

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

베스트장기채(채권-파생형)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

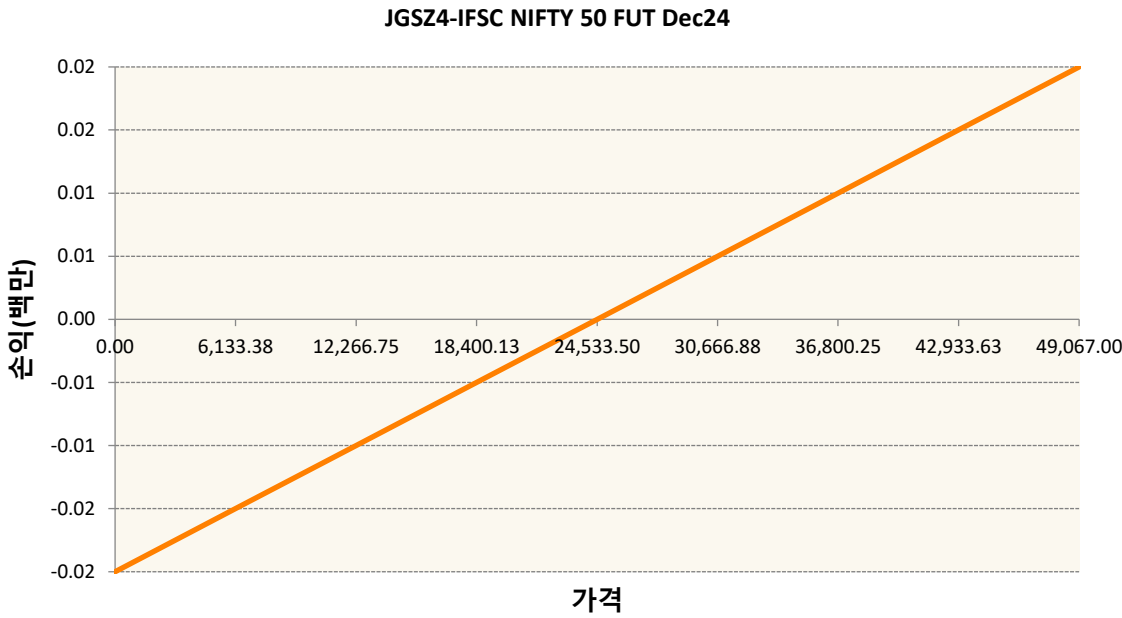
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,359	0	3,359	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSZ4	IFSC NIFTY 50 FUT Dec24	269
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

177

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

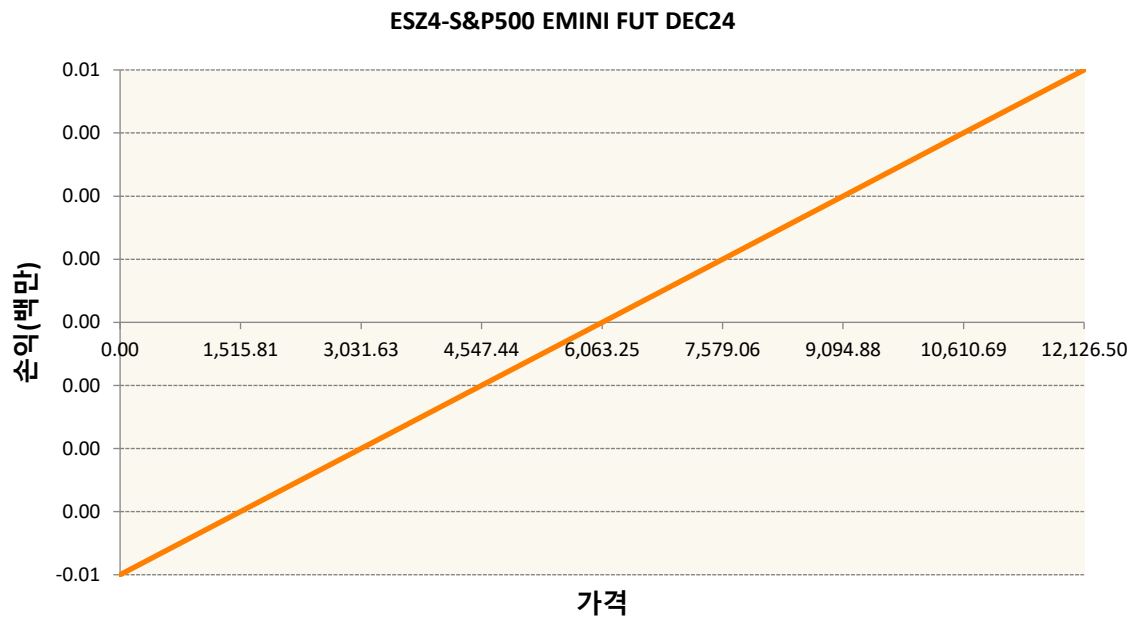
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	839	0	839	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOSPXWUS€SPXW US 12/04/24 C6050 INDEX	0.07
ESZ4 S&P500 EMINI FUT DEC24	67

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

(단위:백만원)

41

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

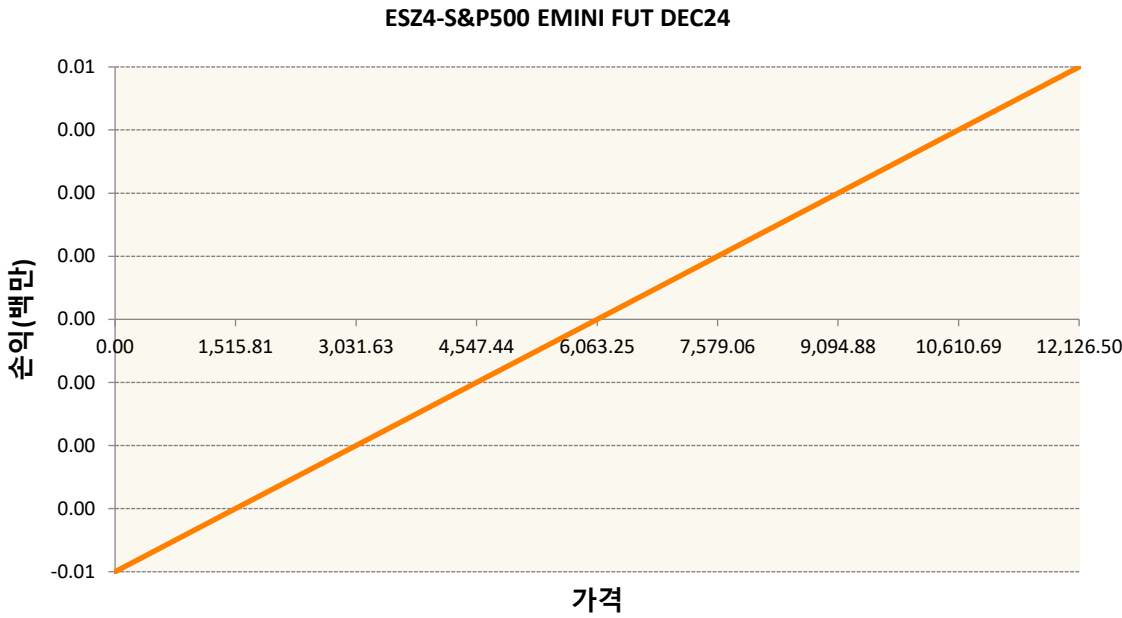
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,549	0	2,549	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	204
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

124

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

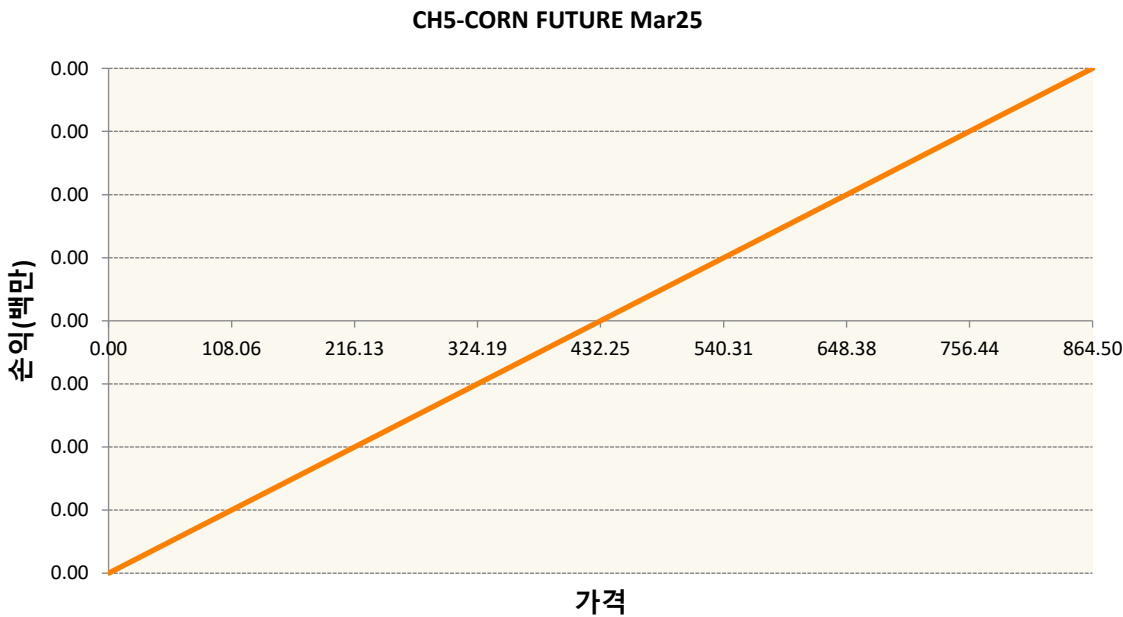
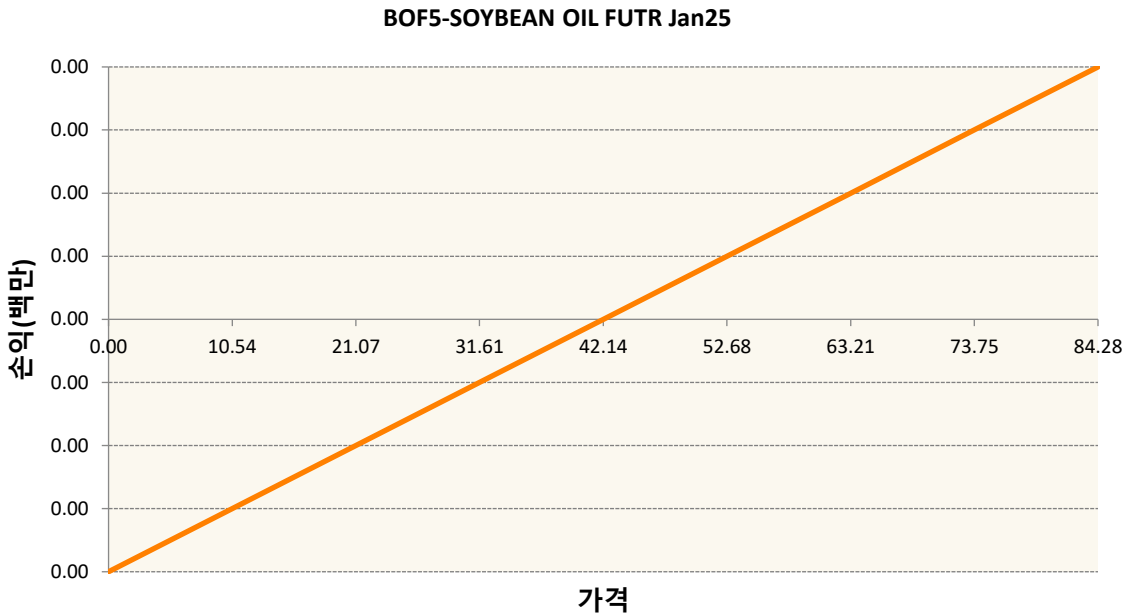
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

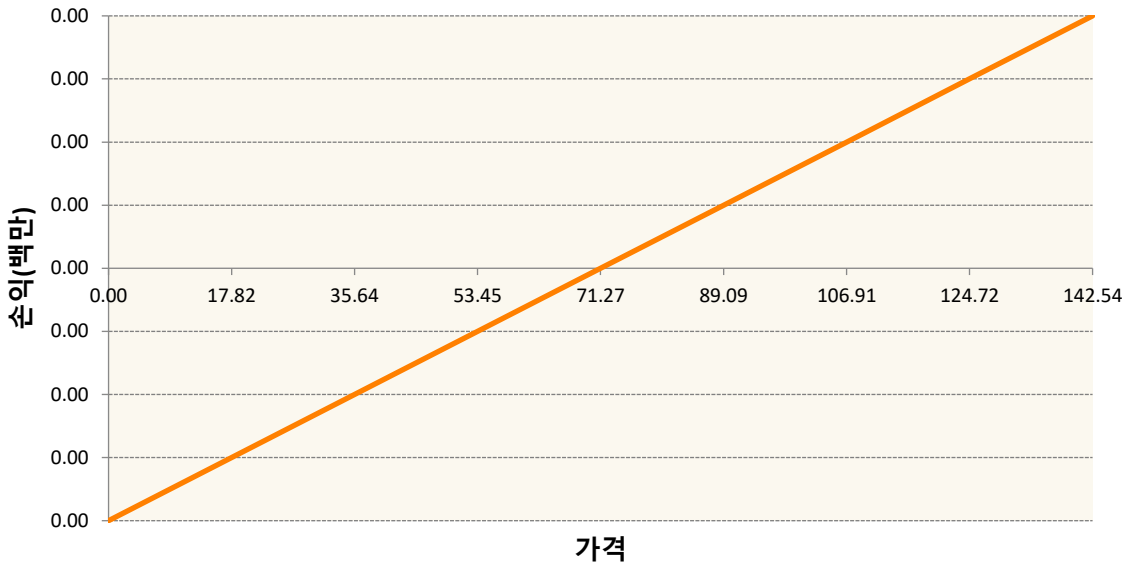
(단위:USD 백만)

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	3,687	0	3,687	
누계	통화	선물	0	423	-423	장내

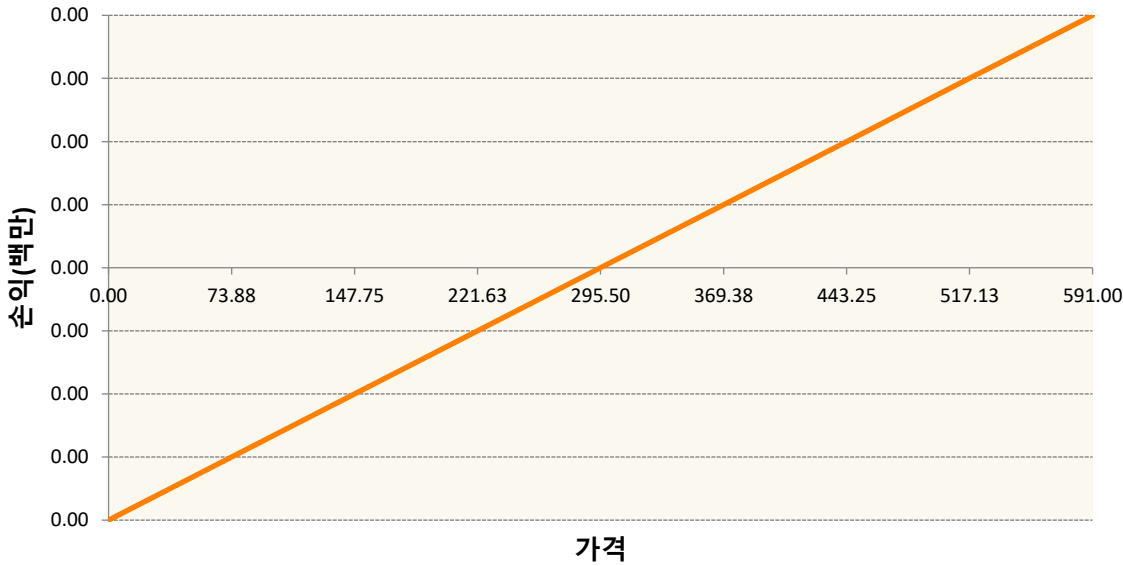
2. 만기시점의 손익구조



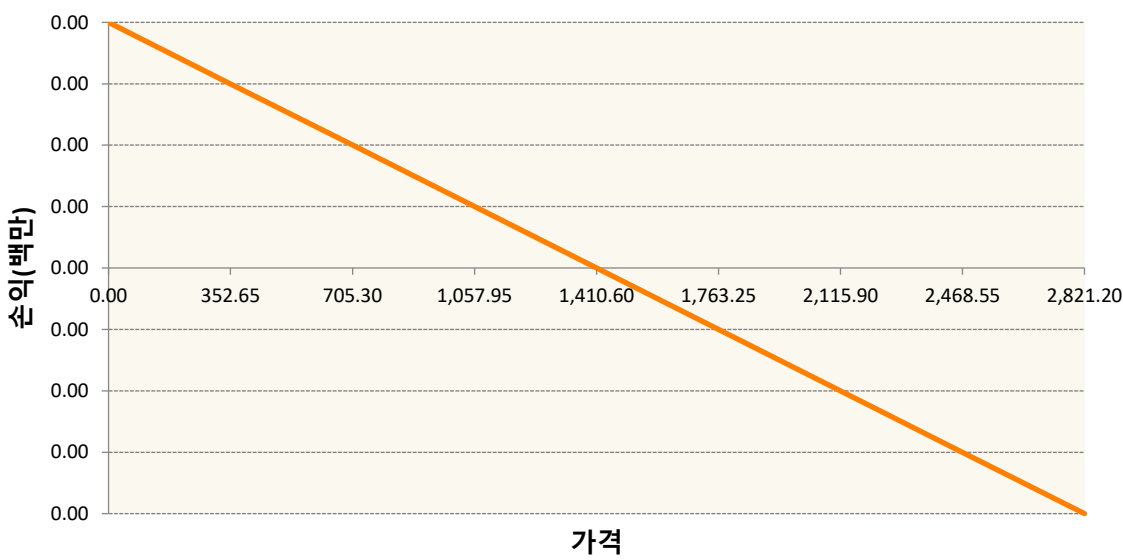
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



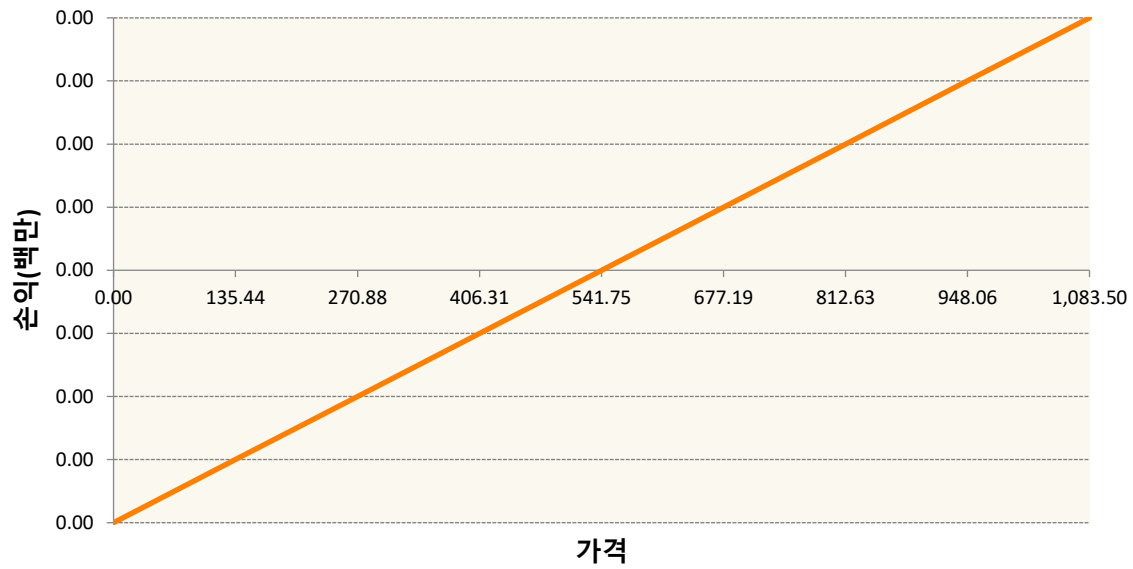
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



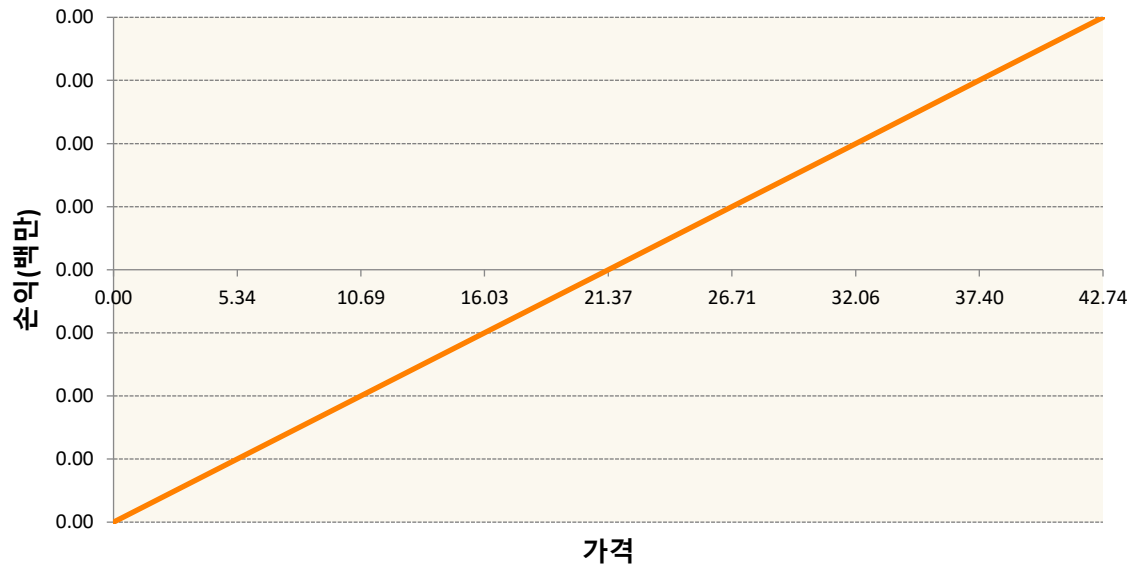
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



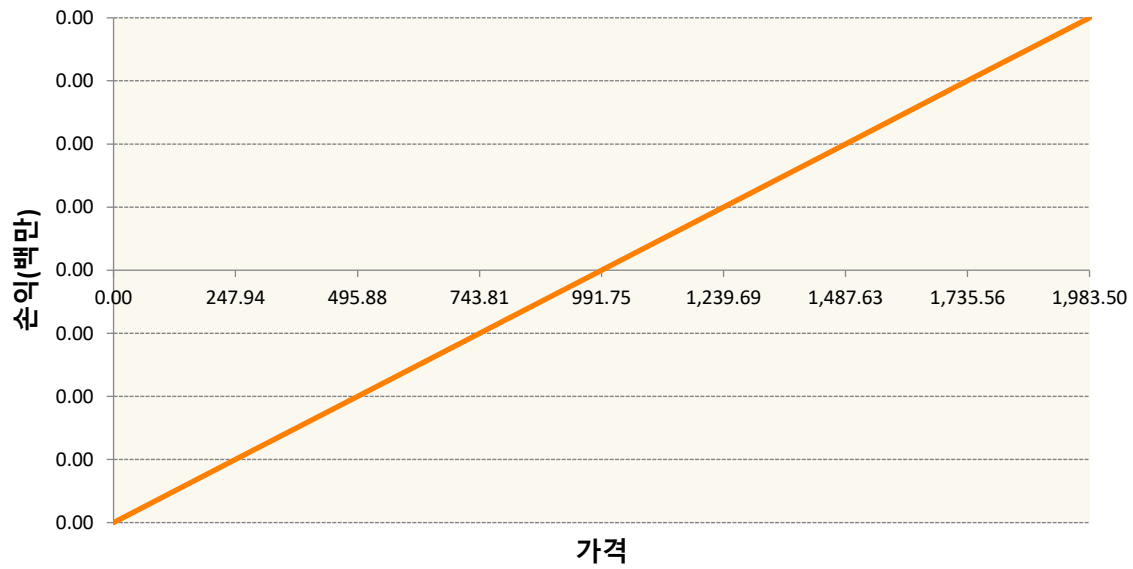
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



