

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

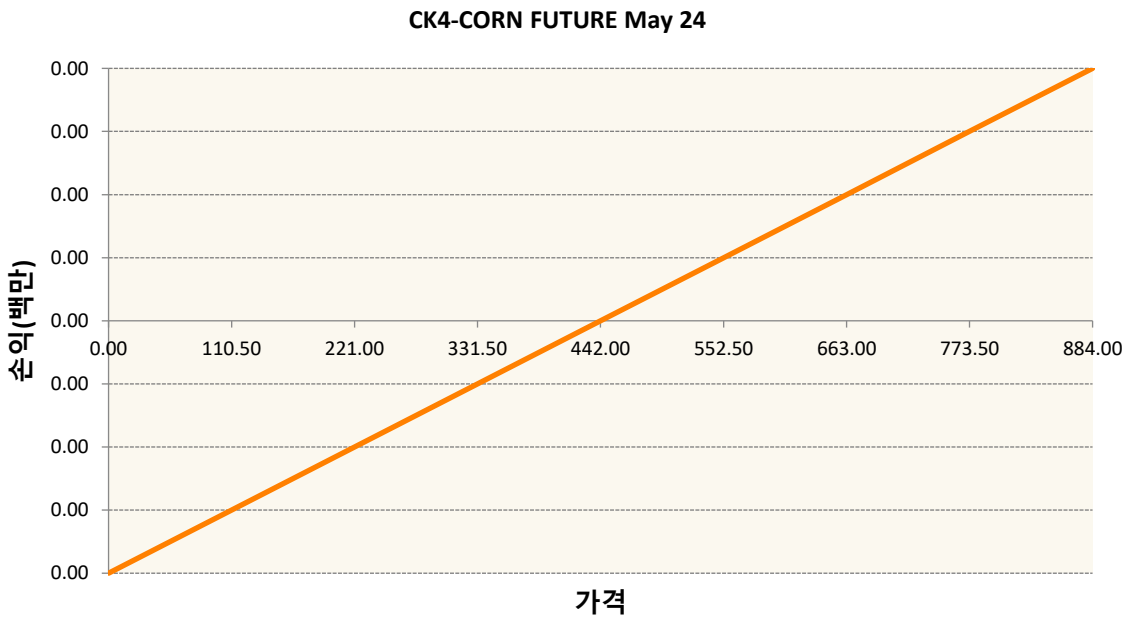
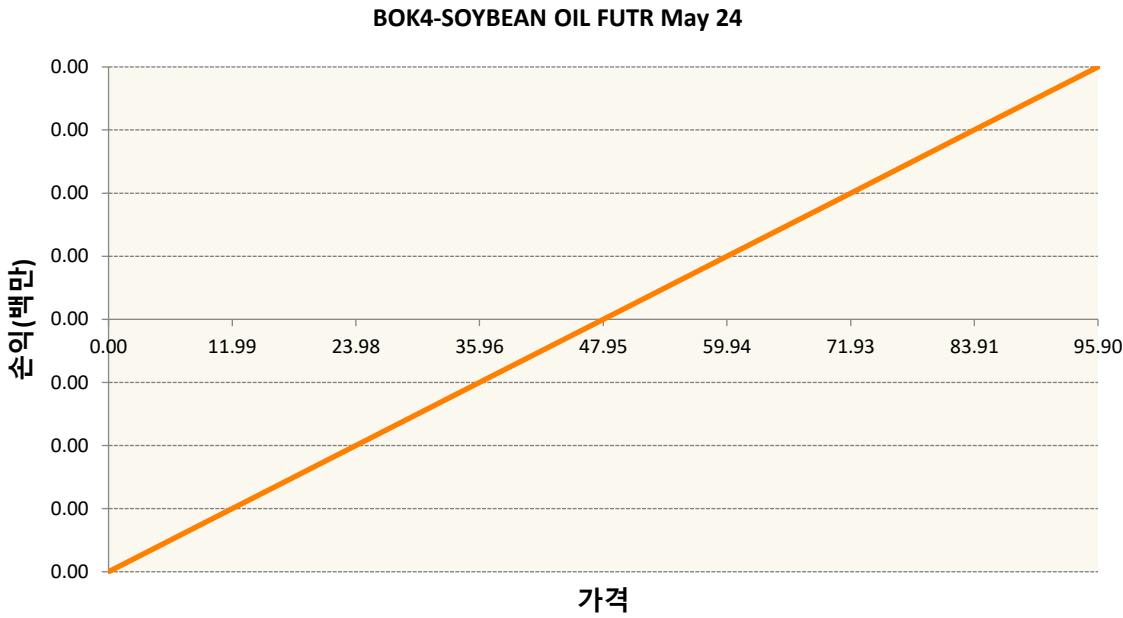
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

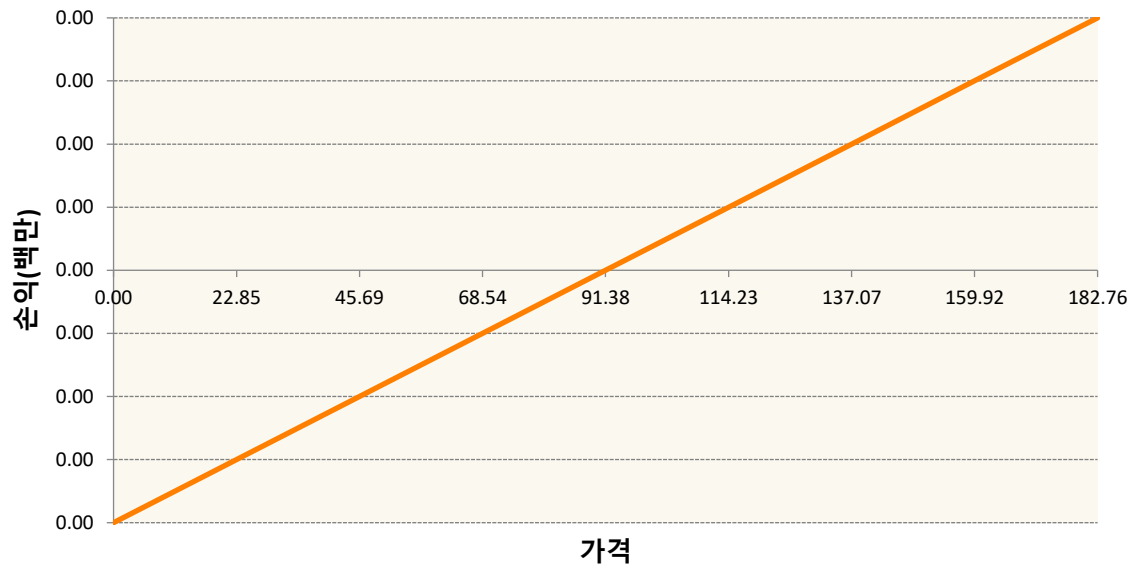
(단위:USD 백만)

| 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     | 526   | -526      | 장내 |

