

공시일 2024-11-05

기준일 2024-11-04

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	2024-11-05
기준일	2024-11-04

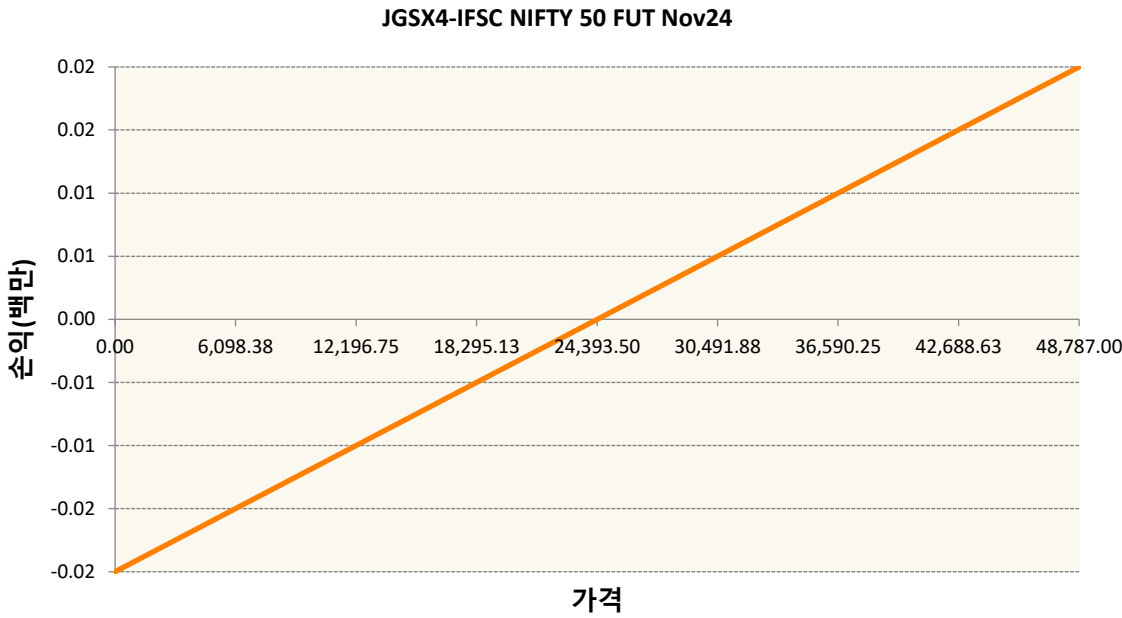
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,238	0	3,238	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSX4	IFSC NIFTY 50 FUT Nov24	259
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

167

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

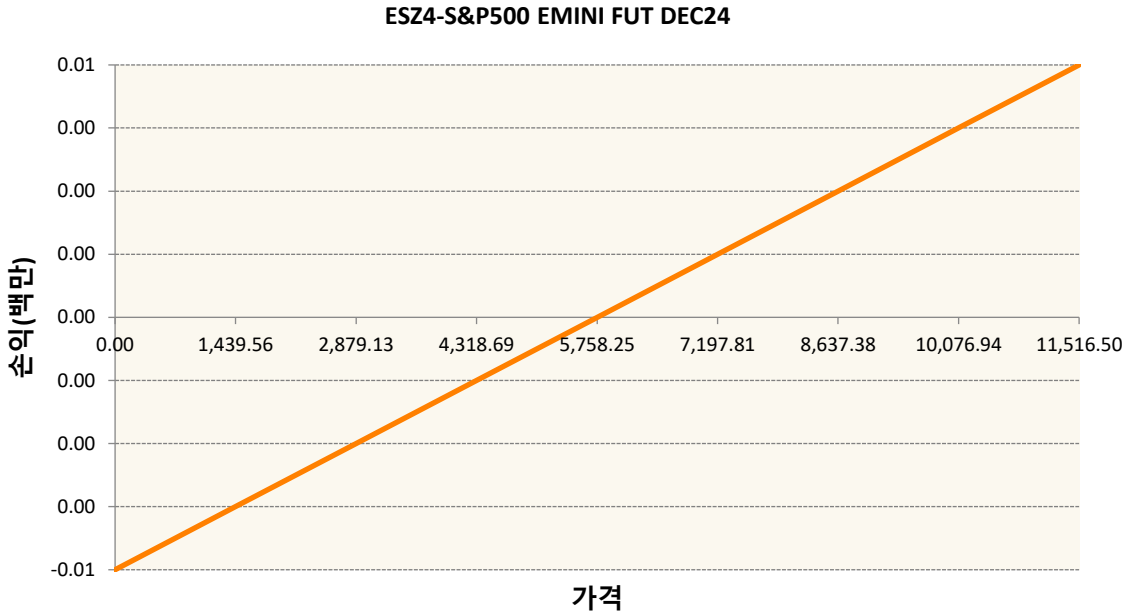
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	789	0	789	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOIXSPUSC5 XSP US 11/04/24 C572 INDEX	0.18
ESZ4 S&P500 EMINI FUT DEC24	63

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

(단위:백만원)

38

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

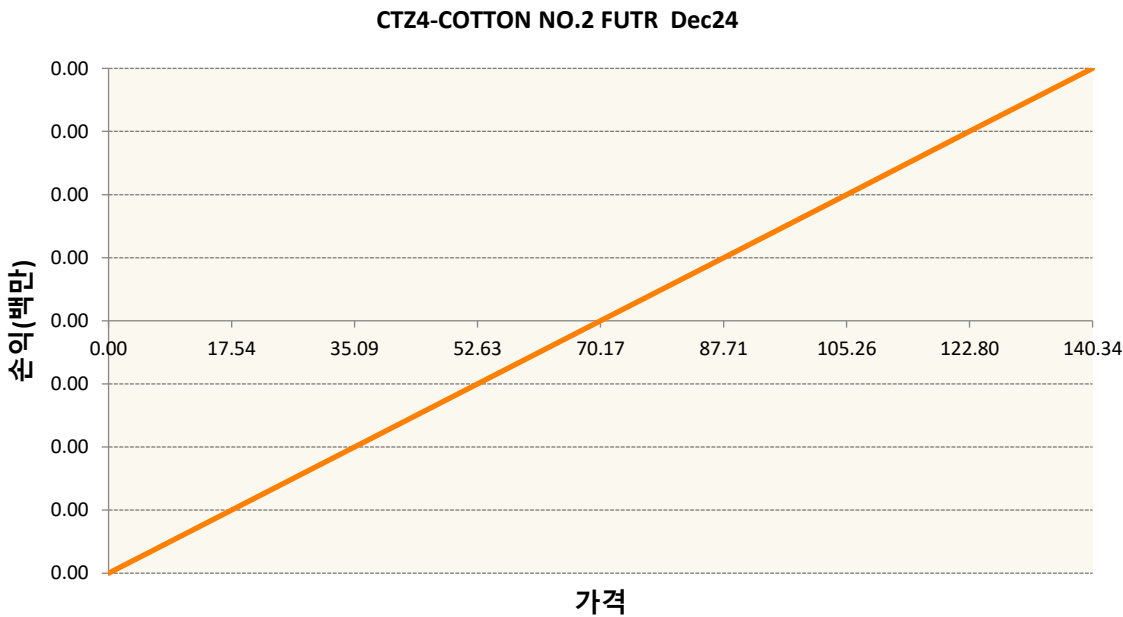
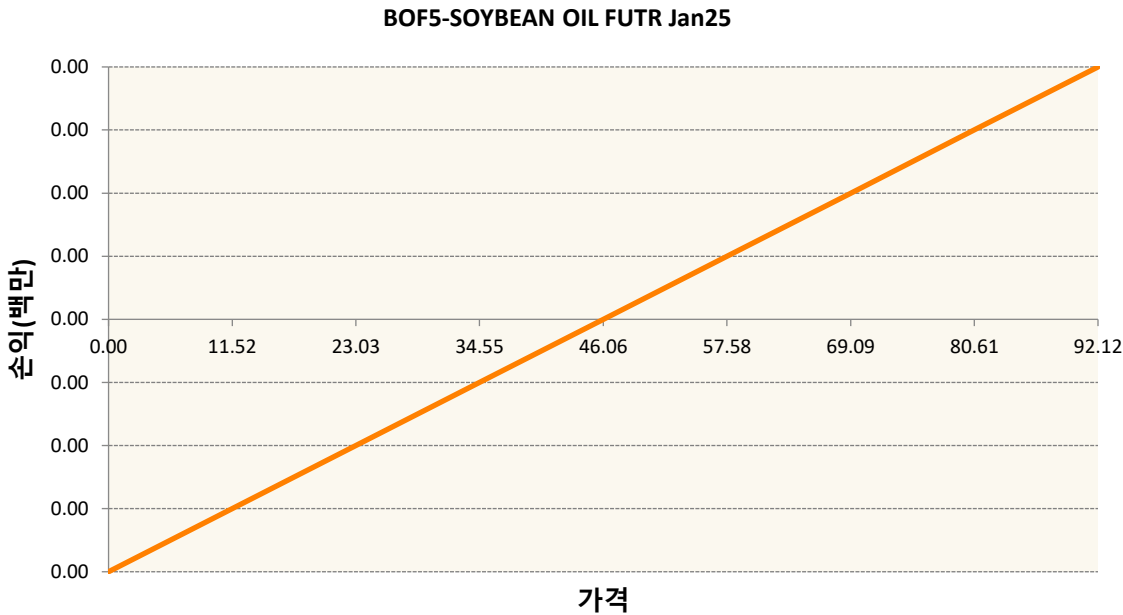
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

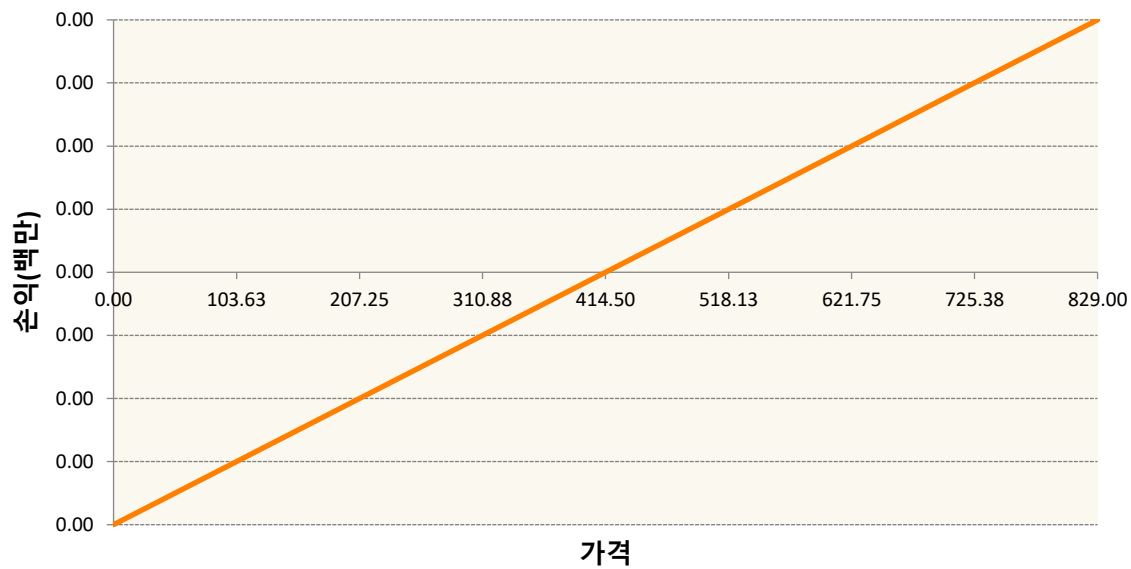
(단위:USD 백만)

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	3,723	0	3,723	
누계	통화	선물	0	480	-480	장내

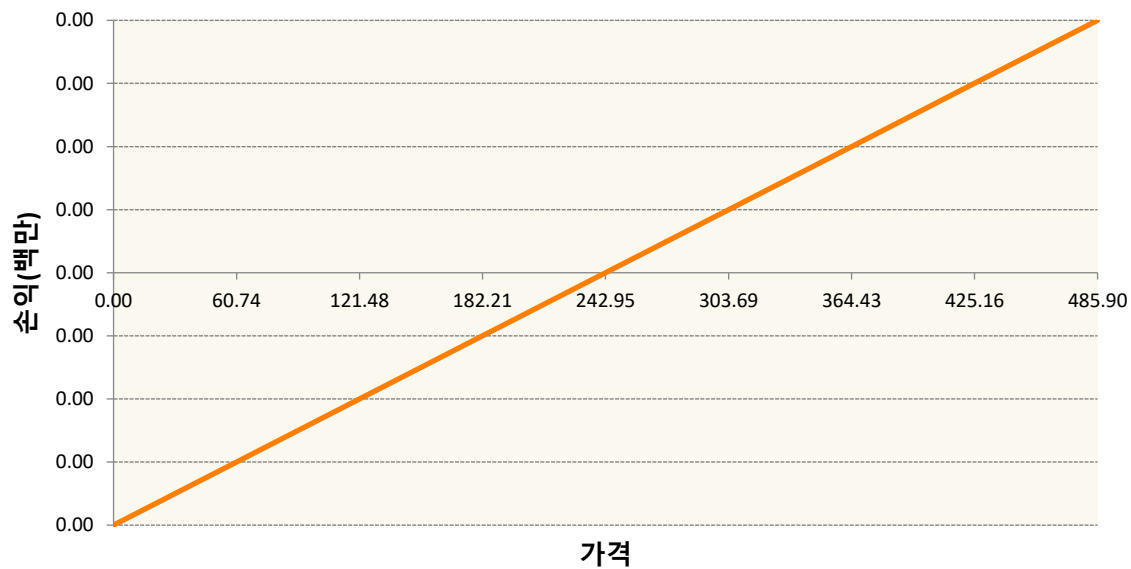
2. 만기시점의 손익구조



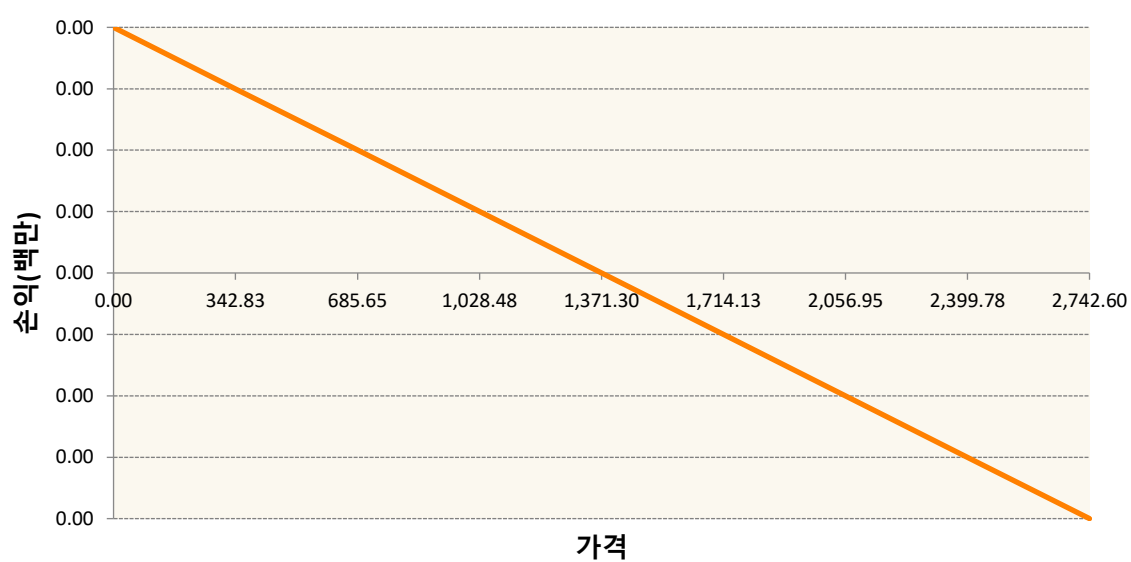
CZ4-CORN FUTURE Dec24



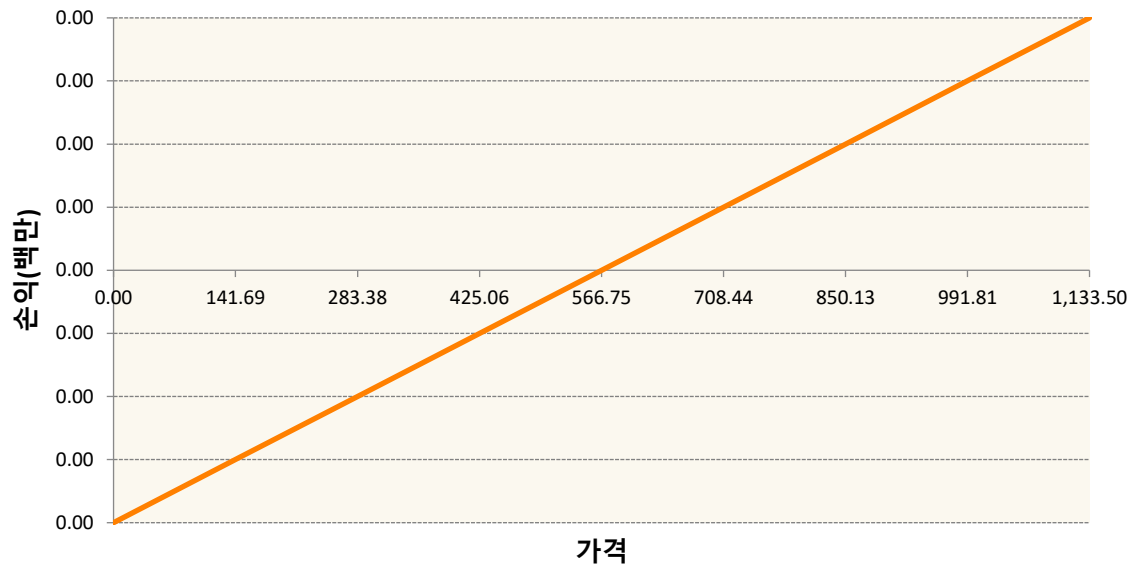
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



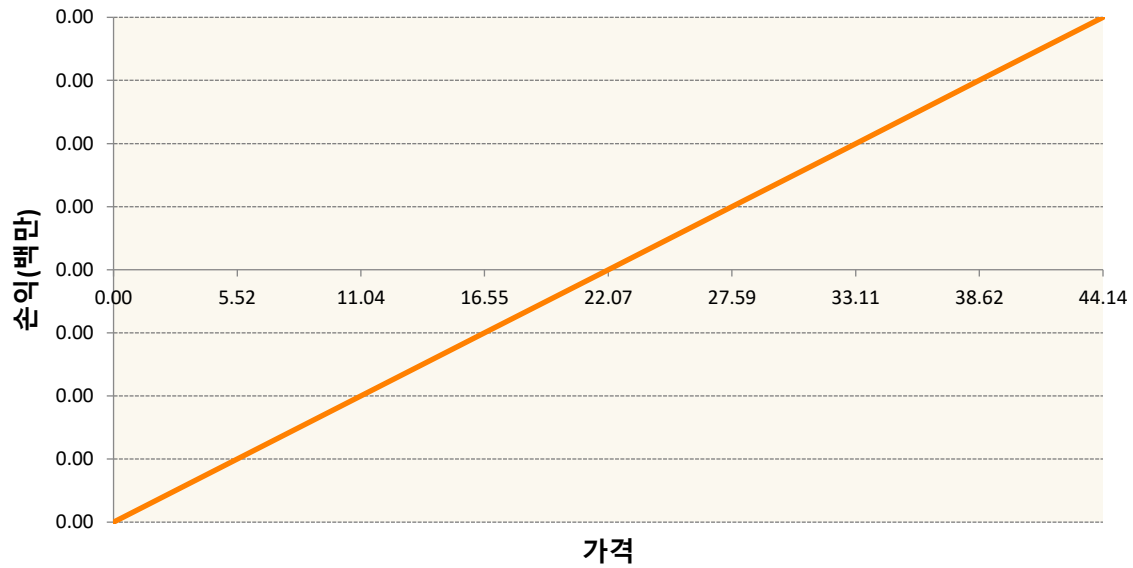
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



