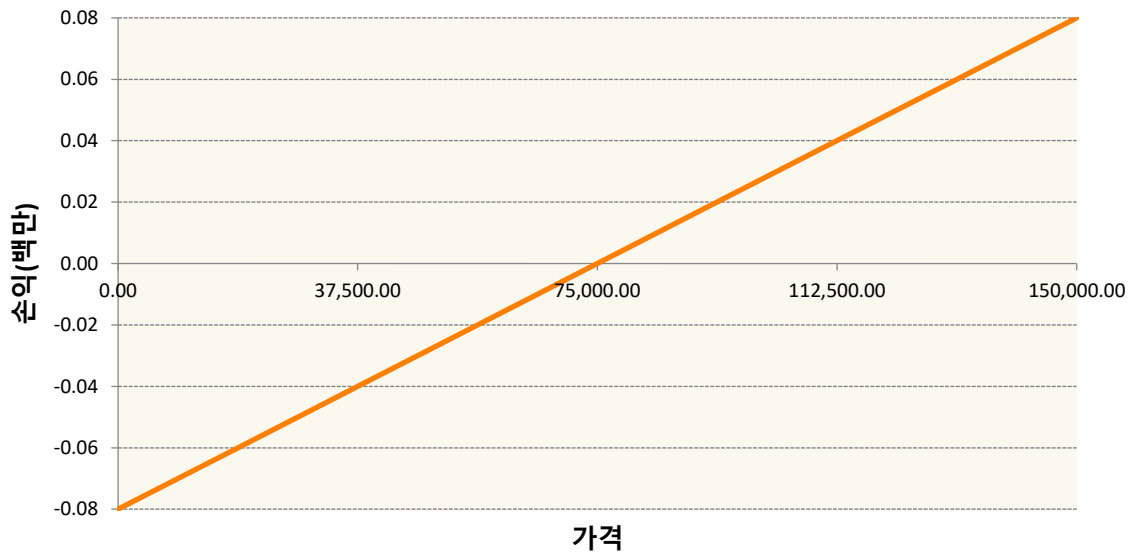
KR41FBV40001-2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물



KR41FCV40009-2024-04 하이브개별선물



KR41G9V40000-2024-04 레고캠바이오개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                   |      |
|-----------------------------------|------|
| KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물     | 45   |
| KR4122V400 2024-04 삼성SDI개별선물      | 1    |
| KR41C6V400 2024-04 아모레퍼시픽개별선물     | 26   |
| KR41CBV400 2024-04 한화솔루션개별선물      | 0.41 |
| KR41CFV400 2024-04 카카오개별선물        | 1    |
| KR41CNV400 2024-04 포스코DX개별선물      | 1    |
| KR41E0V400 2024-04 원익IPS개별선물      | 1    |
| KR41E4V400 2024-04 에스엠개별선물        | 0.07 |
| KR41E5V400 2024-04 넷마블개별선물        | 1    |
| KR41EJV400 2024-04 SKC개별선물        | 2    |
| KR41FBV400 2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물 | 2    |
| KR41FCV400 2024-04 하이브개별선물        | 3    |

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

(단위:백만원)

143

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

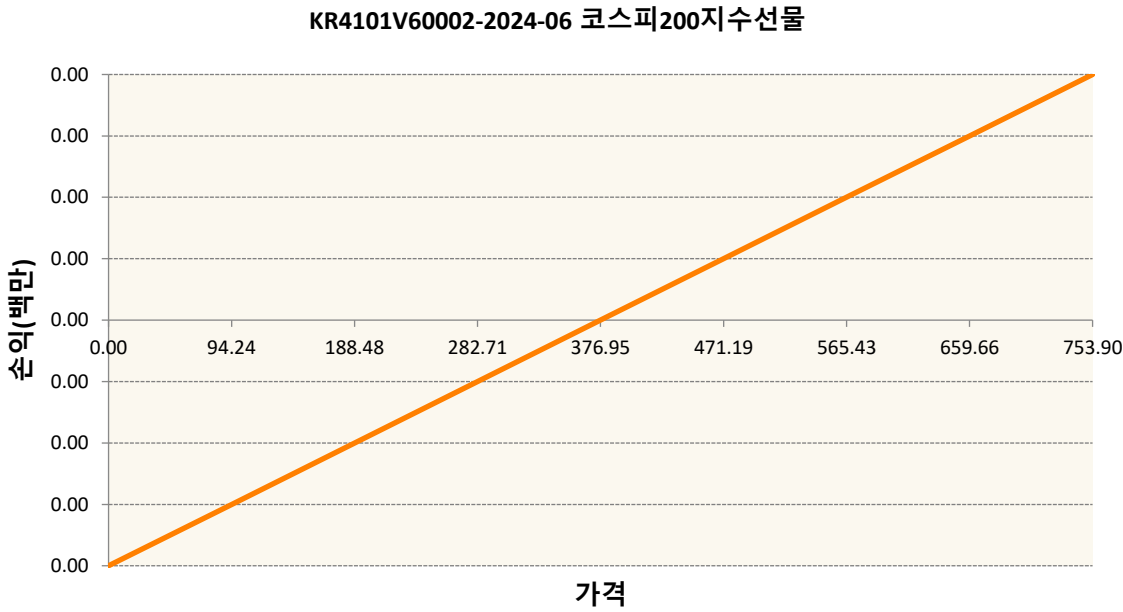
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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   | 2,921 | 0     | 2,921     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           | 2024-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 232    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -232      | -232               | -232   | -232 | -232  | -232   | -232   |
| -5.33%       | -155      | -155               | -155   | -155 | -155  | -155   | -155   |
| -2.67%       | -77       | -77                | -77    | -77  | -77   | -77    | -77    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 77        | 77                 | 77     | 77   | 77    | 77     | 77     |
| 5.33%        | 155       | 155                | 155    | 155  | 155   | 155    | 155    |
| 8.00%        | 232       | 232                | 232    | 232  | 232   | 232    | 232    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

