

공시일 2024-10-23

기준일 2024-10-22

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	2024-10-23
기준일	2024-10-22

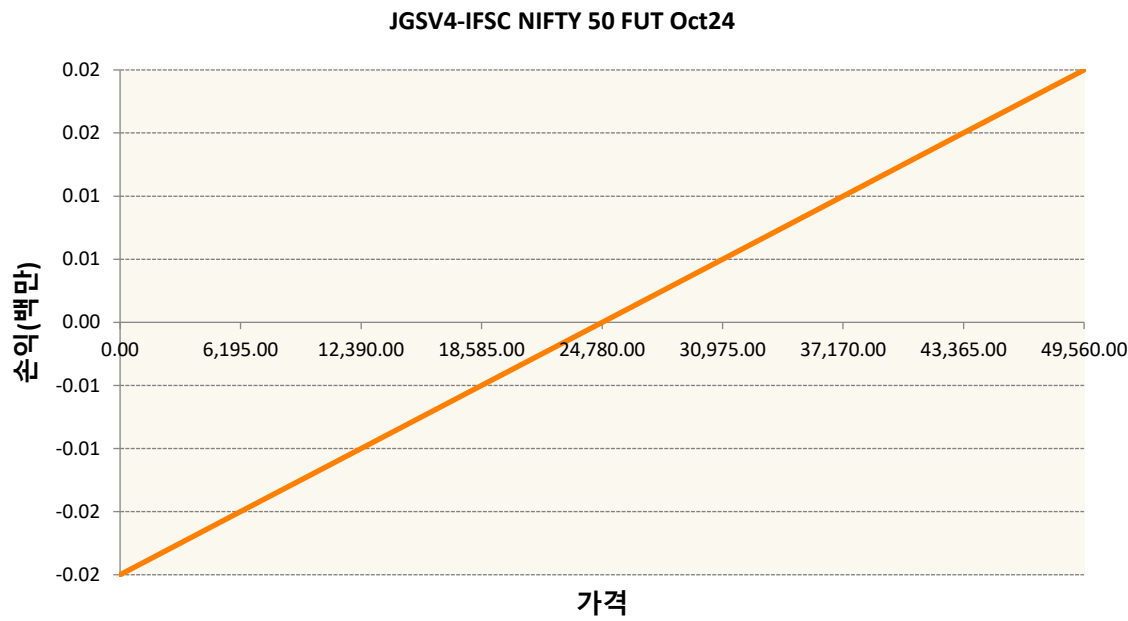
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,369	0	3,369	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSV4	IFSC NIFTY 50 FUT Oct24	270
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

172

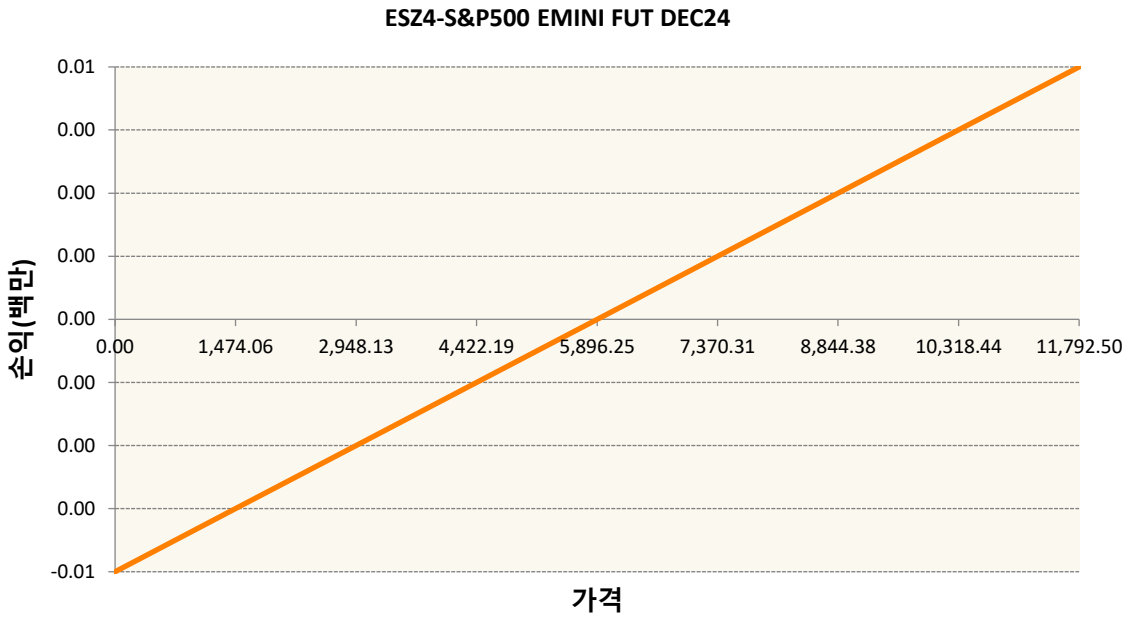
공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	
누계	유가증권	선물	808	0	808	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

AOSPXWUS5 SPXW US 10/22/24 C5865 Index	0.03
ESZ4 S&P500 EMINI FUT DEC24	65

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

39

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

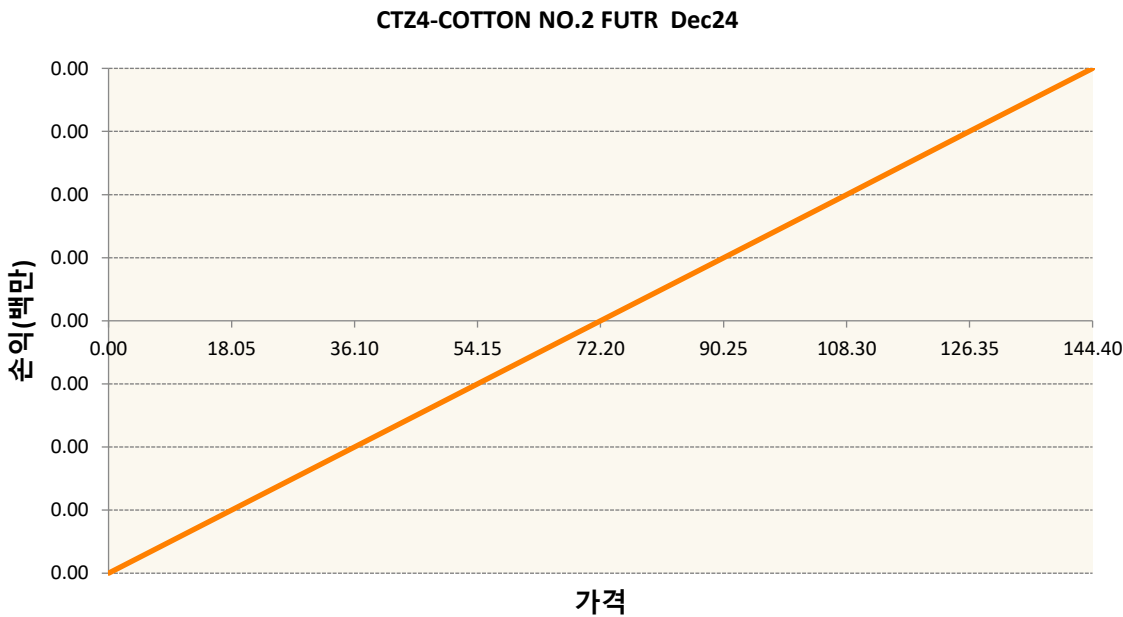
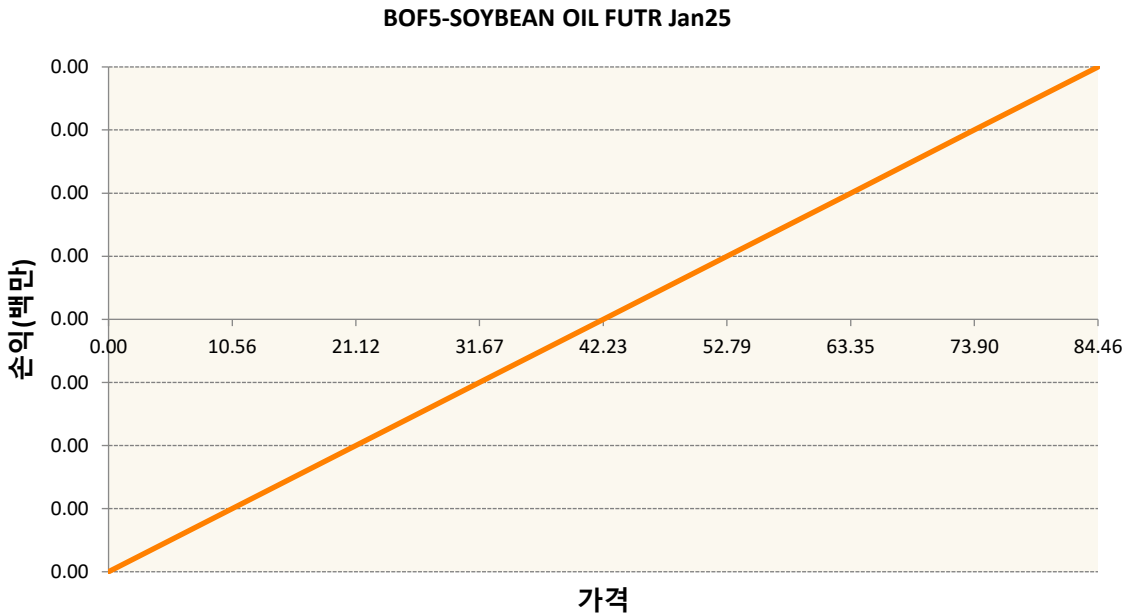
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

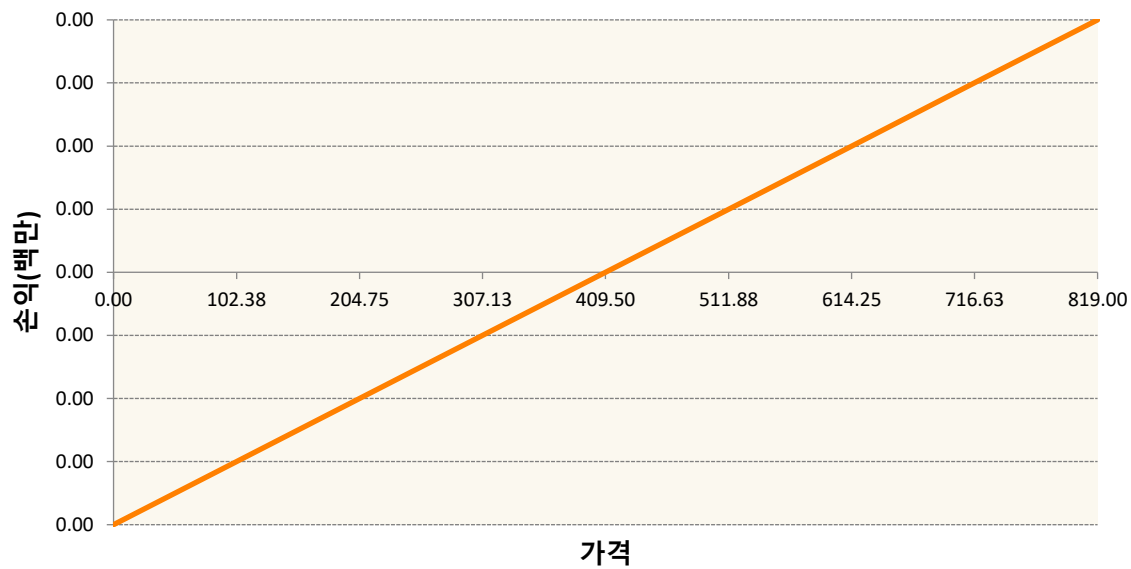
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	41	0	41	장내
누계	유가증권	선물	3,810	0	3,810	
누계	통화	선물	0	482	-482	장내

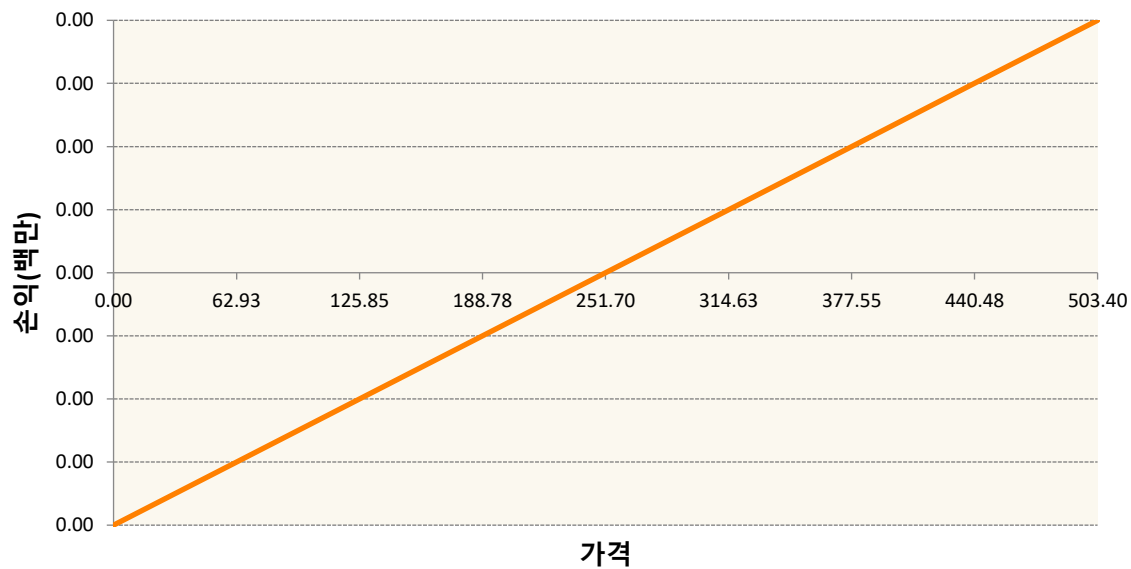
2. 만기시점의 손익구조



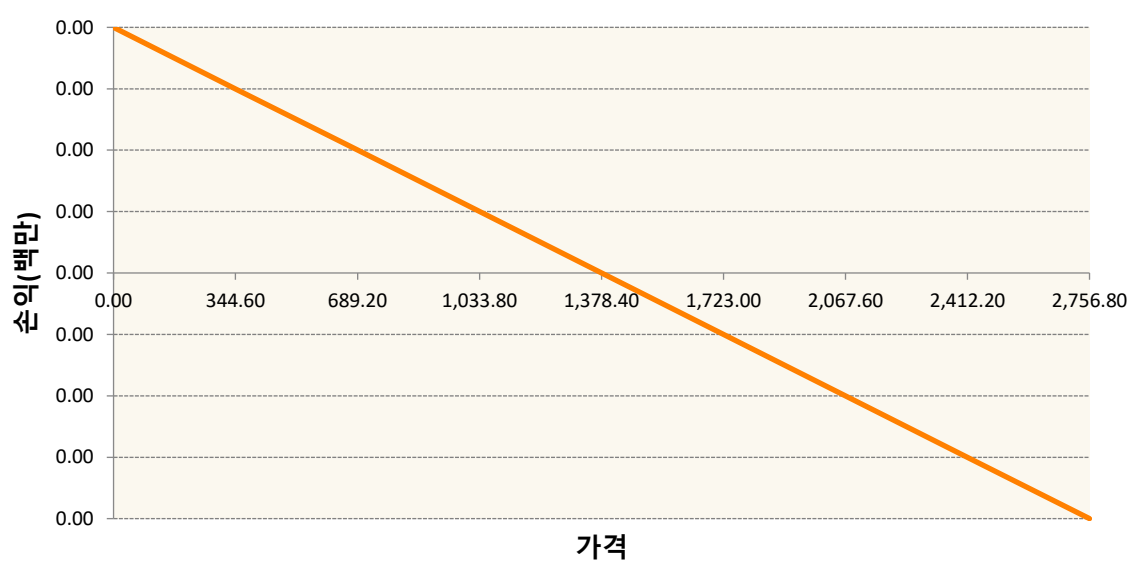
CZ4-CORN FUTURE Dec24



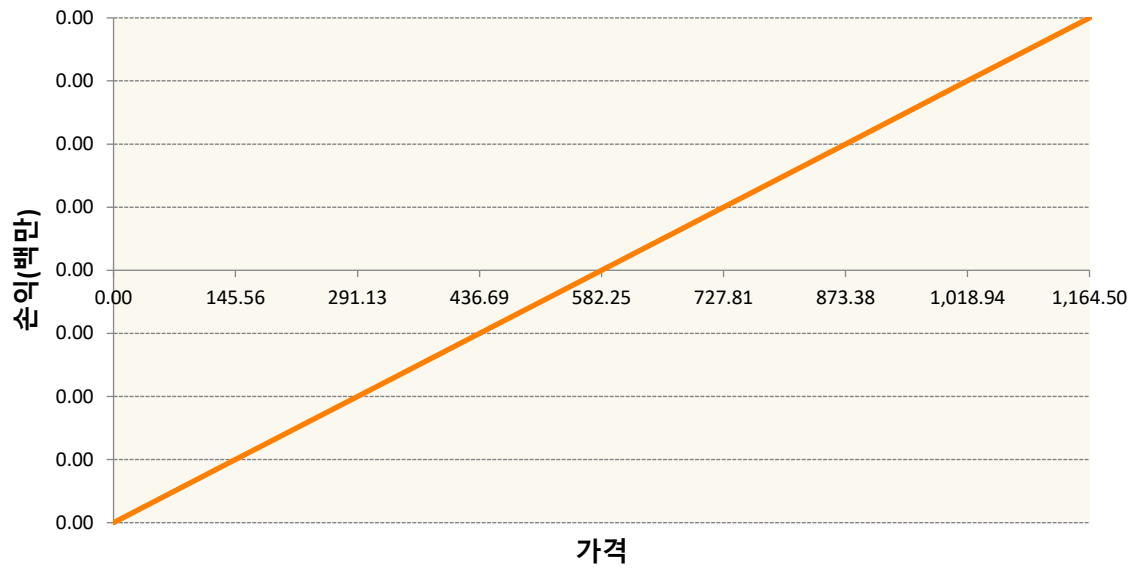
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



