

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

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	2024-12-09
기준일	2024-12-06

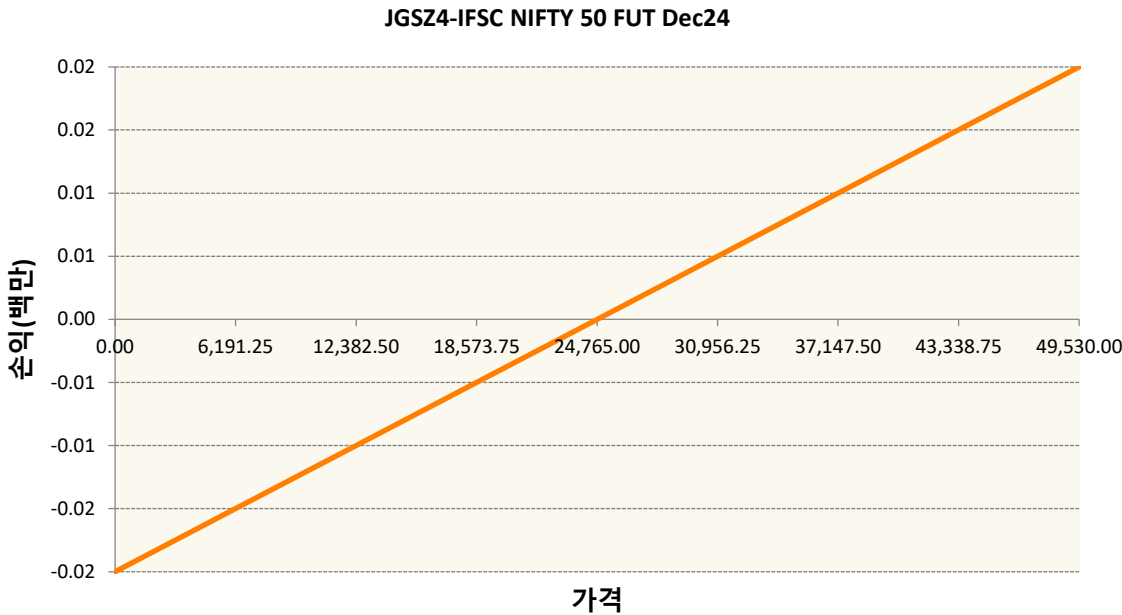
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,392	0	3,392	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSZ4	IFSC NIFTY 50 FUT Dec24	271
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

179

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

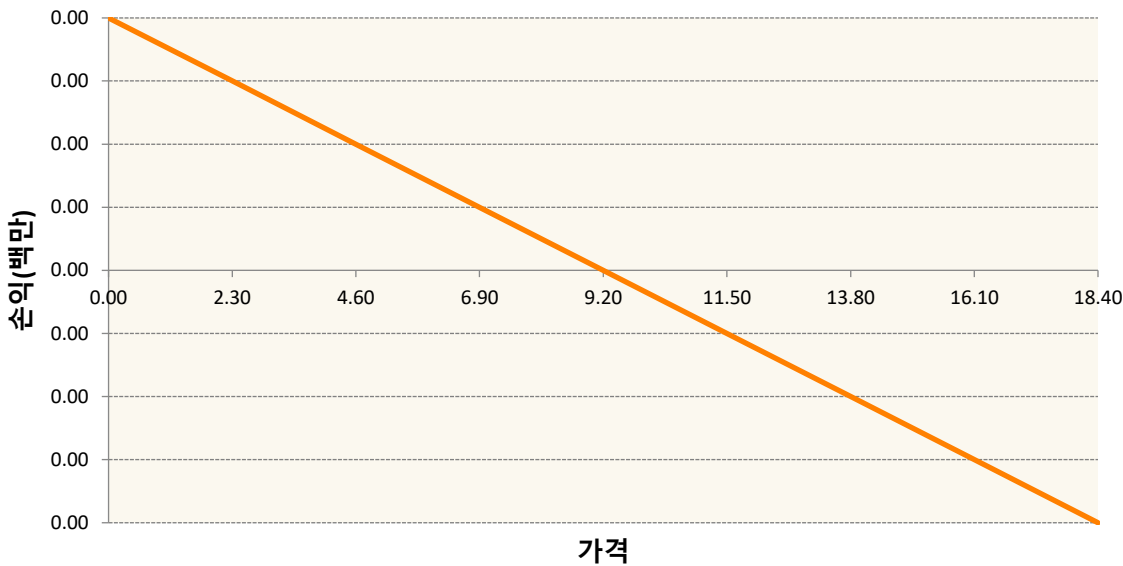
1. 계약금액

(단위:백만원)

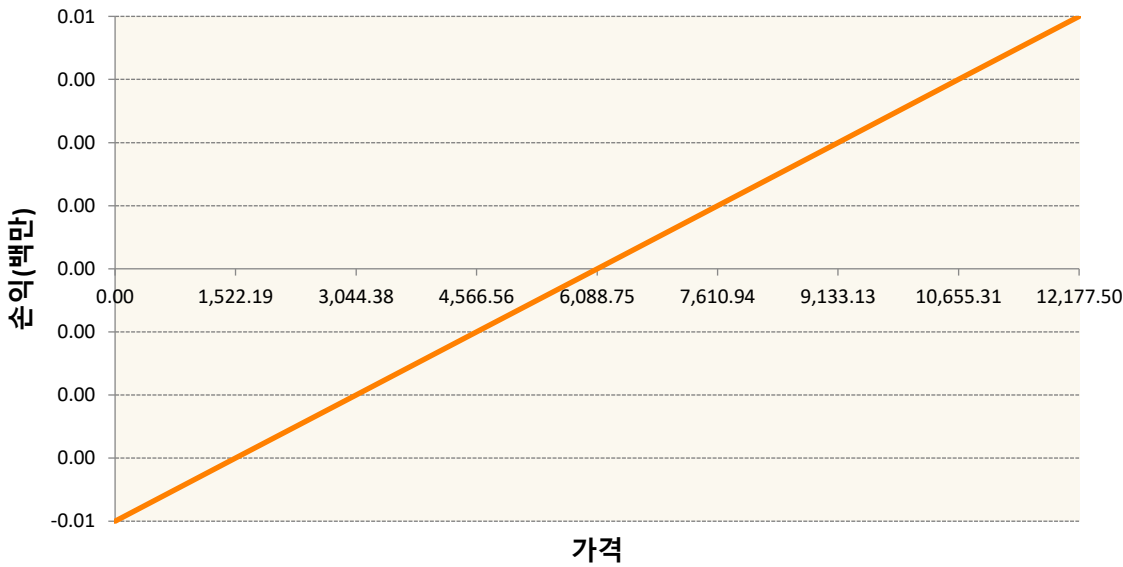
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	
누계	유가증권	선물	843	0	843	
누계	지수	스왑	0	3	-3	

2. 만기시점의 손익구조

AOSPXWUS6085-SPXW US 12/06/24 C6085 Index



ESZ4-S&P500 EMINI FUT DEC24



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOSPXWUS€ SPXW US 12/06/24 C6085 Index		0.2
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	67

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	41

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

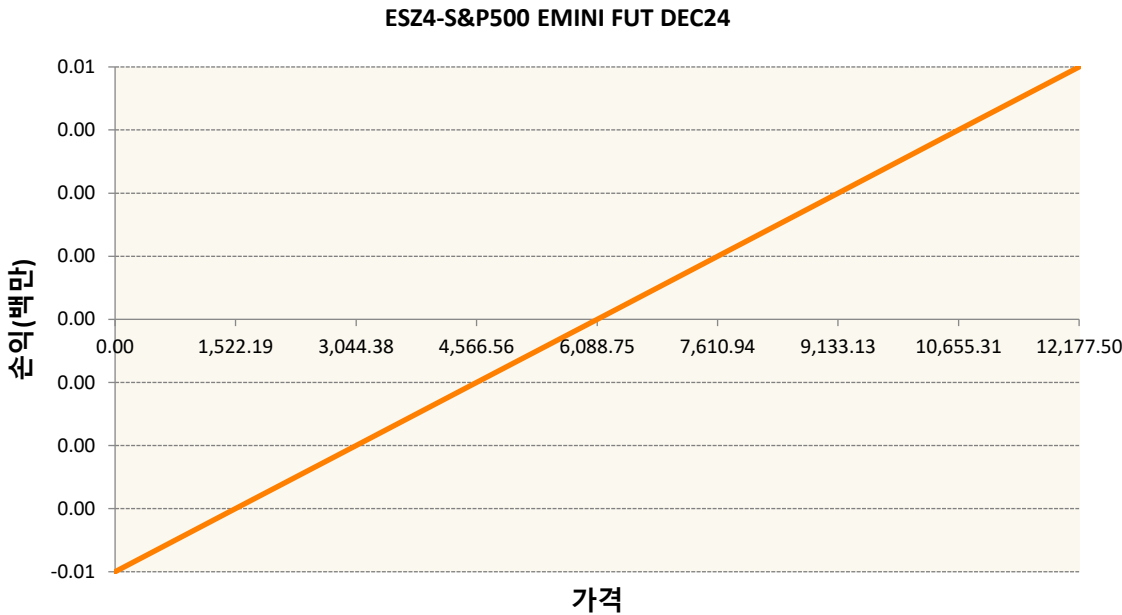
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,560	0	2,560	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	205
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

125

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

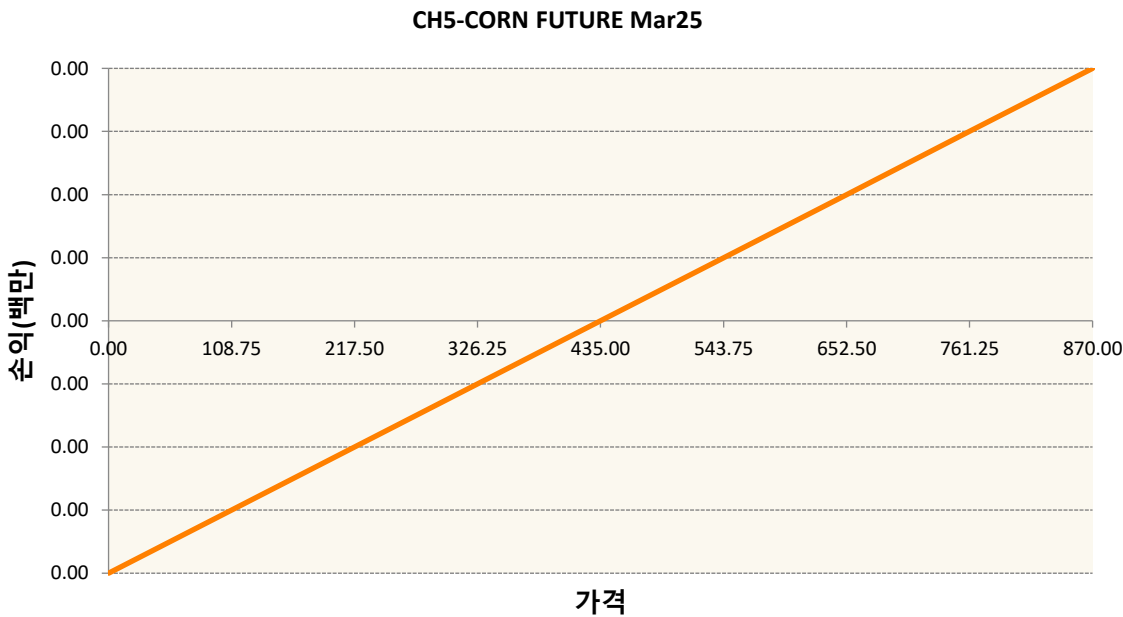
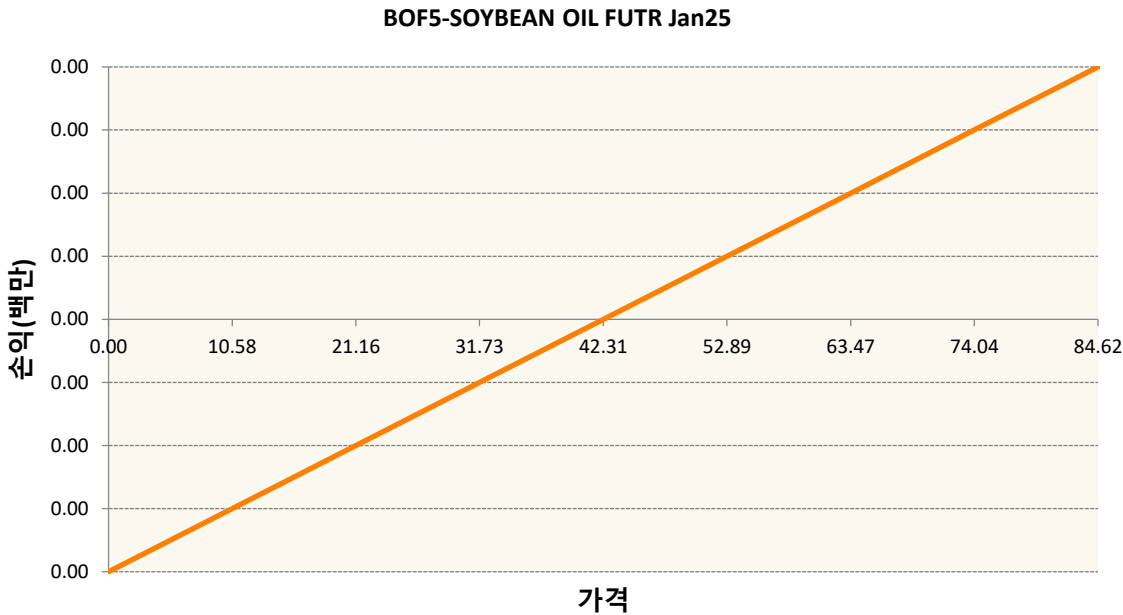
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

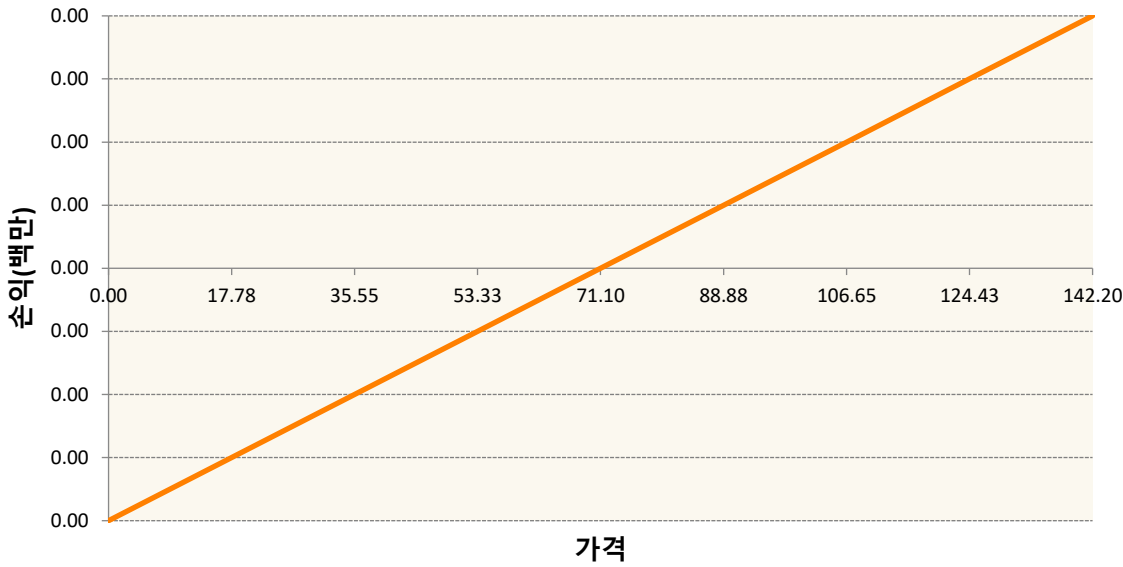
(단위:USD 백만)

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	3,741	0	3,741	
누계	통화	선물	0	426	-426	장내

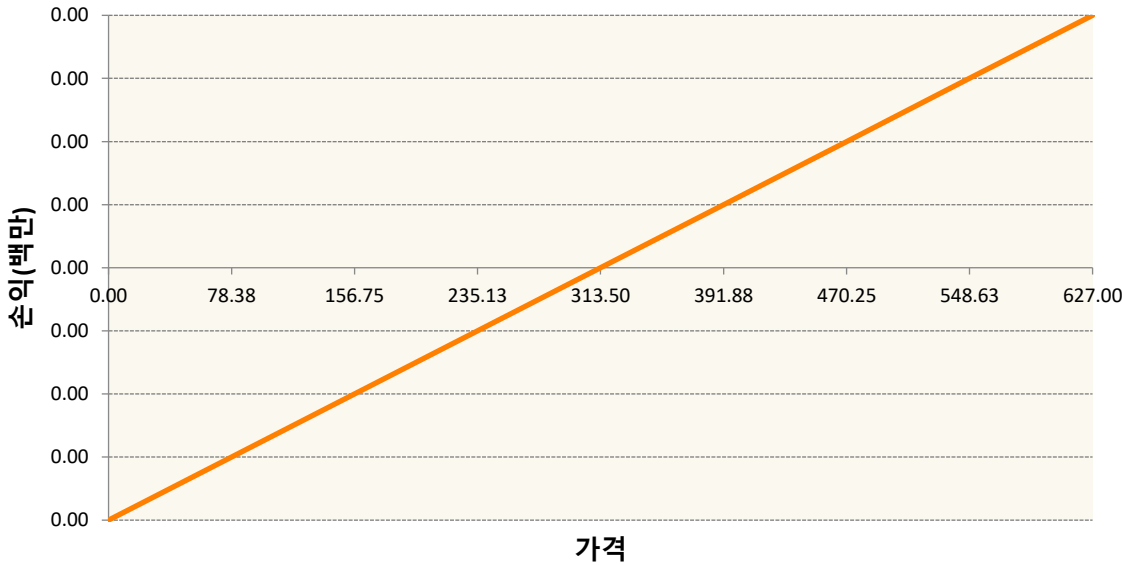
2. 만기시점의 손익구조



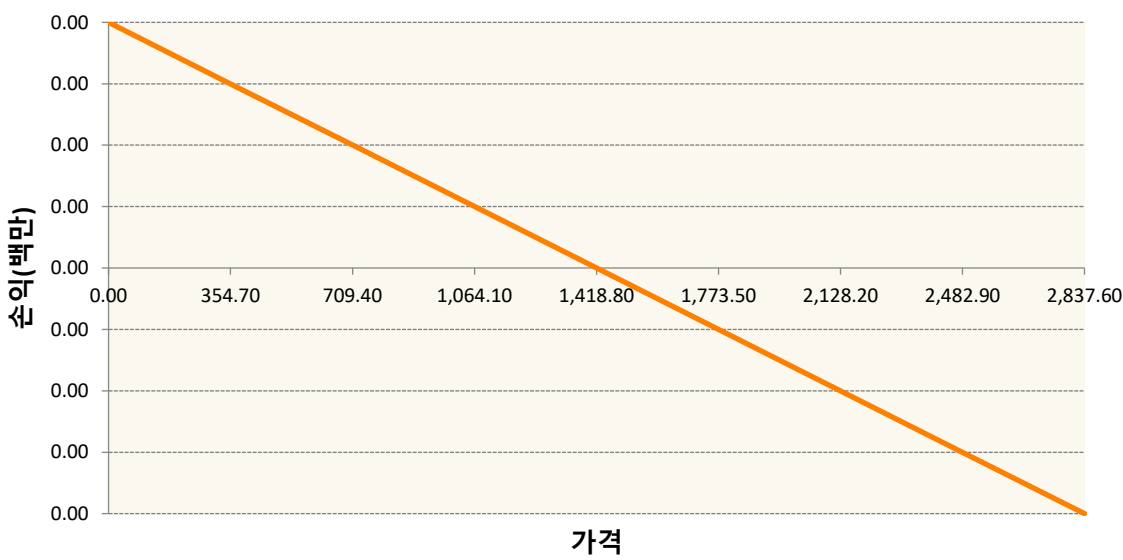
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



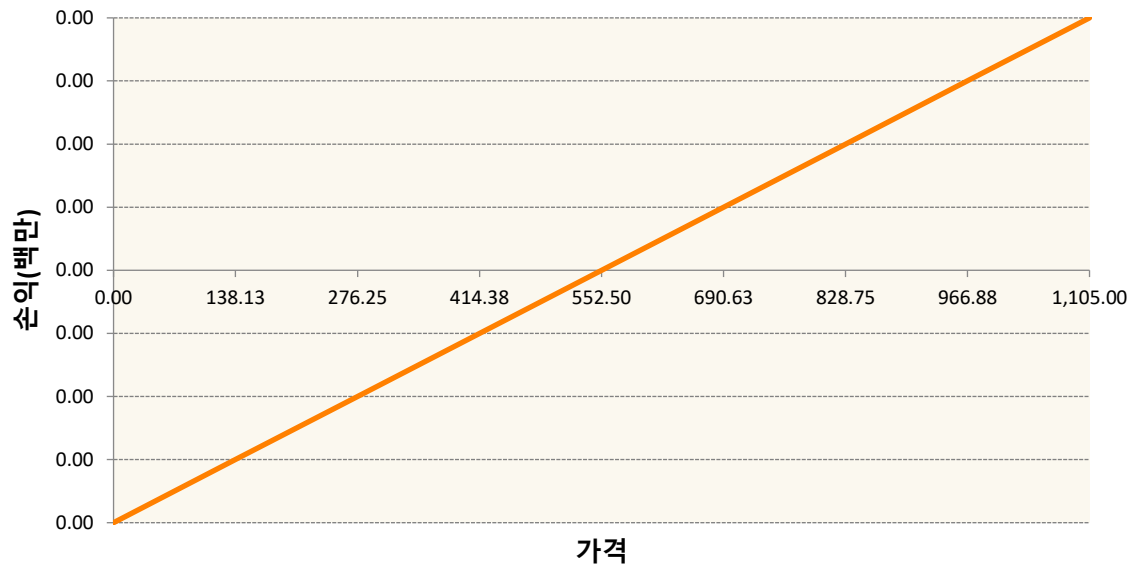
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



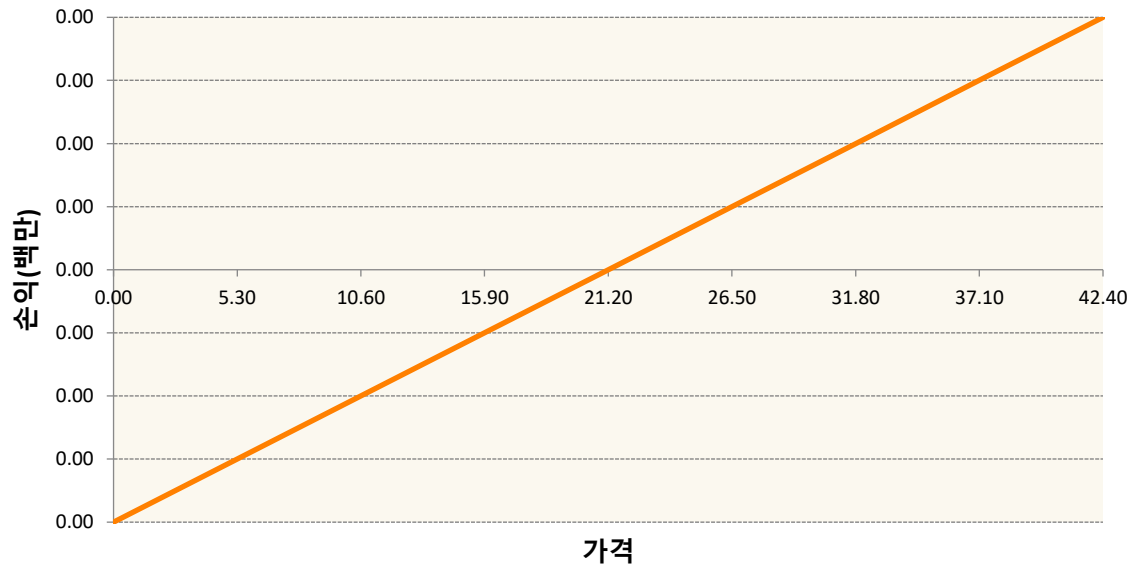
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



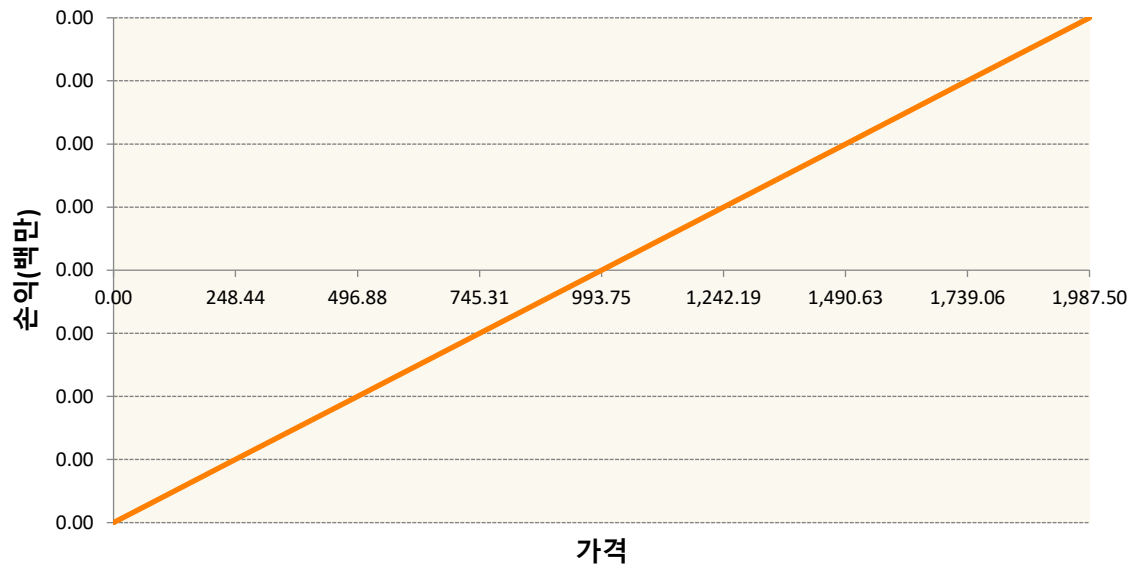
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



