

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

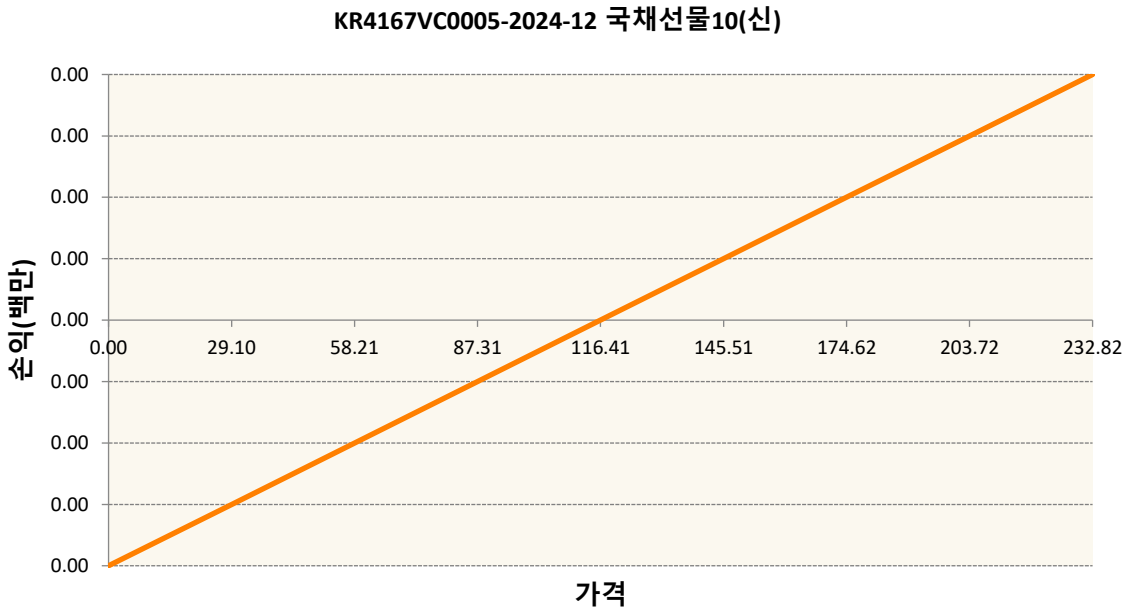
베스트장기채(채권-파생형)

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	149,587	0	149,587	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4167VC00 2024-12 국채선물10(신)	11,967
------------------------------	--------

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

3,973

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

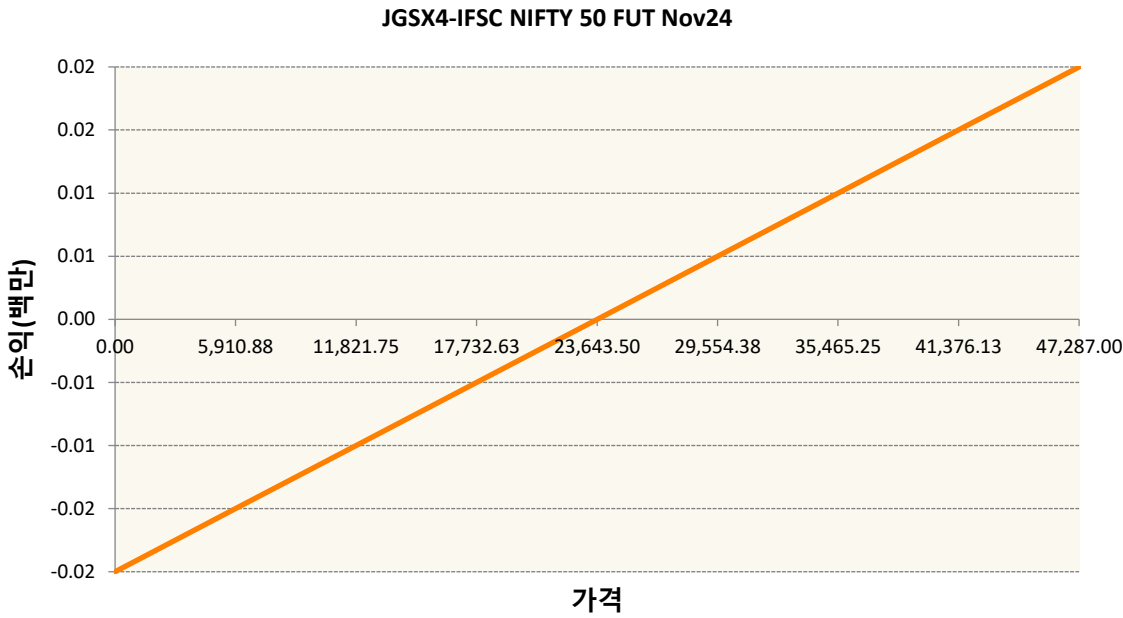
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,202	0	3,202	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSX4	IFSC NIFTY 50 FUT Nov24	256
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

166

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

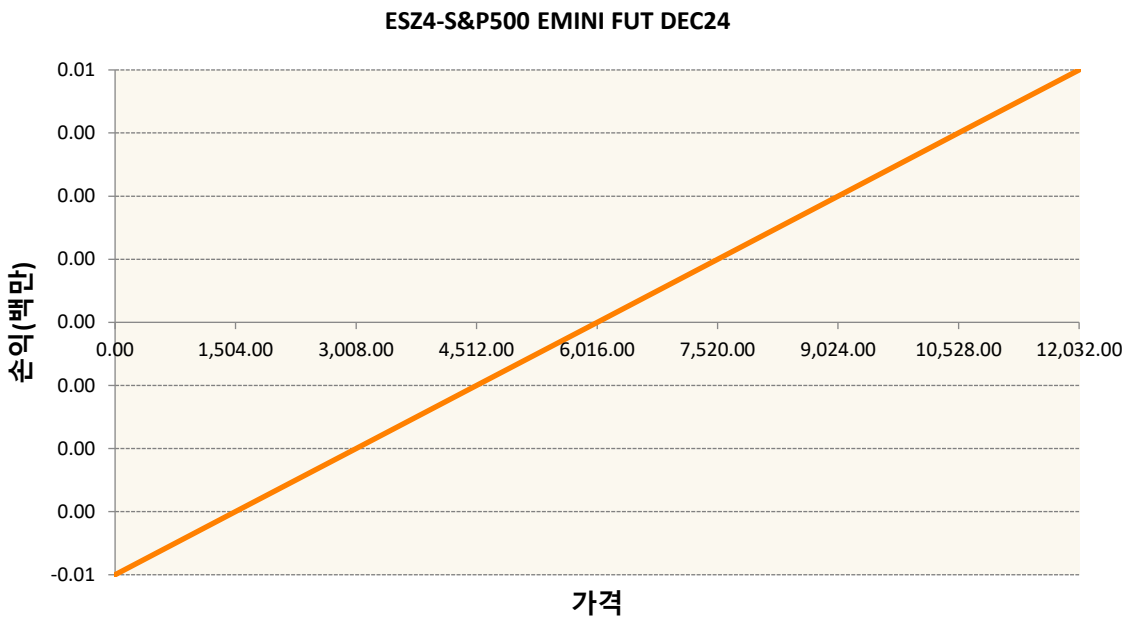
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	824	0	824	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	66
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

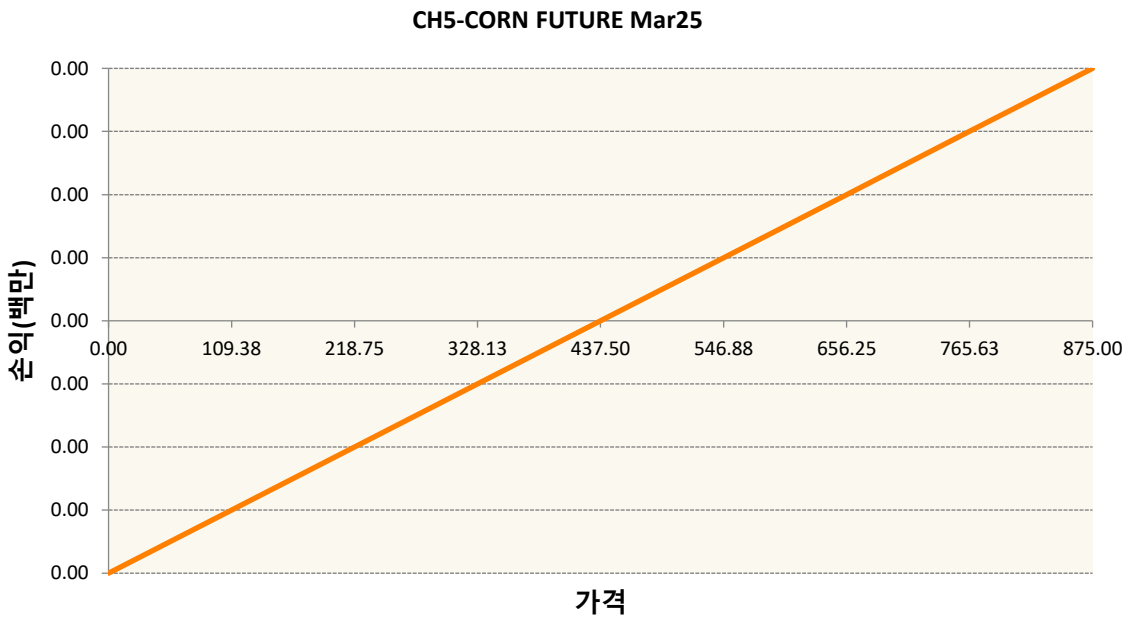
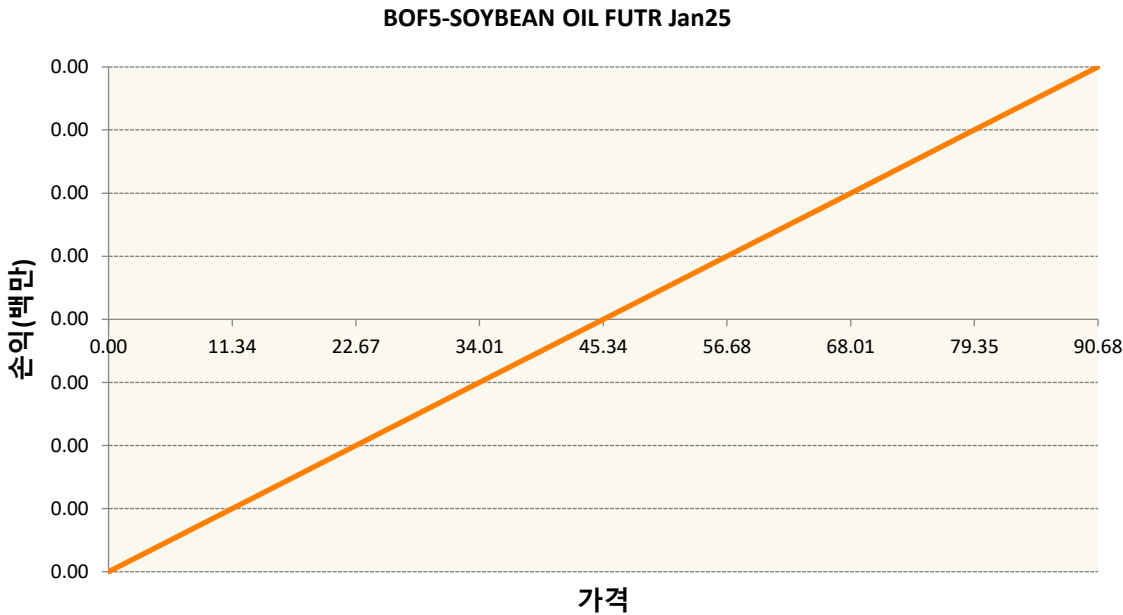
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

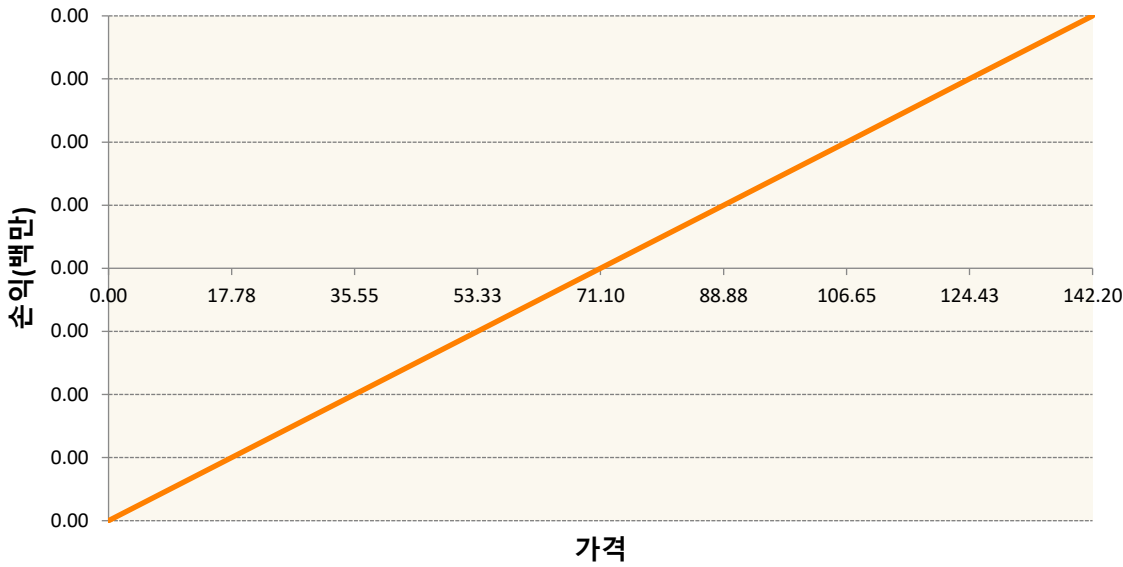
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	548	-548	장내
누계	유가증권	선물	3,772	0	3,772	
누계	통화	선물	0	548	-548	장내

