

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

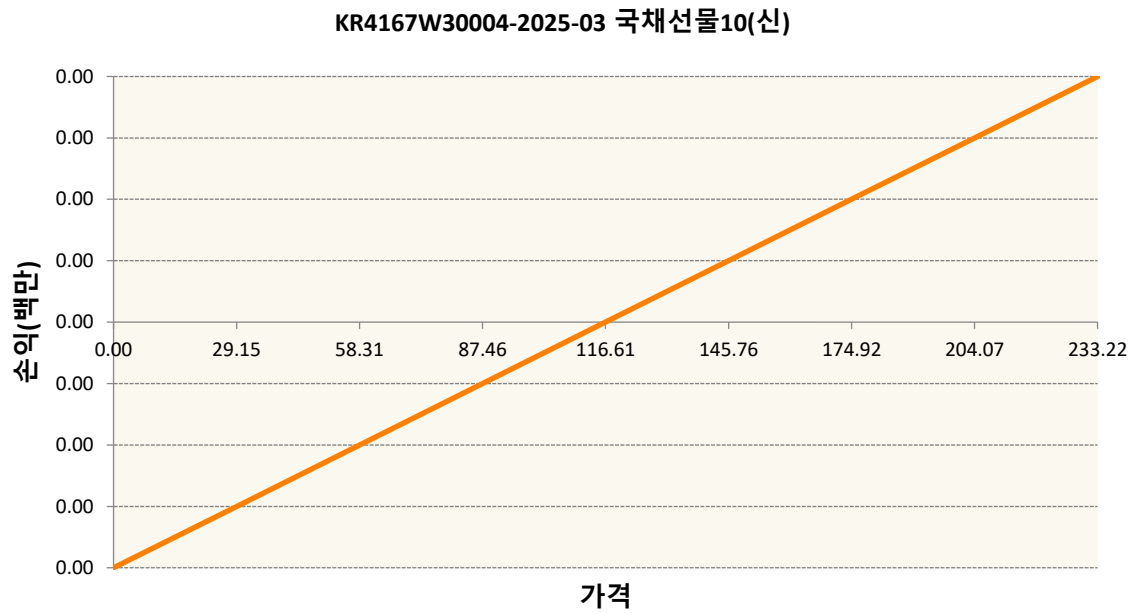
베스트장기채(채권-파생형)

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	172,583	0	172,583	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

4,531

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

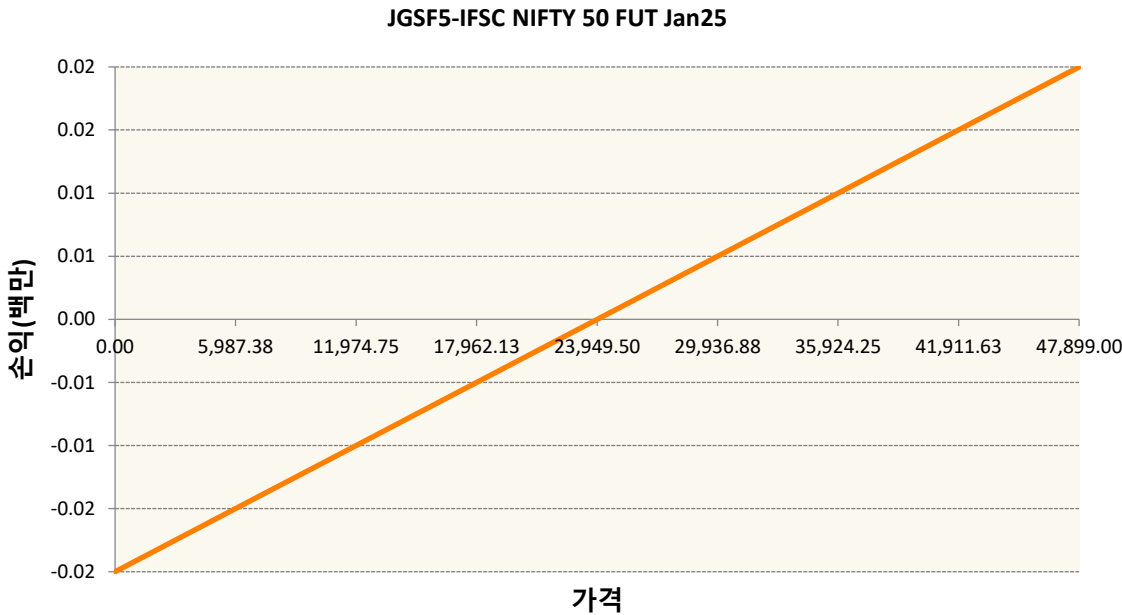
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	0	1	
누계	유가증권	선물	3,438	0	3,438	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSF5	IFSC NIFTY 50 FUT Jan25	275
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

184

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

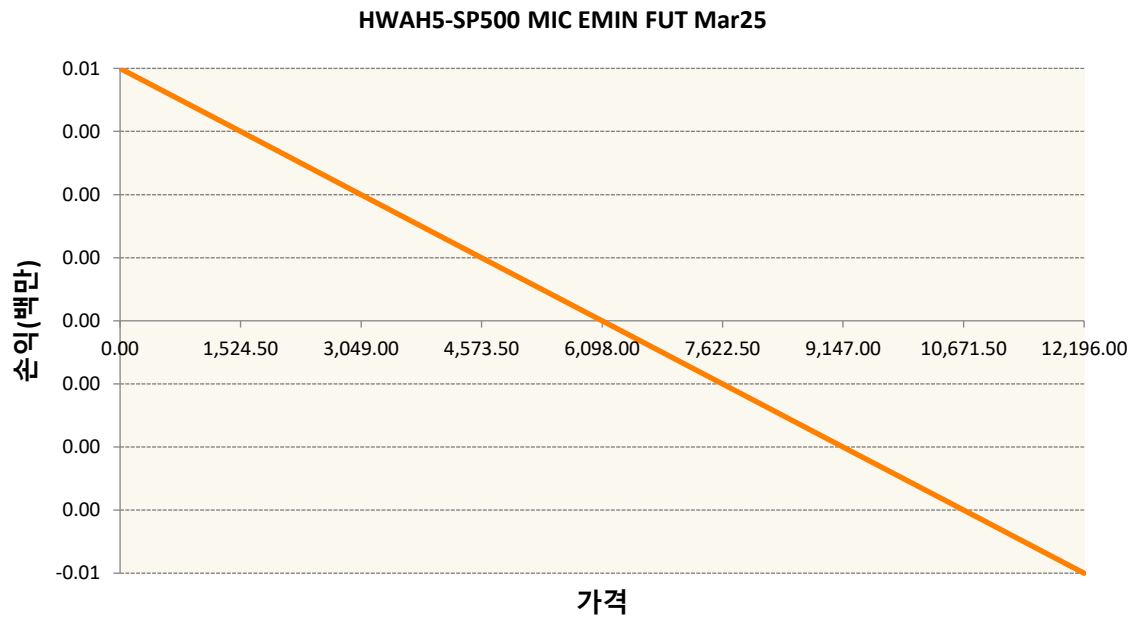
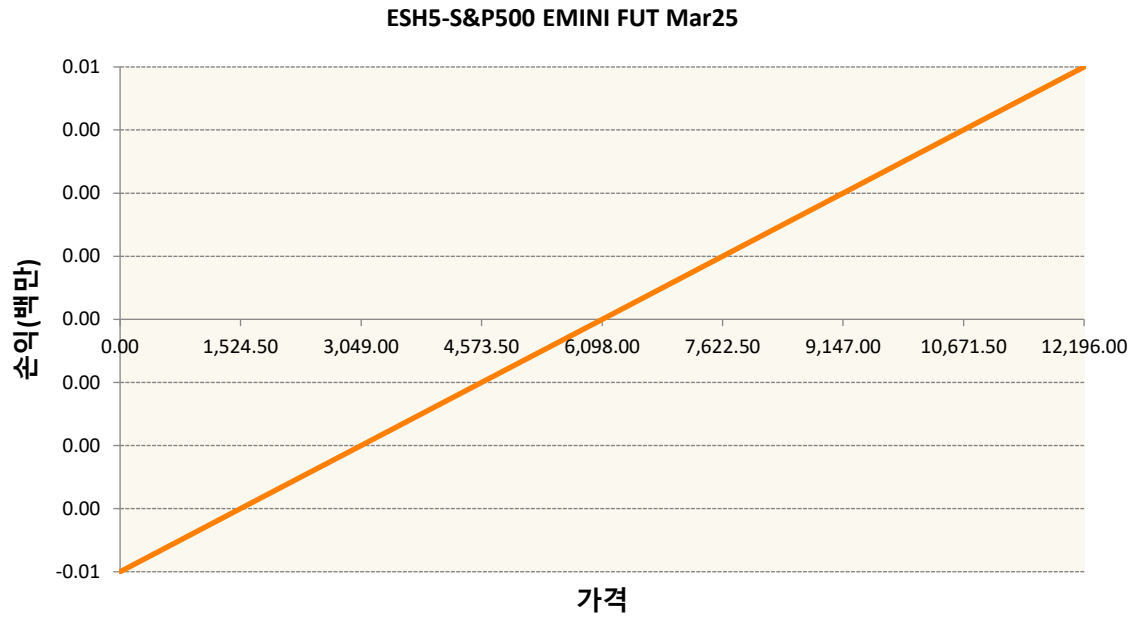
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	887	0	887	
누계	유가증권	선물	0	89	-89	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	71
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	101

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

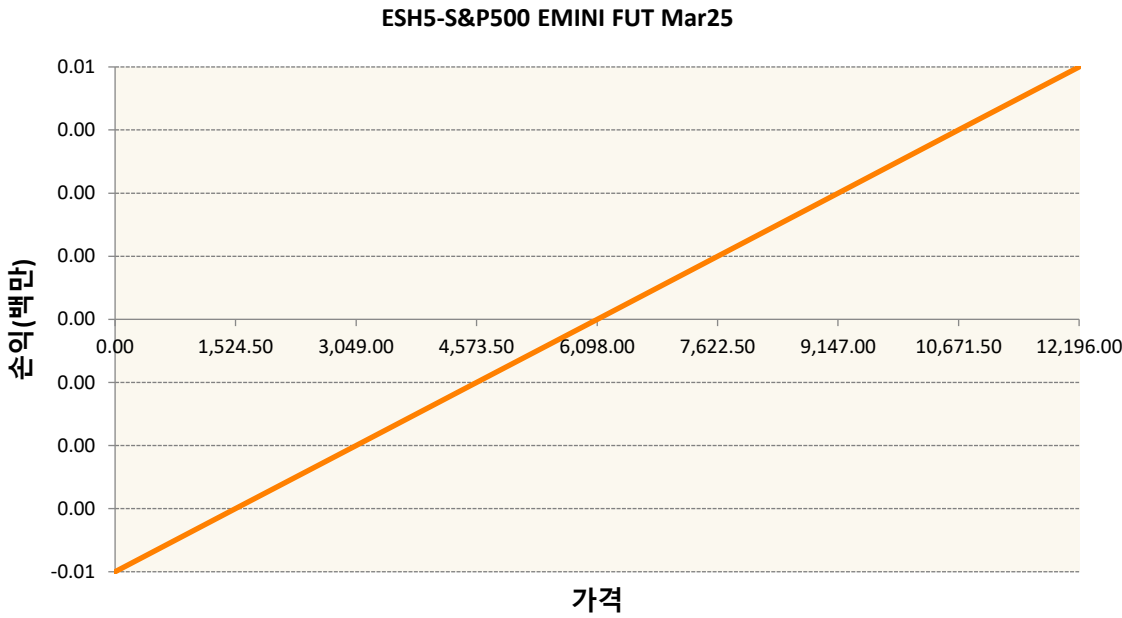
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,656	0	2,656	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	212
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

