

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

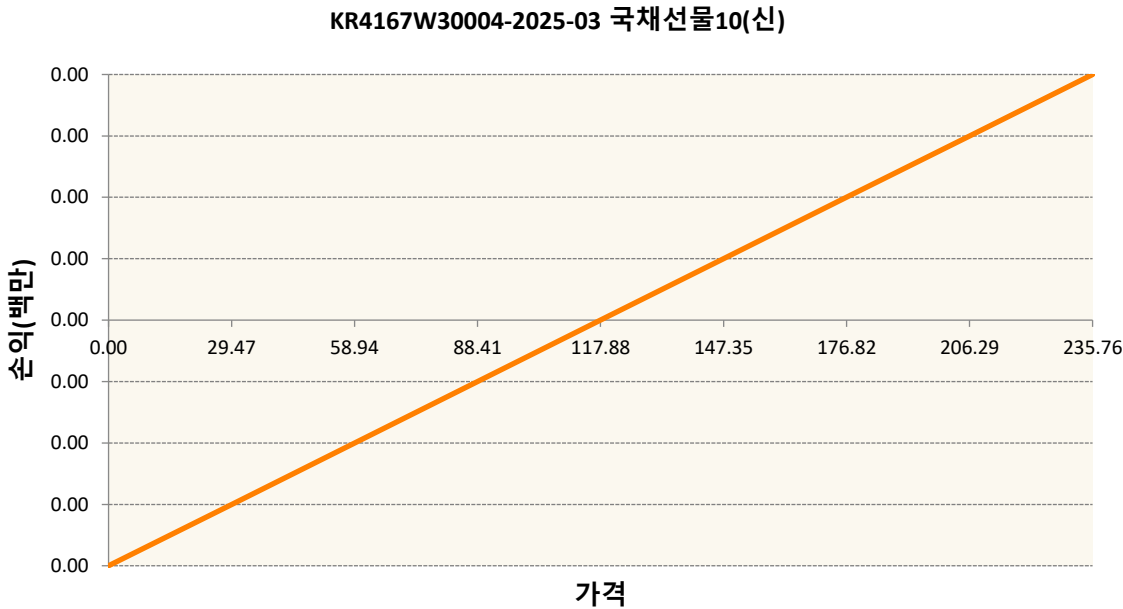
베스트장기채(채권-파생형)

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	116,701	0	116,701	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,023

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

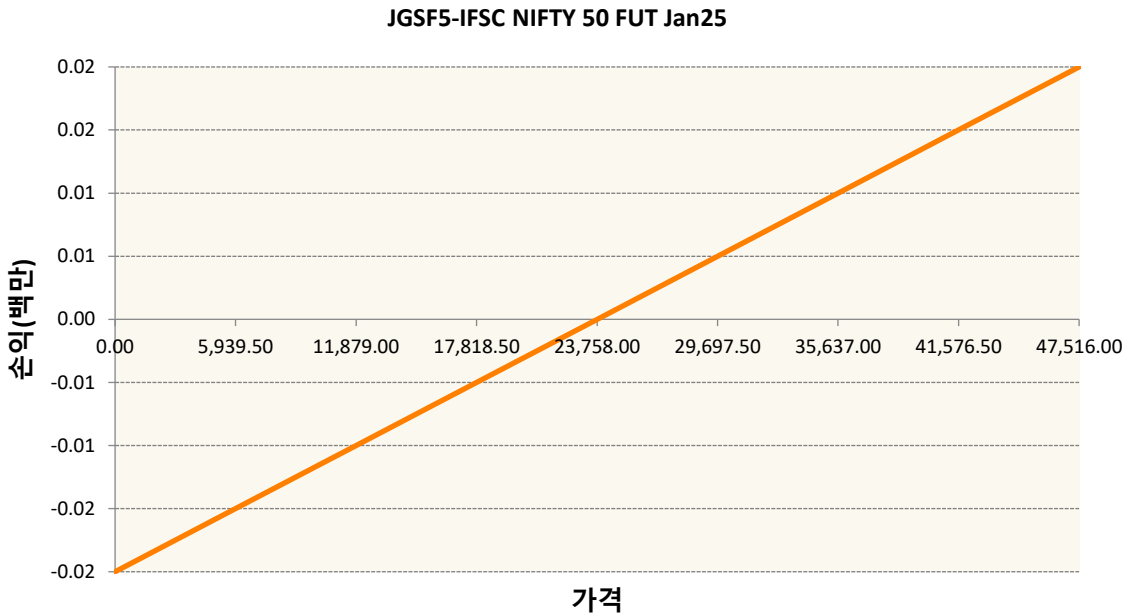
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,481	0	3,481	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSF5	IFSC NIFTY 50 FUT Jan25	278
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

187

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

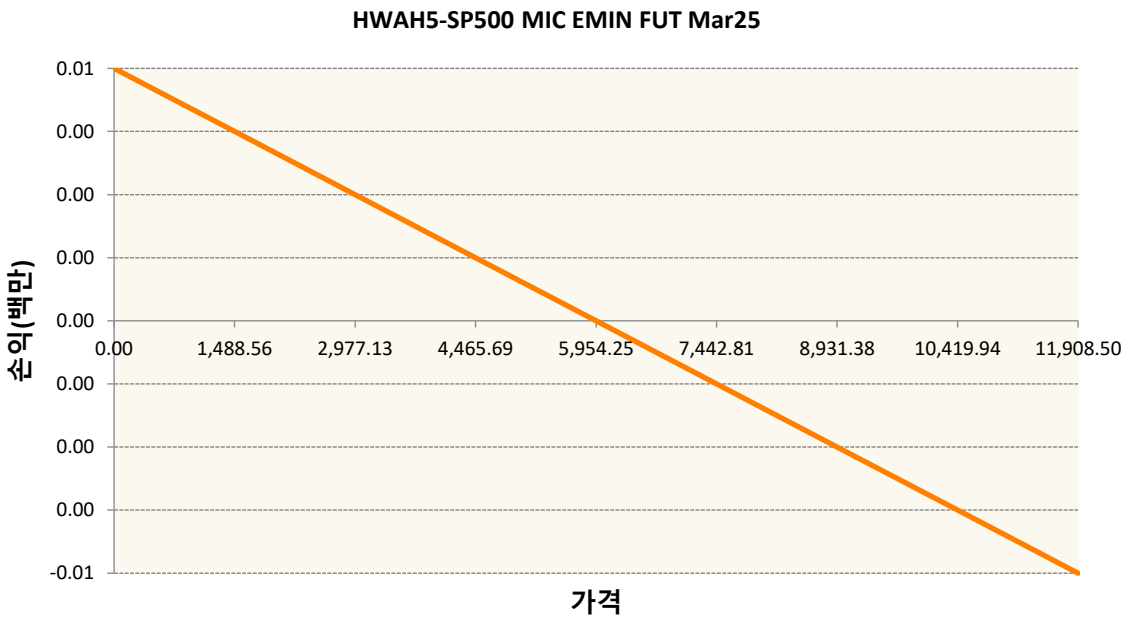
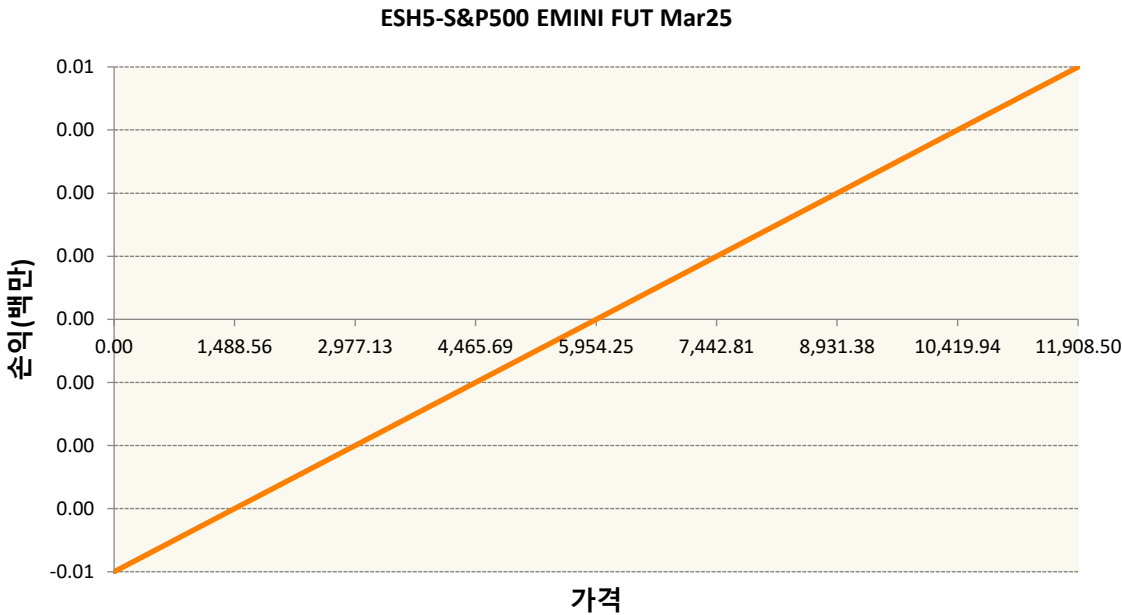
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	865	0	865	
누계	유가증권	선물	0	91	-91	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	69
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	7

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

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

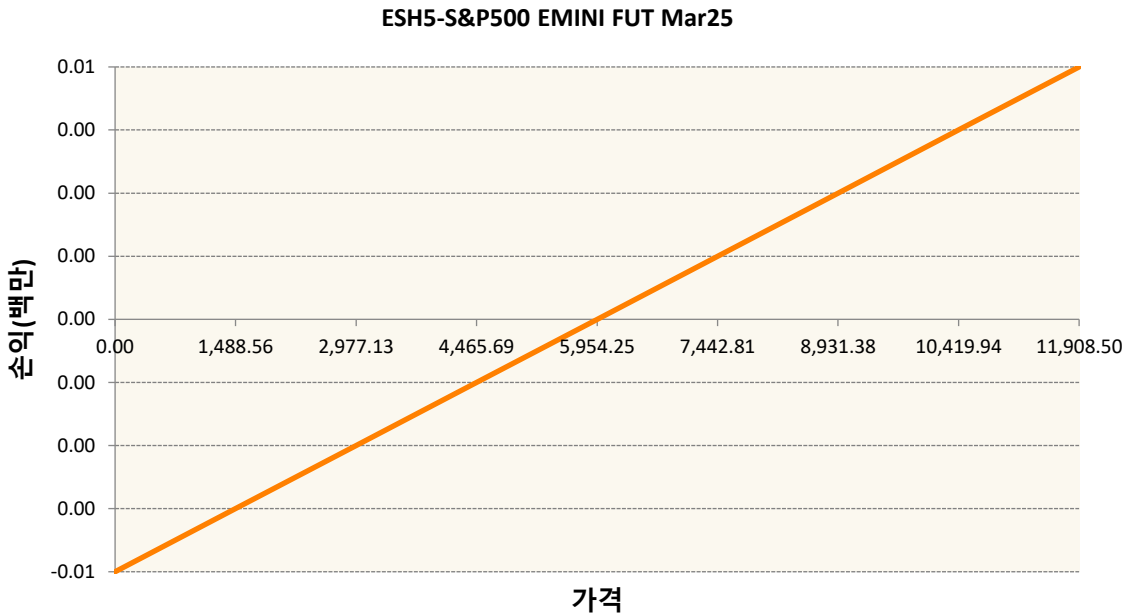
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,593	0	2,593	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	207
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

282

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

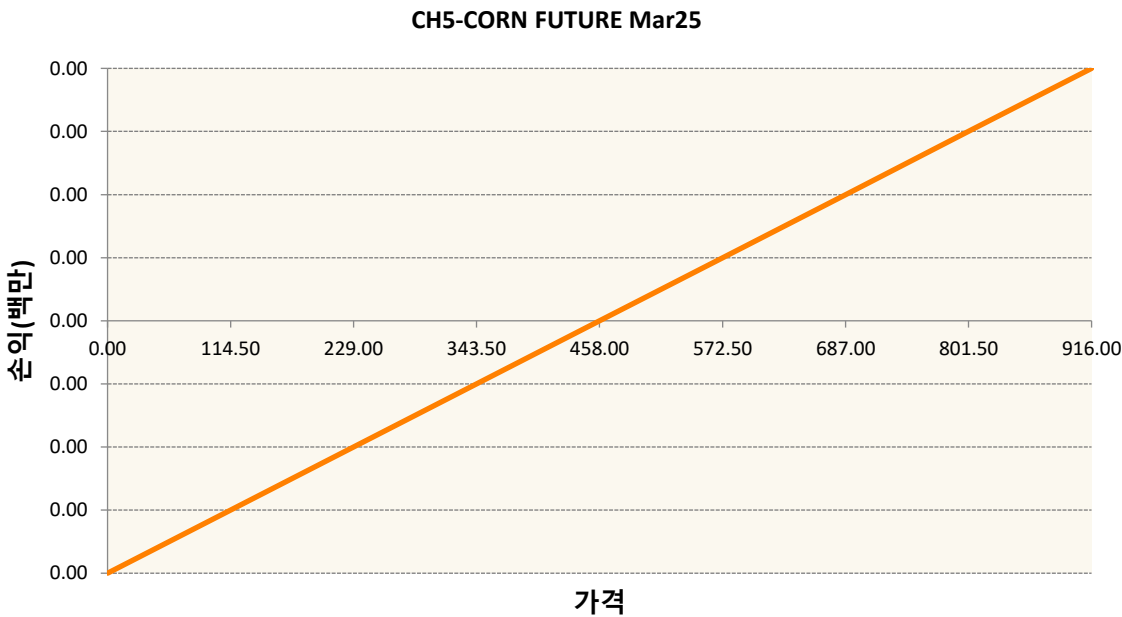
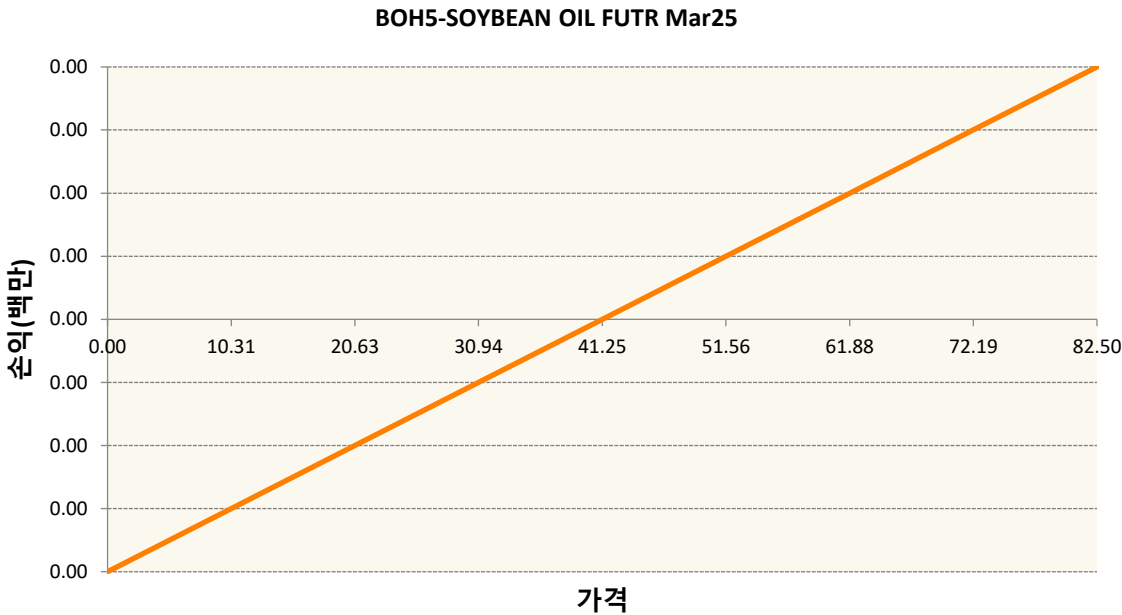
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

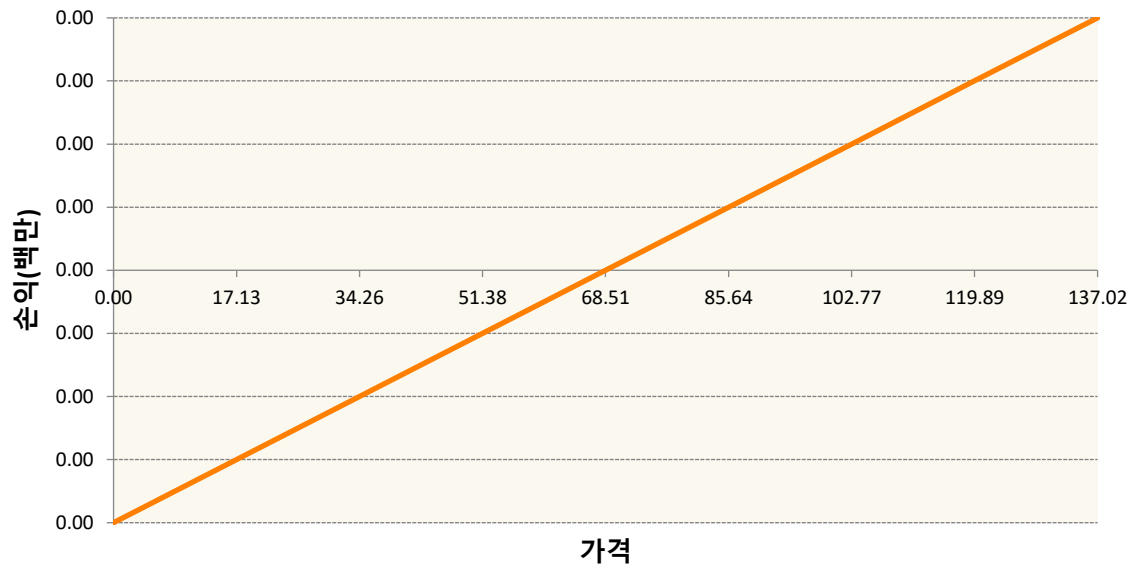
(단위:USD 백만)

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	3,632	0	3,632	
누계	통화	선물	0	422	-422	장내

