

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

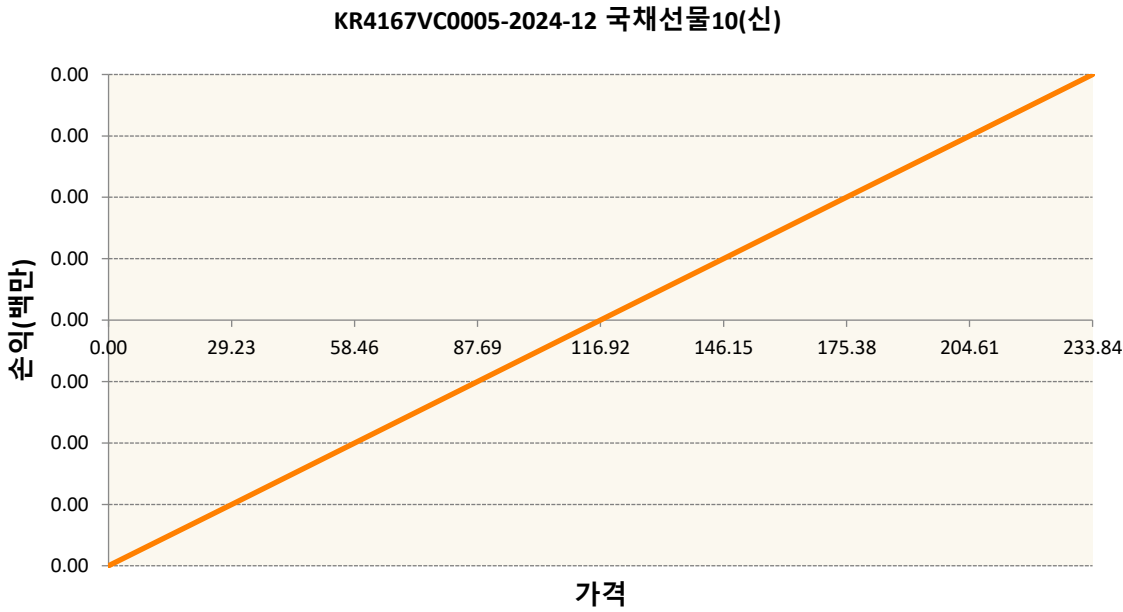
베스트장기채(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	금리	선물	0	0	0	장내
누계	금리	선물	70,152	0	70,152	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4167VC00 2024-12 국채선물10(신)	5,612
------------------------------	-------

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

(단위:백만원)

1,869

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

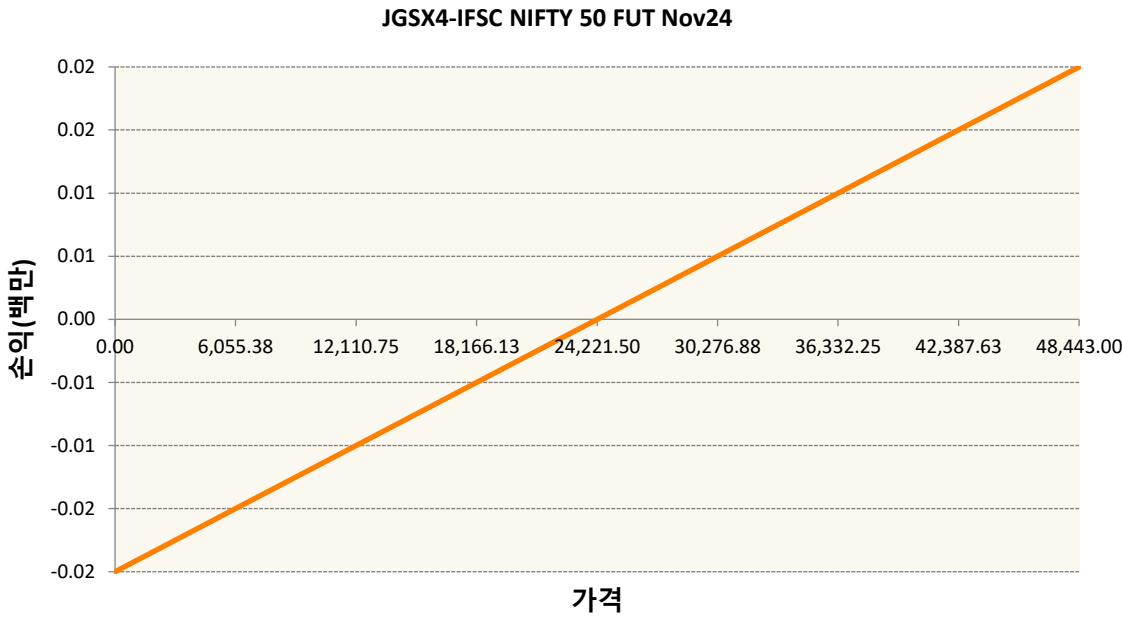
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,282	0	3,282	

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	2024-11-13
기준일	2024-11-12

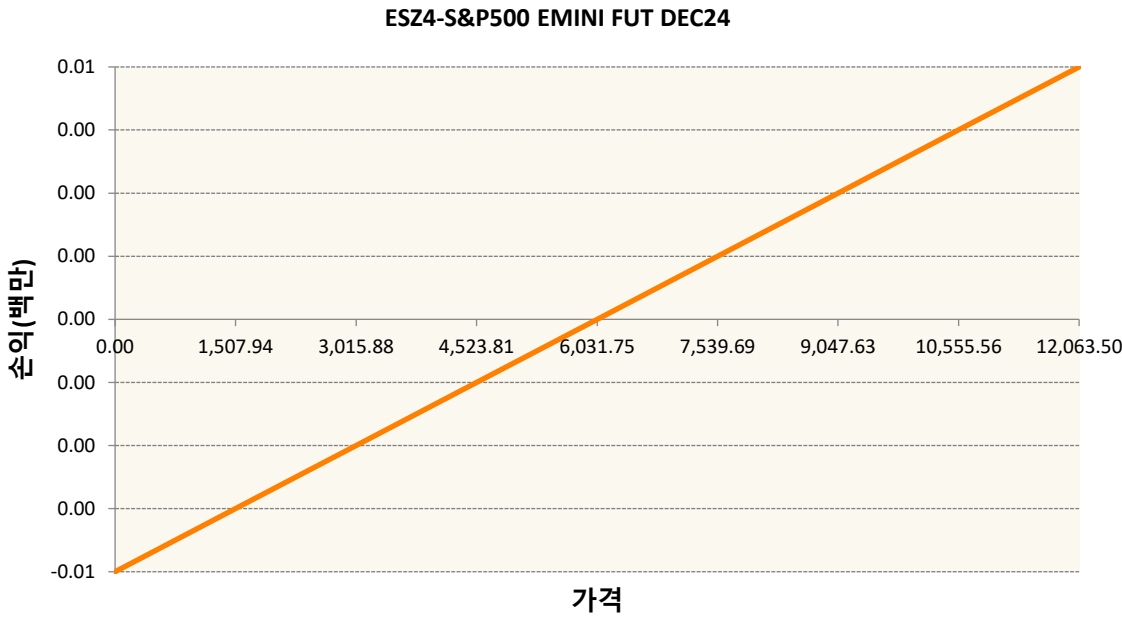
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	827	0	827	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOSPXWUS€SPXW US 11/12/24 C6000 Index	0.11
ESZ4 S&P500 EMINI FUT DEC24	66

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

(단위:백만원)

41

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

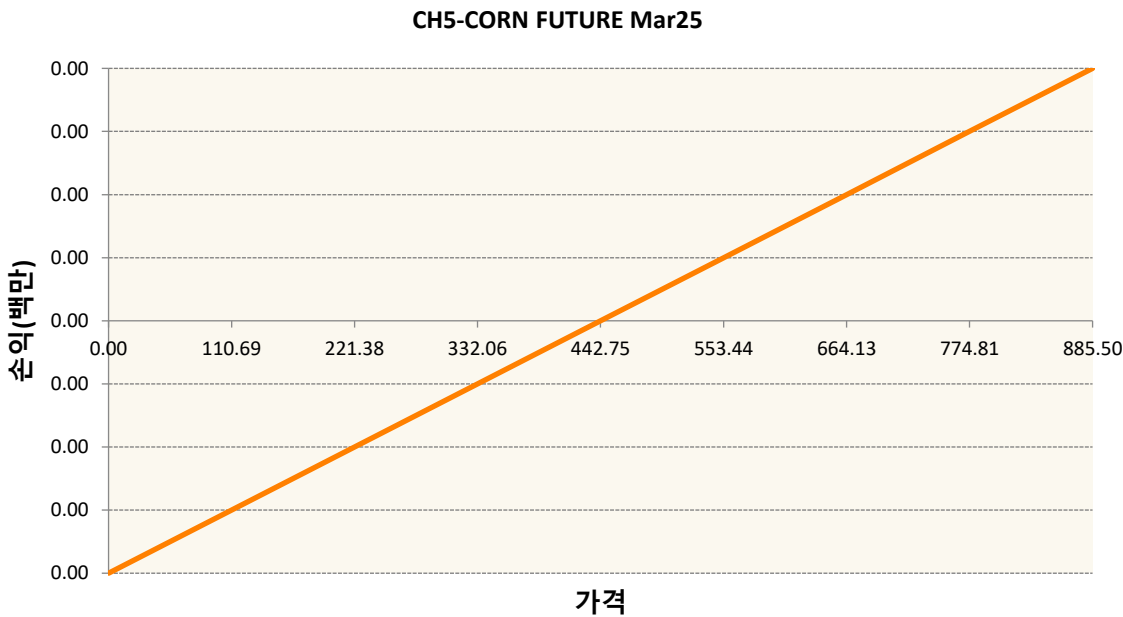
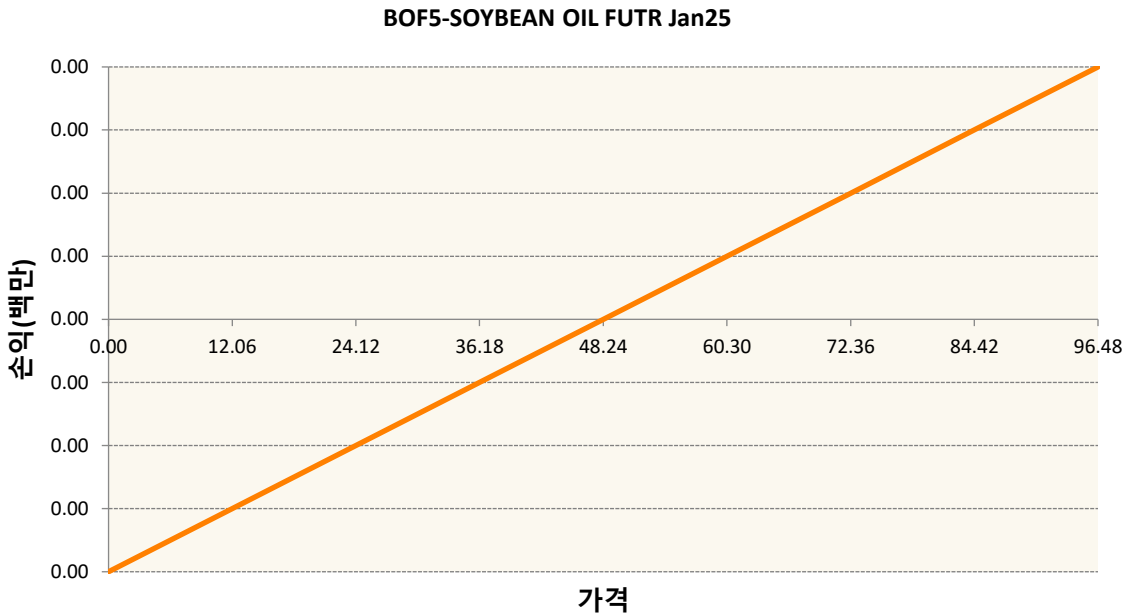
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

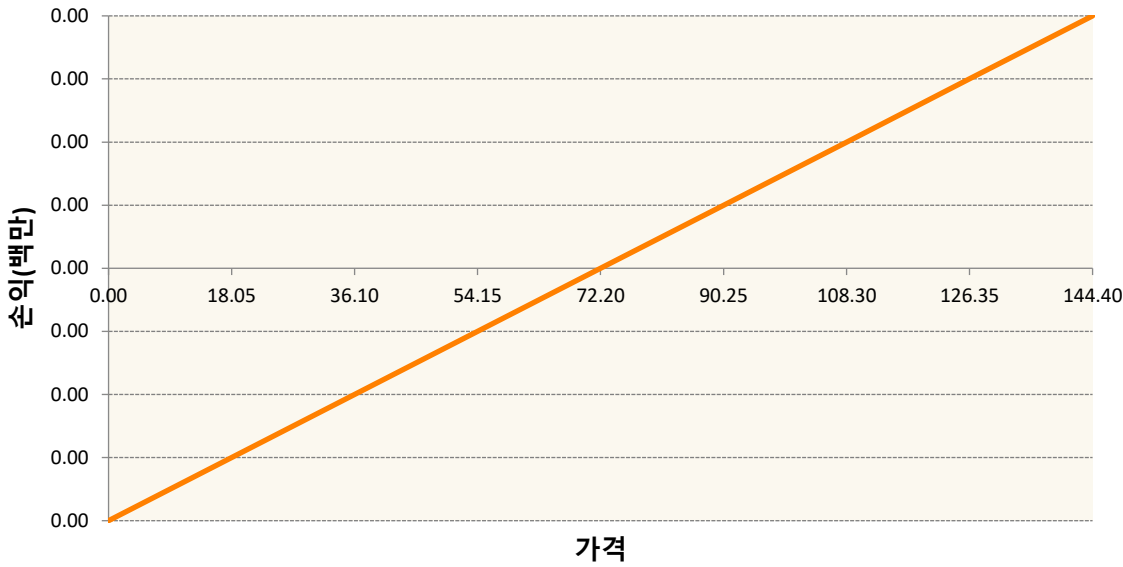
(단위:USD 백만)

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	3,818	0	3,818	
누계	통화	선물	0	548	-548	장내

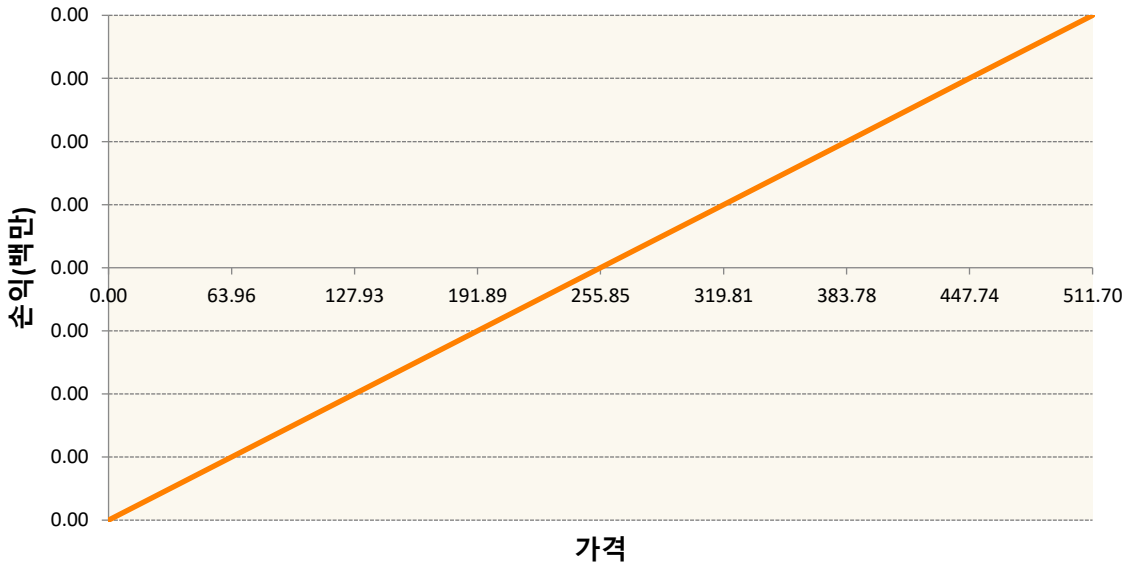
2. 만기시점의 손익구조



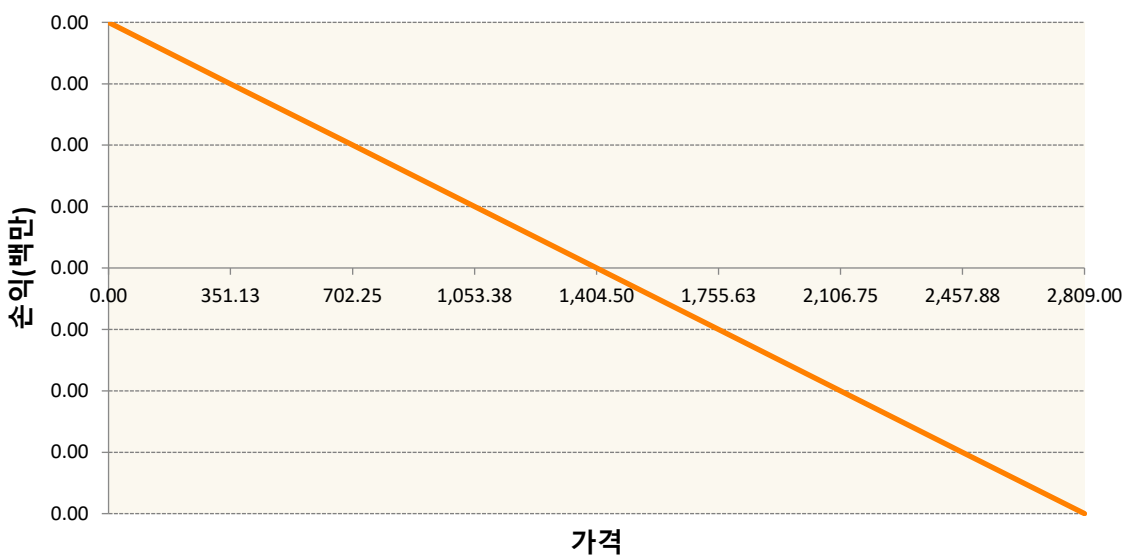
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



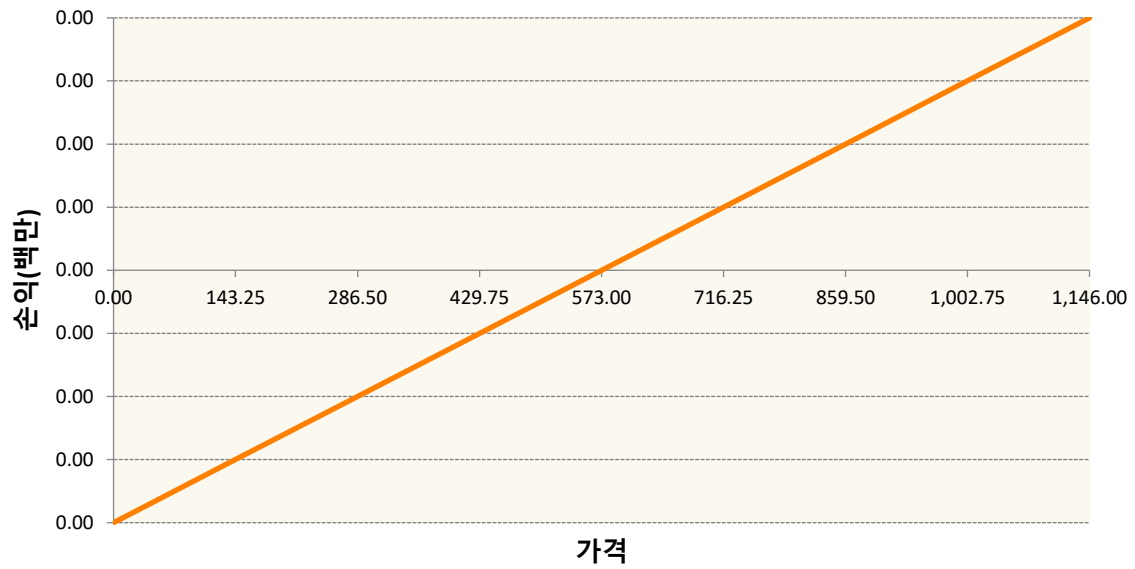
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



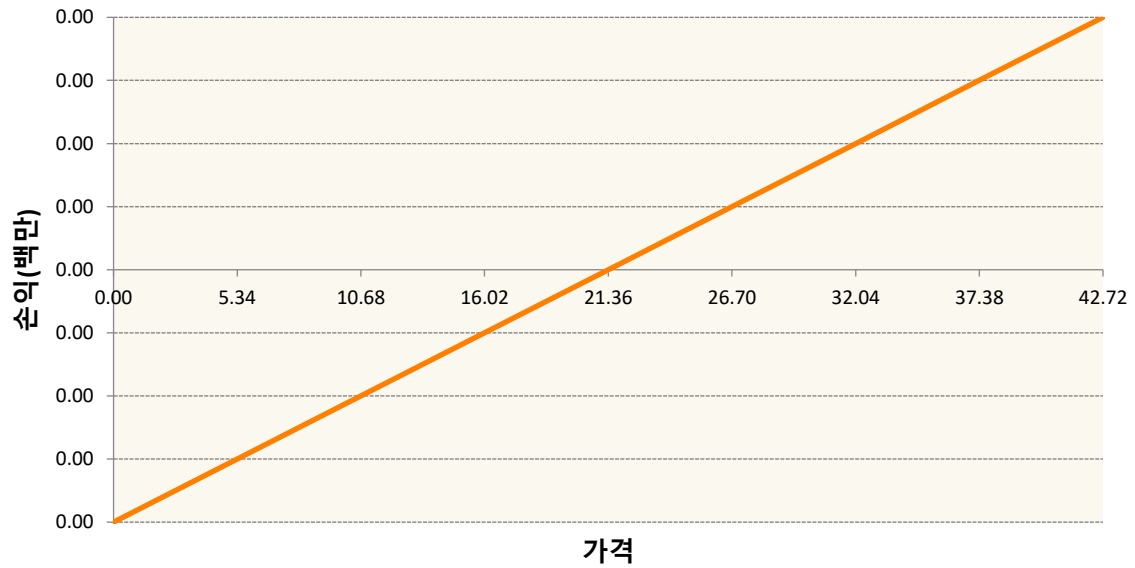
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



