

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

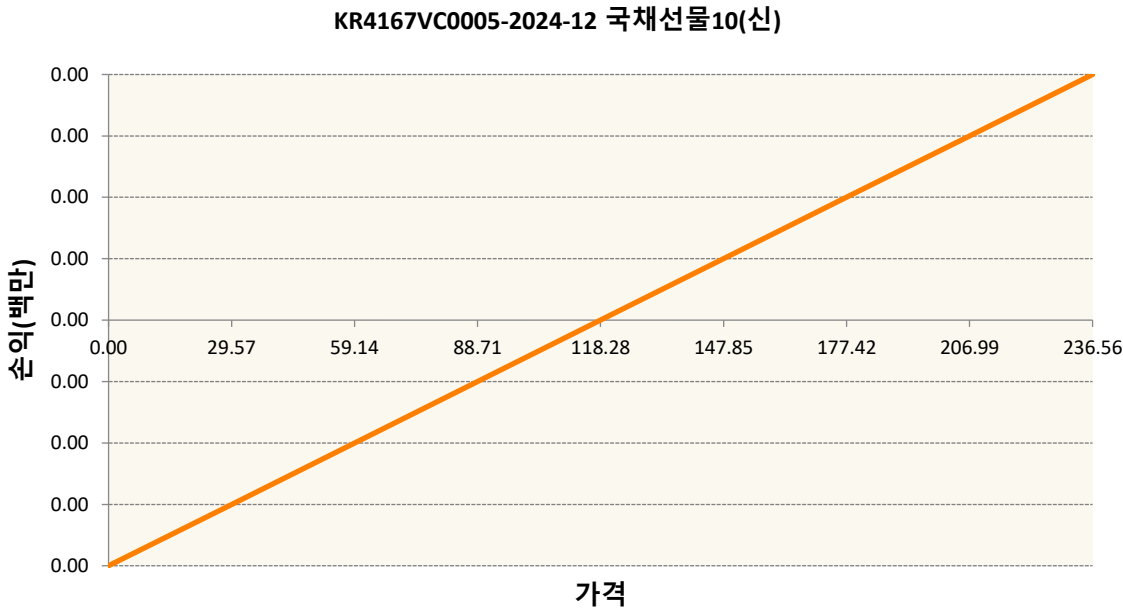
베스트장기채(채권-파생형)

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	151,990	0	151,990	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4167VC00 2024-12 국채선물10(신)	12,159
------------------------------	--------

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

(단위:백만원)

3,949

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

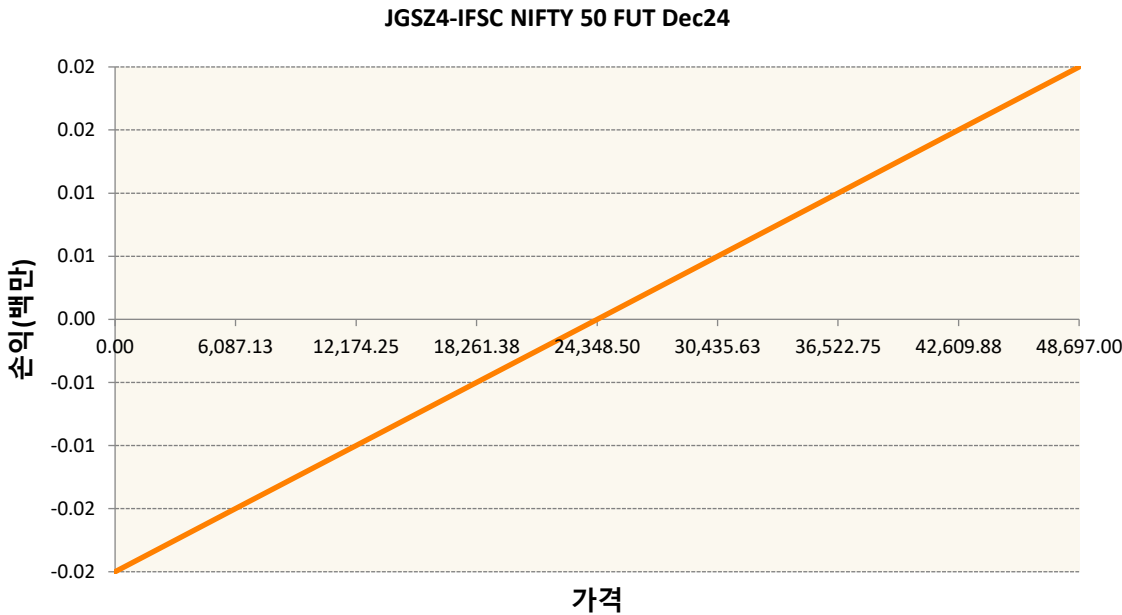
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	
누계	유가증권	선물	3,333	0	3,333	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSZ4	IFSC NIFTY 50 FUT Dec24	267
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

175

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

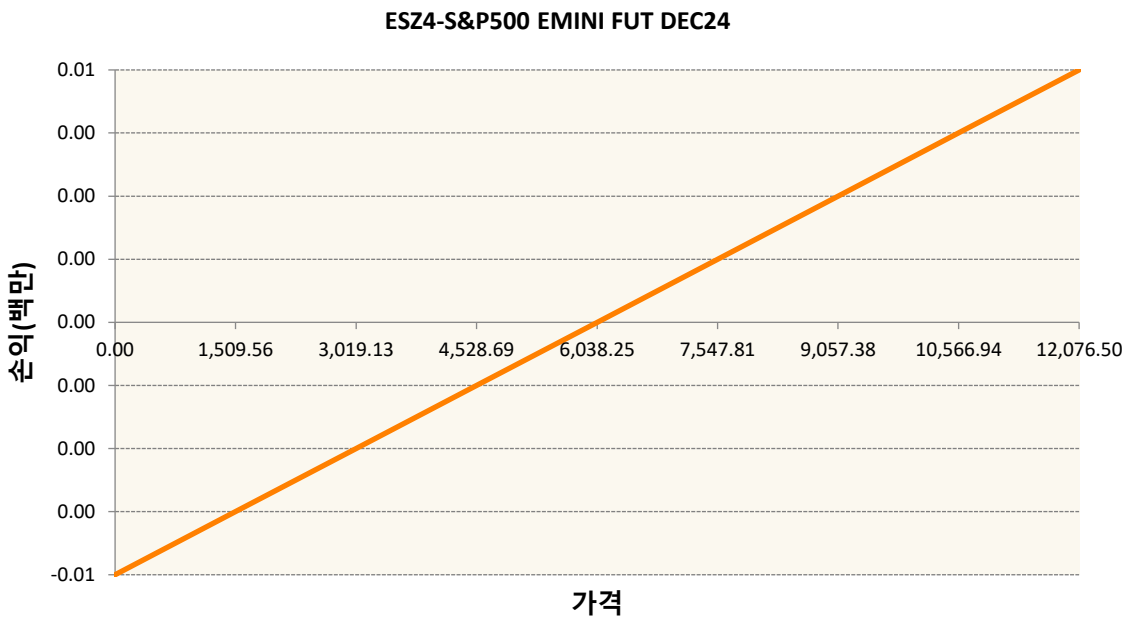
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	836	0	836	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	67
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

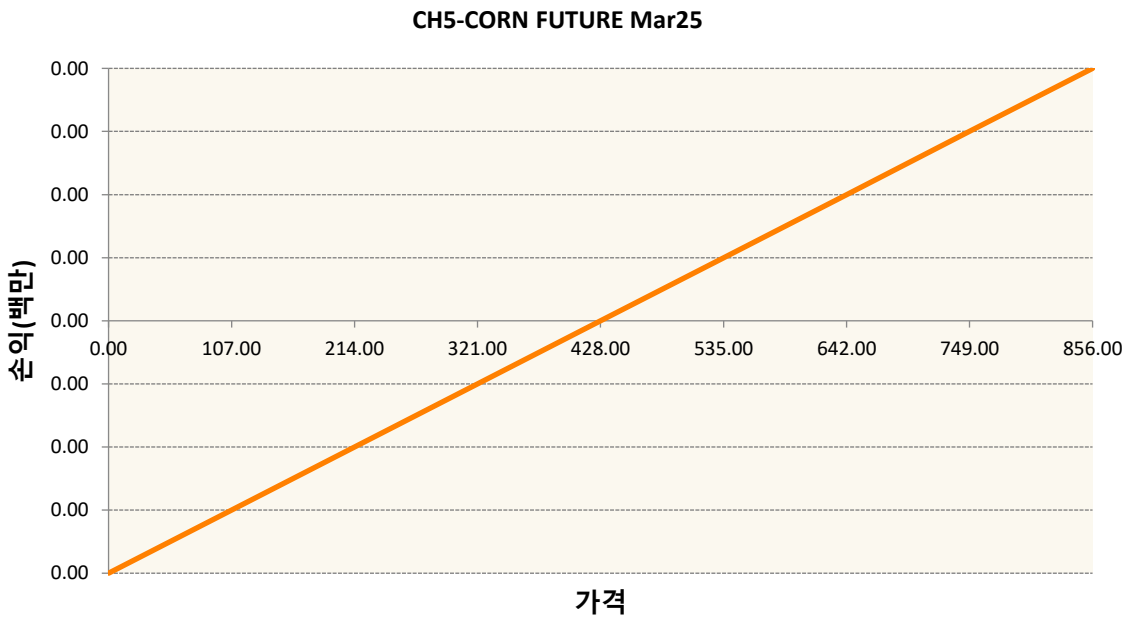
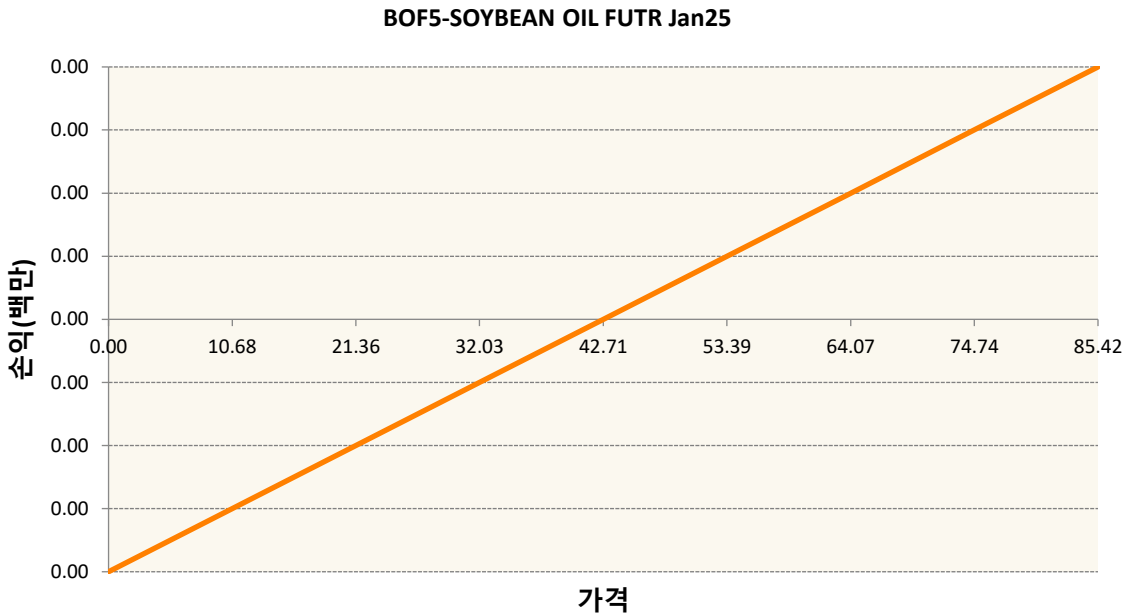
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

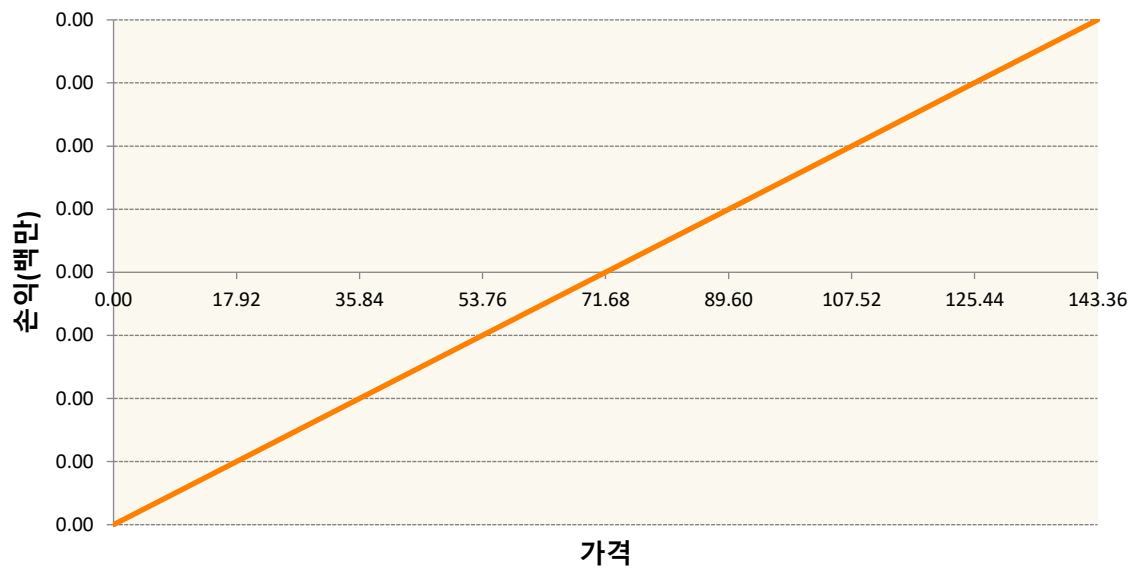
(단위:USD 백만)

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	3,766	0	3,766	
누계	통화	선물	0	475	-475	장내

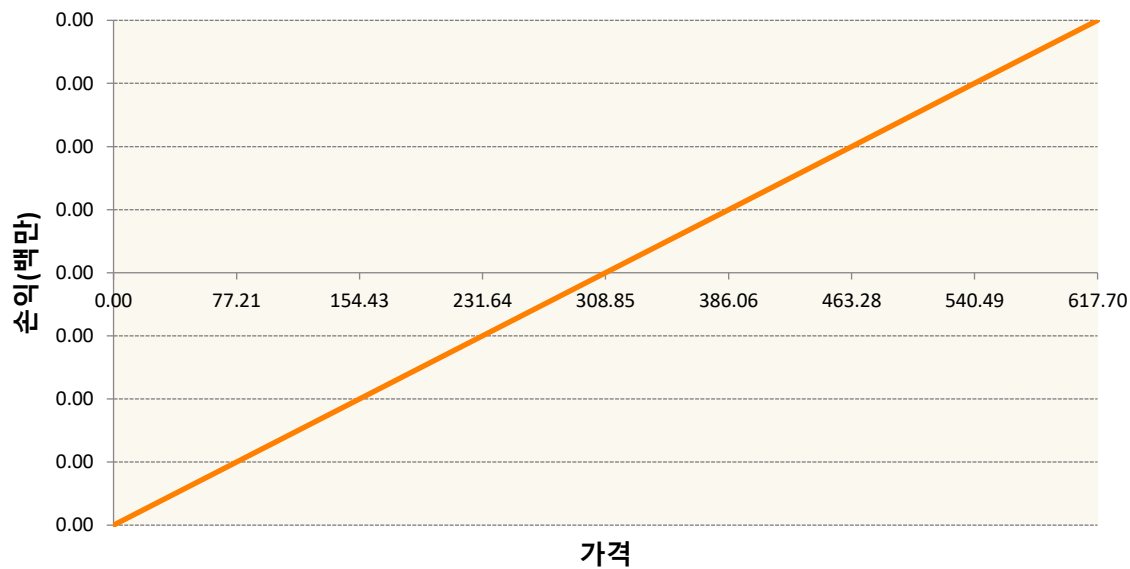
2. 만기시점의 손익구조



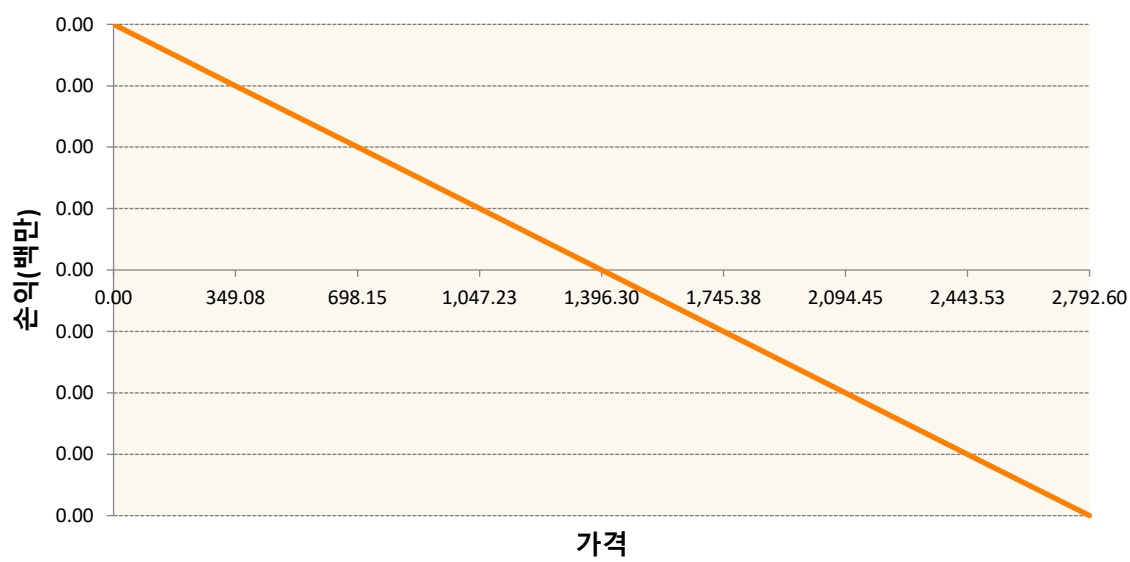
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



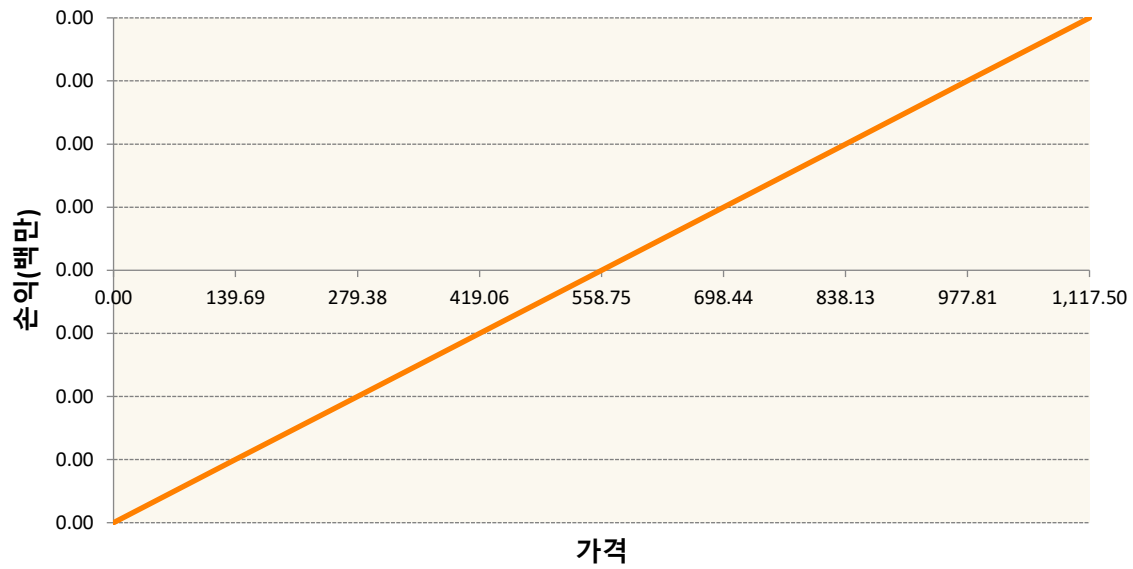
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



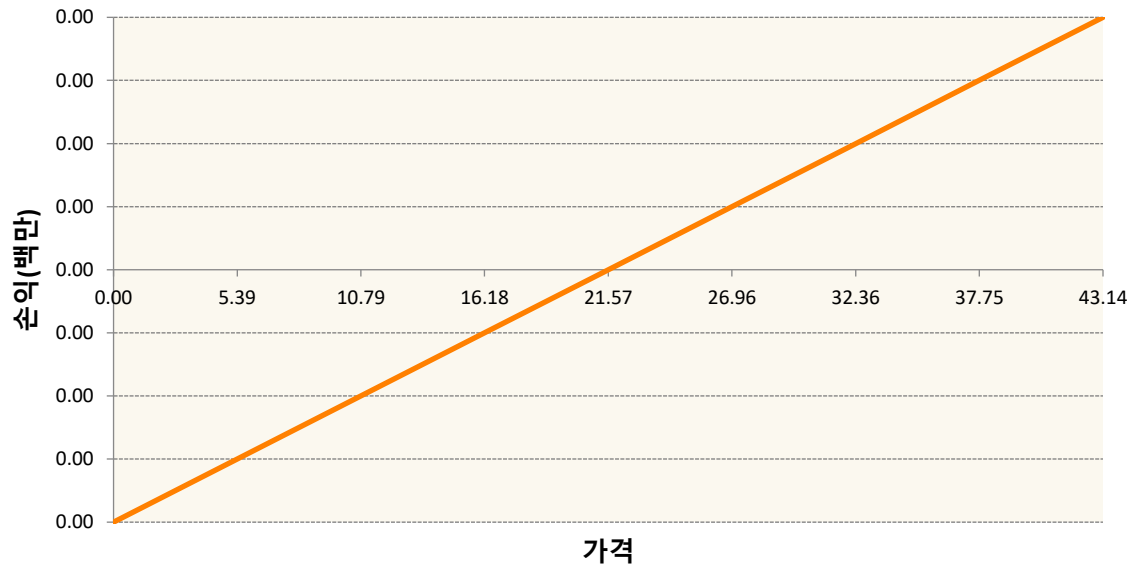
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



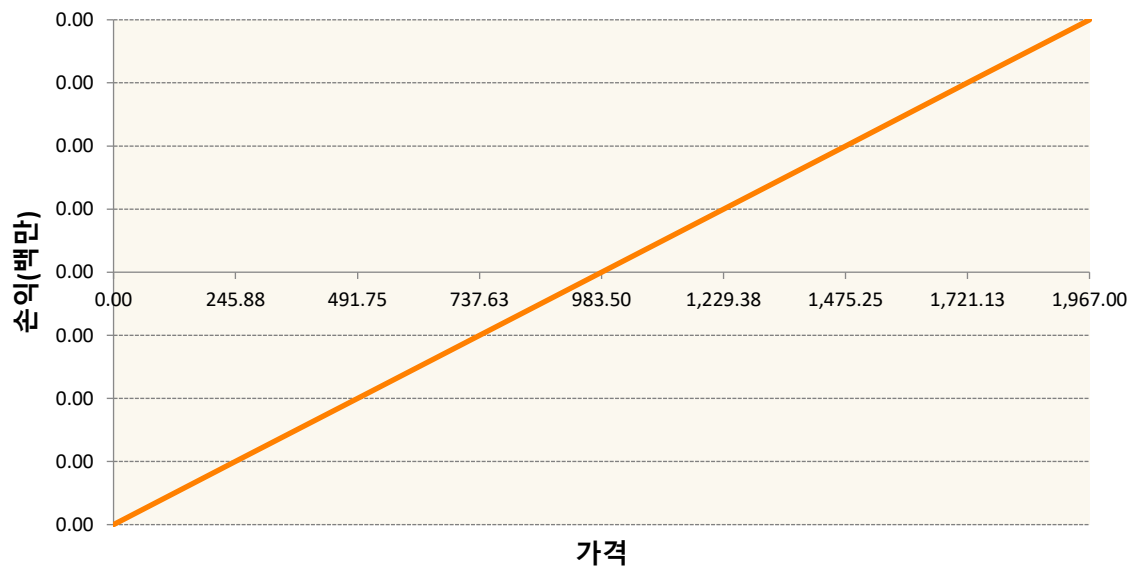
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



