

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

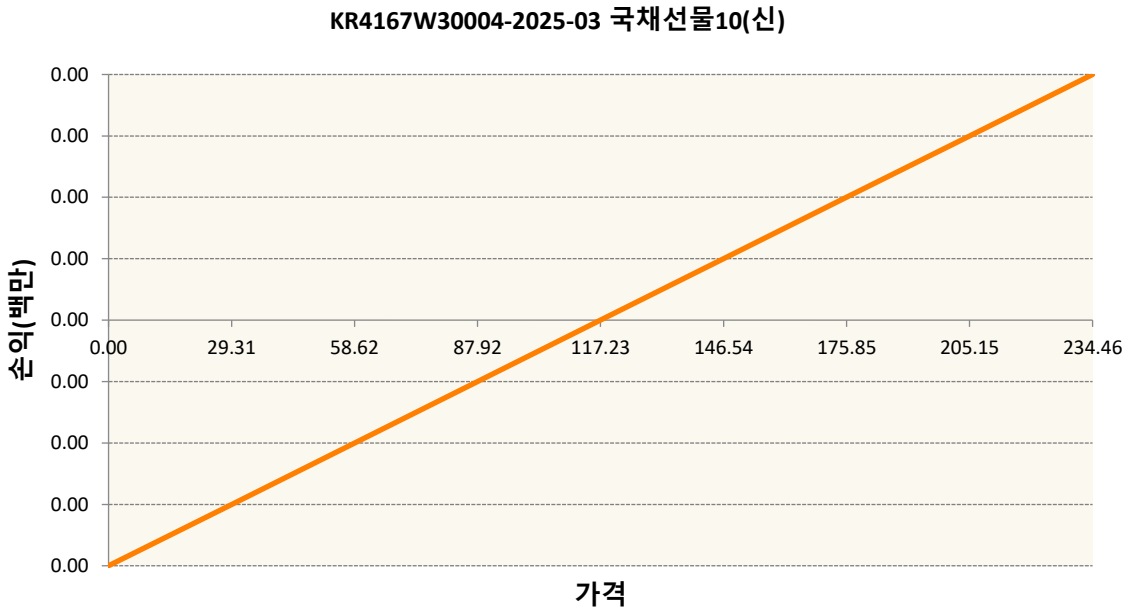
베스트장기채(채권-파생형)

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	112,541	0	112,541	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

2,915

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

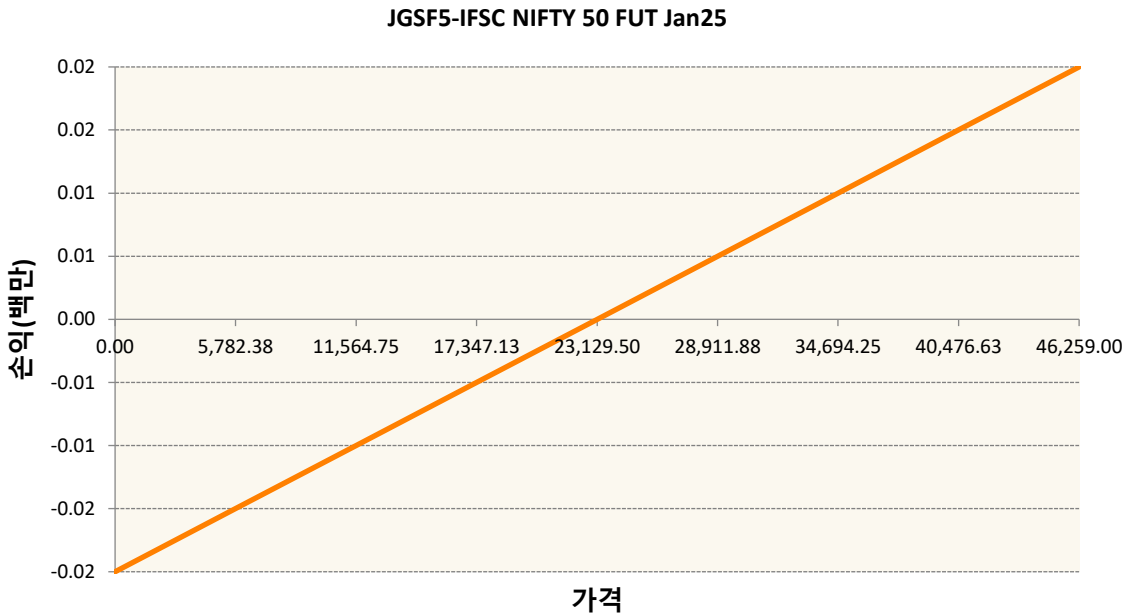
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,388	0	3,388	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSF5	IFSC NIFTY 50 FUT Jan25	271
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

182

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

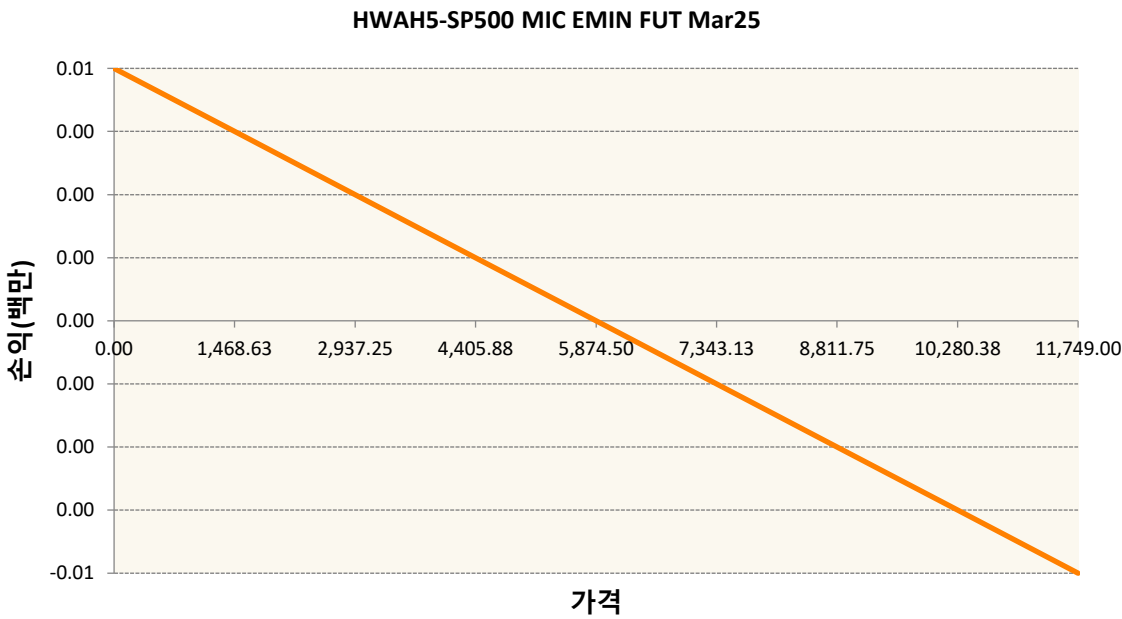
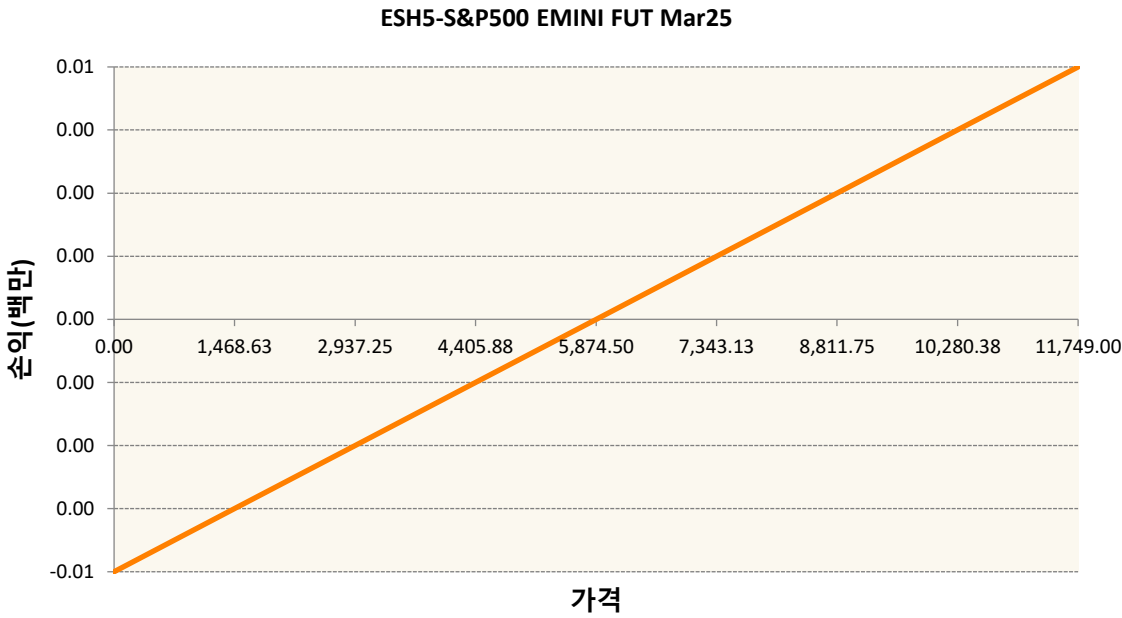
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	854	0	854	
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	2025-01-15
기준일	2025-01-14

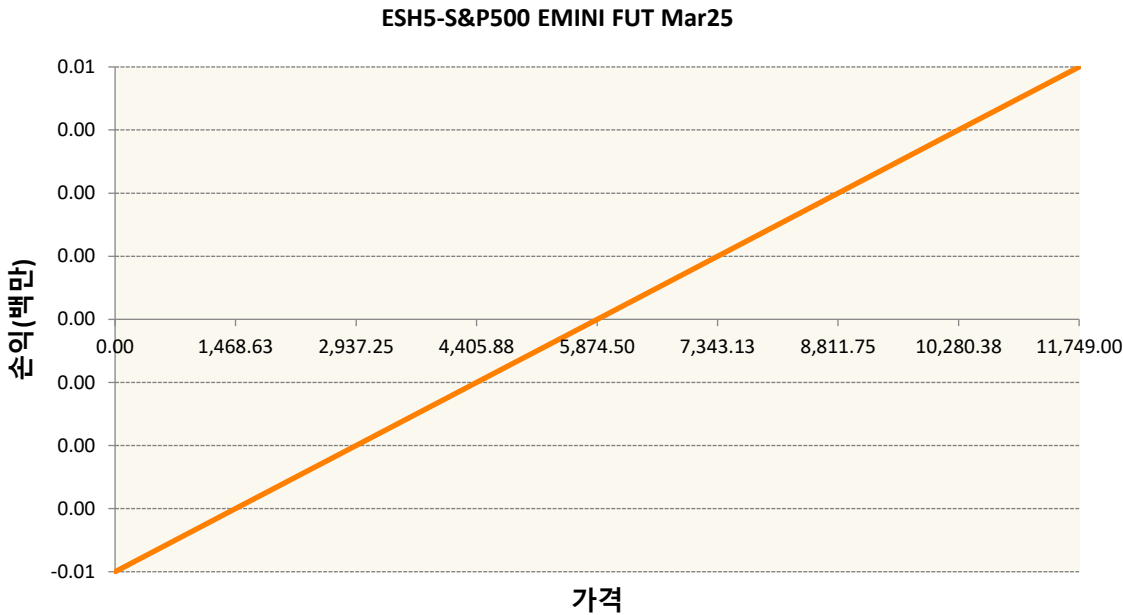
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,558	0	2,558	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	205
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

279

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

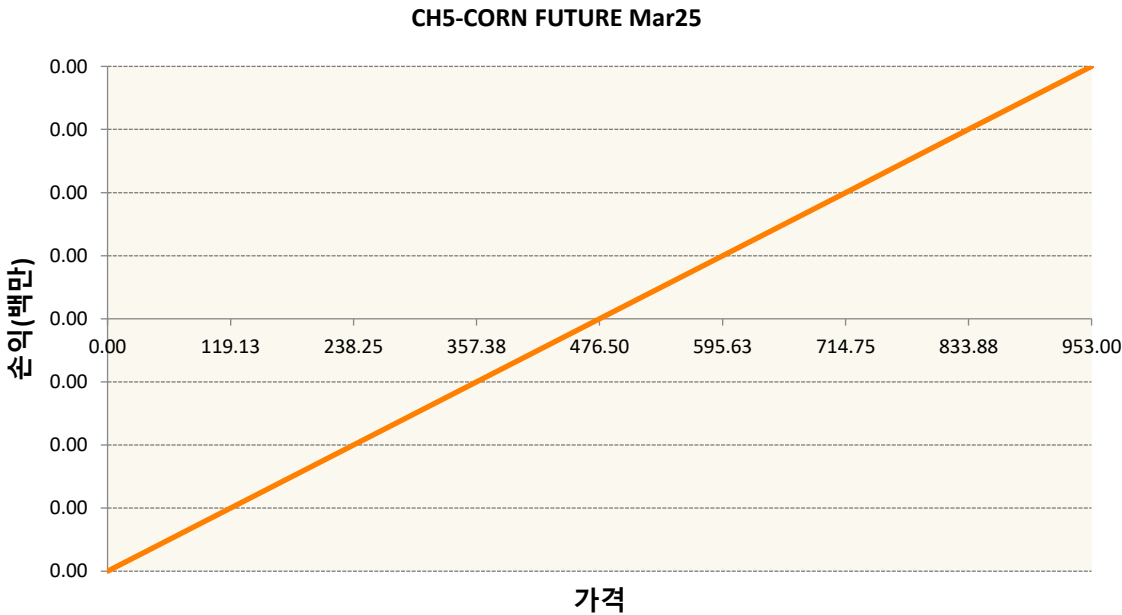
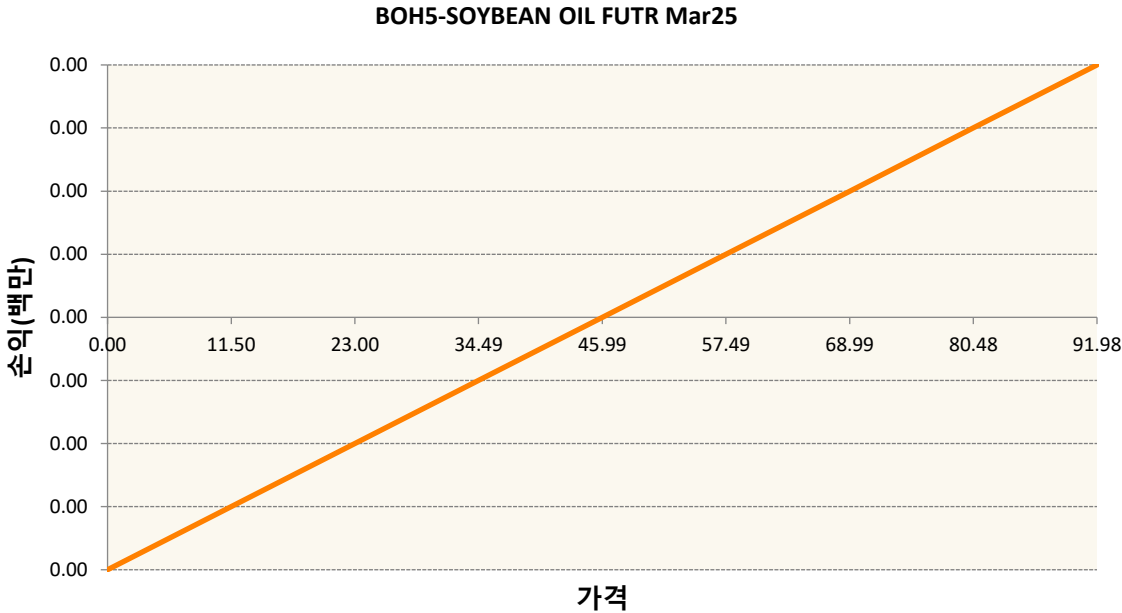
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

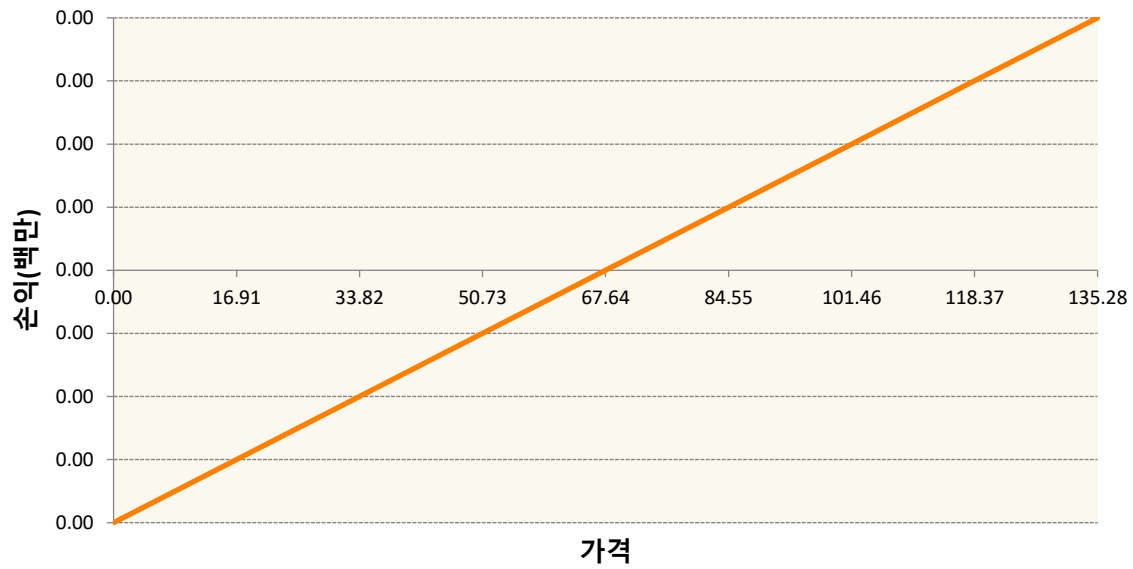
(단위:USD 백만)

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	3,751	0	3,751	
누계	통화	선물	0	424	-424	장내

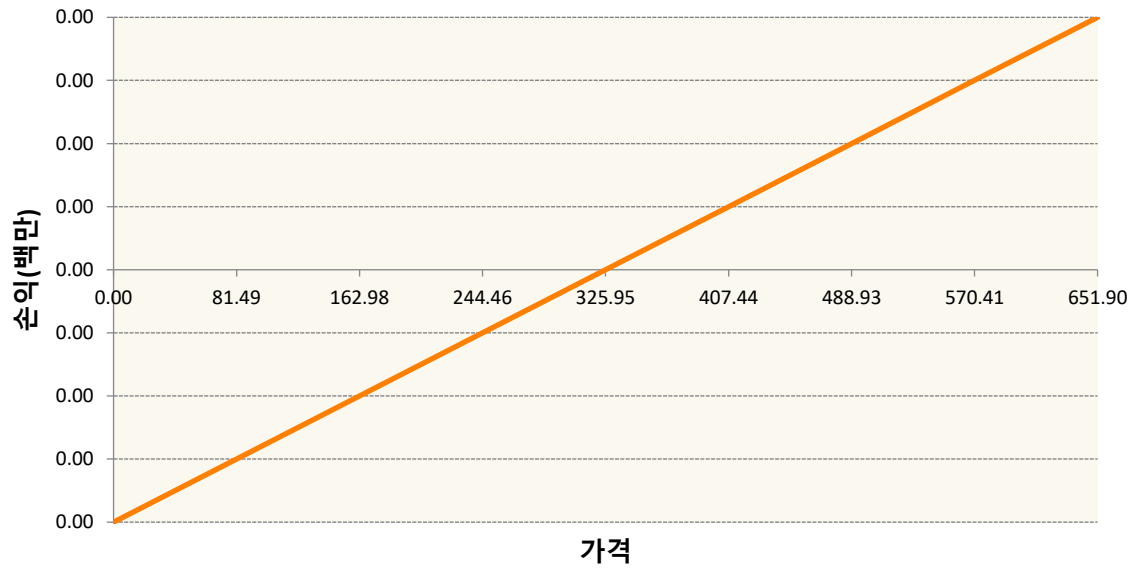
2. 만기시점의 손익구조



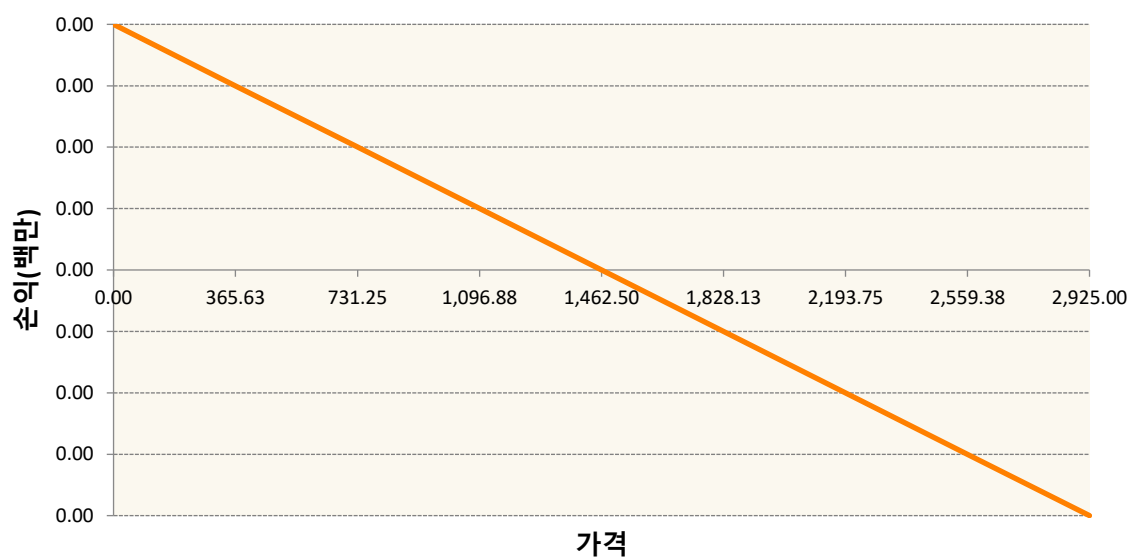
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



