

공시일 2024-10-31

기준일 2024-10-30

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	2024-10-31
기준일	2024-10-30

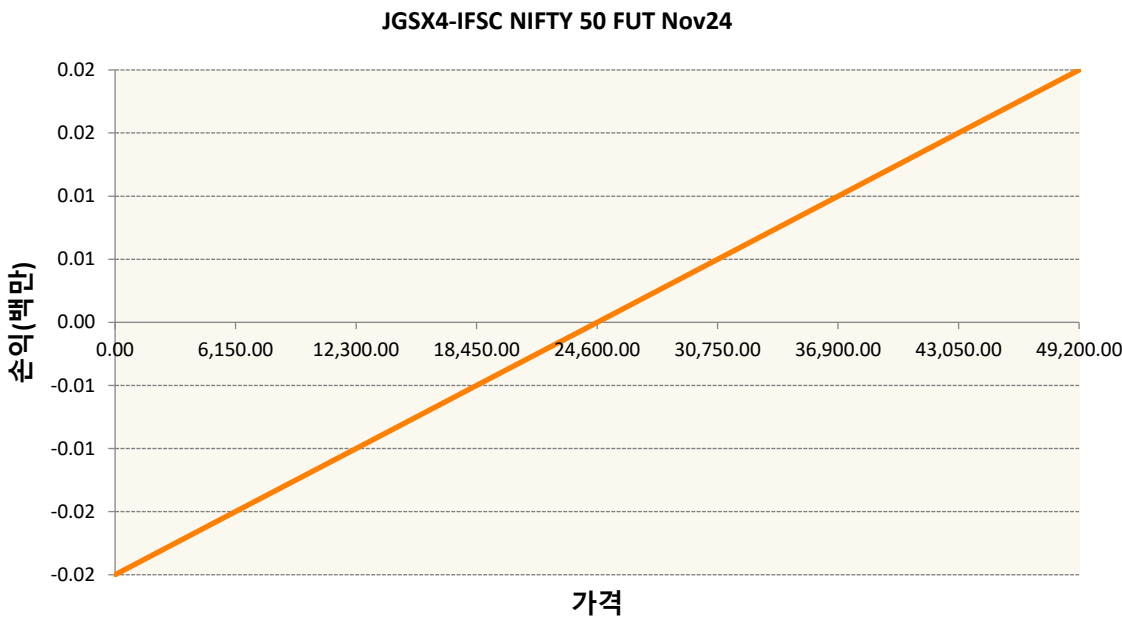
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	
누계	유가증권	선물	3,265	0	3,265	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSX4	IFSC NIFTY 50 FUT Nov24	261
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

168

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

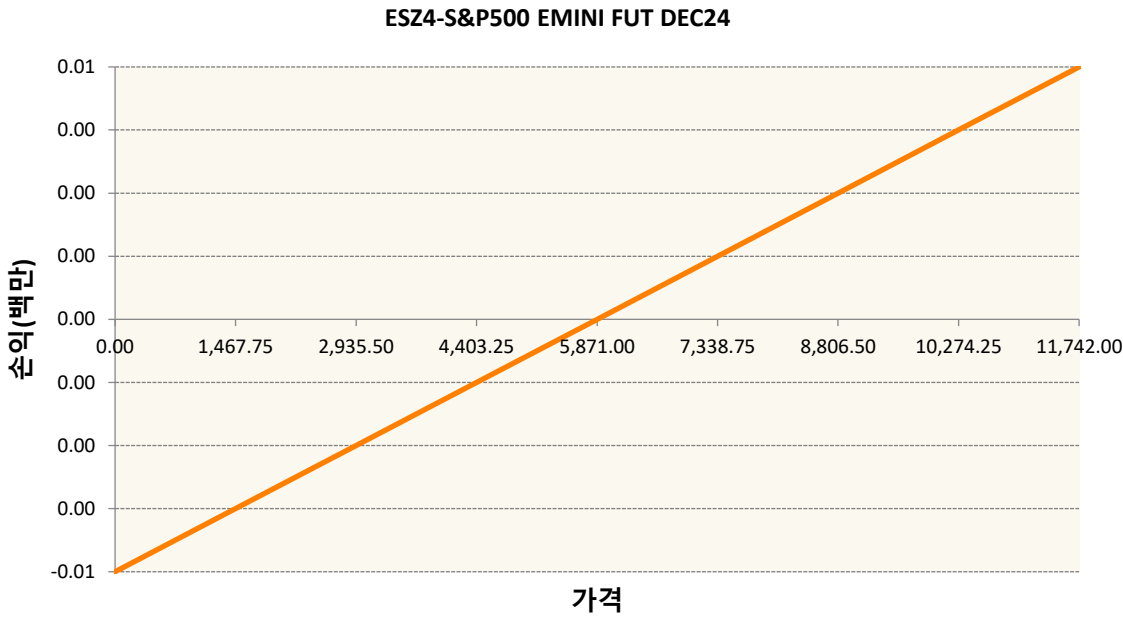
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	804	0	804	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOSPXWUC!SPXW US 10/30/24 C5835 INDEX	0.12
ESZ4 S&P500 EMINI FUT DEC24	64

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

(단위:백만원)

39

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

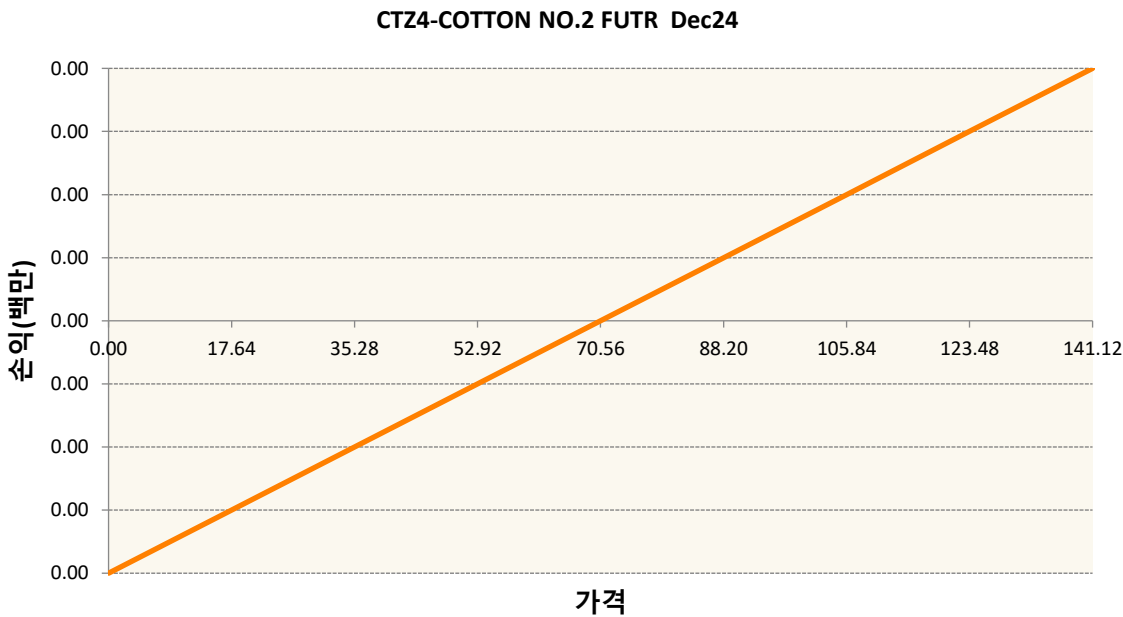
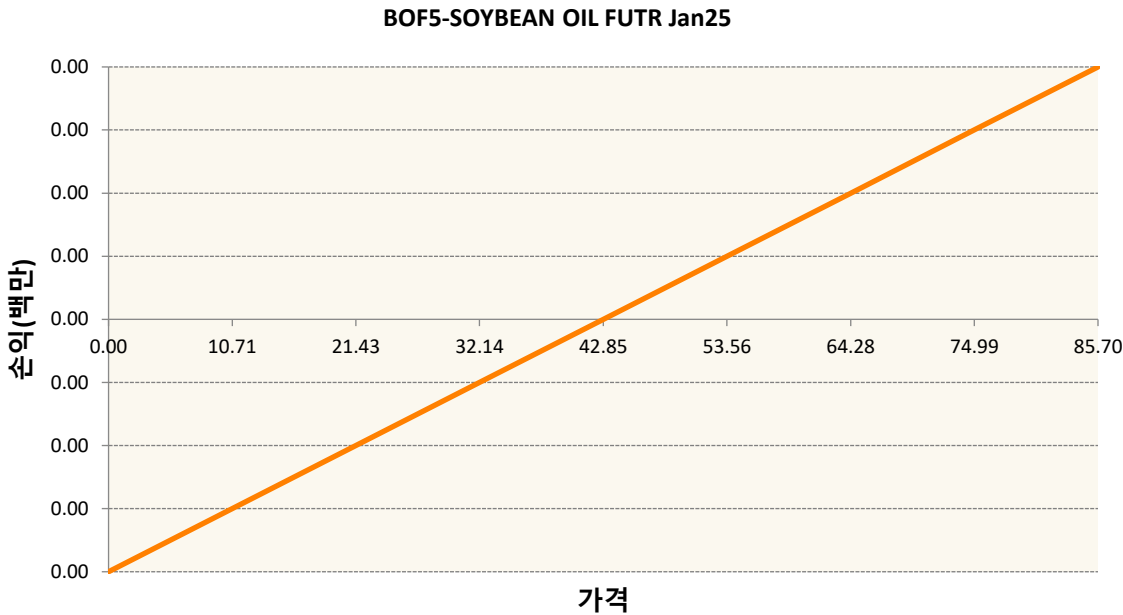
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

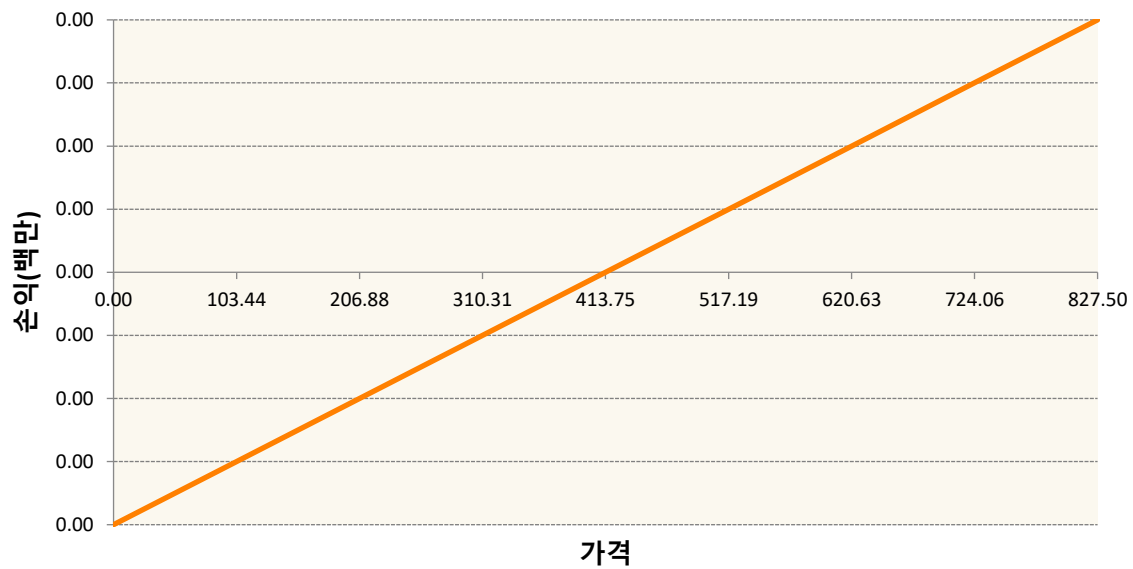
(단위:USD 백만)

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	3,706	0	3,706	
누계	통화	선물	0	483	-483	장내

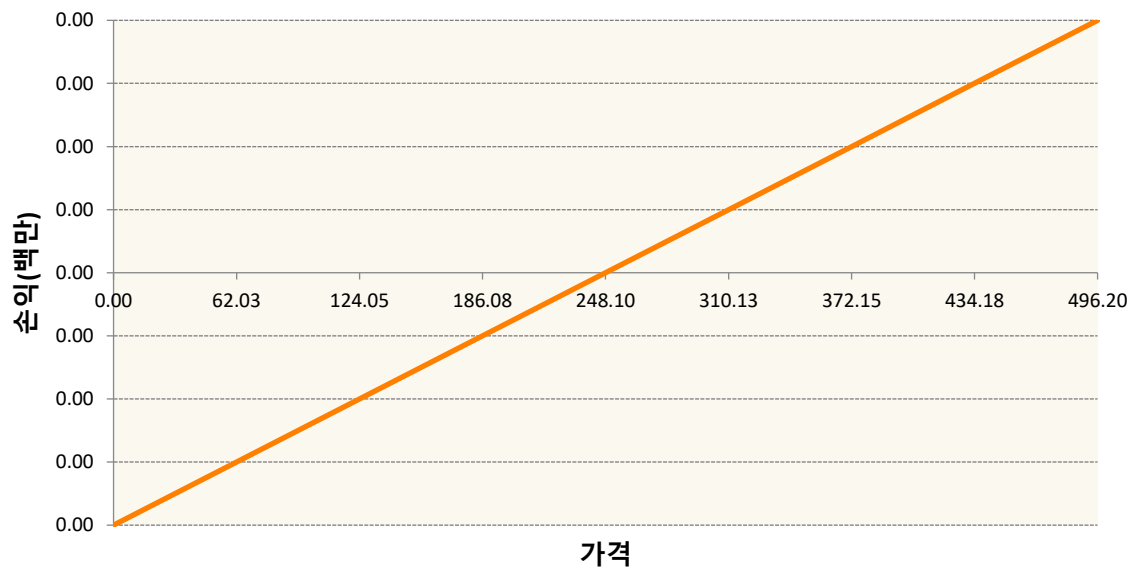
2. 만기시점의 손익구조



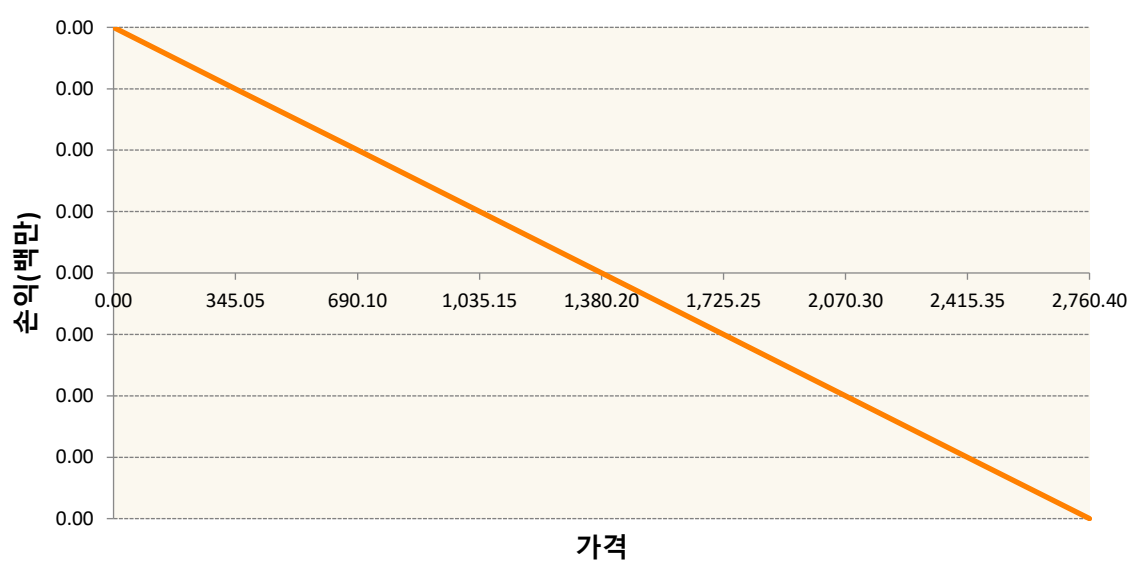
CZ4-CORN FUTURE Dec24



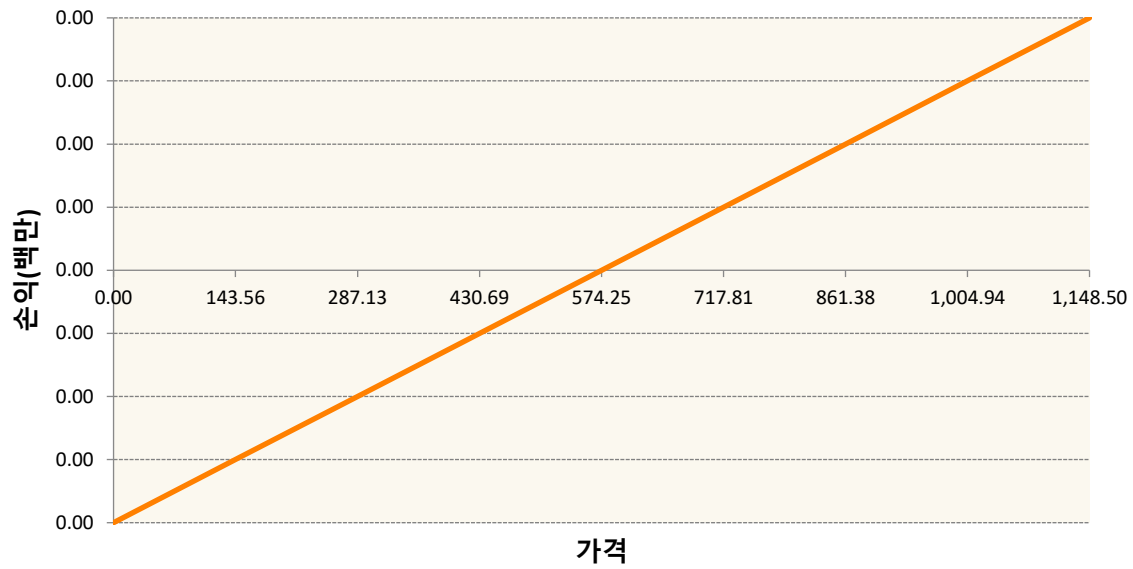
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