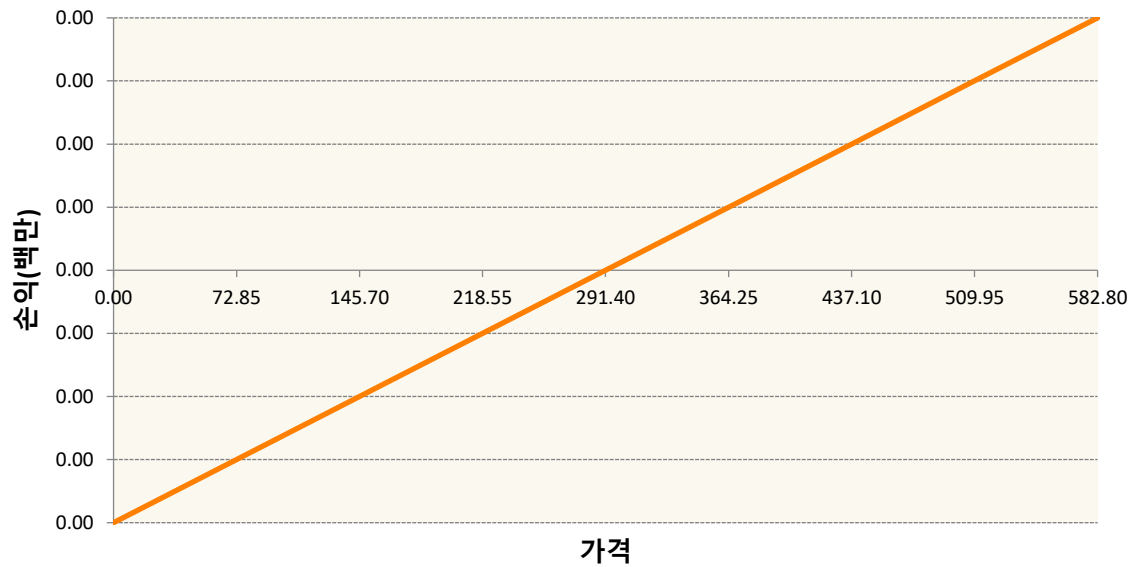
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



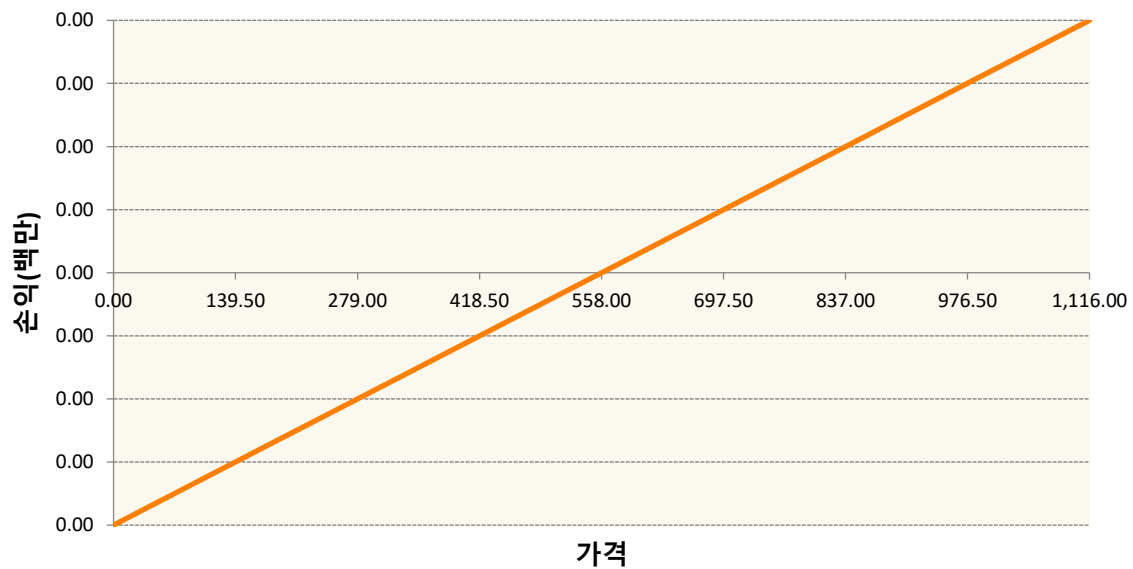
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-11-28
기준일	2024-11-27

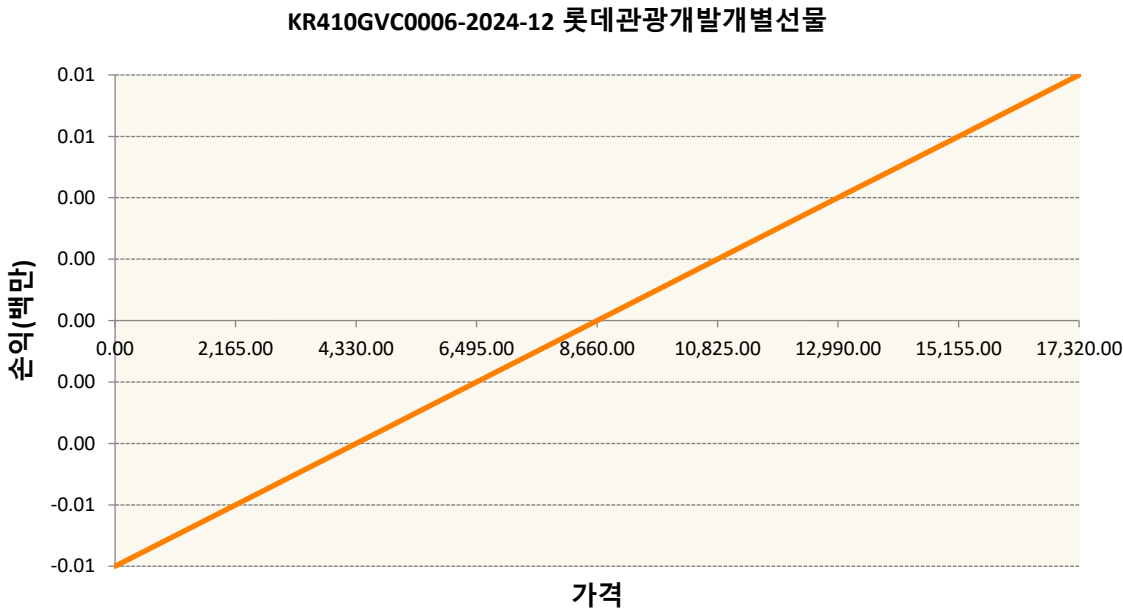
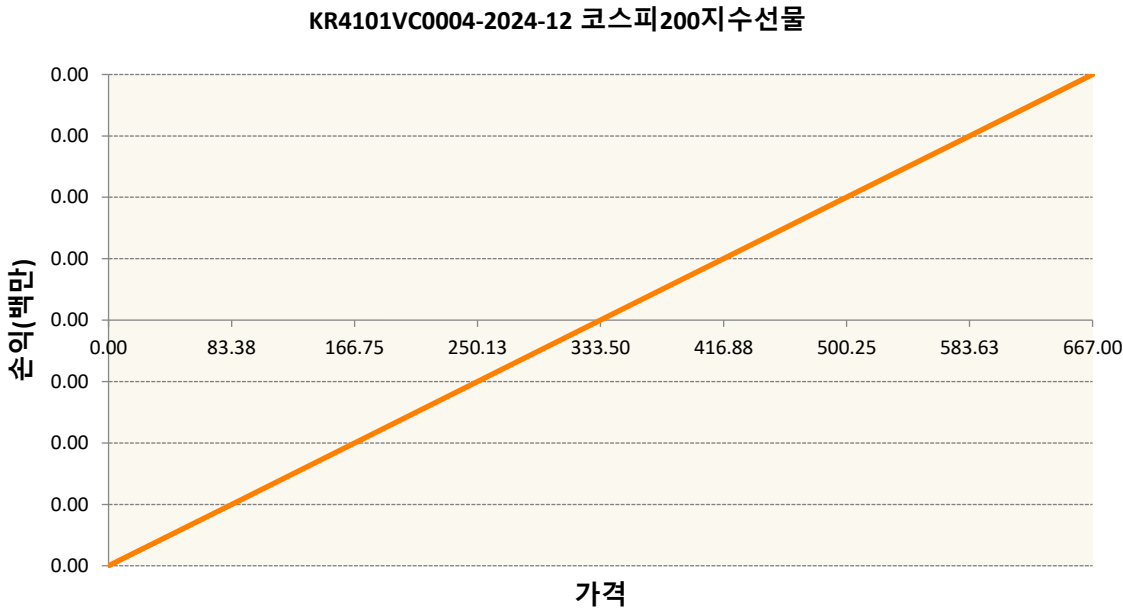
스마트인덱스모

1. 계약금액

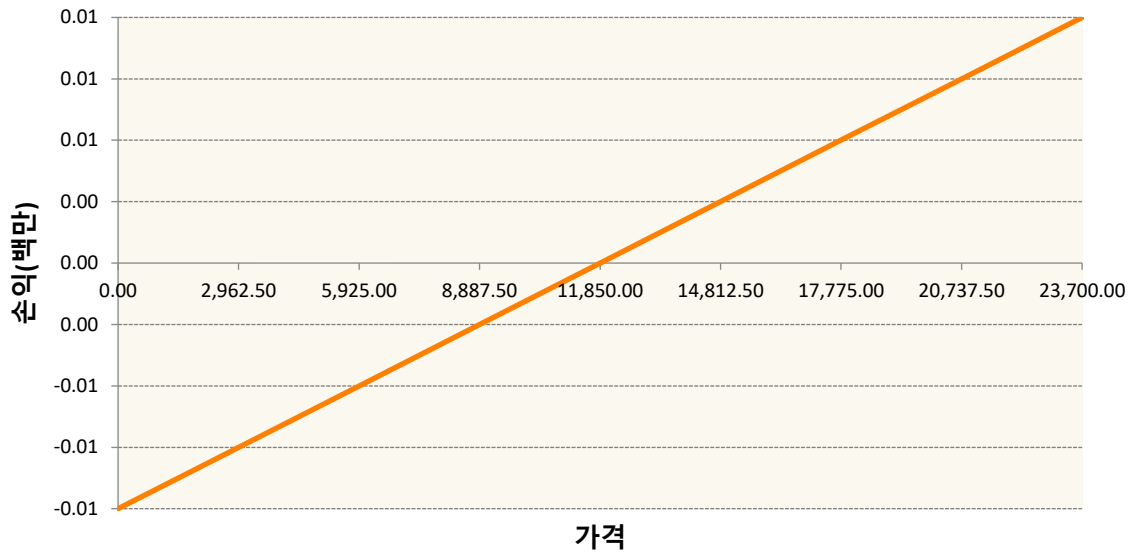
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	65	0	65	장내
누계	유가증권	선물	2,387	0	2,387	장내

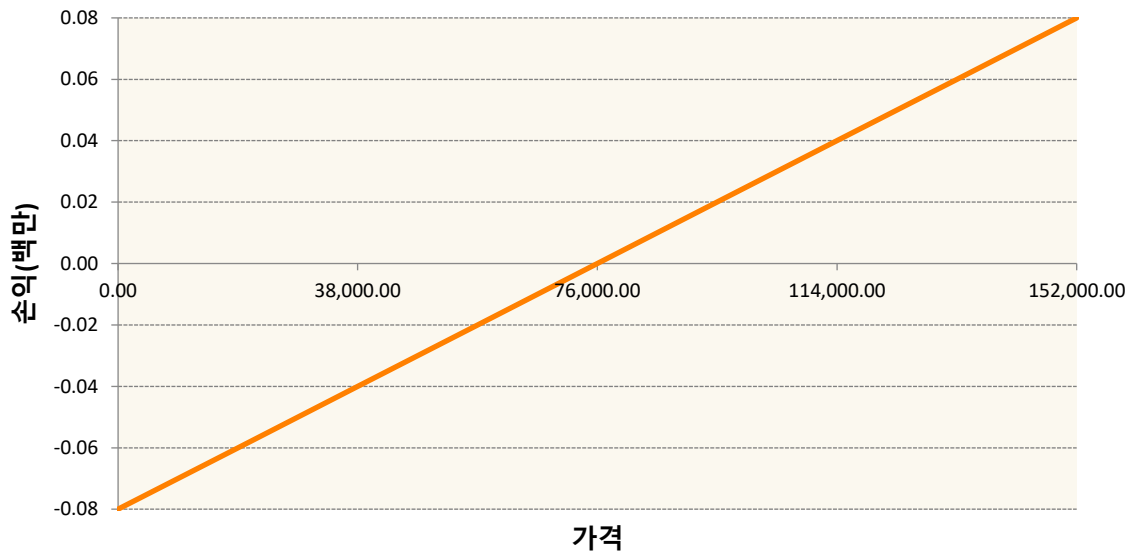
2. 만기시점의 손익구조



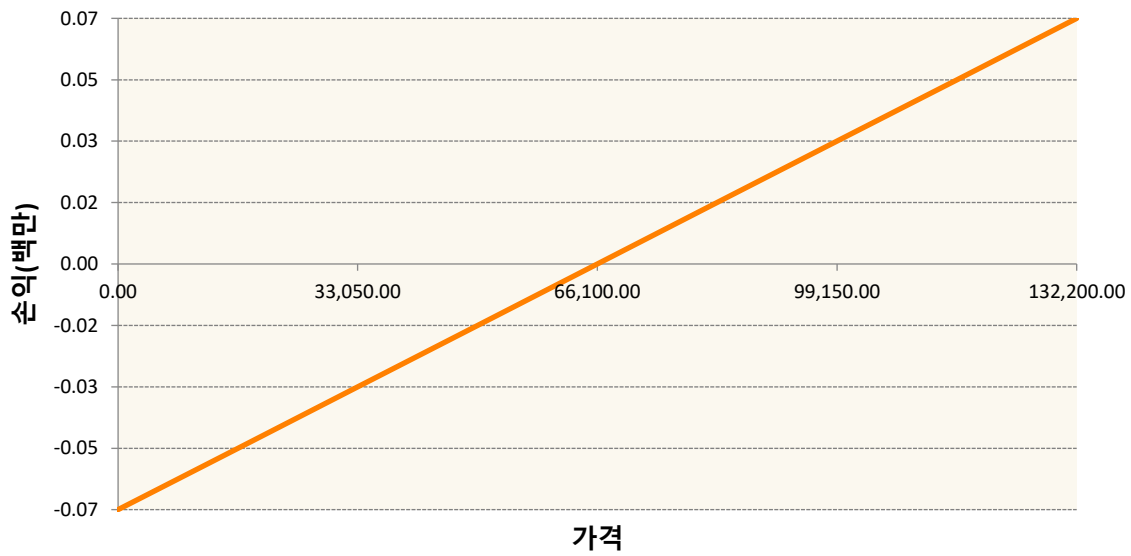
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



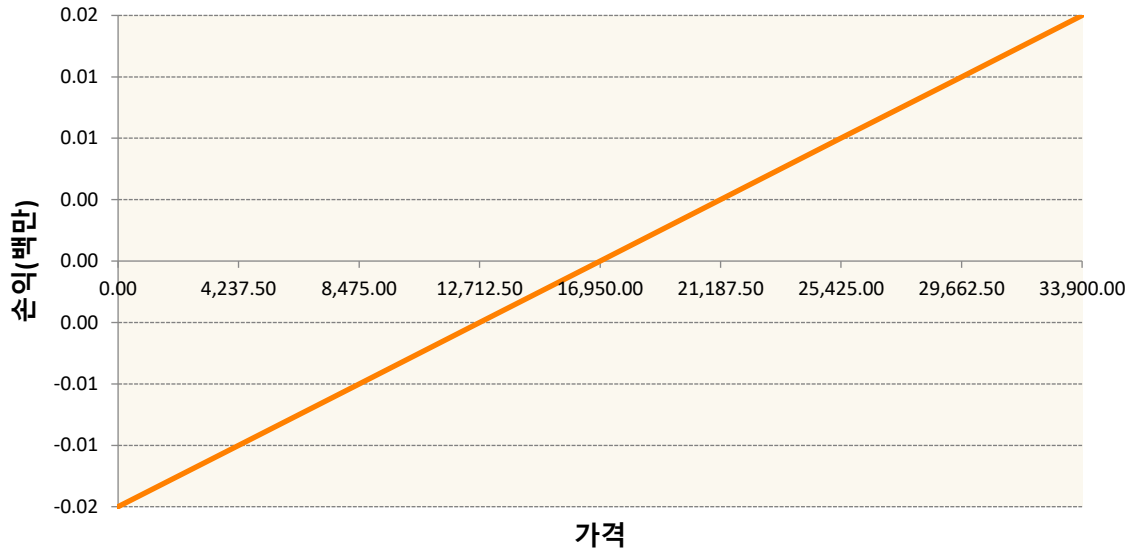
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



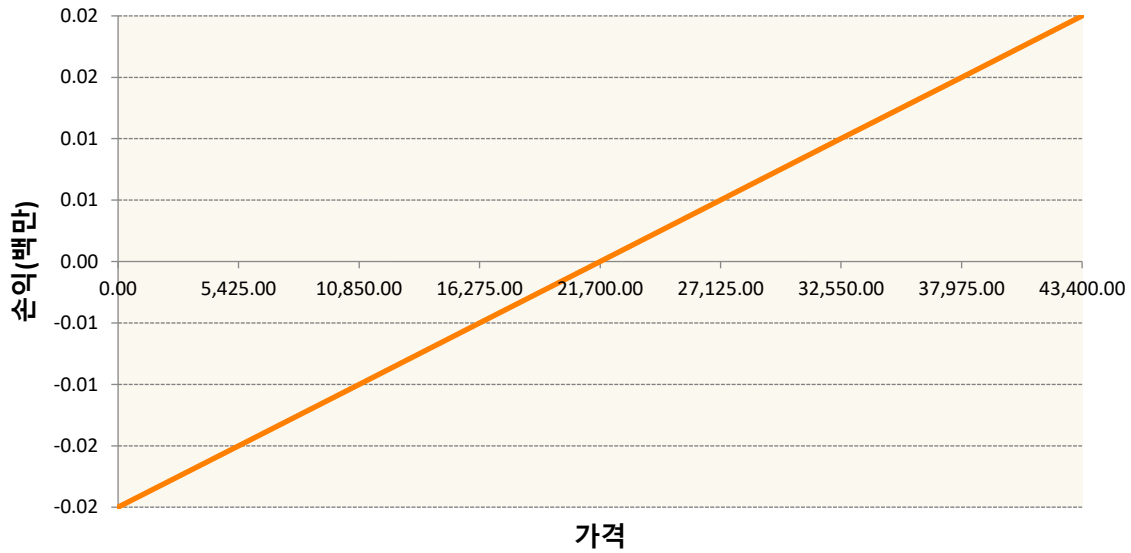
KR41BBVC0009-2024-12 롯데케미칼개별선물



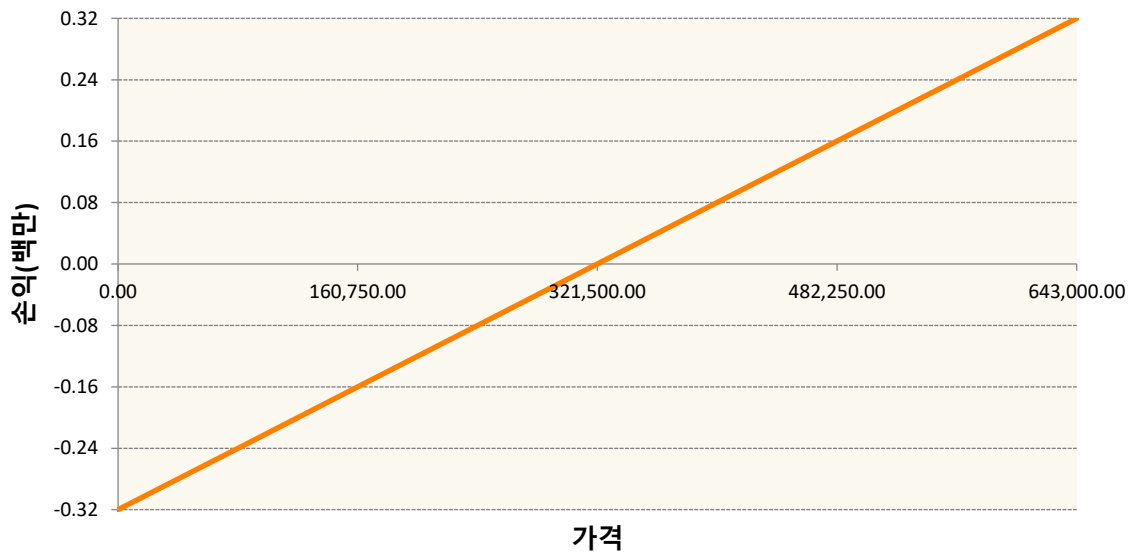
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