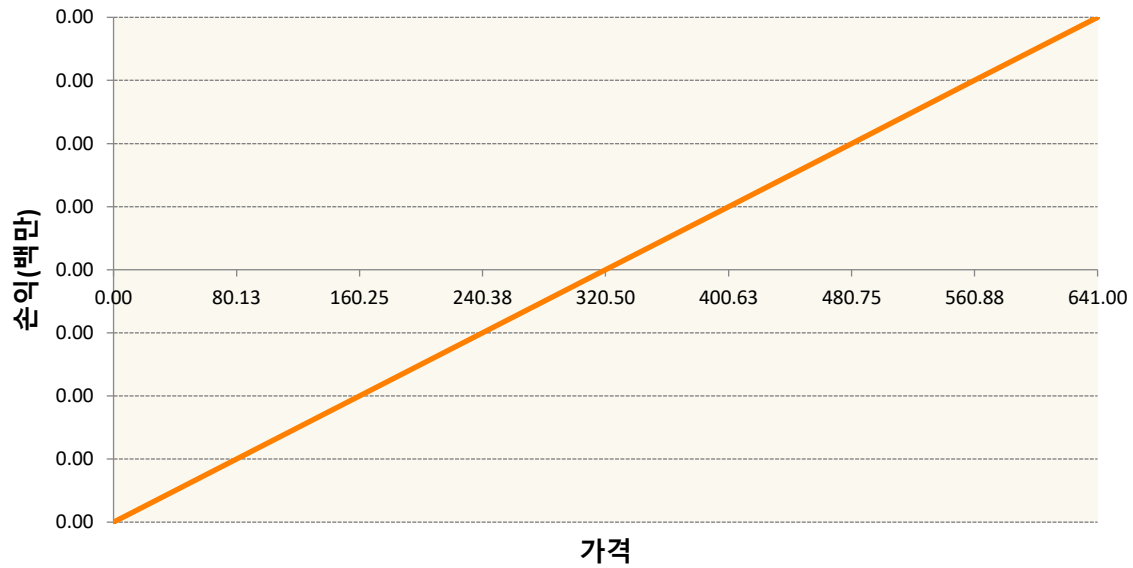
2. 만기시점의 손익구조



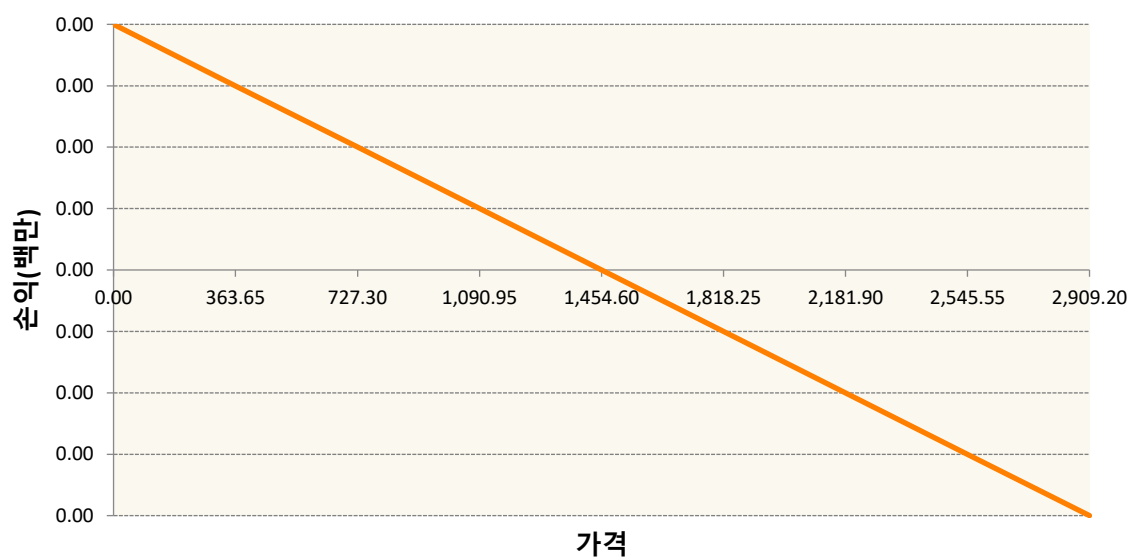
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



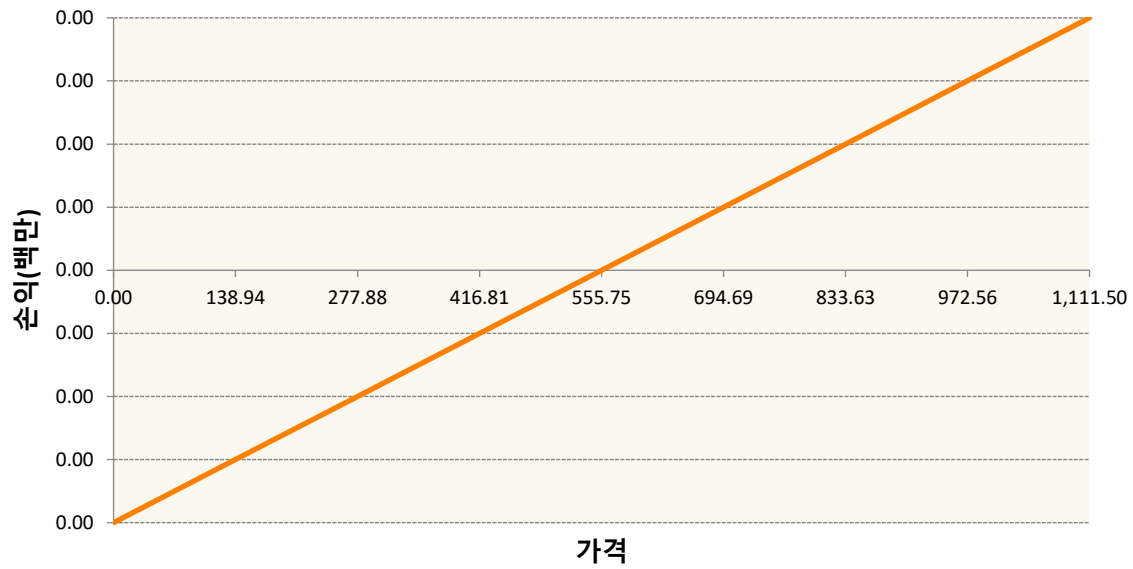
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



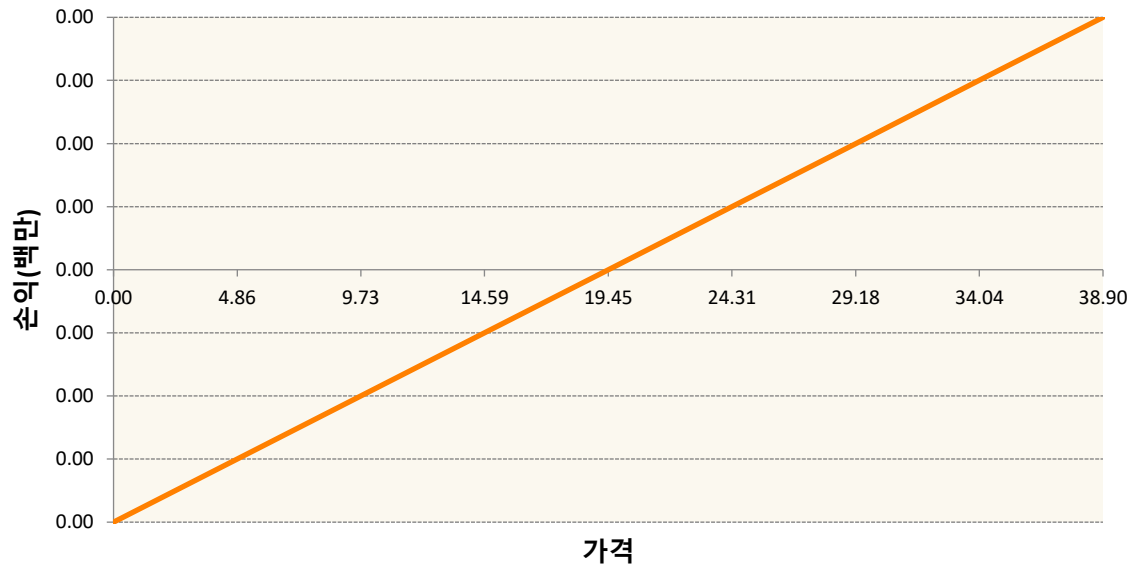
KR4175W10009-2025-01 달러선물



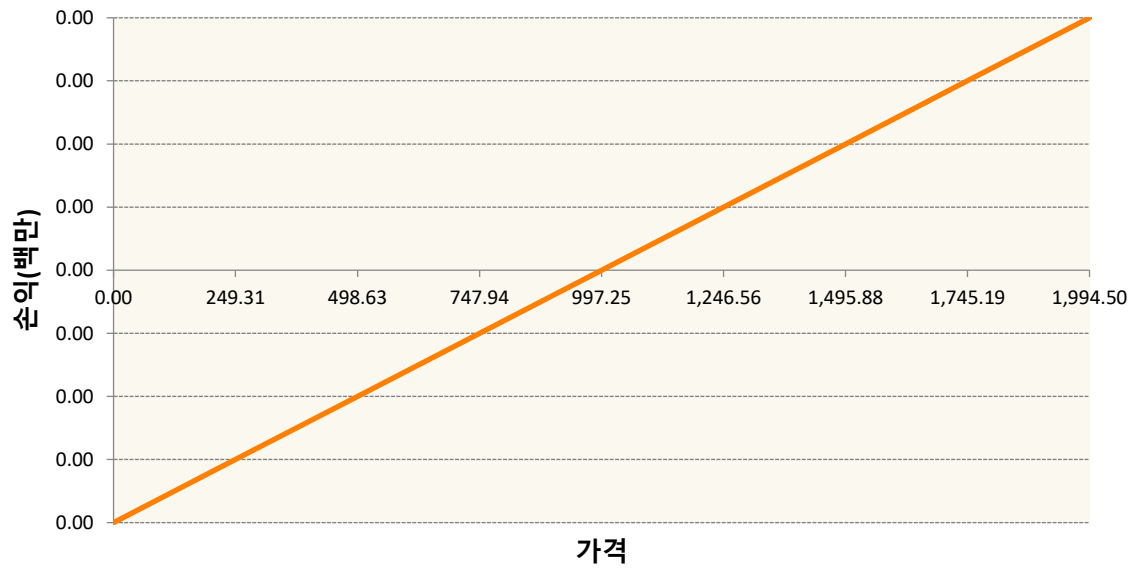
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



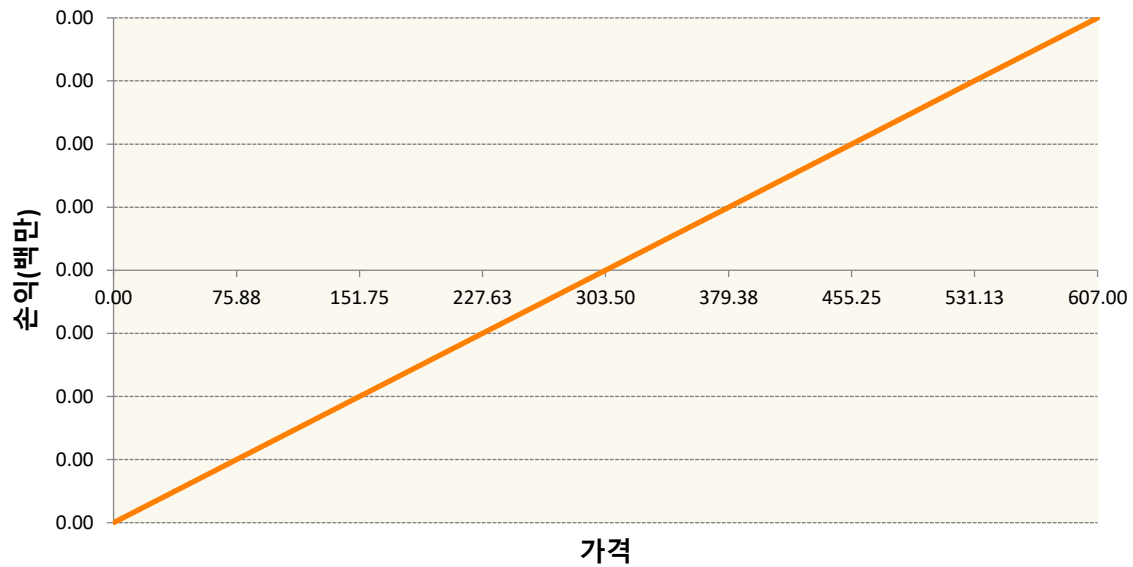
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



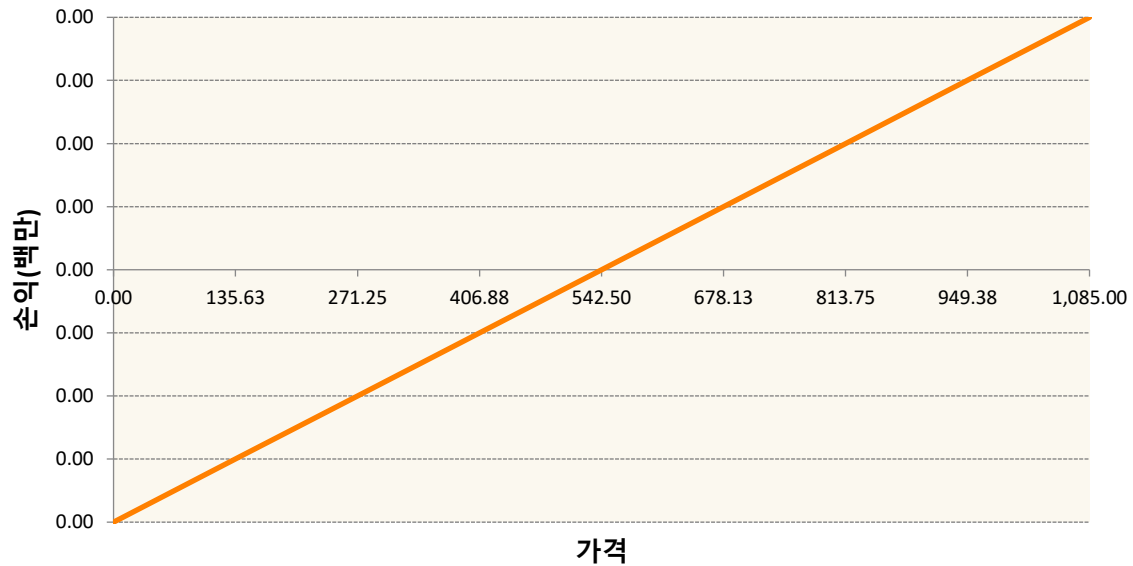
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar25



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	2025-01-09
기준일	2025-01-08

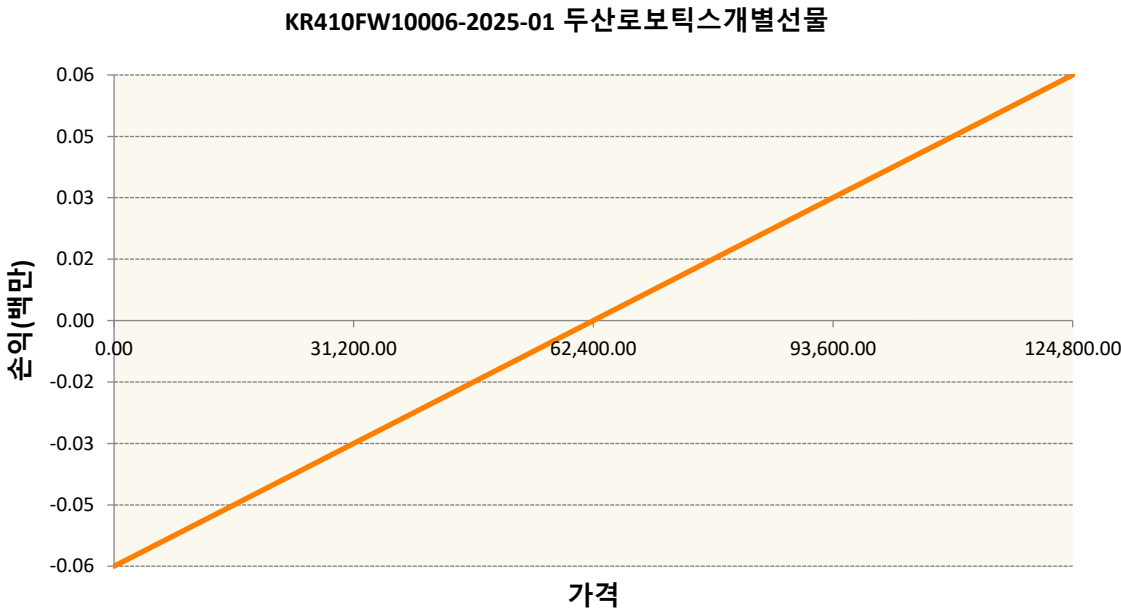
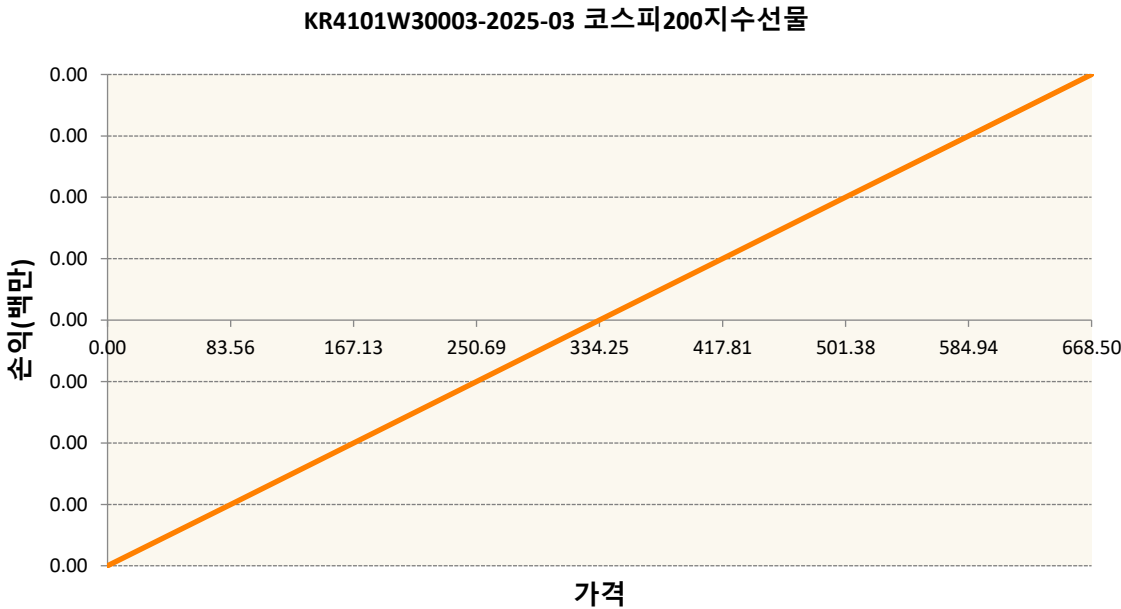
스마트인덱스모

1. 계약금액

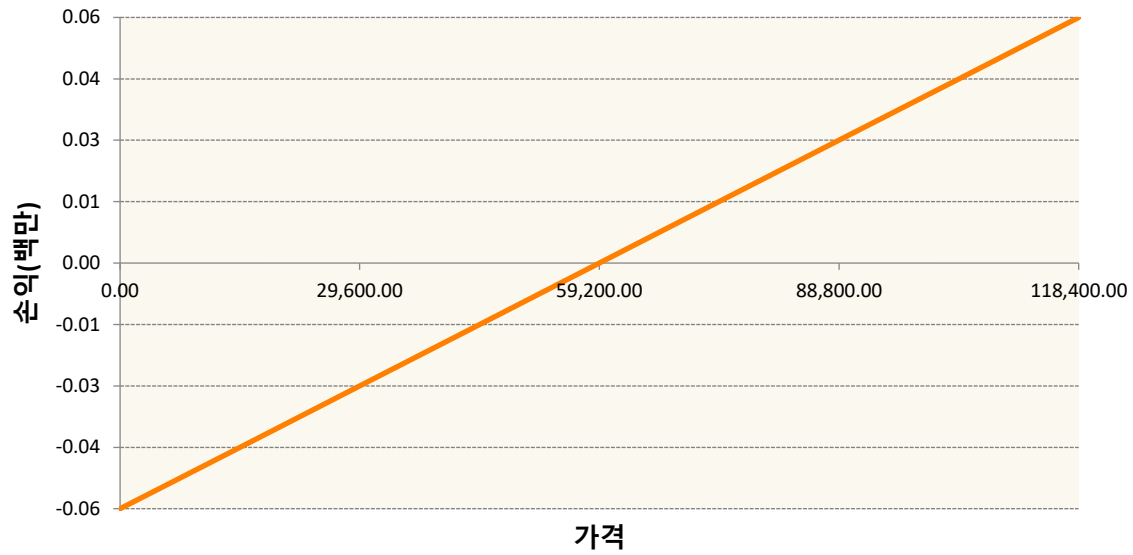
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	82	-82	장내
누계	유가증권	선물	1,178	0	1,178	장내

