

공시일 2024-10-18

기준일 2024-10-17

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	2024-10-18
기준일	2024-10-17

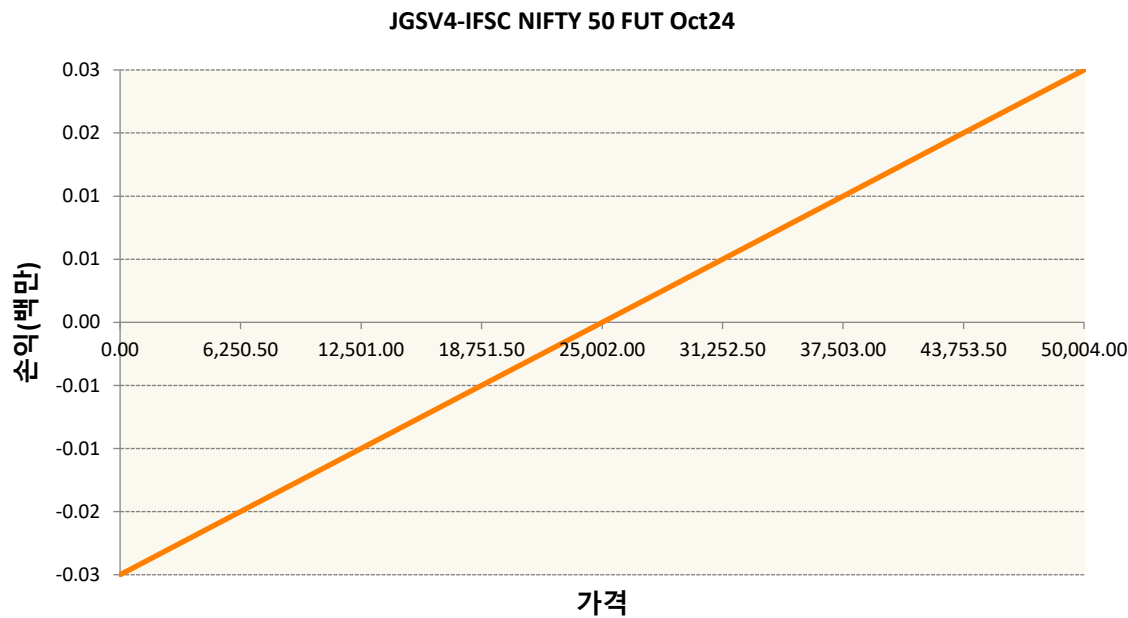
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,802	0	3,802	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSV4	IFSC NIFTY 50 FUT Oct24	304
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

195

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

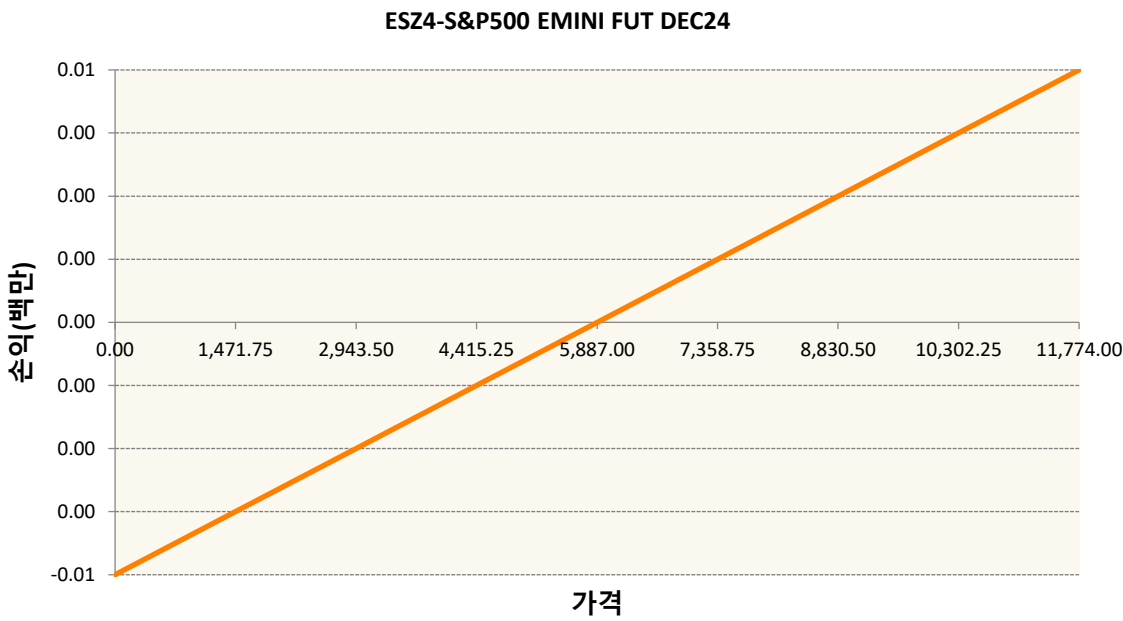
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	801	0	801	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	64
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

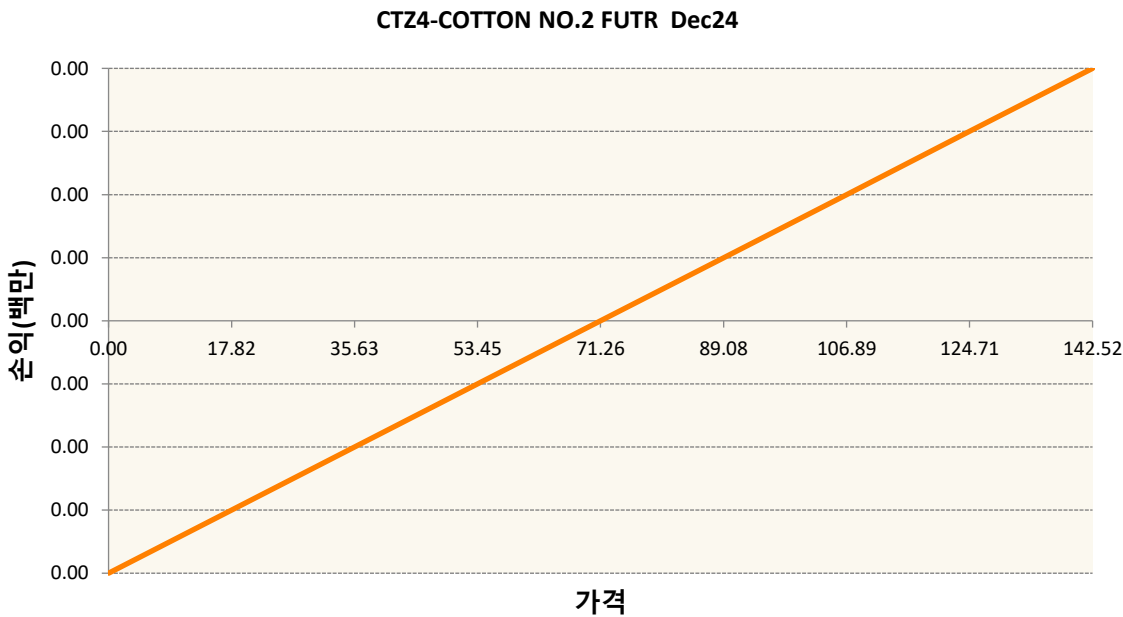
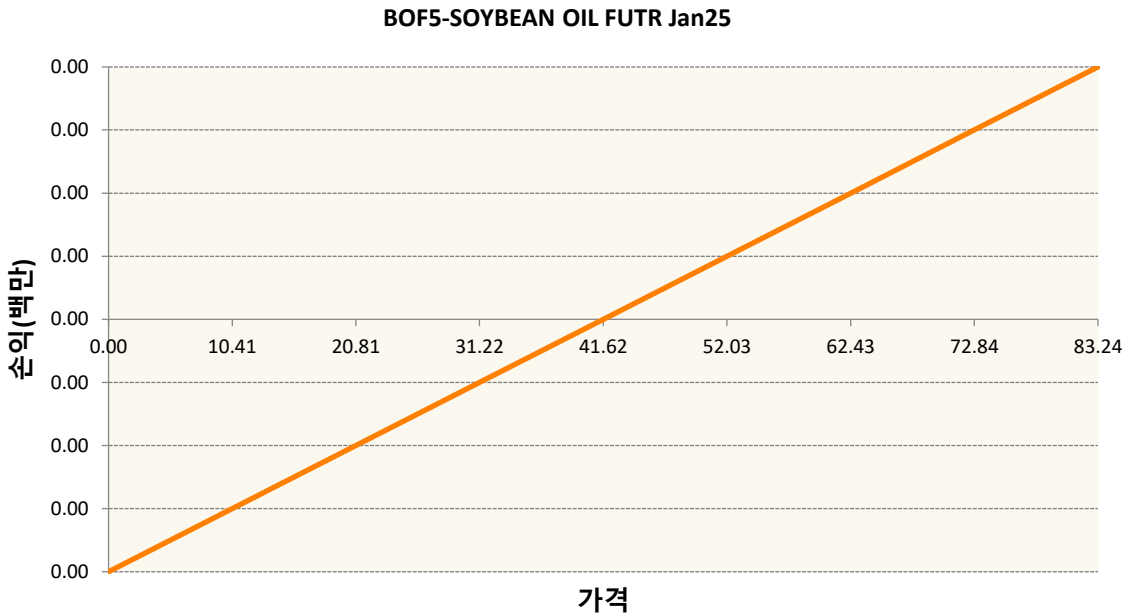
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

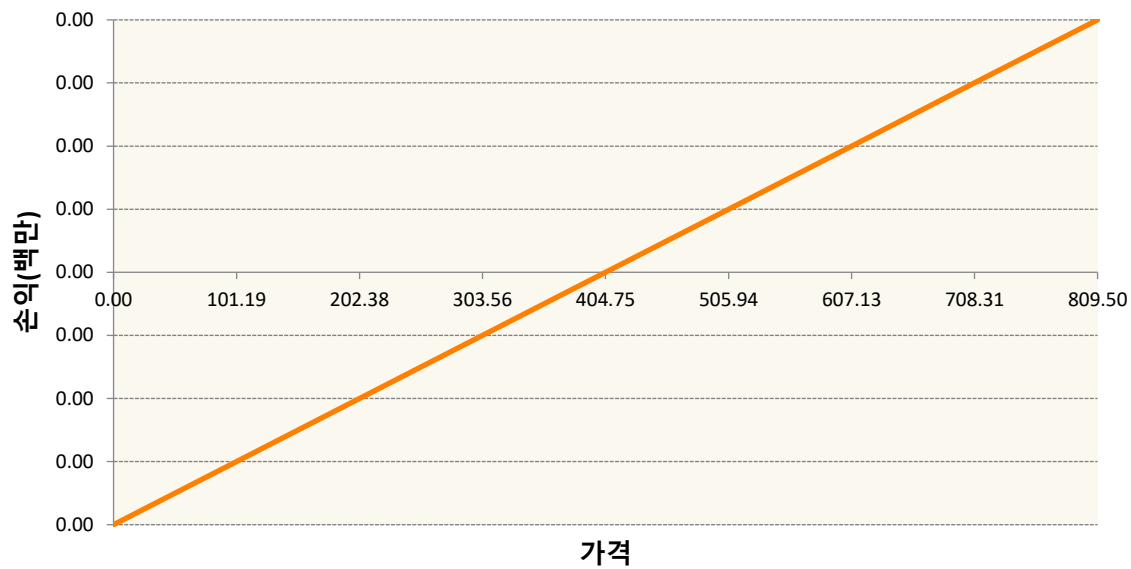
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	519	-519	장내
누계	유가증권	선물	3,818	0	3,818	
누계	통화	선물	0	519	-519	장내