290

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

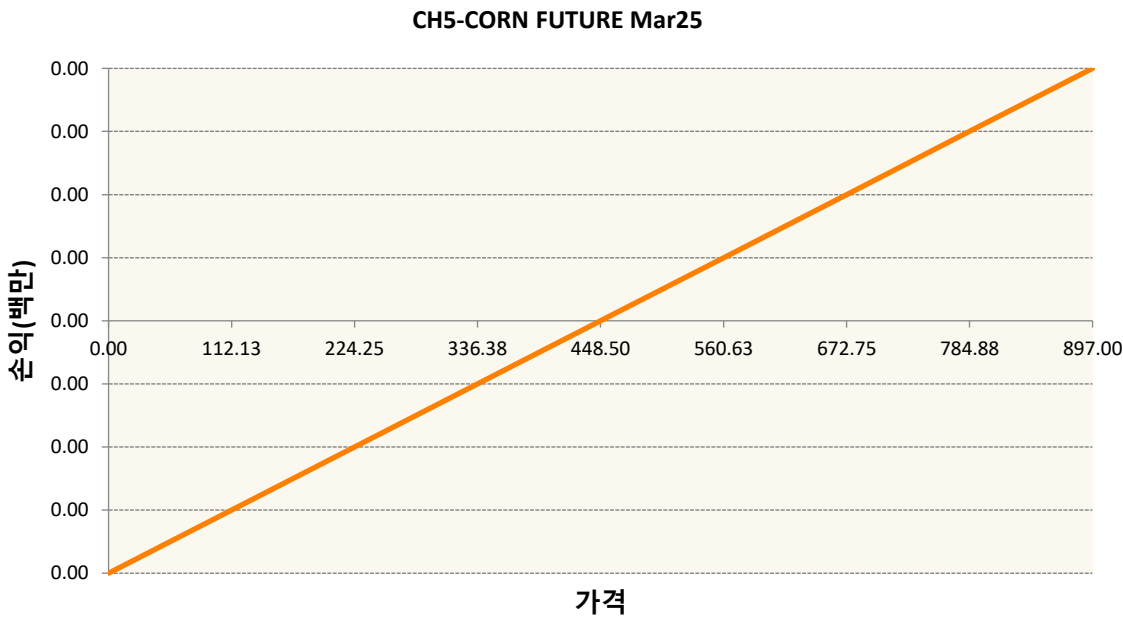
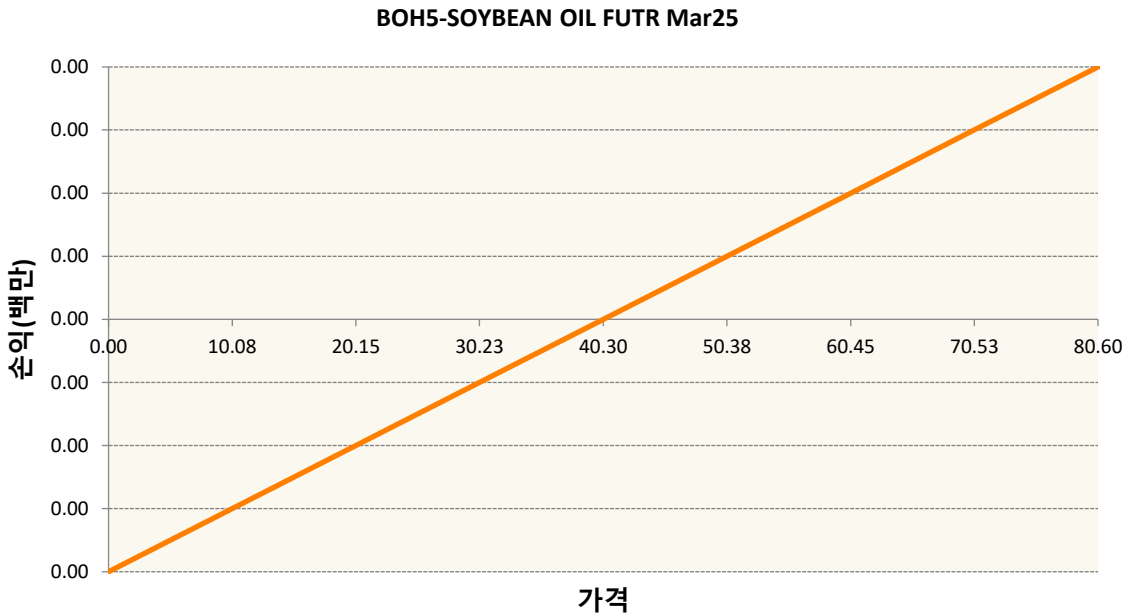
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

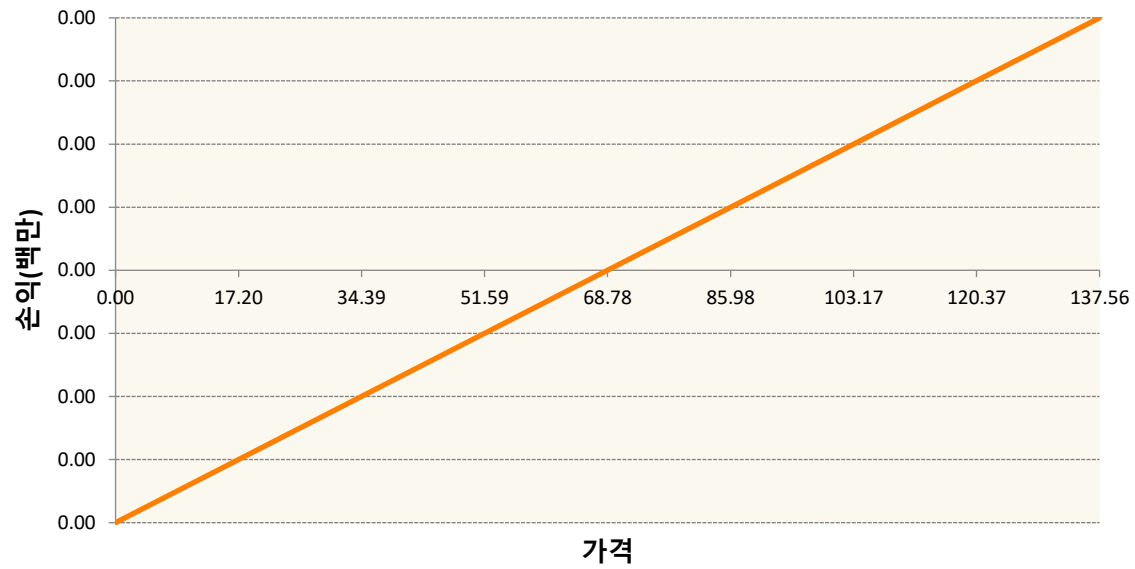
(단위:USD 백만)

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	3,679	0	3,679	
누계	통화	선물	0	425	-425	장내

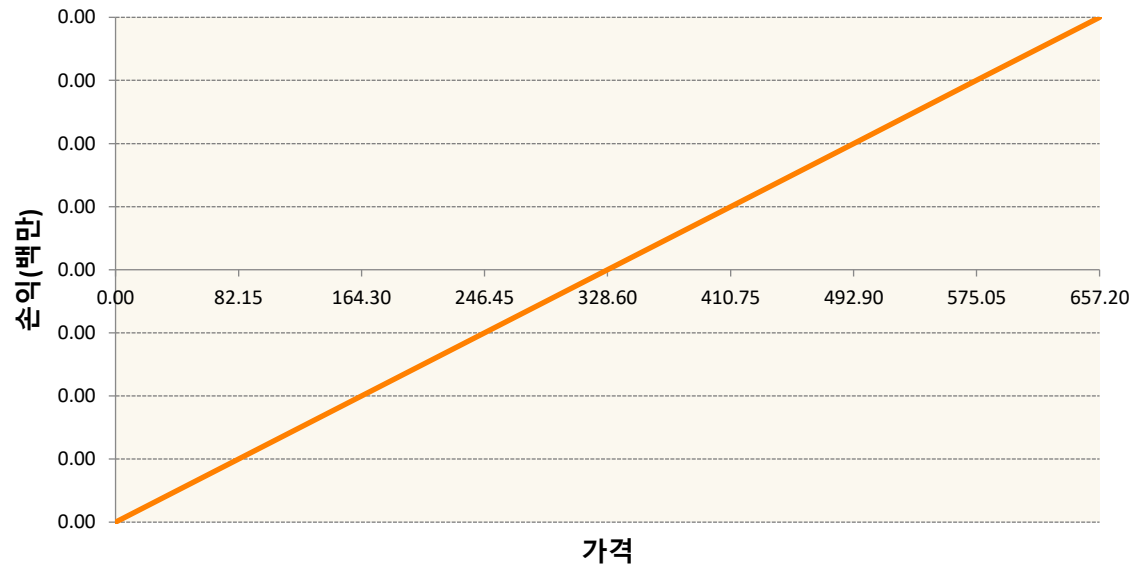
2. 만기시점의 손익구조



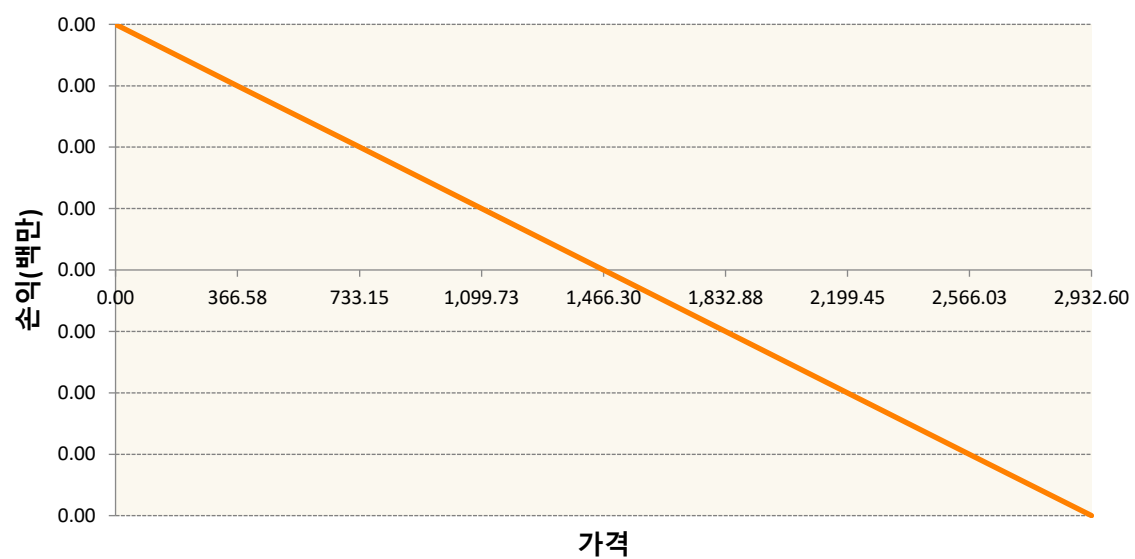
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



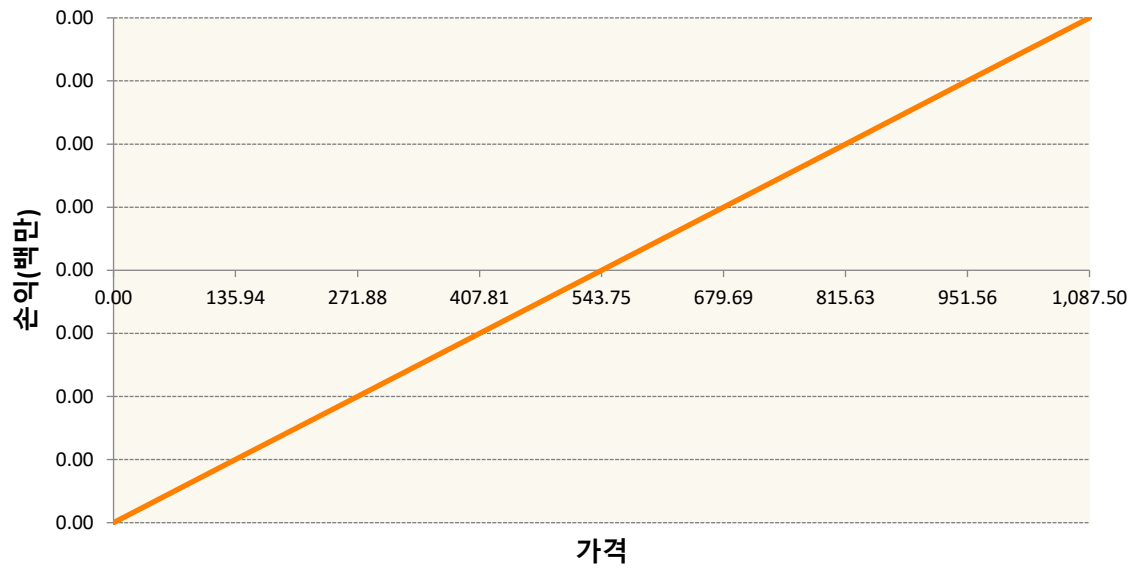
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



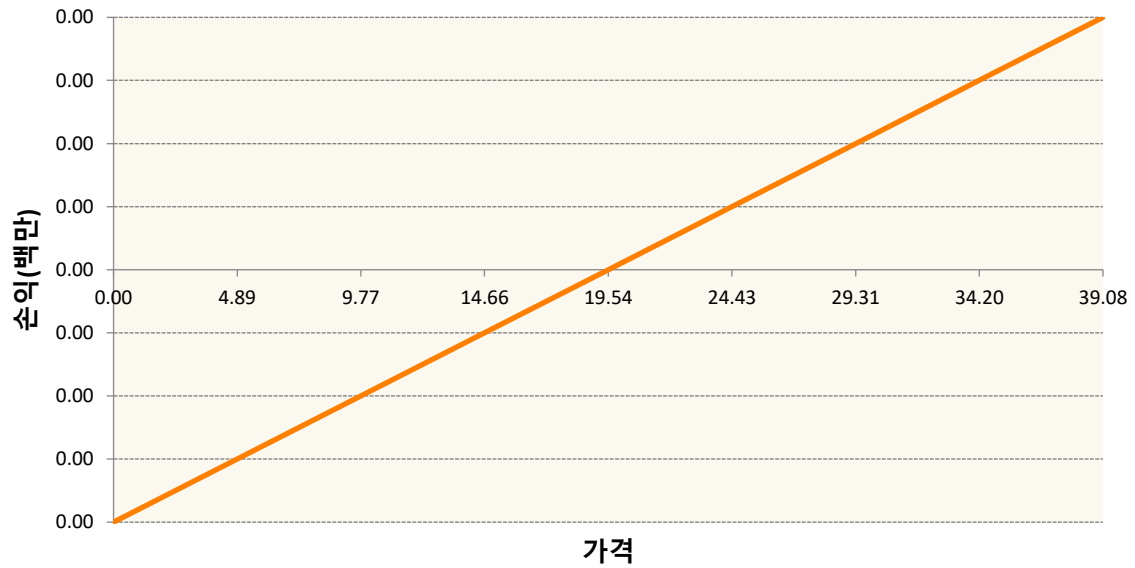
KR4175W10009-2025-01 달러선물



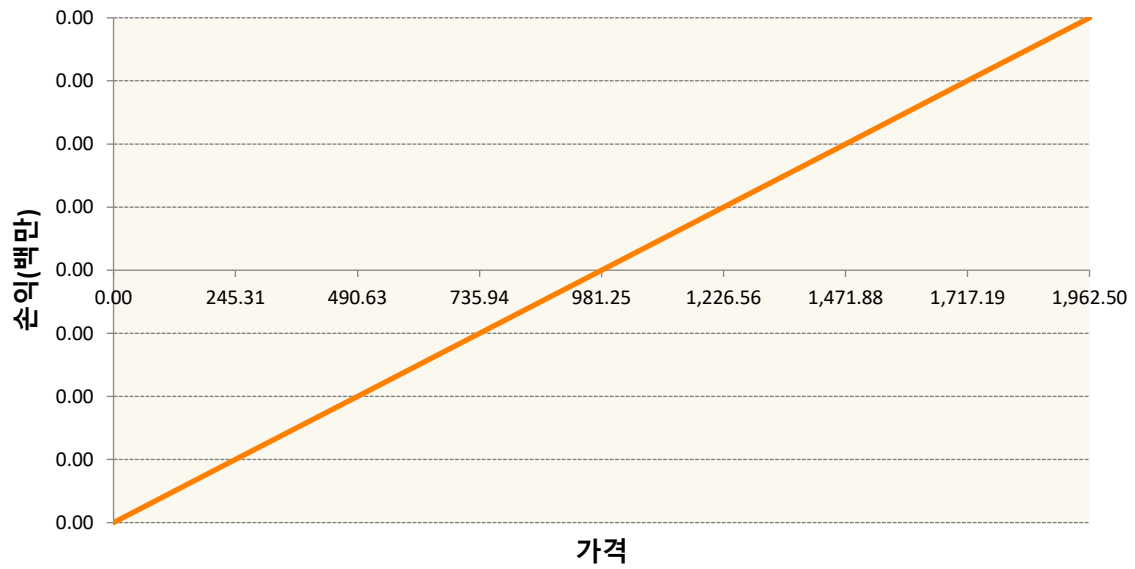
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



