

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

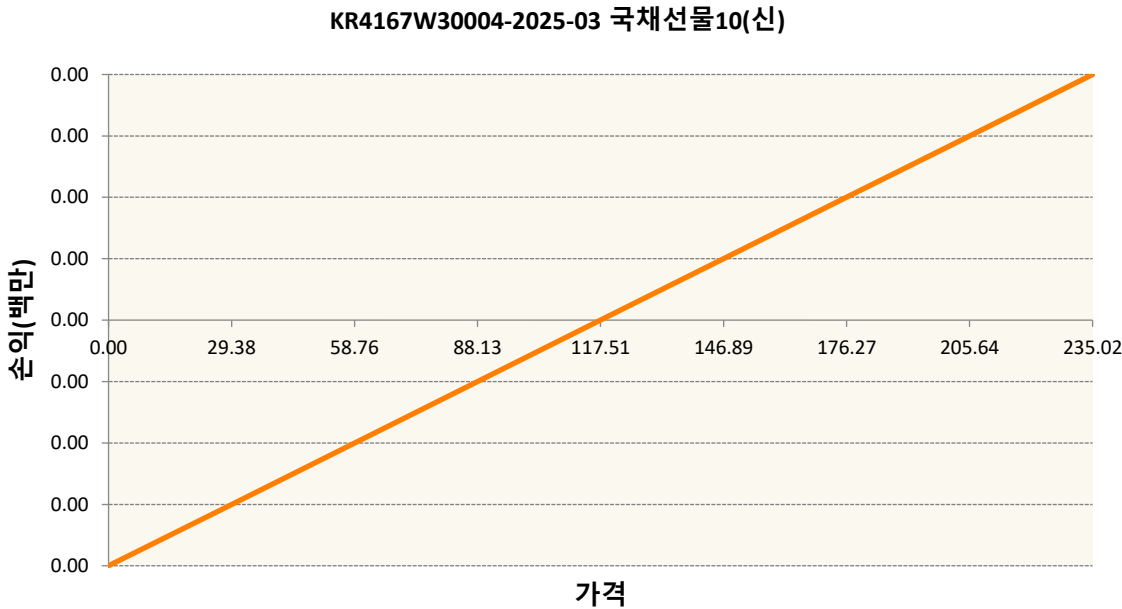
베스트장기채(채권-파생형)

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	112,810	0	112,810	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

2,926

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

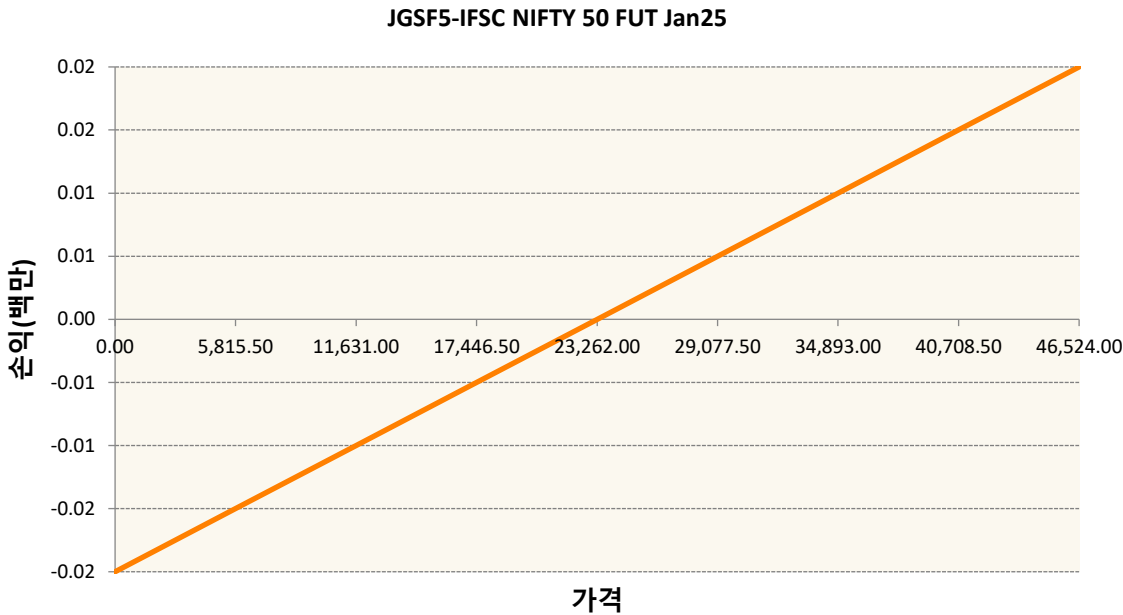
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,408	0	3,408	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSF5	IFSC NIFTY 50 FUT Jan25	273
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

183

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

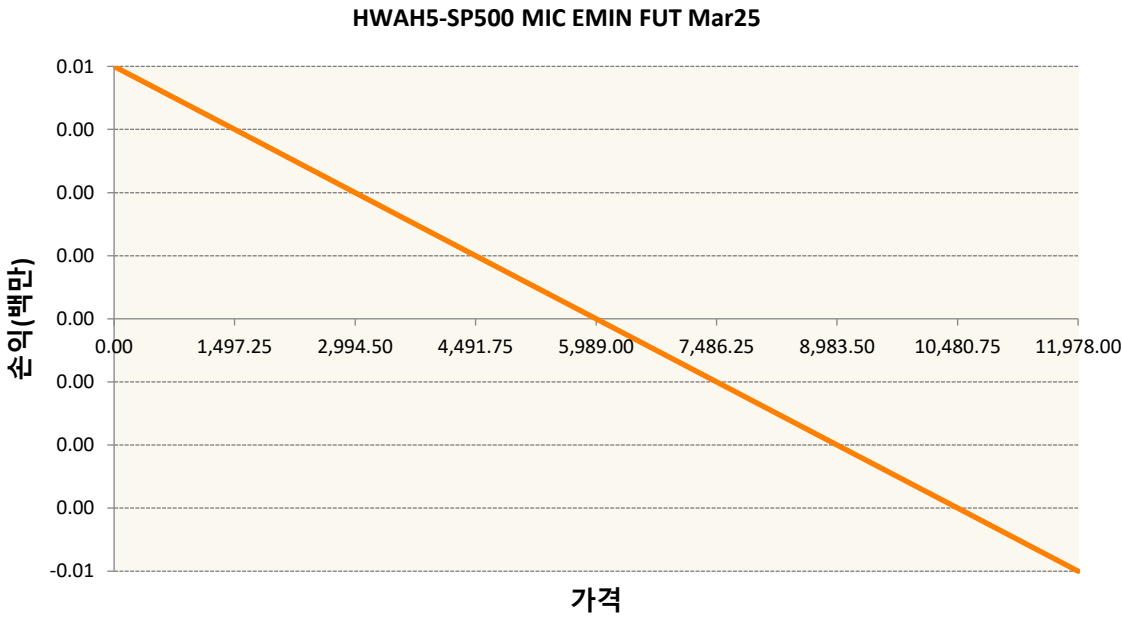
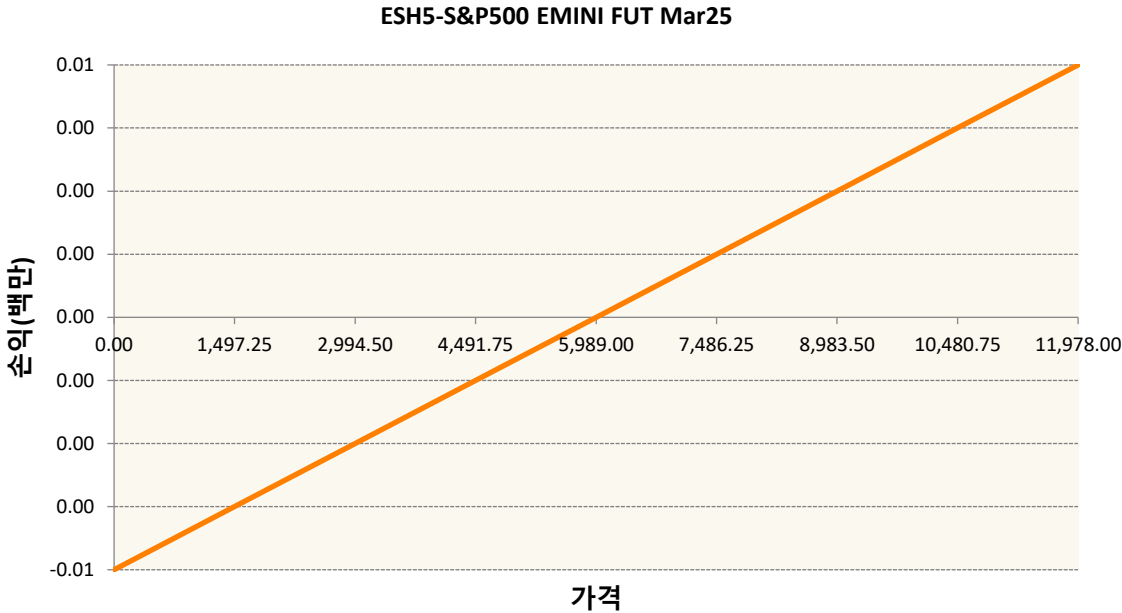
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	870	0	870	
누계	유가증권	선물	0	91	-91	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	70
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	100

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

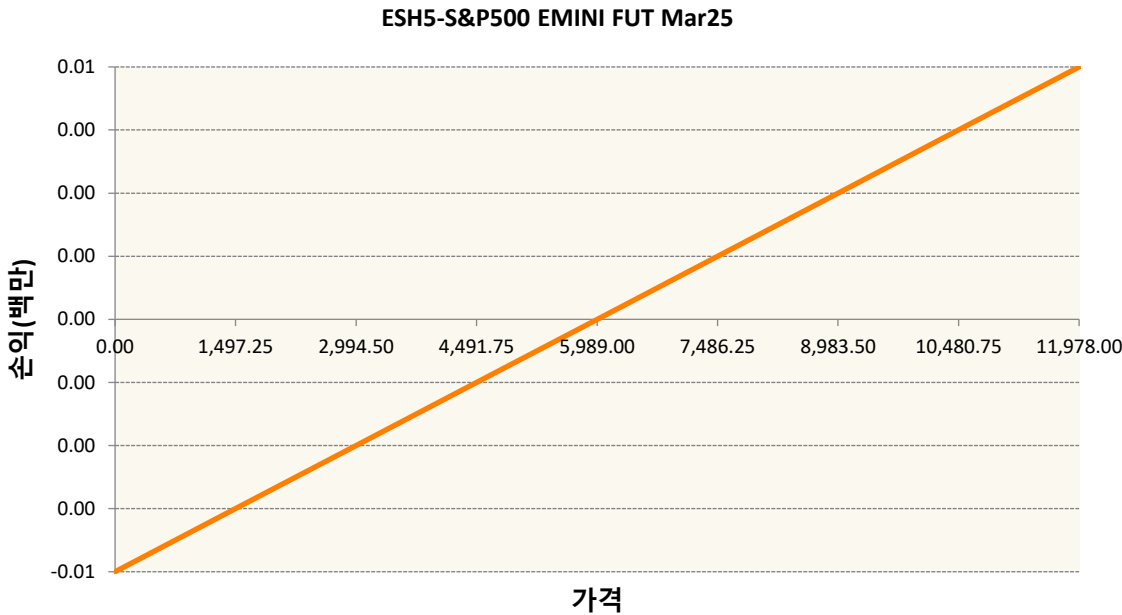
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,608	0	2,608	
누계	통화	선도	0	102	-102	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	209
FXW213F1G(KRW/USD 07-02-25E		8

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

(단위:백만원)

288

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

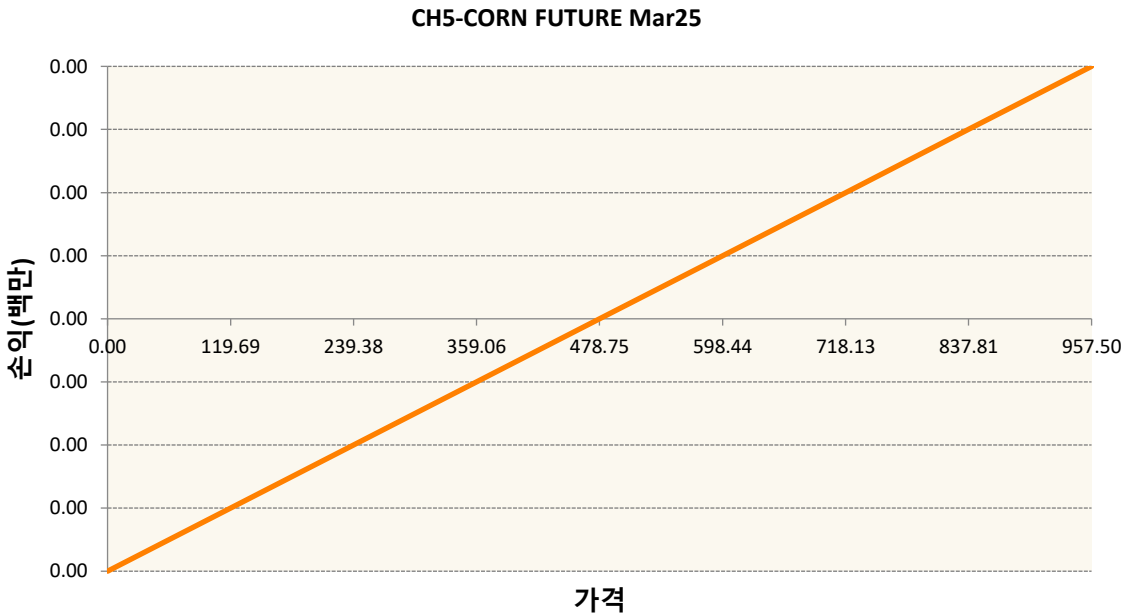
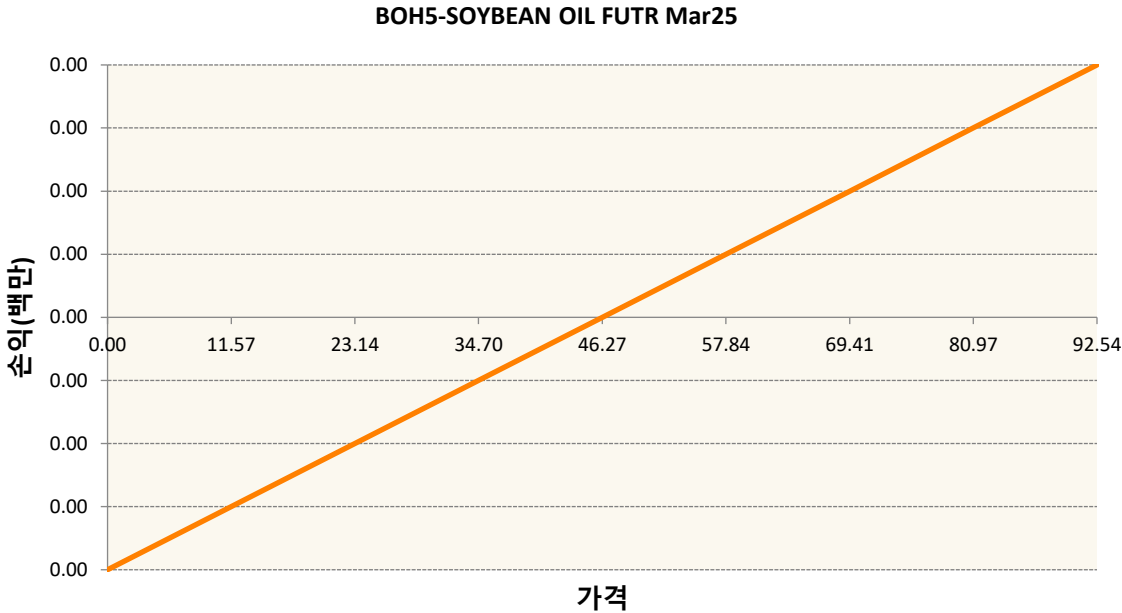
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

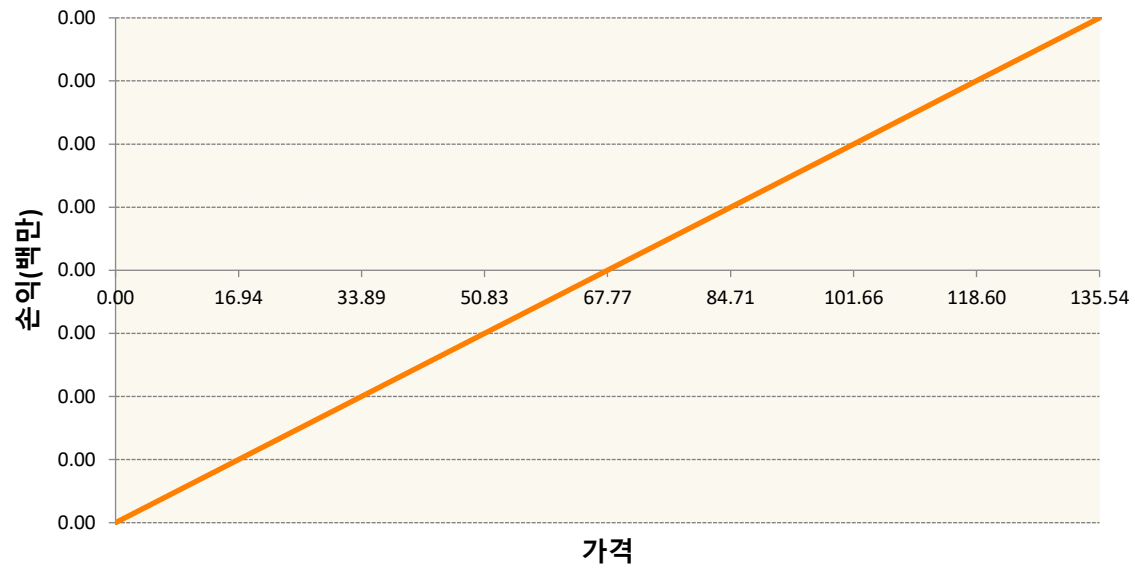
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	422	-422	장내
누계	유가증권	선물	3,767	0	3,767	
누계	통화	선물	0	422	-422	장내

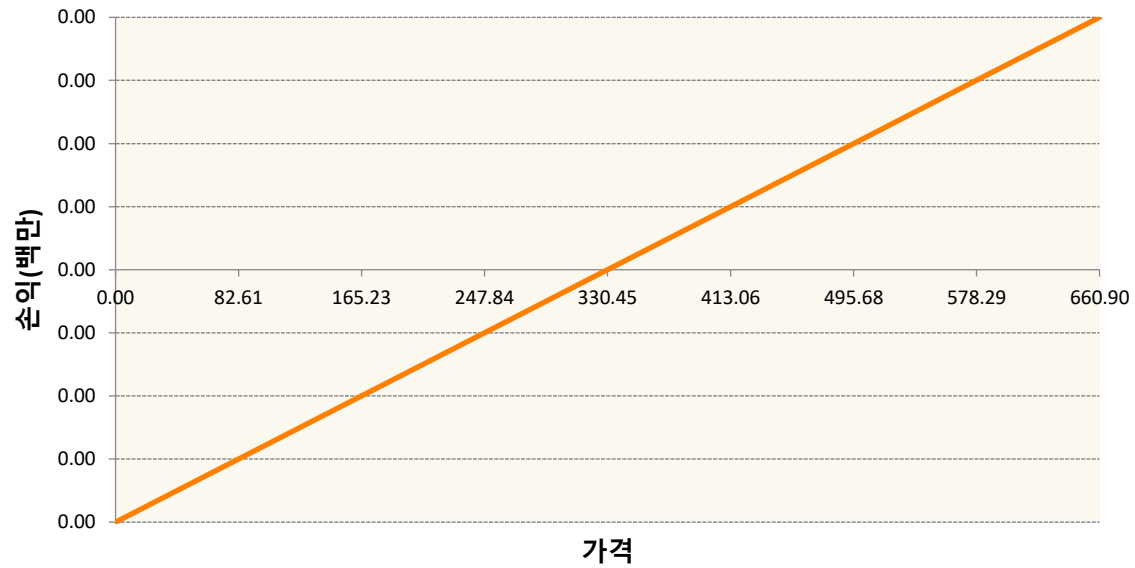
2. 만기시점의 손익구조



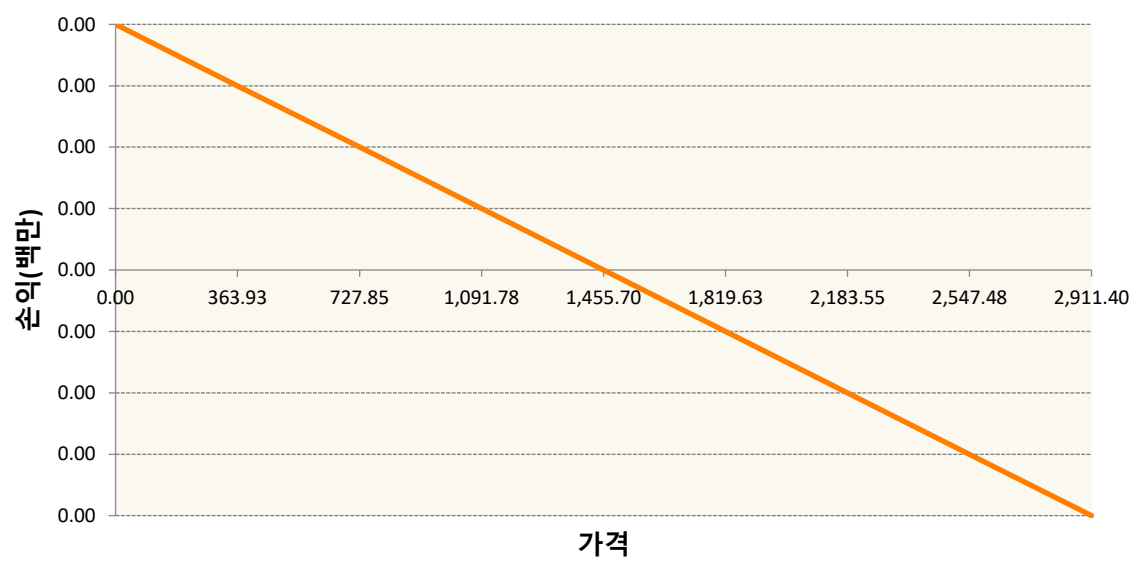
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



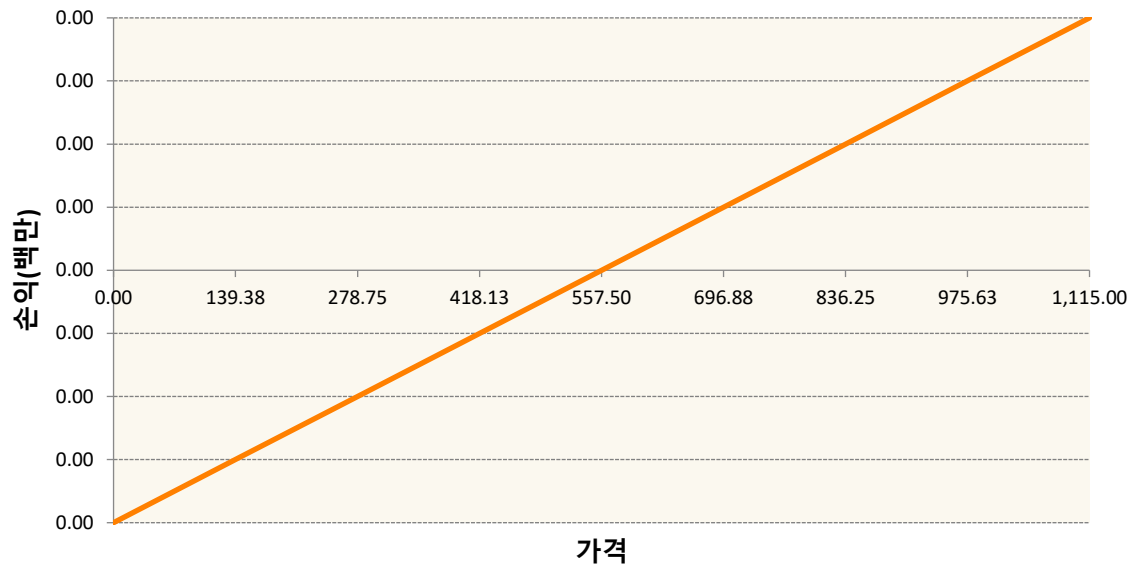
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



