

공시일 2024-10-14

기준일 2024-10-11

## 베스트장기채(채권-파생형)

### 1. 계약금액

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 2. 만기시점의 손익구조

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

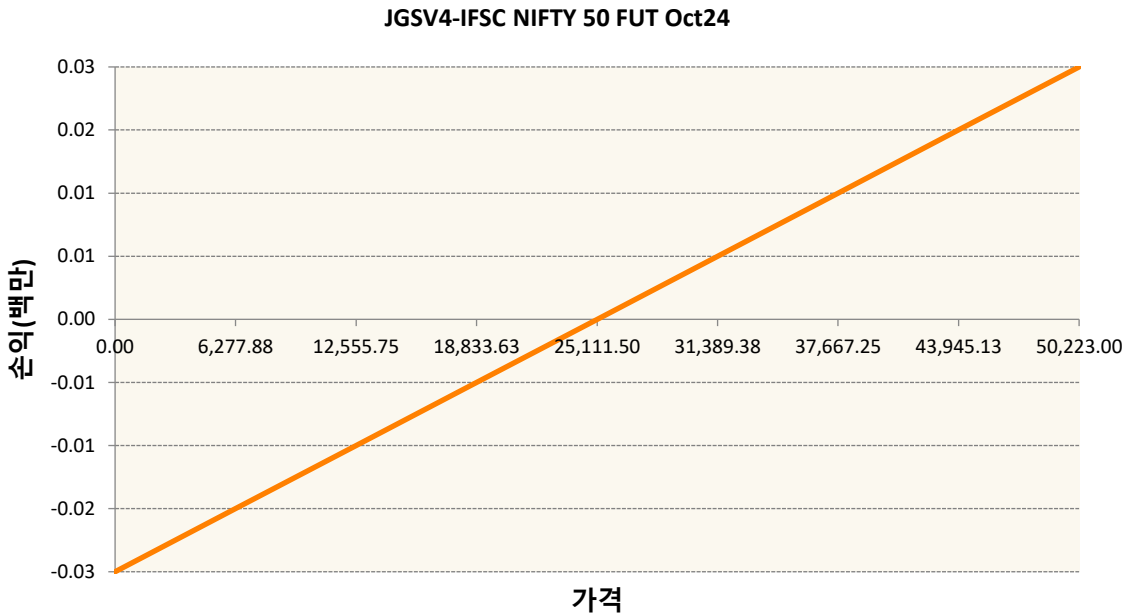
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 4,559 | 0     | 4,559     |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |     |
|-------|-------------------------|-----|
| JGSV4 | IFSC NIFTY 50 FUT Oct24 | 365 |
|-------|-------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

233

공시일 2024-10-14

기준일 2024-10-11

## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 1. 계약금액

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 2. 만기시점의 손익구조

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

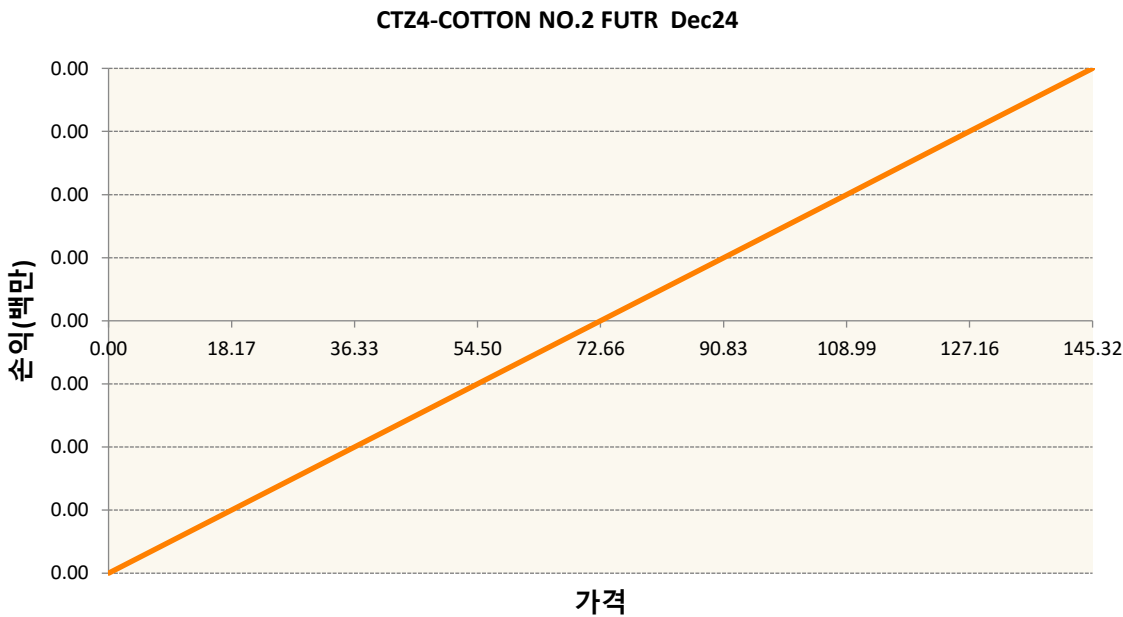
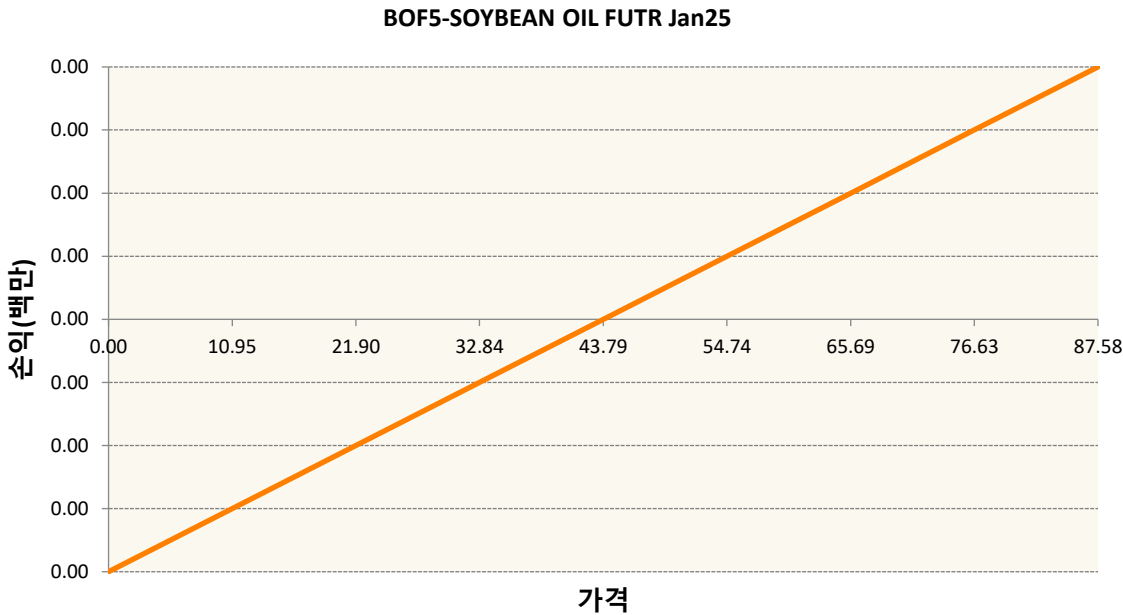
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

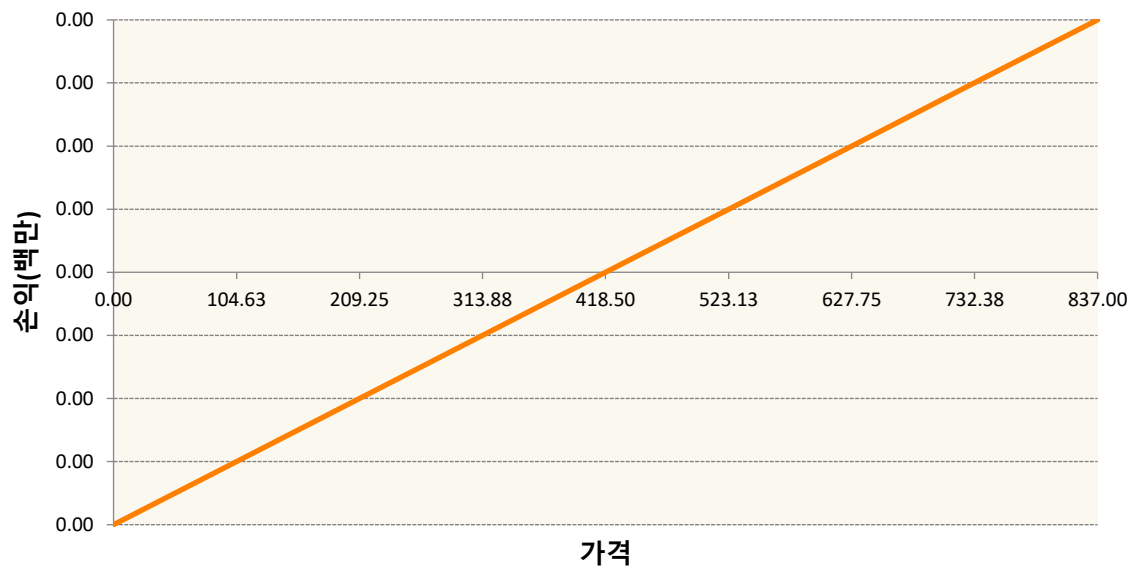
(단위:USD 백만)

| 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   | 3,978 | 0     | 3,978     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 594   | -594      | 장내 |