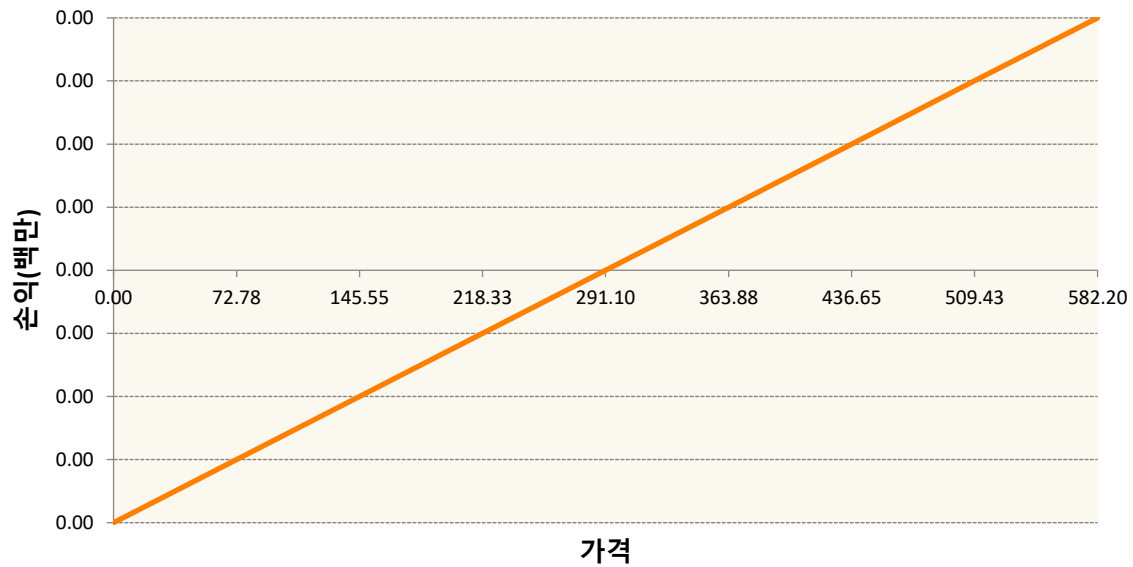
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



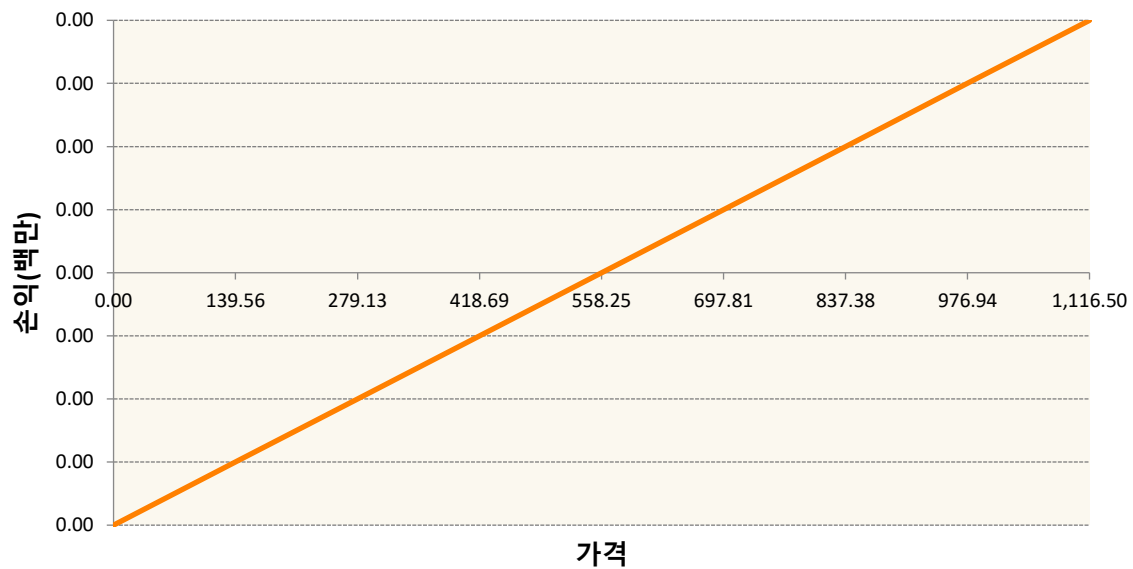
SF5-SOYBEAN FUTURE Jan25



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	2024-12-09
기준일	2024-12-06

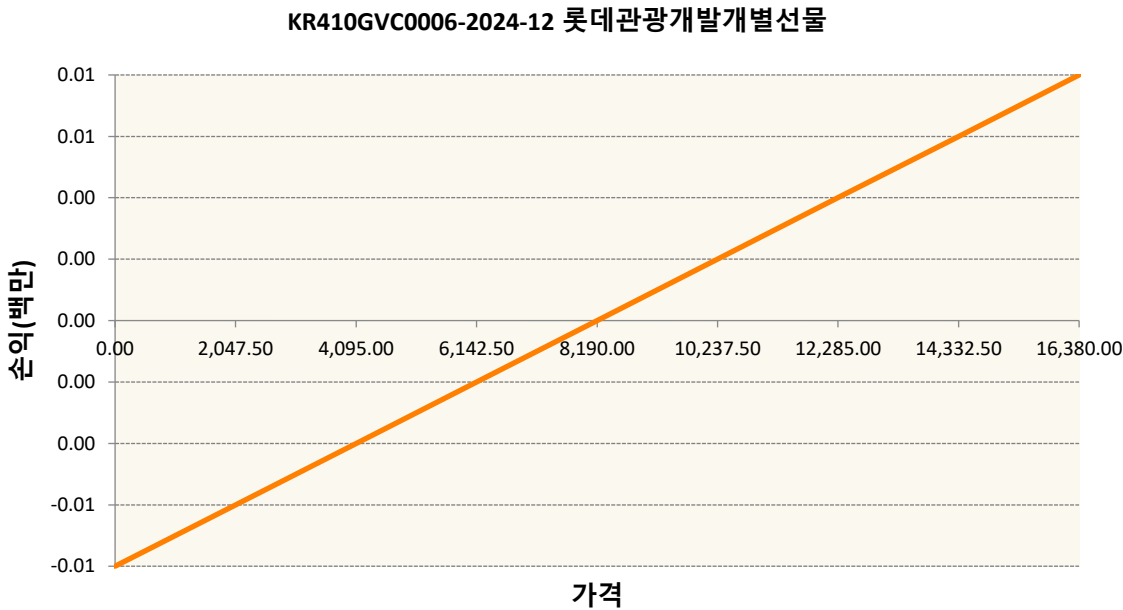
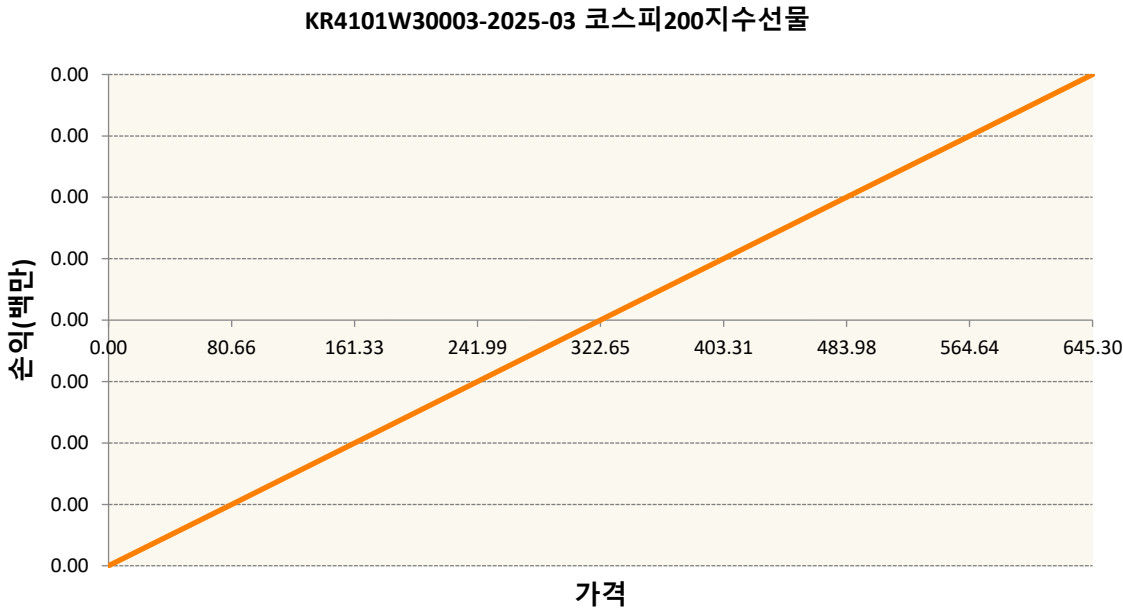
스마트인덱스모

1. 계약금액

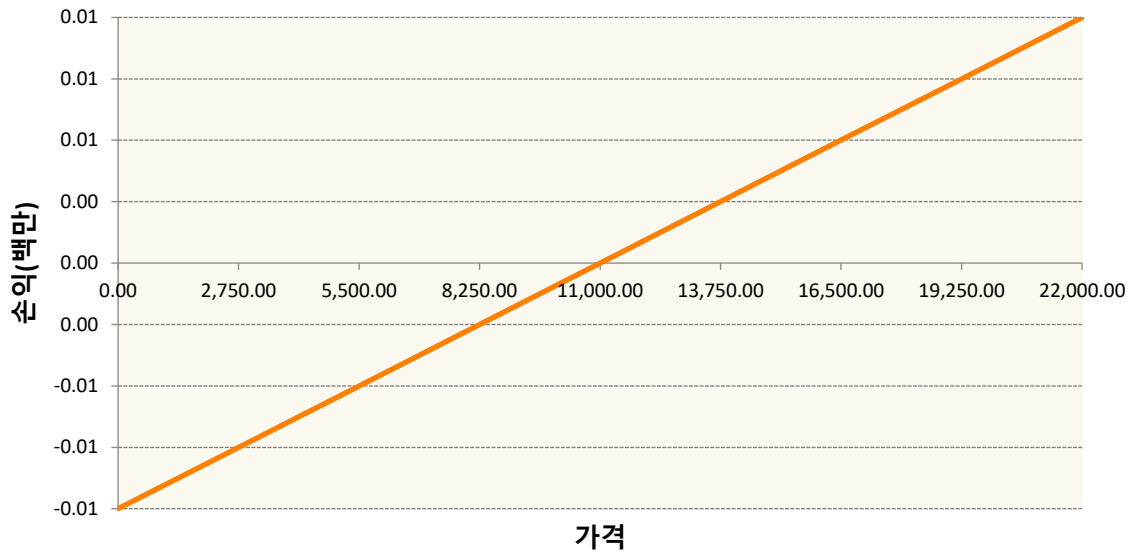
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,775	0	1,775	장내

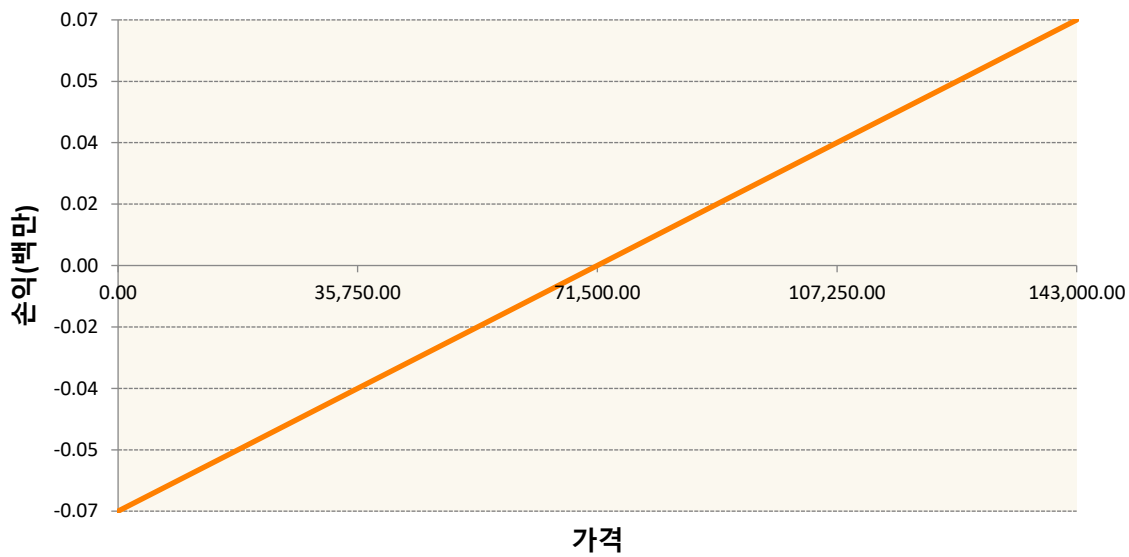
2. 만기시점의 손익구조



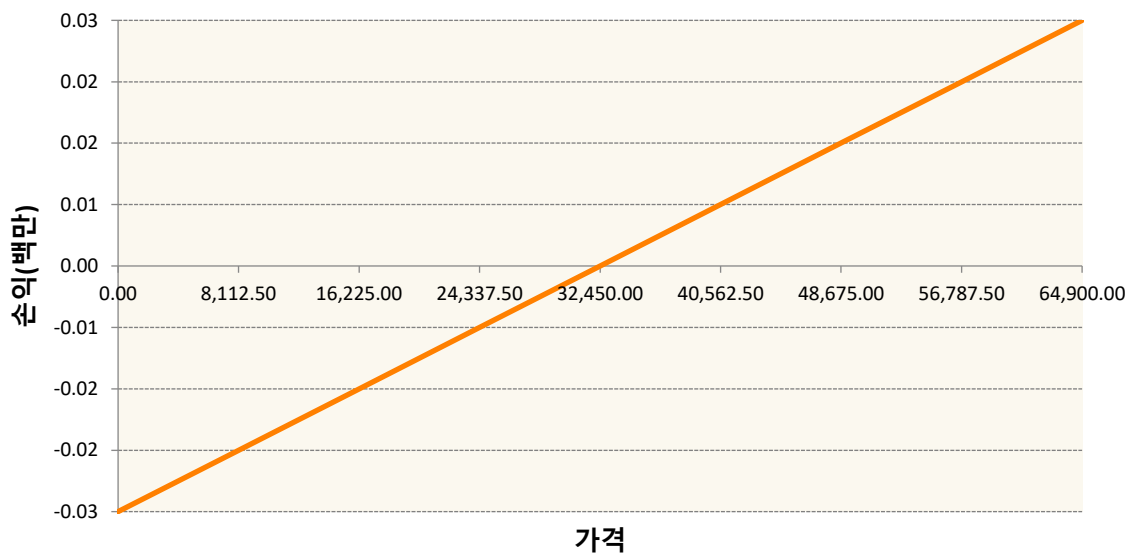
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



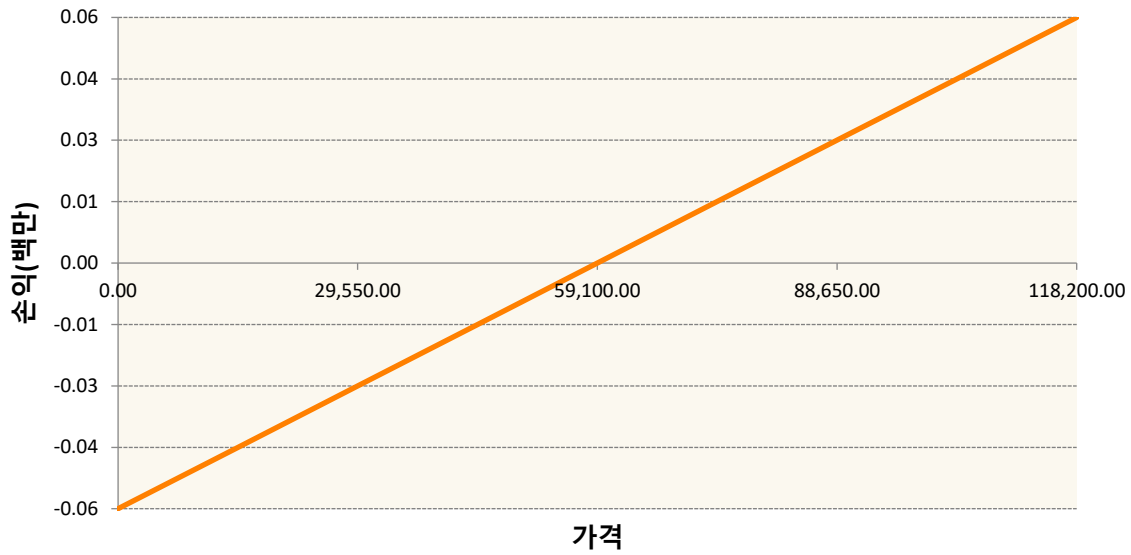
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



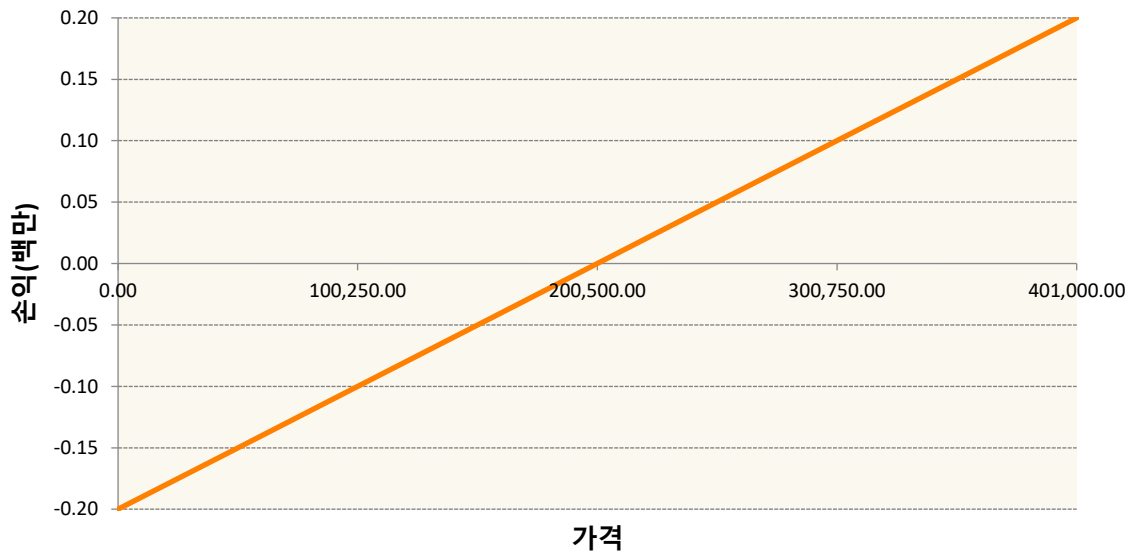
KR4128VC0003-2024-12 한국가스공사개별선물



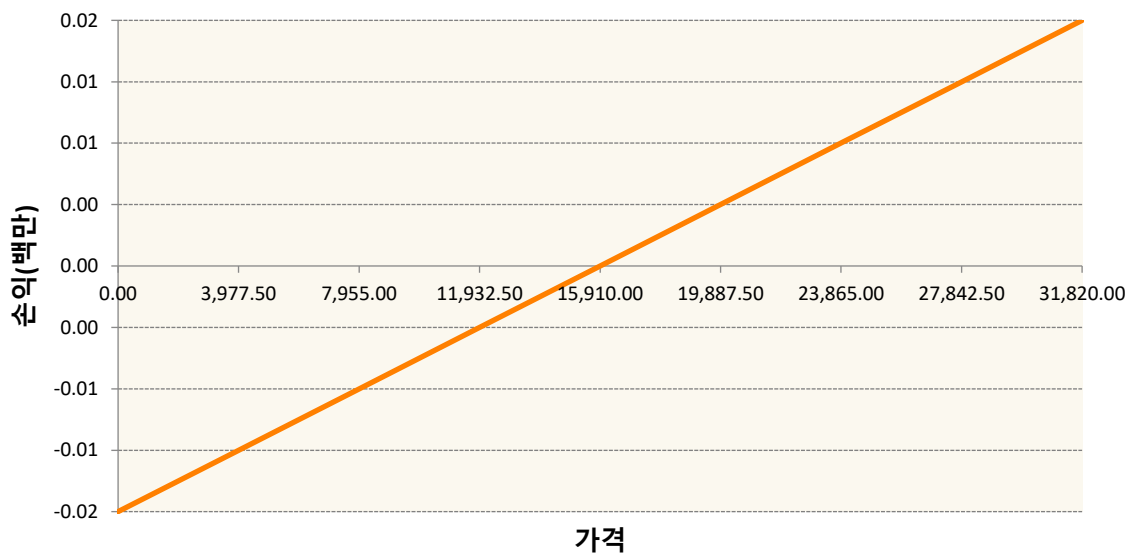
KR41BBVC0009-2024-12 롯데케미칼개별선물



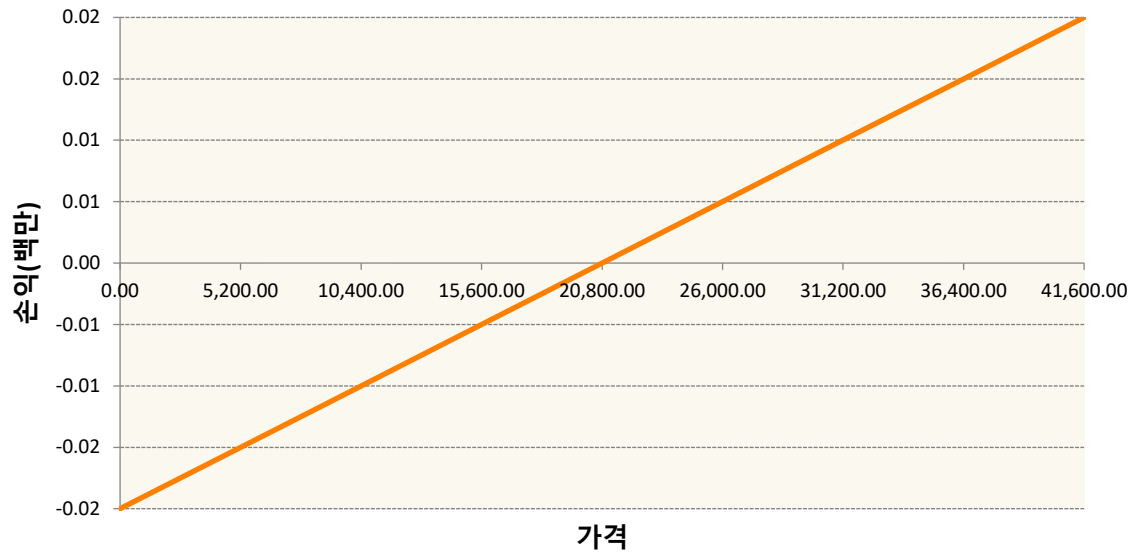
KR41BJVC0001-2024-12 엔씨소프트개별선물



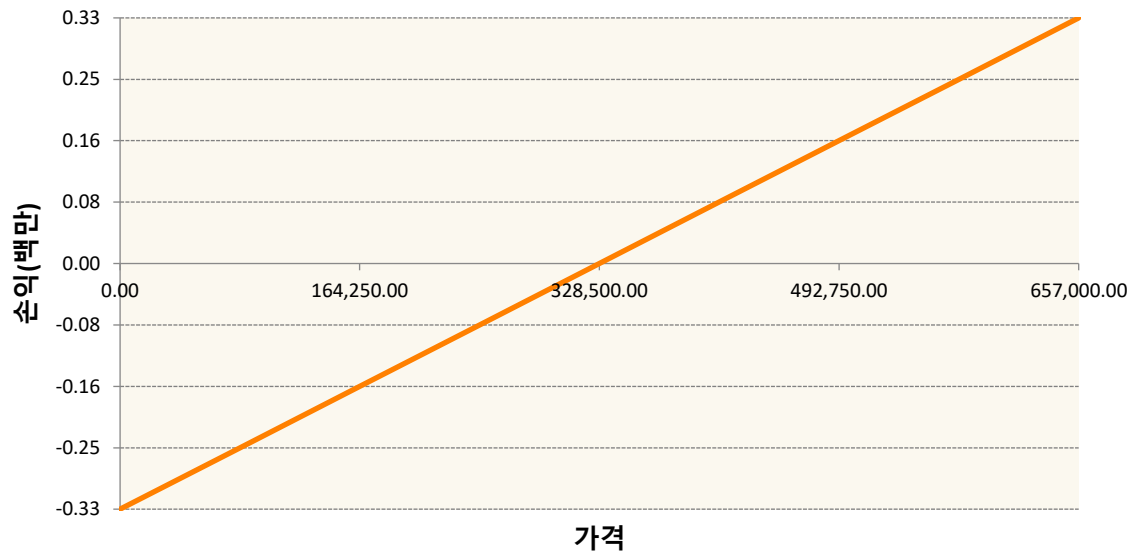
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