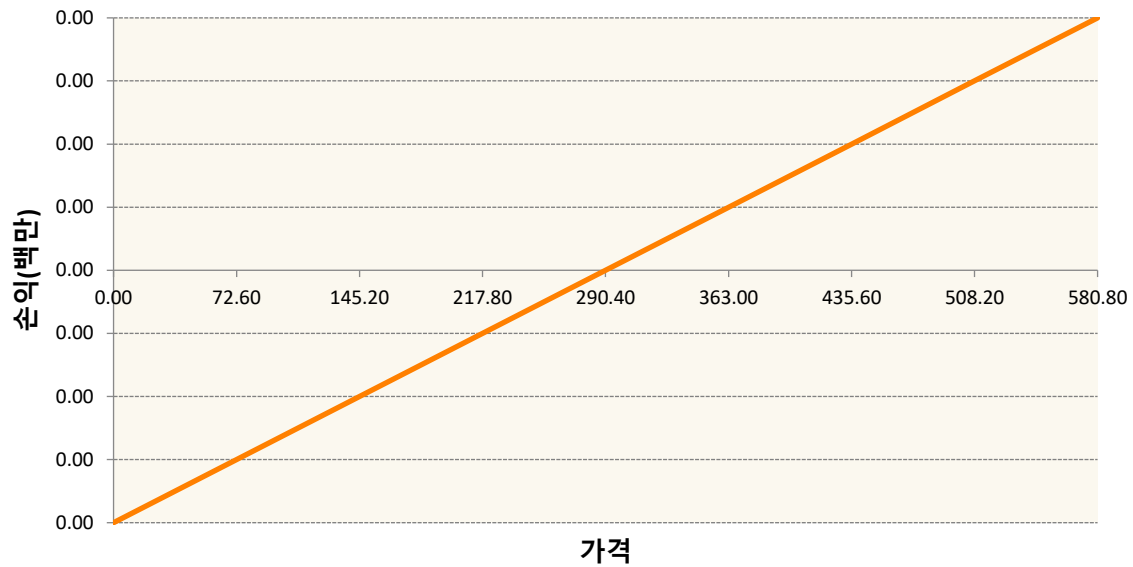
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



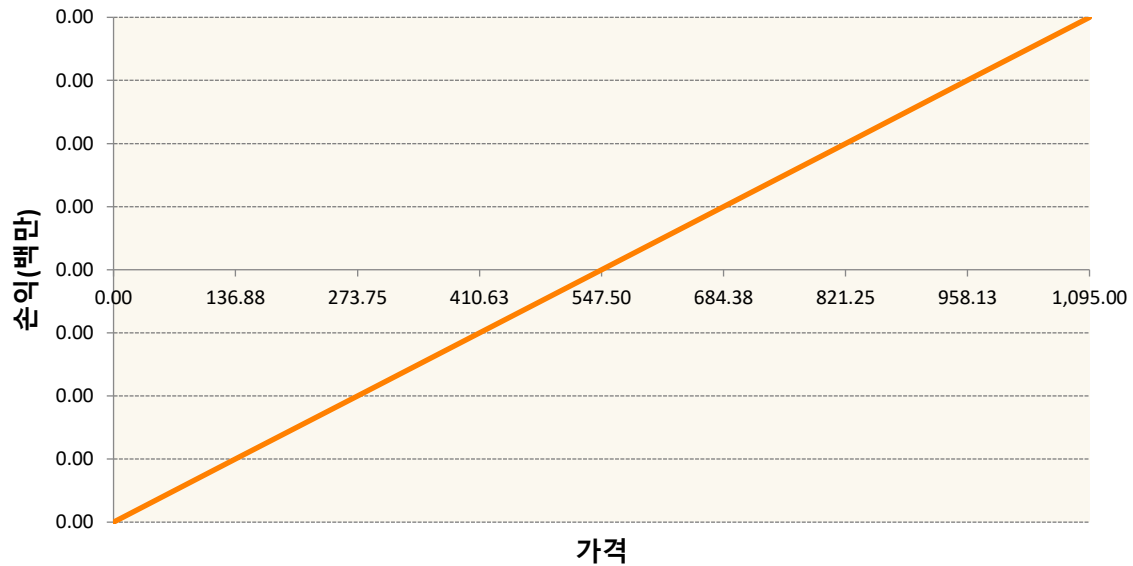
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-12-05
기준일	2024-12-04

스마트인덱스모

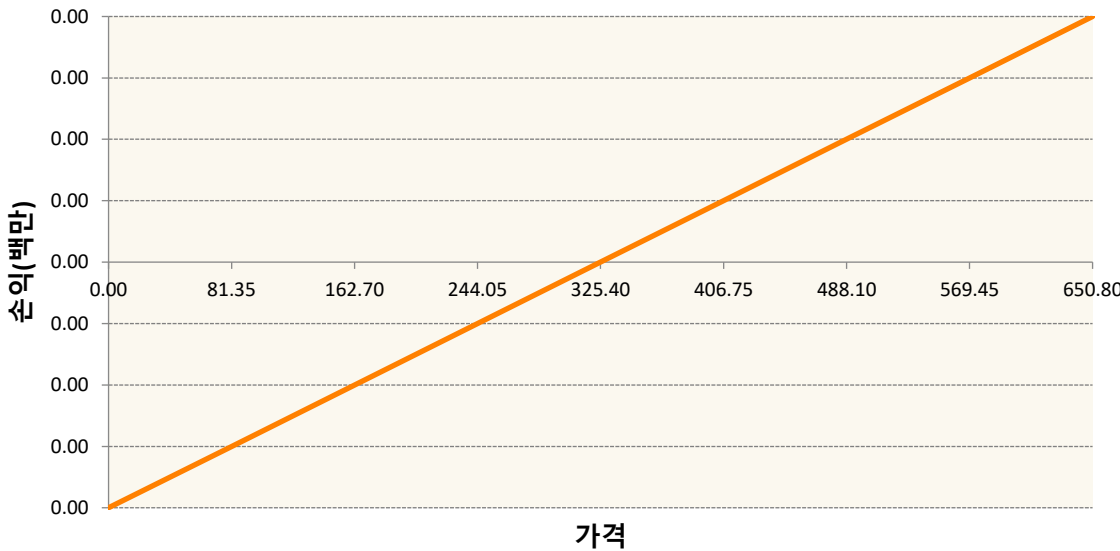
1. 계약금액

(단위:백만원)

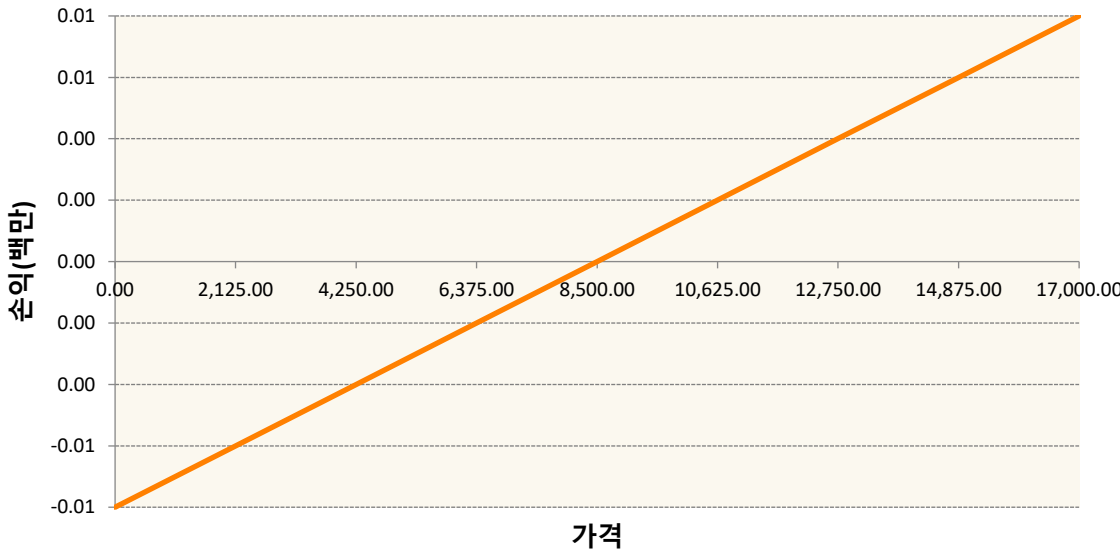
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	16	0	16	장내
누계	유가증권	선물	1,735	0	1,735	장내

2. 만기시점의 손익구조

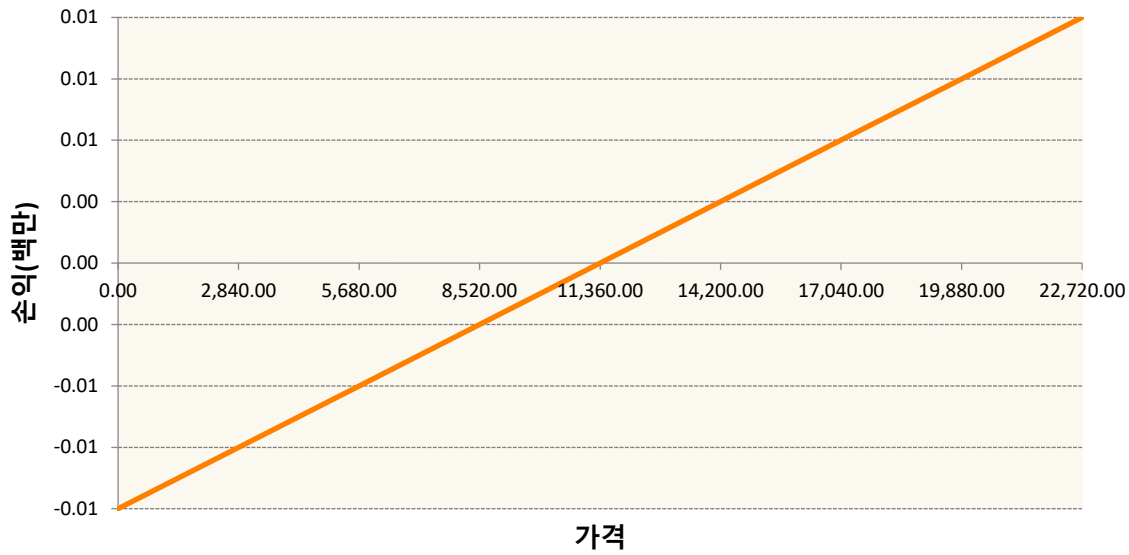
KR4101W30003-2025-03 코스피200지수선물



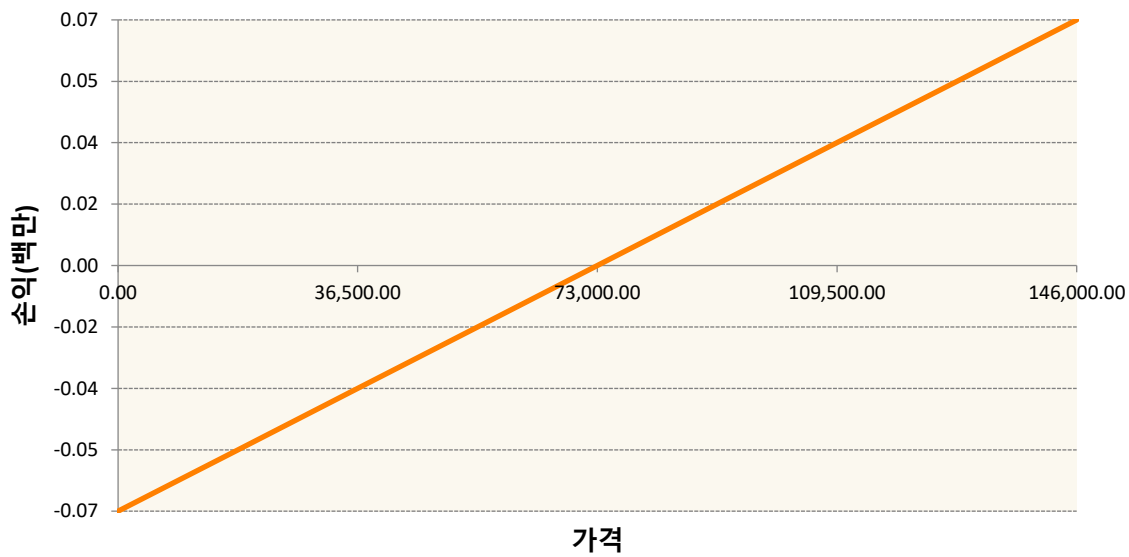
KR410GVC0006-2024-12 롯데관광개발개별선물



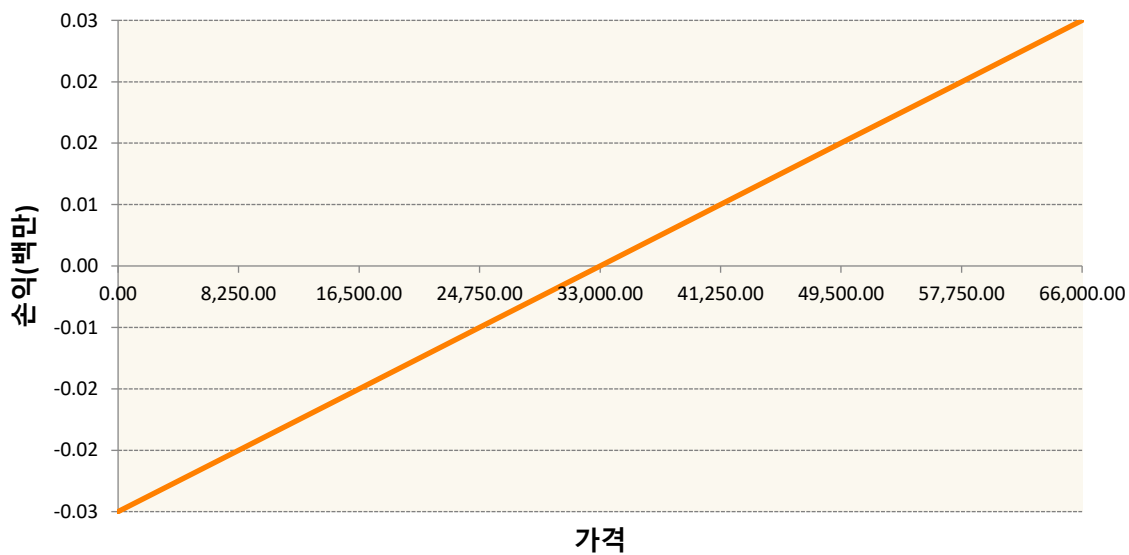
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



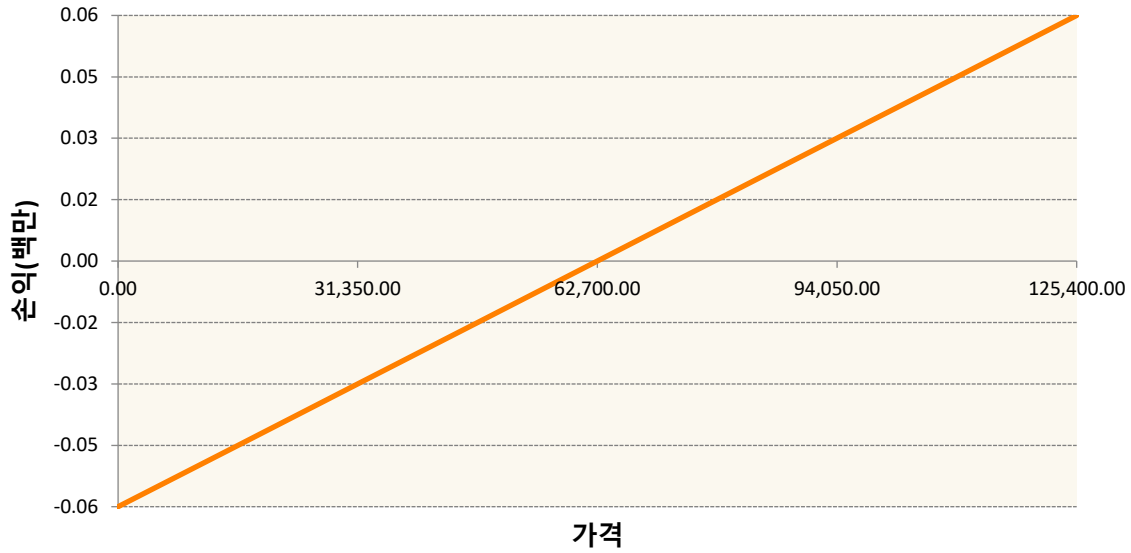
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



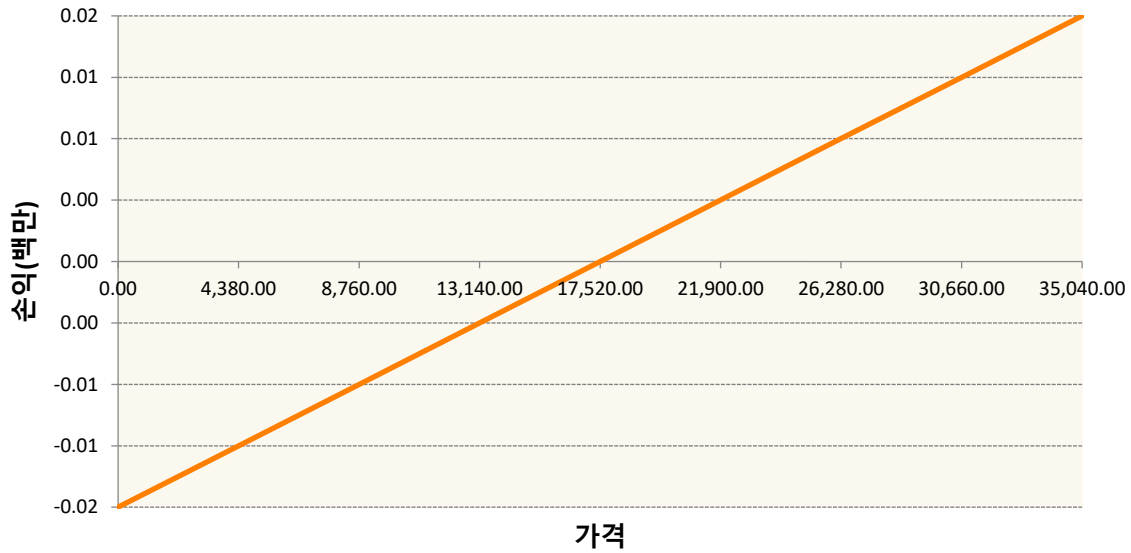
KR4128VC0003-2024-12 한국가스공사개별선물



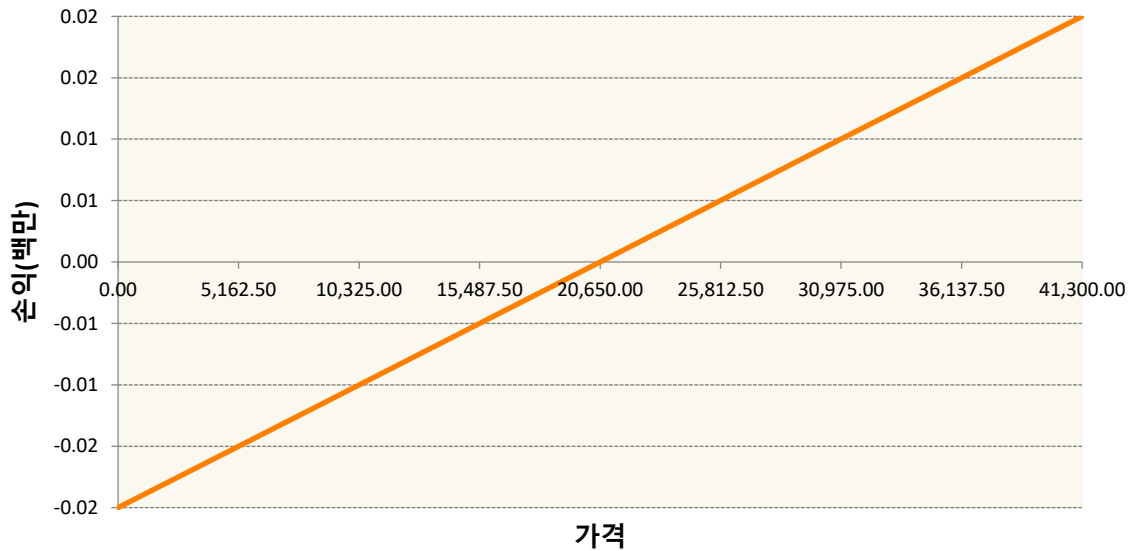
KR41BBVC0009-2024-12 롯데케미칼개별선물



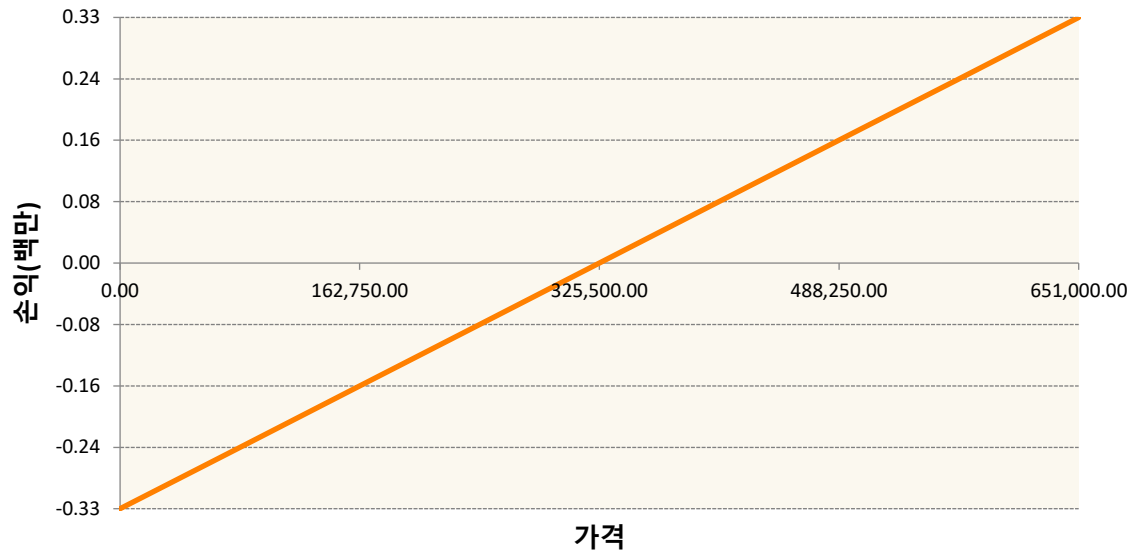
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