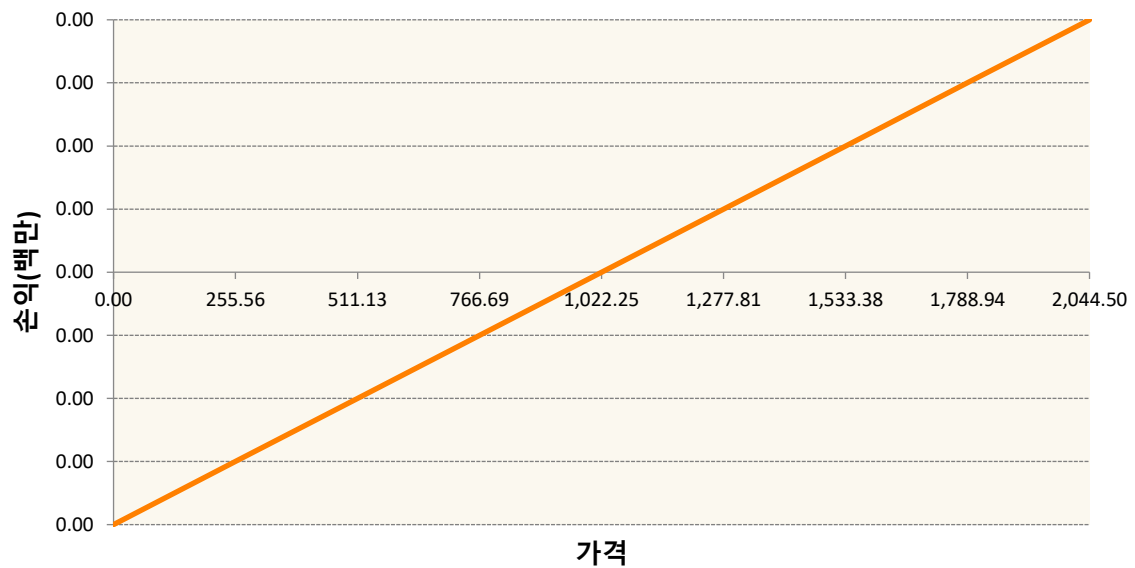
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



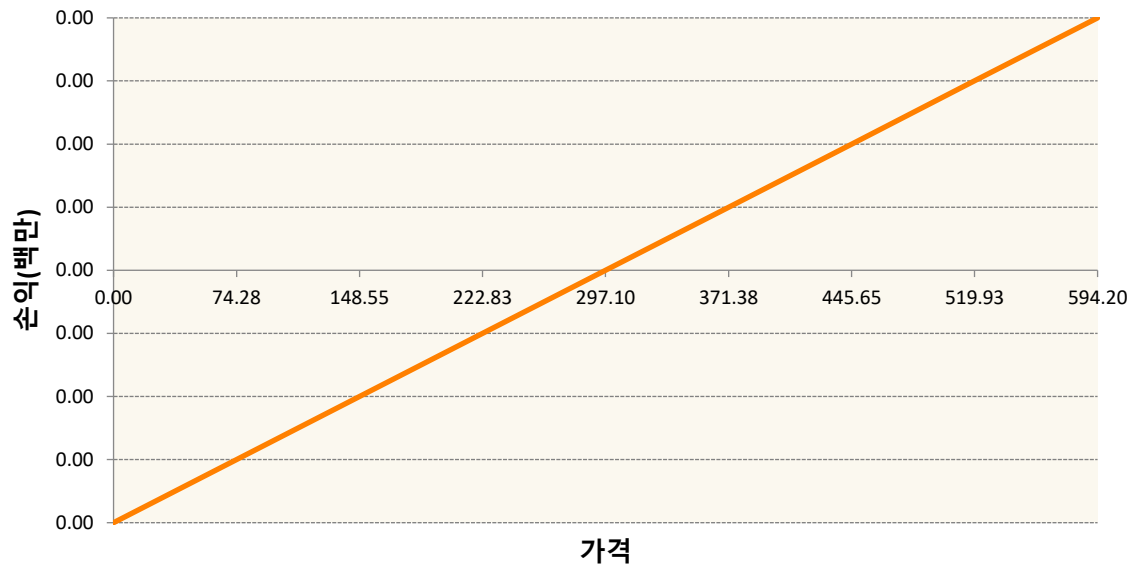
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



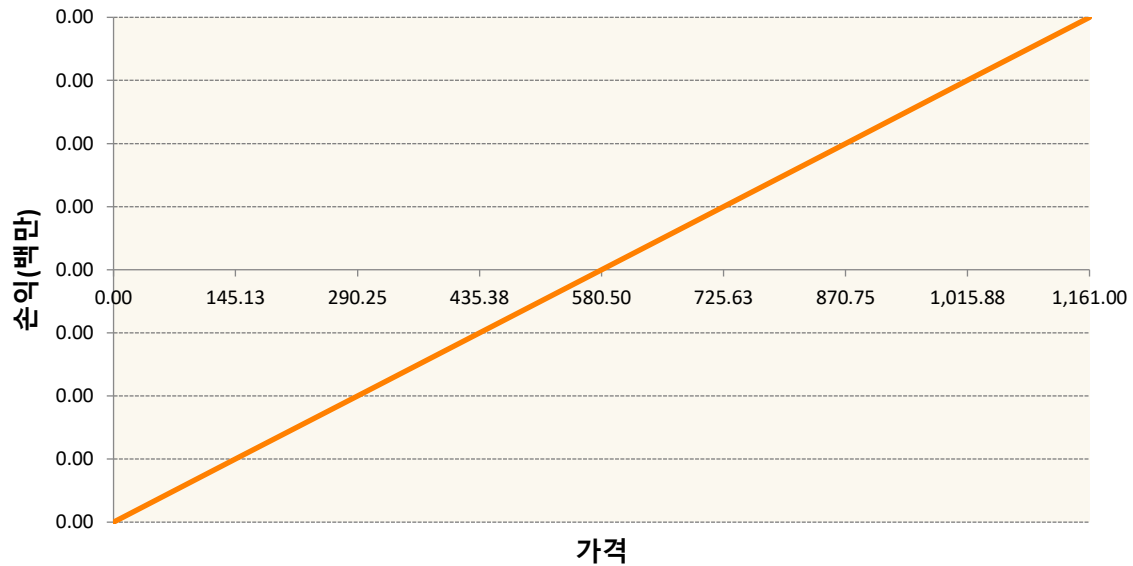
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



SMF5-SOYBEAN MEAL FUTR Jan25



WH5-WHEAT FUTURE(CBT) Mar25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

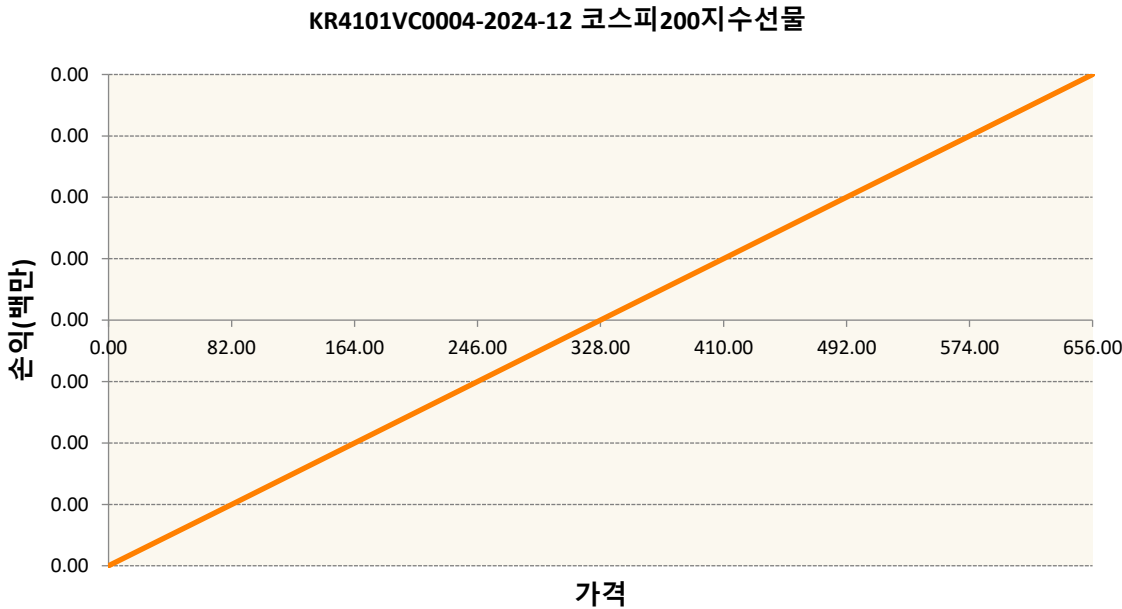
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,313	3,293	20	장내
누계	유가증권	선물	1,722	0	1,722	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					137
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	92	92	92	92	92	92	92
8.00%	137	137	137	137	137	137	137

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

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	328
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

532

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

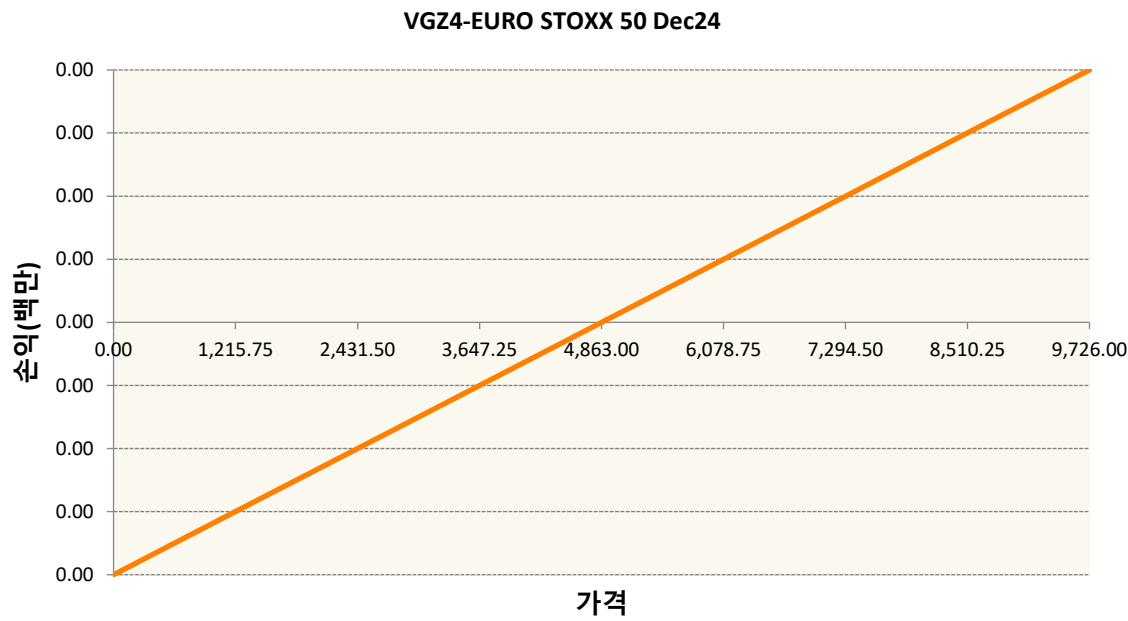
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	939	0	939	

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	2024-11-13
기준일	2024-11-12

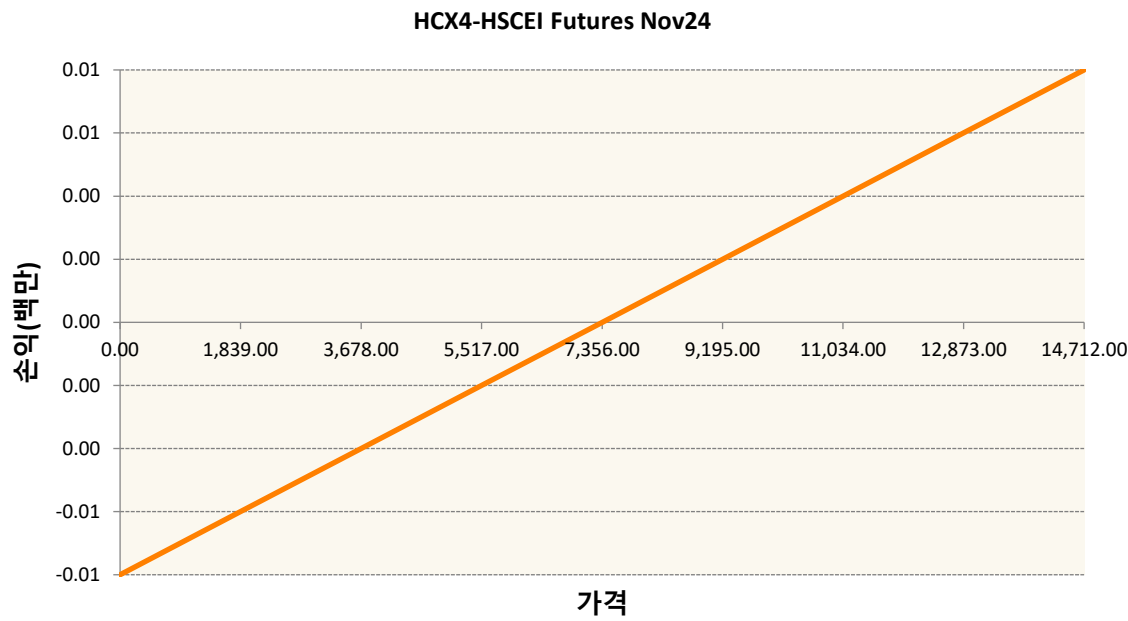
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,572	0	1,572	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX4	HSCEI Futures Nov24	126
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

173

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

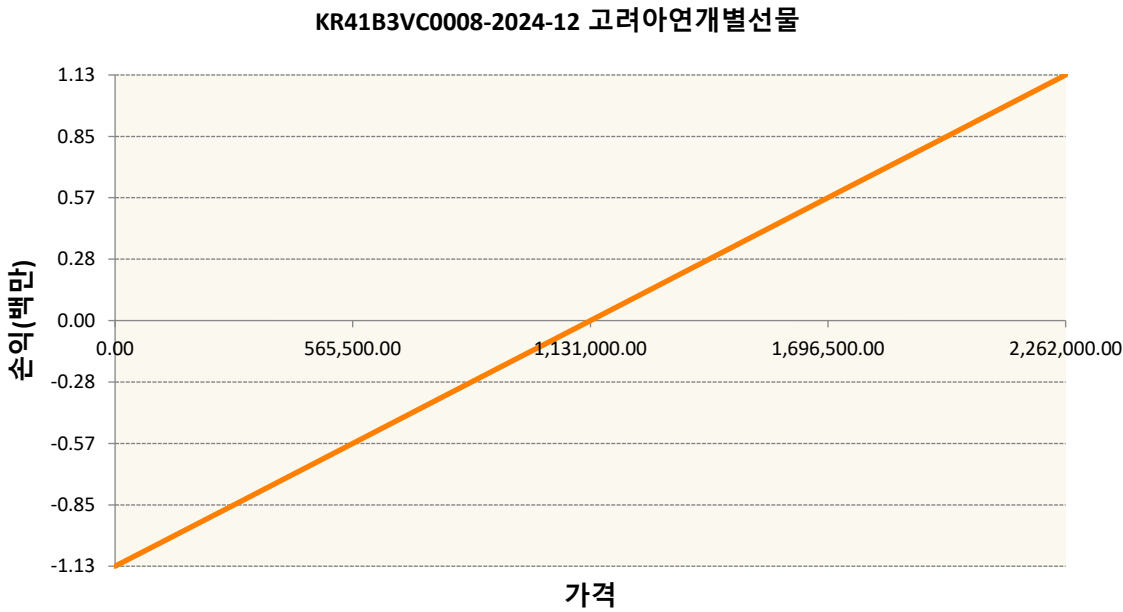
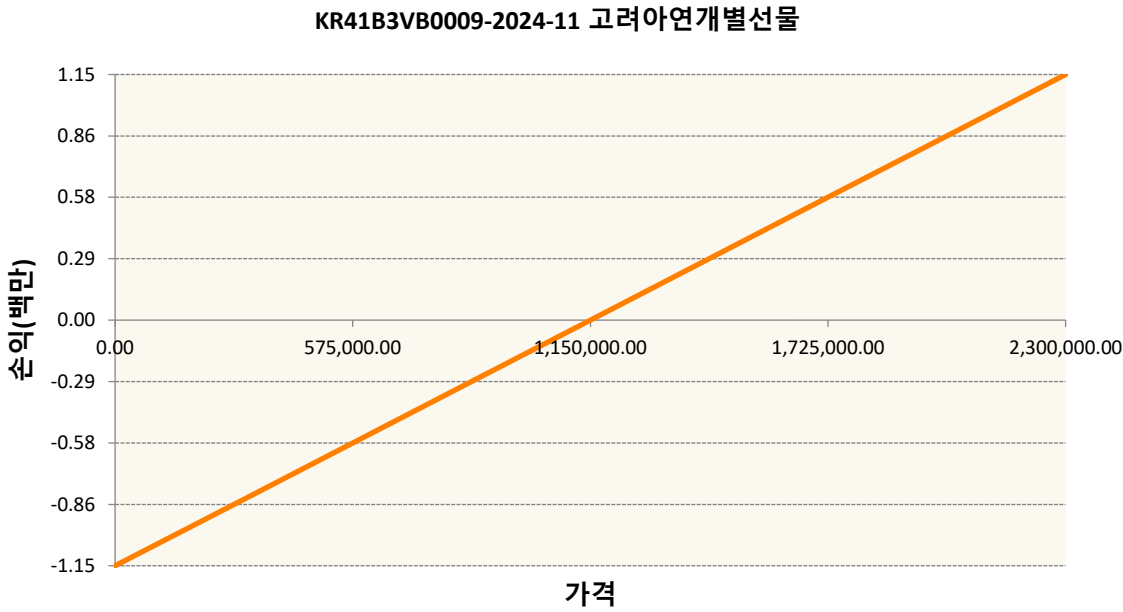
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

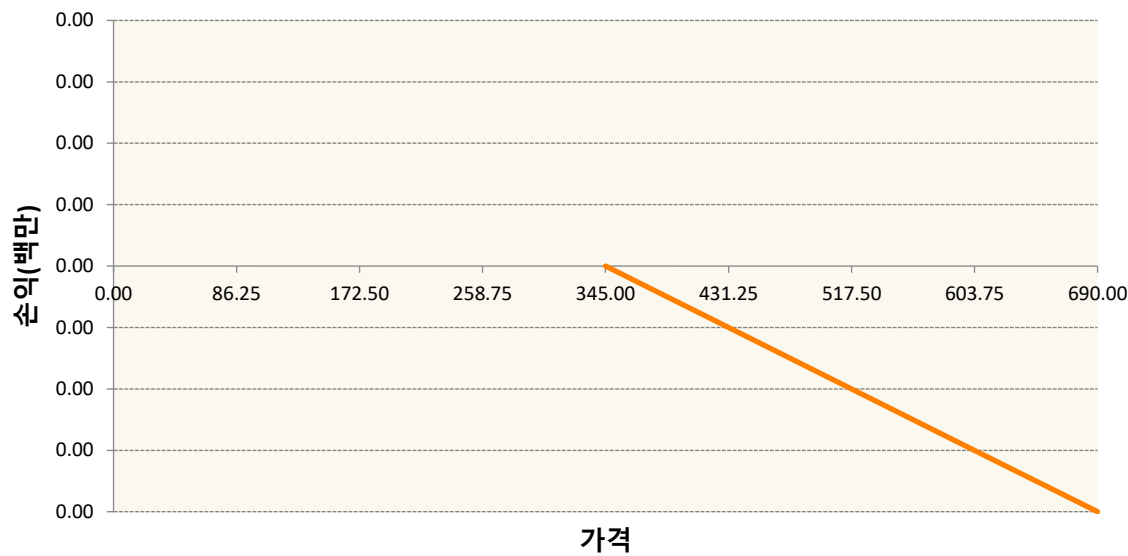
(단위:백만원)

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	299	0	299	장내
누계	유가증권	옵션	0	40,131	-40,131	장내