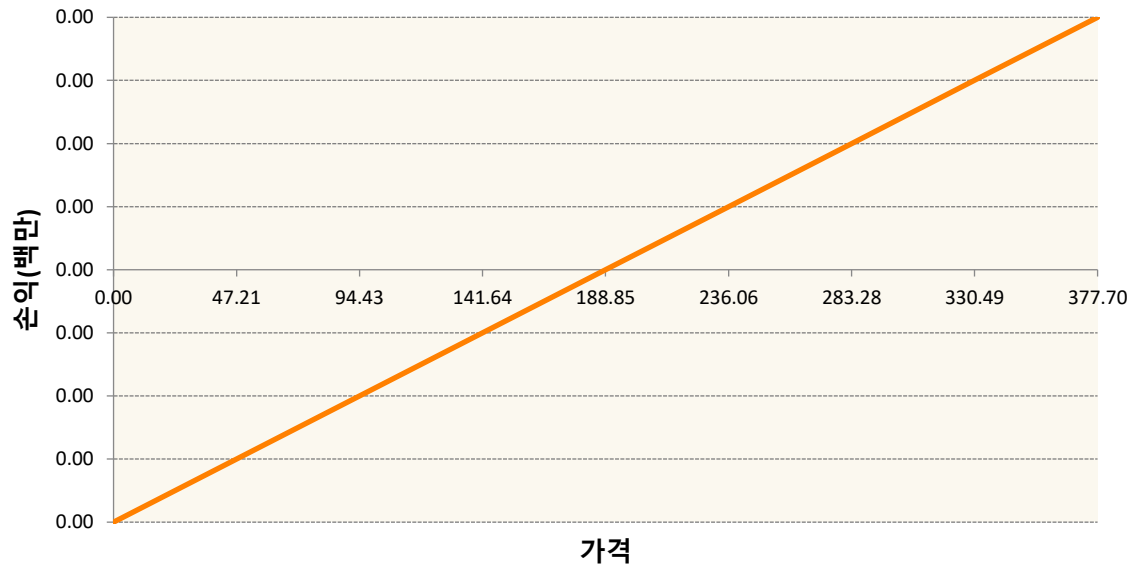
2. 만기시점의 손익구조



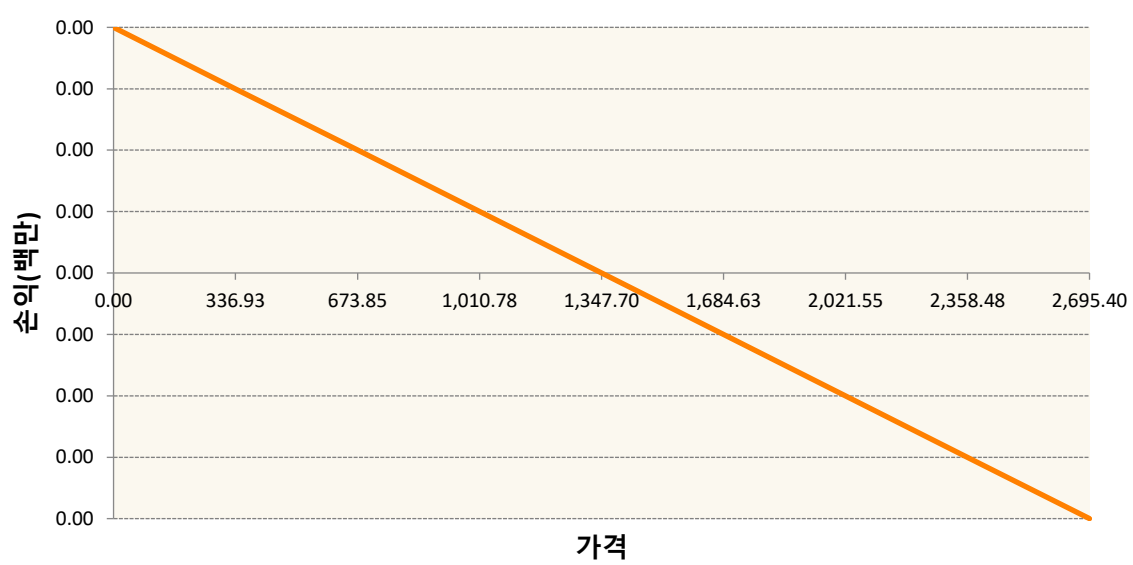
CTK4-COTTON NO.2 FUTR May 24



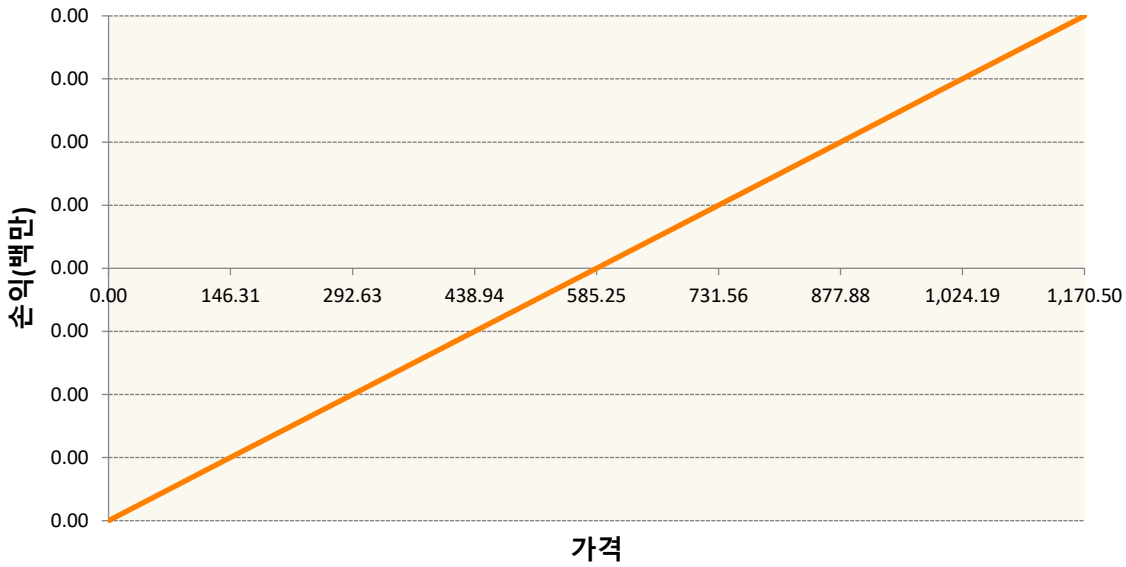
KCK4-COFFEE 'C' FUTURE May 24



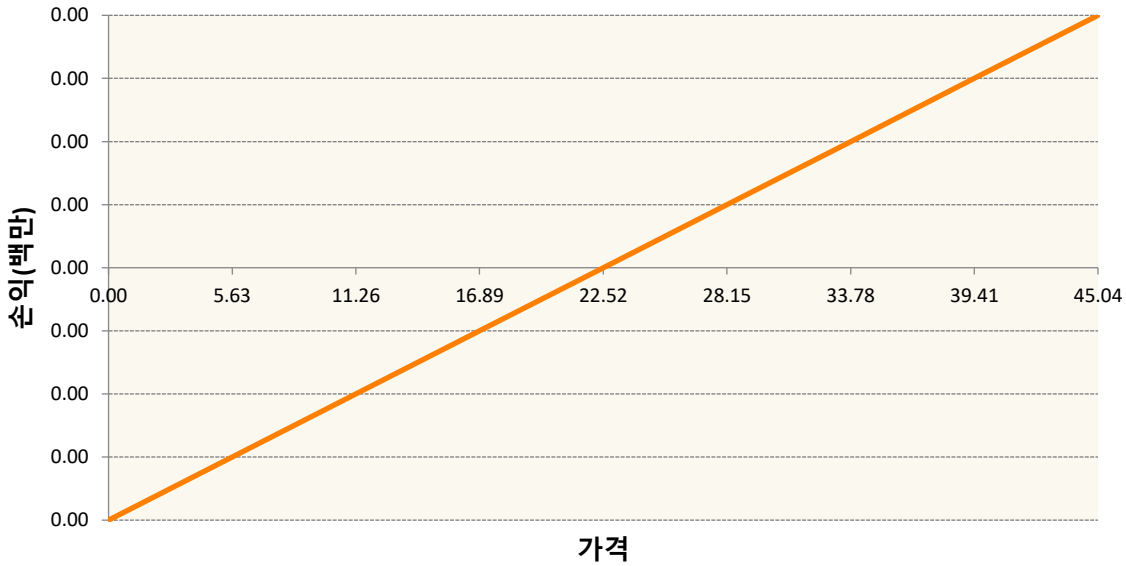
KR4175V40008-2024-04 달러선물



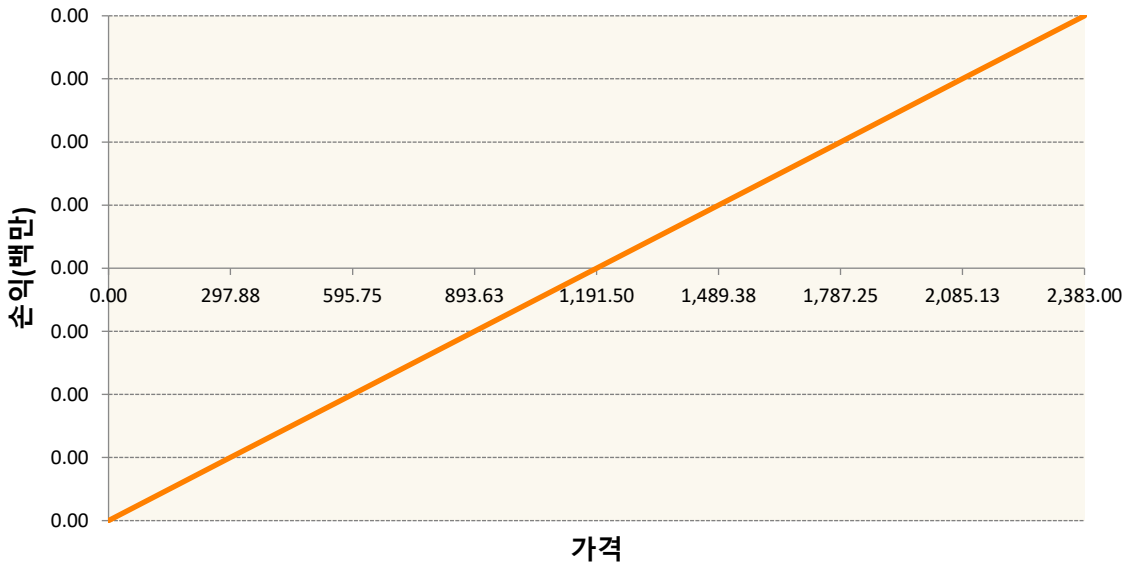
KWK4-KC HRW WHEAT FUT May 24



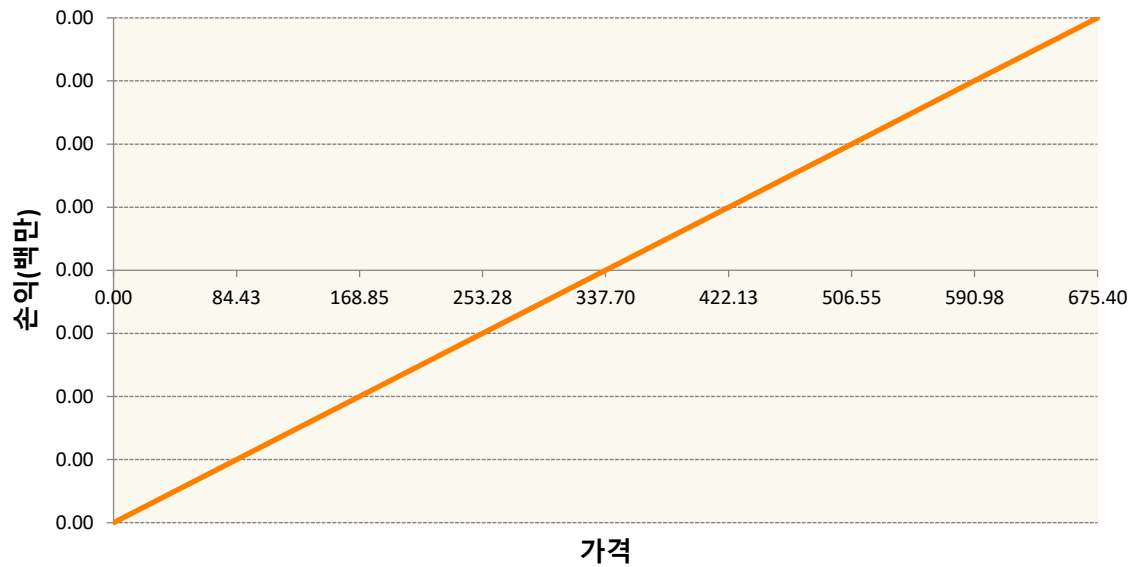
SBK4-Sugar #11 (WORLD) May 24



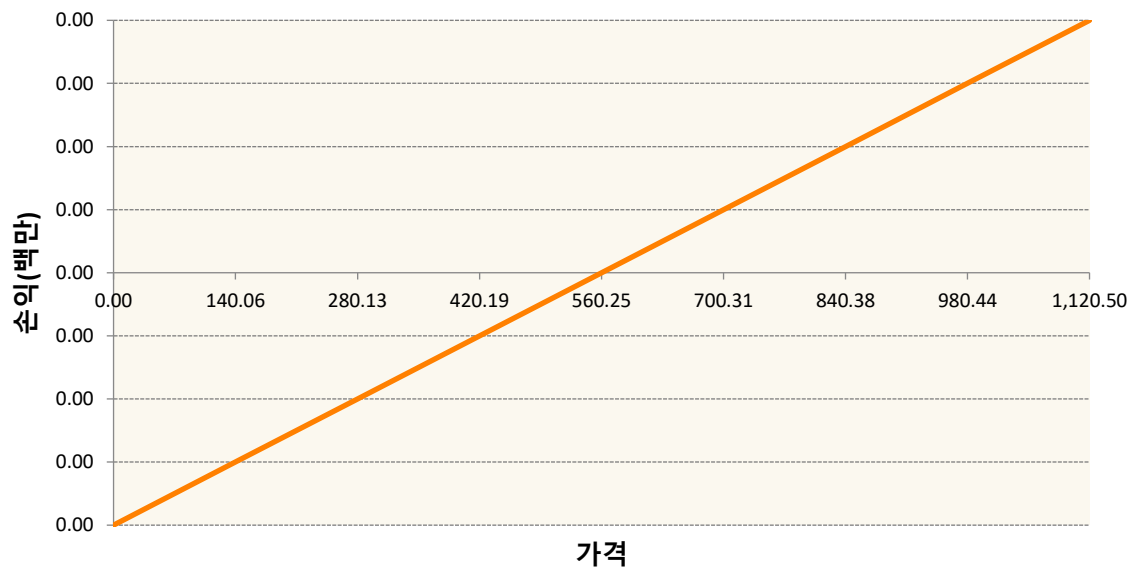
SK4-SOYBEAN FUTURE May 24



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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

스마트인덱스모

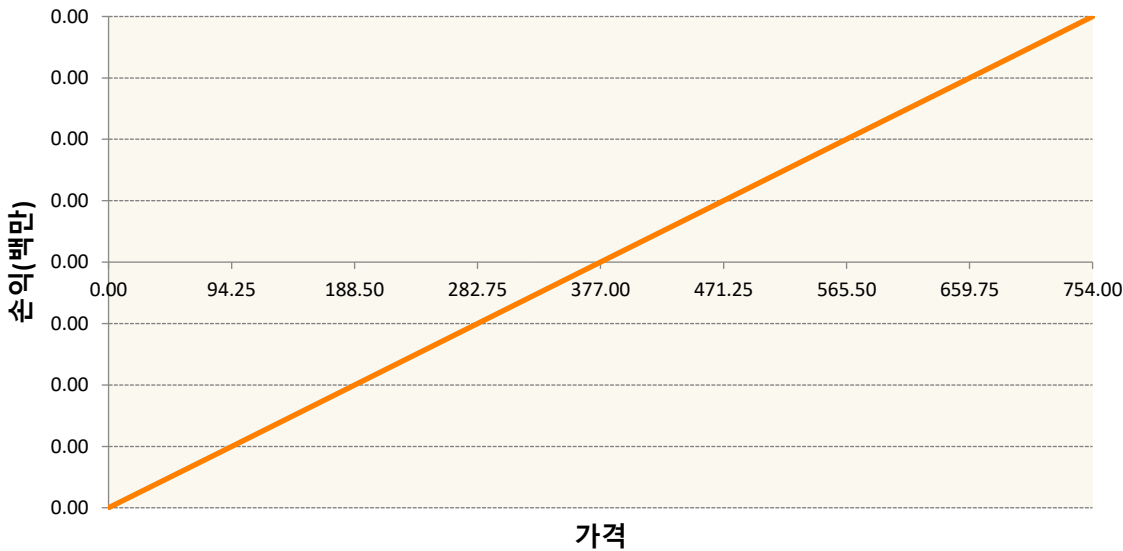
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 950   | 0     | 950       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,639 | 0     | 2,639     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4101V60002-2024-06 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           | 2024-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 210    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -210      | -210               | -210   | -210 | -210  | -210   | -210   |
| -5.33%       | -140      | -140               | -140   | -140 | -140  | -140   | -140   |
| -2.67%       | -70       | -70                | -70    | -70  | -70   | -70    | -70    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 70        | 70                 | 70     | 70   | 70    | 70     | 70     |
| 5.33%        | 140       | 140                | 140    | 140  | 140   | 140    | 140    |
| 8.00%        | 210       | 210                | 210    | 210  | 210   | 210    | 210    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

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 | 263 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 308 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

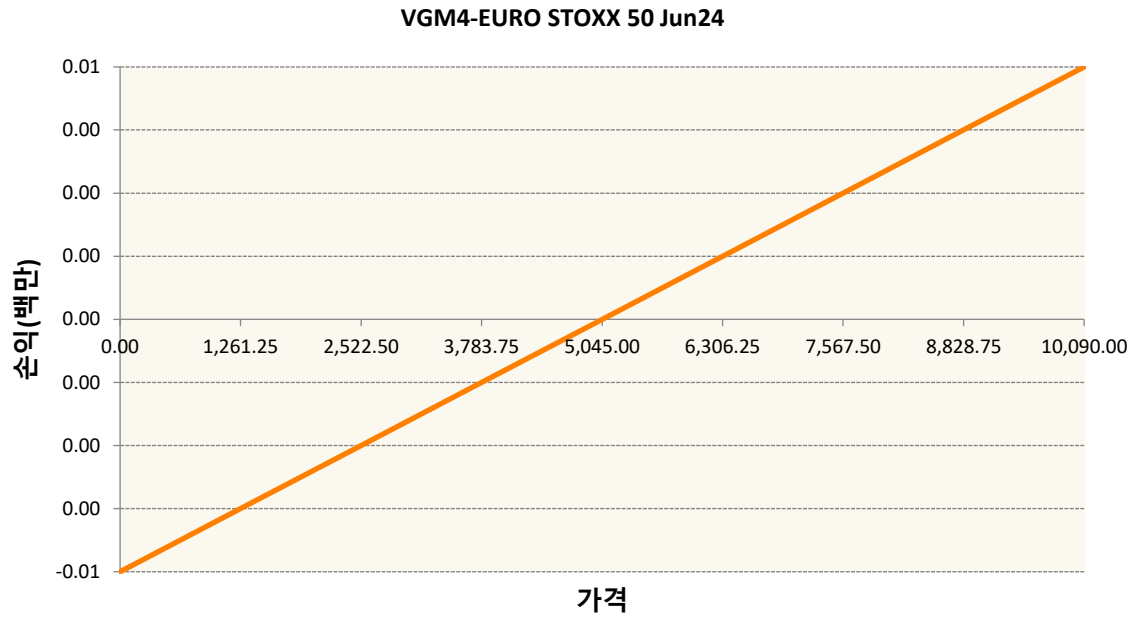
유로인덱스모(주식-파생형)