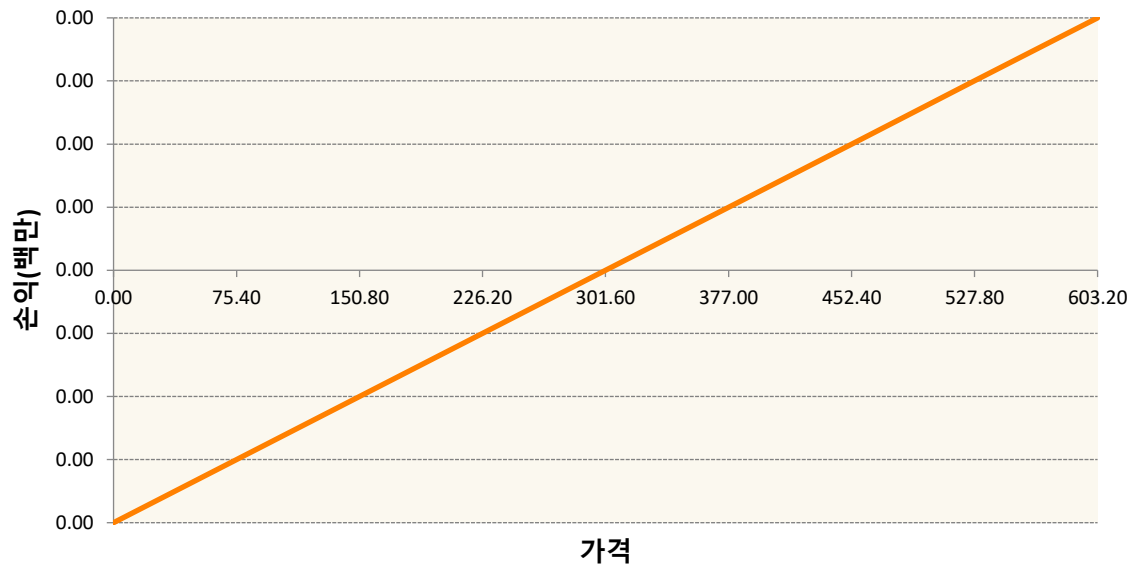
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



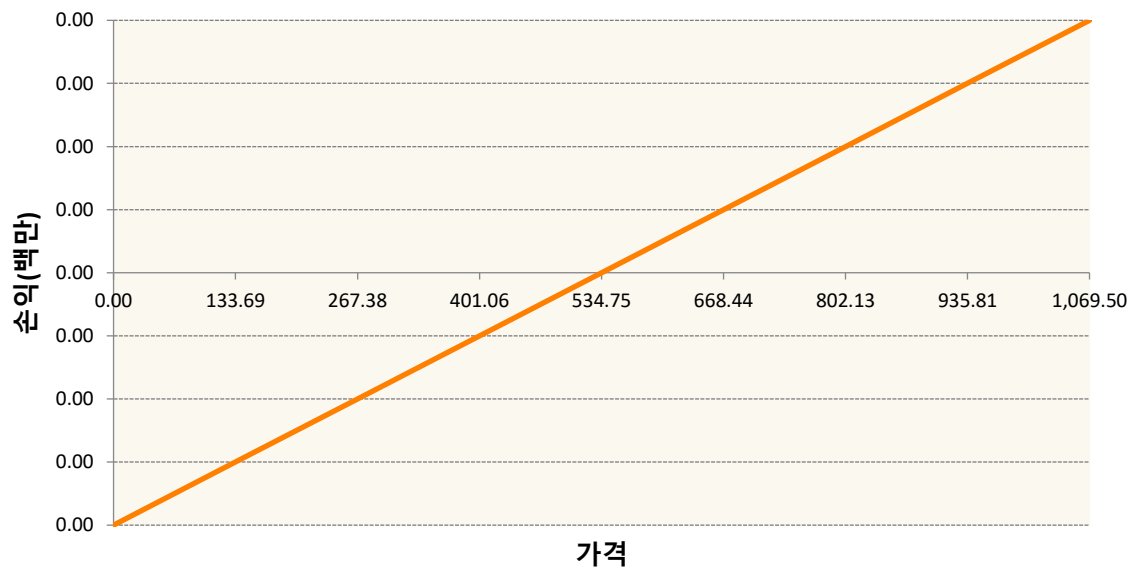
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar25



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	2024-12-27
기준일	2024-12-26

스마트인덱스모

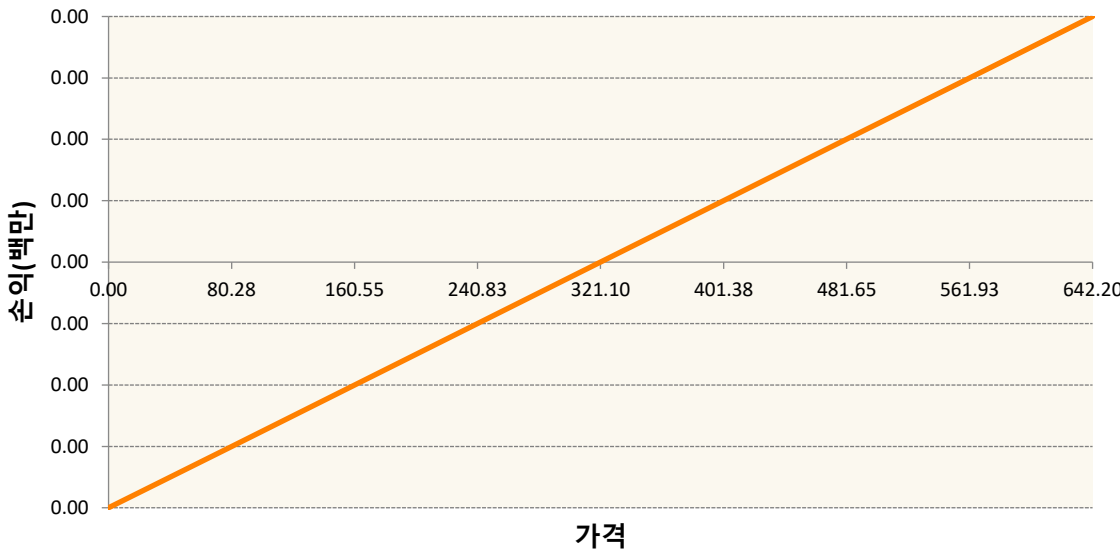
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	963	0	963	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%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-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%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	77	77	77	77	77	77	77

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

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	3,730	0	3,730	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래241219	298
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

498

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

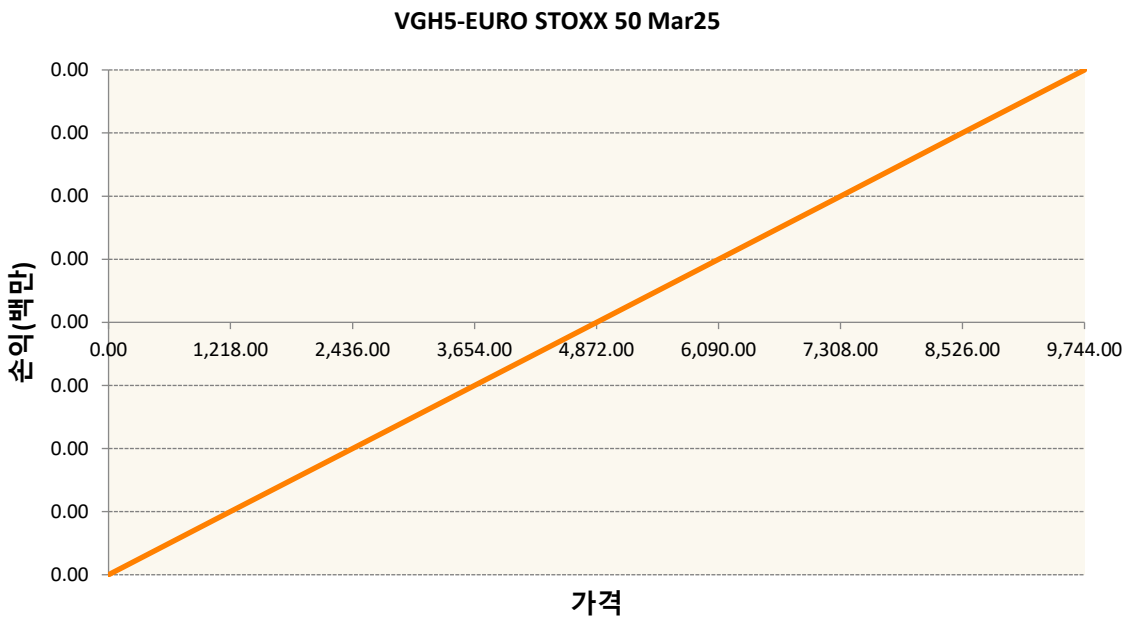
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	955	0	955	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar25	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

51

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

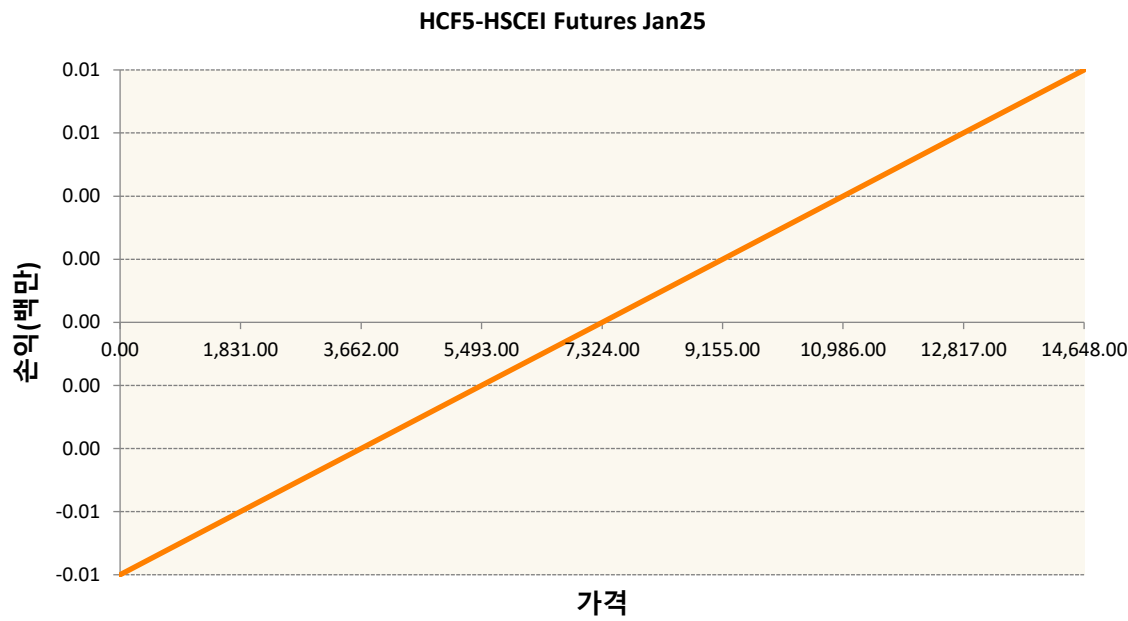
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,511	0	1,511	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	HSCEI Futures Jan25	121
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