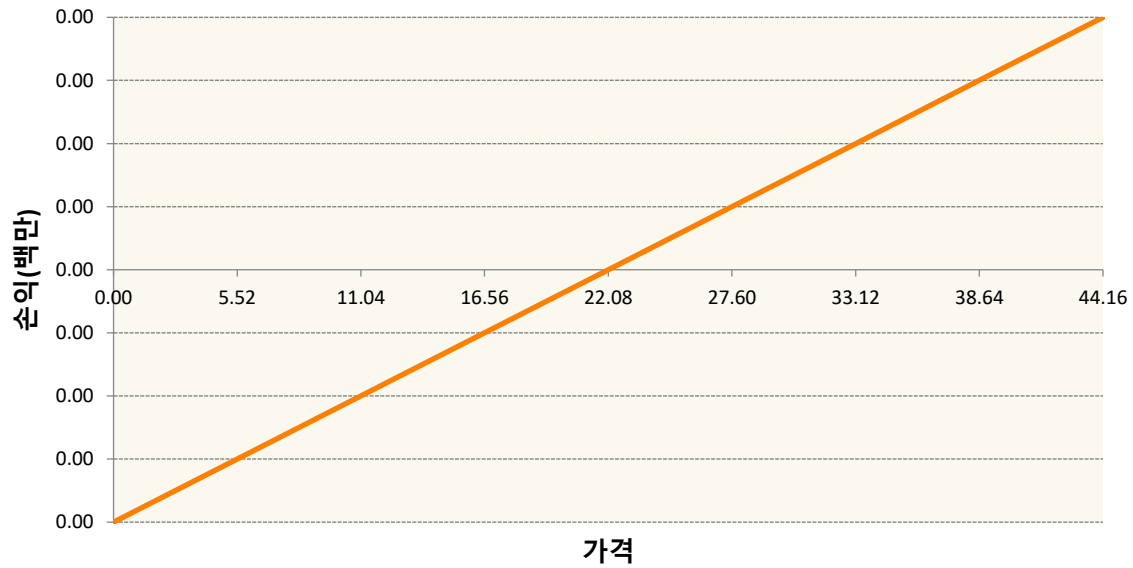
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



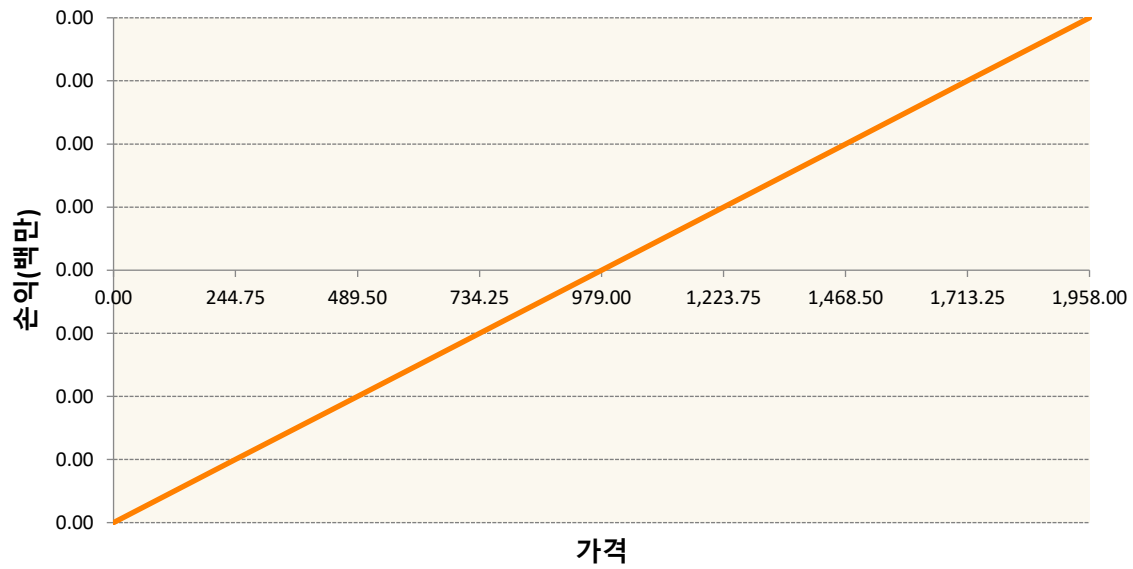
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24



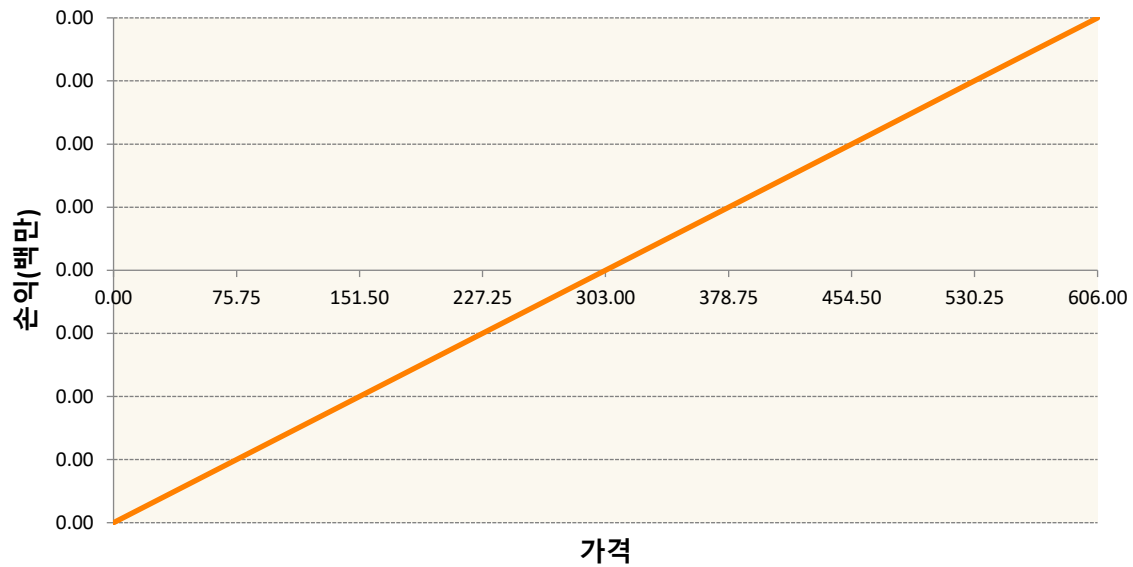
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



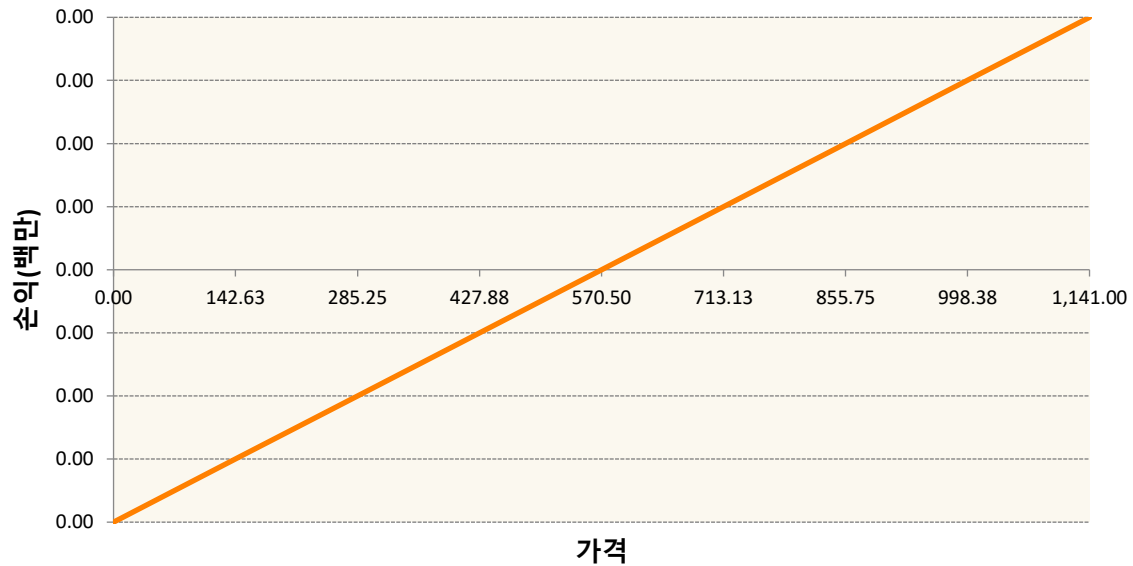
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-10-31
기준일	2024-10-30

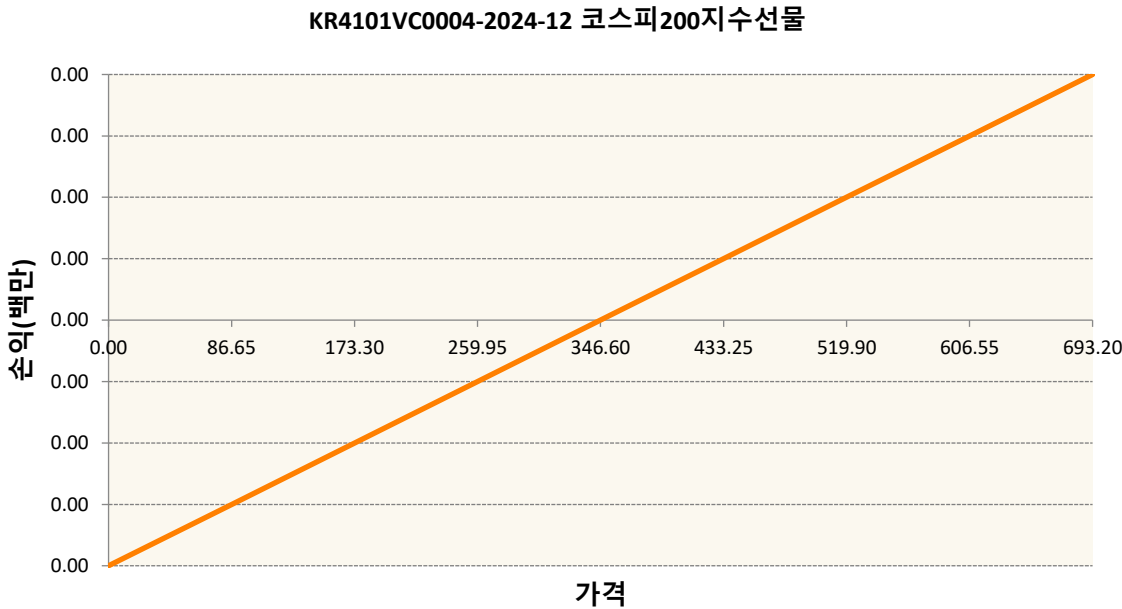
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,453	3,474	-21	장내
누계	유가증권	선물	1,820	0	1,820	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				145
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-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%	97	97	97	97	97	97	97
8.00%	145	145	145	145	145	145	145

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

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	301
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

484

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

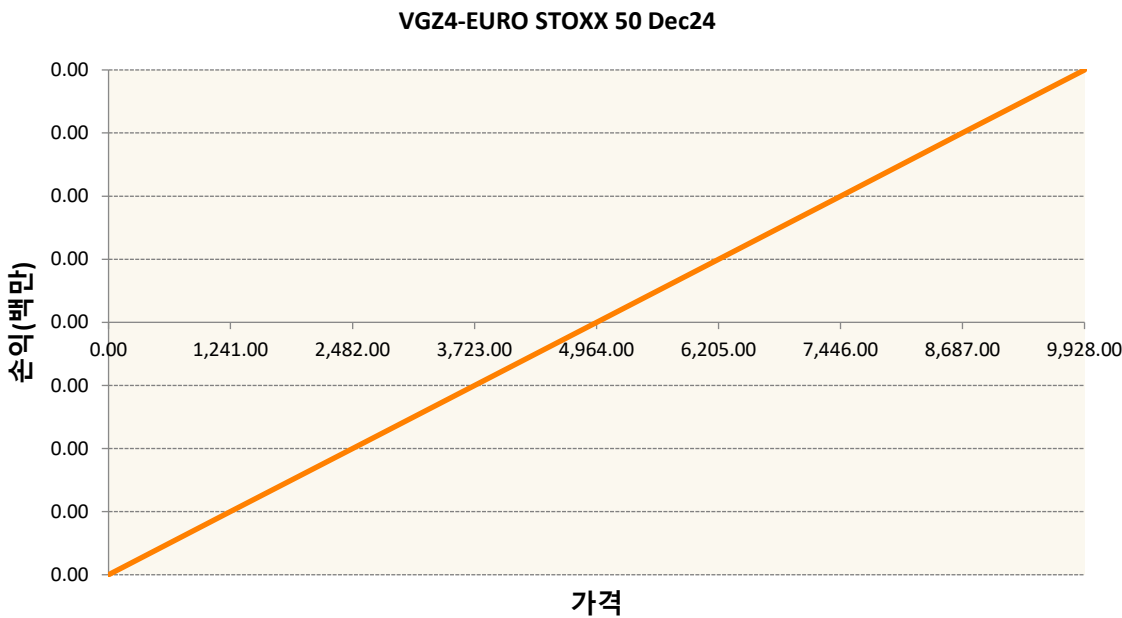
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	959	0	959	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ4 EURO STOXX 50 Dec24

77

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

(단위:백만원)

50

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

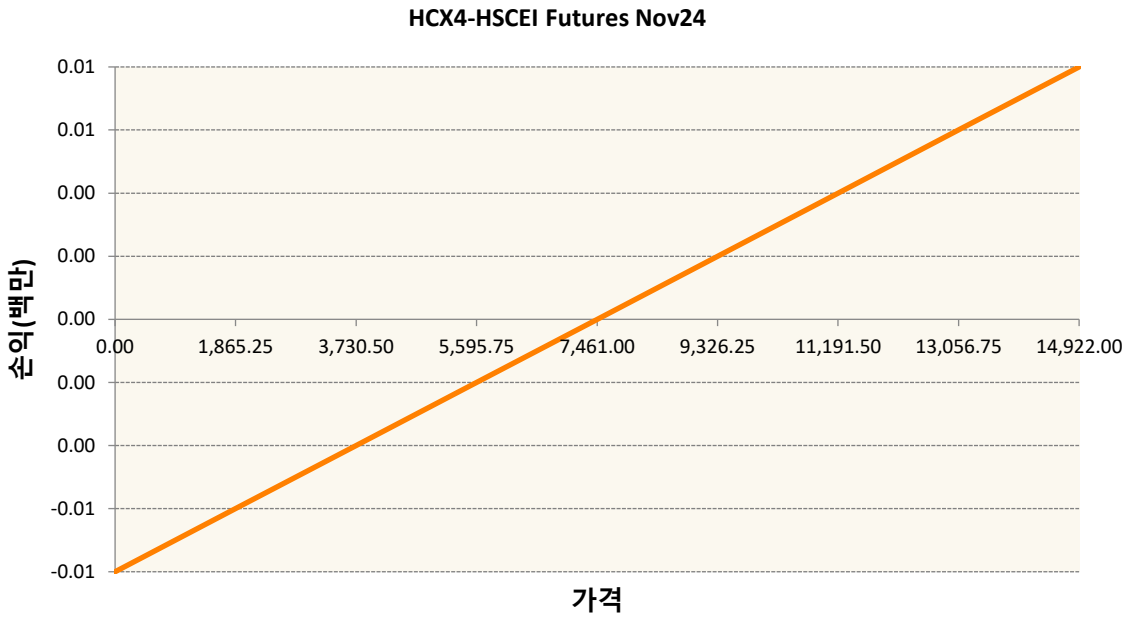
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,463	0	1,463	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX4	HSCEI Futures Nov24	117
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

160

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

커버드콜모(주식혼합-파생형)

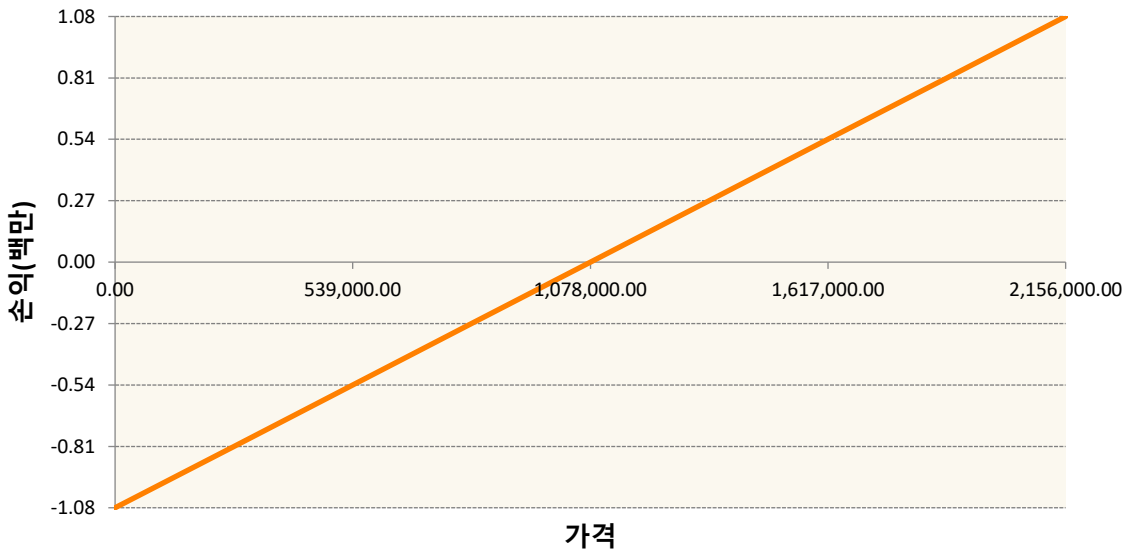
1. 계약금액

(단위:백만원)