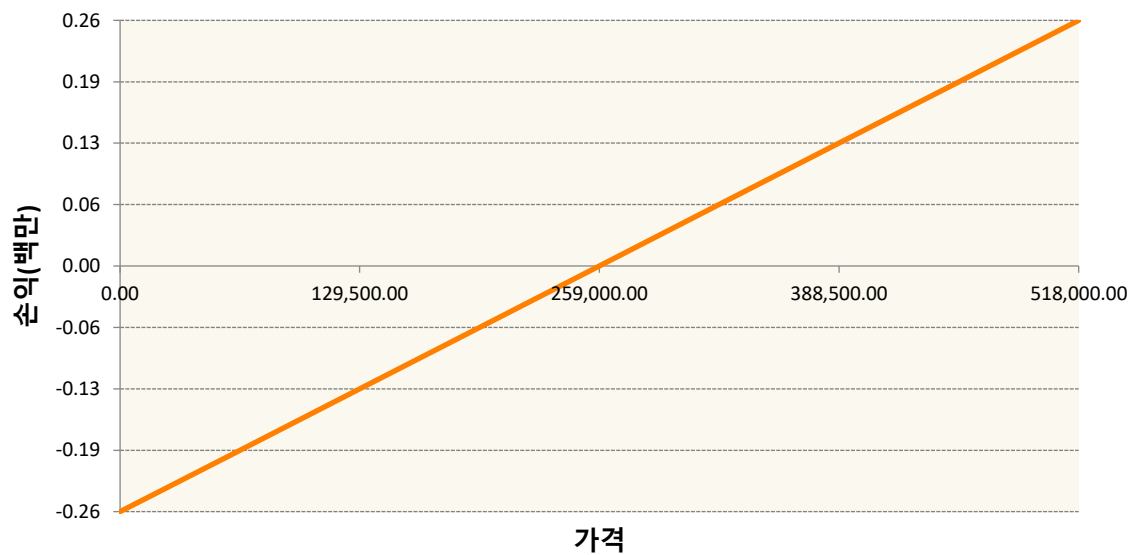
KR41CNVC0004-2024-12 포스코 ICT개별선물



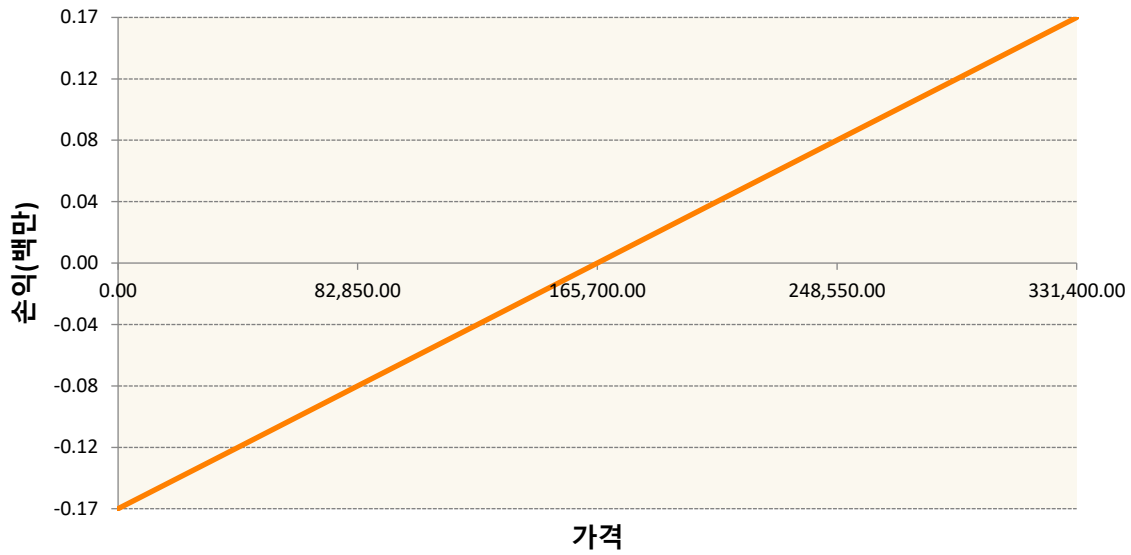
KR41CRVC0000-2024-12 LG생활건강개별선물



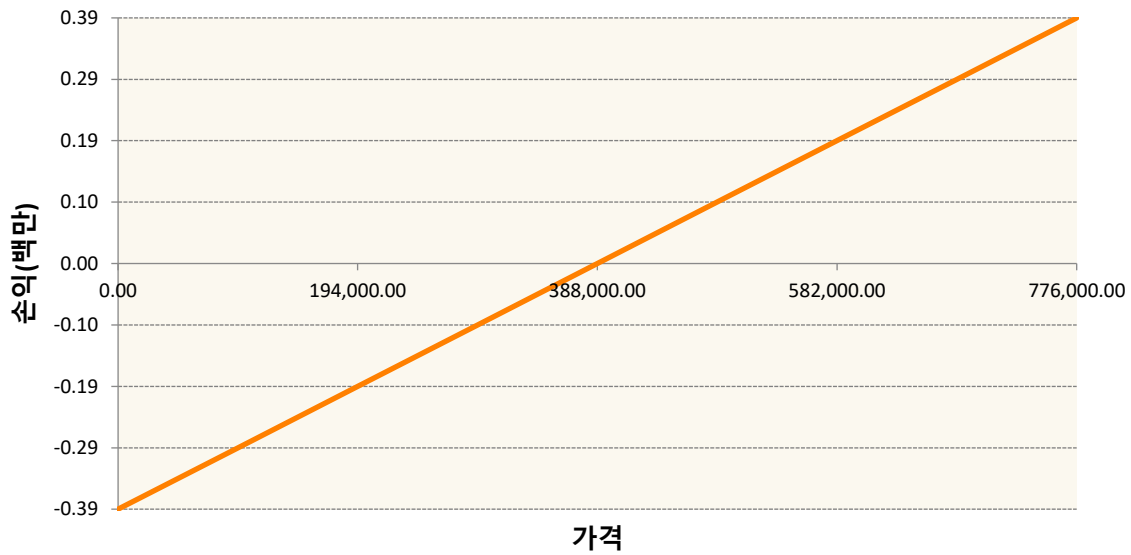
KR41D1VC0006-2024-12 CJ제일제당개별선물



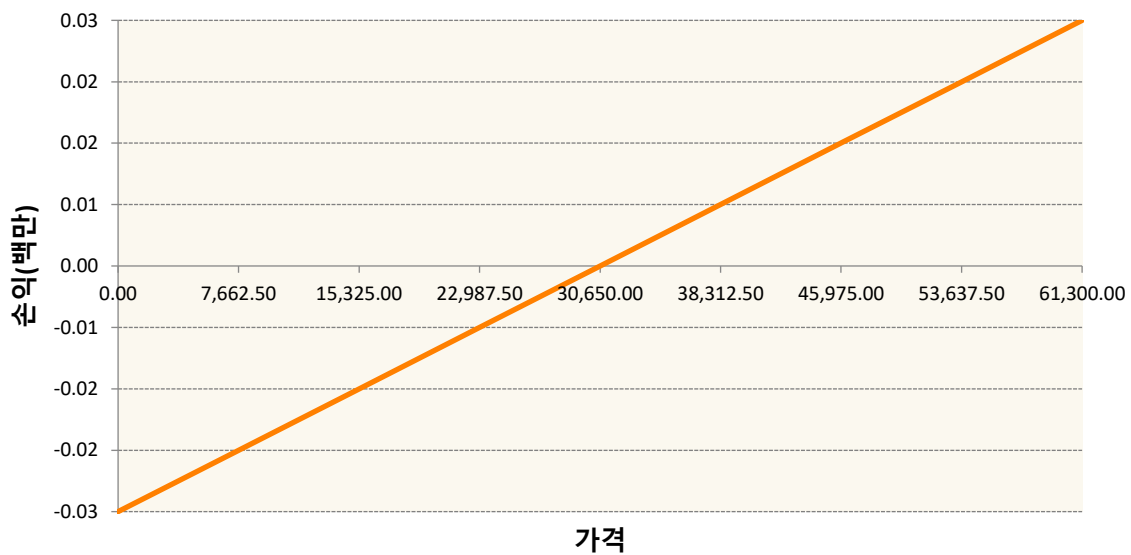
KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



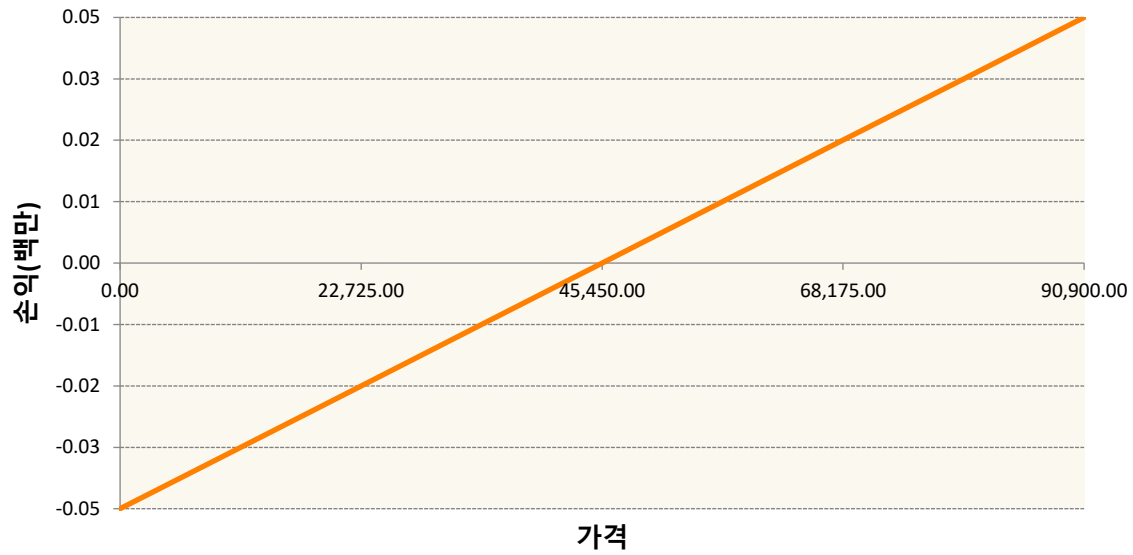
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



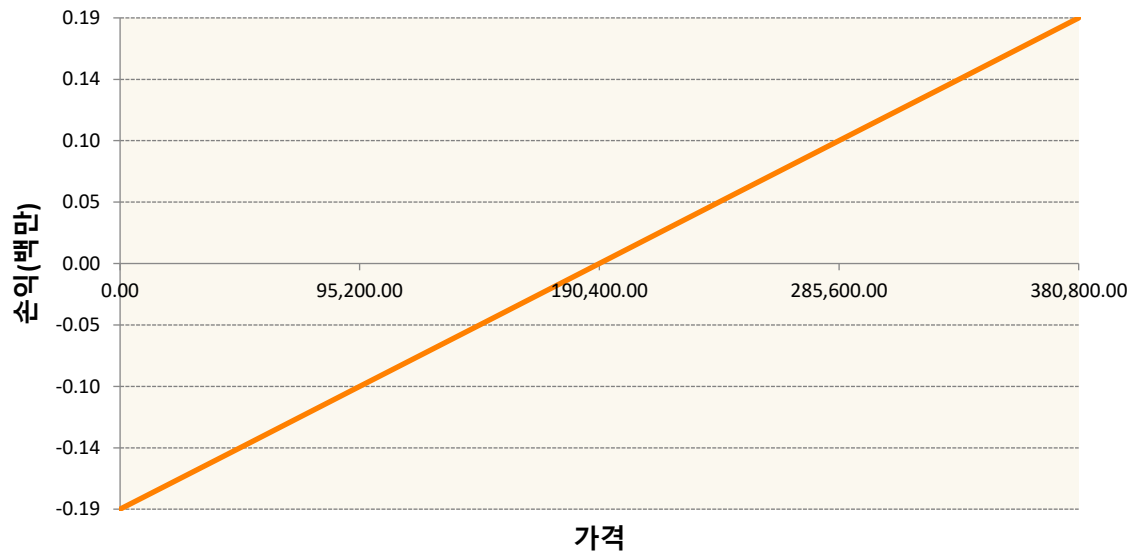
KR41F7VC0005-2024-12 카카오페이개별선물



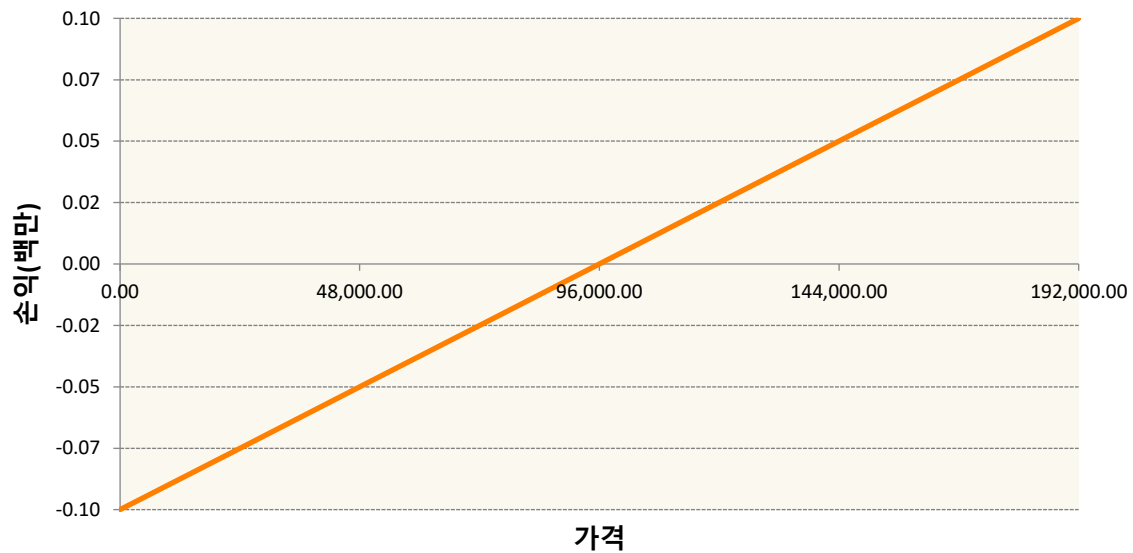
KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCVC0004-2024-12 하이브개별선물



KR41FMVC0002-2024-12 엘앤에프개별선물



(단위:백만원)

KR4101W30003		2025-03 코스피200지수선물					90
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	90	90	90	90	90	90	90
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					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
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%	-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

KR41BBVC0009 2024-12 롯데케미칼개별선물 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

KR41BJVC0001 2024-12 엔씨소프트개별선물 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

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

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

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	2024-12-09
기준일	2024-12-06

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	2024-12-09
기준일	2024-12-06

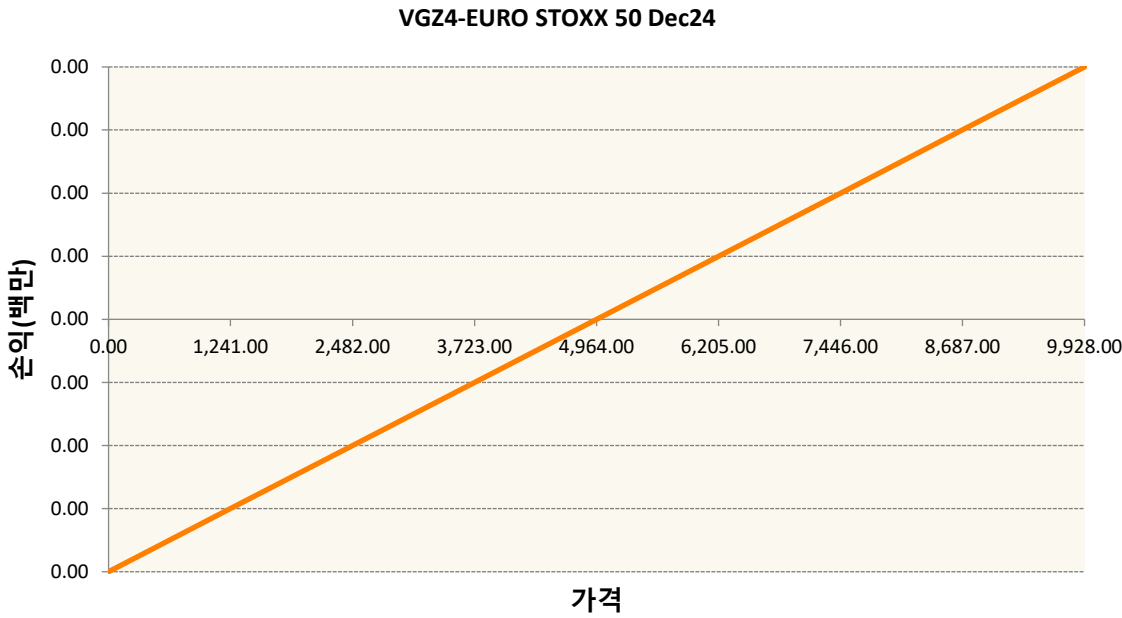
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	959	0	959	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ4	EURO STOXX 50 Dec24	77
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

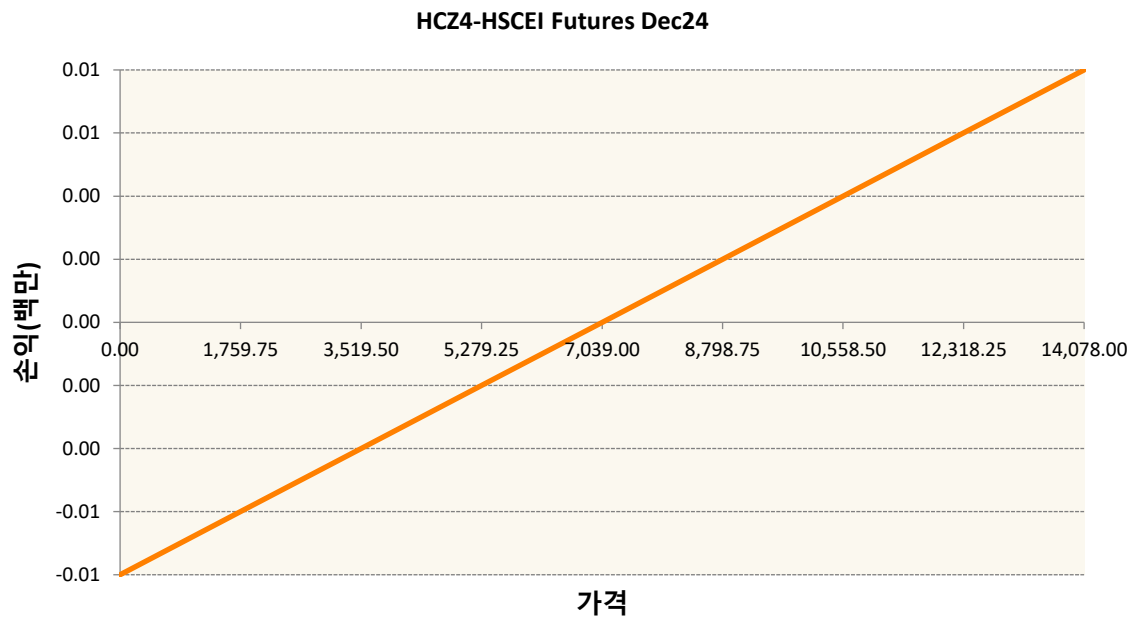
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,390	0	1,390	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

152

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

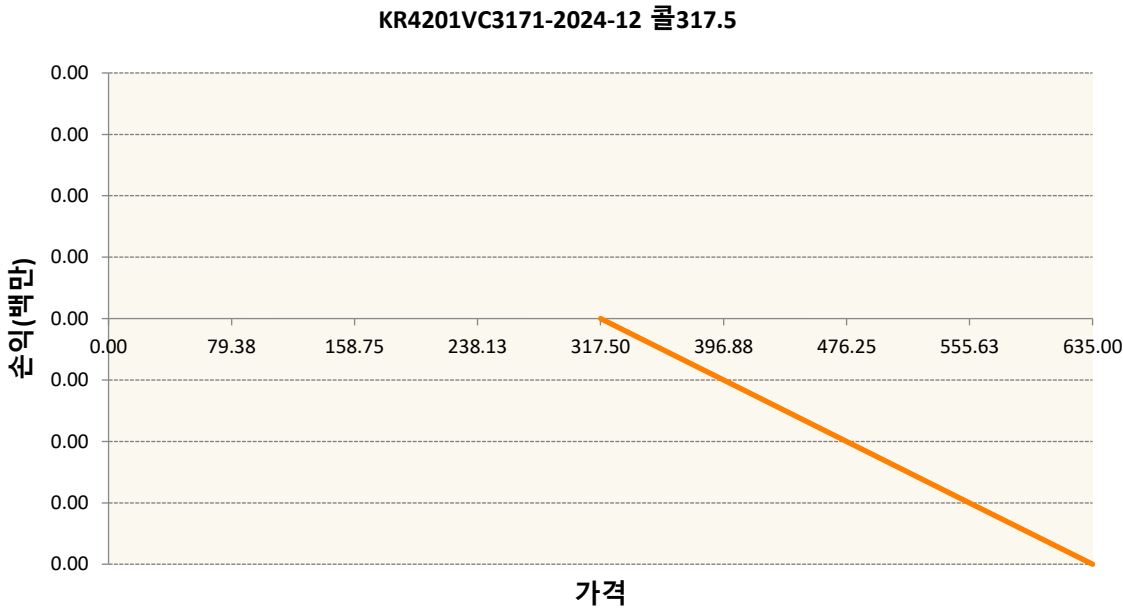
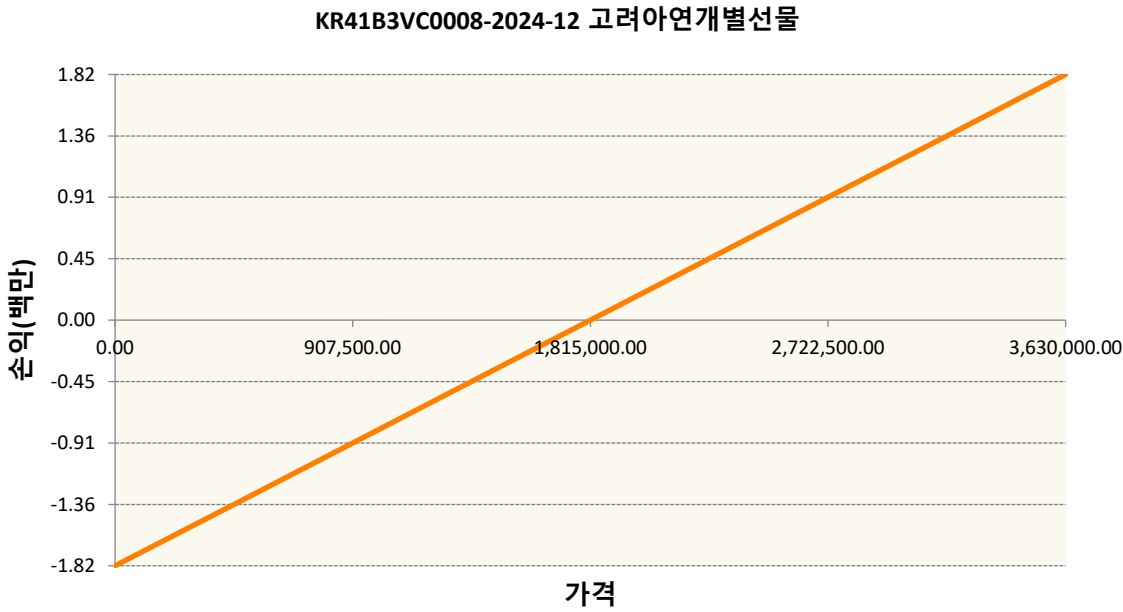
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	472	0	472	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,907	-36,907	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 -10.00 to 10.00. A blue line starts at the point (320.00, 0.00) and slopes downward to the point (640.00, -10.00).

