

공시일	2025-05-09
기준일	2025-05-08

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	2,055	0	2,055	장외
누계	지수	스왑	252,406	0	252,406	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,991
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,027
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,419
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,620
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	160

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

(단위:백만원)

9,890