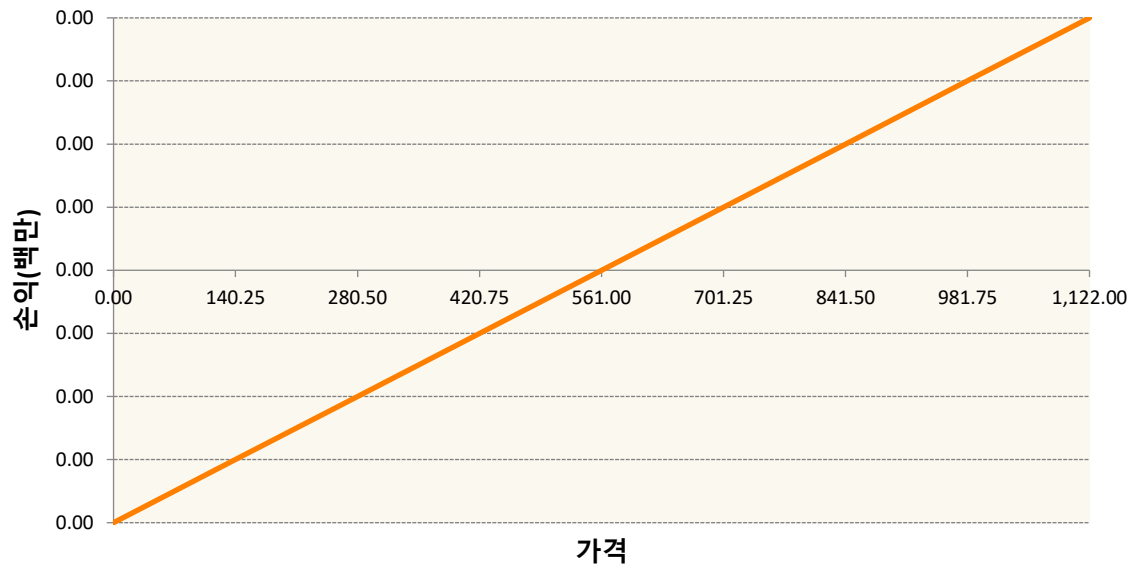
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



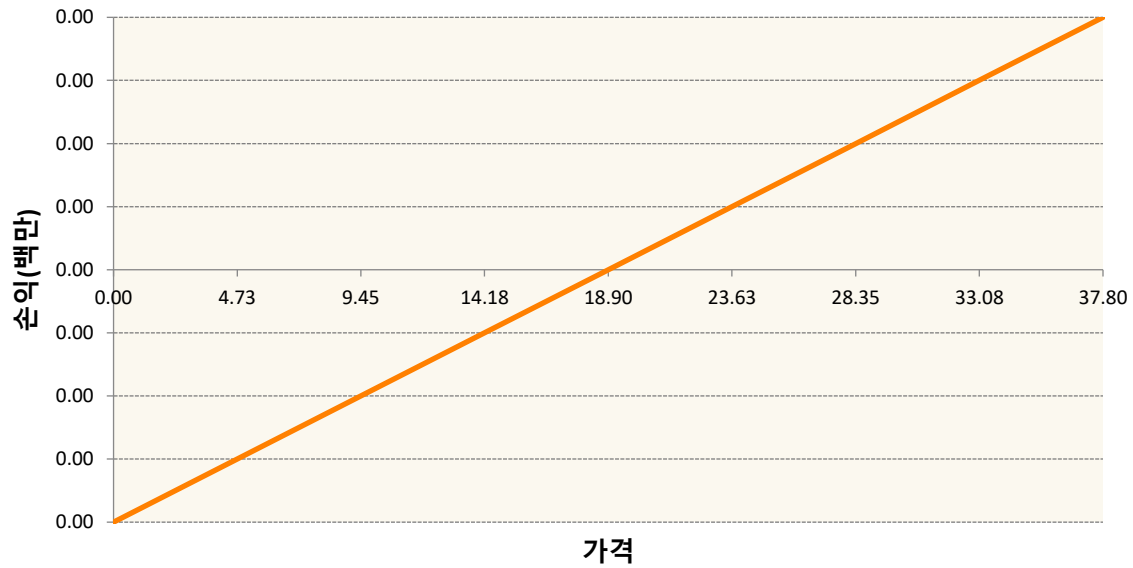
KR4175W10009-2025-01 달러선물



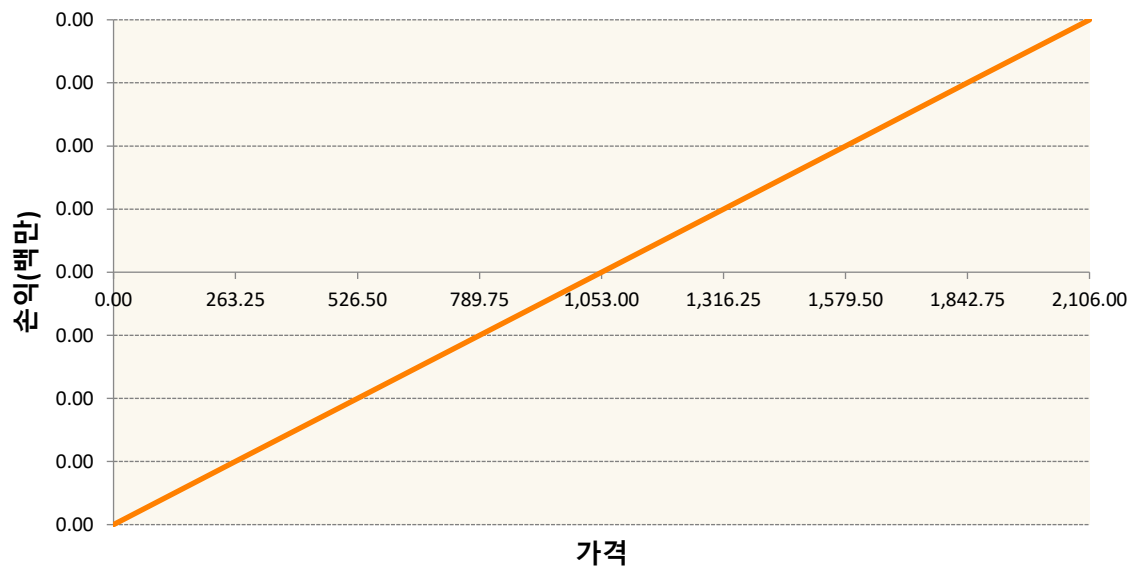
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



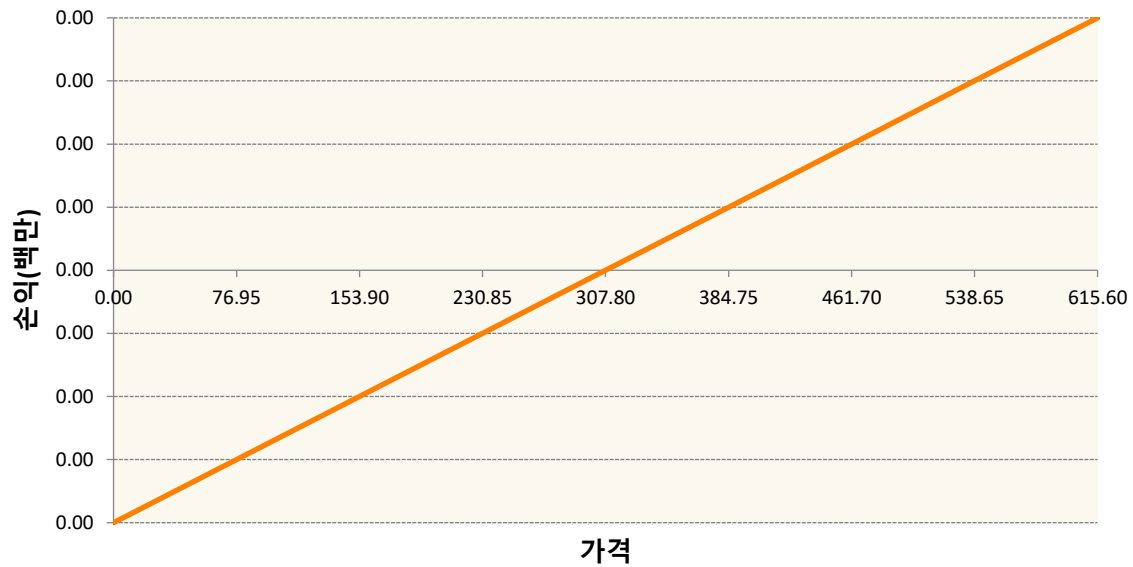
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



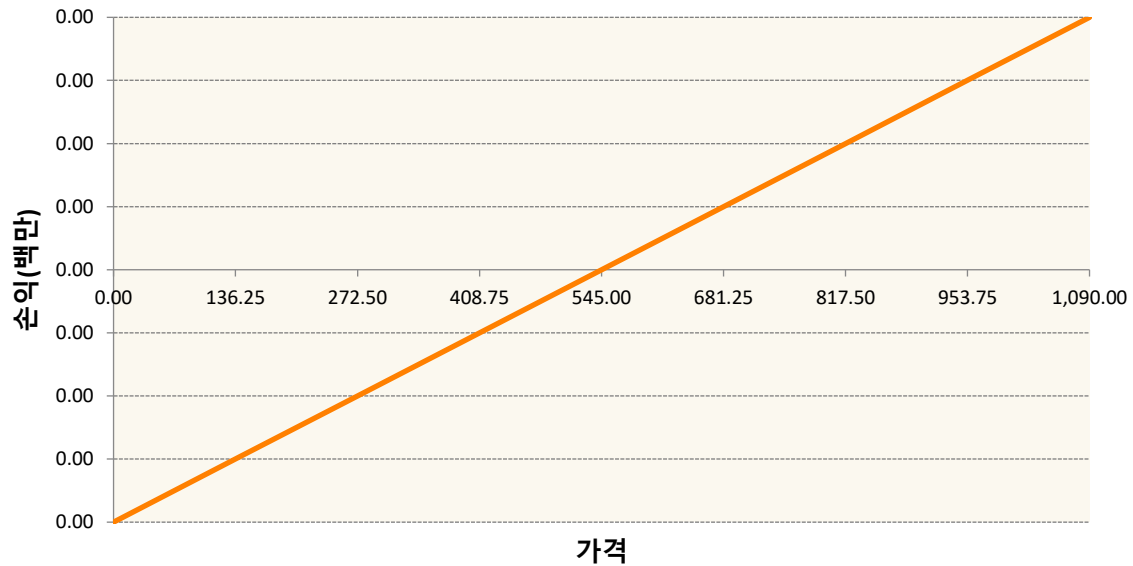
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar25



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	2025-01-15
기준일	2025-01-14

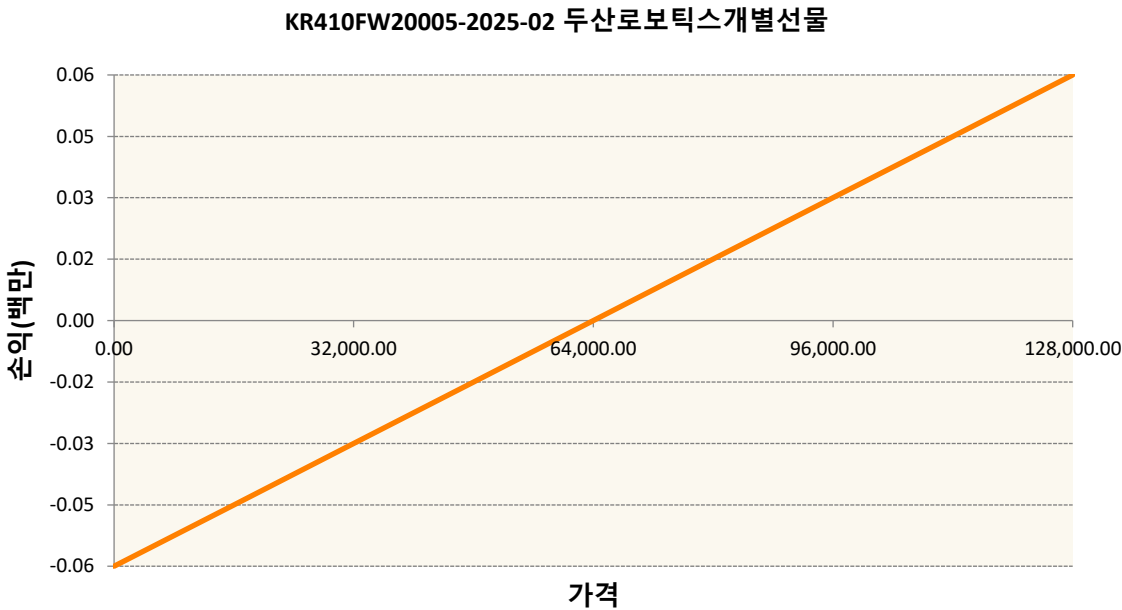
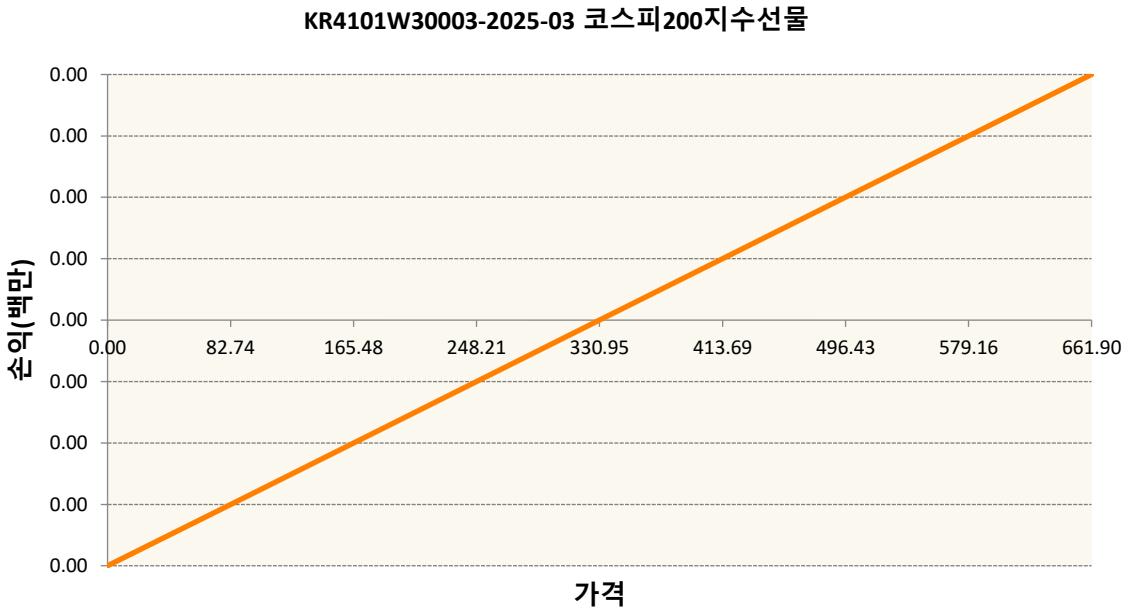
스마트인덱스모

1. 계약금액

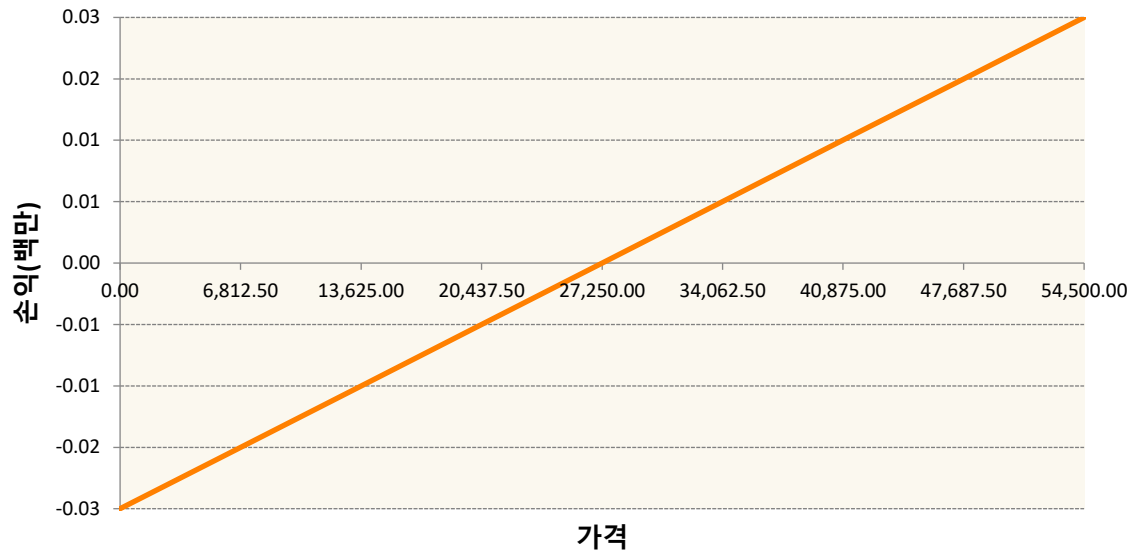
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,190	0	1,190	장내

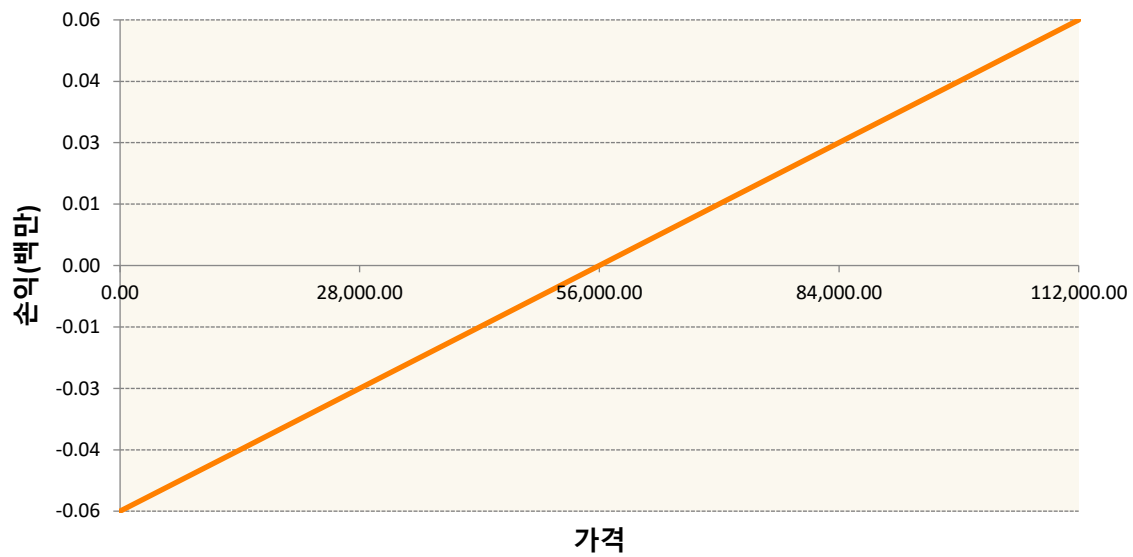
2. 만기시점의 손익구조



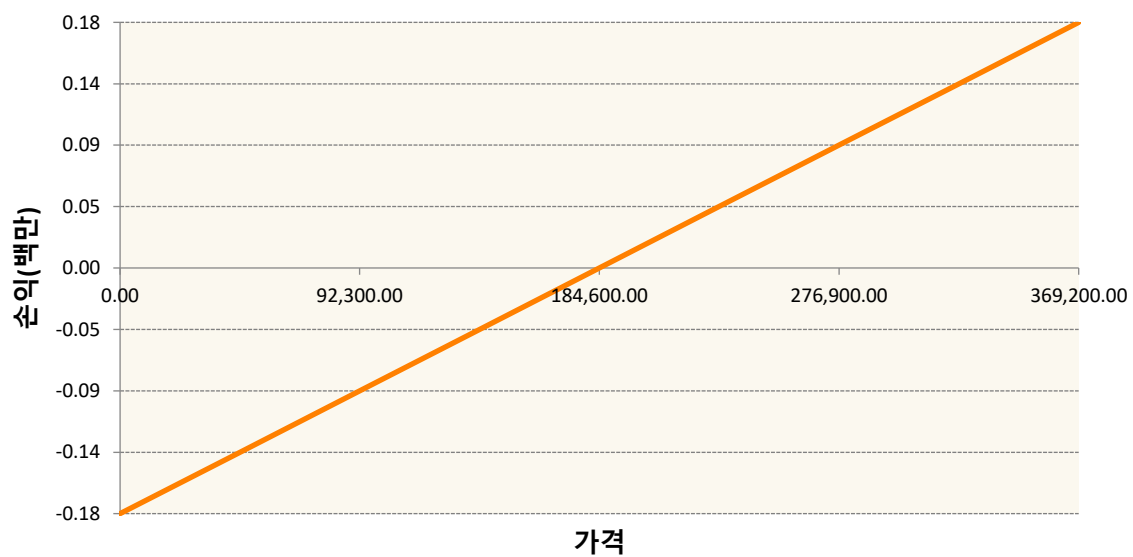
KR410SW20008-2025-02 울촌화학개별선물



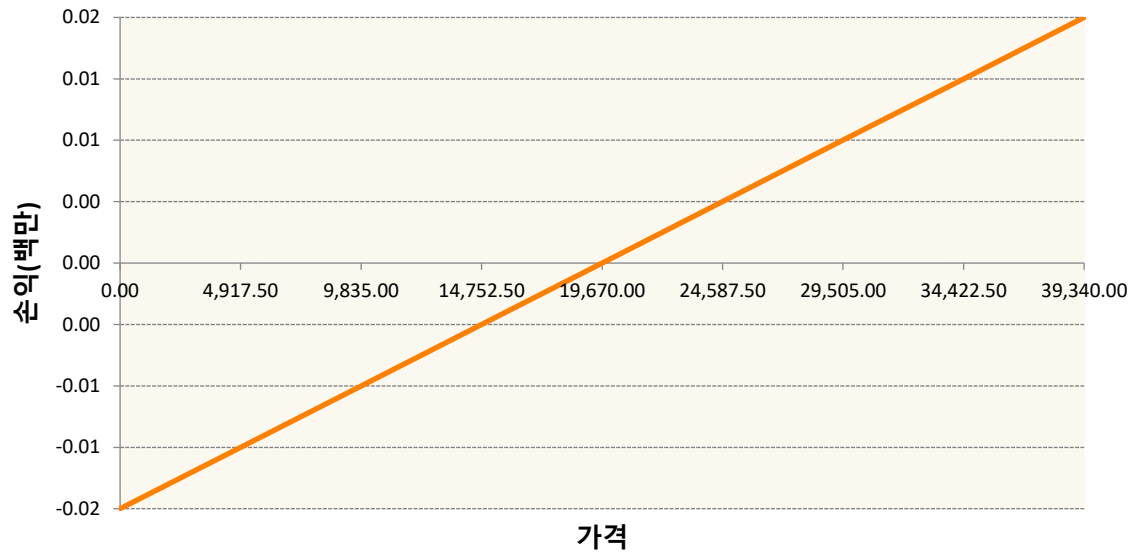
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