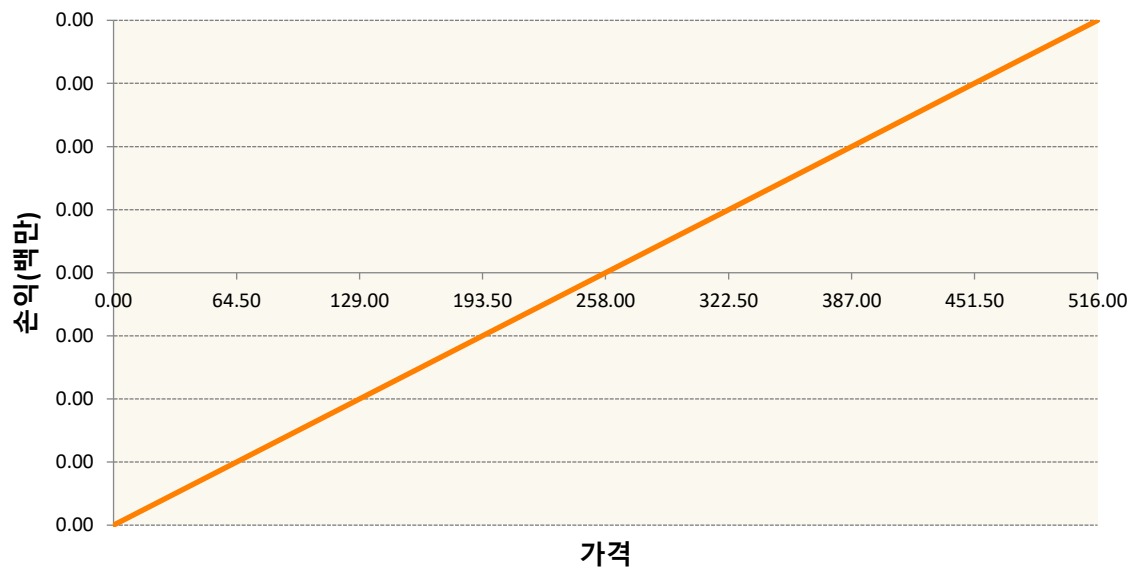
2. 만기시점의 손익구조



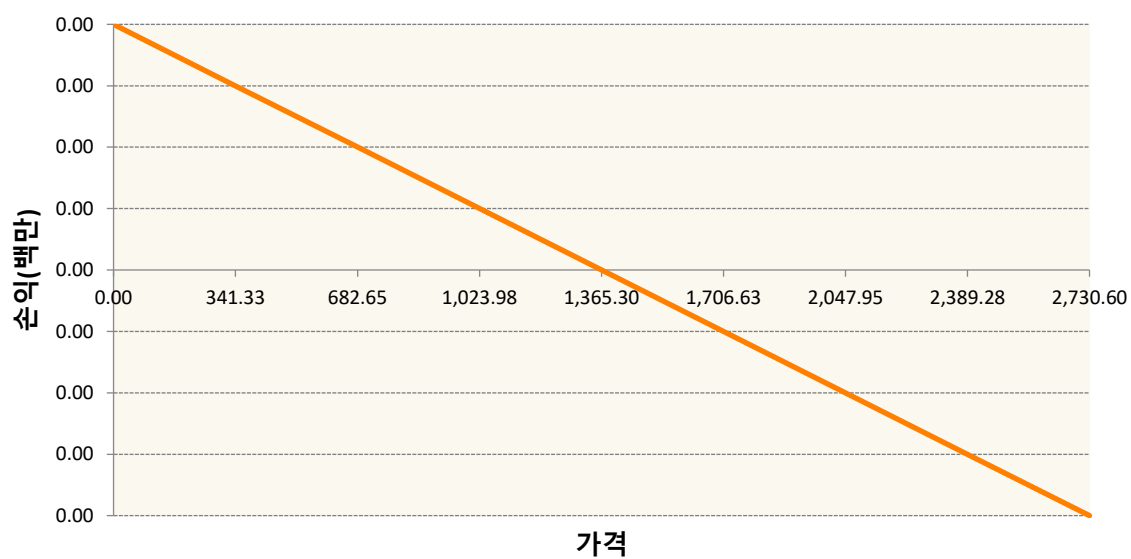
CZ4-CORN FUTURE Dec24



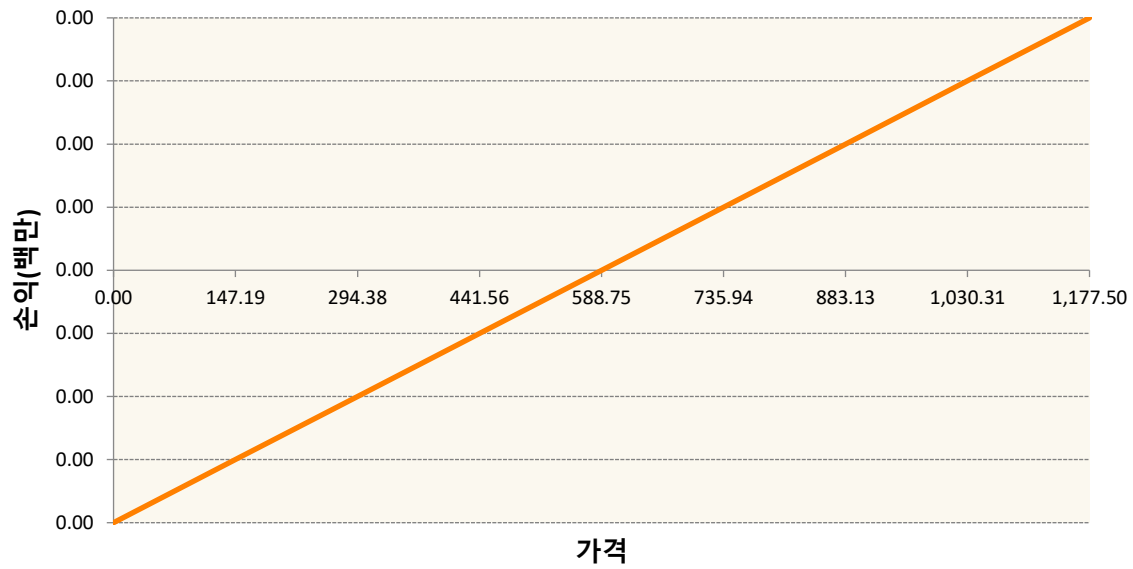
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



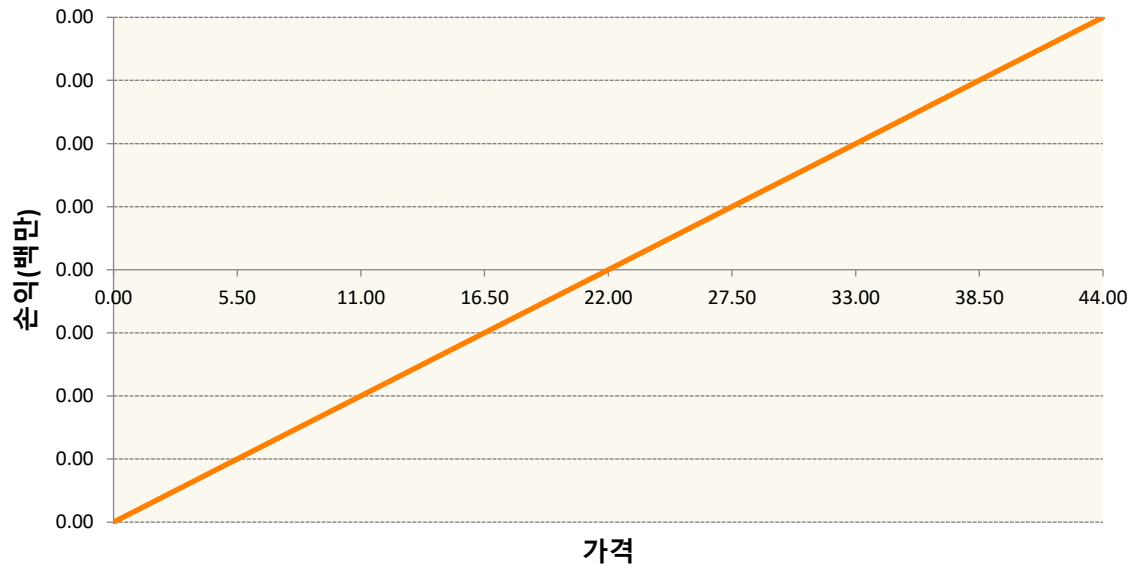
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



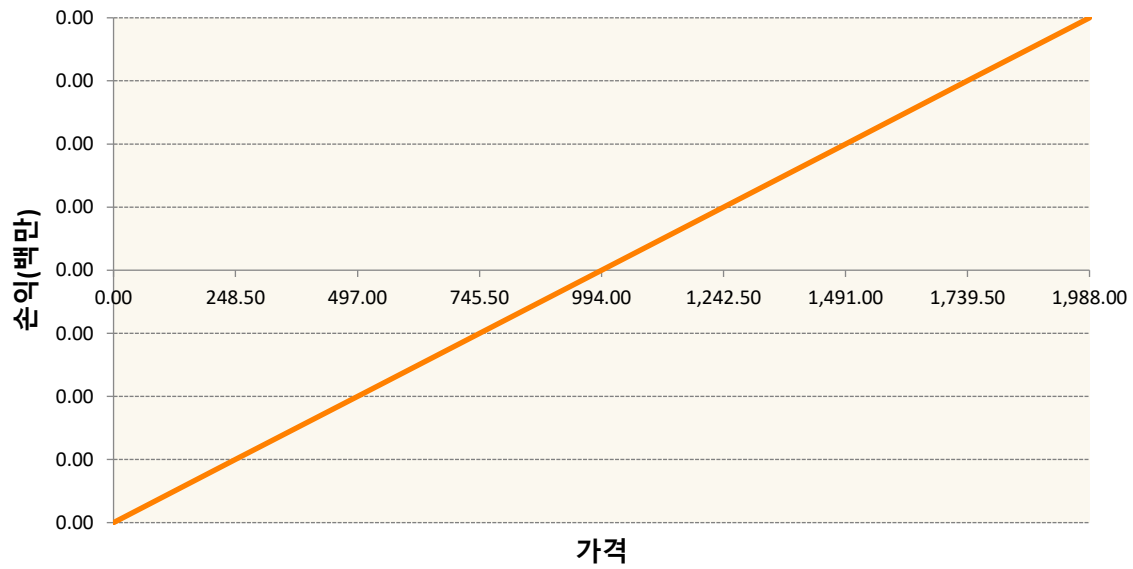
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24



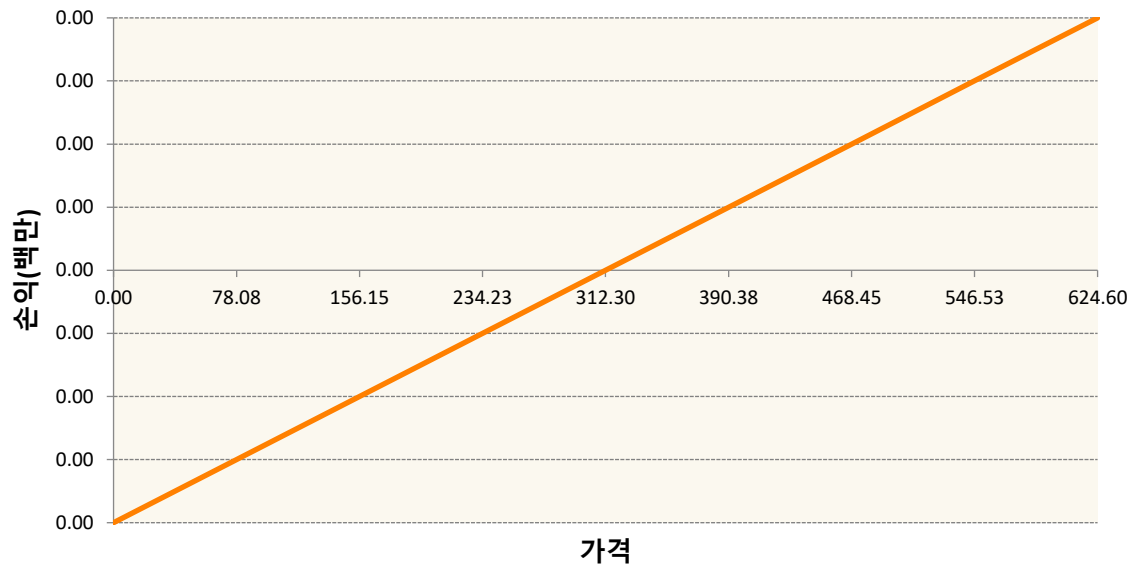
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



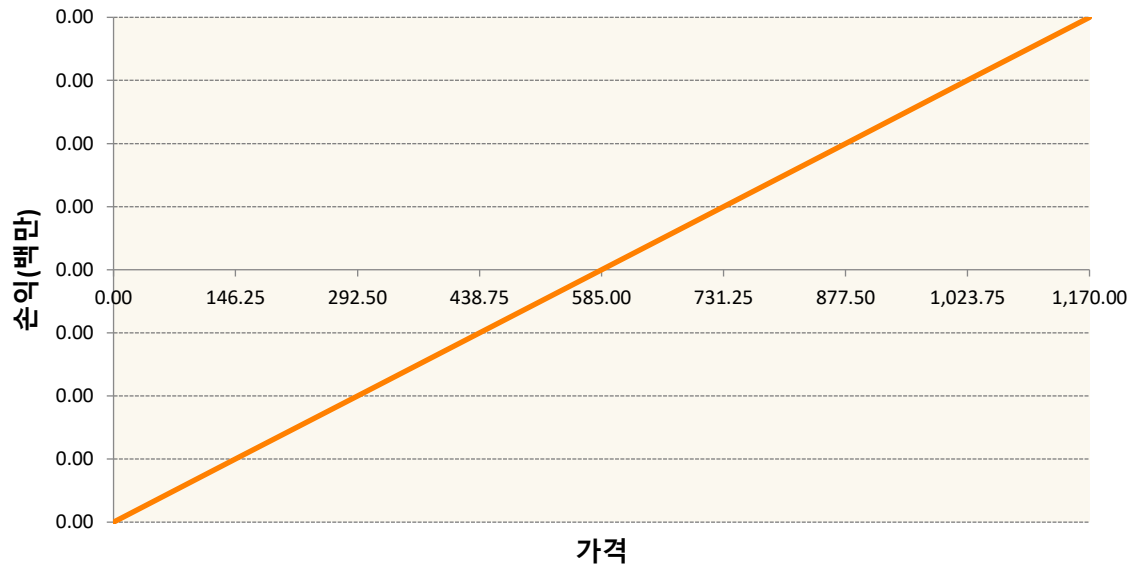
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-10-18
기준일	2024-10-17