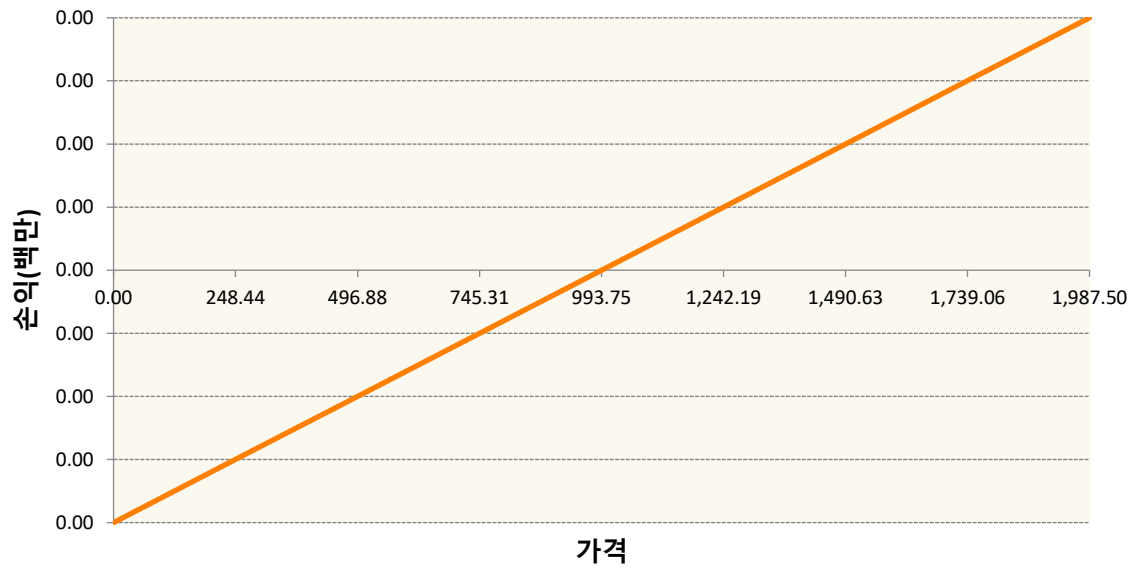
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24



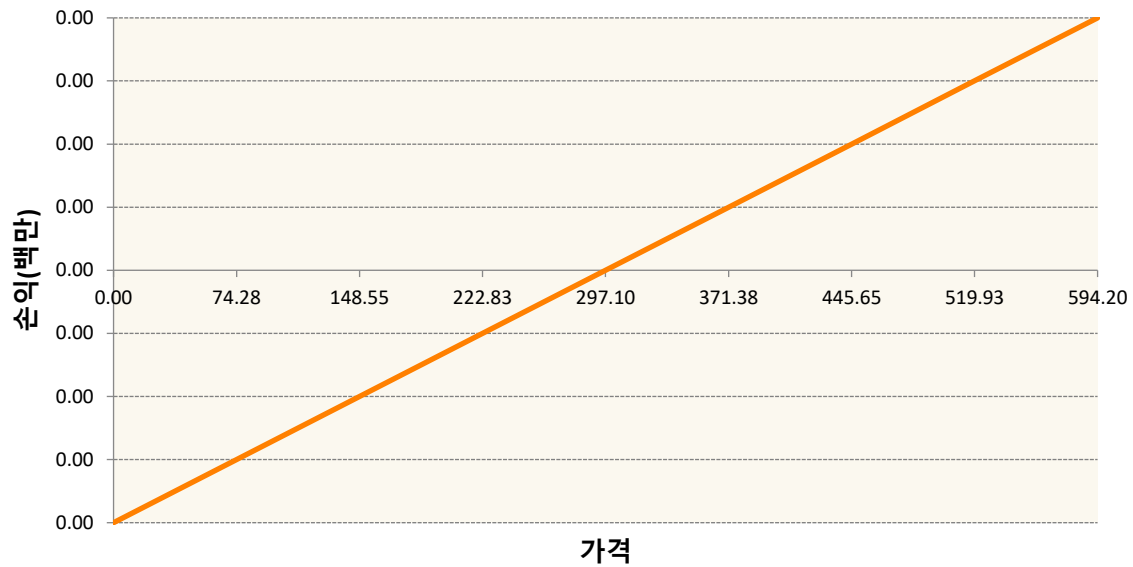
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



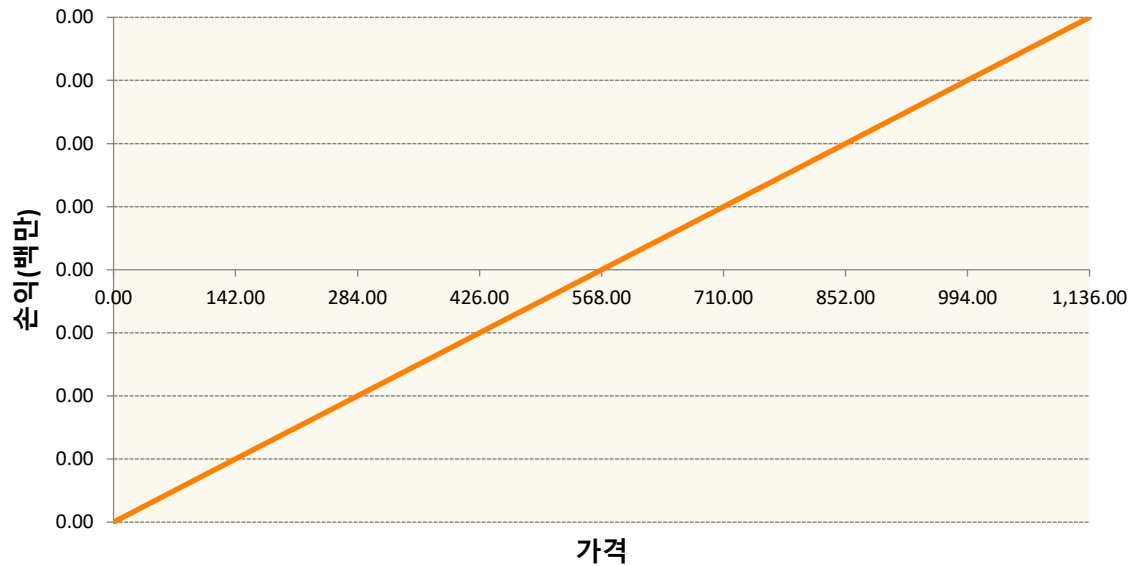
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



SMF5-SOYBEAN MEAL FUTR Jan25



WZ4-WHEAT FUTURE(CBT) Dec24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

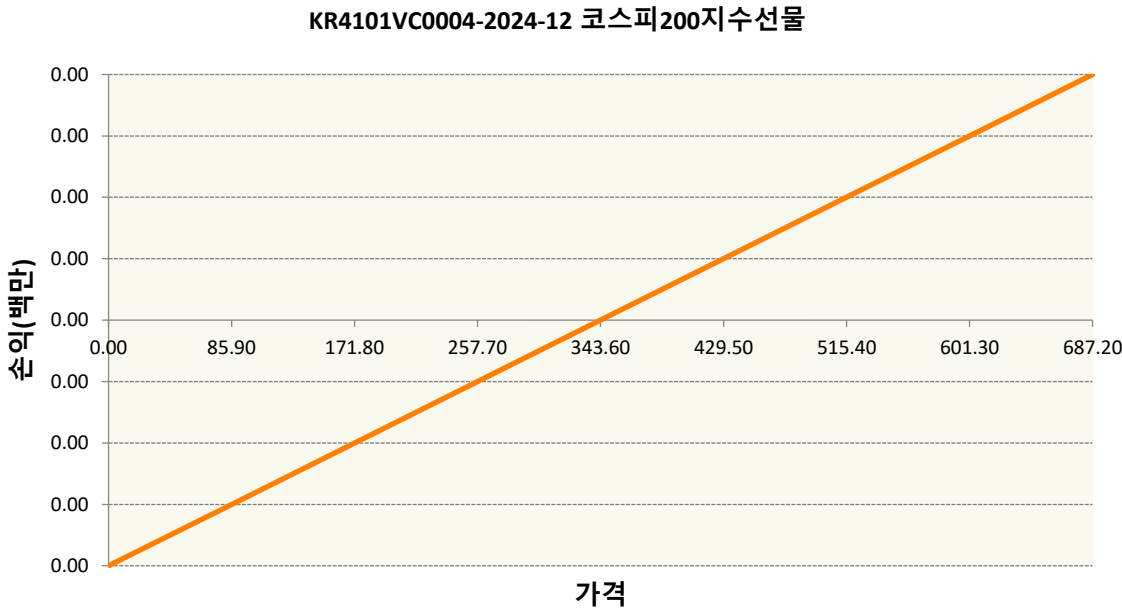
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,437	3,436	1	장내
누계	유가증권	선물	1,804	0	1,804	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				144
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
-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%	96	96	96	96	96	96	96
8.00%	144	144	144	144	144	144	144

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

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	302
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

487

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

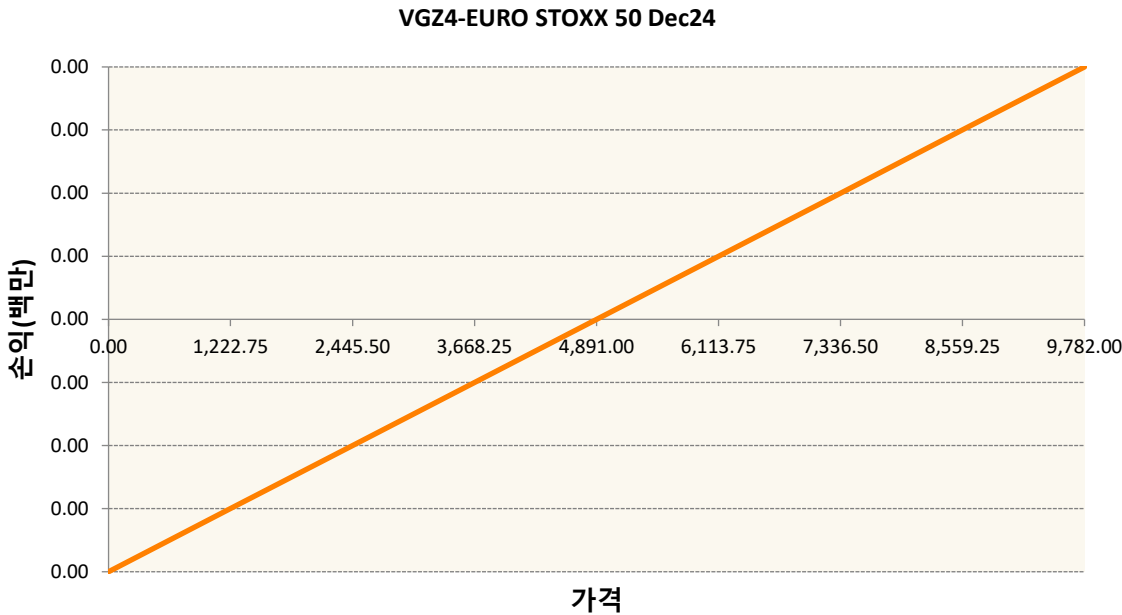
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	945	0	945	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ4	EURO STOXX 50 Dec24	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

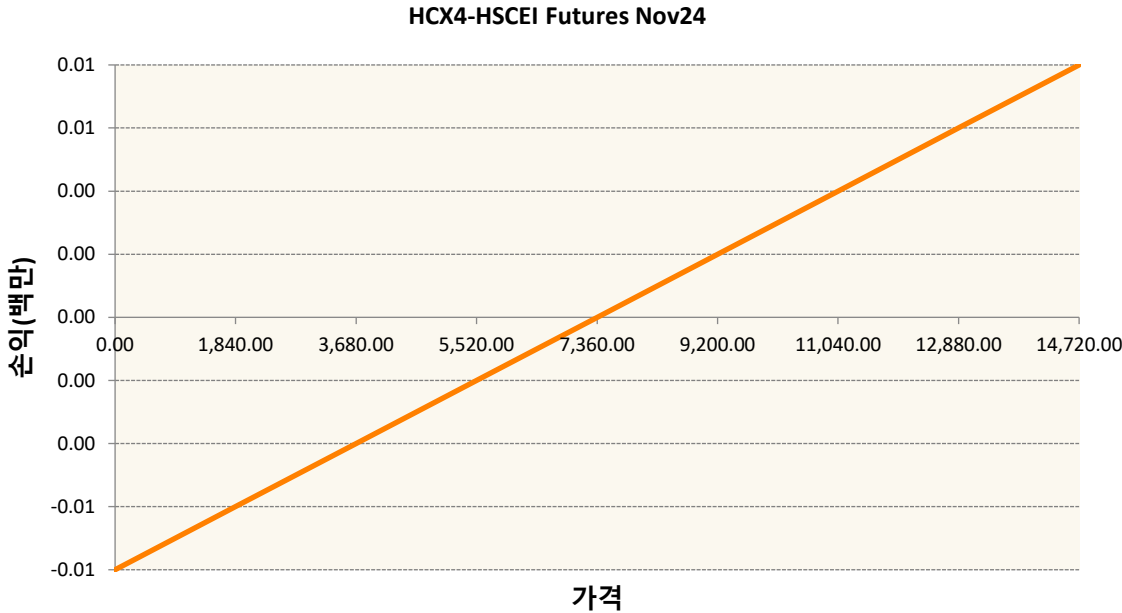
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,574	0	1,574	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX4	HSCEI Futures Nov24	126
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

172

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

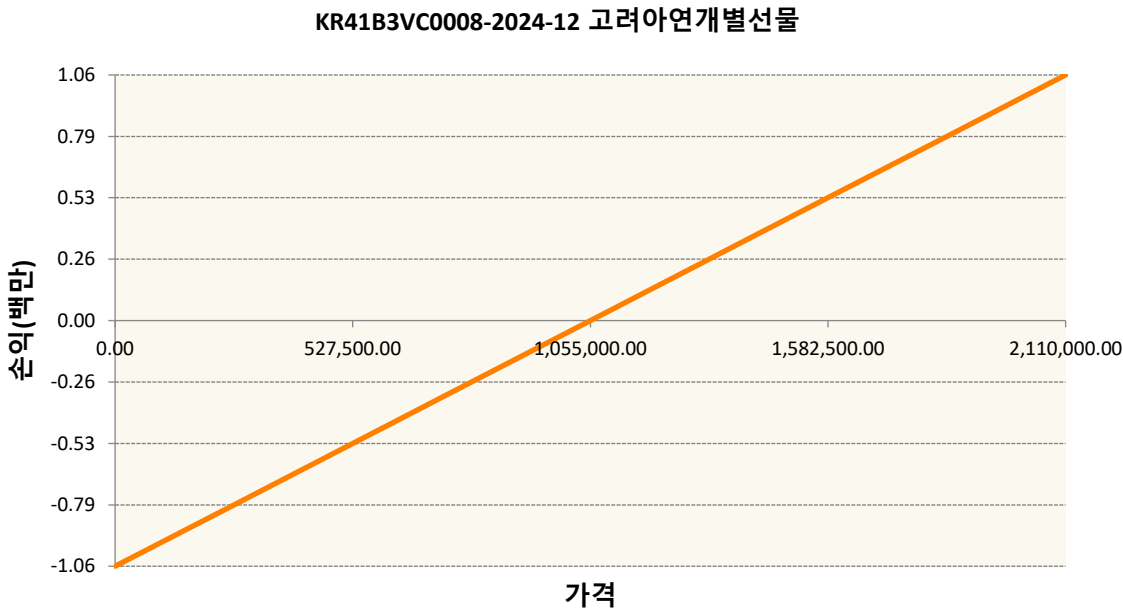
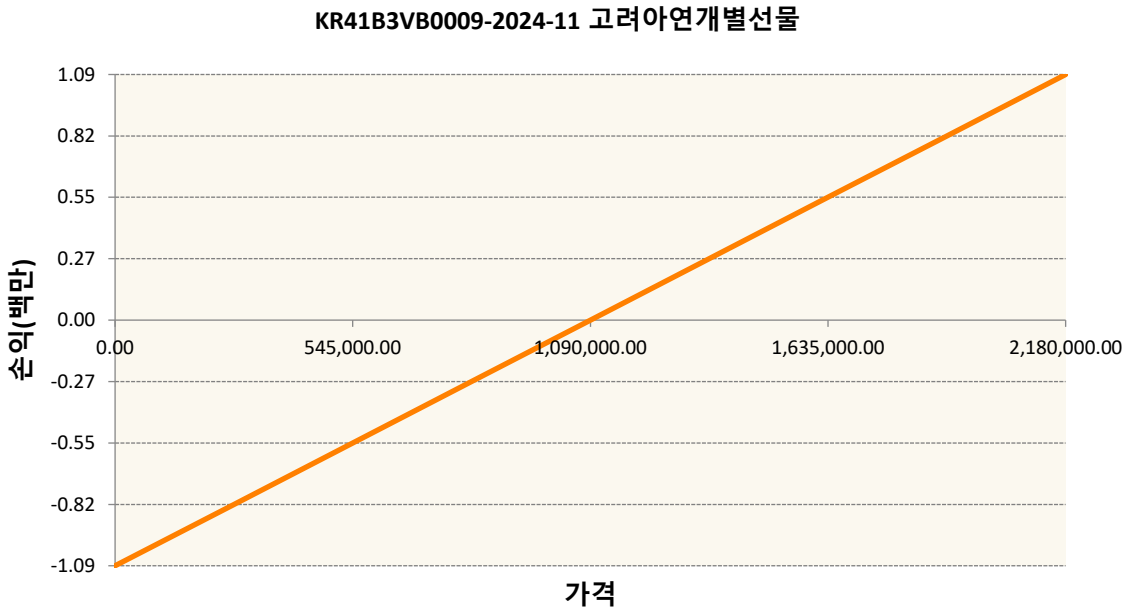
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

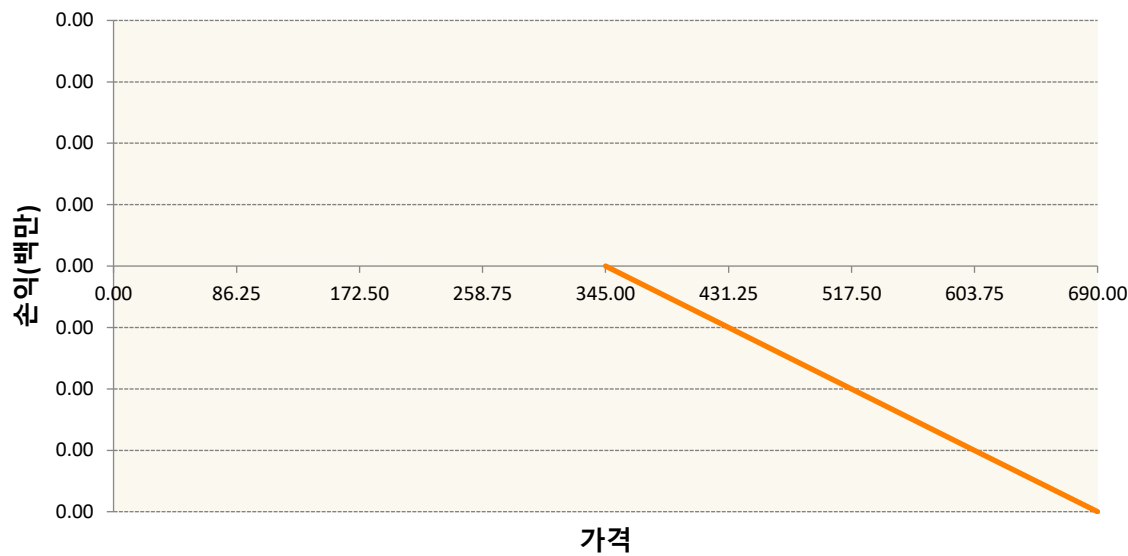
(단위:백만원)

