

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

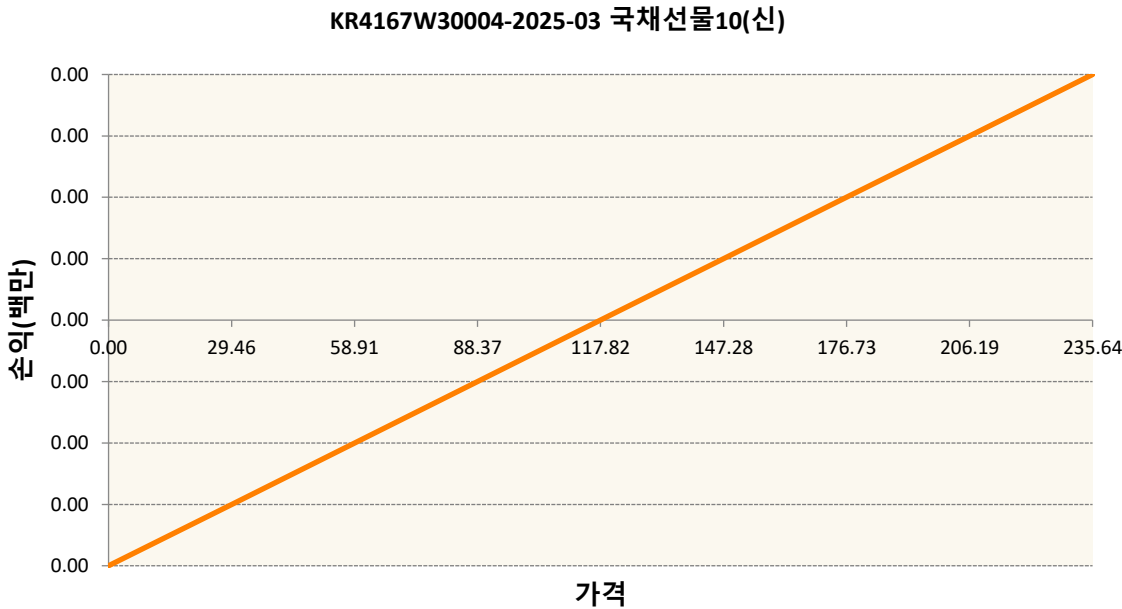
베스트장기채(채권-파생형)

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	113,107	0	113,107	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

2,938

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

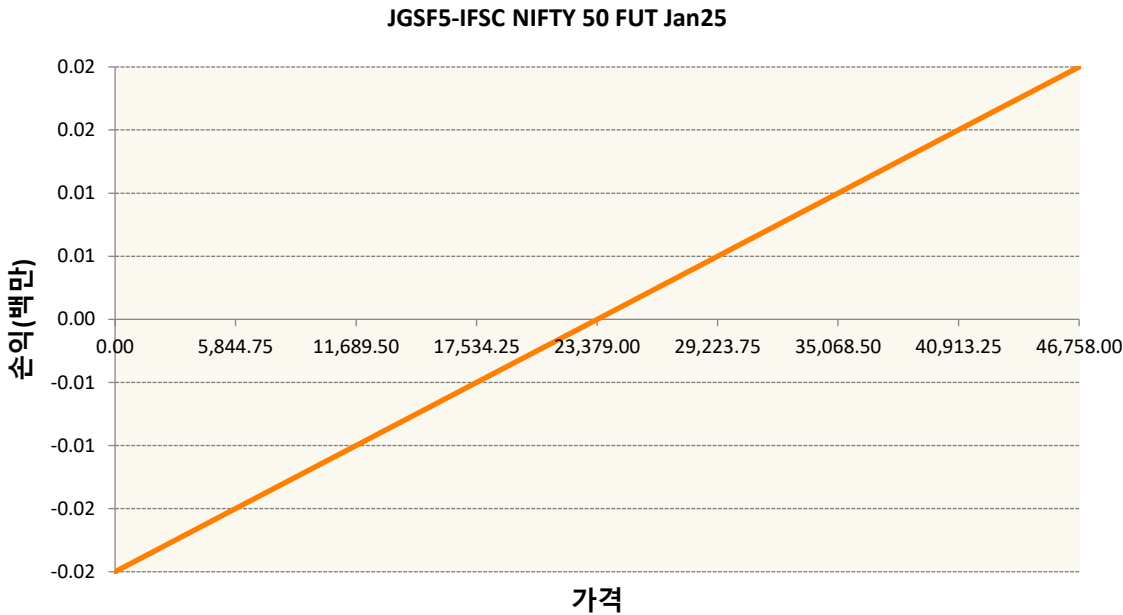
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,425	0	3,425	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSF5	IFSC NIFTY 50 FUT Jan25	274
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

184

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

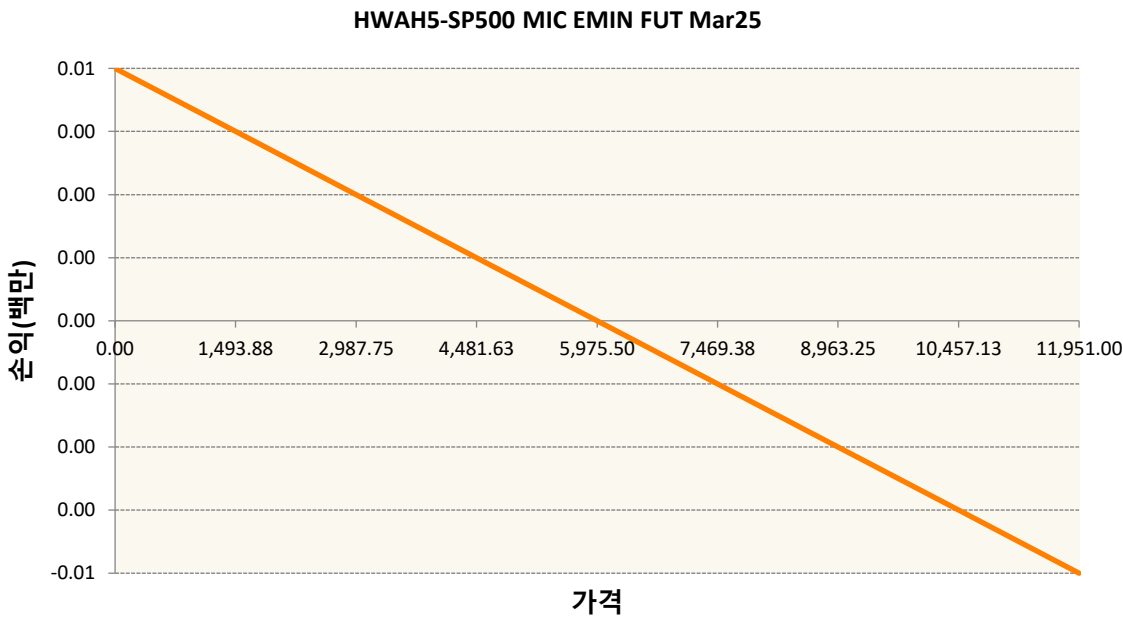
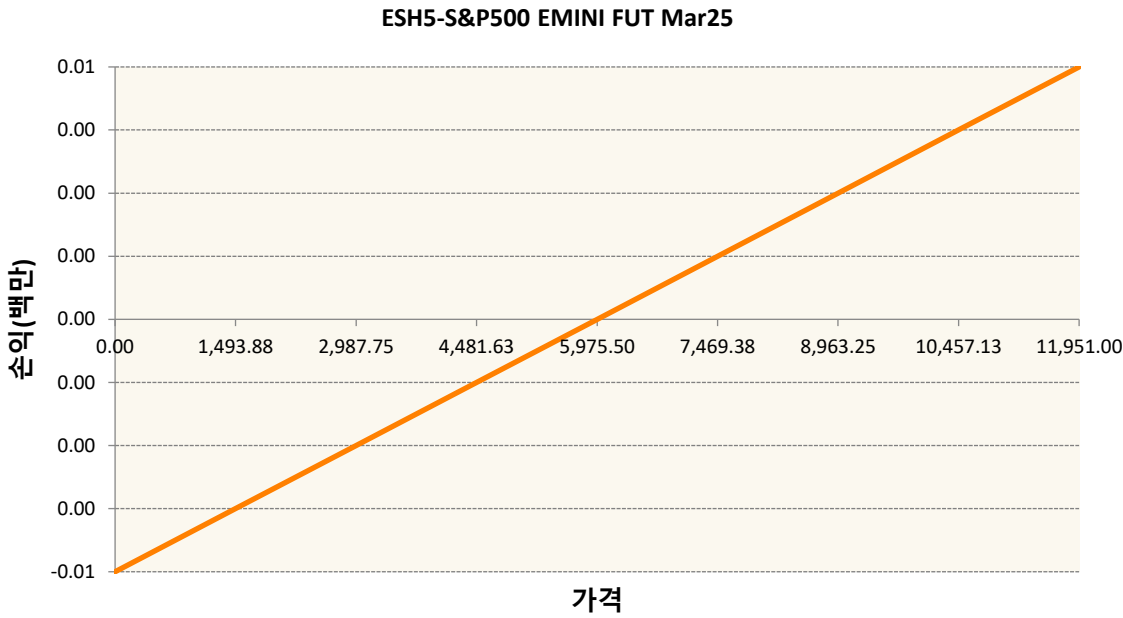
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	869	0	869	
누계	유가증권	선물	0	91	-91	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

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

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

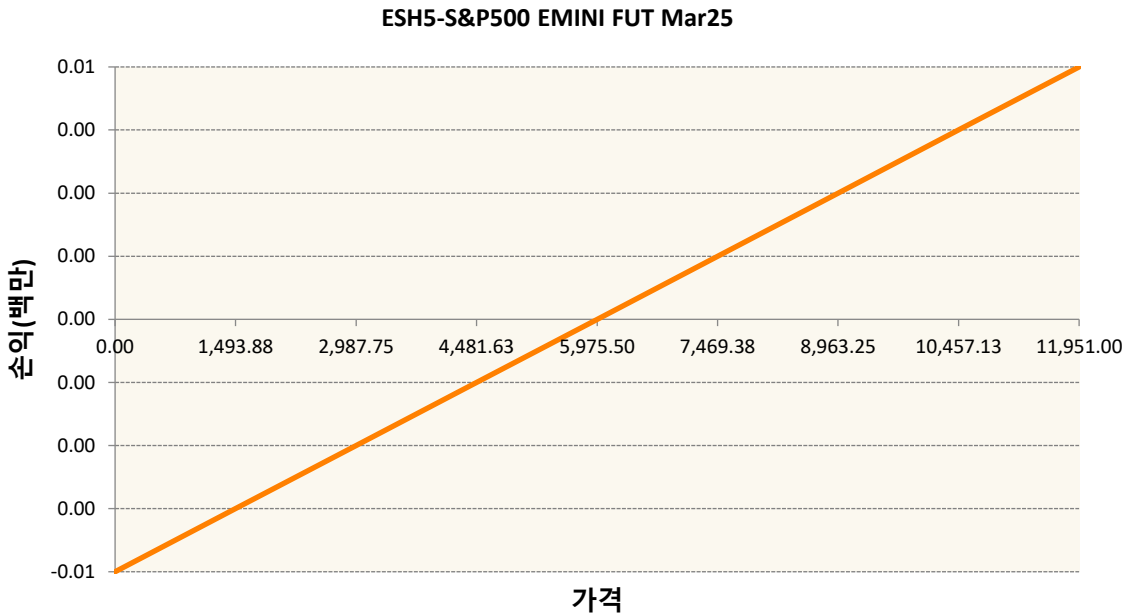
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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	2,602	0	2,602	
누계	통화	선도	0	102	-102	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	208
FXW213F1G(KRW/USD 07-02-25E		8

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

(단위:백만원)

288

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

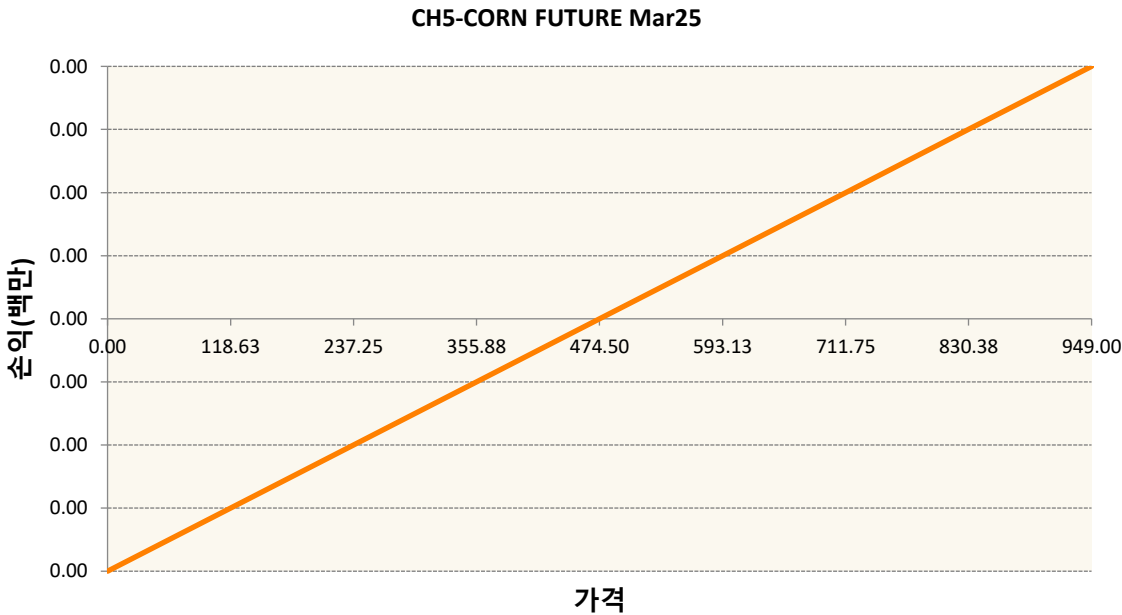
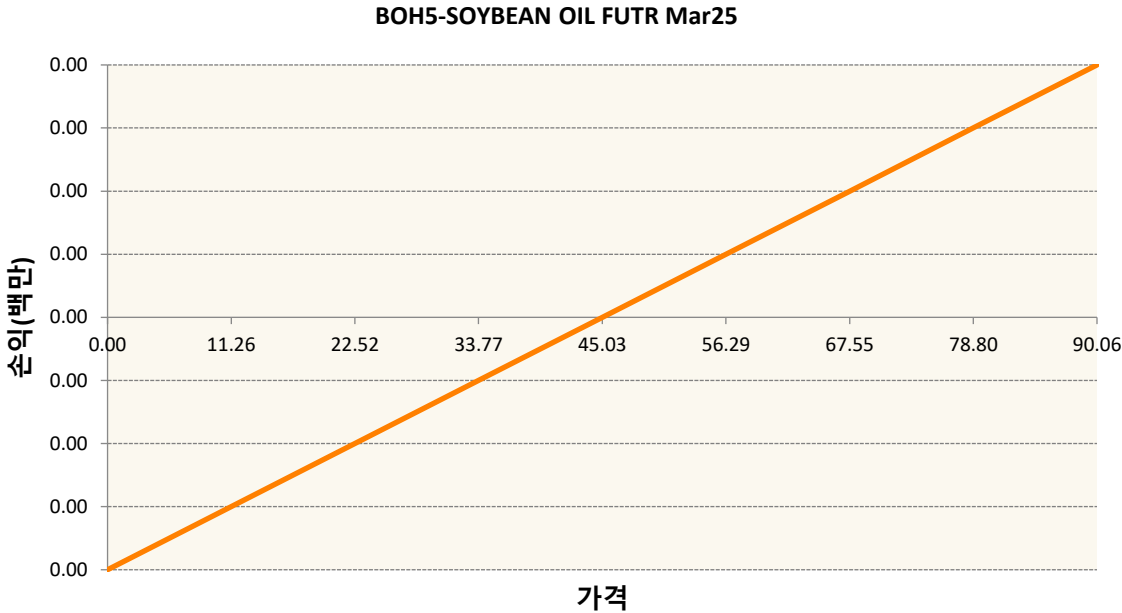
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

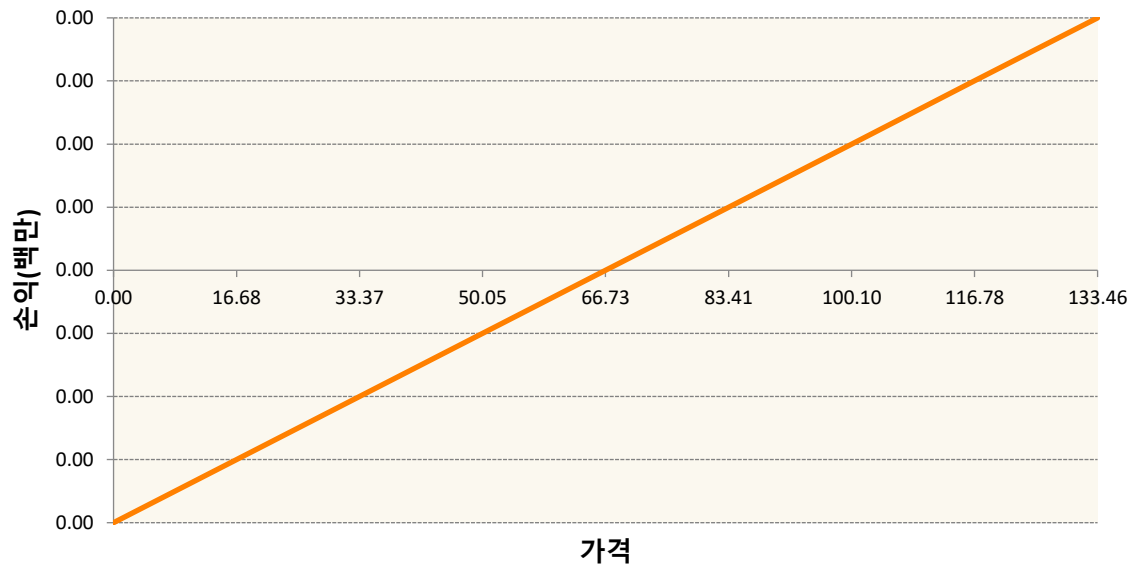
(단위:USD 백만)

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	3,711	0	3,711	
누계	통화	선물	0	422	-422	장내

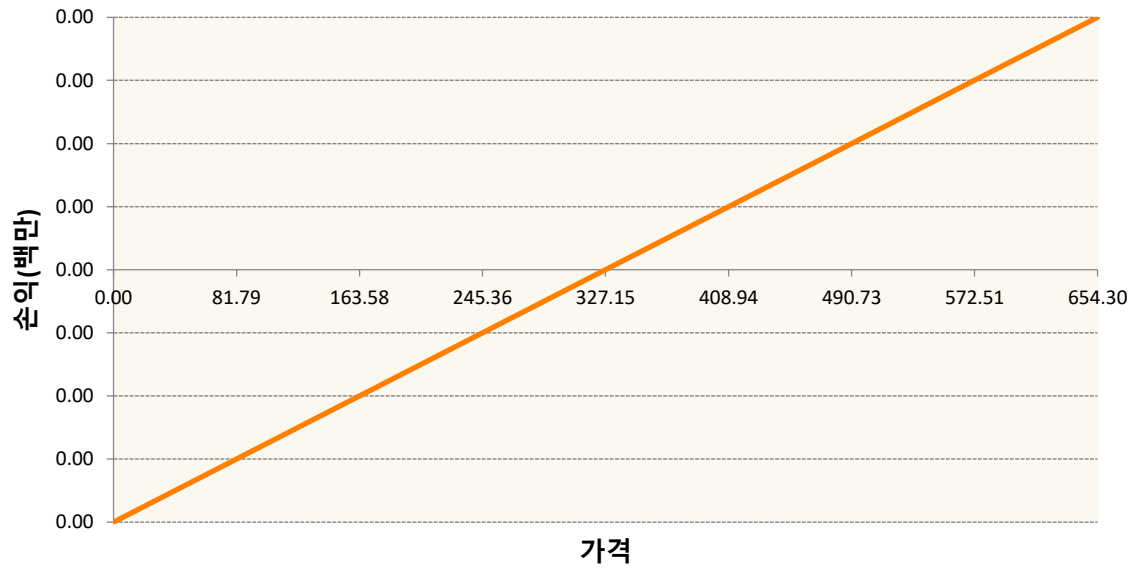
2. 만기시점의 손익구조



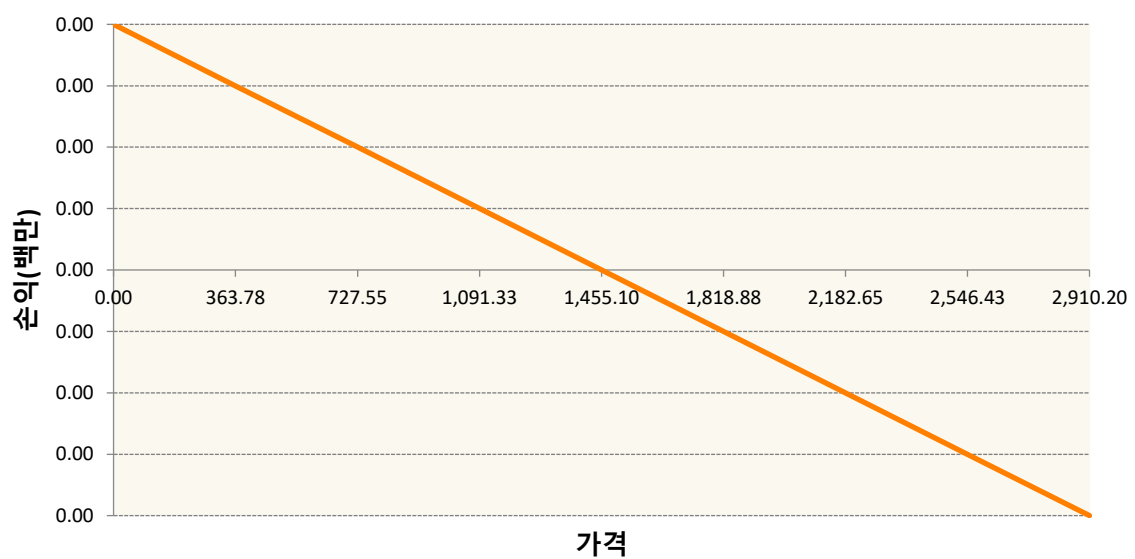
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



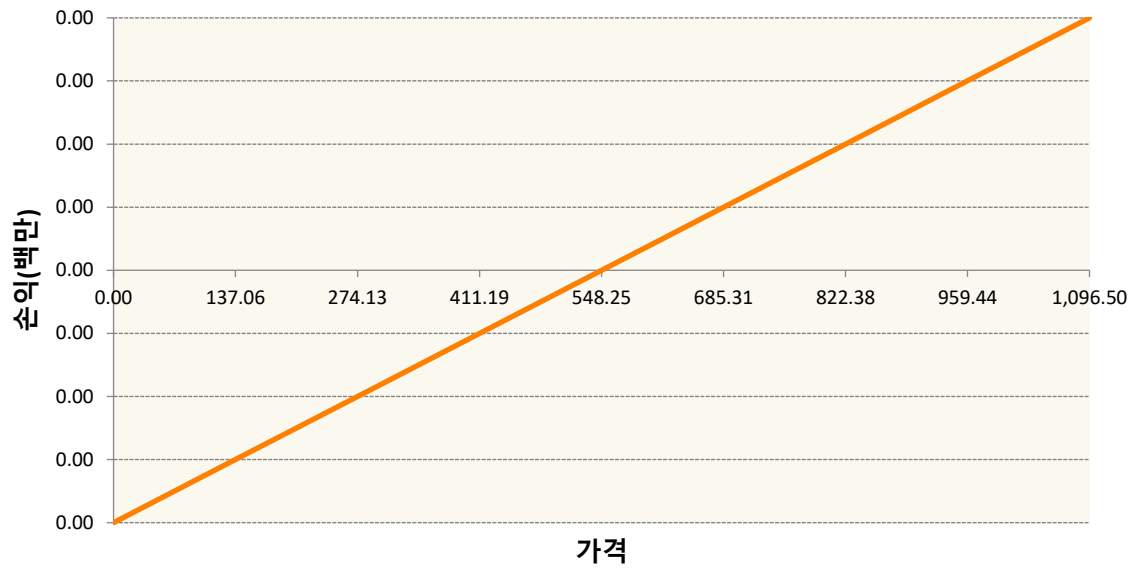
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



