

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

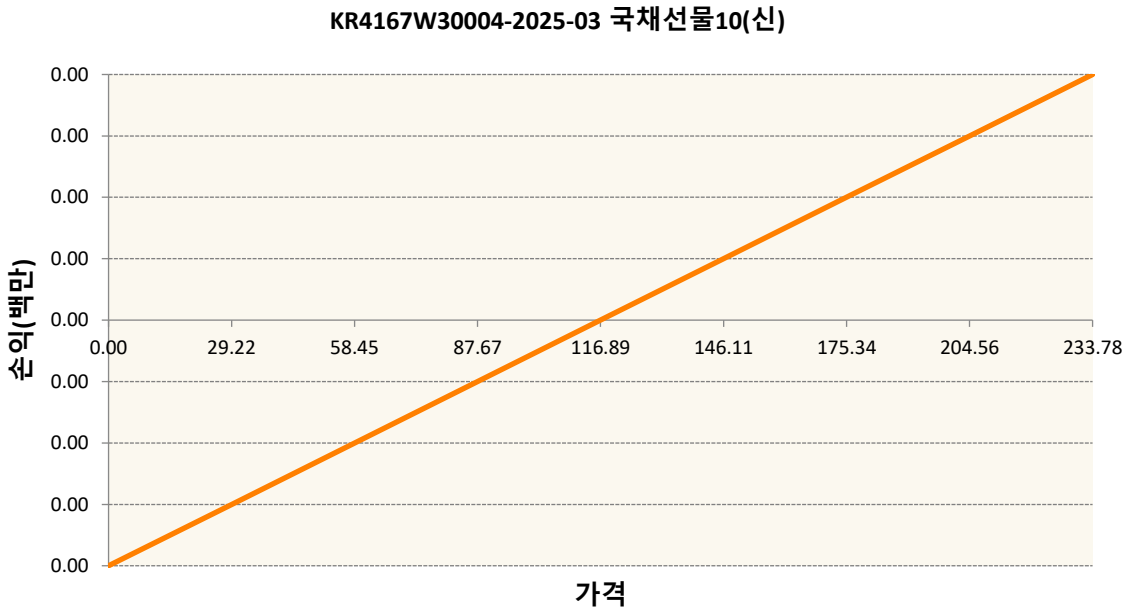
베스트장기채(채권-파생형)

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	112,214	0	112,214	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

2,902

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

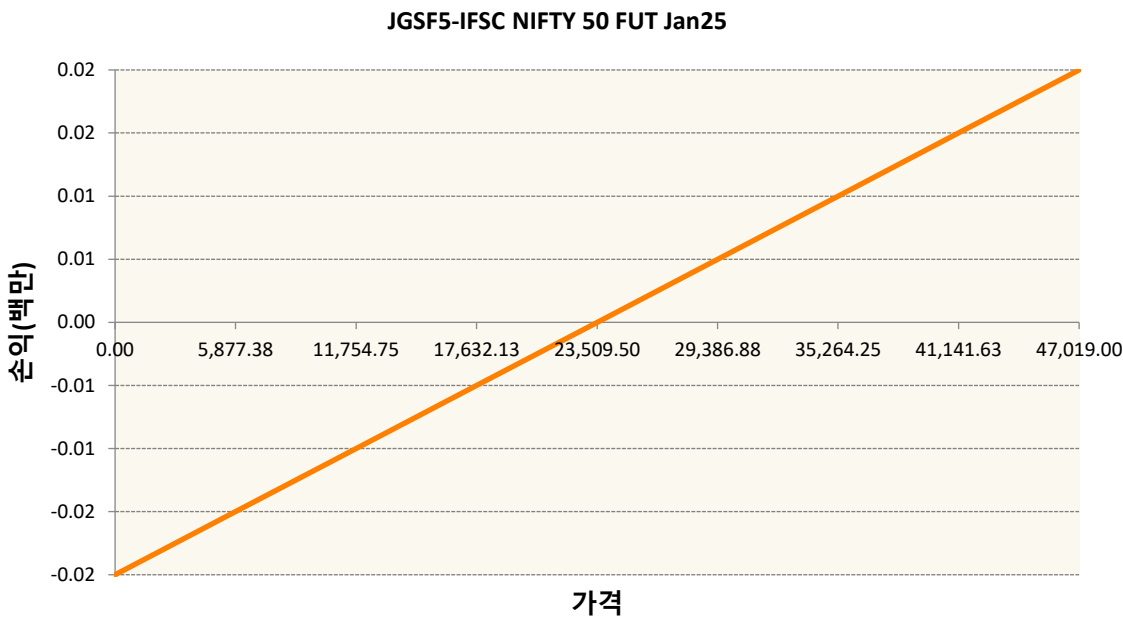
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,444	0	3,444	

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)

185

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

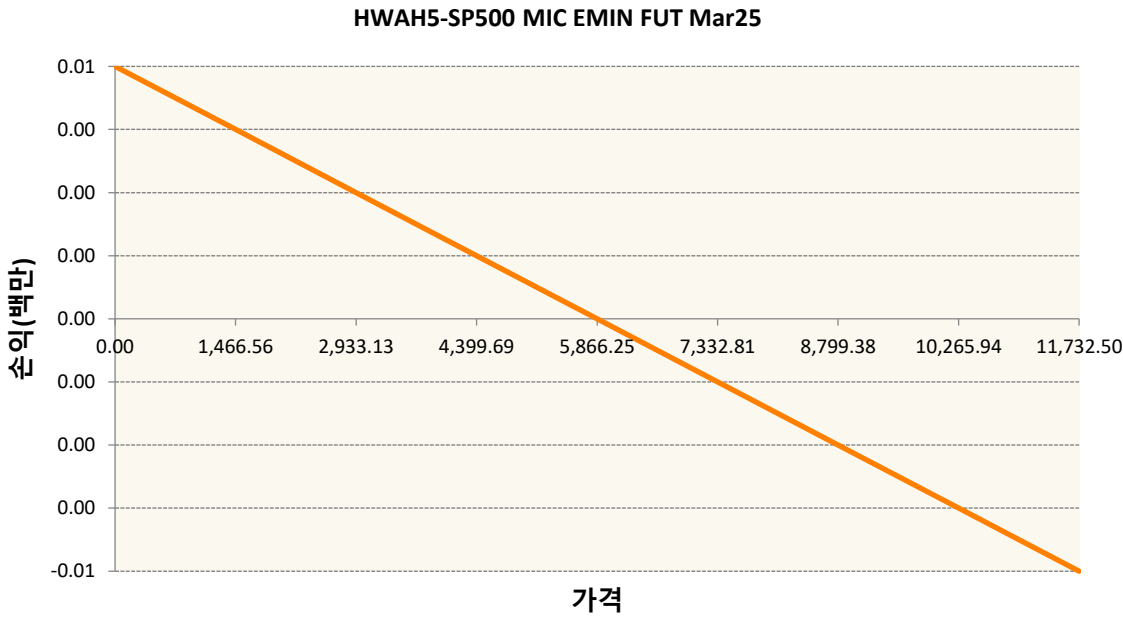
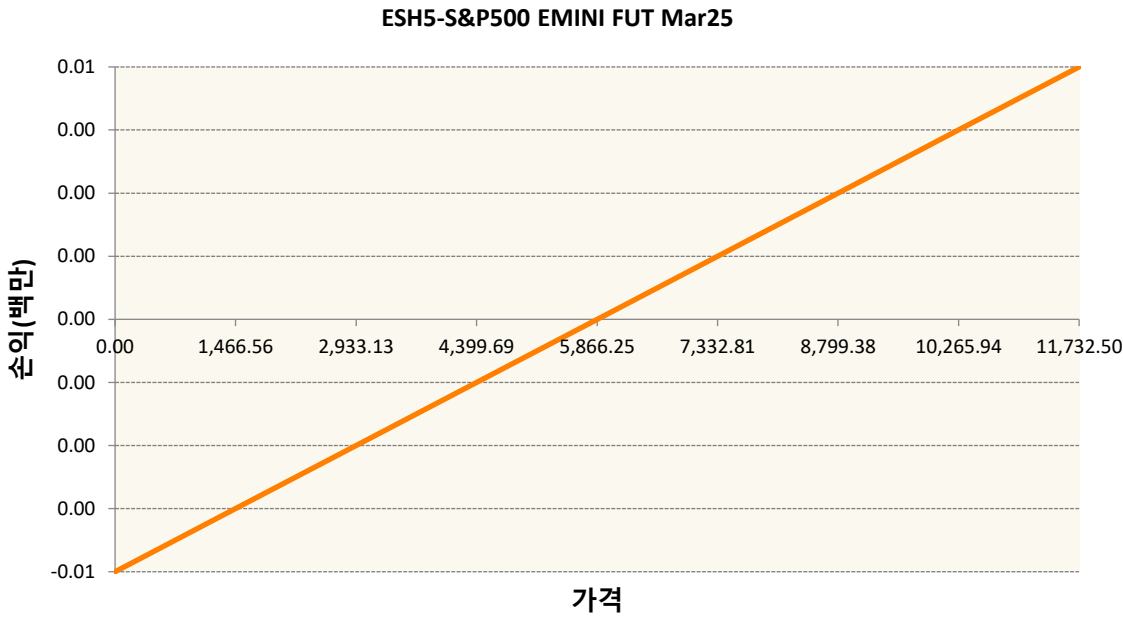
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	852	0	852	
누계	유가증권	선물	0	93	-93	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	68
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	98

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

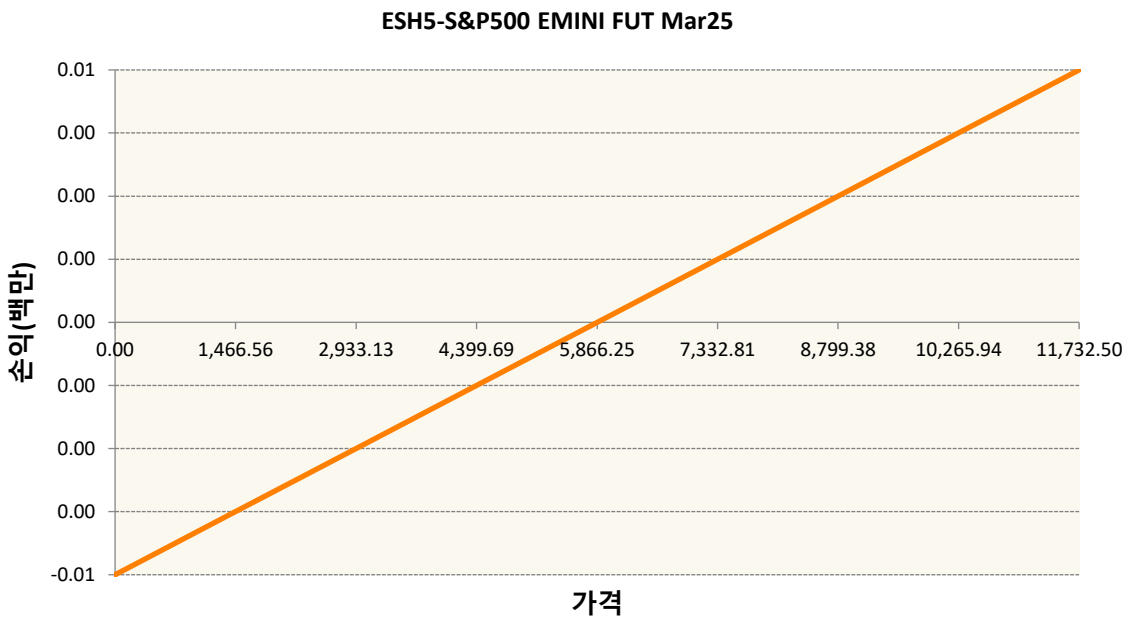
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,554	0	2,554	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	204
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

278

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

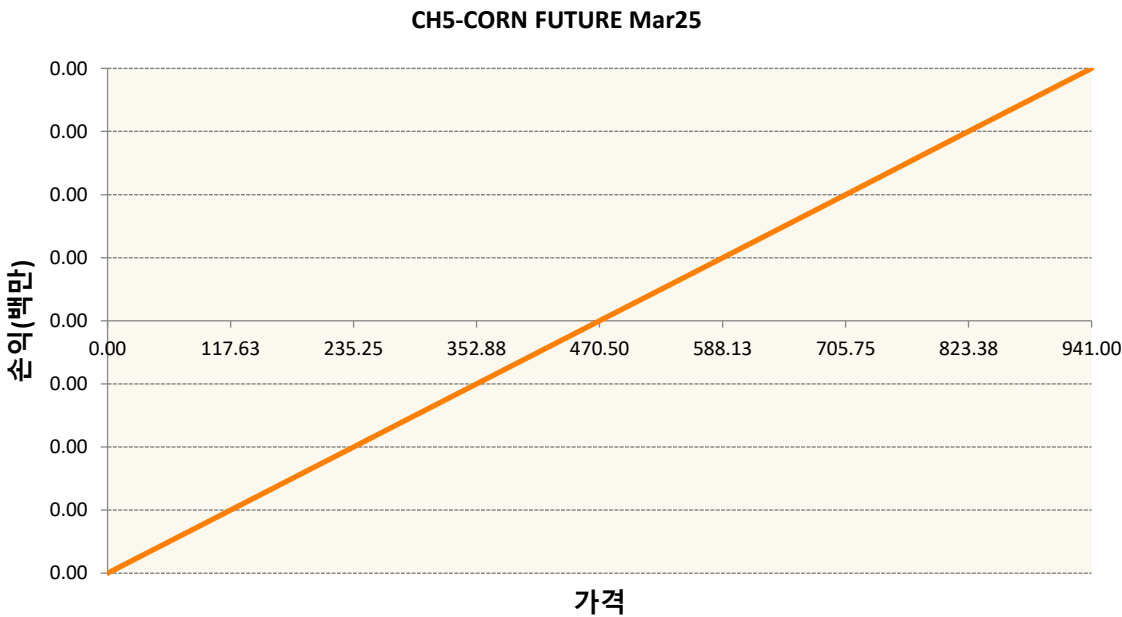
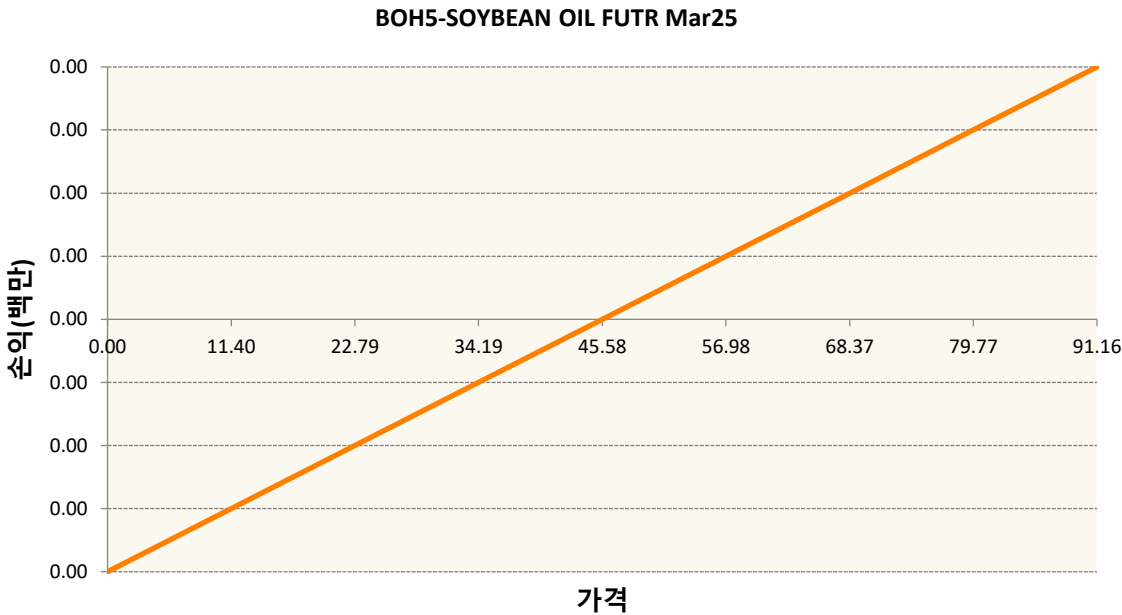
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

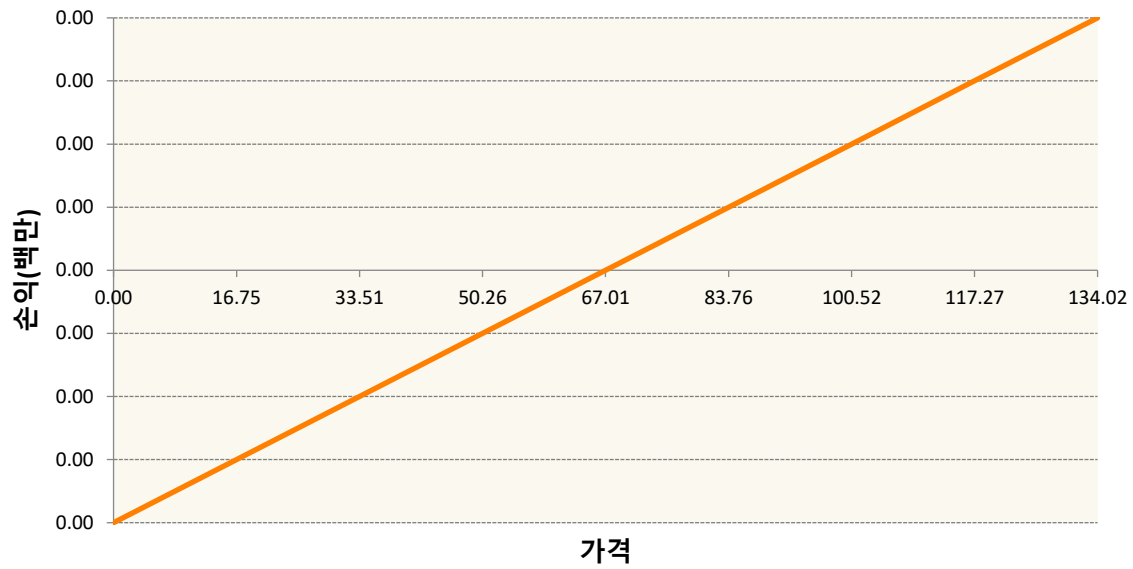
(단위:USD 백만)

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	3,698	0	3,698	
누계	통화	선물	0	427	-427	장내

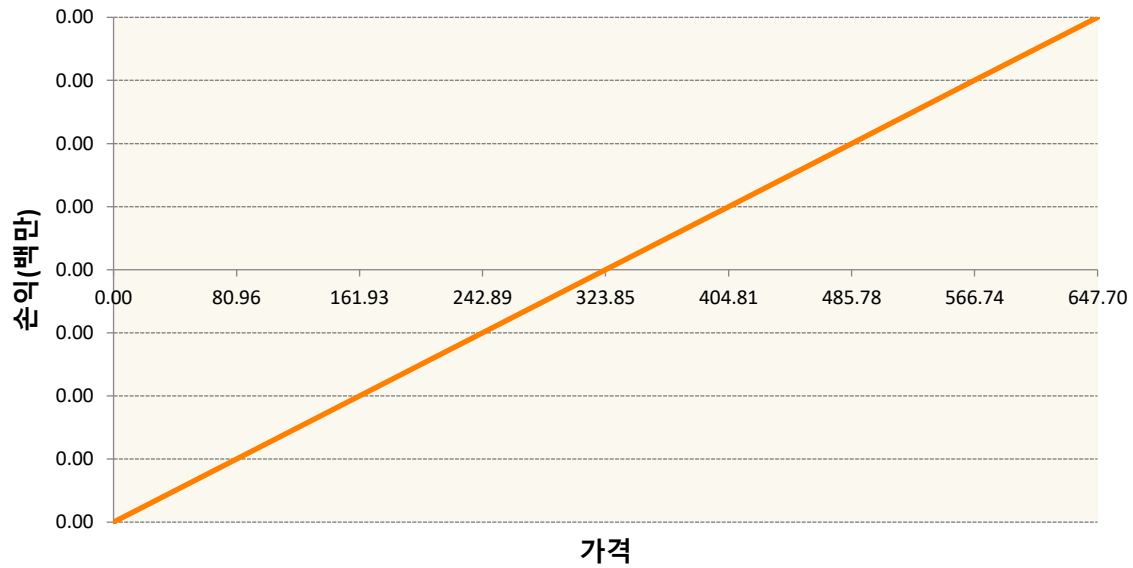
2. 만기시점의 손익구조



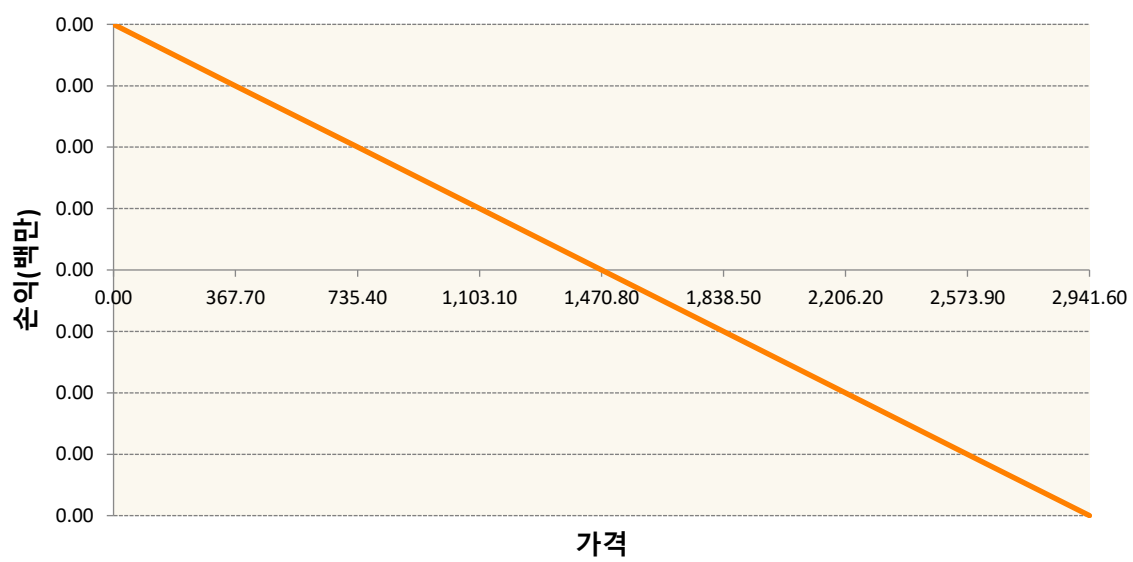
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