163

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

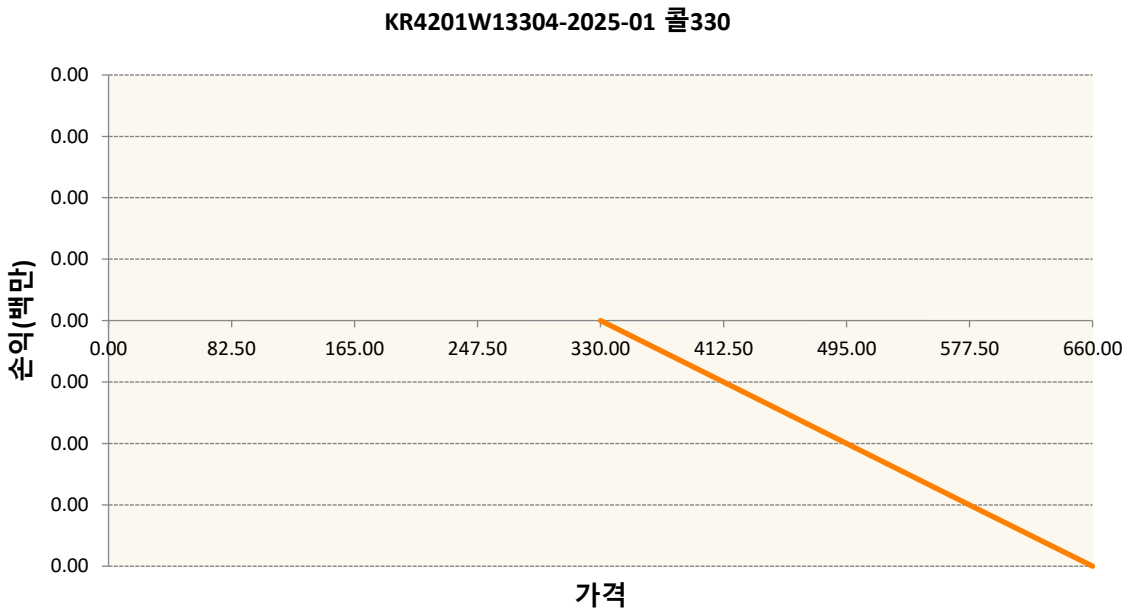
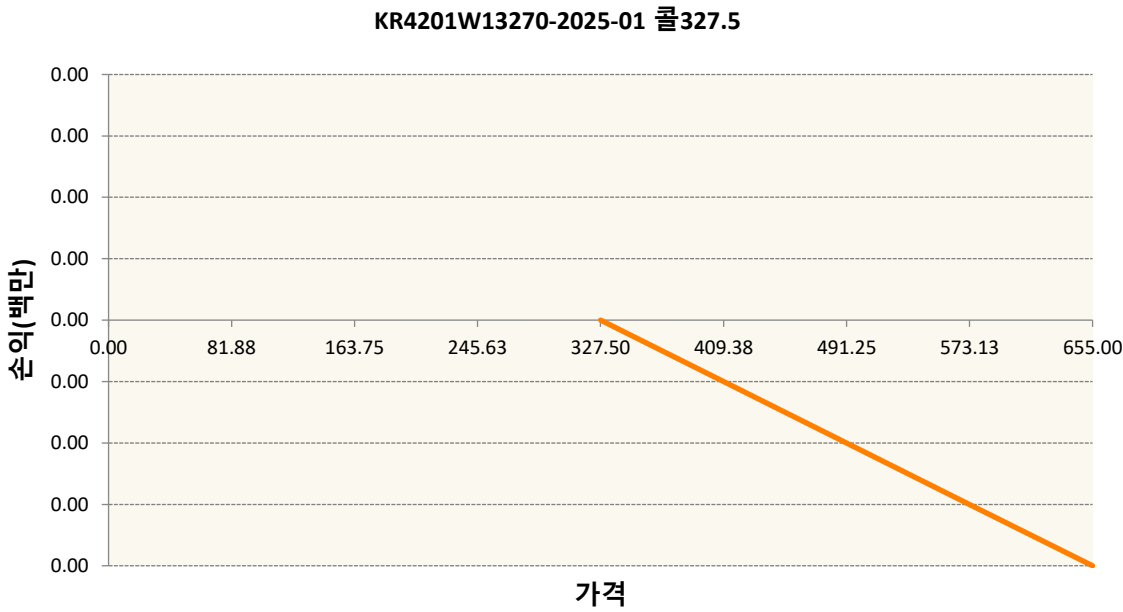
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

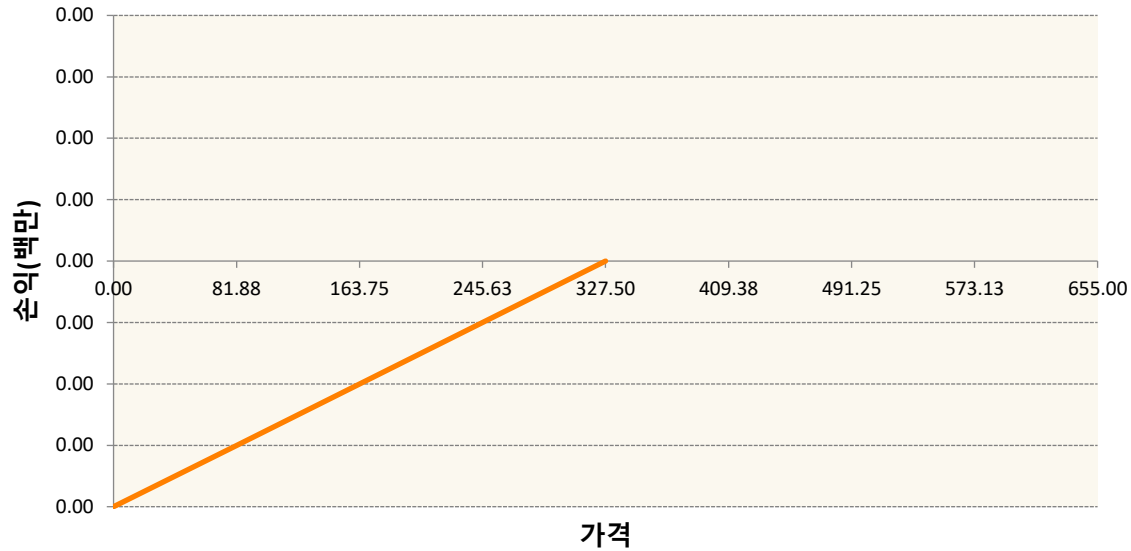
(단위:백만원)

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				404
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	86	85	84	82	80	78
-5.33%	84	82	79	76	72	67	61
-2.67%	72	66	60	52	44	36	27
0%	33	22	11	0	-11	-23	-34
2.67%	-55	-67	-79	-91	-103	-115	-127
5.33%	-194	-203	-212	-221	-231	-242	-252
8.00%	-368	-372	-377	-383	-389	-397	-404
KR4201W13304			2025-01 콜330				1,180
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	214	214	212	210	206	201	194
-5.33%	210	206	200	191	181	168	154
-2.67%	186	172	154	134	113	89	64
0%	94	64	32	0	-33	-67	-102
2.67%	-133	-171	-210	-248	-287	-325	-363
5.33%	-525	-556	-589	-622	-656	-691	-727
8.00%	-1,044	-1,061	-1,080	-1,102	-1,126	-1,152	-1,180
KR4301W13278			2025-01 풋327.5				493
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-489	-489	-489	-490	-490	-491	-493
-5.33%	-306	-307	-308	-310	-312	-315	-318
-2.67%	-128	-132	-136	-141	-147	-153	-159
0%	26	17	9	0	-9	-18	-27

2.67%	129	119	109	100	90	80	71
5.33%	176	170	163	156	149	141	133
8.00%	190	187	185	181	177	172	167

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

(단위:백만원)

2,023

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

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	671	0	671	

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	2024-12-27
기준일	2024-12-26

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	4,356	0	4,356	

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	2024-12-27
기준일	2024-12-26

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	217	-217	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	12,872	0	12,872	
누계	통화	선도	322	14,428	-14,106	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213E9SC KRW/USD 31-12-24E	369
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E	217
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E	568
FXW213EC2(USD/KRW 31-12-24E	26
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

482

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

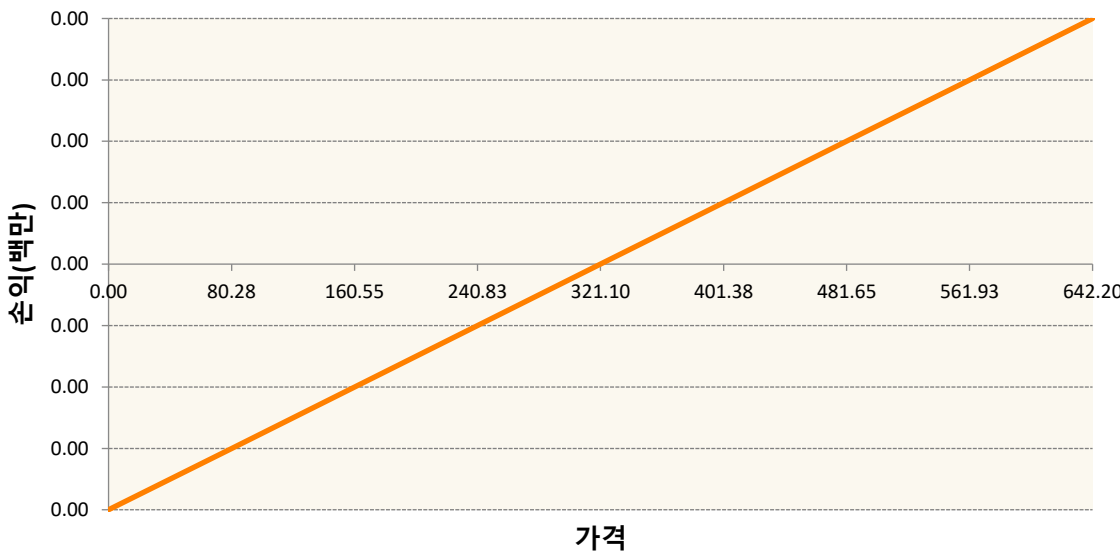
1. 계약금액

(단위:백만원)

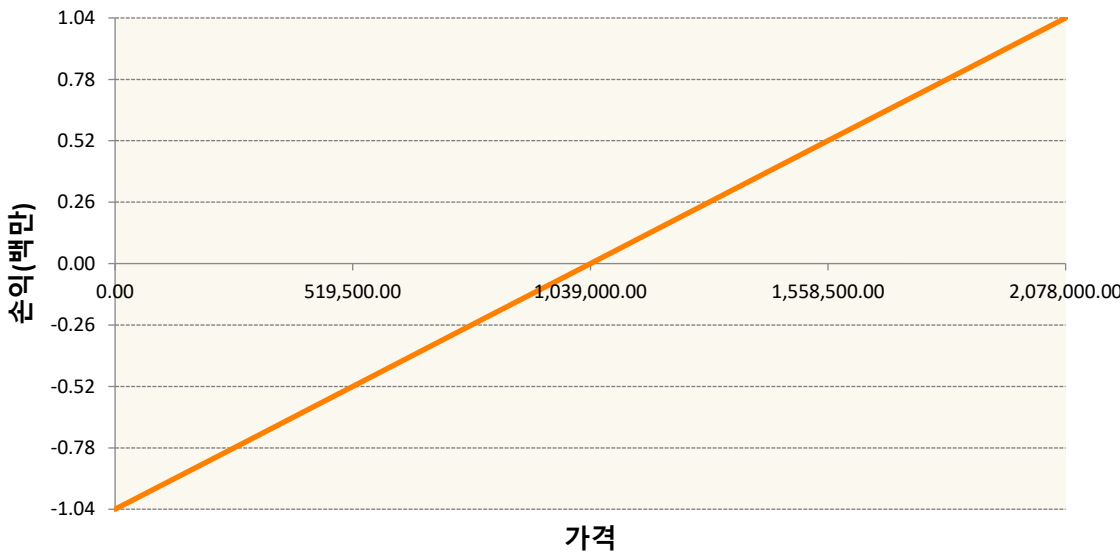
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	101	0	101	장내
누계	유가증권	선물	695	0	695	장내