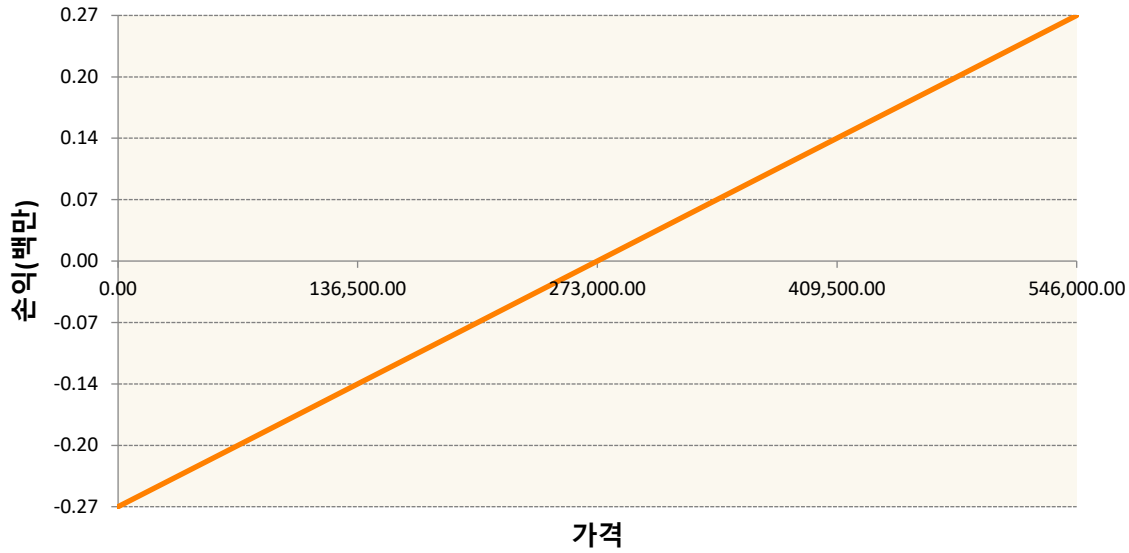
KR41CNVC0004-2024-12 포스코 ICT개별선물



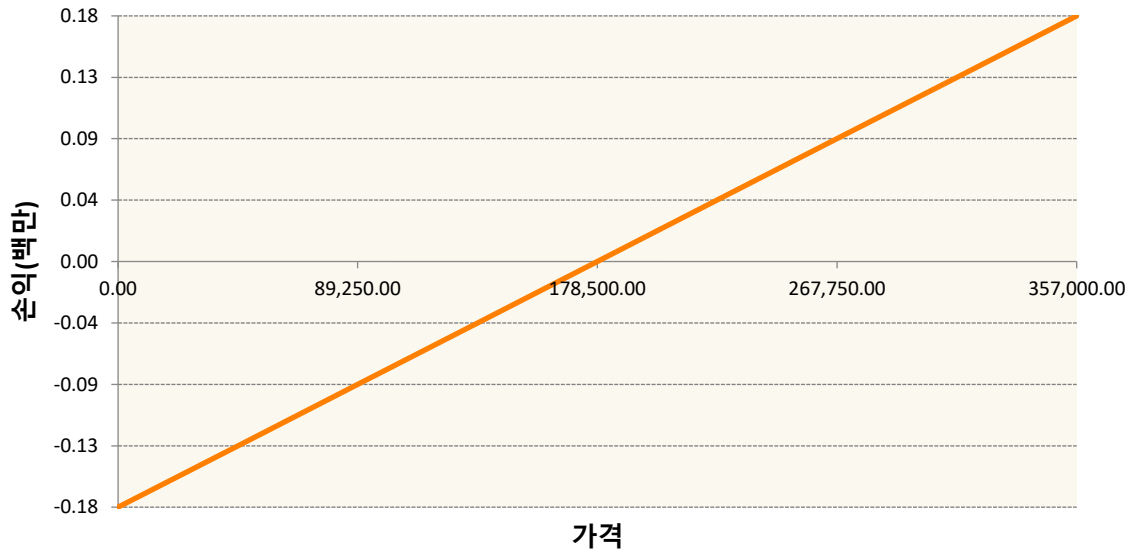
KR41CRVC0000-2024-12 LG생활건강개별선물



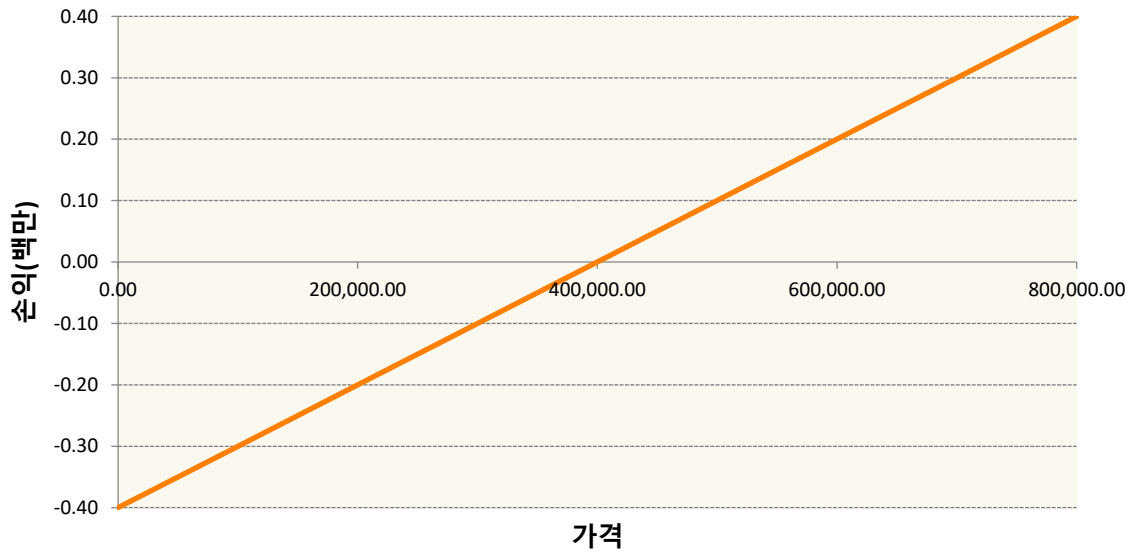
KR41D1VC0006-2024-12 CJ제일제당개별선물



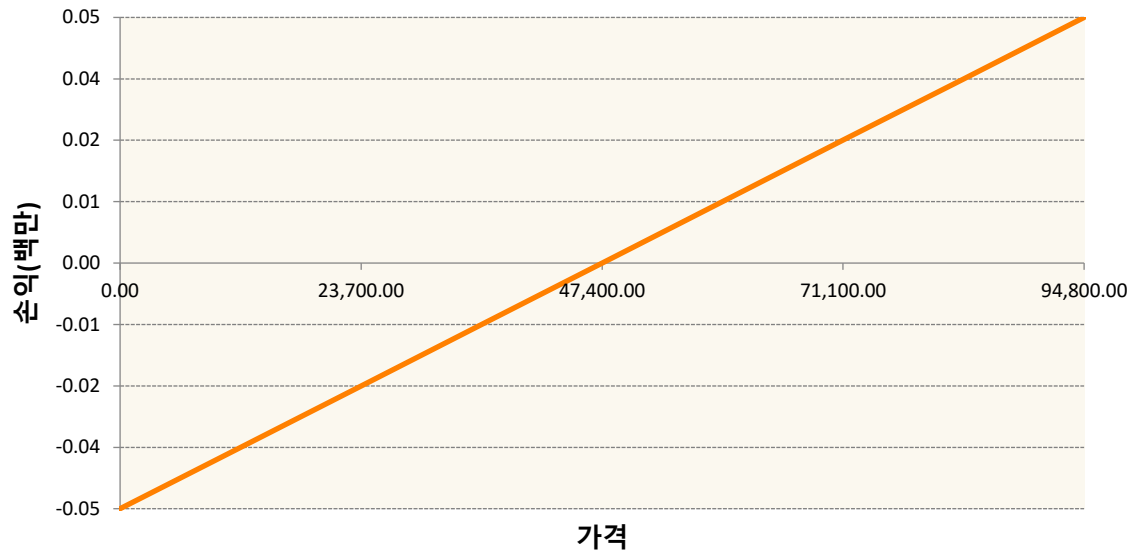
KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



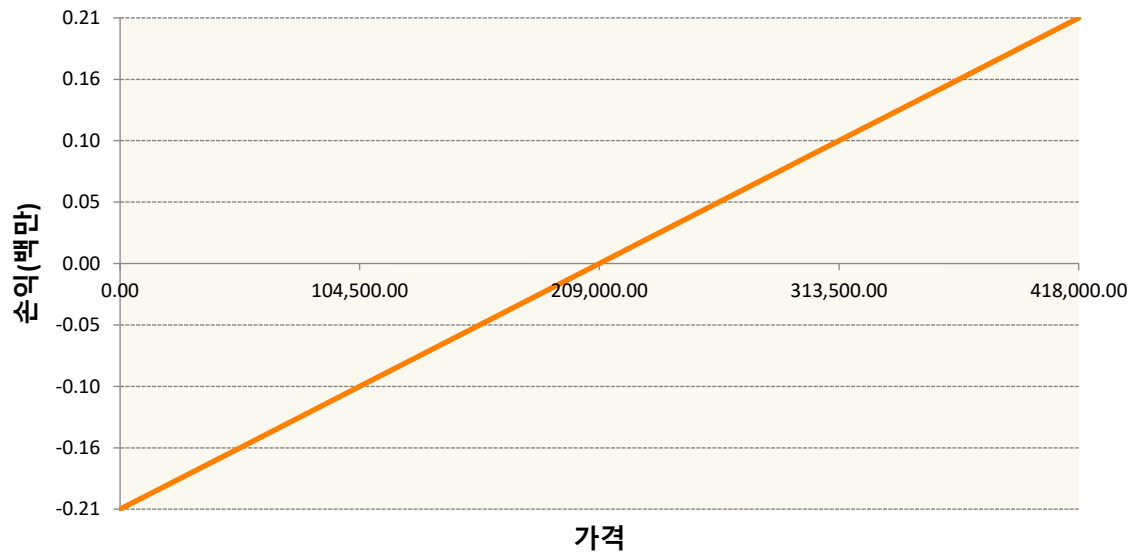
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



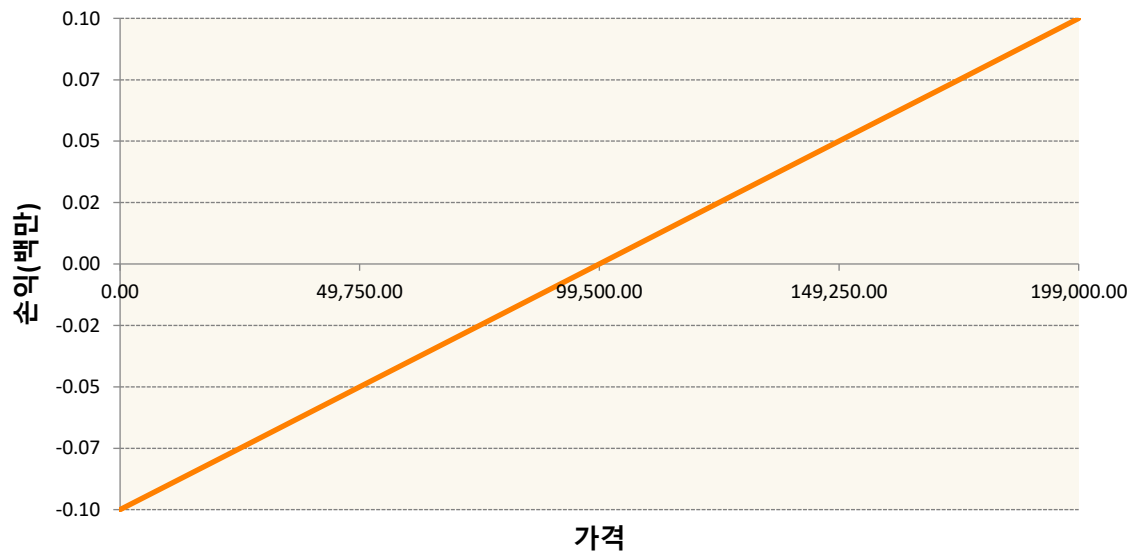
KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCVC0004-2024-12 하이브개별선물



KR41FMVC0002-2024-12 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101VC0004			2024-12 코스피200지수선물				146
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	49	49	49	49	49	49	49
5.33%	97	97	97	97	97	97	97
8.00%	146	146	146	146	146	146	146

KR41BBVC0009		2024-12 롯데케미칼개별선물						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	-2
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	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%	-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%	-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
KR41CRVC0000 2024-12 LG생활건강개별선물							4
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-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%	4	4	4	4	4	4	4
KR41D1VC0006 2024-12 CJ제일제당개별선물							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
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%	-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
KR41F5VC0007 2024-12 LG에너지솔루션개별선물							17
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	17	17	17	17	17	17	17
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

KR41FCVC0004 2024-12 하이브개별선물 5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR41FMVC0002 2024-12 엘앤에프개별선물 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

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

(단위:백만원)

204

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

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	290
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

481

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

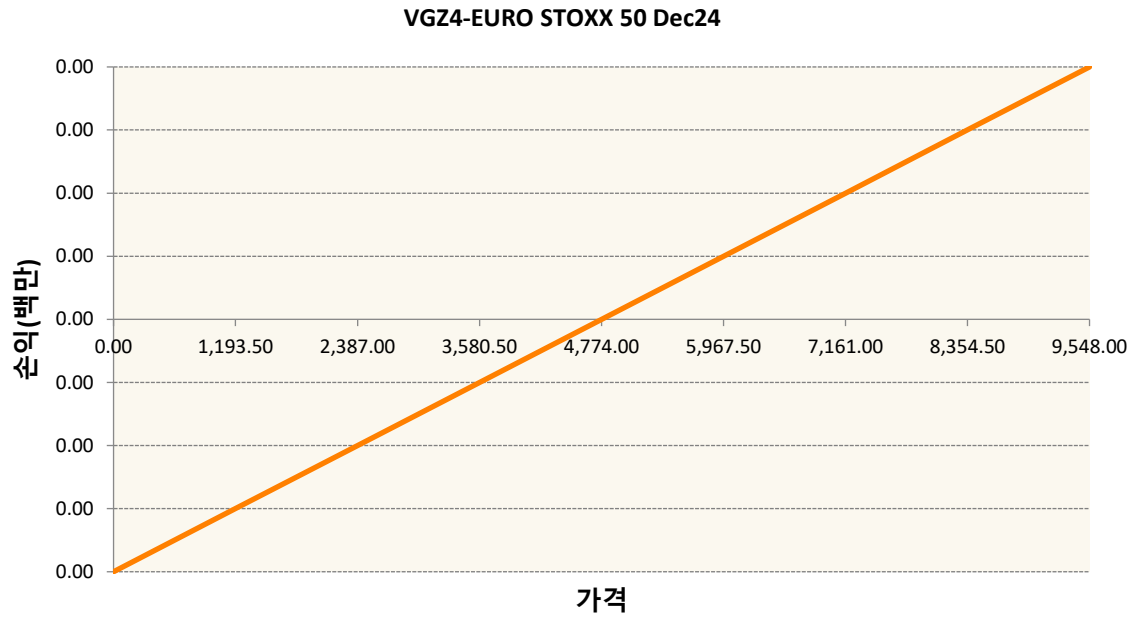
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	923	0	923	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

50

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

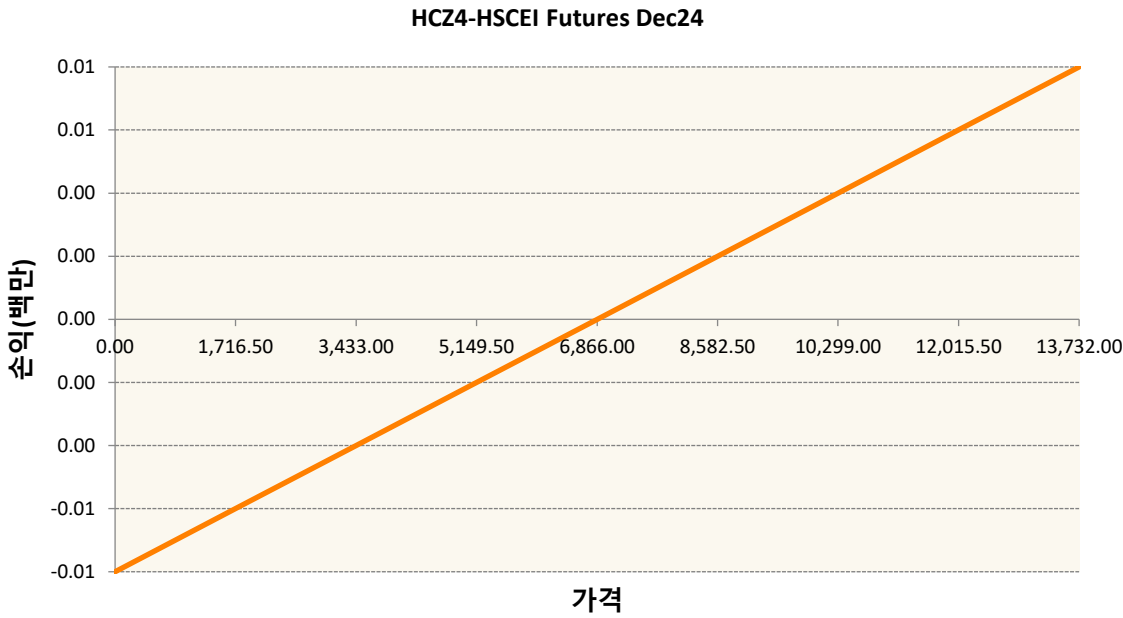
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,356	0	1,356	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ4	HSCEI Futures Dec24	108
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

148

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

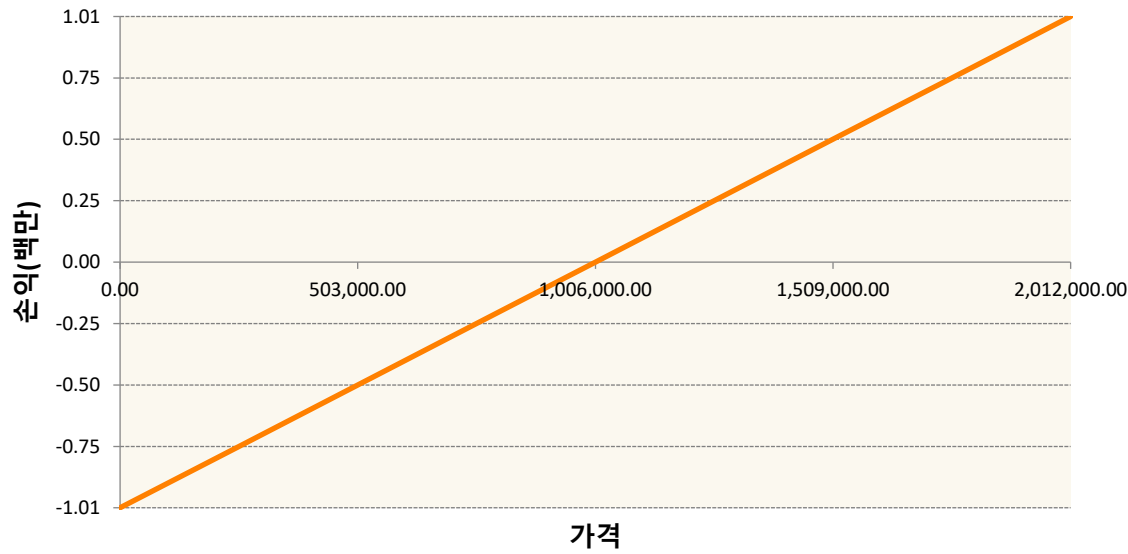
1. 계약금액

(단위:백만원)

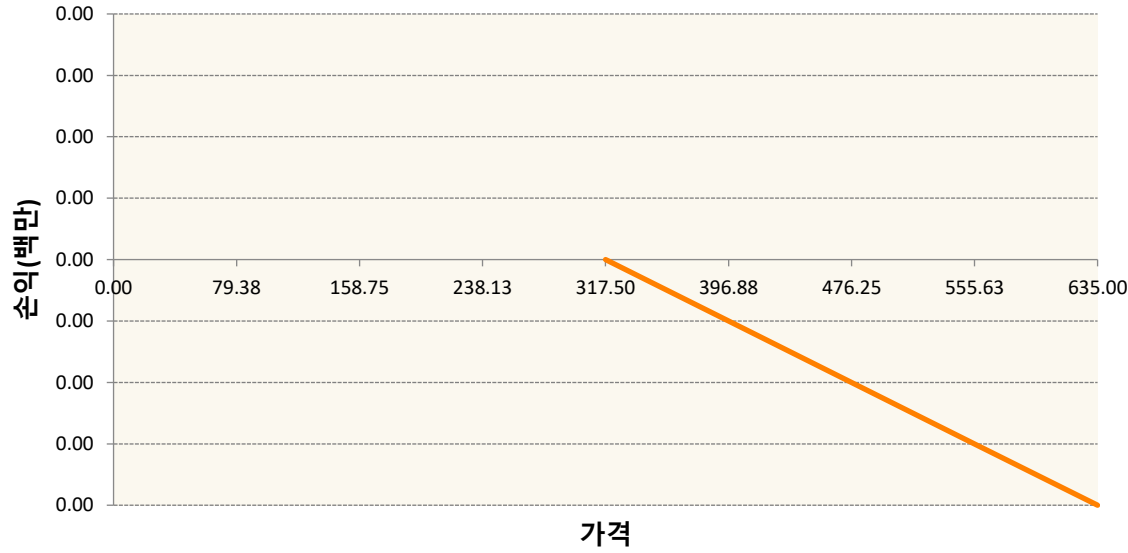
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	262	0	262	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,269	-36,269	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR41B3VC0008-2024-12 고려아연개별선물



KR4201VC3171-2024-12 콜317.5



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 connects the points (320.00, 0.00) and (640.00, 0.00), showing that profit is zero at both price levels.

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
79.38	0.00
158.75	0.00
238.13	0.00
317.50	0.00
396.88	0.00
476.25	0.00
555.63	0.00
635.00	0.00

(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					802
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	490	480	470	458	446	433	420
-5.33%	413	398	382	366	350	334	317
-2.67%	256	241	226	211	196	180	165
0%	28	20	10	0	-11	-23	-35
2.67%	-238	-241	-245	-250	-256	-263	-271
5.33%	-516	-516	-518	-519	-522	-526	-530
8.00%	-796	-796	-797	-797	-798	-800	-802
KR4201VC3205 2024-12 콜320							1,526

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	847	831	813	794	773	751	728
-5.33%	733	704	675	645	615	585	555
-2.67%	473	443	412	380	349	318	286
0%	65	45	23	0	-25	-50	-77
2.67%	-434	-442	-453	-466	-481	-497	-515
5.33%	-968	-971	-974	-980	-987	-995	-1,006
8.00%	-1,511	-1,512	-1,513	-1,514	-1,517	-1,521	-1,526

KR4301VC3170 2024-12 풋317.5							262
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-234	-237	-242	-246	-251	-257	-262
-5.33%	-92	-100	-107	-115	-123	-131	-139
-2.67%	-14	-21	-28	-35	-42	-50	-57
0%	9	7	4	0	-4	-9	-14
2.67%	13	13	12	11	9	7	5
5.33%	13	13	13	13	13	12	11
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

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

(단위:백만원)

2,702

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

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	674	0	674	

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	2024-11-28
기준일	2024-11-27

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	4,386	0	4,386	

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	2024-11-28
기준일	2024-11-27

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	13,976	0	13,976	
누계	통화	선도	210	21,095	-20,885	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E		587
FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E		352
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E		207
FXW213EBFC USD/KRW 29-11-24E		17
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E		542
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	734

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

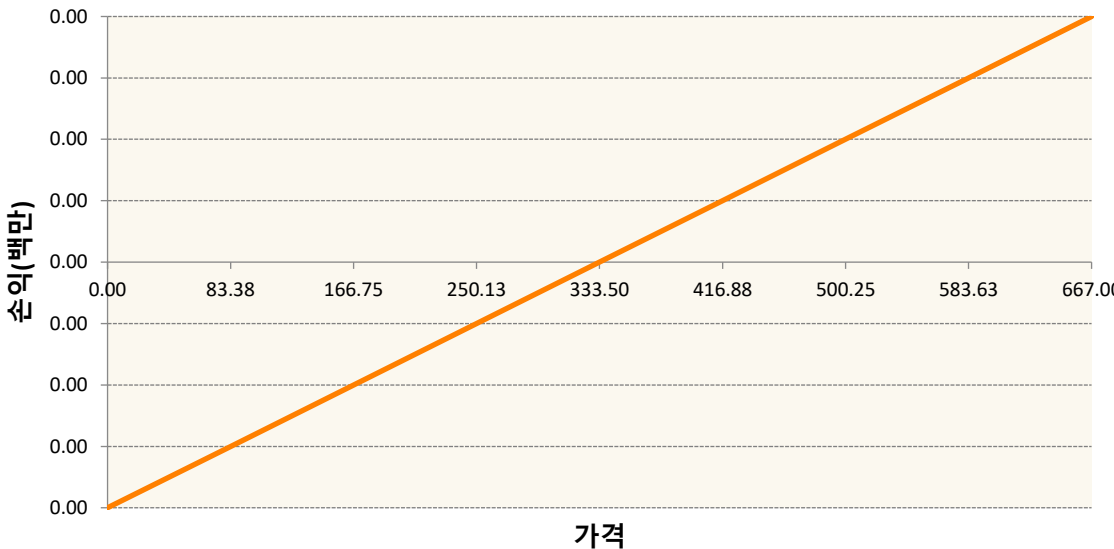
1. 계약금액

(단위:백만원)