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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

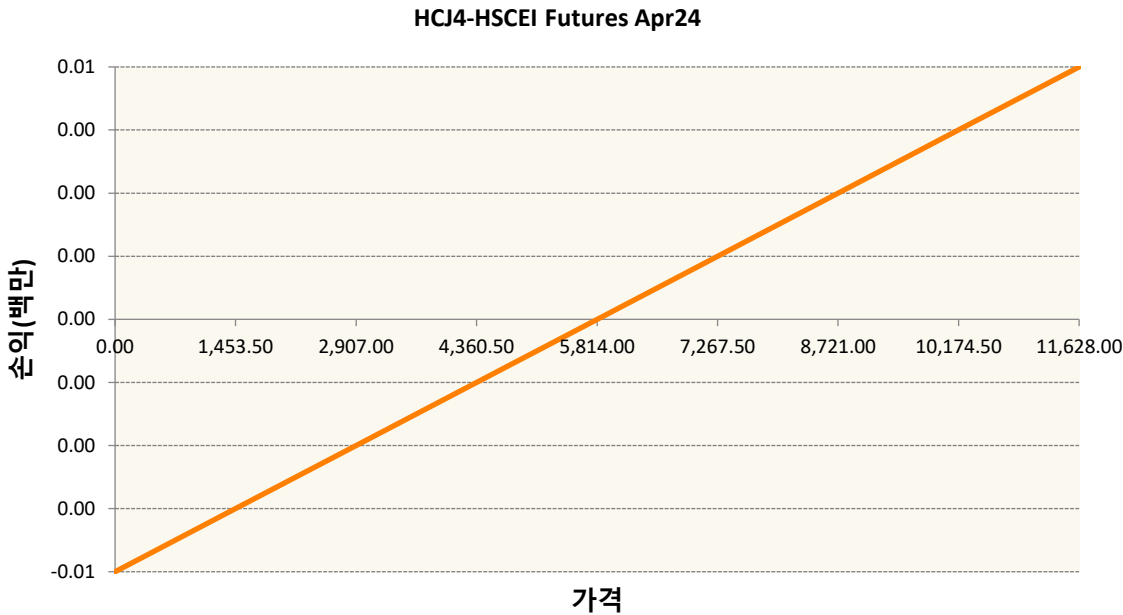
차이나인덱스모(주식-파생형)

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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

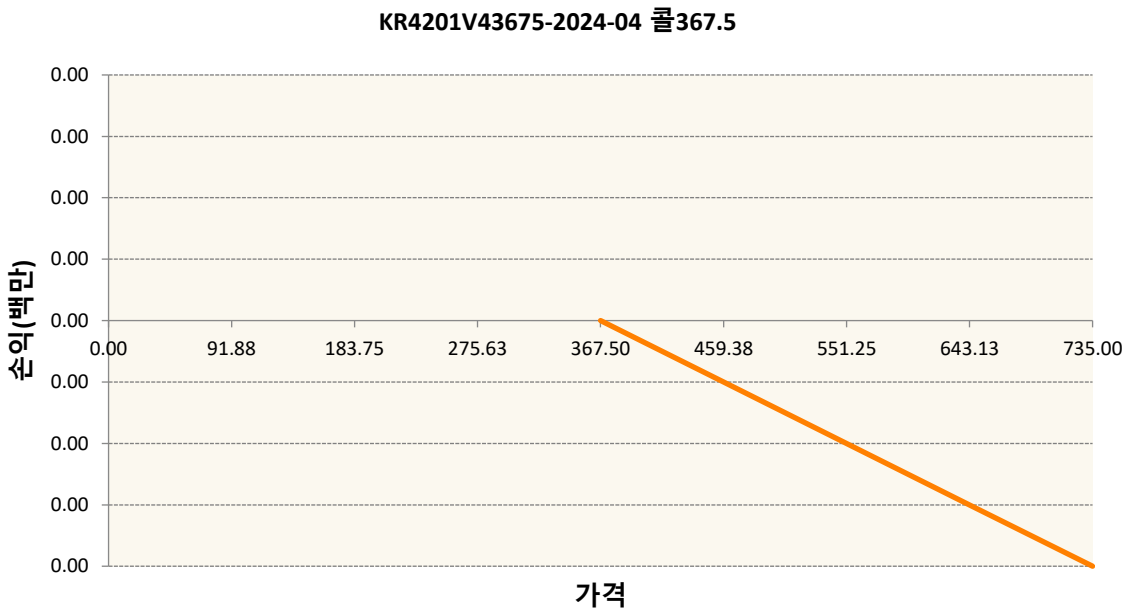
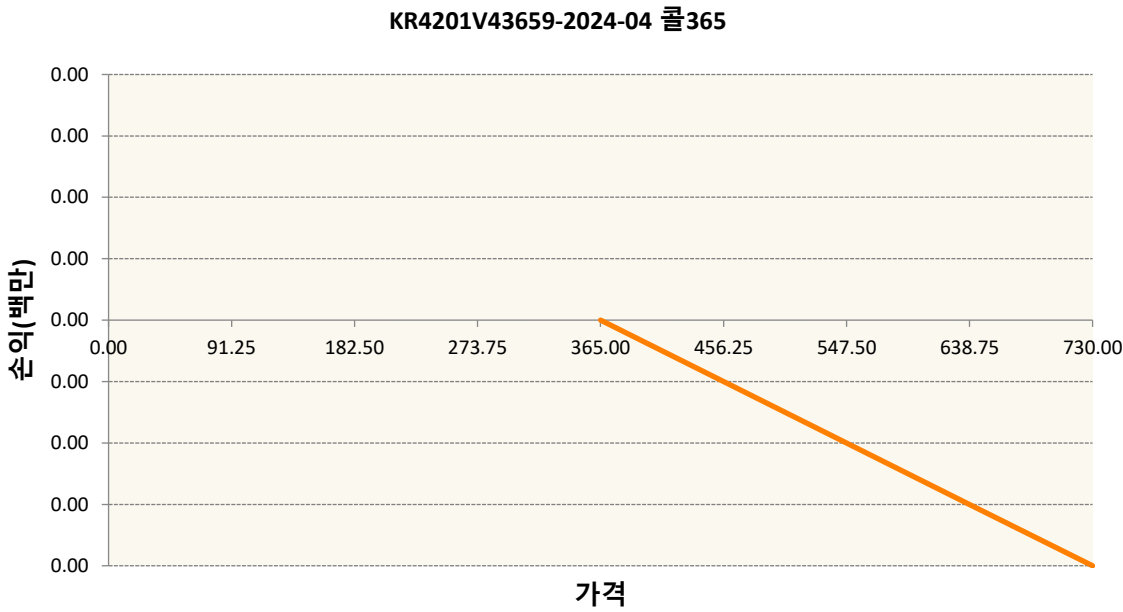
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

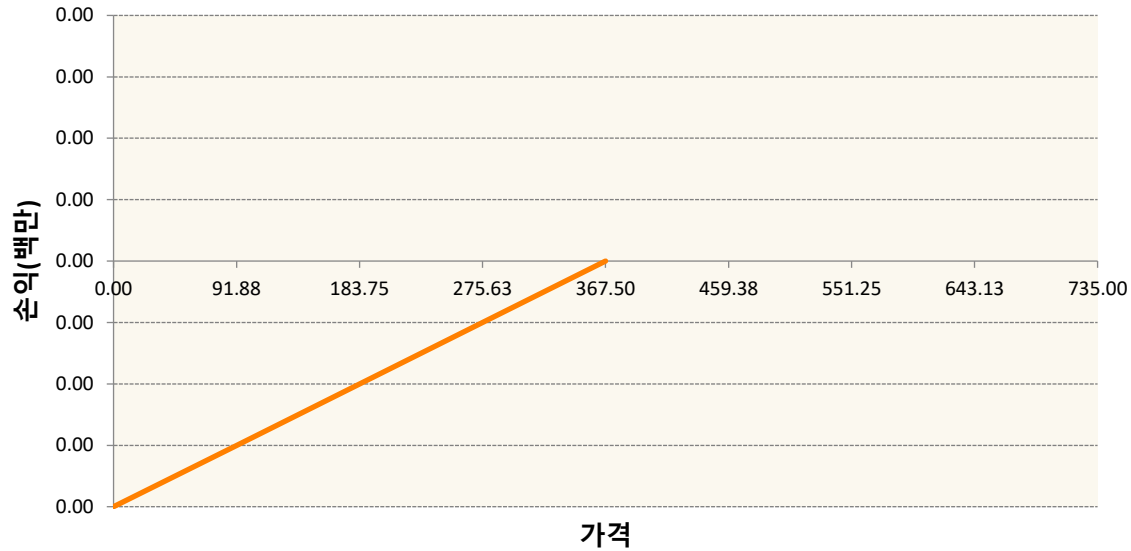
(단위:백만원)

| 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   |        |        |        | 1,178  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 426       | 425     | 424            | 423    | 421    | 419    | 415    |
| -5.33%       | 414       | 409     | 402            | 394    | 386    | 377    | 368    |
| -2.67%       | 312       | 298     | 284            | 270    | 257    | 243    | 229    |
| 0%           | 24        | 17      | 9              | 0      | -10    | -20    | -30    |
| 2.67%        | -365      | -366    | -368           | -370   | -373   | -377   | -381   |
| 5.33%        | -771      | -771    | -771           | -771   | -772   | -773   | -774   |
| 8.00%        | -1,178    | -1,178  | -1,178         | -1,178 | -1,178 | -1,178 | -1,178 |
| KR4201V43675 |           |         | 2024-04 콜367.5 |        |        |        | 1,858  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 557       | 557     | 556            | 555    | 553    | 550    | 547    |
| -5.33%       | 548       | 542     | 535            | 526    | 516    | 504    | 492    |
| -2.67%       | 440       | 419     | 398            | 377    | 355    | 334    | 312    |
| 0%           | 51        | 35      | 18             | 0      | -19    | -38    | -57    |
| 2.67%        | -553      | -556    | -560           | -566   | -573   | -581   | -591   |
| 5.33%        | -1,203    | -1,203  | -1,204         | -1,205 | -1,206 | -1,208 | -1,211 |
| 8.00%        | -1,857    | -1,857  | -1,857         | -1,857 | -1,857 | -1,857 | -1,858 |
| KR4301V43673 |           |         | 2024-04 풋367.5 |        |        |        | 486    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -482      | -482    | -482           | -483   | -483   | -484   | -486   |
| -5.33%       | -261      | -263    | -265           | -268   | -272   | -276   | -280   |
| -2.67%       | -73       | -80     | -88            | -95    | -102   | -110   | -117   |
| 0%           | 17        | 12      | 6              | 0      | -6     | -13    | -20    |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 2.67% | 35 | 33 | 32 | 30 | 28 | 25 | 21 |
| 5.33% | 36 | 36 | 35 | 35 | 35 | 34 | 33 |
| 8.00% | 36 | 36 | 36 | 36 | 36 | 35 | 35 |

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

(단위:백만원)

4,125

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

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 | 1,751 | 0     | 1,751     |    |

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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

## 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 | 4,578 | 0     | 4,578     |    |

### 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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

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 | 15,937 | 0      | 15,937    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 15,633 | -15,633   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |                                 |
|------------------------------|---------------------------------|
| FXW213E1W KRW/USD 30-04-24E  | 252                             |
| FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E | 583                             |
| FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E | 416                             |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

591

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

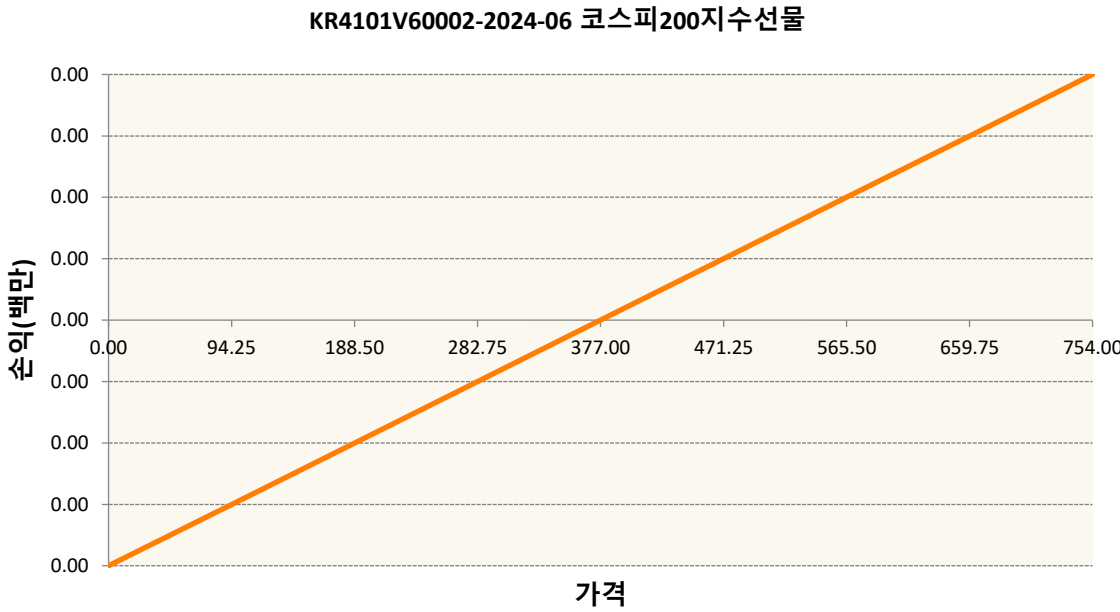
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 566   | 0     | 566       | 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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