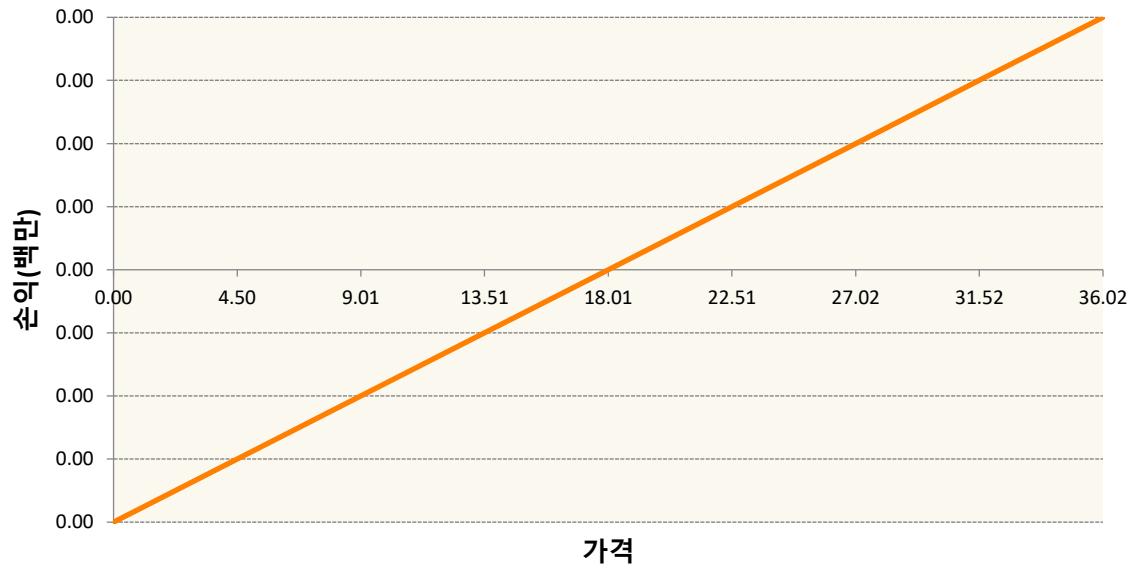
KR4175W20008-2025-02 달러선물



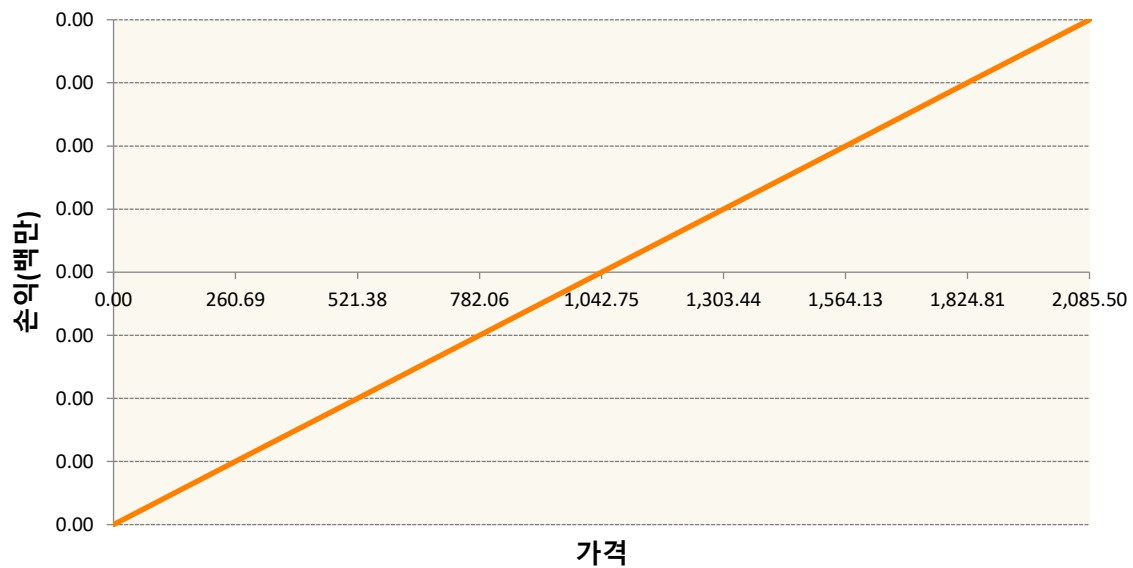
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



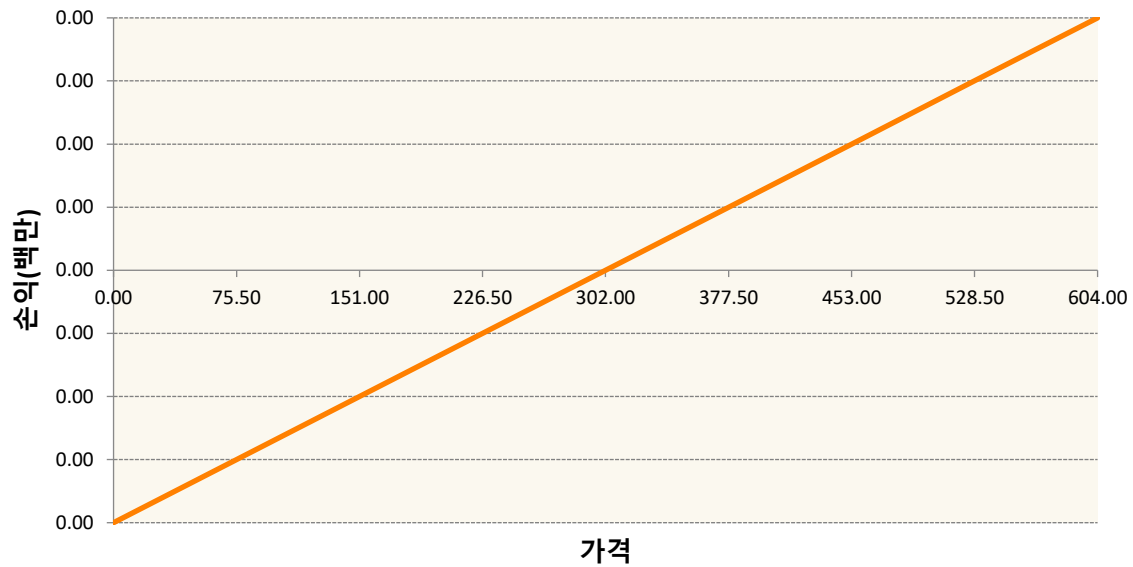
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



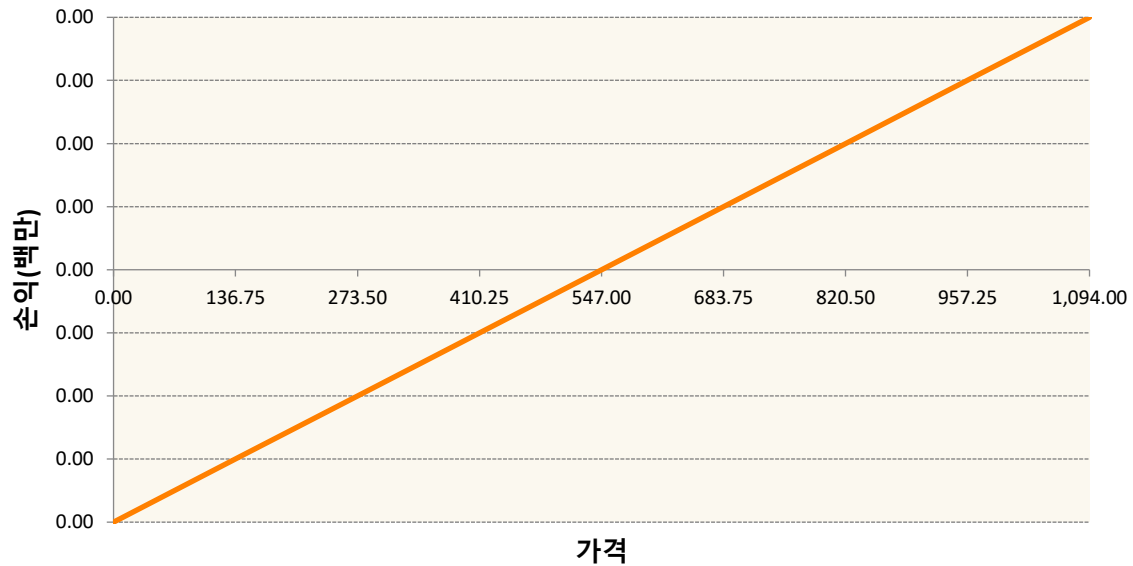
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar25



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	2025-01-17
기준일	2025-01-16

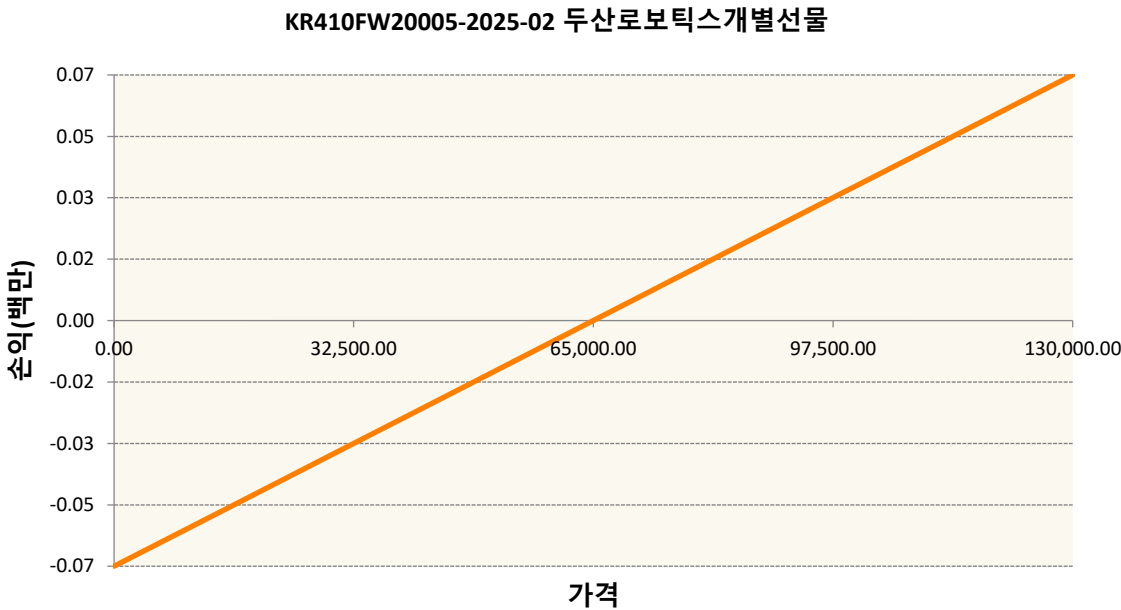
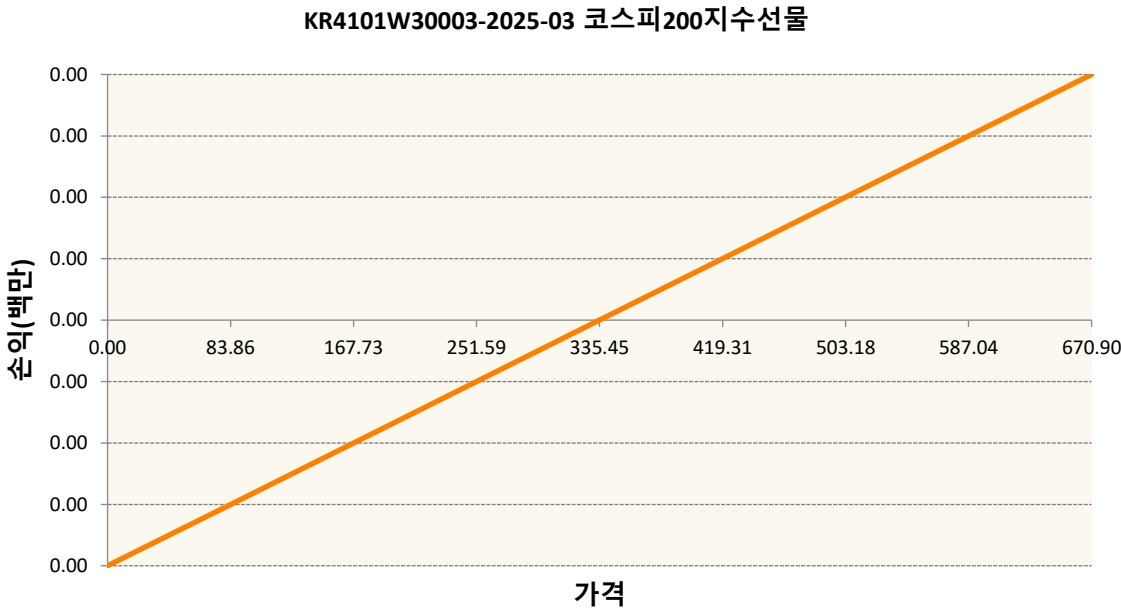
스마트인덱스모

1. 계약금액

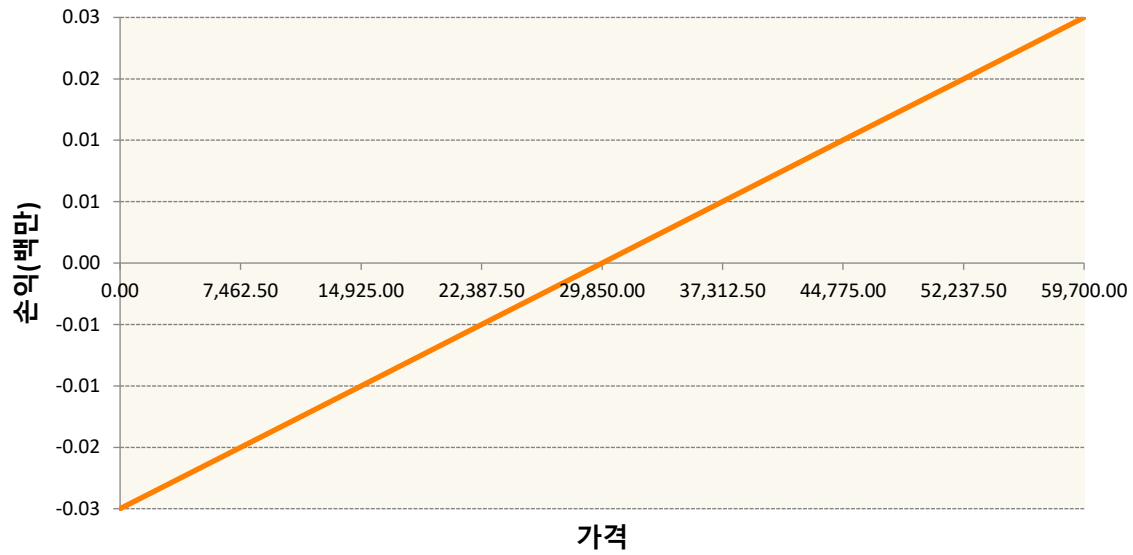
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,270	0	1,270	장내

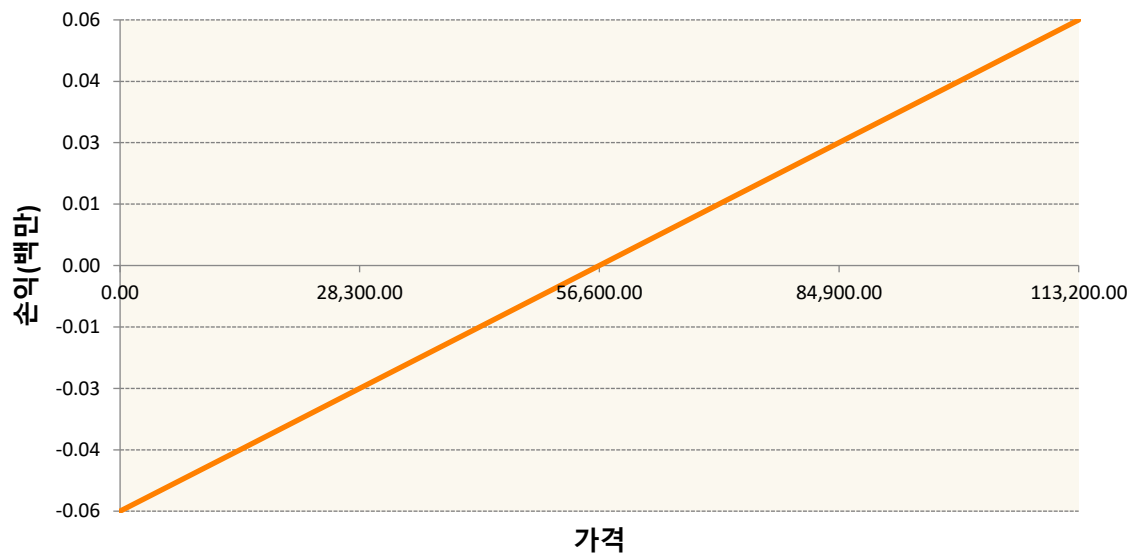
2. 만기시점의 손익구조



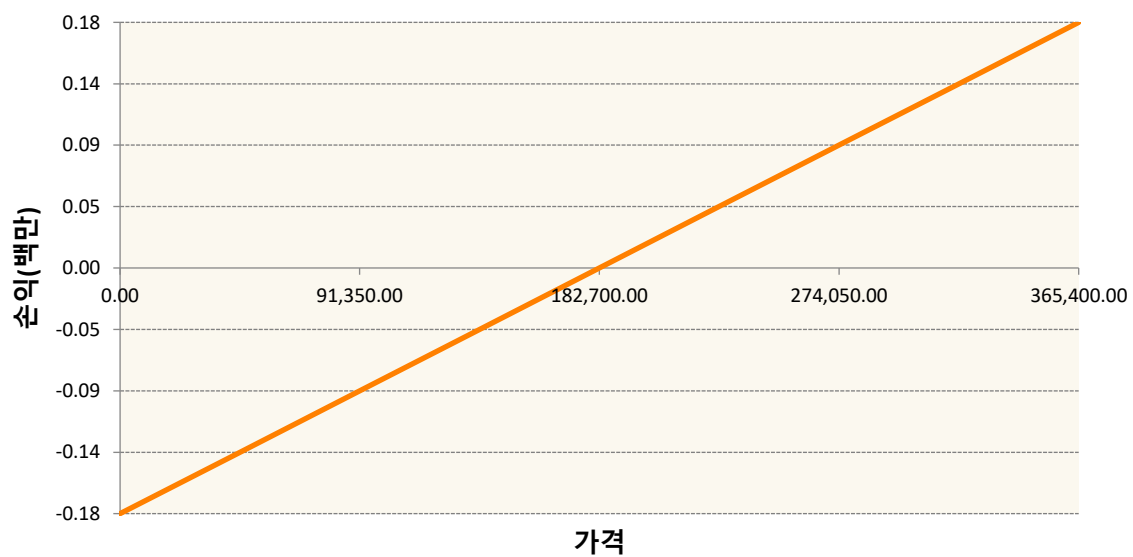
KR410SW20008-2025-02 울촌화학개별선물



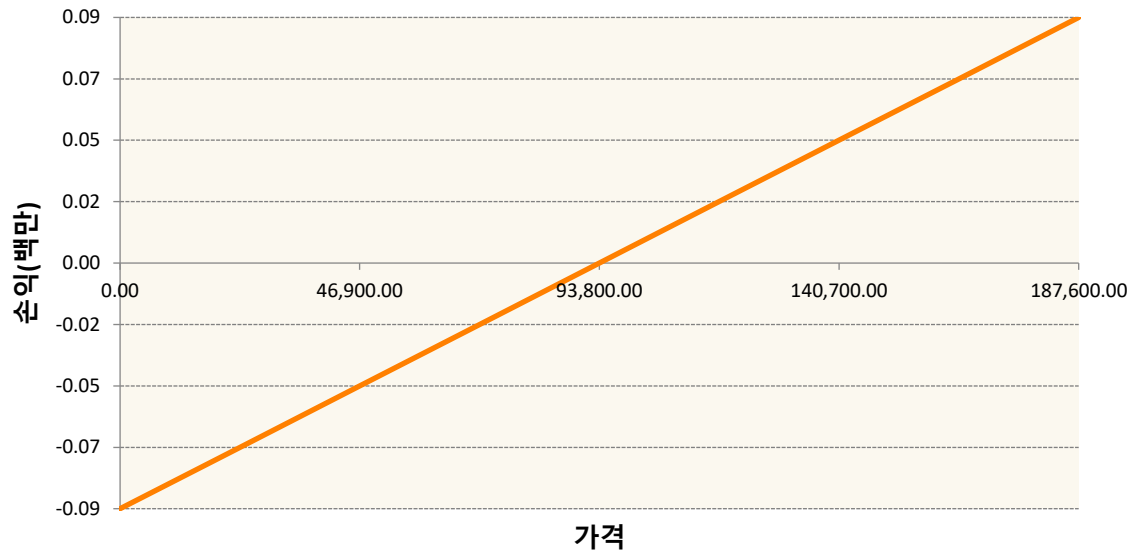
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



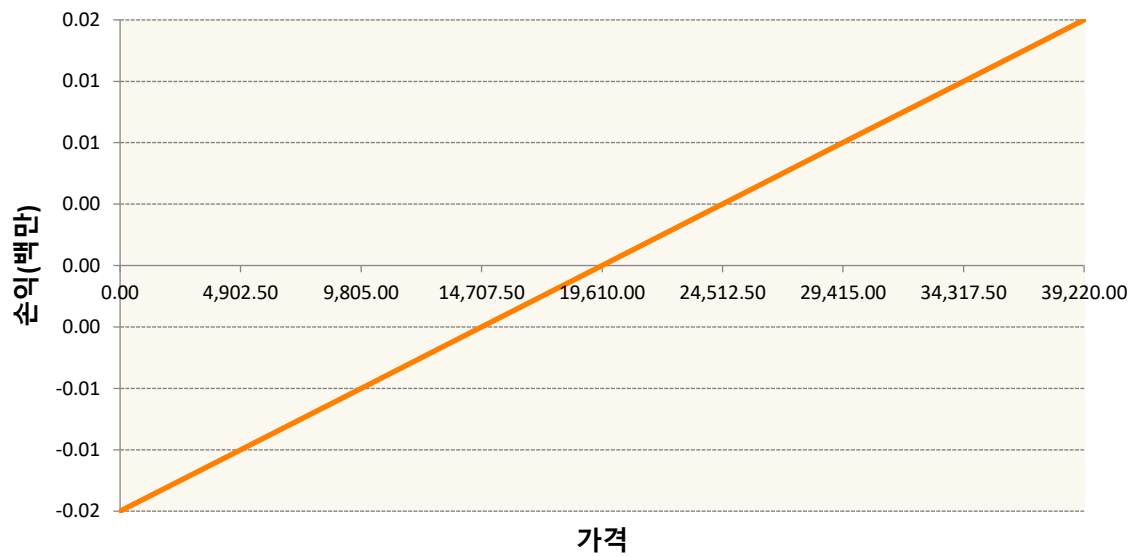
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



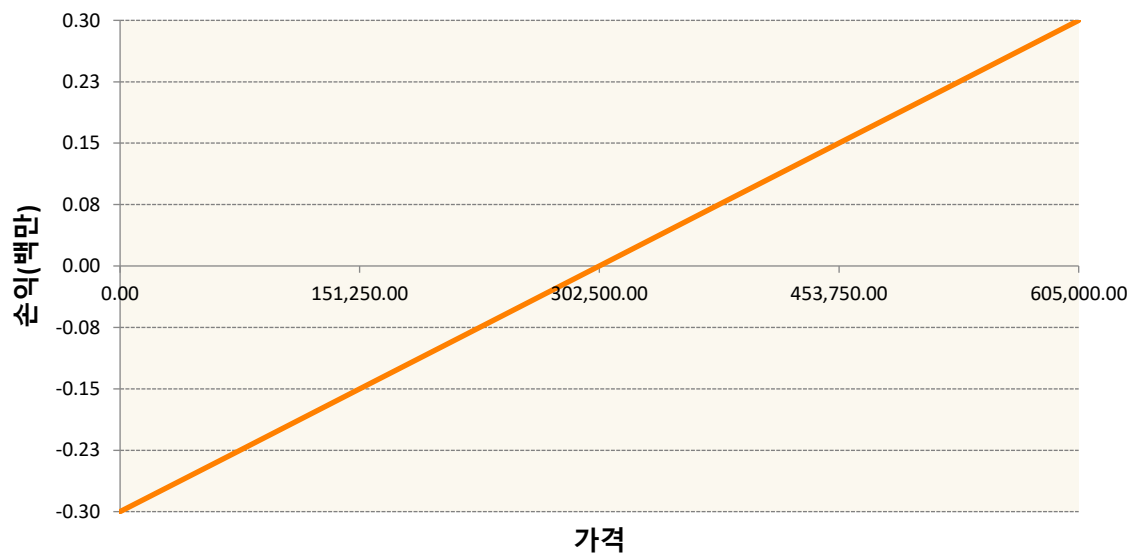
KR41C3W20007-2025-02 금호석유개별선물



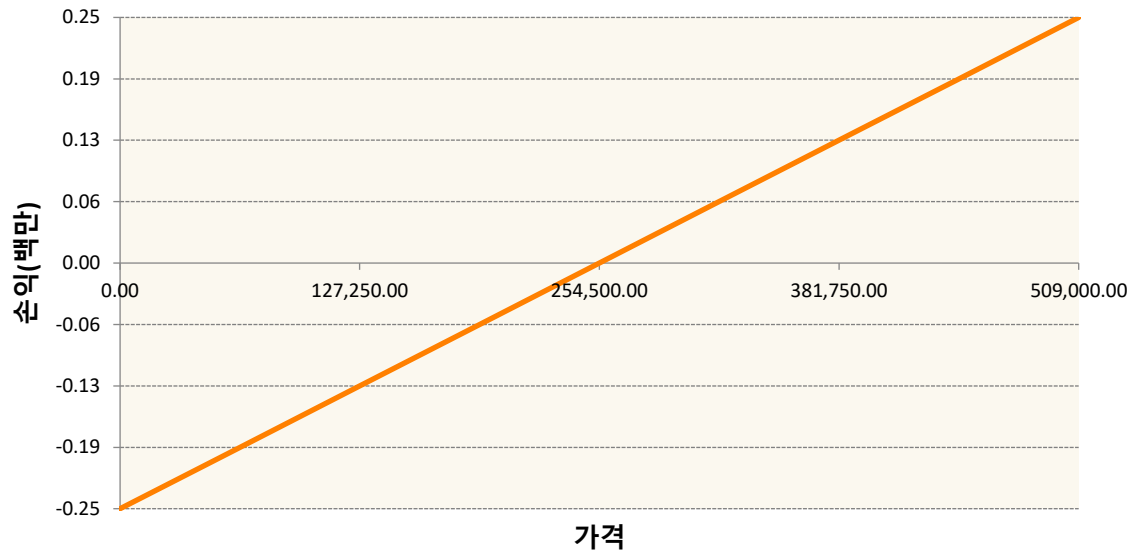
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