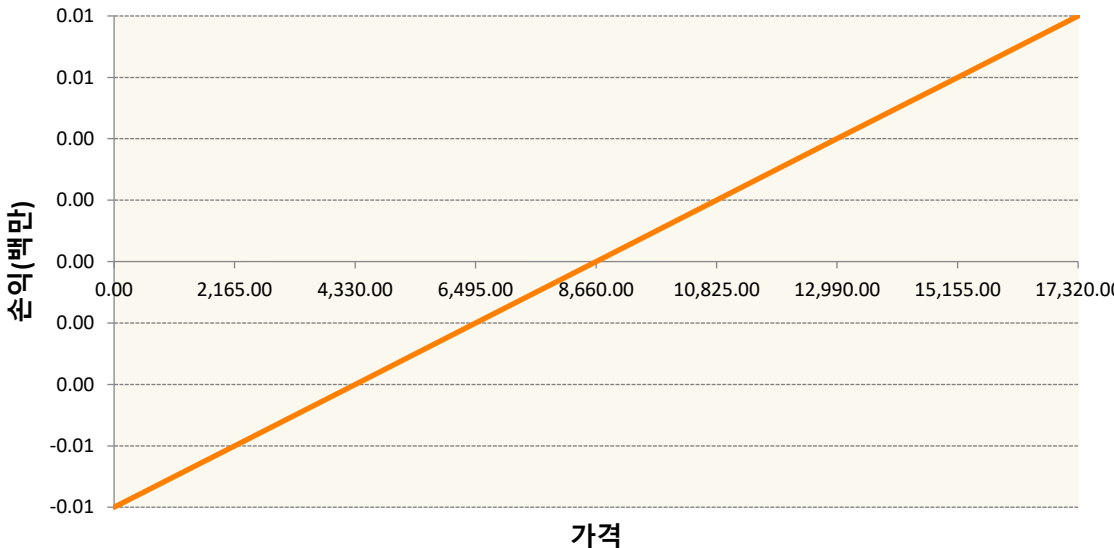
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	27	0	27	장내
누계	유가증권	선물	1,234	0	1,234	장내

2. 만기시점의 손익구조

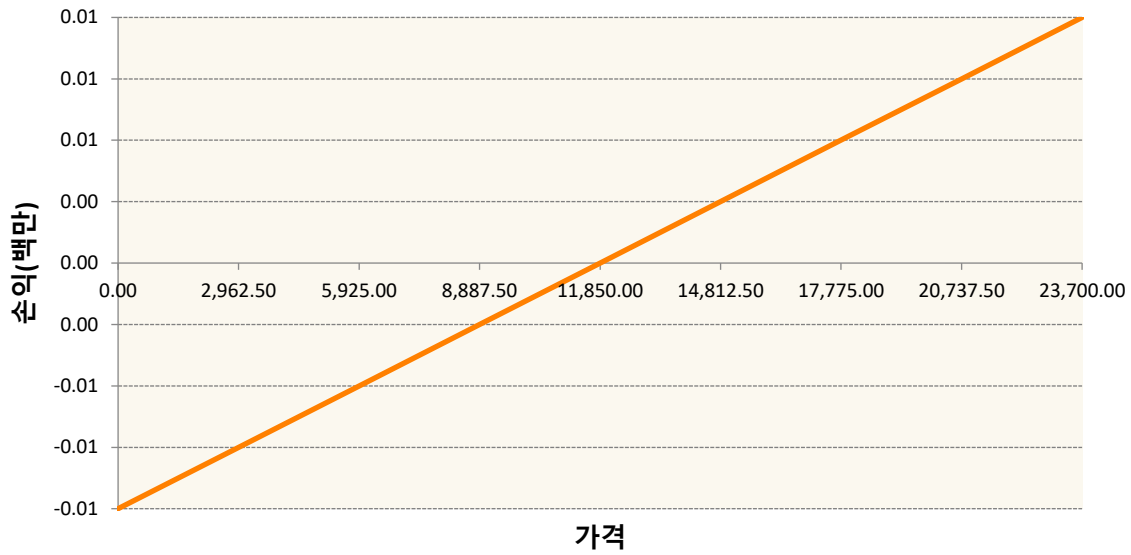
KR4101VC0004-2024-12 코스피200지수선물



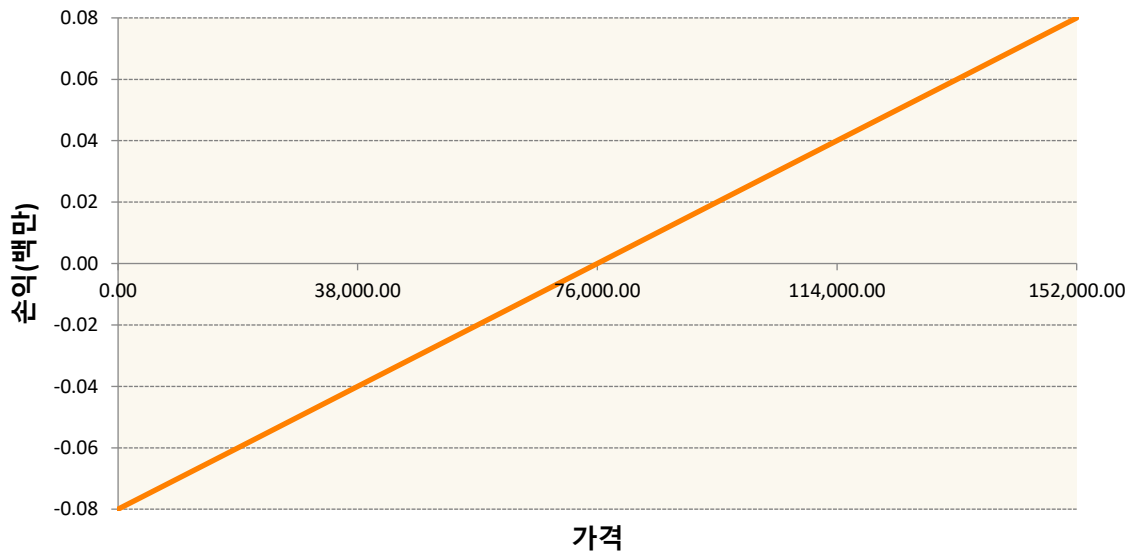
KR410GVC0006-2024-12 롯데관광개발개별선물



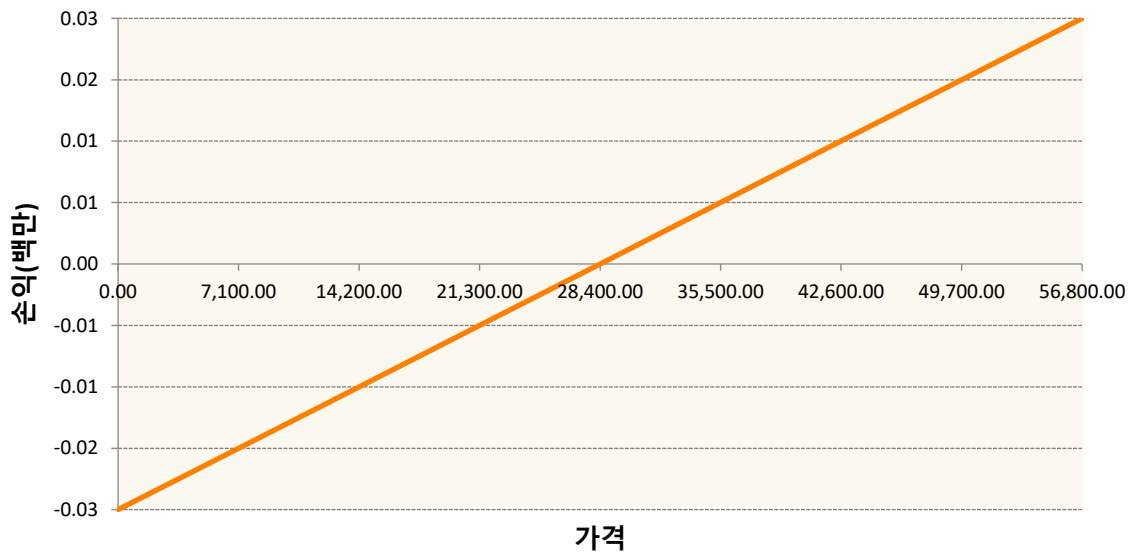
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



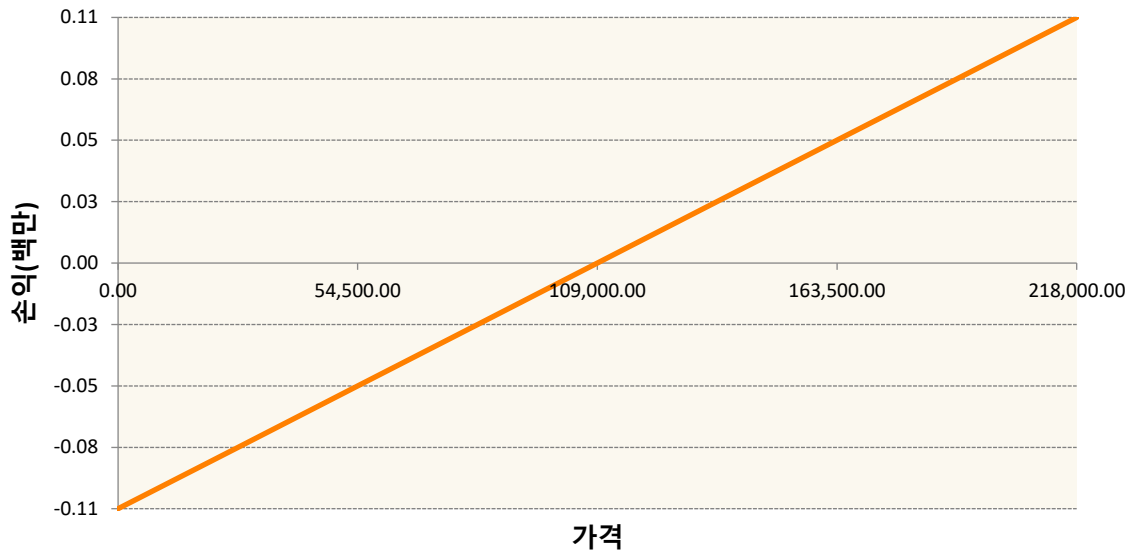
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



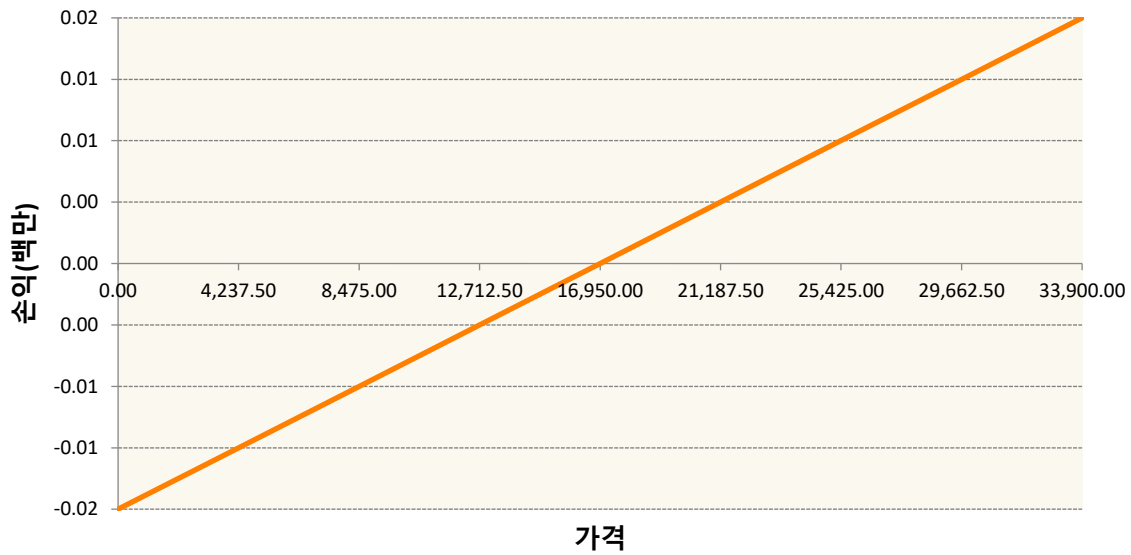
KR41BNVC0005-2024-12 현대건설개별선물



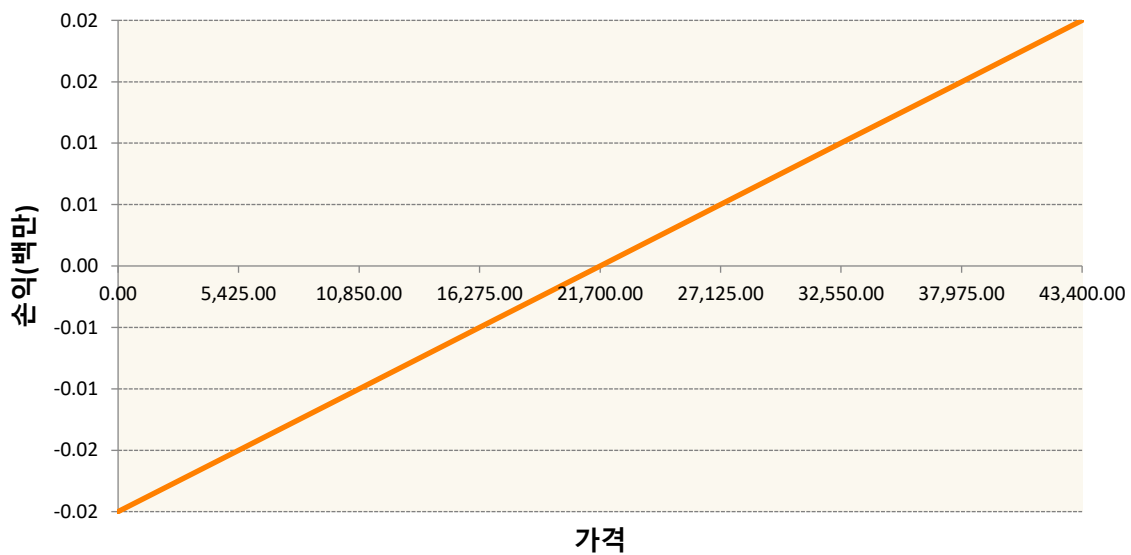
KR41C6VC0003-2024-12 아모레퍼시픽개별선물



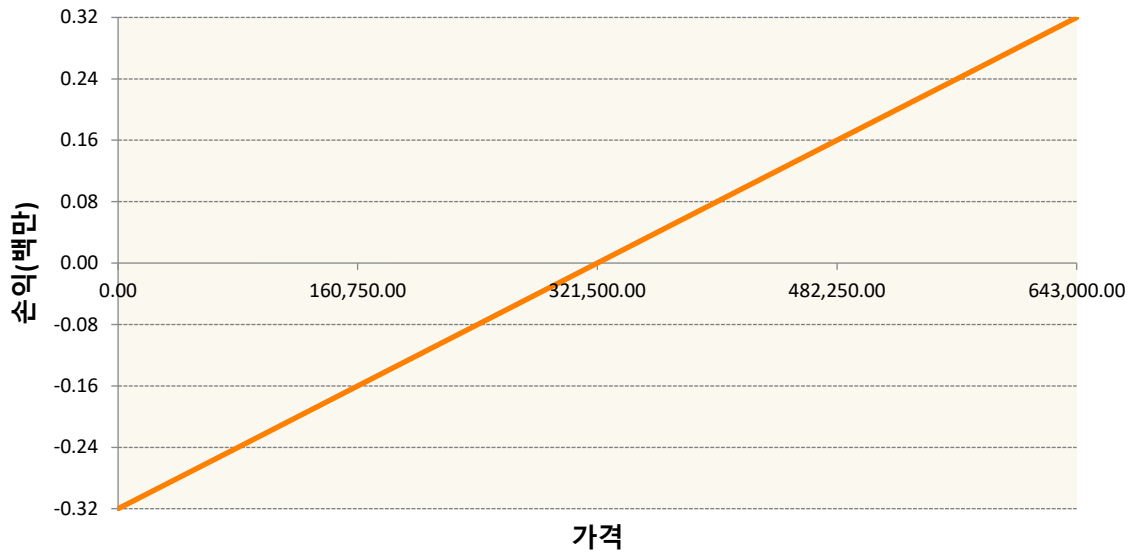
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



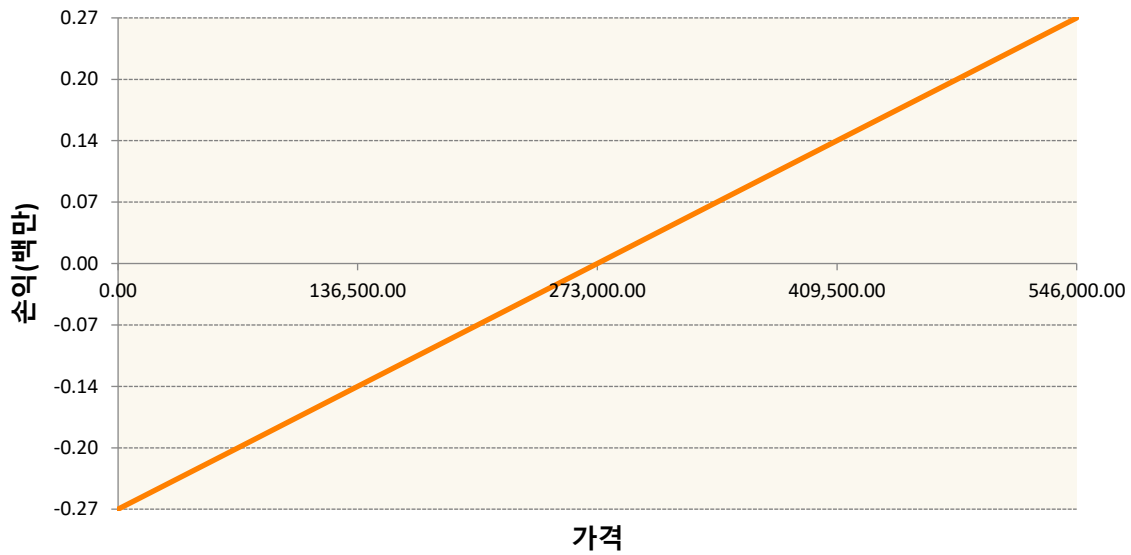
KR41CNVC0004-2024-12 포스코 ICT개별선물



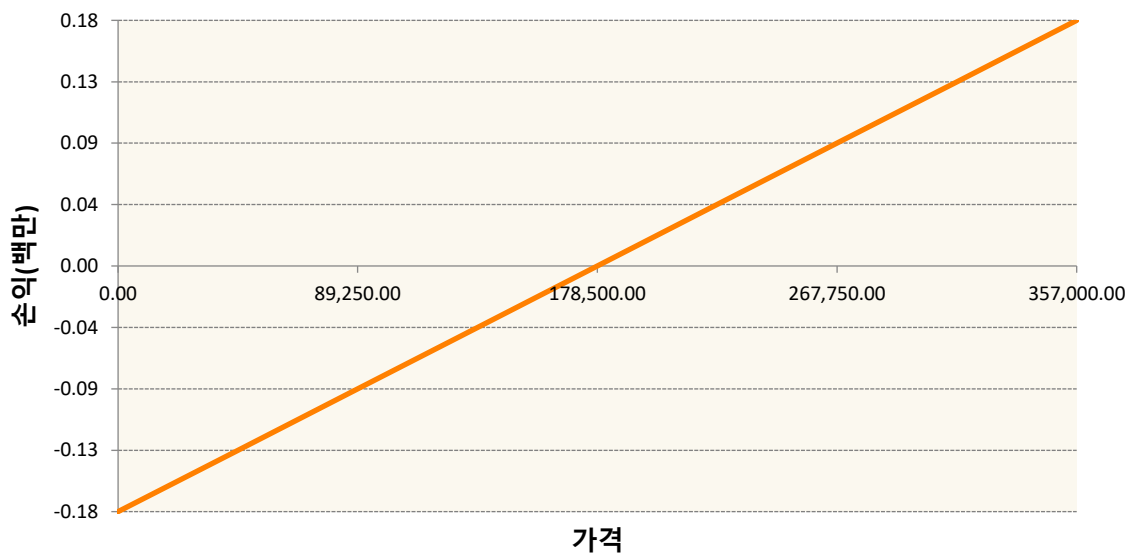
KR41CRVC0000-2024-12 LG생활건강개별선물



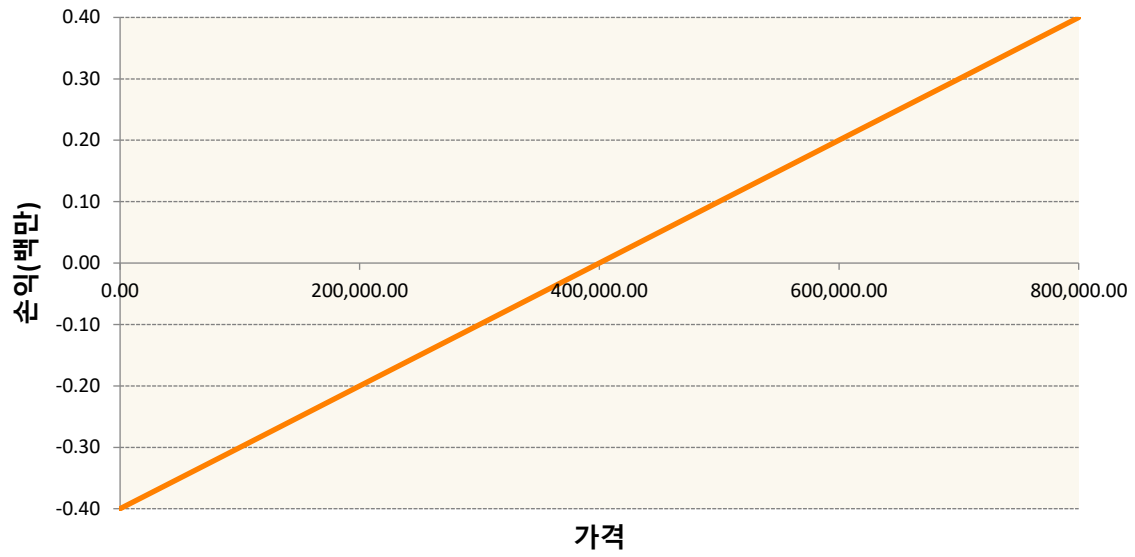
KR41D1VC0006-2024-12 CJ제일제당개별선물



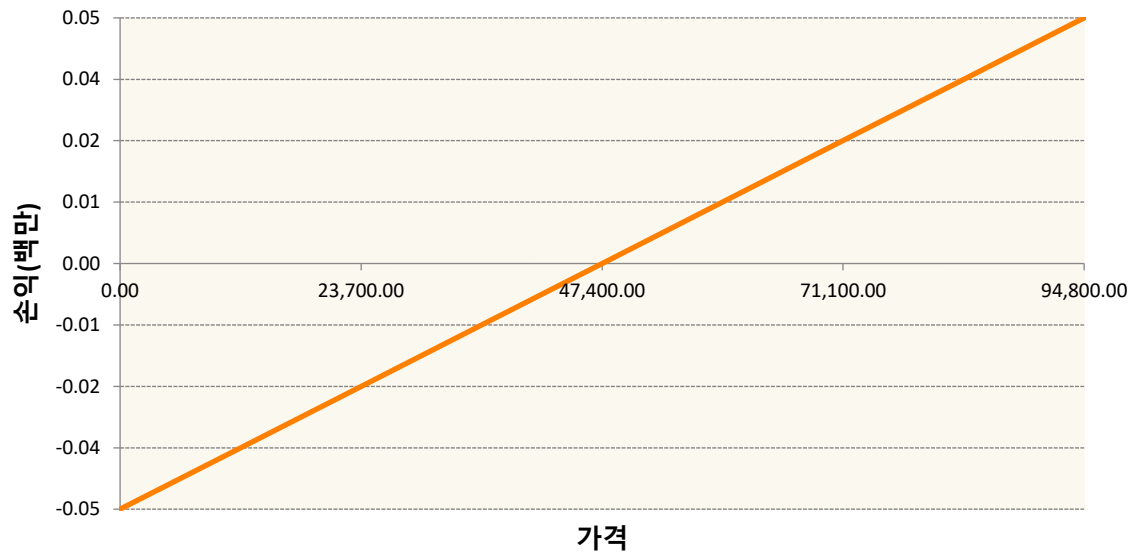
KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