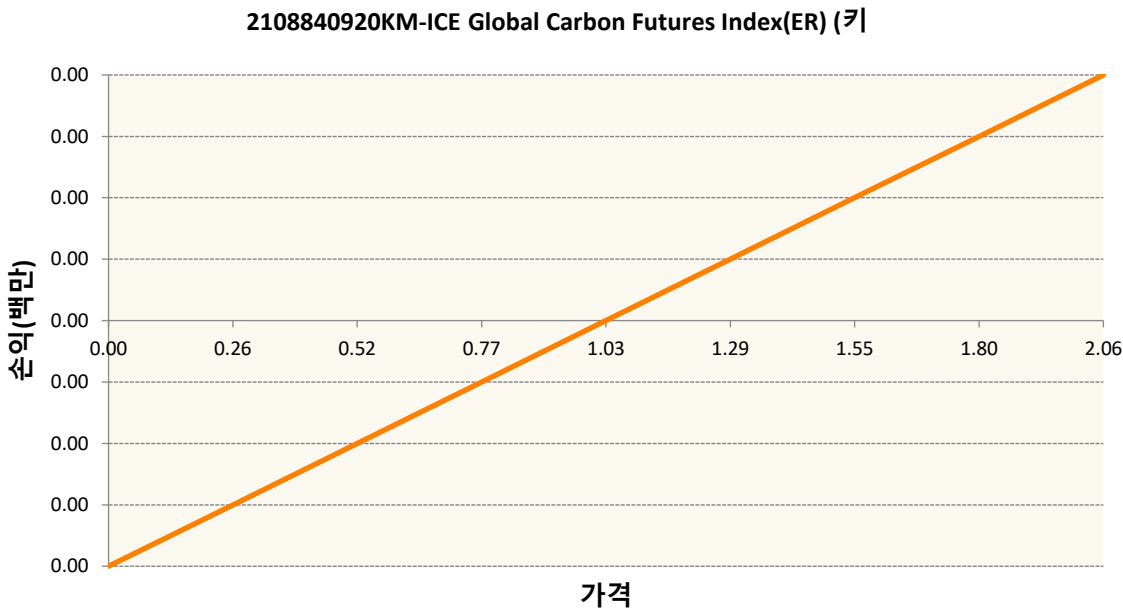
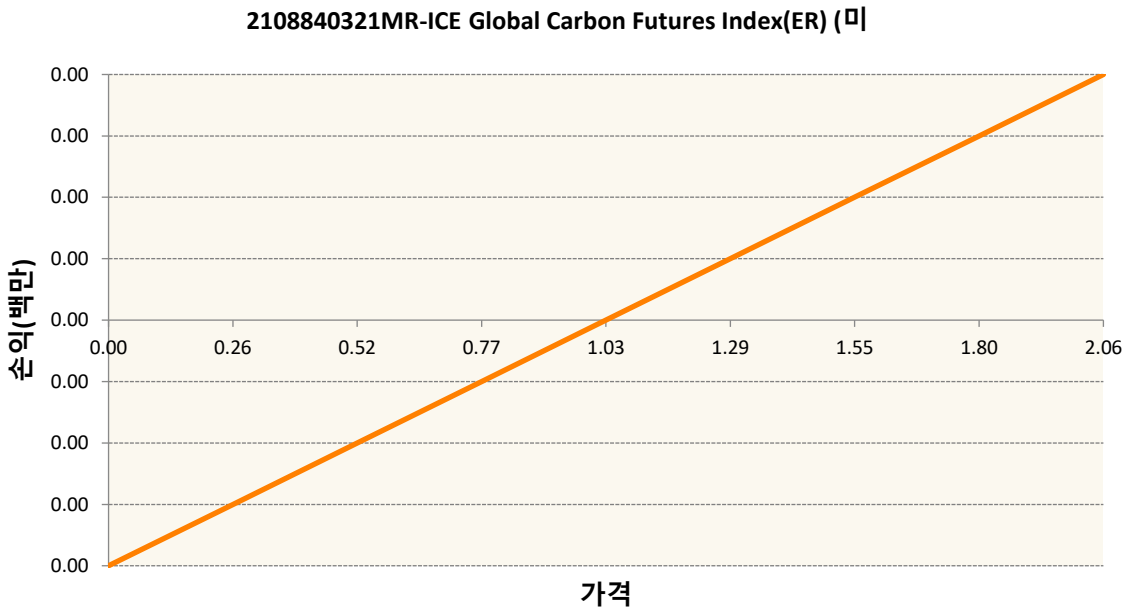
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

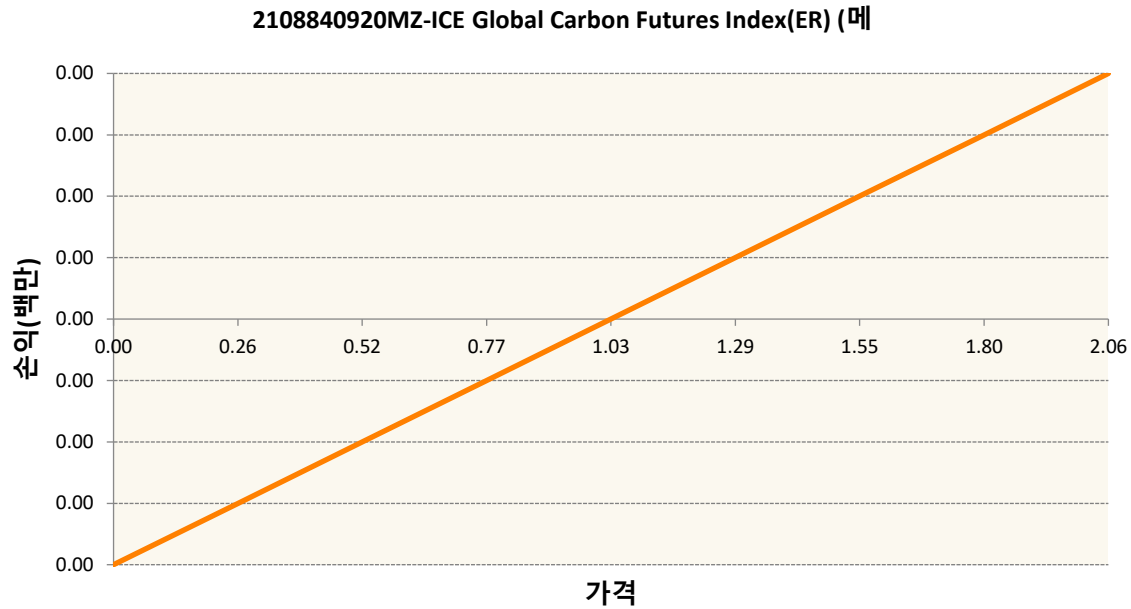
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 18,993 | 0     | 18,993    |    |

2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 445      |
| 2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키 |  | 891      |
| 2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 178      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 1,778    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

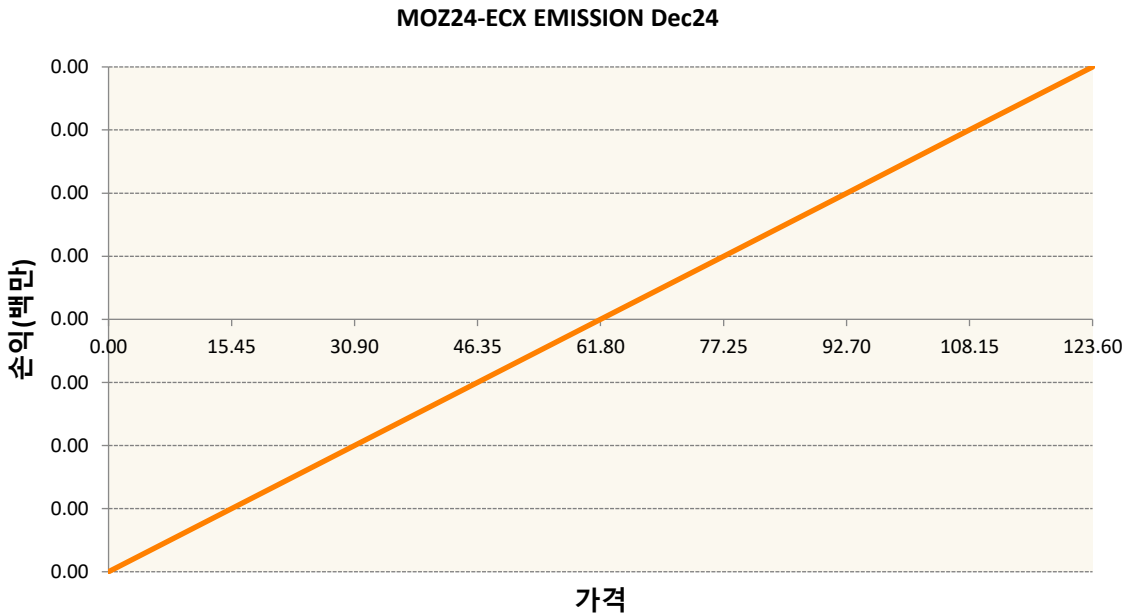
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 9,234 | 0     | 9,234     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 331   | 0     | 331       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,583 | -2,583    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |      |
|----------------------------------------------------|------|
| FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E                       | 61   |
| FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E                       | 146  |
| 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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

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)  | 4 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)  | 4 |

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

(단위:백만원)

32

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

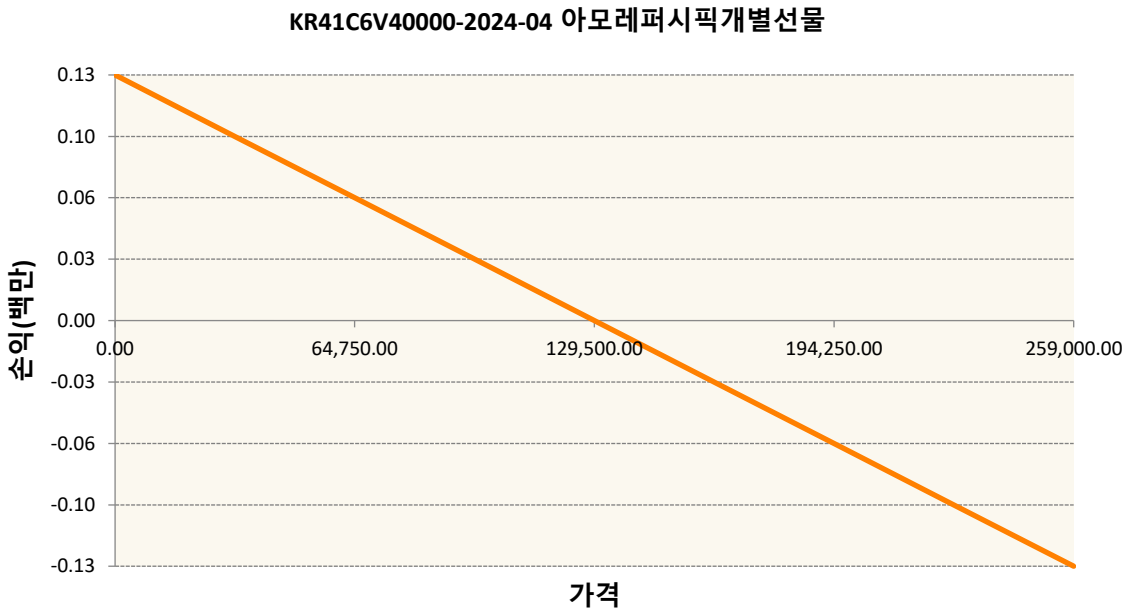
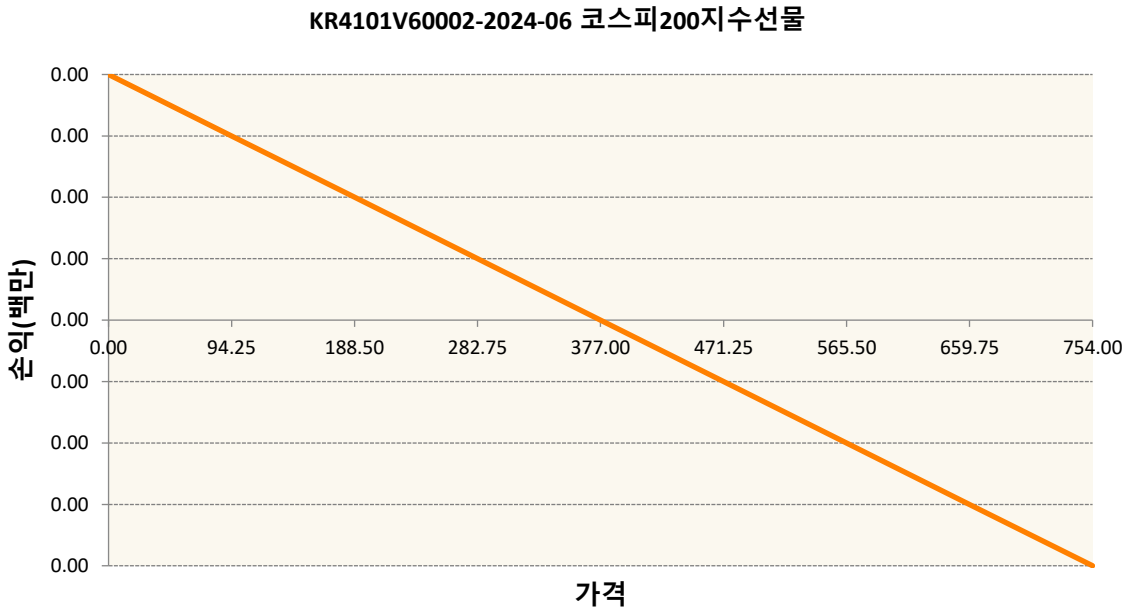
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