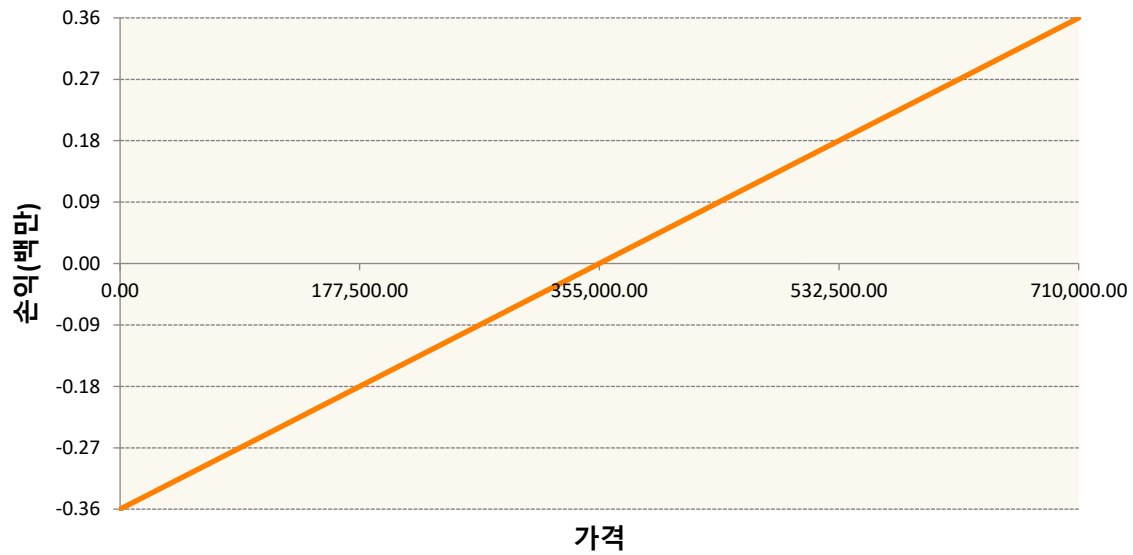
2. 만기시점의 손익구조



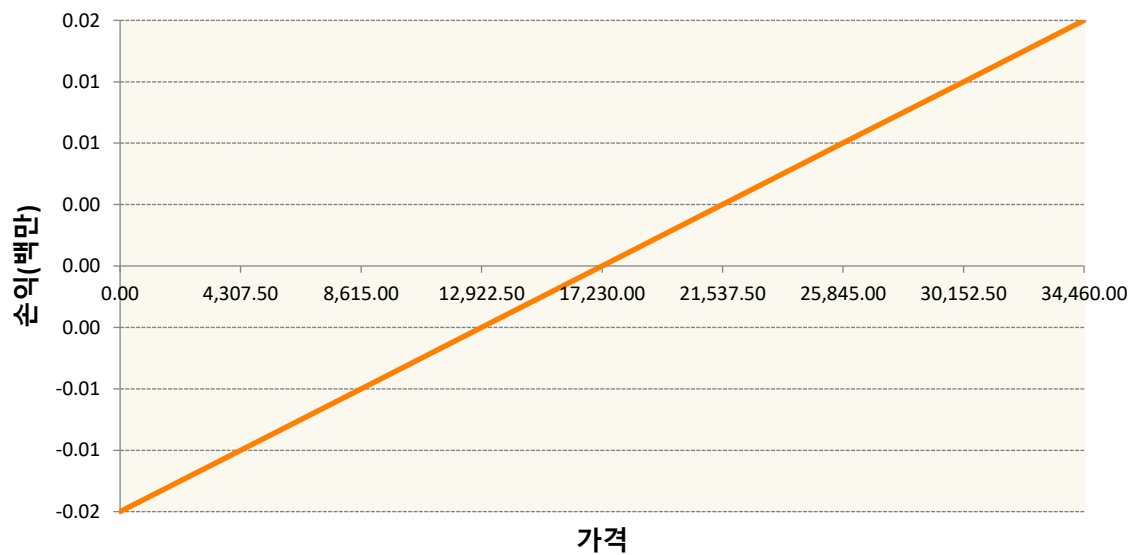
KR41BBW10001-2025-01 롯데케미칼개별선물



KR41DAW10009-2025-01 농심개별선물



KR41ETW10007-2025-01 삼성E&A개별선물



가격	순익(백만)
0.00	-0.05
25,800.00	-0.03
51,600.00	-0.01
77,400.00	0.01
103,200.00	0.05

The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격', represents price in units from 0.00 to 412,000.00. The y-axis, labeled '순익(백만)', represents net income in millions, ranging from -0.21 to 0.21. A solid orange line shows that as the price increases, the net income also increases linearly, crossing the zero net income point at a price of 206,000.00.

가격 (Price)	순익(백만) (Net Income)
0.00	-0.21
103,000.00	-0.10
206,000.00	0.00
309,000.00	0.10
412,000.00	0.21

(단위:백만원)

KR4101W30003		2025-03 코스피200지수선물					80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	80	80	80	80	80	80	80
KR41BBW10001		2025-01 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

KR41DAW10009 2025-01 농심개별선물 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

KR41ETW10007 2025-01 삼성E&A개별선물 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

KR41F9W10002 2025-01 SK바이오사이언스개별선물 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

KR41FCW10000 2025-01 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

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

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

278

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

470

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

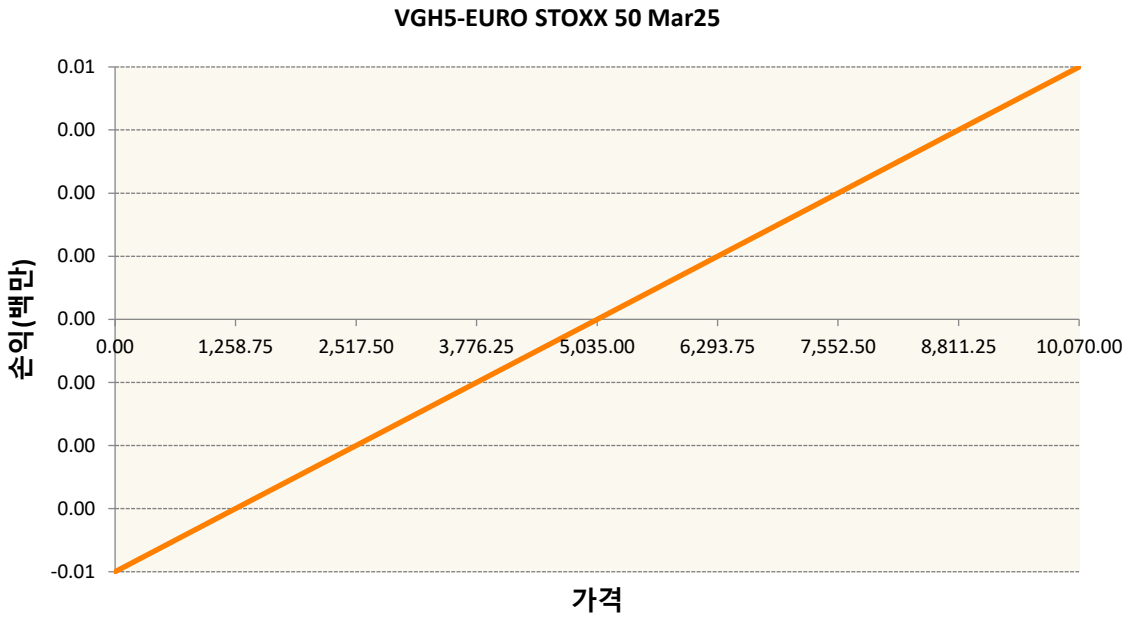
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	911	0	911	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar25	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

48

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

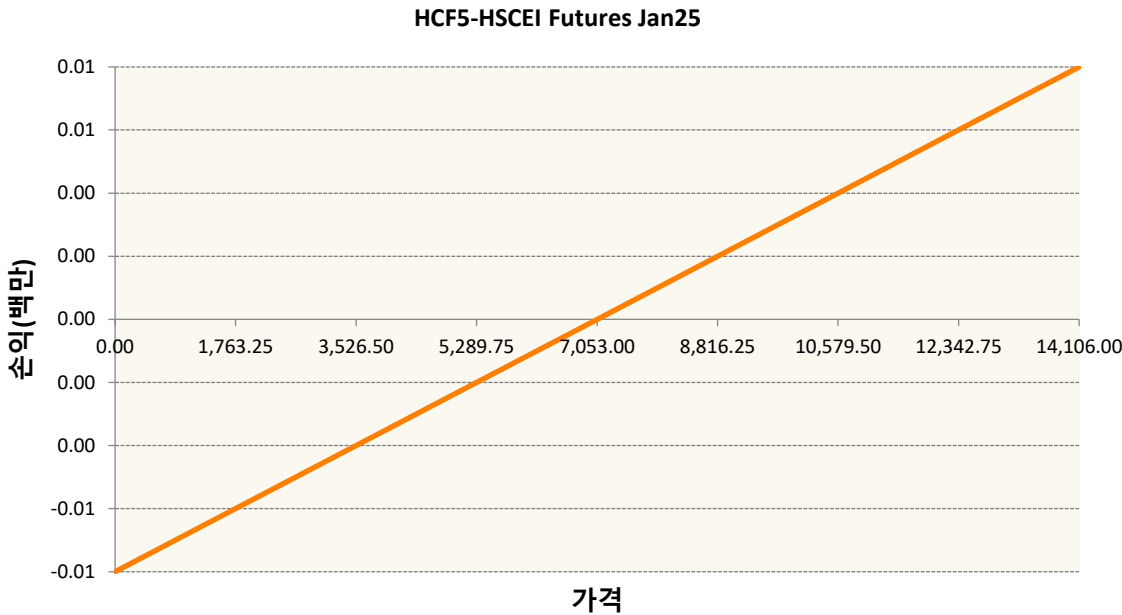
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,455	0	1,455	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	HSCEI Futures Jan25	116
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

156

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

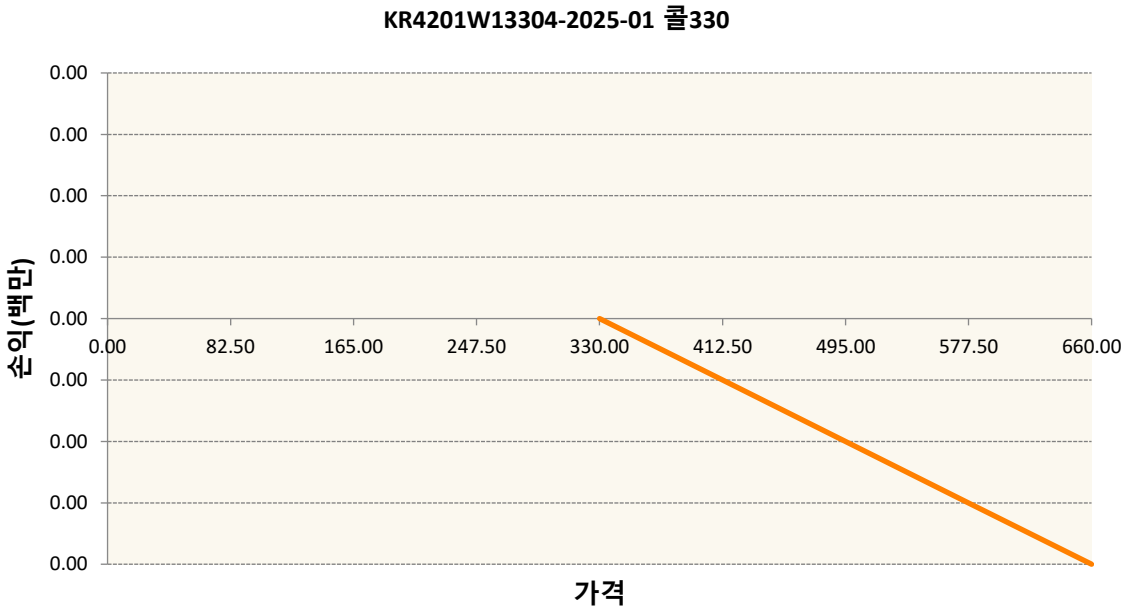
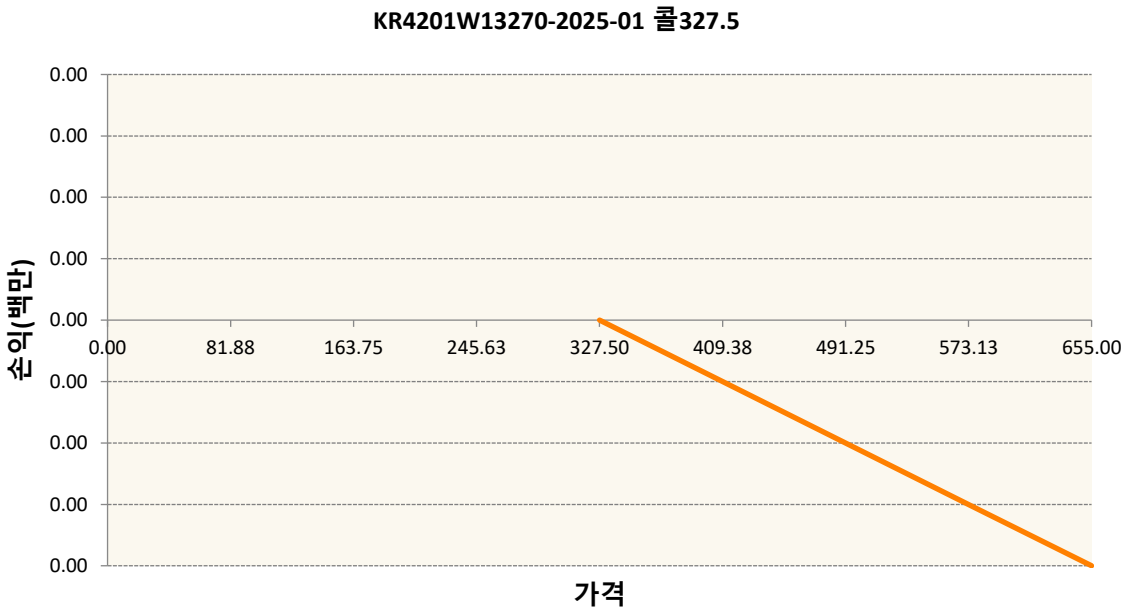
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

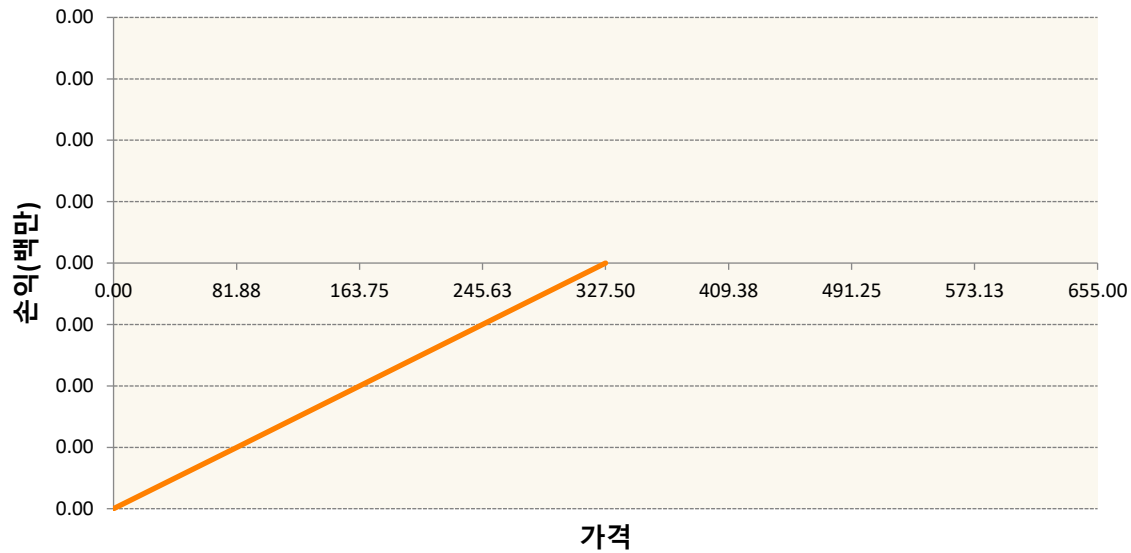
(단위:백만원)

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				608
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	171	171	171	171	171	171	171
-5.33%	171	171	171	171	171	170	170
-2.67%	156	154	151	148	145	142	139
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202
5.33%	-405	-405	-405	-405	-405	-405	-405
8.00%	-608	-608	-608	-608	-608	-608	-608
KR4201W13304			2025-01 콜330				1,891
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	371	371	371	371	371	371	371
-5.33%	371	371	371	371	371	371	370
-2.67%	360	355	350	344	337	331	323
0%	12	9	5	0	-5	-11	-17
2.67%	-619	-619	-619	-619	-619	-619	-619
5.33%	-1,255	-1,255	-1,255	-1,255	-1,255	-1,255	-1,255
8.00%	-1,891	-1,891	-1,891	-1,891	-1,891	-1,891	-1,891
KR4301W13278			2025-01 풋327.5				415
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-415	-415	-415	-415	-415	-415	-415
-5.33%	-223	-223	-223	-223	-223	-223	-224
-2.67%	-41	-43	-45	-48	-50	-52	-54
0%	0	0	0	0	0	-1	-1

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)

3,704

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

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	658	0	658	

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	2025-01-09
기준일	2025-01-08

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	4,349	0	4,349	

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	2025-01-09
기준일	2025-01-08

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	12,851	0	12,851	
누계	통화	선도	0	13,241	-13,241	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E	215
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E	565
FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E	260
FXW213F17C KRW/USD 31-01-25E	20
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

