

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

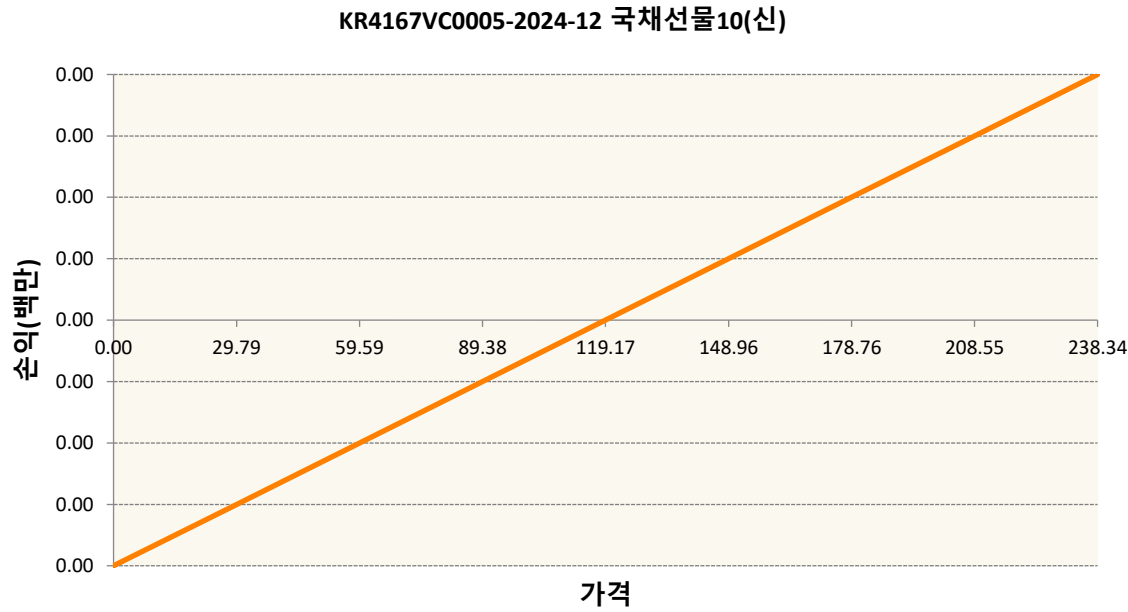
베스트장기채(채권-파생형)

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	206,760	0	206,760	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4167VC00 2024-12 국채선물10(신)	16,541
------------------------------	--------

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

(단위:백만원)

5,380

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

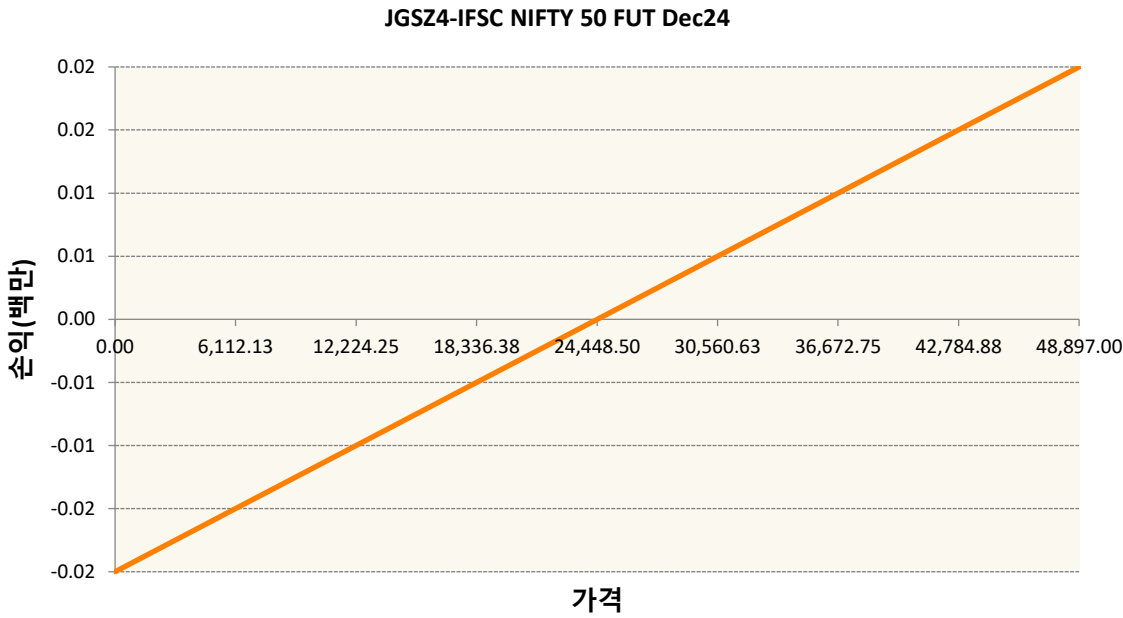
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,347	0	3,347	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSZ4	IFSC NIFTY 50 FUT Dec24	268
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

176

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

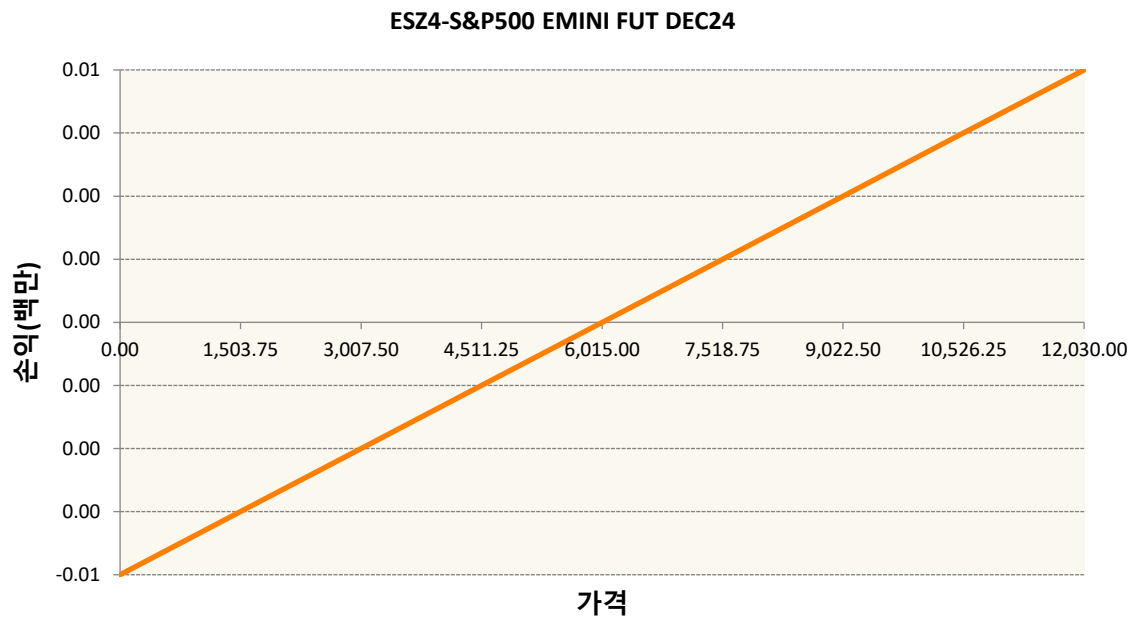
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	832	0	832	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOSPXWUS€SPXW US 11/29/24 C6025 INDEX	0.06
ESZ4 S&P500 EMINI FUT DEC24	67

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

(단위:백만원)

41

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

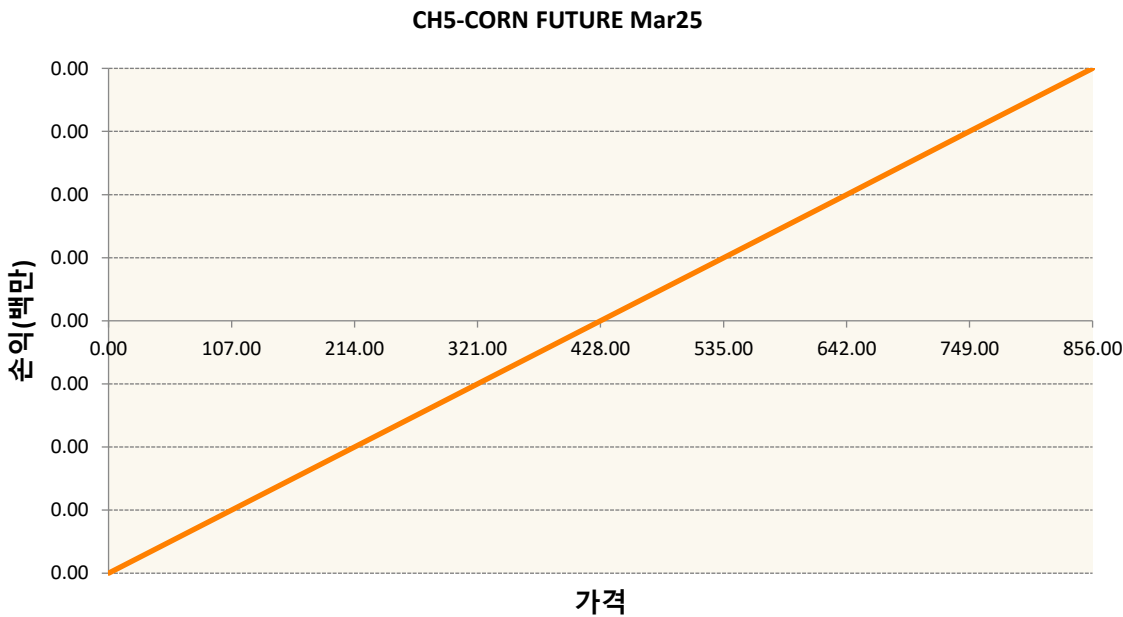
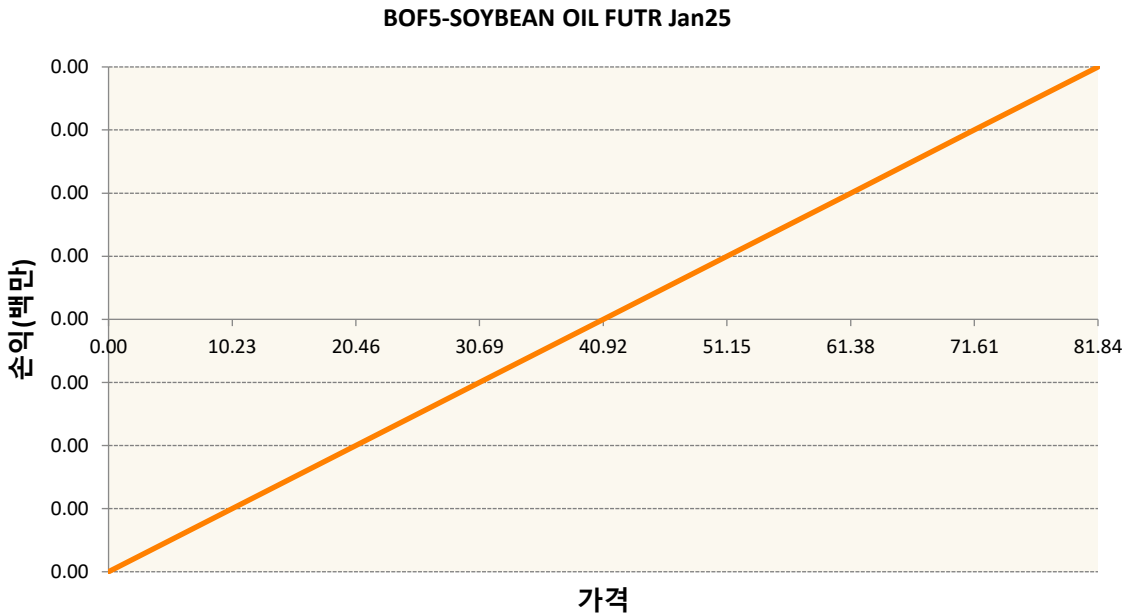
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

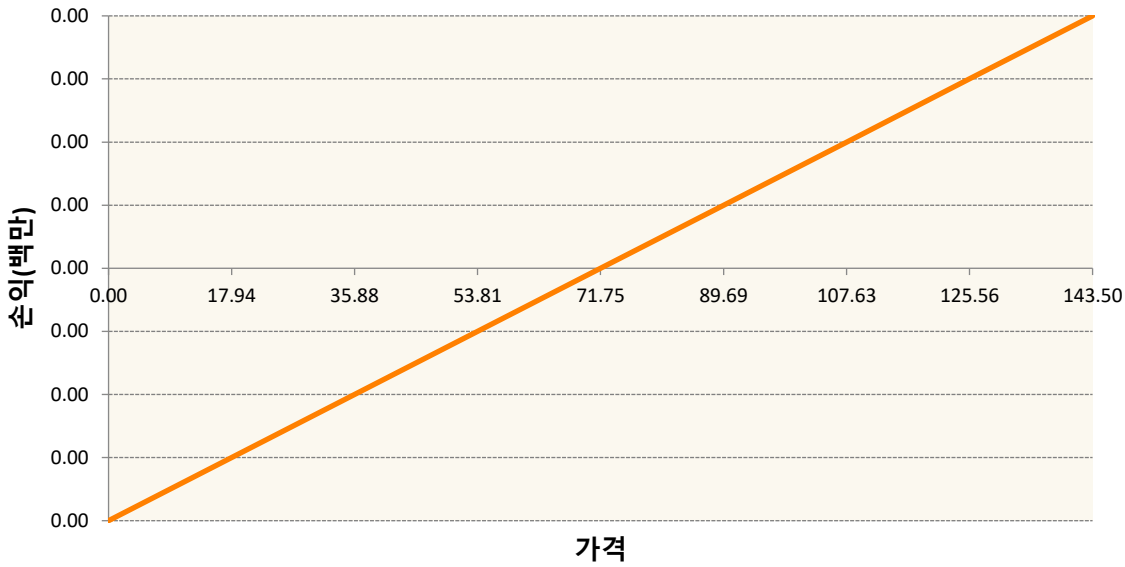
(단위:USD 백만)

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	3,779	0	3,779	
누계	통화	선물	0	474	-474	장내

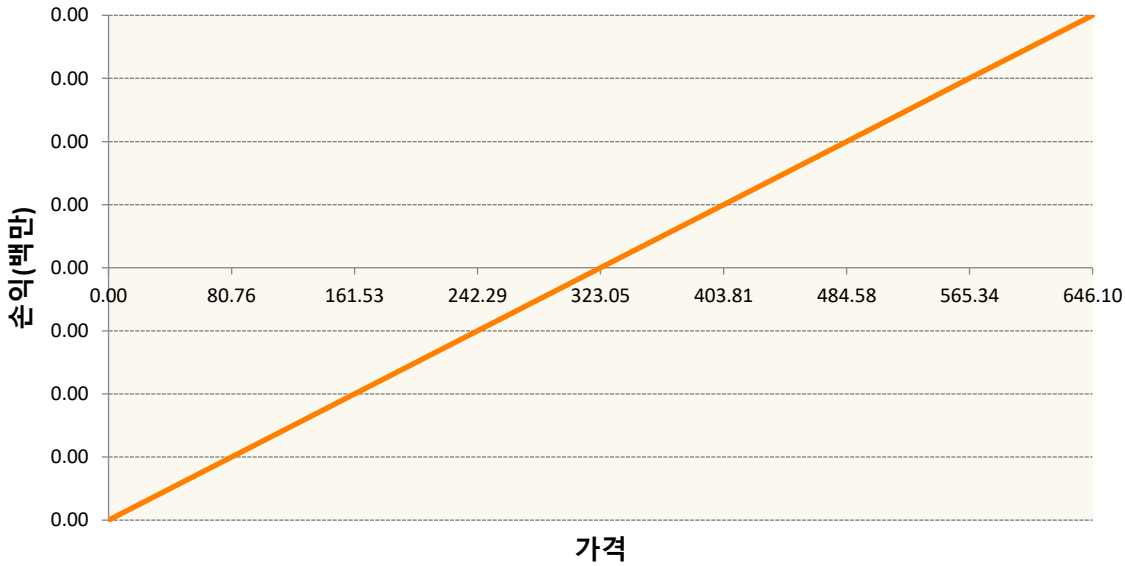
2. 만기시점의 손익구조



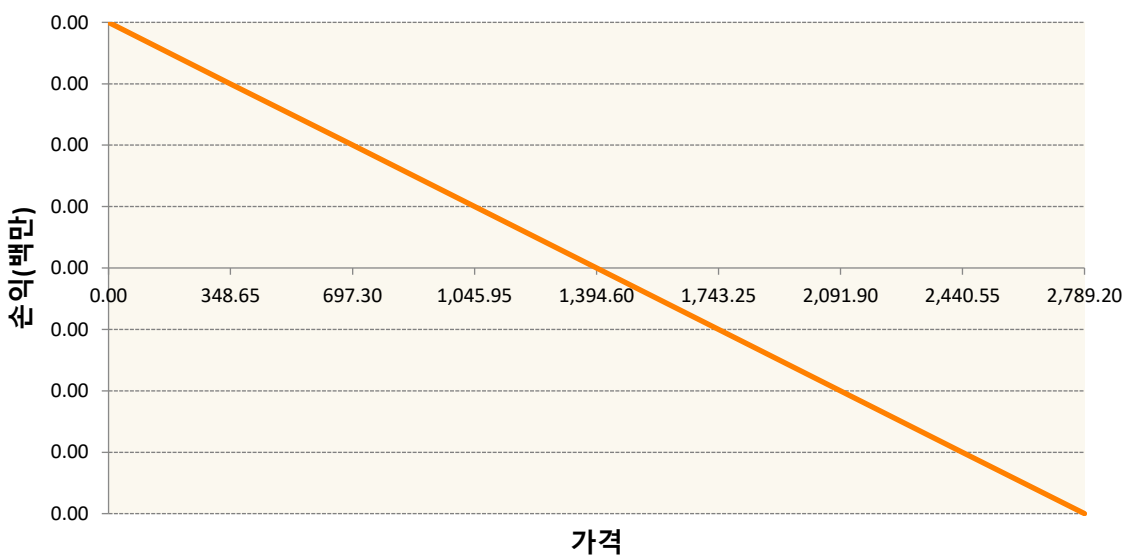
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



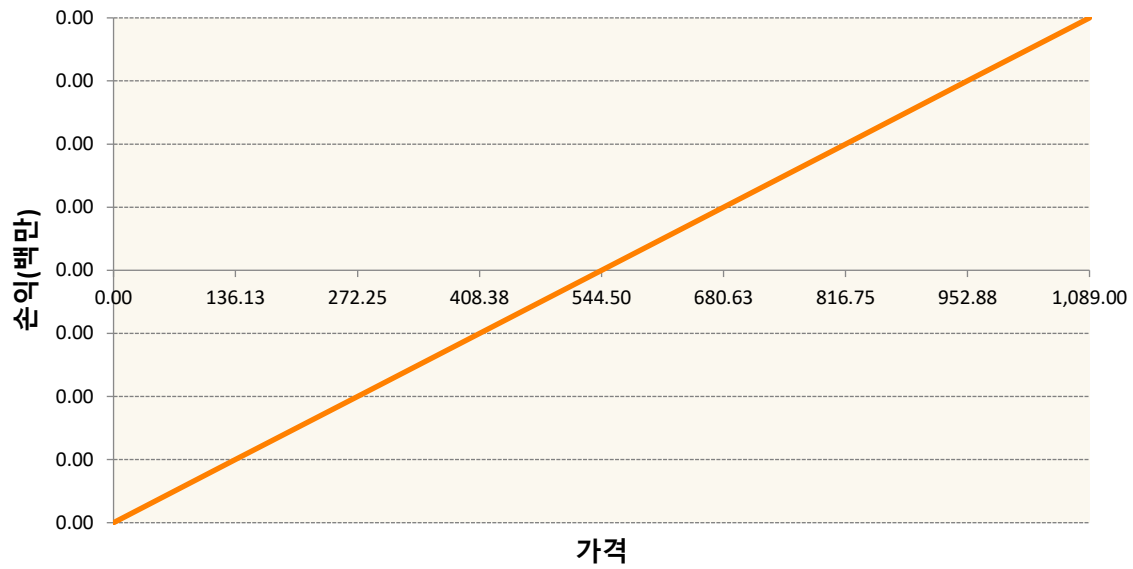
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



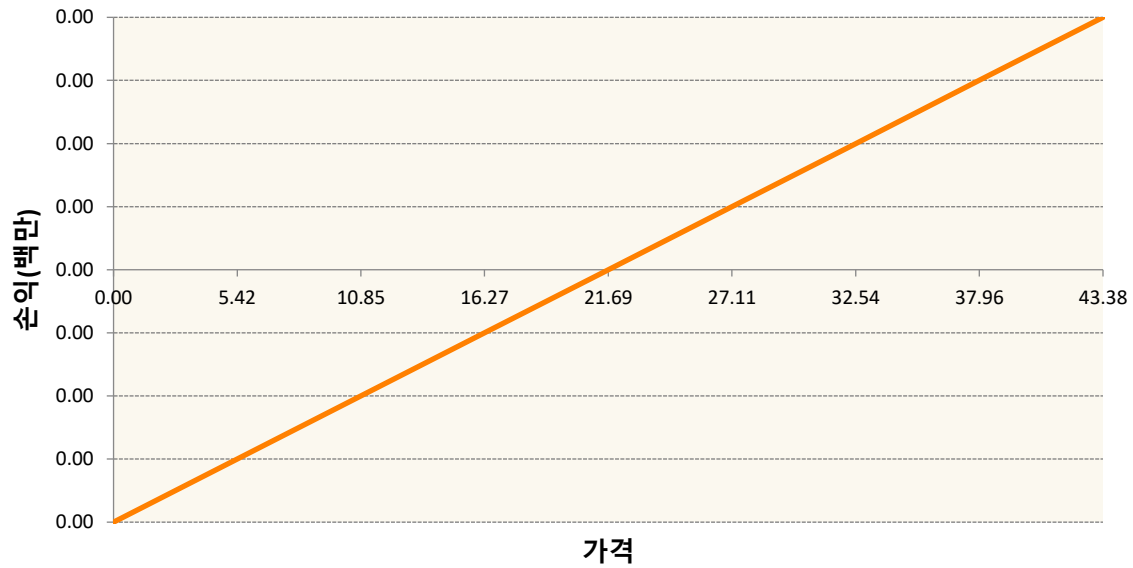
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



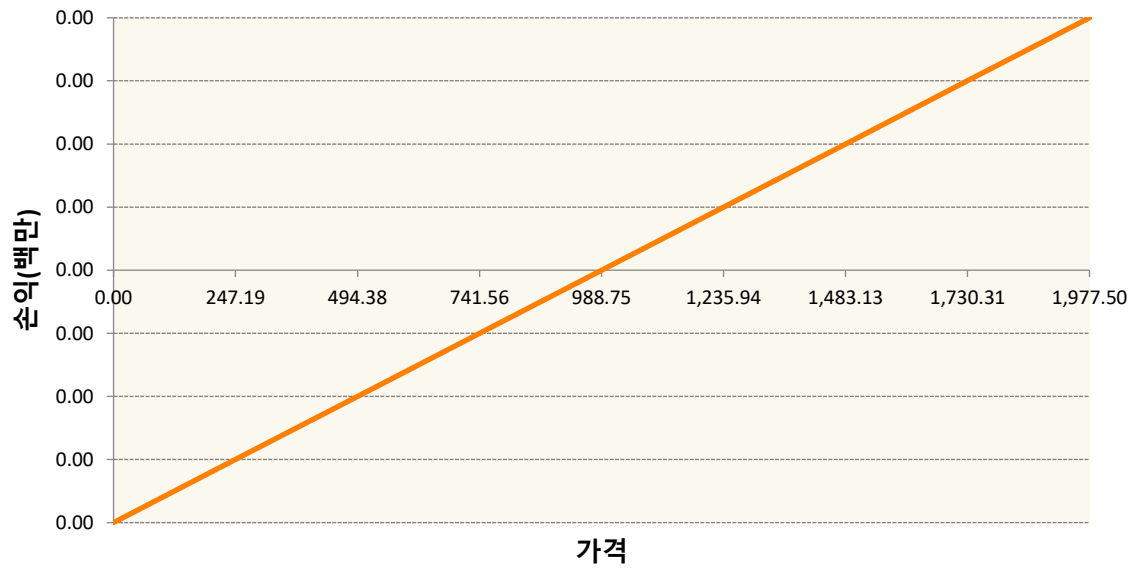
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



