

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

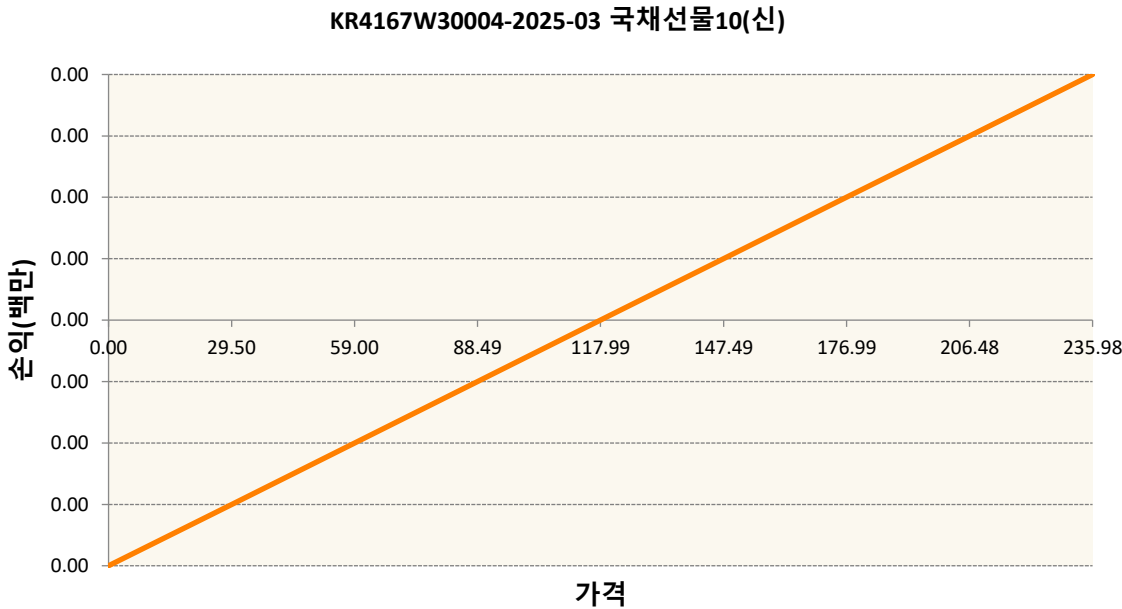
베스트장기채(채권-파생형)

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	68,434	0	68,434	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

1,794

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

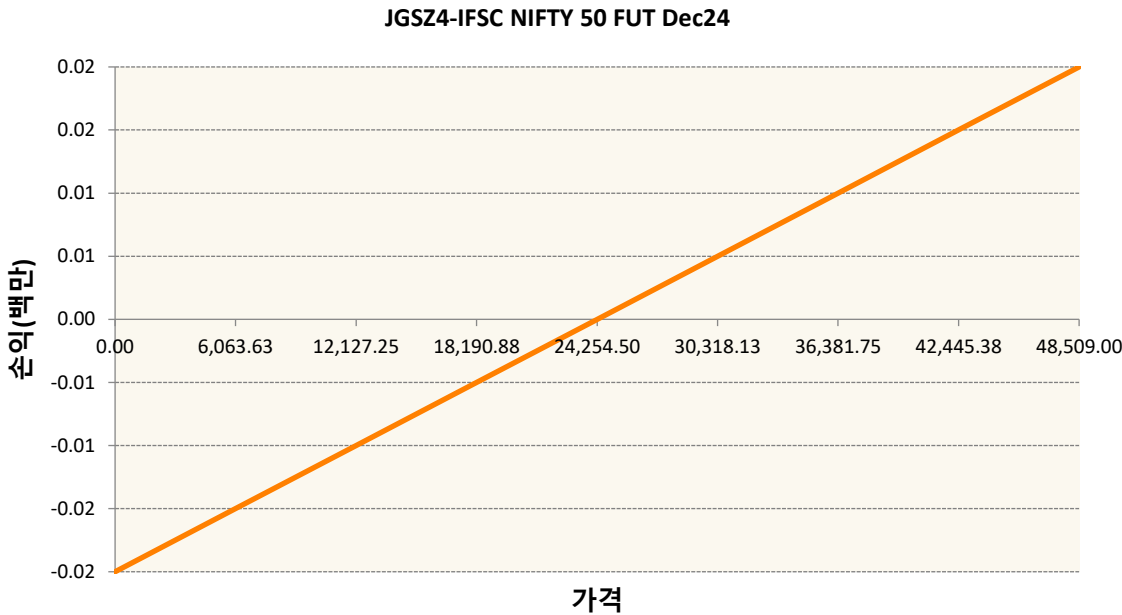
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,321	0	3,321	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSZ4	IFSC NIFTY 50 FUT Dec24	266
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

177

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

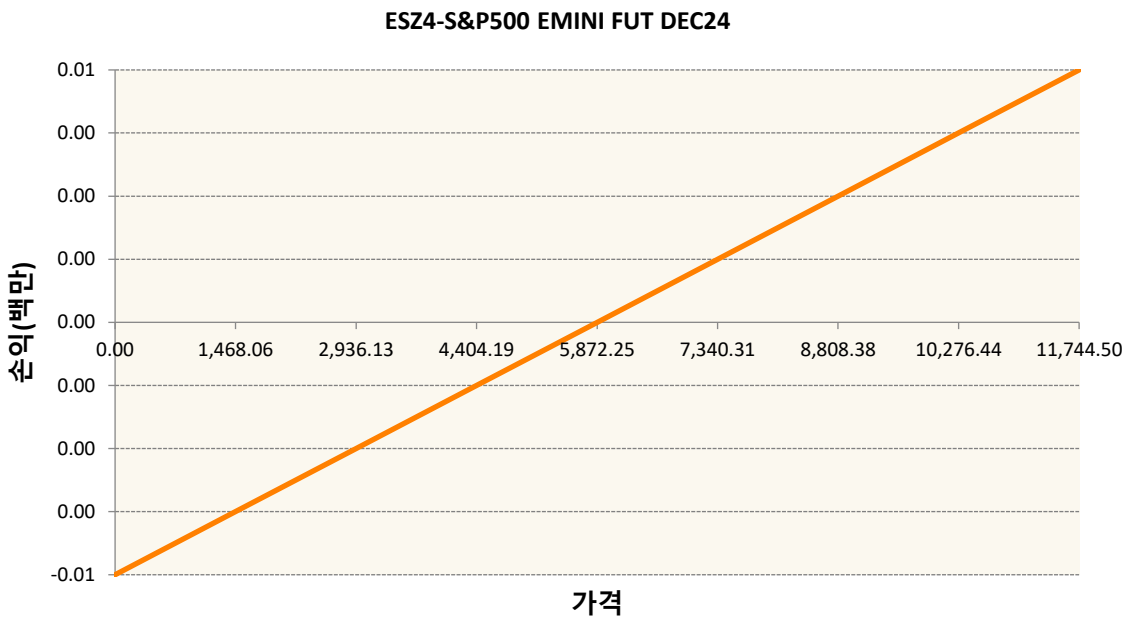
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	812	0	812	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

40

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

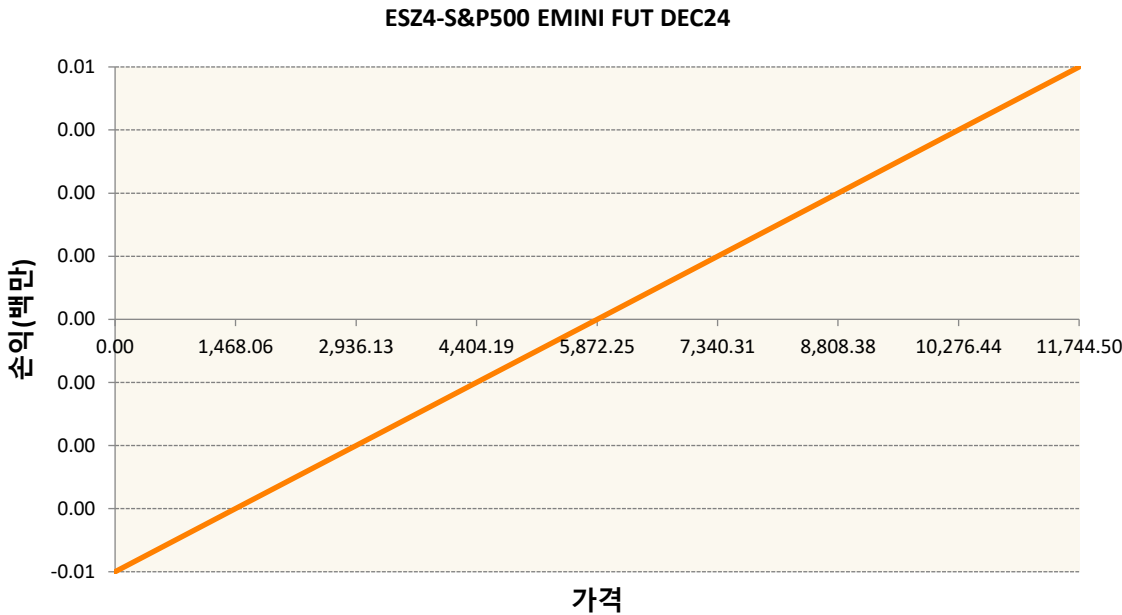
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,466	0	2,466	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	197
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

123

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

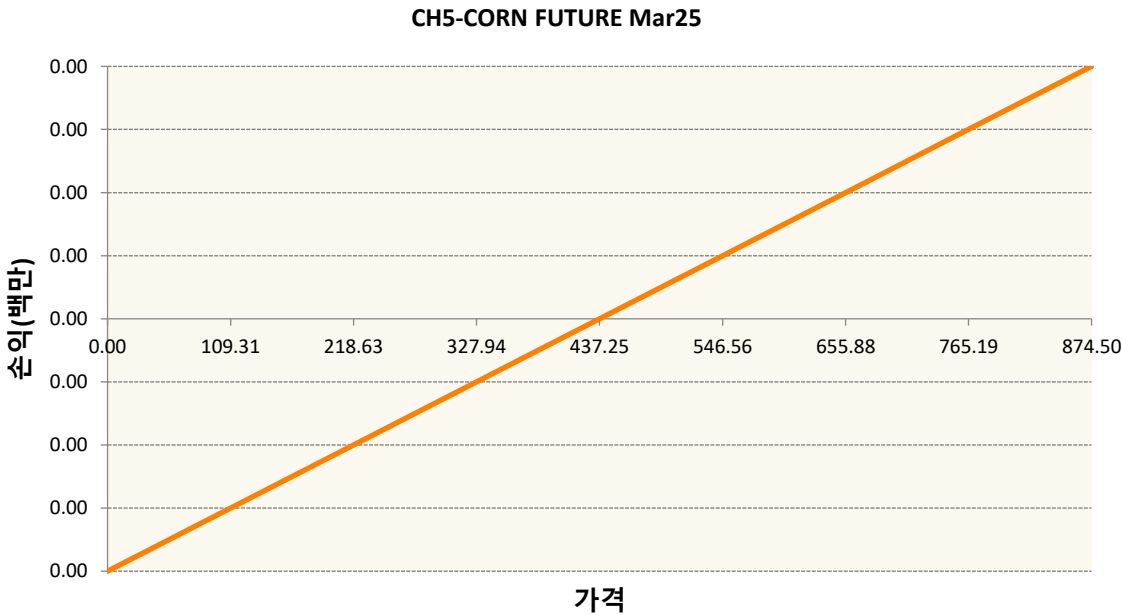
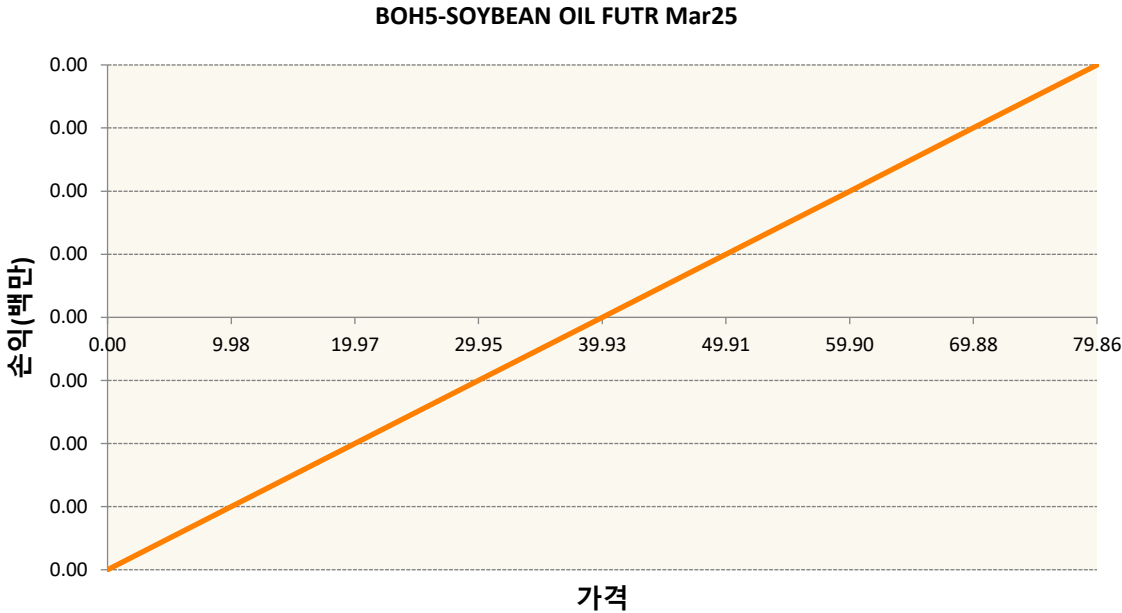
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