439

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

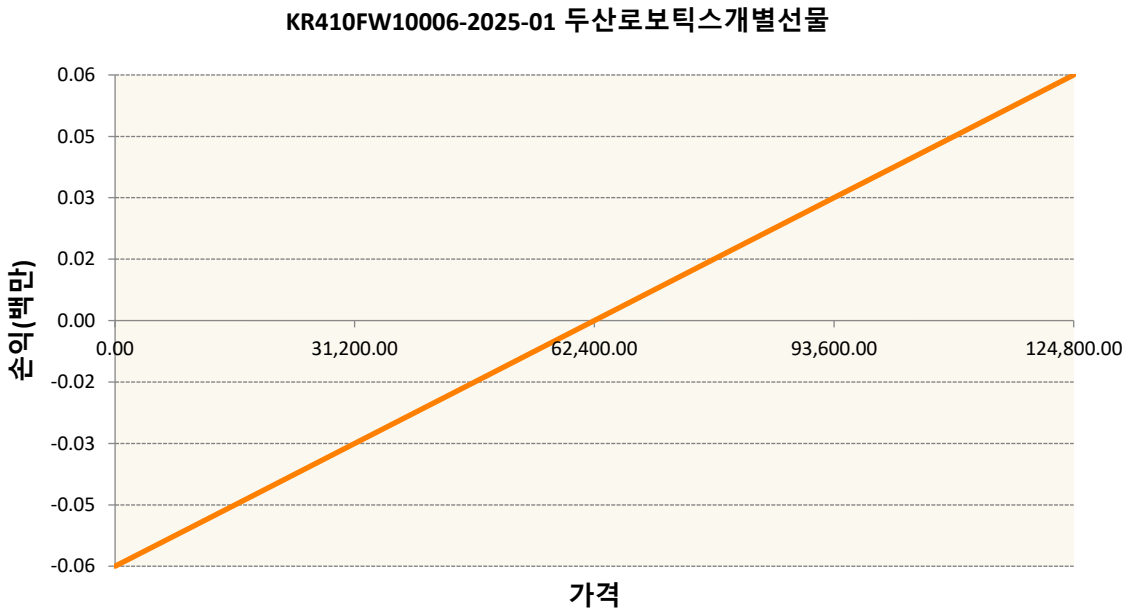
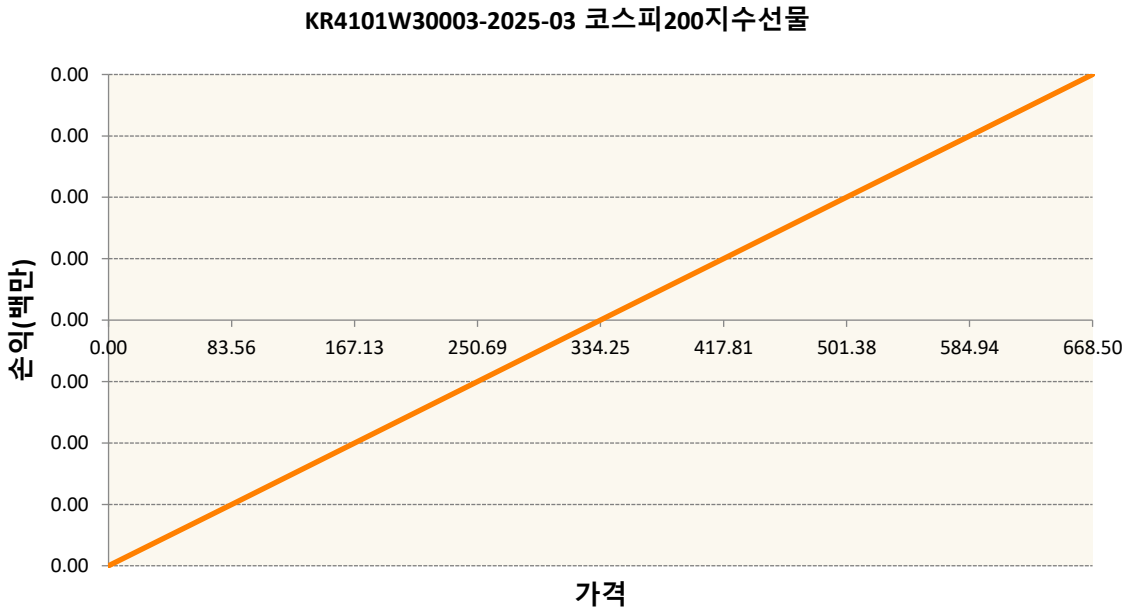
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

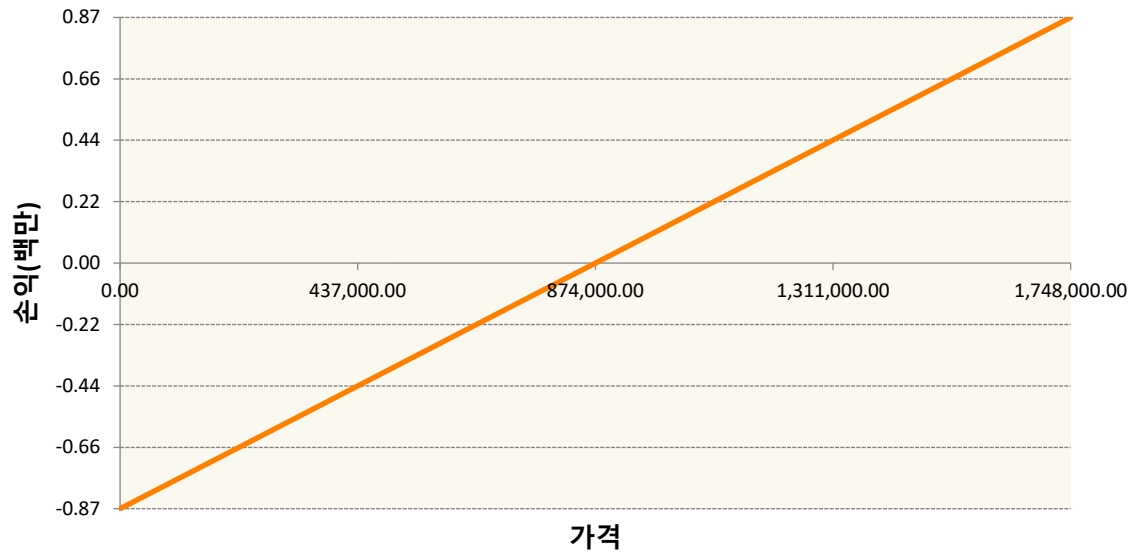
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	907	0	907	장내