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	283	0	283	장내
누계	유가증권	옵션	0	40,131	-40,131	장내

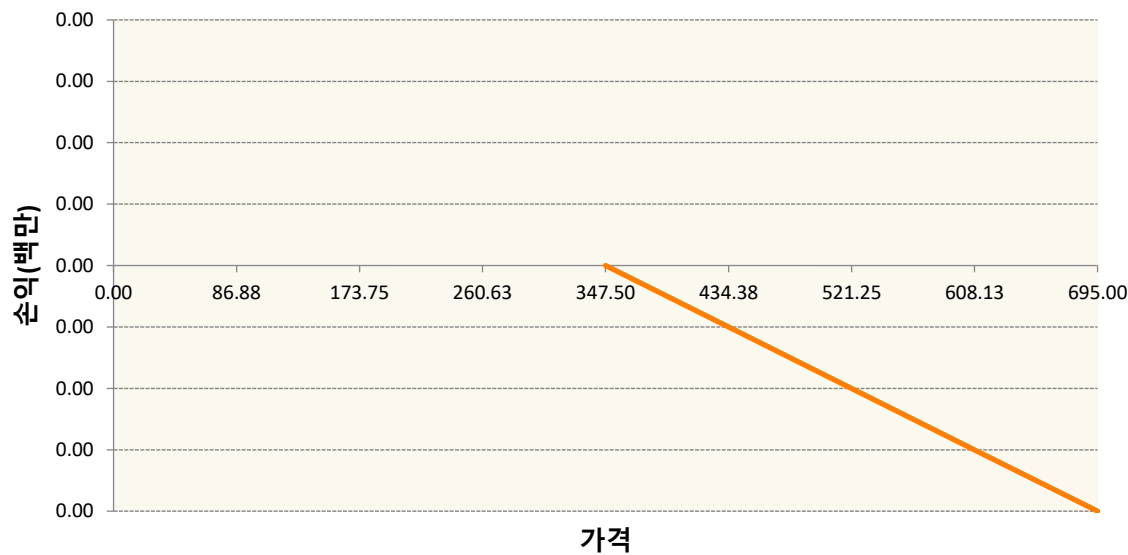
2. 만기시점의 손익구조



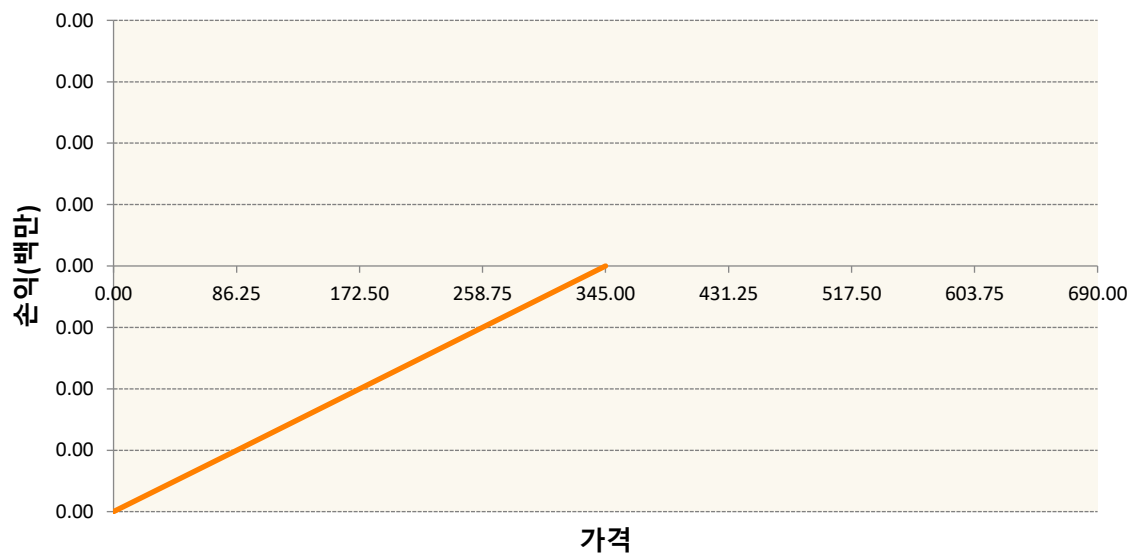
KR4201VB3453-2024-11 콜345



KR4201VB3479-2024-11 콜347.5



KR4301VB3452-2024-11 풋345



(단위:백만원)

KR41B3VB0009							2024-11 고려아연개별선물		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			
KR41B3VC0008							2024-12 고려아연개별선물		1	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1			
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1			
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	0	0	0	0	0	0	0			
5.33%	1	1	1	1	1	1	1			
8.00%	1	1	1	1	1	1	1			
KR4201VB3453							2024-11 콜345		1,833	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	434	433	430	427	421	414	405			
-5.33%	424	415	404	390	374	356	335			
-2.67%	356	330	301	271	240	207	174			
0%	122	81	41	0	-41	-81	-122			
2.67%	-357	-390	-424	-460	-496	-533	-570			
5.33%	-1,026	-1,041	-1,059	-1,079	-1,102	-1,127	-1,154			
8.00%	-1,776	-1,780	-1,786	-1,795	-1,805	-1,818	-1,833			
KR4201VB3479							2024-11 콜347.5		200	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	40	40	40	39	39	38	37			
-5.33%	39	39	38	36	35	33	31			
-2.67%	34	32	29	26	23	19	16			
0%	14	9	5	0	-5	-9	-14			
2.67%	-34	-38	-43	-47	-52	-56	-61			
5.33%	-106	-109	-111	-114	-117	-121	-124			
8.00%	-191	-192	-193	-194	-196	-198	-200			
KR4301VB3452							2024-11 풋345		499	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-491	-492	-492	-493	-495	-497	-499
-5.33%	-293	-295	-298	-301	-306	-310	-316
-2.67%	-109	-116	-123	-131	-139	-147	-156
0%	32	21	11	0	-11	-21	-32
2.67%	109	100	91	82	72	63	53
5.33%	136	132	127	122	116	109	102
8.00%	142	141	139	137	134	131	127

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

(단위:백만원)

2,691

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

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	650	0	650	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

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	4,275	0	4,275	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	13,751	0	13,751	
누계	통화	선도	0	14,052	-14,052	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E	576
FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E	345
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E	203
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

514

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

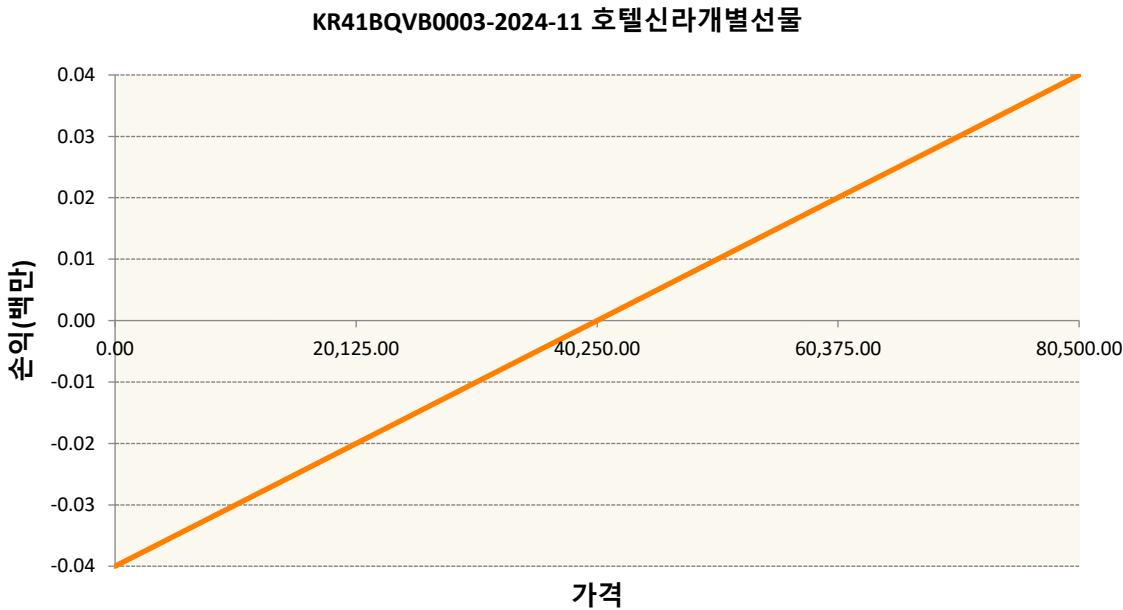
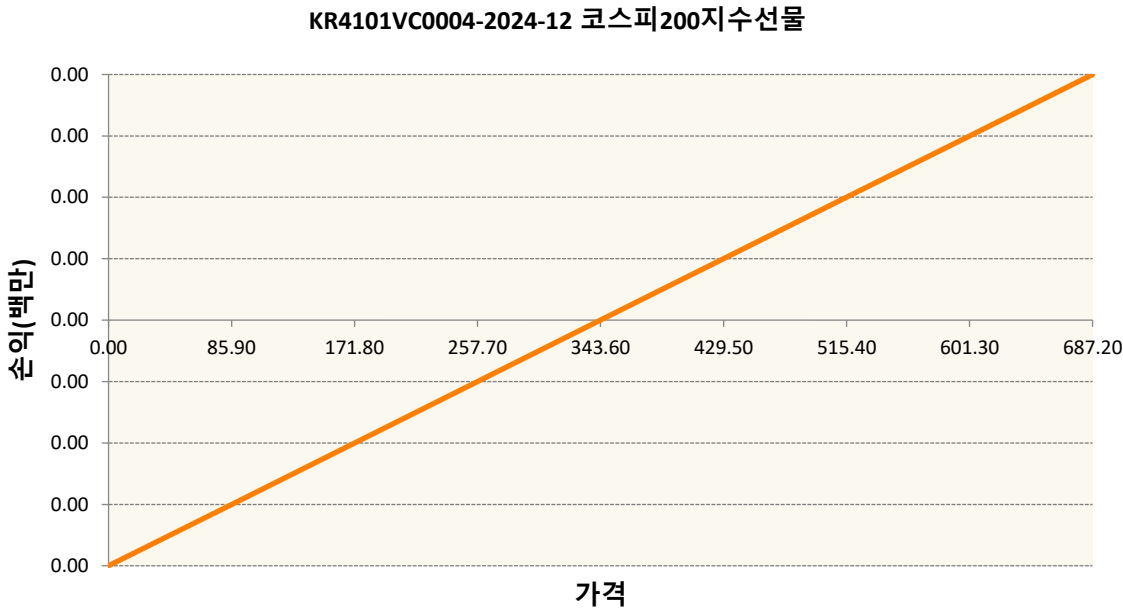
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

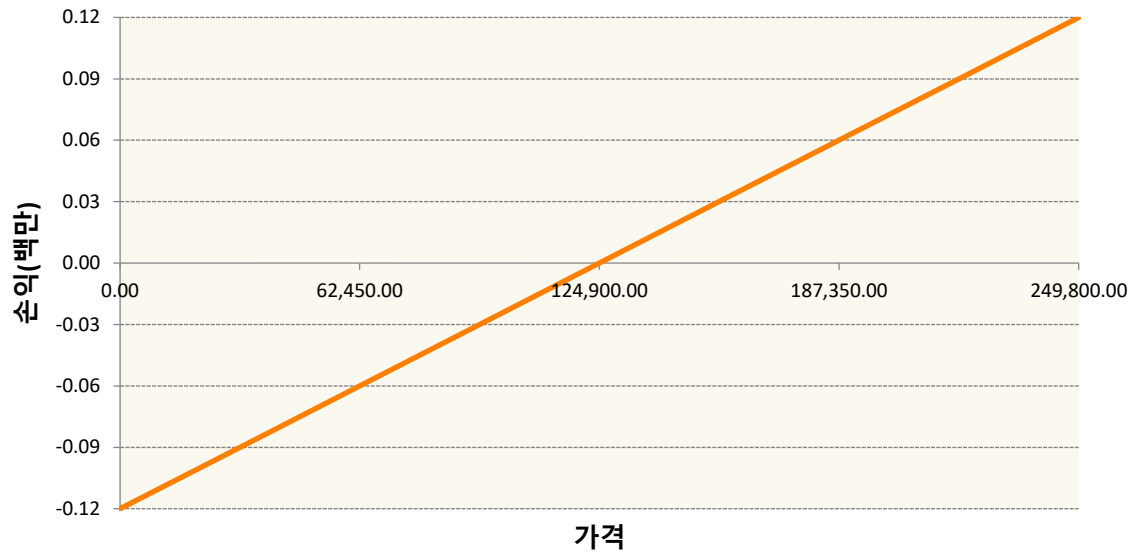
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	11	0	11	장내
누계	유가증권	선물	889	0	889	장내