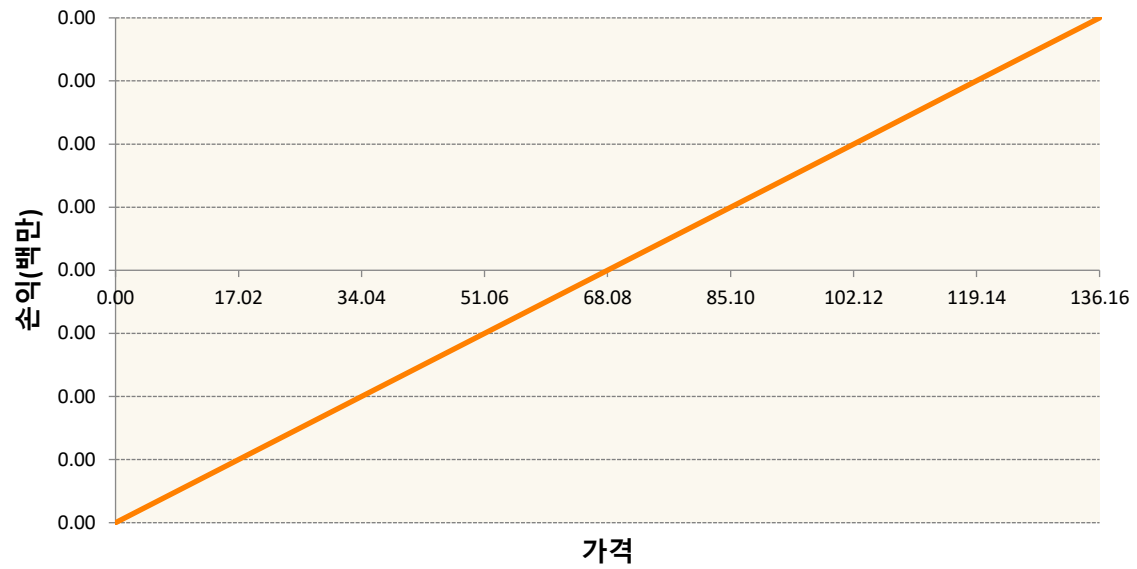
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	73	0	73	장내
누계	유가증권	선물	3,635	0	3,635	
누계	통화	선물	0	421	-421	장내

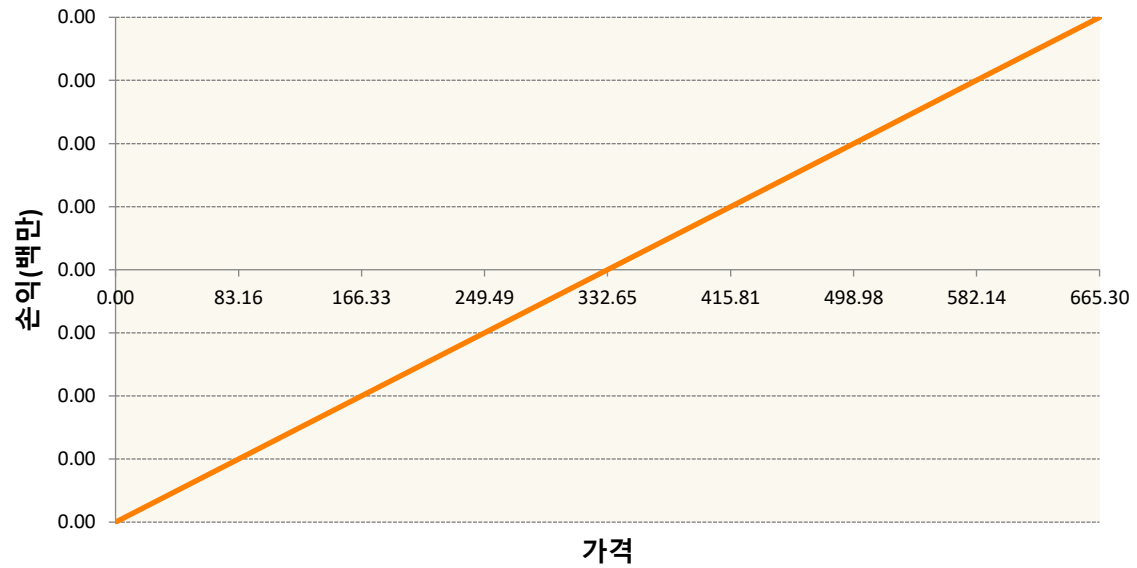
2. 만기시점의 손익구조



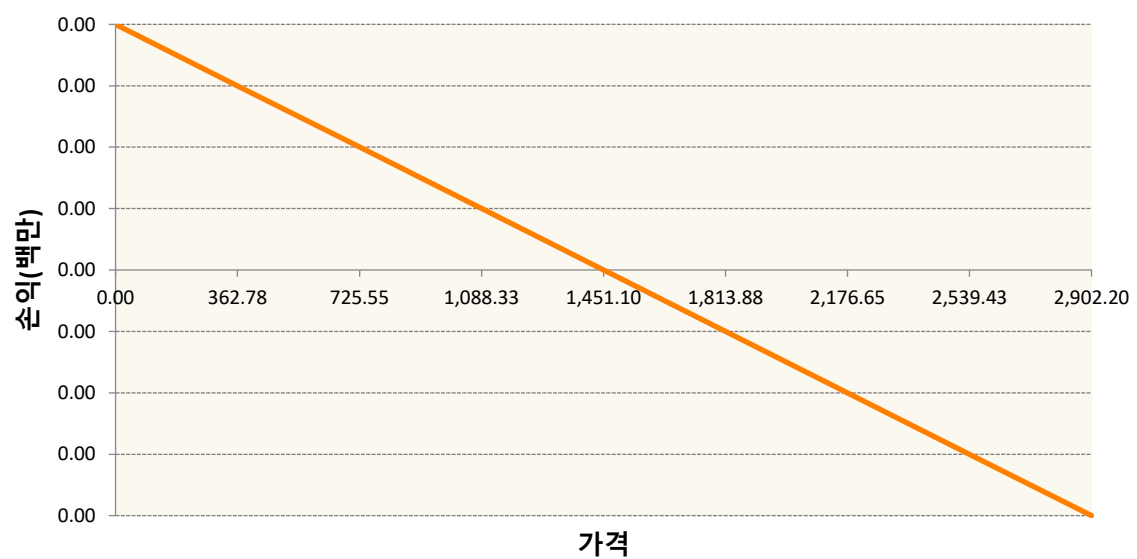
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



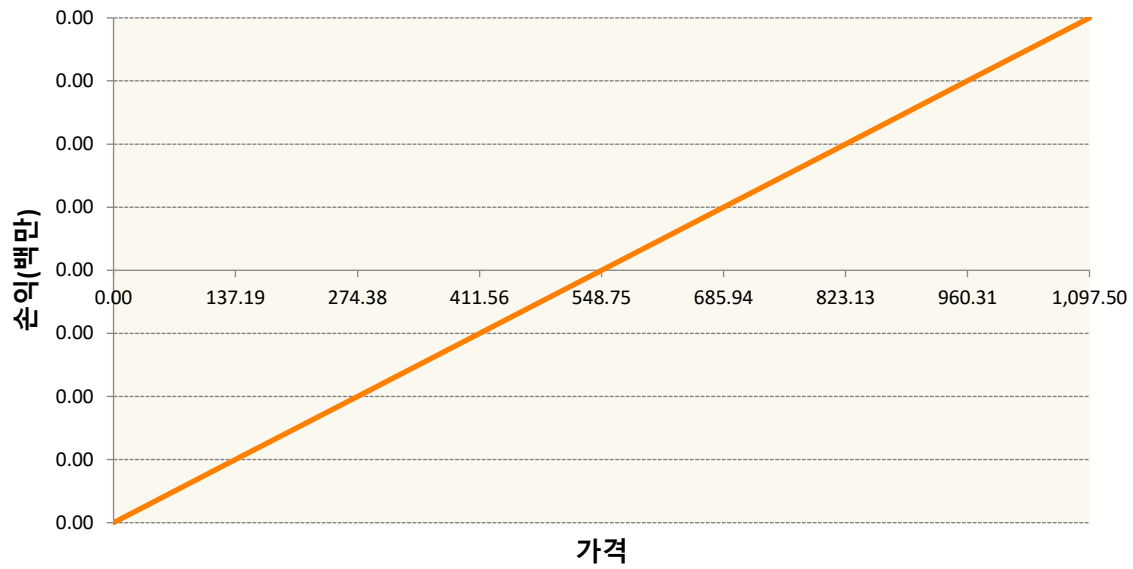
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



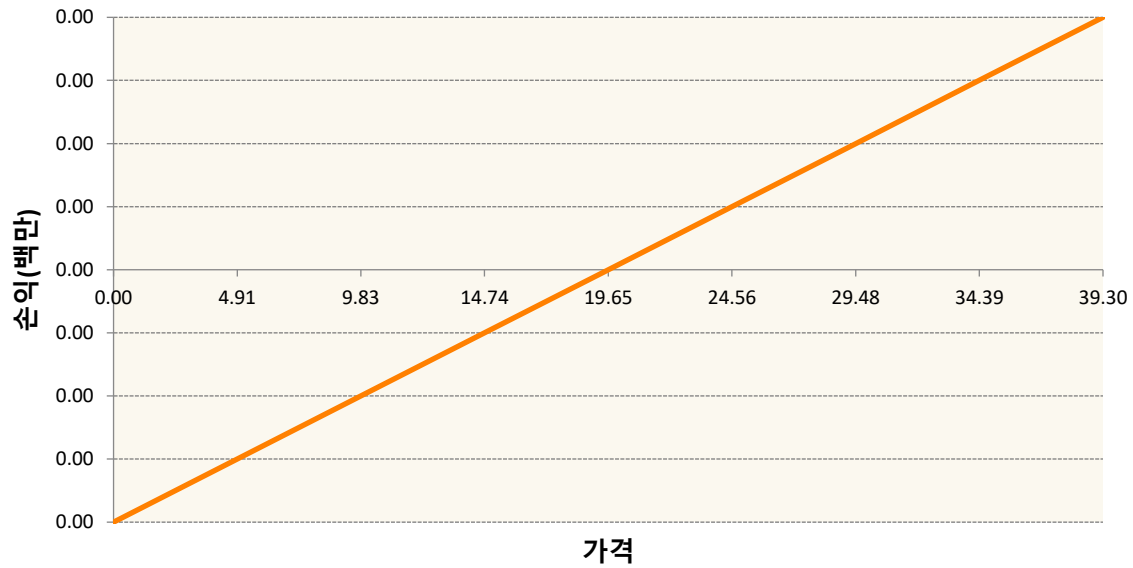
KR4175W10009-2025-01 달러선물



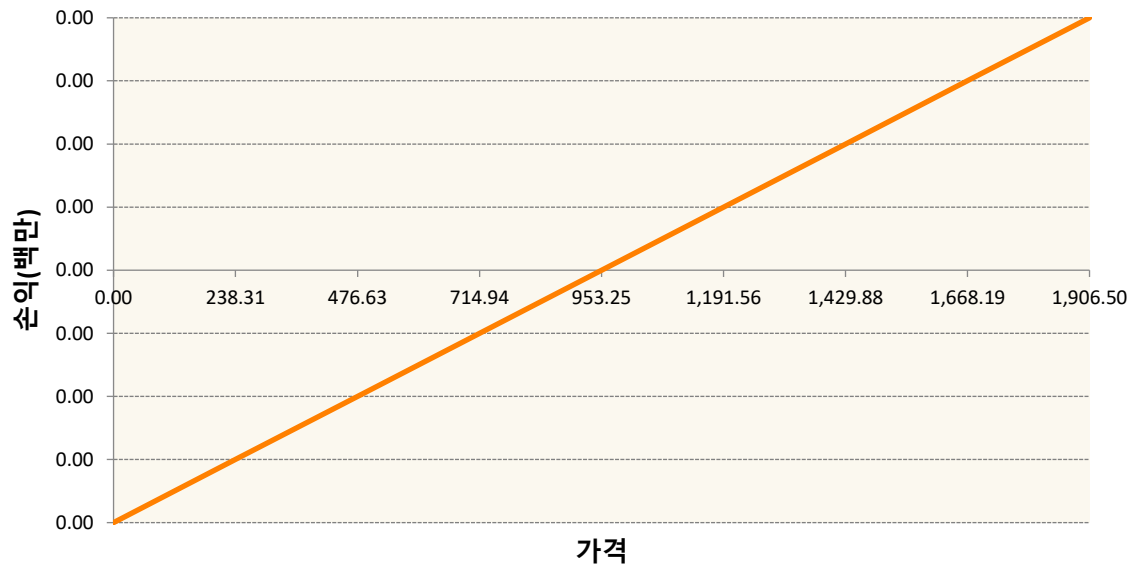
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