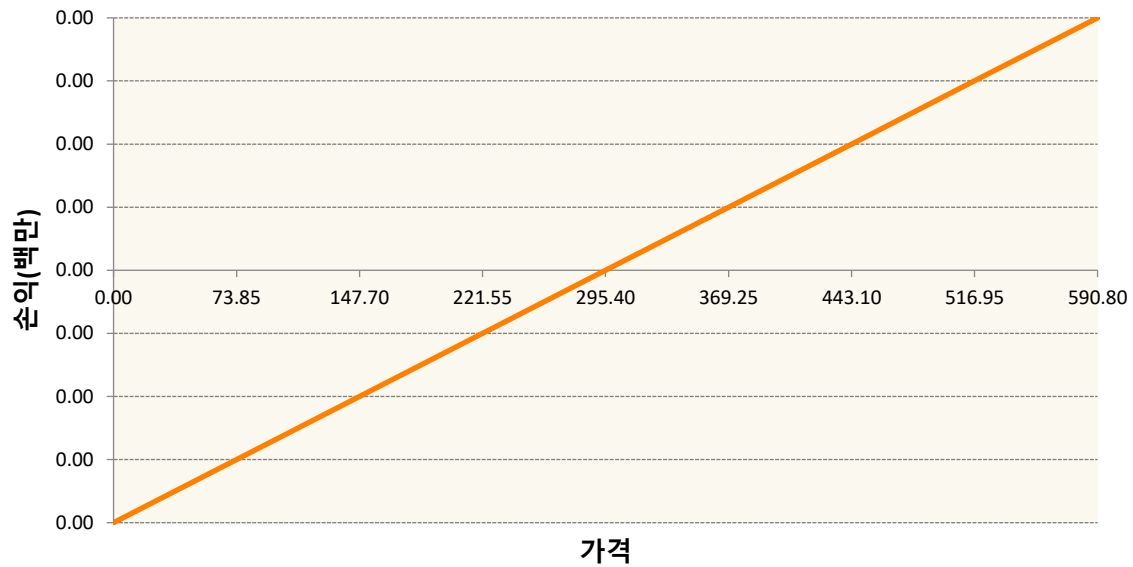
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



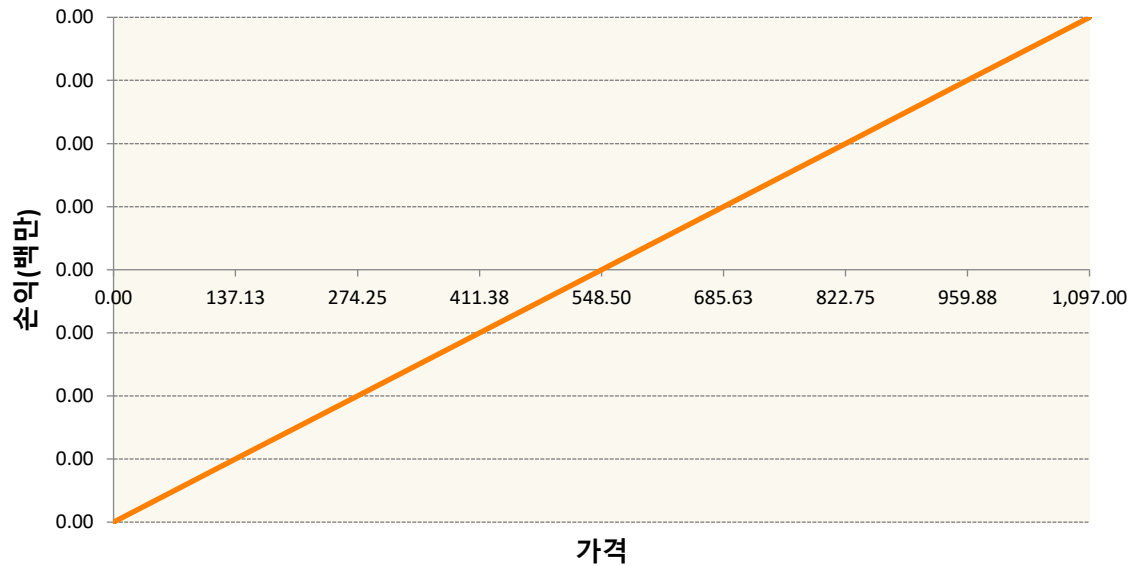
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-11-29
기준일	2024-11-28

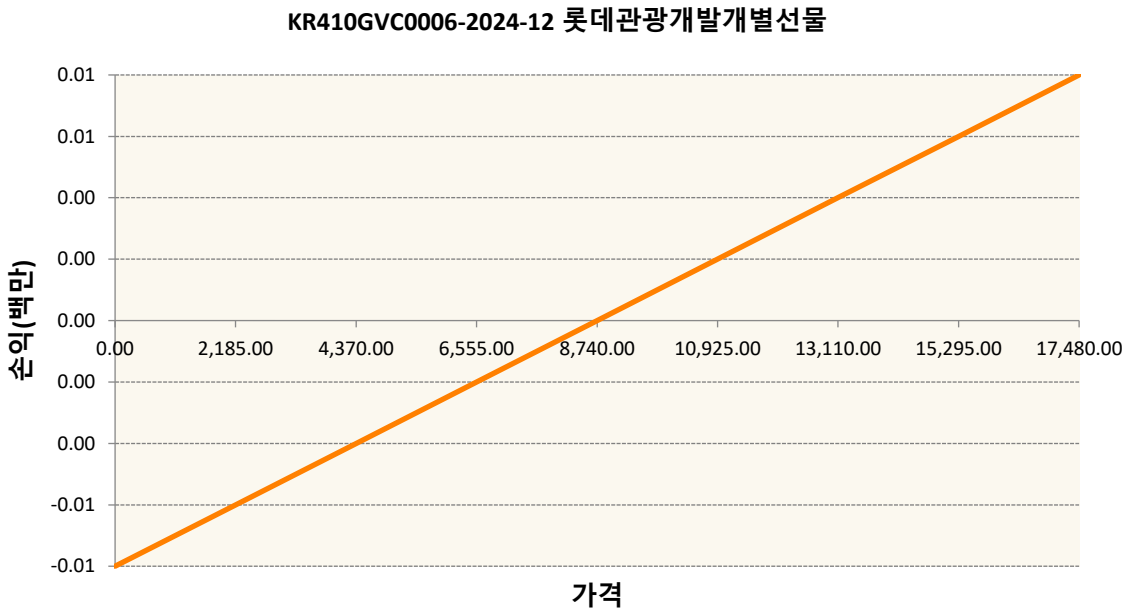
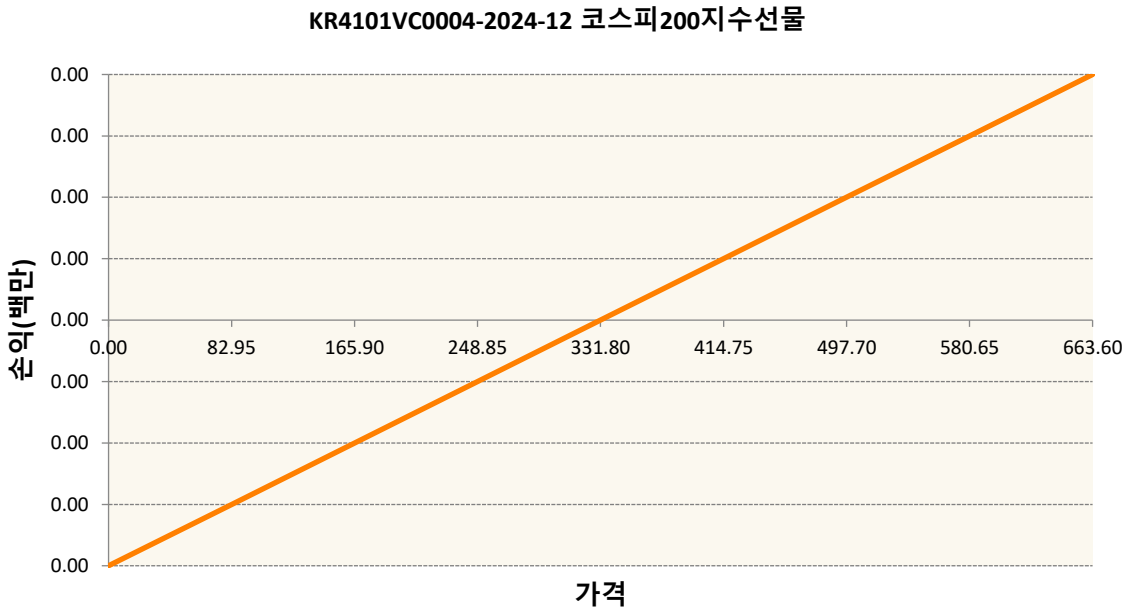
스마트인덱스모

1. 계약금액

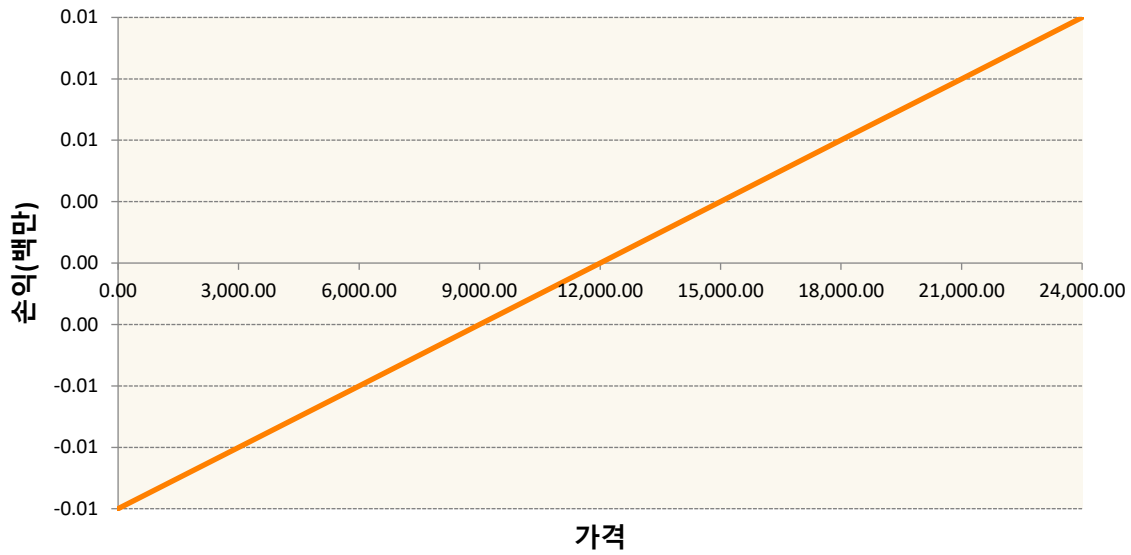
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	46	0	46	장내
누계	유가증권	선물	2,426	0	2,426	장내

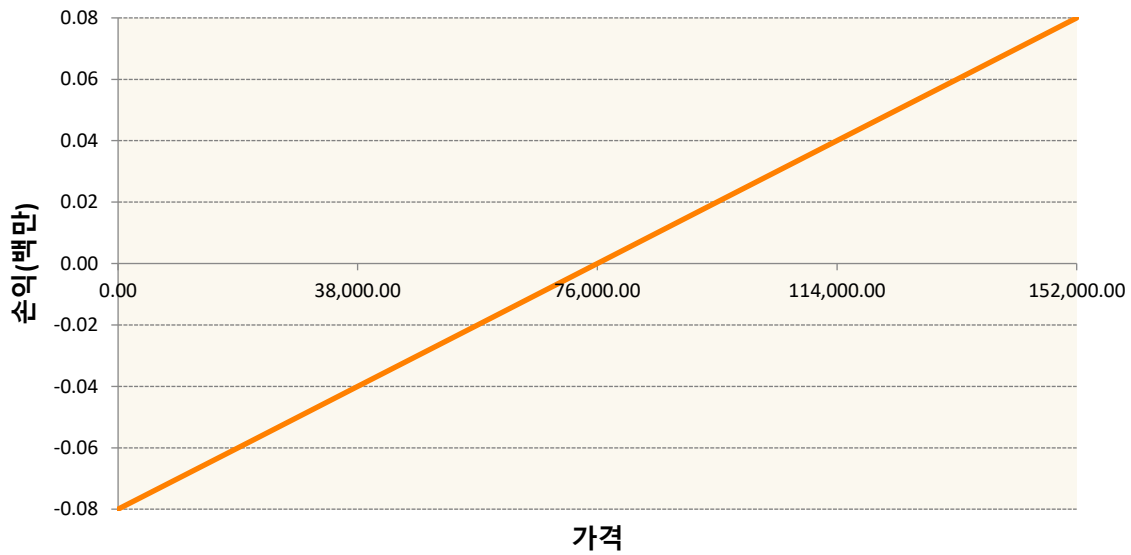
2. 만기시점의 손익구조



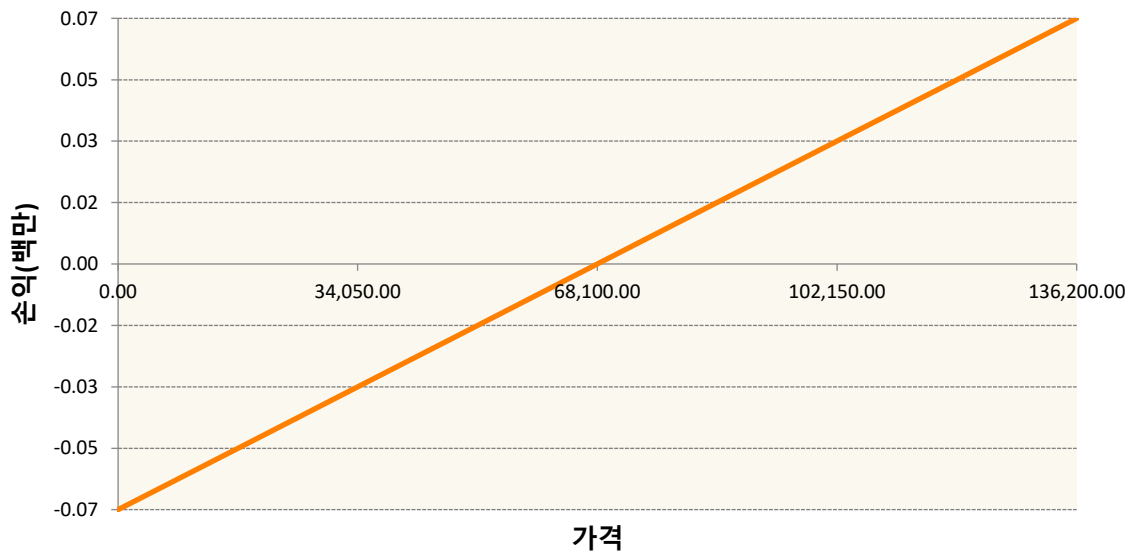
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



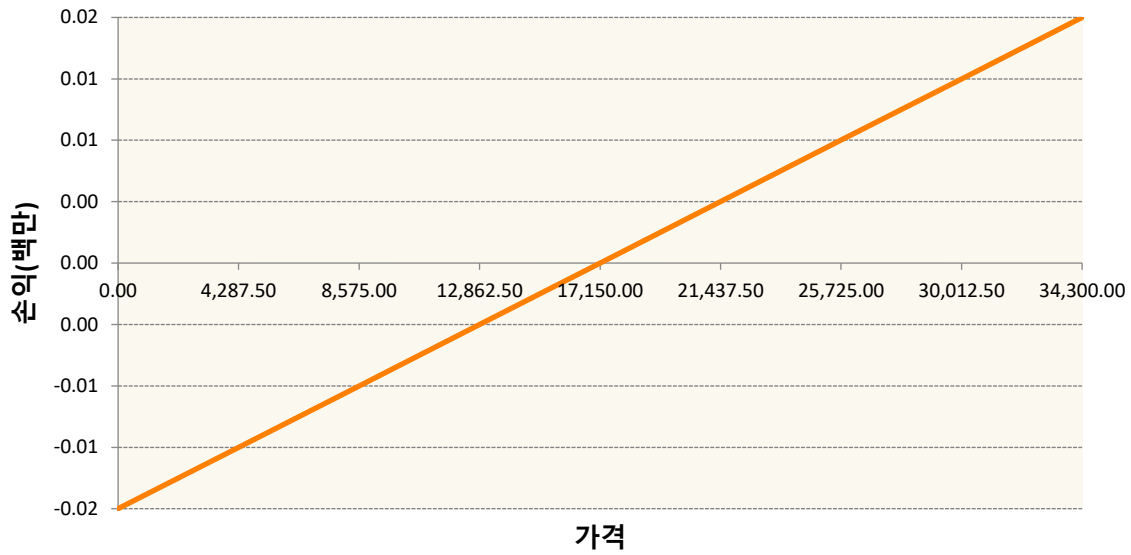
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



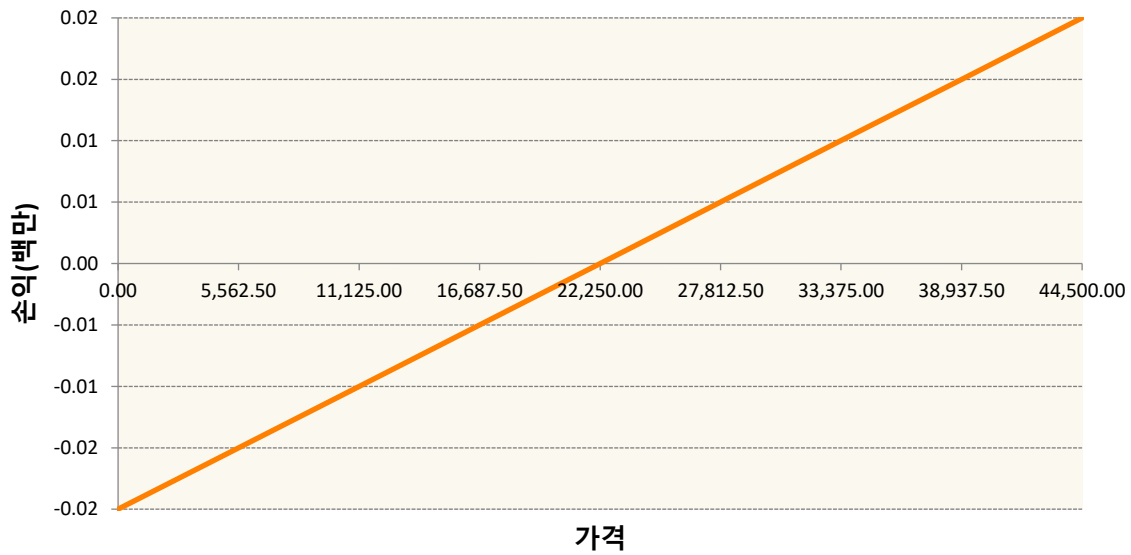
KR41BBVC0009-2024-12 롯데케미칼개별선물



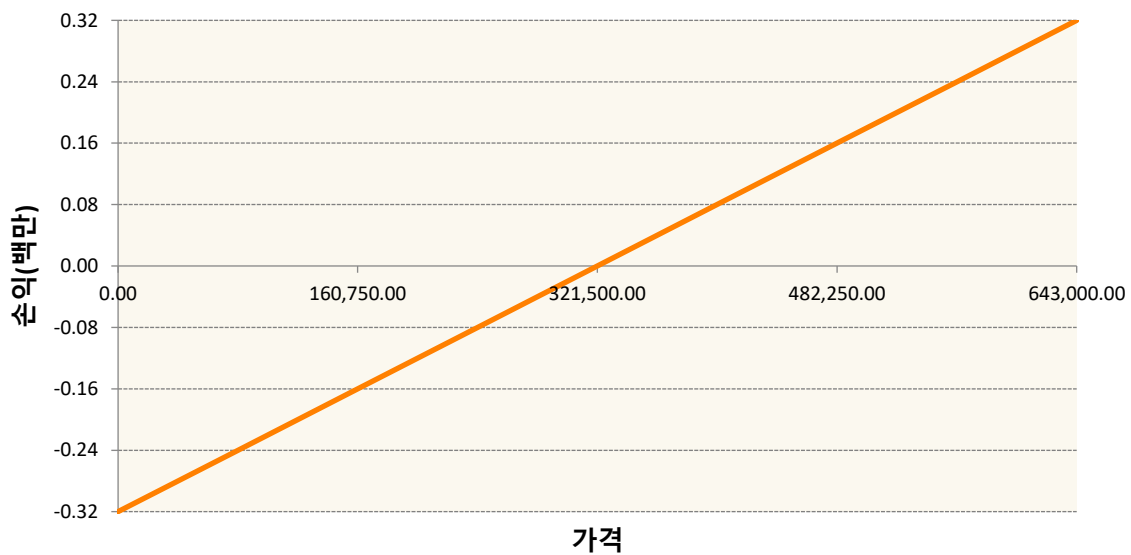
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