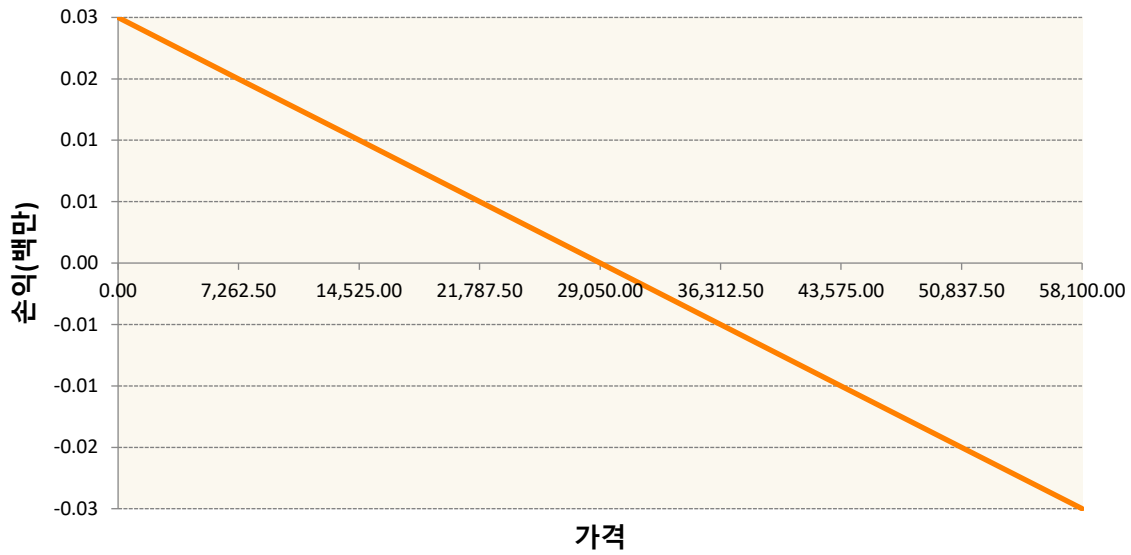
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 3     | 44    | -41       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 25    | 1,097 | -1,073    | 장내 |