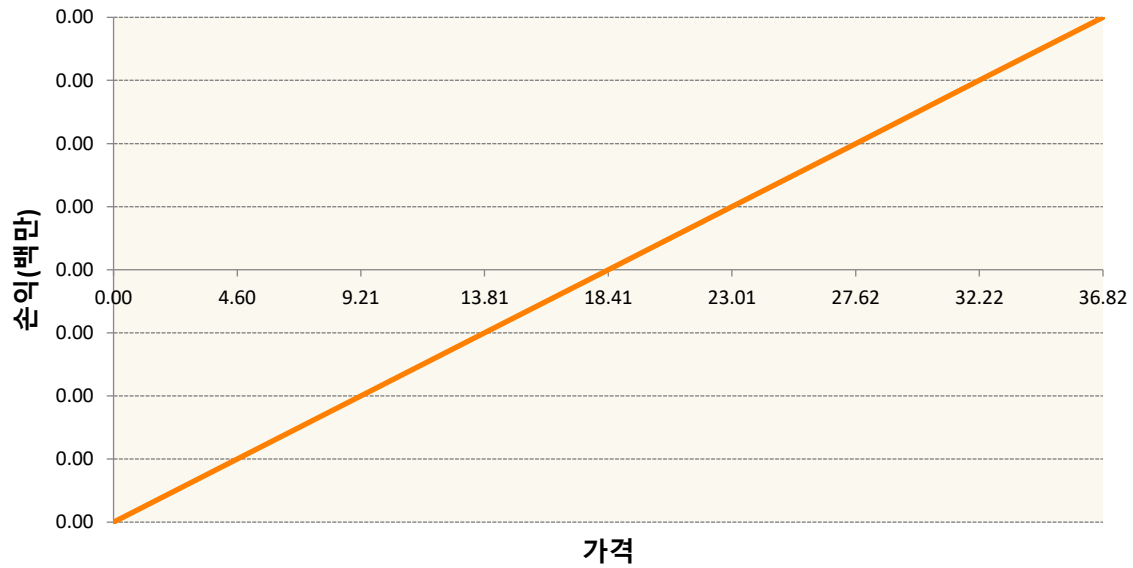
KR4175W20008-2025-02 달러선물



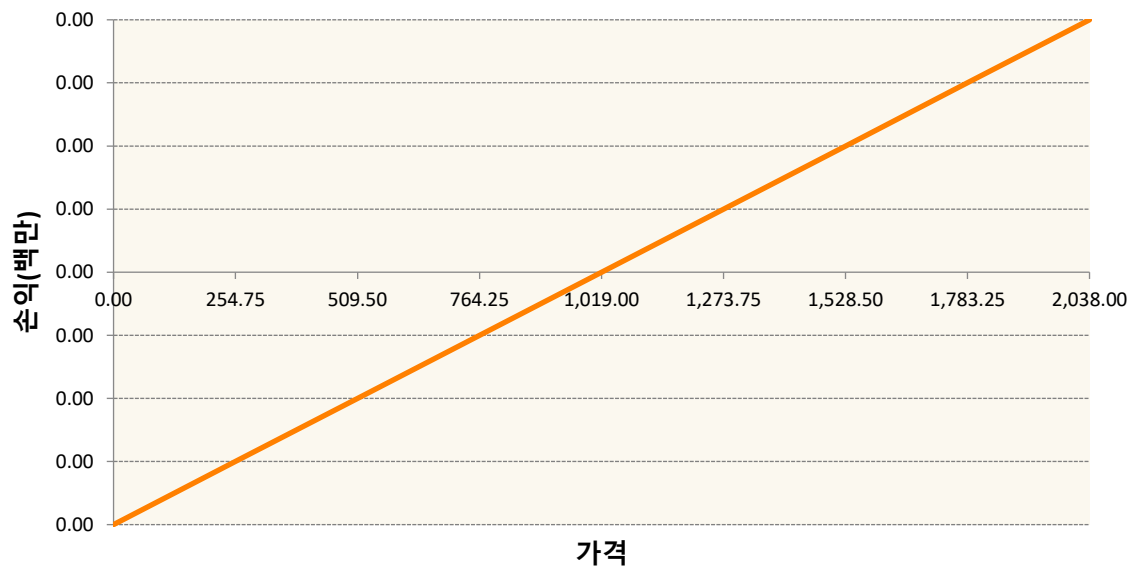
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



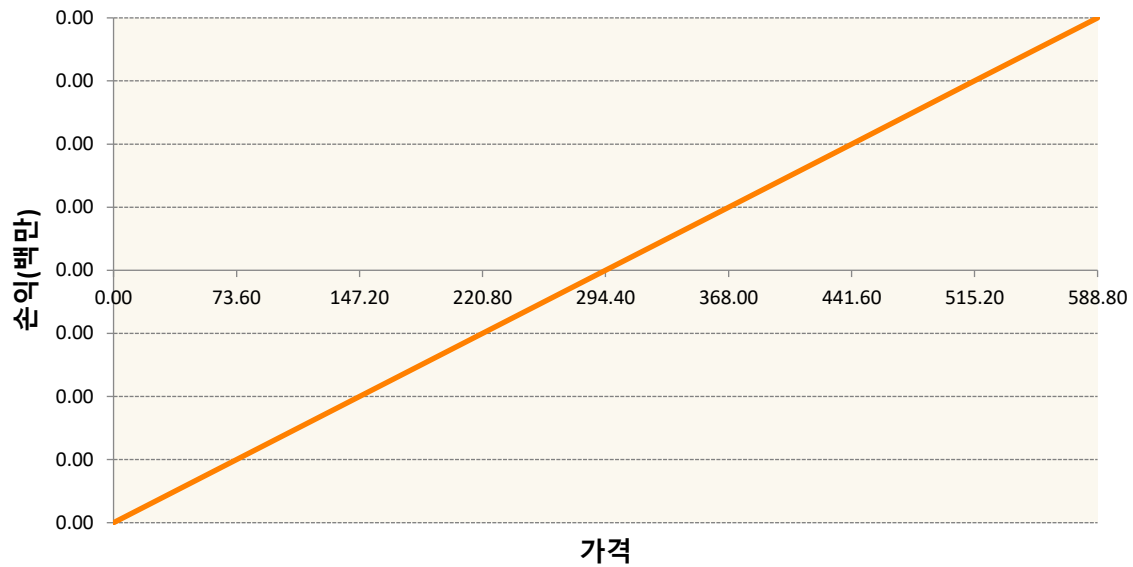
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



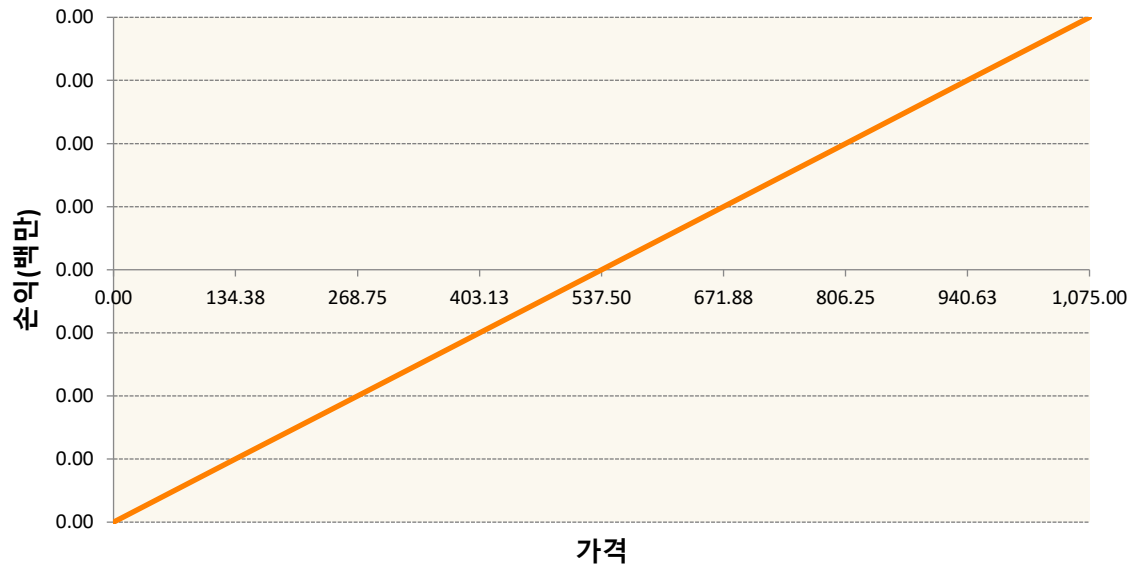
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar25



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	2025-01-20
기준일	2025-01-17

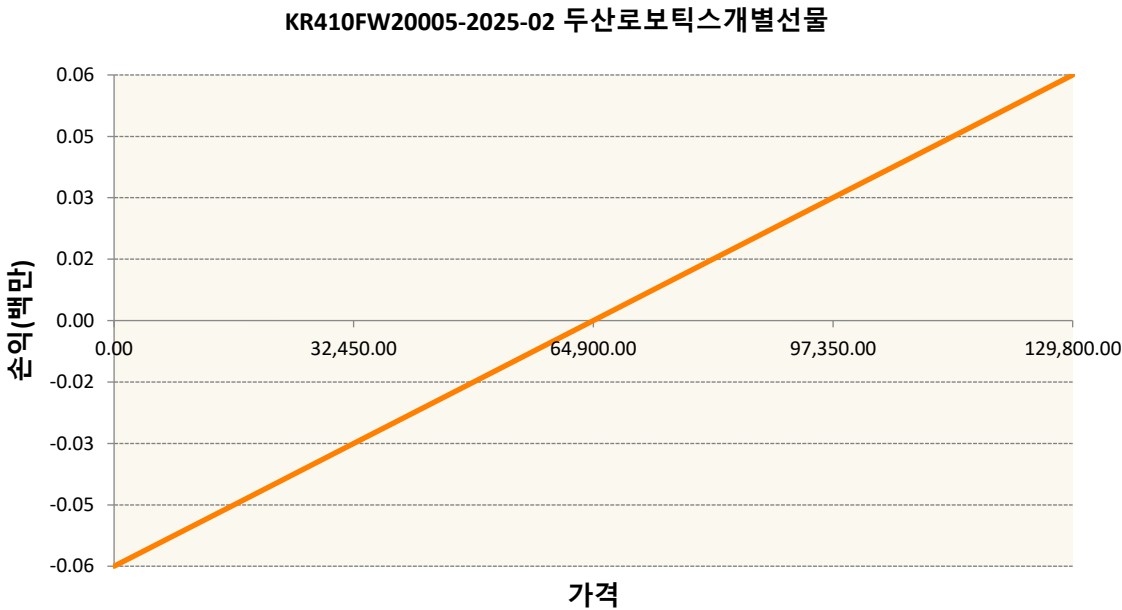
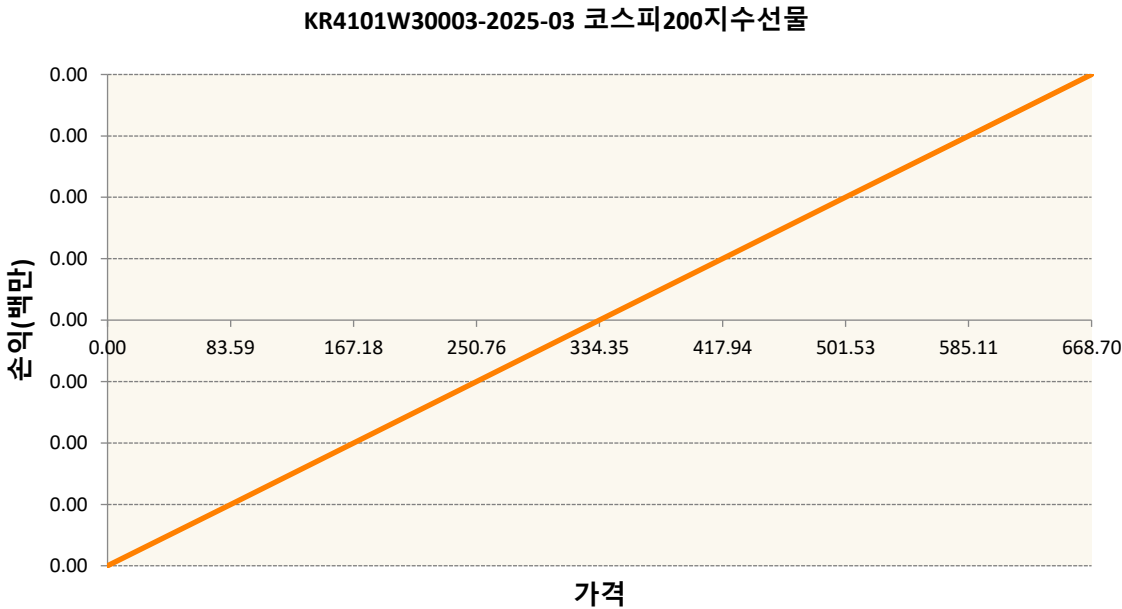
스마트인덱스모

1. 계약금액

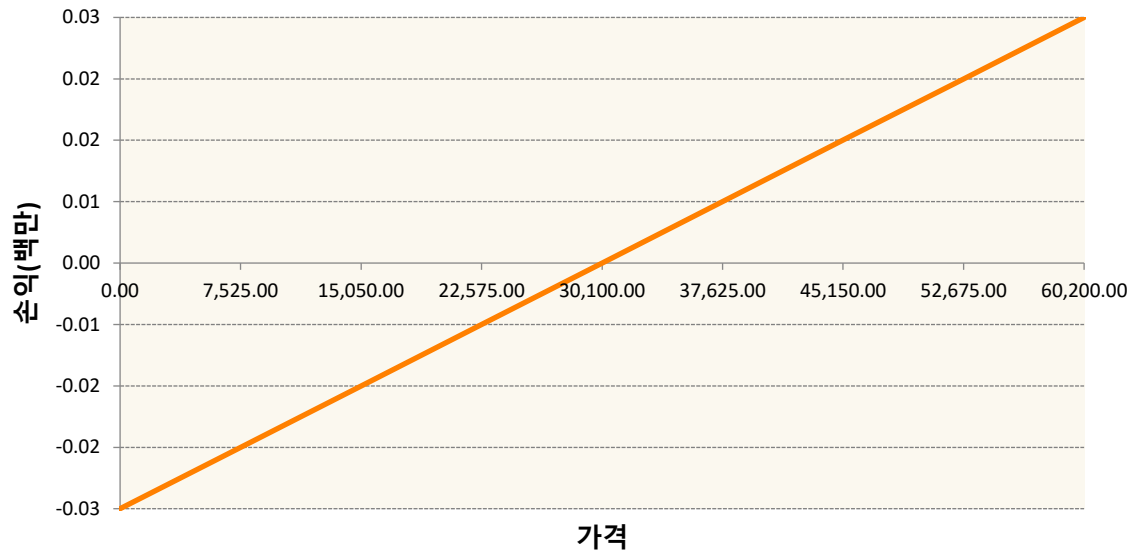
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	164	0	164	장내
누계	유가증권	선물	1,435	0	1,435	장내

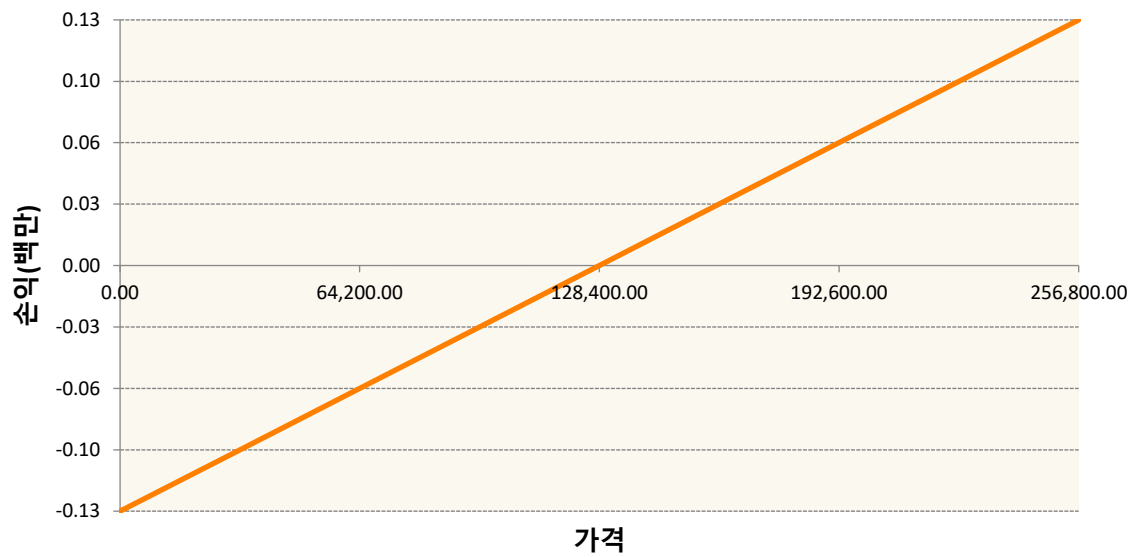
2. 만기시점의 손익구조



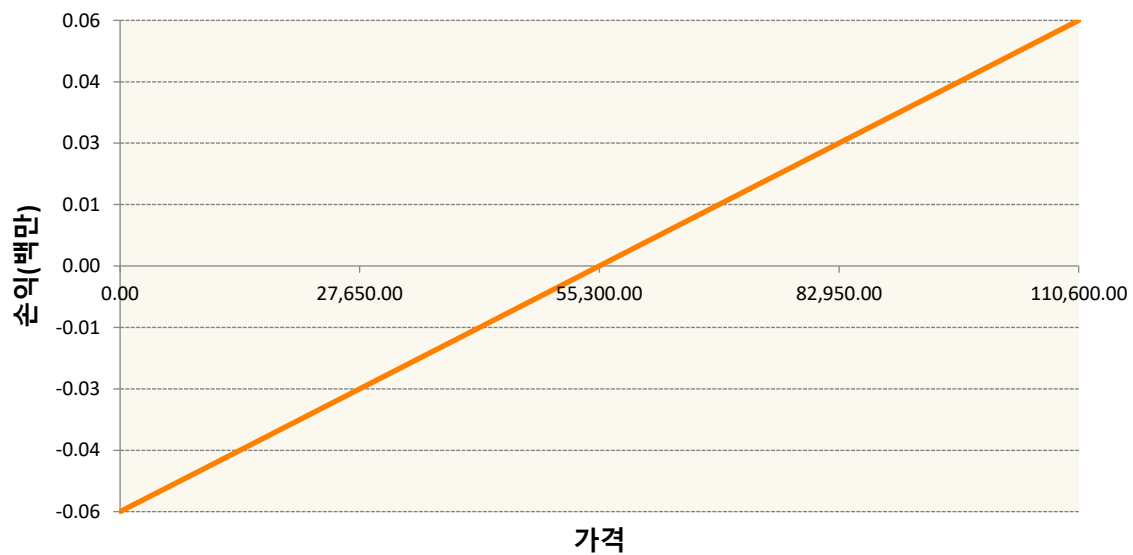
KR410SW20008-2025-02 울촌화학개별선물



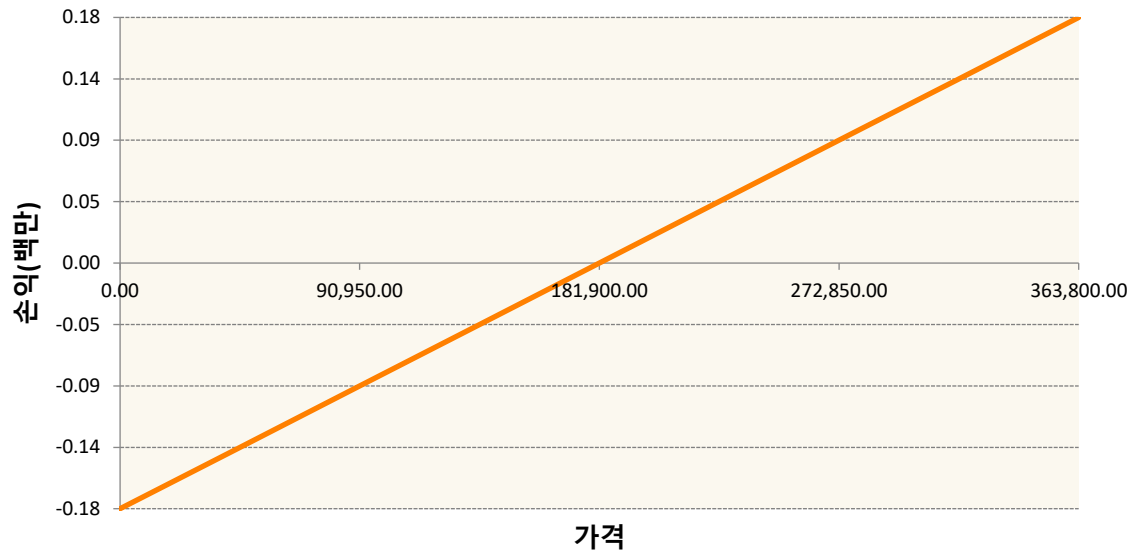
KR4123W20008-2025-02 삼성전기개별선물



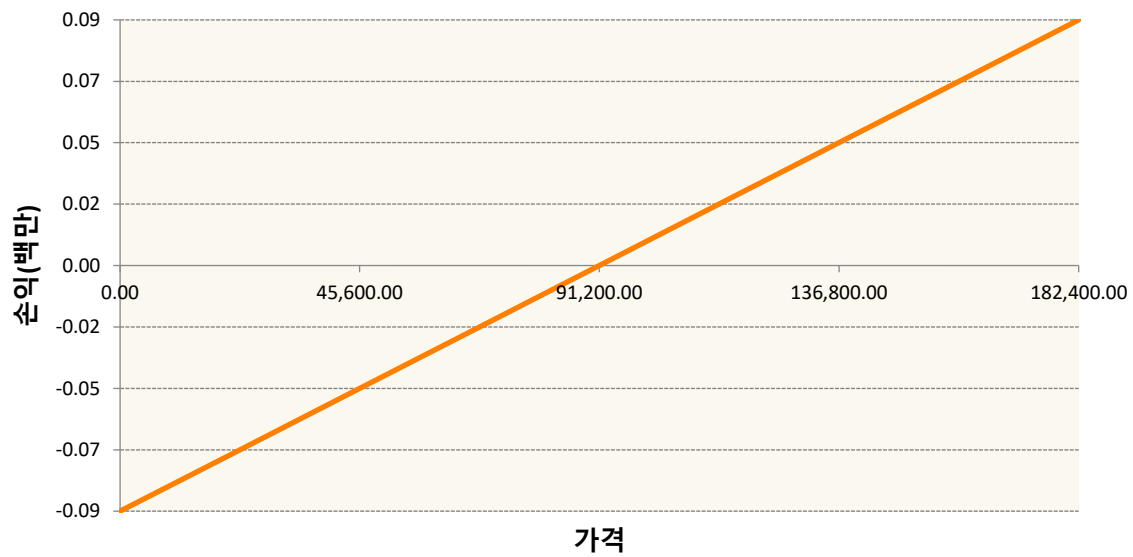
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