2. 만기시점의 손익구조

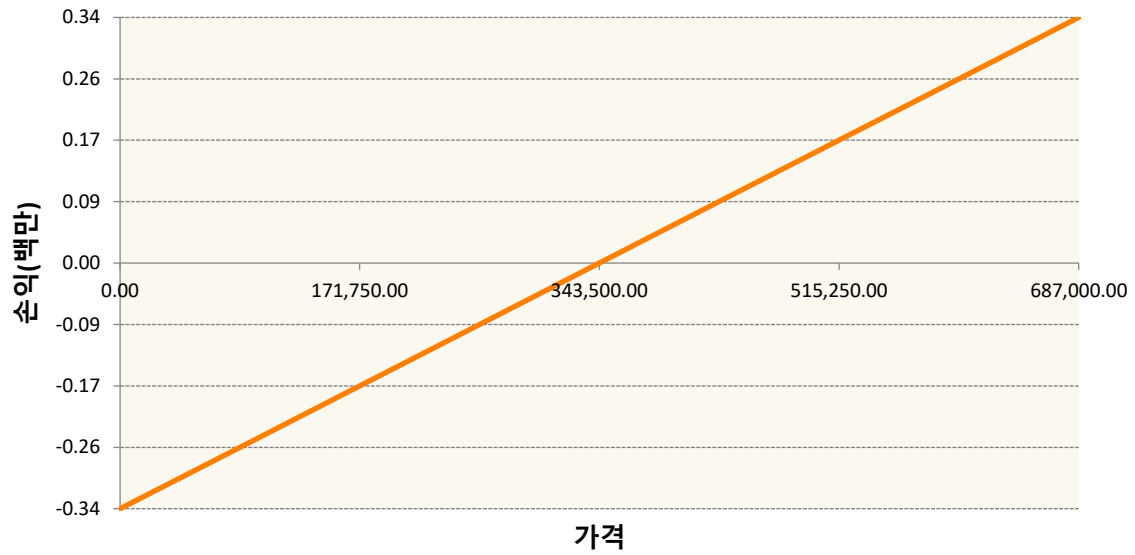
KR4101W30003-2025-03 코스피200지수선물



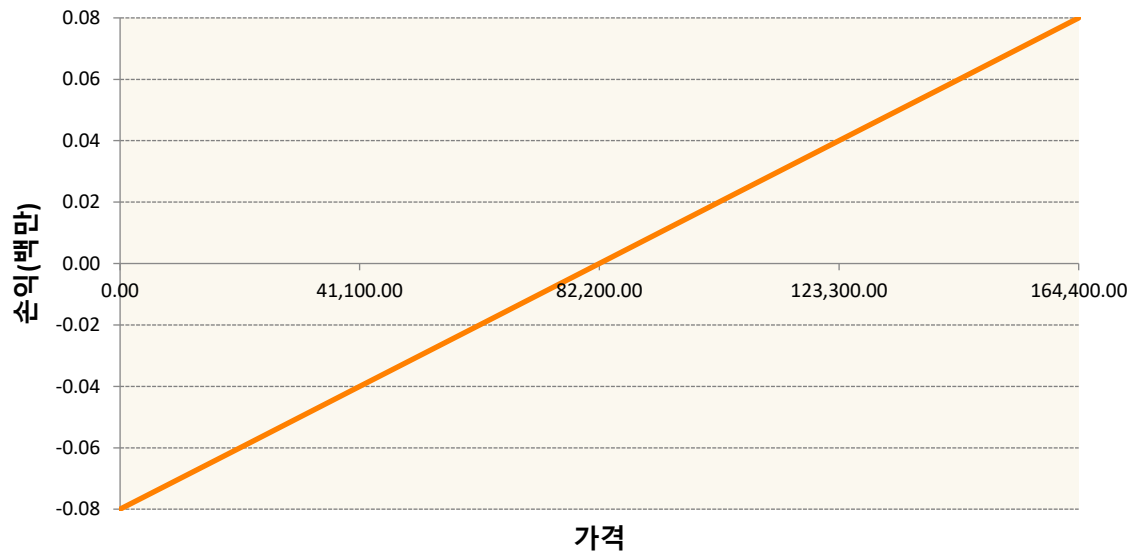
KR41B3W20008-2025-02 고려아연개별선물



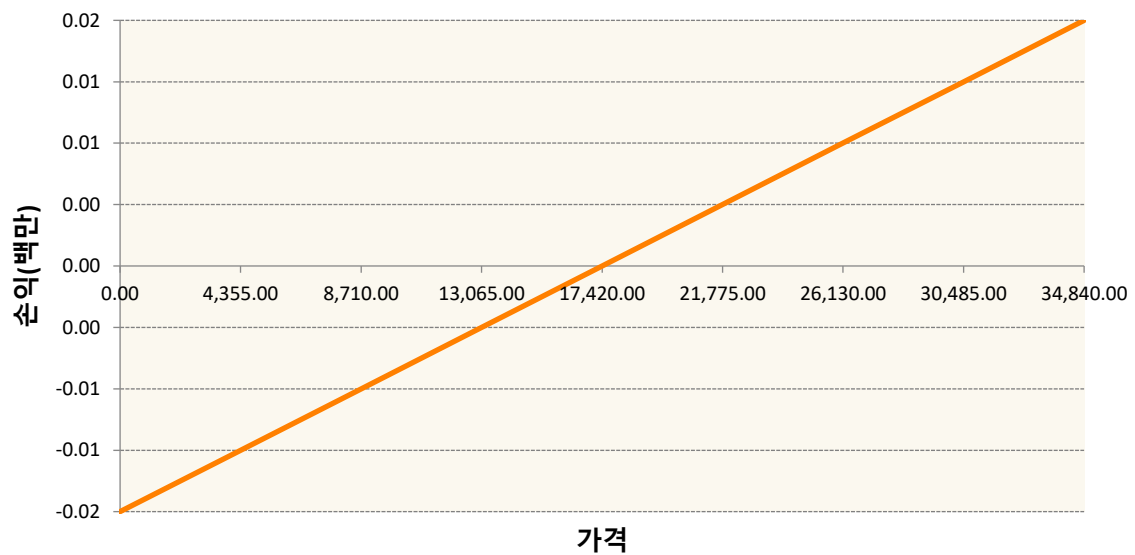
KR41F5W10000-2025-01 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW10009-2025-01 엘앤에프개별선물



KR41GNW10005-2025-01 금양개별선물



(단위:백만원)

KR4101W30003							2025-03 코스피200지수선물		45	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45		
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30		
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	15		
5.33%	30	30	30	30	30	30	30	30		
8.00%	45	45	45	45	45	45	45	45		
KR41B3W20008							2025-02 고려아연개별선물		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	-4		
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3		
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1		
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3		
8.00%	4	4	4	4	4	4	4	4		
KR41F5W10000							2025-01 LG에너지솔루션개별선물		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	-6		
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4		
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2		
5.33%	4	4	4	4	4	4	4	4		
8.00%	6	6	6	6	6	6	6	6		
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	-1		
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1		
-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%	1	1	1	1	1	1	1	1		
8.00%	1	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)

62

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

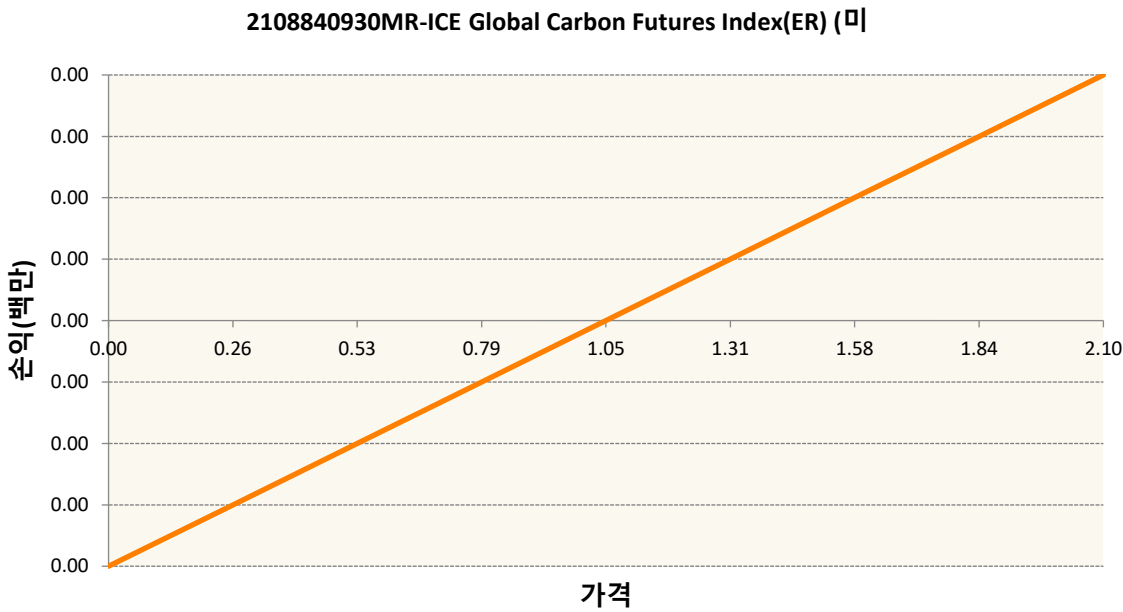
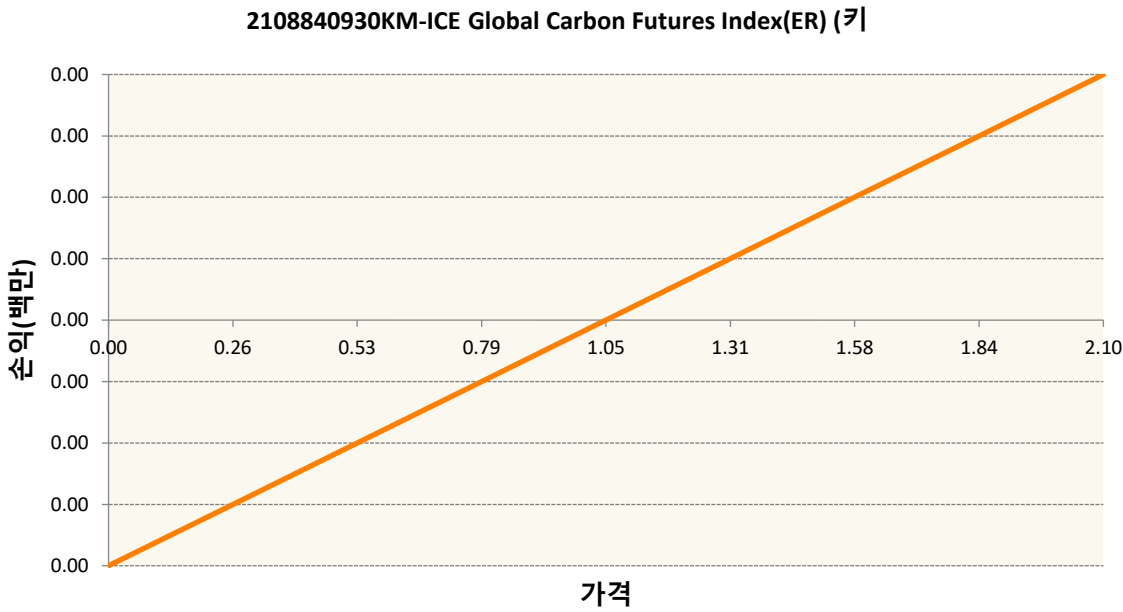
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

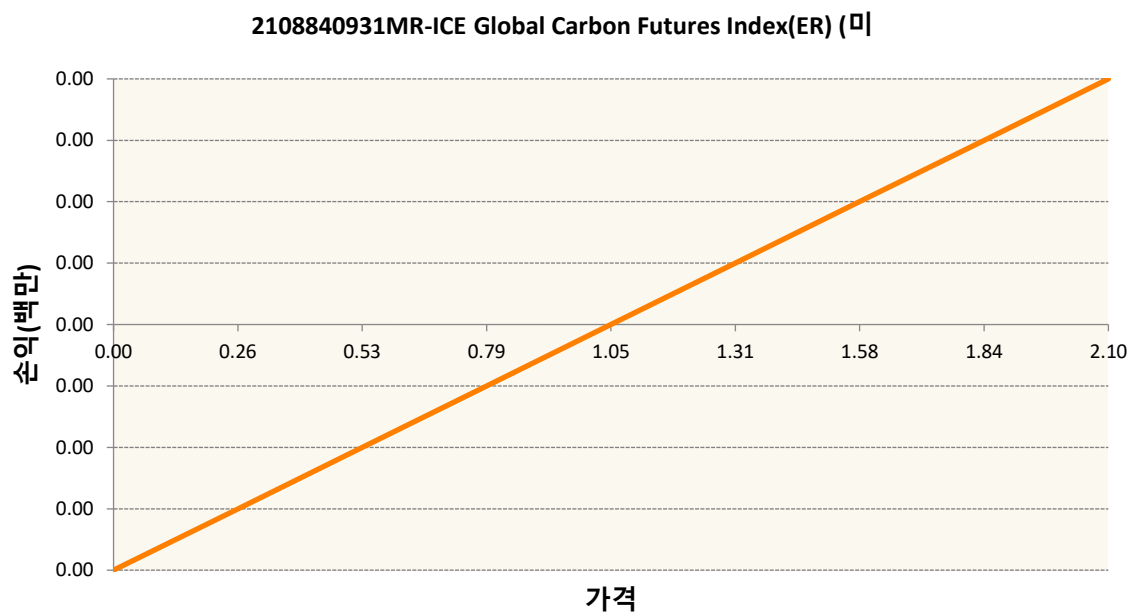
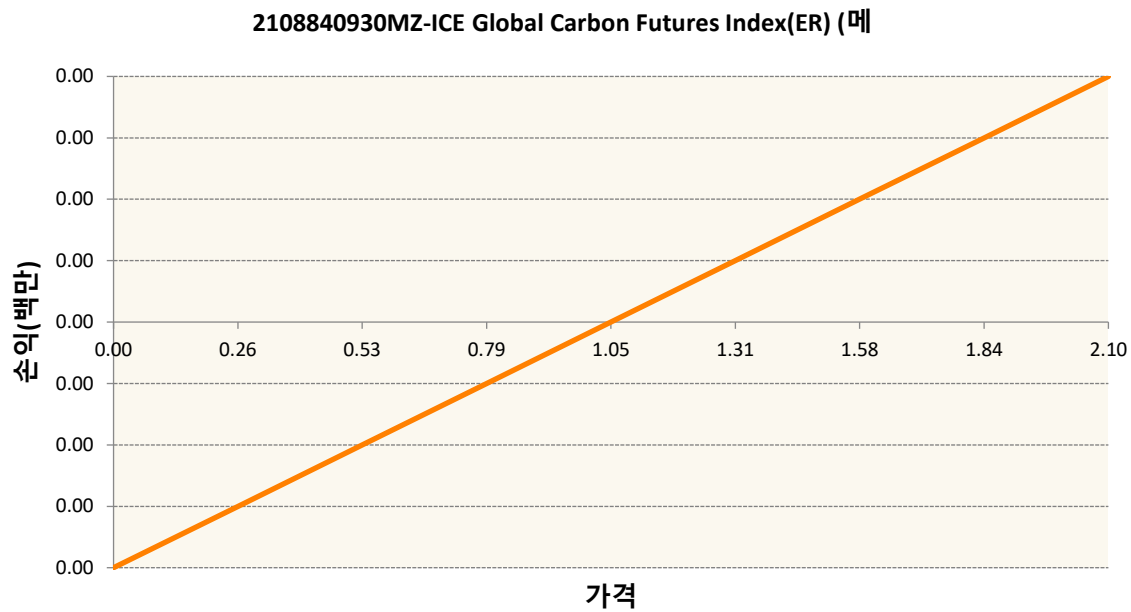
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,736	0	11,736	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		94
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		471
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		188
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		188