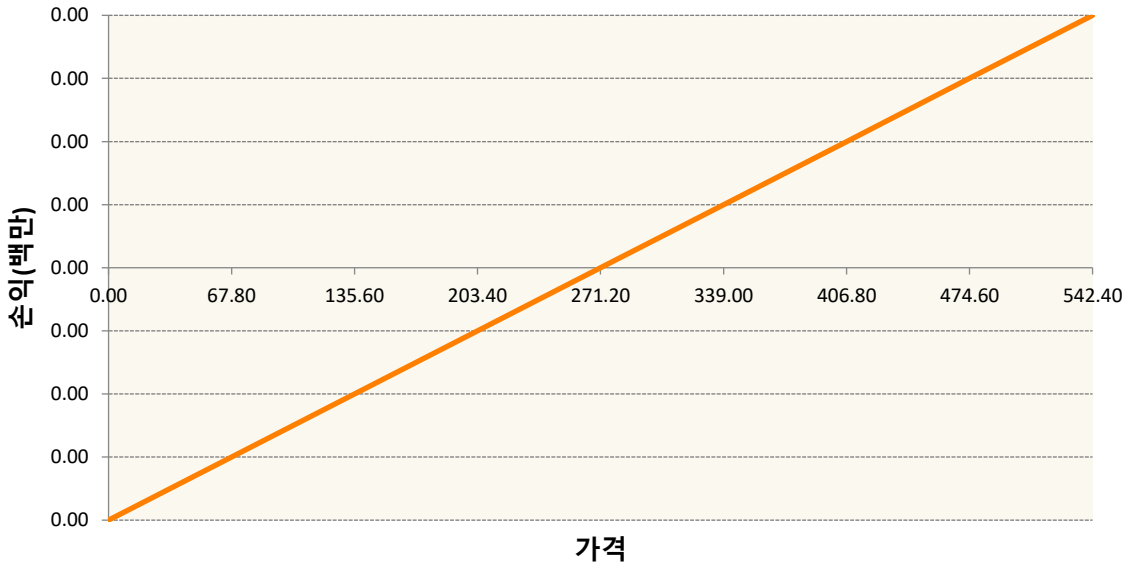
2. 만기시점의 손익구조



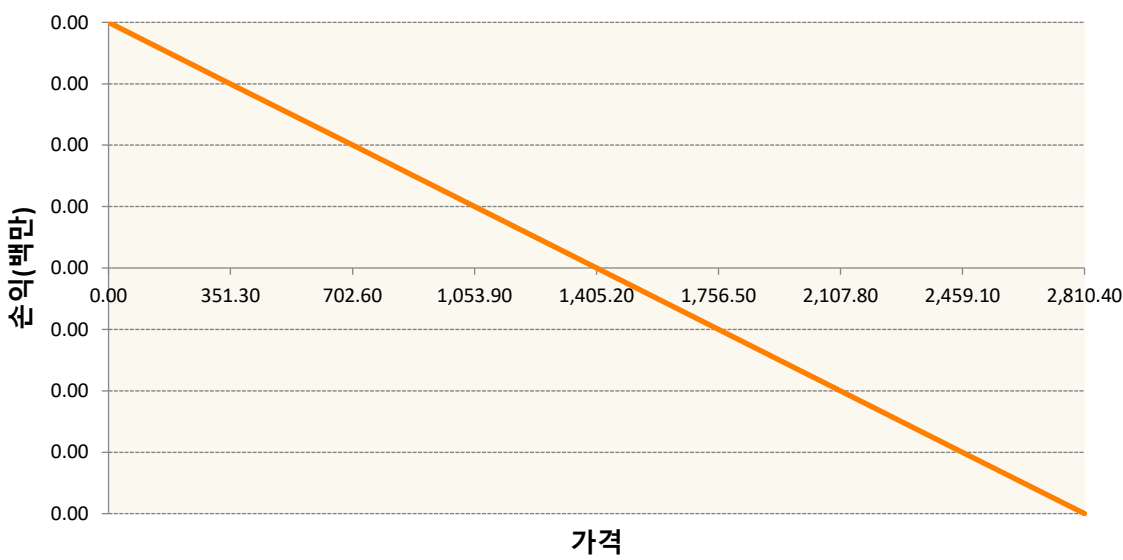
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



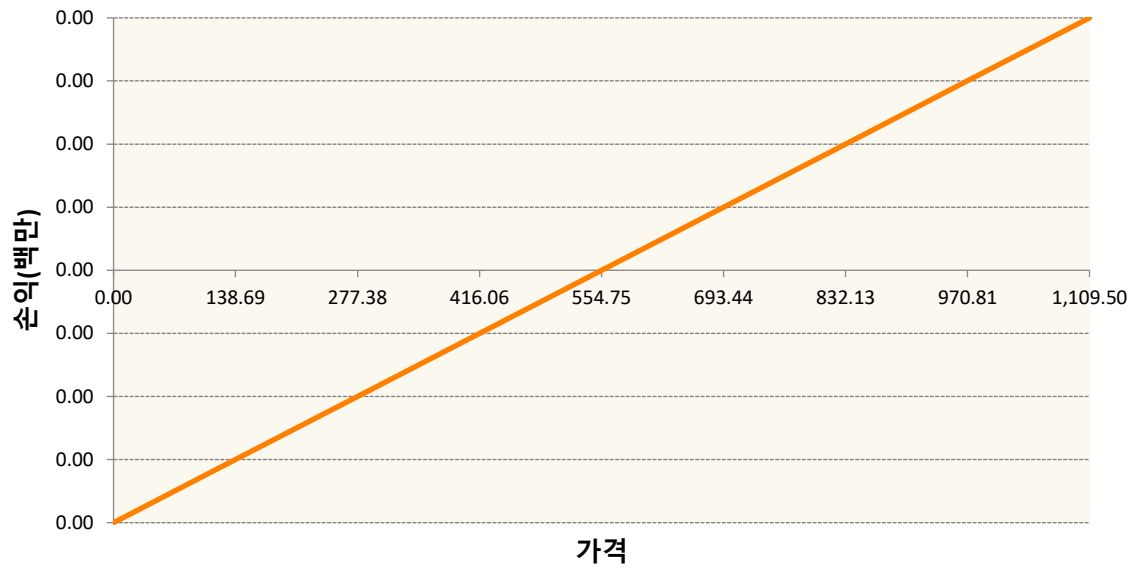
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



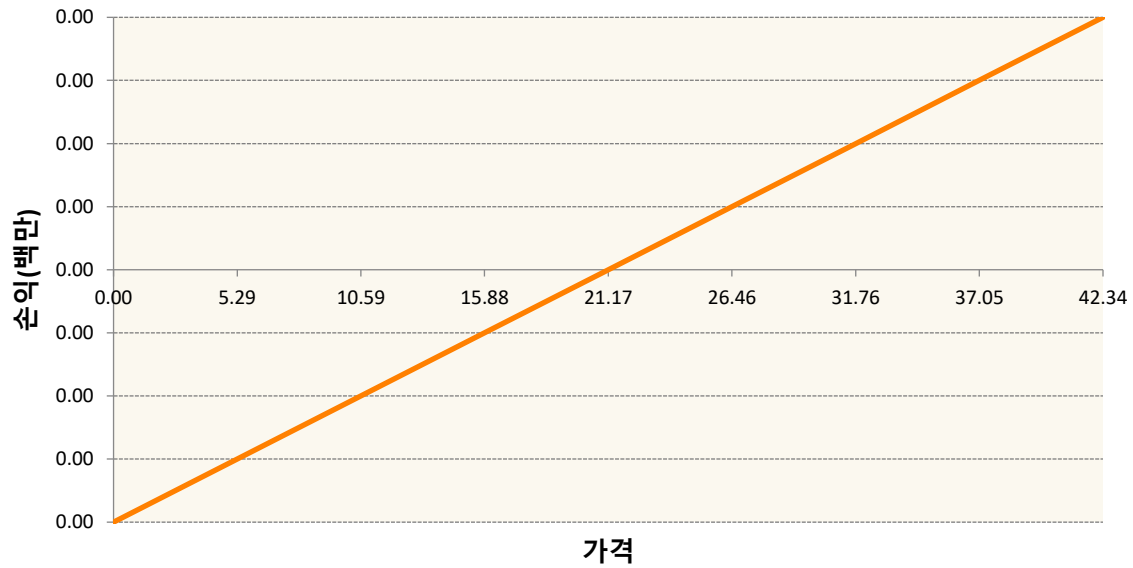
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



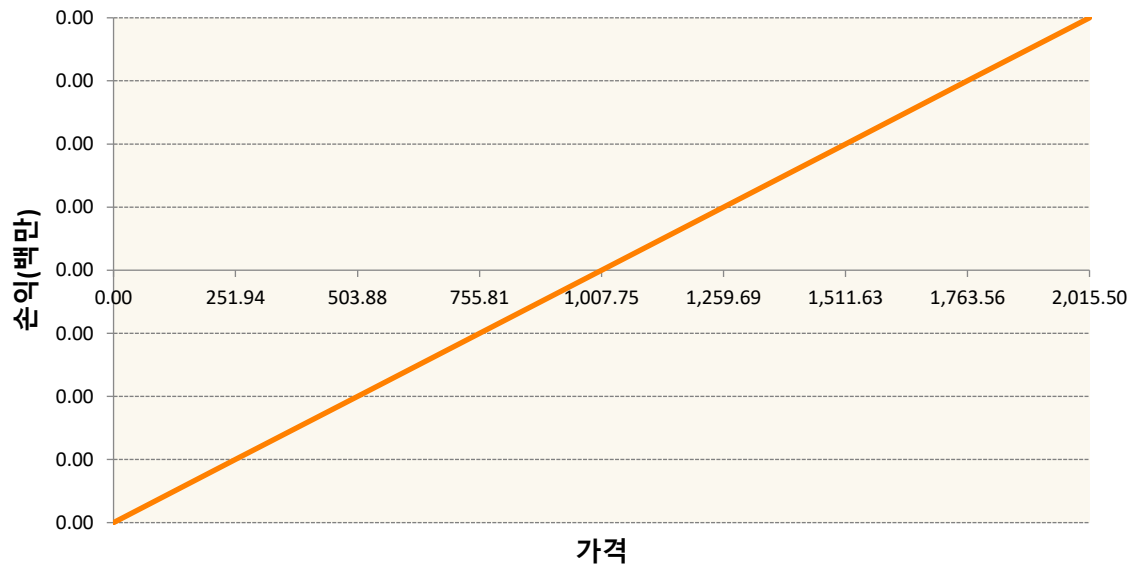
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



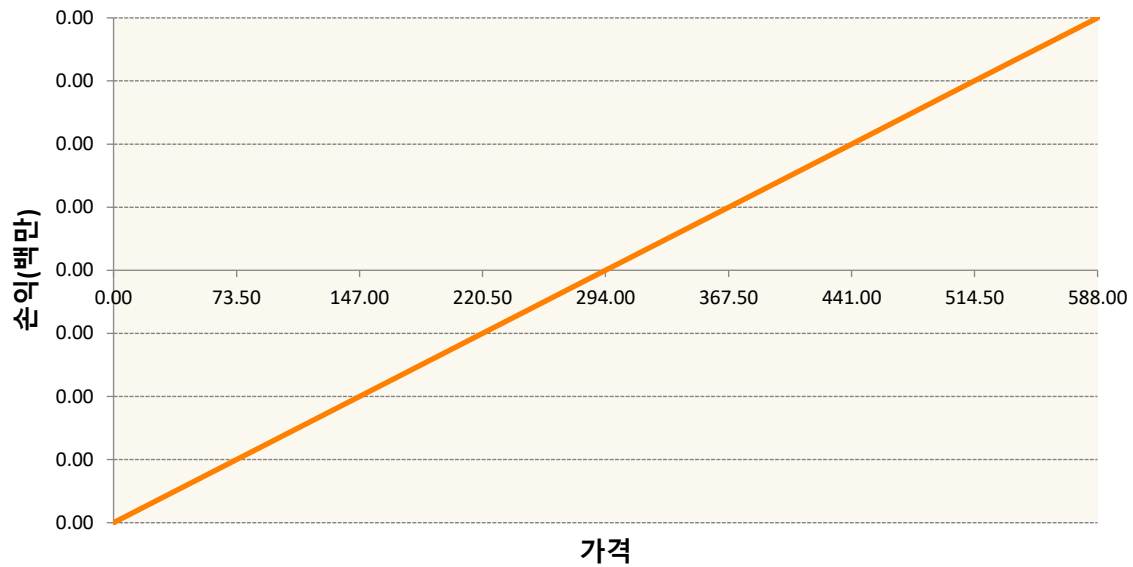
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



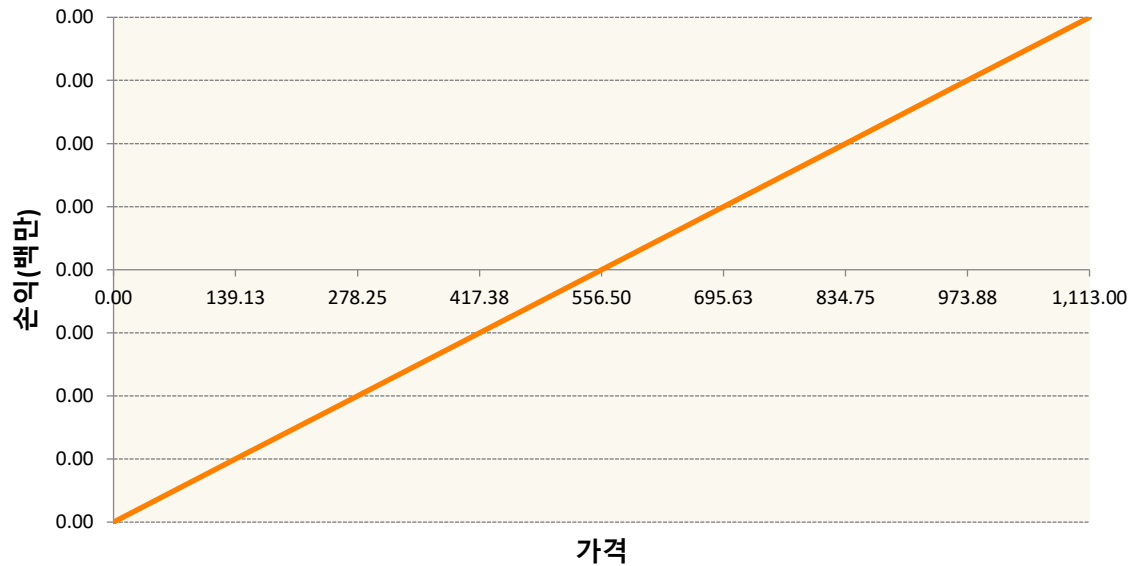
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-11-15
기준일	2024-11-14

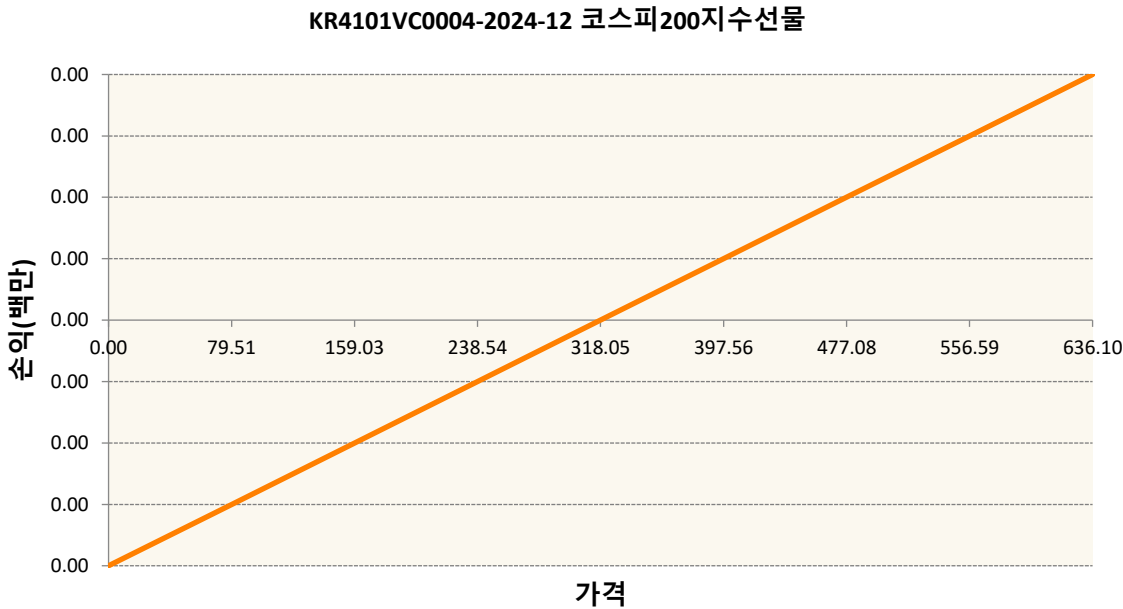
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,268	3,197	72	장내
누계	유가증권	선물	1,749	0	1,749	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				140
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140
-5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	47	47	47	47	47	47	47
5.33%	93	93	93	93	93	93	93
8.00%	140	140	140	140	140	140	140

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

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	322
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