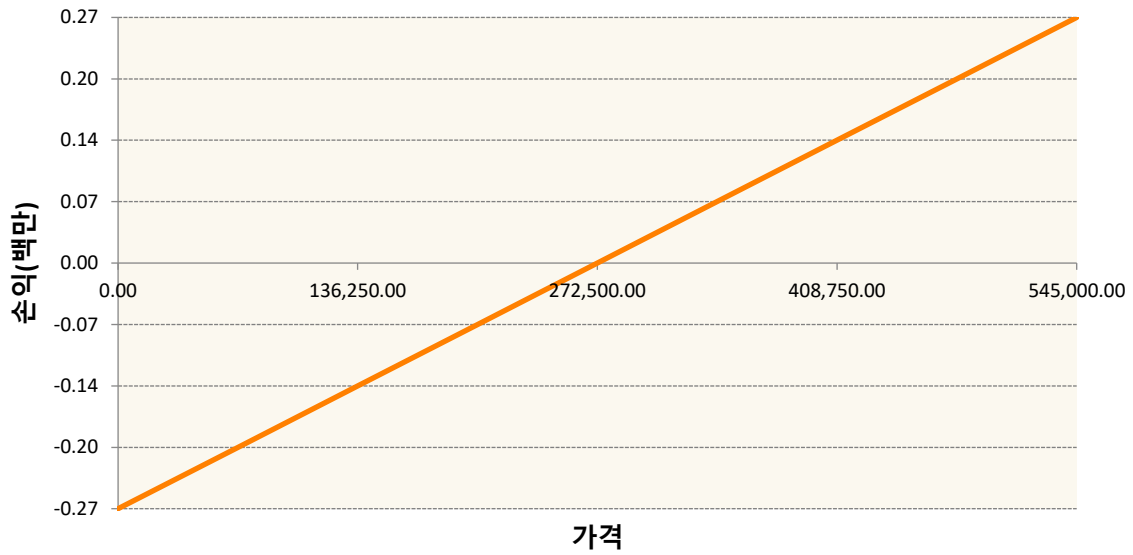
KR41CNVC0004-2024-12 포스코 ICT개별선물



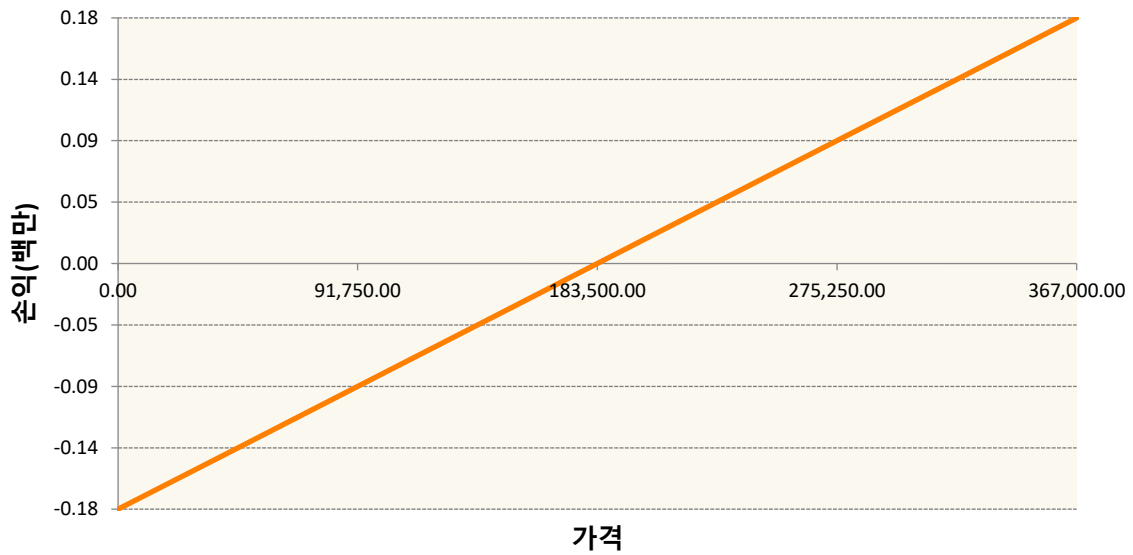
KR41CRVC0000-2024-12 LG생활건강개별선물



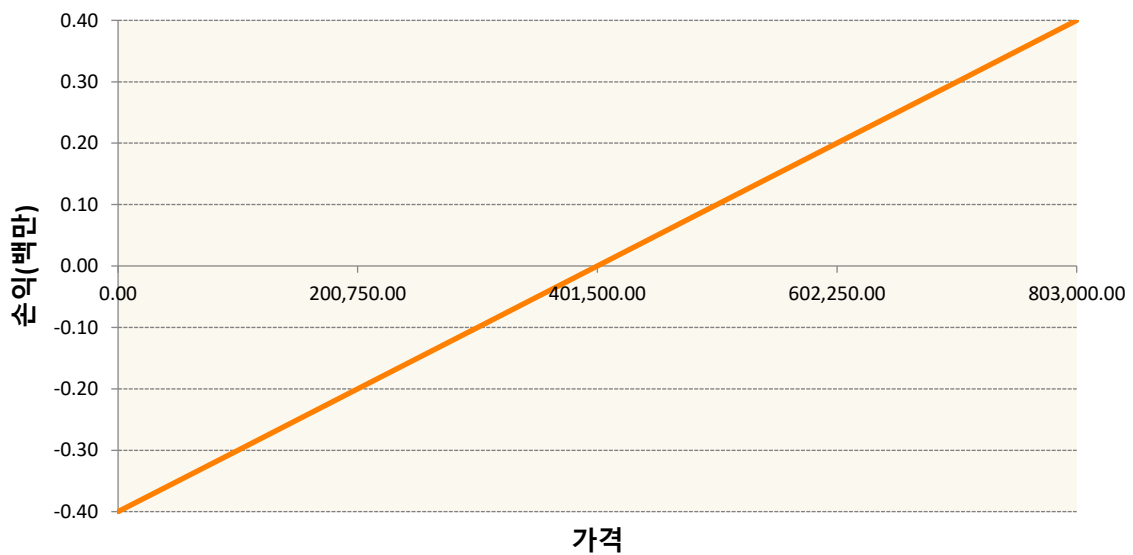
KR41D1VC0006-2024-12 CJ제일제당개별선물



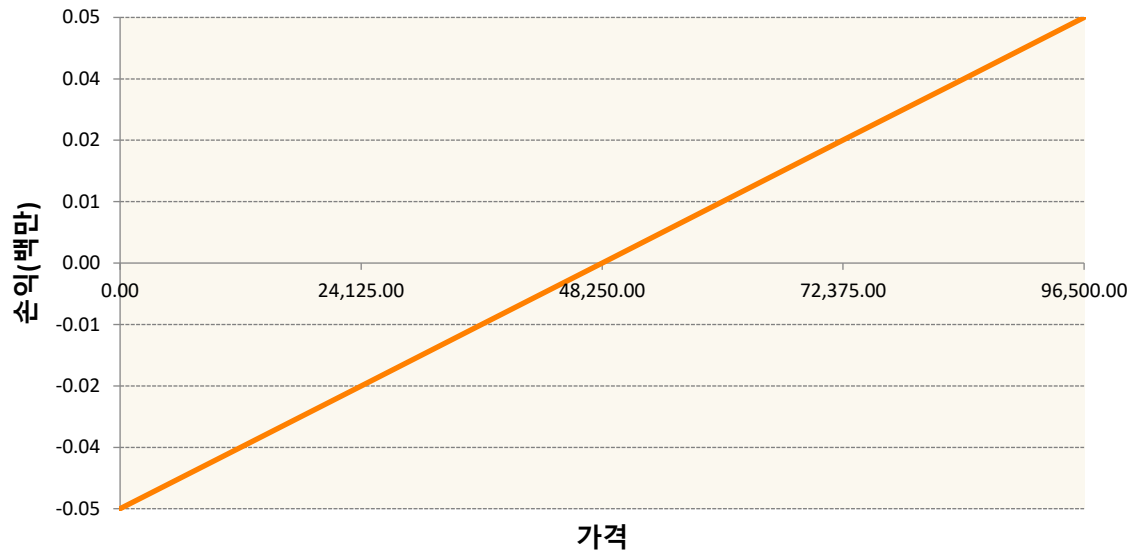
KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



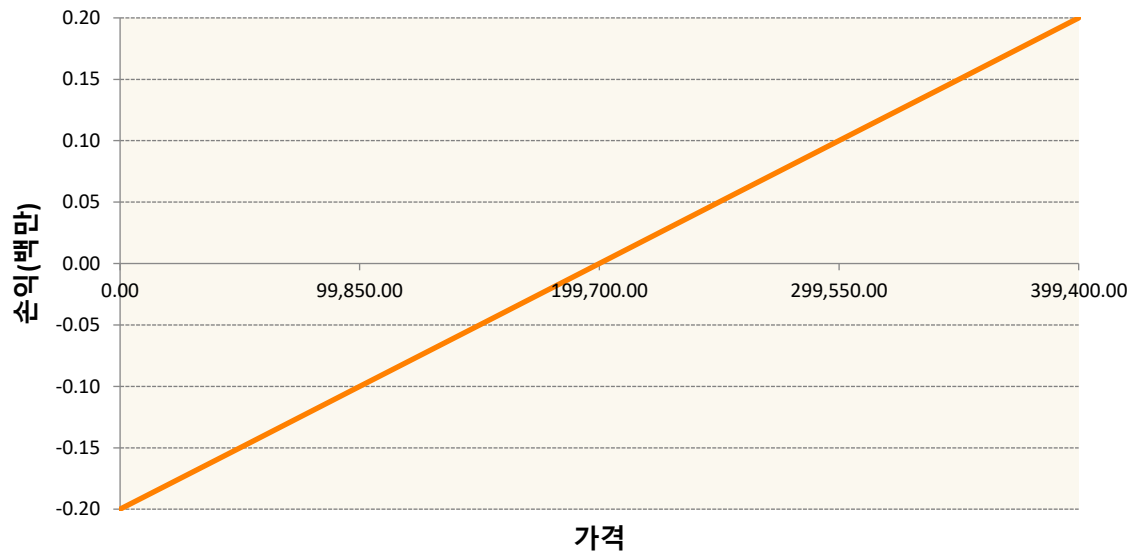
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



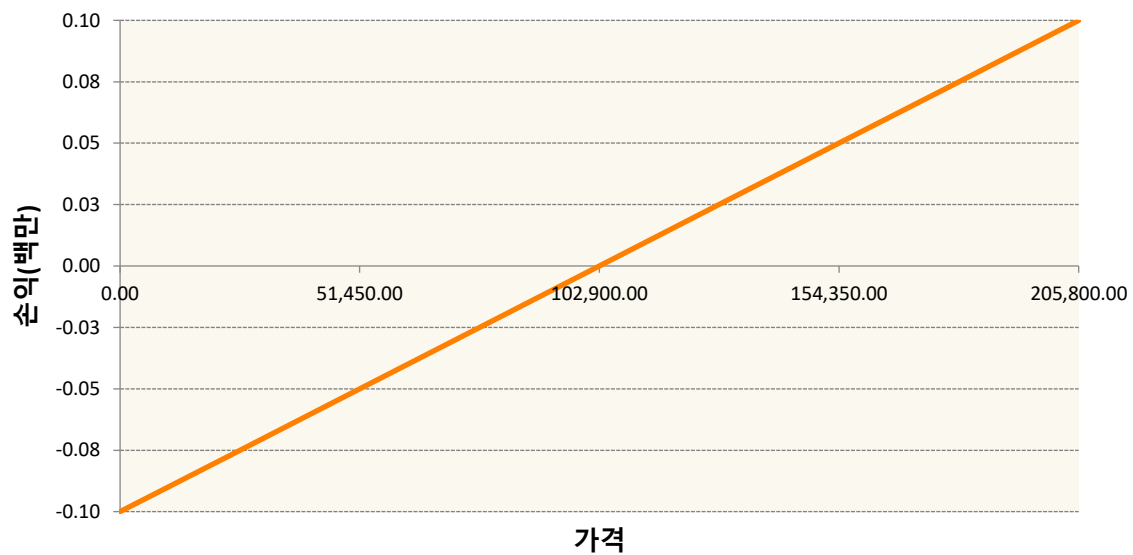
KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCVC0004-2024-12 하이브개별선물



KR41FMVC0002-2024-12 엘앤에프개별선물



(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
KR410GVC0006			2024-12 롯데관광개발개별선물				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
KR410JVC0003			2024-12 명신산업개발선물				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
KR410ZVC0003			2024-12 한미반도체개별선물				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%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-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%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4
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
-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

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

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)

212

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

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	296
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

492

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

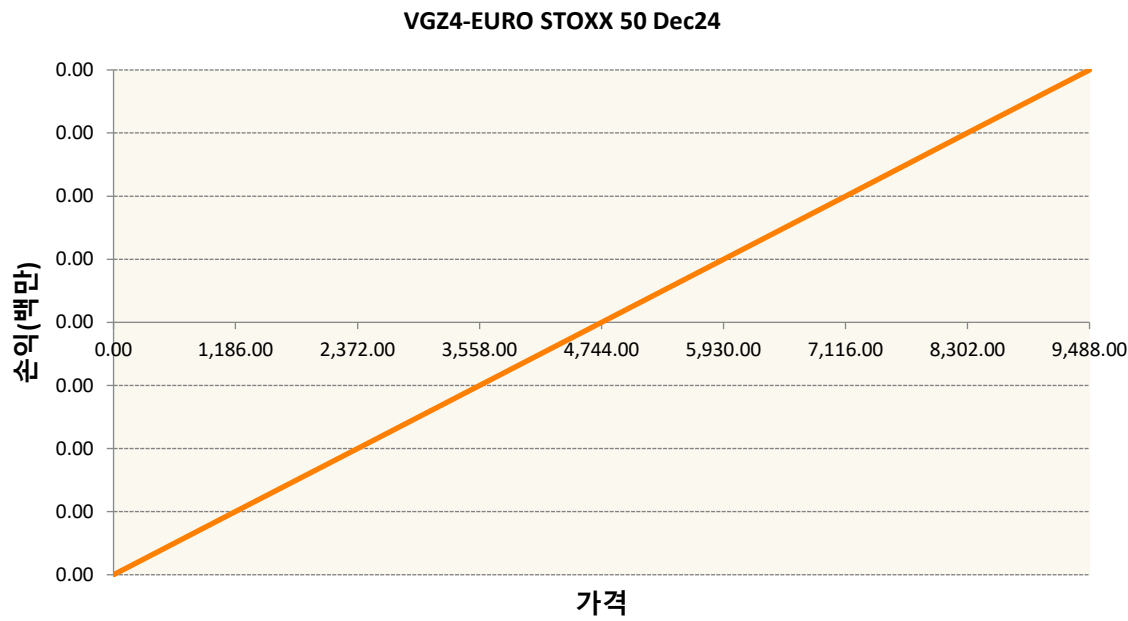
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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	2024-11-29
기준일	2024-11-28

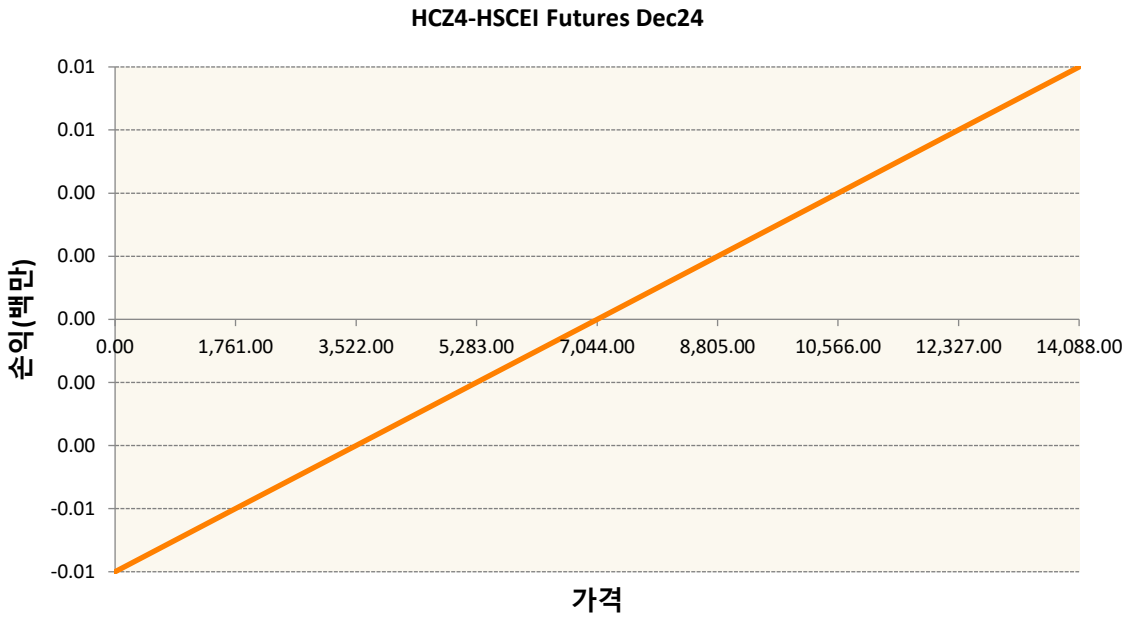
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,391	0	1,391	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ4	HSCEI Futures Dec24	111
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

153

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

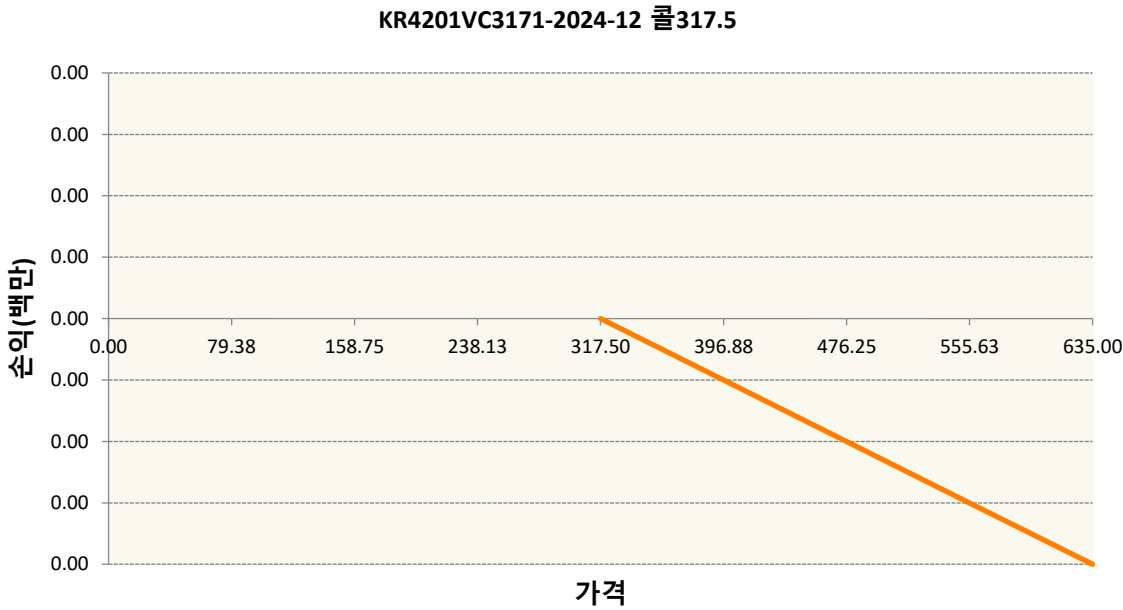
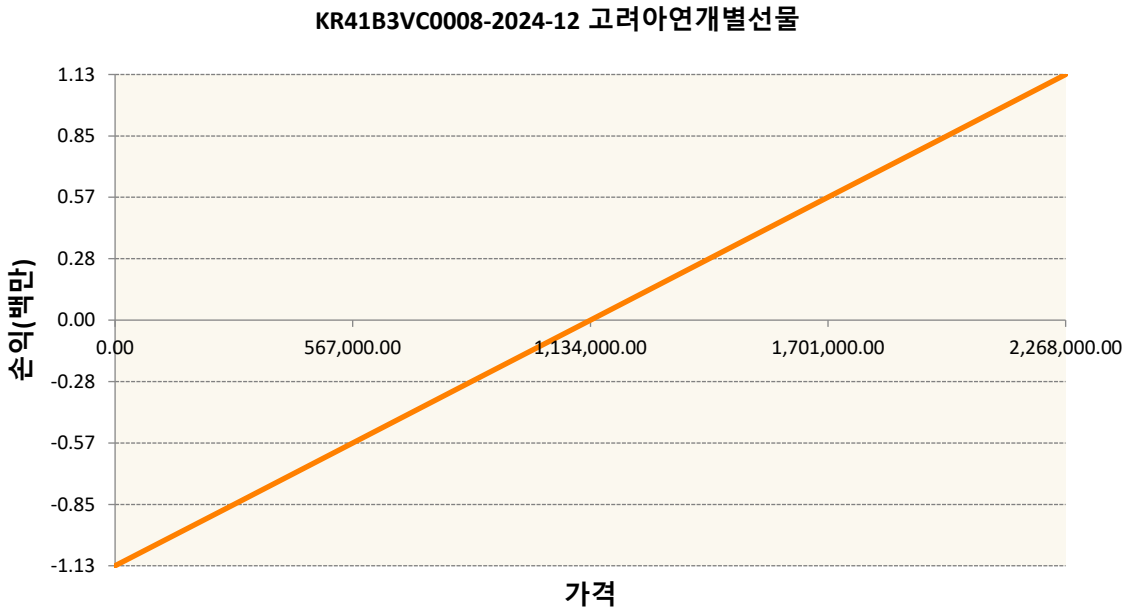
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	295	0	295	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,269	-36,269	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 640.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -100.00 to 100.00. A single orange line represents the data, starting at a price of 320.00 with zero profit/loss, and decreasing linearly to a price of 640.00 with a profit/loss of -100.00.

가격	손익(백만)
320.00	0.00
640.00	-100.00

The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 635.00. The y-axis, labeled '순이익 (백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the data, starting at the origin (0, 0) and ending at (317.50, 0.00). This indicates that net income is zero at a price of 317.50.

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
317.50	0.00

(단위:백만원)

KR41B3VC0008		2024-12 고려아연개별선물					24
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	24	24	24	24	24	24	24
KR4201VC3171		2024-12 콜317.5					799
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	469	461	451	441	430	418	406
-5.33%	401	386	371	356	341	326	310
-2.67%	252	237	223	208	193	178	162
0%	28	19	10	0	-11	-22	-34
2.67%	-237	-240	-244	-249	-254	-261	-269
5.33%	-514	-515	-516	-518	-520	-524	-528
8.00%	-794	-794	-795	-795	-796	-797	-799
KR4201VC3205 2024-12 콜320							1,519

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	803	790	775	758	739	719	699
-5.33%	705	678	651	624	595	567	538
-2.67%	463	433	402	372	342	311	281
0%	64	45	23	0	-24	-49	-75
2.67%	-432	-440	-450	-462	-477	-493	-510
5.33%	-965	-967	-970	-975	-982	-990	-1,000
8.00%	-1,506	-1,507	-1,508	-1,509	-1,511	-1,515	-1,519

KR4301VC3170 2024-12 풋317.5							281
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-240	-246	-252	-259	-266	-273	-281
-5.33%	-103	-113	-122	-132	-142	-152	-162
-2.67%	-18	-28	-37	-47	-57	-66	-76
0%	18	13	7	0	-7	-14	-22
2.67%	28	26	24	21	17	12	7
5.33%	30	30	29	28	26	24	21
8.00%	30	30	30	30	29	28	27

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

(단위:백만원)

2,748

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

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	673	0	673	

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	2024-11-29
기준일	2024-11-28

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	4,378	0	4,378	

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	2024-11-29
기준일	2024-11-28

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	13,947	0	13,947	
누계	통화	선도	209	21,074	-20,864	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213E8V(KRW/USD 29-11-24E		586
FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E		352
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E		207
FXW213EBFC USD/KRW 29-11-24E		17
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E		541
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