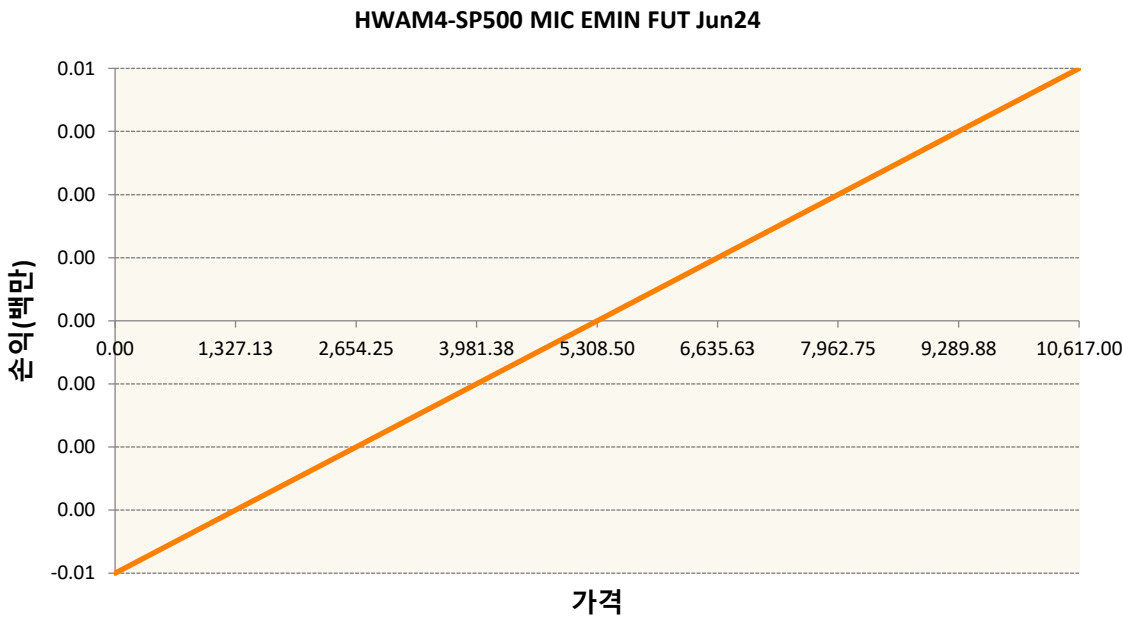
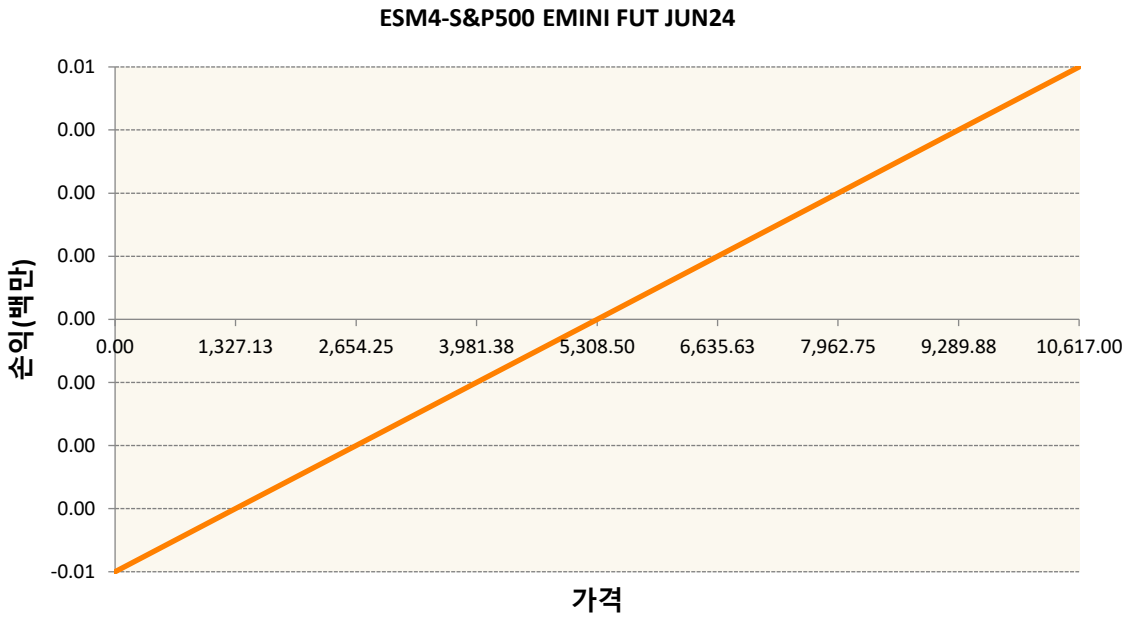
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 4,204 | 0     | 4,204     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,714 | 0     | 1,714     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESM4                      | S&P500 EMINI FUT JUN24   | 336      |
| HWAM4                     | SP500 MIC EMIN FUT Jun24 | 137      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 338      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