522

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

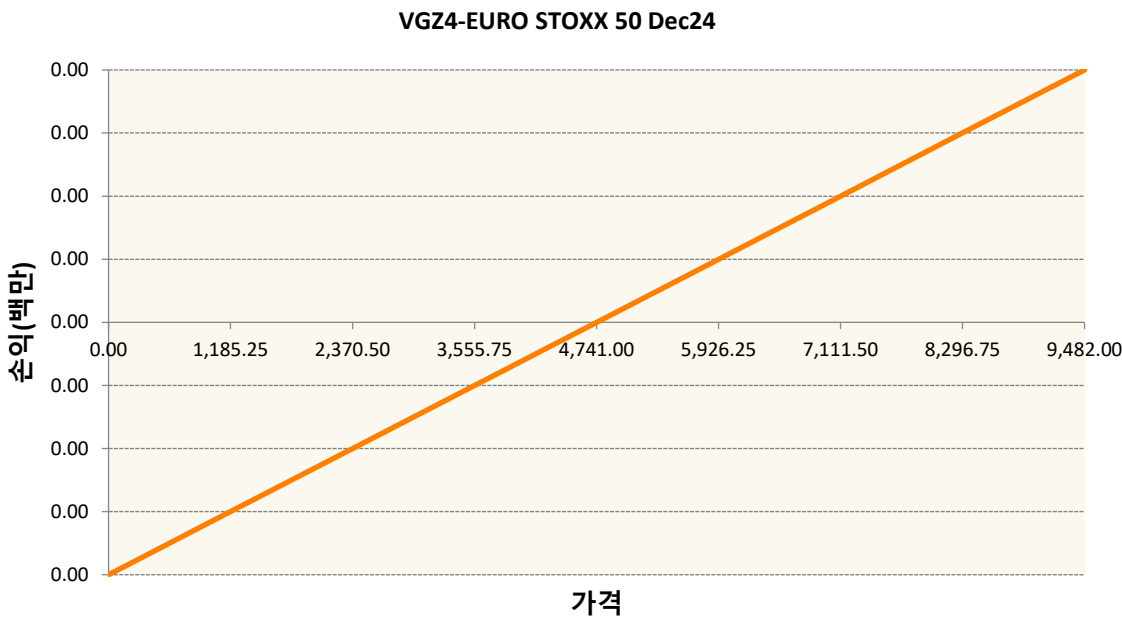
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	916	0	916	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ4 EURO STOXX 50 Dec24

73

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

(단위:백만원)

50

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

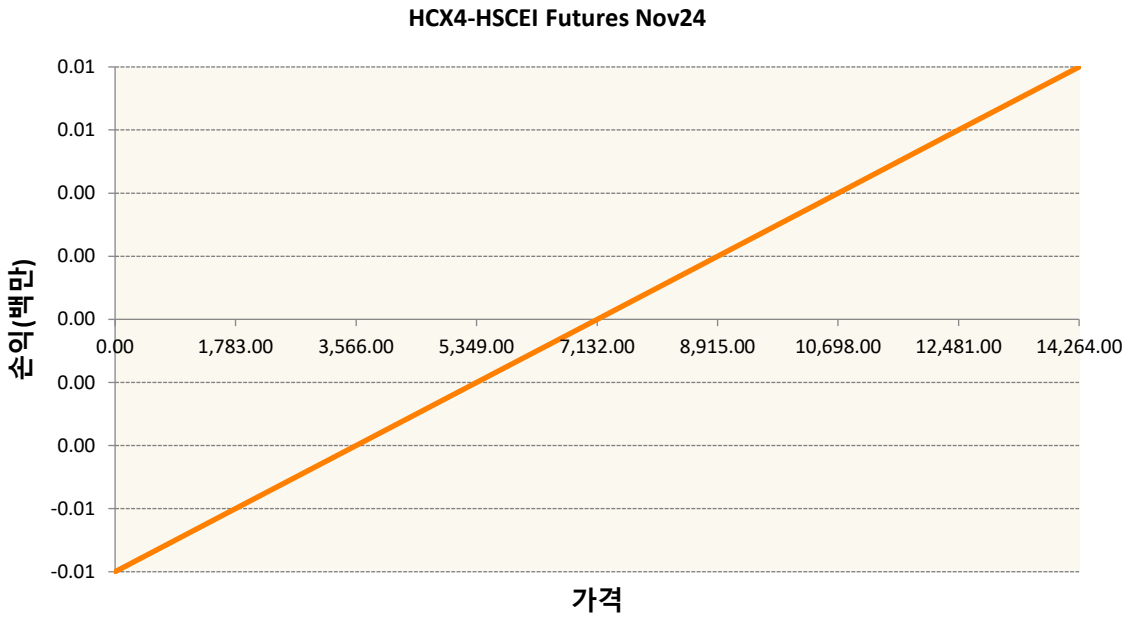
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,397	0	1,397	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX4	HSCEI Futures Nov24	112
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

154

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

커버드콜모(주식혼합-파생형)

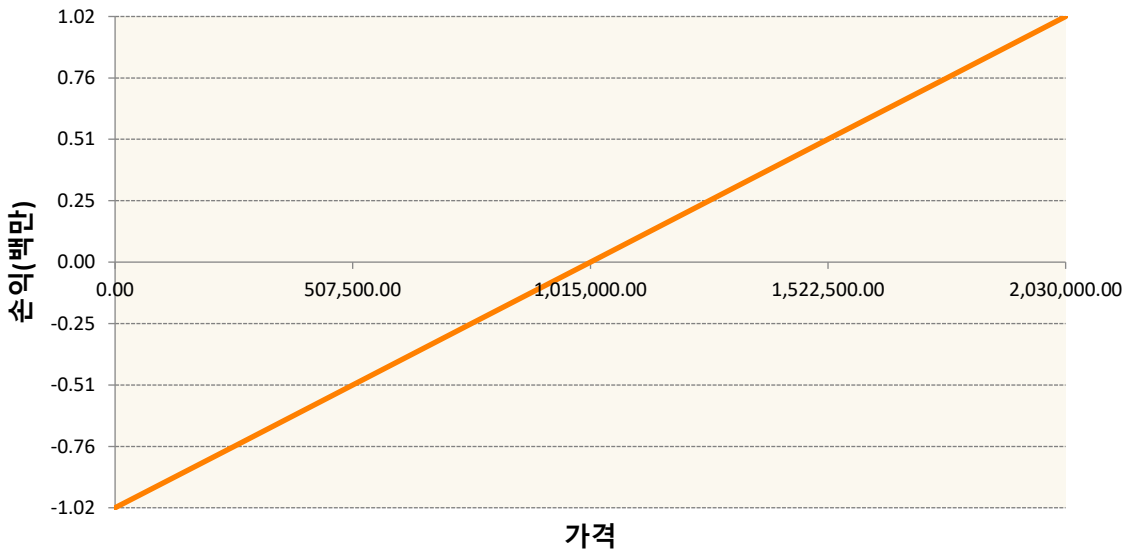
1. 계약금액

(단위:백만원)

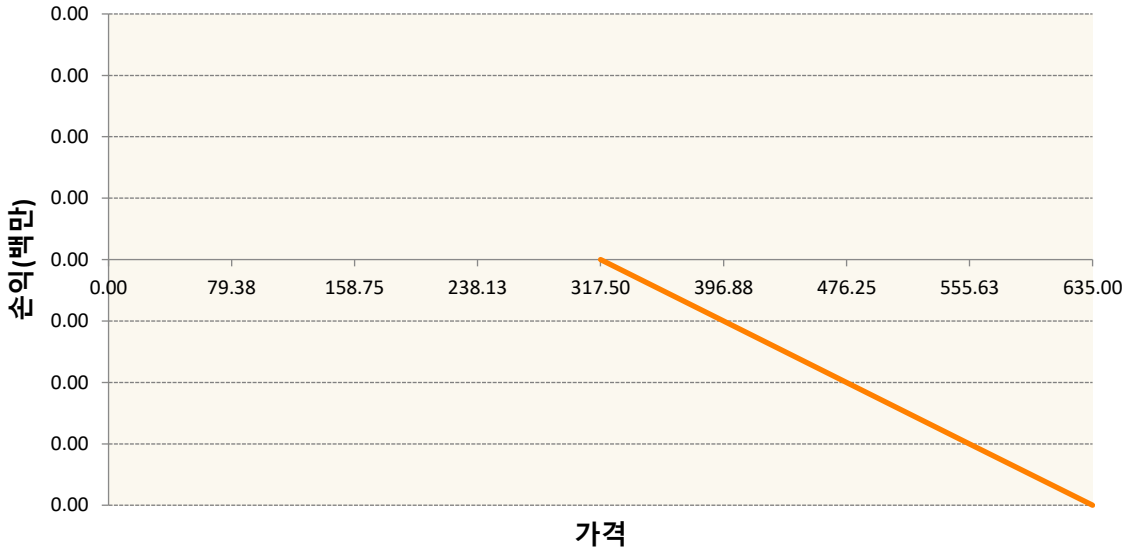
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	23,607	-23,607	장내
누계	유가증권	선물	264	0	264	장내
누계	유가증권	옵션	0	23,096	-23,096	장내

2. 만기시점의 손익구조

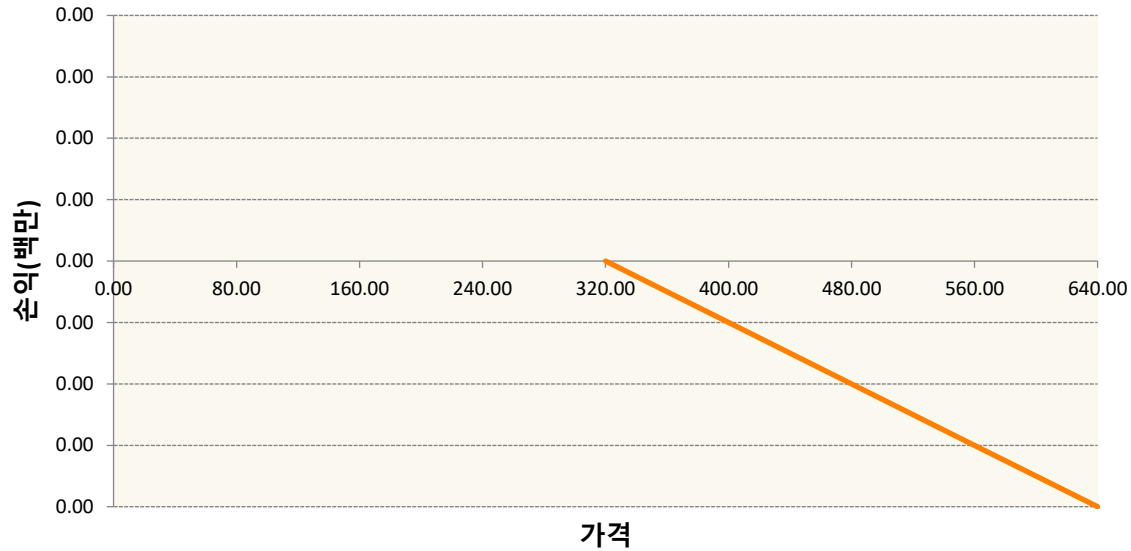
KR41B3VC0008-2024-12 고려아연개별선물



KR4201VC3171-2024-12 콜317.5



KR4201VC3205-2024-12 콜320



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR41B3VC0008			2024-12 고려아연개별선물				21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-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%	21	21	21	21	21	21	21
KR4201VC3171			2024-12 콜317.5				191
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	83	81	78	75	71	67	63
-5.33%	74	70	66	61	55	50	45
-2.67%	55	49	43	36	30	23	17
0%	21	14	7	0	-7	-14	-21
2.67%	-30	-36	-42	-49	-56	-62	-69
5.33%	-95	-99	-104	-109	-115	-120	-126
8.00%	-169	-171	-175	-178	-182	-187	-191
KR4201VC3205			2024-12 콜320				1,177
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	464	453	439	422	402	380	356
-5.33%	424	400	374	346	315	283	249
-2.67%	325	288	249	210	170	129	88
0%	136	90	45	0	-45	-91	-136

2.67%	-160	-203	-247	-291	-335	-380	-425
5.33%	-551	-584	-619	-656	-695	-734	-774
8.00%	-1,011	-1,032	-1,056	-1,083	-1,112	-1,143	-1,177

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

(단위:백만원)

1,307

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

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	667	0	667	

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	2024-11-15
기준일	2024-11-14

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	4,389	0	4,389	

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	2024-11-15
기준일	2024-11-14

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	13,837	0	13,837	
누계	통화	선도	0	14,402	-14,402	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E	590
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)

512

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

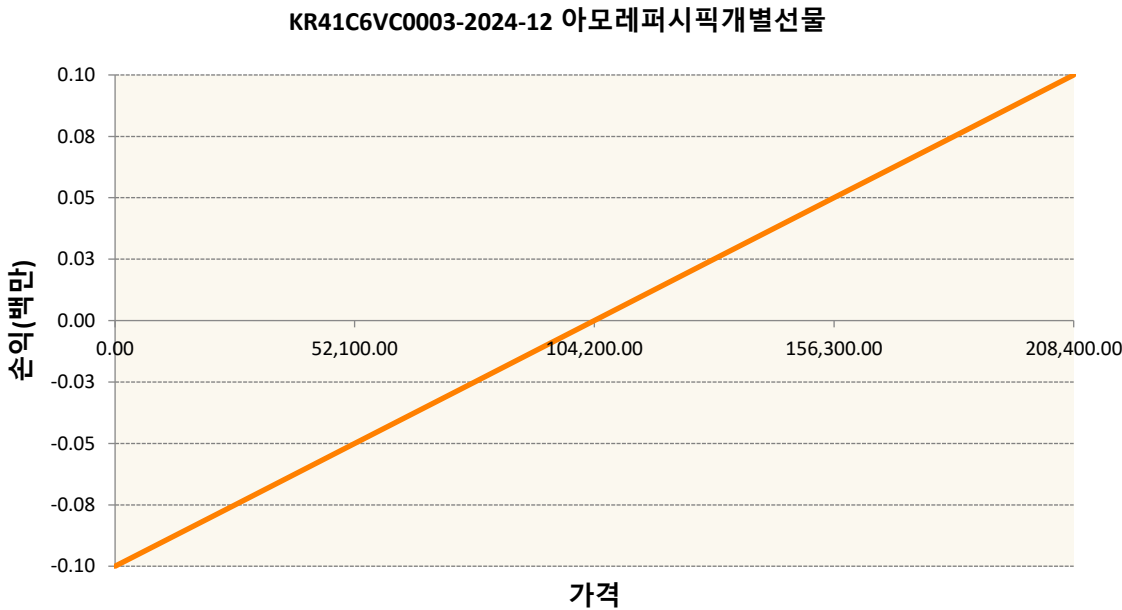
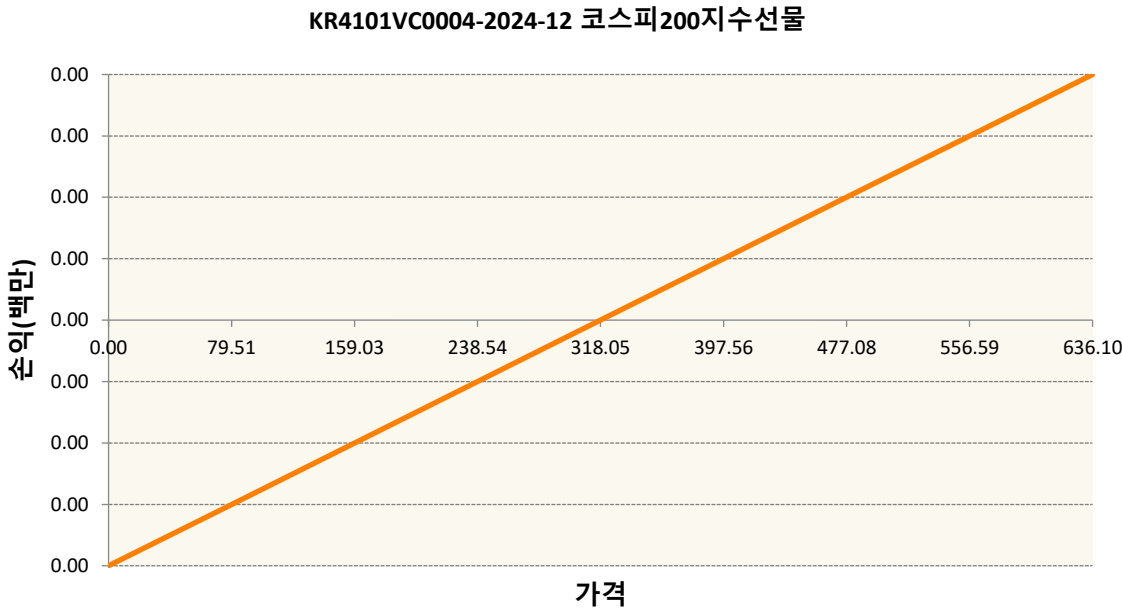
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	758	0	758	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격	손익(백만)
0.00	-0.02
5,525.00	-0.015
11,050.00	-0.01
16,575.00	-0.005
22,100.00	0.00
27,625.00	0.005
33,150.00	0.01
38,675.00	0.015
44,200.00	0.02

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 288,800.00. The y-axis, labeled '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -0.14 to 0.14. A solid orange line represents the relationship, starting at (0, -0.14) and ending at (288,800, 0.14). The line crosses the x-axis at approximately 144,400.00, where profit is zero.

