

공시일 2024-11-07

기준일 2024-11-06

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	2024-11-07
기준일	2024-11-06

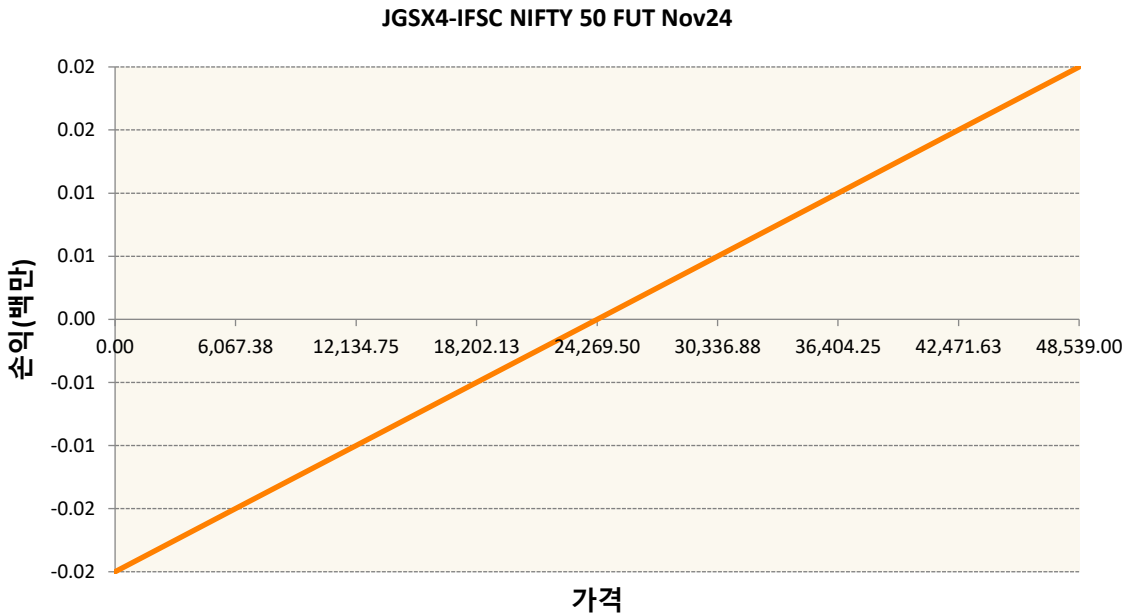
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,288	0	3,288	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSX4	IFSC NIFTY 50 FUT Nov24	263
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

170

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

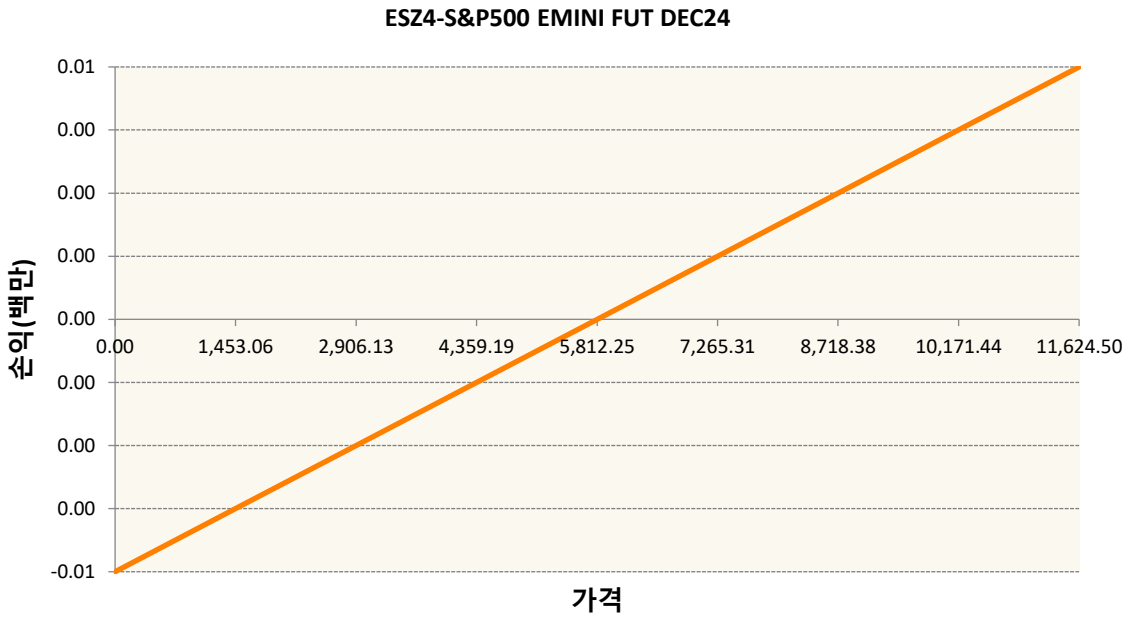
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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	2024-11-07
기준일	2024-11-06

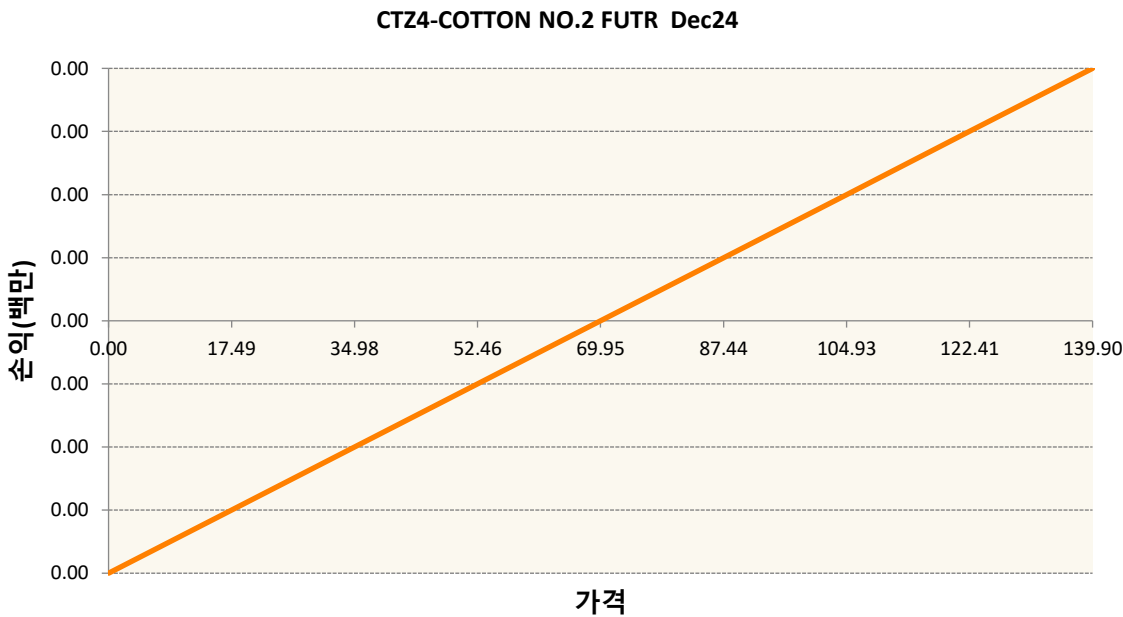
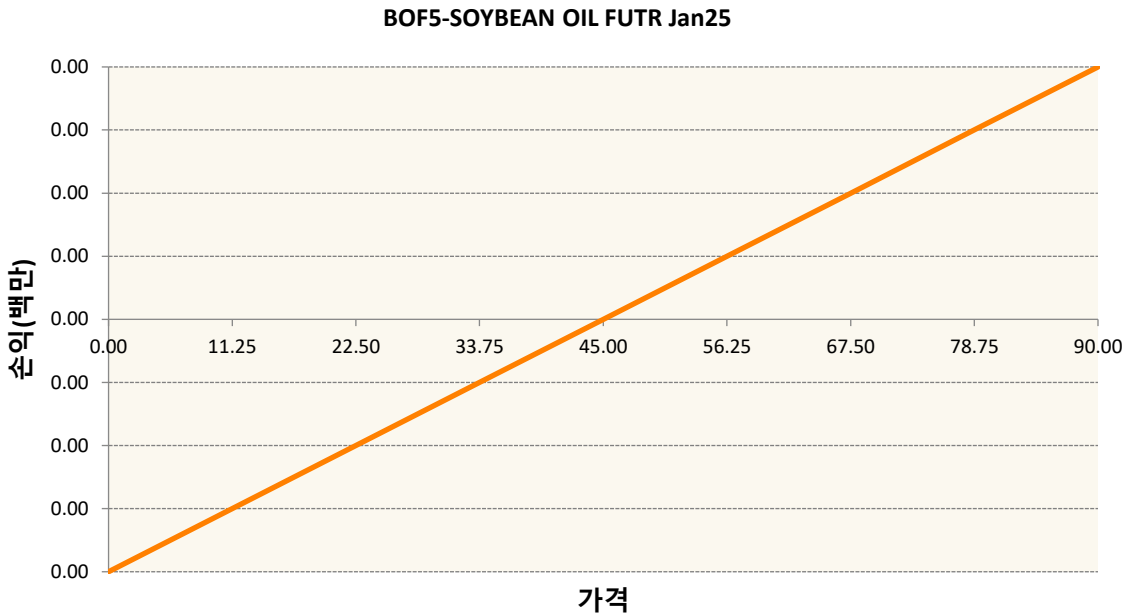
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

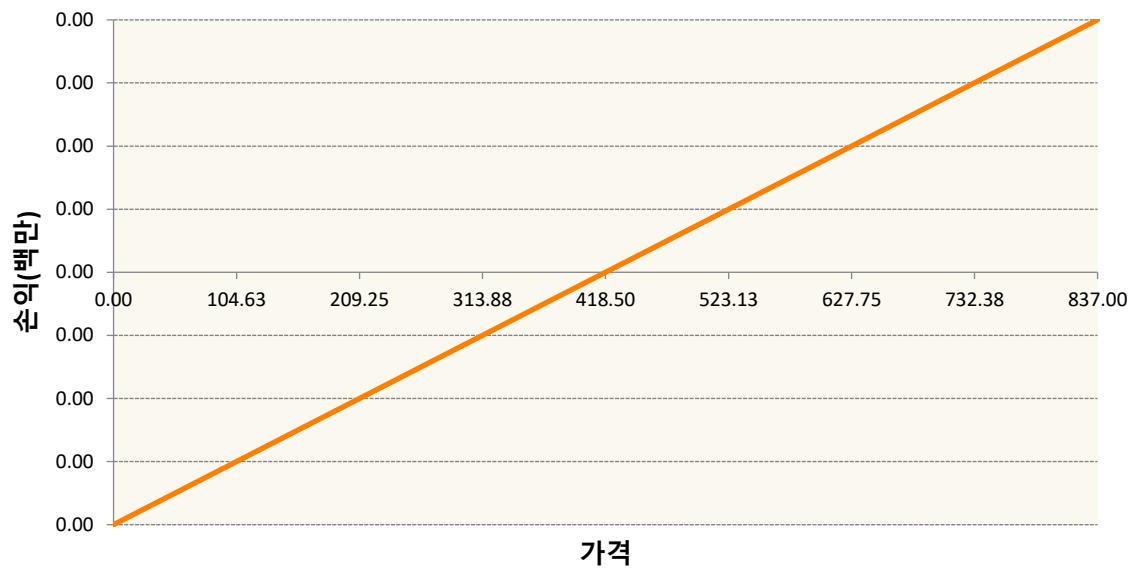
(단위:USD 백만)

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	3,749	0	3,749	
누계	통화	선물	0	489	-489	장내

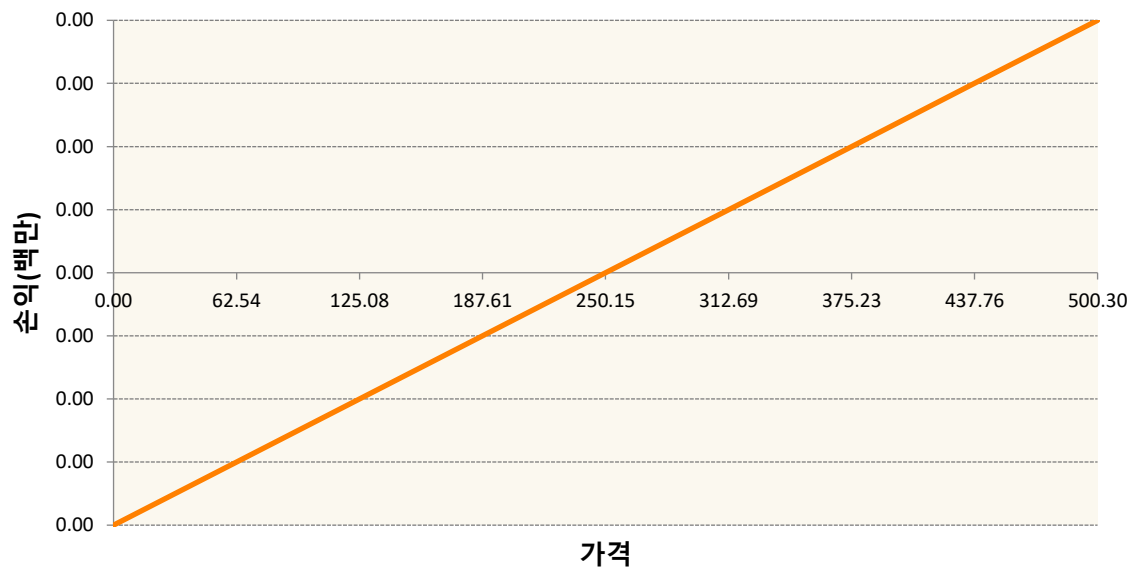
2. 만기시점의 손익구조



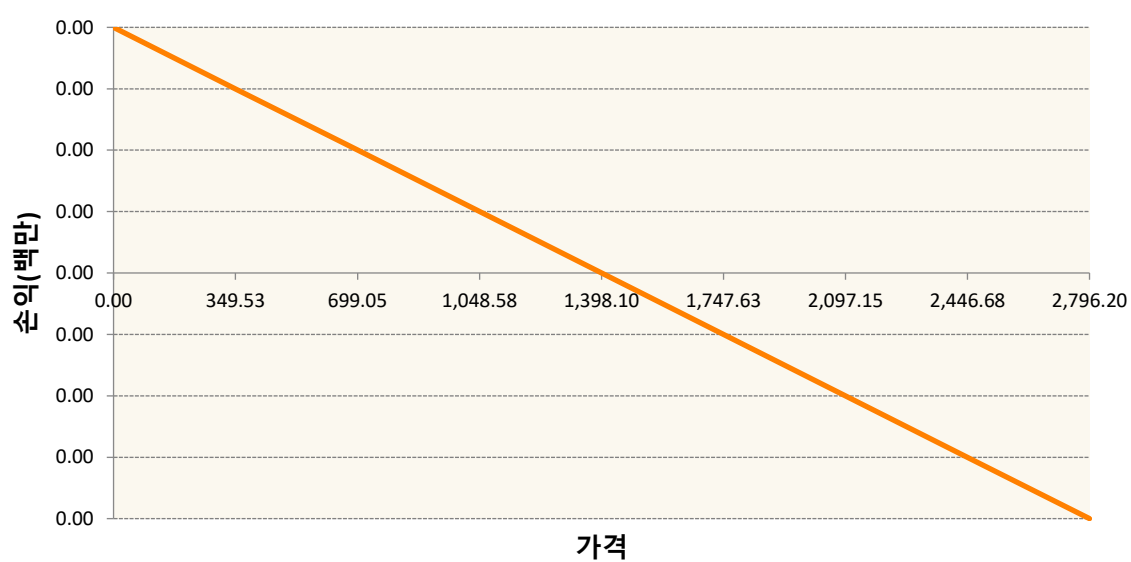
CZ4-CORN FUTURE Dec24



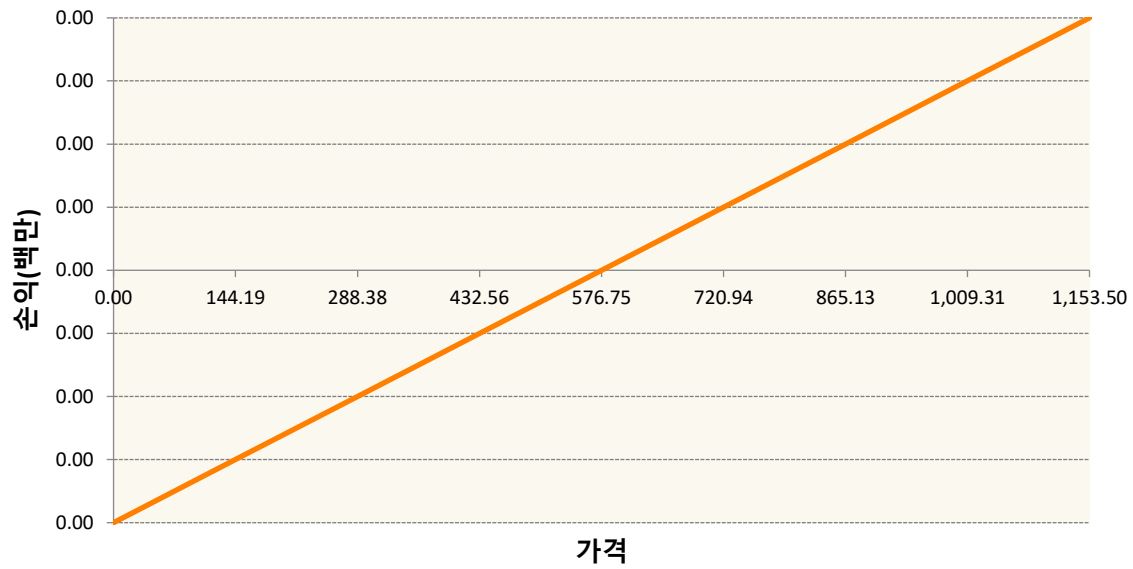
KCZ4-COFFEE 'C' FUTURE Dec24



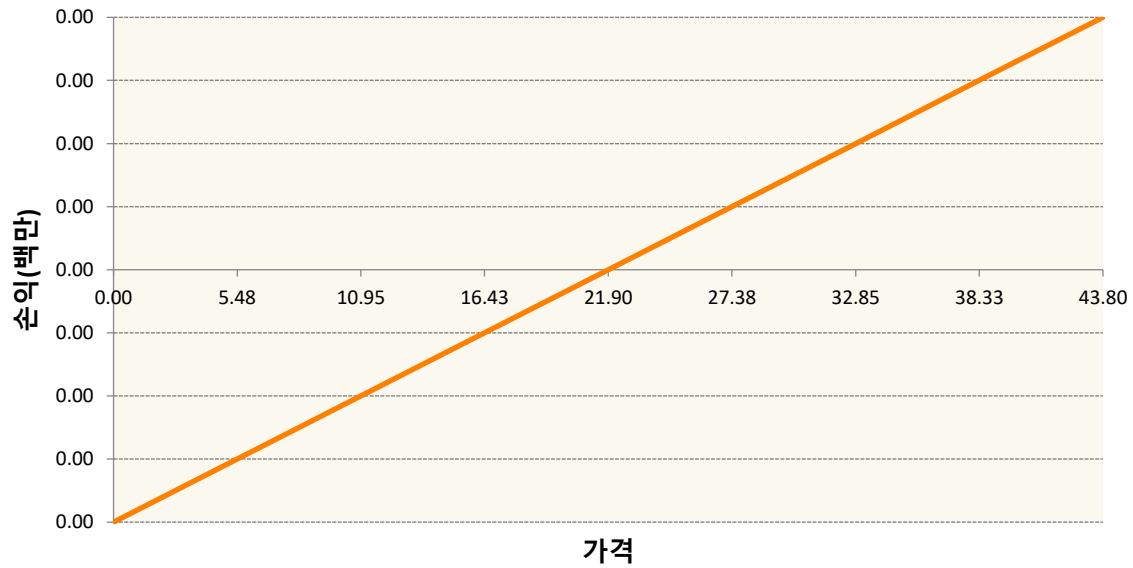
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