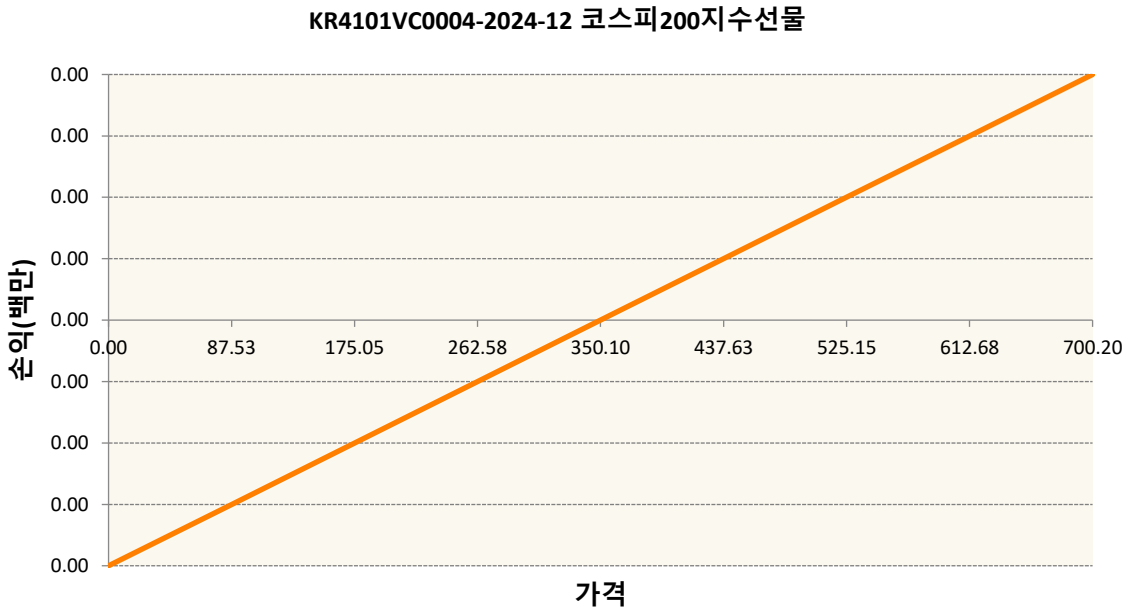
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,497	3,487	10	장내
누계	유가증권	선물	1,663	0	1,663	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				132
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-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%	132	132	132	132	132	132	132

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

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	282
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

451

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

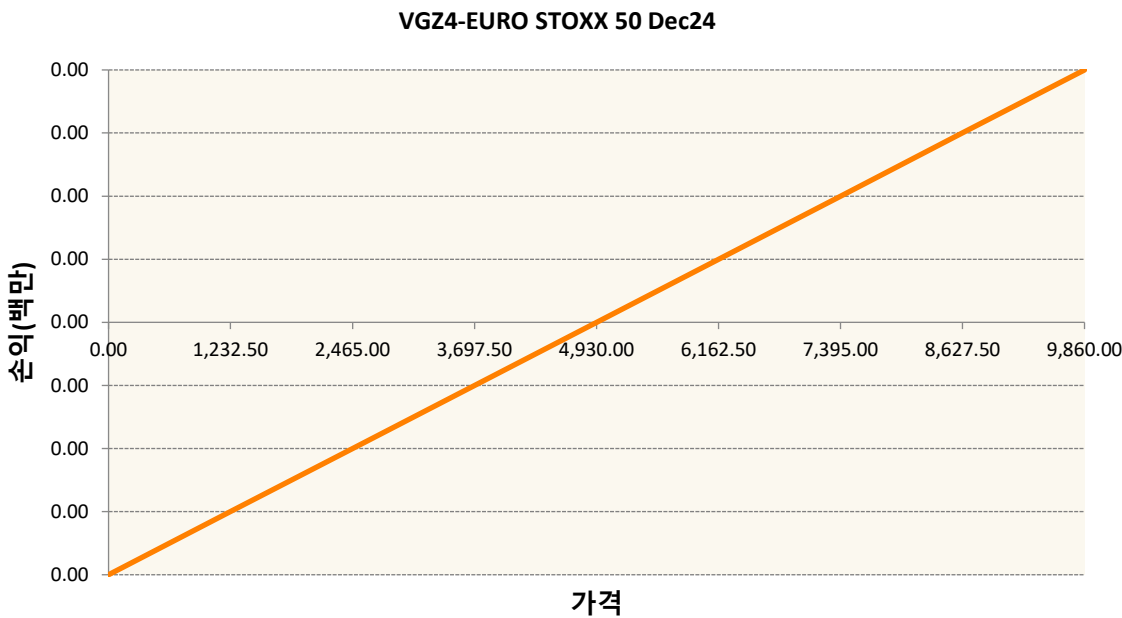
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	952	0	952	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ4 EURO STOXX 50 Dec24

76

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

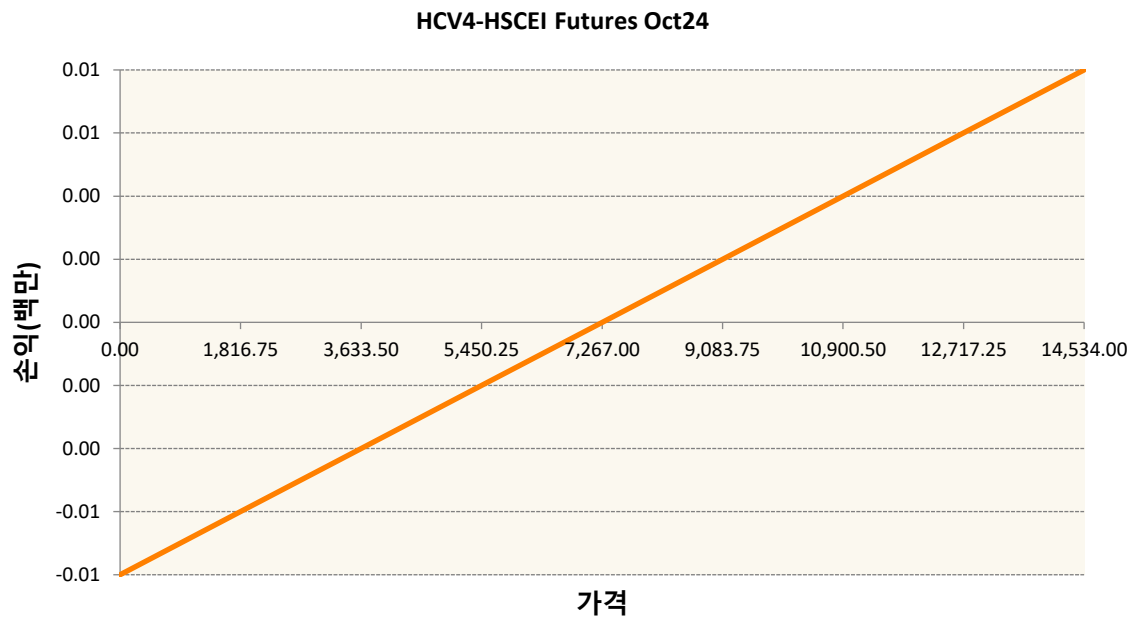
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,366	0	1,366	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV4	HSCEI Futures Oct24	109
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

149

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

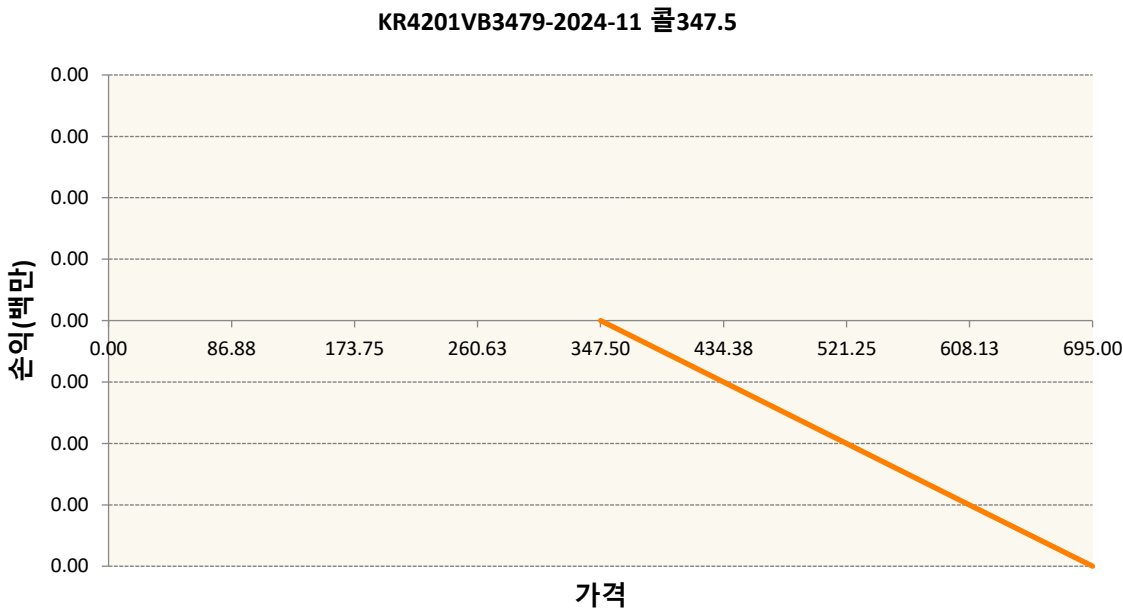
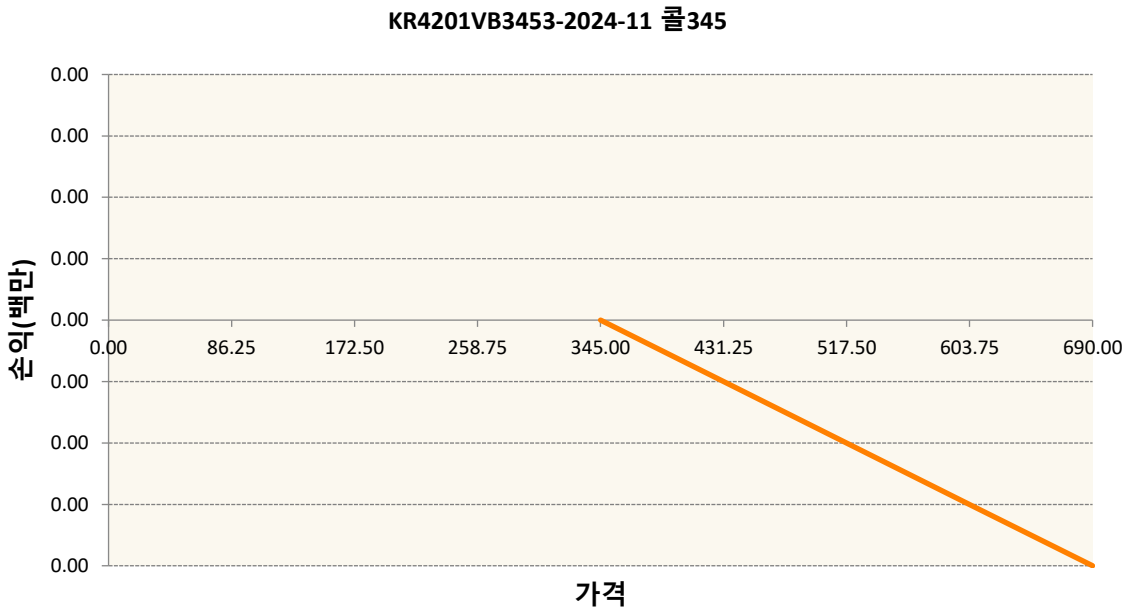
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

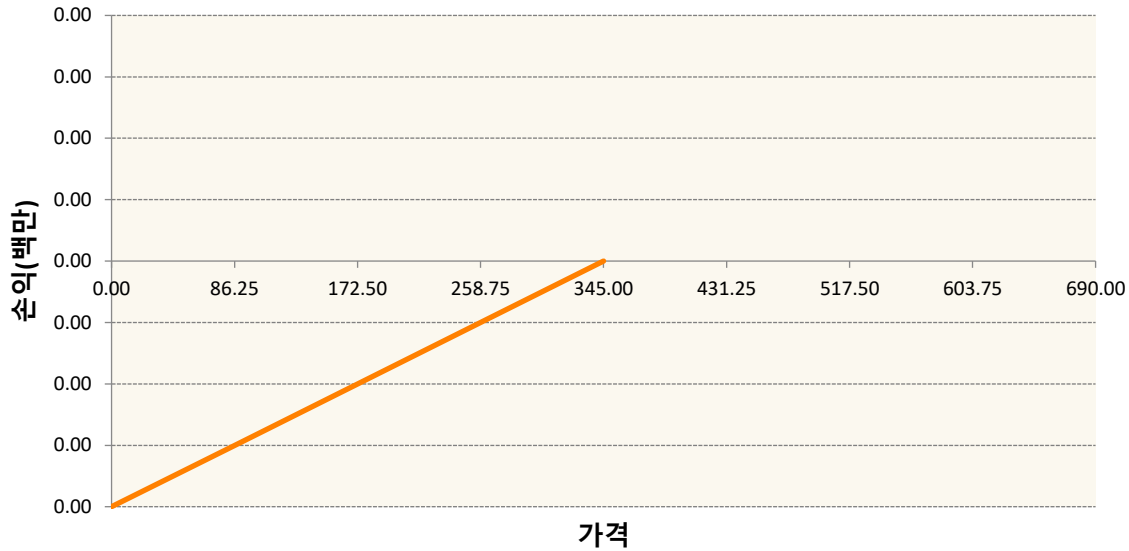
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301VB3452-2024-11 풋345



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201VB3453		2024-11 콜345					1,881
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	900	873	842	806	767	725	681
-5.33%	794	747	697	644	590	534	476
-2.67%	574	510	446	381	315	250	184
0%	203	136	68	0	-68	-136	-204
2.67%	-320	-377	-436	-496	-558	-621	-684
5.33%	-962	-1,001	-1,045	-1,091	-1,141	-1,194	-1,248
8.00%	-1,681	-1,703	-1,730	-1,762	-1,798	-1,838	-1,881
KR4201VB3479		2024-11 콜347.5					210
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	93	90	87	84	80	75	70
-5.33%	83	78	73	67	62	55	49
-2.67%	62	55	48	40	33	26	18
0%	24	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	-32	-39	-46	-54	-61	-69	-76
5.33%	-103	-108	-114	-119	-126	-132	-139
8.00%	-184	-187	-190	-195	-199	-204	-210
KR4301VB3452		2024-11 풋345					442
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-405	-409	-414	-420	-426	-434	-442
-5.33%	-220	-229	-238	-248	-259	-270	-282
-2.67%	-65	-79	-92	-106	-120	-134	-148
0%	44	29	15	0	-15	-29	-44