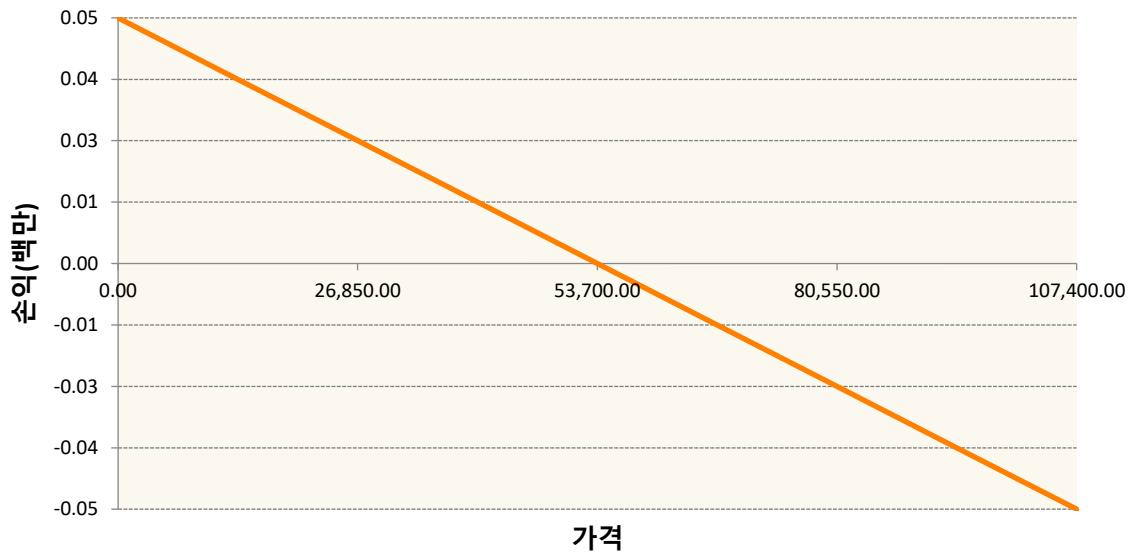
2. 만기시점의 손익구조



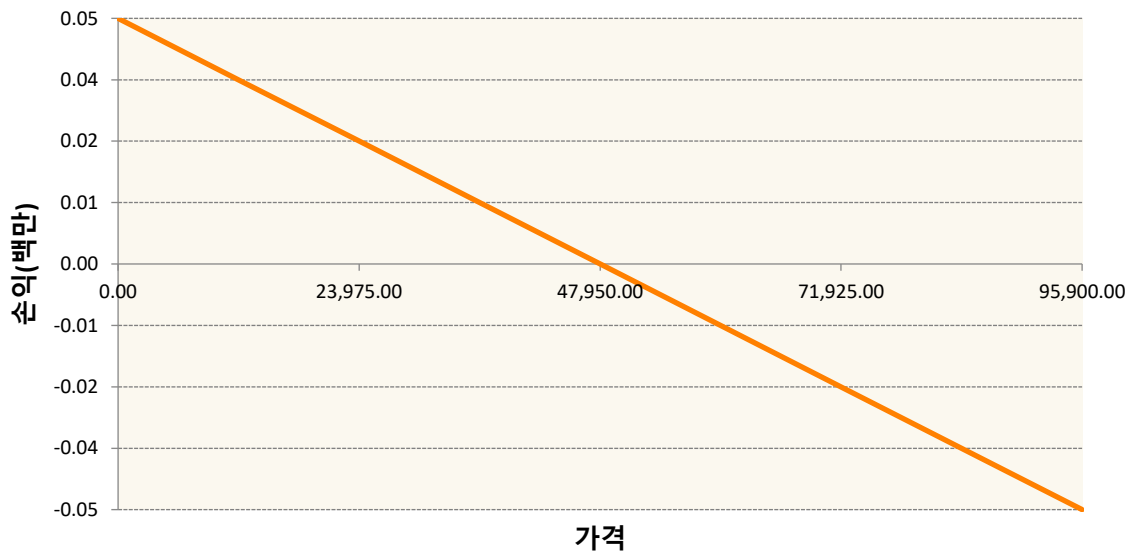
KR41CBV40008-2024-04 한화솔루션개별선물



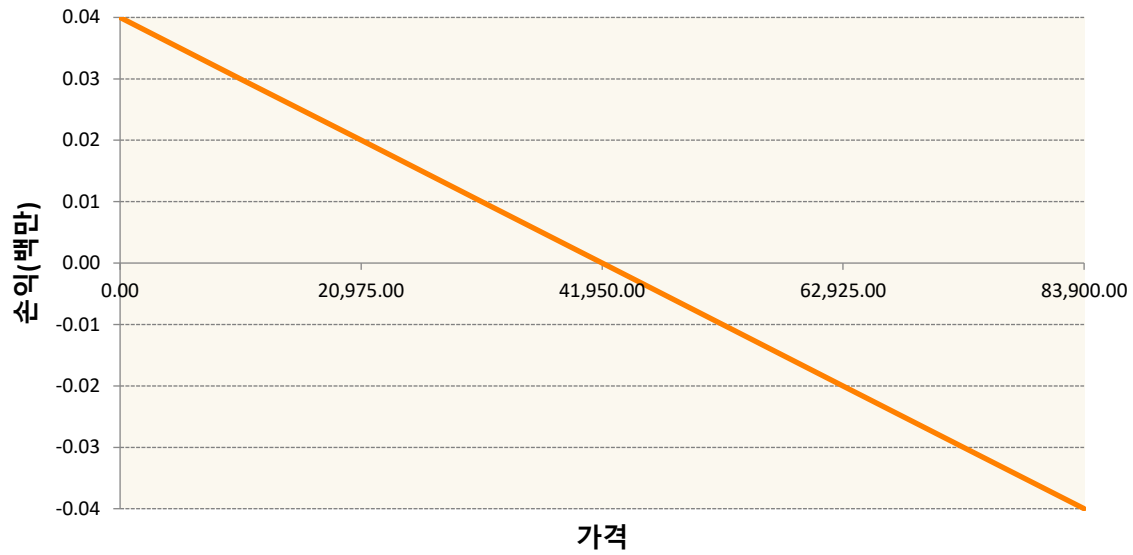
KR41CFV40009-2024-04 카카오개별선물



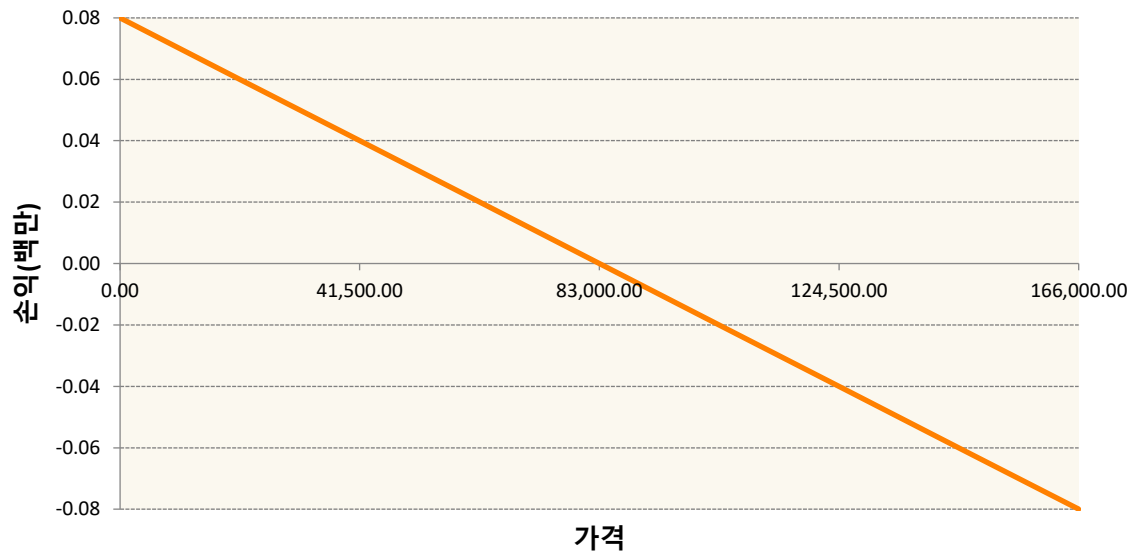
KR41CNV40003-2024-04 포스코DX개별선물



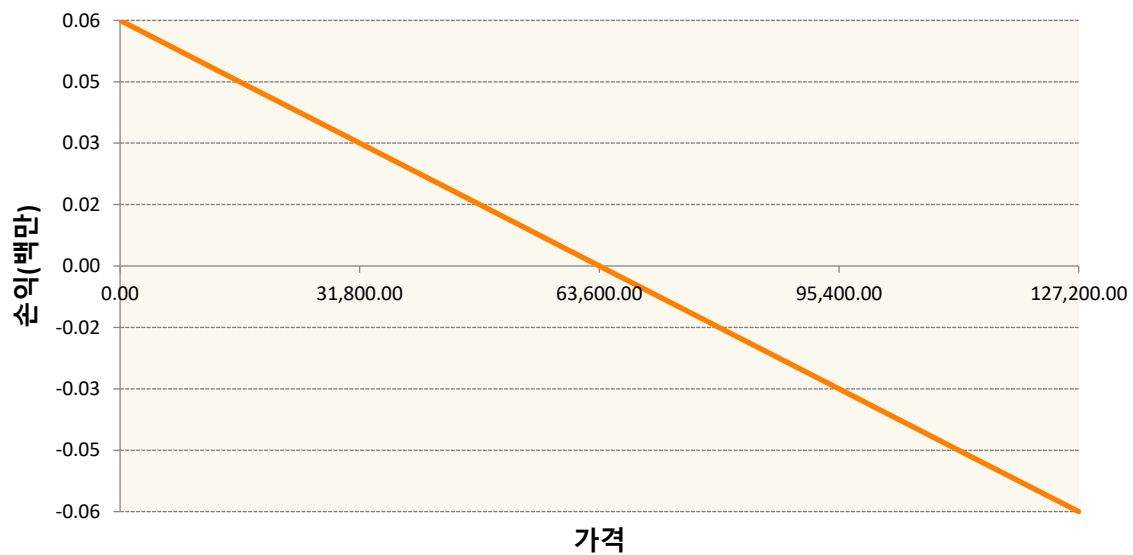
KR41E0V40001-2024-04 원익IPS개별선물



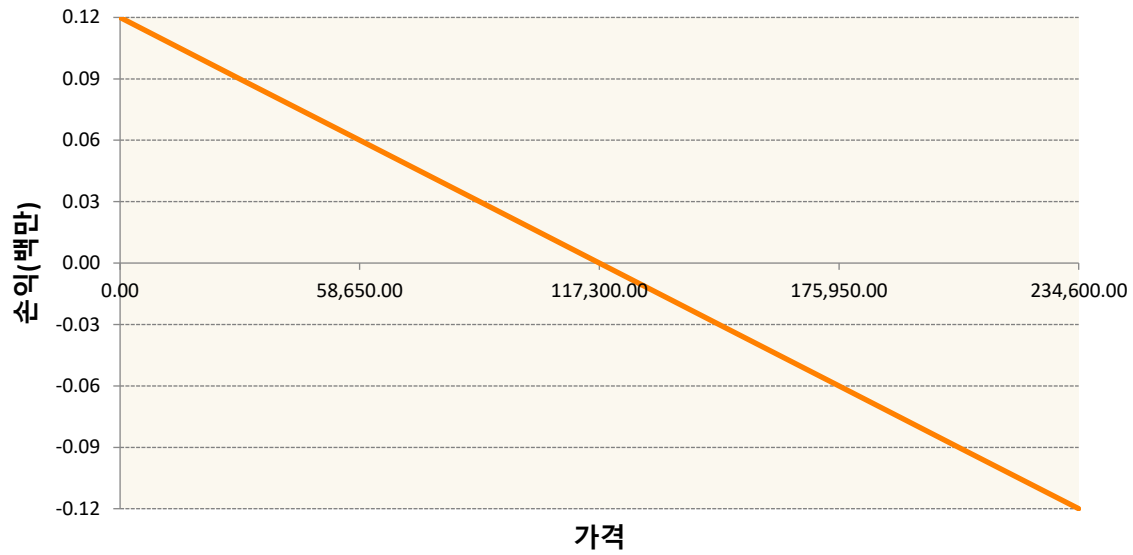
KR41E4V40003-2024-04 에스엠개별선물



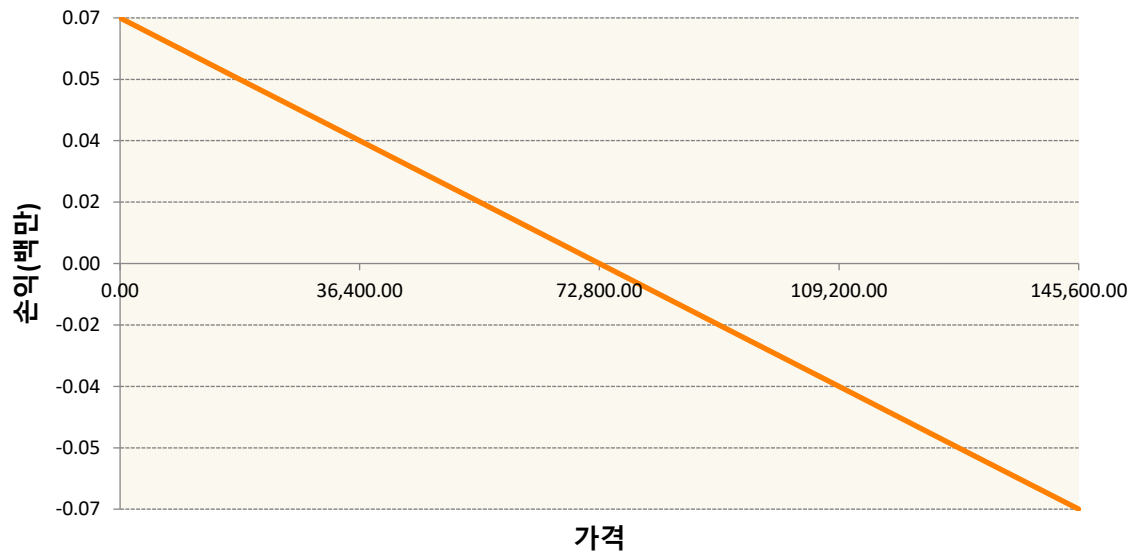
KR41E5V40000-2024-04 넷마블개별선물



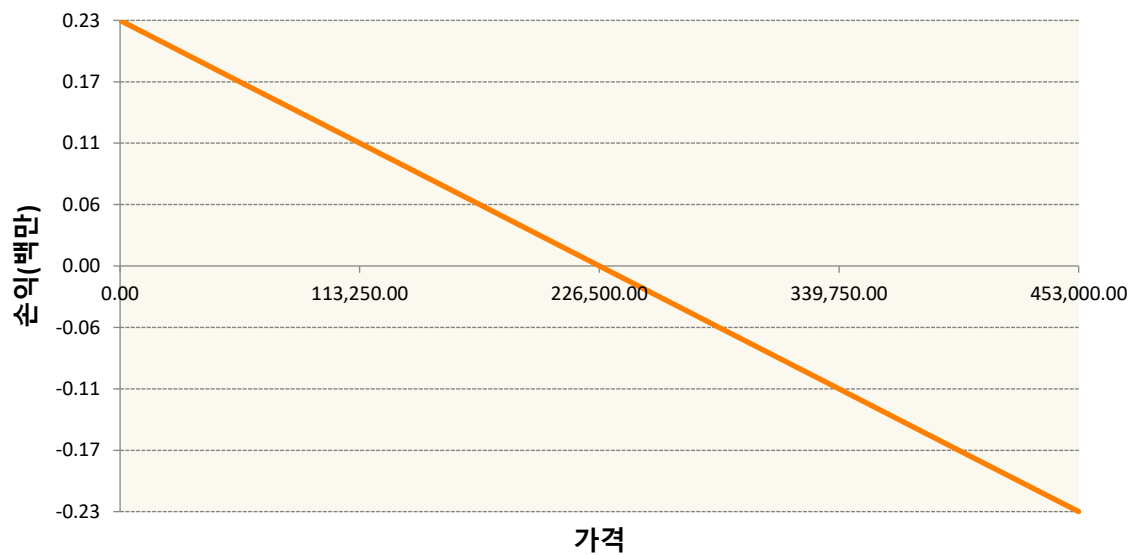
KR41EJV40007-2024-04 SKC개별선물



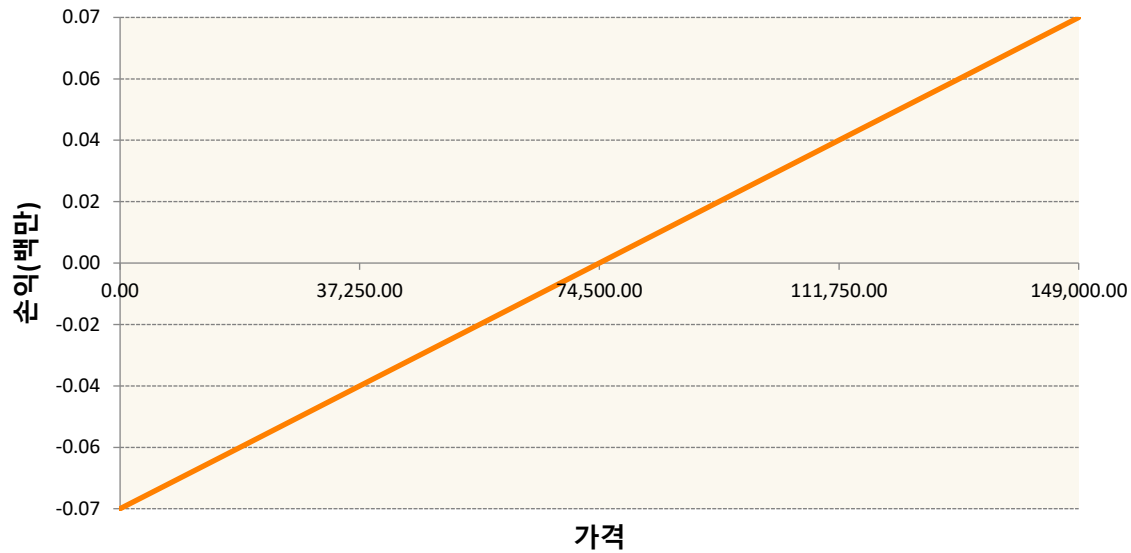
KR41FBV40001-2024-04 SK아이이테크놀로지개별선물



KR41FCV40009-2024-04 하이브개별선물



### KR41G9V40000-2024-04 레고캠바이오개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                   |      |
|-----------------------------------|------|
| KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물     | 45   |
| KR41C6V400 2024-04 아모레퍼시픽개별선물     | 31   |
| KR41CBV400 2024-04 한화솔루션개별선물      | 0.42 |
| 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    |
| KR41G9V400 2024-04 레고캠바이오개별선물     | 2    |

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

(단위:백만원)

153

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

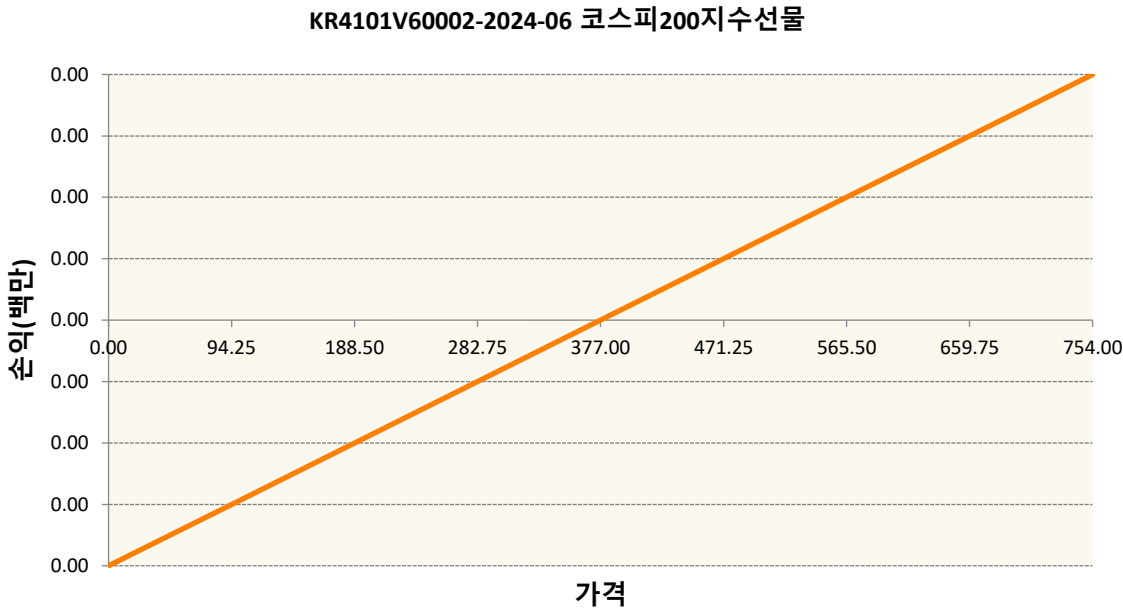
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 95    | 0     | 95        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,016 | 0     | 3,016     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           |         | 2024-06 코스피200지수선물 |      |       |        | 240    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -240      | -240    | -240               | -240 | -240  | -240   | -240   |
| -5.33%       | -160      | -160    | -160               | -160 | -160  | -160   | -160   |
| -2.67%       | -80       | -80     | -80                | -80  | -80   | -80    | -80    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 80        | 80      | 80                 | 80   | 80    | 80     | 80     |
| 5.33%        | 160       | 160     | 160                | 160  | 160   | 160    | 160    |
| 8.00%        | 240       | 240     | 240                | 240  | 240   | 240    | 240    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

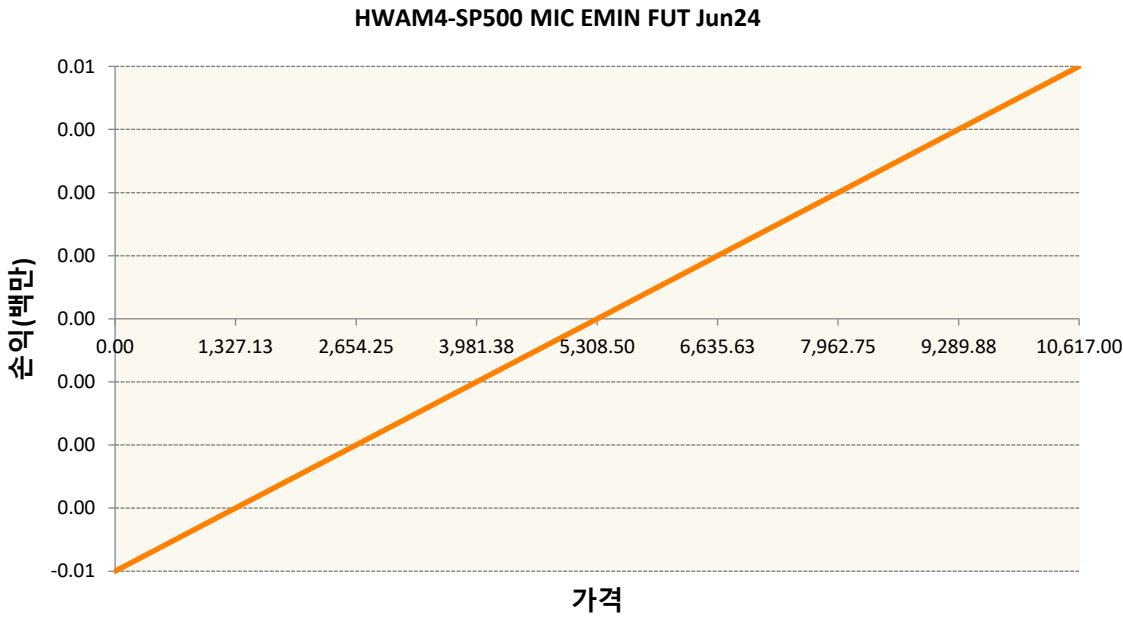
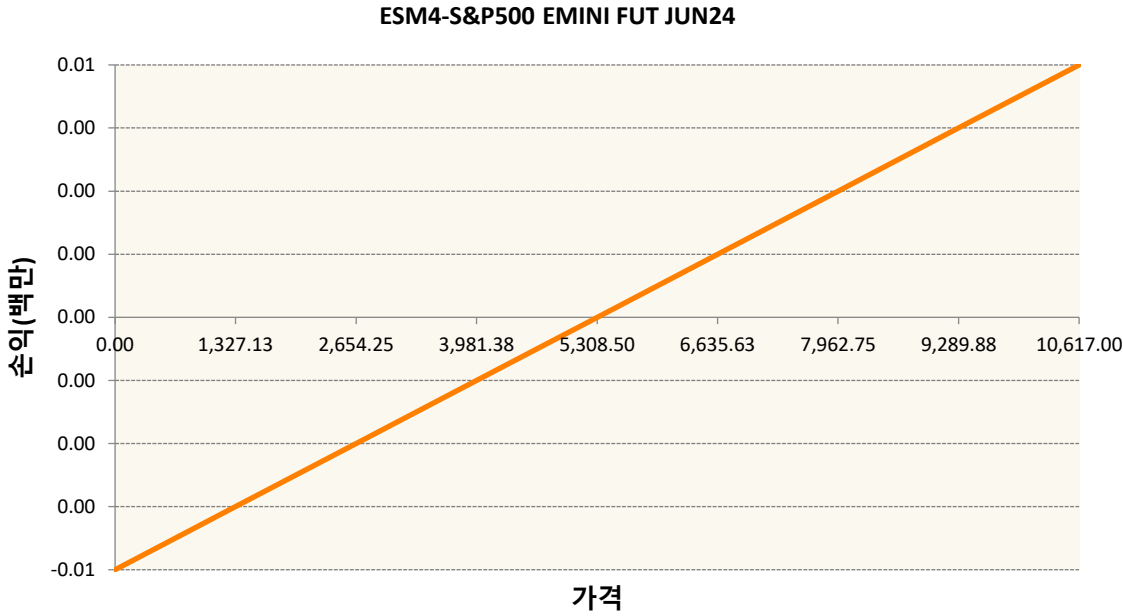
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