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

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

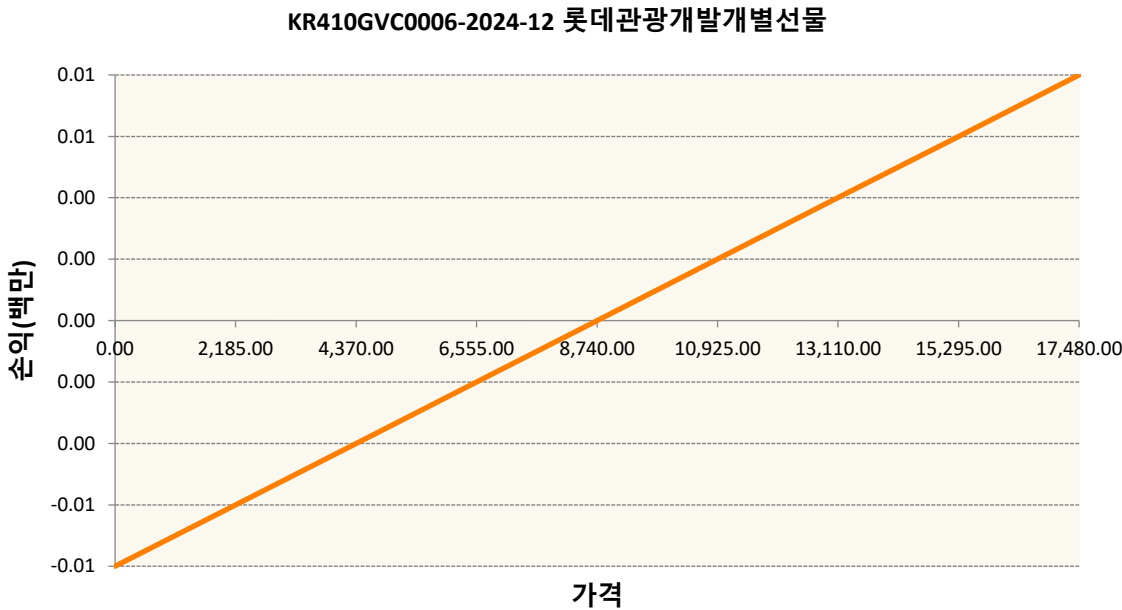
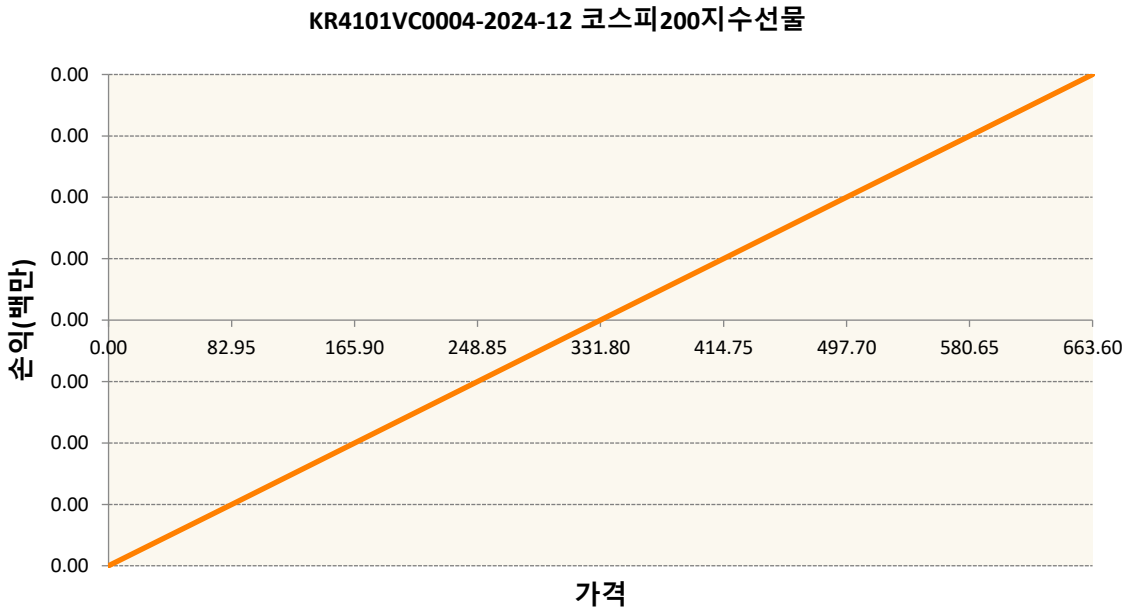
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

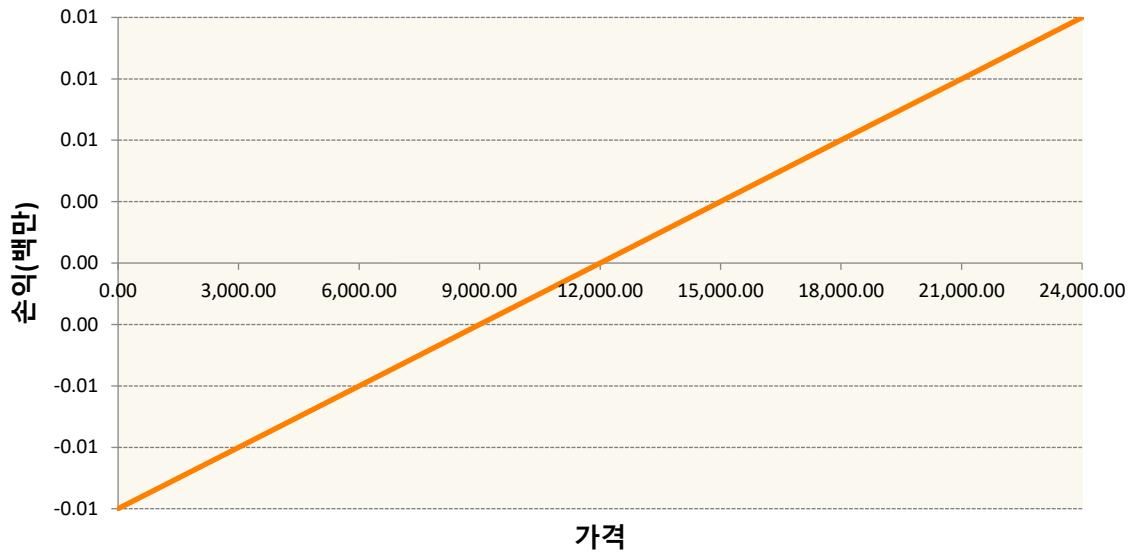
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	68	0	68	장내
누계	유가증권	선물	1,299	0	1,299	장내

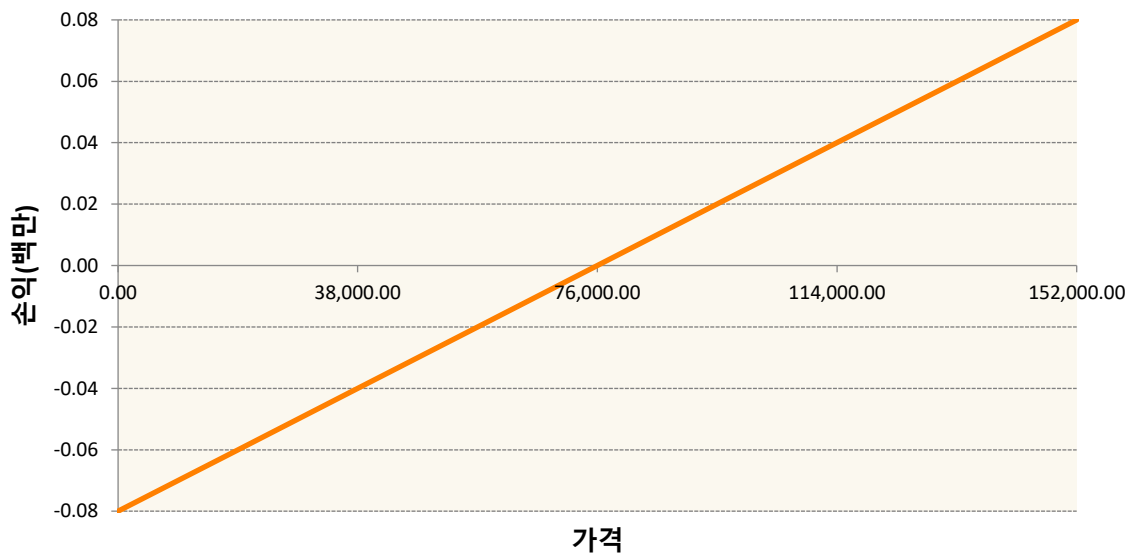
2. 만기시점의 손익구조



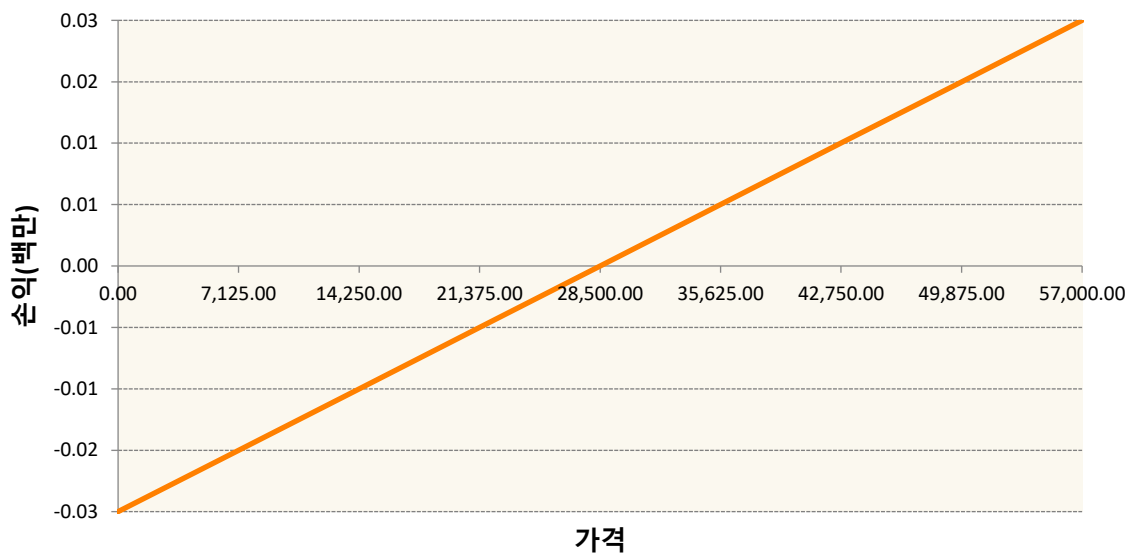
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



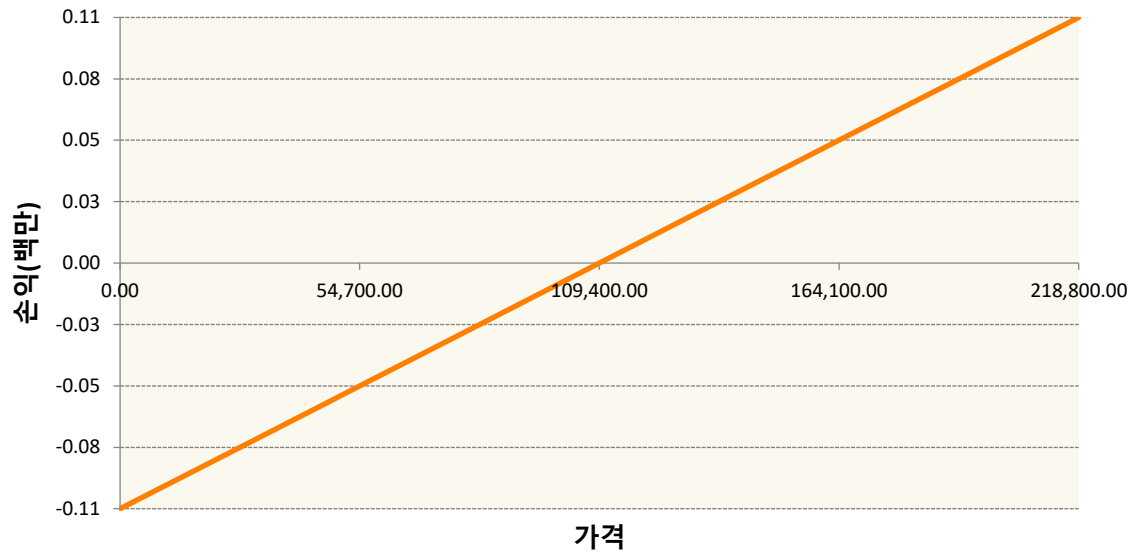
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



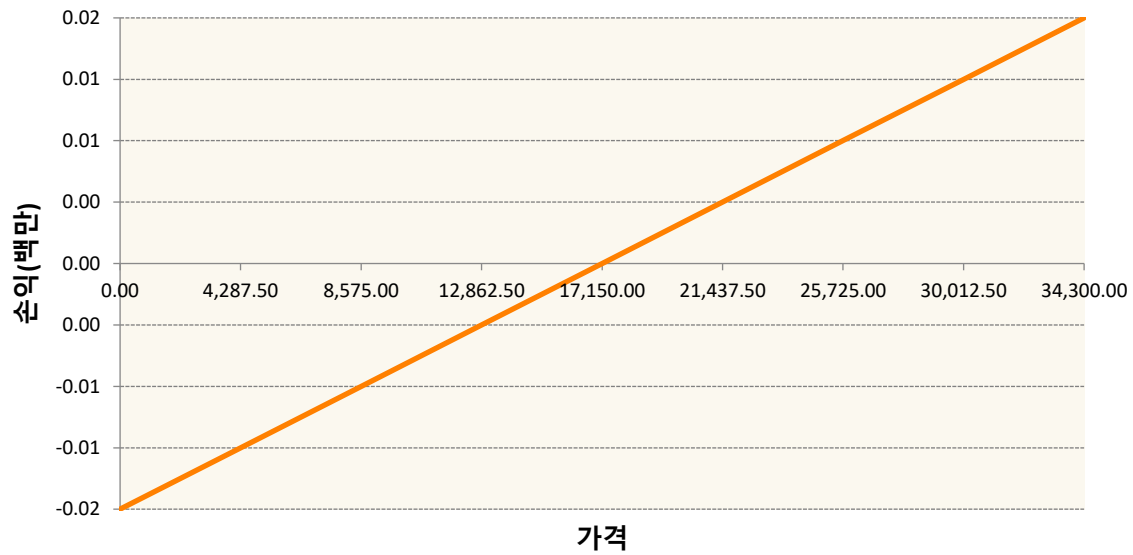
KR41BNVC0005-2024-12 현대건설개별선물



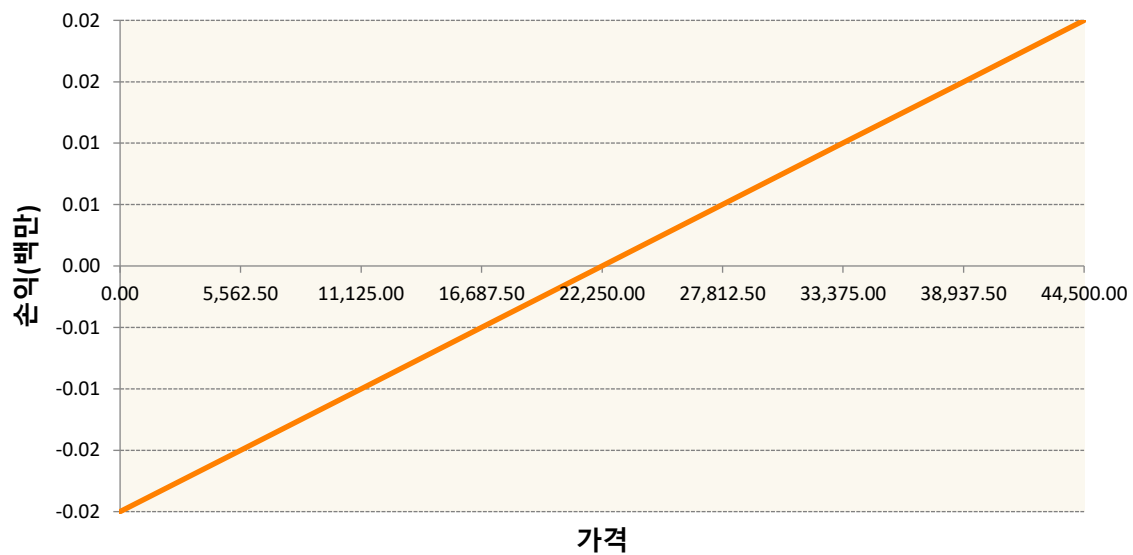
KR41C6VC0003-2024-12 아모레퍼시픽개별선물



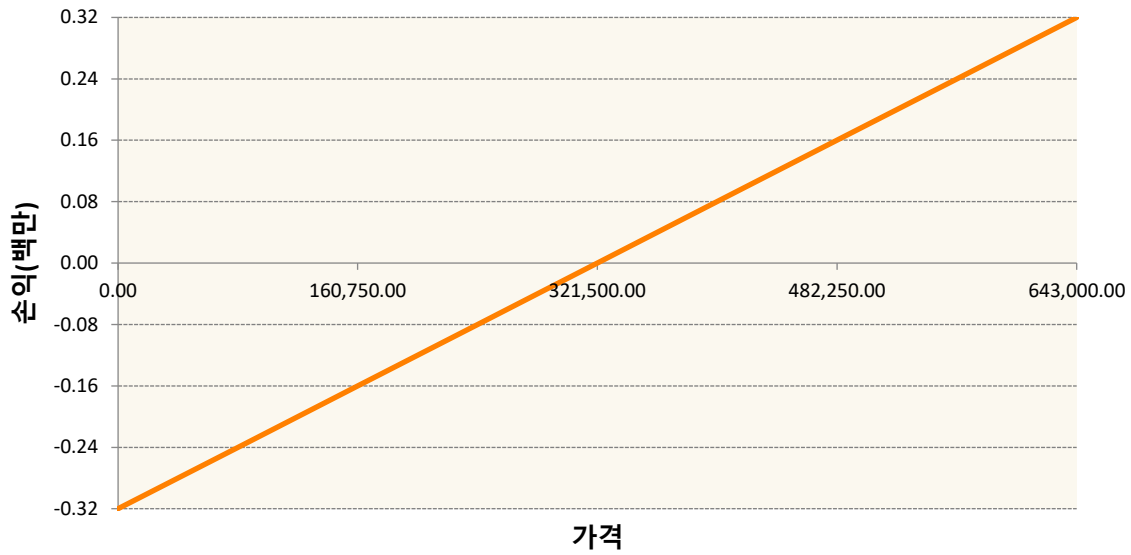
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



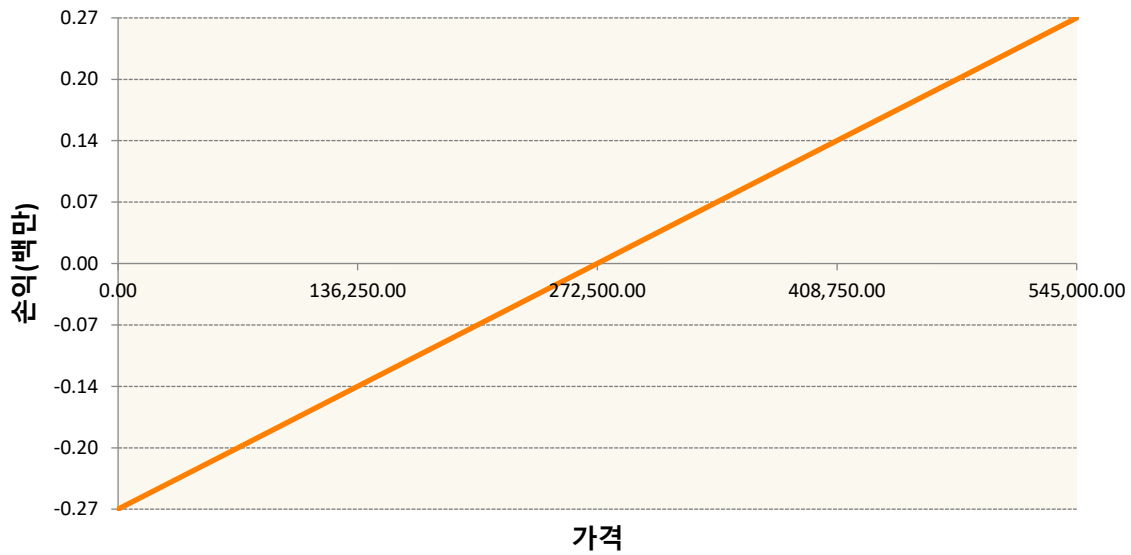
KR41CNVC0004-2024-12 포스코 ICT개별선물



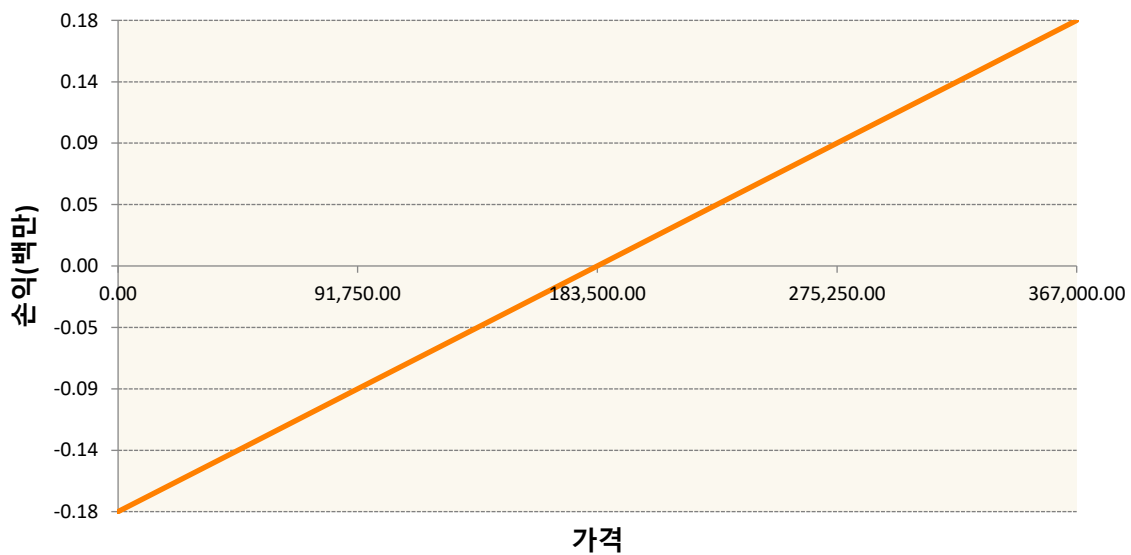
KR41CRVC0000-2024-12 LG생활건강개별선물



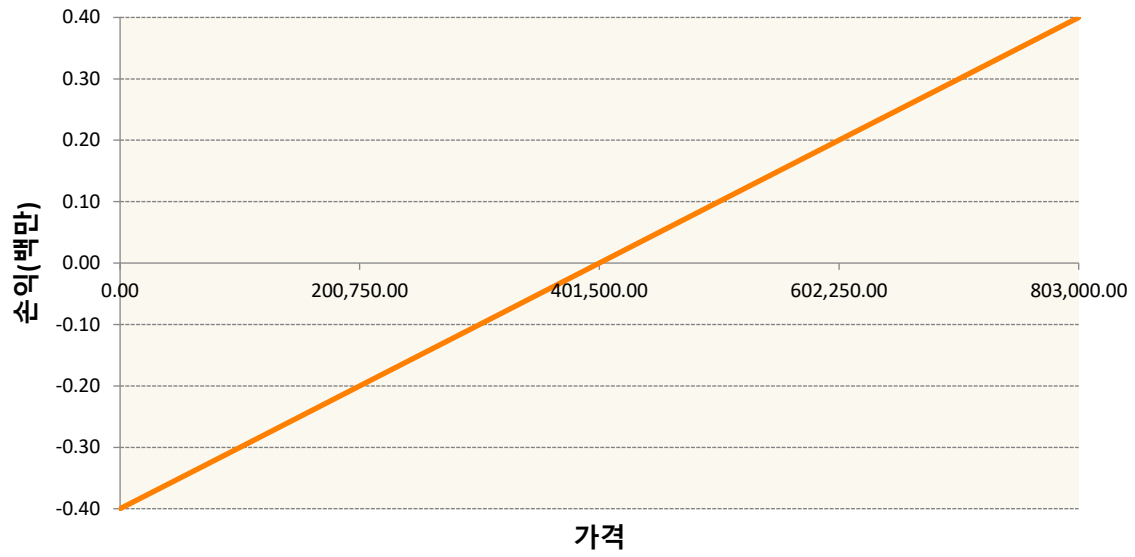
KR41D1VC0006-2024-12 CJ제일제당개별선물



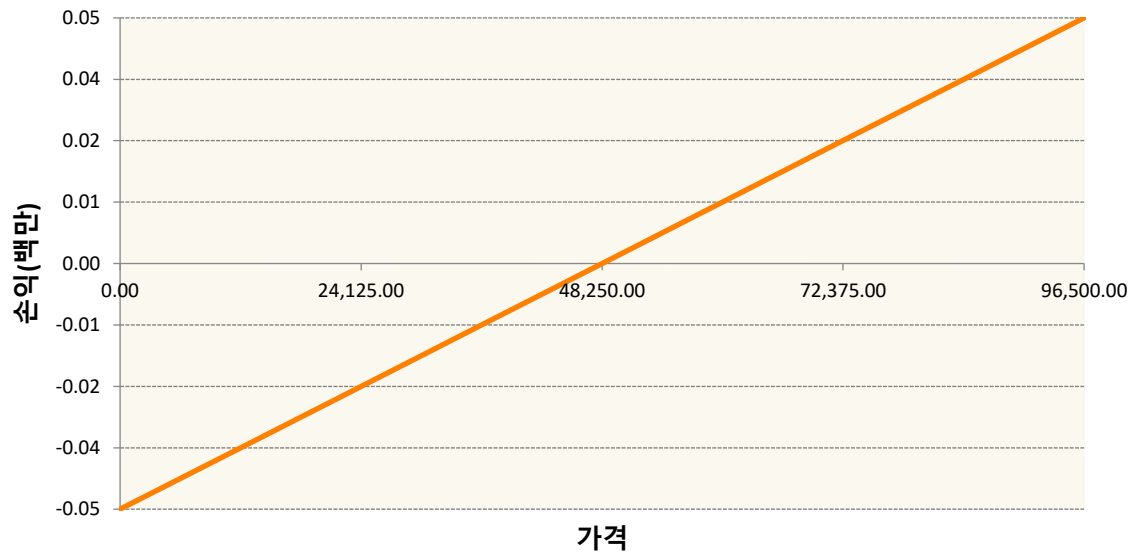
KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



