

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

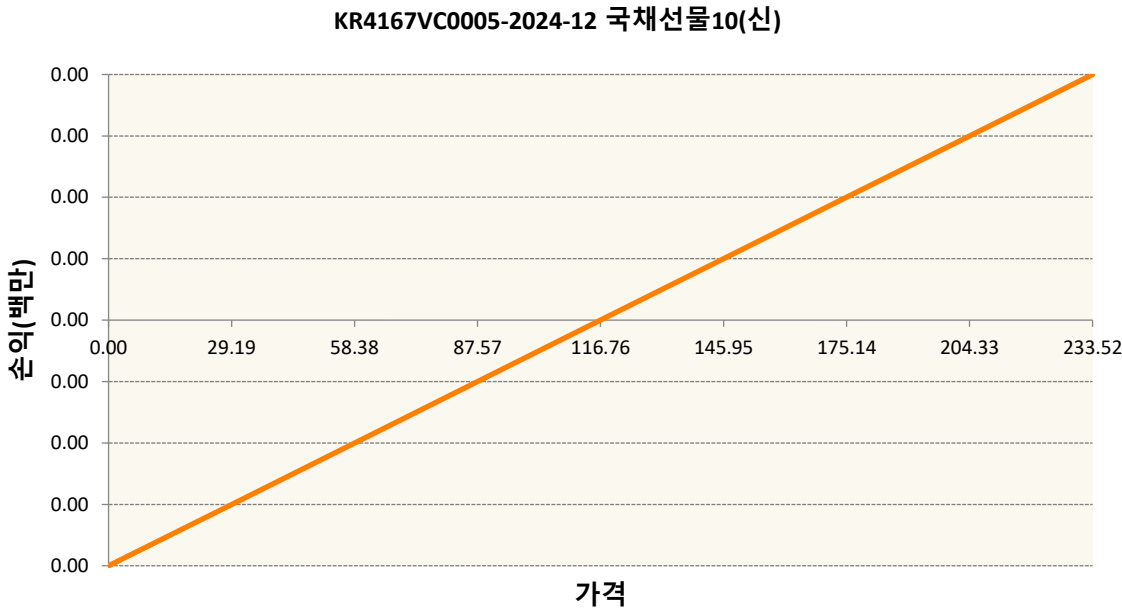
베스트장기채(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 금리   | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 금리   | 선물   | 70,056 | 0     | 70,056    | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4167VC00 2024-12 국채선물10(신)

5,604

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

(단위:백만원)

1,866

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

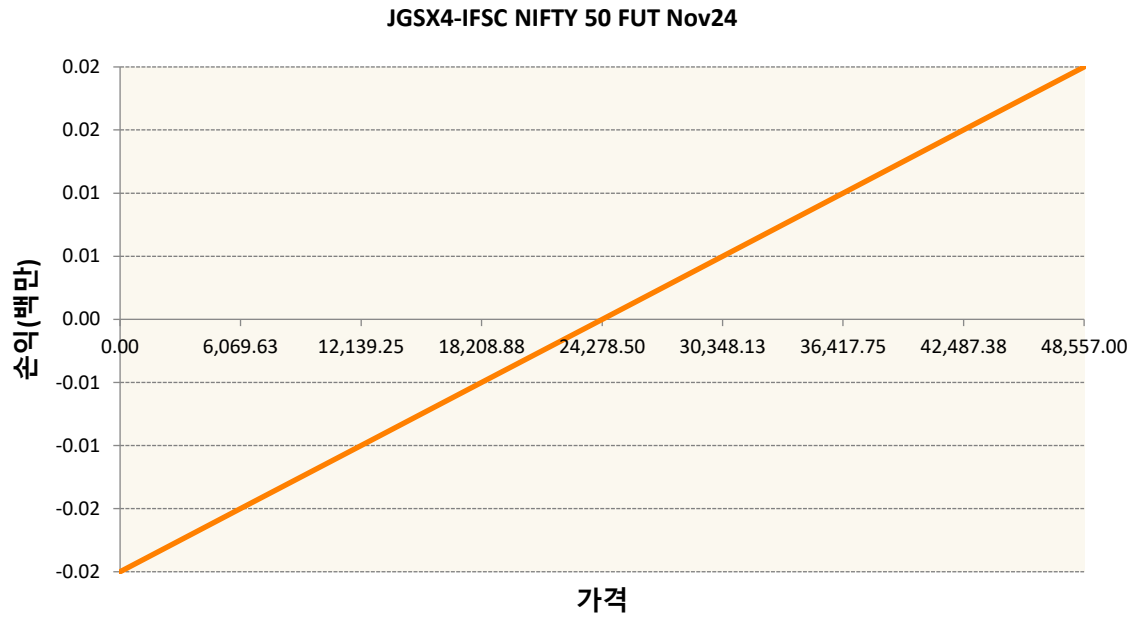
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,289 | 0     | 3,289     |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |     |
|-------|-------------------------|-----|
| JGSX4 | IFSC NIFTY 50 FUT Nov24 | 263 |
|-------|-------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 170 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

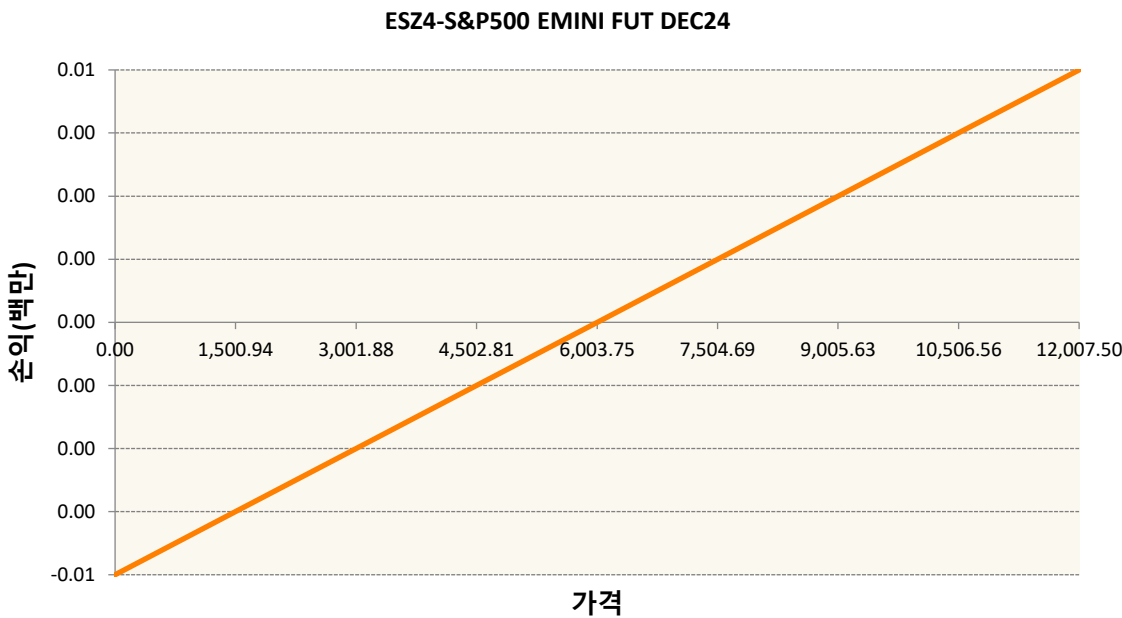
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 823   | 0     | 823       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |    |
|------|------------------------|----|
| ESZ4 | S&P500 EMINI FUT DEC24 | 66 |
|------|------------------------|----|

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

(단위:백만원)

40

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

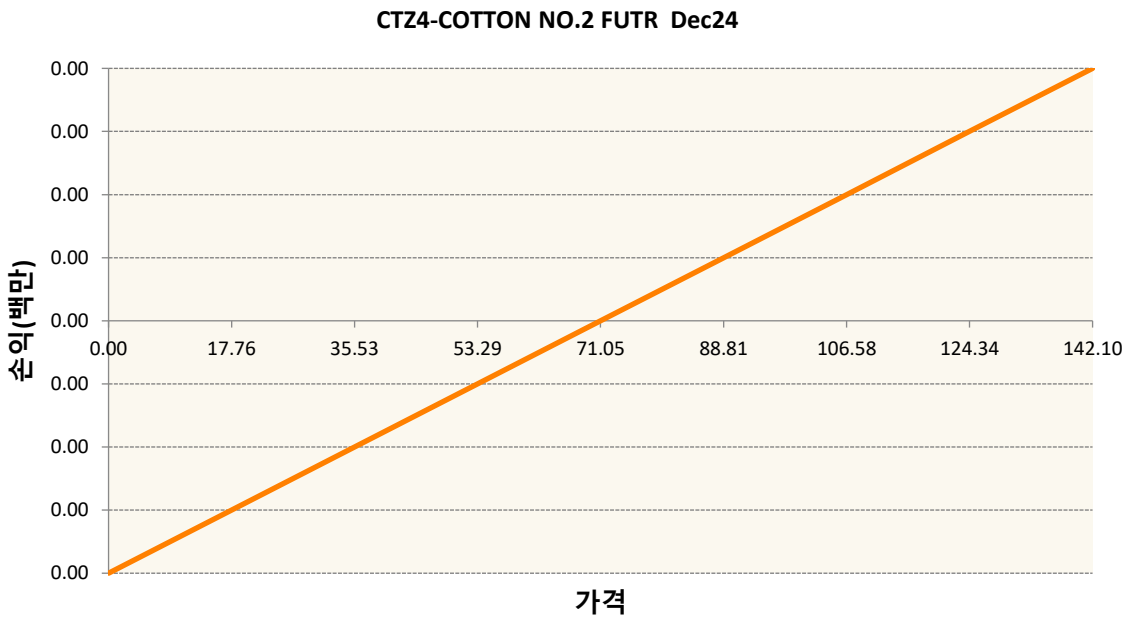
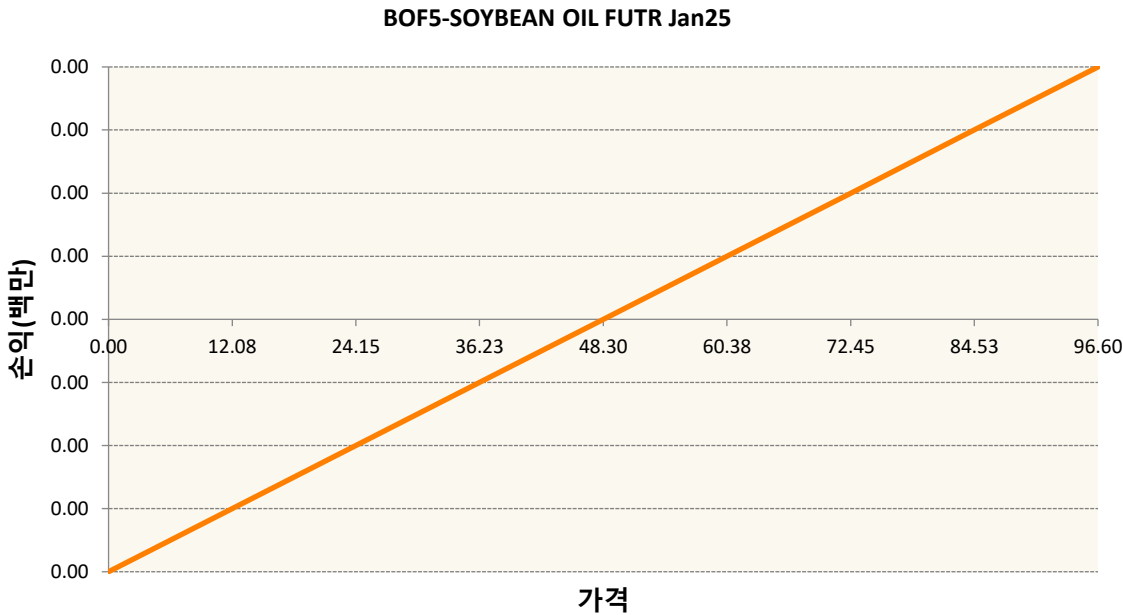
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

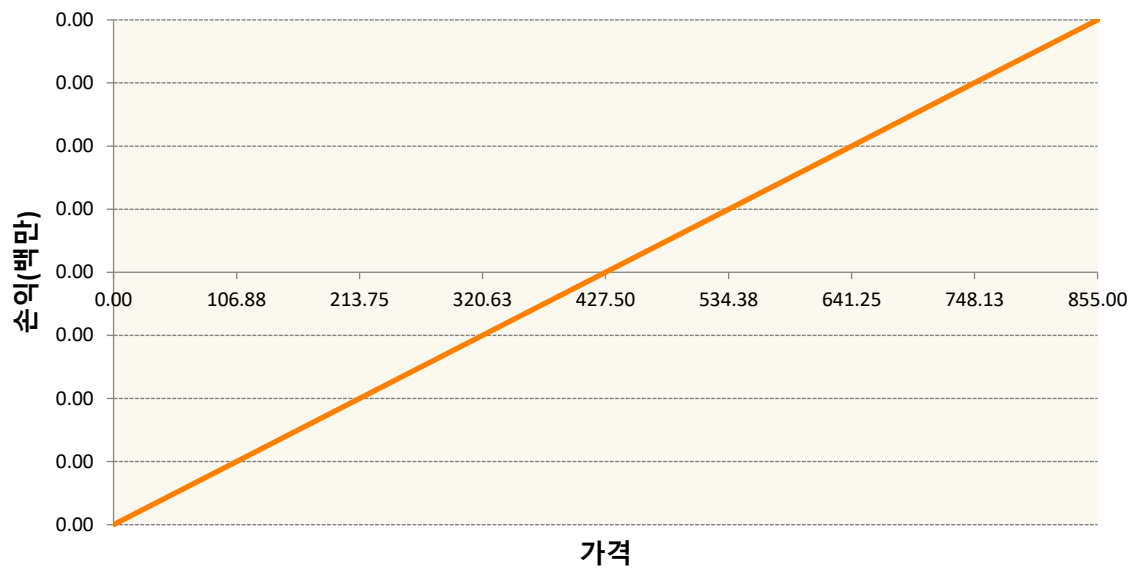
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 55    | -55       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,807 | 0     | 3,807     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 541   | -541      | 장내 |

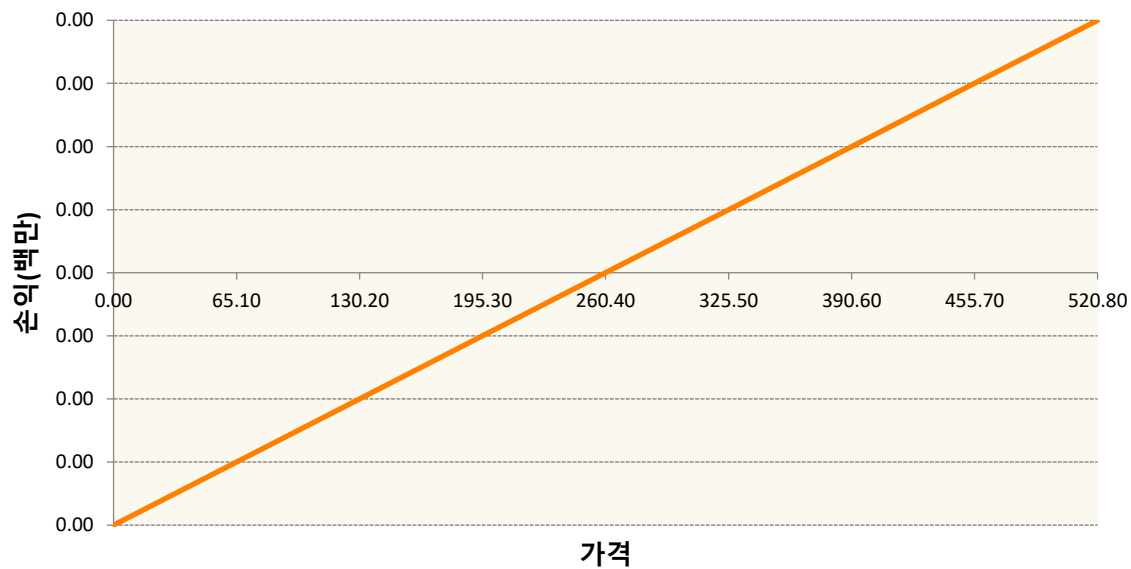
2. 만기시점의 손익구조



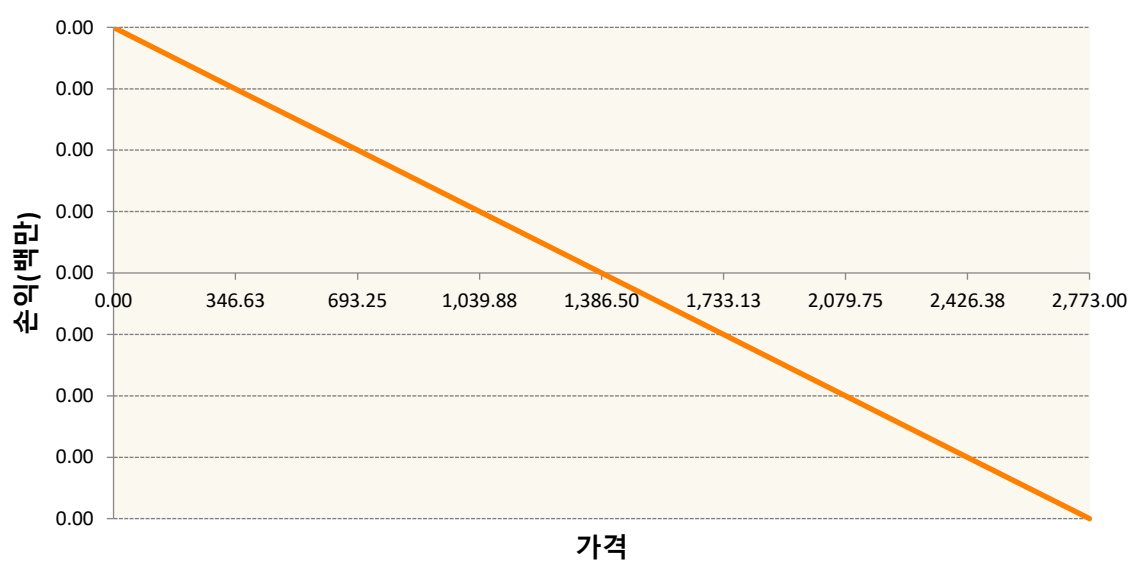
CZ4-CORN FUTURE Dec24



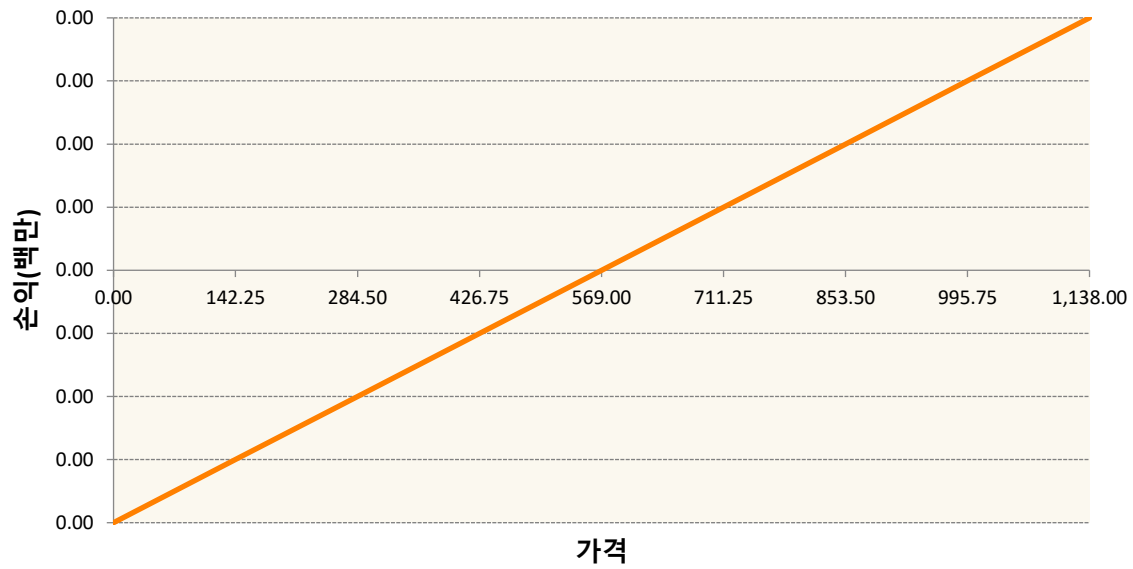
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



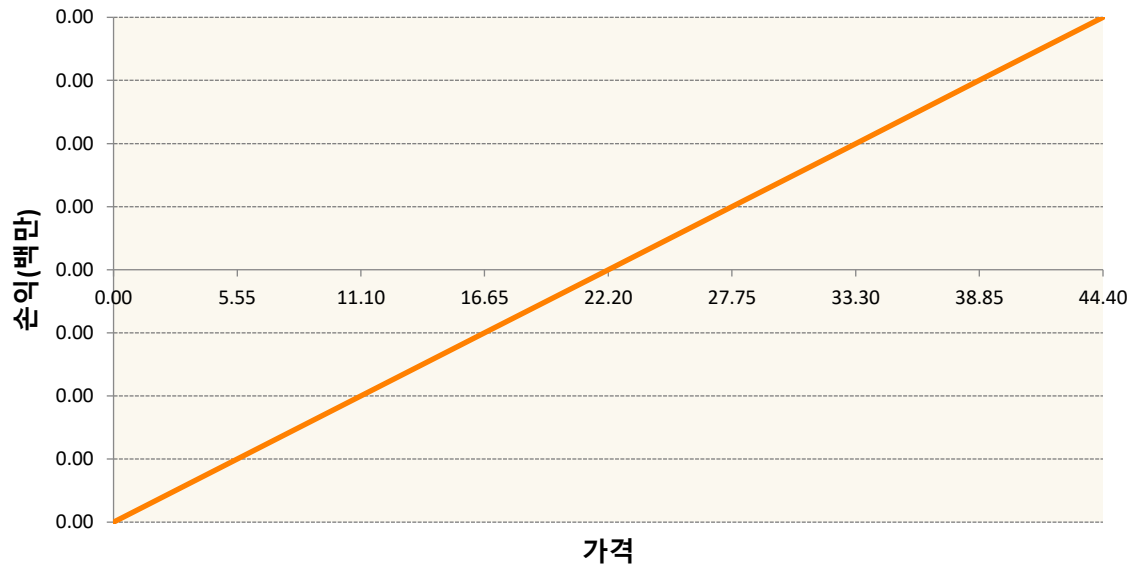
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