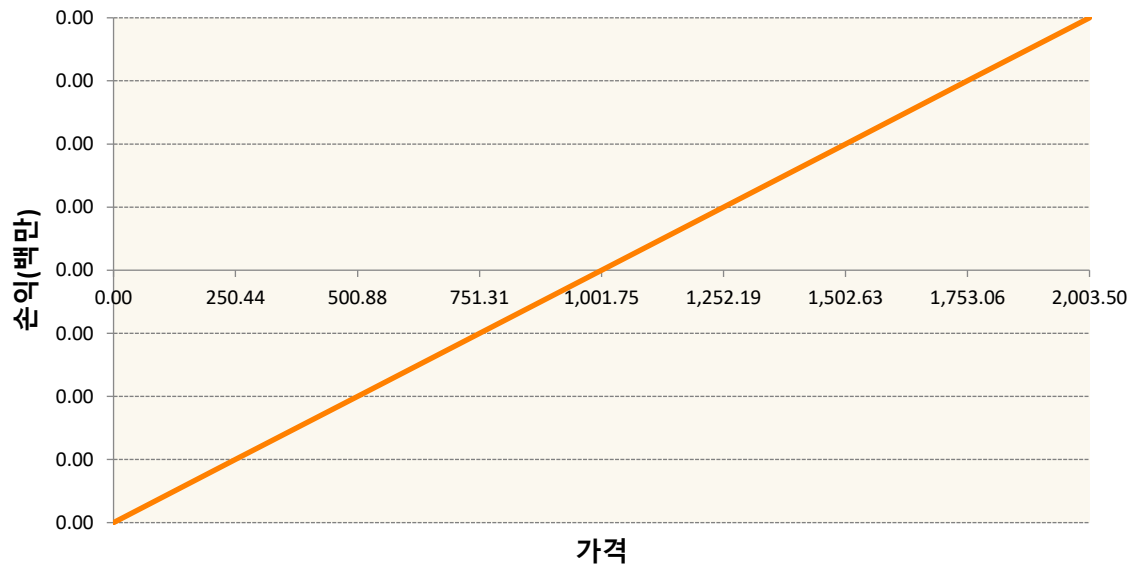
KWZ4-KC HRW WHEAT FUT Dec24



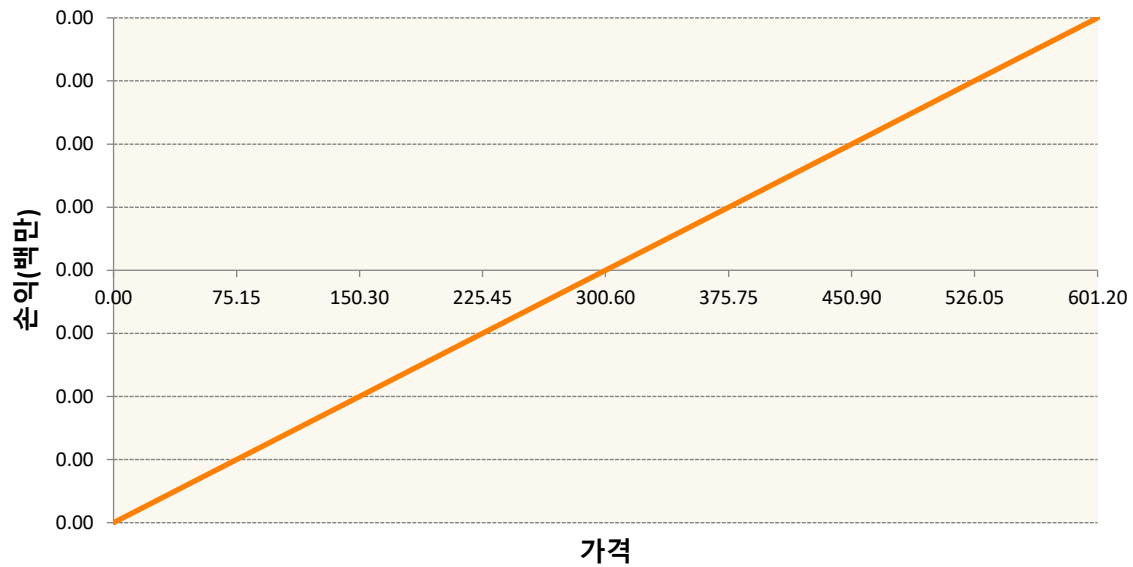
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



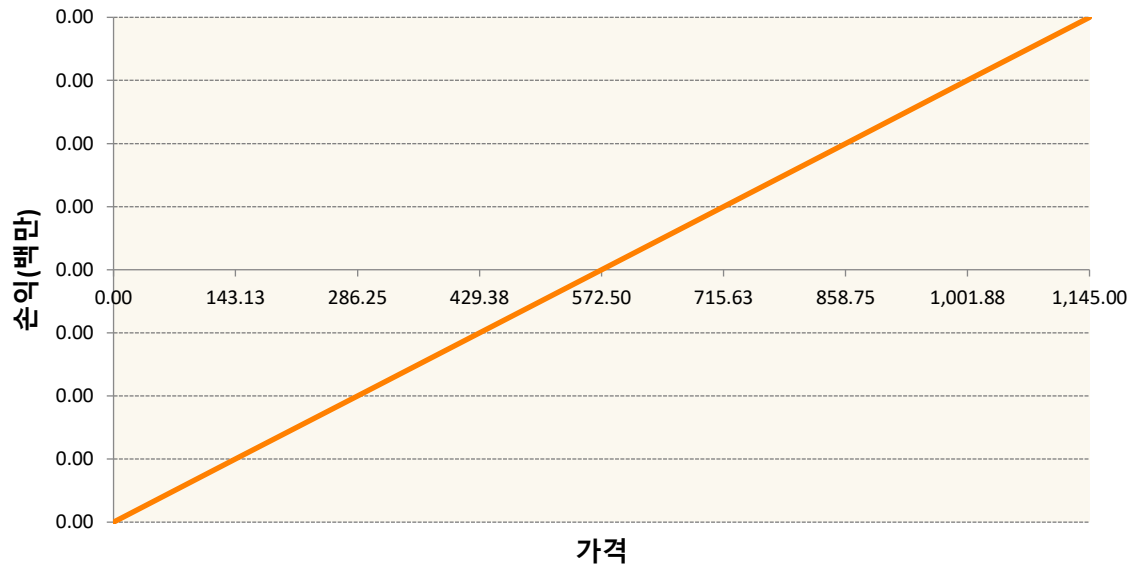
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-11-07
기준일	2024-11-06

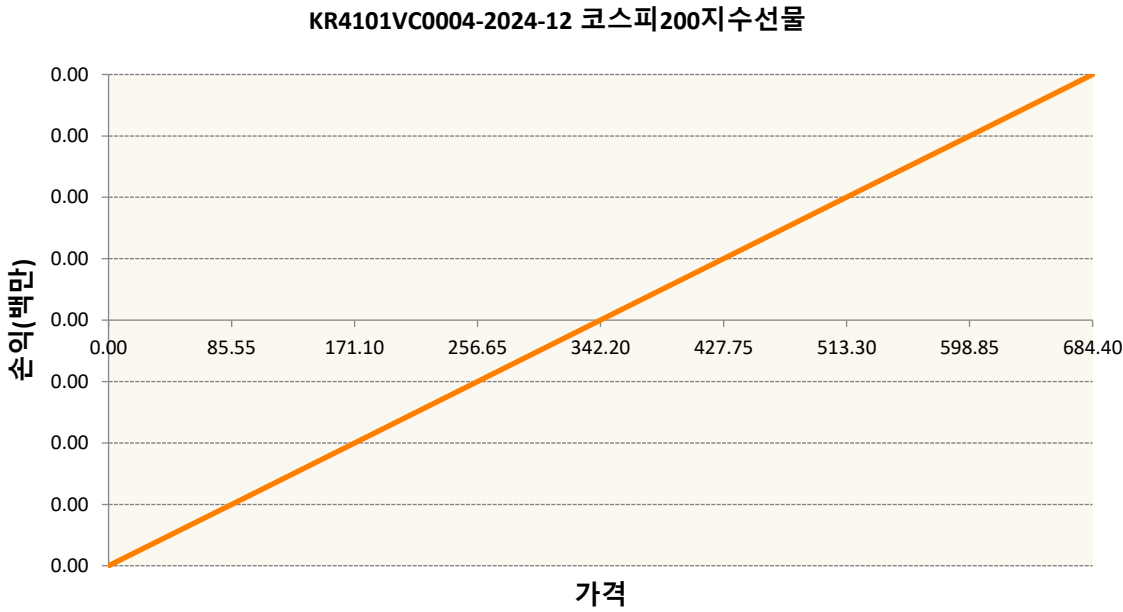
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,434	3,417	16	장내
누계	유가증권	선물	1,797	0	1,797	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				143
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-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%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	143	143	143	143	143	143	143

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

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	319
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

517

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

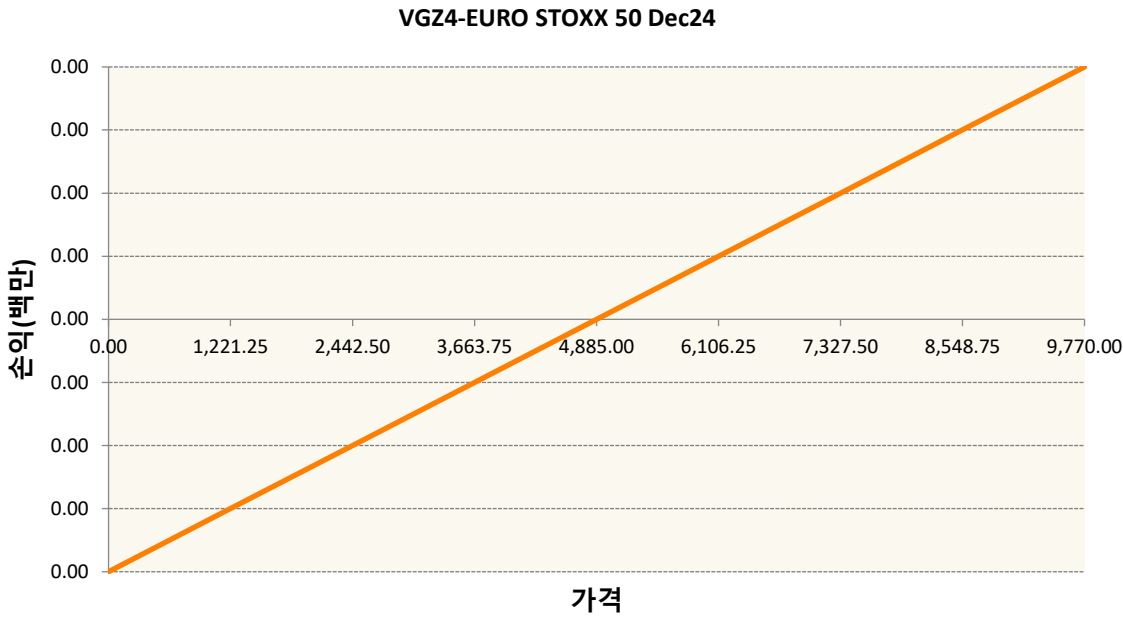
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	943	0	943	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ4	EURO STOXX 50 Dec24	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

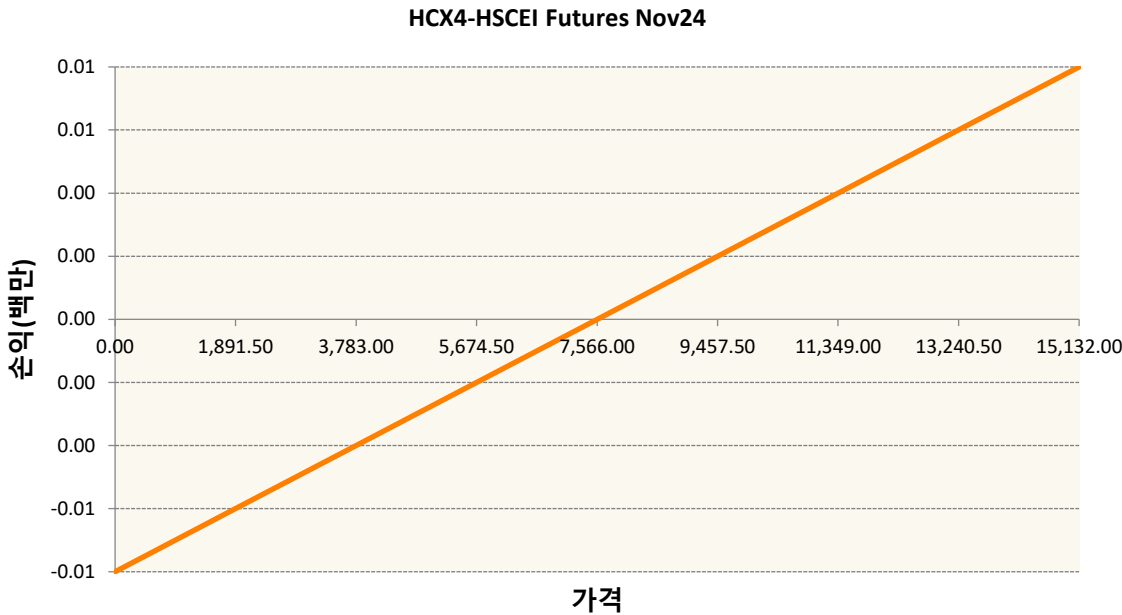
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,618	0	1,618	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX4	HSCEI Futures Nov24	129
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

177

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

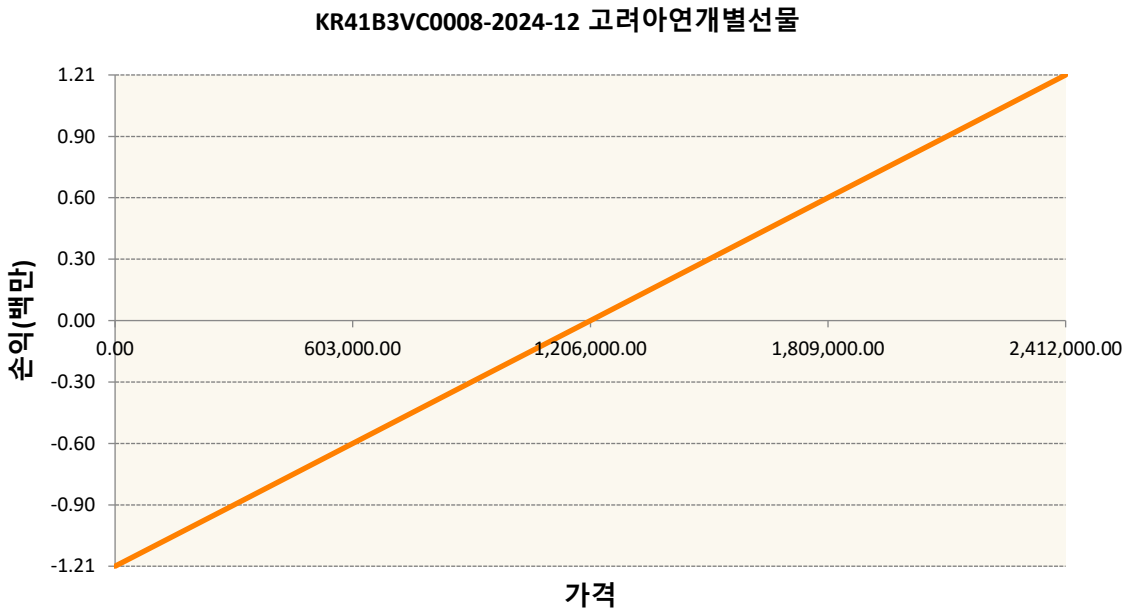
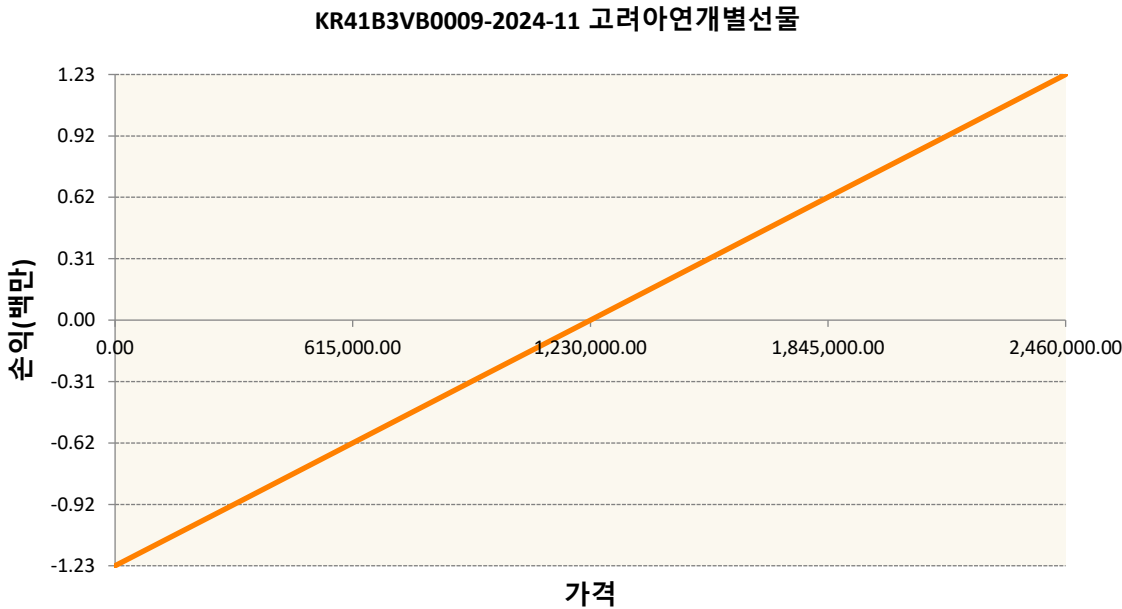
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