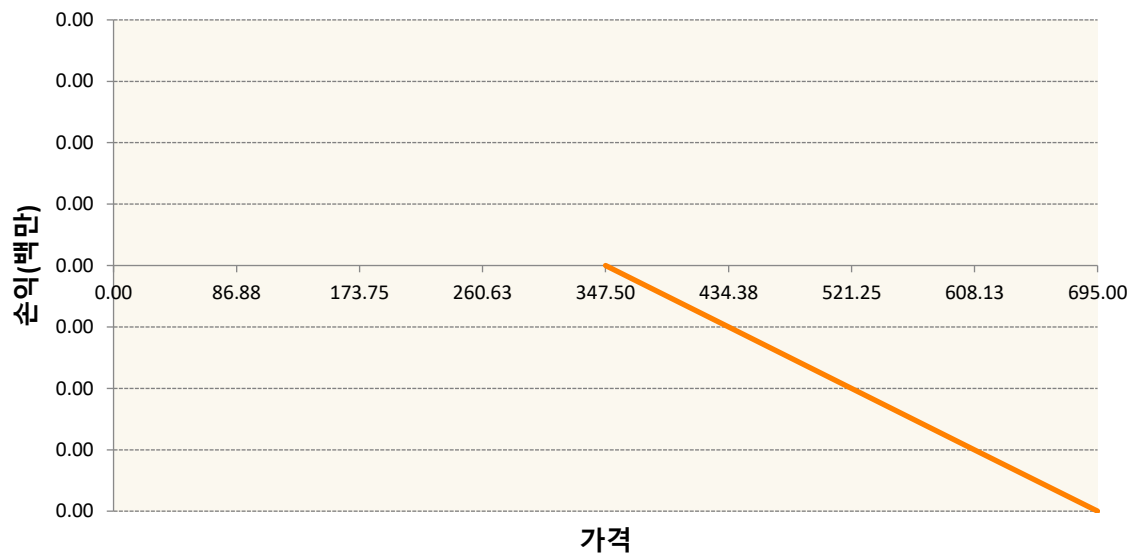
2. 만기시점의 손익구조



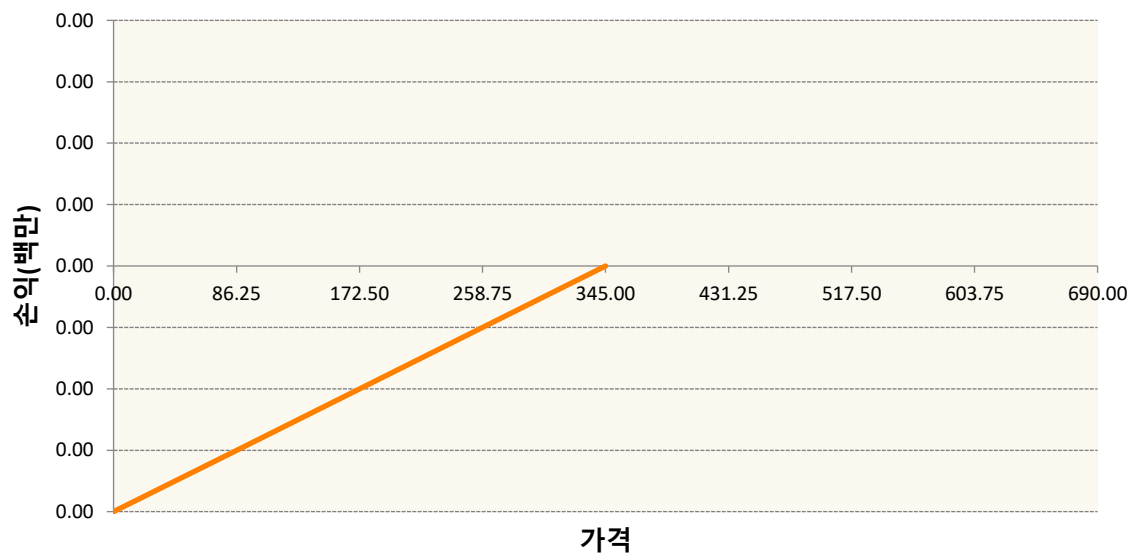
KR4201VB3453-2024-11 콜345



KR4201VB3479-2024-11 콜347.5



KR4301VB3452-2024-11 풋345



(단위:백만원)

KR41B3VB0009							2024-11 고려아연개별선물		23	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23			
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15			
-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%	15	15	15	15	15	15	15			
8.00%	23	23	23	23	23	23	23			
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		767	
	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	-1	-2			
2.67%	-4	-7	-12	-17	-24	-31	-40			
5.33%	-149	-167	-184	-202	-220	-237	-255			
8.00%	-724	-728	-734	-741	-749	-757	-767			
KR4201VB3479							2024-11 콜347.5		69	
	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	-1	-1	-2	-2			
5.33%	-8	-10	-12	-13	-15	-17	-19			
8.00%	-61	-62	-63	-64	-66	-67	-69			
KR4301VB3452							2024-11 풋345		576	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-576	-576	-576	-576	-576	-576	-576
-5.33%	-384	-384	-384	-384	-384	-384	-384
-2.67%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	191	190	189	188	186	184	182
5.33%	345	341	336	331	327	322	318
8.00%	387	386	385	383	381	379	376

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

(단위:백만원)

729

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

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	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	2024-11-13
기준일	2024-11-12

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	4,402	0	4,402	

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	2024-11-13
기준일	2024-11-12

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	13,878	0	13,878	
누계	통화	선도	0	14,386	-14,386	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E	589
FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E	354
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E	208
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

530

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

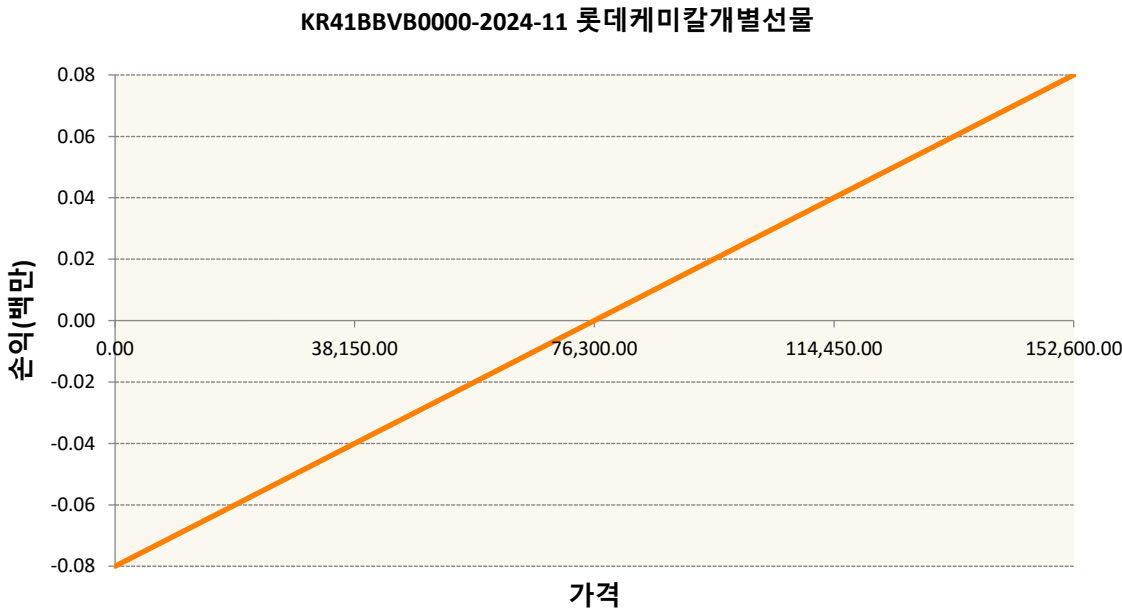
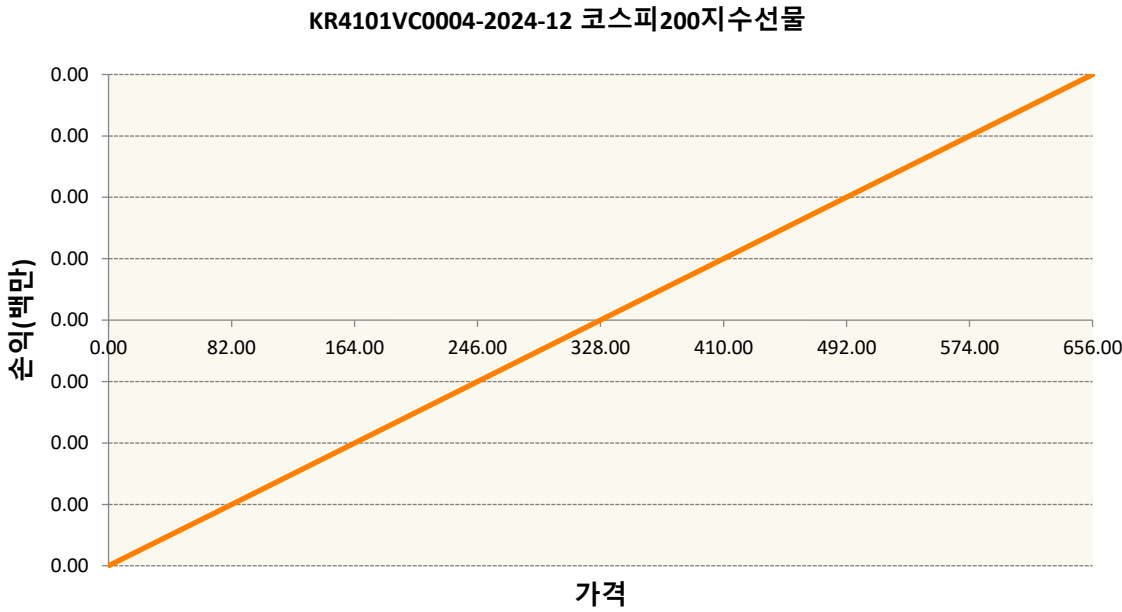
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

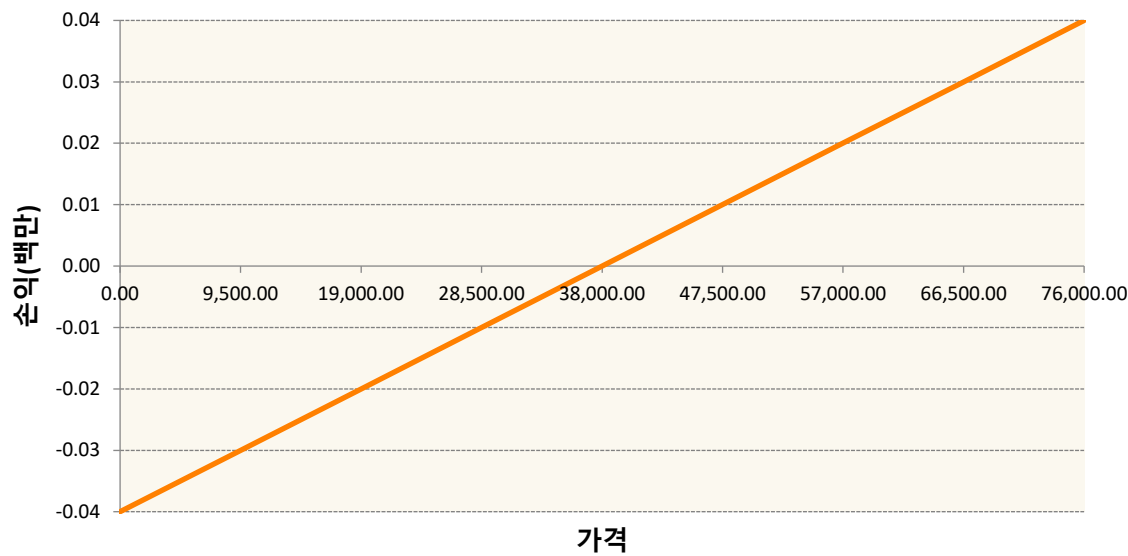
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	43	0	43	장내
누계	유가증권	선물	917	0	917	장내