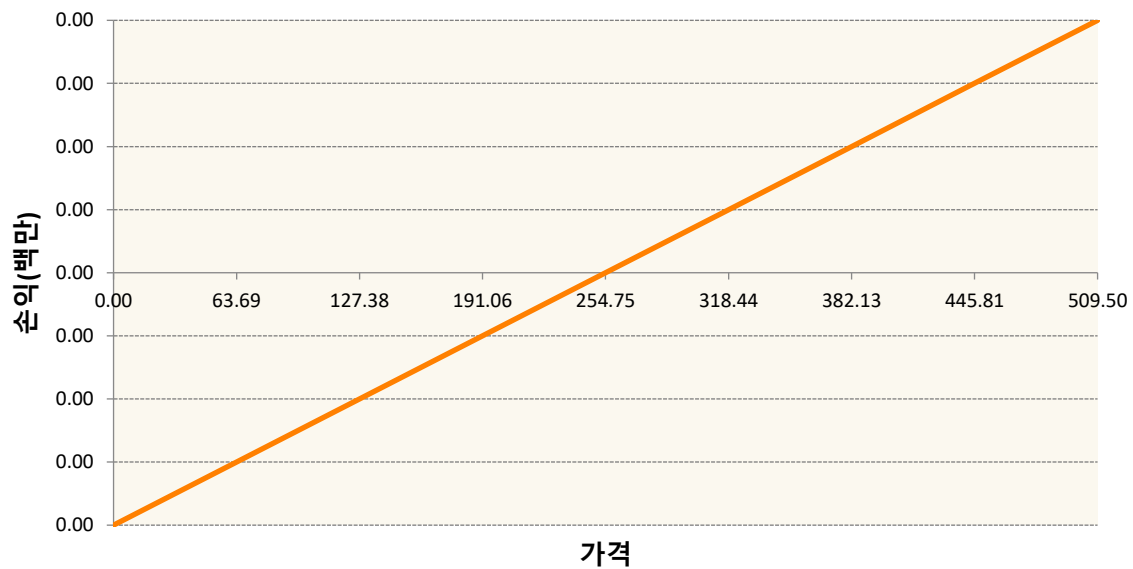
2. 만기시점의 손익구조



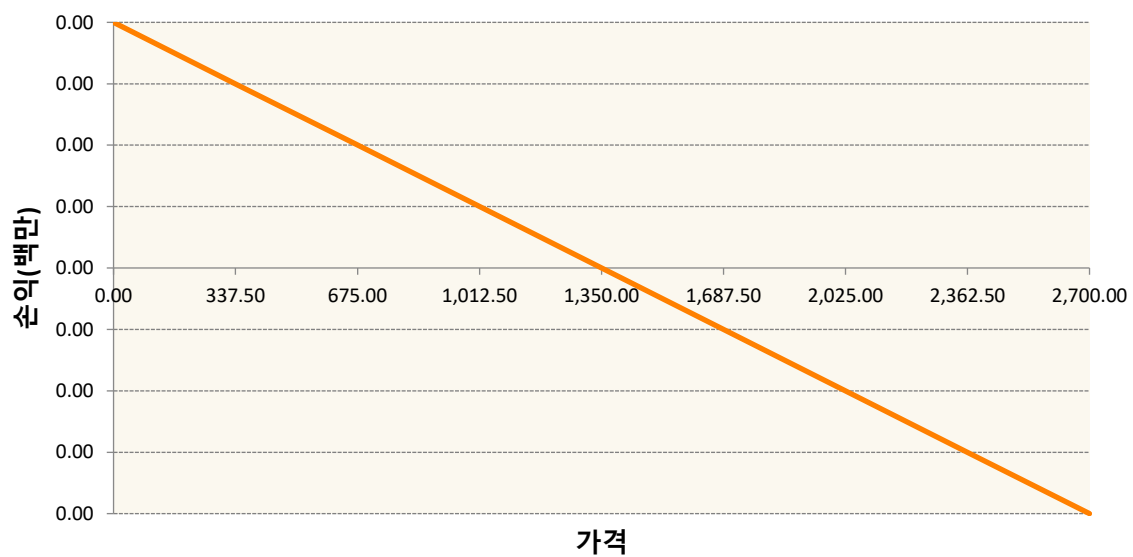
CZ4-CORN FUTURE Dec24



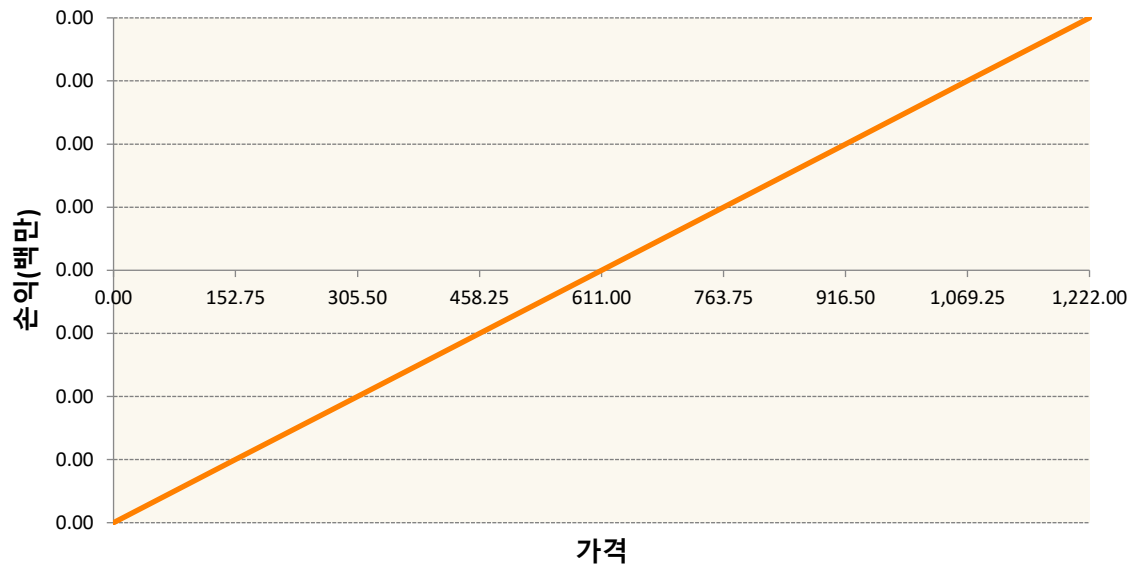
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



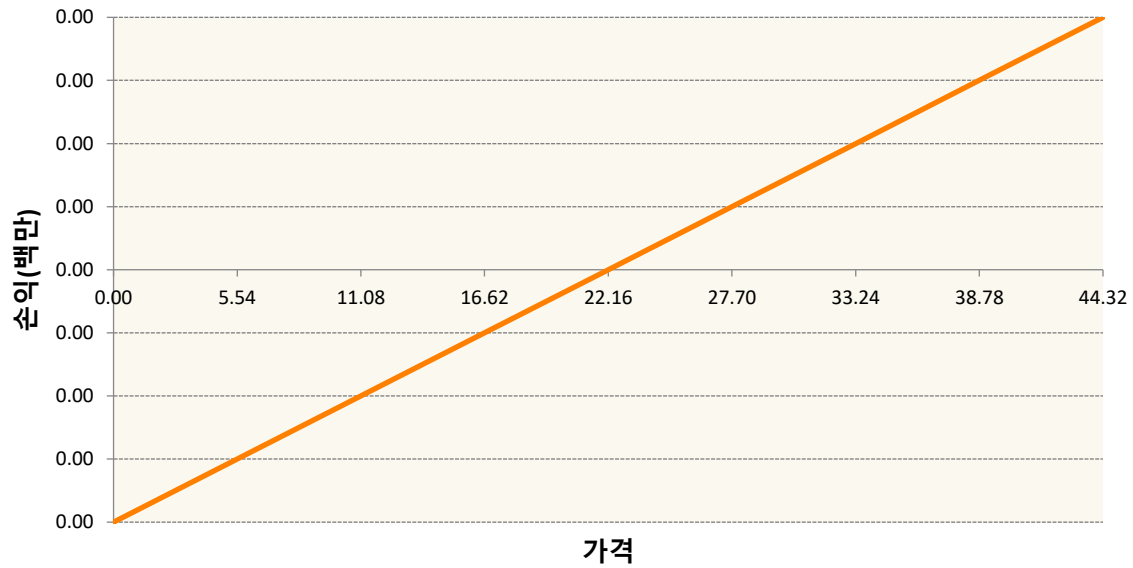
KR4175VA0007-2024-10 달러선물



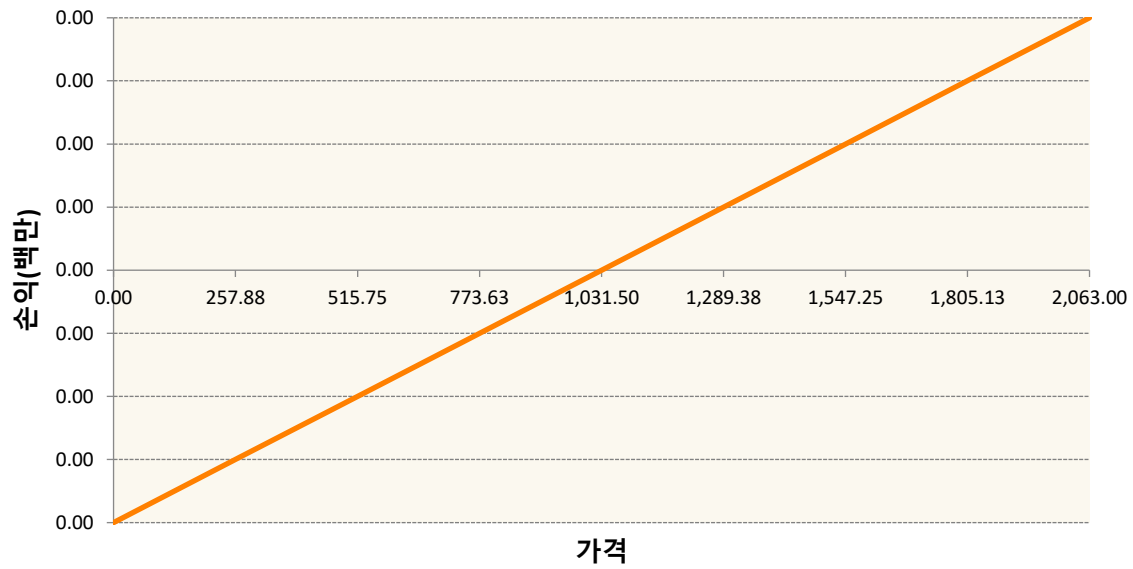
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24



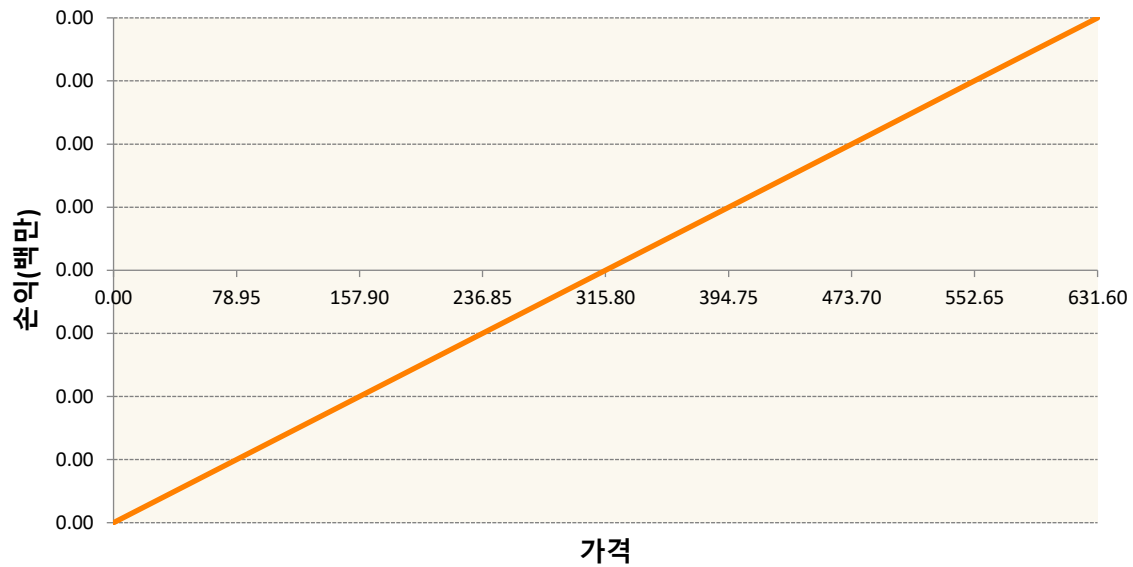
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



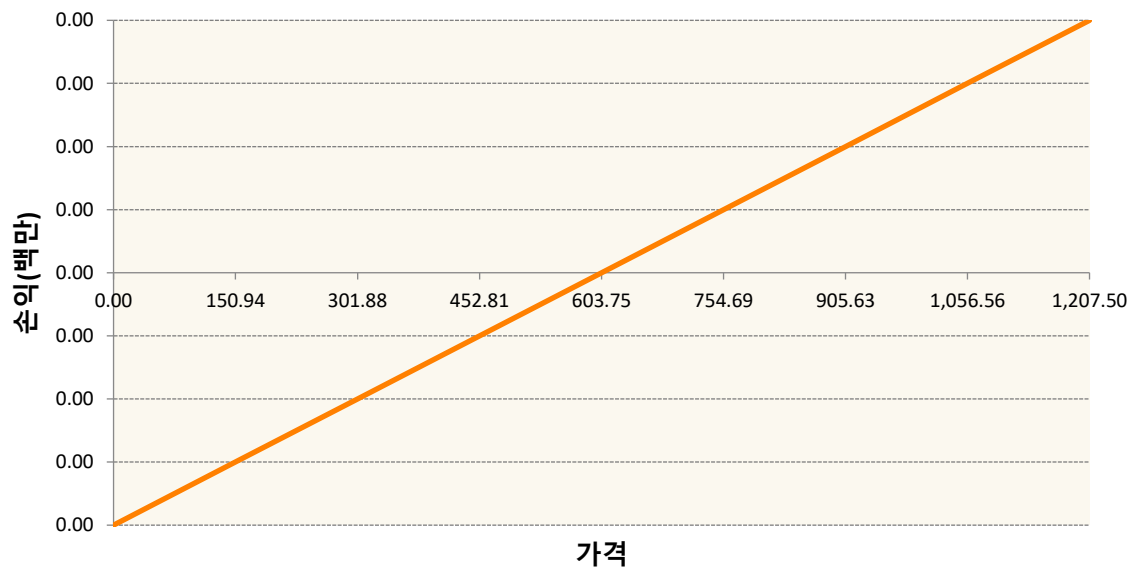
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

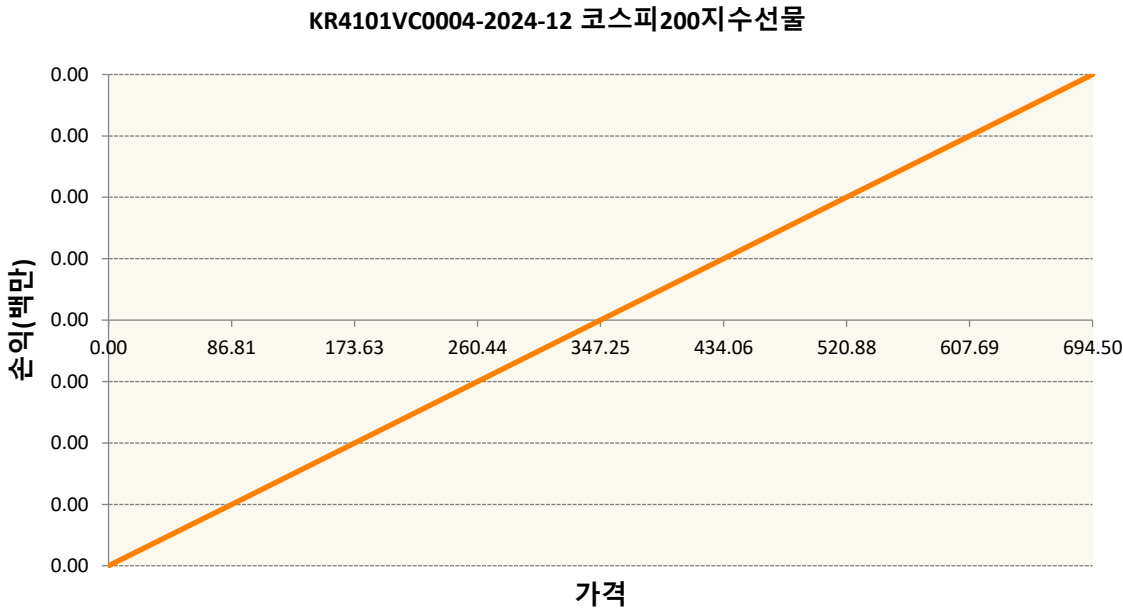
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 3,390 | 3,482 | -92       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,649 | 0     | 1,649     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101VC0004 |           |         | 2024-12 코스피200지수선물 |      |       |        | 131    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -131      | -131    | -131               | -131 | -131  | -131   | -131   |
| -5.33%       | -88       | -88     | -88                | -88  | -88   | -88    | -88    |
| -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%        | 88        | 88      | 88                 | 88   | 88    | 88     | 88     |
| 8.00%        | 131       | 131     | 131                | 131  | 131   | 131    | 131    |





|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

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 | 296 |
|-----------------------------|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 463 |
|-----|