가격 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
320.00	0.00
640.00	-10.00

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					38
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	38	38	38	38	38	38	38
KR4201VC3171		2024-12 콜317.5					749
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	216	215	215	214	213	211	209
-5.33%	211	208	204	200	195	189	183
-2.67%	170	160	151	141	131	121	111
0%	29	19	10	0	-10	-20	-30
2.67%	-207	-210	-214	-219	-224	-230	-236
5.33%	-475	-476	-476	-477	-479	-481	-484
8.00%	-748	-748	-748	-748	-748	-748	-749

KR4201VC3205

2024-12 콜320

1,418

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	328	327	327	326	325	322	319
-5.33%	324	320	316	309	302	293	284
-2.67%	275	260	244	227	209	191	173
0%	63	42	21	0	-21	-42	-63
2.67%	-359	-368	-379	-391	-405	-419	-435
5.33%	-877	-878	-881	-885	-889	-895	-903
8.00%	-1,412	-1,412	-1,413	-1,413	-1,414	-1,416	-1,418

KR4301VC3170

2024-12 풋317.5

412

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-408	-408	-408	-409	-410	-411	-412
-5.33%	-226	-228	-231	-234	-237	-241	-245
-2.67%	-70	-76	-83	-89	-96	-103	-110
0%	19	13	7	0	-7	-14	-20
2.67%	44	42	40	37	33	29	25
5.33%	47	47	47	46	45	43	42
8.00%	48	48	48	47	47	47	46

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

(단위:백만원)

2,978

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

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	688	0	688	

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	2024-12-09
기준일	2024-12-06

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	4,480	0	4,480	

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	2024-12-09
기준일	2024-12-06

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	13,915	0	13,915	
누계	통화	선도	312	13,979	-13,667	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E	358
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E	210
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E	551
FXW213EC2(USD/KRW 31-12-24E	25
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

490

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

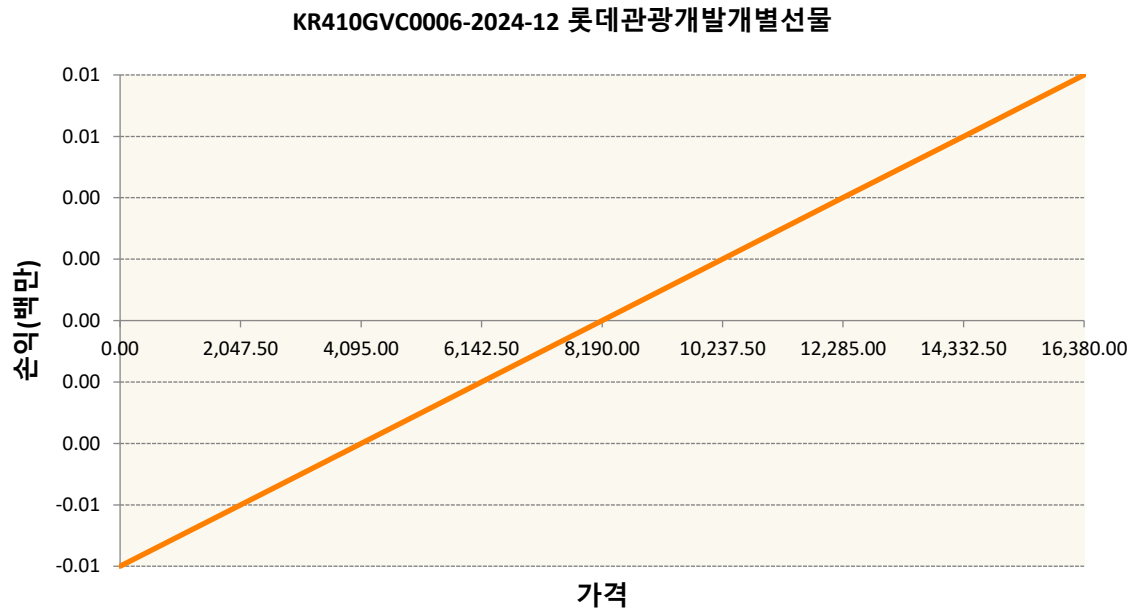
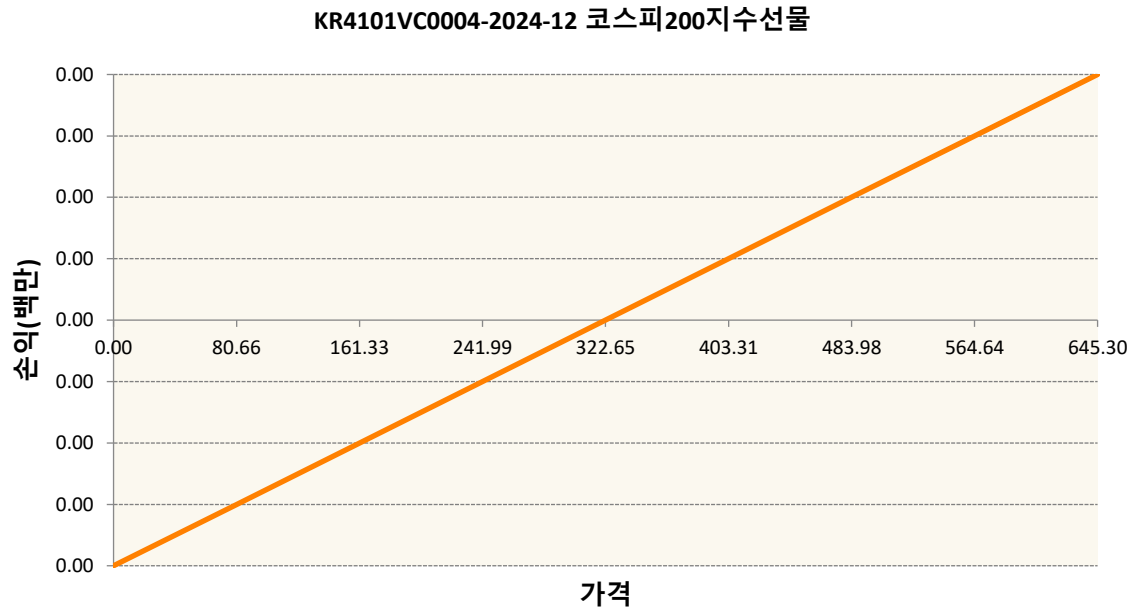
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

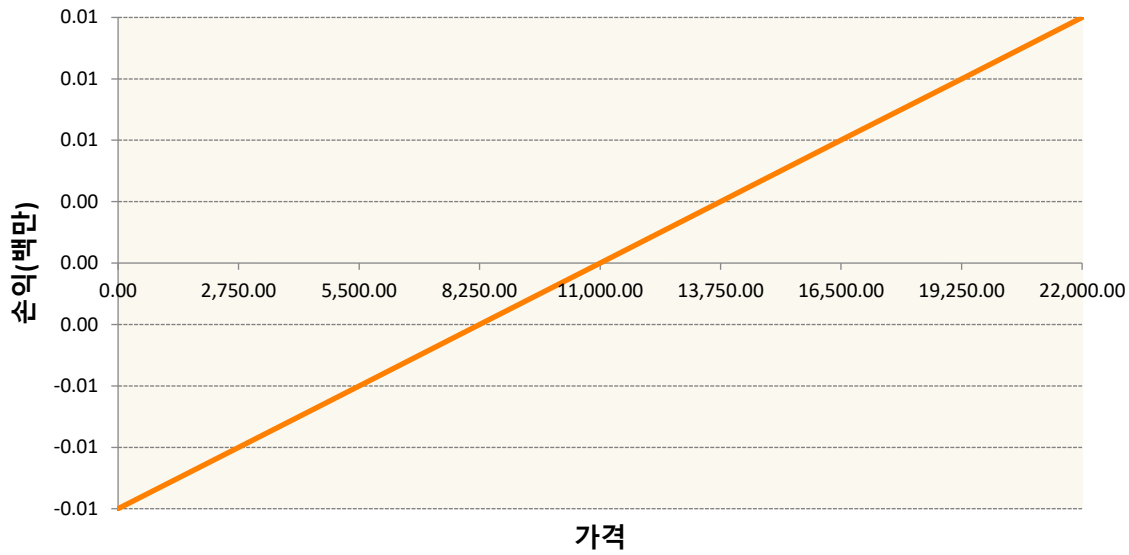
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,470	0	1,470	장내