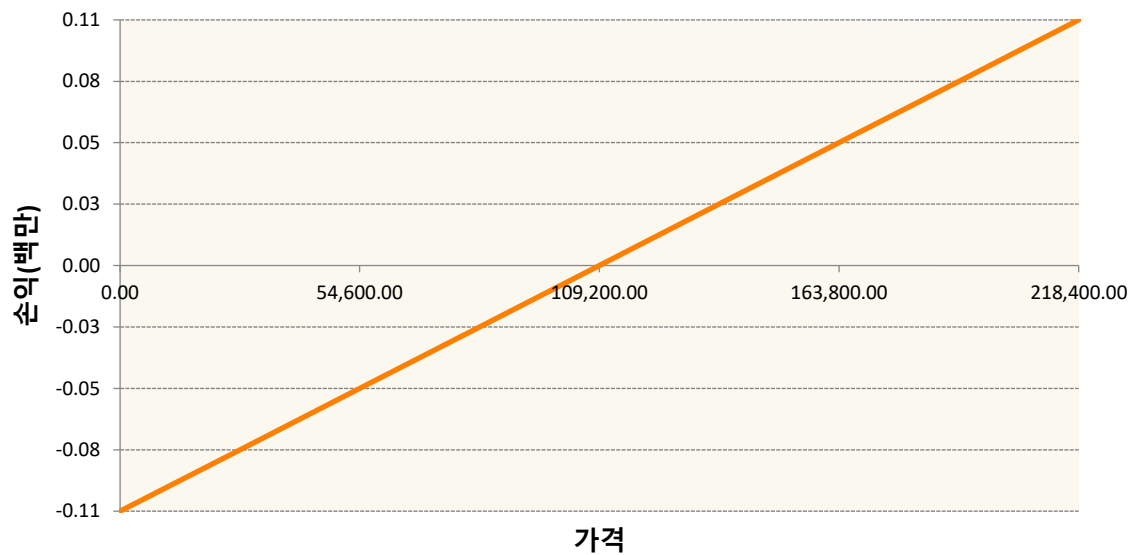
2. 만기시점의 손익구조



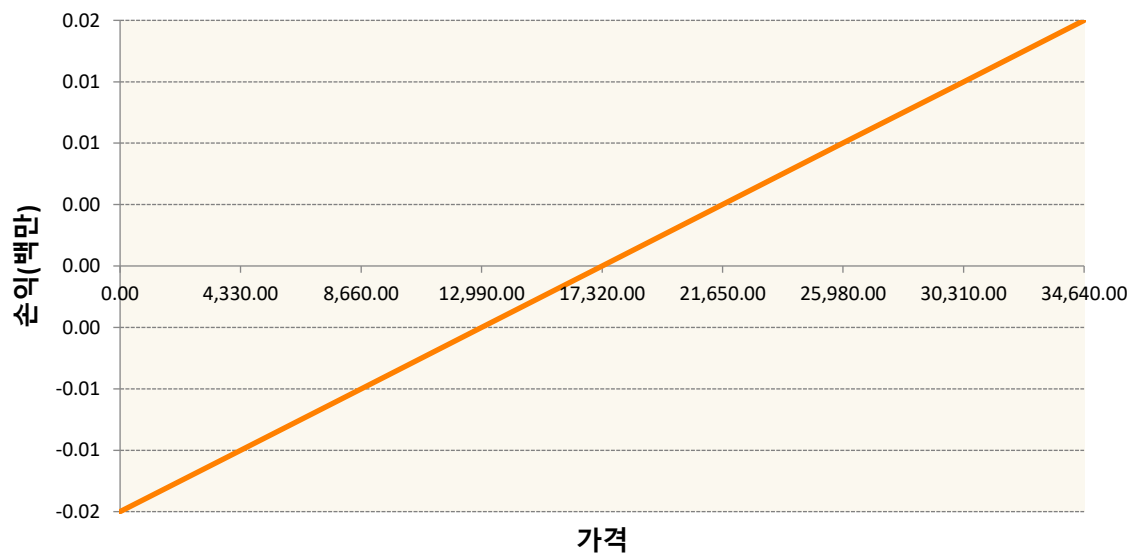
KR41BQVB0003-2024-11 호텔신라개별선물



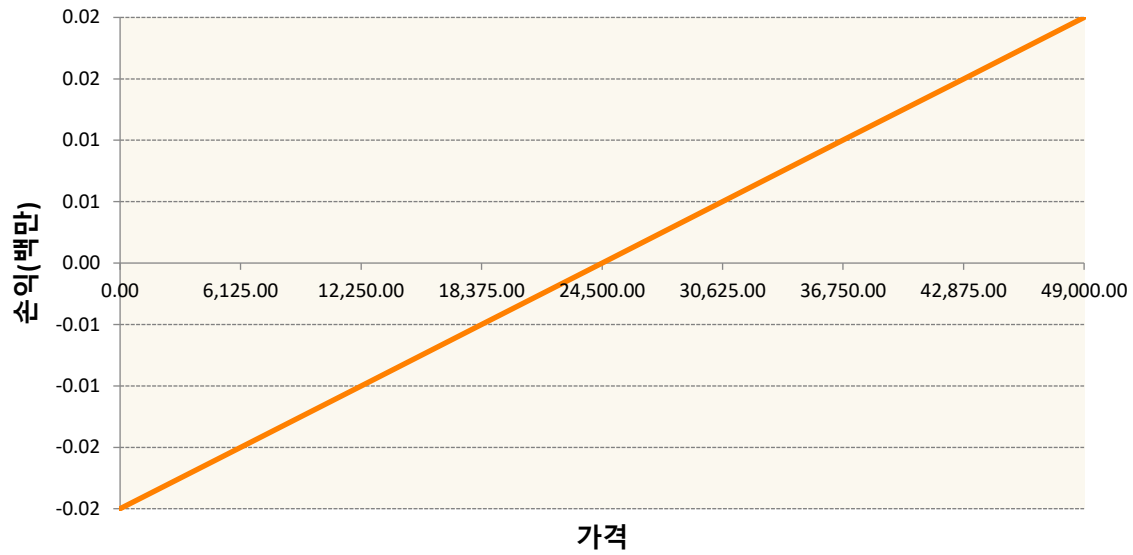
KR41C6VC0003-2024-12 아모레퍼시픽개별선물



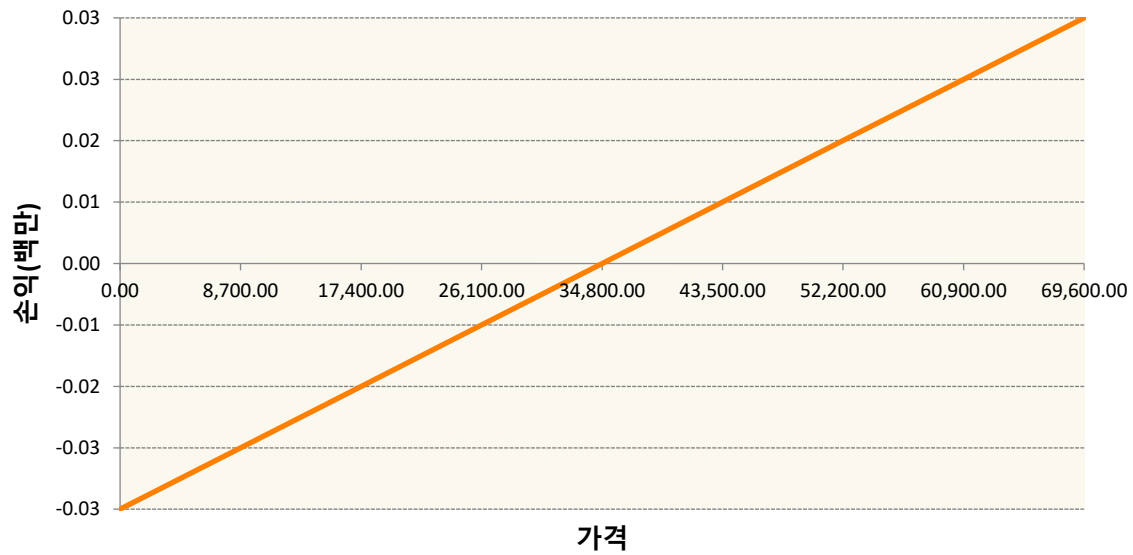
KR41CBVB0009-2024-11 한화솔루션개별선물



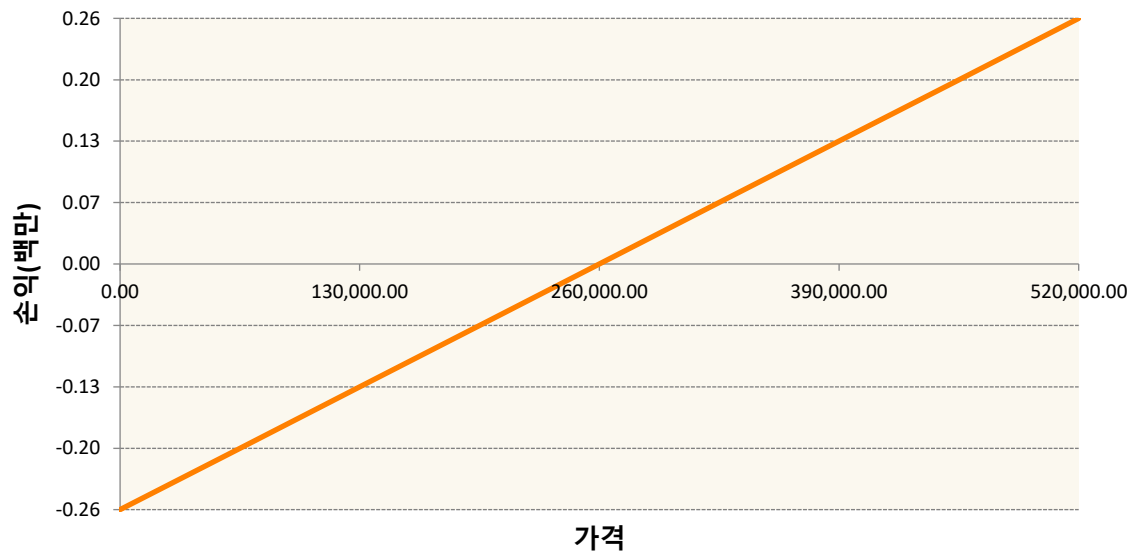
KR41CNVB0005-2024-11 포스코DX개별선물



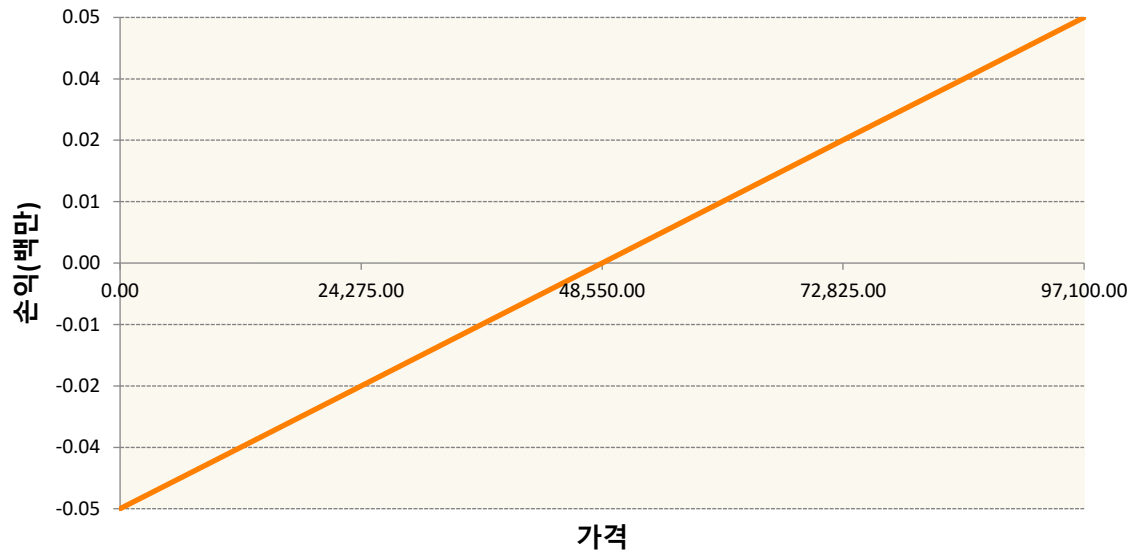
KR41CVVB0005-2024-11 한미사이언스개별선물



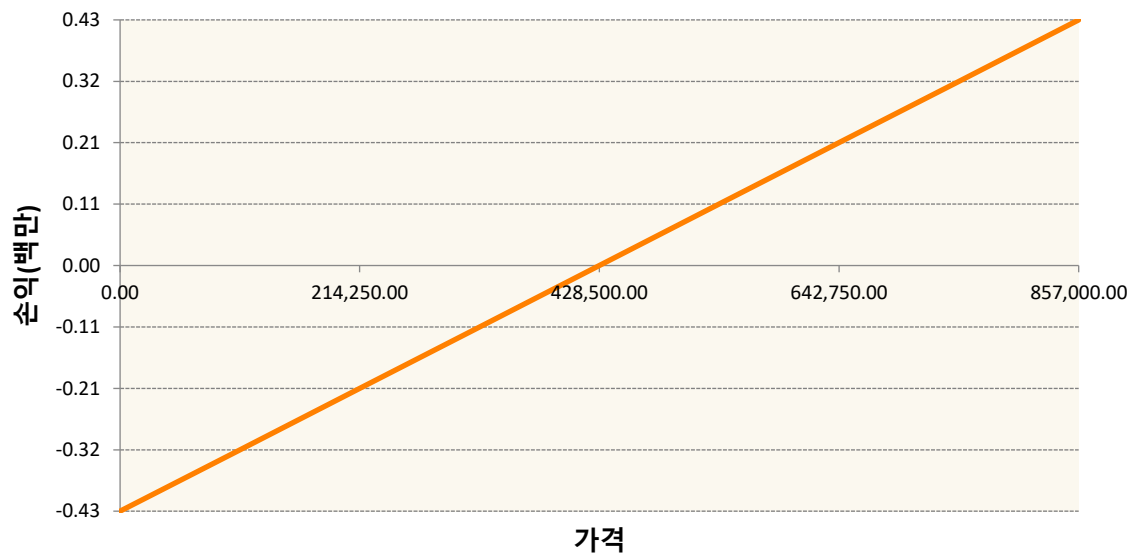
KR41DBVB0008-2024-11 LIG넥스원개별선물



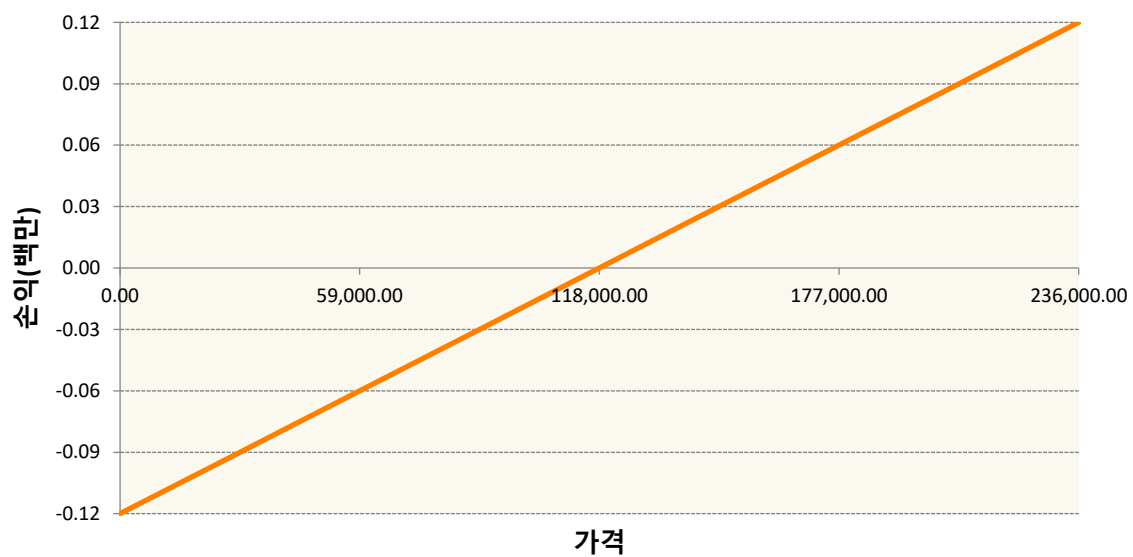
KR41DNVB0004-2024-11 하나투어개별선물



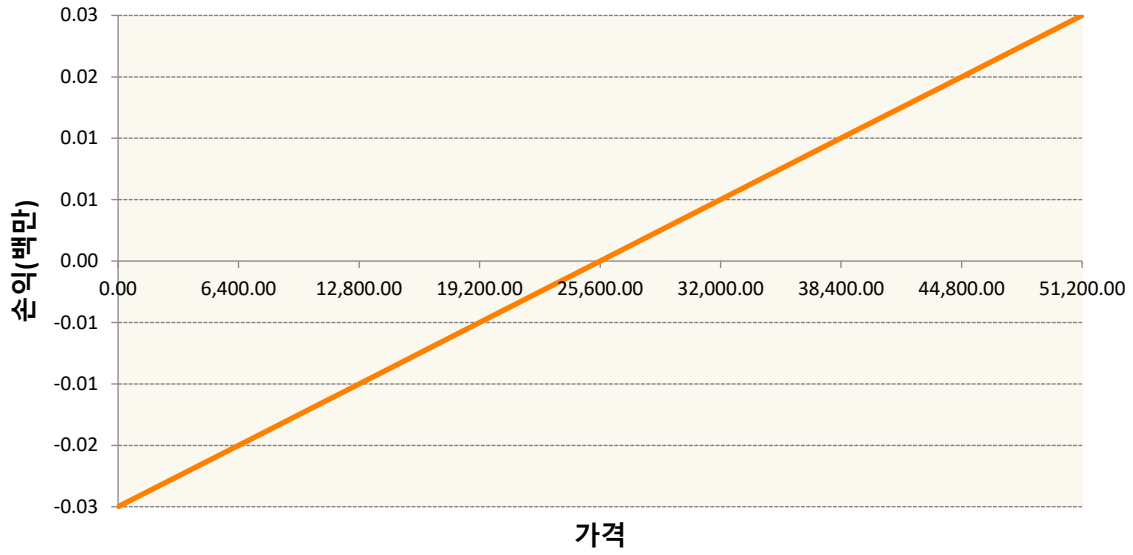
KR41F5VB0008-2024-11 LG에너지솔루션개별선물



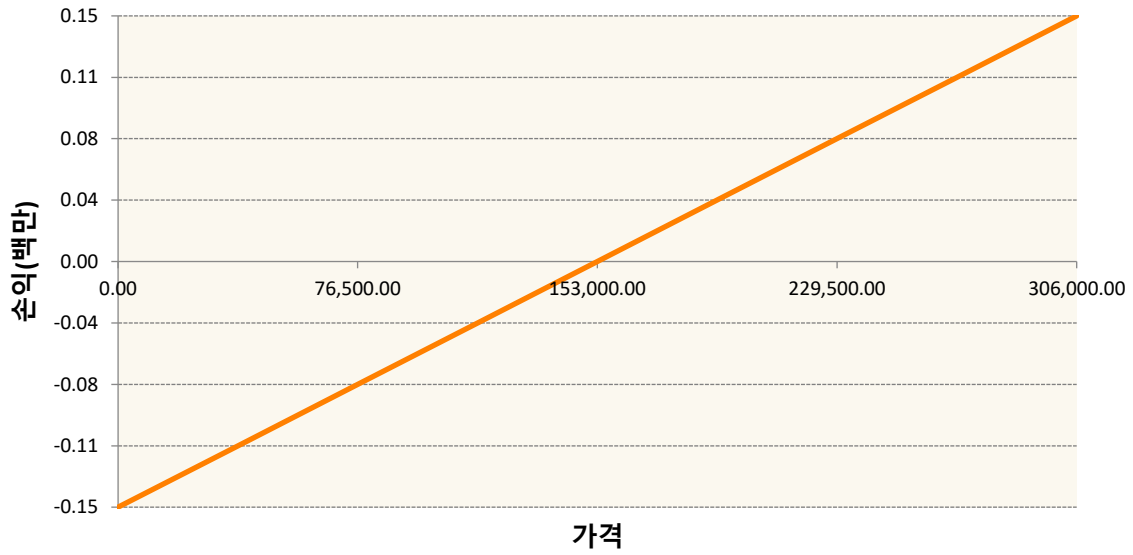
KR41FMVB0003-2024-11 엘앤에프개별선물



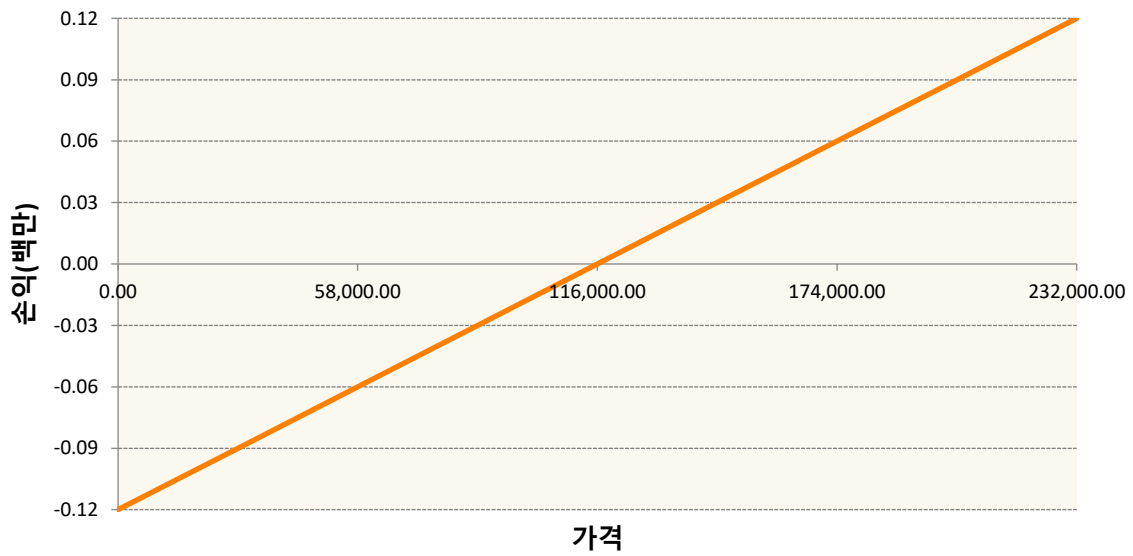
KR41FXVB0000-2024-11 동서개별선물



KR41GLVB0003-2024-11 LS ELECTRIC개별선물



KR41GZVB0007-2024-11 에코프로머티개별선물



(단위:백만원)

KR4101VC0004							2024-12 코스피200지수선물		59	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59			
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39			
-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%	39	39	39	39	39	39	39			
8.00%	59	59	59	59	59	59	59			
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			
-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			
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			
KR41C6VC0003							2024-12 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			
KR41CBVB0009							2024-11 한화솔루션개별선물		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

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%	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

KR41CVVB0005 2024-11 한미사이언스개별선물 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

KR41DBVB0008 2024-11 LIG넥스원개별선물 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

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

KR41F5VB0008	2024-11 LG에너지솔루션개별선물	3
--------------	----------------------	---

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-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%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR41FMVB0003	2024-11 엘앤에프개별선물	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

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 ELECTRIC 개별선물	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)

81

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

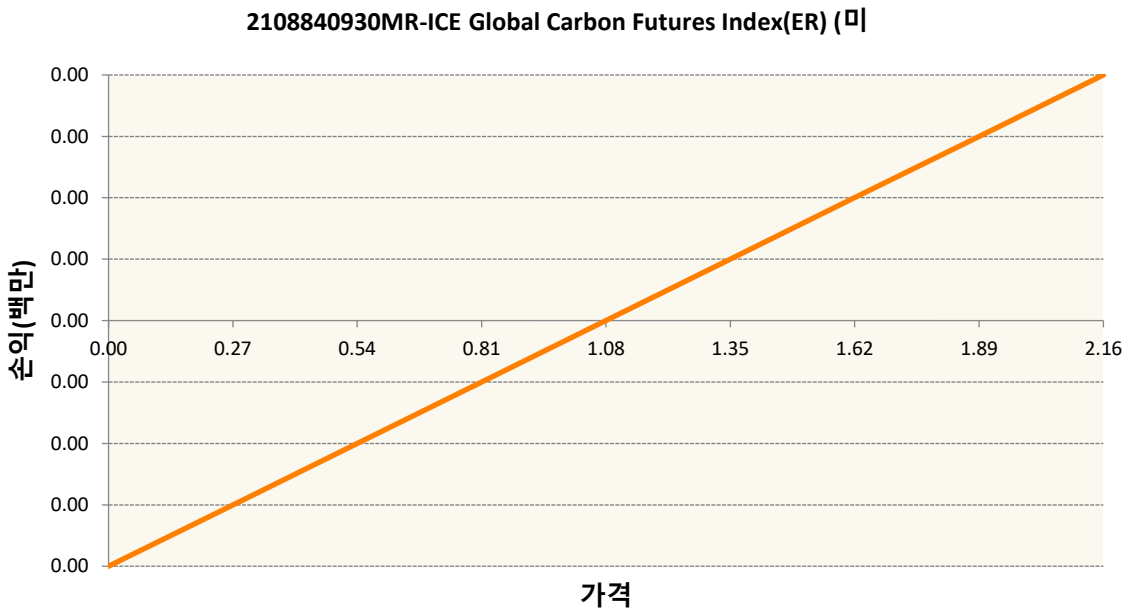
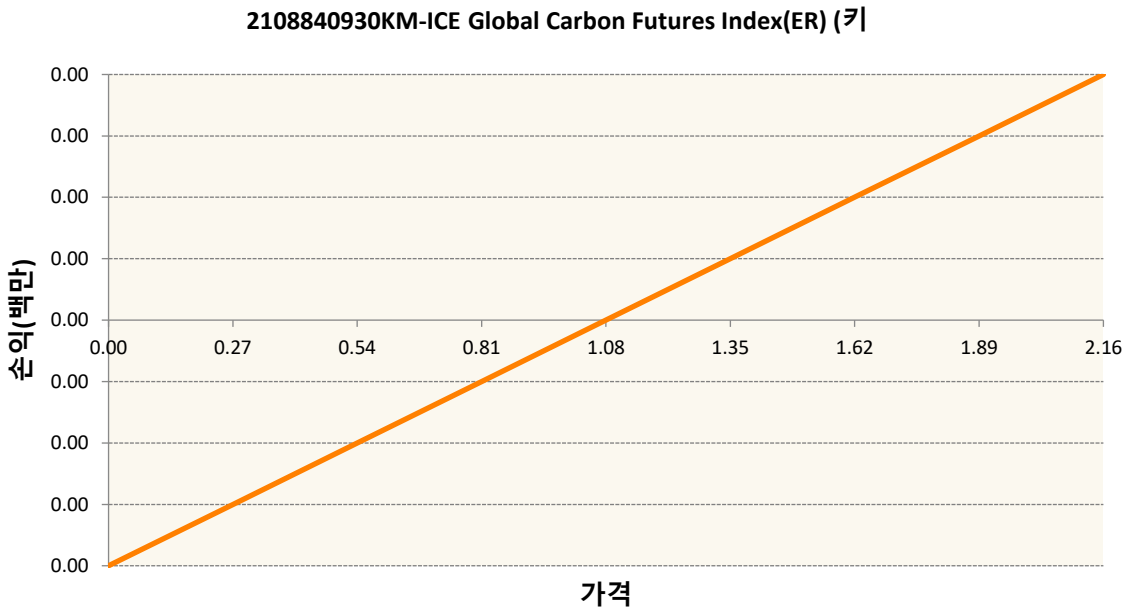
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

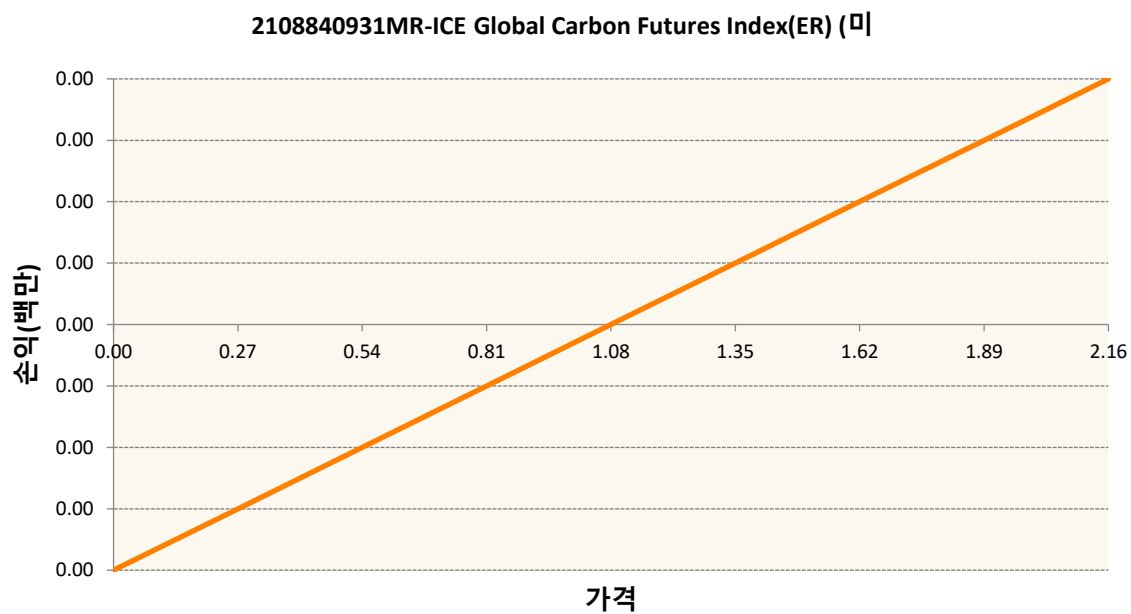
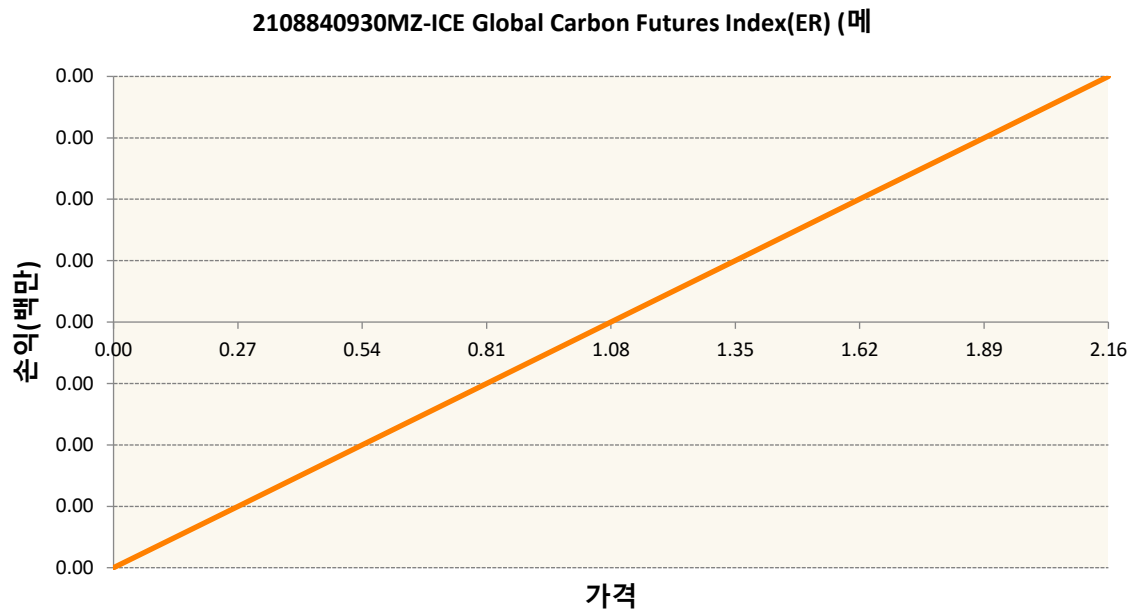
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	12,206	0	12,206	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		97
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		489
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		195
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		195