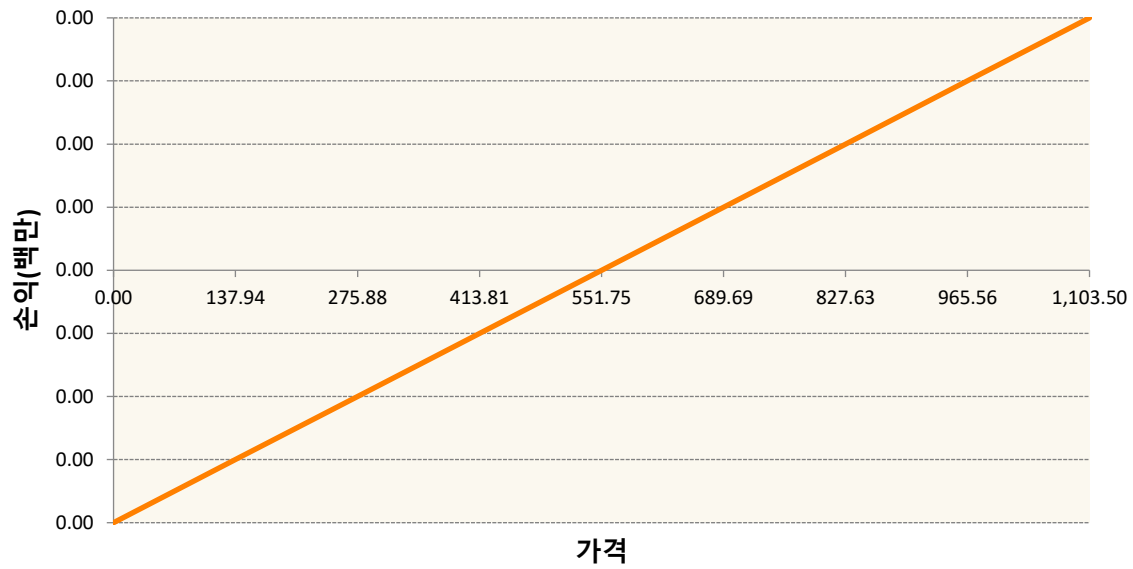
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



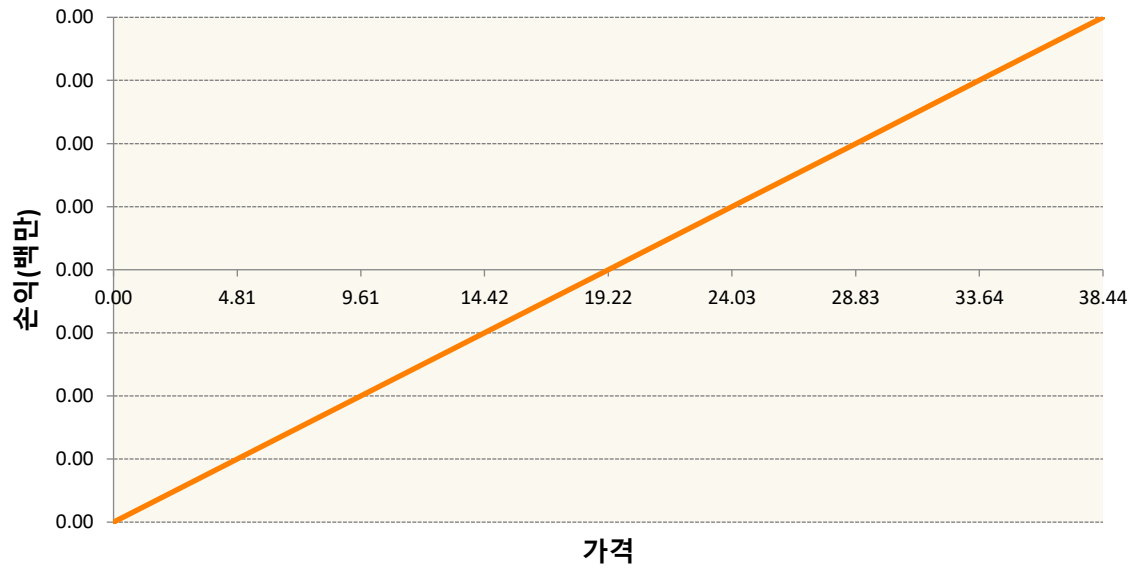
KR4175W10009-2025-01 달러선물



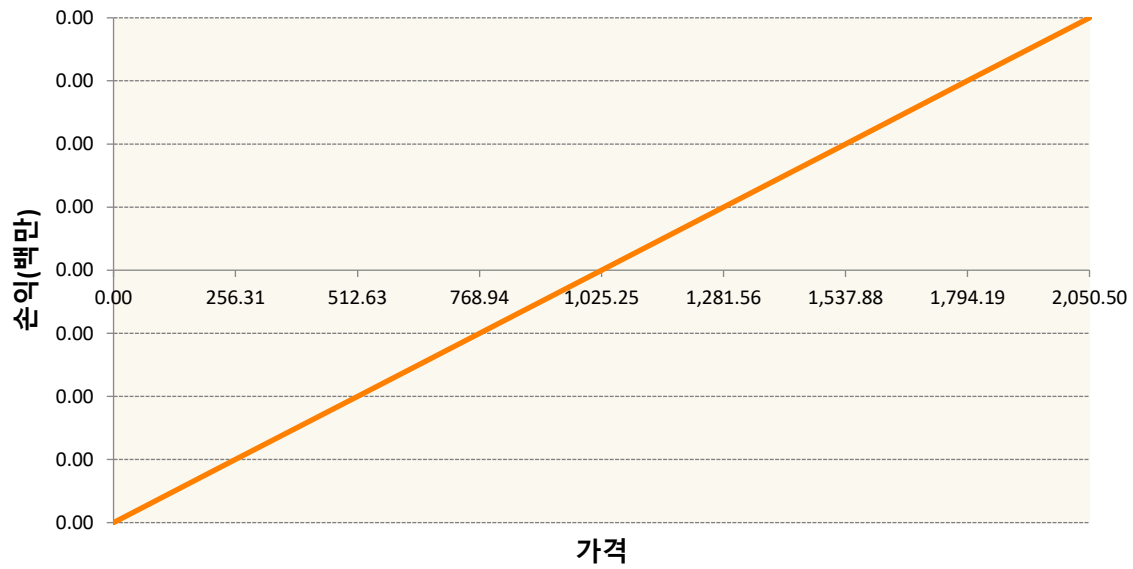
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



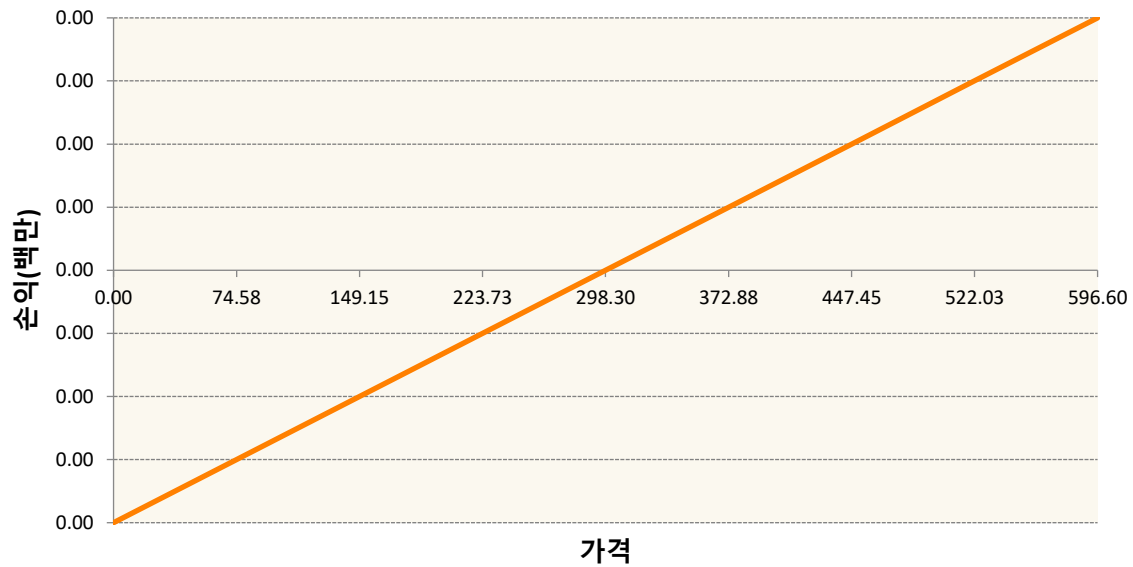
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



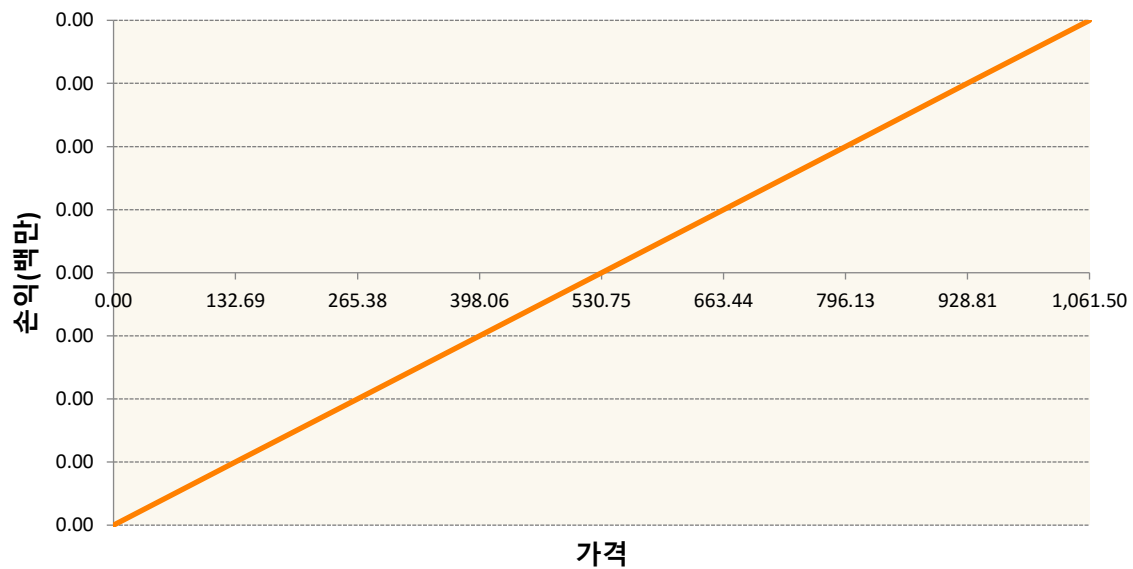
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar25



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	2025-01-14
기준일	2025-01-13

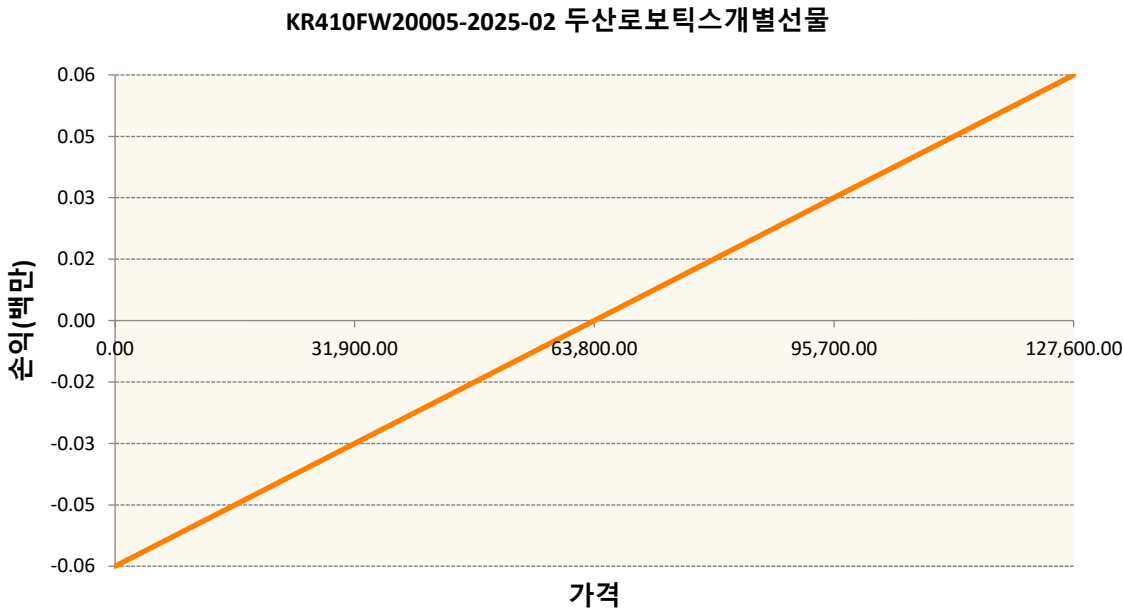
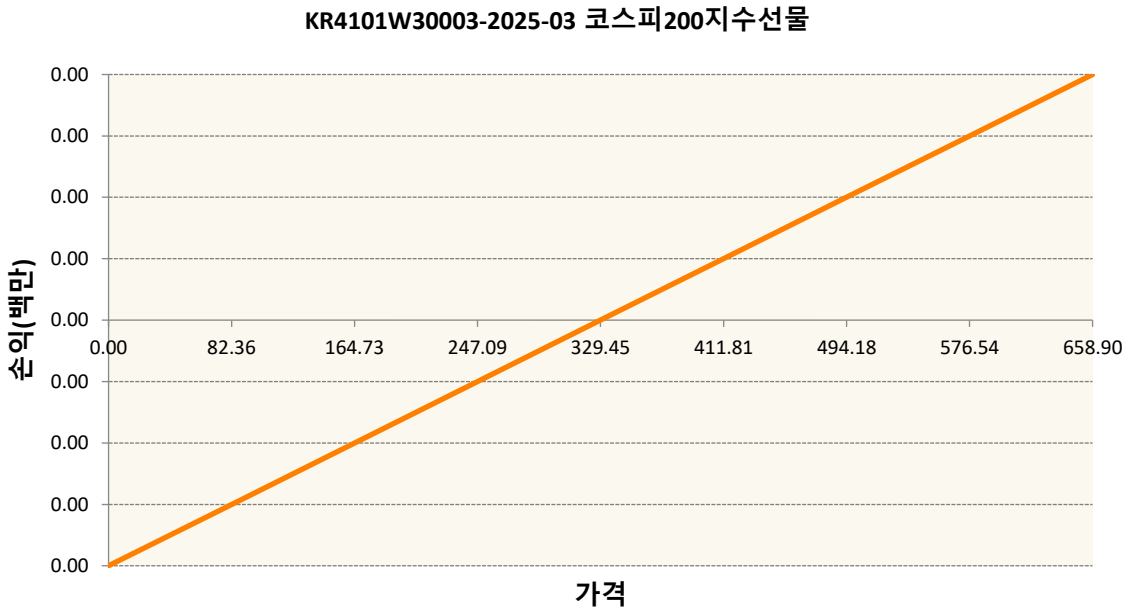
스마트인덱스모

1. 계약금액

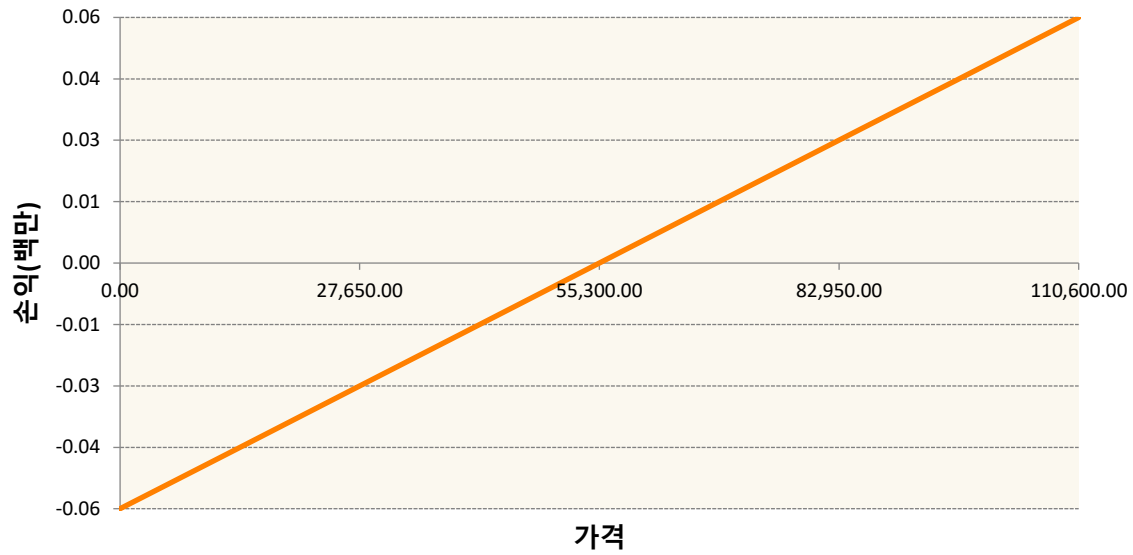
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	161	0	161	장내
누계	유가증권	선물	1,178	0	1,178	장내

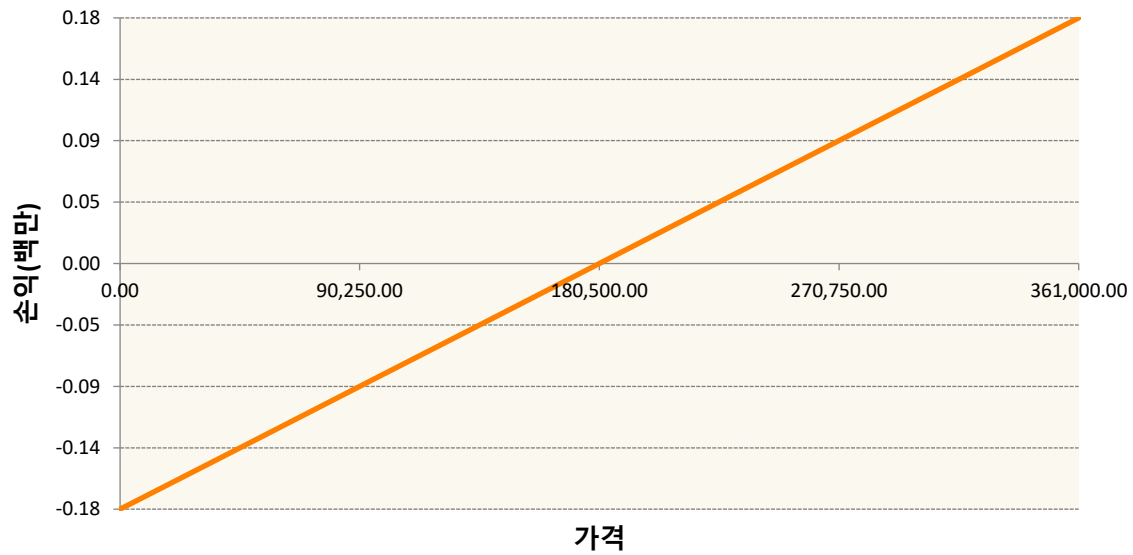
2. 만기시점의 손익구조



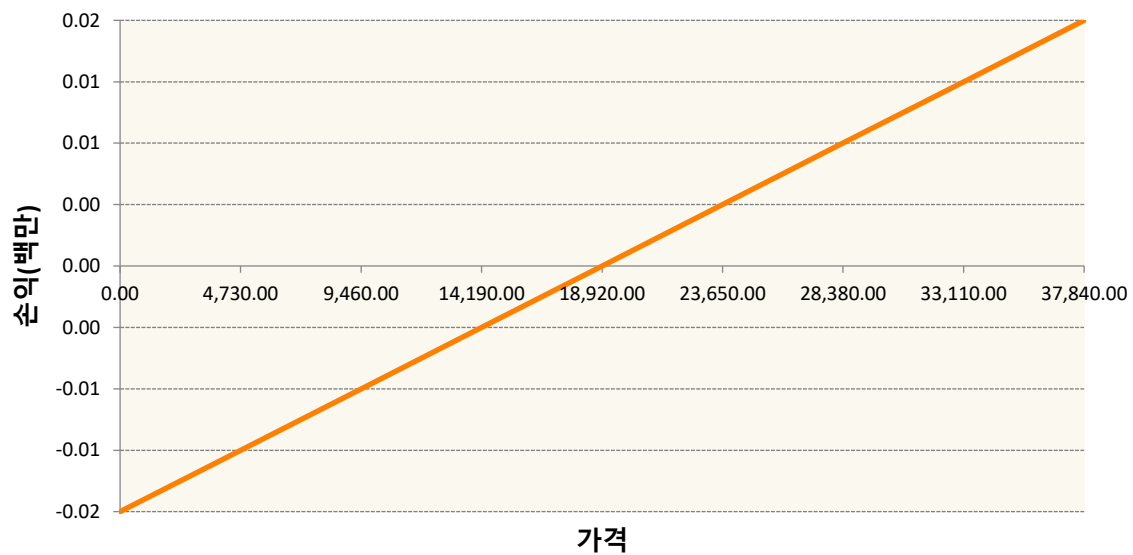
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