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

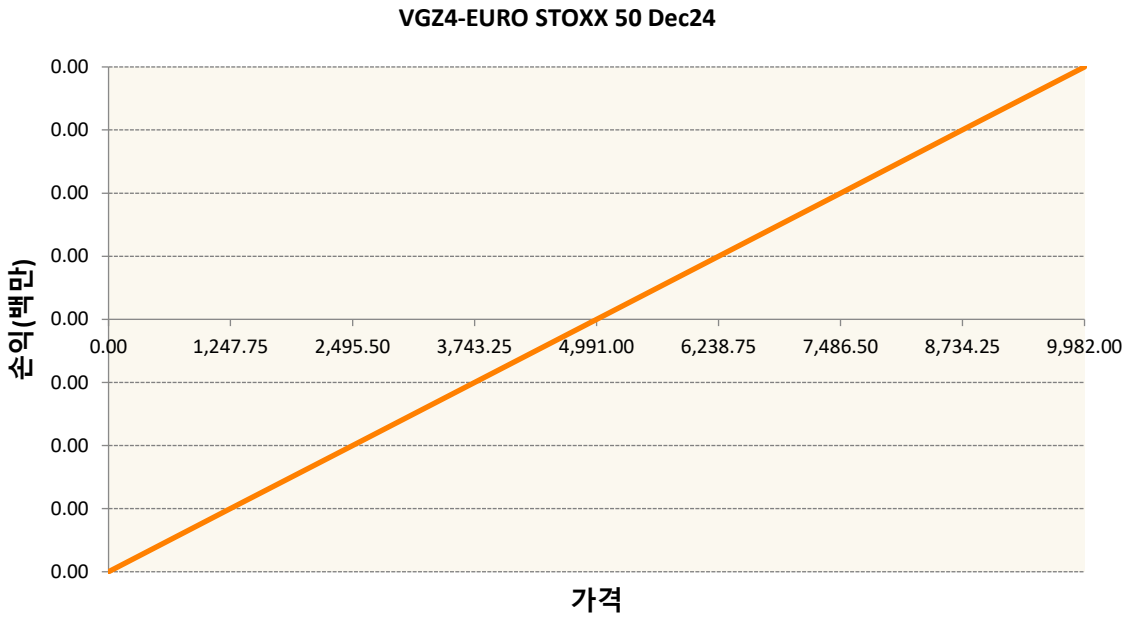
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 964   | 0     | 964       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGZ4 | EURO STOXX 50 Dec24 | 77 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 52 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

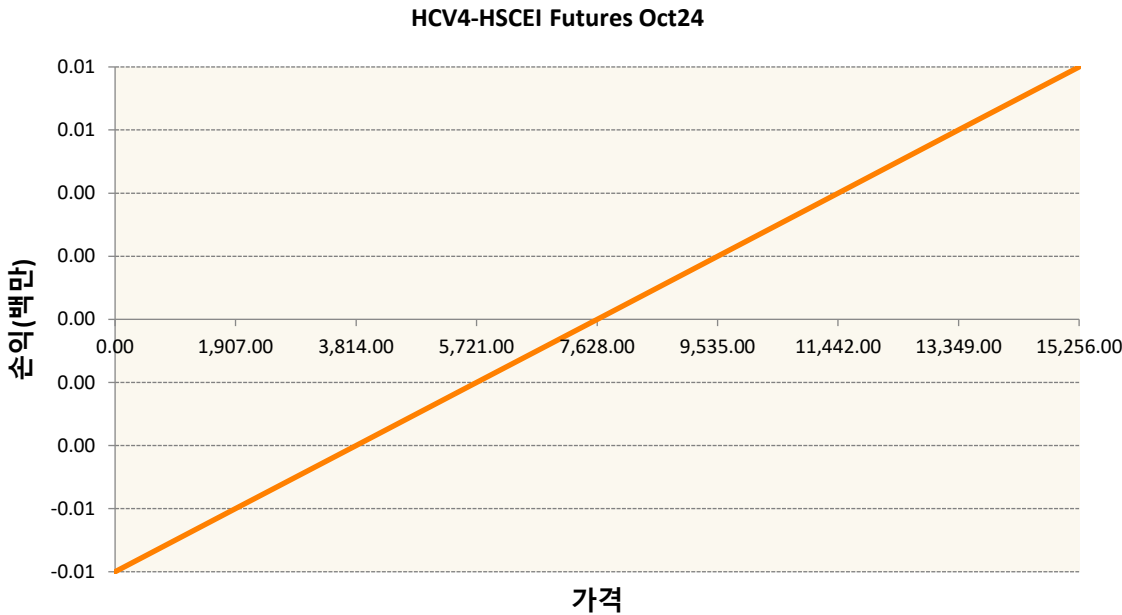
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,499 | 0     | 1,499     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCV4 | HSCEI Futures Oct24 | 120 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 162 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

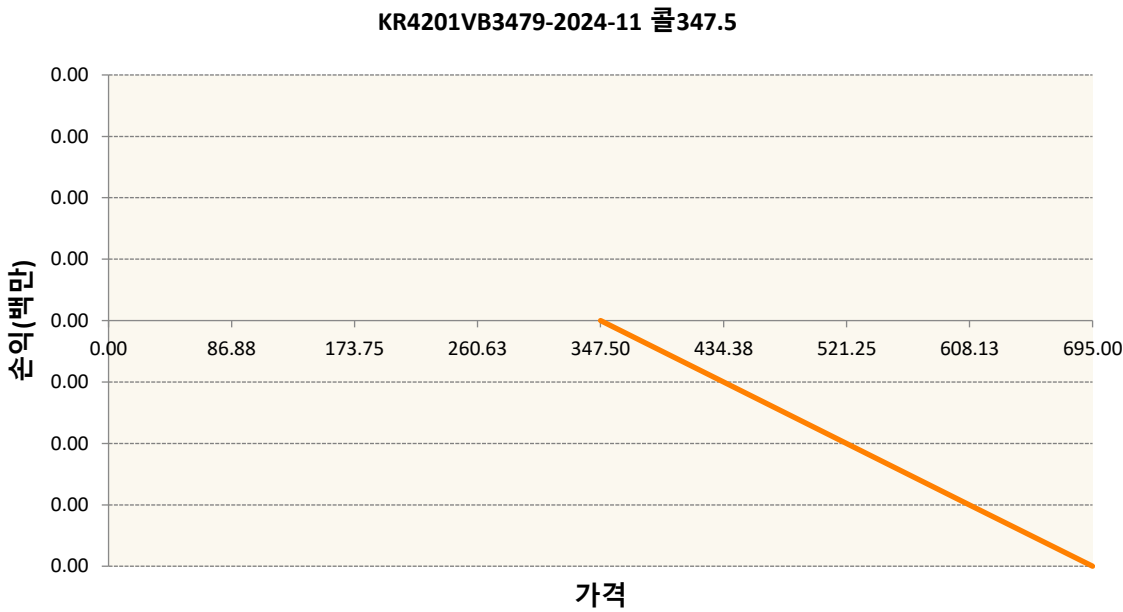
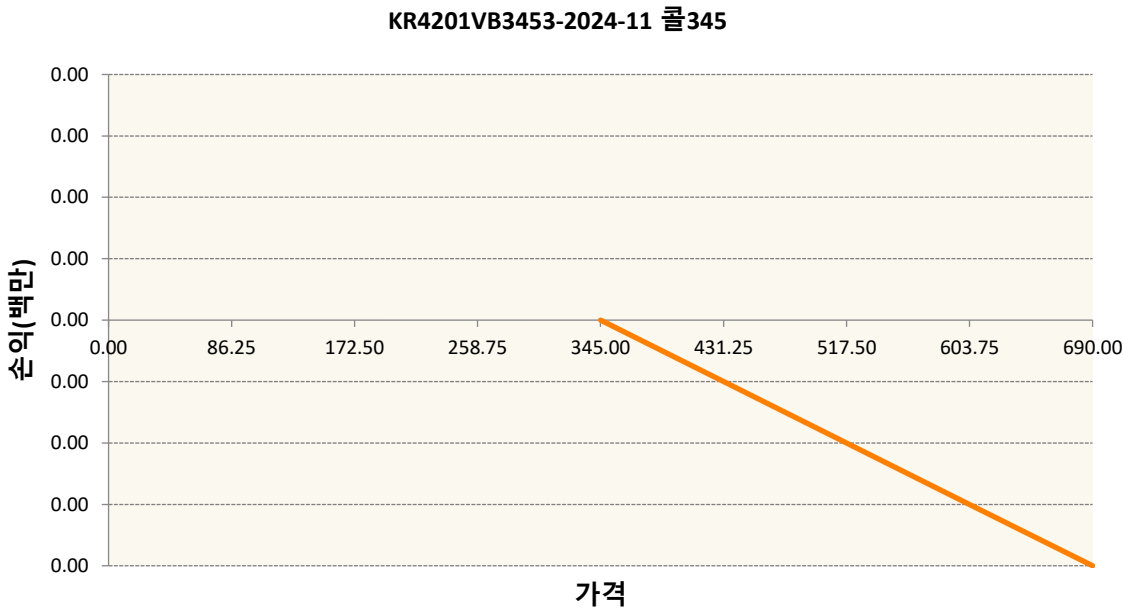
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

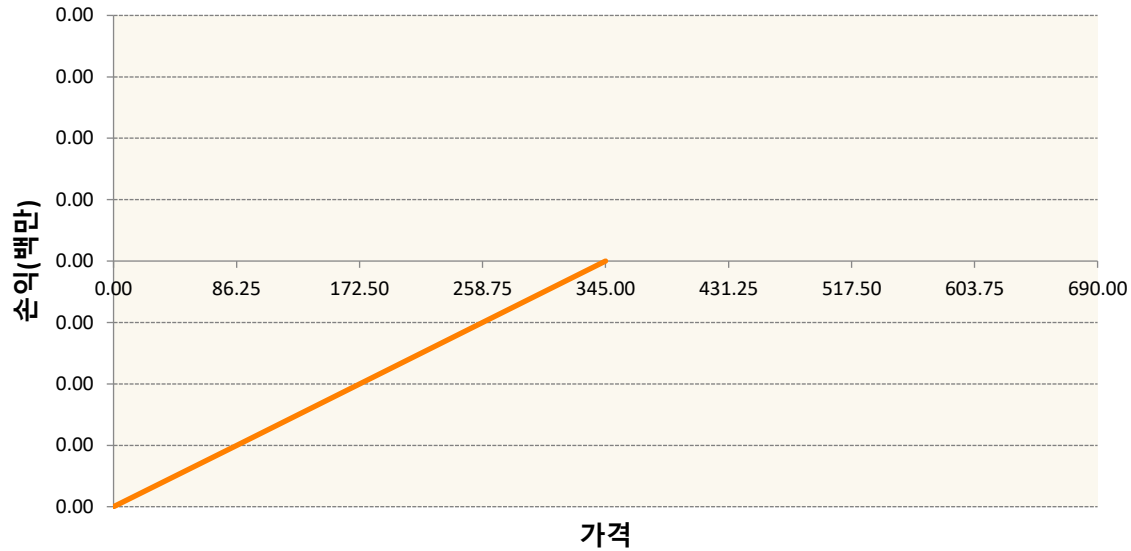
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 5,762 | 22,483 | -16,721   | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 40,131 | -40,131   | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



KR4301VB3452-2024-11 풋345



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4201VB3453 |           |         | 2024-11 콜345   |        |        |        | 1,802  |
|--------------|-----------|---------|----------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 892       | 860     | 822            | 780    | 734    | 684    | 632    |
| -5.33%       | 783       | 729     | 673            | 613    | 552    | 488    | 423    |
| -2.67%       | 572       | 501     | 430            | 357    | 284    | 211    | 137    |
| 0%           | 232       | 155     | 77             | 0      | -77    | -155   | -232   |
| 2.67%        | -243      | -314    | -386           | -460   | -533   | -608   | -683   |
| 5.33%        | -836      | -891    | -950           | -1,012 | -1,076 | -1,142 | -1,210 |
| 8.00%        | -1,513    | -1,550  | -1,592         | -1,639 | -1,690 | -1,745 | -1,802 |
| KR4201VB3479 |           |         | 2024-11 콜347.5 |        |        |        | 201    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 93        | 90      | 86             | 82     | 77     | 71     | 66     |
| -5.33%       | 83        | 77      | 71             | 65     | 58     | 51     | 44     |
| -2.67%       | 62        | 54      | 46             | 38     | 30     | 22     | 13     |
| 0%           | 27        | 18      | 9              | 0      | -9     | -18    | -27    |
| 2.67%        | -24       | -32     | -41            | -50    | -59    | -67    | -76    |
| 5.33%        | -89       | -96     | -103           | -111   | -119   | -127   | -135   |
| 8.00%        | -165      | -169    | -175           | -181   | -187   | -194   | -201   |
| KR4301VB3452 |           |         | 2024-11 풋345   |        |        |        | 442    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%         | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -375      | -383    | -393           | -404   | -416   | -429   | -442   |
| -5.33%       | -201      | -215    | -229           | -245   | -261   | -277   | -294   |
| -2.67%       | -53       | -72     | -90            | -109   | -128   | -147   | -167   |
| 0%           | 60        | 40      | 20             | 0      | -20    | -40    | -60    |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 139 | 120 | 102 | 83  | 63  | 44  | 24  |
| 5.33% | 187 | 173 | 157 | 141 | 125 | 107 | 90  |
| 8.00% | 213 | 203 | 192 | 180 | 167 | 153 | 138 |

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

(단위:백만원)