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,056

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

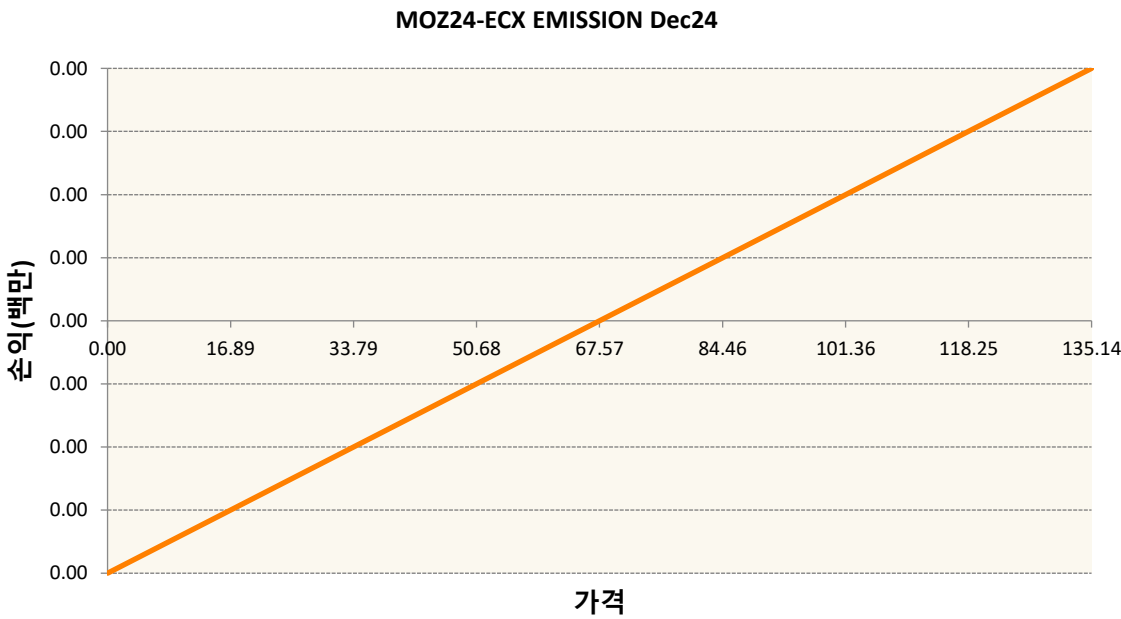
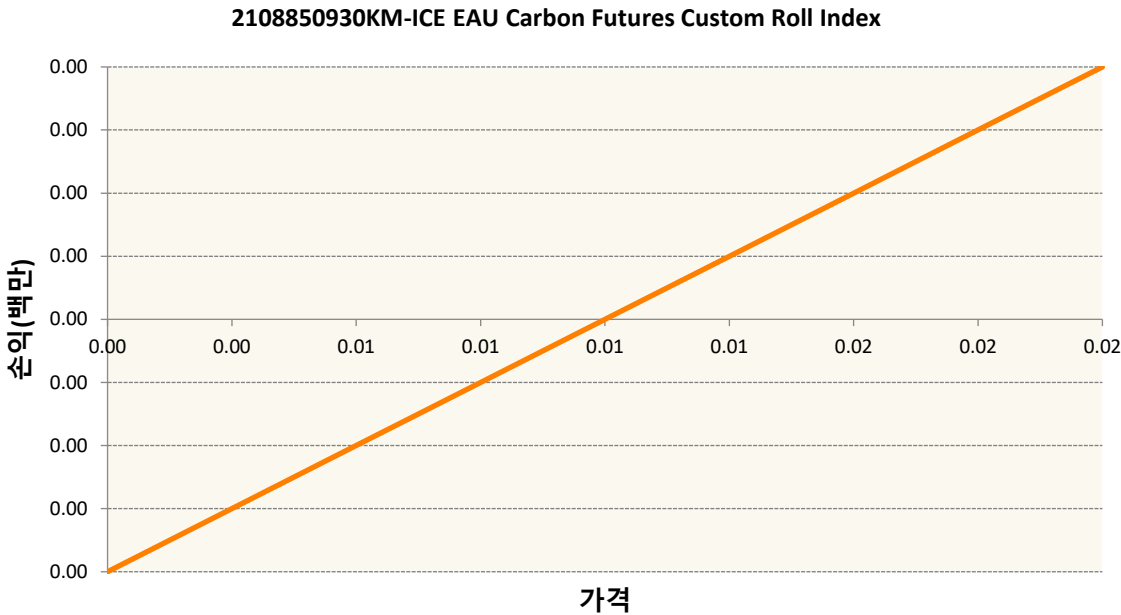
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

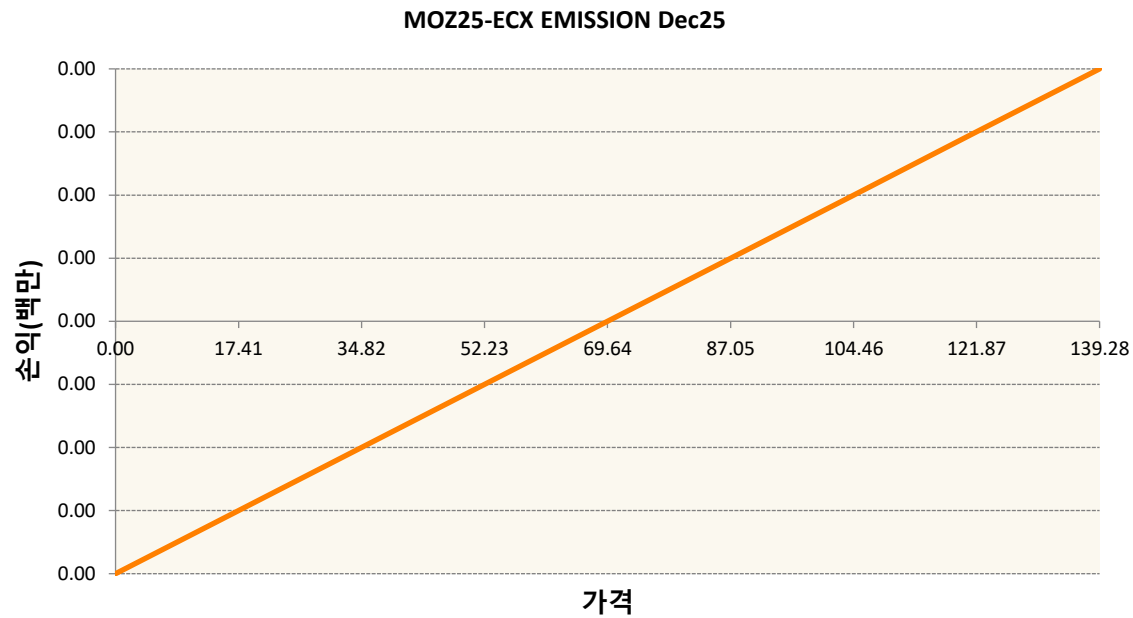
1. 계약금액

(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	8,342	0	8,342	
누계	통화	선도	0	1,913	-1,913	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		0.43
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E		11
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E		142
MOZ24	ECX EMISSION Dec24	243
MOZ25	ECX EMISSION Dec25	424

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,202

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

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)	26
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	38
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	38

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

(단위:백만원)

219

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

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)	76
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	65
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	91
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	19

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

(단위:백만원)

409

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

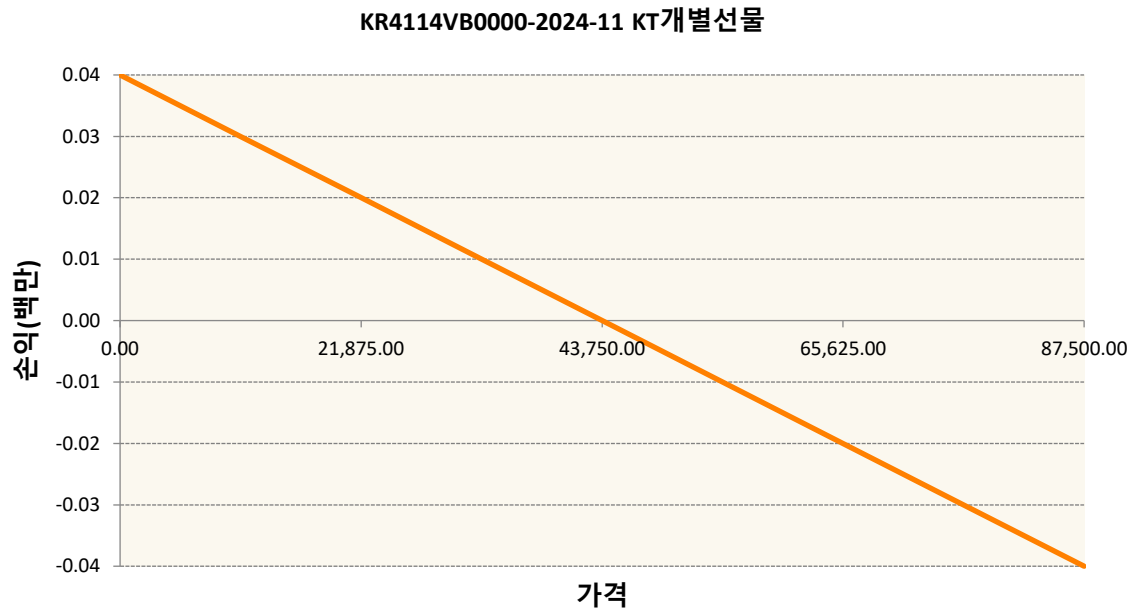
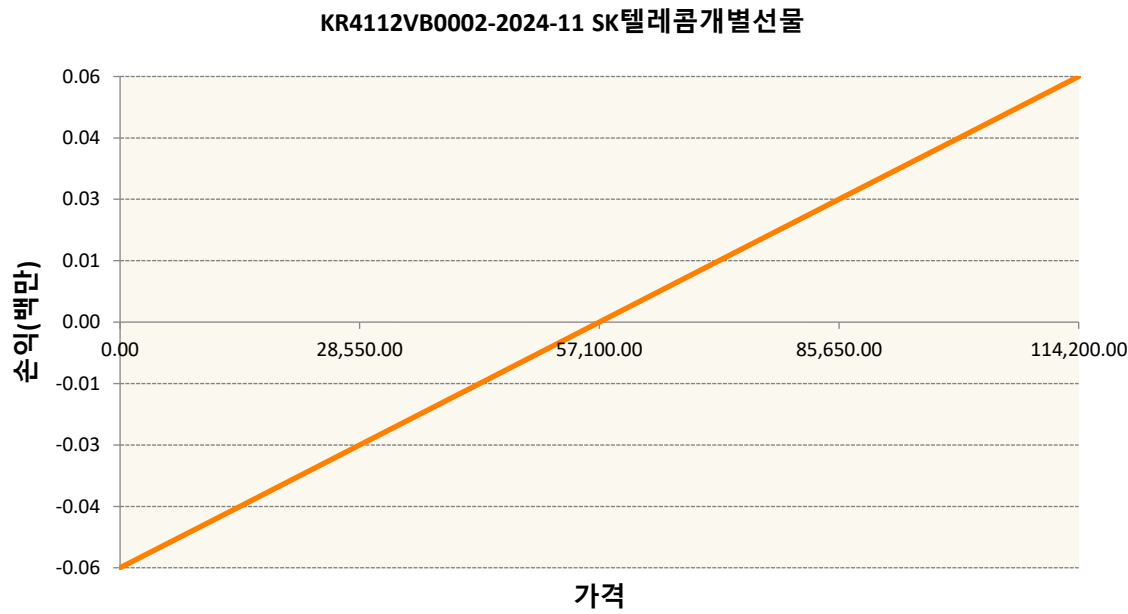
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

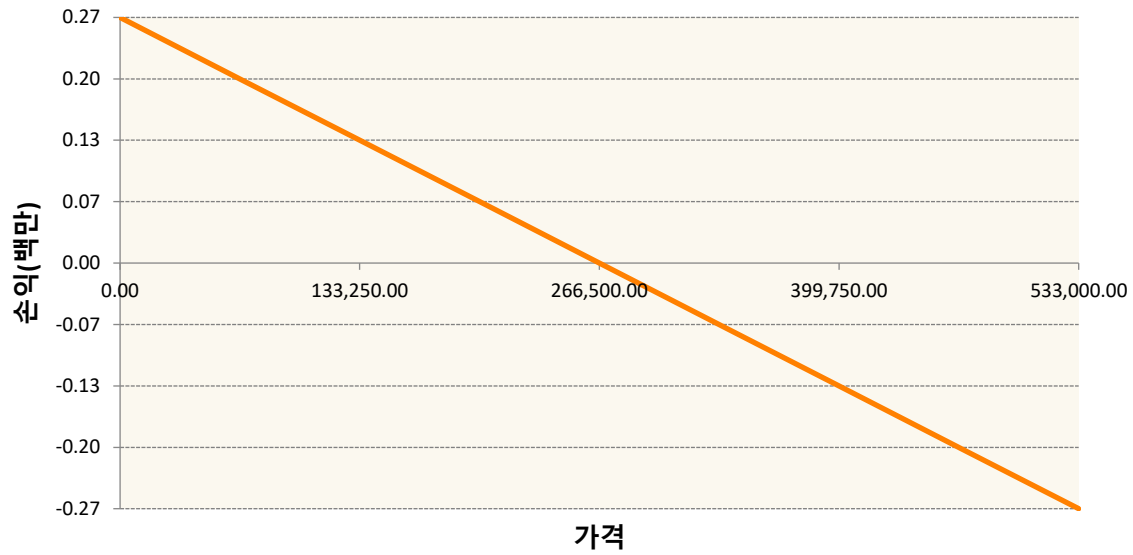
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	25	22	3	장내
누계	유가증권	선물	14	71	-57	장내