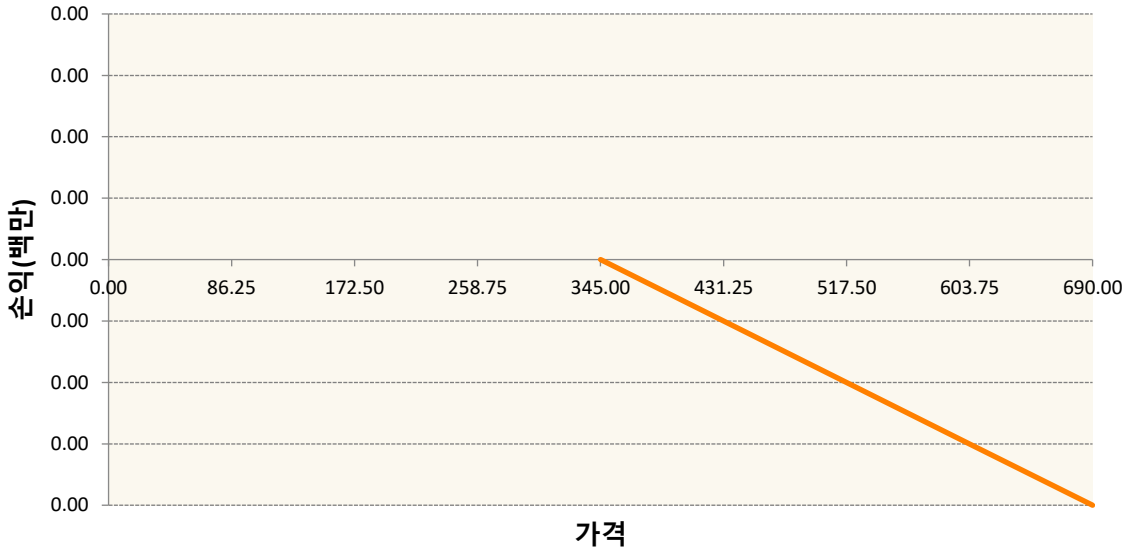
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	270	0	270	장내
누계	유가증권	옵션	0	40,131	-40,131	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR41B3VB0009-2024-11 고려아연개별선물



KR4201VB3453-2024-11 콜345



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					22
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	22	22	22	22	22	22	22
KR4201VB3453		2024-11 콜345					1,838
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	618	611	601	587	571	552	530
-5.33%	580	558	533	504	473	440	404
-2.67%	452	410	366	322	276	230	183
0%	155	104	52	0	-52	-103	-155
2.67%	-340	-383	-427	-473	-520	-567	-616
5.33%	-991	-1,016	-1,044	-1,076	-1,110	-1,146	-1,185
8.00%	-1,726	-1,736	-1,750	-1,767	-1,788	-1,812	-1,838
KR4201VB3479 2024-11 콜347.5							203

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	60	59	58	56	54	52
-5.33%	57	55	53	50	47	44	40
-2.67%	46	42	37	33	28	23	17
0%	18	12	6	0	-6	-12	-18
2.67%	-33	-39	-44	-50	-56	-61	-67
5.33%	-104	-108	-112	-116	-120	-125	-130
8.00%	-187	-189	-191	-193	-196	-199	-203

KR4301VB3452 2024-11 풋345							482
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-471	-472	-474	-476	-479	-482
-5.33%	-273	-276	-281	-286	-291	-297	-304
-2.67%	-96	-104	-113	-122	-132	-141	-151
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34
2.67%	103	94	85	76	66	56	46
5.33%	128	124	119	113	107	100	93
8.00%	133	132	131	128	125	122	117

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

(단위:백만원)

2,590

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

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	663	0	663	

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	2024-10-31
기준일	2024-10-30

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	4,363	0	4,363	

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	2024-10-31
기준일	2024-10-30

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	14,033	0	14,033	
누계	통화	선도	346	17,280	-16,934	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213E7W KRW/USD 31-10-24E		227
FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E		581
FXW213E9L0 KRW/USD 31-10-24E		22
FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E		348
FXW213EAQ USD/KRW 31-10-24E		28
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E		205
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	647

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

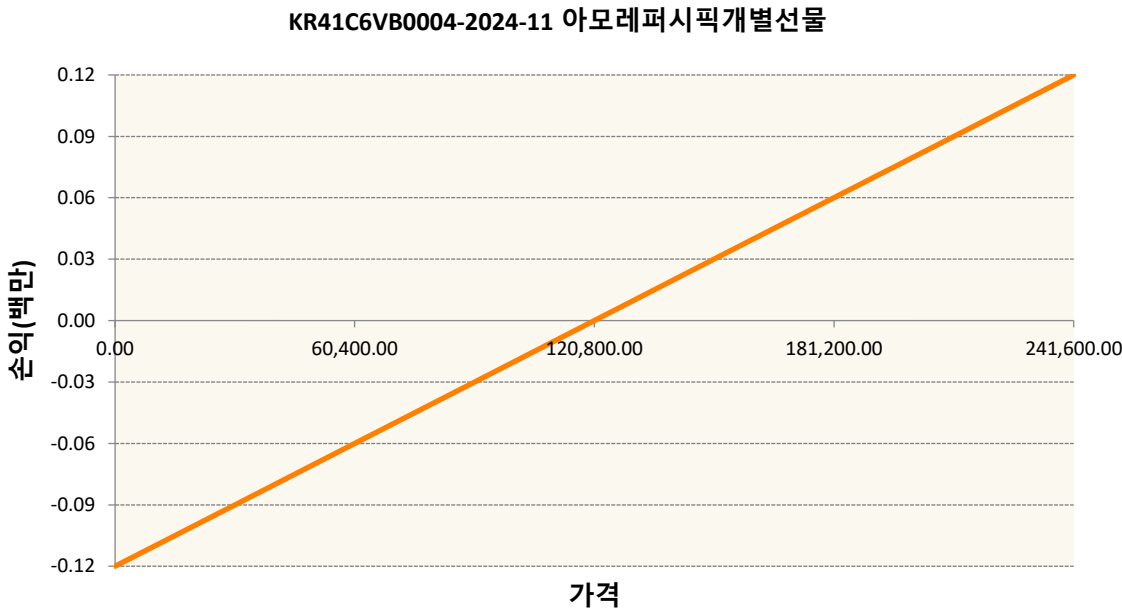
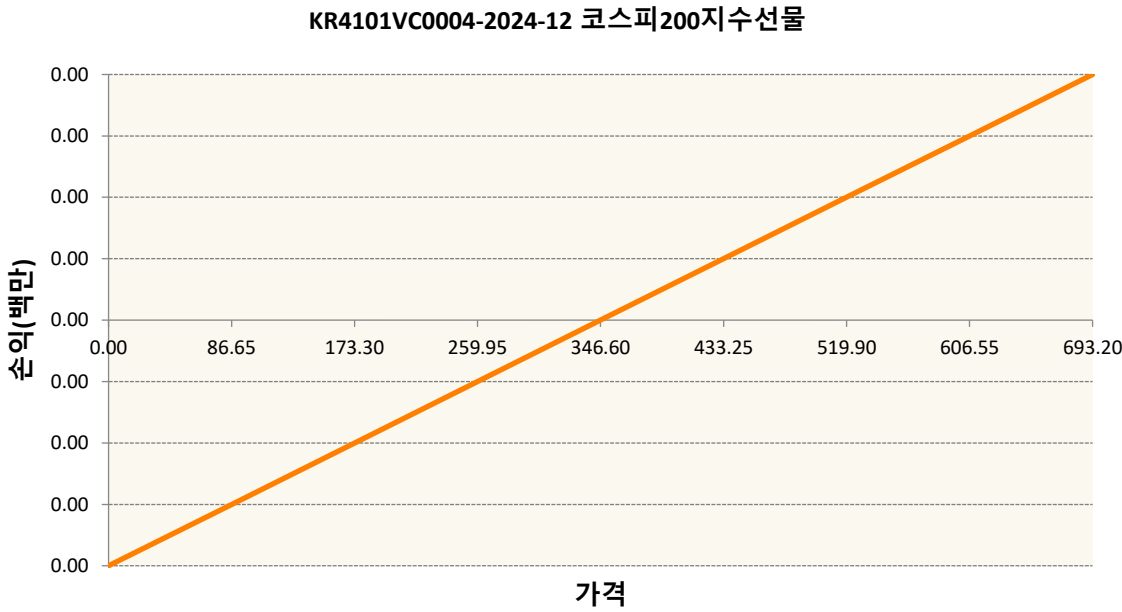
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

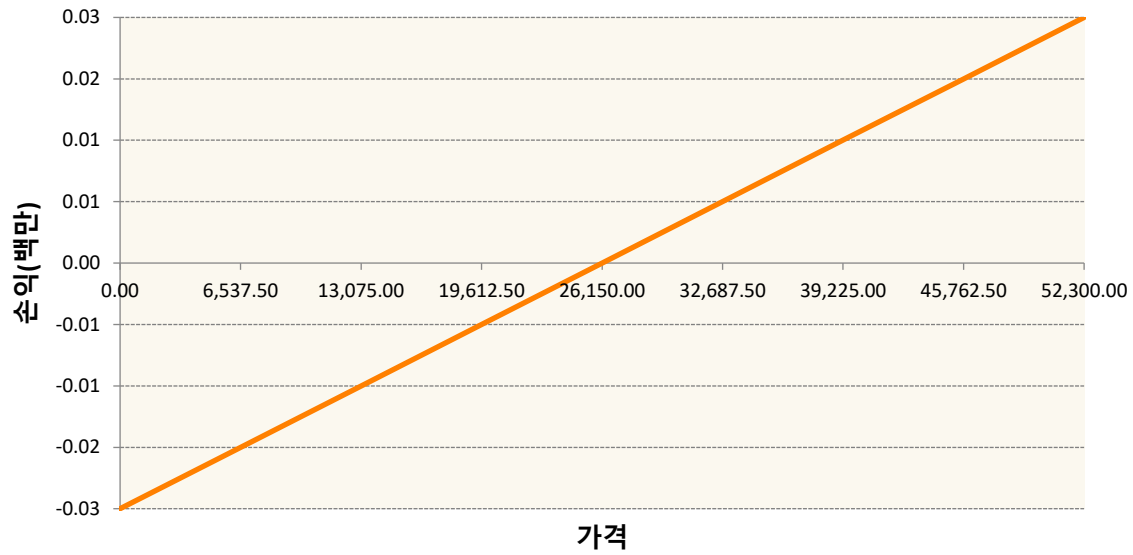
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	22	0	22	장내
누계	유가증권	선물	882	0	882	장내