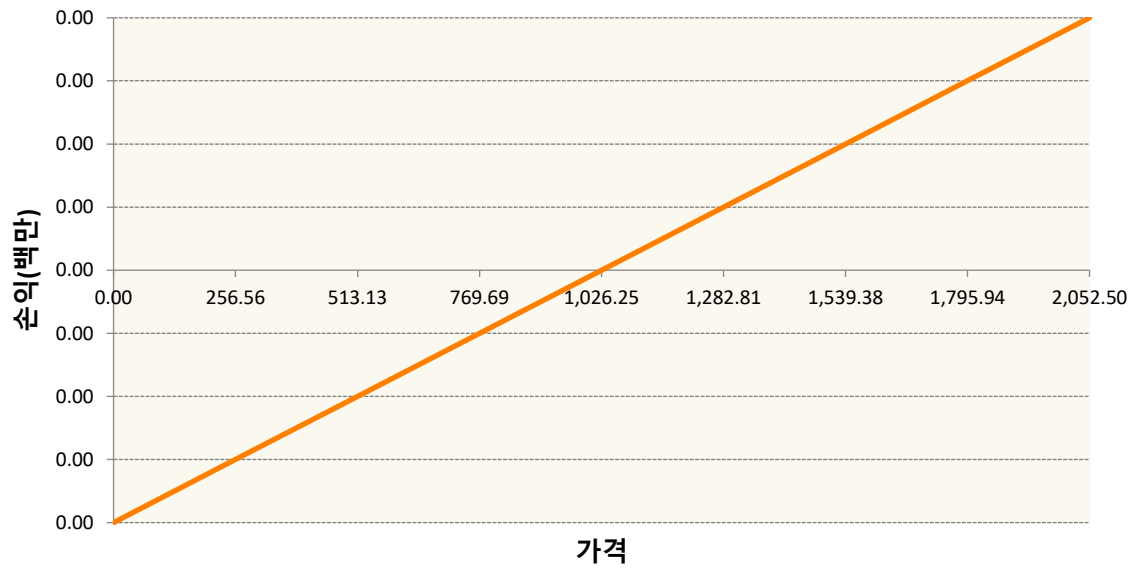
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24



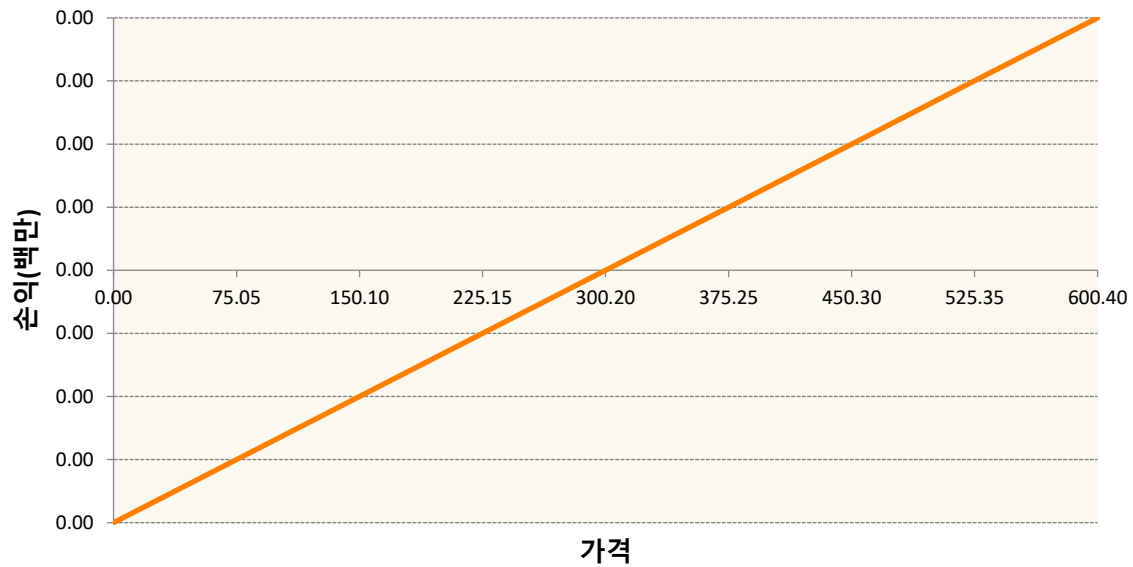
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



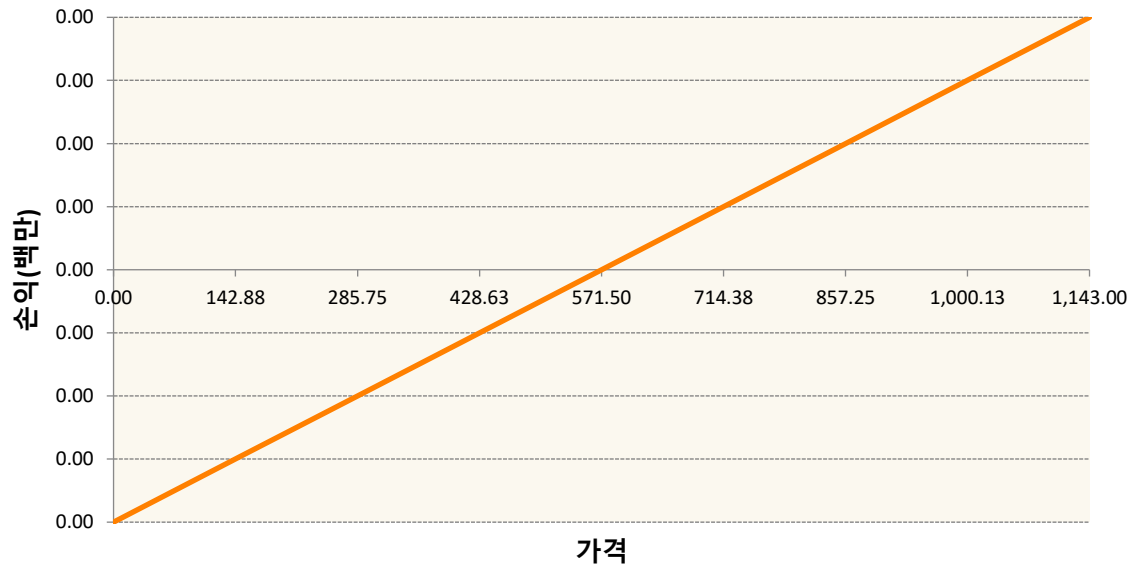
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



SMF5-SOYBEAN MEAL FUTR Jan25



WZ4-WHEAT FUTURE(CBT) Dec24



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

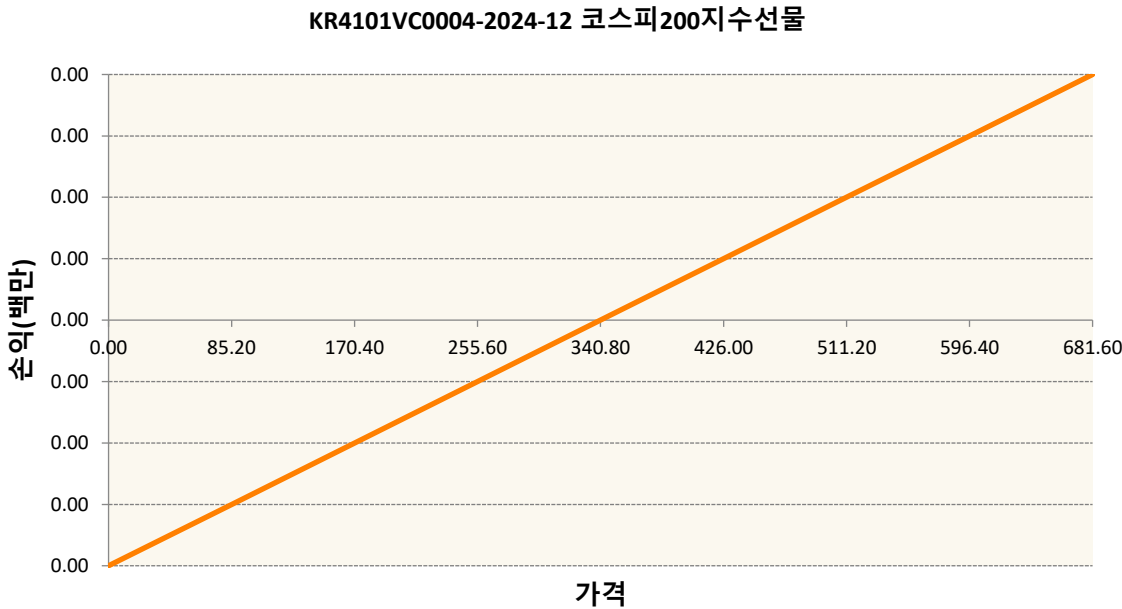
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 1,704 | 1,719 | -15       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,789 | 0     | 1,789     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101VC0004 |           |         | 2024-12 코스피200지수선물 |      |       |        | 143    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -143      | -143    | -143               | -143 | -143  | -143   | -143   |
| -5.33%       | -95       | -95     | -95                | -95  | -95   | -95    | -95    |
| -2.67%       | -48       | -48     | -48                | -48  | -48   | -48    | -48    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 48        | 48      | 48                 | 48   | 48    | 48     | 48     |
| 5.33%        | 95        | 95      | 95                 | 95   | 95    | 95     | 95     |
| 8.00%        | 143       | 143     | 143                | 143  | 143   | 143    | 143    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

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   | 3,224 | 0     | 3,224     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| SWCSI50000 신한CSI500미래231226 | 323 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 523 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

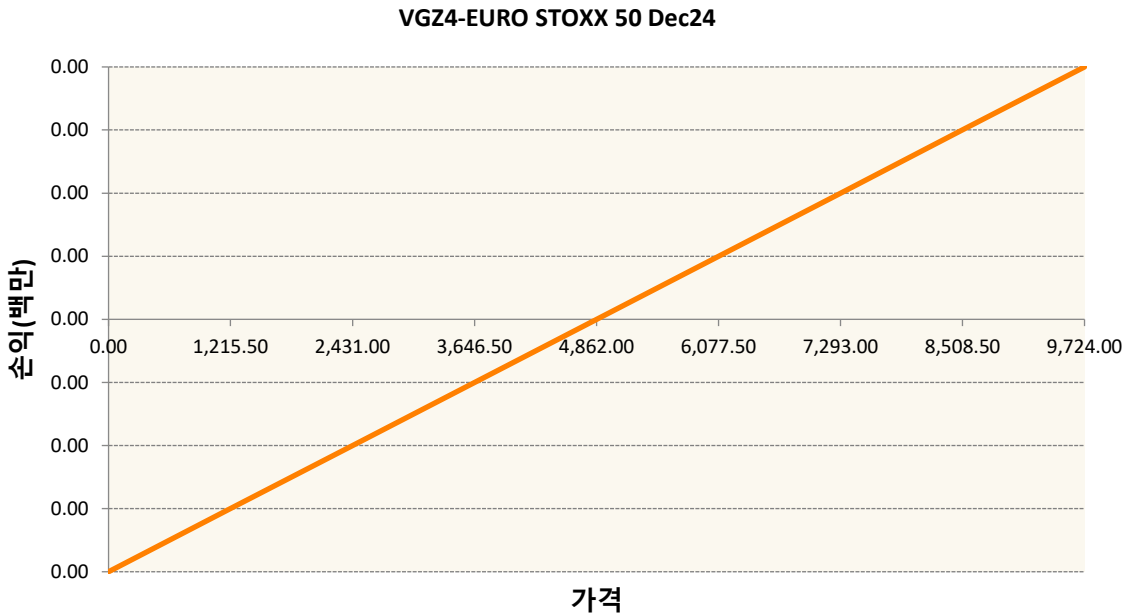
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 939   | 0     | 939       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGZ4 | EURO STOXX 50 Dec24 | 75 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 50 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

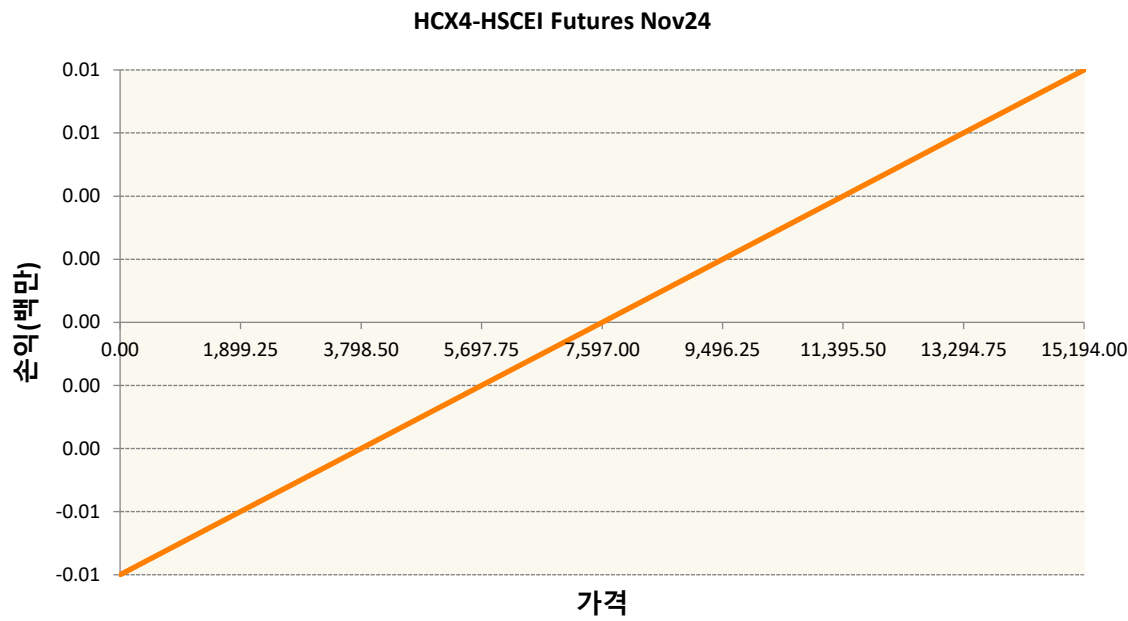
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,624 | 0     | 1,624     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HGX4 | HSCEI Futures Nov24 | 130 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 178 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

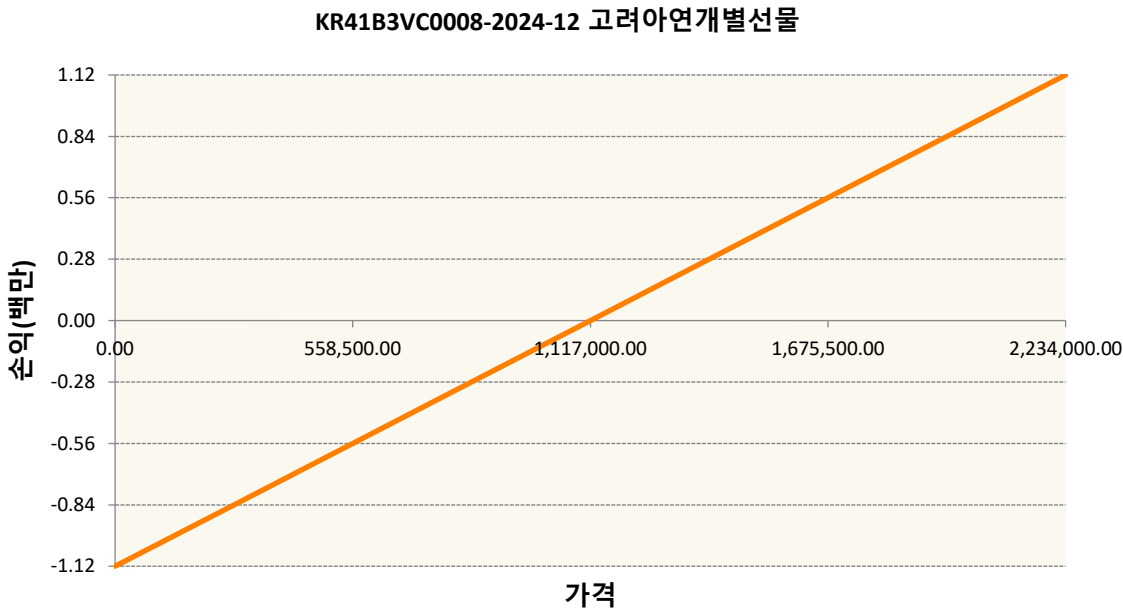
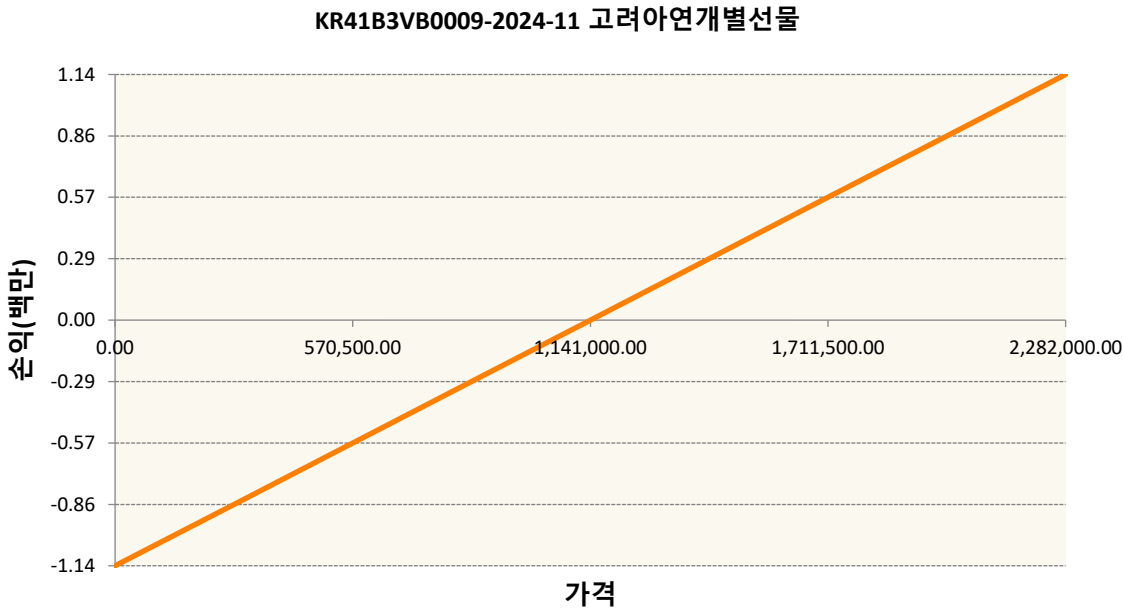
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

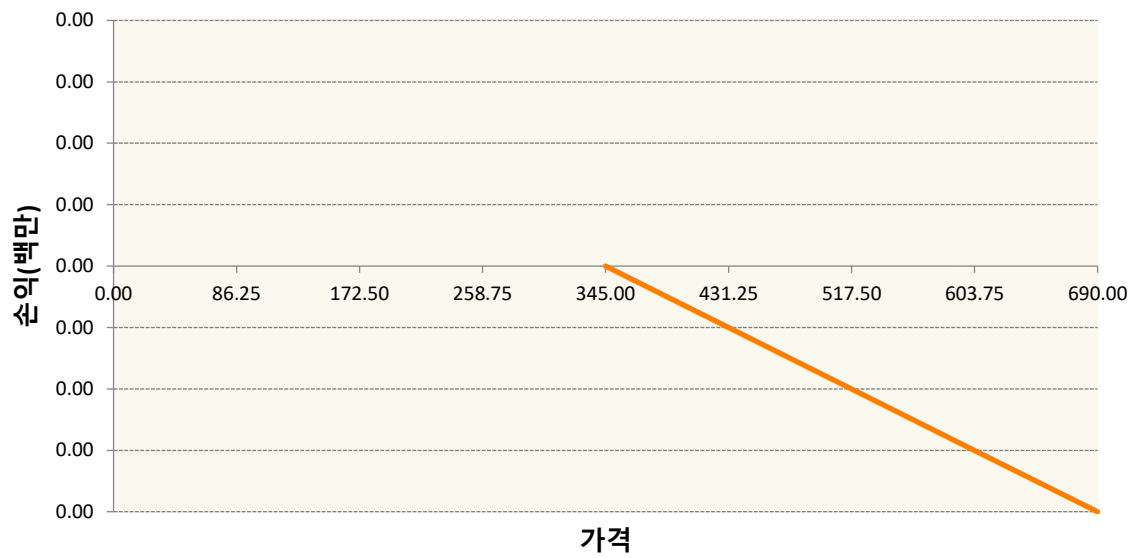
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 296   | 0      | 296       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 40,131 | -40,131   | 장내 |