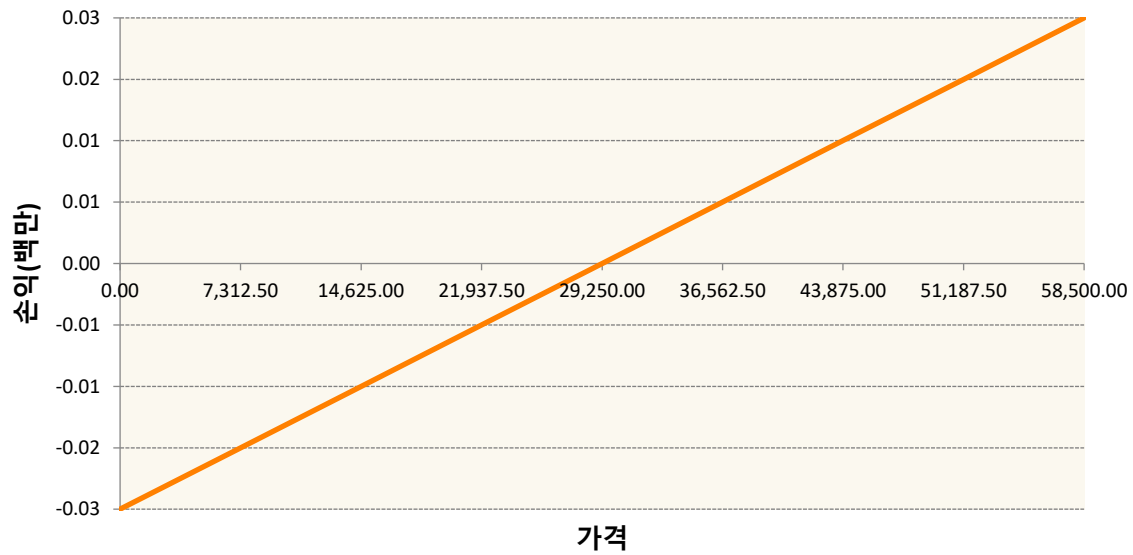
2. 만기시점의 손익구조



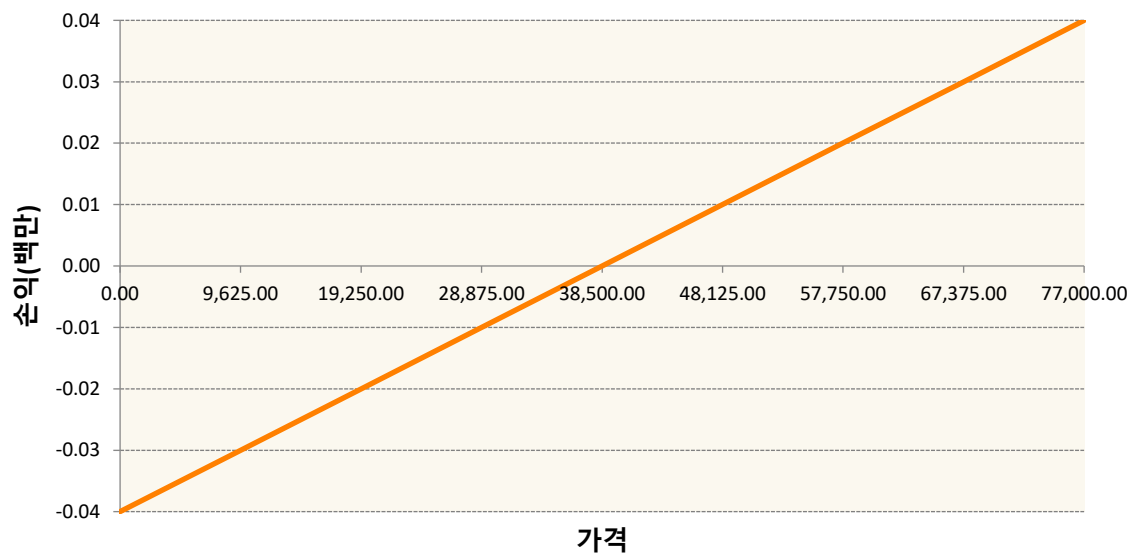
KR41C6VB0004-2024-11 아모레퍼시픽개별선물



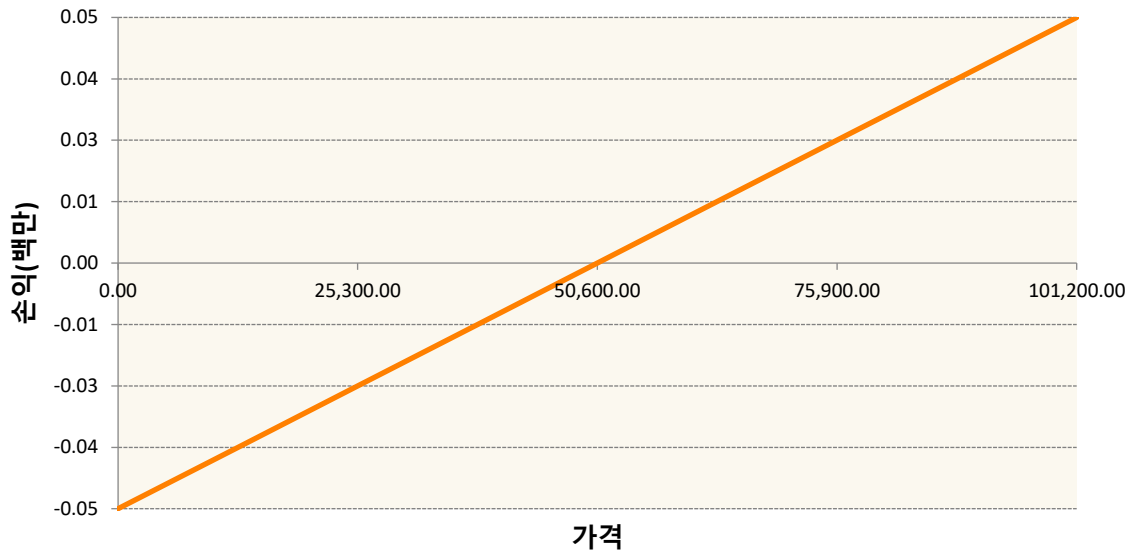
KR41CNVB0005-2024-11 포스코DX개별선물



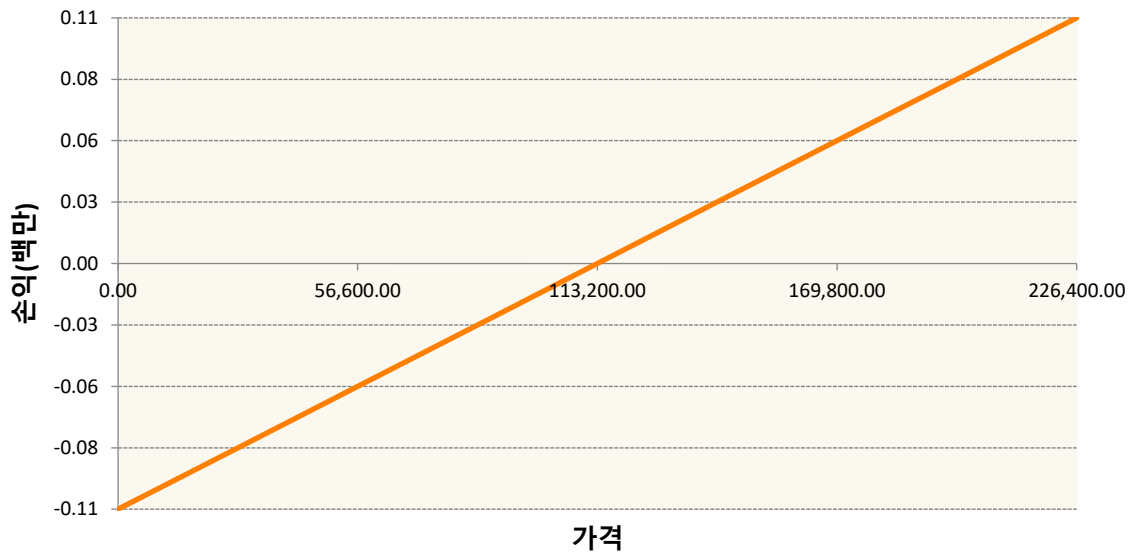
KR41CVVB0005-2024-11 한미사이언스개별선물



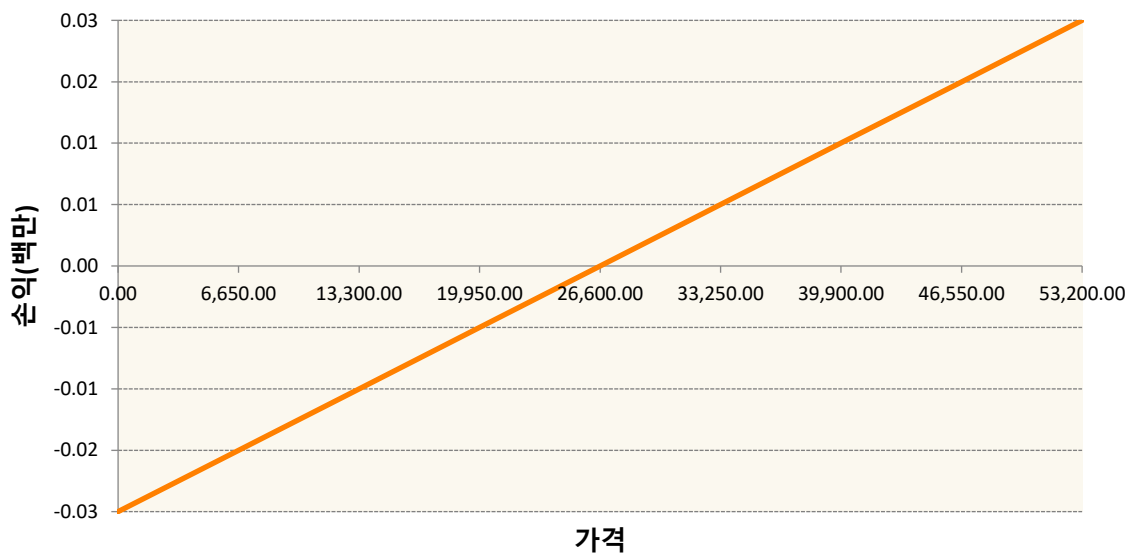
KR41DNVB0004-2024-11 하나투어개별선물



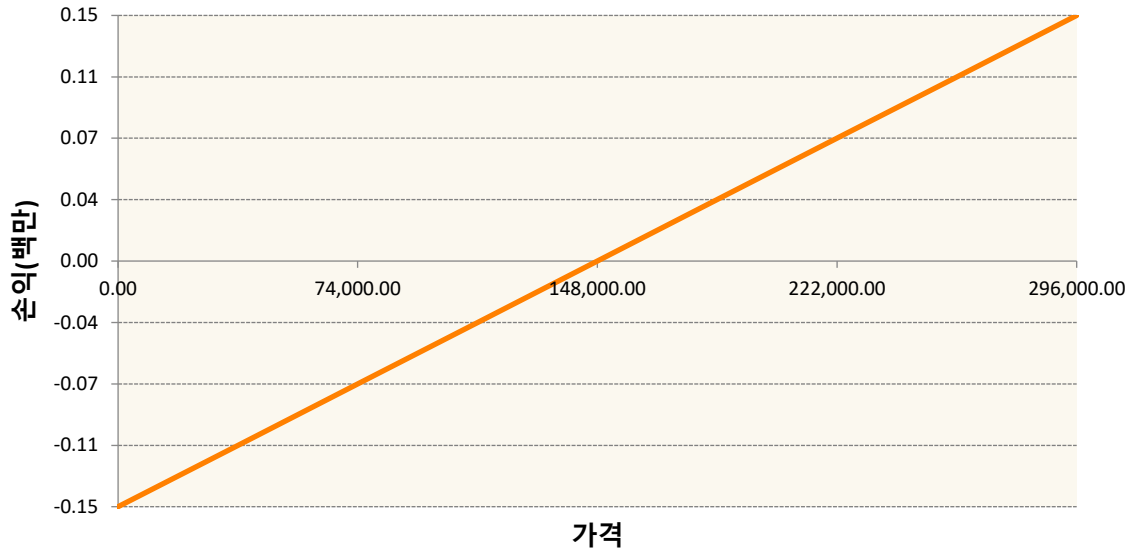
KR41FMVB0003-2024-11 엘앤에프개별선물



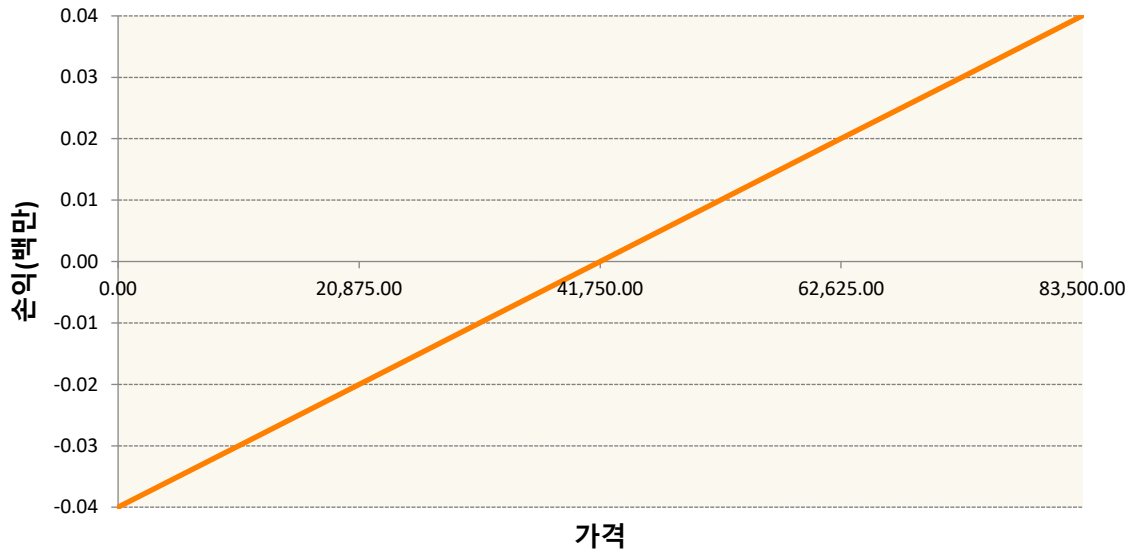
KR41FXVB0000-2024-11 동서개별선물



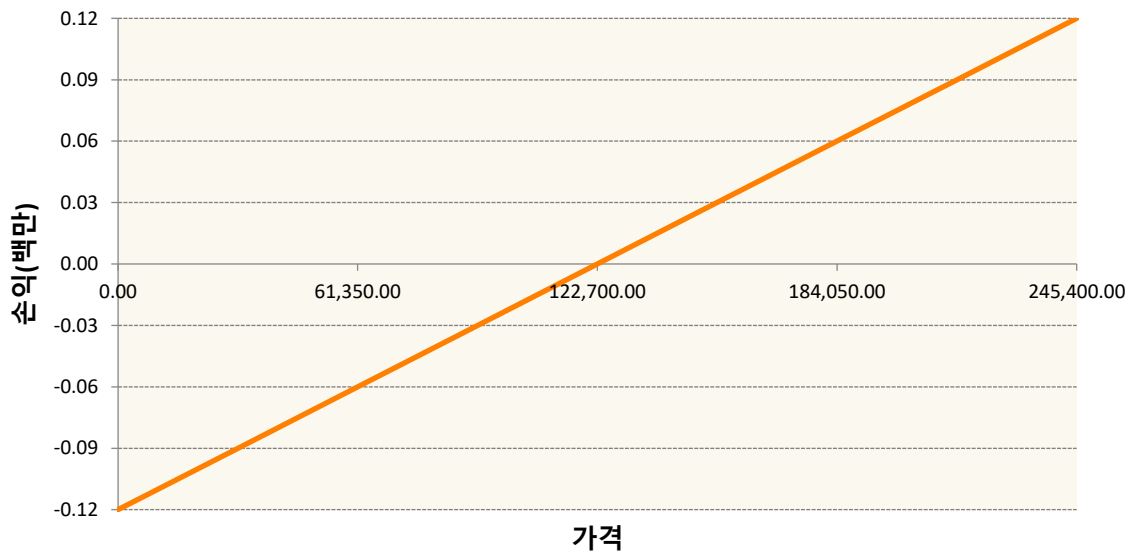
KR41GLVB0003-2024-11 LS ELECTRIC 개별선물



KR41GNVB0001-2024-11 금양개별선물



KR41GZVB0007-2024-11 에코프로머티개별선물



(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
KR41BQVB0003			2024-11 호텔신라개별선물				1
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
KR41C6VB0004			2024-11 아모레퍼시픽개별선물				2
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2
KR41CNVB0005			2024-11 포스코DX개별선물				1
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-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
KR41CVVB0005			2024-11 한미사이언스개별선물				1
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR41DNVB0004 2024-11 하나투어개별선물 0

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

KR41FMVB0003 2024-11 엘앤에프개별선물 1

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

KR41FXVB0000 2024-11 동서개별선물 0

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

KR41GLVB0003 2024-11 LS ELECTRIC개별선물 1

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

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
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%	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

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

(단위:백만원)

81

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

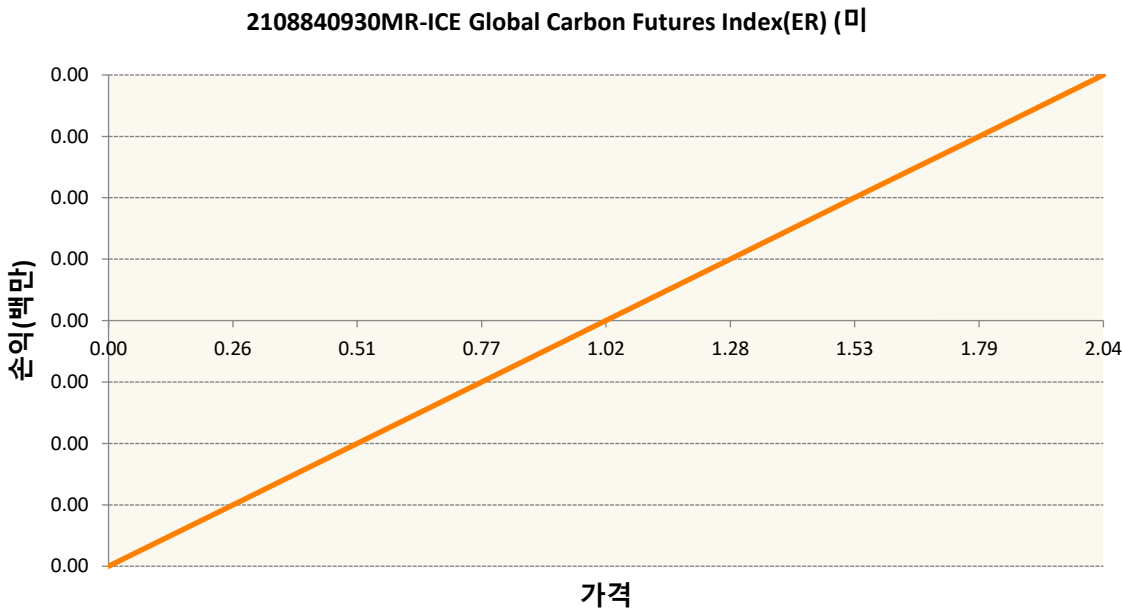
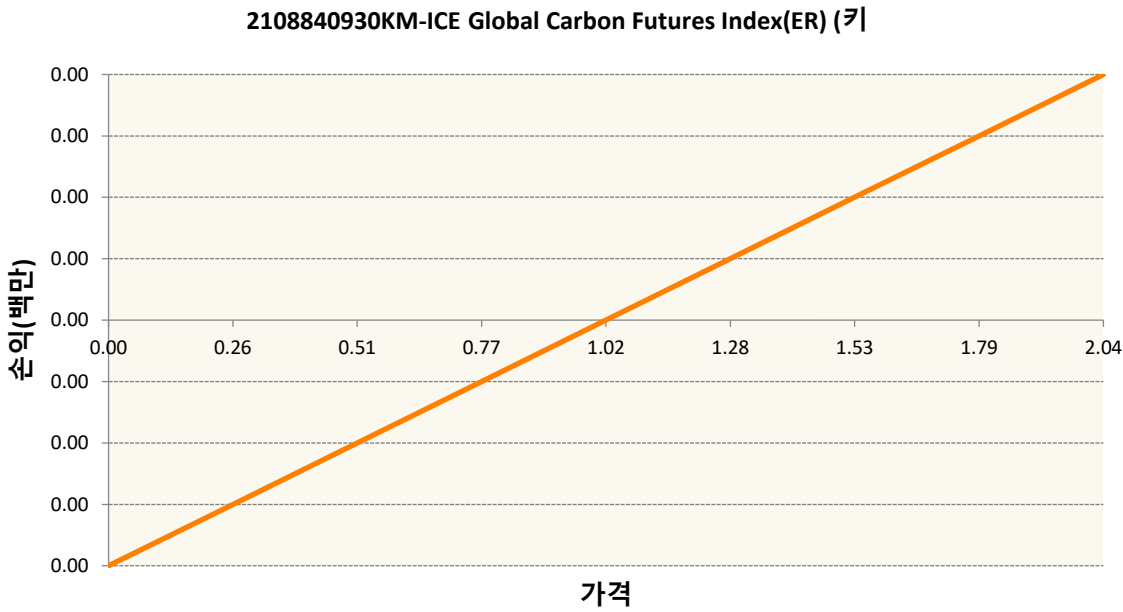
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

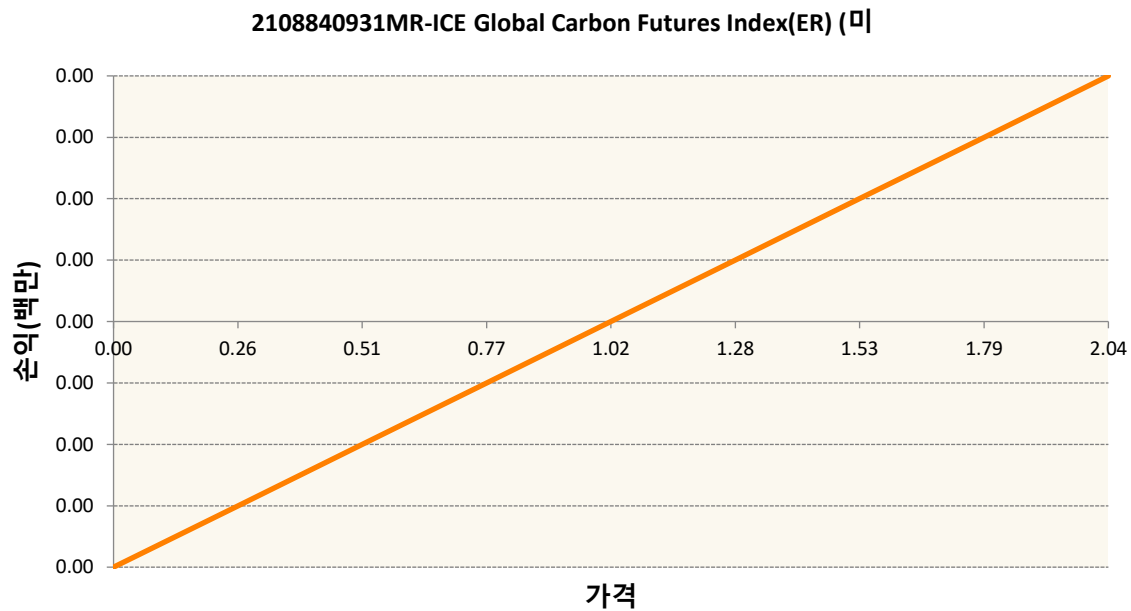
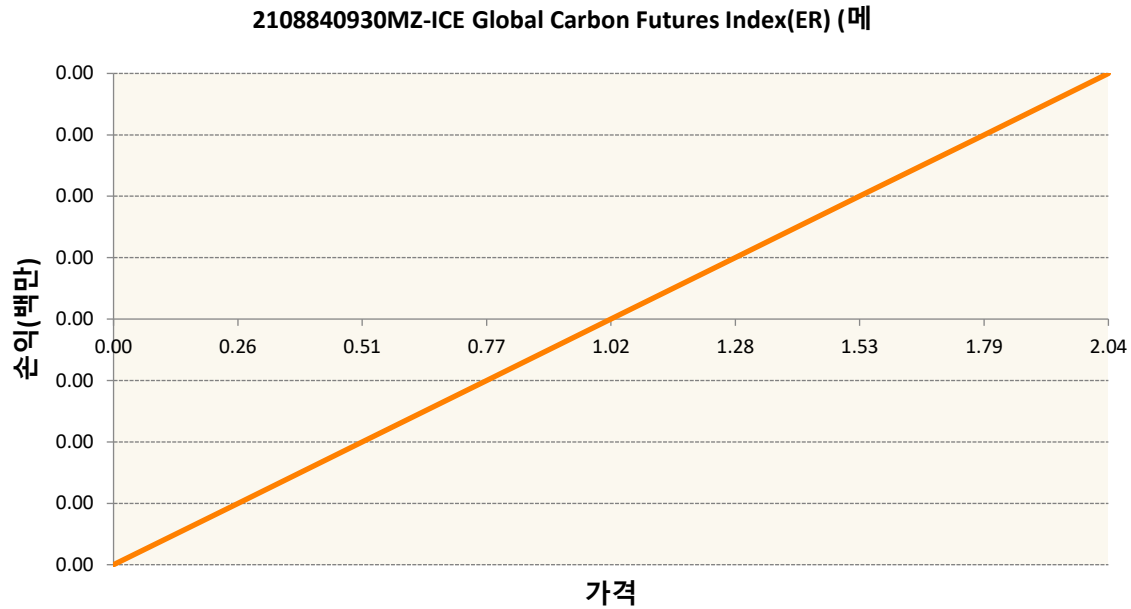
1. 계약금액

(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		462
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)
		997