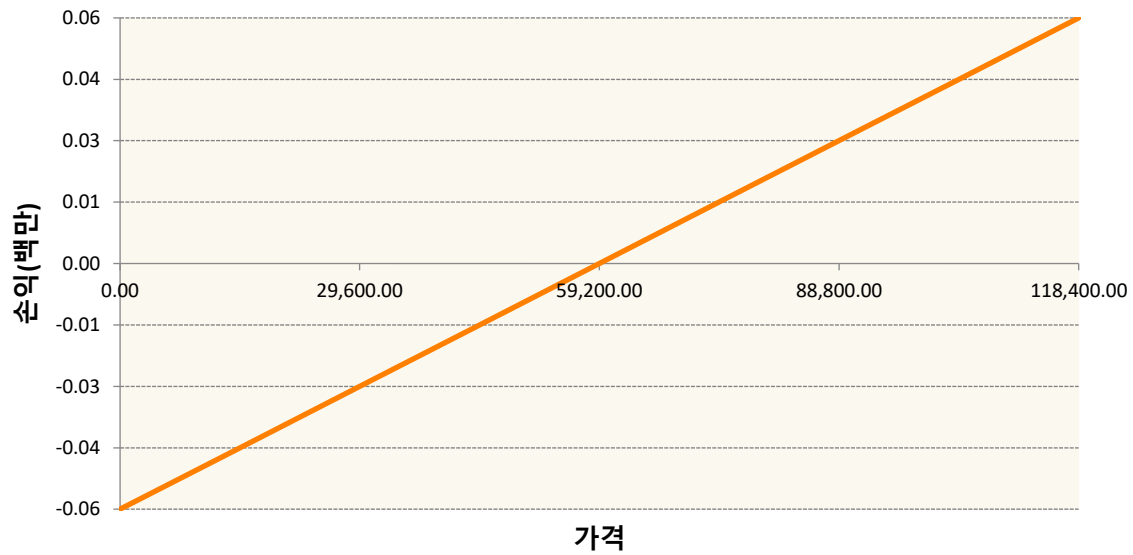
2. 만기시점의 손익구조



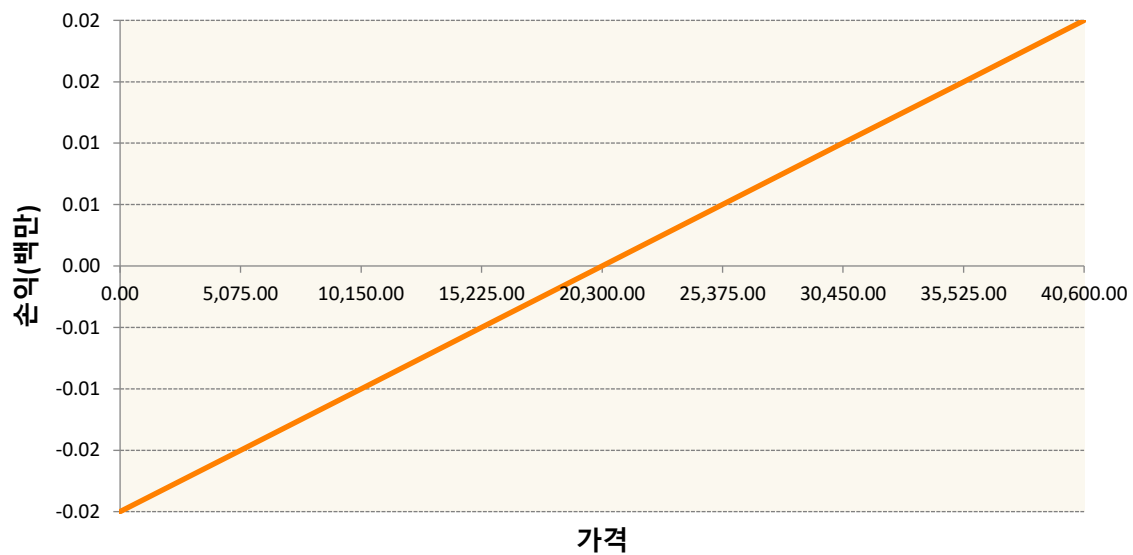
KR41B3W20008-2025-02 고려아연개별선물



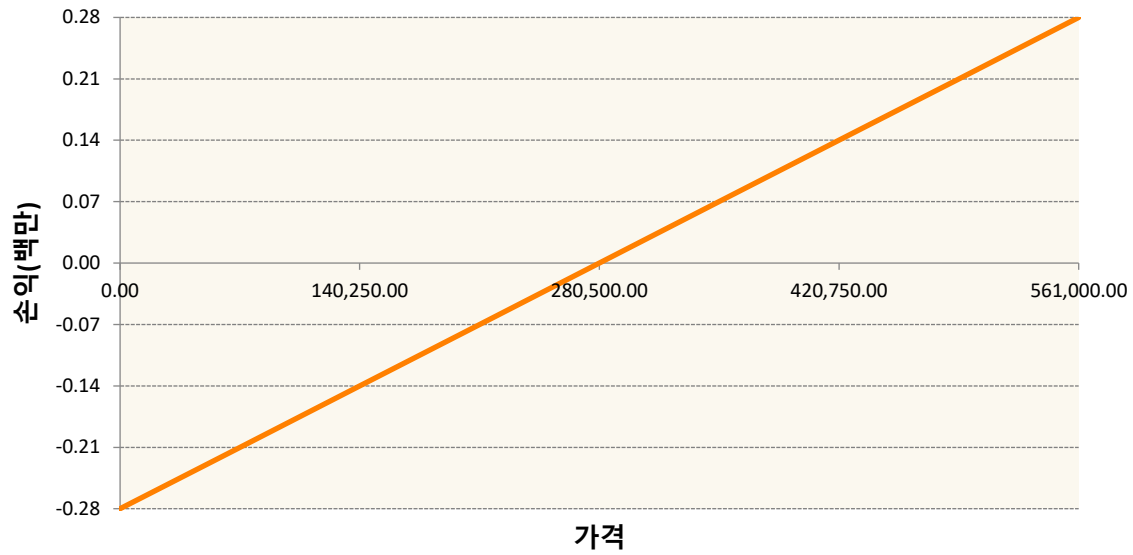
KR41BBW10001-2025-01 롯데케미칼개별선물



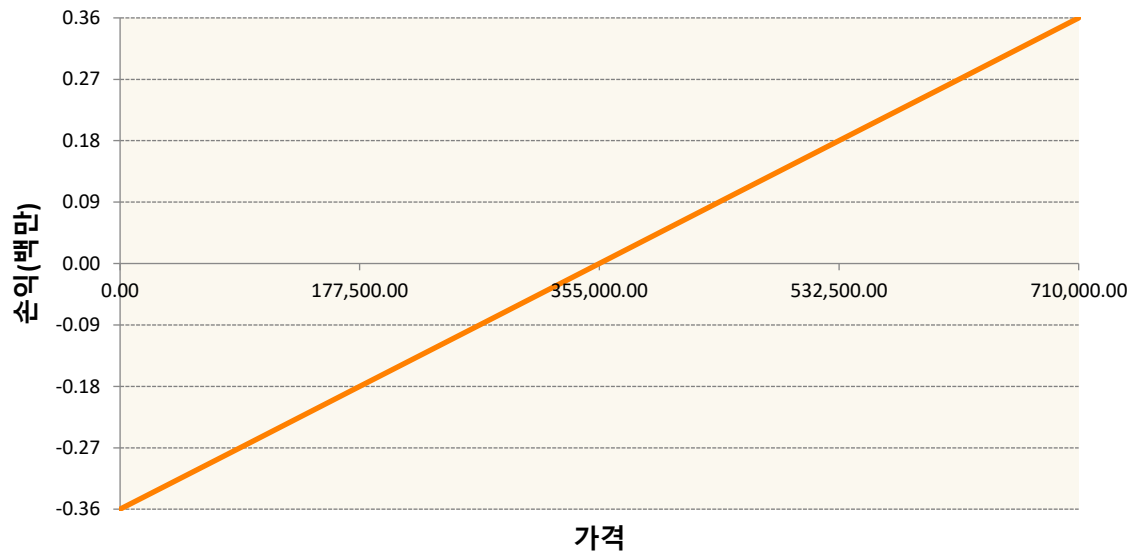
KR41CNW10004-2025-01 포스코DX개별선물



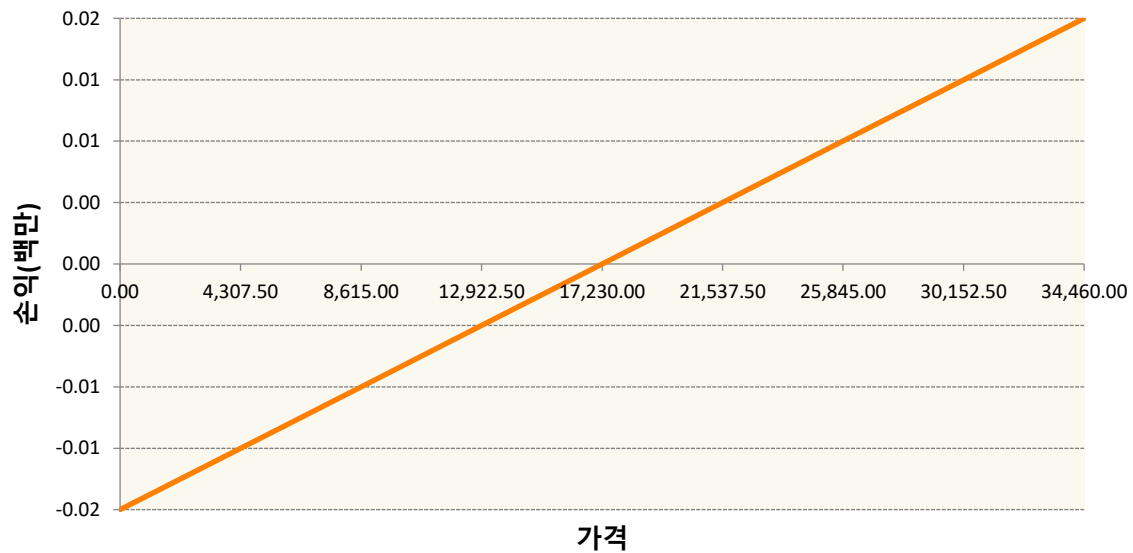
KR41CXW10003-2025-01 한미약품개별선물



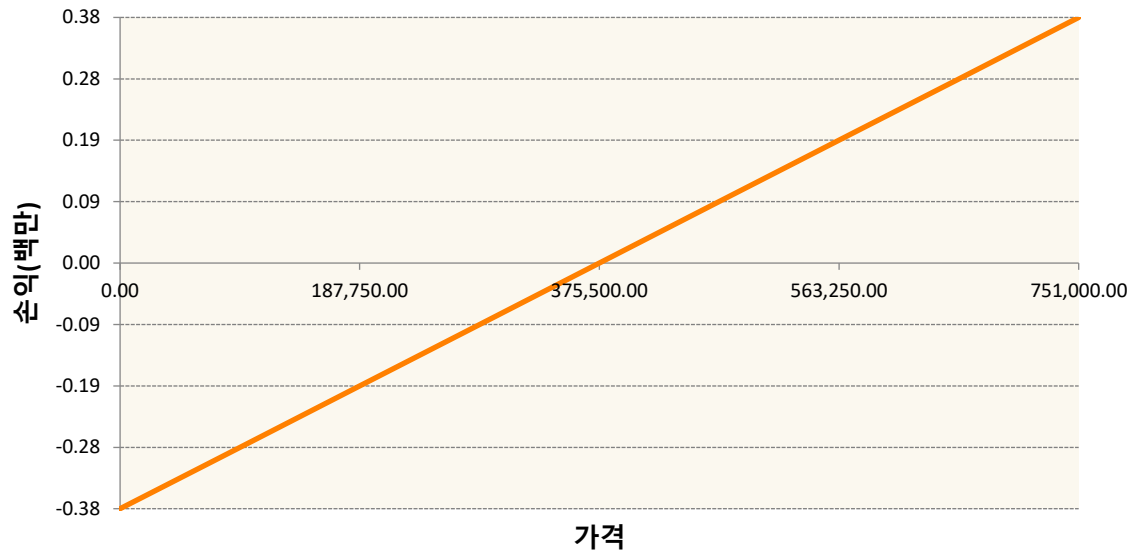
KR41DAW10009-2025-01 농심개별선물



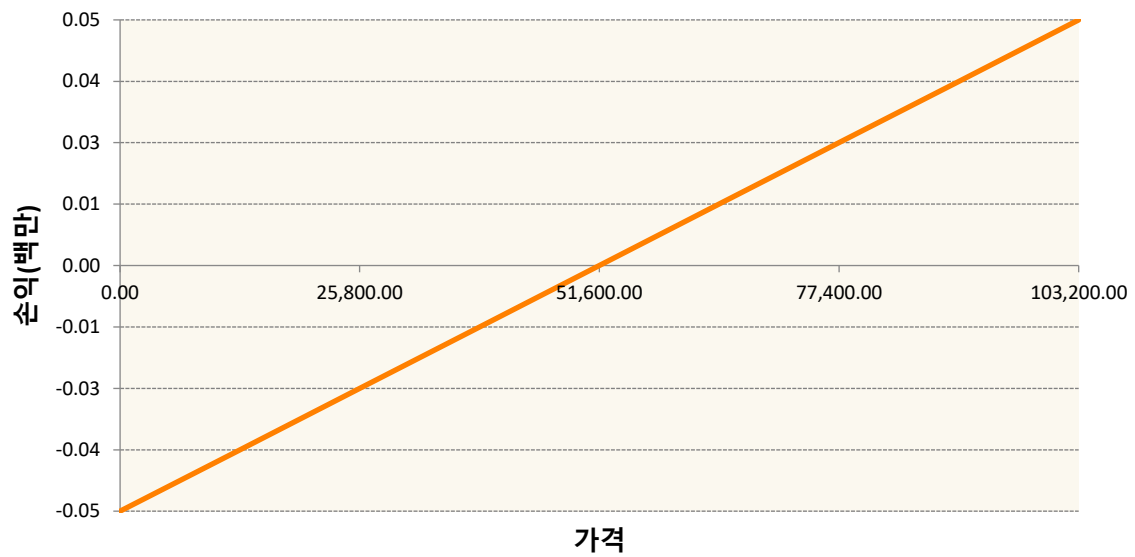
KR41ETW10007-2025-01 삼성E&A개별선물



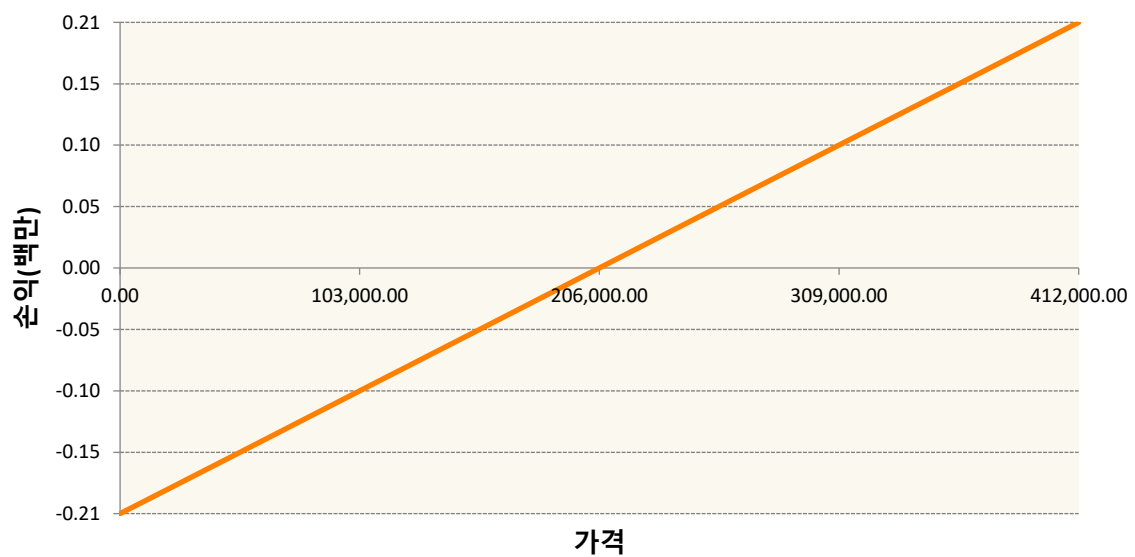
KR41F5W10000-2025-01 LG에너지솔루션개별선물



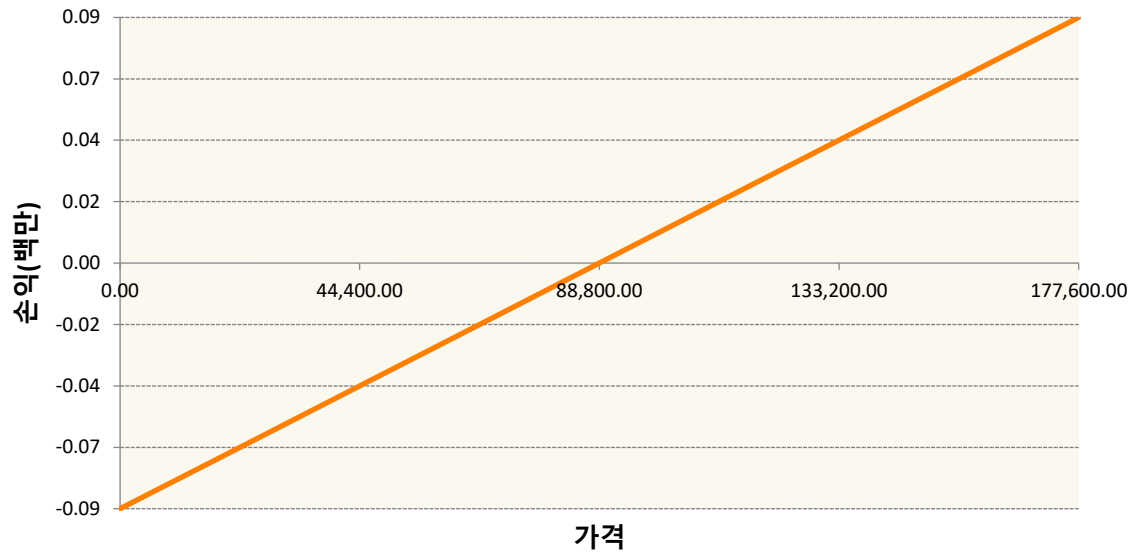
KR41F9W10002-2025-01 SK바이오사이언스개별선물



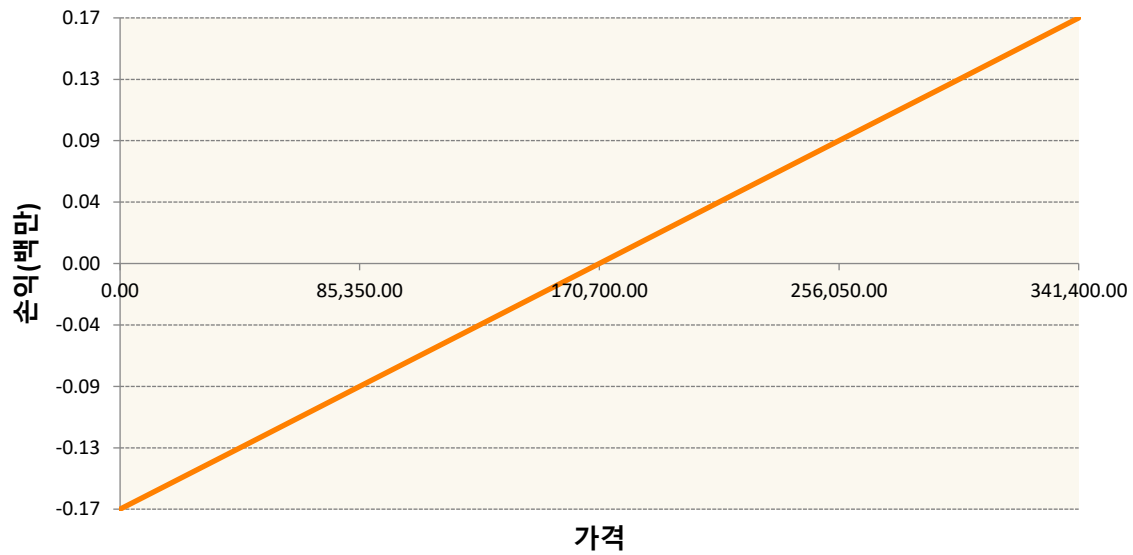
KR41FCW10000-2025-01 하이브개별선물



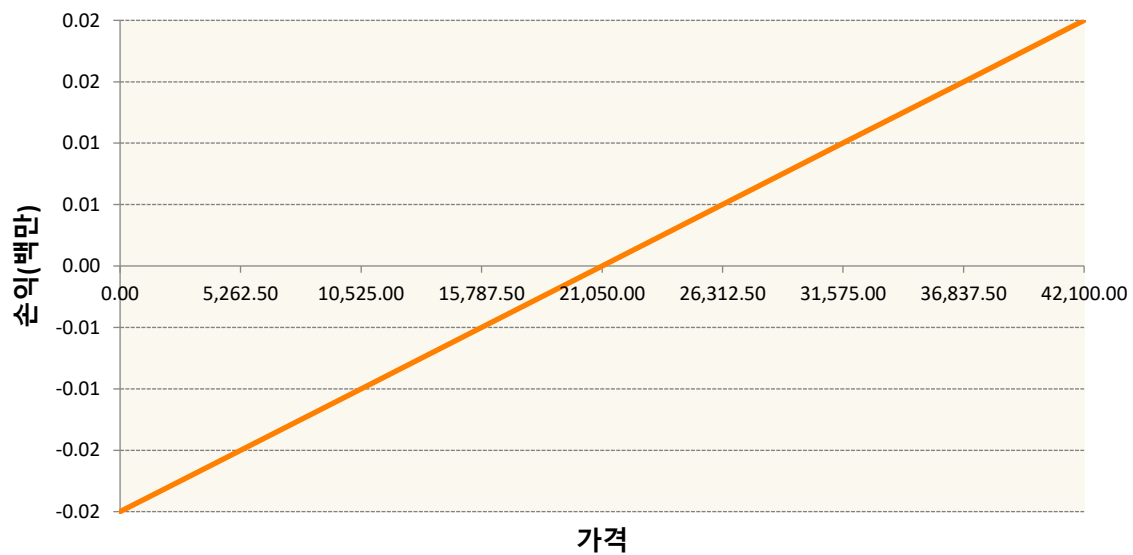
KR41FMW10009-2025-01 엘애프개별선물



KR41GLW10009-2025-01 LS ELECTRIC개별선물



KR41GNW10005-2025-01 금양개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W30003							2025-03 코스피200지수선물		54	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54		
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36		
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	18	18	18	18	18	18	18	18		
5.33%	36	36	36	36	36	36	36	36		
8.00%	54	54	54	54	54	54	54	54		
KR41B3W20008								2025-02 고려아연개별선물		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	-3		
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2		
-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%	2	2	2	2	2	2	2	2		
8.00%	3	3	3	3	3	3	3	3		
KR41BBW10001								2025-01 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	-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		
KR41CNW10004								2025-01 포스코DX개별선물		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		
KR41CXW10003								2025-01 한미약품개별선물		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

KR41DAW10009

2025-01 농심개별선물

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

KR41ETW10007

2025-01 삼성E&A개별선물

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

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

KR41F9W10002

2025-01 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

KR41FCW10000 2025-01 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

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

KR41GLW10009 2025-01 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

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

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

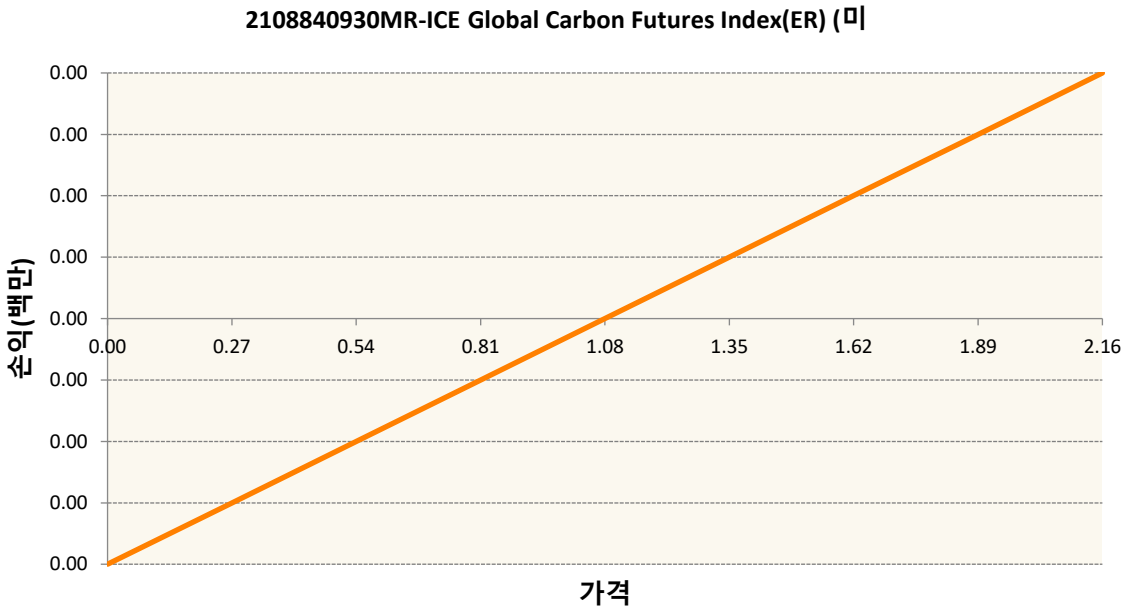
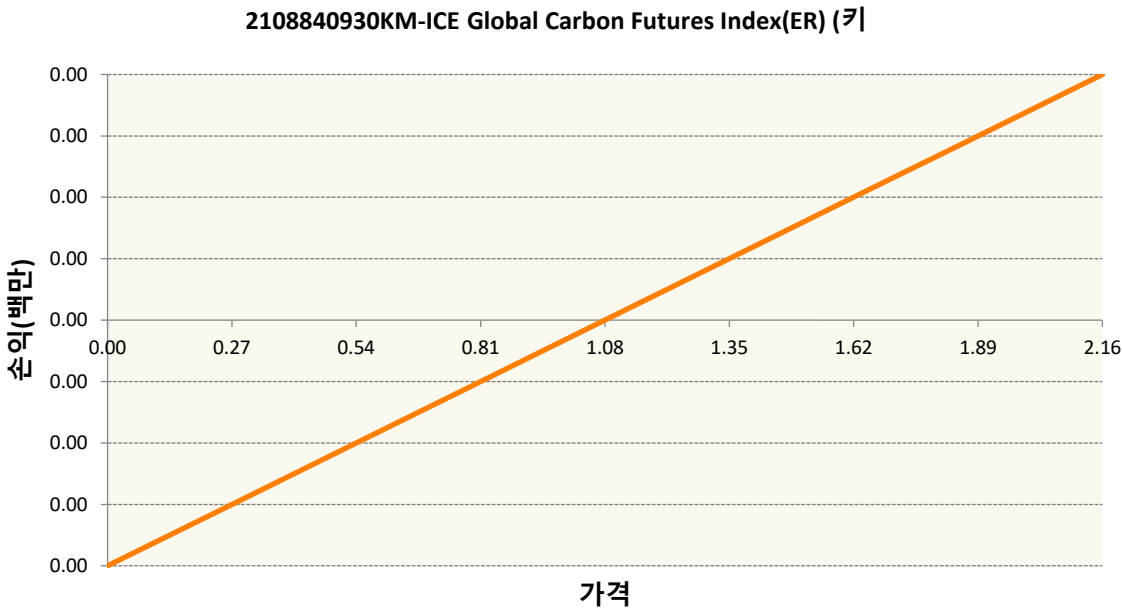
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

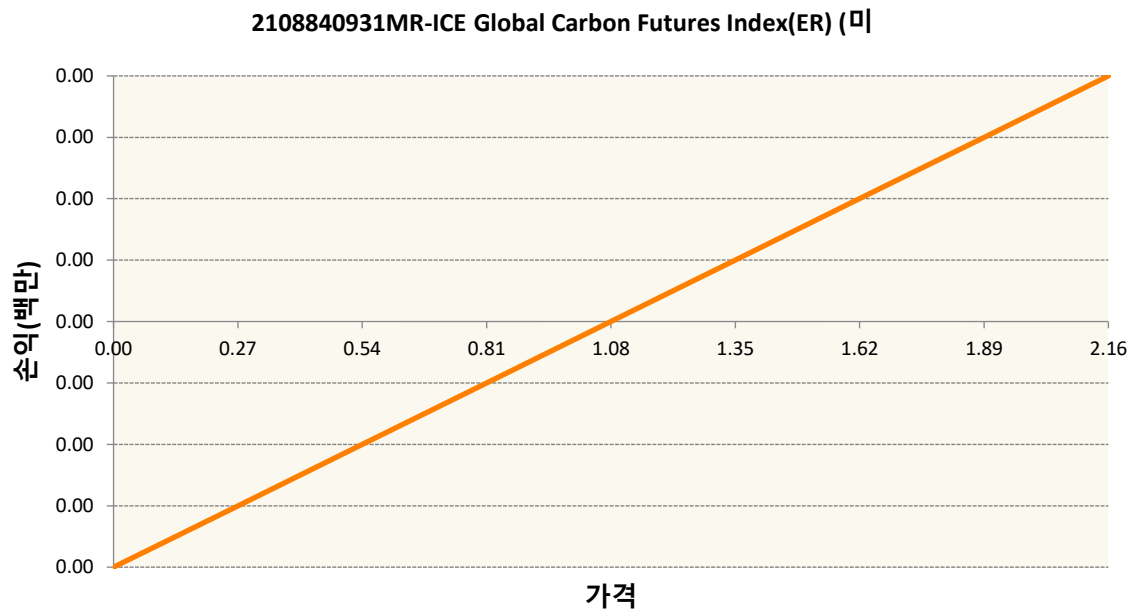
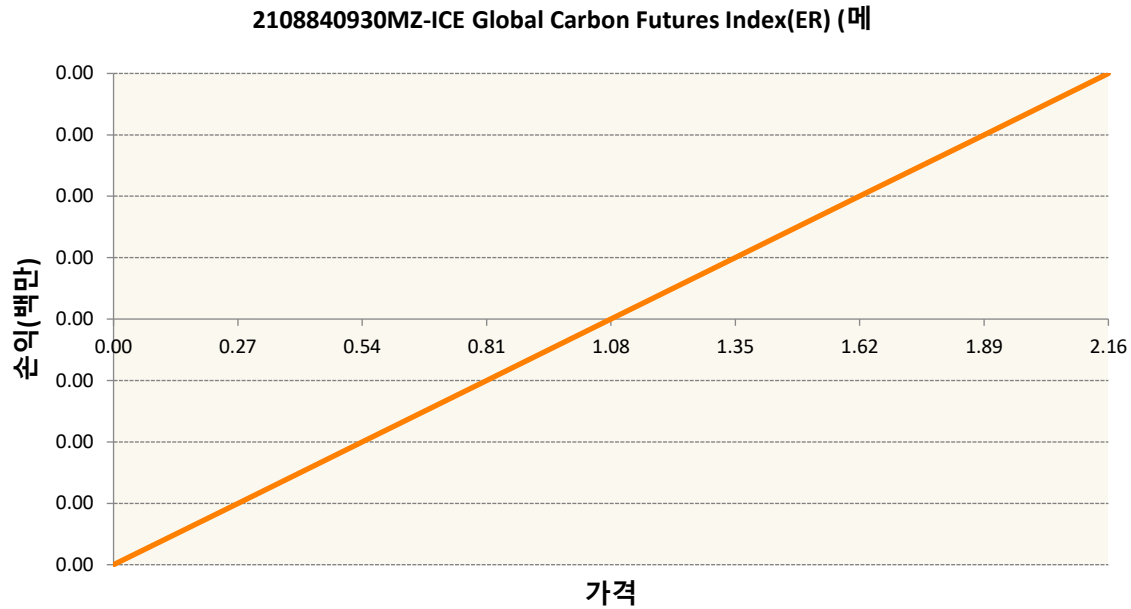
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	12,072	0	12,072	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		96
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		483
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		193
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		193

