

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

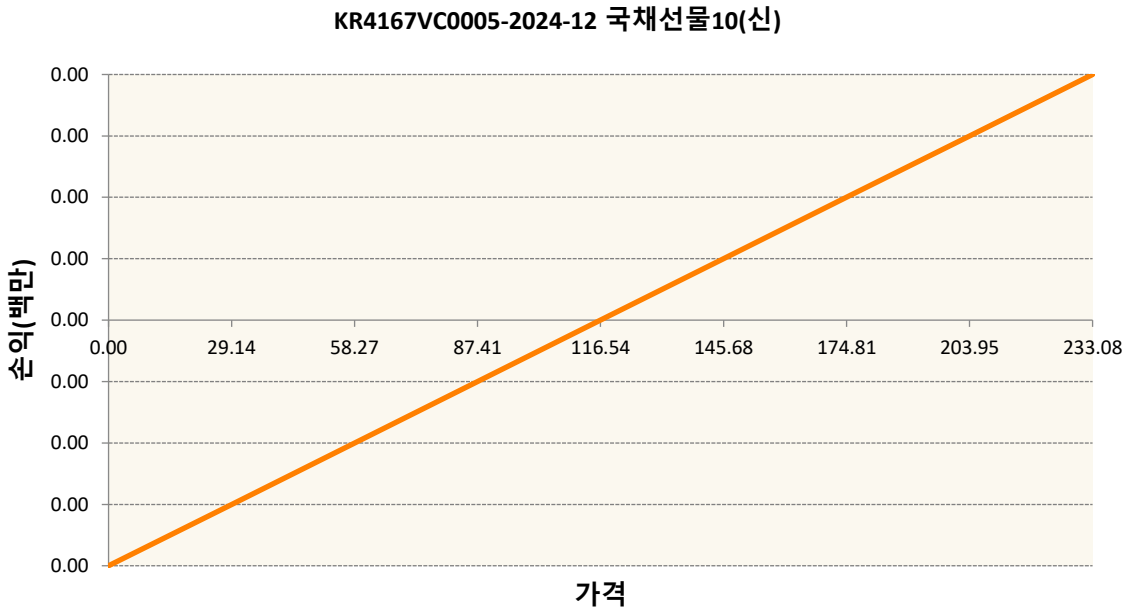
베스트장기채(채권-파생형)

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	149,754	0	149,754	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4167VC00 2024-12 국채선물10(신)	11,980
------------------------------	--------

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

(단위:백만원)

3,955

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

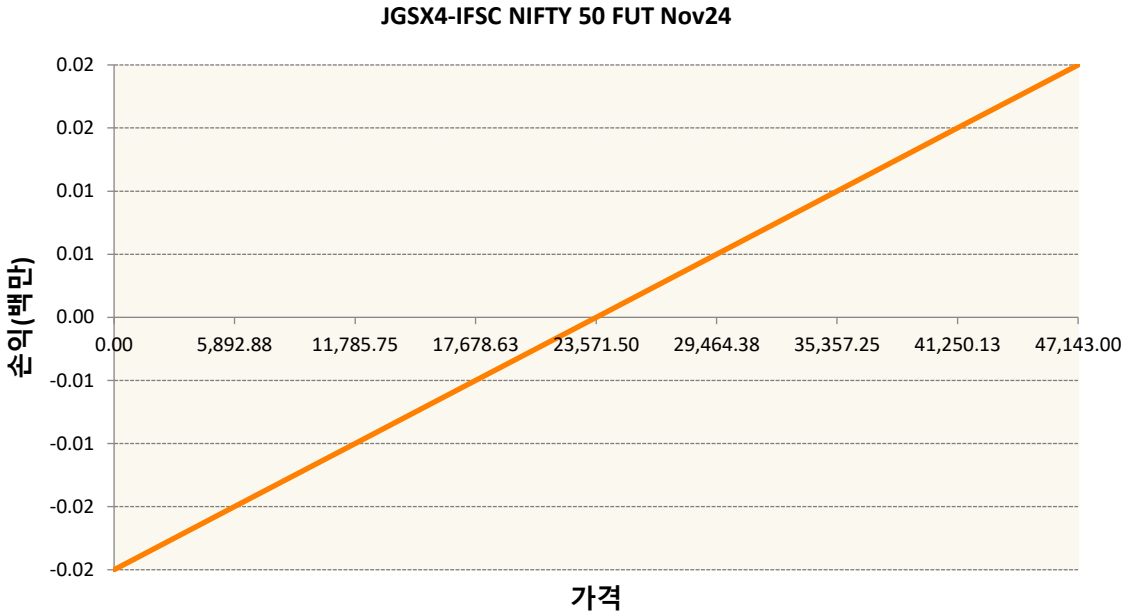
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,192	0	3,192	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSX4	IFSC NIFTY 50 FUT Nov24	255
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

166

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

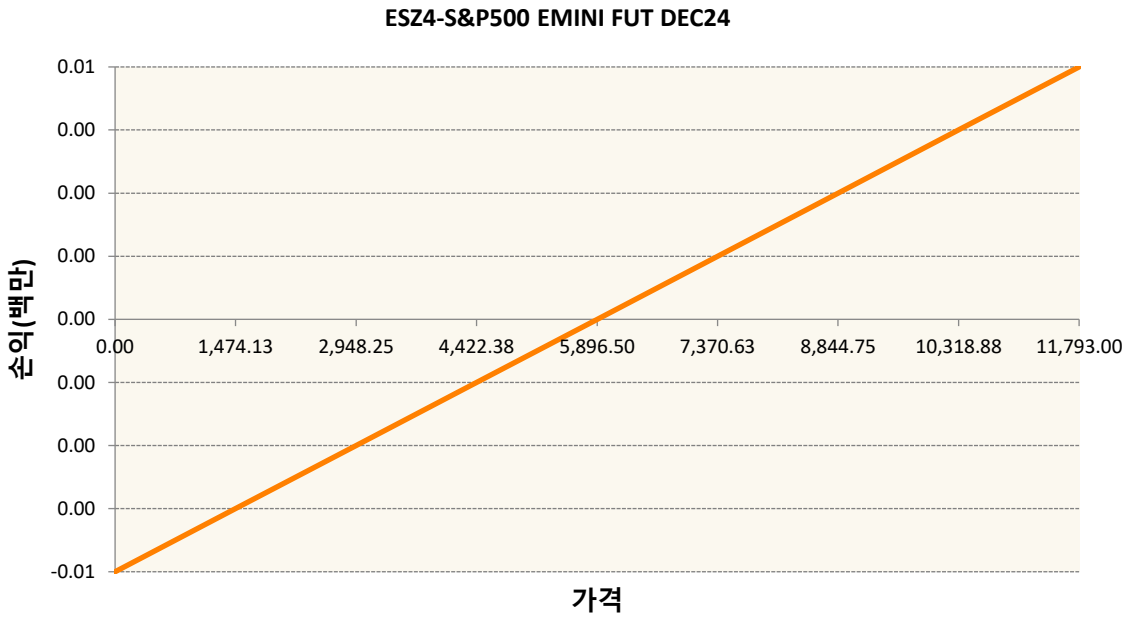
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	808	0	808	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	65
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

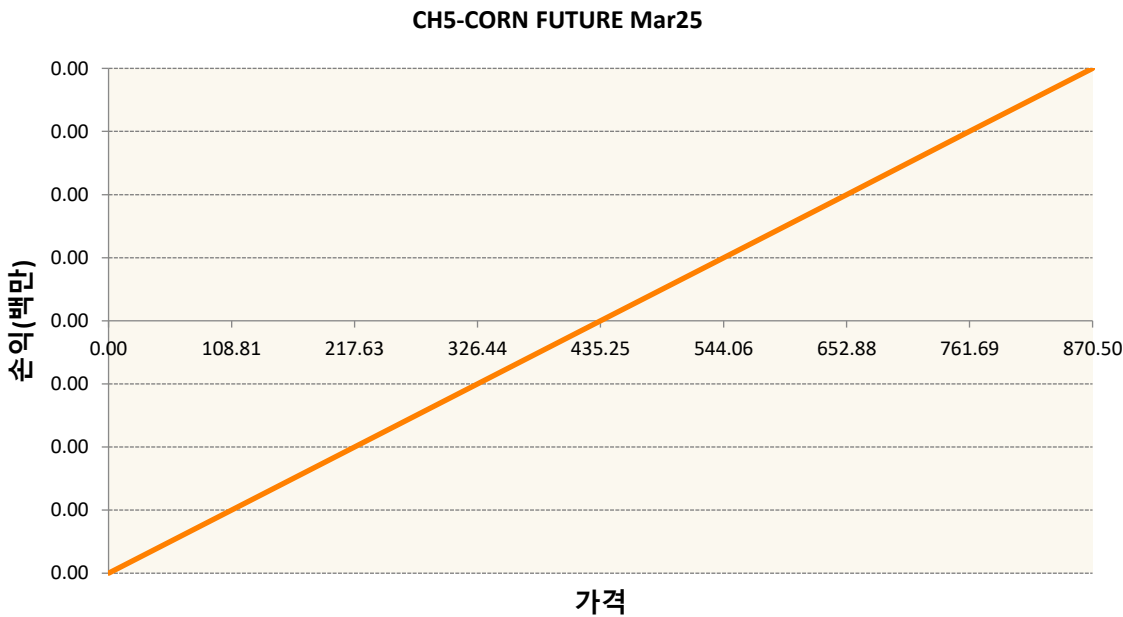
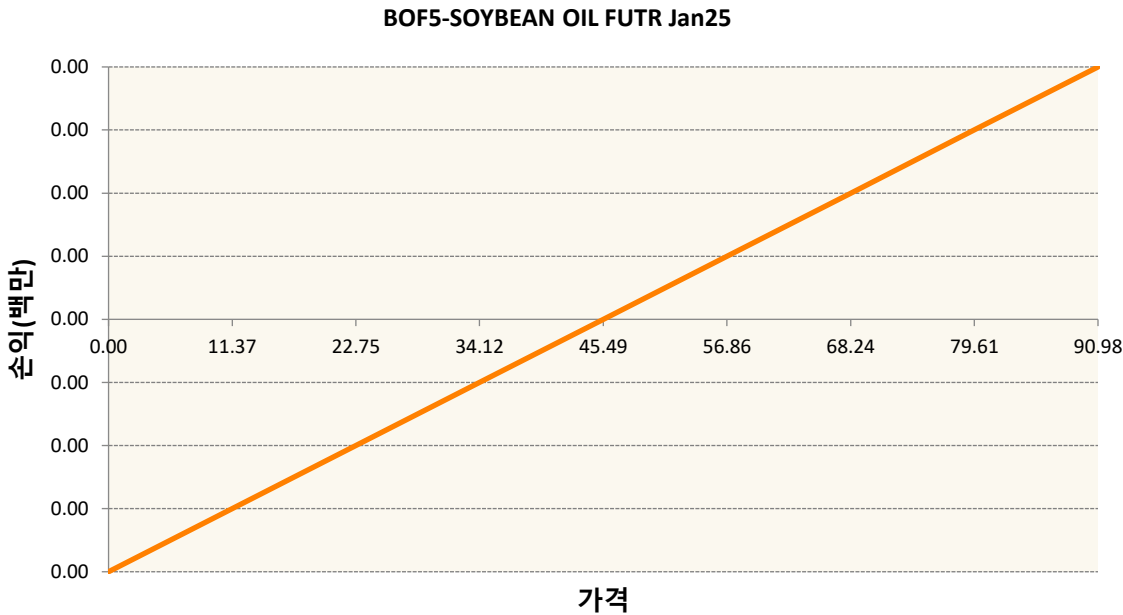
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

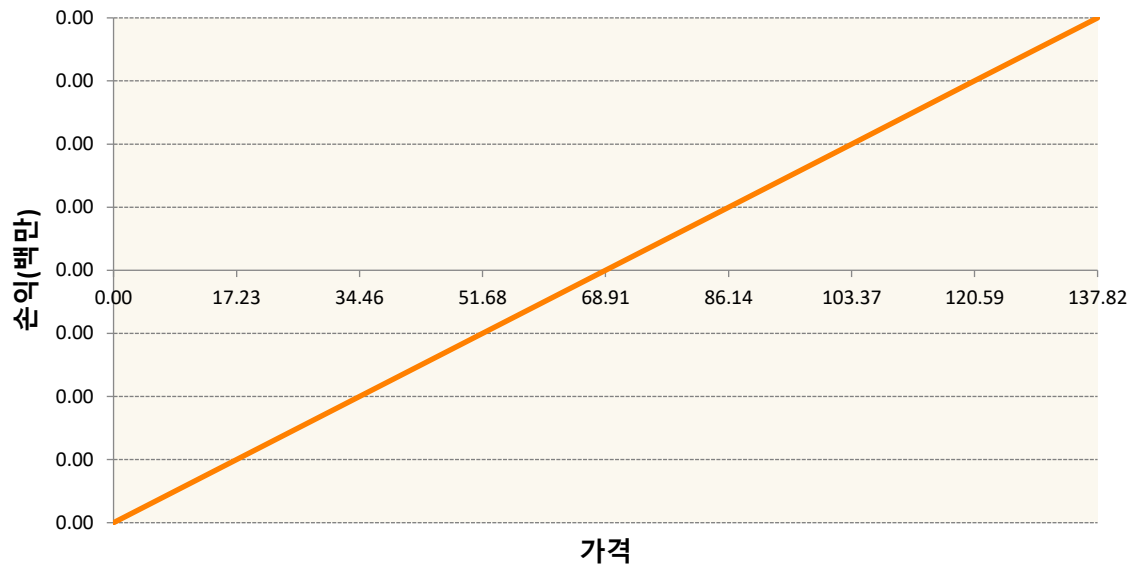
(단위:USD 백만)

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	3,785	0	3,785	
누계	통화	선물	0	474	-474	장내

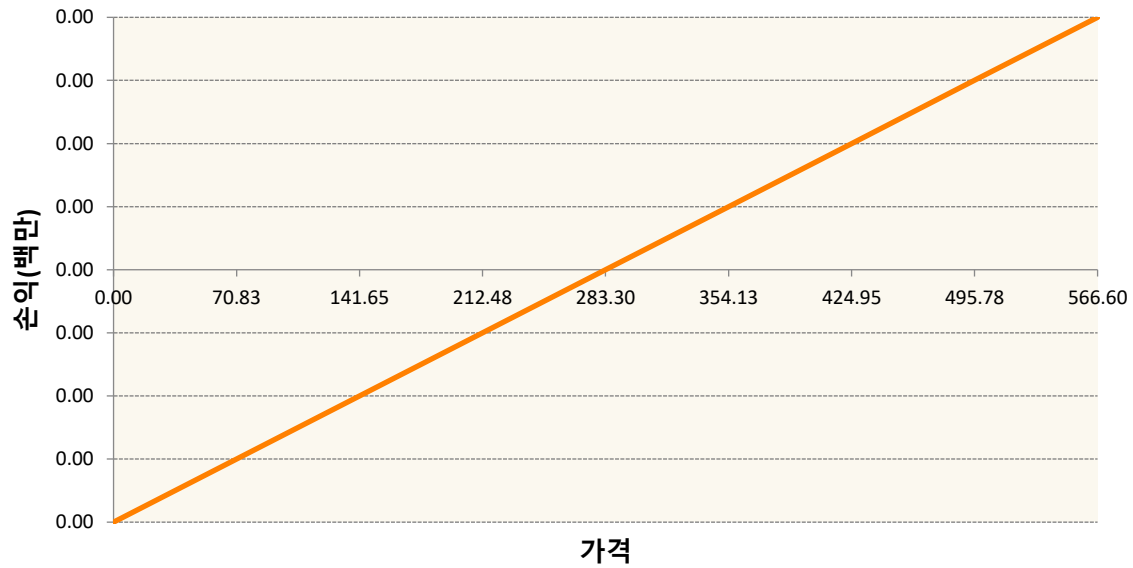
2. 만기시점의 손익구조



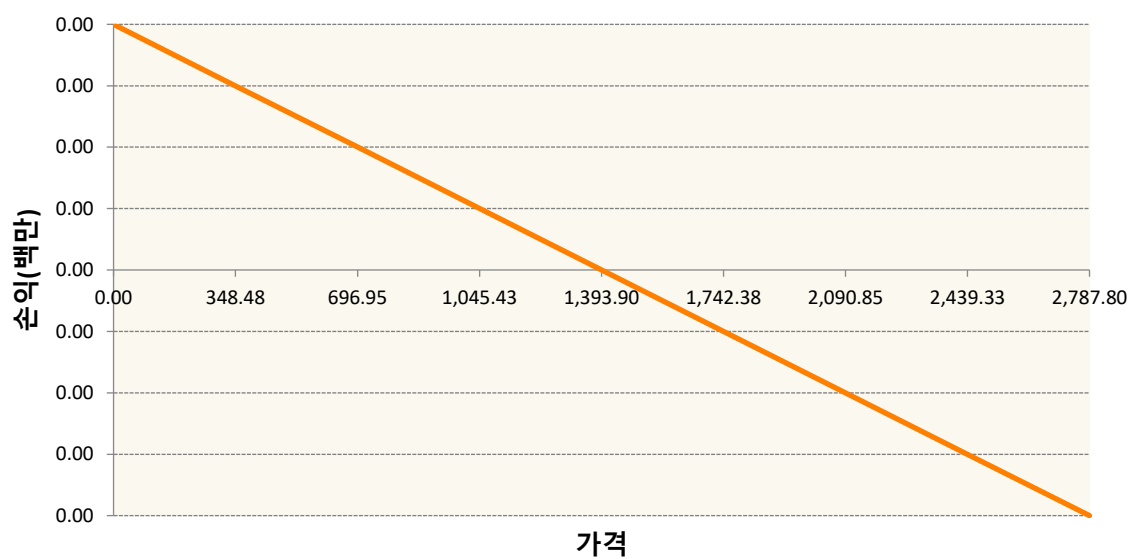
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



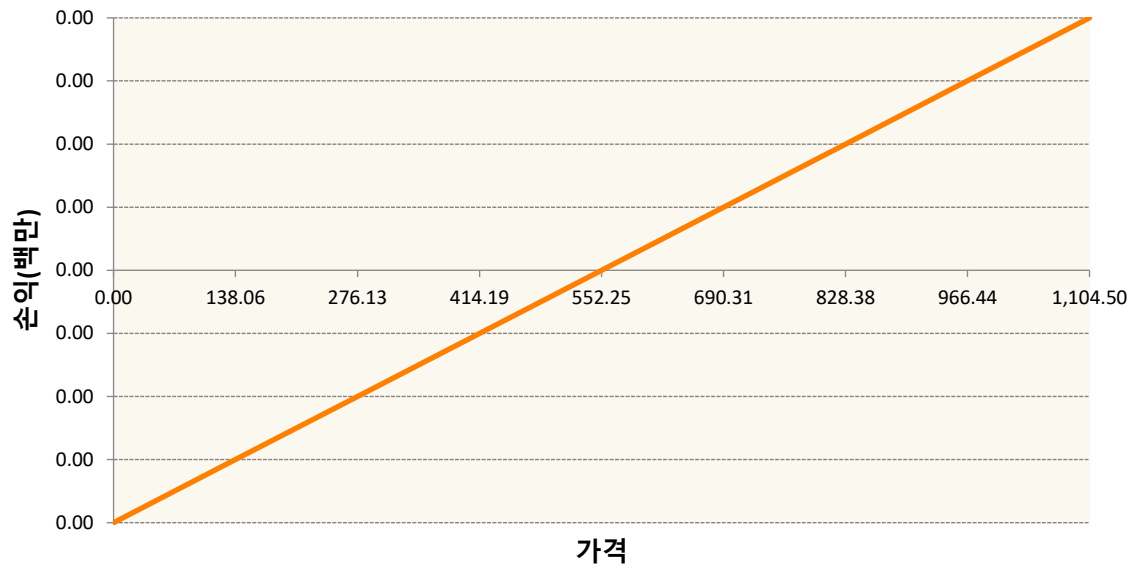
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