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

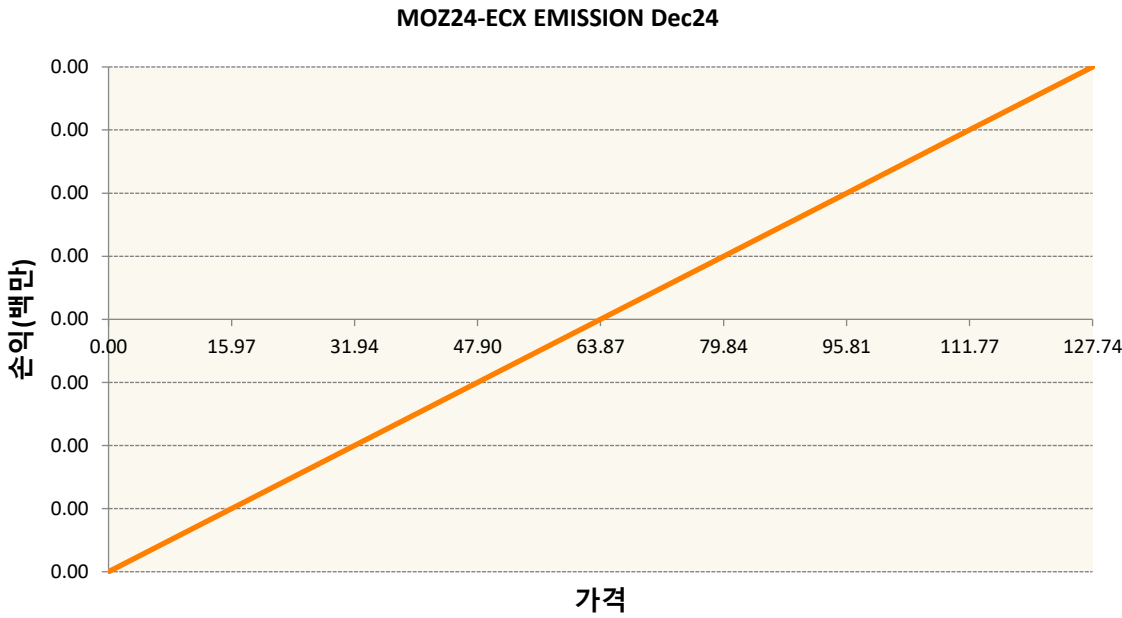
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,644	0	7,644	
누계	통화	선도	0	1,915	-1,915	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	1
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E	11
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E	142
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	613

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

(단위:백만원)

1,111

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

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)	22
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	22
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	33
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	33

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

(단위:백만원)

188

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

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)	50
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	42
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	60
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	13

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

(단위:백만원)

264

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

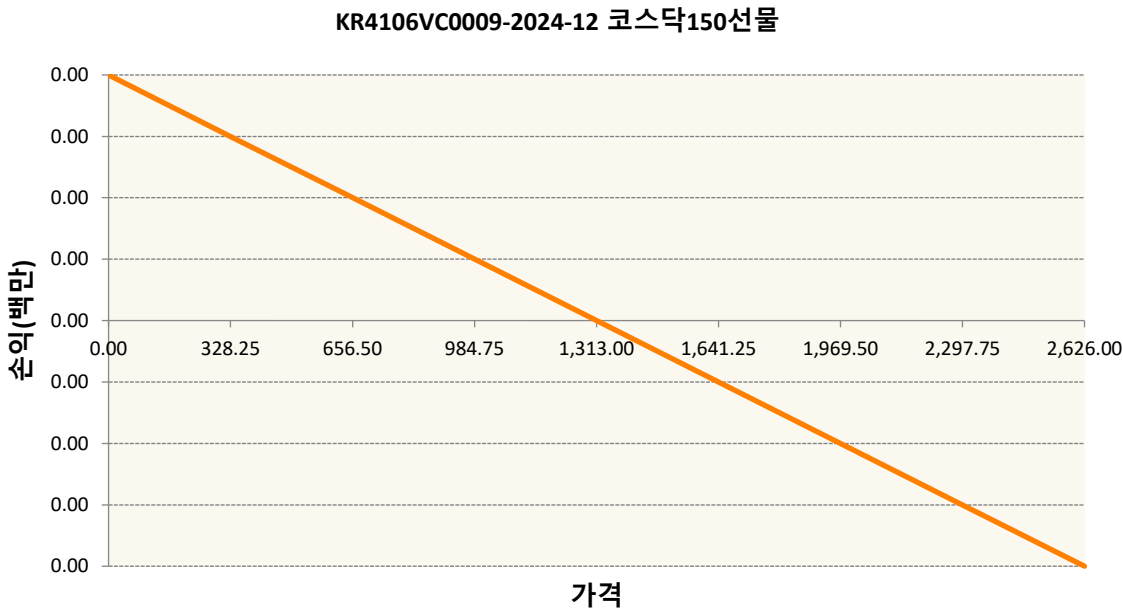
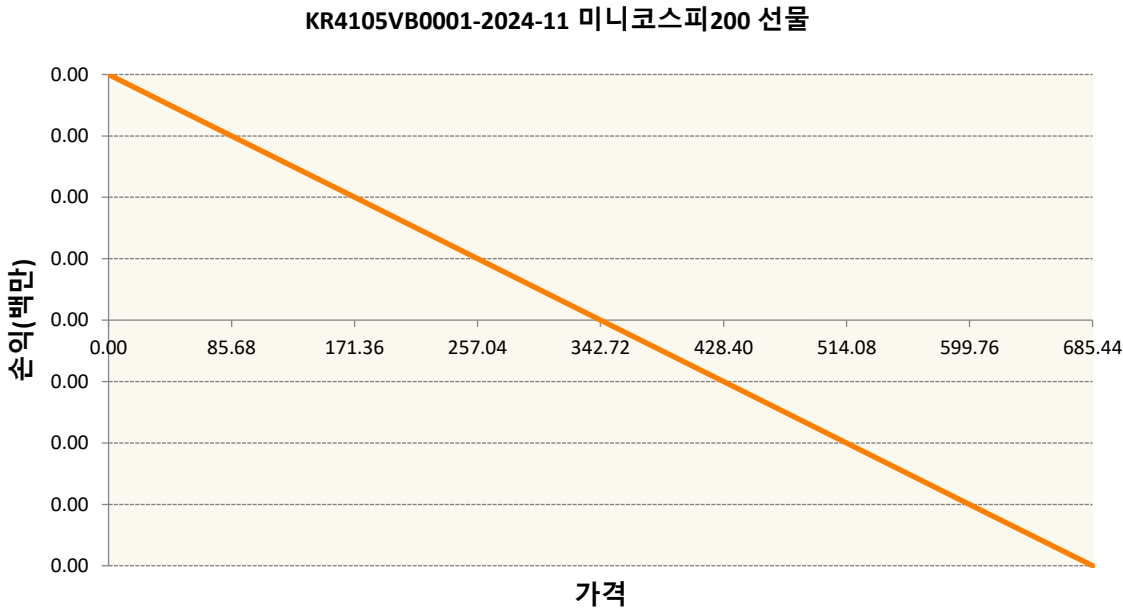
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

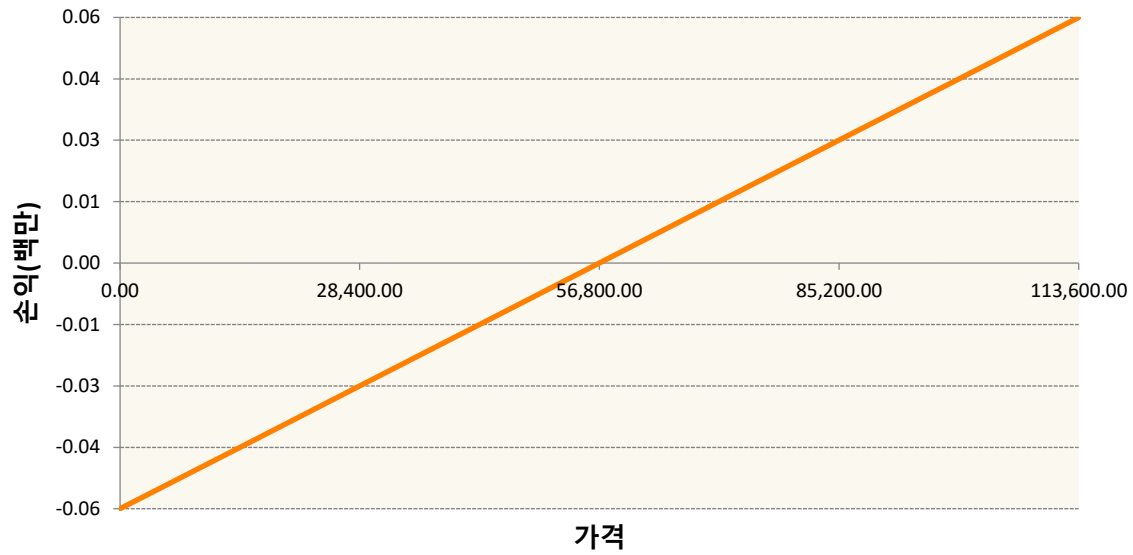
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10	136	-126	장내
누계	유가증권	선물	22	256	-234	장내