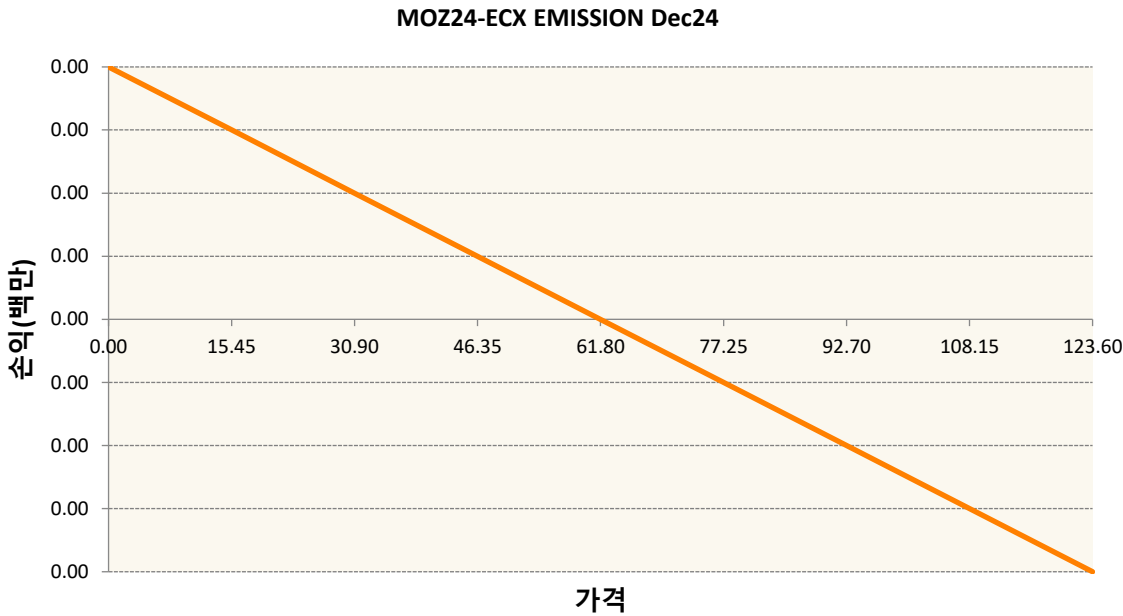
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 5,594 | -5,594    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 331   | 0     | 331       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,100 | -1,100    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |      |
|----------------------------------------------------|------|
| FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E                       | 88   |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 448  |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 0.42 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 827 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