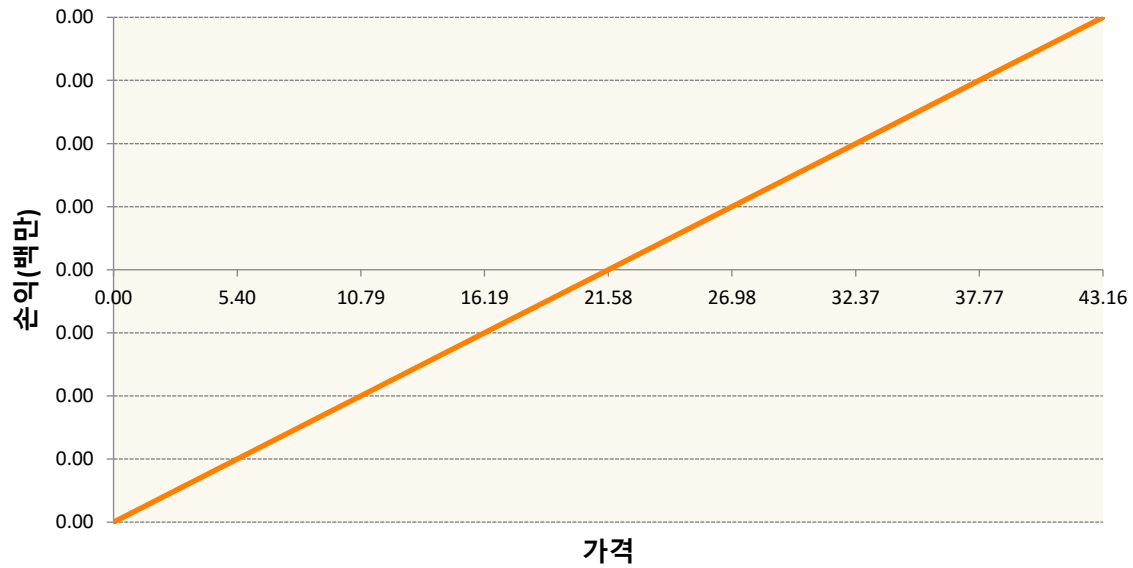
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



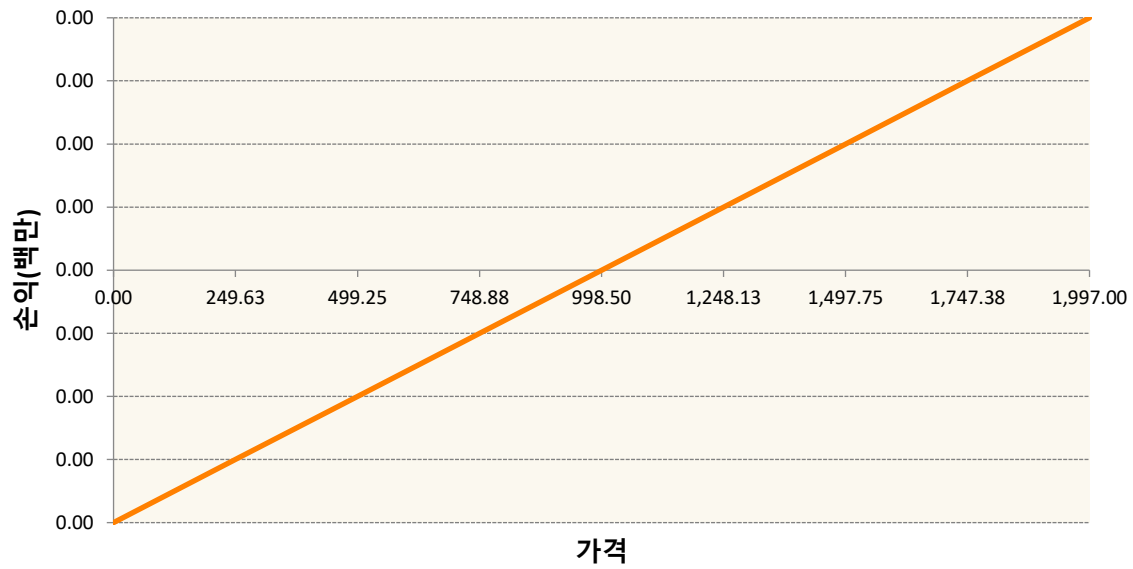
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



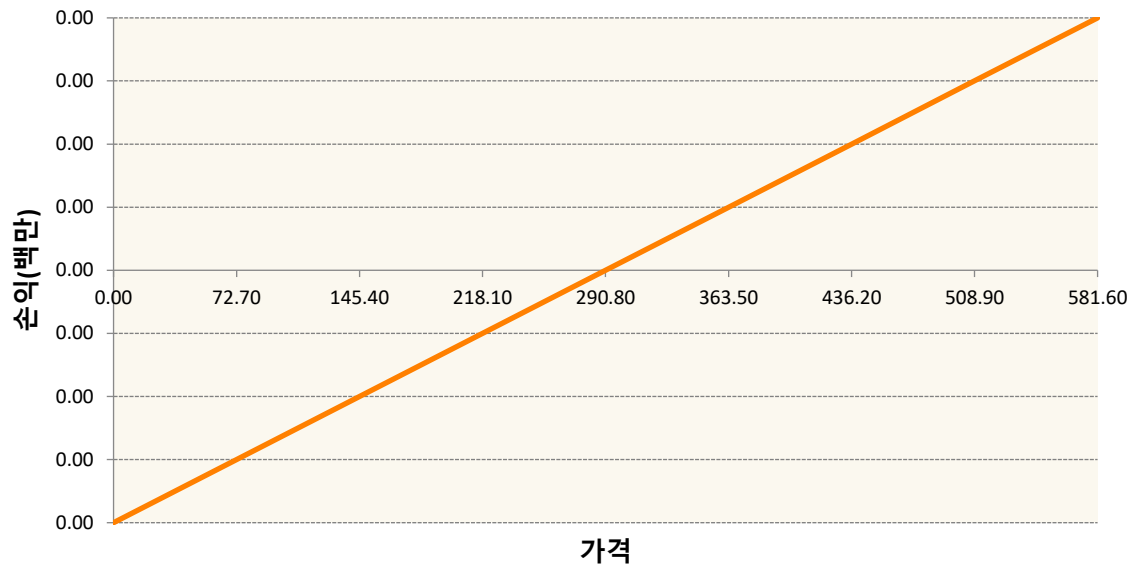
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



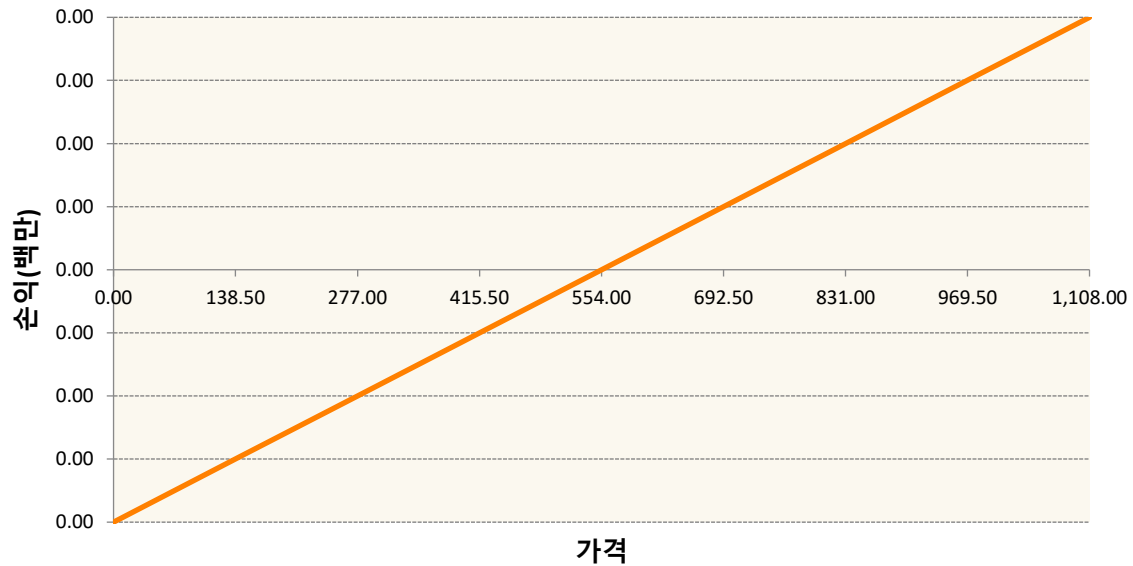
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-11-19
기준일	2024-11-18

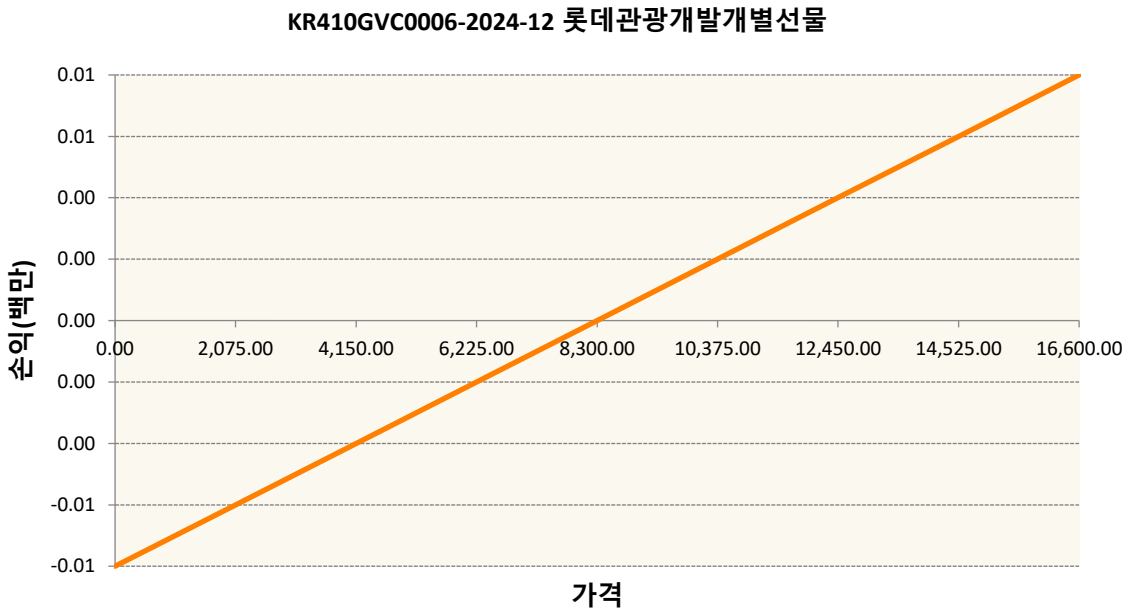
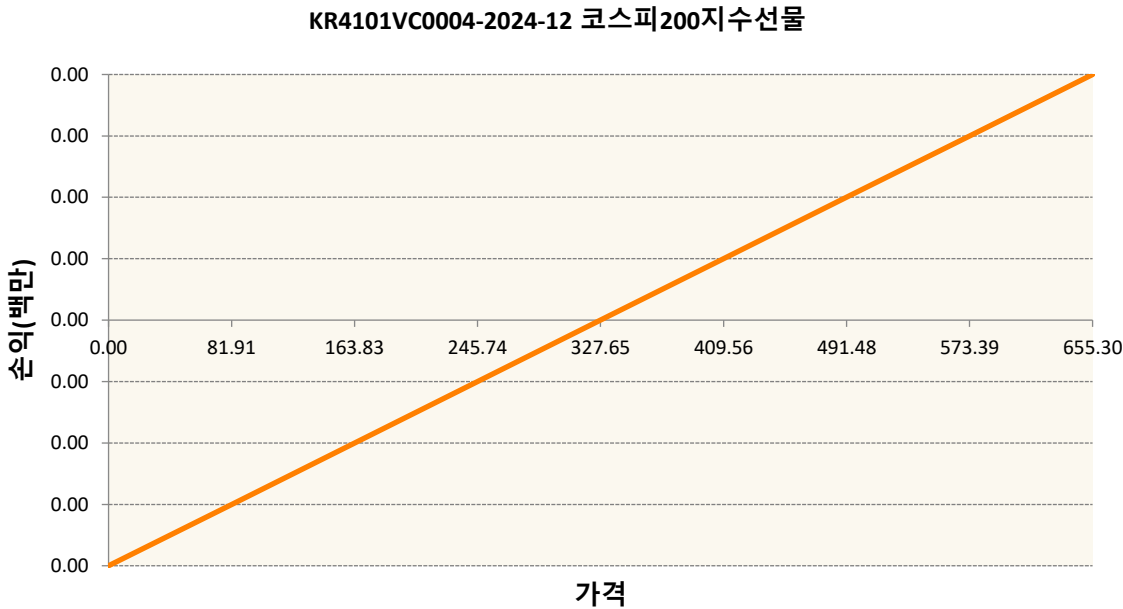
스마트인덱스모

1. 계약금액

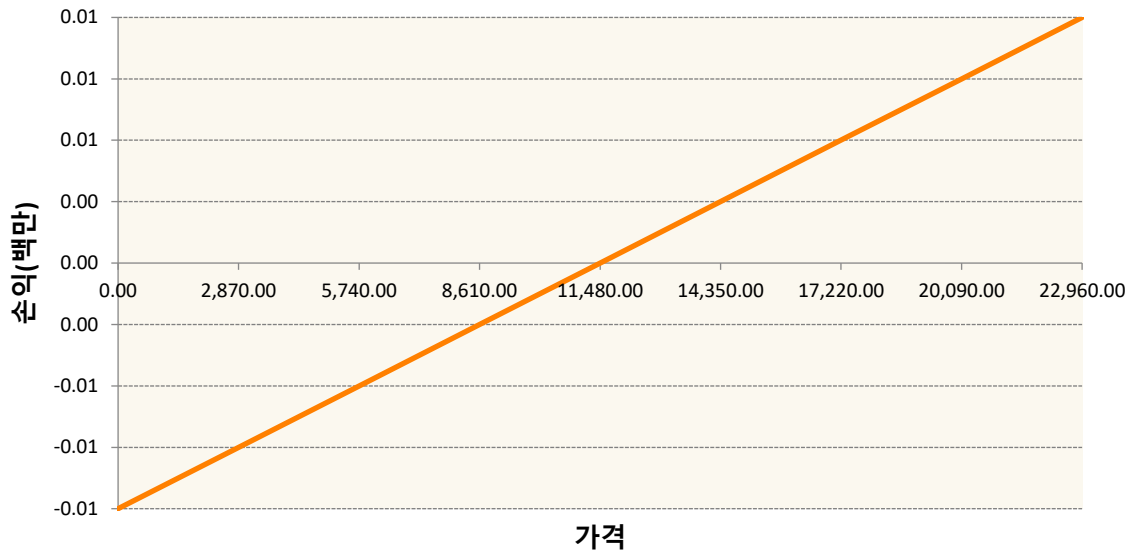
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	94	0	94	장내
누계	유가증권	선물	1,957	0	1,957	장내

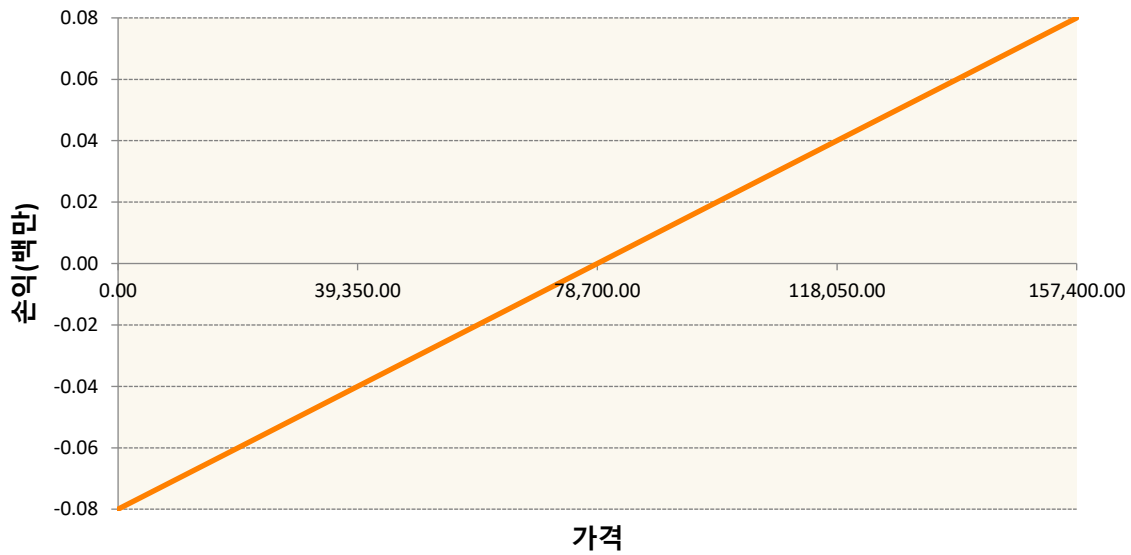
2. 만기시점의 손익구조



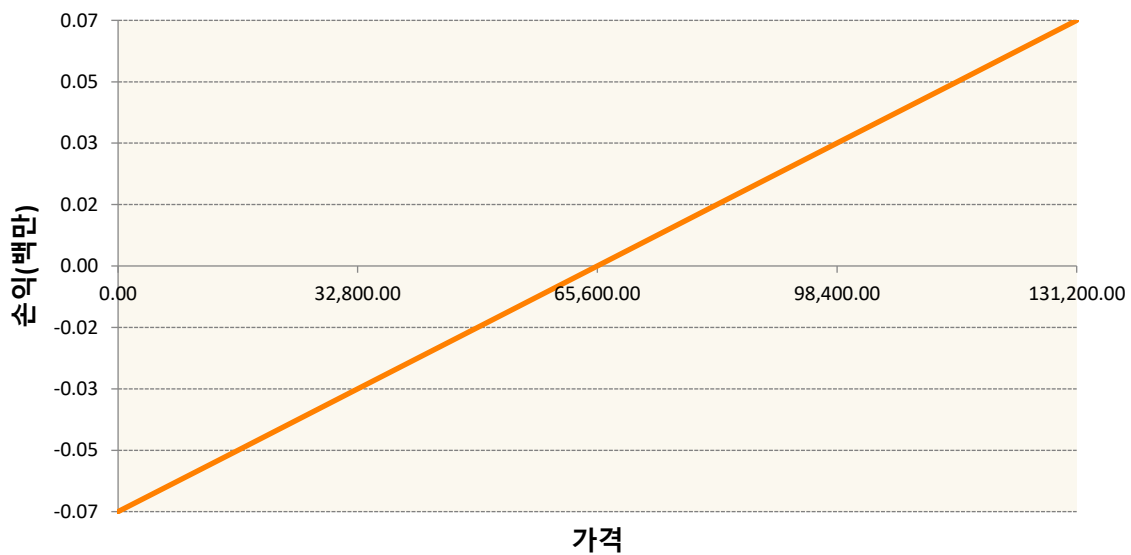
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