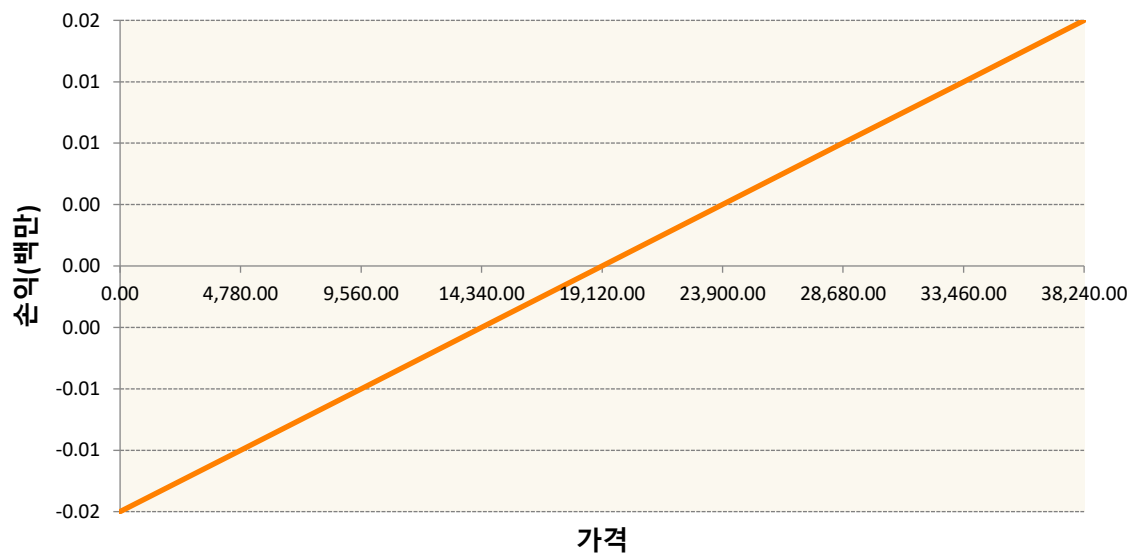
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



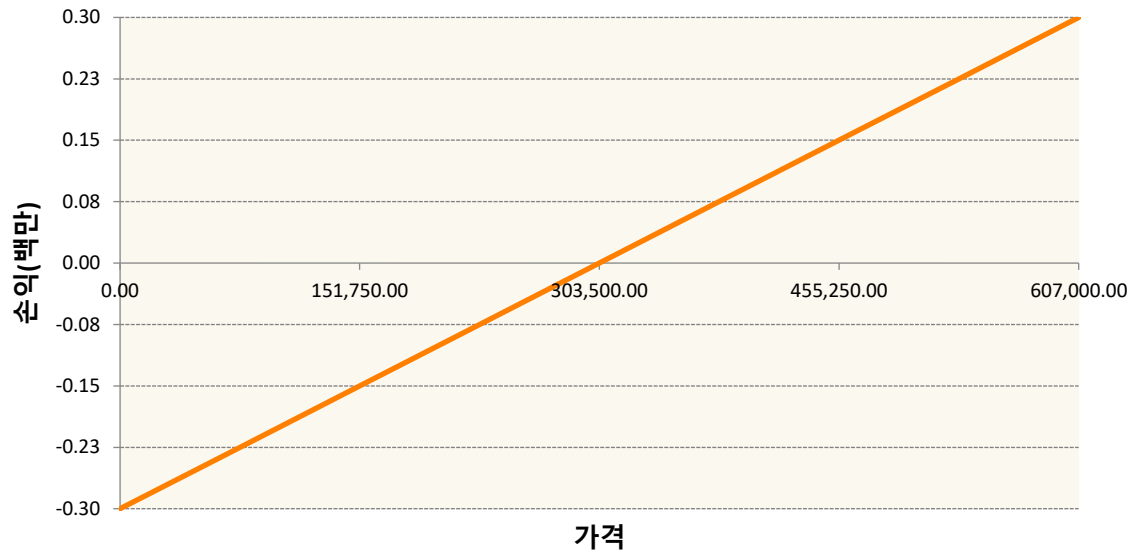
KR41C3W20007-2025-02 금호석유개별선물



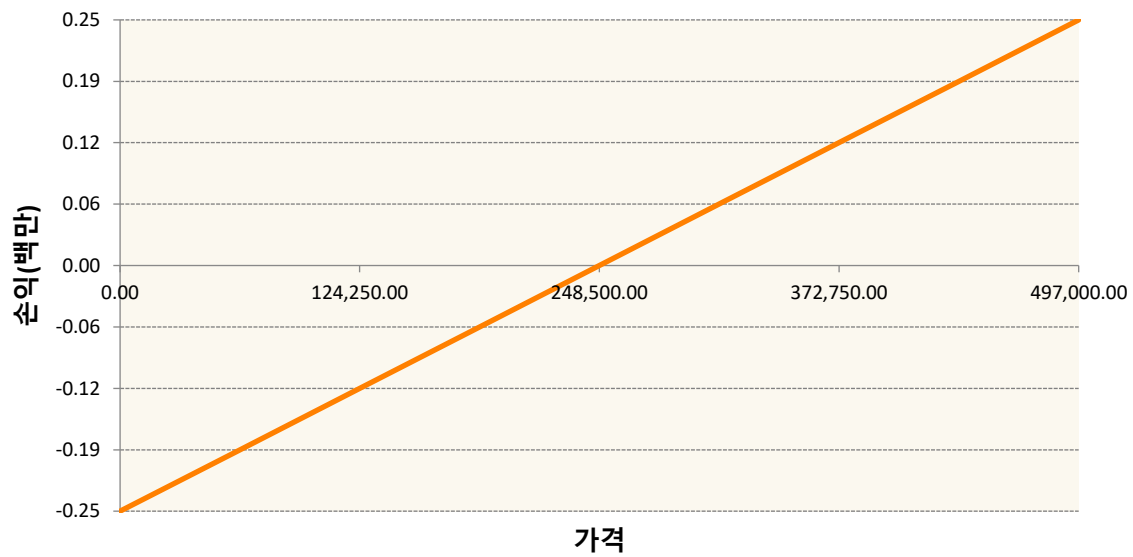
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



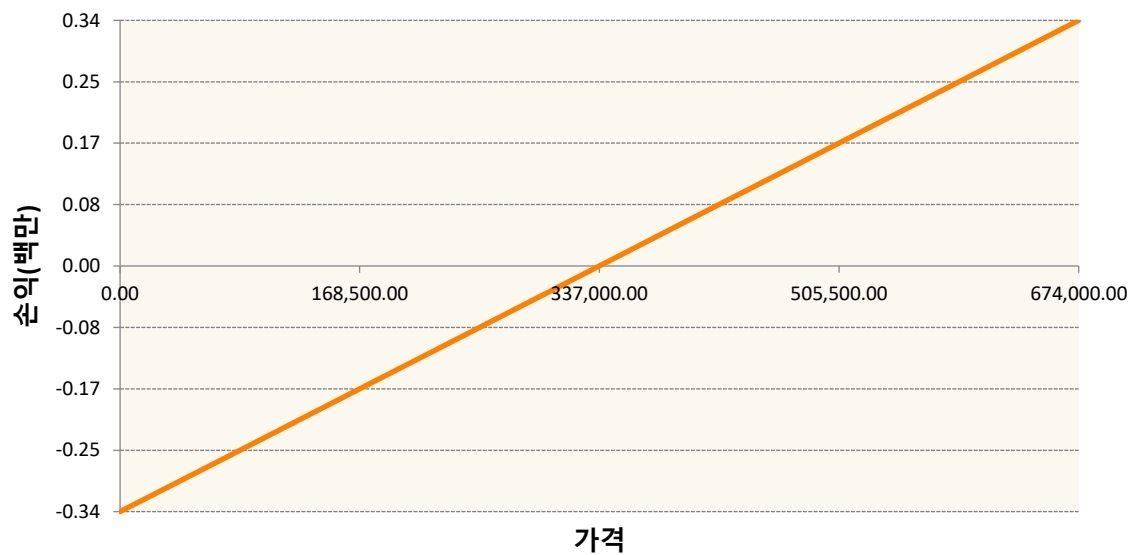
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



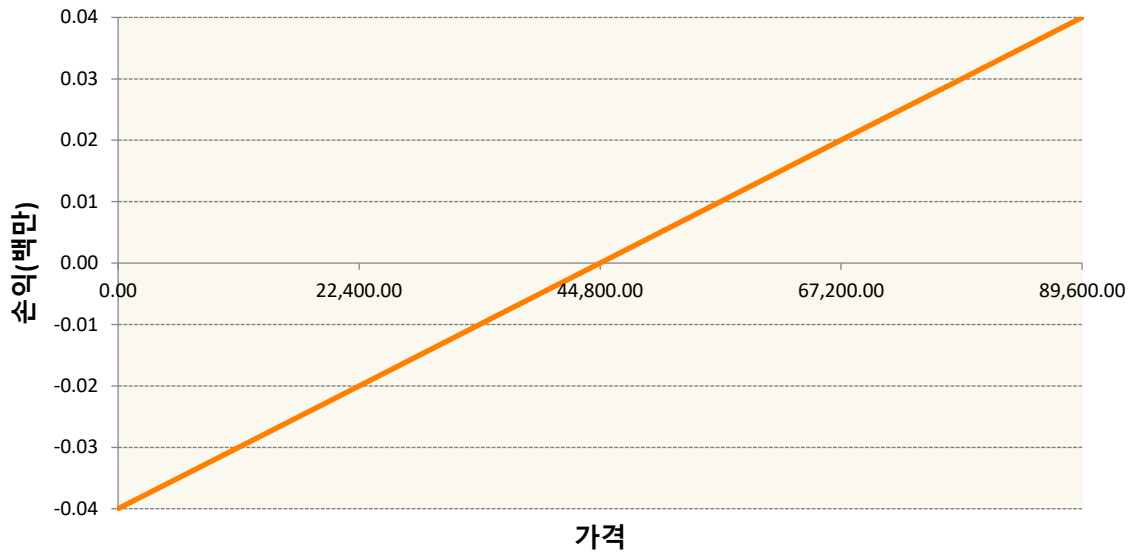
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



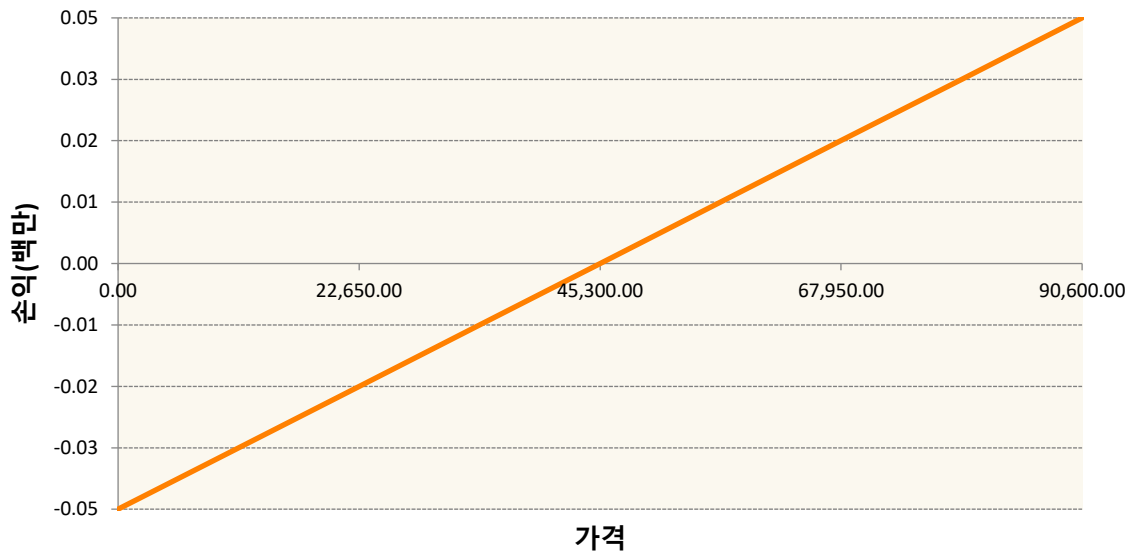
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



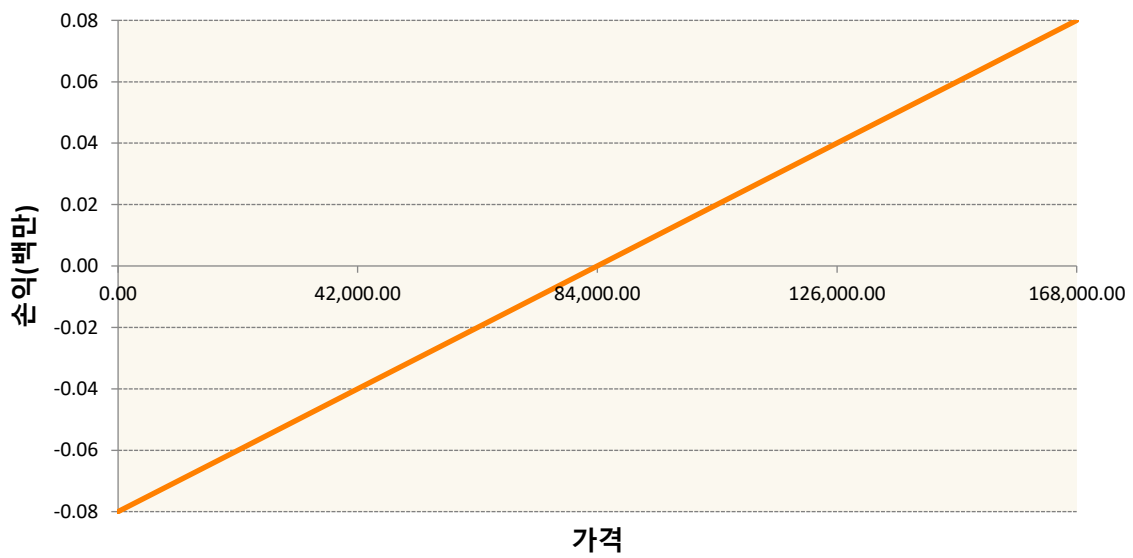
KR41DCW20004-2025-02 HL만도개별선물



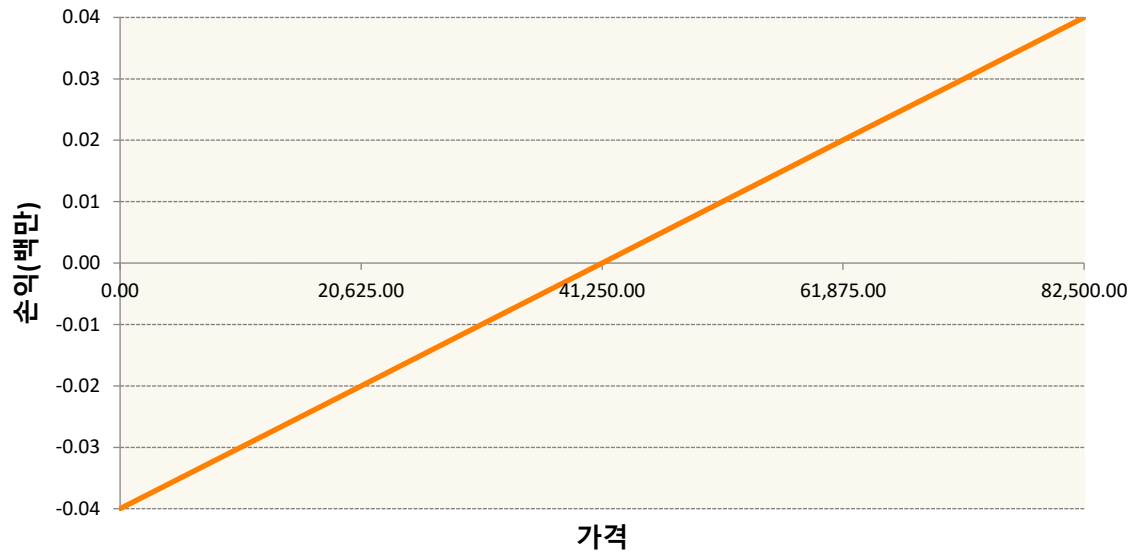
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



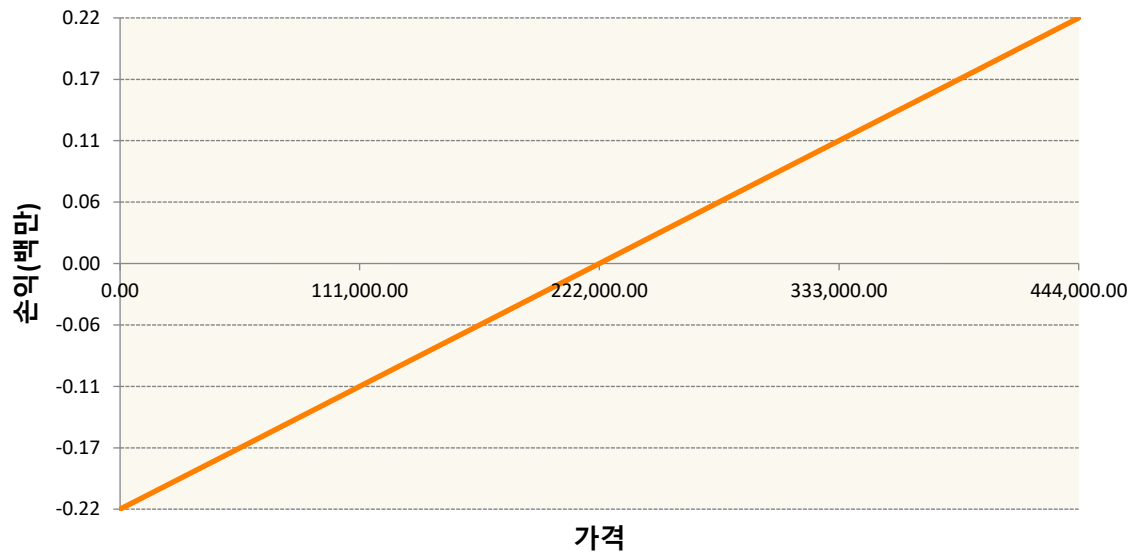
KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



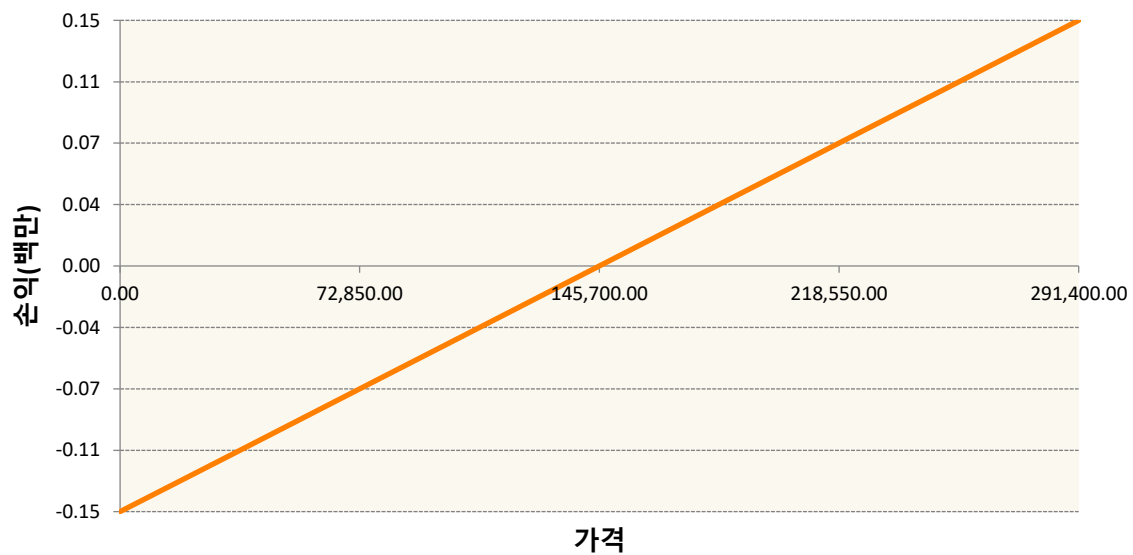
KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



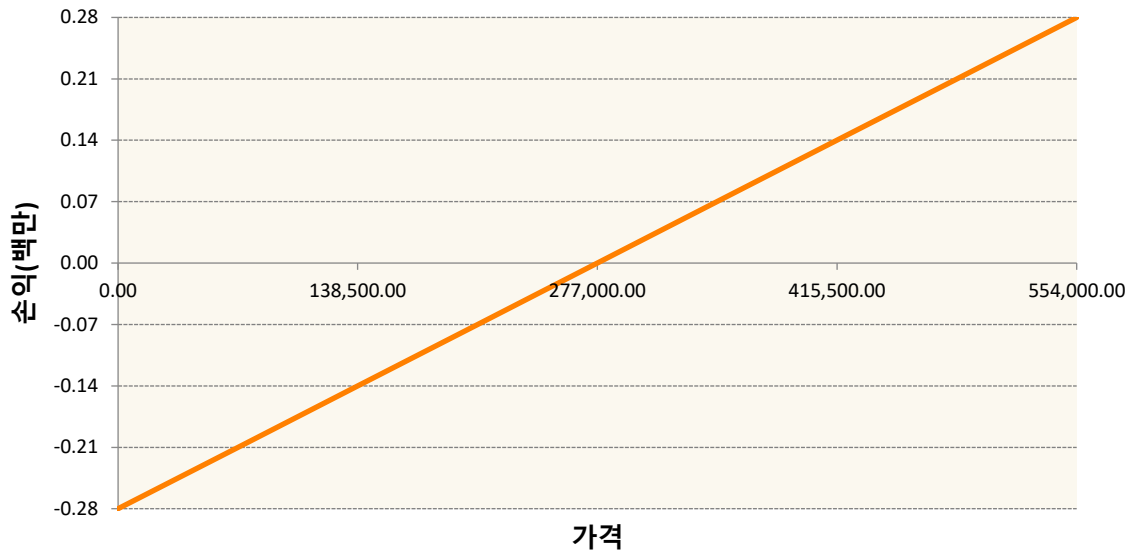
KR41GLW20008-2025-02 LS ELECTRIC개별선물



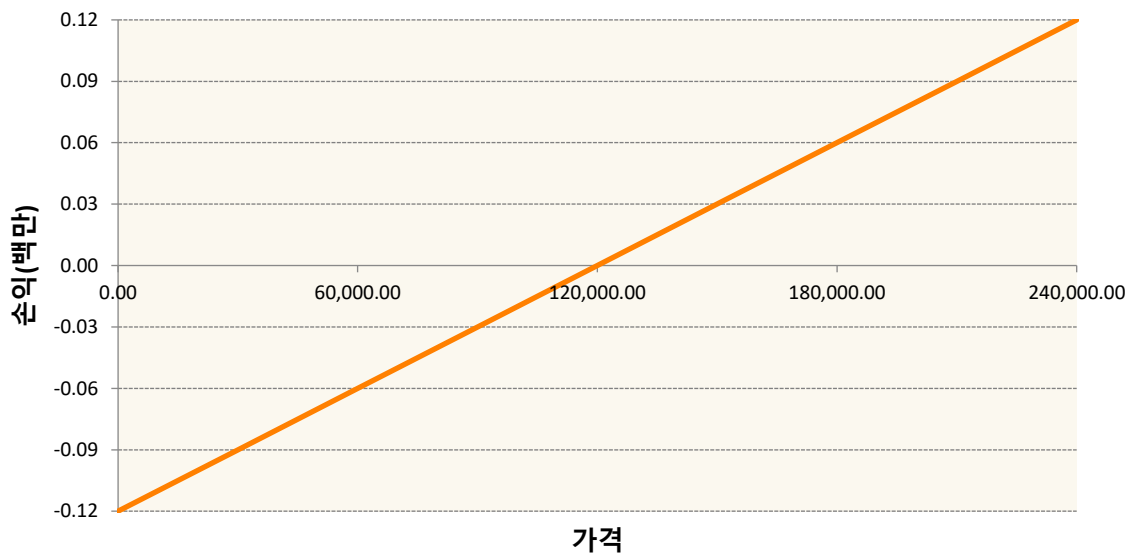
KR41GQW20007-2025-02 녹십자개별선물



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
KR4123W20(2025-02 삼성전기개별선물	9
KR41BBW20(2025-02 롯데케미칼개별선물	1
KR41BJW20(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 씨에스윈드개별선물	1
KR41GLW20(2025-02 LS ELECTRIC개별선물	4
KR41GQW20 2025-02 녹십자개별선물	1
KR41GTW20(2025-02 두산개별선물	2
KR41HEW20(2025-02 키움증권개별선물	2