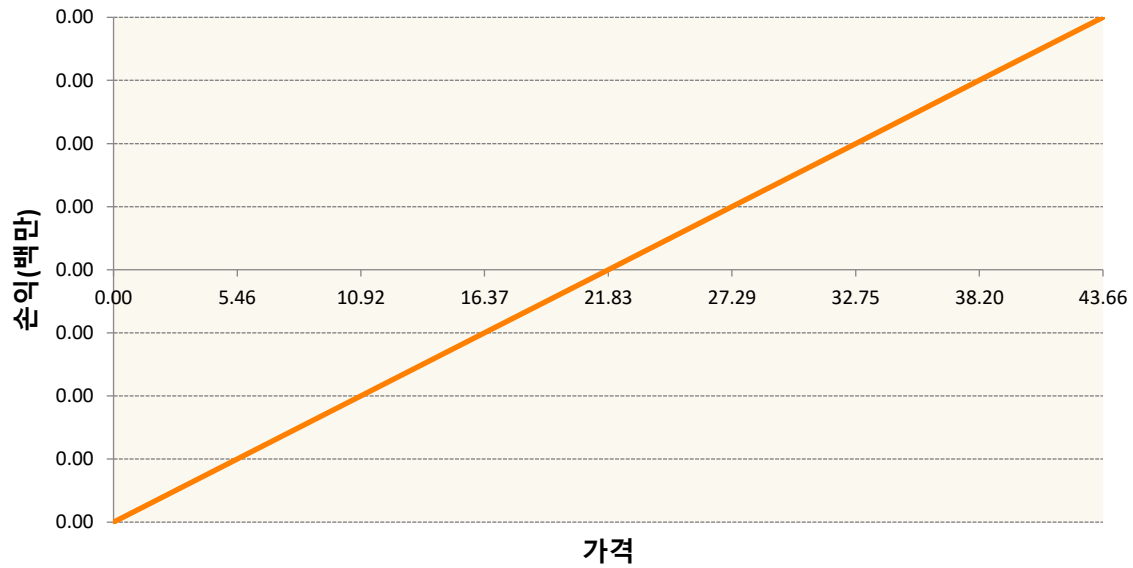
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



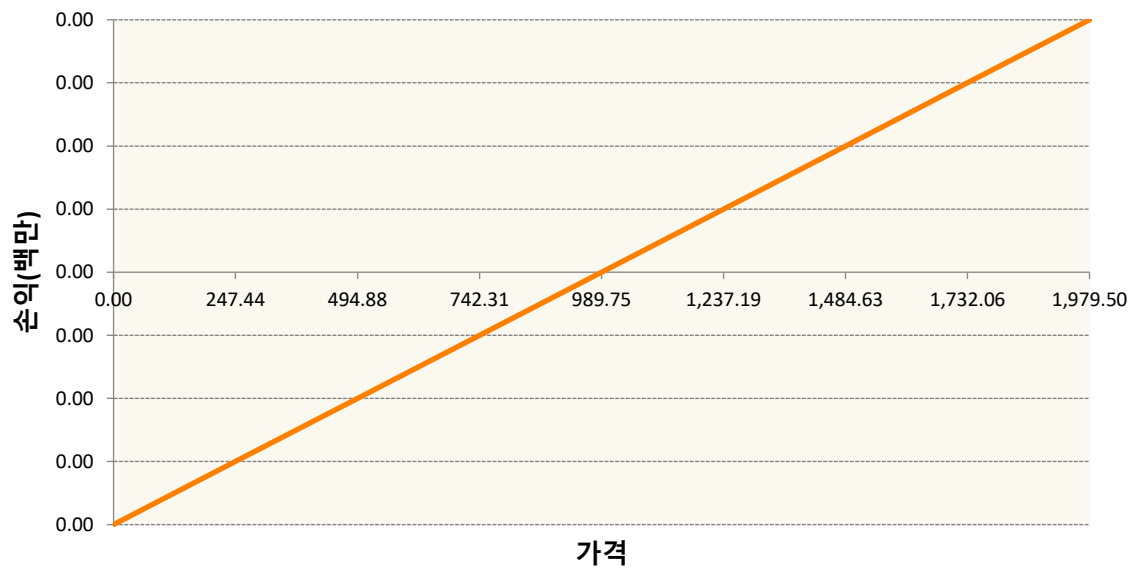
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24



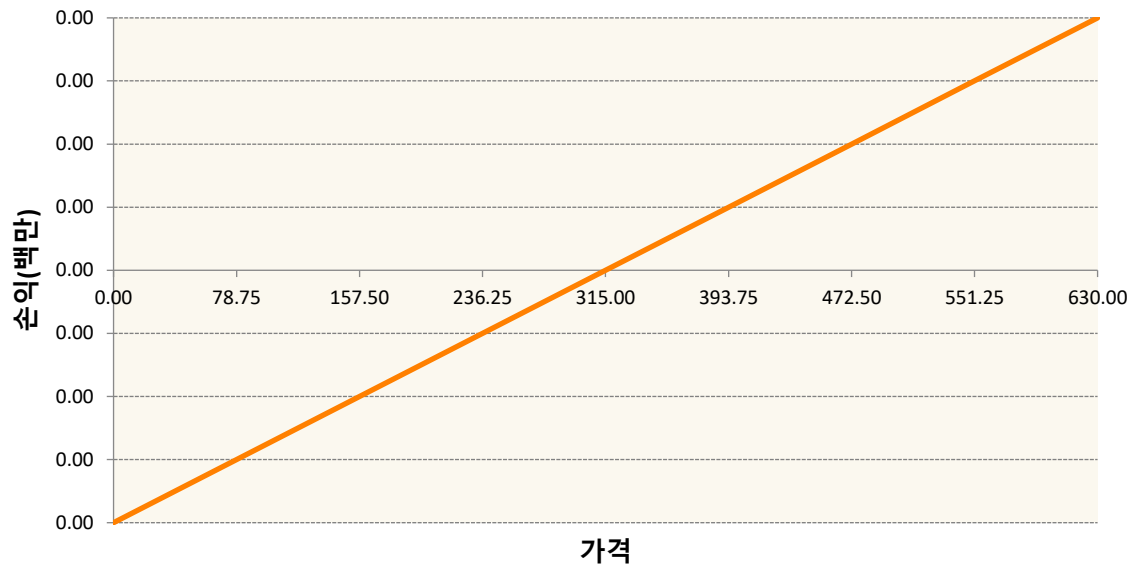
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



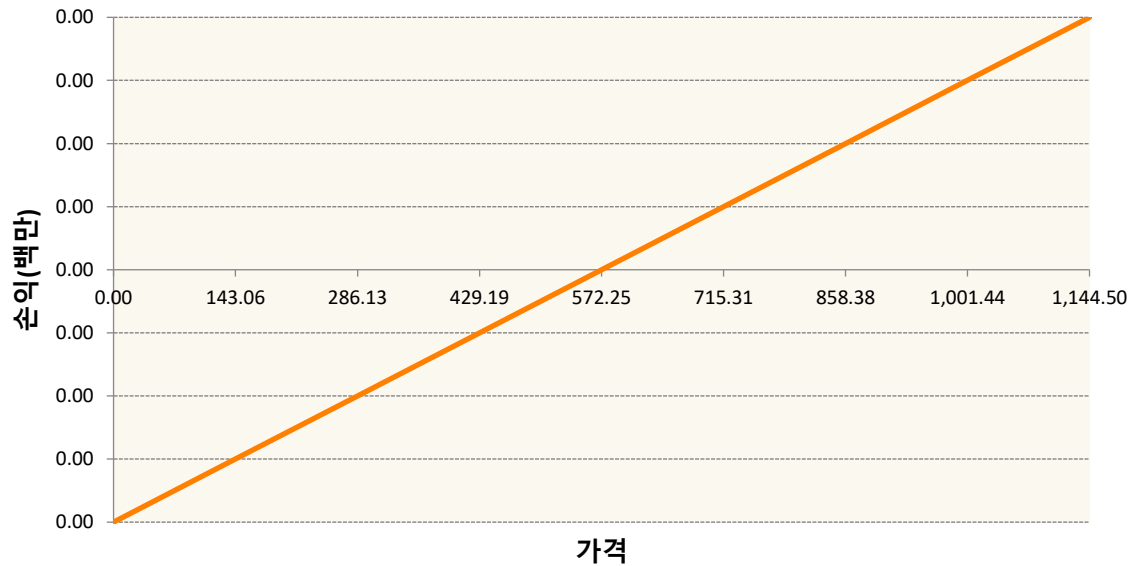
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-10-23
기준일	2024-10-22

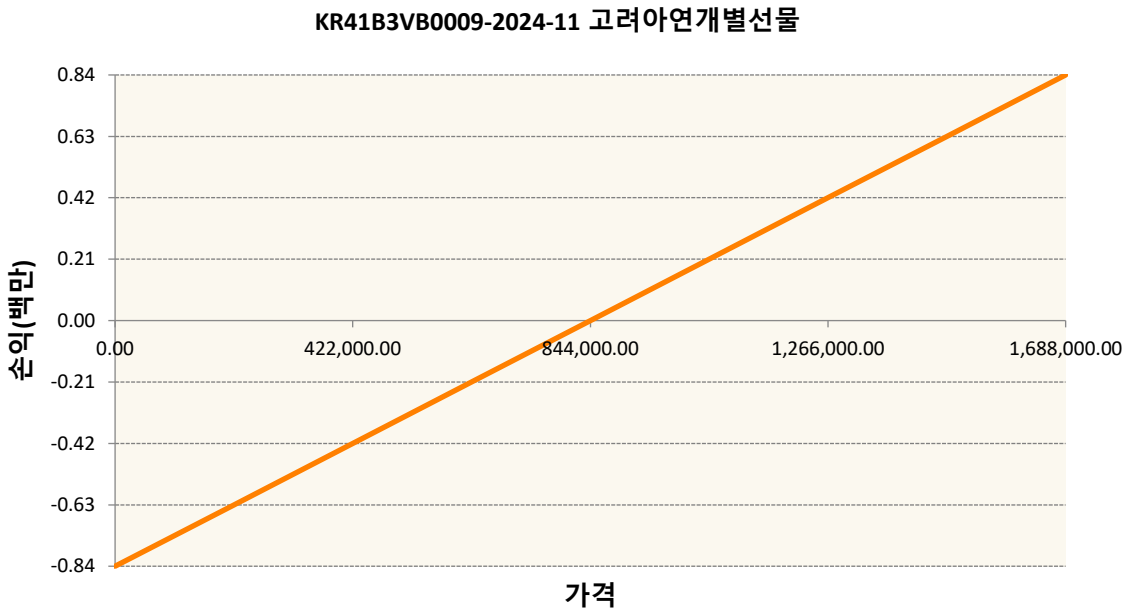
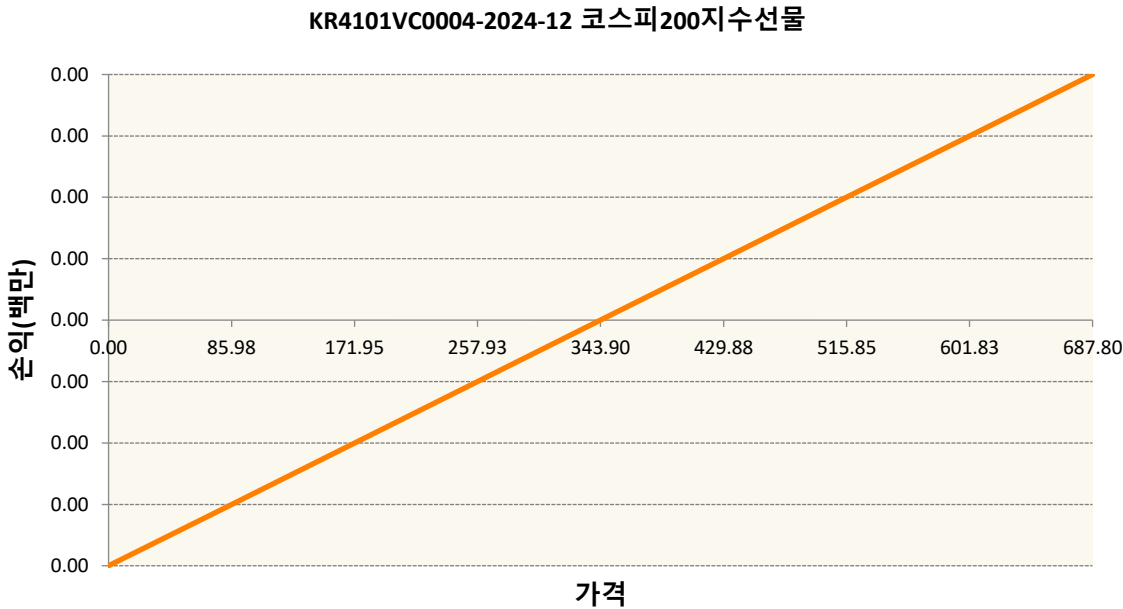
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,439	3,440	0	장내
누계	유가증권	선물	1,769	0	1,769	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					130
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	43	43	43	43	43	43	43
5.33%	87	87	87	87	87	87	87
8.00%	130	130	130	130	130	130	130
KR41B3VB0009		2024-11 고려아연개별선물					11
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

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

165

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

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)