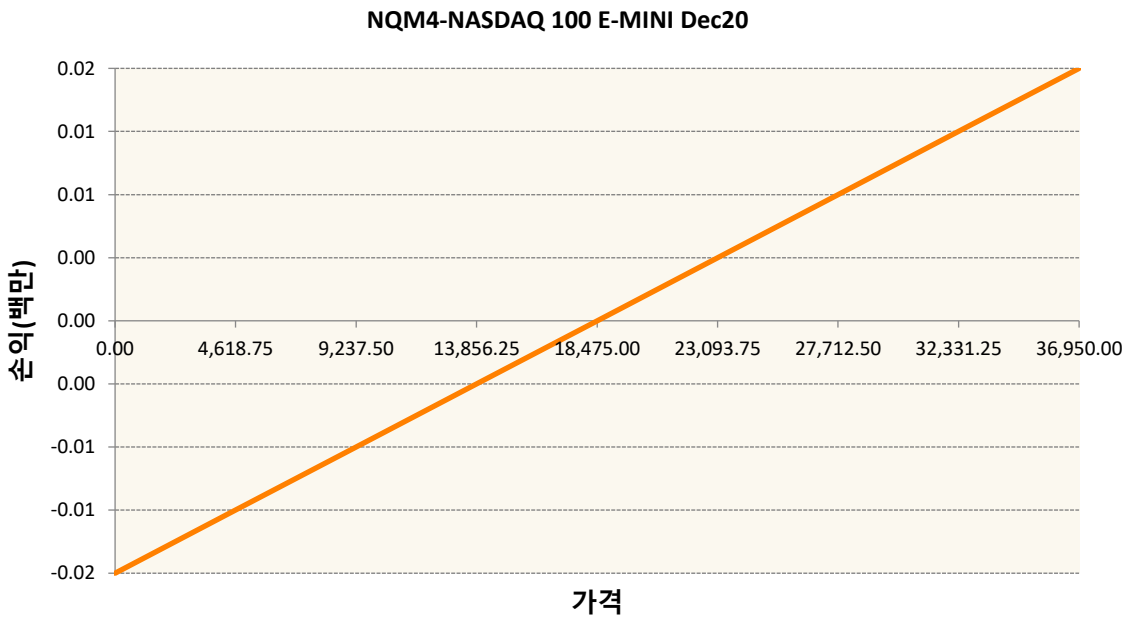
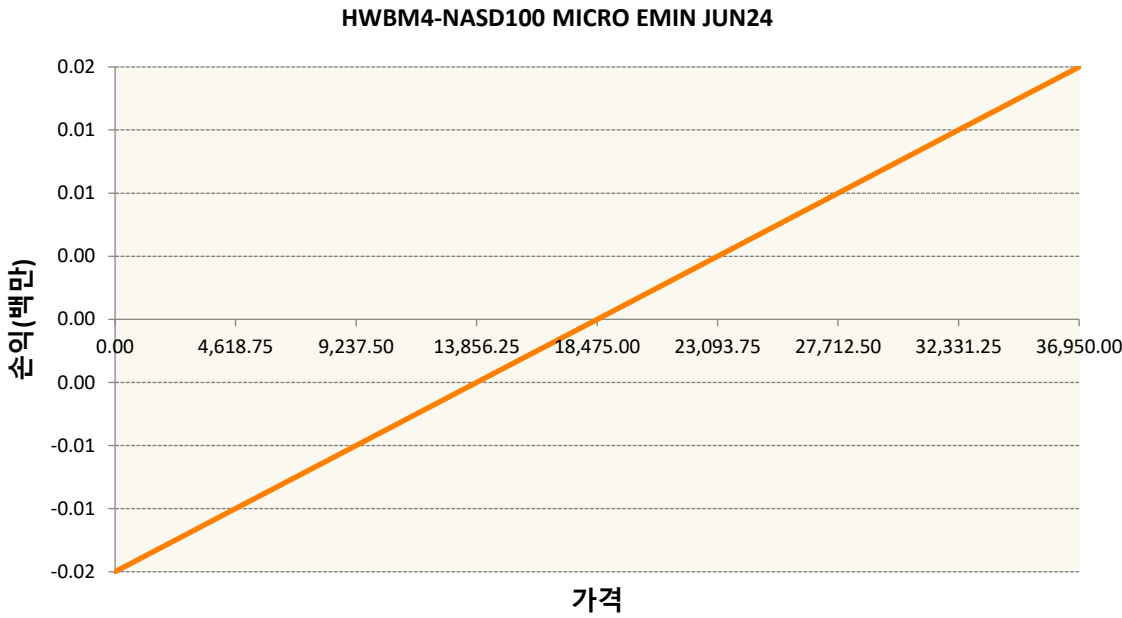
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 2,442 | 0     | 2,442     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,388 | 0     | 2,388     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBM4                     | NASD100 MICRO EMIN JUN24 |  | 191      |
| NQM4                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 195      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 329      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