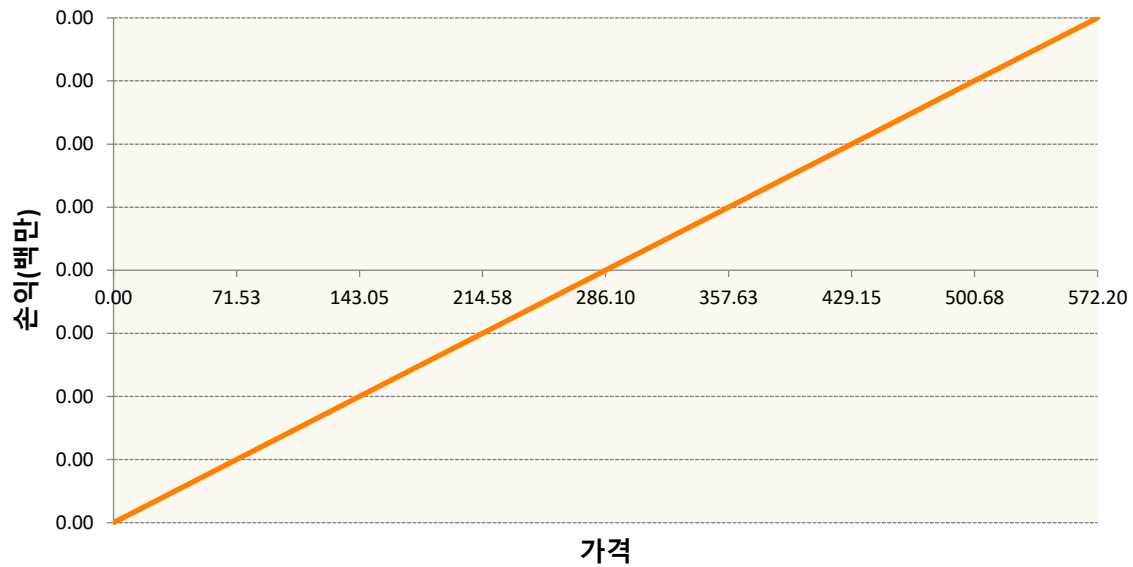
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



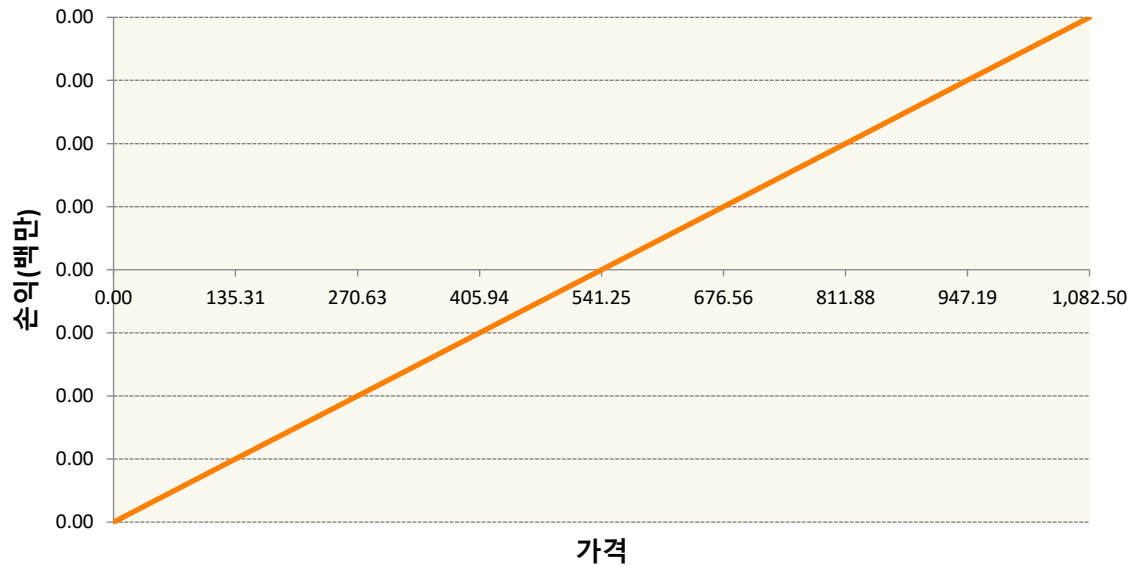
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar25



SMH5-SOYBEAN MEAL FUTR Mar25



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	2024-12-20
기준일	2024-12-19

스마트인덱스모

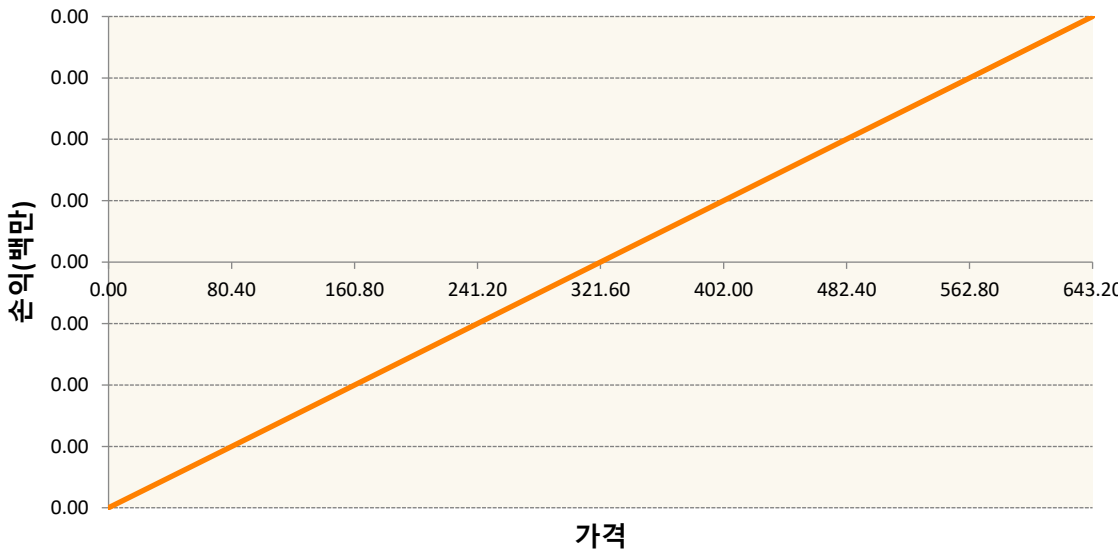
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	965	0	965	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101W30003-2025-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30003			2025-03 코스피200지수선물				77
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	77	77	77	77	77	77	77

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	3,730	0	3,730	장외
누계	지수	스왑	3,730	0	3,730	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래241219	301
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

503

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

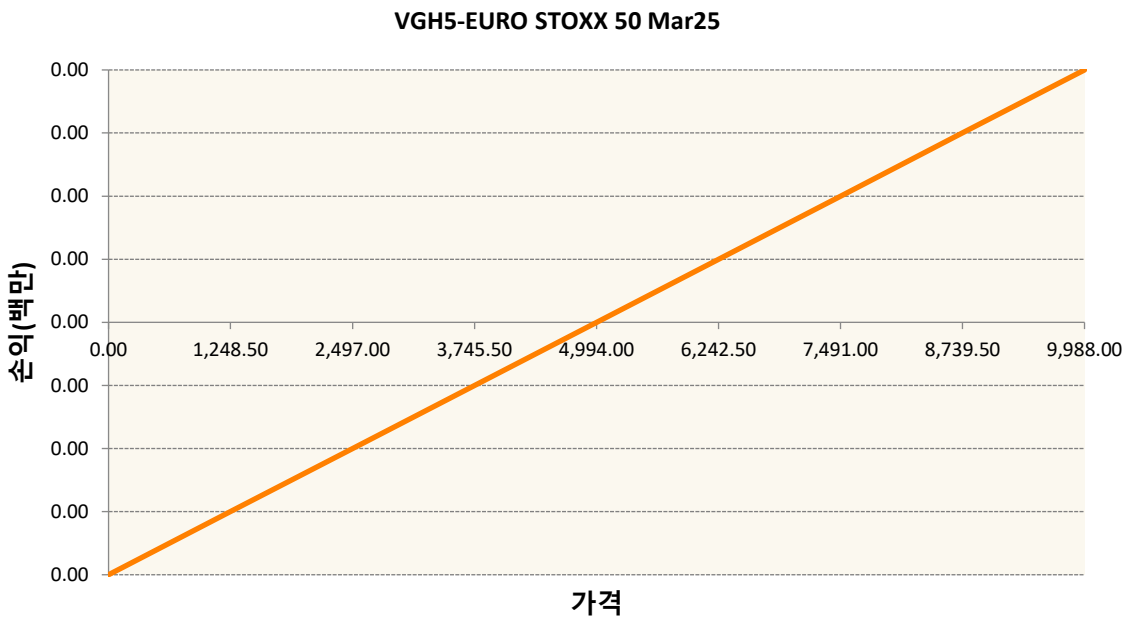
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	979	0	979	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5 EURO STOXX 50 Mar25

78

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

(단위:백만원)

52

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

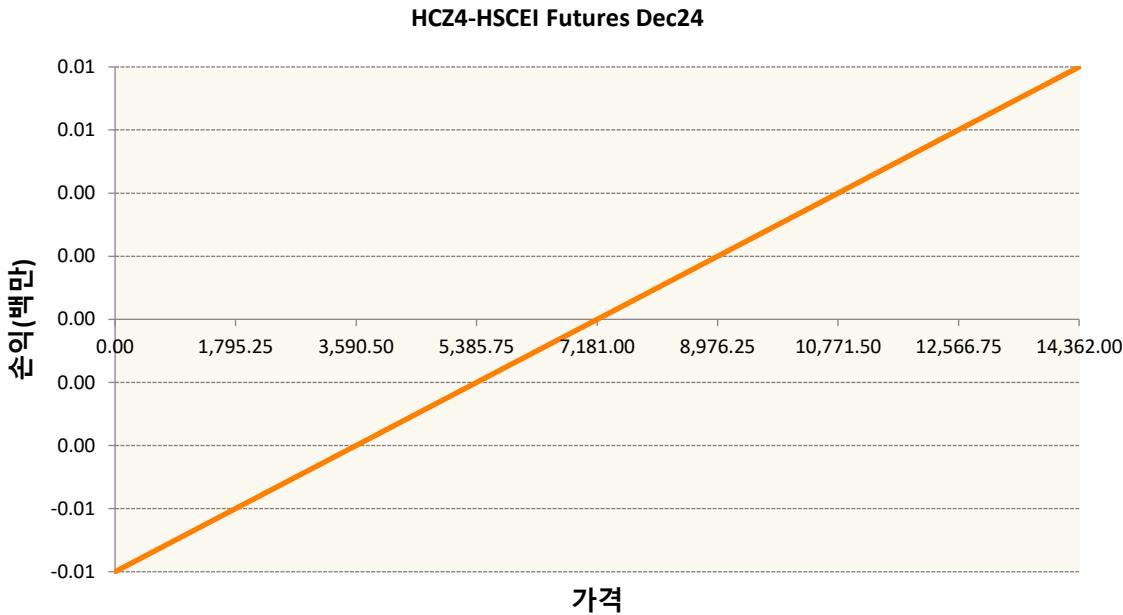
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,420	0	1,420	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ4	HSCEI Futures Dec24	114
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

153

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

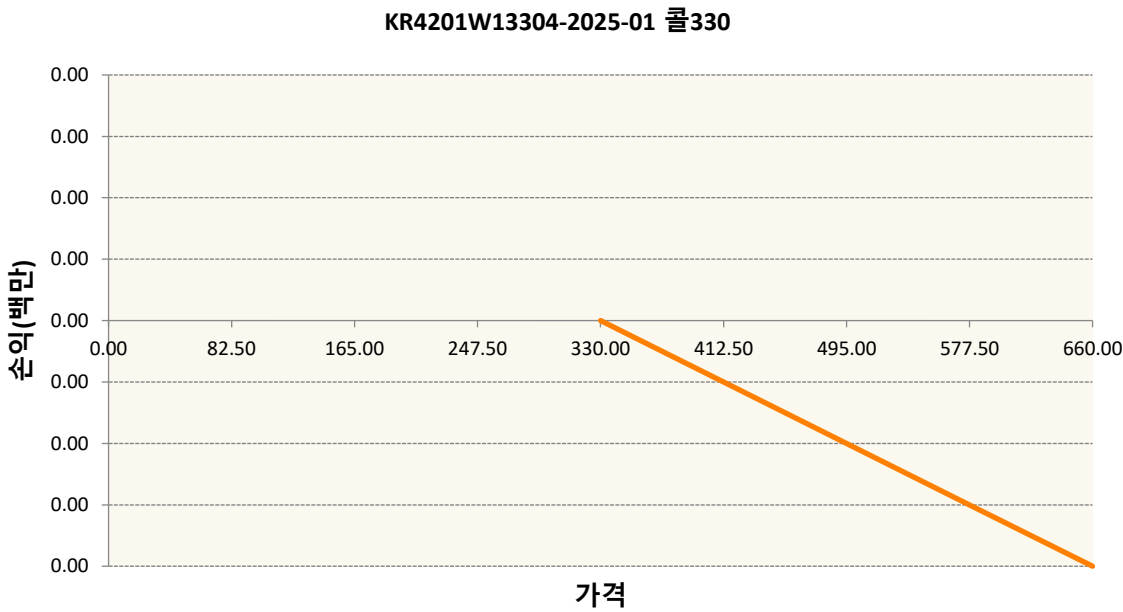
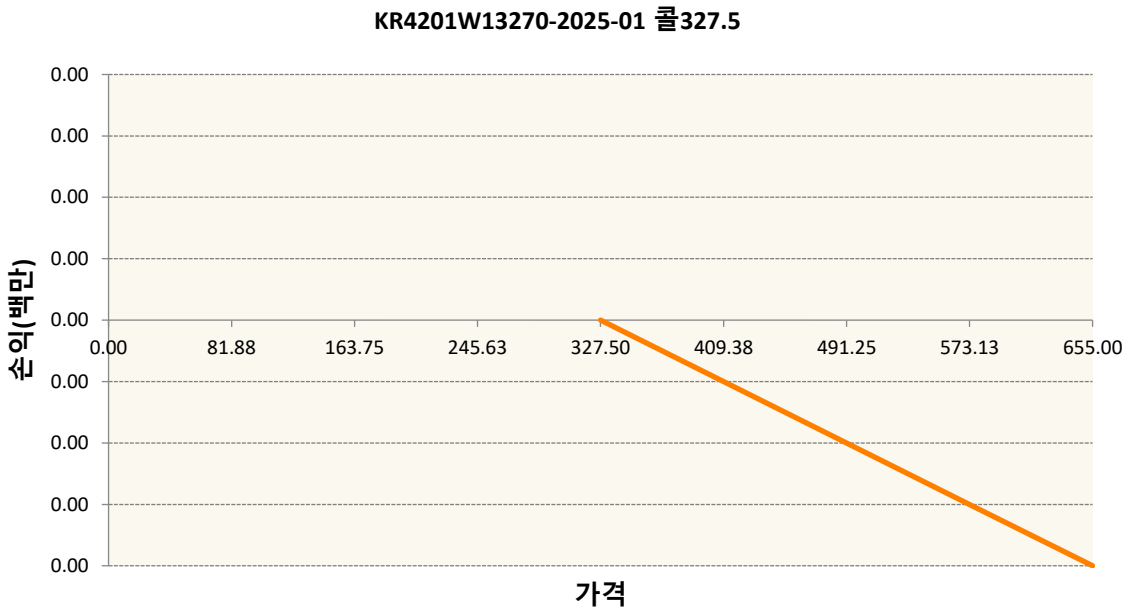
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