2.67%	106	94	82	70	58	45	31
5.33%	133	127	119	111	102	92	81
8.00%	143	140	136	132	126	119	112

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

(단위:백만원)

2,462

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

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	1,255	0	1,255	

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	2024-10-18
기준일	2024-10-17

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	4,410	0	4,410	

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	2024-10-18
기준일	2024-10-17

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	14,592	0	14,592	
누계	통화	선도	0	14,576	-14,576	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E7W KRW/USD 31-10-24E	224
FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E	575
FXW213E9L0 KRW/USD 31-10-24E	22
FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E	345
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

536

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

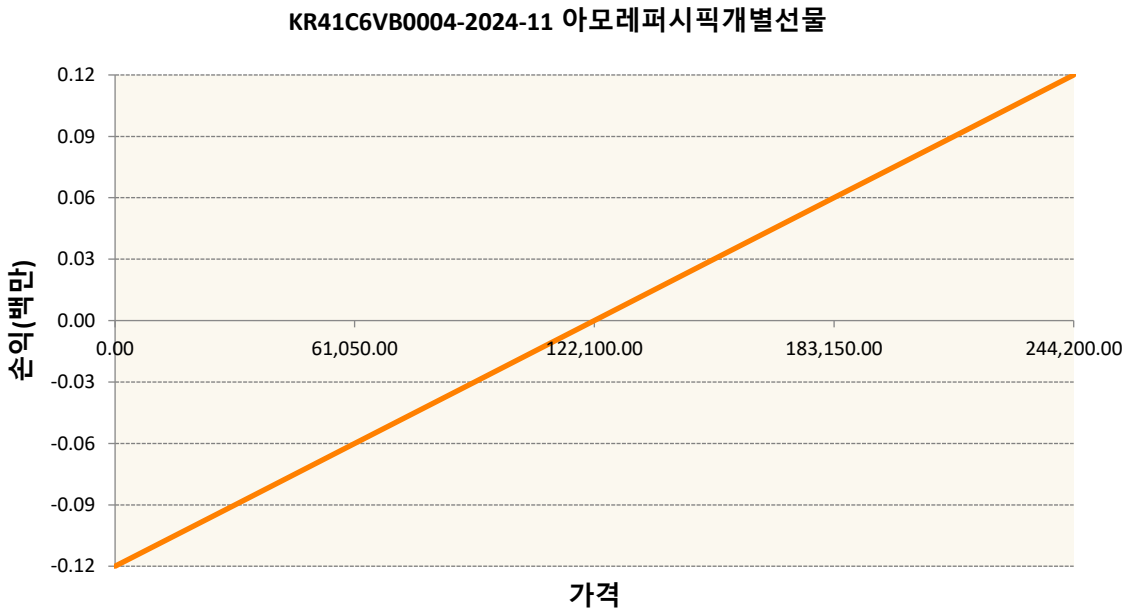
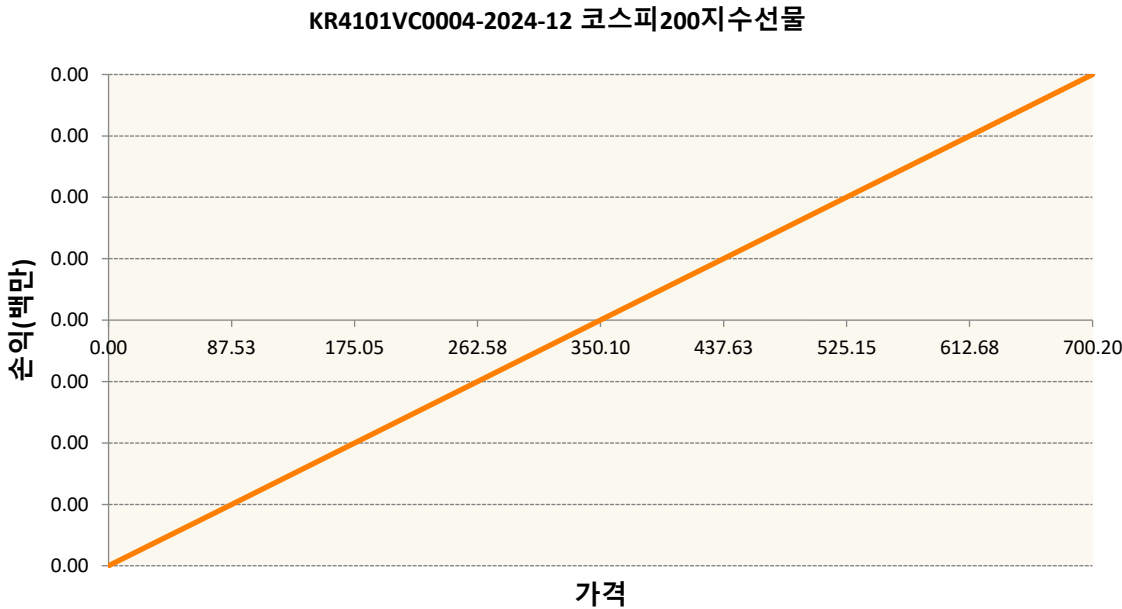
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

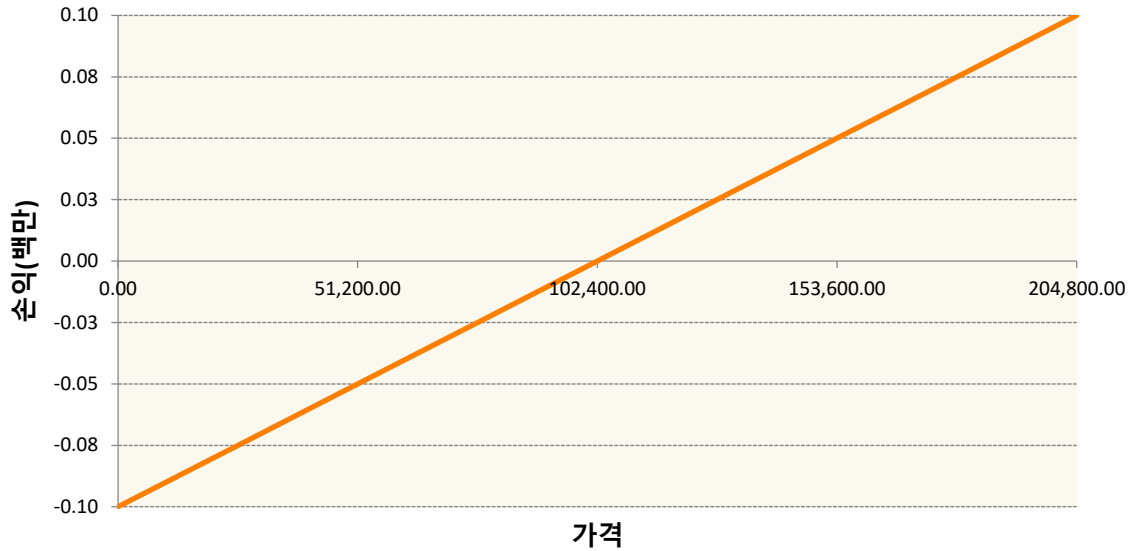
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	829	0	829	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41FMVB0003-2024-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004 2024-12 코스피200지수선물								63
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	42	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	63	63	63	63	63	63	63	63
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	-2
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2	2
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	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	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)

79

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

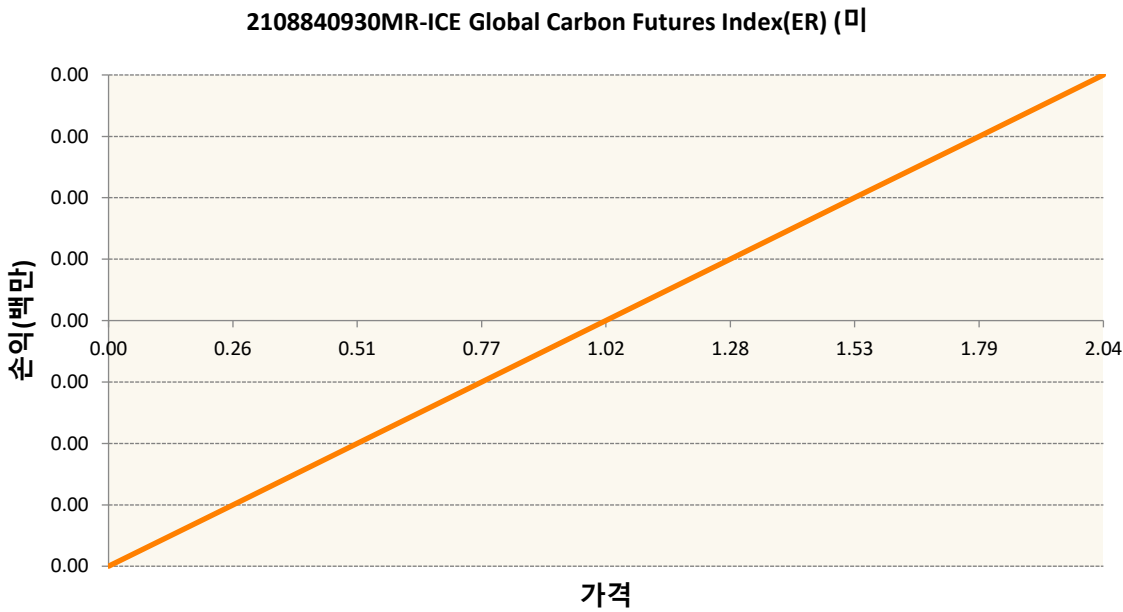
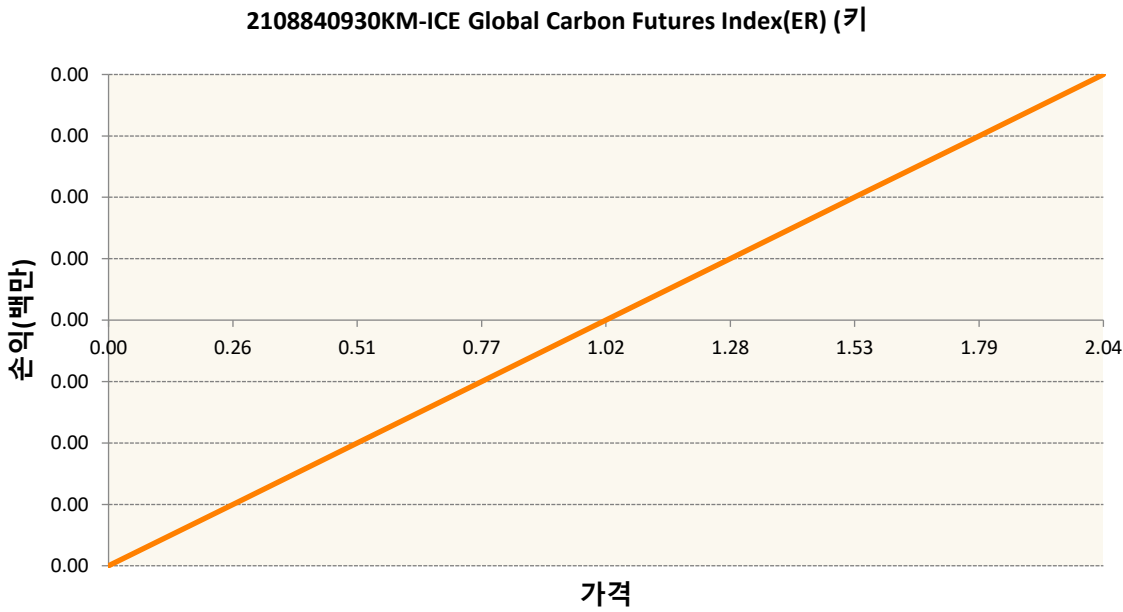
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