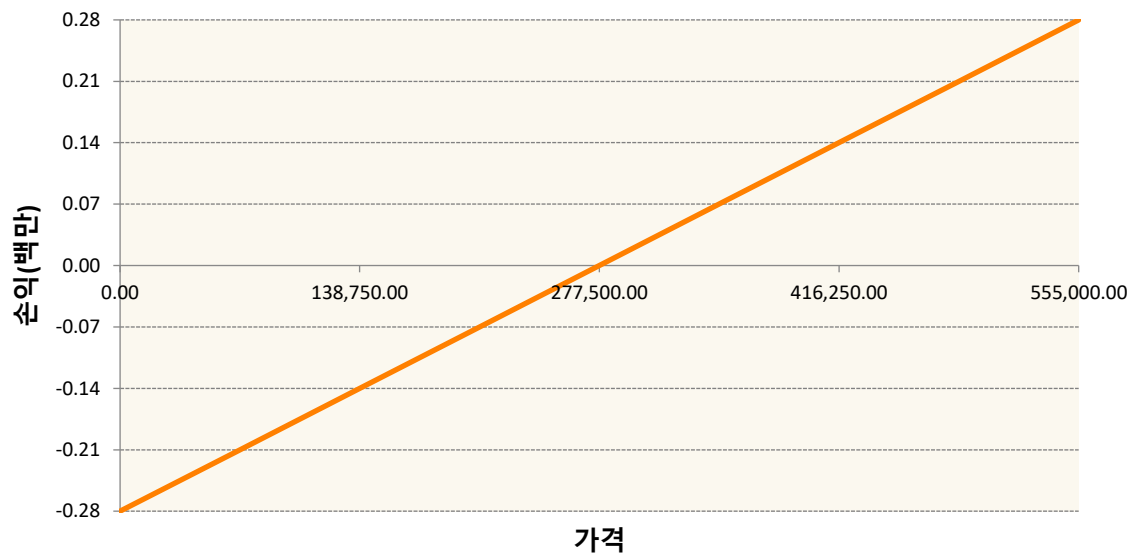
KR41CNVC0004-2024-12 포스코 ICT개별선물



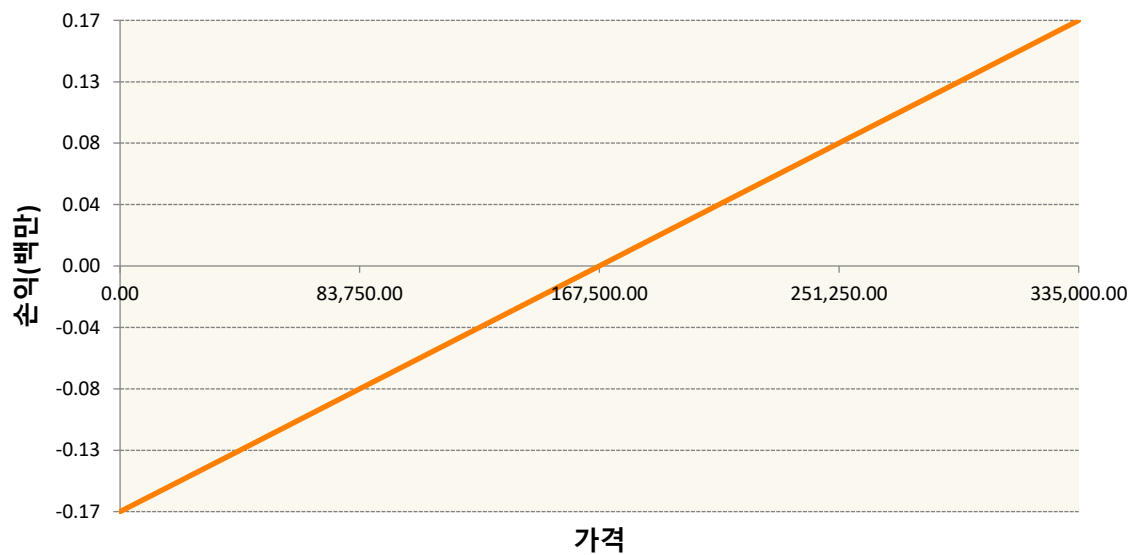
KR41CRVC0000-2024-12 LG생활건강개별선물



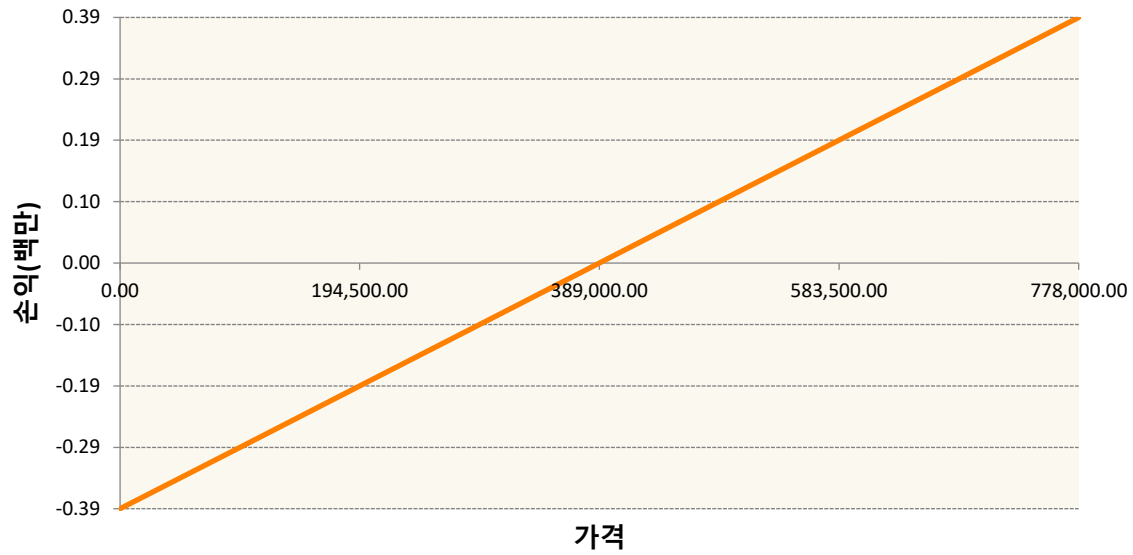
KR41D1VC0006-2024-12 CJ제일제당개별선물



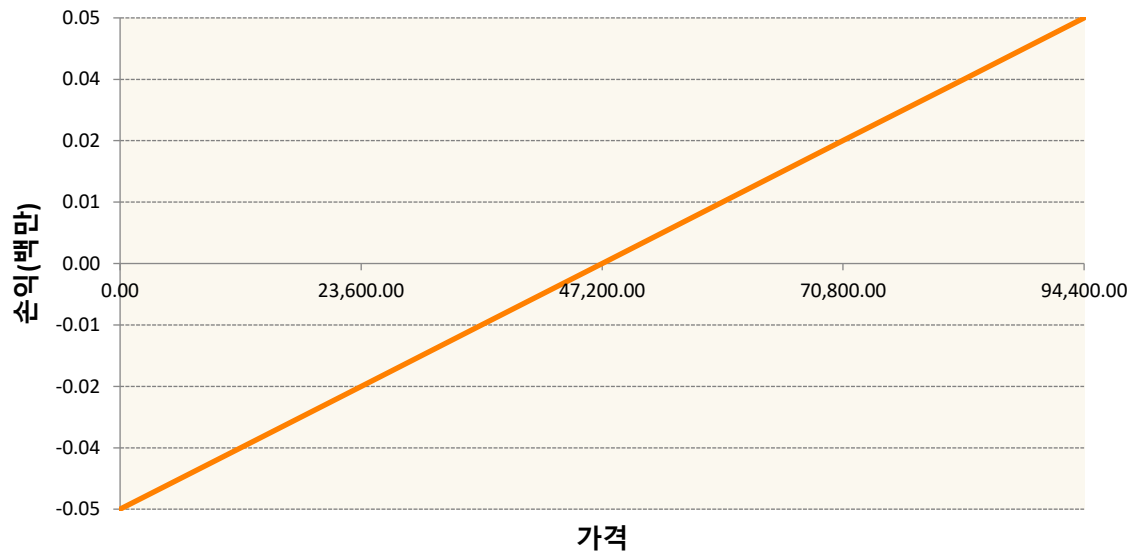
KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



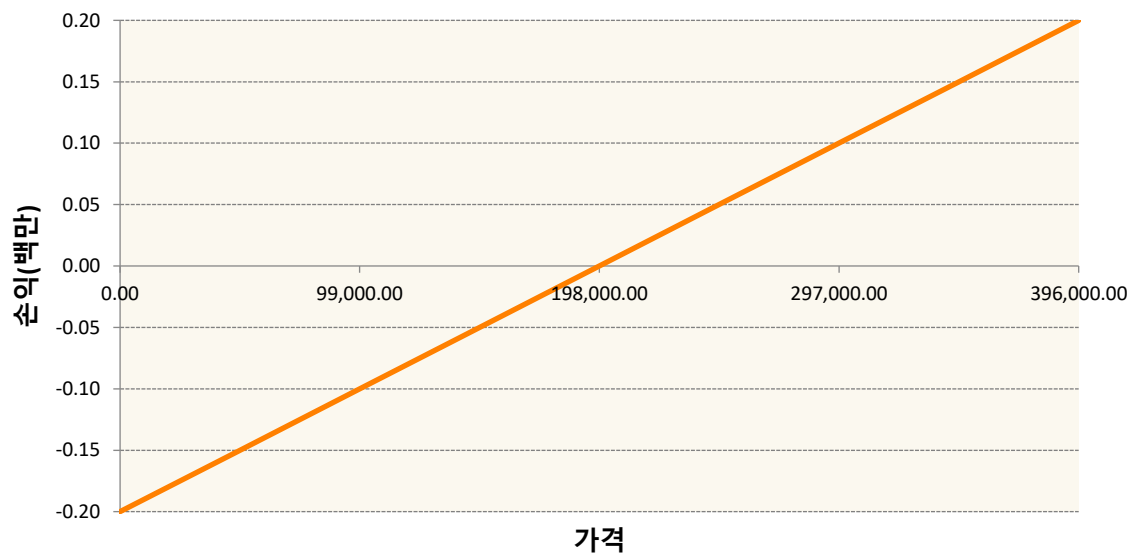
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



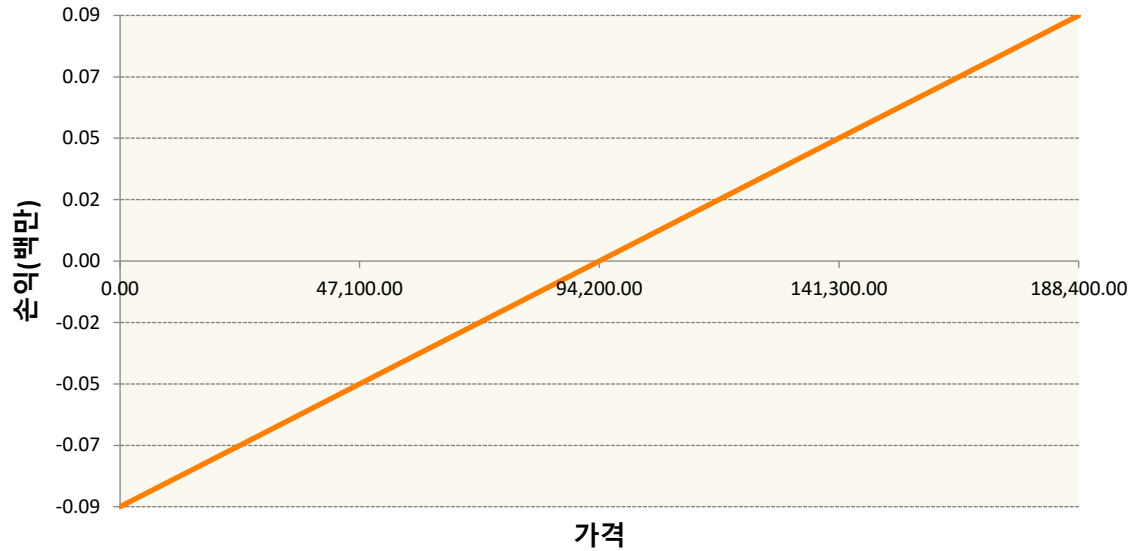
KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCVC0004-2024-12 하이브개별선물



KR41FMVC0002-2024-12 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30003 2025-03 코스피200지수선물								91
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	61	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	91	91	91	91	91	91	91	91
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	-1
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1	1
KR410JVC0003 2024-12 명신산업개별선물								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	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

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 6

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-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%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

KR41F5VC0007 2024-12 LG에너지솔루션개별선물 16

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	16	16	16	16	16	16	16
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)

148

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

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	302
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

502

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

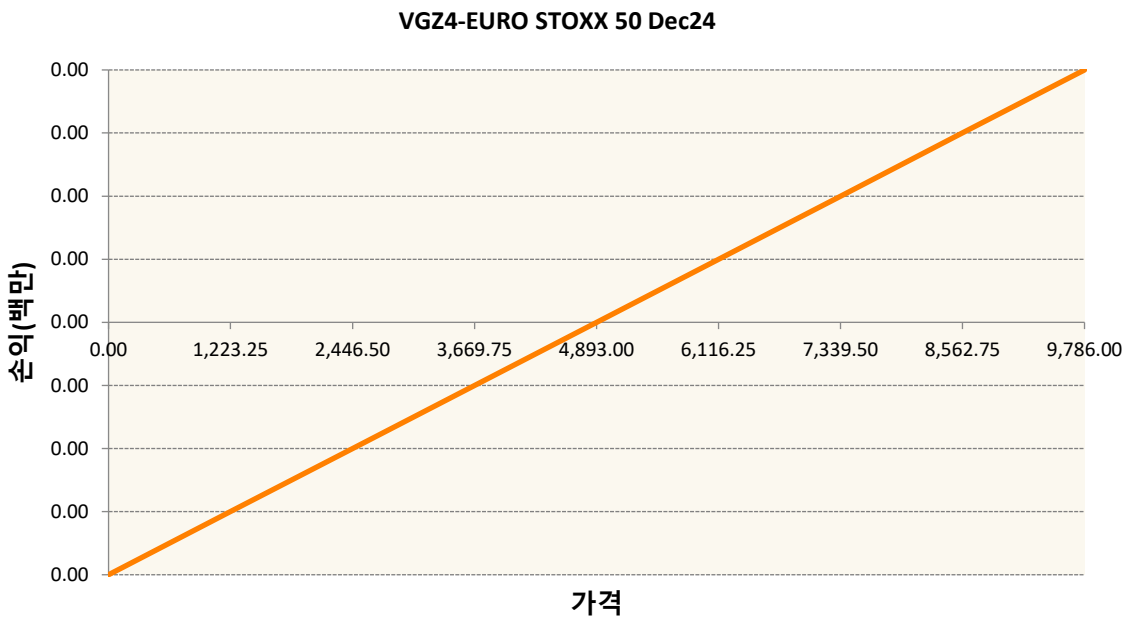
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	945	0	945	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ4 EURO STOXX 50 Dec24

76

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

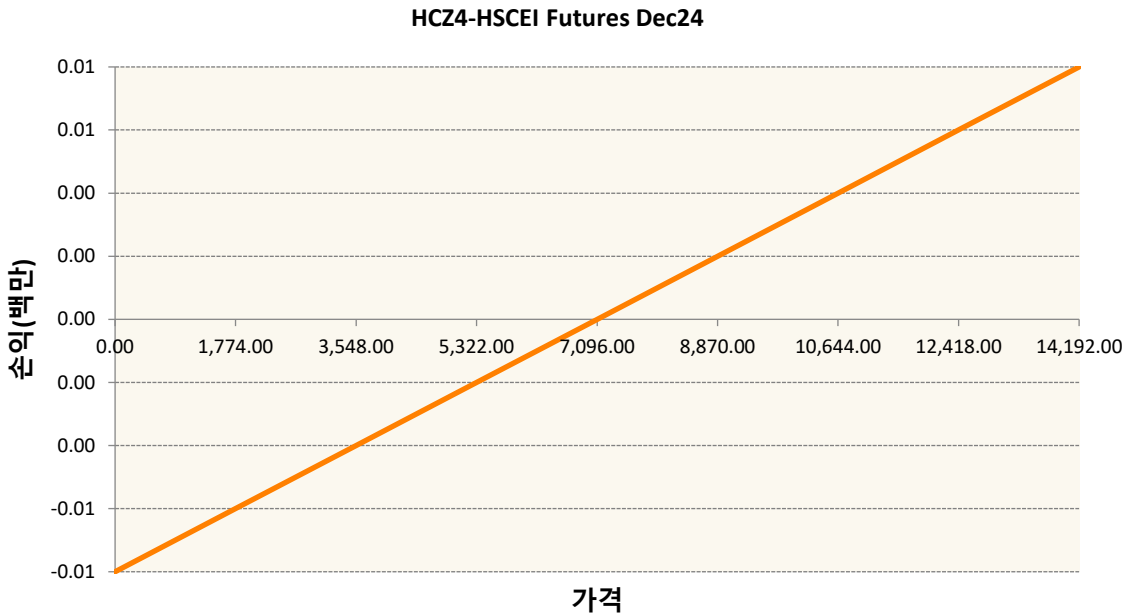
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,402	0	1,402	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ4	HSCEI Futures Dec24	112
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

153

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

커버드콜모(주식혼합-파생형)

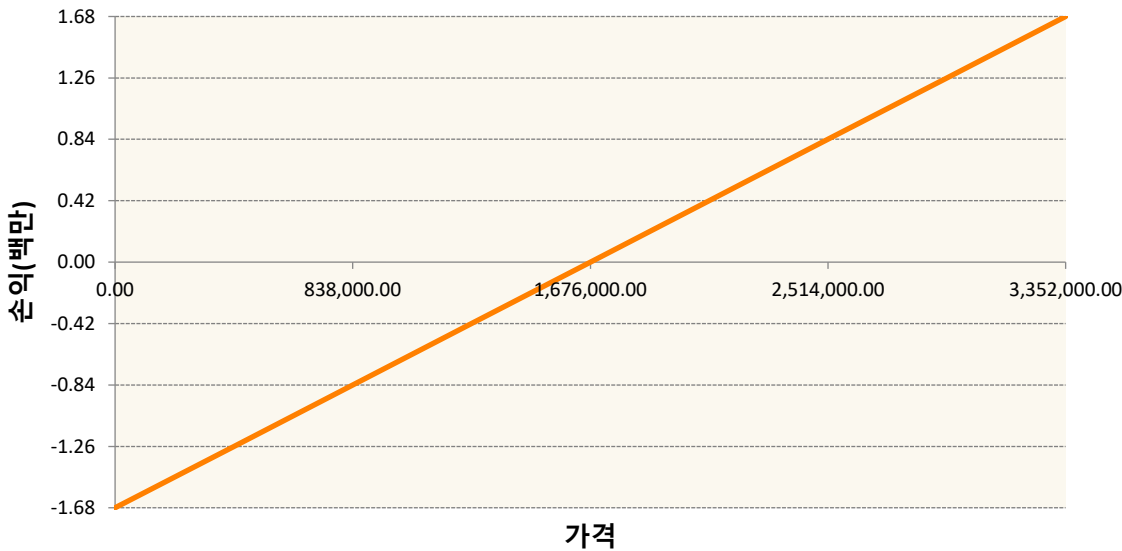
1. 계약금액

(단위:백만원)

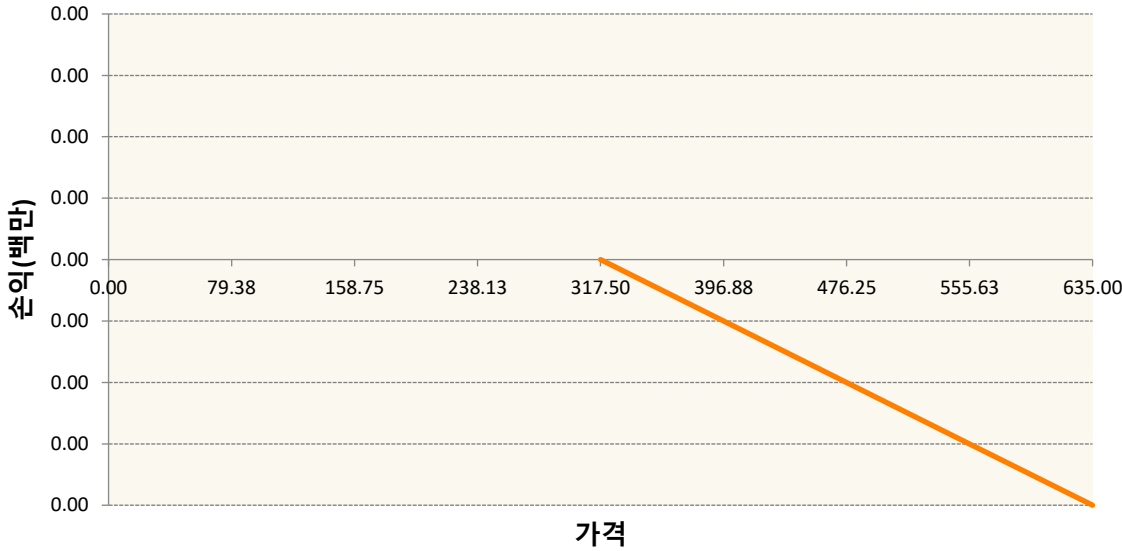
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	436	0	436	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,587	-36,587	장내

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 points.