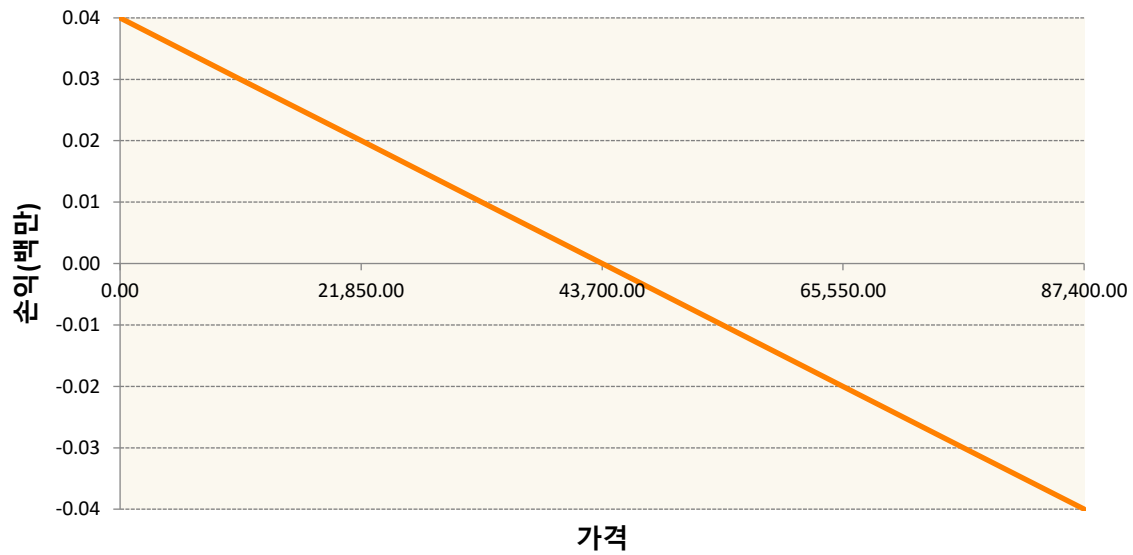
2. 만기시점의 손익구조



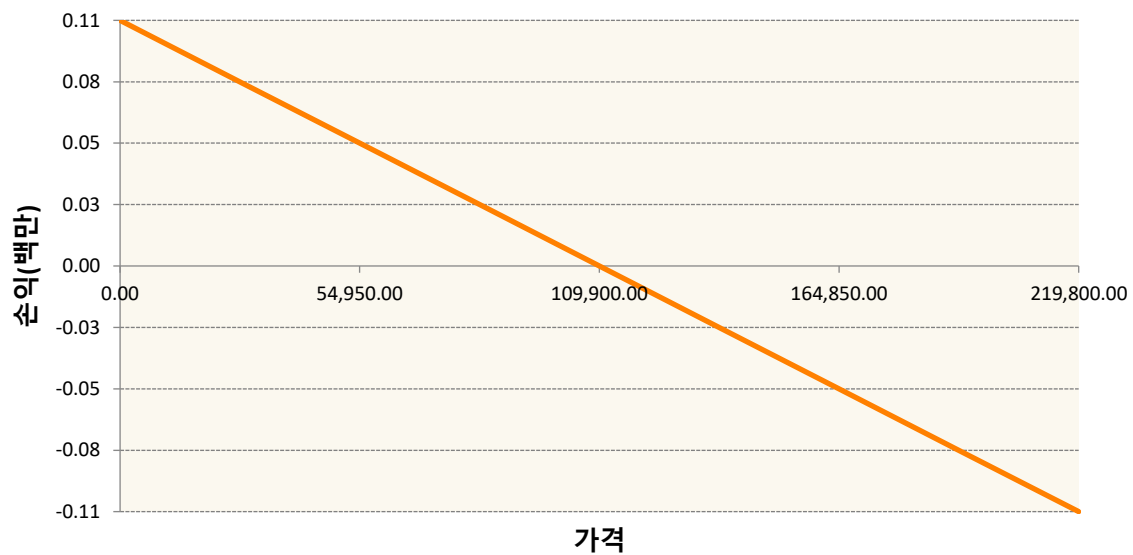
KR4112VB0002-2024-11 SK텔레콤개별선물



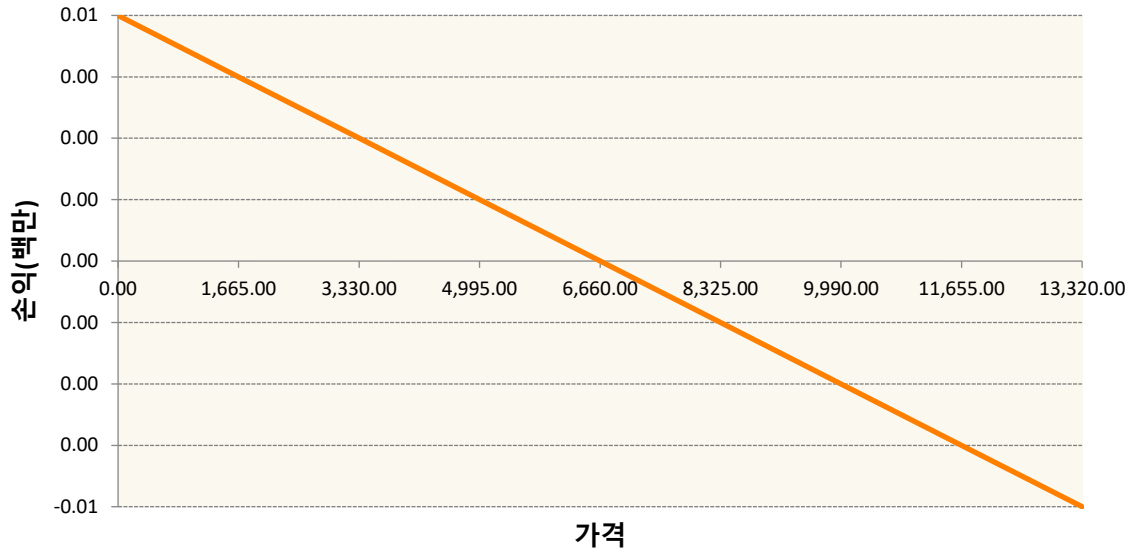
KR4114VB0000-2024-11 KT개별선물



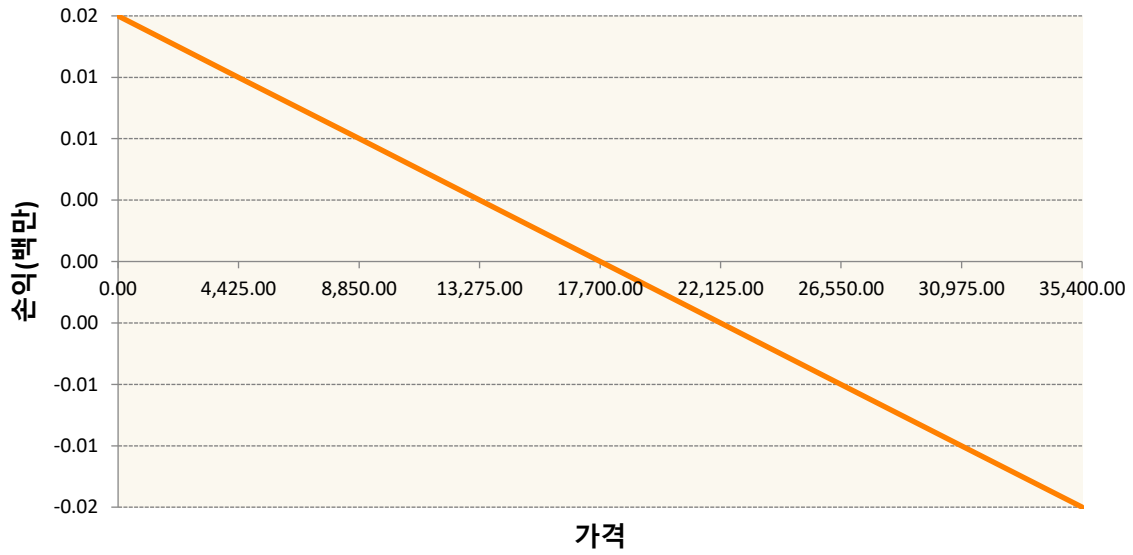
KR4136VB0004-2024-11 KT&G개별선물



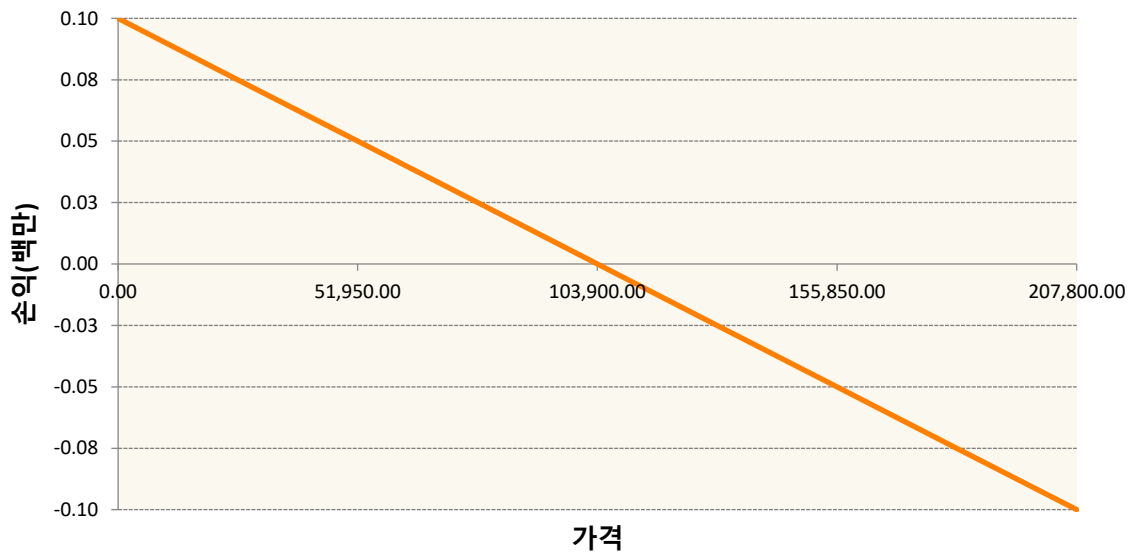
KR4149VB0009-2024-11 HD현대인프라코어개별선물



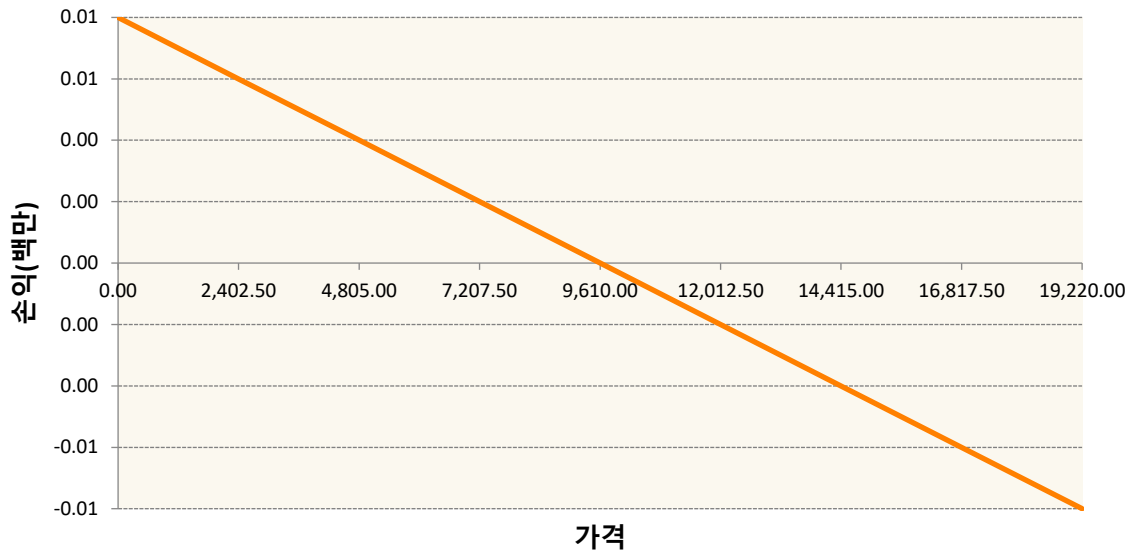
KR4151VB0004-2024-11 GS건설개별선물



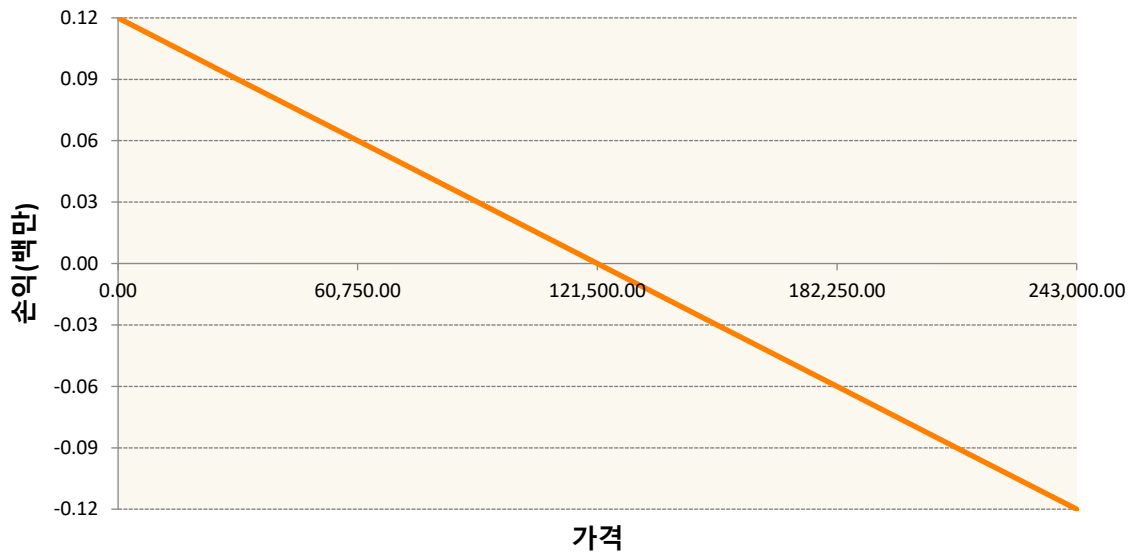
KR41BDVB0008-2024-11 삼성생명개별선물



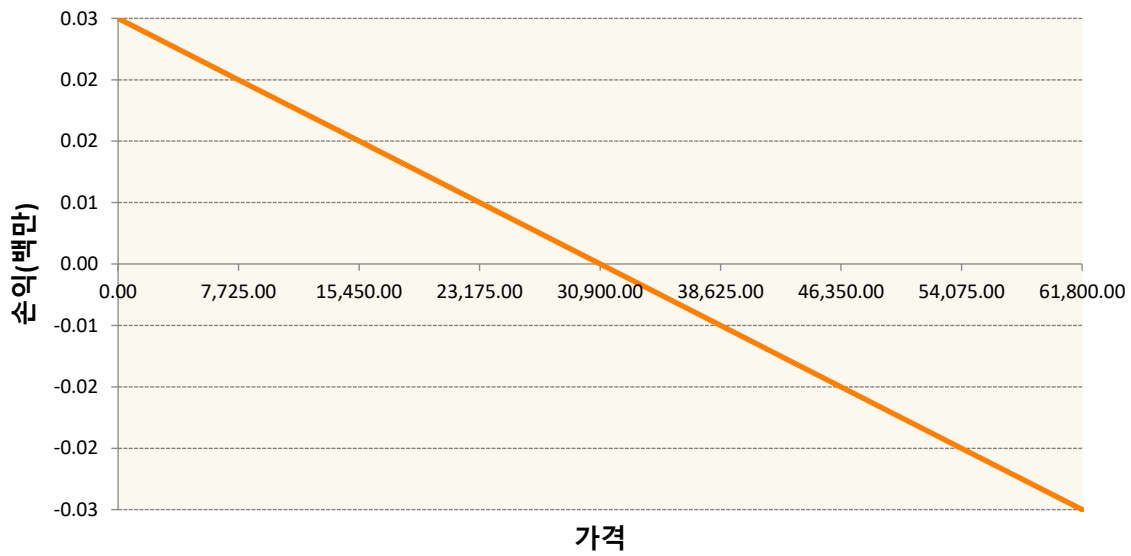
KR41BFVB0006-2024-11 삼성중공업개별선물



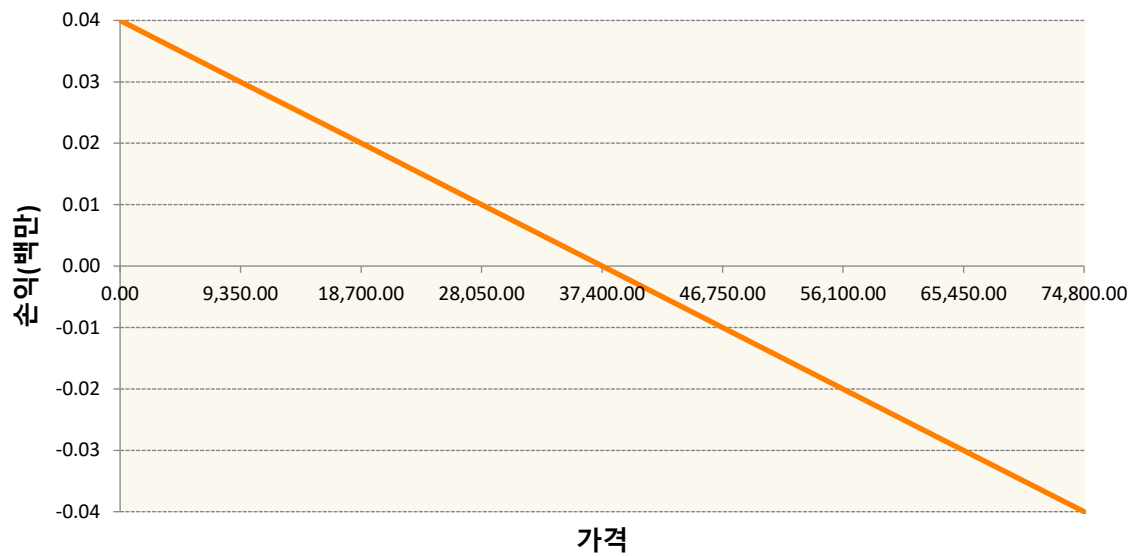
KR41CCVB0008-2024-11 현대글로벌비스개별선물



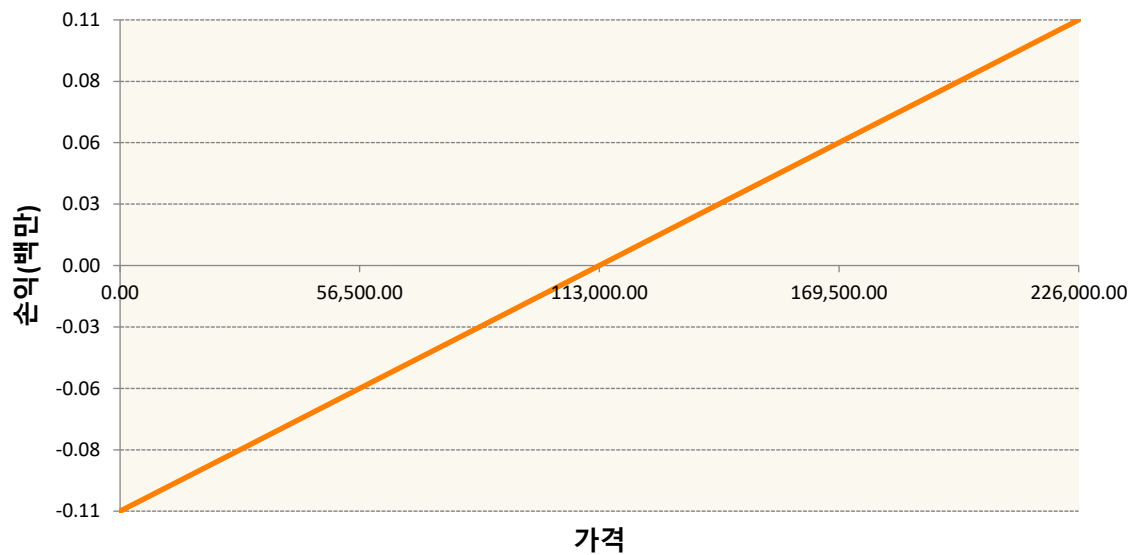
KR41CEVB0006-2024-11 현대해상개별선물



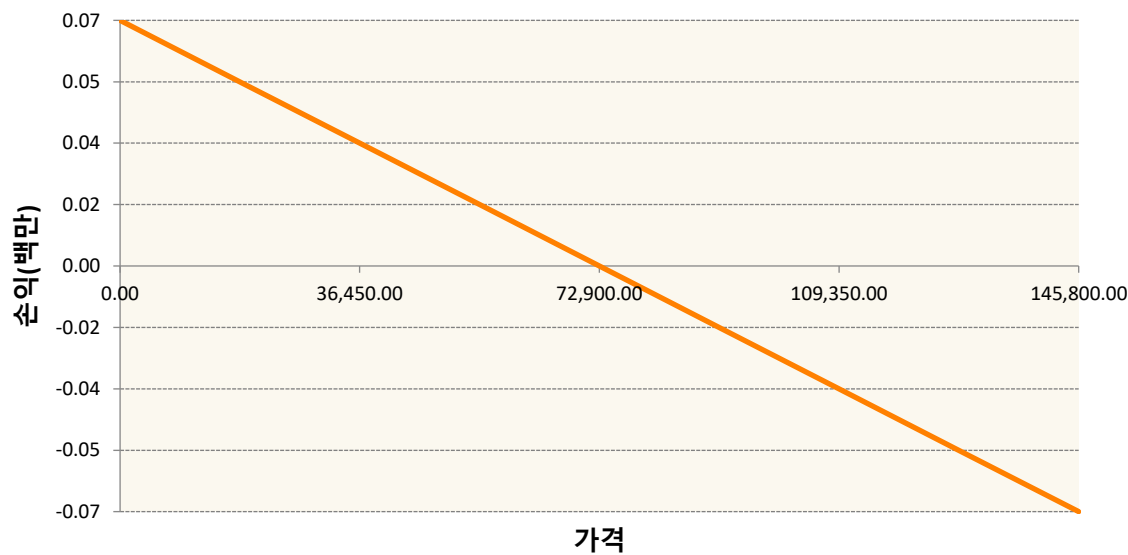
KR41CFVB0005-2024-11 카카오개별선물



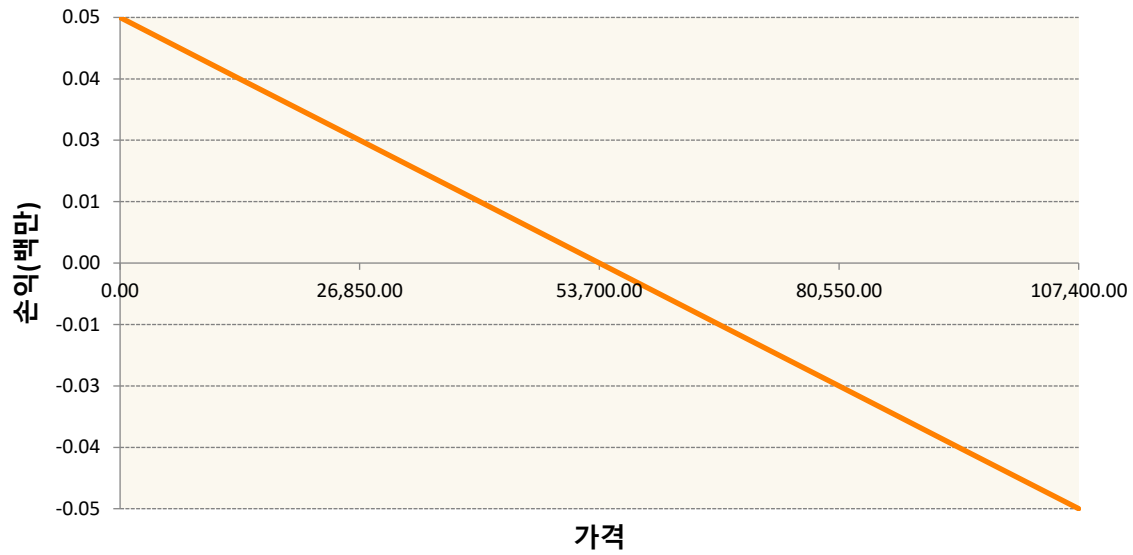
KR41D0VB0008-2024-11 DB손해보험개별선물



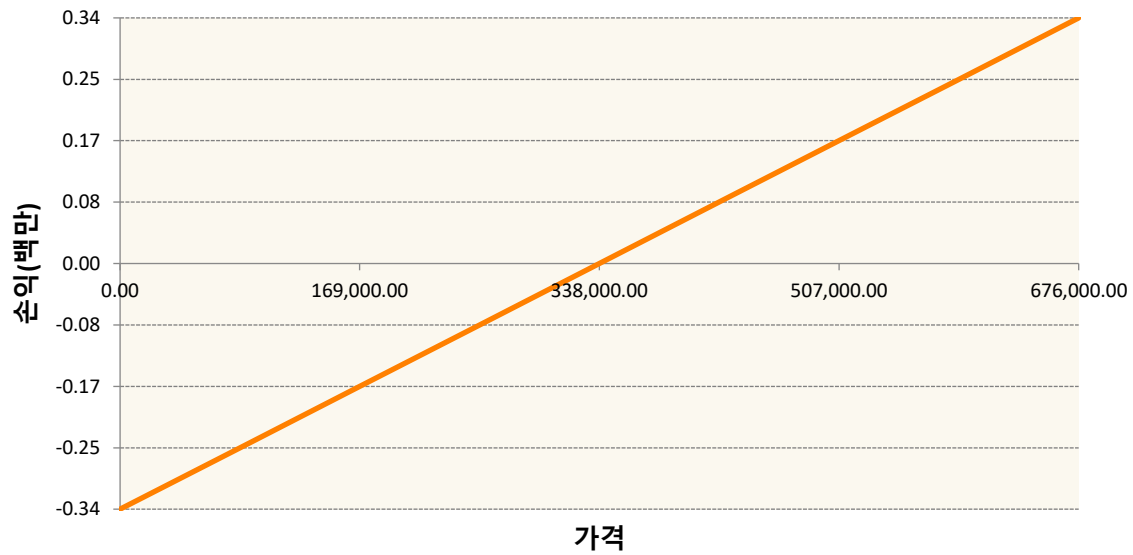
KR41E4VB0002-2024-11 에스엠개별선물



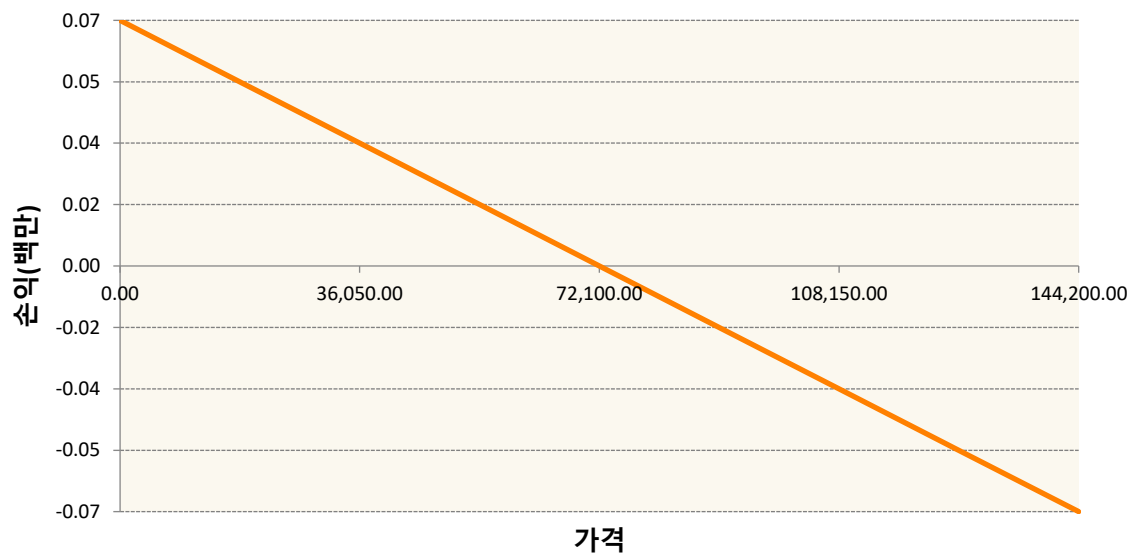
KR41EFVB0003-2024-11 JYP Ent.개별선물



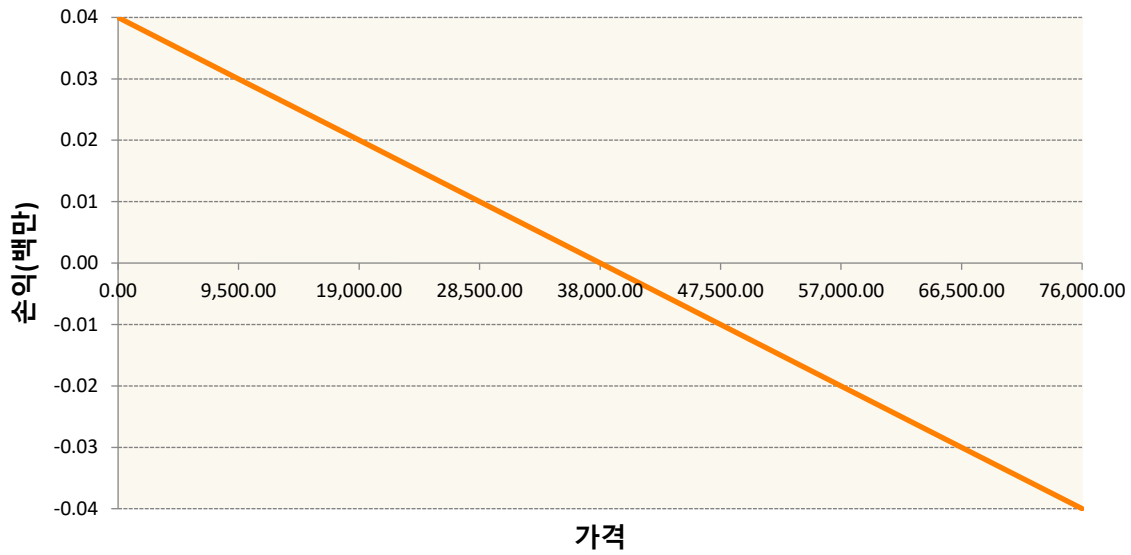
KR41F8VB0005-2024-11 크래프톤개별선물



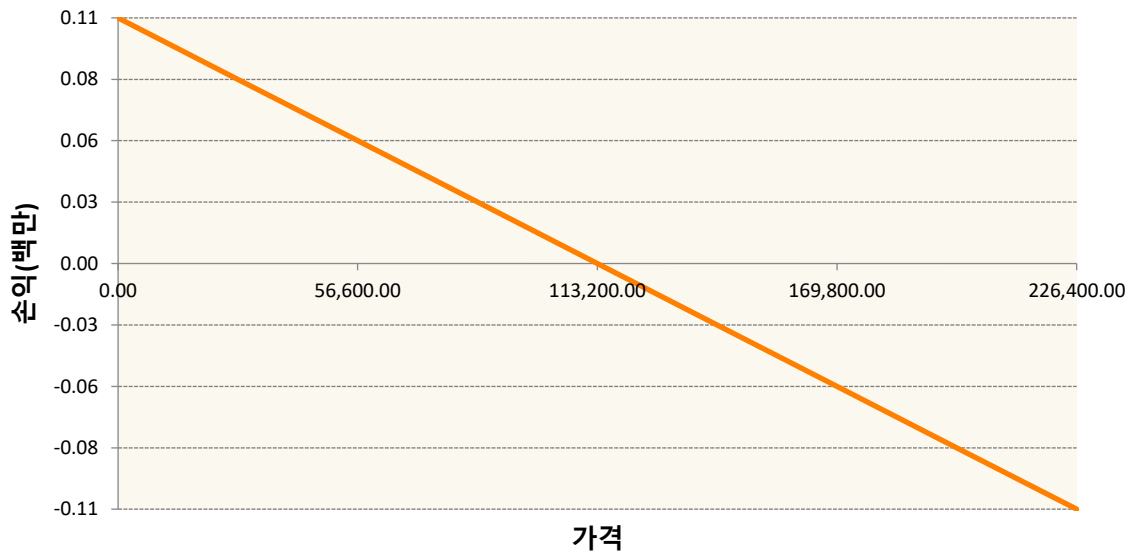
KR41FHVB0000-2024-11 HD현대개별선물



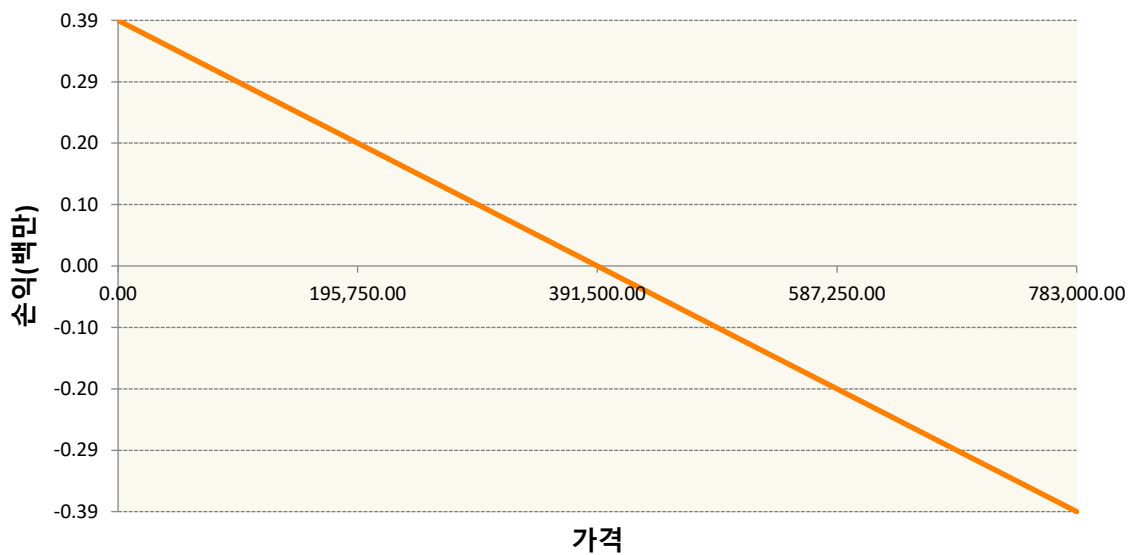
KR41FLVB0004-2024-11 펄어비스개별선물



KR41FMVB0003-2024-11 엘앤에프개별선물



KR41FPVC0009-2024-12 알테오젠개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4105VB00 2024-11 미니코스피200 선물		1
KR4106VC00 2024-12 코스닥150선물		5
KR4112VB00 2024-11 SK텔레콤개별선물		1
KR4114VB00 2024-11 KT개별선물		1
KR4136VB00 2024-11 KT&G개별선물		0.26
KR4149VB00 2024-11 HD현대인프라코어개별선물		0.29
KR4151VB00 2024-11 GS건설개별선물		1
KR41BDVB00 2024-11 삼성생명개별선물		0.42
KR41BFVB00 2024-11 삼성중공업개별선물		3
KR41CCVB00 2024-11 현대글로비스개별선물		0.29
KR41CEVB00 2024-11 현대해상개별선물		0.05
KR41CFVB00 2024-11 카카오개별선물		1
KR41D0VB00 2024-11 DB손해보험개별선물		1
KR41E4VB00 2024-11 에스엠개별선물		0.35
KR41EFVB00 2024-11 JYP Ent.개별선물		1
KR41F8VB00 2024-11 크래프톤개별선물		0.27
KR41FHVB00 2024-11 HD현대개별선물		0.23