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   | 106,800 | 0     | 106,800   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |       |
|-----------------------------------------------------|-------|
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 449   |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 5,861 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 1,644 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 726   |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 5,362 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-01 |
| 기준일 | 2024-03-29 |

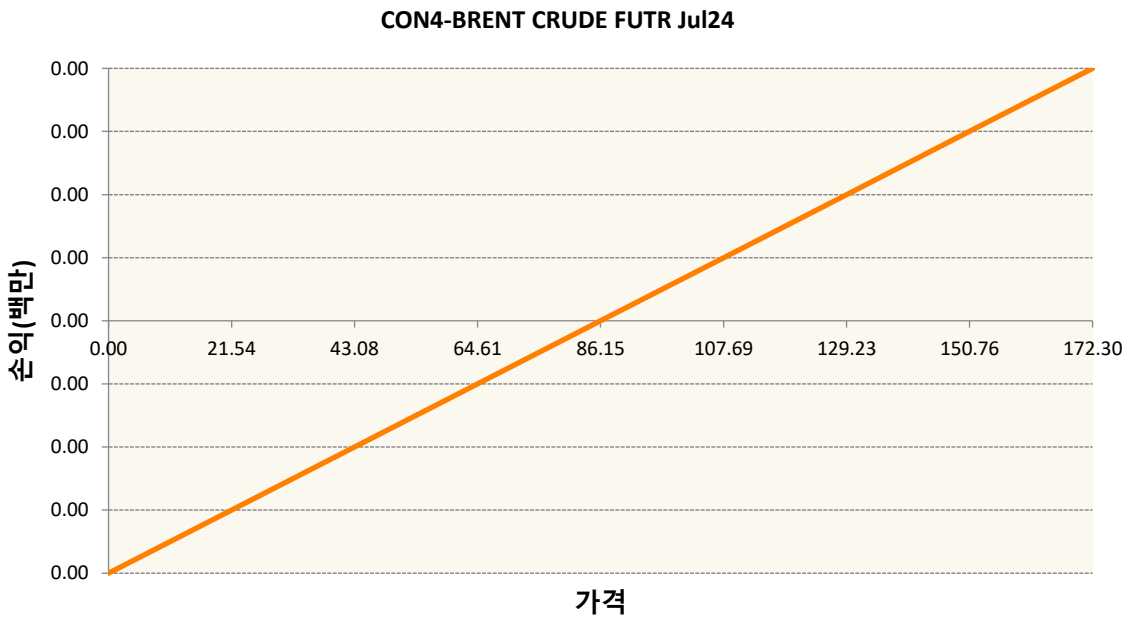
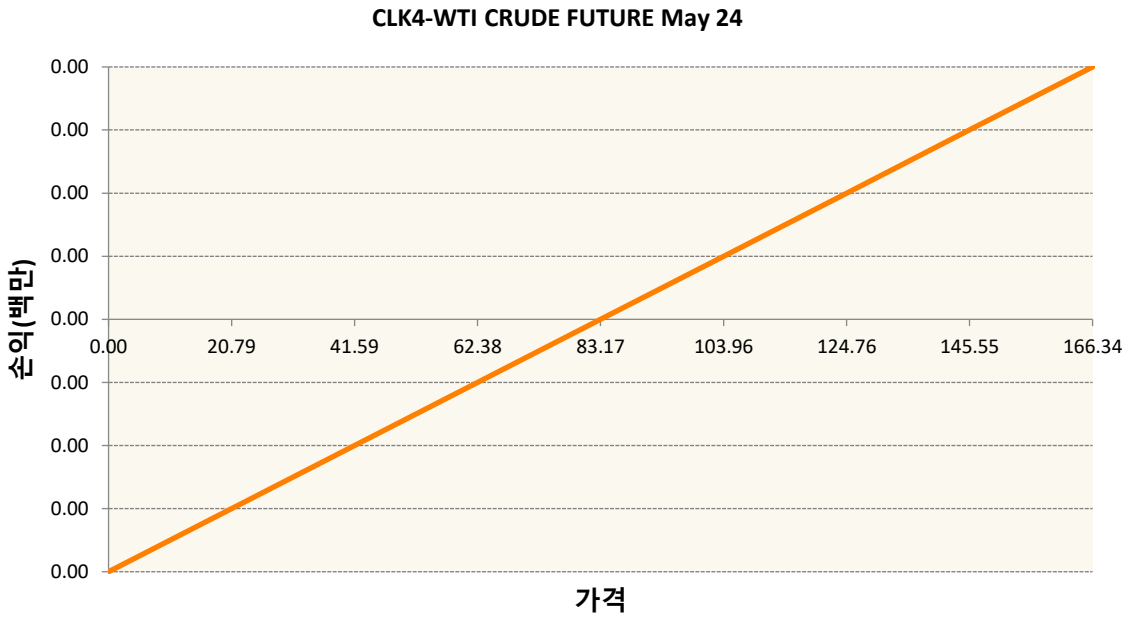
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