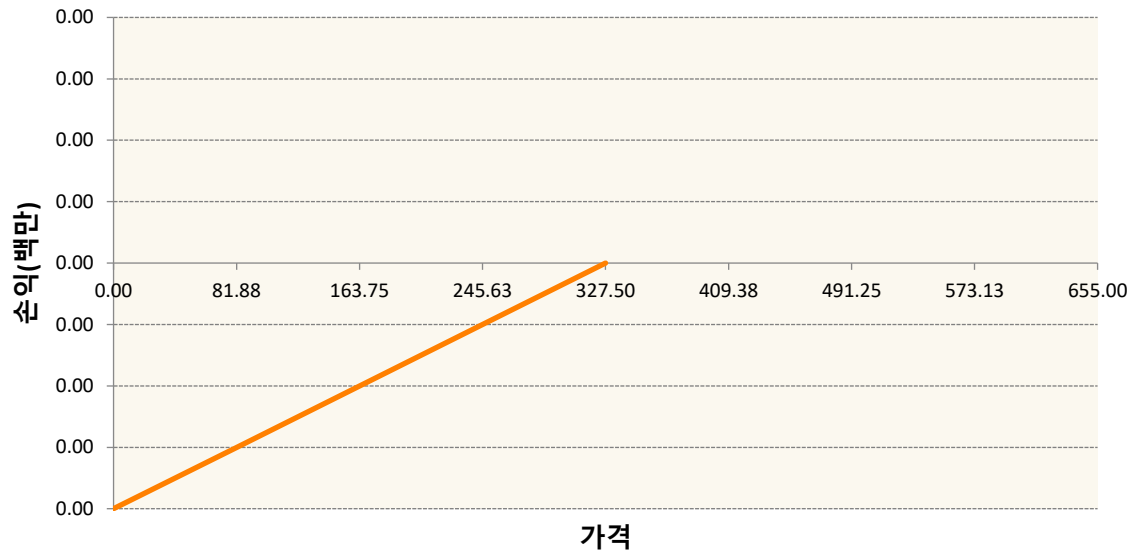
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	38,004	-38,004	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301W13278-2025-01 풋327.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201W13270			2025-01 콜327.5				413
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	122	121	119	115	111	107	101
-5.33%	116	111	106	99	91	83	74
-2.67%	94	85	74	63	52	40	28
0%	42	28	14	0	-14	-28	-43
2.67%	-53	-68	-82	-97	-111	-126	-141
5.33%	-191	-202	-214	-226	-239	-252	-265
8.00%	-360	-367	-374	-383	-392	-402	-413
KR4201W13304			2025-01 콜330				1,220
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	321	318	312	304	294	282	267
-5.33%	307	296	281	264	243	221	196
-2.67%	257	231	203	172	139	105	69
0%	125	84	42	0	-43	-86	-130
2.67%	-133	-179	-226	-273	-319	-366	-412
5.33%	-528	-567	-608	-649	-692	-735	-778
8.00%	-1,032	-1,057	-1,086	-1,116	-1,149	-1,184	-1,220
KR4301W13278			2025-01 풋327.5				476
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-468	-468	-469	-470	-471	-473	-476
-5.33%	-285	-287	-290	-293	-297	-302	-307
-2.67%	-113	-119	-125	-132	-140	-148	-156
0%	31	21	11	0	-11	-21	-32

2.67%	127	116	105	94	83	72	61
5.33%	174	167	159	151	142	133	123
8.00%	191	187	183	179	173	167	160

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

(단위:백만원)

2,022

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	11	-11	
누계	유가증권	수익증권	672	0	672	

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	2024-12-20
기준일	2024-12-19

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	71	-71	
누계	유가증권	수익증권	4,362	0	4,362	

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	2024-12-20
기준일	2024-12-19

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	358	-358	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	13,105	0	13,105	
누계	통화	선도	319	14,301	-13,982	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E	366
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E	215
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E	563
FXW213EC2(USD/KRW 31-12-24E	26
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

487

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

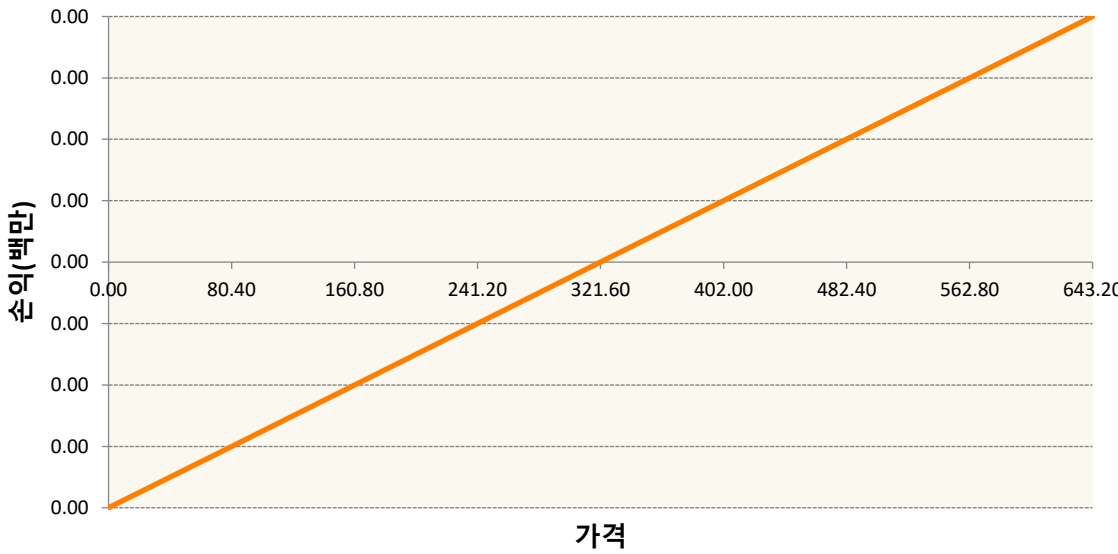
1. 계약금액

(단위:백만원)

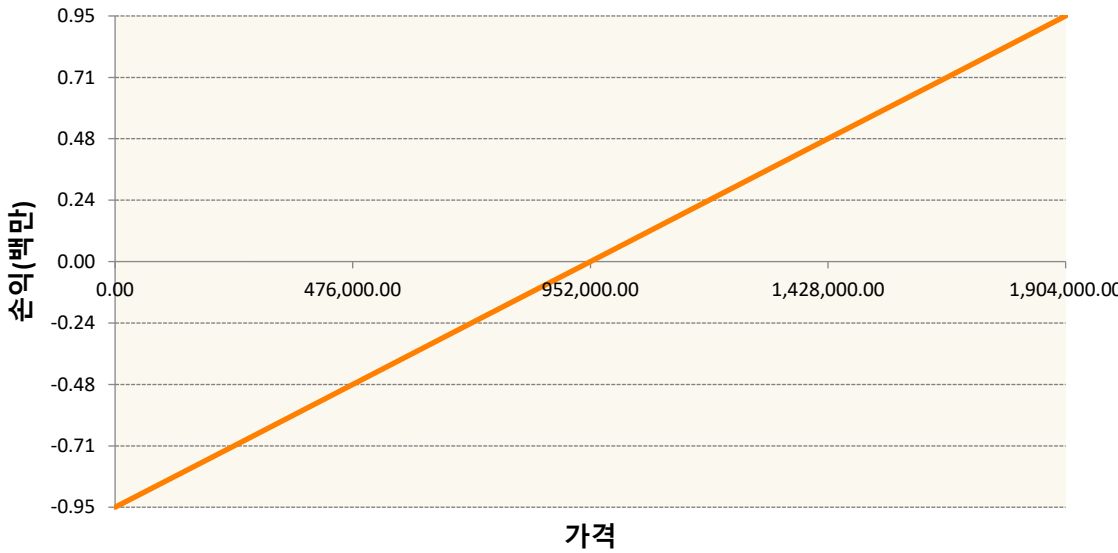
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	602	0	602	장내