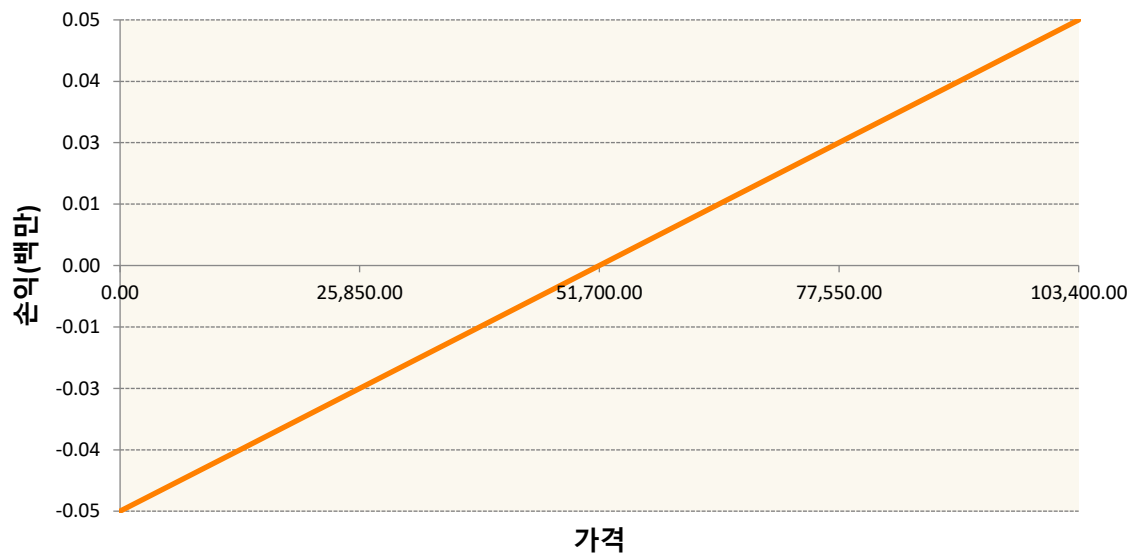
2. 만기시점의 손익구조



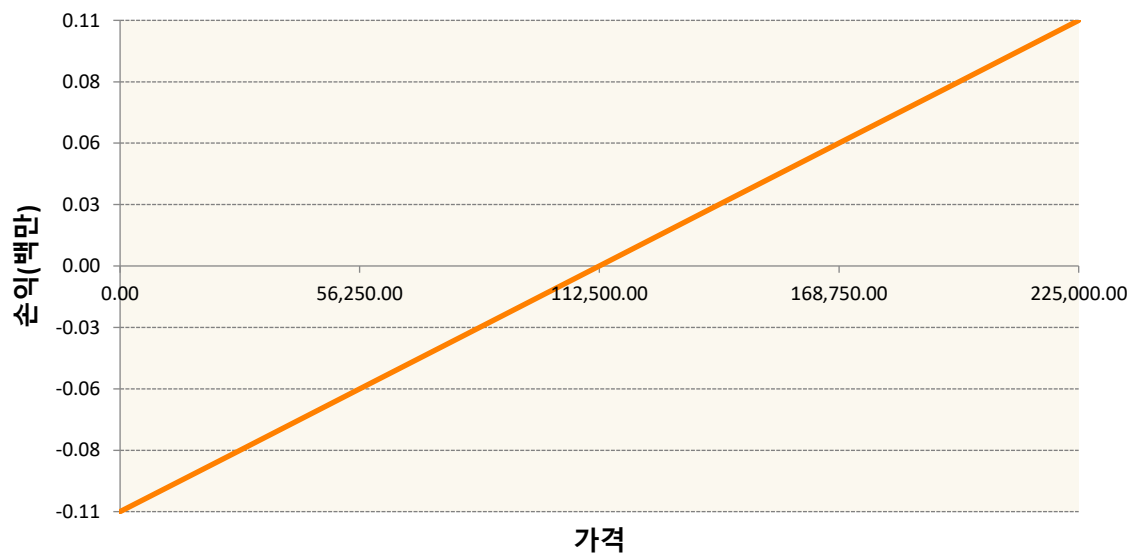
KR41CNVB0005-2024-11 포스코DX개별선물



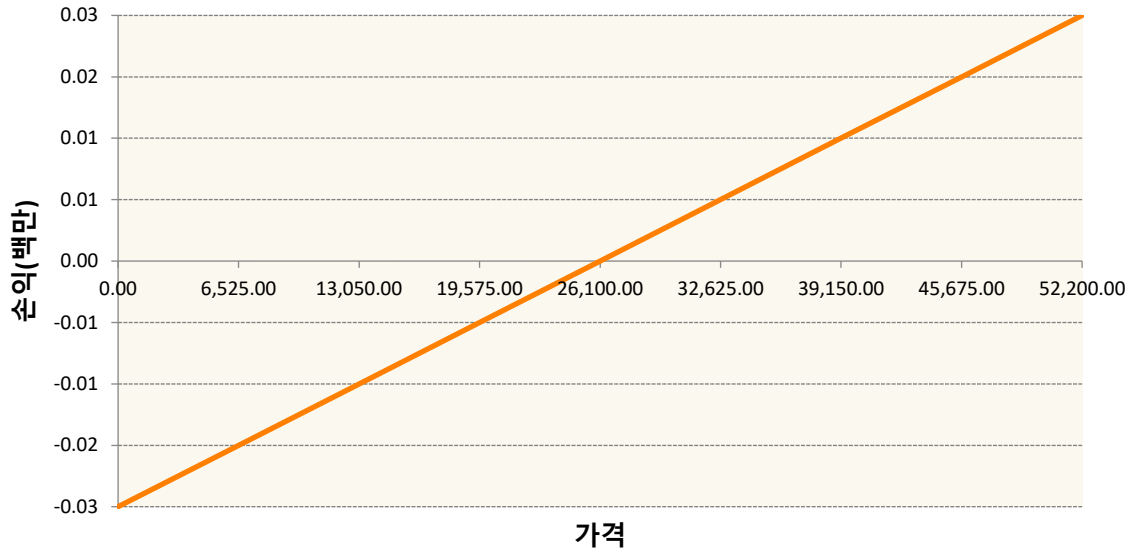
KR41CVVB0005-2024-11 한미사이언스개별선물



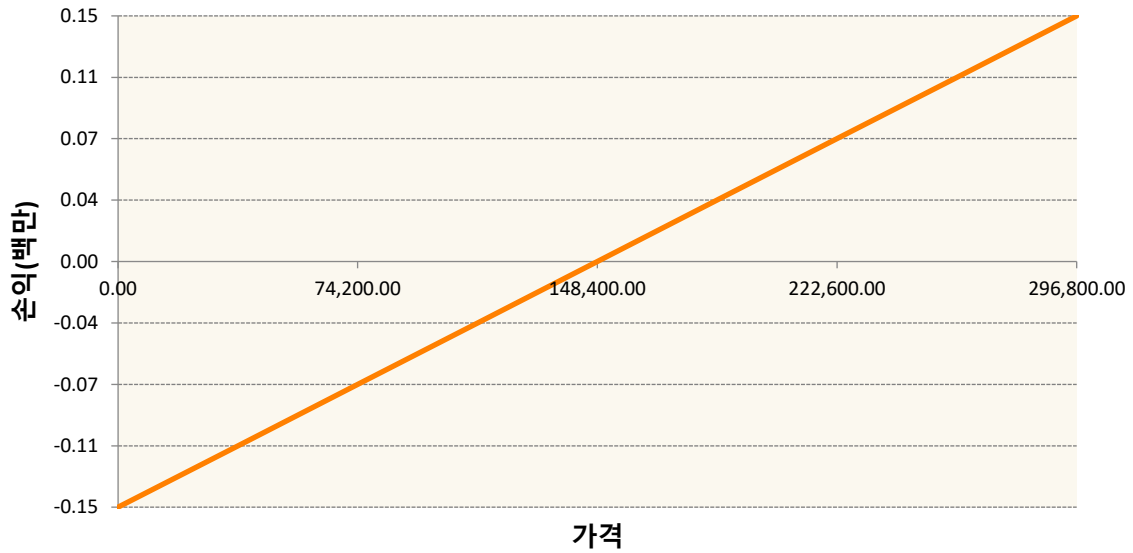
KR41FMVB0003-2024-11 엘앤에프개별선물



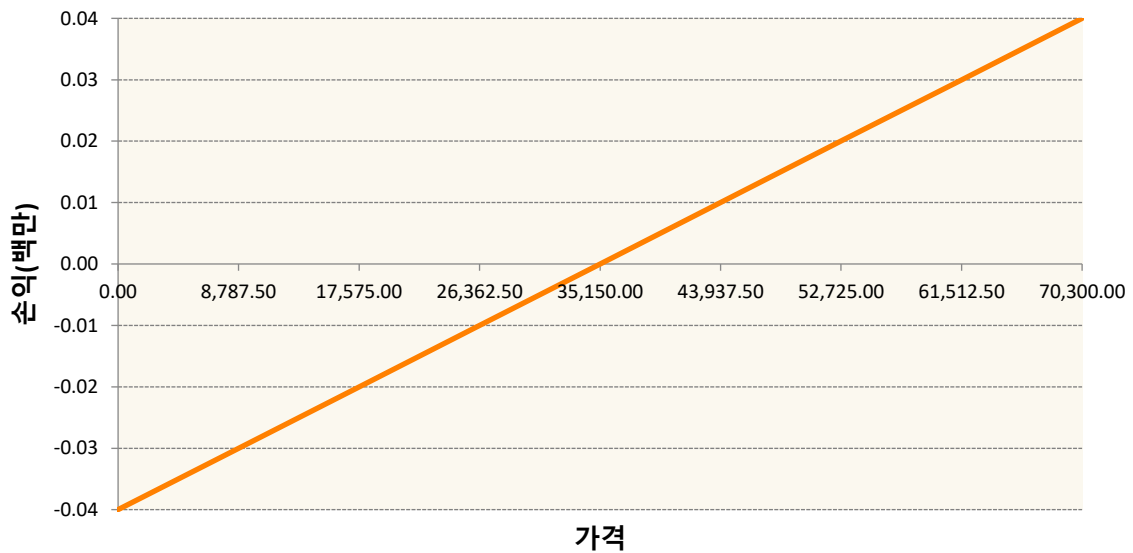
KR41FXVB0000-2024-11 동서개별선물



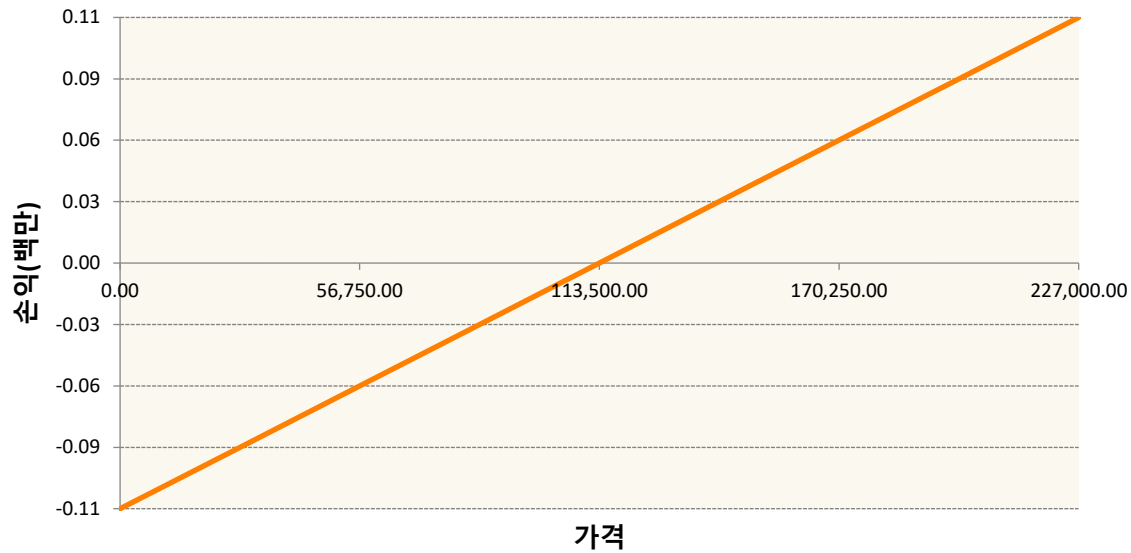
KR41GLVB0003-2024-11 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNVB0001-2024-11 금양개별선물



KR41GZVB0007-2024-11 에코프로머티개별선물



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	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-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%	41	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	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	-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
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	-1
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

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

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

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

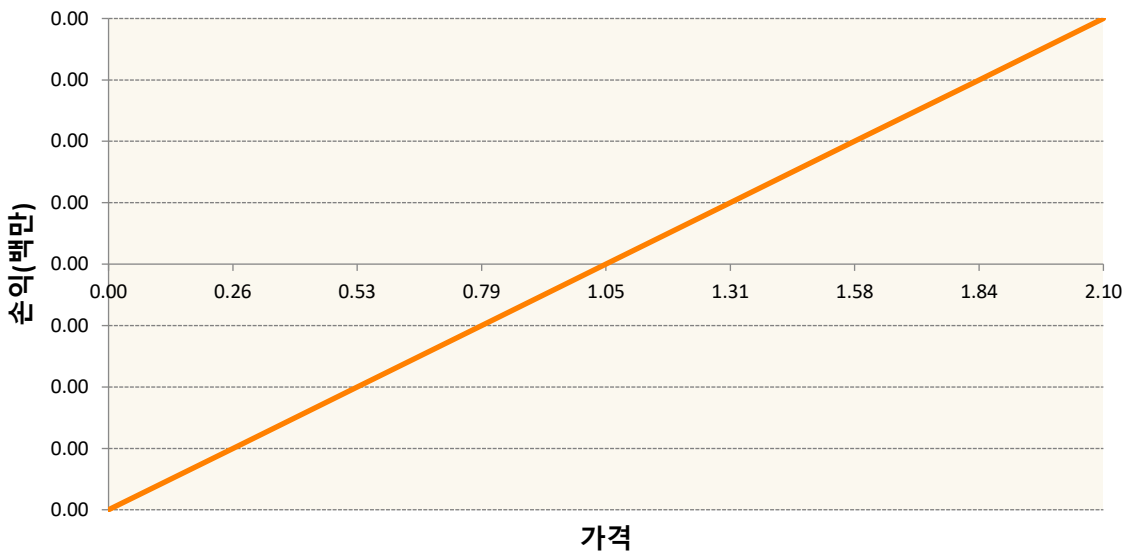
1. 계약금액

(단위:백만원)

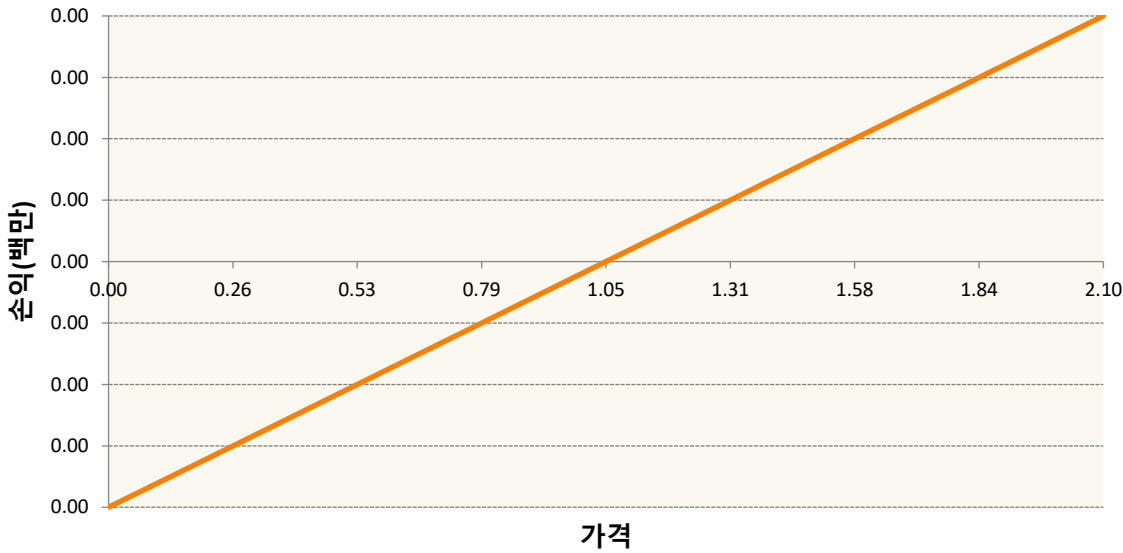
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,867	0	11,867	

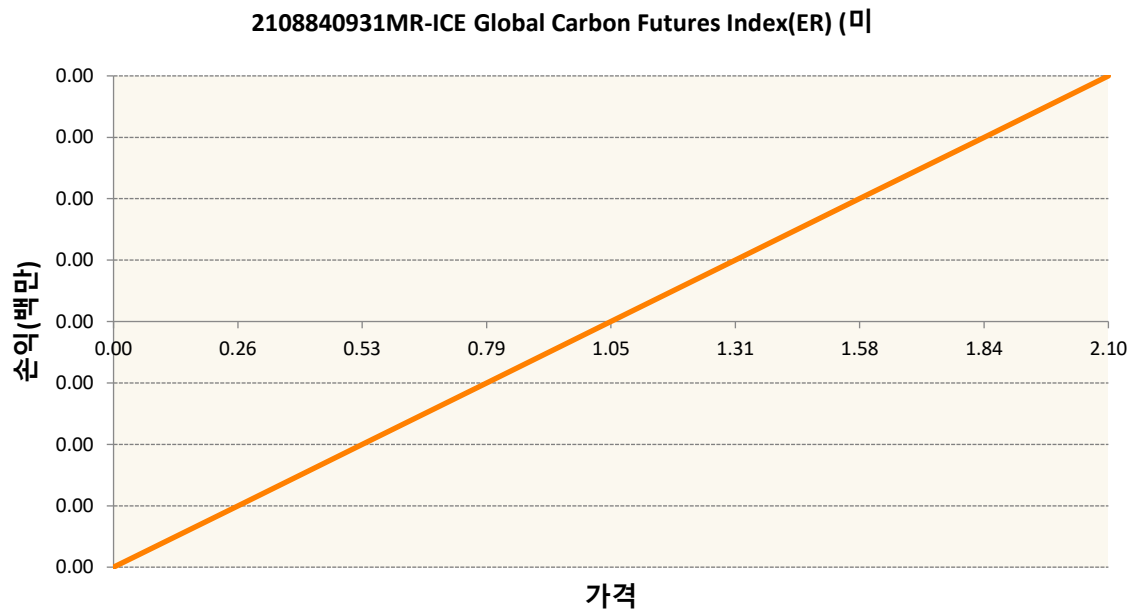
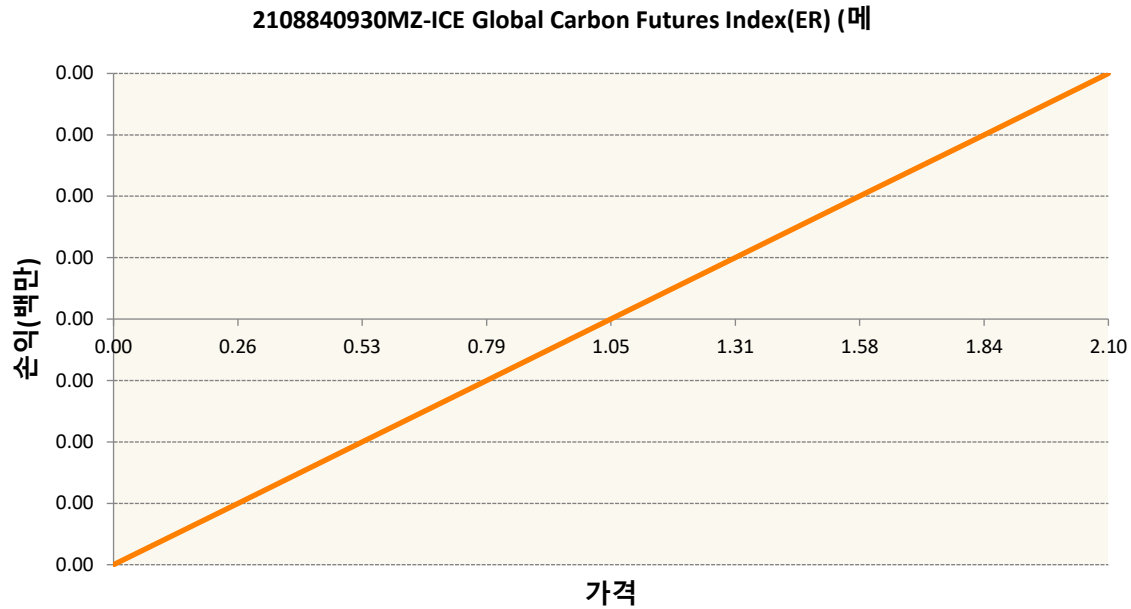
2. 만기시점의 손익구조

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		95
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		476
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		191
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		191

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,028

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

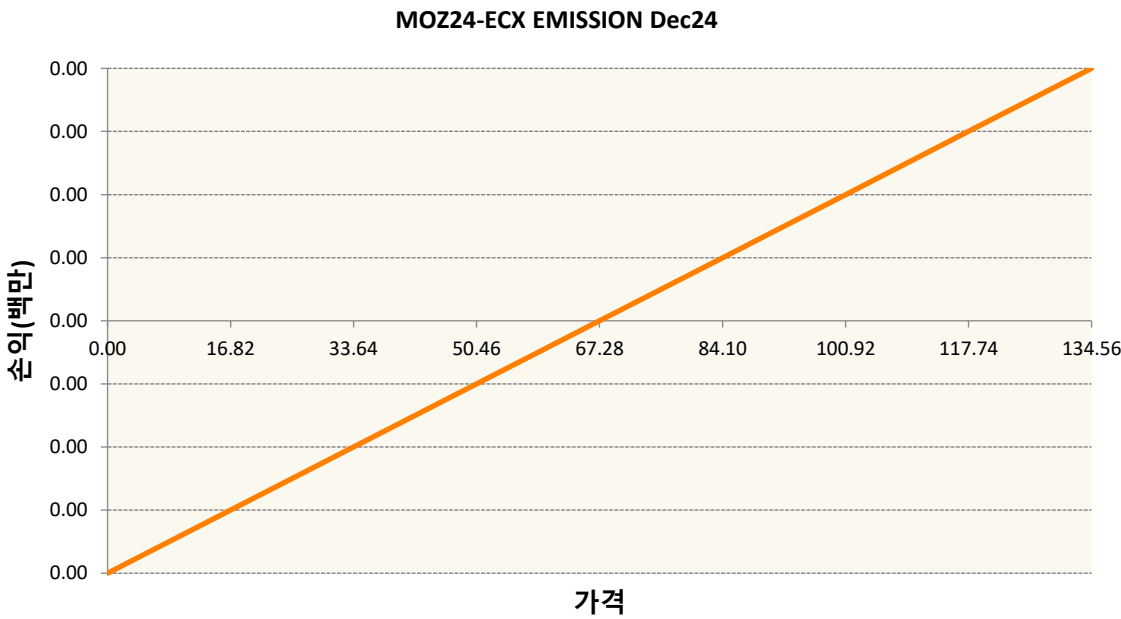
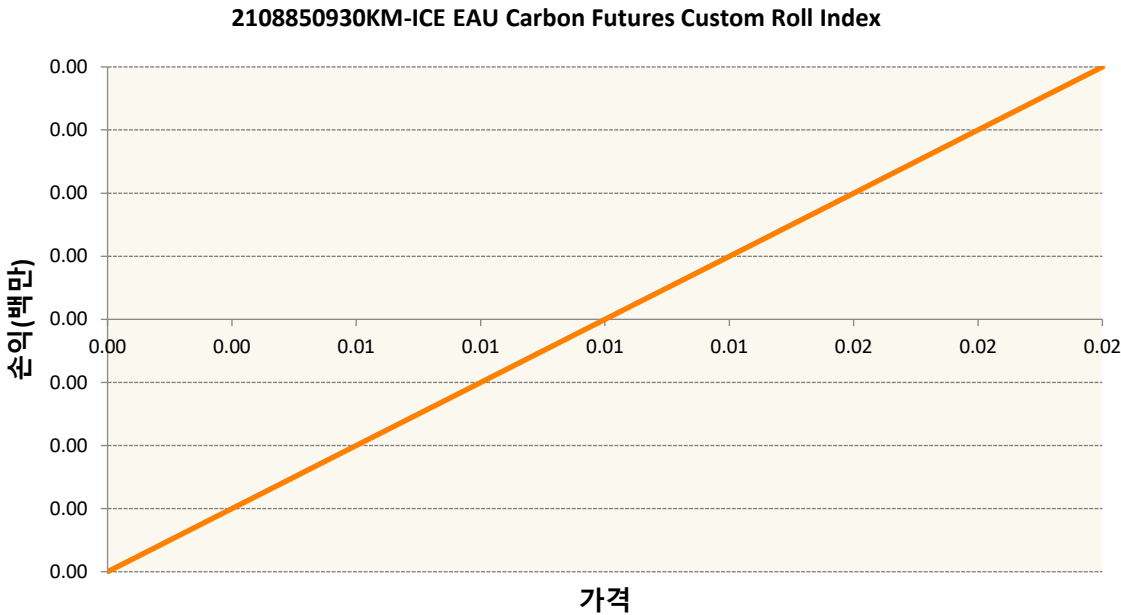
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,093	0	8,093	
누계	통화	선도	0	3,548	-3,548	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		0.31
FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E		130
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E		11
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E		142
MOZ24 ECX EMISSION Dec24		647