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,026

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

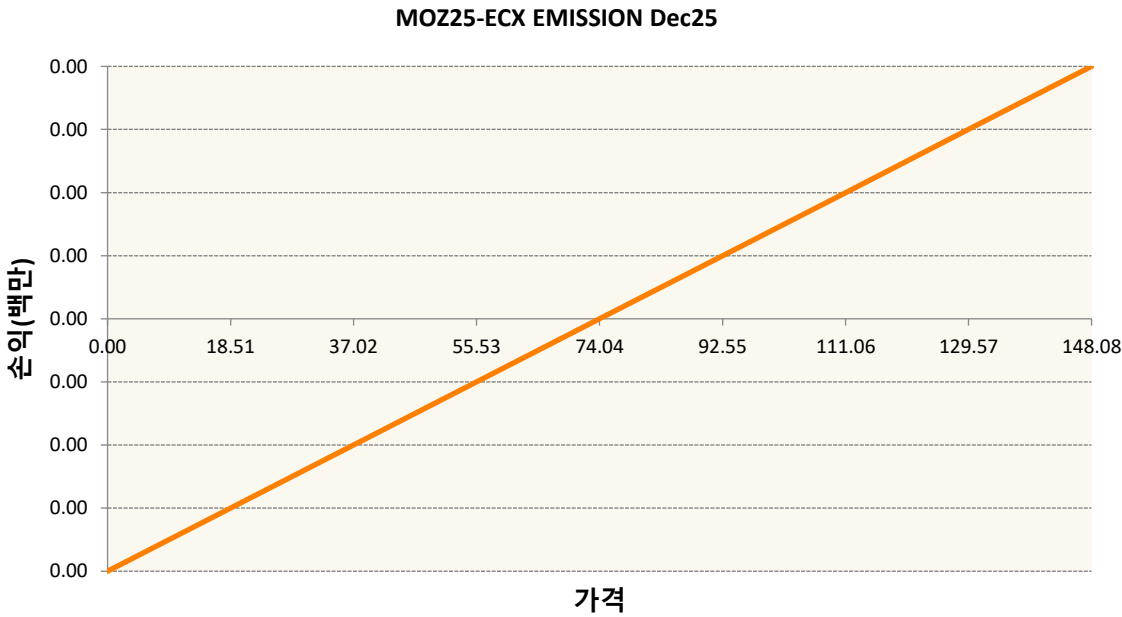
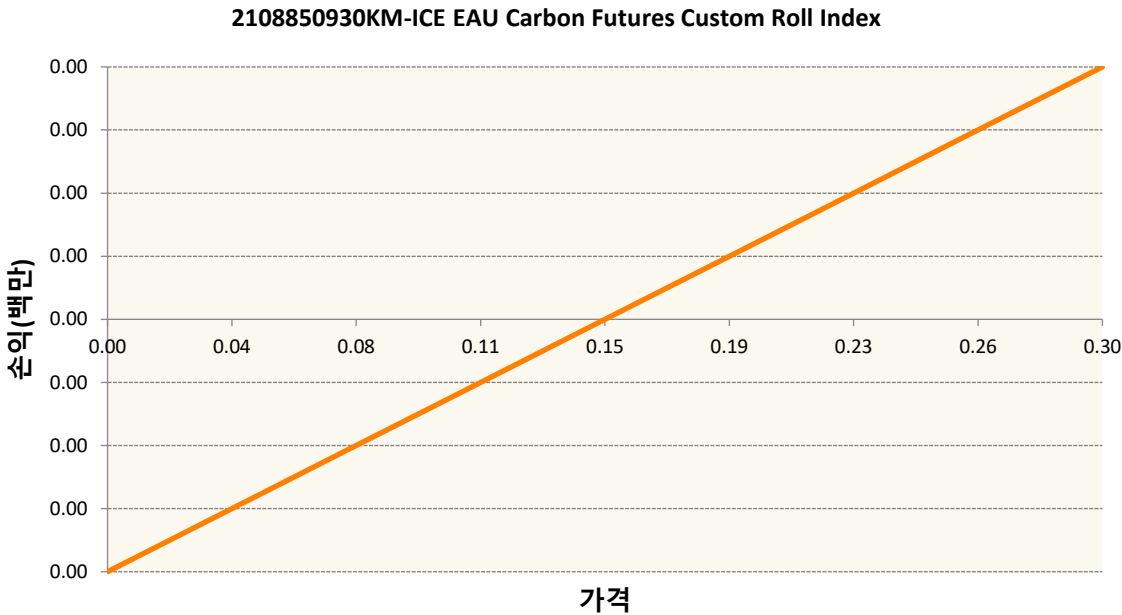
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,330	0	9,330	
누계	통화	선도	0	2,059	-2,059	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		4
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E		165
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		742

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,341

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

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)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	7

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

(단위:백만원)

40

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

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)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	0.48
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.14

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

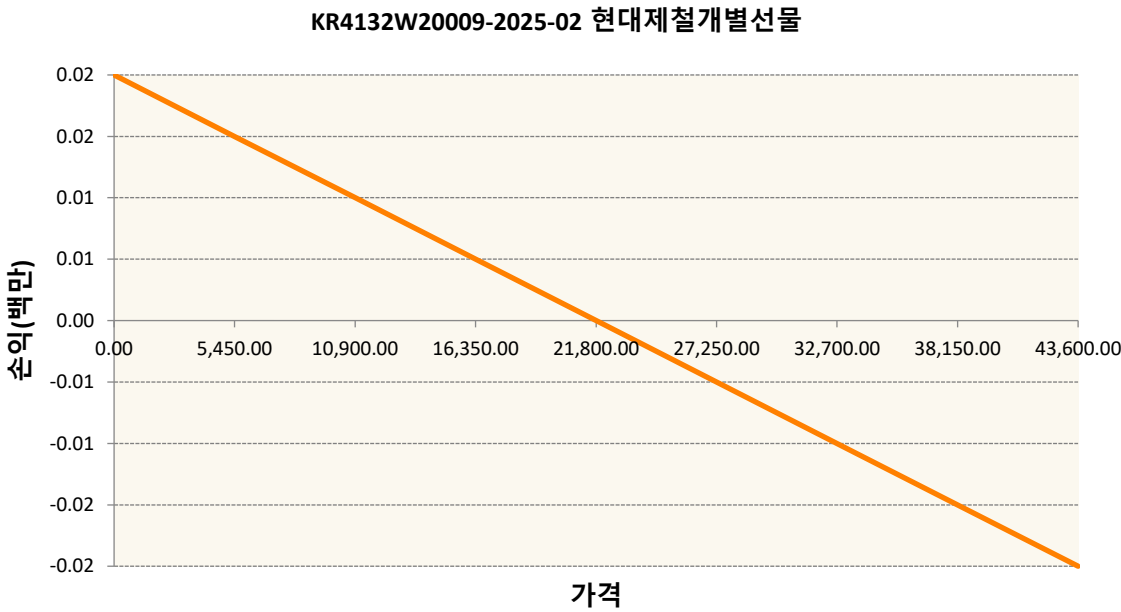
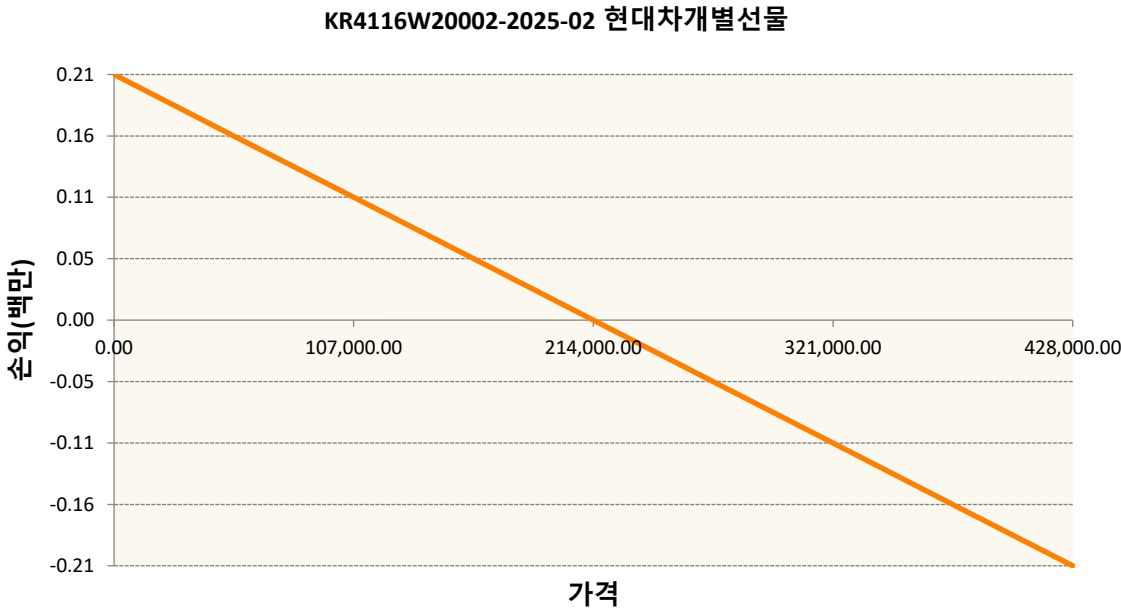
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

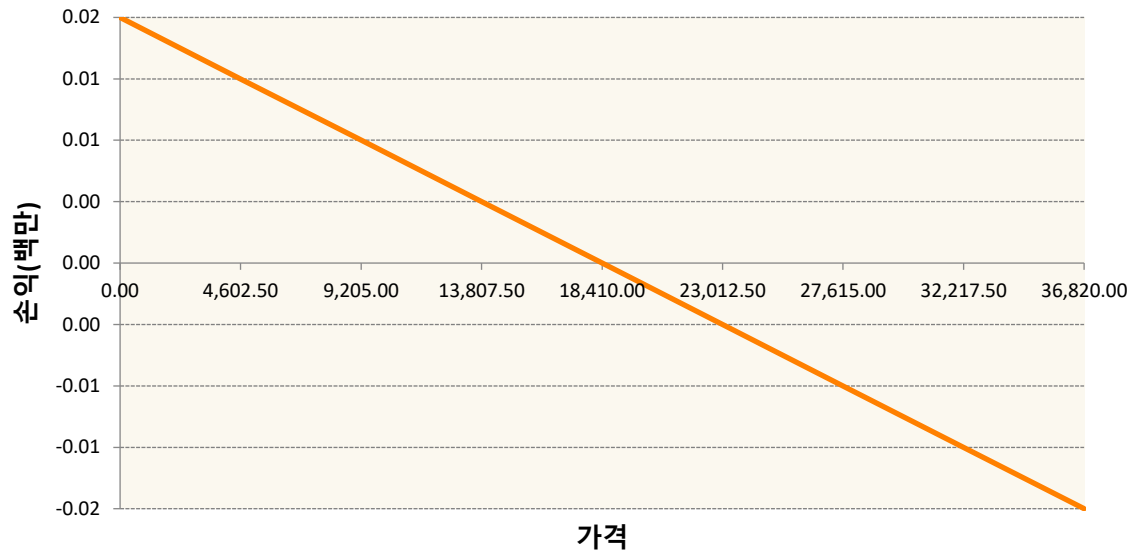
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	12	-12	장내
누계	유가증권	선물	0	13	-13	장내

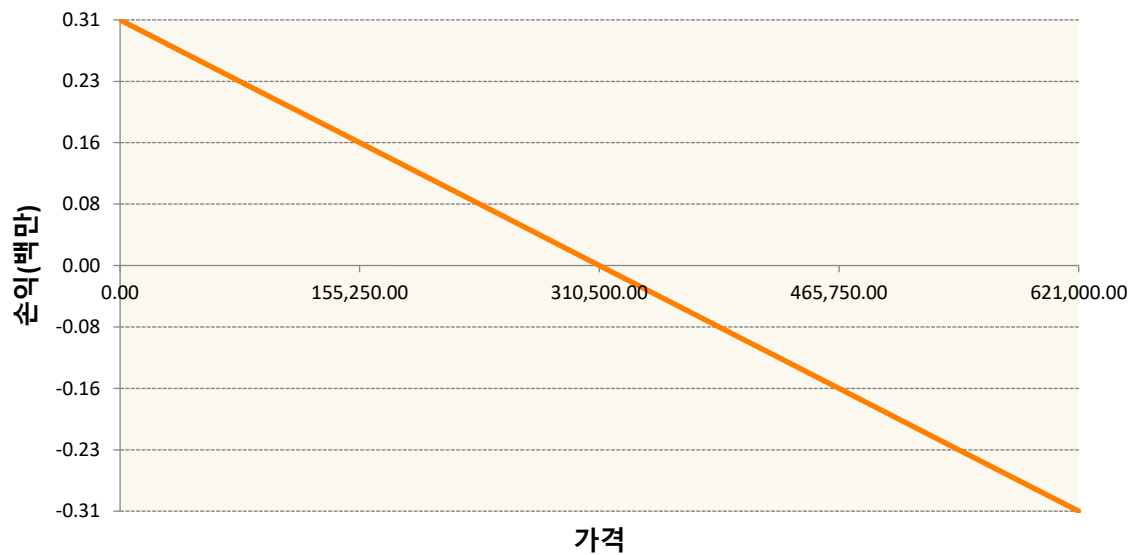
2. 만기시점의 손익구조



KR4151W20009-2025-02 GS건설개별선물



KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4116W20(2025-02 현대차개별선물	0.34
KR4132W20(2025-02 현대제철개별선물	0.02
KR4151W20(2025-02 GS건설개별선물	0.4
KR41CRW20(2025-02 LG생활건강개별선물	0.25

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

(단위:백만원)

2

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

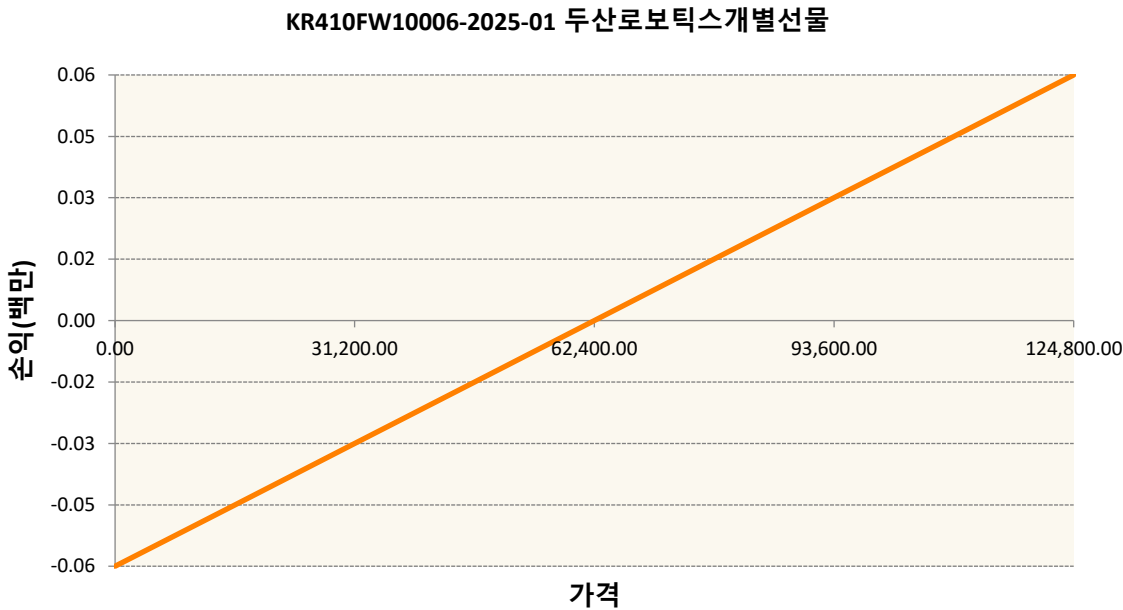
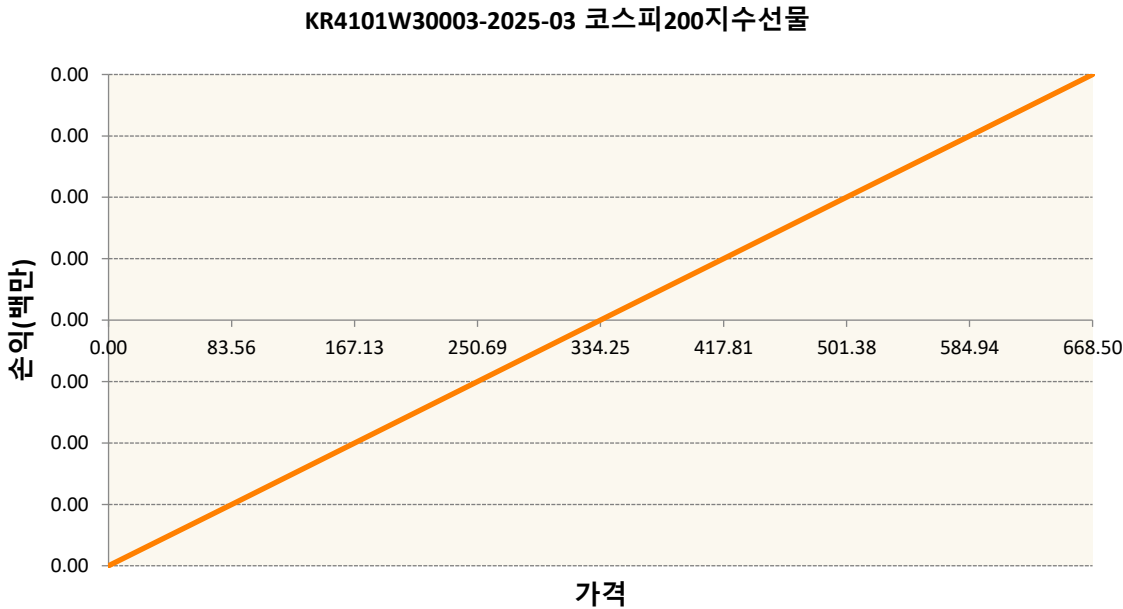
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

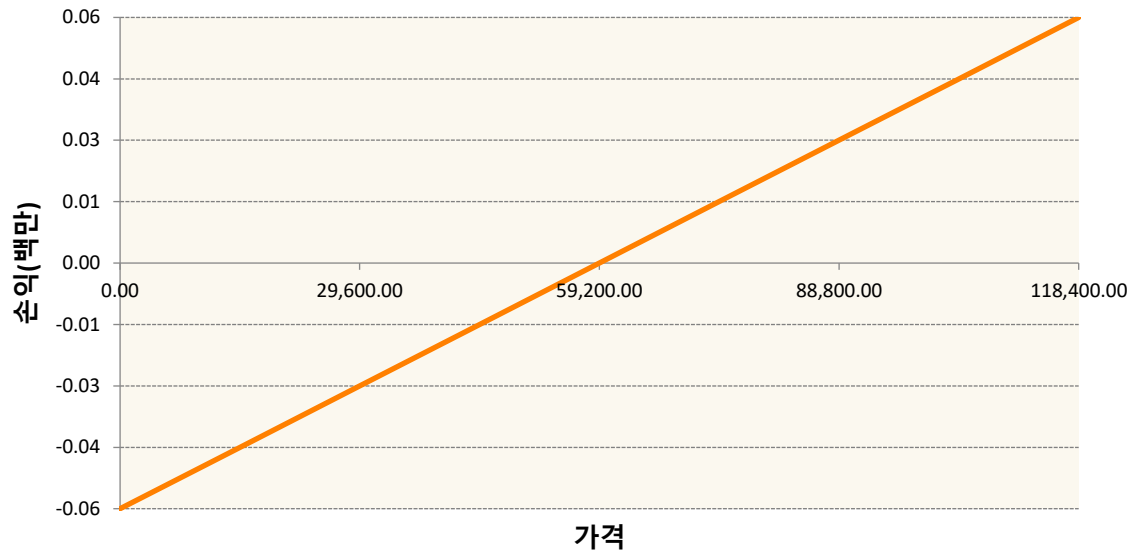
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,675	0	7,675	장내