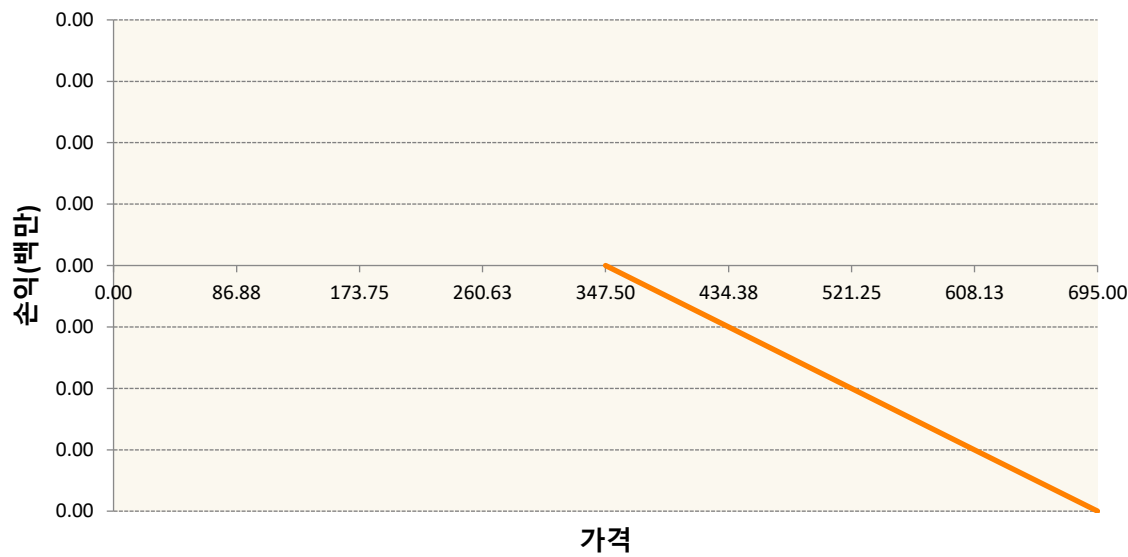
2. 만기시점의 손익구조



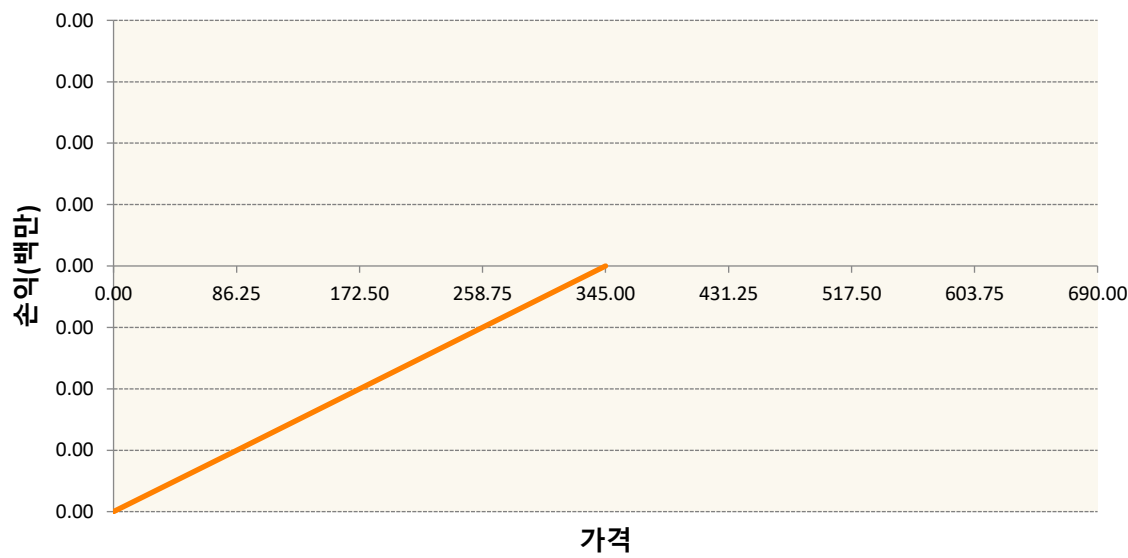
KR4201VB3453-2024-11 콜345



KR4201VB3479-2024-11 콜347.5



KR4301VB3452-2024-11 풋345



(단위:백만원)

|              |           |         |        |        |        |        |                  |  |       |  |
|--------------|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|------------------|--|-------|--|
| KR41B3VB0009 |           |         |        |        |        |        | 2024-11 고려아연개별선물 |  | 23    |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |        |        |        |                  |  |       |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00%           |  |       |  |
| -8.00%       | -23       | -23     | -23    | -23    | -23    | -23    | -23              |  |       |  |
| -5.33%       | -15       | -15     | -15    | -15    | -15    | -15    | -15              |  |       |  |
| -2.67%       | -8        | -8      | -8     | -8     | -8     | -8     | -8               |  |       |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0                |  |       |  |
| 2.67%        | 8         | 8       | 8      | 8      | 8      | 8      | 8                |  |       |  |
| 5.33%        | 15        | 15      | 15     | 15     | 15     | 15     | 15               |  |       |  |
| 8.00%        | 23        | 23      | 23     | 23     | 23     | 23     | 23               |  |       |  |
| KR41B3VC0008 |           |         |        |        |        |        | 2024-12 고려아연개별선물 |  | 1     |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |        |        |        |                  |  |       |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00%           |  |       |  |
| -8.00%       | -1        | -1      | -1     | -1     | -1     | -1     | -1               |  |       |  |
| -5.33%       | -1        | -1      | -1     | -1     | -1     | -1     | -1               |  |       |  |
| -2.67%       | 0         | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0                |  |       |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0                |  |       |  |
| 2.67%        | 0         | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0                |  |       |  |
| 5.33%        | 1         | 1       | 1      | 1      | 1      | 1      | 1                |  |       |  |
| 8.00%        | 1         | 1       | 1      | 1      | 1      | 1      | 1                |  |       |  |
| KR4201VB3453 |           |         |        |        |        |        | 2024-11 콜345     |  | 1,702 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |        |        |        |                  |  |       |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00%           |  |       |  |
| -8.00%       | 177       | 177     | 177    | 177    | 176    | 176    | 175              |  |       |  |
| -5.33%       | 177       | 176     | 175    | 173    | 171    | 167    | 162              |  |       |  |
| -2.67%       | 168       | 162     | 153    | 143    | 131    | 117    | 101              |  |       |  |
| 0%           | 75        | 51      | 26     | 0      | -26    | -53    | -81              |  |       |  |
| 2.67%        | -284      | -311    | -339   | -367   | -395   | -423   | -452             |  |       |  |
| 5.33%        | -926      | -936    | -948   | -962   | -978   | -995   | -1,014           |  |       |  |
| 8.00%        | -1,675    | -1,677  | -1,679 | -1,682 | -1,687 | -1,694 | -1,702           |  |       |  |
| KR4201VB3479 |           |         |        |        |        |        | 2024-11 콜347.5   |  | 180   |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |        |        |        |                  |  |       |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00%           |  |       |  |
| -8.00%       | 14        | 14      | 14     | 14     | 14     | 14     | 14               |  |       |  |
| -5.33%       | 14        | 14      | 14     | 14     | 14     | 13     | 13               |  |       |  |
| -2.67%       | 14        | 13      | 12     | 12     | 11     | 9      | 8                |  |       |  |
| 0%           | 7         | 5       | 3      | 0      | -3     | -5     | -8               |  |       |  |
| 2.67%        | -24       | -28     | -31    | -34    | -38    | -41    | -45              |  |       |  |
| 5.33%        | -91       | -93     | -95    | -97    | -99    | -101   | -104             |  |       |  |
| 8.00%        | -176      | -176    | -176   | -177   | -178   | -179   | -180             |  |       |  |
| KR4301VB3452 |           |         |        |        |        |        | 2024-11 풋345     |  | 569   |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |        |        |        |                  |  |       |  |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | -569    | -569    | -569   | -569 | -569  | -569   | -569   |
| -5.33% | -369    | -369    | -370   | -370 | -370  | -370   | -370   |
| -2.67% | -171    | -171    | -172   | -173 | -175  | -176   | -178   |
| 0%     | 14      | 9       | 5      | 0    | -5    | -10    | -15    |
| 2.67%  | 121     | 116     | 111    | 105  | 100   | 94     | 88     |
| 5.33%  | 143     | 142     | 141    | 139  | 137   | 135    | 132    |
| 8.00%  | 145     | 145     | 144    | 144  | 144   | 143    | 143    |

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

(단위:백만원)

2,665

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

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 | 657   | 0     | 657       |    |

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 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

## 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 | 4,325 | 0     | 4,325     |    |

### 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 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

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 | 13,912 | 0      | 13,912    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 14,211 | -14,211   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |                                 |
|------------------------------|---------------------------------|
| FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E  | 582                             |
| FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E | 349                             |
| FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E  | 205                             |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

523

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

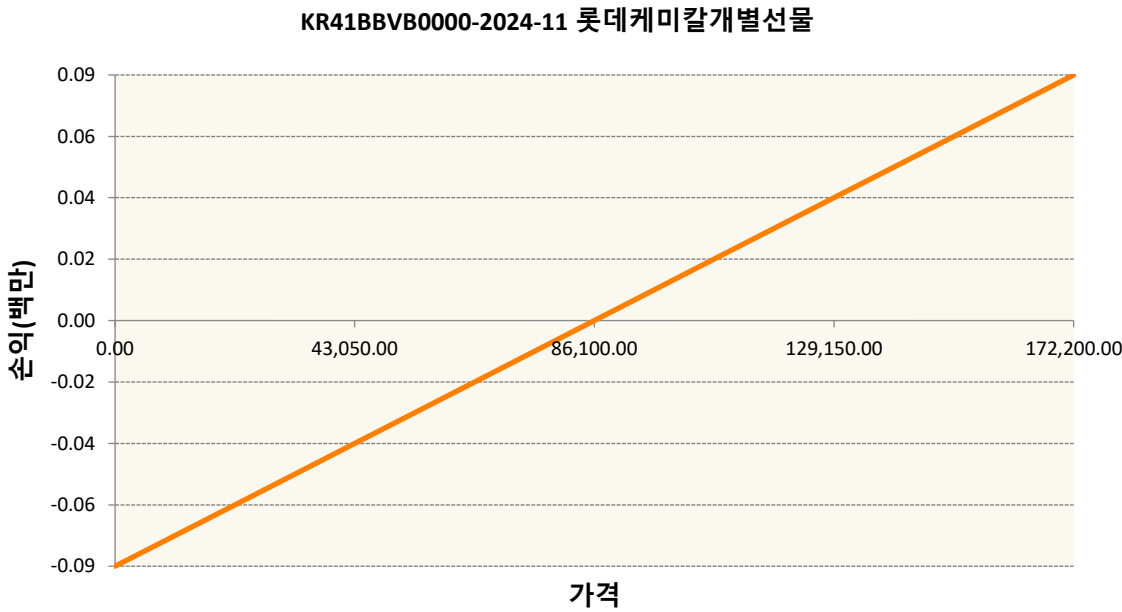
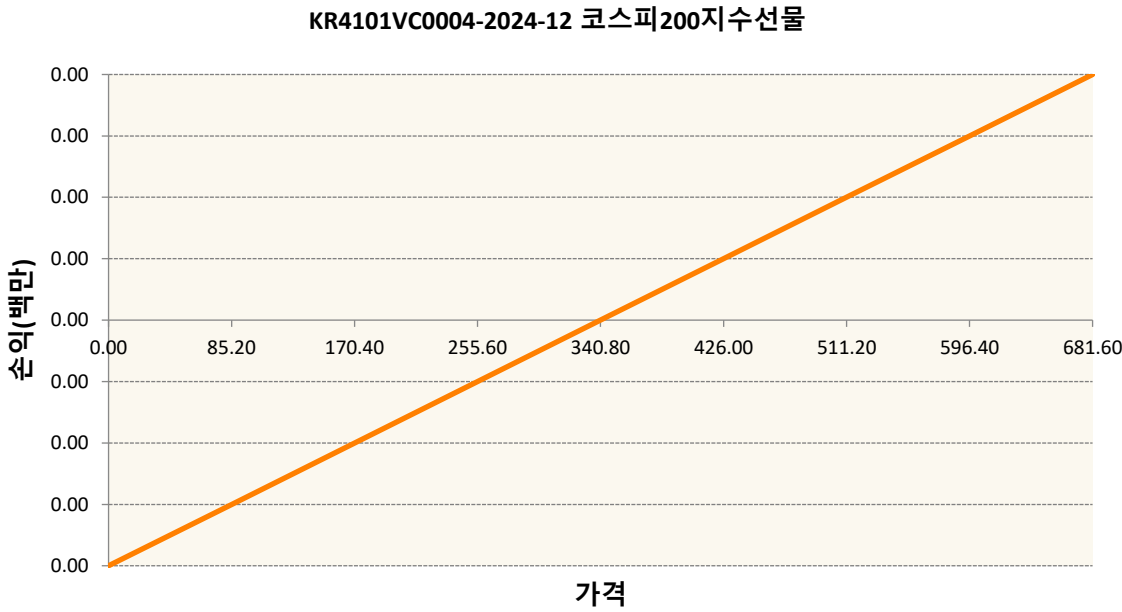
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

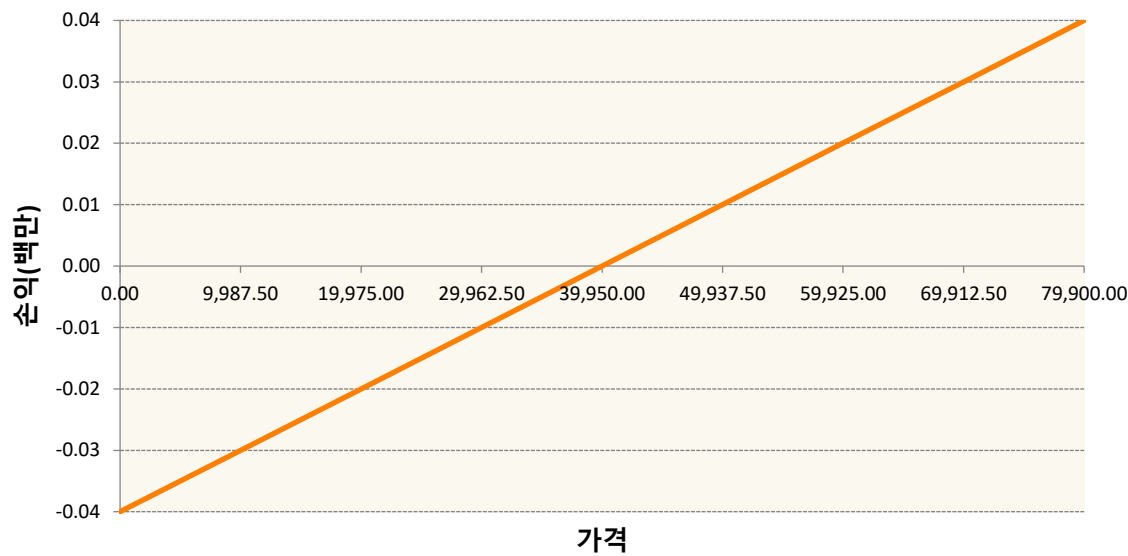
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 897   | 0     | 897       | 장내 |