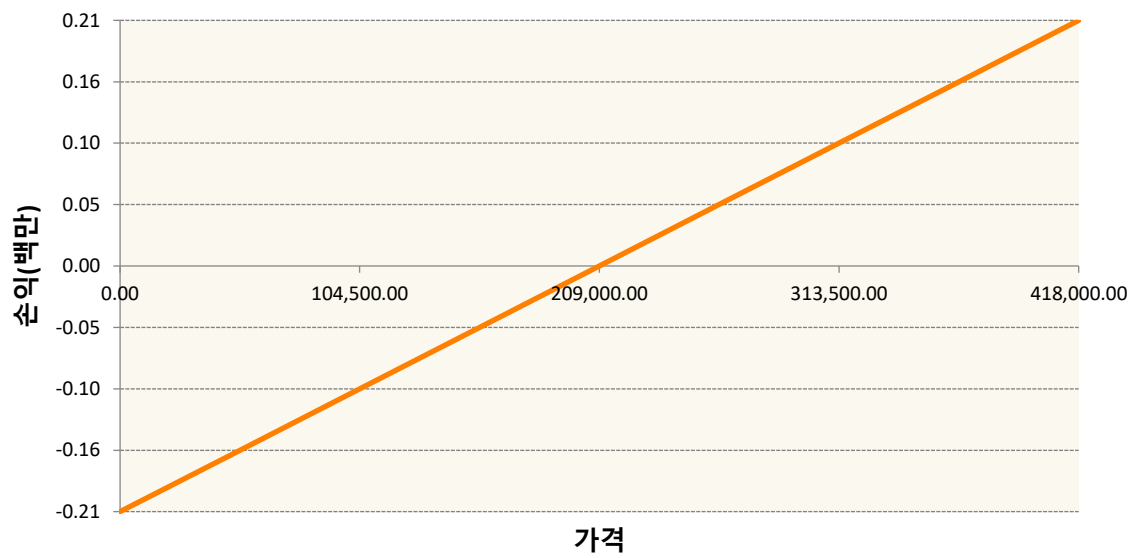
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



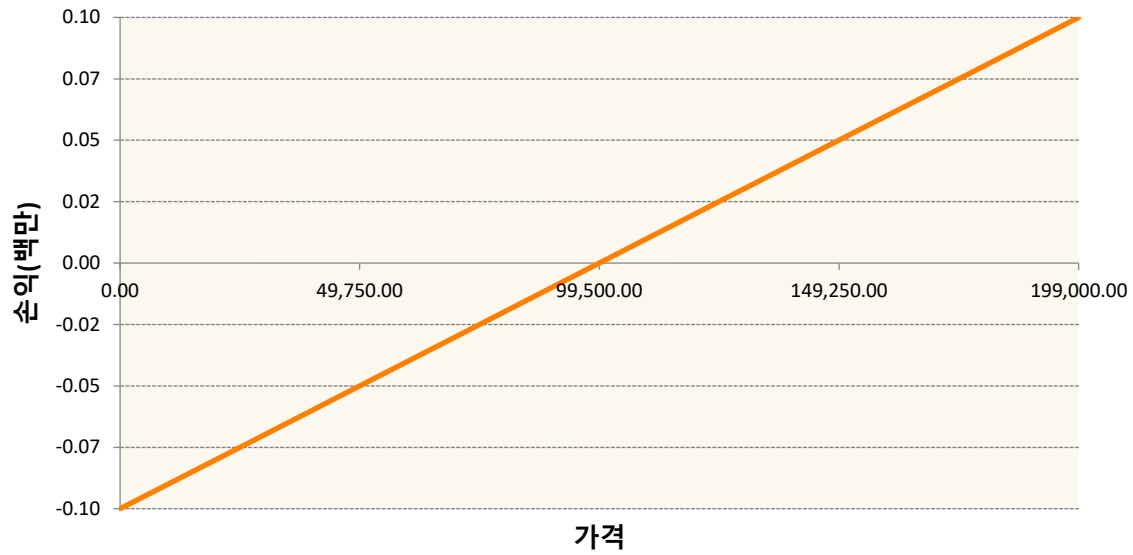
KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



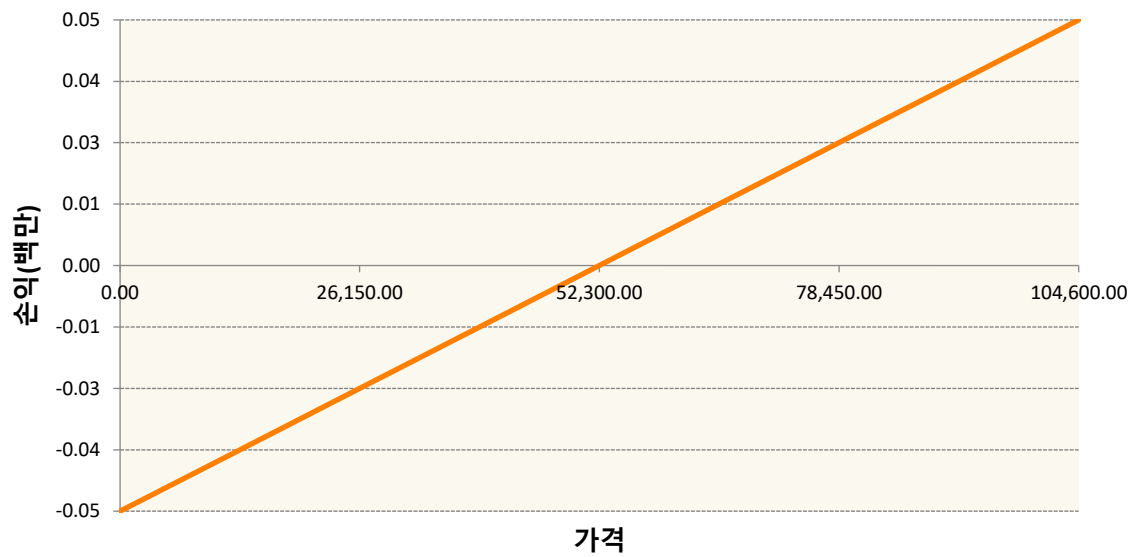
KR41FCVC0004-2024-12 하이브개별선물



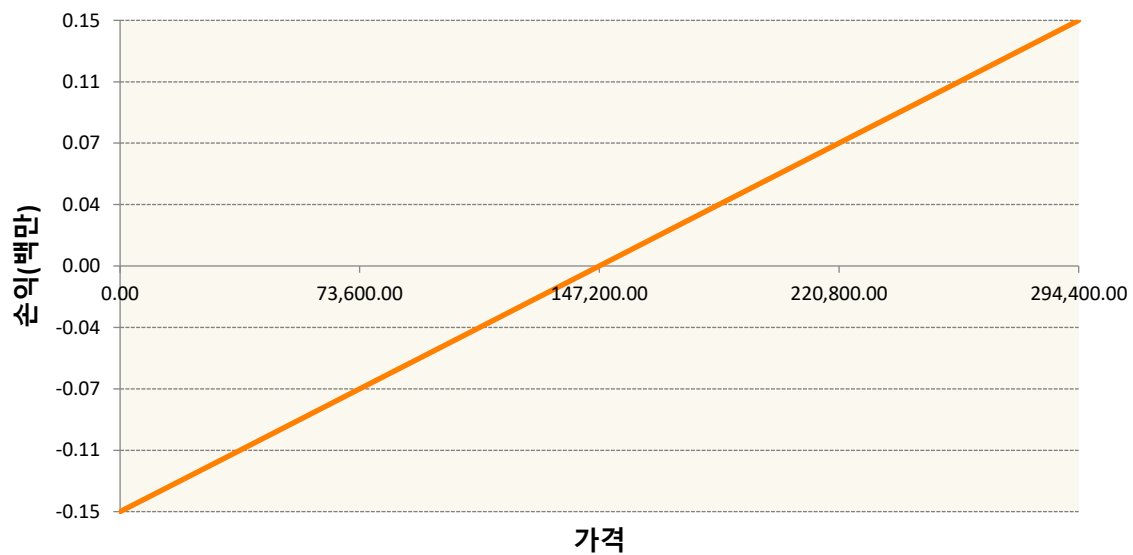
KR41FMVC0002-2024-12 엘앤에프개별선물



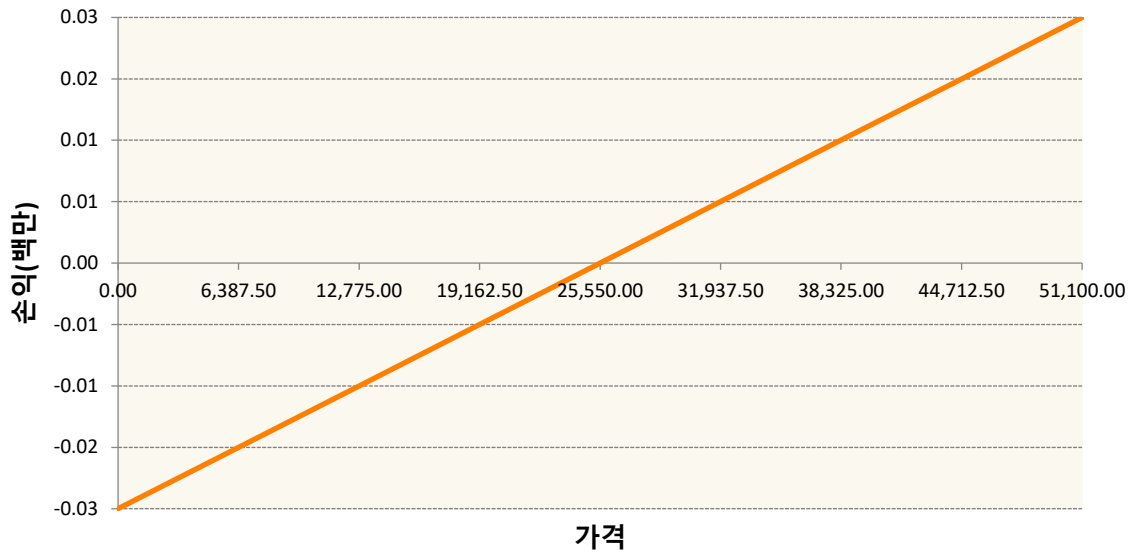
KR41G6VC0004-2024-12 현대로템개별선물



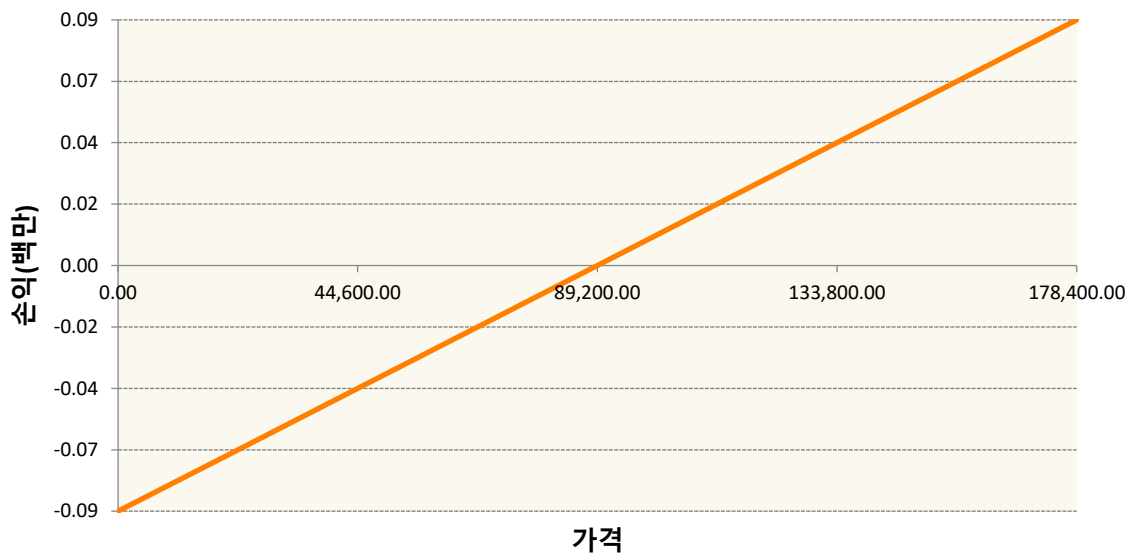
KR41GLVC0002-2024-12 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNVC0000-2024-12 금양개발선물



KR41GZVC0006-2024-12 에코프로머티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC00 2024-12 코스피200지수선물	73
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
KR41CRVC00 2024-12 LG생활건강개별선물	2
KR41D1VC00 2024-12 CJ제일제당개별선물	1
KR41E8VC00 2024-12 포스코케미칼개별선물	1
KR41F5VC00 2024-12 LG에너지솔루션개별선물	7

KR41F9VC00 2024-12 SK바이오사이언스개별선물	1
KR41FCVC00 2024-12 하이브개별선물	2
KR41FMVC00 2024-12 엘앤에프개별선물	1
KR41G6VC00 2024-12 현대로템개별선물	2
KR41GLVC00 2024-12 LS ELECTRIC개별선물	1
KR41GNVC00 2024-12 금양개별선물	0.43
KR41GZVC00 2024-12 에코프로머티개별선물	1

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

(단위:백만원)

154

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

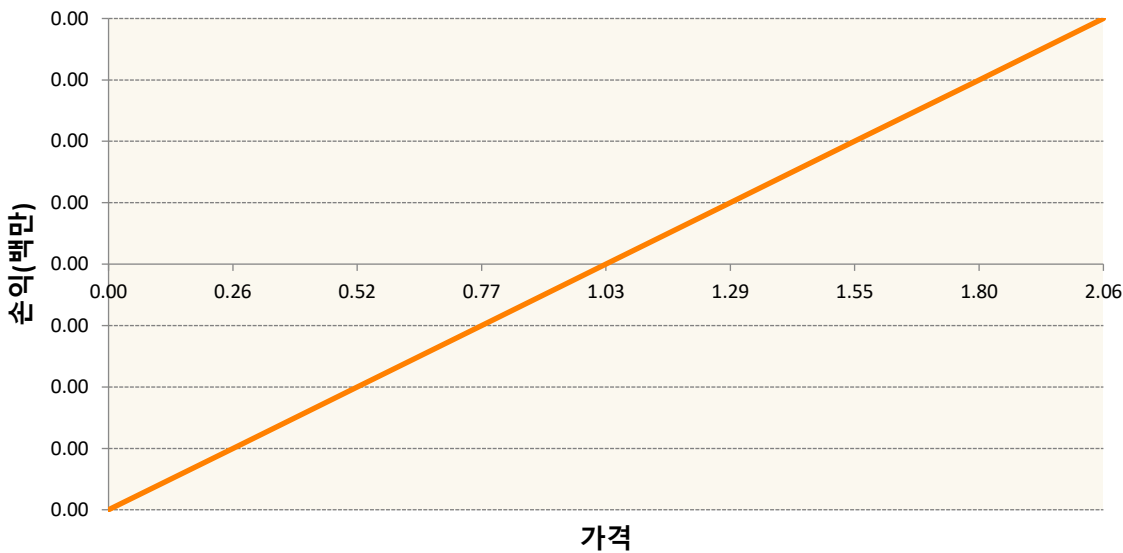
1. 계약금액

(단위:백만원)

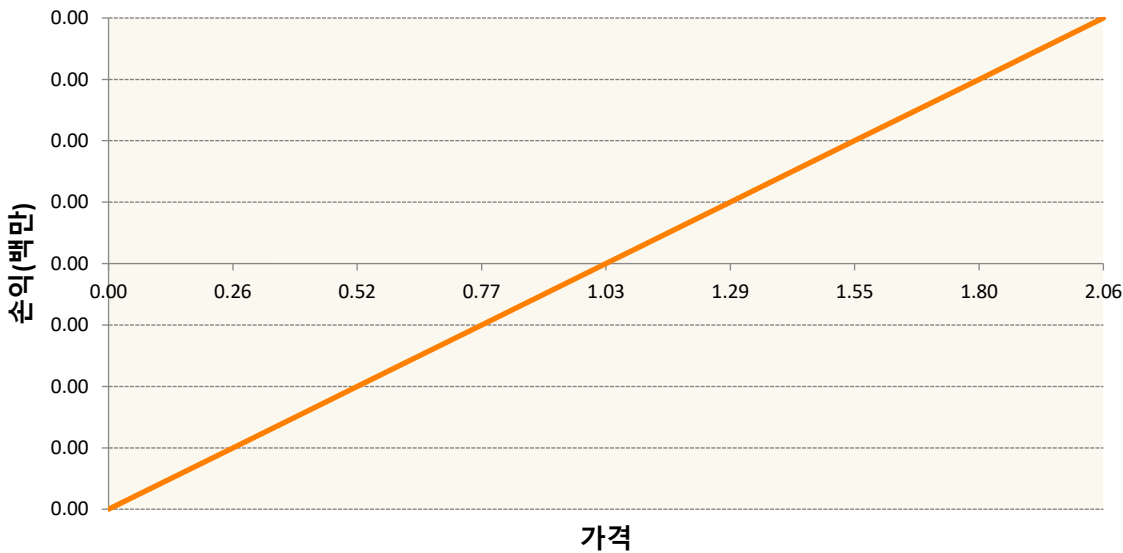
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,641	0	11,641	

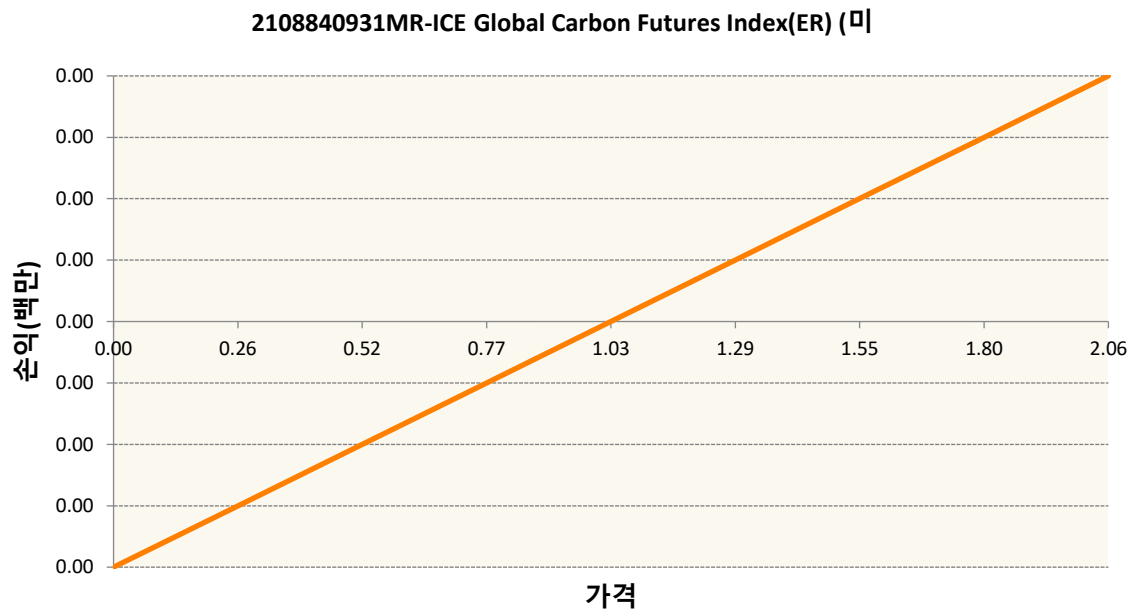
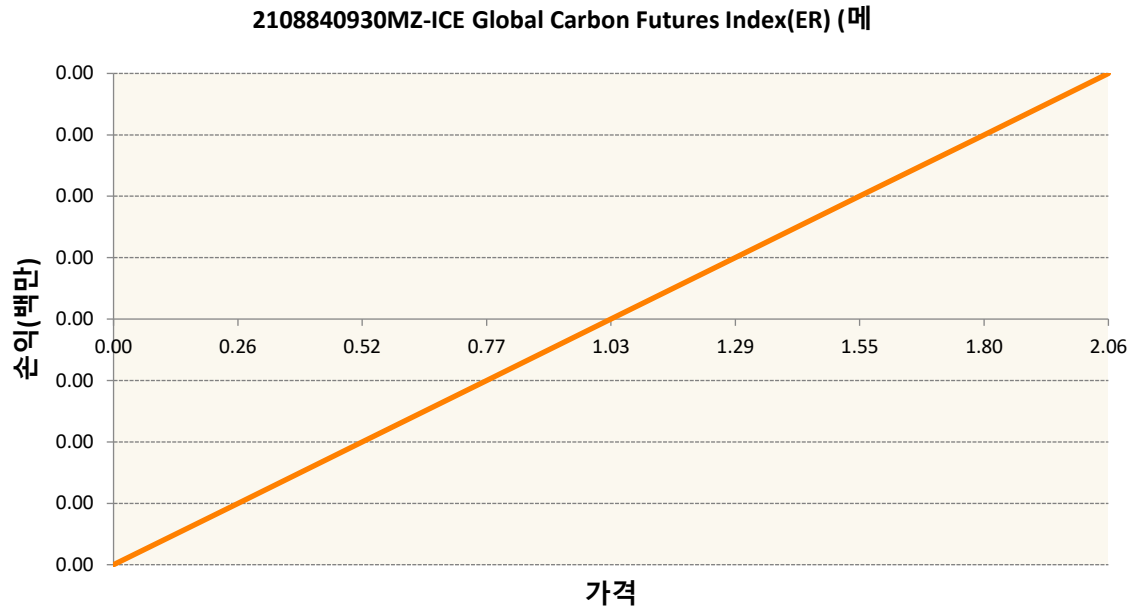
2. 만기시점의 손익구조

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		468
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		187
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		187