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

(단위:백만원)

195

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

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

281

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

477

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

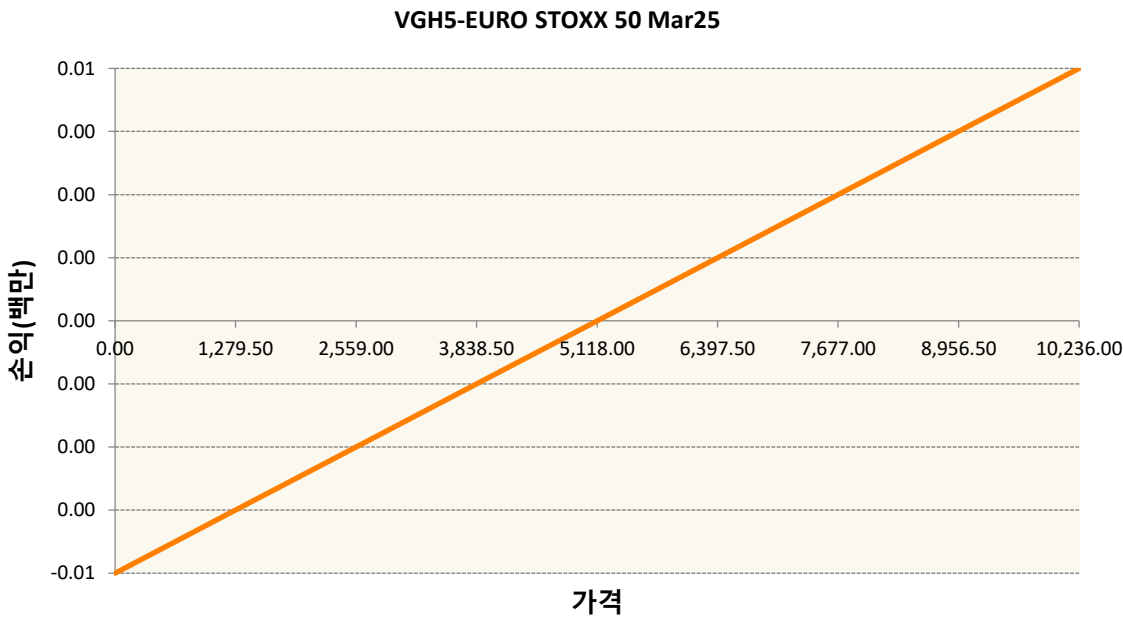
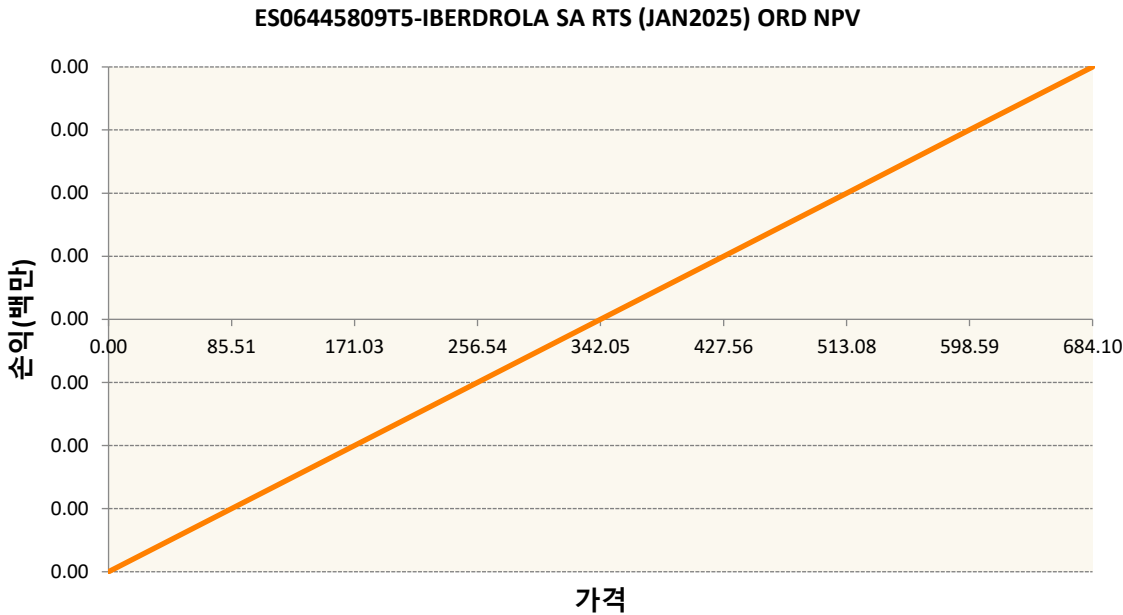
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	927	0	927	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ES06445809`IBERDROLA SA RTS (JAN2025) ORD NPV		0.11
VGH5 EURO STOXX 50 Mar25		74

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	49

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

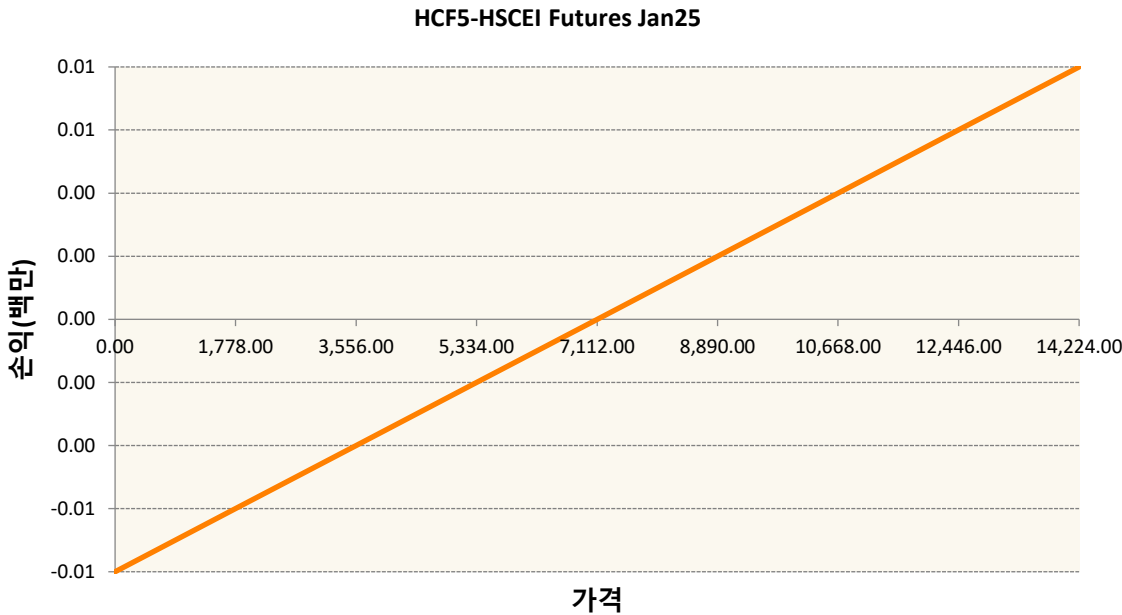
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,467	0	1,467	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	HSCEI Futures Jan25	117
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

157

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

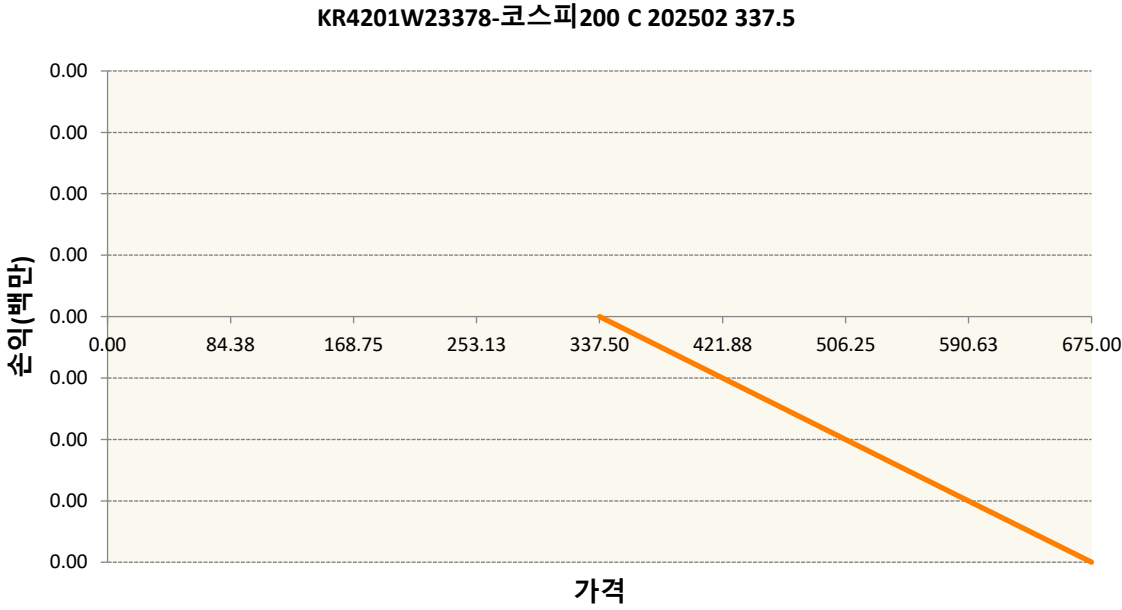
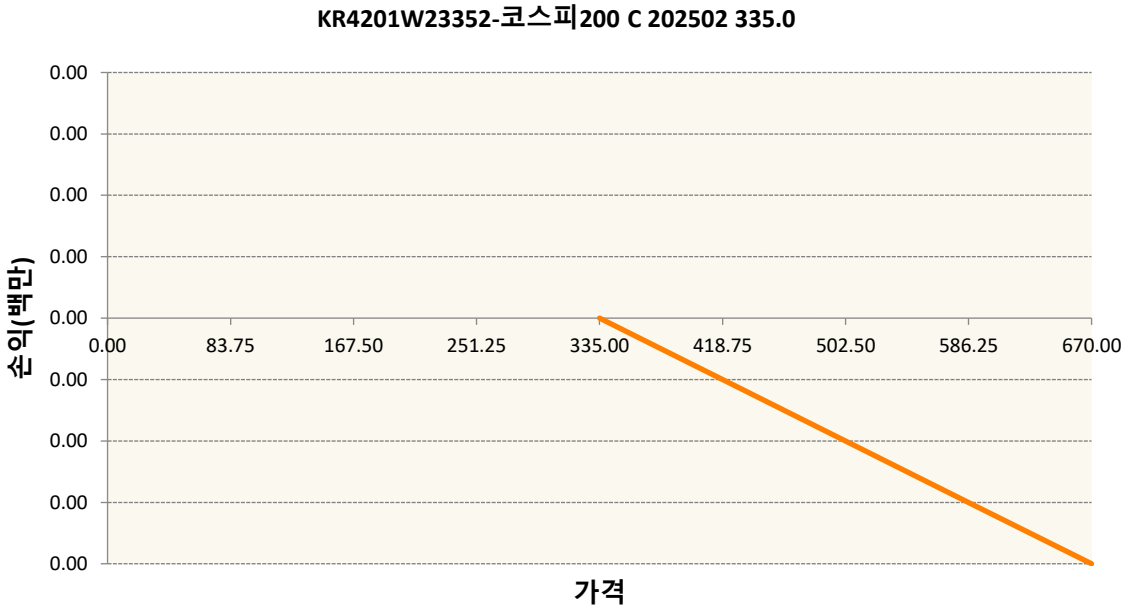
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

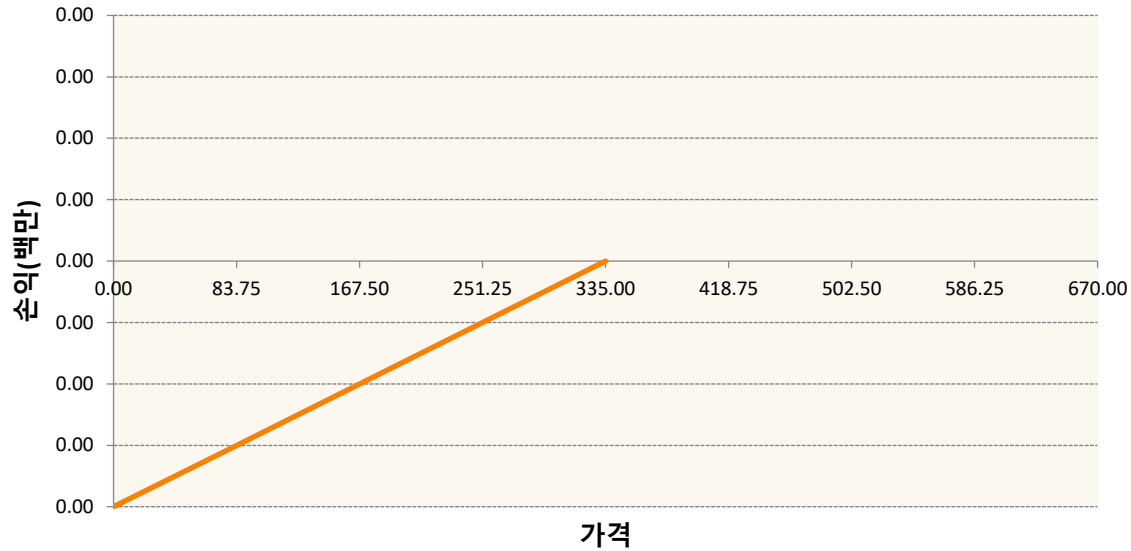
(단위:백만원)

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)

KR4201W23352 코스피200 C 202502 335.0							1,559
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	632	618	600	580	556	529	500
-5.33%	575	545	512	477	439	400	359
-2.67%	433	386	339	291	242	192	142
0%	161	107	54	0	-54	-107	-161
2.67%	-255	-302	-350	-400	-450	-500	-552
5.33%	-790	-822	-858	-896	-936	-979	-1,022
8.00%	-1,401	-1,419	-1,440	-1,465	-1,494	-1,525	-1,559
KR4201W23378 코스피200 C 202502 337.5							369
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	136	133	130	125	120	114	108
-5.33%	125	119	112	104	96	87	77
-2.67%	97	87	76	64	53	41	29
0%	40	26	13	0	-13	-26	-40
2.67%	-53	-66	-78	-91	-104	-117	-130
5.33%	-178	-187	-197	-207	-218	-229	-241
8.00%	-324	-330	-336	-343	-351	-360	-369
KR4301W23350 코스피200 P 202502 335.0							440
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-425	-426	-428	-430	-433	-436	-440
-5.33%	-244	-248	-253	-259	-265	-271	-279
-2.67%	-84	-93	-102	-111	-121	-131	-141
0%	34	23	11	0	-11	-23	-34

2.67%	99	90	81	71	61	51	41
5.33%	125	120	115	109	102	95	87
8.00%	132	130	128	125	121	117	112

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,334

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

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	662	0	662	

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	2025-01-20
기준일	2025-01-17

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	4,371	0	4,371	

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	2025-01-20
기준일	2025-01-17

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	12,917	0	12,917	
누계	통화	선도	0	13,271	-13,271	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E		216
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E		566
FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E		260
FXW213F17C KRW/USD 31-01-25E		20
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

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

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

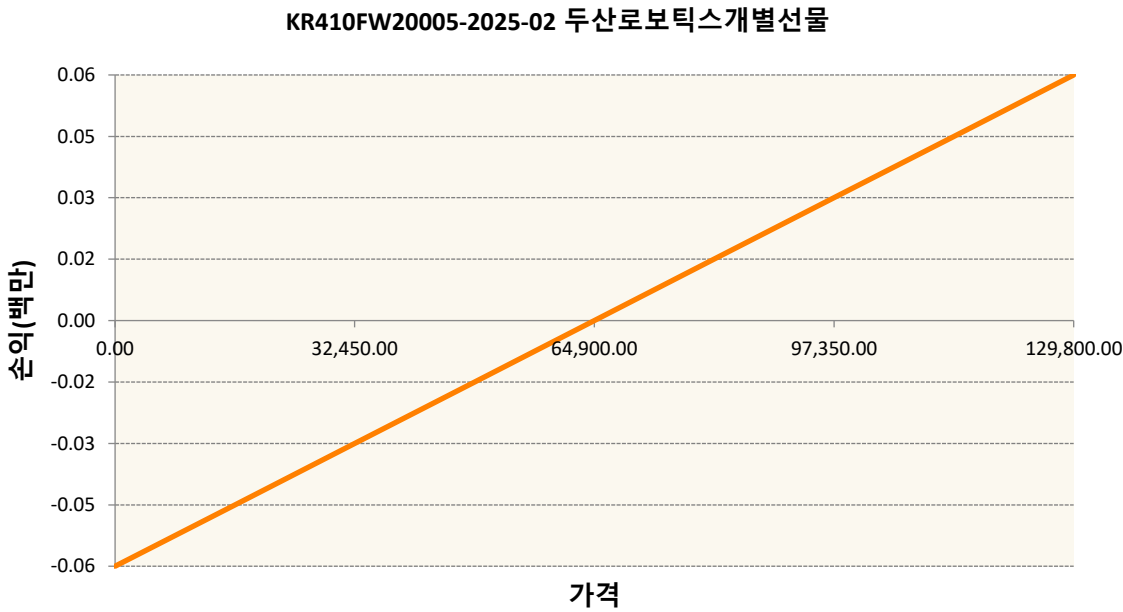
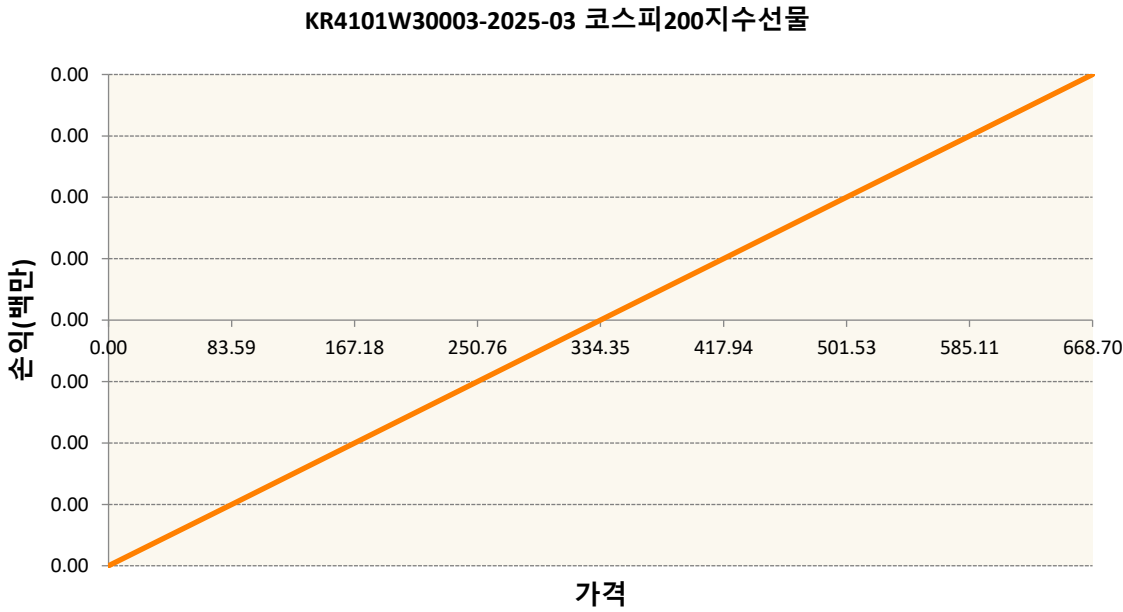
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

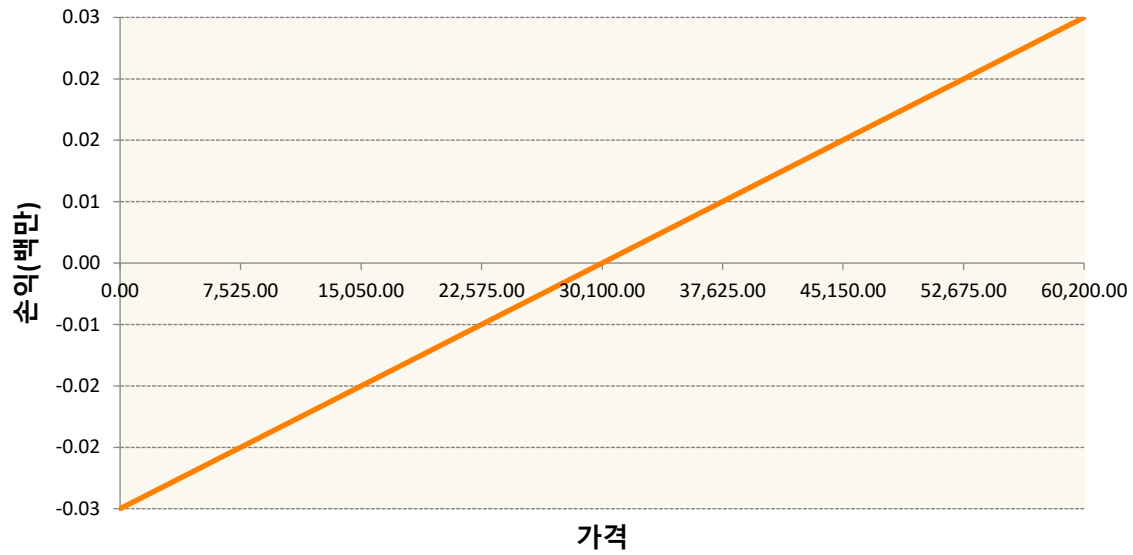
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	75	0	75	장내
누계	유가증권	선물	896	0	896	장내