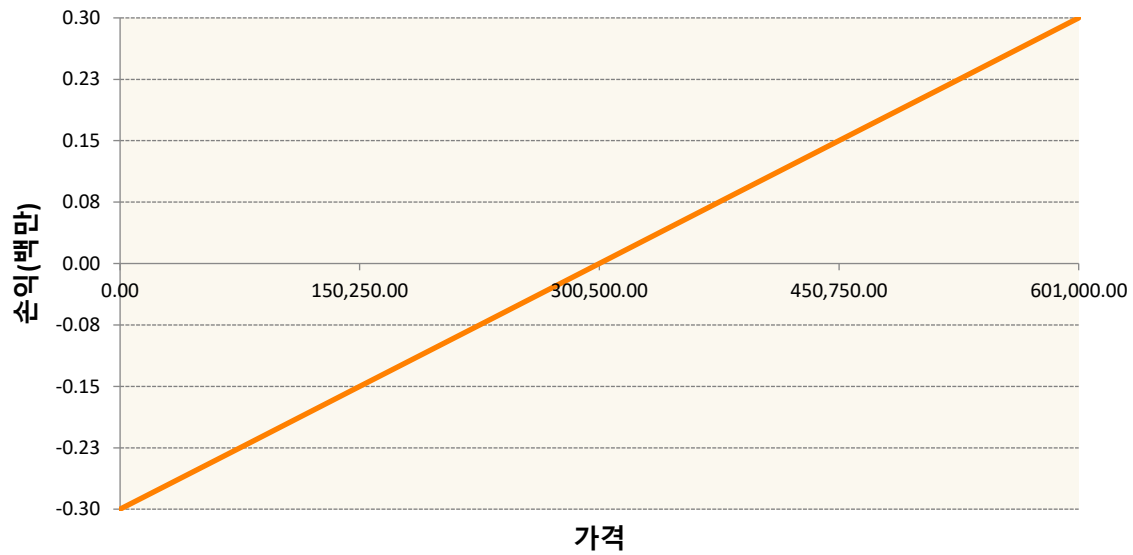
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



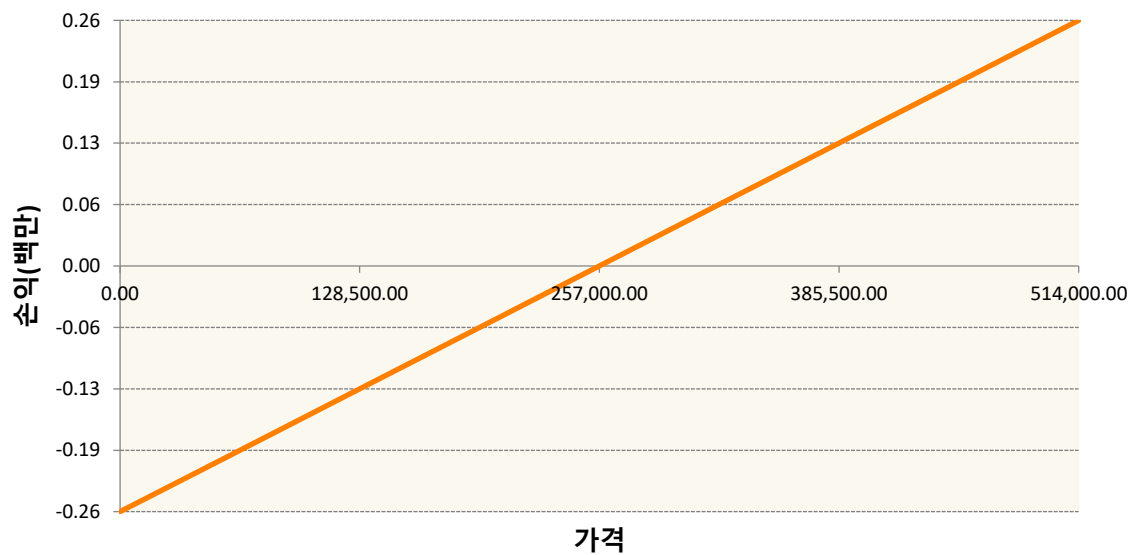
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



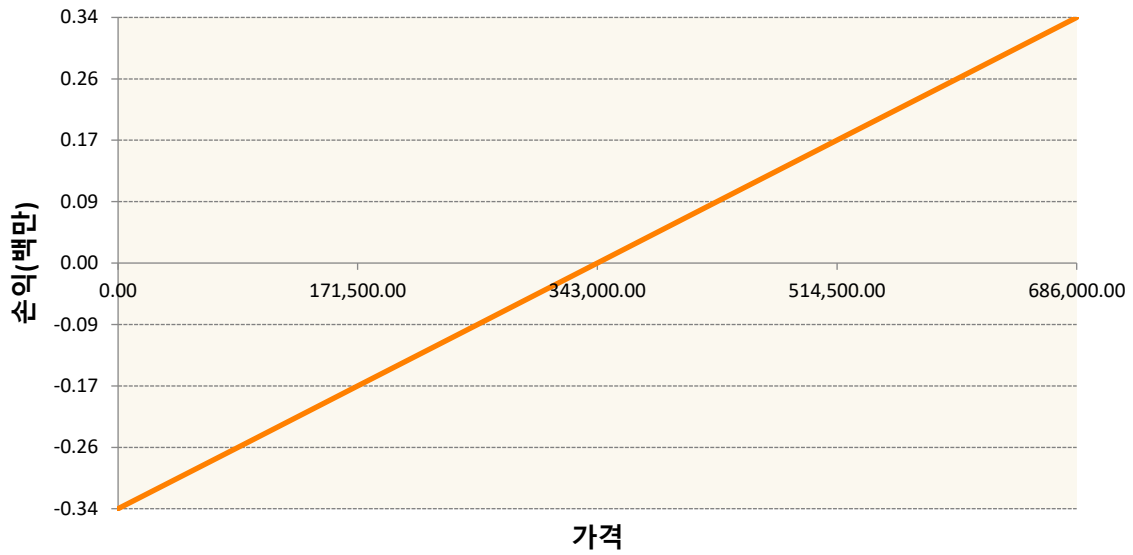
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



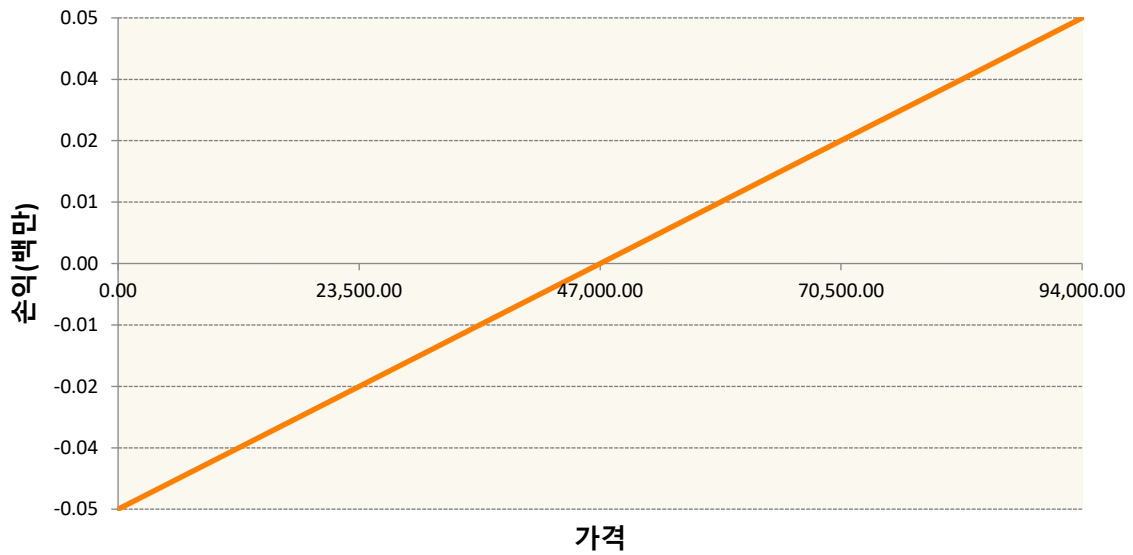
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



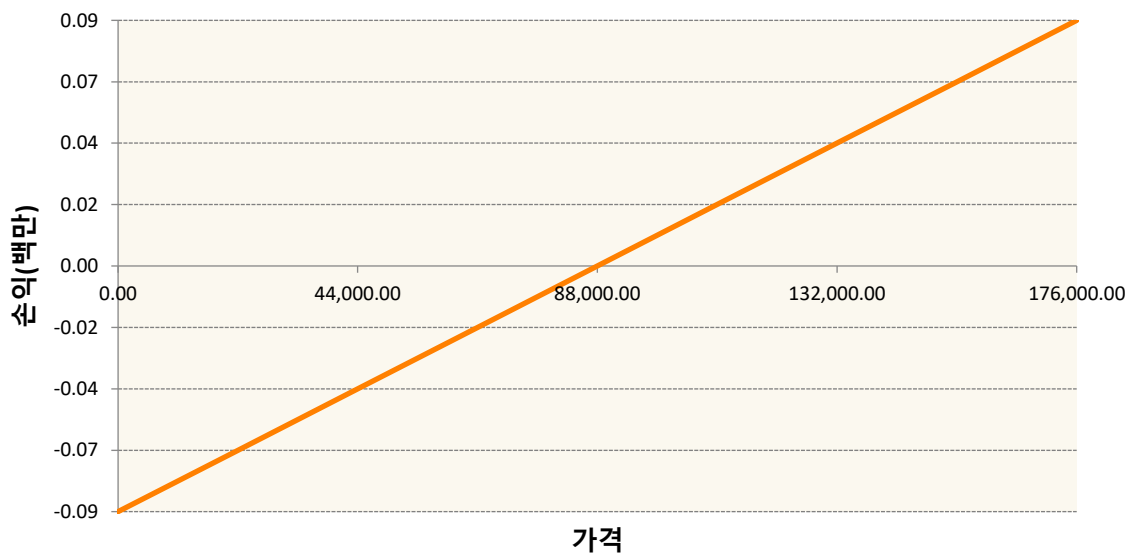
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



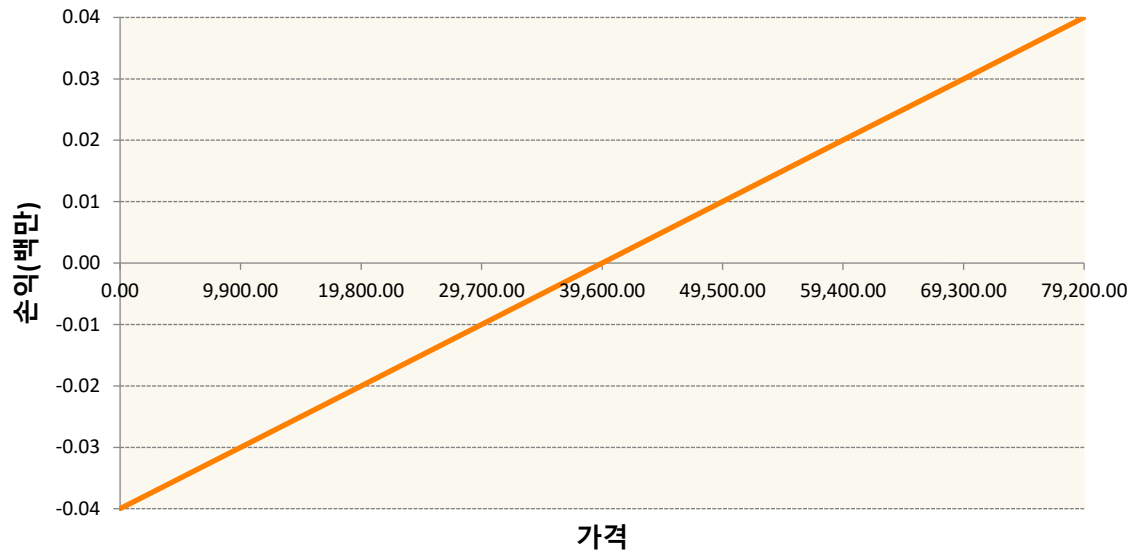
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



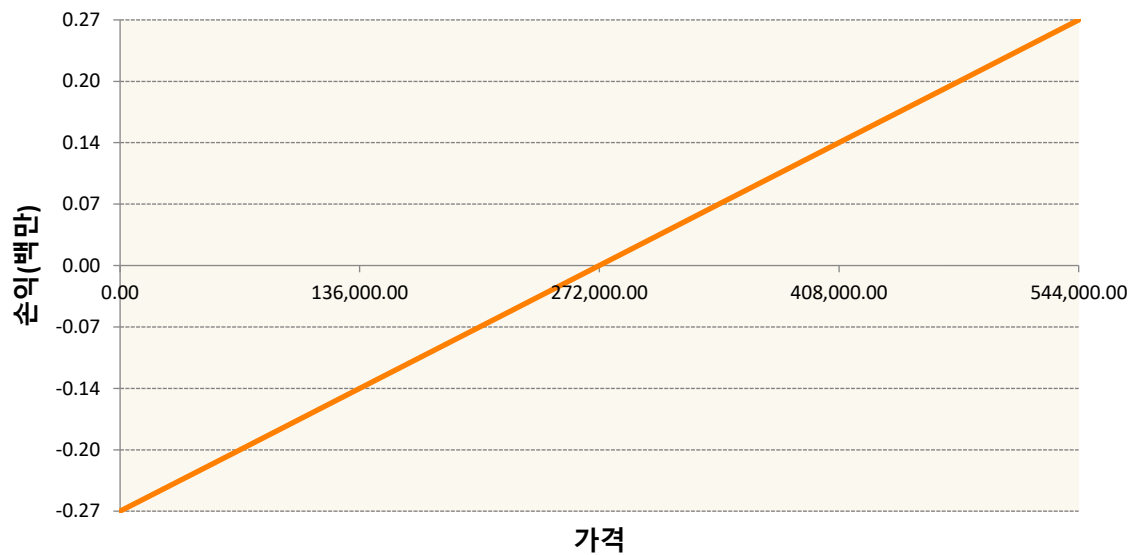
KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



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%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-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%	49	49	49	49	49	49	49	
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	-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	
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	-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	
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	-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	
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	-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	
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	-2	
-5.33%	-2	-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 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

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

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

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

(단위:백만원)

103

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

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	273
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

460

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

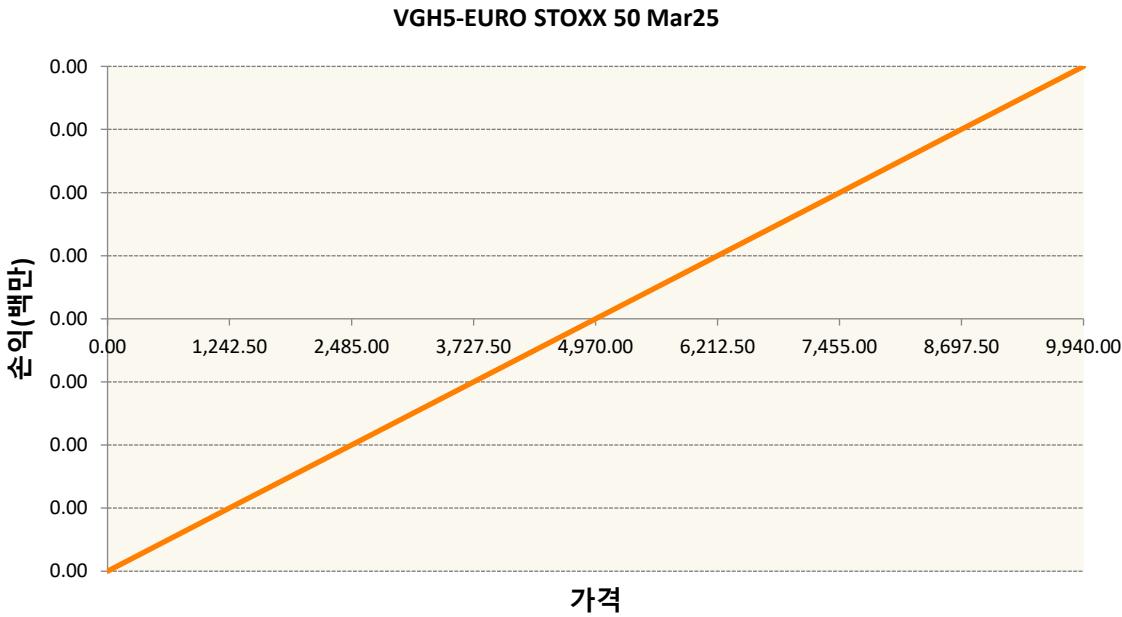
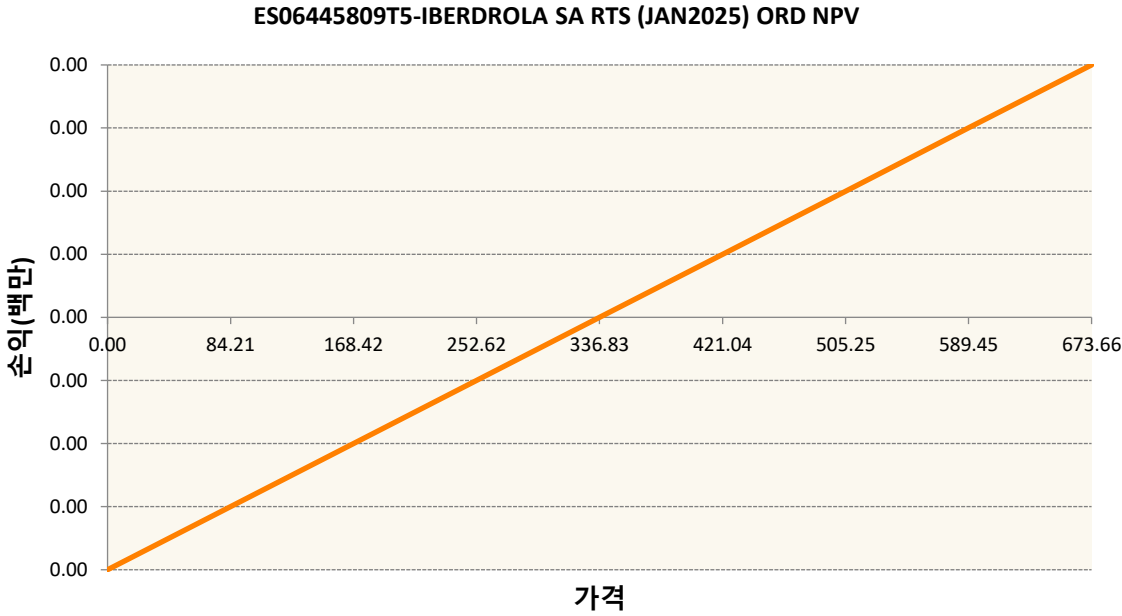
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	900	0	900	

2. 만기시점의 손익구조



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	2025-01-15
기준일	2025-01-14

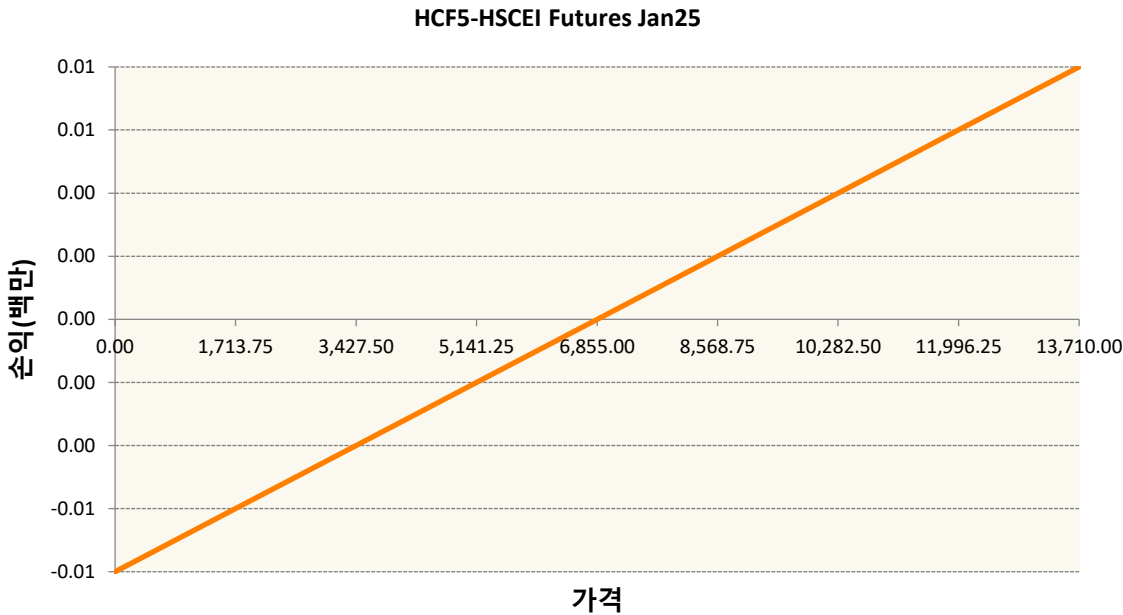
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,414	0	1,414	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	HSCEI Futures Jan25	113
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