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

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

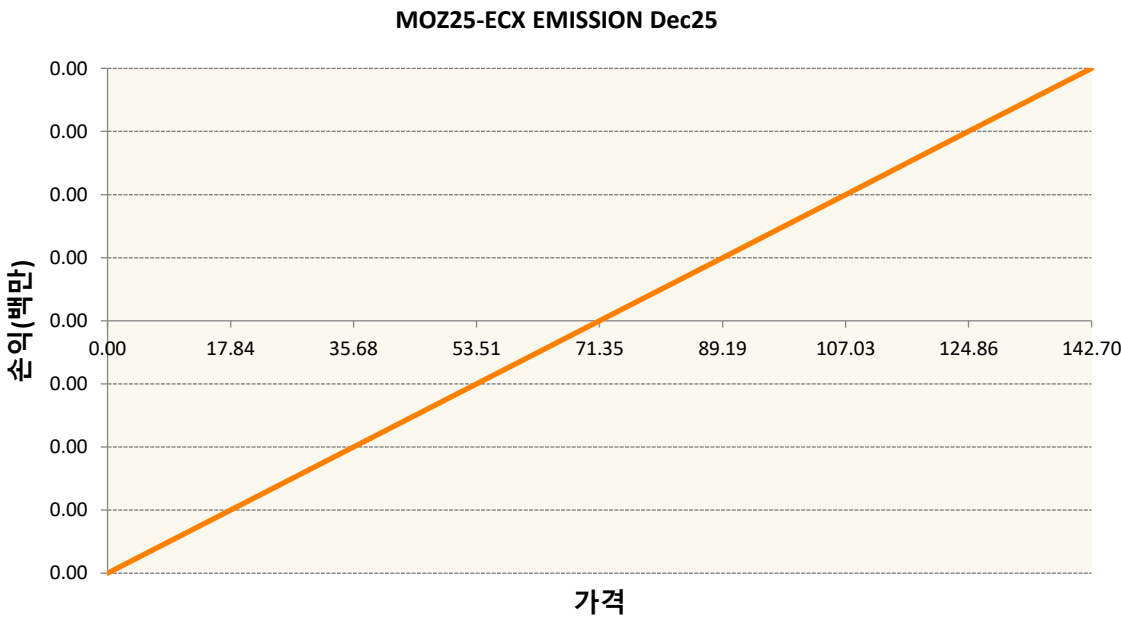
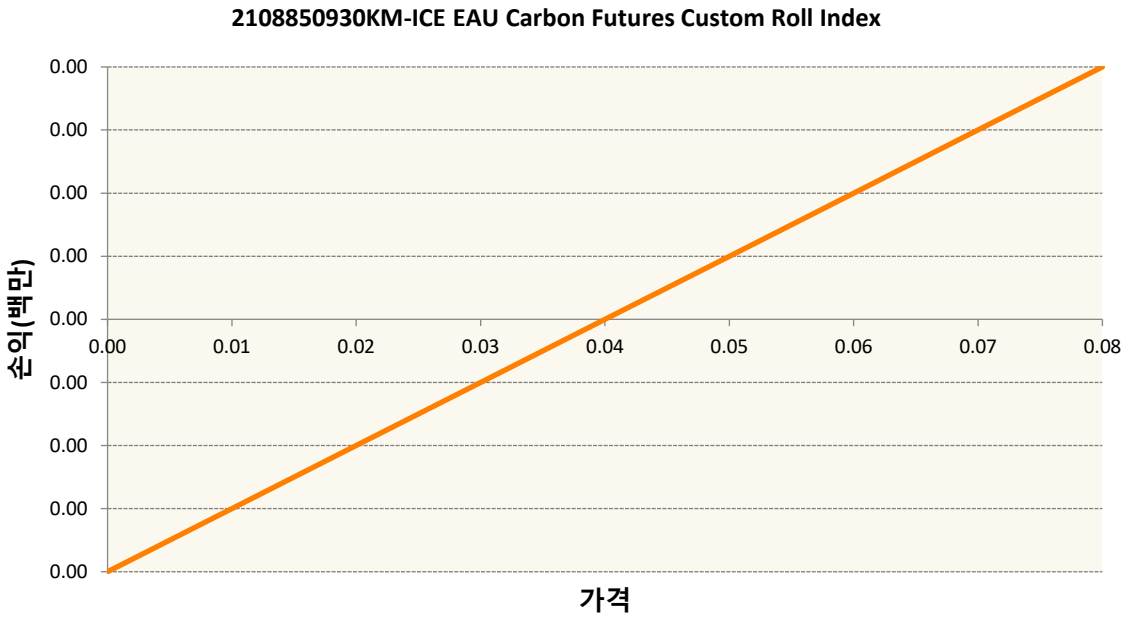
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,735	0	8,735	
누계	통화	선도	0	4,063	-4,063	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		139
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		25
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		150
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		698

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,328

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

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)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	24
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	24

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

(단위:백만원)

137

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

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)	51
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	44
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	61
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	13

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

(단위:백만원)

280

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

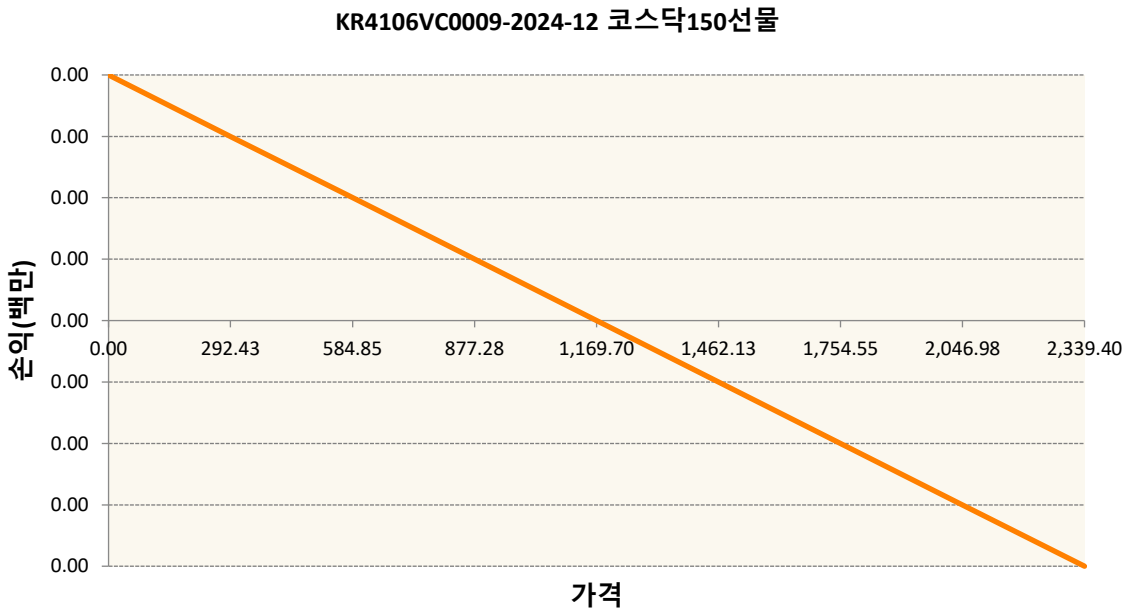
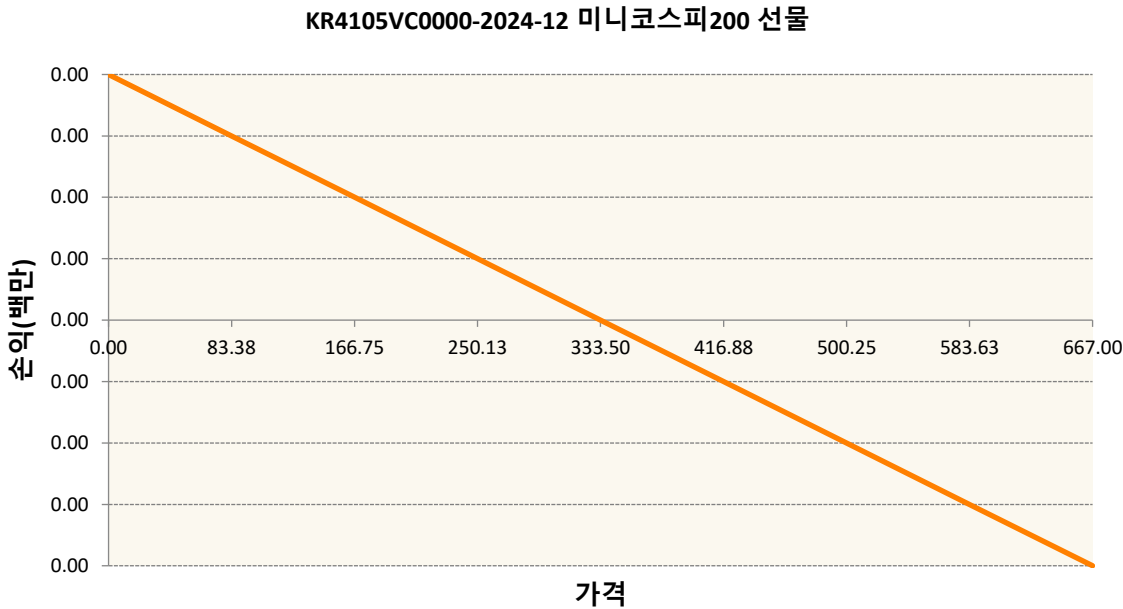
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

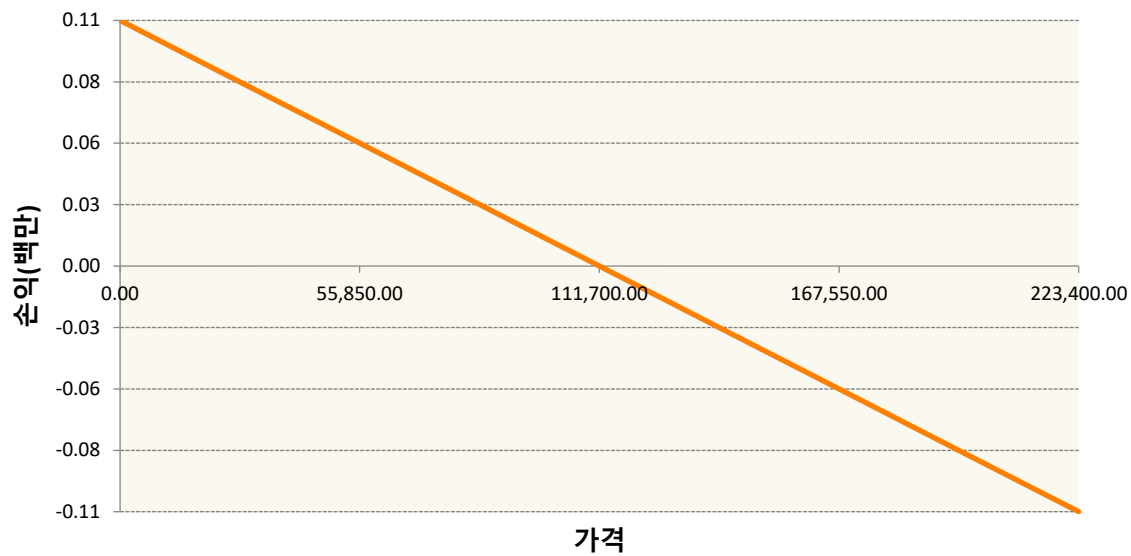
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	32	-32	장내
누계	유가증권	선물	9	256	-248	장내