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					35
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	35	35	35	35	35	35	35
KR4201VC3171		2024-12 콜317.5					783
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	335	333	330	326	322	317	312
-5.33%	312	304	296	286	277	267	257
-2.67%	219	207	195	182	170	158	145
0%	26	18	9	0	-10	-20	-30
2.67%	-231	-233	-236	-240	-245	-250	-256
5.33%	-505	-505	-506	-507	-508	-510	-513
8.00%	-781	-781	-781	-781	-782	-782	-783

KR4201VC3205

2024-12 콜320

1,479

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	538	535	532	527	521	513	505
-5.33%	512	500	487	472	456	439	422
-2.67%	382	358	334	311	287	263	239
0%	60	41	21	0	-21	-43	-65
2.67%	-412	-419	-428	-438	-450	-463	-477
5.33%	-938	-939	-941	-944	-949	-954	-961
8.00%	-1,473	-1,473	-1,473	-1,474	-1,475	-1,476	-1,479

KR4301VC3170

2024-12 풋317.5

350

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-335	-336	-338	-340	-343	-347	-350
-5.33%	-163	-168	-174	-180	-187	-194	-201
-2.67%	-39	-47	-55	-64	-72	-80	-89
0%	17	12	6	0	-6	-13	-20
2.67%	31	29	27	25	21	18	14
5.33%	33	32	32	31	30	29	27
8.00%	33	33	33	32	32	32	31

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

(단위:백만원)

2,900

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

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	682	0	682	

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	2024-12-05
기준일	2024-12-04

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	4,436	0	4,436	

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	2024-12-05
기준일	2024-12-04

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	13,779	0	13,779	
누계	통화	선도	310	13,889	-13,579	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E	355
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E	209
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E	547
FXW213EC2(USD/KRW 31-12-24E	25
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

488

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

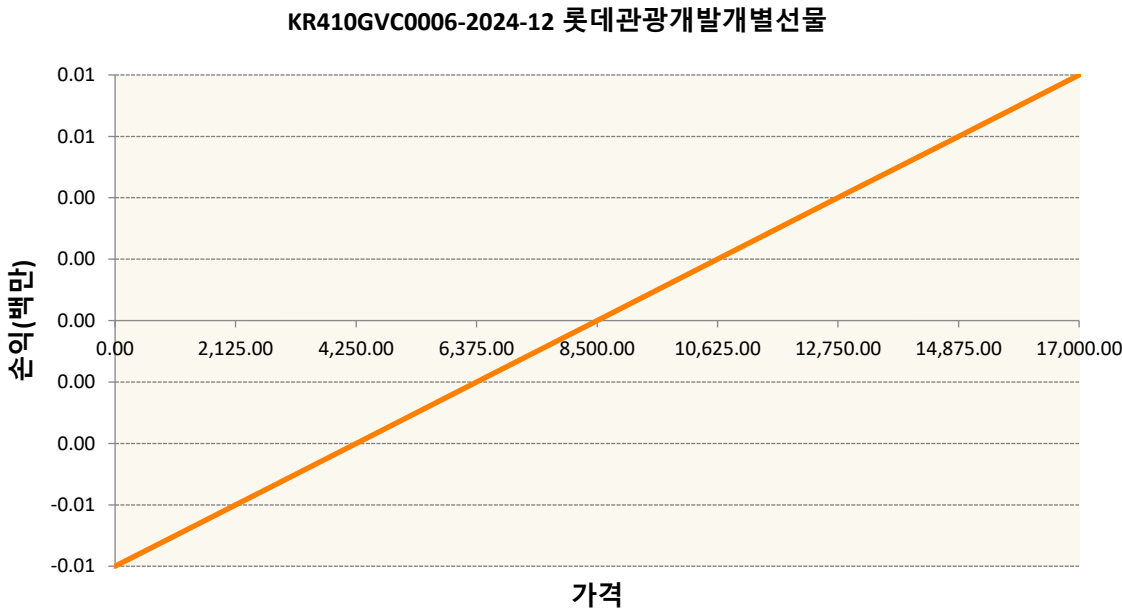
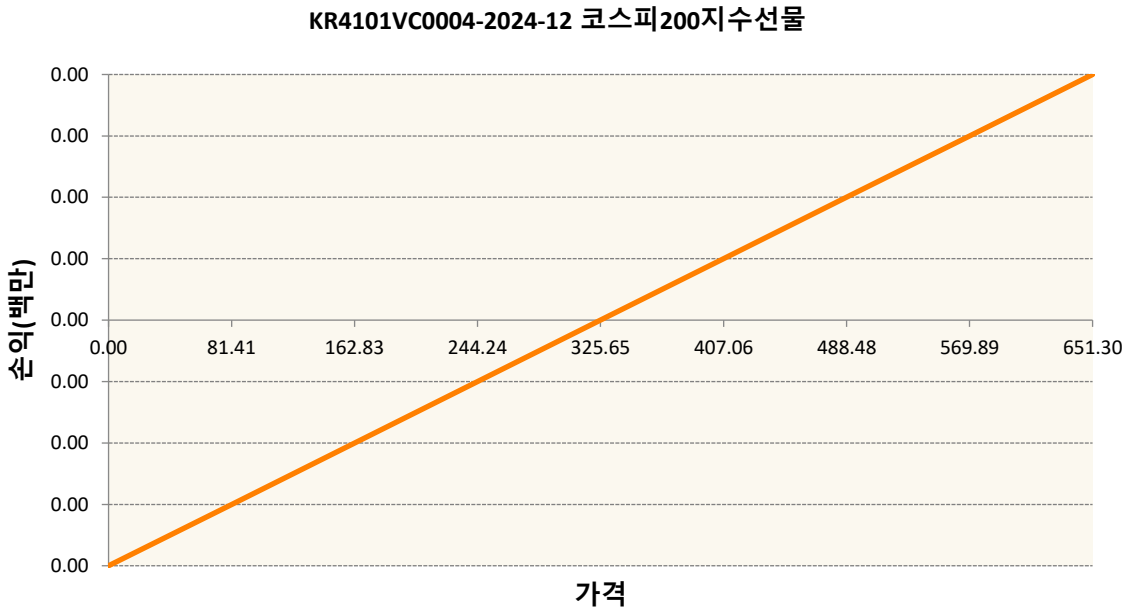
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

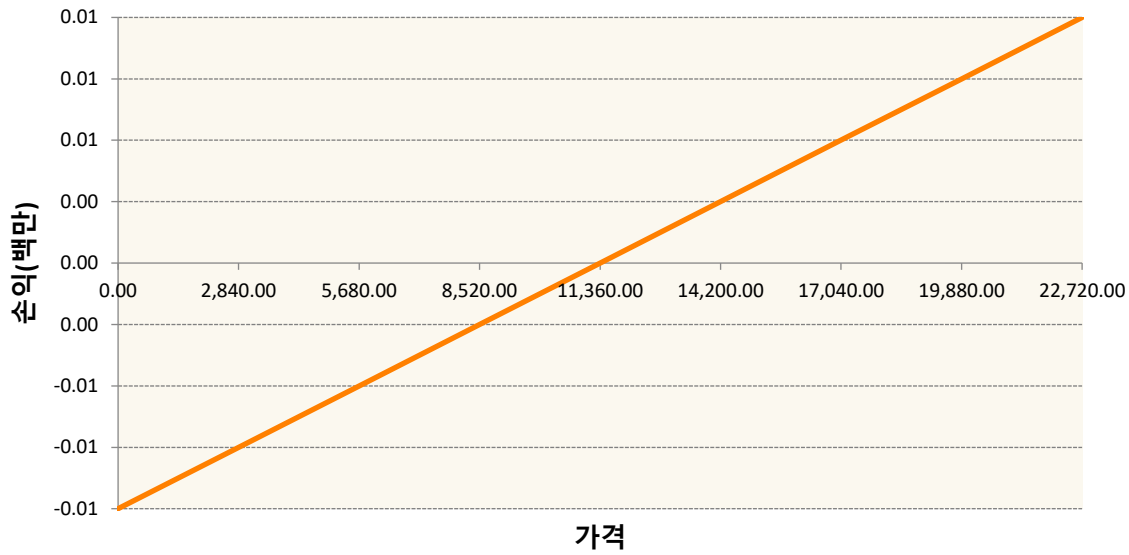
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	169	0	169	장내
누계	유가증권	선물	1,440	0	1,440	장내

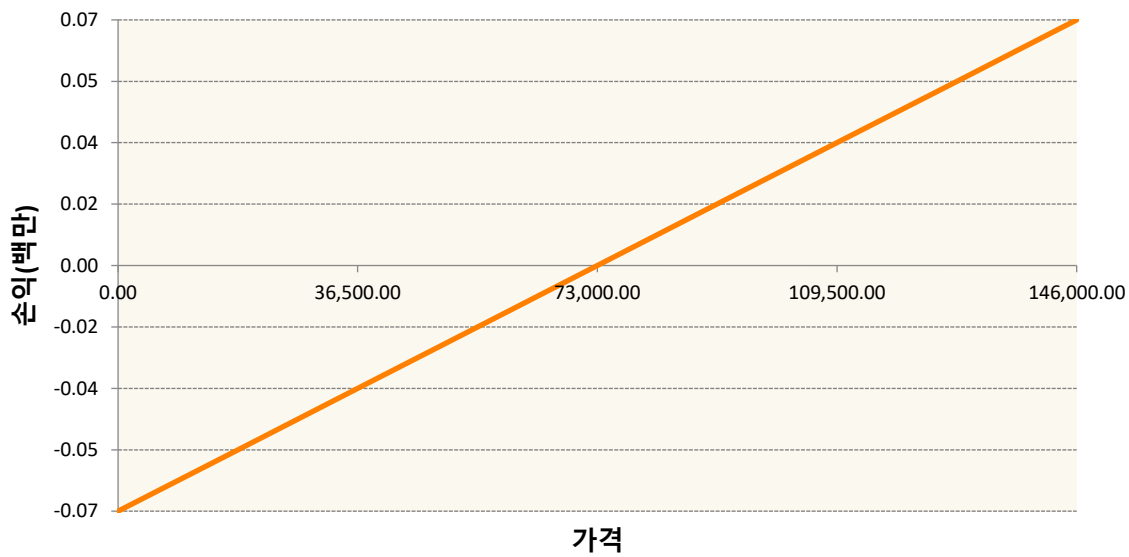
2. 만기시점의 손익구조



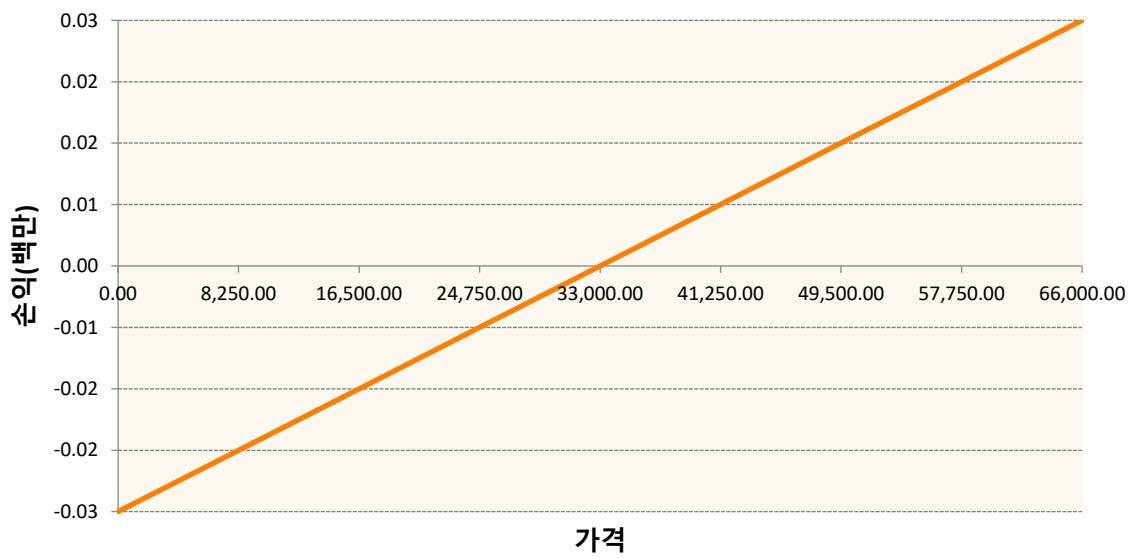
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



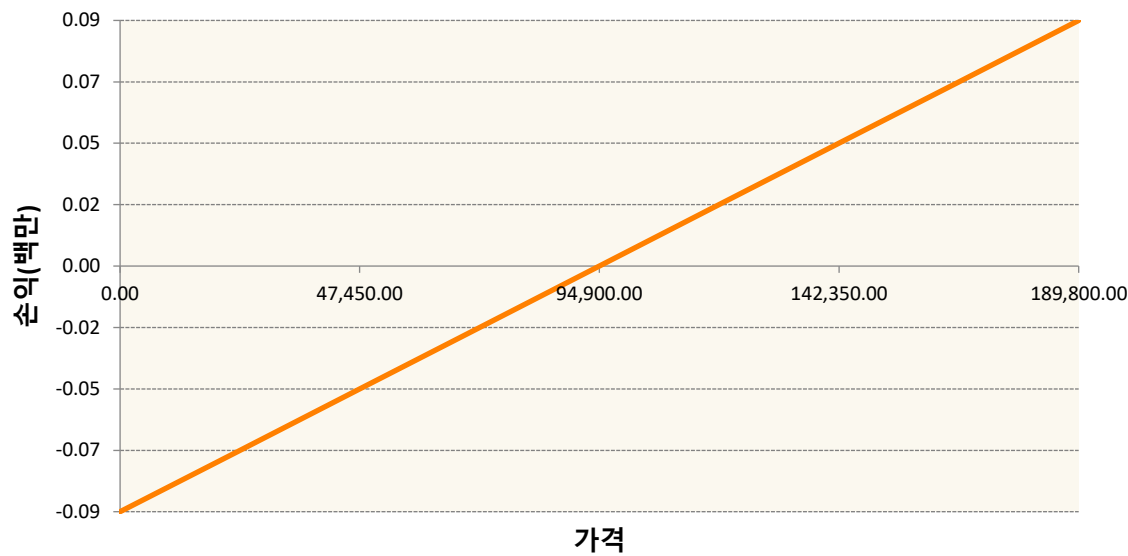
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



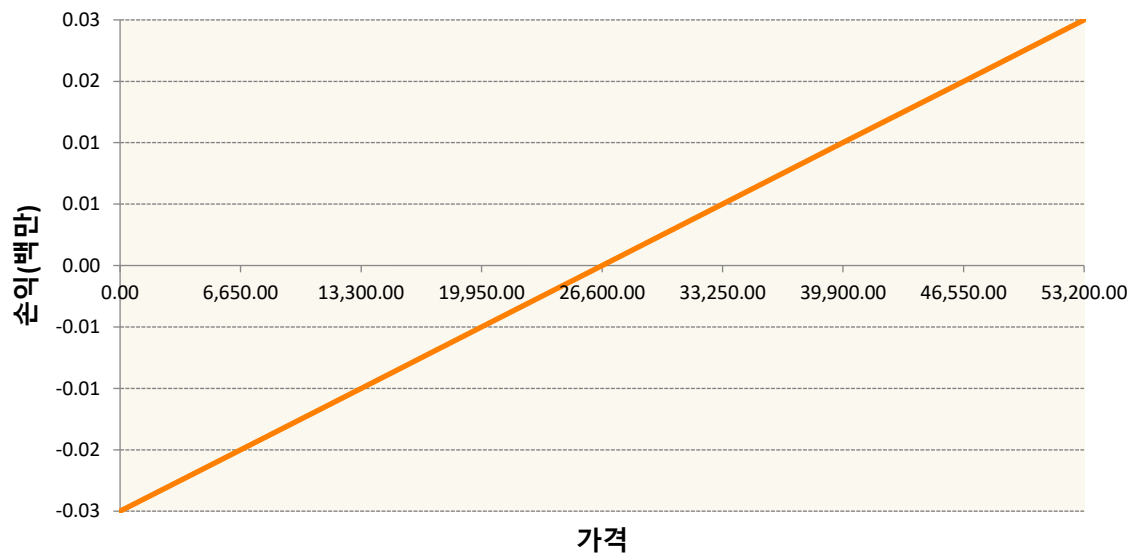
KR4128VC0003-2024-12 한국가스공사개별선물



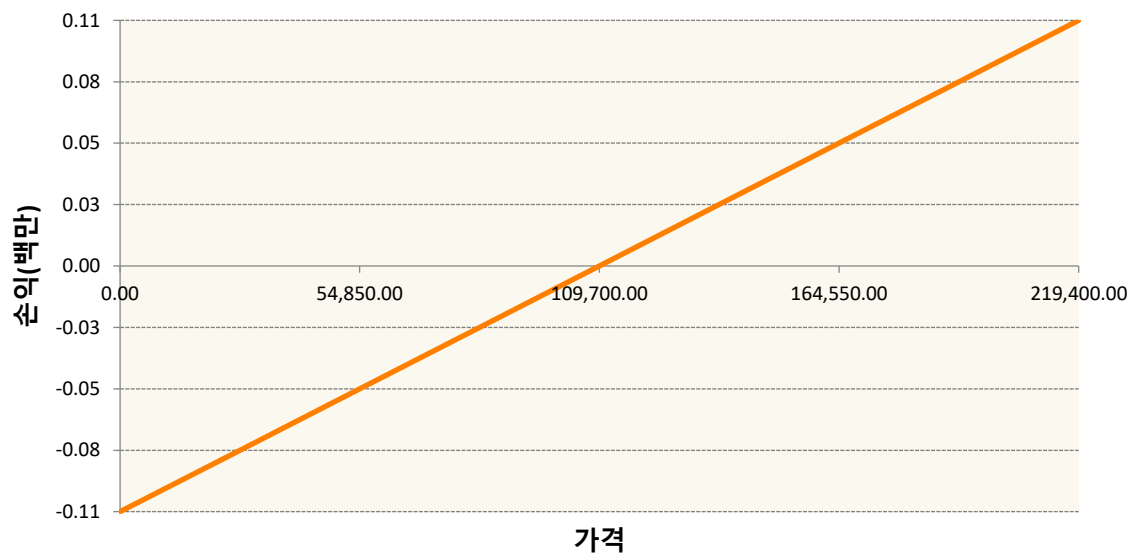
KR4146VC0001-2024-12 KB금융개별선물



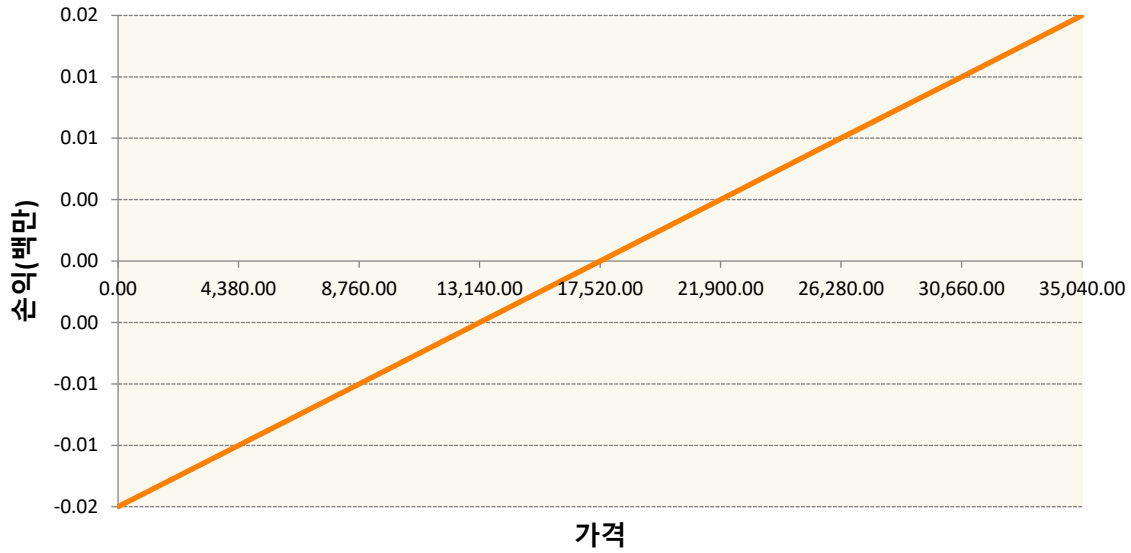
KR41BNVC0005-2024-12 현대건설개별선물



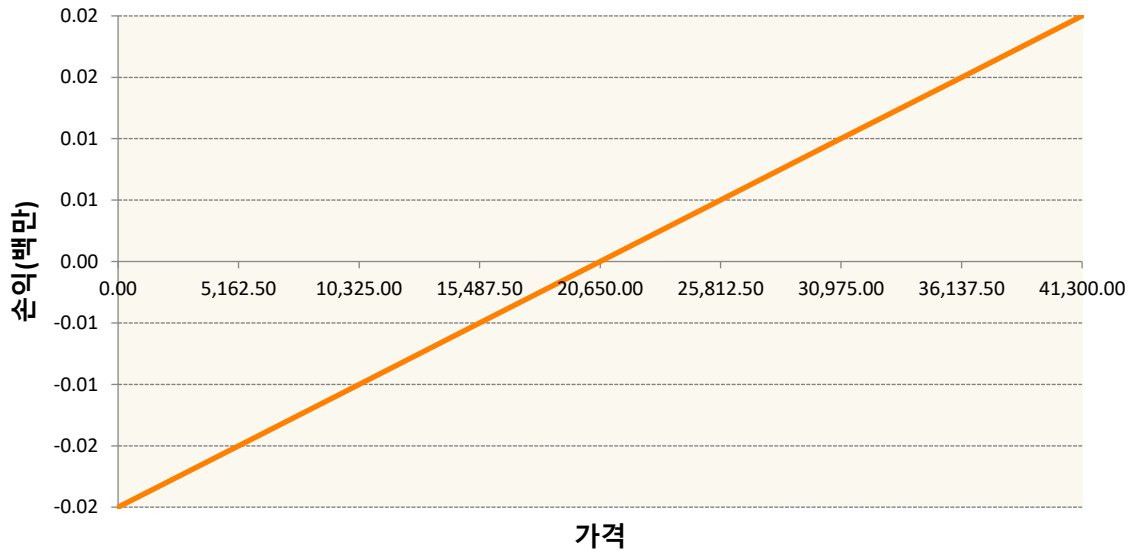
KR41C6VC0003-2024-12 아모레퍼시픽개별선물



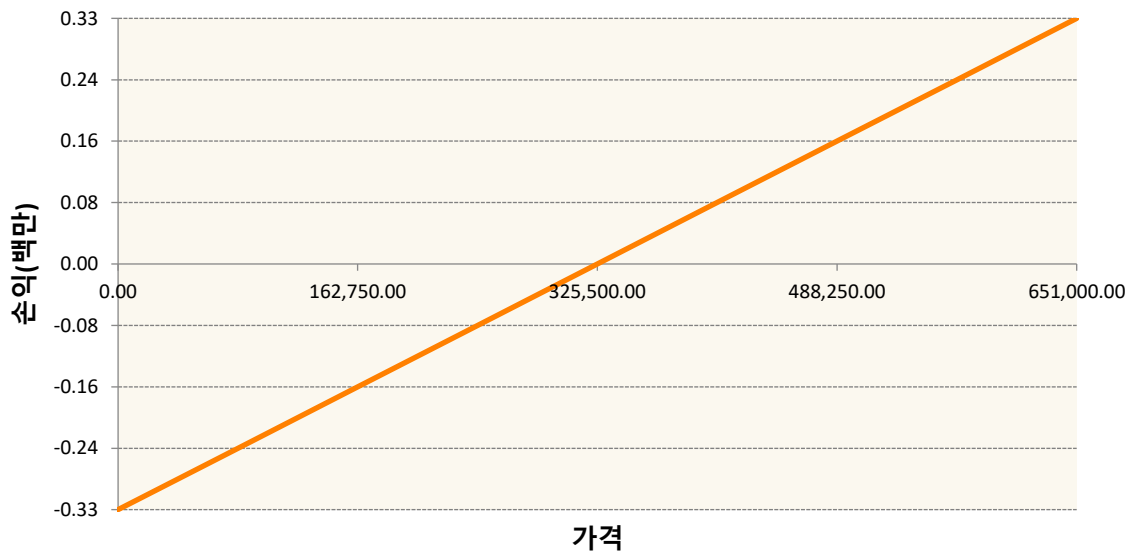
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