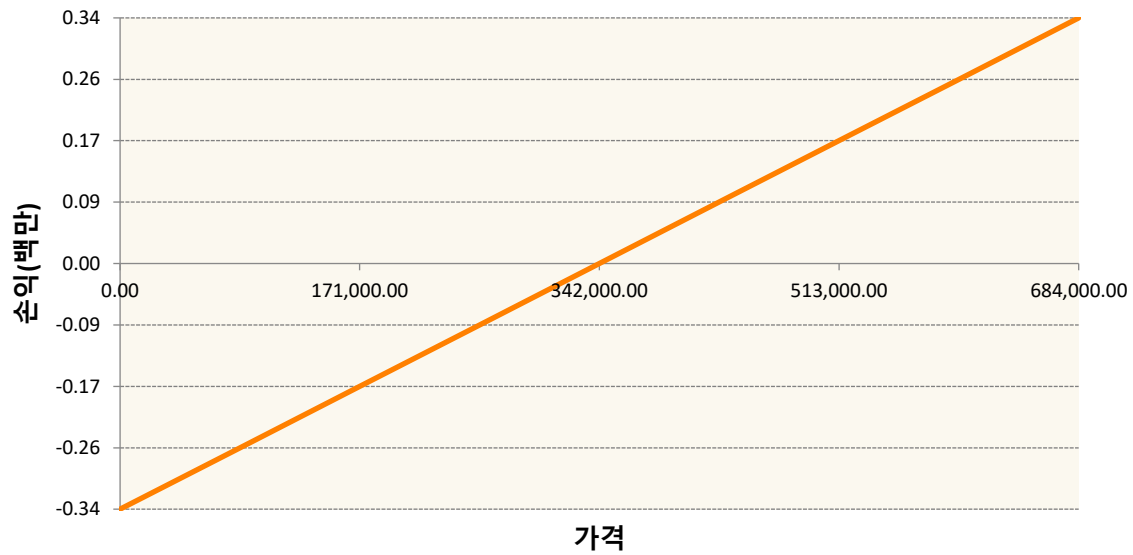
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



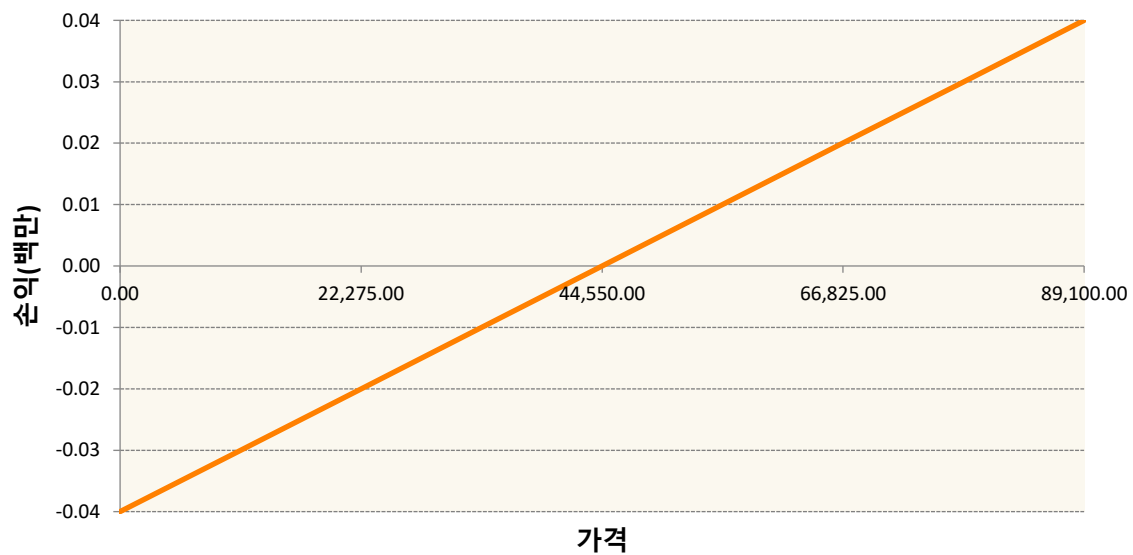
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



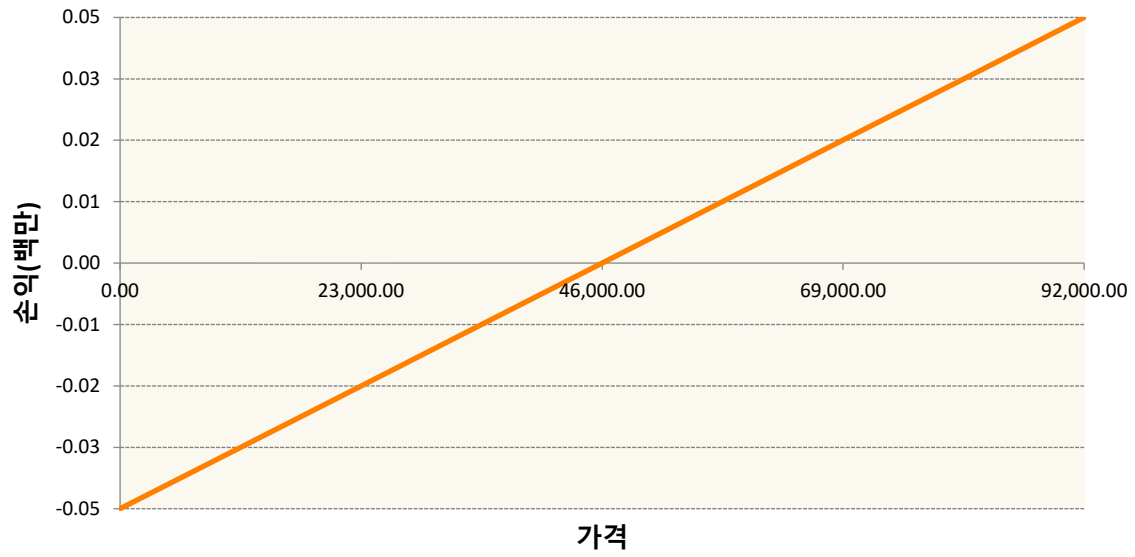
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



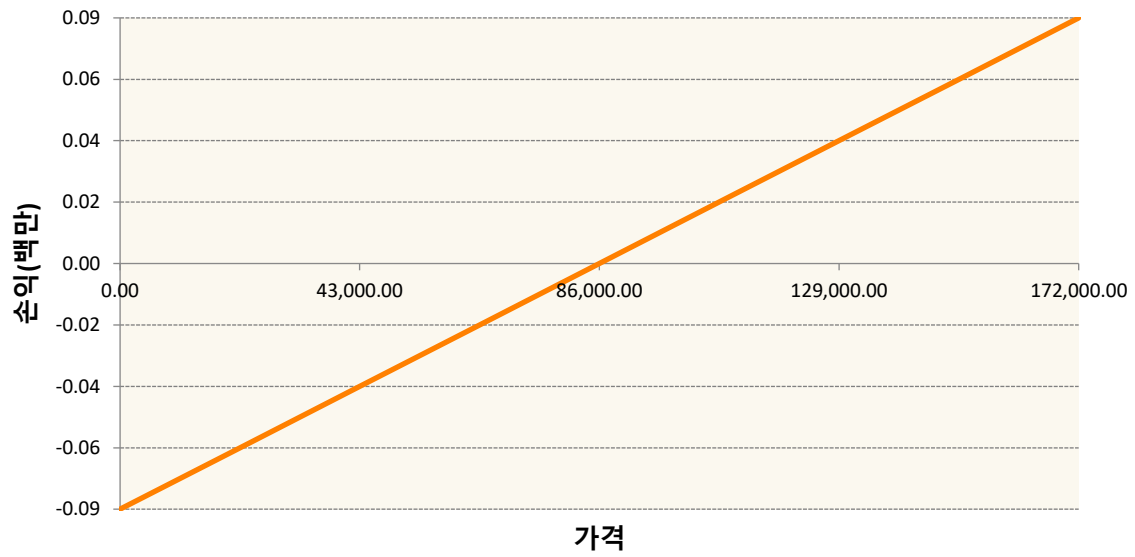
KR41DCW20004-2025-02 HL만도개별선물



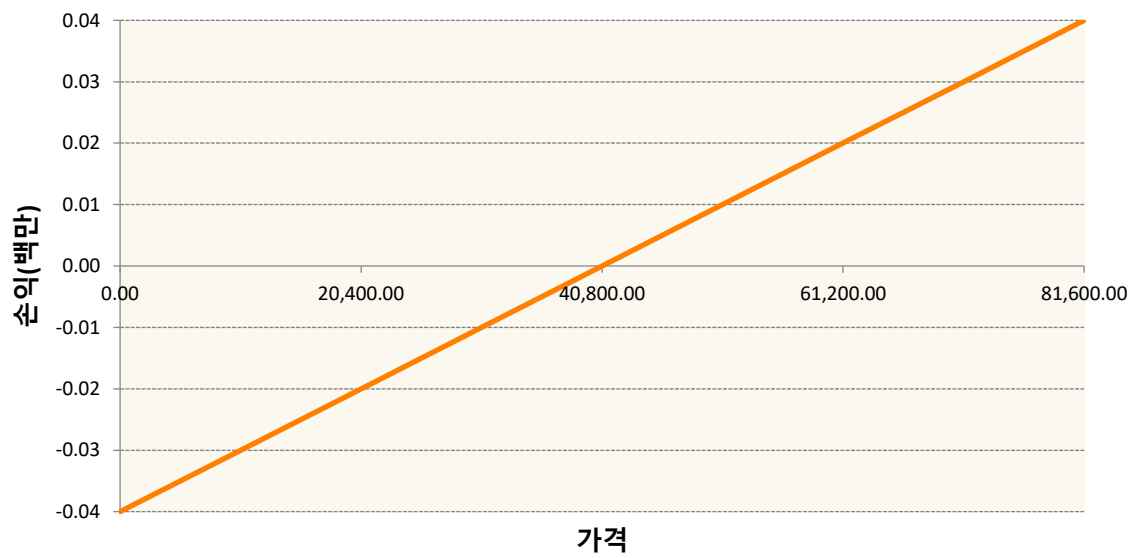
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



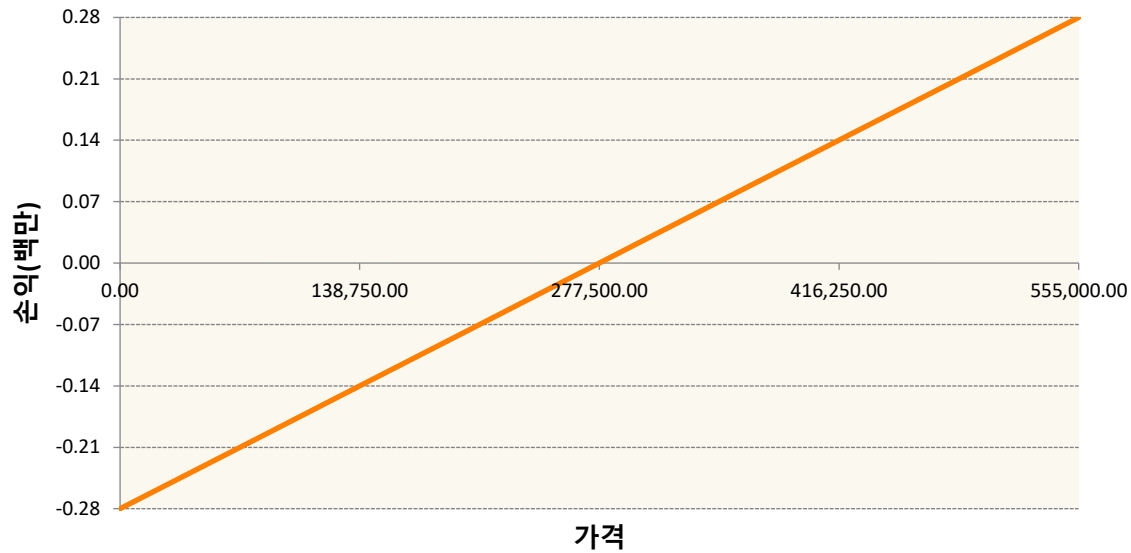
KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



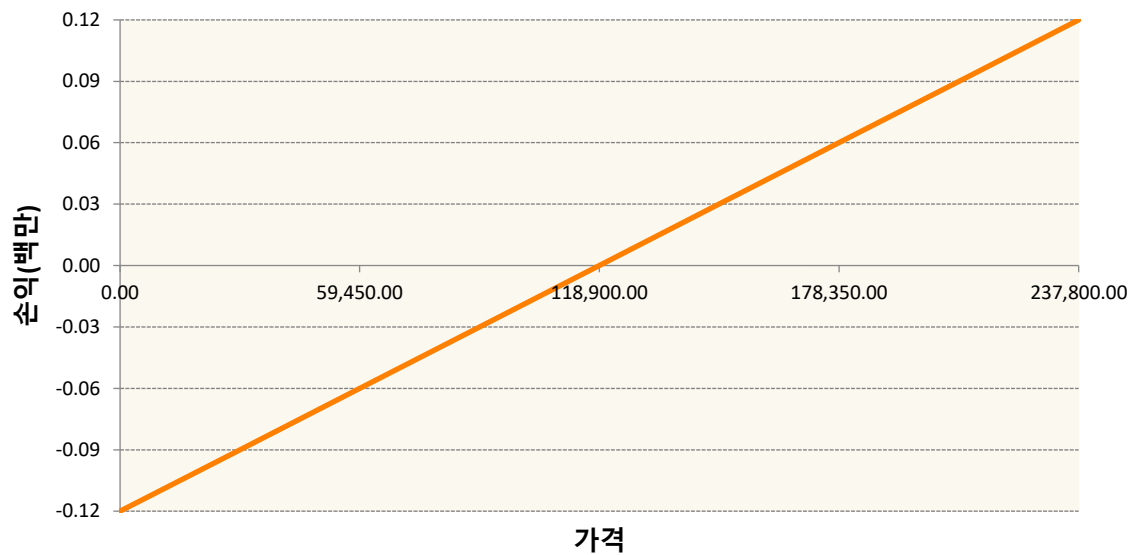
KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



KR41HEW20001-2025-02 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	74
KR410FW20(2025-02 두산로보틱스개별선물	2
KR410SW20(2025-02 울촌화학개별선물	0.36
KR41BBW20(2025-02 롯데케미칼개별선물	1
KR41BJW20C 2025-02 엔씨소프트개별선물	4
KR41C3W20(2025-02 금호석유개별선물	2
KR41CNW20 2025-02 포스코DX개별선물	1
KR41CRW20(2025-02 LG생활건강개별선물	3
KR41CXW20(2025-02 한미약품개별선물	2
KR41DAW20 2025-02 농심개별선물	1
KR41DCW20 2025-02 HL만도개별선물	2
KR41F9W20(2025-02 SK바이오사이언스개별선물	1

KR41FMW20 2025-02 엘앤에프개별선물	3
KR41G0W20 2025-02 씨에스원드개별선물	1
KR41GTW20 2025-02 두산개별선물	2
KR41HEW20 2025-02 키움증권개별선물	2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	164

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

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

280

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

475

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

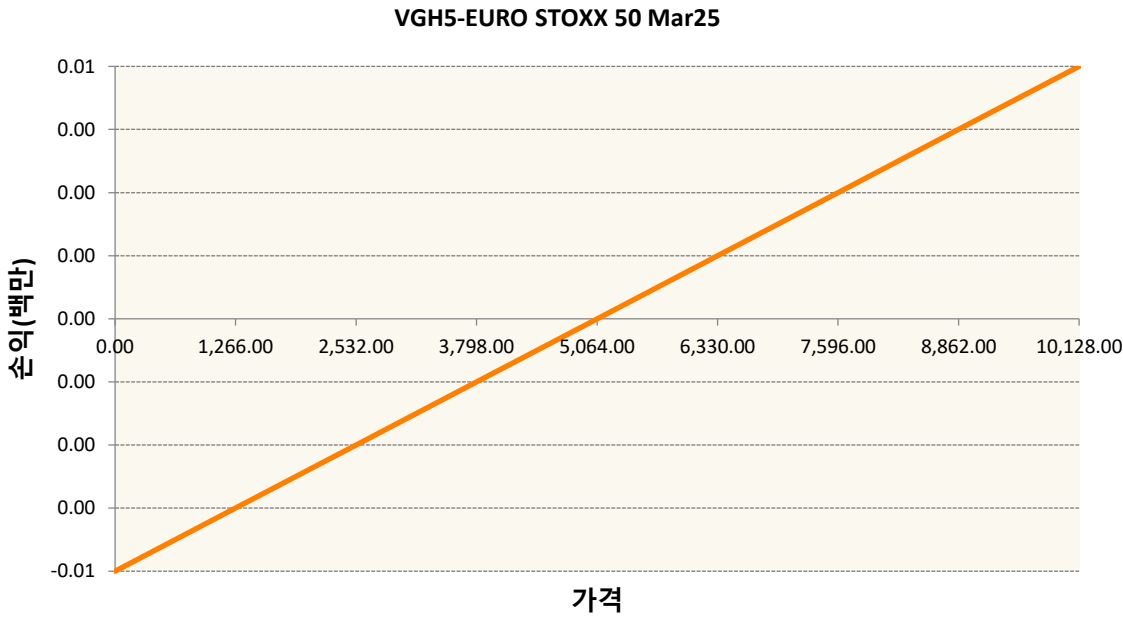
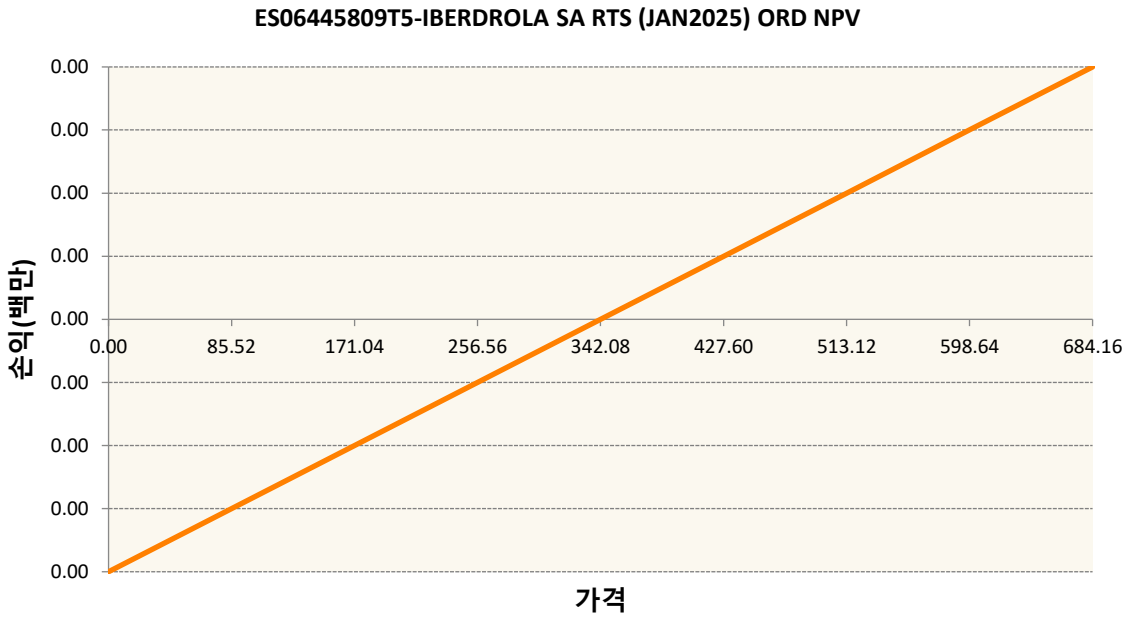
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	917	0	917	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ES06445809`IBERDROLA SA RTS (JAN2025) ORD NPV		0.11
VGH5 EURO STOXX 50 Mar25		73

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

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

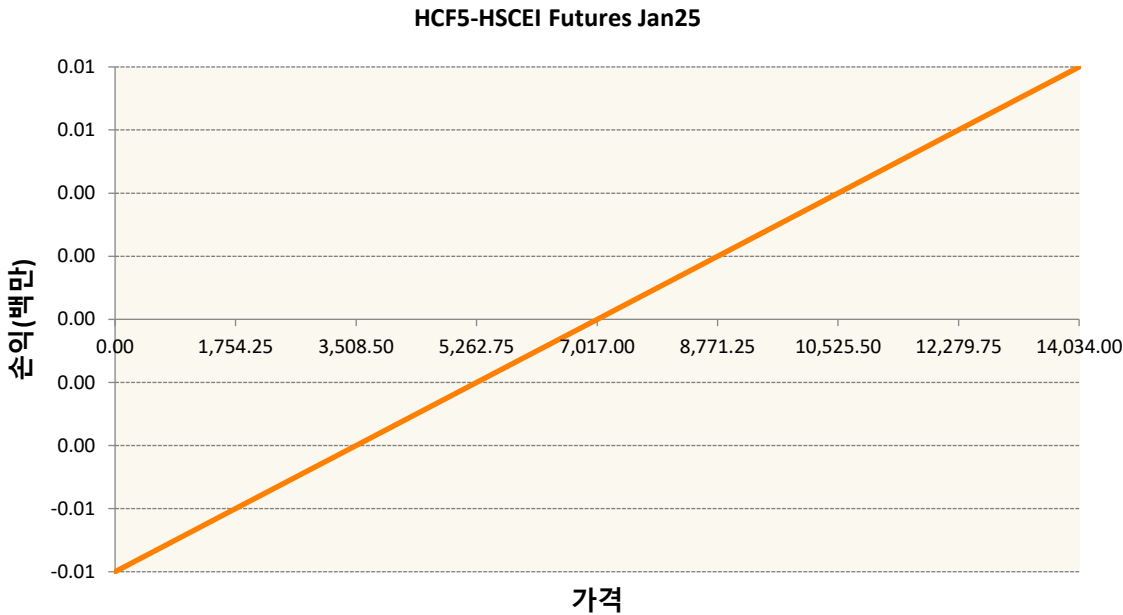
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,447	0	1,447	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