가격 (Price)	손익 (백만) (Profit/Loss in millions)
0.00	-0.14
72,200.00	-0.07
144,400.00	0.00
216,600.00	0.07
288,800.00	0.14

(단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					57
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	38	38	38	38	38	38	38
8.00%	57	57	57	57	57	57	57
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
KR41CNVC0004 2024-12 포스코 ICT개별선물							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

KR41GLVC0002 2024-12 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

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

(단위:백만원)

70

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

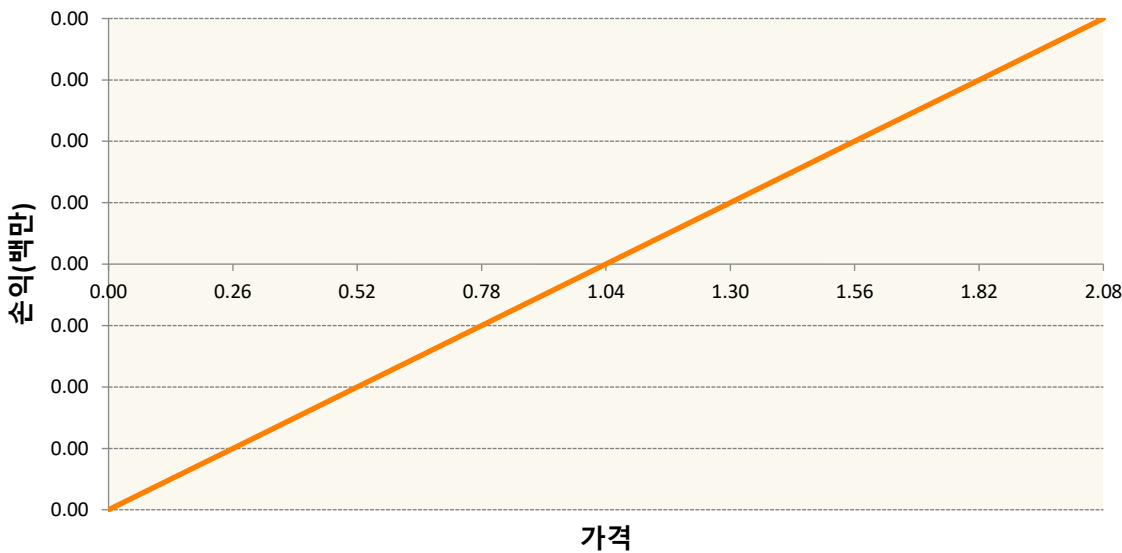
1. 계약금액

(단위:백만원)

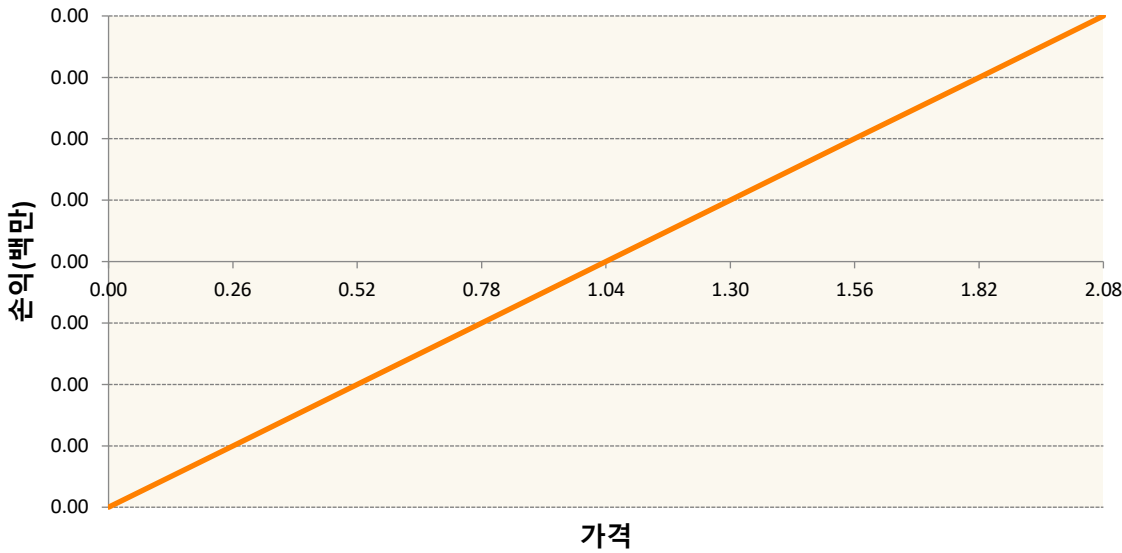
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,754	0	11,754	

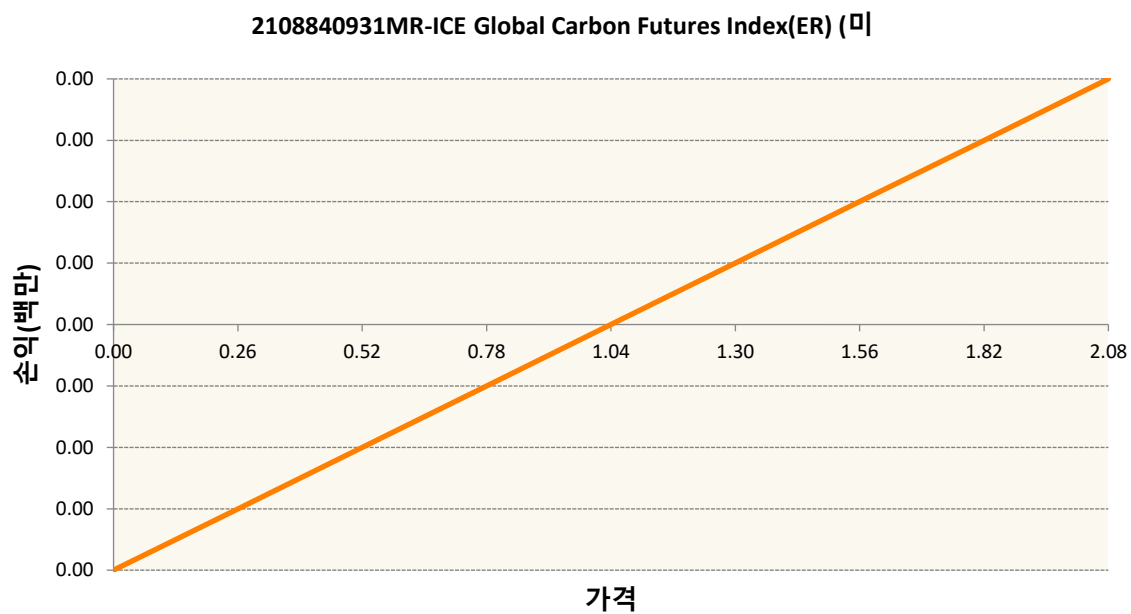
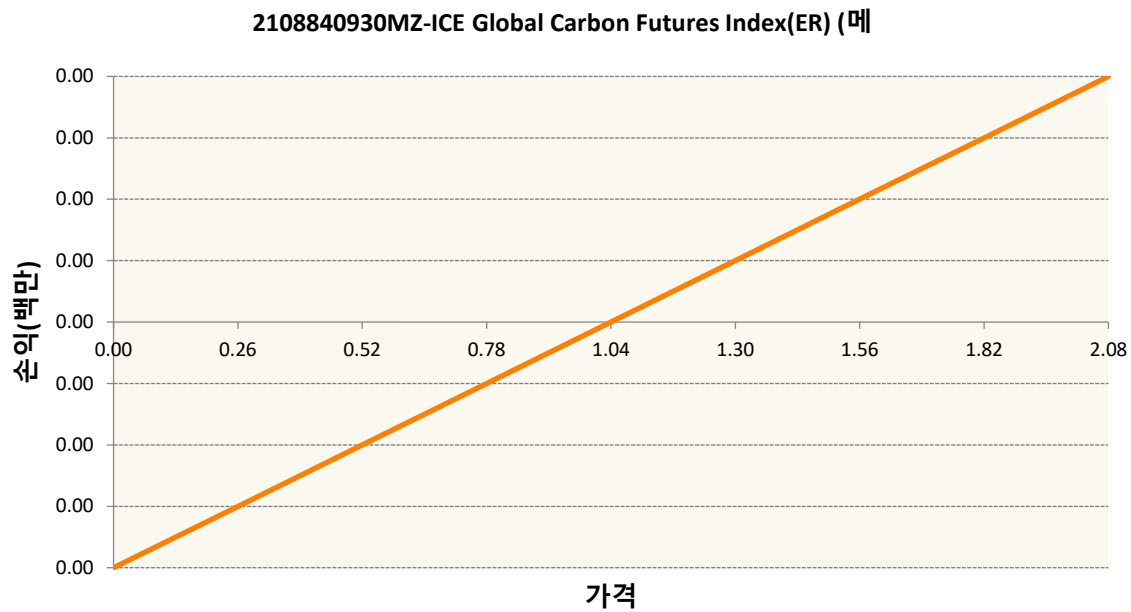
2. 만기시점의 손익구조

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		472
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)
	1,020

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

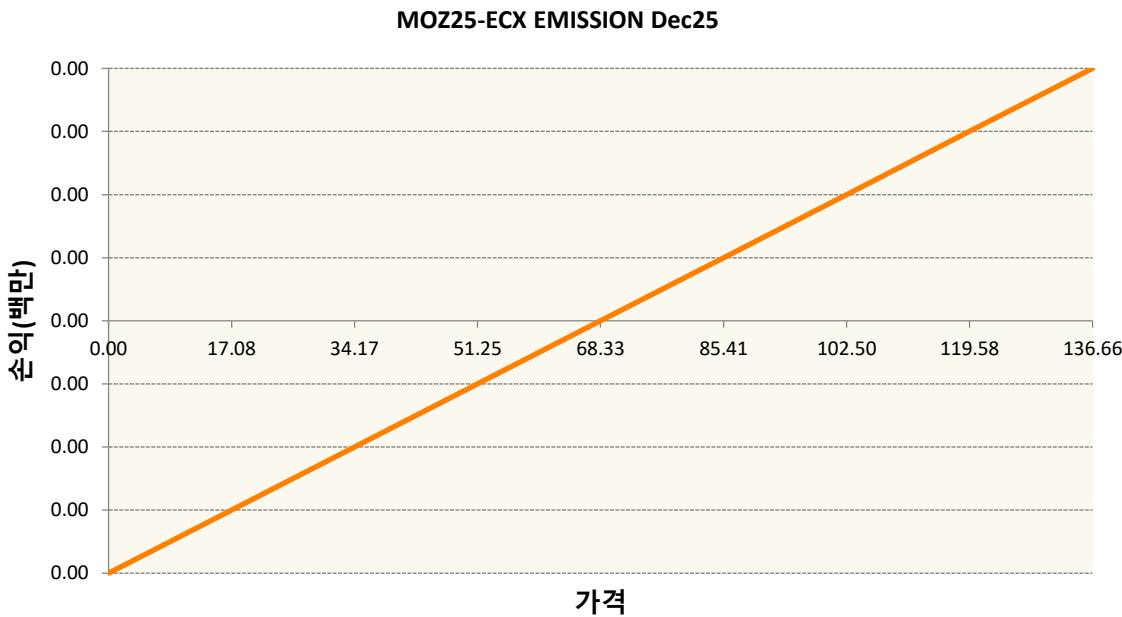
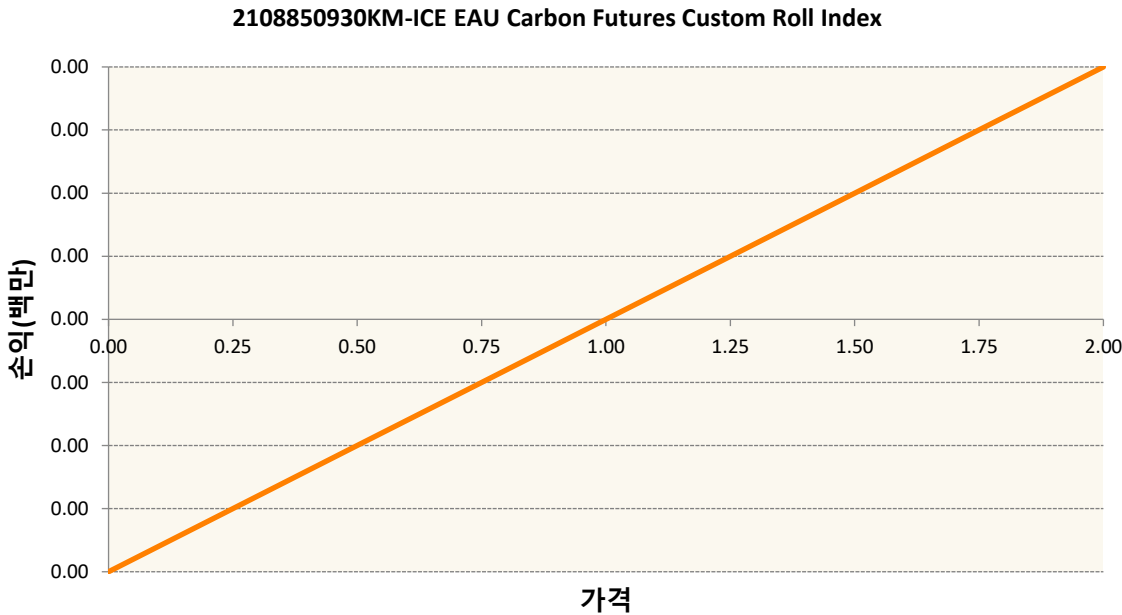
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,357	0	8,357	
누계	통화	선도	0	1,901	-1,901	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		0.12
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E		11
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E		141
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		669

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,196

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

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	2024-11-15
기준일	2024-11-14

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)	74
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	63
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	89
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	18

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

(단위:백만원)