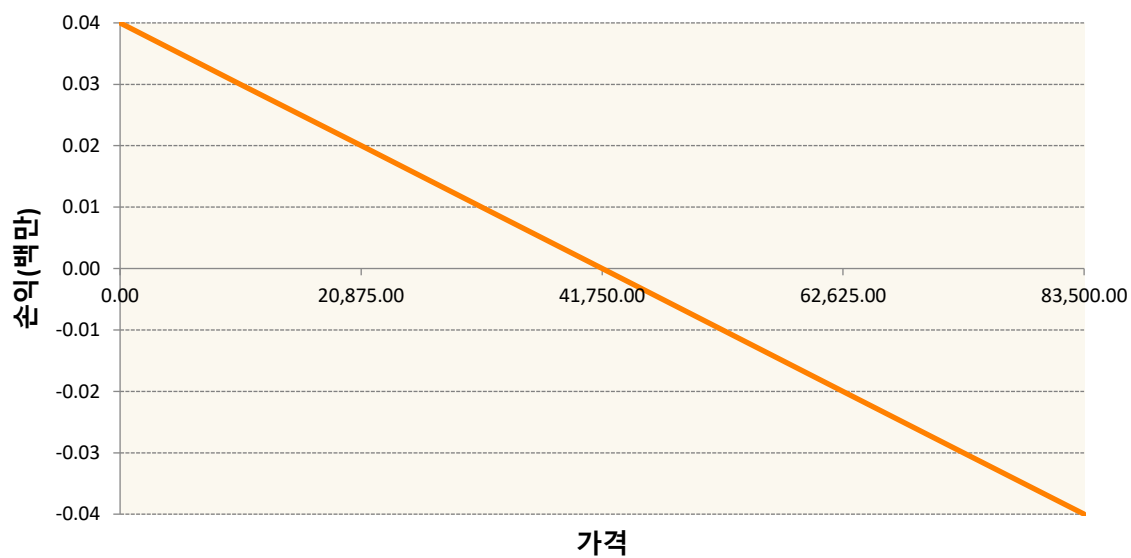
2. 만기시점의 손익구조



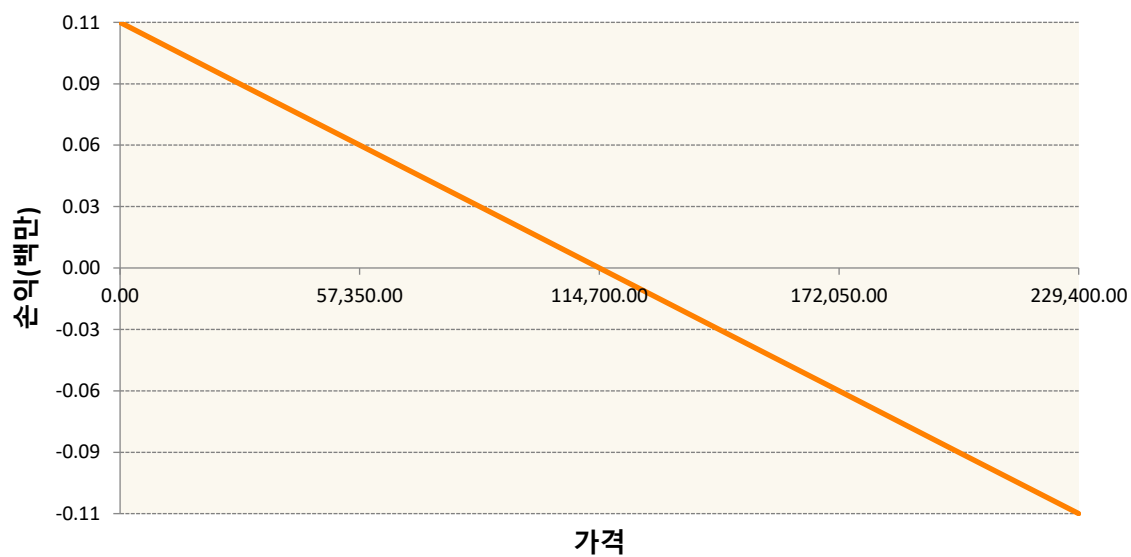
KR4123VC0008-2024-12 삼성전기개별선물



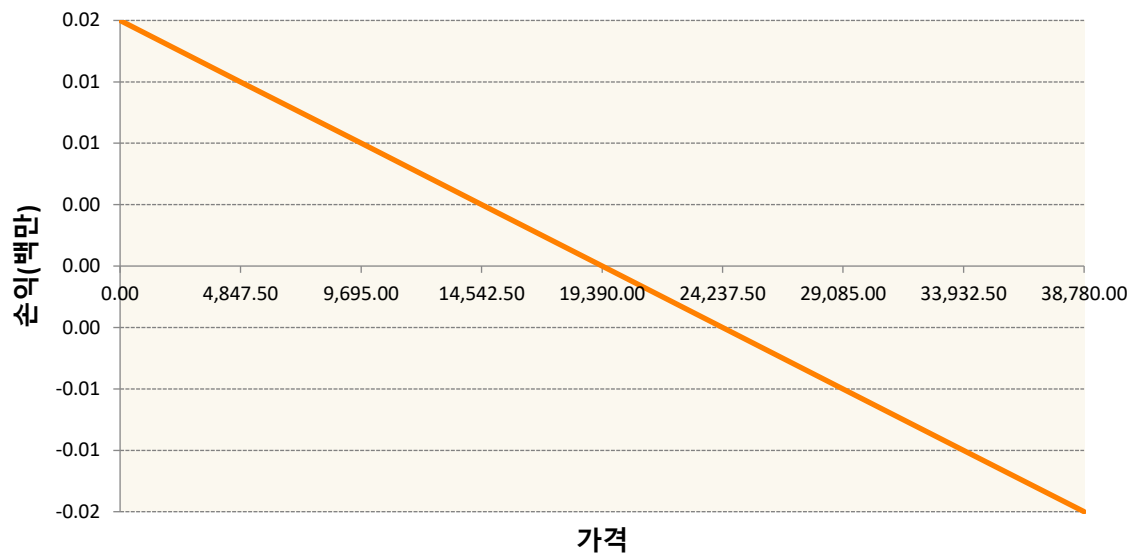
KR4135VC0004-2024-12 GS개별선물



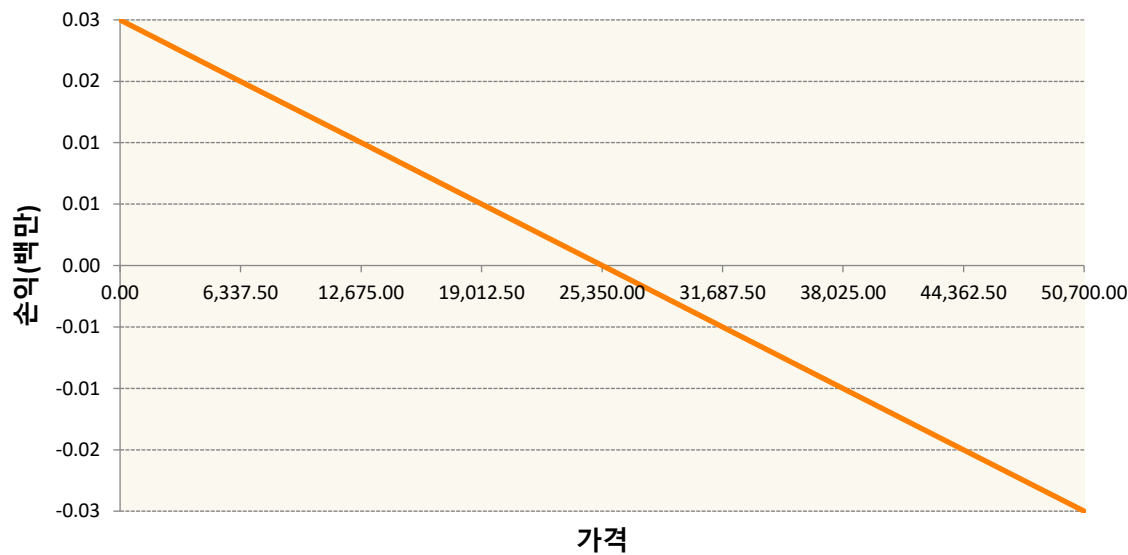
KR4141VC0006-2024-12 SK이노베이션개별선물



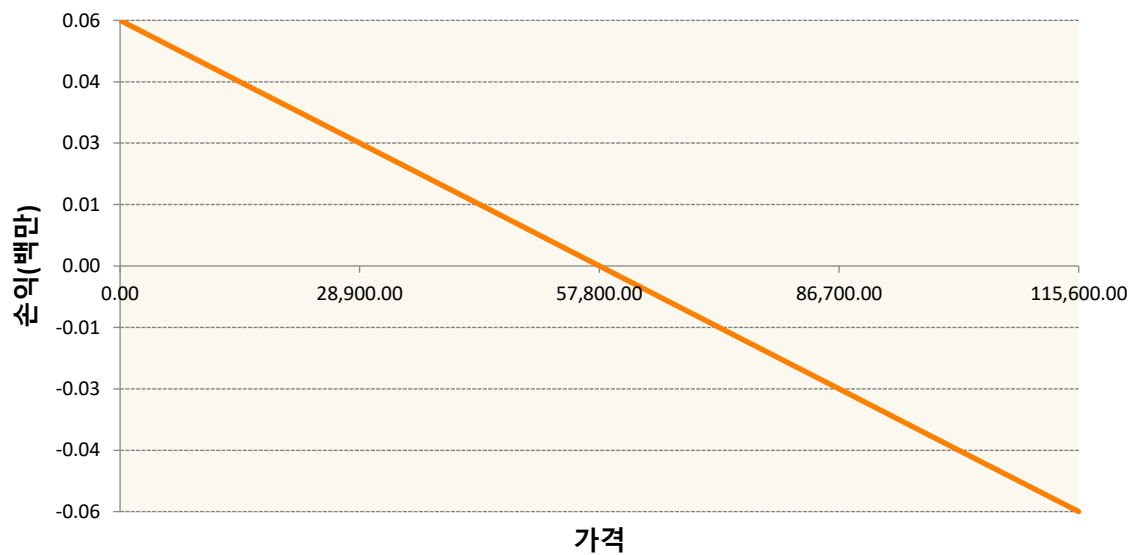
KR4151VC0003-2024-12 GS건설개별선물



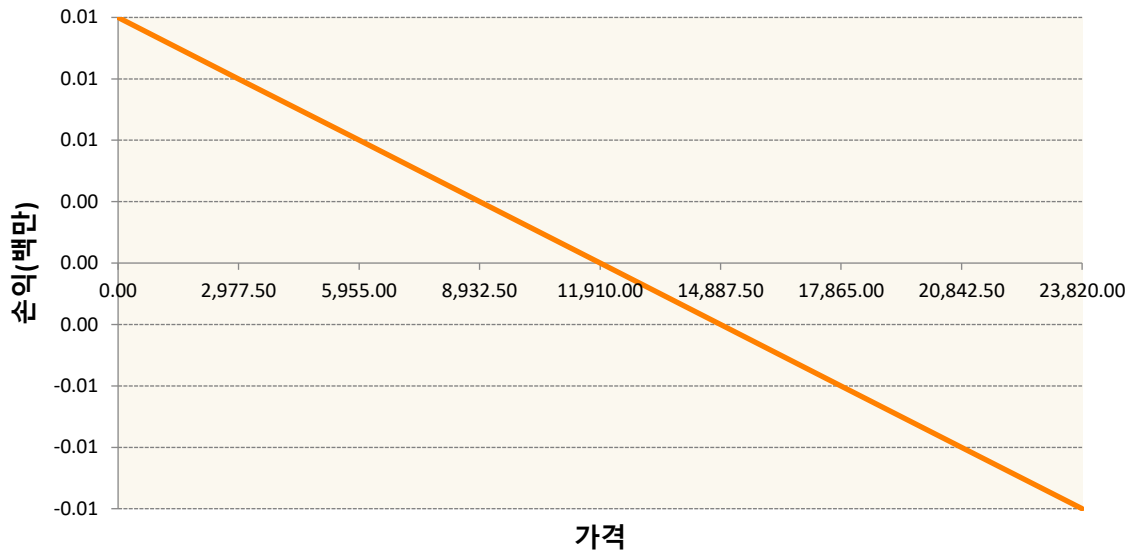
KR4157VC0007-2024-12 대한항공개별선물



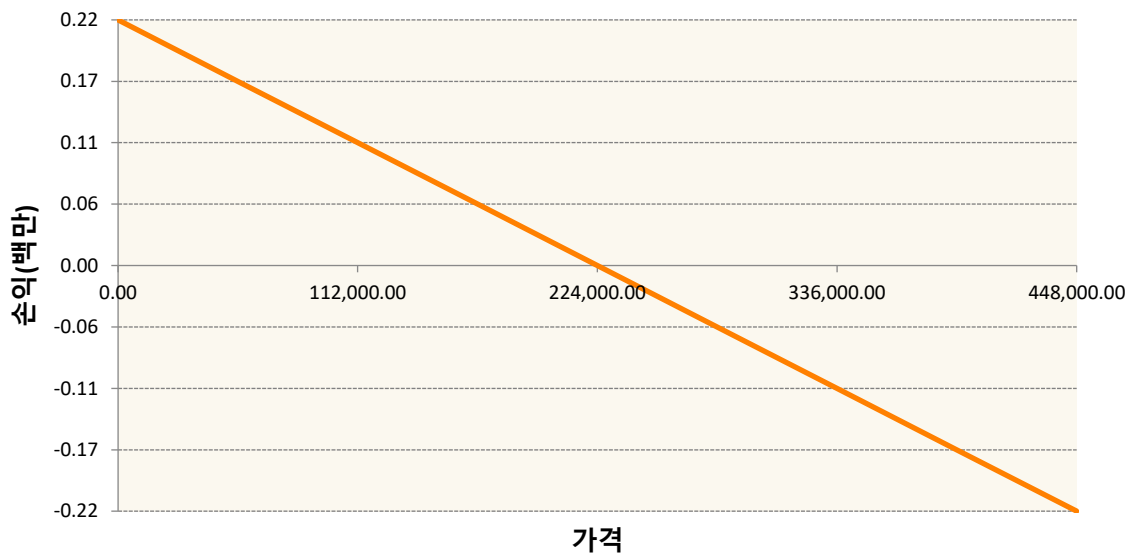
KR41B2VC0009-2024-12 S-Oil개별선물



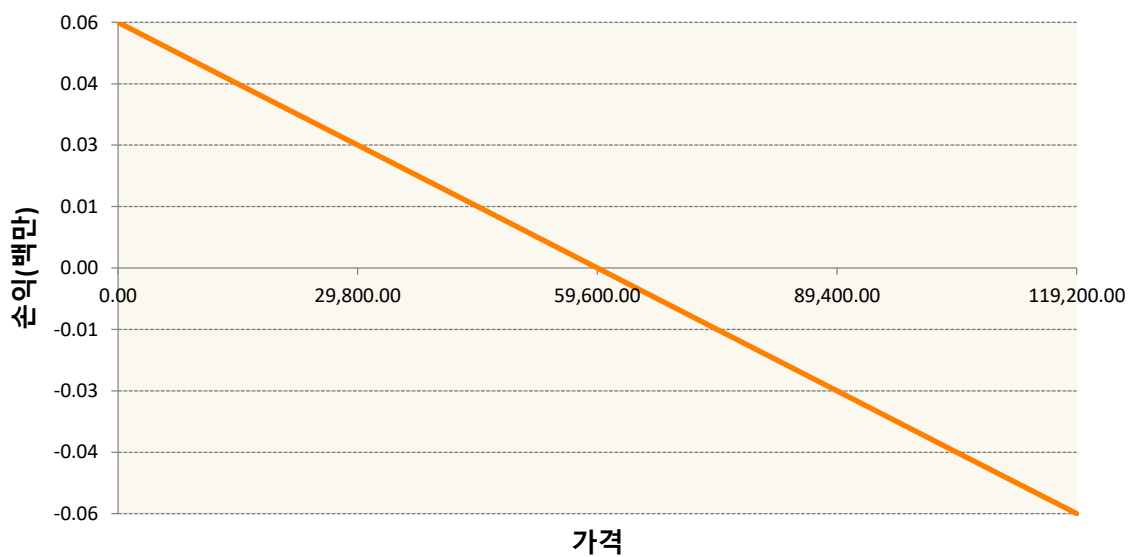
KR41BFVC0005-2024-12 삼성중공업개별선물



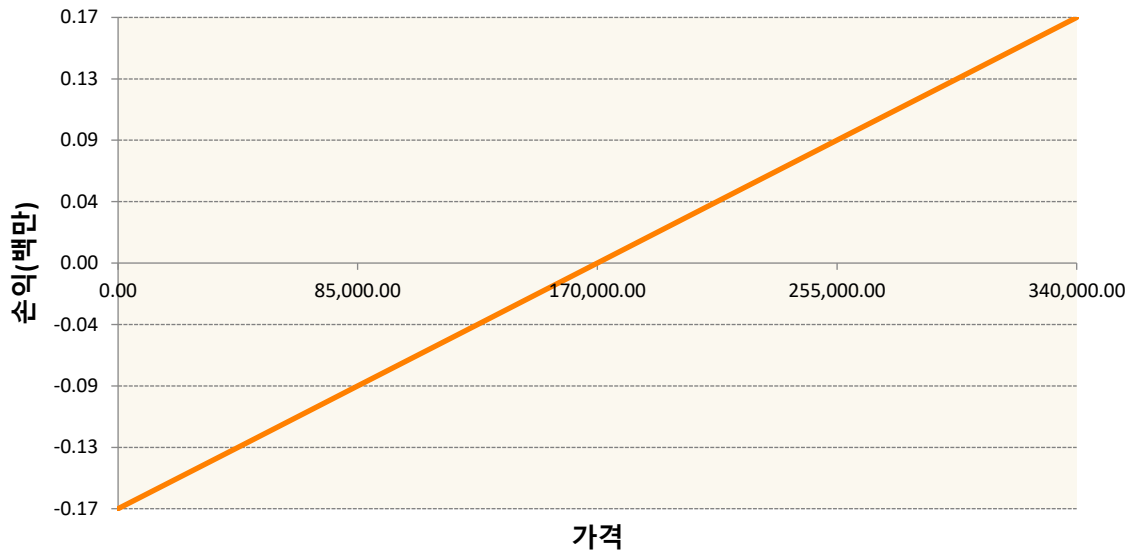
KR41BJVC0001-2024-12 엔씨소프트개별선물



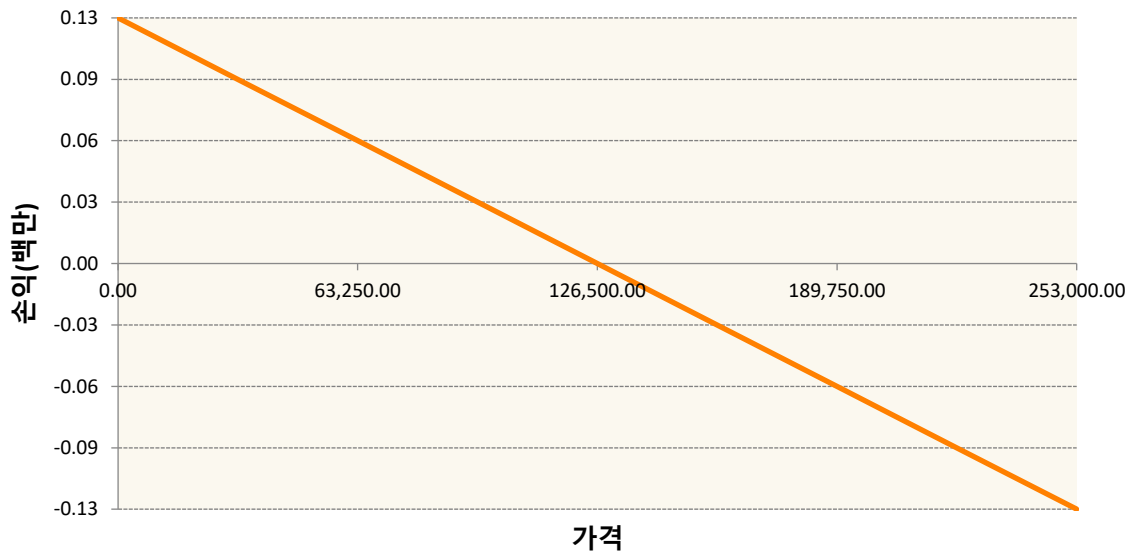
KR41BMVC0006-2024-12 한국항공우주개별선물



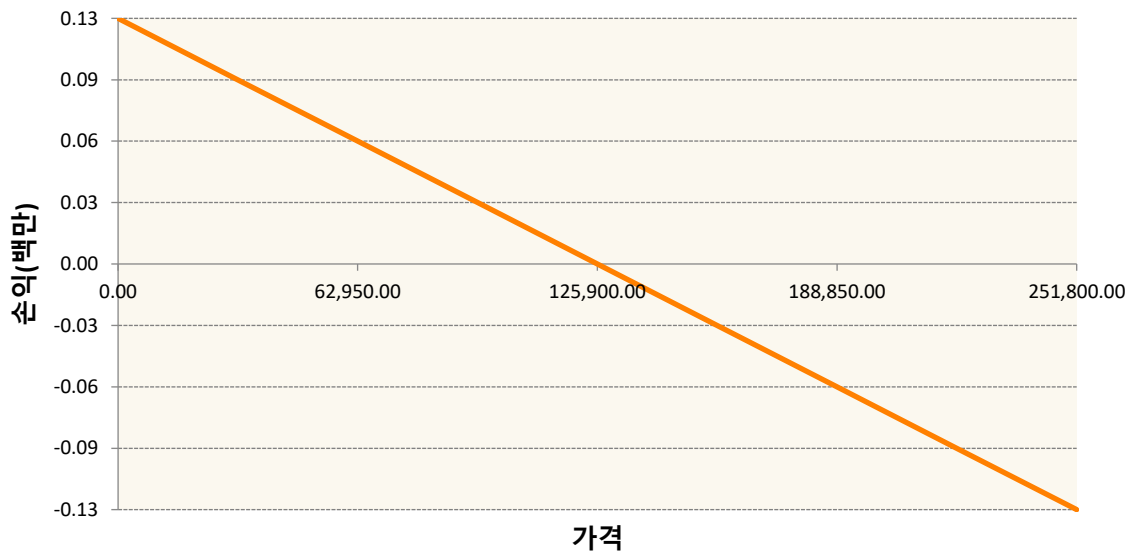
KR41BYVC0002-2024-12 LG이노텍개별선물



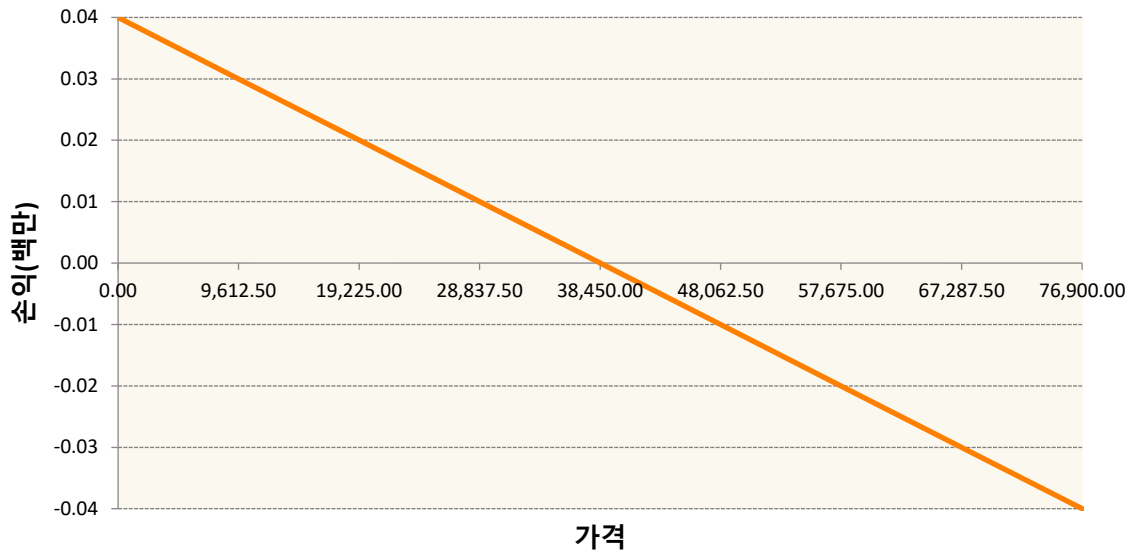
KR41CCVC0007-2024-12 현대글로벌비스개별선물



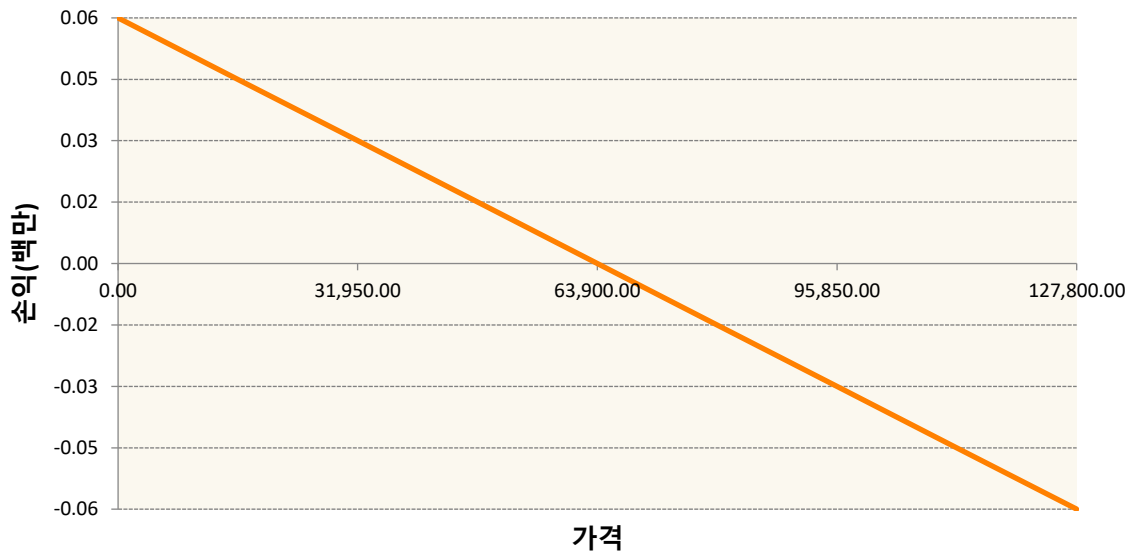
KR41CDVC0006-2024-12 현대미포조선개별선물



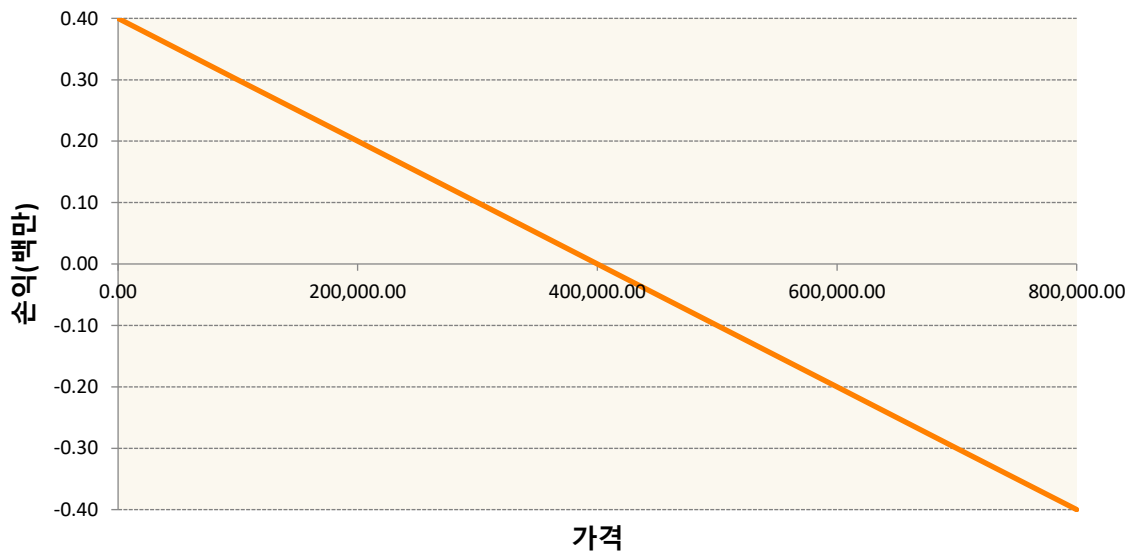
KR41CFVC0004-2024-12 카카오개별선물



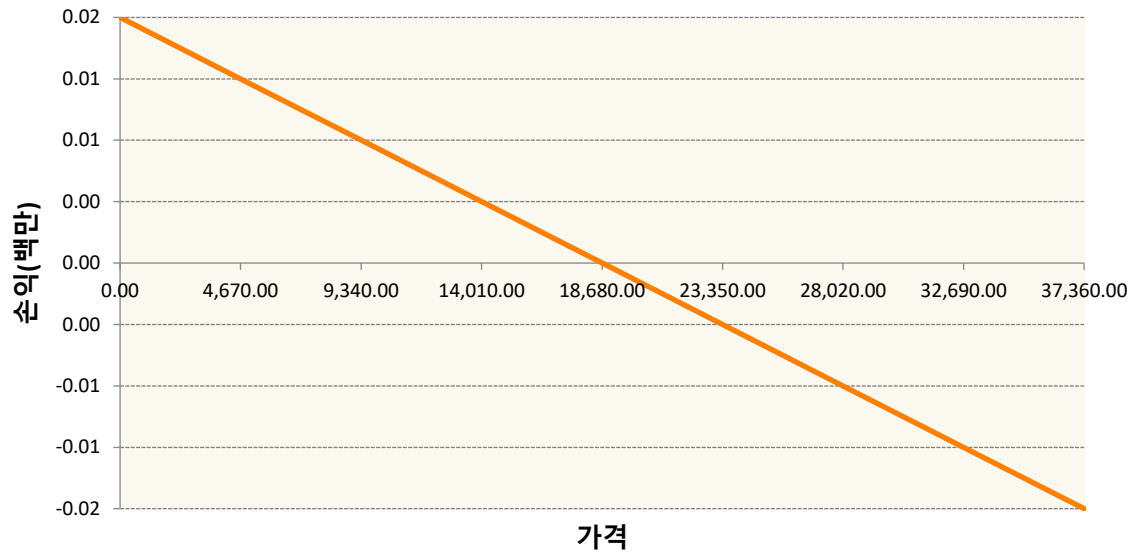
KR41DTVC0007-2024-12 CJ ENM개별선물



KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



KR41FAVC0006-2024-12 HMM개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105VC00 2024-12 미니코스피200 선물	3
KR4106VC00 2024-12 코스닥150선물	1
KR4123VC00 2024-12 삼성전기개별선물	1
KR4135VC00 2024-12 GS개별선물	0.3
KR4141VC00 2024-12 SK이노베이션개별선물	0.37
KR4151VC00 2024-12 GS건설개별선물	1
KR4157VC00 2024-12 대한항공개별선물	0.37
KR41B2VC00 2024-12 S-Oil개별선물	0.05
KR41BFVC00 2024-12 삼성중공업개별선물	0.31
KR41BJVC00 2024-12 엔씨소프트개별선물	1
KR41BMVC00 2024-12 한국항공우주개별선물	0.48
KR41BYVC00 2024-12 LG이노텍개별선물	1
KR41CCVC00 2024-12 현대글로비스개별선물	0.3
KR41CDVC00 2024-12 현대미포조선개별선물	0.3
KR41CFVC00 2024-12 카카오개별선물	0.22
KR41DTVC00 2024-12 CJ ENM개별선물	0.46
KR41F5VC00 2024-12 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41FAVC00 2024-12 HMM개별선물	0.45

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

(단위:백만원)

19

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

(단위:백만원)

2,336

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

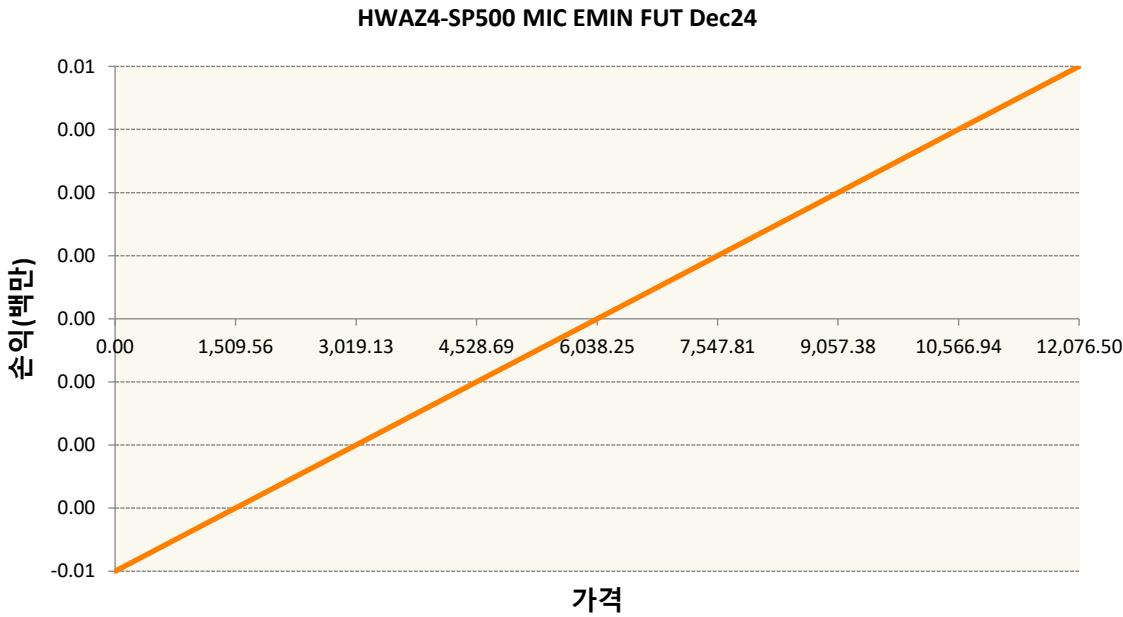
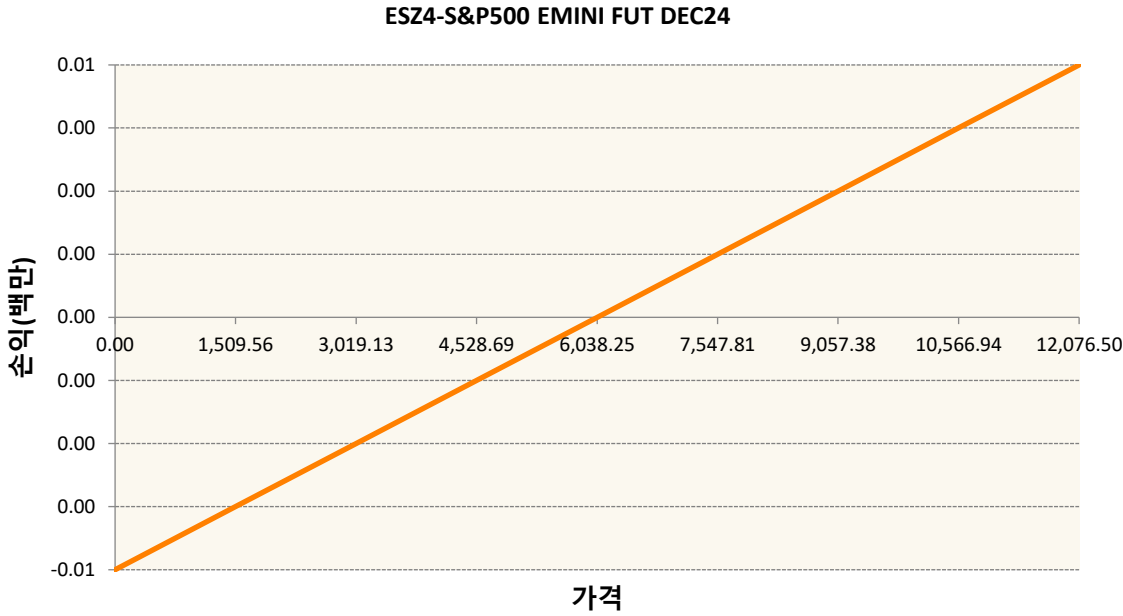
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	18,121	0	18,121	
누계	유가증권	선물	1,988	0	1,988	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,450
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	159