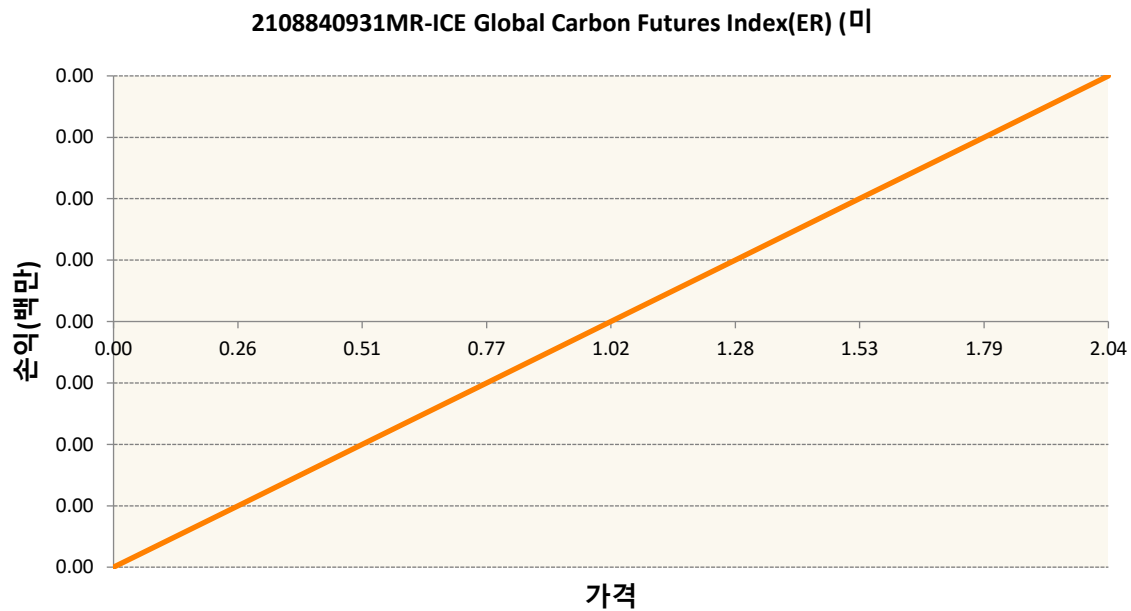
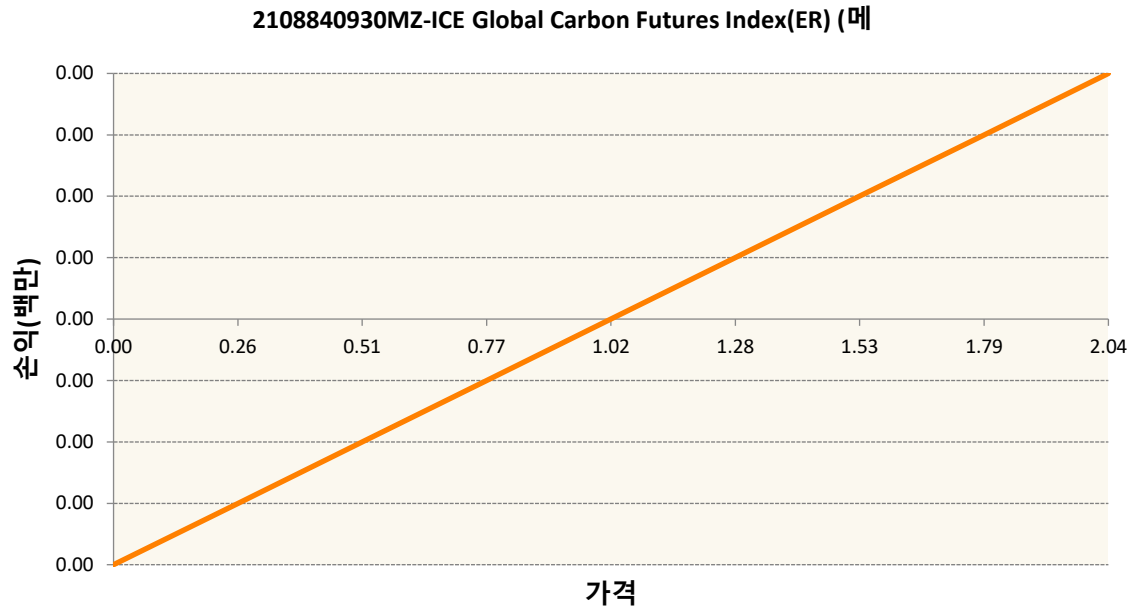
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,528	0	11,528	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		92
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		463
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		185
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		185

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,002

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

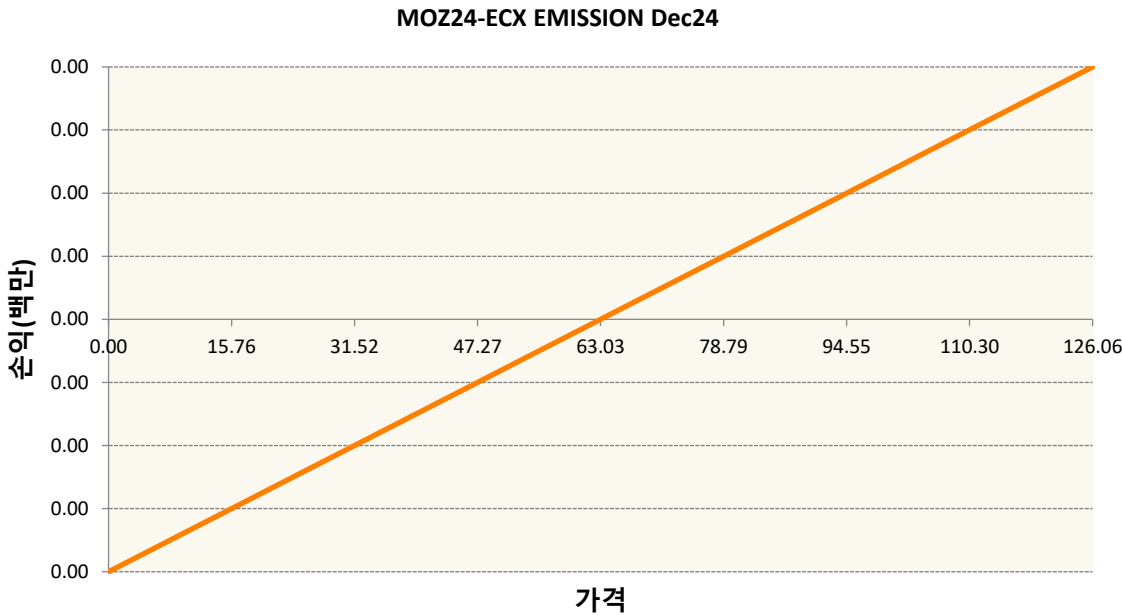
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,542	0	7,542	
누계	통화	선도	0	1,618	-1,618	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	2
FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E	129
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	605

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

(단위:백만원)

1,092

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

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)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	15

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

(단위:백만원)

85

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

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)	37
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	32
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	44
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	9

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

(단위:백만원)

190

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

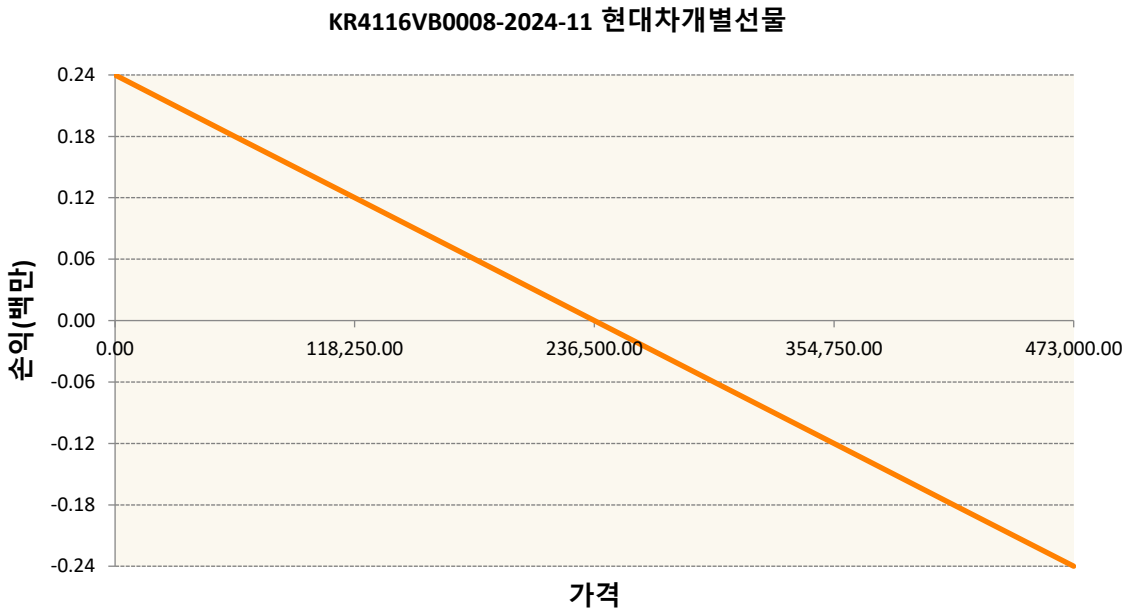
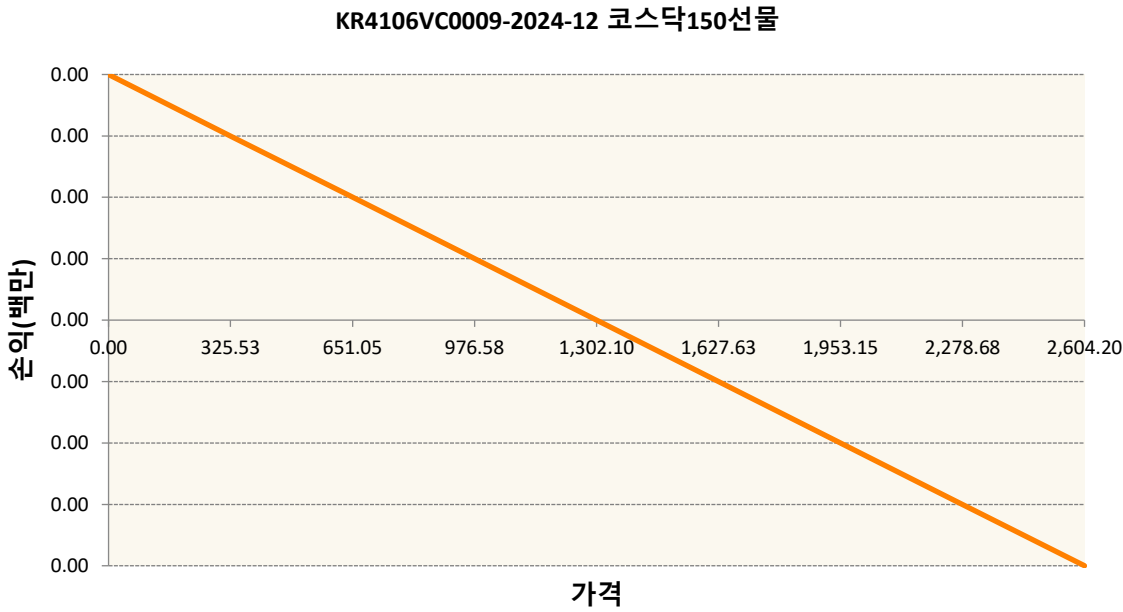
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

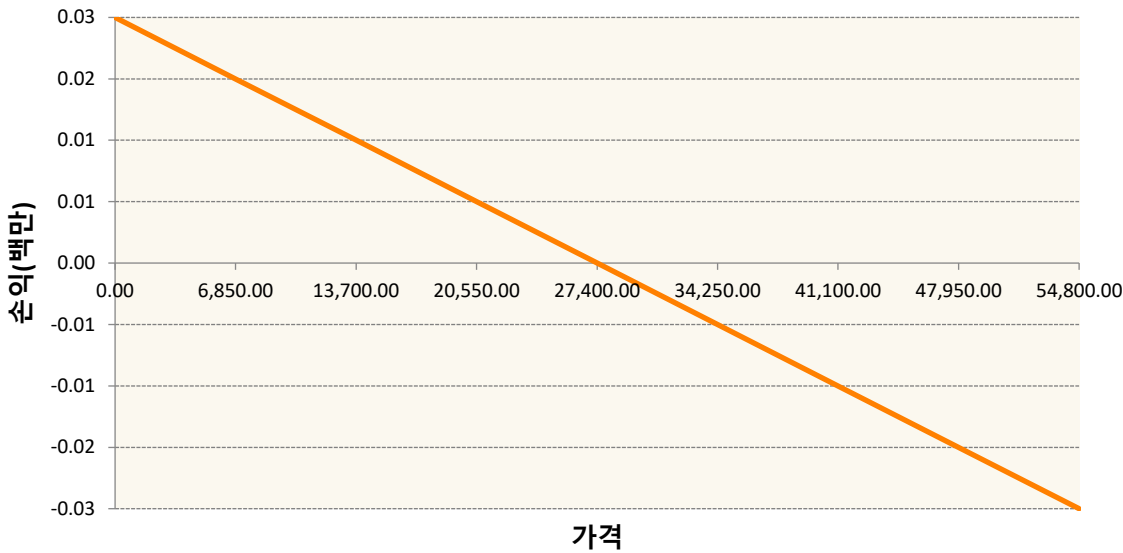
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	17	0	17	장내
누계	유가증권	선물	11	59	-47	장내