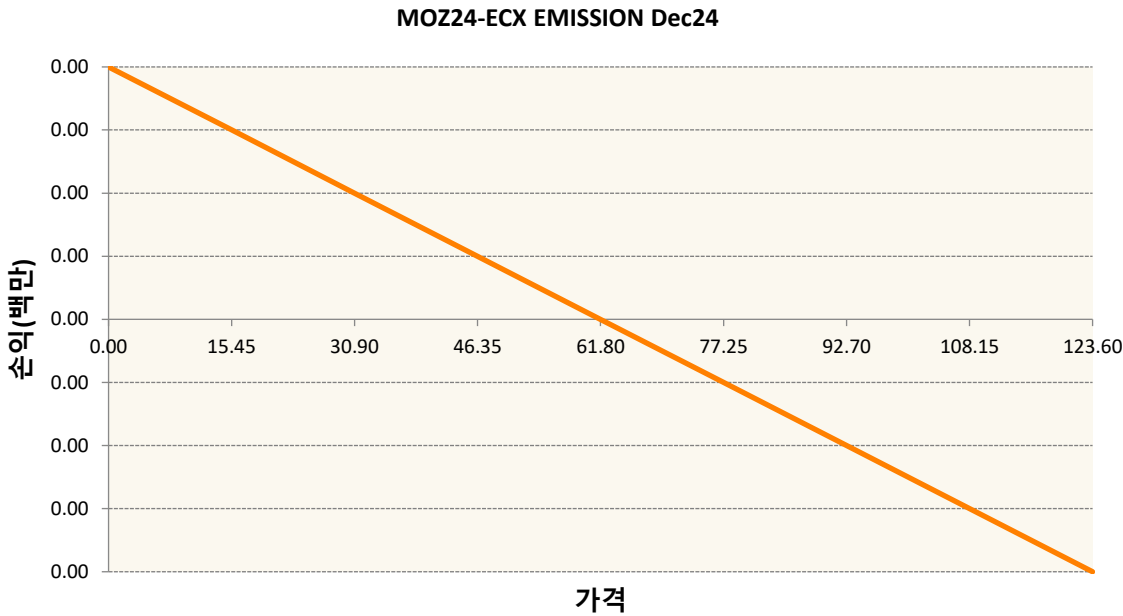
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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     | 5,593 | -5,593    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 331   | 0     | 331       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,103 | -1,103    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |      |
|----------------------------------------------------|------|
| FXW213E3SC KRW/EUR 30-04-24E                       | 88   |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 447  |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 0.42 |

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

(단위:백만원)

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

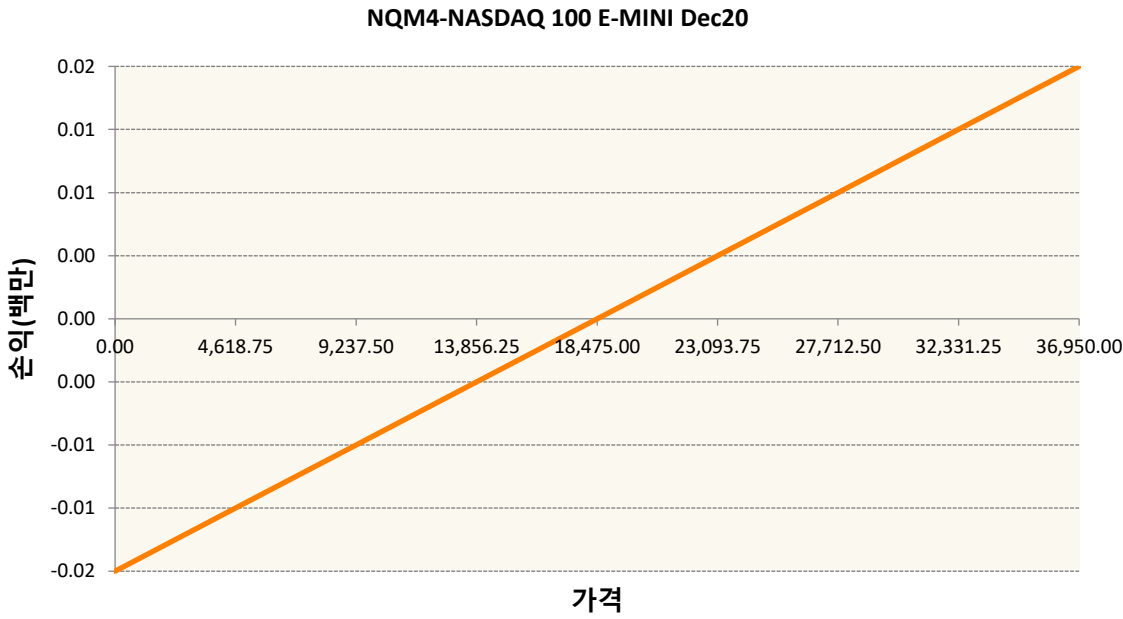
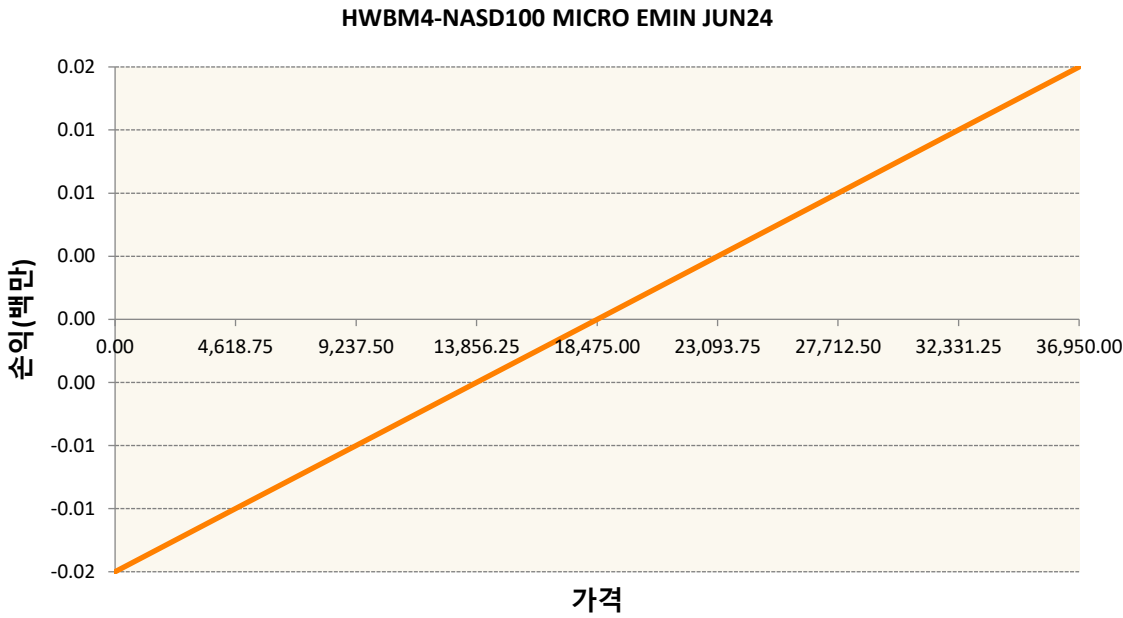
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

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 | 450   |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 5,870 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 1,646 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 727   |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 5,370 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-04-02 |
| 기준일 | 2024-04-01 |

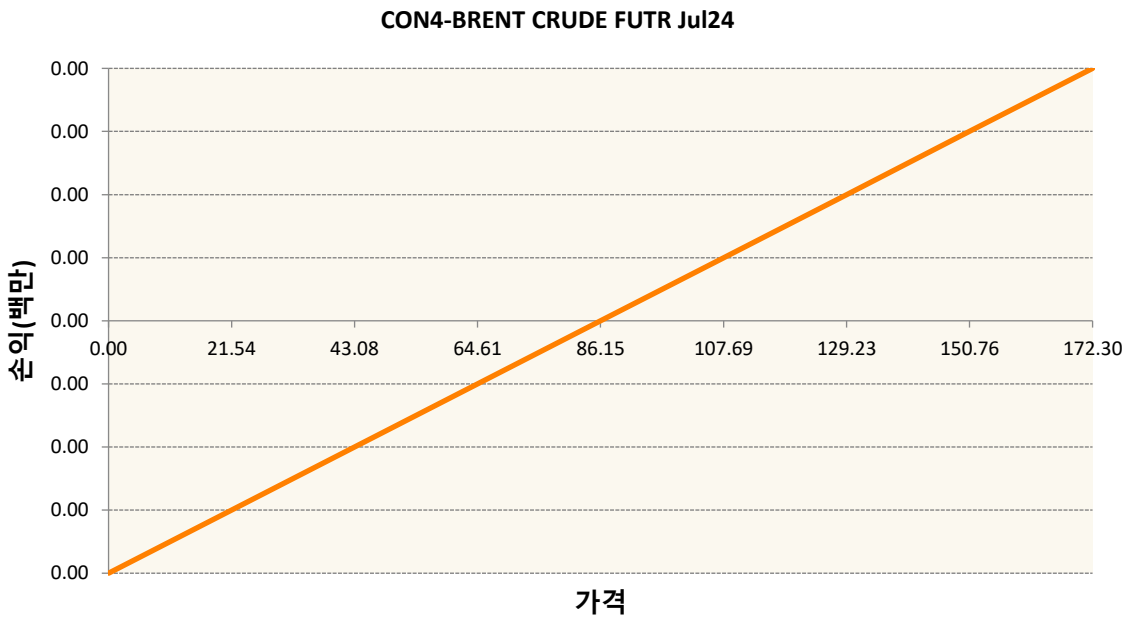
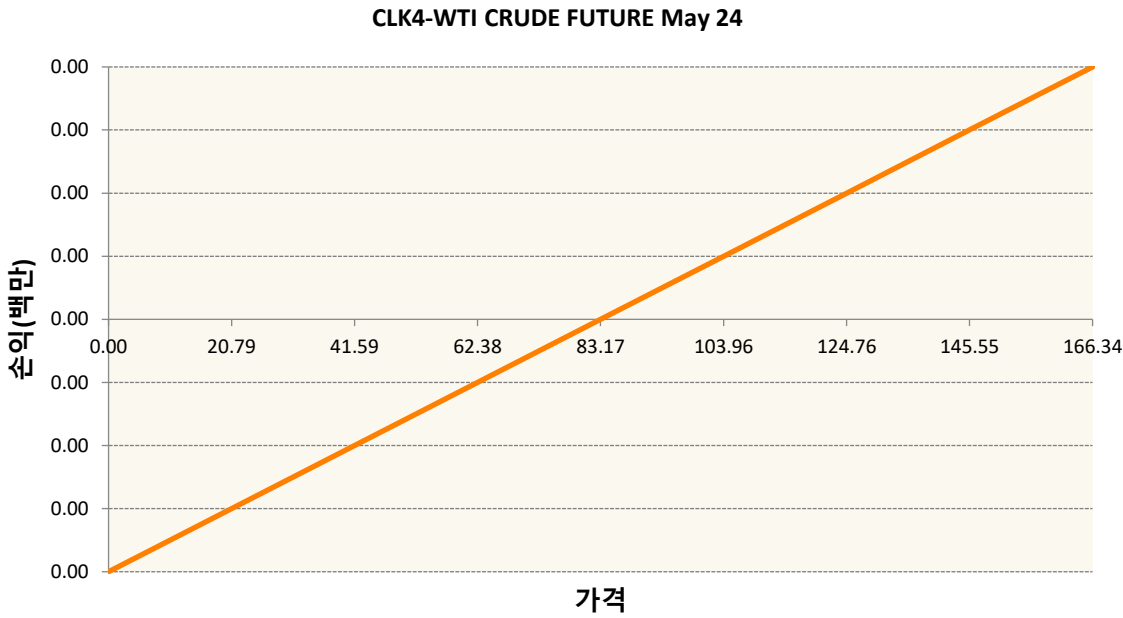
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