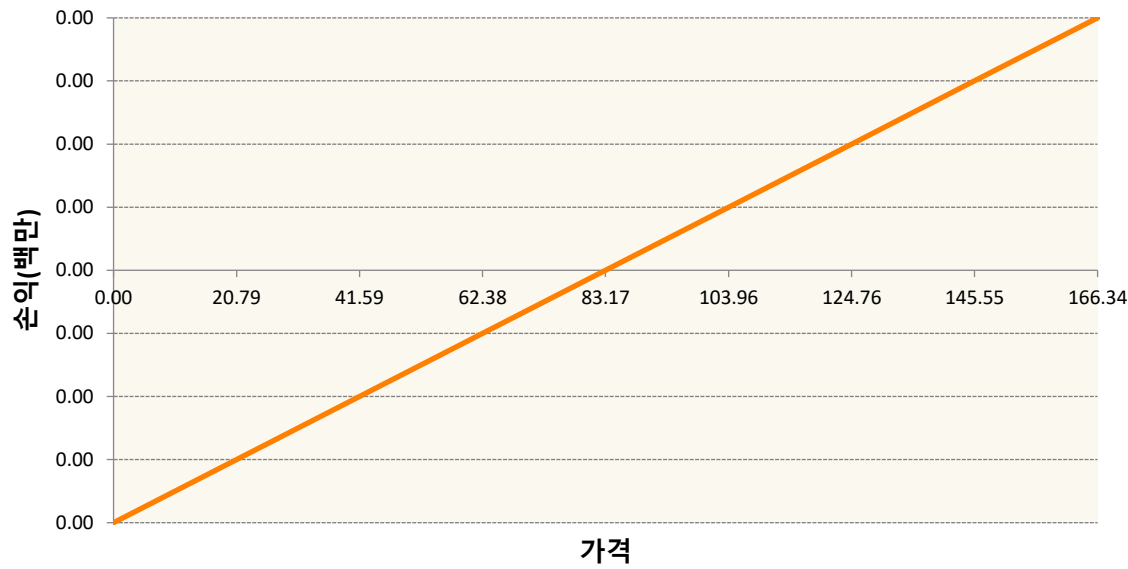
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,166 | 0     | 1,166     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 202   | -202      | 장내 |