2,279

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

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 | 1,235 | 0     | 1,235     |    |

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 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

## 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 | 4,338 | 0     | 4,338     |    |

### 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 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

## 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 | 14,353 | 0      | 14,353    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 14,372 | -14,372   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FXW213E7W KRW/USD 31-10-24E  | 221 |
| FXW213E8V( KRW/USD 29-11-24E | 567 |
| FXW213E9L0 KRW/USD 31-10-24E | 22  |
| FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E | 340 |
| IE00BD8RGM75                 |     |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

533

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

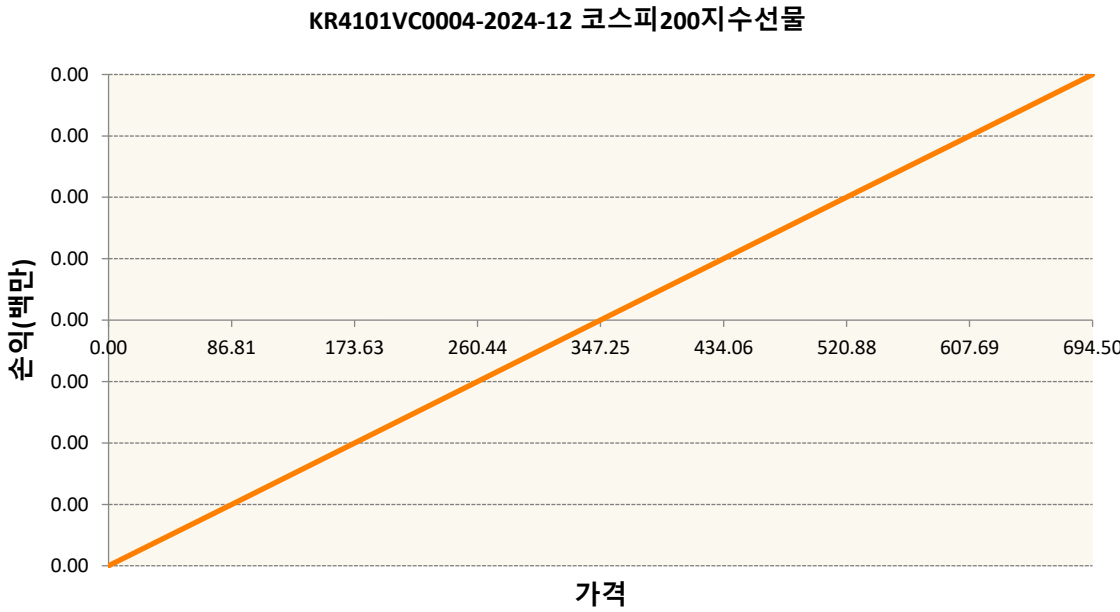
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 781   | 0     | 781       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101VC0004 |           |         | 2024-12 코스피200지수선물 |     |       |        | 62     |
|--------------|-----------|---------|--------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -62       | -62     | -62                | -62 | -62   | -62    | -62    |
| -5.33%       | -41       | -41     | -41                | -41 | -41   | -41    | -41    |
| -2.67%       | -21       | -21     | -21                | -21 | -21   | -21    | -21    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 21        | 21      | 21                 | 21  | 21    | 21     | 21     |
| 5.33%        | 41        | 41      | 41                 | 41  | 41    | 41     | 41     |
| 8.00%        | 62        | 62      | 62                 | 62  | 62    | 62     | 62     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

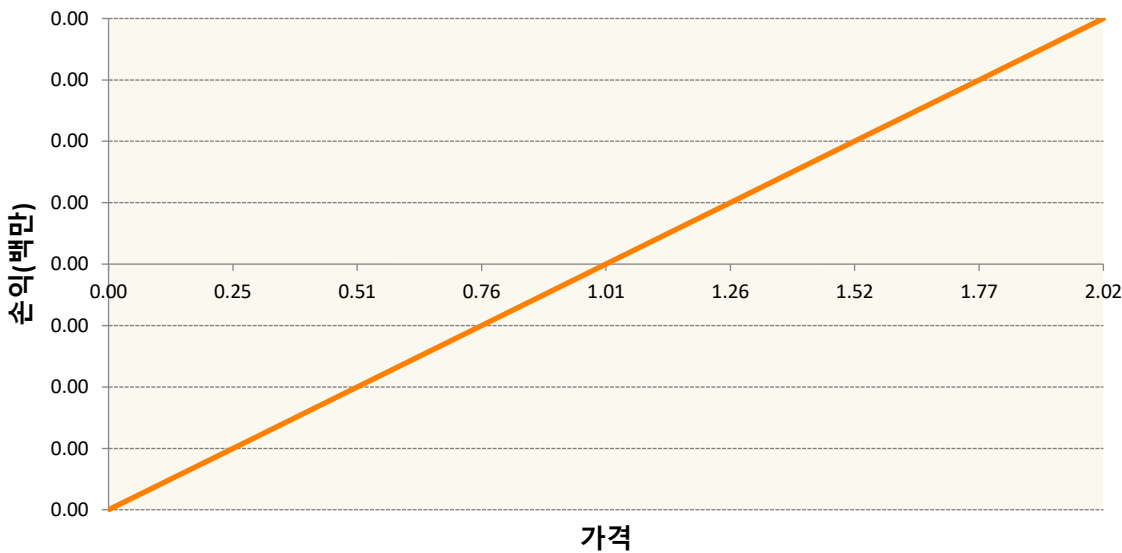
1. 계약금액

(단위:백만원)

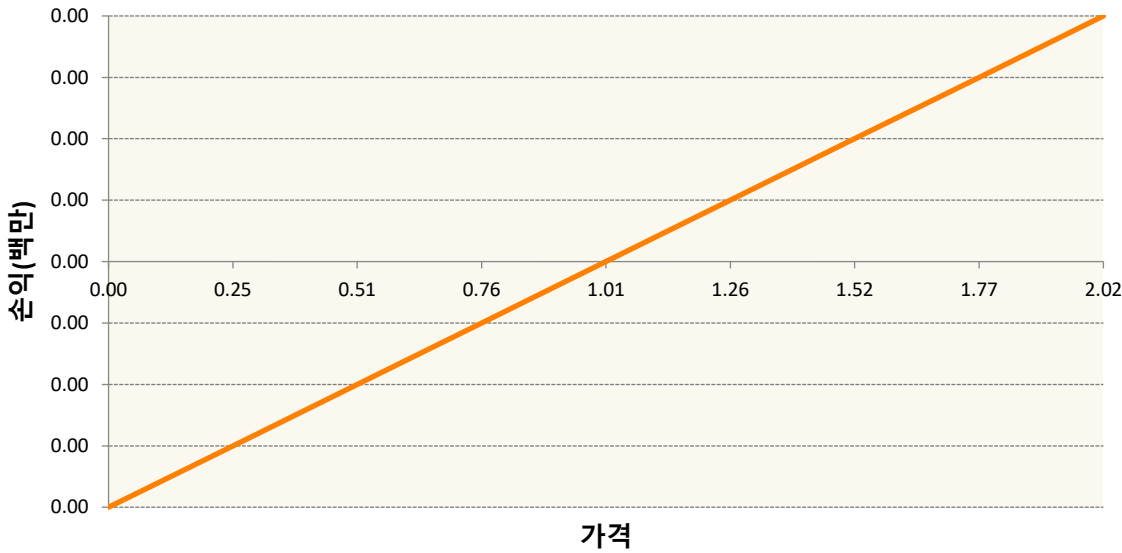
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 11,415 | 0     | 11,415    |    |

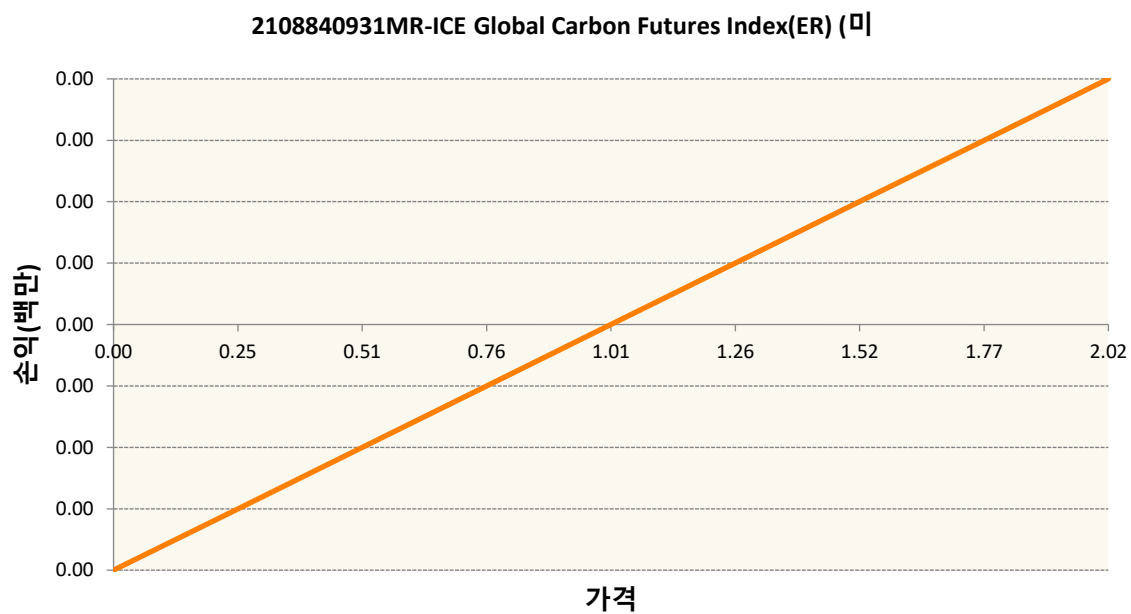
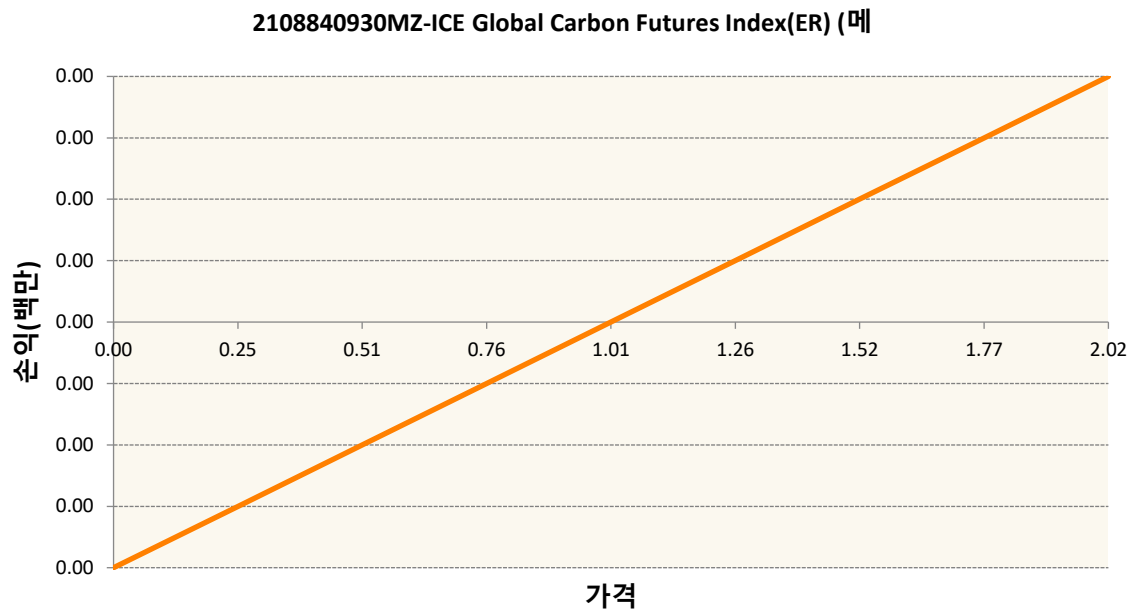
2. 만기시점의 손익구조

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 |  | 91       |
| 2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 455      |
| 2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 182      |
| 2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 182      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 988      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

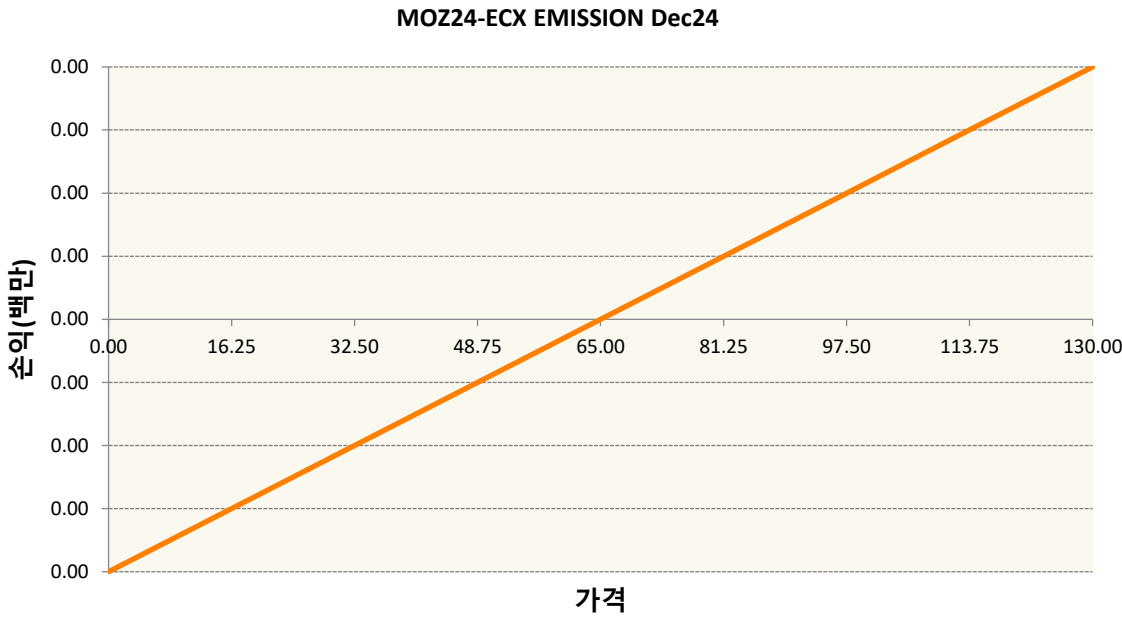
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 7,810 | 0     | 7,810     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,607 | -1,607    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |     |
|-----------------------------------------------------|-----|
| 2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index | 1   |
| FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E                        | 129 |
| MOZ24 ECX EMISSION Dec24                            | 625 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,126 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

