

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

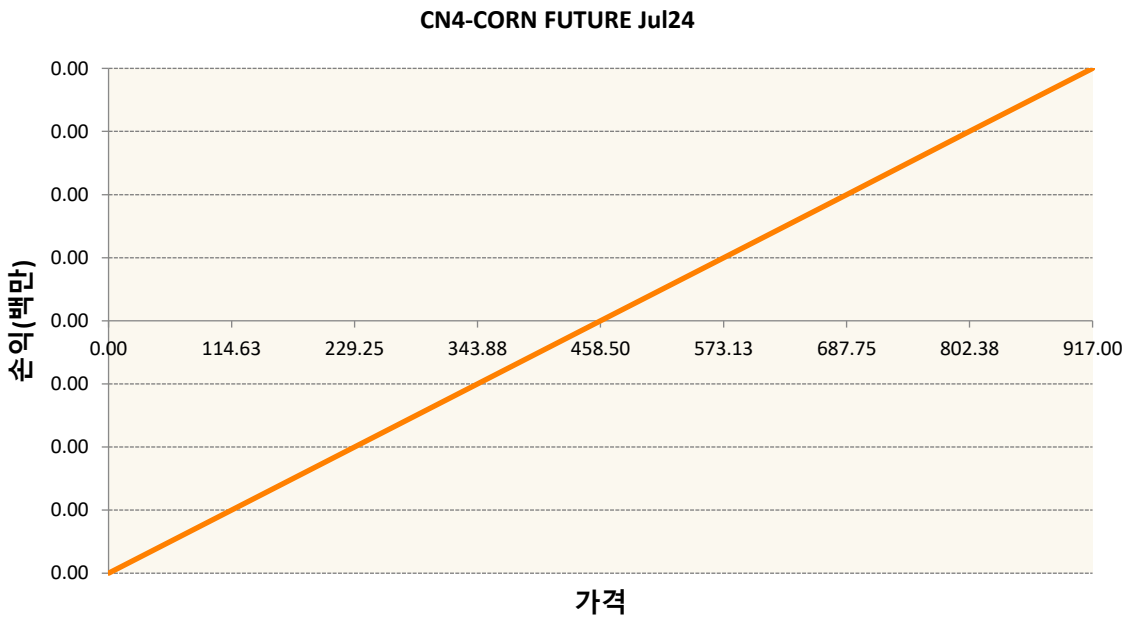
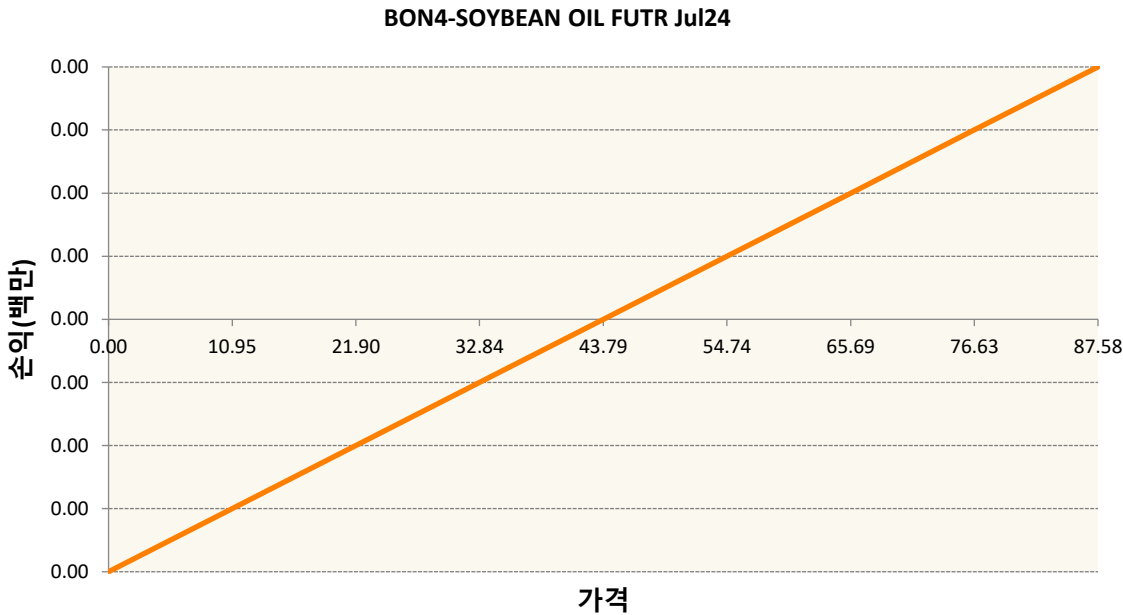
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

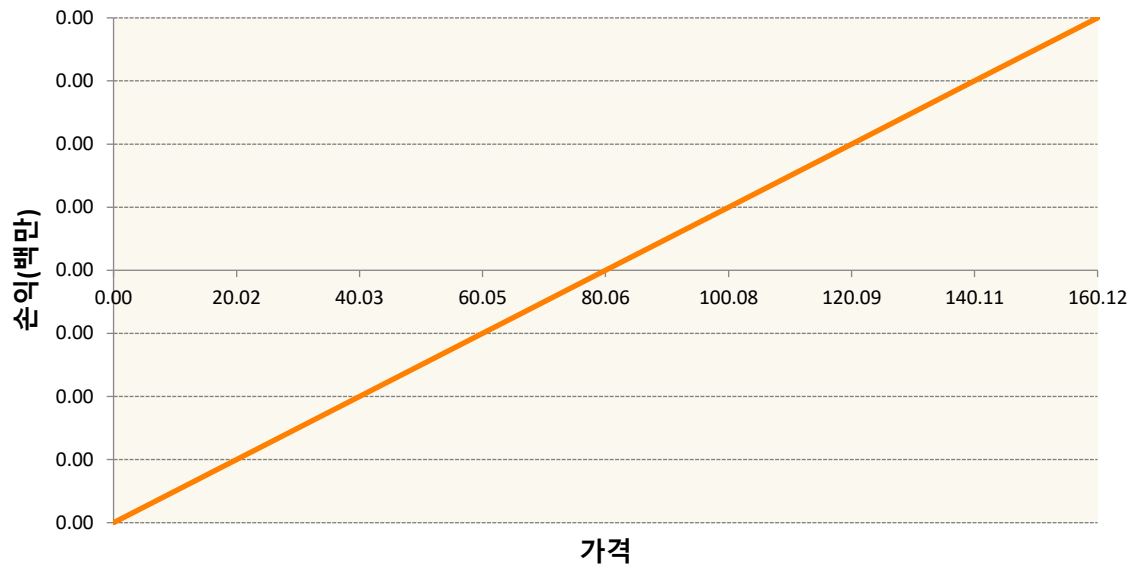
(단위:USD 백만)

| 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   | 4,288 | 0     | 4,288     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 507   | -507      | 장내 |