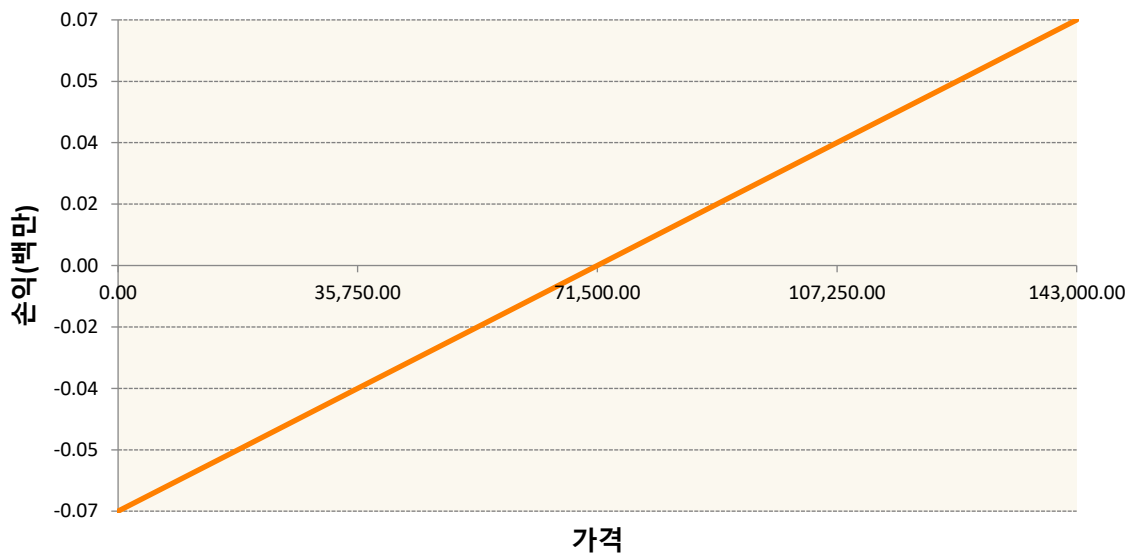
2. 만기시점의 손익구조



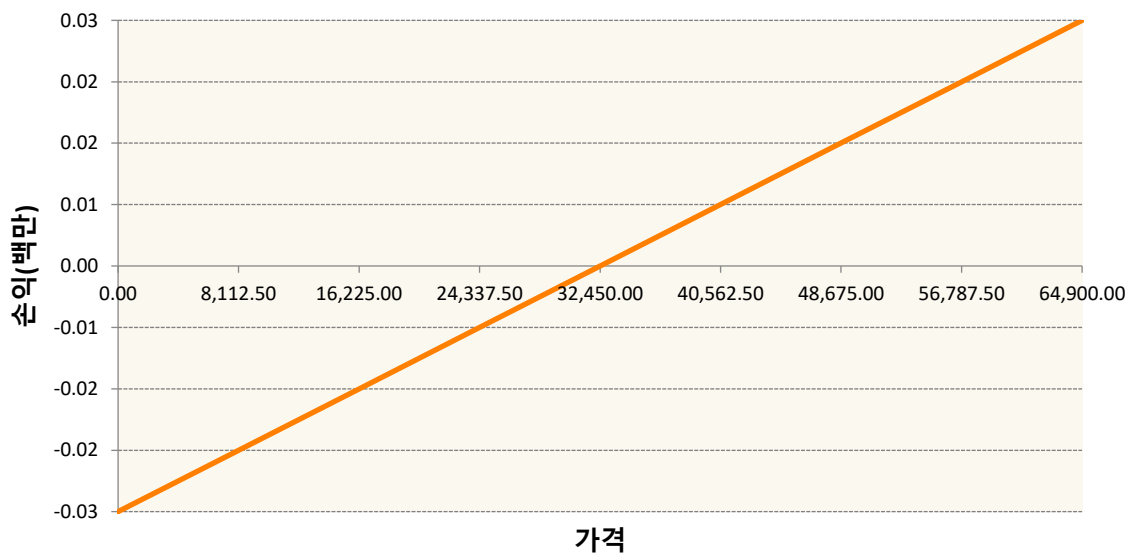
KR410JVC0003-2024-12 명신산업개별선물



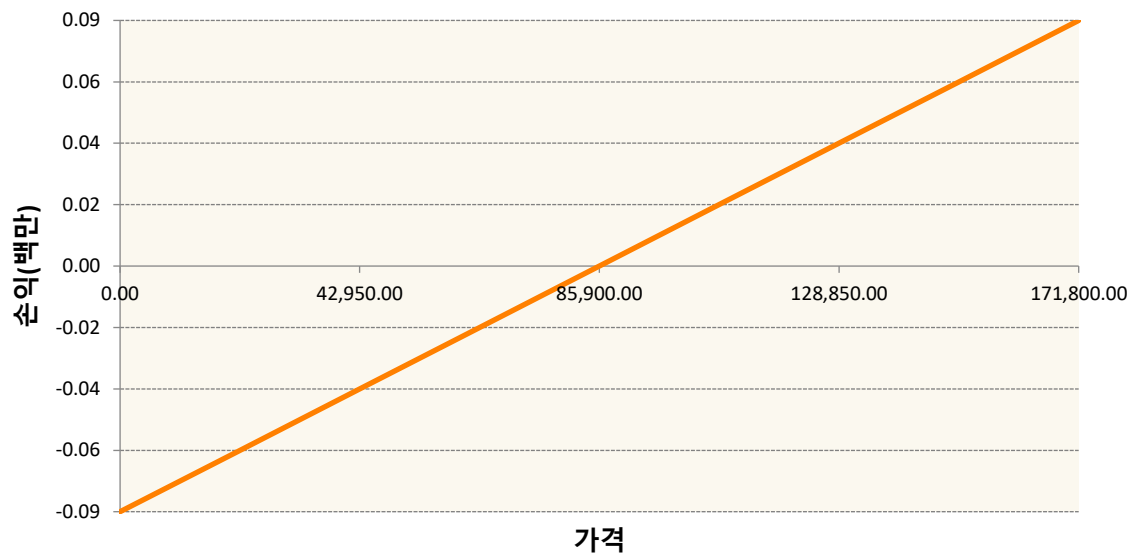
KR410ZVC0003-2024-12 한미반도체개별선물



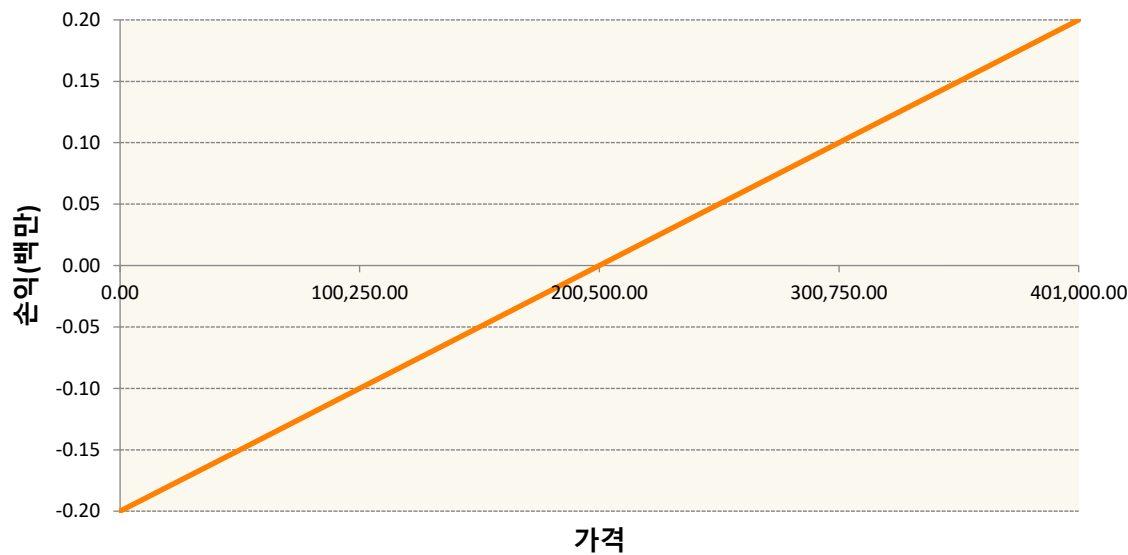
KR4128VC0003-2024-12 한국가스공사개별선물



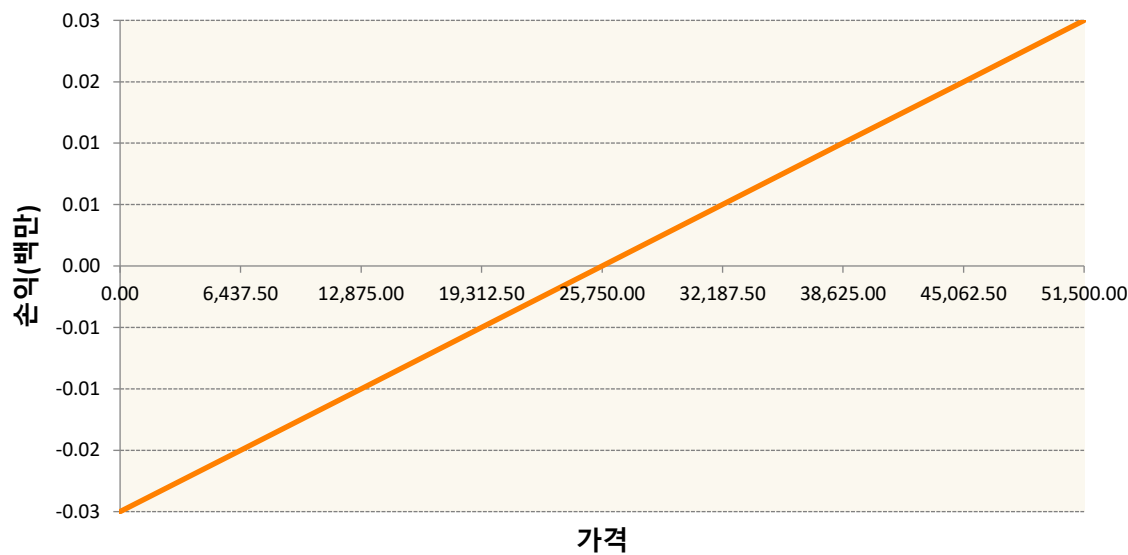
KR4146VC0001-2024-12 KB금융개별선물



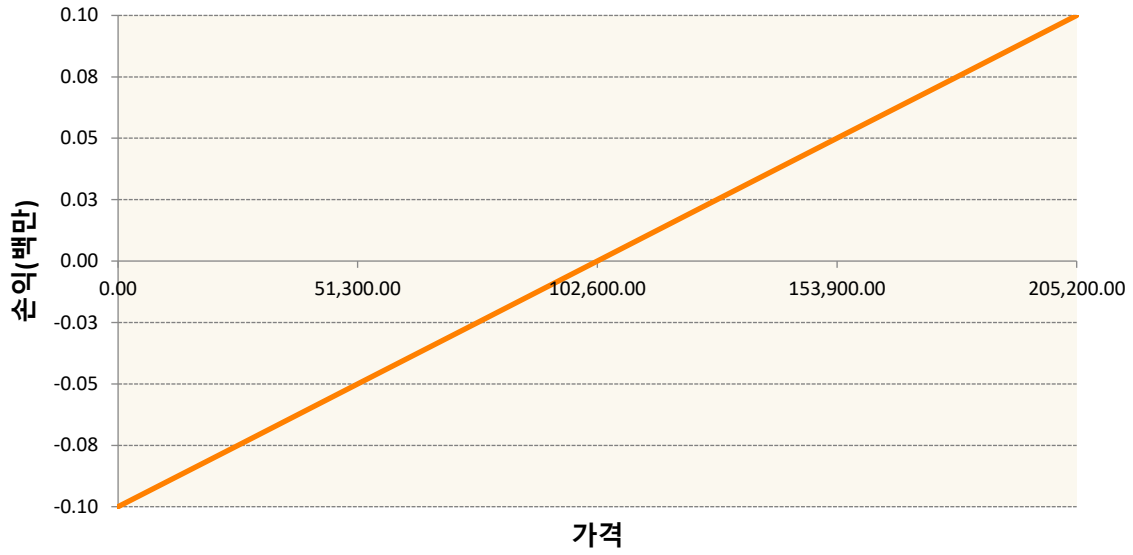
KR41BJVC0001-2024-12 엔씨소프트개별선물



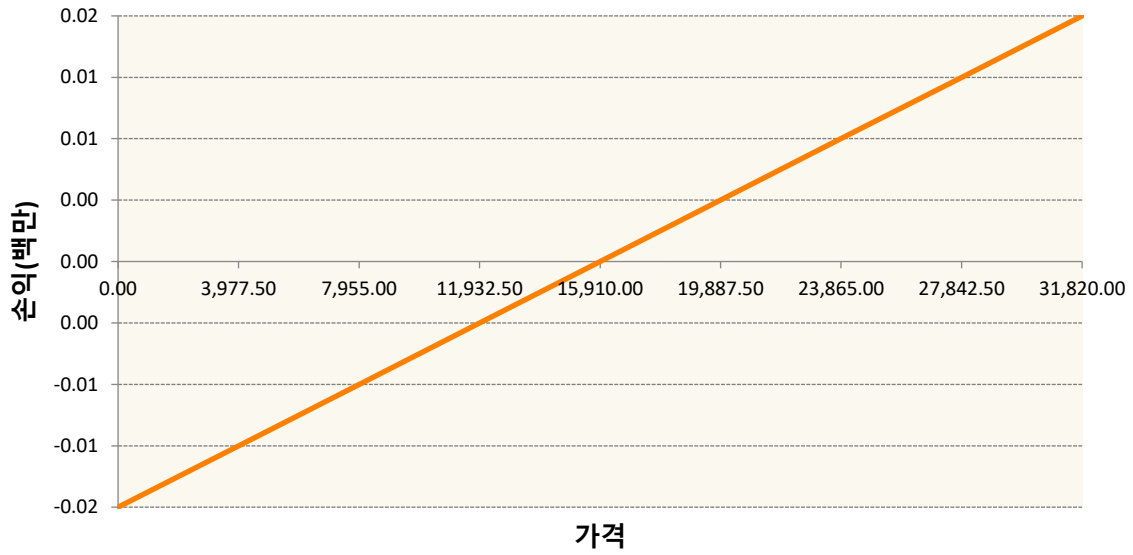
KR41BNVC0005-2024-12 현대건설개별선물



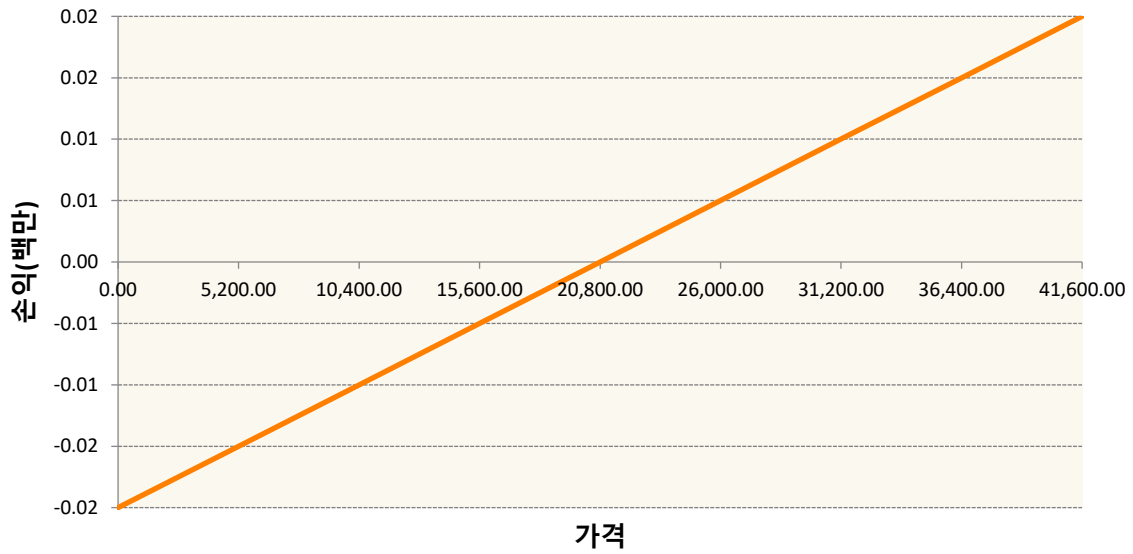
KR41C6VC0003-2024-12 아모레퍼시픽개별선물



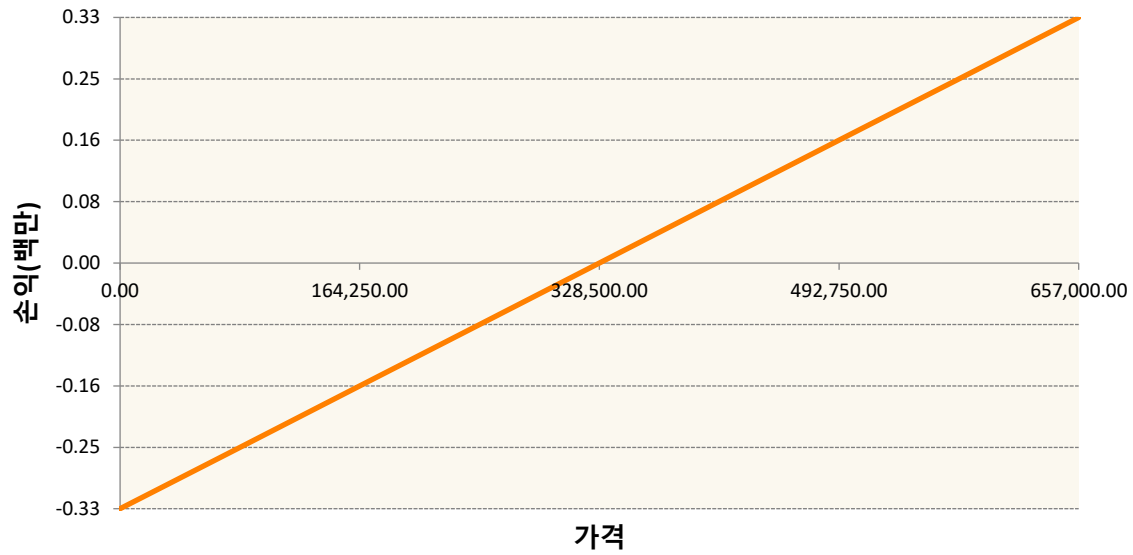
KR41CBVC0008-2024-12 한화솔루션개별선물



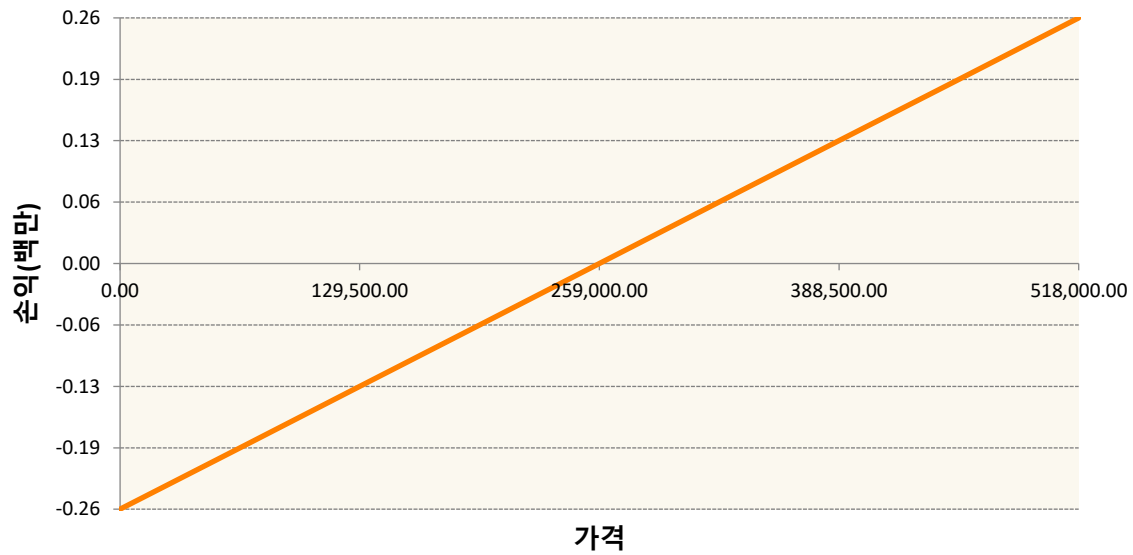
KR41CNVC0004-2024-12 포스코 ICT개별선물



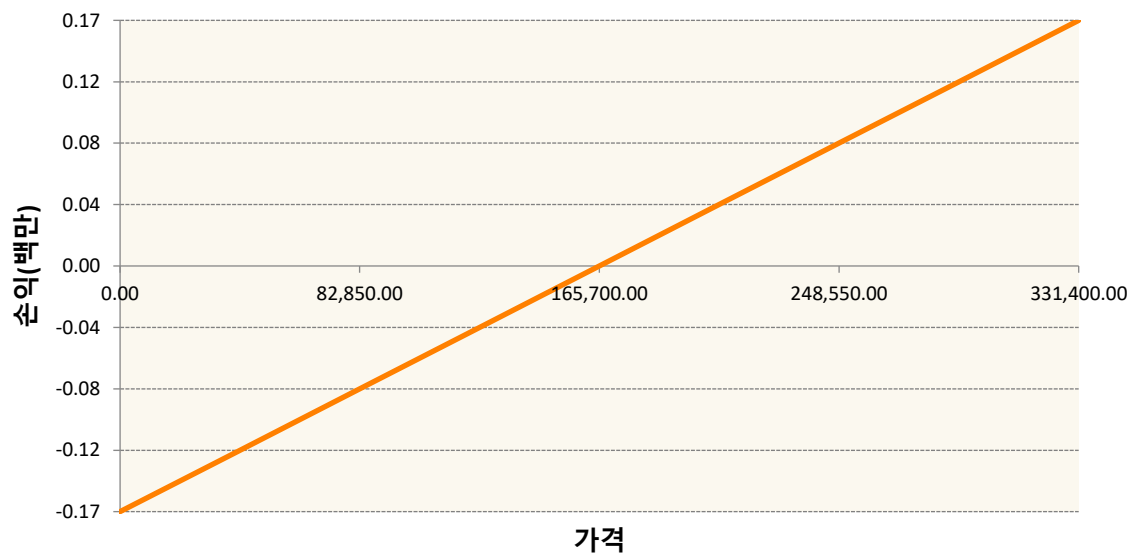
KR41CRVC0000-2024-12 LG생활건강개별선물



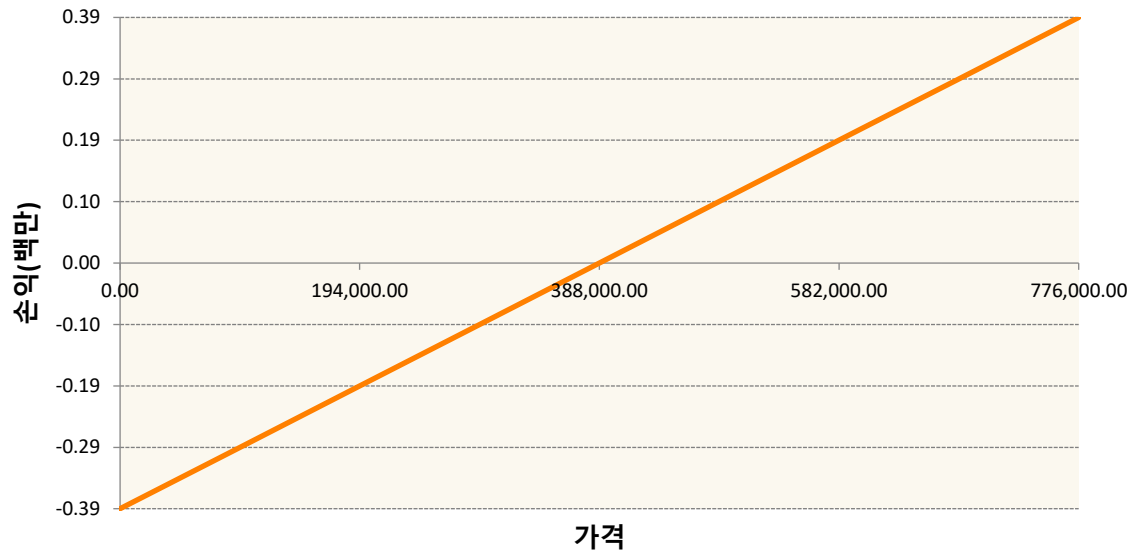
KR41D1VC0006-2024-12 CJ제일제당개별선물



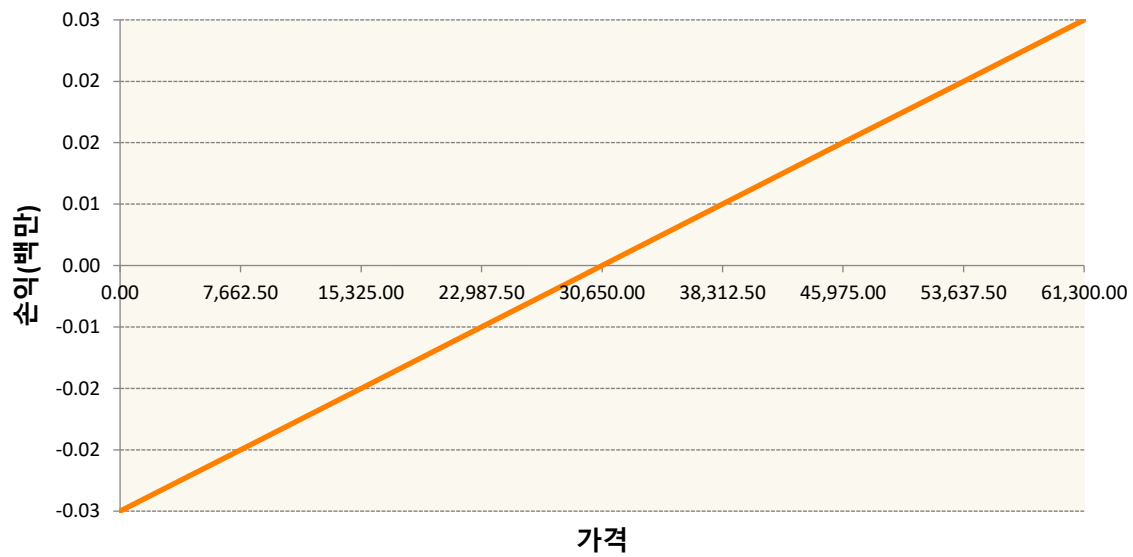
KR41E8VC0007-2024-12 포스코케미칼개별선물



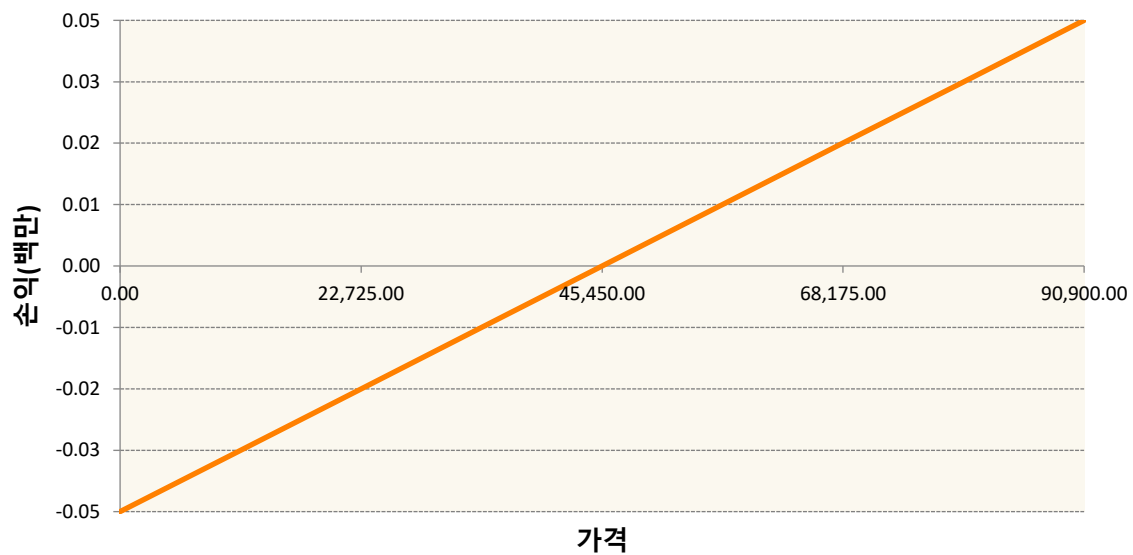
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



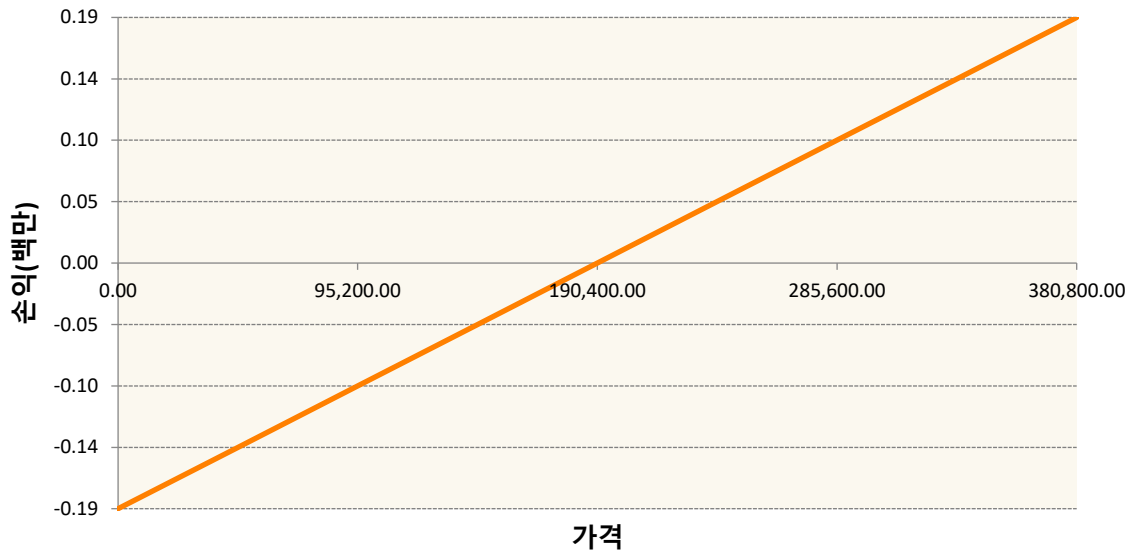
KR41F7VC0005-2024-12 카카오페이개별선물



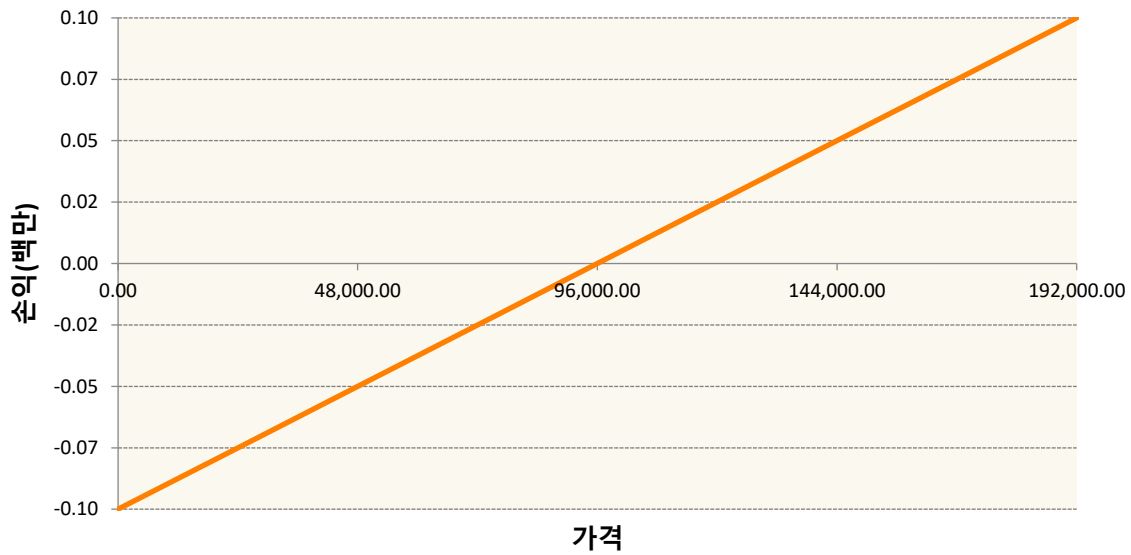
KR41F9VC0003-2024-12 SK바이오사이언스개별선물



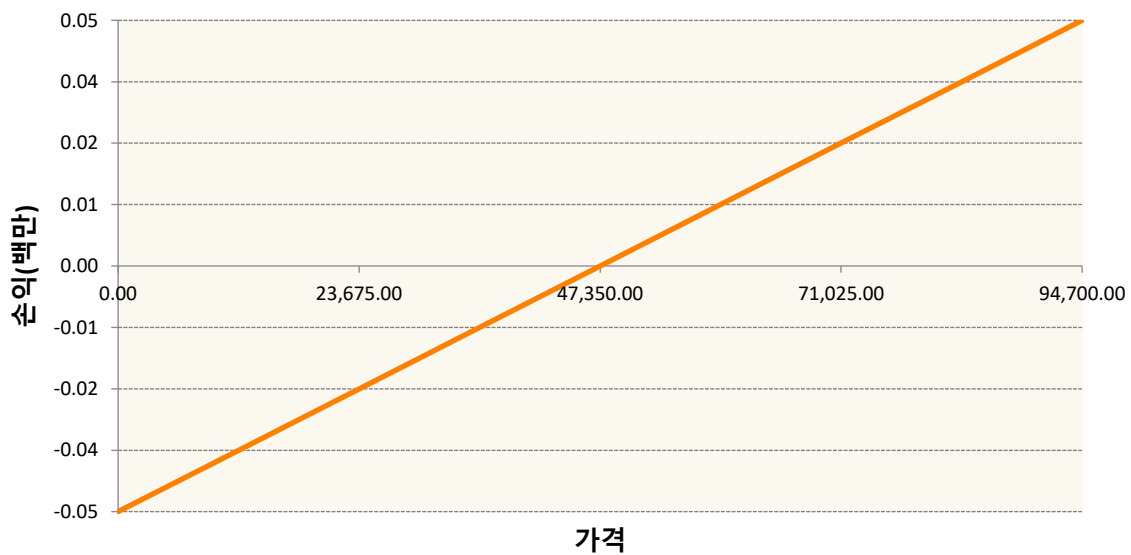
KR41FCVC0004-2024-12 하이브개별선물



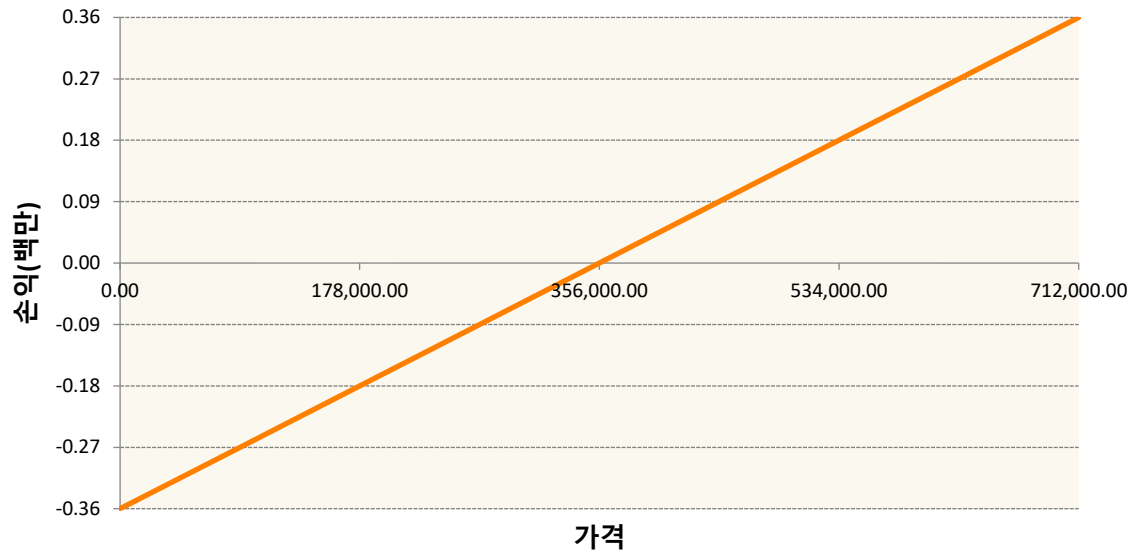
KR41FMVC0002-2024-12 엘앤에프개별선물



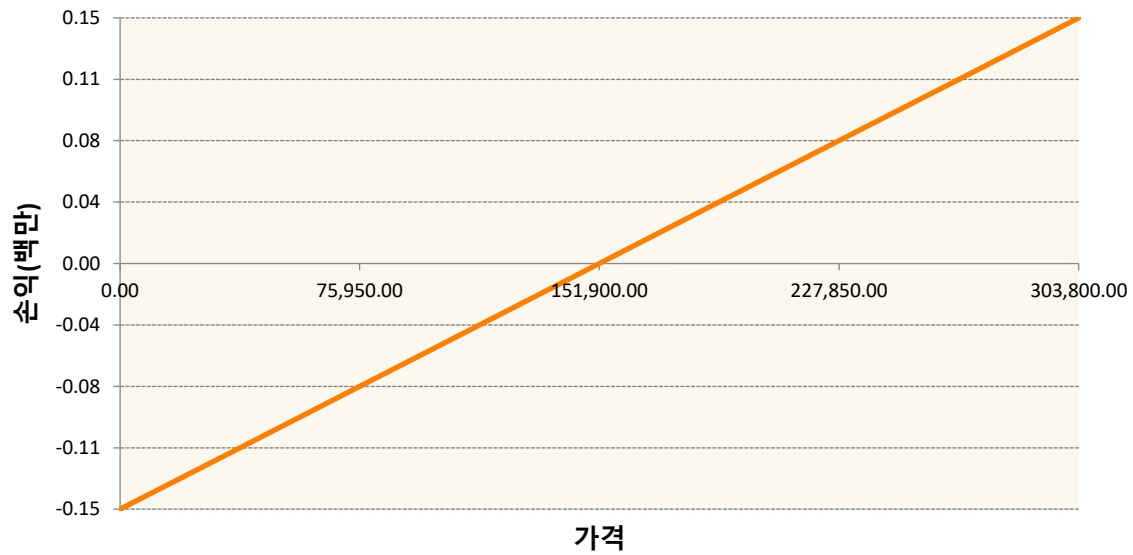
KR41G6VC0004-2024-12 현대로템개별선물



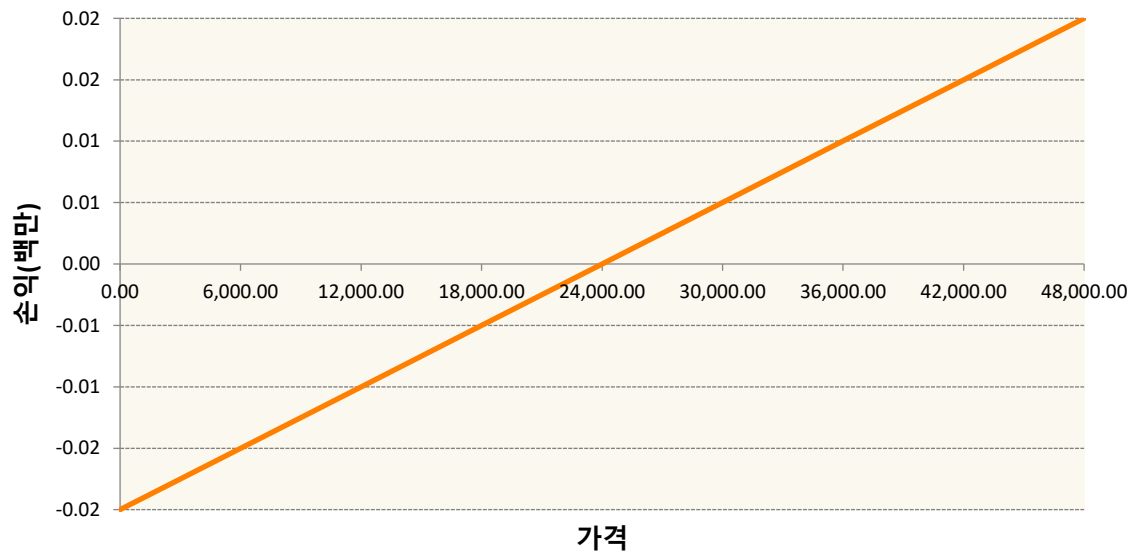
KR41GHVC0008-2024-12 HD현대일렉트릭개별선물



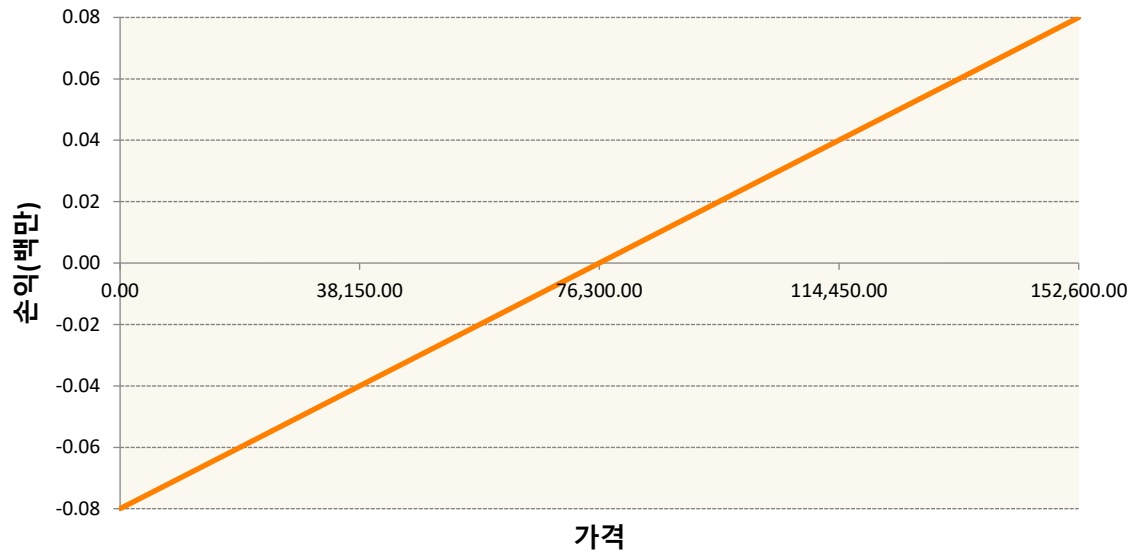
KR41GLVC0002-2024-12 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNVC0000-2024-12 금양개별선물