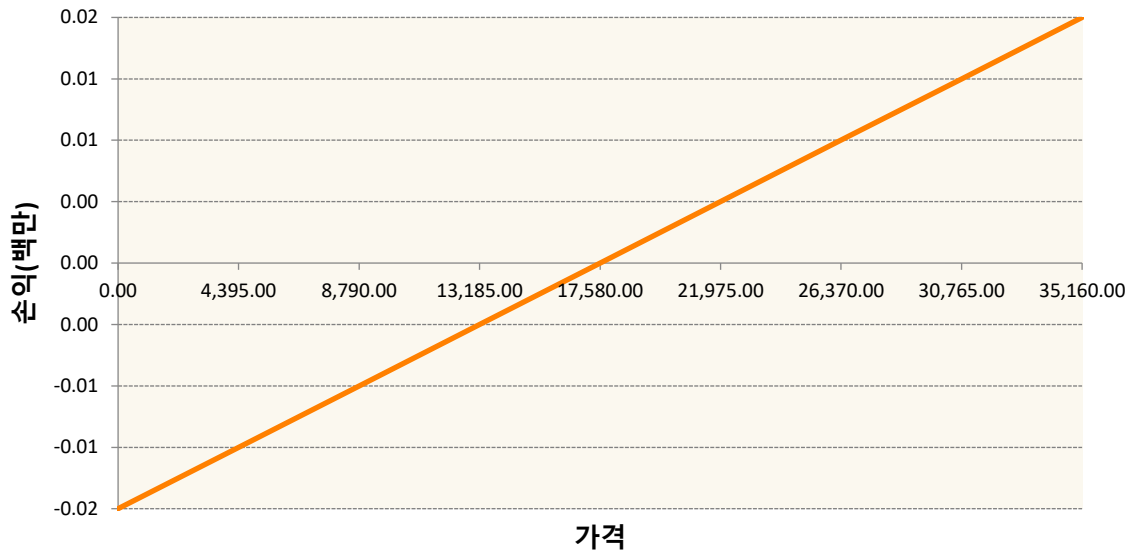
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



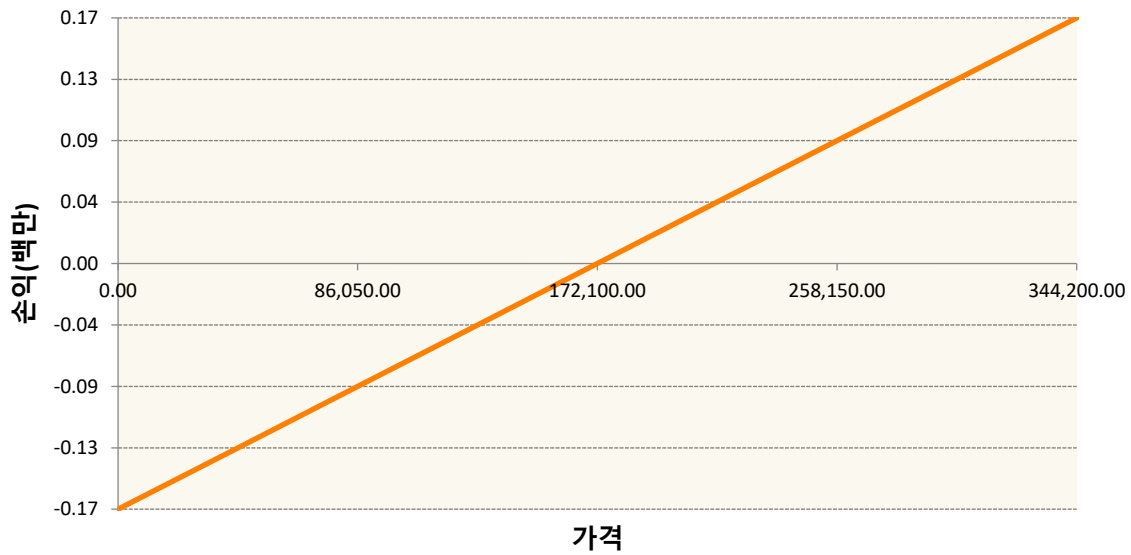
KR41BBVC0009-2024-12 롯데케미칼개별선물



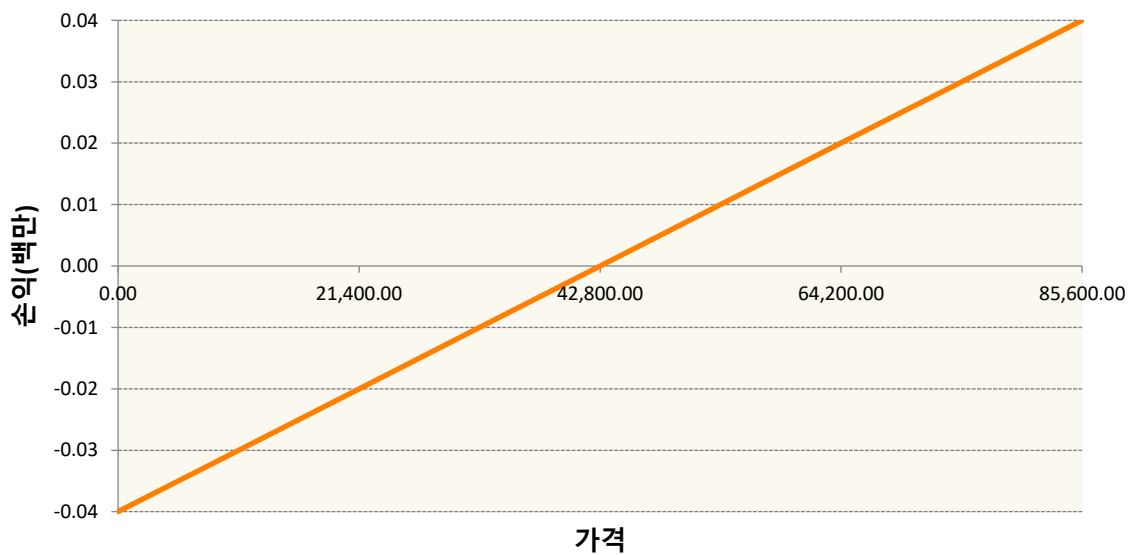
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

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

								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

KR41CBVC0008		2024-12 한화솔루션개별선물					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%	-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%	2	2	2	2	2	2	2

KR41E8VC0007		2024-12 포스코케미칼개별선물					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
KR41F9VC0003 2024-12 SK바이오사이언스개별선물							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)
	182

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

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	303
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

497

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

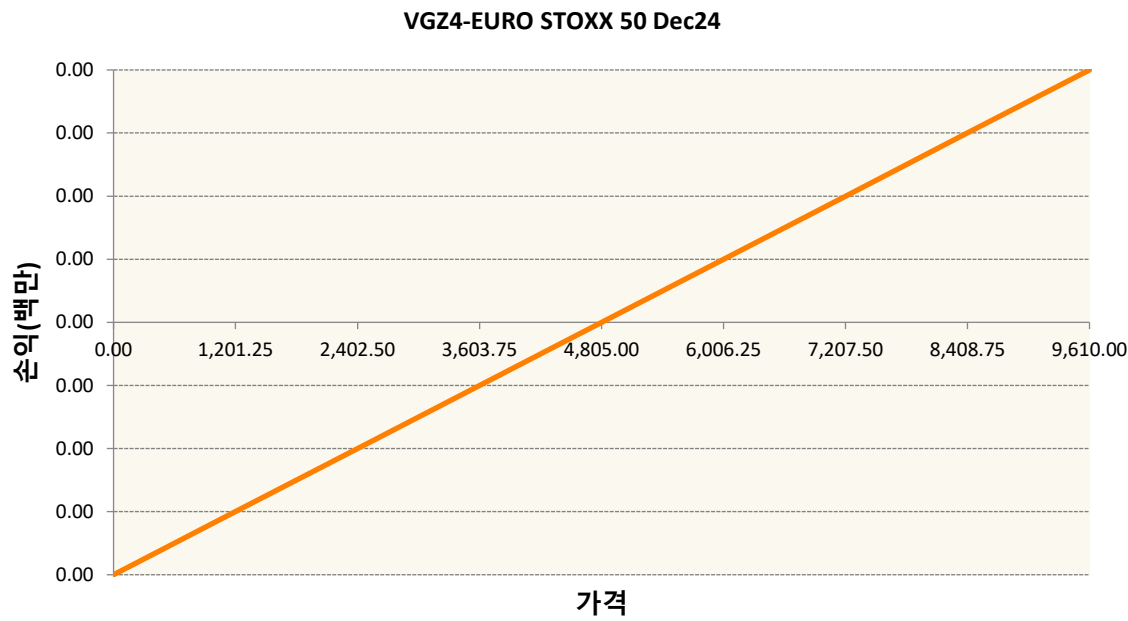
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	928	0	928	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ4	EURO STOXX 50 Dec24	74
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

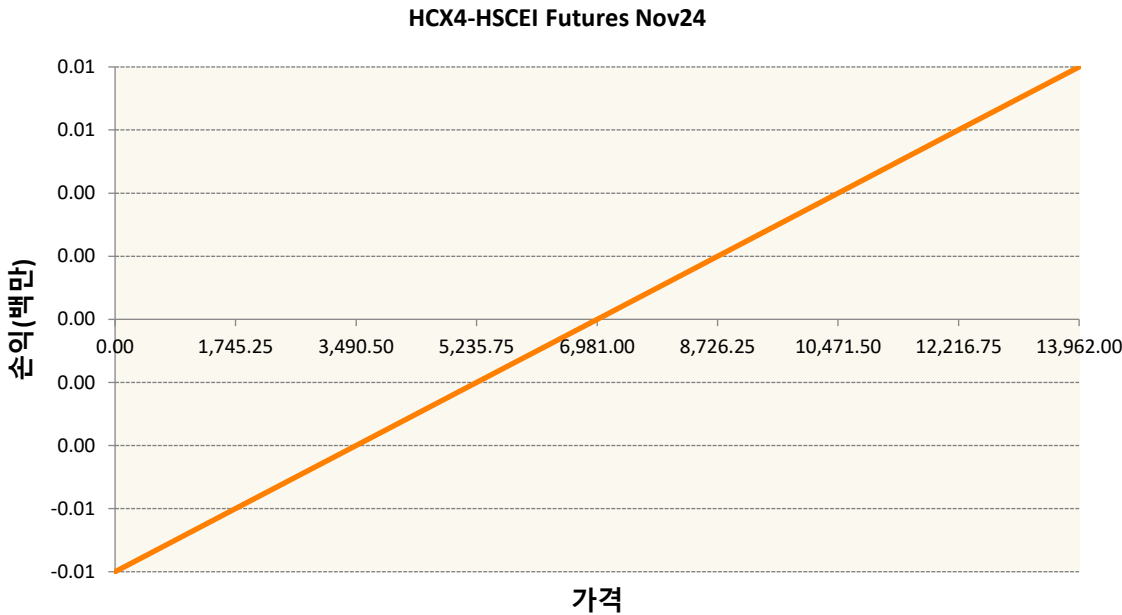
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,368	0	1,368	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX4	HSCEI Futures Nov24	109
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

151

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

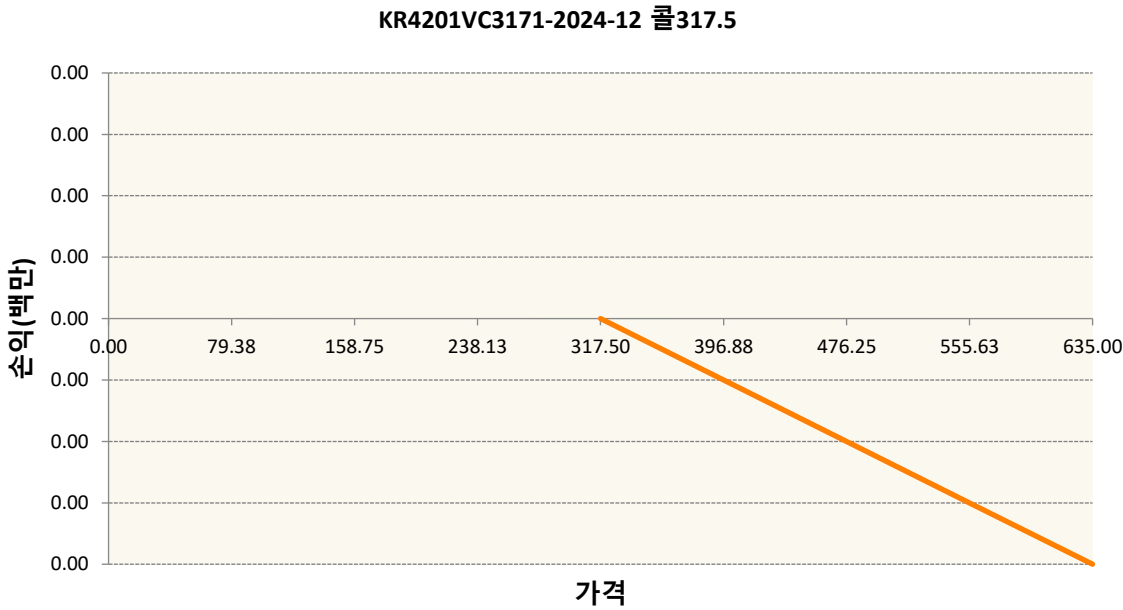
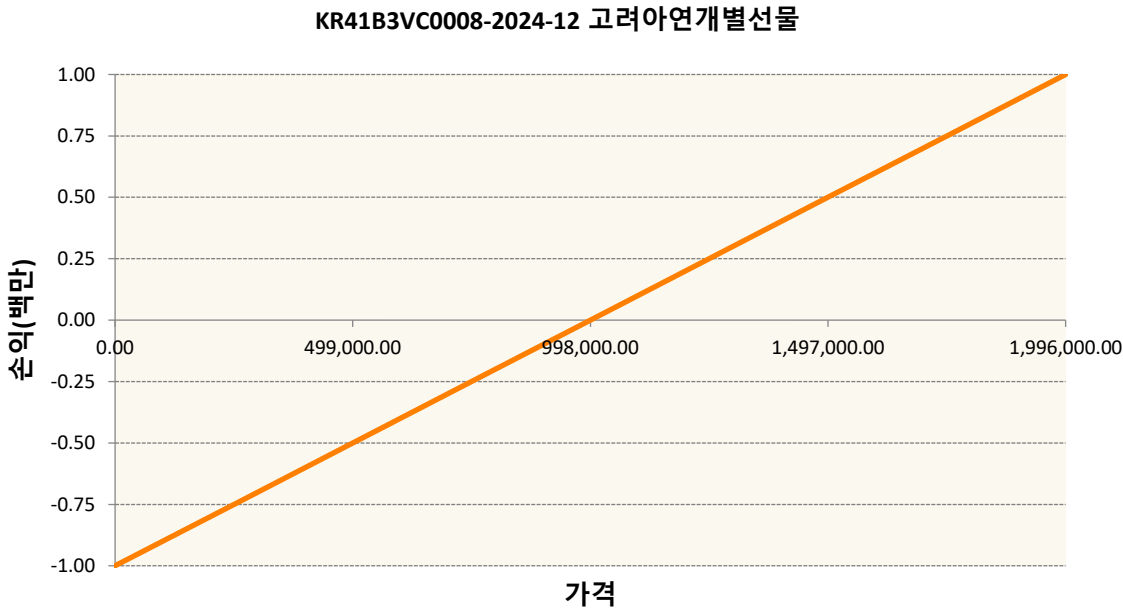
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	259	0	259	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,066	-37,066	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 640.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at a price of 320.00 with zero profit and slopes downward to a price of 640.00 with a profit of -0.00.

가격 (Price)	이익 (Profit)
320.00	0.00
640.00	-0.00

The graph illustrates the relationship between price and profit/loss. The x-axis represents '가격' (Price) from 0.00 to 635.00. The y-axis represents '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions) from -100.00 to 100.00. A line starts at (0,0) and passes through (317.50, 0). The area above the line is light blue, and the area below is light orange.

가격	손익 (백만)
0.00	-100.00
79.38	-20.00
158.75	-10.00
238.13	0.00
317.50	0.00
396.88	10.00
476.25	20.00
555.63	30.00
635.00	40.00

(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					743
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	435	422	408	393	377	361	344
-5.33%	367	348	328	308	288	268	248
-2.67%	241	220	199	177	156	135	114
0%	54	36	18	0	-19	-38	-58
2.67%	-180	-191	-203	-216	-231	-246	-262
5.33%	-441	-446	-453	-461	-470	-481	-493
8.00%	-713	-715	-718	-722	-728	-735	-743
KR4201VC3205 2024-12 콜320							1,426

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	771	750	725	699	671	641	609
-5.33%	664	629	592	555	517	478	440
-2.67%	450	408	366	324	281	239	197
0%	115	77	39	0	-40	-80	-120
2.67%	-323	-348	-376	-405	-437	-470	-504
5.33%	-824	-837	-853	-872	-894	-918	-944
8.00%	-1,355	-1,360	-1,368	-1,379	-1,392	-1,408	-1,426

KR4301VC3170 2024-12 풋317.5							336
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-287	-294	-301	-309	-318	-327	-336
-5.33%	-135	-146	-158	-169	-181	-193	-205
-2.67%	-28	-41	-54	-66	-79	-92	-104
0%	30	21	11	0	-11	-22	-33
2.67%	54	49	43	36	29	21	12
5.33%	62	60	57	53	49	44	38
8.00%	63	63	62	60	58	56	52

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

(단위:백만원)

2,523

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

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	665	0	665	

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	2024-11-19
기준일	2024-11-18

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	4,373	0	4,373	

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	2024-11-19
기준일	2024-11-18

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	13,786	0	13,786	
누계	통화	선도	209	14,301	-14,092	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	206
FXW213EBFC USD/KRW 29-11-24E	17
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

516

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

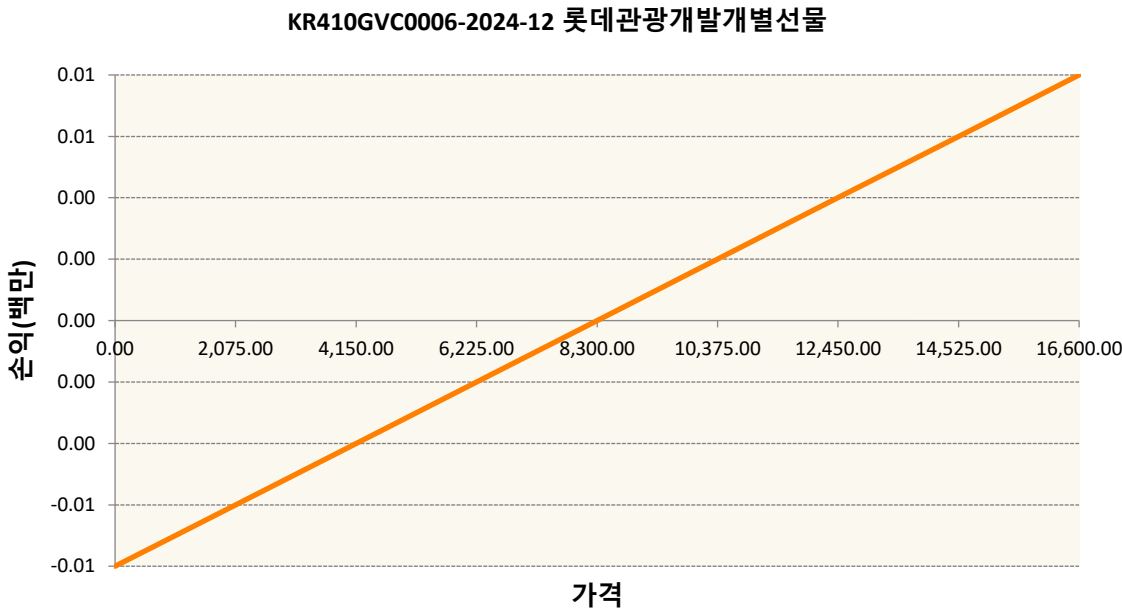
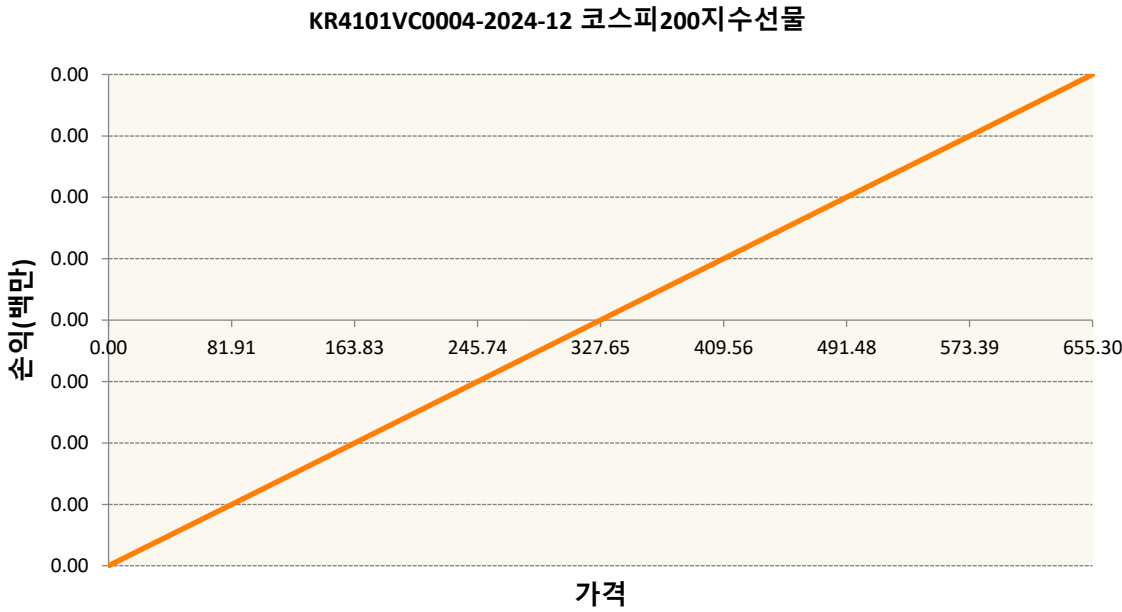
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