478

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

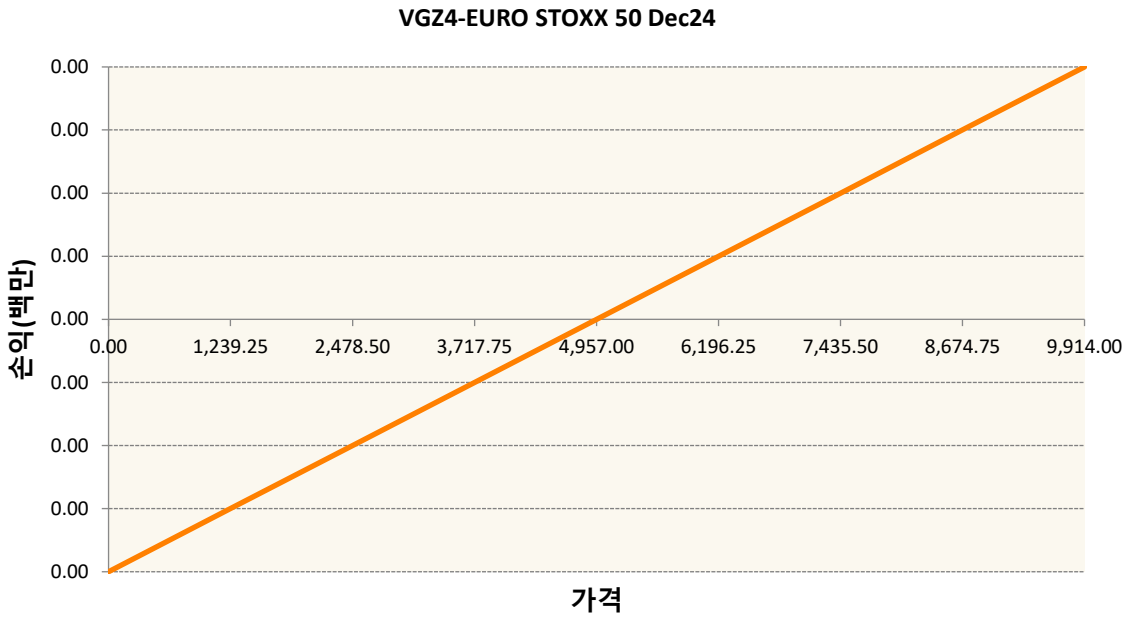
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	957	0	957	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

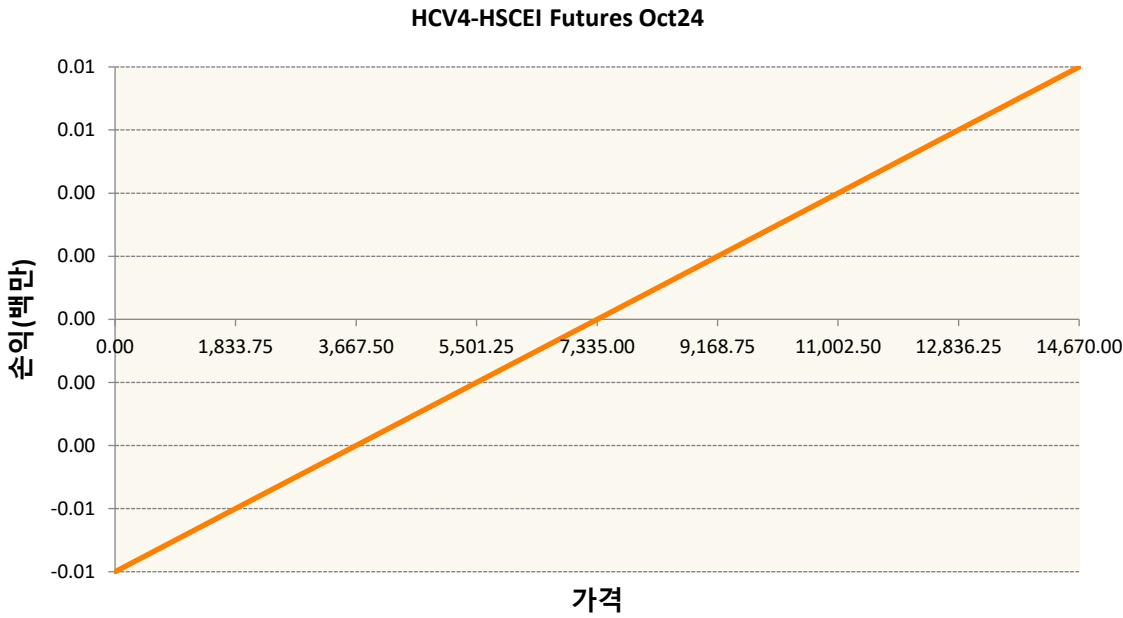
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,380	0	1,380	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV4	HSCEI Futures Oct24	110
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

151

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

커버드콜모(주식혼합-파생형)

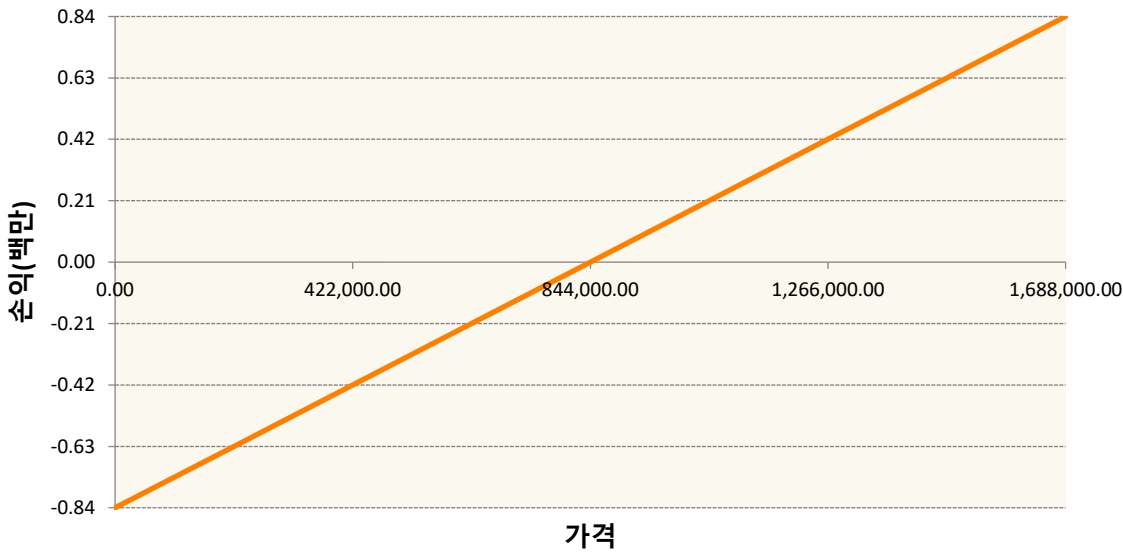
1. 계약금액

(단위:백만원)

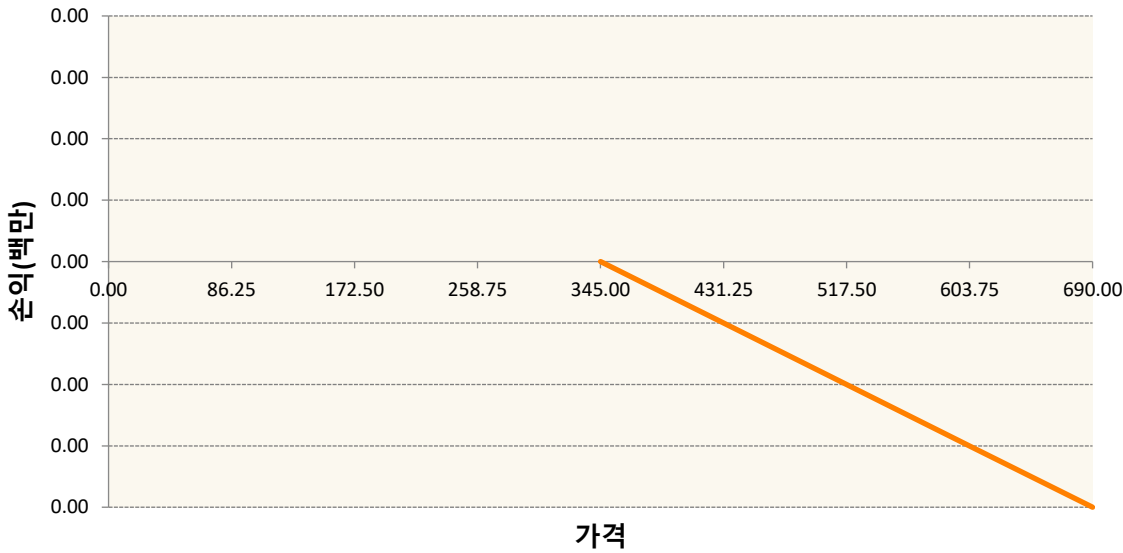
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	211	0	211	장내
누계	유가증권	옵션	0	40,131	-40,131	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR41B3VB0009-2024-11 고려아연개별선물



KR4201VB3453-2024-11 콜345



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 695.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line represents the relationship, starting at a price of 347.50 with a profit/loss of 0.00, and ending at a price of 695.00 with a profit/loss of -0.00.

가격	손익(백만)
347.50	0.00
695.00	-0.00

The graph displays a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 690.00. The y-axis, labeled '순이익 (백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line is plotted, starting at the origin (0, 0) and ending at (345, 0). This indicates that the net income is zero for all prices shown on the x-axis.

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
86.25	0.00
172.50	0.00
258.75	0.00
345.00	0.00
431.25	0.00
517.50	0.00
603.75	0.00
690.00	0.00

(단위:백만원)

KR41B3VB0009		2024-11 고려아연개별선물					17
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	17	17	17	17	17	17	17
KR4201VB3453		2024-11 콜345					1,707
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	622	610	593	573	550	523	493
-5.33%	574	546	513	477	438	396	353
-2.67%	447	398	347	295	242	187	132
0%	185	123	62	0	-62	-123	-185
2.67%	-241	-300	-360	-420	-480	-541	-603
5.33%	-815	-859	-906	-956	-1,007	-1,060	-1,115
8.00%	-1,494	-1,520	-1,550	-1,585	-1,623	-1,664	-1,707
KR4201VB3479 2024-11 콜347.5							188

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	61	60	58	55	53	49
-5.33%	58	55	52	48	44	40	35
-2.67%	46	41	36	30	25	19	12
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-23	-30	-37	-45	-52	-59	-66
5.33%	-85	-91	-97	-103	-109	-116	-122
8.00%	-160	-164	-168	-173	-178	-183	-188

KR4301VB3452 2024-11 풋345							485
--	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-465	-466	-469	-472	-475	-480	-485
-5.33%	-272	-276	-282	-289	-296	-304	-313
-2.67%	-97	-107	-117	-128	-139	-151	-163
0%	41	27	14	0	-14	-27	-41
2.67%	129	117	104	90	77	64	50
5.33%	174	166	156	146	136	125	113
8.00%	191	187	182	176	169	161	153

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

(단위:백만원)

2,315

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	298	-298	
누계	유가증권	수익증권	669	0	669	

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	2024-10-23
기준일	2024-10-22

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	4,473	0	4,473	

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	2024-10-23
기준일	2024-10-22

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	14,604	0	14,604	
누계	통화	선도	0	14,698	-14,698	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E7W KRW/USD 31-10-24E	226
FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E	580
FXW213E9L0 KRW/USD 31-10-24E	22
FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E	348
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

540

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

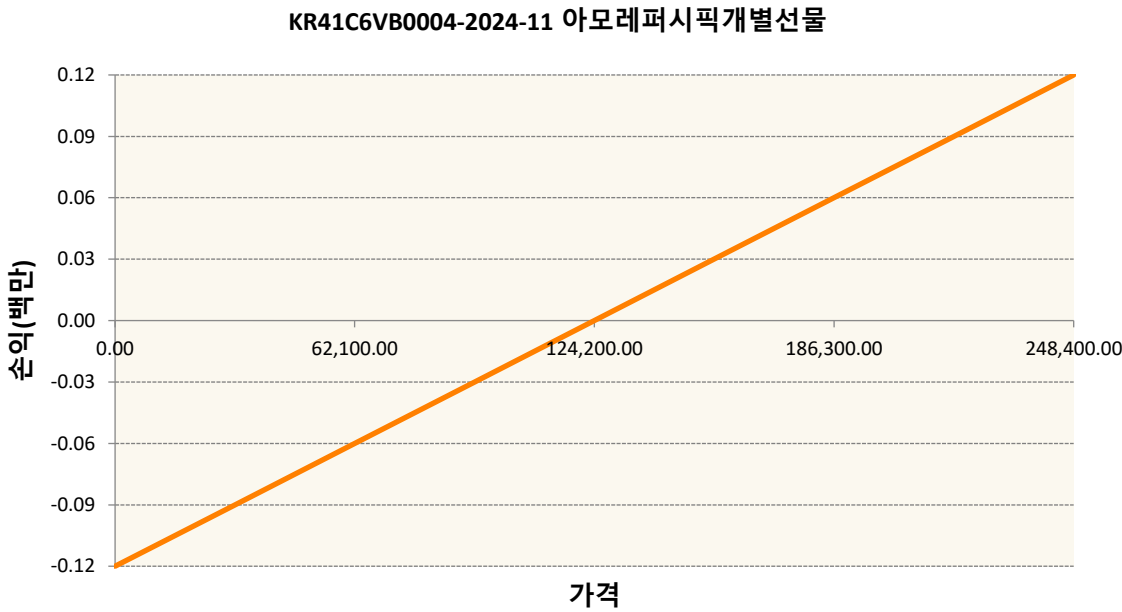
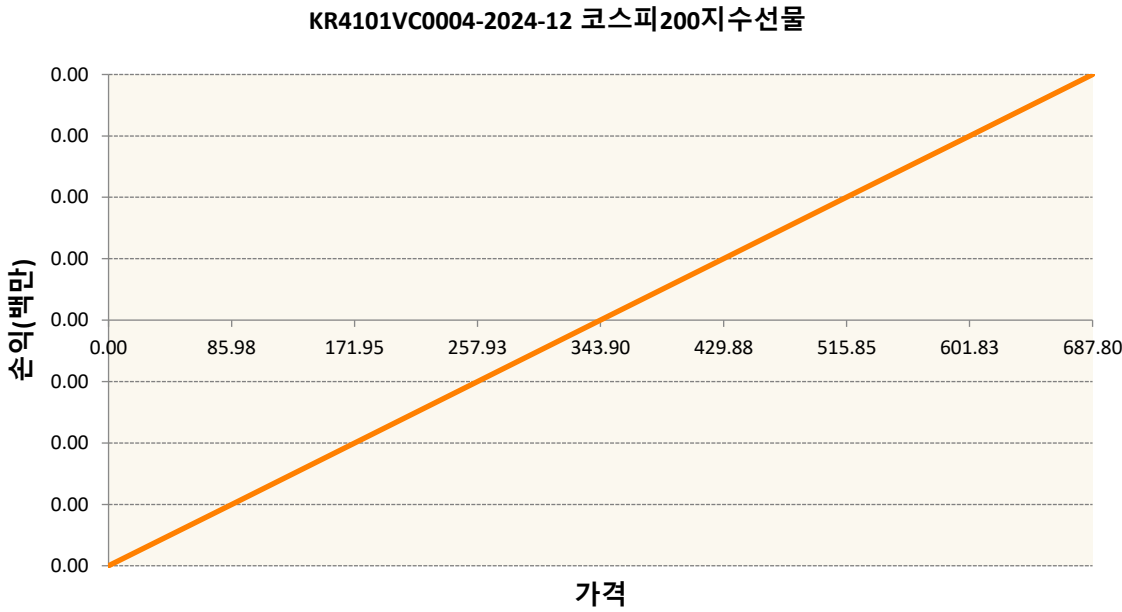
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