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,004

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

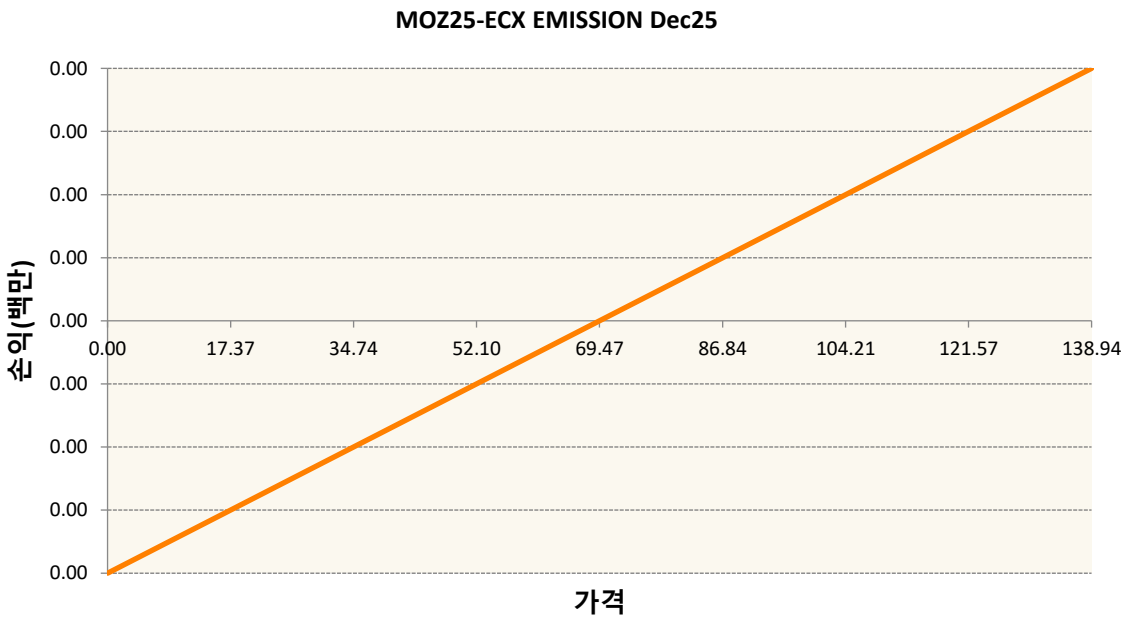
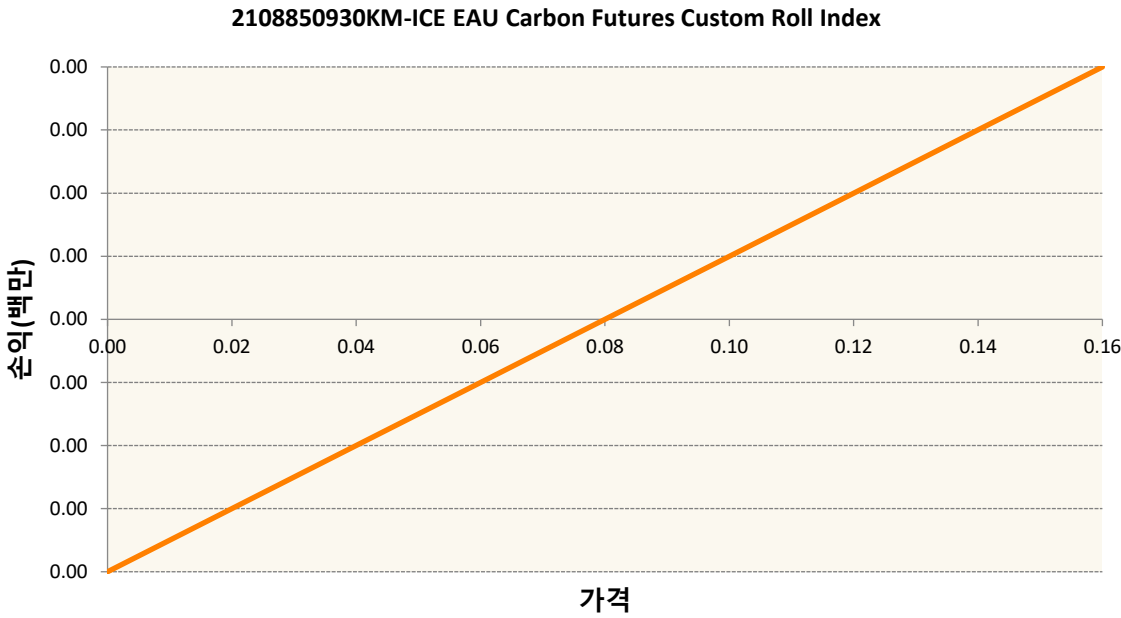
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,729	0	8,729	
누계	통화	선도	2,276	4,358	-2,082	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		2
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		26
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E		156
FXW213ECS(EUR/KRW 31-12-24E		16
FXW213ECS(EUR/KRW 31-12-24E		167
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E		167
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		696

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,443

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

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	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)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	2

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

(단위:백만원)

11

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

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	7,700	0	7,700	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

72

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

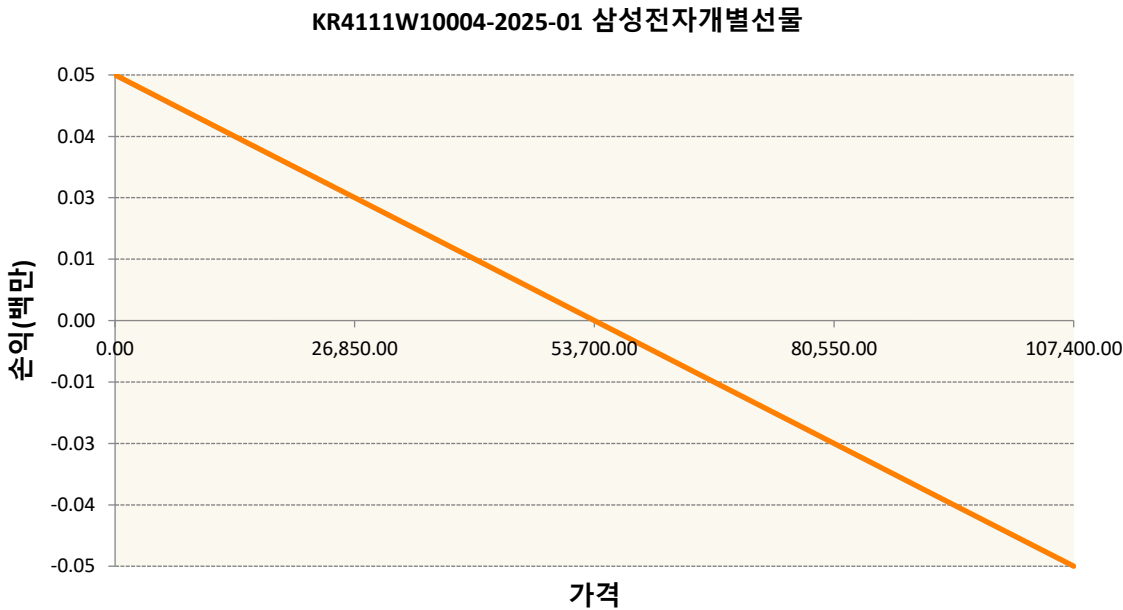
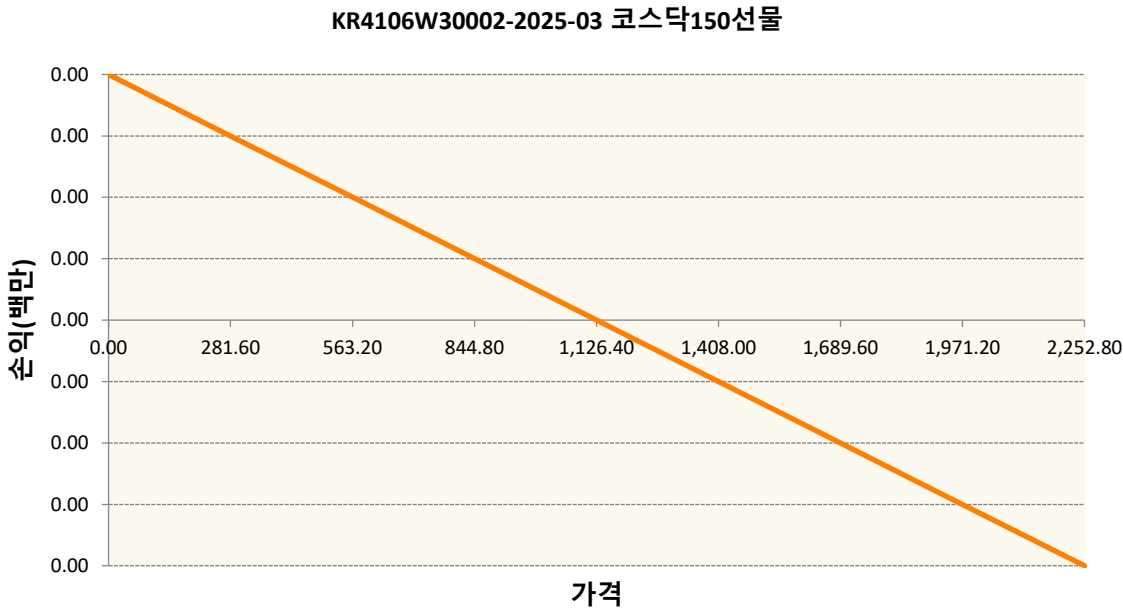
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	0	18	-18	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4106W30(2025-03 코스닥150선물		1
KR4111W10(2025-01 삼성전자개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		2

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

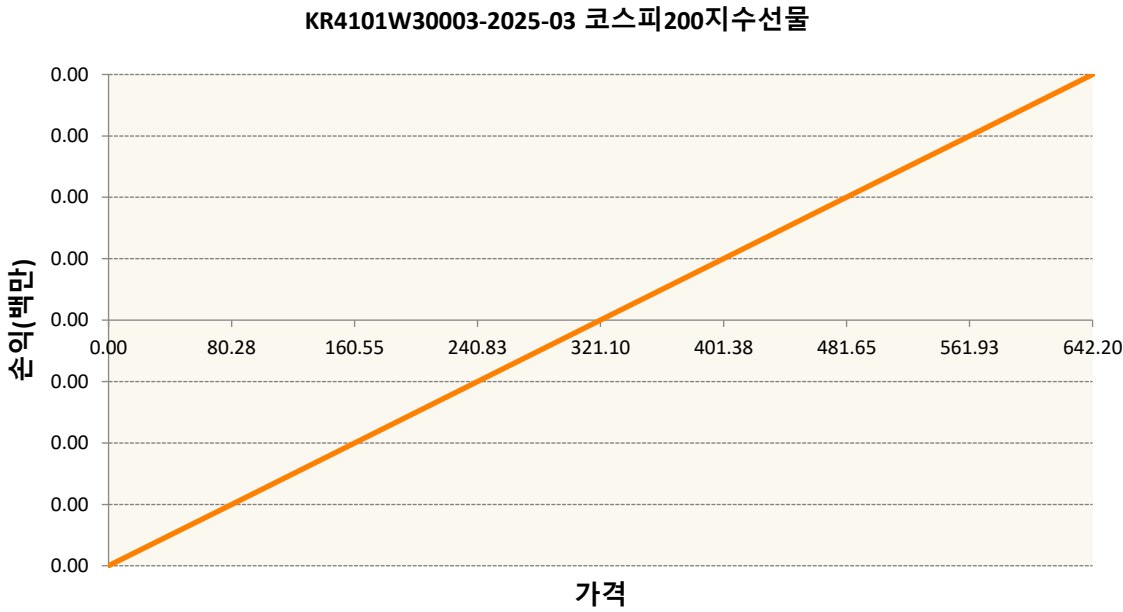
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	7,225	0	7,225	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30003			2025-03 코스피200지수선물				579
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579
-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%	579	579	579	579	579	579	579

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

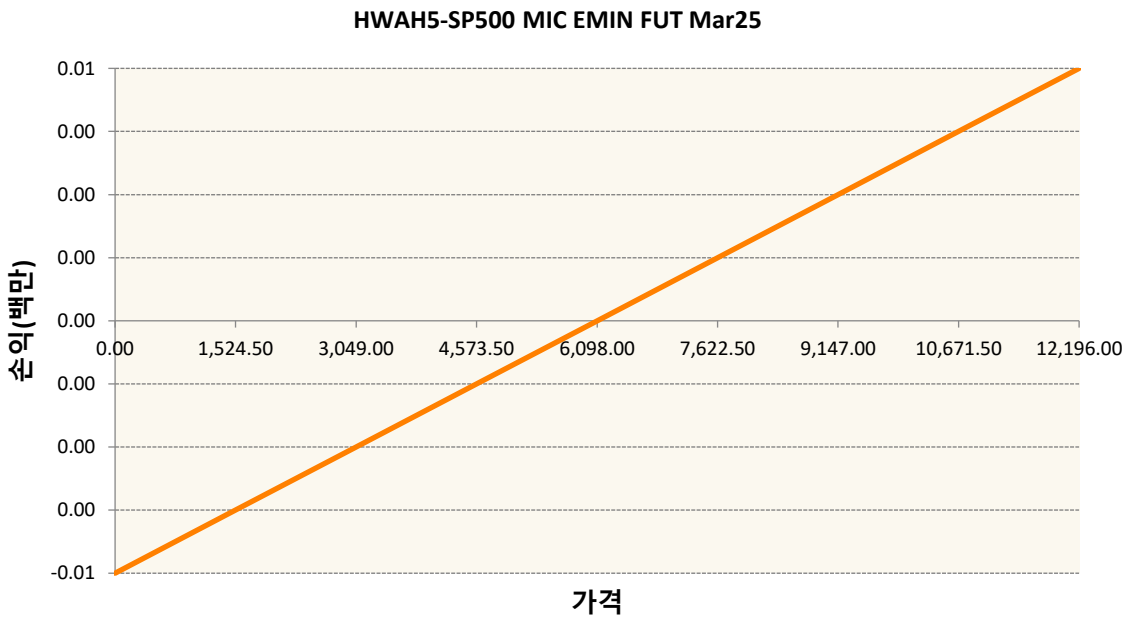
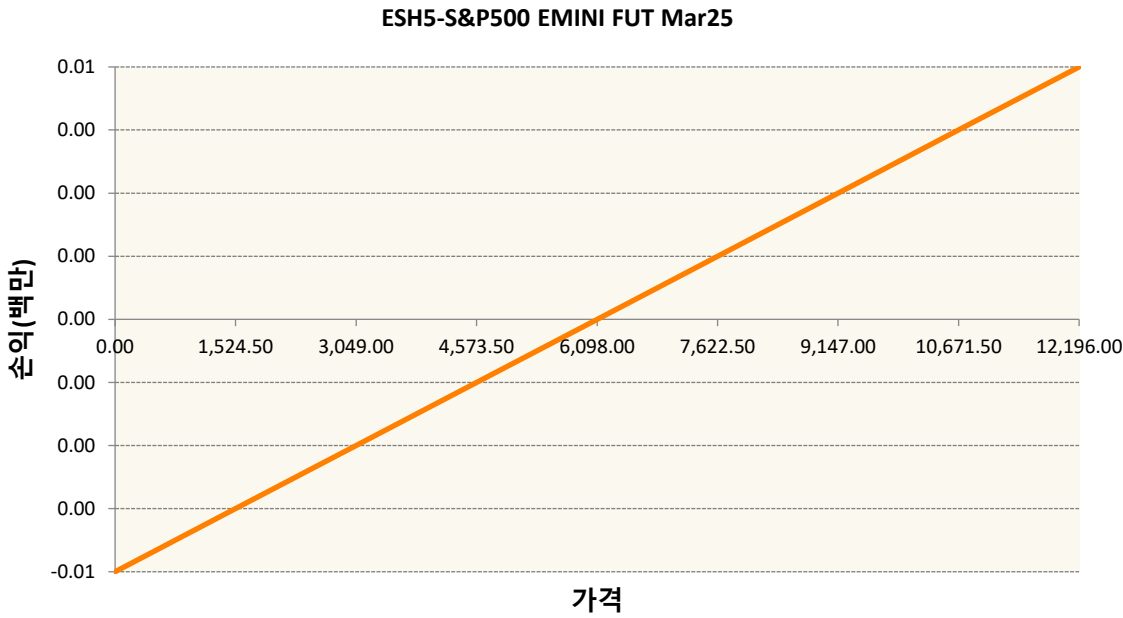
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	23,905	0	23,905	
누계	유가증권	선물	2,390	0	2,390	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	1,912
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	191