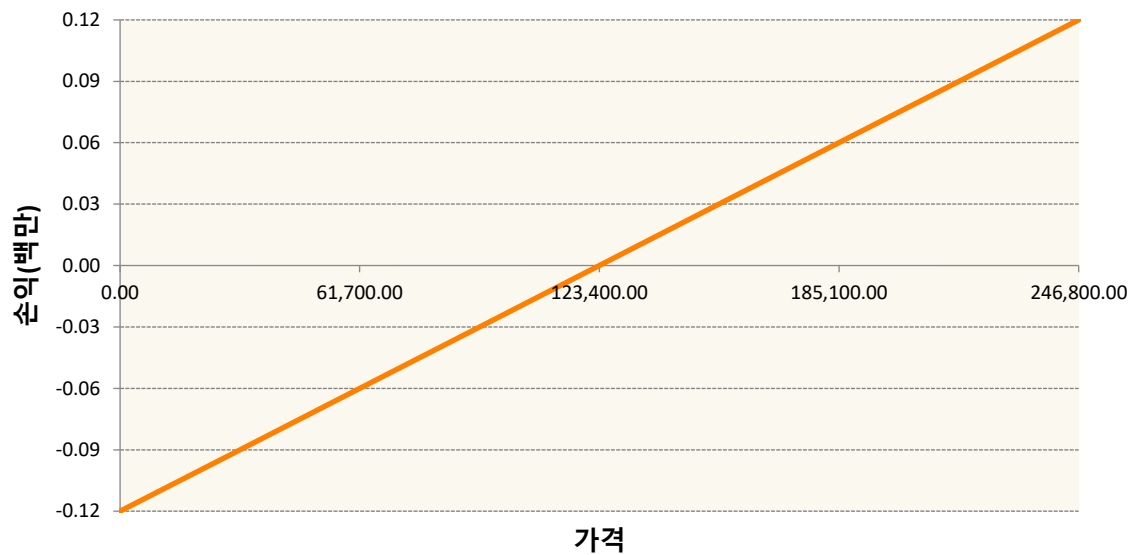
2. 만기시점의 손익구조



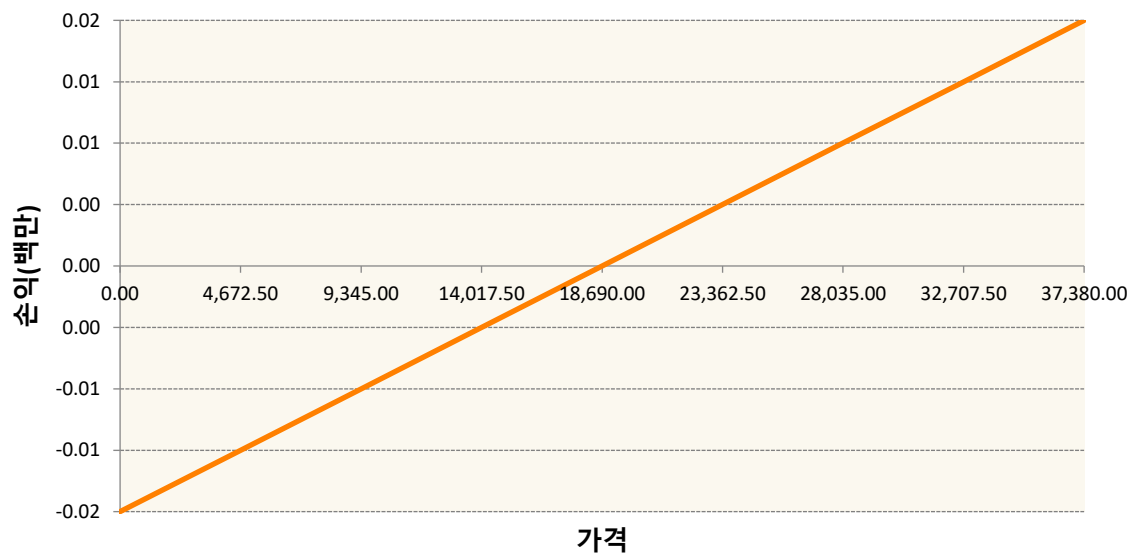
KR41BQVB0003-2024-11 호텔신라개별선물



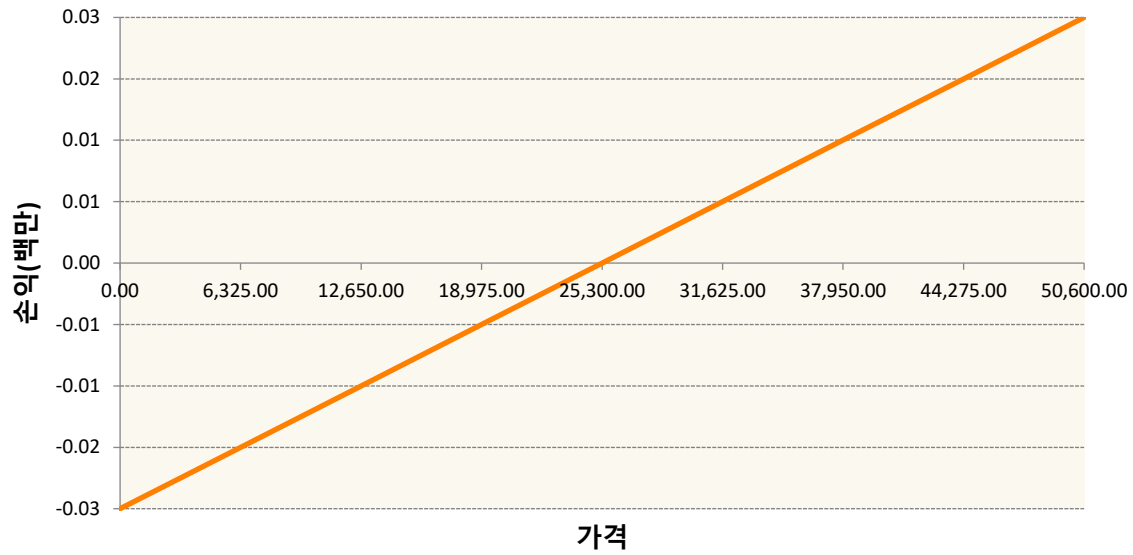
KR41C6VB0004-2024-11 아모레퍼시픽개별선물



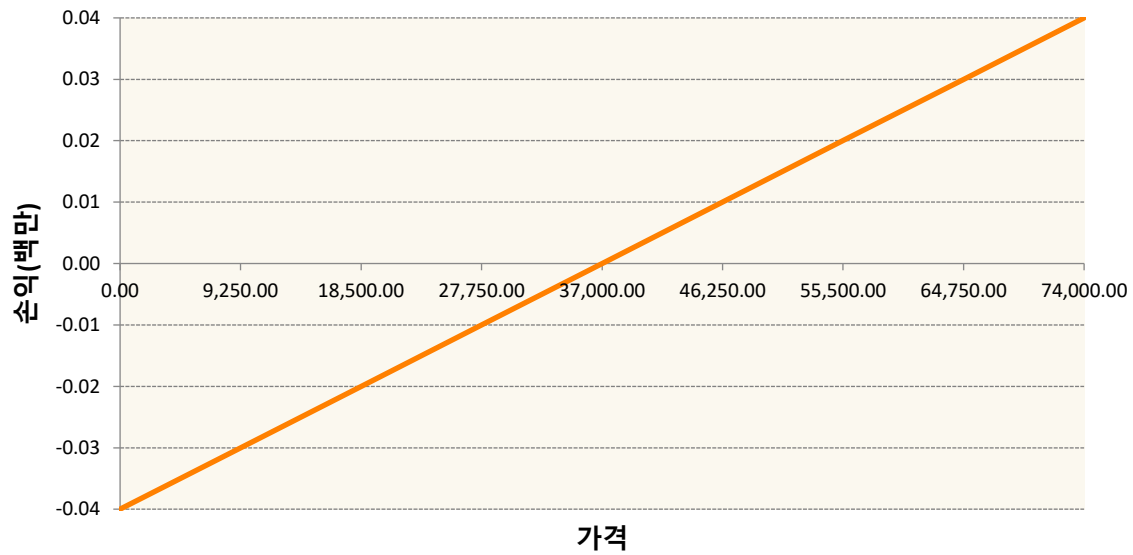
KR41CBVB0009-2024-11 한화솔루션개별선물



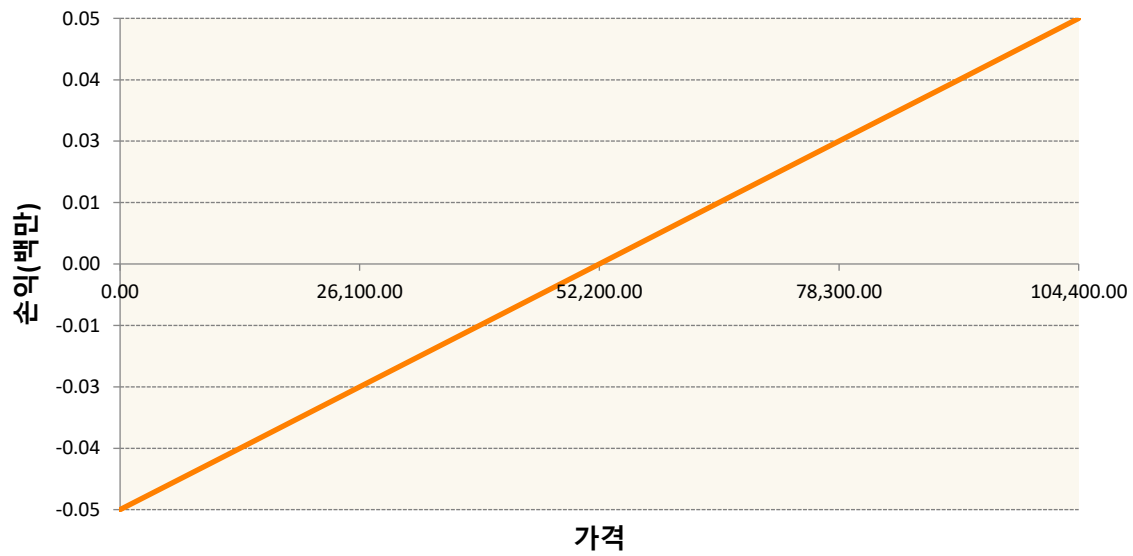
KR41CNVB0005-2024-11 포스코DX개별선물



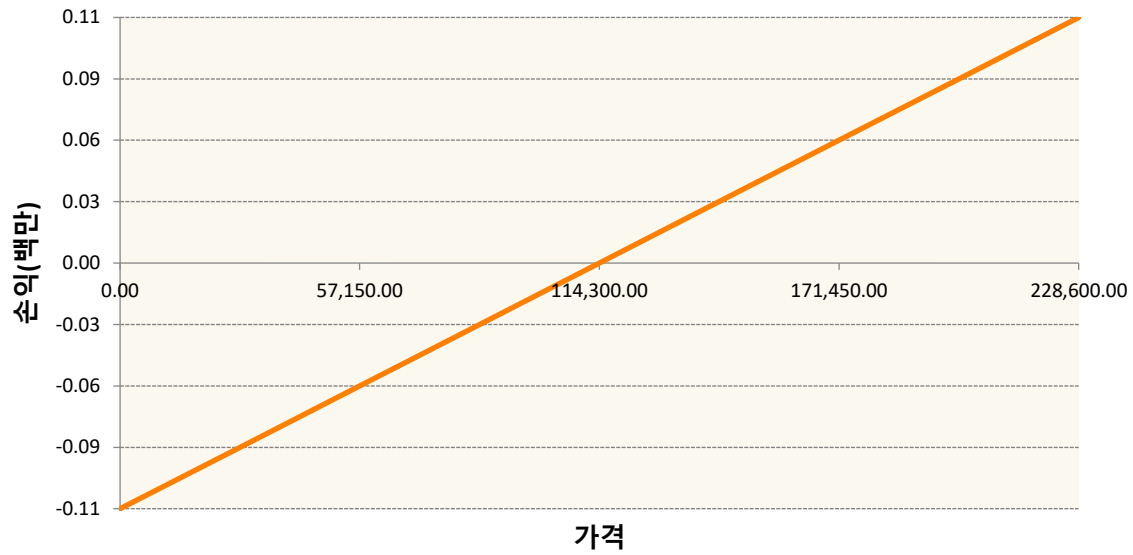
KR41CVVB0005-2024-11 한미사이언스개별선물



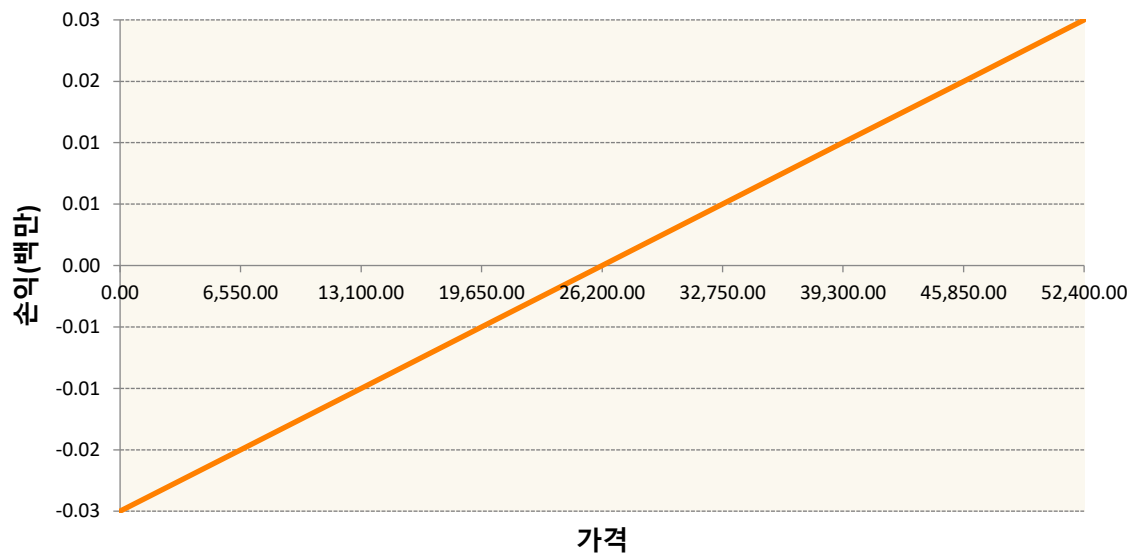
KR41DNVB0004-2024-11 하나투어개별선물



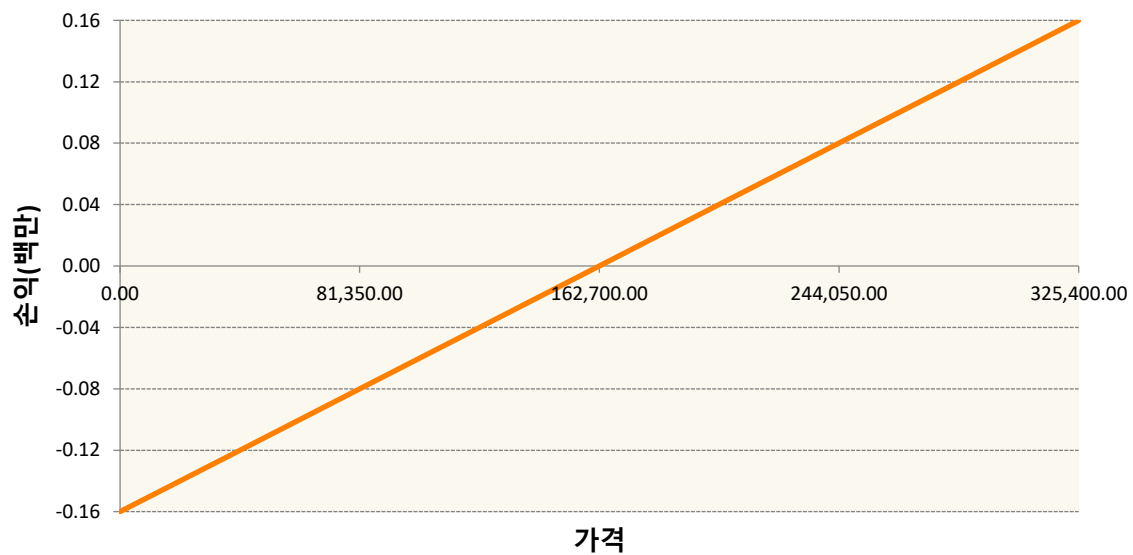
KR41FMVB0003-2024-11 엘앤에프개별선물



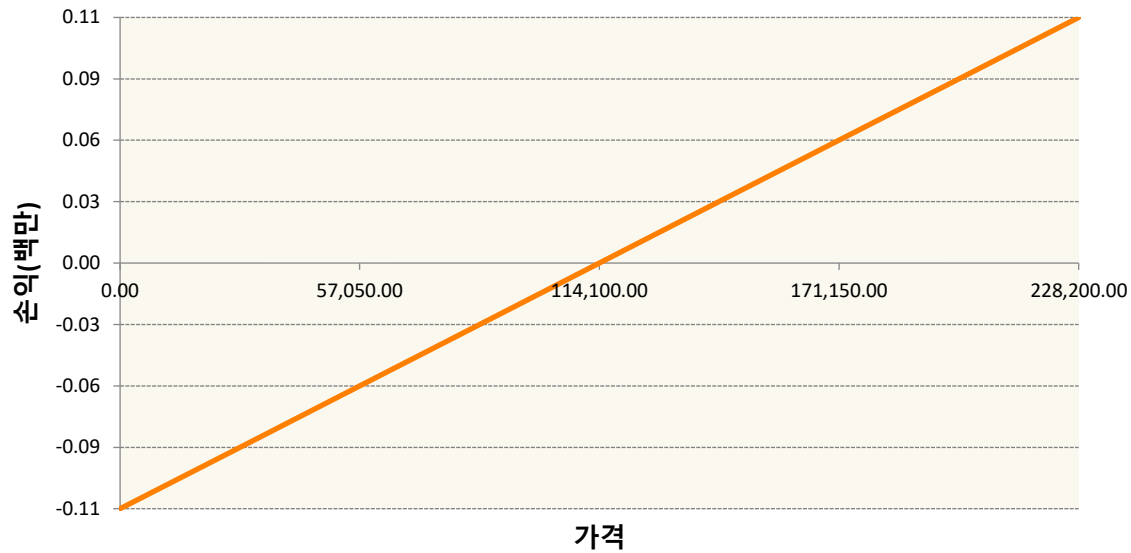
KR41FXVB0000-2024-11 동서개별선물



KR41GLVB0003-2024-11 LS ELECTRIC개별선물



# KR41GZVB0007-2024-11 에코프로머티개별선물



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101VC0004      2024-12 코스피200지수선물      61

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -61     | -61     | -61    | -61 | -61   | -61    | -61    |
| -5.33%    | -41     | -41     | -41    | -41 | -41   | -41    | -41    |
| -2.67%    | -20     | -20     | -20    | -20 | -20   | -20    | -20    |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 20      | 20      | 20     | 20  | 20    | 20     | 20     |
| 5.33%     | 41      | 41      | 41     | 41  | 41    | 41     | 41     |
| 8.00%     | 61      | 61      | 61     | 61  | 61    | 61     | 61     |

KR41BBVB0000      2024-11 롯데케미칼개별선물      1

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -5.33%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -2.67%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 5.33%     | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |
| 8.00%     | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |

KR41BQVB0003      2024-11 호텔신라개별선물      1

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -5.33%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| -2.67%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |

|       |   |   |   |   |   |   |   |
|-------|---|---|---|---|---|---|---|
| 2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5.33% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8.00% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |

|              |                    |   |
|--------------|--------------------|---|
| KR41C6VB0004 | 2024-11 아모레퍼시픽개별선물 | 2 |
|--------------|--------------------|---|

|        | 기초자산의 변동성 |         |        |    |       |        |        |
|--------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -2        | -2      | -2     | -2 | -2    | -2     | -2     |
| -5.33% | -1        | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -2.67% | -1        | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| 0%     | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 1         | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |
| 5.33%  | 1         | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |
| 8.00%  | 2         | 2       | 2      | 2  | 2     | 2      | 2      |

|              |                   |   |
|--------------|-------------------|---|
| KR41CBVB0009 | 2024-11 한화솔루션개별선물 | 1 |
|--------------|-------------------|---|

|        | 기초자산의 변동성 |         |        |    |       |        |        |
|--------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1        | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -5.33% | -1        | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -2.67% | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%     | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 5.33%  | 1         | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |
| 8.00%  | 1         | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |

|              |                   |   |
|--------------|-------------------|---|
| KR41CNVB0005 | 2024-11 포스코DX개별선물 | 1 |
|--------------|-------------------|---|

|        | 기초자산의 변동성 |         |        |    |       |        |        |
|--------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1        | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -5.33% | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| -2.67% | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%     | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 5.33%  | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 8.00%  | 1         | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |

|              |                    |   |
|--------------|--------------------|---|
| KR41CVVB0005 | 2024-11 한미사이언스개별선물 | 1 |
|--------------|--------------------|---|

|        | 기초자산의 변동성 |         |        |    |       |        |        |
|--------|-----------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1        | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -5.33% | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| -2.67% | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%     | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 5.33%  | 0         | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 8.00%  | 1         | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |

|              |                  |   |
|--------------|------------------|---|
| KR41DNVB0004 | 2024-11 하나투어개별선물 | 0 |
|--------------|------------------|---|

|  |           |
|--|-----------|
|  | 기초자산의 변동성 |
|--|-----------|

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| -8.00% | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| -5.33% | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| -2.67% | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 5.33%  | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 8.00%  | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |

KR41FMVB0003 2024-11 엘앤에프개별선물 1

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -5.33%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -2.67%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 5.33%     | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |
| 8.00%     | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |

KR41FXVB0000 2024-11 동서개별선물 0

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| -5.33%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| -2.67%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 5.33%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 8.00%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |

KR41GLVB0003 2024-11 LS ELECTRIC개별선물 1

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -5.33%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -2.67%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%     | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 5.33%     | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |
| 8.00%     | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |

KR41GZVB0007 2024-11 에코프로머티개별선물 1

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -5.33%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -2.67%    | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |

|       |   |   |   |   |   |   |   |
|-------|---|---|---|---|---|---|---|
| 2.67% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5.33% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| 8.00% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |

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

(단위:백만원)

81

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

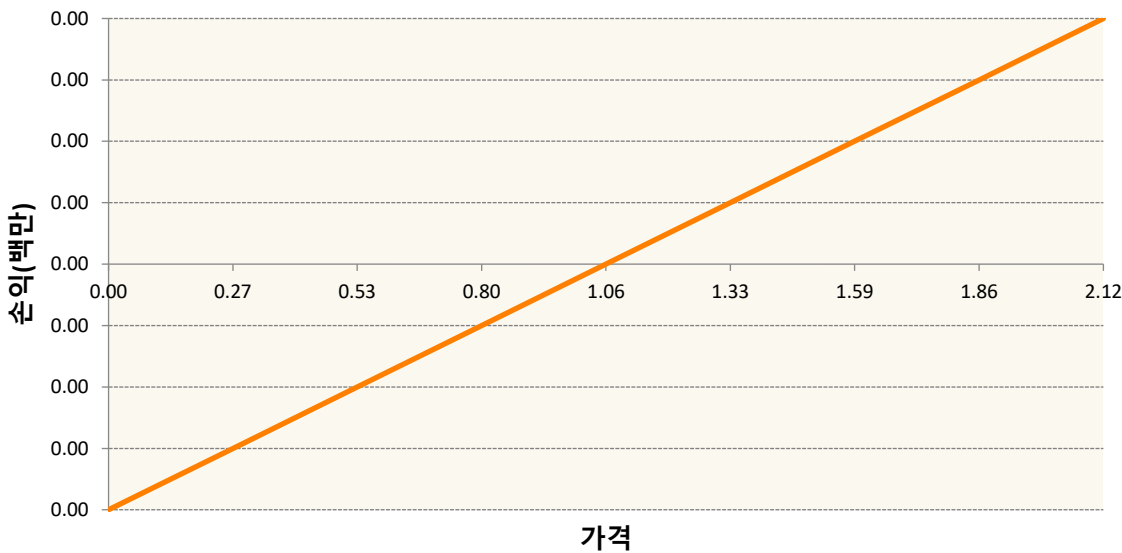
1. 계약금액

(단위:백만원)

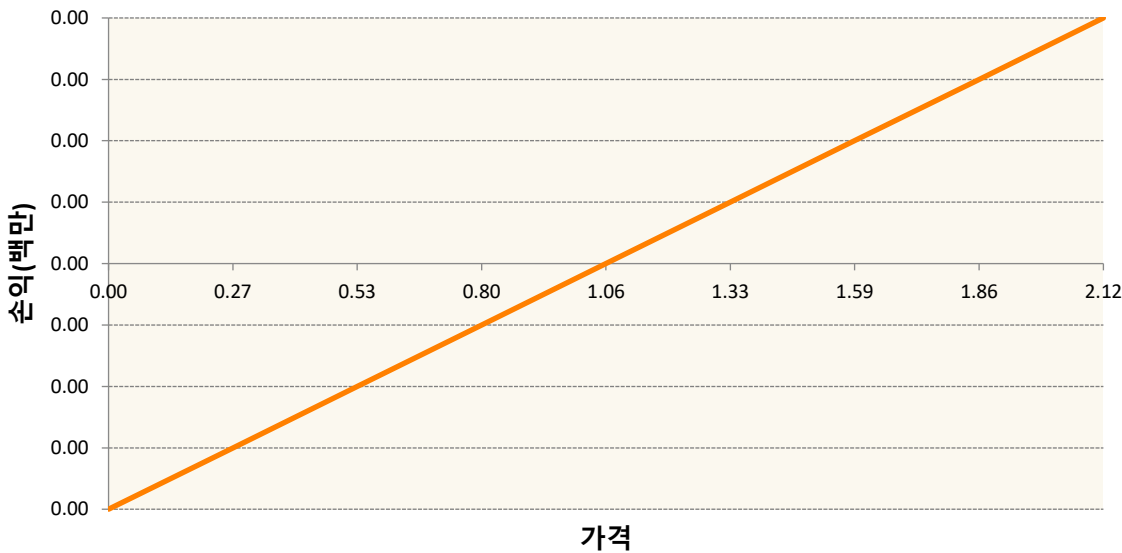
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 11,980 | 0     | 11,980    |    |

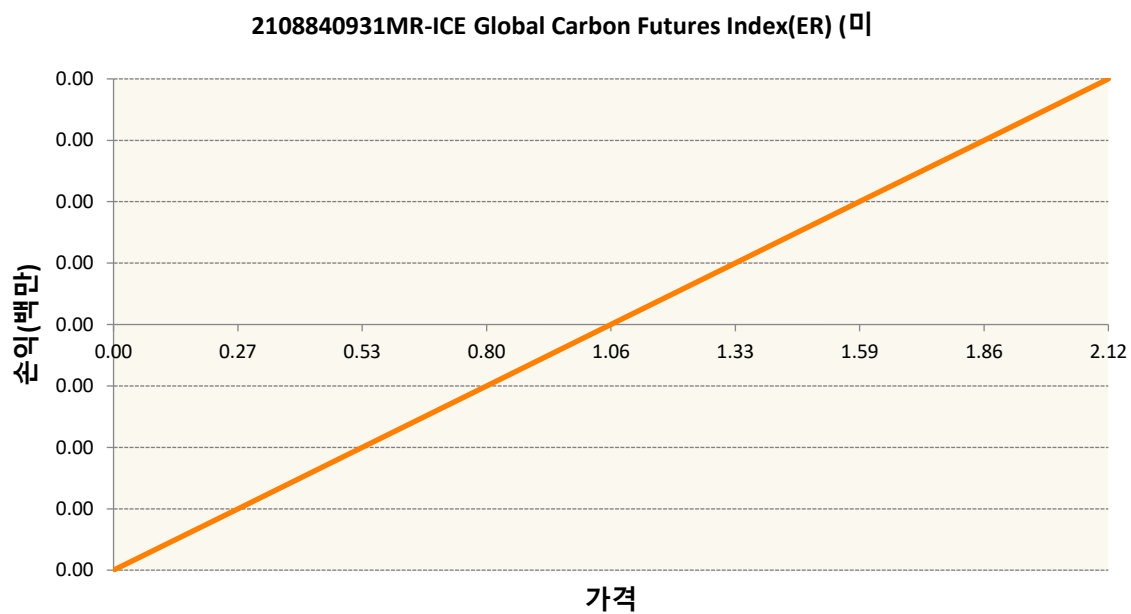
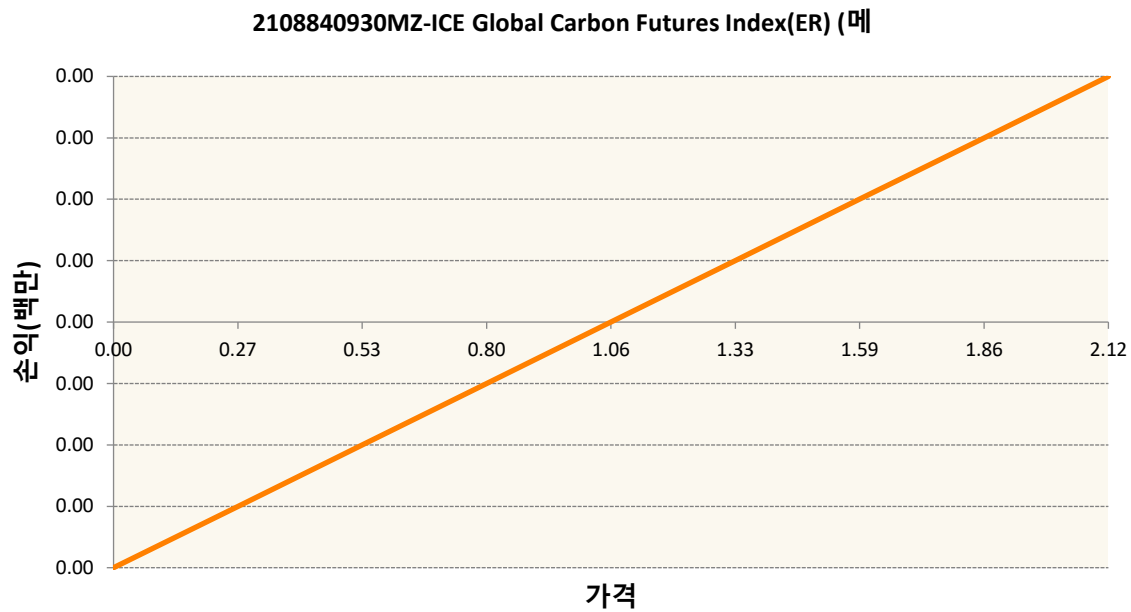
2. 만기시점의 손익구조