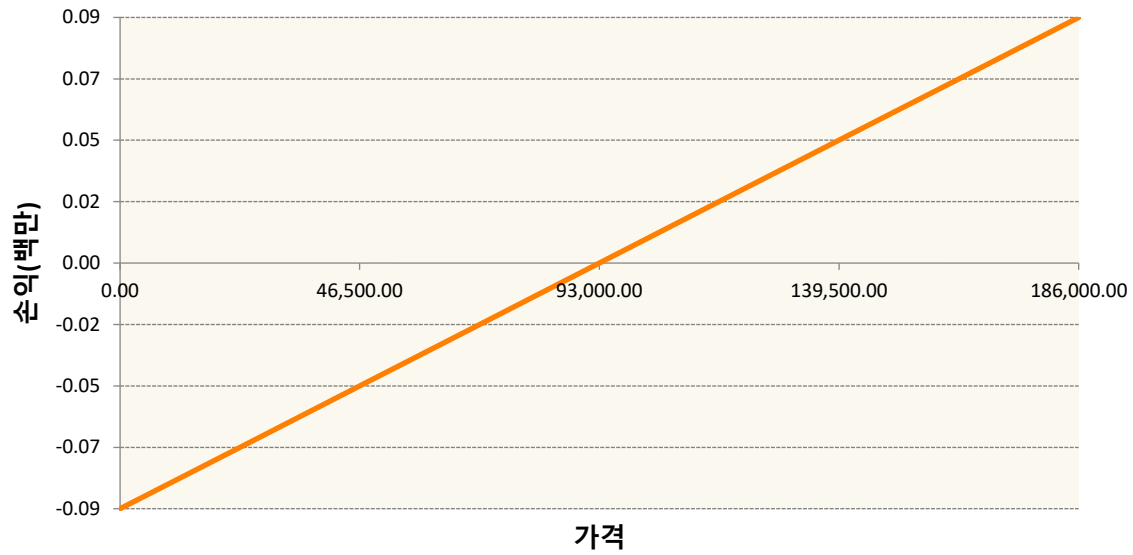
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	838	0	838	장내

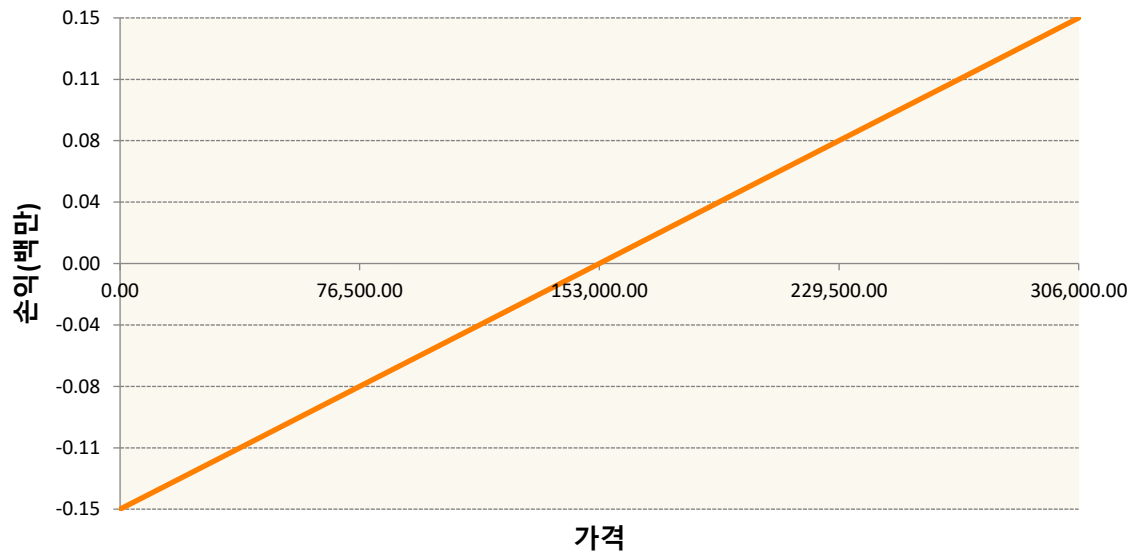
2. 만기시점의 손익구조



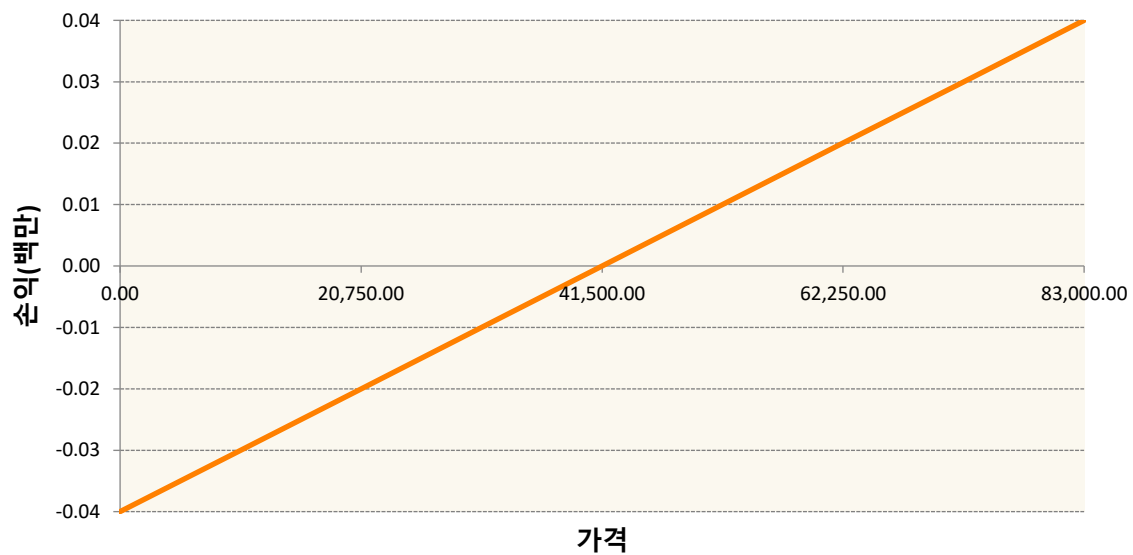
KR41FMVB0003-2024-11 엘앤에프개별선물



KR41GLVB0003-2024-11 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNVB0001-2024-11 금양개별선물



(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
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
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
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
KR41GNVB0001			2024-11 금양개별선물				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)

78

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

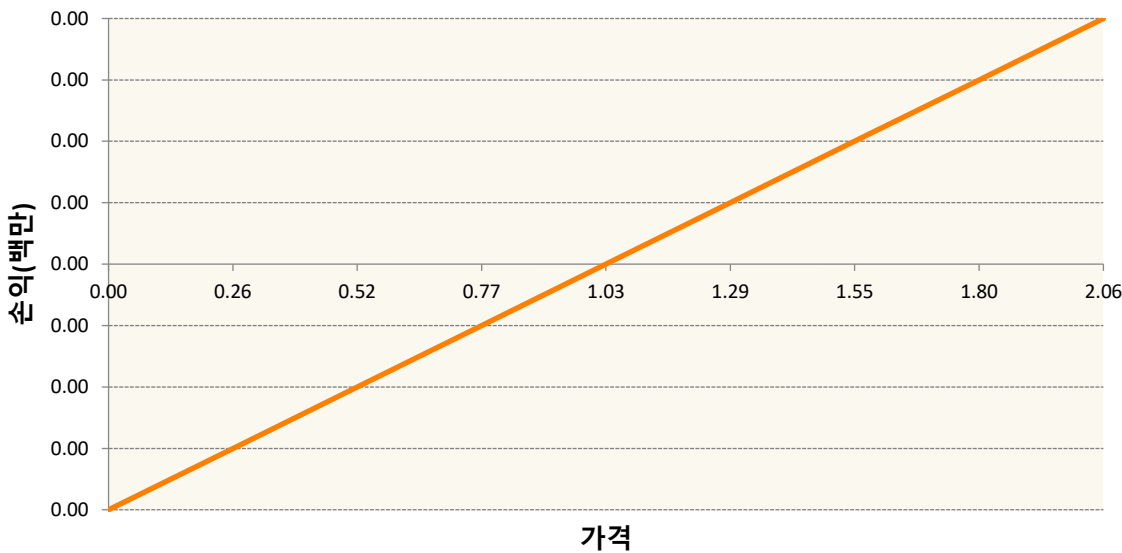
1. 계약금액

(단위:백만원)

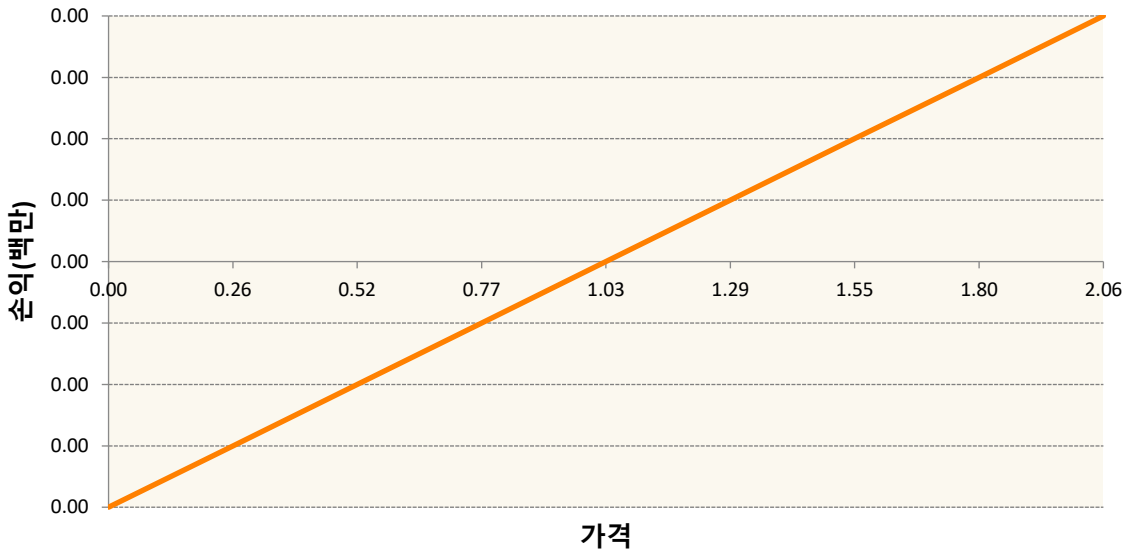
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,641	0	11,641	

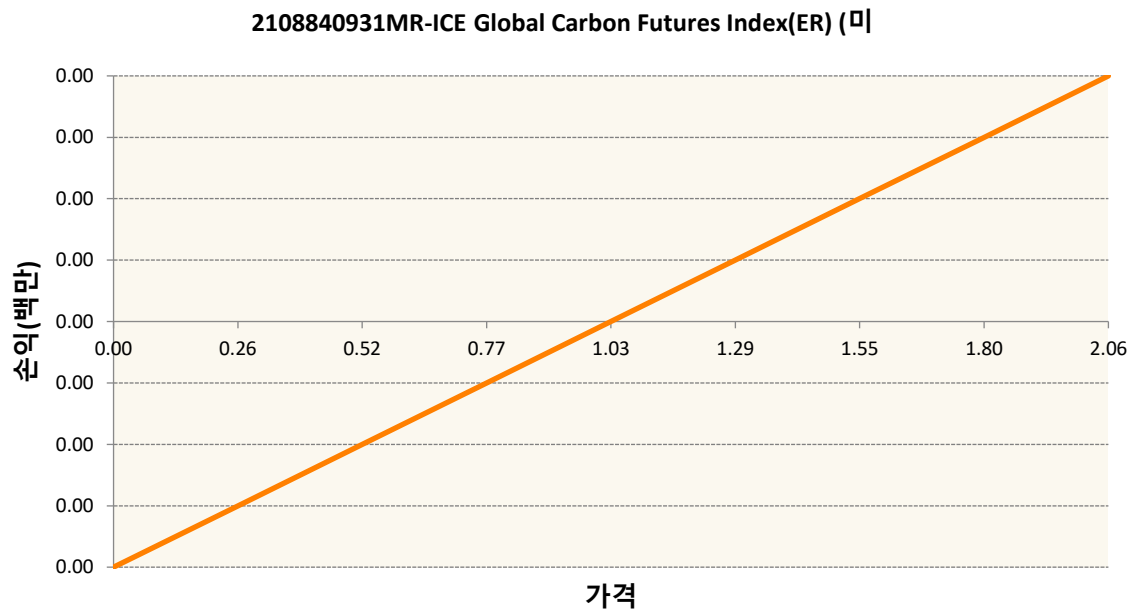
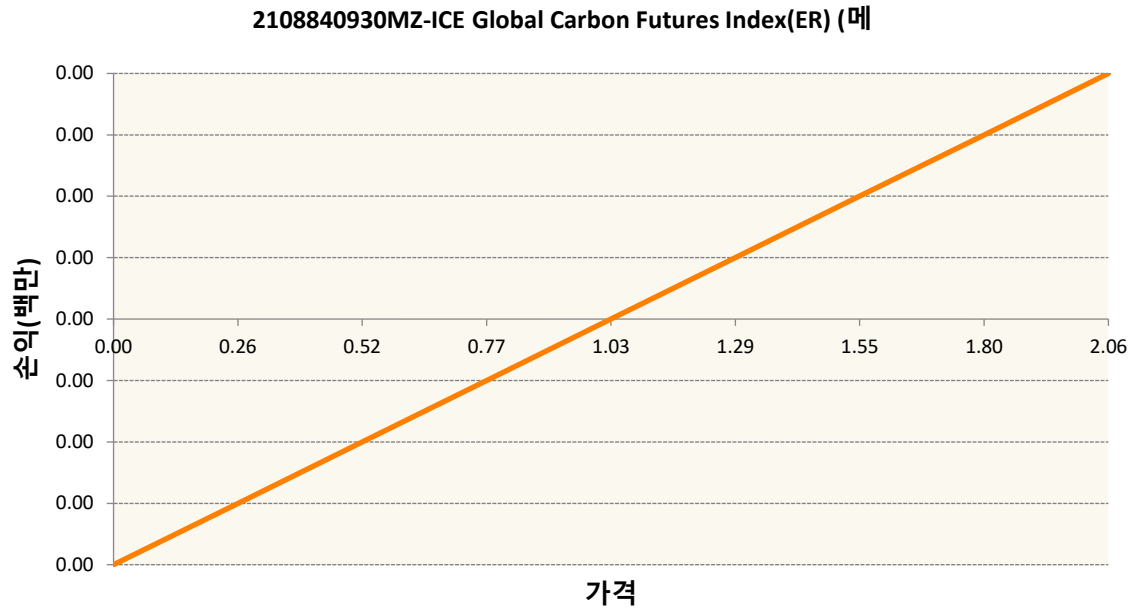
2. 만기시점의 손익구조

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		92
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		465
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		186
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		186

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,004

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

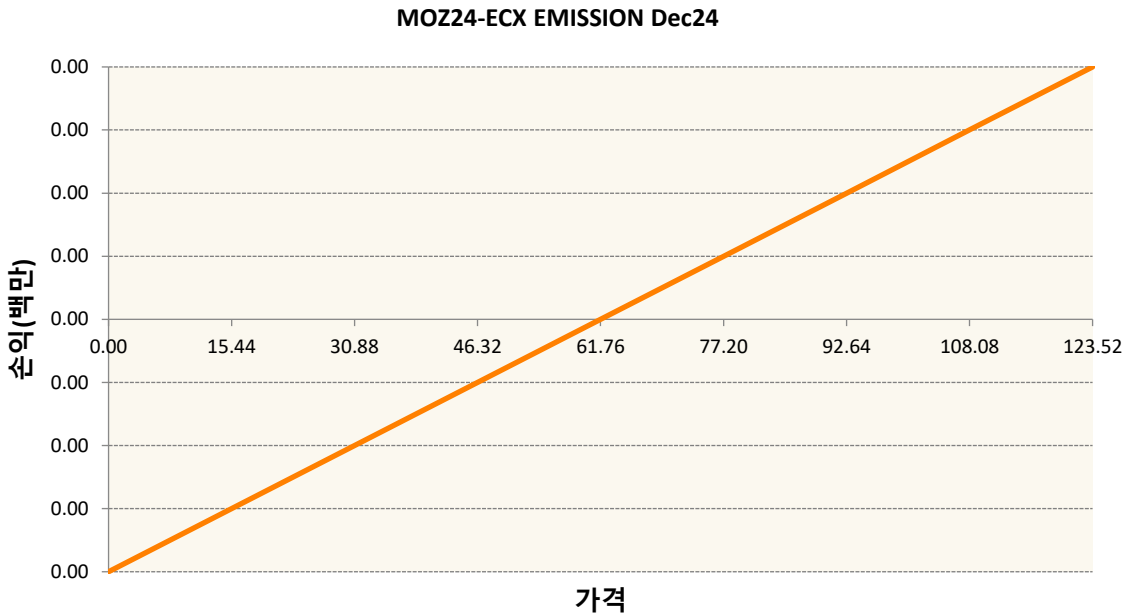
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,365	0	7,365	
누계	통화	선도	0	1,627	-1,627	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	2
FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E	130
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	591