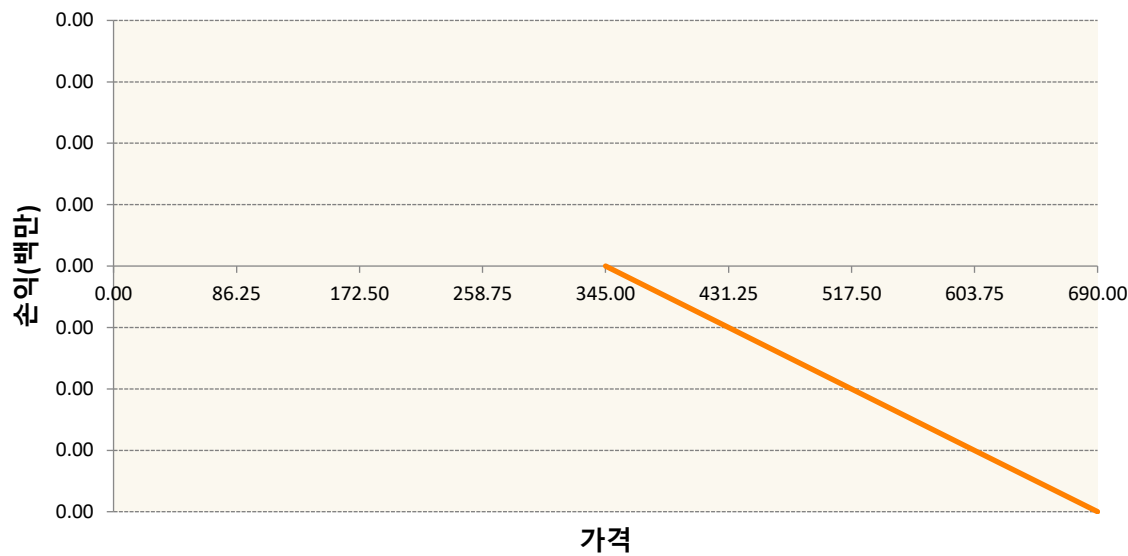
(단위:백만원)

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	320	0	320	장내
누계	유가증권	옵션	0	40,131	-40,131	장내

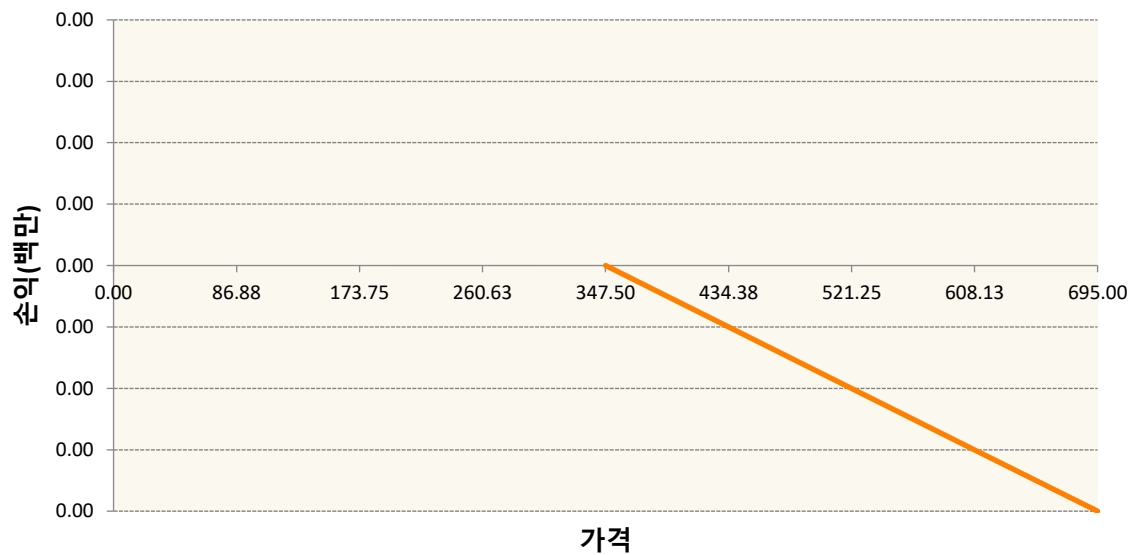
2. 만기시점의 손익구조



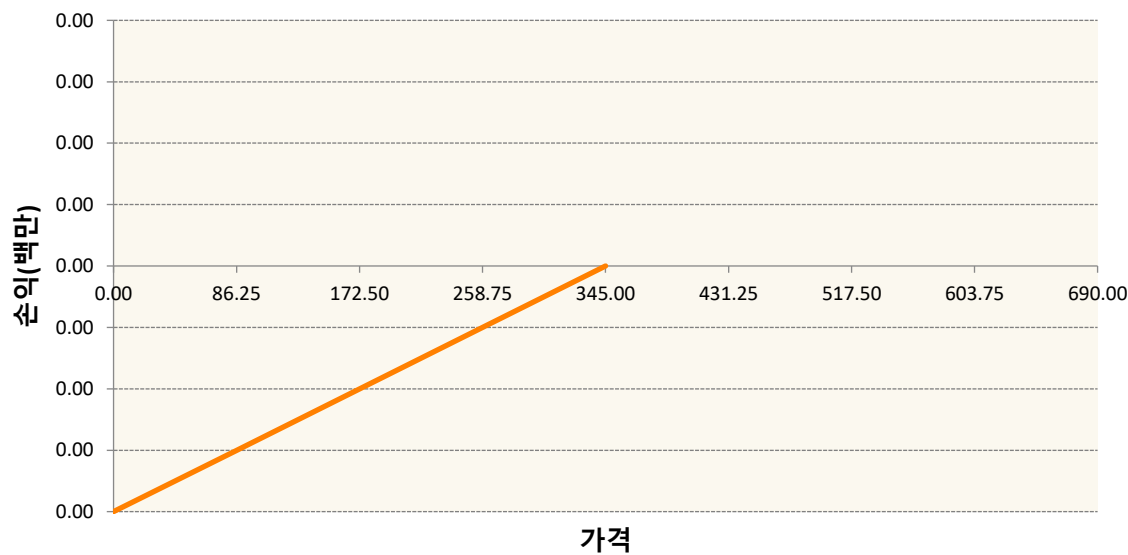
KR4201VB3453-2024-11 콜345



KR4201VB3479-2024-11 콜347.5



KR4301VB3452-2024-11 풋345



(단위:백만원)

KR41B3VB0009							2024-11 고려아연개별선물		25	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25			
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16			
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	8	8	8	8	8	8	8			
5.33%	16	16	16	16	16	16	16			
8.00%	25	25	25	25	25	25	25			
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		1,721	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	262	262	261	260	259	257	254			
-5.33%	260	258	254	249	242	233	223			
-2.67%	237	223	207	189	169	148	125			
0%	97	65	33	0	-33	-66	-100			
2.67%	-297	-328	-361	-393	-427	-460	-494			
5.33%	-933	-947	-964	-983	-1,004	-1,026	-1,050			
8.00%	-1,675	-1,678	-1,683	-1,690	-1,698	-1,709	-1,721			
KR4201VB3479							2024-11 콜347.5		184	
	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%	22	22	22	22	21	20	19			
-2.67%	21	20	18	17	15	13	11			
0%	10	7	3	0	-4	-7	-11			
2.67%	-26	-31	-35	-39	-43	-47	-51			
5.33%	-93	-96	-98	-101	-104	-107	-110			
8.00%	-177	-178	-179	-180	-181	-183	-184			
KR4301VB3452							2024-11 풋345		547	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-547	-547	-547	-547	-547	-547	-547
-5.33%	-347	-347	-348	-348	-349	-350	-352
-2.67%	-150	-152	-155	-158	-161	-165	-170
0%	21	14	7	0	-7	-14	-22
2.67%	118	111	104	97	90	83	76
5.33%	145	142	140	137	133	129	124
8.00%	148	147	147	146	145	144	142

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

(단위:백만원)

2,632

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

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	662	0	662	

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	2024-11-07
기준일	2024-11-06

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	4,352	0	4,352	

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	2024-11-07
기준일	2024-11-06

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	13,997	0	13,997	
누계	통화	선도	0	14,311	-14,311	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E	586
FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E	352
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E	207
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

522

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

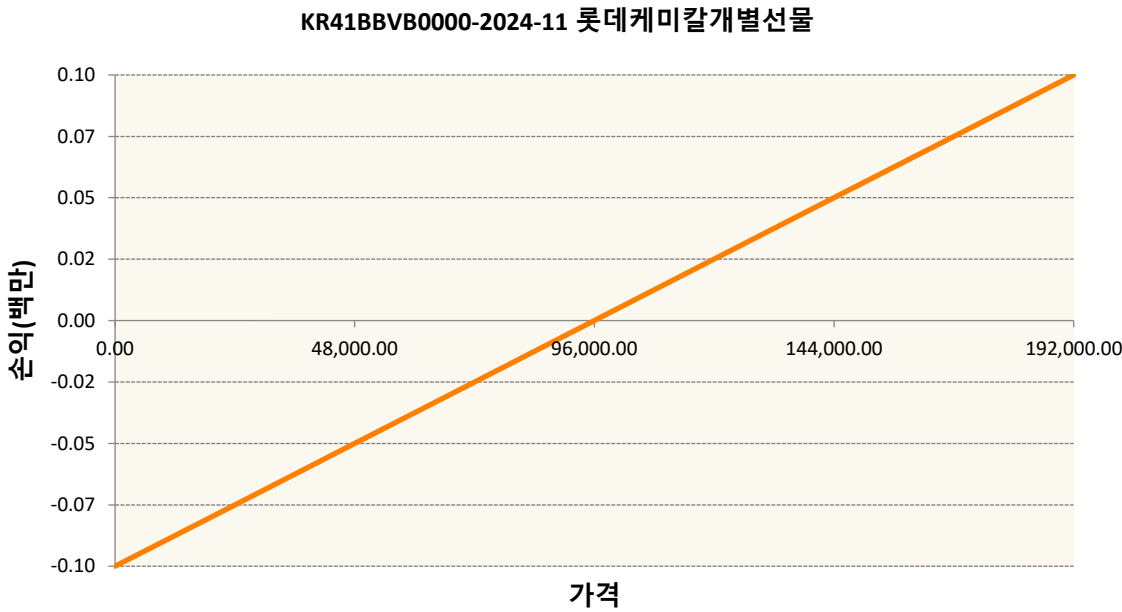
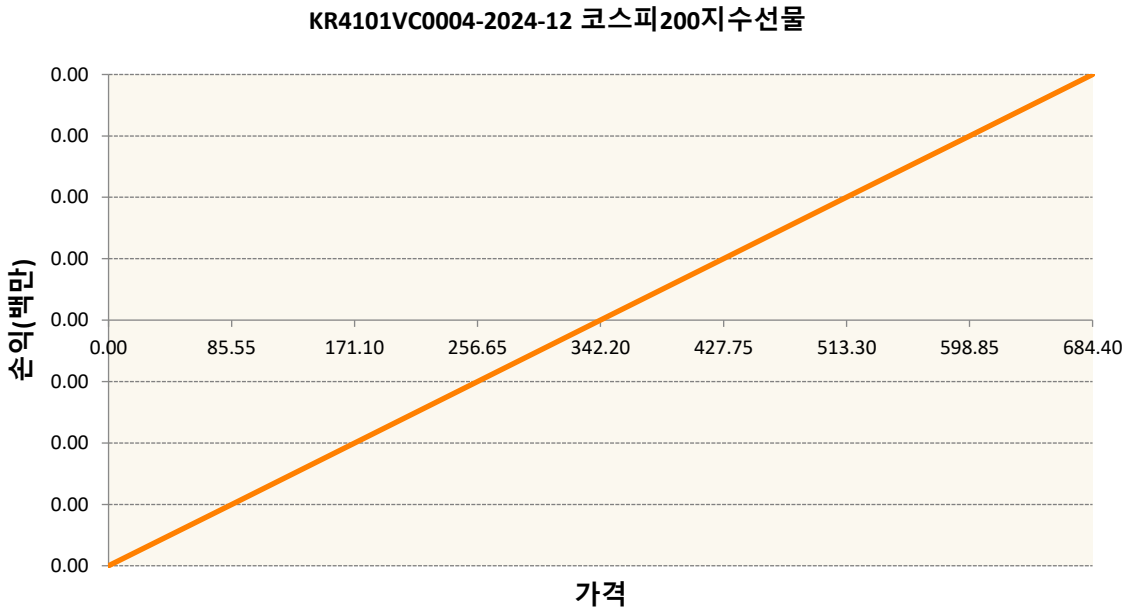
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

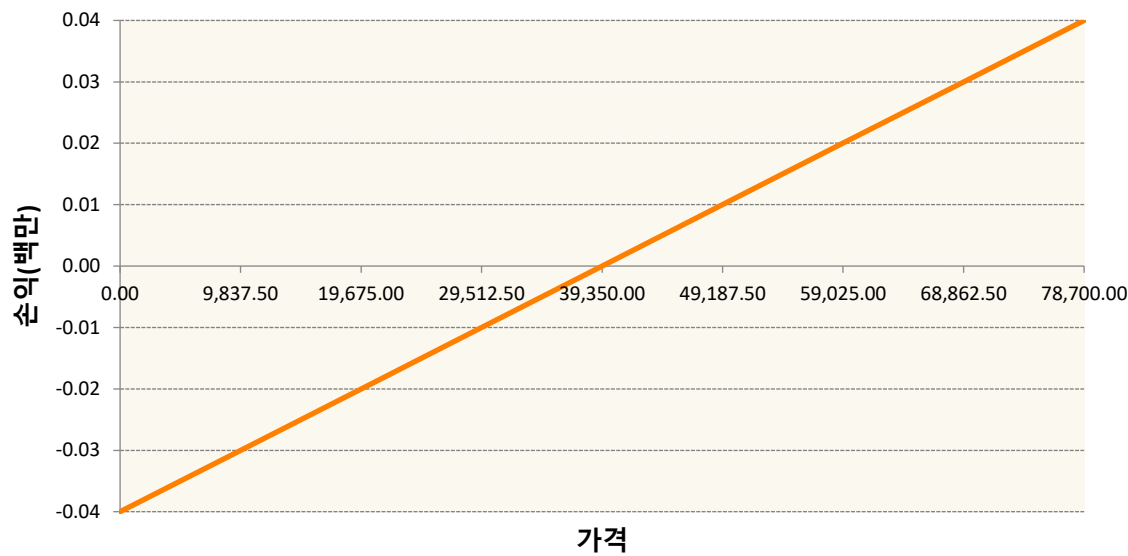
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	27	0	27	장내
누계	유가증권	선물	900	0	900	장내