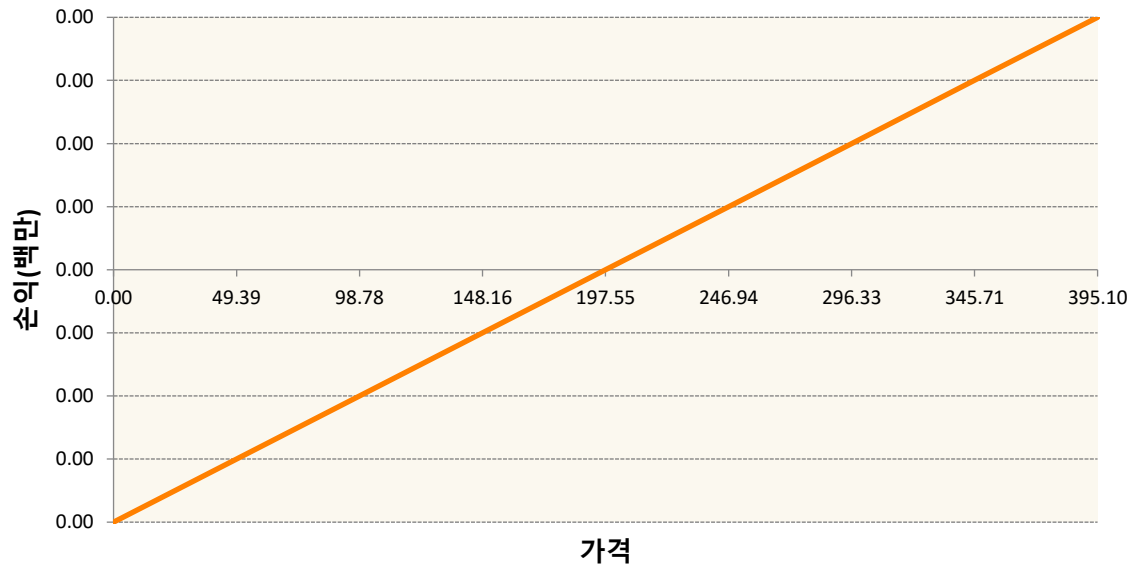
2. 만기시점의 손익구조



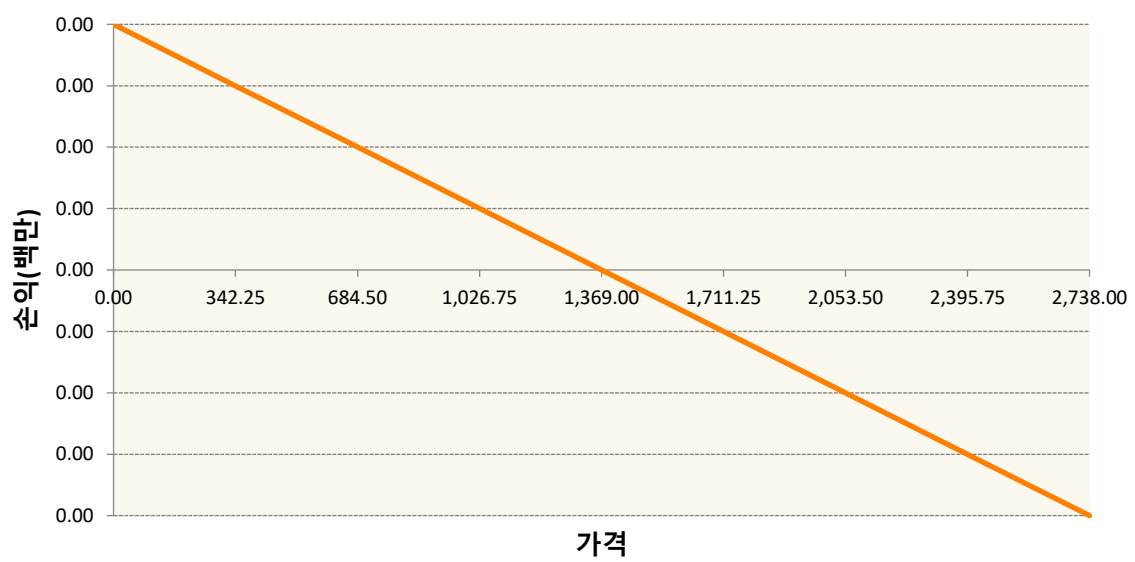
CTN4-COTTON NO.2 FUTR Jul24



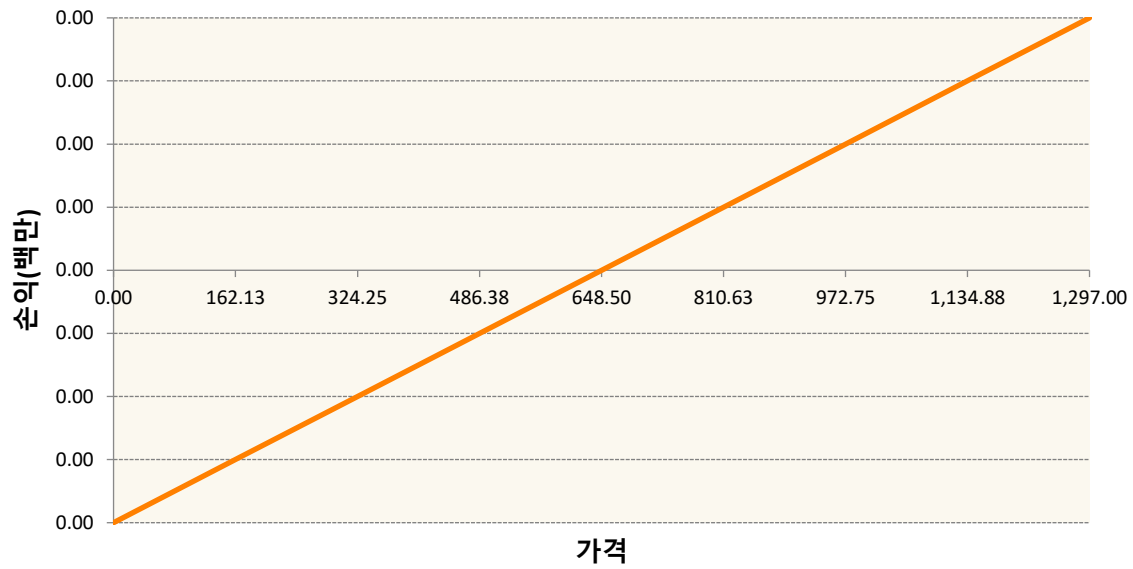
KCN4-COFFEE 'C' FUTURE Jul24



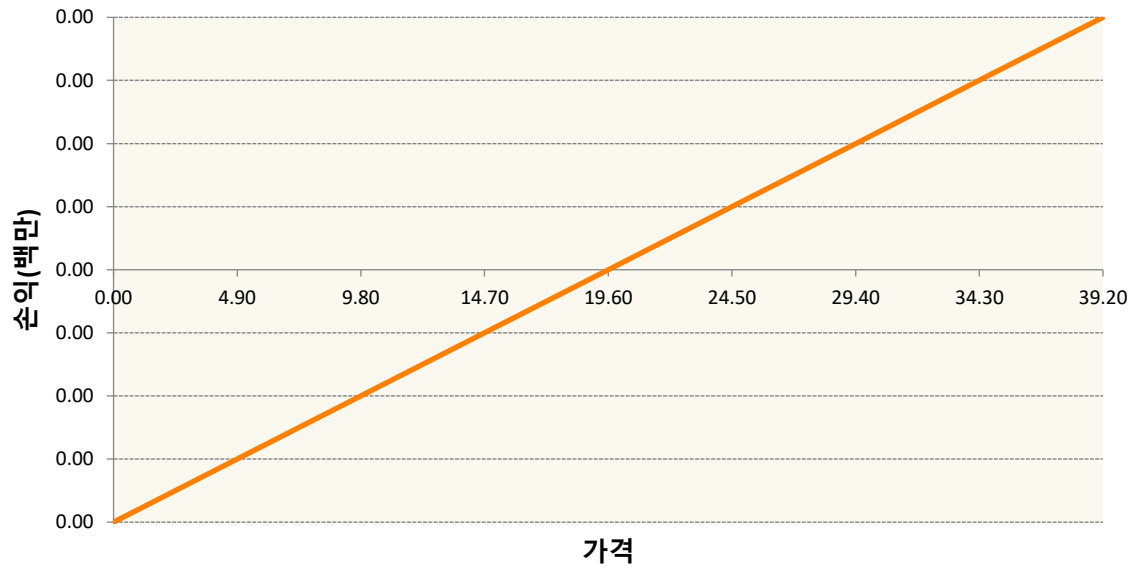
KR4175V50007-2024-05 달러선물



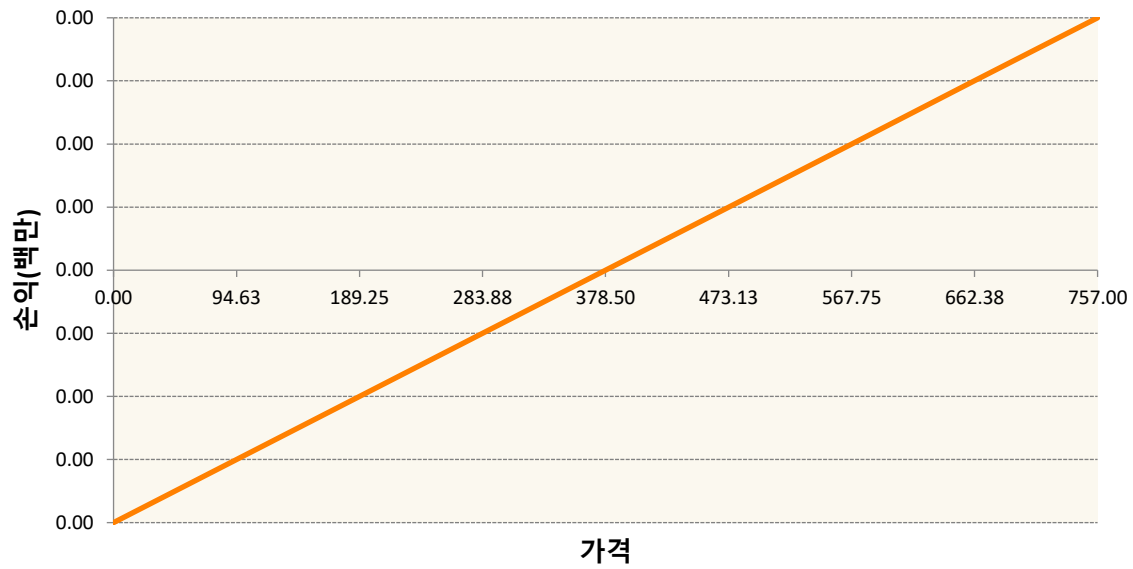
KWN4-KC HRW WHEAT FUT Jul24

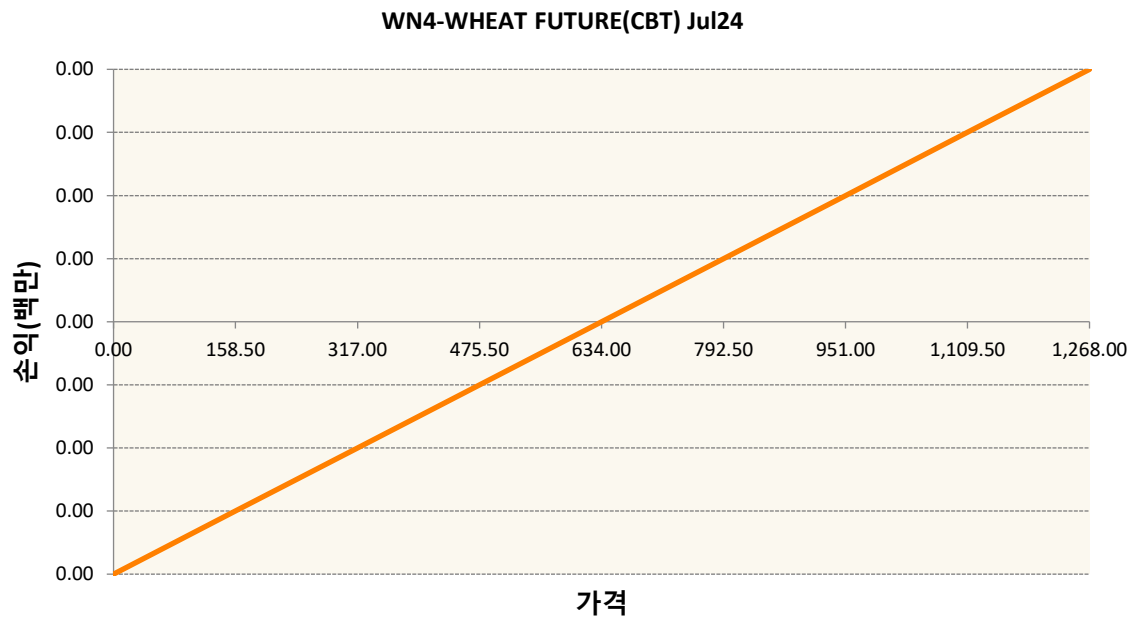
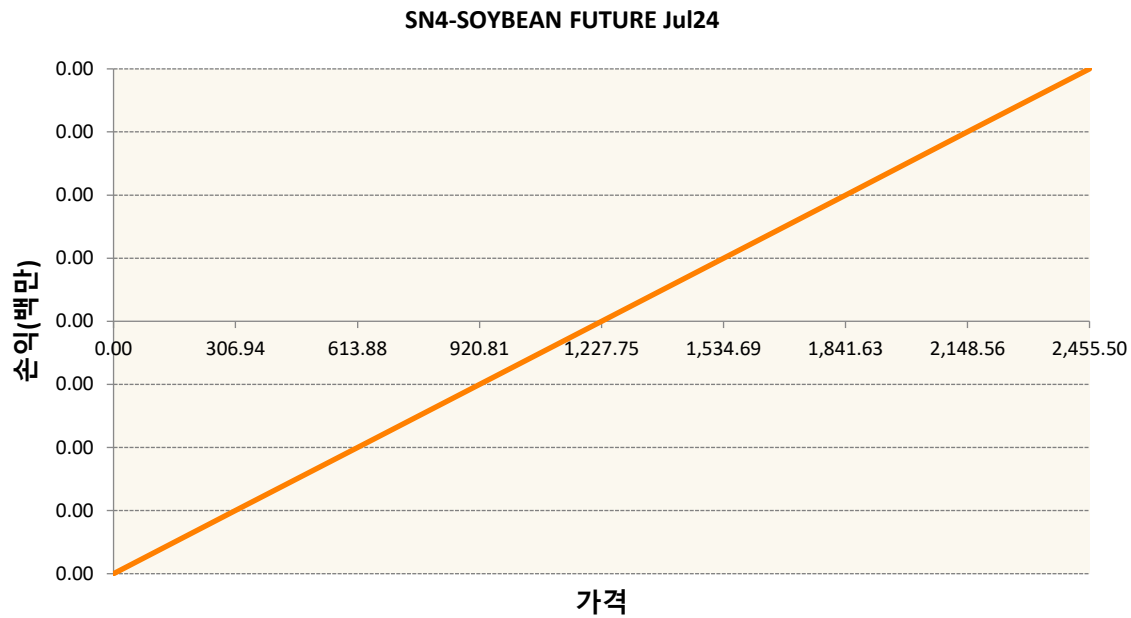


SBN4-Sugar #11 (WORLD) Jul24



SMN4-SOYBEAN MEAL FUTR Jul24





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

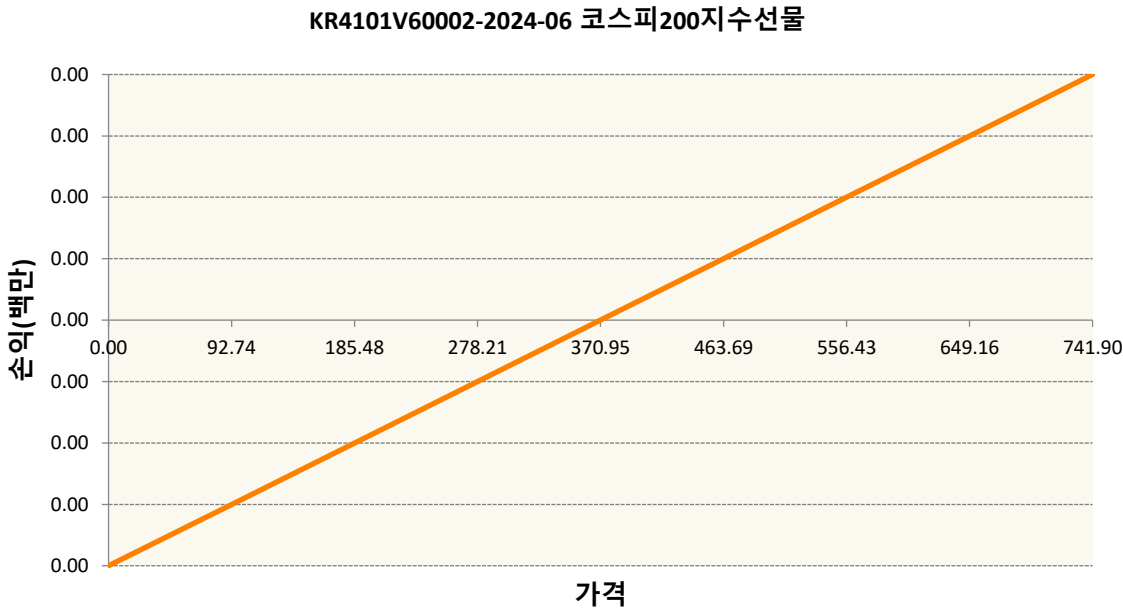
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 741   | -741      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,669 | 0     | 1,669     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           | 2024-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 133    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -133      | -133               | -133   | -133 | -133  | -133   | -133   |
| -5.33%       | -89       | -89                | -89    | -89  | -89   | -89    | -89    |
| -2.67%       | -44       | -44                | -44    | -44  | -44   | -44    | -44    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 44        | 44                 | 44     | 44   | 44    | 44     | 44     |
| 5.33%        | 89        | 89                 | 89     | 89   | 89    | 89     | 89     |
| 8.00%        | 133       | 133                | 133    | 133  | 133   | 133    | 133    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

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 | 272 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 328 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