2. 만기시점의 손익구조

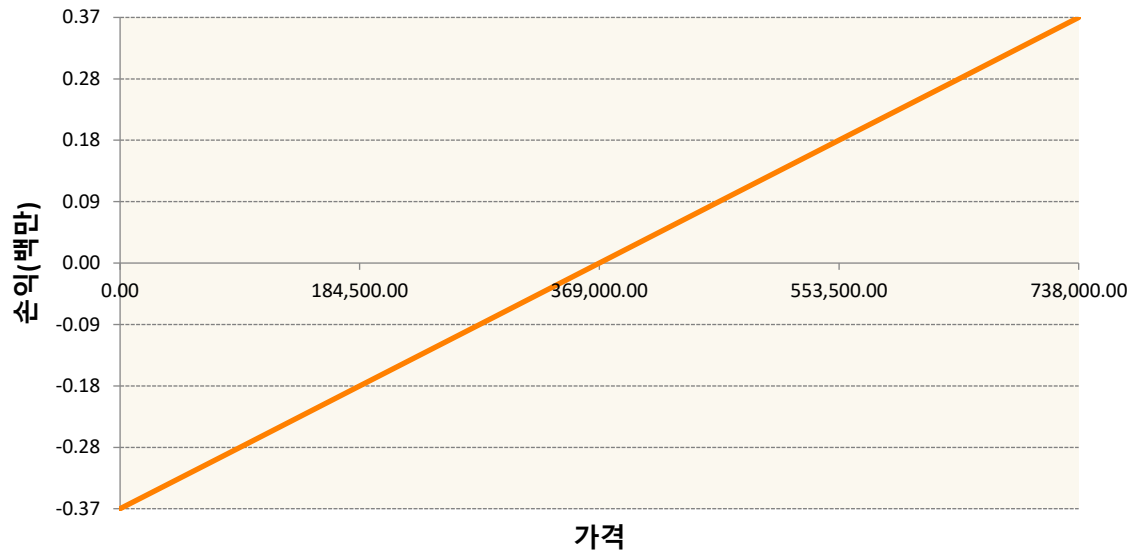
KR4101W30003-2025-03 코스피200지수선물



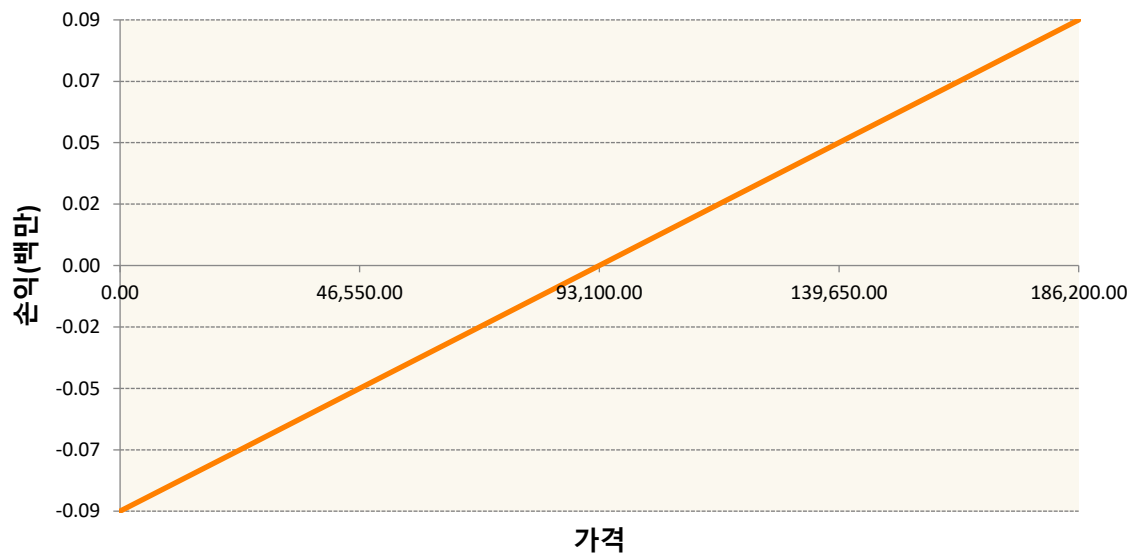
KR41B3W20008-2025-02 고려아연개별선물



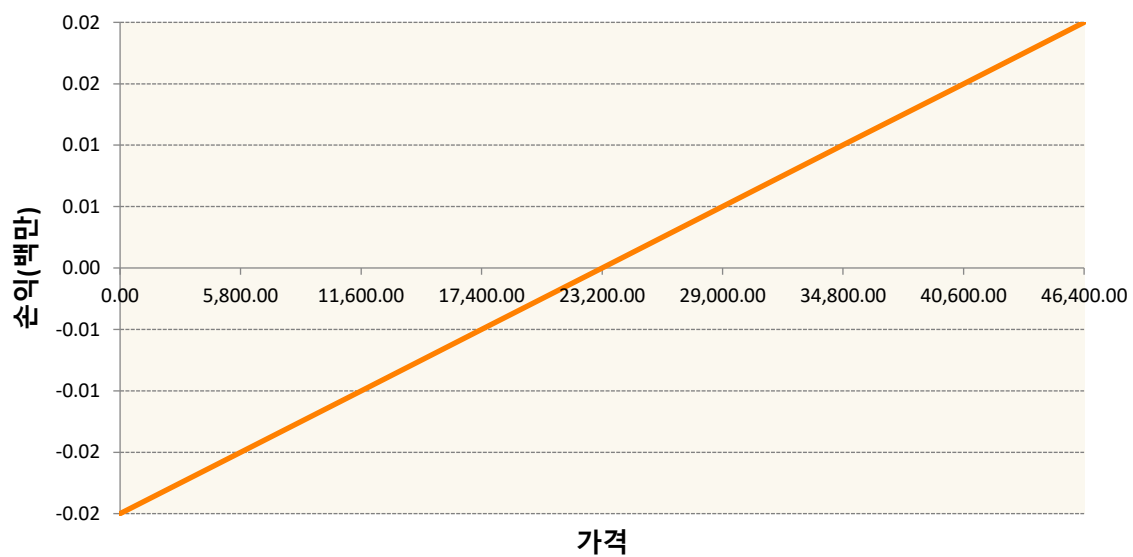
KR41F5W10000-2025-01 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW10009-2025-01 엘앤에프개별선물



KR41GNW10005-2025-01 금양개별선물



(단위:백만원)

KR4101W30003							2025-03 코스피200지수선물		39		
	기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39				
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26				
-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%	26	26	26	26	26	26	26				
8.00%	39	39	39	39	39	39	39				
KR41B3W20008							2025-02 고려아연개별선물		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				
KR41F5W10000							2025-01 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%	-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%	7	7	7	7	7	7	7				
KR41FMW10009							2025-01 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				
KR41GNW10005							2025-01 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

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

(단위:백만원)

54

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

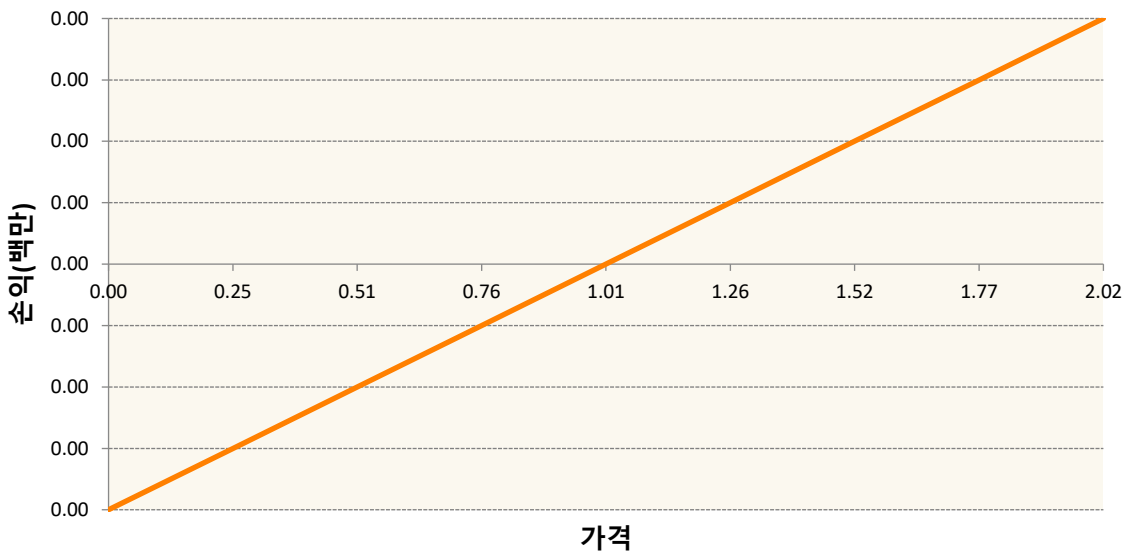
1. 계약금액

(단위:백만원)

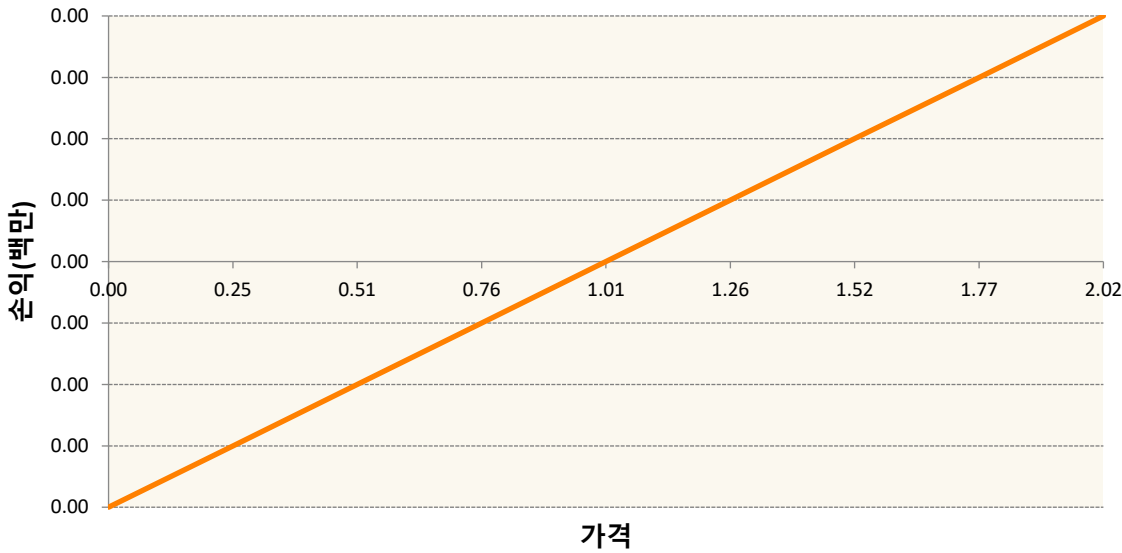
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	11,178	11,189	-12	
누계	유가증권	선물	11,289	0	11,289	

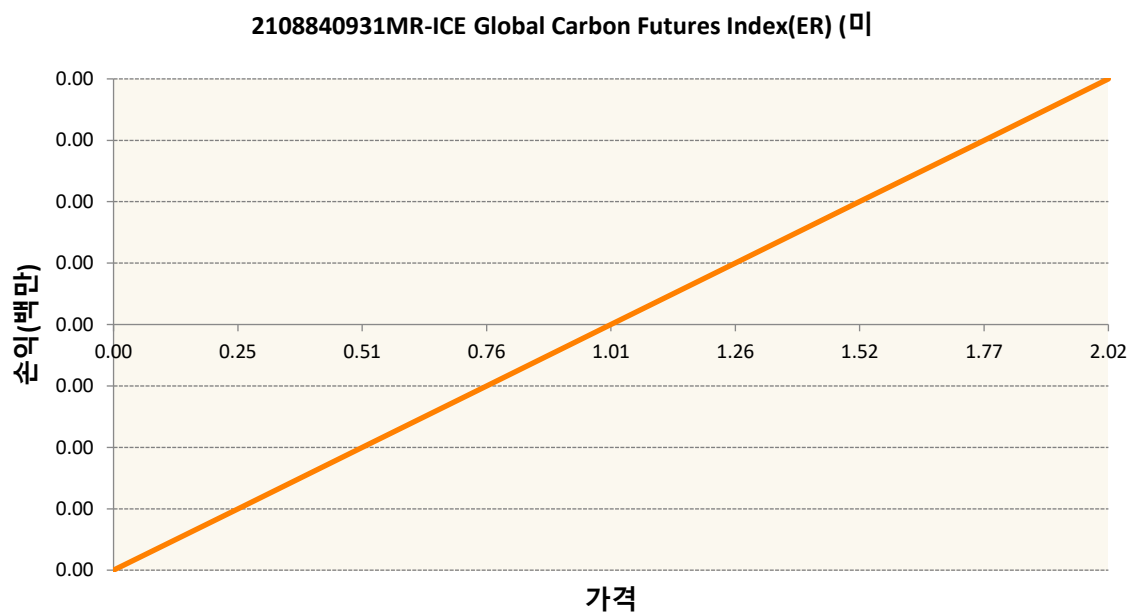
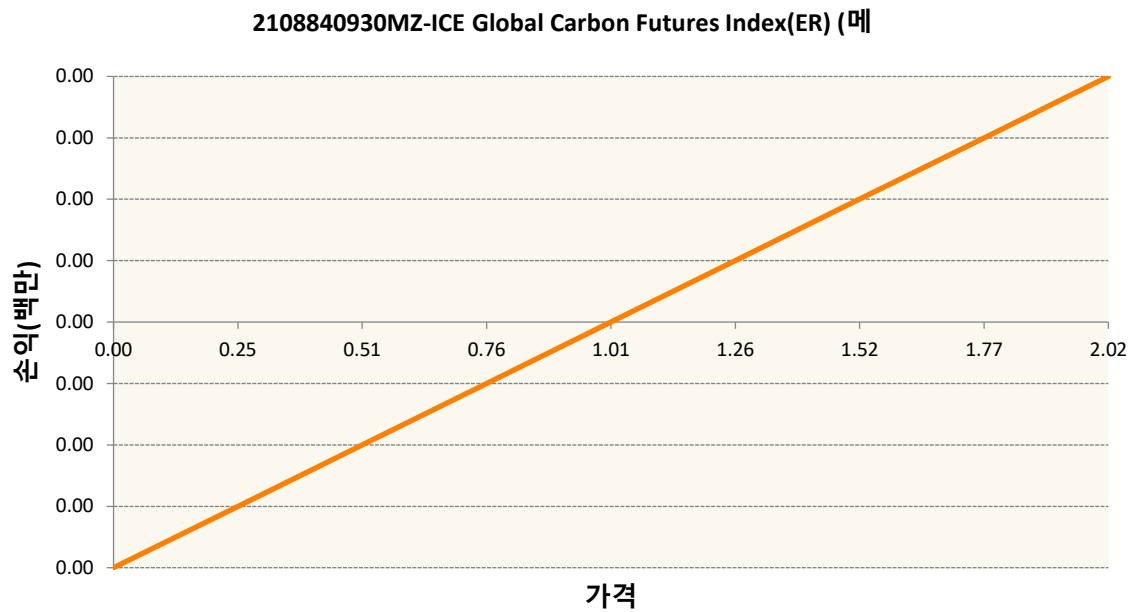
2. 만기시점의 손익구조

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		90
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		451
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		181
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		181