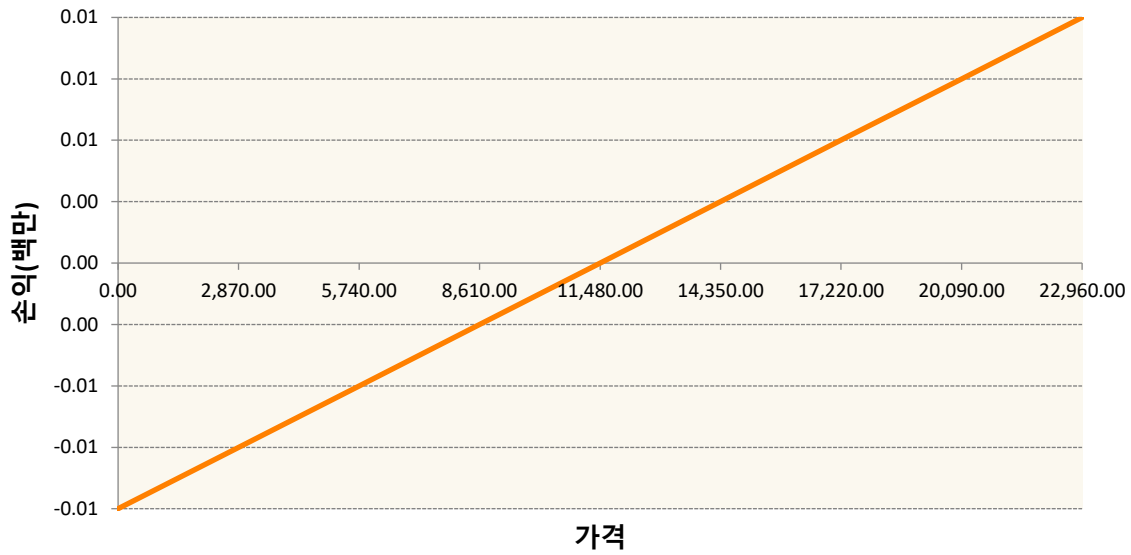
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7	0	7	장내
누계	유가증권	선물	862	0	862	장내

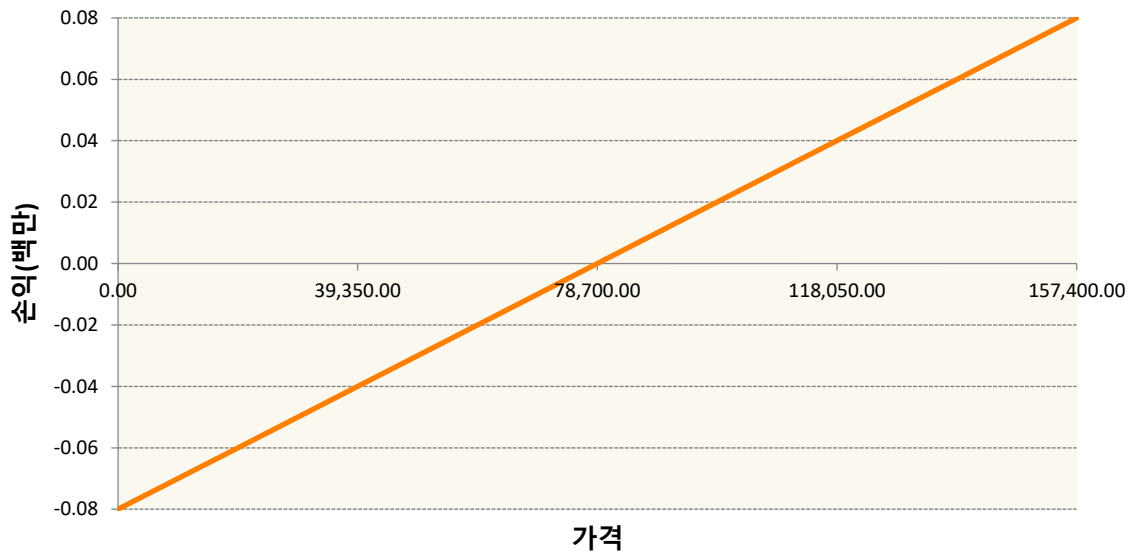
2. 만기시점의 손익구조



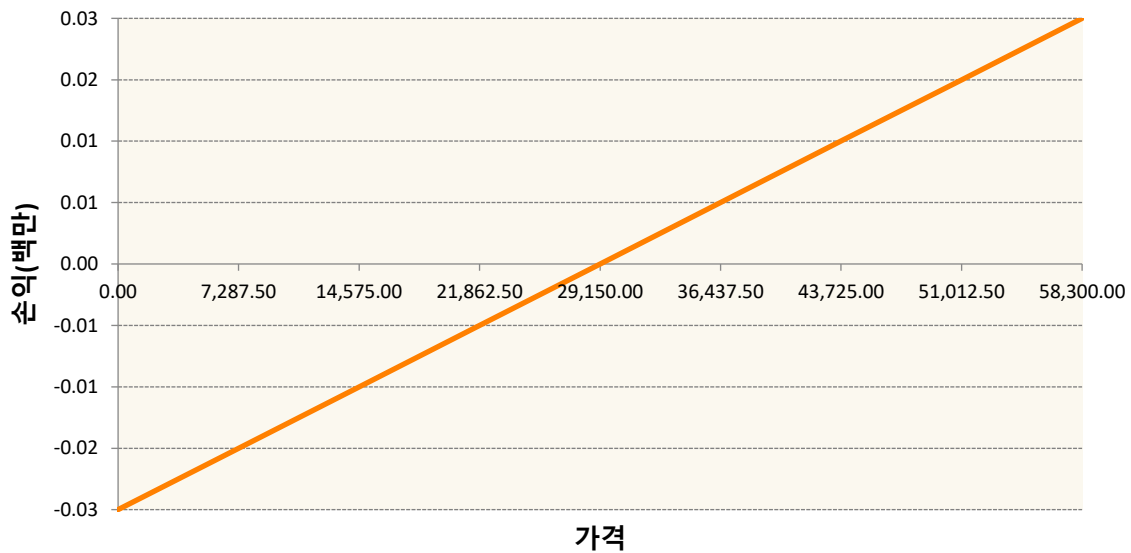
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



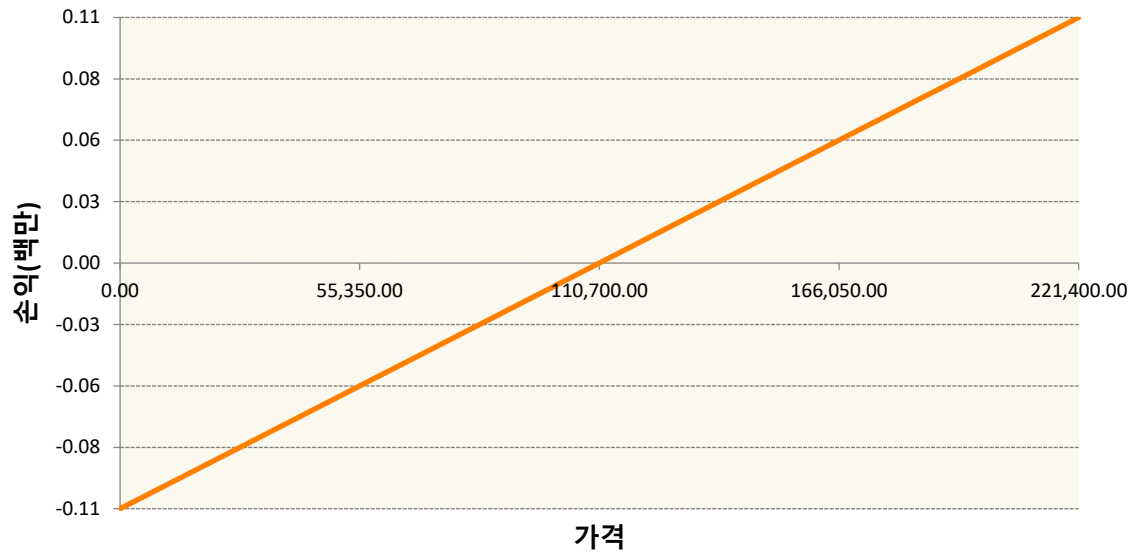
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



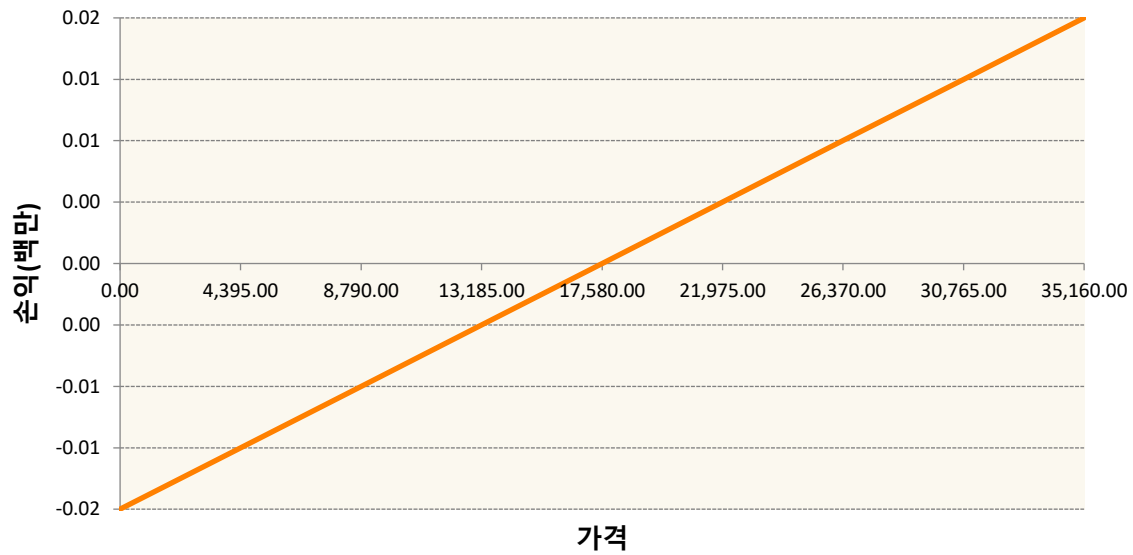
KR41BNVC0005-2024-12 현대건설개별선물



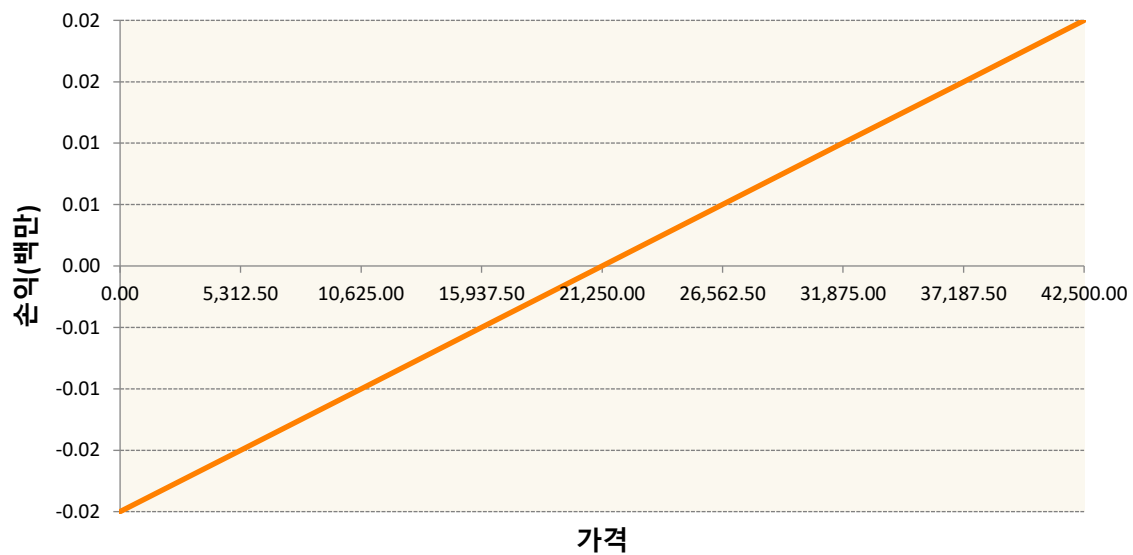
KR41C6VC0003-2024-12 아모레퍼시픽개별선물



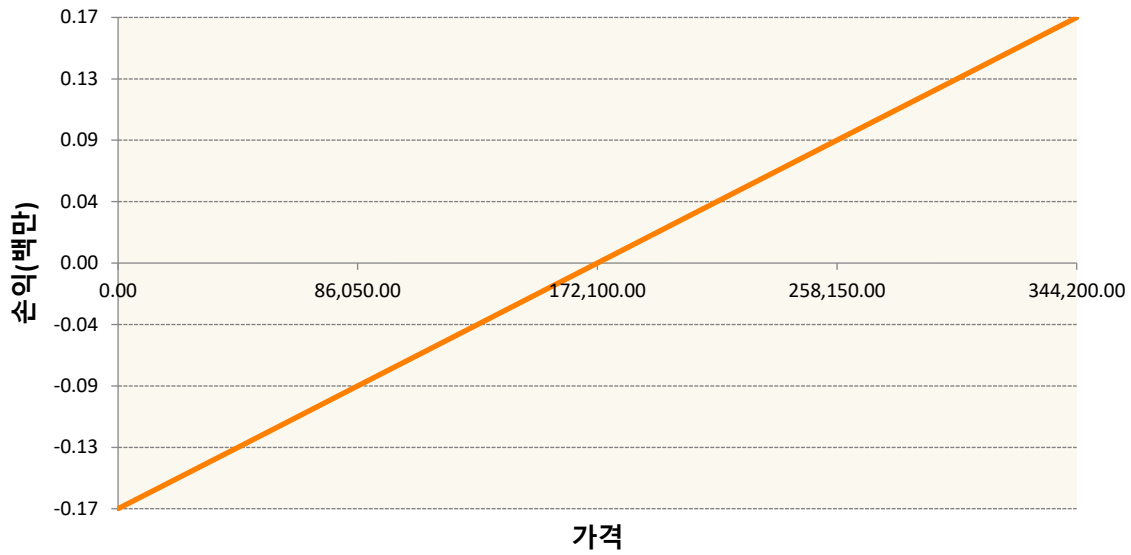
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



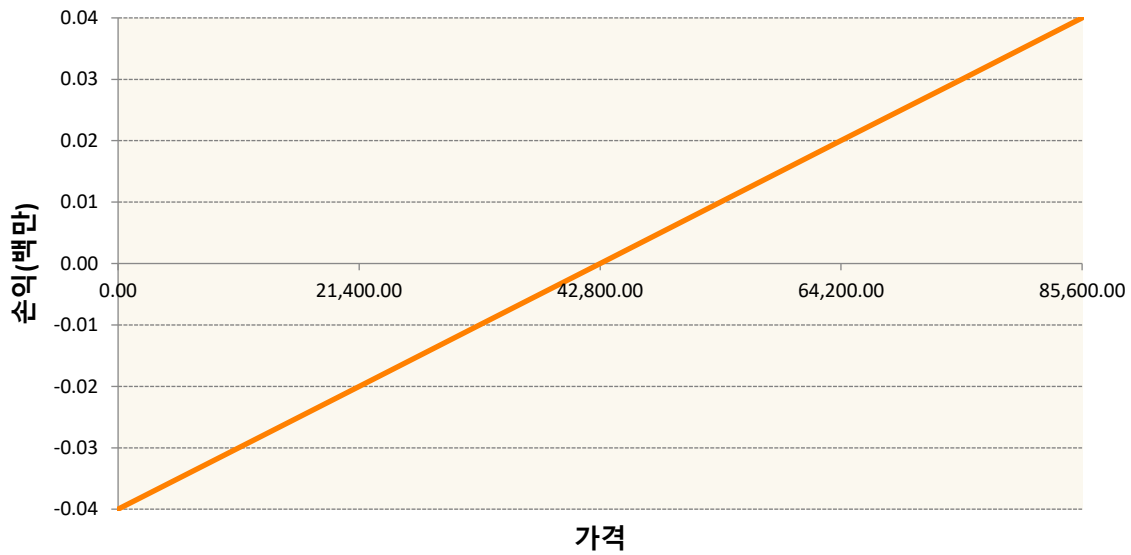
KR41CNVC0004-2024-12 포스코 ICT개별선물



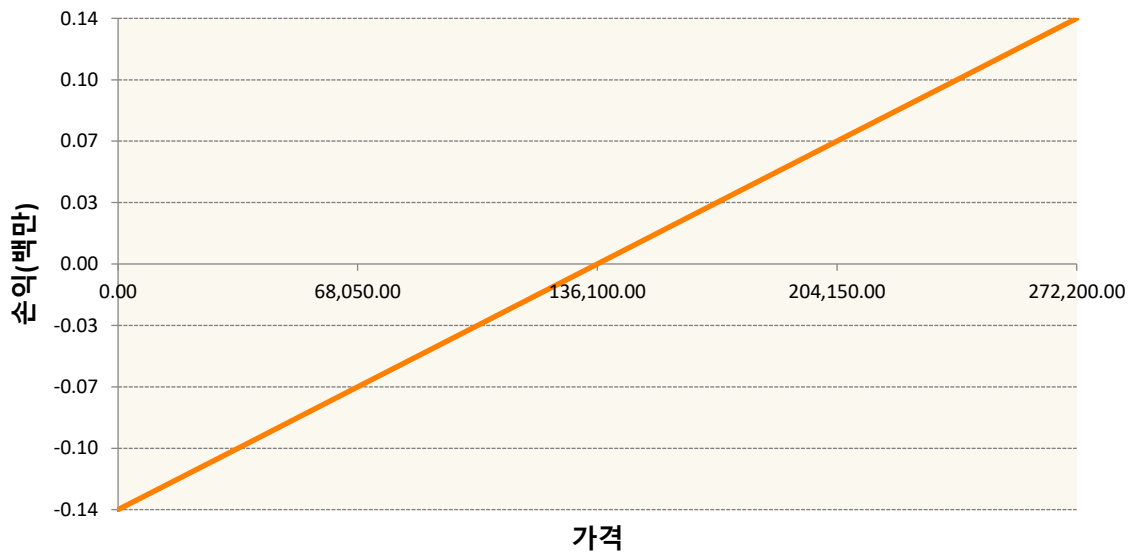
KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