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)  | 15 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)  | 15 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠) | 23 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)  | 23 |

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

(단위:백만원)

126



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

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)  | 51 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(NH)  | 43 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(메리츠) | 61 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 13 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 255 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

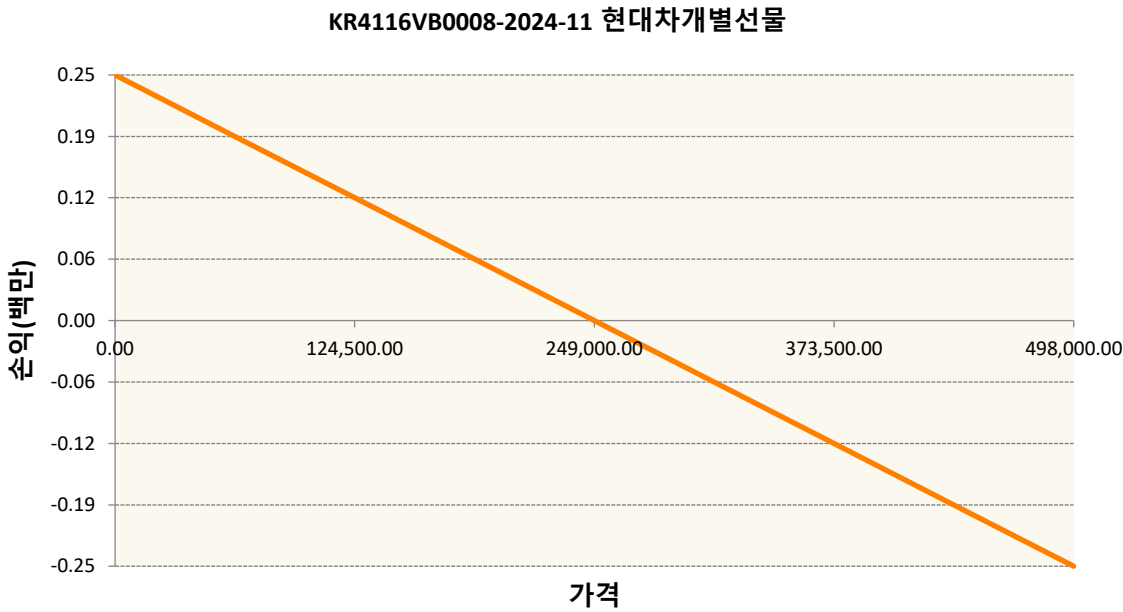
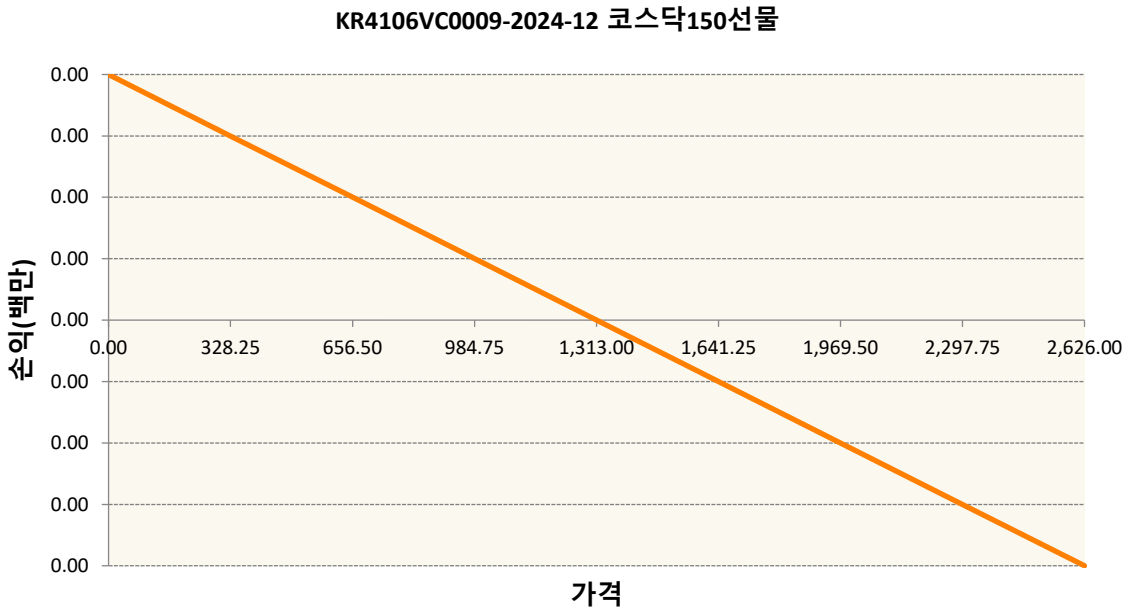
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

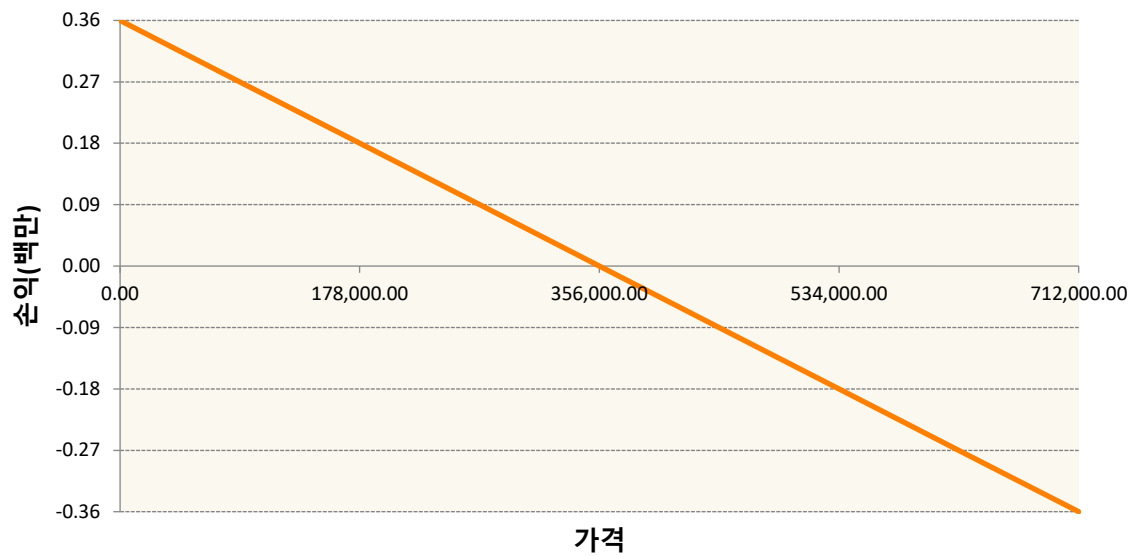
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8     | 105   | -97       | 장내 |