152

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

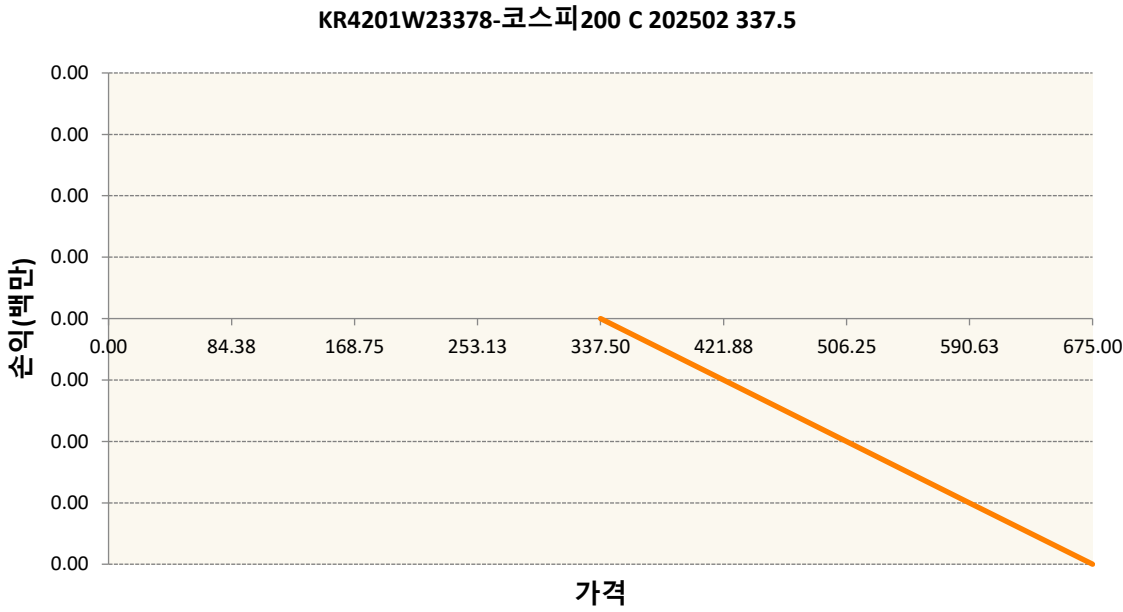
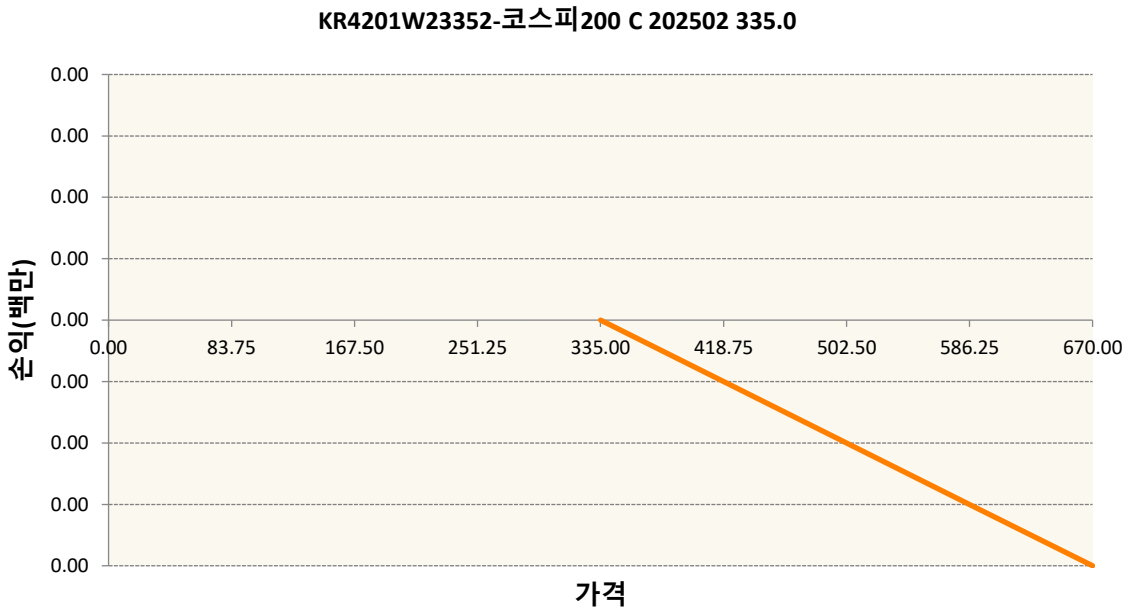
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

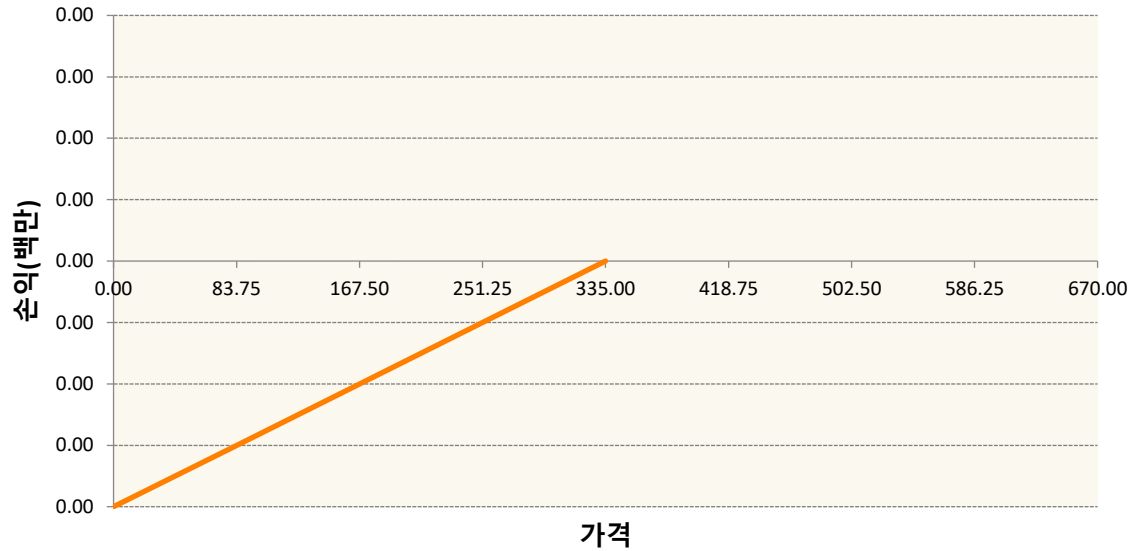
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	509	-509	장내
누계	유가증권	옵션	0	38,404	-38,404	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301W23350-코스피200 P 202502 335.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201W23352 코스피200 C 202502 335.0							1,424
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	528	516	501	481	459	433	405
-5.33%	486	460	430	397	361	322	282
-2.67%	380	336	290	243	195	145	94
0%	168	112	56	0	-56	-113	-169
2.67%	-173	-229	-286	-343	-399	-456	-514
5.33%	-639	-684	-731	-780	-831	-882	-935
8.00%	-1,198	-1,227	-1,261	-1,298	-1,338	-1,380	-1,424
KR4201W23378 코스피200 C 202502 337.5							335
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	113	111	108	104	99	93	87
-5.33%	105	100	94	86	78	70	60
-2.67%	84	75	64	54	42	31	19
0%	40	27	14	0	-14	-27	-41
2.67%	-35	-49	-63	-78	-92	-106	-120
5.33%	-141	-154	-166	-179	-192	-206	-219
8.00%	-273	-282	-291	-301	-312	-323	-335
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%	-407	-410	-415	-420	-426	-433	-441
-5.33%	-234	-241	-249	-259	-269	-280	-291
-2.67%	-79	-91	-104	-117	-130	-144	-158
0%	47	31	16	0	-16	-32	-47

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

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	656	0	656	

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	2025-01-15
기준일	2025-01-14

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	4,337	0	4,337	

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	2025-01-15
기준일	2025-01-14

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	12,814	0	12,814	
누계	통화	선도	0	13,315	-13,315	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E		217
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E		568
FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E		261
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	2025-01-15
기준일	2025-01-14

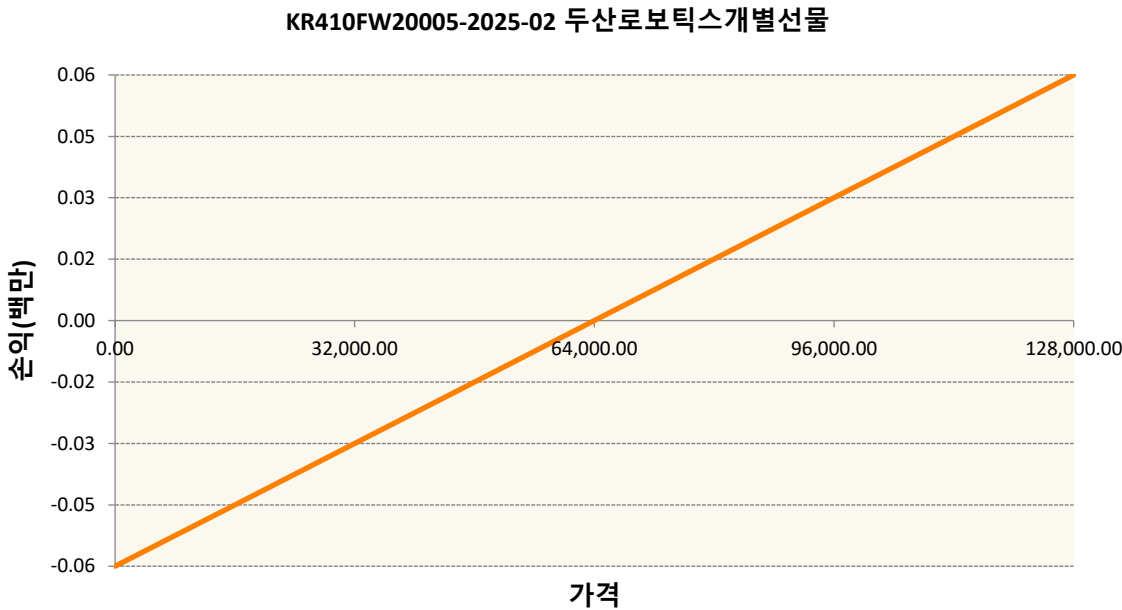
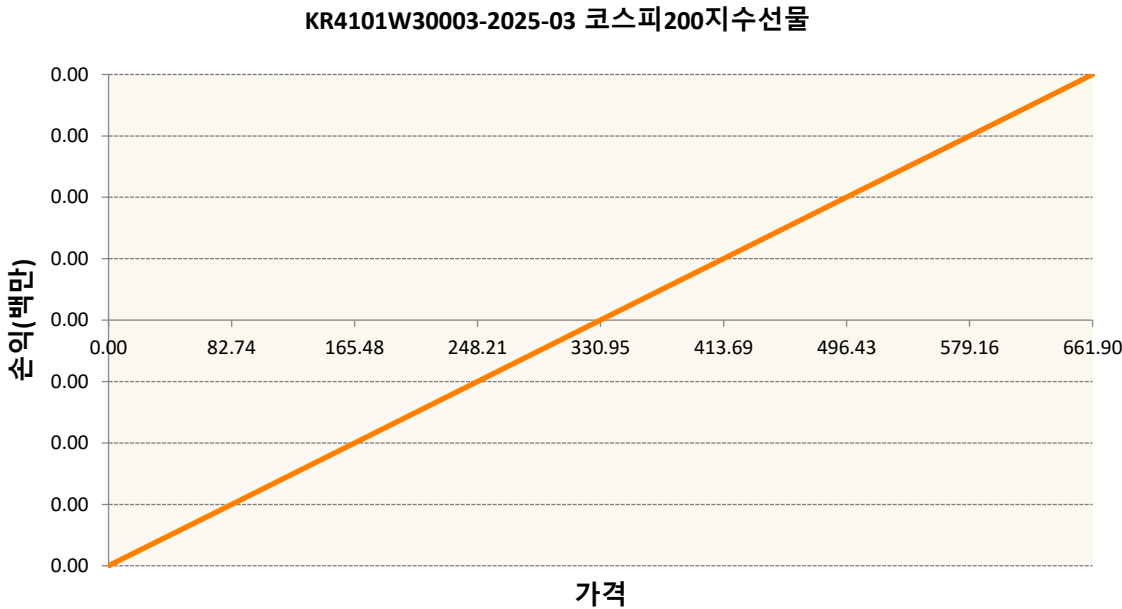
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

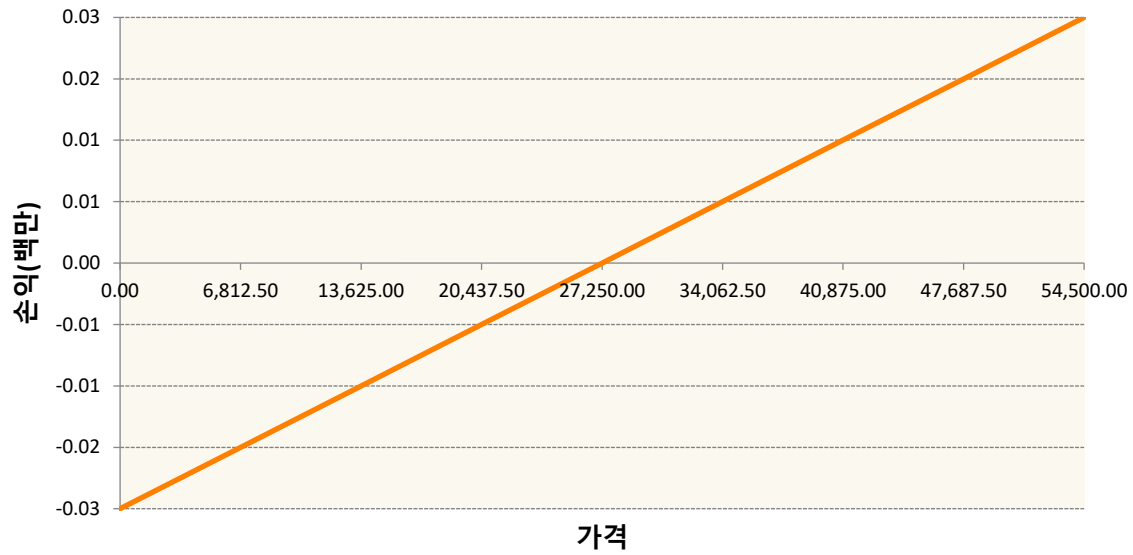
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3	0	3	장내
누계	유가증권	선물	784	0	784	장내

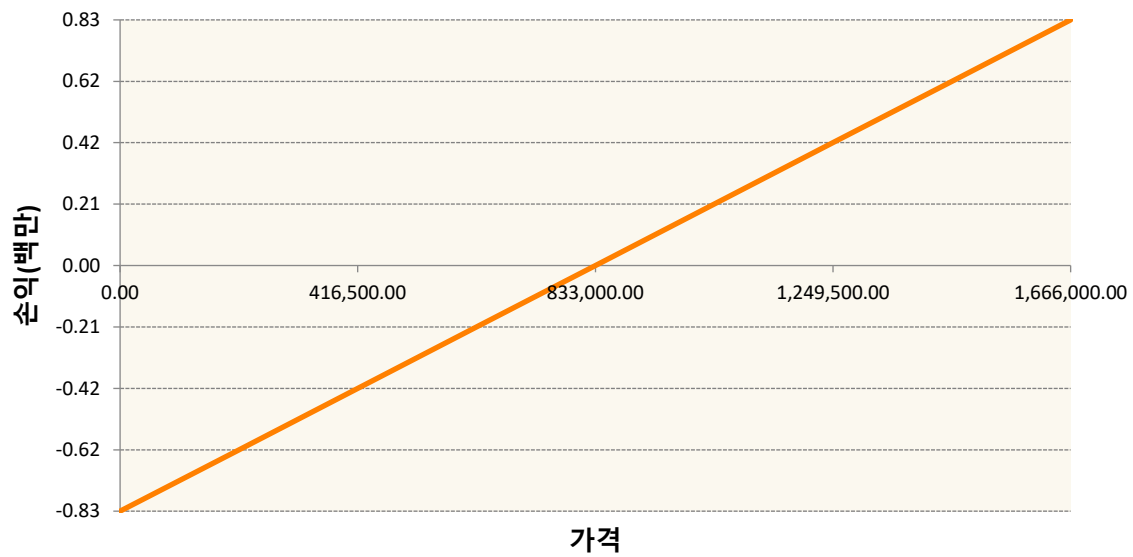
2. 만기시점의 손익구조



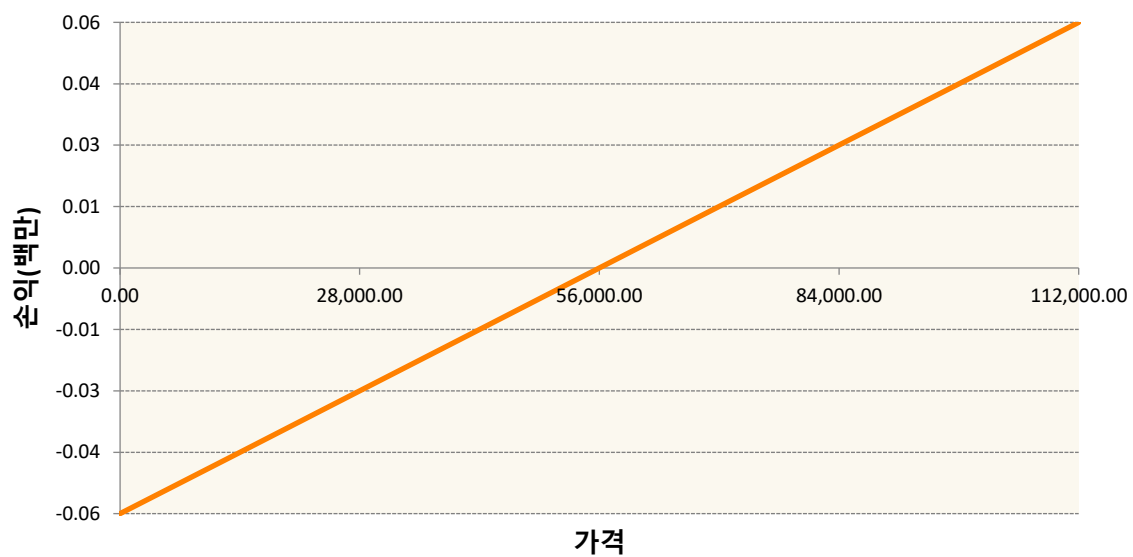
KR410SW20008-2025-02 울촌화학개별선물



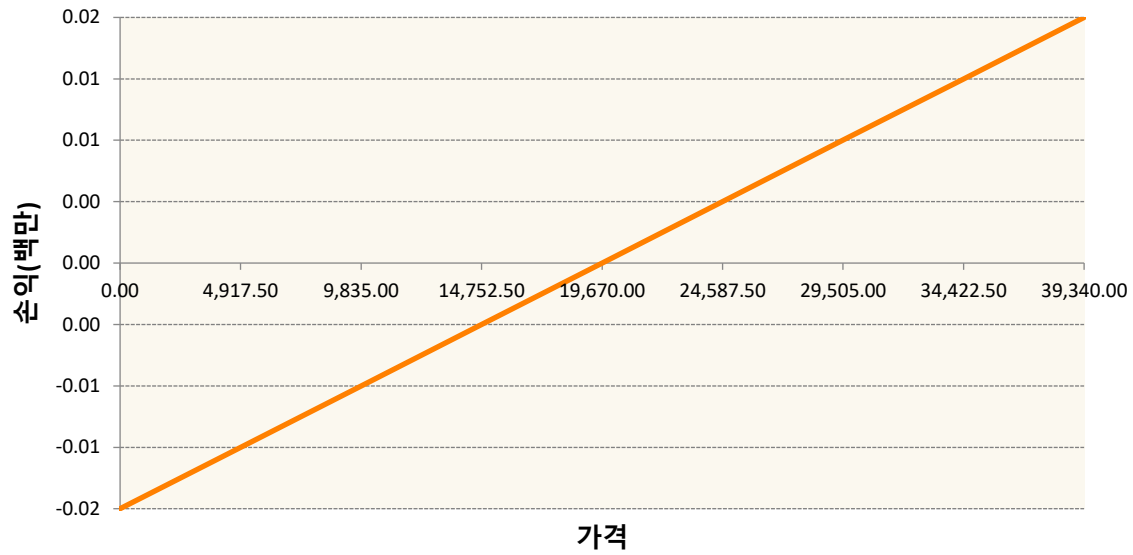
KR41B3W20008-2025-02 고려아연개별선물



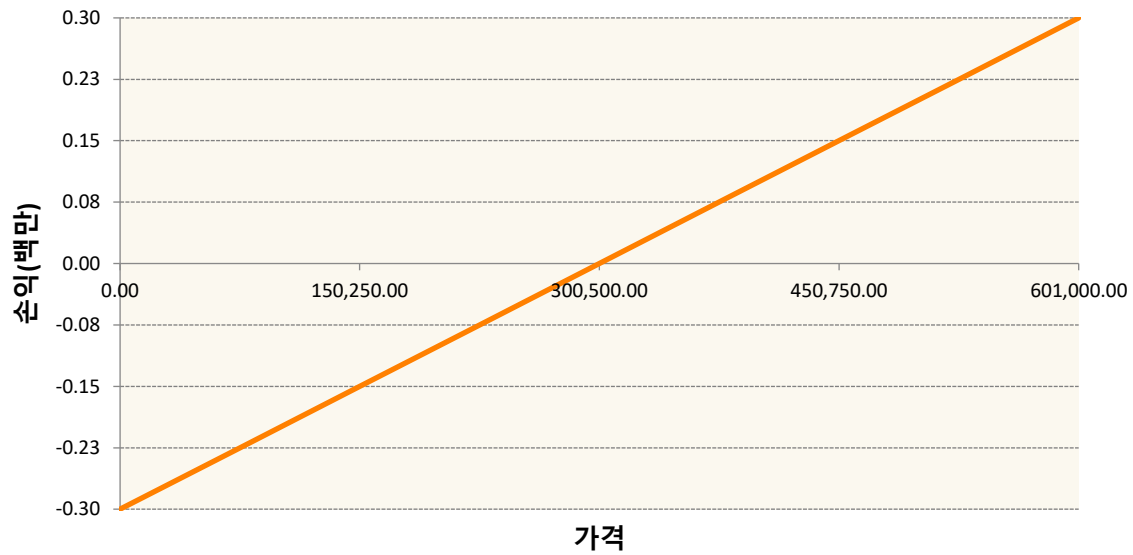
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