KR41GZVC0006-2024-12 에코프로머티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101VC0004 2024-12 코스피200지수선물 71

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-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%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	71	71	71	71	71	71	71

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

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%	-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

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

KR41F7VC0005	2024-12 카카오페이가별선물	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

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
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

KR41FCVC0004 2024-12 하이브개별선물 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

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 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)

122

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

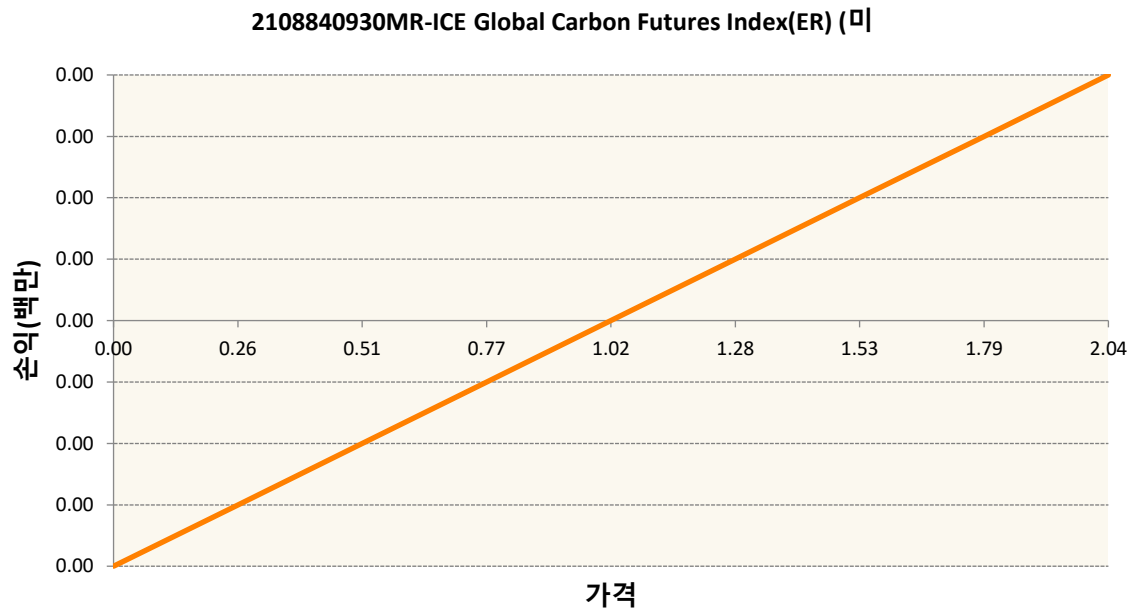
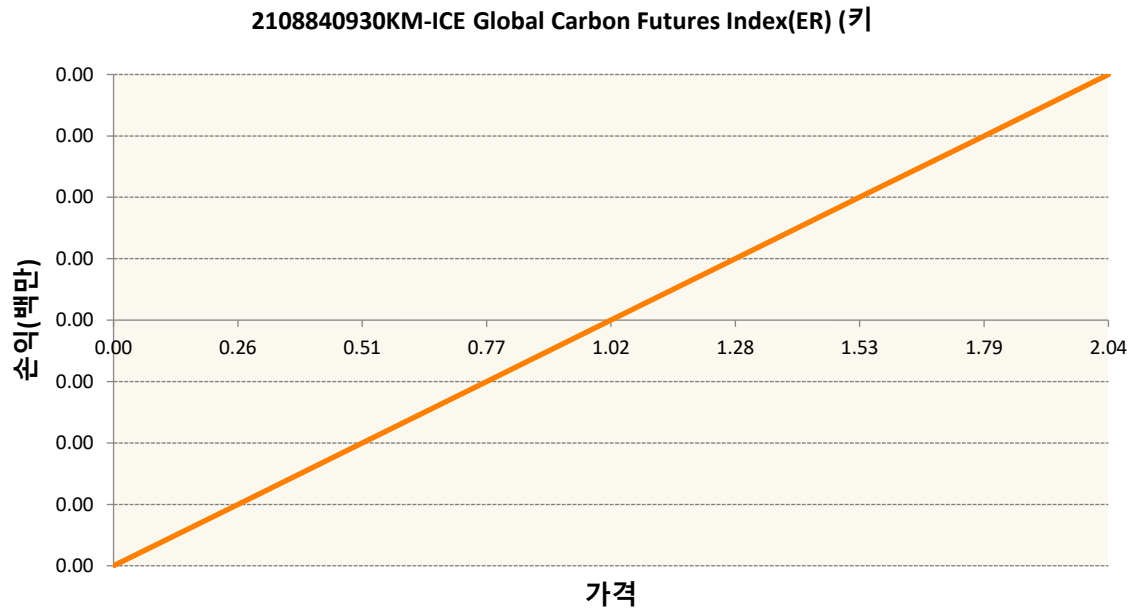
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

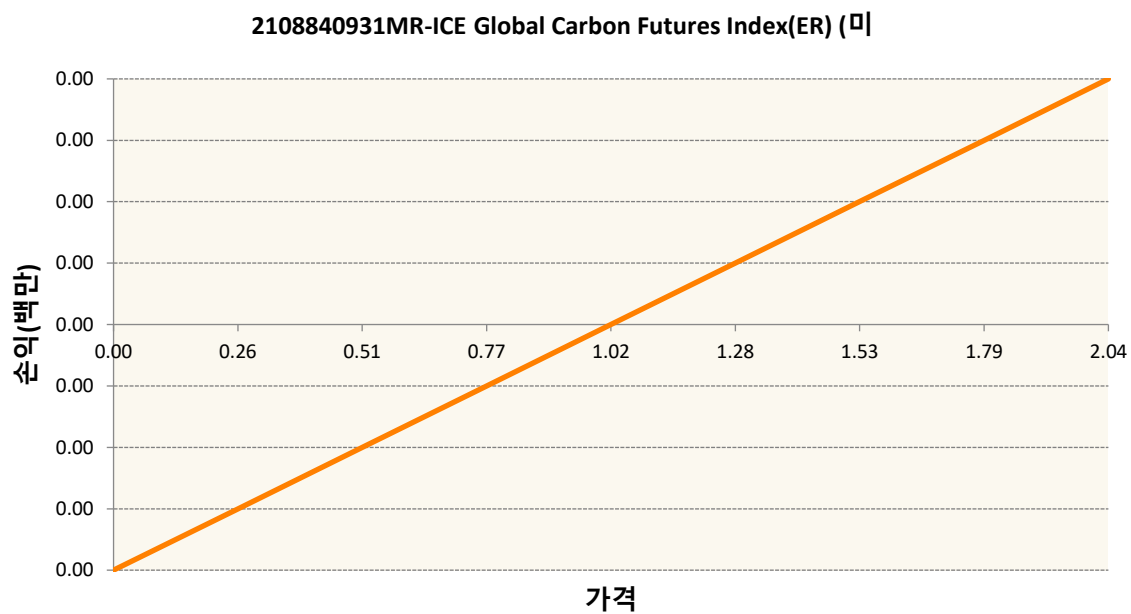
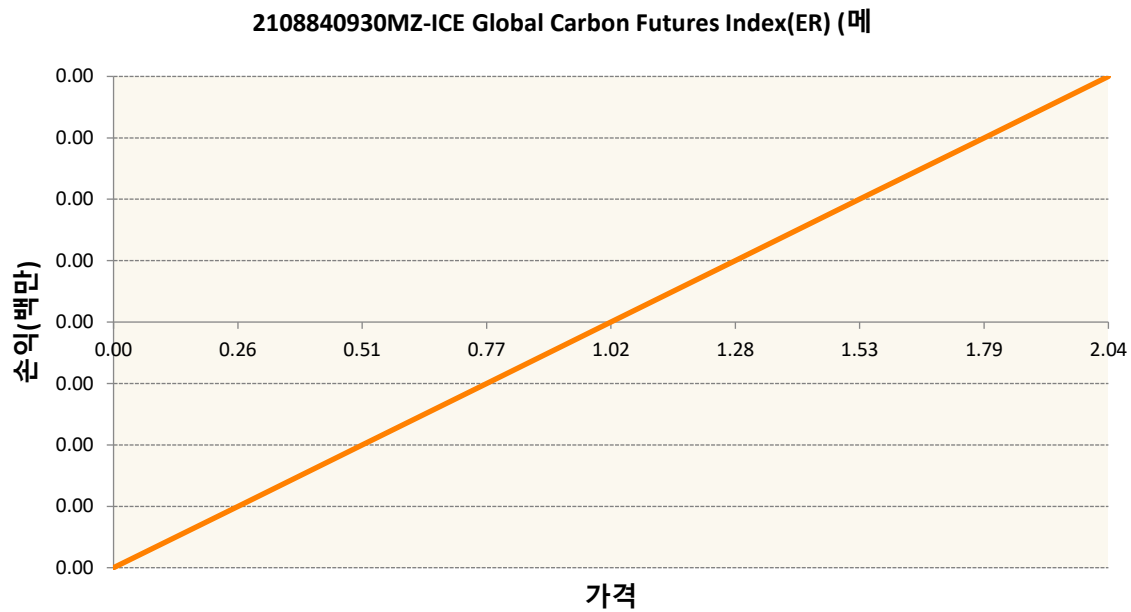
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,528	0	11,528	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		92
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		461
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		184
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		184

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	975

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

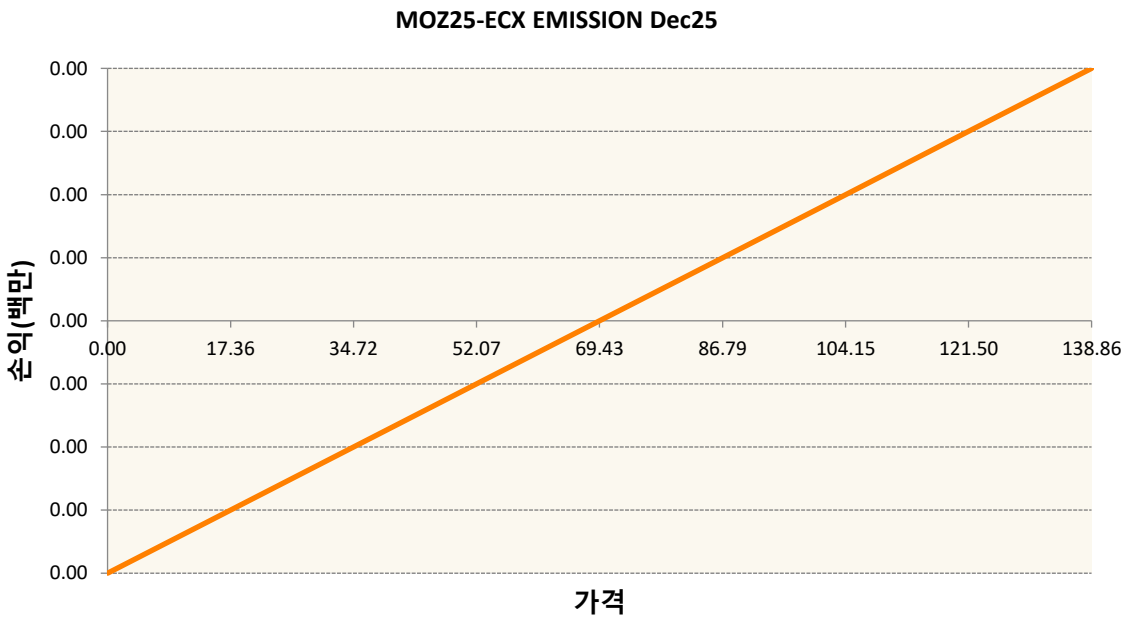
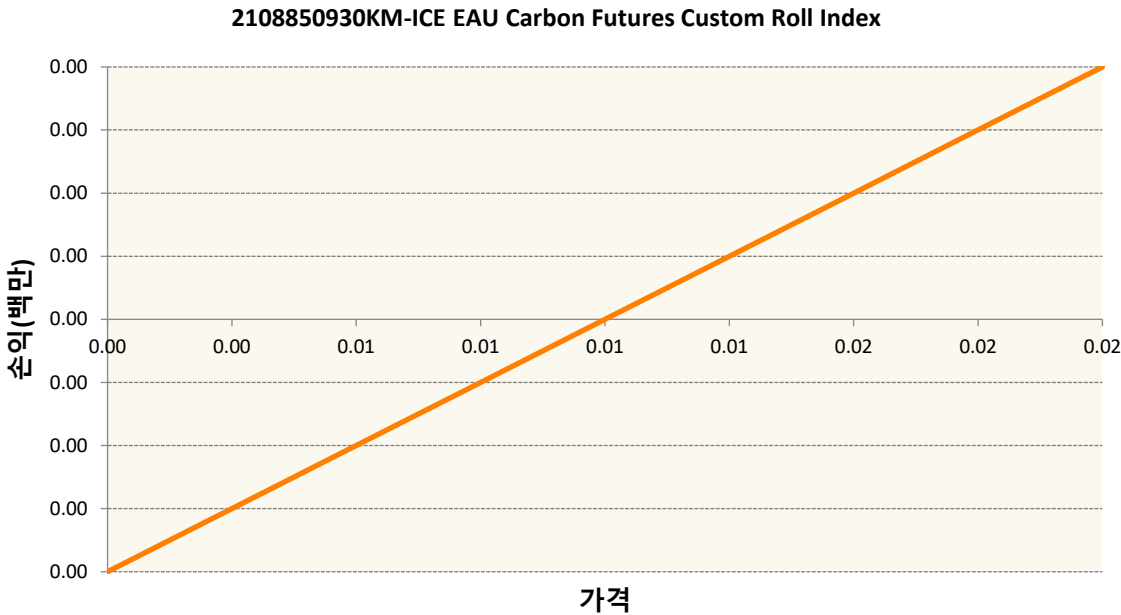
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,699	0	8,699	
누계	통화	선도	0	2,243	-2,243	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		0.33
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		25
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		154
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		696

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,254

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

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)

152

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

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)	64
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(NH)	54
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(메리츠)	76
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	16

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

(단위:백만원)

348

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

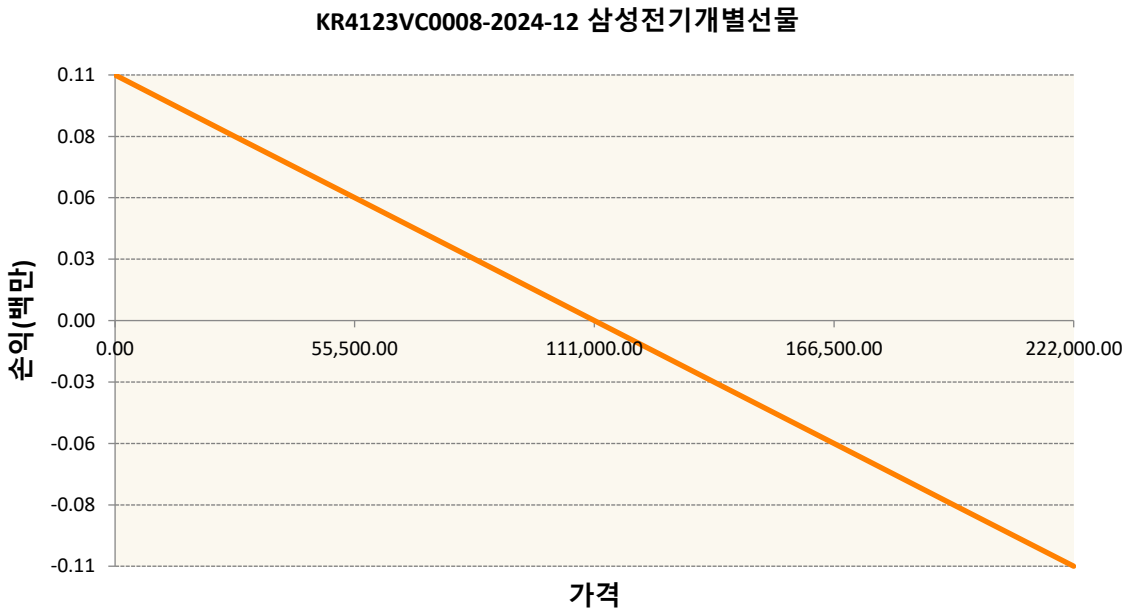
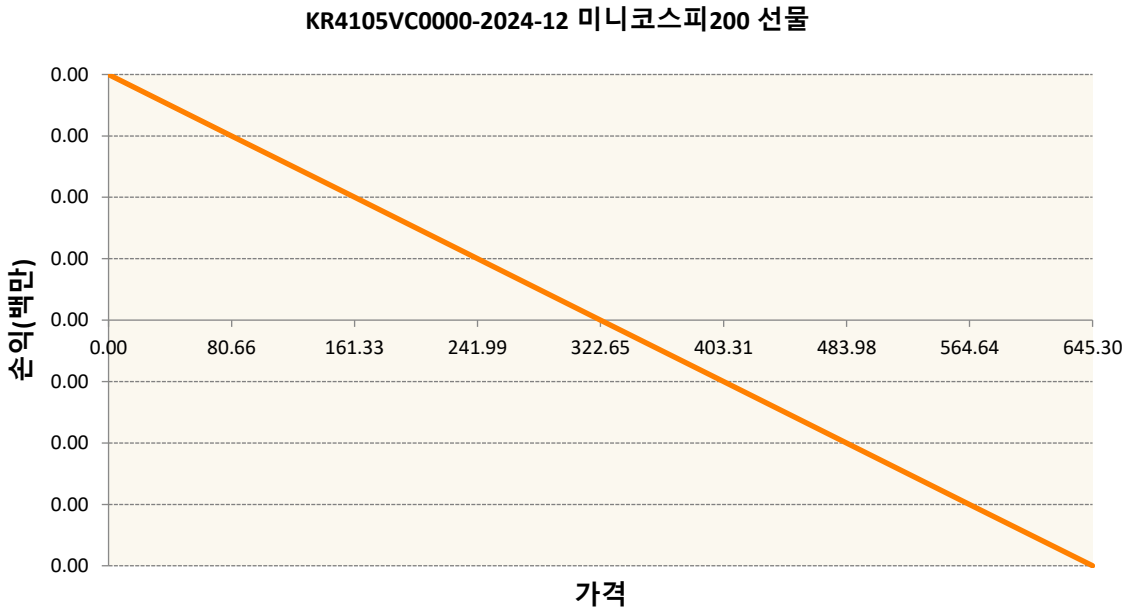
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

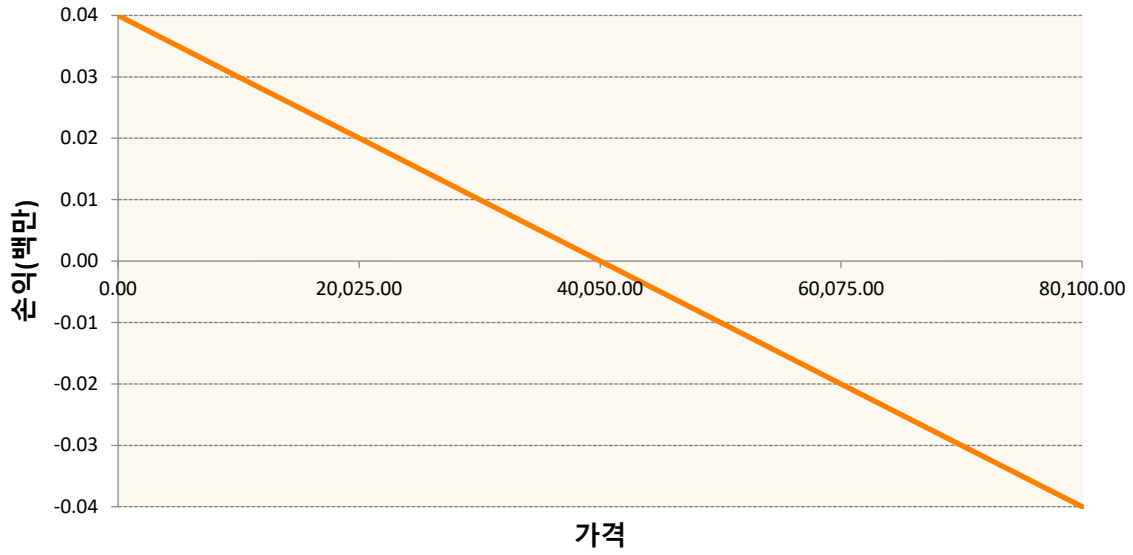
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8	218	-210	장내