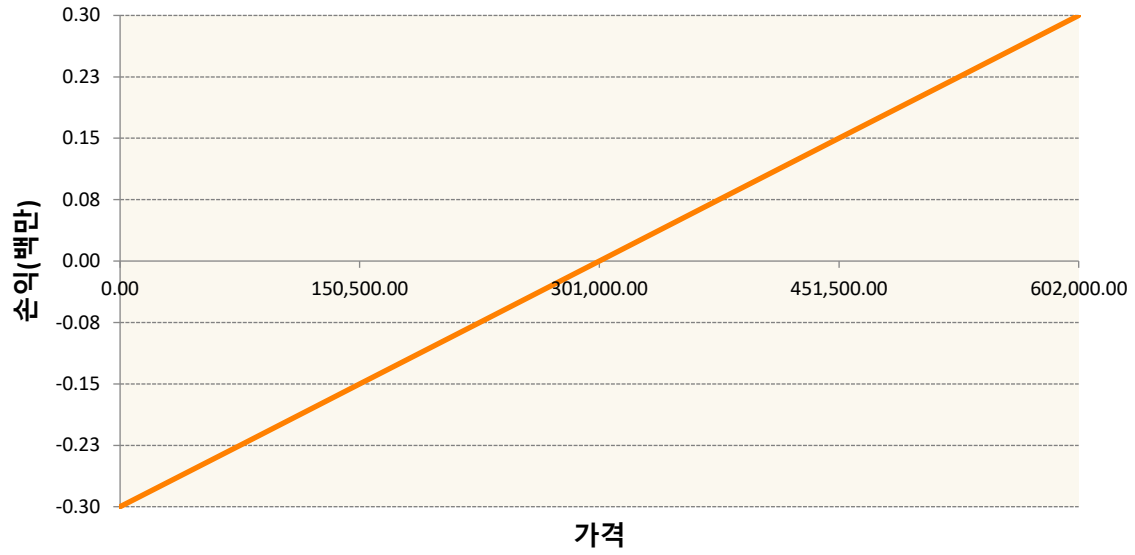
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



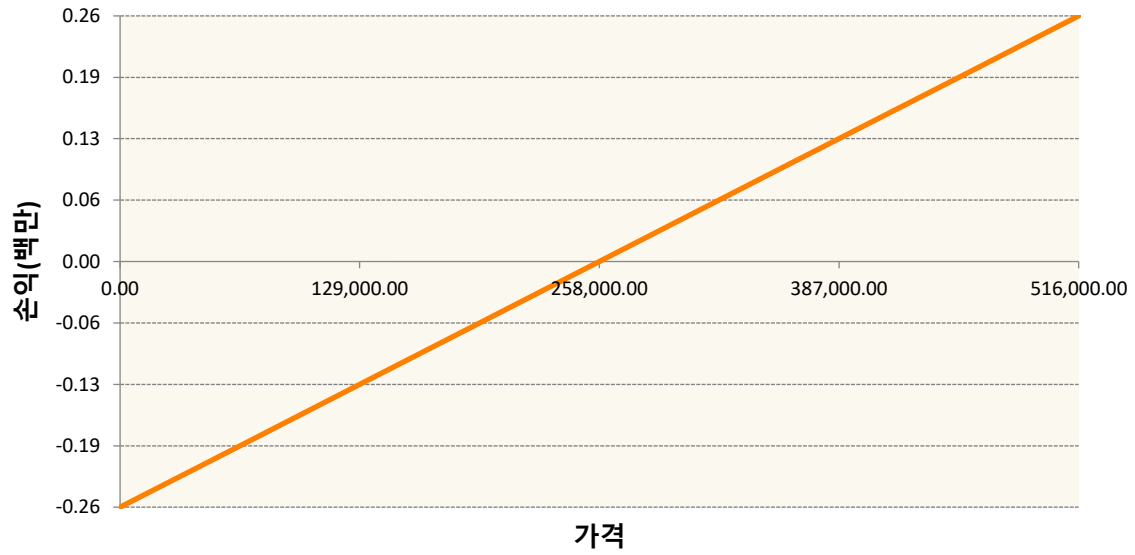
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



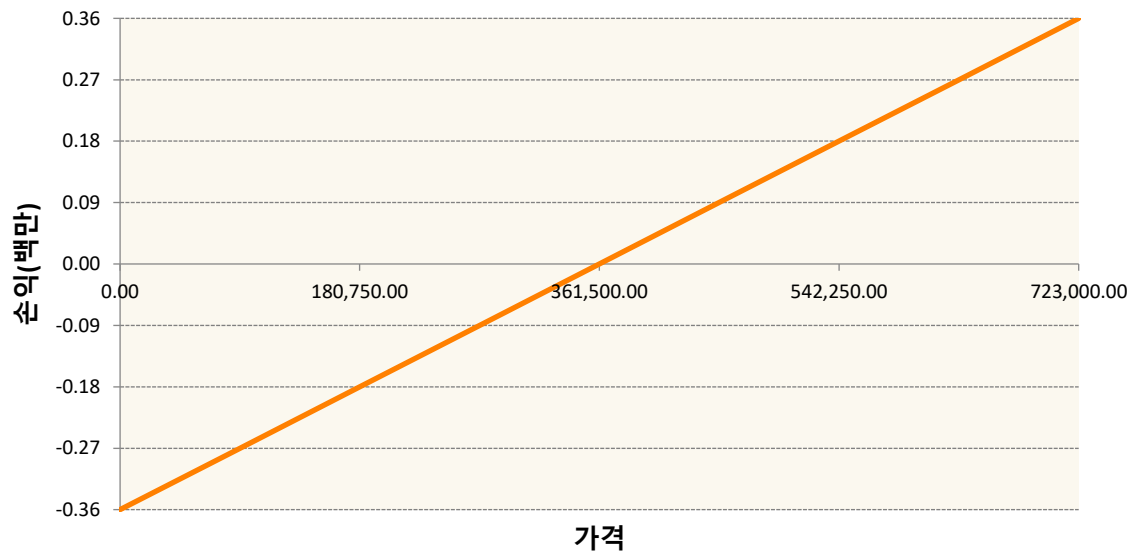
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



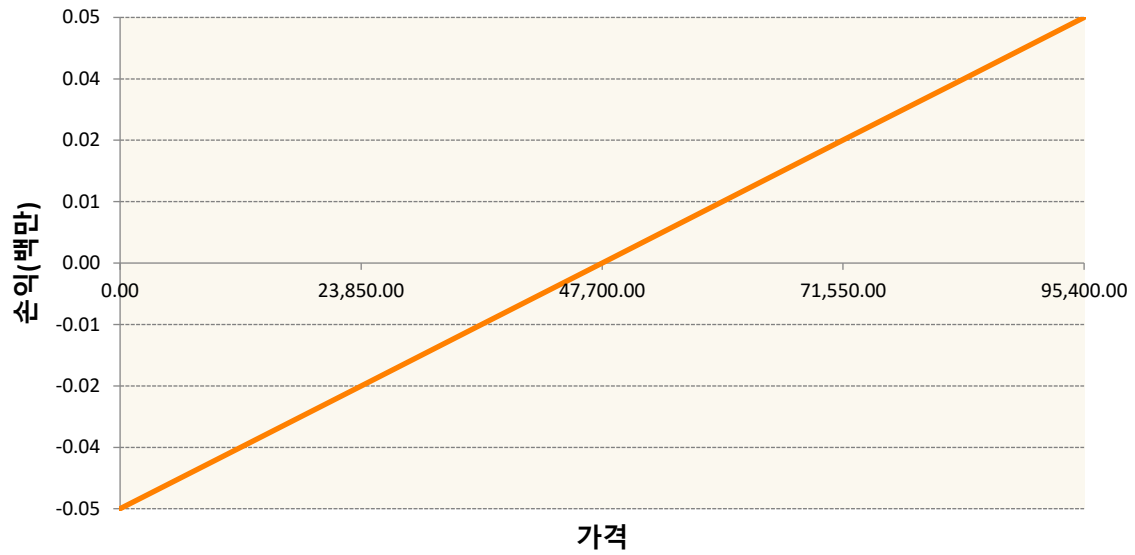
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



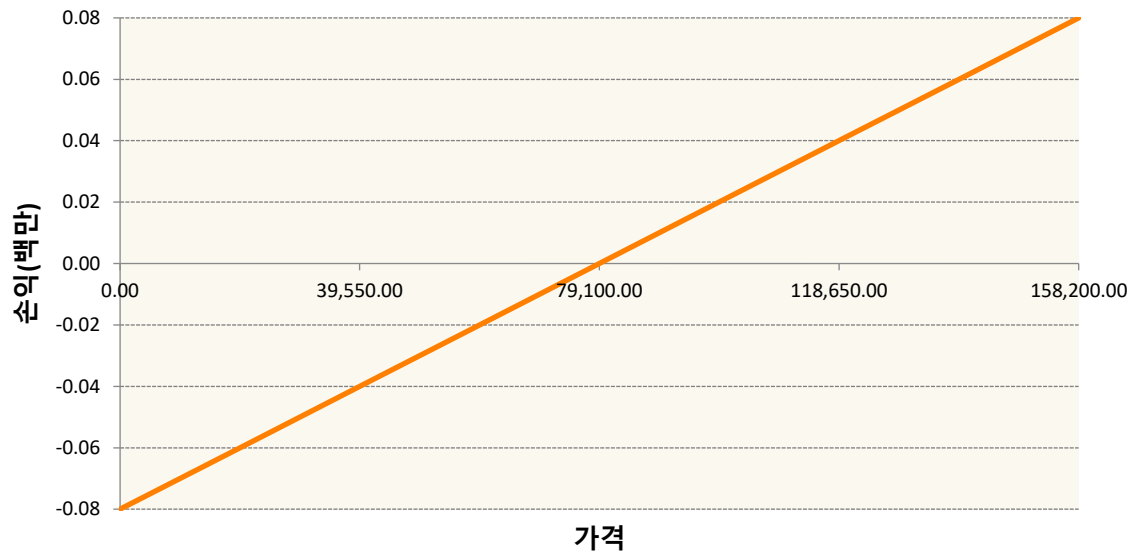
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



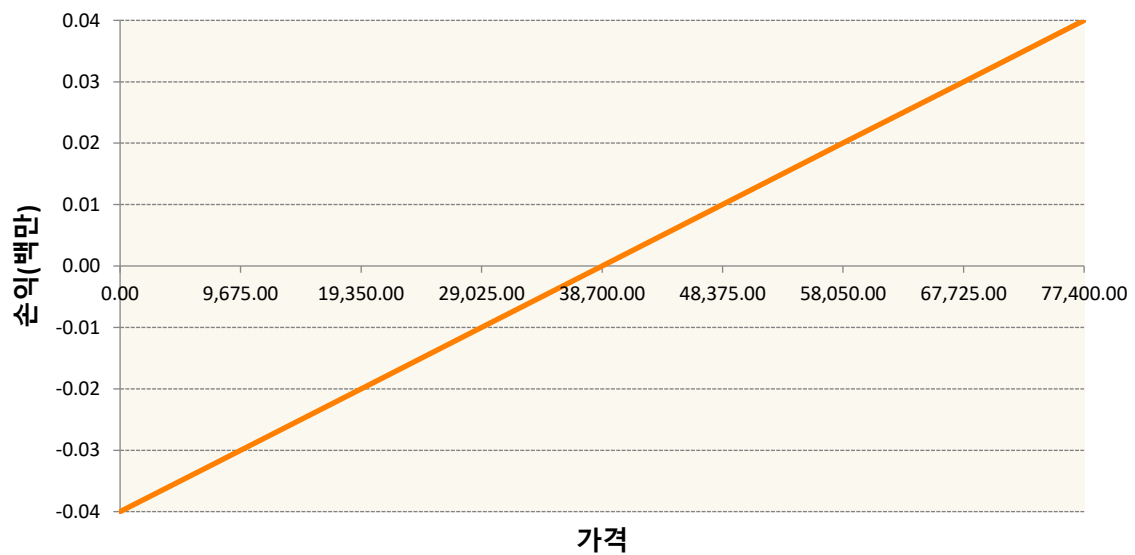
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



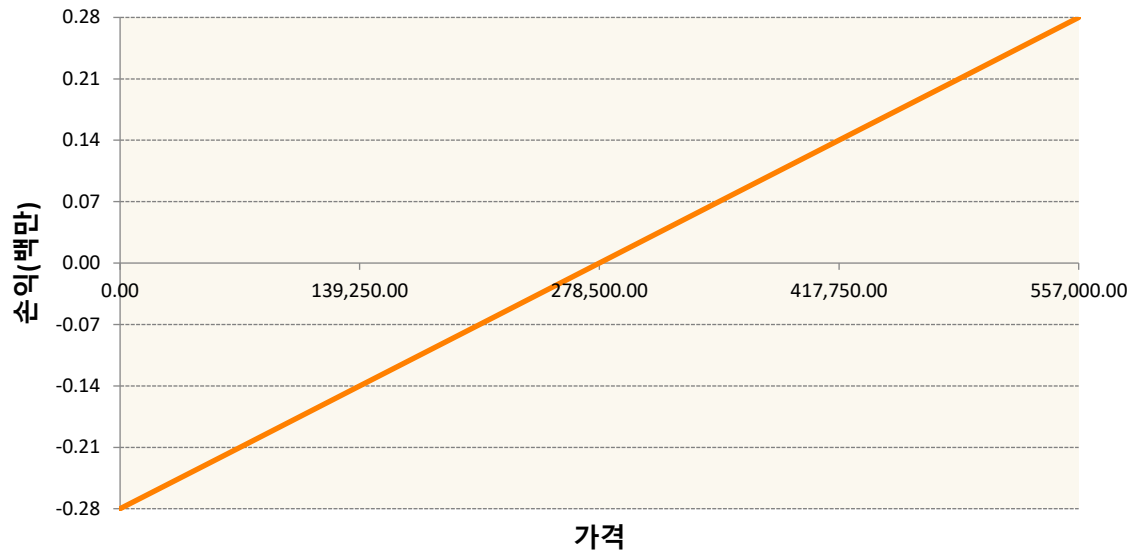
KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W30003			2025-03 코스피200지수선물				73
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-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%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	73	73	73	73	73	73	73
KR41BBW20000			2025-02 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
KR41BJW20003			2025-02 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

KR41CNW20003 2025-02 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
-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

KR41CRW20004 2025-02 LG생활건강개별선물 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

KR41CXW20002 2025-02 한미약품개별선물 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%	-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%	2	2	2	2	2	2	2

KR41DAW20008 2025-02 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

KR41F9W20001 2025-02 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
KR41FMW20008 2025-02 엘앤에프개별선물							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%	-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%	2	2	2	2	2	2	2
KR41G0W20009 2025-02 씨에스원드개별선물							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
KR41GTW20001 2025-02 두산개별선물							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%	-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%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

103

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

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

272

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

459

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

유로인덱스모(주식-파생형)

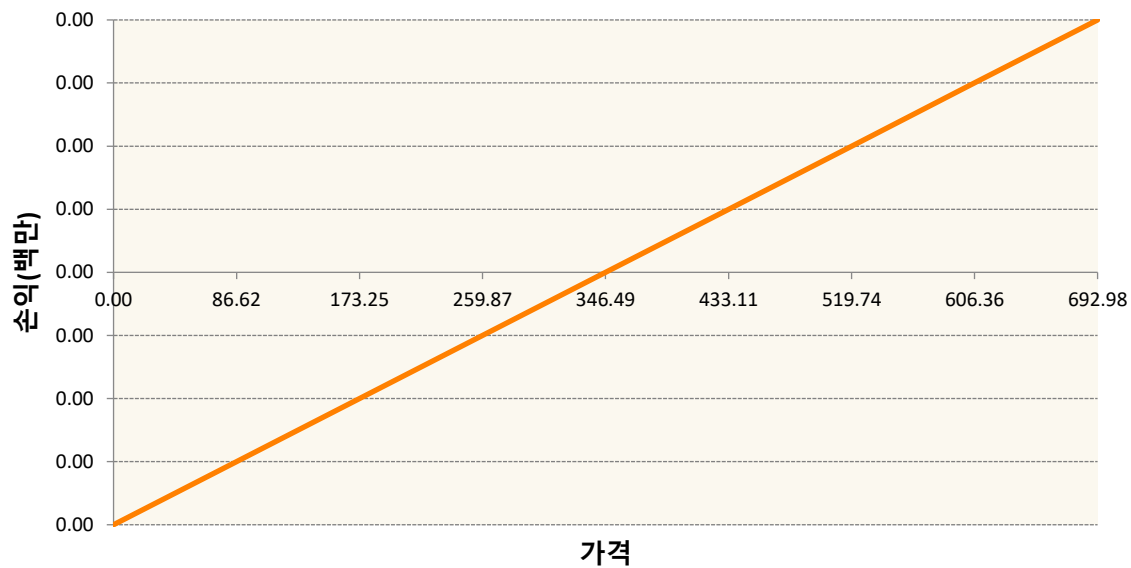
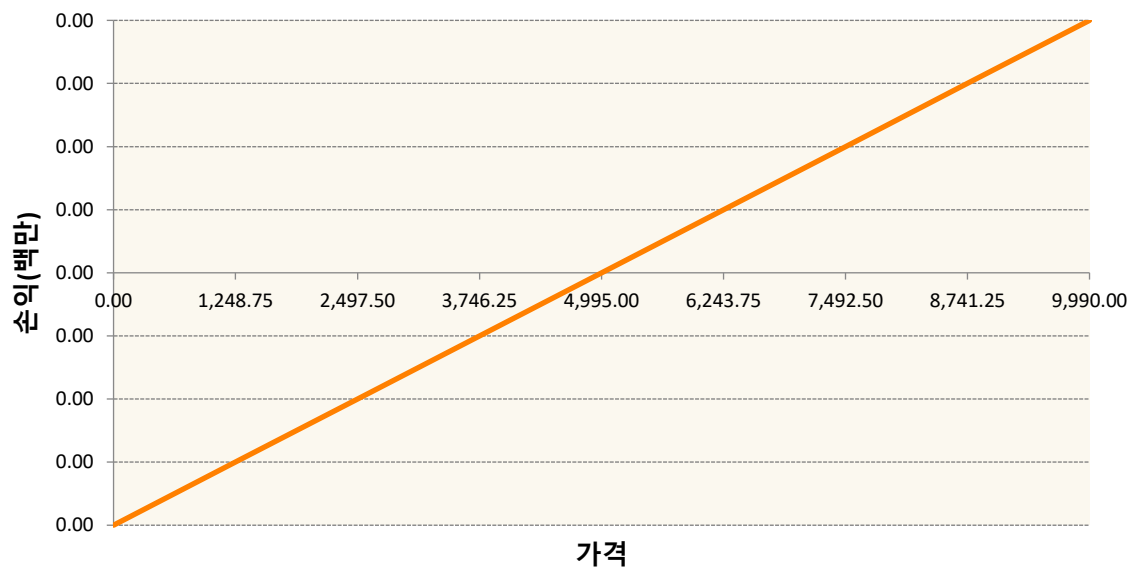
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	905	0	905	

2. 만기시점의 손익구조

ES06445809T5-IBERDROLA SA RTS (JAN2025) ORD NPV

**VGH5-EURO STOXX 50 Mar25**

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ES06445809` IBERDROLA SA RTS (JAN2025) ORD NPV		0.11
VGH5 EURO STOXX 50 Mar25		72

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	48

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

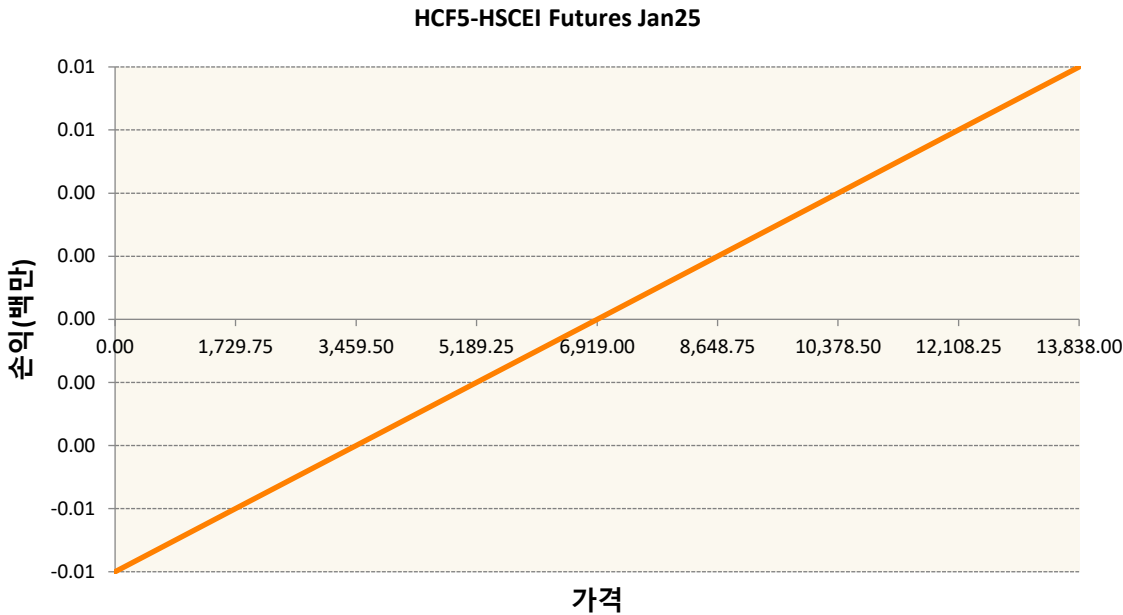
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,427	0	1,427	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	HSCEI Futures Jan25	114
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