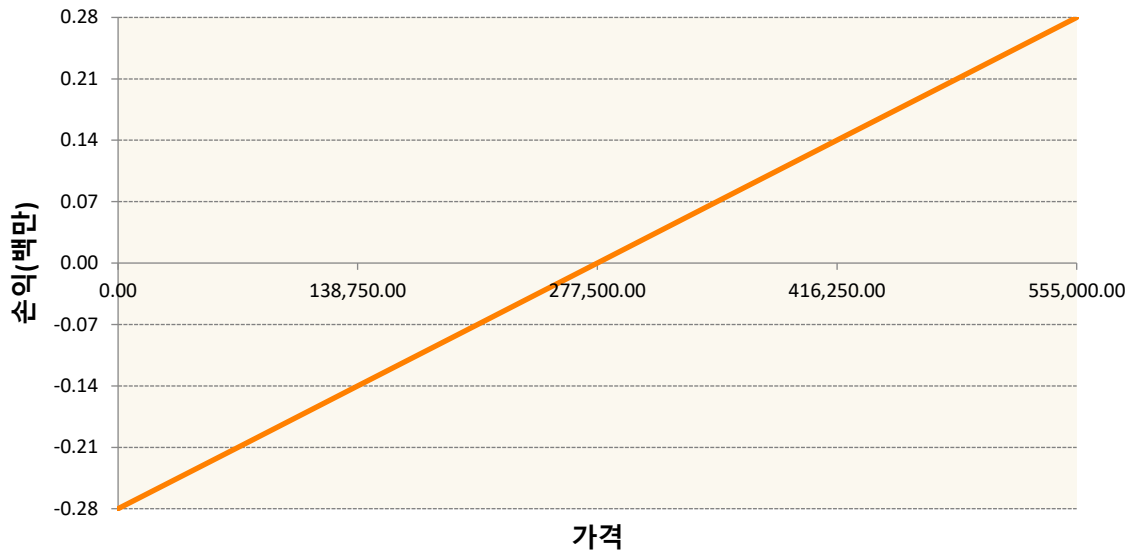
KR41CNVC0004-2024-12 포스코 ICT개별선물



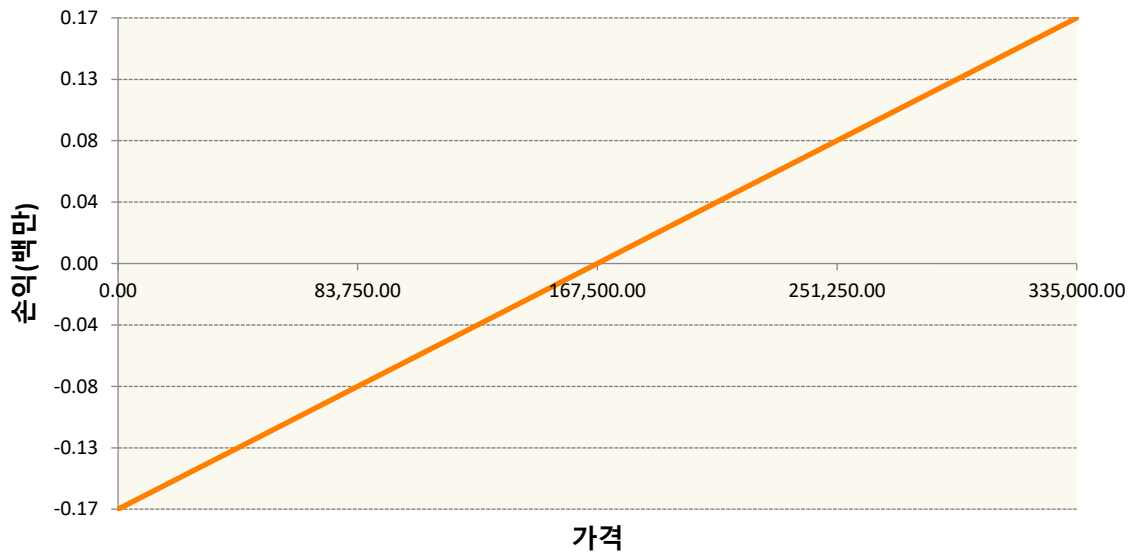
KR41CRVC0000-2024-12 LG생활건강개별선물



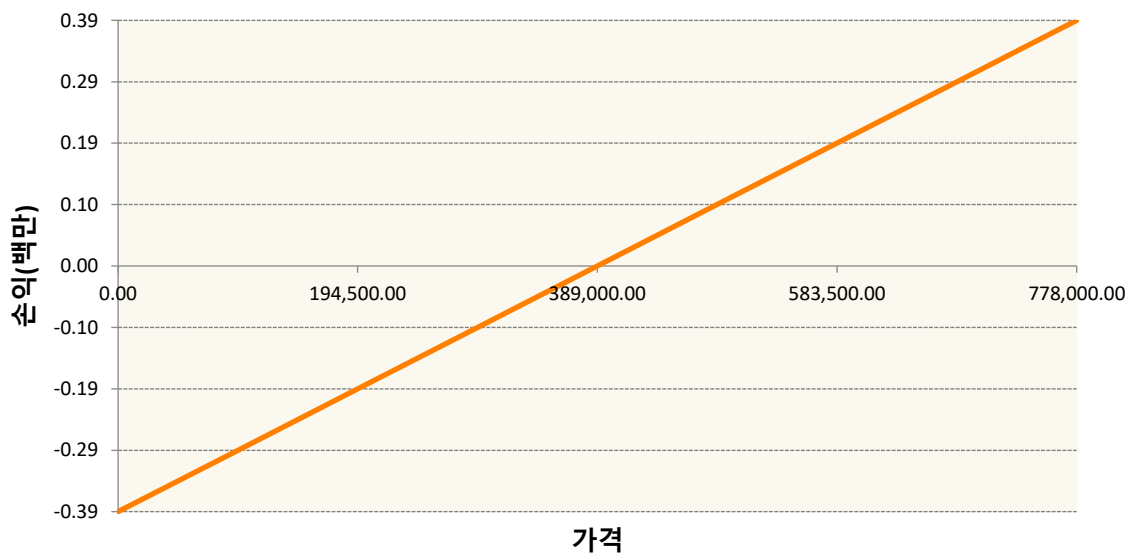
KR41D1VC0006-2024-12 CJ제일제당개별선물



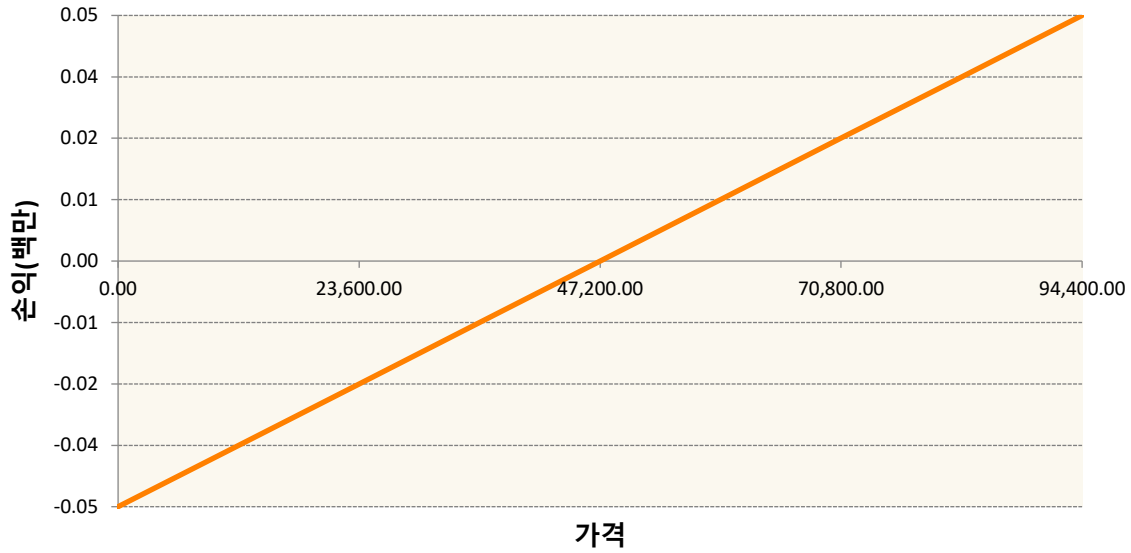
KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



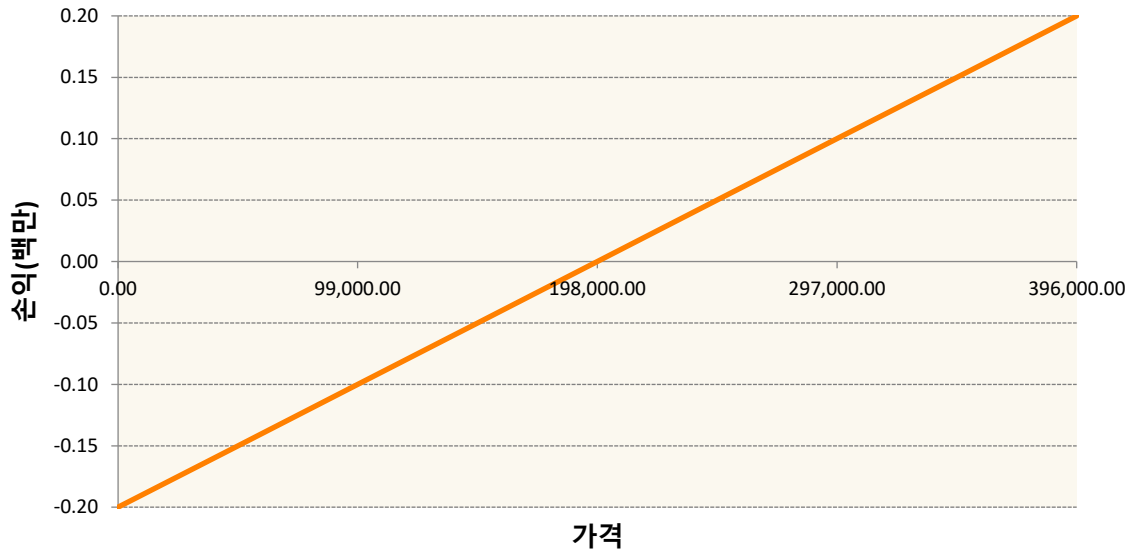
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



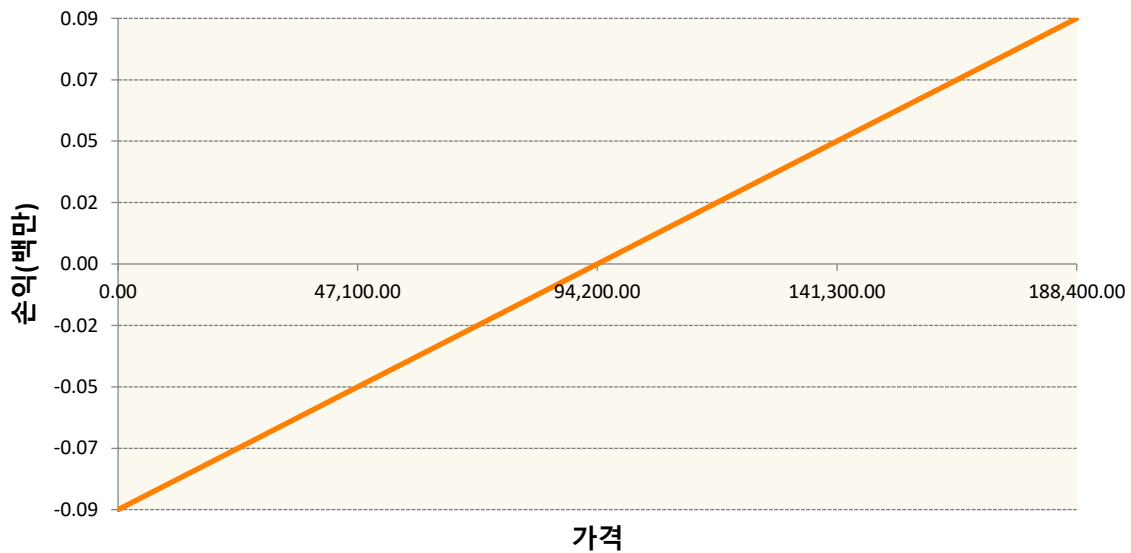
KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



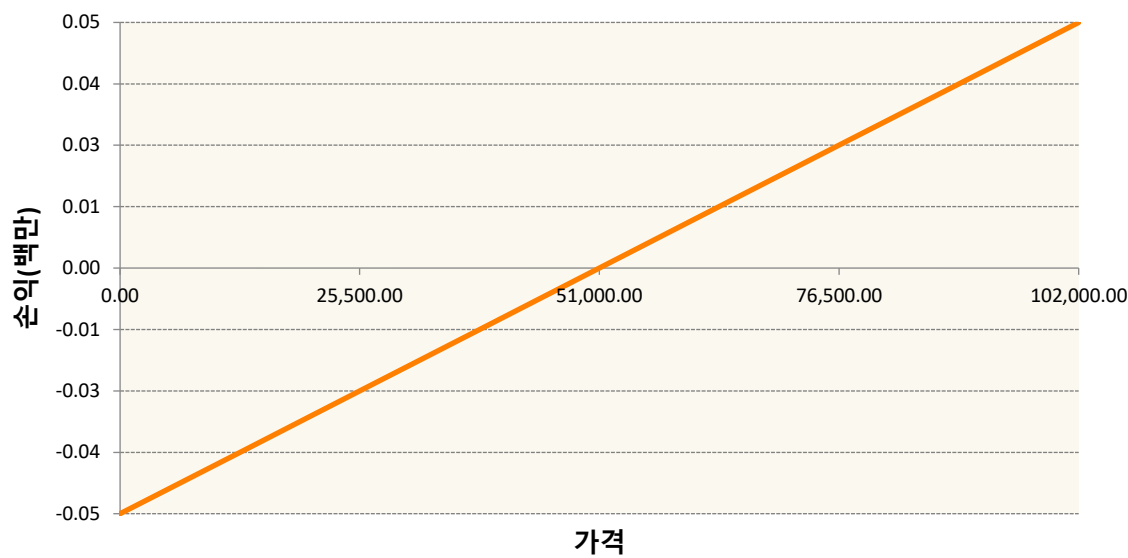
KR41FCVC0004-2024-12 하이브개별선물



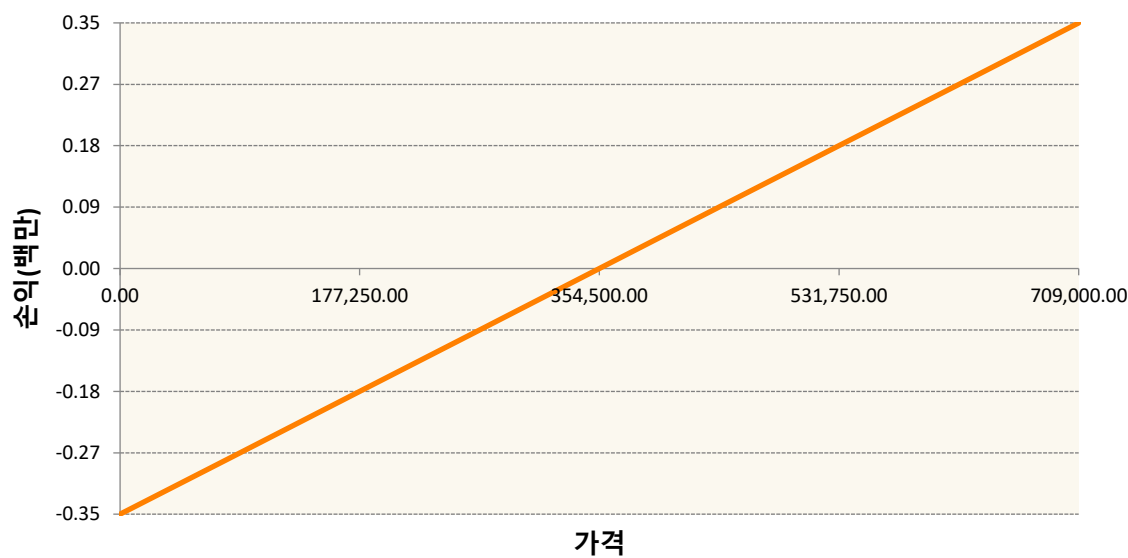
KR41FMVC0002-2024-12 엘앤에프개별선물



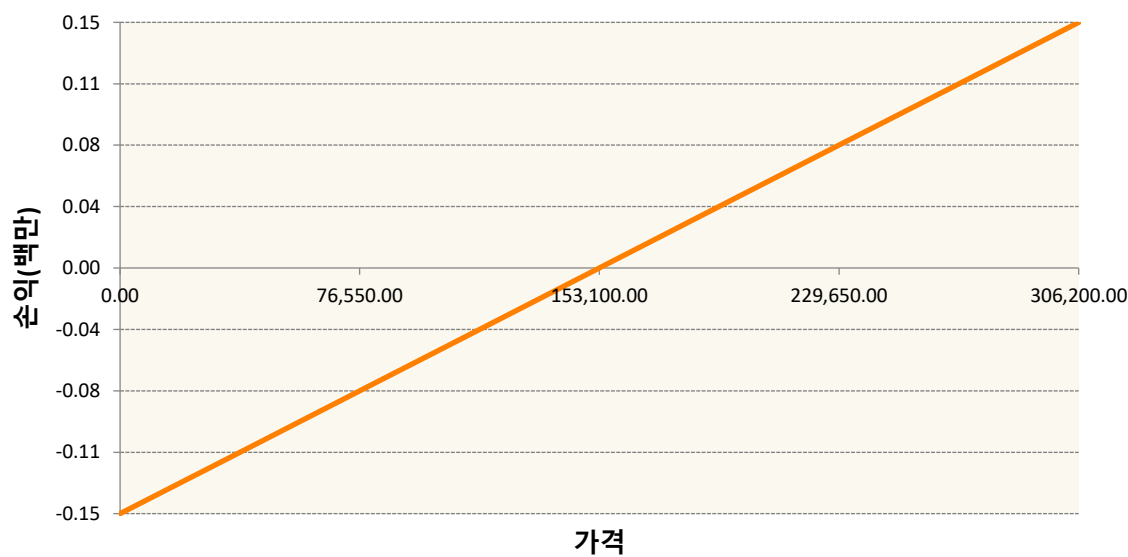
KR41G6VC0004-2024-12 현대로템개별선물



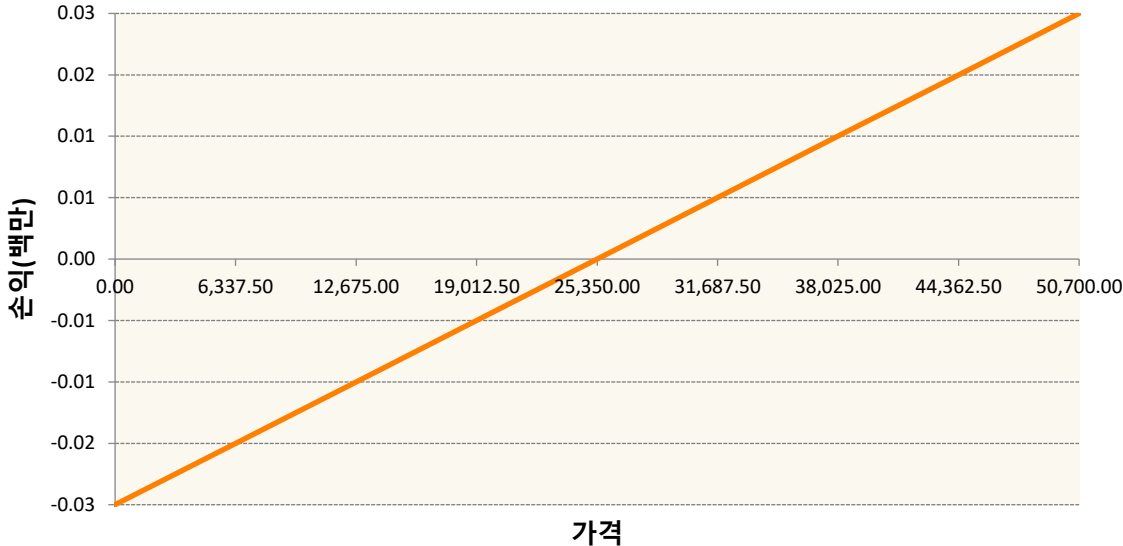
KR41GHVC0008-2024-12 HD현대일렉트릭개별선물



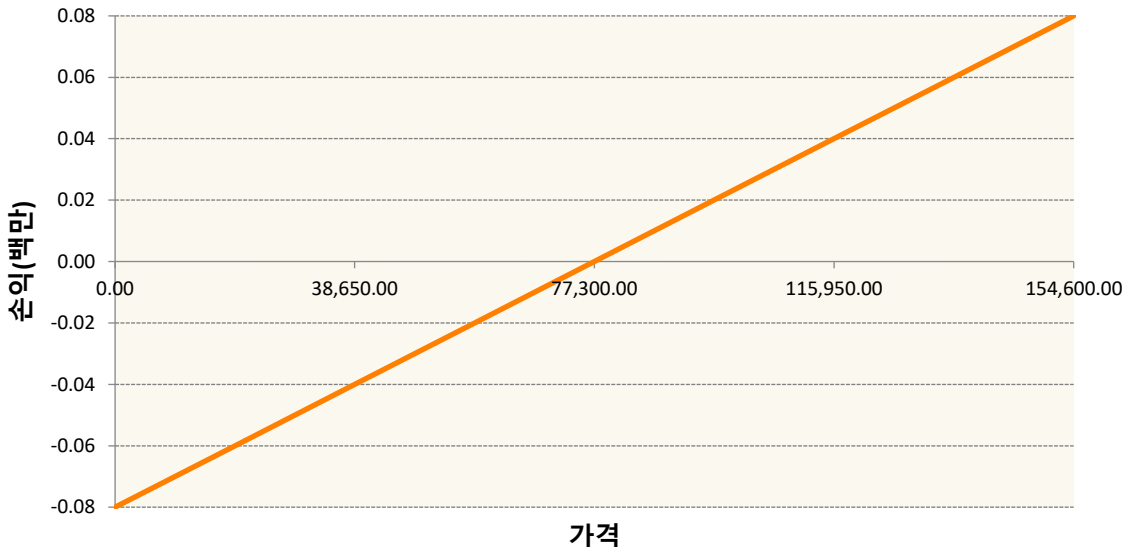
KR41GLVC0002-2024-12 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNVC0000-2024-12 금양개별선물



KR41GZVC0006-2024-12 에코프로머티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					72
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-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%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	72	72	72	72	72	72	72
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 명신산업개별선물							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

KR4128VC0003 2024-12 한국가스공사개별선물							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

KR4146VC0001 2024-12 KB금융개별선물							13
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

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
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

KR41D1VC0006 2024-12 CJ제일제당개별선물 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

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 7

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-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%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

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%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0

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

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

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)

121

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

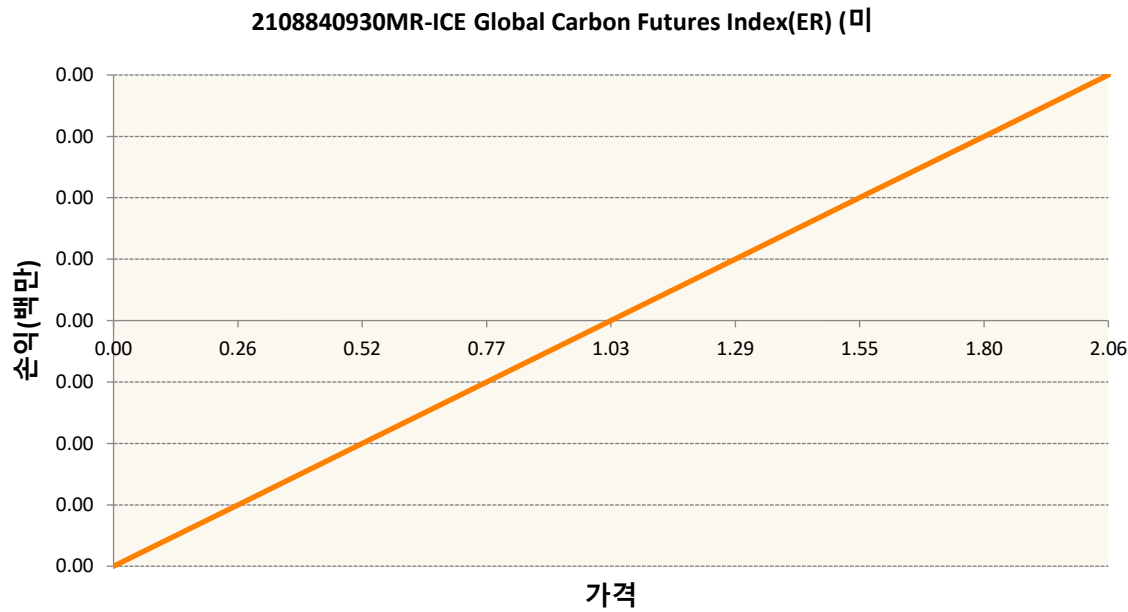
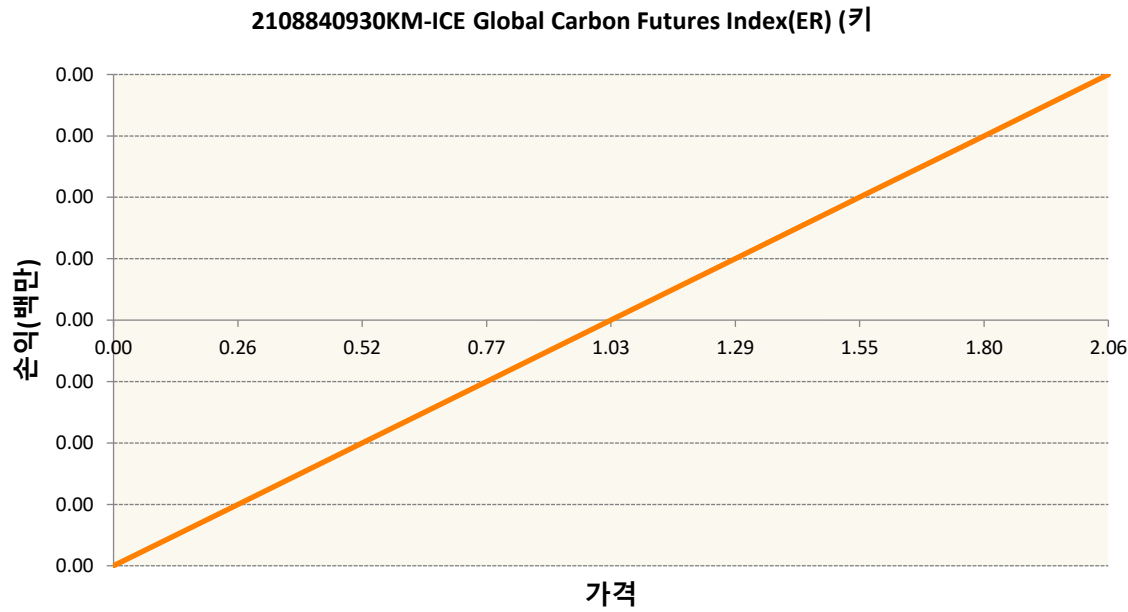
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