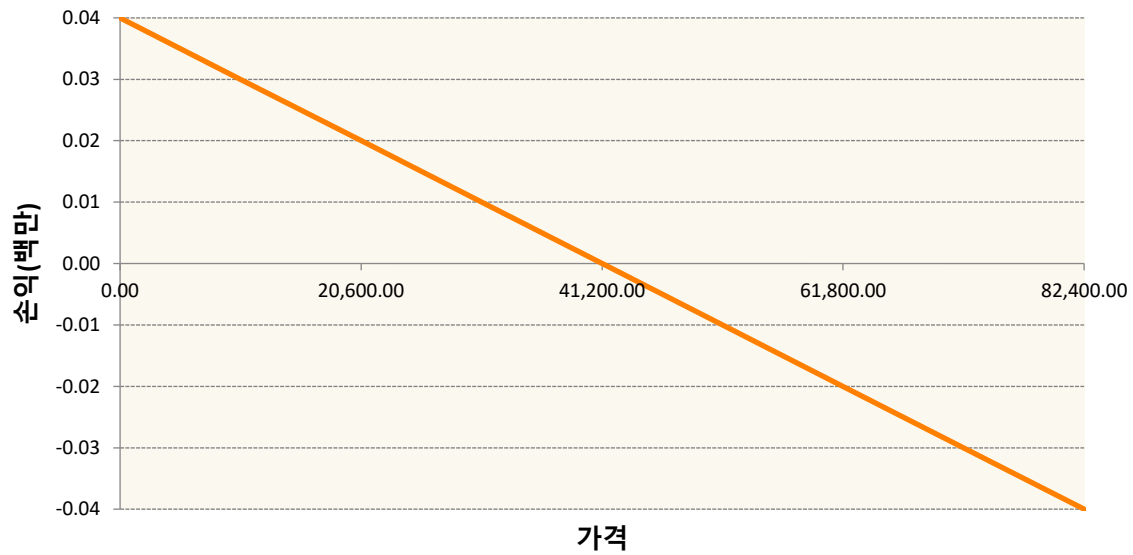
2. 만기시점의 손익구조



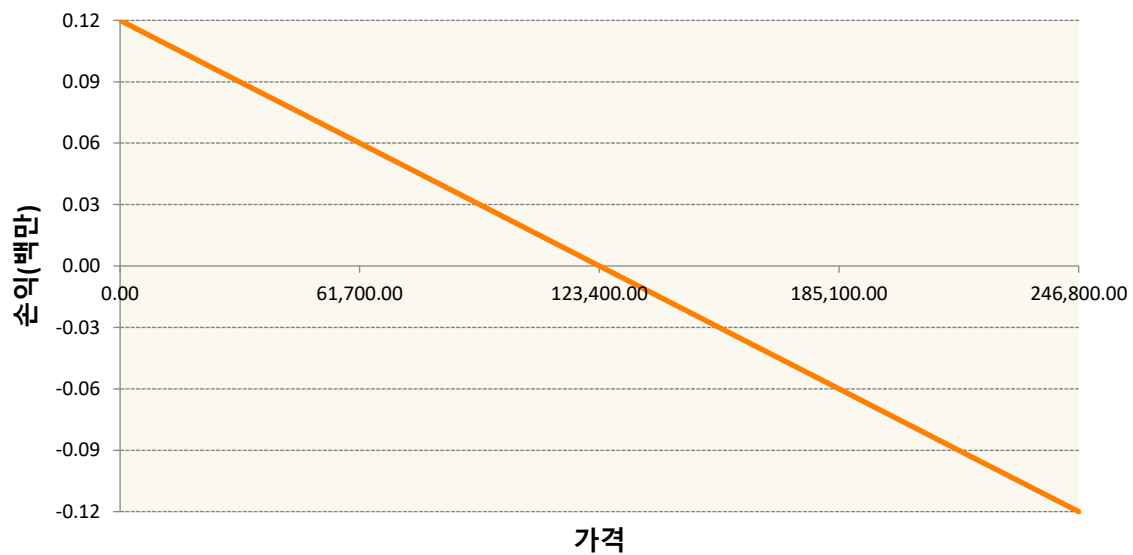
KR4122VC0009-2024-12 삼성SDI개별선물



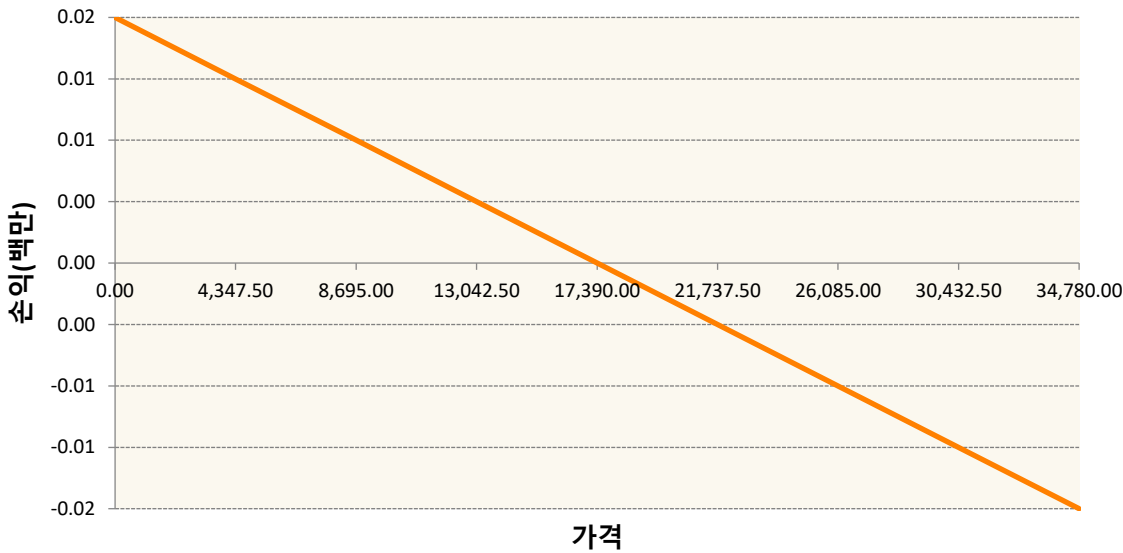
KR4135VB0005-2024-11 GS개별선물



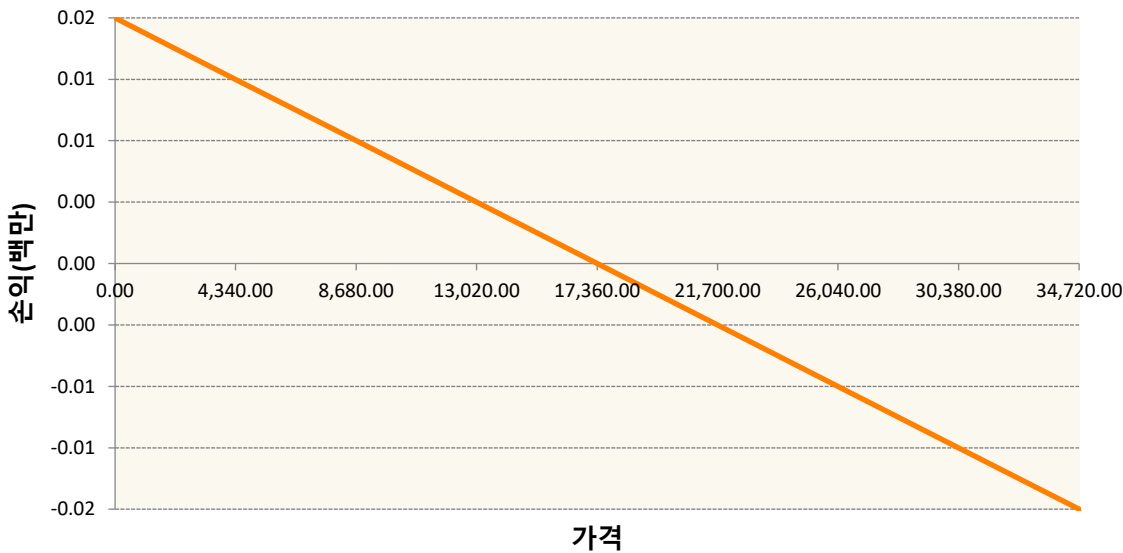
KR4136VB0004-2024-11 KT&G개별선물



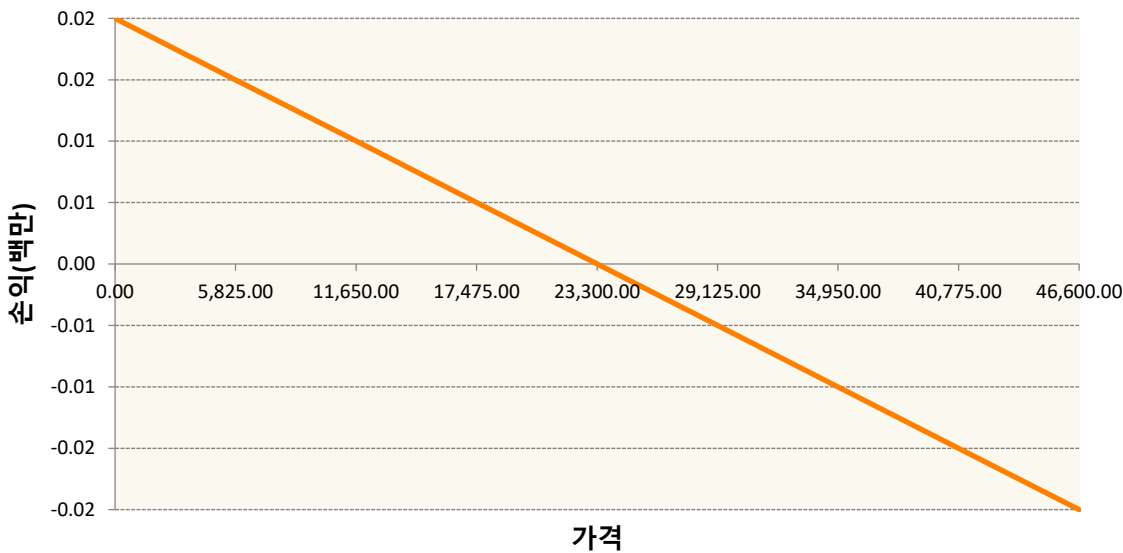
KR4151VB0004-2024-11 GS건설개별선물



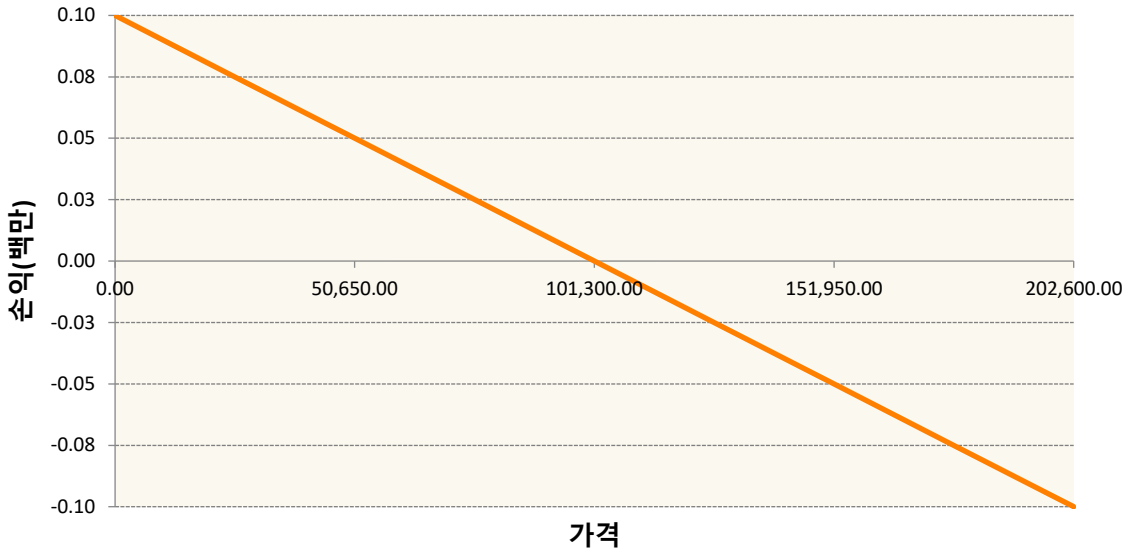
KR4151VC0003-2024-12 GS건설개별선물



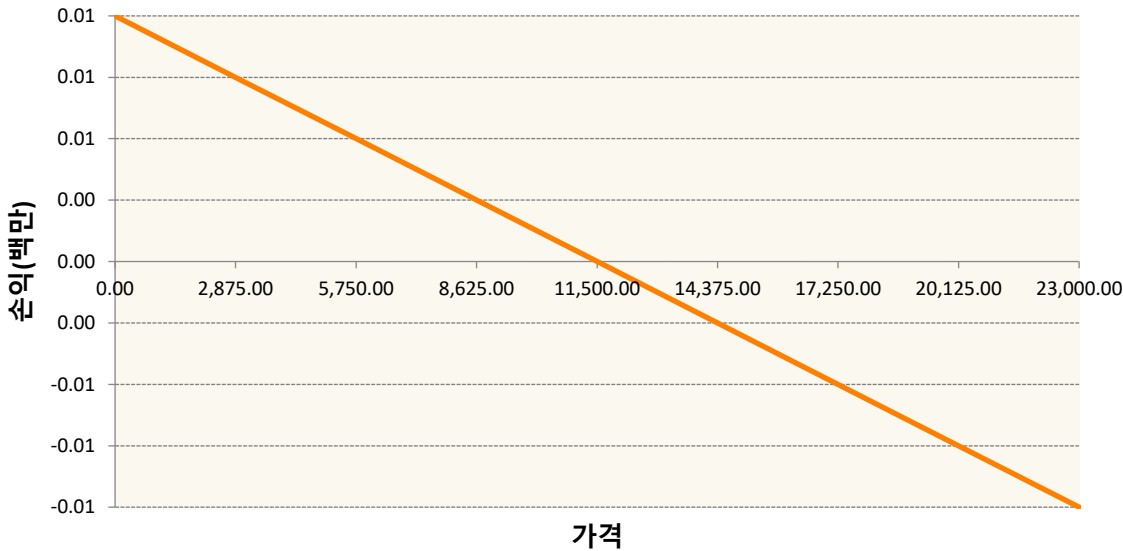
KR4157VC0007-2024-12 대한항공개별선물



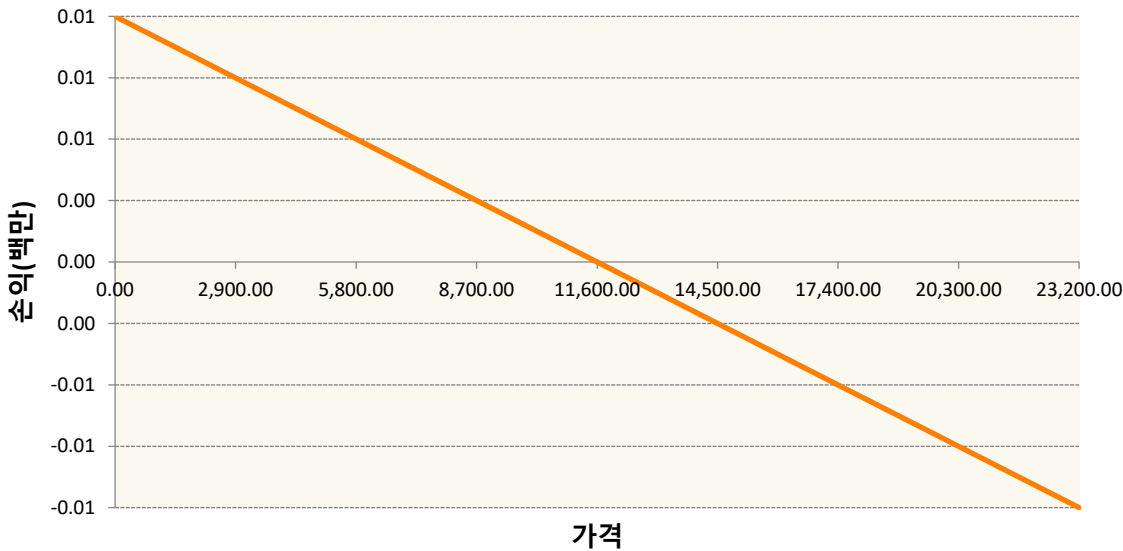
KR41BDVB0008-2024-11 삼성생명개별선물



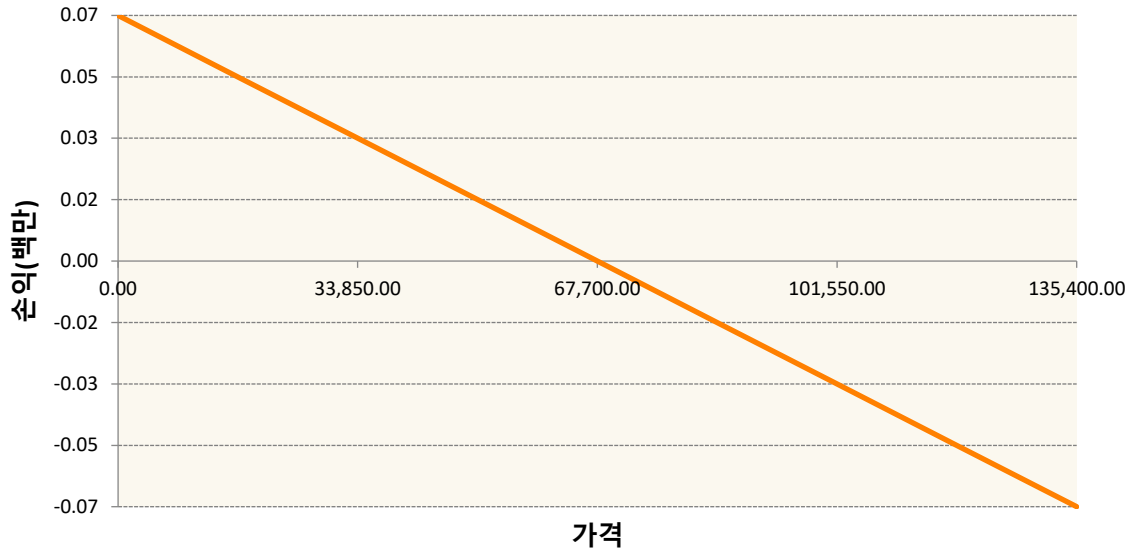
KR41BFVB0006-2024-11 삼성중공업개별선물



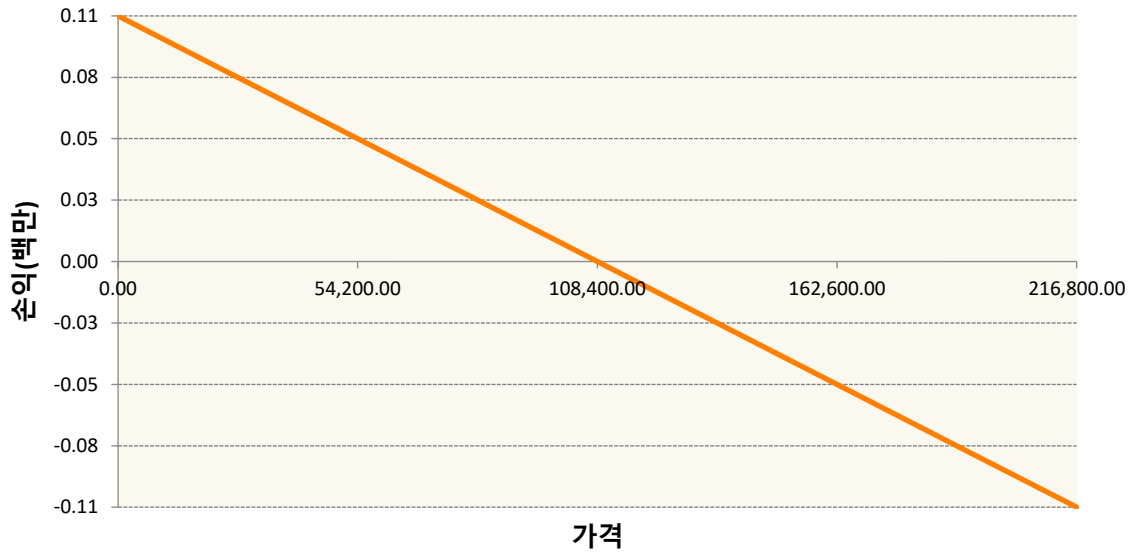
KR41BFVC0005-2024-12 삼성중공업개별선물



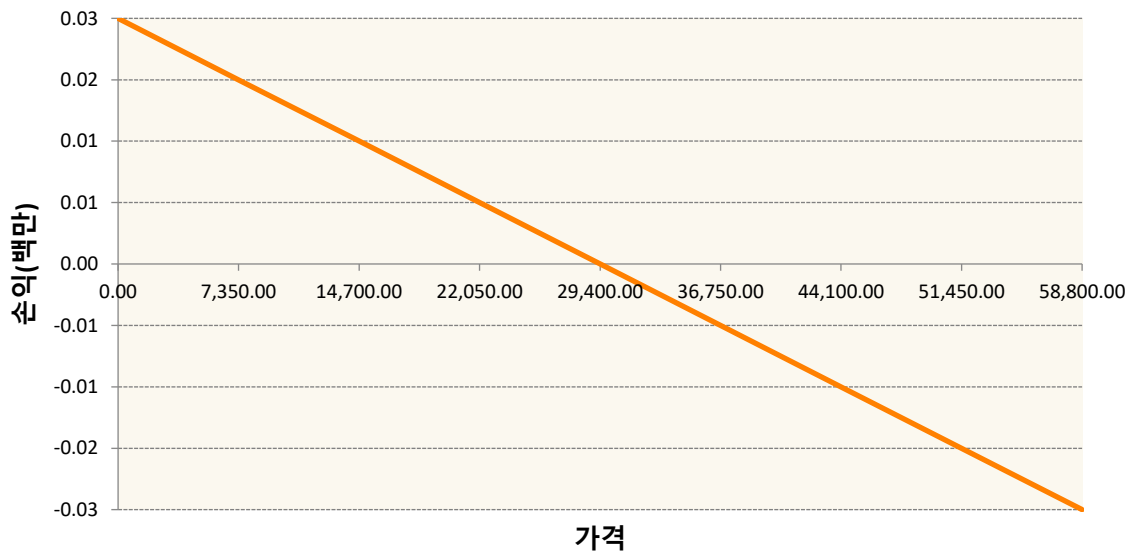
KR41BMVC0006-2024-12 한국항공우주개별선물



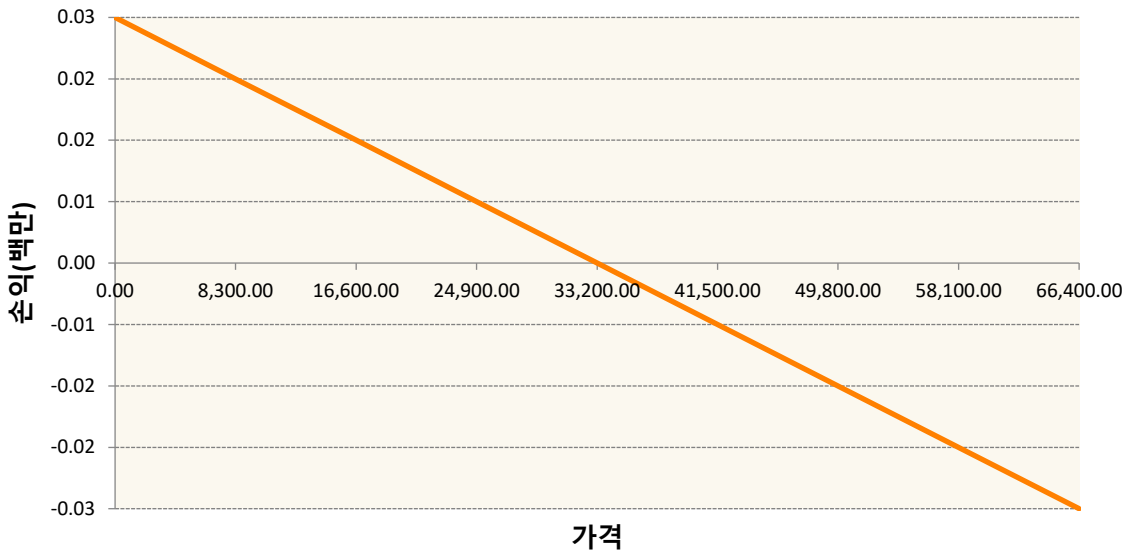
KR41CDVC0006-2024-12 현대미포조선개별선물



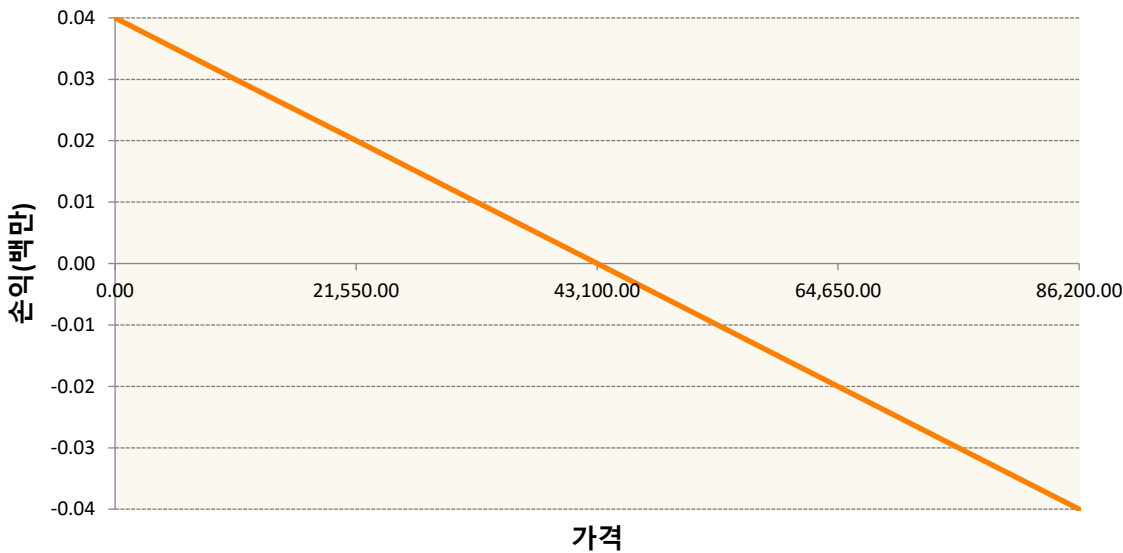
KR41CEVB0006-2024-11 현대해상개별선물



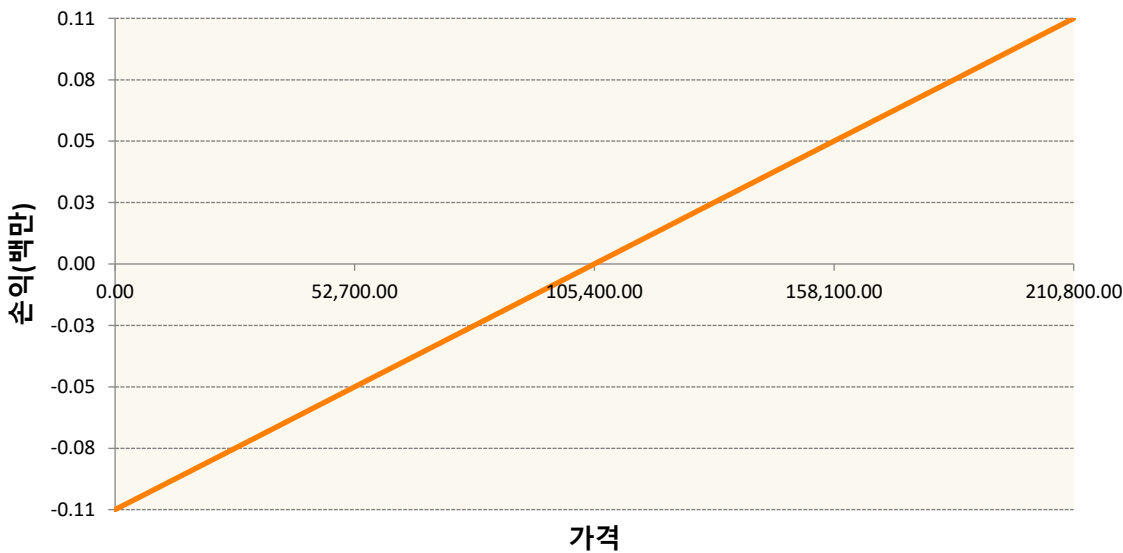
KR41CFVB0005-2024-11 카카오개별선물



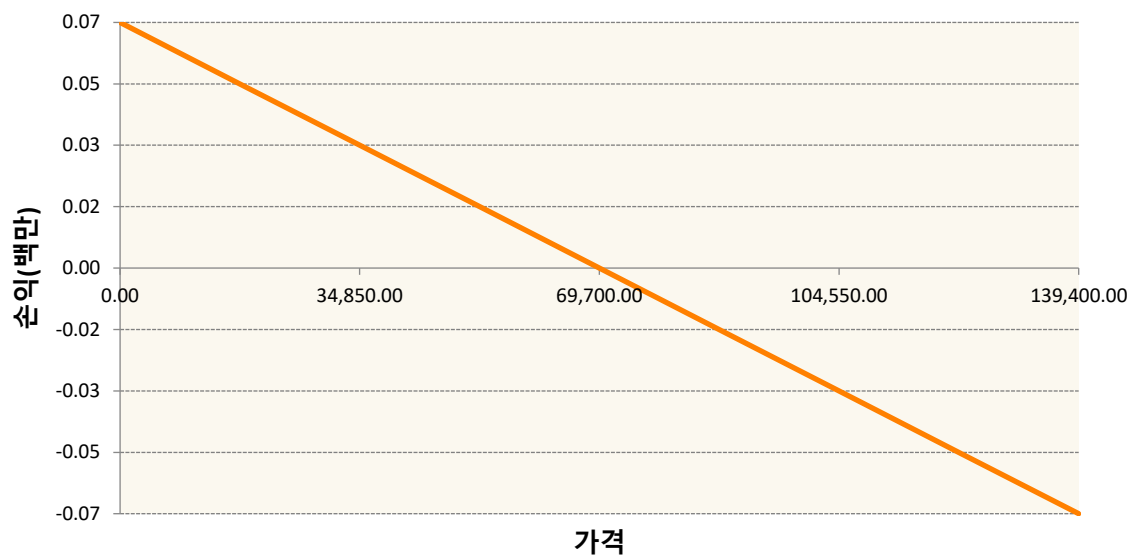
KR41CQVC0001-2024-12 와이지엔터테인먼트개별선물



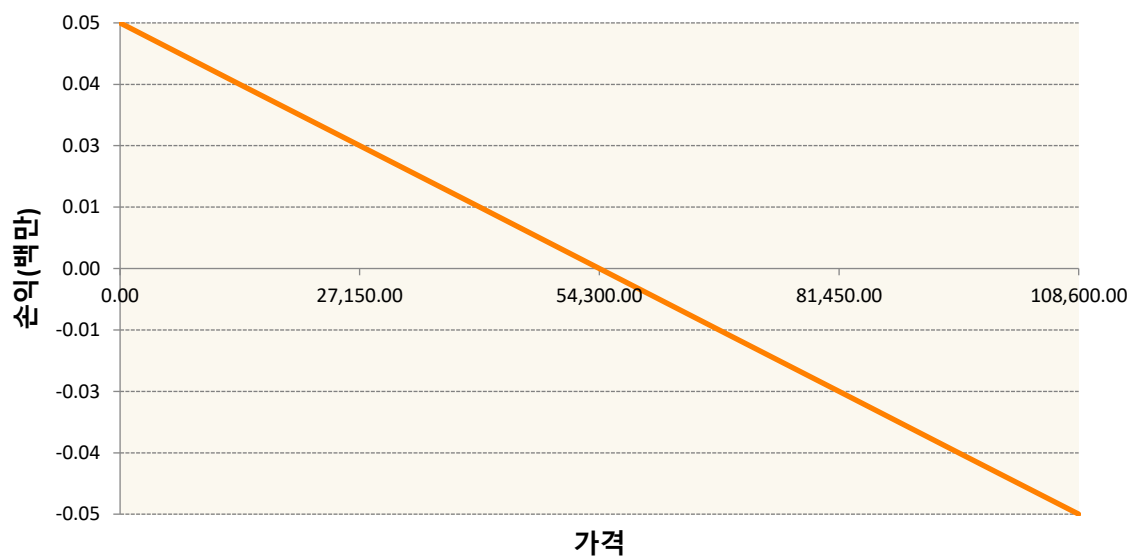
KR41D0VB0008-2024-11 DB손해보험개별선물



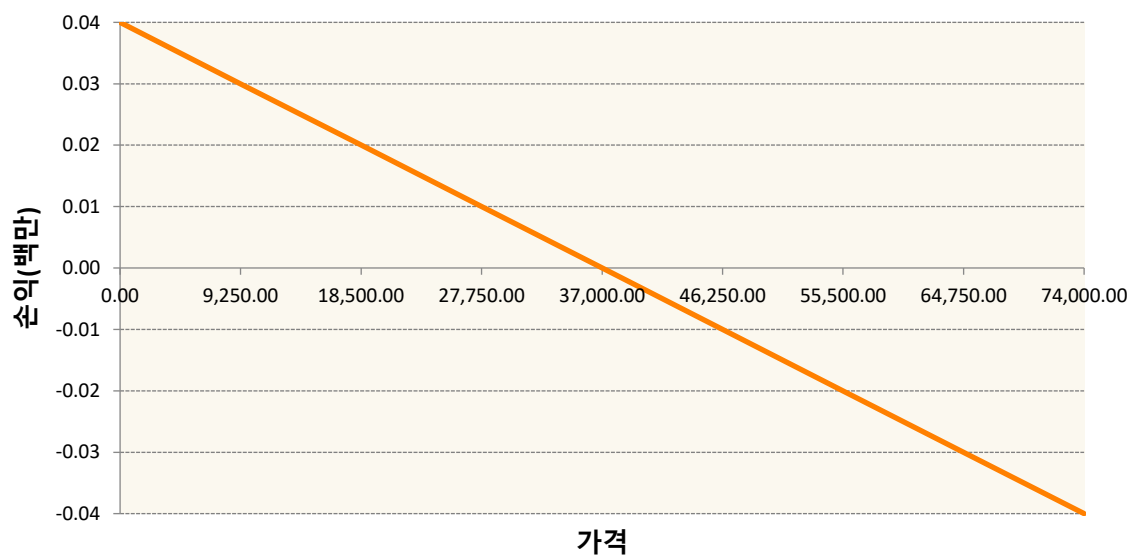
KR41E4VB0002-2024-11 에스엠개별선물



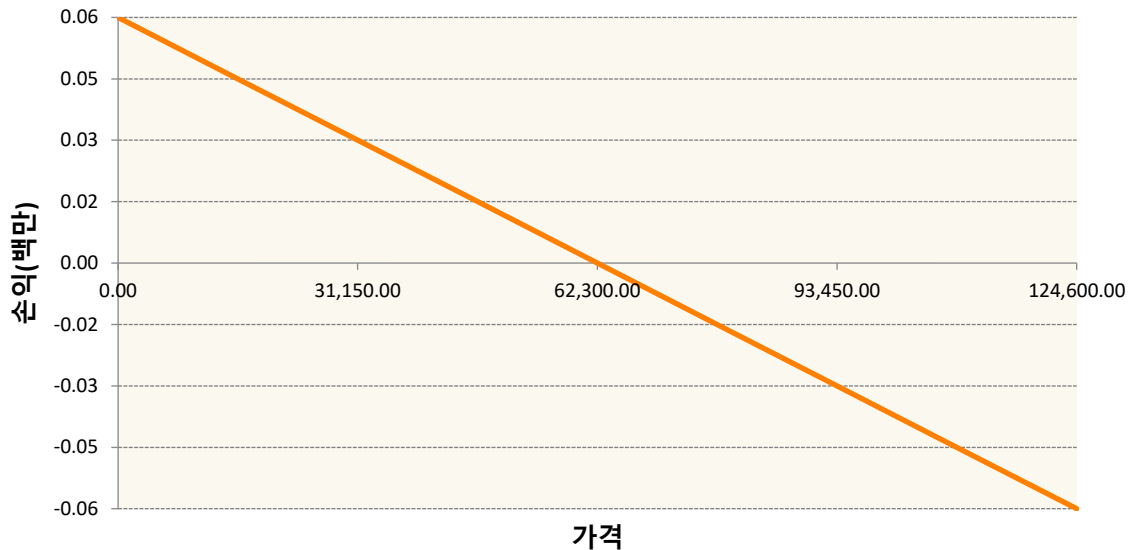
KR41EFVB0003-2024-11 JYP Ent.개별선물



KR41FLVB0004-2024-11 펠어비스개별선물



KR41G6VC0004-2024-12 현대로템개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4112VB00 2024-11 SK텔레콤개별선물	1
KR4114VB00 2024-11 KT개별선물	1
KR4122VC00 2024-12 삼성SDI개별선물	0.43
KR4135VB00 2024-11 GS개별선물	0.13
KR4136VB00 2024-11 KT&G개별선물	0.1
KR4151VB00 2024-11 GS건설개별선물	0.28
KR4151VC00 2024-12 GS건설개별선물	0.06
KR4157VC00 2024-12 대한항공개별선물	0.11
KR41BDVB00 2024-11 삼성생명개별선물	0.41
KR41BFVB00 2024-11 삼성중공업개별선물	0.34
KR41BFVC00 2024-12 삼성중공업개별선물	0.28
KR41BMVC00 2024-12 한국항공우주개별선물	1