398

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

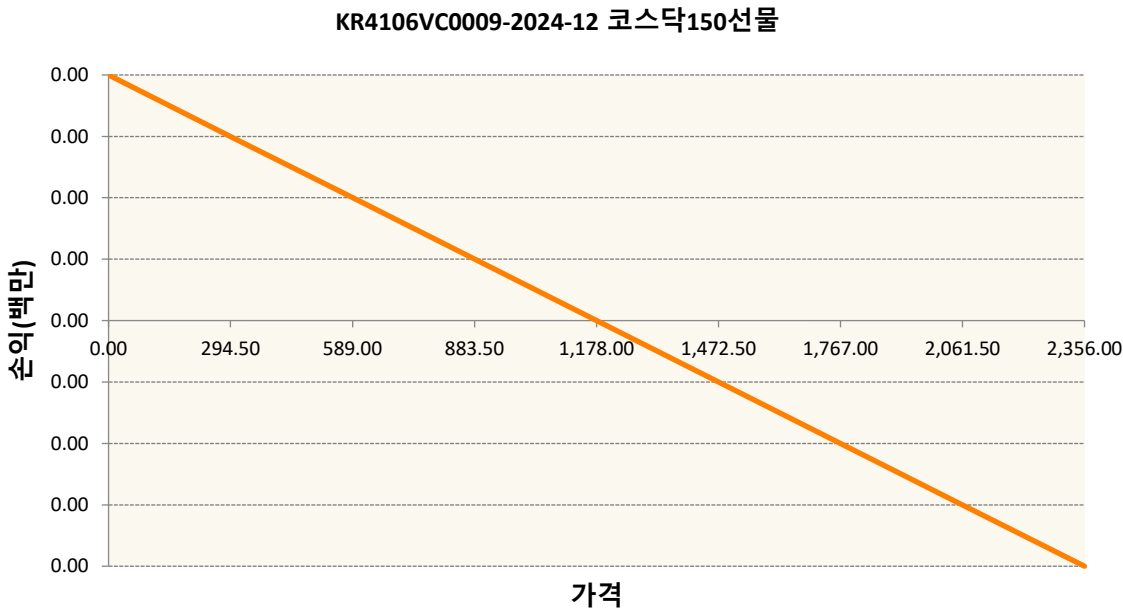
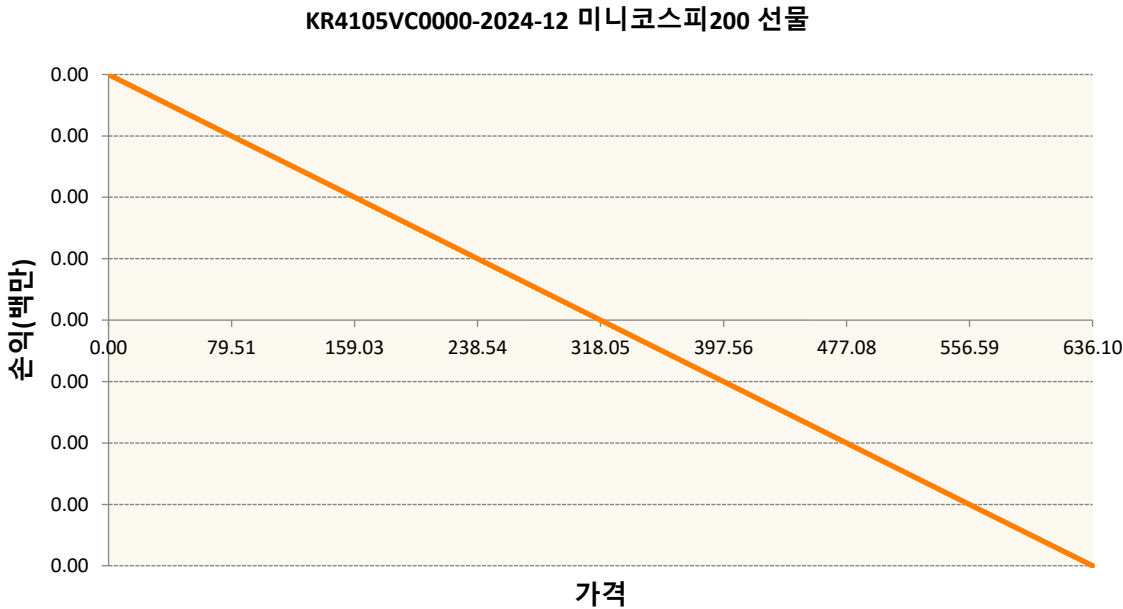
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

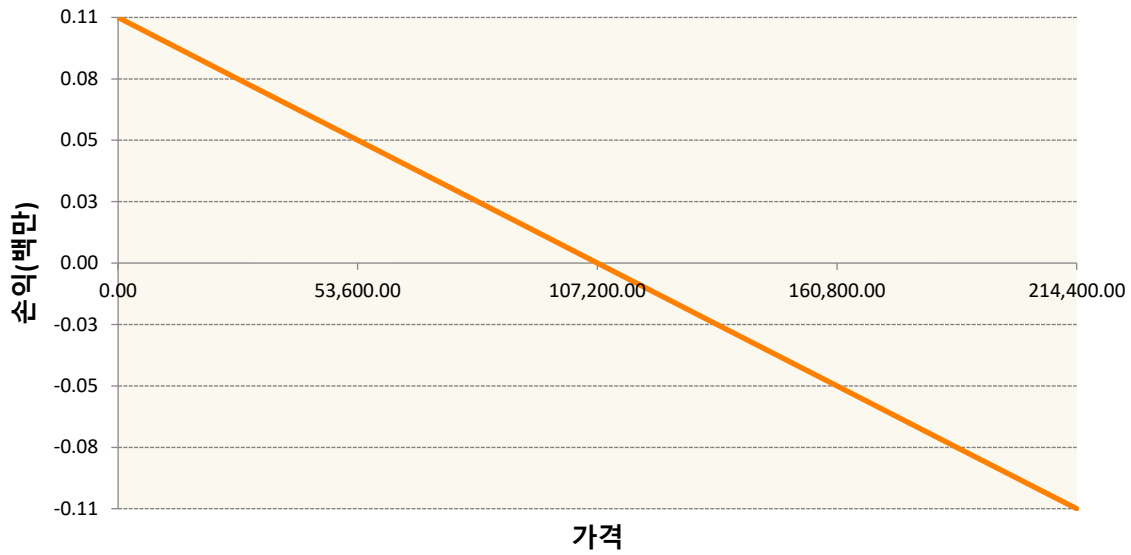
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5	100	-95	장내
누계	유가증권	선물	5	152	-147	장내