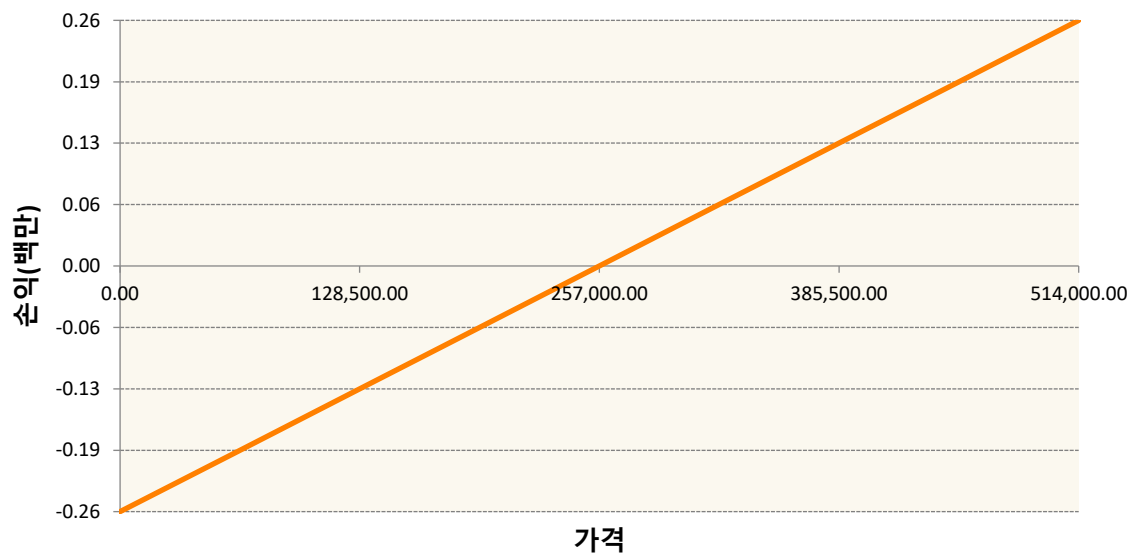
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



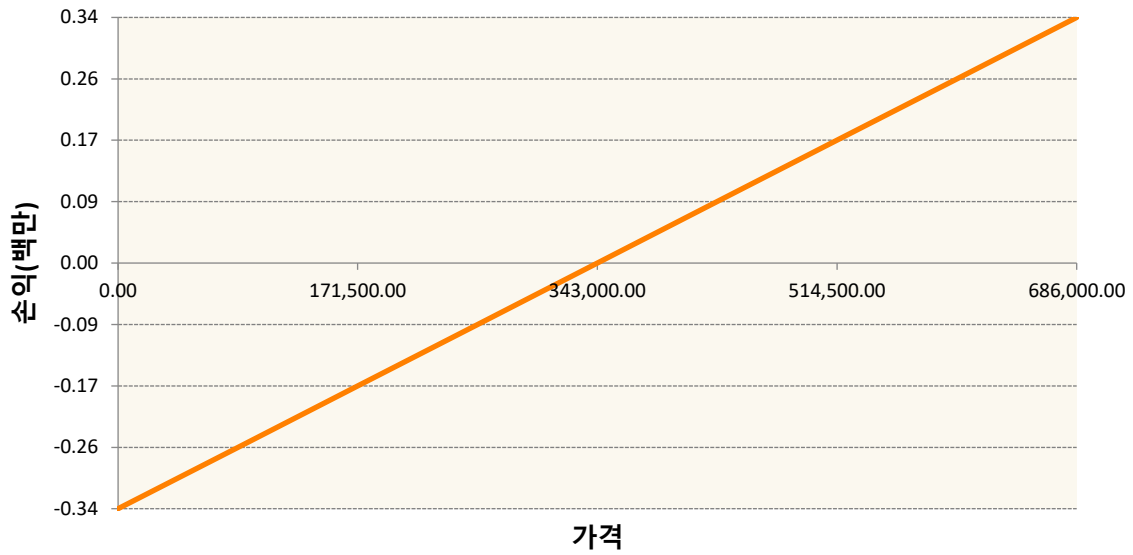
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



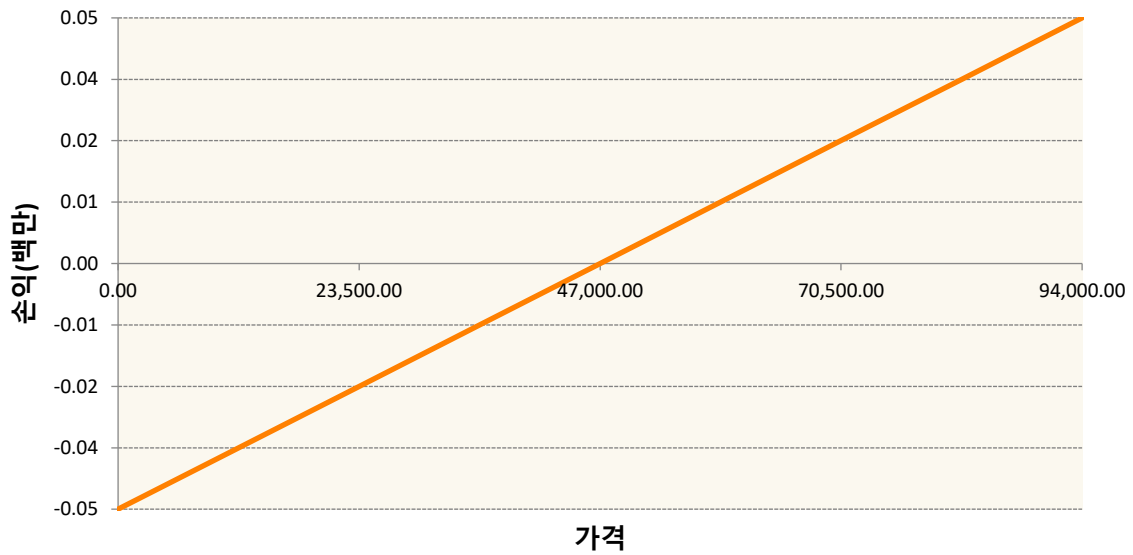
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



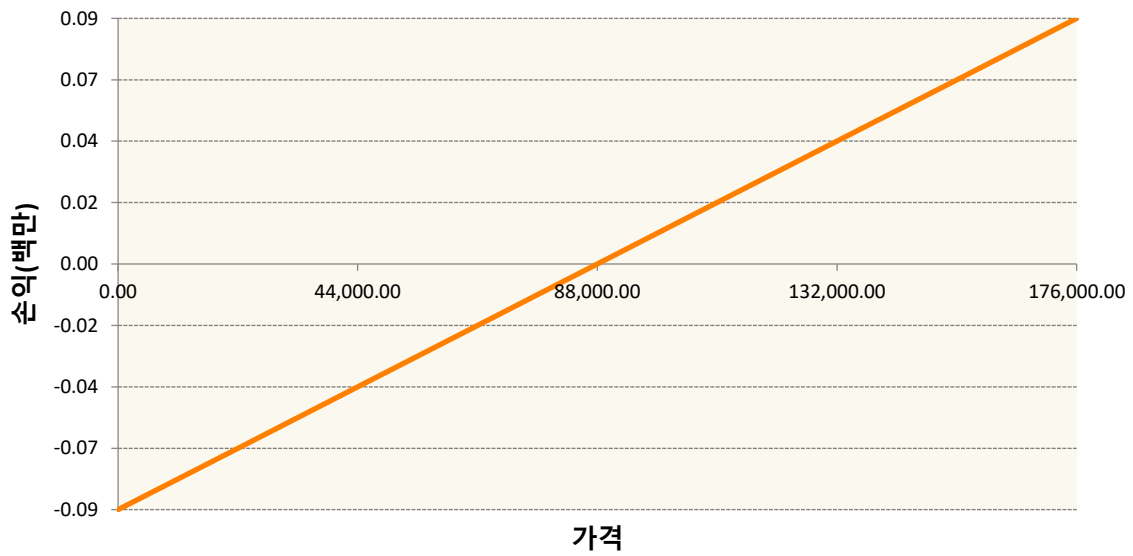
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



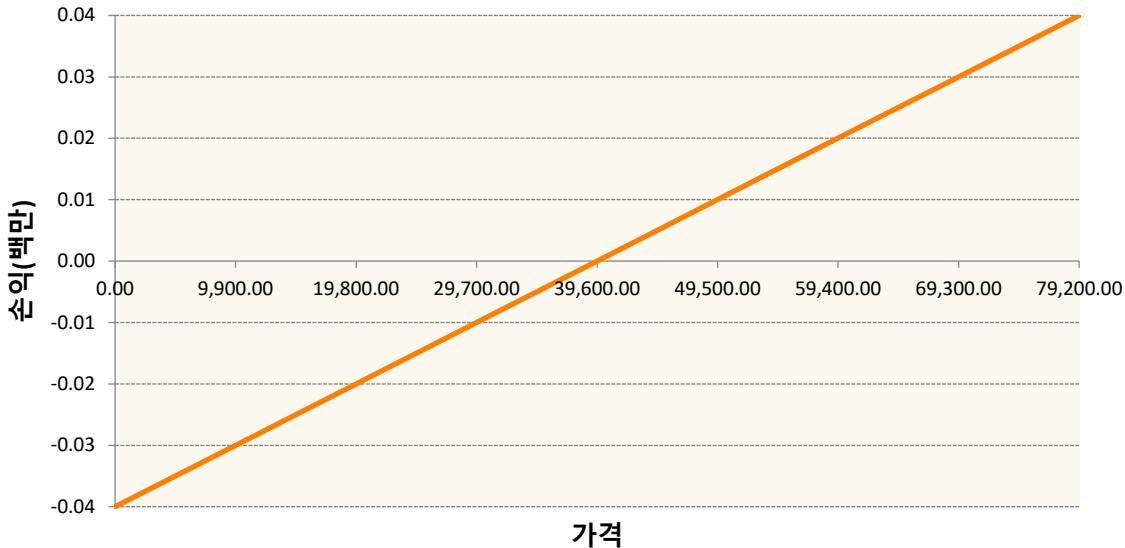
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



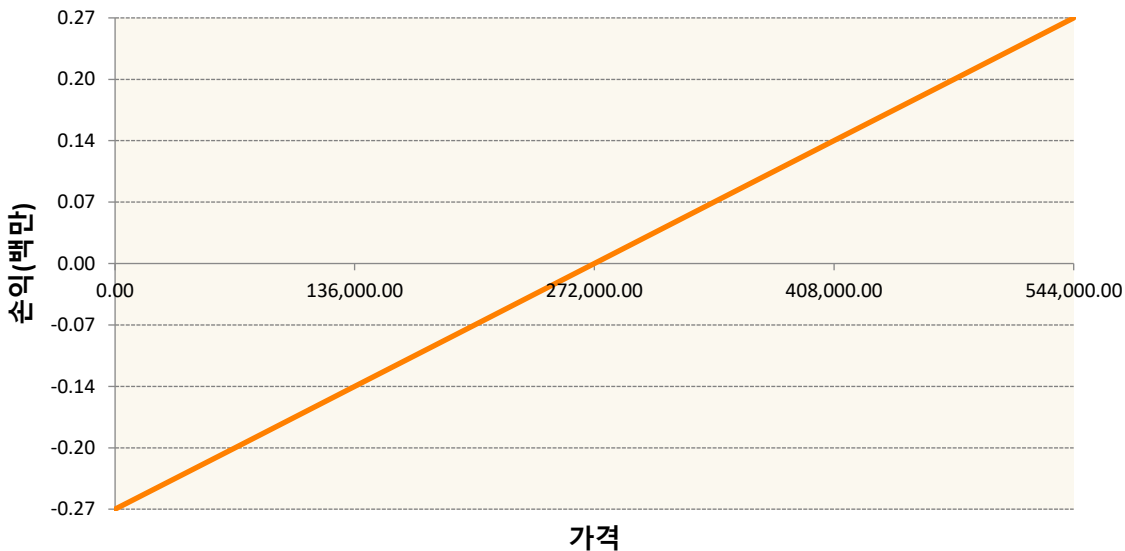
KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



KR41G0W20009-2025-02 씨에스윈드개별선물



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	-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
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	-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
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	0
-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%	0	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	-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
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	-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
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

KR41DAW20008 2025-02 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

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

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

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

(단위:백만원)

71

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

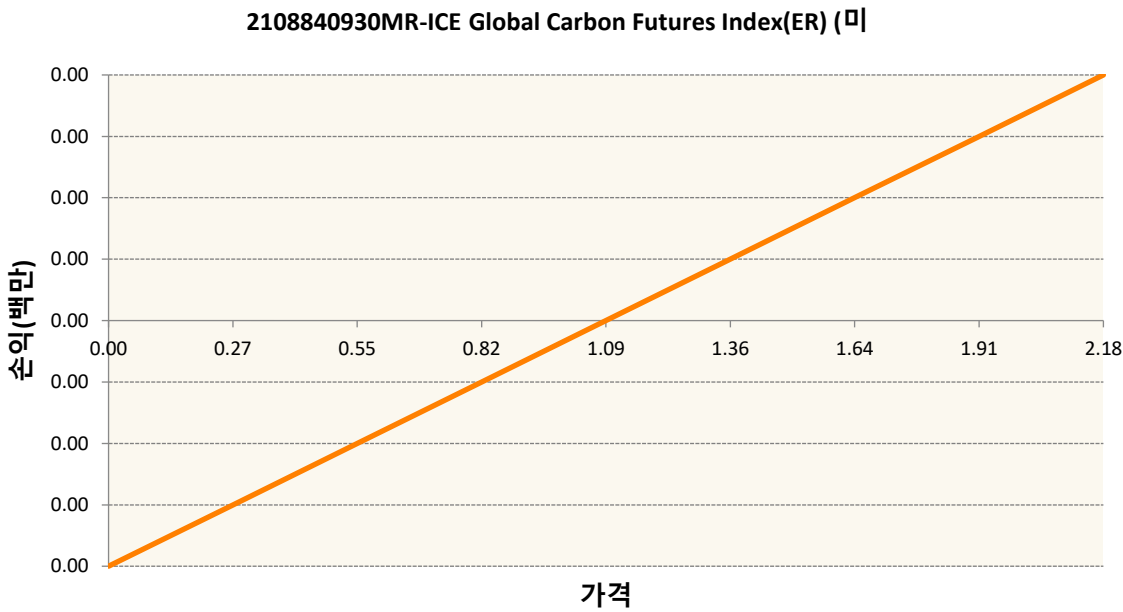
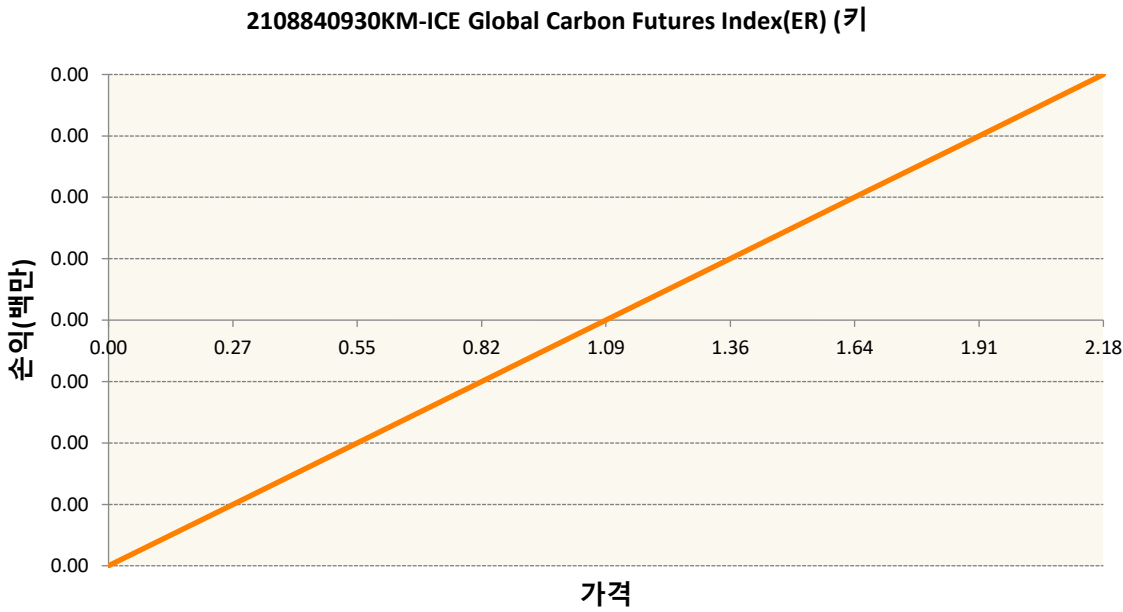
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

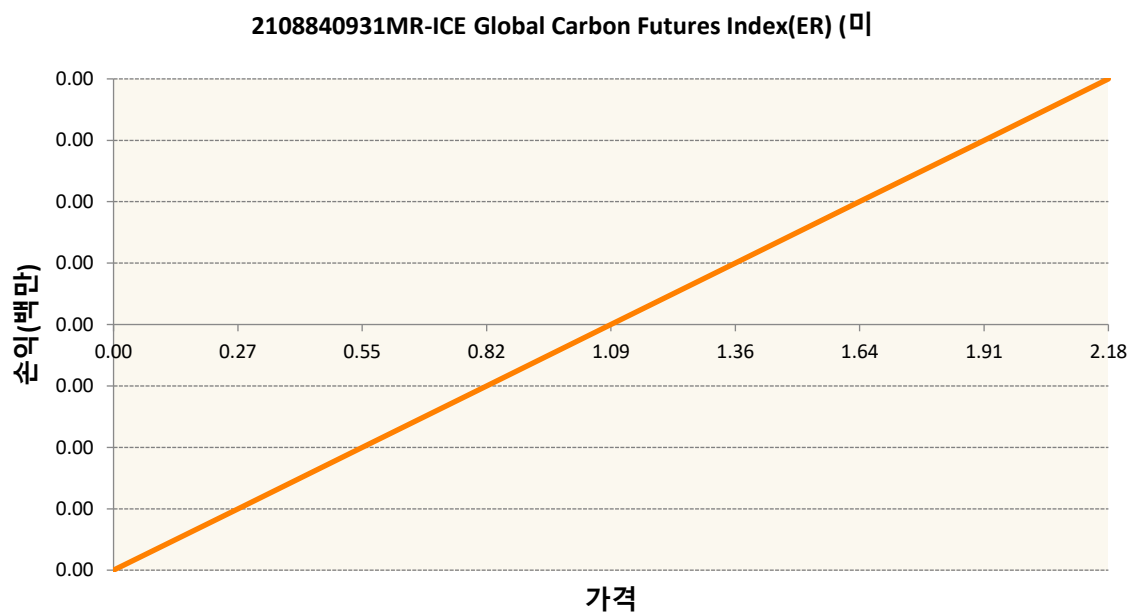
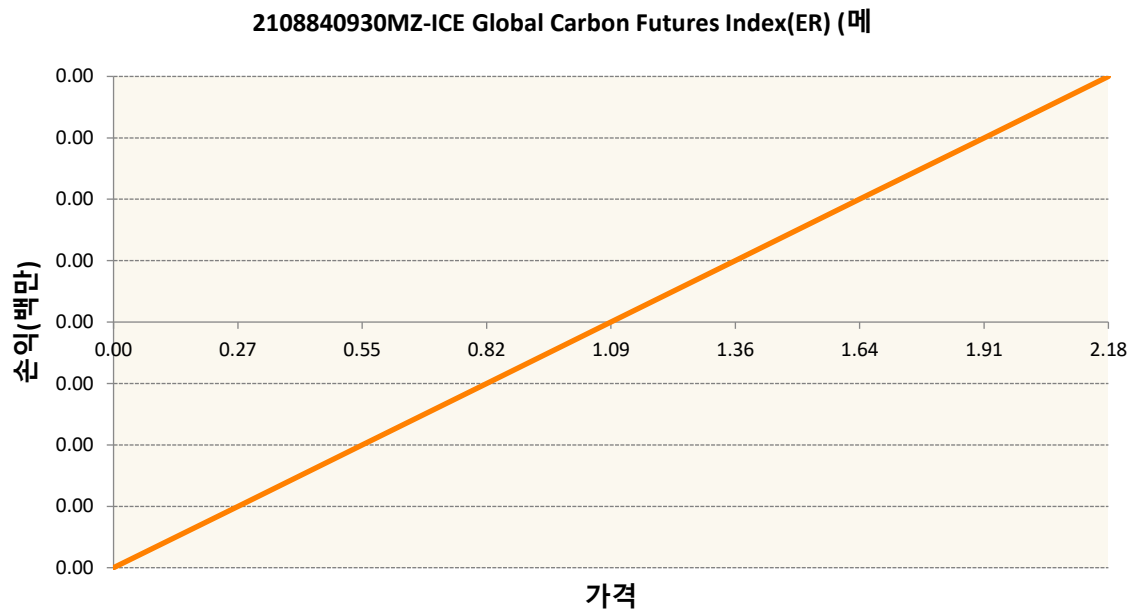
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	12,184	0	12,184	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		97
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		486
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		195
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		195

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,044

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

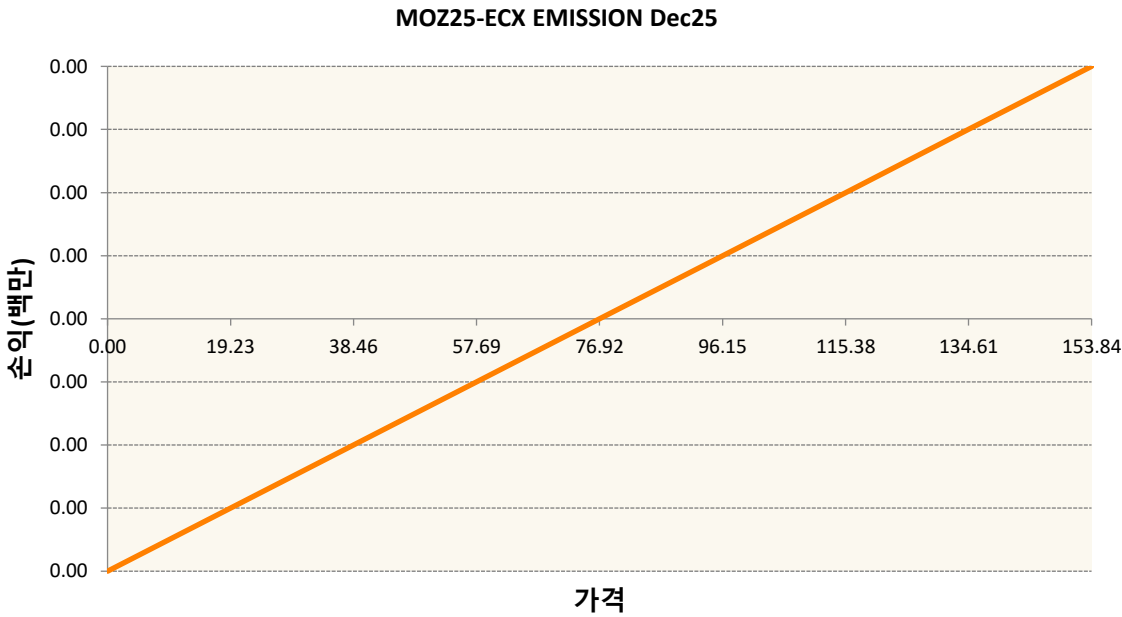
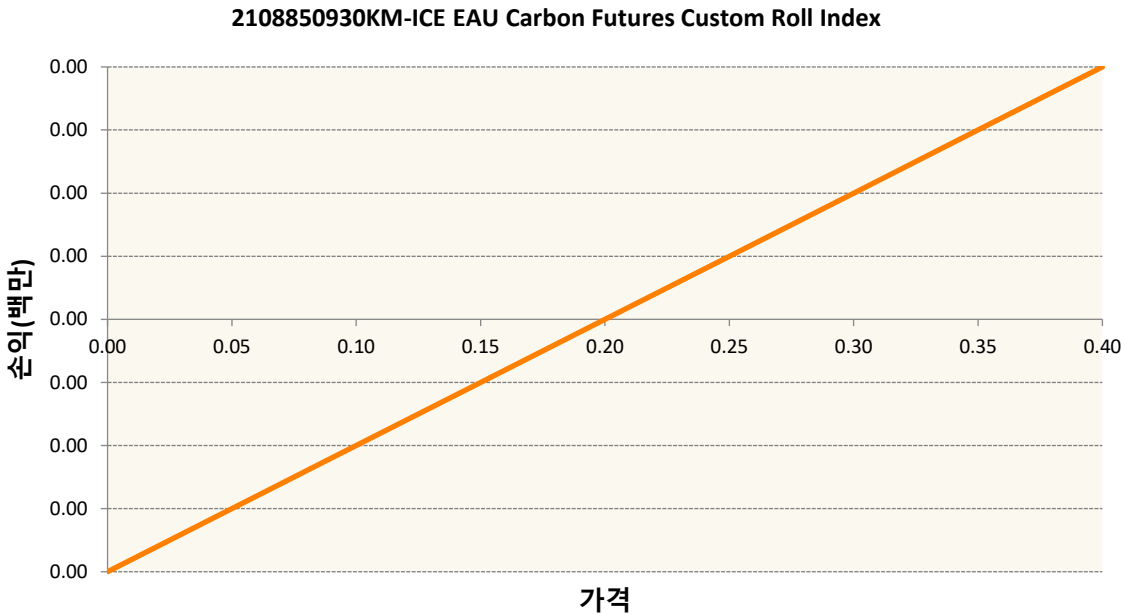
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,707	0	9,707	
누계	통화	선도	0	2,050	-2,050	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	5
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	164
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	771