2108840930KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키)



2108840930MR-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                        |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키 |  | 96       |
| 2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 480      |
| 2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 192      |
| 2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 192      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,039    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

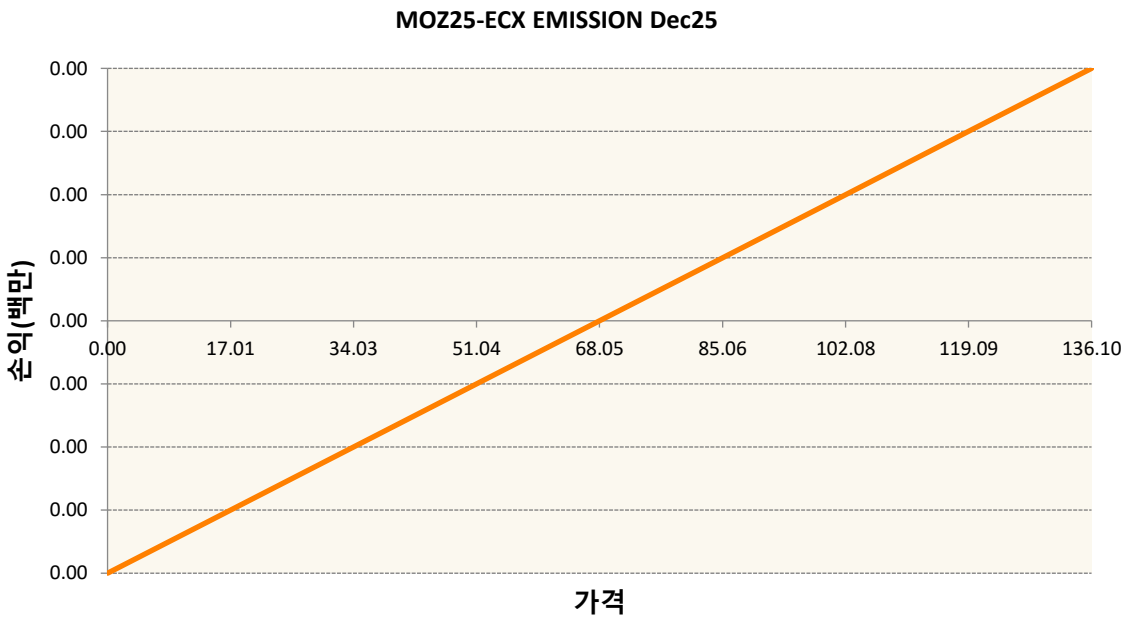
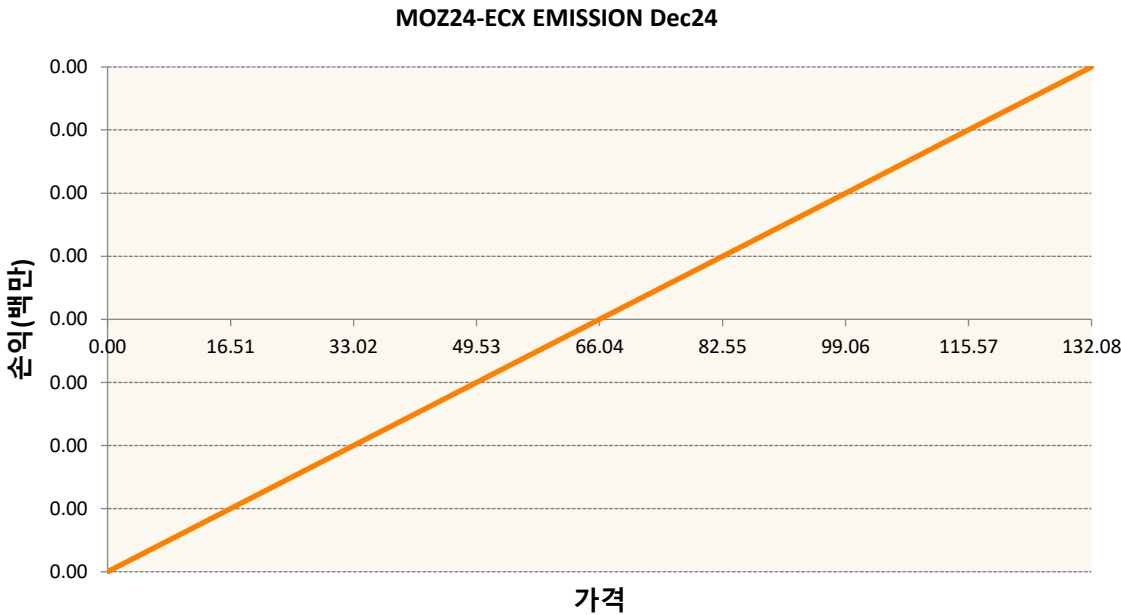
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 7,923 | 0     | 7,923     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,915 | -1,915    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           |                    | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|--------------------|----------|
| 2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index |                    | 0.23     |
| FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E                         |                    | 11       |
| FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E                         |                    | 142      |
| MOZ24                                               | ECX EMISSION Dec24 | 496      |
| MOZ25                                               | ECX EMISSION Dec25 | 138      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,146    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

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   | 3,519 | 0     | 3,519     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                     |    |
|-------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)  | 23 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)  | 23 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠) | 34 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)  | 34 |

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

(단위:백만원)

197

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

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   | 5,295 | 0     | 5,295     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(미래)  | 67 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(NH)  | 57 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(메리츠) | 81 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 17 |

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

(단위:백만원)

360

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

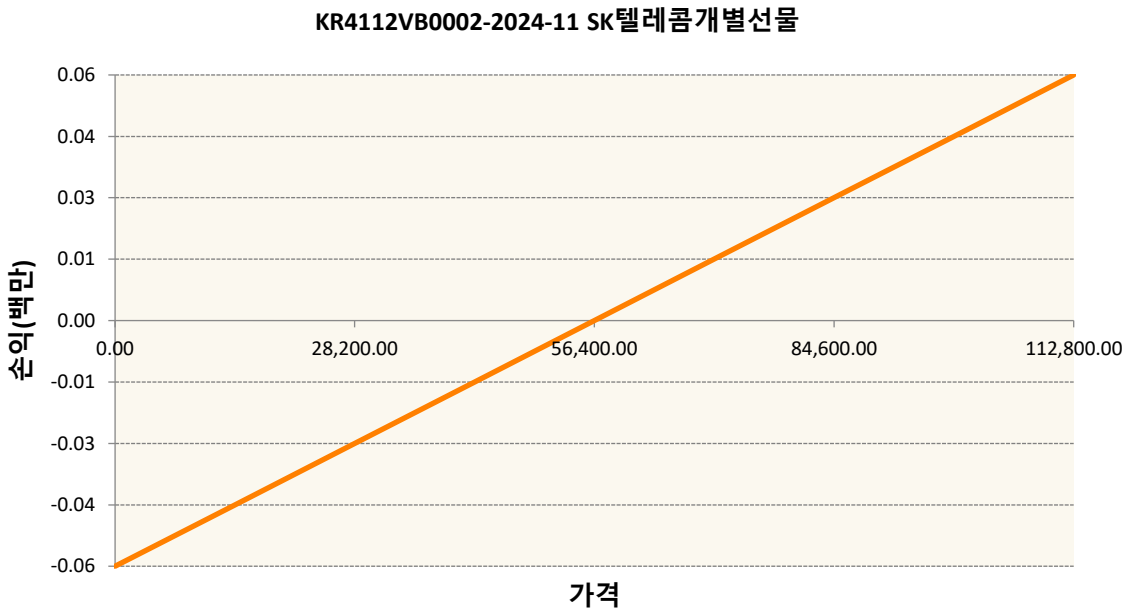
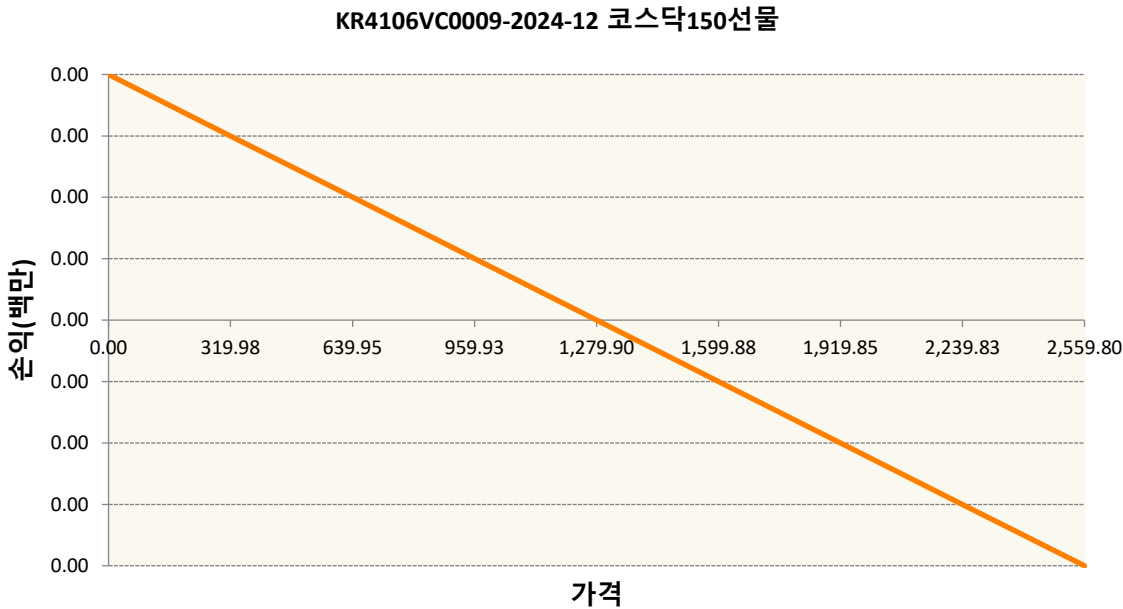
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

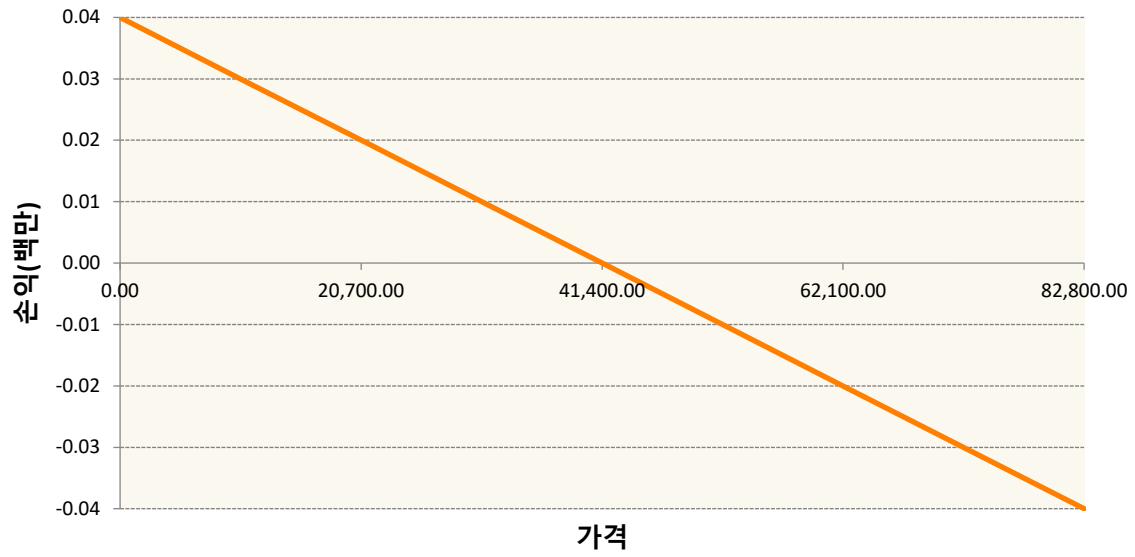
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 2     | 0     | 2         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 25    | 120   | -95       | 장내 |