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		960

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

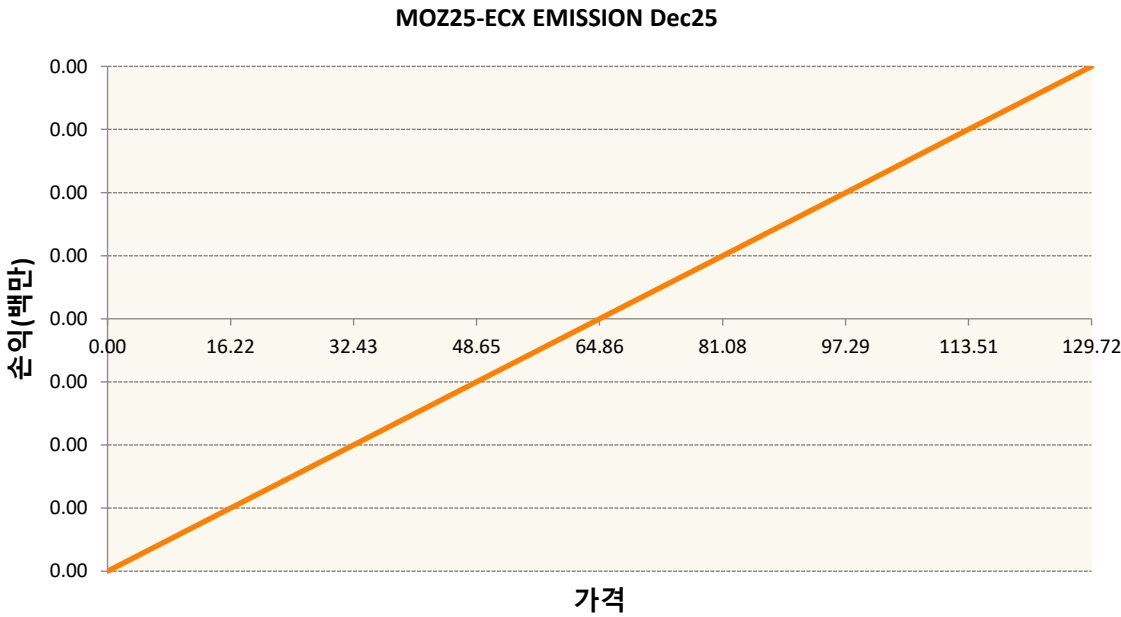
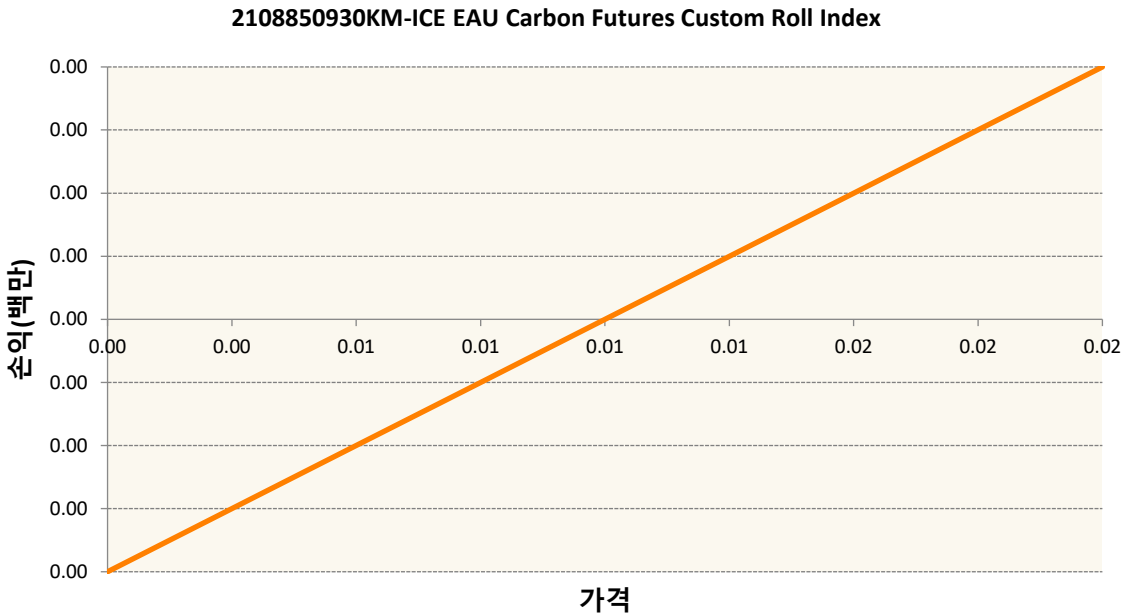
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	-23	23	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	8,121	0	8,121	
누계	통화	선도	0	2,252	-2,252	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		0.25
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		26
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		155
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		649

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,181

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	905	0	905	장외
누계	지수	스왑	4,425	0	4,425	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	1

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

(단위:백만원)

4

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	7,700	0	7,700	장외
누계	지수	스왑	7,700	0	7,700	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	5
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	1

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

(단위:백만원)

25

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

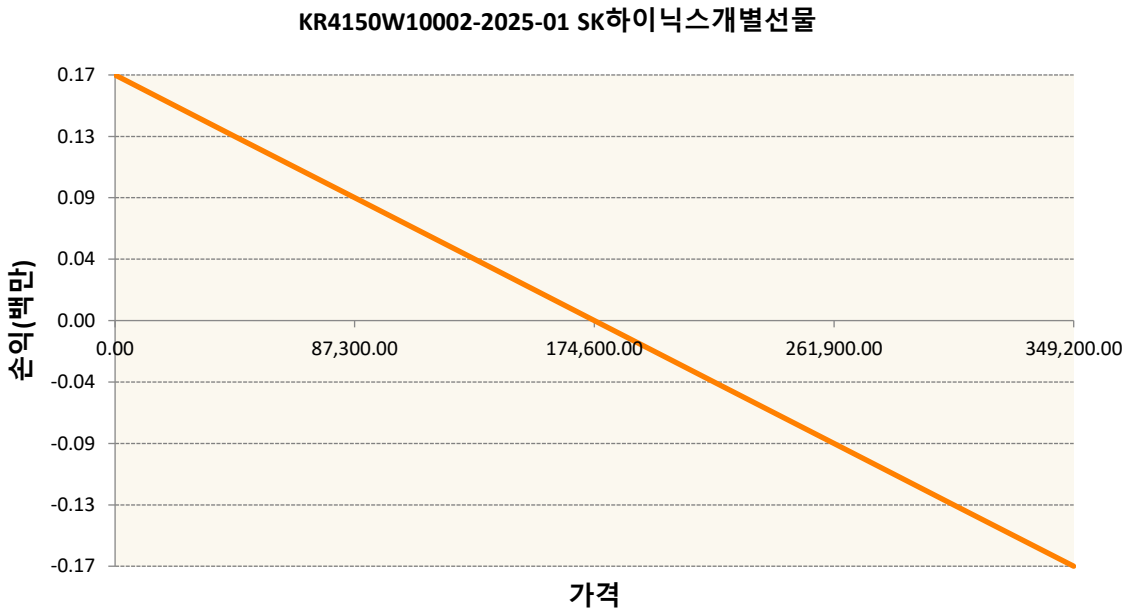
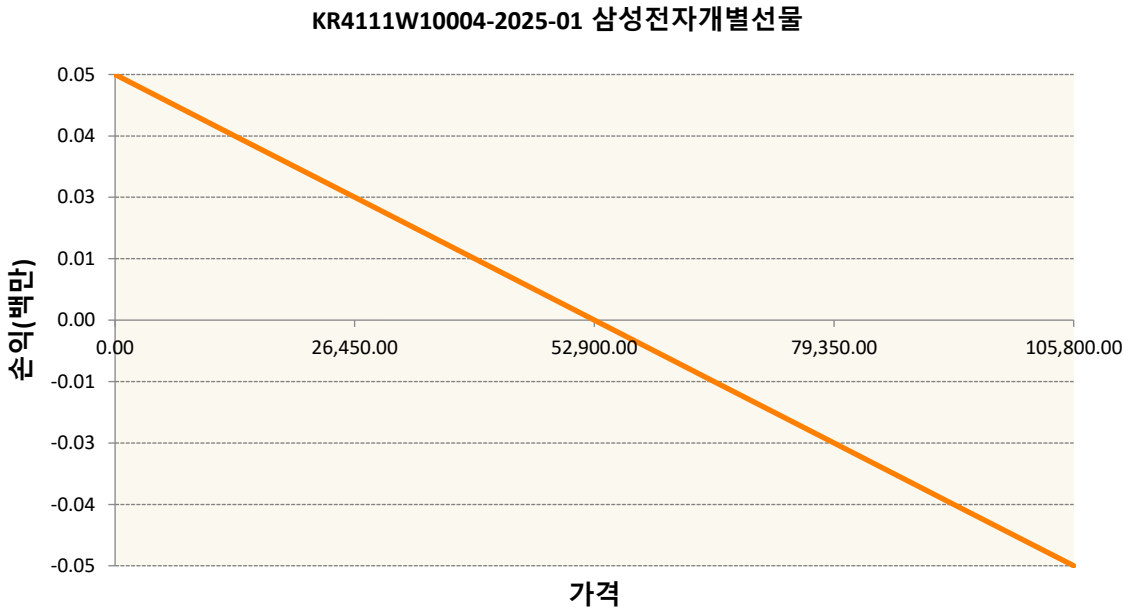
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4111W10(2025-01 삼성전자개별선물		1
KR4150W10(2025-01 SK하이닉스개별선물		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	8

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

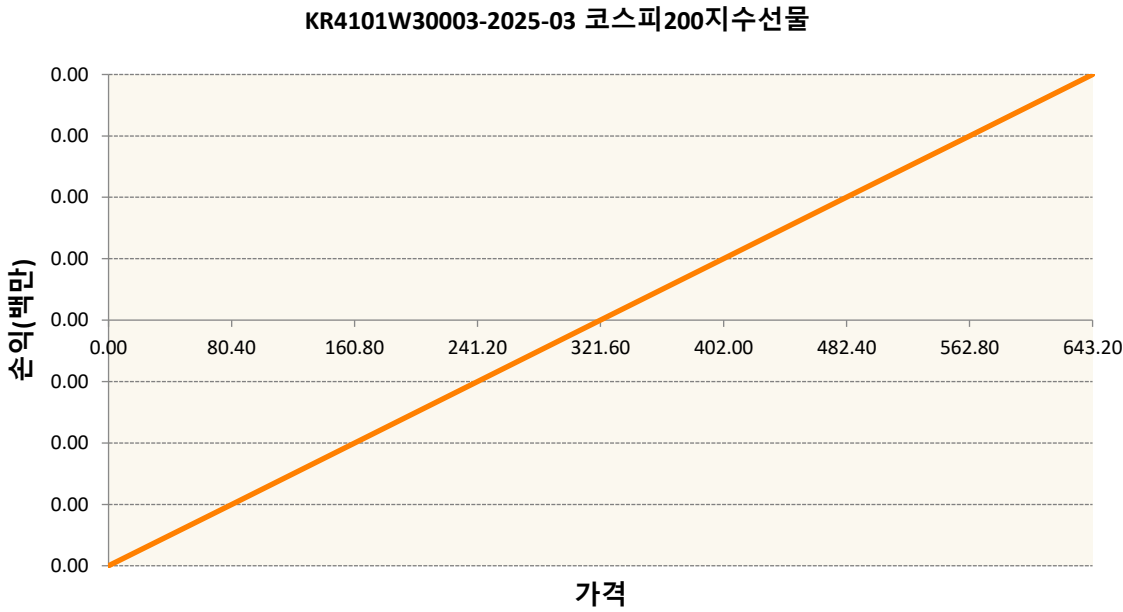
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	804	0	804	장내
누계	유가증권	선물	7,236	0	7,236	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30003			2025-03 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%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
-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%	387	387	387	387	387	387	387
8.00%	580	580	580	580	580	580	580

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

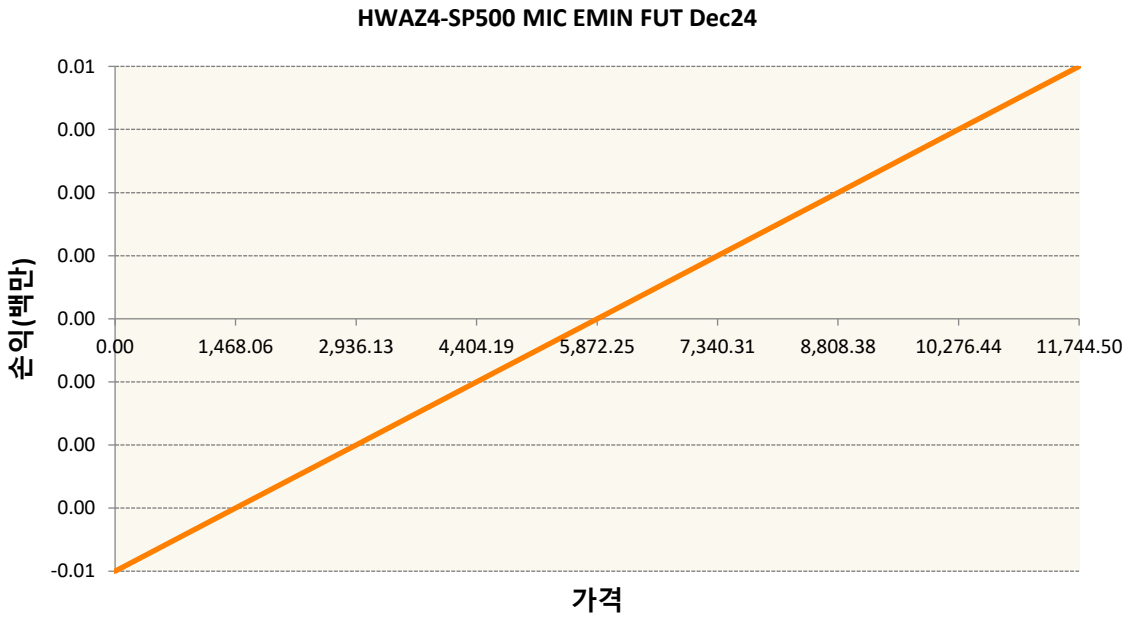
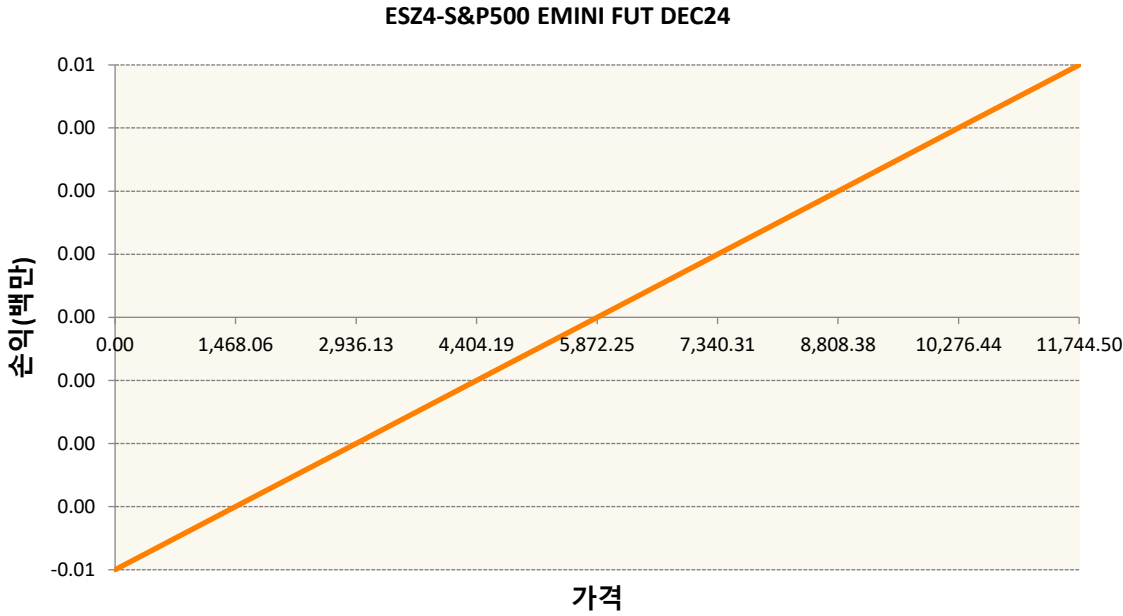
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	19,659	0	19,659	
누계	유가증권	선물	1,932	0	1,932	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ4	S&P500 EMINI FUT DEC24	1,573
HWAZ4	SP500 MIC EMIN FUT Dec24	155