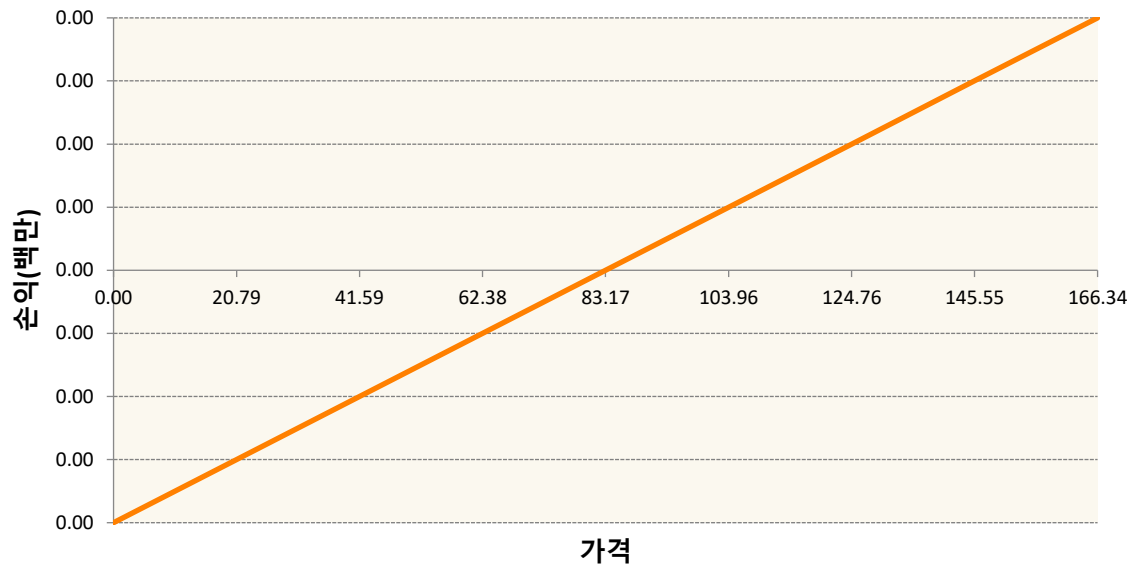
(단위:백만원)

| 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 |

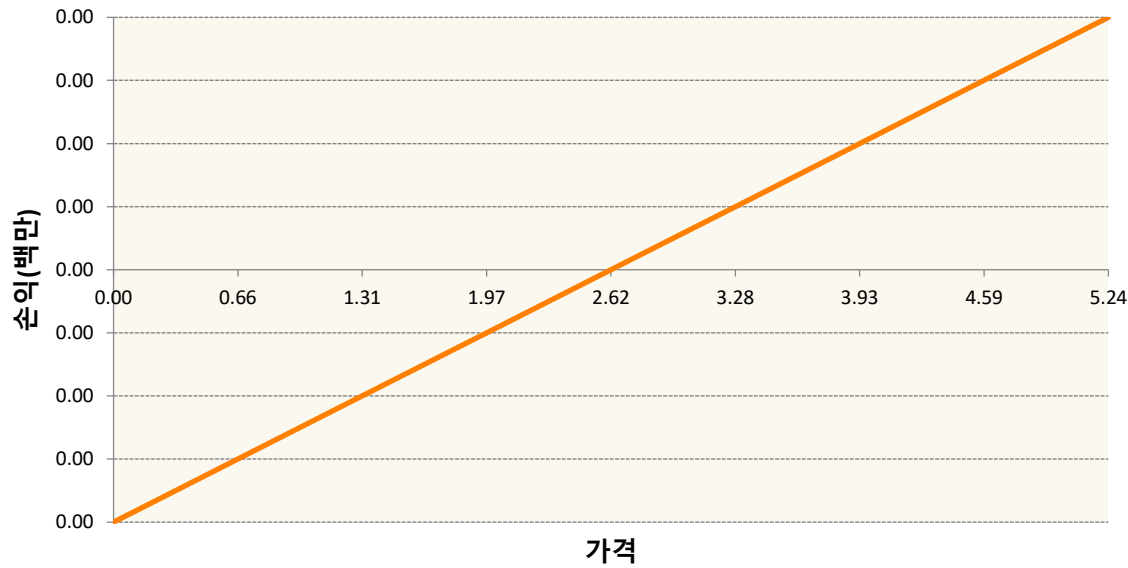
2. 만기시점의 손익구조



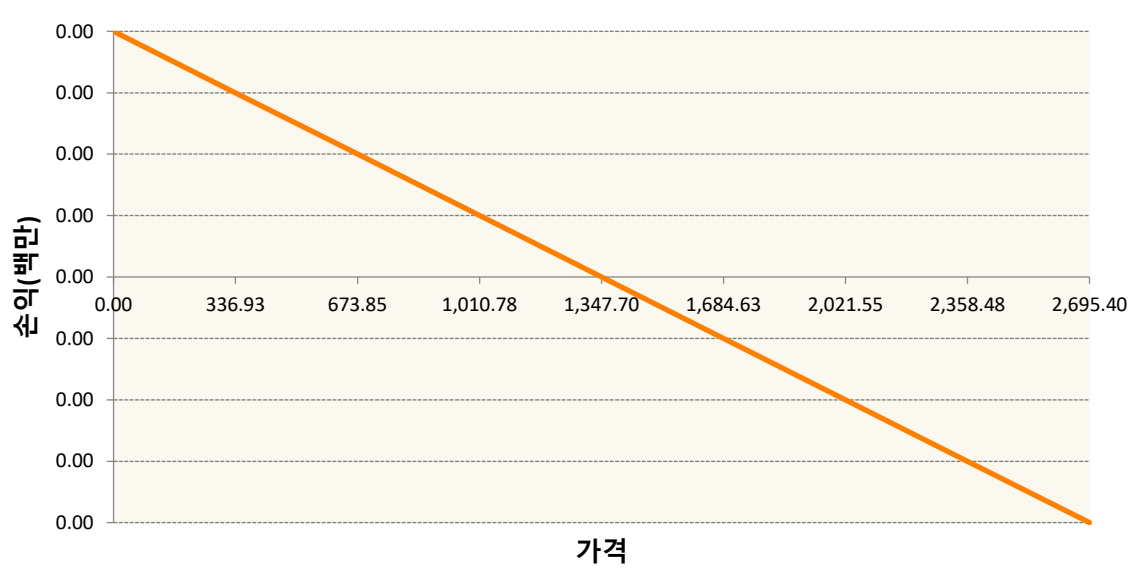
ECK4-E-mini Crude Oil May 24



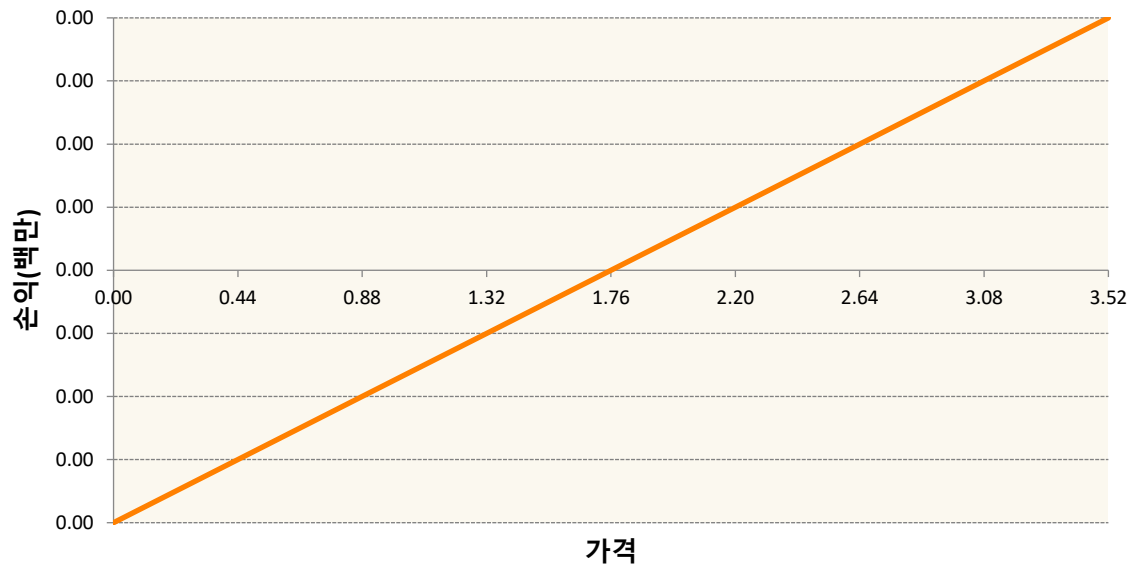
HOK4-NY Harb ULSD Fut May 24



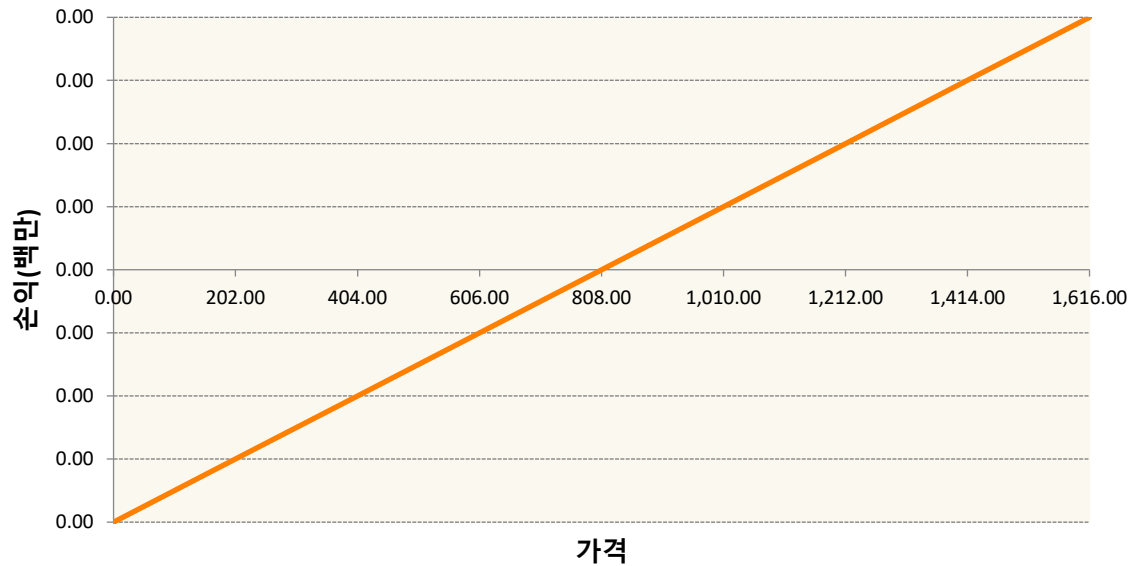
KR4175V40008-2024-04 달러선물



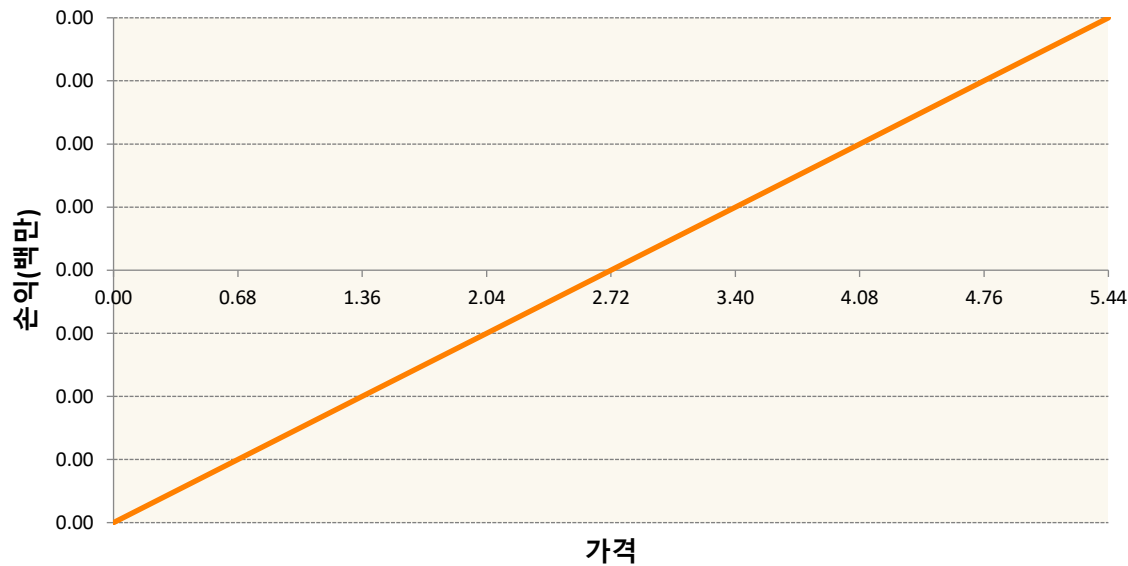
NGK24-NATURAL GAS FUTR May 24



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