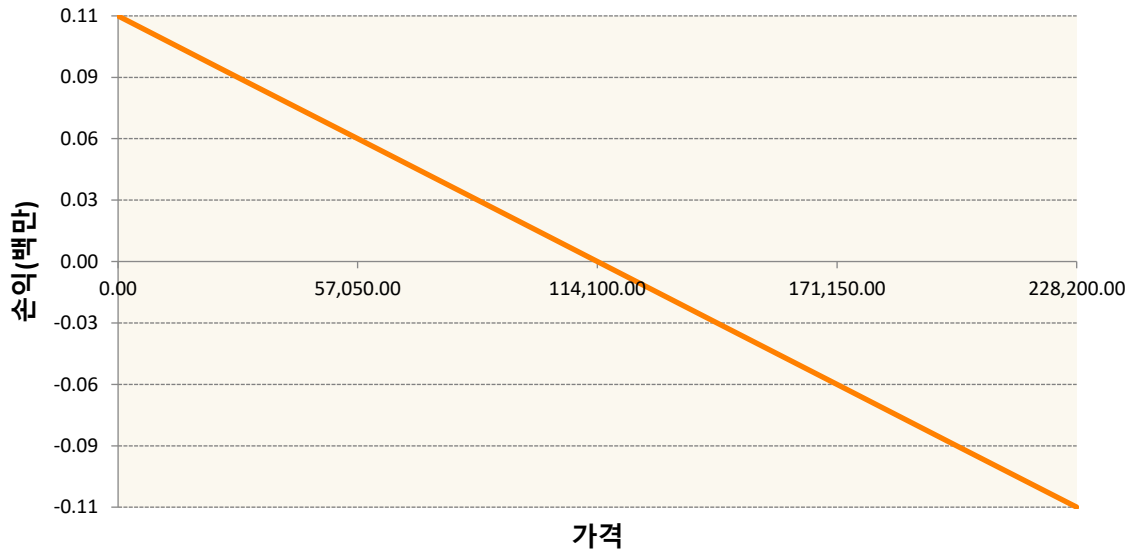
2. 만기시점의 손익구조



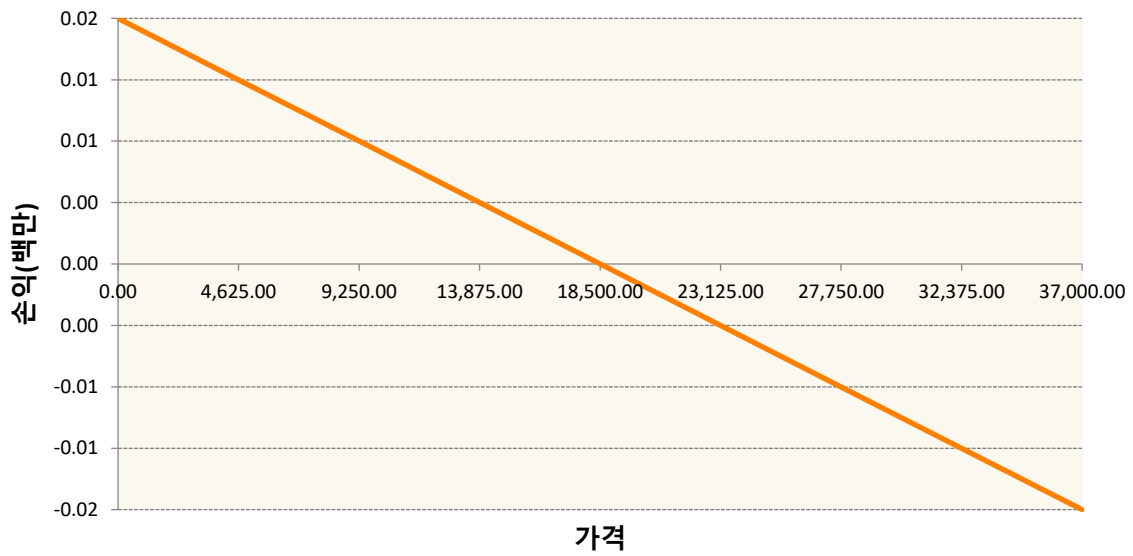
KR4135VC0004-2024-12 GS개별선물



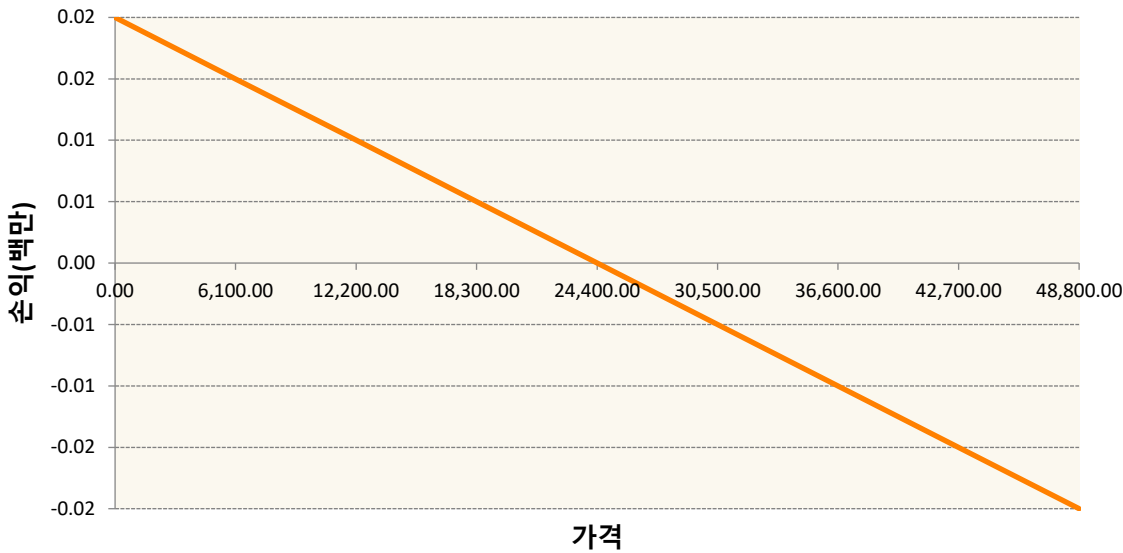
KR4141VC0006-2024-12 SK이노베이션개별선물



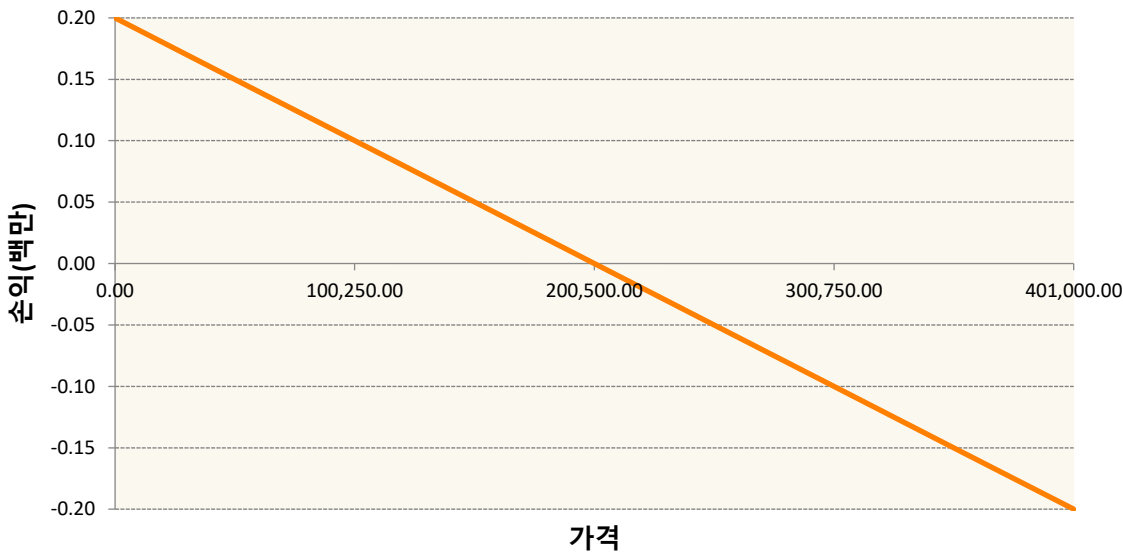
KR4151VC0003-2024-12 GS건설개별선물



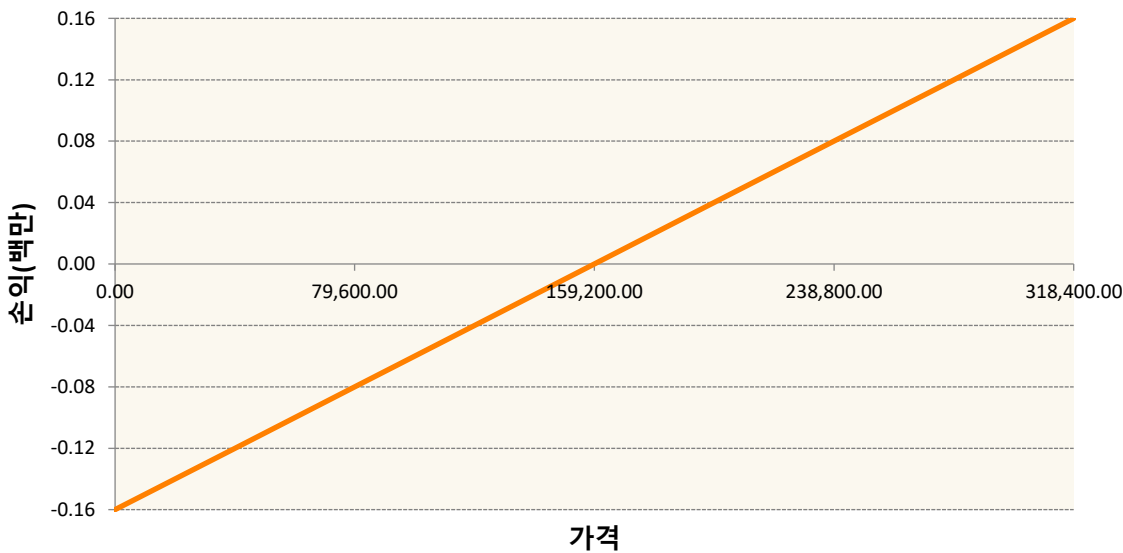
KR4157VC0007-2024-12 대한항공개별선물



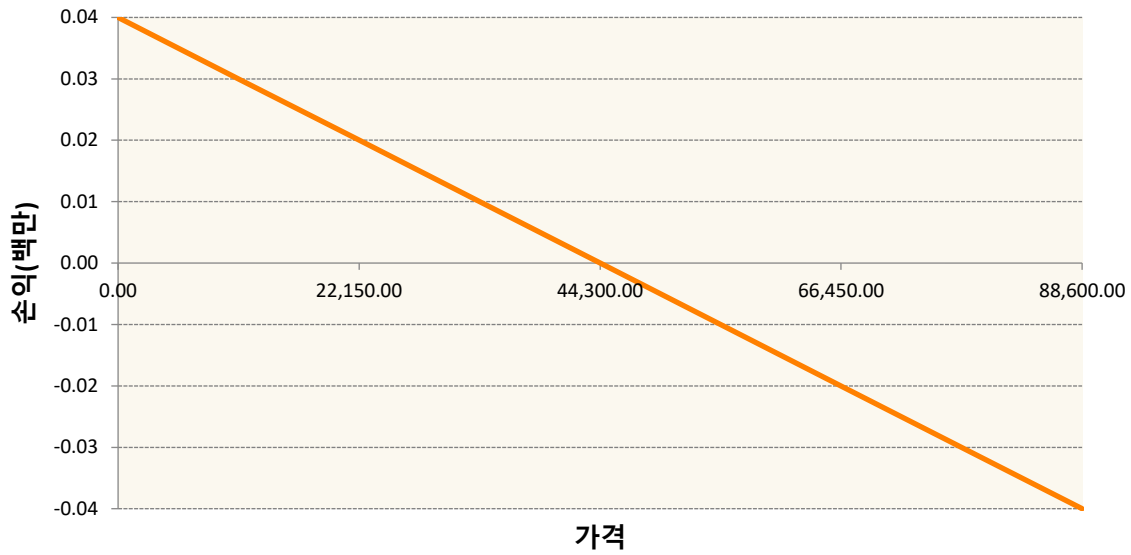
KR41BJVC0001-2024-12 엔씨소프트개별선물



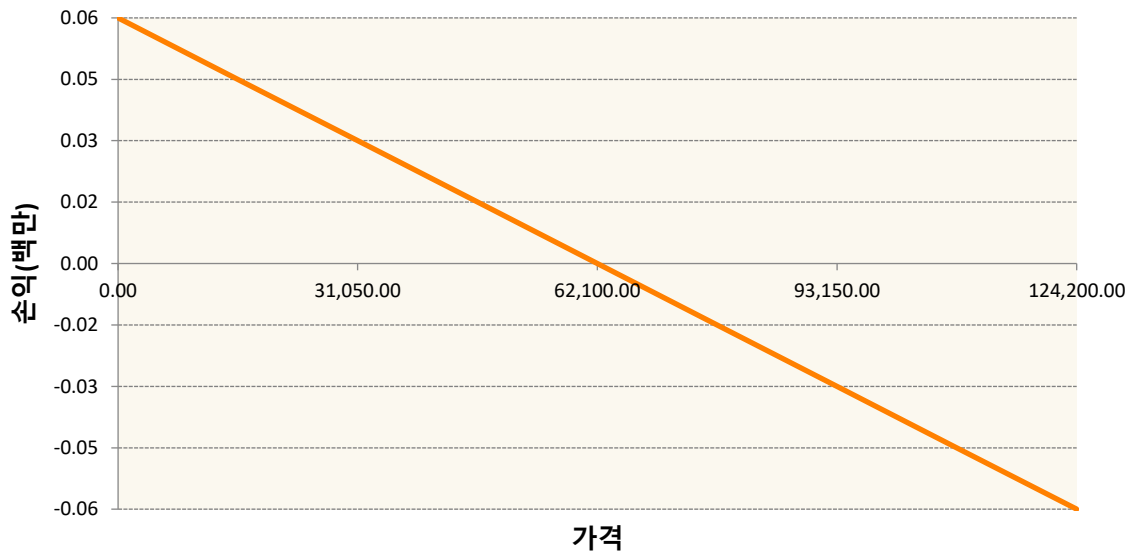
KR41BYVC0002-2024-12 LG이노텍개별선물



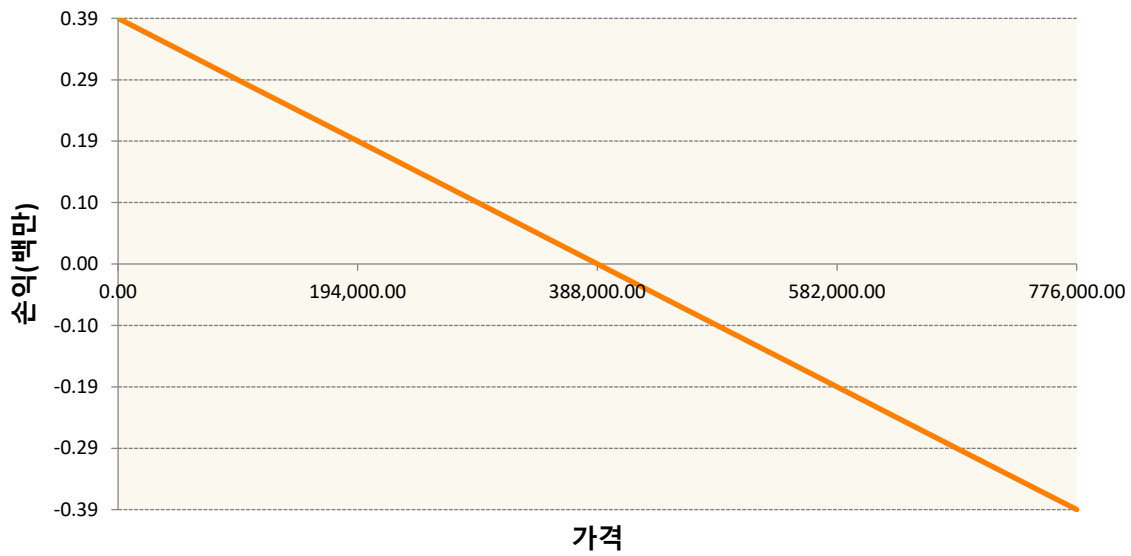
KR41CFVC0004-2024-12 카카오개별선물



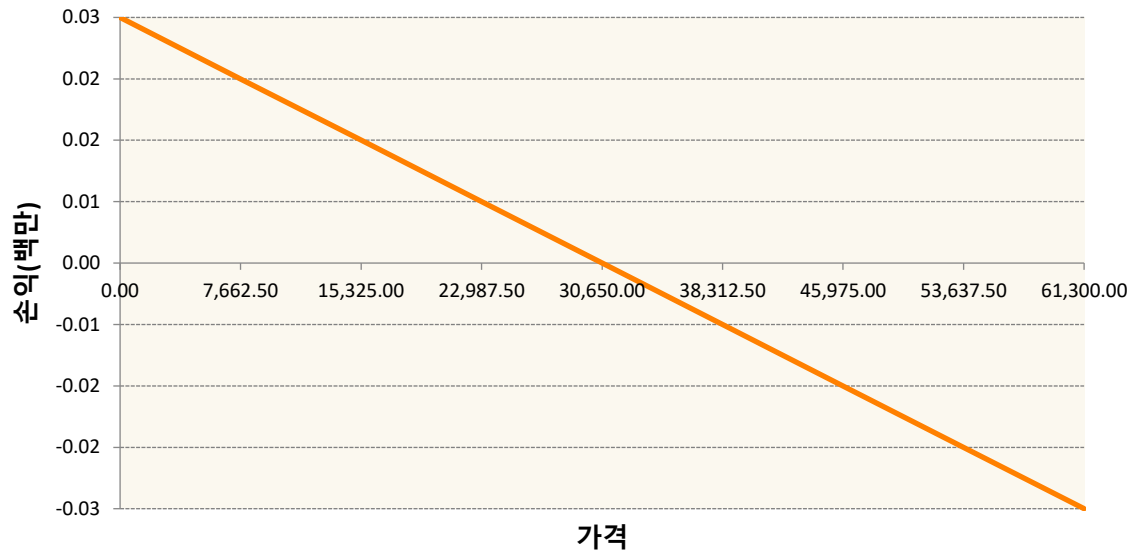
KR41DTVC0007-2024-12 CJ ENM개별선물



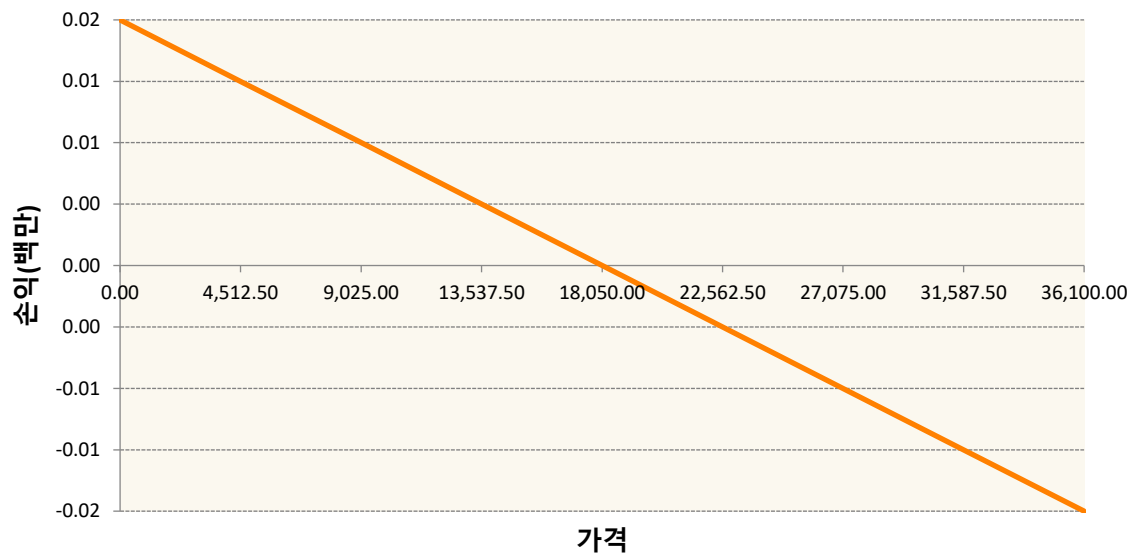
KR41F5VC0007-2024-12 LG에너지솔루션개별선물



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	0.16
KR4141VC00 2024-12 SK이노베이션개별선물	0.18
KR4151VC00 2024-12 GS건설개별선물	0.27
KR4157VC00 2024-12 대한항공개별선물	0.35
KR41BJVC00 2024-12 엔씨소프트개별선물	1
KR41BYVC00 2024-12 LG이노텍개별선물	1
KR41CFVC00 2024-12 카카오개별선물	0.5
KR41DTVC00 2024-12 CJ ENM개별선물	0.25
KR41F5VC00 2024-12 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F7VC00 2024-12 카카오페이개별선물	0.29

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

(단위:백만원)

14

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

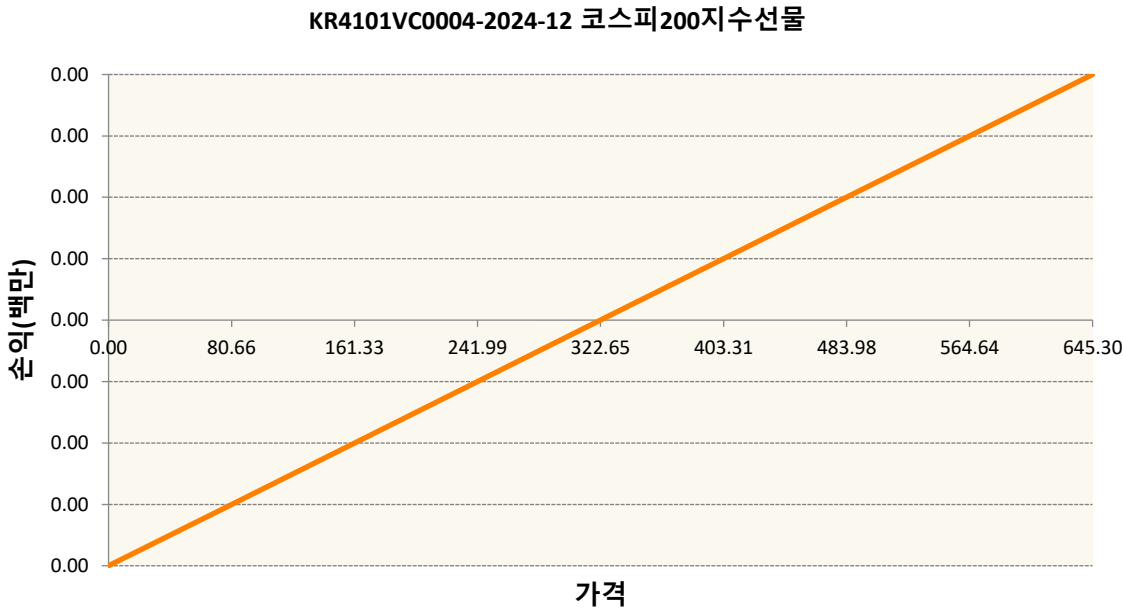
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	7,260	0	7,260	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101VC0004		2024-12 코스피200지수선물					580
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-580	-580	-580	-580	-580	-580	-580
-5.33%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386
-2.67%	-193	-193	-193	-193	-193	-193	-193
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	193	193	193	193	193	193	193
5.33%	386	386	386	386	386	386	386
8.00%	580	580	580	580	580	580	580

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

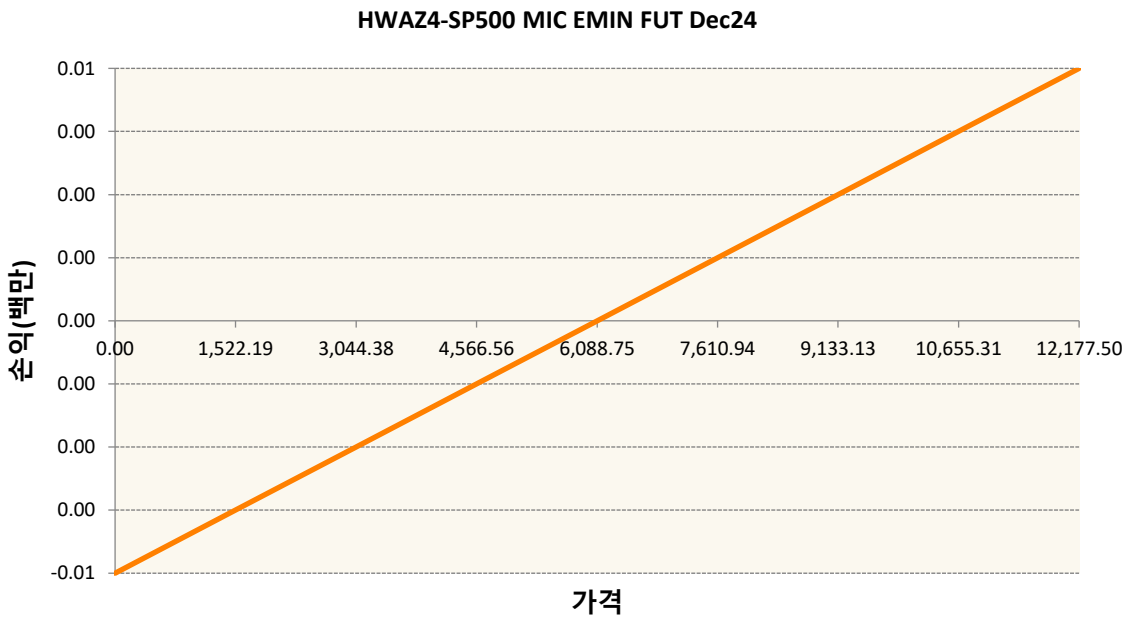
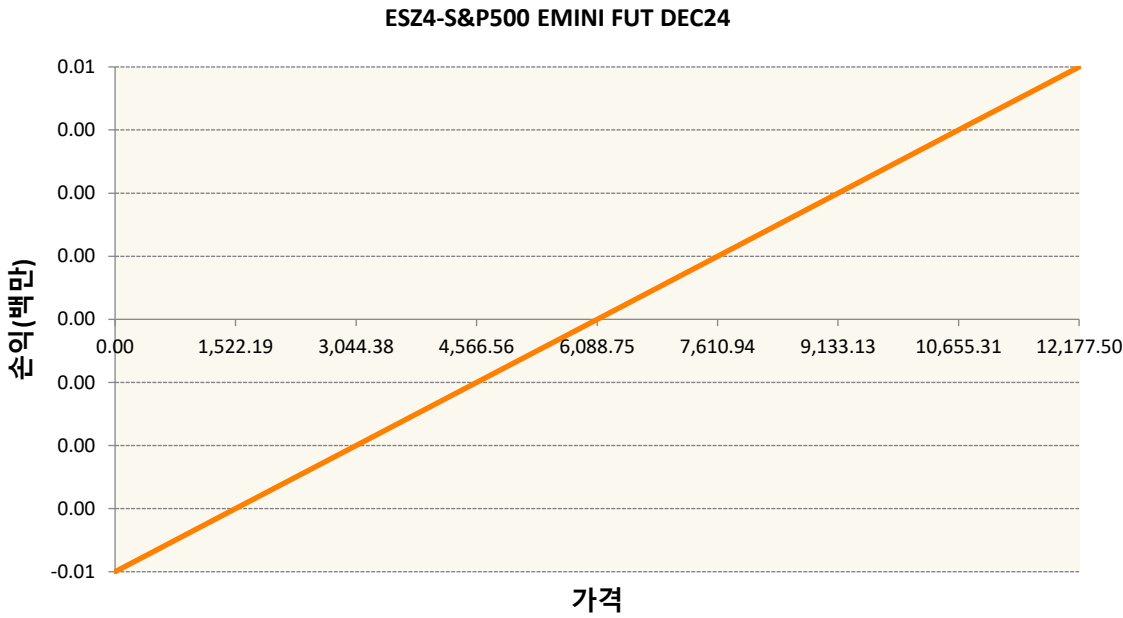
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	20,411	0	20,411	
누계	유가증권	선물	2,007	0	2,007	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,633
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	161

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,094

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

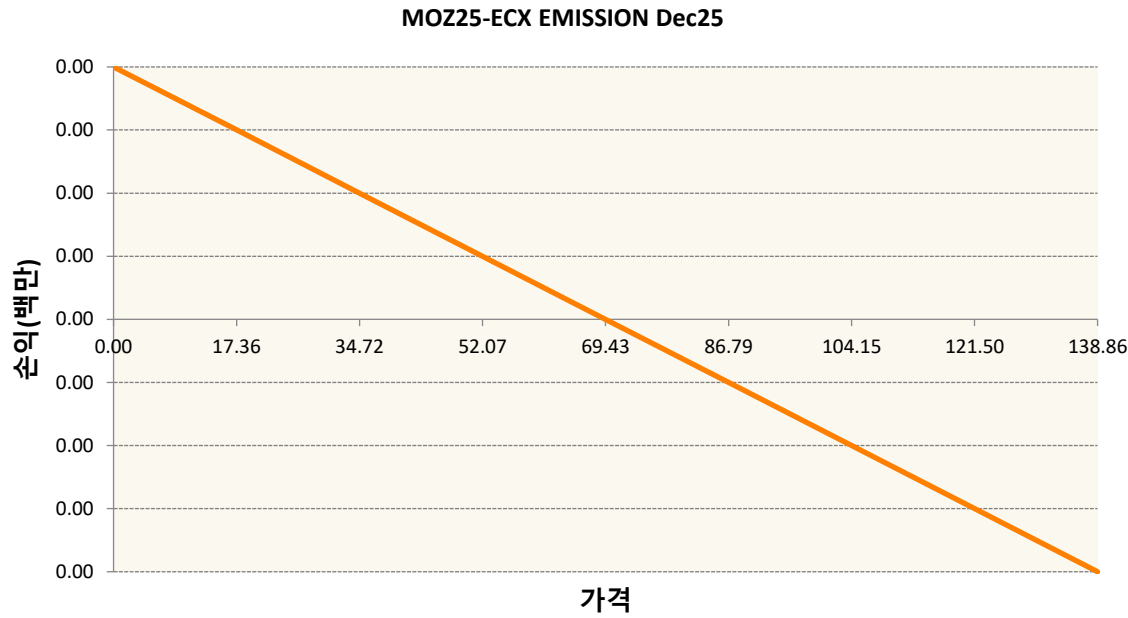
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-4	5,698	-5,702	
누계	통화	선도	0	1,156	-1,156	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.41
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E	93
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	456