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	985

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

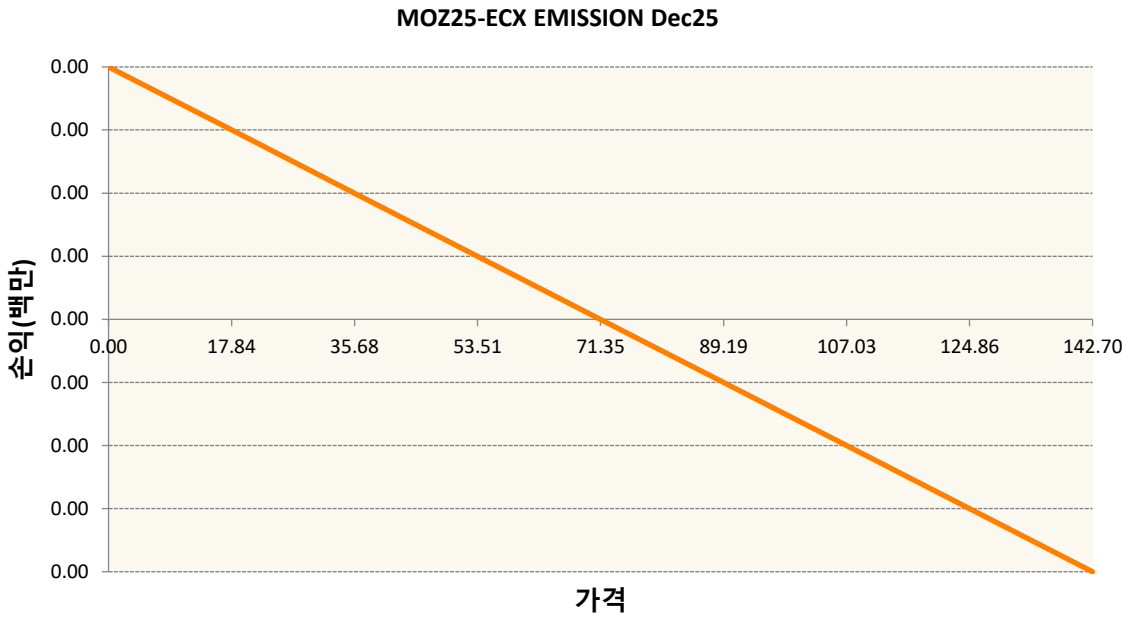
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	-14	5,432	-5,447	
누계	통화	선도	0	2,525	-2,525	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
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E	90
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	435

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

(단위:백만원)

828

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

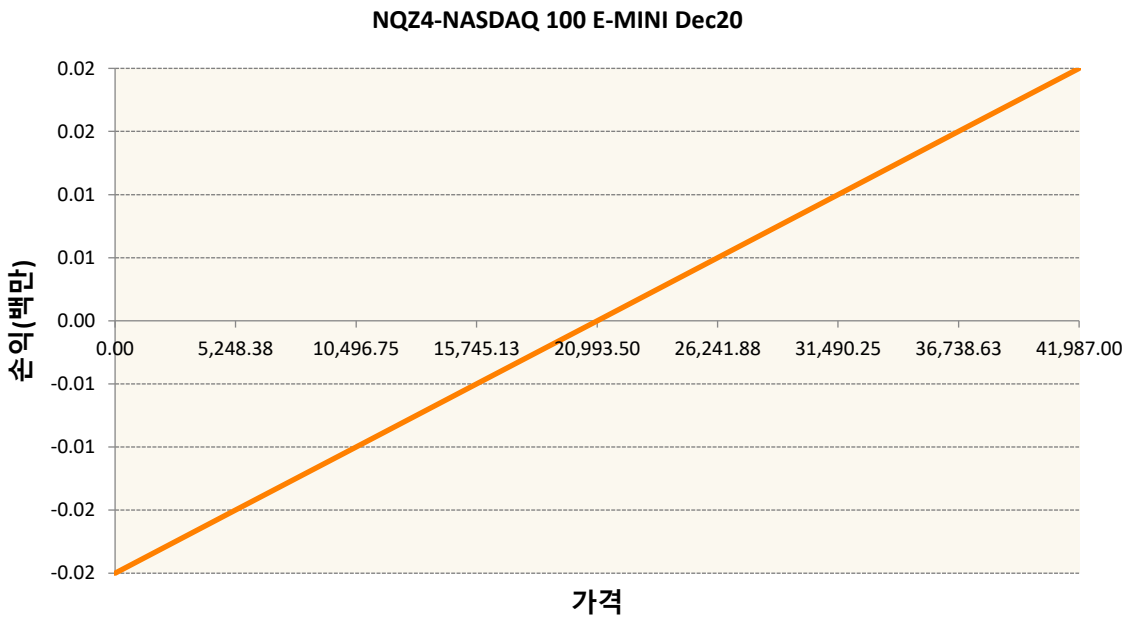
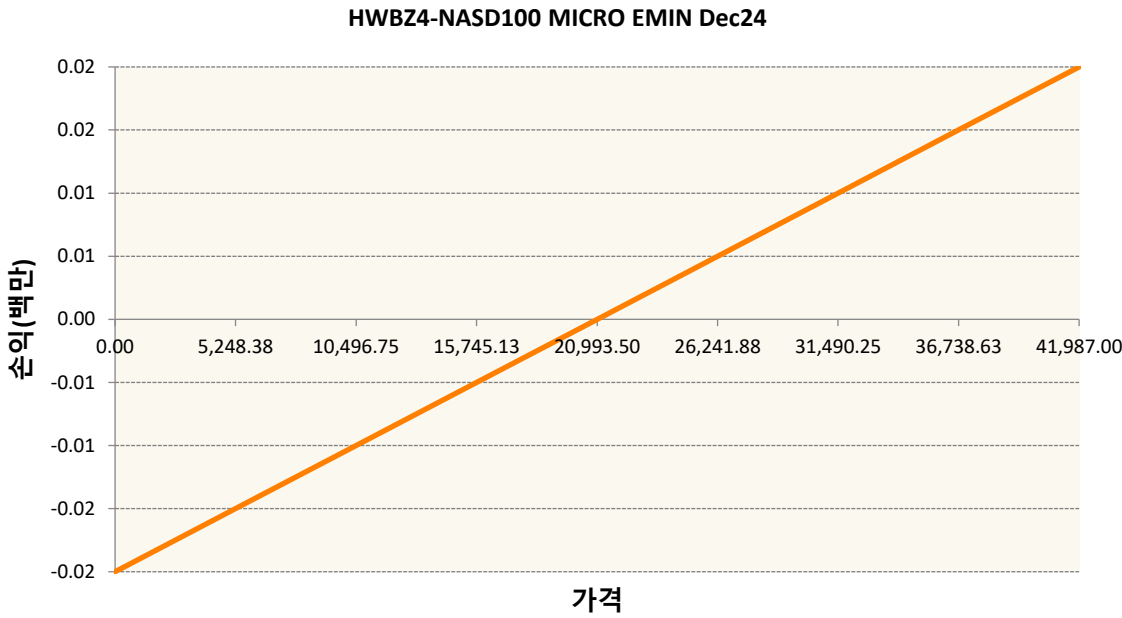
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	10,289	0	10,289	
누계	유가증권	선물	1,327	0	1,327	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		106
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		823

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			770

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	84,047	0	84,047	장외
누계	지수	스왑	203,286	0	203,286	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	704
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,685
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,267
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,704

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

(단위:백만원)

9,812

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

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	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15

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

(단위:백만원)

66

공시일	2024-11-28
기준일	2024-11-27

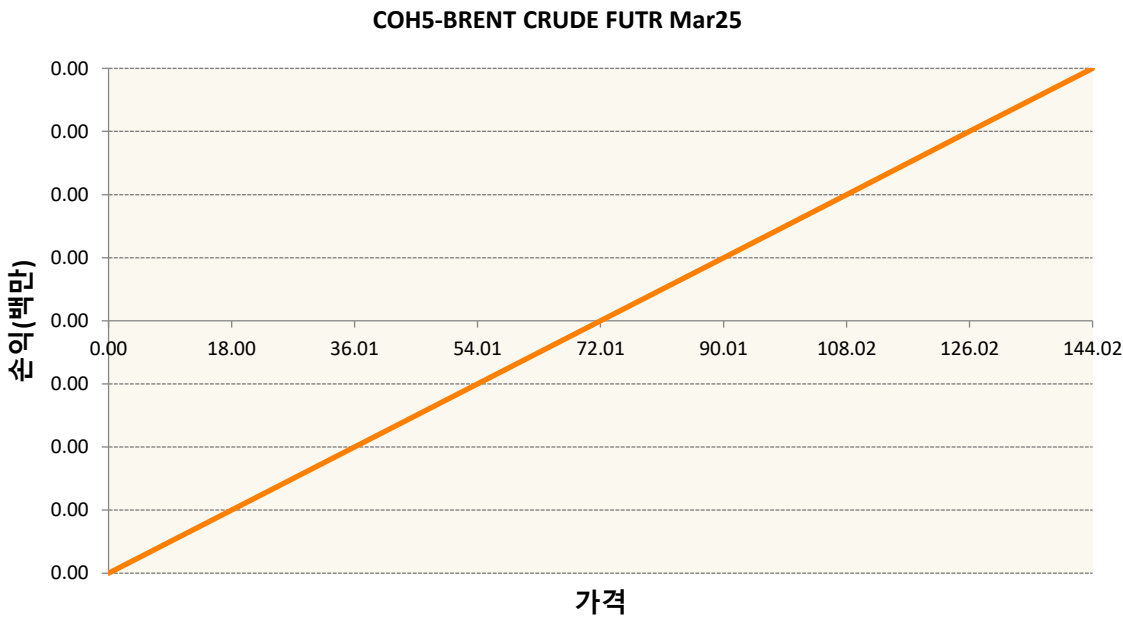
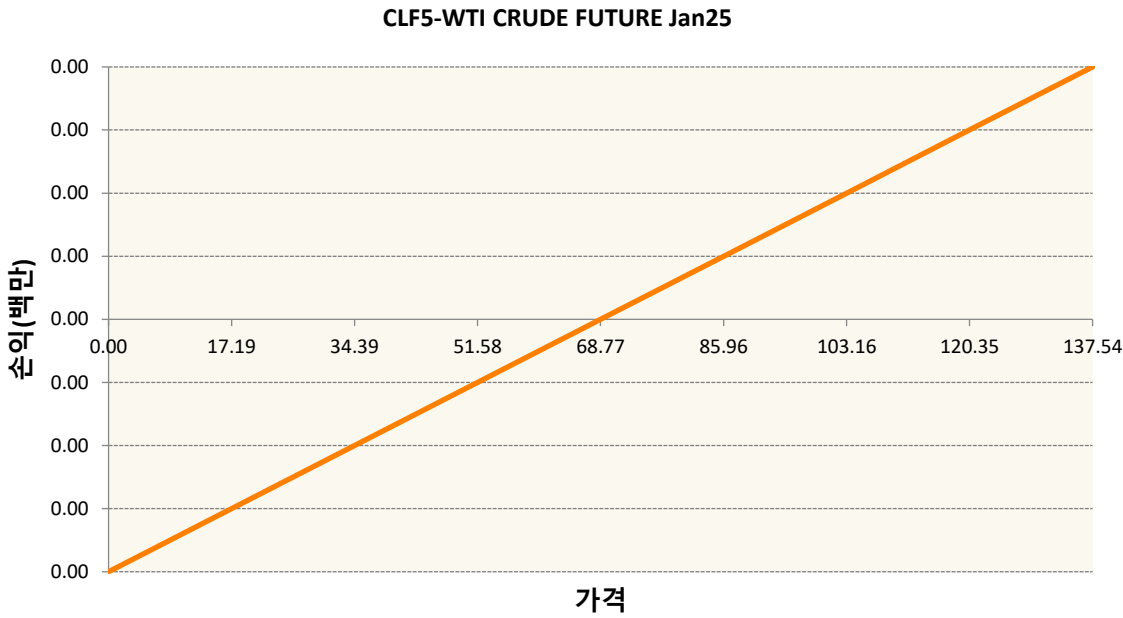
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

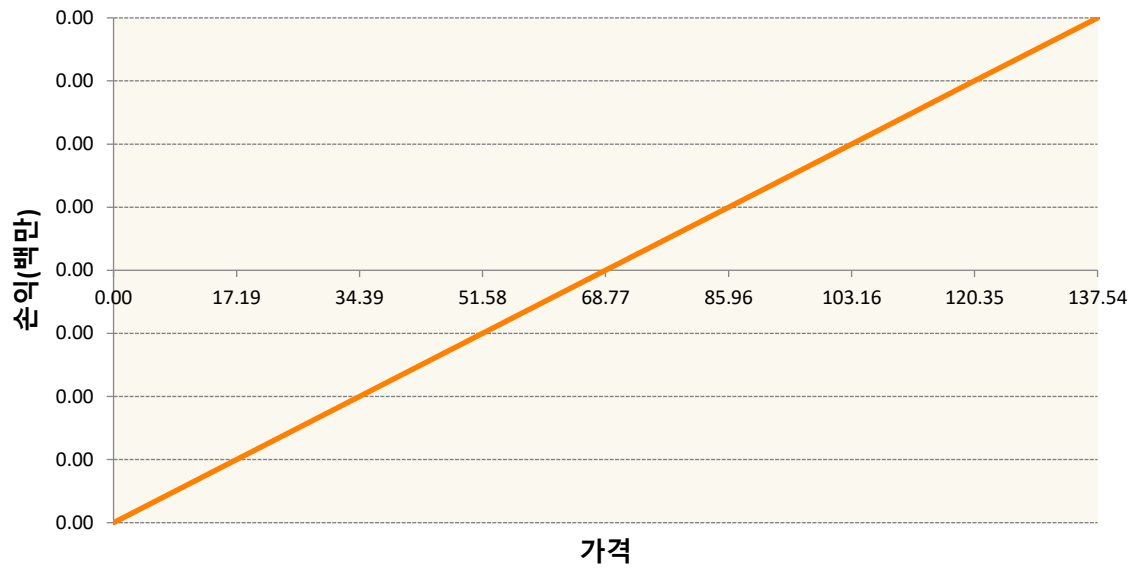
(단위:백만원)

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	802	0	802	
누계	통화	선물	0	140	-140	장내

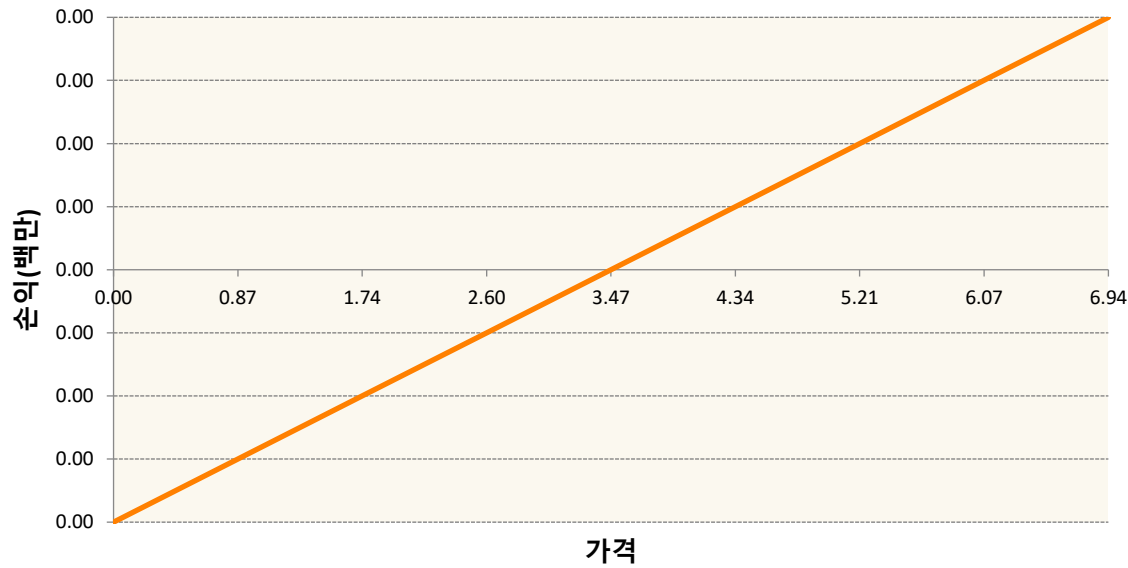
2. 만기시점의 손익구조



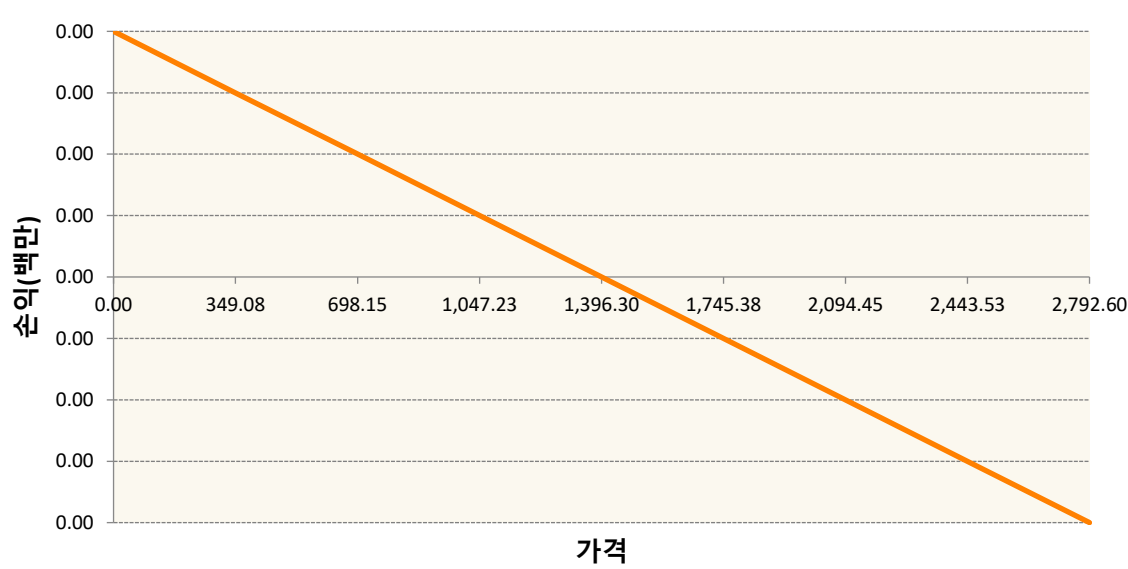
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



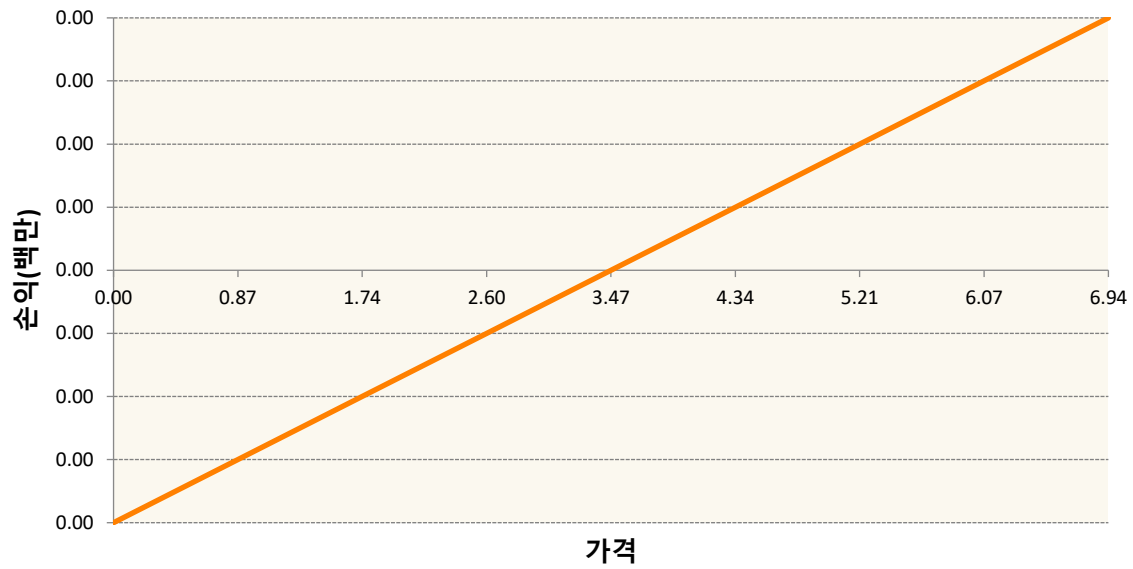
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



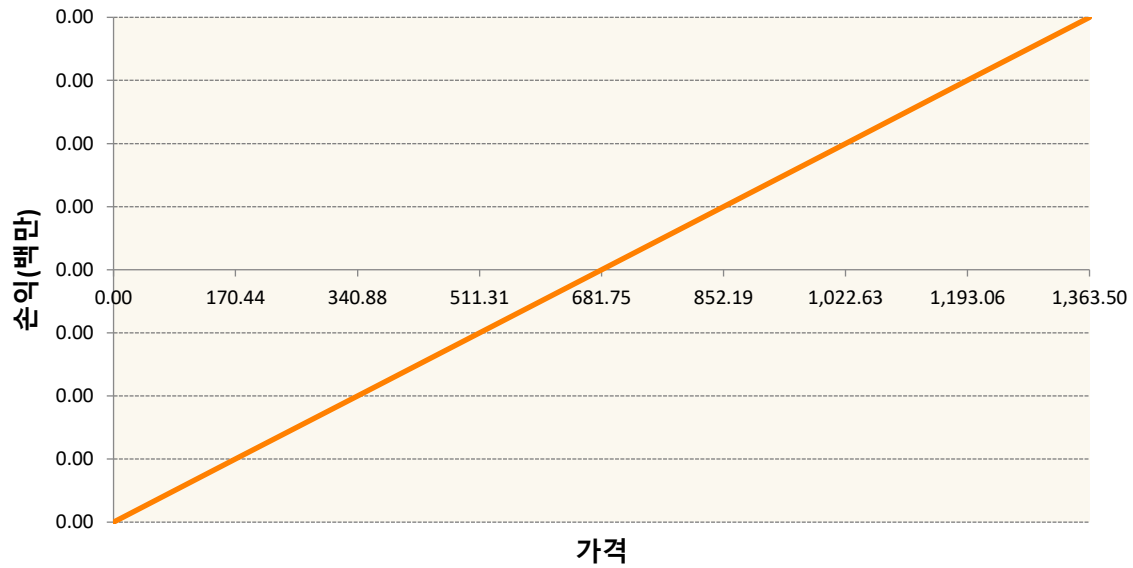
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



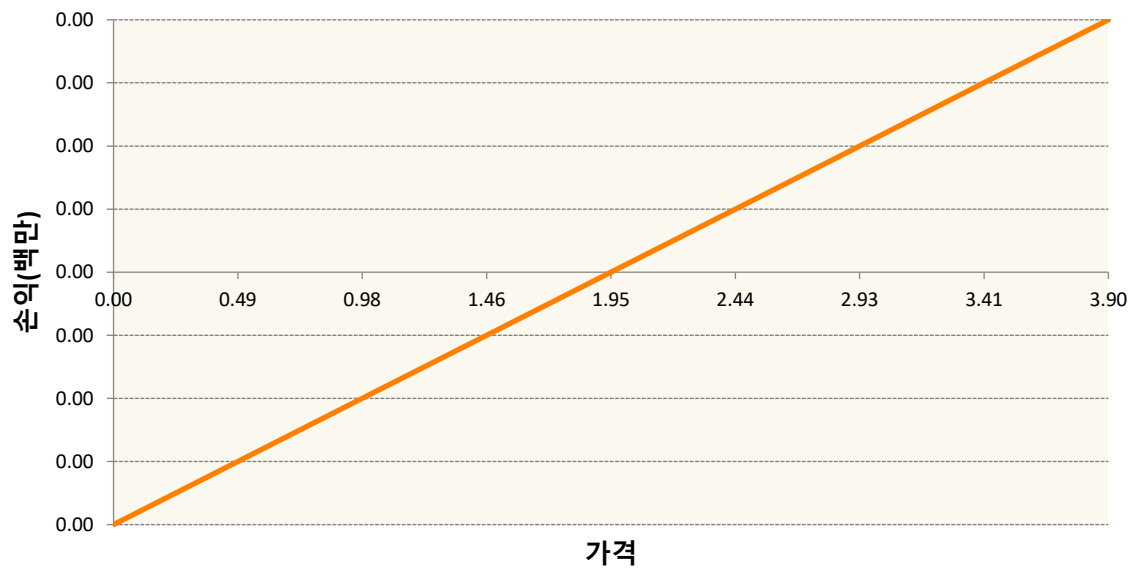
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



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		11
NGF25	NATURAL GAS FUTR Jan25	19
QSF5	Low Su Gasoil G Jan25	7
XBF5	GASOLINE RBOB FUT Jan25	9

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

143