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,075

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

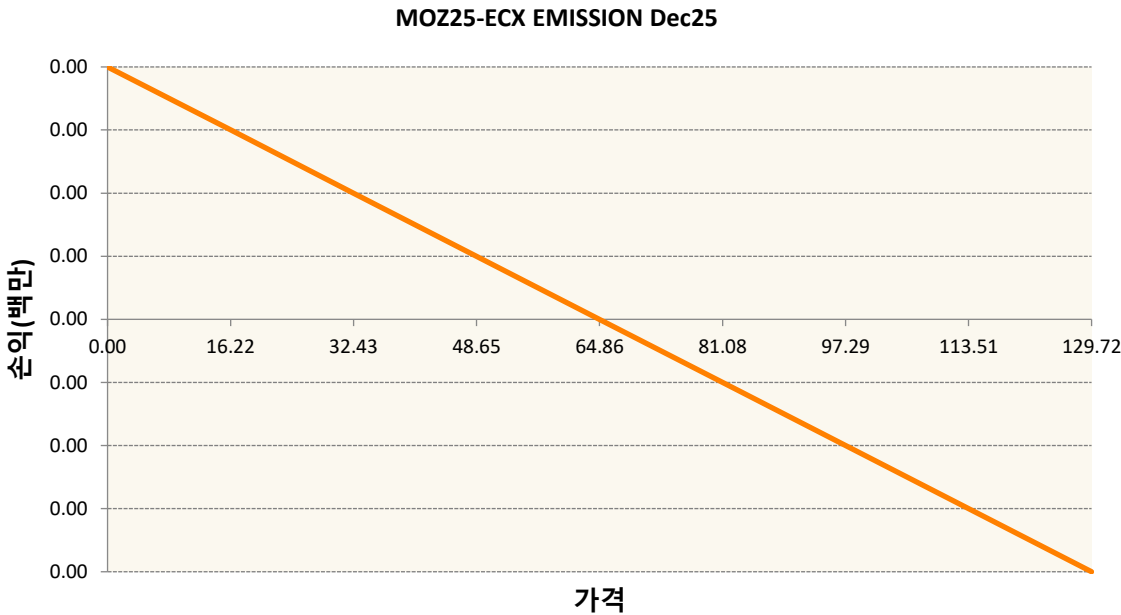
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	22	-22	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	-3	6,969	-6,972	
누계	통화	선도	0	1,161	-1,161	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.25
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E	93
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	558

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

(단위:백만원)

983

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

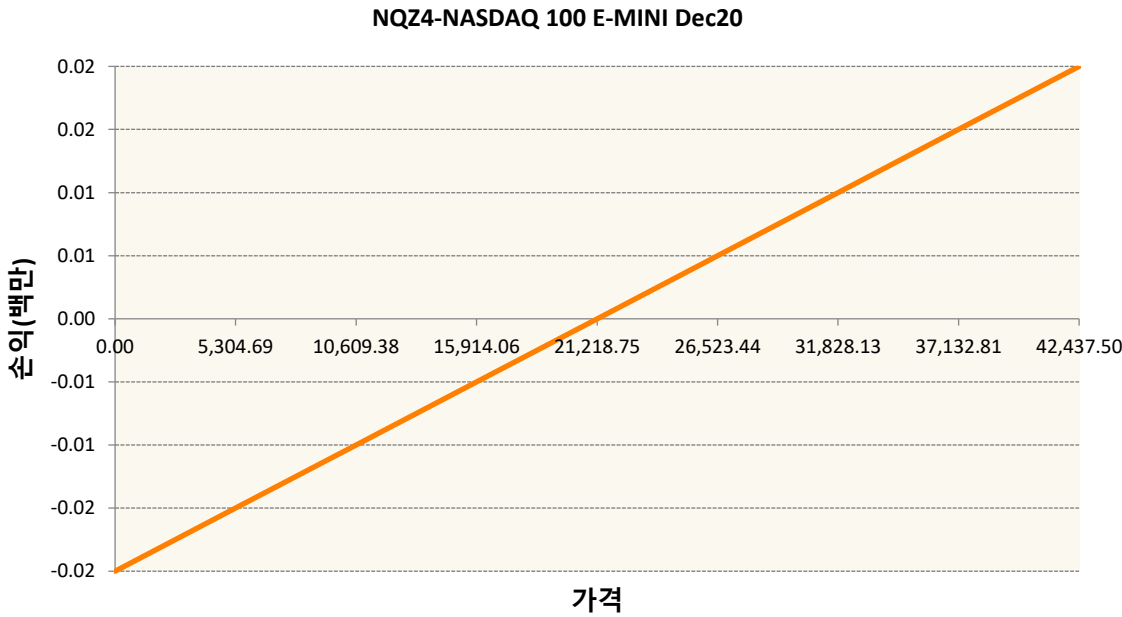
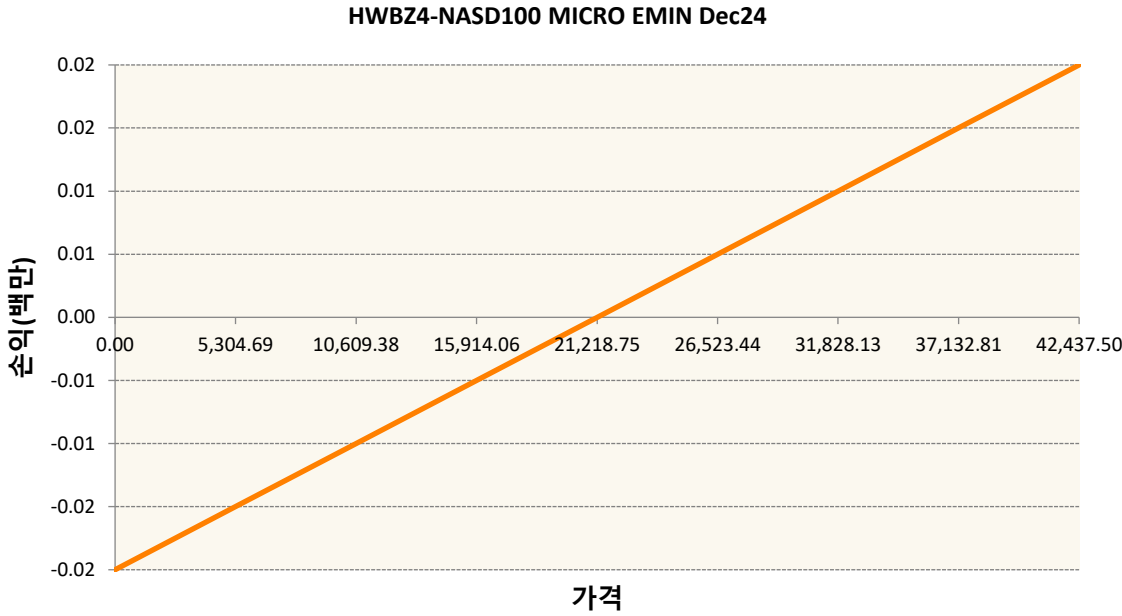
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	11,013	0	11,013	
누계	유가증권	선물	1,344	0	1,344	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ4	NASD100 MICRO EMIN Dec24		107
NQZ4	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		881

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			834

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

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	197,575	0	197,575	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	722
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,741
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,190
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,272

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	9,327

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	1,490	-1,490	장외
누계	지수	스왑	5,635	0	5,635	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3

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

(단위:백만원)

12

공시일	2024-12-20
기준일	2024-12-19

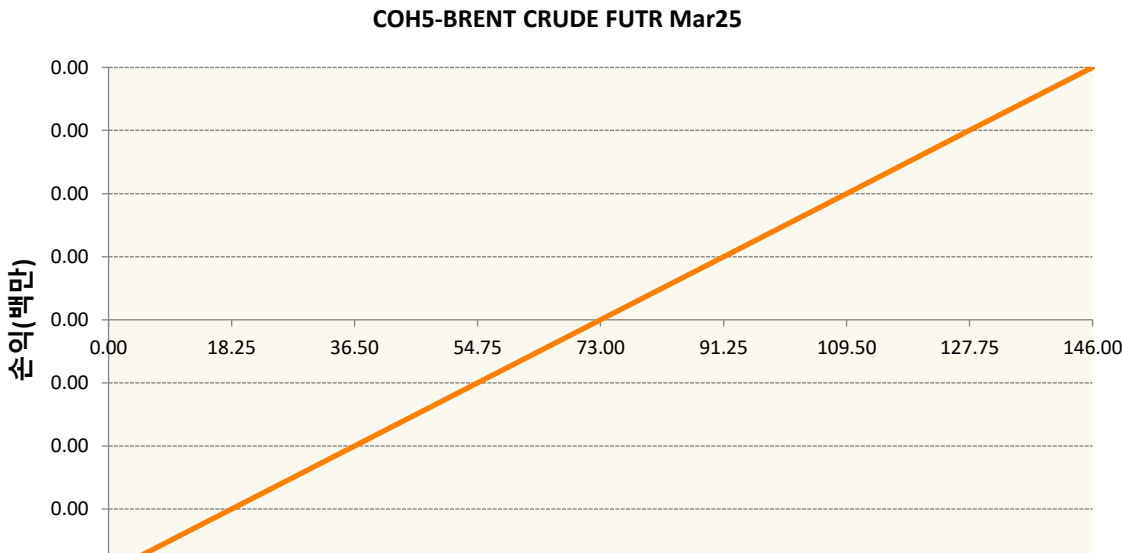
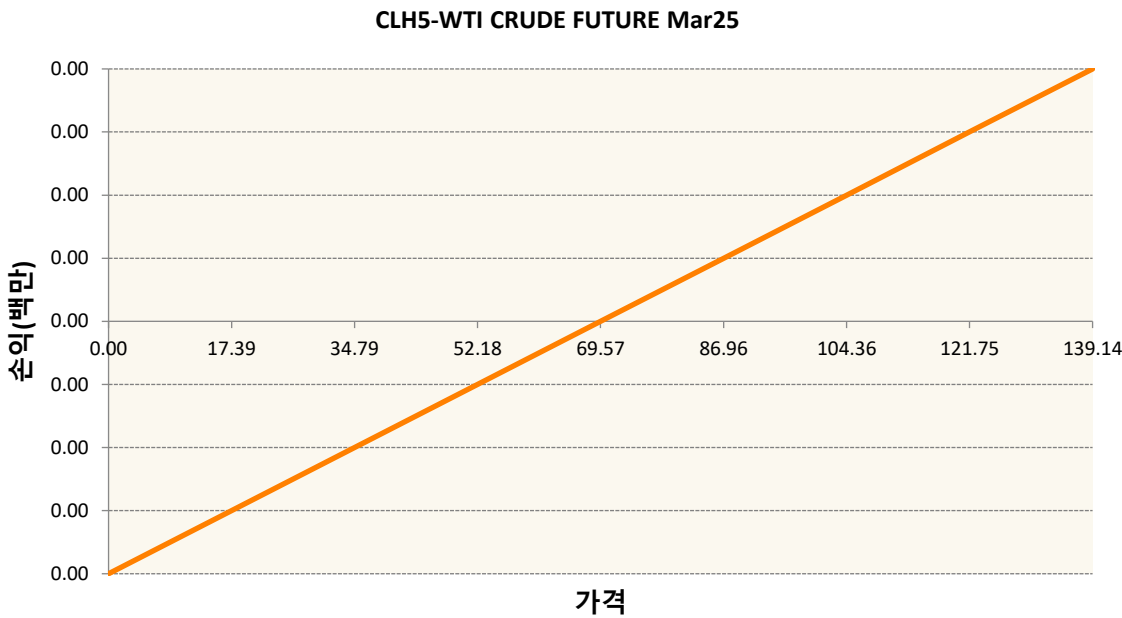
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