153

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

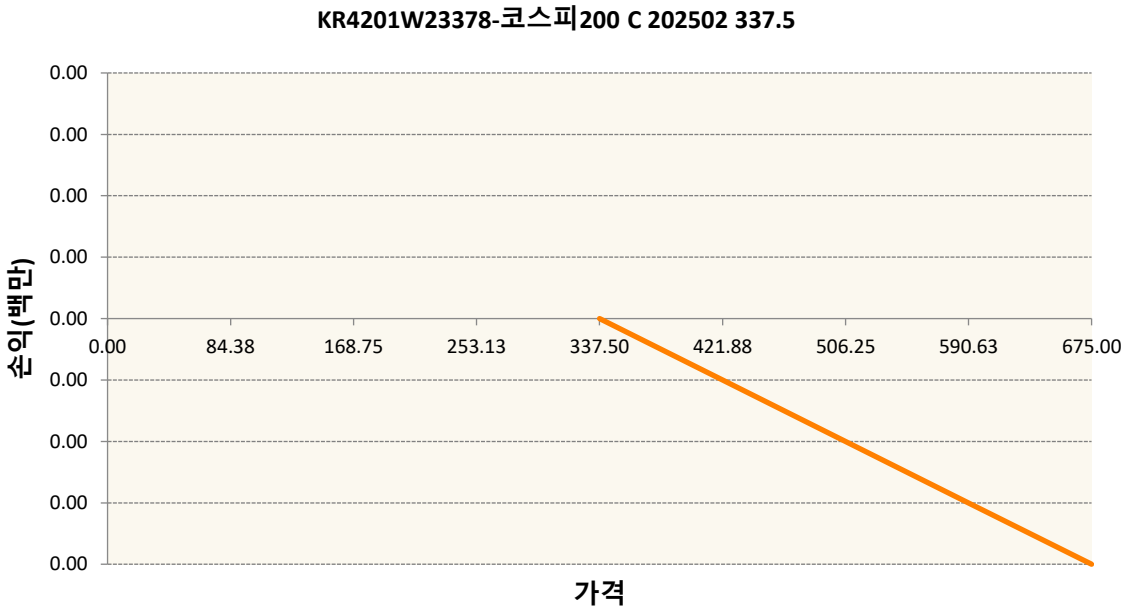
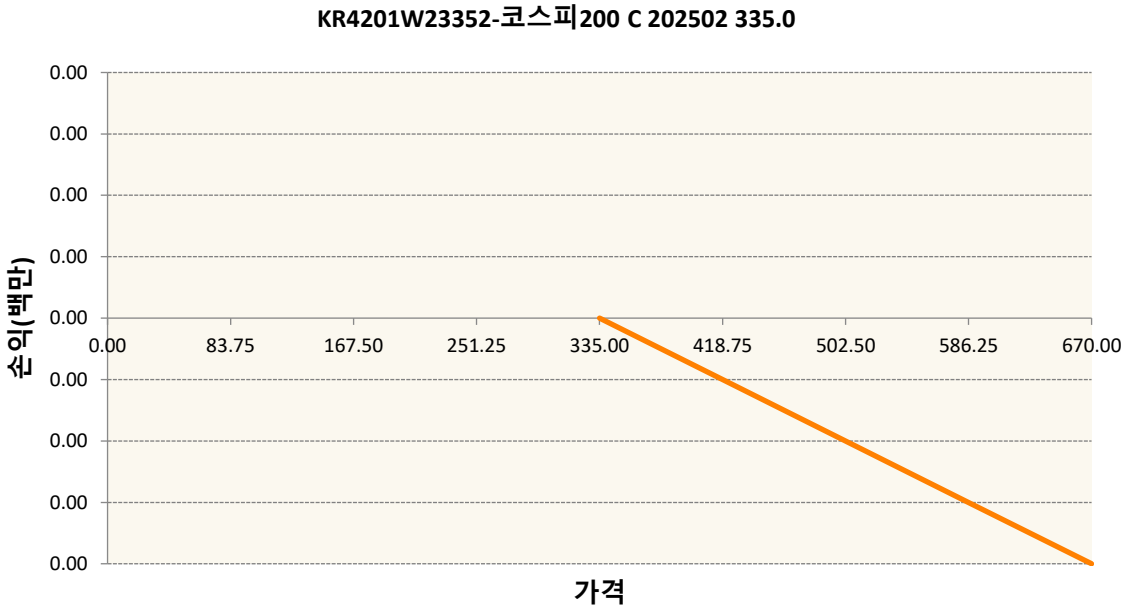
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

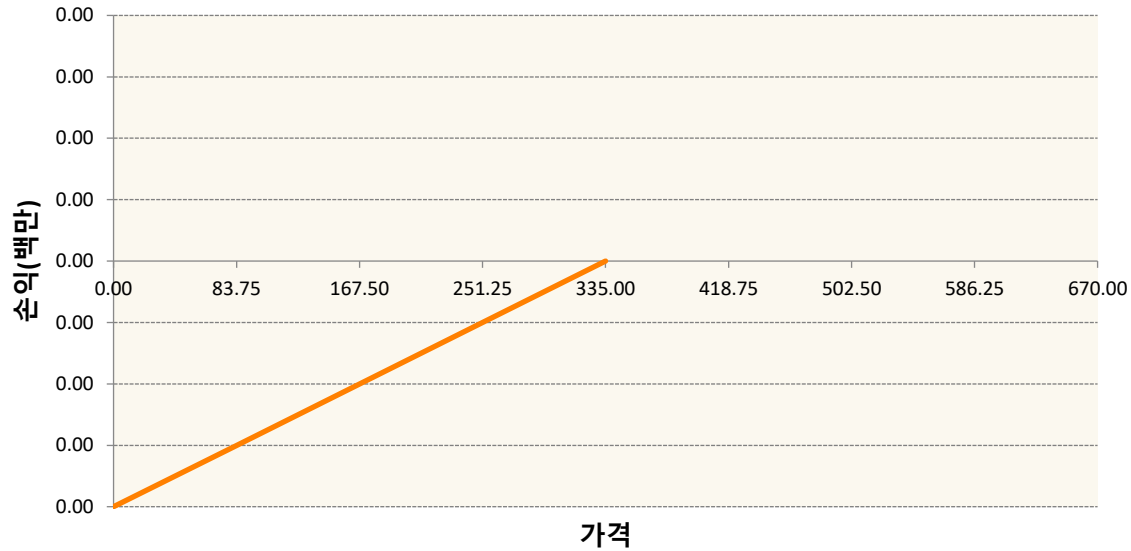
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	510	-510	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,901	-37,901	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301W23350-코스피200 P 202502 335.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201W23352 코스피200 C 202502 335.0							1,383
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	522	510	493	473	450	423	394
-5.33%	480	453	422	388	351	312	271
-2.67%	374	330	284	237	188	137	87
0%	169	113	57	0	-57	-114	-171
2.67%	-159	-216	-273	-331	-388	-446	-504
5.33%	-606	-653	-702	-753	-804	-857	-911
8.00%	-1,145	-1,177	-1,213	-1,252	-1,293	-1,337	-1,383
KR4201W23378 코스피200 C 202502 337.5							332
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	115	112	109	105	99	93	87
-5.33%	107	101	94	86	78	69	59
-2.67%	85	75	65	53	42	30	17
0%	41	28	14	0	-14	-28	-42
2.67%	-32	-47	-62	-77	-91	-106	-121
5.33%	-137	-150	-163	-176	-190	-204	-218
8.00%	-266	-276	-286	-297	-308	-320	-332
KR4301W23350 코스피200 P 202502 335.0							441
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-405	-408	-413	-419	-425	-433	-441
-5.33%	-232	-240	-249	-258	-269	-280	-292
-2.67%	-78	-90	-103	-117	-131	-145	-160
0%	48	32	16	0	-16	-32	-49

2.67%	139	123	107	90	74	57	41
5.33%	196	183	169	154	139	124	109
8.00%	227	218	207	196	184	172	159

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,008

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

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	666	0	666	

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	2025-01-14
기준일	2025-01-13

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	4,398	0	4,398	

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	2025-01-14
기준일	2025-01-13

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	12,994	0	12,994	
누계	통화	선도	0	13,384	-13,384	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E		218
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E		571
FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E		262
FXW213F17C KRW/USD 31-01-25E		20
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	440

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

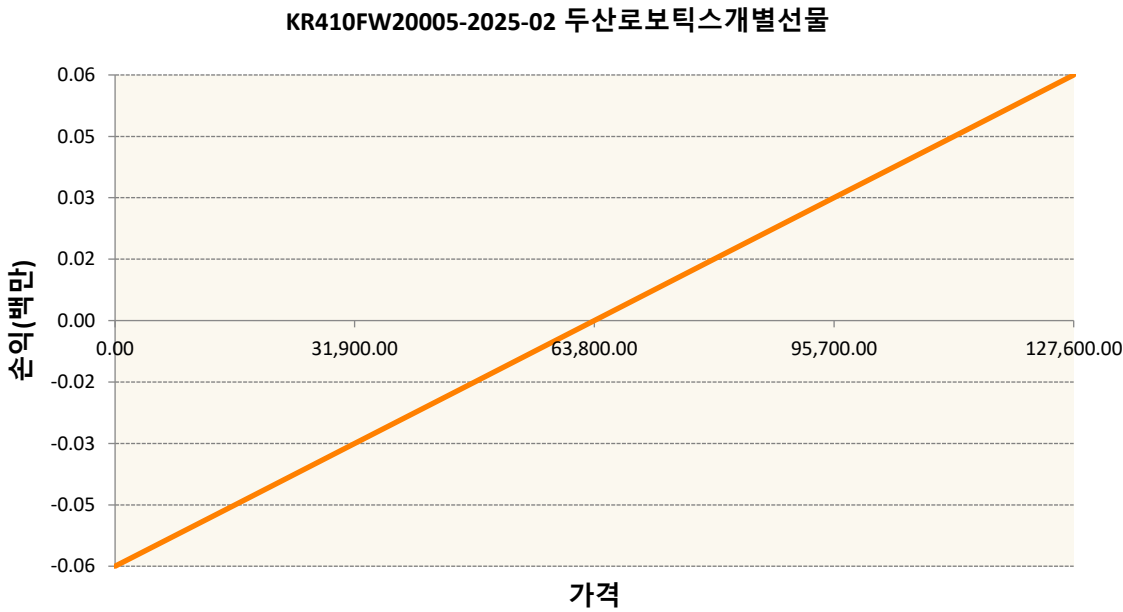
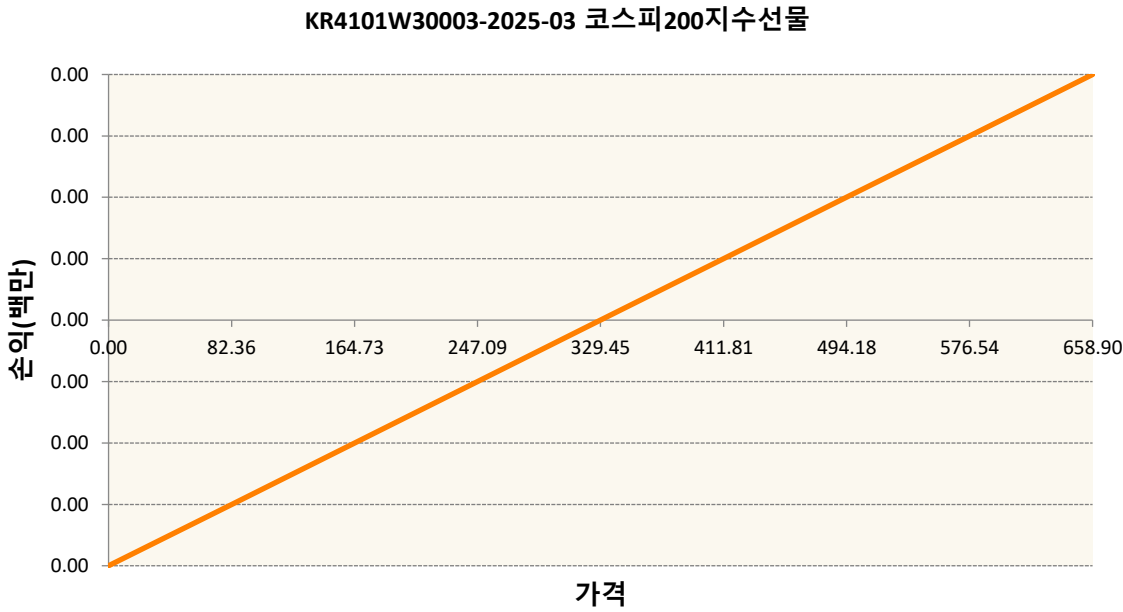
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

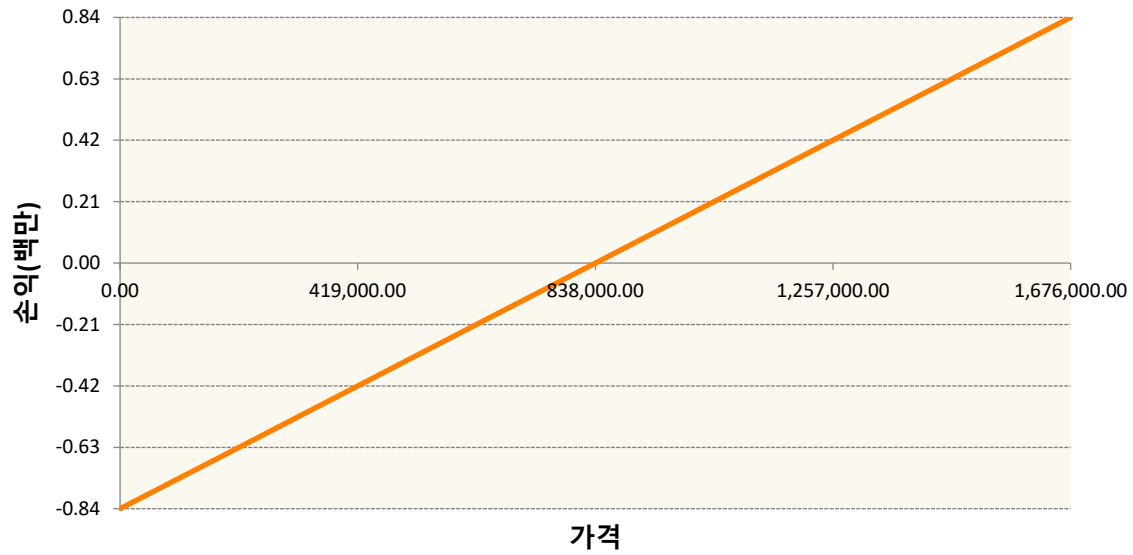
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	21	0	21	장내
누계	유가증권	선물	774	0	774	장내

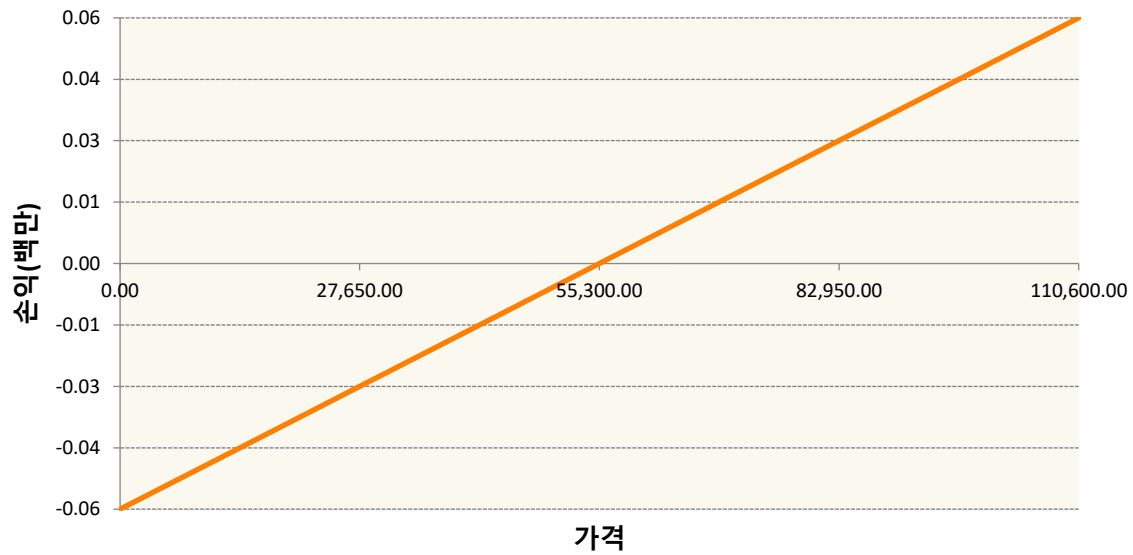
2. 만기시점의 손익구조



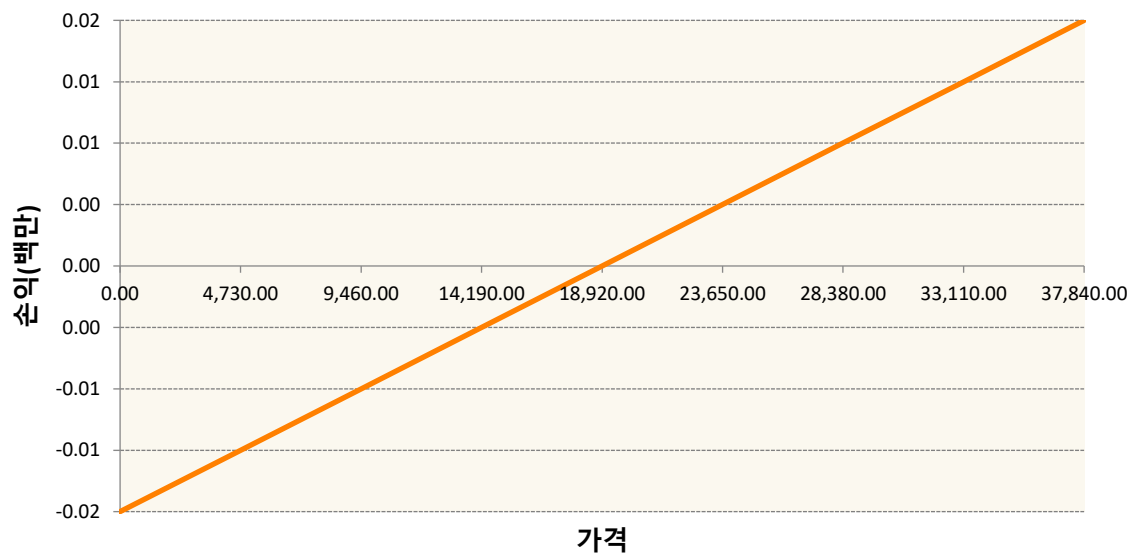
KR41B3W20008-2025-02 고려아연개별선물



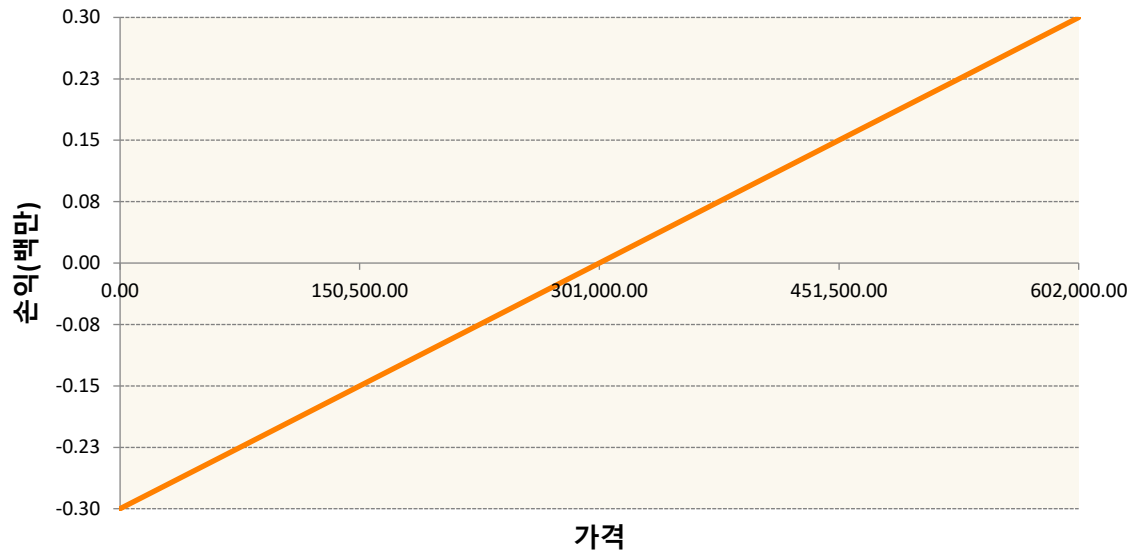
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