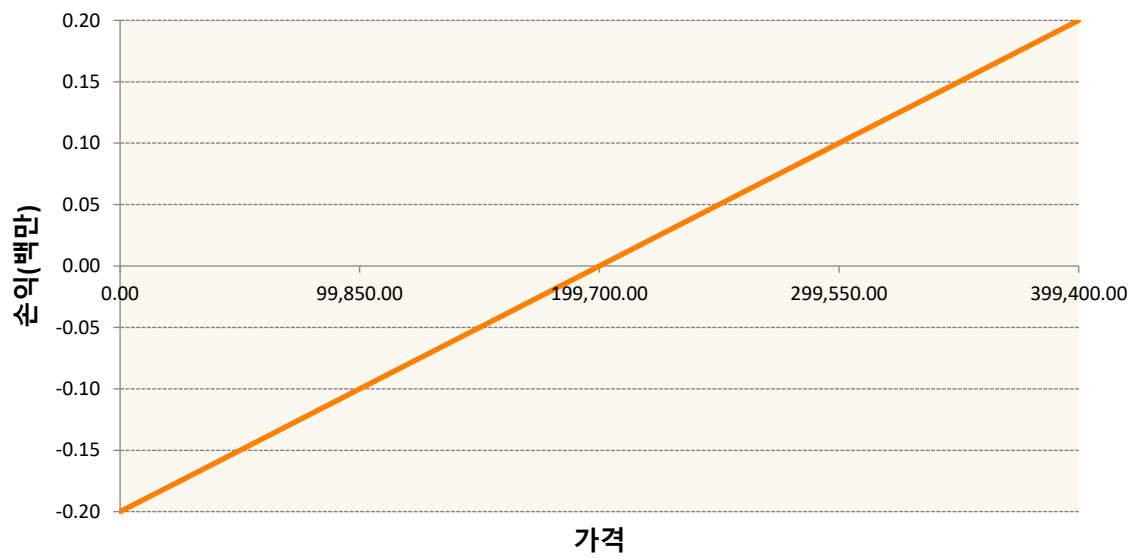
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



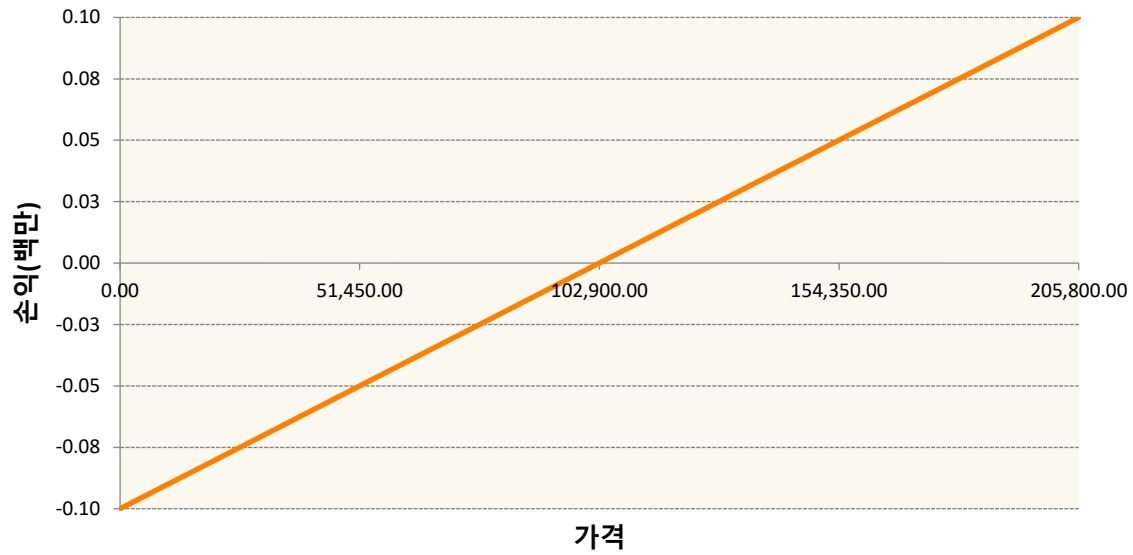
KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



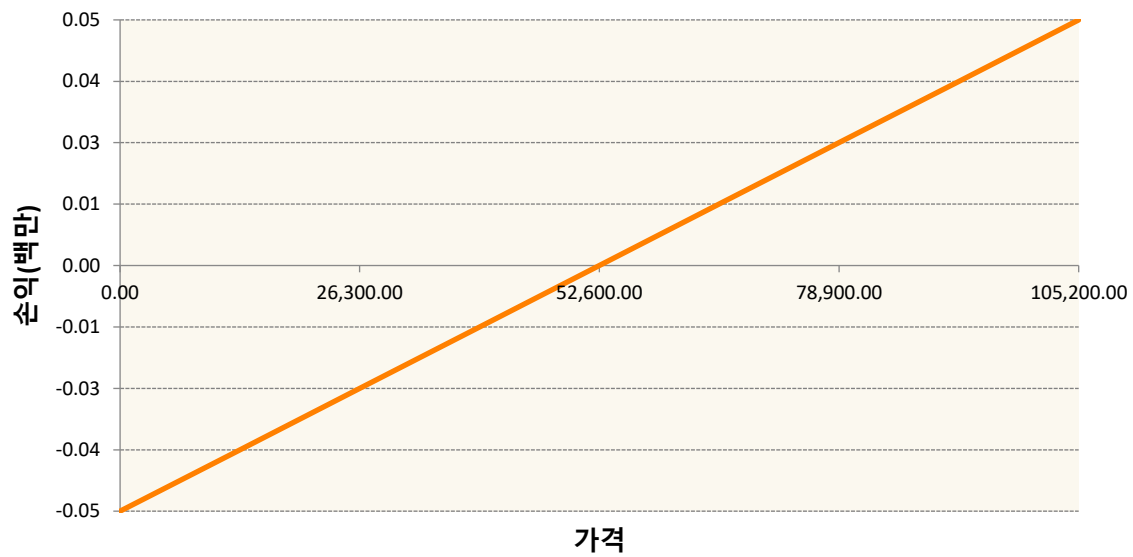
KR41FCVC0004-2024-12 하이브개별선물



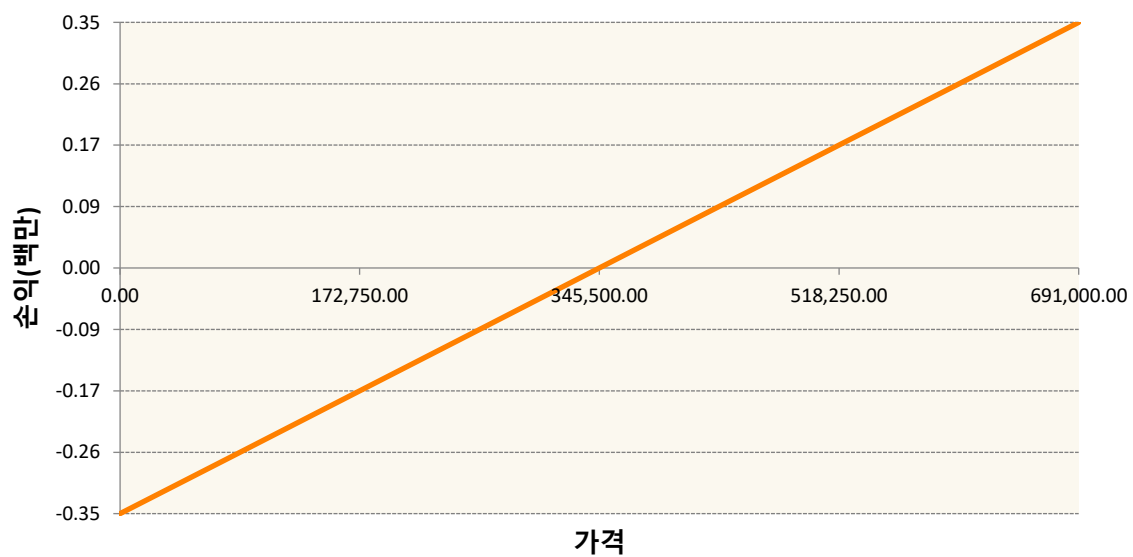
KR41FMVC0002-2024-12 엘앤에프개별선물



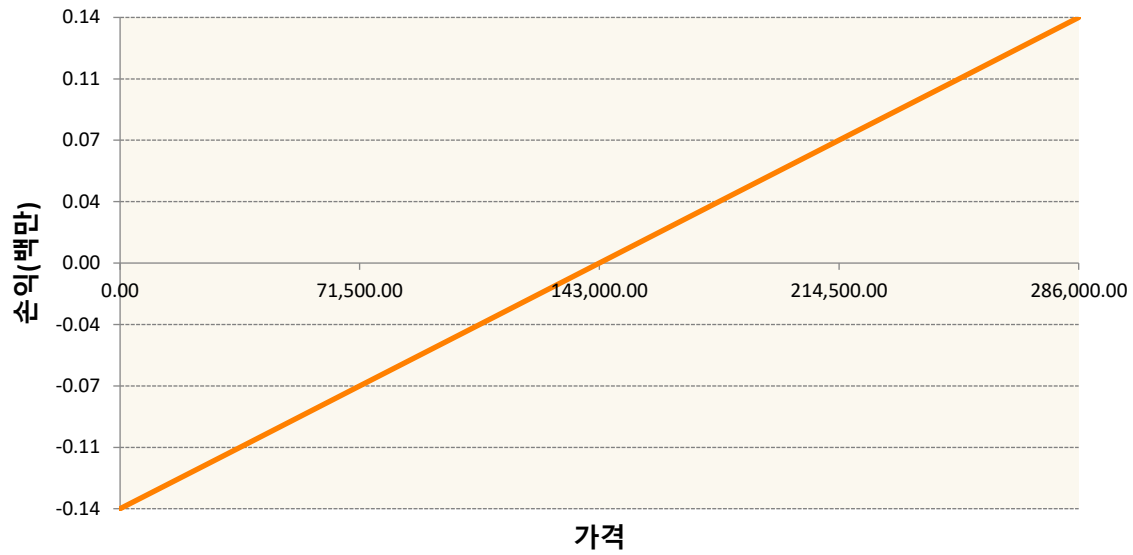
KR41G6VC0004-2024-12 현대로템개별선물



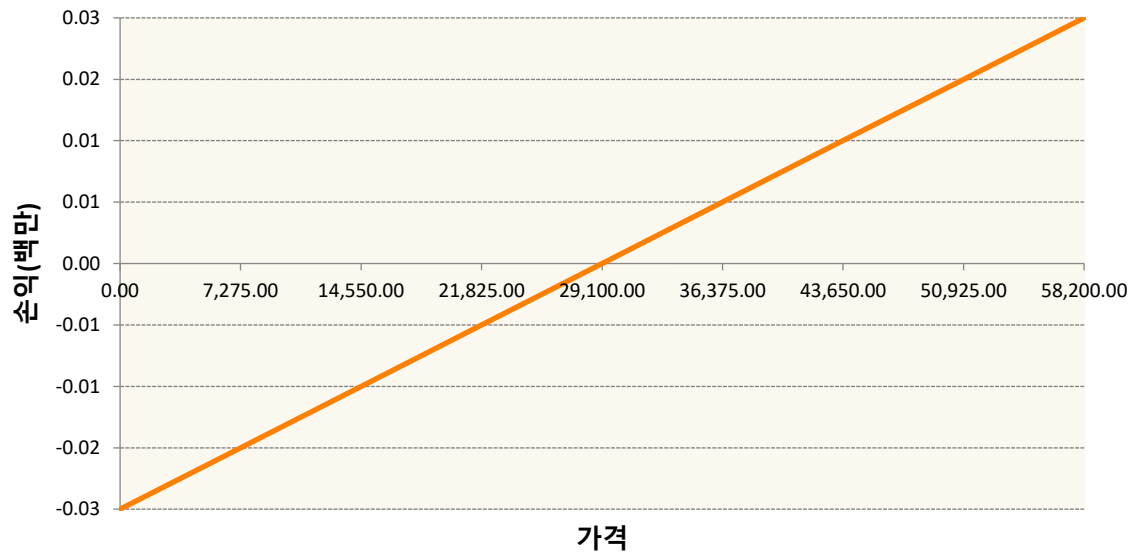
KR41GHVC0008-2024-12 HD현대일렉트릭개별선물



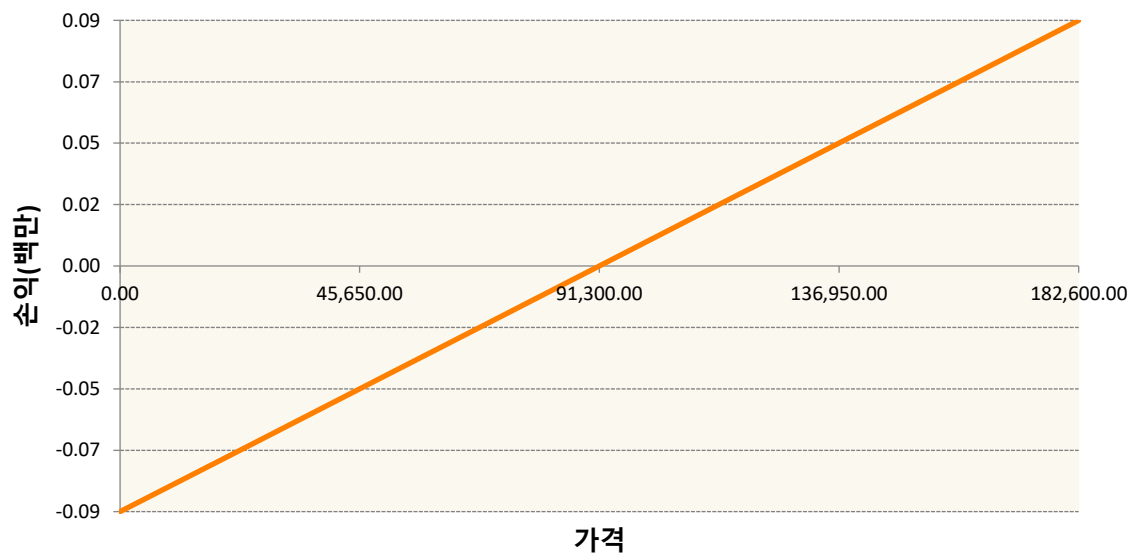
KR41GLVC0002-2024-12 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNVC0000-2024-12 금양개별선물



KR41GZVC0006-2024-12 에코프로머티개별선물



(단위:백만원)

KR4101VC0004							2024-12 코스피200지수선물		73	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73			
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49			
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	24	24	24	24	24	24	24			
5.33%	49	49	49	49	49	49	49			
8.00%	73	73	73	73	73	73	73			
KR410GVC0006							2024-12 롯데관광개발개별선물		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			
KR410JVC0003							2024-12 명신산업개발선물		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			
KR410ZVC0003							2024-12 한미반도체개별선물		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			
KR41BNVC0005							2024-12 현대건설개별선물		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

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

KR41CBVC0008 2024-12 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

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

KR41CRVC0000 2024-12 LG생활건강개별선물 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

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

KR41FMVC0002 2024-12 엘앤에프개별선물 1

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR41G6VC0004 2024-12 현대로템개별선물 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

KR41GHVC0008 2024-12 HD현대일렉트릭개별선물 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

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
KR41GNVC0000 2024-12 금양개별선물							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
KR41GZVC0006 2024-12 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)

107

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

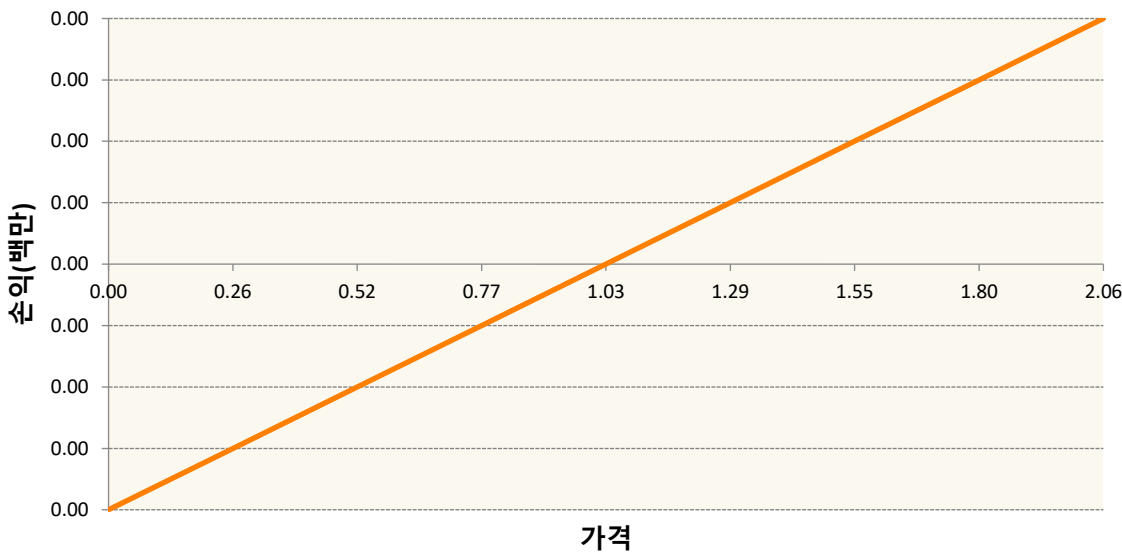
1. 계약금액

(단위:백만원)

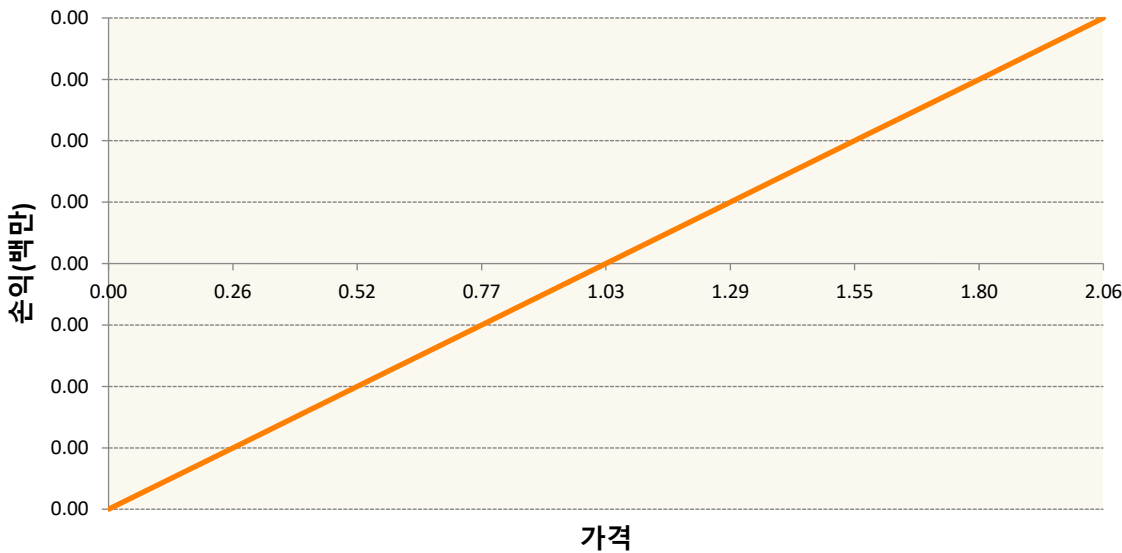
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,641	0	11,641	

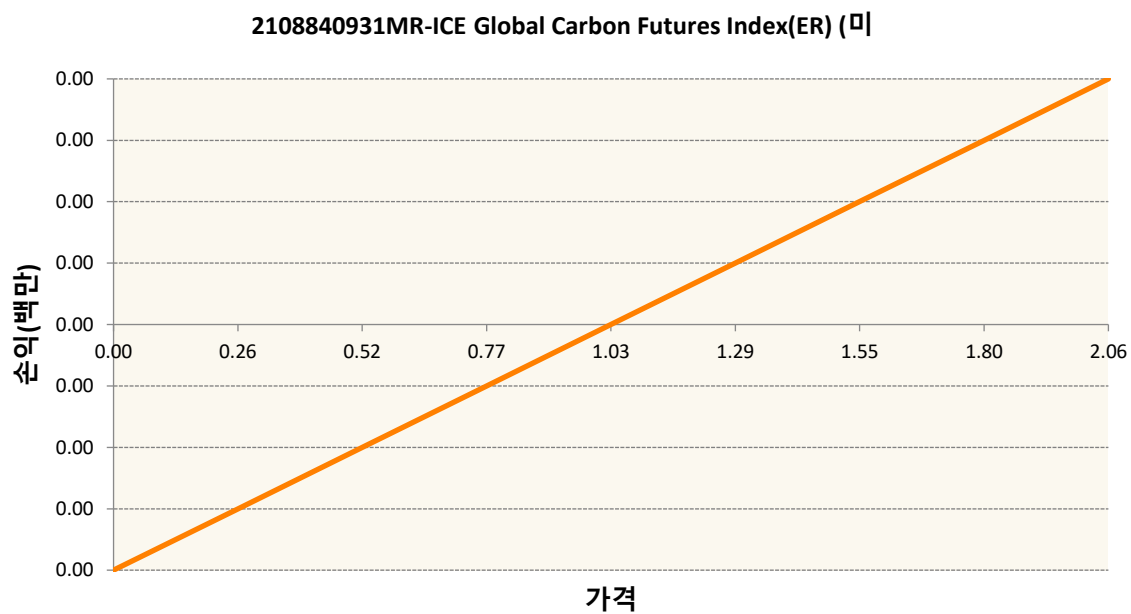
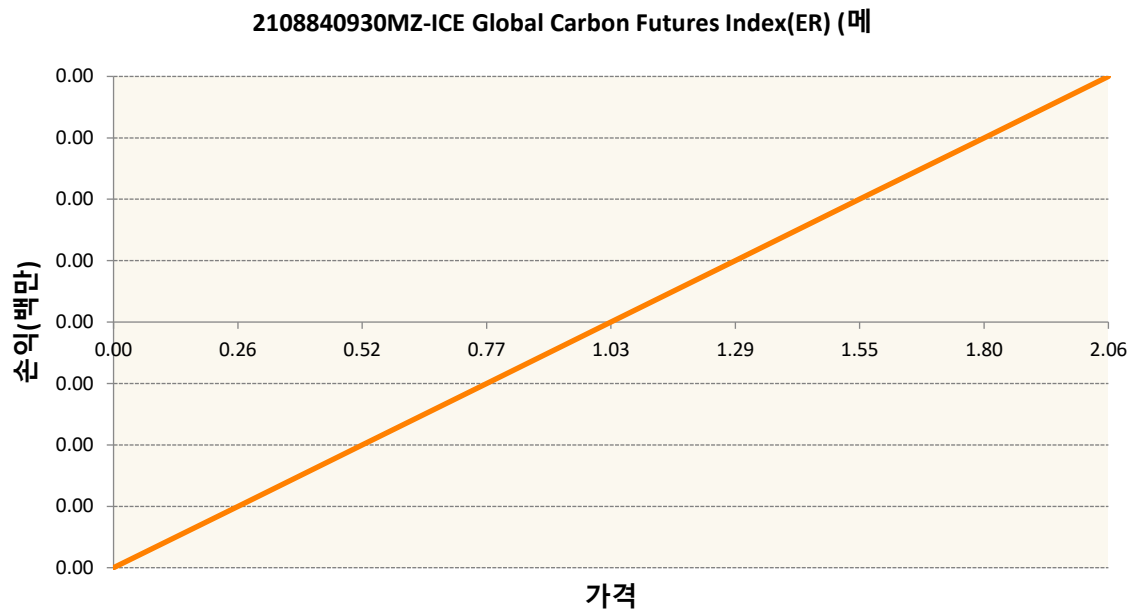
2. 만기시점의 손익구조