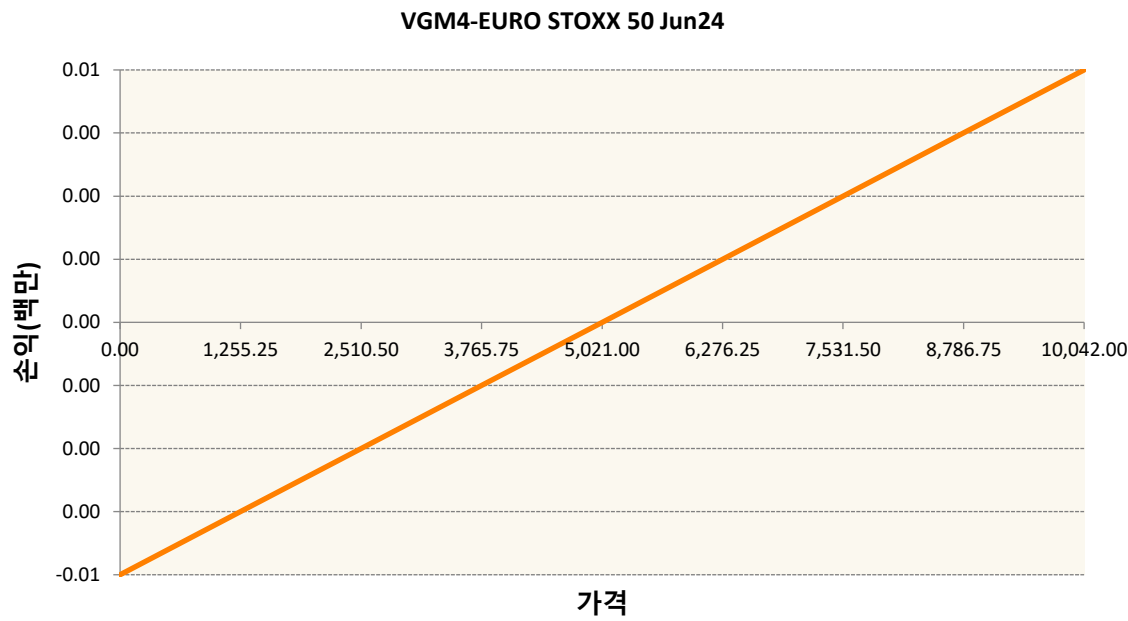
유로인덱스모(주식-파생형)

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   | 937   | 0     | 937       |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 221   | 0     | 221       | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |    |
|------------------------------|----|
| FXW213E3K( EUR/KRW 21-06-24E | 18 |
| VGM4 EURO STOXX 50 Jun24     | 75 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 62 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

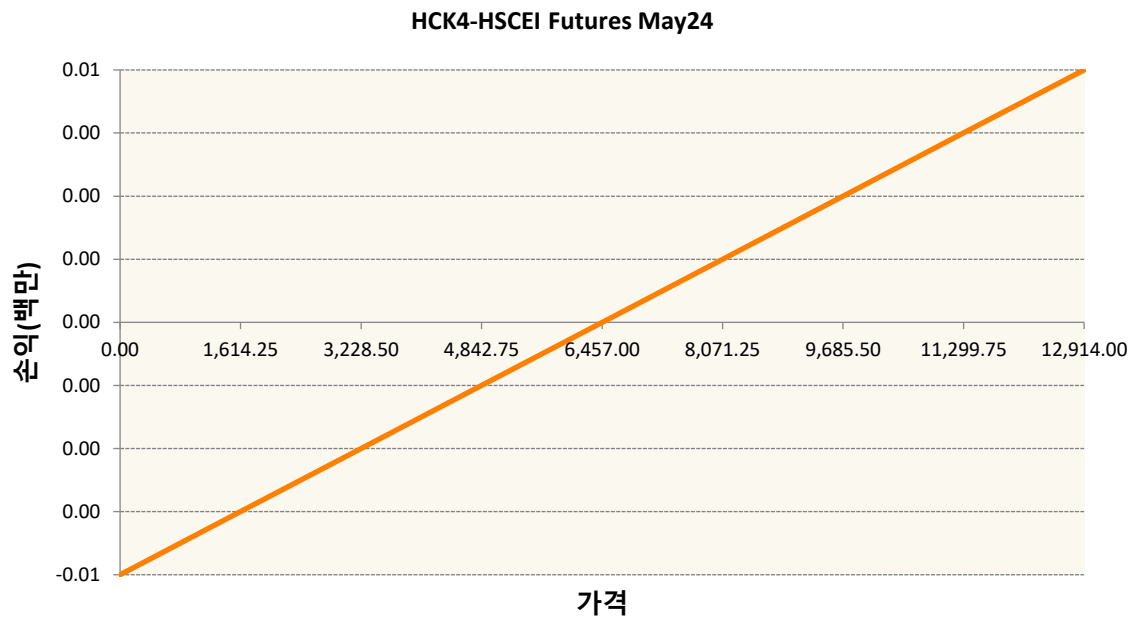
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,247 | 0     | 1,247     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCK4 | HSCEI Futures May24 | 100 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 126 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

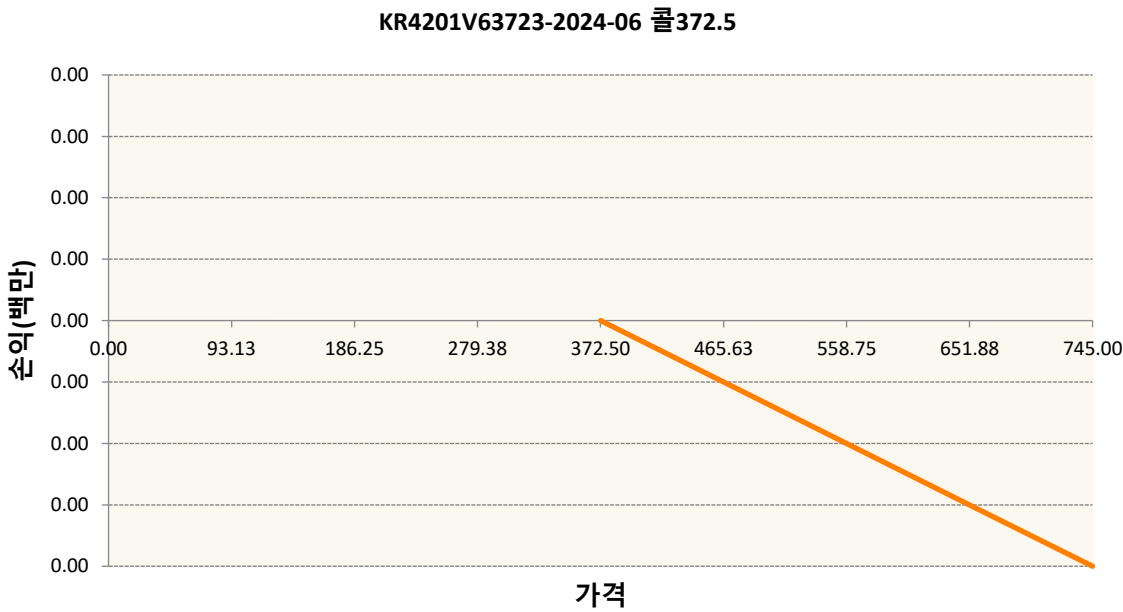
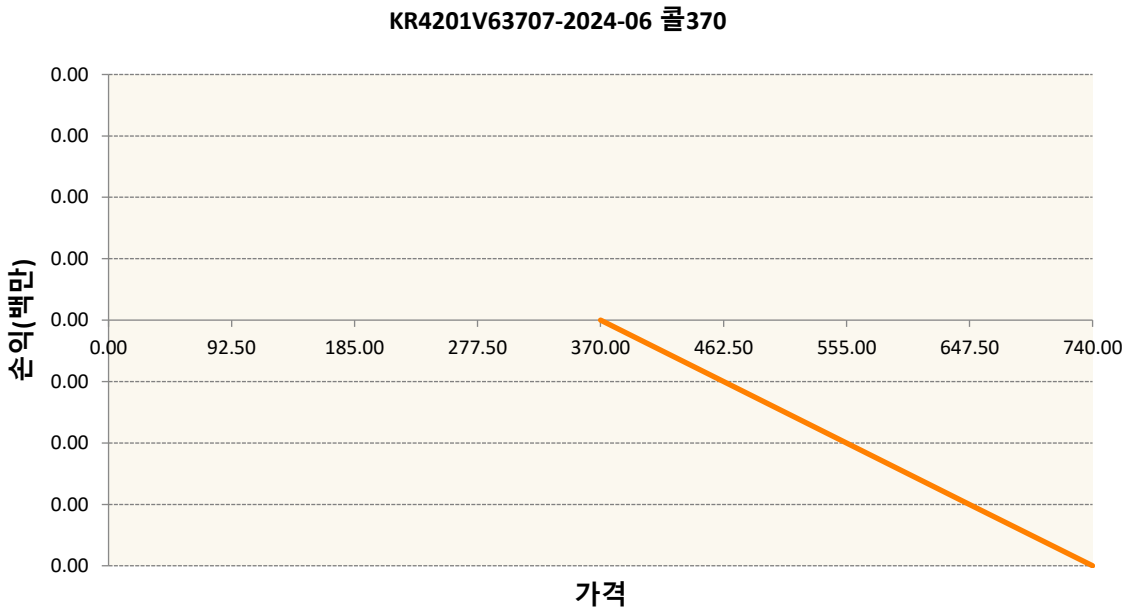
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

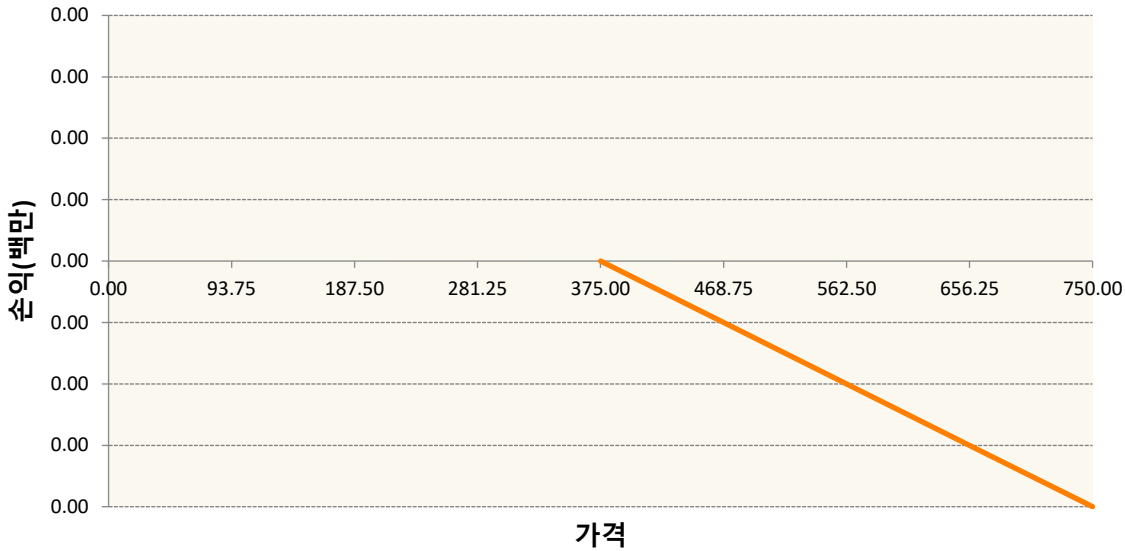
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 32,257 | -32,257   | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 31,631 | -31,631   | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