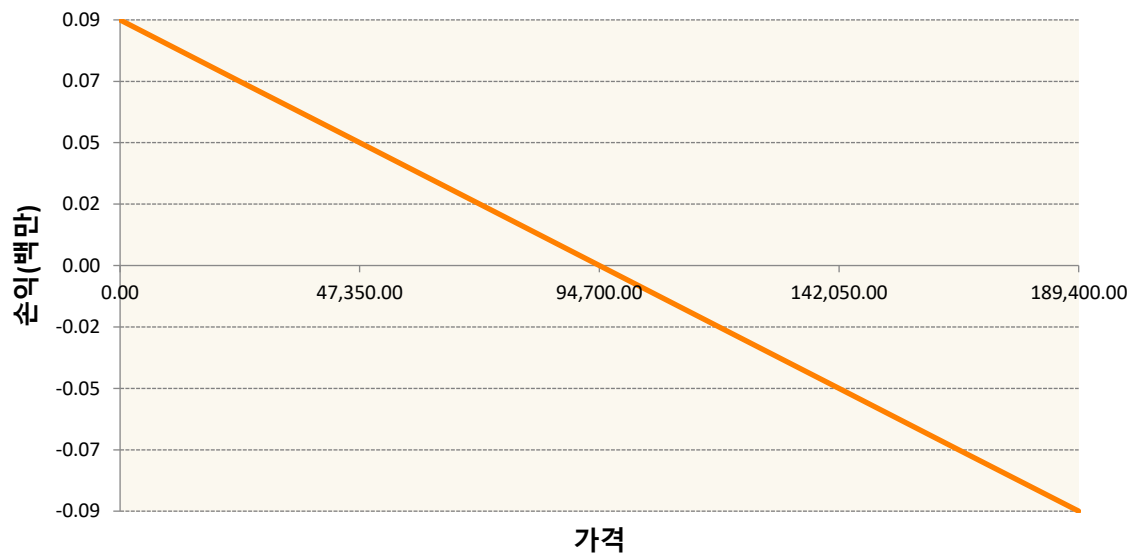
2. 만기시점의 손익구조



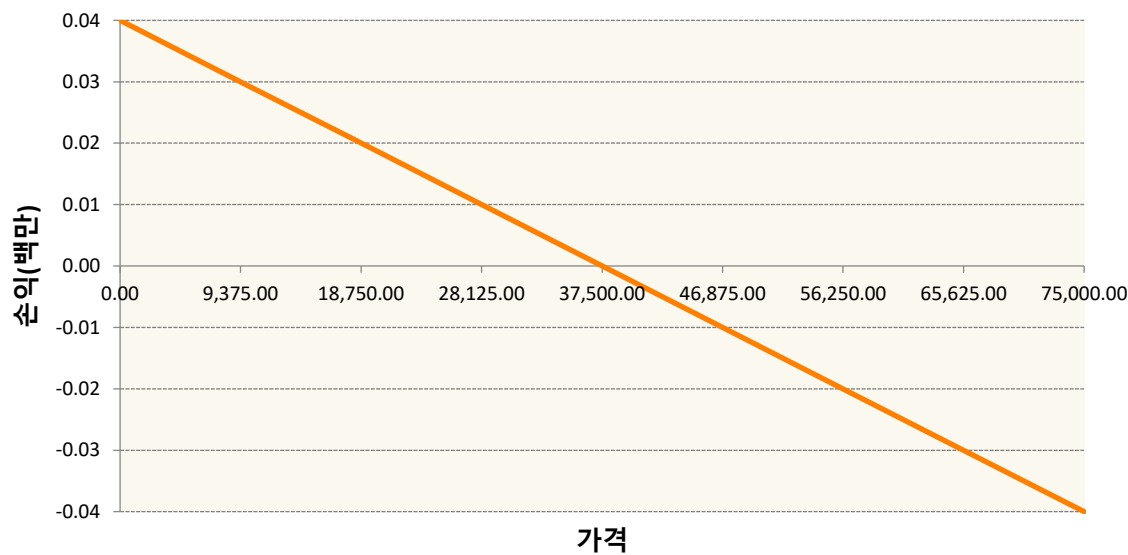
KR4147VB0001-2024-11 LG화학개별선물



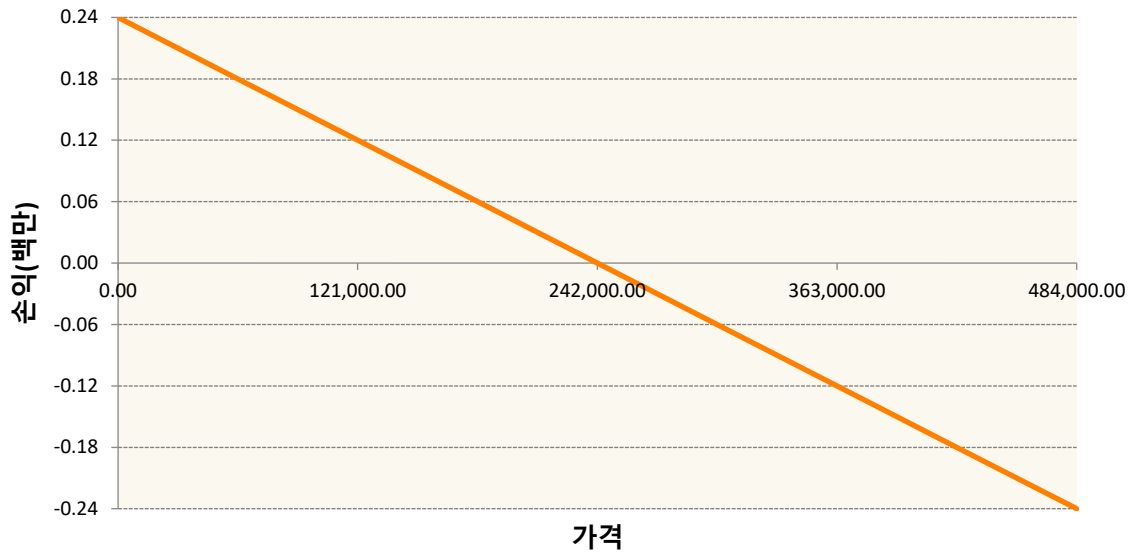
KR41BBVB0000-2024-11 롯데케미칼개별선물



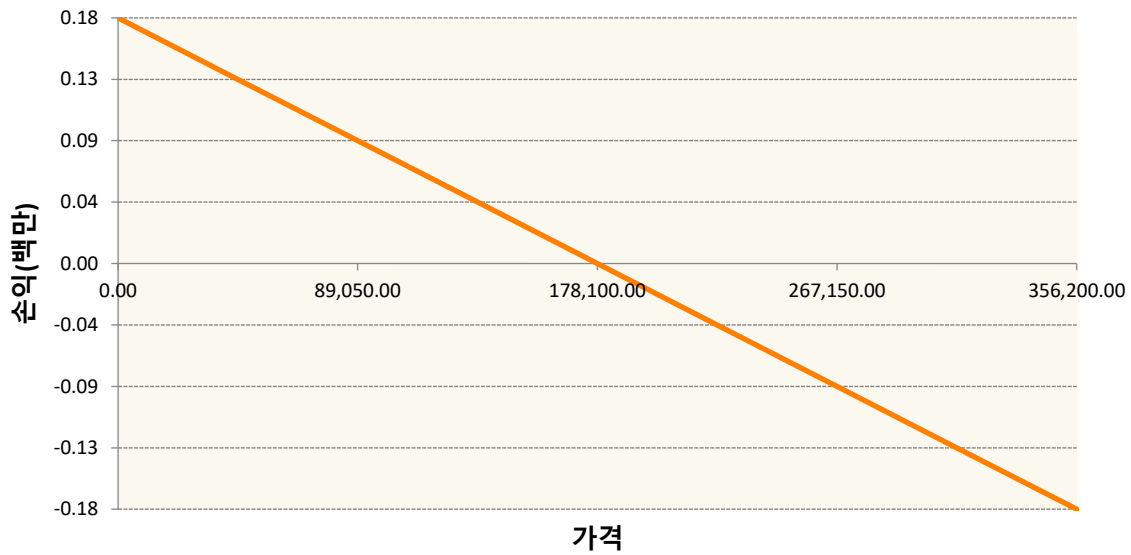
KR41CFVB0005-2024-11 카카오개별선물



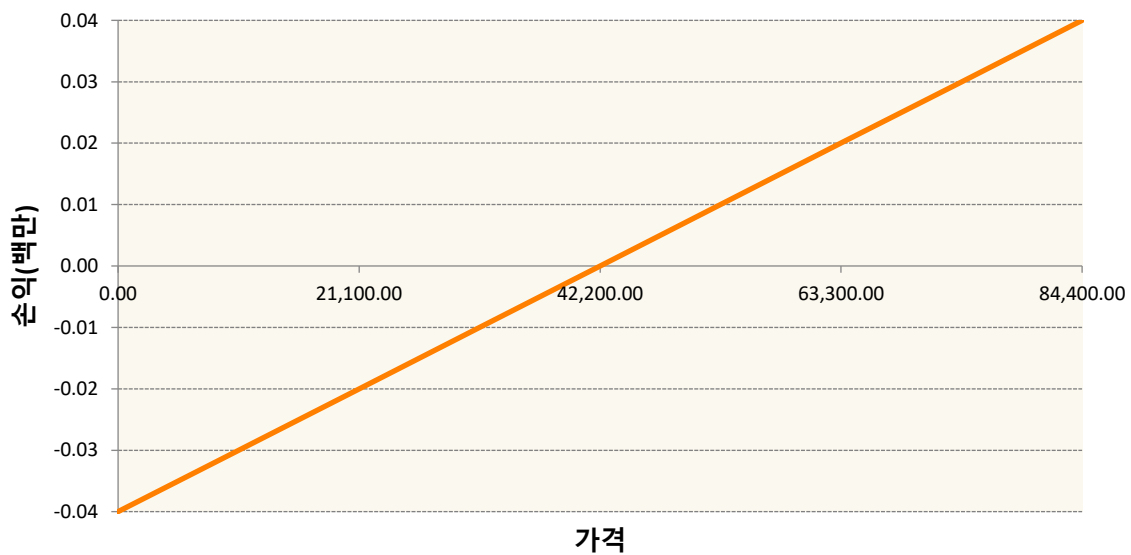
KR41DBVB0008-2024-11 LIG넥스원개별선물



KR41GCVB0004-2024-11 이오테크닉스개별선물



KR41GNVB0001-2024-11 금양개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|                               |      |
|-------------------------------|------|
| KR4106VC00 2024-12 코스닥150선물   | 3    |
| KR4116VB00 2024-11 현대차개별선물    | 2    |
| KR4147VB00 2024-11 LG화학개별선물   | 1    |
| KR41BBVB00 2024-11 롯데케미칼개별선물  | 1    |
| KR41CFVB00 2024-11 카카오개별선물    | 0.45 |
| KR41DBVB00 2024-11 LG넥스원개별선물  | 1    |
| KR41GCVB00 2024-11 이오테크닉스개별선물 | 1    |
| KR41GNVB00 2024-11 금양개별선물     | 1    |

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

|    |
|----|
| 20 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

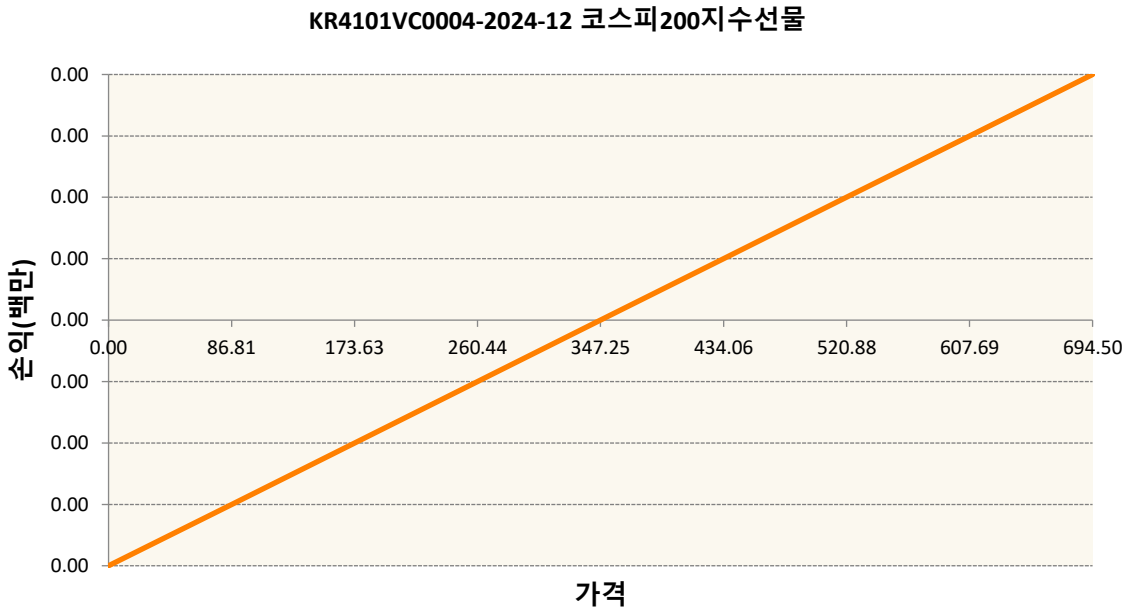
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 174   | -174      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,247 | 0     | 8,247     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101VC0004 |           |         | 2024-12 코스피200지수선물 |      |       |        | 656    |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -656      | -656    | -656               | -656 | -656  | -656   | -656   |
| -5.33%       | -438      | -438    | -438               | -438 | -438  | -438   | -438   |
| -2.67%       | -219      | -219    | -219               | -219 | -219  | -219   | -219   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 219       | 219     | 219                | 219  | 219   | 219    | 219    |
| 5.33%        | 438       | 438     | 438                | 438  | 438   | 438    | 438    |
| 8.00%        | 656       | 656     | 656                | 656  | 656   | 656    | 656    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

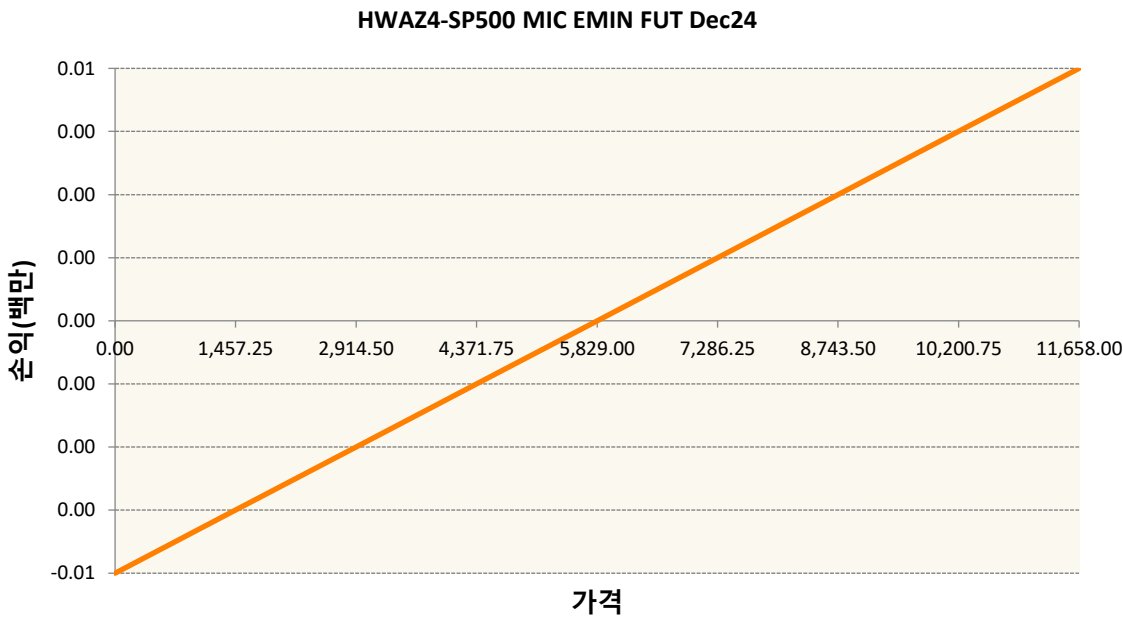
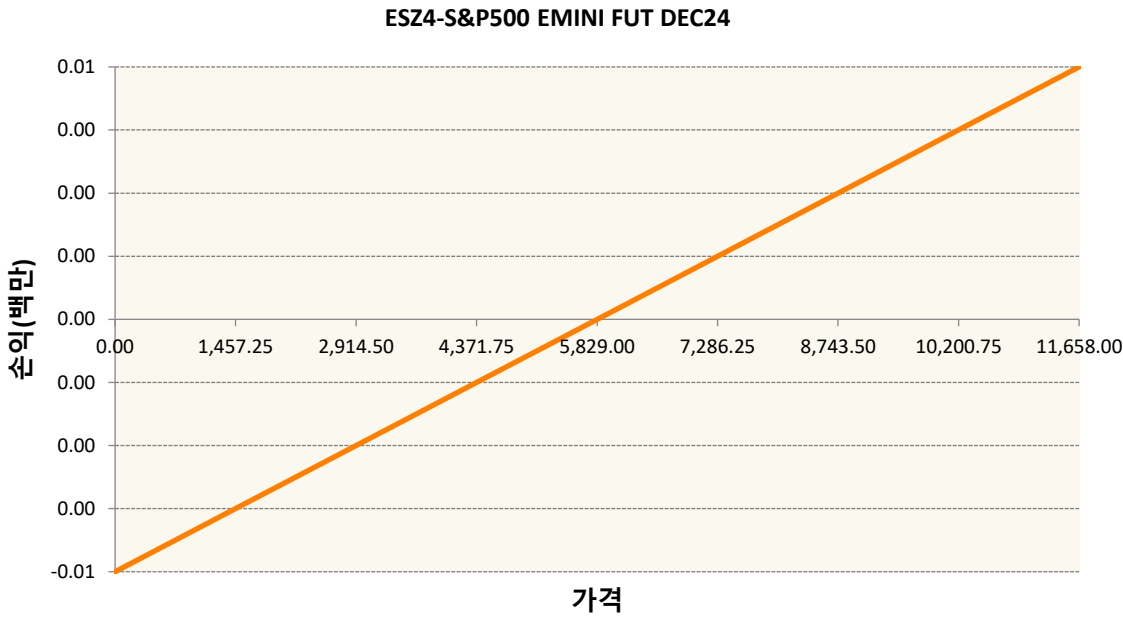
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 11,253 | 0     | 11,253    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,589  | 0     | 1,589     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ4                      | S&P500 EMINI FUT DEC24   | 900      |
| HWAZ4                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec24 | 127      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 624      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