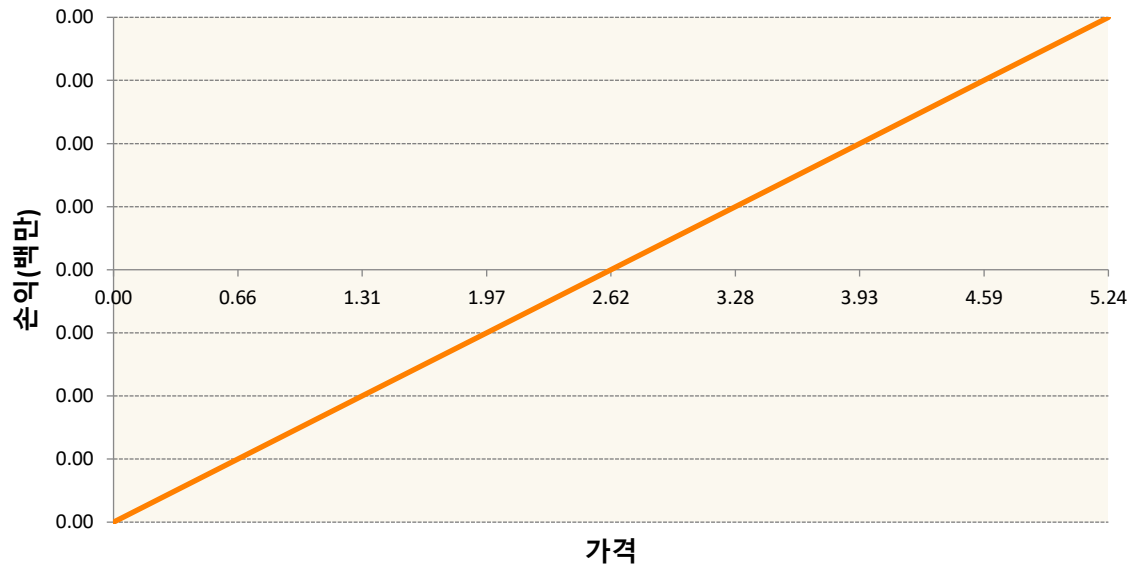
2. 만기시점의 손익구조



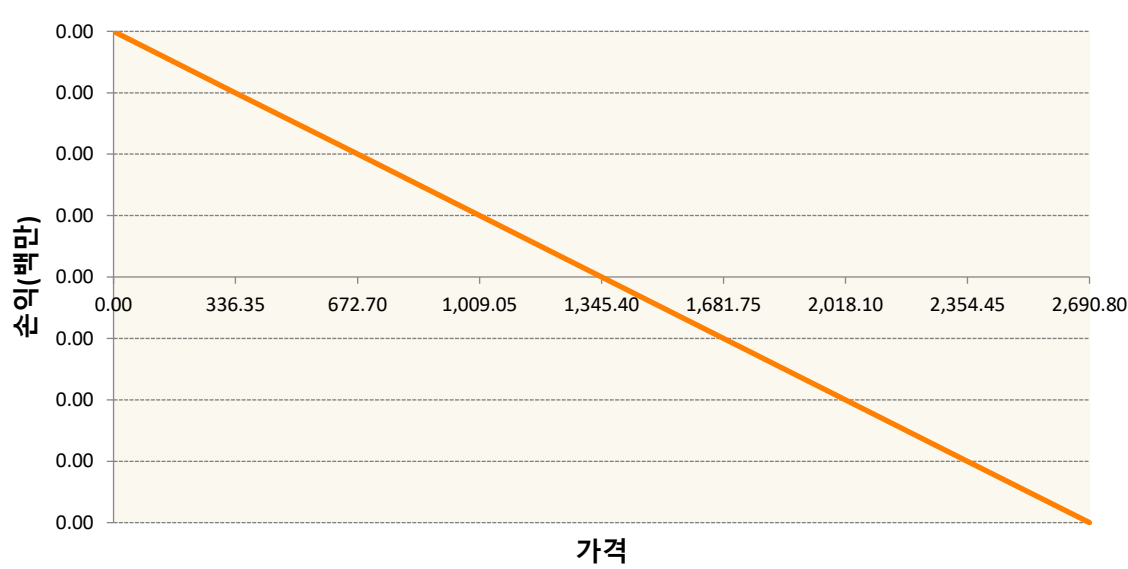
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



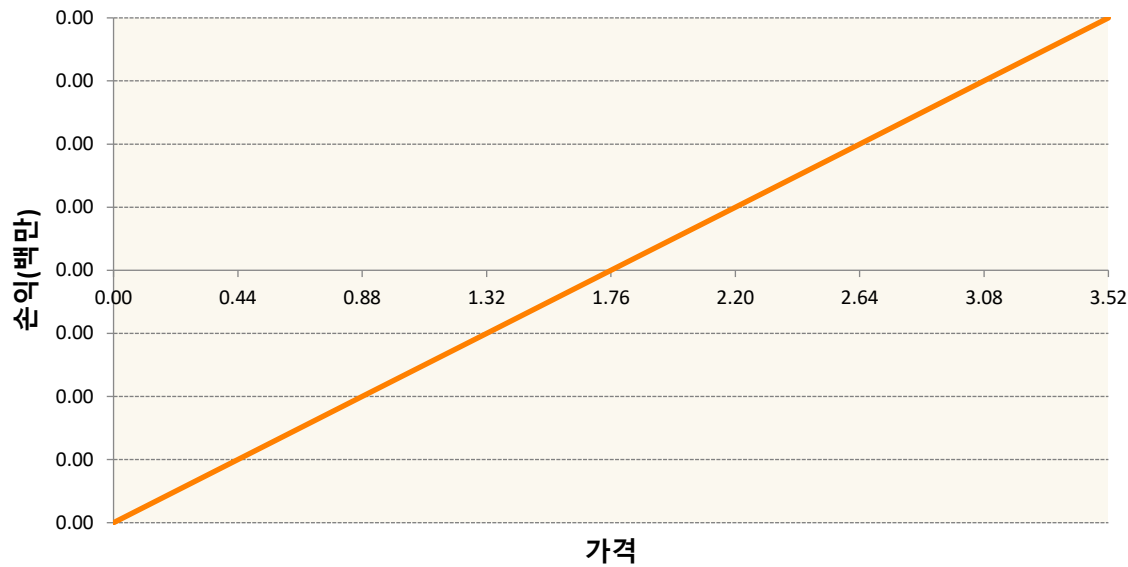
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