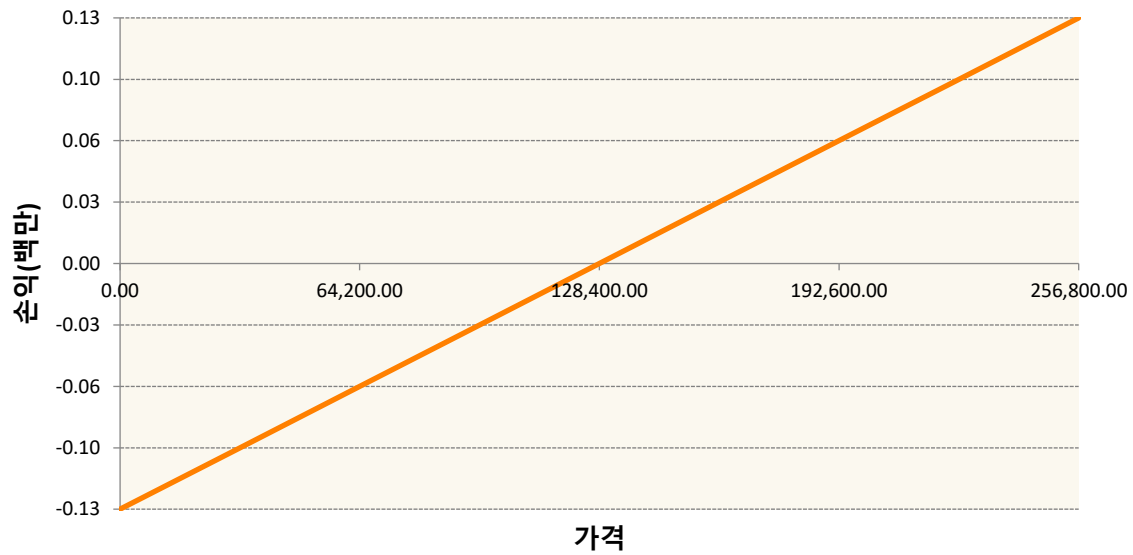
2. 만기시점의 손익구조



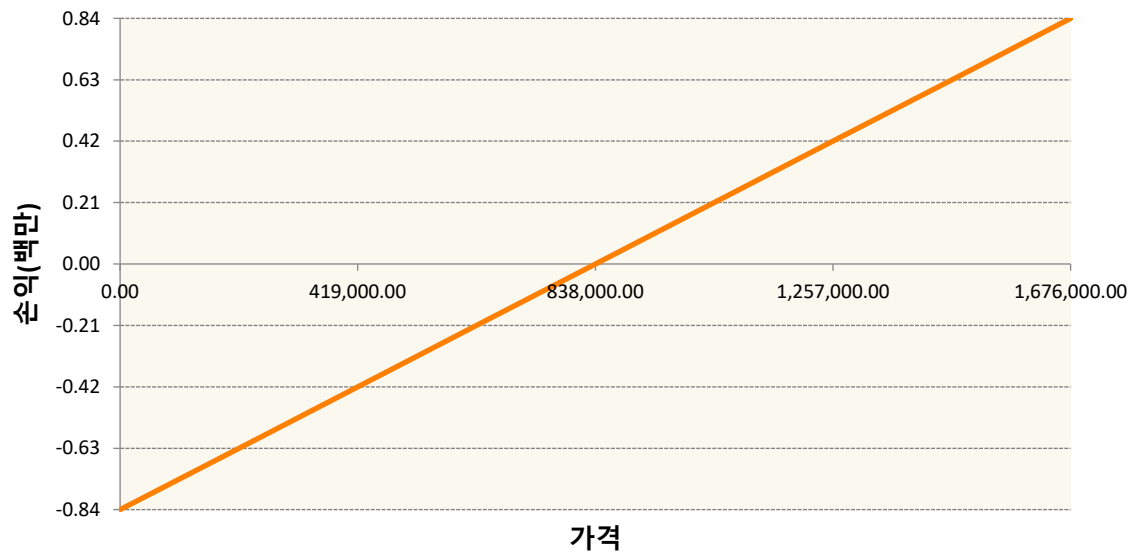
KR410SW20008-2025-02 울촌화학개별선물



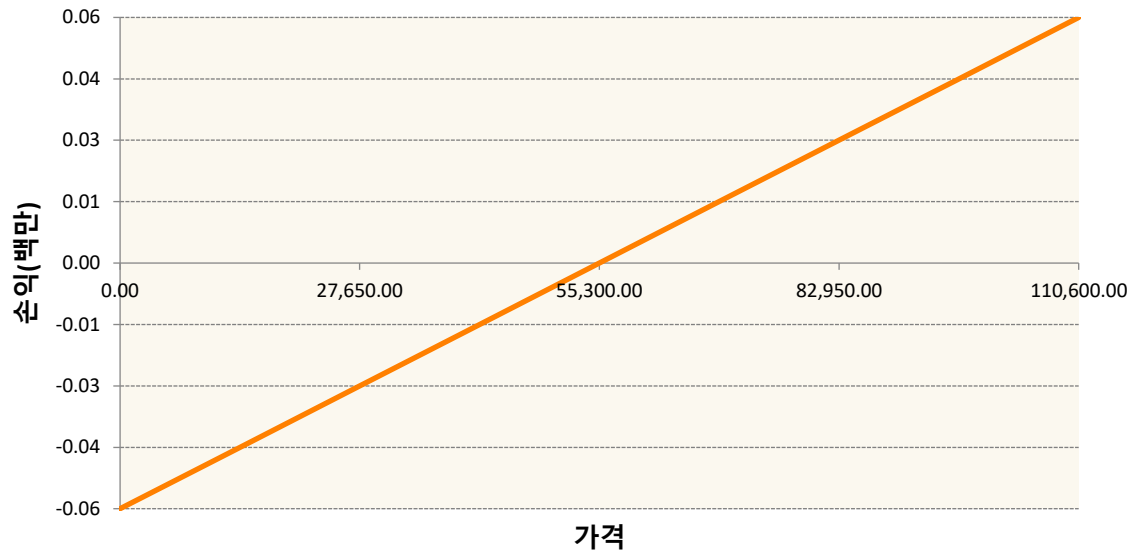
KR4123W20008-2025-02 삼성전기개별선물



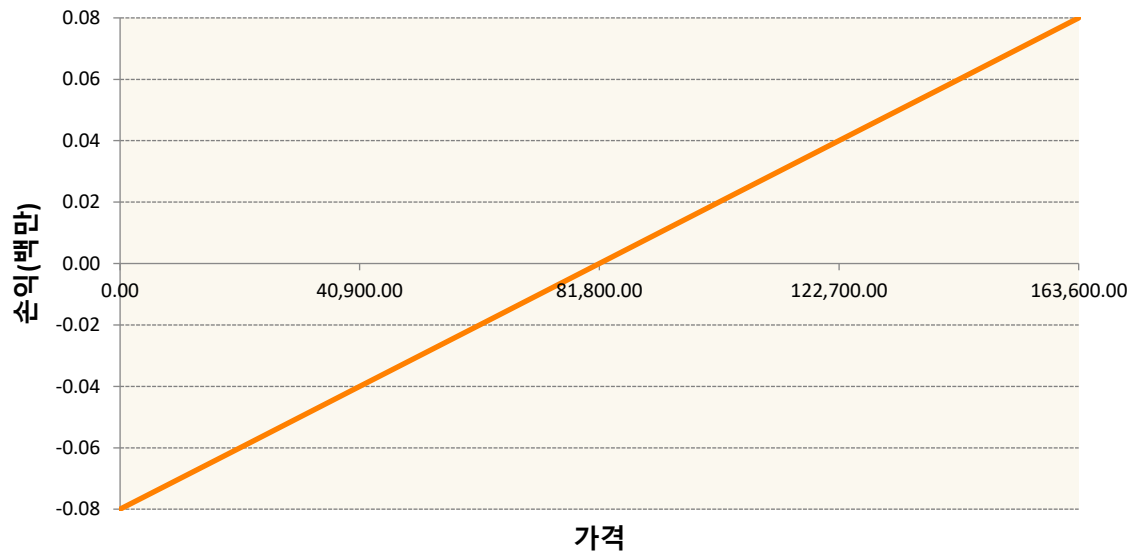
KR41B3W20008-2025-02 고려아연개별선물



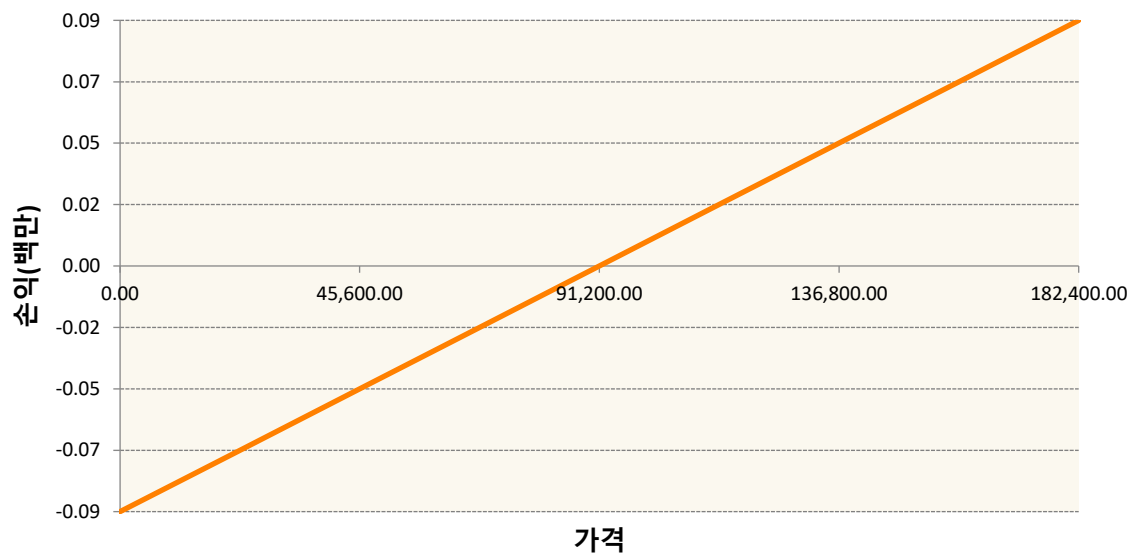
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



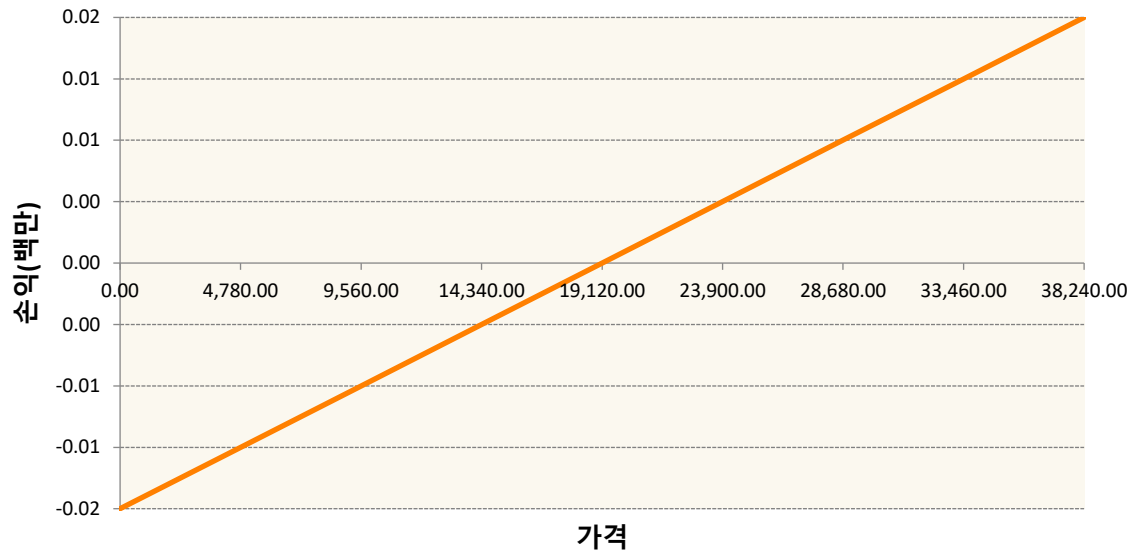
KR41C0W20003-2025-02 OCI홀딩스개별선물



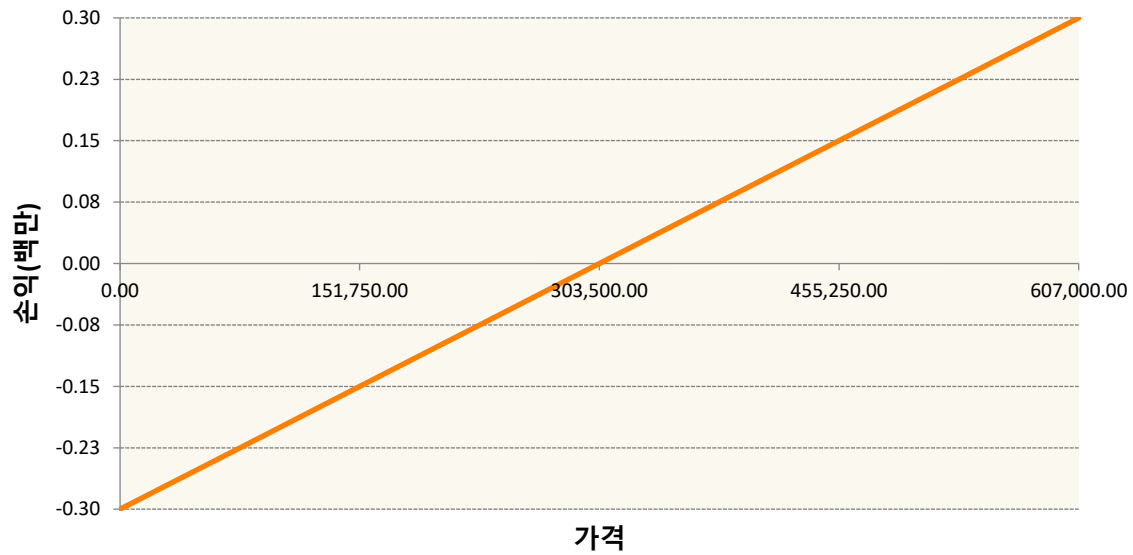
KR41C3W20007-2025-02 금호석유개별선물



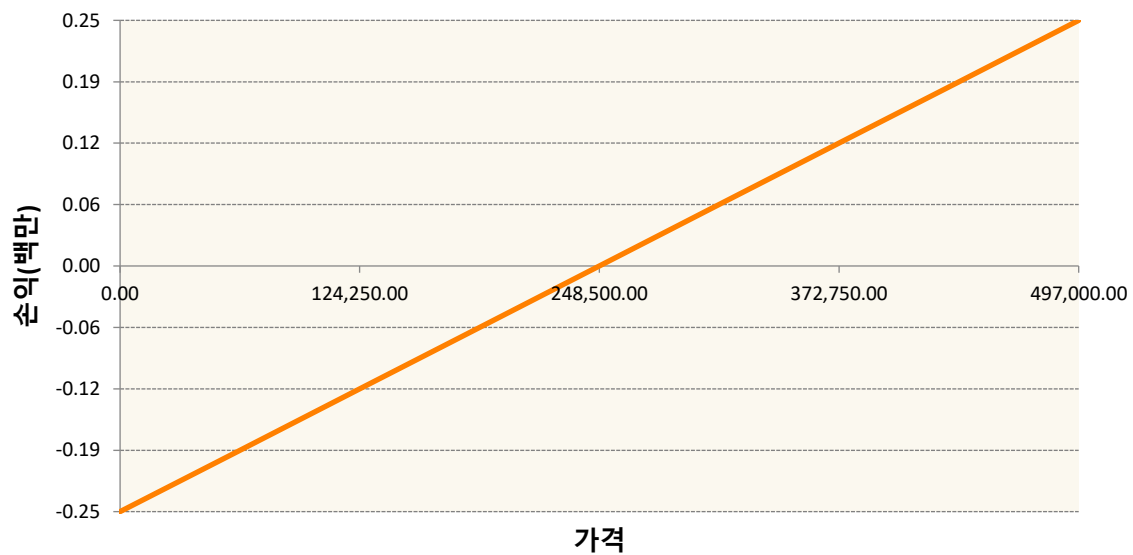
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



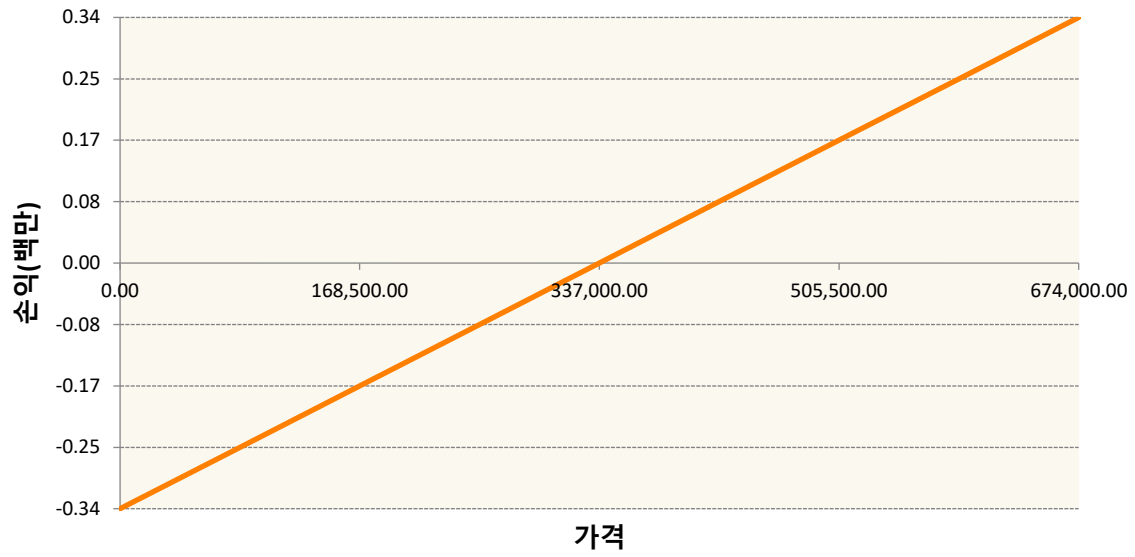
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



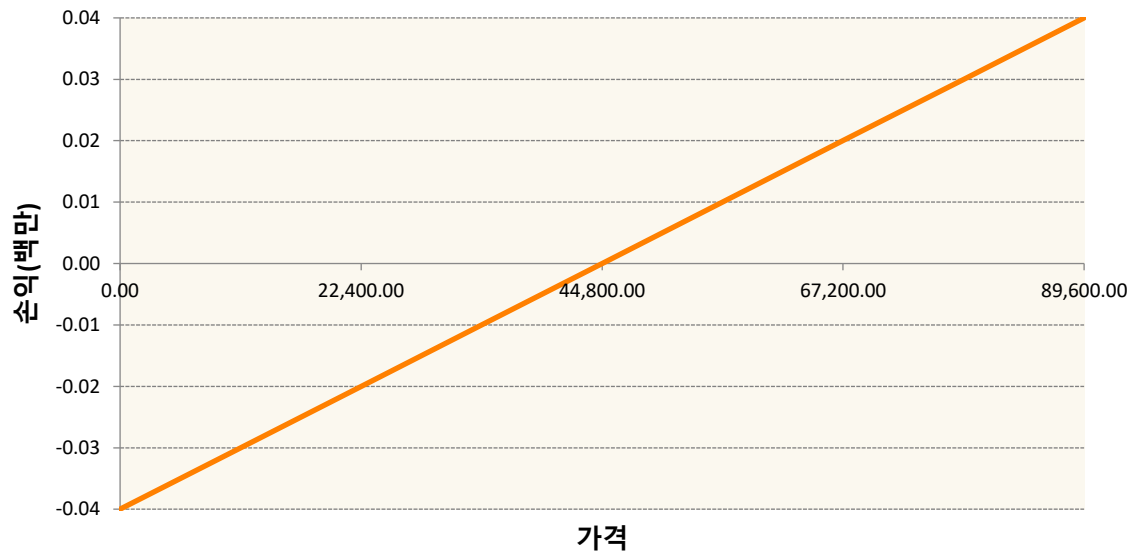
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



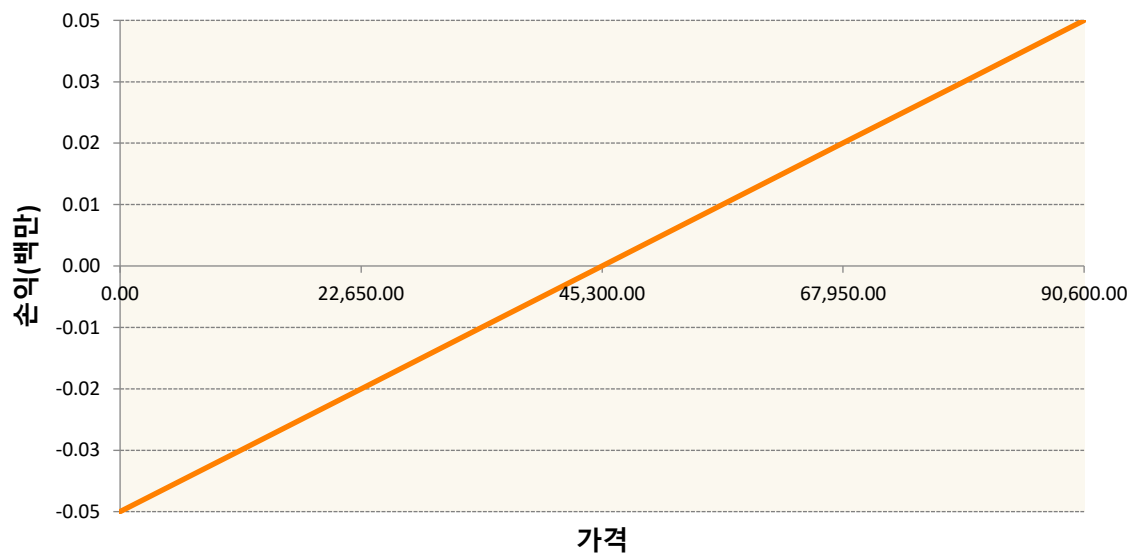
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