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,241

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

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)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	32
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	32

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

(단위:백만원)

181

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

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)	57
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	49
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	69
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	14

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

(단위:백만원)

303

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

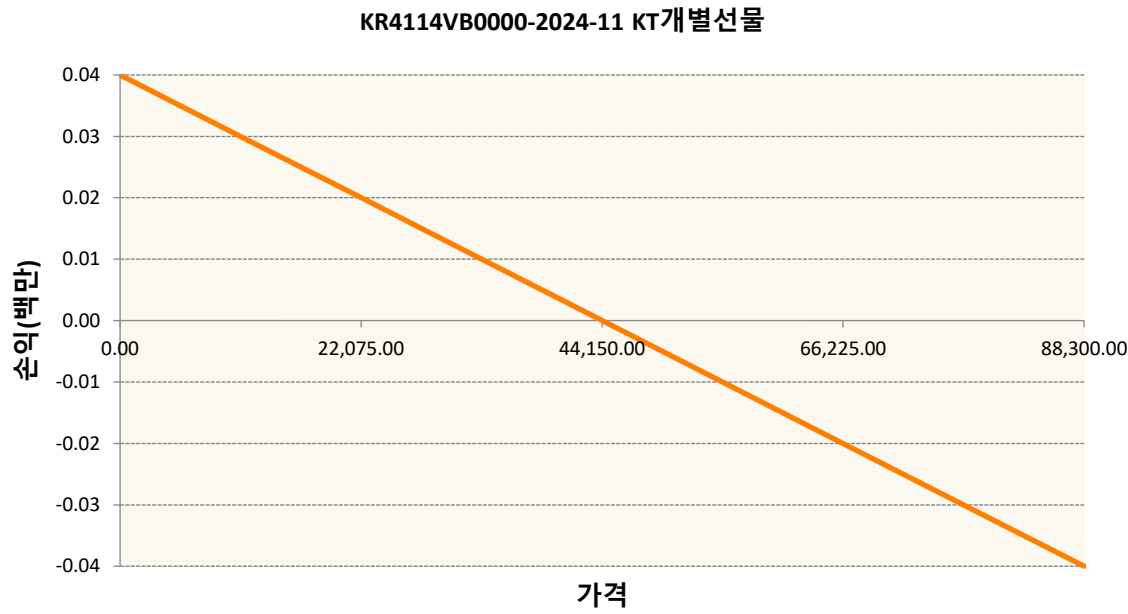
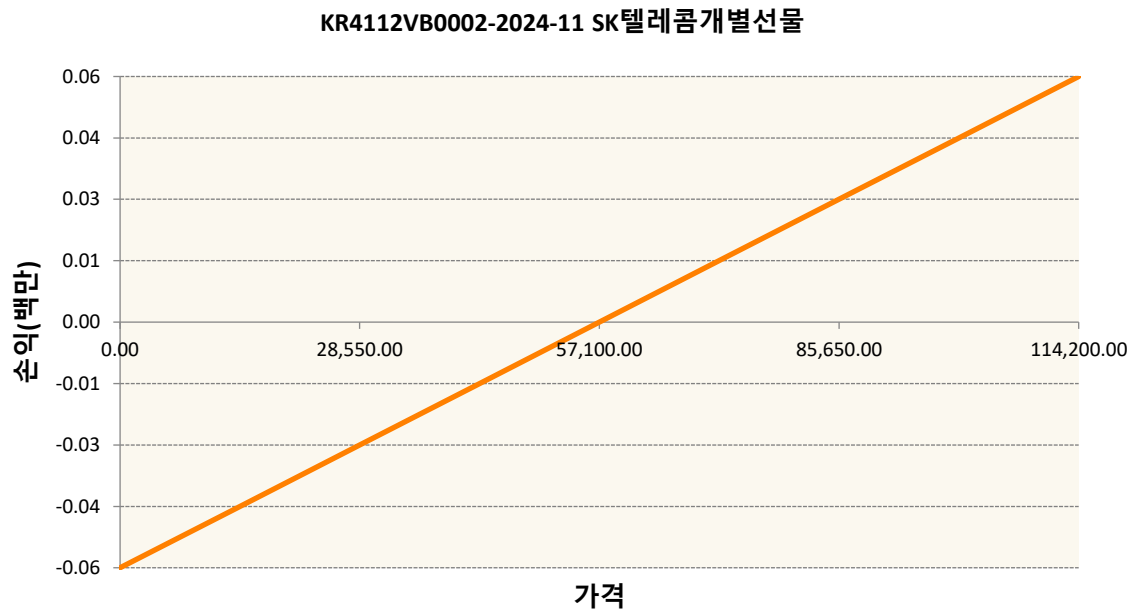
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

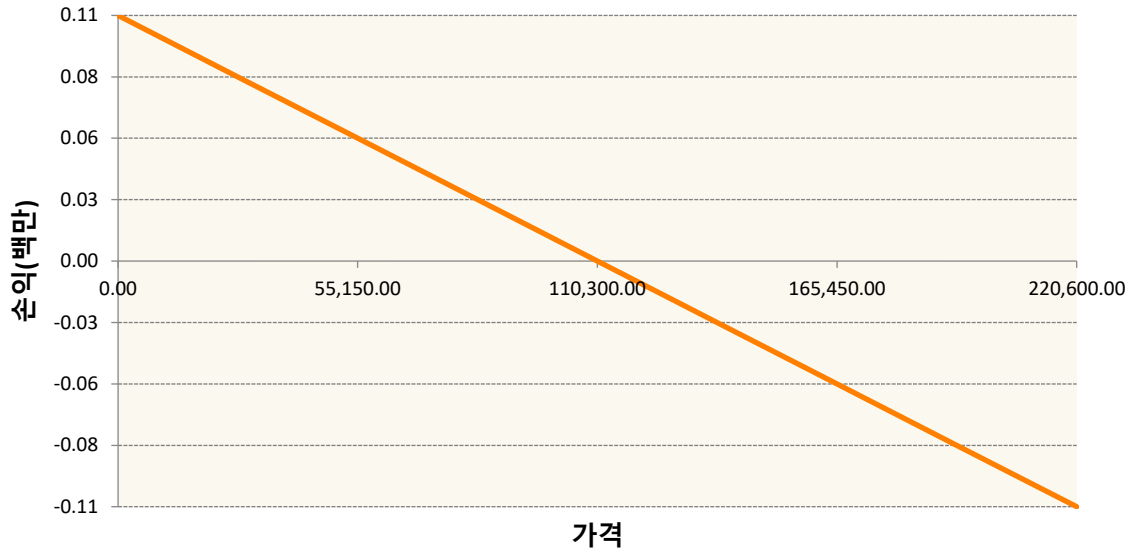
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7	44	-36	장내
누계	유가증권	선물	25	80	-55	장내