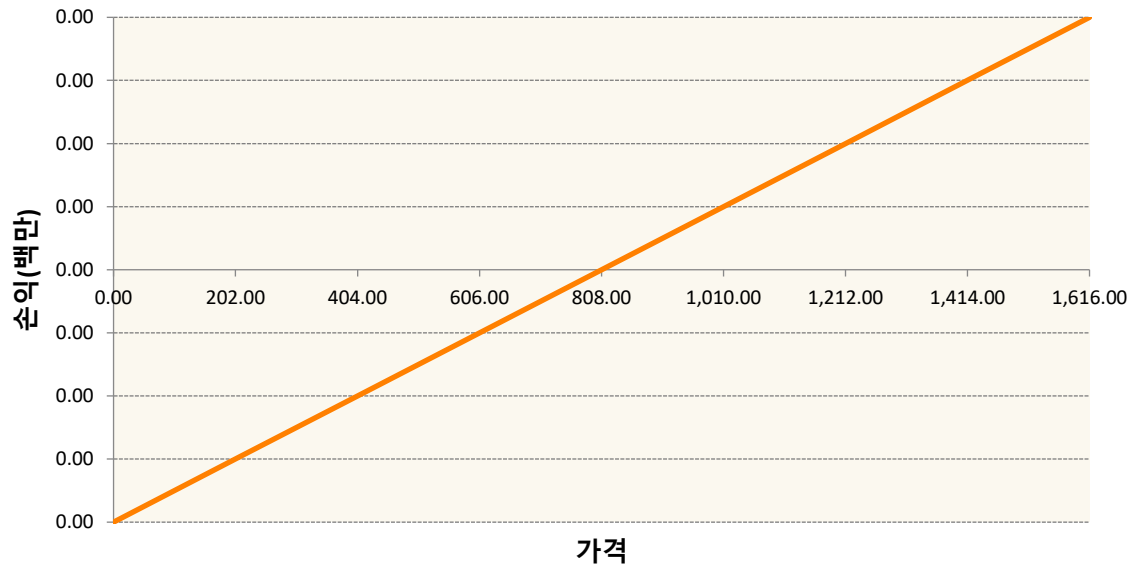
KR4175V40008-2024-04 달러선물



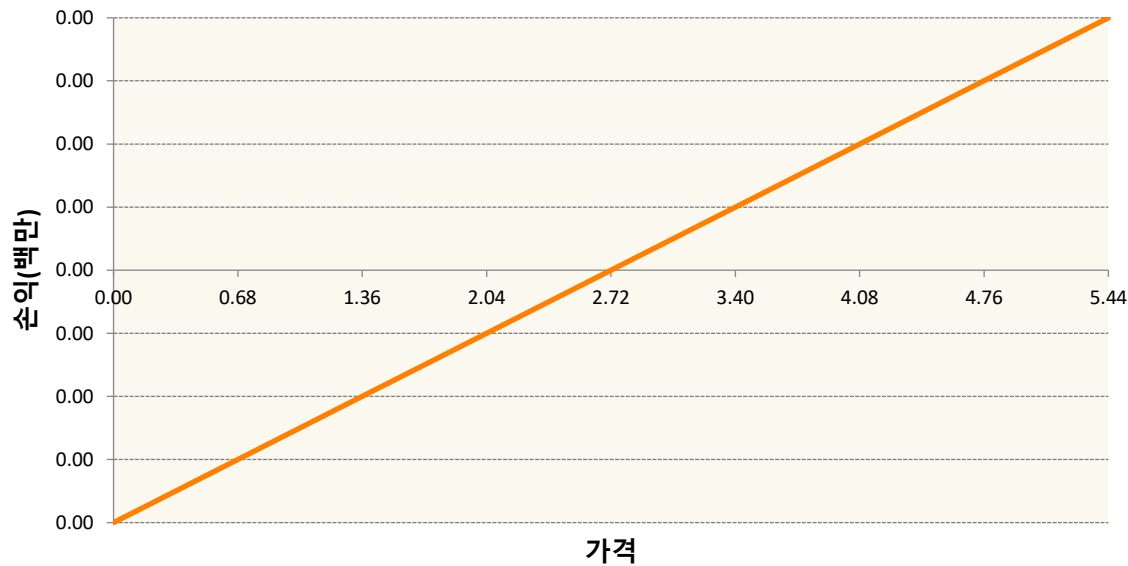
NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



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 |                          | 16 |
| NGK24                   | NATURAL GAS FUTR May 24  | 11 |
| QSK4                    | Low Su Gasoil G May 24   | 9  |
| XBK4                    | GASOLINE RBOB FUT May 24 | 12 |

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

204