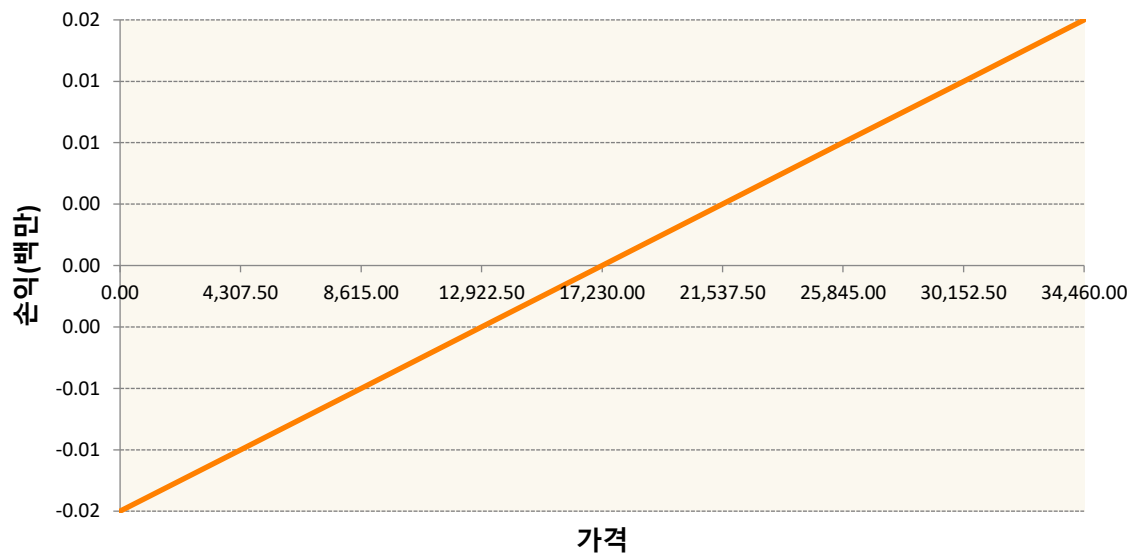
2. 만기시점의 손익구조



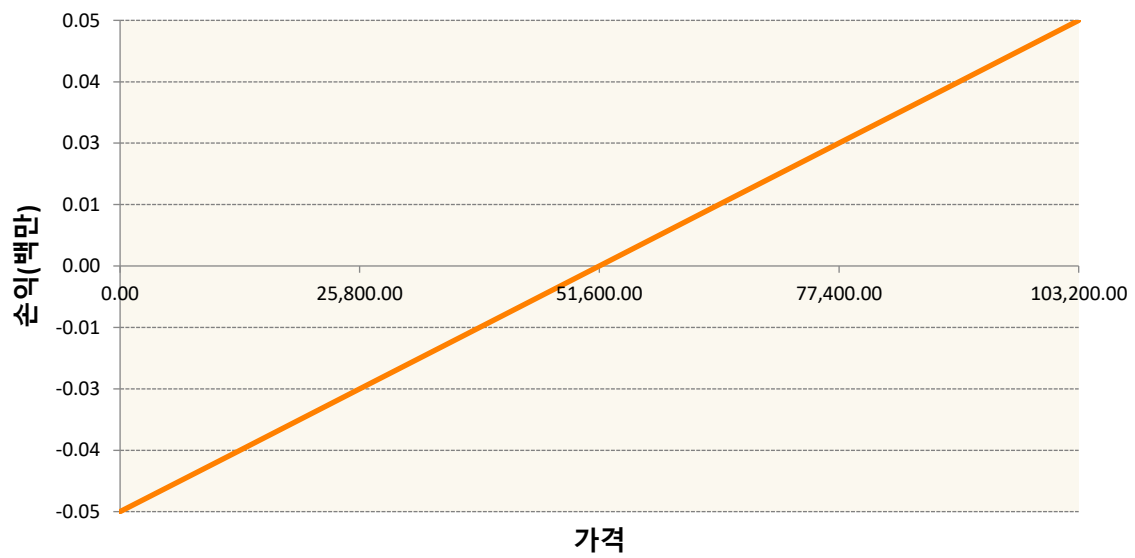
KR41BBW10001-2025-01 롯데케미칼개별선물



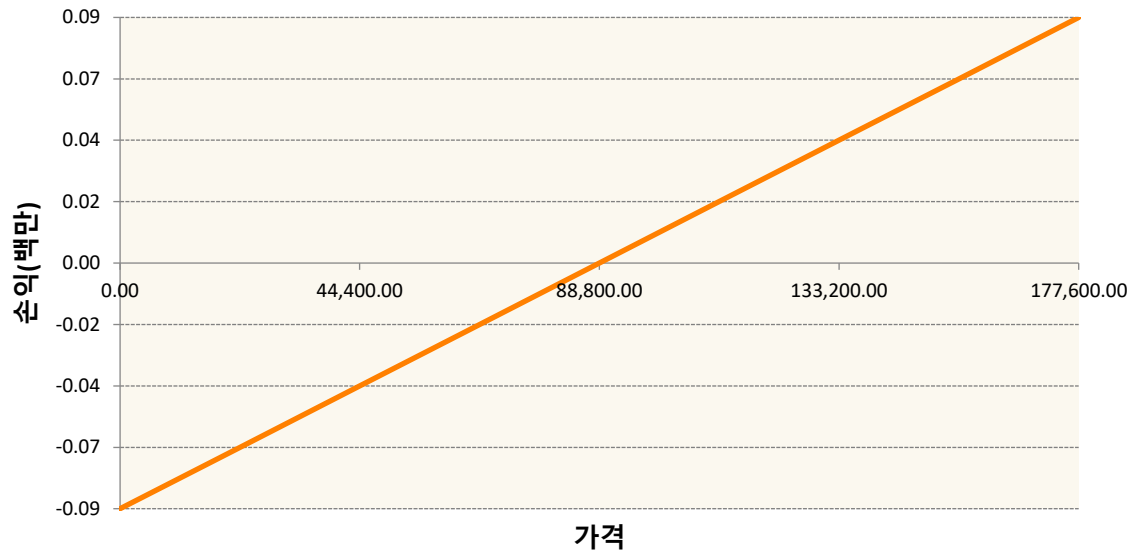
KR41ETW10007-2025-01 삼성E&A개별선물



KR41F9W10002-2025-01 SK바이오사이언스개별선물



KR41FMW10009-2025-01 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W30003 2025-03 코스피200지수선물								569
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-569	-569	-569	-569	-569	-569	-569	-569
-5.33%	-380	-380	-380	-380	-380	-380	-380	-380
-2.67%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	190	190	190	190	190	190	190	190
5.33%	380	380	380	380	380	380	380	380
8.00%	569	569	569	569	569	569	569	569
KR41BBW10001 2025-01 롯데케미칼개별선물								12
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	8	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	12	12	12	12	12	12	12	12
KR41ETW10007 2025-01 삼성E&A개별선물								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	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-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
KR41F9W10002 2025-01 SK바이오사이언스개별선물							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
KR41FMW10009 2025-01 엘앤에프개별선물							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

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

(단위:백만원)

733

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

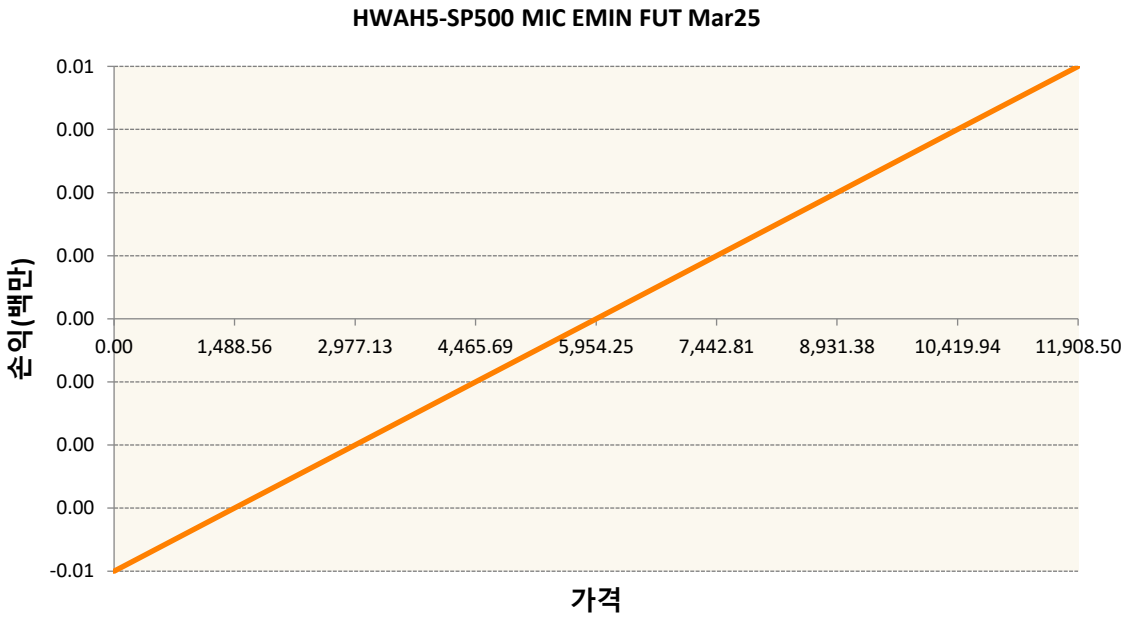
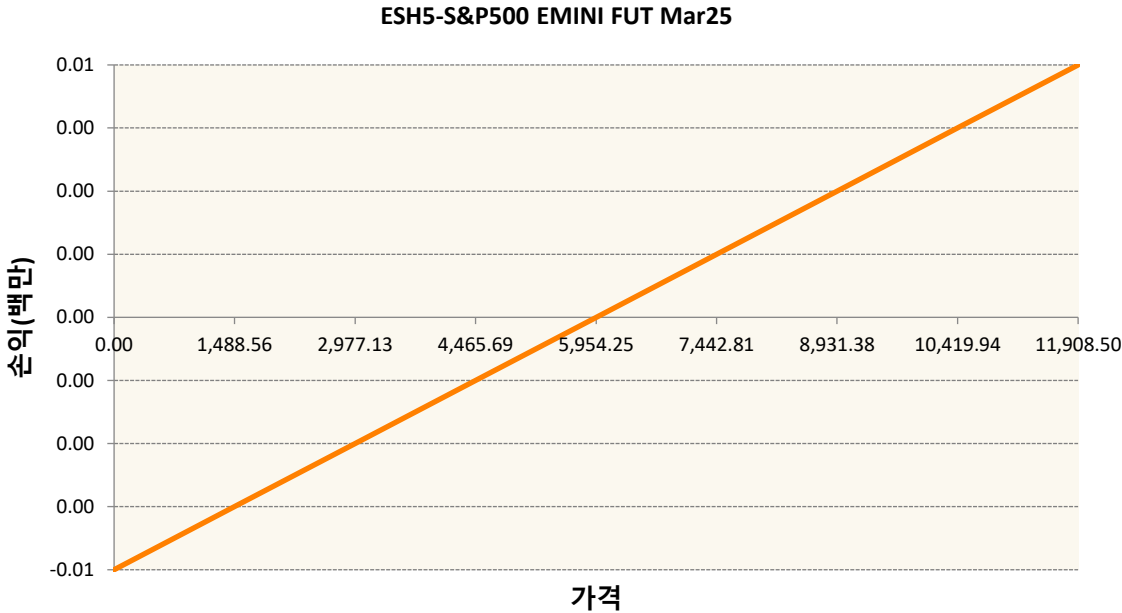
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	25,520	0	25,520	
누계	유가증권	선물	2,031	0	2,031	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,042
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	162

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,876

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

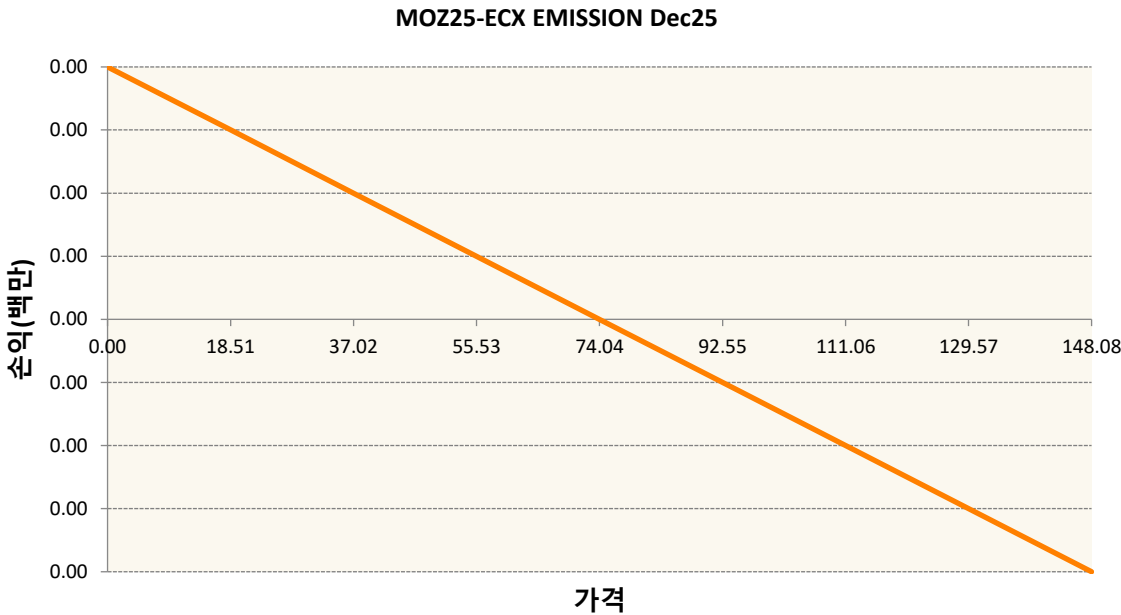
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-51	4,450	-4,501	
누계	통화	선도	0	1,271	-1,271	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	4
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	9
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	93
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	356

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

(단위:백만원)

657

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

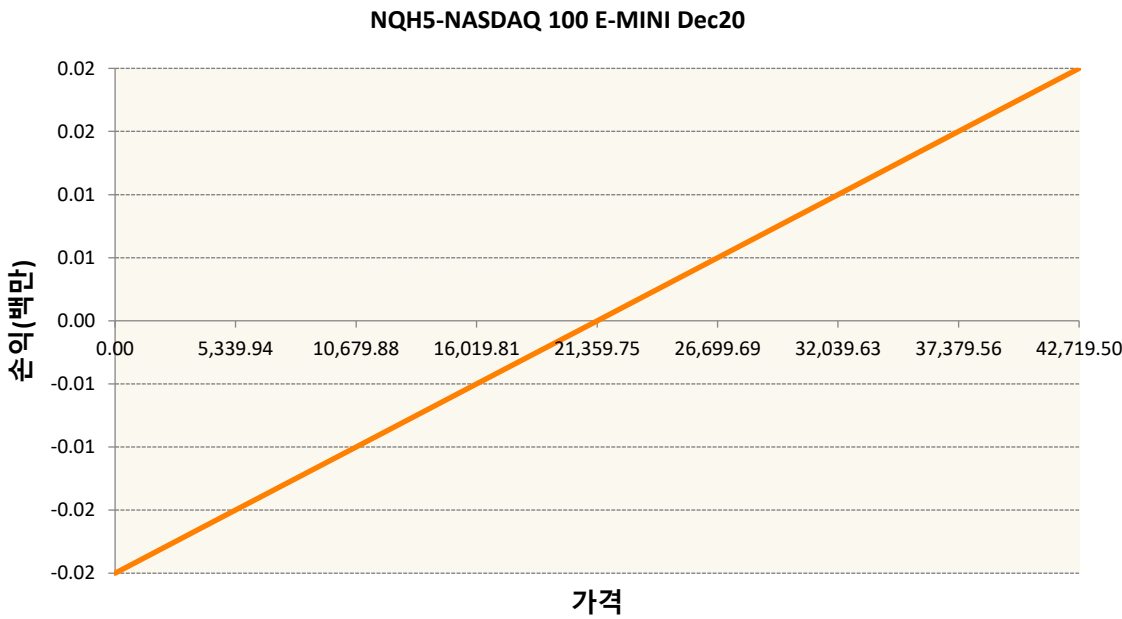
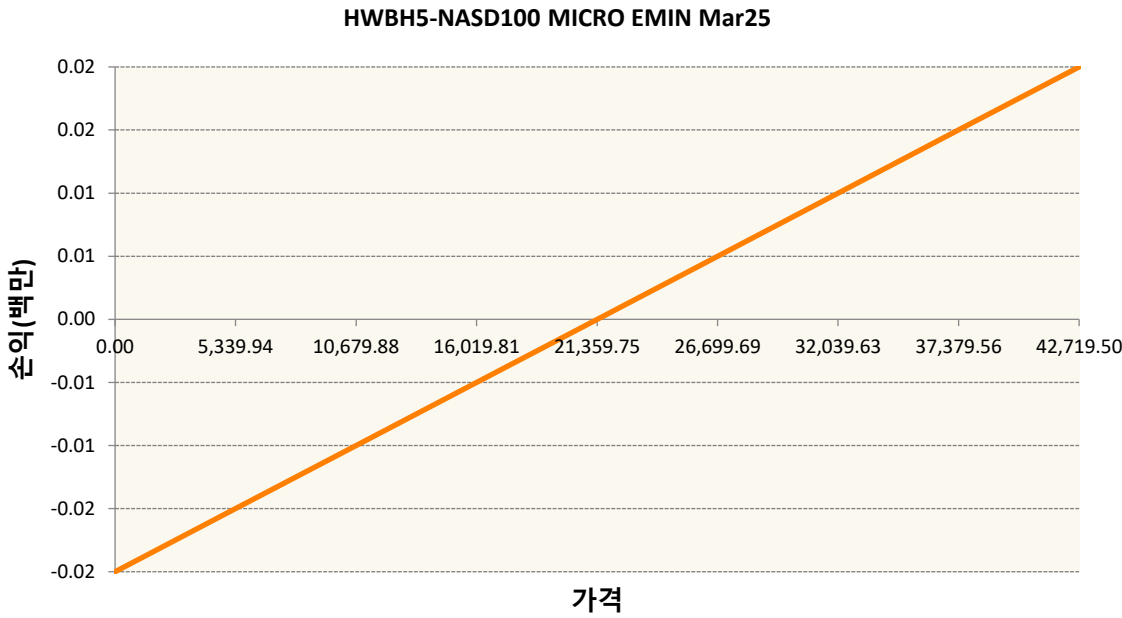
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,667	0	13,667	
누계	유가증권	선물	1,178	0	1,178	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25		94
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,093