KR4201V63756-2024-06 콜375



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|              |           |                |        |      |       |        |        |
|--------------|-----------|----------------|--------|------|-------|--------|--------|
| KR4201V63707 |           | 2024-06 콜370   |        |      |       |        | 648    |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 322       | 310            | 295    | 278  | 261   | 242    | 221    |
| -5.33%       | 282       | 262            | 241    | 218  | 194   | 170    | 145    |
| -2.67%       | 208       | 181            | 154    | 126  | 99    | 70     | 42     |
| 0%           | 90        | 60             | 30     | 0    | -30   | -60    | -90    |
| 2.67%        | -76       | -105           | -133   | -162 | -191  | -221   | -250   |
| 5.33%        | -284      | -308           | -332   | -357 | -383  | -410   | -437   |
| 8.00%        | -525      | -541           | -560   | -580 | -602  | -624   | -648   |
| KR4201V63723 |           | 2024-06 콜372.5 |        |      |       |        | 855    |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 401       | 386            | 368    | 348  | 325   | 301    | 275    |
| -5.33%       | 356       | 330            | 303    | 274  | 243   | 212    | 179    |
| -2.67%       | 267       | 232            | 197    | 160  | 123   | 86     | 48     |
| 0%           | 122       | 81             | 41     | 0    | -41   | -81    | -122   |
| 2.67%        | -88       | -128           | -168   | -209 | -249  | -290   | -331   |
| 5.33%        | -358      | -392           | -427   | -463 | -500  | -538   | -576   |
| 8.00%        | -675      | -700           | -728   | -757 | -789  | -821   | -855   |
| KR4201V63756 |           | 2024-06 콜375   |        |      |       |        | 345    |
|              | 기초자산의 변동성 |                |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%        | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 153       | 147            | 140    | 133  | 124   | 114    | 104    |
| -5.33%       | 137       | 127            | 117    | 105  | 93    | 80     | 67     |
| -2.67%       | 105       | 91             | 77     | 62   | 47    | 32     | 16     |
| 0%           | 50        | 34             | 17     | 0    | -17   | -34    | -51    |

|       |      |      |      |      |      |      |      |
|-------|------|------|------|------|------|------|------|
| 2.67% | -31  | -48  | -65  | -82  | -99  | -116 | -134 |
| 5.33% | -137 | -152 | -168 | -184 | -200 | -216 | -232 |
| 8.00% | -265 | -277 | -289 | -302 | -316 | -331 | -345 |

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

(단위:백만원)

1,673

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

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 | 1,598 | 0     | 1,598     |    |

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 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

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 | 4,400 | 0     | 4,400     |    |

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 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

## 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 | 15,227 | 0      | 15,227    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 15,119 | -15,119   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |                                 |
|------------------------------|---------------------------------|
| FXW213E2TC KRW/USD 31-05-24E | 592                             |
| FXW213E3TC KRW/USD 28-06-24E | 422                             |
| FXW213E4SC KRW/USD 31-07-24E | 196                             |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 562 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

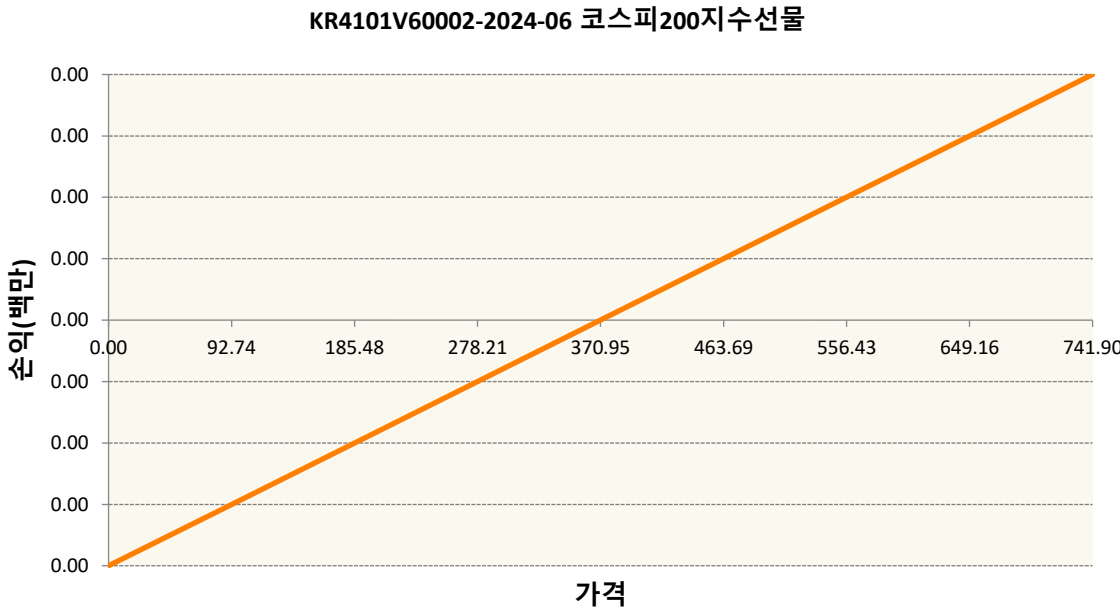
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,113 | 0     | 1,113     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           | 2024-06 코스피200지수선물 |        |     |       |        | 89     |
|--------------|-----------|--------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -89       | -89                | -89    | -89 | -89   | -89    | -89    |
| -5.33%       | -59       | -59                | -59    | -59 | -59   | -59    | -59    |
| -2.67%       | -30       | -30                | -30    | -30 | -30   | -30    | -30    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 30        | 30                 | 30     | 30  | 30    | 30     | 30     |
| 5.33%        | 59        | 59                 | 59     | 59  | 59    | 59     | 59     |
| 8.00%        | 89        | 89                 | 89     | 89  | 89    | 89     | 89     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

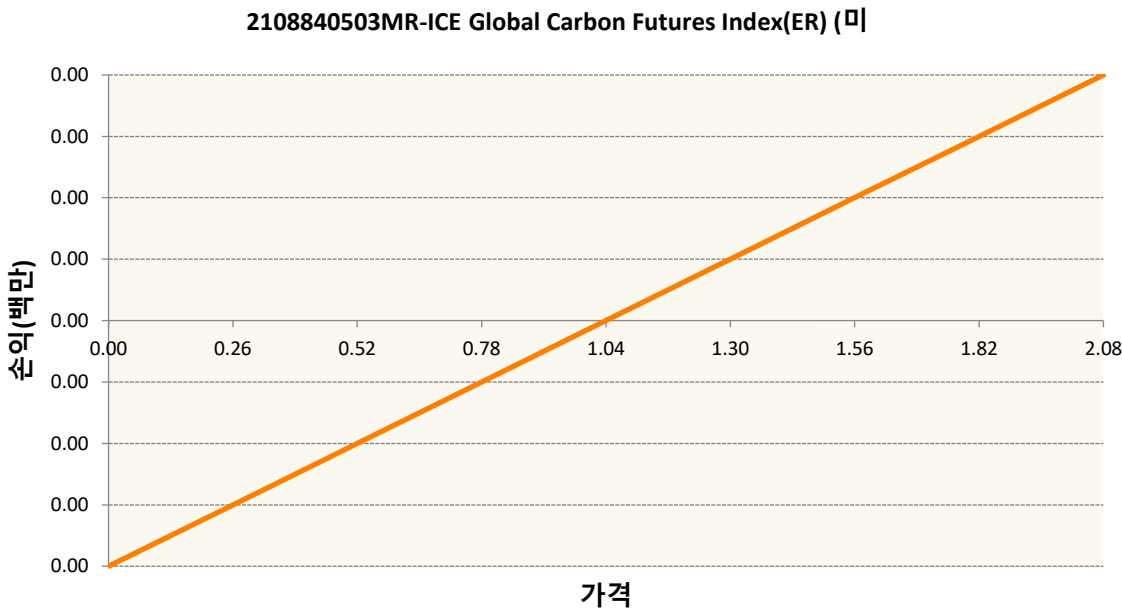
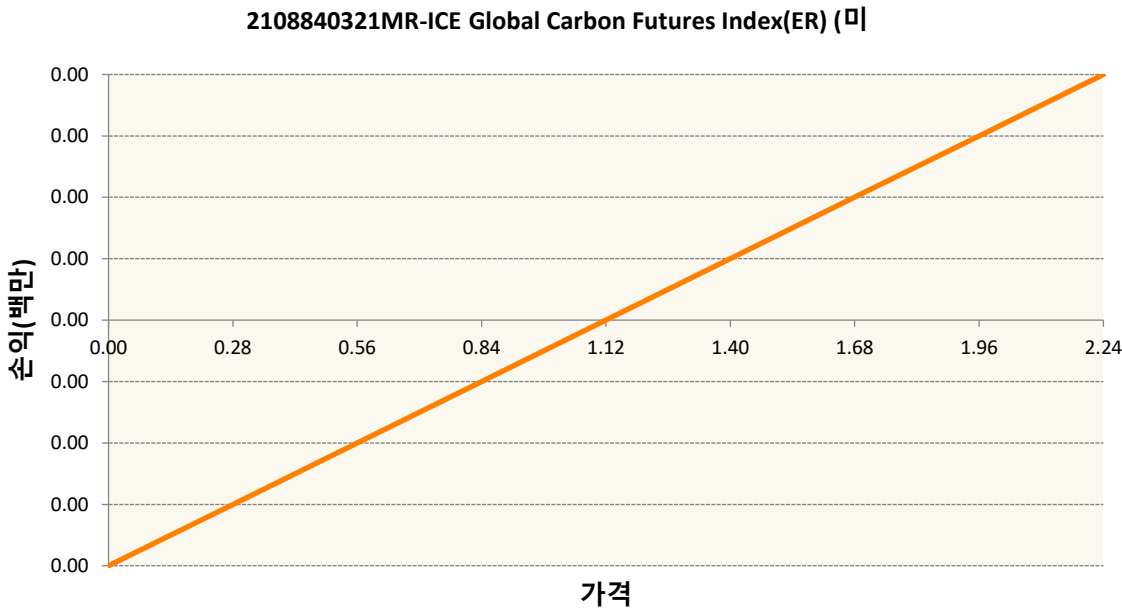
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

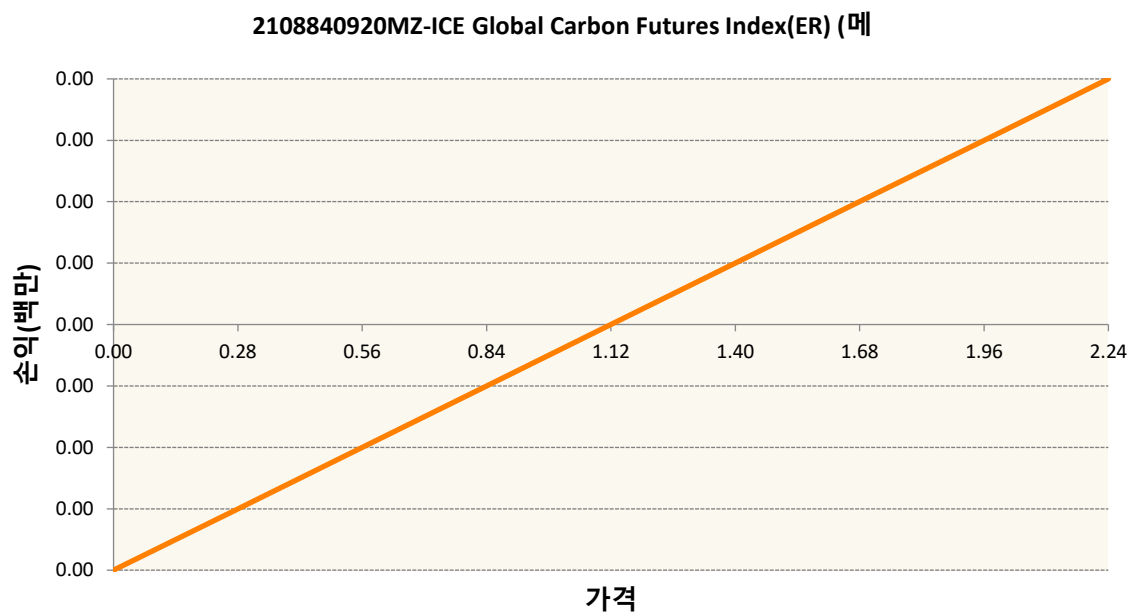
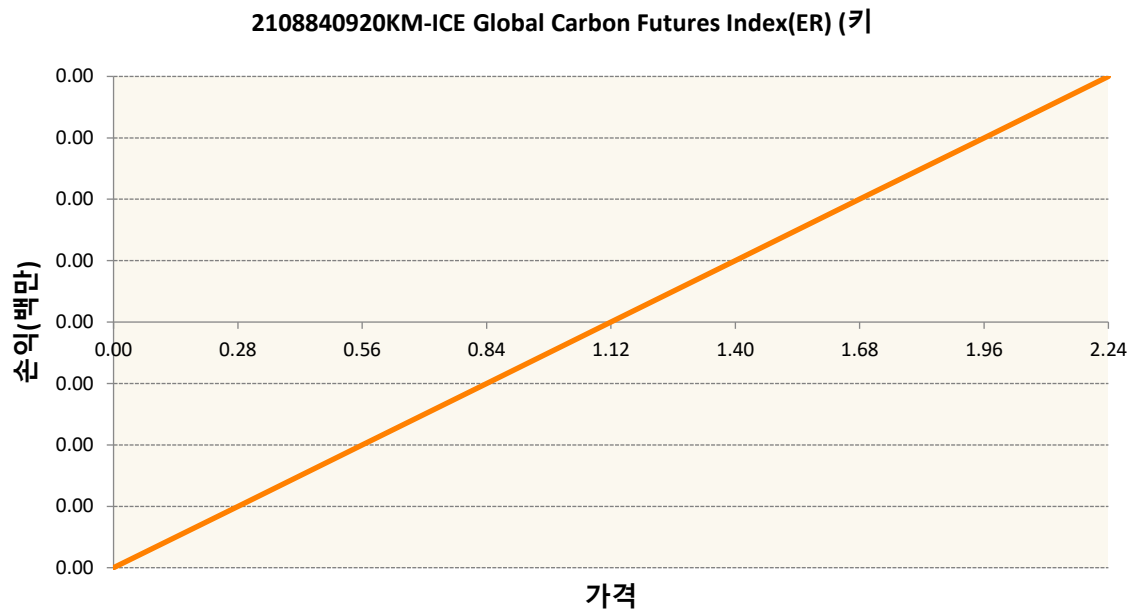
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 23,087 | 0     | 23,087    |    |