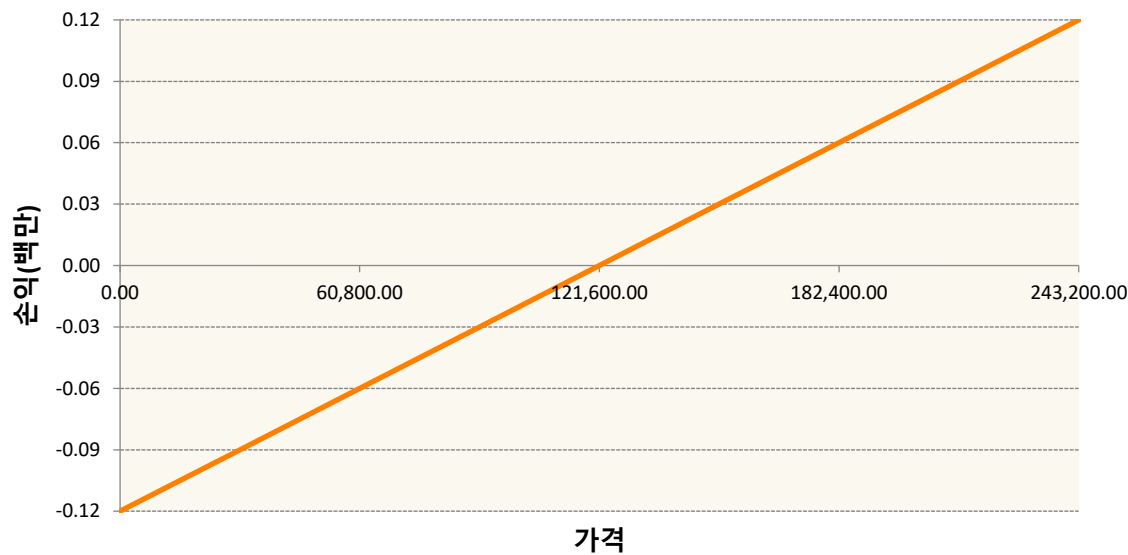
2. 만기시점의 손익구조



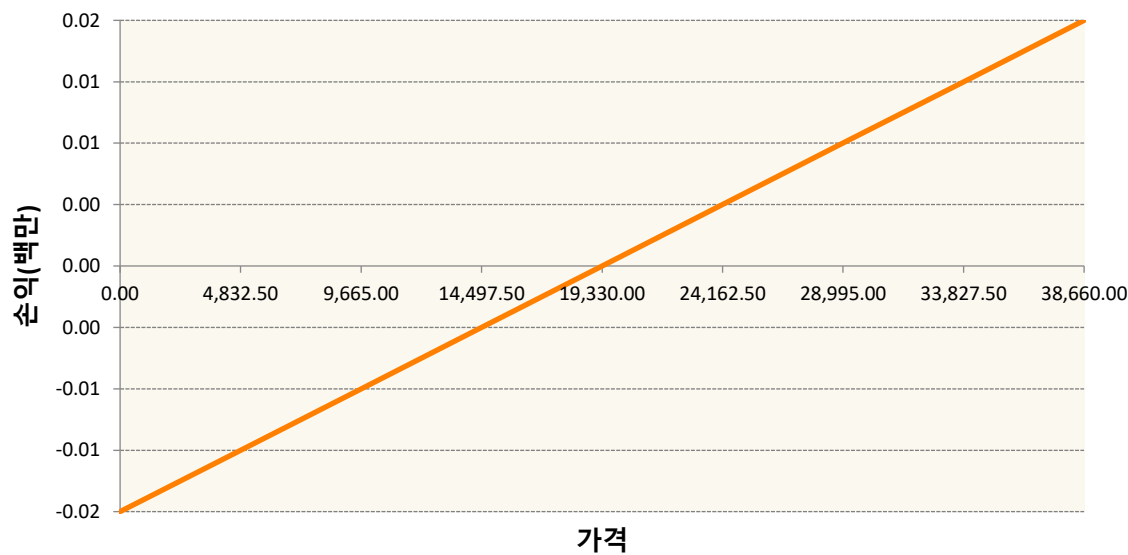
KR41BQVB0003-2024-11 호텔신라개별선물



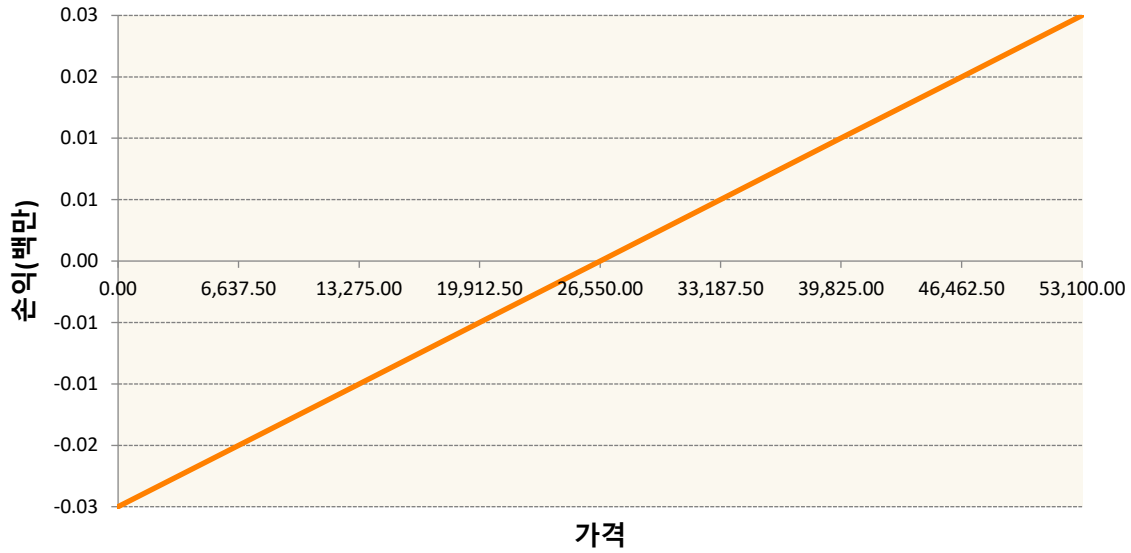
KR41C6VB0004-2024-11 아모레퍼시픽개별선물



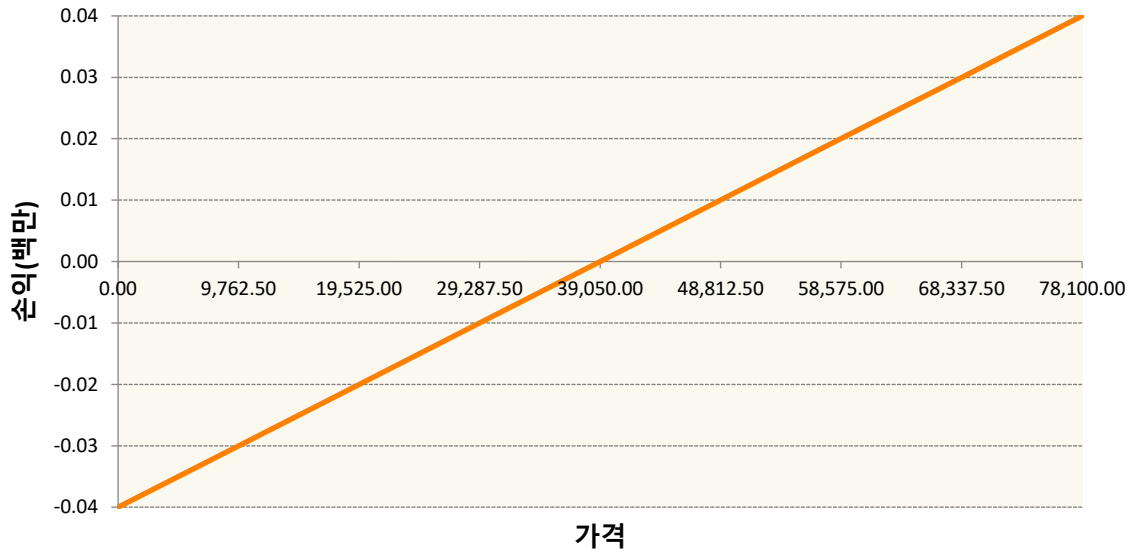
KR41CBVB0009-2024-11 한화솔루션개별선물



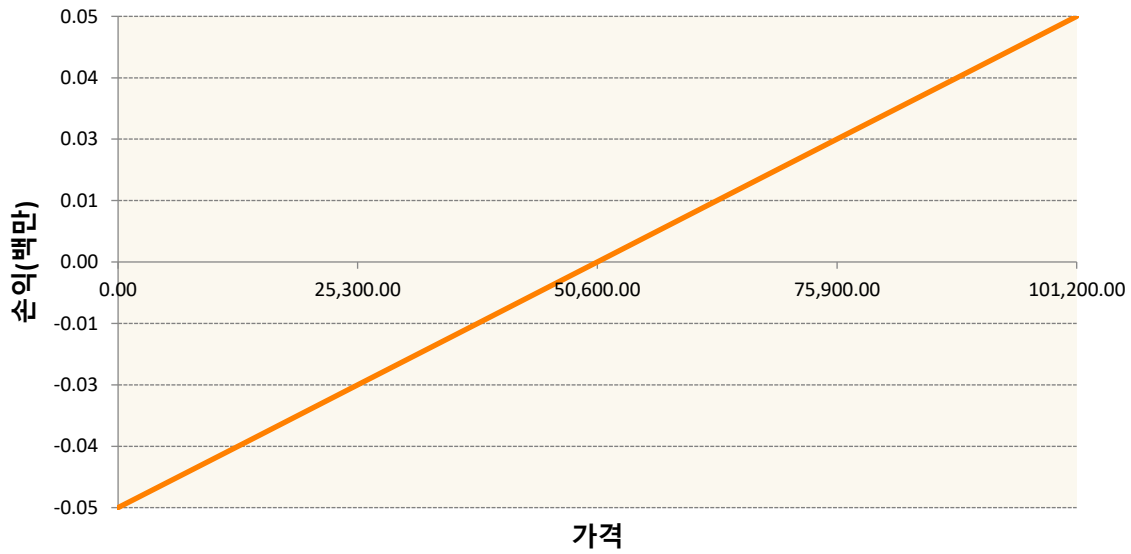
KR41CNVB0005-2024-11 포스코DX개별선물



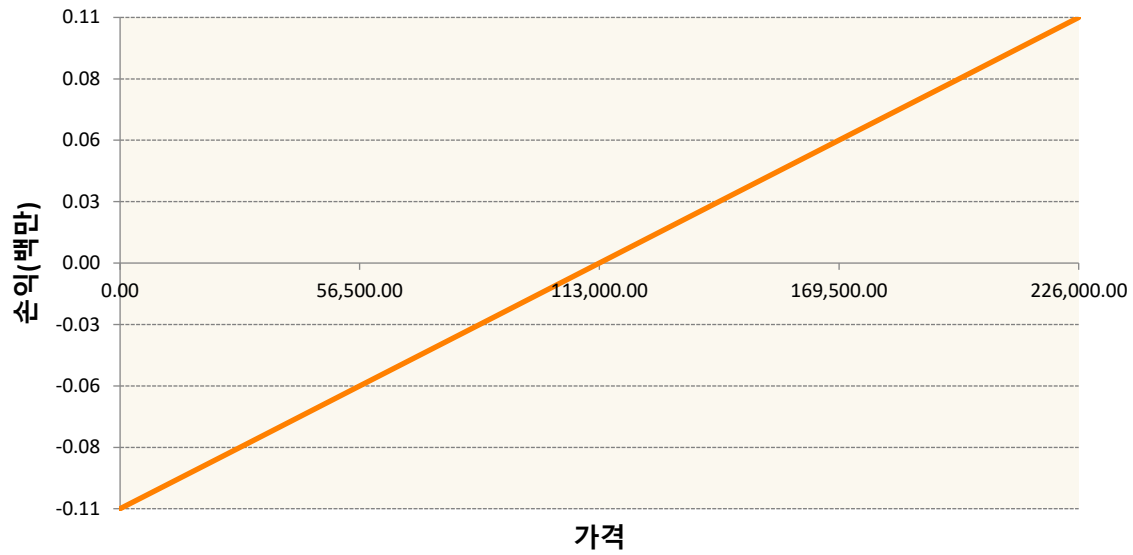
KR41CVVB0005-2024-11 한미사이언스개별선물



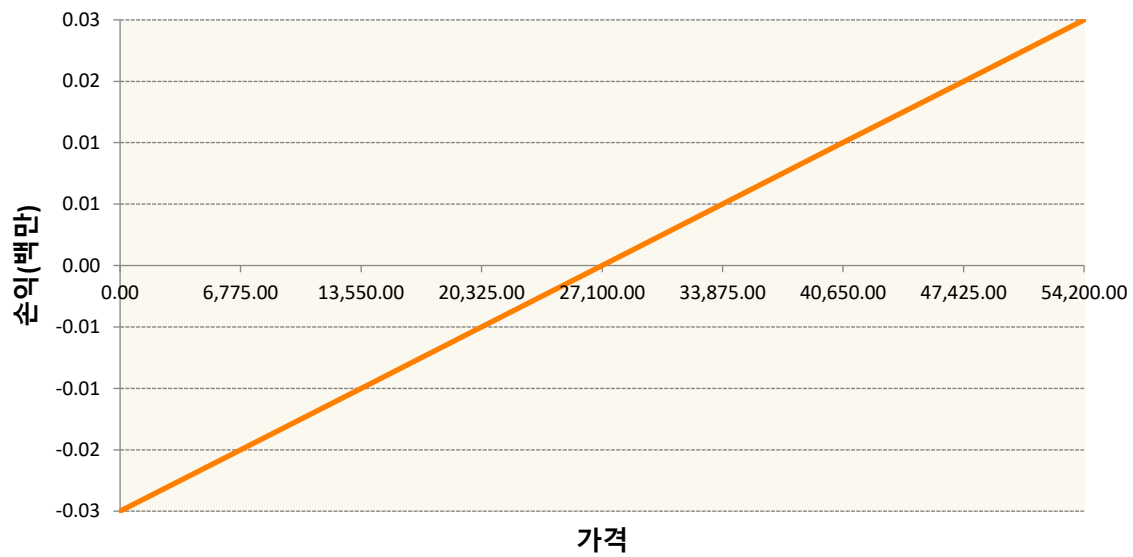
KR41DNVB0004-2024-11 하나투어개별선물



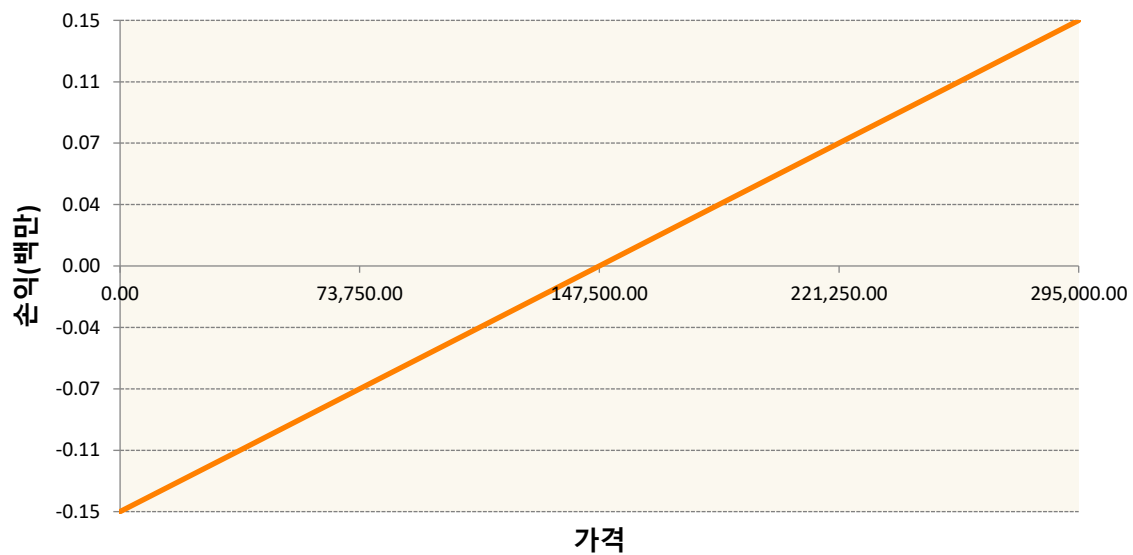
KR41FMVB0003-2024-11 엘앤에프개별선물



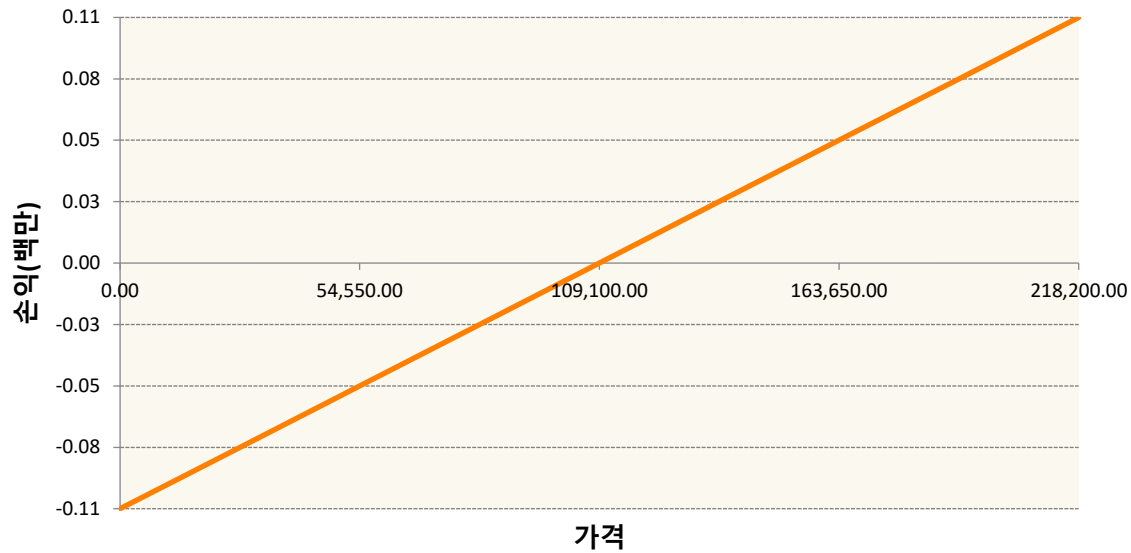
KR41FXVB0000-2024-11 동서개별선물



KR41GLVB0003-2024-11 LS ELECTRIC개별선물



KR41GZVB0007-2024-11 에코프로머티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101VC0004 2024-12 코스피200지수선물								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	-61
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	41	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	61	61	61	61	61	61	61	61
KR41BBVB0000 2024-11 롯데케미칼개별선물								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	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1	1
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	-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%	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

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)

82

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

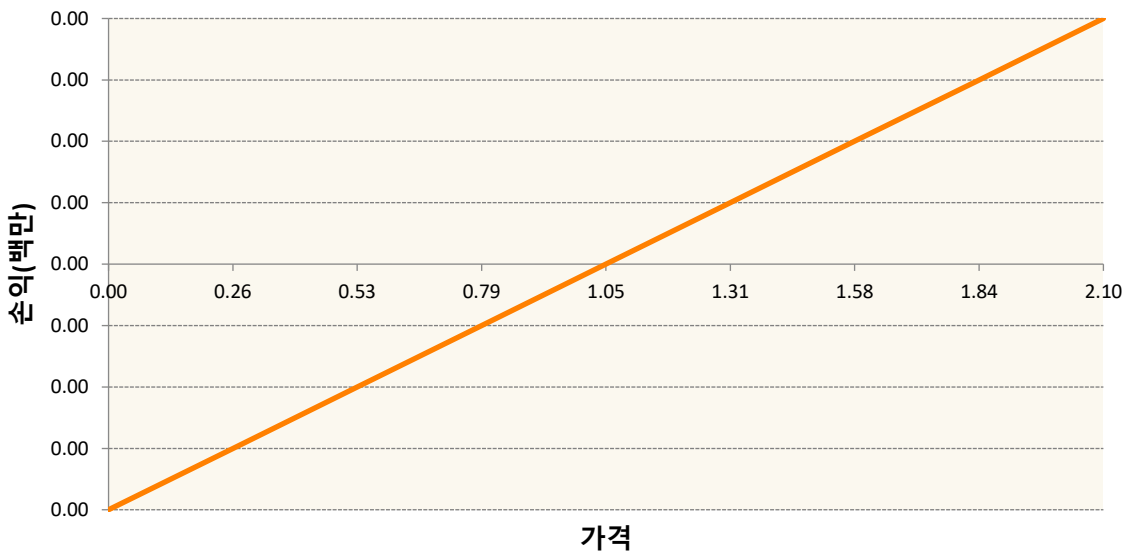
1. 계약금액

(단위:백만원)

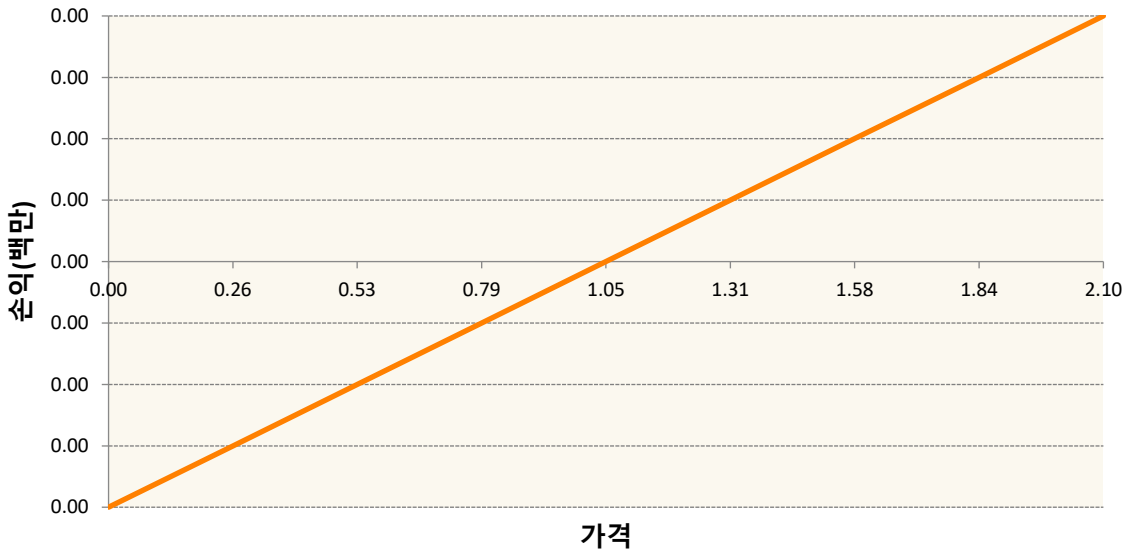
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,867	0	11,867	