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		92
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		464
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)
	985

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

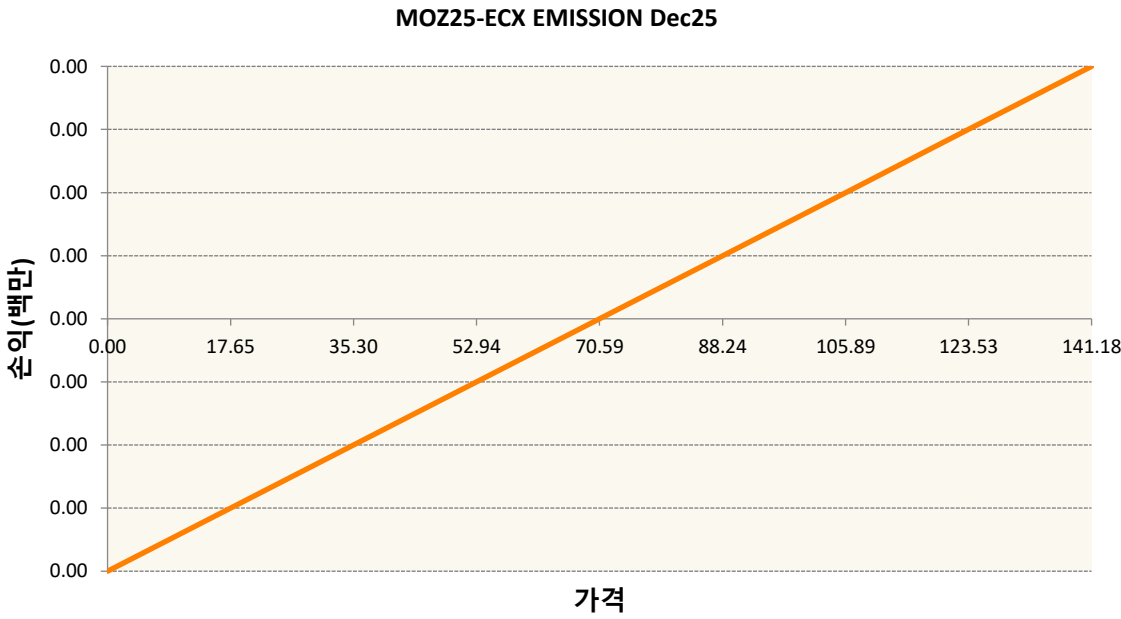
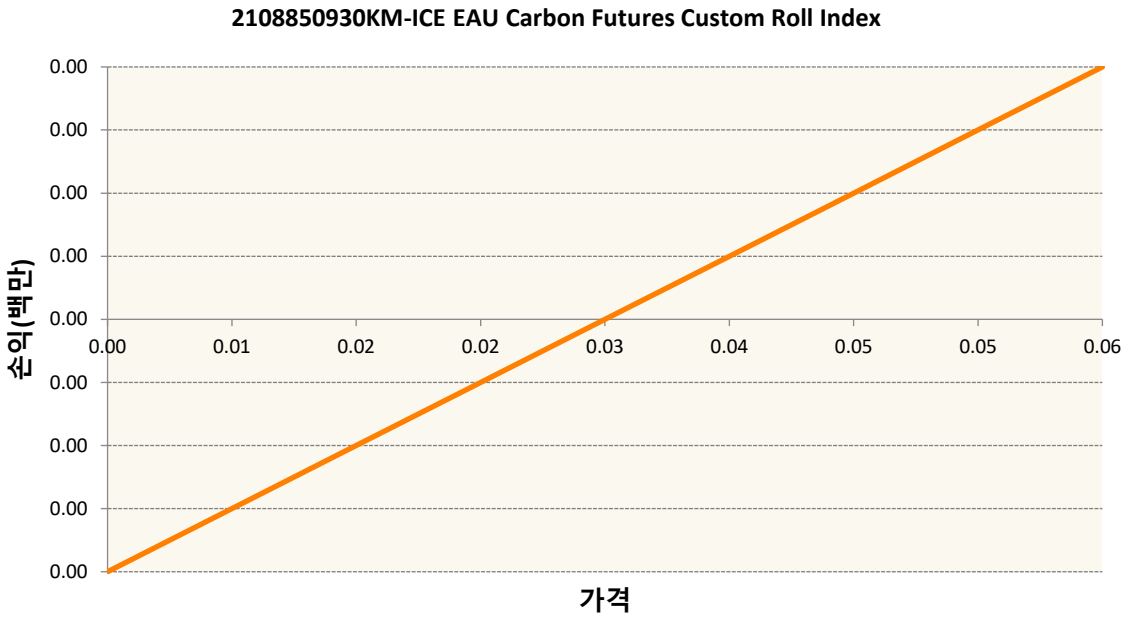
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,849	0	8,849	
누계	통화	선도	0	4,087	-4,087	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
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E	25
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E	151
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	707

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

1,345

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

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)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	26
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	26

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

(단위:백만원)

151

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

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)	69
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	14

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

(단위:백만원)

318

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

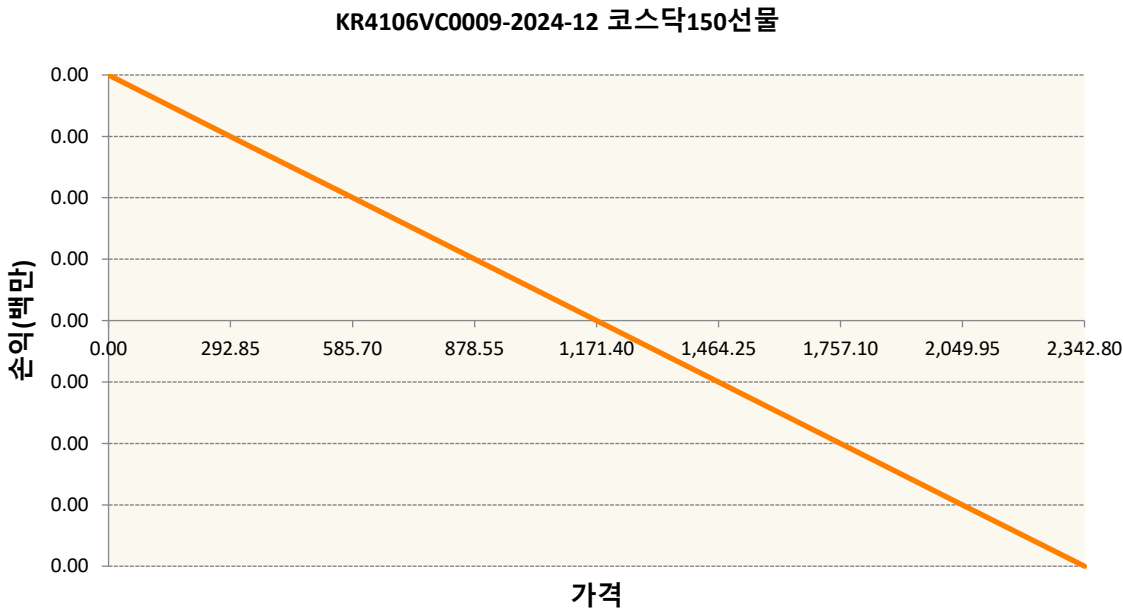
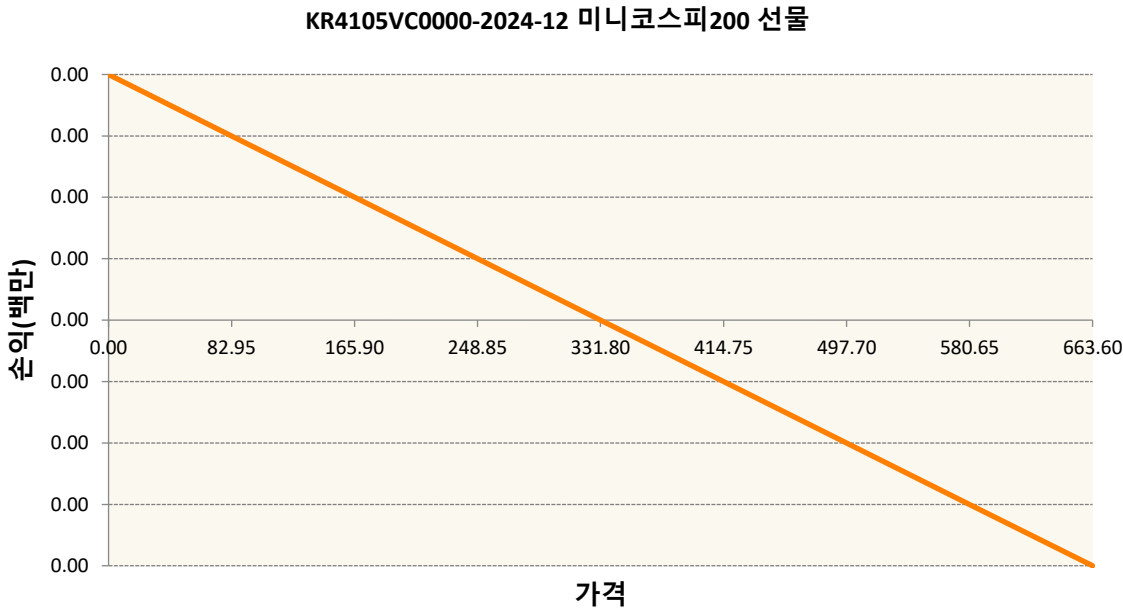
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

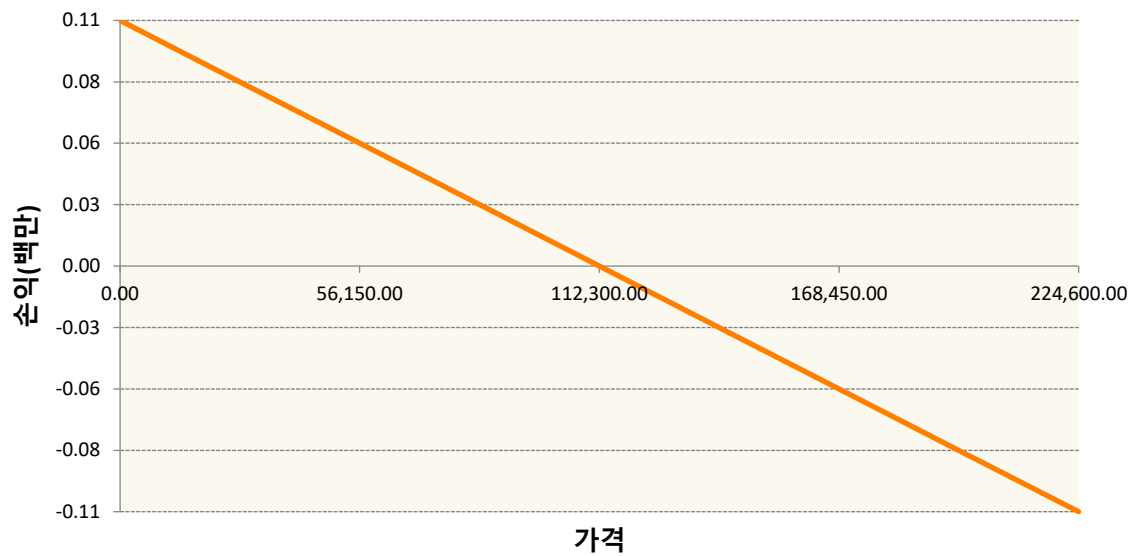
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	4	-4	장내
누계	유가증권	선물	8	256	-248	장내