155

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

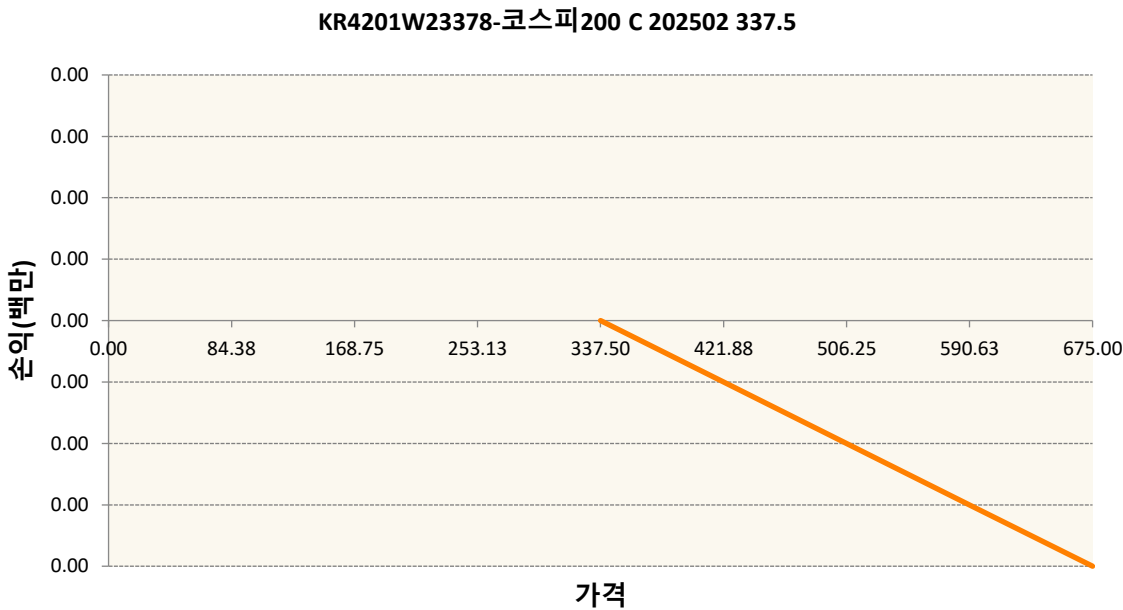
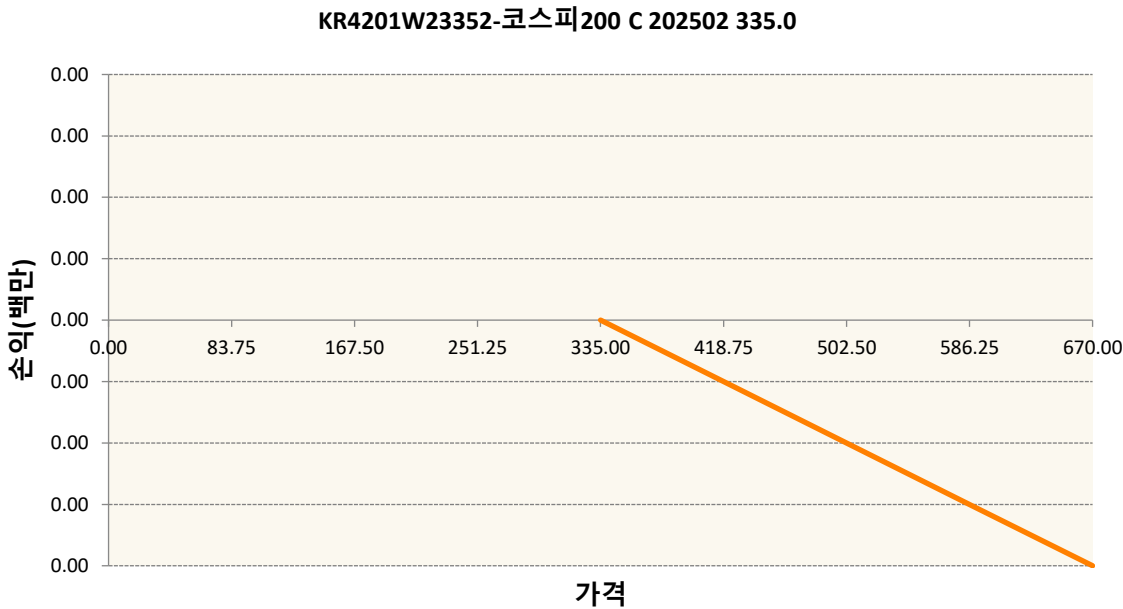
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

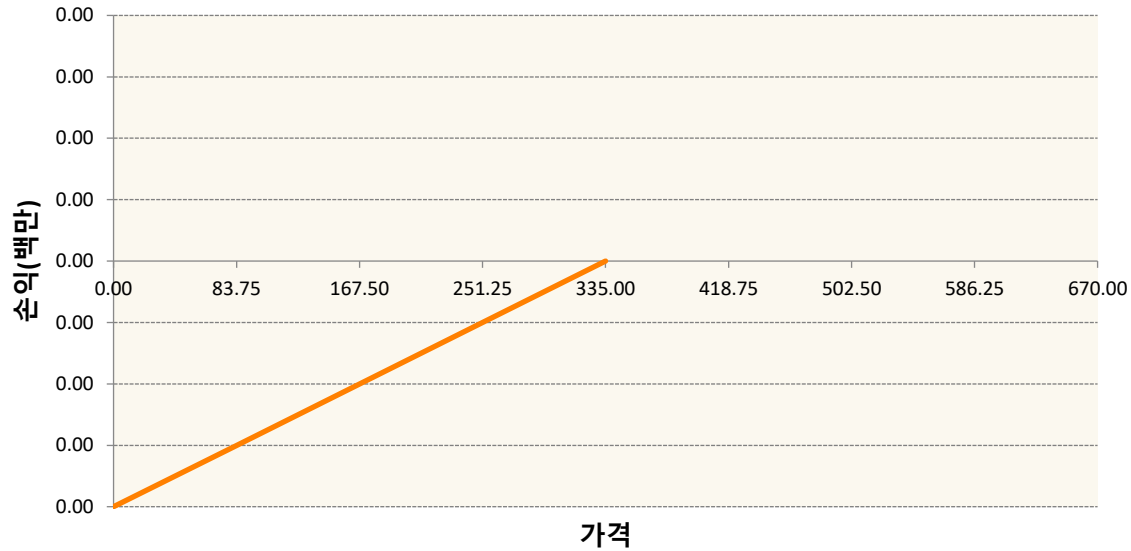
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301W23350-코스피200 P 202502 335.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201W23352코스피200 C 202502 335.0							1,575
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	665	649	630	607	581	552	521
-5.33%	601	569	534	496	456	415	372
-2.67%	448	399	350	300	250	198	147
0%	164	109	55	0	-55	-109	-164
2.67%	-261	-309	-357	-407	-458	-509	-561
5.33%	-802	-834	-870	-908	-949	-992	-1,036
8.00%	-1,416	-1,433	-1,455	-1,481	-1,509	-1,541	-1,575
KR4201W23378코스피200 C 202502 337.5							373
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	144	141	137	132	126	120	113
-5.33%	132	125	117	109	100	90	80
-2.67%	101	90	78	67	55	43	30
0%	40	27	13	0	-13	-27	-41
2.67%	-55	-67	-80	-93	-106	-119	-133
5.33%	-181	-190	-200	-211	-222	-233	-245
8.00%	-328	-334	-340	-347	-355	-364	-373
KR4301W23350코스피200 P 202502 335.0							434
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-416	-417	-419	-422	-425	-429	-434
-5.33%	-236	-241	-246	-253	-259	-267	-274
-2.67%	-79	-88	-98	-108	-118	-129	-139
0%	35	23	12	0	-12	-23	-35

2.67%	97	88	79	69	59	49	38
5.33%	121	117	112	105	99	91	83
8.00%	128	127	125	122	118	114	109

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

2,343

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

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	655	0	655	

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	2025-01-17
기준일	2025-01-16

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	4,326	0	4,326	

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	2025-01-17
기준일	2025-01-16

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	
누계	유가증권	수익증권	12,783	0	12,783	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

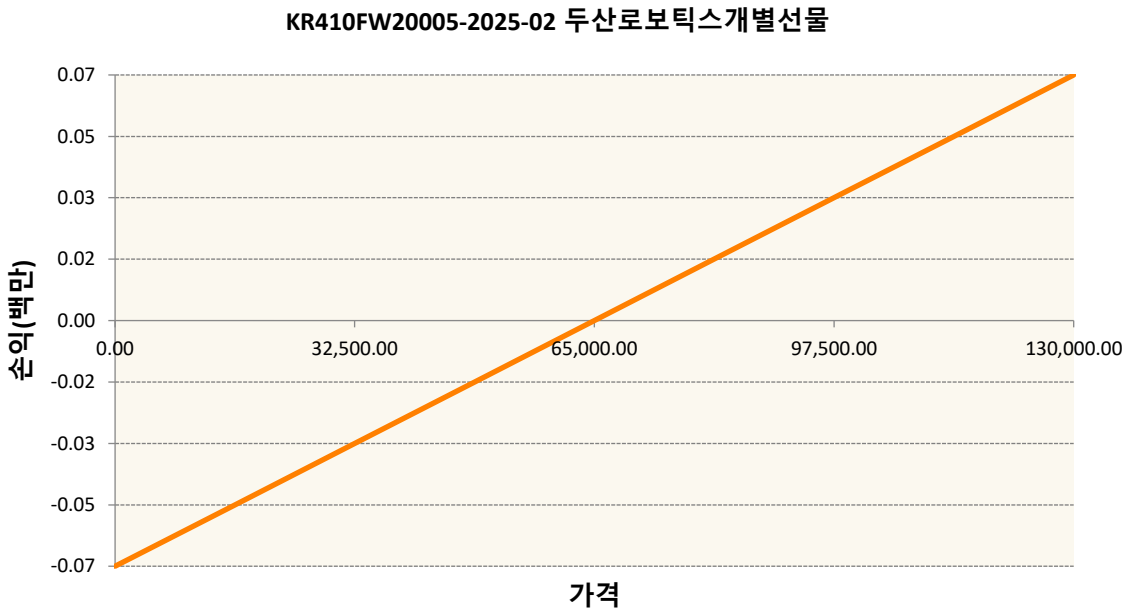
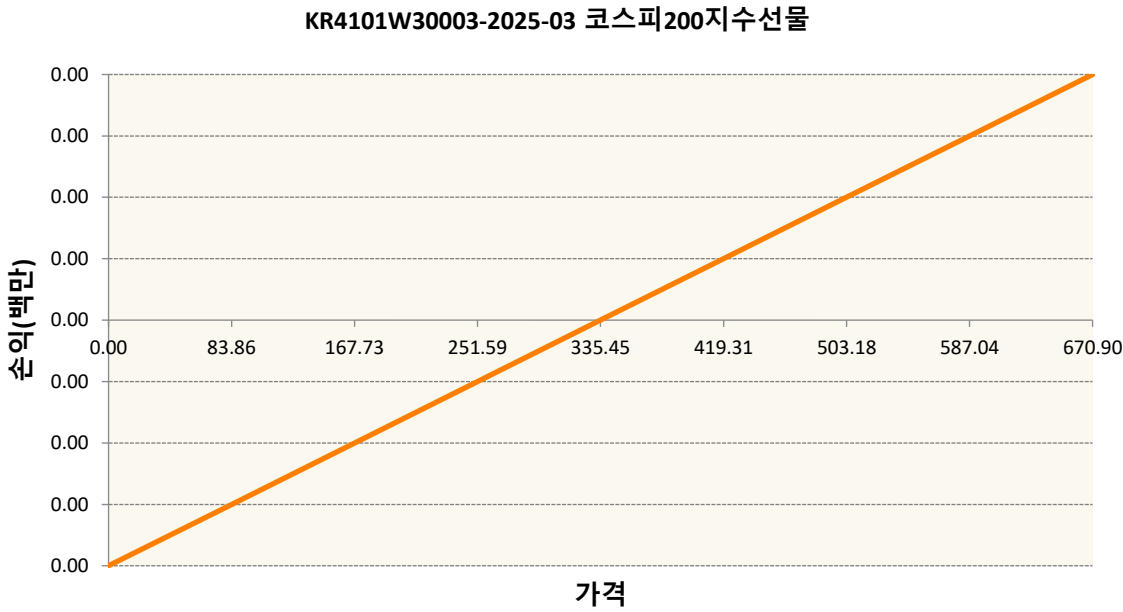
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

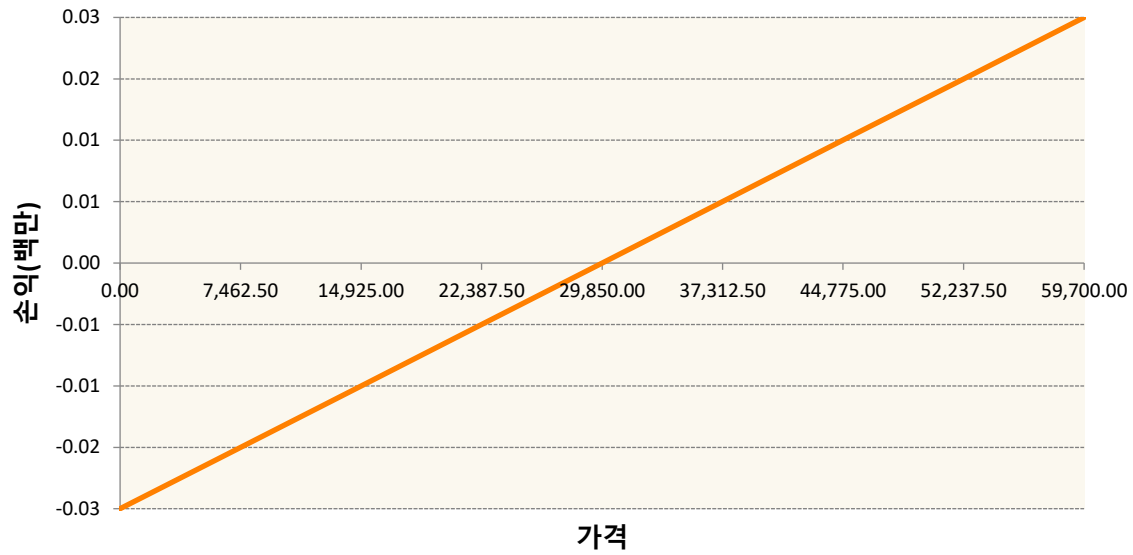
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	820	0	820	장내

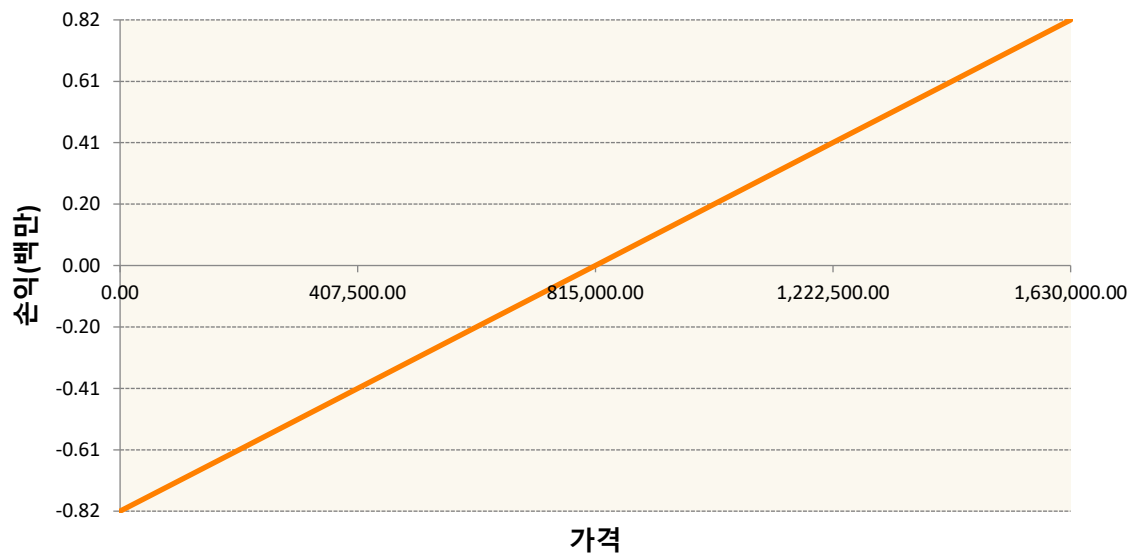
2. 만기시점의 손익구조



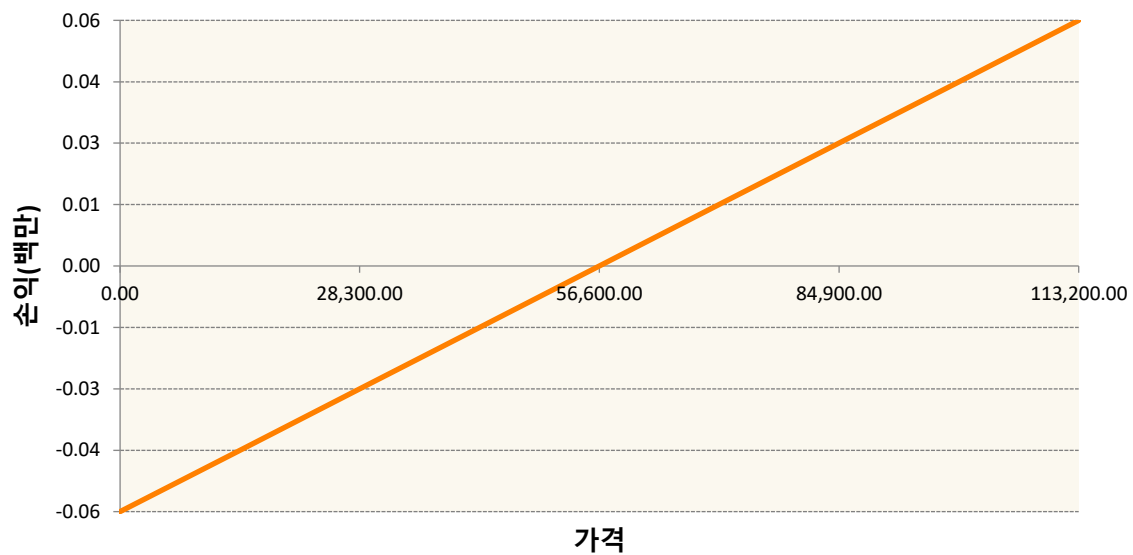
KR410SW20008-2025-02 울촌화학개별선물



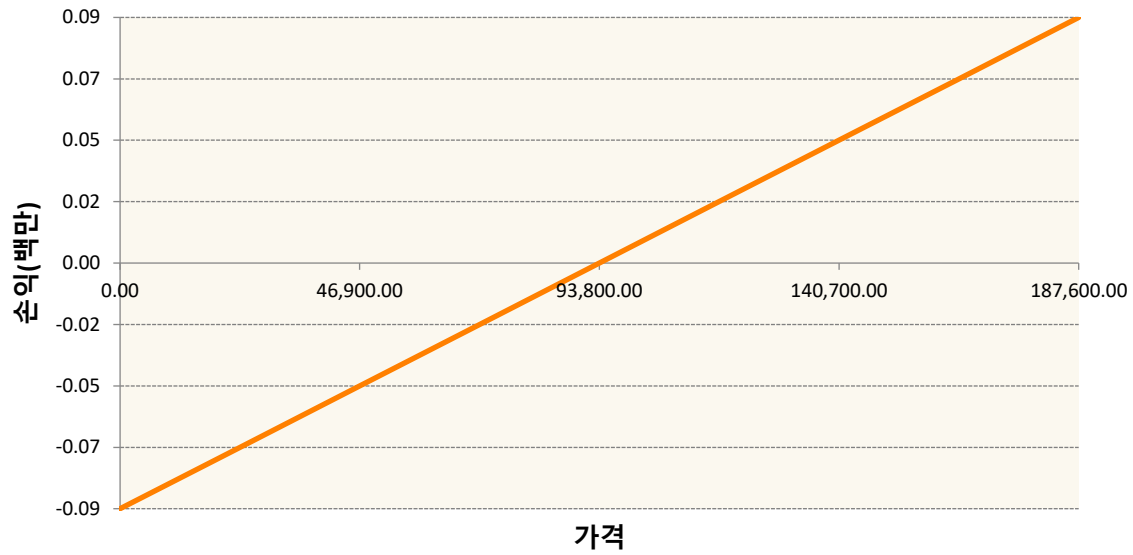
KR41B3W20008-2025-02 고려아연개별선물



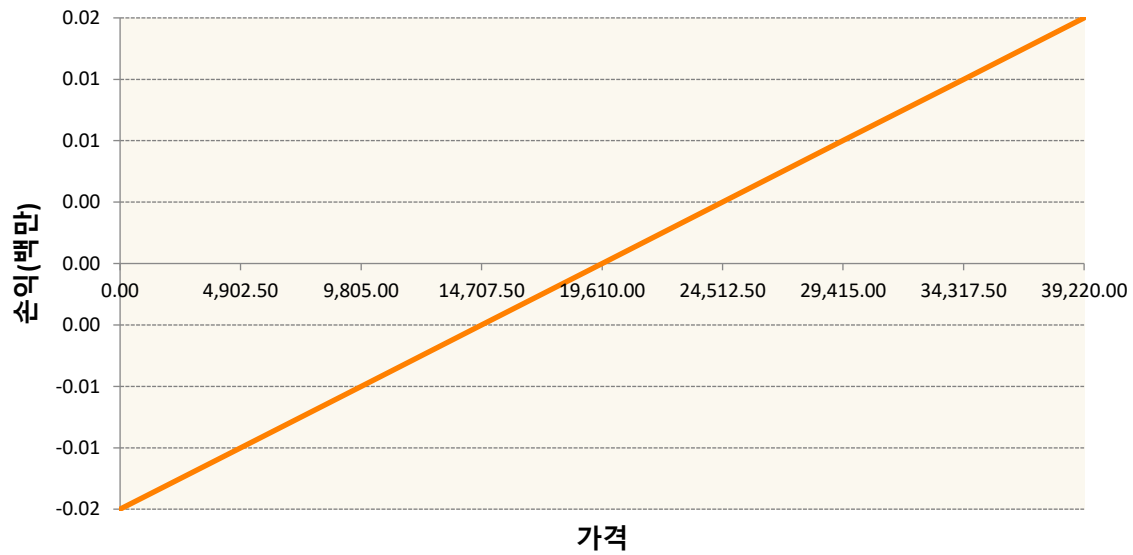
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



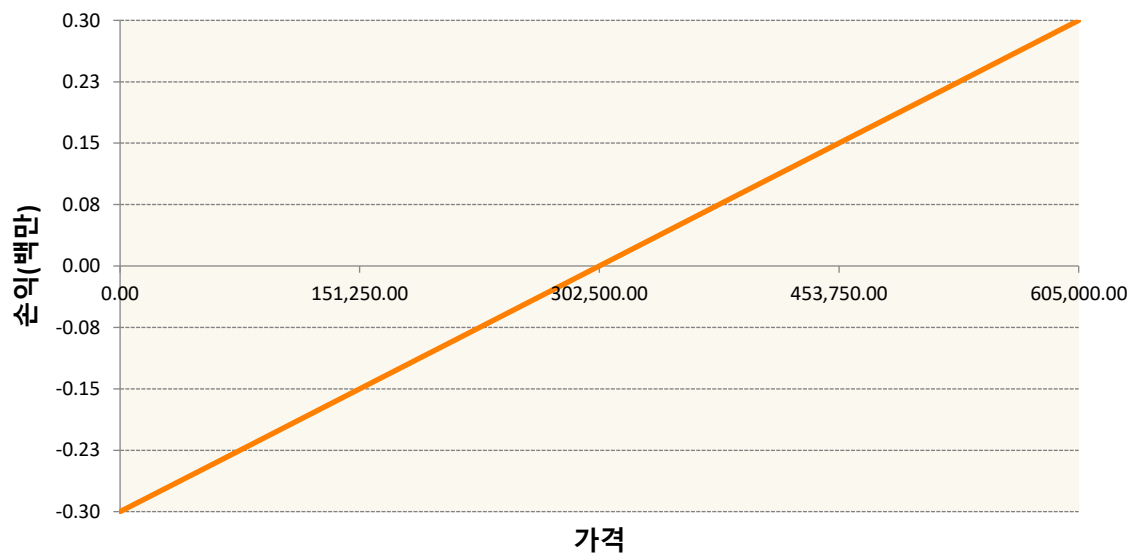
KR41C3W20007-2025-02 금호석유개별선물



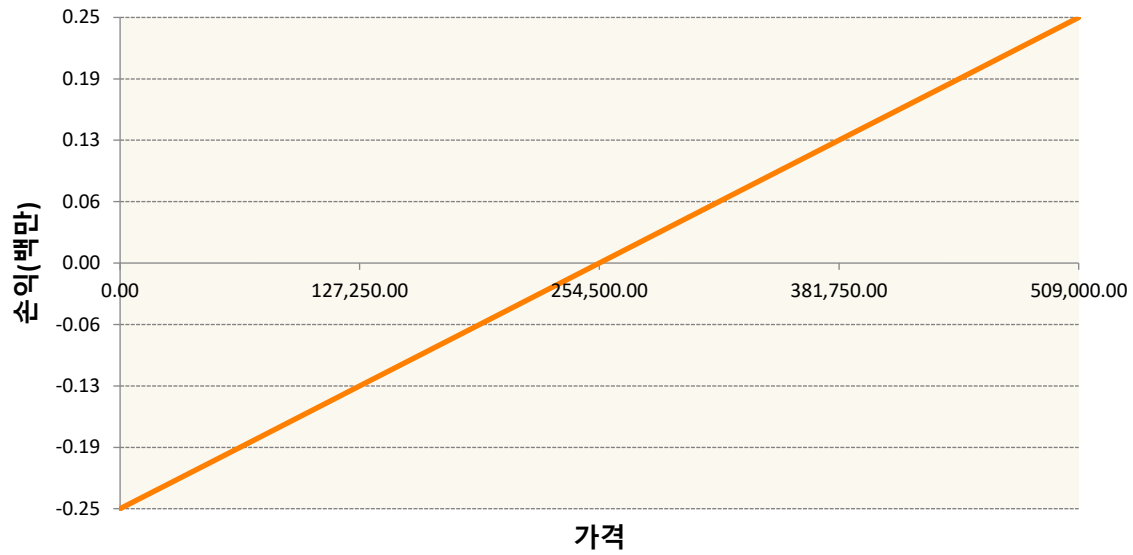
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