2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                          |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840321IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미) |  | 485      |
| 2108840503IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미) |  | 194      |
| 2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (키) |  | 970      |
| 2108840920IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메) |  | 194      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 2,162    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

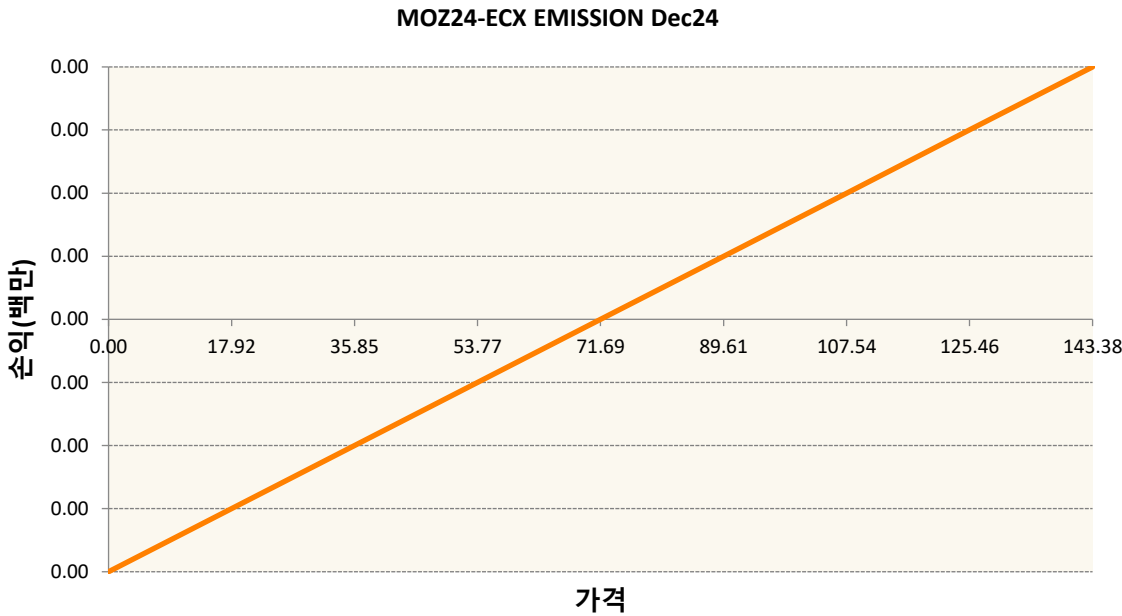
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 10,752 | 0     | 10,752    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 331    | 0     | 331       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 2,675 | -2,675    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E                        | 23  |
| FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E                        | 191 |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 860 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 5   |

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

(단위:백만원)

1,700

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

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)  | 11 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230622 (메리츠) | 11 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 230922 (키움)  | 7  |
| SWCSI00000 신한CSI Index 231013 (NH)  | 8  |

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

(단위:백만원)

53

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

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)  | 7 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(NH)  | 6 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(메리츠) | 9 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 2 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 27 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

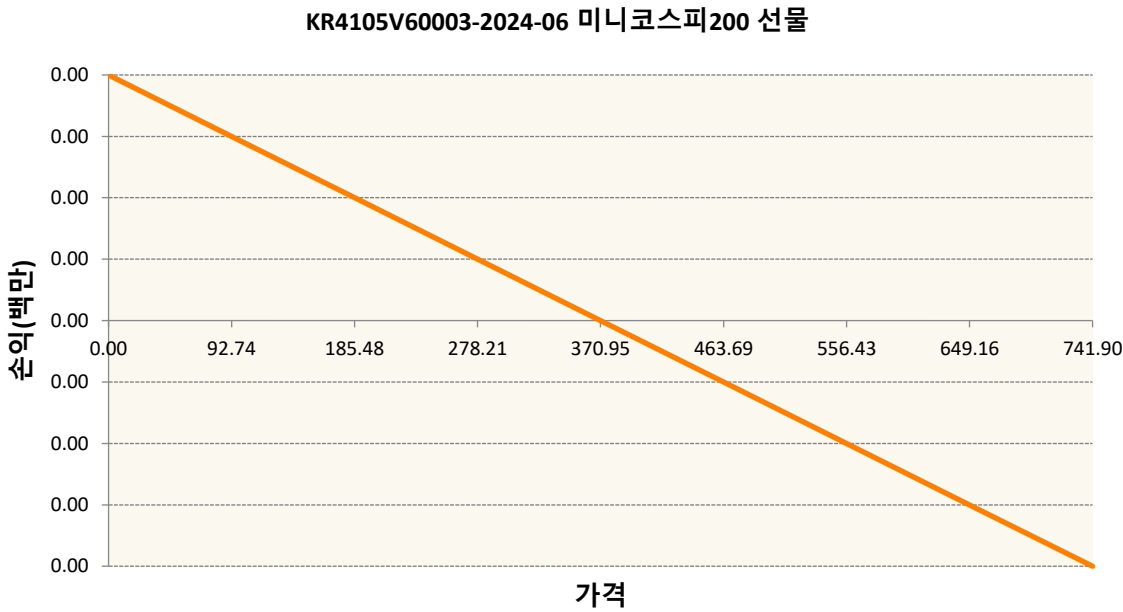
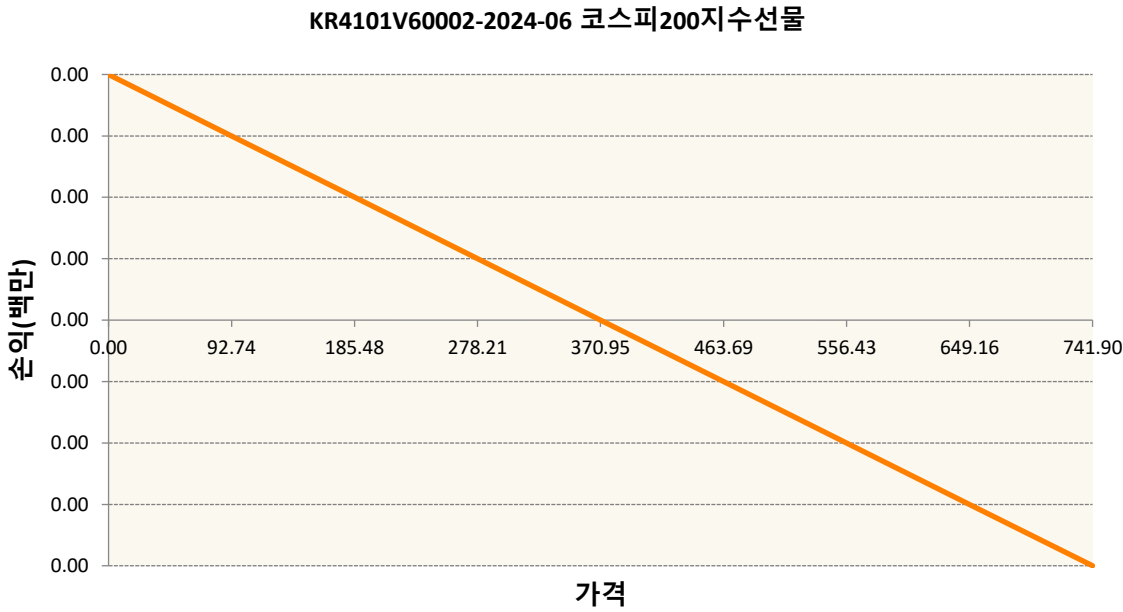
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

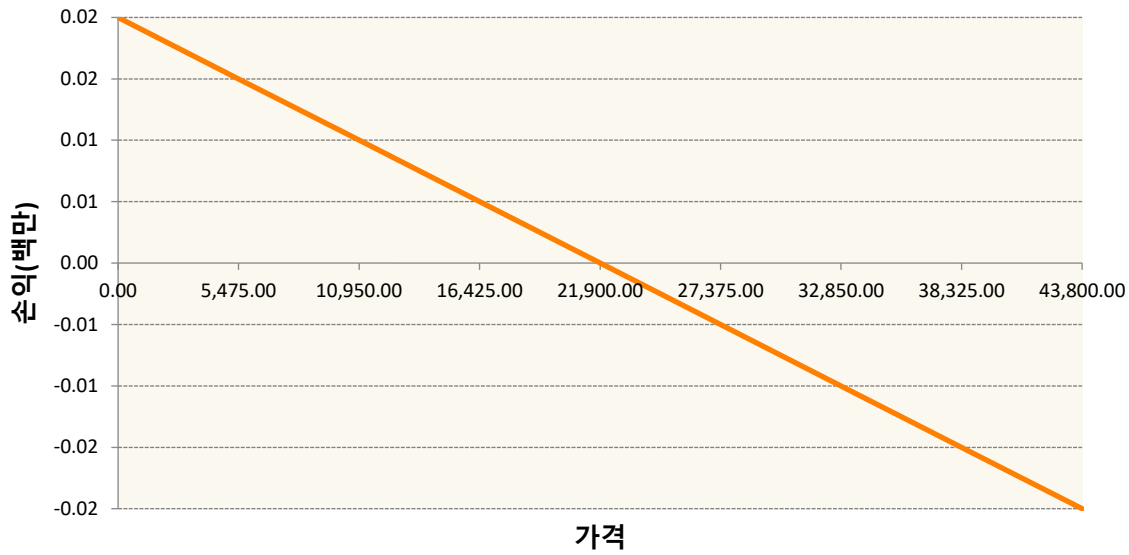
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 475   | -475      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 847   | -847      | 장내 |