KR41CDVC00 2024-12 현대미포조선개별선물	0.17
KR41CEVB00 2024-11 현대해상개별선물	0.02
KR41CFVB00 2024-11 카카오개별선물	1
KR41CQVC00 2024-12 와이지엔터테인먼트개별선물	0.28
KR41D0VB00 2024-11 DB손해보험개별선물	1
KR41E4VB00 2024-11 에스엠개별선물	0.22
KR41EFVB00 2024-11 JYP Ent.개별선물	0.35
KR41FLVB00 2024-11 펄어비스개별선물	0.12
KR41G6VC00 2024-12 현대로템개별선물	0.25

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

(단위:백만원)

13

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

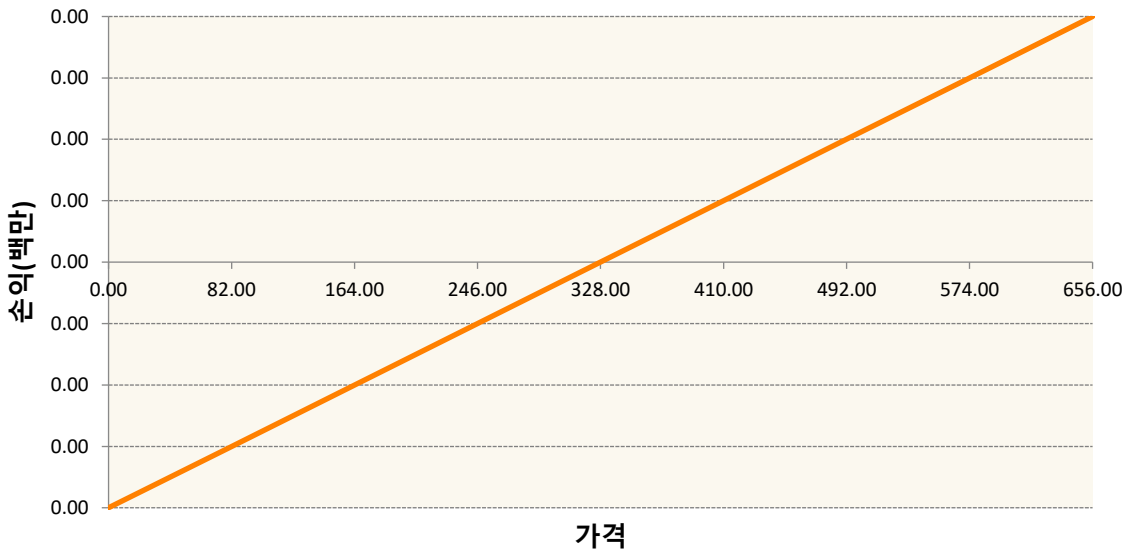
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	410	0	410	장내
누계	유가증권	선물	9,430	0	9,430	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101VC0004-2024-12 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				753
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-753	-753	-753	-753	-753	-753	-753
-5.33%	-502	-502	-502	-502	-502	-502	-502
-2.67%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	251	251	251	251	251	251	251
5.33%	502	502	502	502	502	502	502
8.00%	753	753	753	753	753	753	753

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

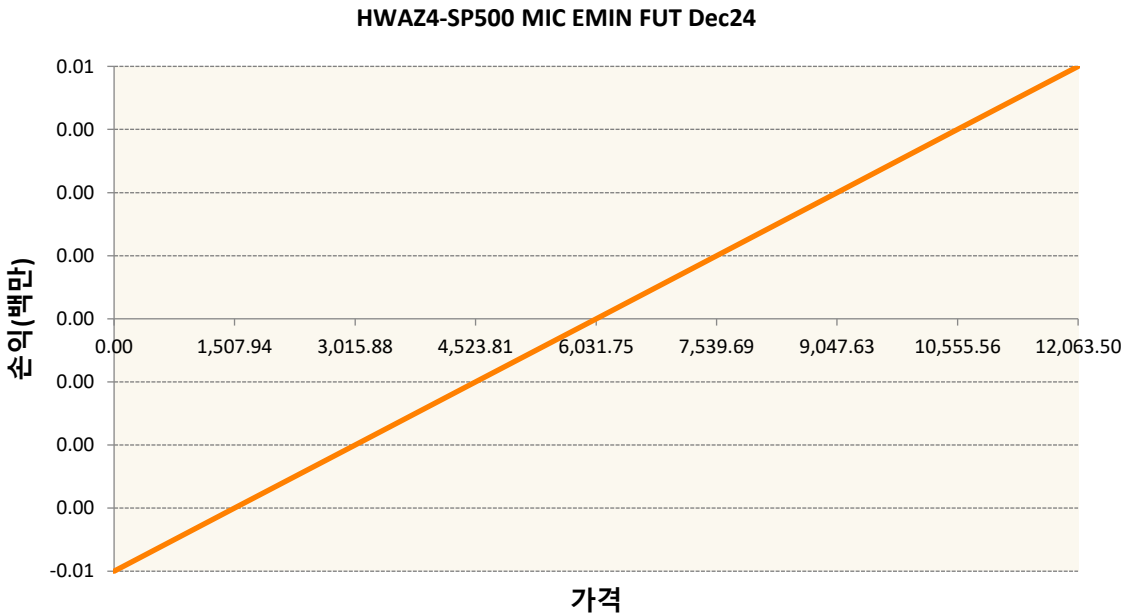
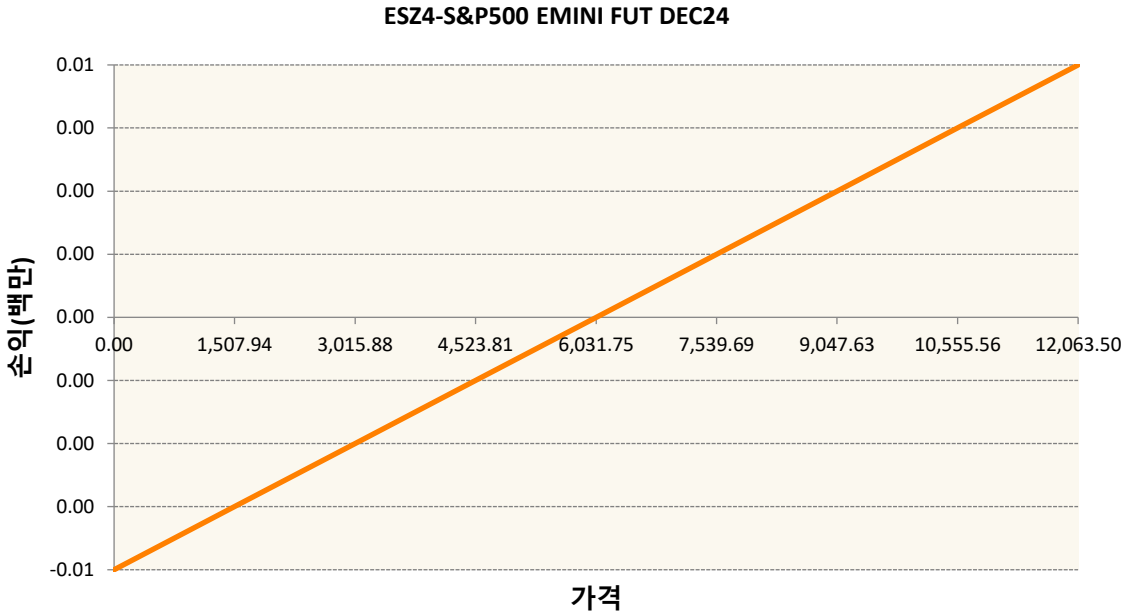
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	15,872	0	15,872	
누계	유가증권	선물	1,648	0	1,648	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,270
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	132

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	860

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

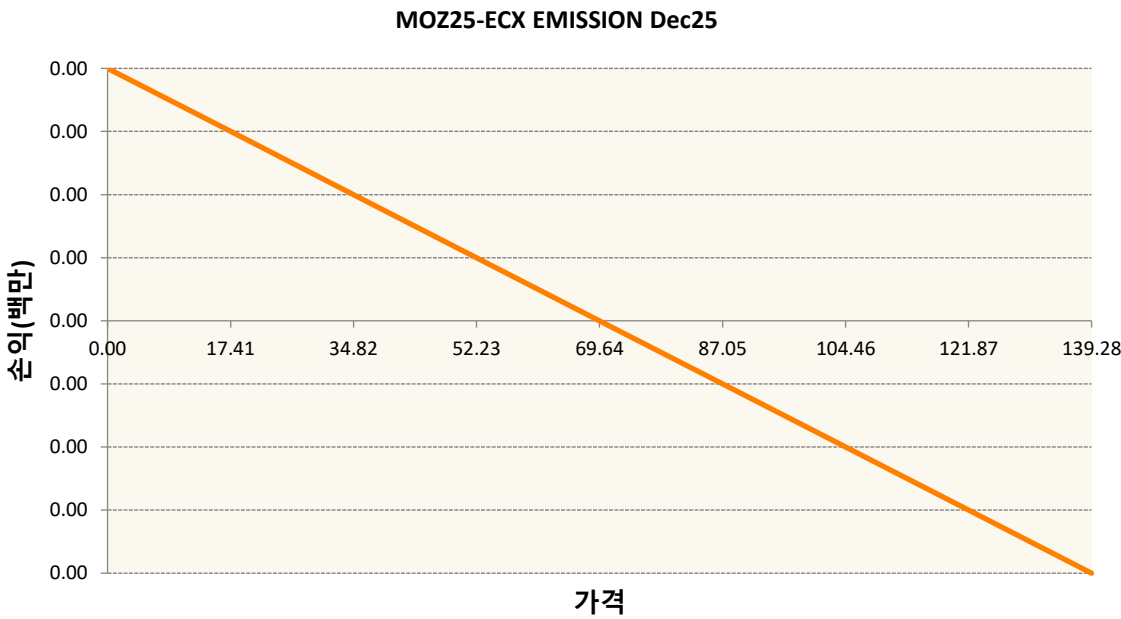
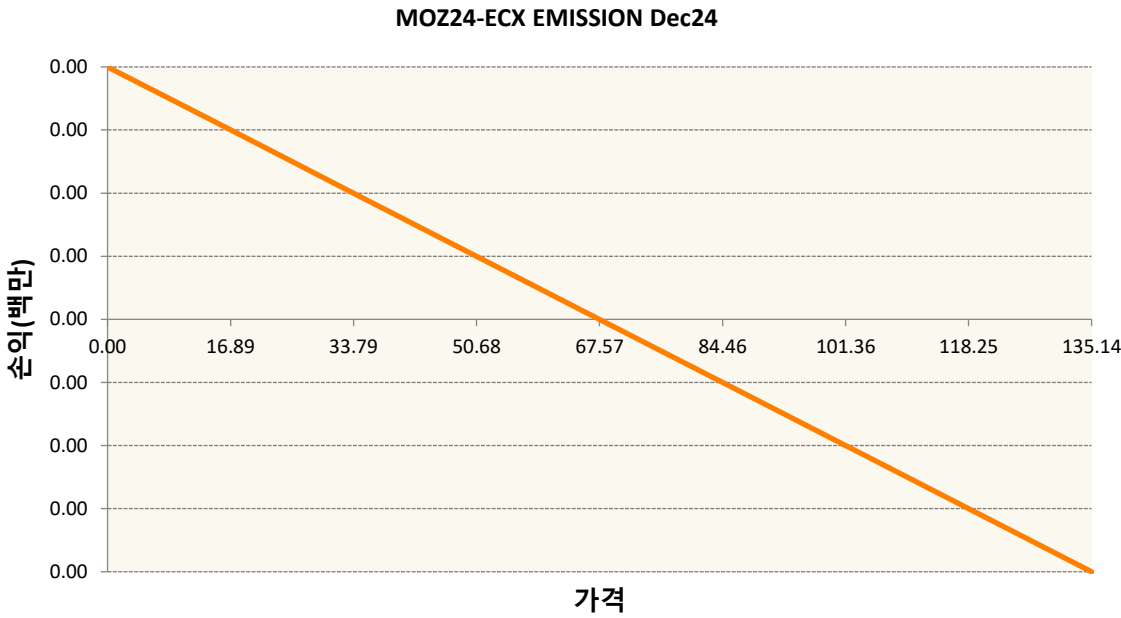
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-7	5,387	-5,394	
누계	통화	선도	0	1,425	-1,425	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		0.48
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E		114
MOZ24	ECX EMISSION Dec24	151
MOZ25	ECX EMISSION Dec25	280