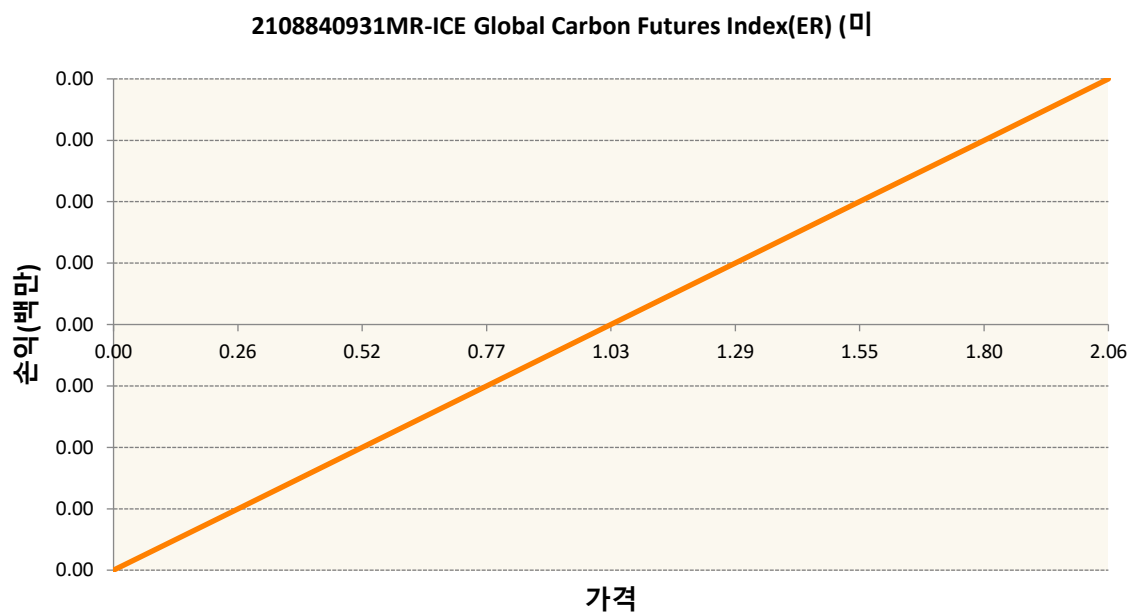
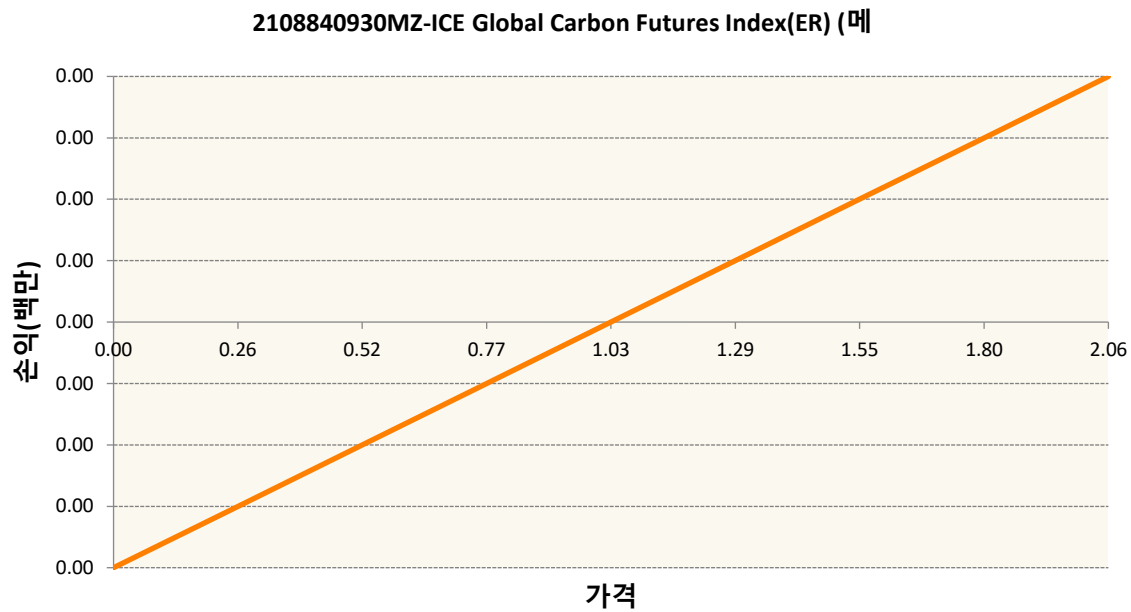
1. 계약금액

(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





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)
		990

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

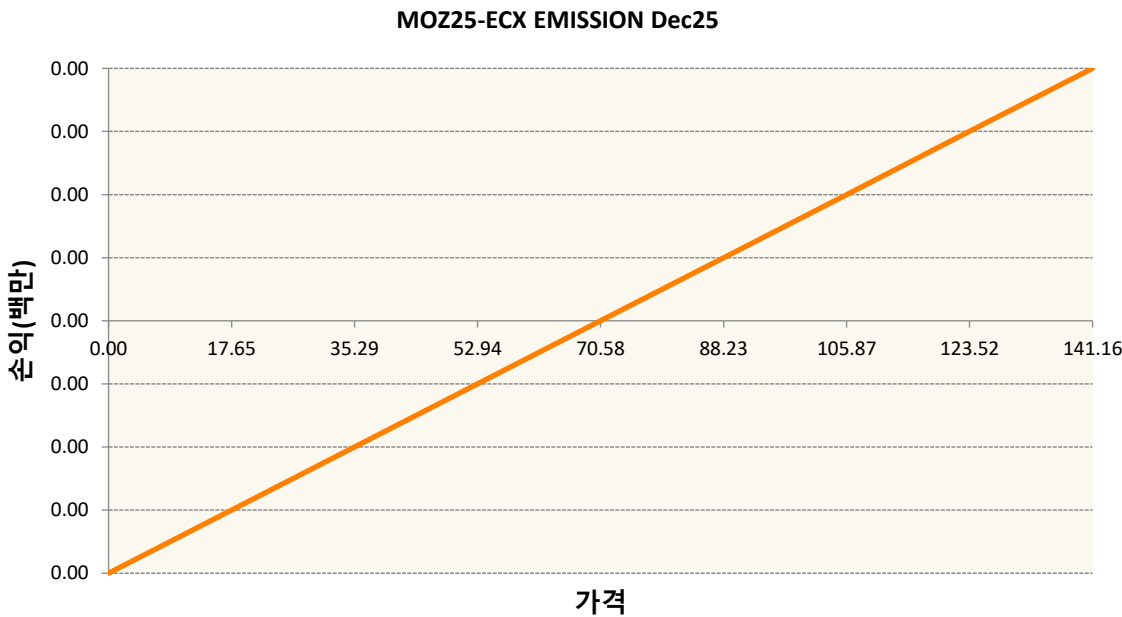
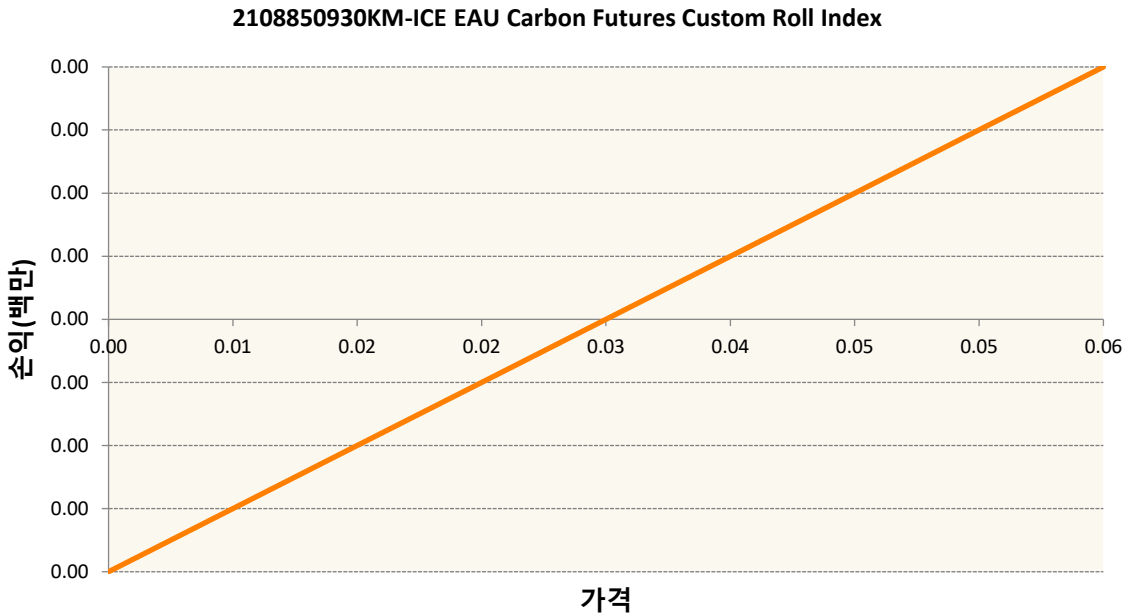
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	2,216	-2,216	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		1
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		25
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		152
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		707

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,271

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

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	2024-12-05
기준일	2024-12-04

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)	63
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	53
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	75
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	16

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

(단위:백만원)

344

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

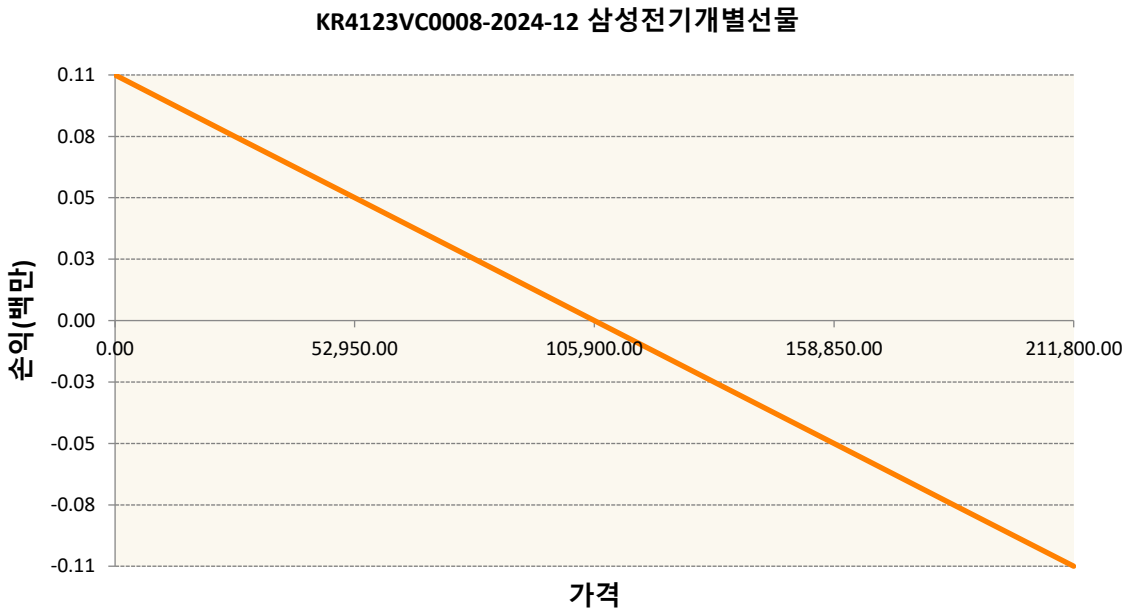
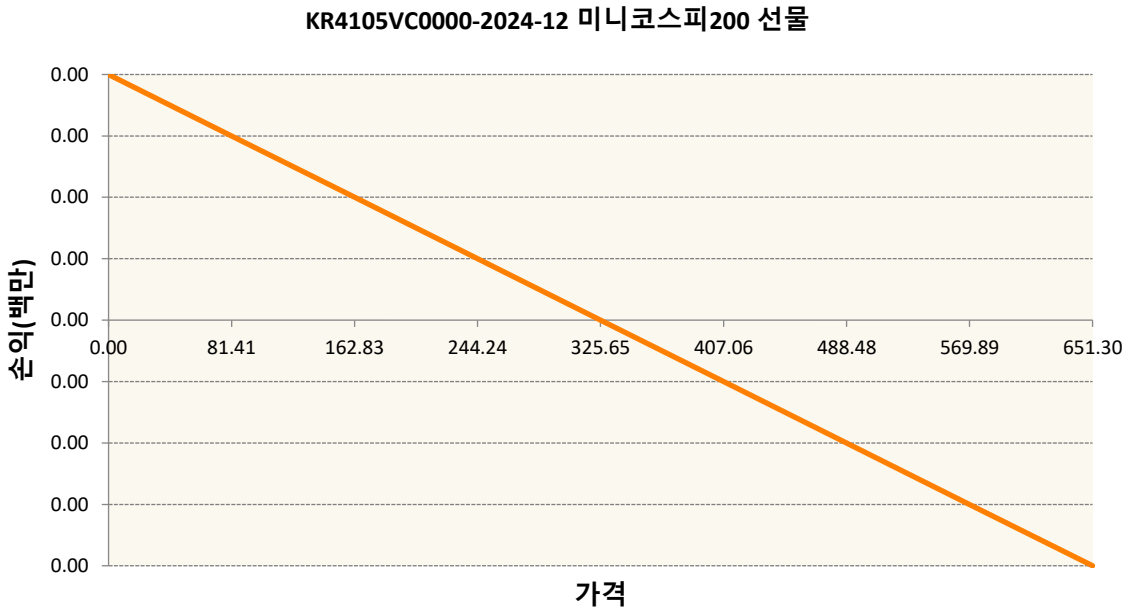
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

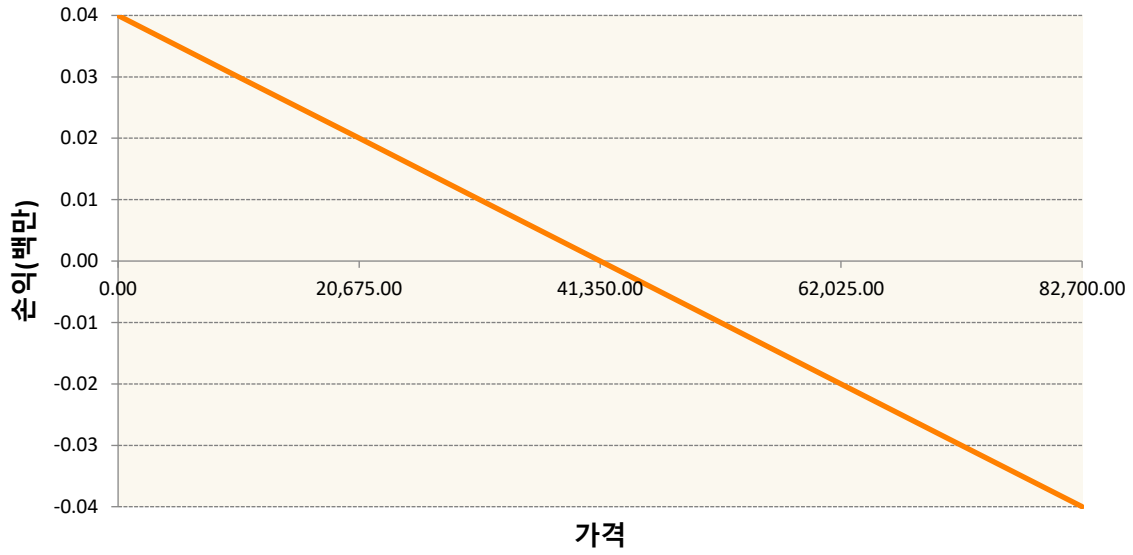
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	175	167	7	장내
누계	유가증권	선물	8	222	-214	장내