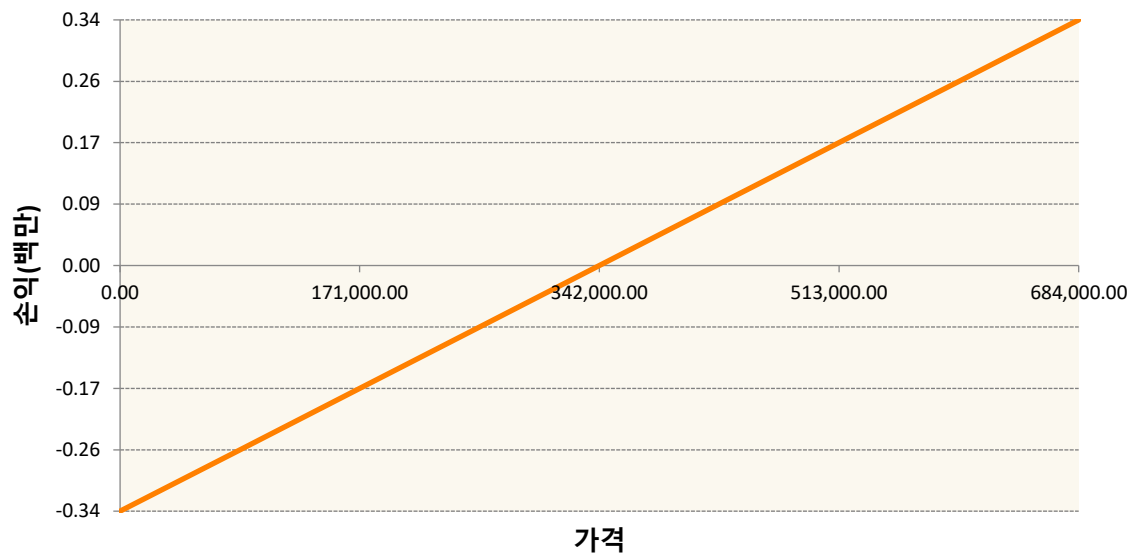
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



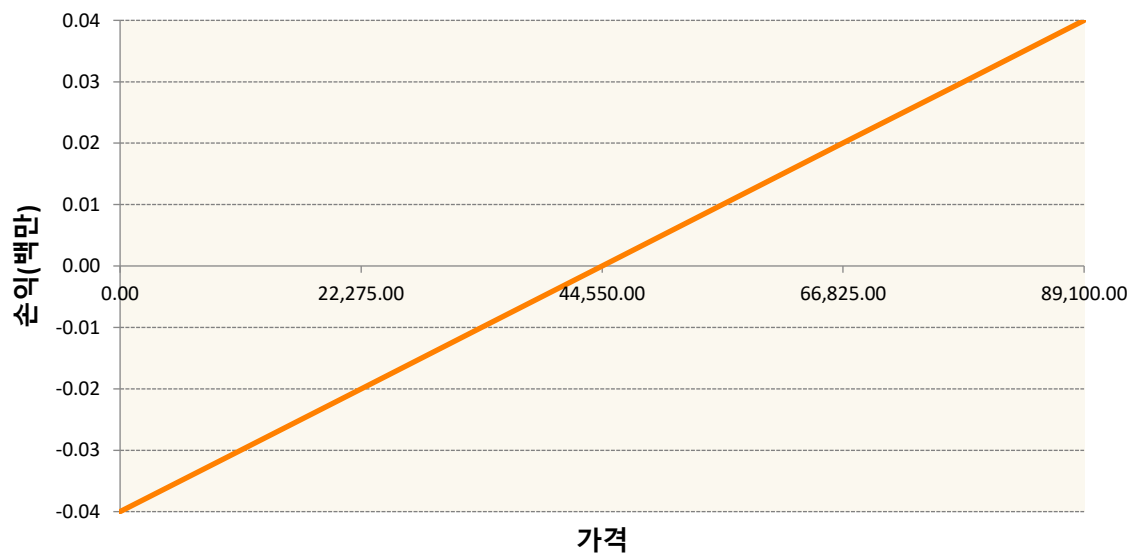
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



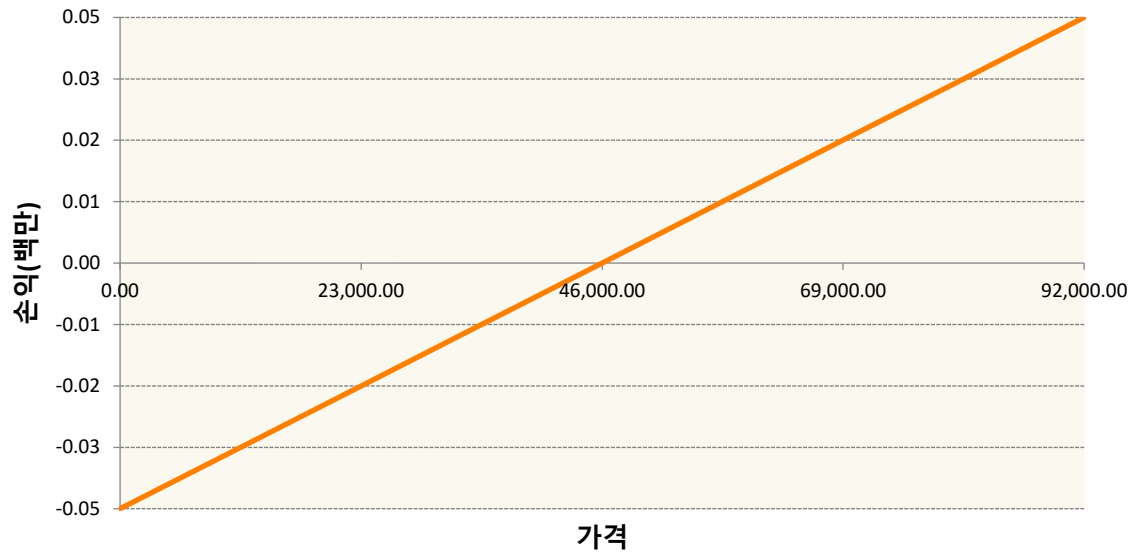
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



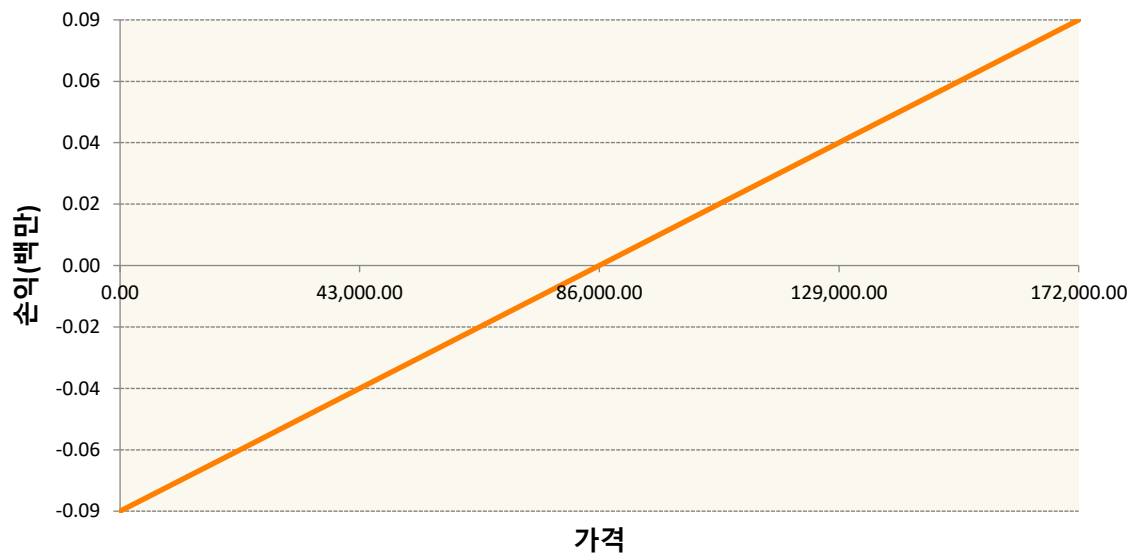
KR41DCW20004-2025-02 HL만도개별선물



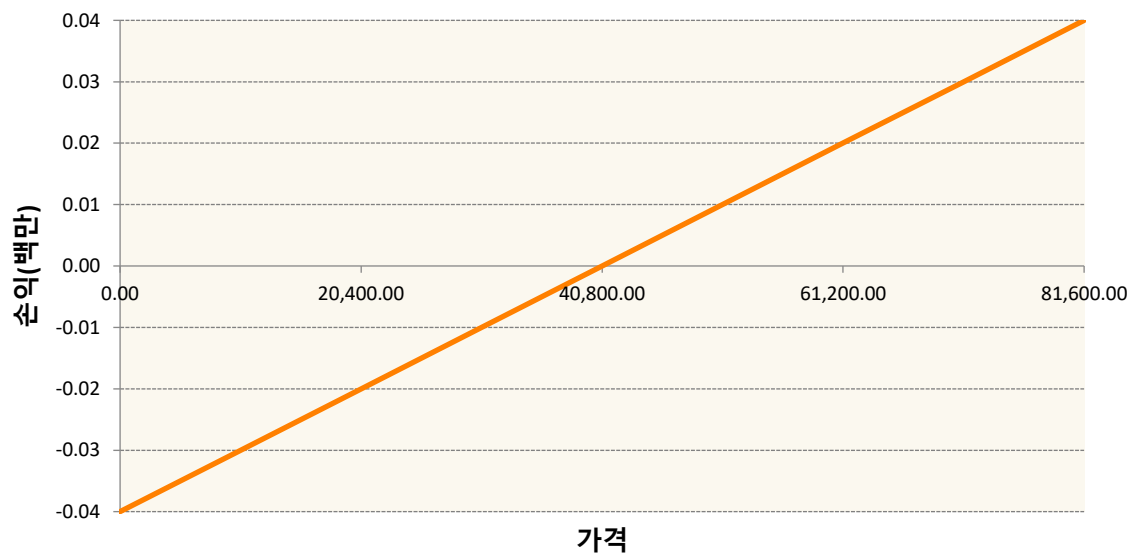
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



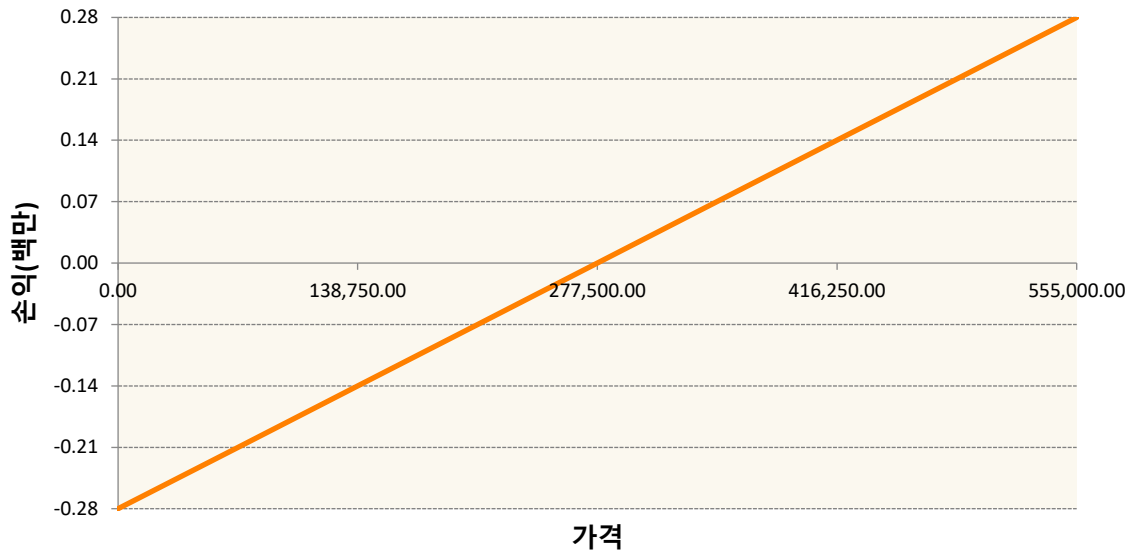
KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



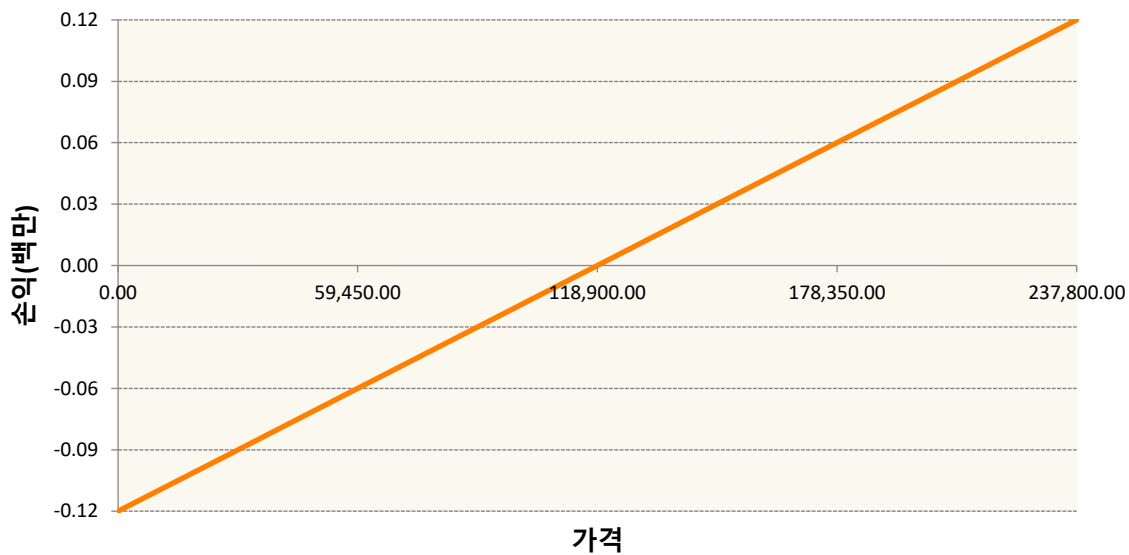
KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



KR41HEW20001-2025-02 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	54
KR410FW20(2025-02 두산로보틱스개별선물	1
KR410SW20(2025-02 울촌화학개별선물	0.14
KR41B3W20(2025-02 고려아연개별선물	3
KR41BBW20(2025-02 롯데케미칼개별선물	1
KR41C3W20(2025-02 금호석유개별선물	1
KR41CNW20 2025-02 포스코DX개별선물	0.49
KR41CRW20(2025-02 LG생활건강개별선물	1
KR41CXW20(2025-02 한미약품개별선물	1
KR41DAW20 2025-02 농심개별선물	0.27
KR41DCW20 2025-02 HL만도개별선물	1
KR41F9W20(2025-02 SK바이오사이언스개별선물	1

KR41FMW20 2025-02 엘앤에프개별선물	1
KR41G0W20 2025-02 씨에스원드개별선물	0.49
KR41GTW20 2025-02 두산개별선물	1
KR41HEW20 2025-02 키움증권개별선물	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	100

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

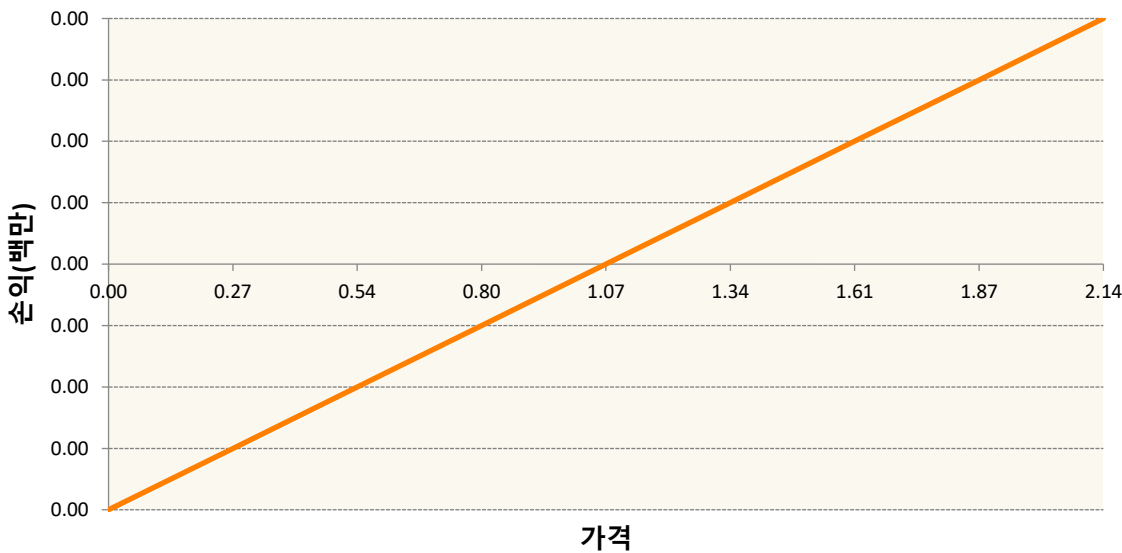
1. 계약금액

(단위:백만원)

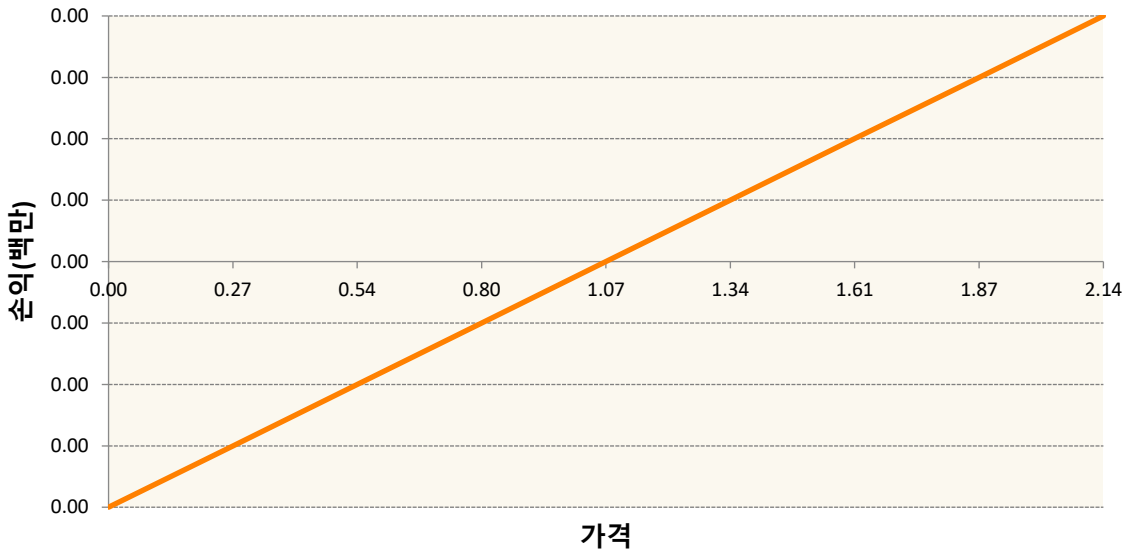
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	11,960	0	11,960	

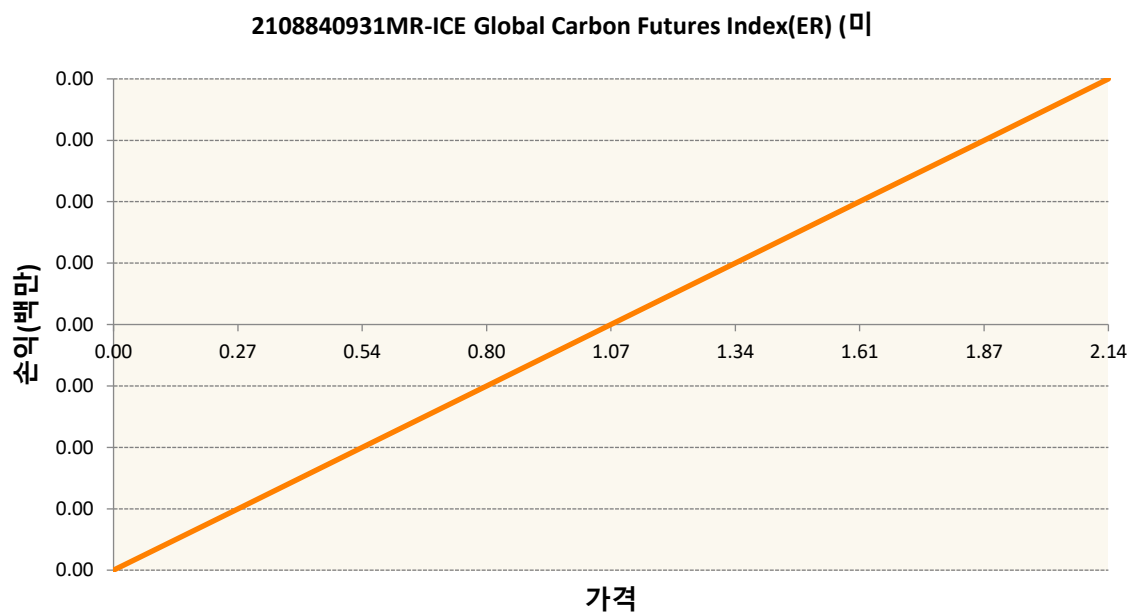
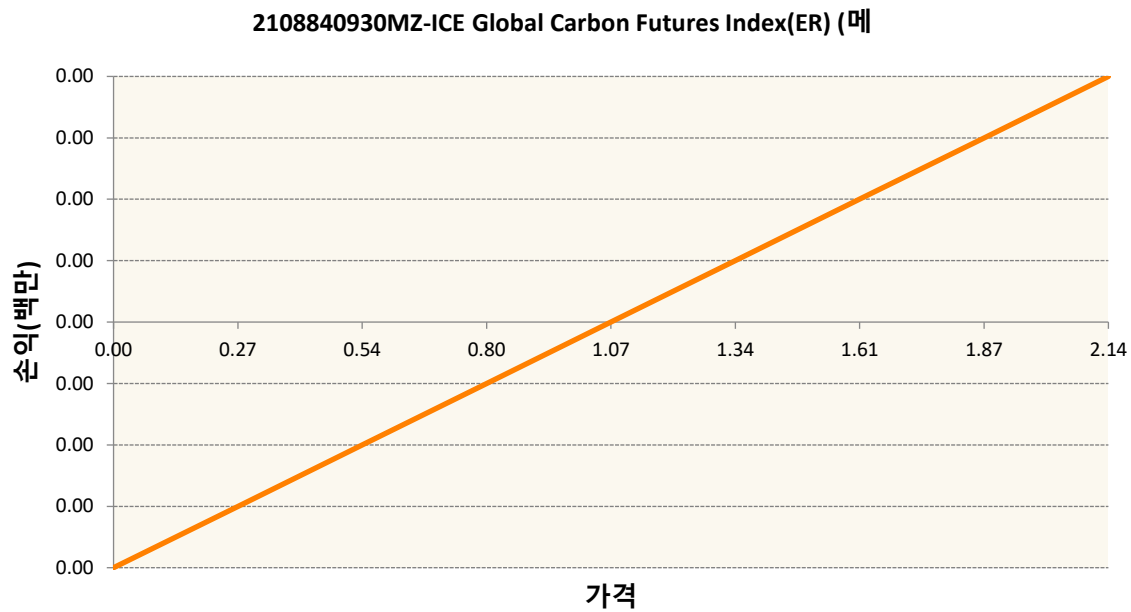
2. 만기시점의 손익구조

2108840930KM-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키



2108840930MR-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		95
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		477
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		191
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		191