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

1,397

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

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)

59

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

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)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.27

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

(단위:백만원)

6

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

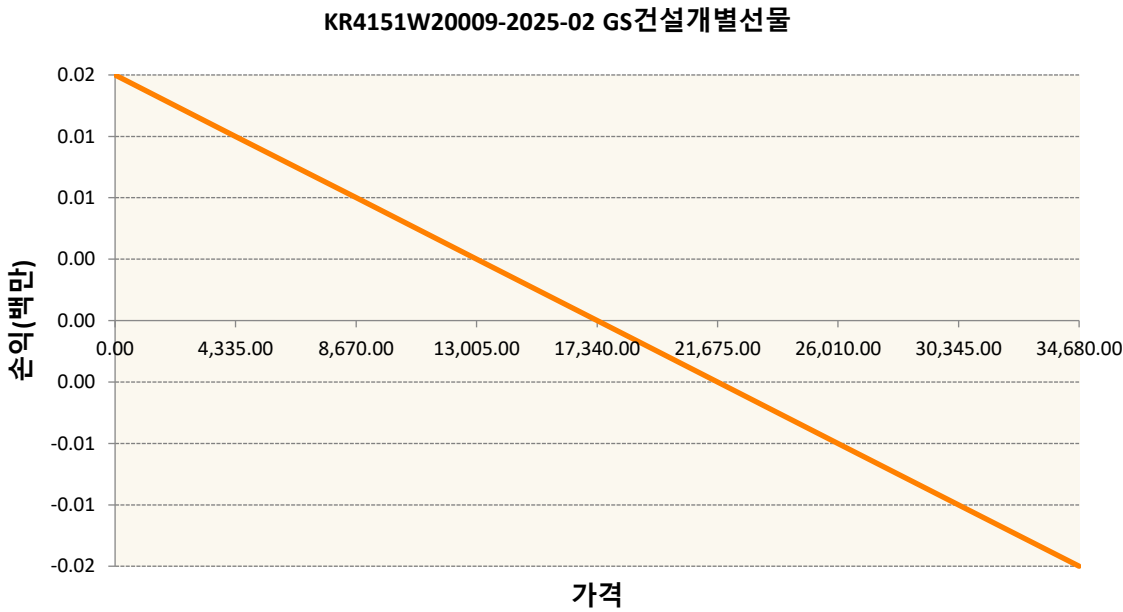
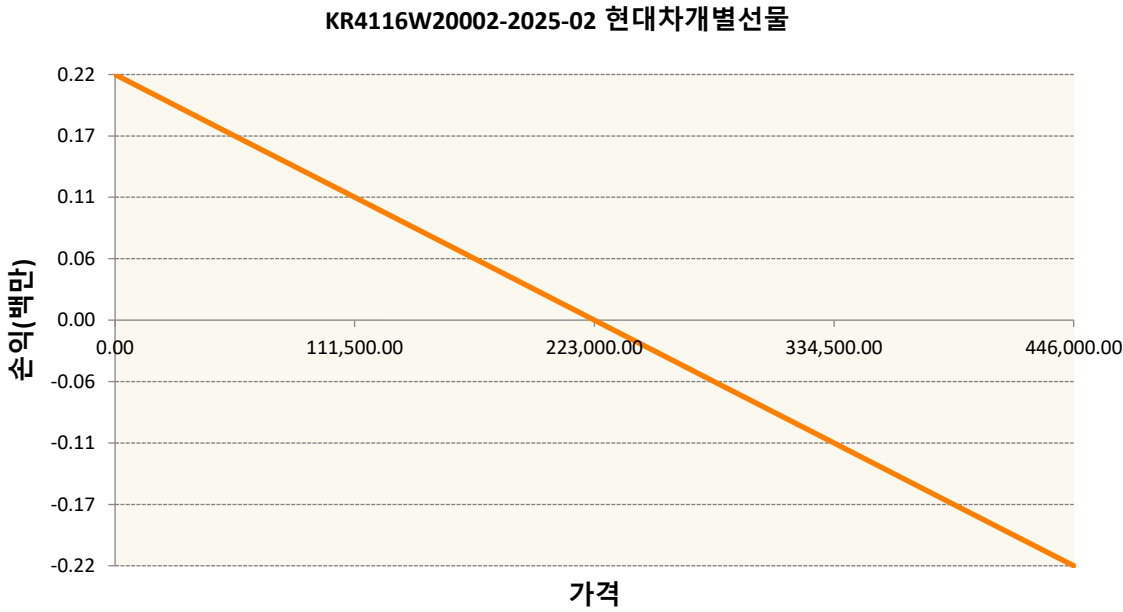
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

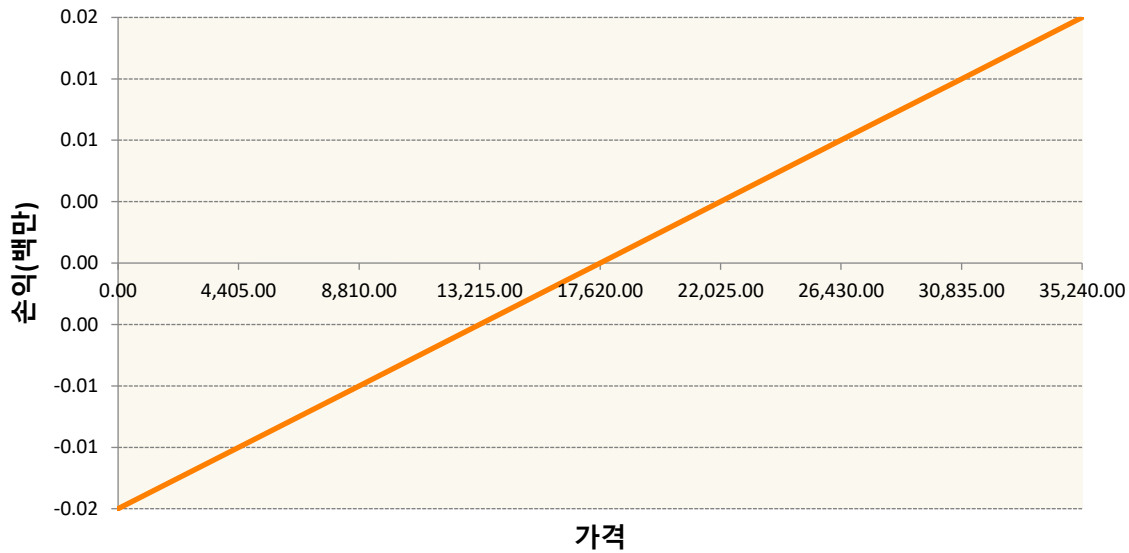
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3	-3	장내
누계	유가증권	선물	4	19	-14	장내

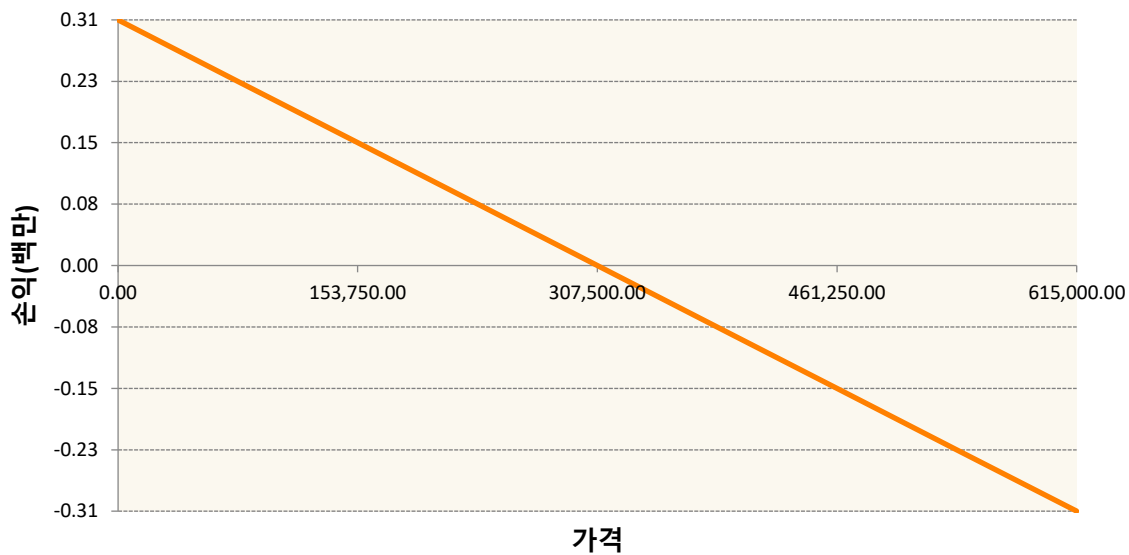
2. 만기시점의 손익구조



KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



KR41FDW20007-2025-02 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4116W20(2025-02 현대차개별선물	1
KR4151W20(2025-02 GS건설개별선물	1
KR41ETW20(2025-02 삼성E&A개별선물	0.34
KR41FDW20(2025-02 HD현대중공업개별선물	0.25

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

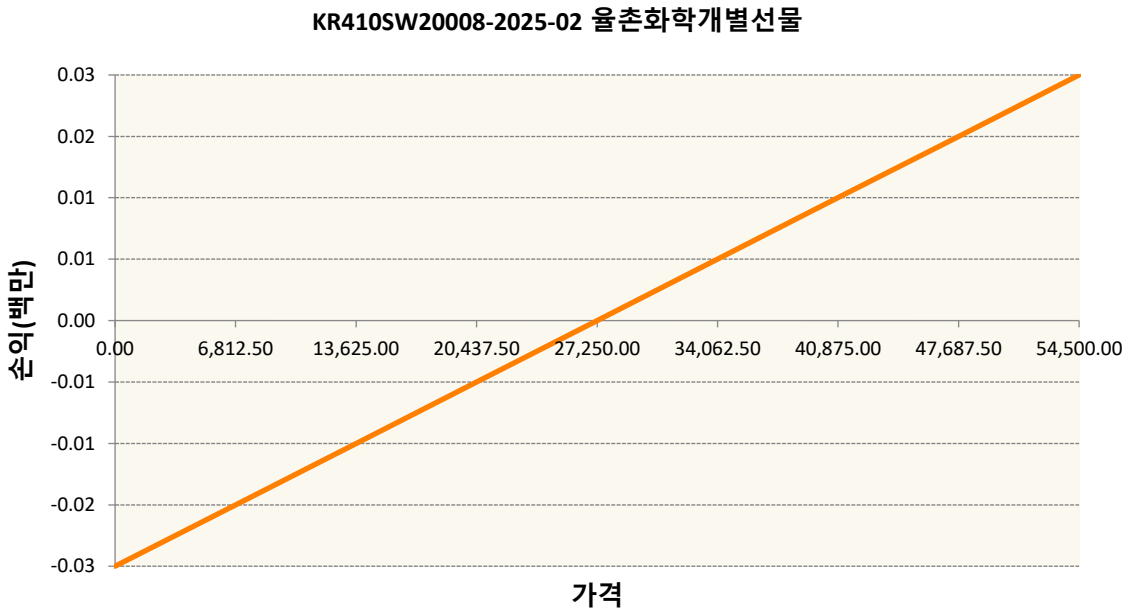
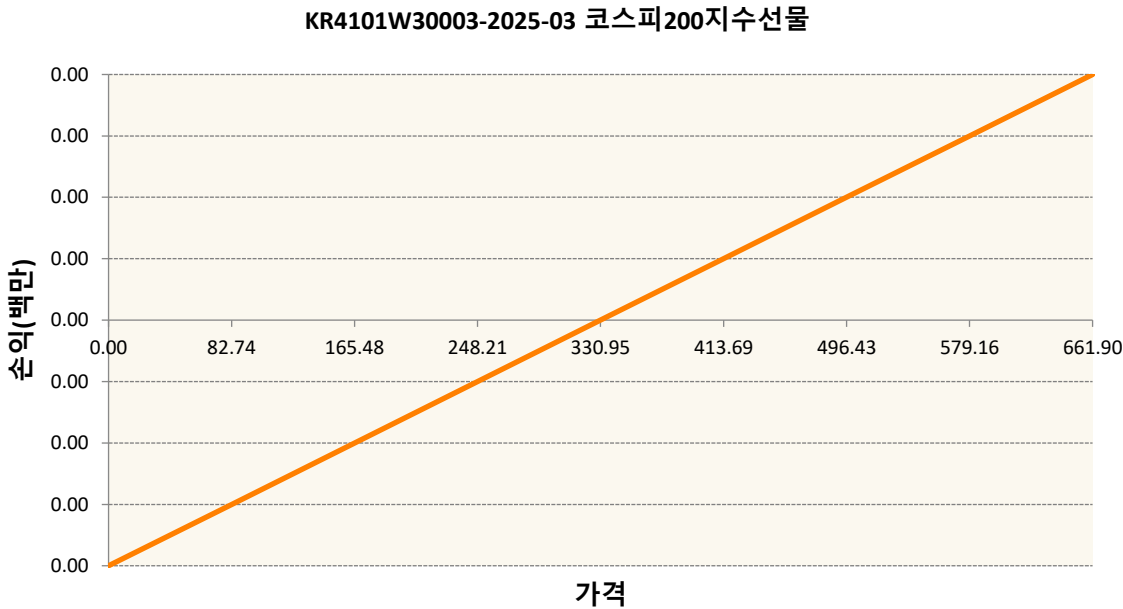
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

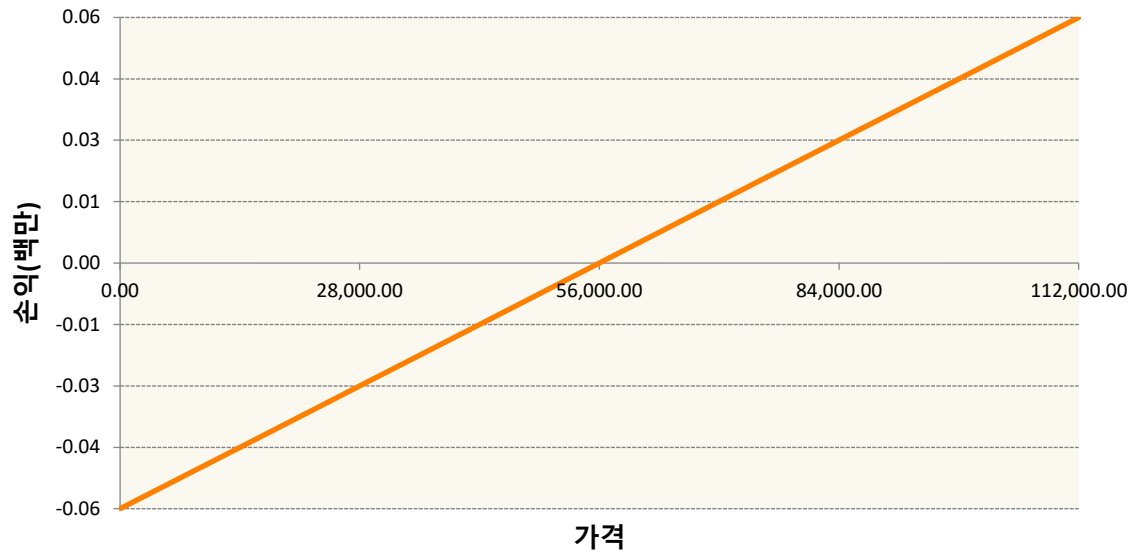
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,722	1,654	69	장내
누계	유가증권	선물	9,409	0	9,409	장내

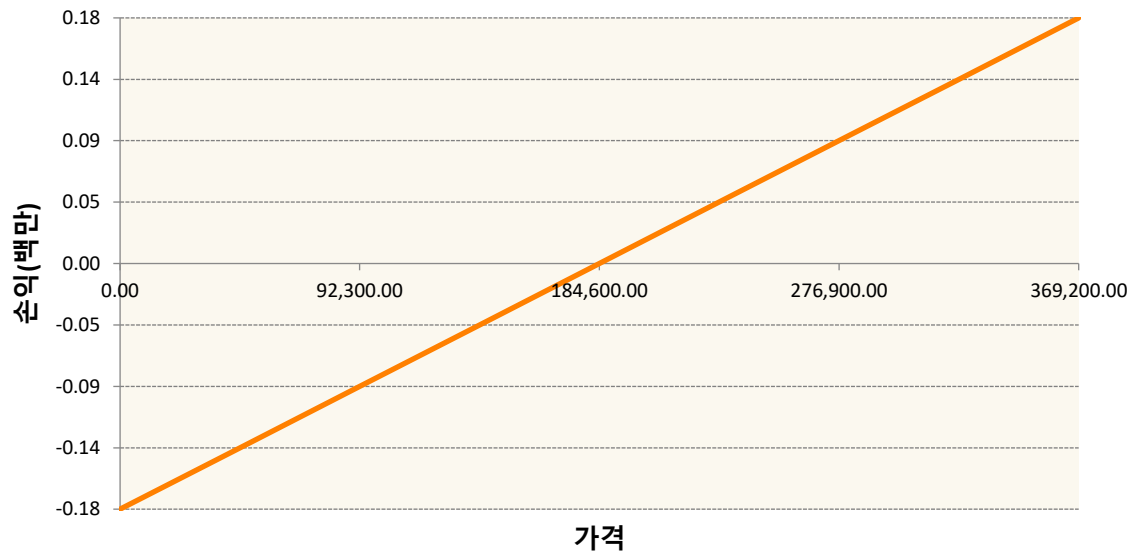
2. 만기시점의 손익구조



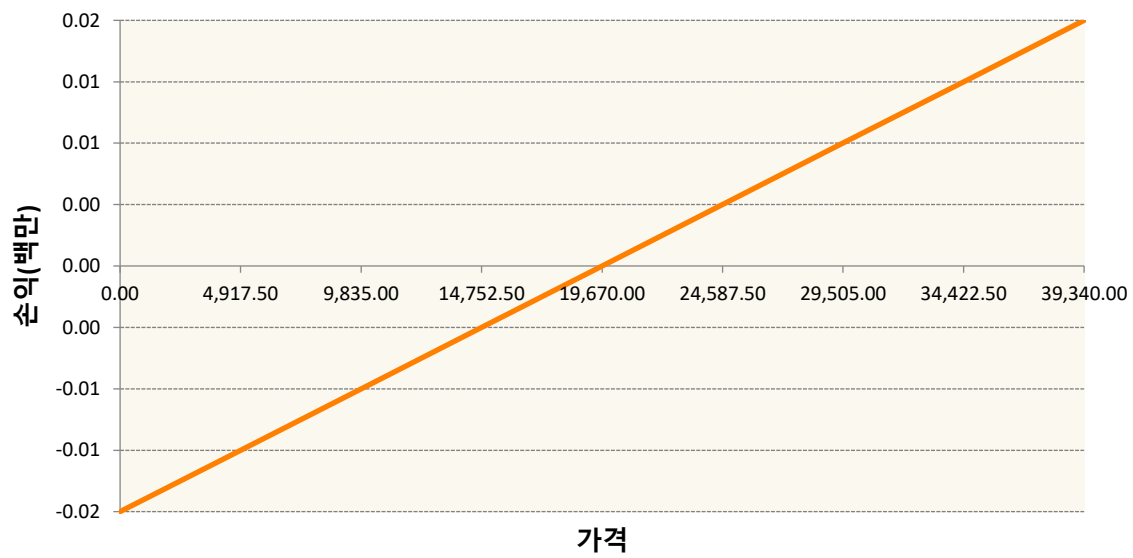
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