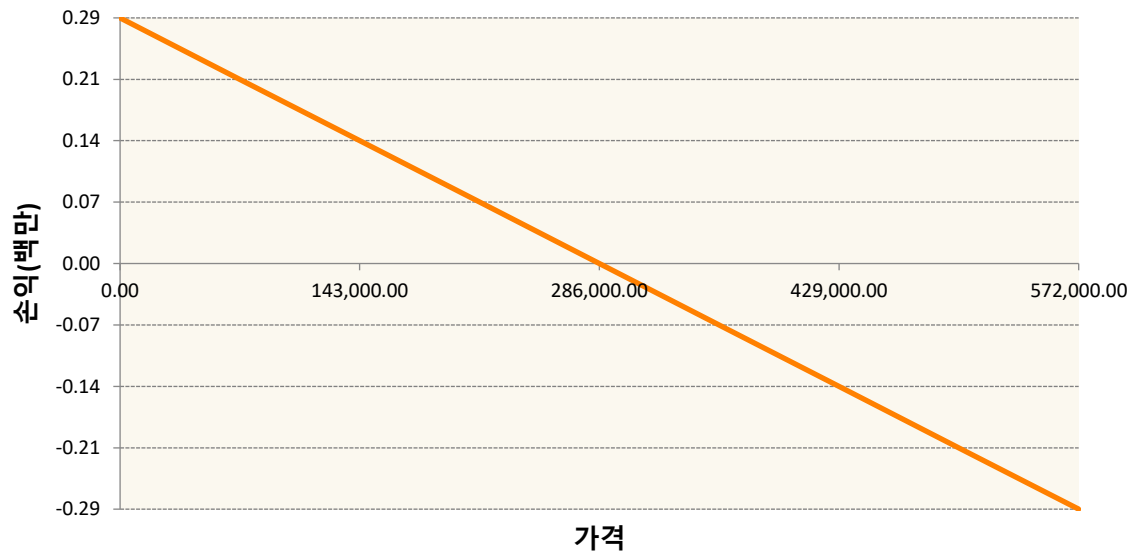
2. 만기시점의 손익구조



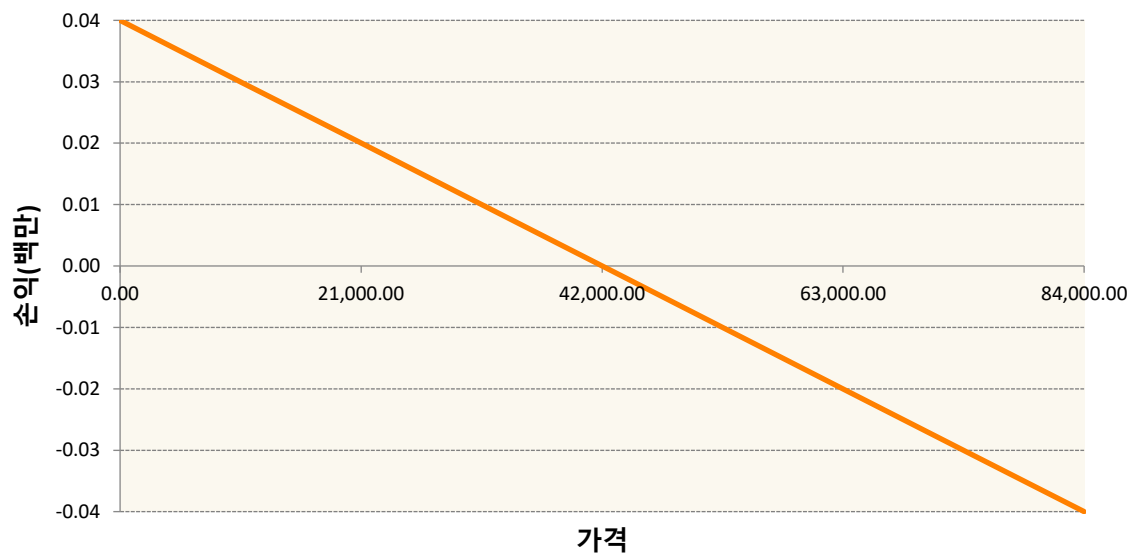
KR4114VB0000-2024-11 KT개별선물



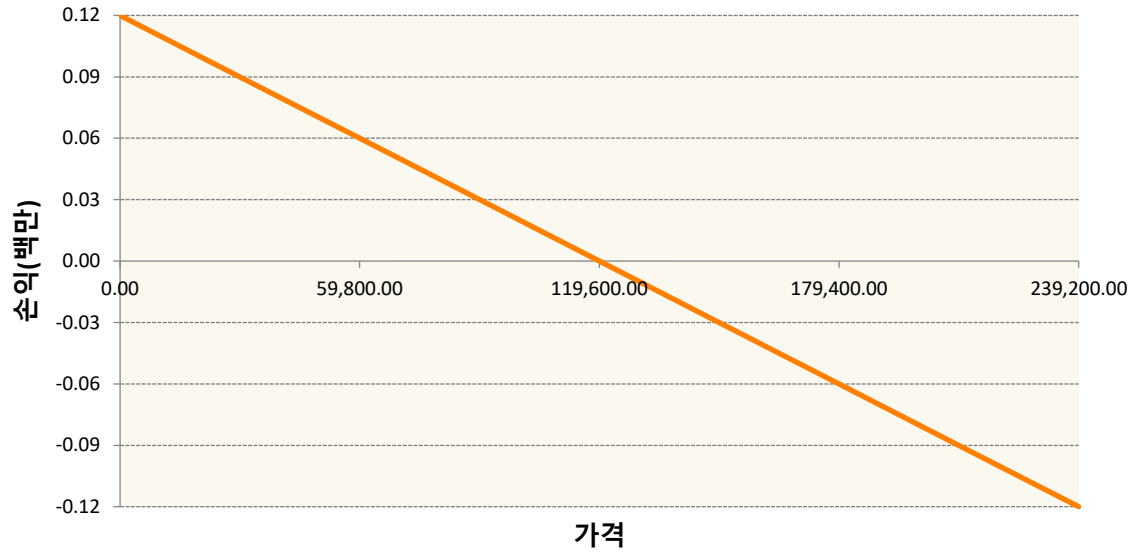
KR4122VC0009-2024-12 삼성SDI개별선물



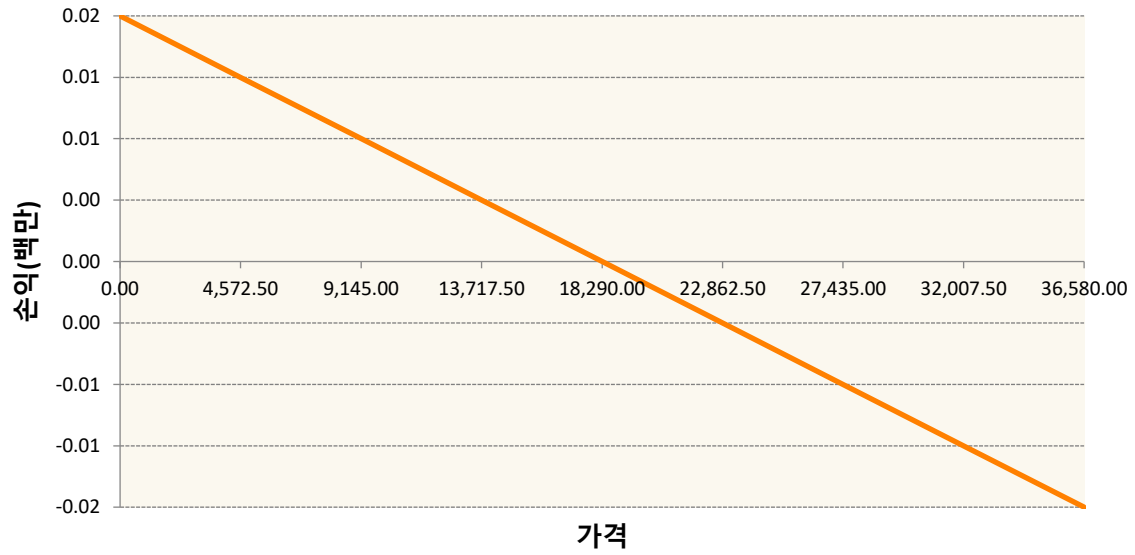
KR4135VB0005-2024-11 GS개별선물



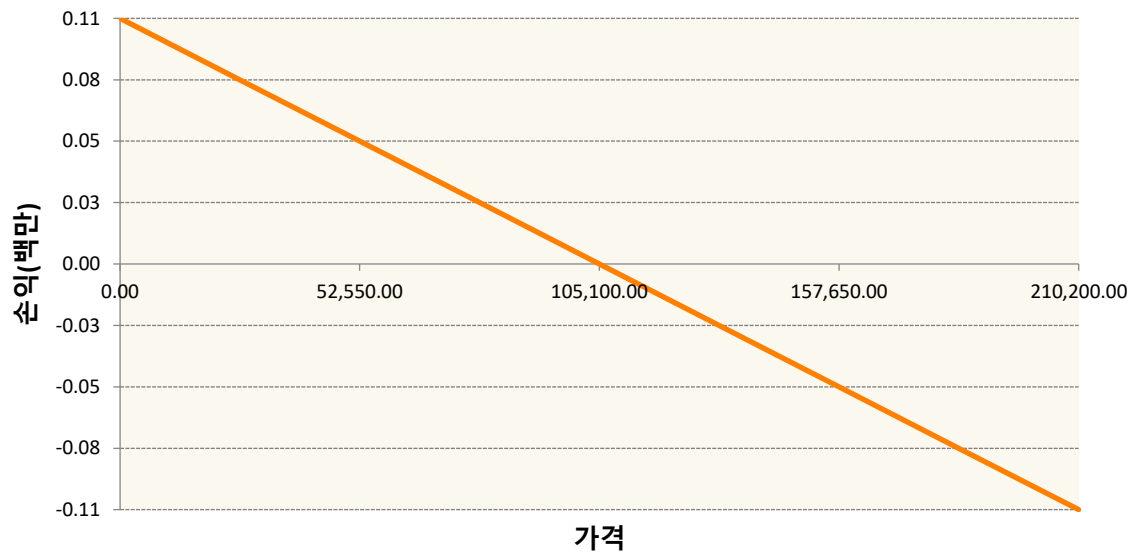
KR4136VB0004-2024-11 KT&G개별선물



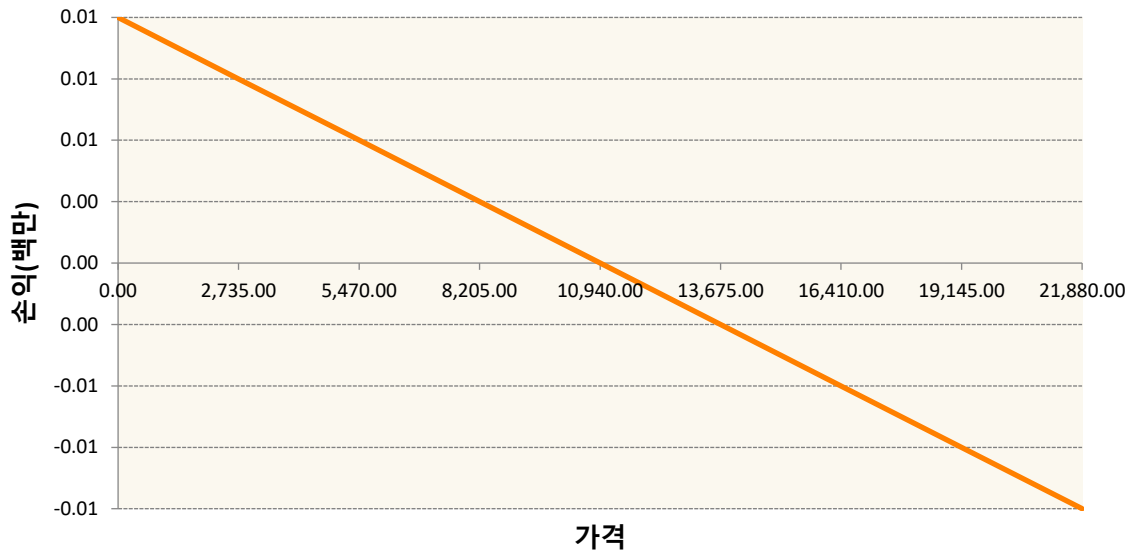
KR4151VB0004-2024-11 GS건설개별선물



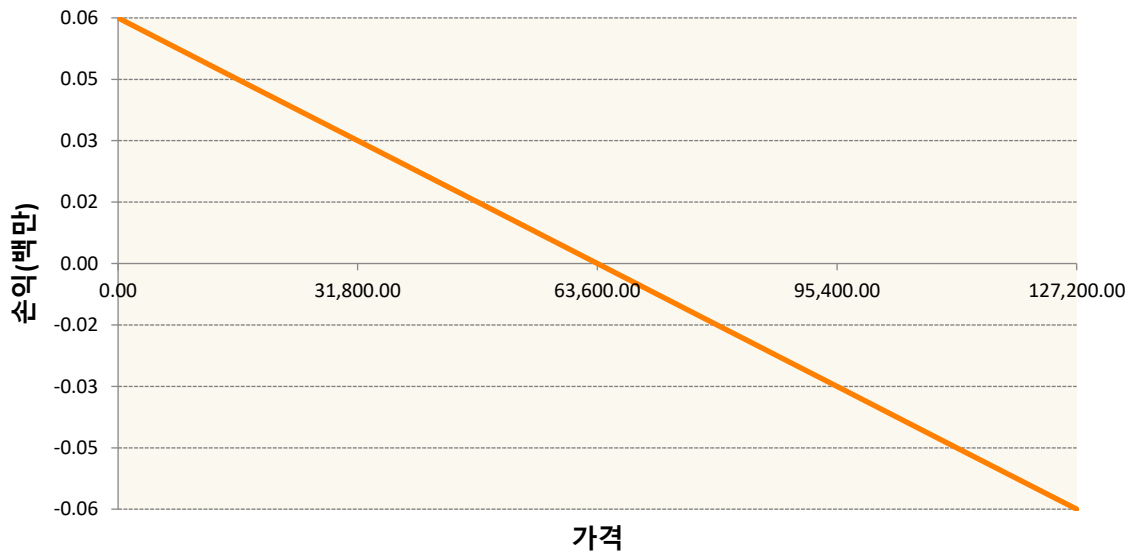
KR41BDVB0008-2024-11 삼성생명개별선물



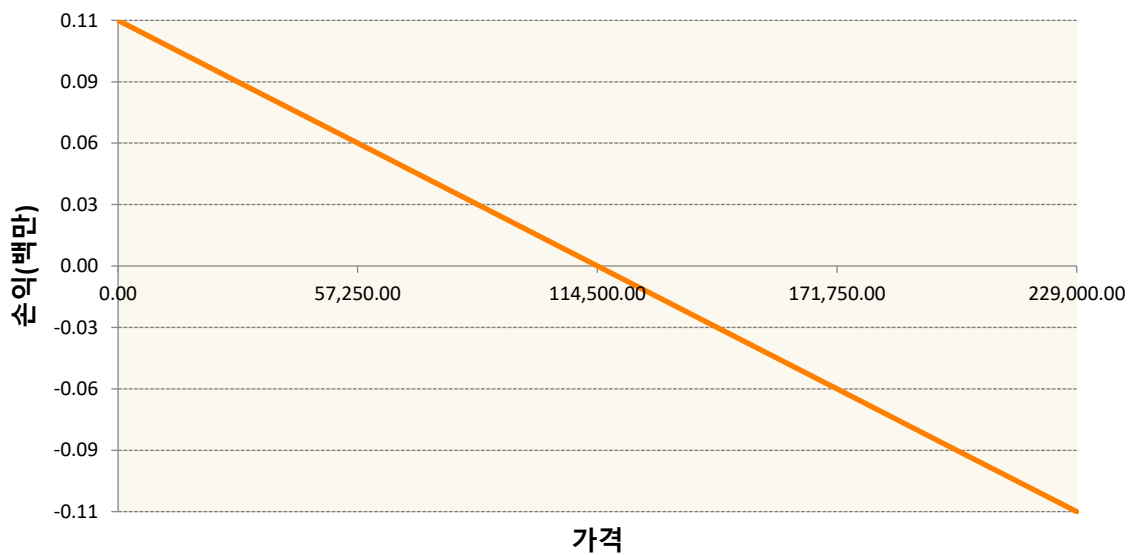
KR41BFVB0006-2024-11 삼성중공업개별선물



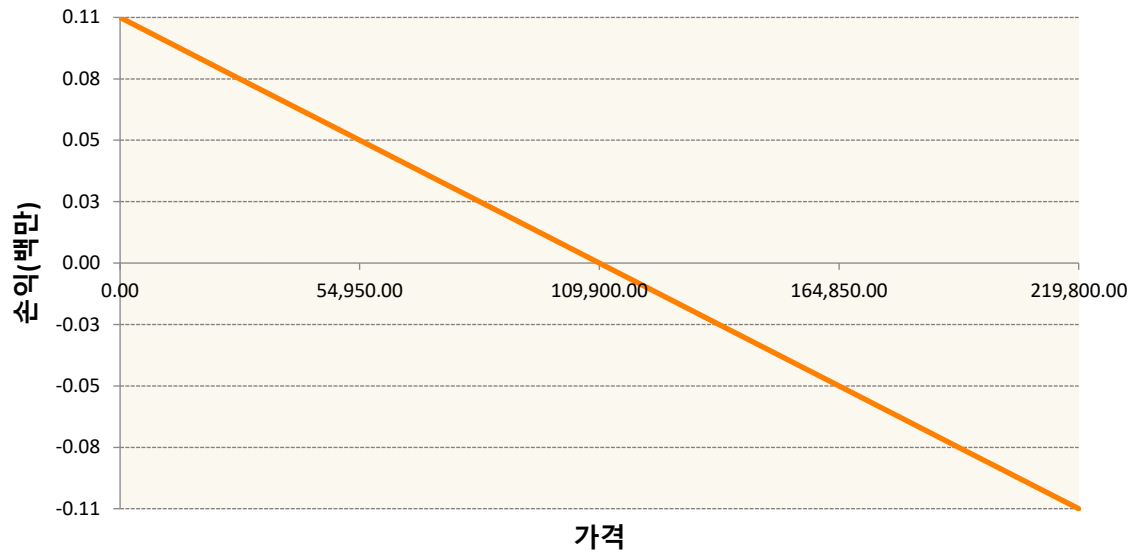
KR41BMVC0006-2024-12 한국항공우주개별선물



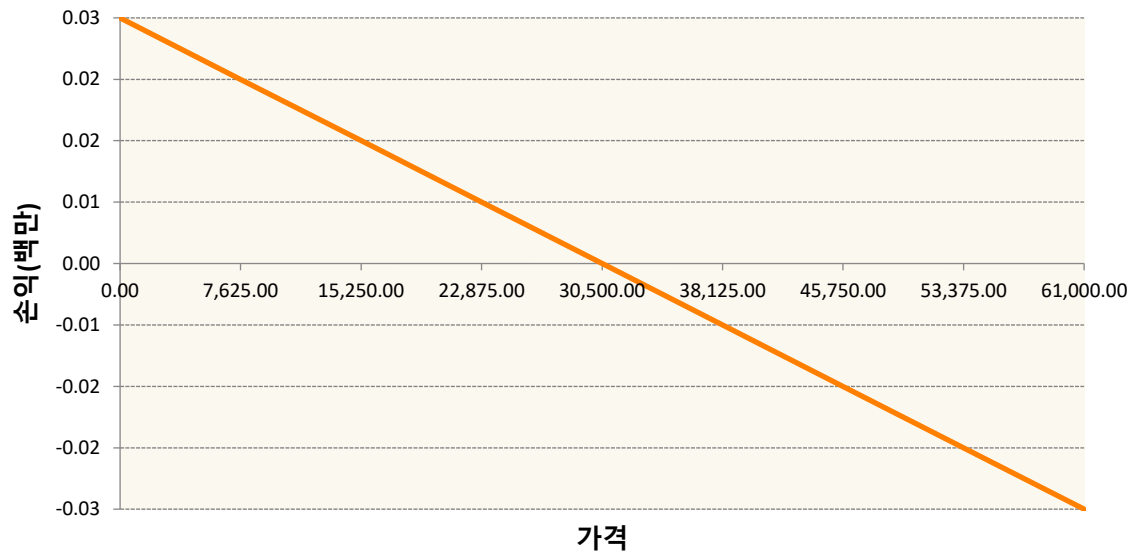
KR41CCVB0008-2024-11 현대글로비스개별선물



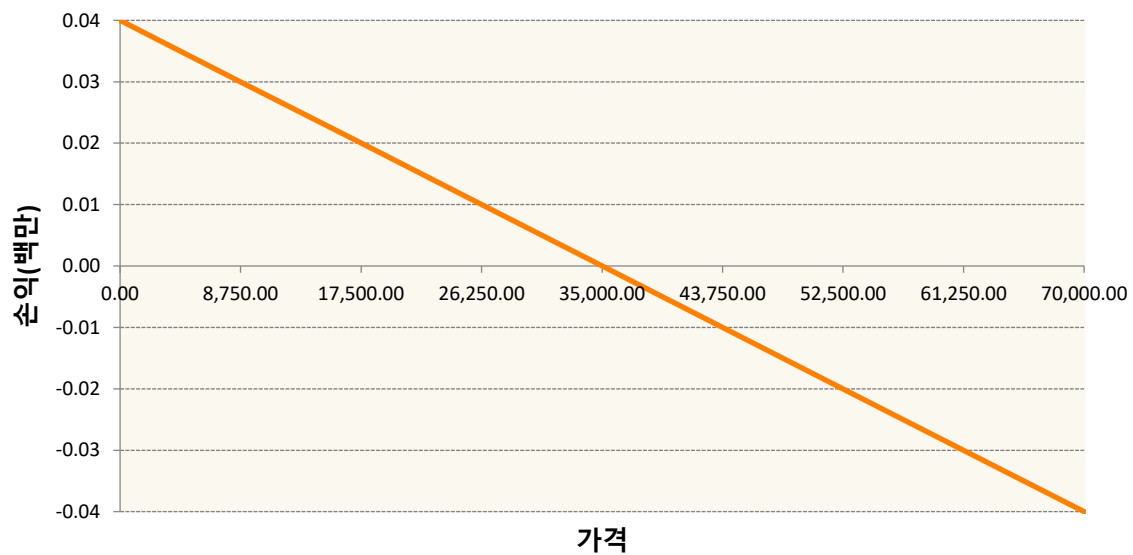
KR41CDVC0006-2024-12 현대미포조선개별선물



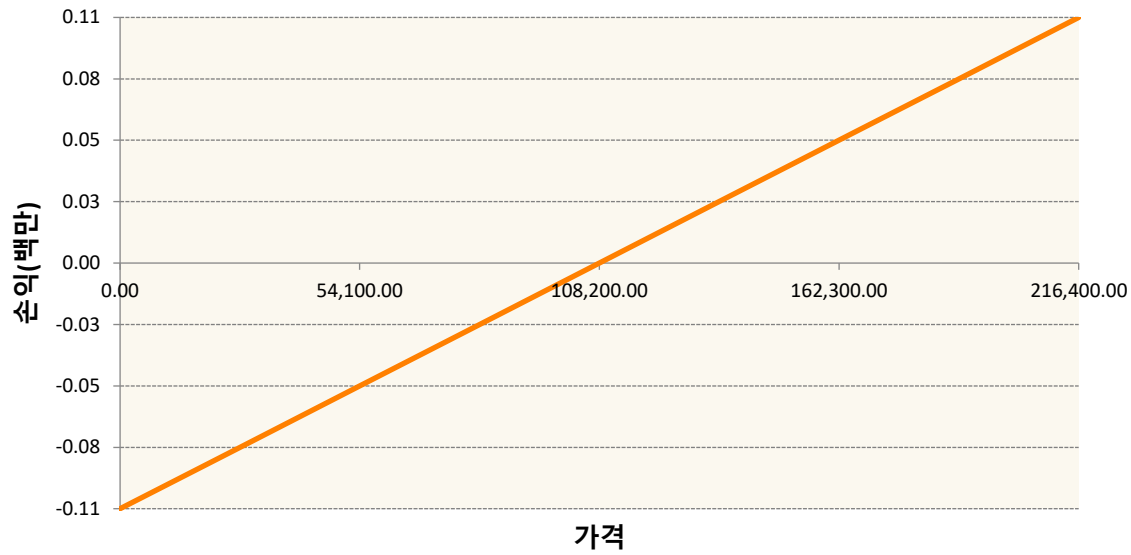
KR41CEVB0006-2024-11 현대해상개별선물



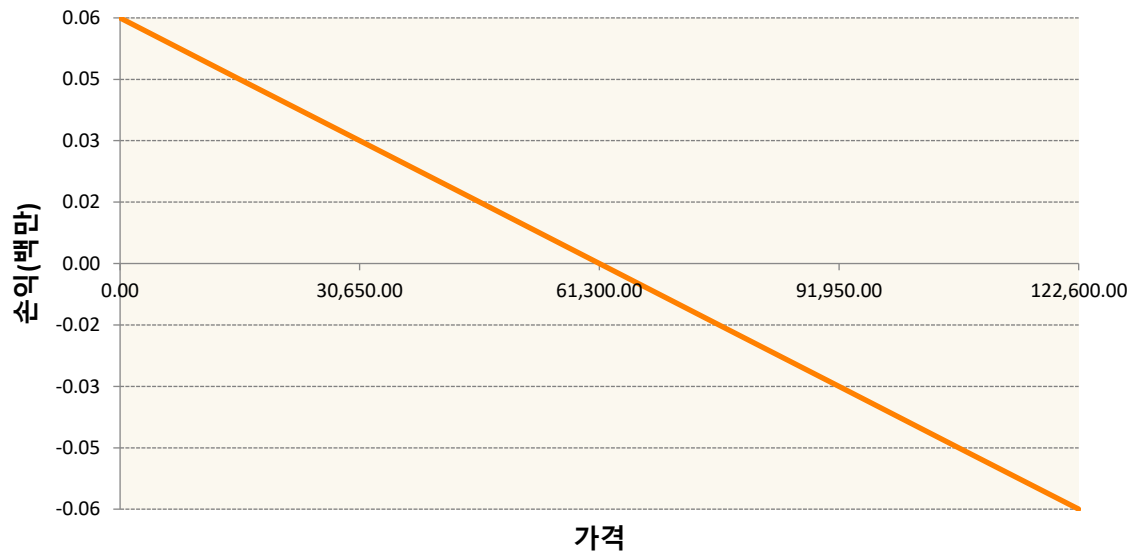
KR41CFVB0005-2024-11 카카오개별선물



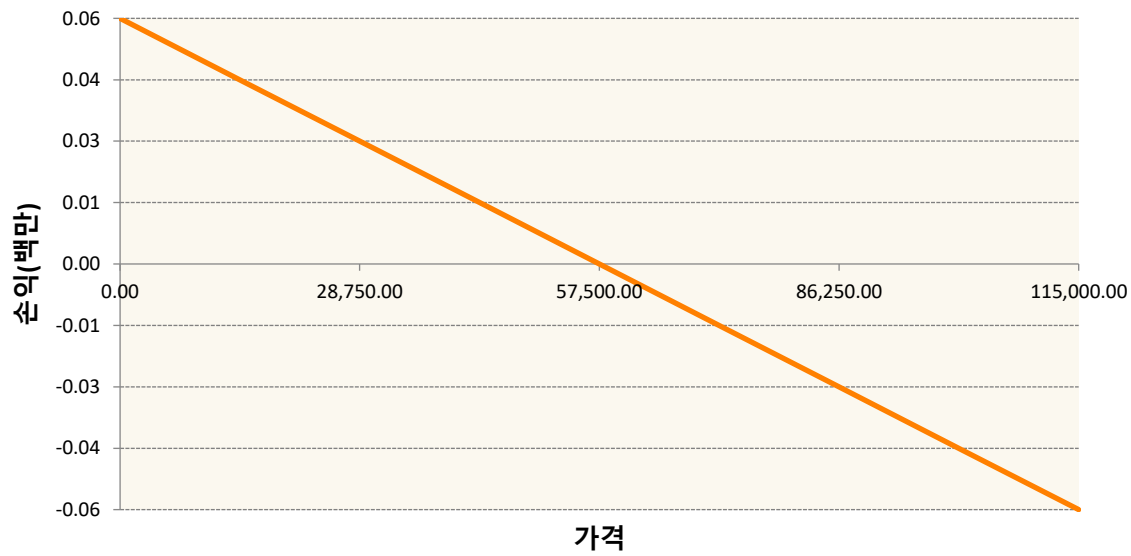
KR41D0VB0008-2024-11 DB손해보험개별선물



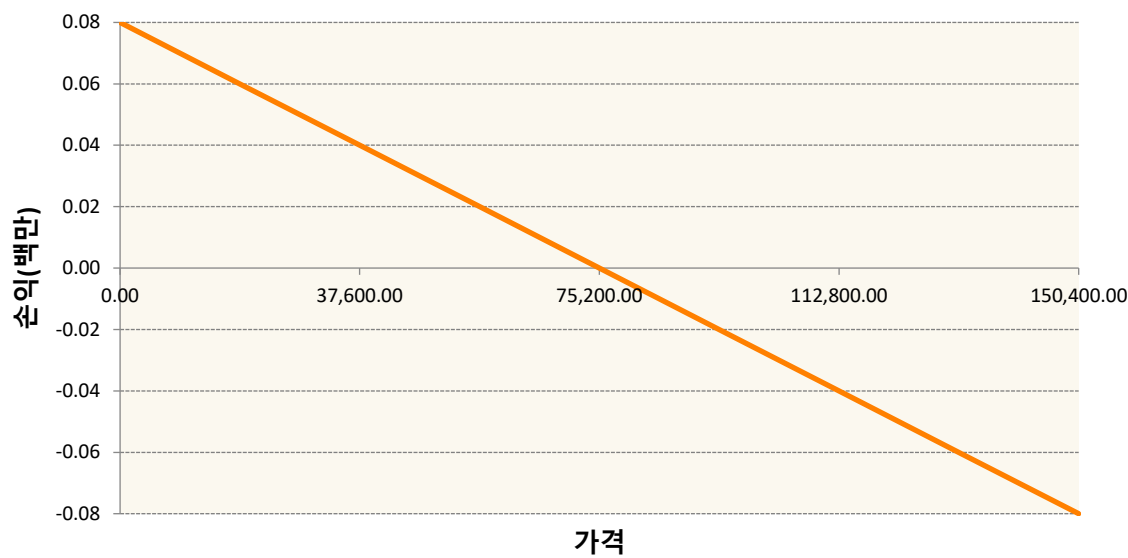
KR41DEVC0004-2024-12 한국콜마개별선물



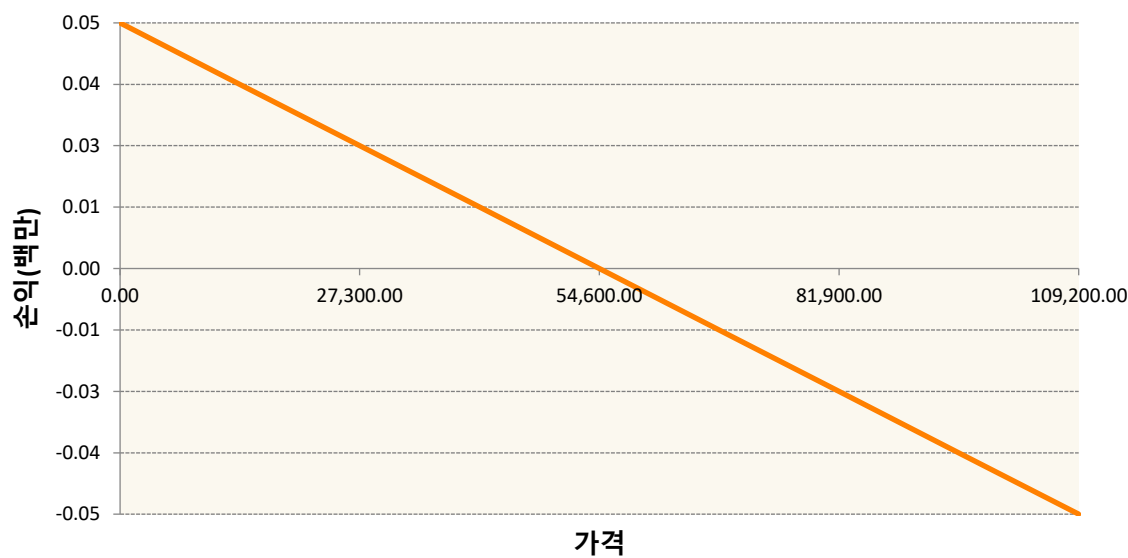
KR41DTVB0008-2024-11 CJ ENM개별선물



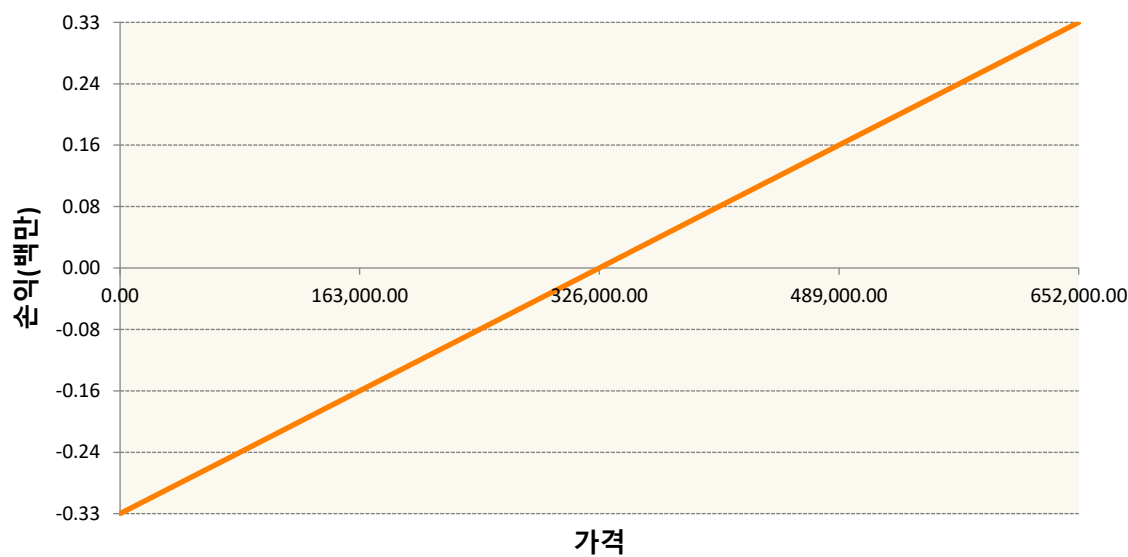
KR41E4VB0002-2024-11 에스엠개별선물



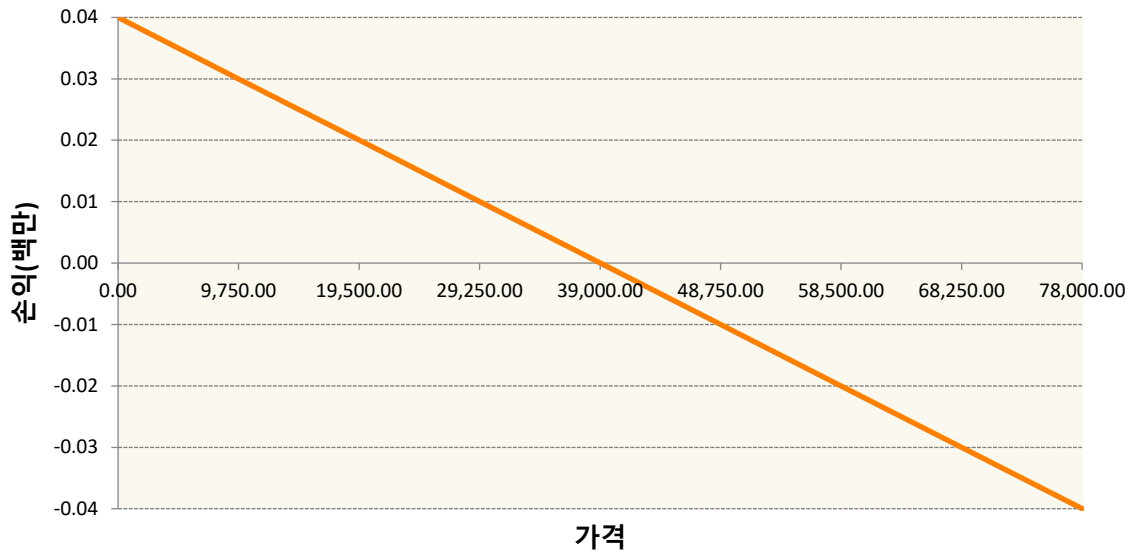
KR41EFVB0003-2024-11 JYP Ent.개별선물



KR41F8VB0005-2024-11 크래프톤개별선물



### KR41FLVB0004-2024-11 펠어비스개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                 |      |
|---------------------------------|------|
| KR4106VC00 2024-12 코스닥150선물     | 2    |
| KR4112VB00 2024-11 SK텔레콤개별선물    | 1    |
| KR4114VB00 2024-11 KT개별선물       | 1    |
| KR4122VC00 2024-12 삼성SDI개별선물    | 0.46 |
| KR4135VB00 2024-11 GS개별선물       | 0.27 |
| KR4136VB00 2024-11 KT&G개별선물     | 0.1  |
| KR4151VB00 2024-11 GS건설개별선물     | 1    |
| KR41BDVB00 2024-11 삼성생명개별선물     | 0.42 |
| KR41BFVB00 2024-11 삼성중공업개별선물    | 1    |
| KR41BMVC00 2024-12 한국항공우주개별선물   | 1    |
| KR41CCVB00 2024-11 현대글로벌비스개별선물  | 1    |
| KR41CDVC00 2024-12 현대미포조선개별선물   | 0.18 |
| KR41CEVB00 2024-11 현대해상개별선물     | 0.05 |
| KR41CFVB00 2024-11 카카오개별선물      | 1    |
| KR41D0VB00 2024-11 DB손해보험개별선물   | 1    |
| KR41DEVC00 2024-12 한국콜마개별선물     | 0.34 |
| KR41DTVB00 2024-11 CJ ENM개별선물   | 0.09 |
| KR41E4VB00 2024-11 에스엠개별선물      | 0.48 |
| KR41EFVB00 2024-11 JYP Ent.개별선물 | 1    |
| KR41F8VB00 2024-11 크래프톤개별선물     | 0.26 |
| KR41FLVB00 2024-11 펠어비스개별선물     | 0.28 |

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

(단위:백만원)

22

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

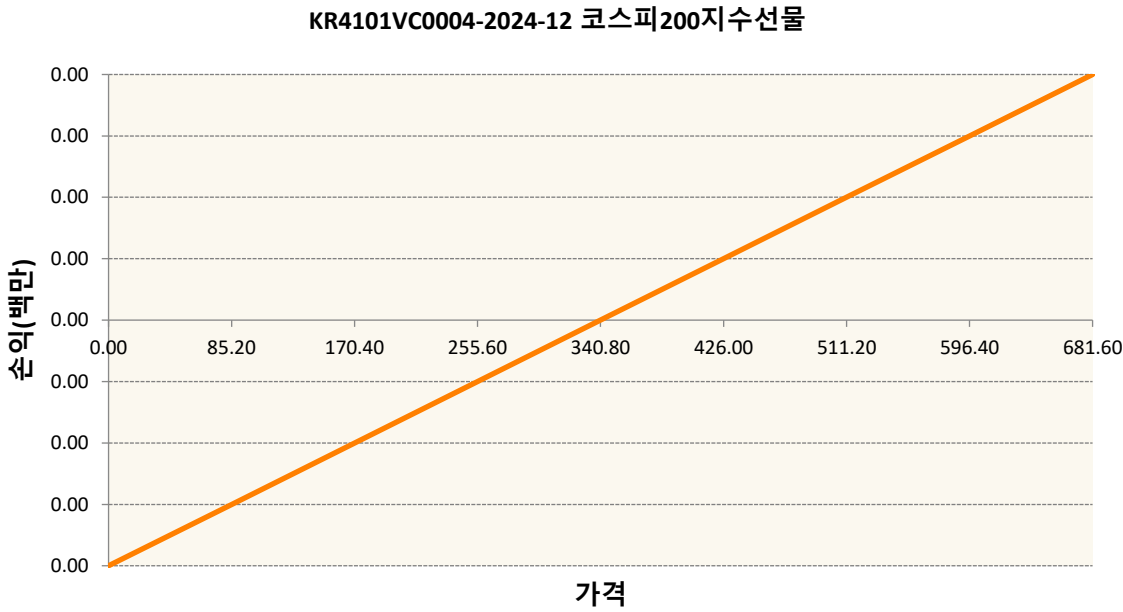