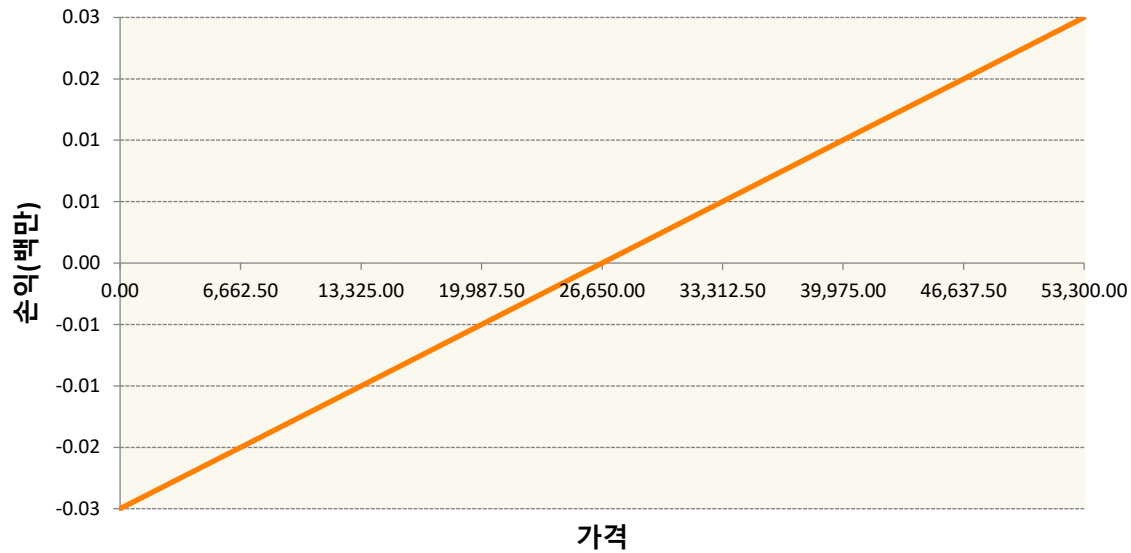
KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



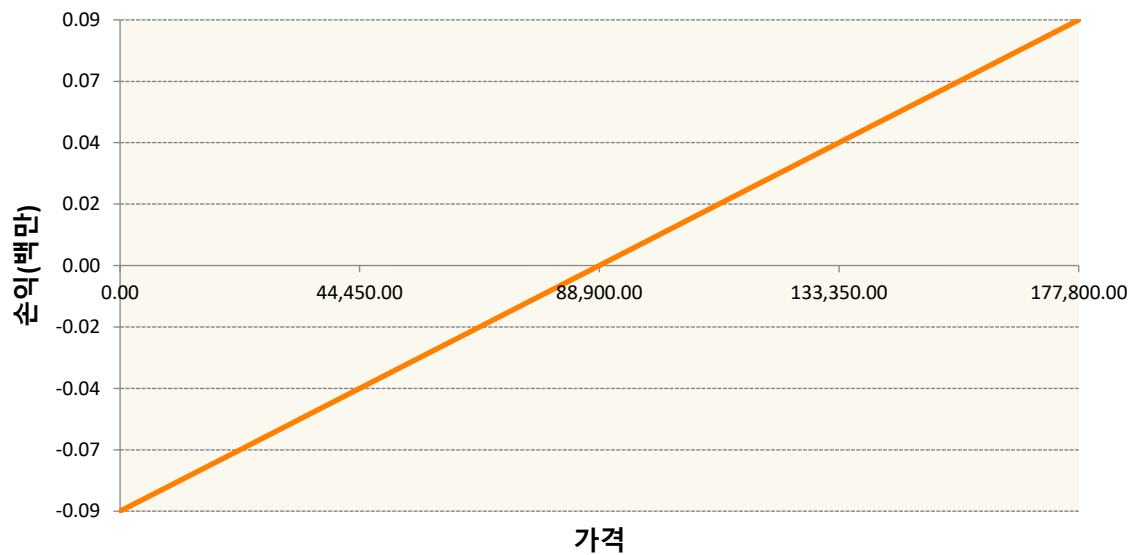
KR41GLVC0002-2024-12 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNVC0000-2024-12 금양개별선물



KR41GZVC0006-2024-12 에코프로머티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC00 2024-12 코스피200지수선물	59
KR410GVC00 2024-12 롯데관광개발개별선물	0.12
KR410JVC00 2024-12 명신산업개별선물	0.16
KR410ZVC00 2024-12 한미반도체개별선물	2
KR41BNVC00 2024-12 현대건설개별선물	1
KR41C6VC00 2024-12 아모레퍼시픽개별선물	2
KR41CBVC00 2024-12 한화솔루션개별선물	1
KR41CNVC00 2024-12 포스코 ICT개별선물	1
KR41E8VC00 2024-12 포스코케미칼개별선물	1
KR41F9VC00 2024-12 SK바이오사이언스개별선물	1
KR41GLVC00 2024-12 LS ELECTRIC개별선물	1
KR41GNVC00 2024-12 금양개별선물	0.45

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

(단위:백만원)

103

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

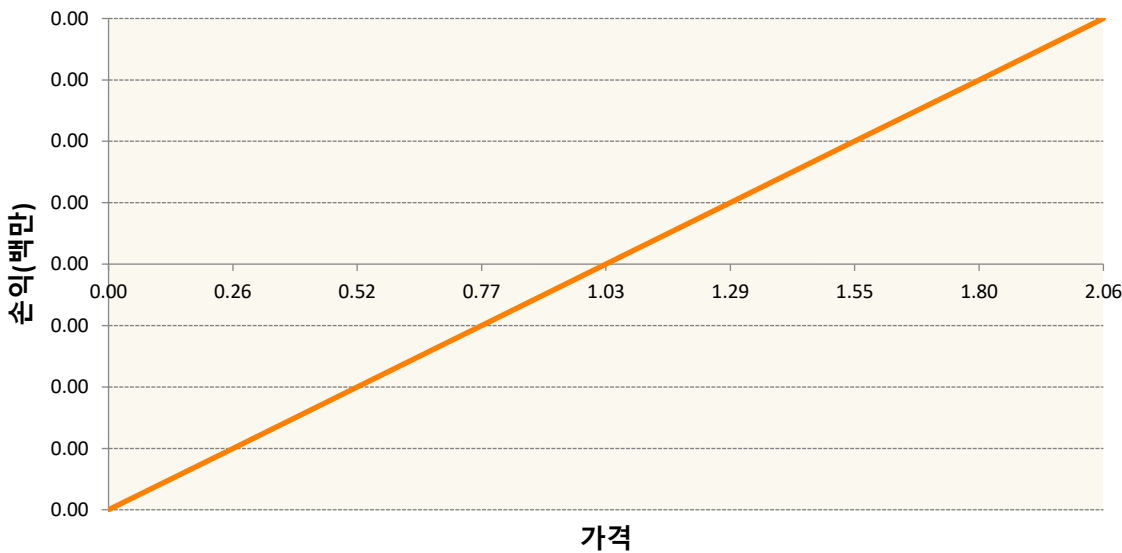
1. 계약금액

(단위:백만원)

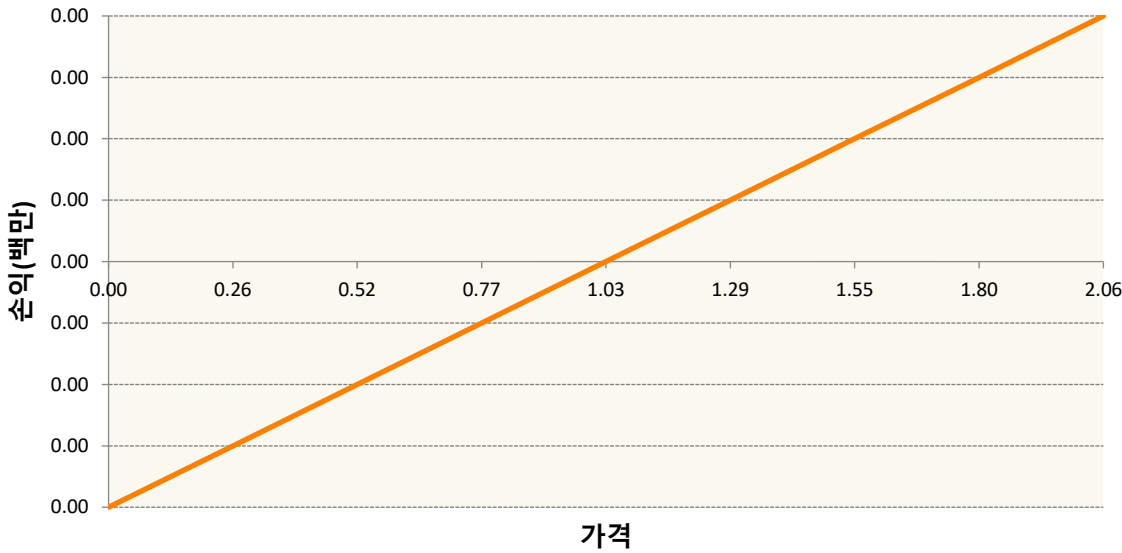
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,641	0	11,641	

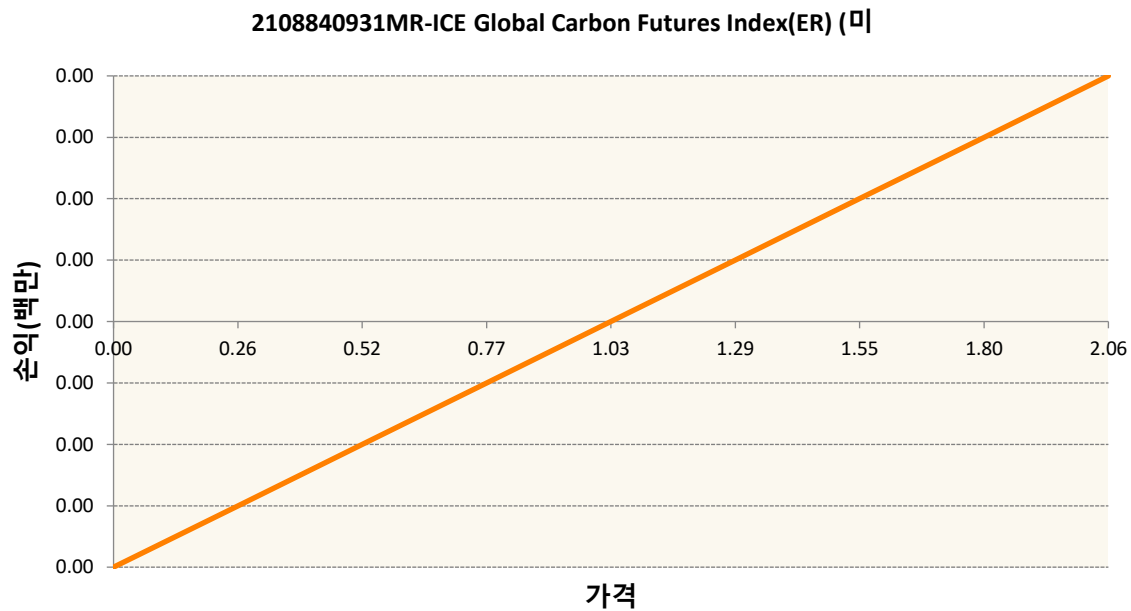
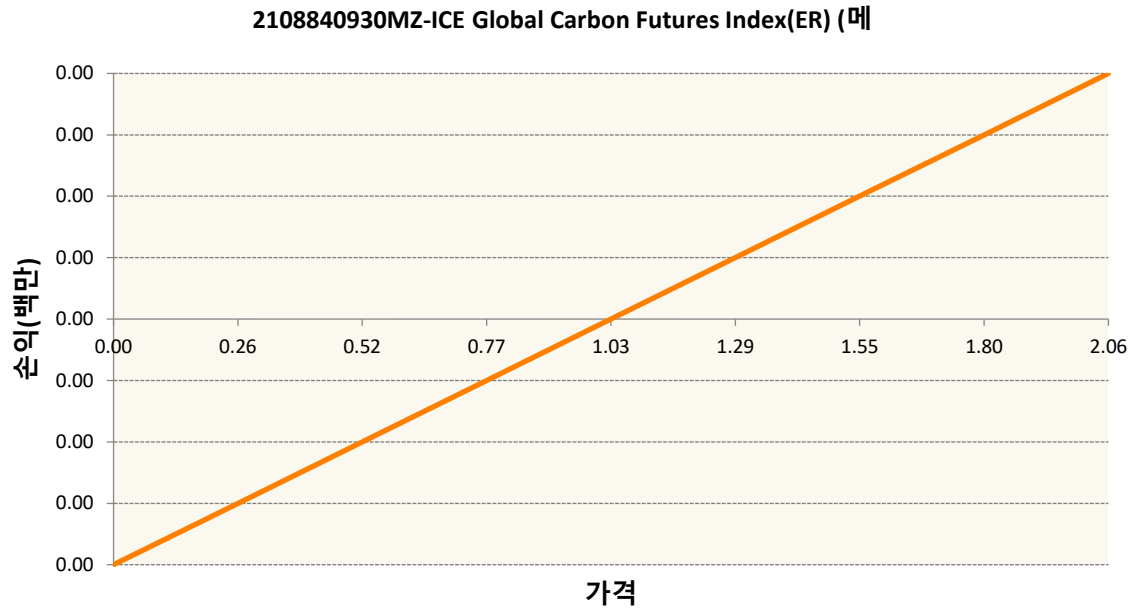
2. 만기시점의 손익구조

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		93
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		466
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		186
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		186

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		996

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

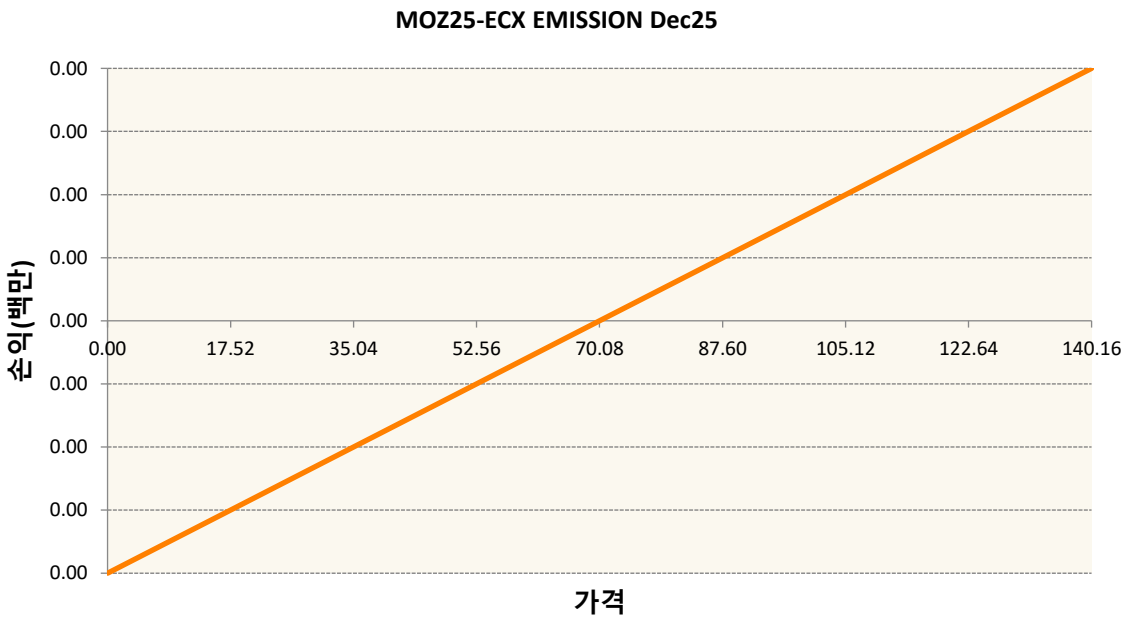
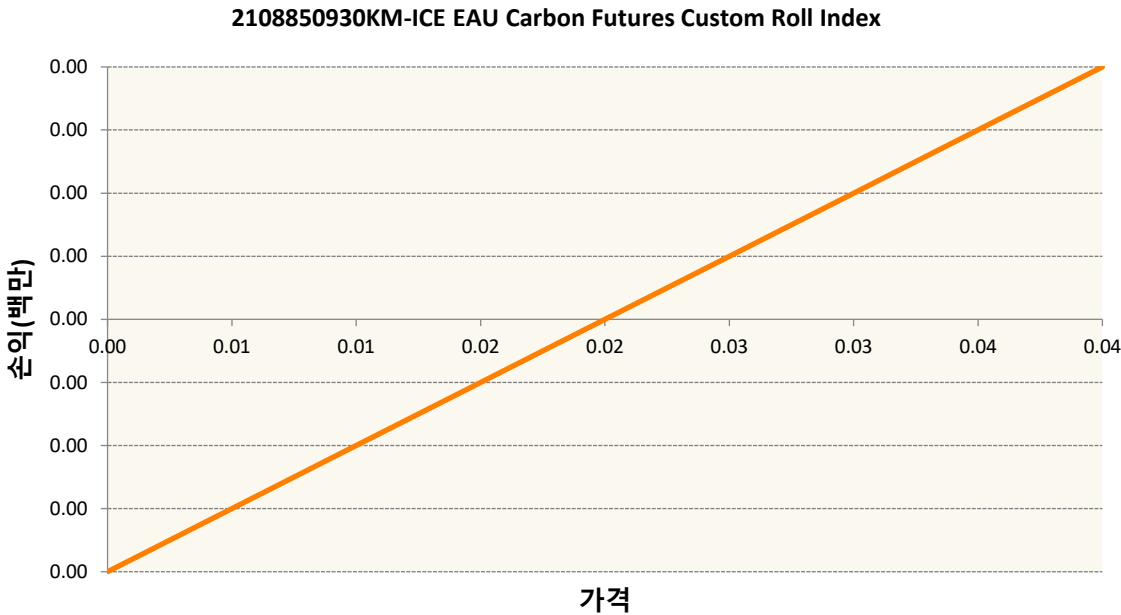
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,576	0	8,576	
누계	통화	선도	0	1,886	-1,886	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	140
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	686

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

1,224

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

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)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	29
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	29

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

(단위:백만원)

165

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

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)	58
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	49
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	70
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	15

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

(단위:백만원)