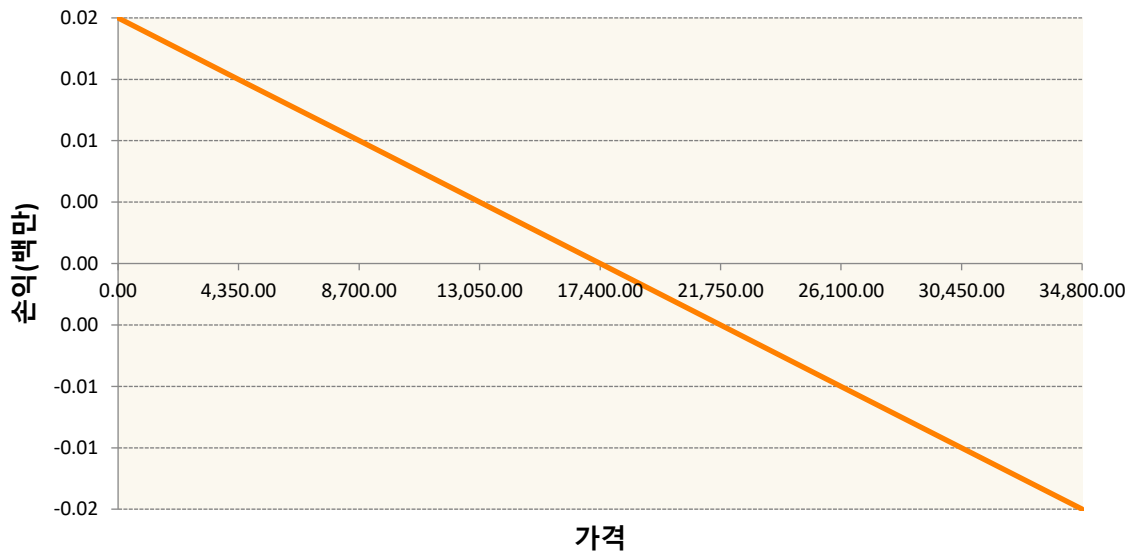
2. 만기시점의 손익구조



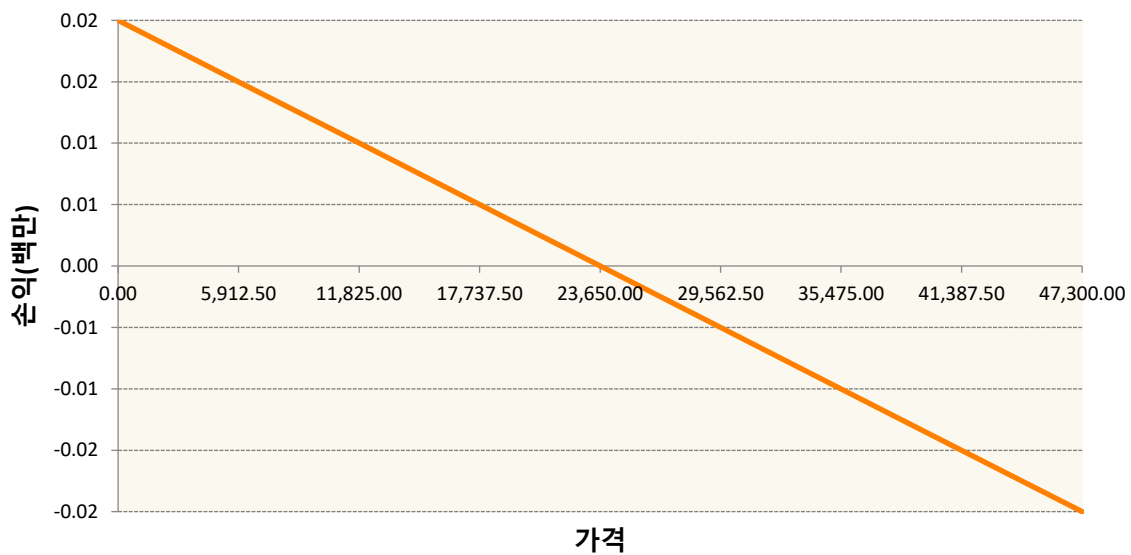
KR4123VC0008-2024-12 삼성전기개별선물



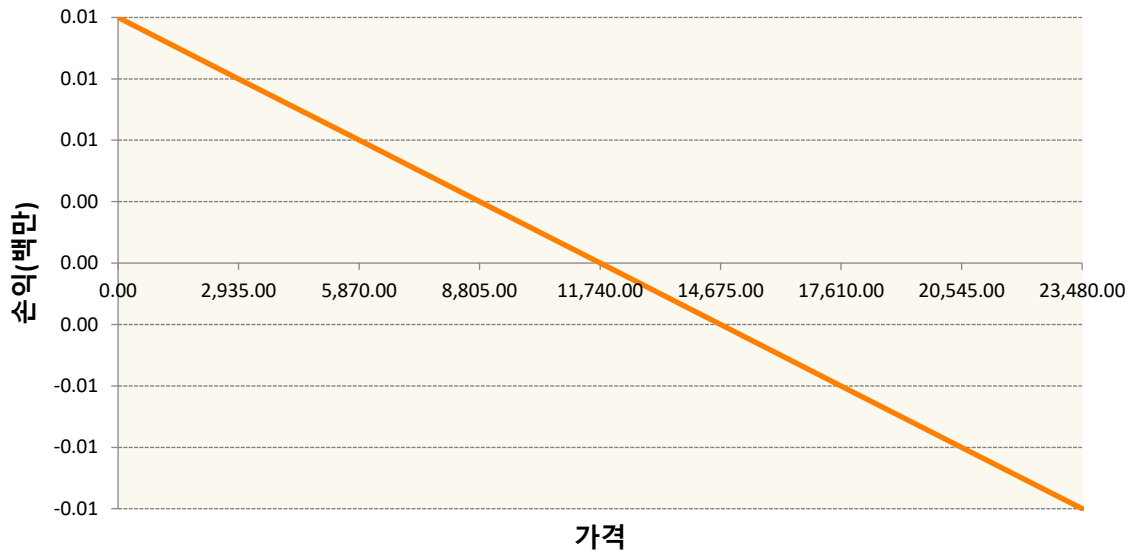
KR4151VC0003-2024-12 GS건설개별선물



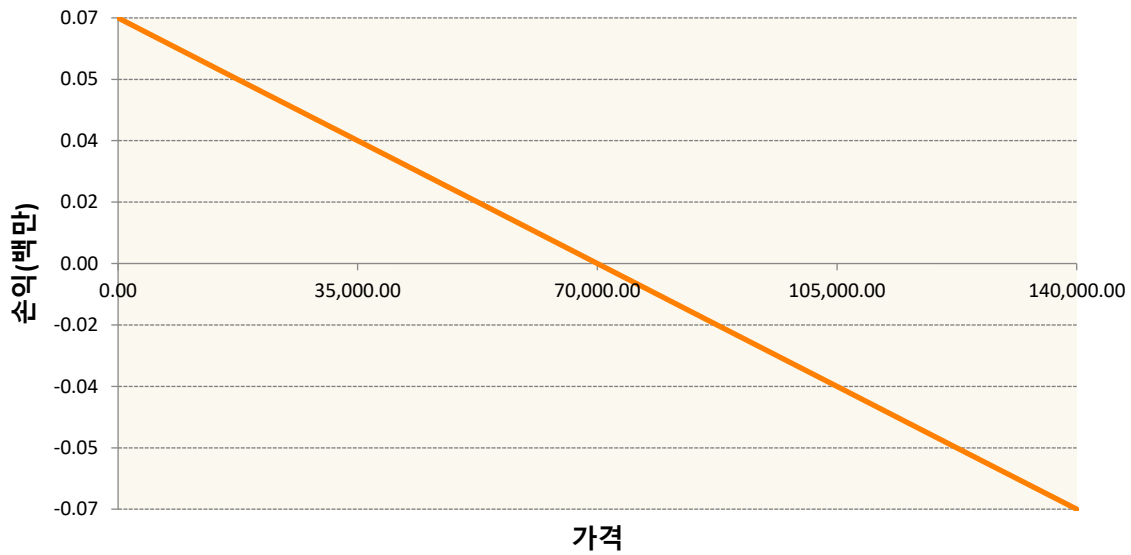
KR4157VC0007-2024-12 대한항공개별선물



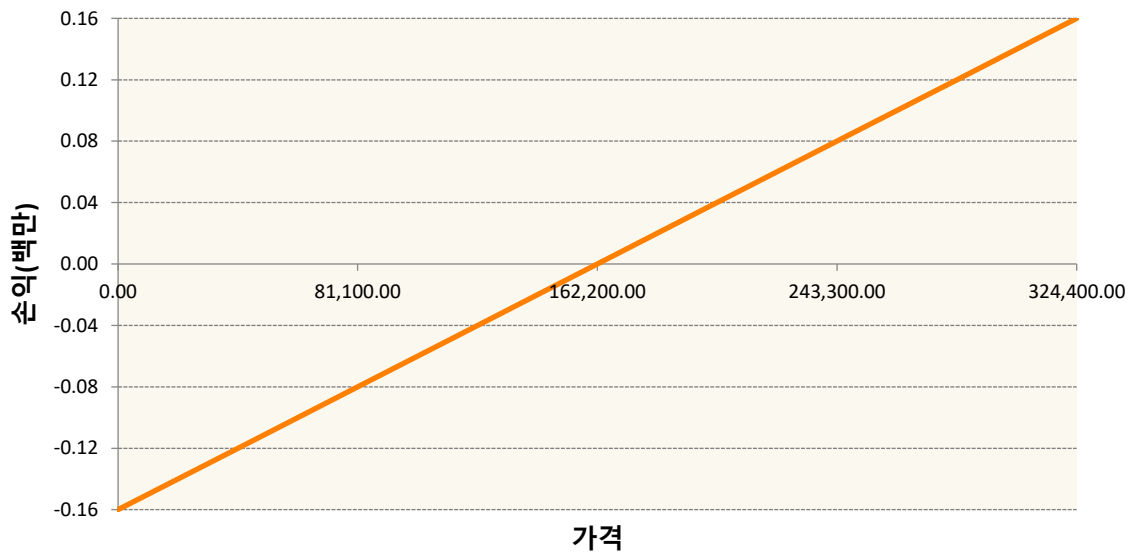
KR41BFVC0005-2024-12 삼성중공업개별선물



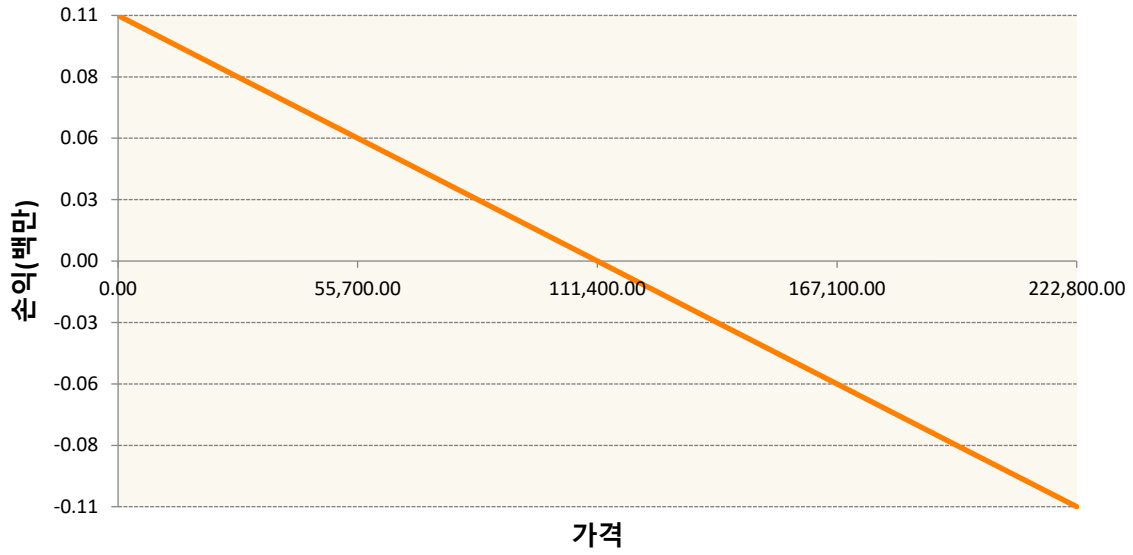
KR41BMVC0006-2024-12 한국항공우주개별선물



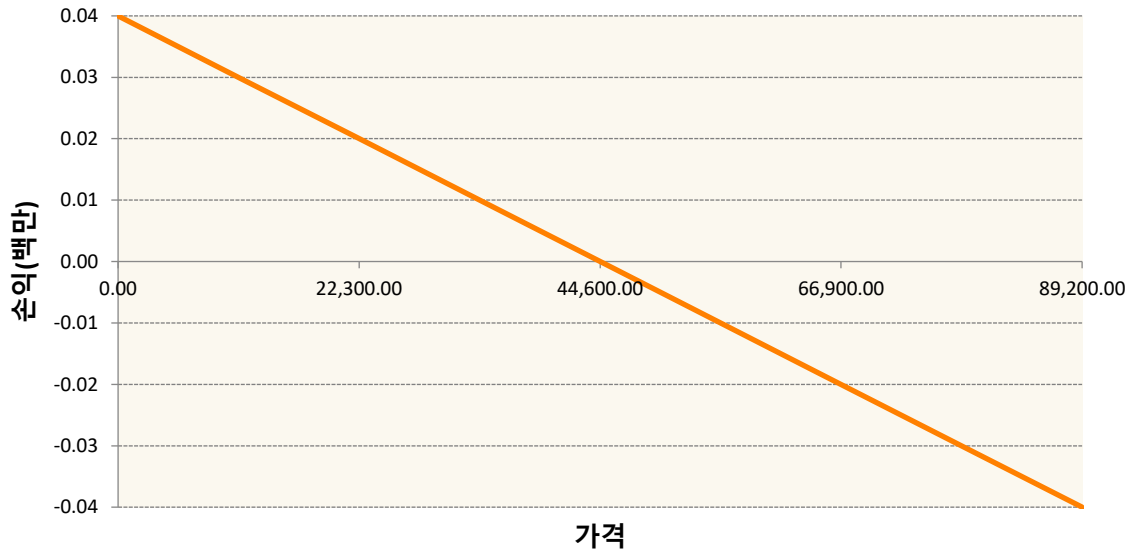
KR41BYVC0002-2024-12 LG이노텍개별선물



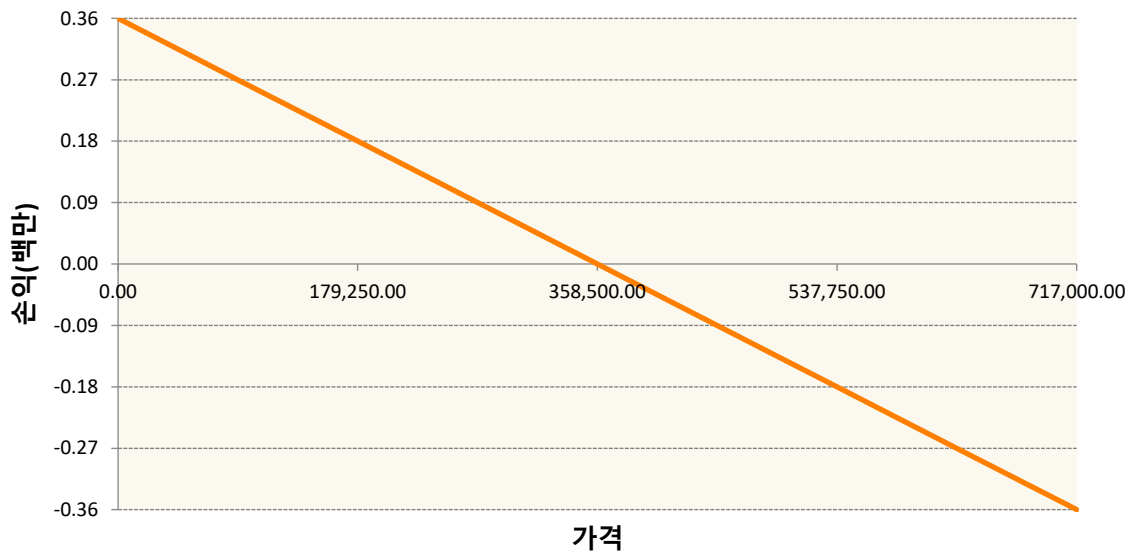
KR41CDVC0006-2024-12 현대미포조선개별선물



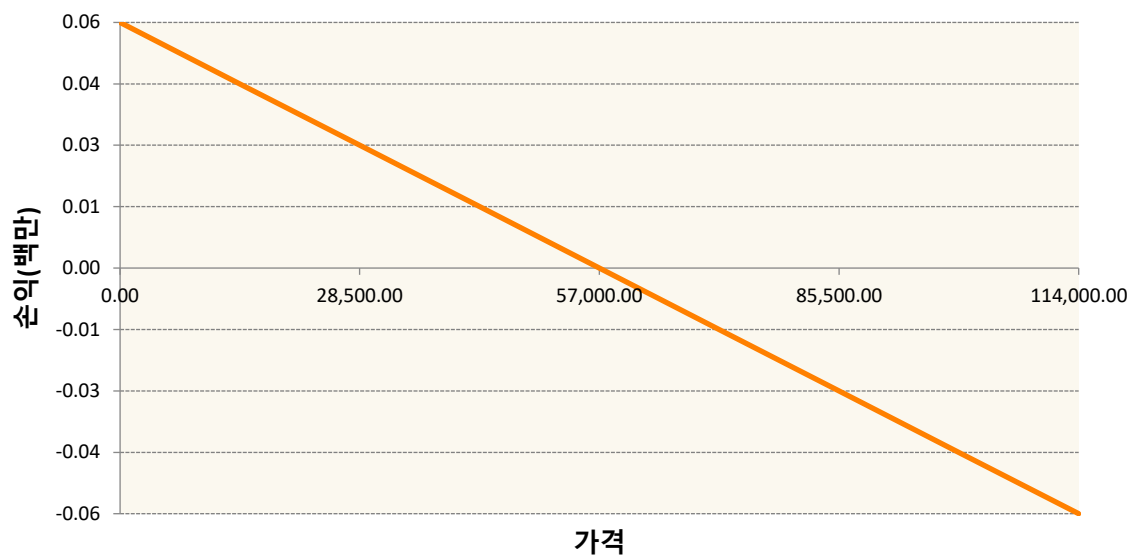
KR41CQVC0001-2024-12 와이지엔터테인먼트개별선물



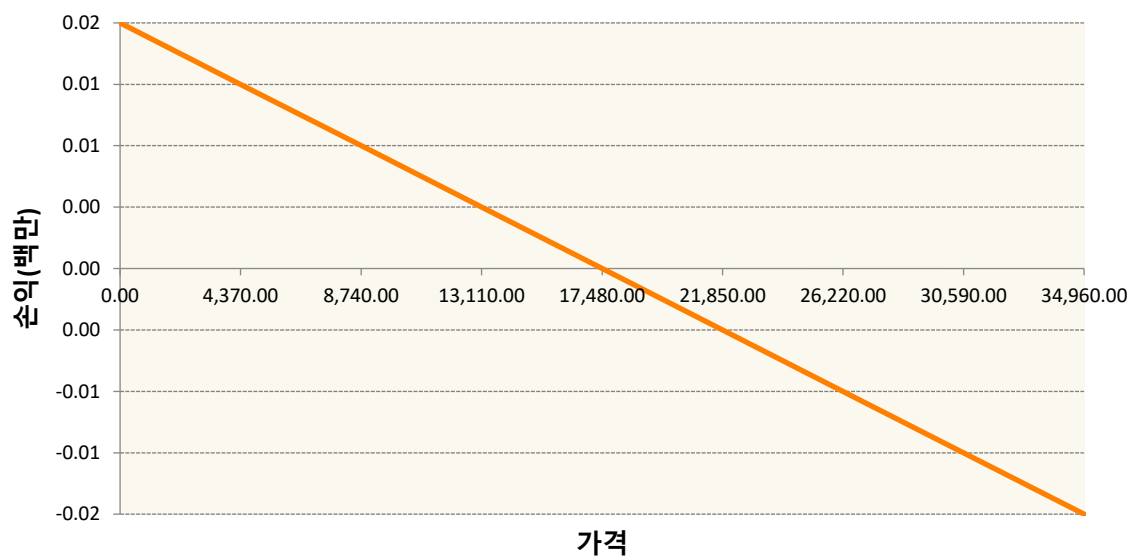
KR41DAVC0008-2024-12 농심개별선물



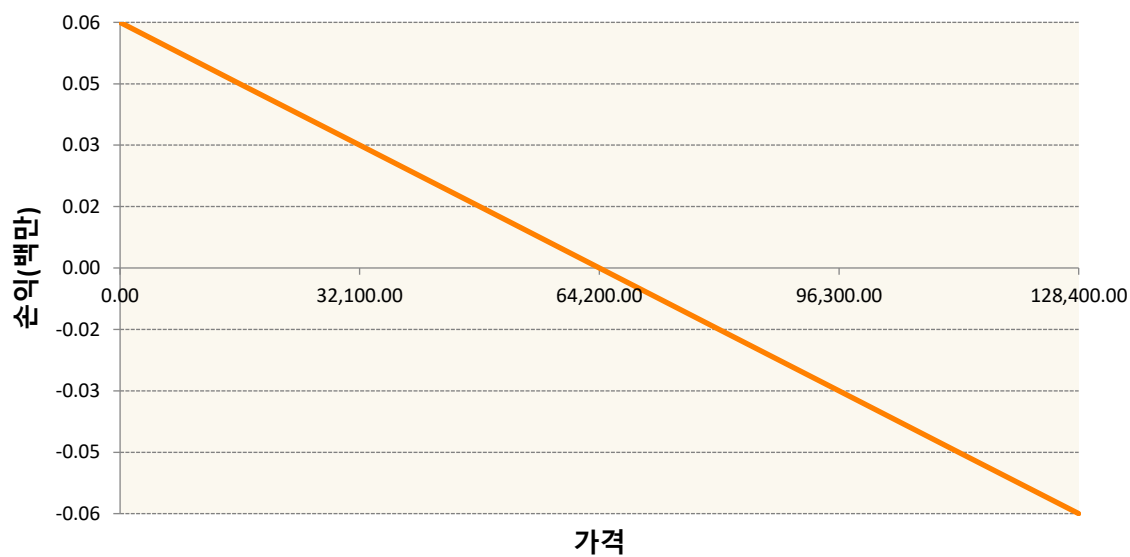
KR41EFVC0002-2024-12 JYP Ent.개별선물



KR41FAVC0006-2024-12 HMM개별선물



KR41G6VC0004-2024-12 현대로템개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4105VC00 2024-12 미니코스피200 선물		1
KR4106VC00 2024-12 코스닥150선물		1
KR4123VC00 2024-12 삼성전기개별선물		0.34
KR4151VC00 2024-12 GS건설개별선물		1
KR4157VC00 2024-12 대한항공개별선물		0.26
KR41BFVC00 2024-12 삼성중공업개별선물		0.28
KR41BMVC0 2024-12 한국항공우주개별선물		1
KR41BYVC00 2024-12 LG이노텍개별선물		0.39
KR41CDVC00 2024-12 현대미포조선개별선물		0.36
KR41CQVC00 2024-12 와이지엔터테인먼트개별선물		1
KR41DAVC00 2024-12 농심개별선물		0.29
KR41EFVC00 2024-12 JYP Ent.개별선물		0.36
KR41FAVC00 2024-12 HMM개별선물		0.28
KR41G6VC00 2024-12 현대로템개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	14

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

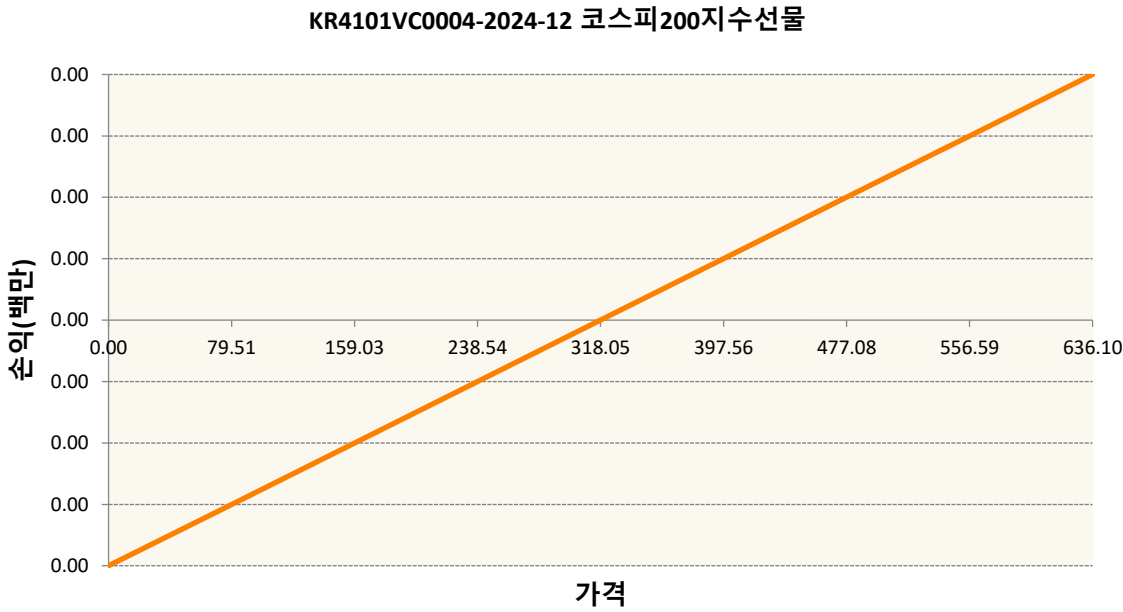
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	398	0	398	장내
누계	유가증권	선물	9,542	0	9,542	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				762
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-762	-762	-762	-762	-762	-762	-762
-5.33%	-508	-508	-508	-508	-508	-508	-508
-2.67%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	254	254	254	254	254	254	254
5.33%	508	508	508	508	508	508	508
8.00%	762	762	762	762	762	762	762