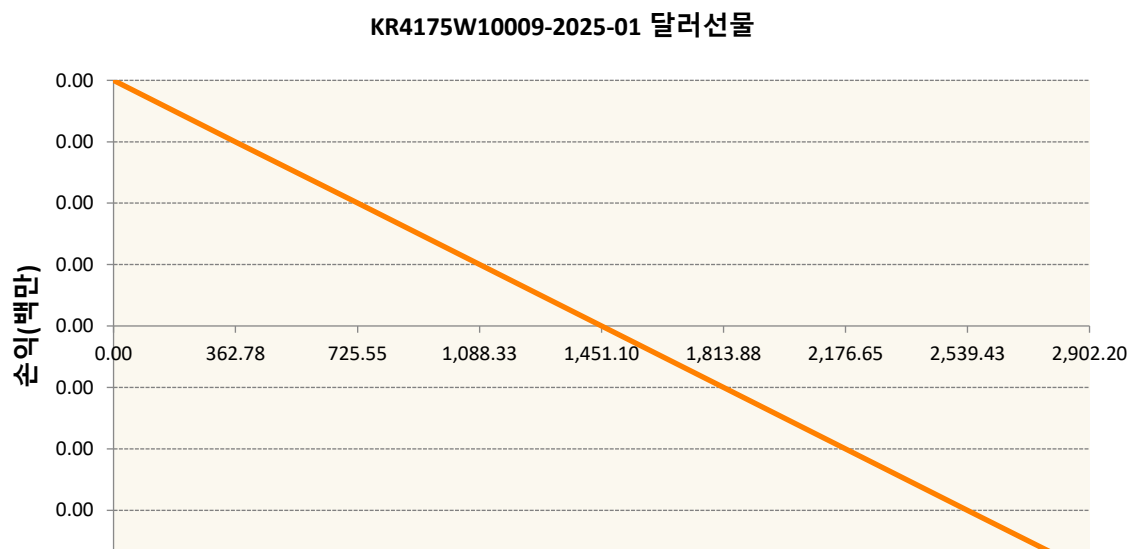
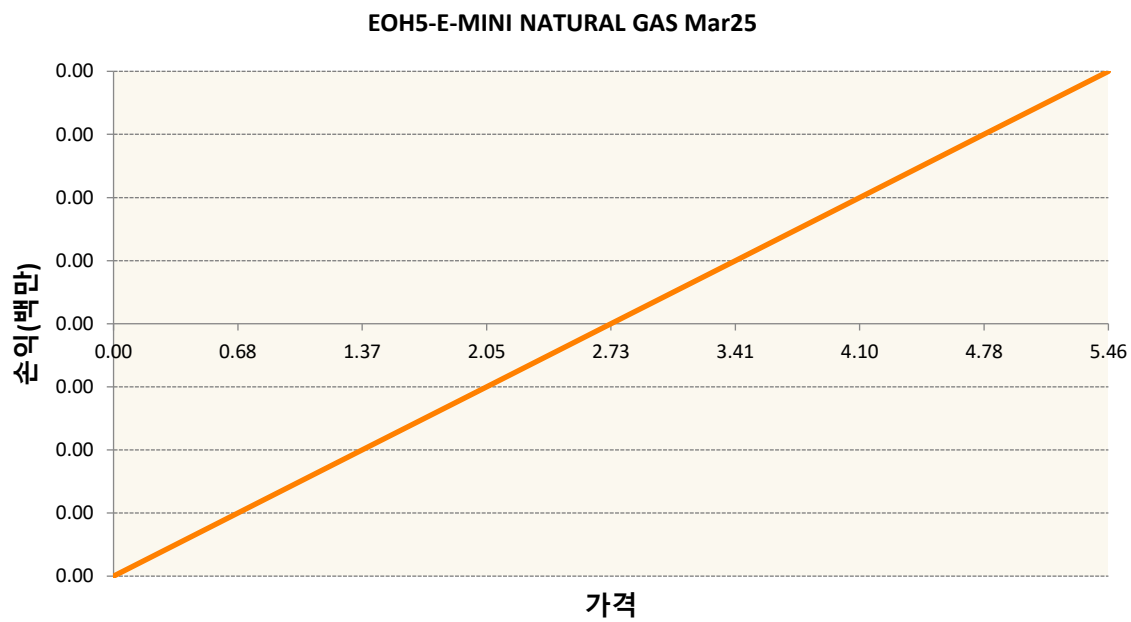
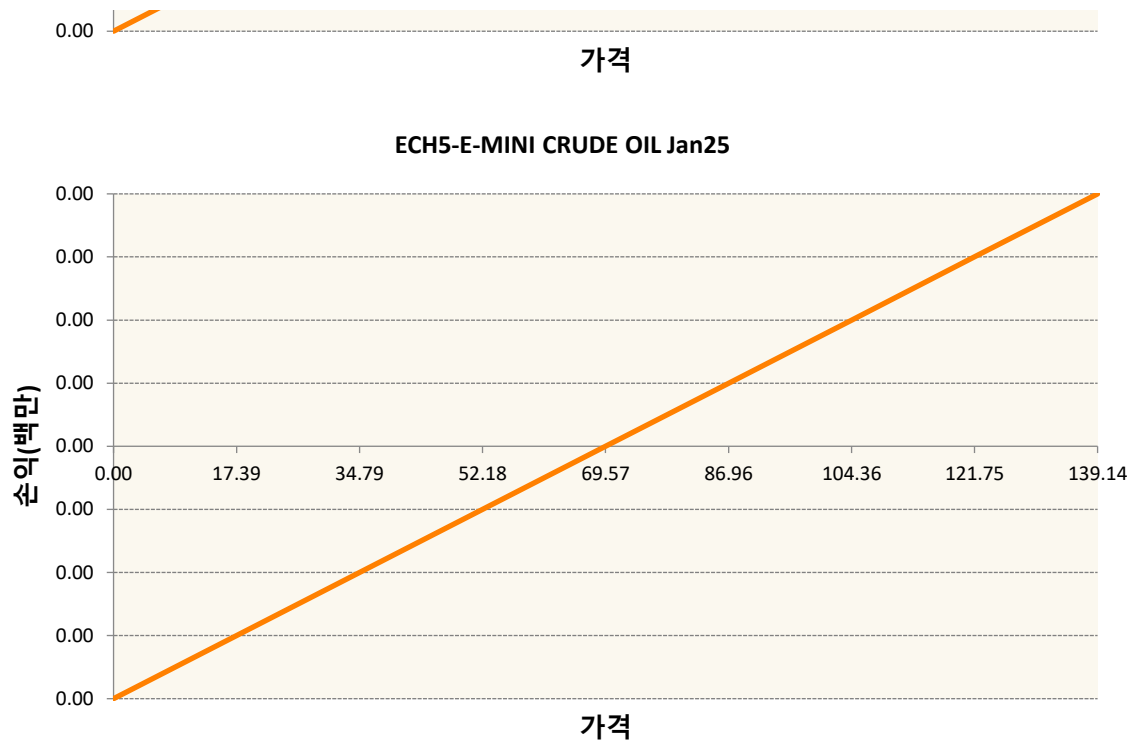
1. 계약금액

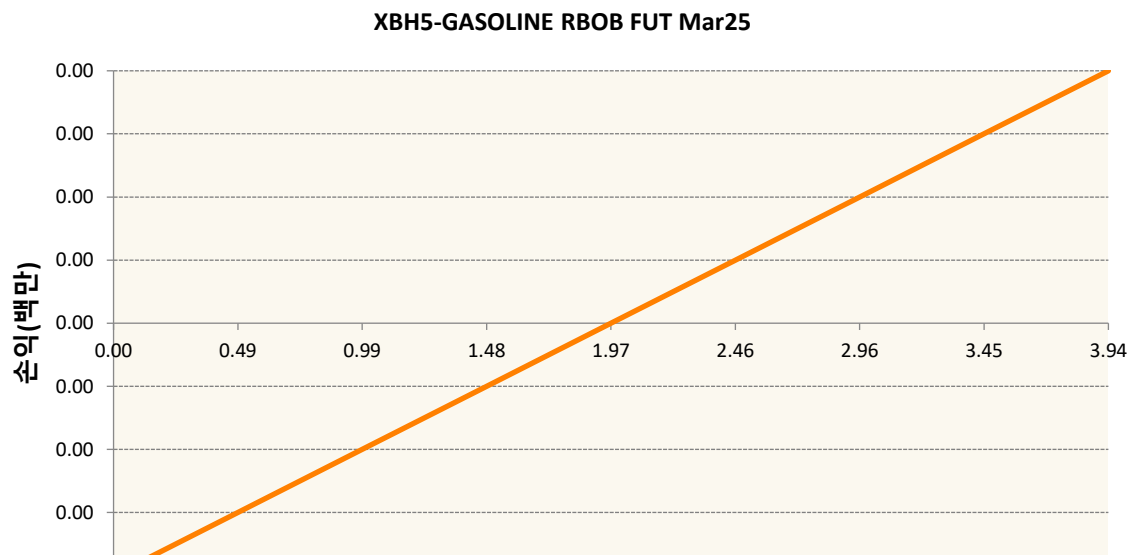
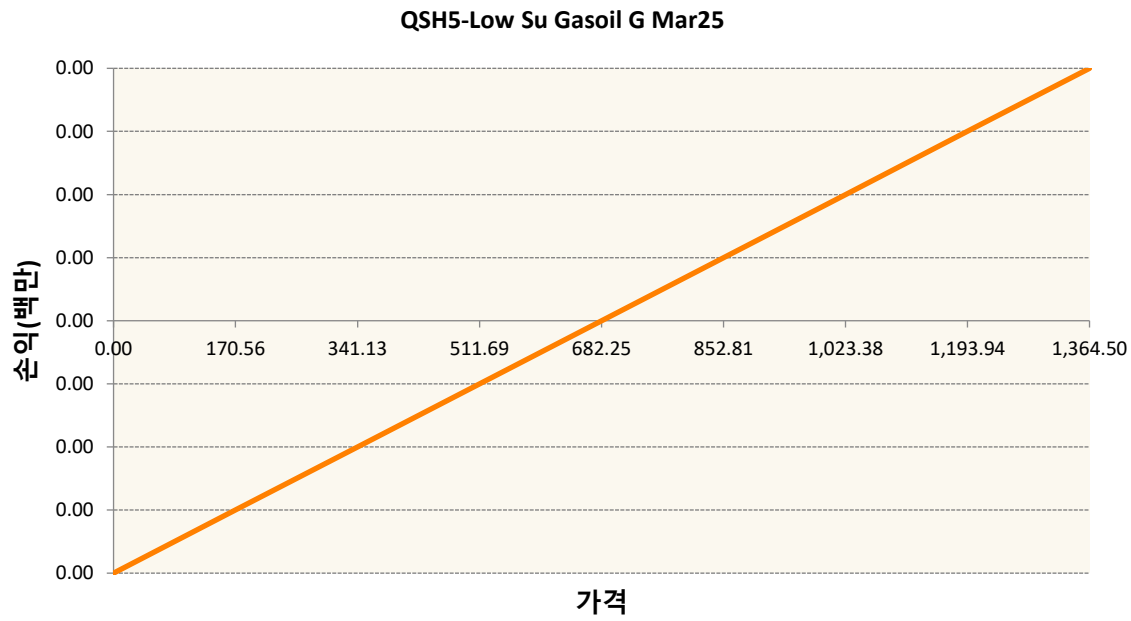
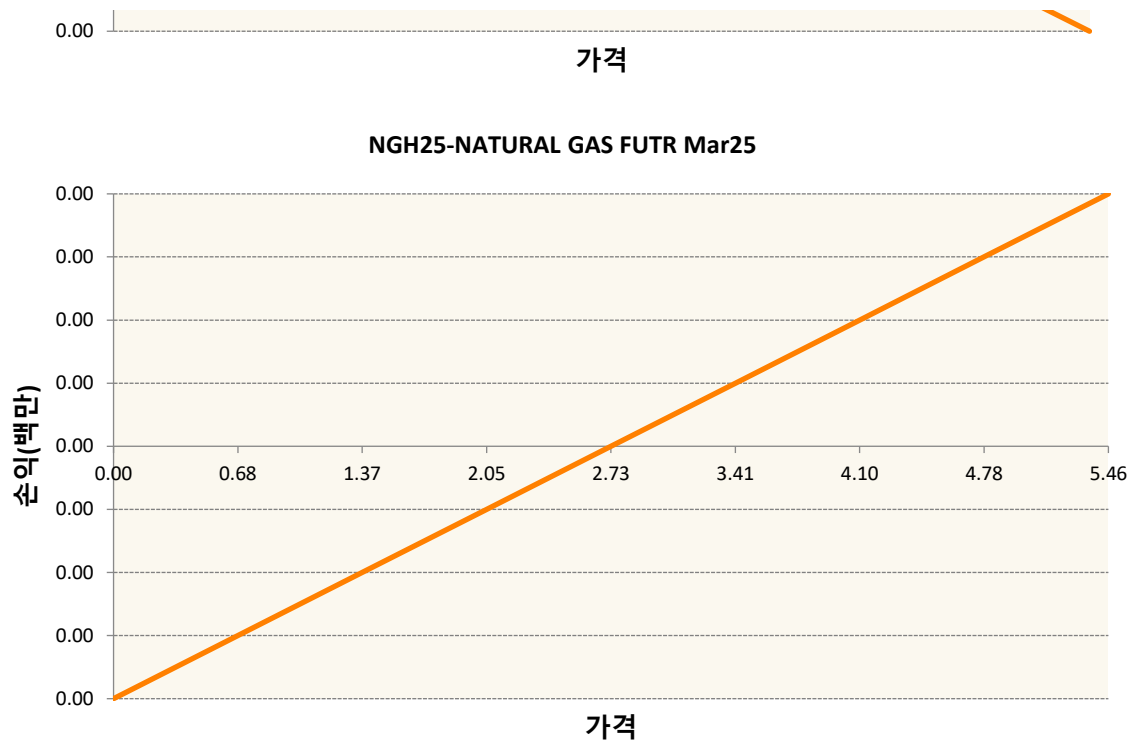
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	선물	유가증권	100	0	100	
누계	유가증권	선물	687	0	687	
누계	통화	선물	0	116	-116	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar25	8
COH5	BRENT CRUDE FUTR Mar25	16
ECH5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	4
EOH5	E-MINI NATURAL GAS Mar25	2
KR4175W10(2025-01 달러선물		9
NGH25	NATURAL GAS FUTR Mar25	16
QSH5	Low Su Gasoil G Mar25	8
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar25	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	138