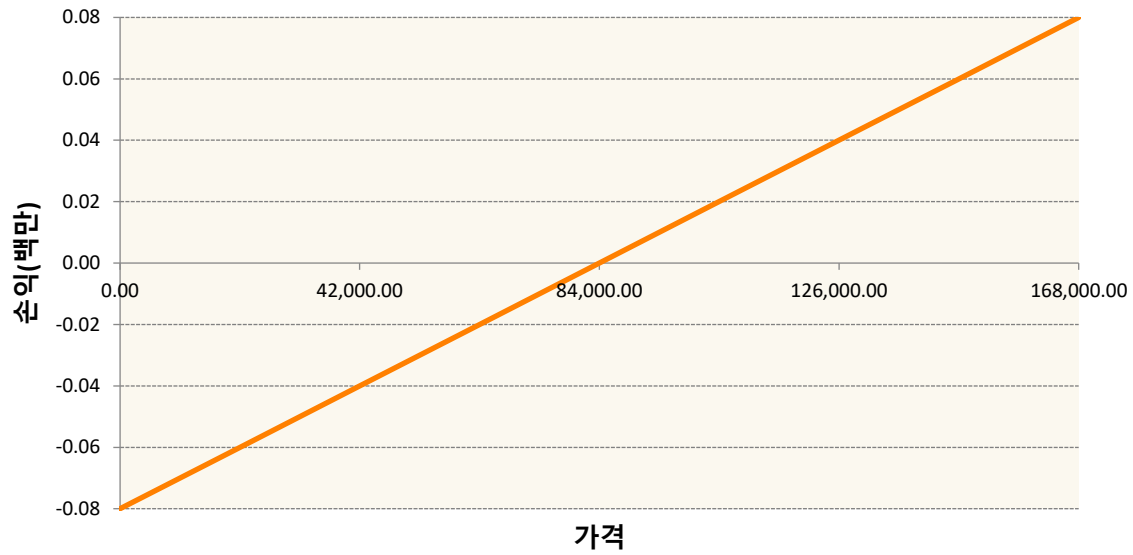
KR41DCW20004-2025-02 HL만도개별선물



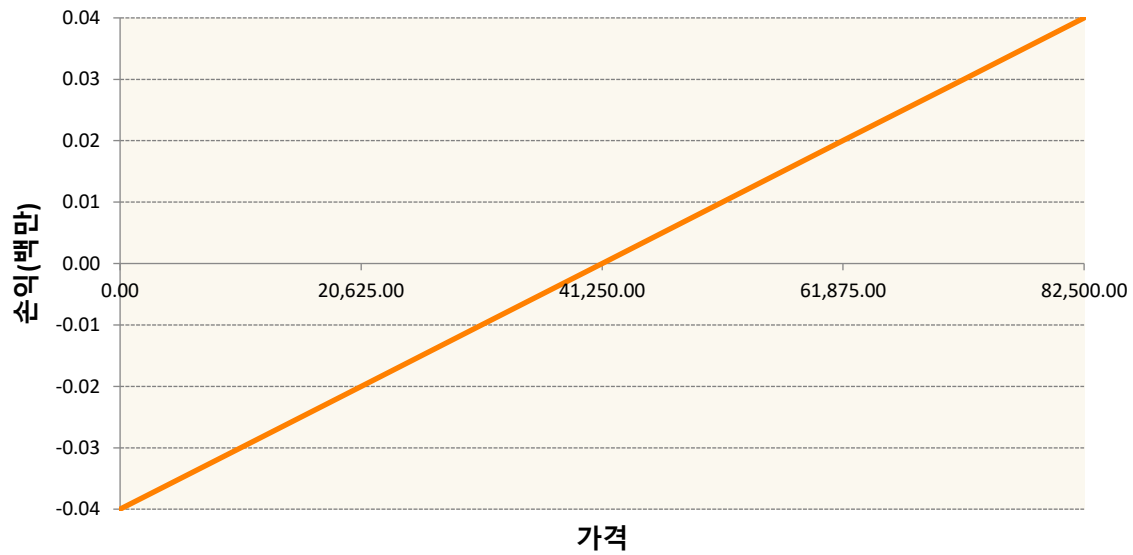
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



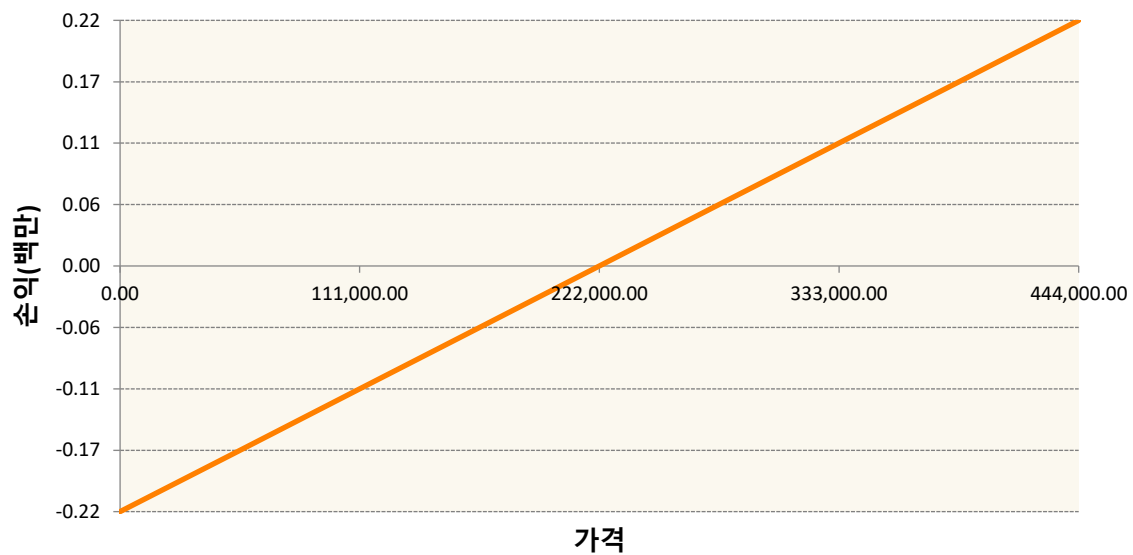
KR41FMW20008-2025-02 엘앤티에프개별선물



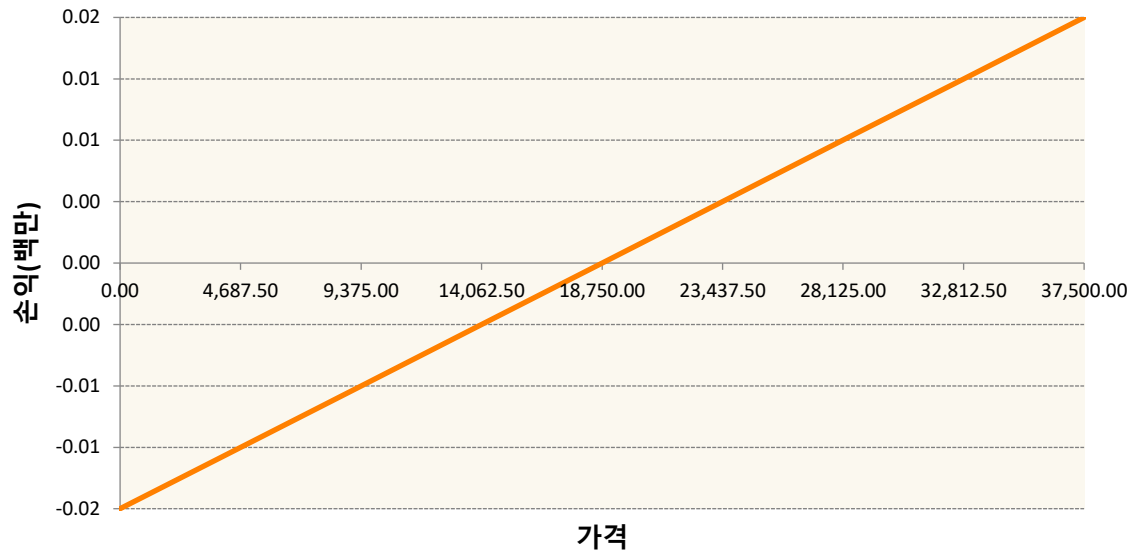
KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



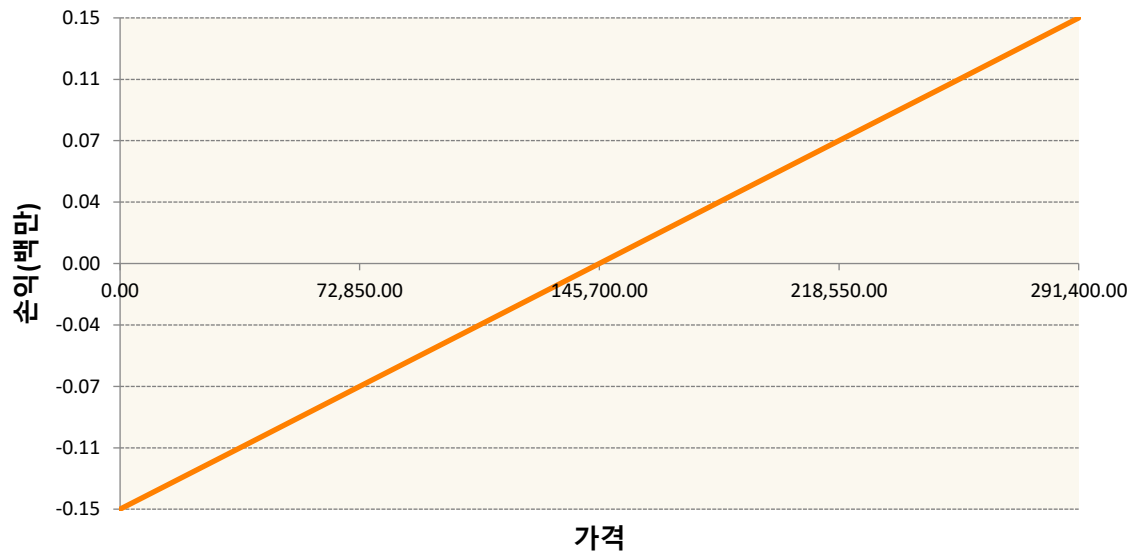
KR41GLW20008-2025-02 LS ELECTRIC개별선물



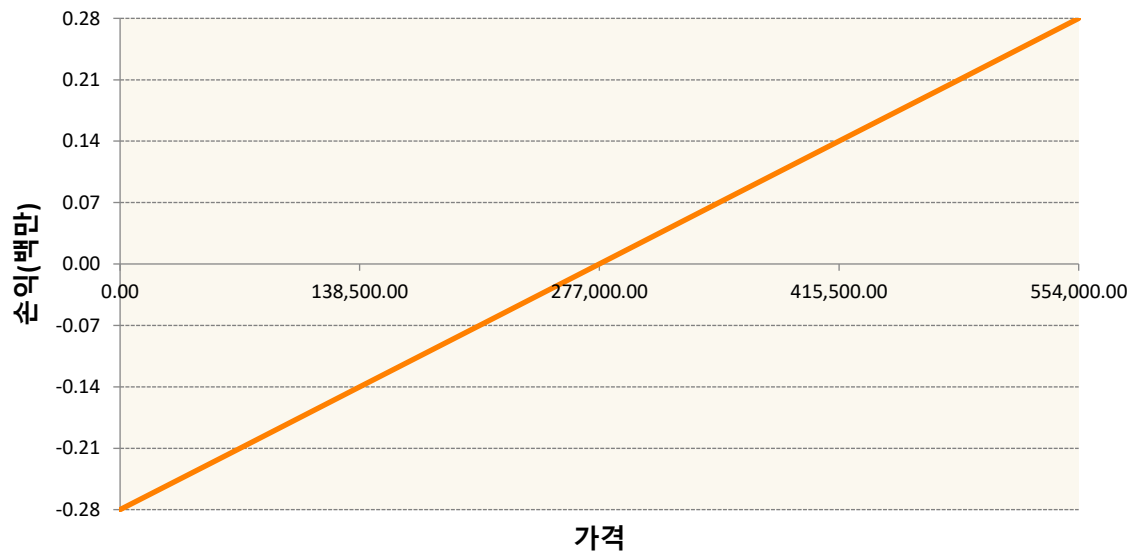
KR41GNW20004-2025-02 금양개별선물



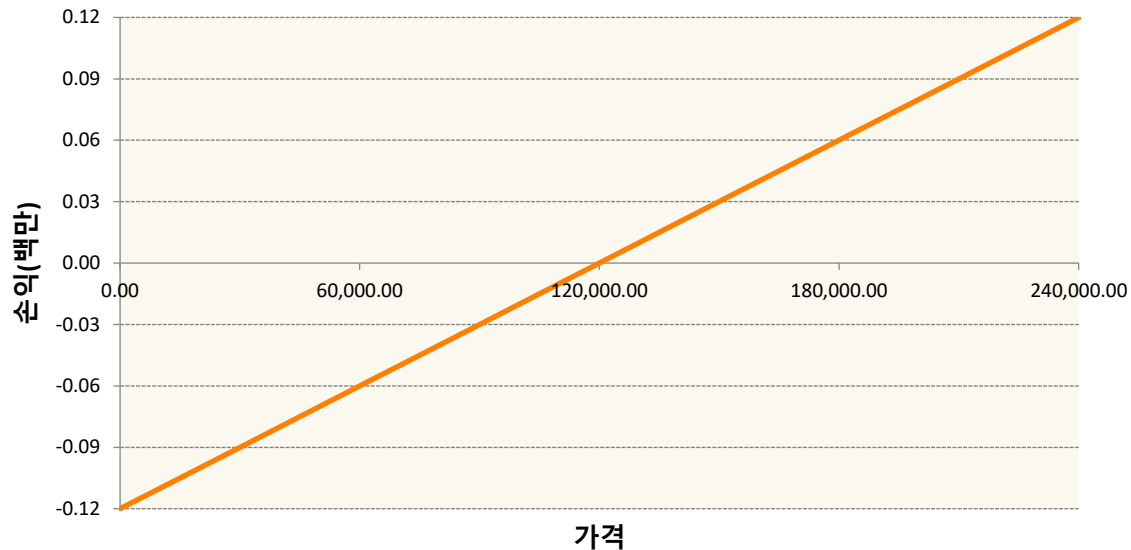
KR41GQW20007-2025-02 녹십자개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



KR41HEW20001-2025-02 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	53
KR410FW20(2025-02 두산로보틱스개별선물	1
KR410SW20(2025-02 울촌화학개별선물	0.14
KR4123W20(2025-02 삼성전기개별선물	4
KR41B3W20(2025-02 고려아연개별선물	3
KR41BBW20(2025-02 롯데케미칼개별선물	1
KR41C0W20(2025-02 OCI홀딩스개별선물	1
KR41C3W20(2025-02 금호석유개별선물	1
KR41CNW20 2025-02 포스코DX개별선물	0.47
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 씨에스윈드개별선물	0.5
KR41GLW20(2025-02 LS ELECTRIC개별선물	2
KR41GNW20 2025-02 금양개별선물	0.17
KR41GQW20 2025-02 녹십자개별선물	0.35
KR41GTW20(2025-02 두산개별선물	1
KR41HEW20(2025-02 키움증권개별선물	1

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

(단위:백만원)

115

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

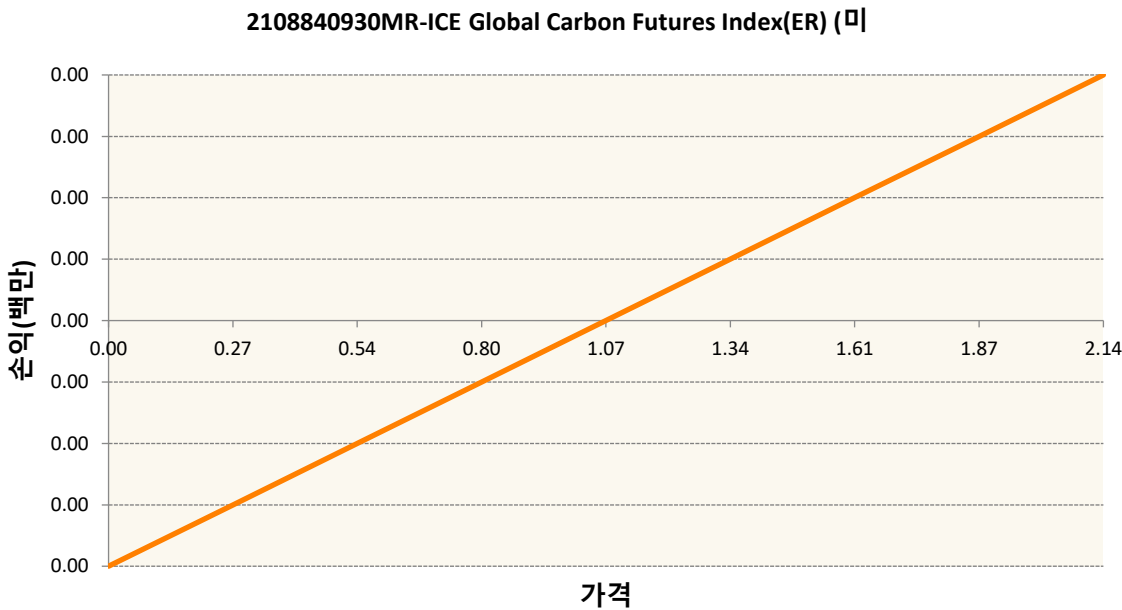
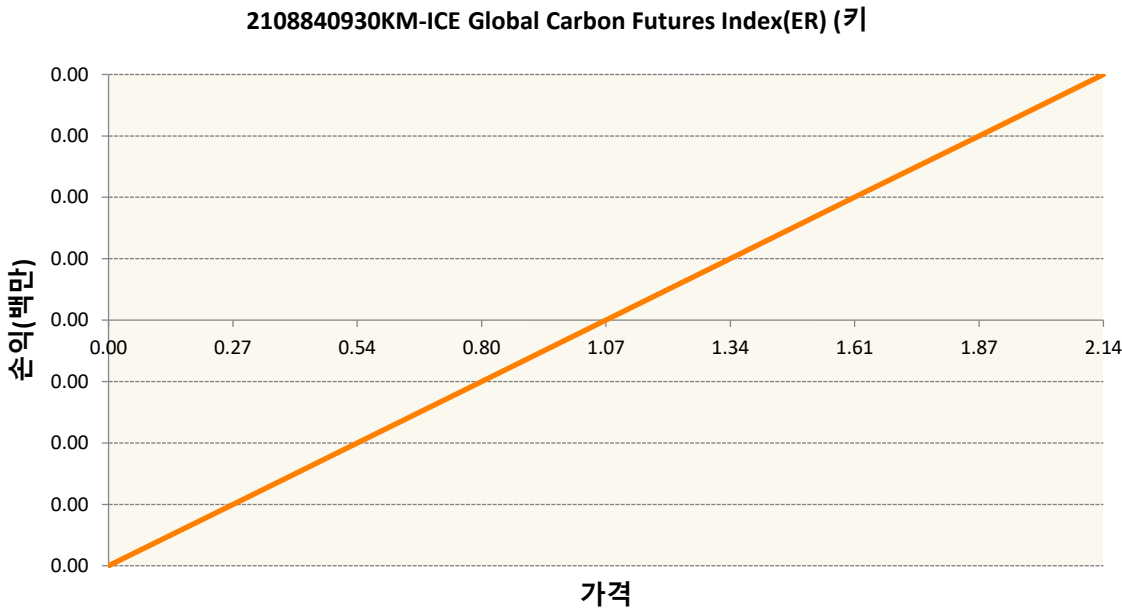
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

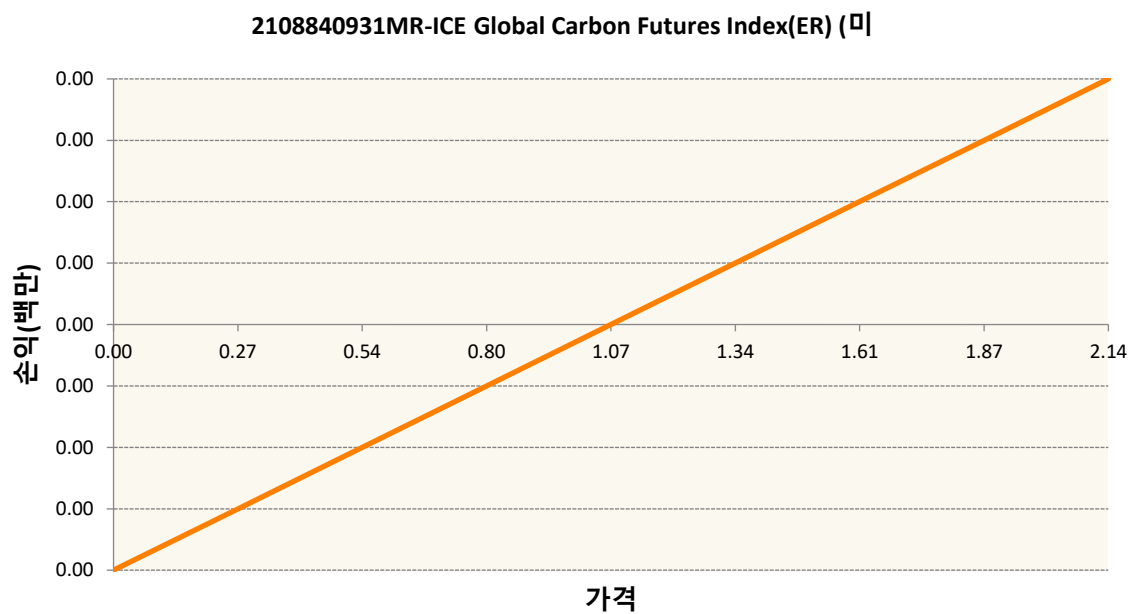
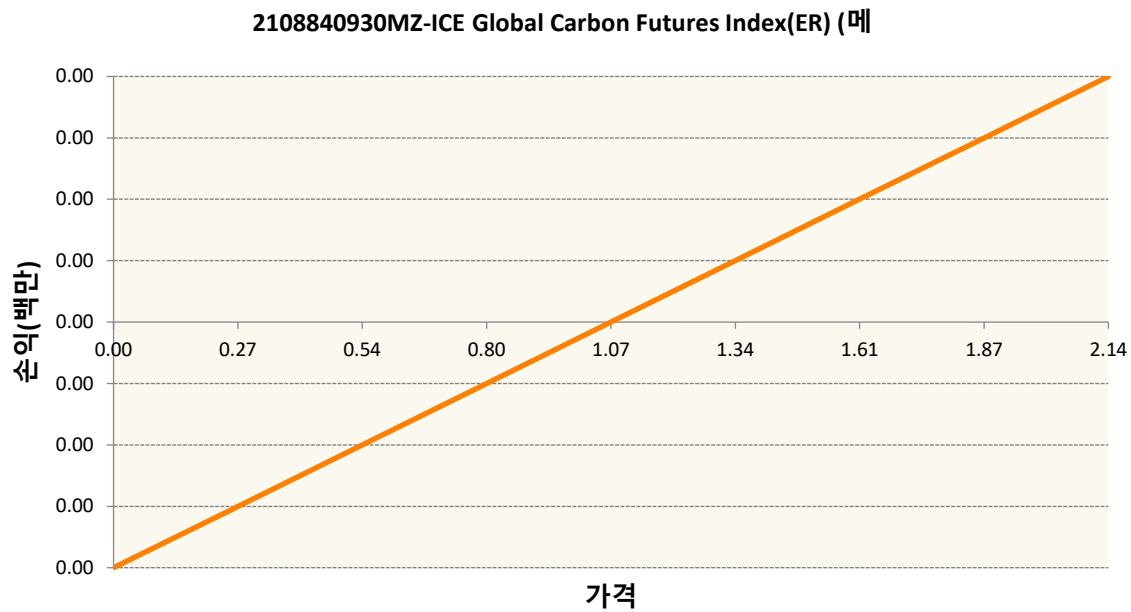
1. 계약금액

(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		95
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		479
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)
	1,029