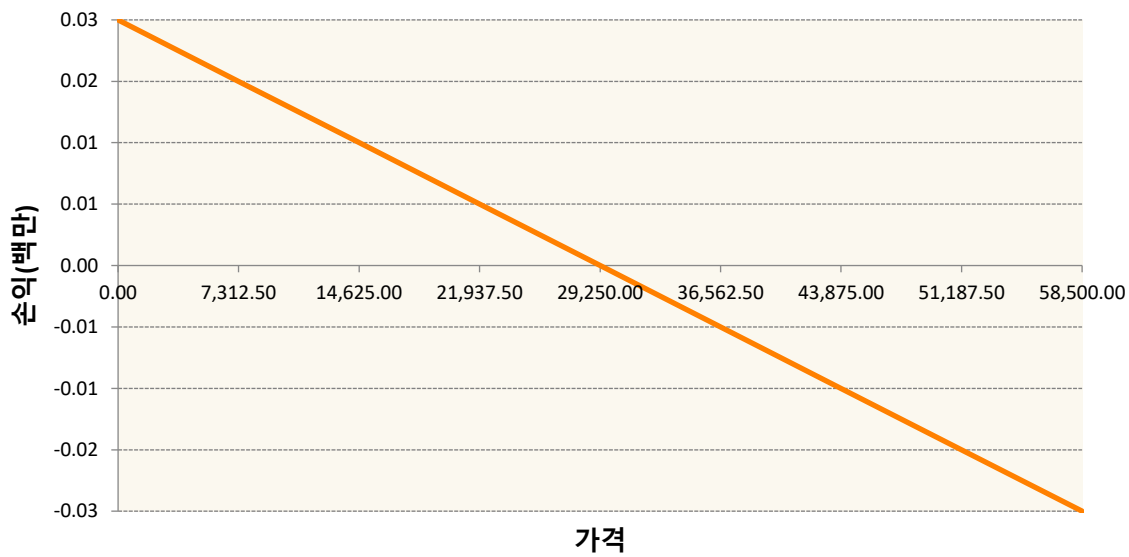
2. 만기시점의 손익구조



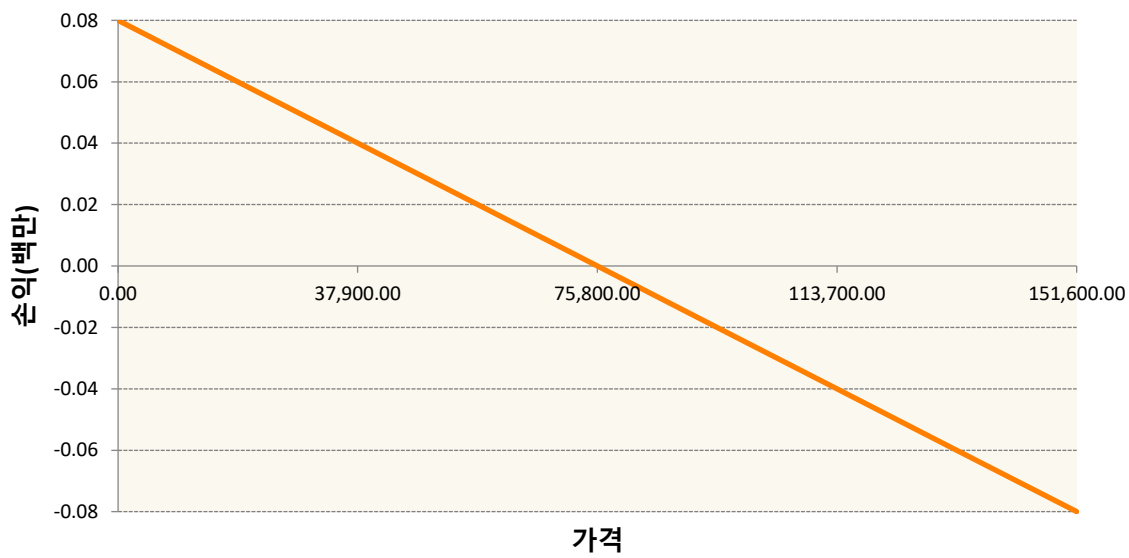
KR4157V60004-2024-06 대한항공개별선물



KR41CBV60006-2024-06 한화솔루션개별선물



KR41CDV60002-2024-06 현대미포조선개별선물



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)      |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------|--|----------|
| KR4101V600 2024-06 코스피200지수선물  |  | 30       |
| KR4105V600 2024-06 미니코스피200 선물 |  | 7        |
| KR4157V600 2024-06 대한항공개별선물    |  | 0.3      |
| KR41CBV600 2024-06 한화솔루션개별선물   |  | 0.23     |
| KR41CDV600 2024-06 현대미포조선개별선물  |  | 0.42     |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 37       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

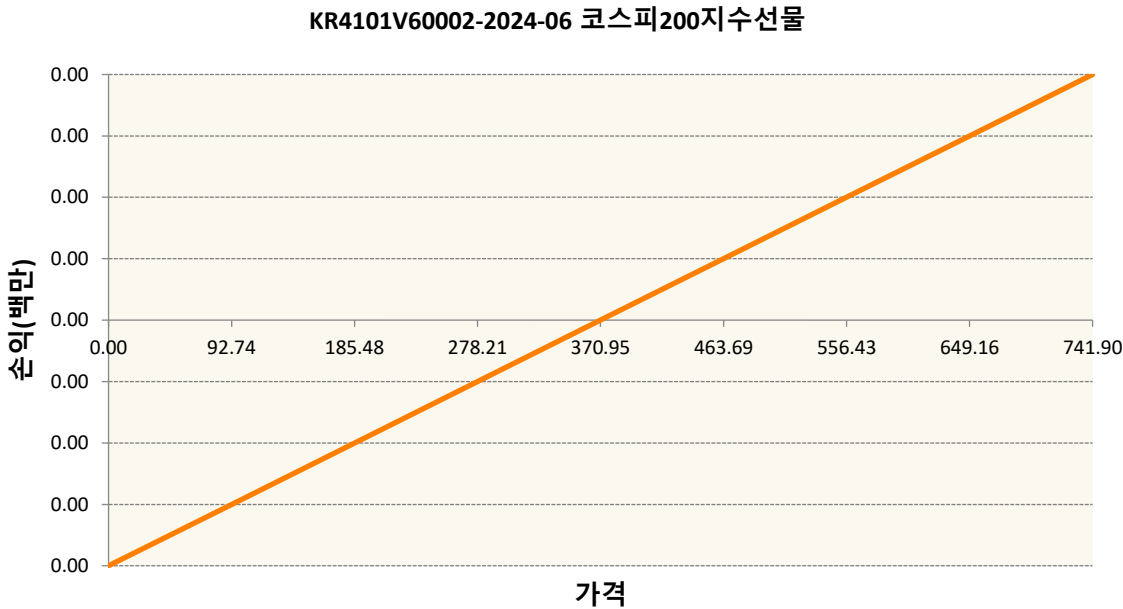
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 1,483 | -1,483    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,782 | 0     | 2,782     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101V60002 |           | 2024-06 코스피200지수선물 |        |      |       |        | 221    |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -221      | -221               | -221   | -221 | -221  | -221   | -221   |
| -5.33%       | -148      | -148               | -148   | -148 | -148  | -148   | -148   |
| -2.67%       | -74       | -74                | -74    | -74  | -74   | -74    | -74    |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 74        | 74                 | 74     | 74   | 74    | 74     | 74     |
| 5.33%        | 148       | 148                | 148    | 148  | 148   | 148    | 148    |
| 8.00%        | 221       | 221                | 221    | 221  | 221   | 221    | 221    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

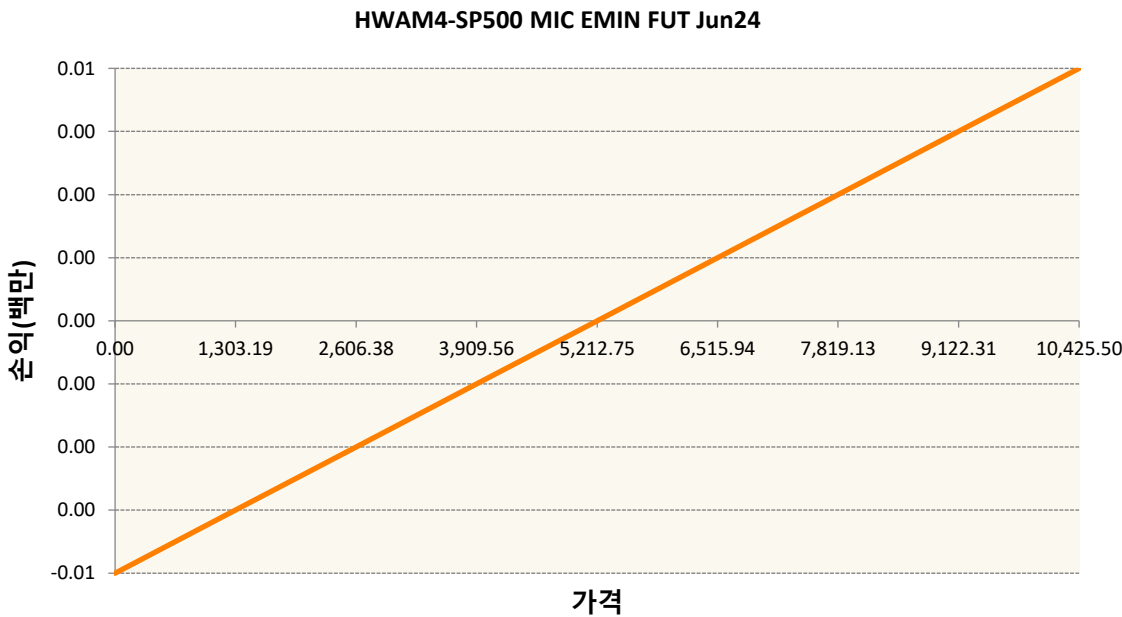
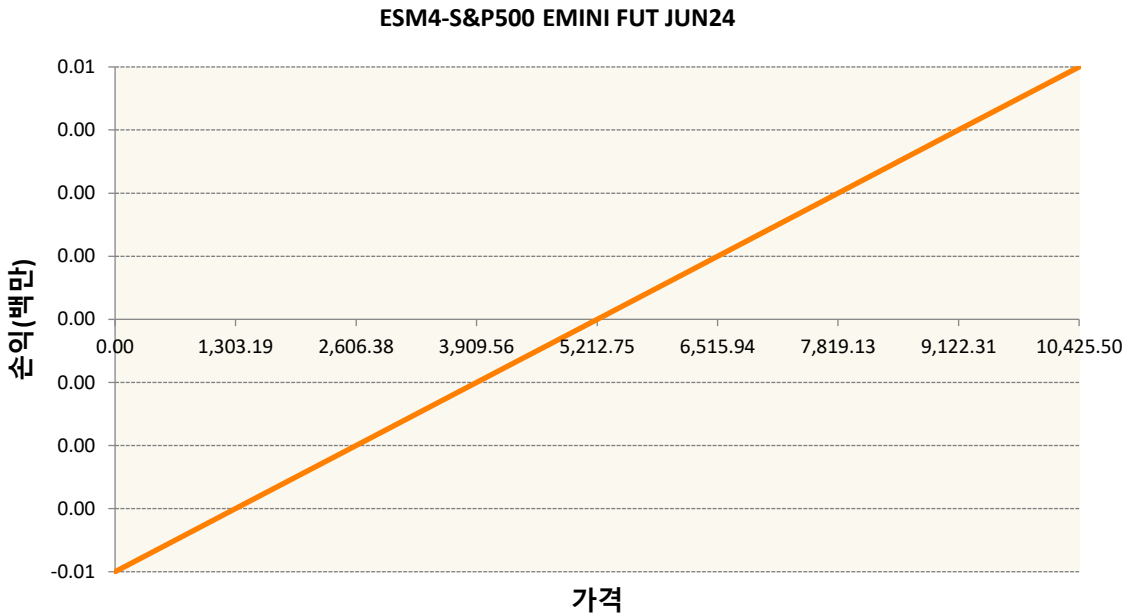
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 5,197 | 0     | 5,197     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,969 | 0     | 1,969     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESM4                      | S&P500 EMINI FUT JUN24   | 416      |
| HWAM4                     | SP500 MIC EMIN FUT Jun24 | 158      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 374      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

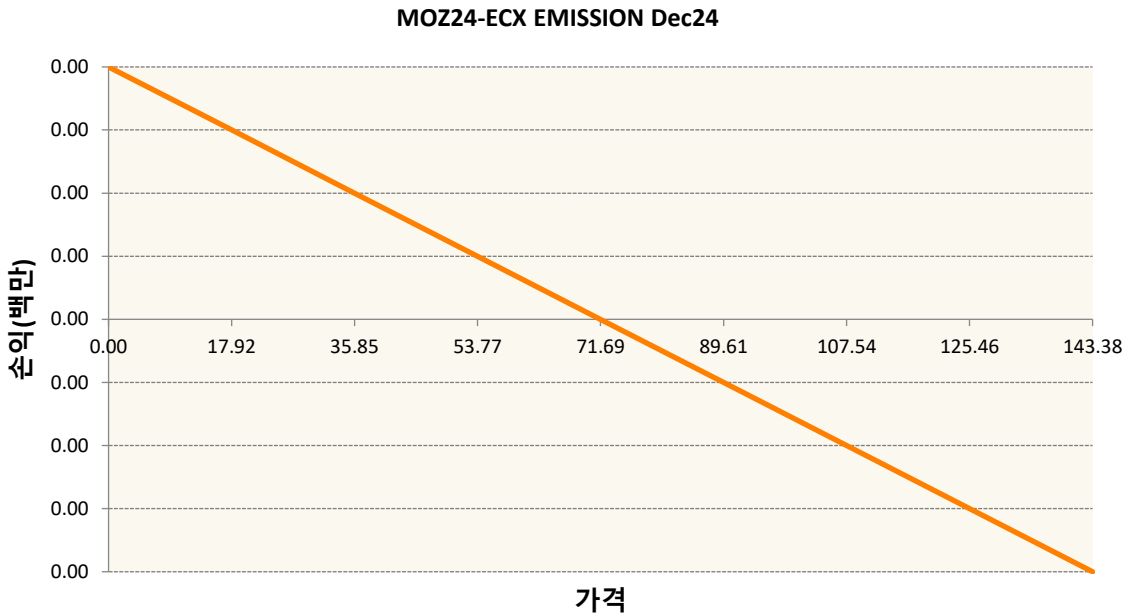
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 4,285 | -4,285    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 331   | 0     | 331       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,447 | -1,447    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |     |
|----------------------------------------------------|-----|
| FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E                        | 9   |
| FXW213E4W KRW/EUR 31-05-24E                        | 107 |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                           | 343 |
| SWICEUACN ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 5   |

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

(단위:백만원)