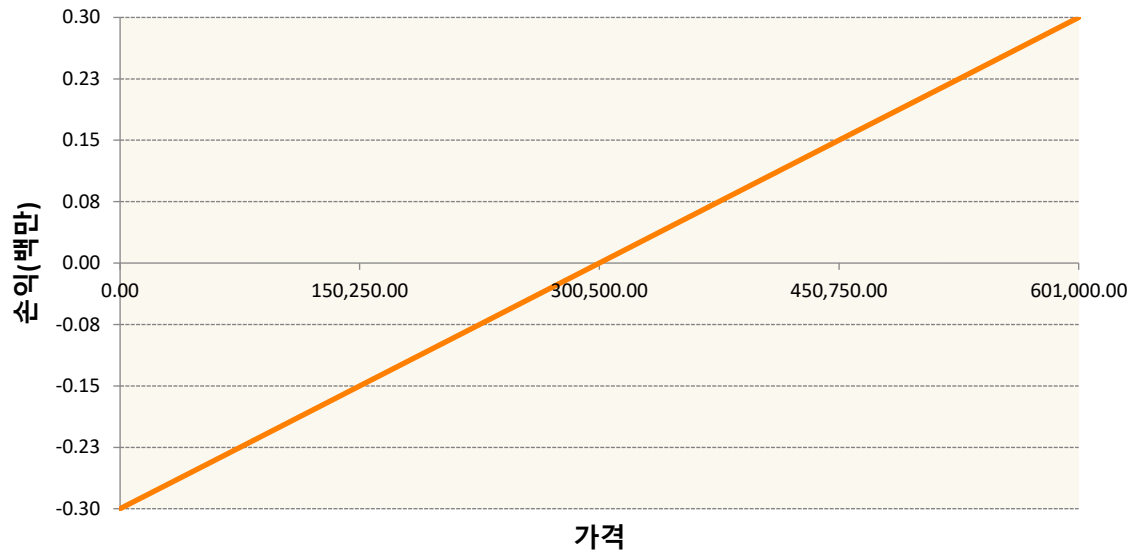
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



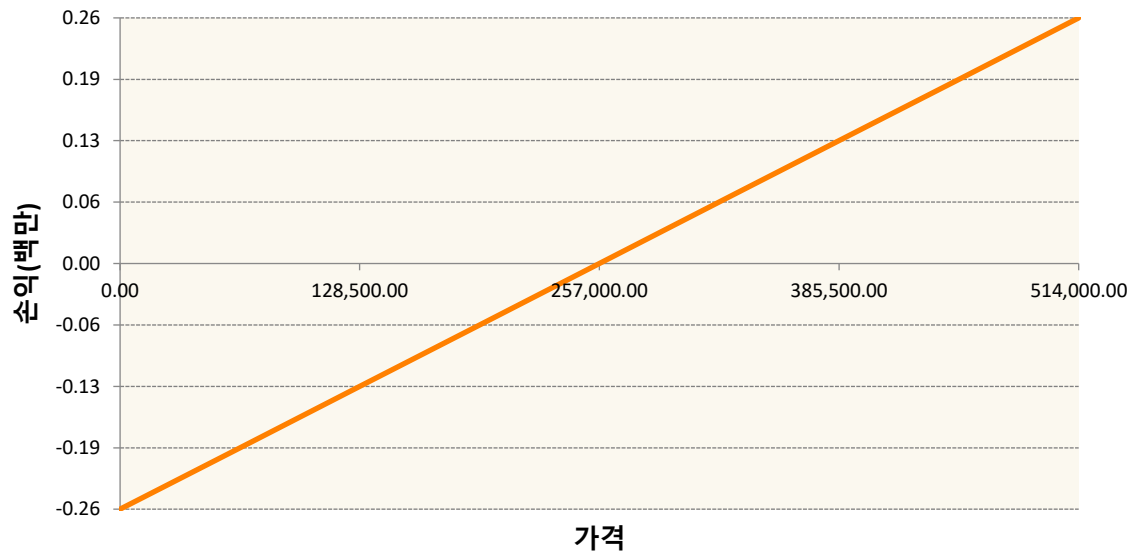
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



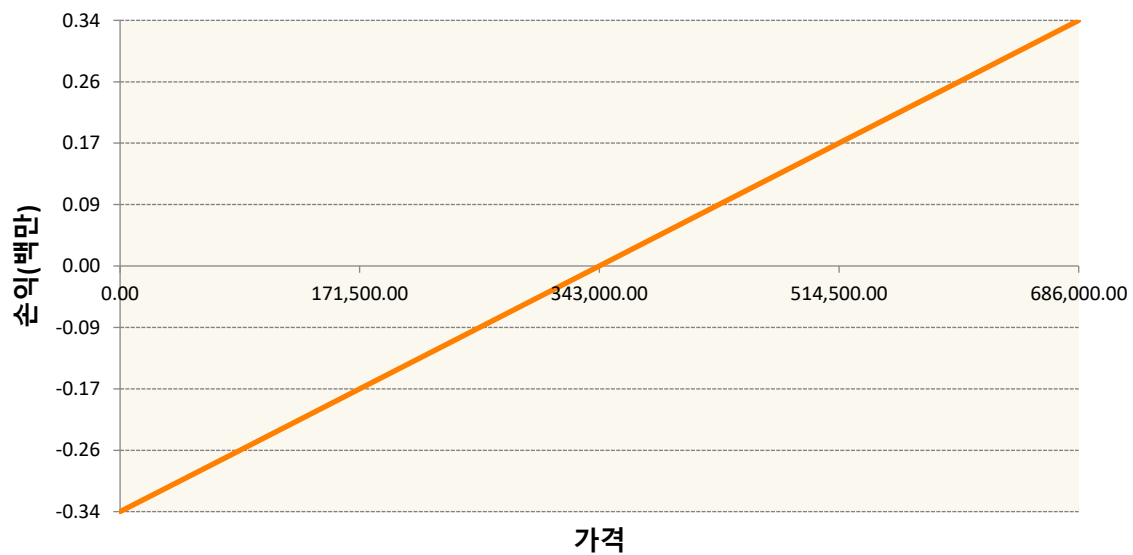
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



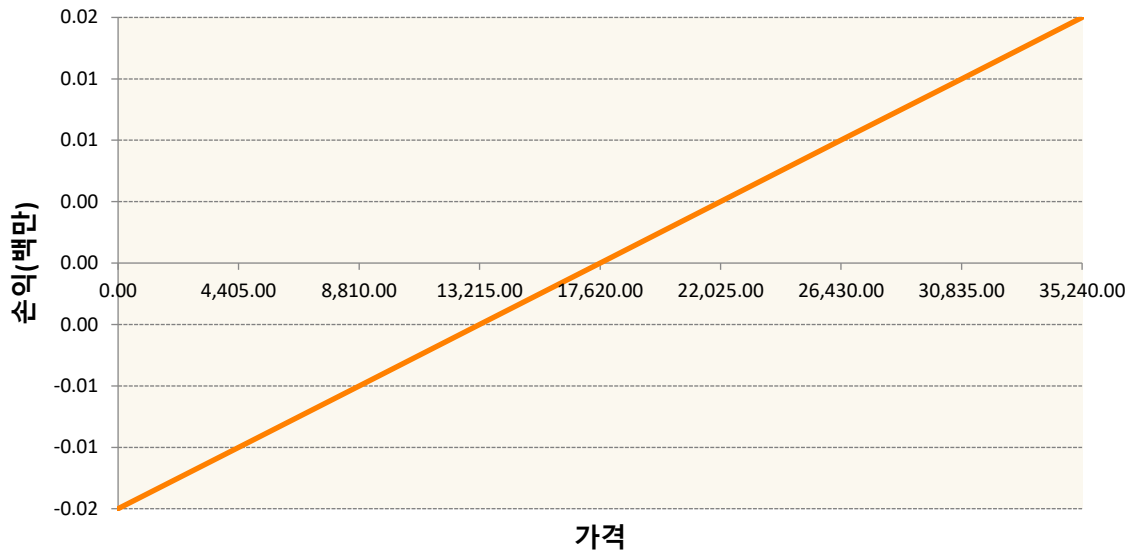
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



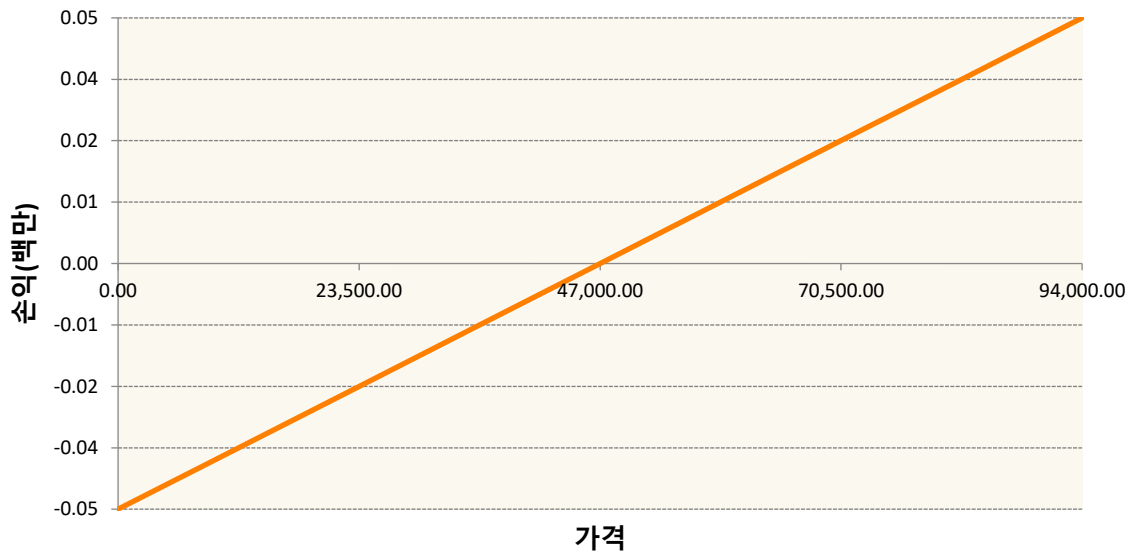
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



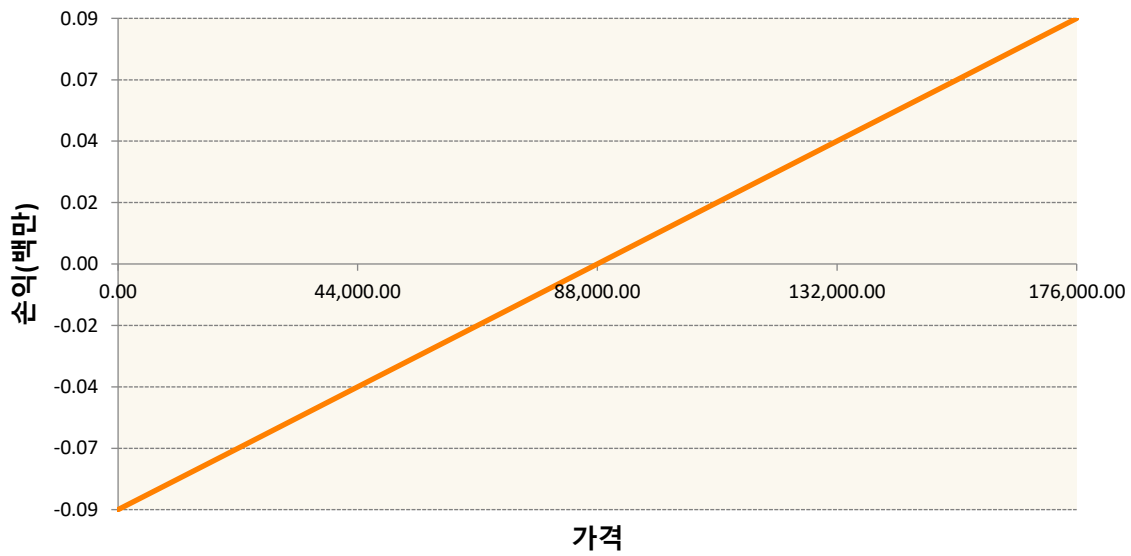
KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



가격	손익(백만)
0.00	-0.04
9,900.00	-0.03
19,800.00	-0.02
29,700.00	-0.01
39,600.00	0.00
49,500.00	0.01
59,400.00	0.02
69,300.00	0.03
79,200.00	0.04

The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 544,000.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -0.27 to 0.27. A blue line represents the profit function, starting at a price of 0 and a profit of -0.27, and ending at a price of 544,000 and a profit of 0.27. The line crosses the x-axis at a price of 272,000.00, which is the break-even point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-0.27
136,000.00	-0.14
272,000.00	0.00
408,000.00	0.14
544,000.00	0.27

(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%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-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%	419	419	419	419	419	419	419
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%	-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%	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%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-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%	15	15	15	15	15	15	15
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

KR41DAW20008 2025-02 농심개별선물 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

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 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
-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%	12	12	12	12	12	12	12

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%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-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%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

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

(단위:백만원)

850

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

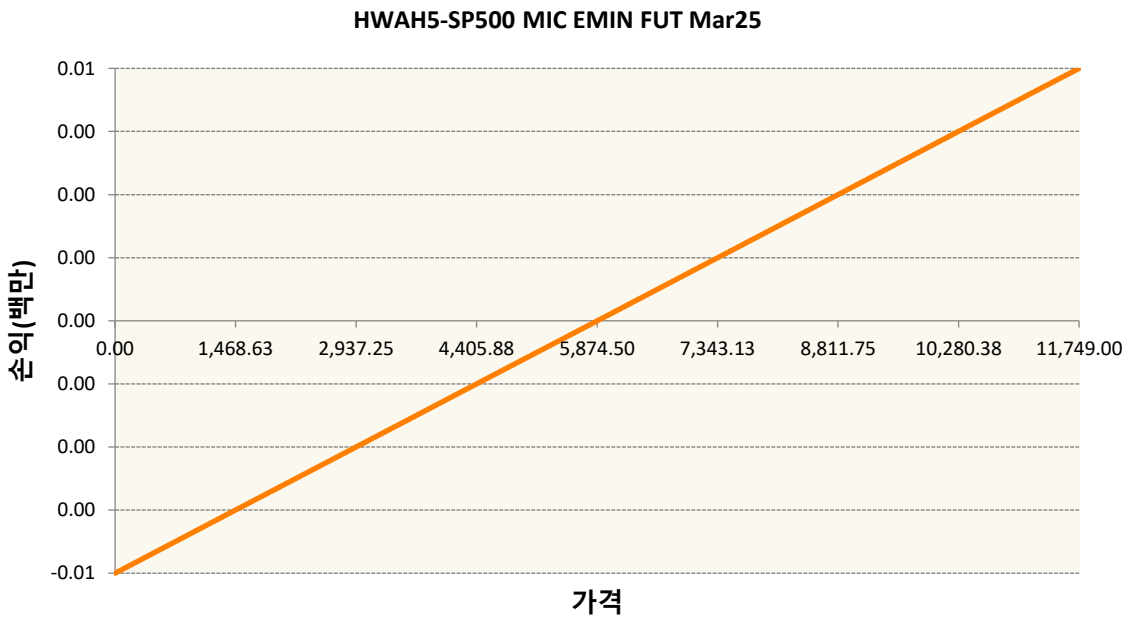
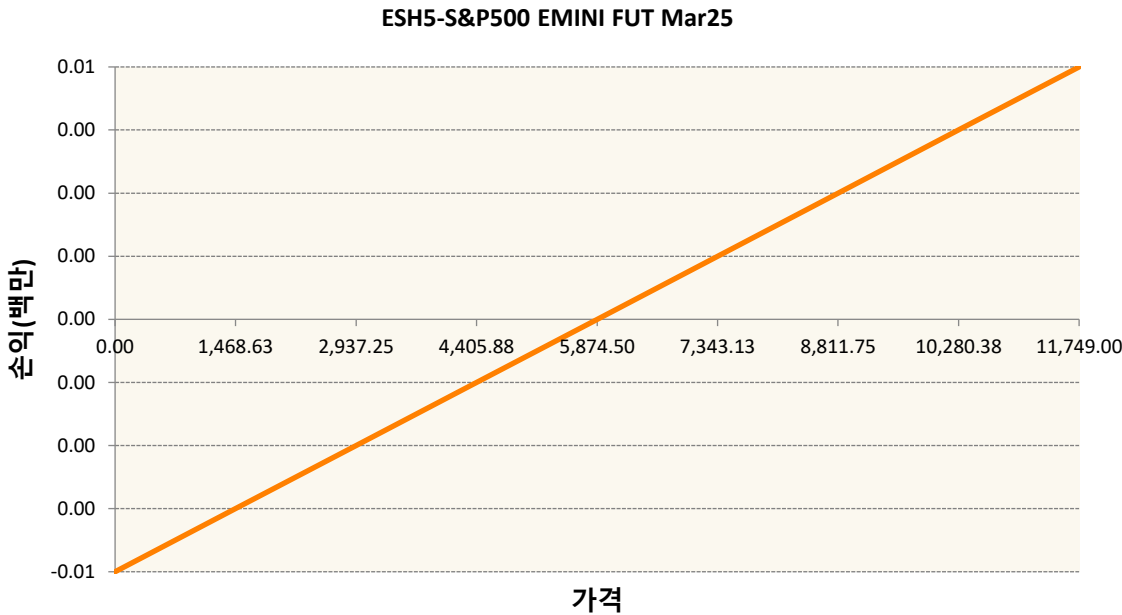
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	26,036	0	26,036	
누계	유가증권	선물	1,620	0	1,620	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,083
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	130

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,921

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

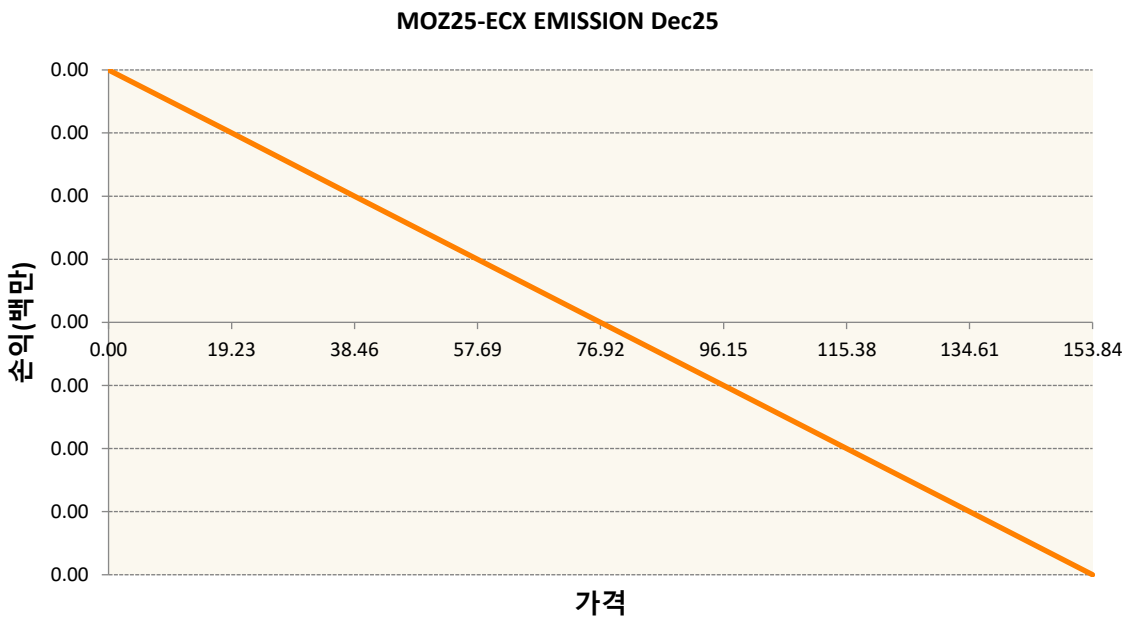
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-68	3,997	-4,064	
누계	통화	선도	0	1,265	-1,265	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	5
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	9
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	92
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	320

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

(단위:백만원)

600

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

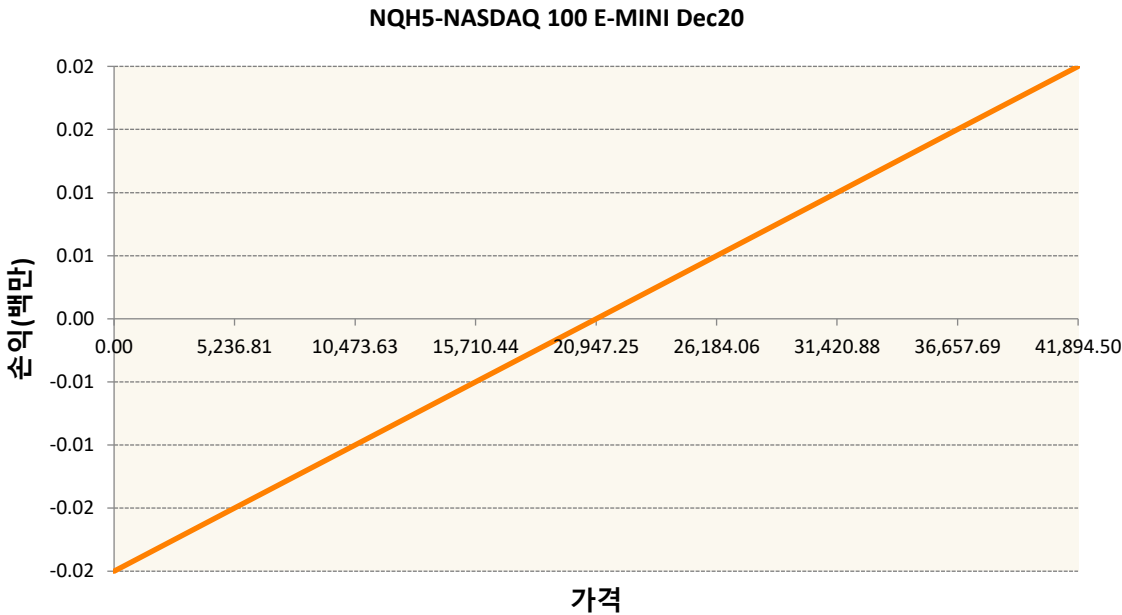
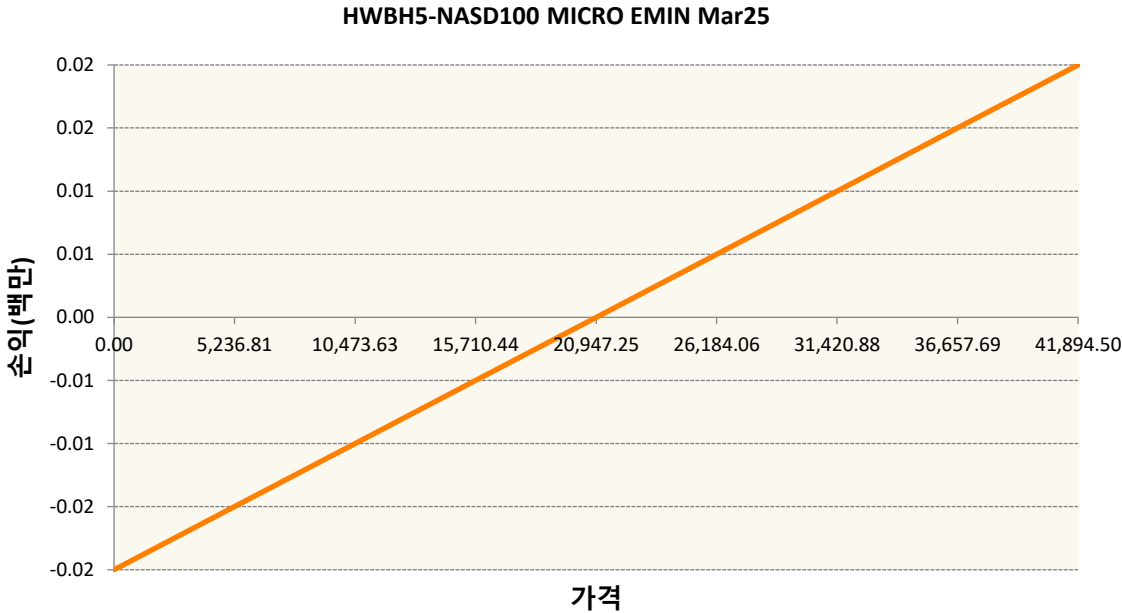
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,402	0	13,402	
누계	유가증권	선물	974	0	974	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25		78
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,072