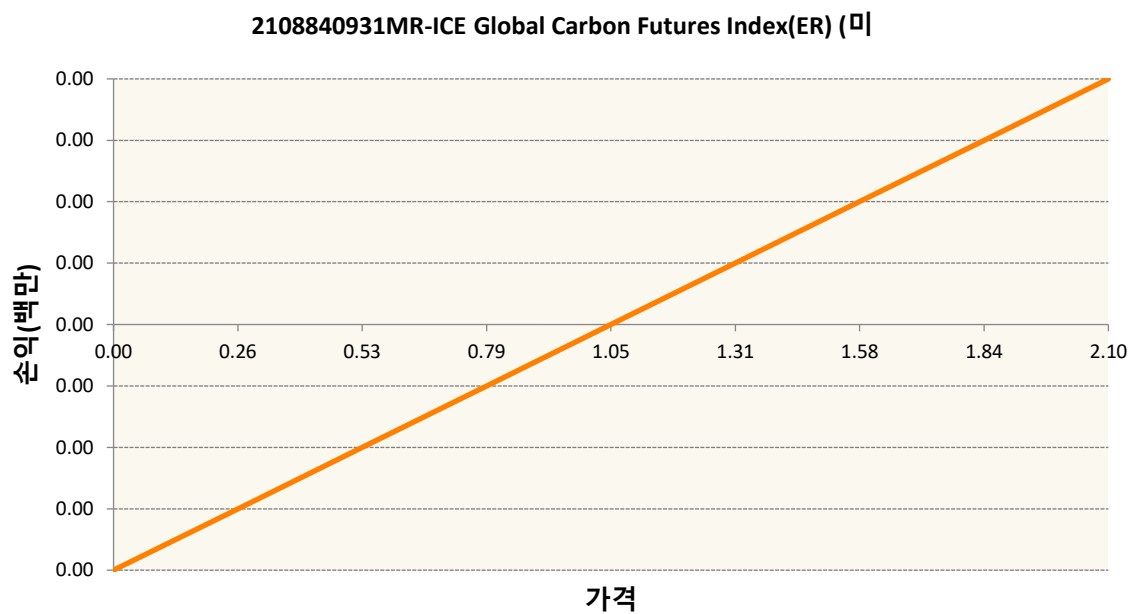
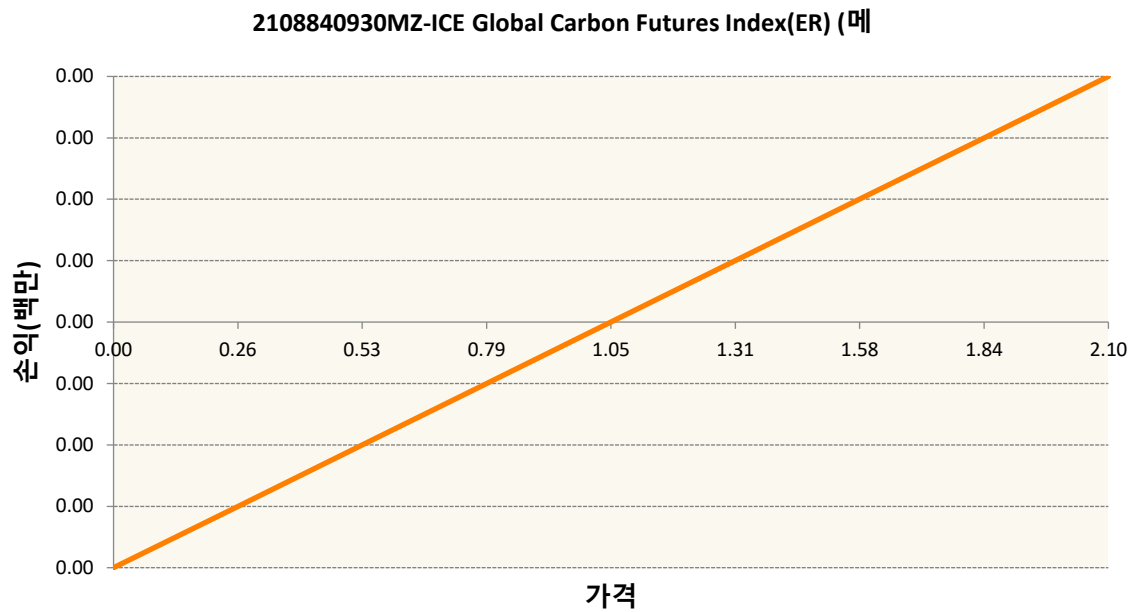
2. 만기시점의 손익구조

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		94
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		473
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		189
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		189

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,021

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

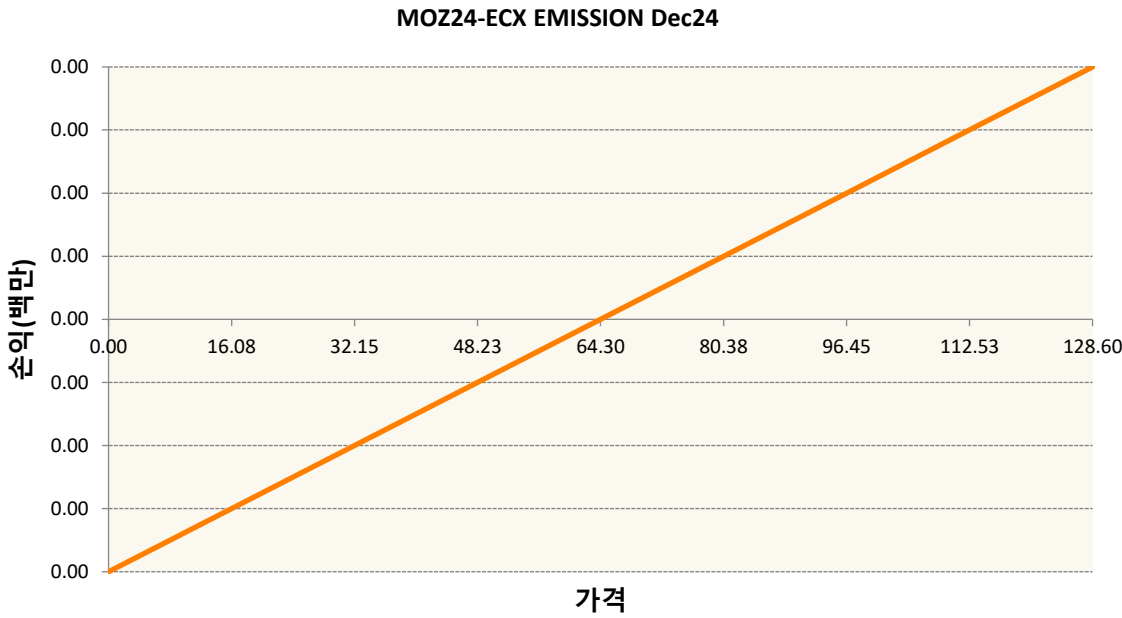
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	7,700	0	7,700	
누계	통화	선도	0	1,918	-1,918	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	617

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

(단위:백만원)

1,113

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

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)	25
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	25
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	37
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	37

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

(단위:백만원)

214

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

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)	74
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	16

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

(단위:백만원)

331

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

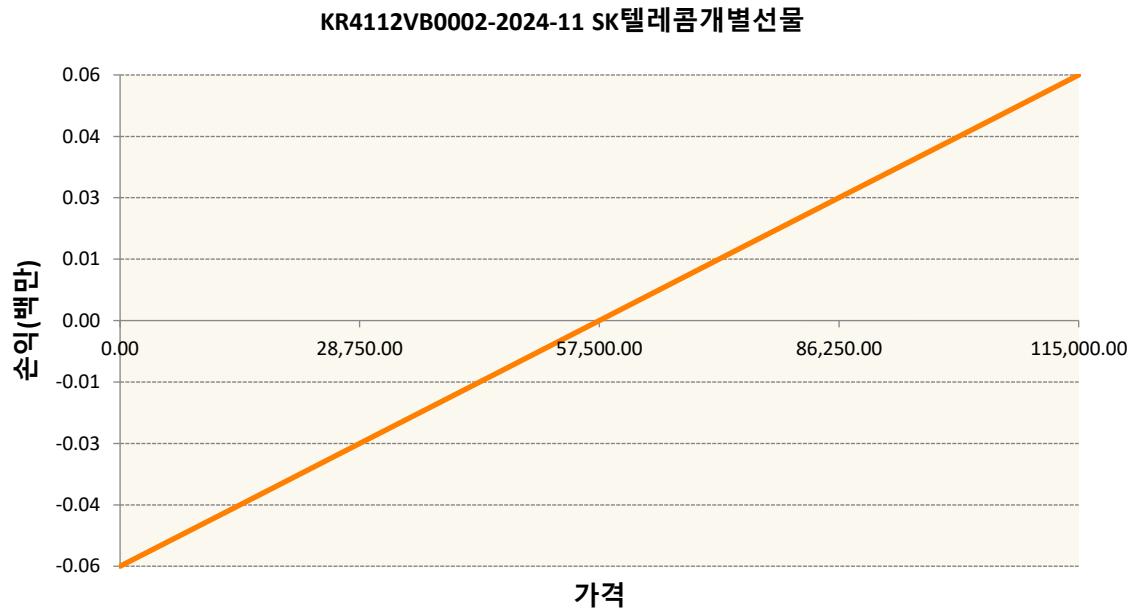
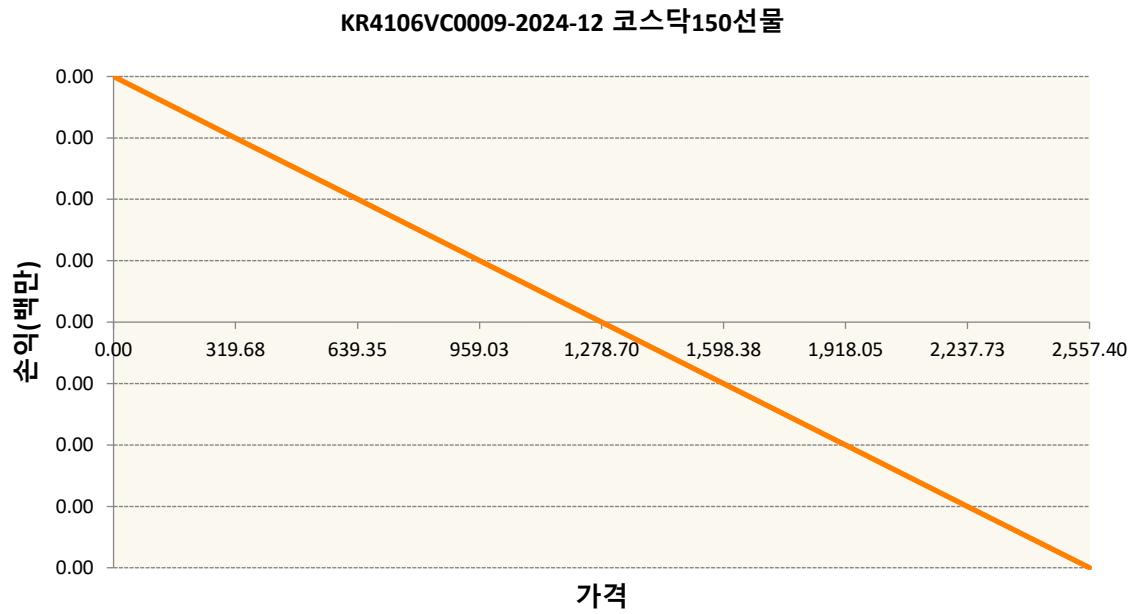
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

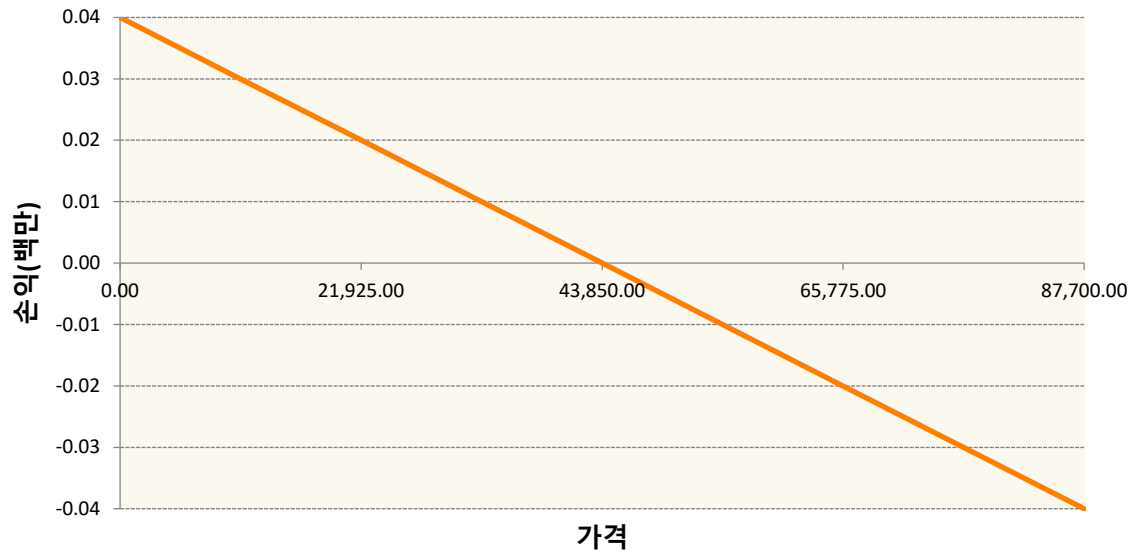
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	33	4	28	장내
누계	유가증권	선물	29	106	-77	장내