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

(단위:백만원)

1,068

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

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)	22
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	22

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

(단위:백만원)

126

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

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)	62
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	53
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	75
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	16

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

(단위:백만원)

329

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

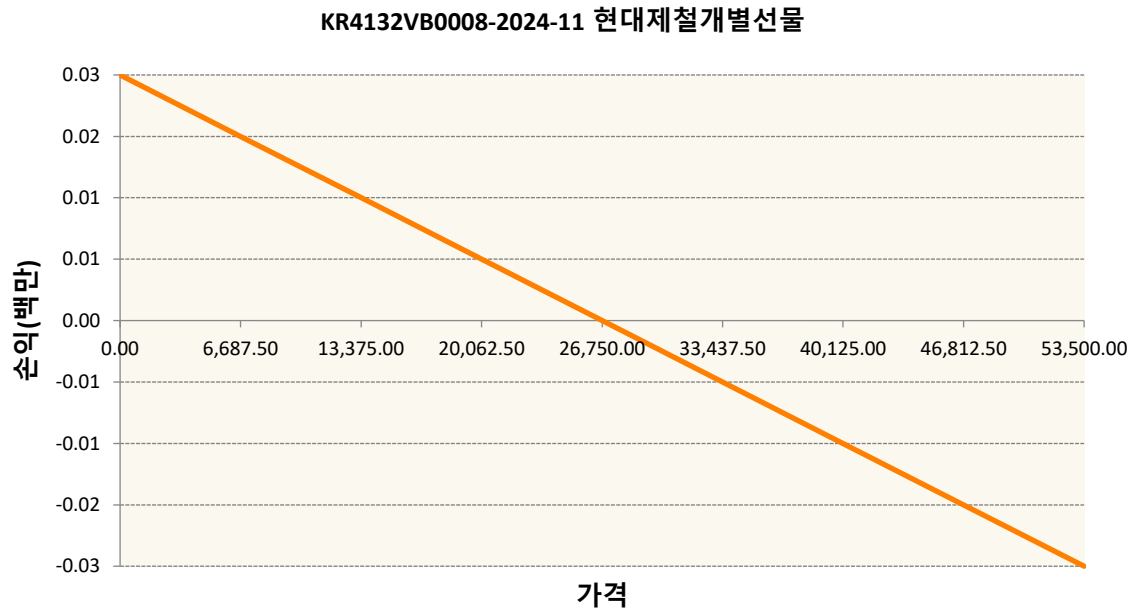
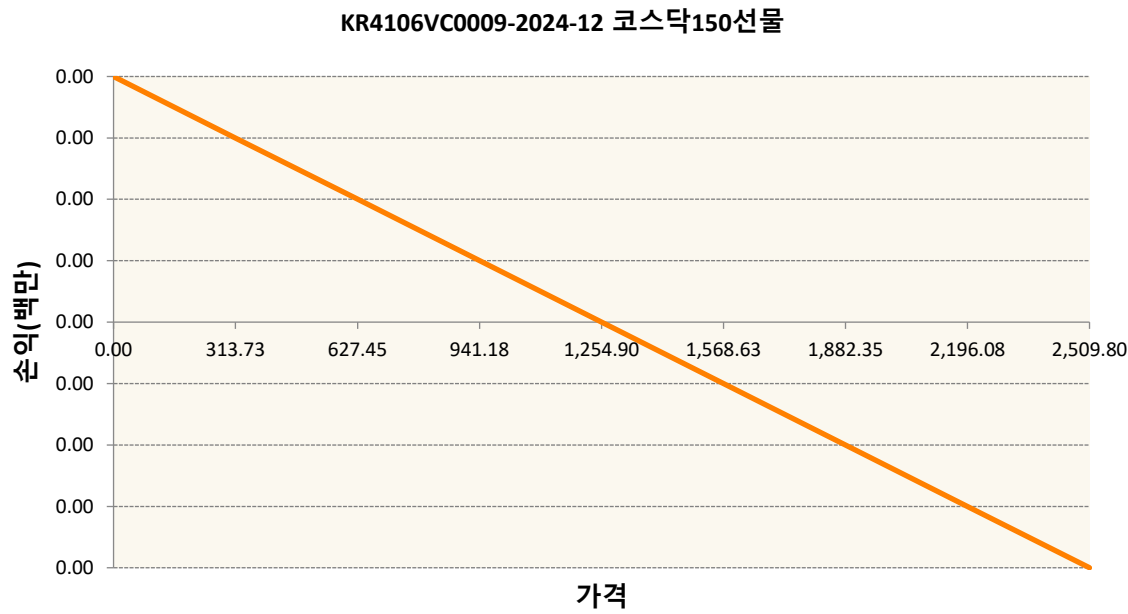
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

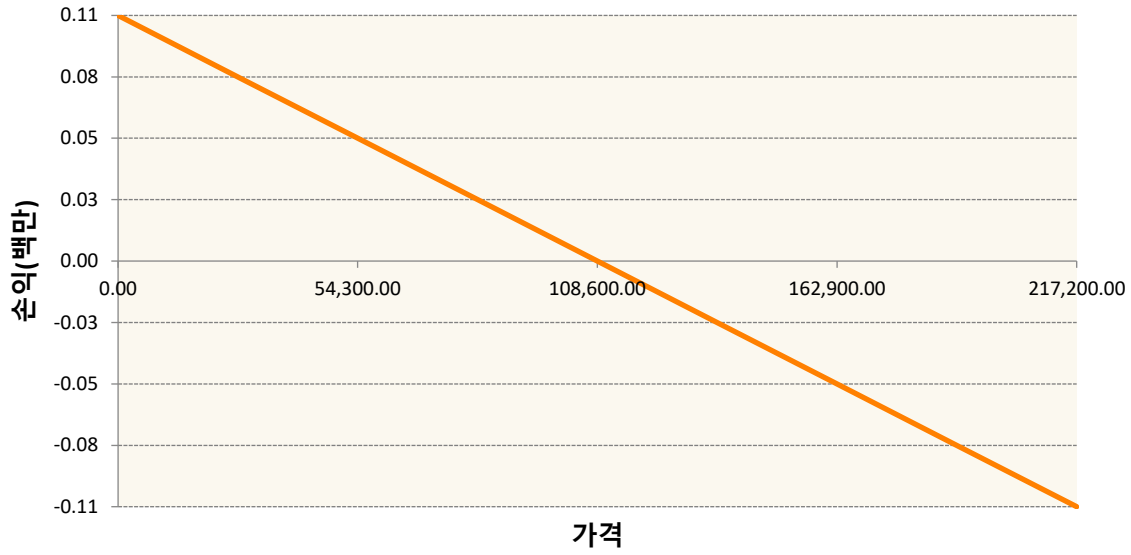
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7	6	1	장내
누계	유가증권	선물	18	68	-50	장내