KR41FLVB00 2024-11 펄어비스개별선물		0.27
KR41FMVB00 2024-11 엘앤에프개별선물		0.27
KR41FPVC00 2024-12 알테오젠개별선물		0.31

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	31

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

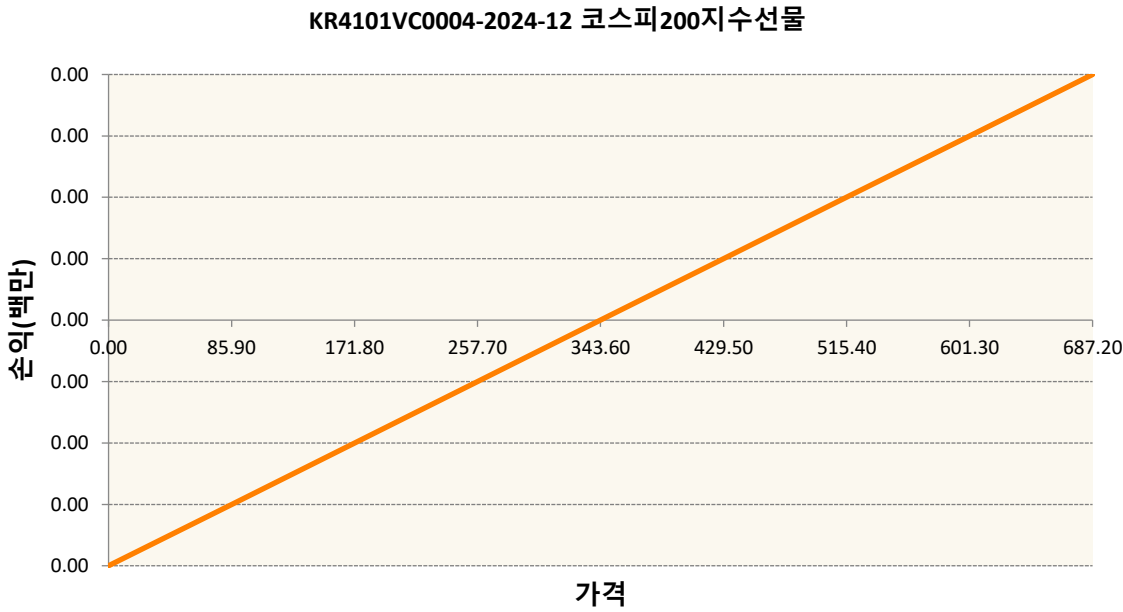
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	430	0	430	장내
누계	유가증권	선물	9,449	0	9,449	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				756
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-756	-756	-756	-756	-756	-756	-756
-5.33%	-504	-504	-504	-504	-504	-504	-504
-2.67%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	252	252	252	252	252	252	252
5.33%	504	504	504	504	504	504	504
8.00%	756	756	756	756	756	756	756

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

(단위:백만원)

920

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

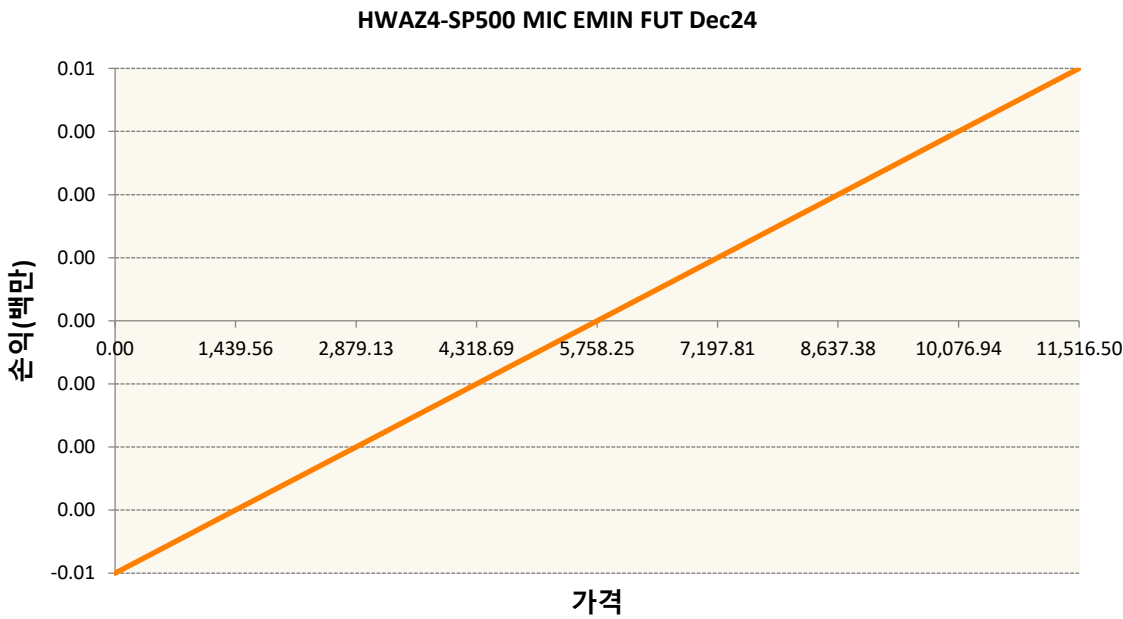
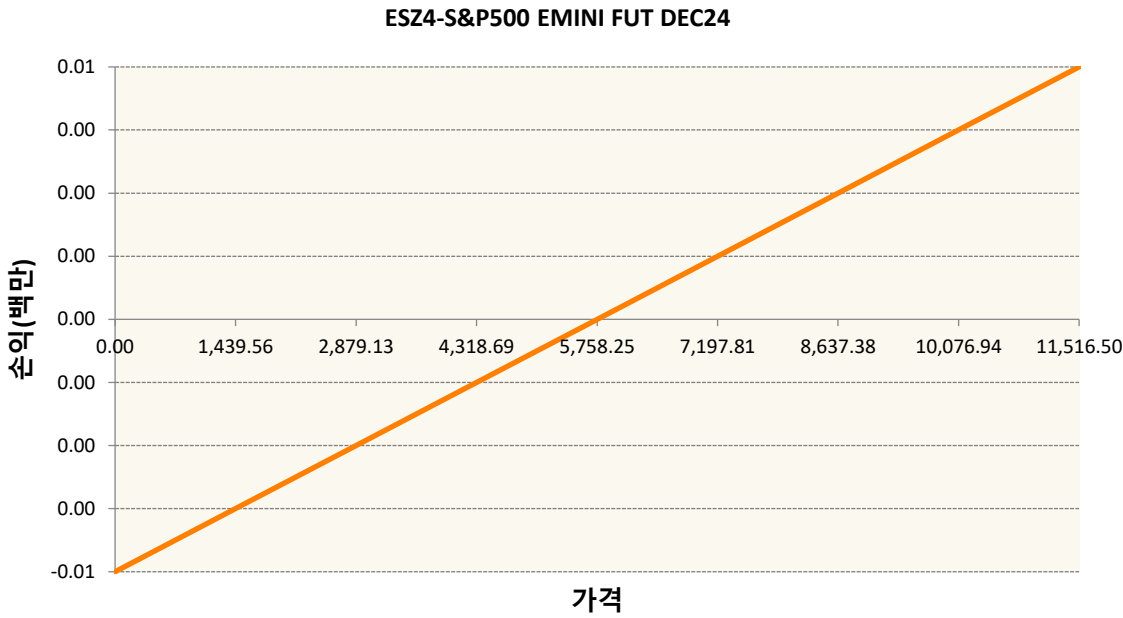
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	12,697	0	12,697	
누계	유가증권	선물	1,569	0	1,569	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,016
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	126

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	693

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

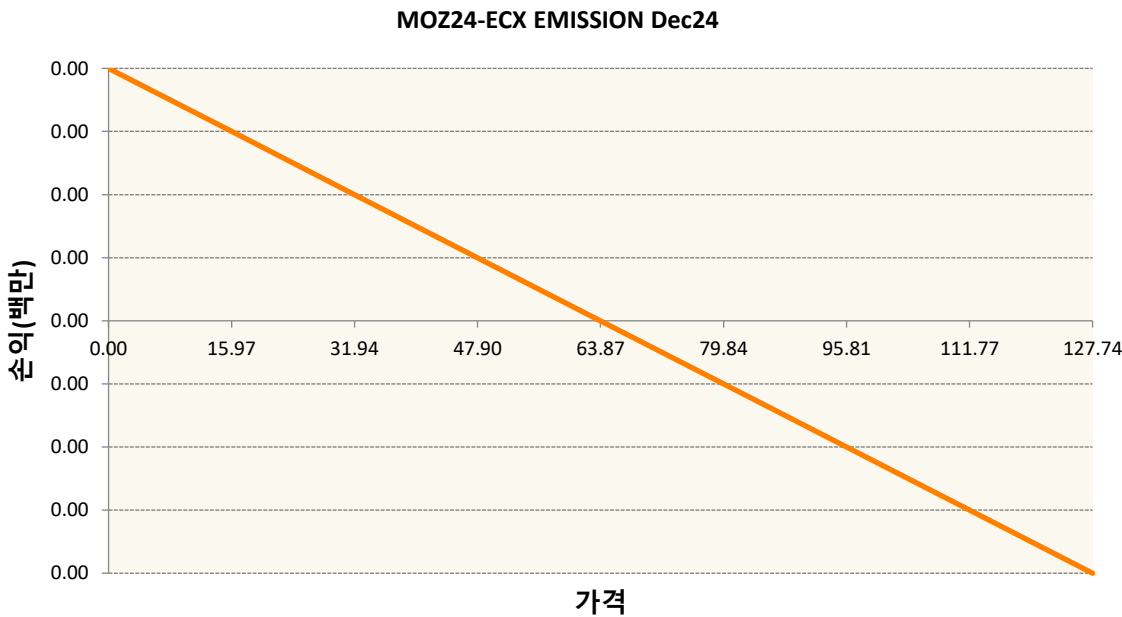
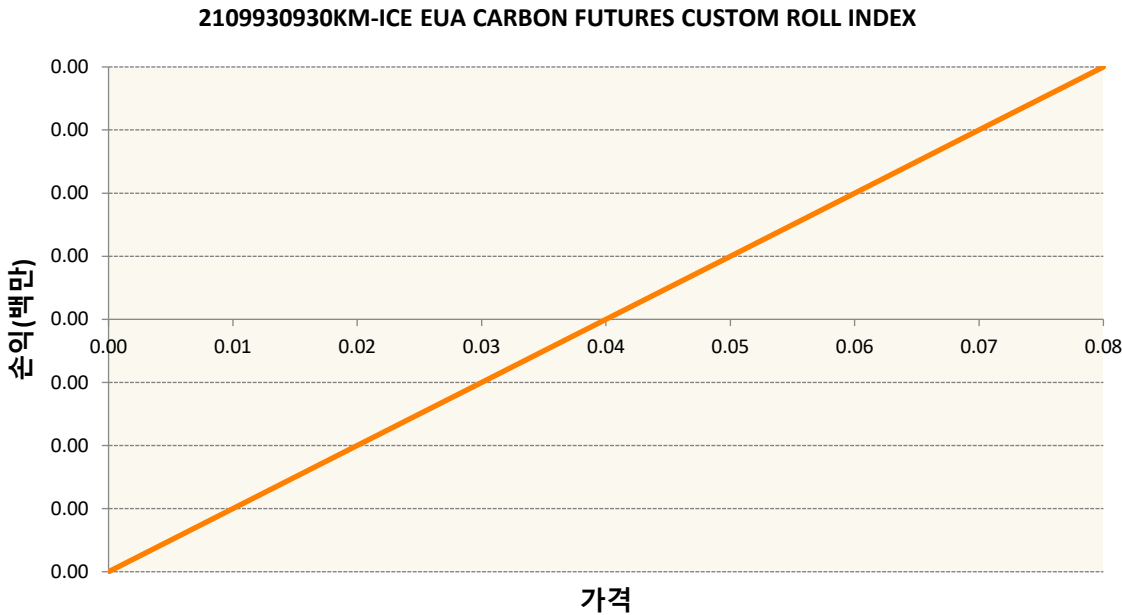
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	14	6,434	-6,419	
누계	통화	선도	0	1,426	-1,426	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E	114
MOZ24 ECX EMISSION Dec24	515

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

925

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

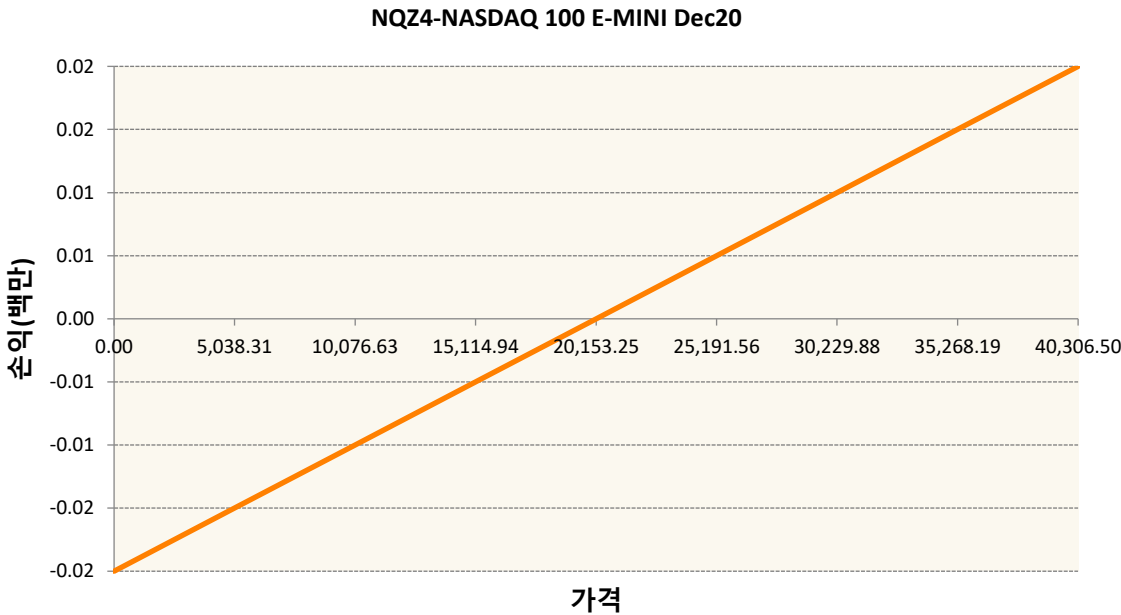
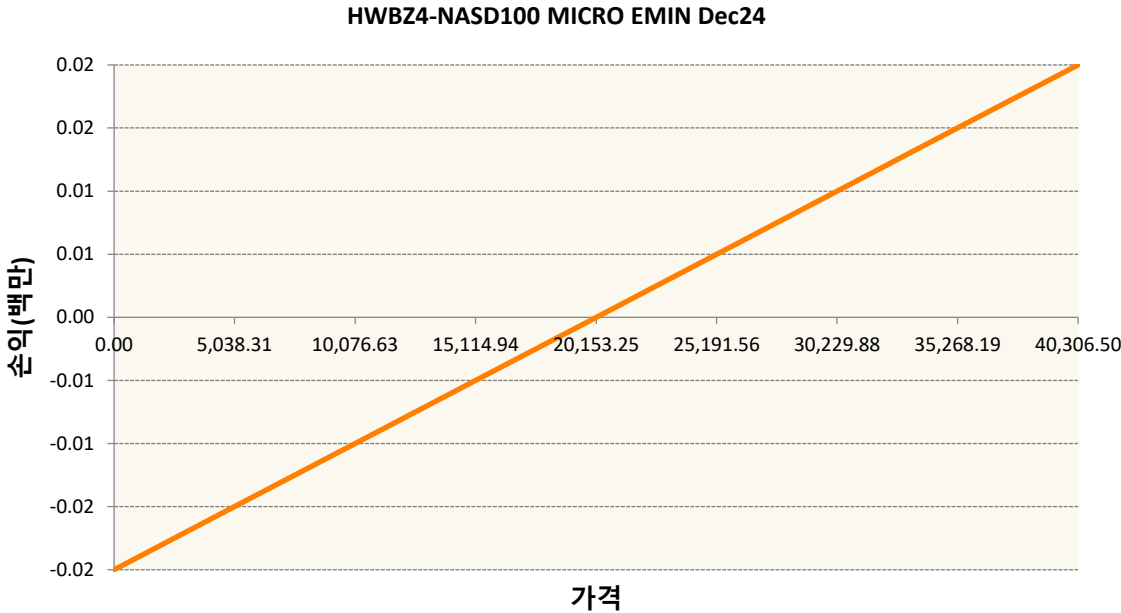
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	6,988	0	6,988	
누계	유가증권	선물	979	0	979	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		78
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		559