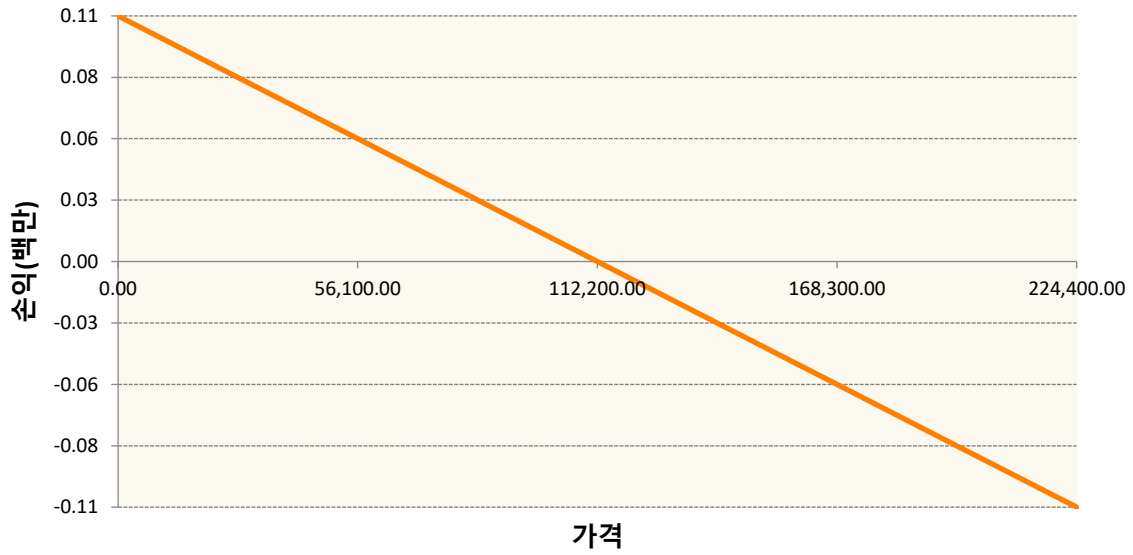
2. 만기시점의 손익구조



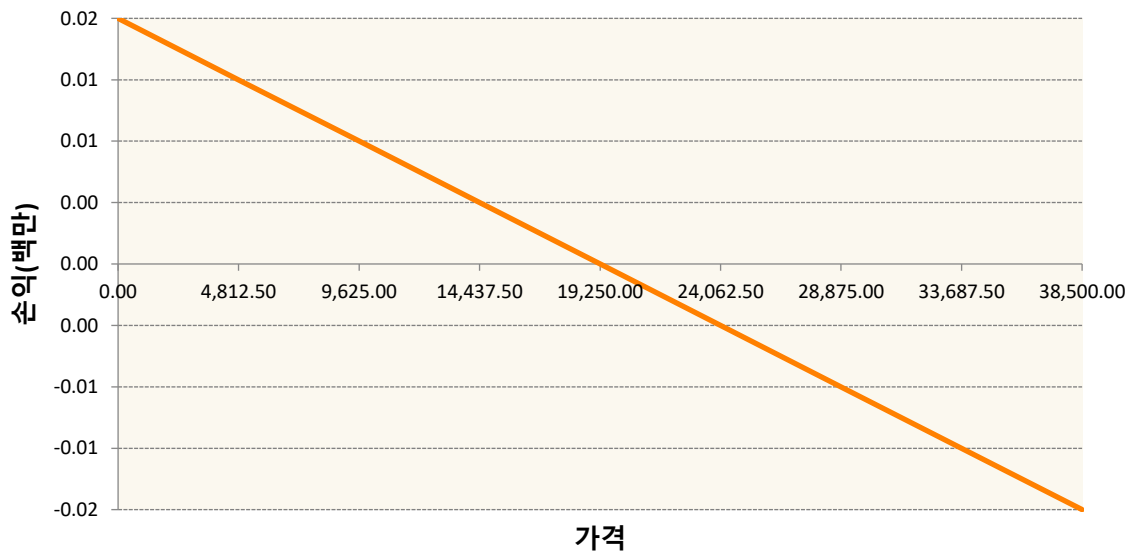
KR4135VC0004-2024-12 GS개별선물



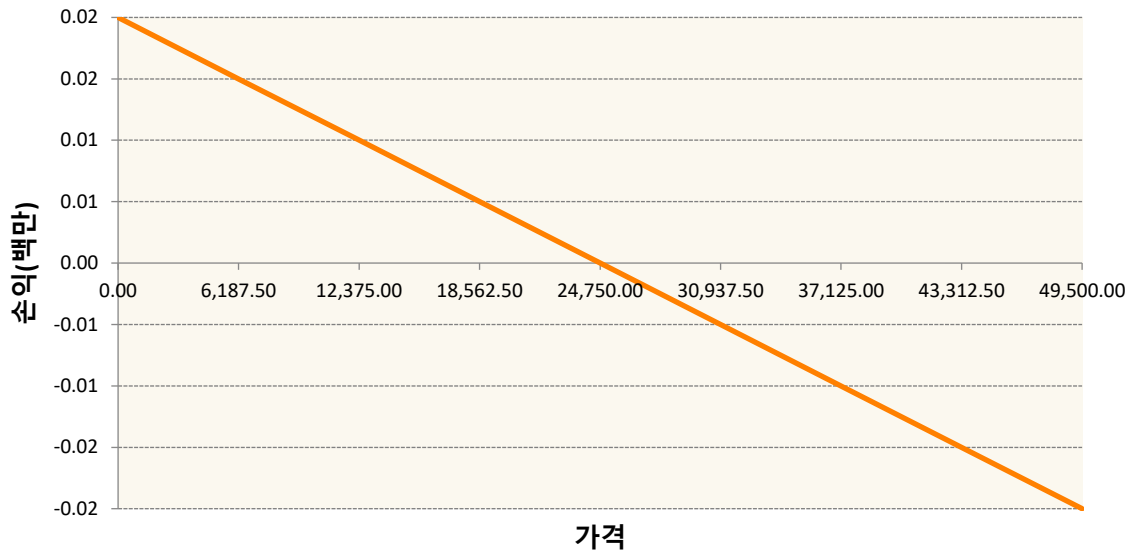
KR4141VC0006-2024-12 SK이노베이션개별선물



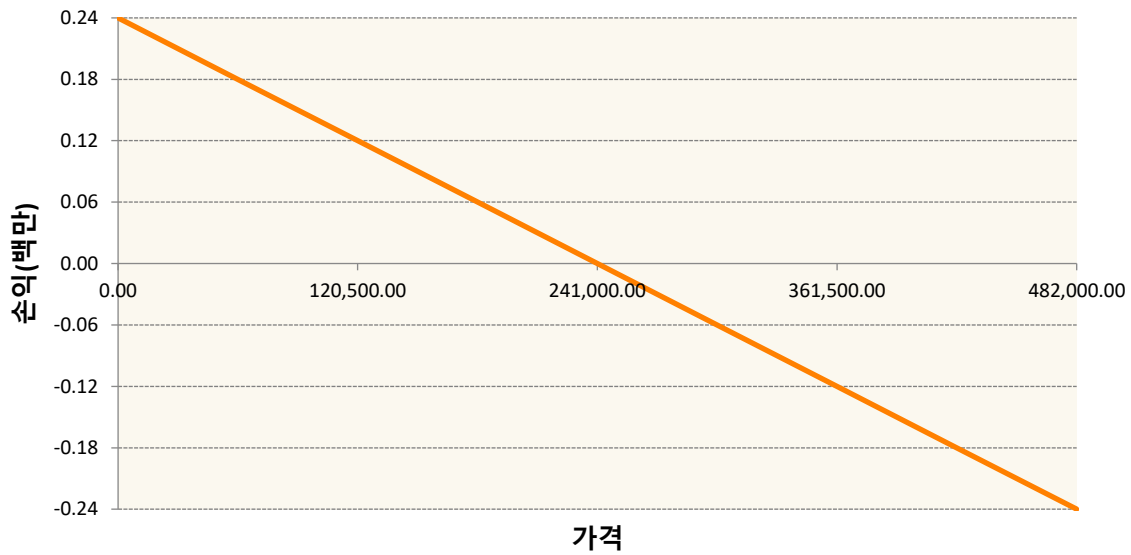
KR4151VC0003-2024-12 GS건설개별선물



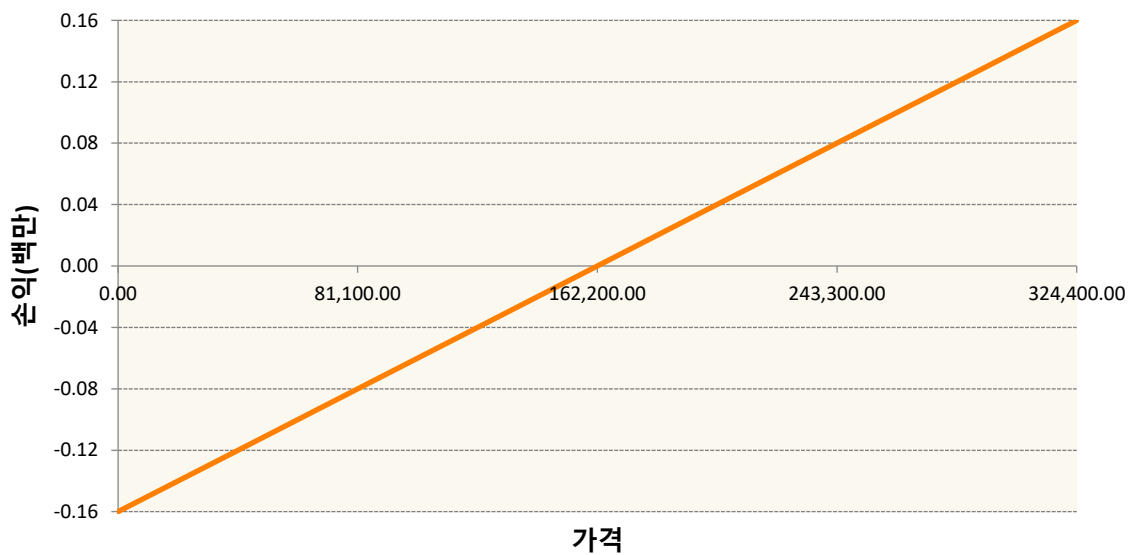
KR4157VC0007-2024-12 대한항공개별선물



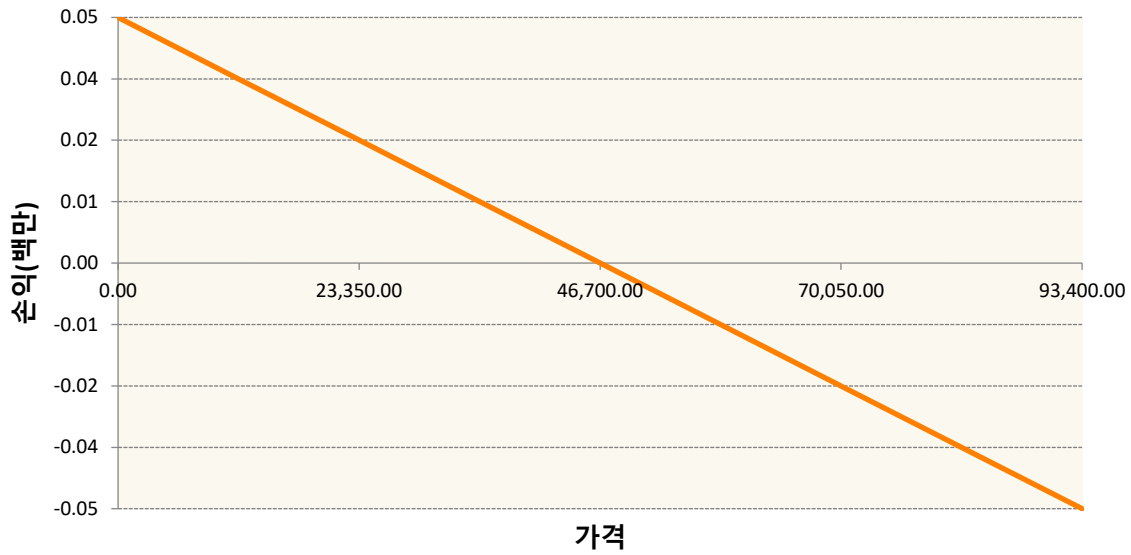
KR41BJVC0001-2024-12 엔씨소프트개별선물



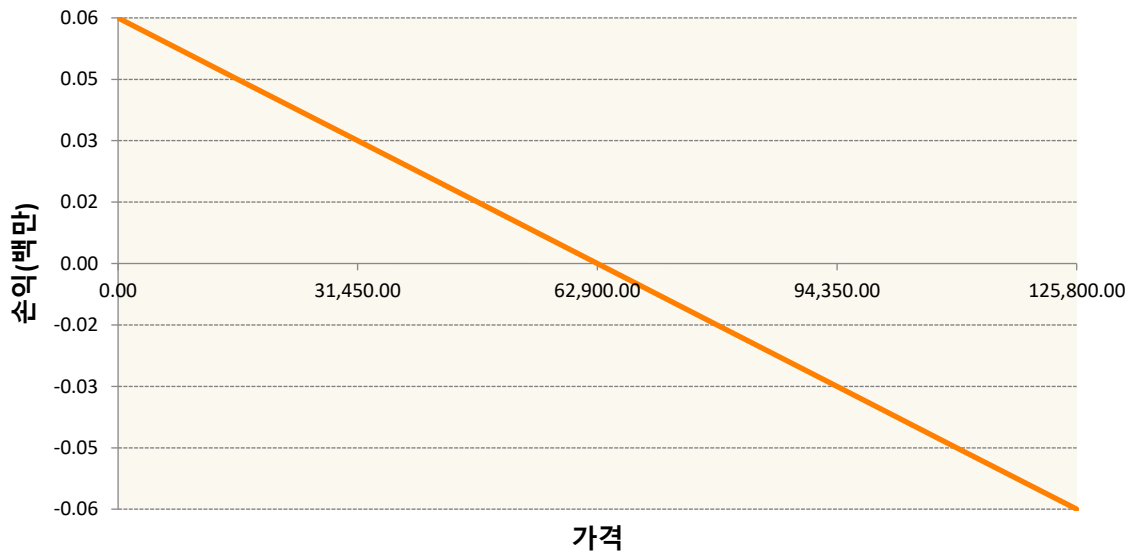
KR41BYVC0002-2024-12 LG이노텍개별선물



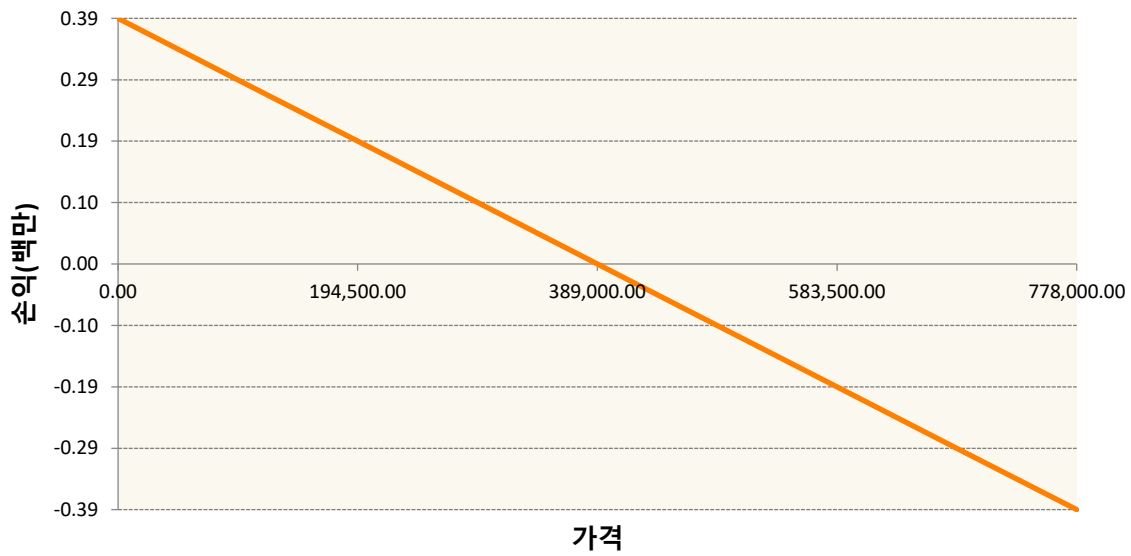
KR41CFVC0004-2024-12 카카오개별선물



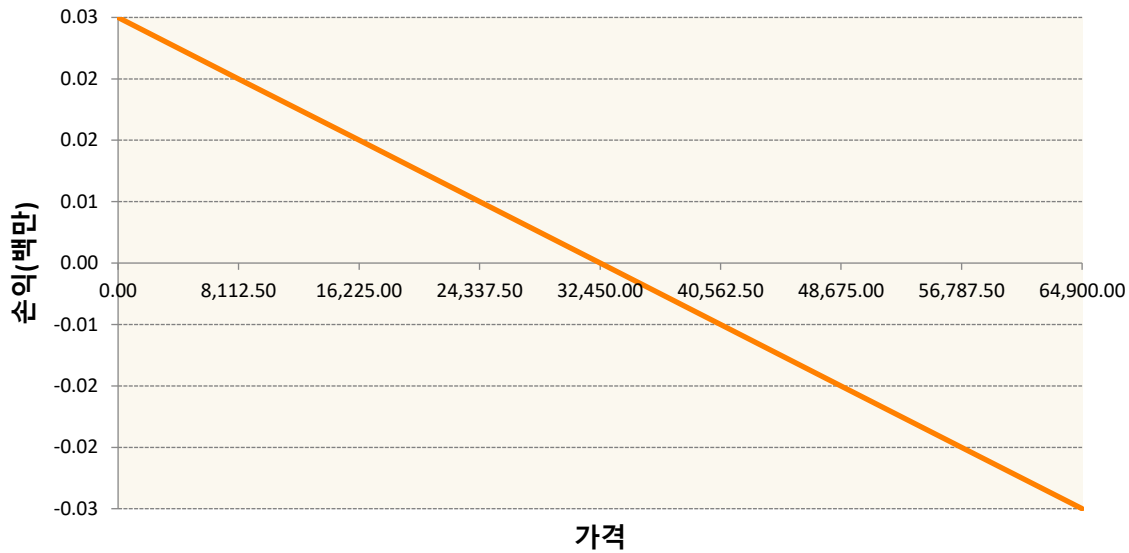
KR41DTVC0007-2024-12 CJ ENM개별선물



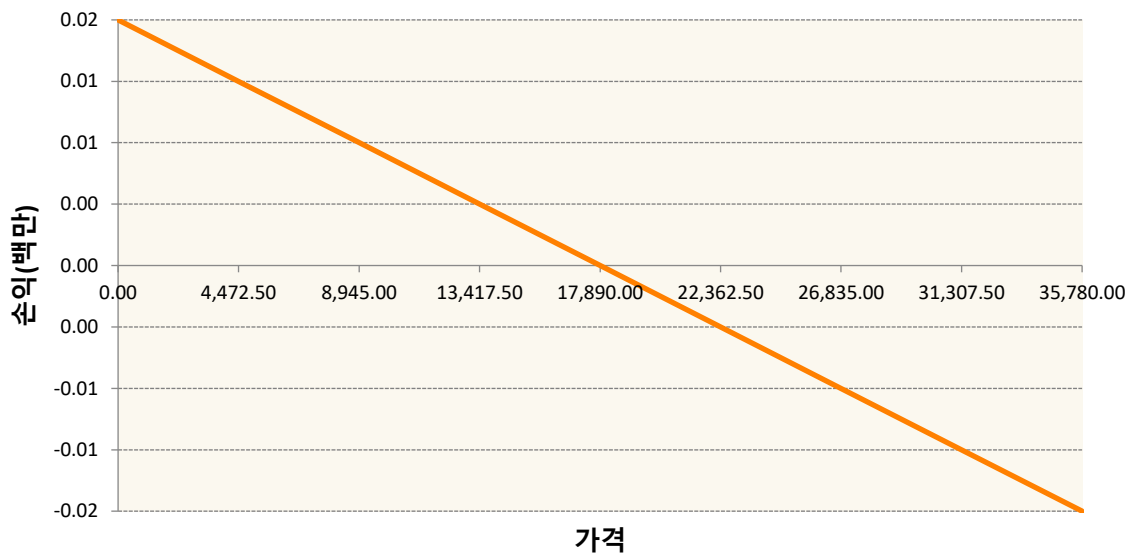
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7VC0005-2024-12 카카오페이개별선물



KR41FAVC0006-2024-12 HMM개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105VC00 2024-12 미니코스피200 선물	3
KR4123VC00 2024-12 삼성전기개별선물	1
KR4135VC00 2024-12 GS개별선물	0.17
KR4141VC00 2024-12 SK이노베이션개별선물	0.18
KR4151VC00 2024-12 GS건설개별선물	0.28
KR4157VC00 2024-12 대한항공개별선물	0.36
KR41BJVC00 2024-12 엔씨소프트개별선물	1
KR41BYVC00 2024-12 LG이노텍개별선물	1
KR41CFVC00 2024-12 카카오개별선물	1
KR41DTVC00 2024-12 CJ ENM개별선물	0.25
KR41F5VC00 2024-12 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F7VC00 2024-12 카카오페이개별선물	0.31

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

(단위:백만원)

15

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

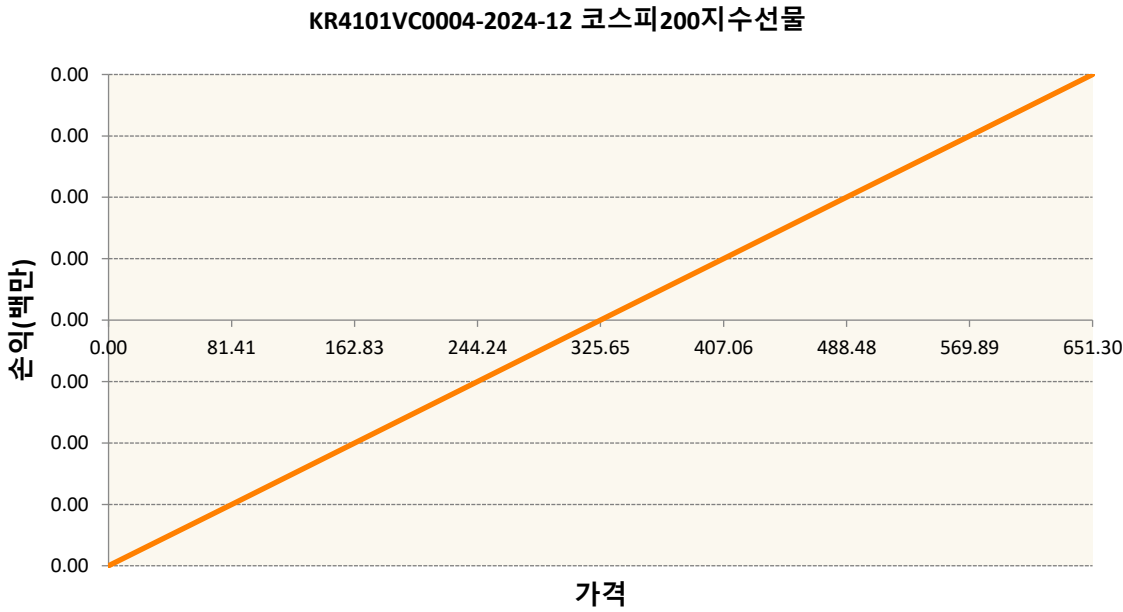
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	7,327	0	7,327	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					588
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-588	-588	-588	-588	-588	-588	-588
-5.33%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
-2.67%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	196	196	196	196	196	196	196
5.33%	392	392	392	392	392	392	392
8.00%	588	588	588	588	588	588	588

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

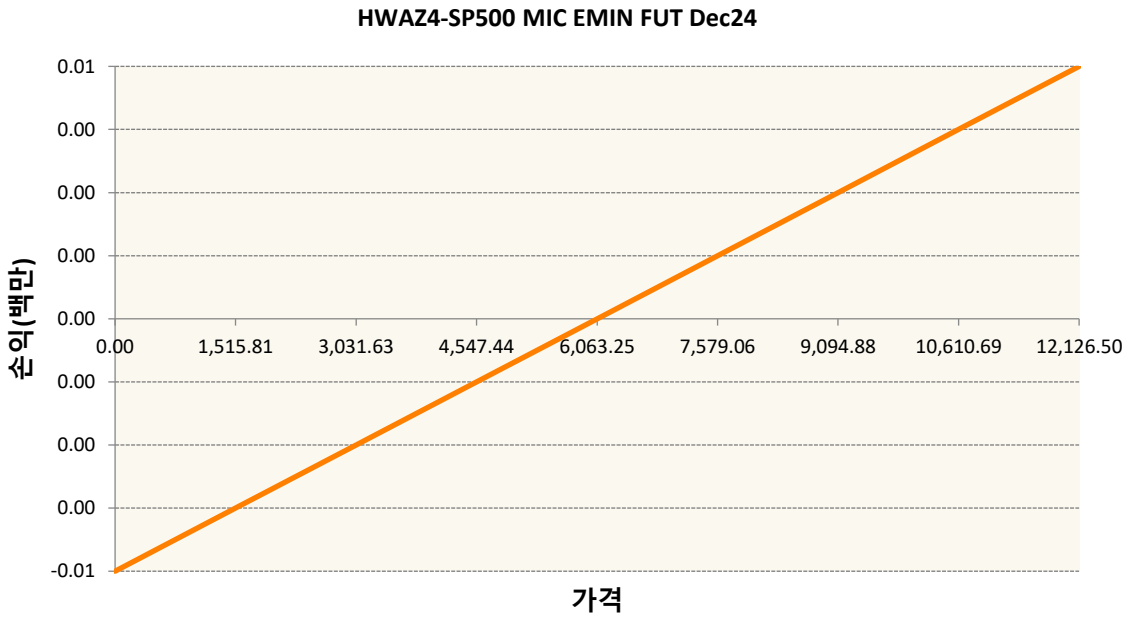
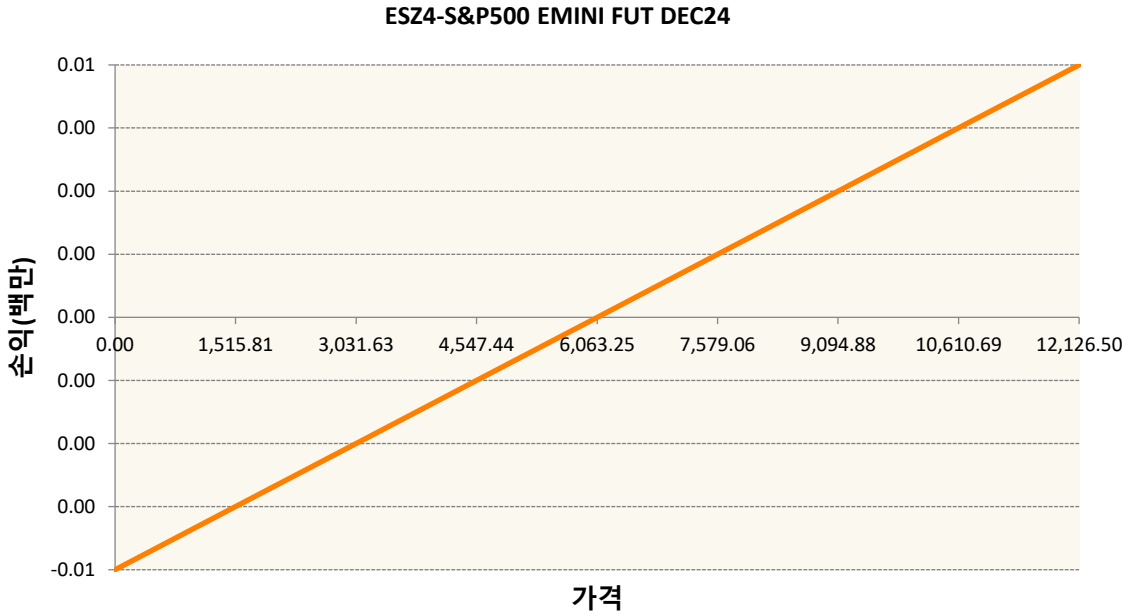
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	20,318	0	20,318	
누계	유가증권	선물	1,997	0	1,997	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,625
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	160

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,089

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

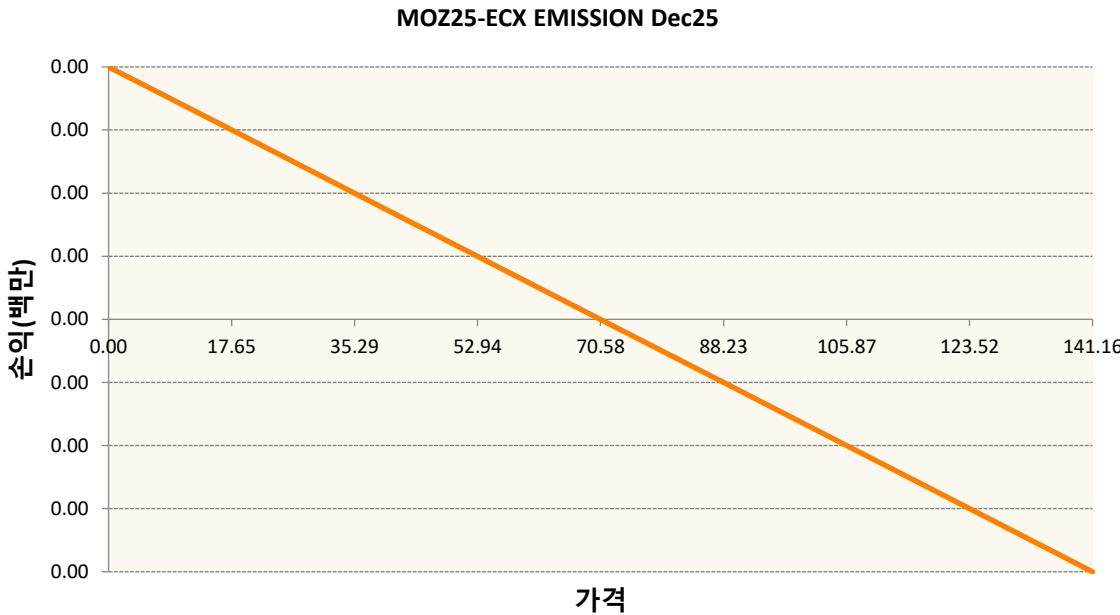
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,398	-5,408	
누계	통화	선도	0	1,142	-1,142	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E	91
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	432