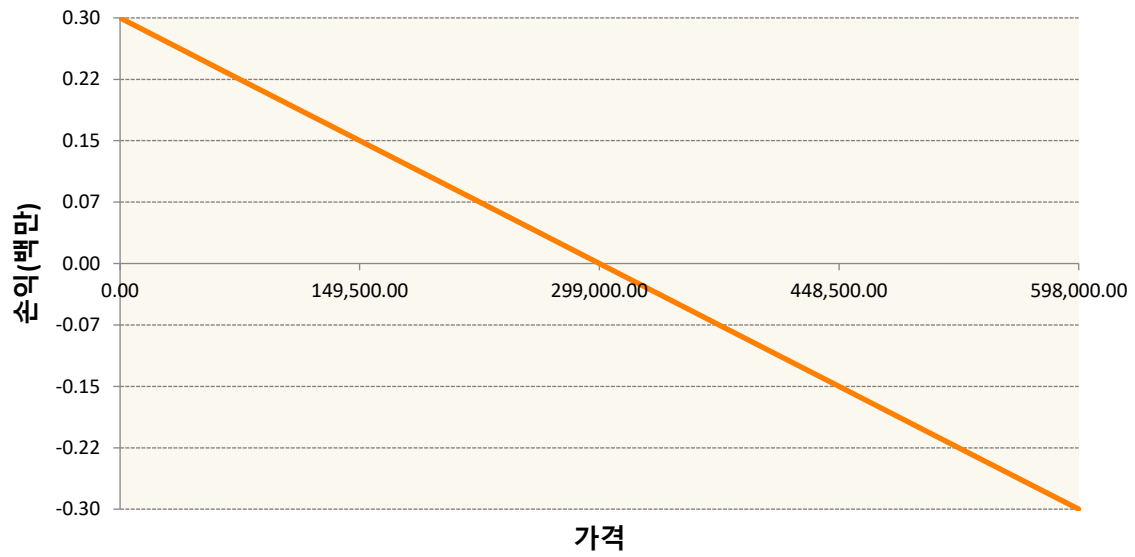
2. 만기시점의 손익구조



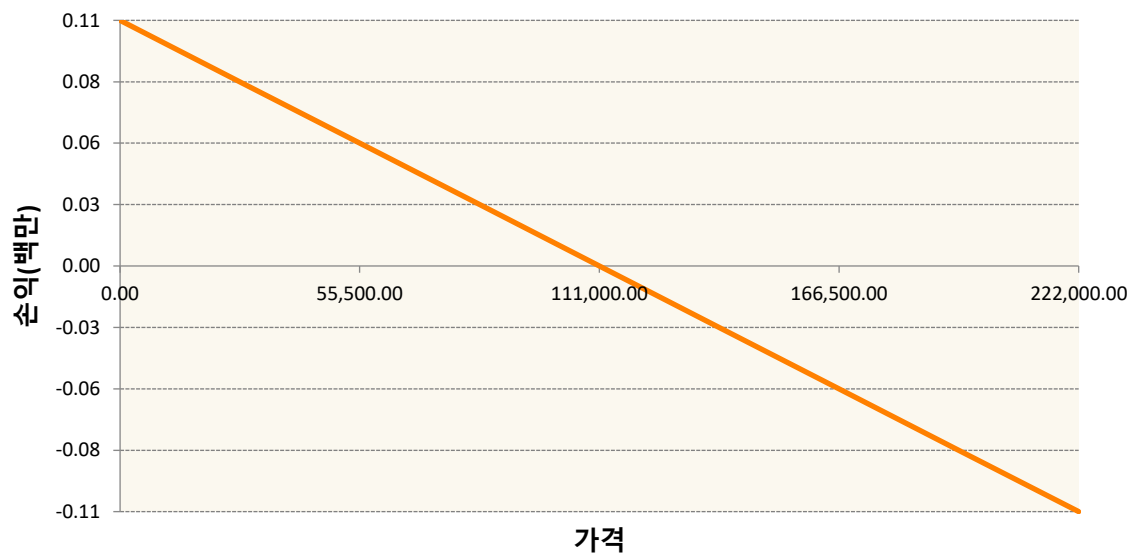
KR4114VB0000-2024-11 KT개별선물



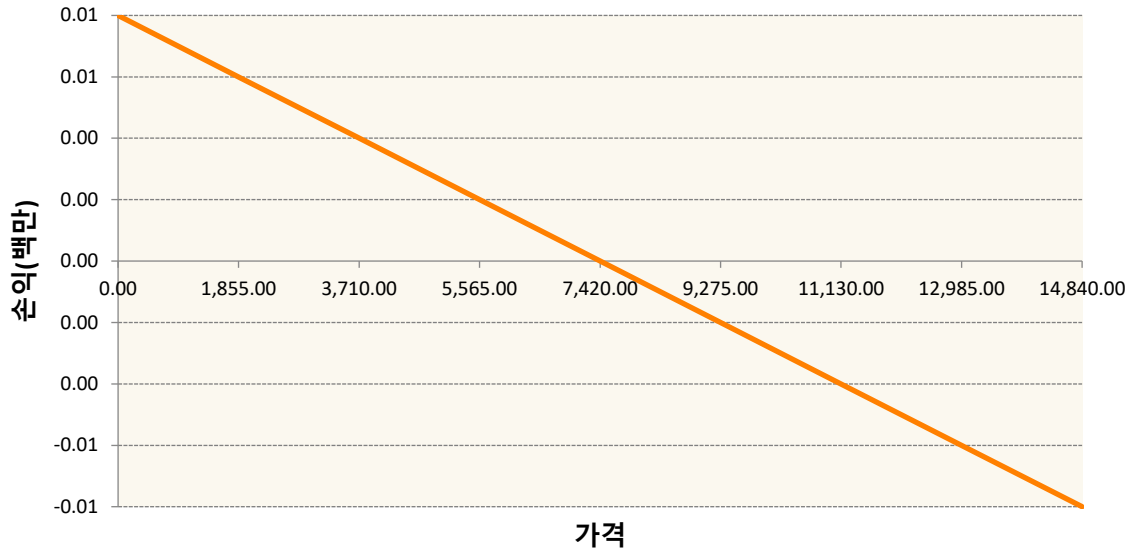
KR4122VC0009-2024-12 삼성SDI개별선물



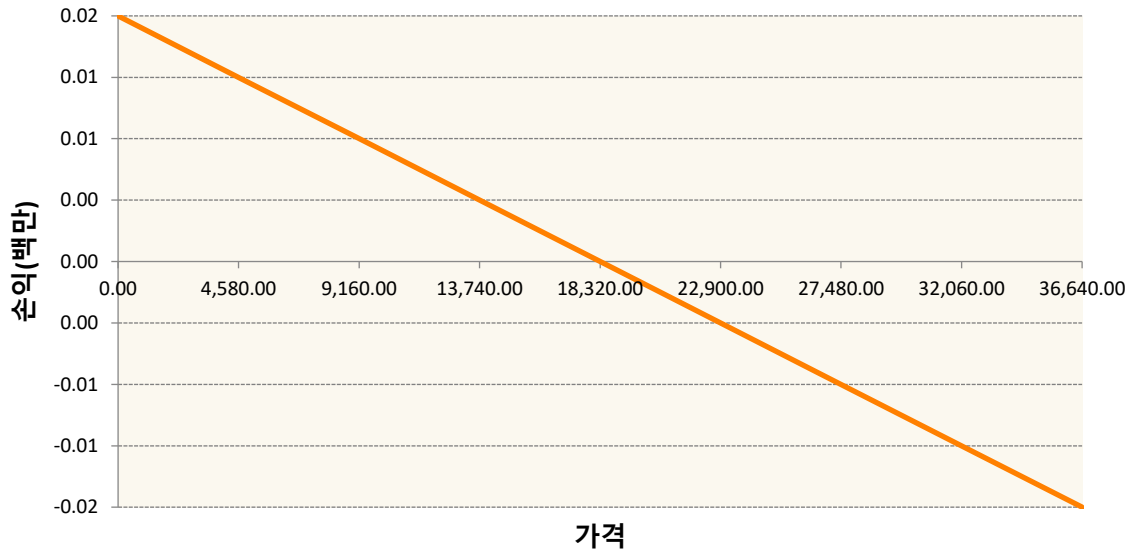
KR4136VB0004-2024-11 KT&G개별선물



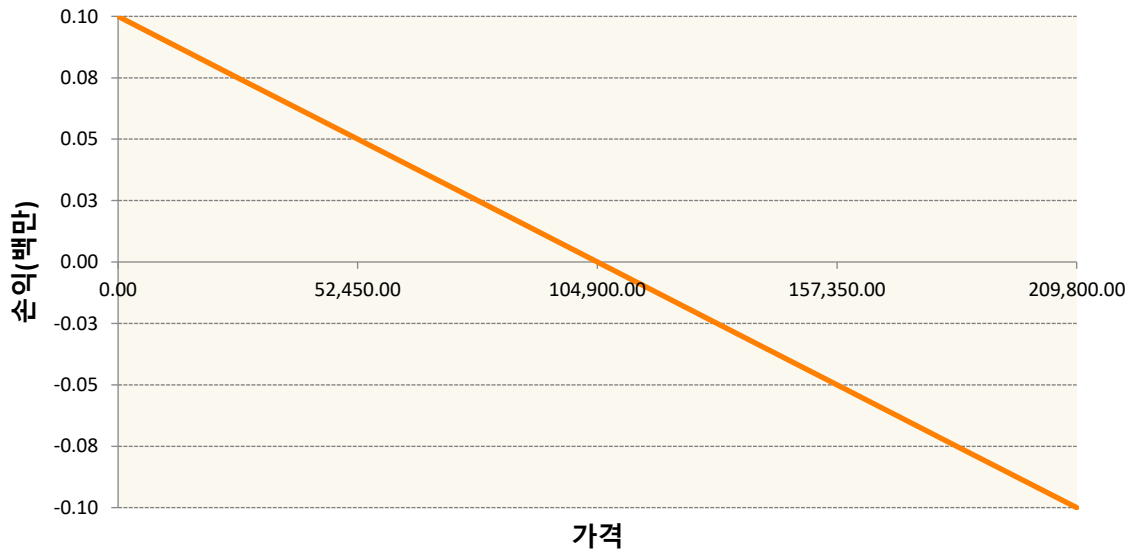
KR4149VB0009-2024-11 HD현대인프라코어개별선물



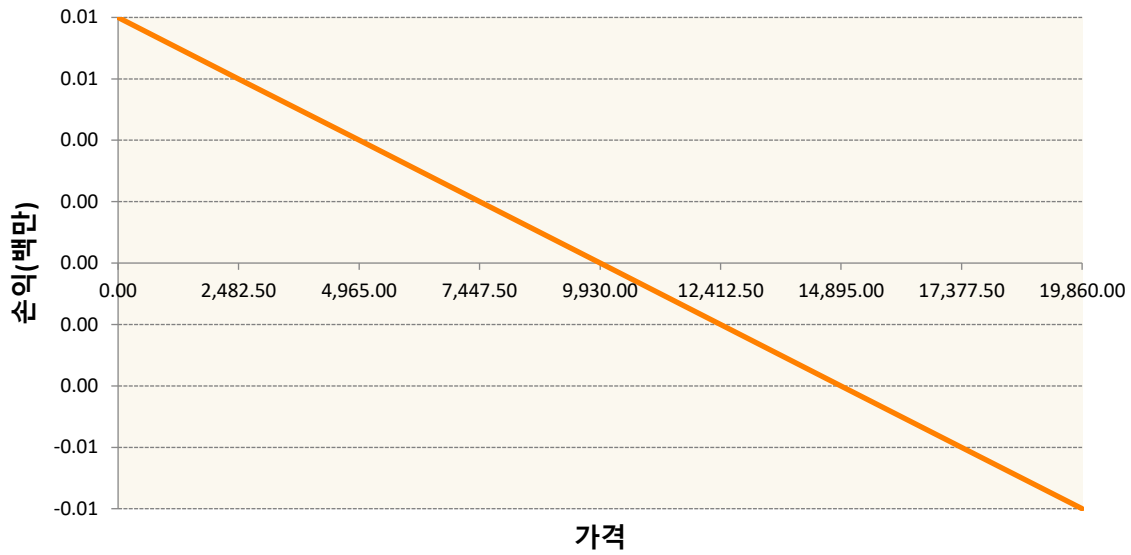
KR4151VB0004-2024-11 GS건설개별선물



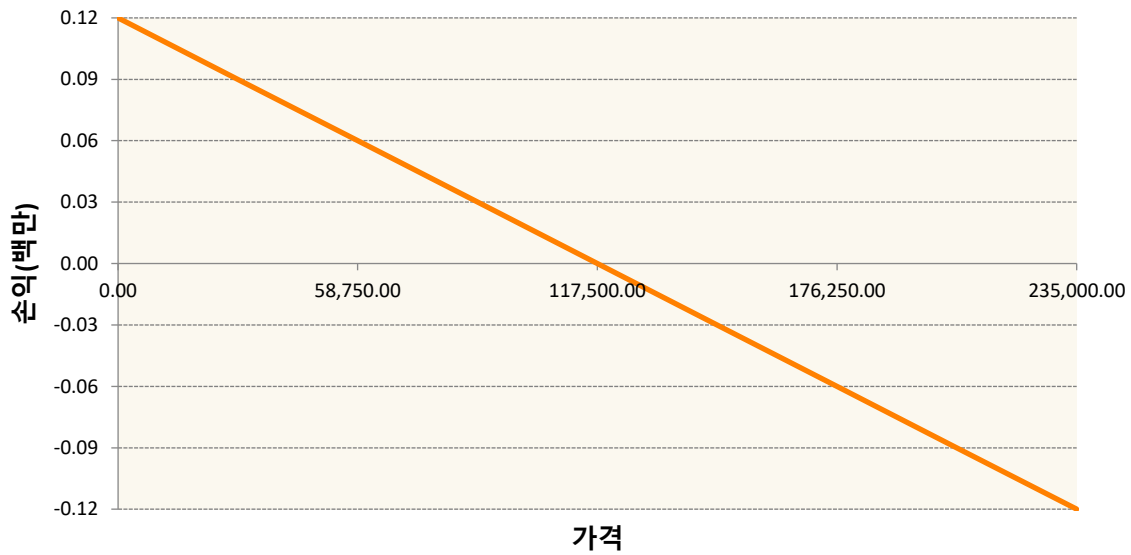
KR41BDVB0008-2024-11 삼성생명개별선물



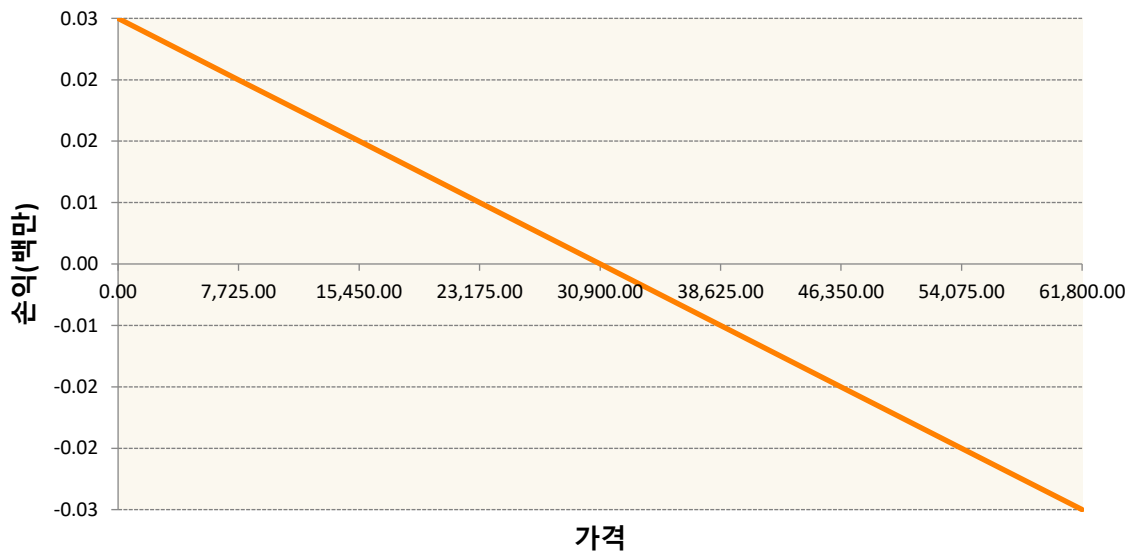
KR41BFVB0006-2024-11 삼성중공업개별선물



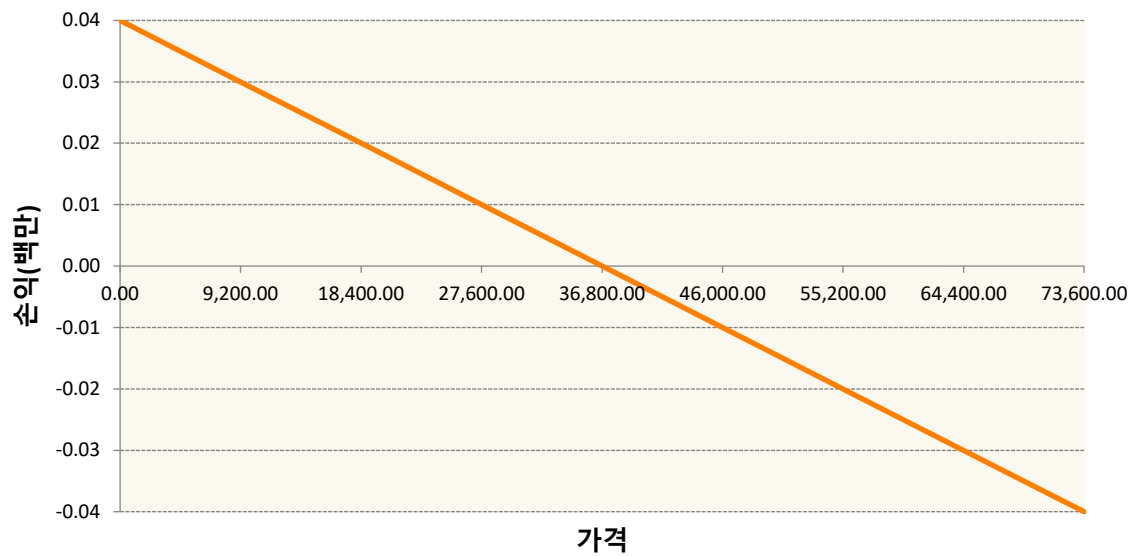
KR41CCVB0008-2024-11 현대글로벌비스개별선물



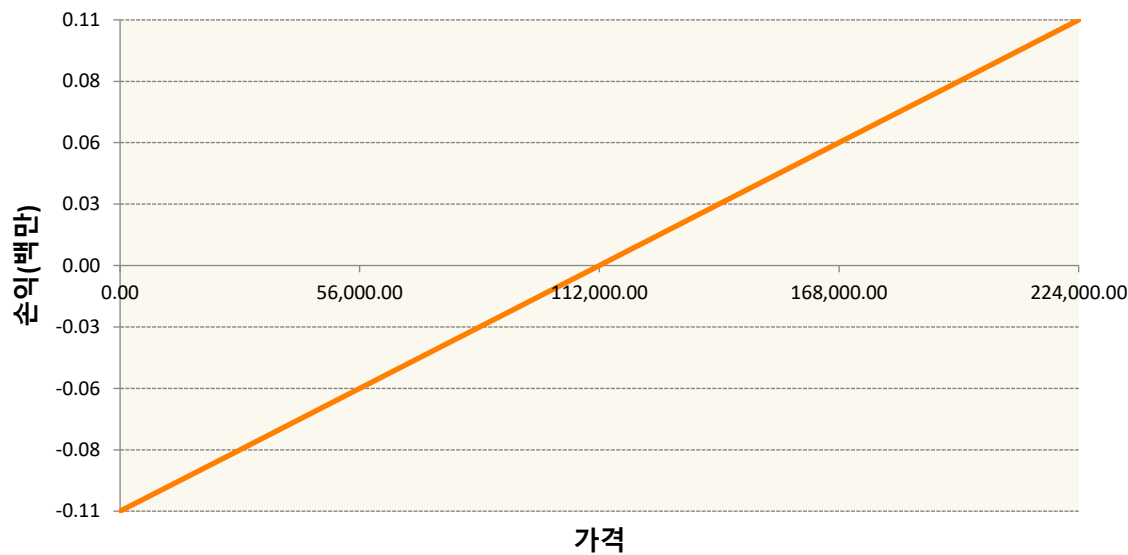
KR41CEVB0006-2024-11 현대해상개별선물



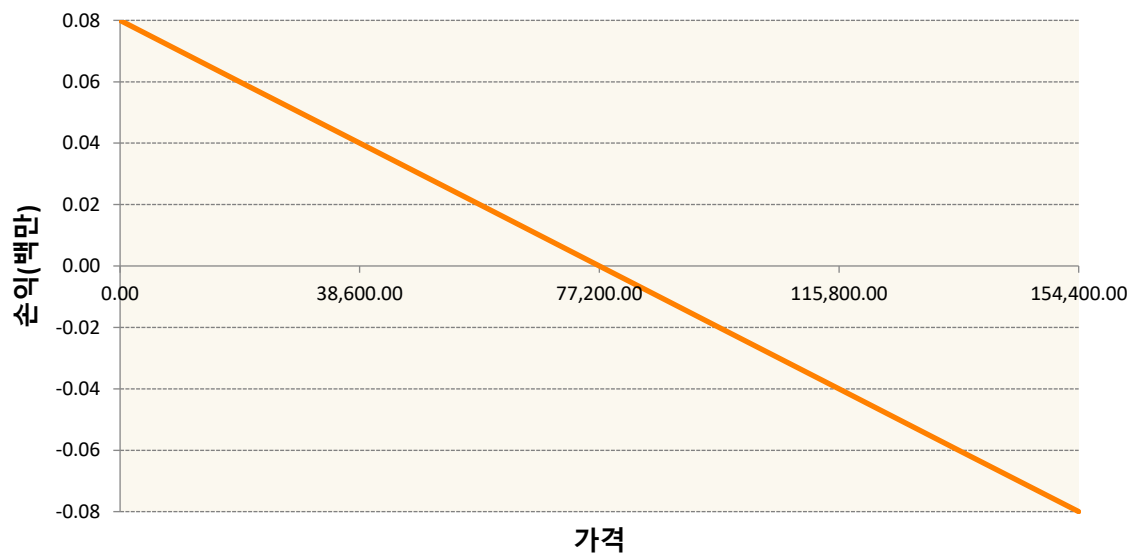
KR41CFVB0005-2024-11 카카오개별선물



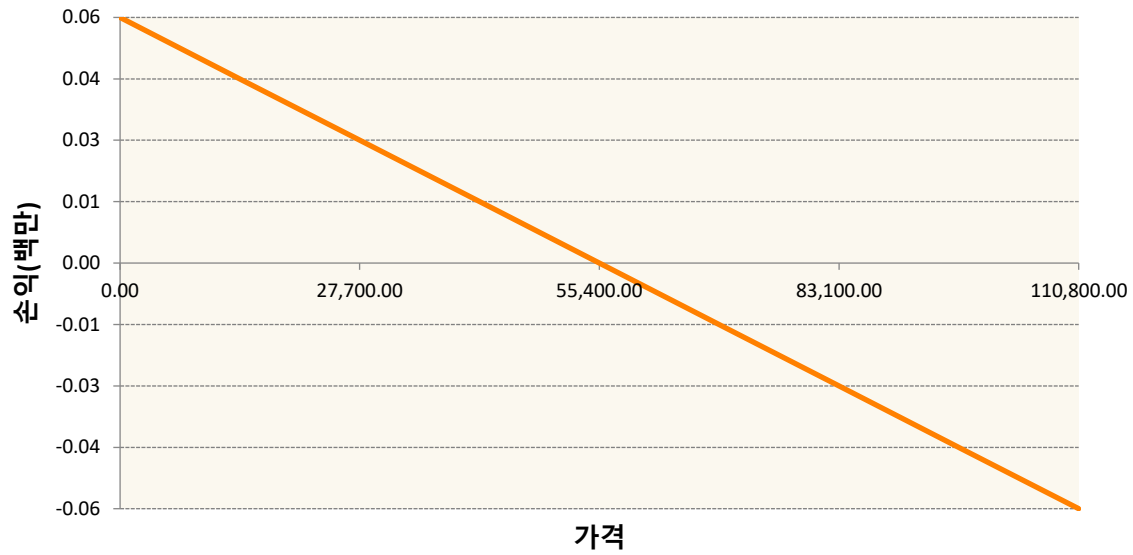
KR41D0VB0008-2024-11 DB손해보험개별선물



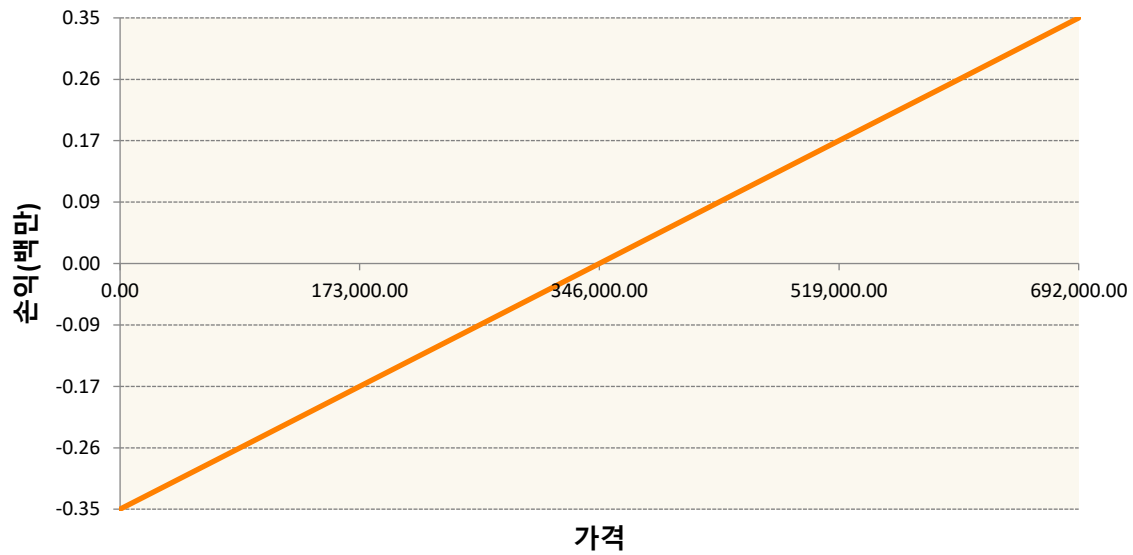
KR41E4VB0002-2024-11 에스엠개별선물



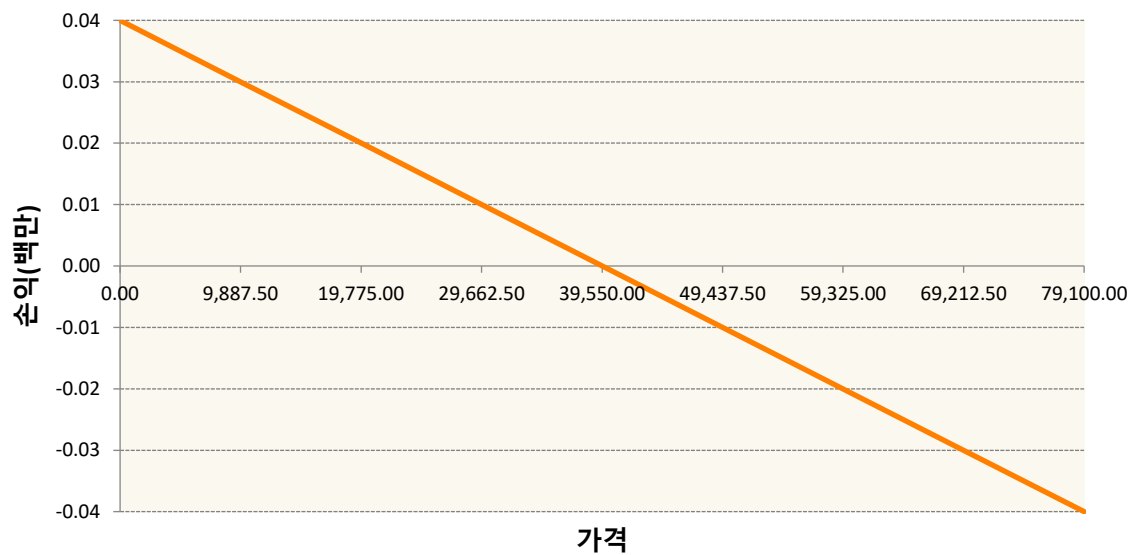
KR41EFVB0003-2024-11 JYP Ent.개별선물



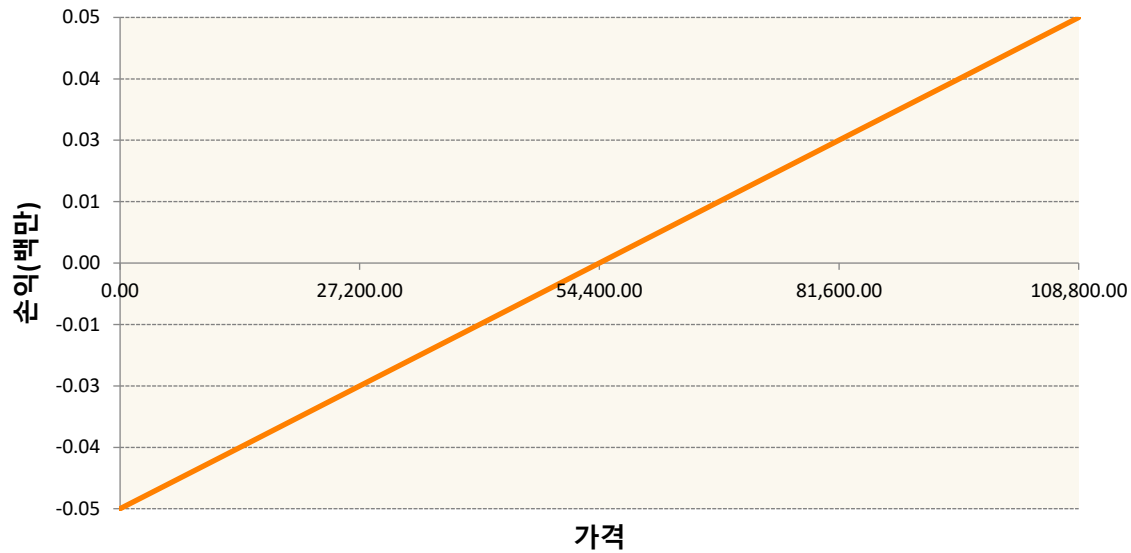
KR41F8VB0005-2024-11 크래프톤개별선물



KR41FLVB0004-2024-11 펠어비스개별선물



KR41G0VB0001-2024-11 씨에스윈드개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4106VC00 2024-12 코스닥150선물	2
KR4112VB00 2024-11 SK텔레콤개별선물	1
KR4114VB00 2024-11 KT개별선물	1
KR4122VC00 2024-12 삼성SDI개별선물	0.48
KR4136VB00 2024-11 KT&G개별선물	0.27
KR4149VB00 2024-11 HD현대인프라코어개별선물	1
KR4151VB00 2024-11 GS건설개별선물	1
KR41BDVB00 2024-11 삼성생명개별선물	0.42
KR41BFVB00 2024-11 삼성중공업개별선물	0.44
KR41CCVB00 2024-11 현대글로비스개별선물	0.28
KR41CEVB00 2024-11 현대해상개별선물	0.05
KR41CFVB00 2024-11 카카오개별선물	1
KR41D0VB00 2024-11 DB손해보험개별선물	1
KR41E4VB00 2024-11 에스엠개별선물	0.49
KR41EFVB00 2024-11 JYP Ent.개별선물	1
KR41F8VB00 2024-11 크래프톤개별선물	0.28
KR41FLVB00 2024-11 펄어비스개별선물	0.28