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,025

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

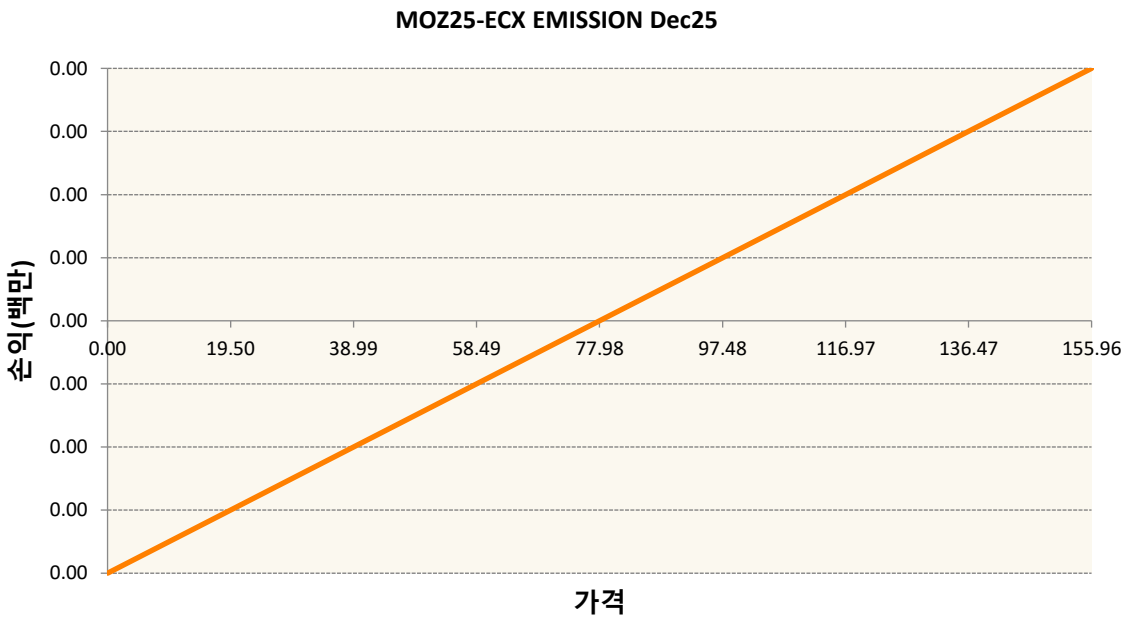
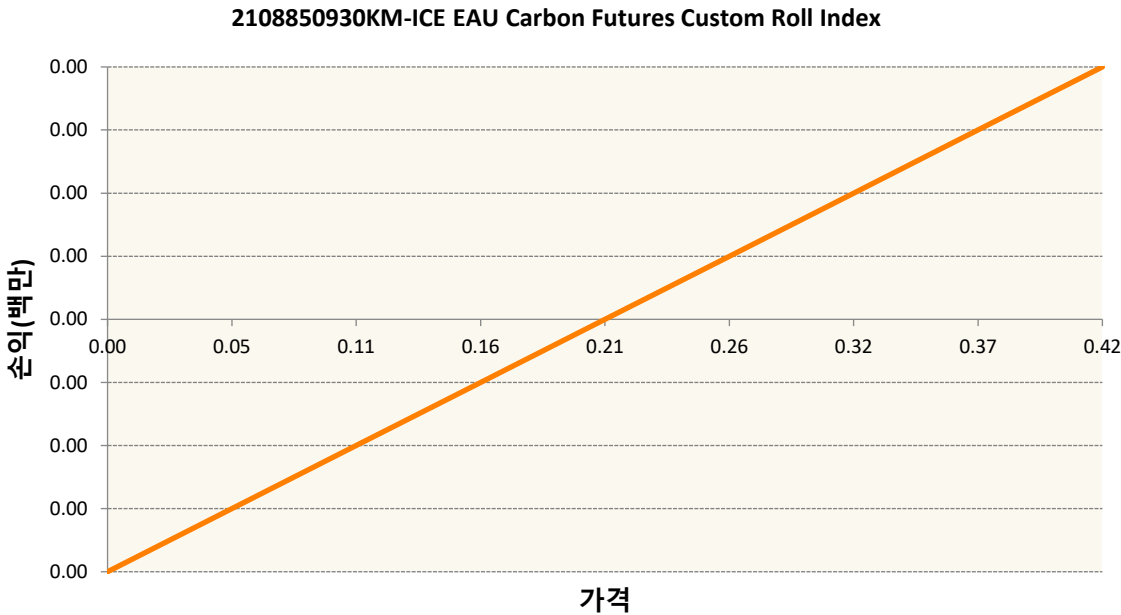
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,843	0	9,843	
누계	통화	선도	0	2,048	-2,048	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		6
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E		164
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		782

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,414

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

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	2025-01-17
기준일	2025-01-16

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)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	4
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	1

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

(단위:백만원)

16

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

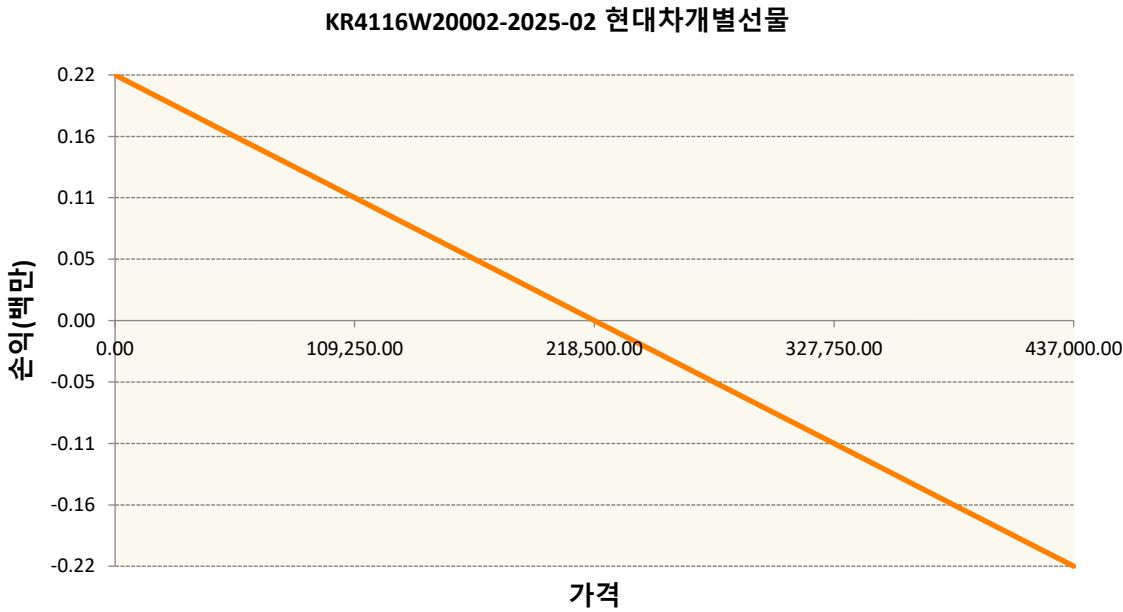
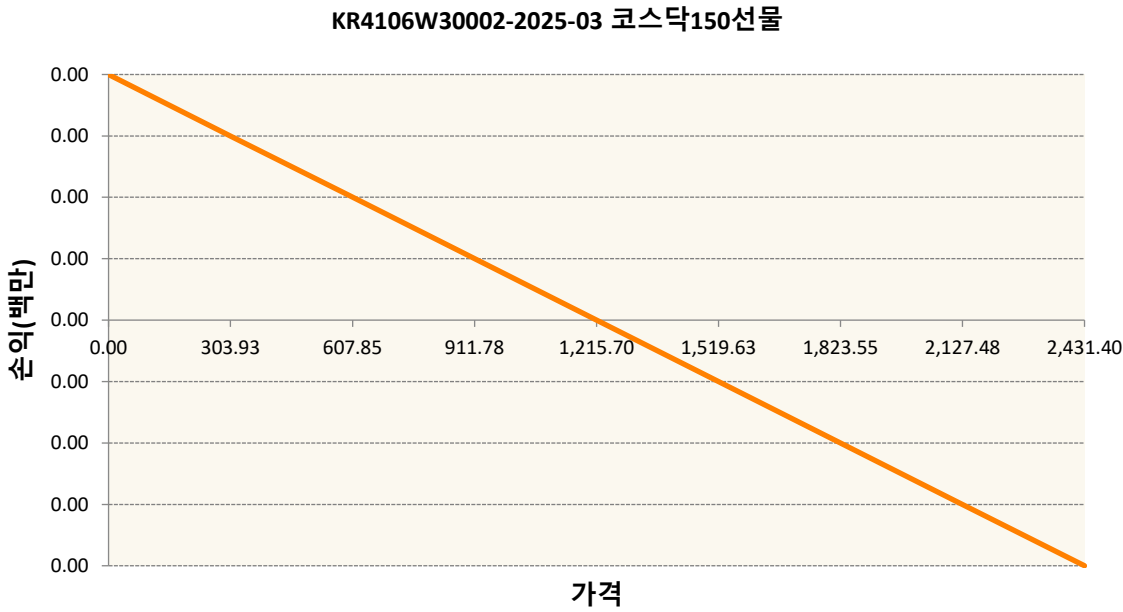
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

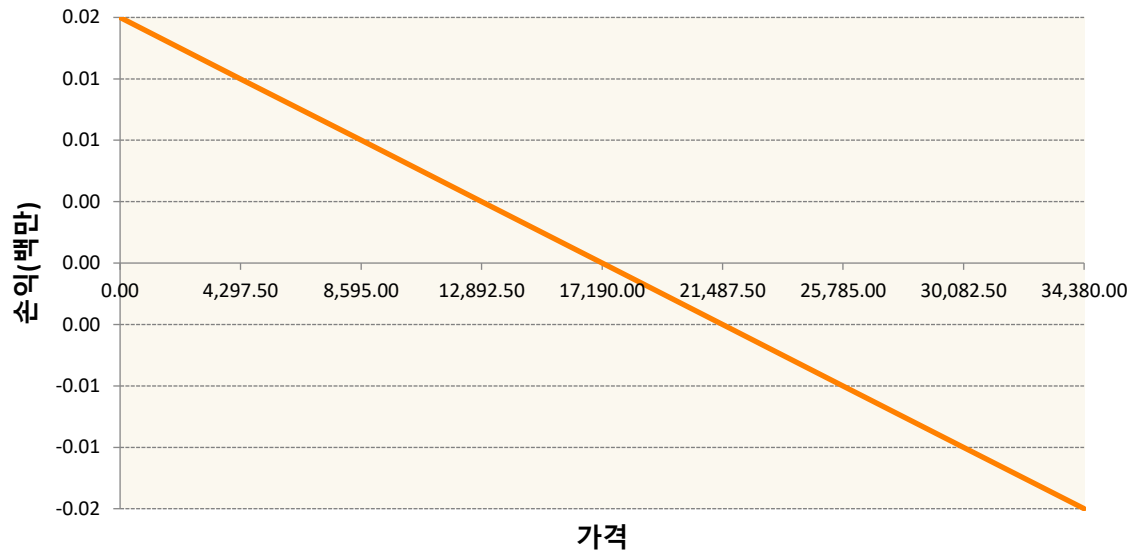
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4	2	2	장내
누계	유가증권	선물	8	41	-34	장내

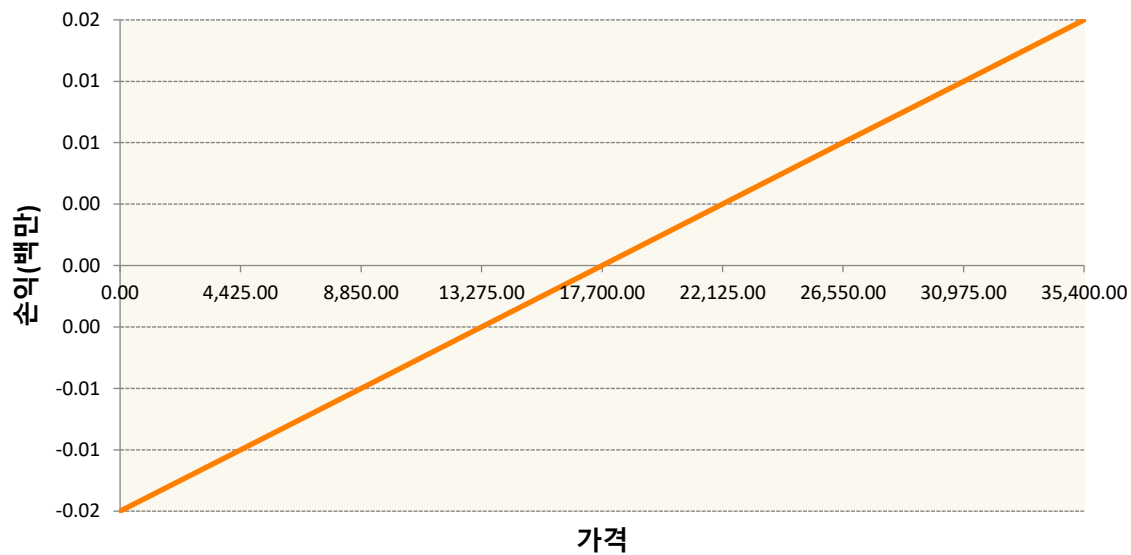
2. 만기시점의 손익구조



KR4151W20009-2025-02 GS건설개별선물



KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4106W30(2025-03 코스닥150선물	2
KR4116W20(2025-02 현대차개별선물	1
KR4151W20(2025-02 GS건설개별선물	1
KR41ETW20(2025-02 삼성E&A개별선물	1

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

(단위:백만원)

7

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

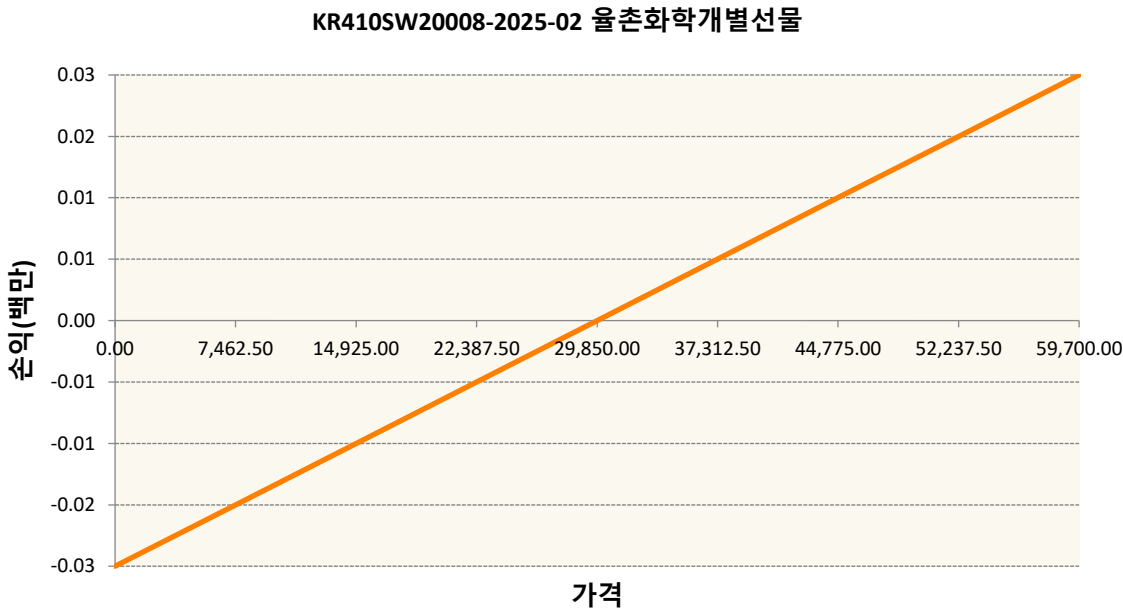
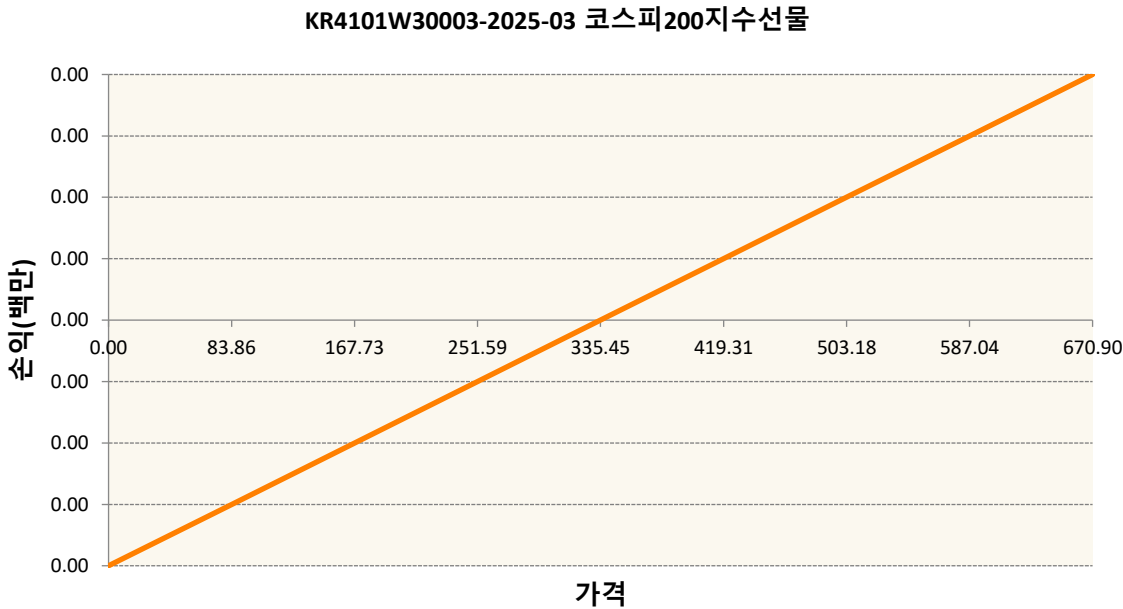
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

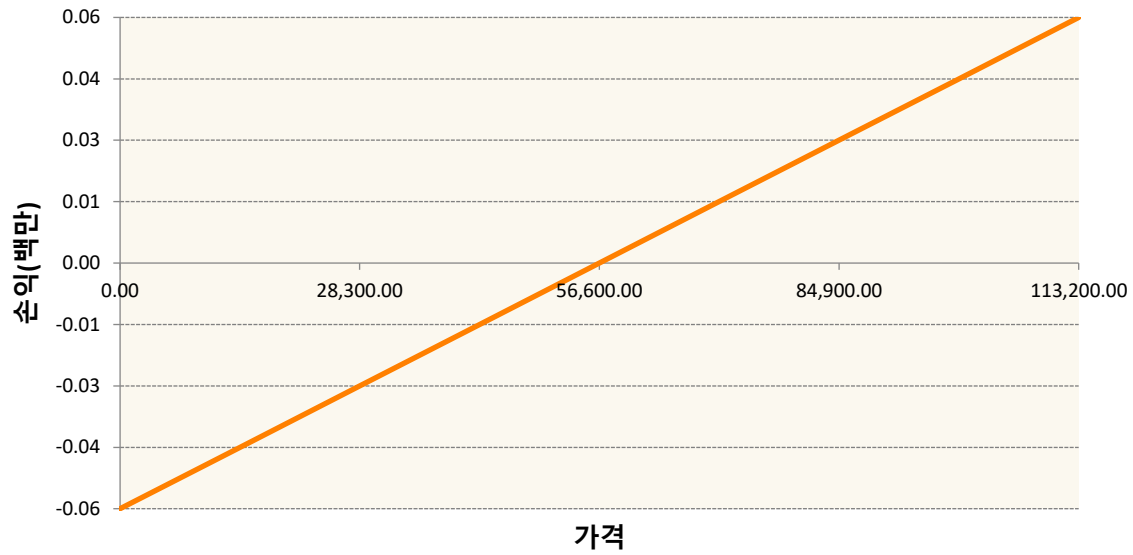
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	848	838	10	장내
누계	유가증권	선물	9,210	0	9,210	장내

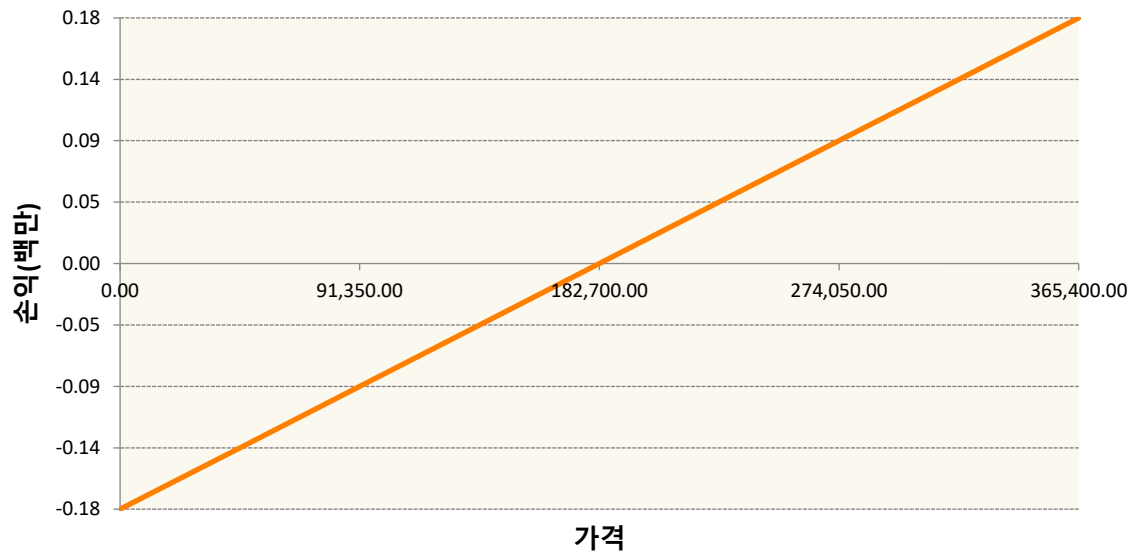
2. 만기시점의 손익구조



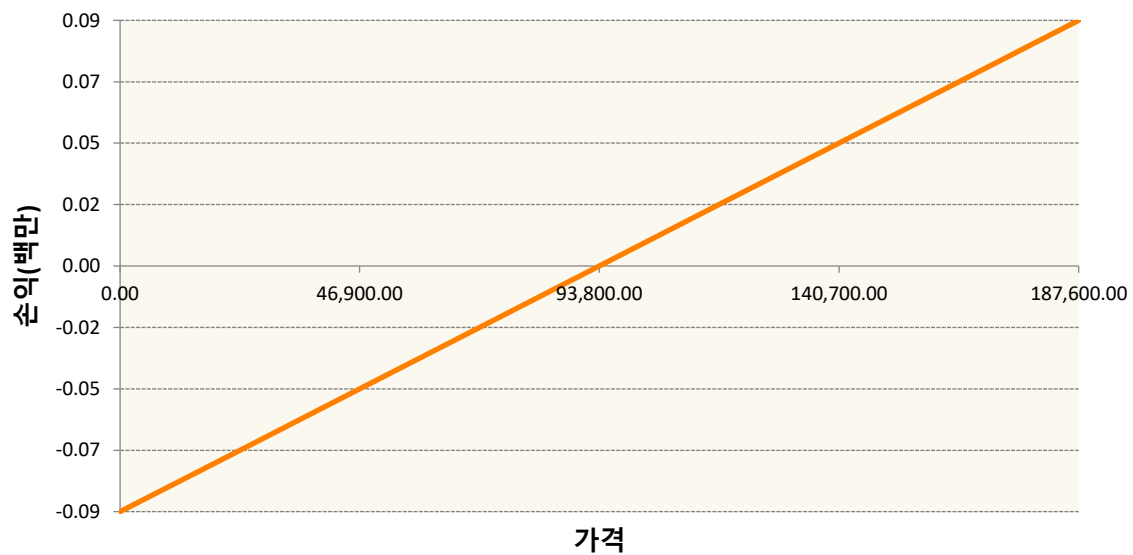
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



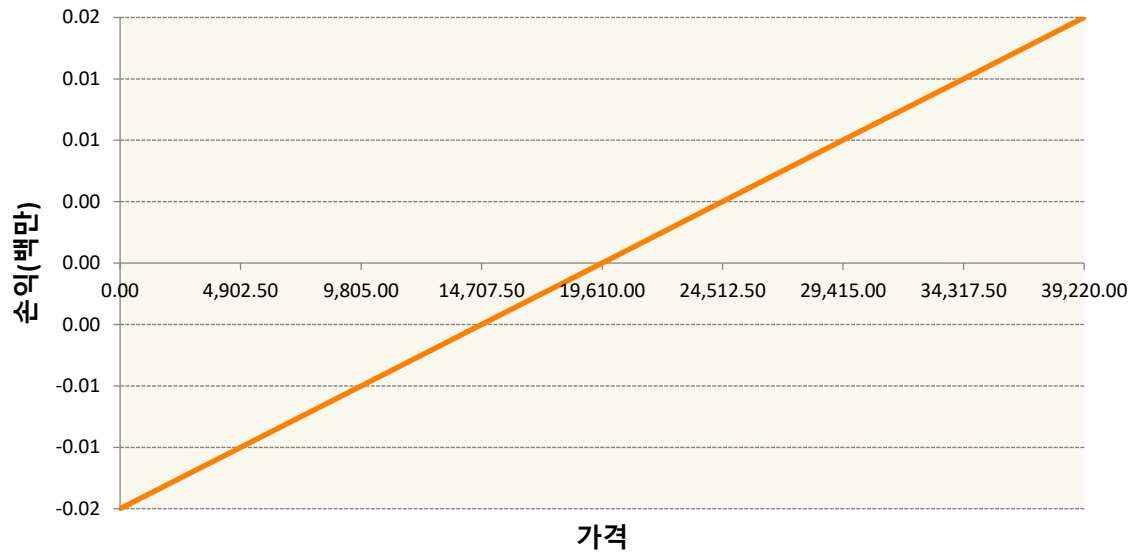
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