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

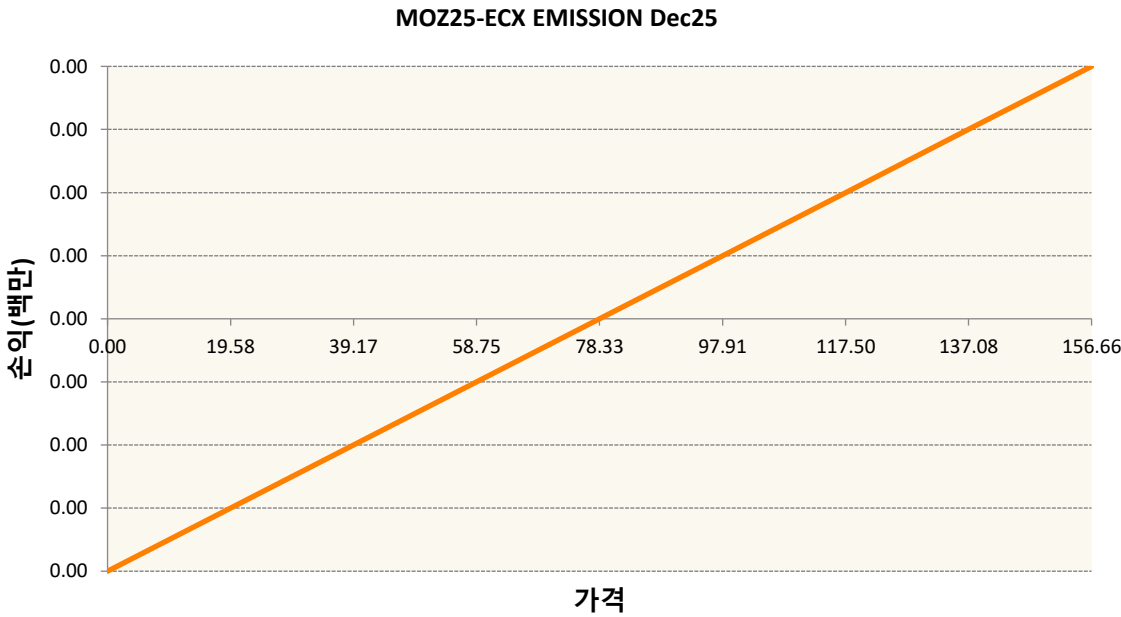
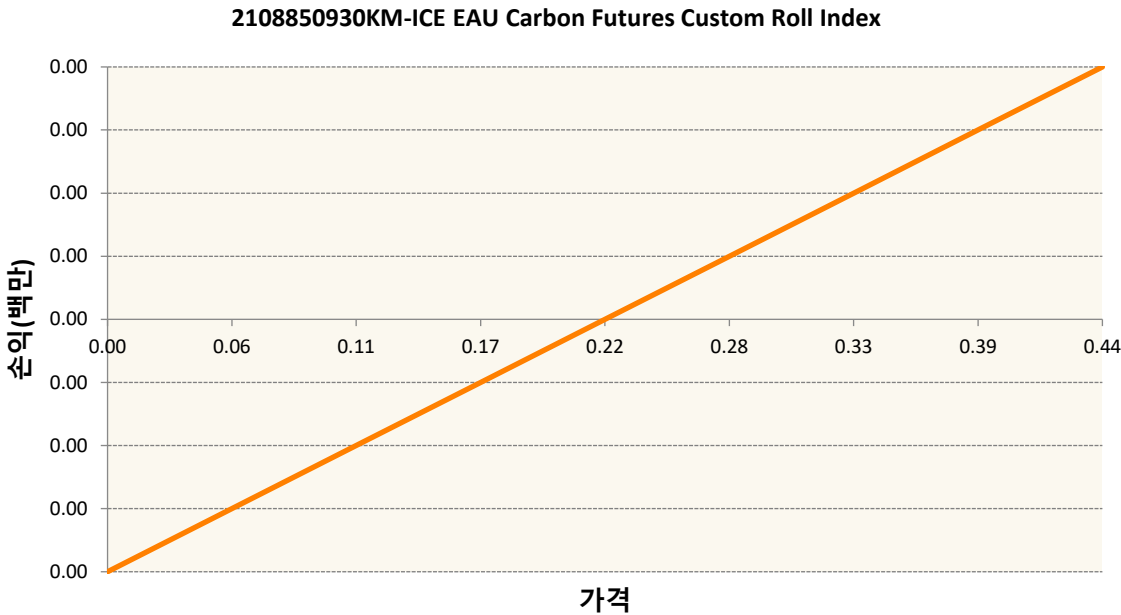
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,892	0	9,892	
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	6
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	164
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	785

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

1,419

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

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)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	5

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

(단위:백만원)

31

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

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)	0.22

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

(단위:백만원)

5

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

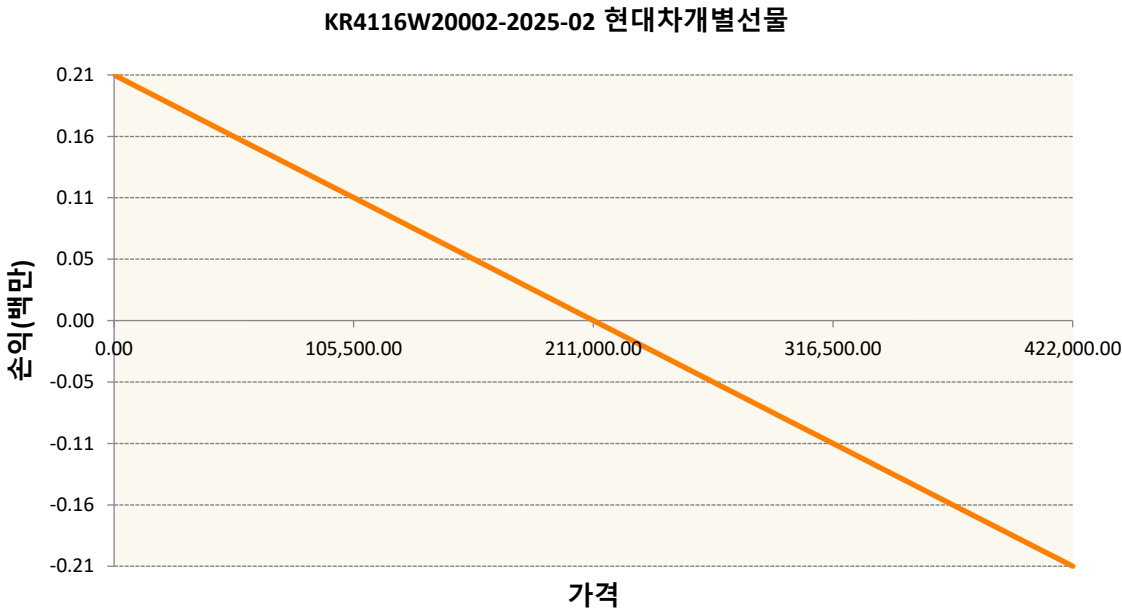
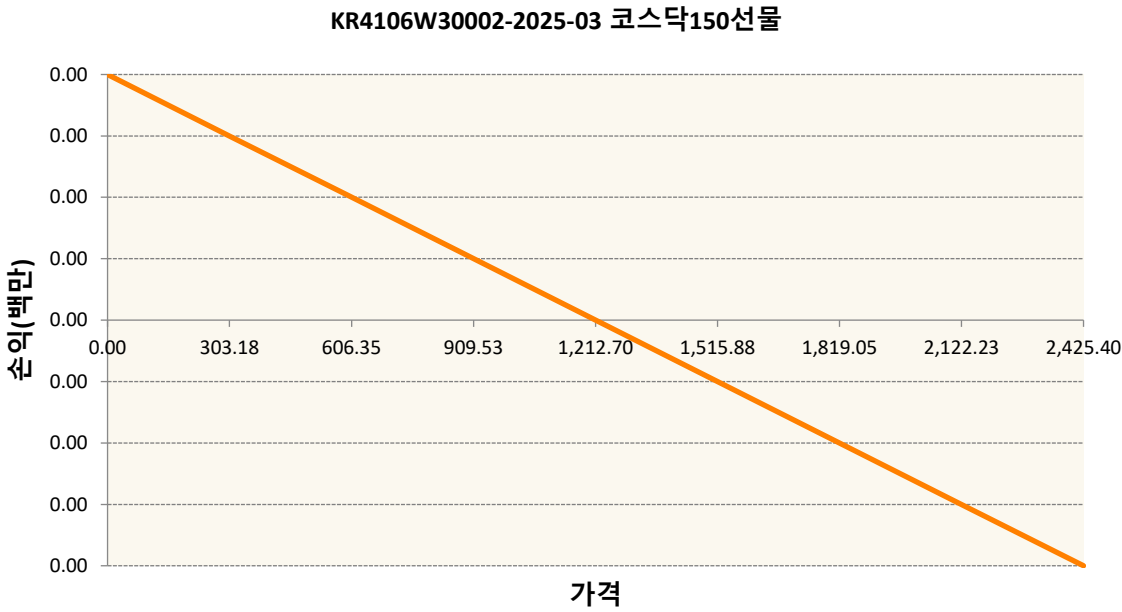
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

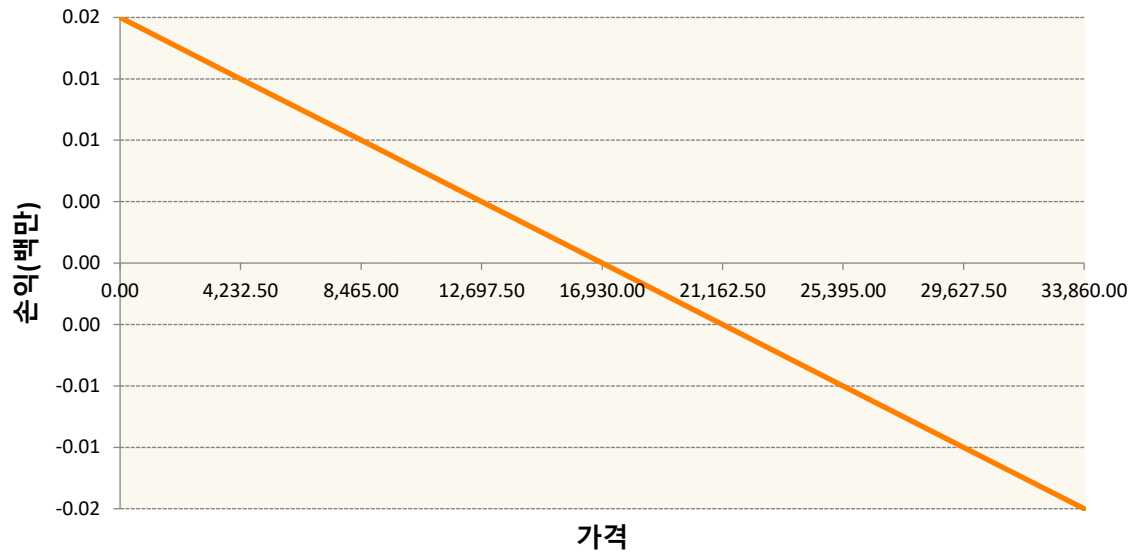
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8	41	-33	장내

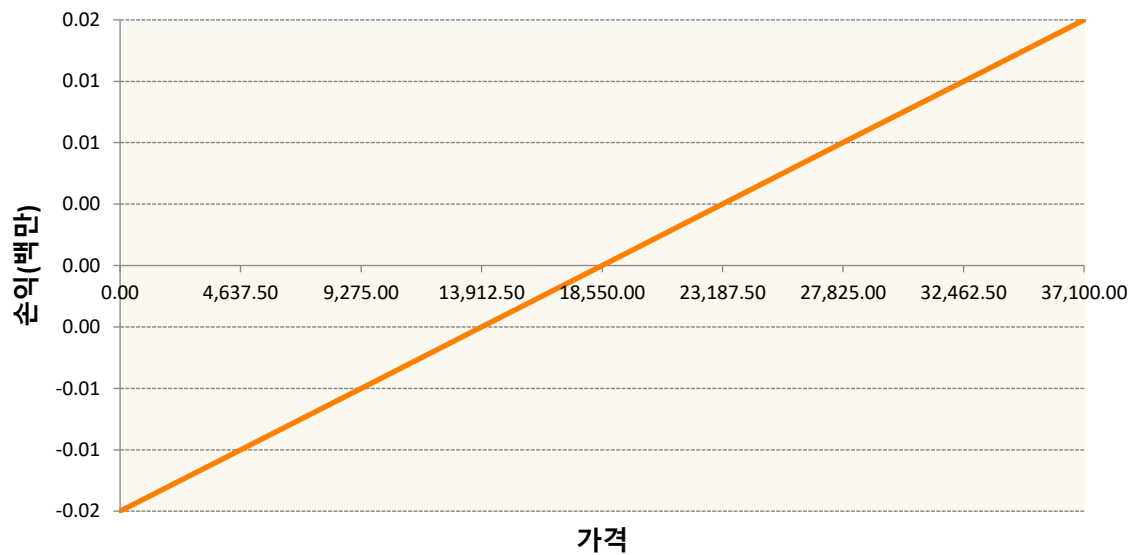
2. 만기시점의 손익구조



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	2025-01-20
기준일	2025-01-17

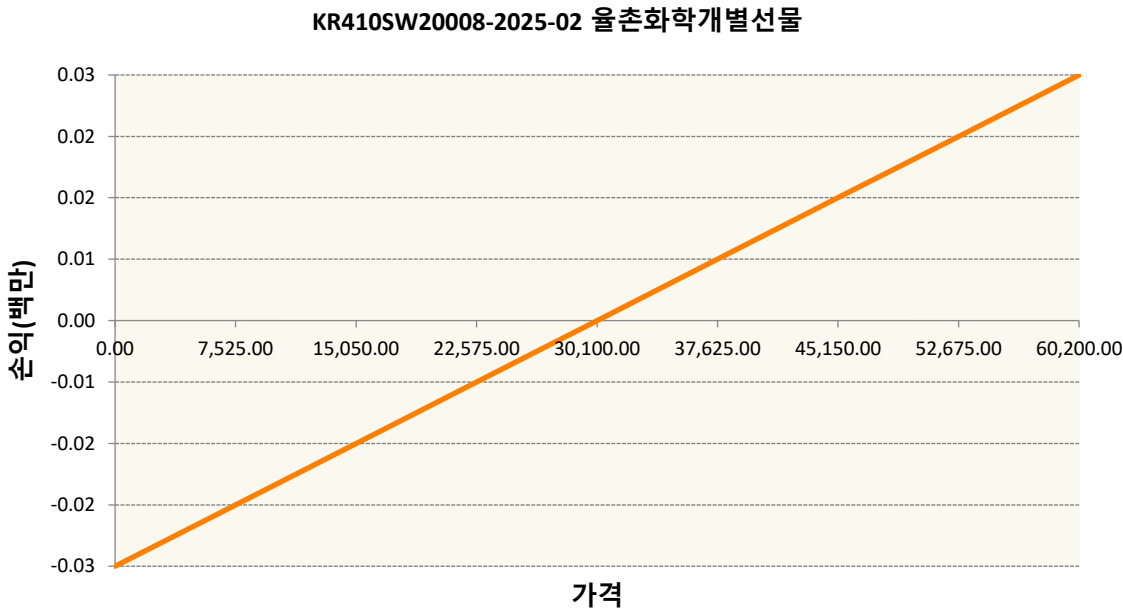
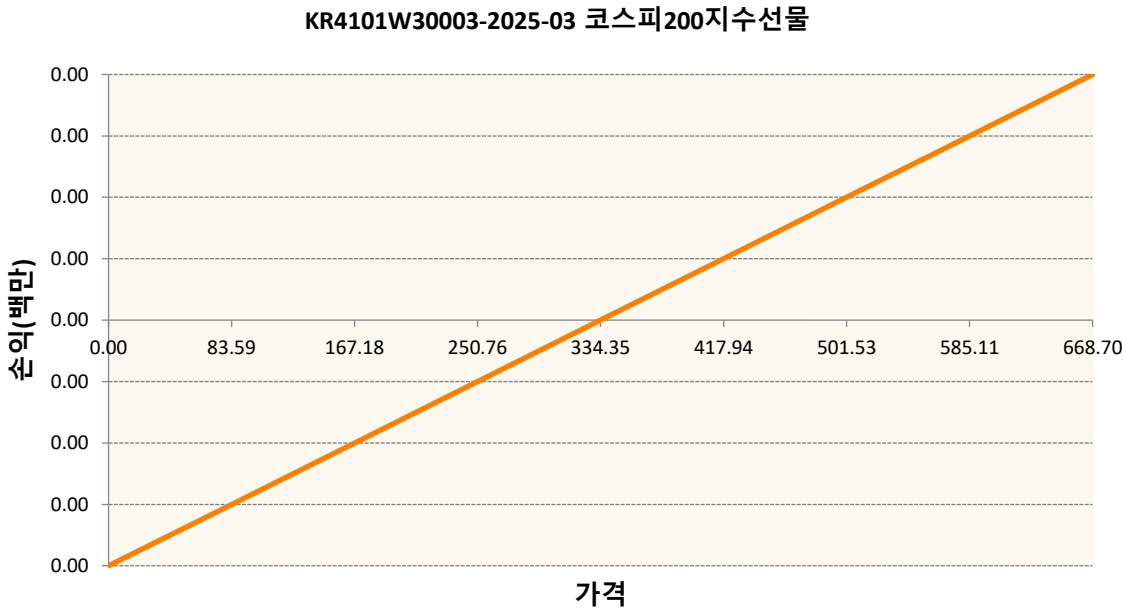
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

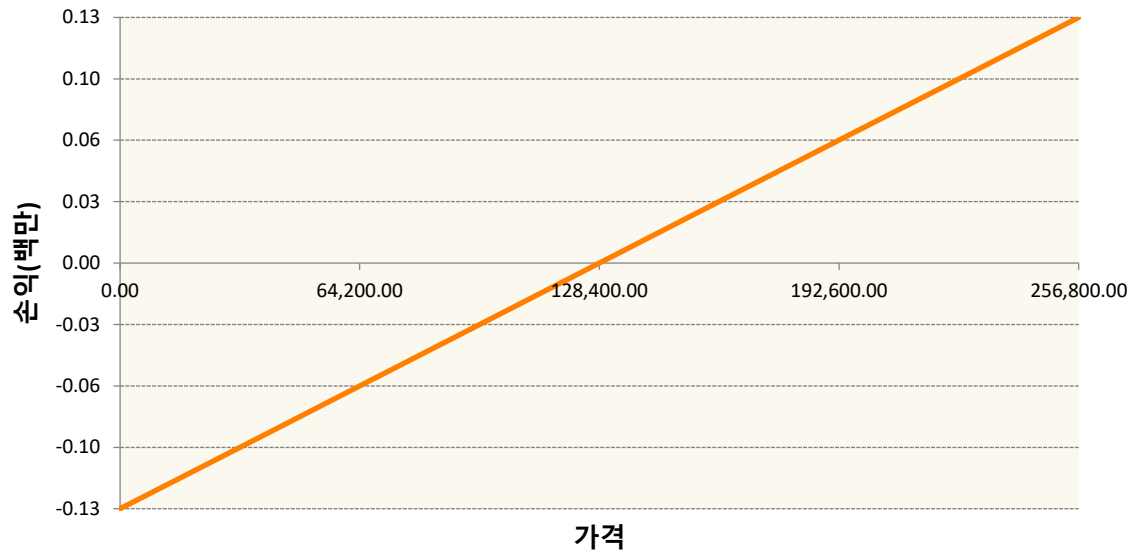
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	938	834	105	장내
누계	유가증권	선물	9,273	0	9,273	장내

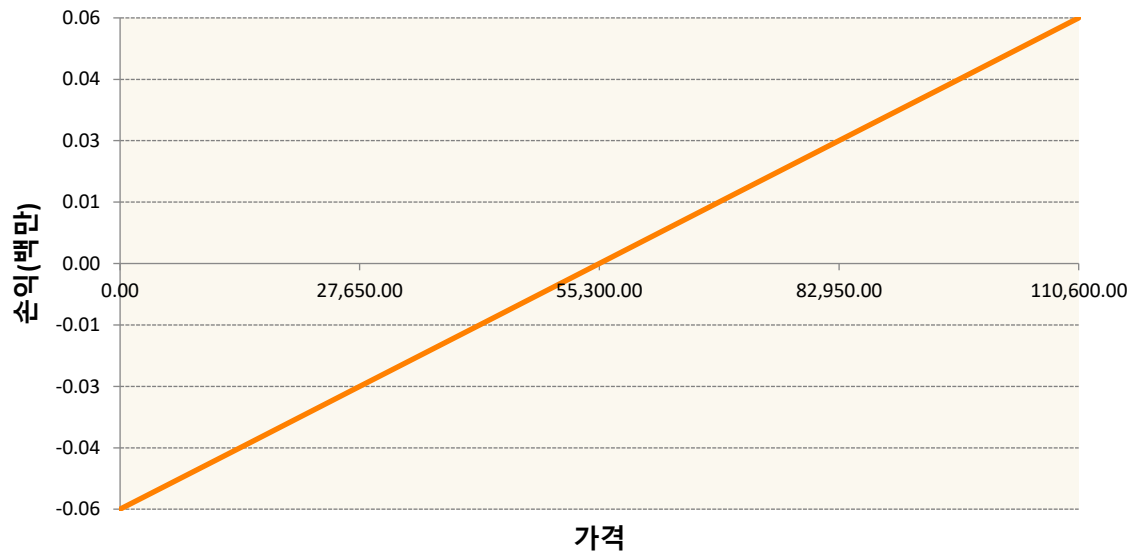
2. 만기시점의 손익구조



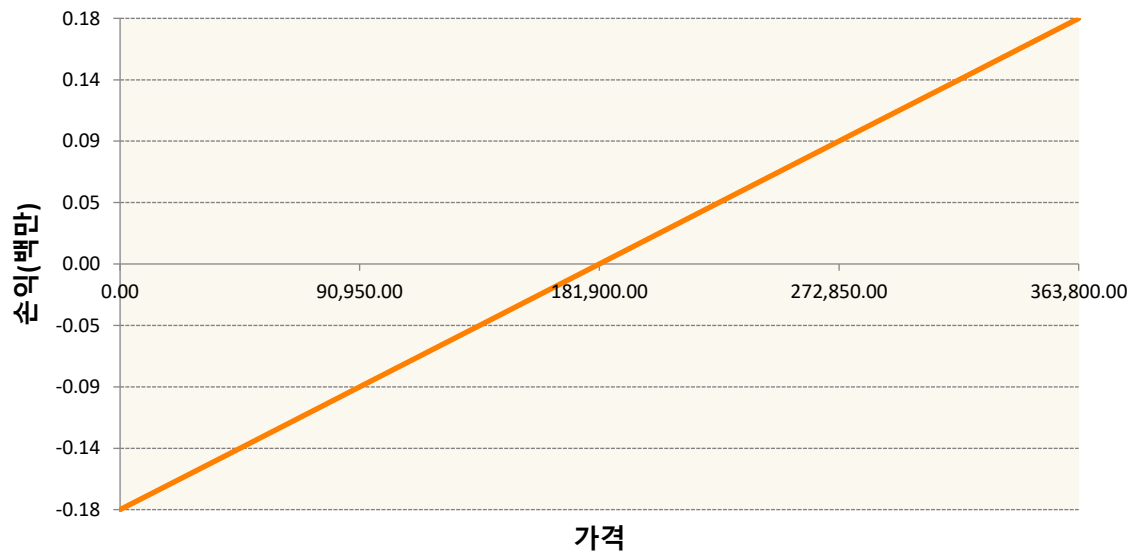
KR4123W20008-2025-02 삼성전기개별선물



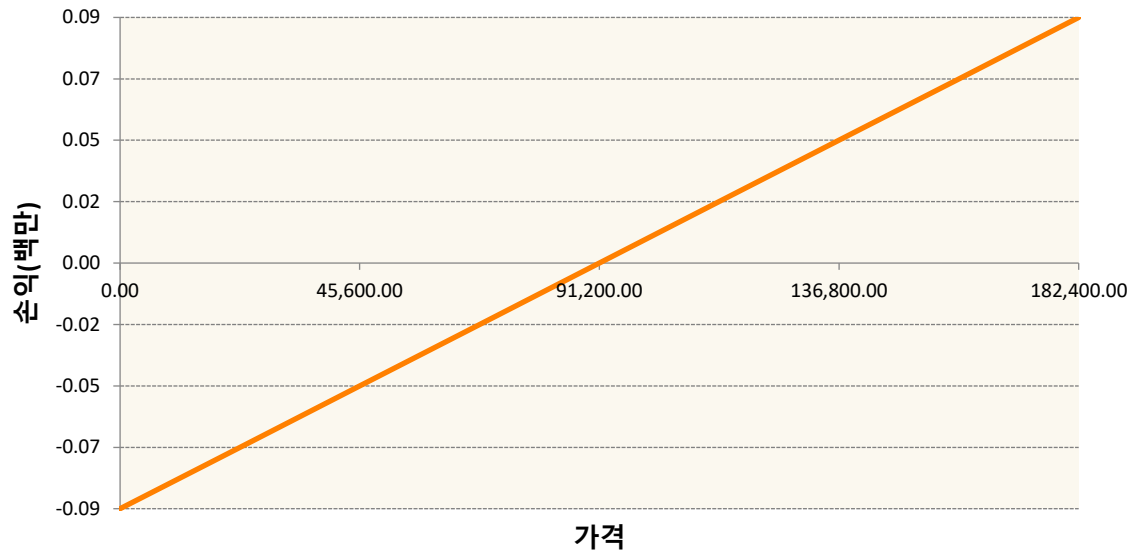
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