KR41G0VB00 2024-11 씨에스윈드개별선물	0.3

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

(단위:백만원)

22

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

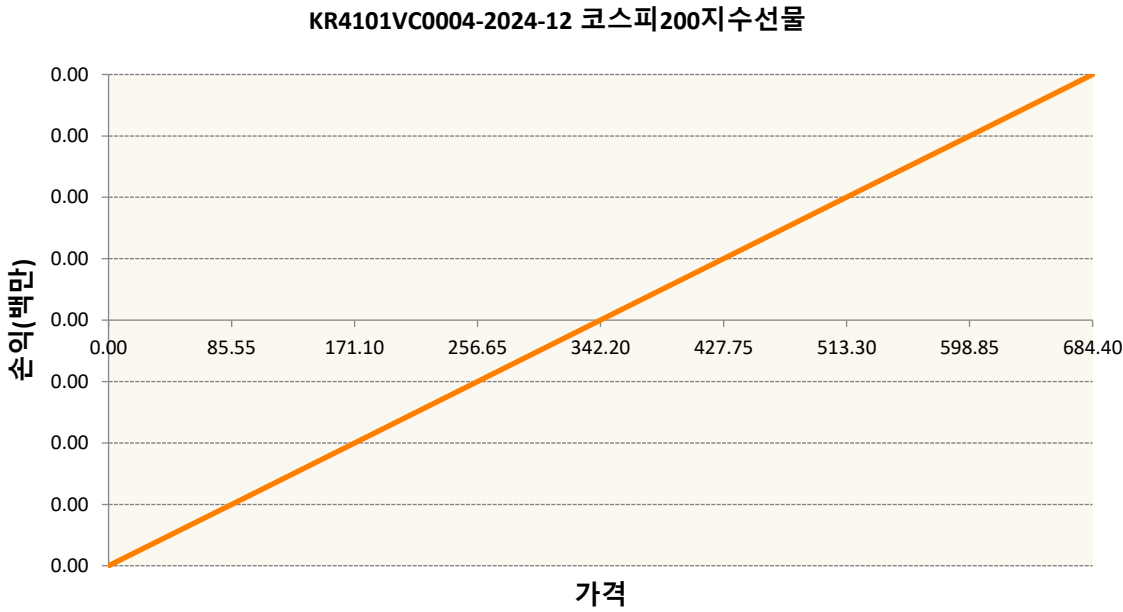
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	9,411	0	9,411	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				749
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-749	-749	-749	-749	-749	-749	-749
-5.33%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
-2.67%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	250	250	250	250	250	250	250
5.33%	500	500	500	500	500	500	500
8.00%	749	749	749	749	749	749	749

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

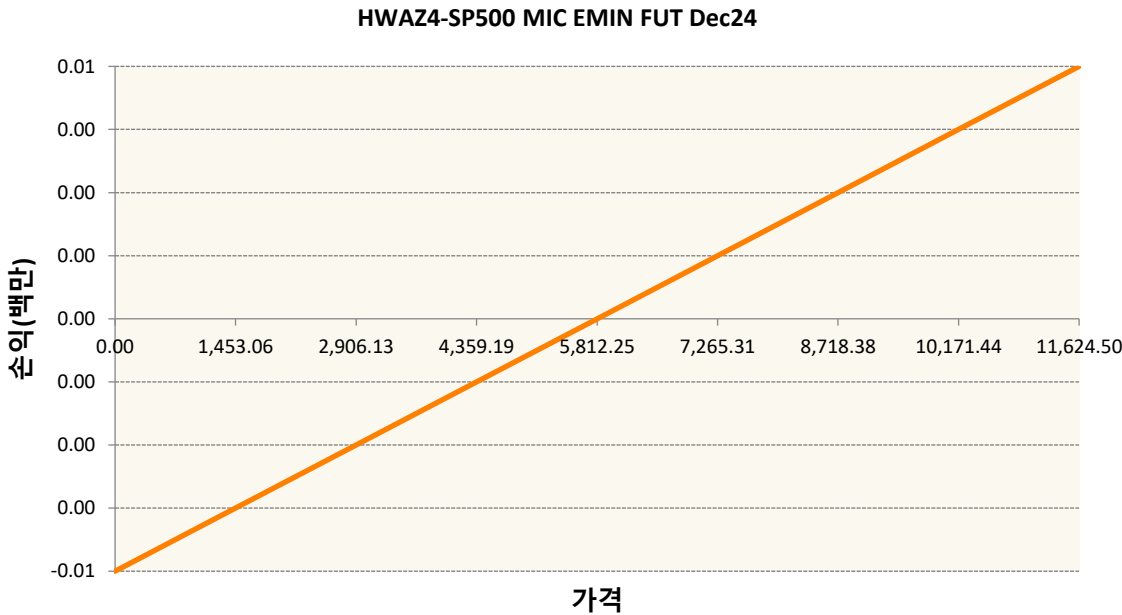
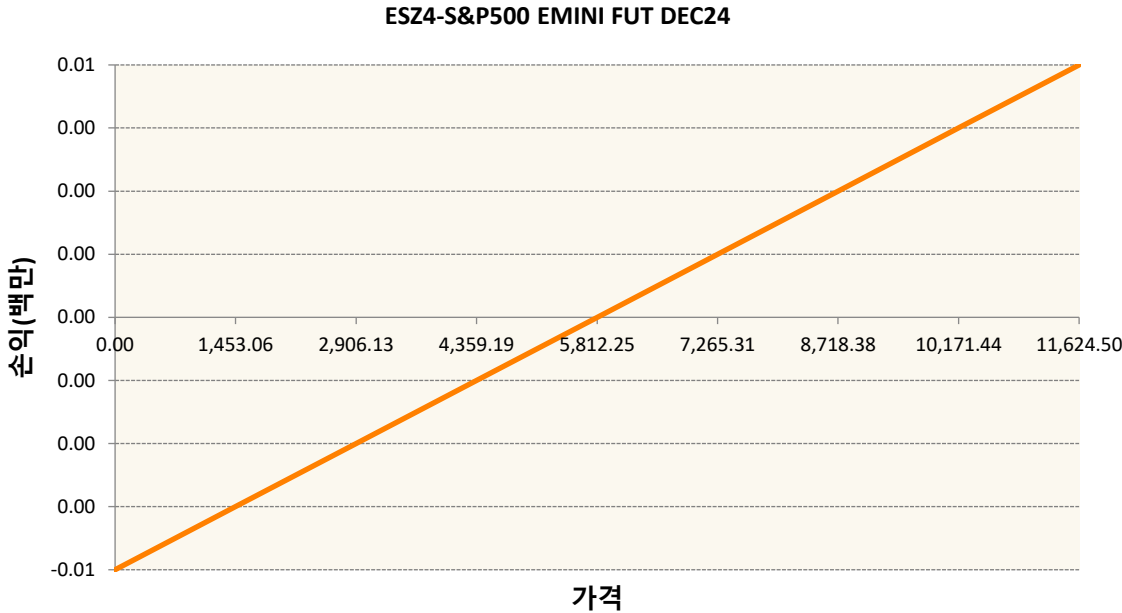
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	13,623	0	13,623	
누계	유가증권	선물	1,585	0	1,585	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,090
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	127

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	736

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

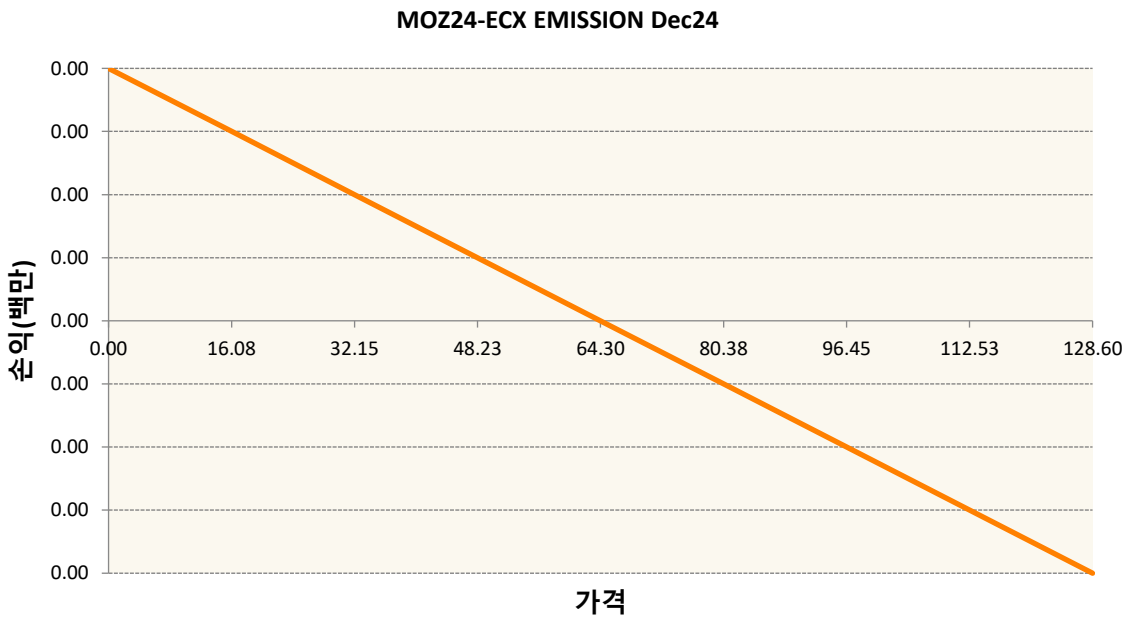
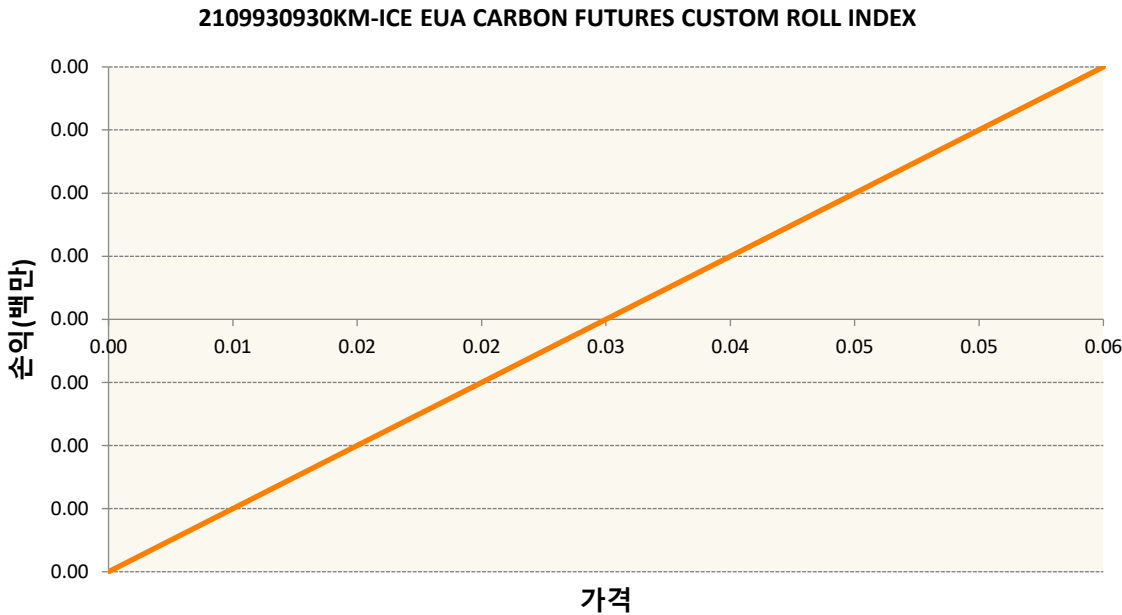
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	11	6,290	-6,280	
누계	통화	선도	0	1,428	-1,428	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	503

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

902

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

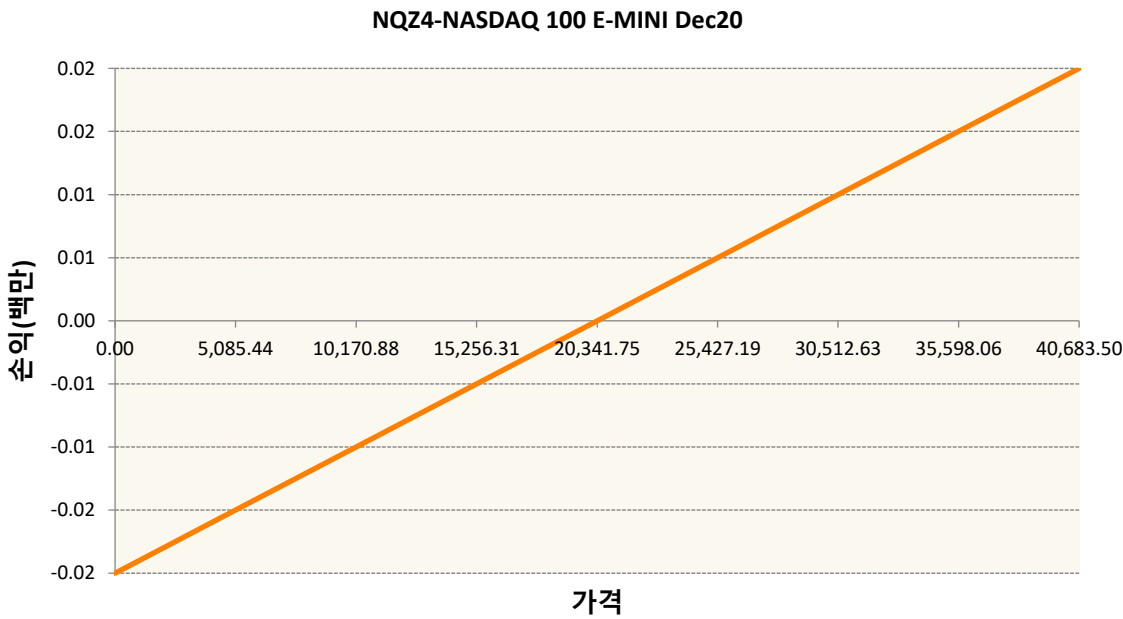
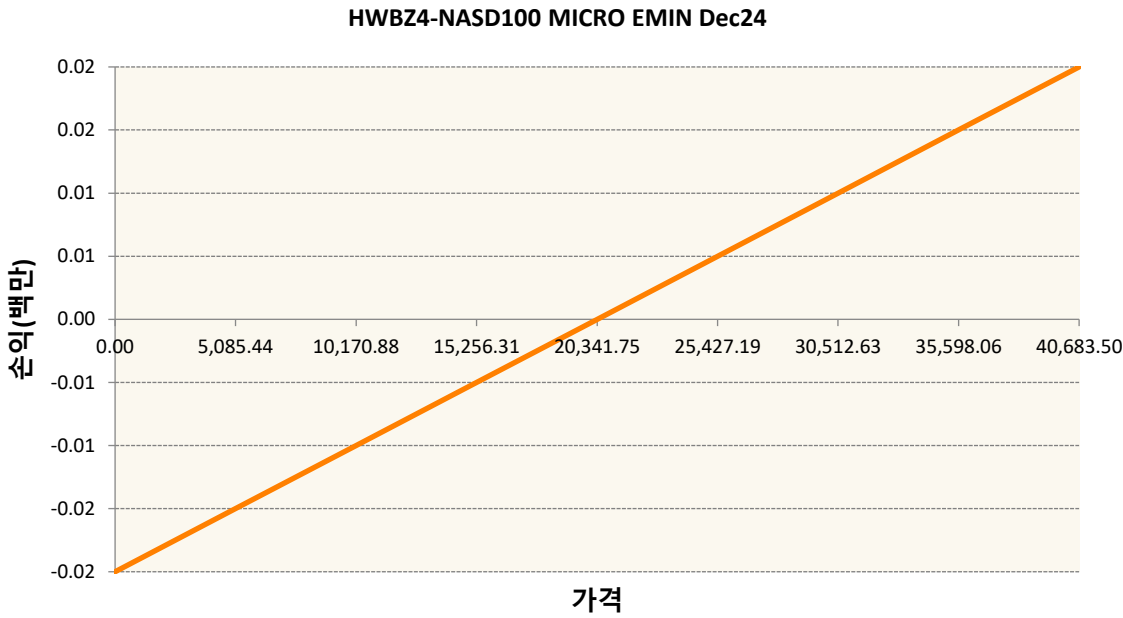
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	7,058	0	7,058	
누계	유가증권	선물	988	0	988	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		79
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		565