700

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

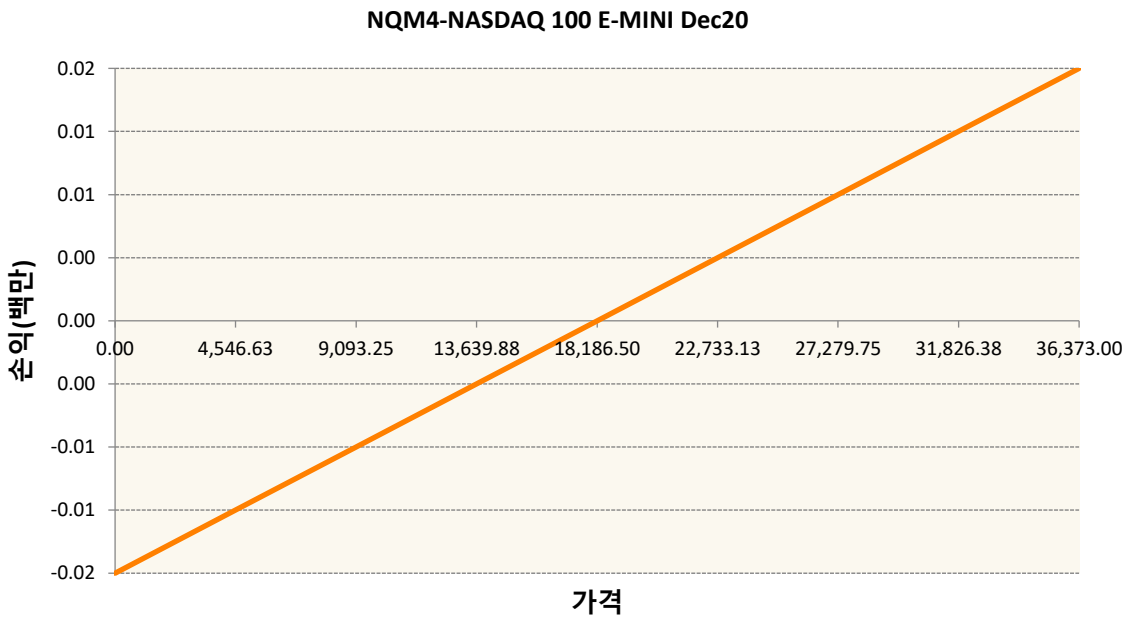
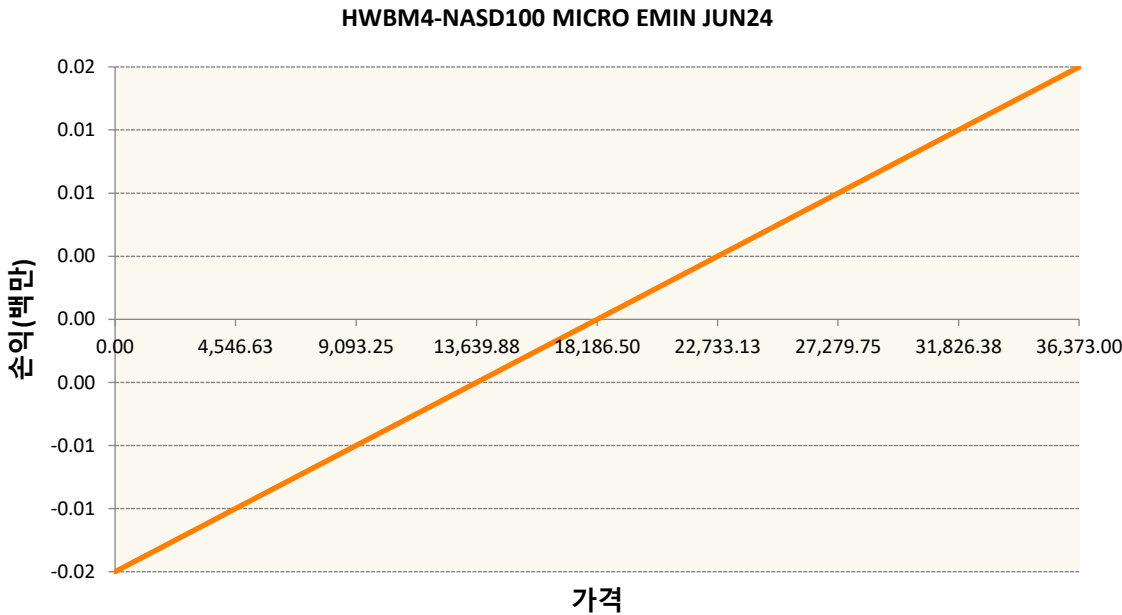
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 2,402 | 0     | 2,402     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,313 | 0     | 2,313     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBM4                     | NASD100 MICRO EMIN JUN24 |  | 185      |
| NQM4                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 192      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 293      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

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   | 150,060 | 0     | 150,060   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |       |
|-----------------------------------------------------|-------|
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 441   |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 949   |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 8,823 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 1,989 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 7,681 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-05-10 |
| 기준일 | 2024-05-09 |

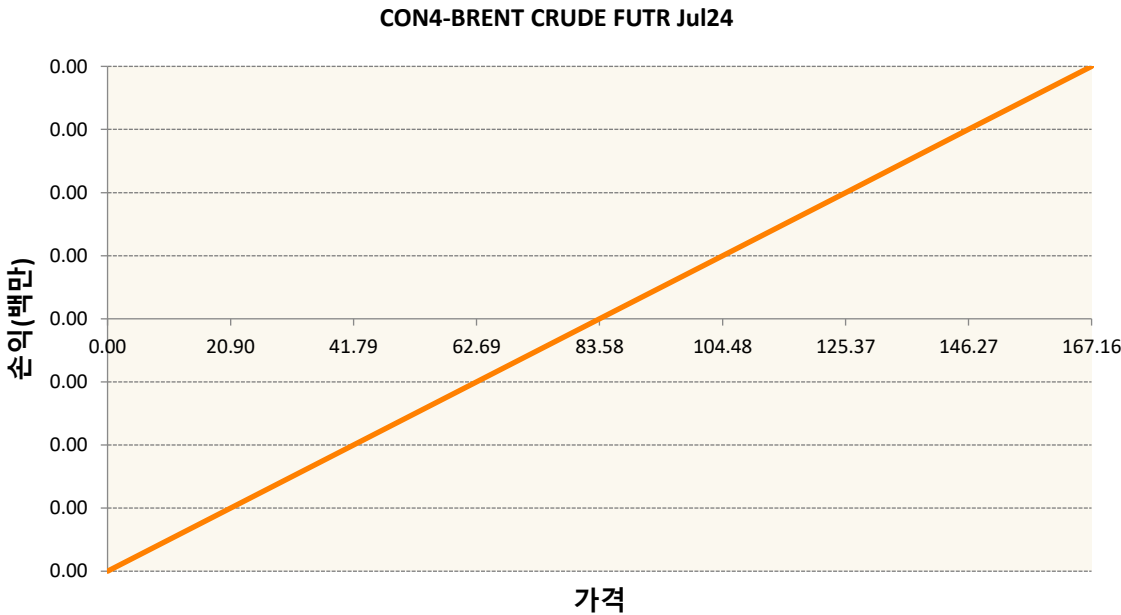
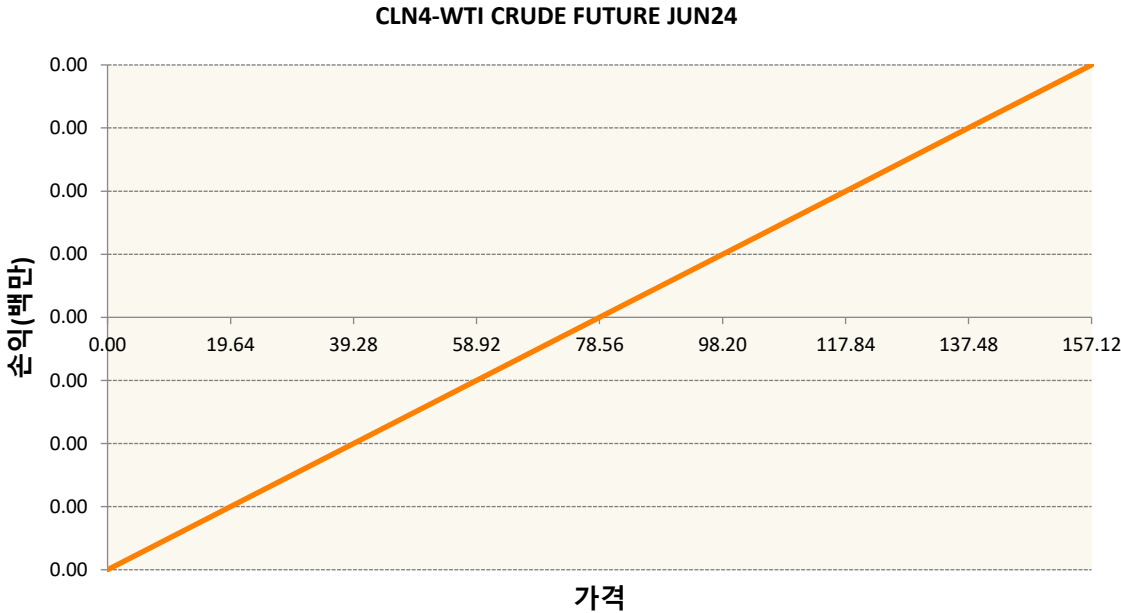
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

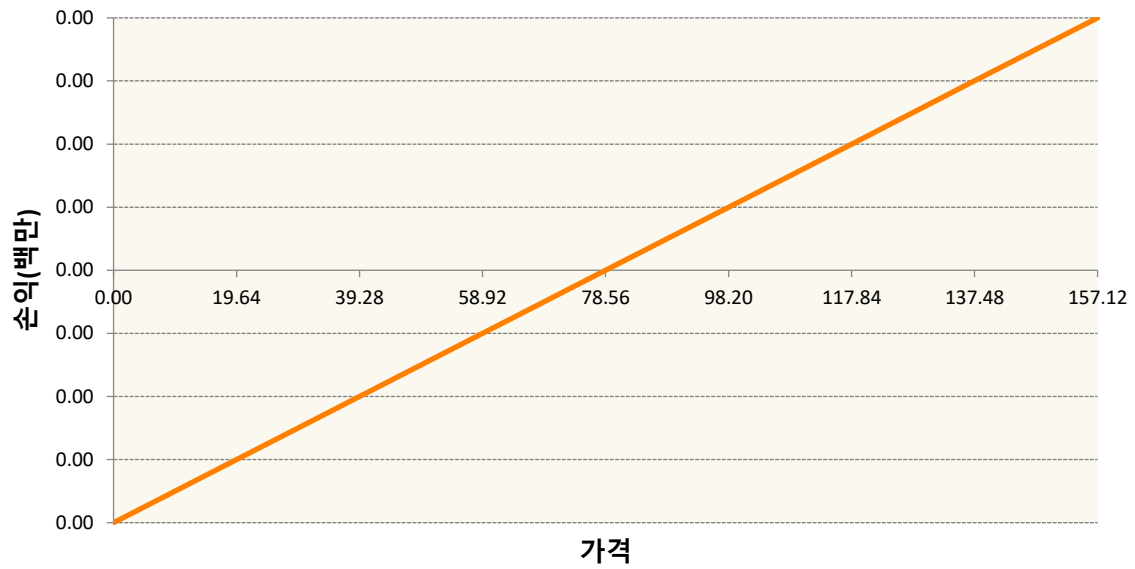
(단위:백만원)

| 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   | 1,114 | 0     | 1,114     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 192   | -192      | 장내 |