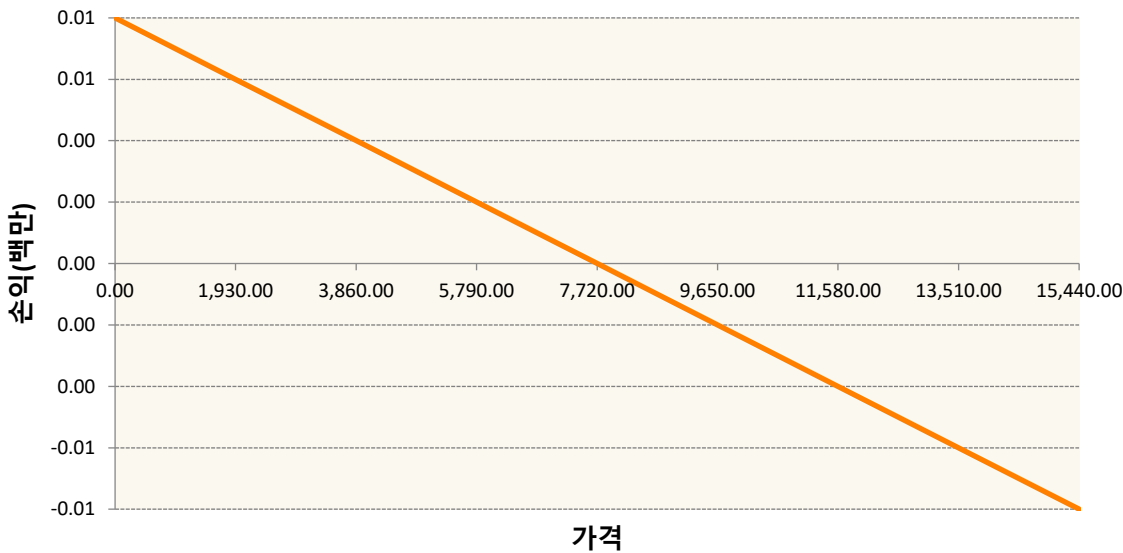
2. 만기시점의 손익구조



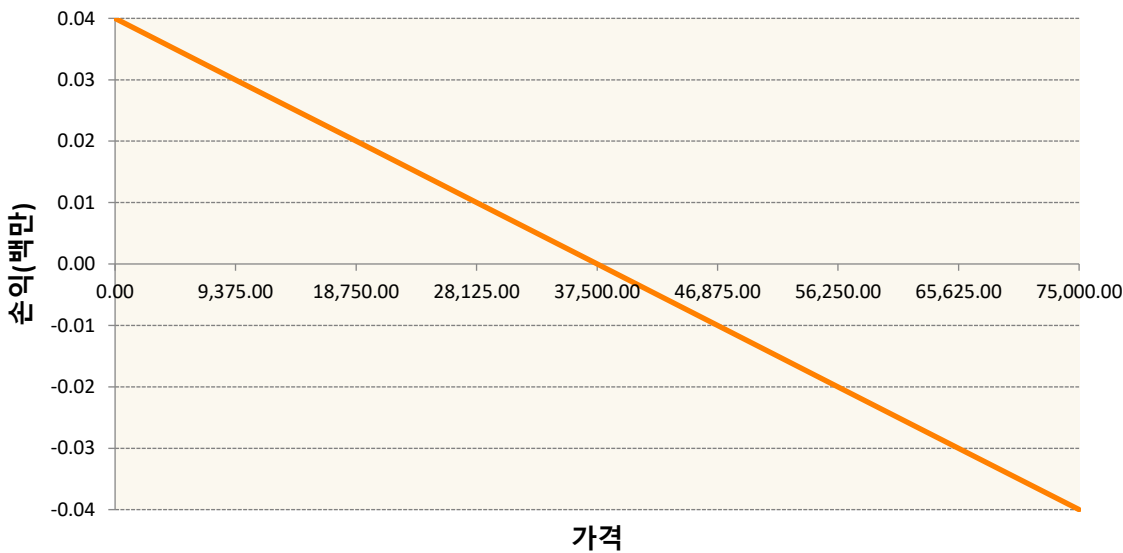
KR4132VB0008-2024-11 현대제철개별선물



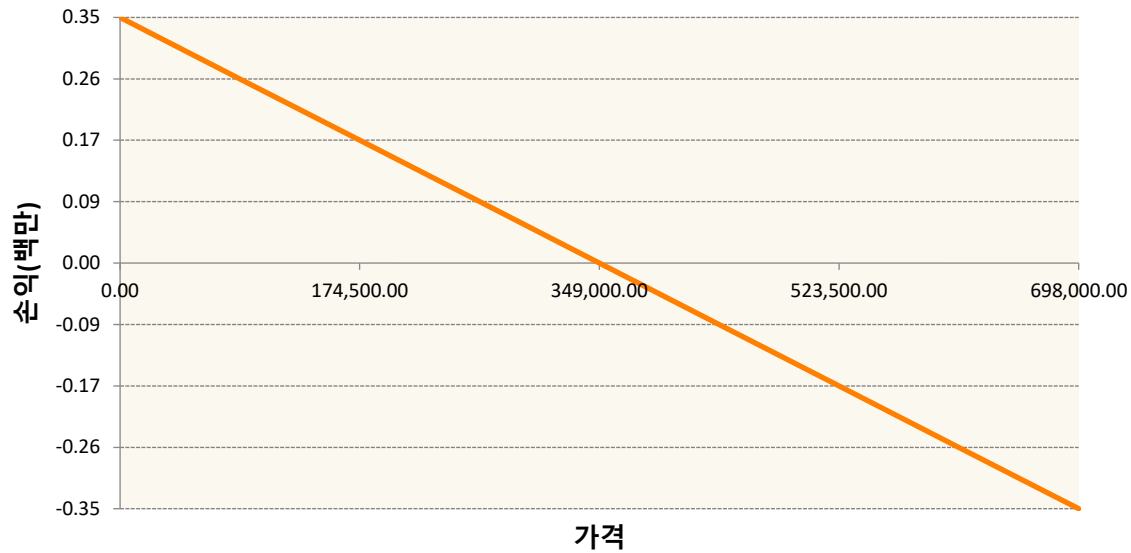
KR4149VB0009-2024-11 HD현대인프라코어개별선물



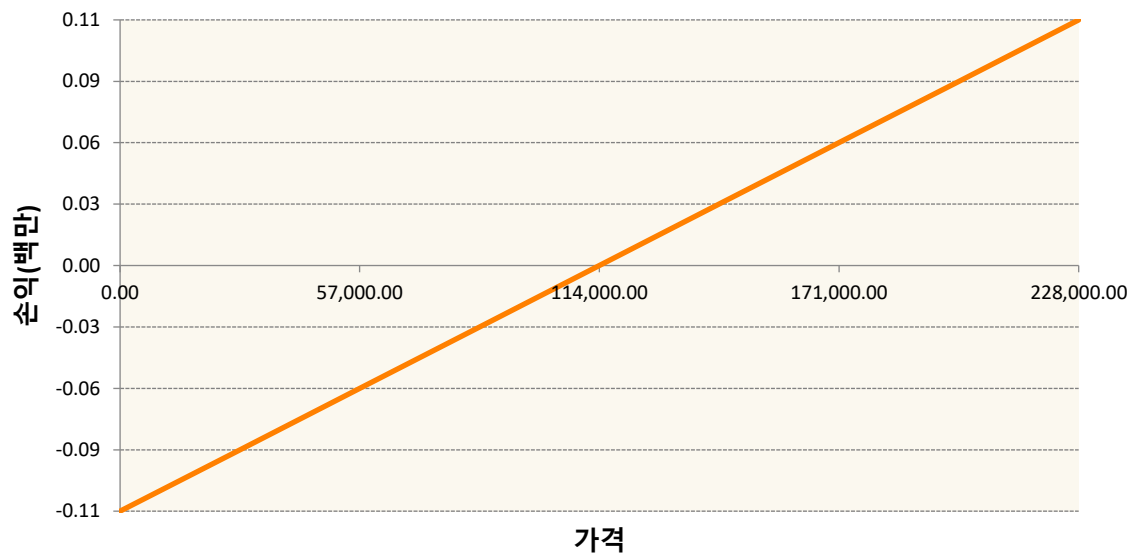
KR41CFVB0005-2024-11 카카오개별선물



KR41CTVB0009-2024-11 삼성화재개별선물



KR41D0VB0008-2024-11 DB손해보험개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4106VC00 2024-12 코스닥150선물	1
KR4116VB00 2024-11 현대차개별선물	1
KR4132VB00 2024-11 현대제철개별선물	1
KR4149VB00 2024-11 HD현대인프라코어개별선물	1
KR41CFVB00 2024-11 카카오개별선물	1
KR41CTVB00 2024-11 삼성화재개별선물	1
KR41D0VB00 2024-11 DB손해보험개별선물	1

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

(단위:백만원)

12

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

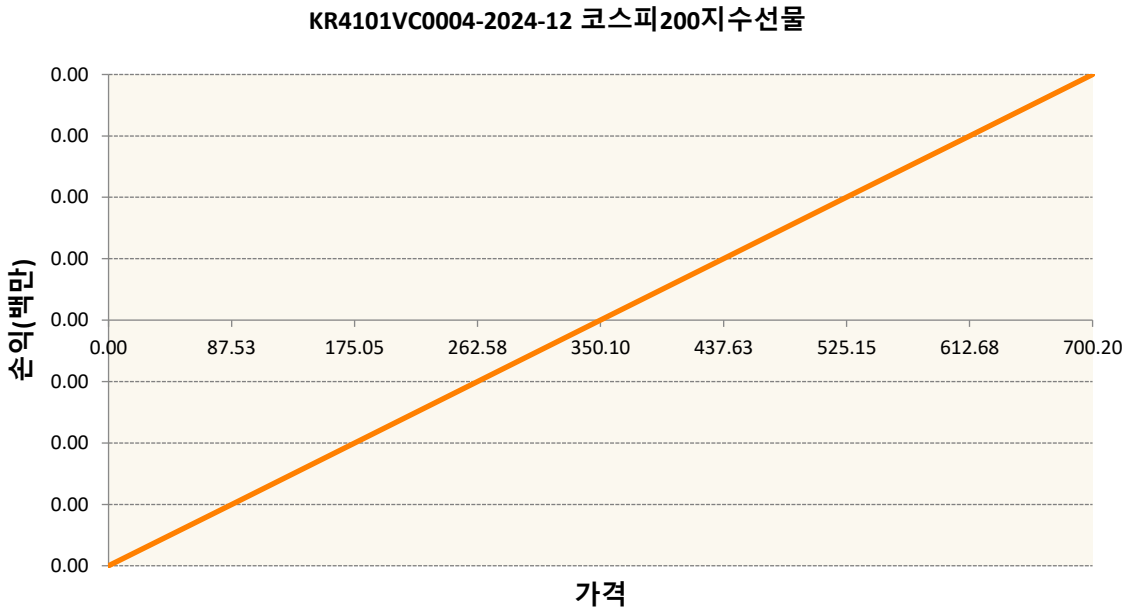
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	8,315	0	8,315	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					661
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-661	-661	-661	-661	-661	-661	-661
-5.33%	-440	-440	-440	-440	-440	-440	-440
-2.67%	-220	-220	-220	-220	-220	-220	-220
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	220	220	220	220	220	220	220
5.33%	440	440	440	440	440	440	440
8.00%	661	661	661	661	661	661	661

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

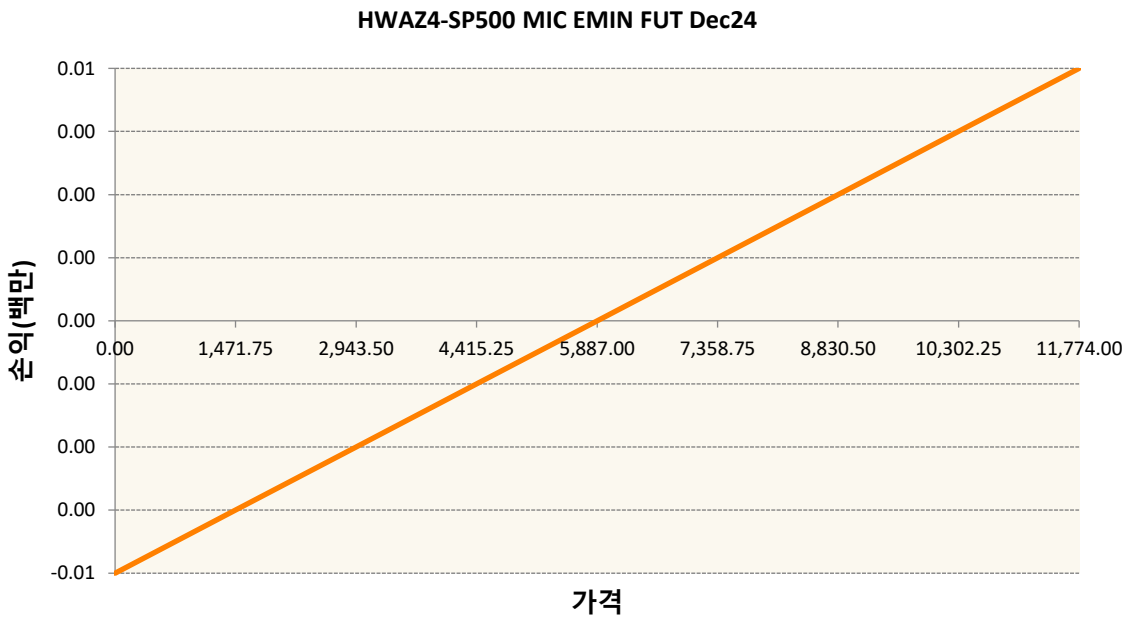
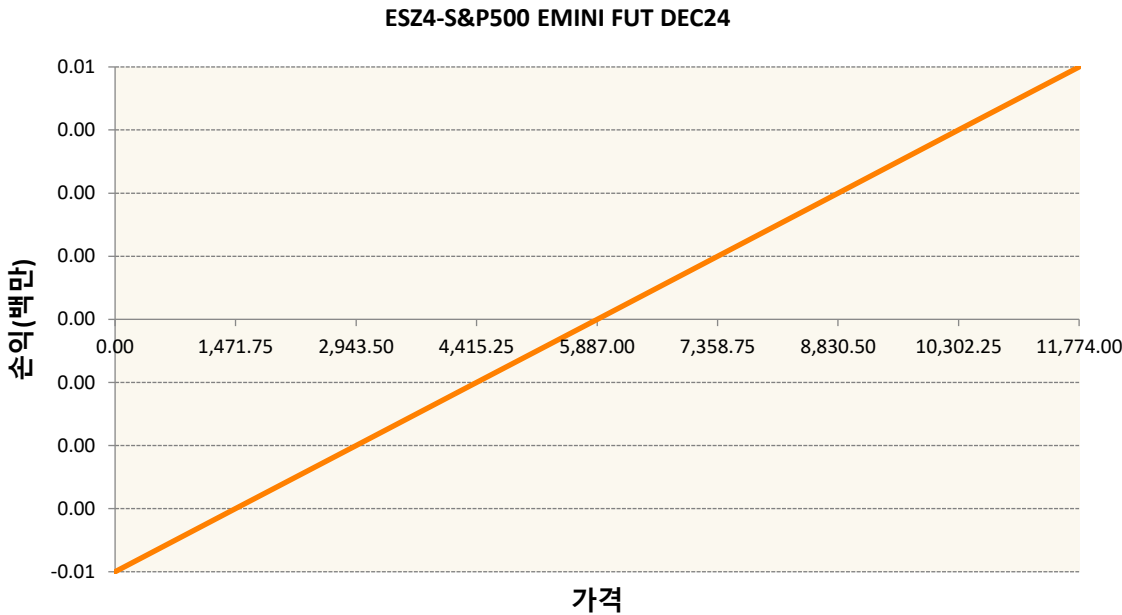
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	12,579	0	12,579	
누계	유가증권	선물	1,605	0	1,605	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,006
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	128