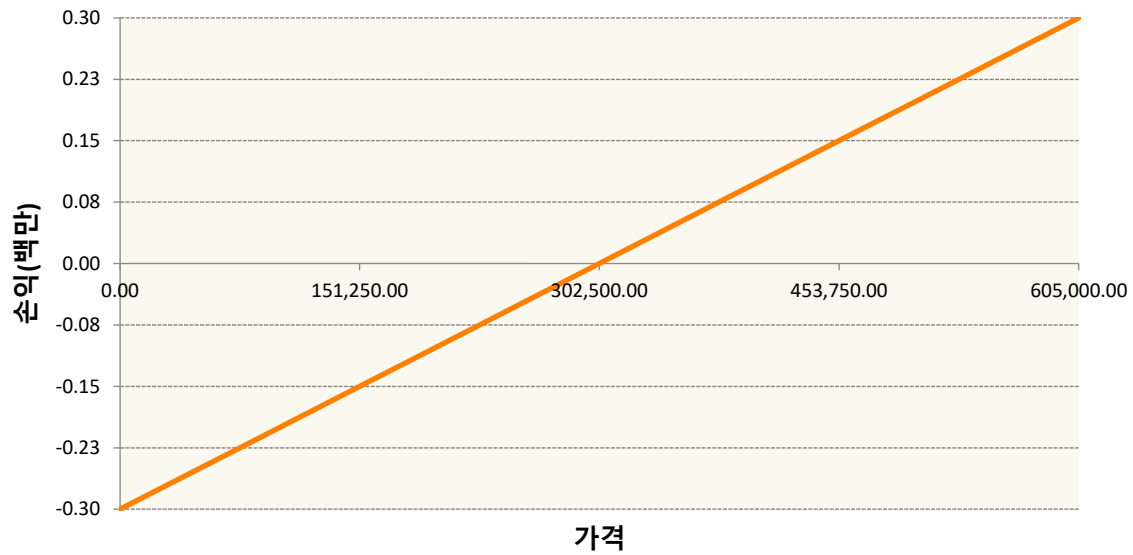
KR41C3W20007-2025-02 금호석유개별선물



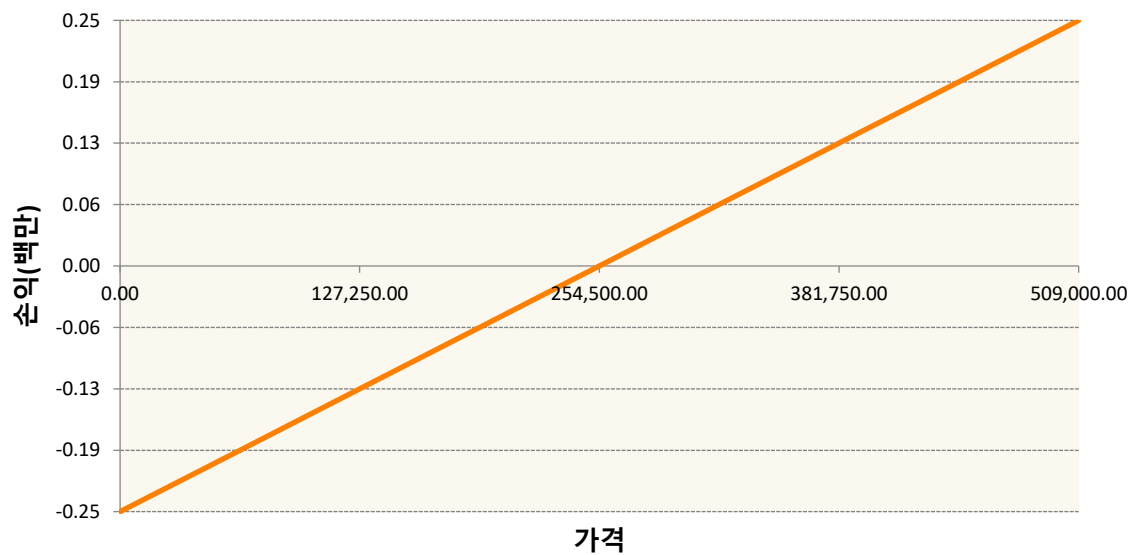
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



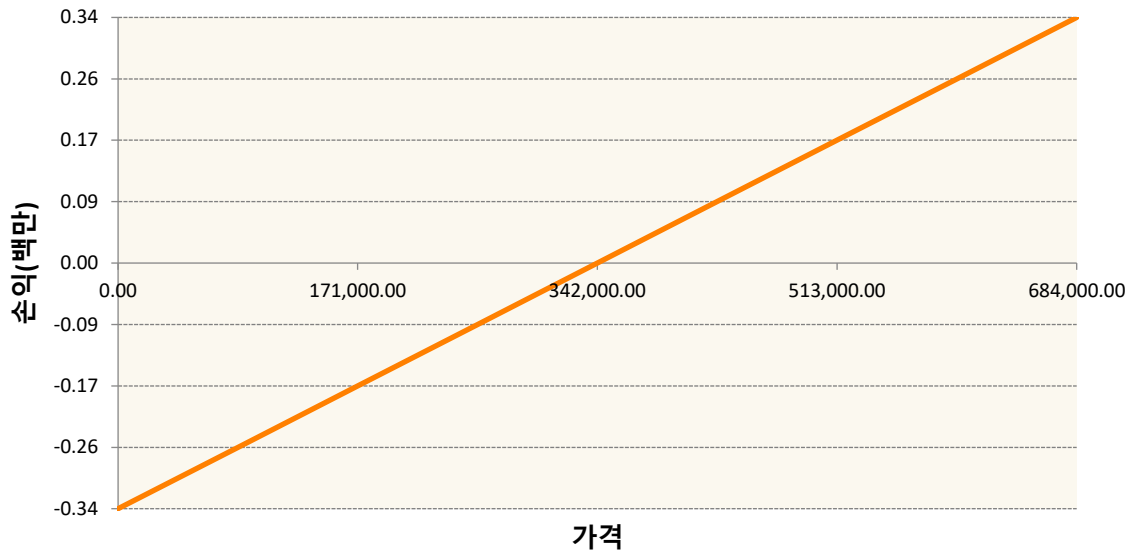
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



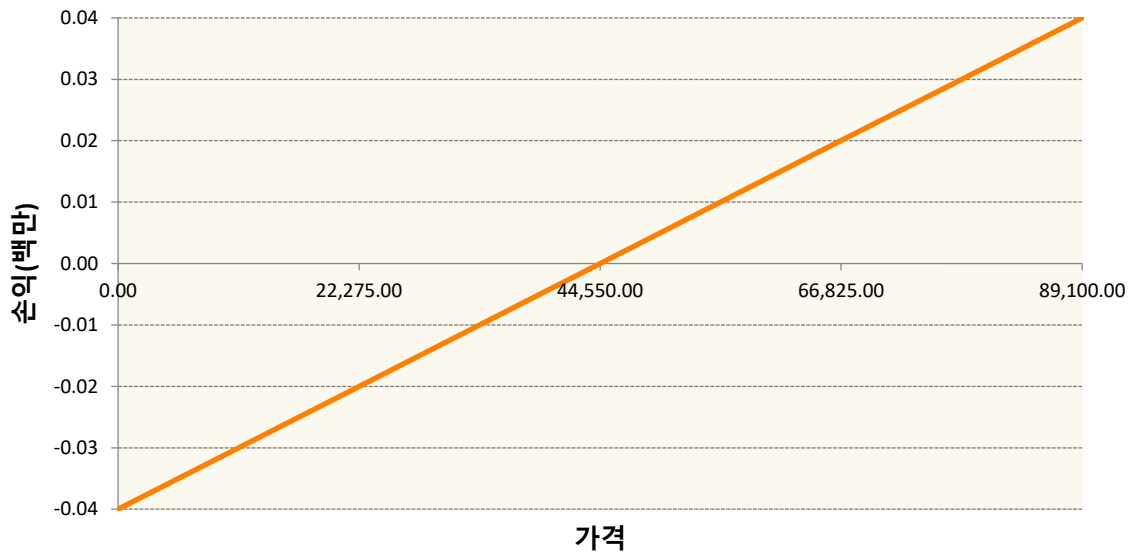
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



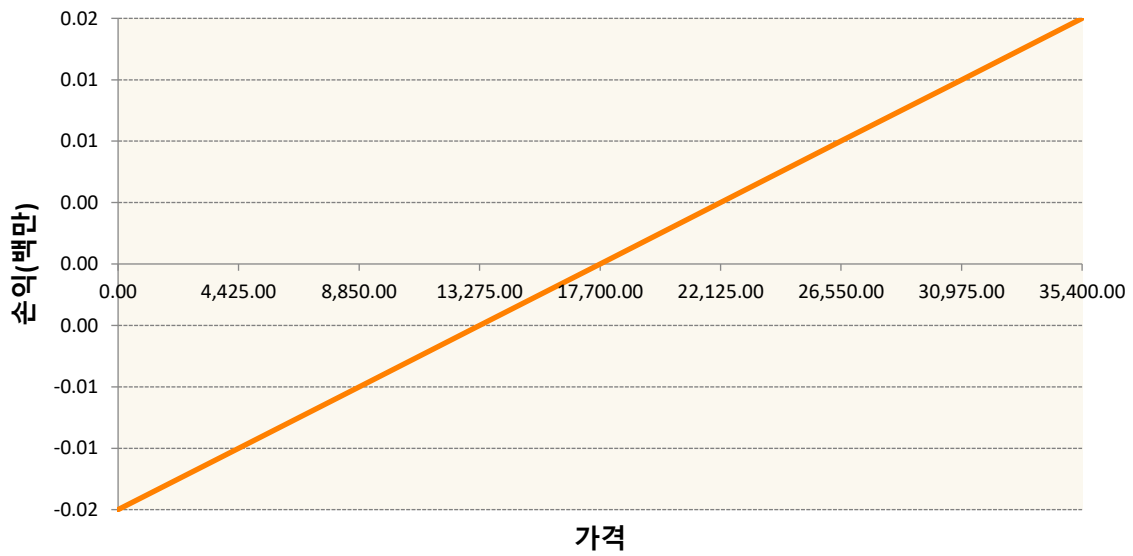
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



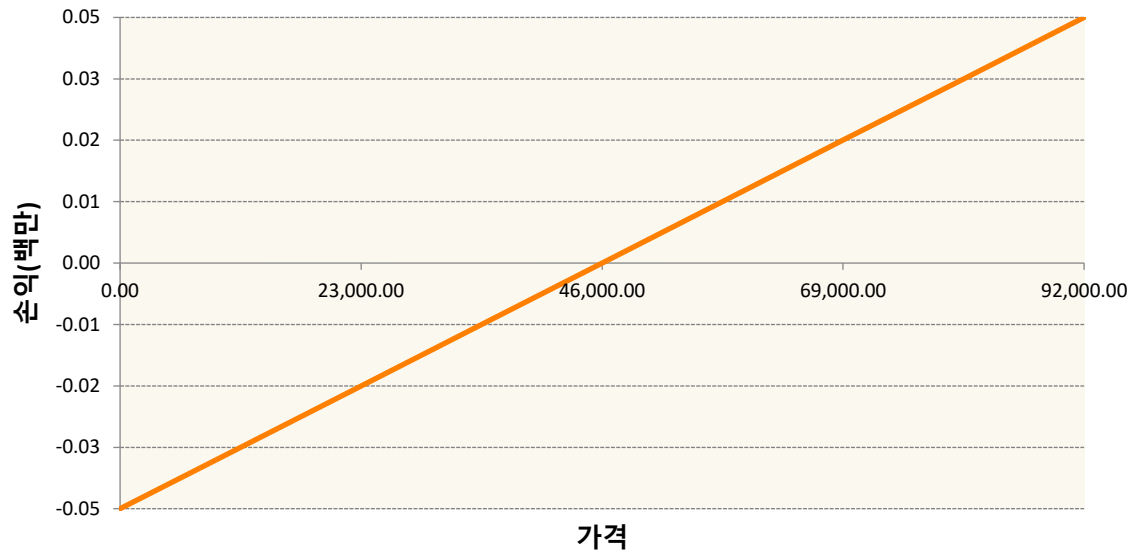
KR41DCW20004-2025-02 HL만도개별선물



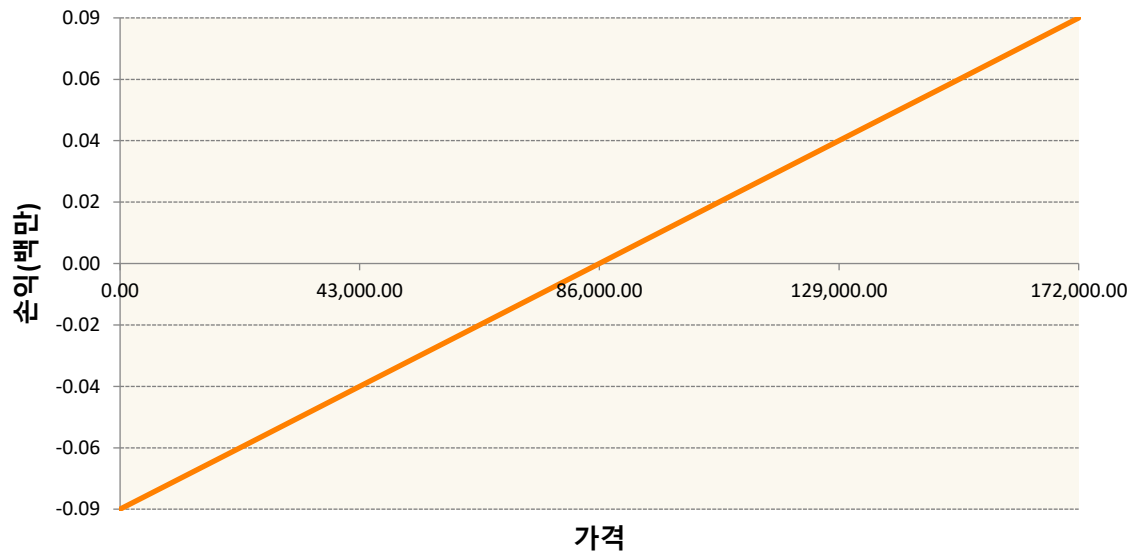
KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



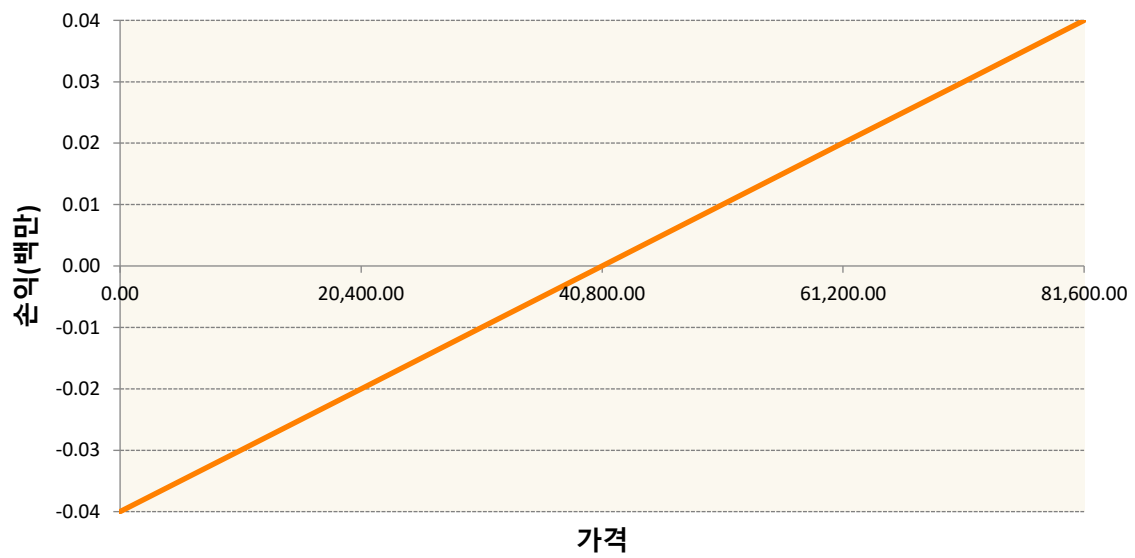
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



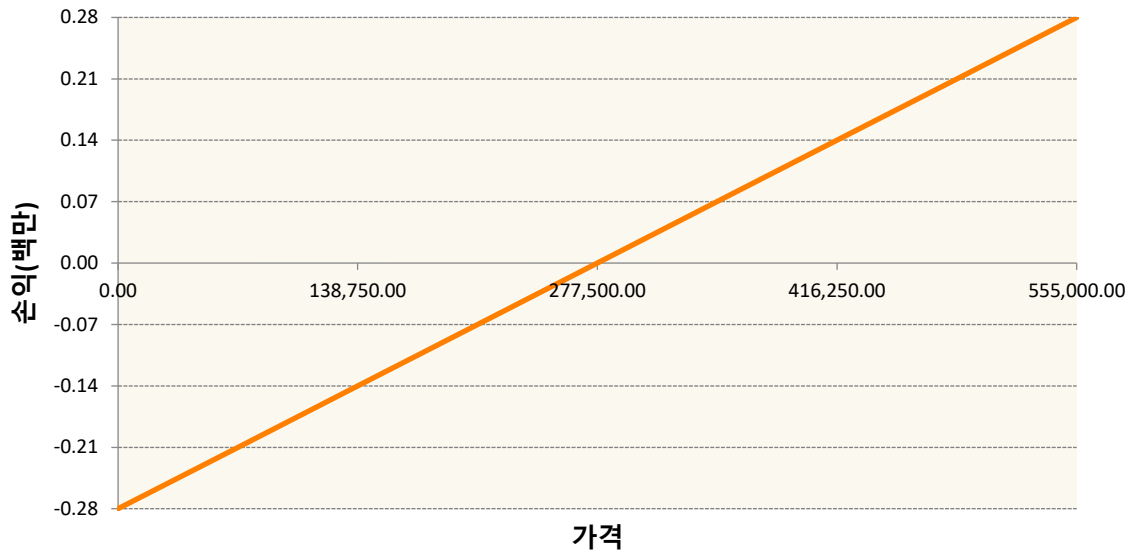
KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



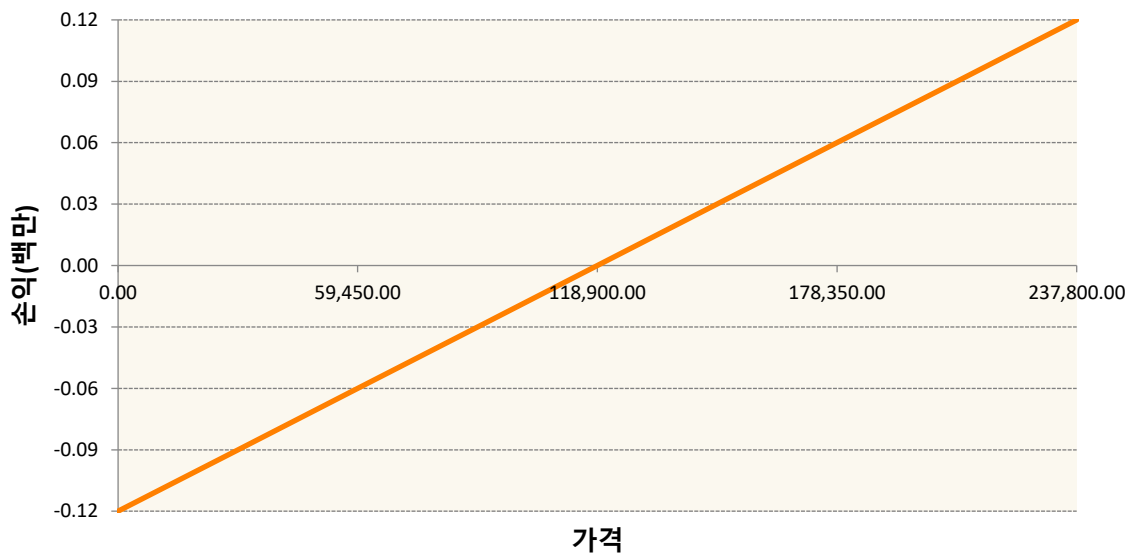
KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



KR41HEW20001-2025-02 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	570
KR410SW20(2025-02 울촌화학개별선물	3
KR41BBW20(2025-02 롯데케미칼개별선물	11
KR41BJW20C 2025-02 엔씨소프트개별선물	22
KR41C3W20(2025-02 금호석유개별선물	11
KR41CNW20 2025-02 포스코DX개별선물	4
KR41CRW20 2025-02 LG생활건강개별선물	10
KR41CXW20(2025-02 한미약품개별선물	19
KR41DAW20 2025-02 농심개별선물	6
KR41DCW20 2025-02 HL만도개별선물	1
KR41ETW20(2025-02 삼성E&A개별선물	3
KR41F9W20(2025-02 SK바이오사이언스개별선물	12

KR41FMW20 2025-02 엘앤에프개별선물	21
KR41G0W20 2025-02 씨에스원드개별선물	9
KR41GTW20 2025-02 두산개별선물	19
KR41HEW20 2025-02 키움증권개별선물	16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,125

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

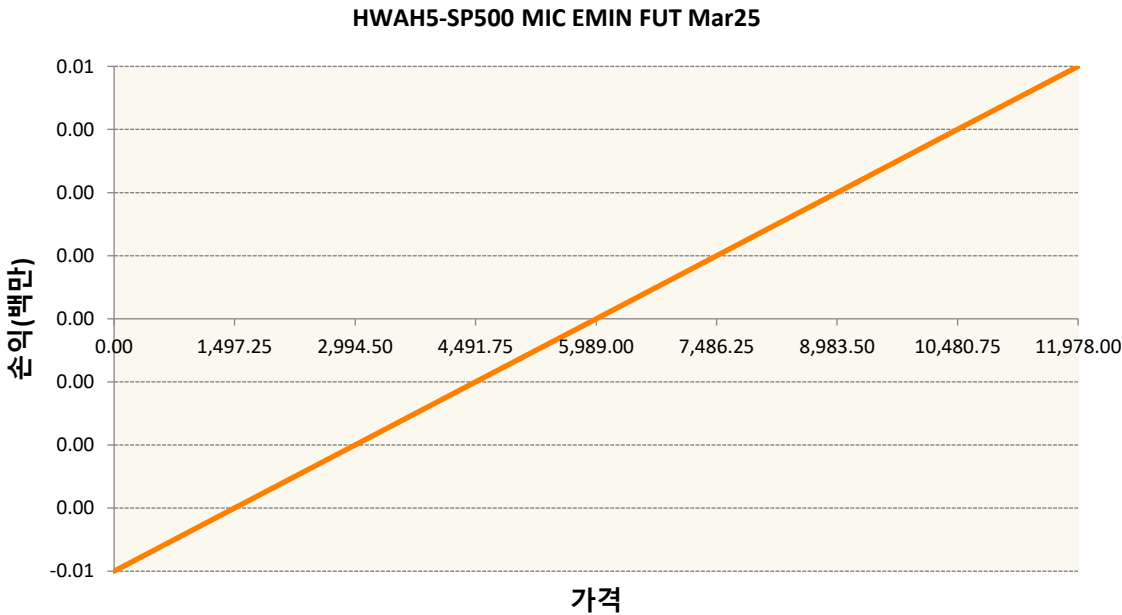
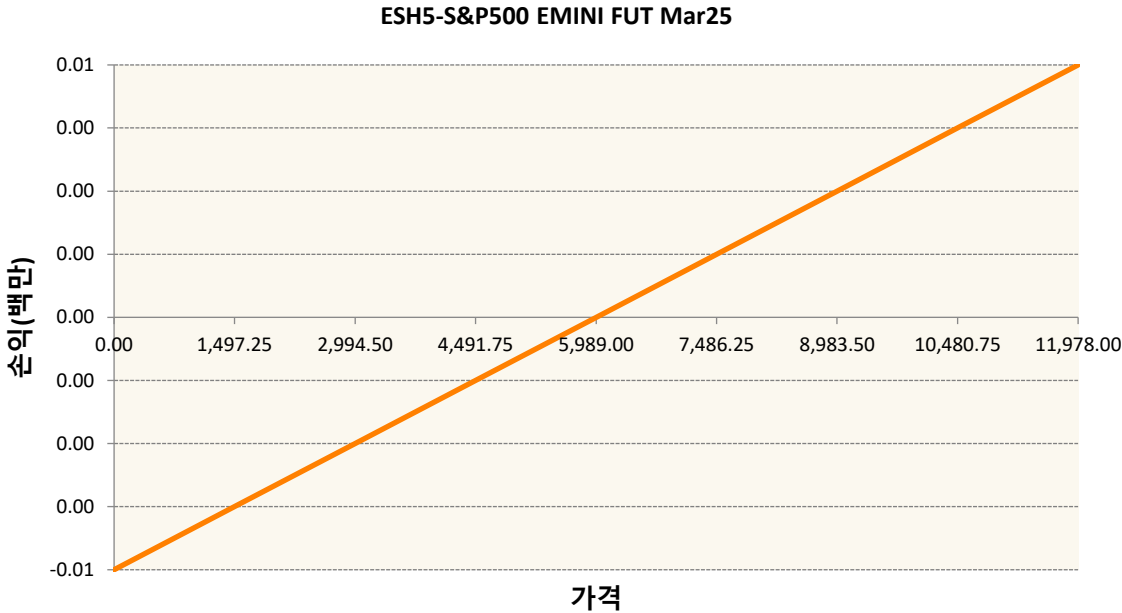
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	26,546	0	26,546	
누계	유가증권	선물	1,391	0	1,391	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,124
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	111