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			526

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	198,129	0	198,129	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	683
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,162
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,573
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,106

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

(단위:백만원)

9,055

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

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	7
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	7
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	7
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	7

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

(단위:백만원)

30

공시일	2024-11-05
기준일	2024-11-04

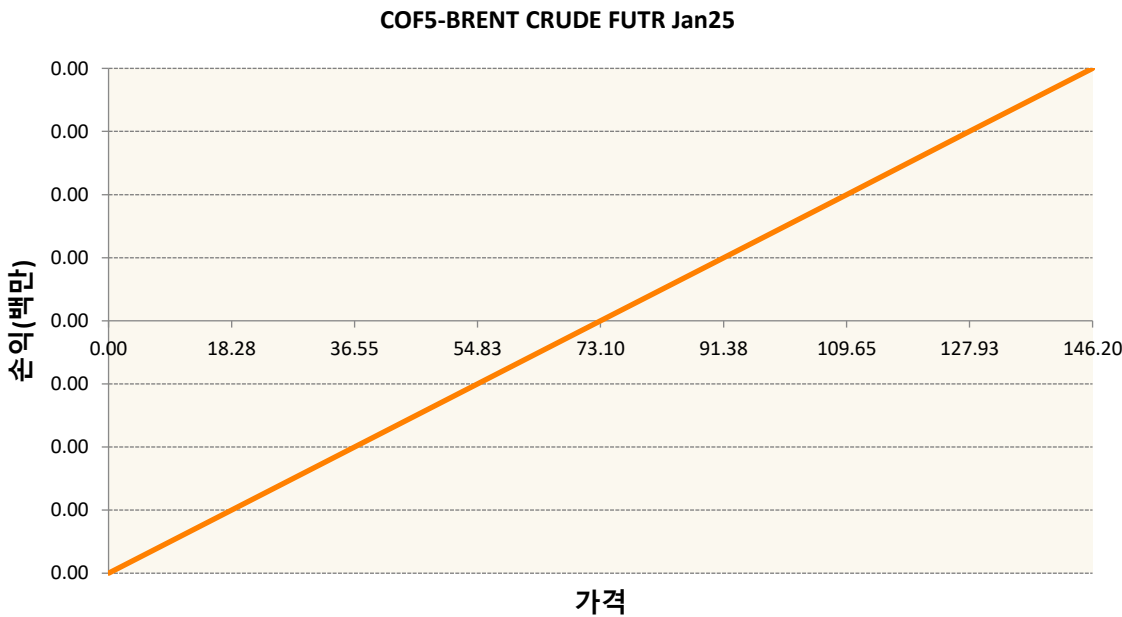
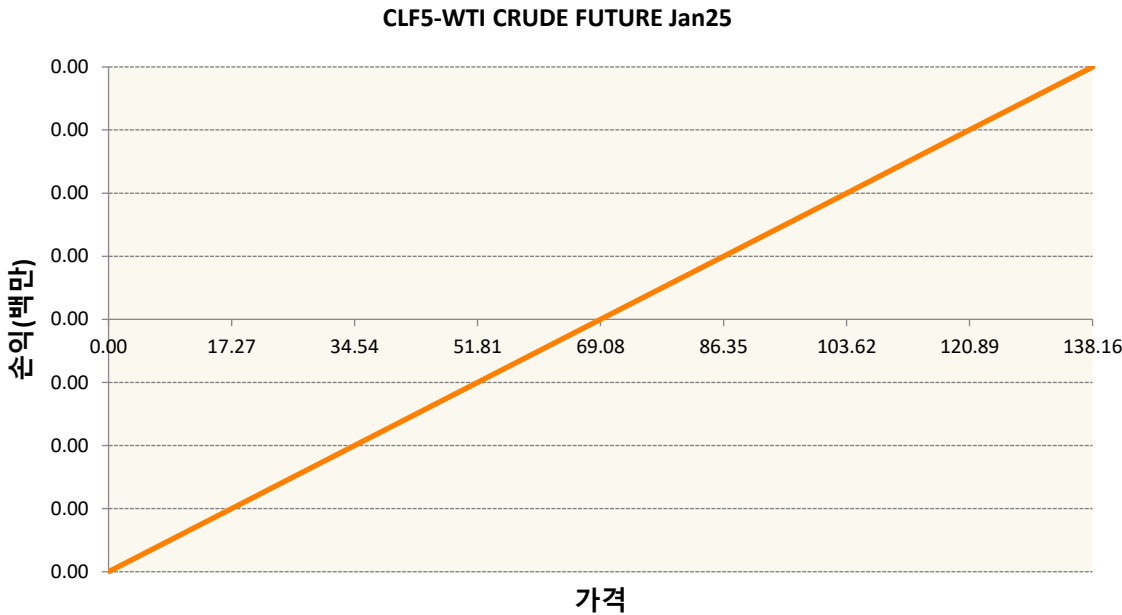
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

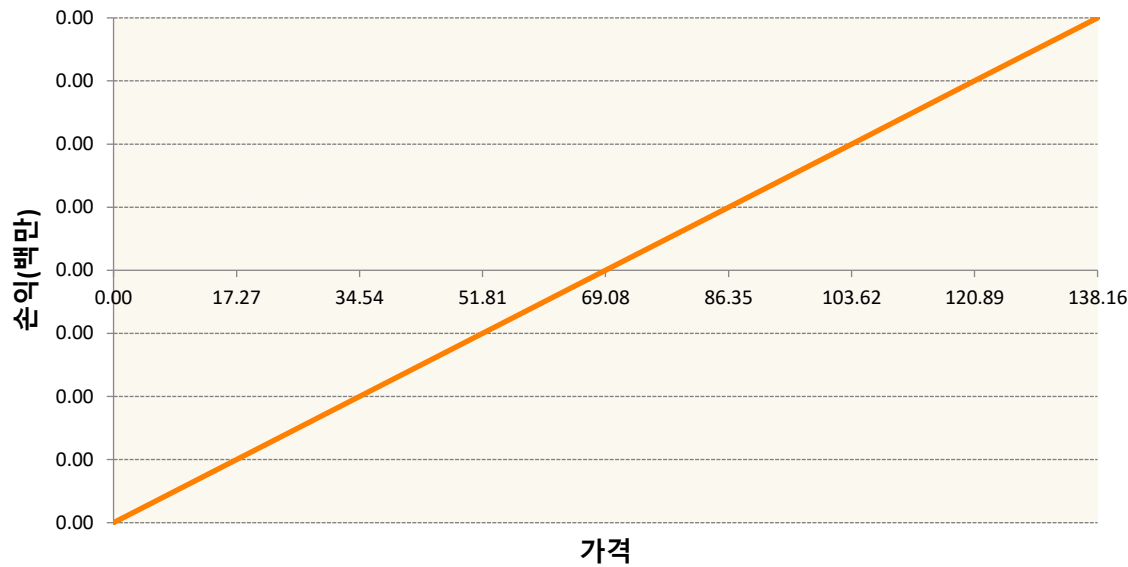
(단위:백만원)

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	765	0	765	
누계	통화	선물	0	96	-96	장내

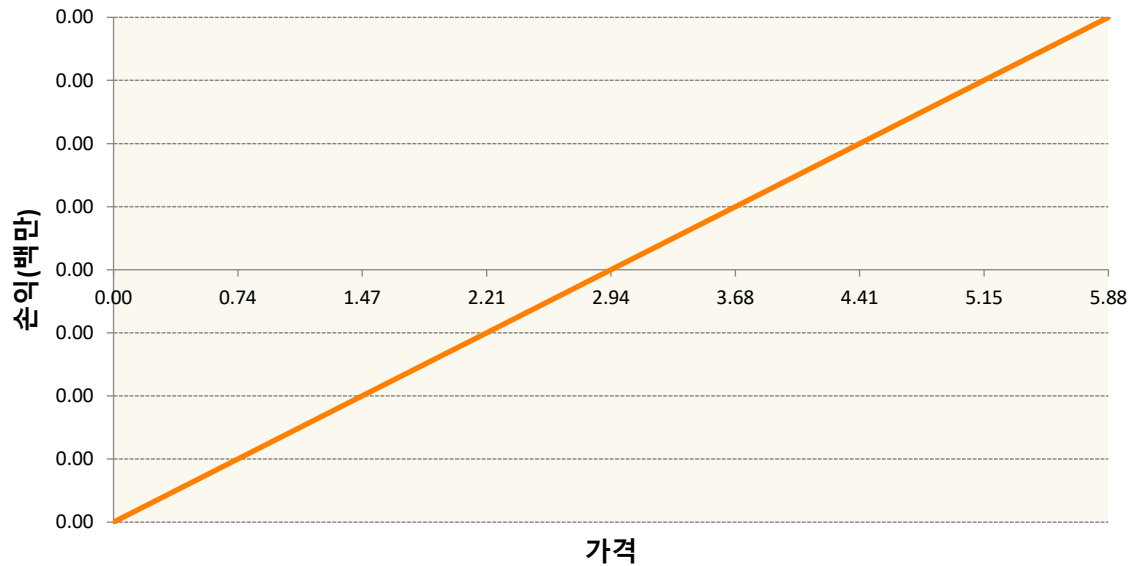
2. 만기시점의 손익구조



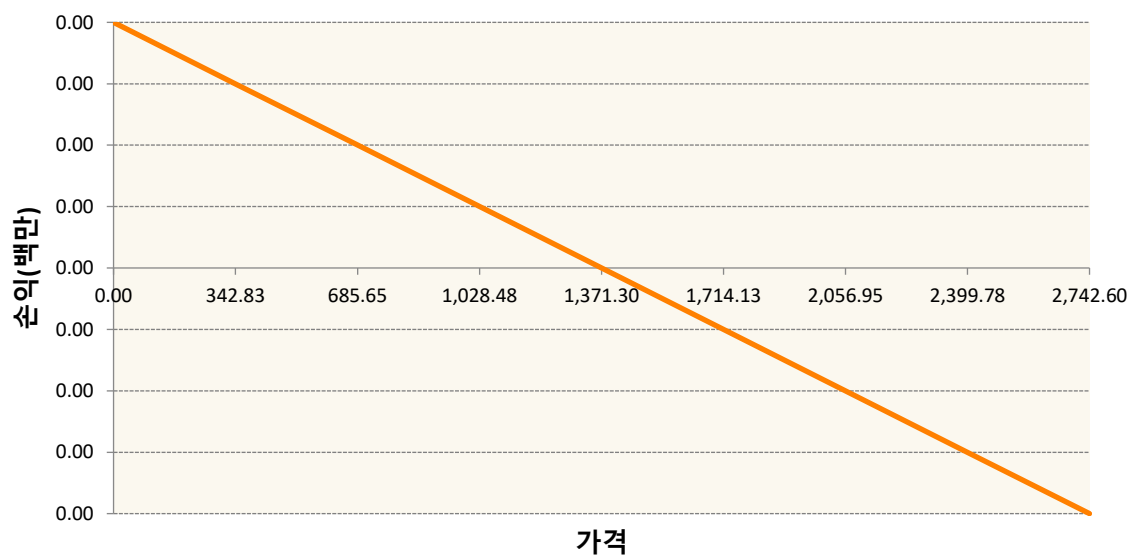
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



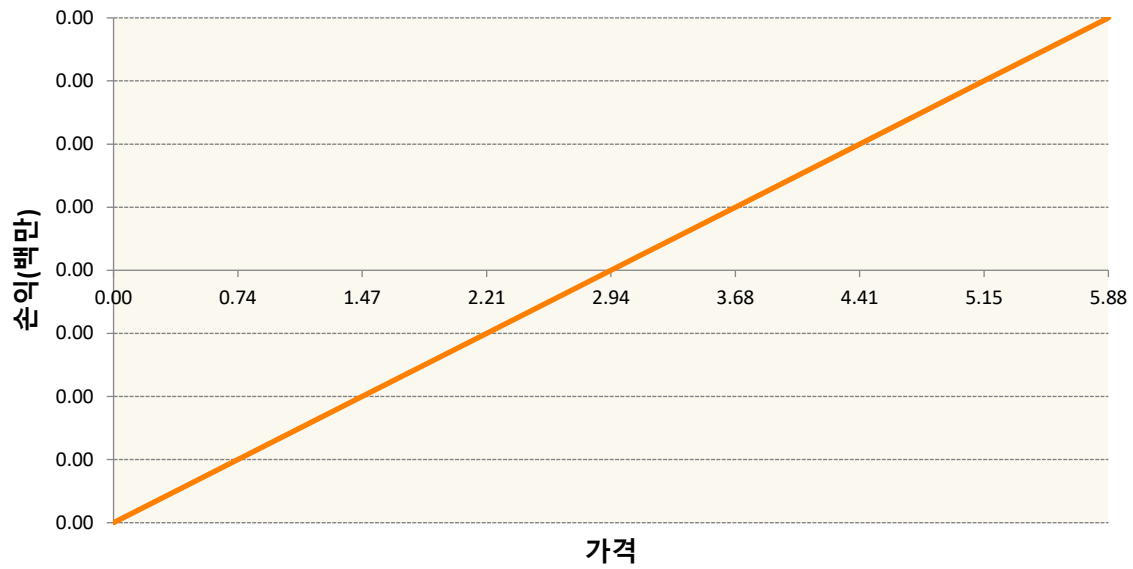
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



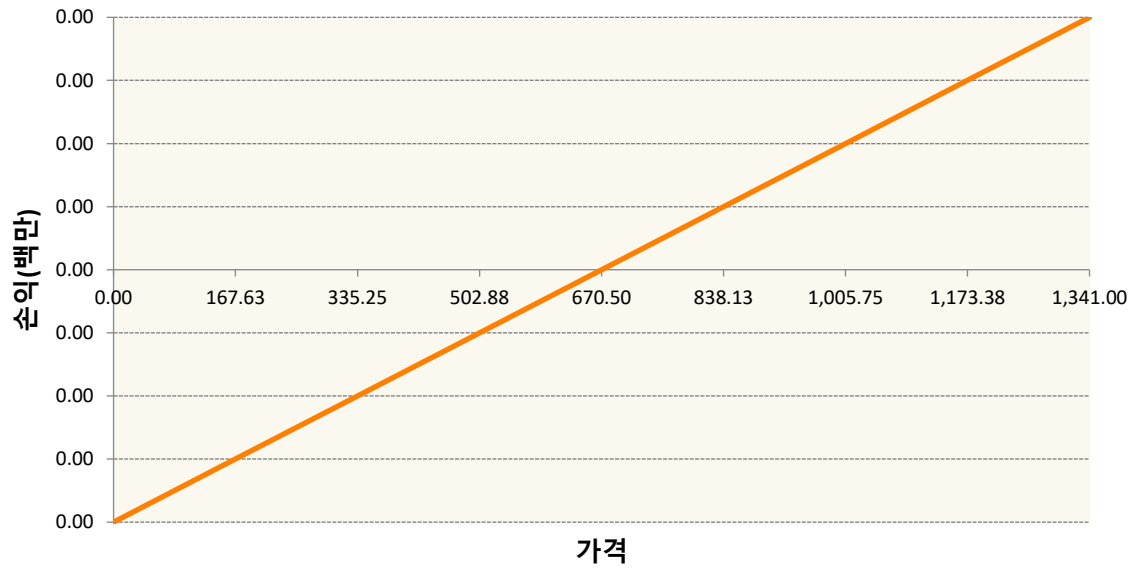
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



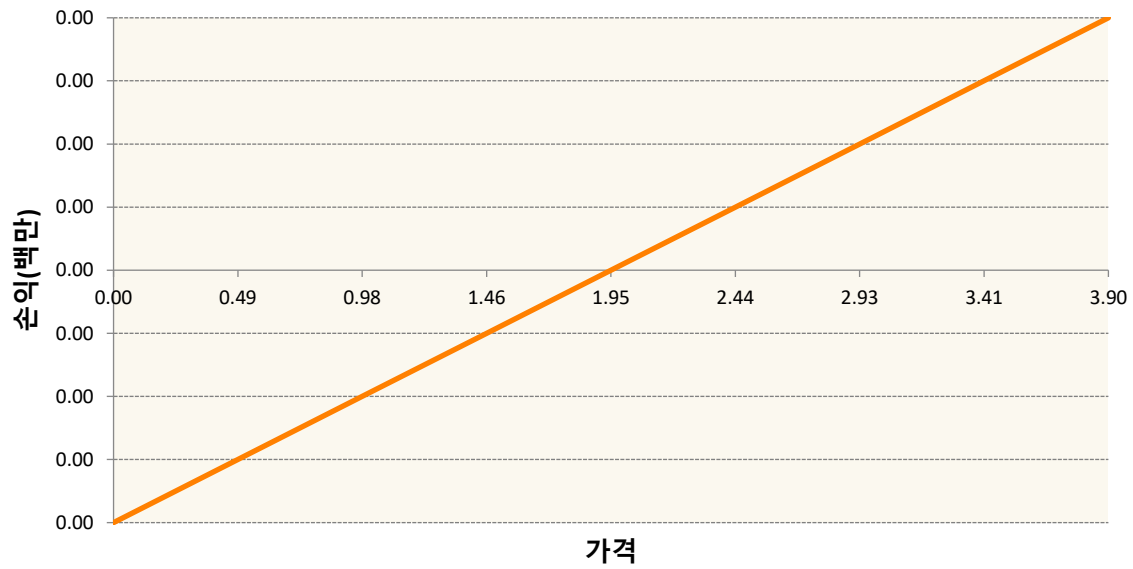
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



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	4
EOF5	E-MINI NATURAL GAS Jan25	2
KR4175VB00 2024-11 달러선물		8
NGF25	NATURAL GAS FUTR Jan25	16
QSF5	Low Su Gasoil G Jan25	7
XBF5	GASOLINE RBOB FUT Jan25	9

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

134