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	691

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

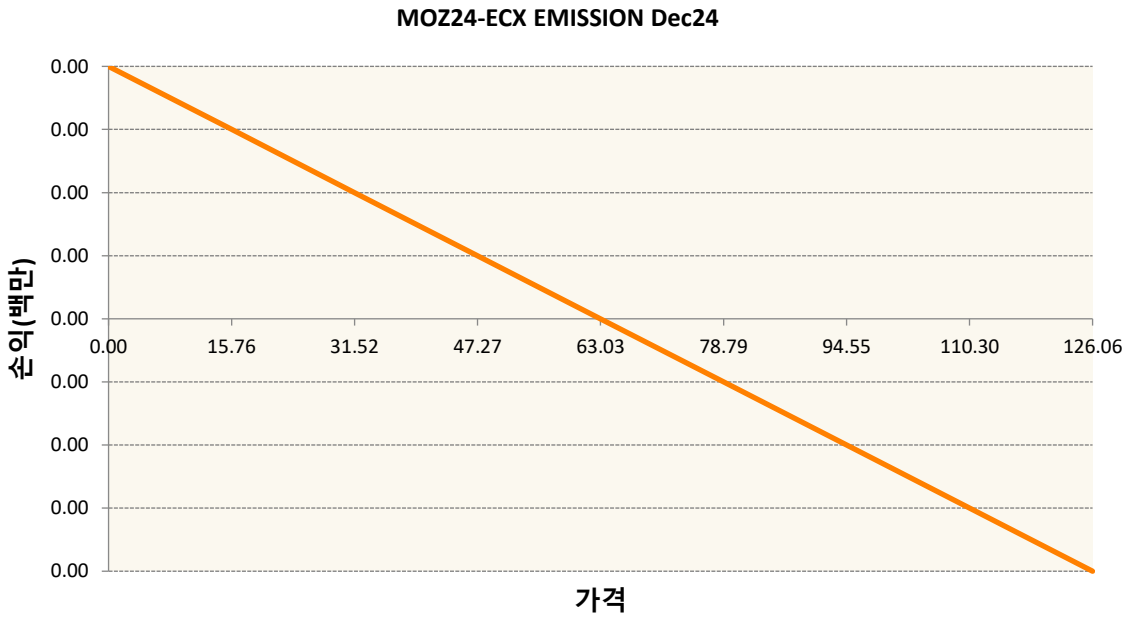
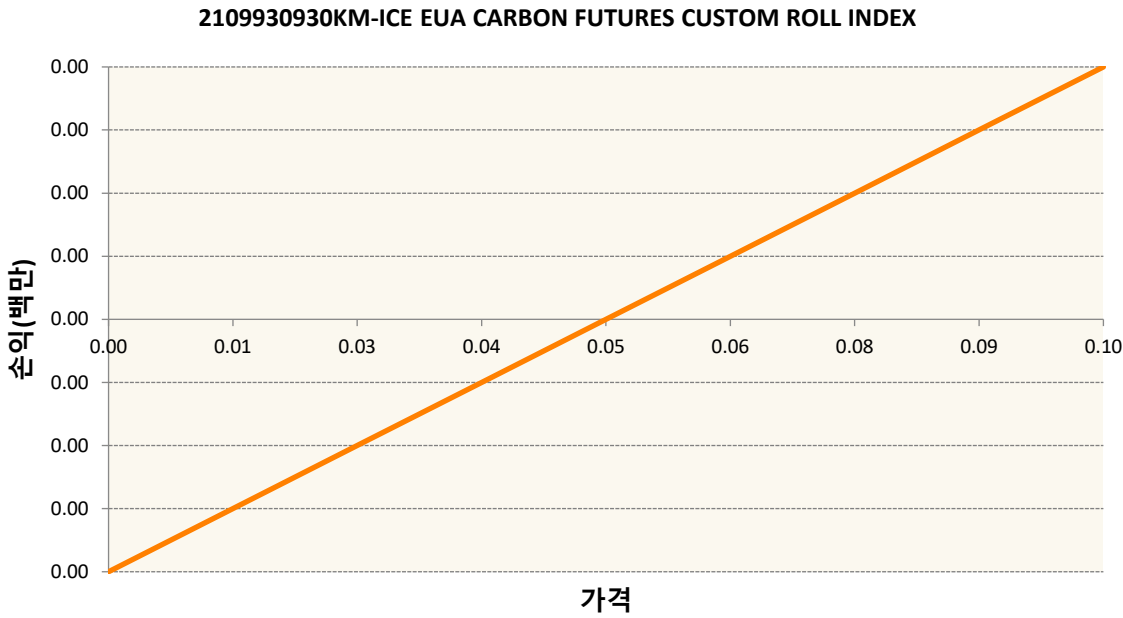
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	18	6,843	-6,825	
누계	통화	선도	0	1,555	-1,555	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		2
FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E		36
FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E		88
MOZ24 ECX EMISSION Dec24		547

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	993

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

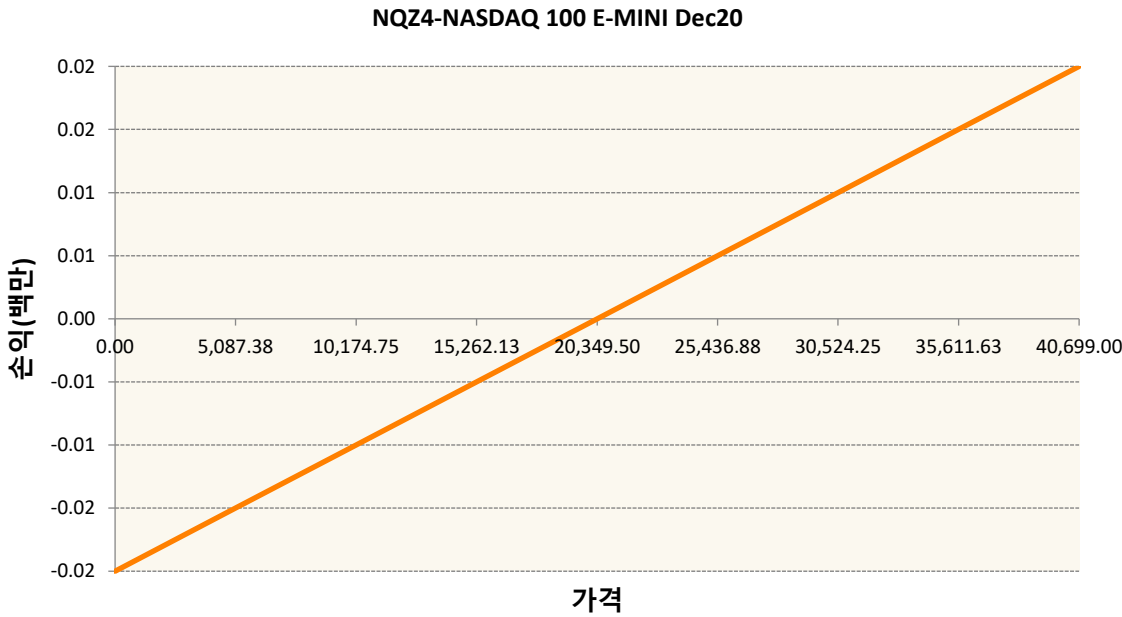
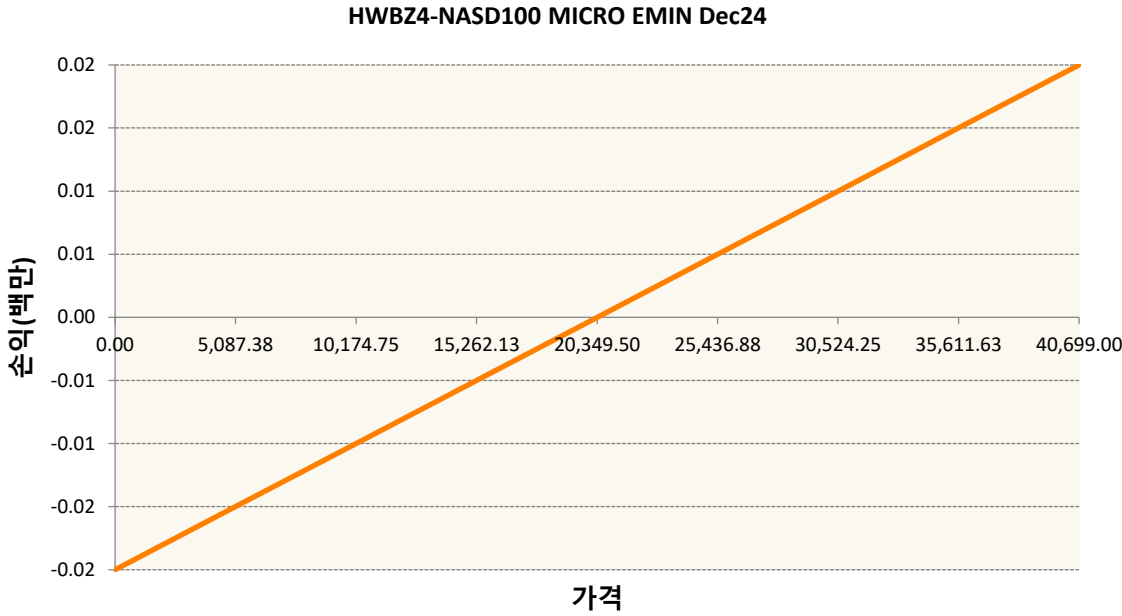
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	6,496	0	6,496	
누계	유가증권	선물	921	0	921	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24	74
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	520

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	493

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

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	3,512
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,661
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,912
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	710
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	240

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

(단위:백만원)

8,752

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

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	6
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	6
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	6
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	6

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

(단위:백만원)

27

공시일	2024-10-18
기준일	2024-10-17

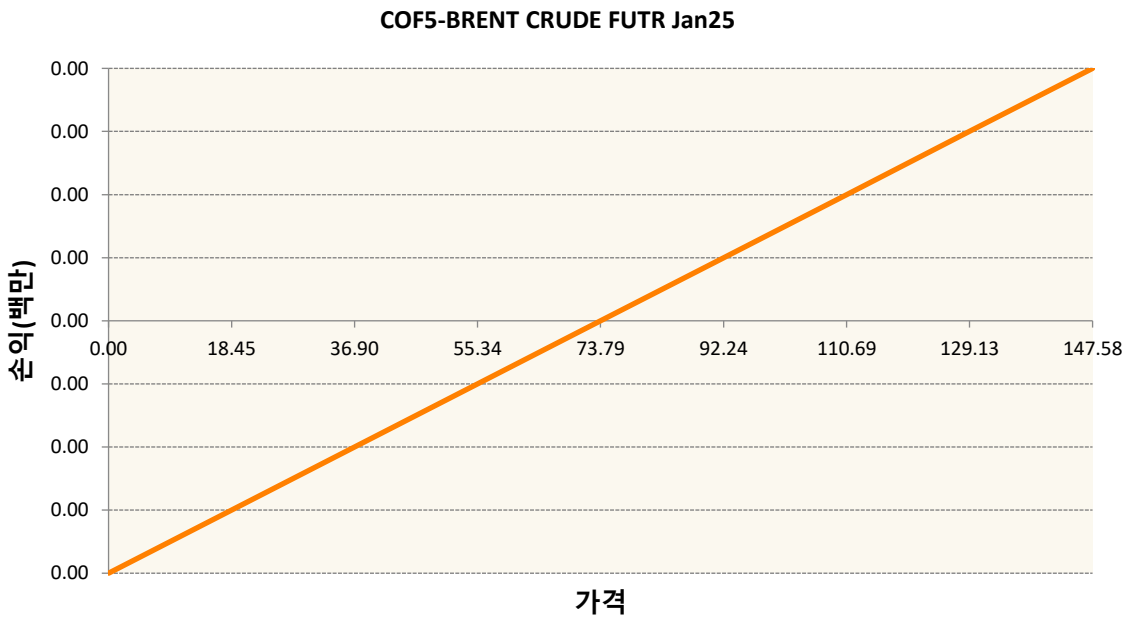
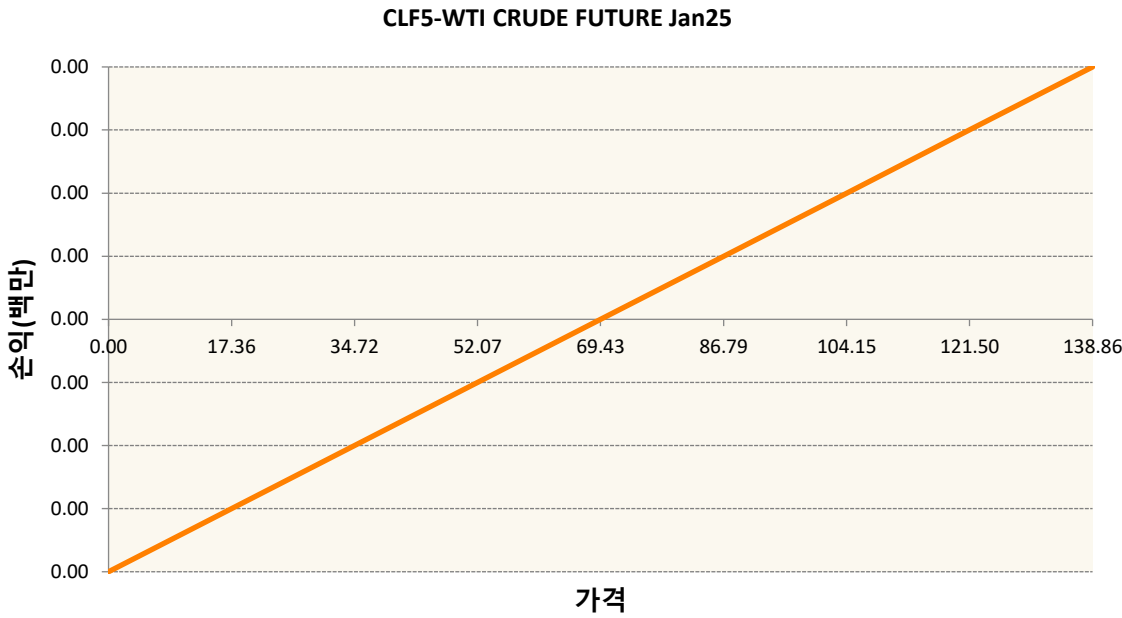
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