316

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

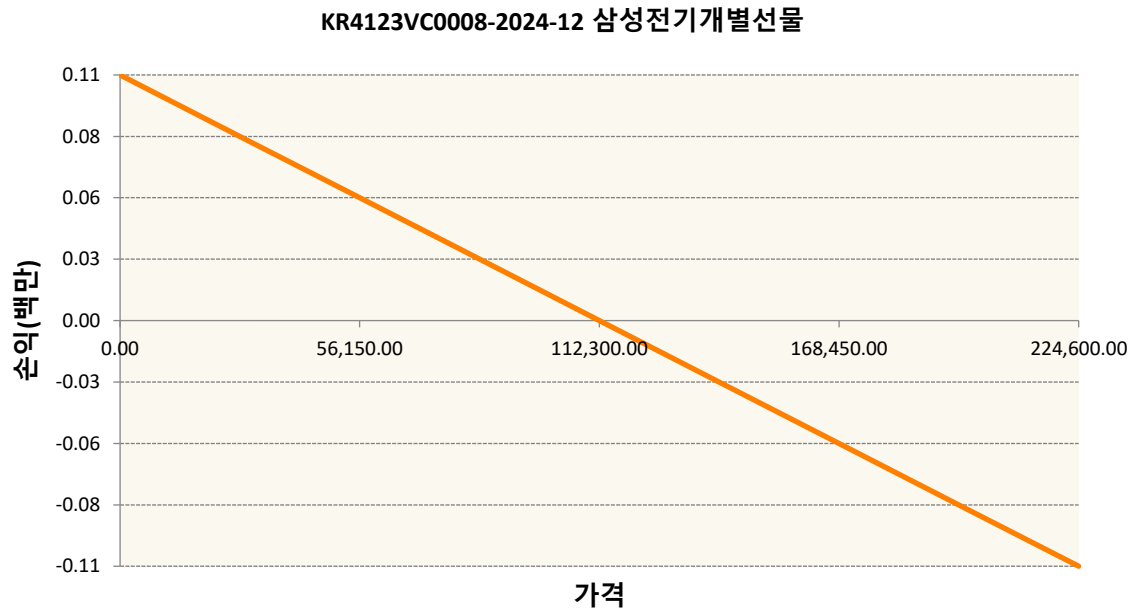
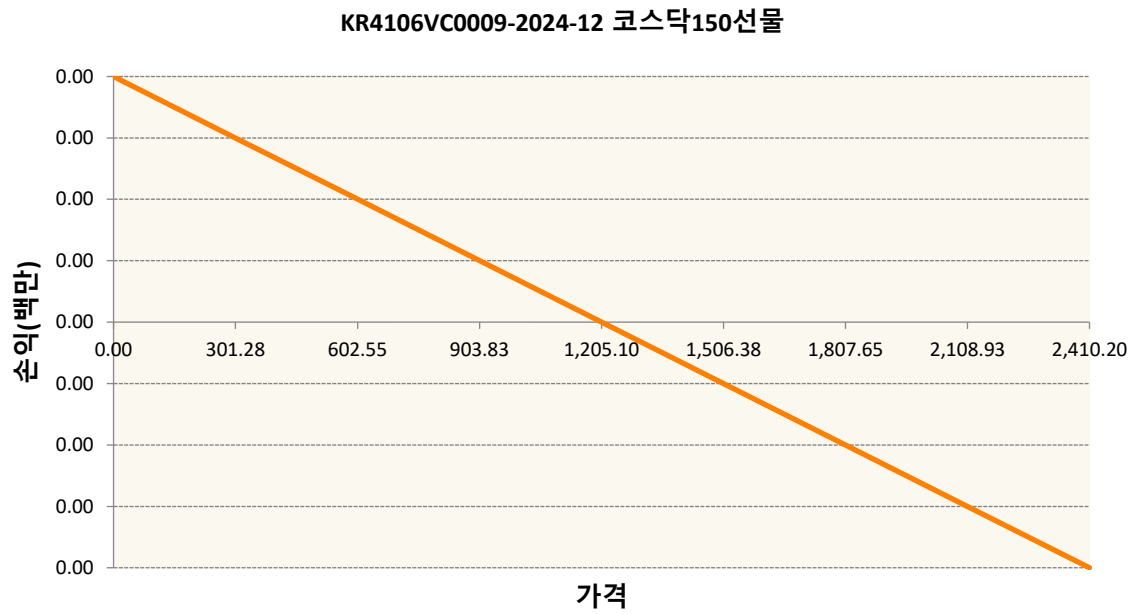
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

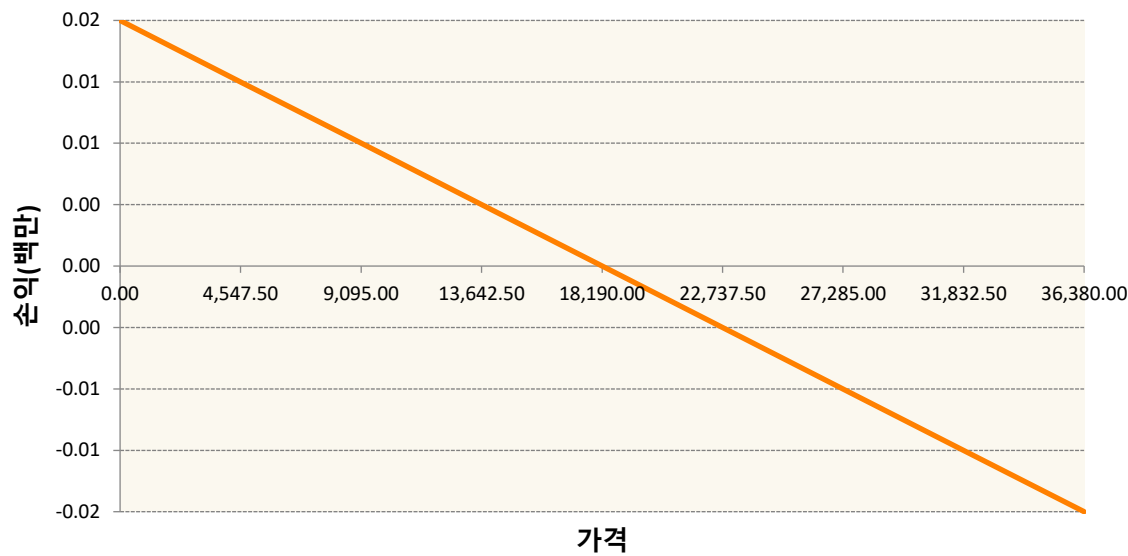
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	11	-11	장내
누계	유가증권	선물	8	116	-108	장내