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

785

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

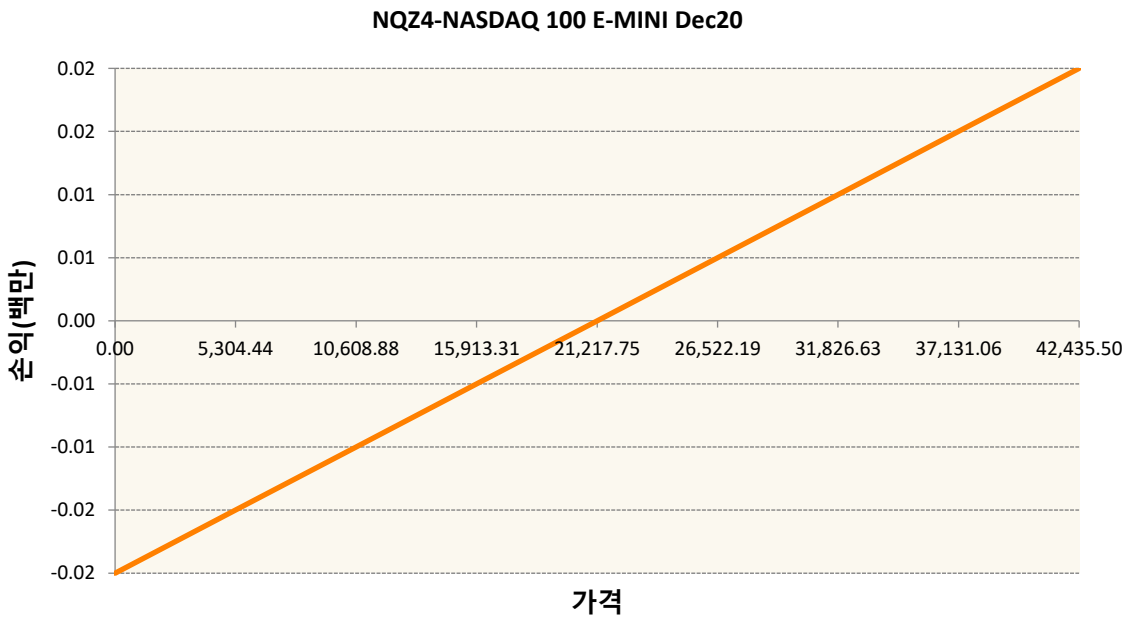
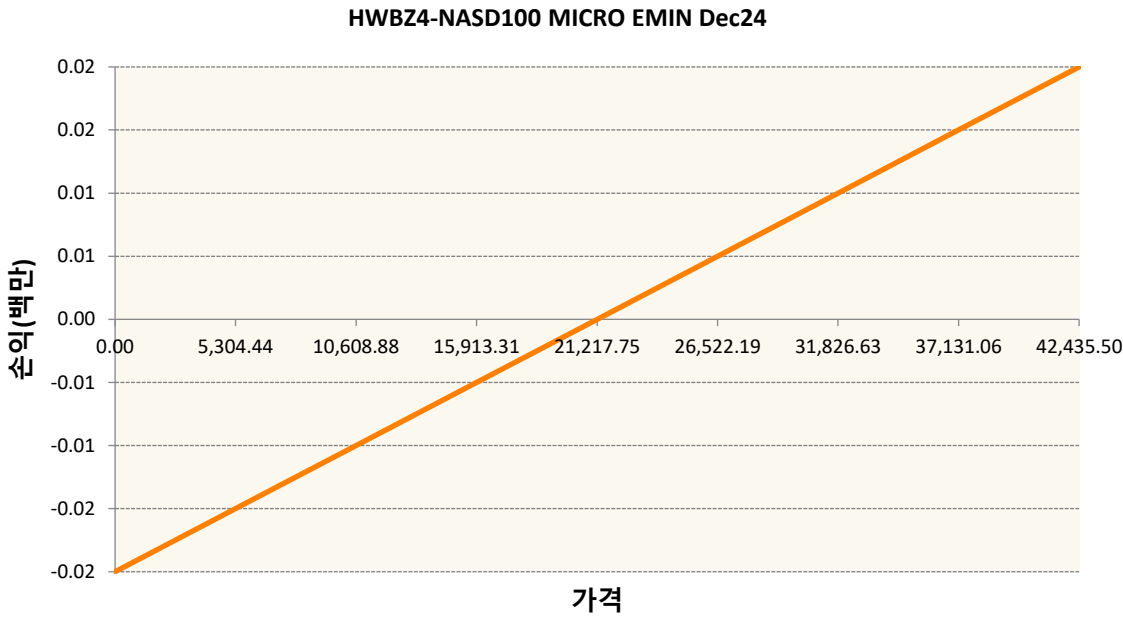
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	8,566	0	8,566	
누계	유가증권	선물	1,158	0	1,158	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		93
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		685

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			646

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

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	710
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,403
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,713
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,306

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

(단위:백만원)

9,642

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

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	17
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	17
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	17
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	17

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

(단위:백만원)

74

공시일	2024-11-13
기준일	2024-11-12

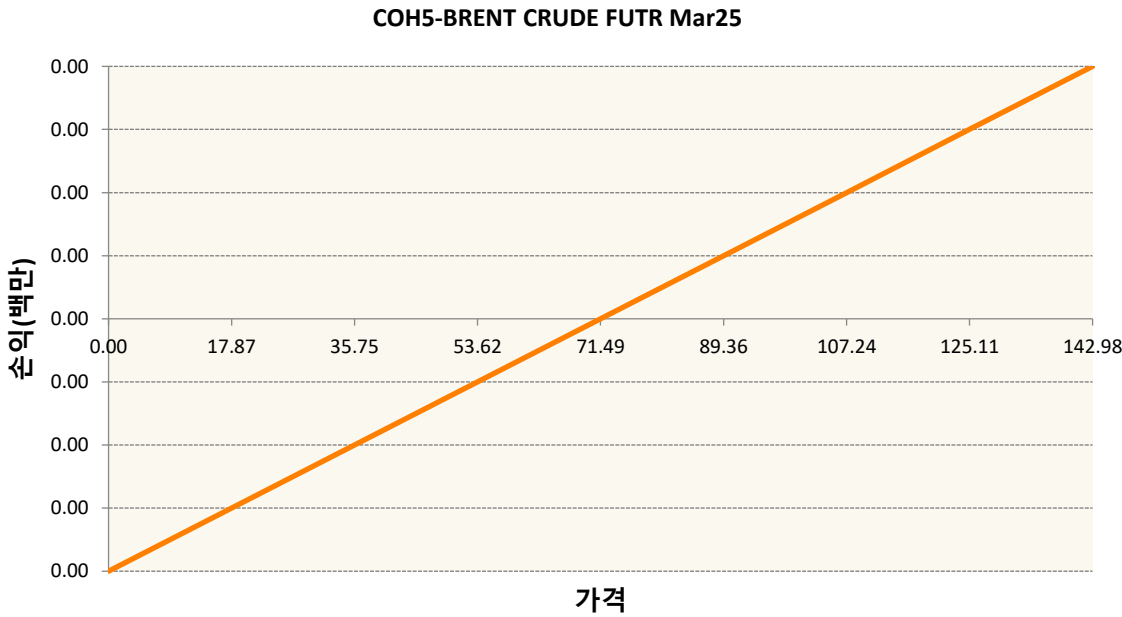
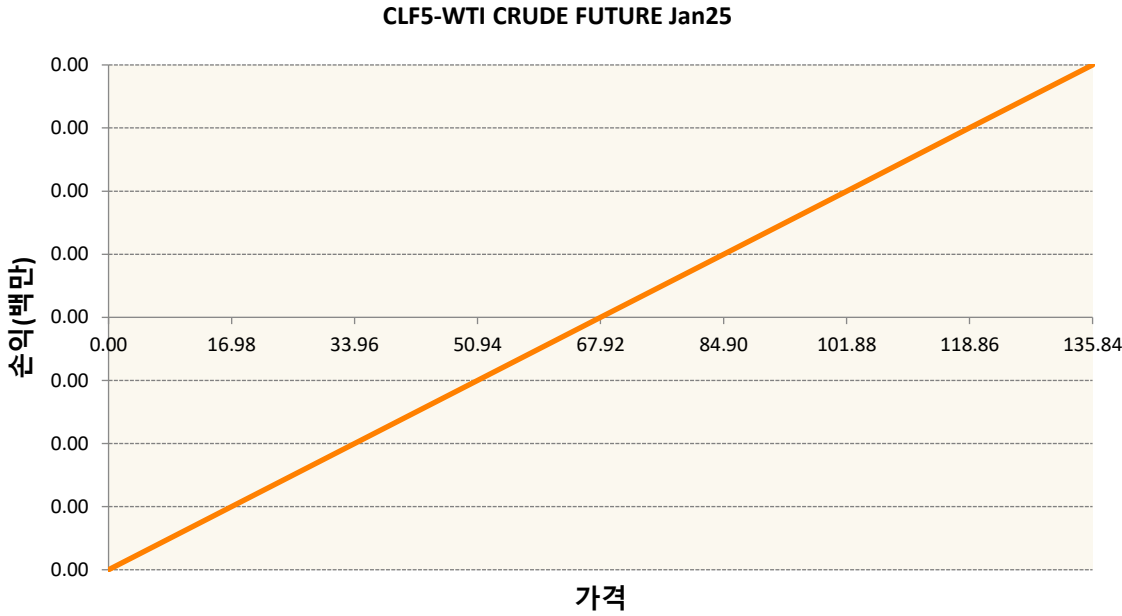
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

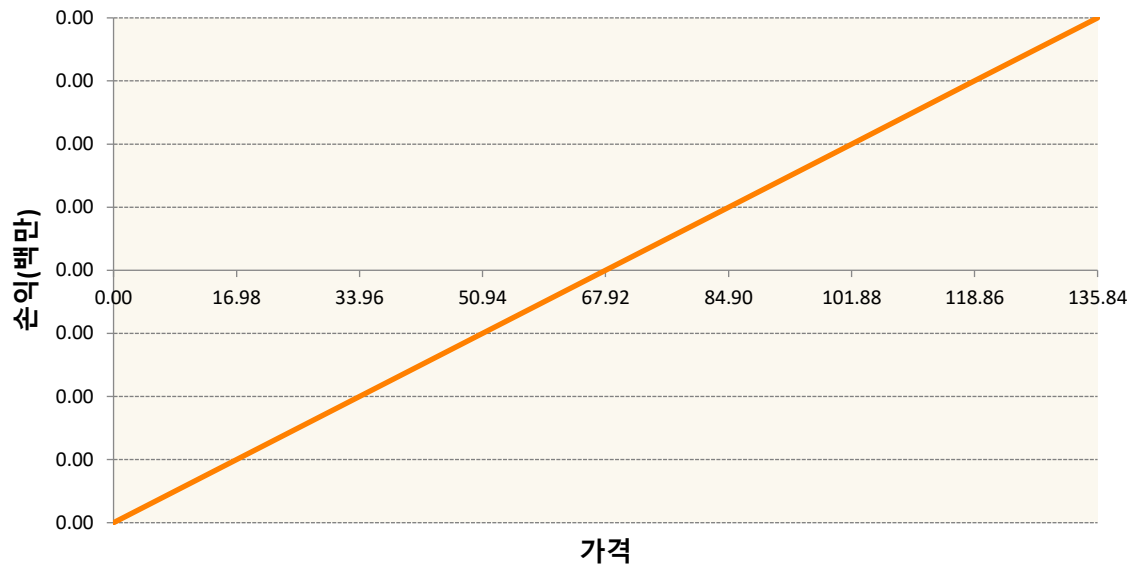
(단위:백만원)

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	778	0	778	
누계	통화	선물	0	98	-98	장내

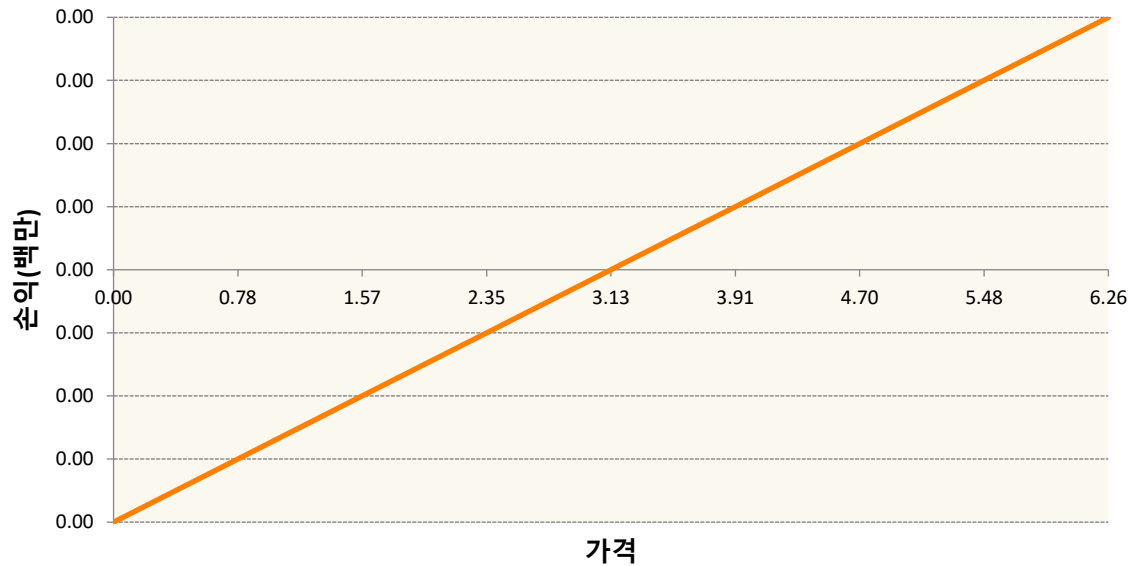
2. 만기시점의 손익구조



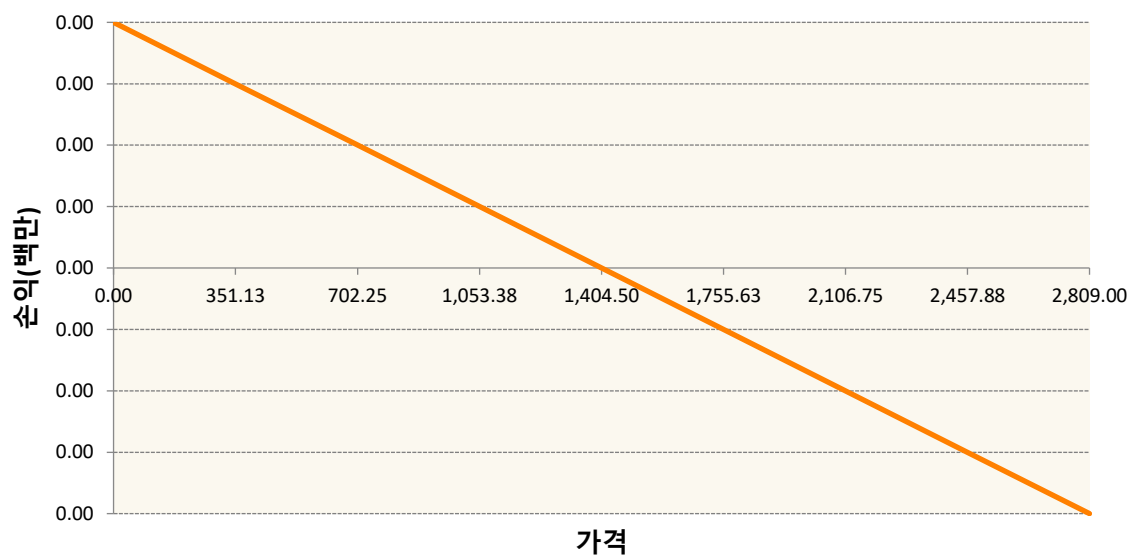
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



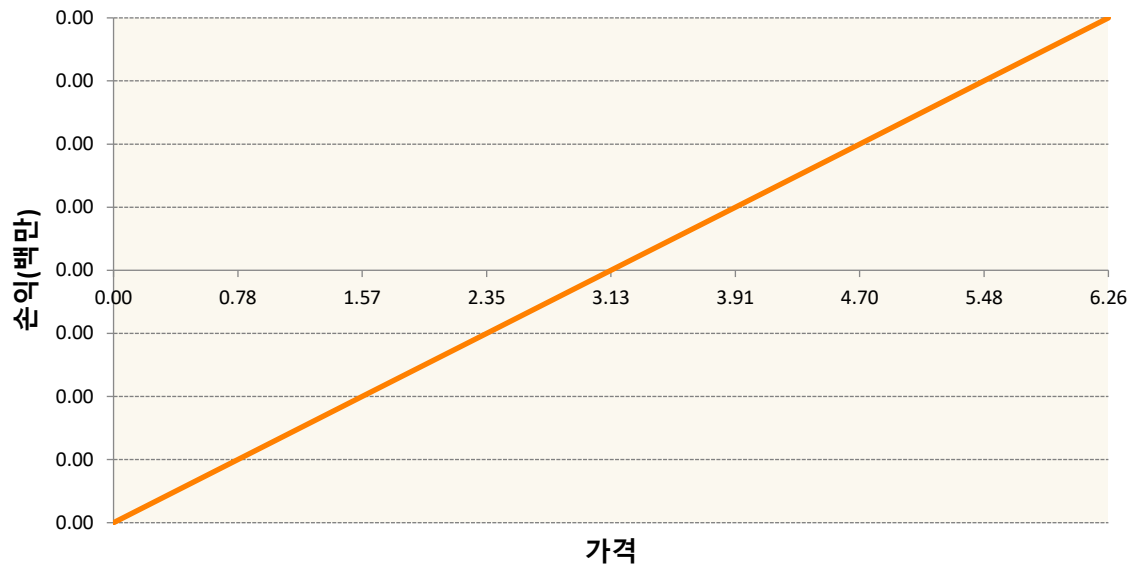
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



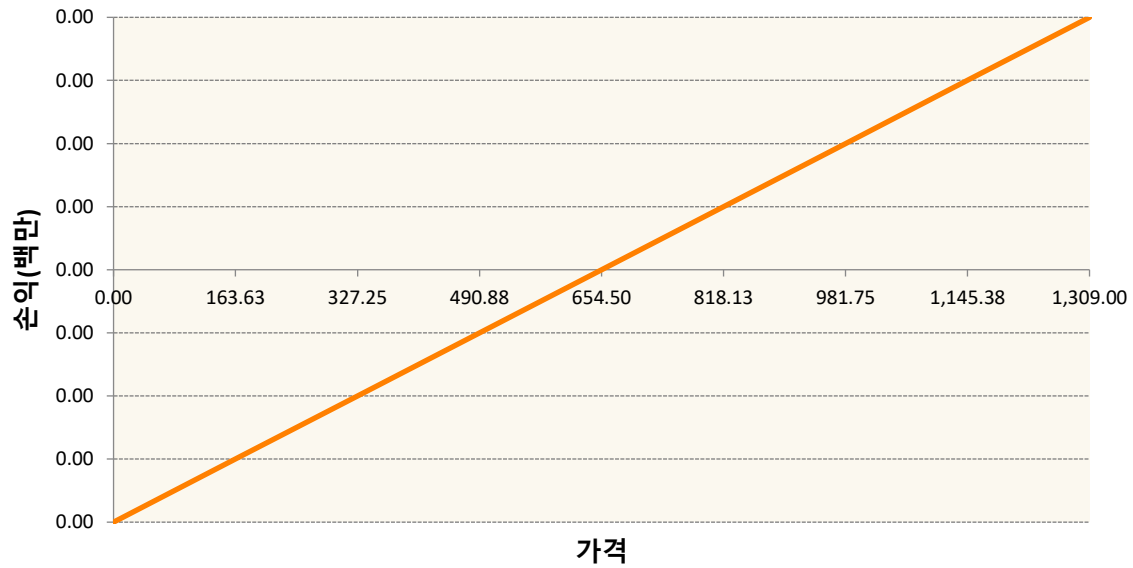
KR4175VB0006-2024-11 달러선물



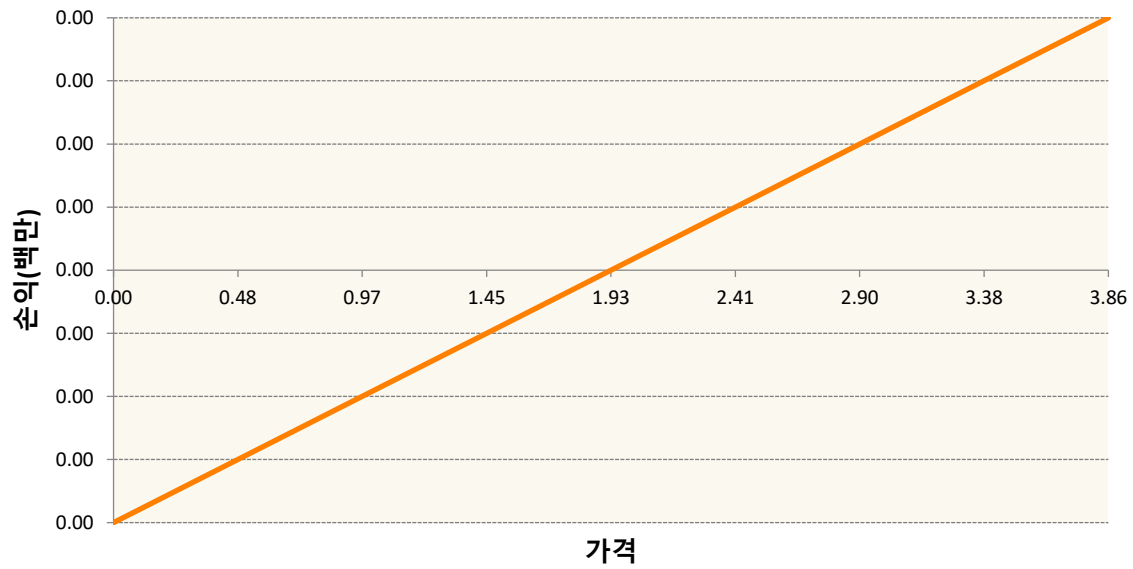
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



QSF5-Low Su Gasoil G Jan25



XBF5-GASOLINE RBOB FUT Jan25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF5	WTI CRUDE FUTURE Jan25	7
COH5	BRENT CRUDE FUTR Mar25	16
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)

137