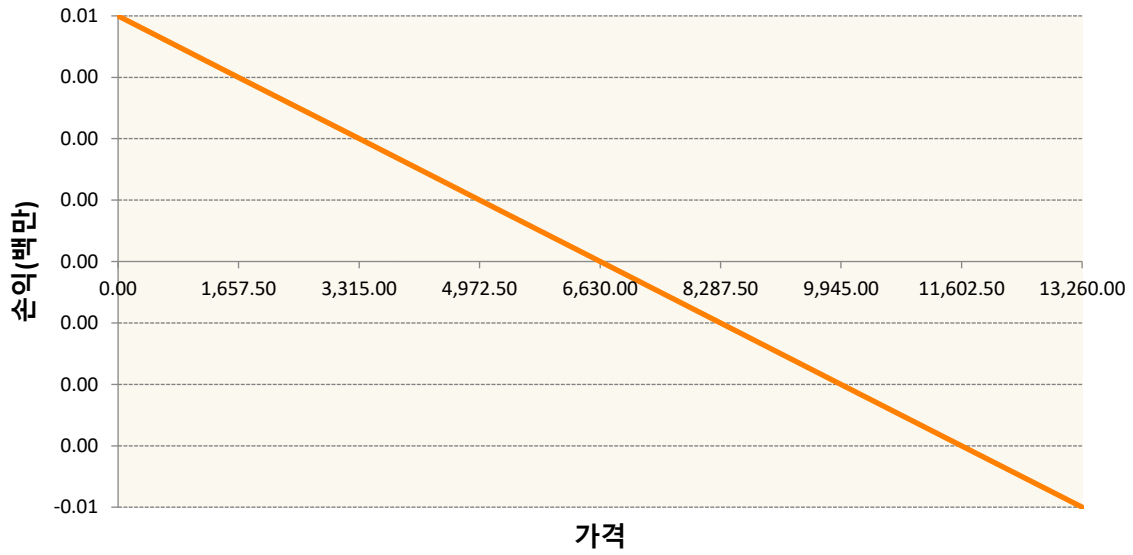
2. 만기시점의 손익구조



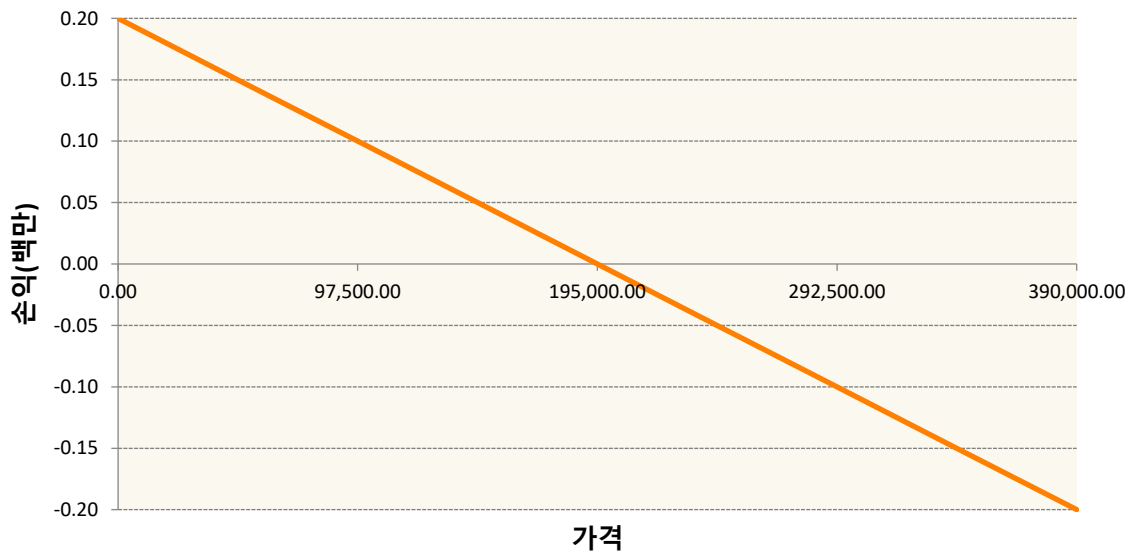
KR4136VB0004-2024-11 KT&G개별선물



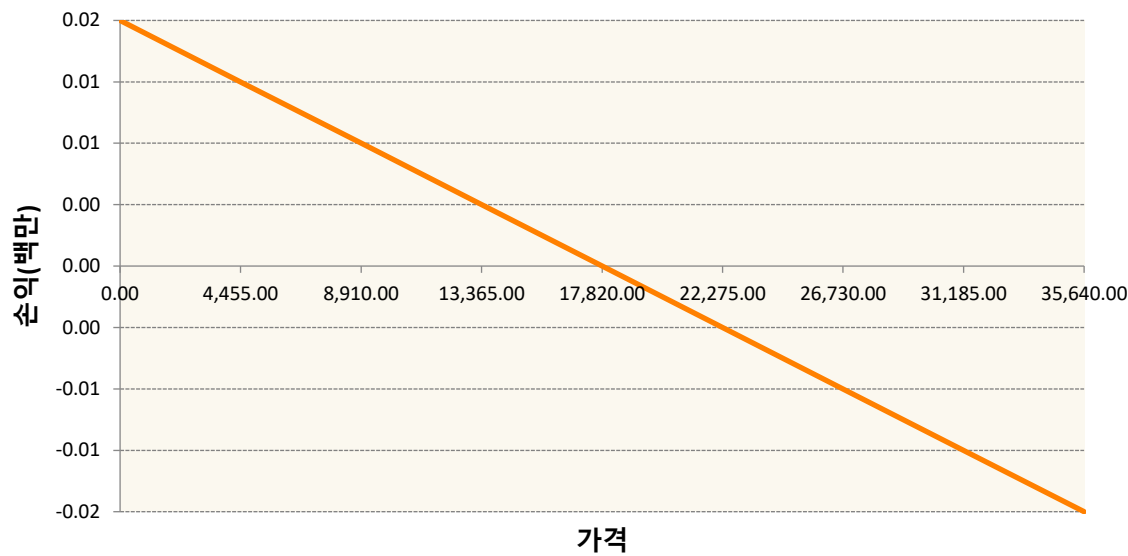
KR4149VB0009-2024-11 HD현대인프라코어개별선물



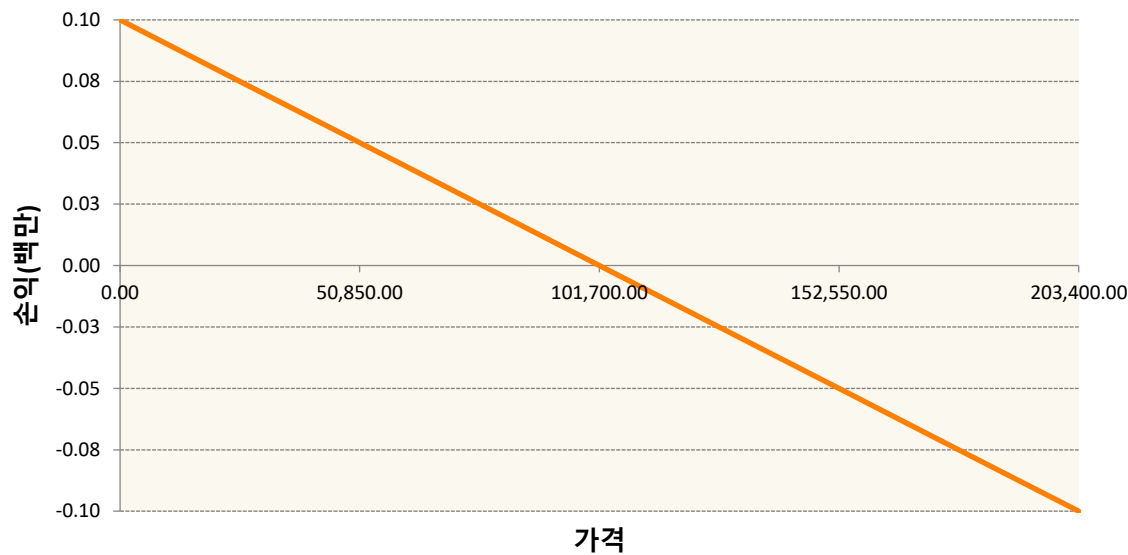
KR4150VB0005-2024-11 SK하이닉스개별선물



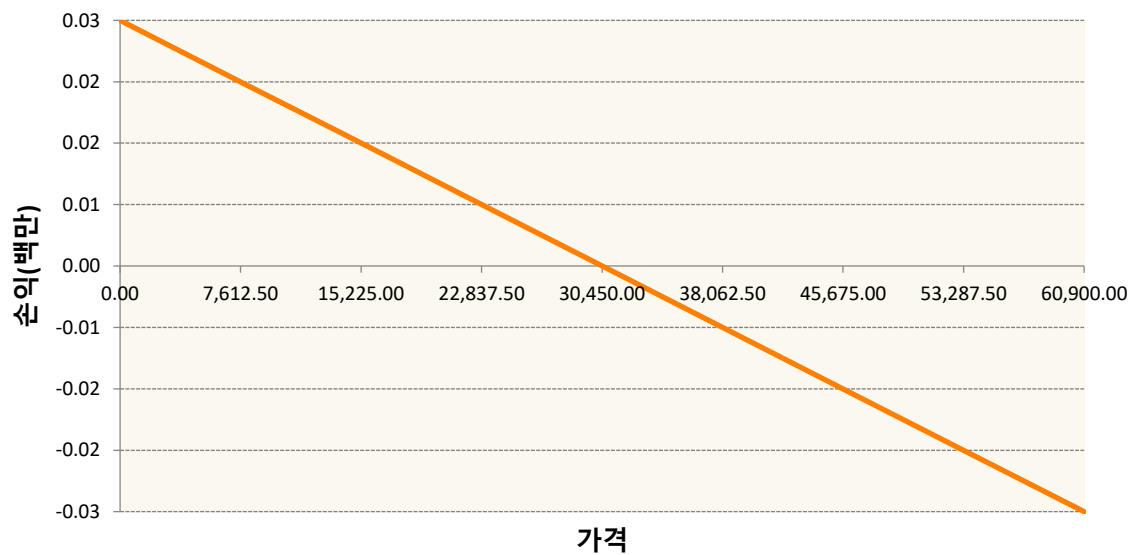
KR4151VB0004-2024-11 GS건설개별선물



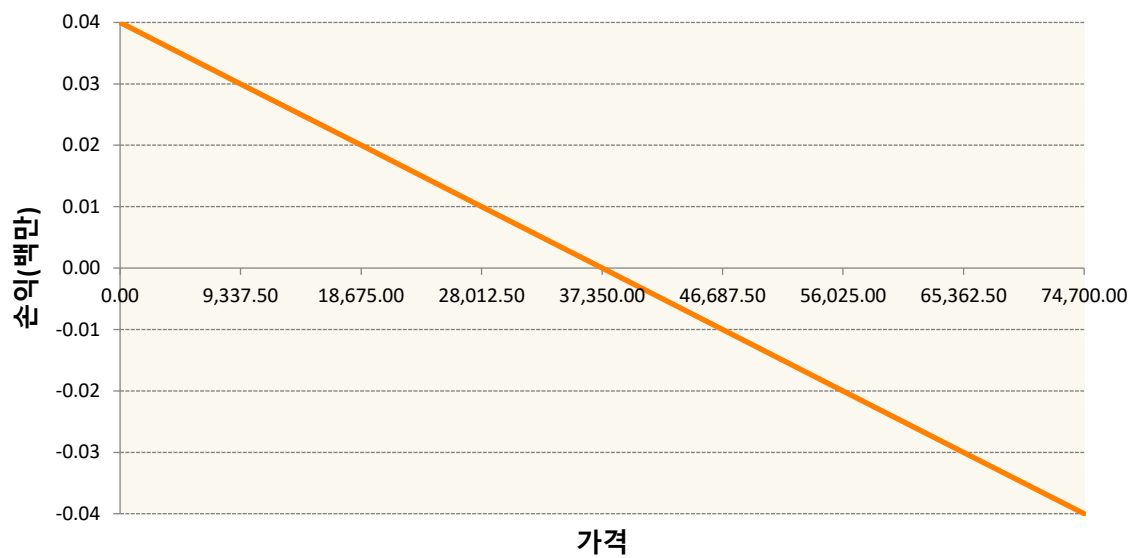
KR41BDVB0008-2024-11 삼성생명개별선물



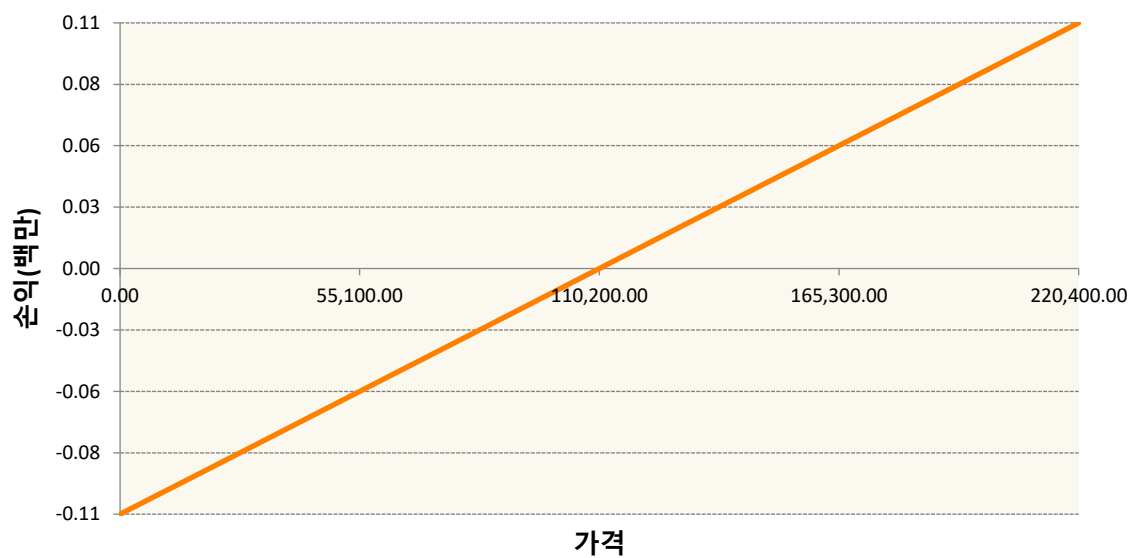
KR41CEVB0006-2024-11 현대해상개별선물



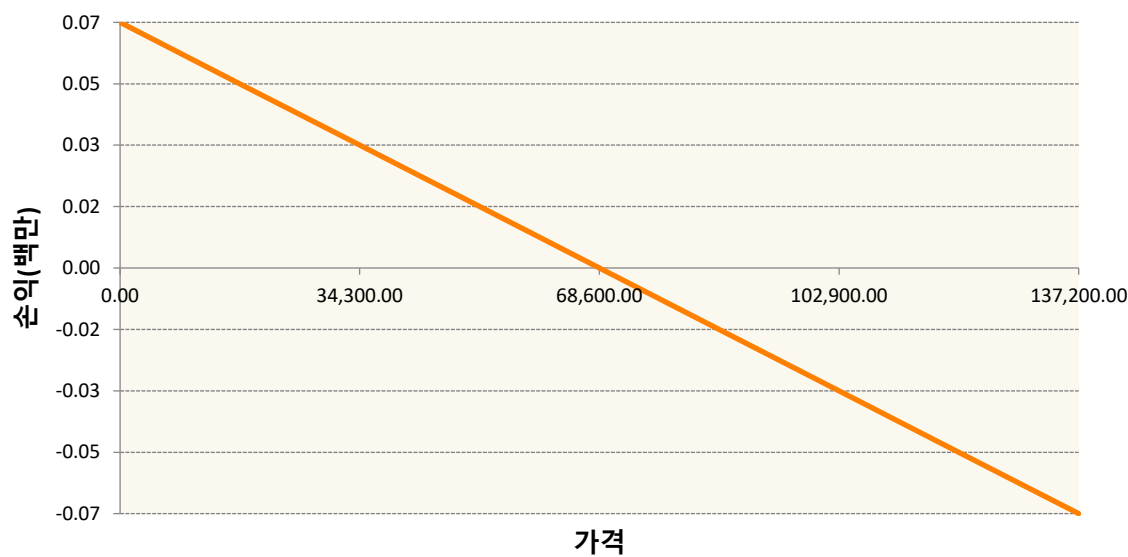
KR41CFVB0005-2024-11 카카오개별선물



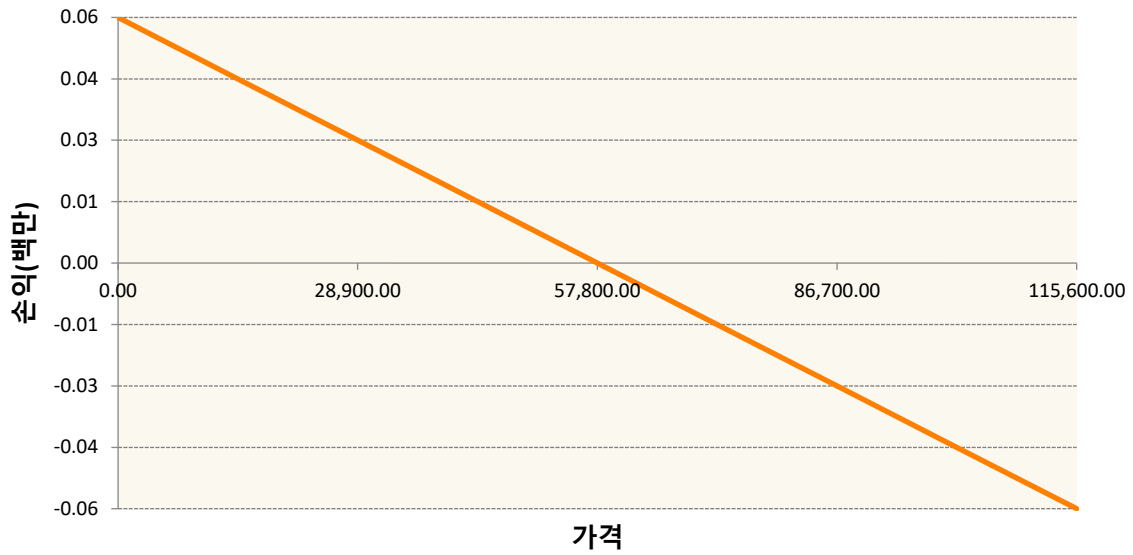
KR41D0VB0008-2024-11 DB손해보험개별선물



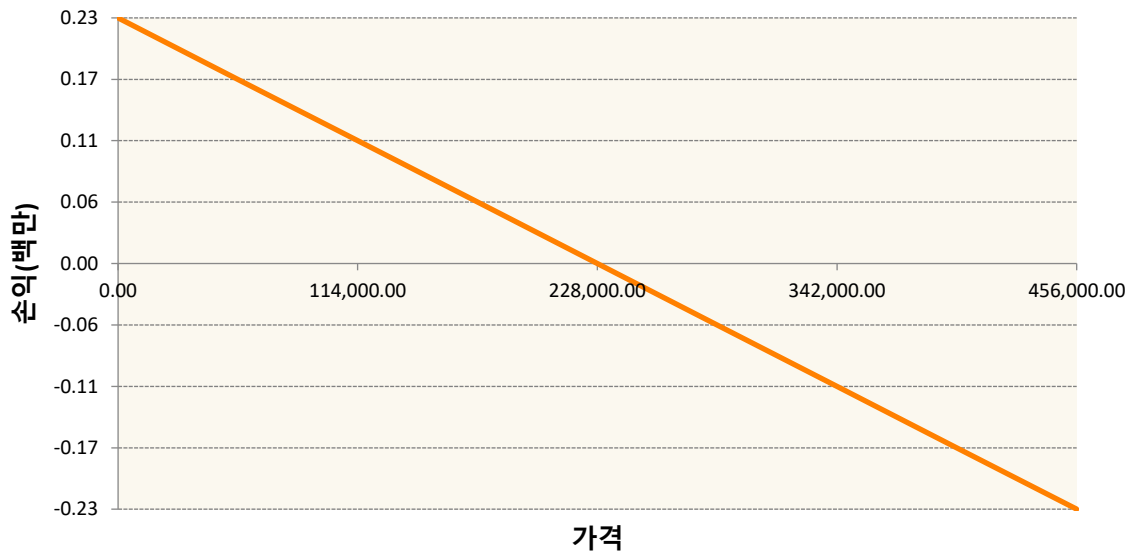
KR41E4VB0002-2024-11 에스엠개별선물



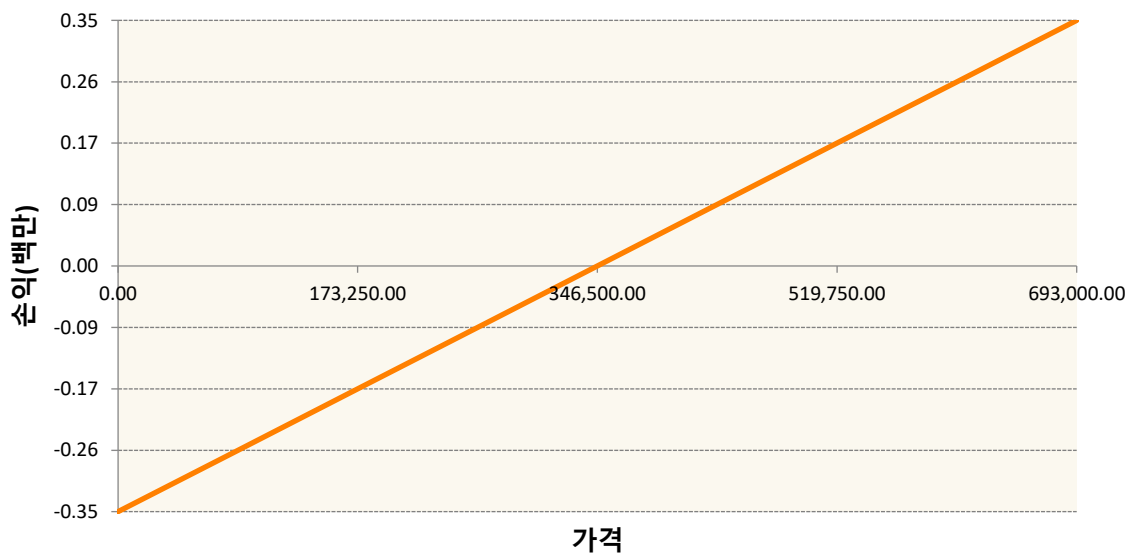
KR41E5VB0001-2024-11 넷마블개별선물



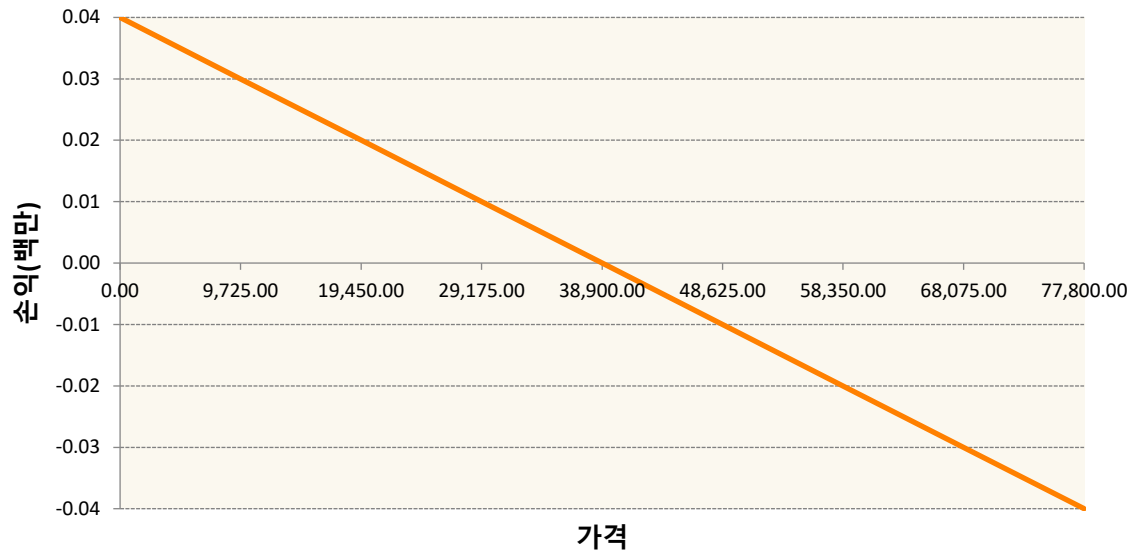
KR41E8VB0008-2024-11 포스코퓨처엠개별선물



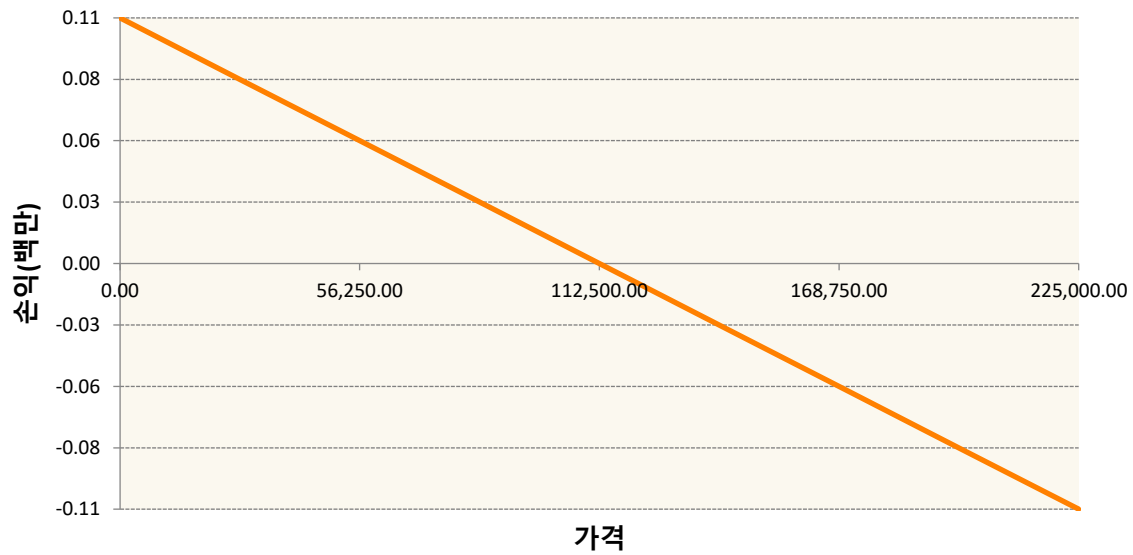
KR41F8VB0005-2024-11 크래프톤개별선물



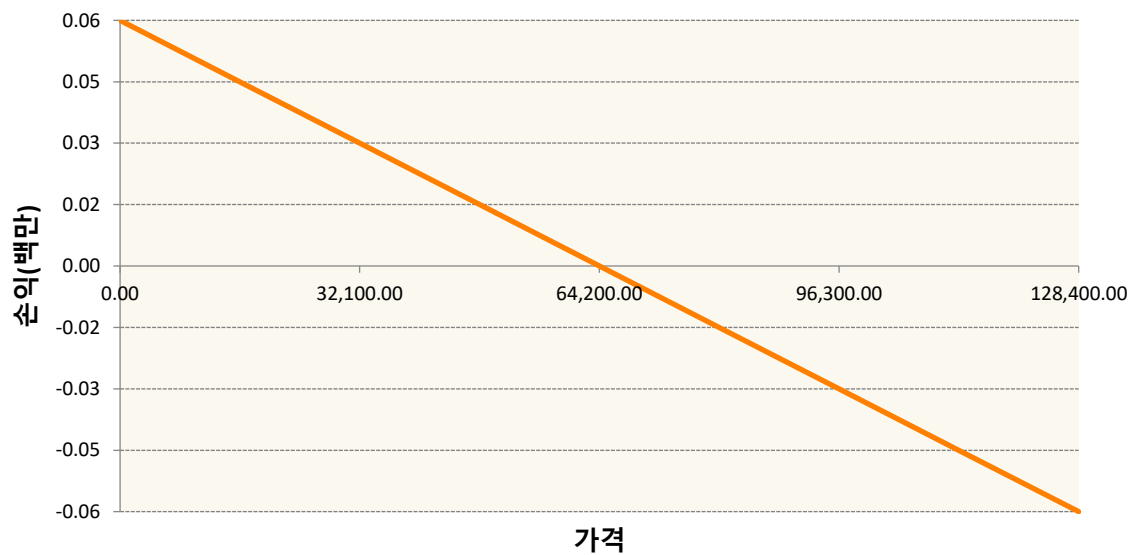
KR41FLVB0004-2024-11 펄어비스개별선물



KR41FMVB0003-2024-11 엘앤에프개별선물



KR41G6VB0005-2024-11 현대로템개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4112VB00 2024-11 SK텔레콤개별선물		1
KR4114VB00 2024-11 KT개별선물		1
KR4136VB00 2024-11 KT&G개별선물		0.26
KR4149VB00 2024-11 HD현대인프라코어개별선물		0.29
KR4150VB00 2024-11 SK하이닉스개별선물		1
KR4151VB00 2024-11 GS건설개별선물		1
KR41BDVB00 2024-11 삼성생명개별선물		0.41
KR41CEVB00 2024-11 현대해상개별선물		0.05
KR41CFVB00 2024-11 카카오개별선물		1
KR41D0VB00 2024-11 DB손해보험개별선물		1
KR41E4VB00 2024-11 에스엠개별선물		0.27
KR41E5VB00 2024-11 넷마블개별선물		0.32
KR41E8VB00 2024-11 포스코퓨처엠개별선물		0.18
KR41F8VB00 2024-11 크래프톤개별선물		1
KR41FLVB00 2024-11 펄어비스개별선물		0.31
KR41FMVB00 2024-11 엘앤에프개별선물		1
KR41G6VB00 2024-11 현대로템개별선물		0.1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	19

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