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

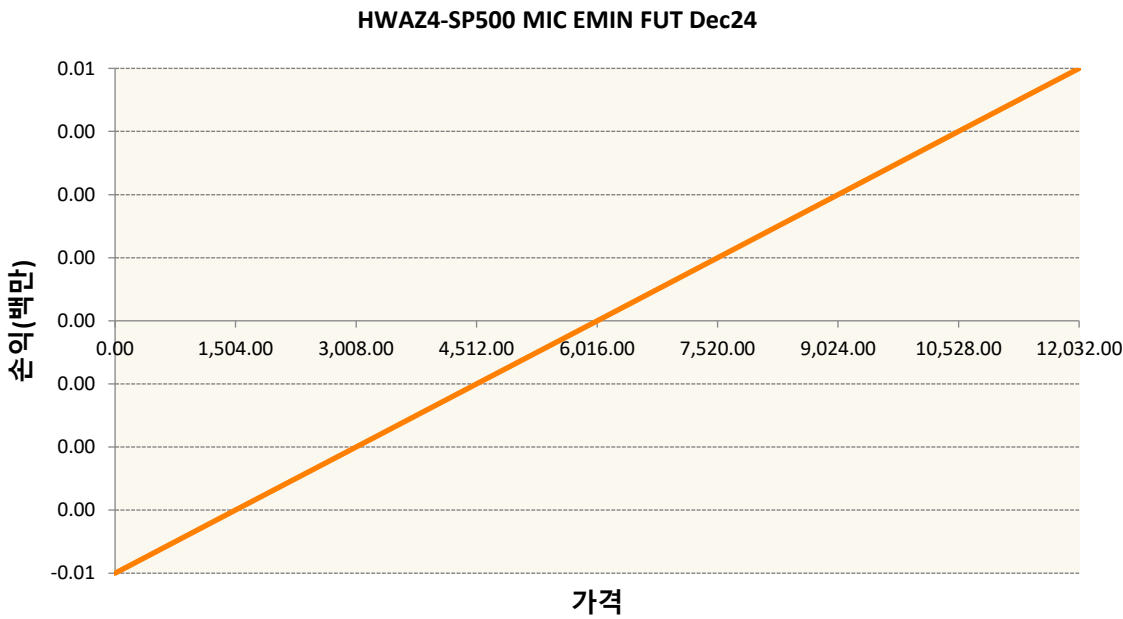
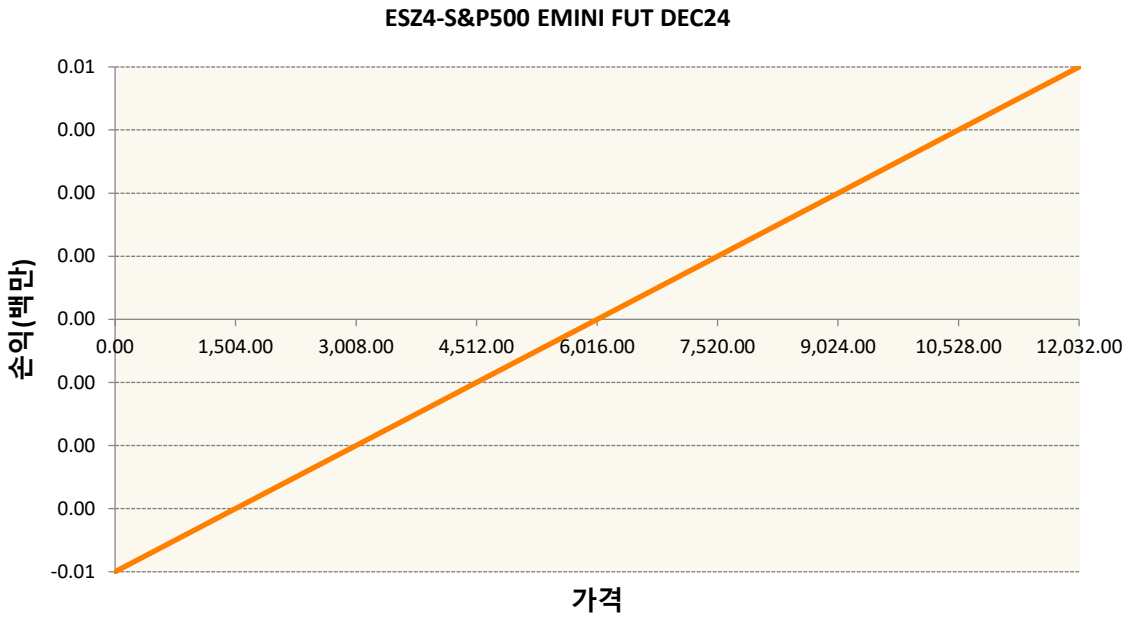
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	16,675	0	16,675	
누계	유가증권	선물	1,644	0	1,644	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,334
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	132

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	898

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

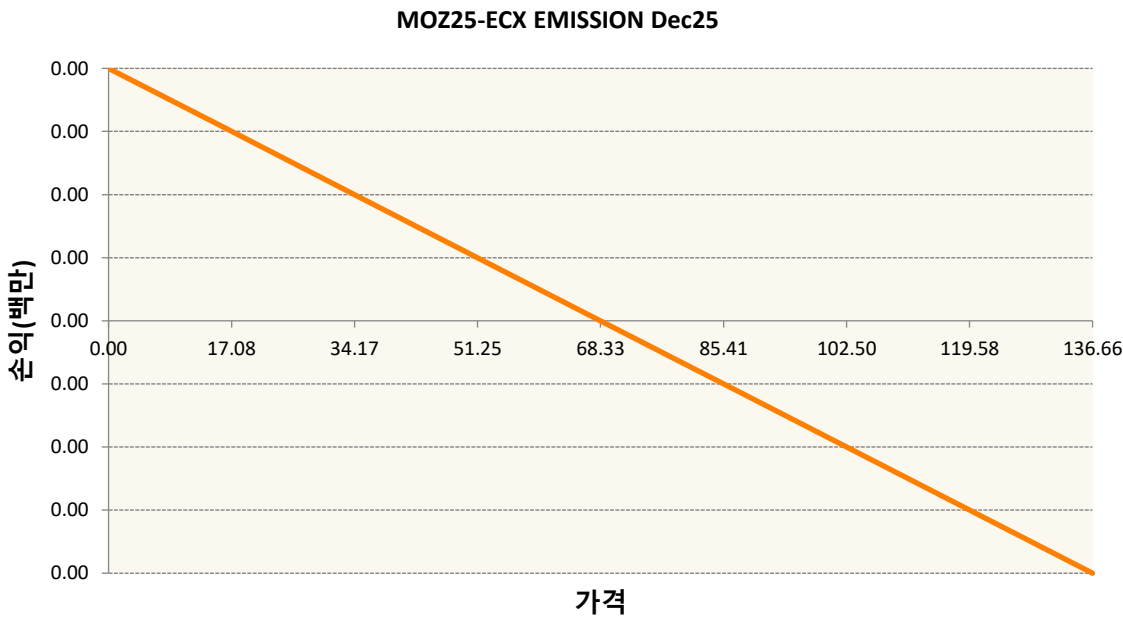
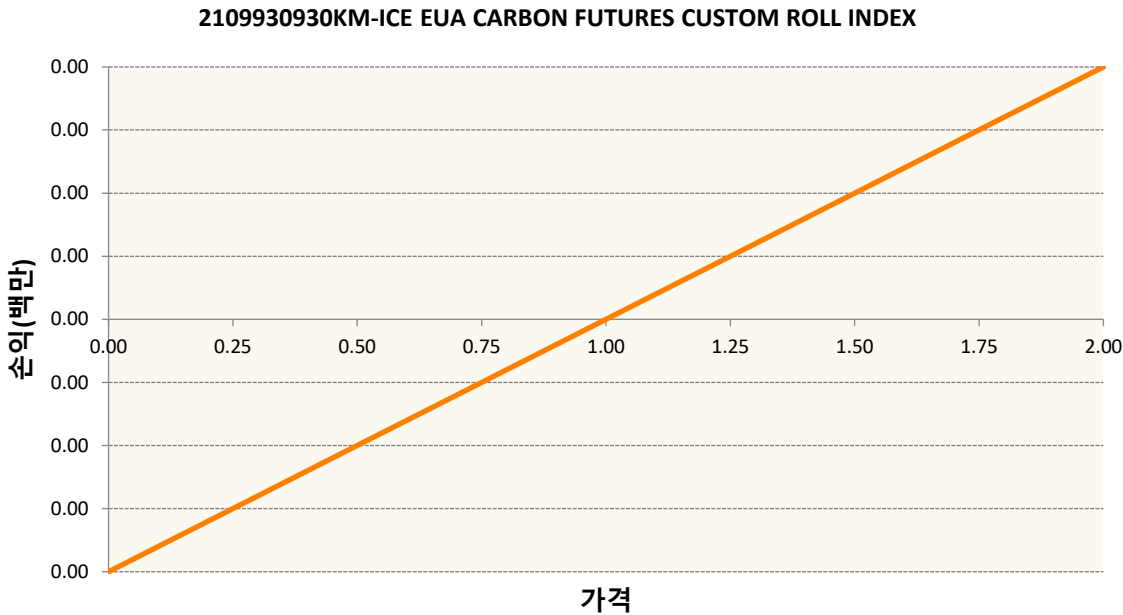
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	0	6,040	-6,040	
누계	통화	선도	0	1,416	-1,416	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.06
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E	113
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	483

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

866

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

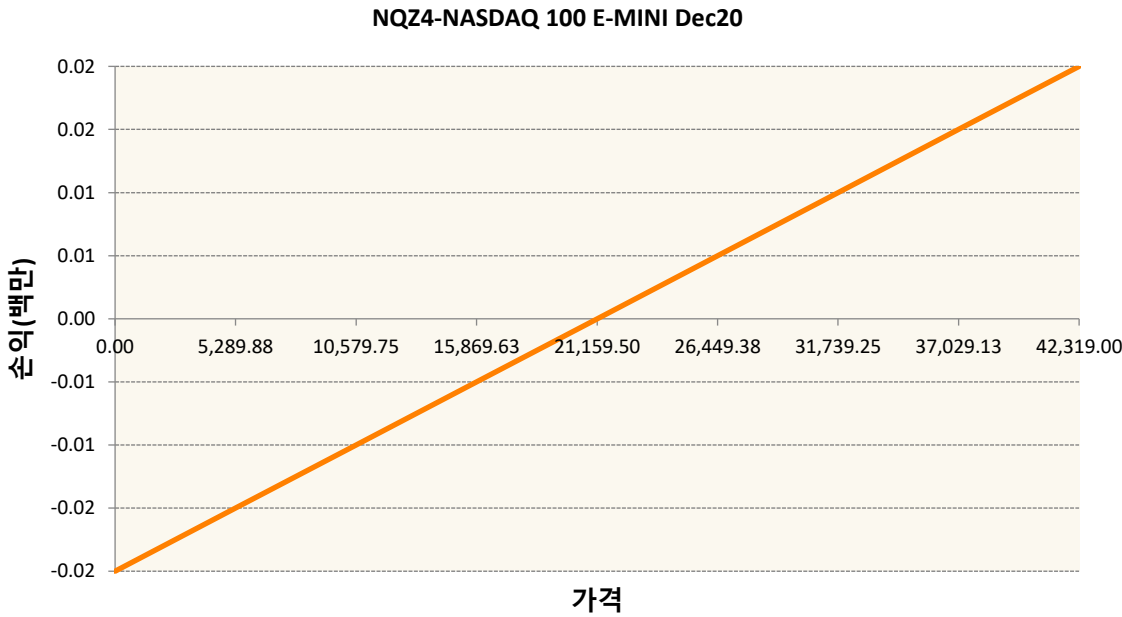
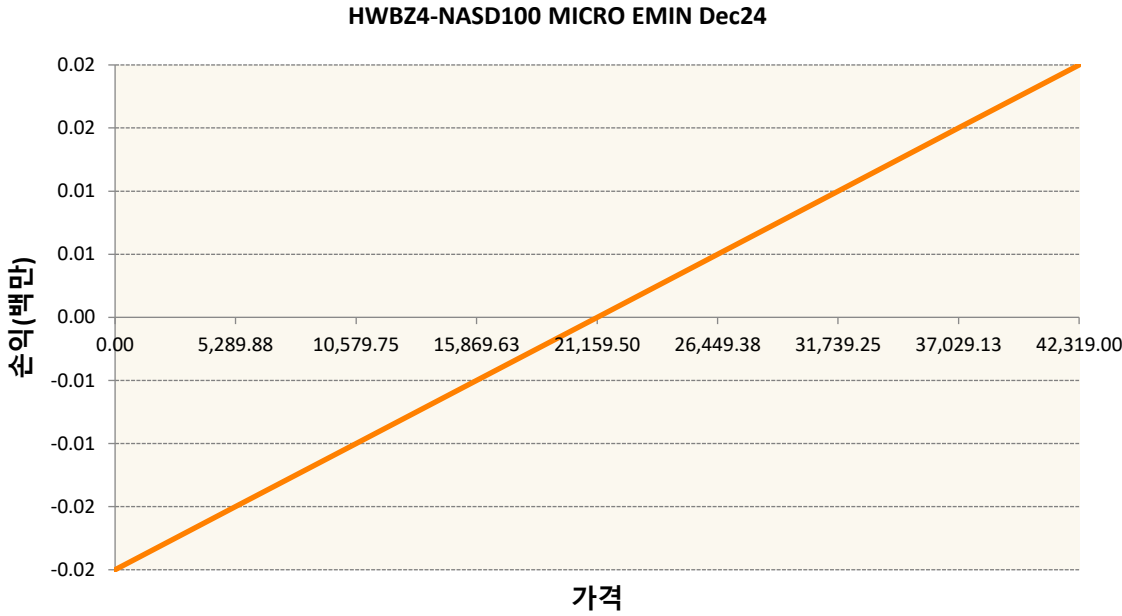
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	9,137	0	9,137	
누계	유가증권	선물	1,155	0	1,155	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		92
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		731

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			684

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

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	694
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,258
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,629
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,186

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

(단위:백만원)

9,488

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

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	18
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	18
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	18
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	18

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

(단위:백만원)