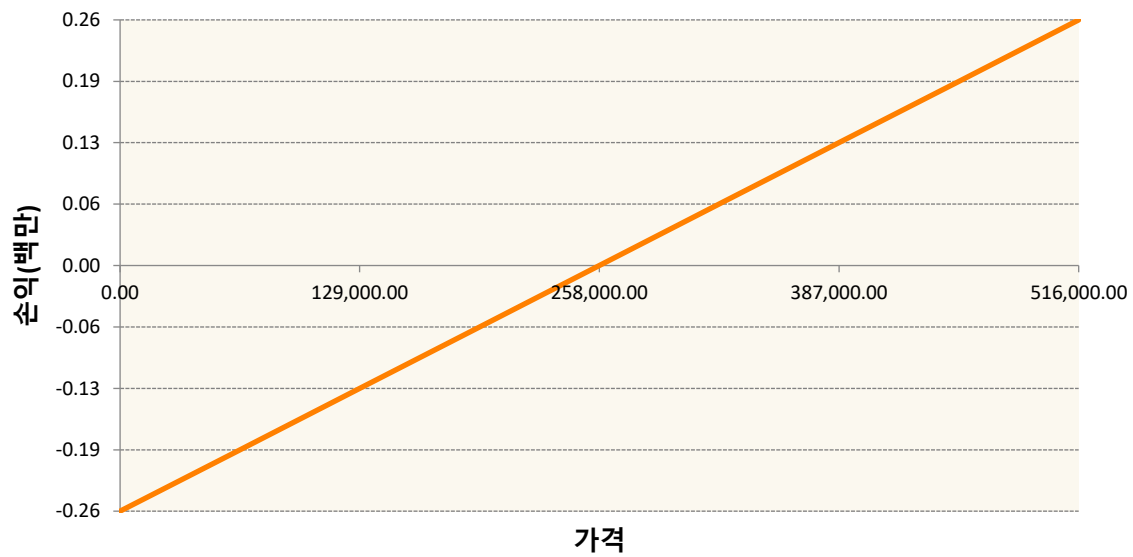
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



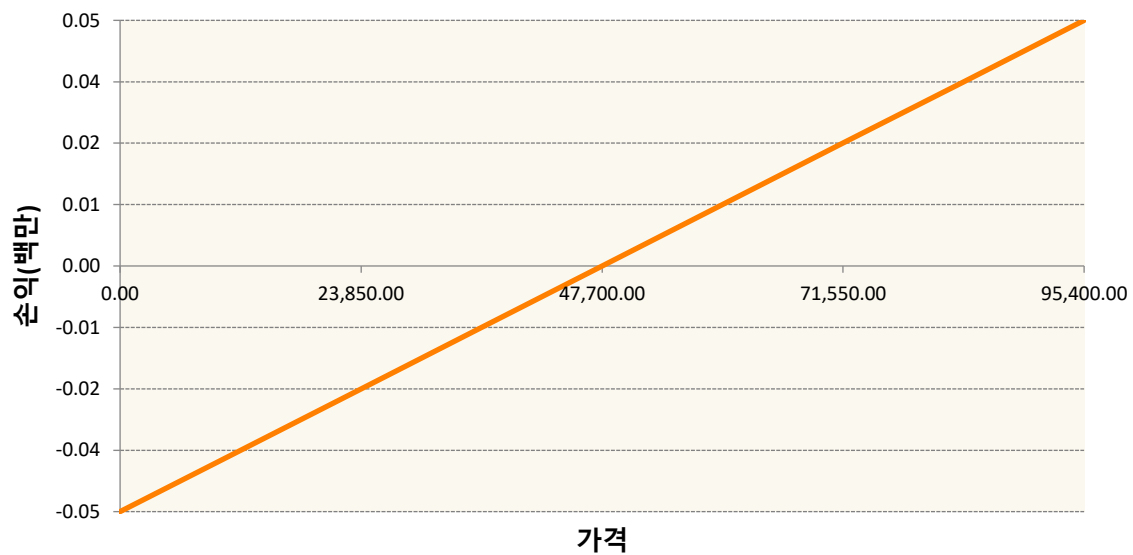
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



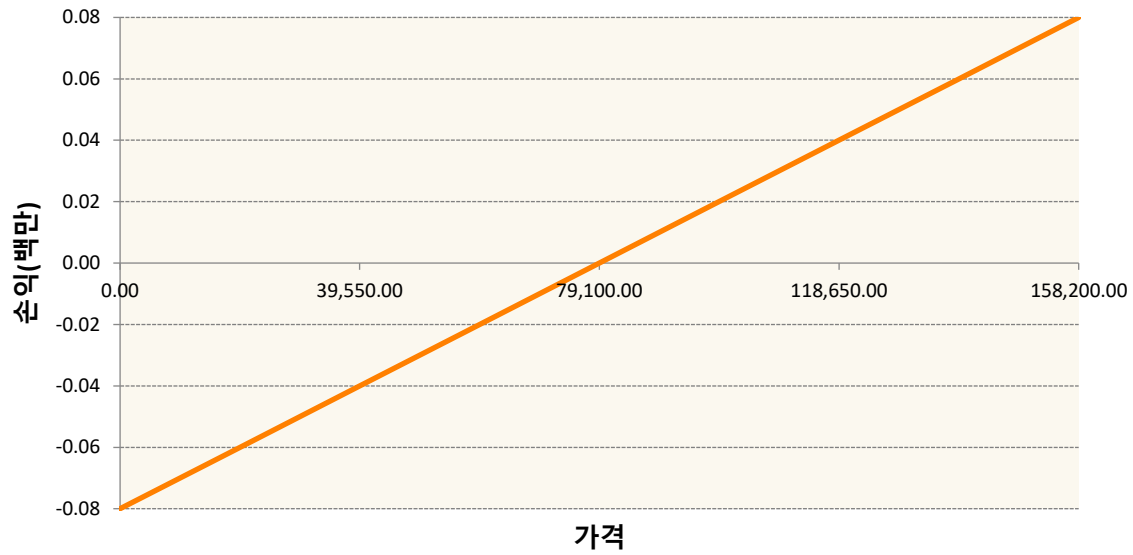
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



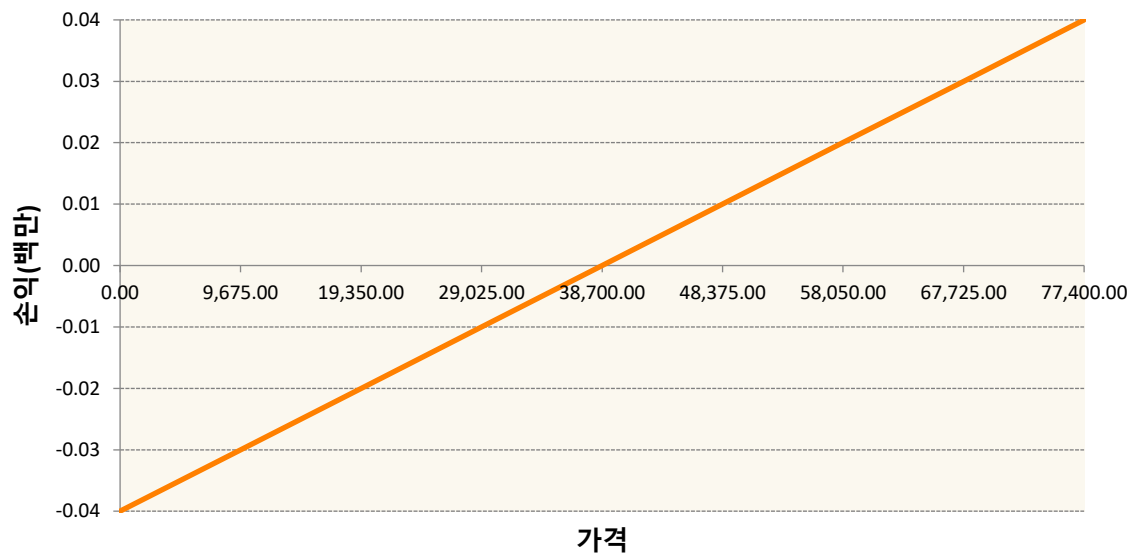
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



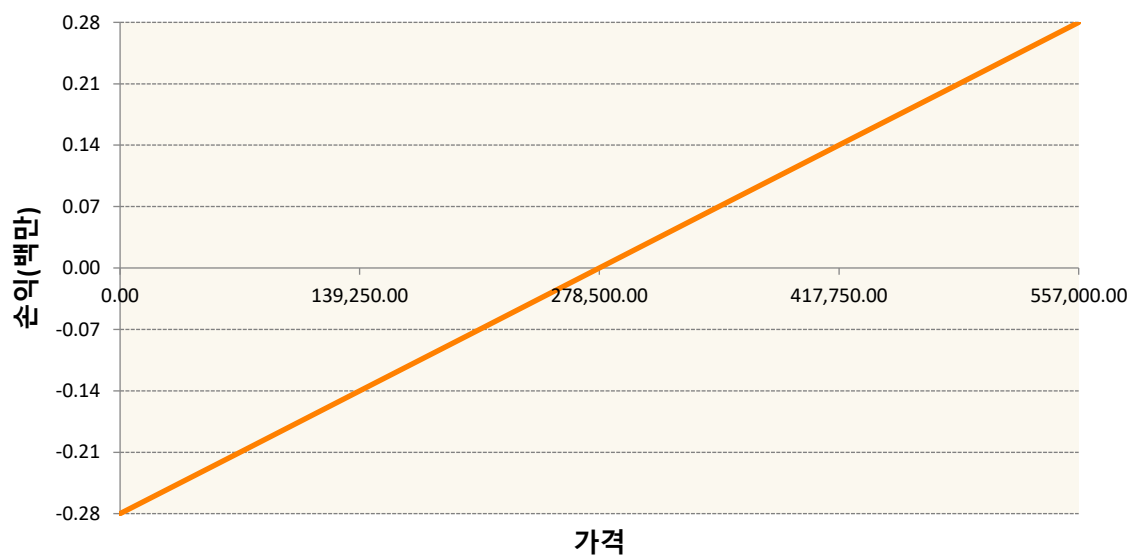
KR41FMW20008-2025-02 엘애프개별선물



KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30003

2025-03 코스피200지수선물

53

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

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
-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

KR41BBW20000

2025-02 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%	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

KR41CNW20003

2025-02 포스코DX개별선물

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

KR41CRW20004

2025-02 LG생활건강개별선물

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

KR41CXW20002

2025-02 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

KR41F9W20001

2025-02 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

KR41FMW20008

2025-02 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

KR41G0W20009

2025-02 씨에스원드개별선물

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
KR41GTW20001 2025-02 두산개별선물							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

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

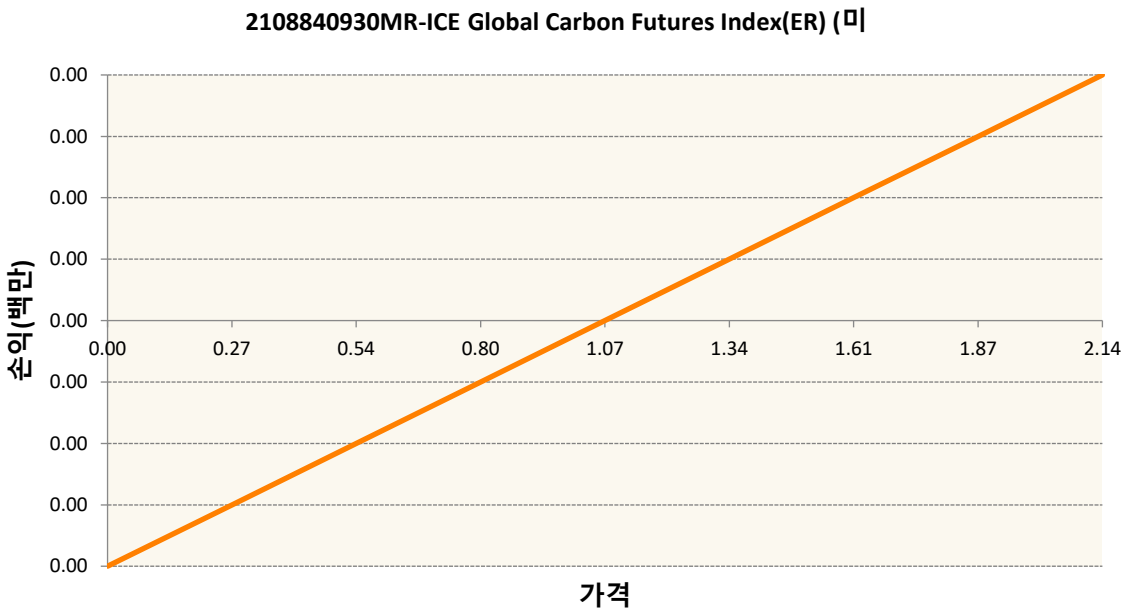
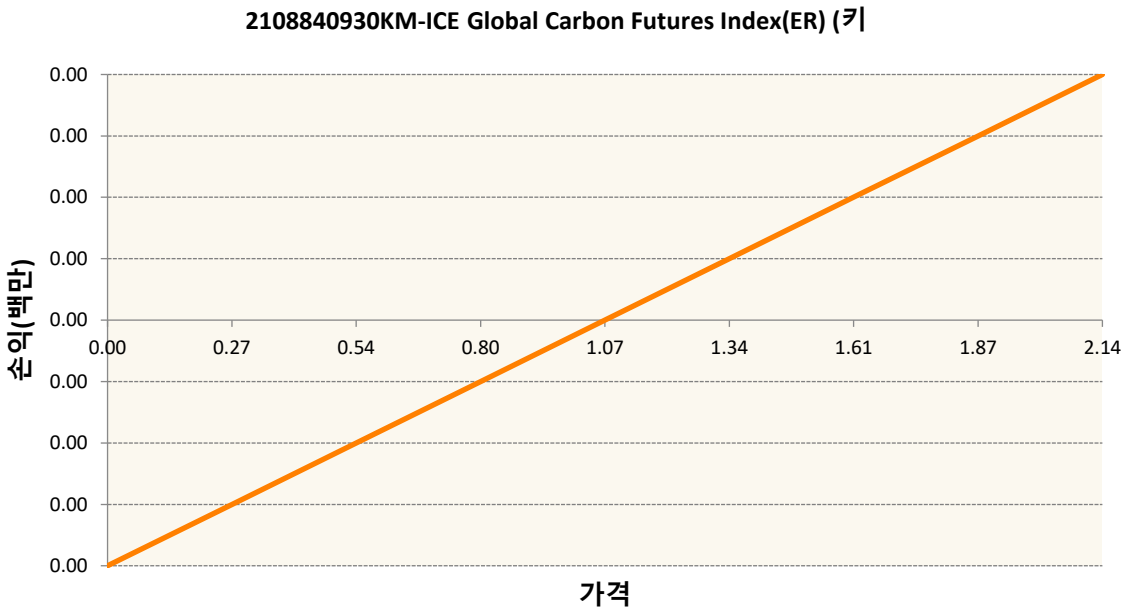
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

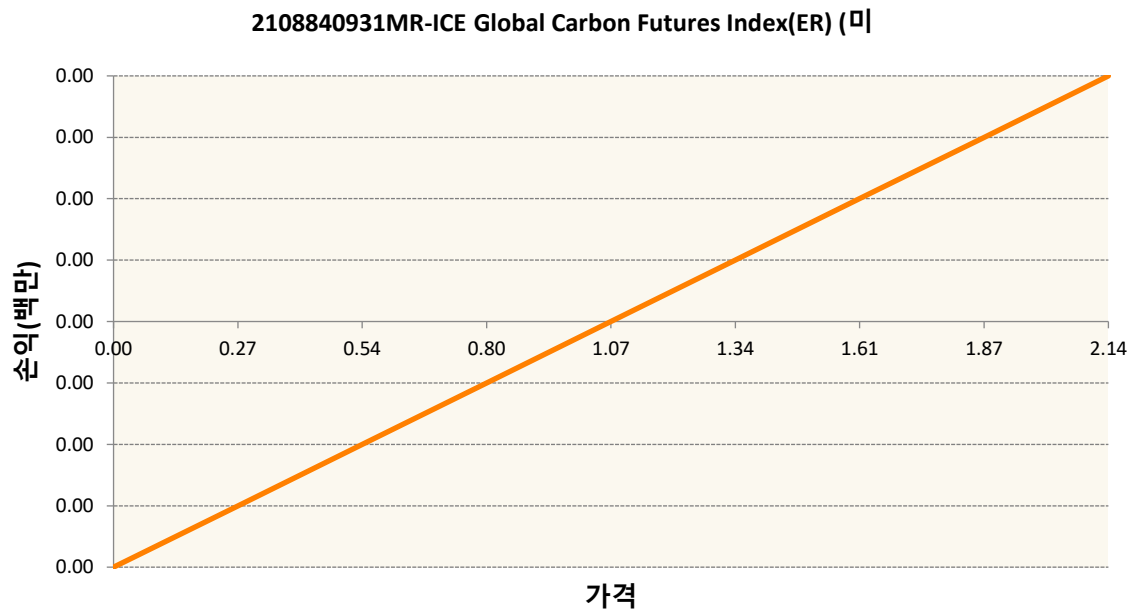
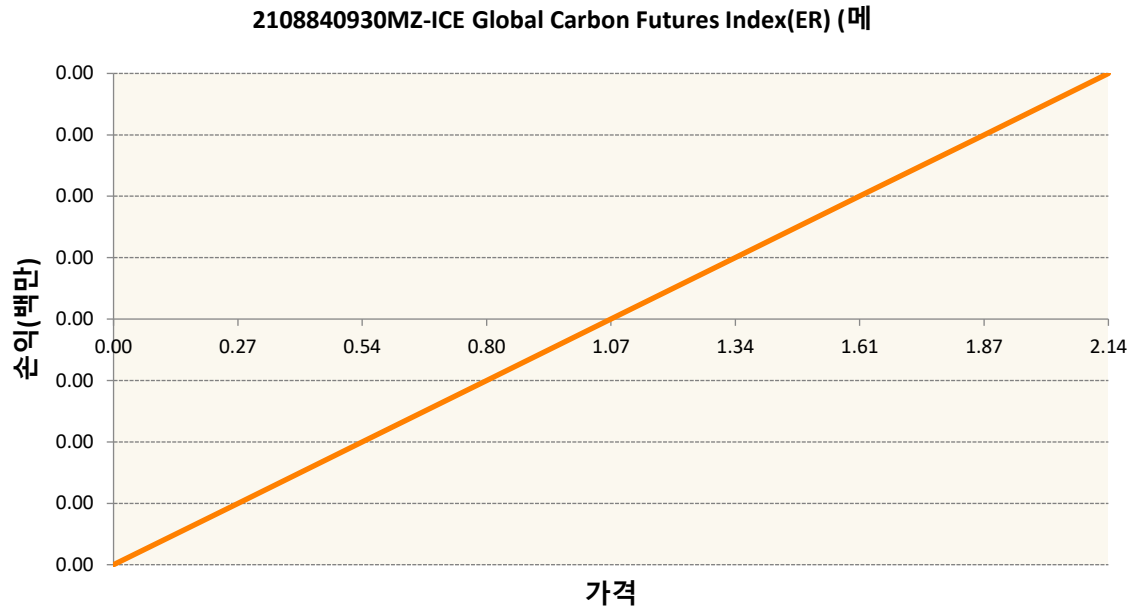
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,960	0	11,960	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		96
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		481
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		192
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		192

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,030

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

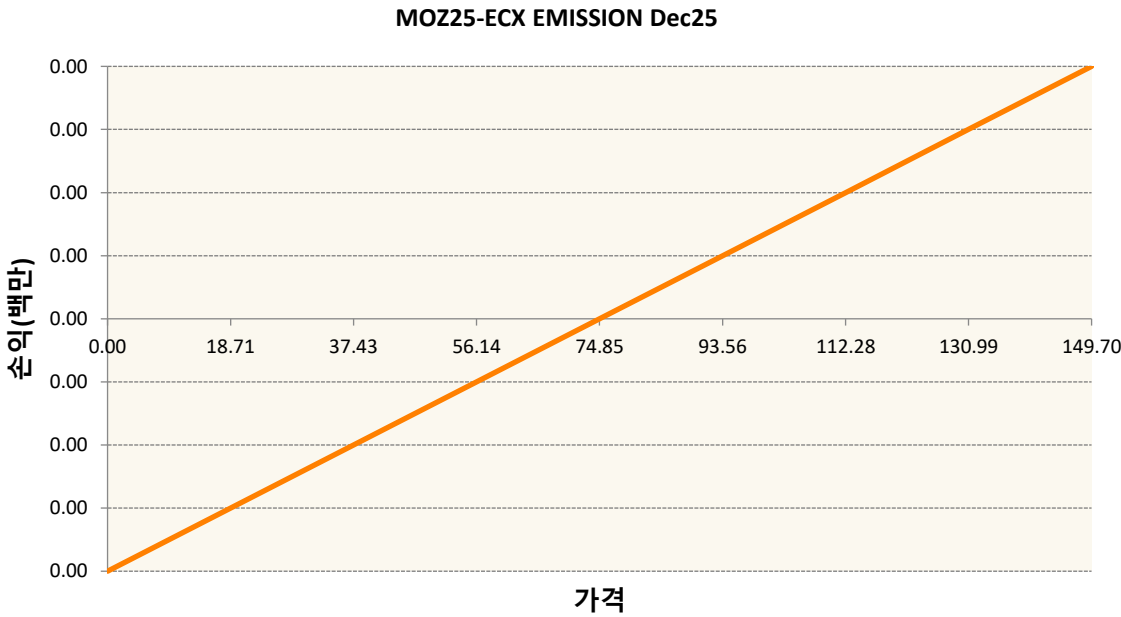
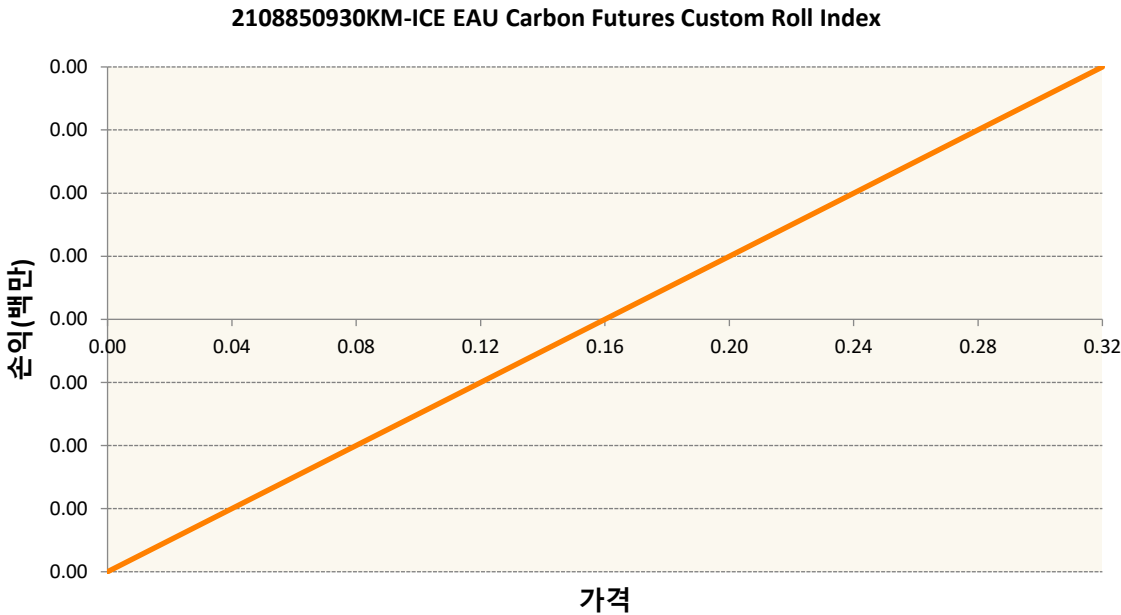
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,434	0	9,434	
누계	통화	선도	0	2,054	-2,054	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	4
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	164
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	750