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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   | 9,372 | 0     | 9,372     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101VC0004 |           |         | 2024-12 코스피200지수선물 |      |       |        | 747    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -747      | -747    | -747               | -747 | -747  | -747   | -747   |
| -5.33%       | -498      | -498    | -498               | -498 | -498  | -498   | -498   |
| -2.67%       | -249      | -249    | -249               | -249 | -249  | -249   | -249   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 249       | 249     | 249                | 249  | 249   | 249    | 249    |
| 5.33%        | 498       | 498     | 498                | 498  | 498   | 498    | 498    |
| 8.00%        | 747       | 747     | 747                | 747  | 747   | 747    | 747    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

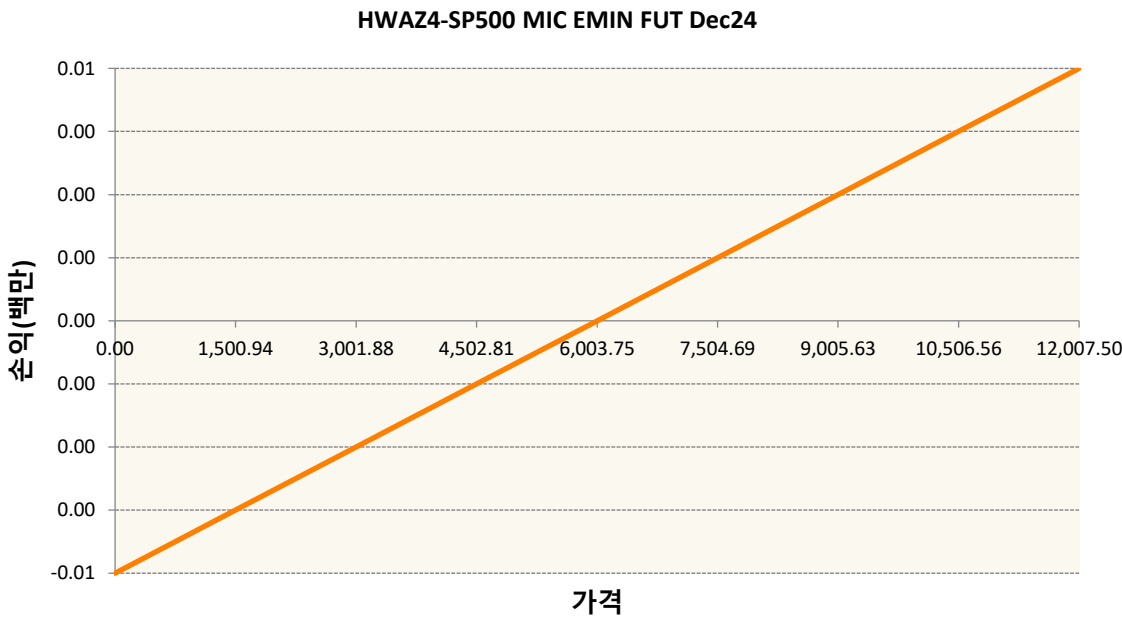
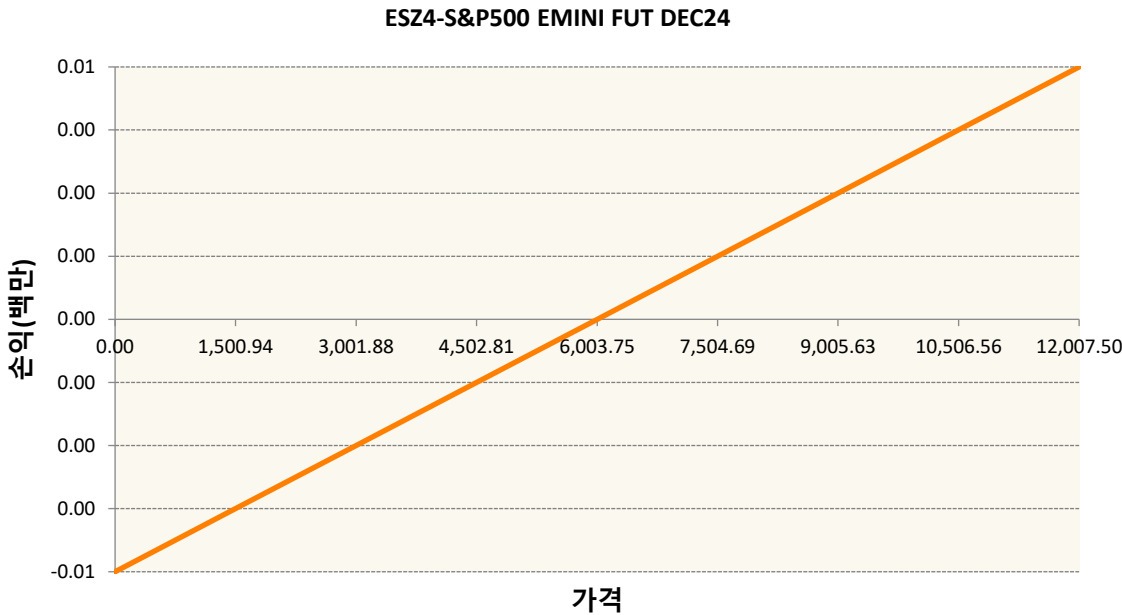
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 13,687 | 0     | 13,687    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,639  | 0     | 1,639     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ4                      | S&P500 EMINI FUT DEC24   | 1,095    |
| HWAZ4                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec24 | 131      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 753      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

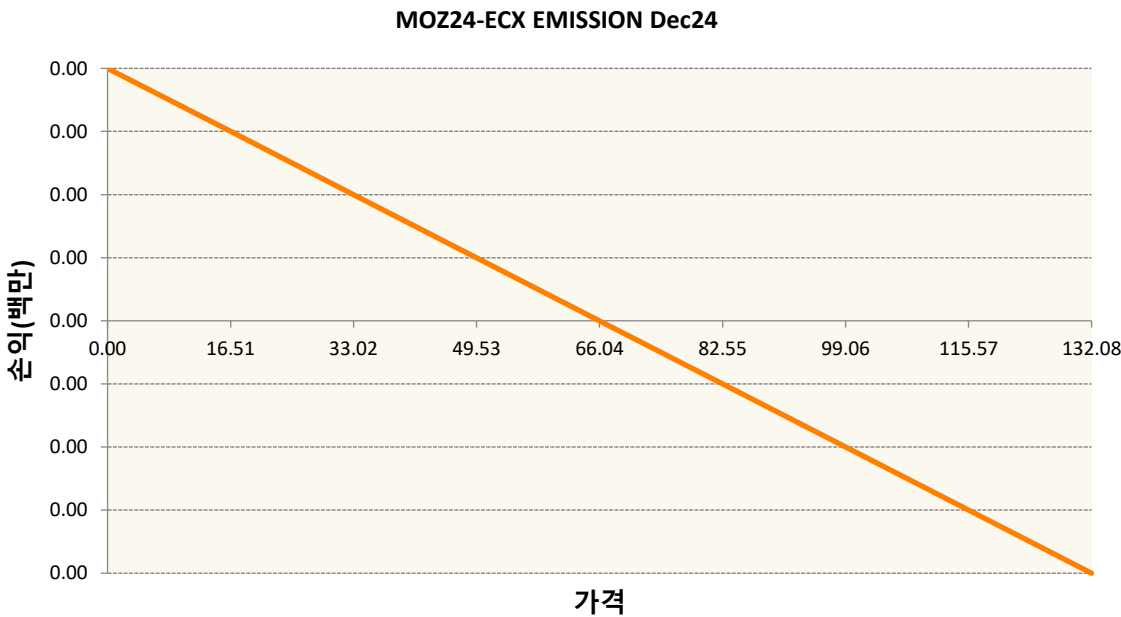
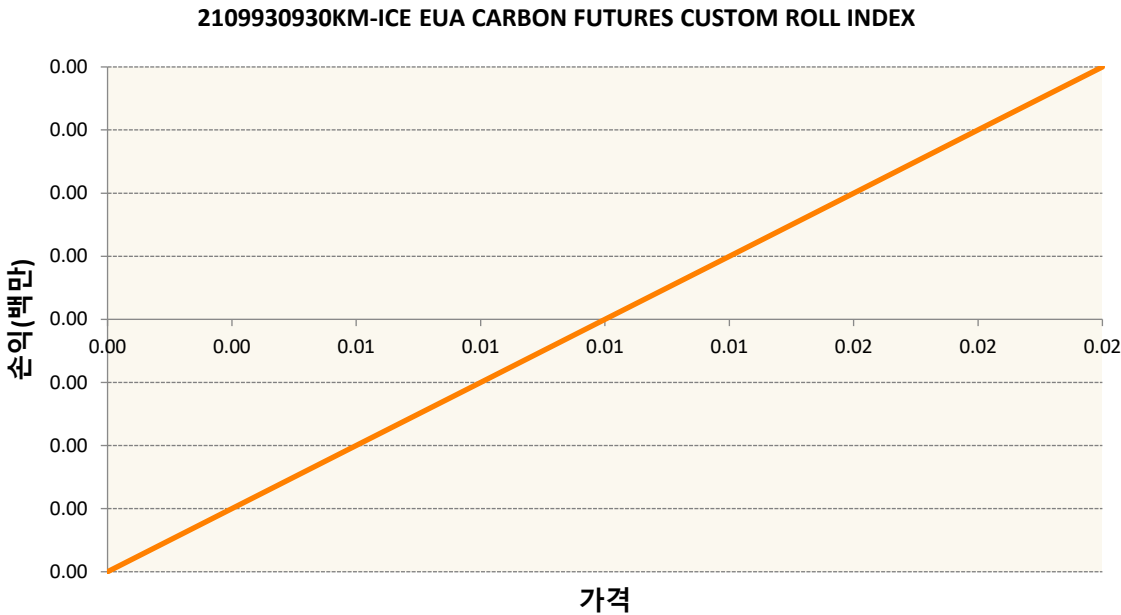
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

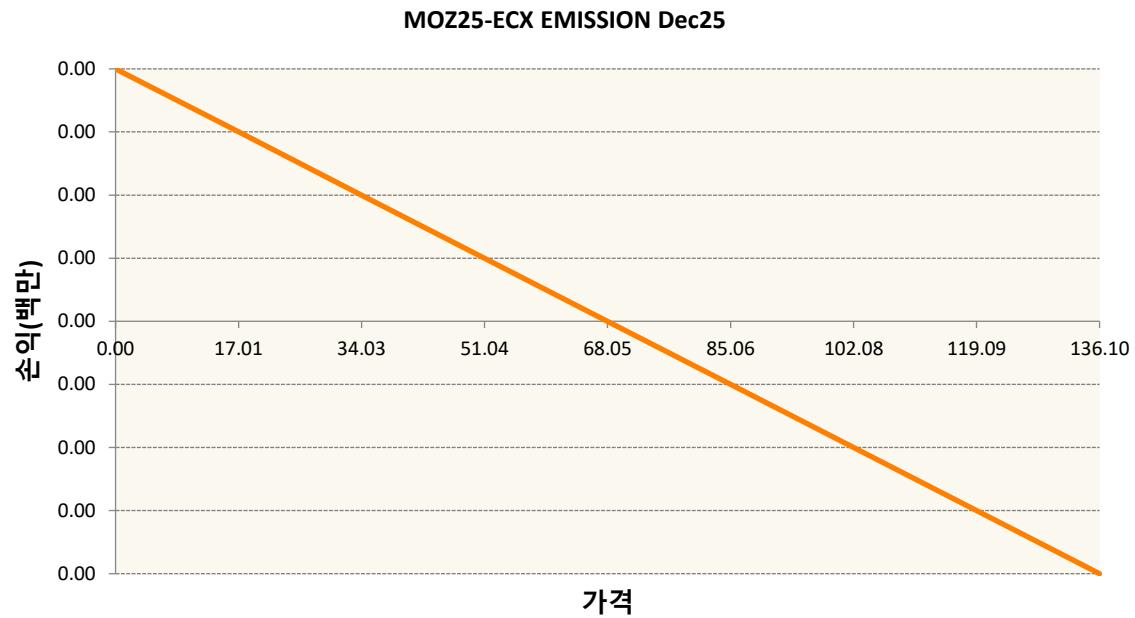
1. 계약금액

(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   | 4     | 5,572 | -5,568    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,426 | -1,426    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           |                    | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|--------------------|----------|
| 2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX |                    | 0.19     |
| FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E                         |                    | 114      |
| MOZ24                                               | ECX EMISSION Dec24 | 348      |
| MOZ25                                               | ECX EMISSION Dec25 | 98       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 809      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