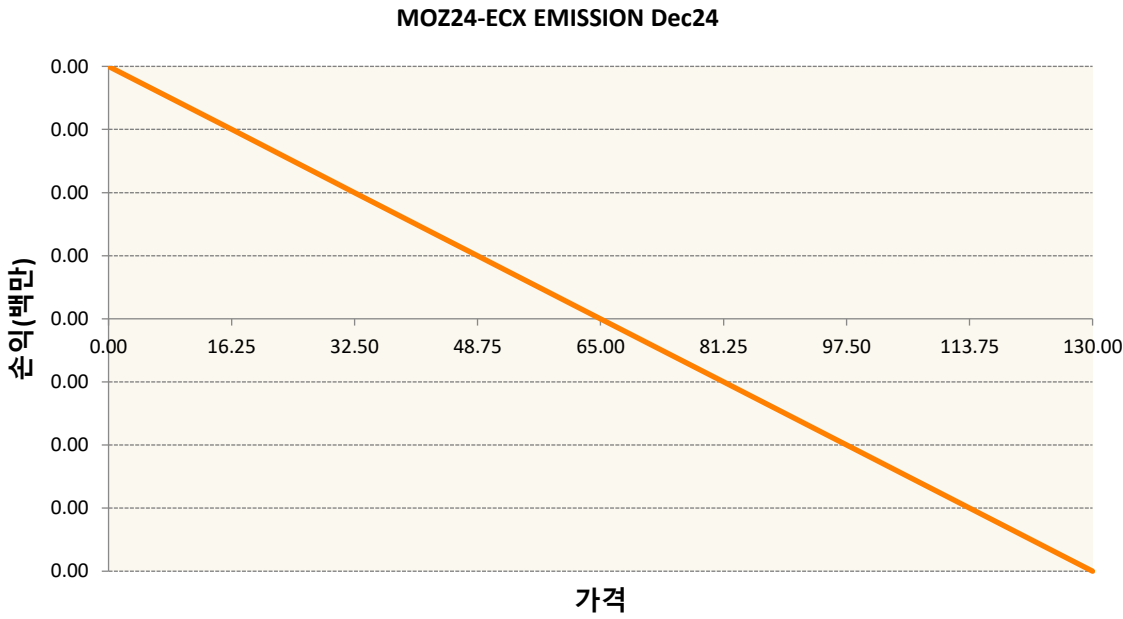
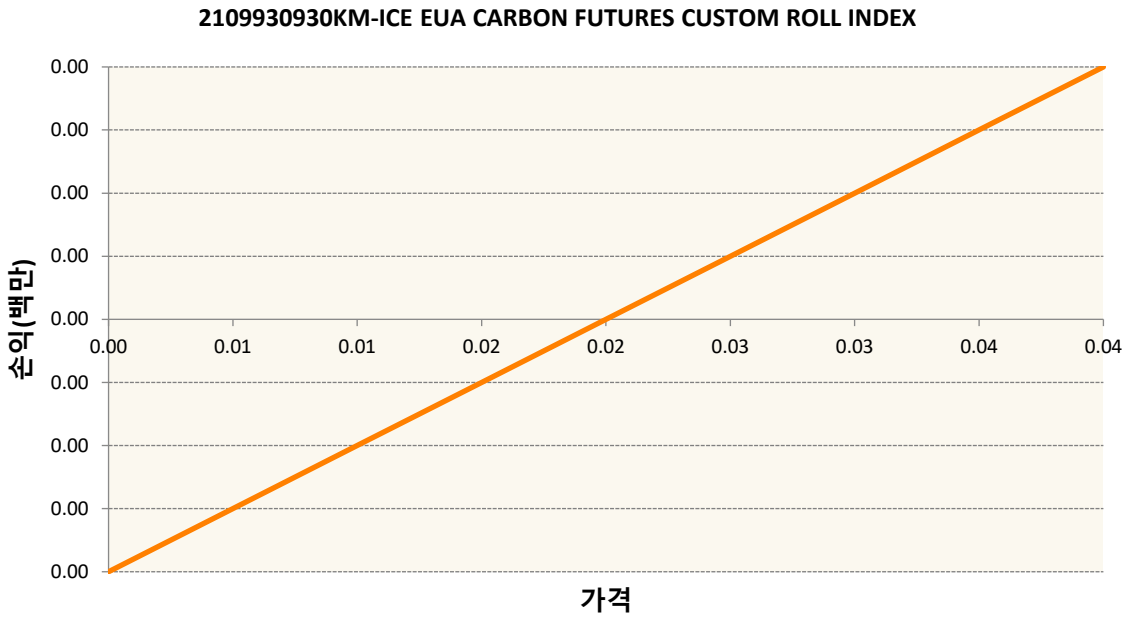
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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   | 7     | 6,410 | -6,403    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,544 | -1,544    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|--|----------|
| 2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX |  | 1        |
| FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E                        |  | 36       |
| FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E                        |  | 87       |
| MOZ24        ECX EMISSION Dec24                     |  | 513      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 934      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

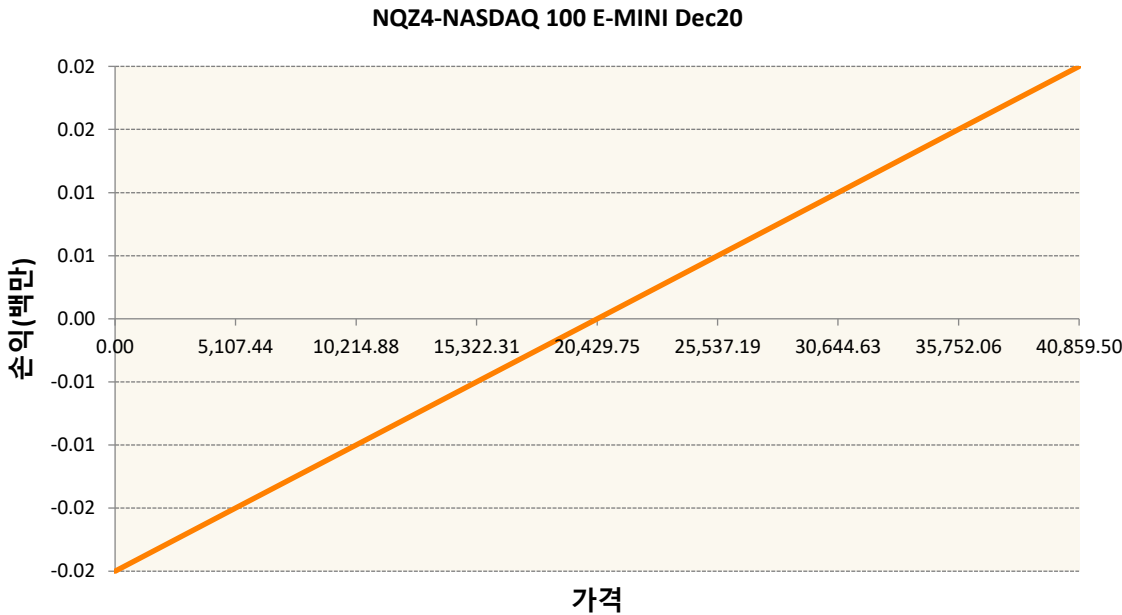
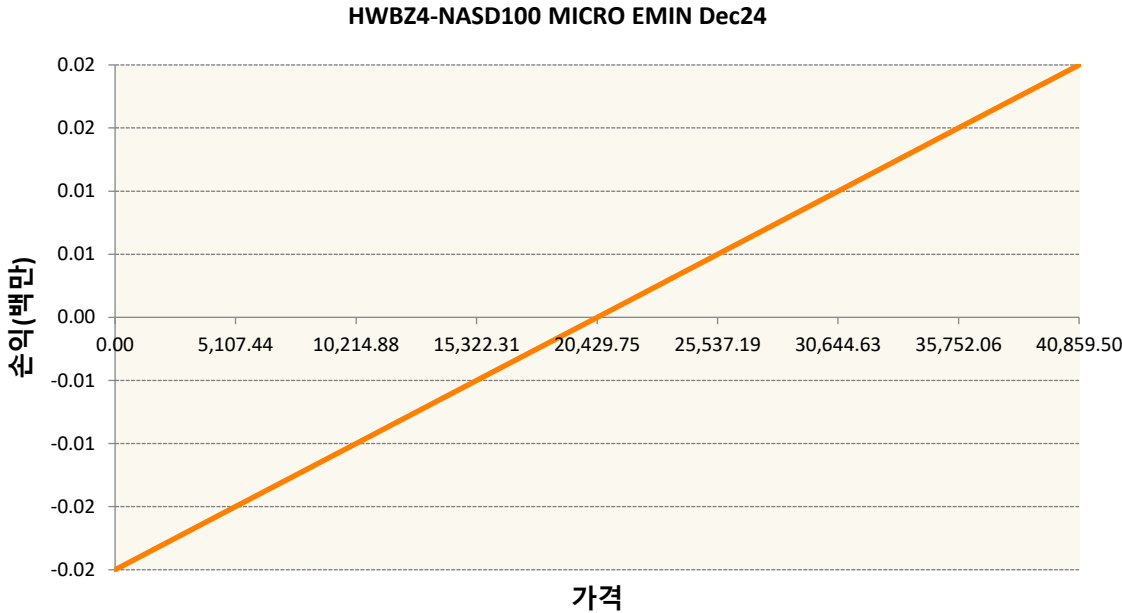
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 6,520 | 0     | 6,520     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 925   | 0     | 925       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBZ4                     | NASD100 MICRO EMIN Dec24 |  | 74       |
| NQZ4                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 522      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 494      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

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   | 187,442 | 0     | 187,442   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |       |
|-----------------------------------------------------|-------|
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 3,419 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 5,512 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 4,782 |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 691   |
| SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 234   |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 8,524 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

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 | 5 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 5 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 5 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 5 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 20 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2024-10-14 |
| 기준일 | 2024-10-11 |

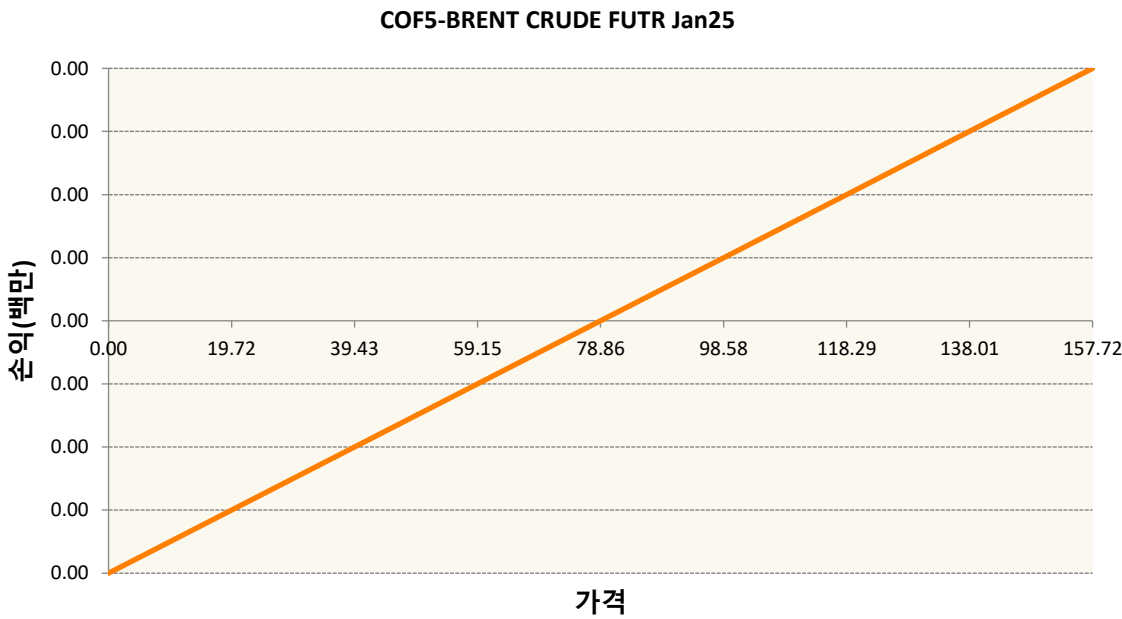
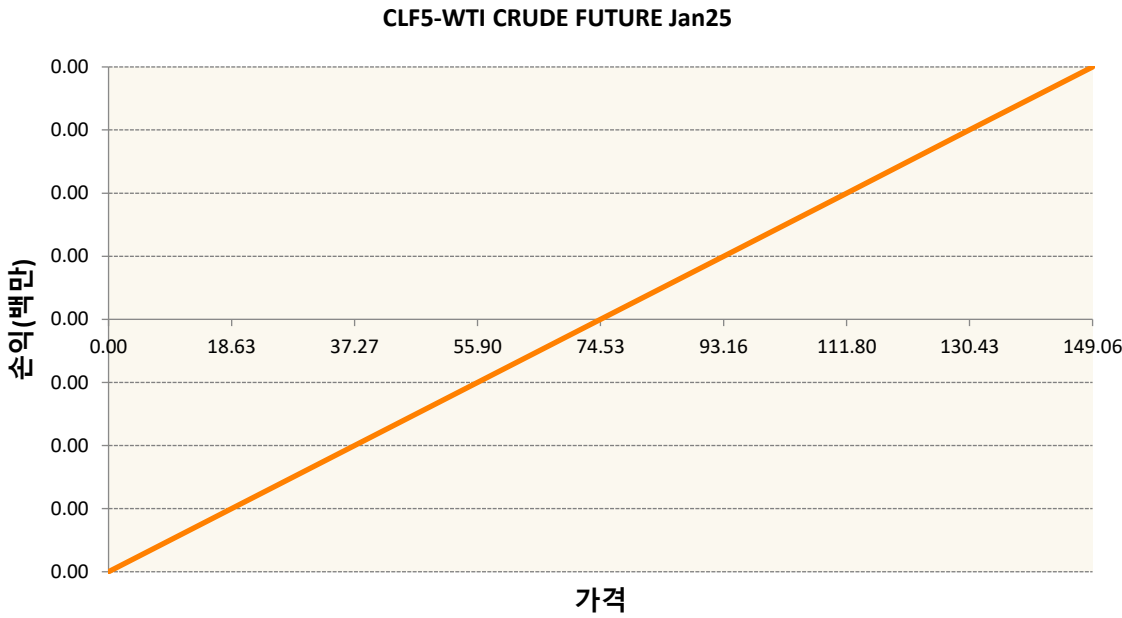
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