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

(단위:백만원)

809

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

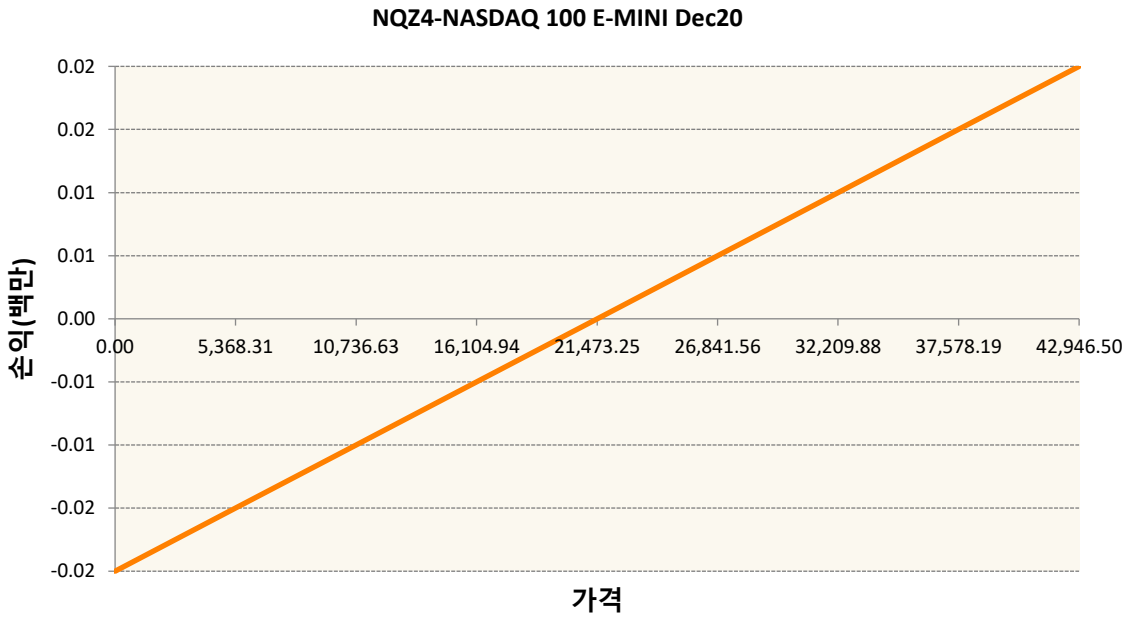
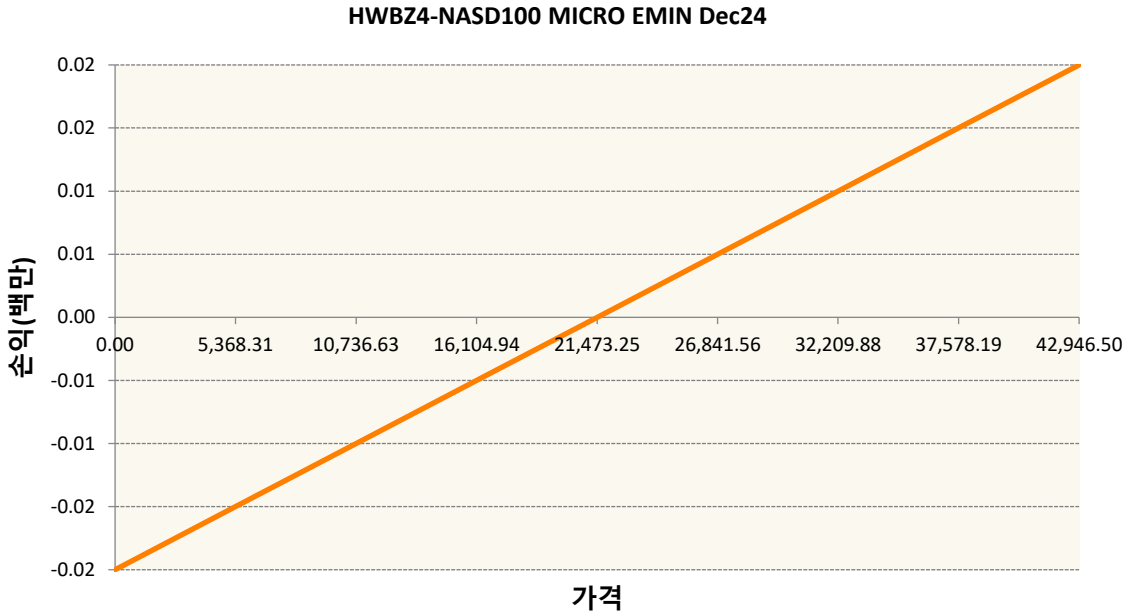
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	11,139	0	11,139	
누계	유가증권	선물	1,359	0	1,359	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		109
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		891

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			829

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

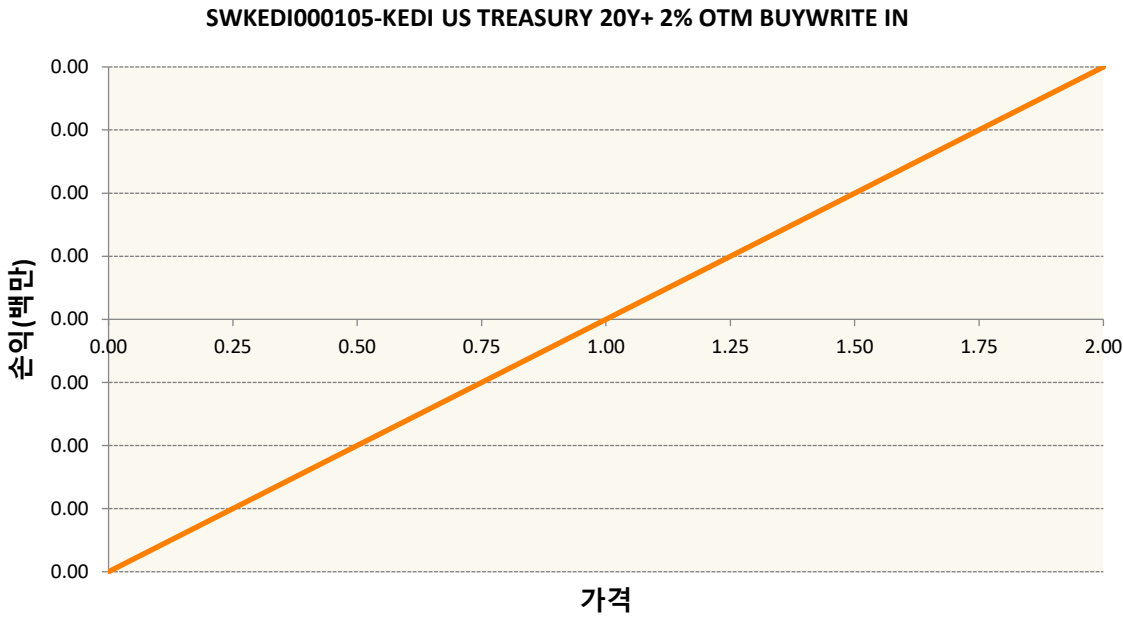
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

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	202,769	0	202,769	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	723
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,884
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,747
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,155

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

(단위:백만원)

9,794

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

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	23
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	23
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	23
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	23

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

(단위:백만원)

98

공시일	2024-12-09
기준일	2024-12-06

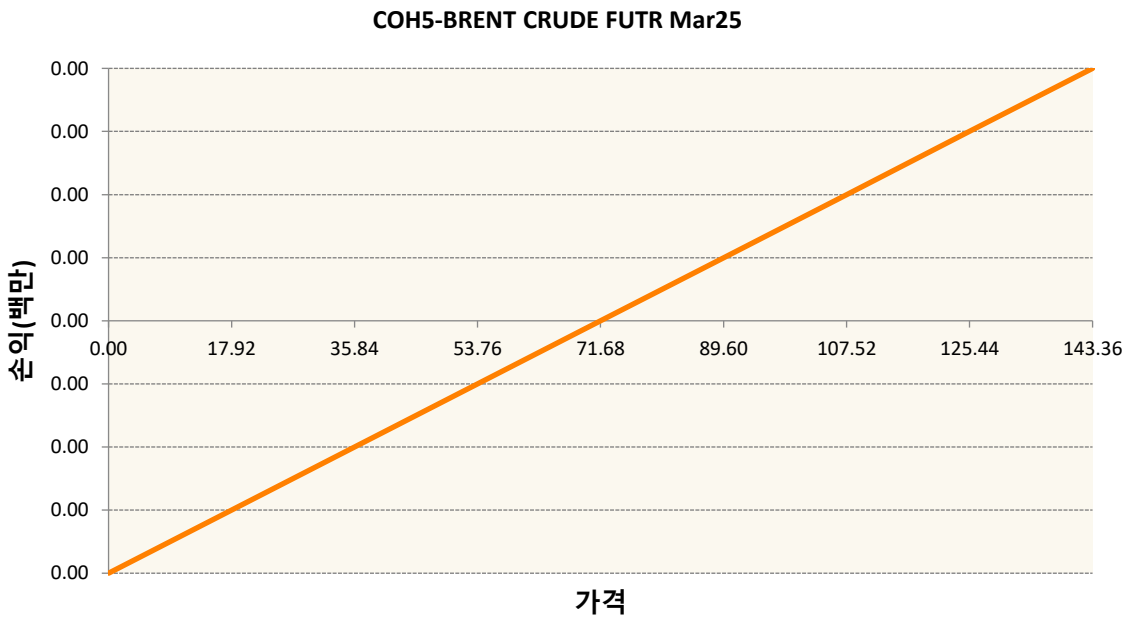
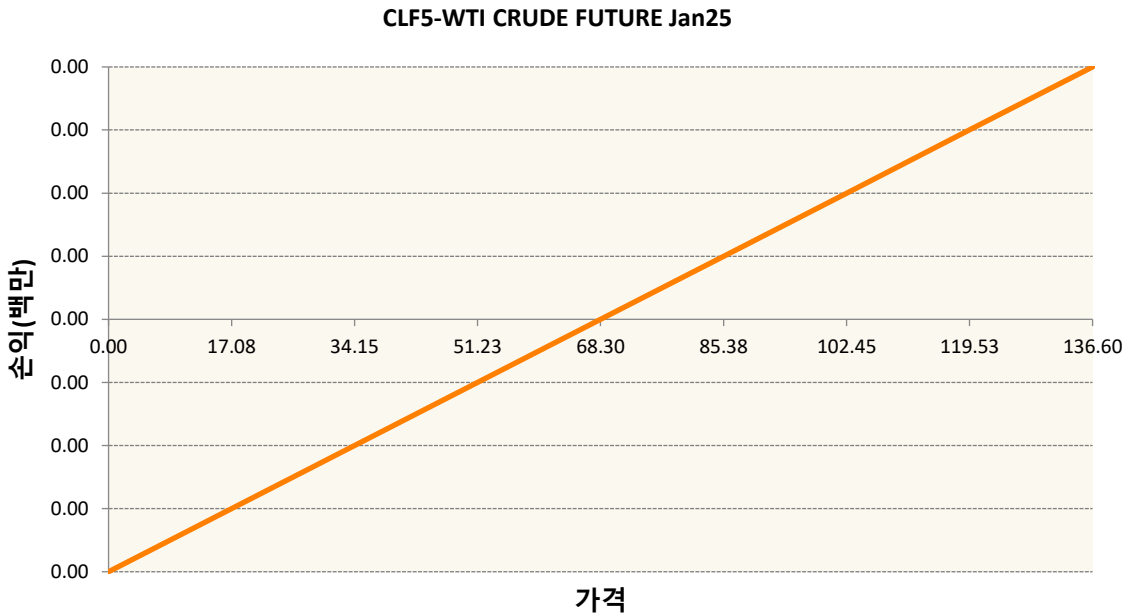
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

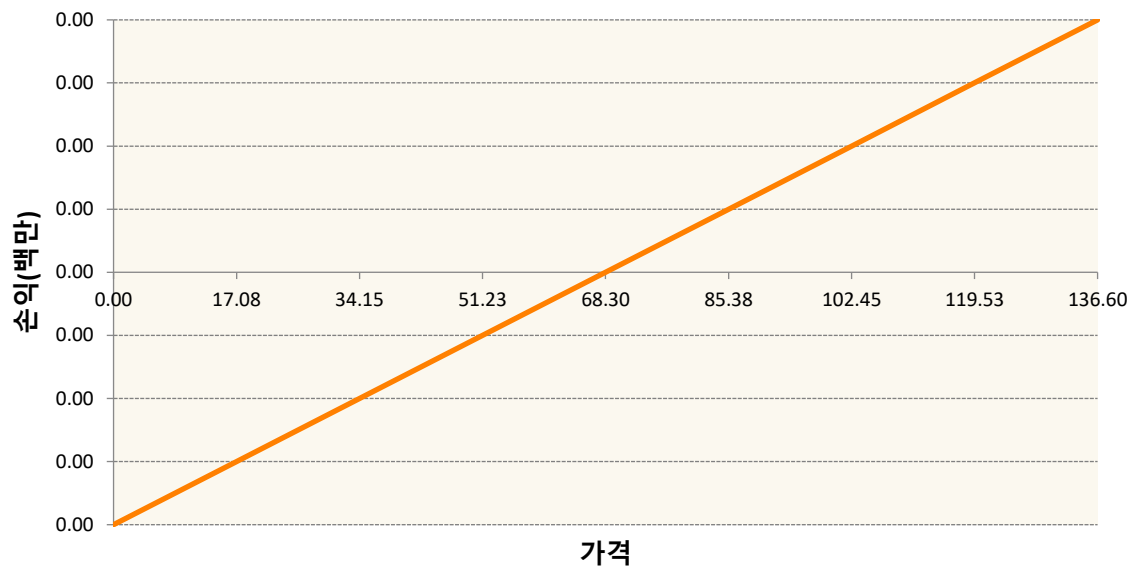
(단위:백만원)

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	734	0	734	
누계	통화	선물	0	99	-99	장내

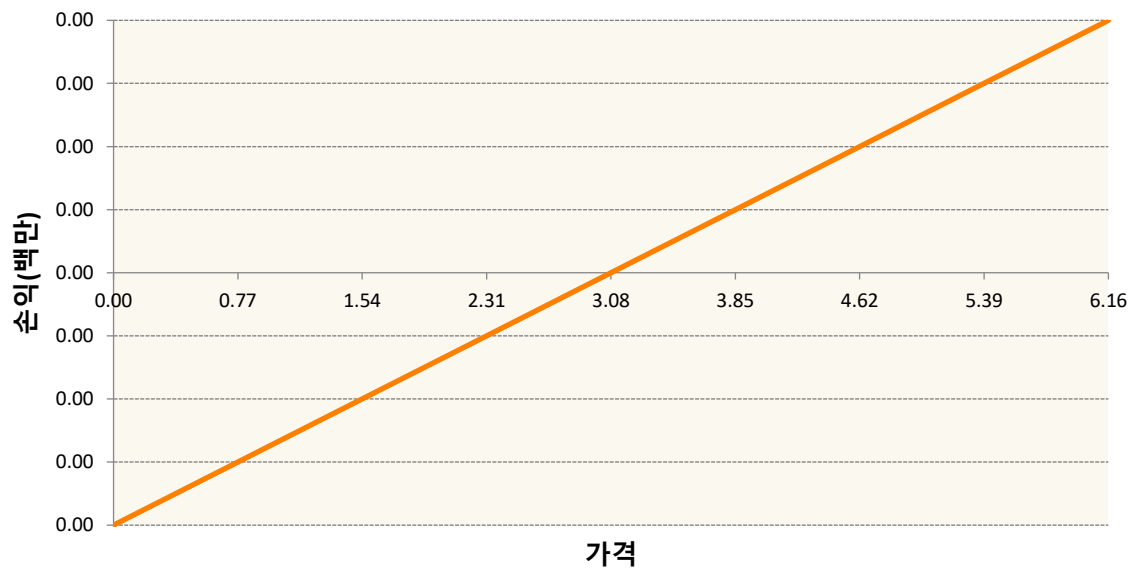
2. 만기시점의 손익구조



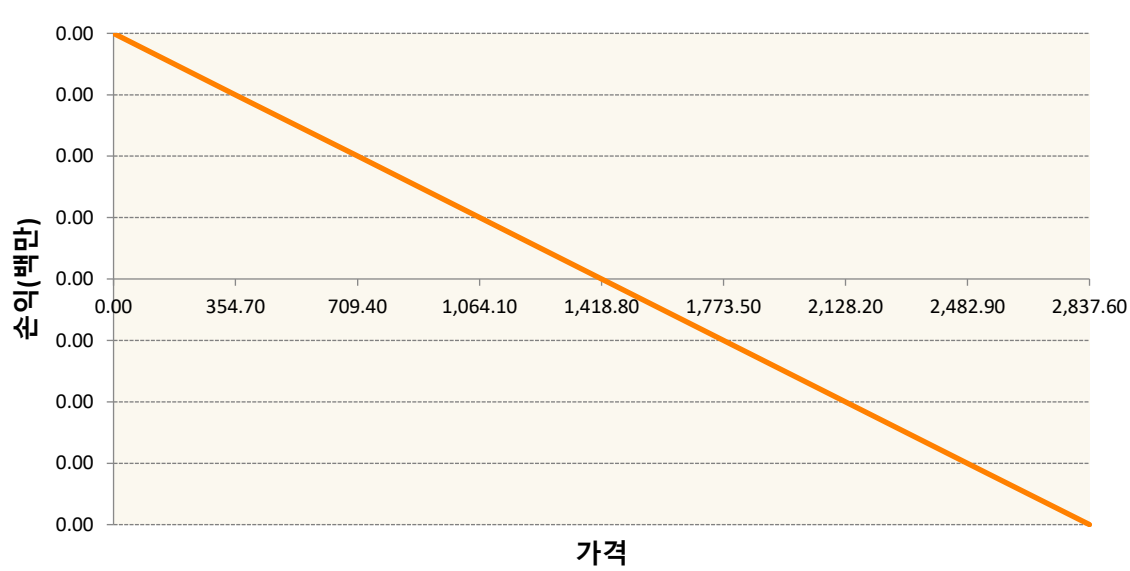
ECF5-E-MINI CRUDE OIL Jan25



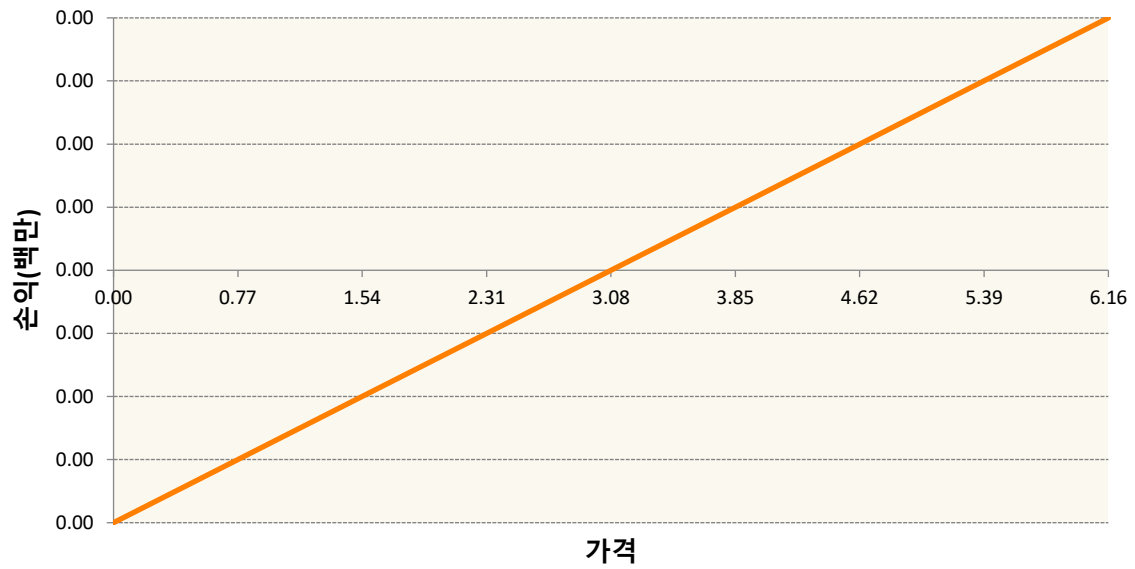
EOF5-E-MINI NATURAL GAS Jan25



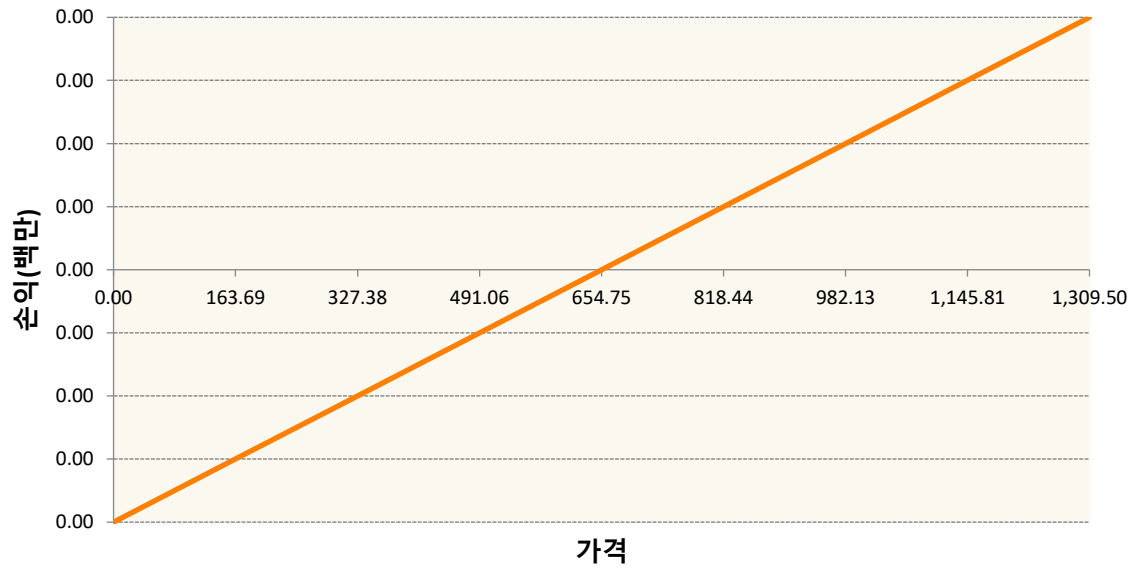
KR4175VC0005-2024-12 달러선물



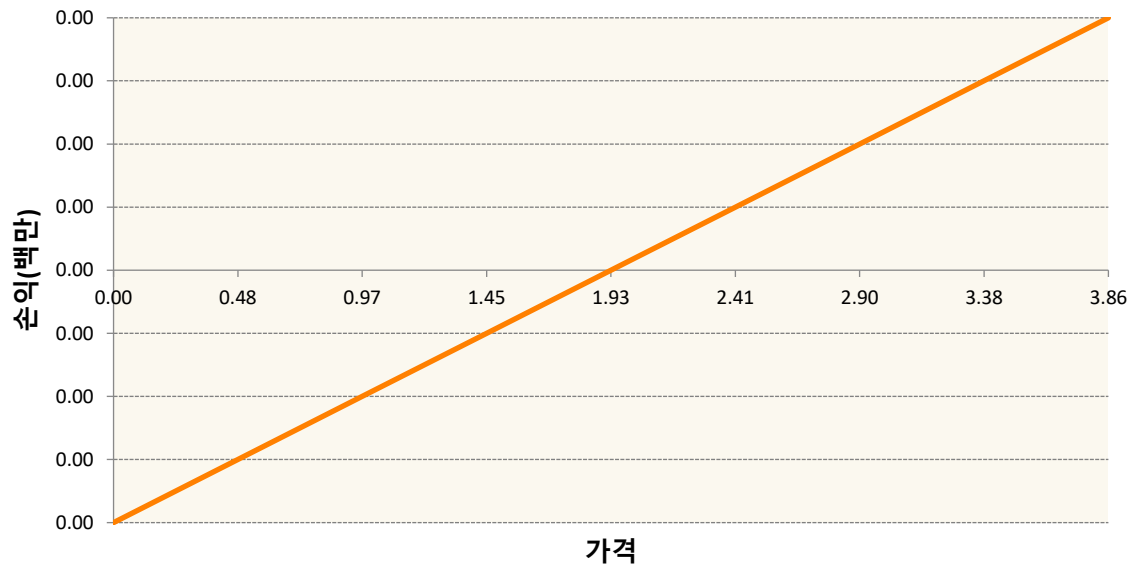
NGF25-NATURAL GAS FUTR Jan25



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	3
KR4175VC00 2024-12 달러선물		8
NGF25	NATURAL GAS FUTR Jan25	13
QSF5	Low Su Gasoil G Jan25	7
XBF5	GASOLINE RBOB FUT Jan25	9

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

124