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		997

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

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	699
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,790
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,408
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,315

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

(단위:백만원)

9,177

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

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	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4

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

(단위:백만원)

16

공시일	2025-01-15
기준일	2025-01-14

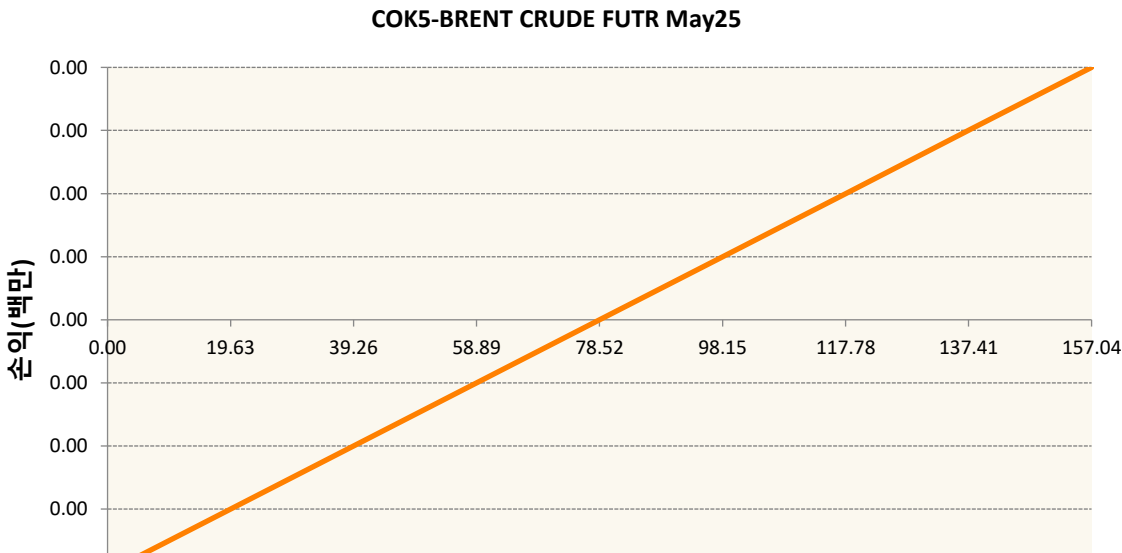
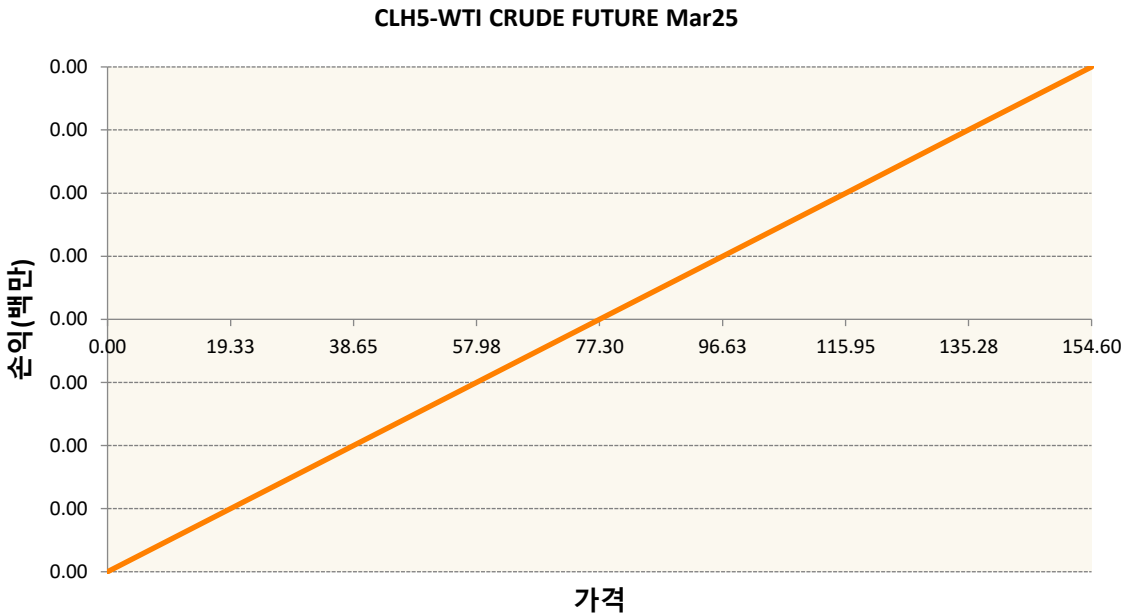
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

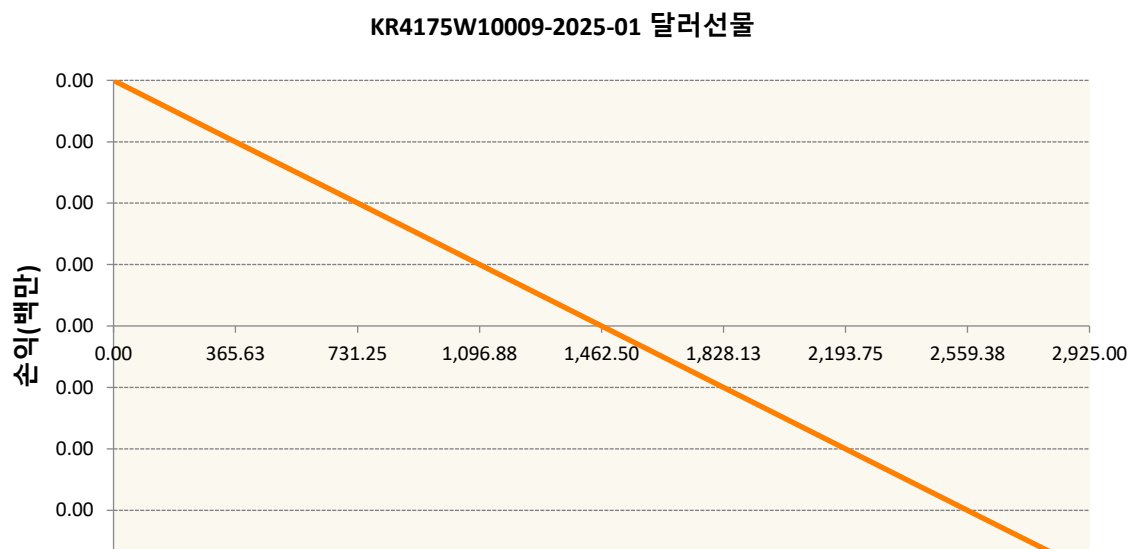
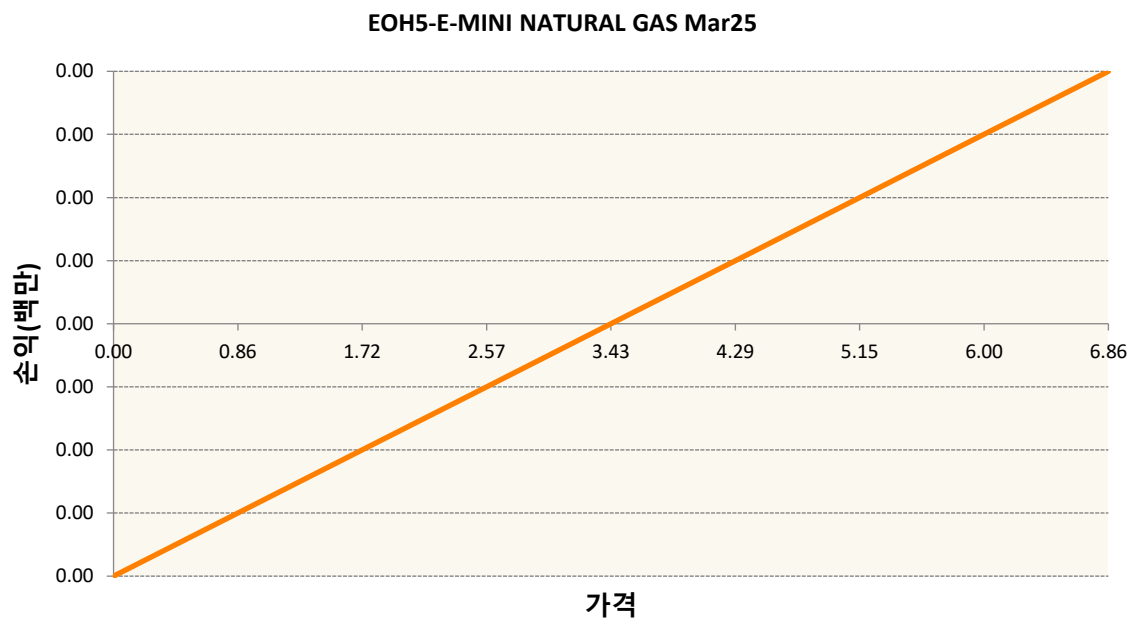
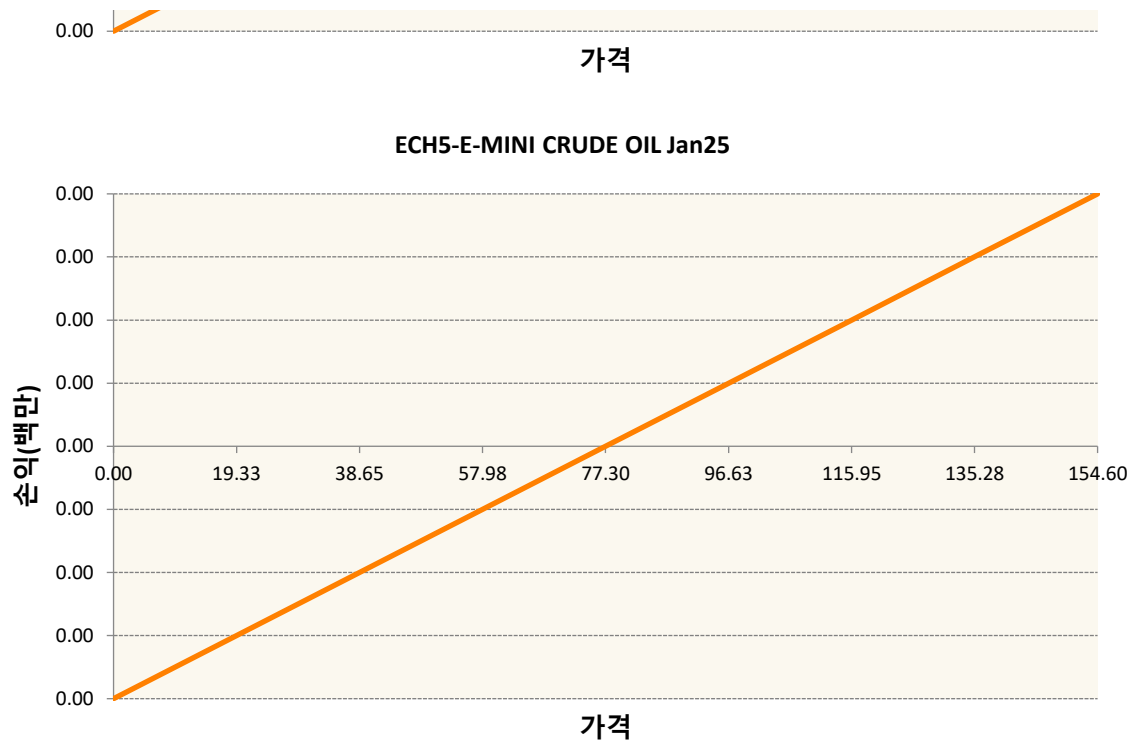
1. 계약금액

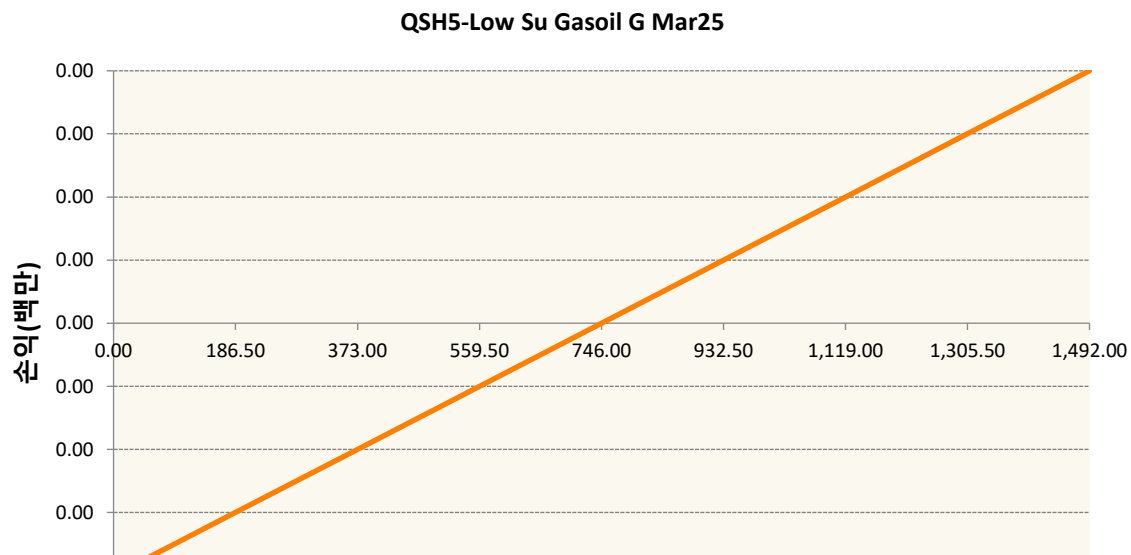
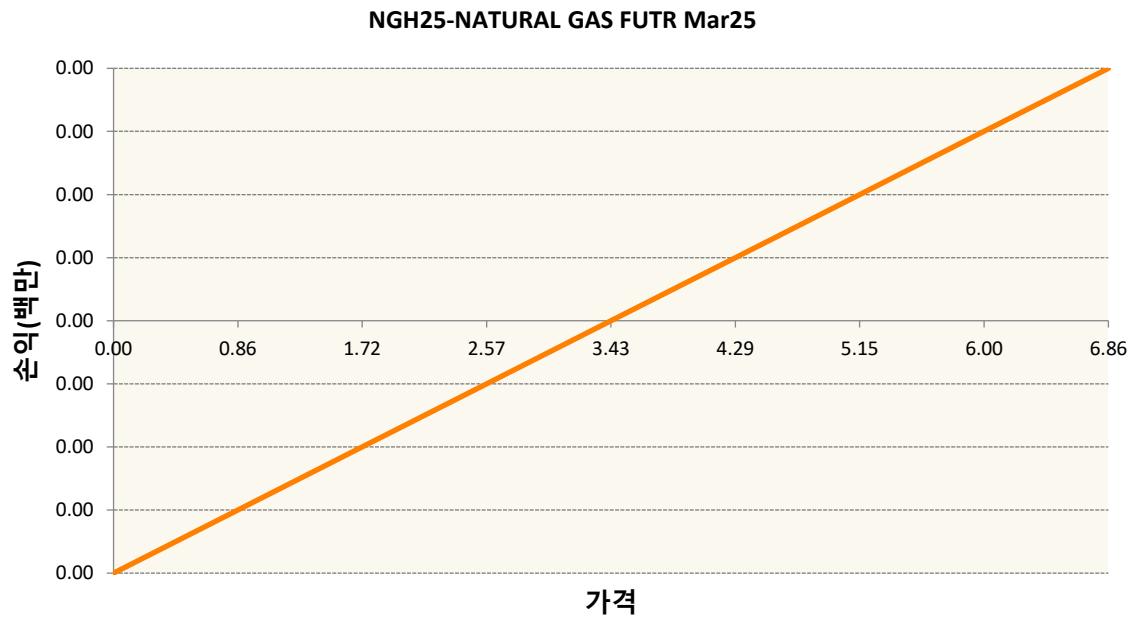
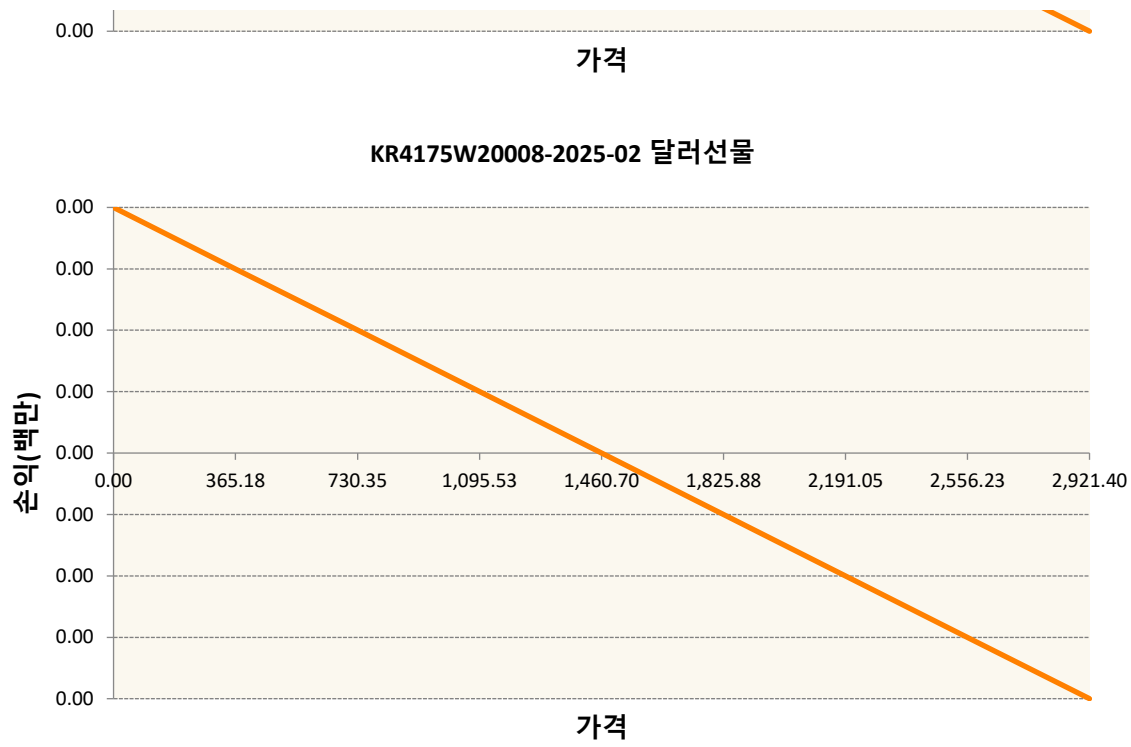
(단위:백만원)

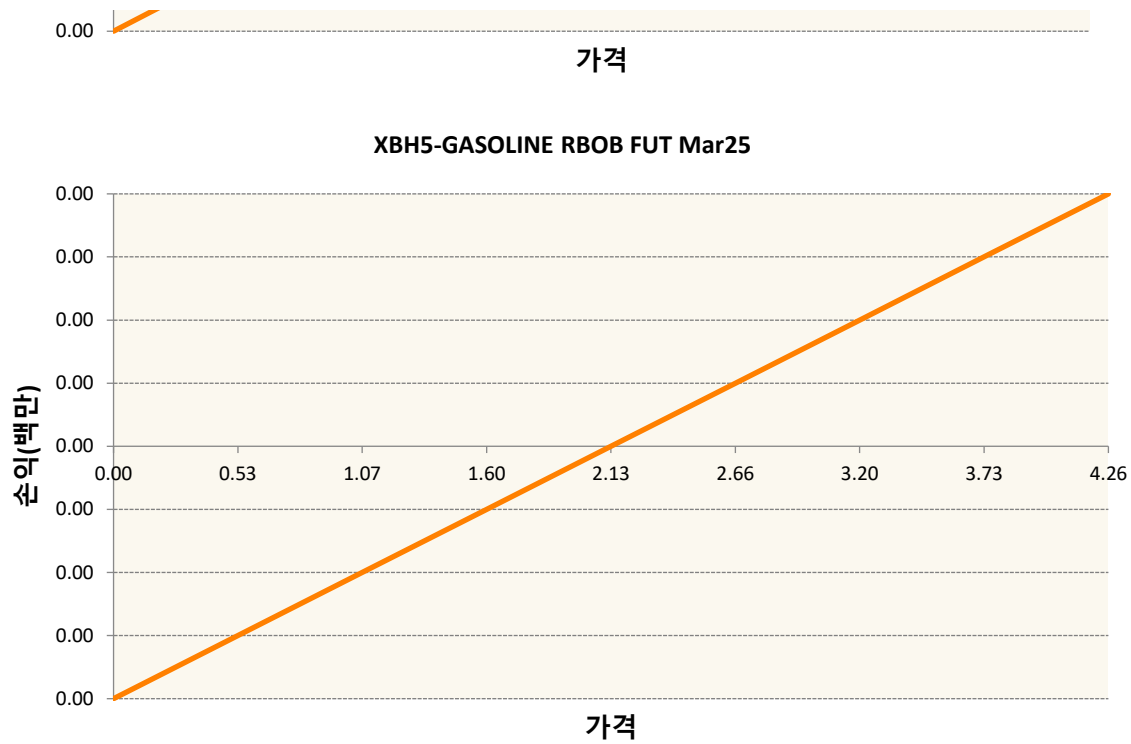
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	15	-15	장내
누계	선물	유가증권	111	0	111	
누계	유가증권	선물	770	0	770	
누계	통화	선물	0	205	-205	장내

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	4
KR4175W10(2025-01 달러선물		14
KR4175W20(2025-02 달러선물		2
NGH25	NATURAL GAS FUTR Mar25	16
QSH5	Low Su Gasoil G Mar25	9
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar25	10

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

(단위:백만원)

158