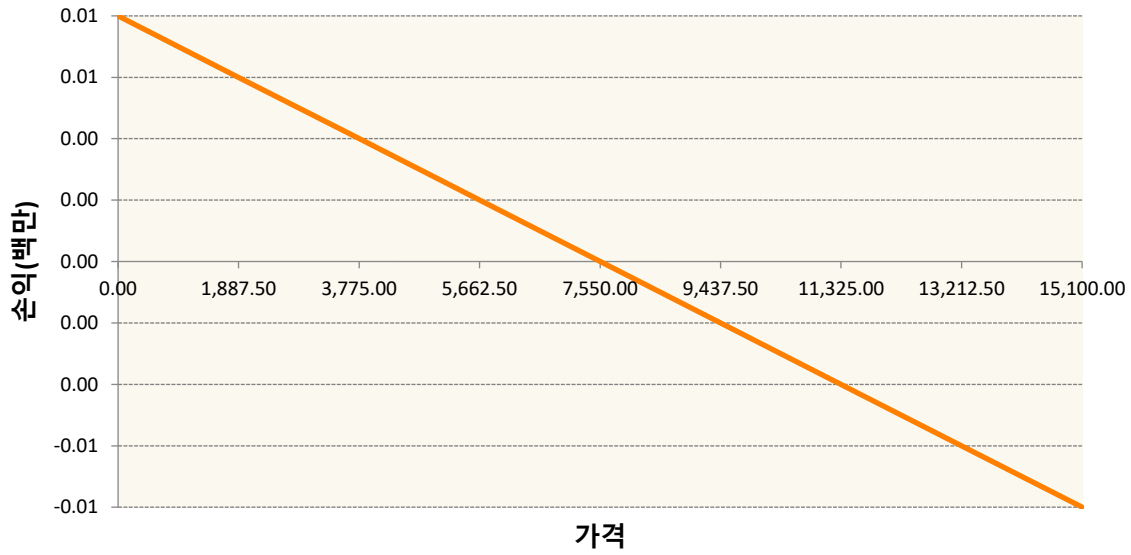
2. 만기시점의 손익구조



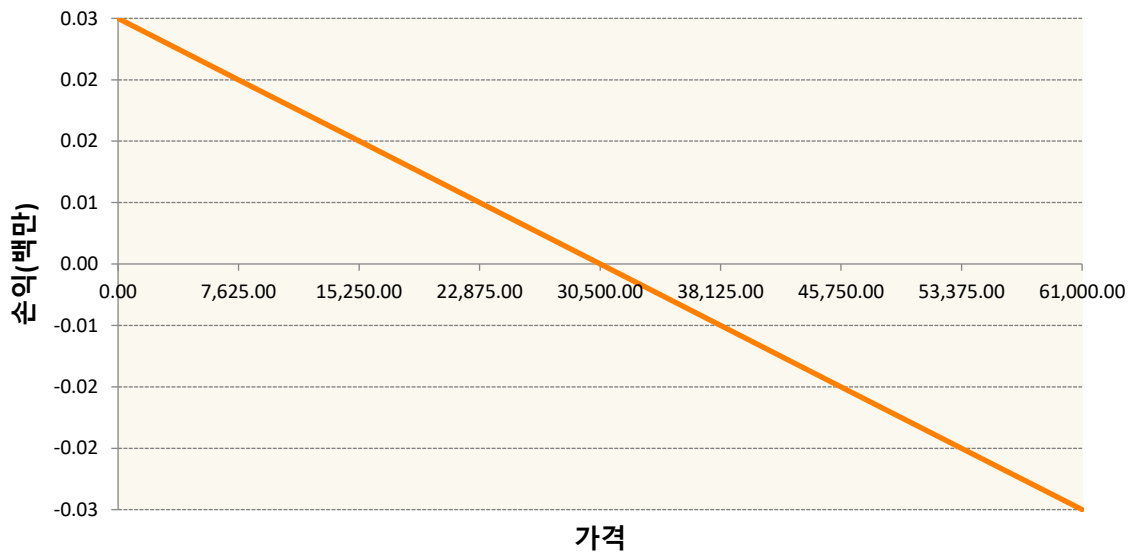
KR4136VB0004-2024-11 KT&G개별선물



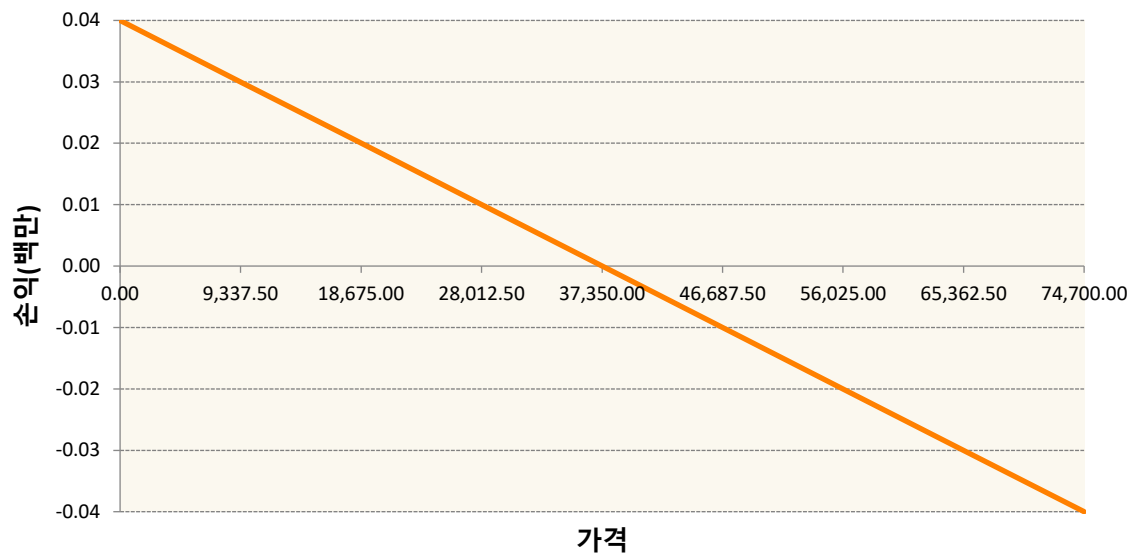
KR4149VB0009-2024-11 HD현대인프라코어개별선물



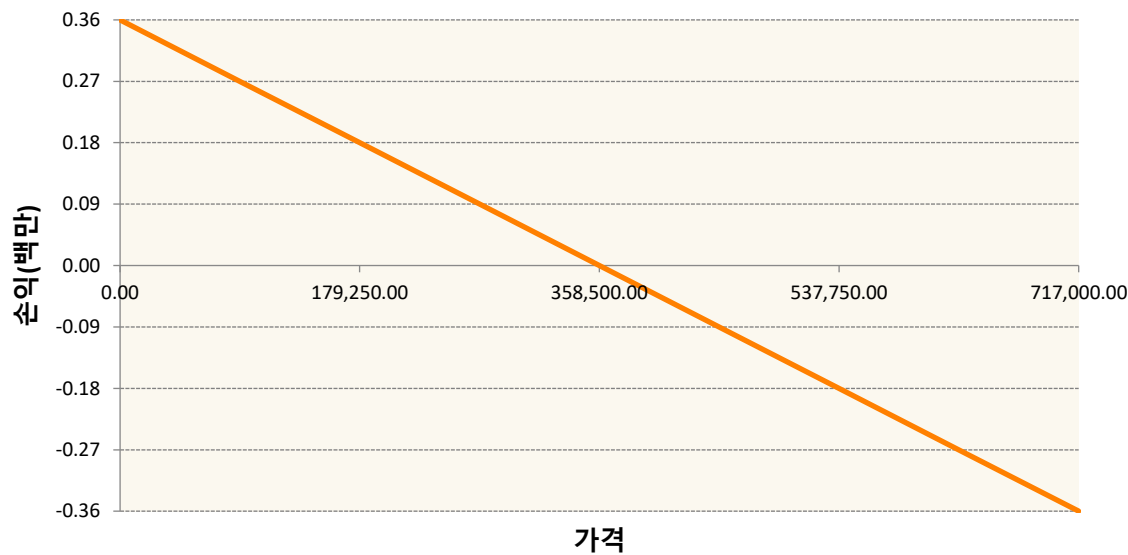
KR41CEVB0006-2024-11 현대해상개별선물



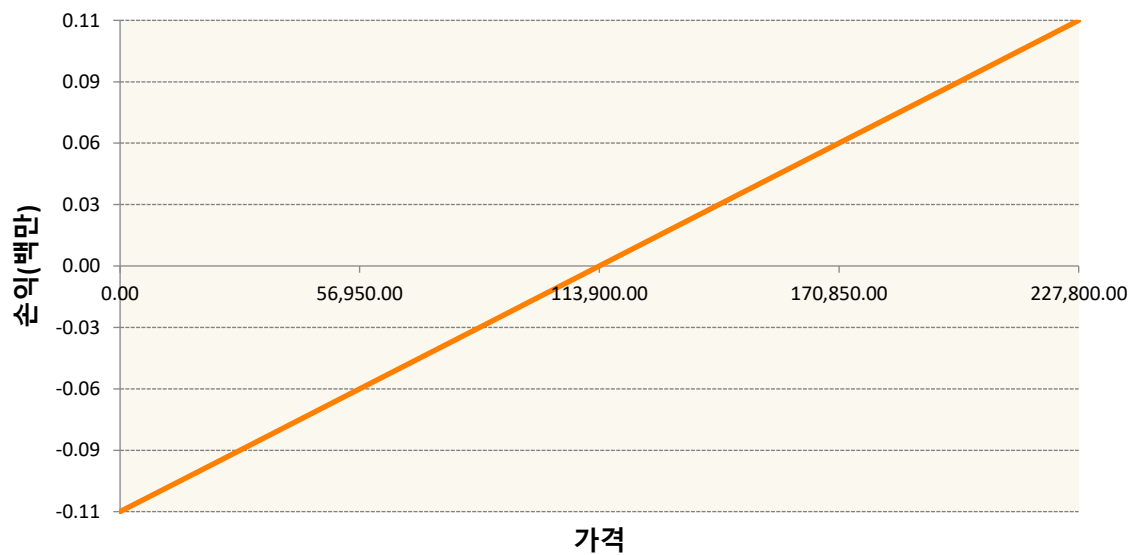
KR41CFVB0005-2024-11 카카오개별선물



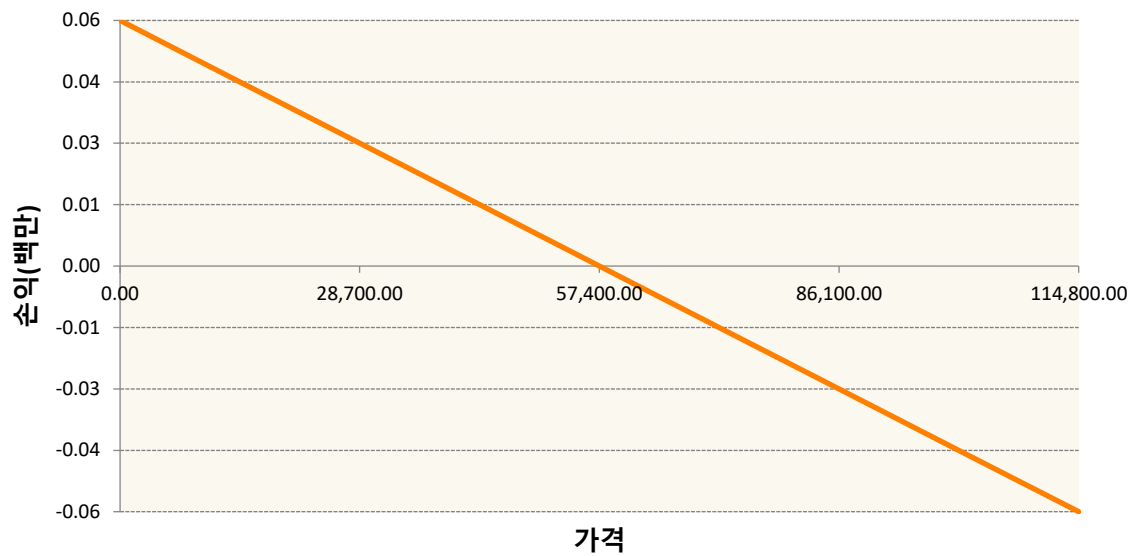
KR41CTVB0009-2024-11 삼성화재개별선물



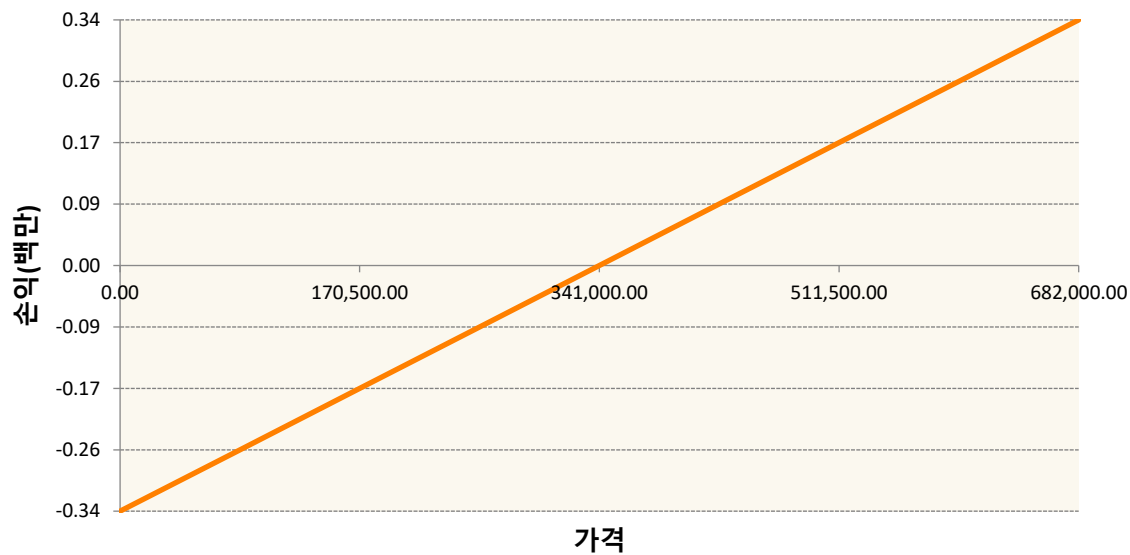
KR41D0VB0008-2024-11 DB손해보험개별선물



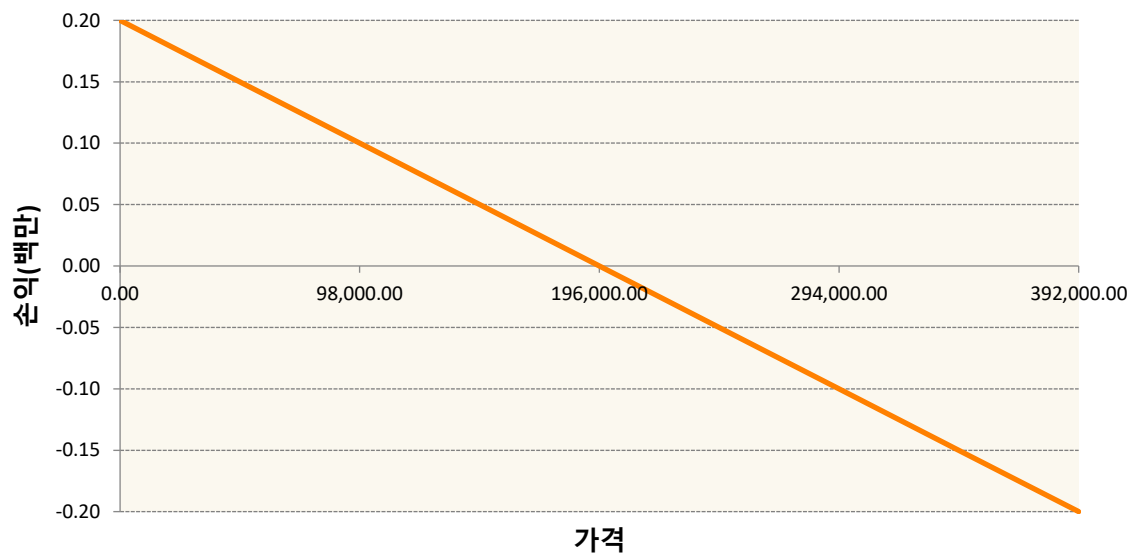
KR41E5VB0001-2024-11 넷마블개별선물



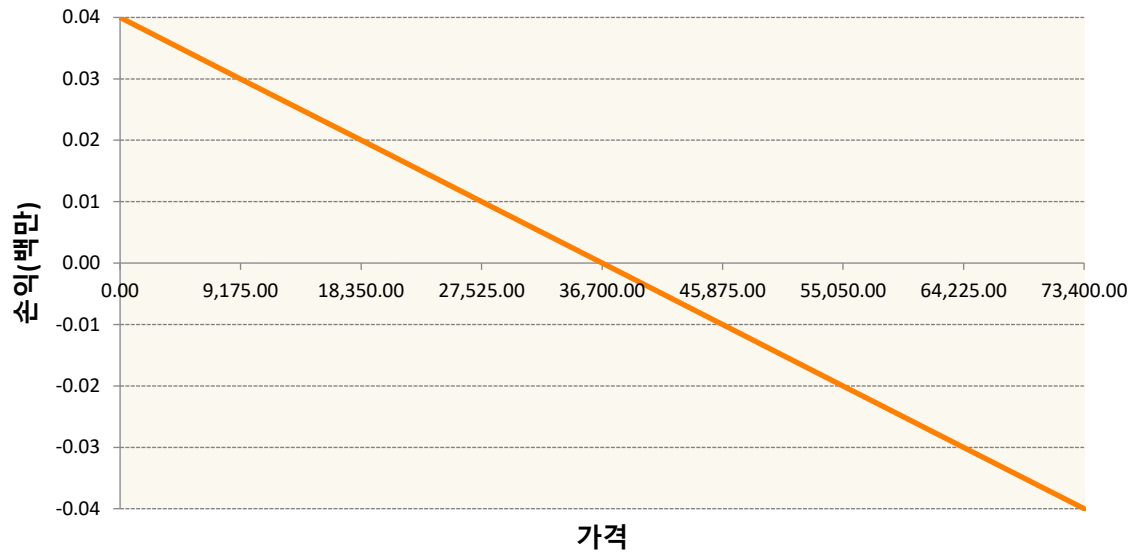
KR41F8VB0005-2024-11 크래프톤개별선물



KR41FCVB0005-2024-11 하이브개별선물



KR41FLVB0004-2024-11 펠어비스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4106VC00 2024-12 코스닥150선물	1
KR4132VB00 2024-11 현대제철개별선물	1
KR4136VB00 2024-11 KT&G개별선물	0.26
KR4149VB00 2024-11 HD현대인프라코어개별선물	1
KR41CEVB00 2024-11 현대해상개별선물	0.02
KR41CFVB00 2024-11 카카오개별선물	1
KR41CTVB00 2024-11 삼성화재개별선물	1
KR41D0VB00 2024-11 DB손해보험개별선물	1
KR41E5VB00 2024-11 넷마블개별선물	0.32
KR41F8VB00 2024-11 크래프톤개별선물	1
KR41FCVB00 2024-11 하이브개별선물	0.16
KR41FLVB00 2024-11 펠어비스개별선물	0.29

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

(단위:백만원)

15

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

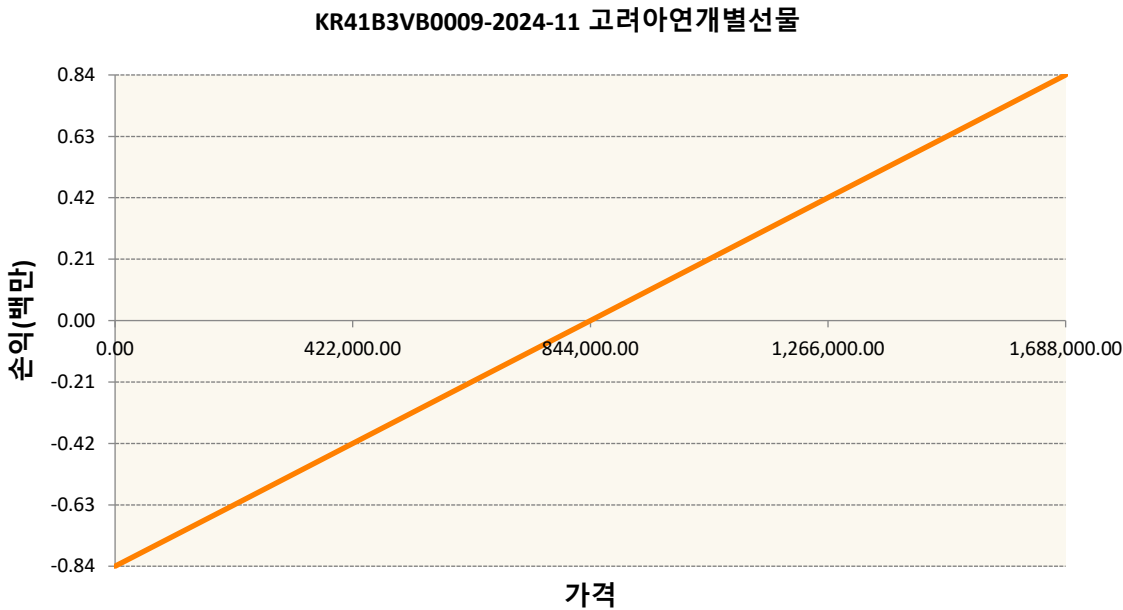
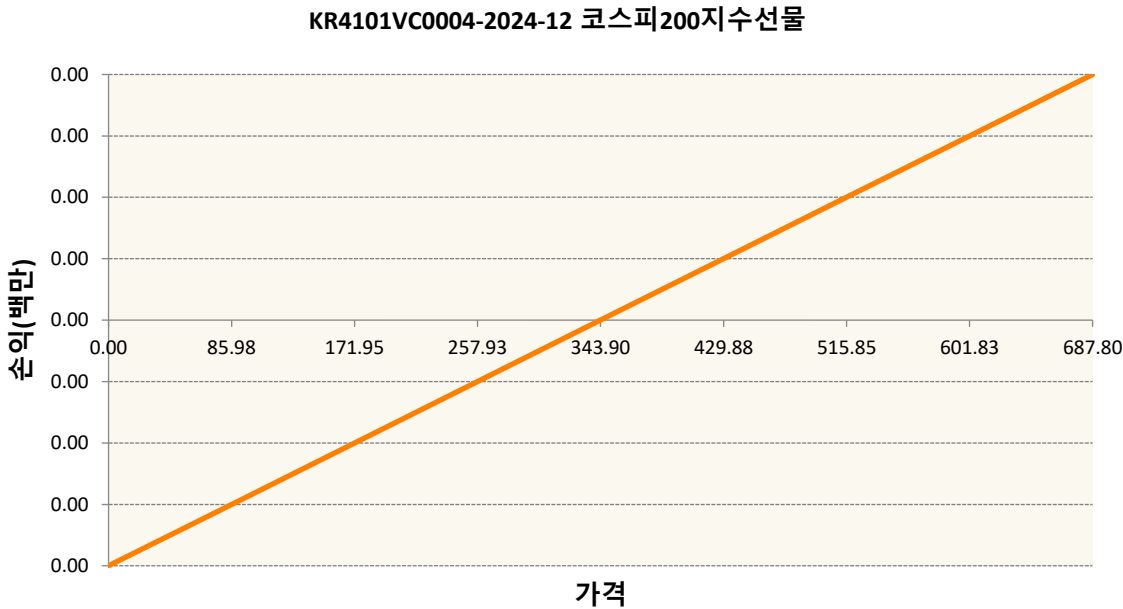
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	8,902	0	8,902	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					650
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-650	-650	-650	-650	-650	-650	-650
-5.33%	-433	-433	-433	-433	-433	-433	-433
-2.67%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-217
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	217	217	217	217	217	217	217
5.33%	433	433	433	433	433	433	433
8.00%	650	650	650	650	650	650	650

KR41B3VB0009		2024-11 고려아연개별선물					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