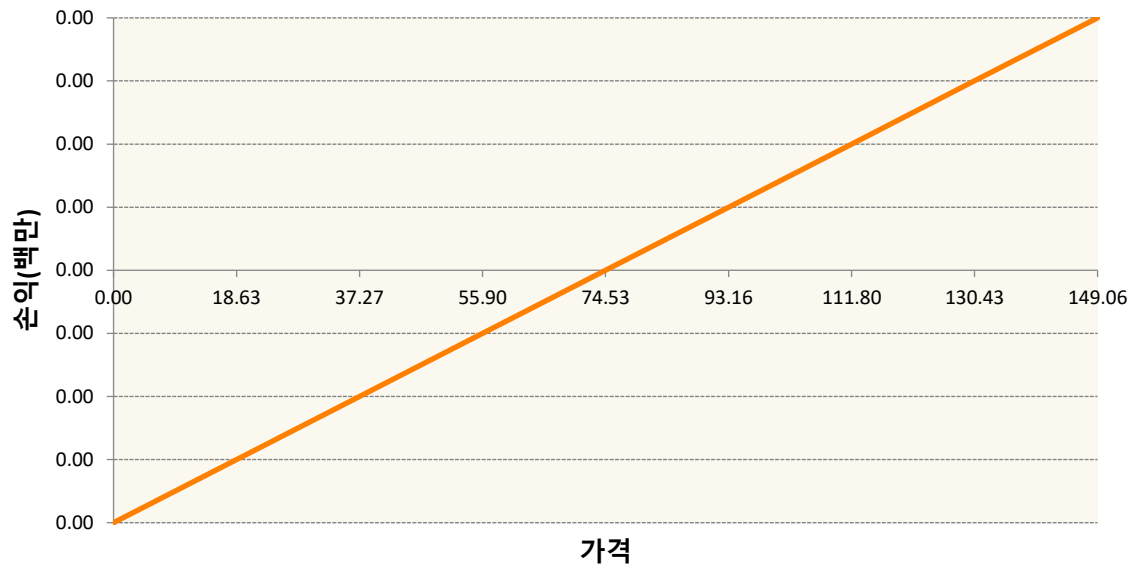
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 852   | 0     | 852       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 149   | -149      | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

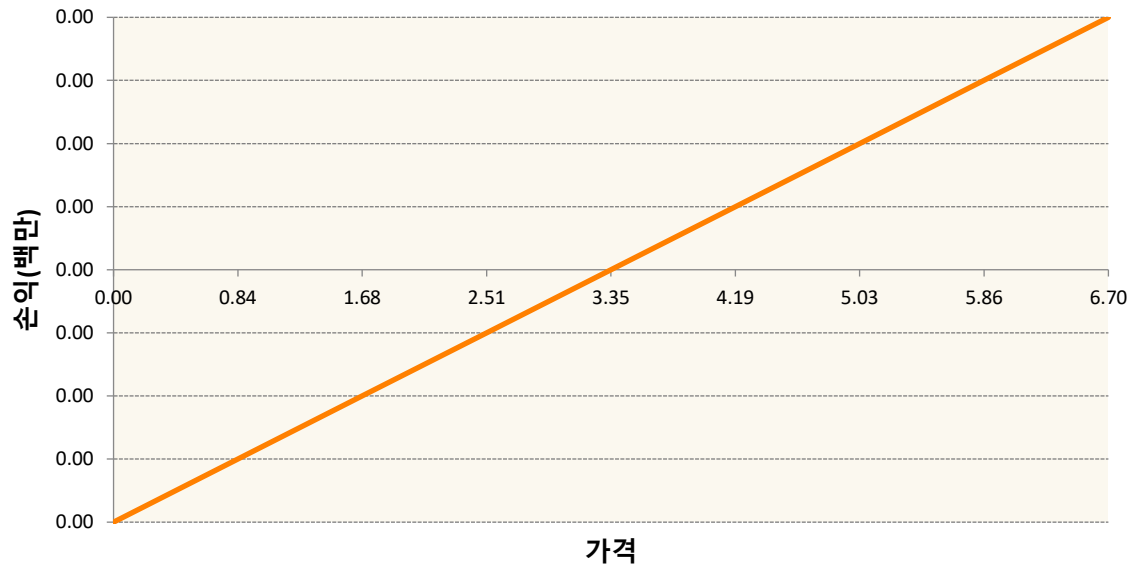




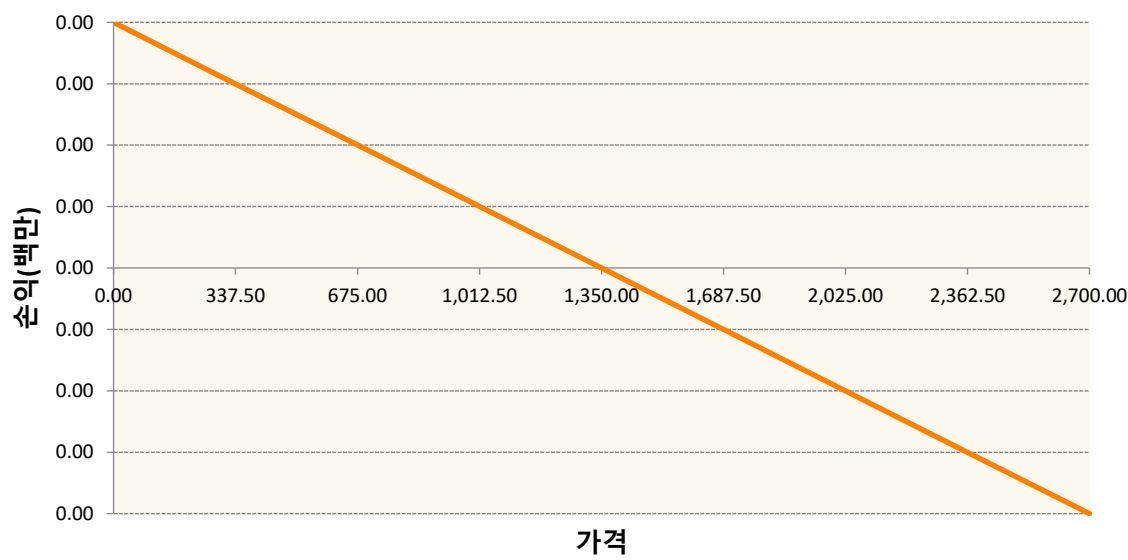
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



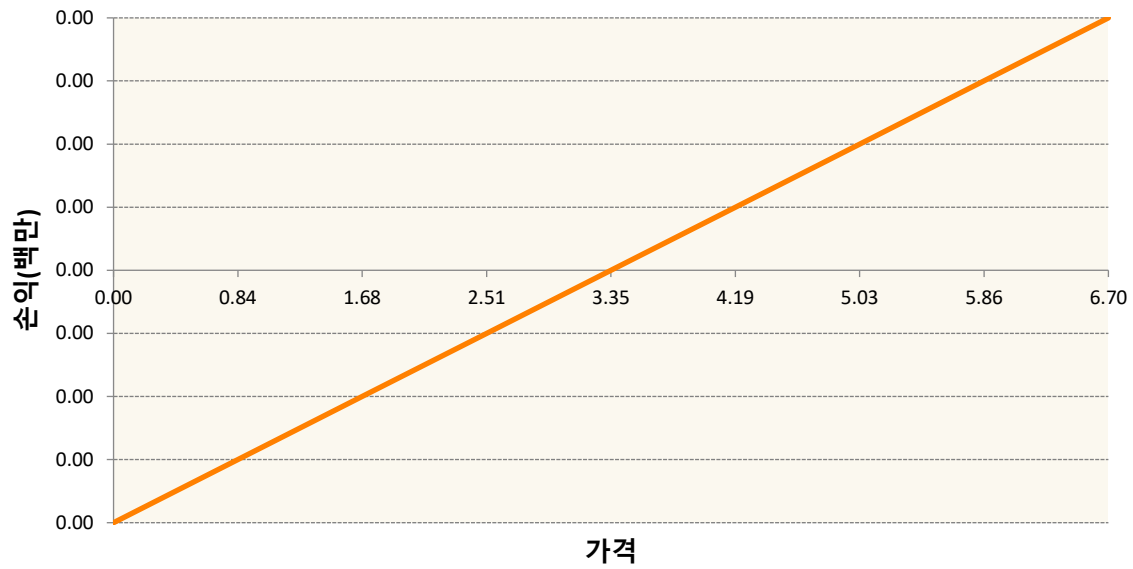
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



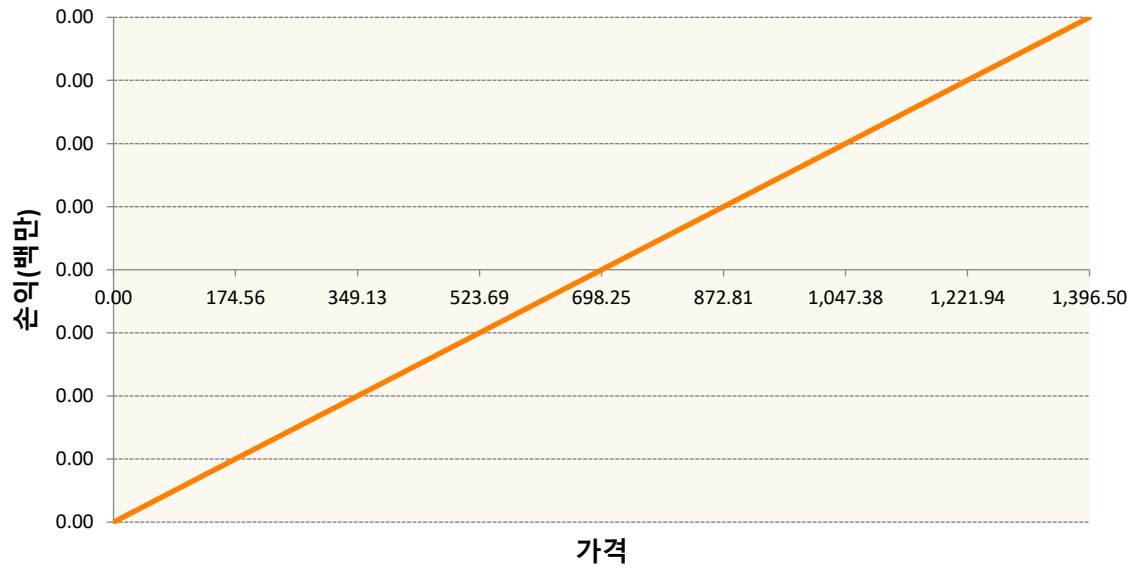
KR4175VA0007-2024-10 달러선물



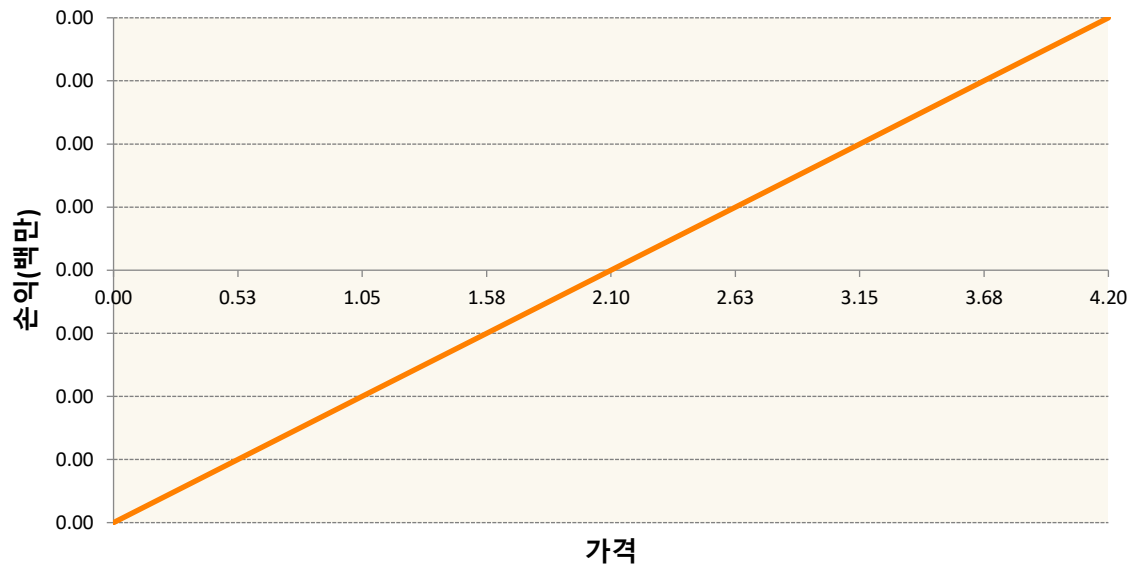
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



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   |  | 17       |
| ECF5                      | E-MINI CRUDE OIL Jan25   |  | 8        |
| EOF5                      | E-MINI NATURAL GAS Jan25 |  | 4        |
| KR4175VA00 2024-10 달러선물   |                          |  | 12       |
| NGF25                     | NATURAL GAS FUTR Jan25   |  | 14       |
| QSF5                      | Low Su Gasoil G Jan25    |  | 8        |
| XBF5                      | GASOLINE RBOB FUT Jan25  |  | 10       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 147      |