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,972

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

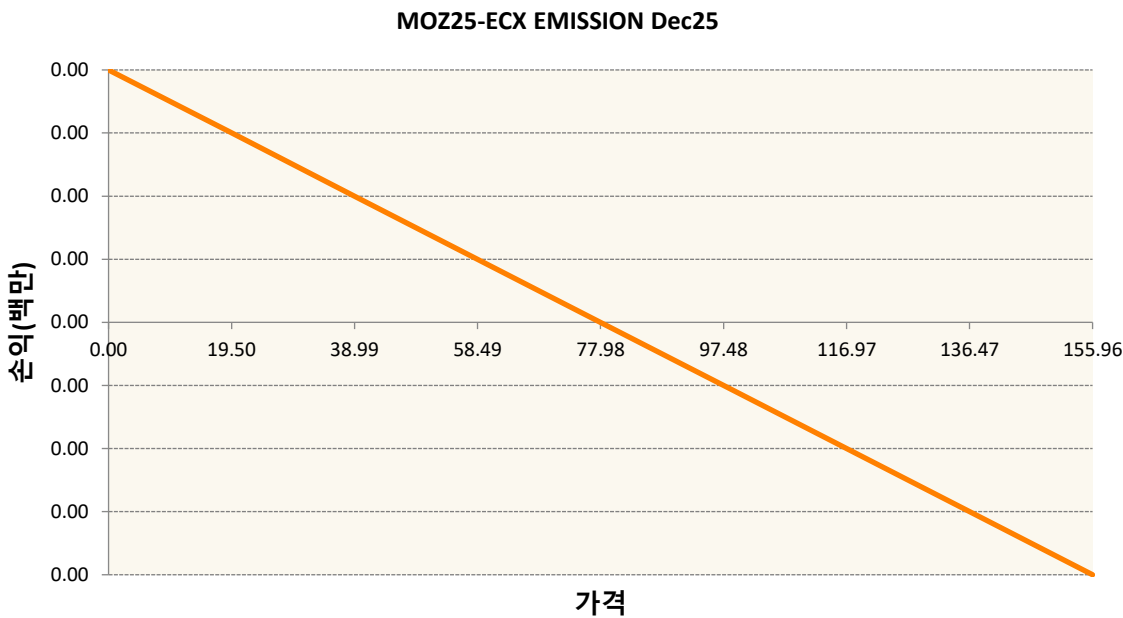
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-71	3,836	-3,907	
누계	통화	선도	0	1,264	-1,264	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	6
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	9
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	92
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	307

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

(단위:백만원)

579

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

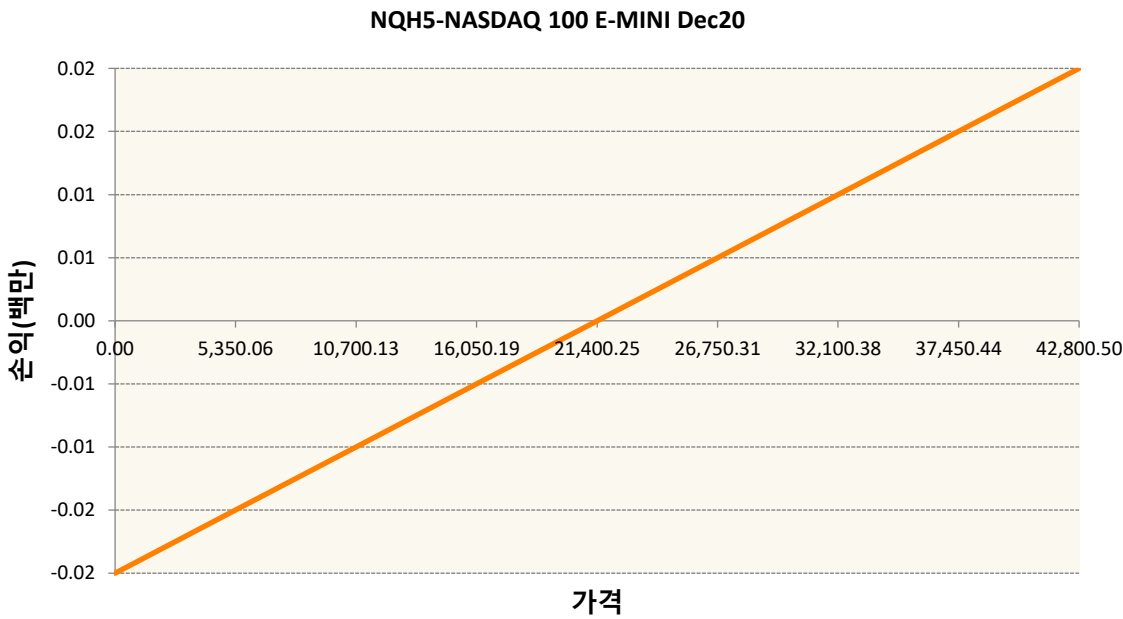
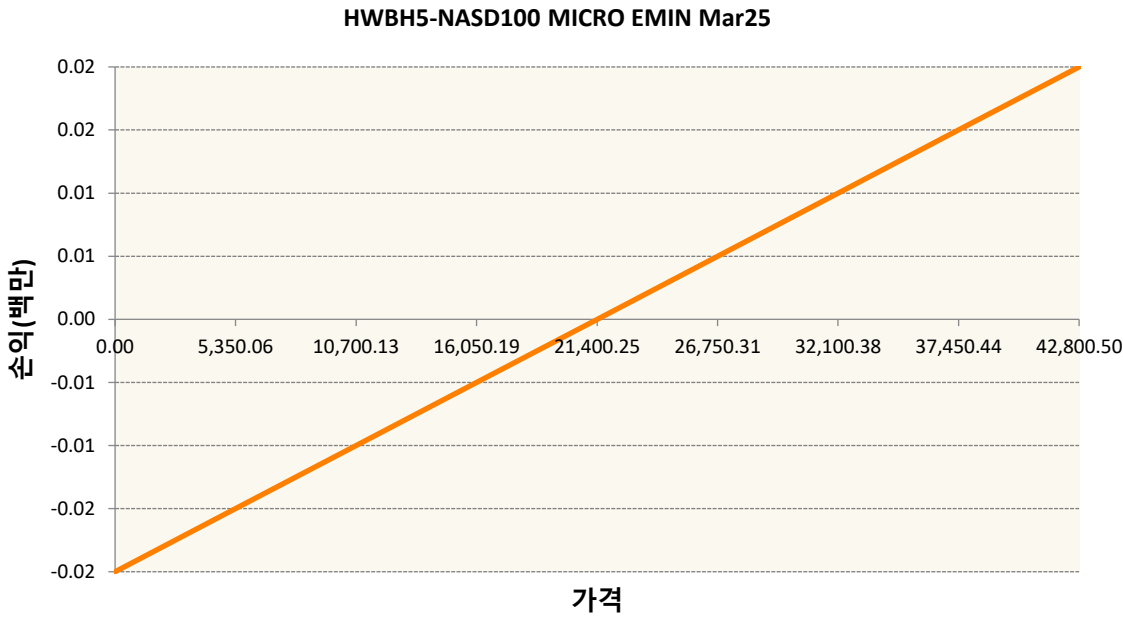
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,693	0	13,693	
누계	유가증권	선물	871	0	871	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	70
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,095

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,017

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	36,232	0	36,232	장외
누계	지수	스왑	205,238	0	205,238	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	707
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,480
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,386
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,940

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

(단위:백만원)

9,413

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

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)
	8

공시일	2025-01-17
기준일	2025-01-16

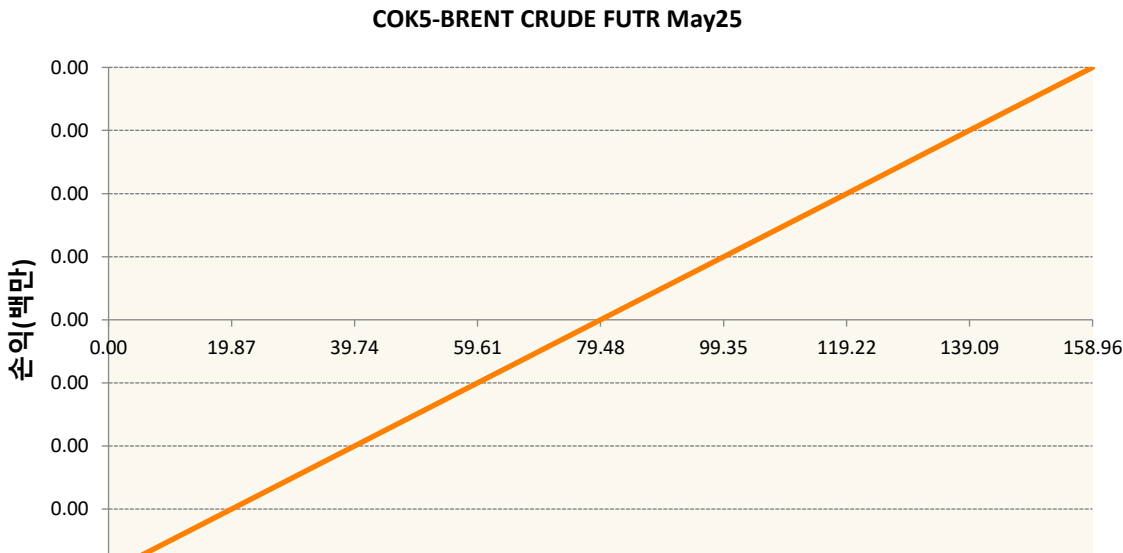
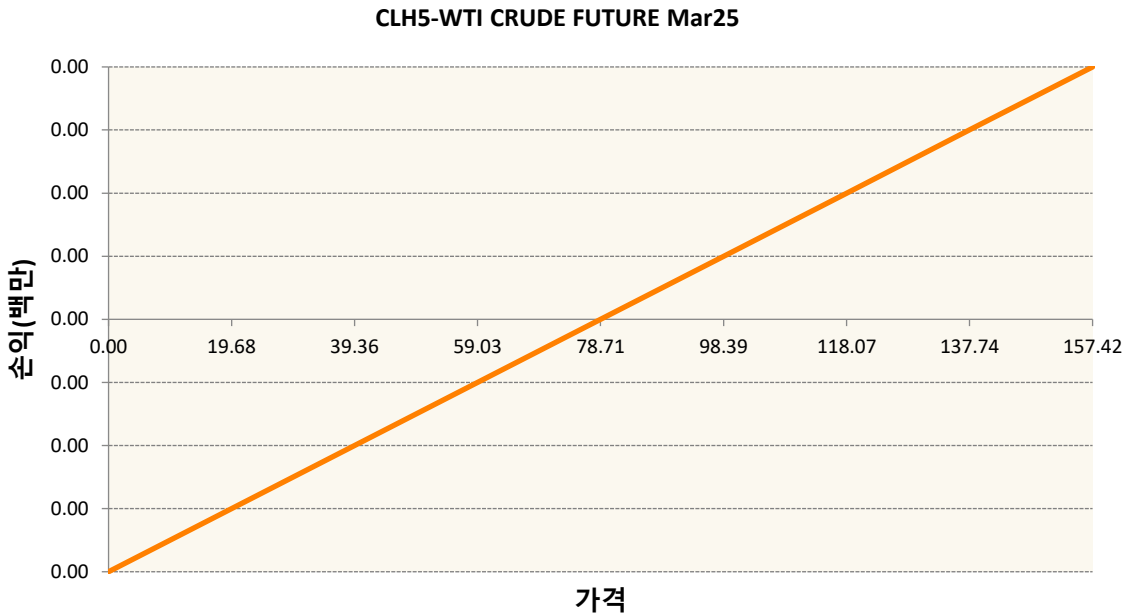
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

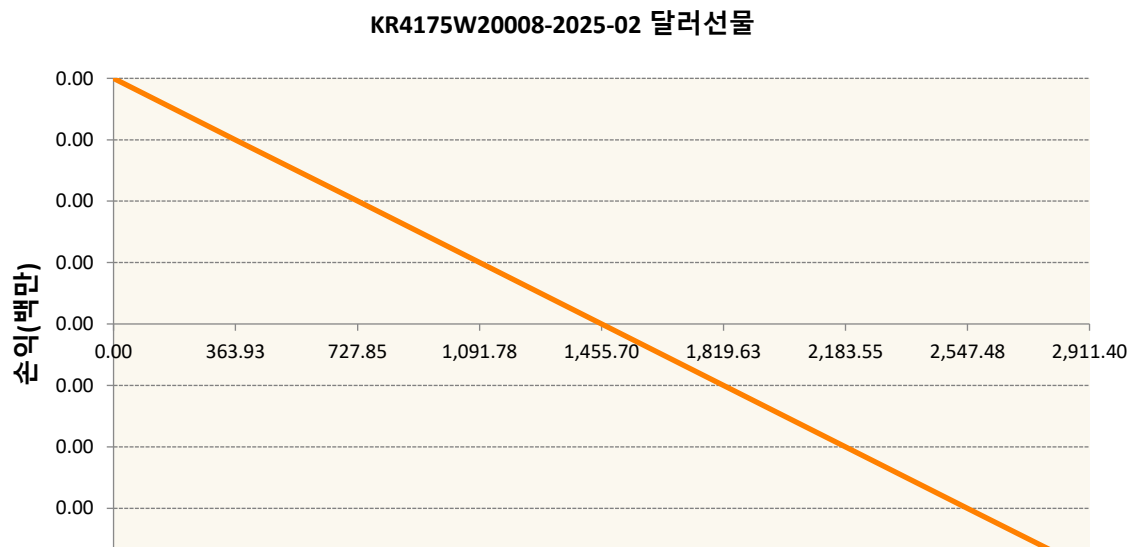
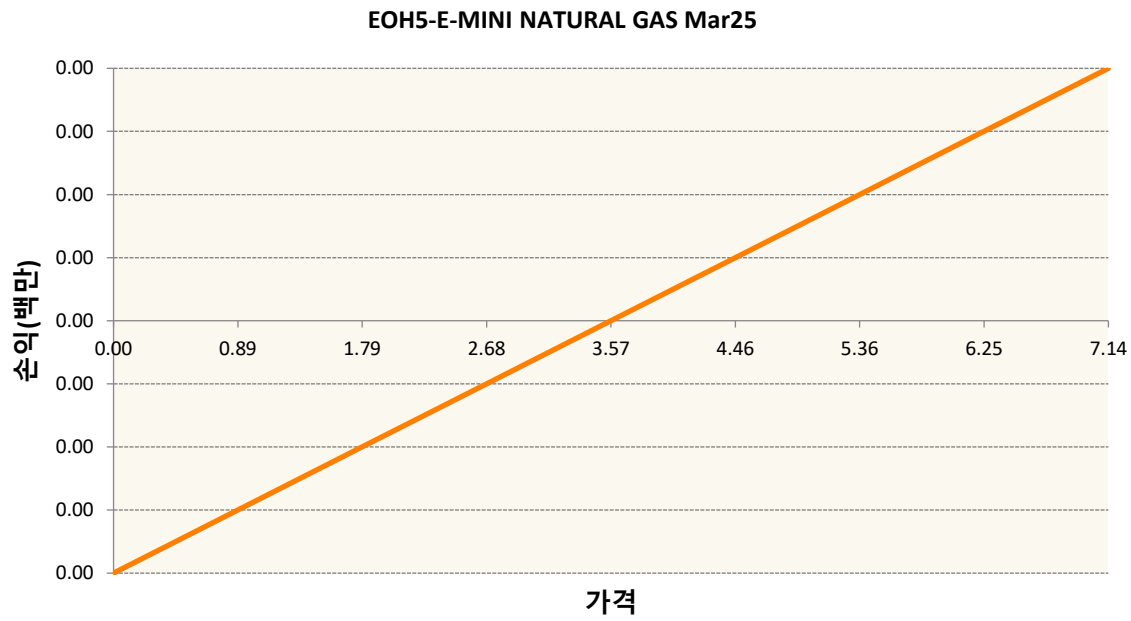
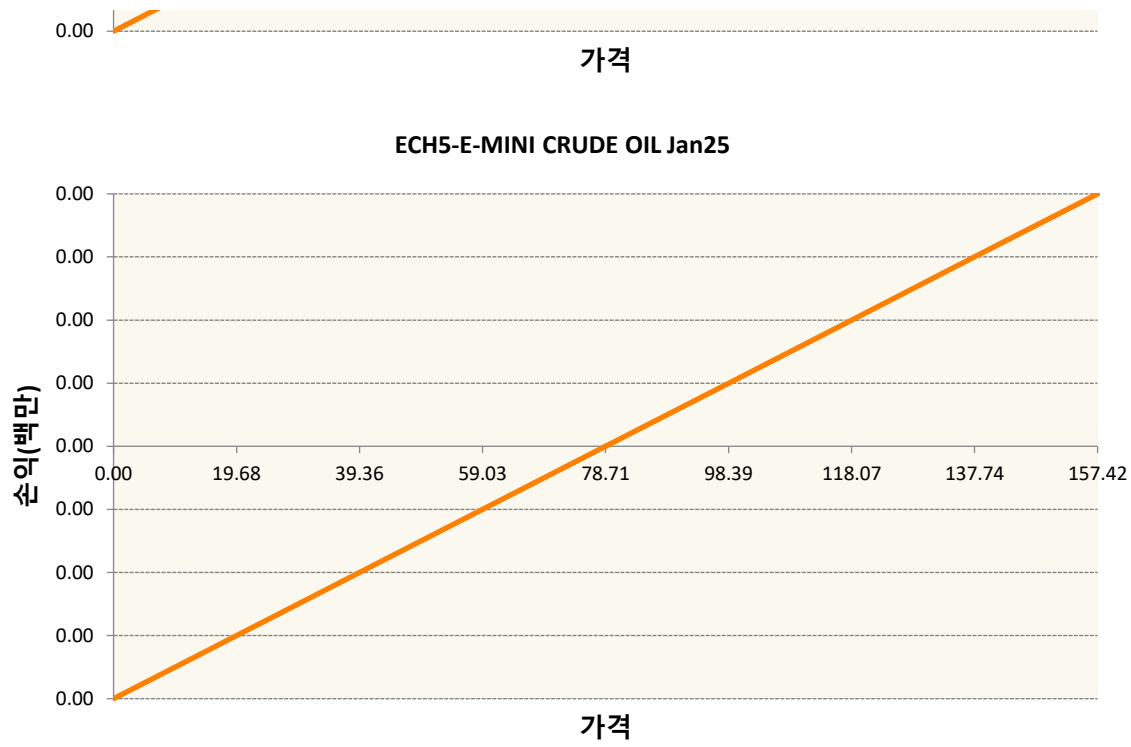
1. 계약금액

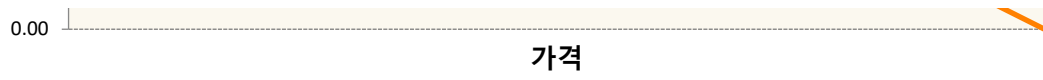
(단위:백만원)

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	175	-175	장내
누계	선물	유가증권	113	0	113	
누계	유가증권	선물	800	0	800	
누계	통화	선물	0	204	-204	장내

2. 만기시점의 손익구조

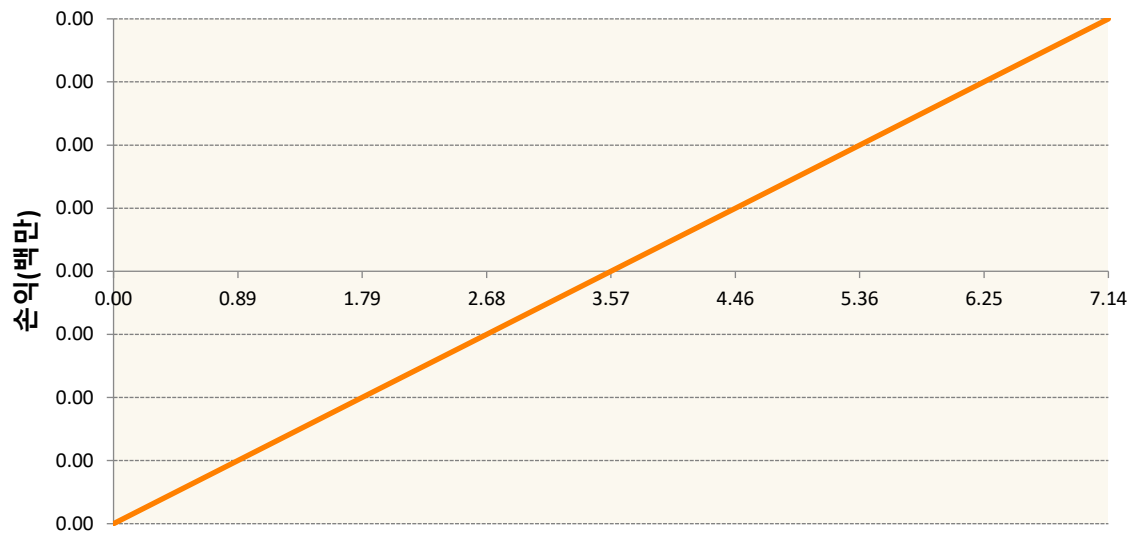






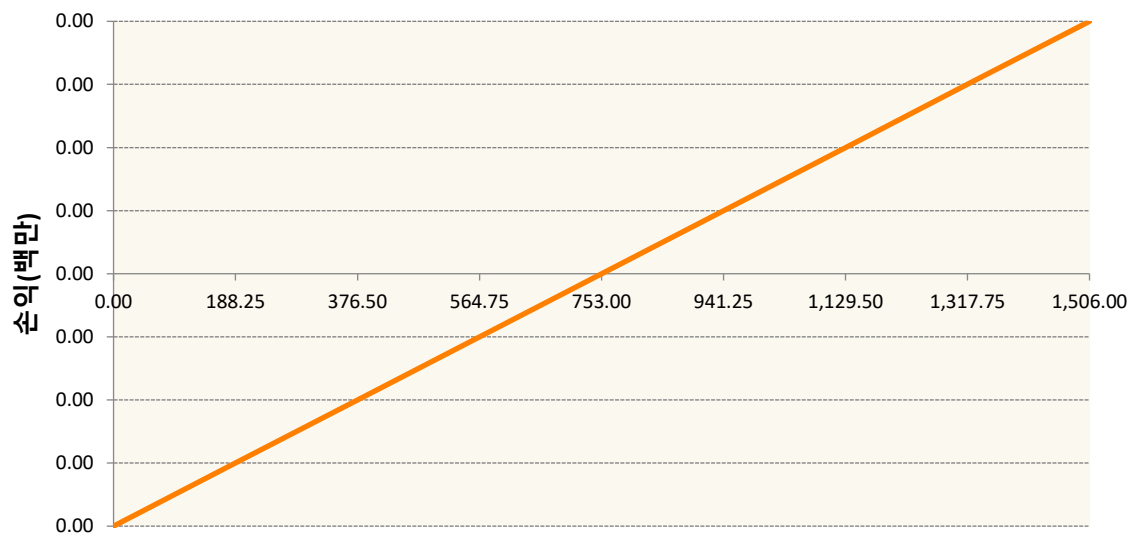
가격

NGH25-NATURAL GAS FUTR Mar25



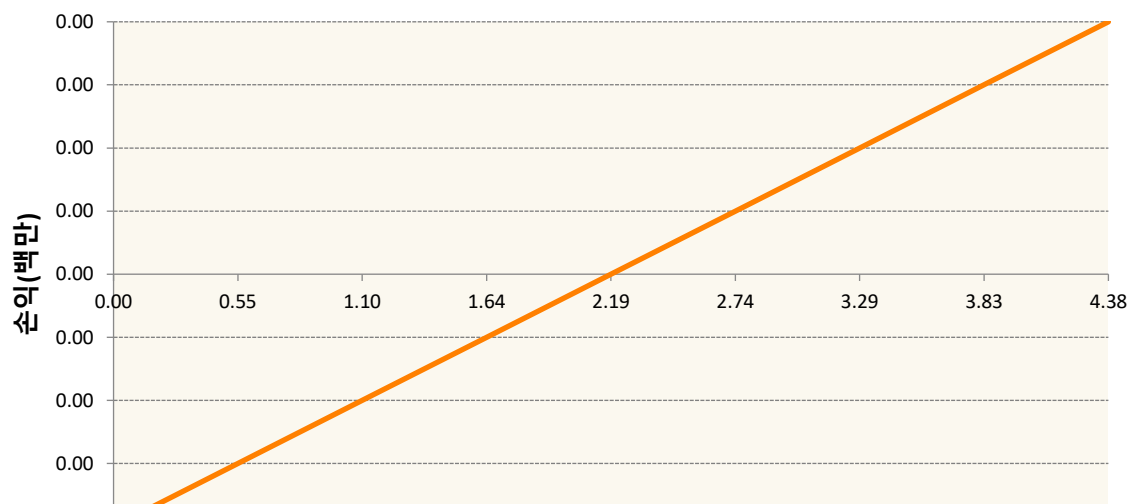
가격

QSH5-Low Su Gasoil G Mar25



가격

XBH5-GASOLINE RBOB FUT Mar25



손익(백만)

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar25	9
COK5	BRENT CRUDE FUTR May25	19
ECH5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	5
EOH5	E-MINI NATURAL GAS Mar25	5
KR4175W20(2025-02 달러선물		16
NGH25	NATURAL GAS FUTR Mar25	16
QSH5	Low Su Gasoil G Mar25	9
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar25	11

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

(단위:백만원)

164