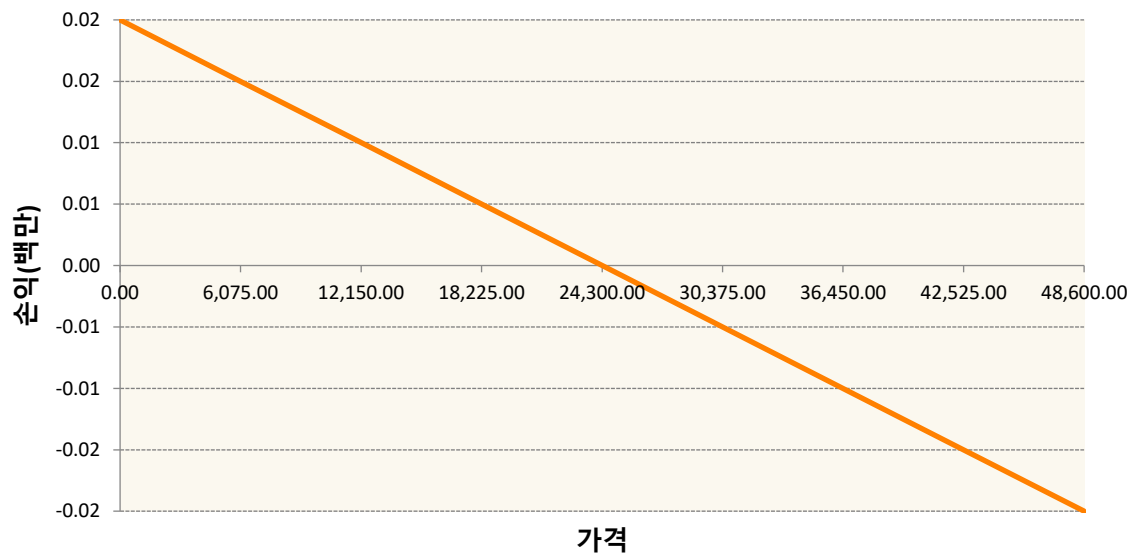
2. 만기시점의 손익구조



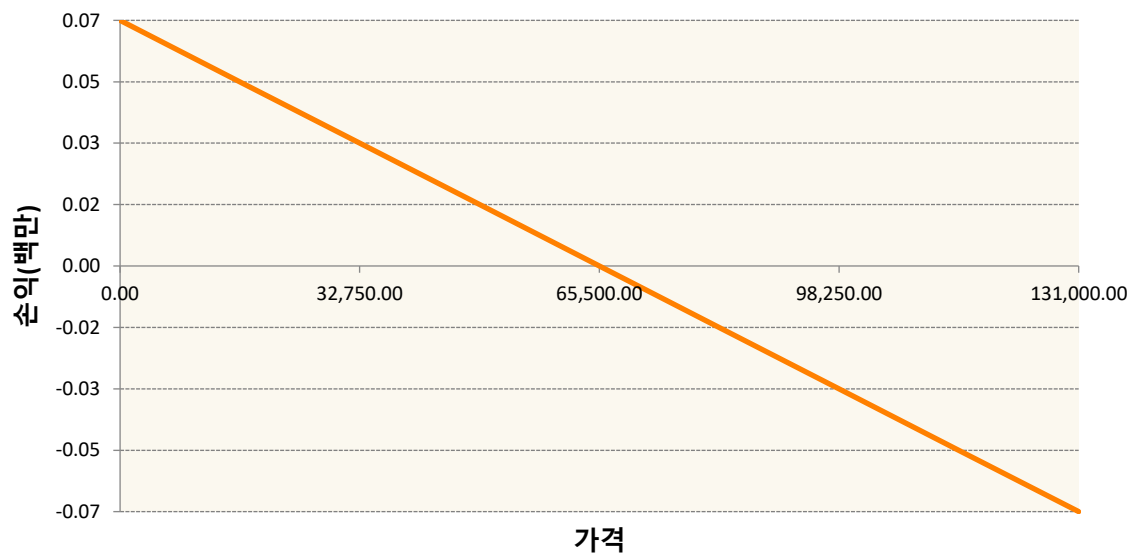
KR4151VC0003-2024-12 GS건설개별선물



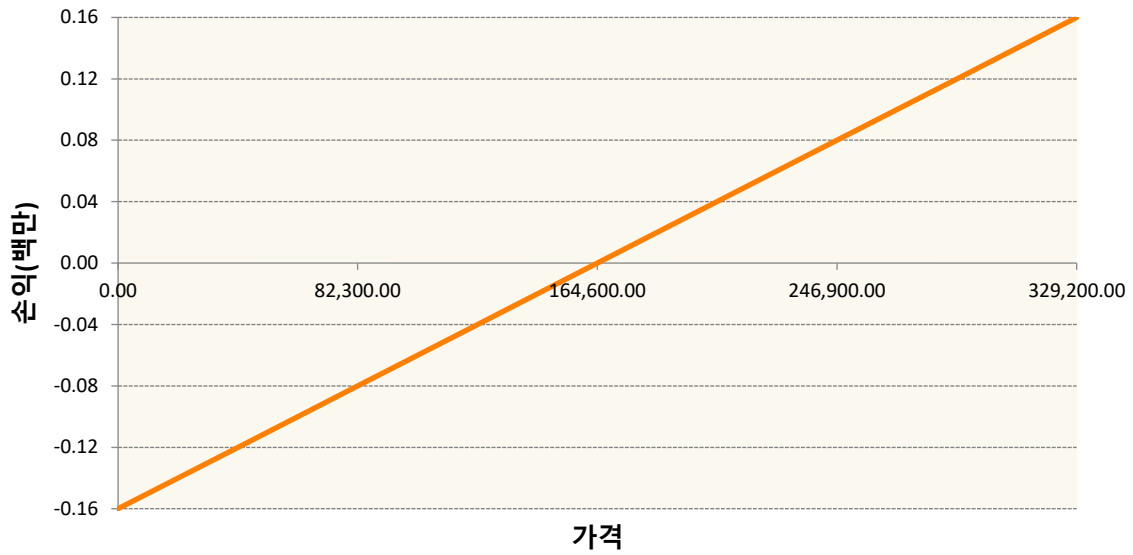
KR4157VC0007-2024-12 대한항공개별선물



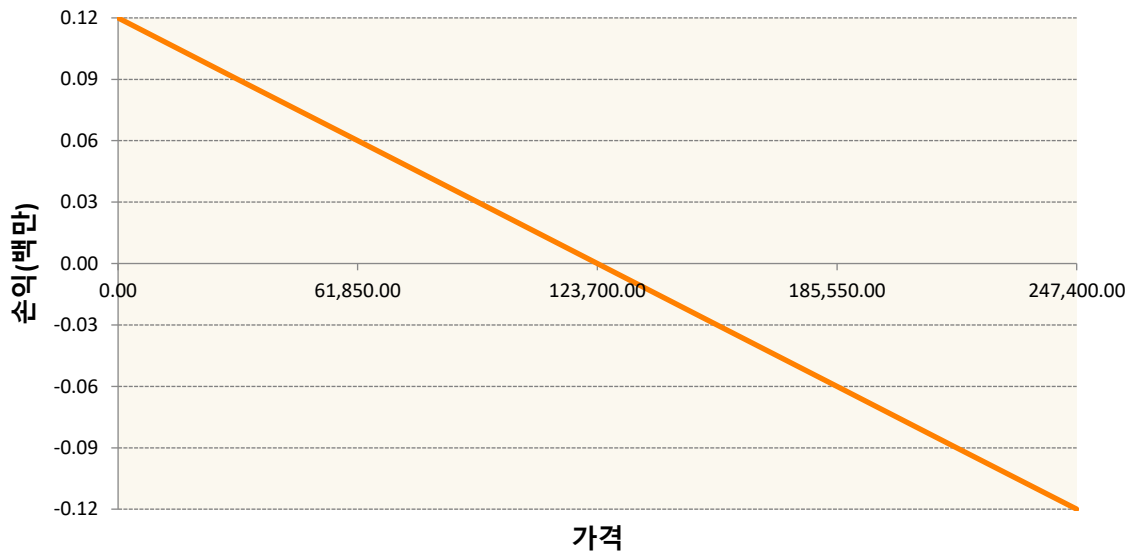
KR41BMVC0006-2024-12 한국항공우주개별선물



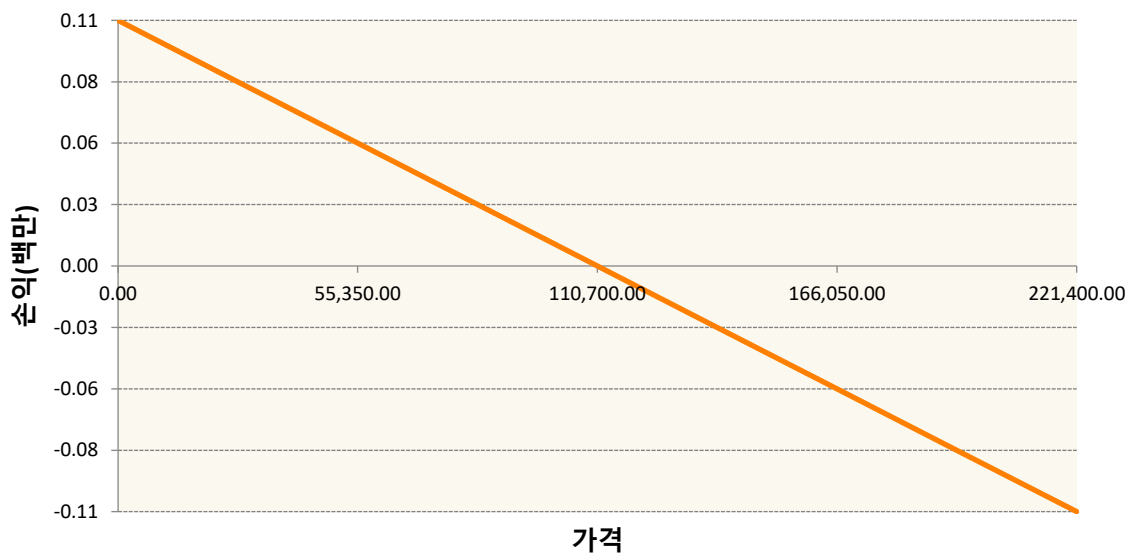
KR41BYVC0002-2024-12 LG이노텍개별선물



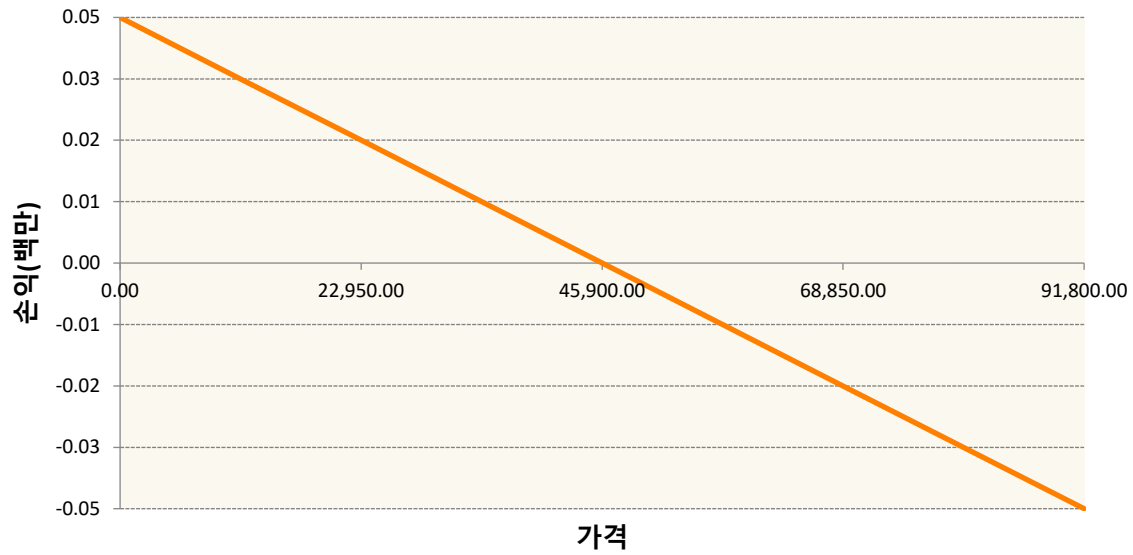
KR41C8VC0001-2024-12 삼성물산개별선물



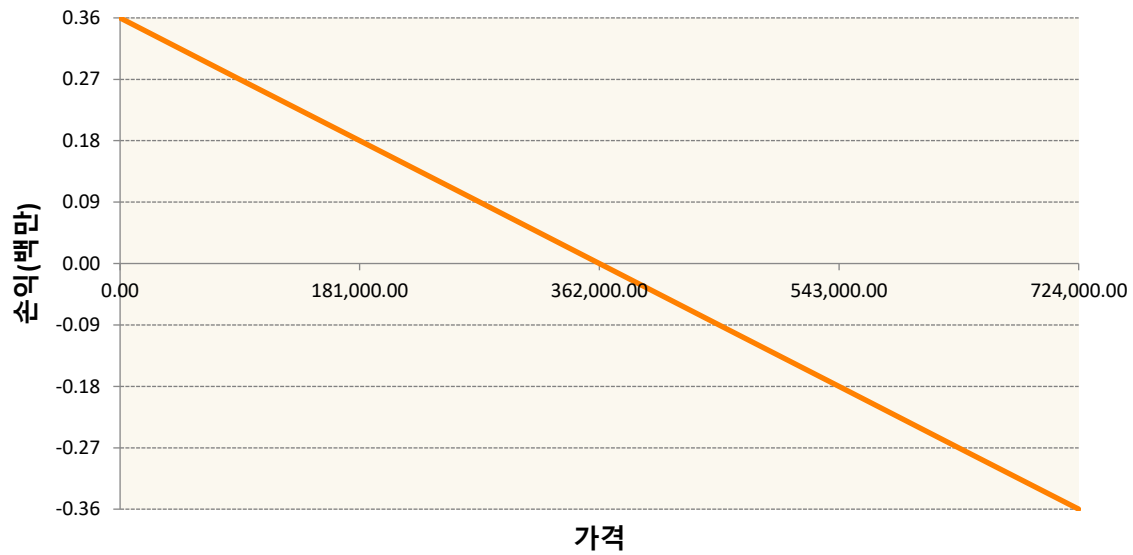
KR41CDVC0006-2024-12 현대미포조선개별선물



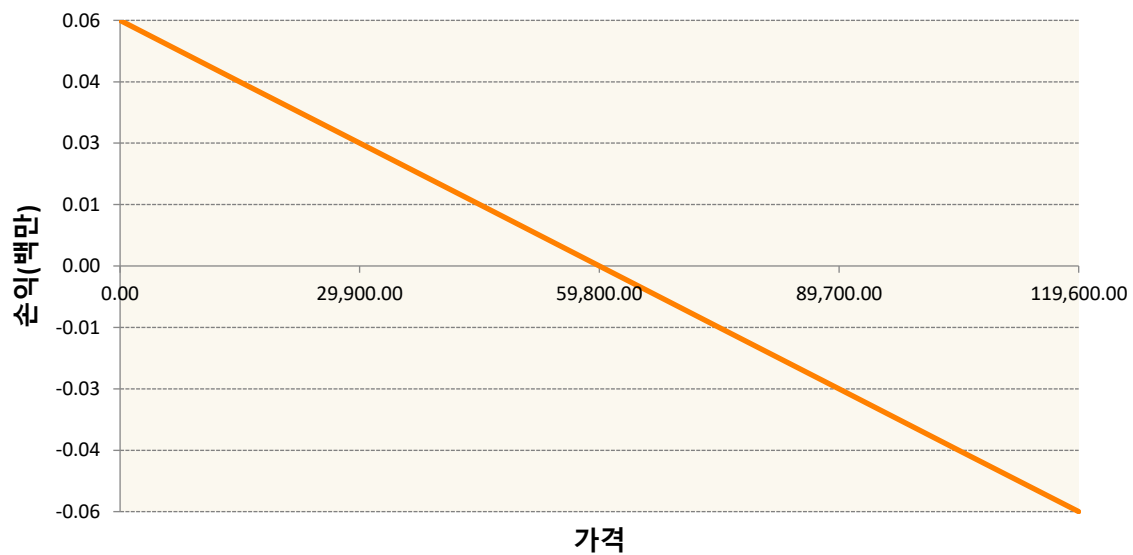
KR41CQVC0001-2024-12 와이지엔터테인먼트개별선물



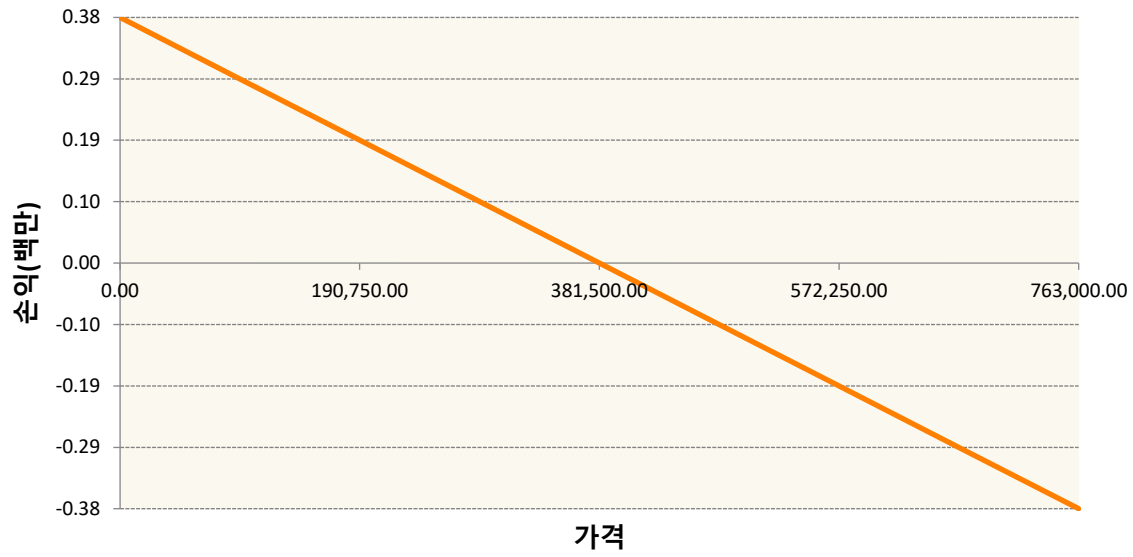
KR41CTVC0008-2024-12 삼성화재개별선물



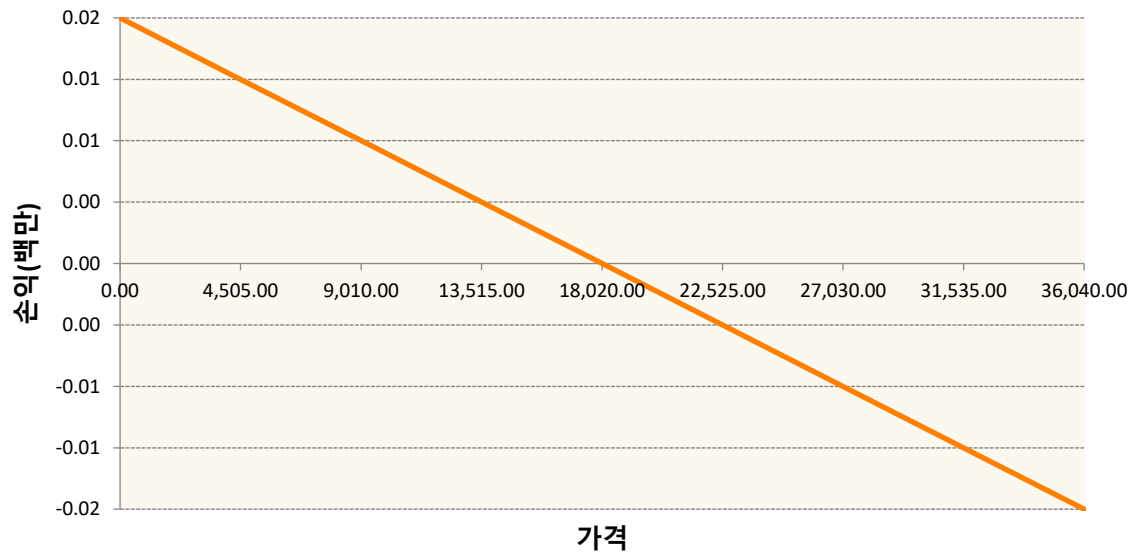
KR41EFVC0002-2024-12 JYP Ent.개별선물



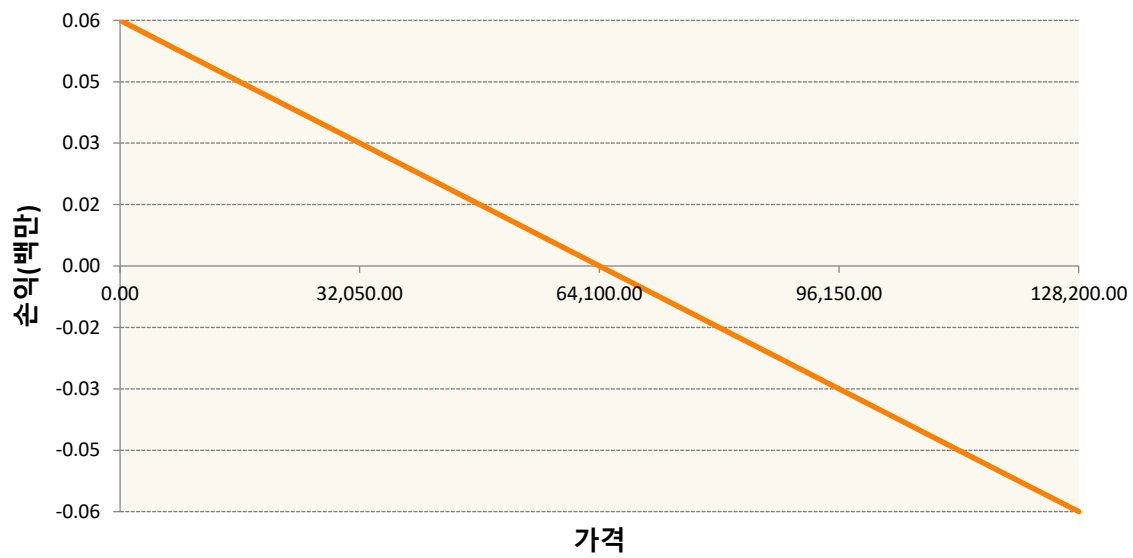
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



KR41FAVC0006-2024-12 HMM개별선물



KR41G6VC0004-2024-12 현대로템개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
KR4106VC00 2024-12 코스닥150선물	4
KR4123VC00 2024-12 삼성전기개별선물	1
KR4151VC00 2024-12 GS건설개별선물	1
KR4157VC00 2024-12 대한항공개별선물	0.27
KR41BMVC0 2024-12 한국항공우주개별선물	0.31
KR41BYVC00 2024-12 LG이노텍개별선물	1
KR41C8VC00 2024-12 삼성물산개별선물	0.3
KR41CDVC00 2024-12 현대미포조선개별선물	1
KR41CQVC00 2024-12 와이지엔터테인먼트개별선물	1
KR41CTVC00 2024-12 삼성화재개별선물	0.29
KR41EFVC00 2024-12 JYP Ent.개별선물	0.38
KR41F5VC00 2024-12 LG에너지솔루션개별선물	0.31
KR41FAVC00 2024-12 HMM개별선물	0.29
KR41G6VC00 2024-12 현대로템개별선물	1

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

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

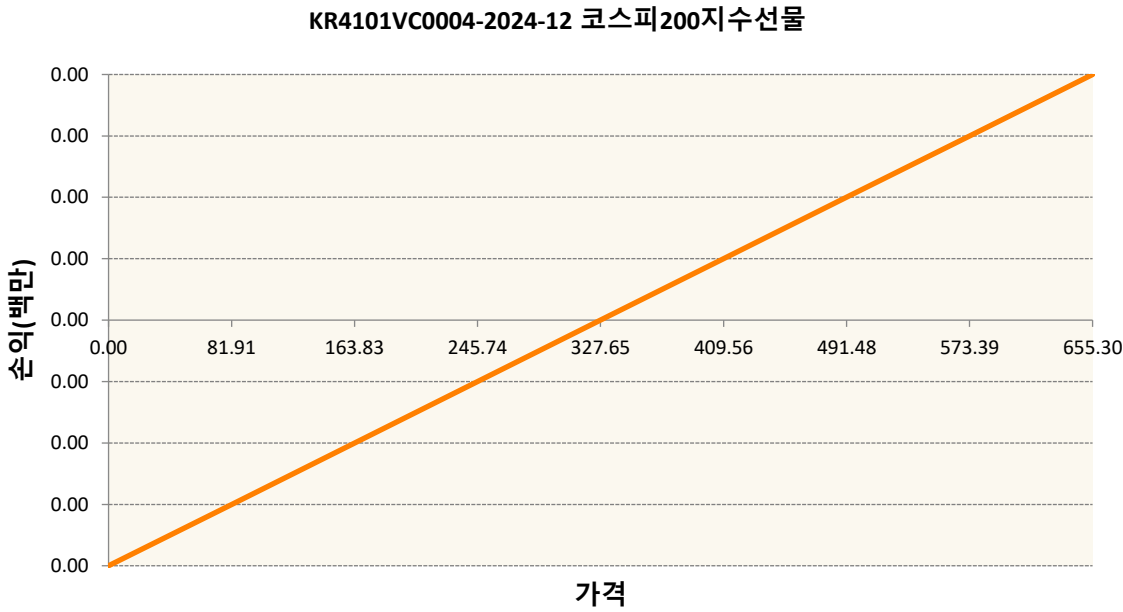
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	9,830	0	9,830	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				788
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-788	-788	-788	-788	-788	-788	-788
-5.33%	-526	-526	-526	-526	-526	-526	-526
-2.67%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	263	263	263	263	263	263	263
5.33%	526	526	526	526	526	526	526
8.00%	788	788	788	788	788	788	788

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

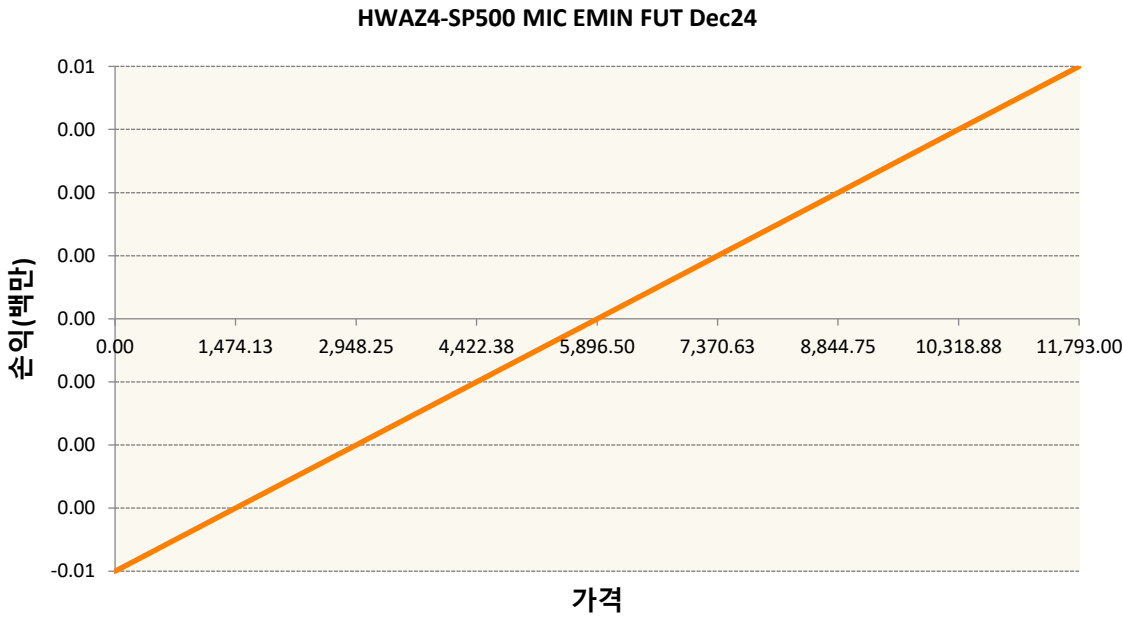
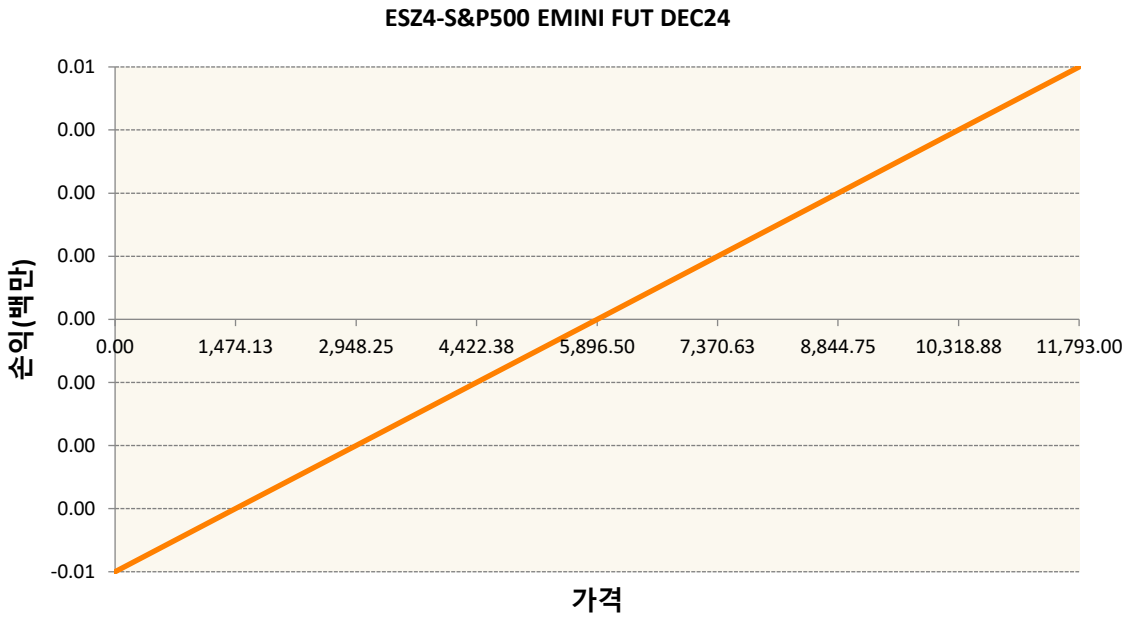
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	17,563	0	17,563	
누계	유가증권	선물	1,732	0	1,732	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,405
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	139

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	951

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

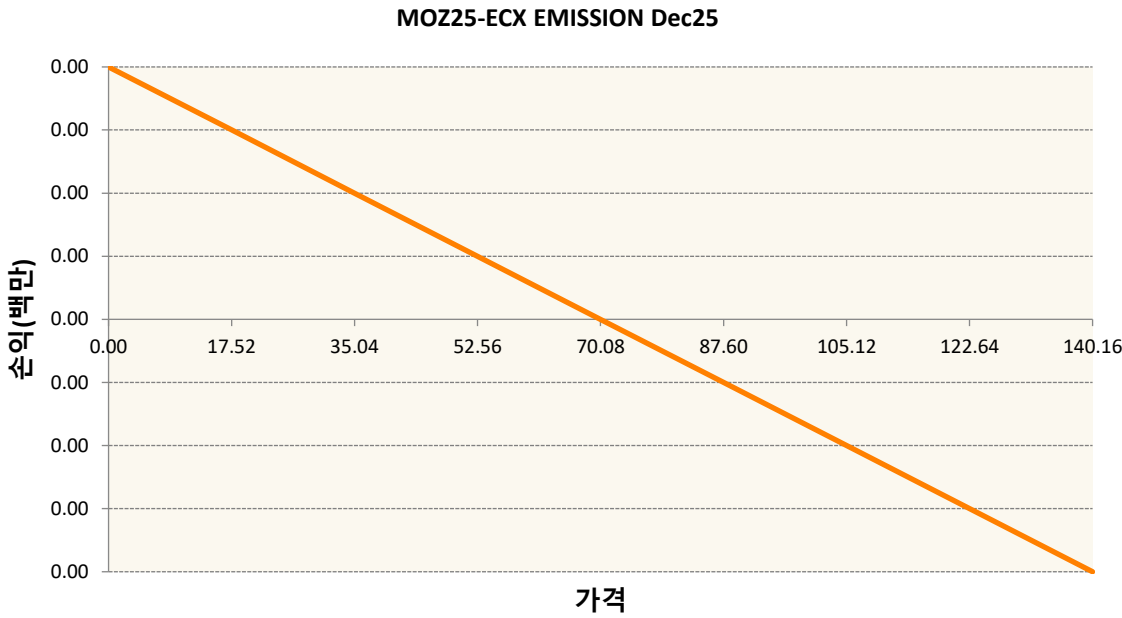
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,594	-5,601	
누계	통화	선도	0	1,405	-1,405	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213EAW KRW/EUR 29-11-24E	112
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	448

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

(단위:백만원)