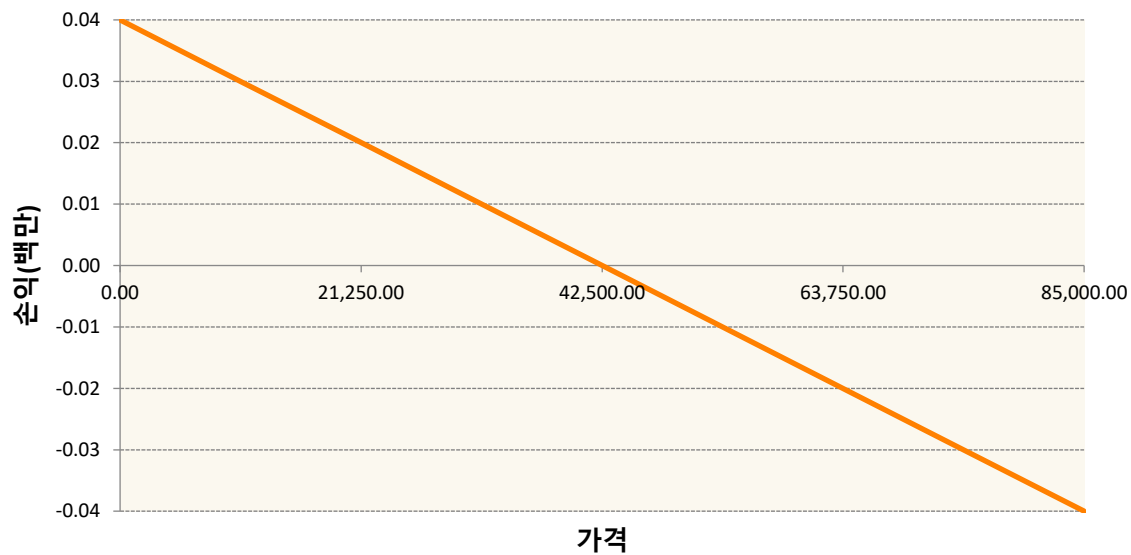
2. 만기시점의 손익구조



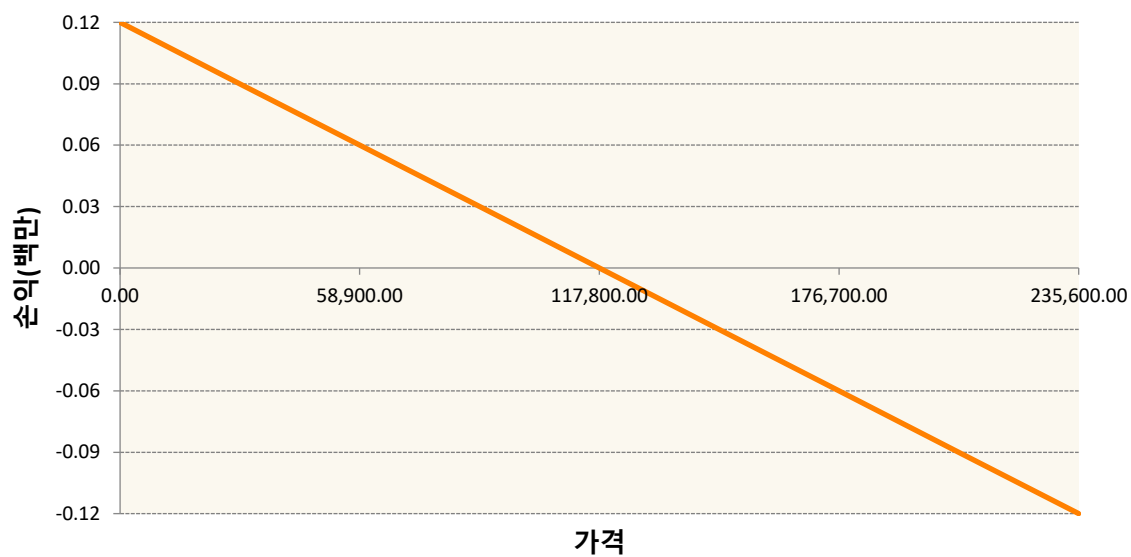
KR4123VC0008-2024-12 삼성전기개별선물



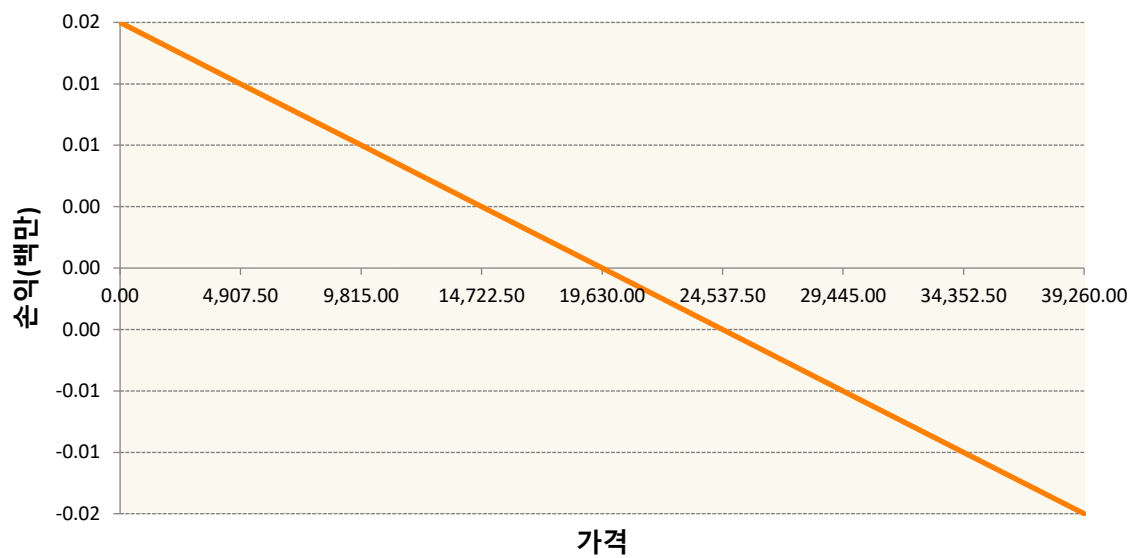
KR4135VC0004-2024-12 GS개별선물



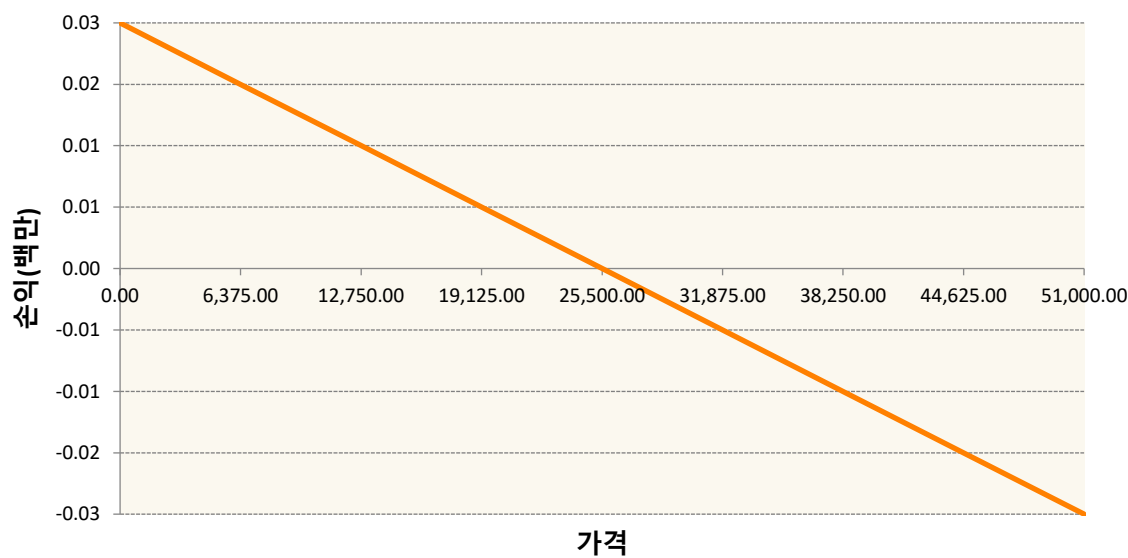
KR4141VC0006-2024-12 SK이노베이션개별선물



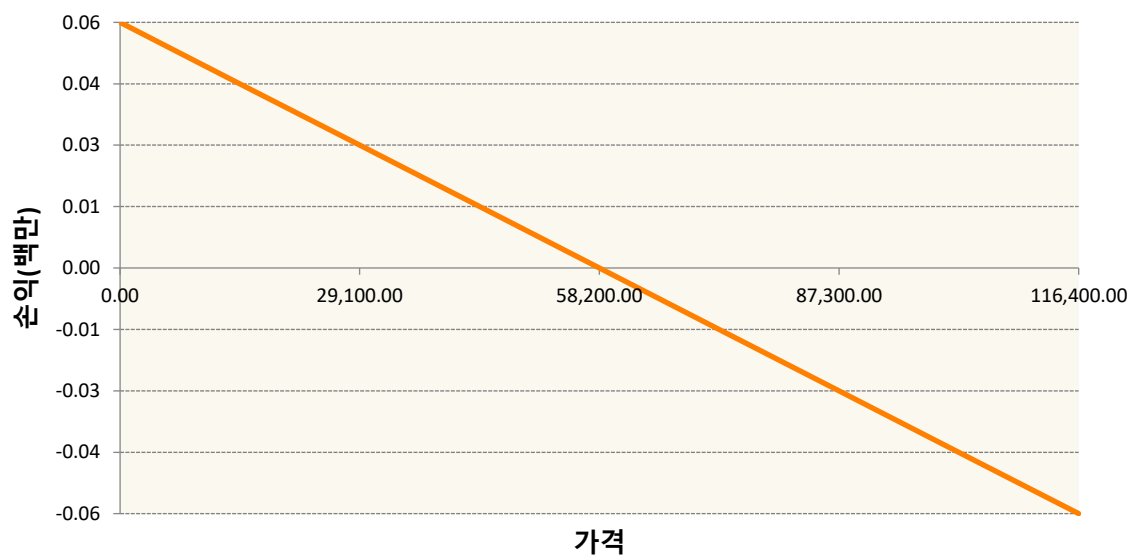
KR4151VC0003-2024-12 GS건설개별선물



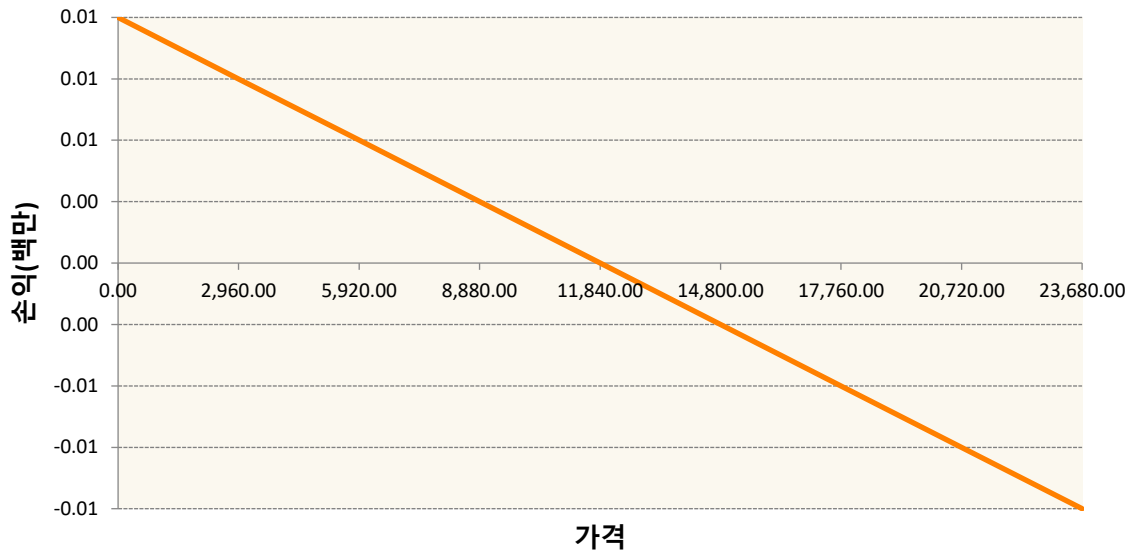
KR4157VC0007-2024-12 대한항공개별선물



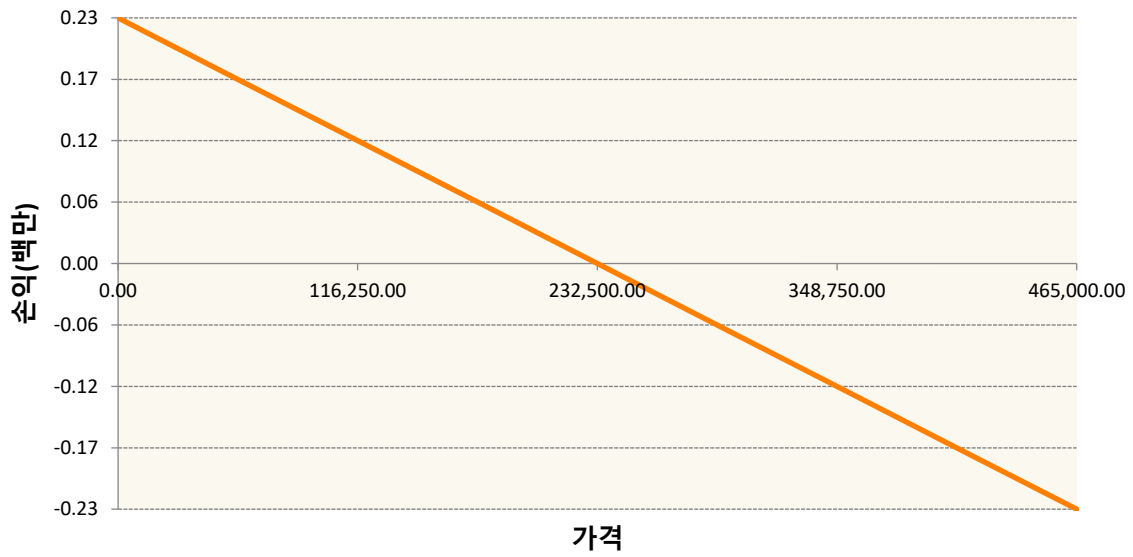
KR41B2VC0009-2024-12 S-Oil개별선물



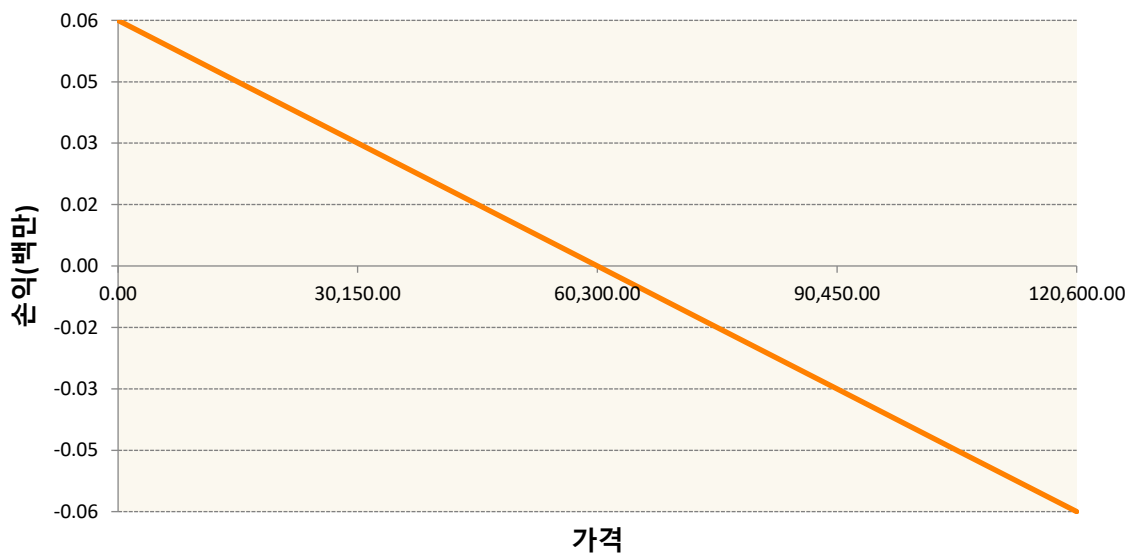
KR41BFVC0005-2024-12 삼성중공업개별선물



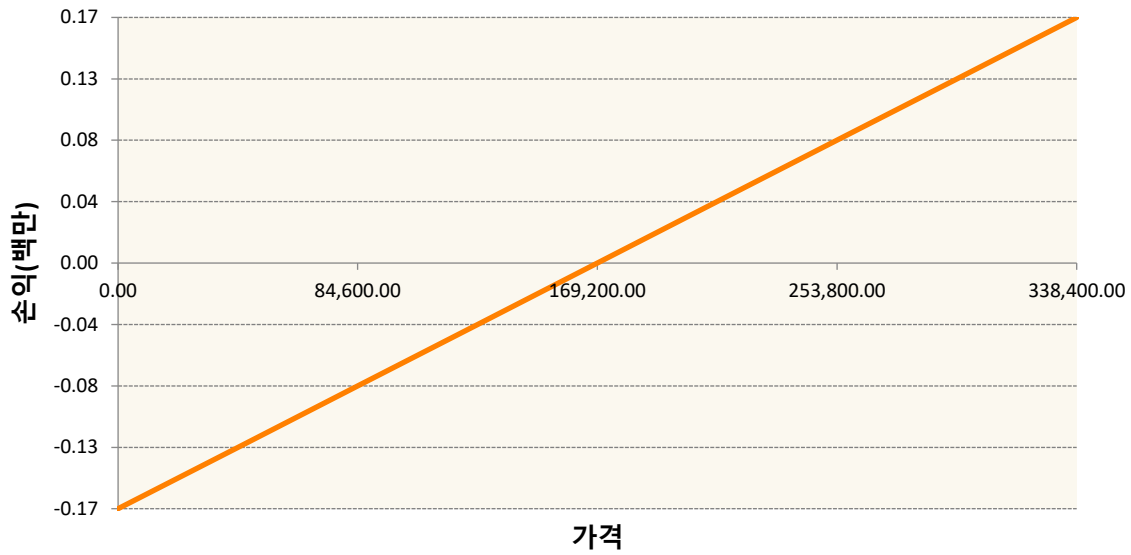
KR41BJVC0001-2024-12 엔씨소프트개별선물



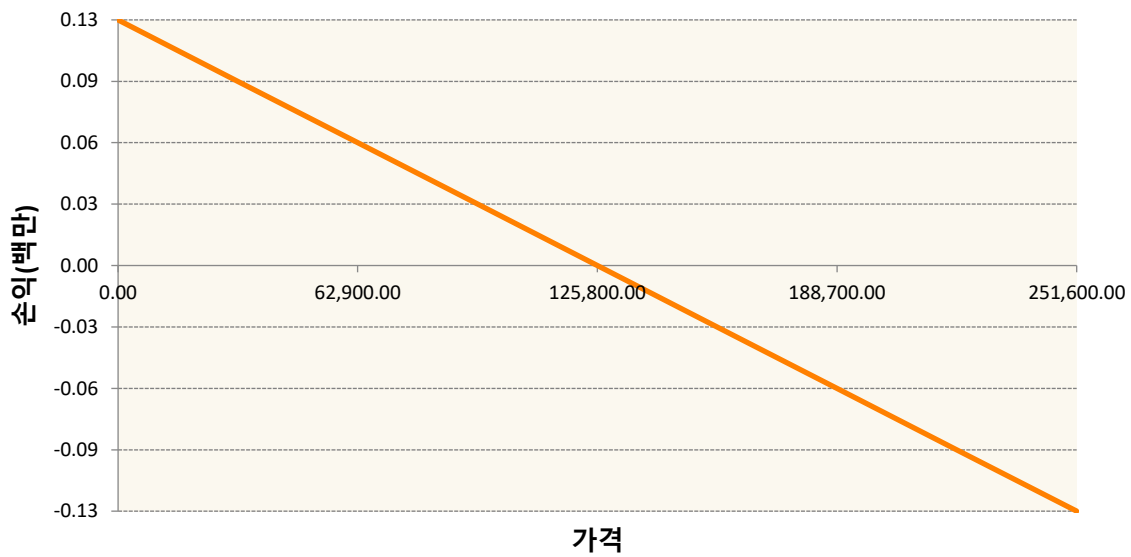
KR41BMVC0006-2024-12 한국항공우주개별선물



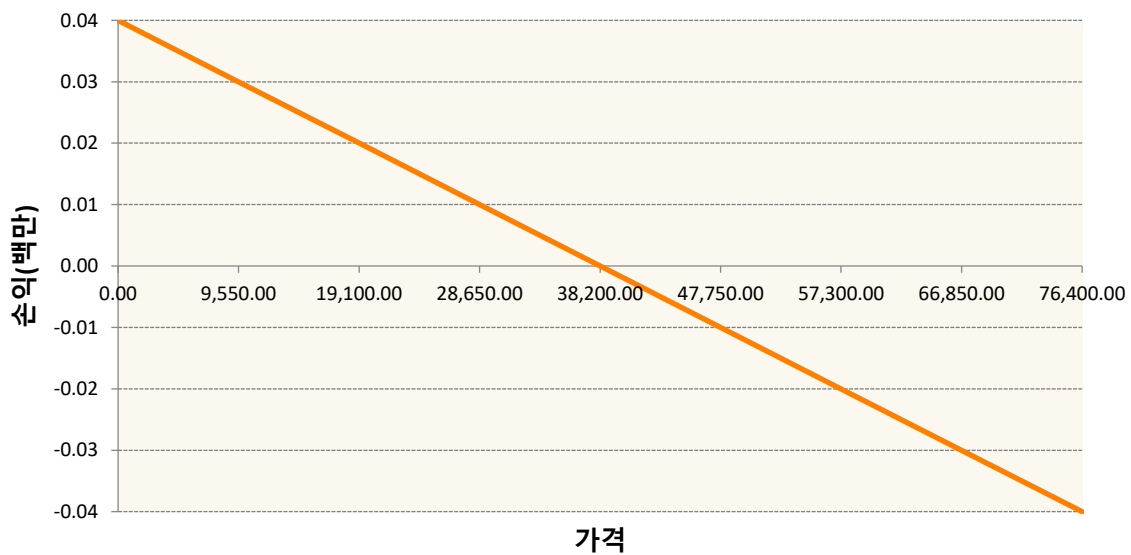
KR41BYVC0002-2024-12 LG이노텍개별선물



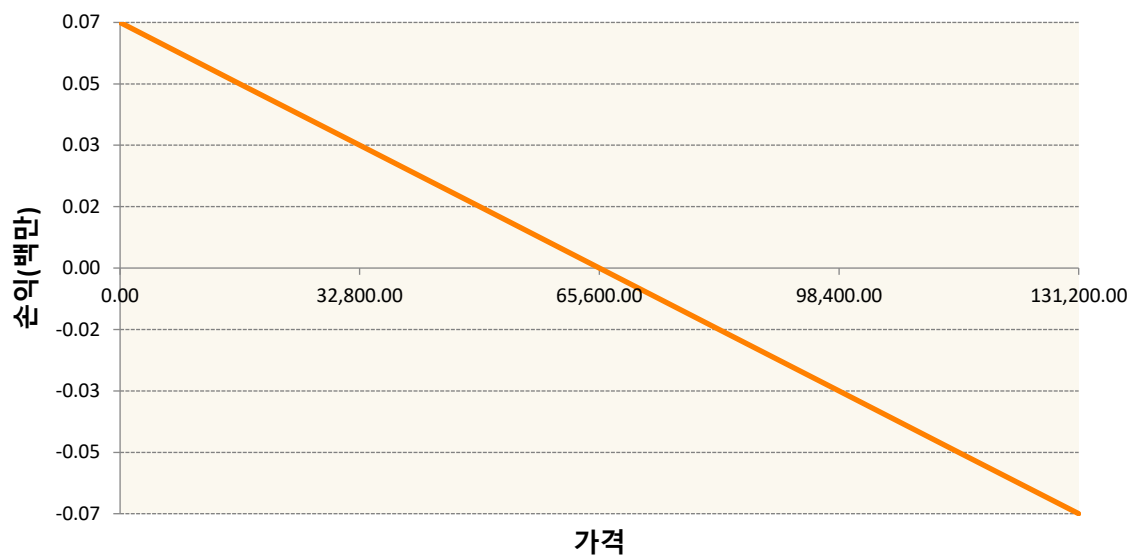
KR41CDVC0006-2024-12 현대미포조선개별선물



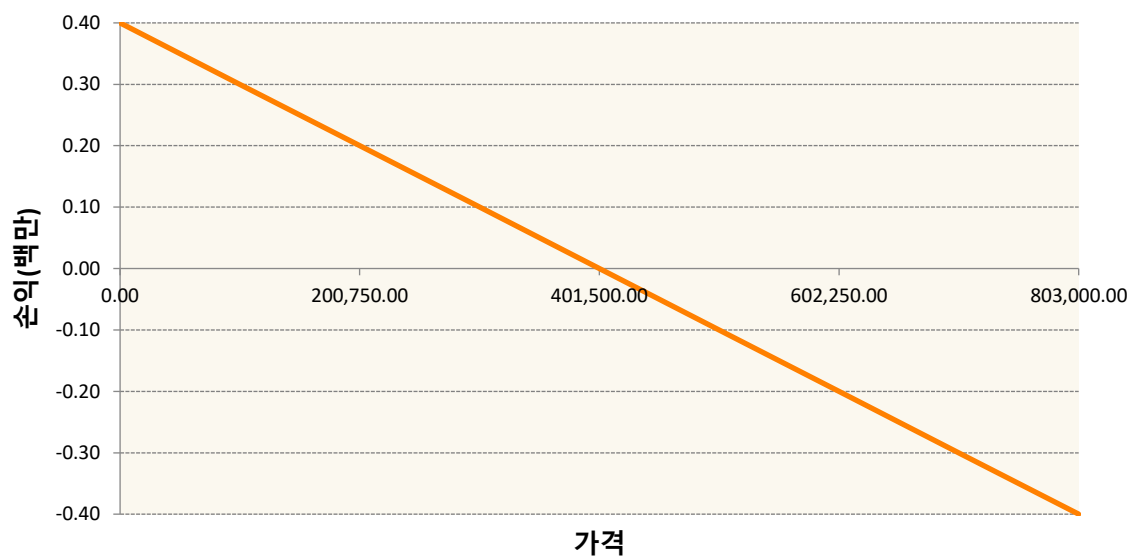
KR41CFVC0004-2024-12 카카오개별선물



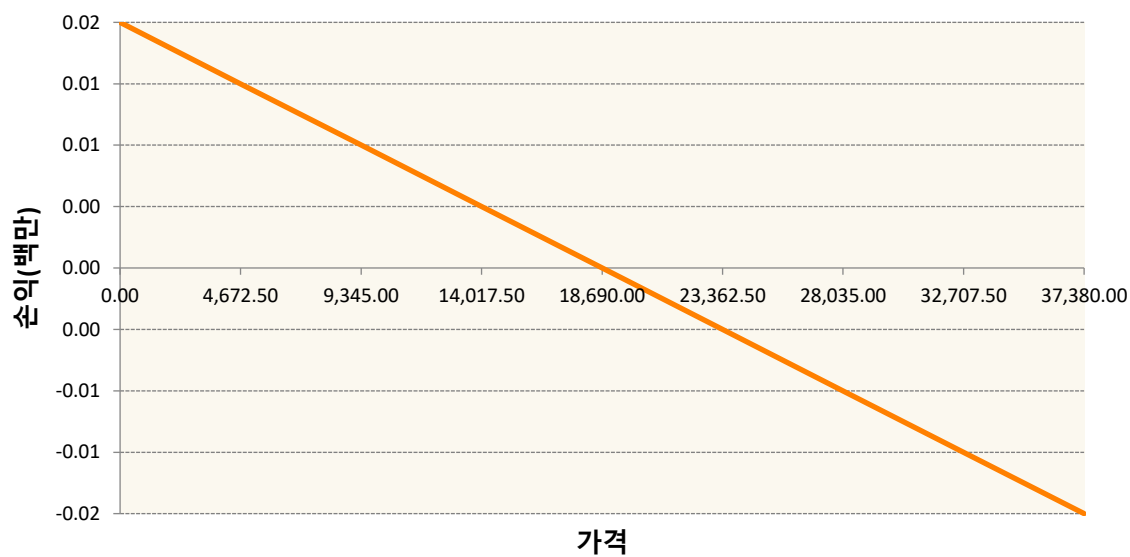
KR41DTVC0007-2024-12 CJ ENM개별선물



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	0.31
KR4141VC00 2024-12 SK이노베이션개별선물	0.38
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	1
KR41BYVC00 2024-12 LG이노텍개별선물	1
KR41CDVC00 2024-12 현대미포조선개별선물	0.3
KR41CFVC00 2024-12 카카오개별선물	0.21
KR41DTVC00 2024-12 CJ ENM개별선물	0.47
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)

2,526

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

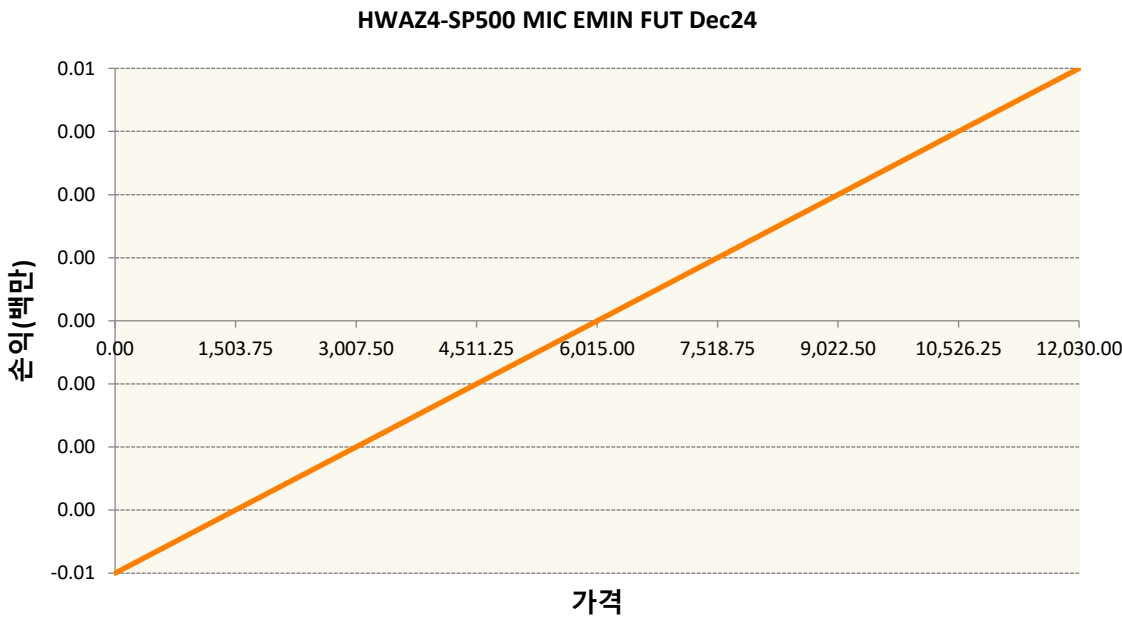
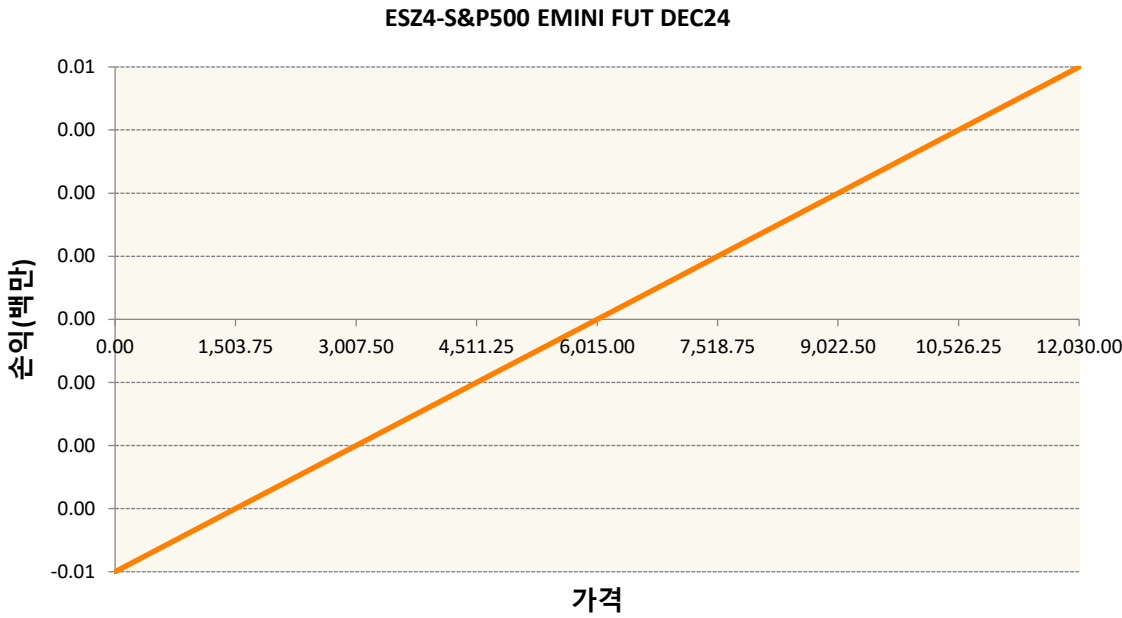
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	18,049	0	18,049	
누계	유가증권	선물	1,980	0	1,980	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,444
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	158