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			531

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

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	709
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,395
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,708
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,299

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

(단위:백만원)

9,444

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

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	11
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11

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

(단위:백만원)

47

공시일	2024-11-07
기준일	2024-11-06

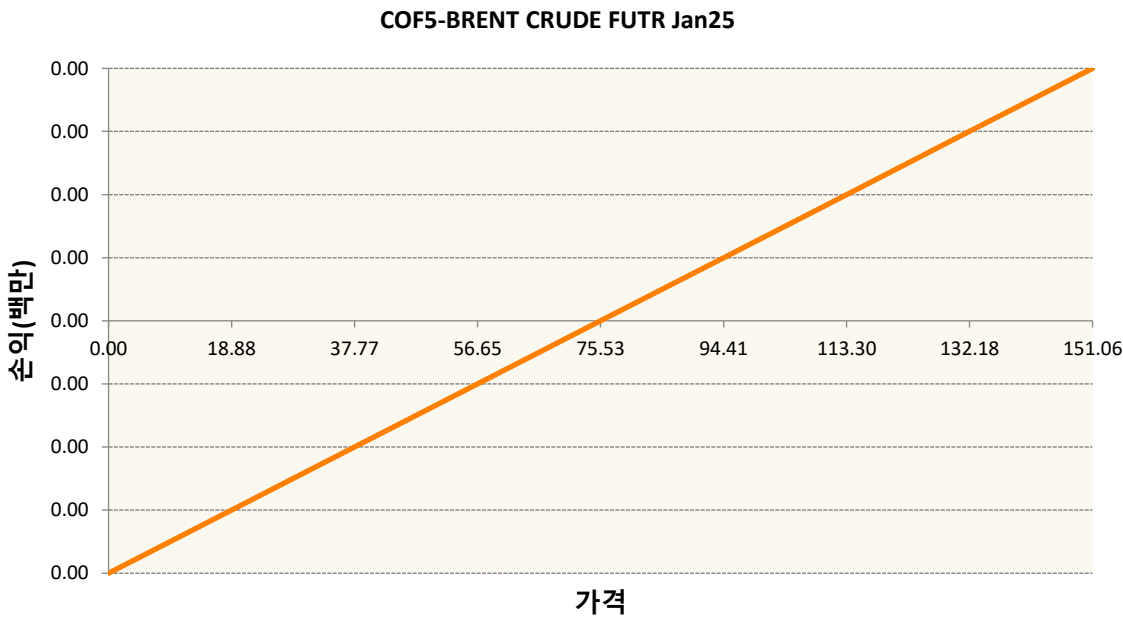
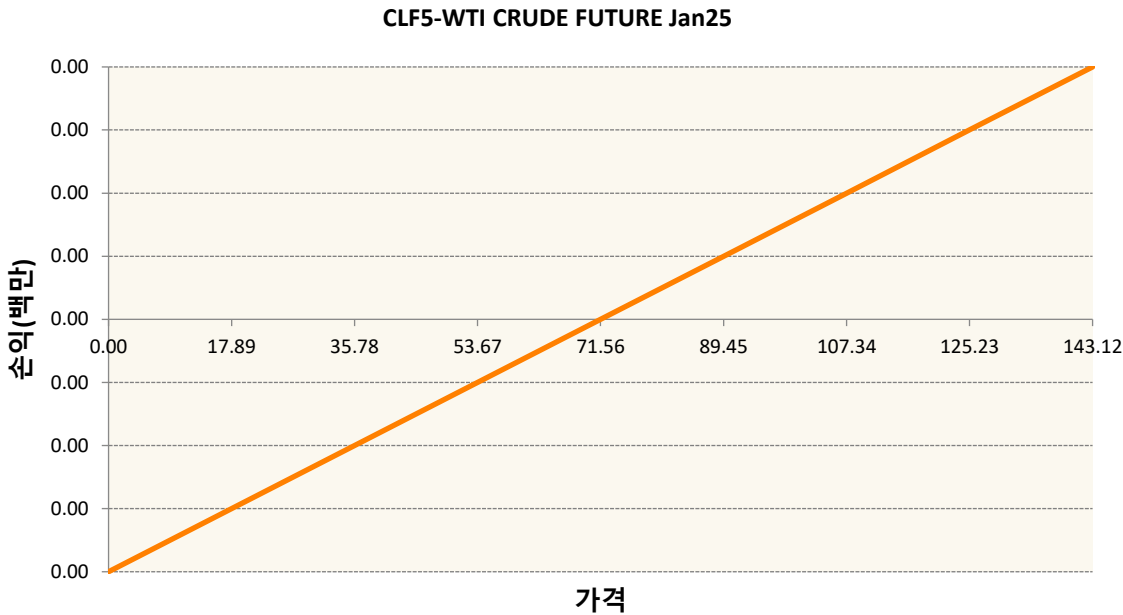
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

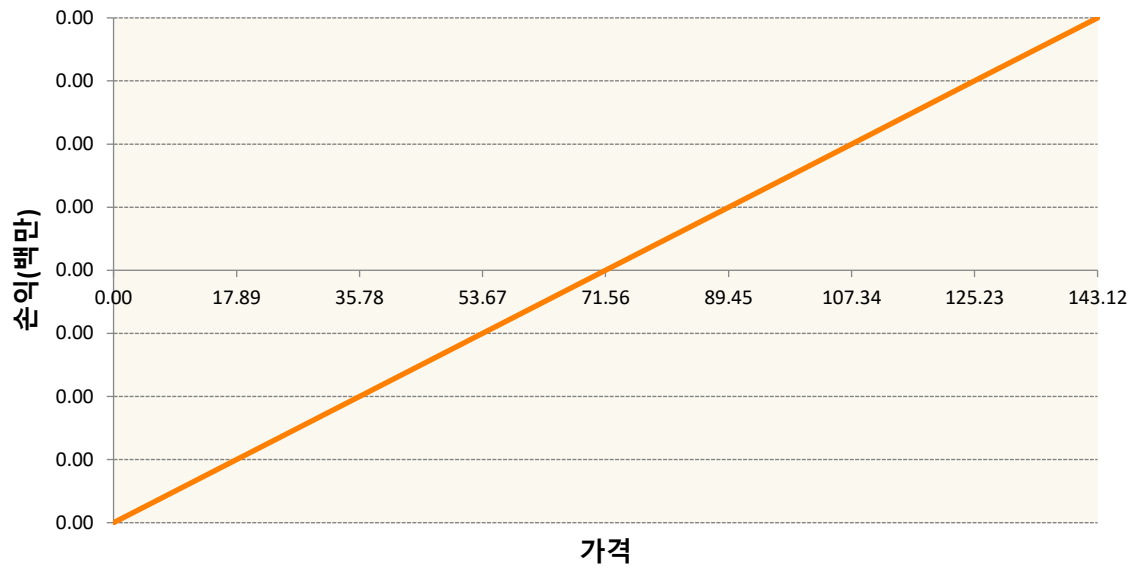
(단위:백만원)

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	126	-126	장내

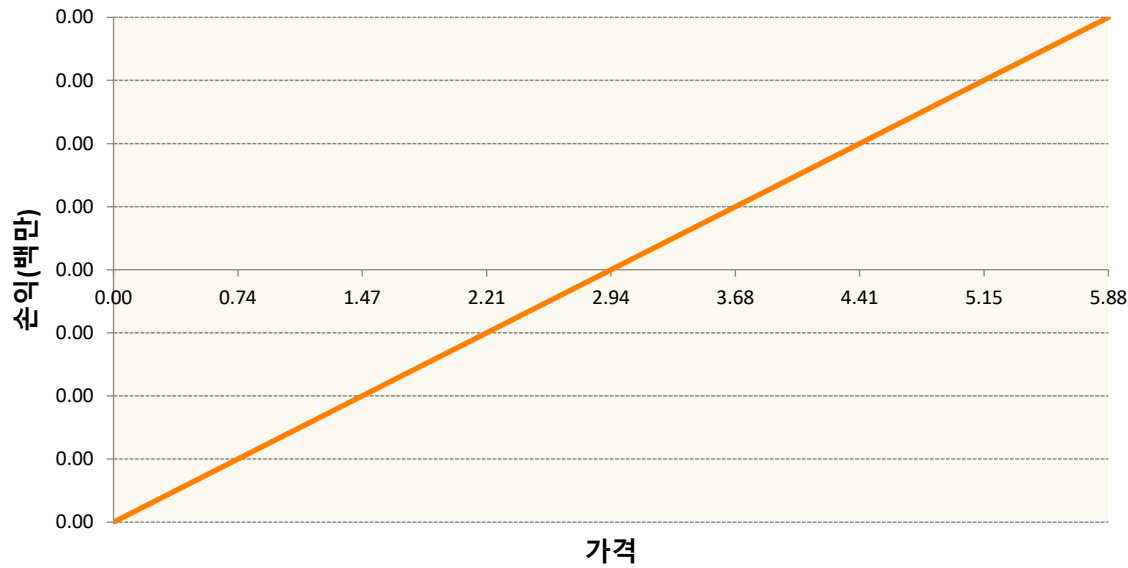
2. 만기시점의 손익구조



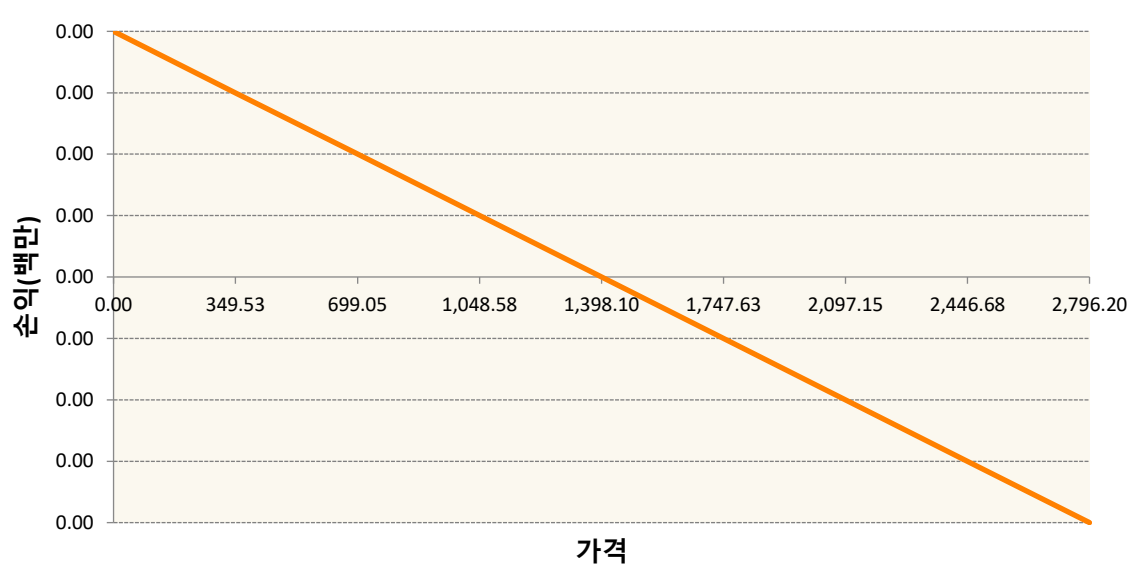
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



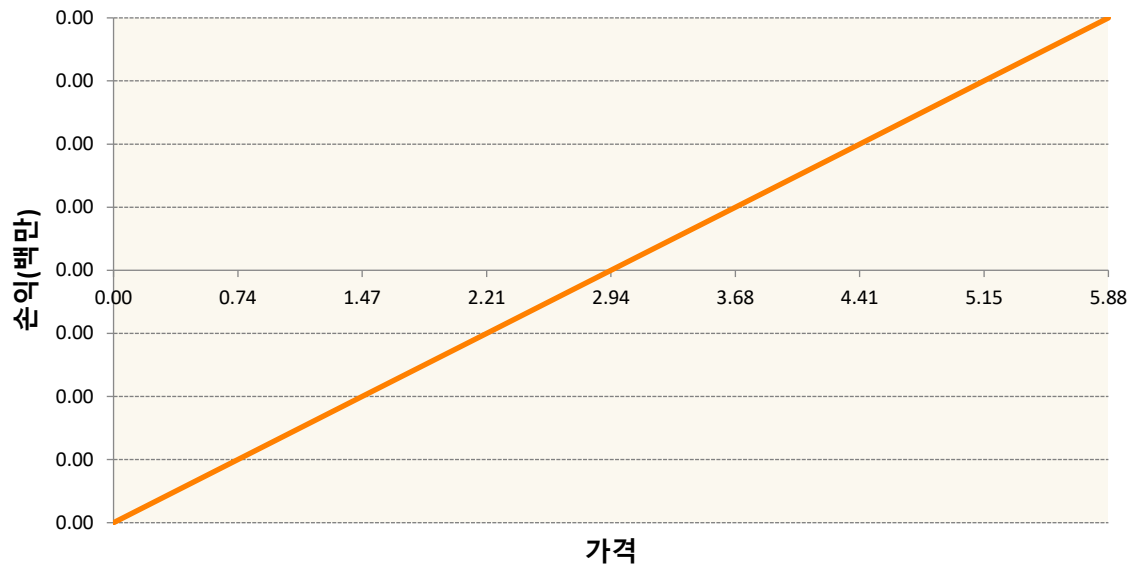
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



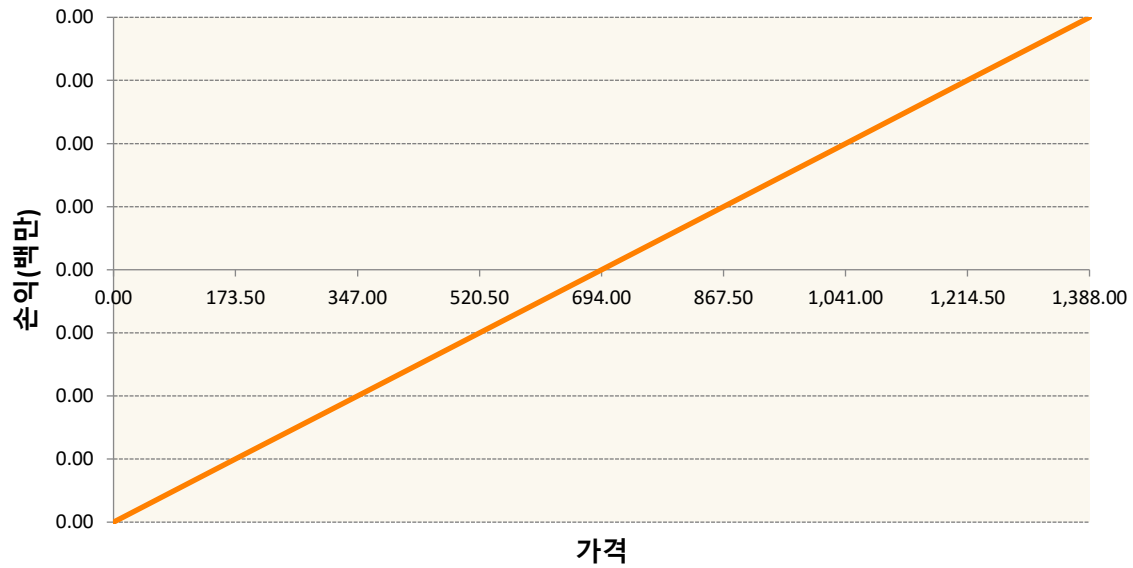
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



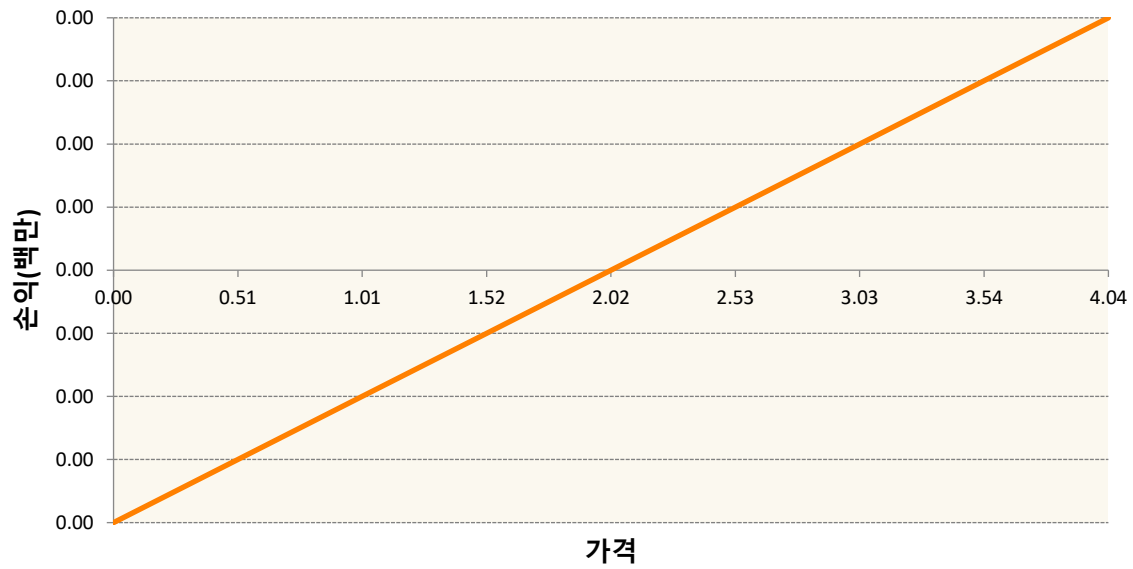
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



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	4
EOF5	E-MINI NATURAL GAS Jan25	2
KR4175VB00 2024-11 달러선물		10
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)

137