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

830

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

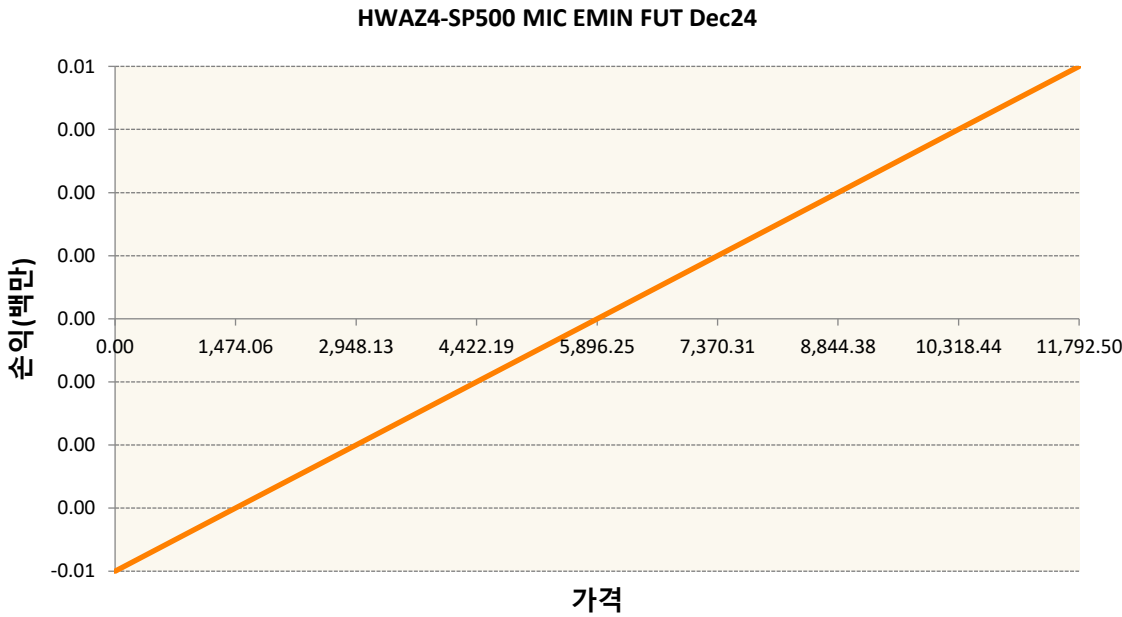
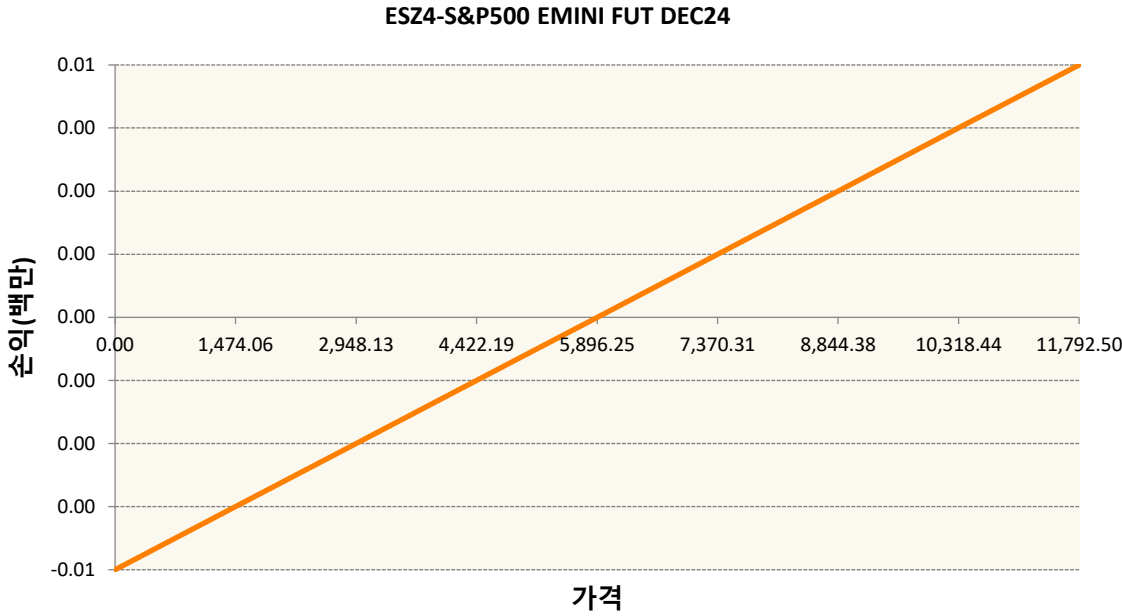
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	12,602	0	12,602	
누계	유가증권	선물	1,608	0	1,608	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,008
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	129

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	690

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

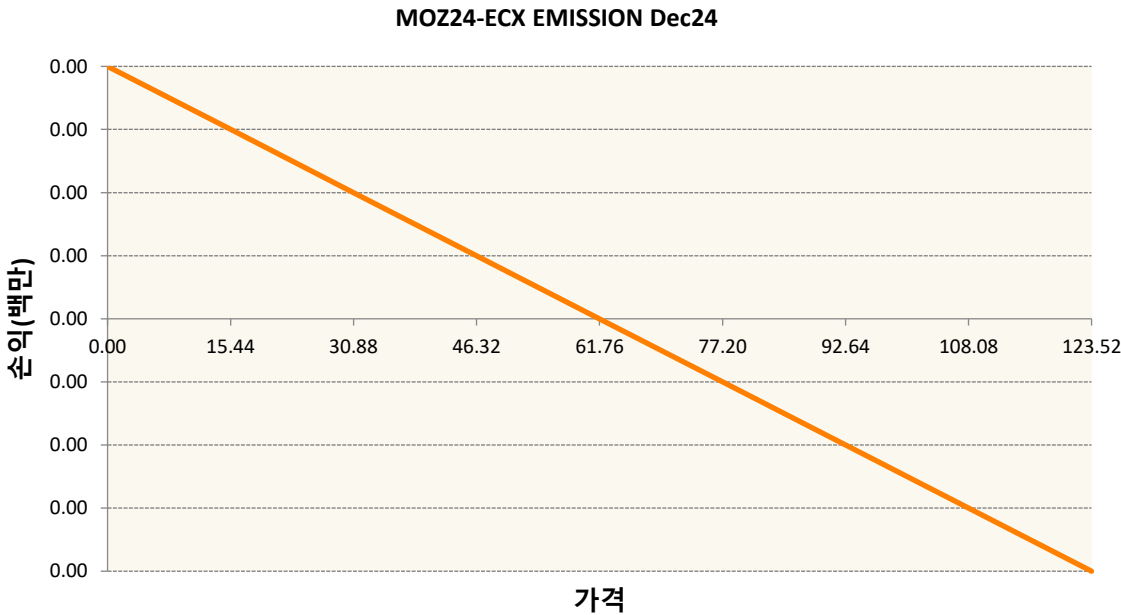
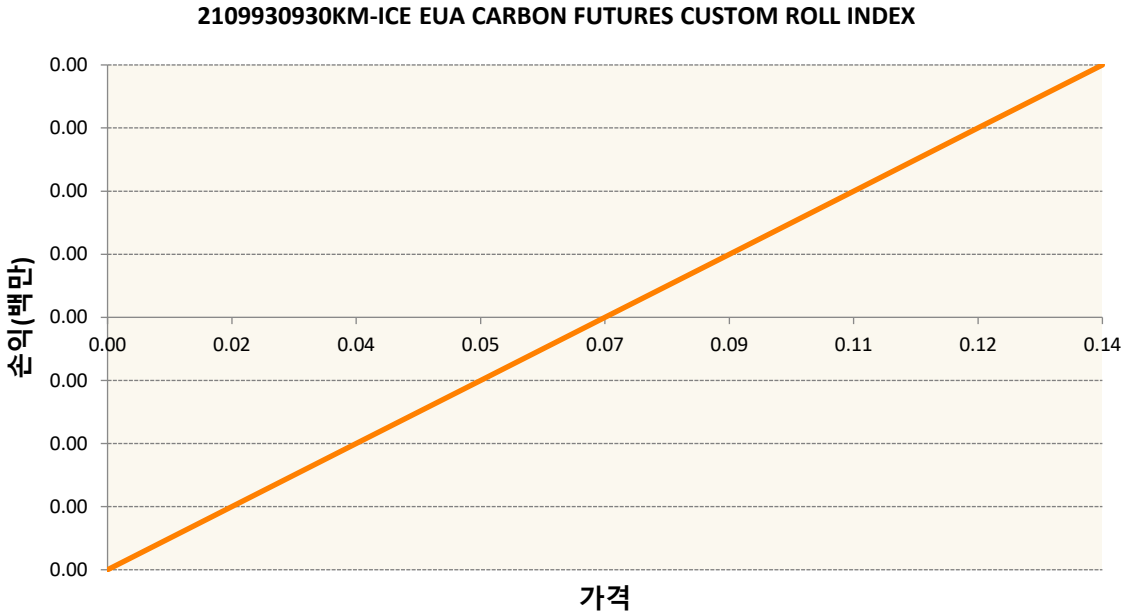
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	25	7,250	-7,224	
누계	통화	선도	0	1,564	-1,564	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		2
FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E		37
FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E		88
MOZ24 ECX EMISSION Dec24		580

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,046

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

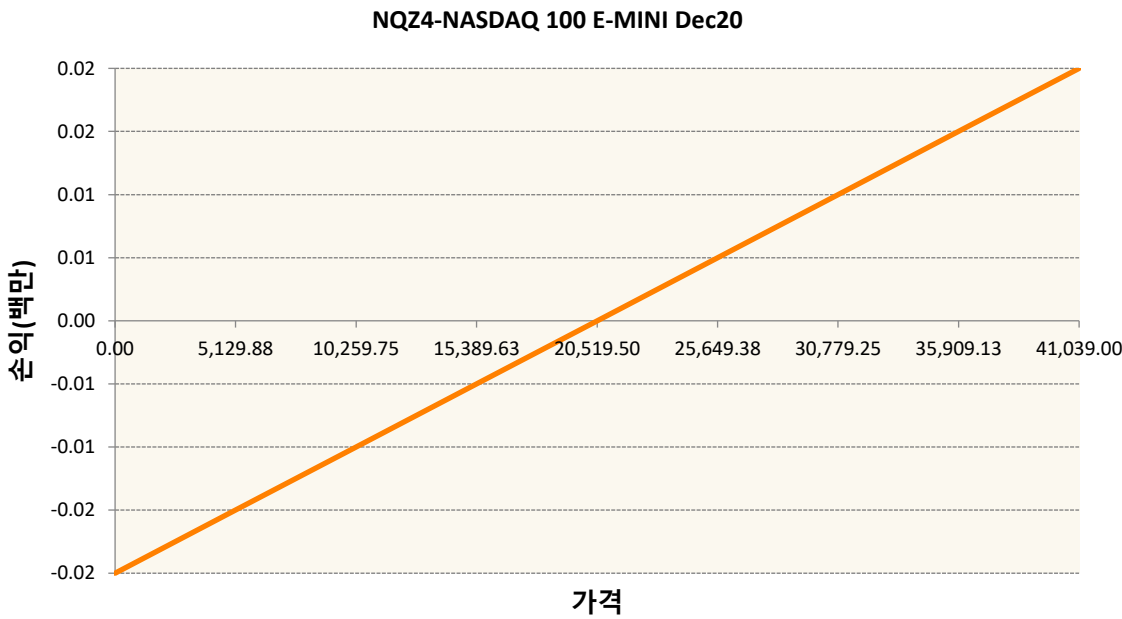
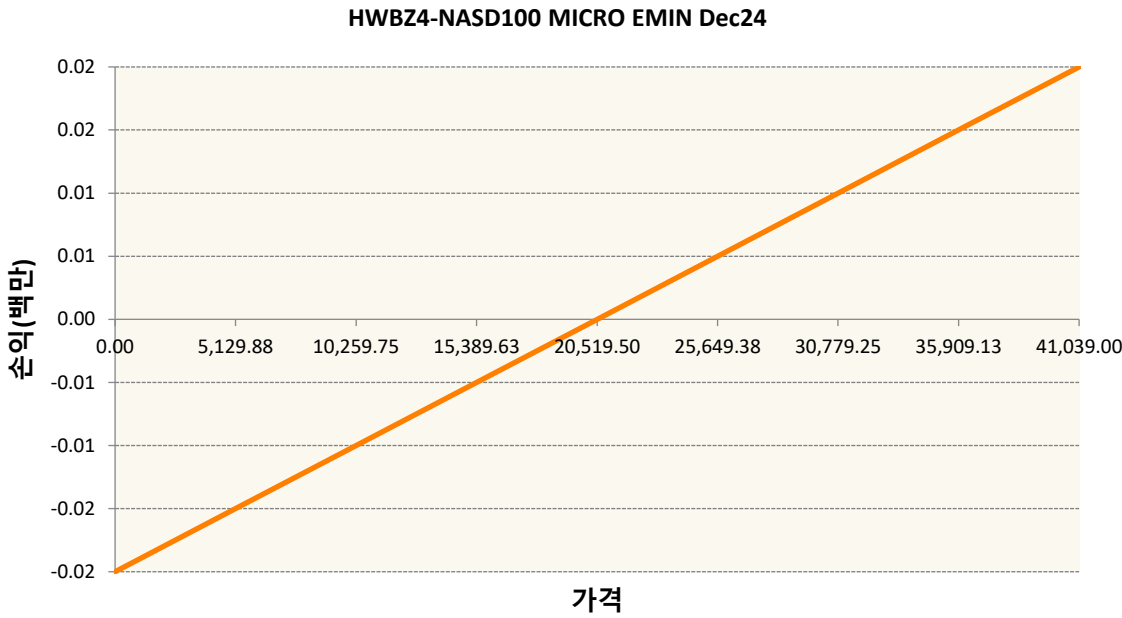
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	6,554	0	6,554	
누계	유가증권	선물	929	0	929	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		74
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		524

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			496

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

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	195,429	0	195,429	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,438
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,808
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	695
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	235
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,271

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

(단위:백만원)

9,080

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

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

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

(단위:백만원)