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	980

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

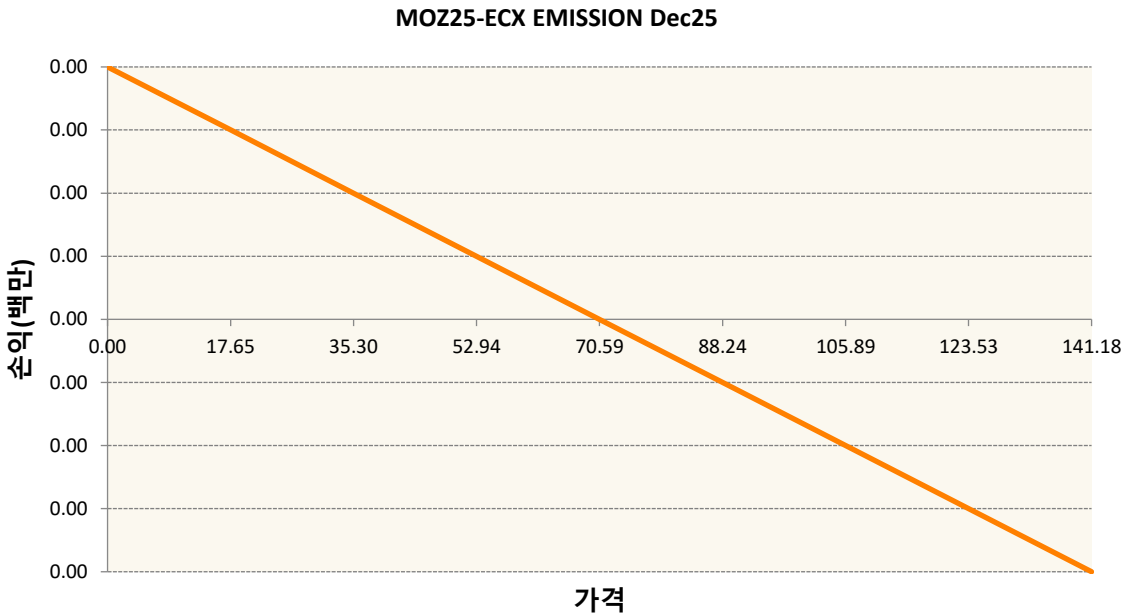
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	-11	5,492	-5,502	
누계	통화	선도	0	2,540	-2,540	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	91
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	439

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

(단위:백만원)

836

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

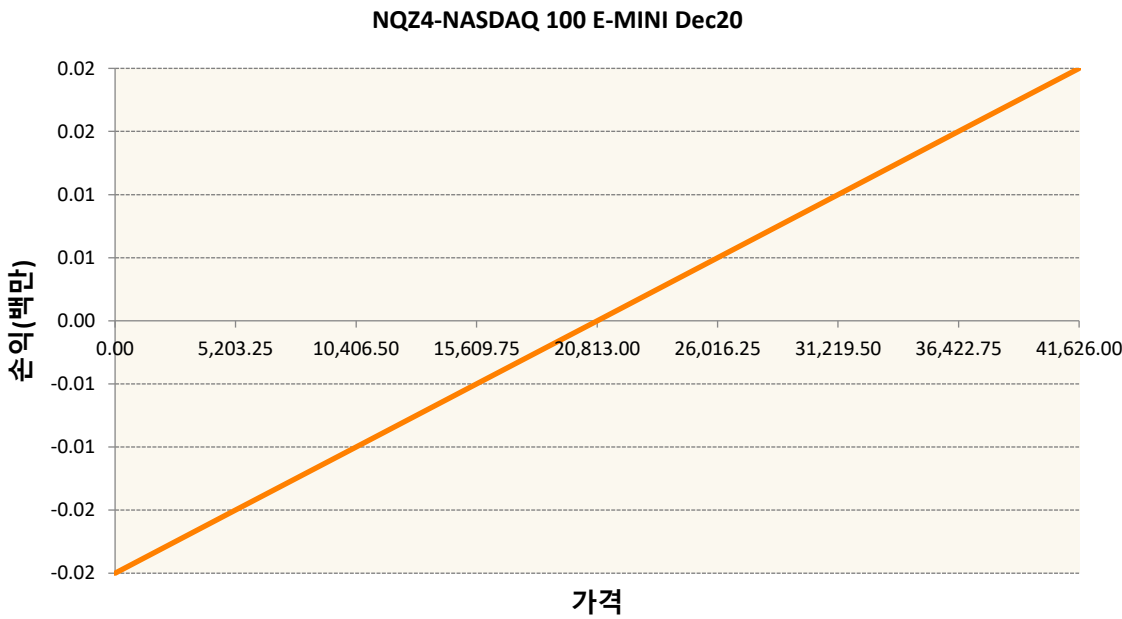
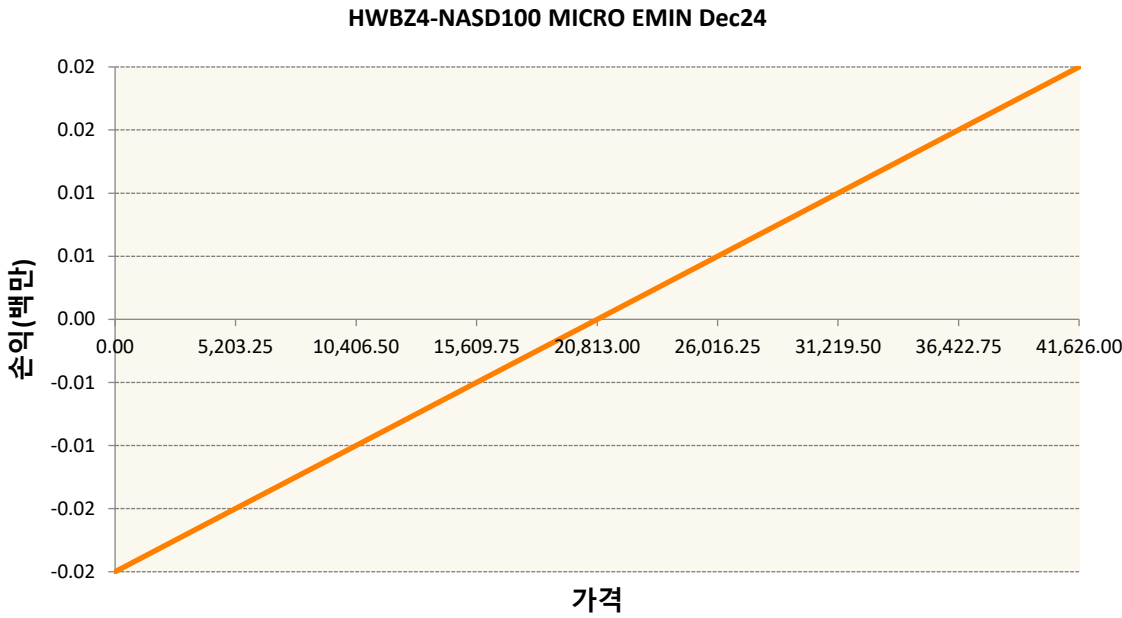
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	10,198	0	10,198	
누계	유가증권	선물	1,316	0	1,316	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		105
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		816

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			762

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

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	203,286	0	203,286	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	706
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,695
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,281
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,722

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

(단위:백만원)

9,812

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

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	14
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	14
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	14
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	14

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

(단위:백만원)

61

공시일	2024-11-29
기준일	2024-11-28

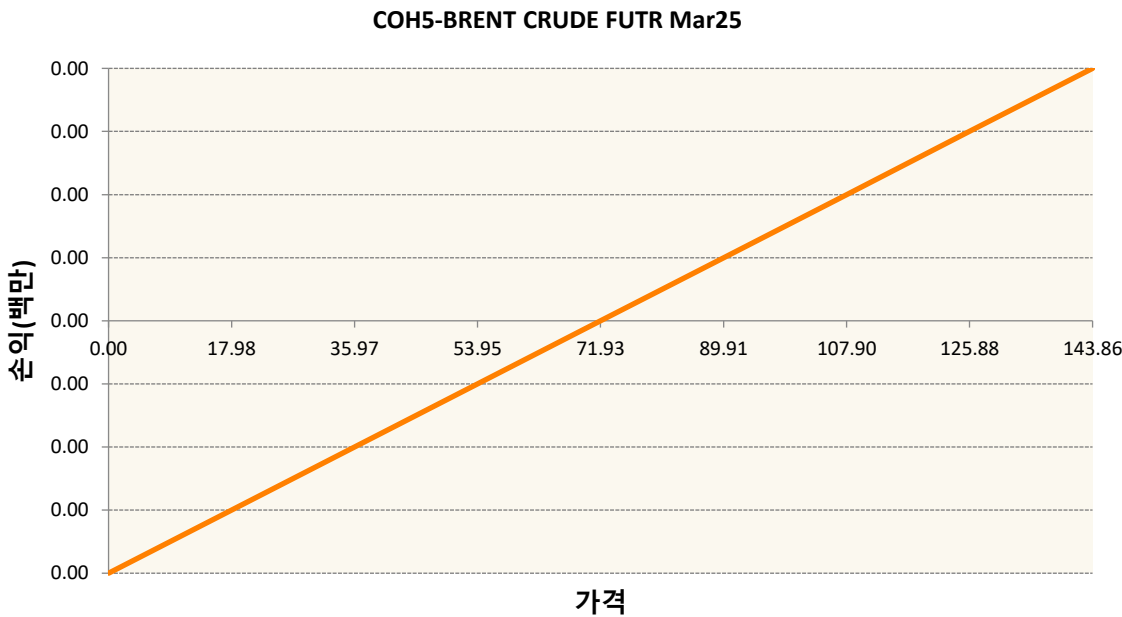
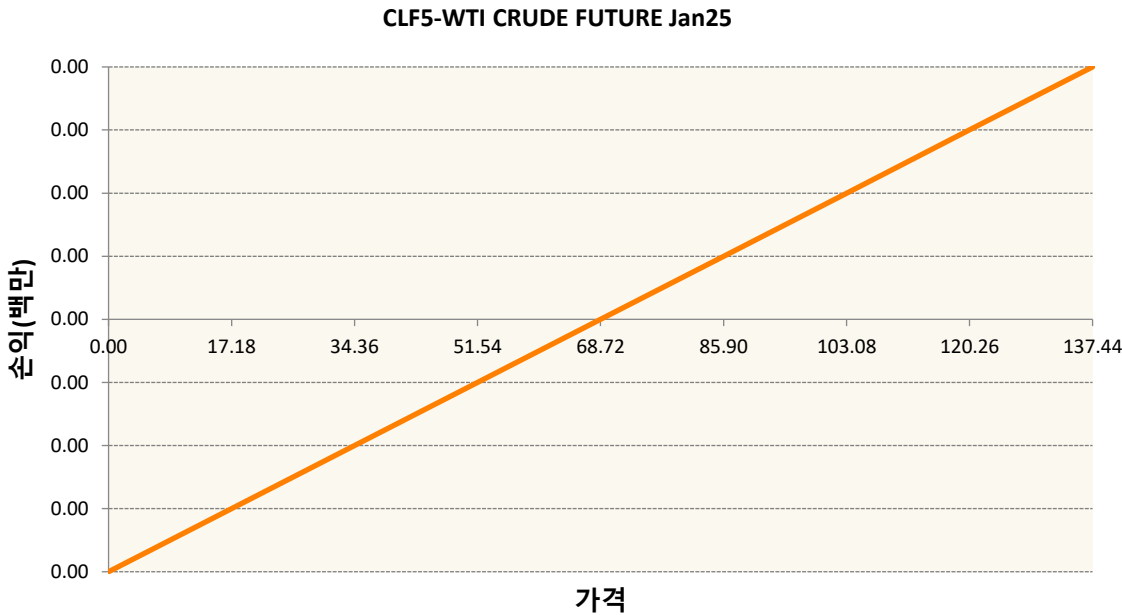
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

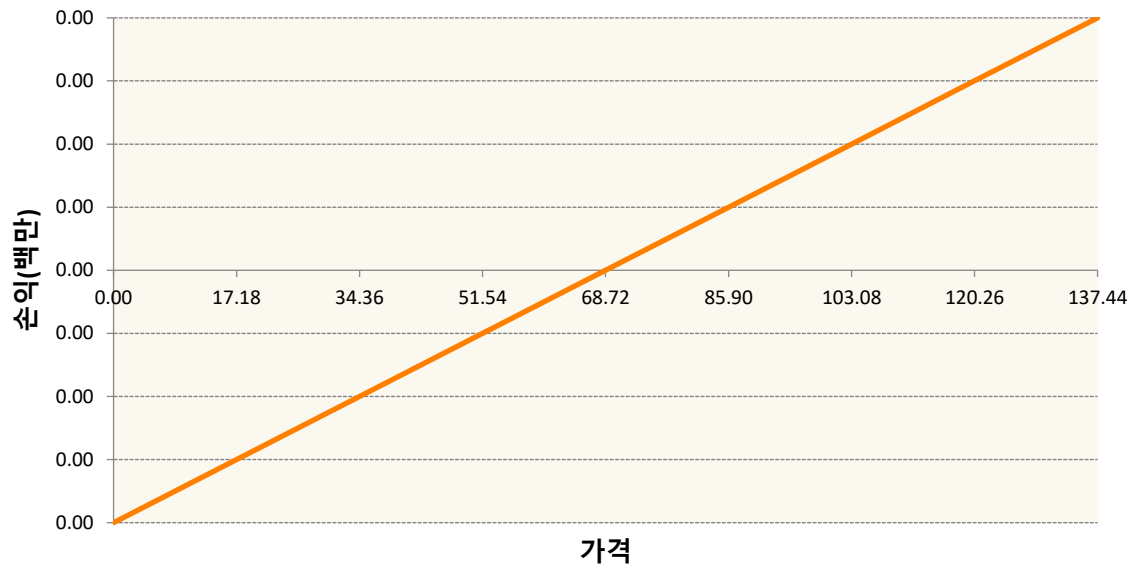
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	42	0	42	장내
누계	유가증권	선물	778	0	778	
누계	통화	선물	0	98	-98	장내

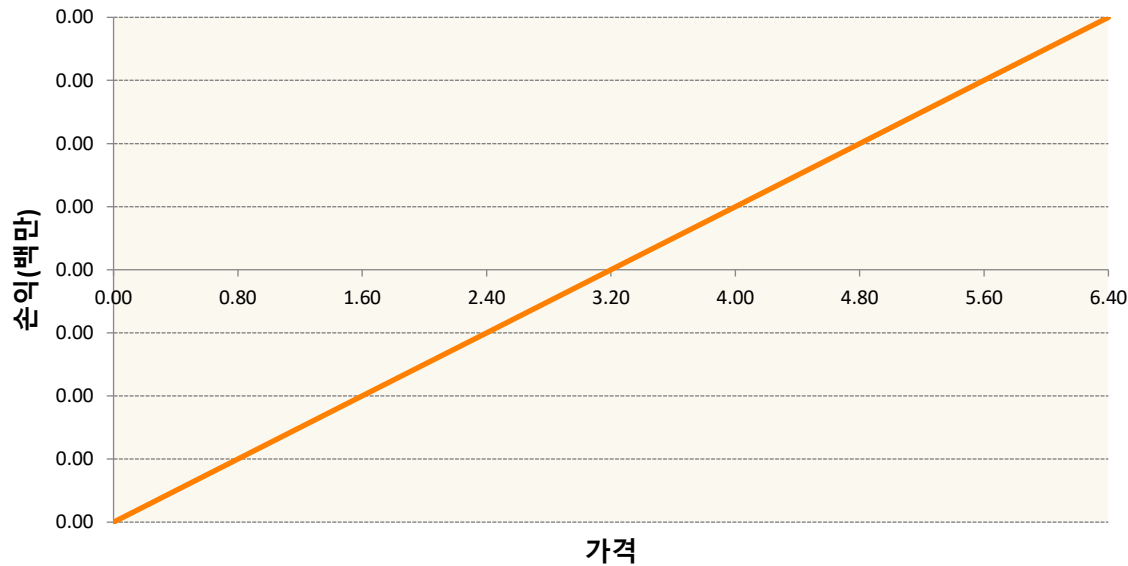
2. 만기시점의 손익구조



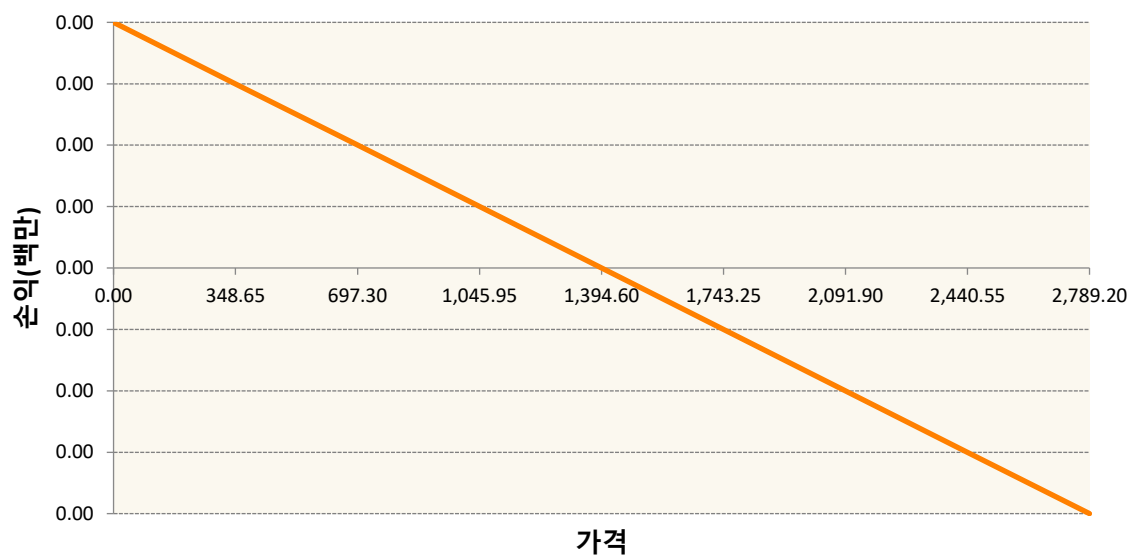
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



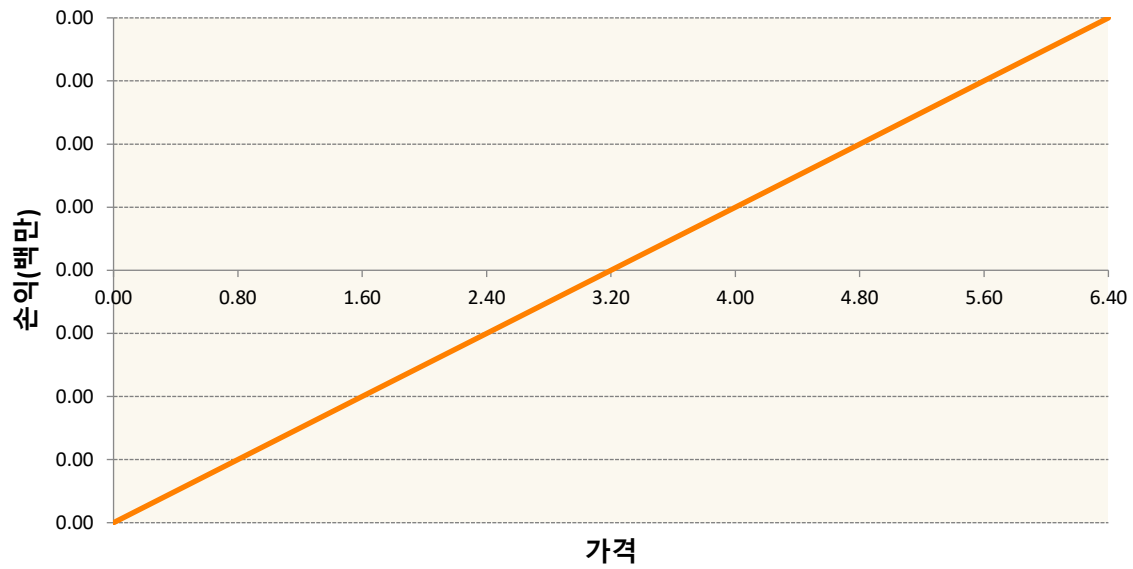
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



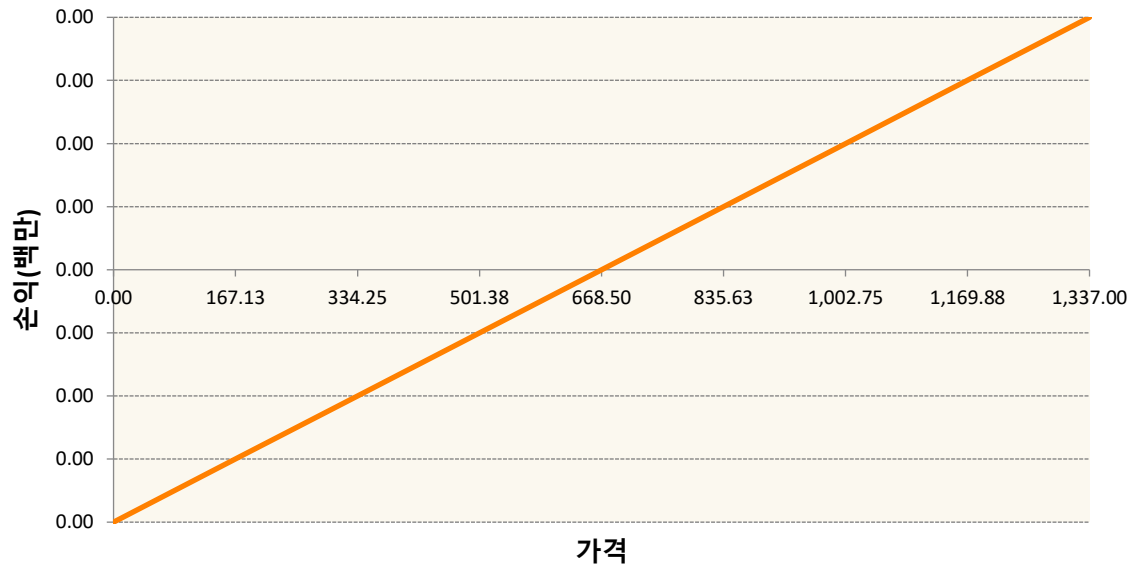
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



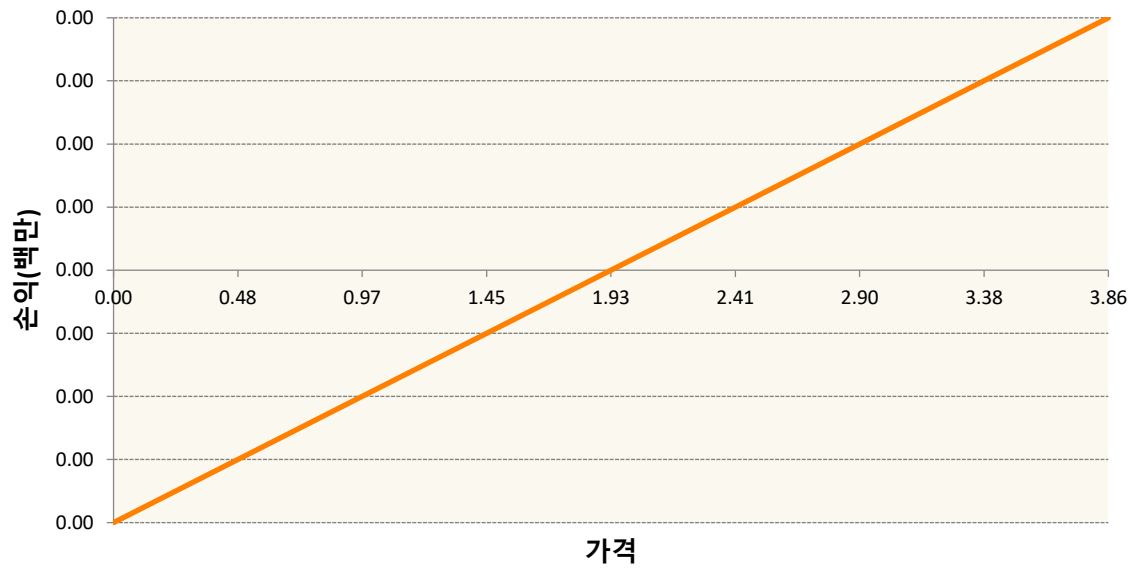
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



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