807

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

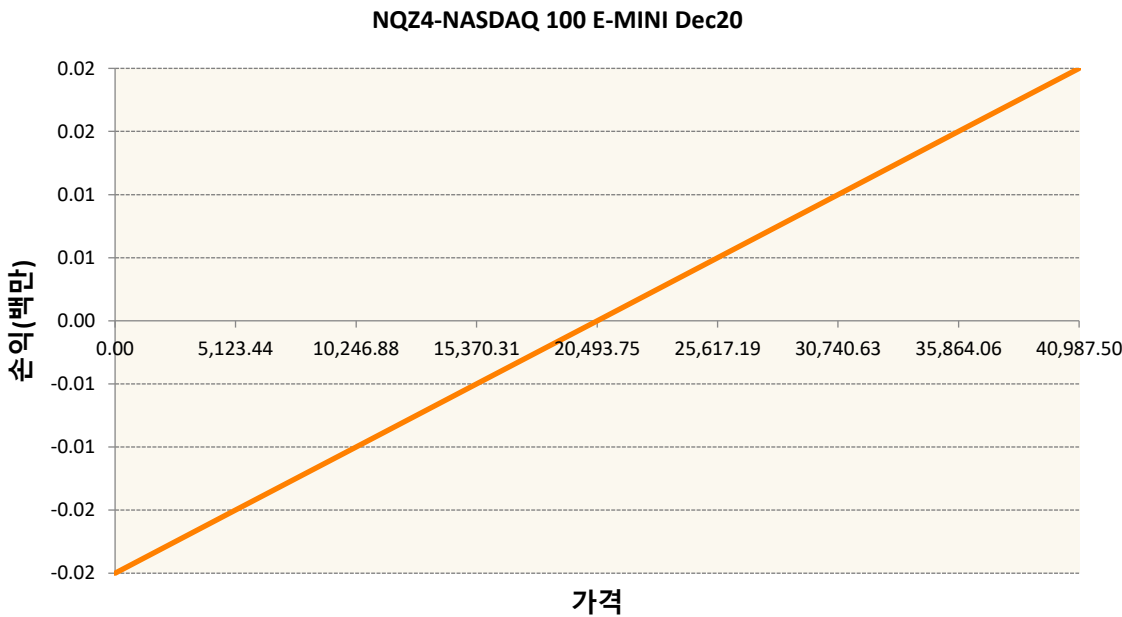
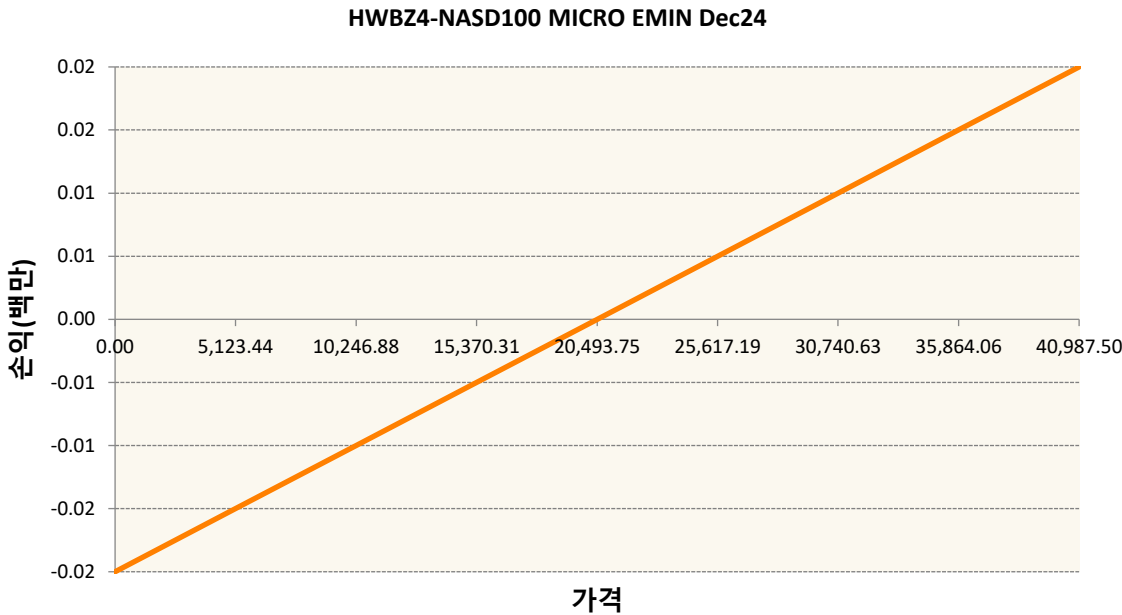
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	9,980	0	9,980	
누계	유가증권	선물	1,289	0	1,289	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		103
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		798

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			753

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

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	691
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,231
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,613
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,164

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

(단위:백만원)

9,413

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

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	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13

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

(단위:백만원)

57

공시일	2024-11-19
기준일	2024-11-18

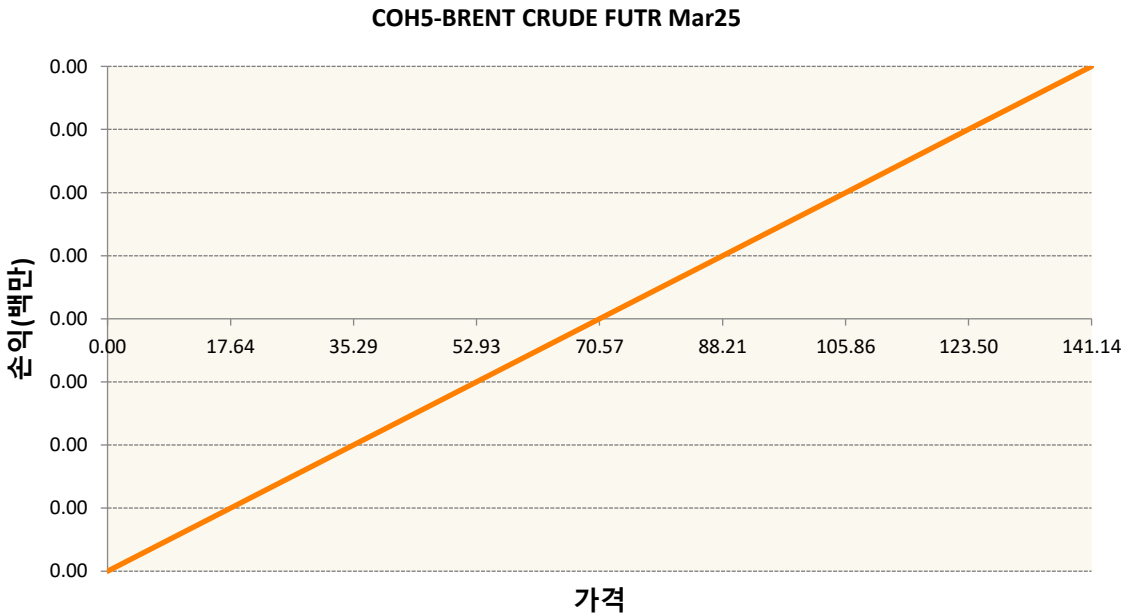
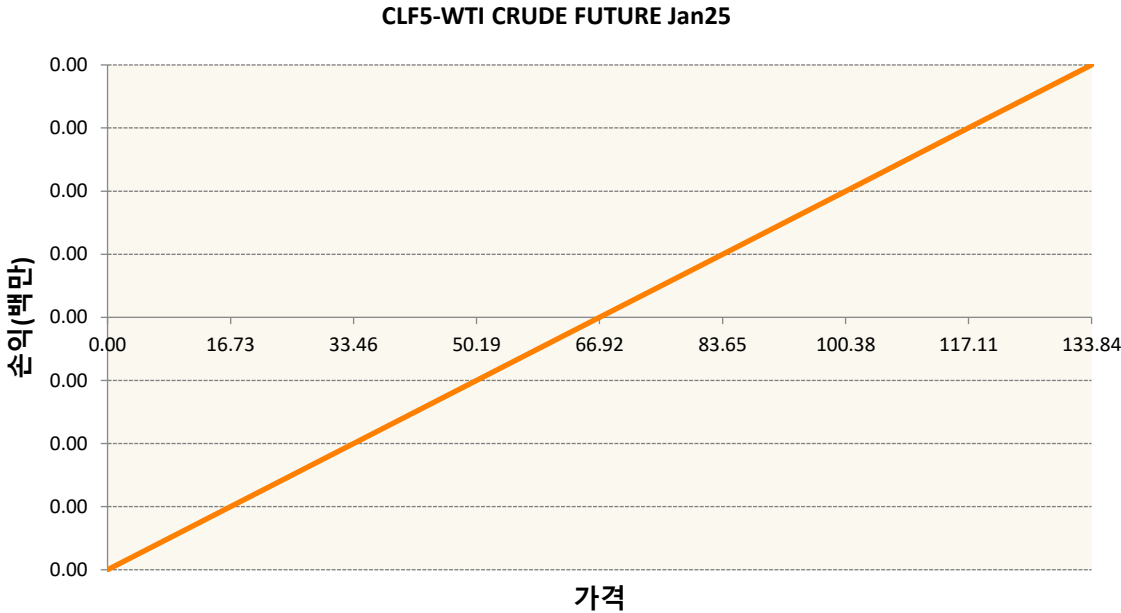
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

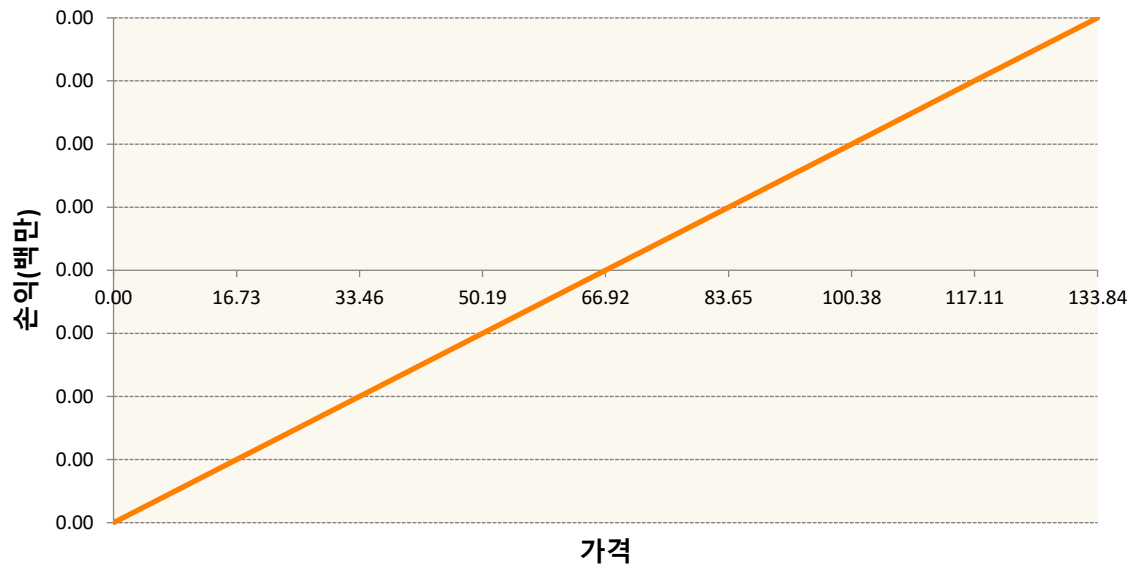
(단위:백만원)

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	762	0	762	
누계	통화	선물	0	98	-98	장내

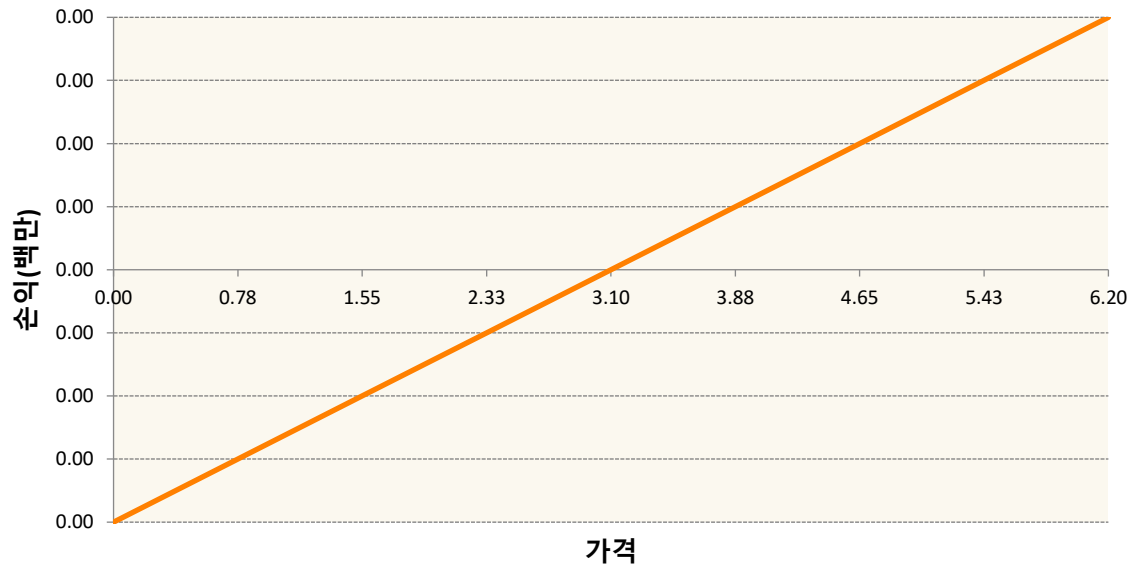
2. 만기시점의 손익구조



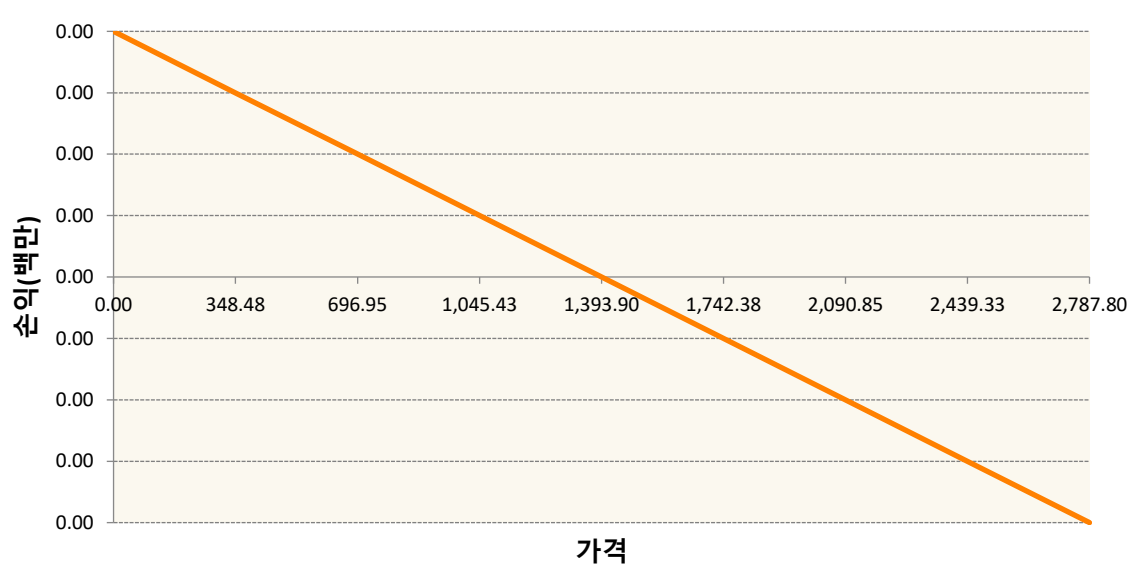
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



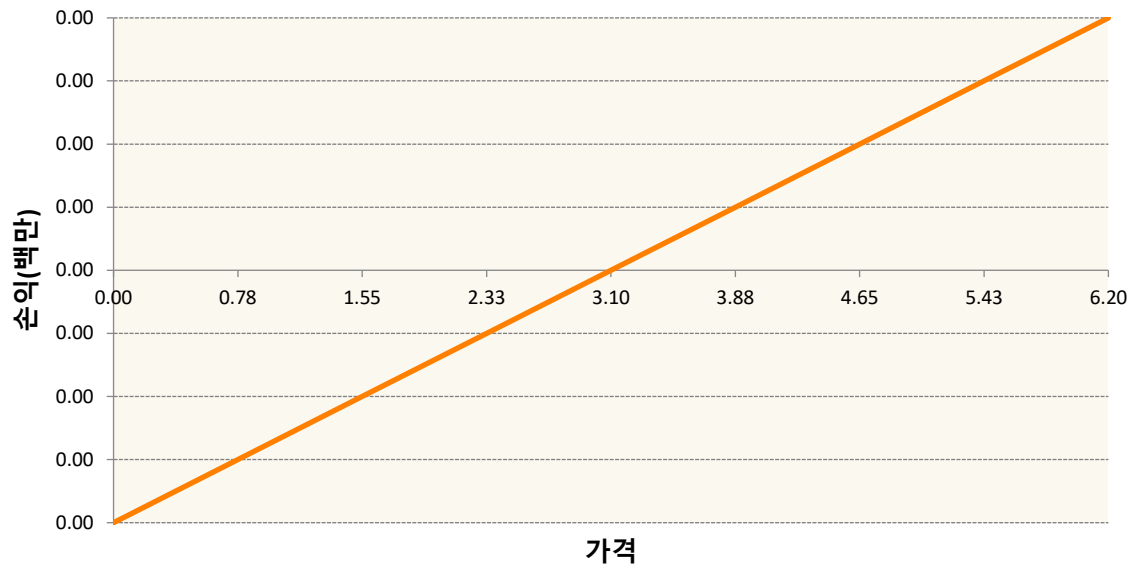
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



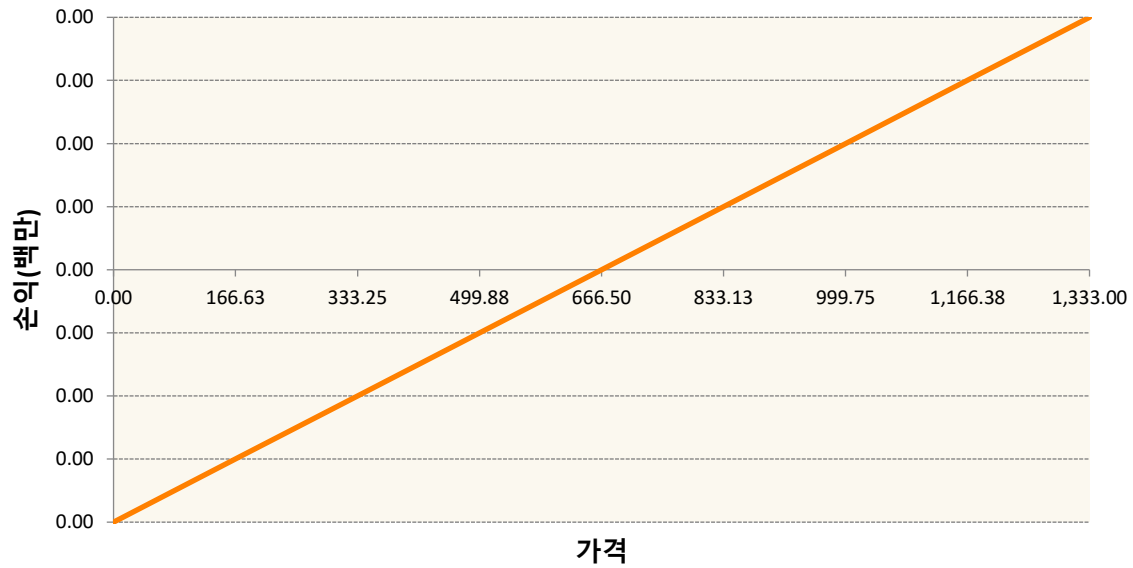
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



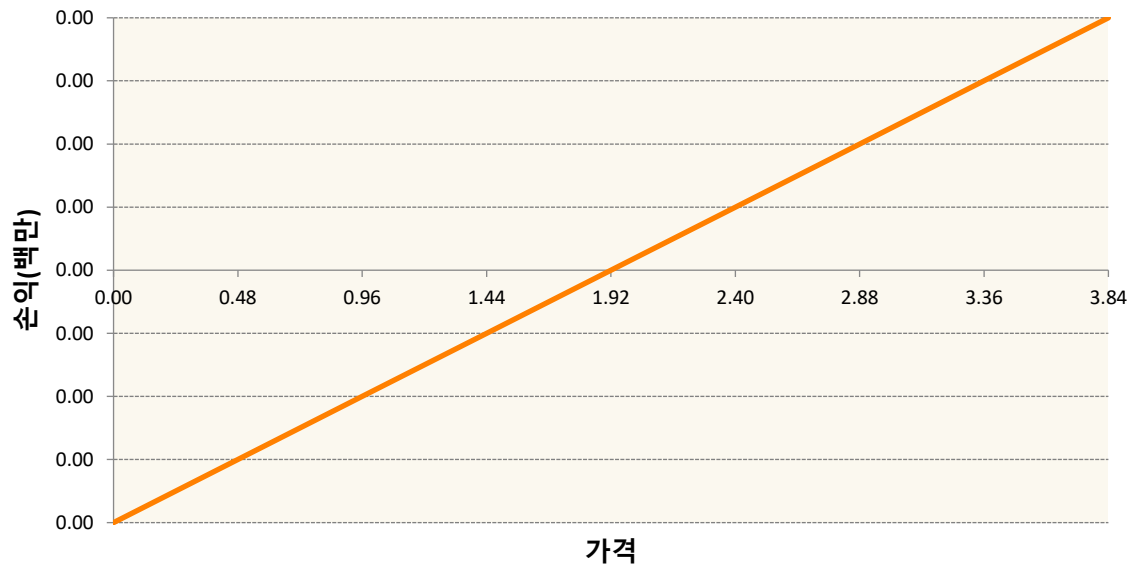
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



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)

133