76

공시일	2024-11-15
기준일	2024-11-14

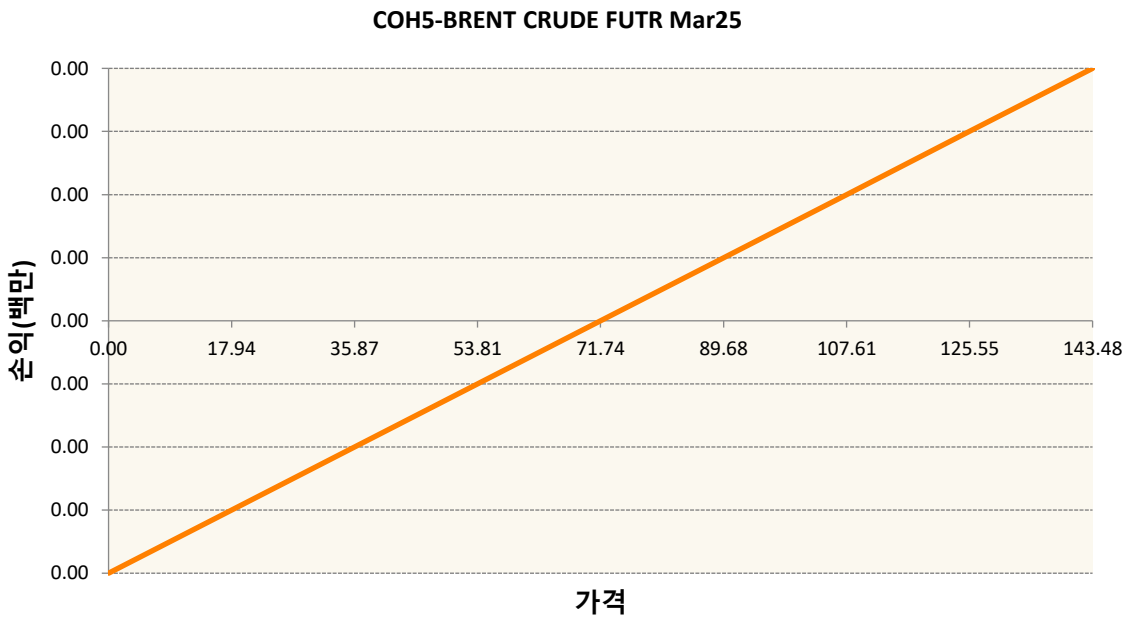
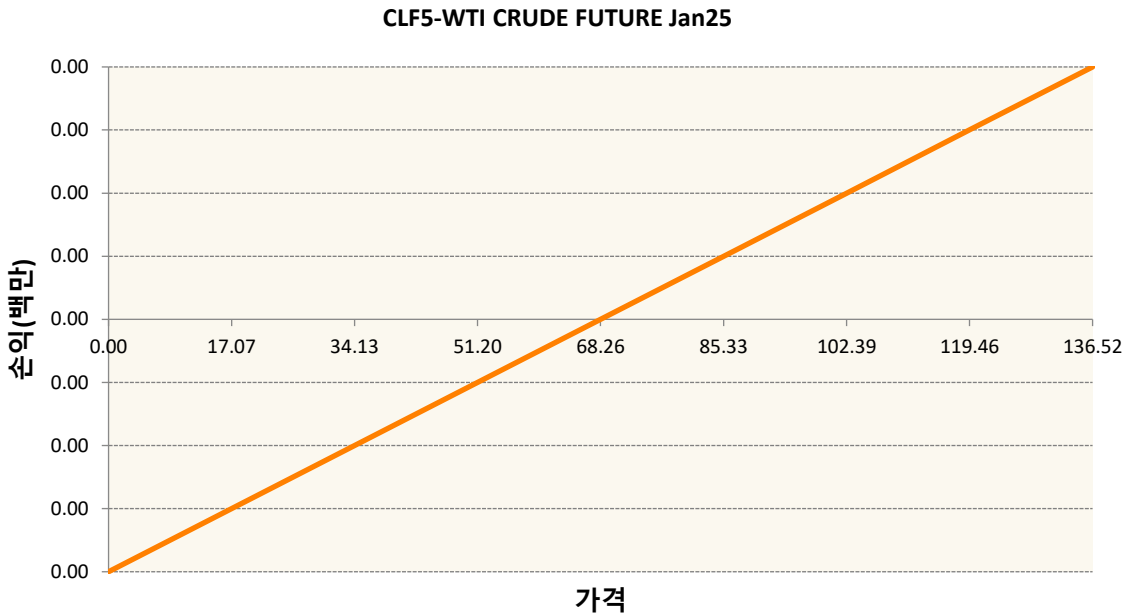
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

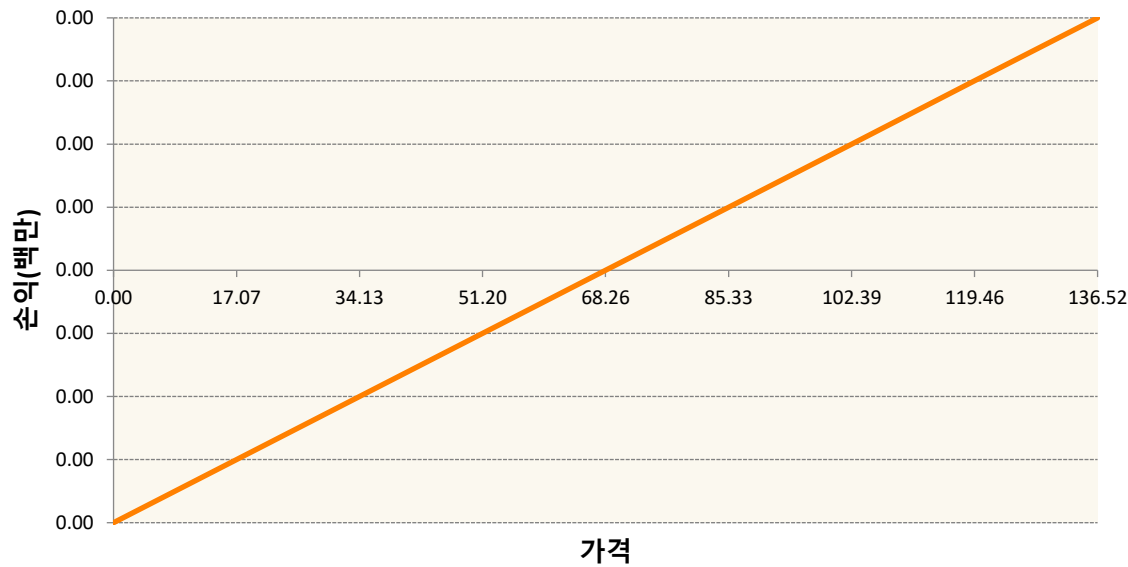
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	98	-98	장내
누계	유가증권	선물	776	0	776	
누계	통화	선물	0	98	-98	장내

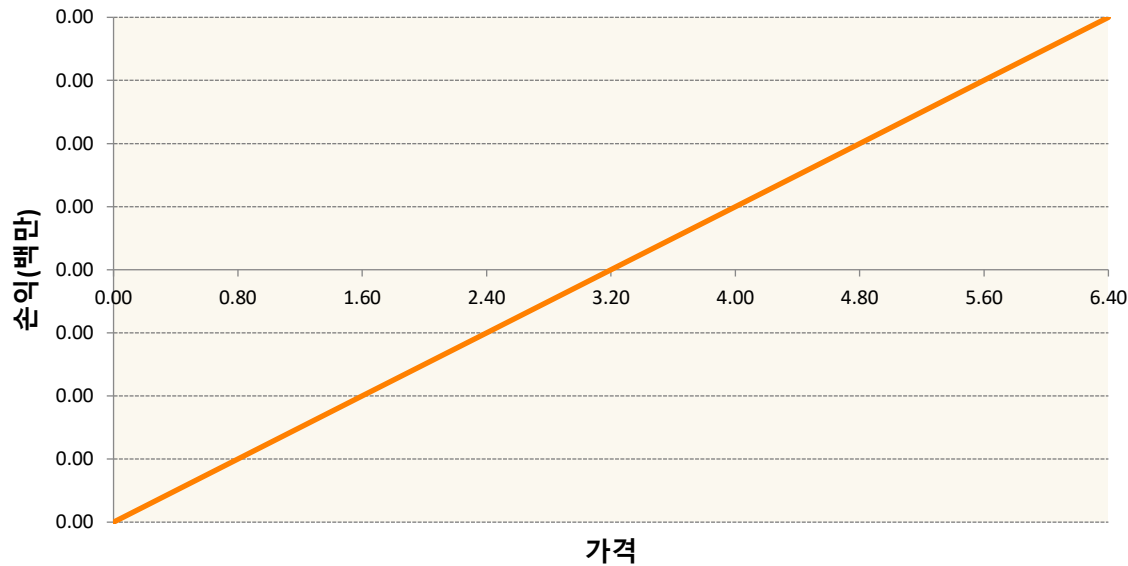
2. 만기시점의 손익구조



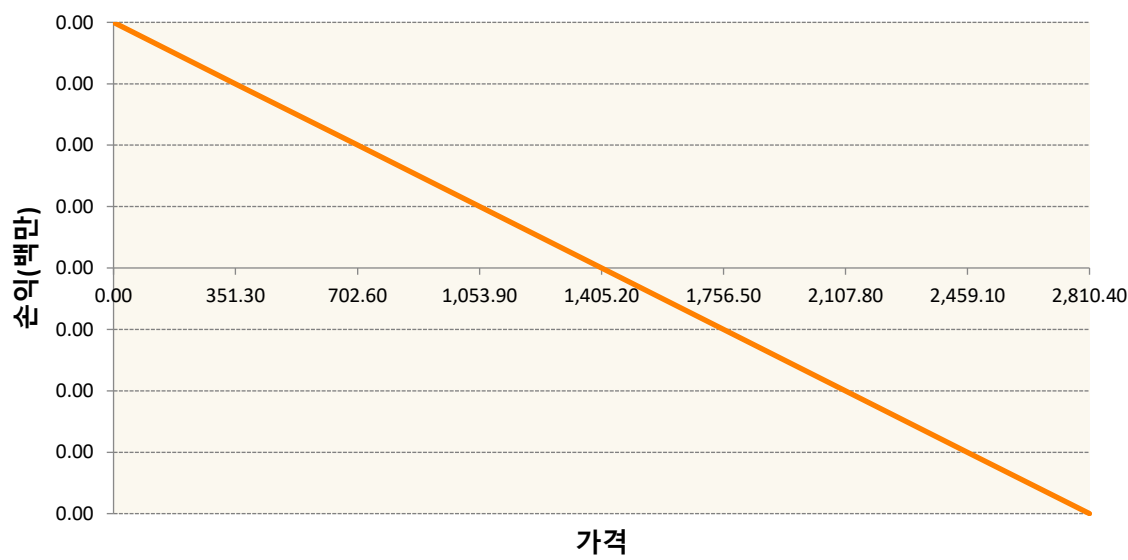
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



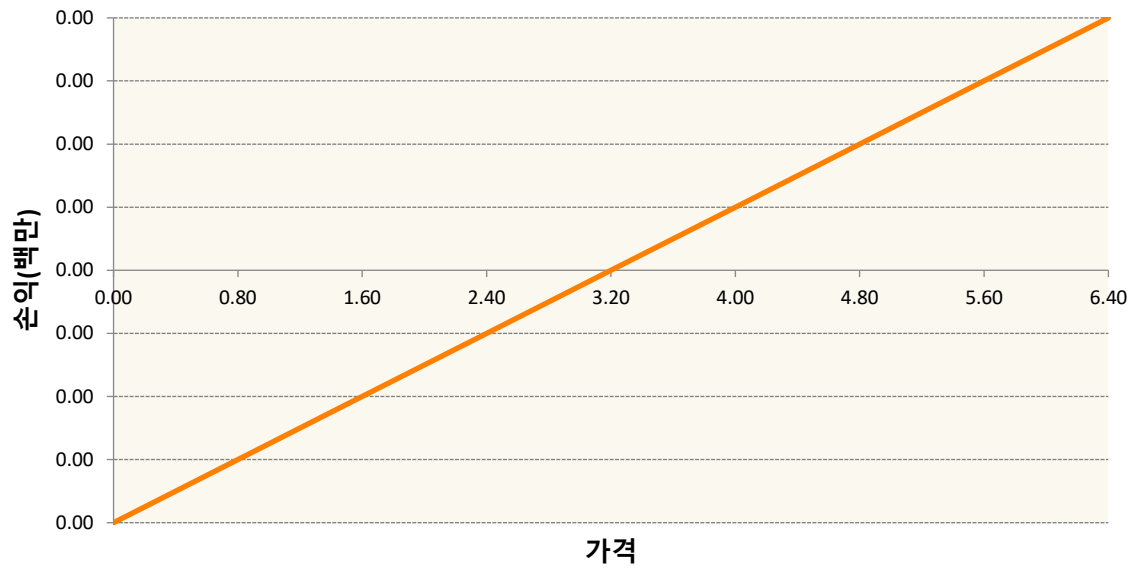
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



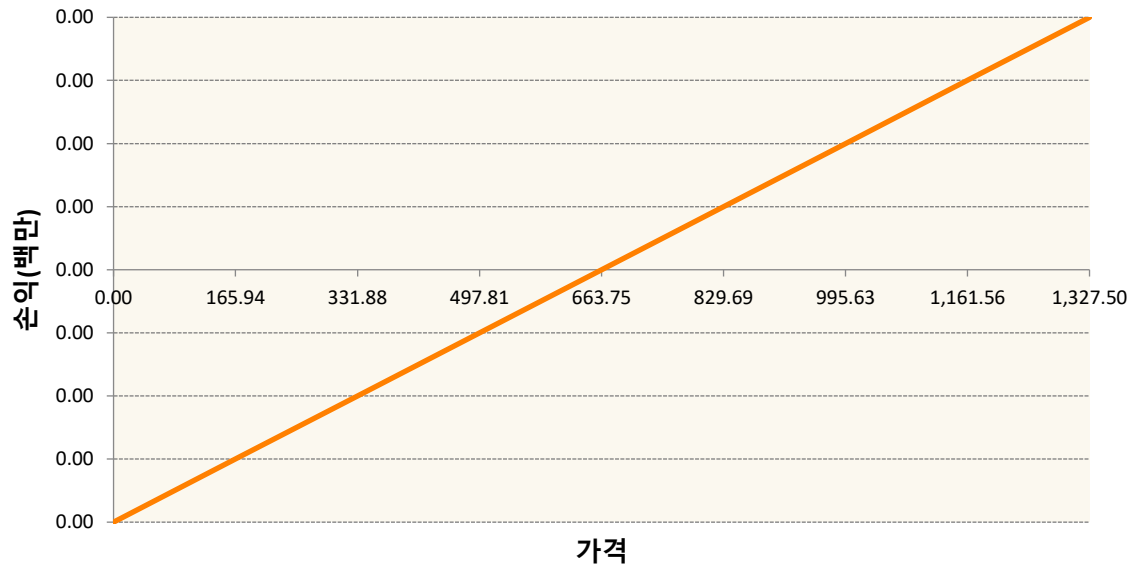
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



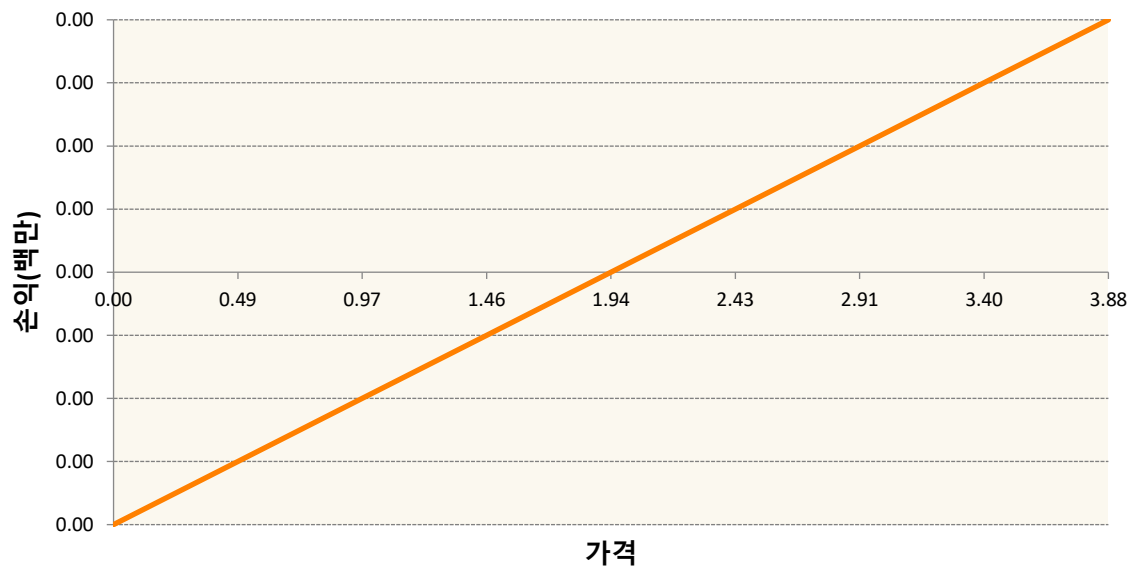
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



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	2
KR4175VC00 2024-12 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)

136