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,730

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

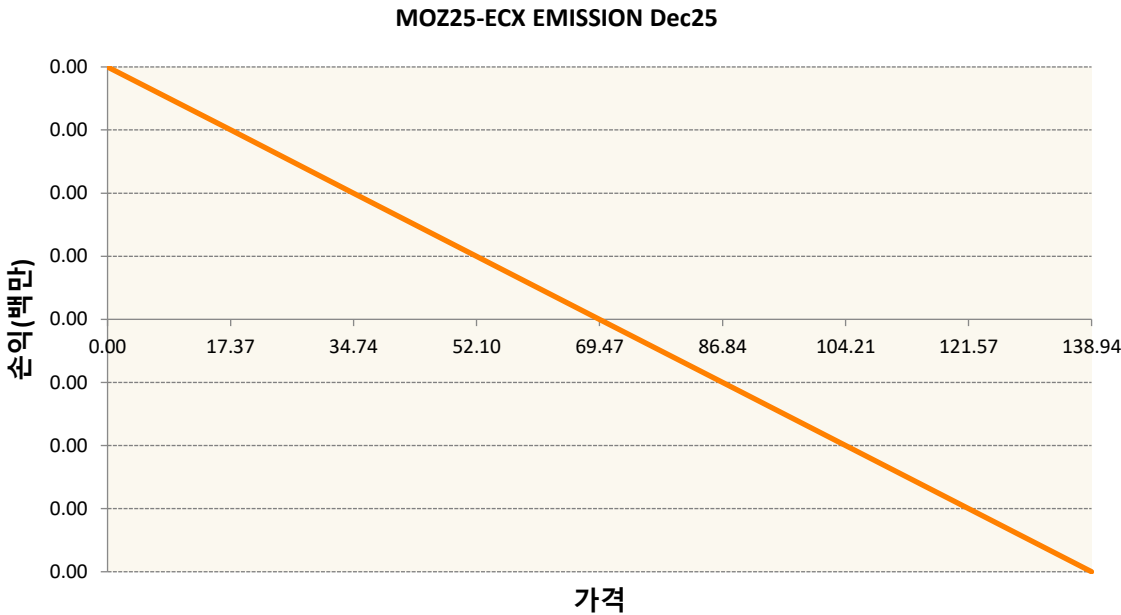
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-27	5,471	-5,498	
누계	통화	선도	1,173	2,458	-1,285	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2
FXW213EBTC KRW/EUR 31-12-24E	94
FXW213ECS(EUR/KRW 31-12-24E	94
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	9
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	94
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	438

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

(단위:백만원)

886

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

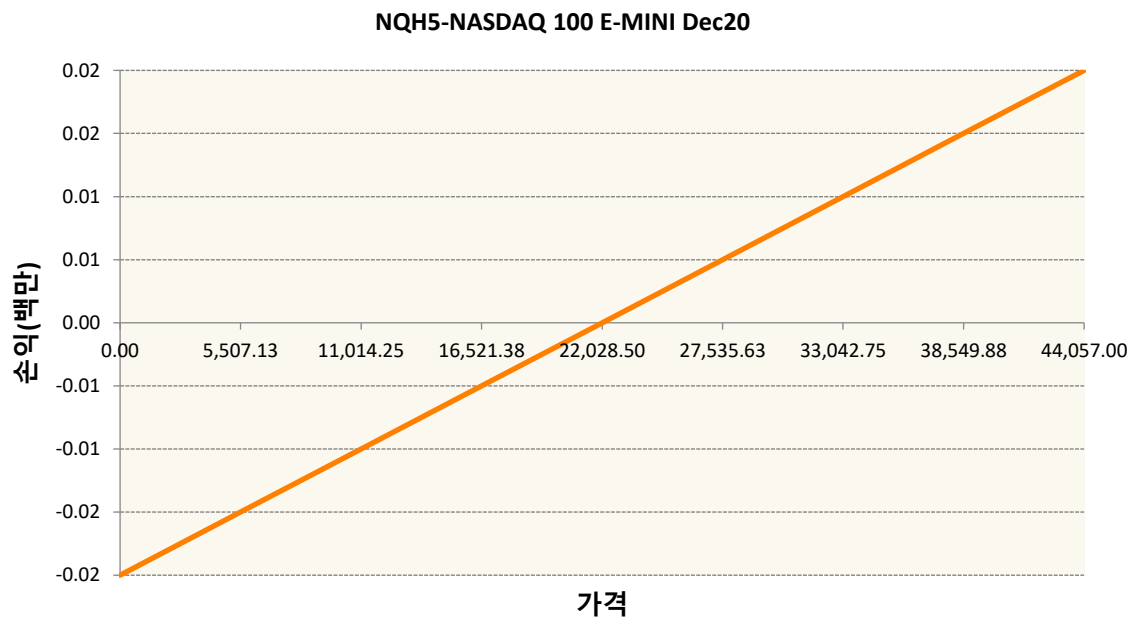
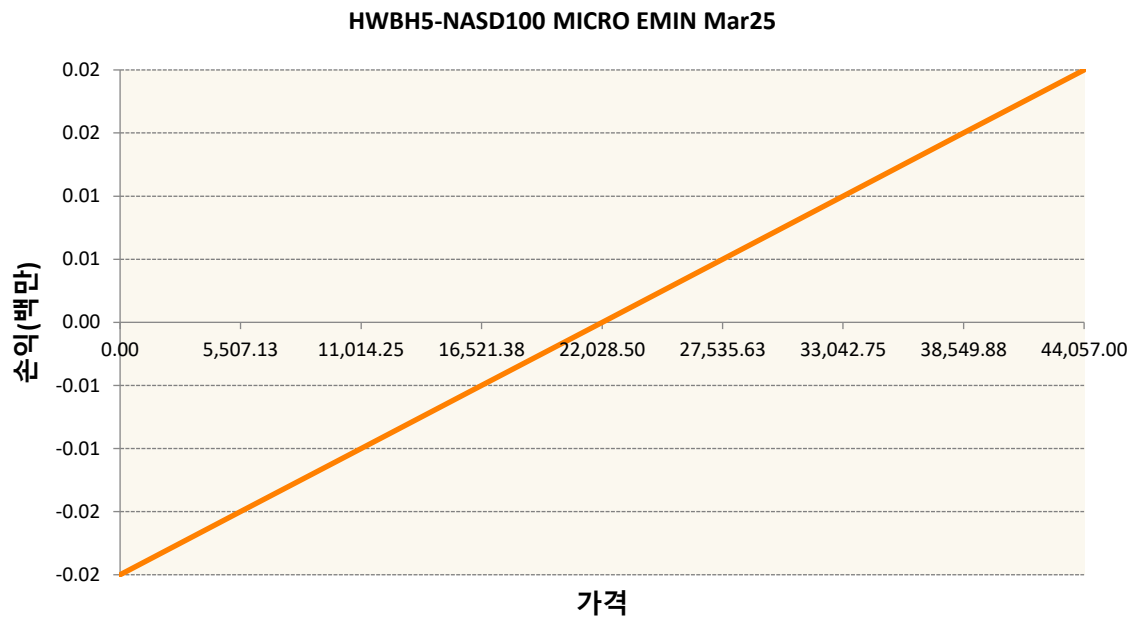
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	12,152	0	12,152	
누계	유가증권	선물	1,471	0	1,471	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25		118
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		972

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			931

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

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	196,883	0	196,883	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	718
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,236
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,959
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,865

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

(단위:백만원)

9,067

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

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	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)

13

공시일	2024-12-27
기준일	2024-12-26

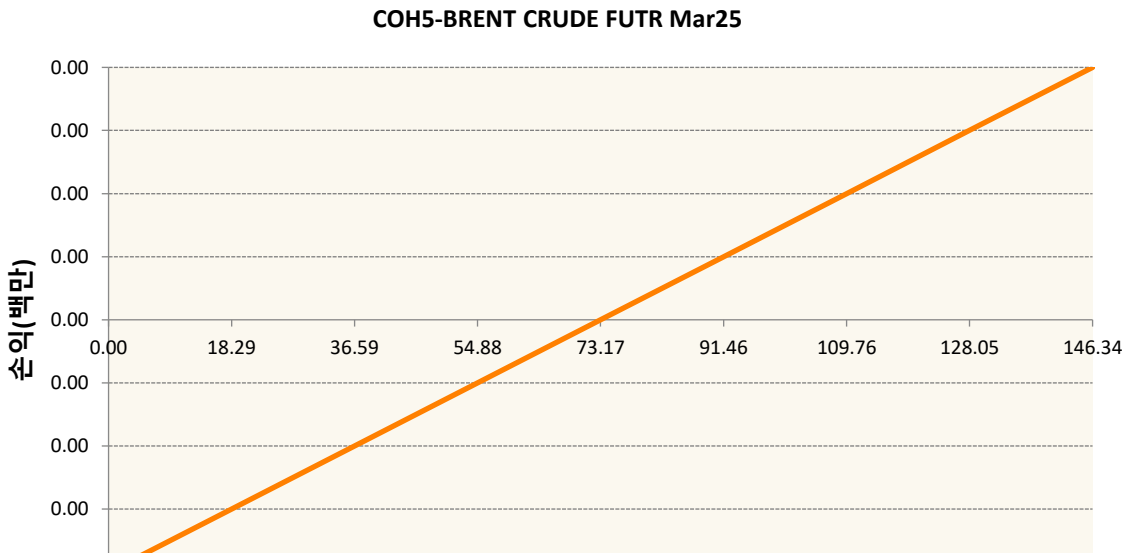
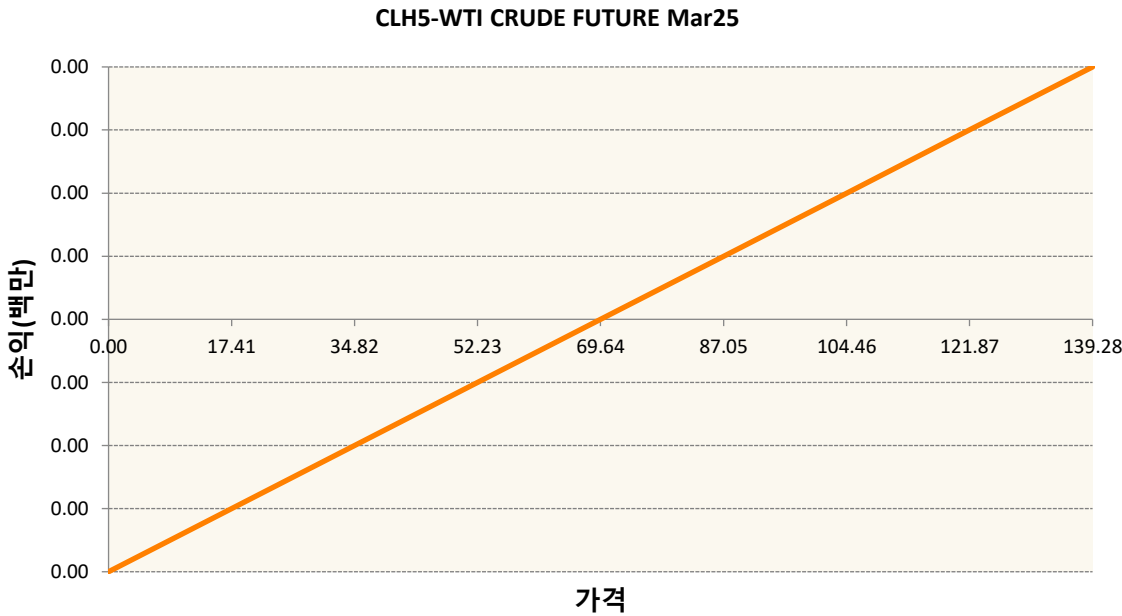
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