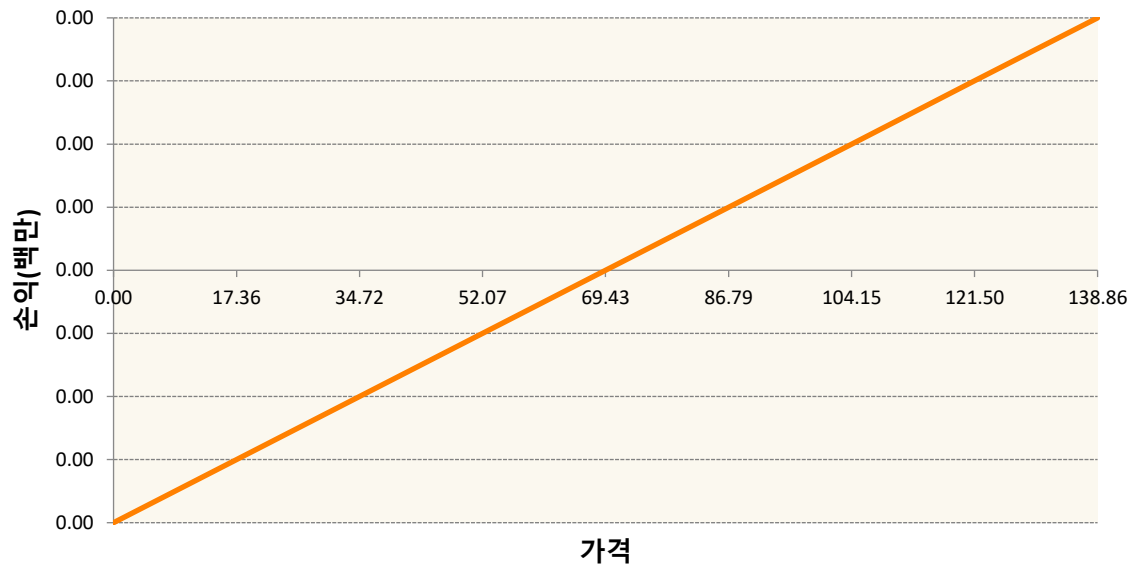
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	95	-95	장내
누계	유가증권	선물	796	0	796	
누계	통화	선물	0	96	-96	장내

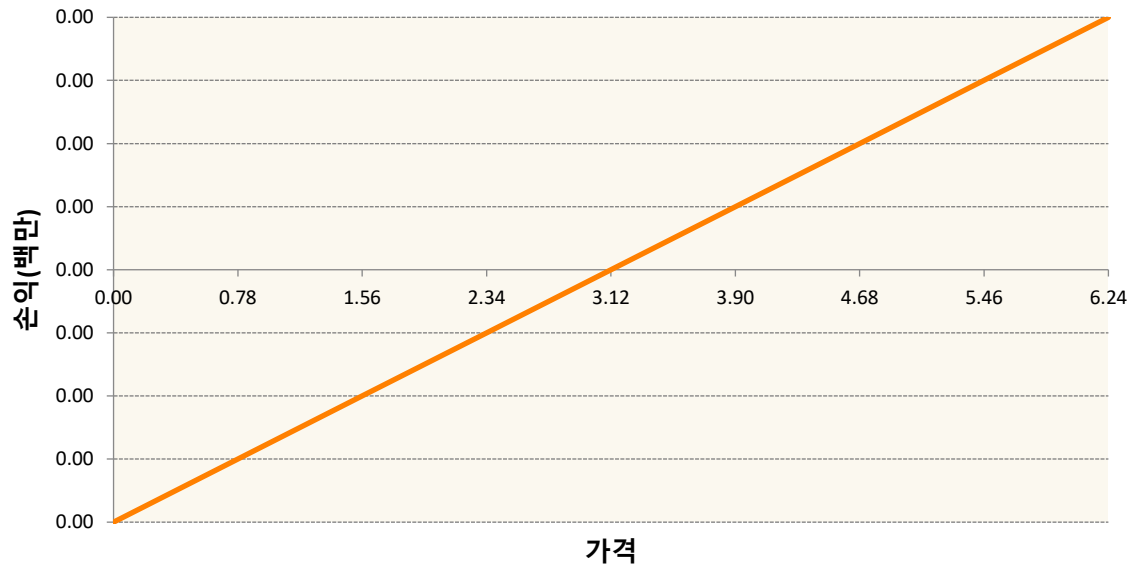
2. 만기시점의 손익구조



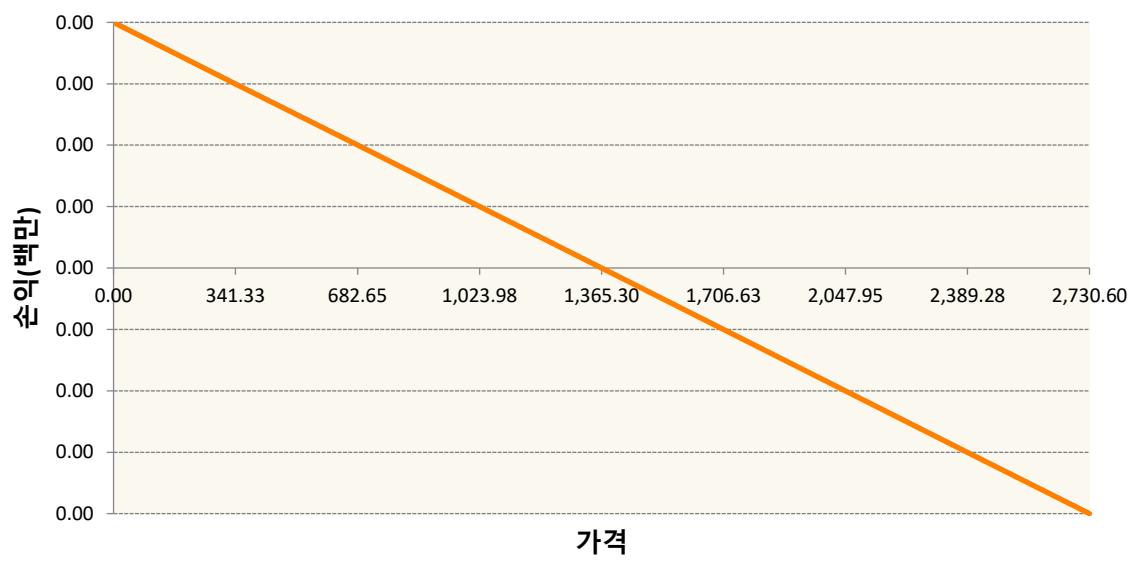
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



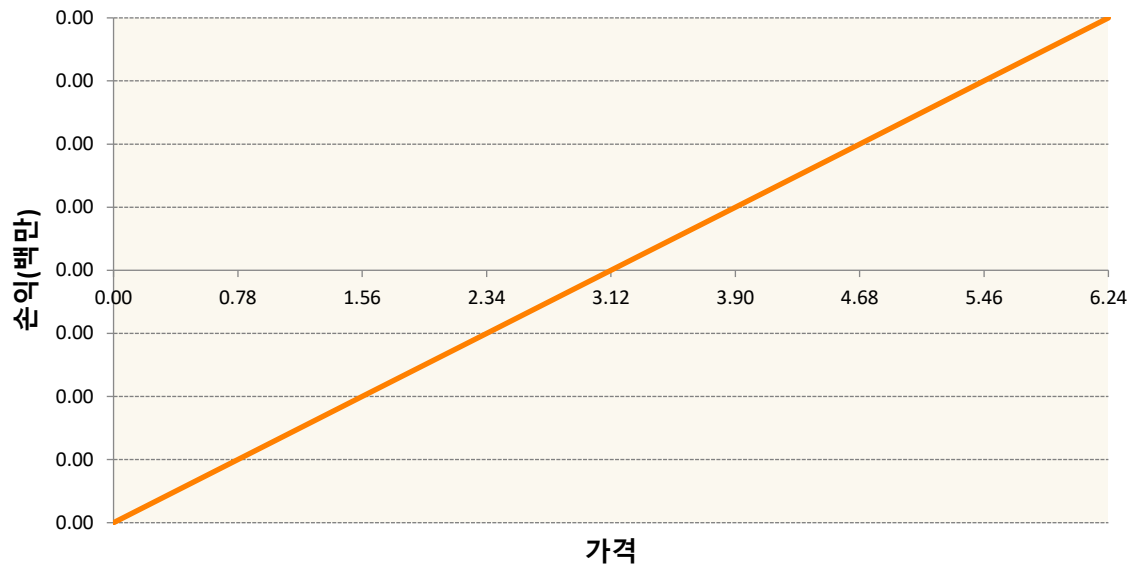
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



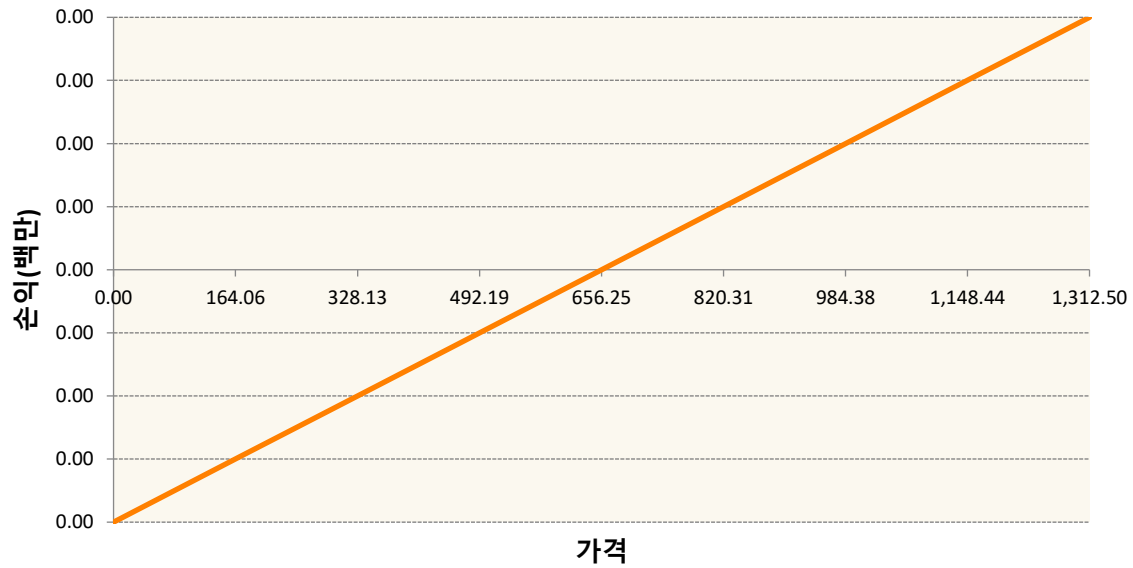
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



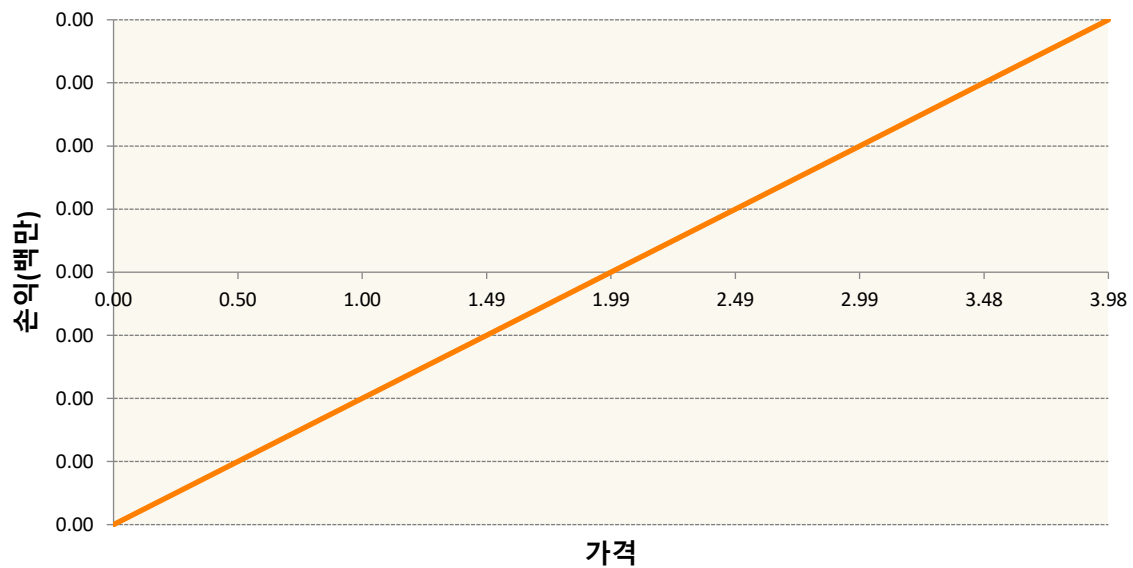
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



QSF5-Low Su Gasoil G Jan25



XBF5-GASOLINE RBOB FUT Jan25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF5	WTI CRUDE FUTURE Jan25	7
COF5	BRENT CRUDE FUTR Jan25	16
ECF5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	7
EOF5	E-MINI NATURAL GAS Jan25	3
KR4175VB00 2024-11 달러선물		8
NGF25	NATURAL GAS FUTR Jan25	13
QSF5	Low Su Gasoil G Jan25	7
XBF5	GASOLINE RBOB FUT Jan25	9

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

133