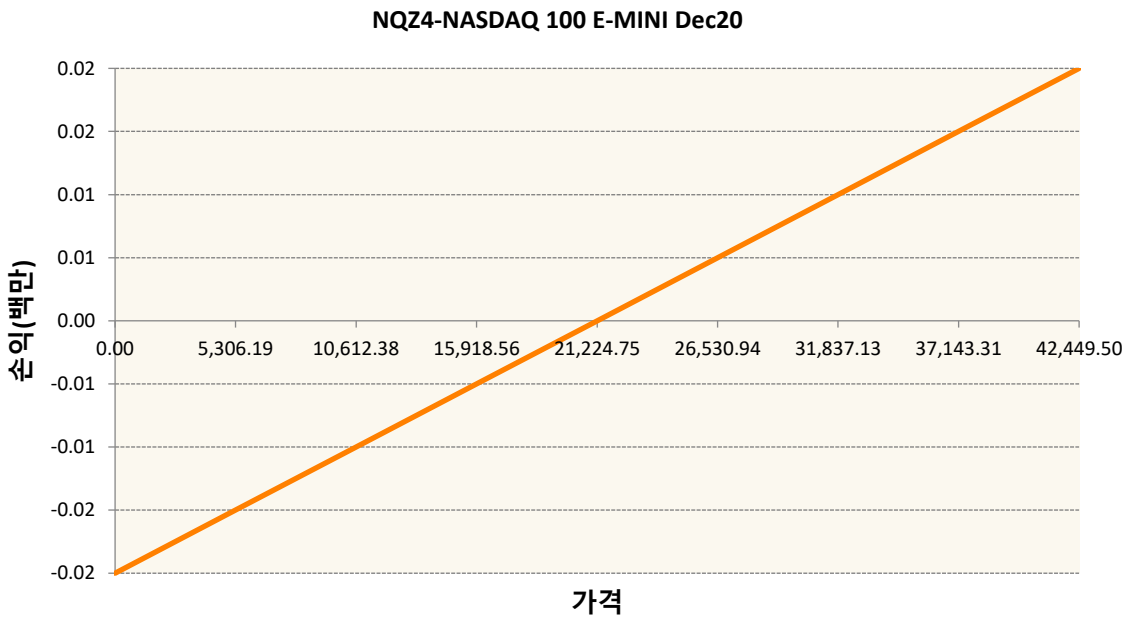
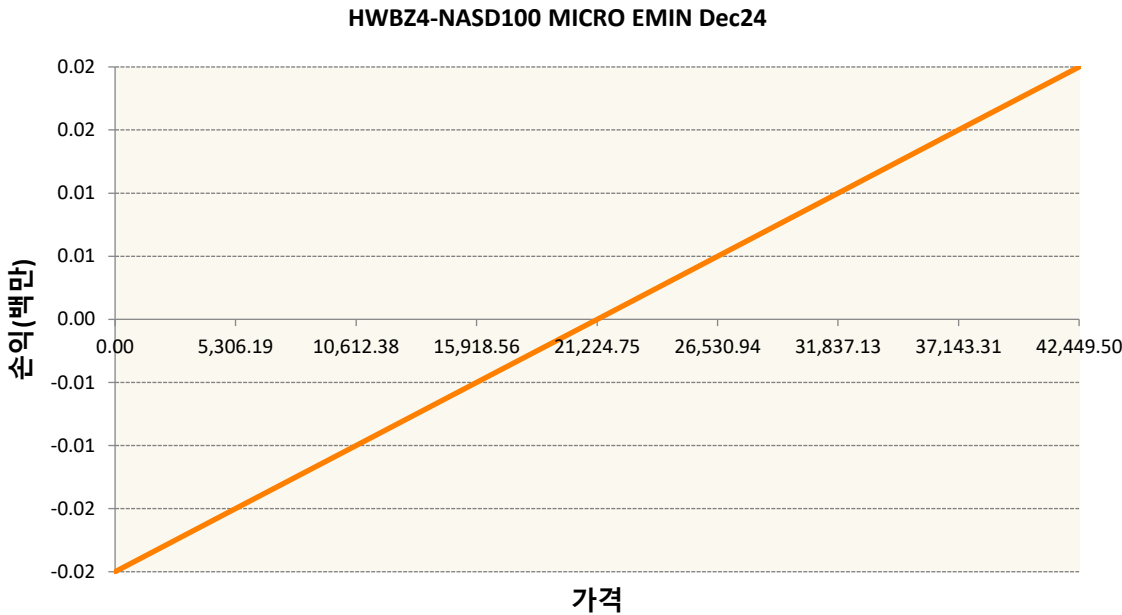
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 7,375 | 0     | 7,375     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 862   | 0     | 862       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBZ4                     | NASD100 MICRO EMIN Dec24 |  | 69       |
| NQZ4                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 590      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 552      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

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   | 198,129 | 0     | 198,129   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |       |
|-----------------------------------------------------|-------|
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 695   |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 6,270 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 3,635 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 5,196 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 9,405 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

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   | 7,124 | 0     | 7,124     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |    |
|----------------------------------------------------|----|
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 16 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 16 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 16 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 16 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 71 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-11-11 |
| 기준일 | 2024-11-08 |

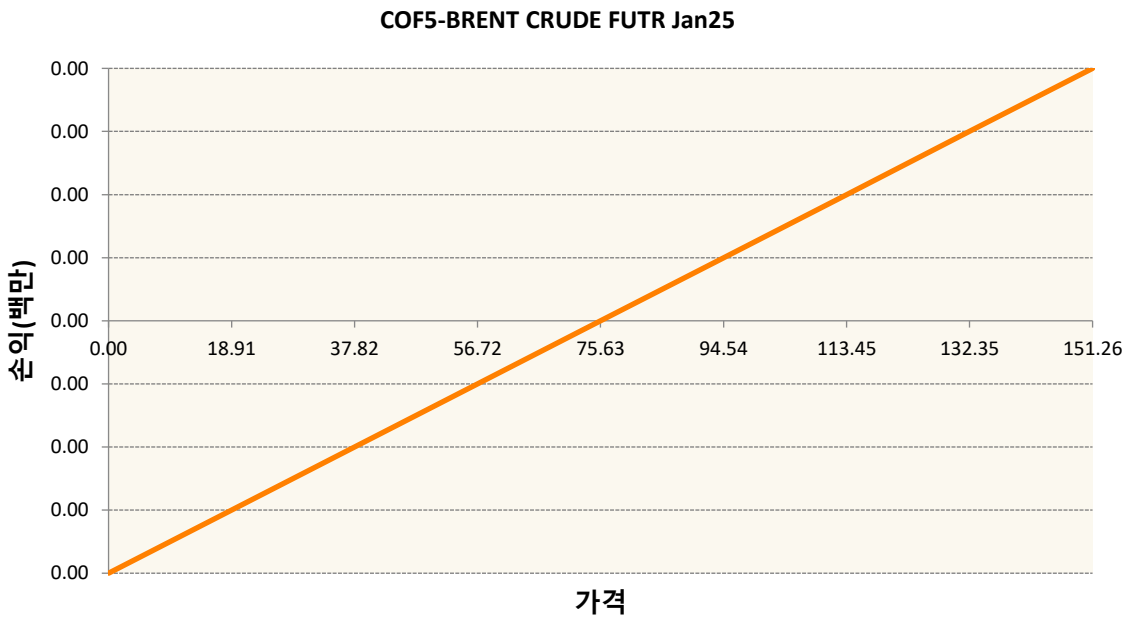
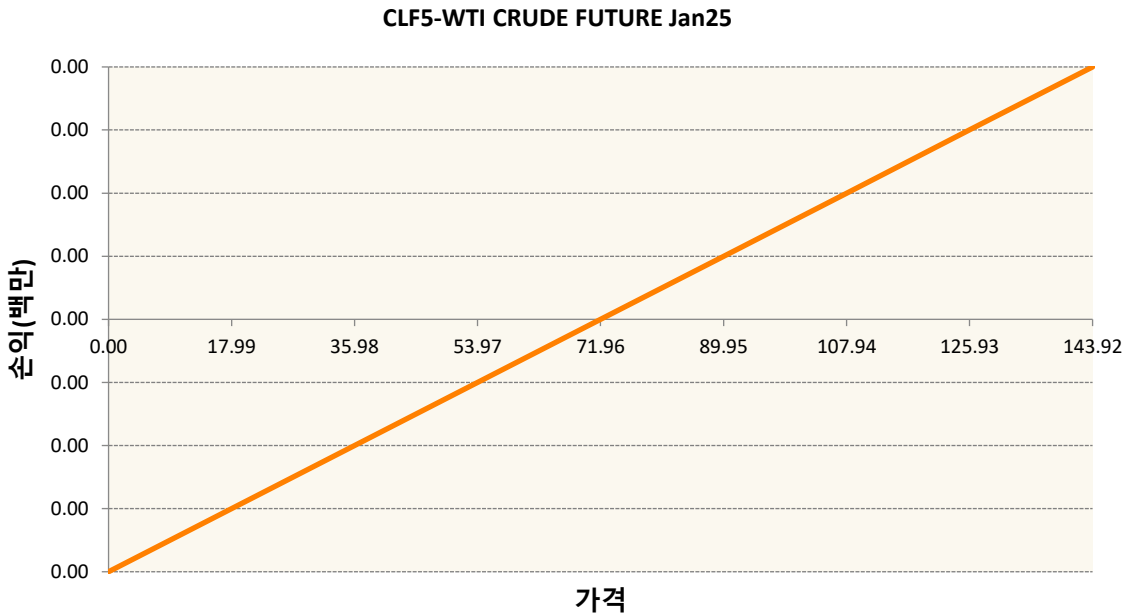
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

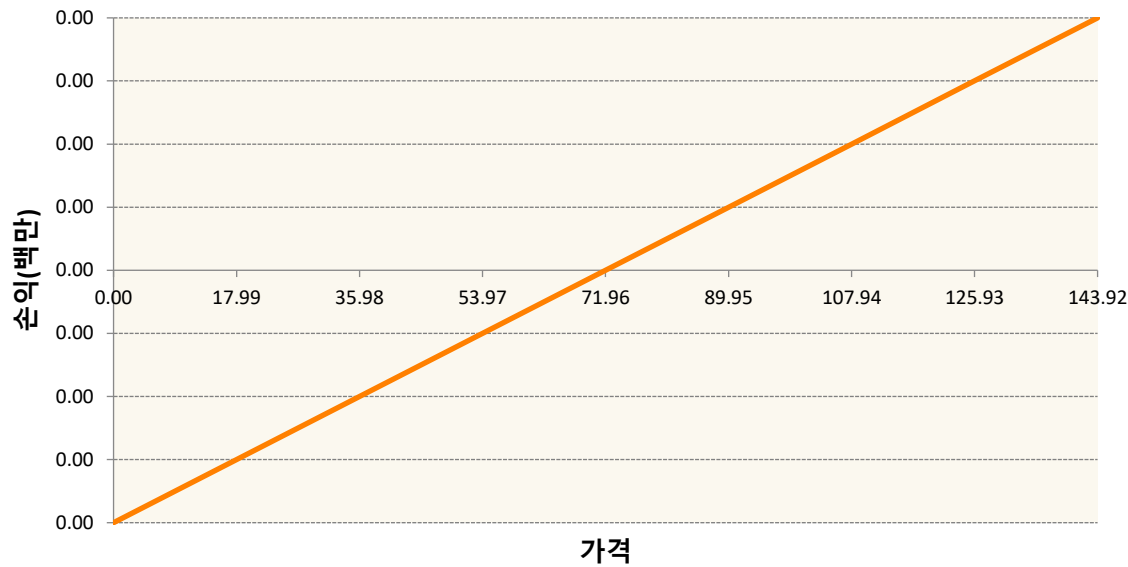
(단위:백만원)

| 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   | 784   | 0     | 784       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 125   | -125      | 장내 |

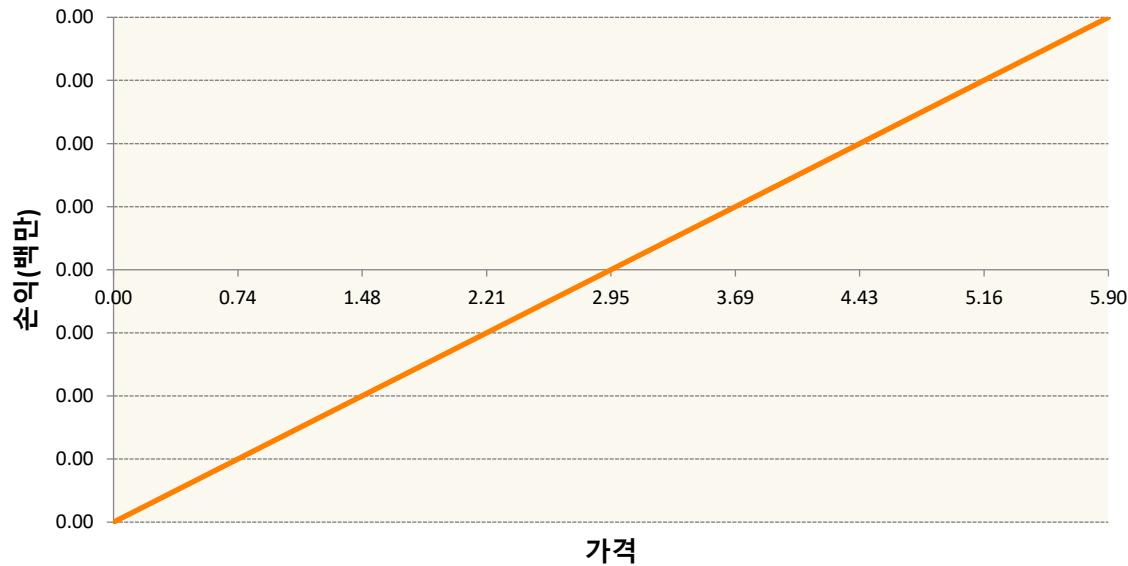
2. 만기시점의 손익구조



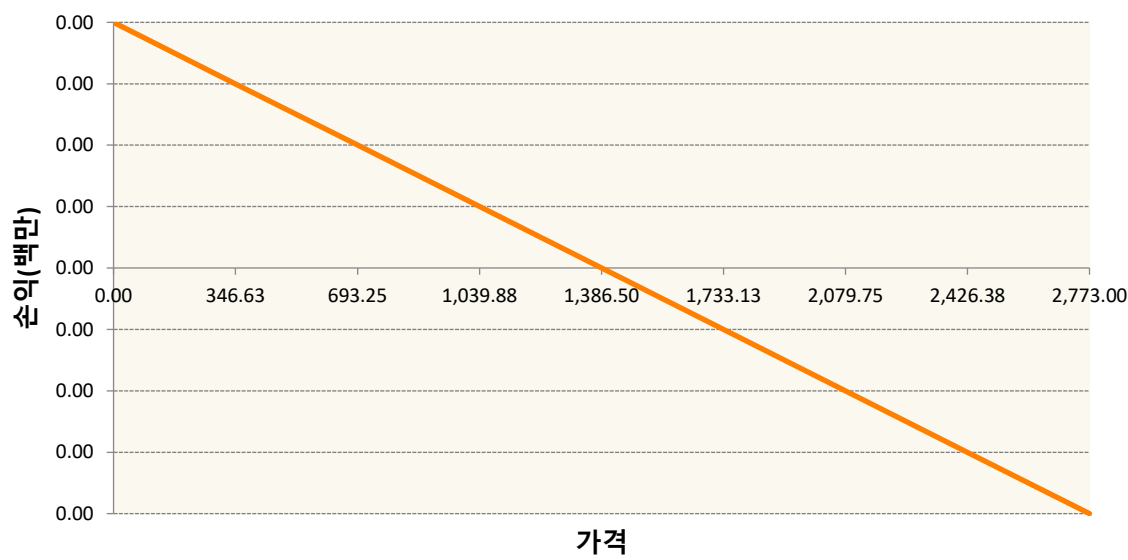
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



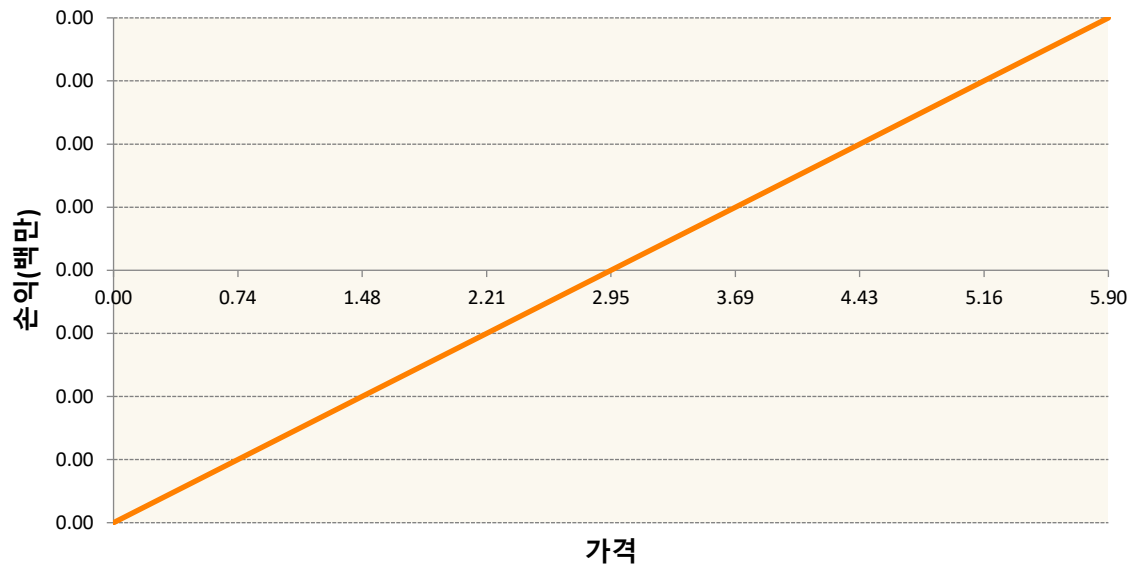
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



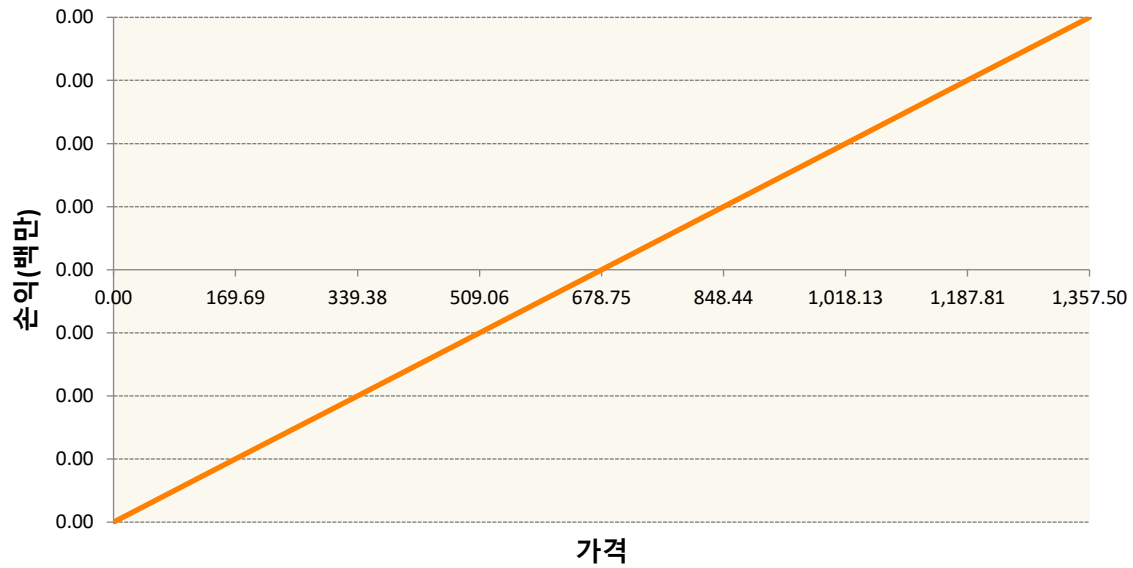
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



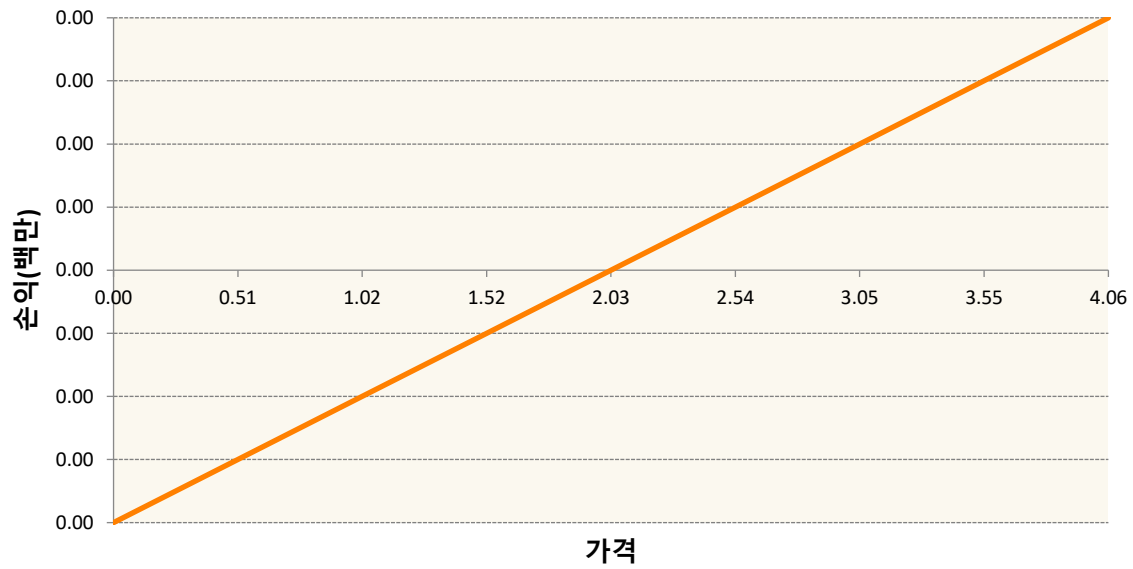
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



QSF5-Low Su Gasoil G Jan25



XBF5-GASOLINE RBOB FUT Jan25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|                         |                          |    |
|-------------------------|--------------------------|----|
| CLF5                    | WTI CRUDE FUTURE Jan25   | 8  |
| COF5                    | BRENT CRUDE FUTR Jan25   | 16 |
| ECF5                    | E-MINI CRUDE OIL Jan25   | 4  |
| EOF5                    | E-MINI NATURAL GAS Jan25 | 2  |
| KR4175VB00 2024-11 달러선물 |                          | 10 |
| NGF25                   | NATURAL GAS FUTR Jan25   | 16 |
| QSF5                    | Low Su Gasoil G Jan25    | 7  |
| XBF5                    | GASOLINE RBOB FUT Jan25  | 9  |

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

137