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

1,359

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

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)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	10

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

(단위:백만원)

58

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

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)	0.44
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	0.38
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.11

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

(단위:백만원)

2

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

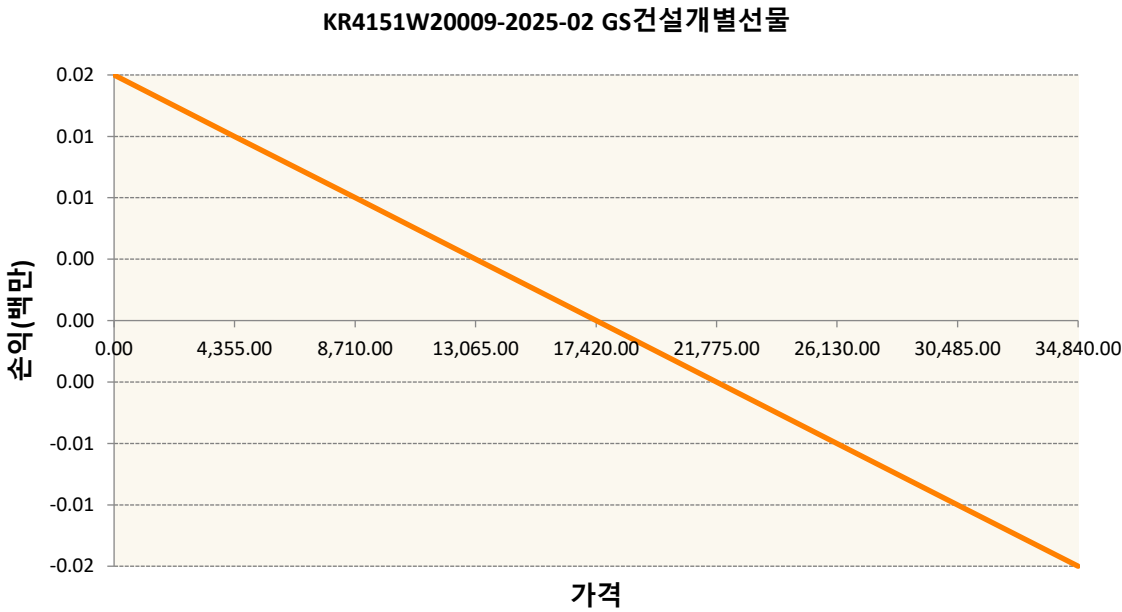
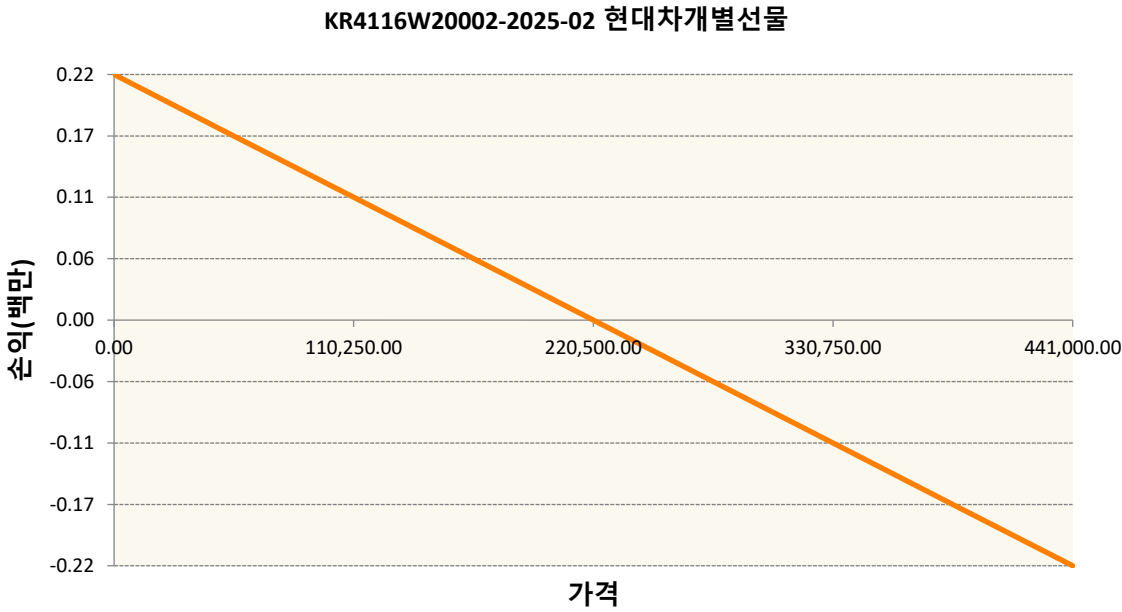
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

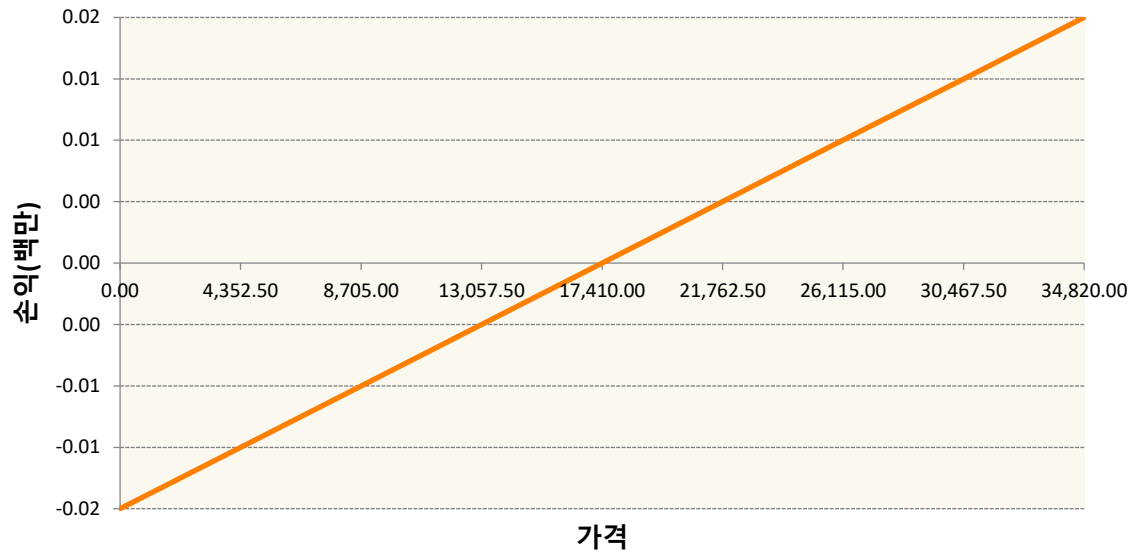
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4	15	-11	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4116W20(2025-02 현대차개별선물
KR4151W20(2025-02 GS건설개별선물
KR41ETW20(2025-02 삼성E&A개별선물

1
1
0.33

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

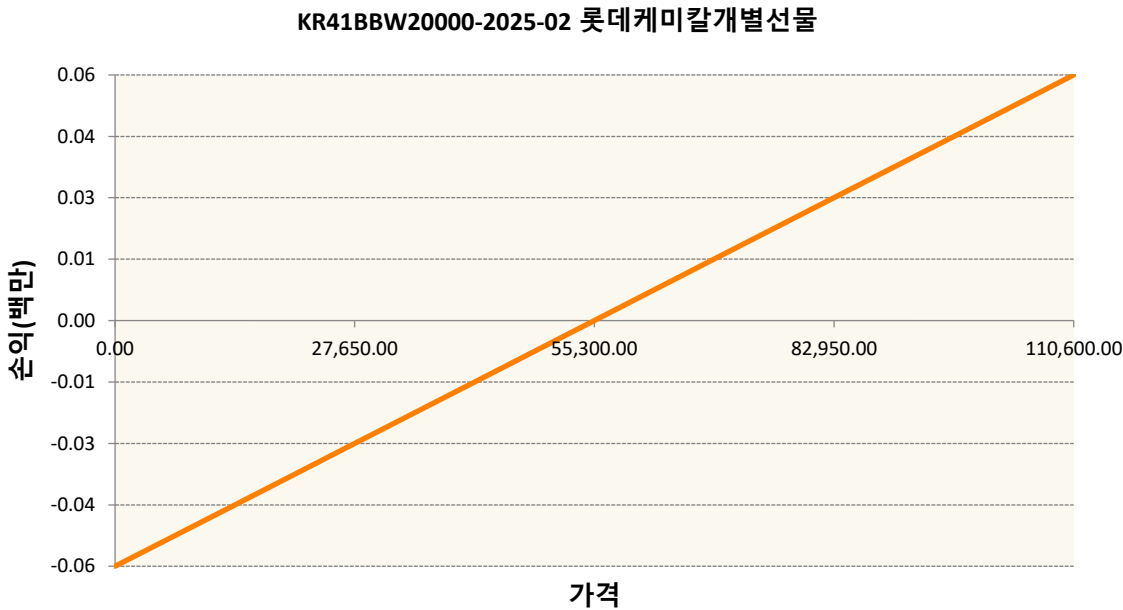
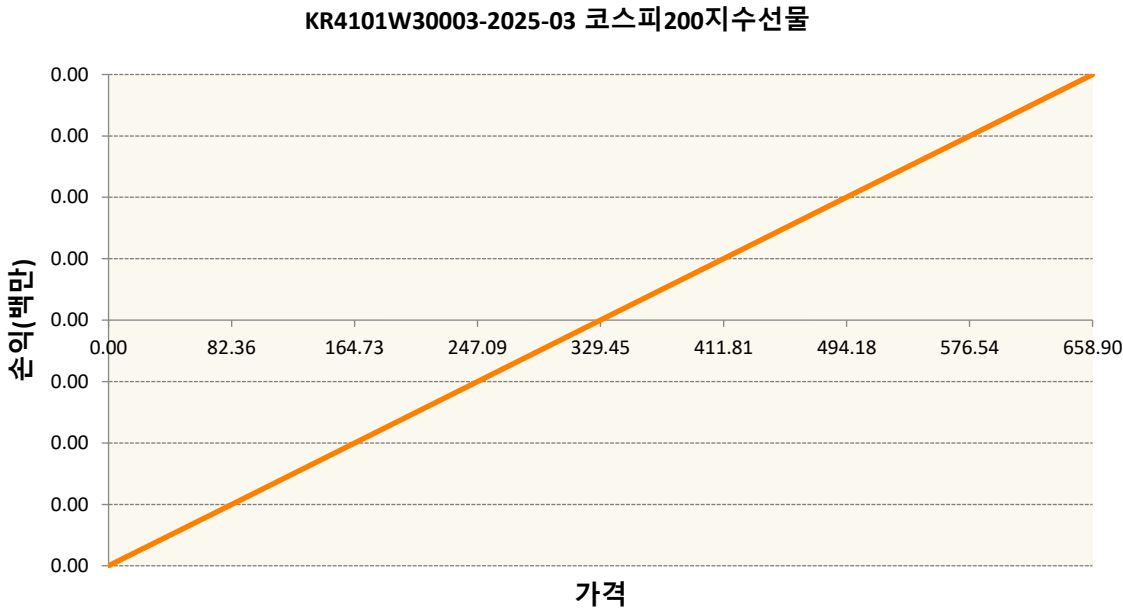
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

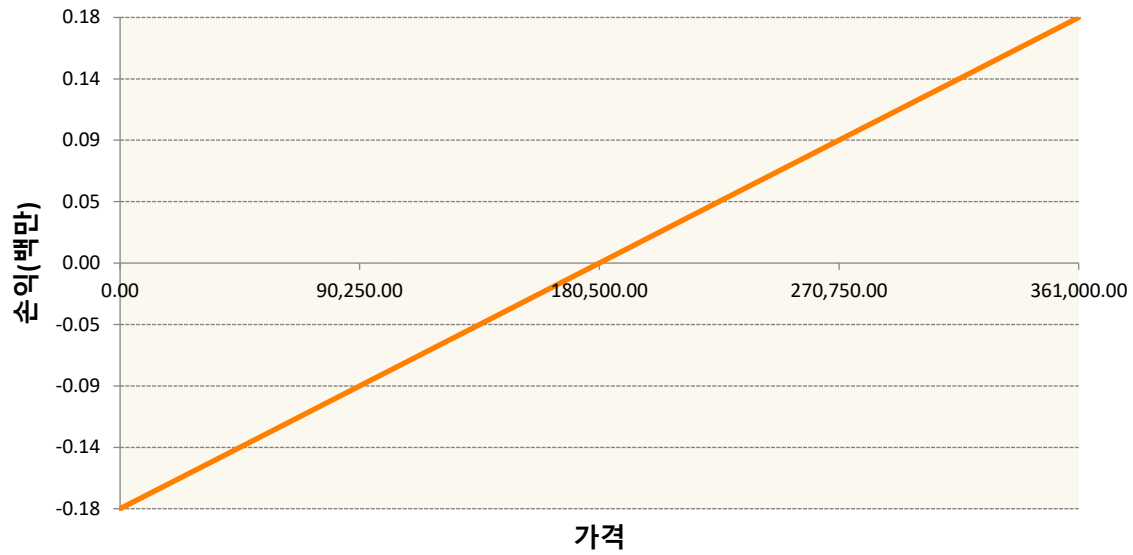
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,246	0	2,246	장내
누계	유가증권	선물	9,254	0	9,254	장내

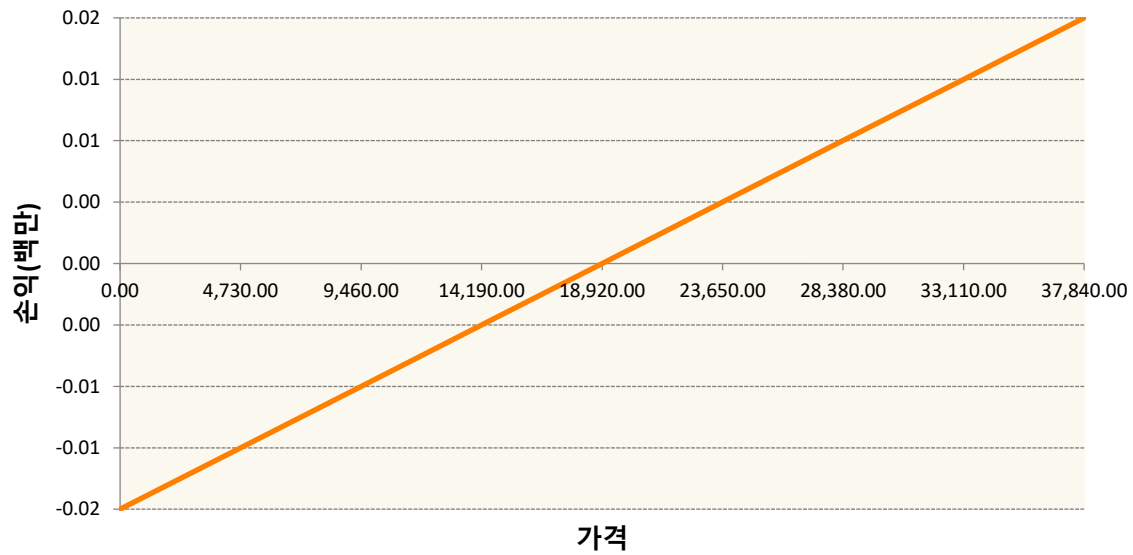
2. 만기시점의 손익구조



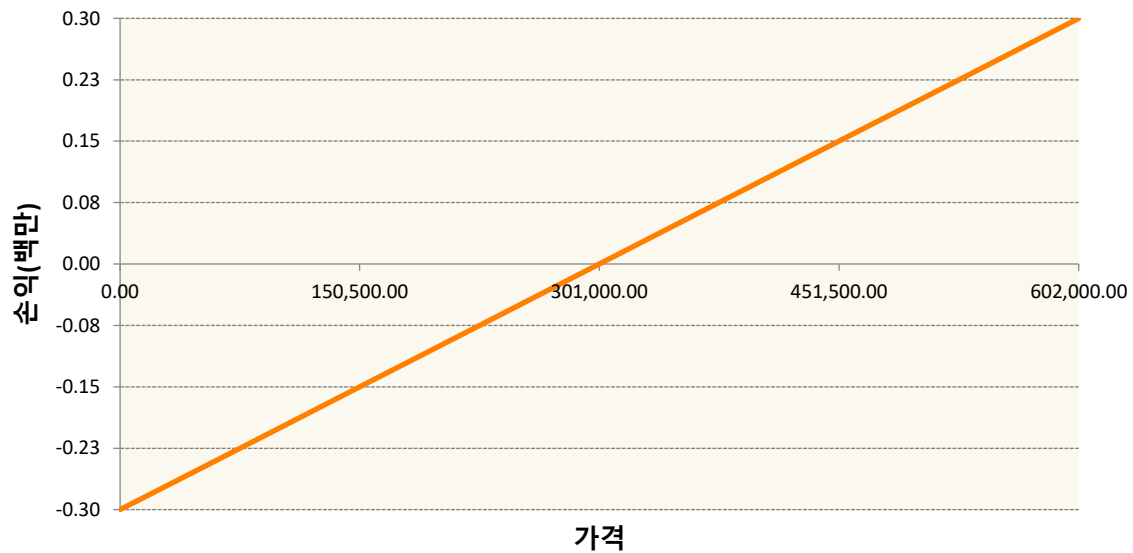
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



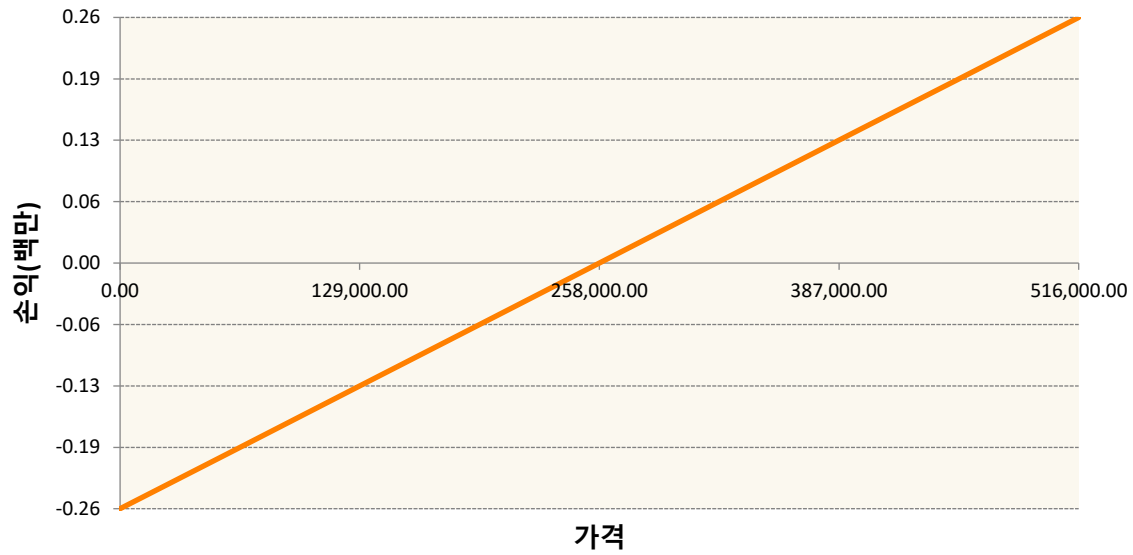
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