43

공시일	2024-10-23
기준일	2024-10-22

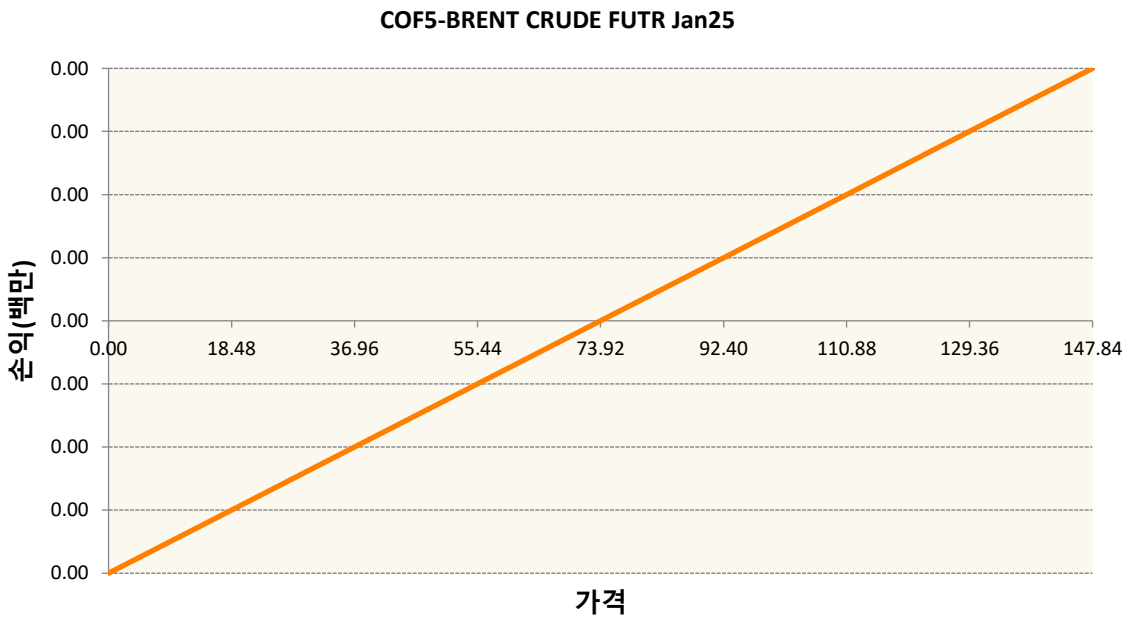
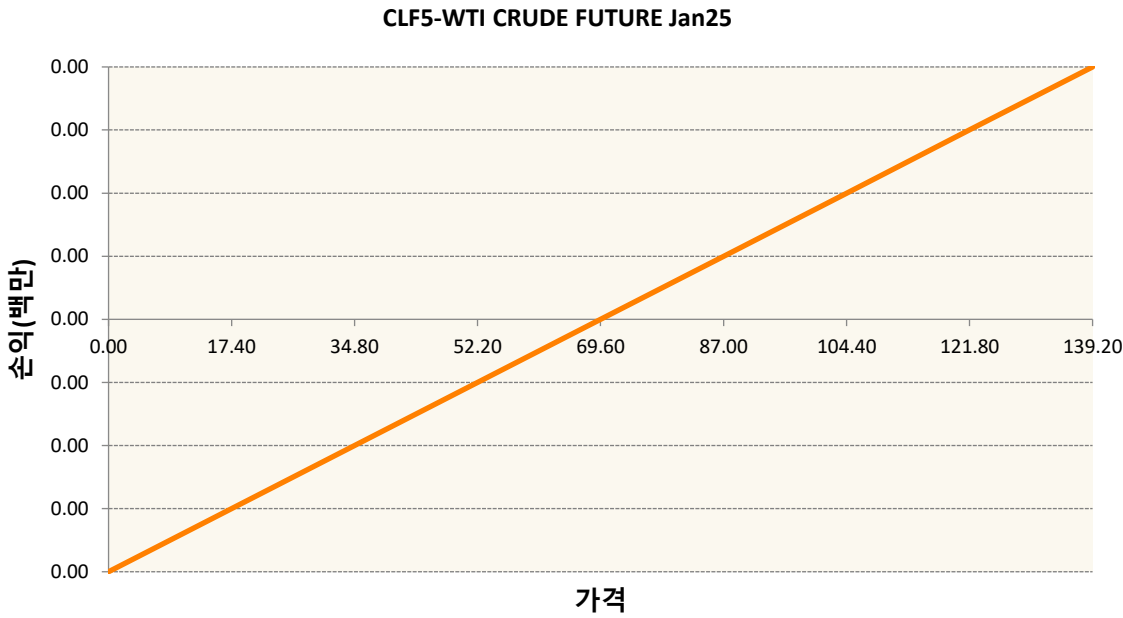
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

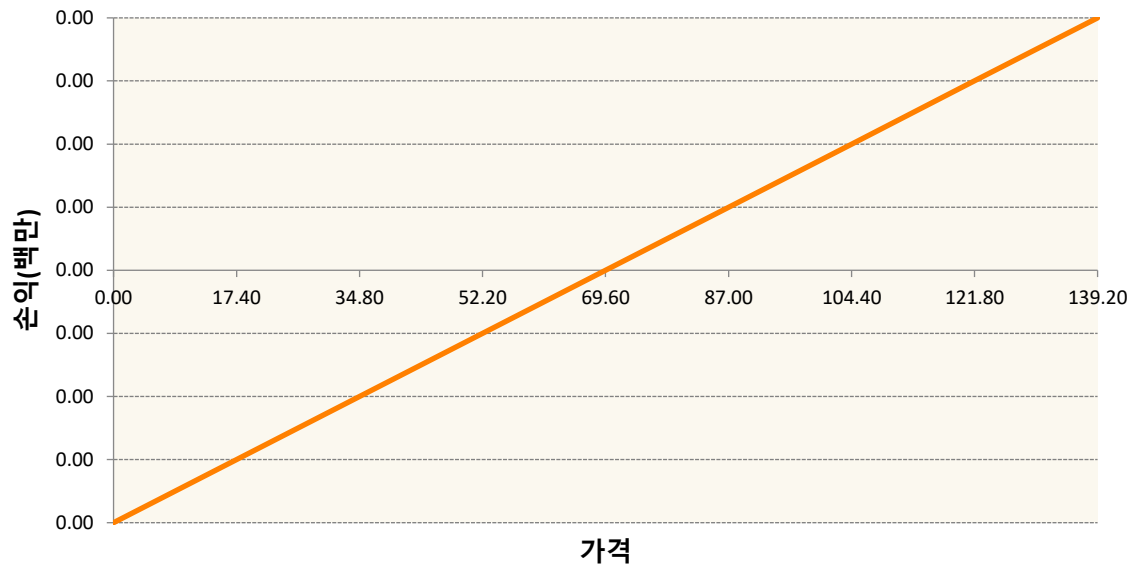
(단위:백만원)

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	783	0	783	
누계	통화	선물	0	96	-96	장내

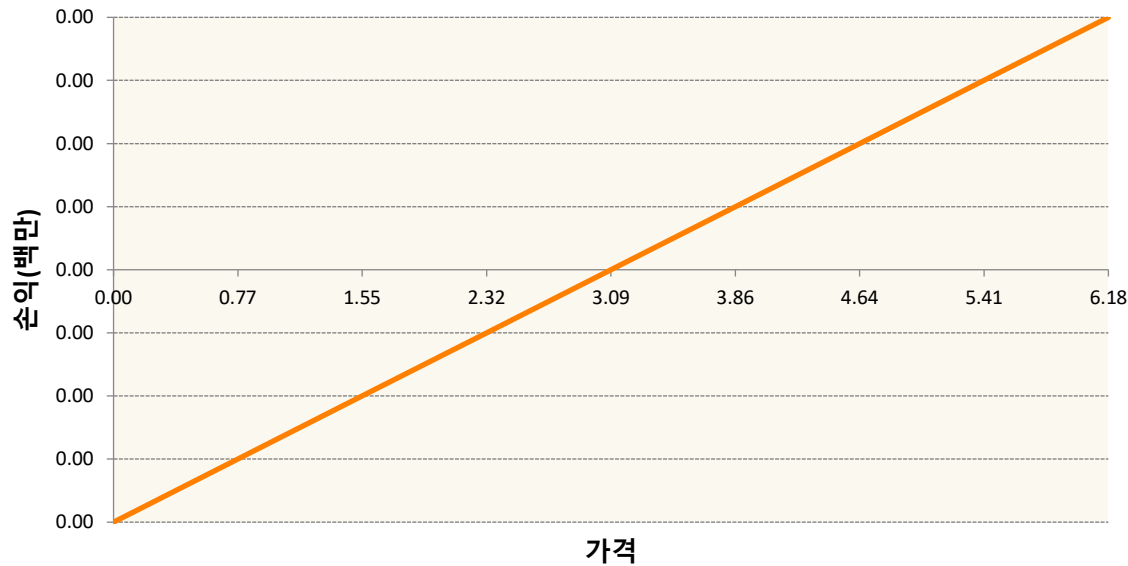
2. 만기시점의 손익구조



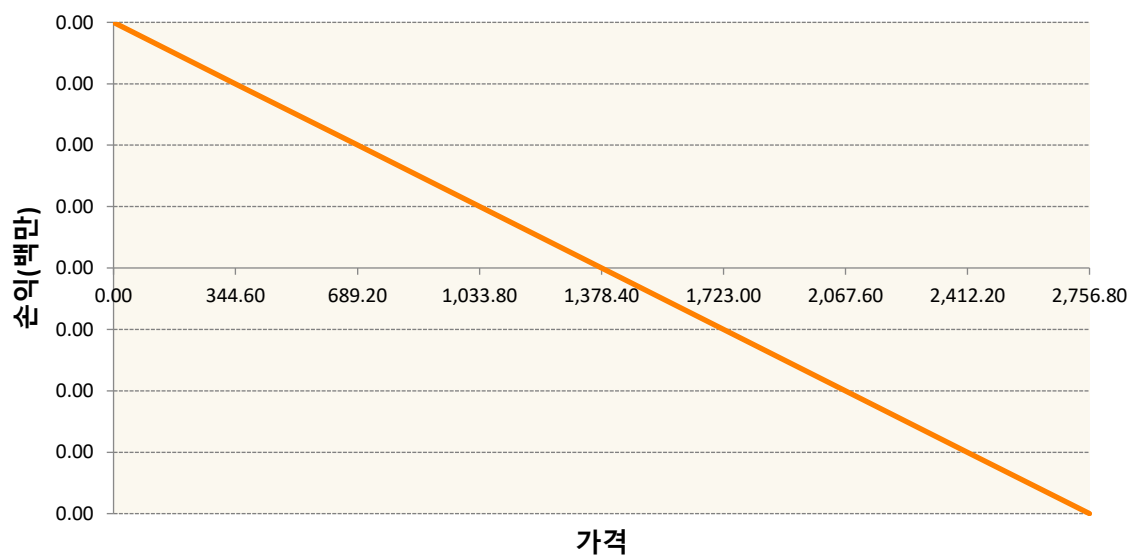
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



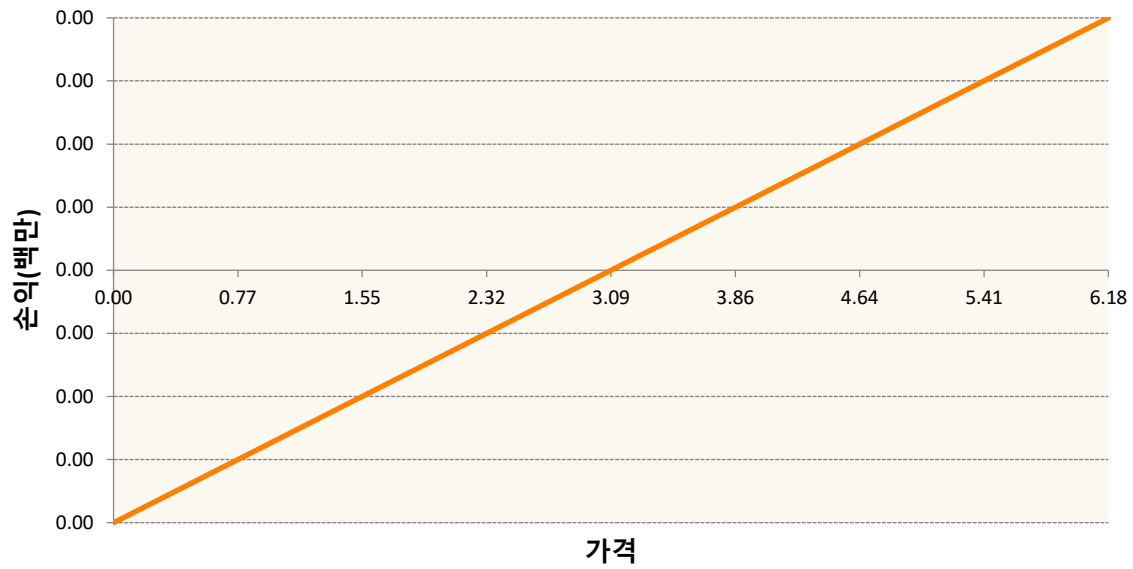
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



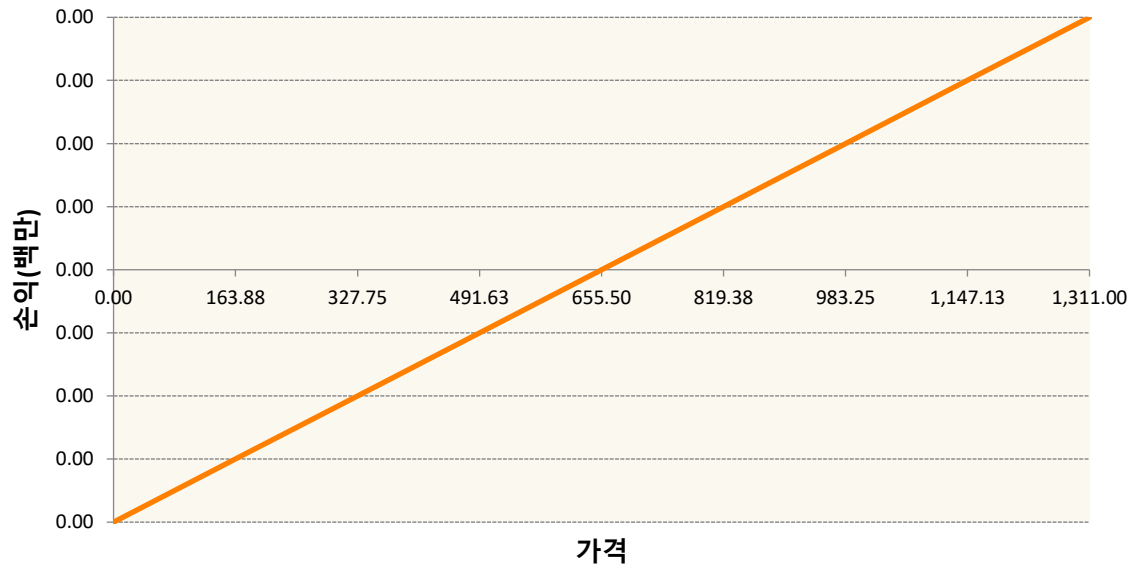
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



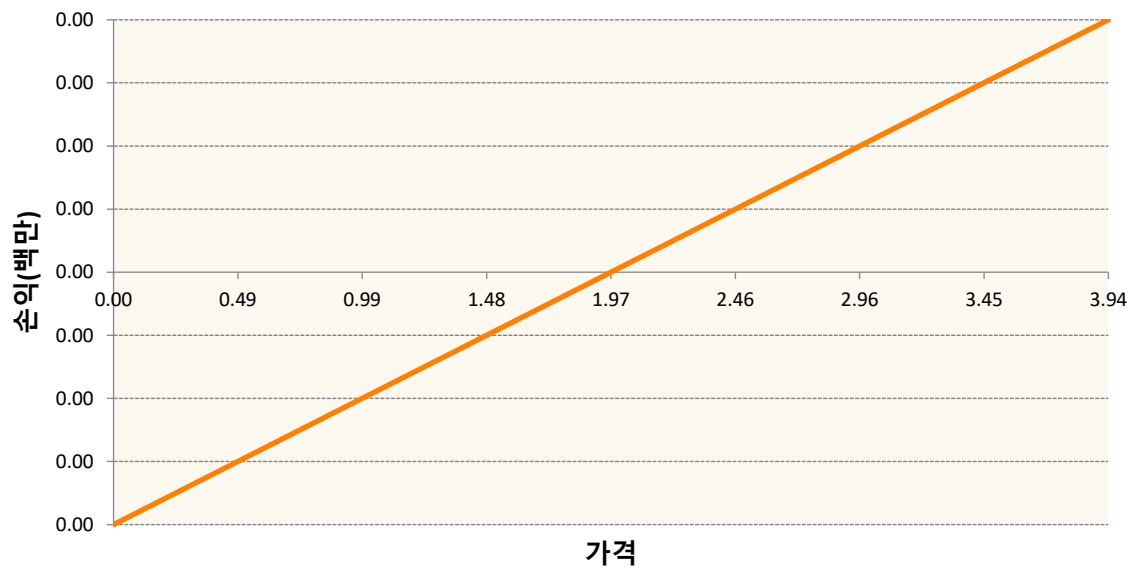
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



QSF5-Low Su Gasoil G Jan25



XBF5-GASOLINE RBOB FUT Jan25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF5	WTI CRUDE FUTURE Jan25	8
COF5	BRENT CRUDE FUTR Jan25	16
ECF5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	8
EOF5	E-MINI NATURAL GAS Jan25	2
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)

129