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,026

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

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	195,192	0	195,192	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	700
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,809
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,793
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,945

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

(단위:백만원)

8,697

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

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	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	7

공시일	2025-01-09
기준일	2025-01-08

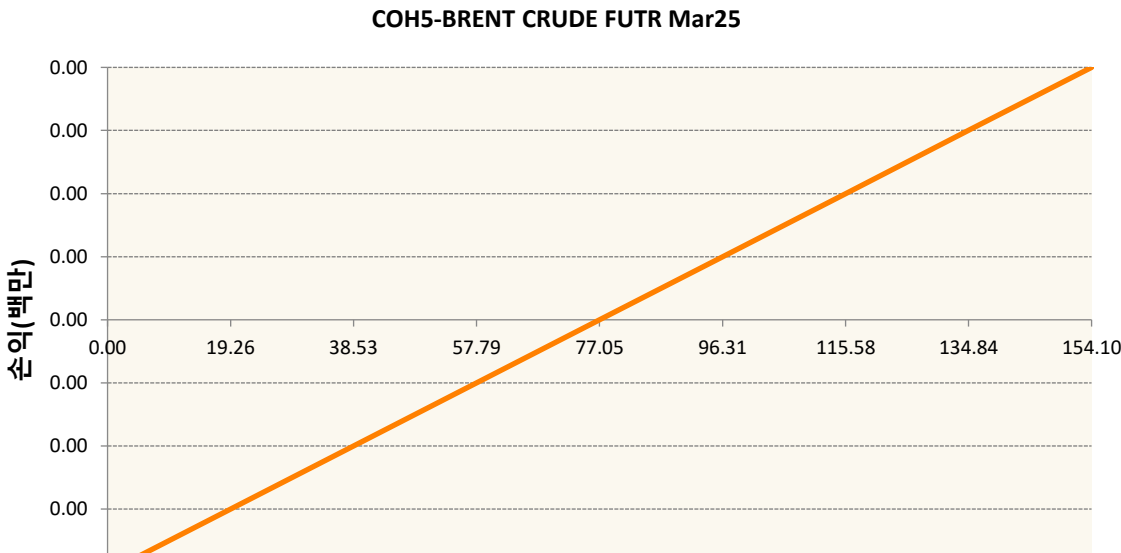
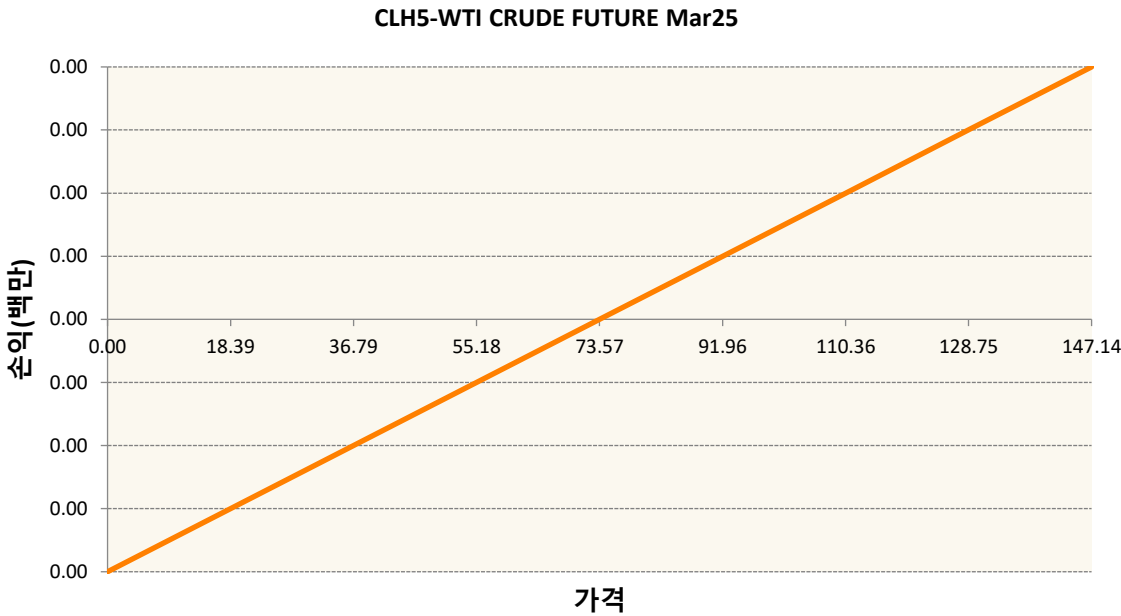
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

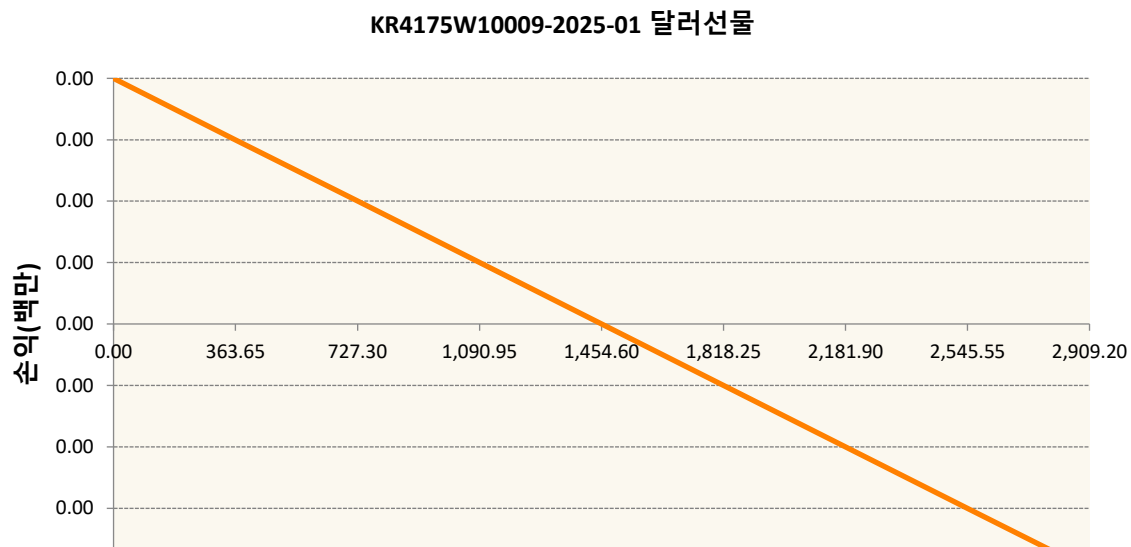
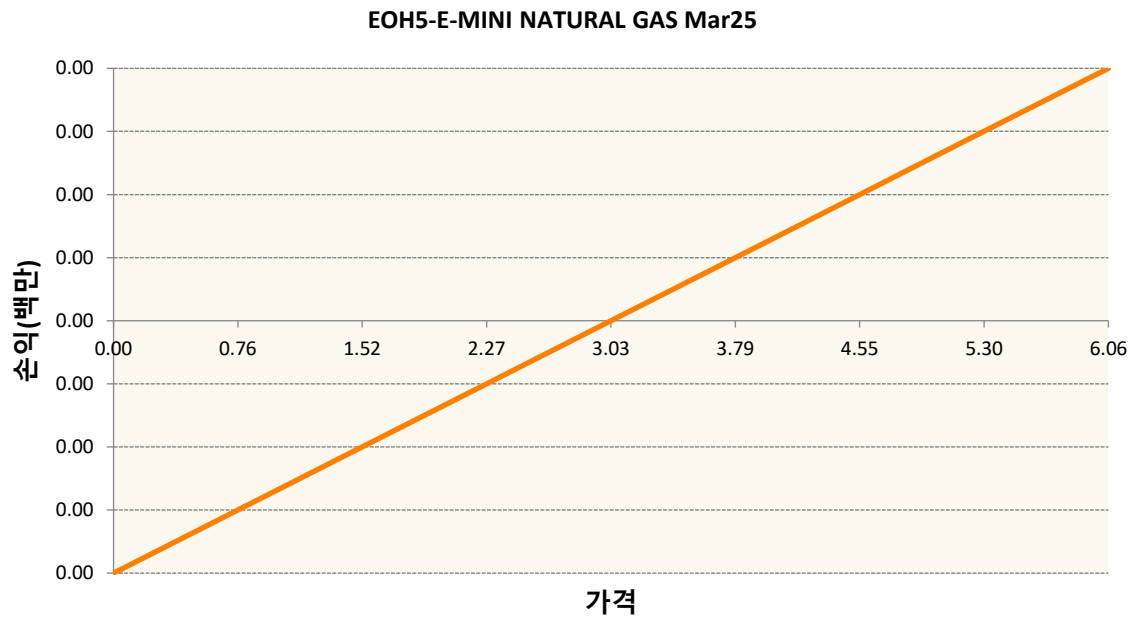
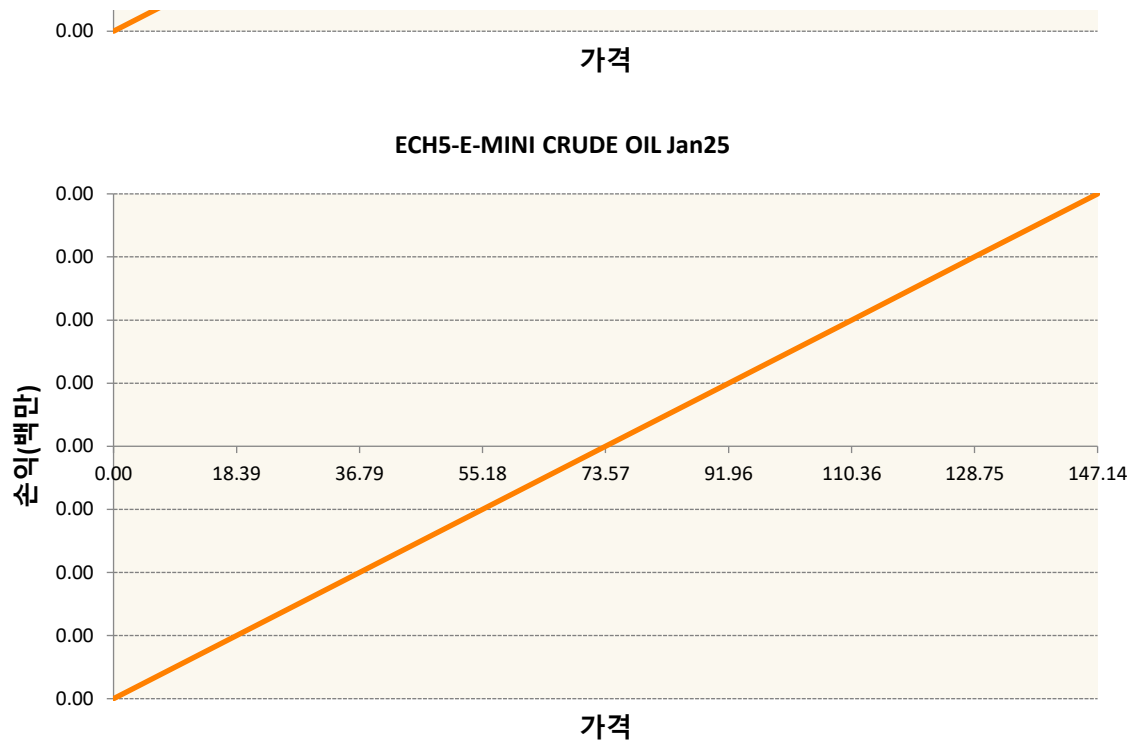
1. 계약금액

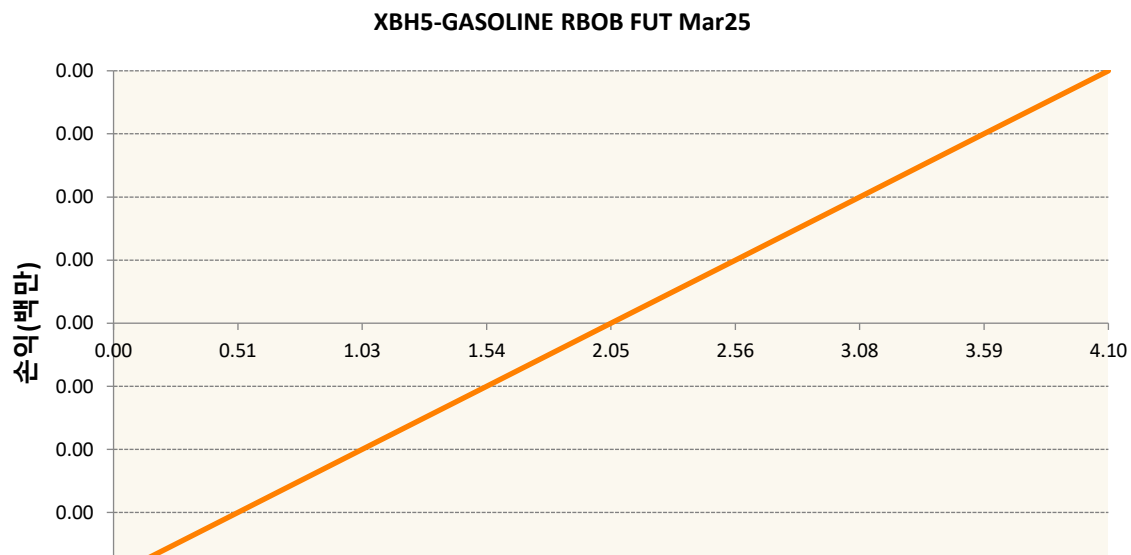
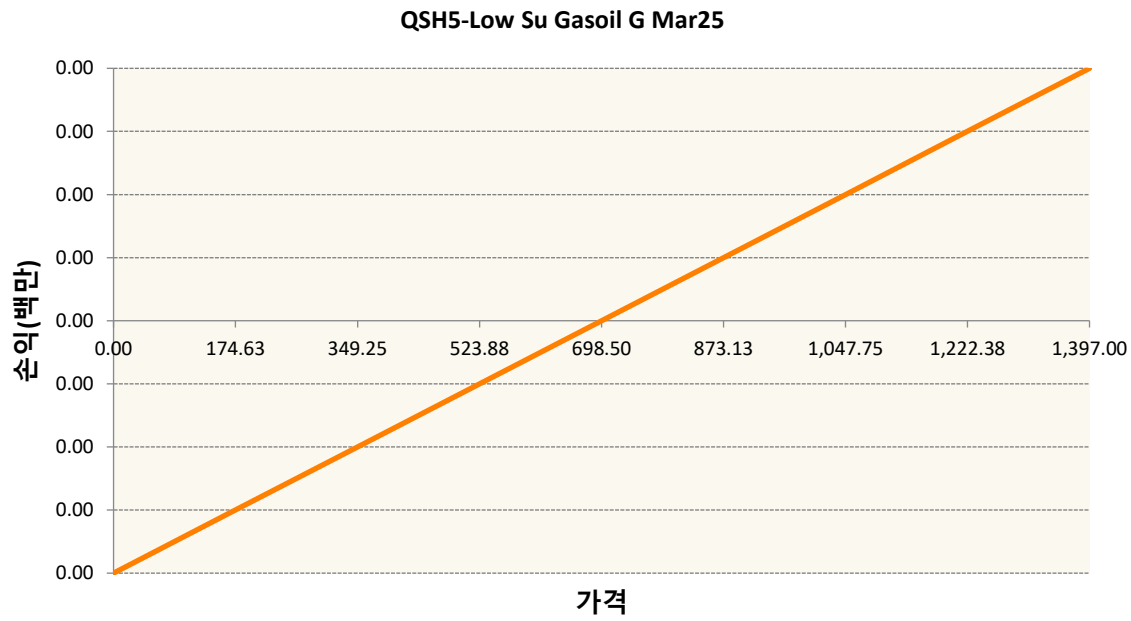
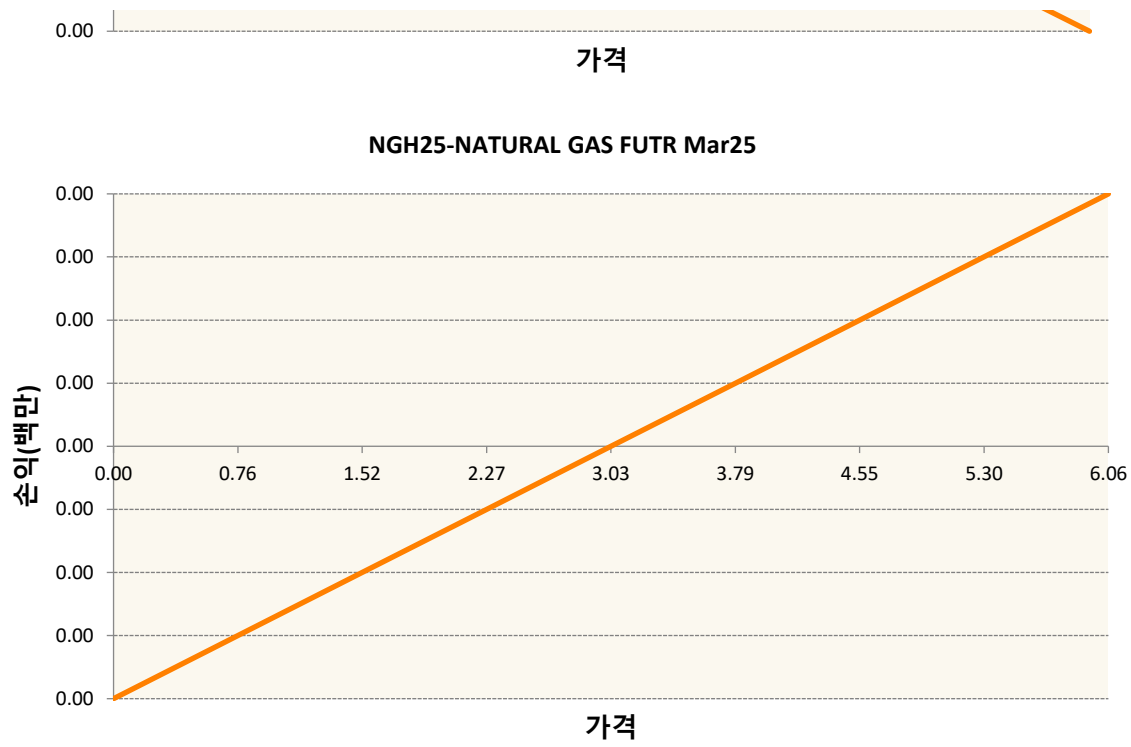
(단위:백만원)

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	105	0	105	
누계	유가증권	선물	723	0	723	
누계	통화	선물	0	160	-160	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar25	8
COH5	BRENT CRUDE FUTR Mar25	17
ECH5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	4
EOH5	E-MINI NATURAL GAS Mar25	4
KR4175W10(2025-01 달러선물		13
NGH25	NATURAL GAS FUTR Mar25	14
QSH5	Low Su Gasoil G Mar25	8
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar25	10

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

146