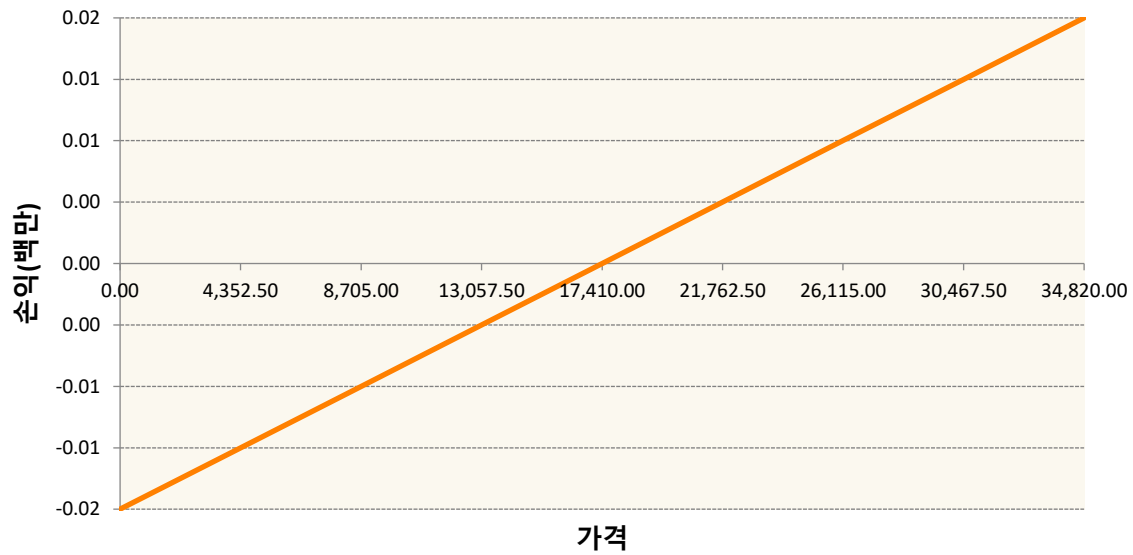
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



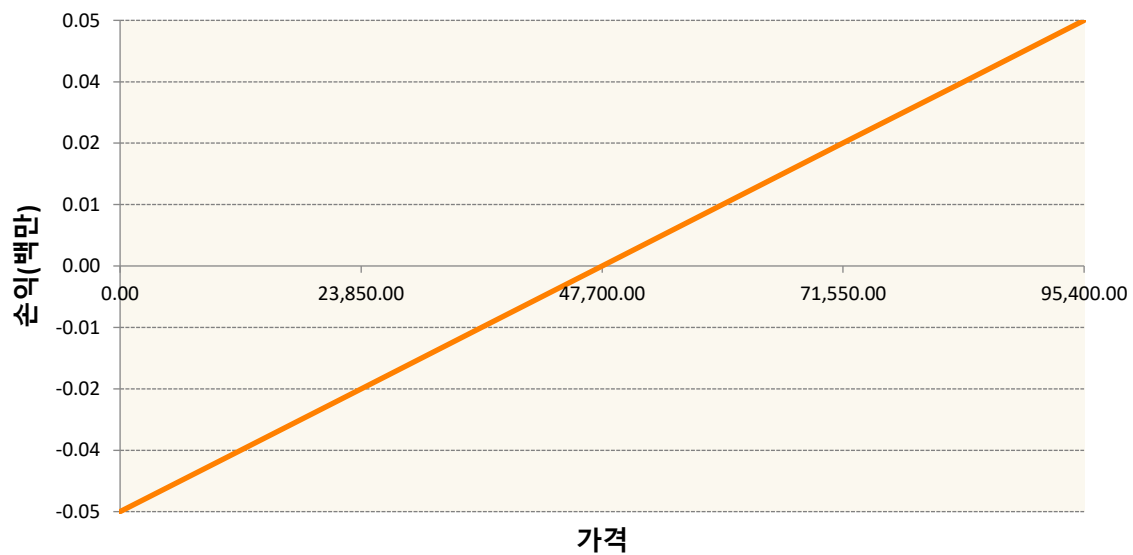
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



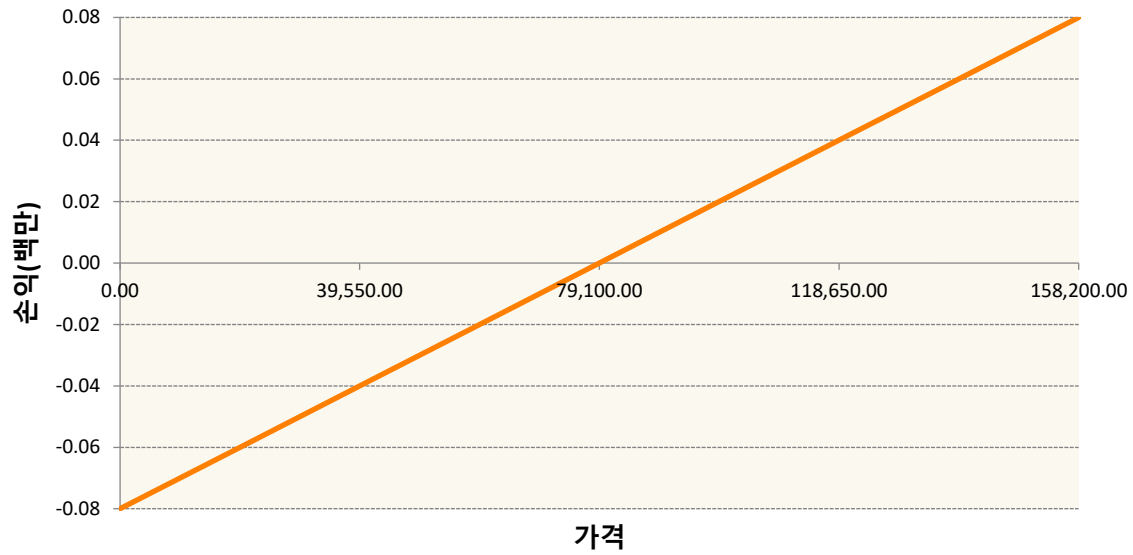
KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



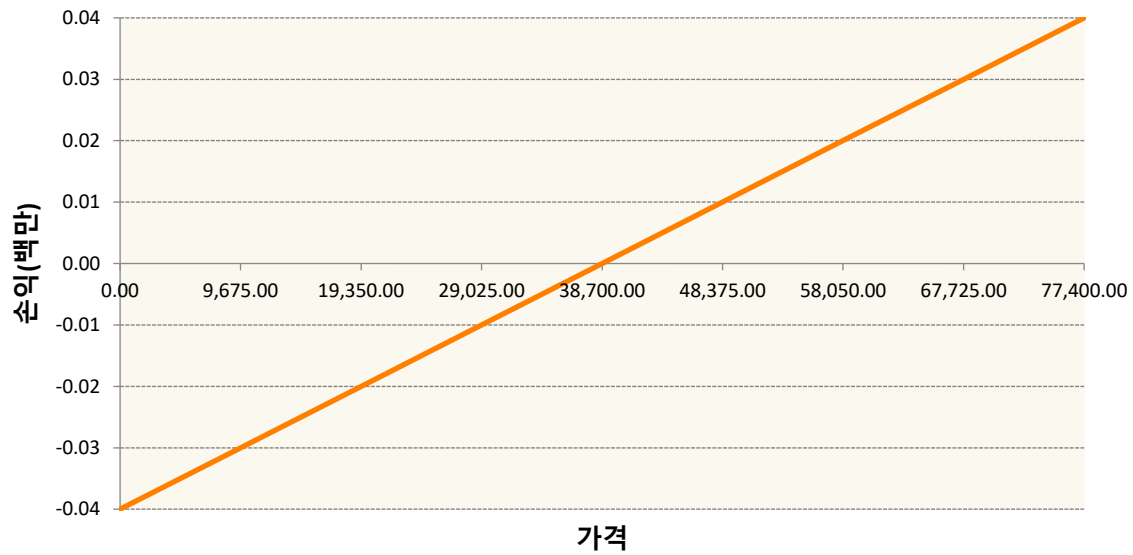
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



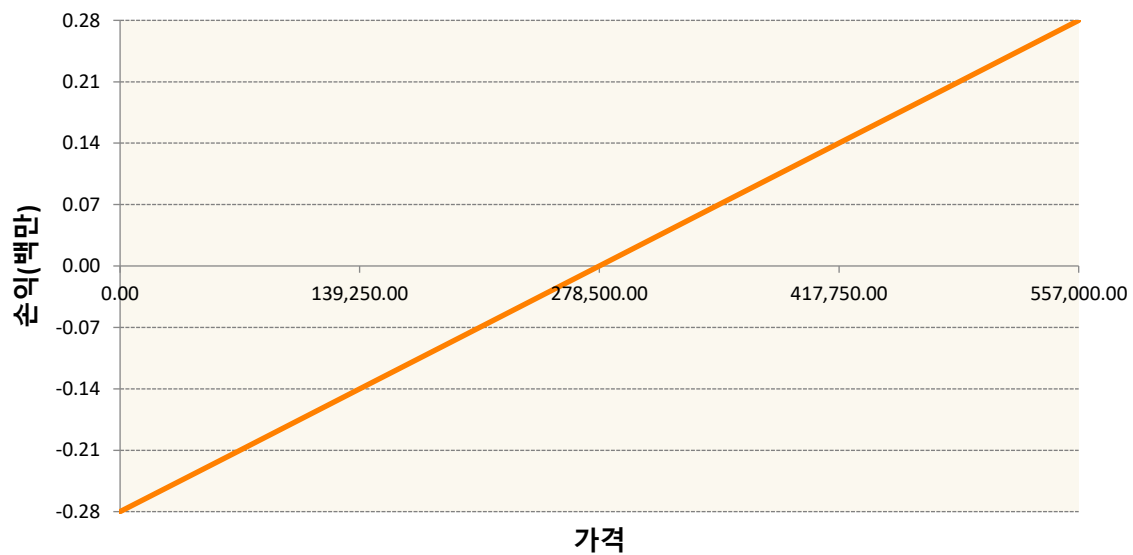
KR41FMW20008-2025-02 엘애프개별선물



KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



(단위:백만원)

KR4101W30003							2025-03 코스피200지수선물		628	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628			
-5.33%	-418	-418	-418	-418	-418	-418	-418			
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	209	209	209	209	209	209	209			
5.33%	418	418	418	418	418	418	418			
8.00%	628	628	628	628	628	628	628			
KR41BBW20000							2025-02 롯데케미칼개별선물		11	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11			
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7			
-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%	7	7	7	7	7	7	7			
8.00%	11	11	11	11	11	11	11			
KR41BJW20003							2025-02 엔씨소프트개별선물		22	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22			
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14			
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	7	7	7	7	7	7	7			
5.33%	14	14	14	14	14	14	14			
8.00%	22	22	22	22	22	22	22			
KR41CNW20003							2025-02 포스코DX개별선물		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			
KR41CRW20004							2025-02 LG생활건강개별선물		10	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

KR41CXW20002

2025-02 한미약품개별선물

19

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

KR41ETW20006

2025-02 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

KR41F9W20001

2025-02 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%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-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%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

KR41FMW20008

2025-02 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
KR41G0W20009 2025-02 씨에스원드개별선물							9
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9
KR41GTW20001 2025-02 두산개별선물							19
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

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

(단위:백만원)

845

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

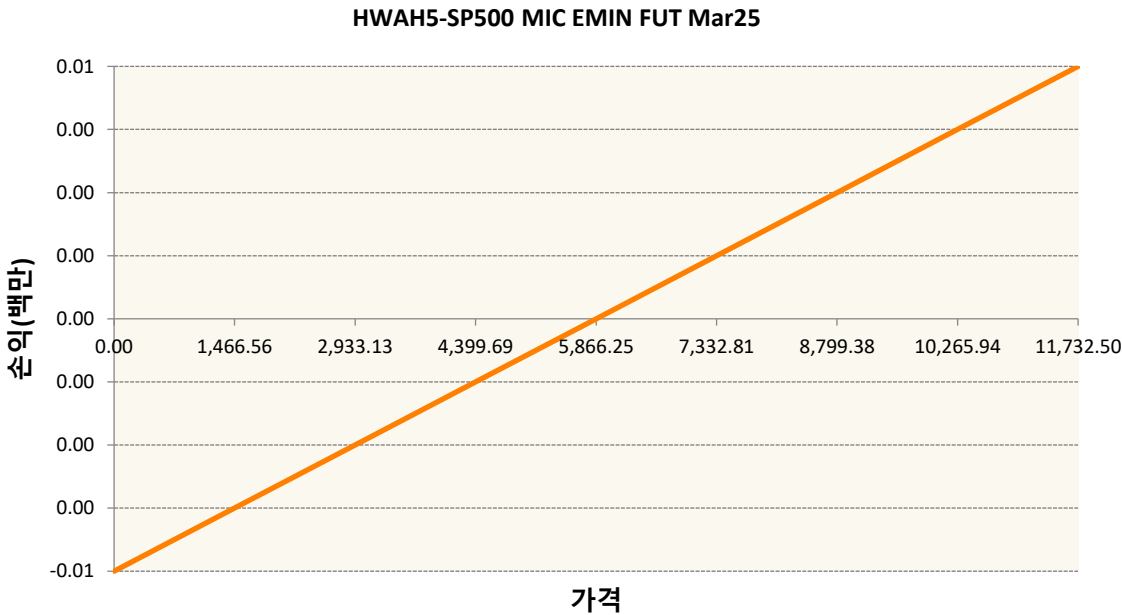
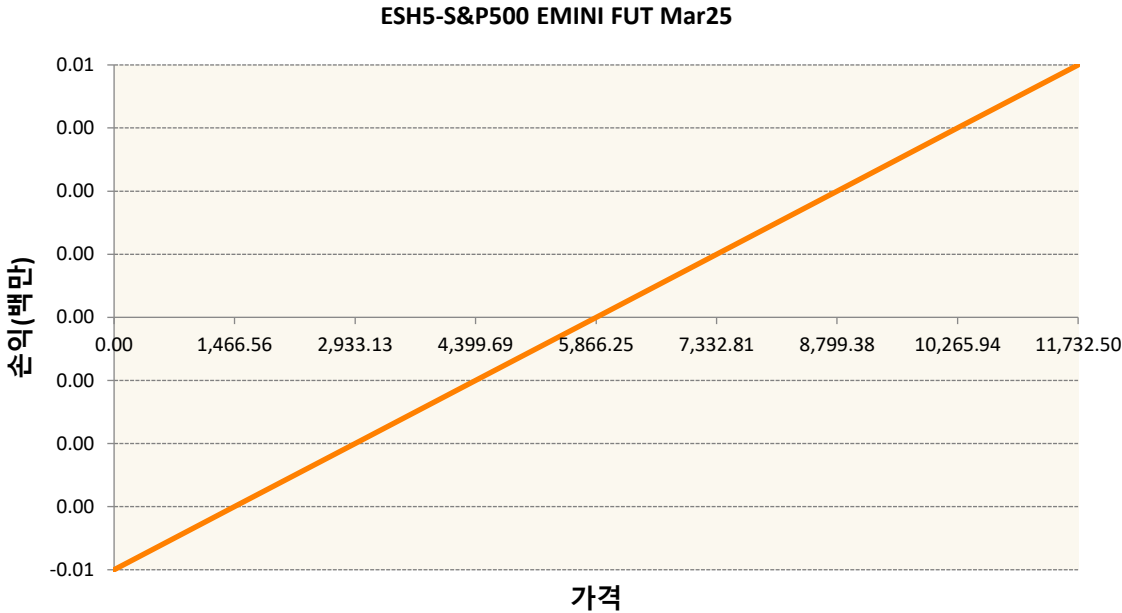
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	25,997	0	25,997	
누계	유가증권	선물	1,703	0	1,703	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,080
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	136

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,922

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

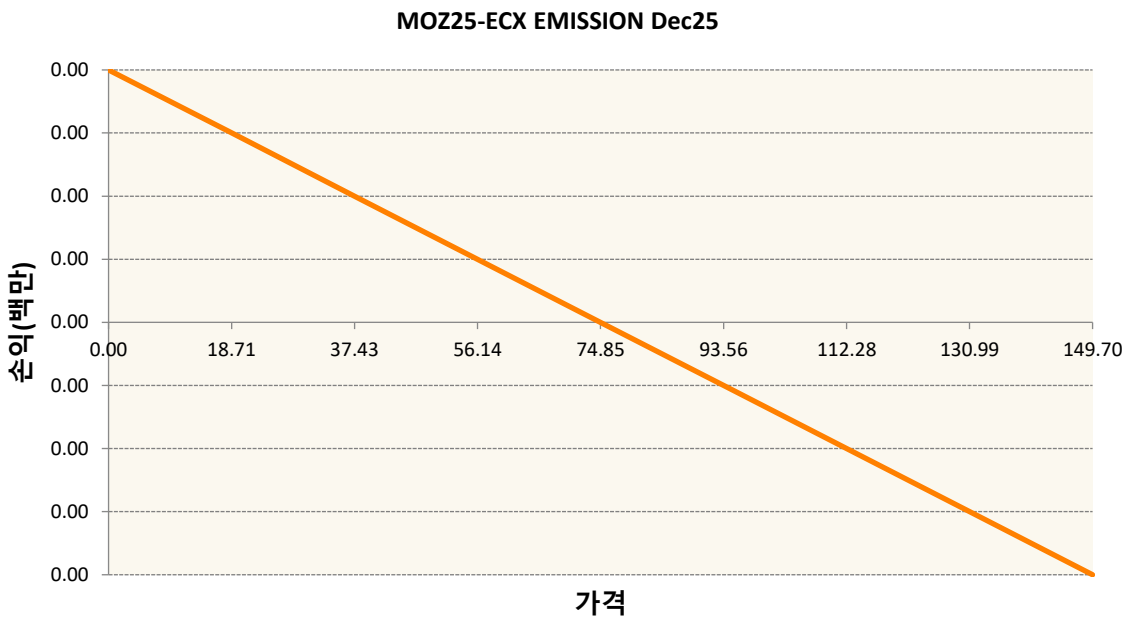
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-58	4,324	-4,382	
누계	통화	선도	0	1,268	-1,268	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	346

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

(단위:백만원)

642

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

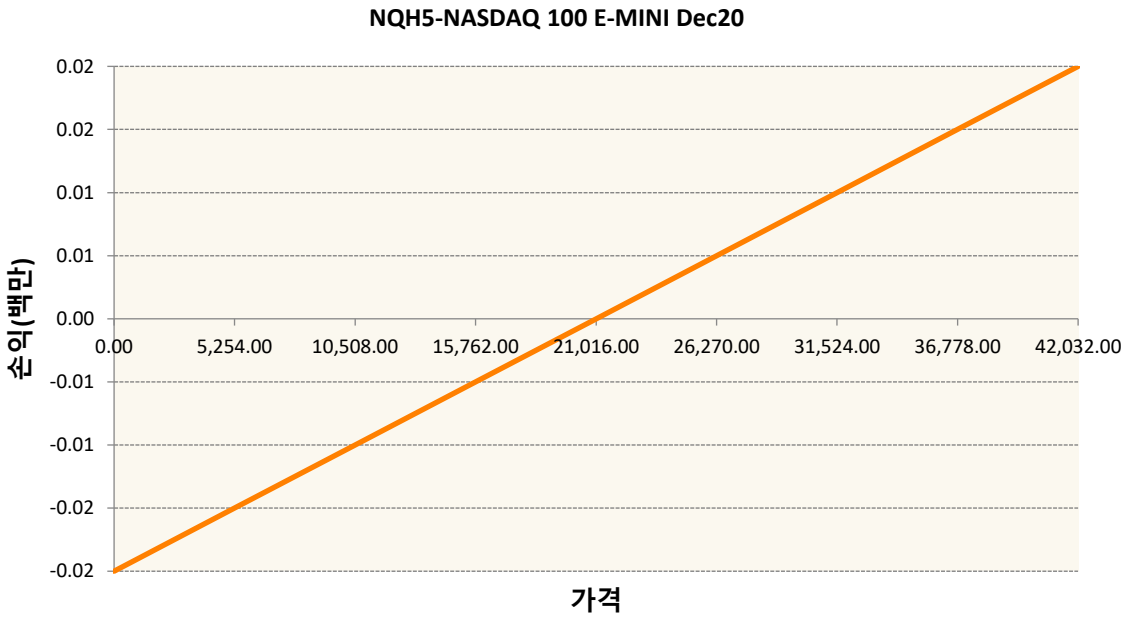
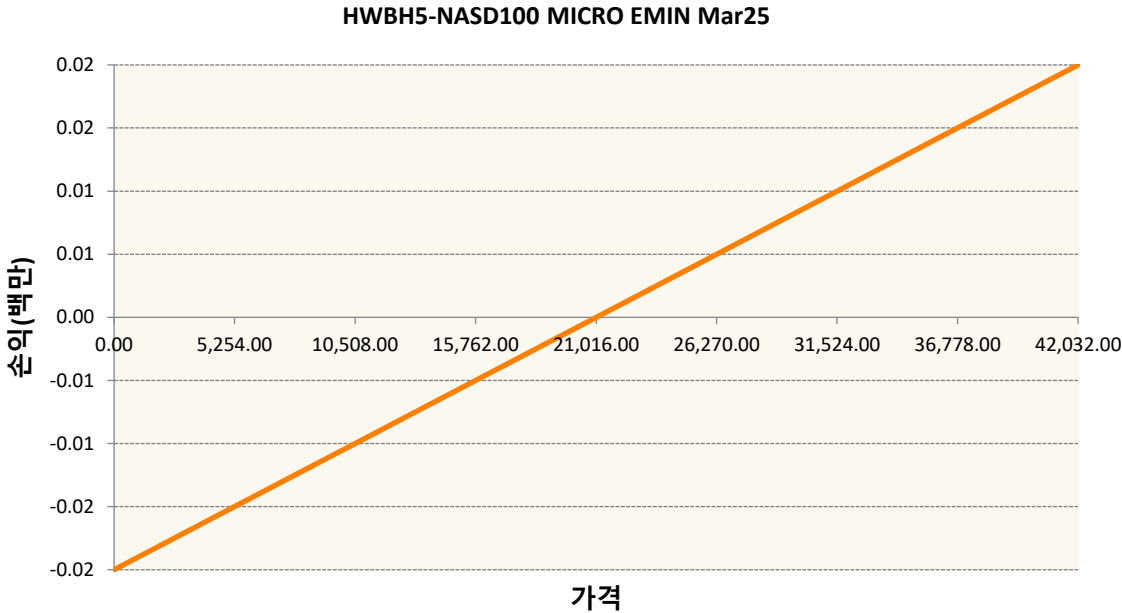
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,444	0	13,444	
누계	유가증권	선물	1,099	0	1,099	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	88
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,076