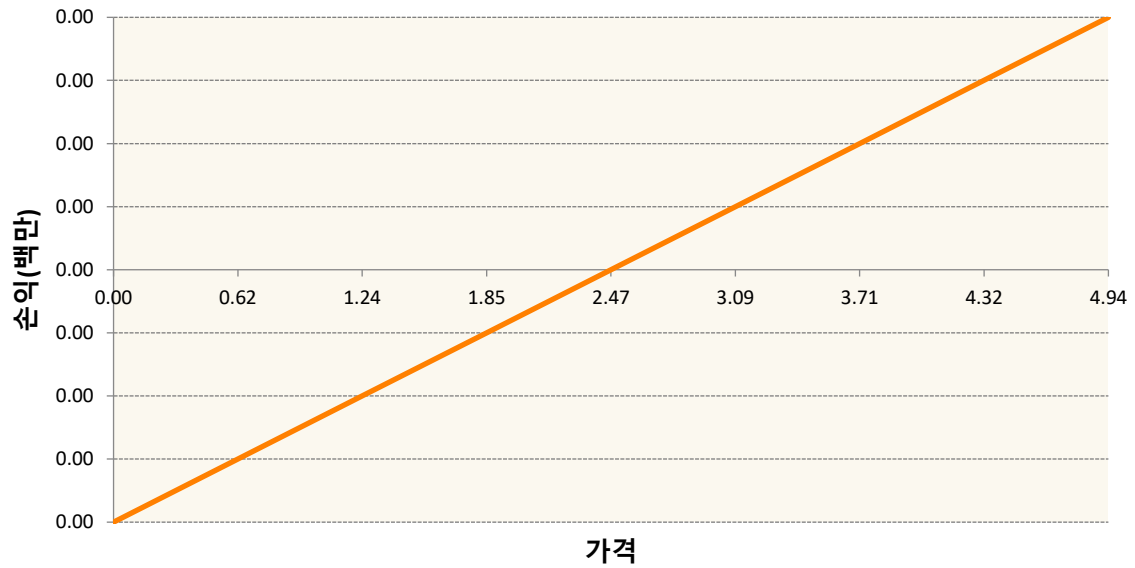
### 2. 만기시점의 손익구조



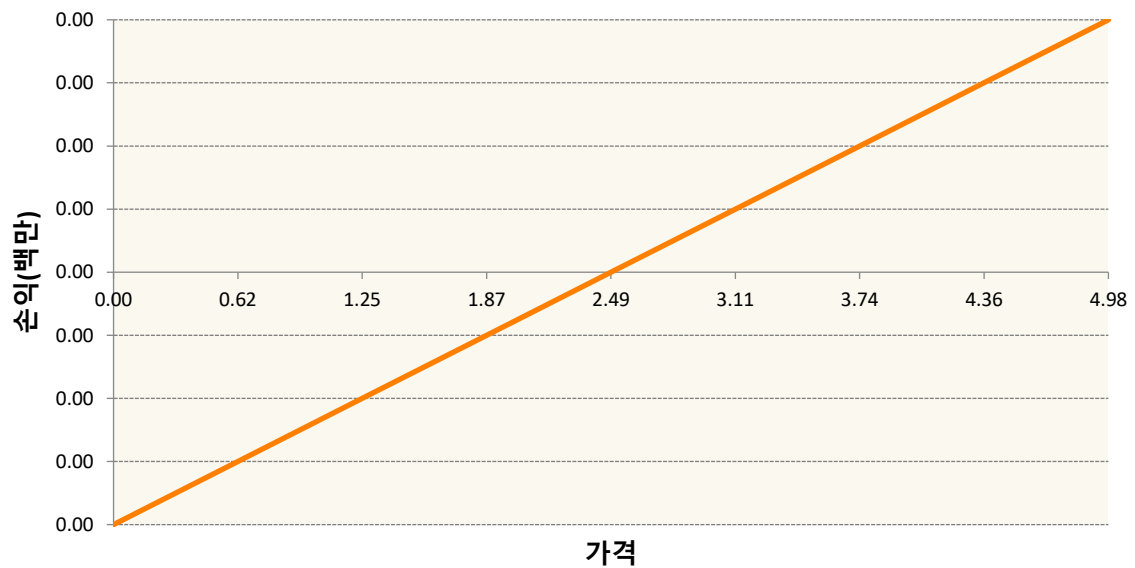
ECN4-E-mini Crude Oil Jul24



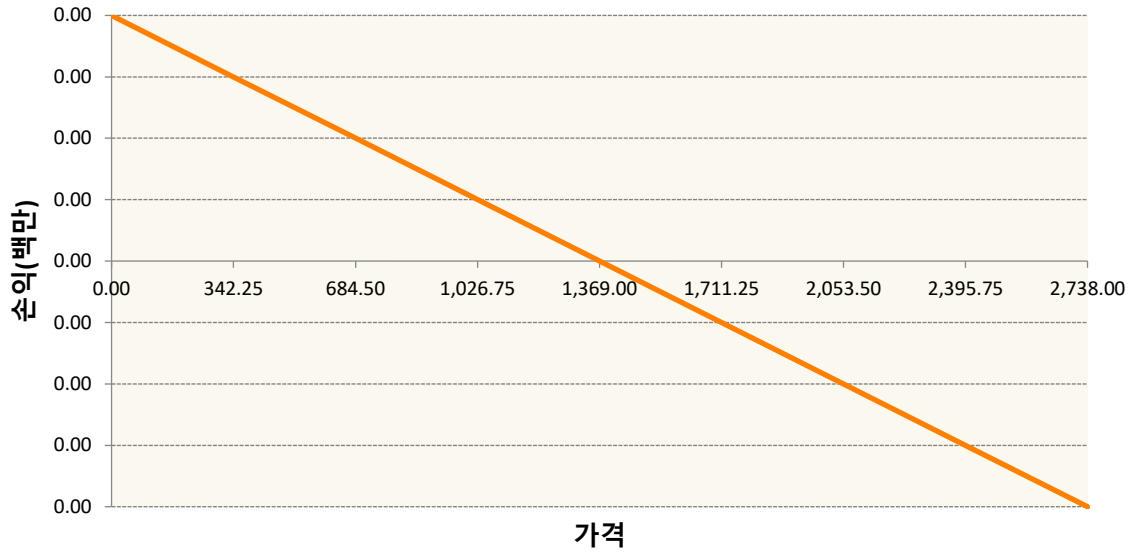
EON4-E-MINI NATURAL GAS Jul24



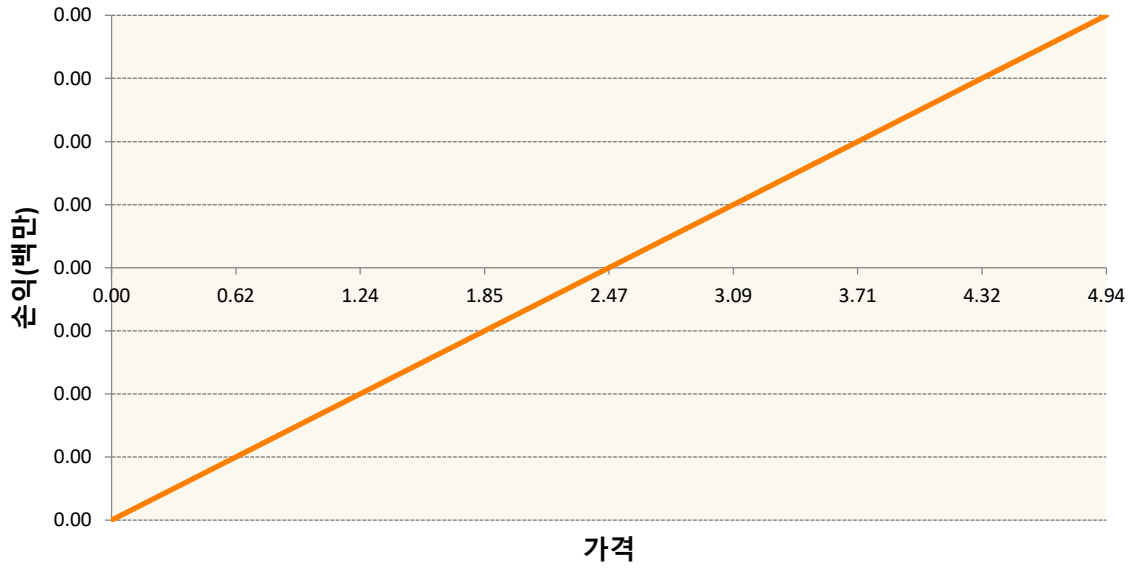
HON4-NY Harb ULSD Fut Jul24



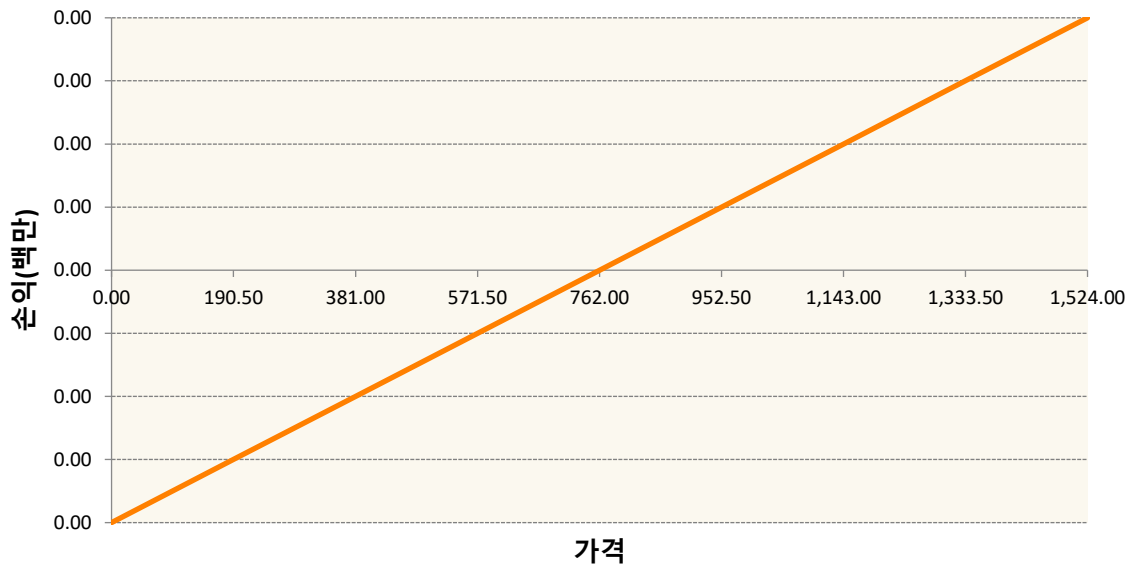
KR4175V50007-2024-05 달러선물

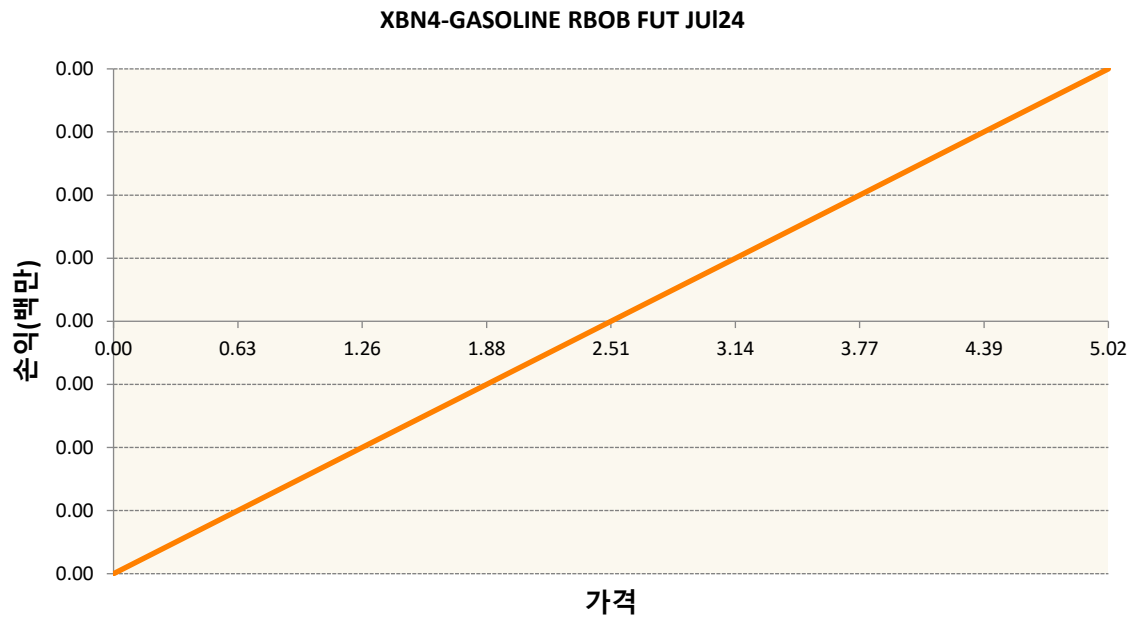


NGN24-NATURAL GAS FUTR JUL24



QSN4-Low Su Gasoil G JUL24





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| CLN4                      | WTI CRUDE FUTURE JUN24   | 9        |
| CON4                      | BRENT CRUDE FUTR Jul24   | 26       |
| ECN4                      | E-mini Crude Oil JUL24   | 9        |
| EON4                      | E-MINI NATURAL GAS JUL24 | 1        |
| HON4                      | NY Harb ULSD Fut Jul24   | 11       |
| KR4175V500 2024-05 달러선물   |                          | 15       |
| NGN24                     | NATURAL GAS FUTR JUL24   | 13       |
| QSN4                      | Low Su Gasoil G JUL24    | 8        |
| XBN4                      | GASOLINE RBOB FUT JUL24  | 11       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 191      |