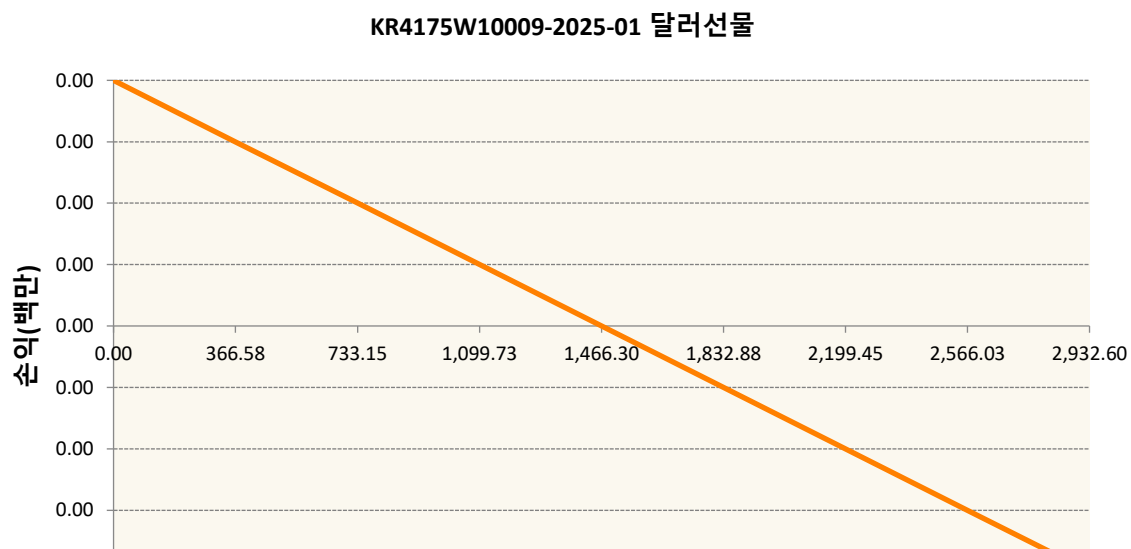
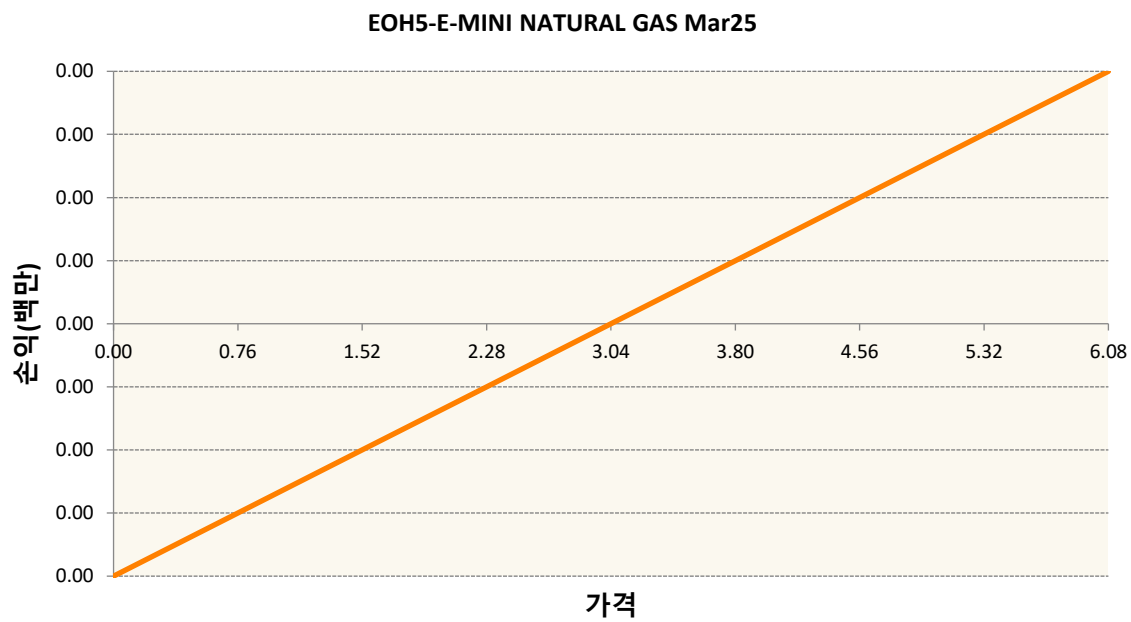
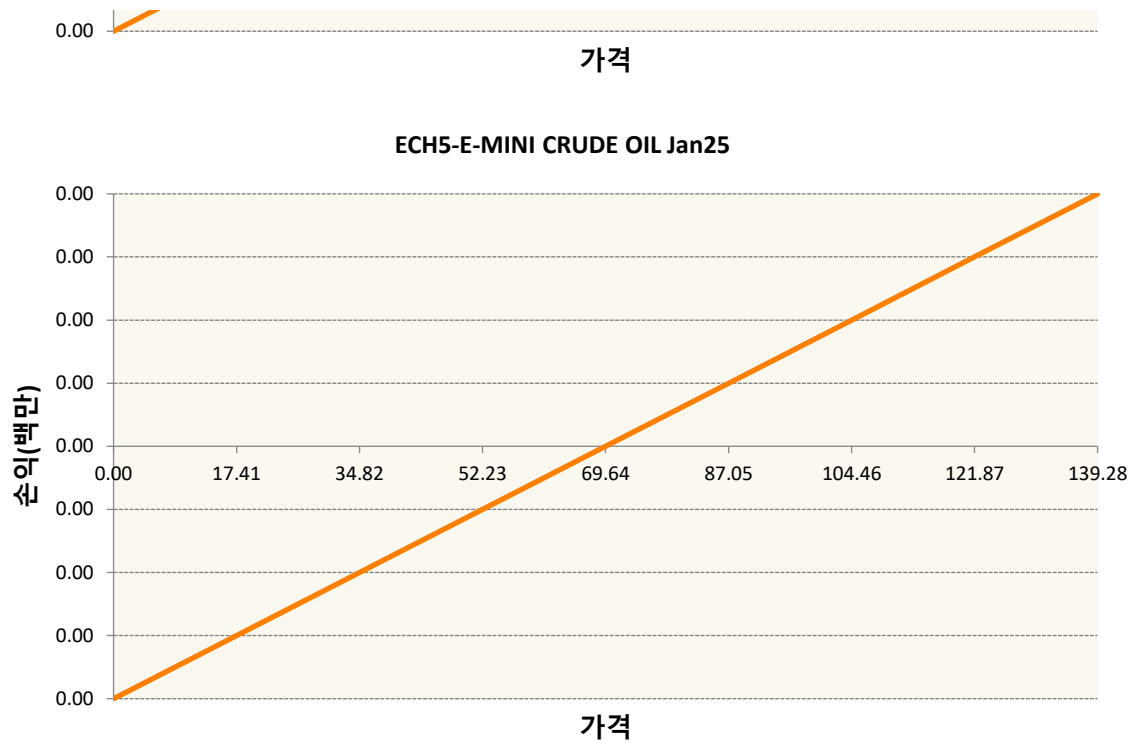
1. 계약금액

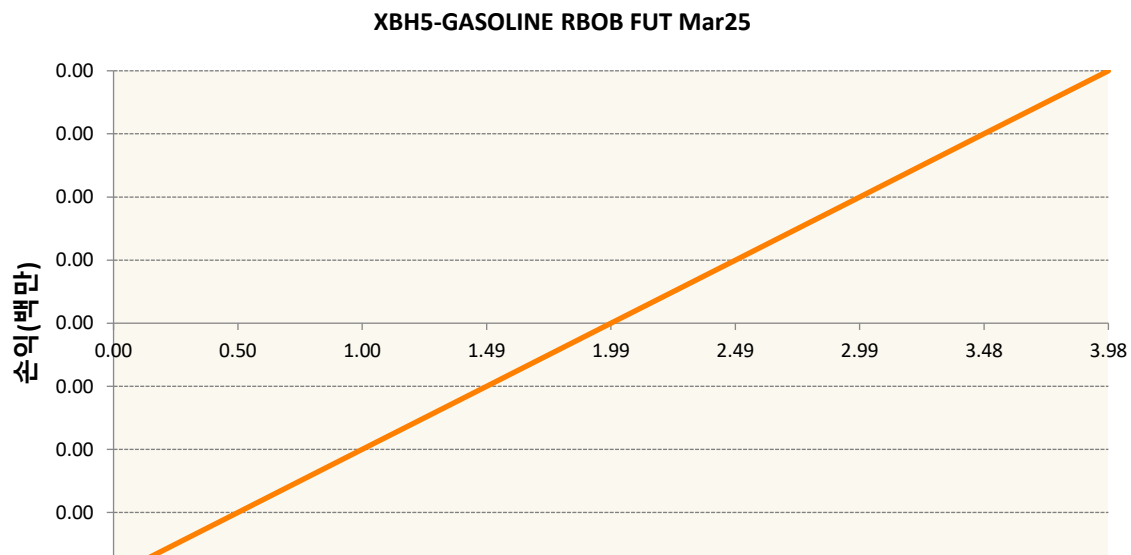
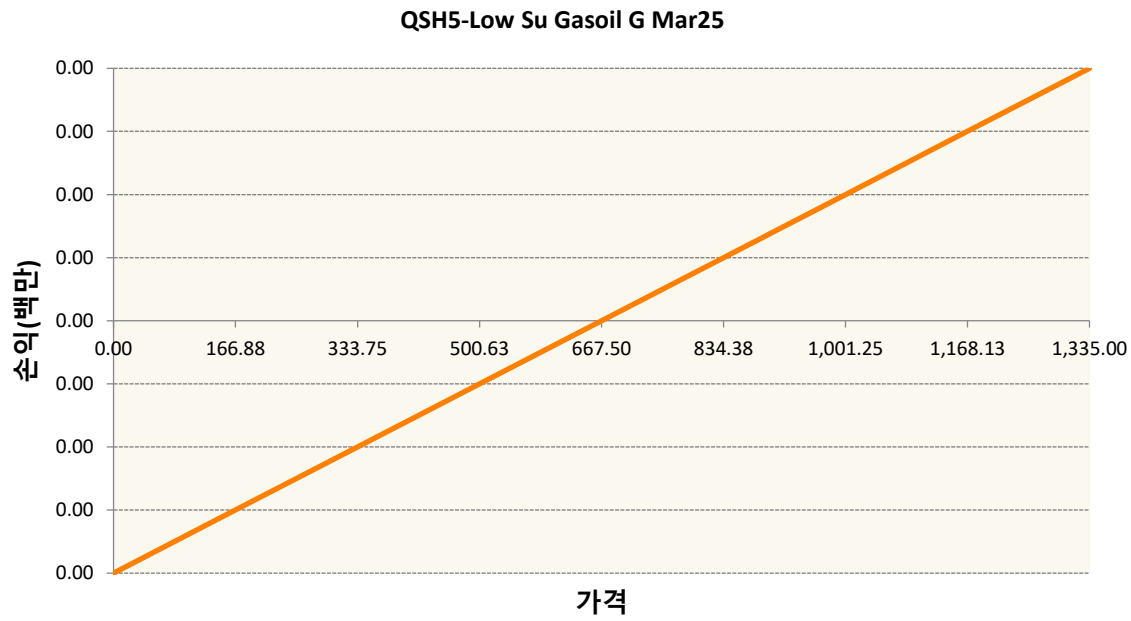
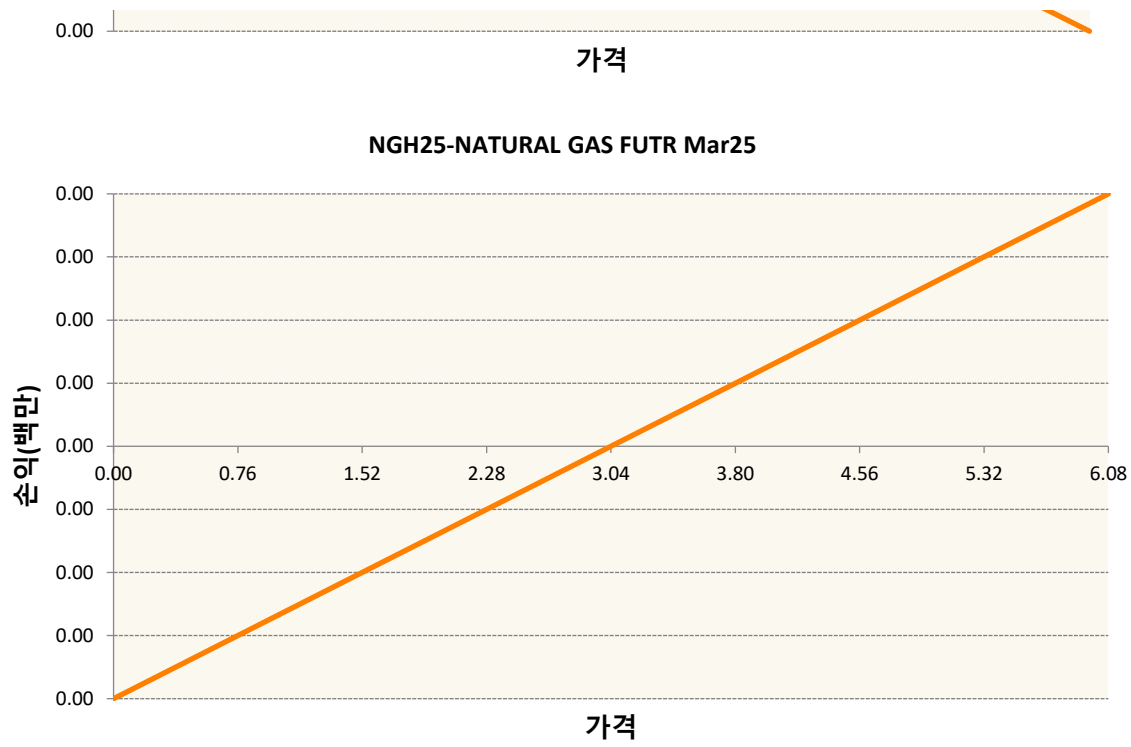
(단위:백만원)

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	700	0	700	
누계	통화	선물	0	132	-132	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	1
KR4175W10(2025-01 달러선물		11
NGH25	NATURAL GAS FUTR Mar25	17
QSH5	Low Su Gasoil G Mar25	8
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar25	10

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

(단위:백만원)

143