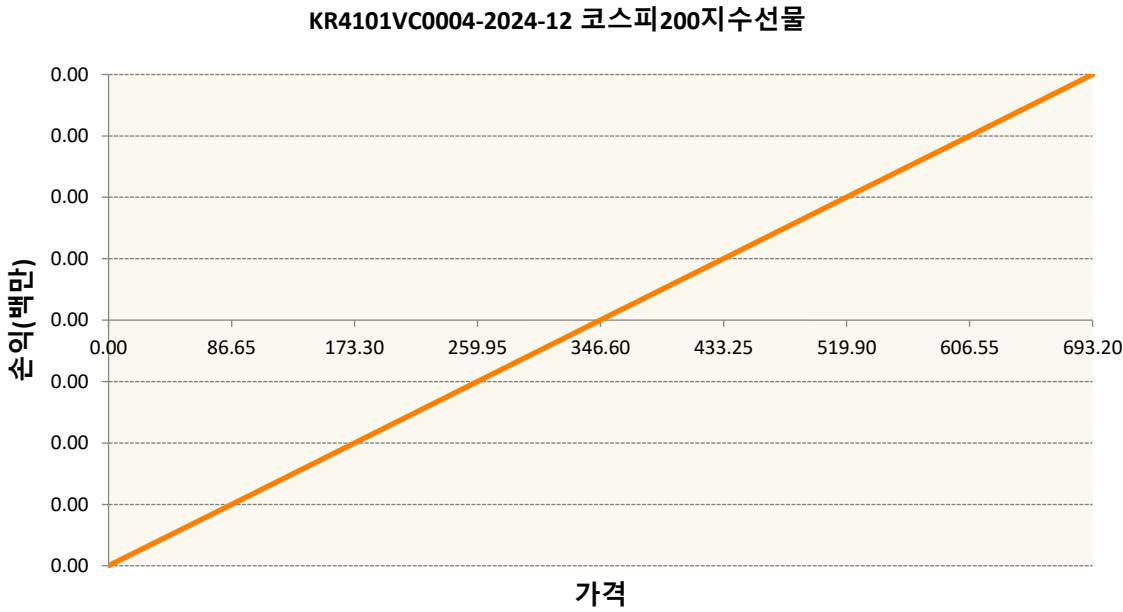
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	8,665	0	8,665	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					690
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-690	-690	-690	-690	-690	-690	-690
-5.33%	-460	-460	-460	-460	-460	-460	-460
-2.67%	-230	-230	-230	-230	-230	-230	-230
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	230	230	230	230	230	230	230
5.33%	460	460	460	460	460	460	460
8.00%	690	690	690	690	690	690	690

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

(단위:백만원)

842

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

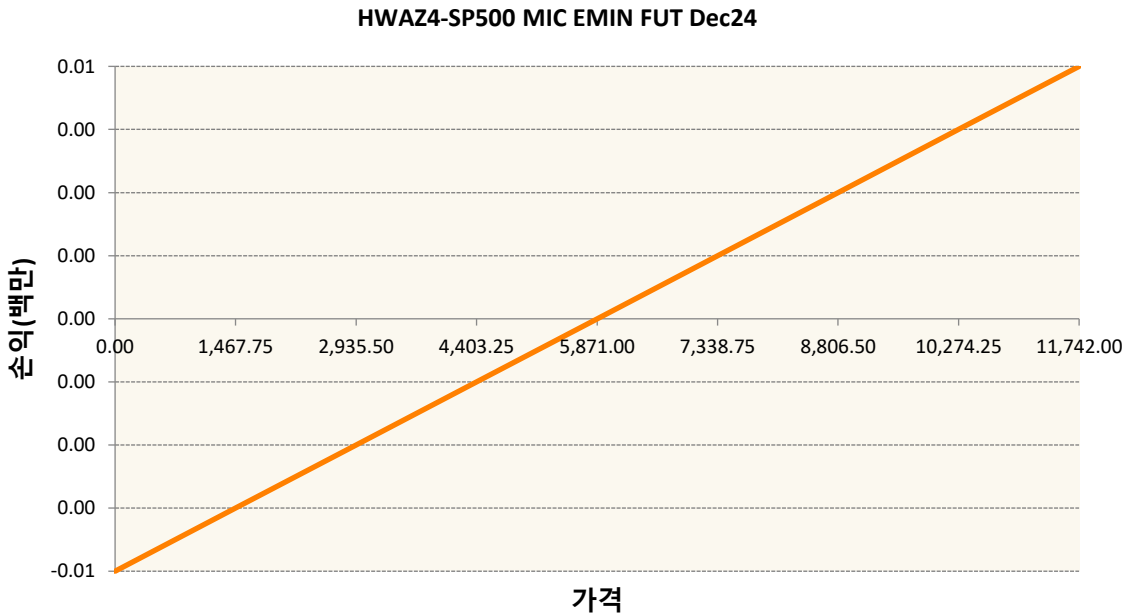
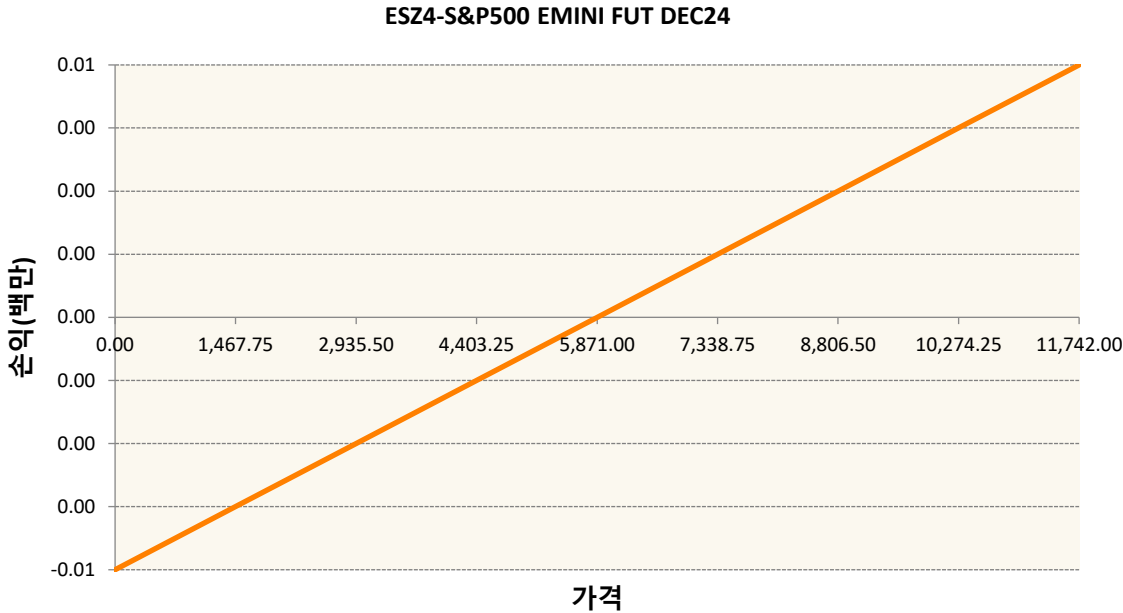
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	12,954	0	12,954	
누계	유가증권	선물	1,601	0	1,601	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,036
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	128

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	703

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

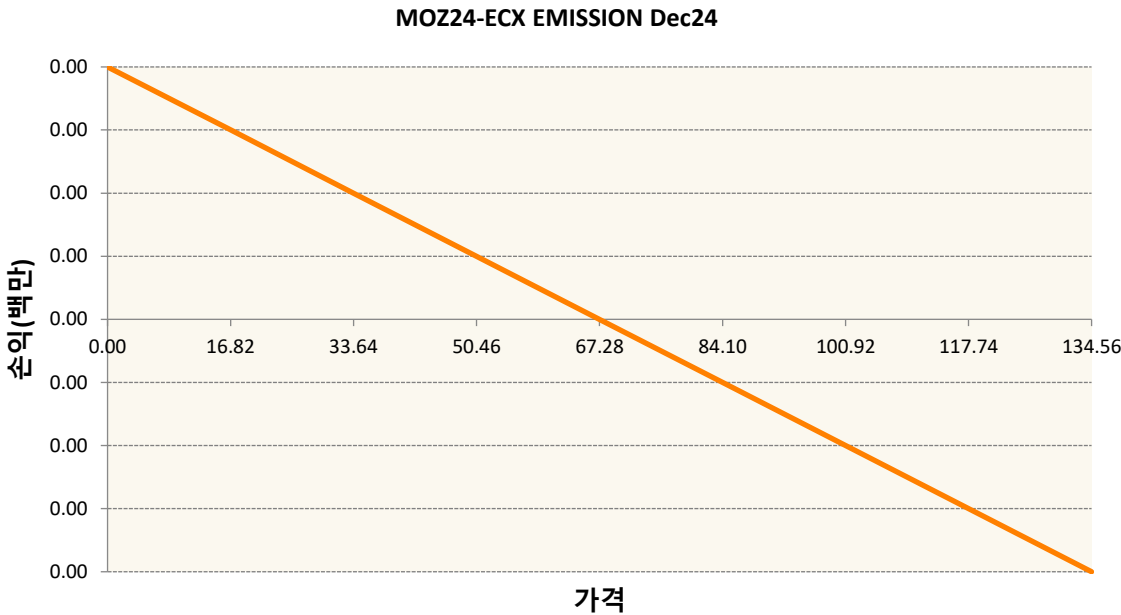
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,450	-5,454	
누계	통화	선도	0	2,995	-2,995	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.35
FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E	37
FXW213E9SC KRW/EUR 31-10-24E	89
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E	114
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	436

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

(단위:백만원)

863

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

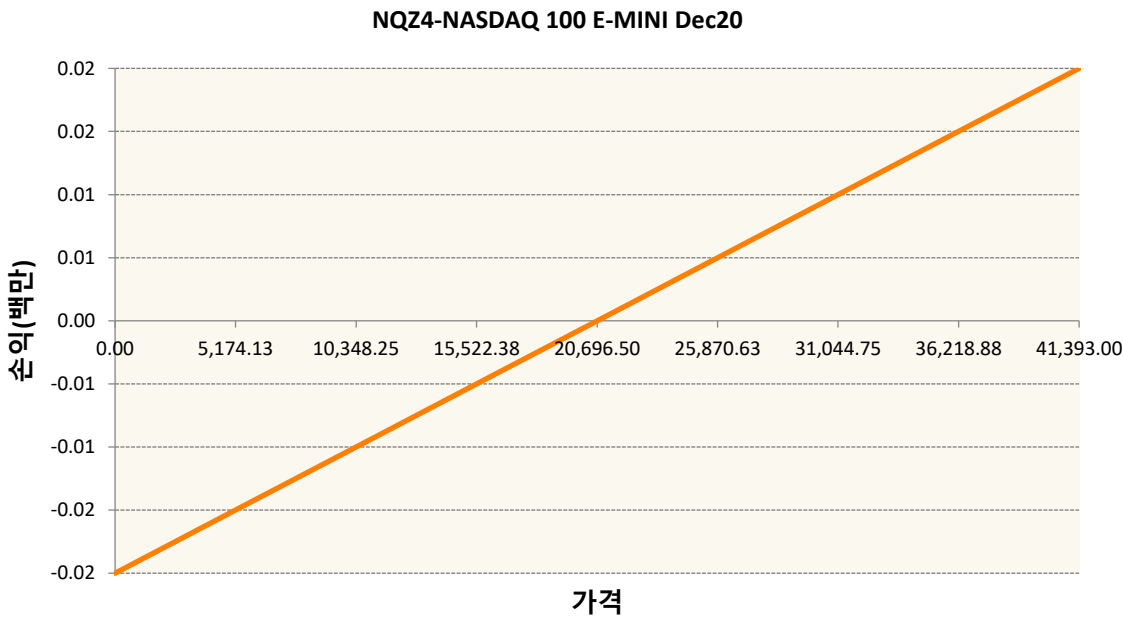
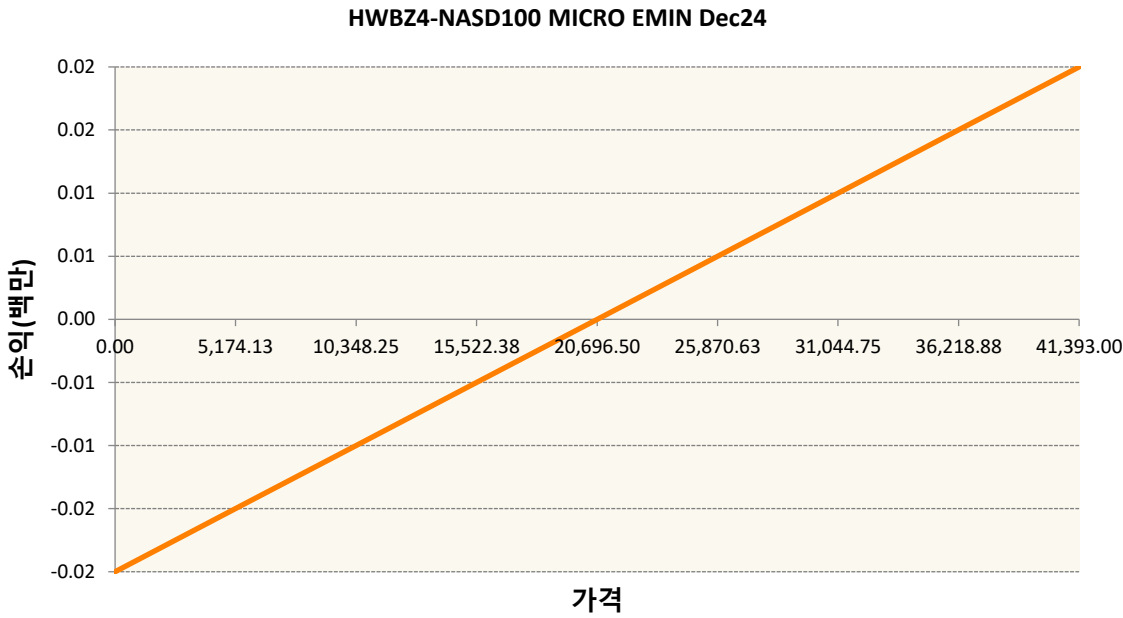
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	6,613	0	6,613	
누계	유가증권	선물	1,282	0	1,282	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24	103
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	529