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,008

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

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	204,668	0	204,668	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	704
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,809
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,451
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,358

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

(단위:백만원)

9,240

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

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)

11

공시일	2025-01-14
기준일	2025-01-13

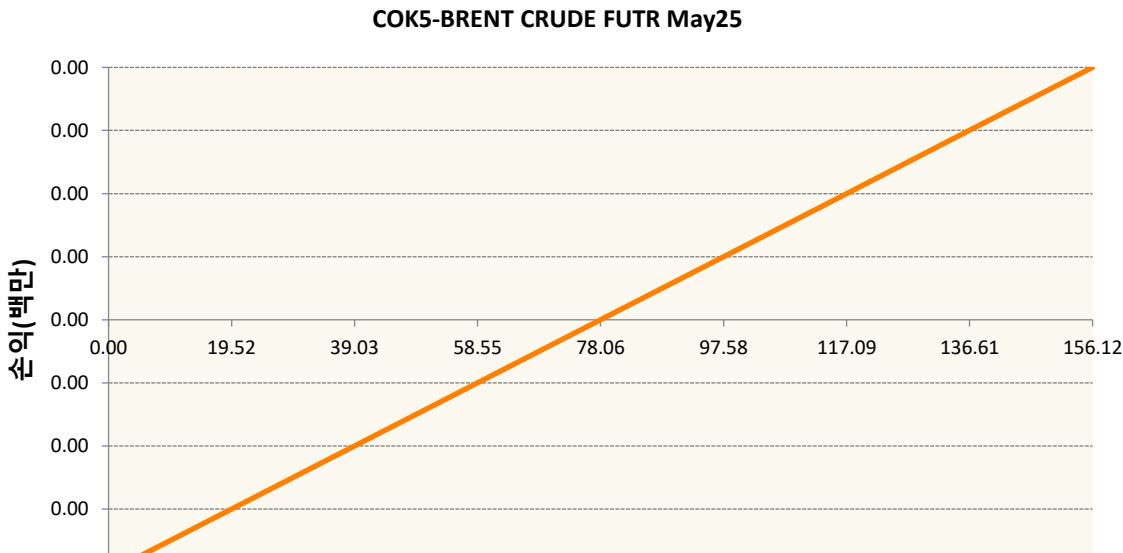
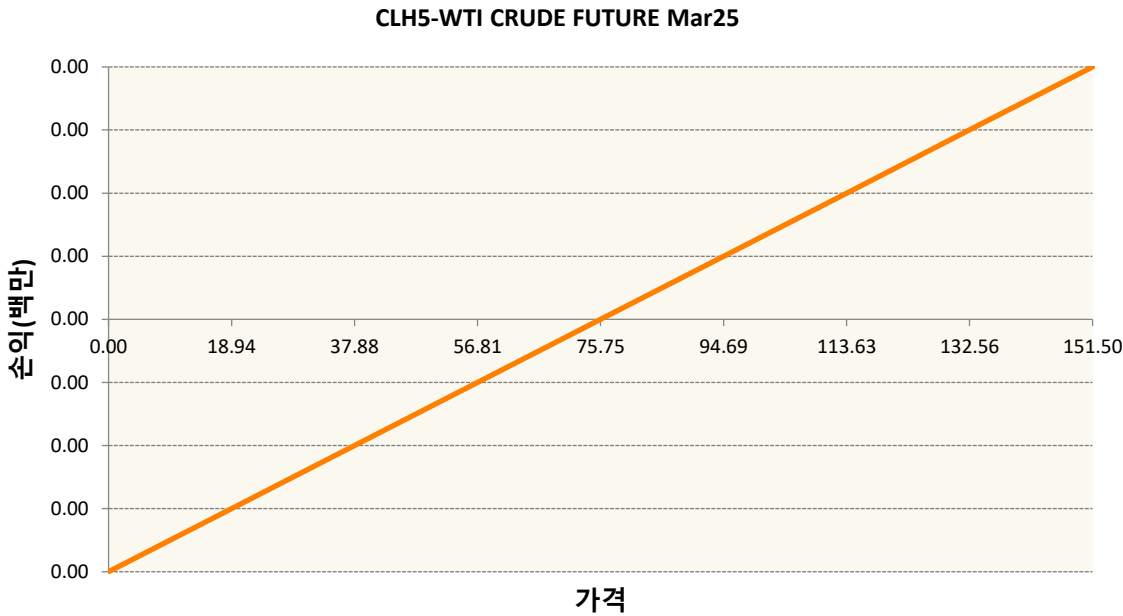
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

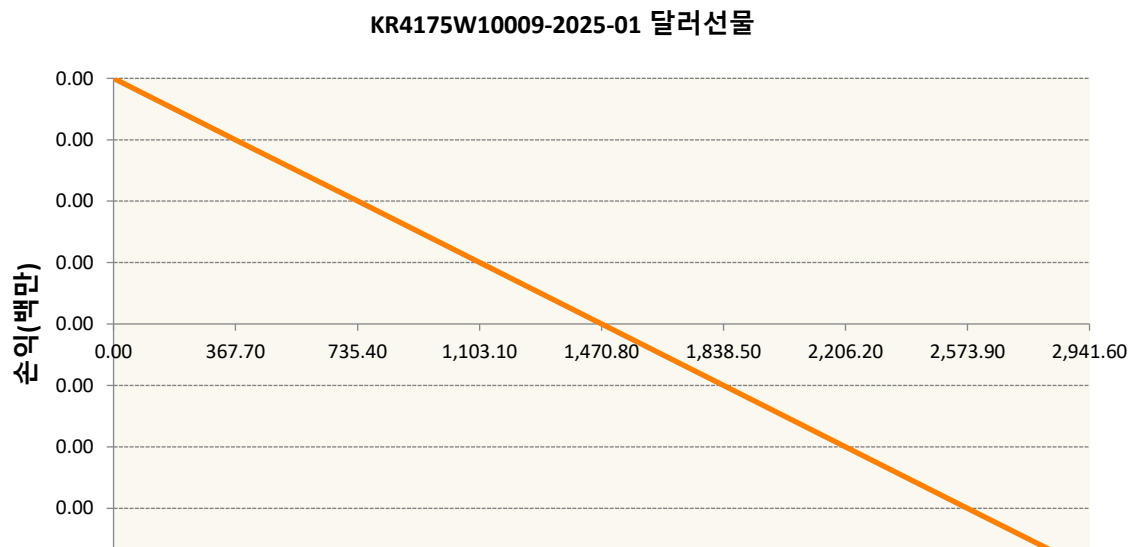
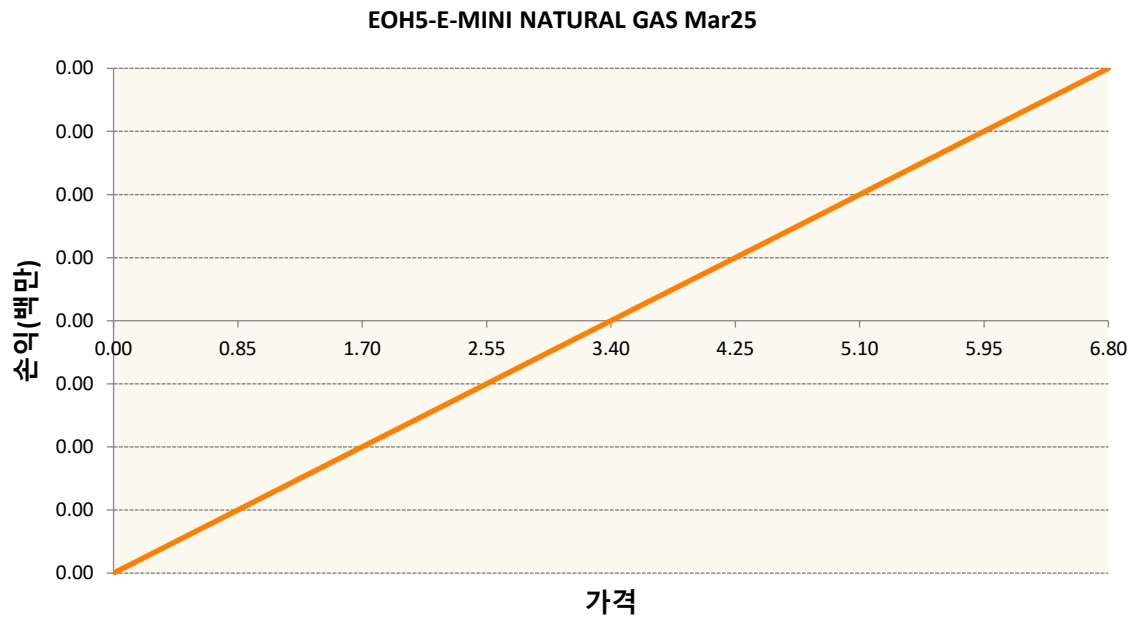
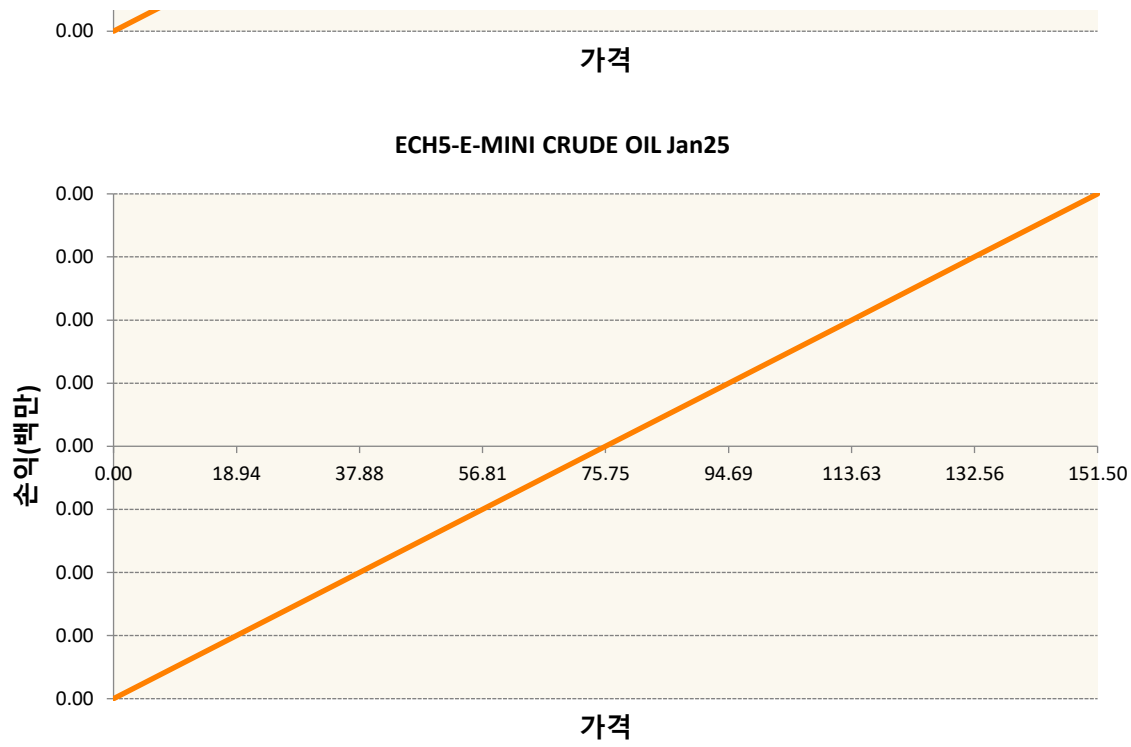
1. 계약금액

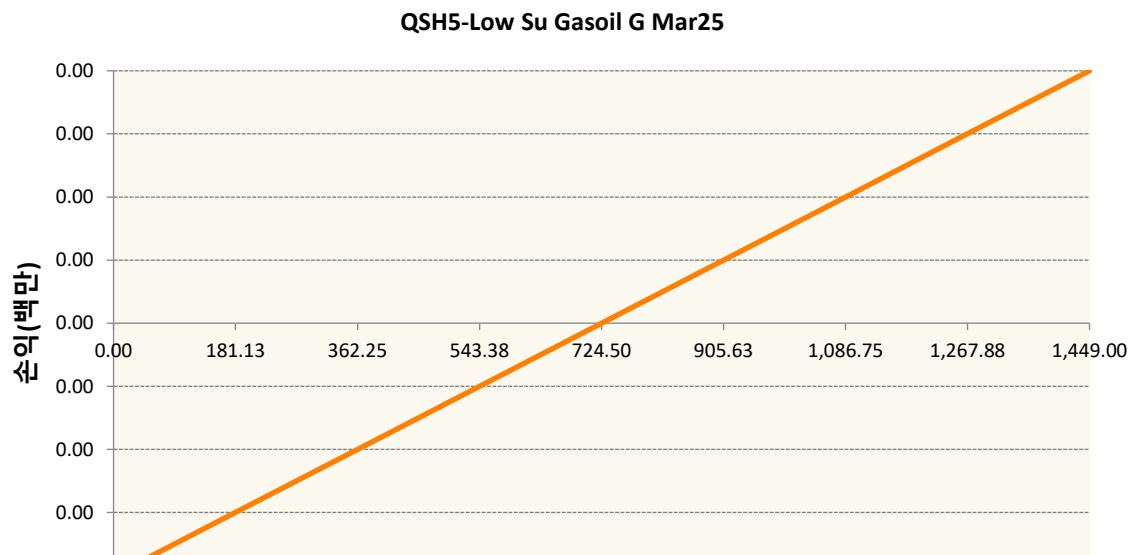
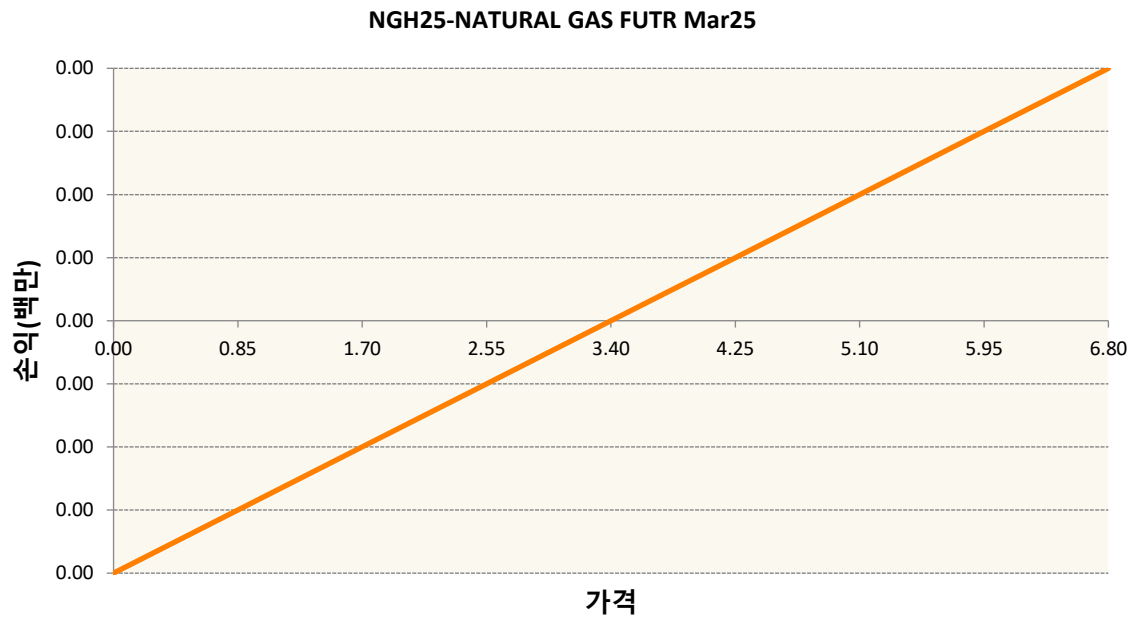
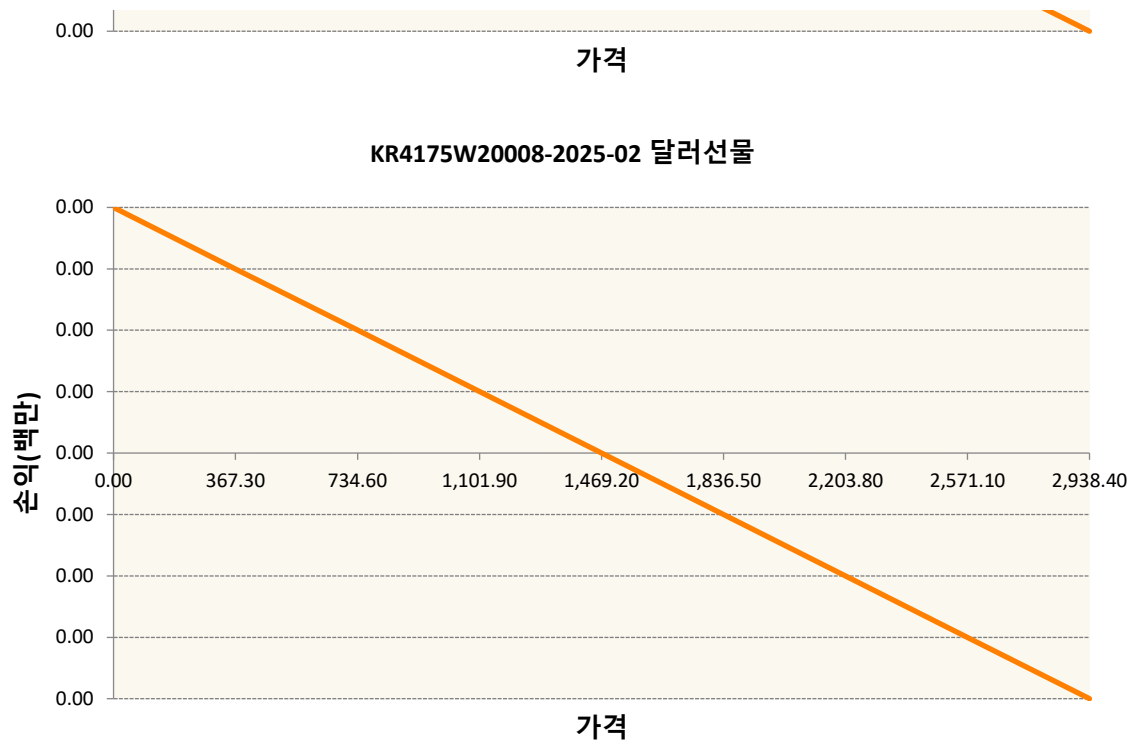
(단위:백만원)

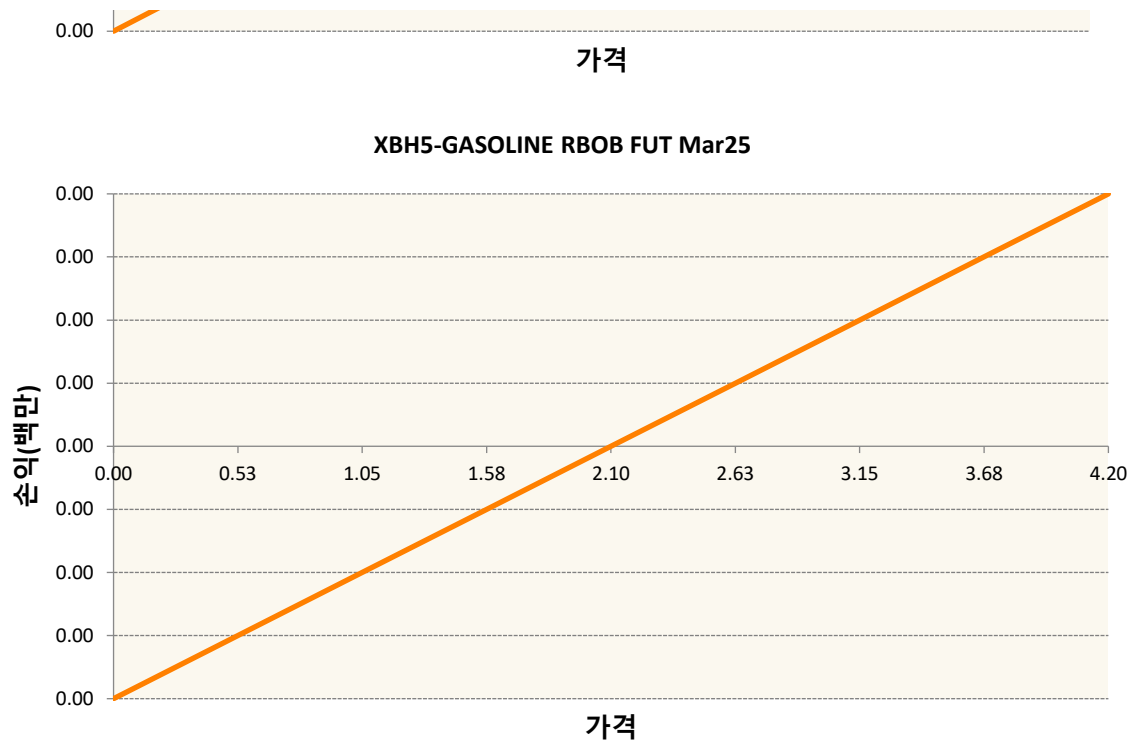
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	15	-15	장내
누계	선물	유가증권	109	0	109	
누계	유가증권	선물	785	0	785	
누계	통화	선물	0	191	-191	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar25	9
COK5	BRENT CRUDE FUTR May25	18
ECH5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	4
EOH5	E-MINI NATURAL GAS Mar25	6
KR4175W10(2025-01 달러선물		14
KR4175W20(2025-02 달러선물		1
NGH25	NATURAL GAS FUTR Mar25	16
QSH5	Low Su Gasoil G Mar25	8
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar25	10

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

(단위:백만원)

161