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

(단위:백만원)

768

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

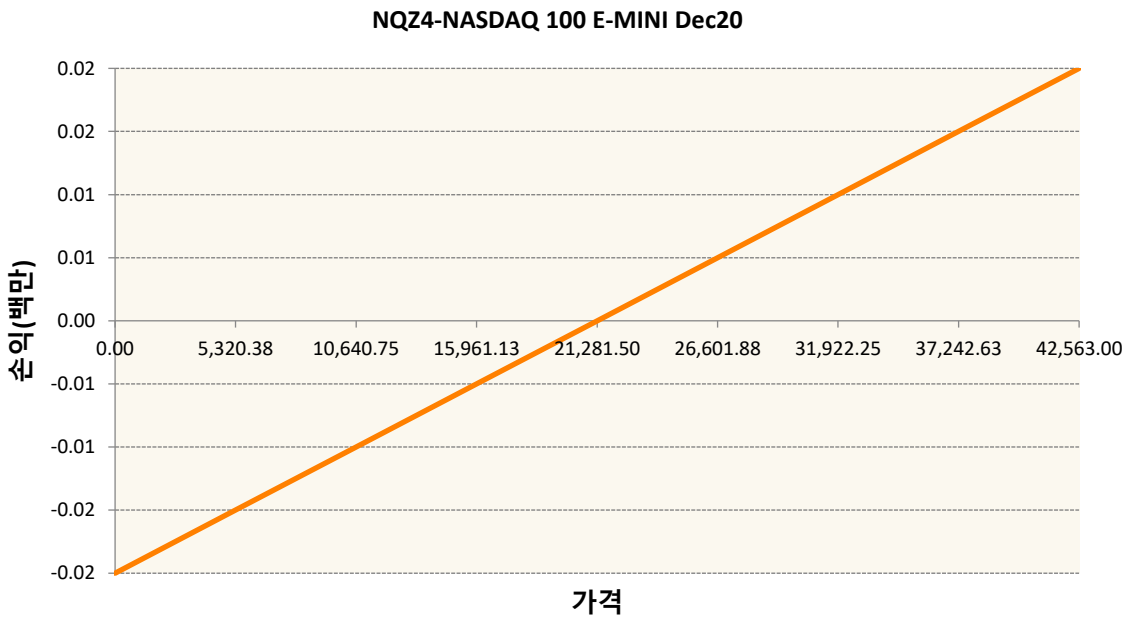
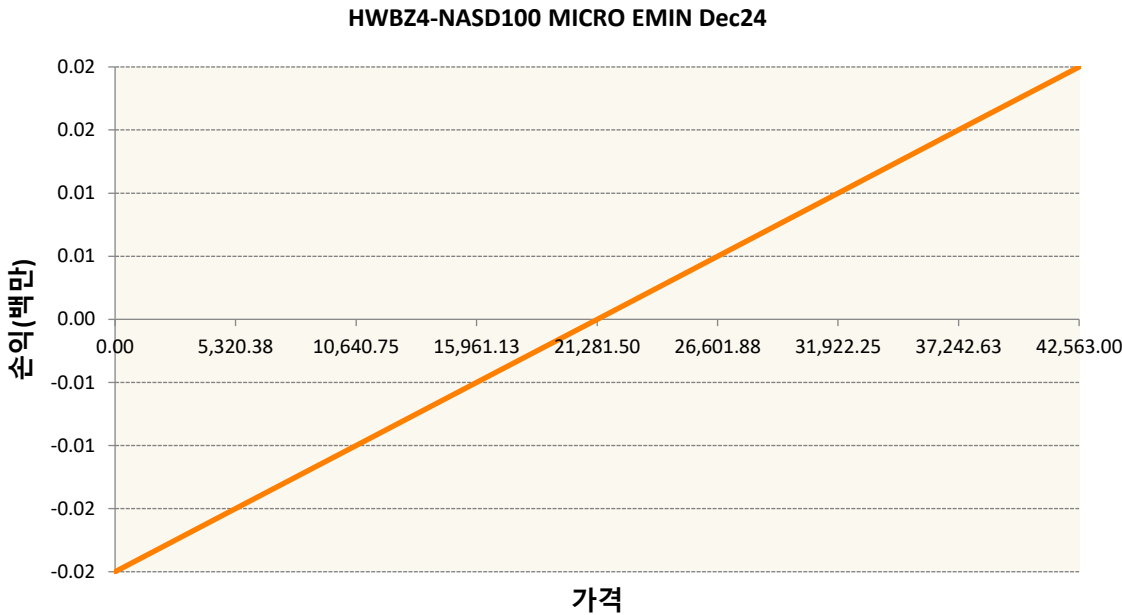
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	11,032	0	11,032	
누계	유가증권	선물	1,347	0	1,347	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		108
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		883

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			820

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

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	203,895	0	203,895	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	716
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,814
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,300
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,708

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

(단위:백만원)

9,868

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

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	20
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	20
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	20
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	20

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

(단위:백만원)

85

공시일	2024-12-05
기준일	2024-12-04

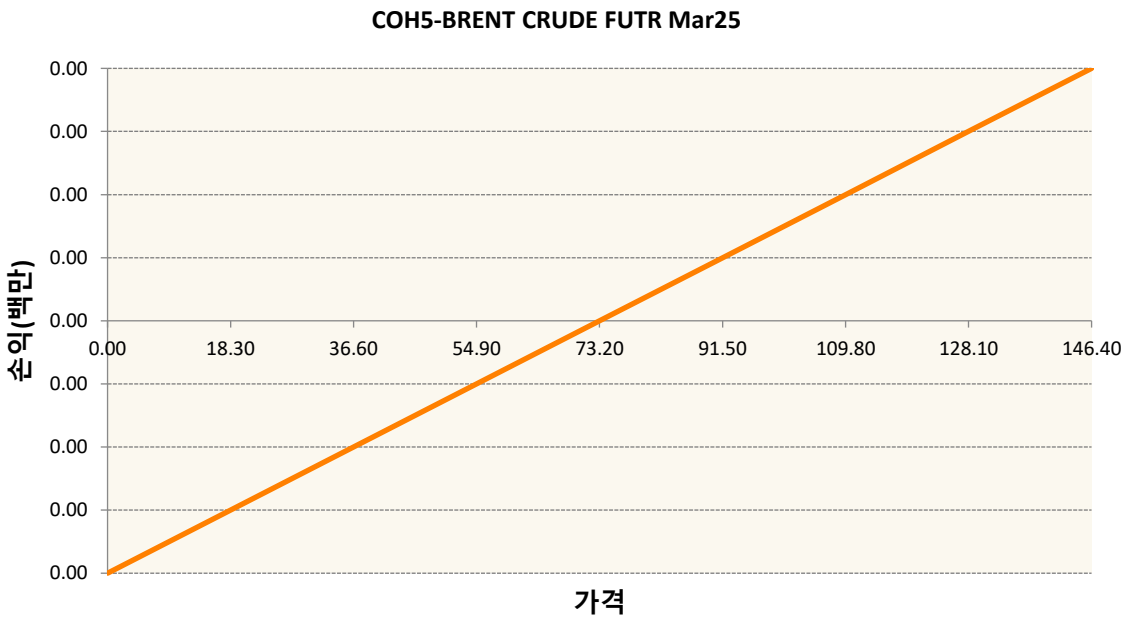
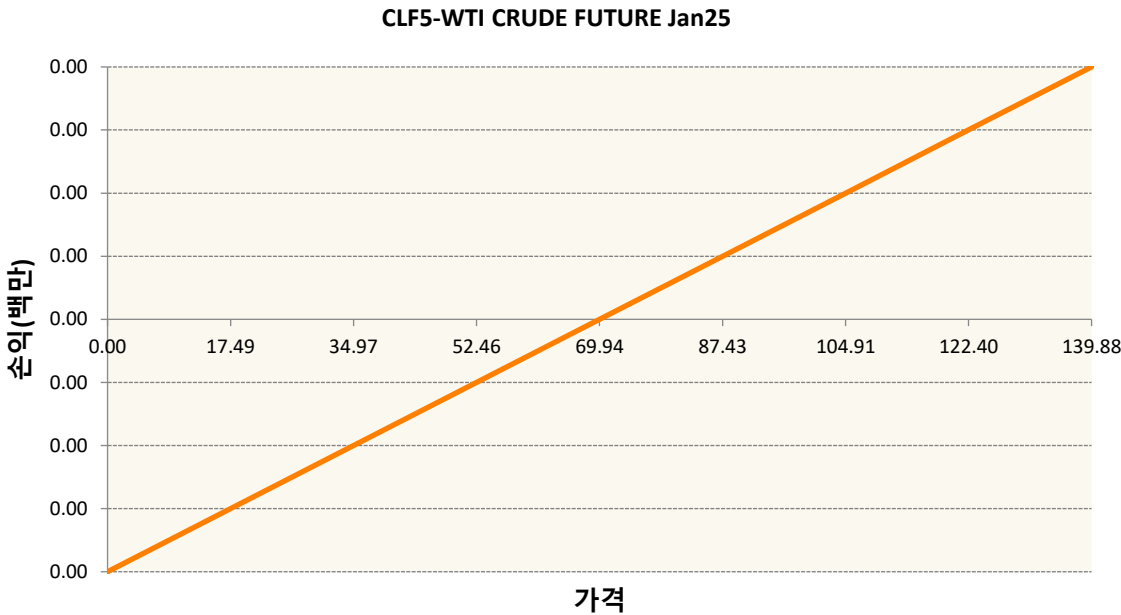
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

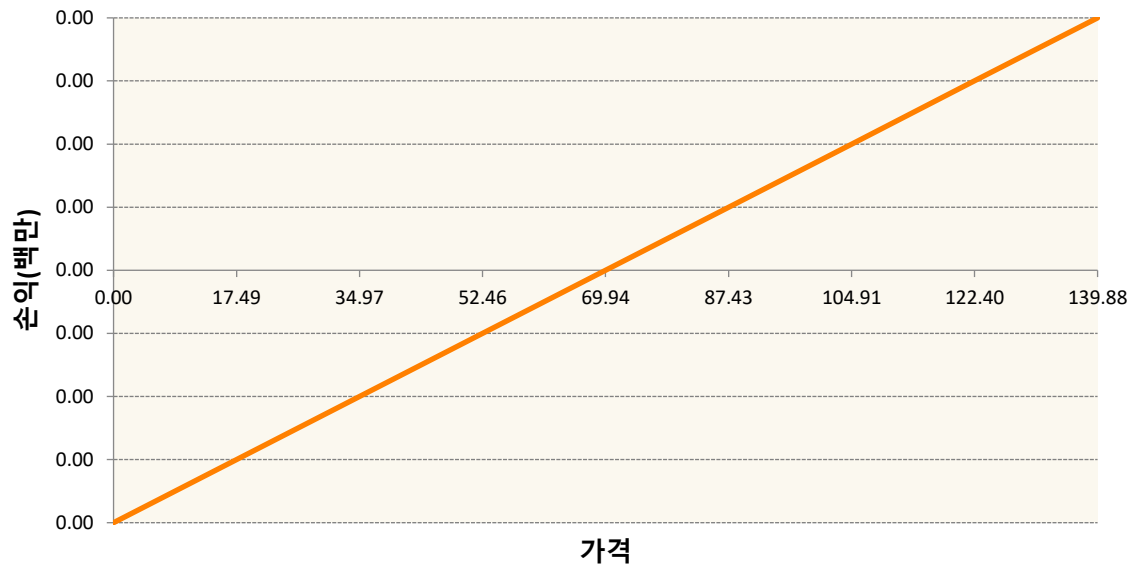
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	14	-14	장내
누계	유가증권	선물	785	0	785	
누계	통화	선물	0	113	-113	장내

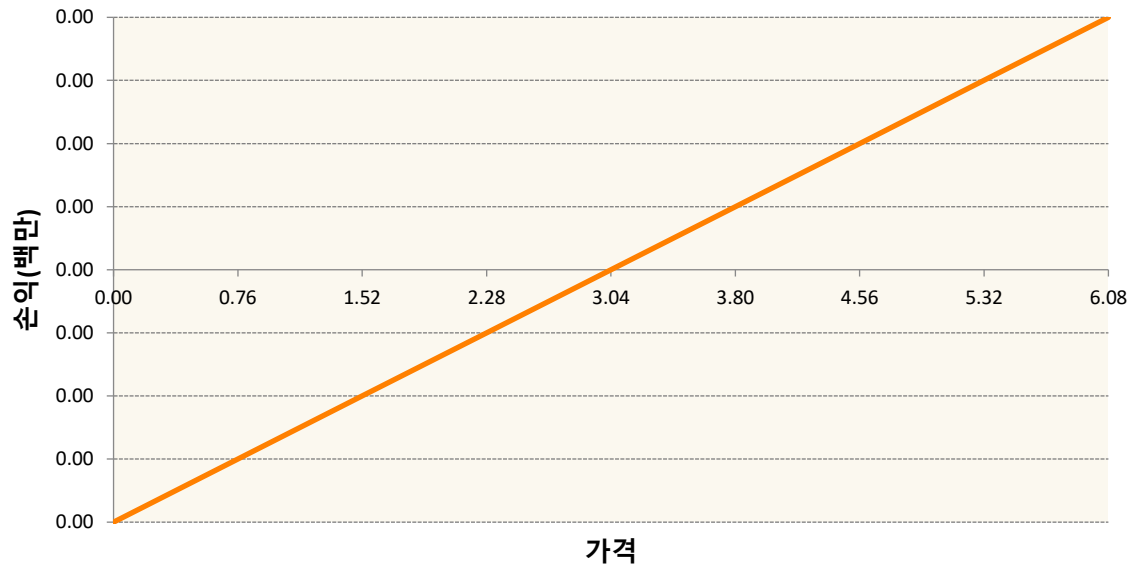
2. 만기시점의 손익구조



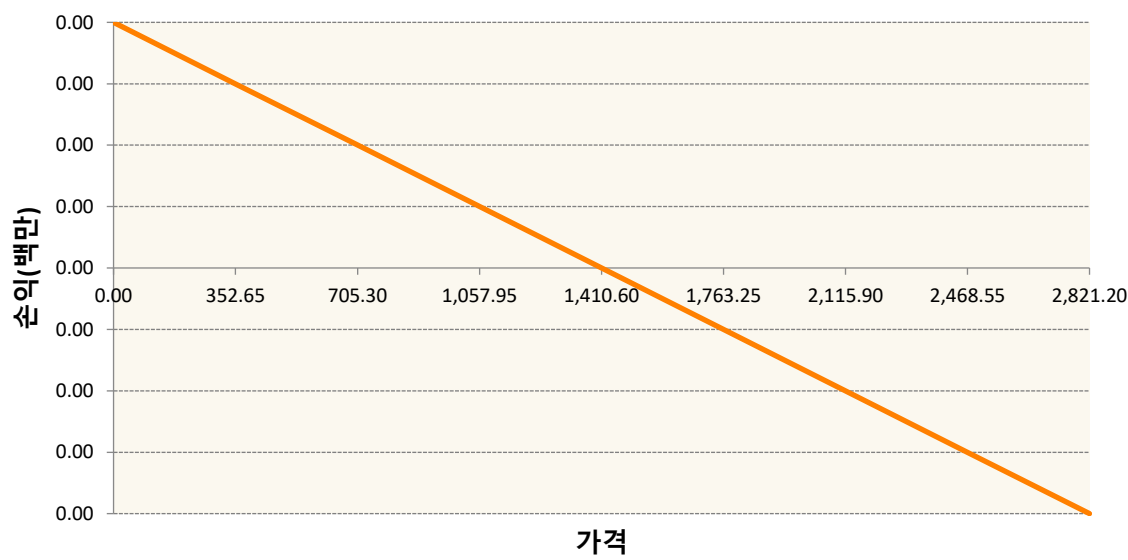
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



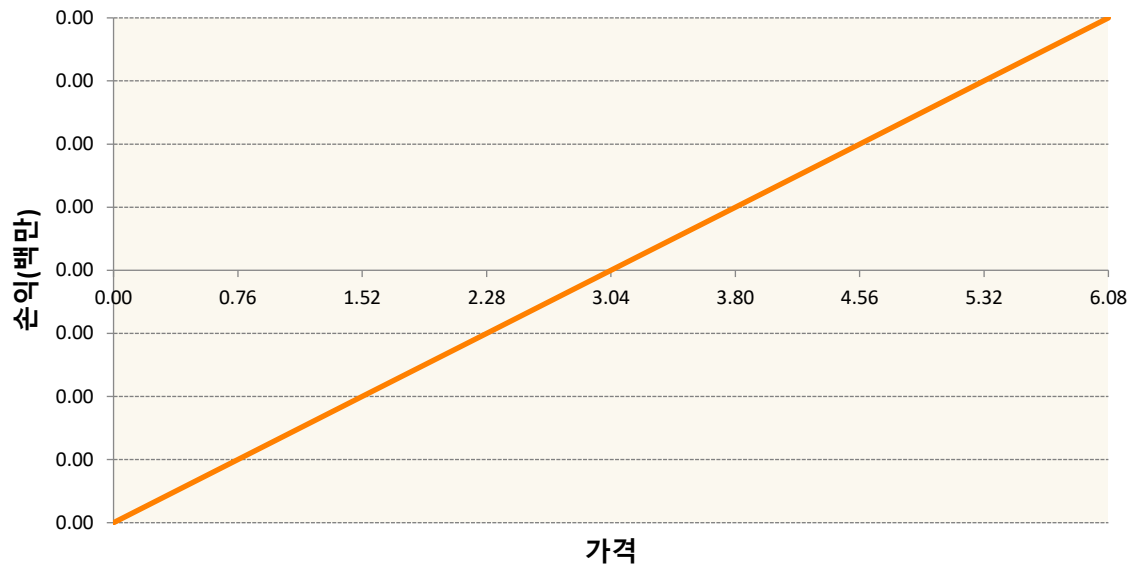
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



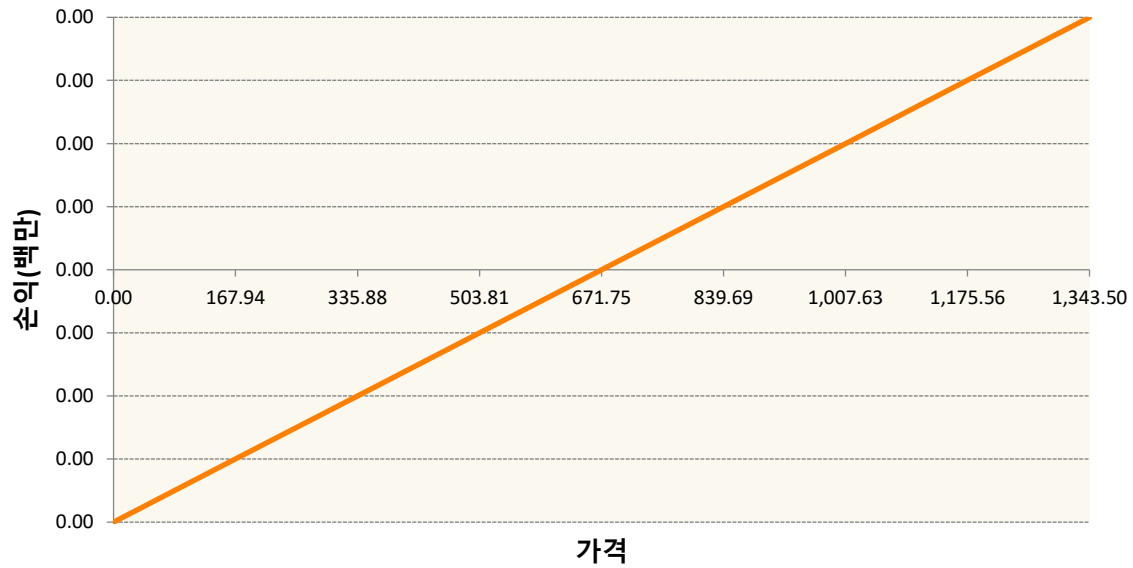
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



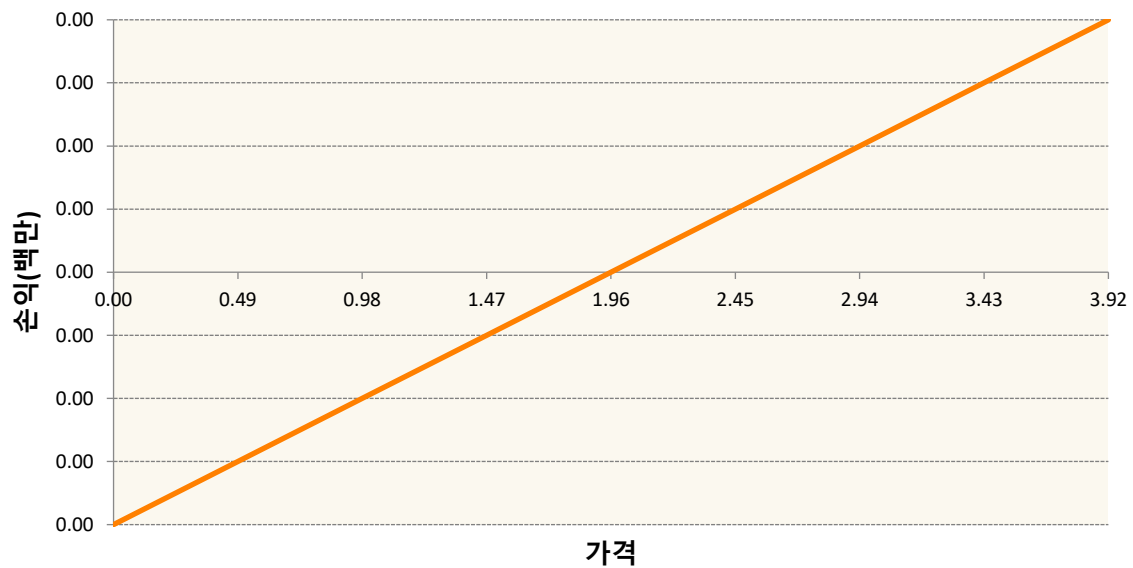
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



QSF5-Low Su Gasoil G Jan25



XBF5-GASOLINE RBOB FUT Jan25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLF5	WTI CRUDE FUTURE Jan25	8
COH5	BRENT CRUDE FUTR Mar25	16
ECF5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	4
EOF5	E-MINI NATURAL GAS Jan25	2
KR4175VC00 2024-12 달러선물		9
NGF25	NATURAL GAS FUTR Jan25	16
QSF5	Low Su Gasoil G Jan25	7
XBF5	GASOLINE RBOB FUT Jan25	9

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

137