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	514

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

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	4,809
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)

9,003

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

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	12
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-10-31
기준일	2024-10-30

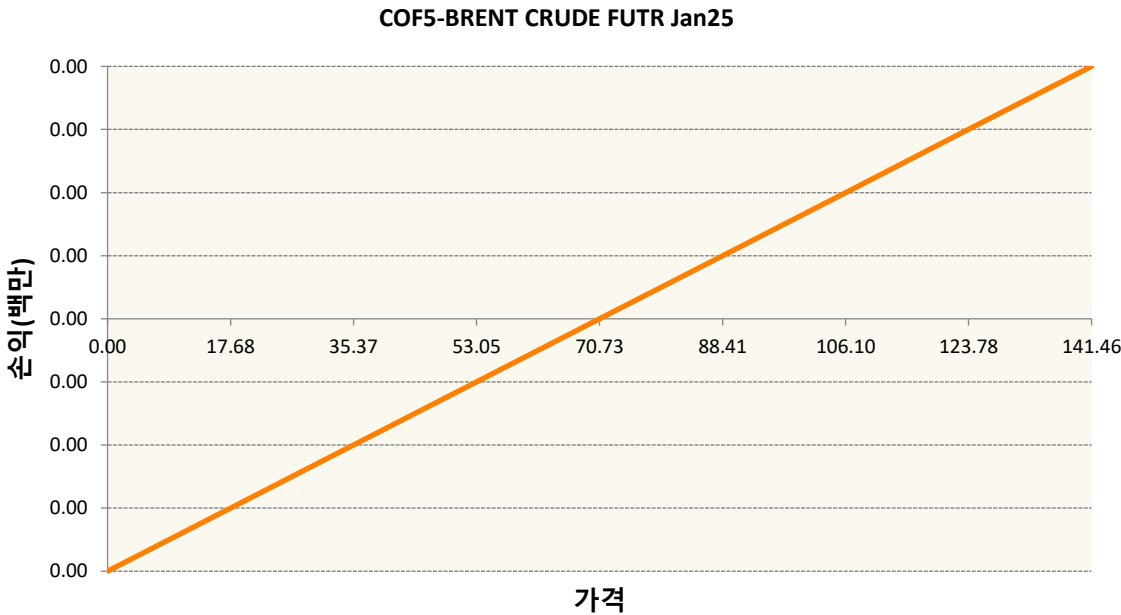
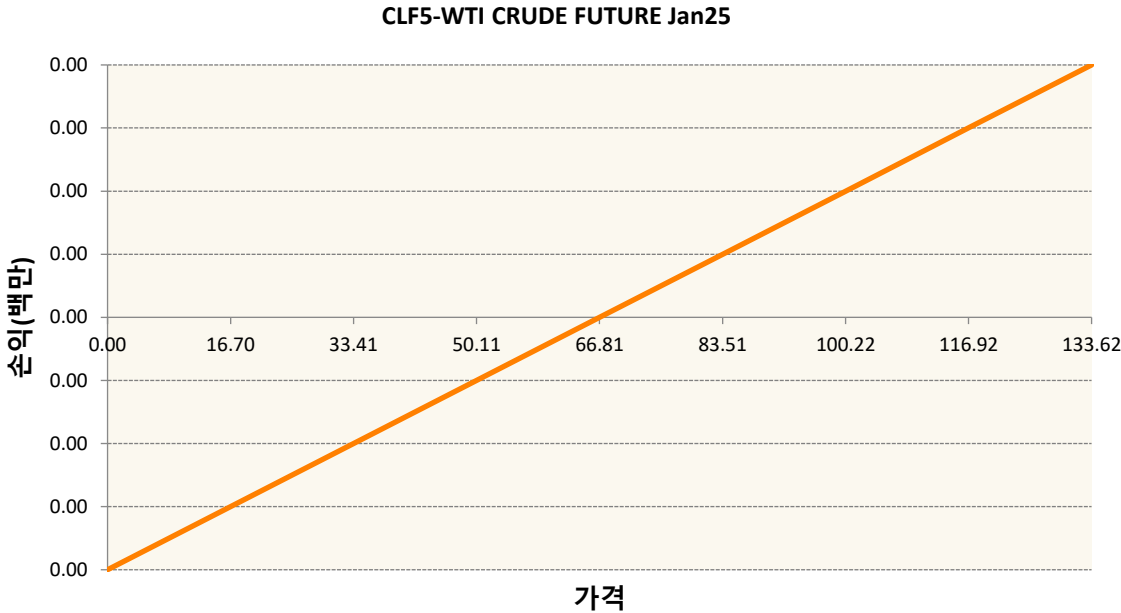
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

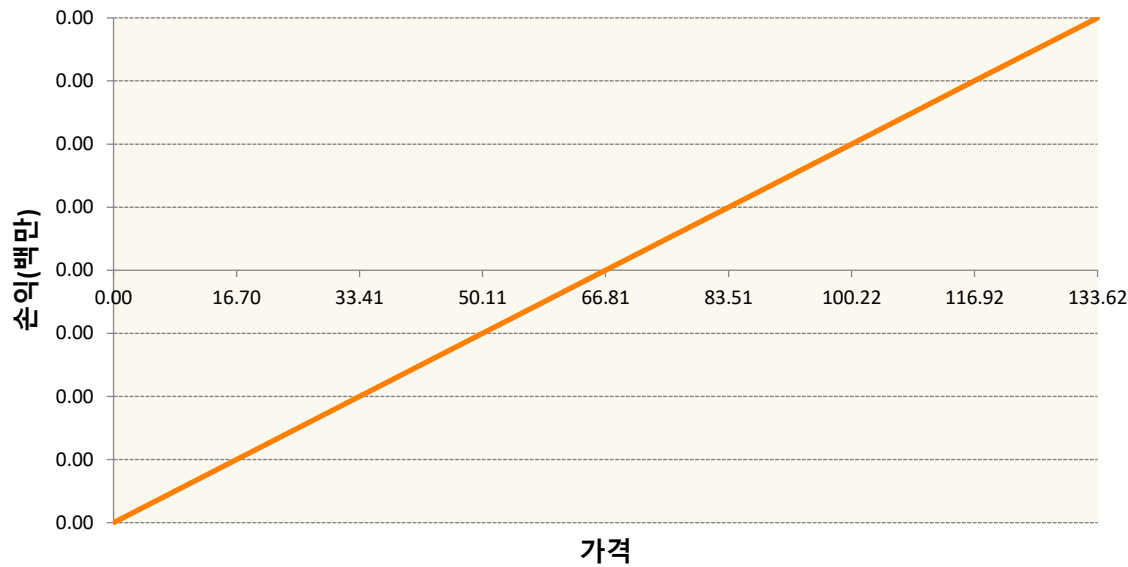
(단위:백만원)

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	760	0	760	
누계	통화	선물	0	97	-97	장내

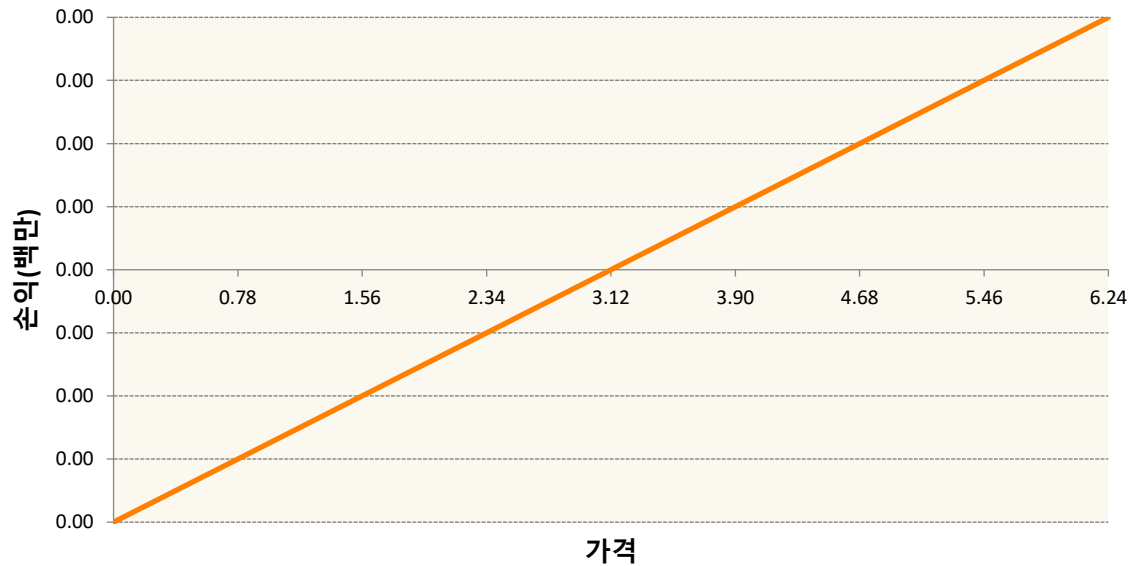
2. 만기시점의 손익구조



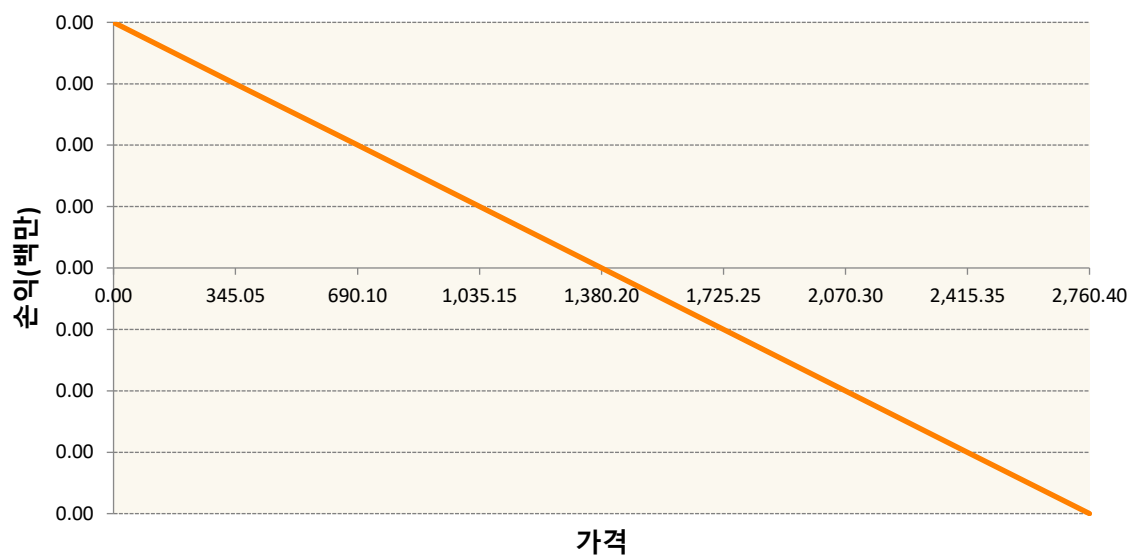
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



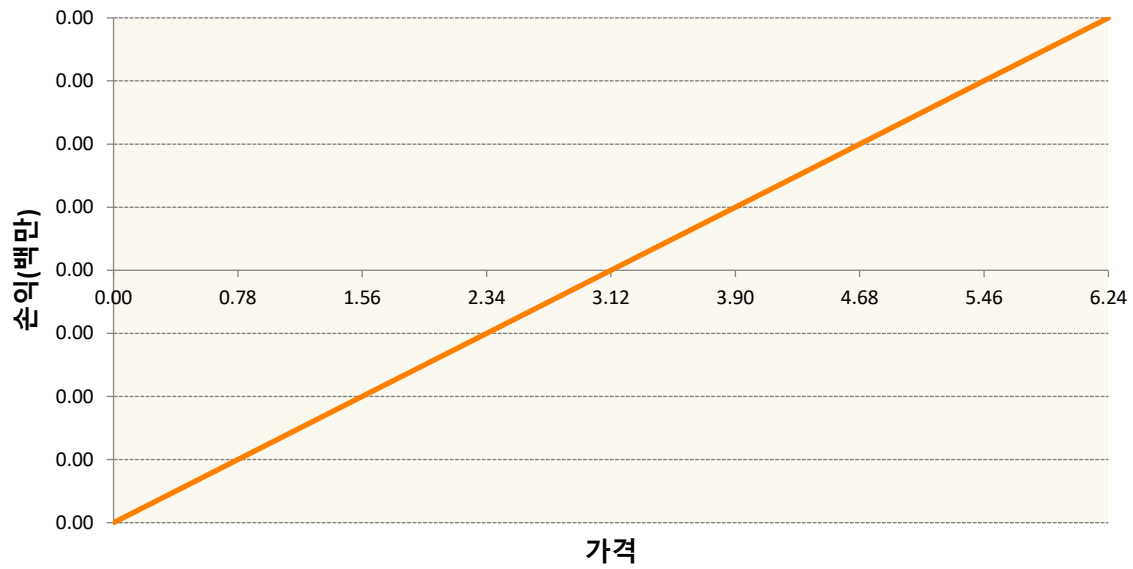
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



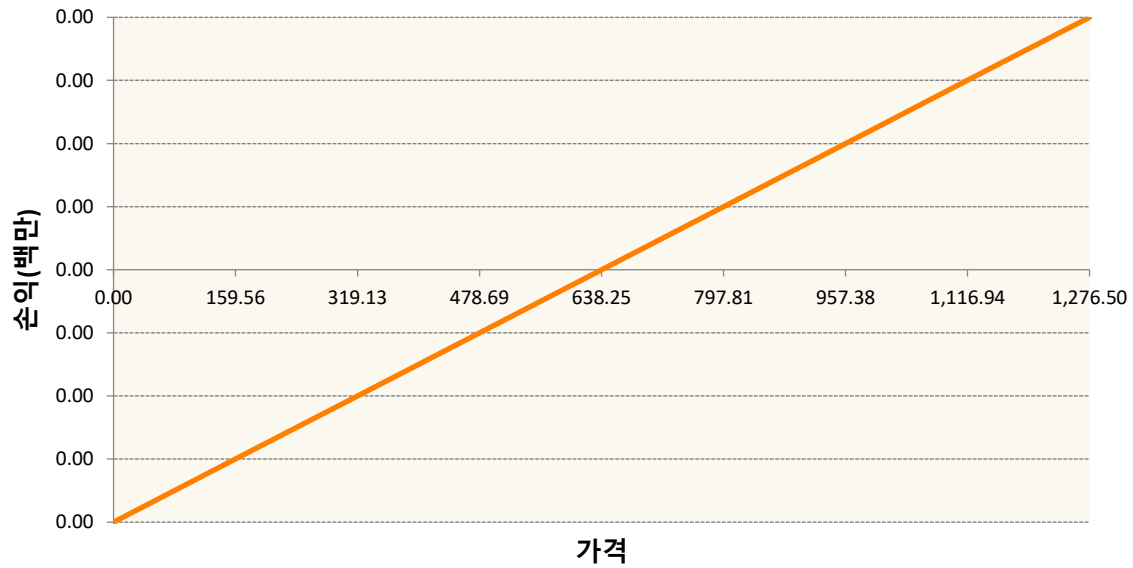
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



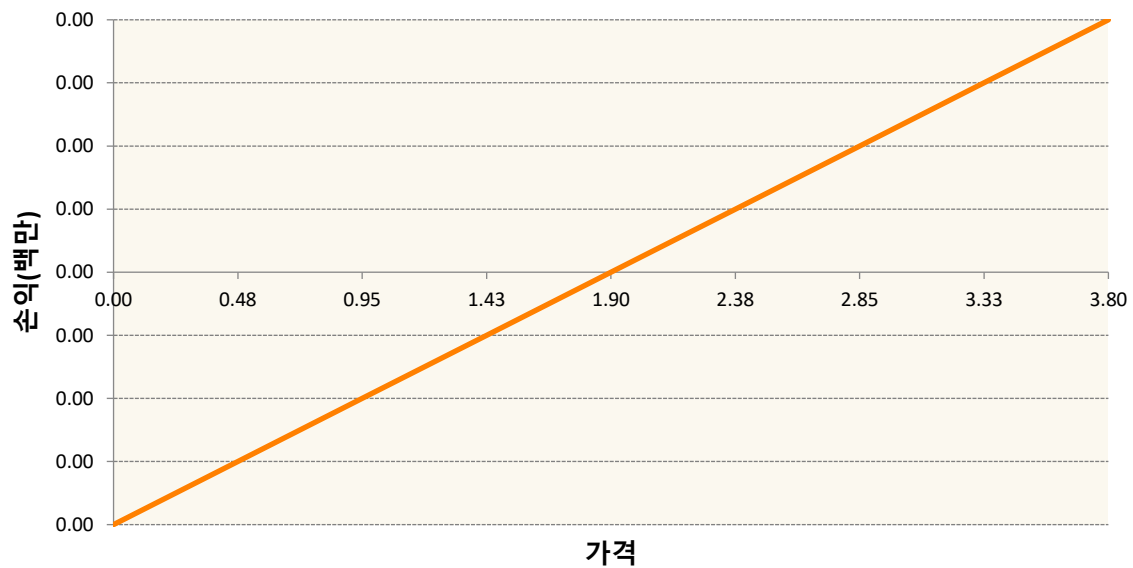
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



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	15
ECF5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	4
EOF5	E-MINI NATURAL GAS Jan25	3
KR4175VB00 2024-11 달러선물		8
NGF25	NATURAL GAS FUTR Jan25	17
QSF5	Low Su Gasoil G Jan25	7
XBF5	GASOLINE RBOB FUT Jan25	9

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

134