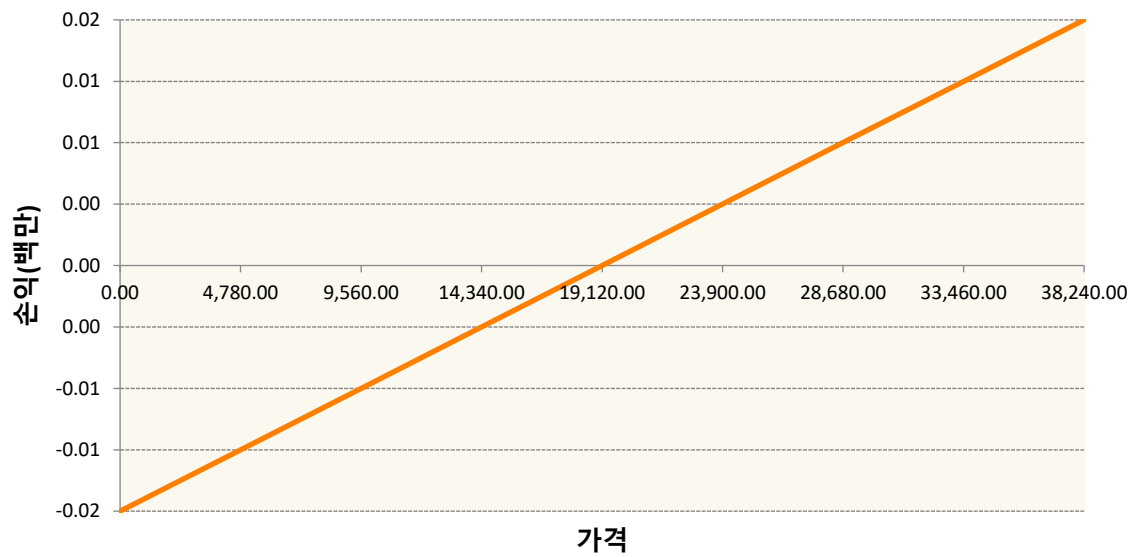
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



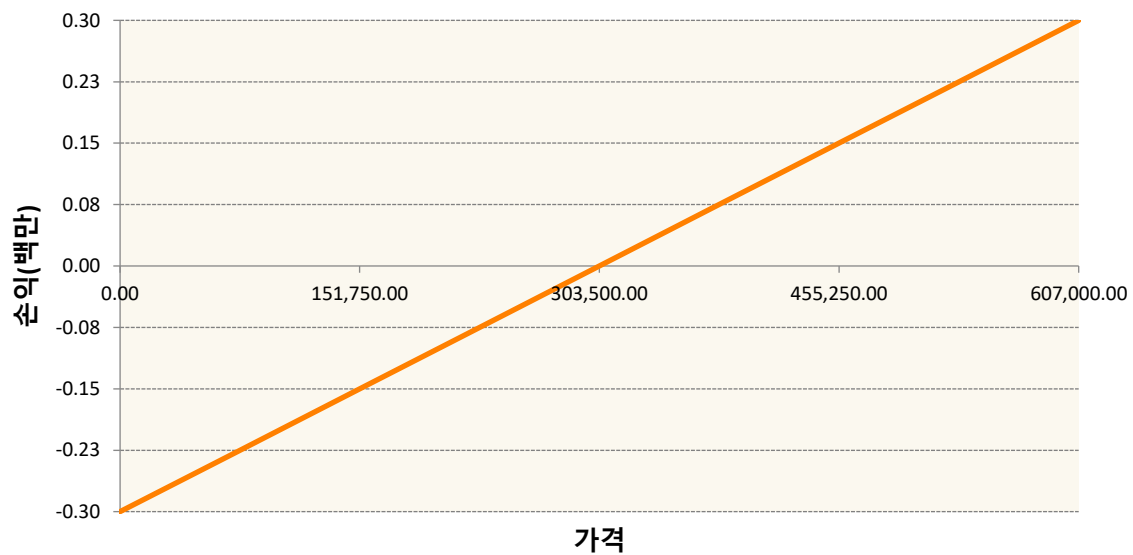
KR41C3W20007-2025-02 금호석유개별선물



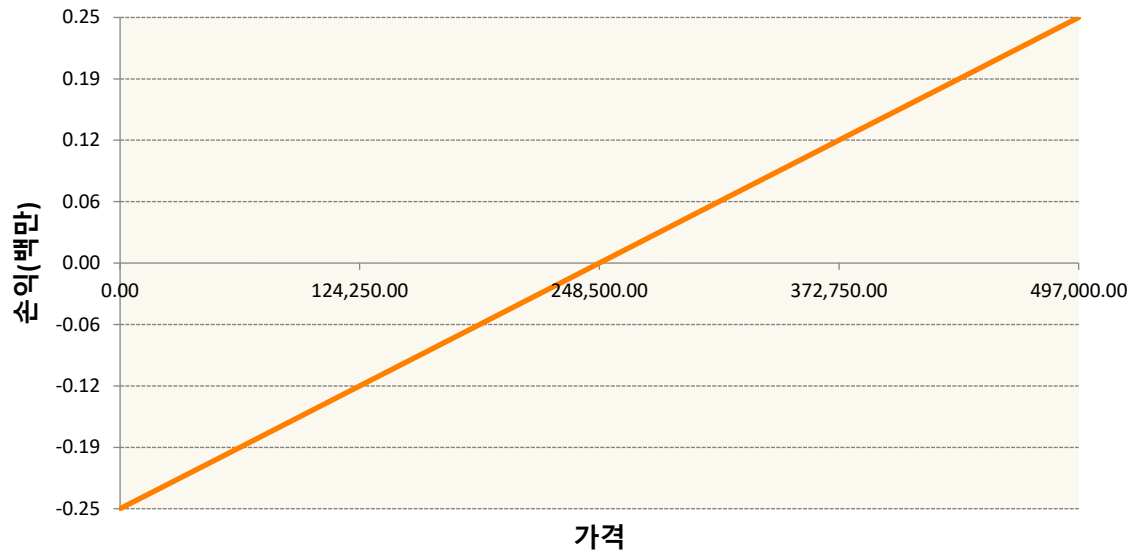
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



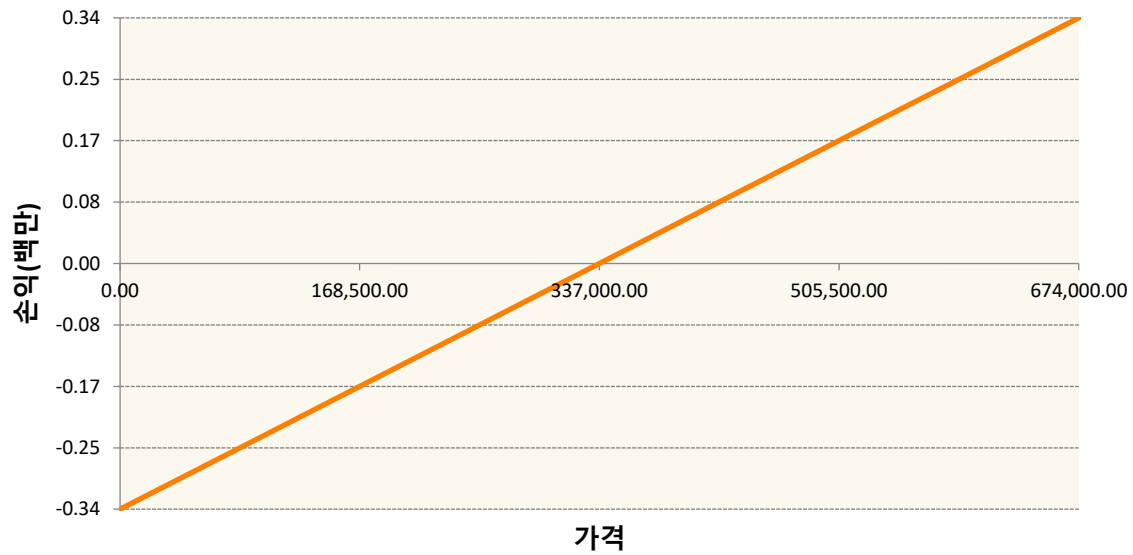
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



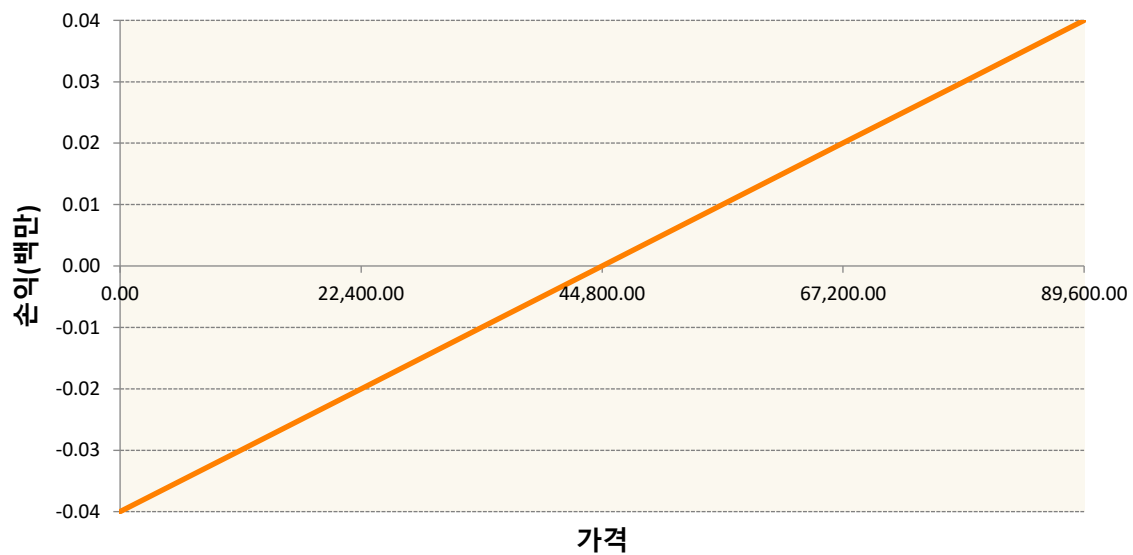
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



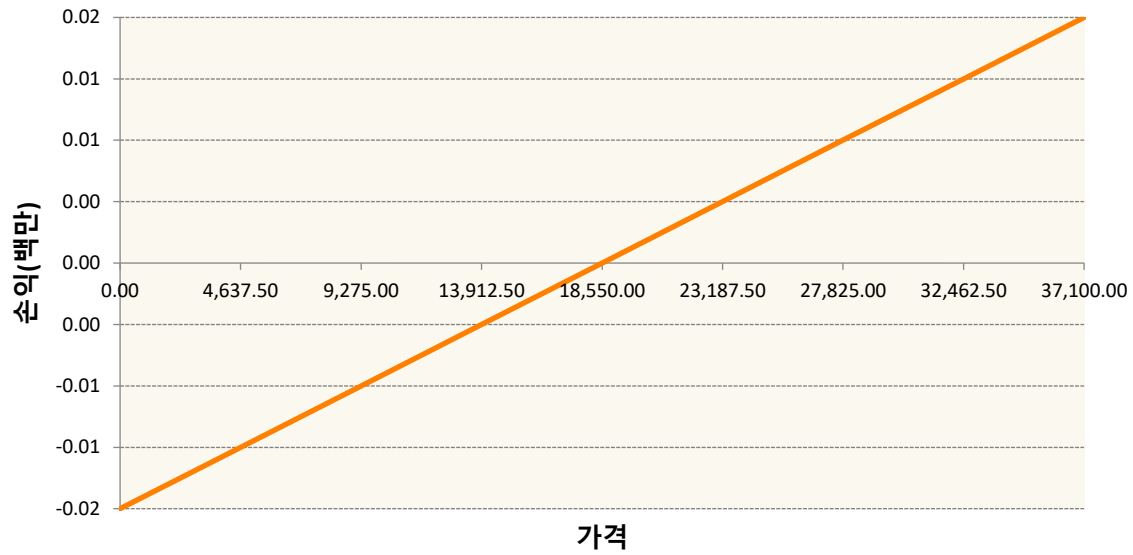
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



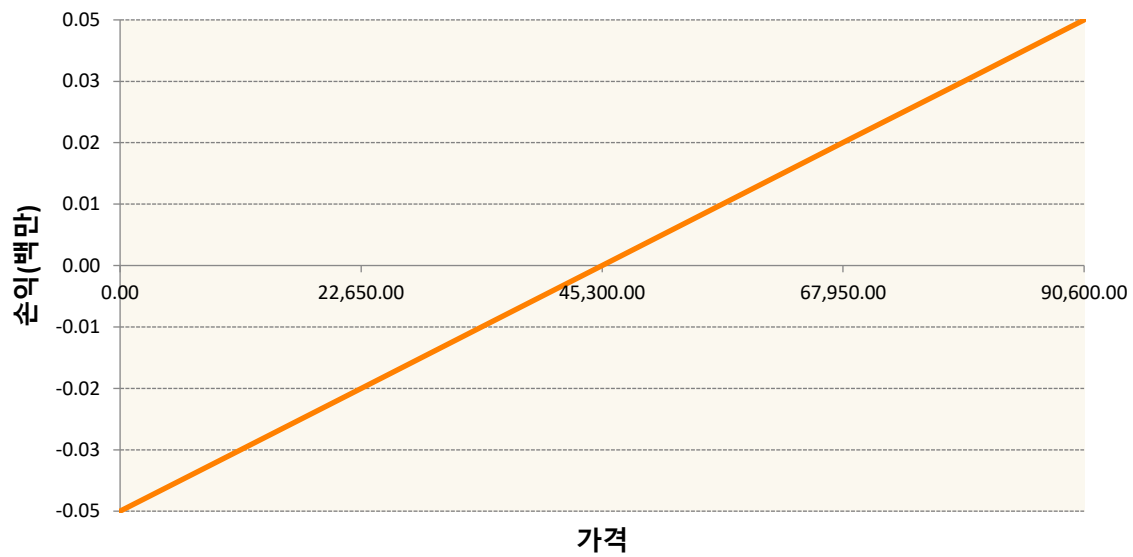
KR41DCW20004-2025-02 HL만도개별선물



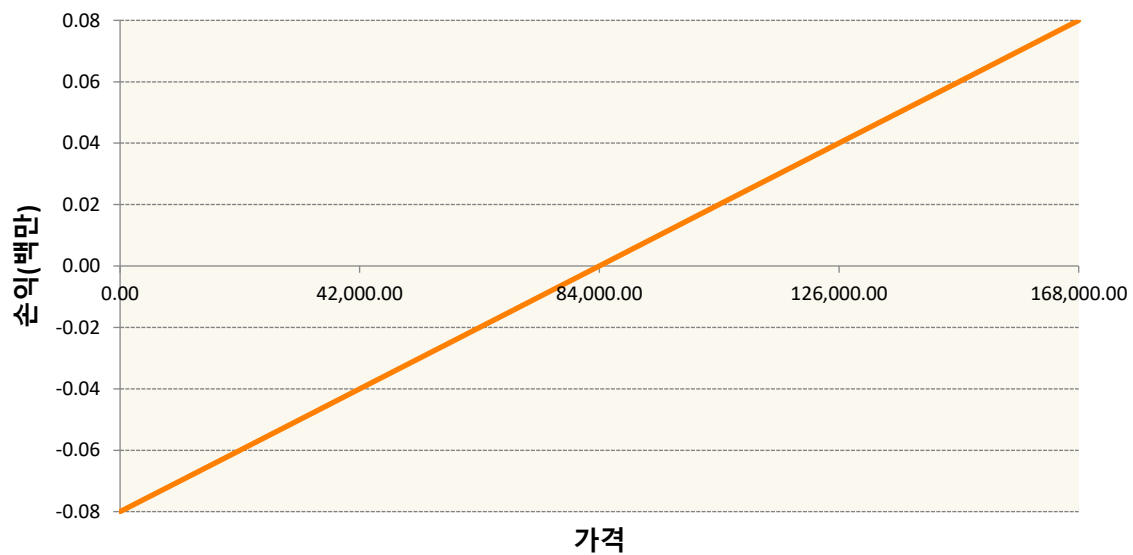
KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



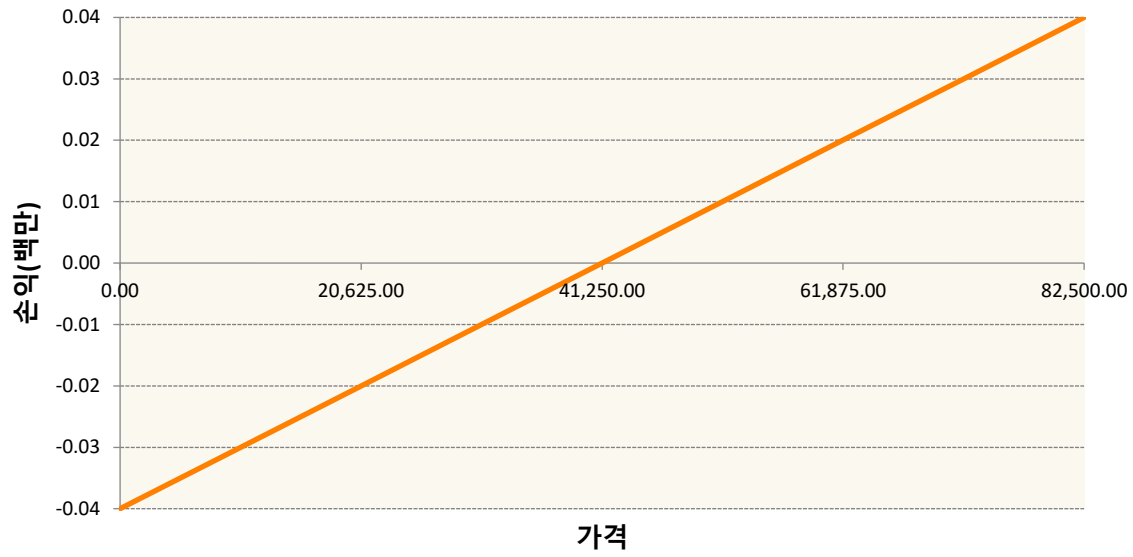
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



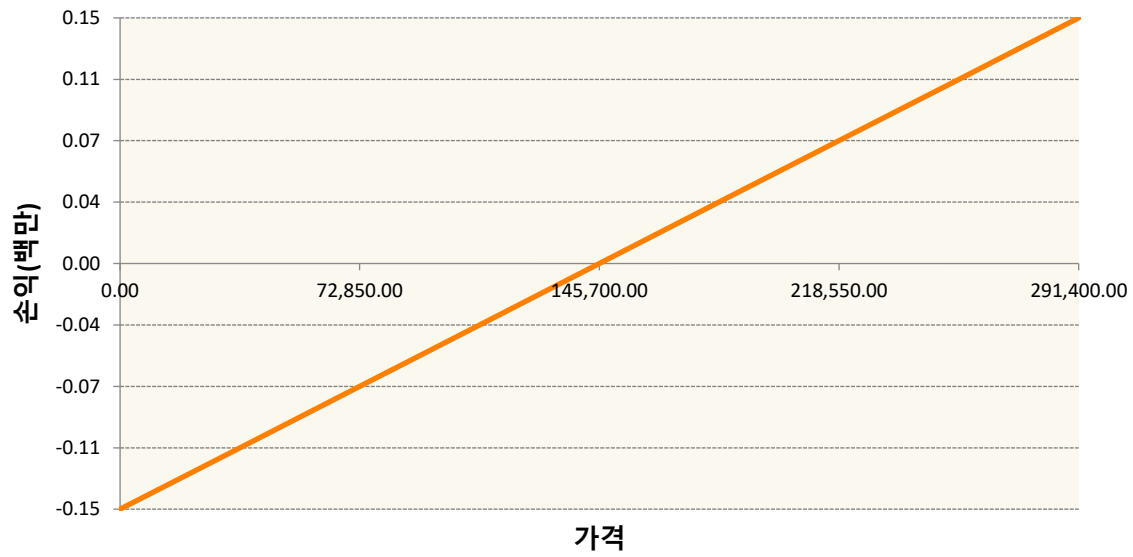
KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



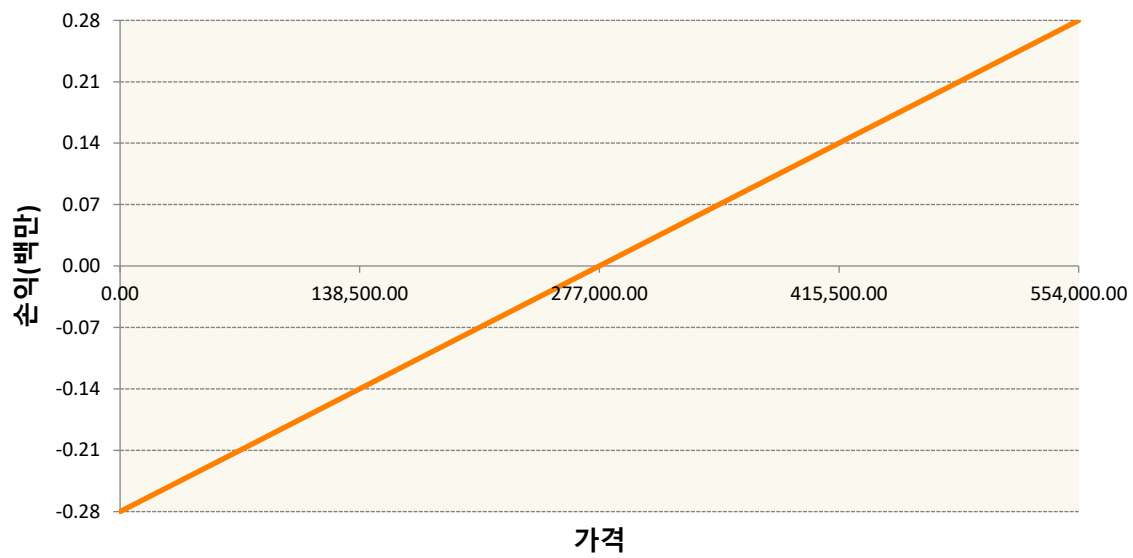
KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



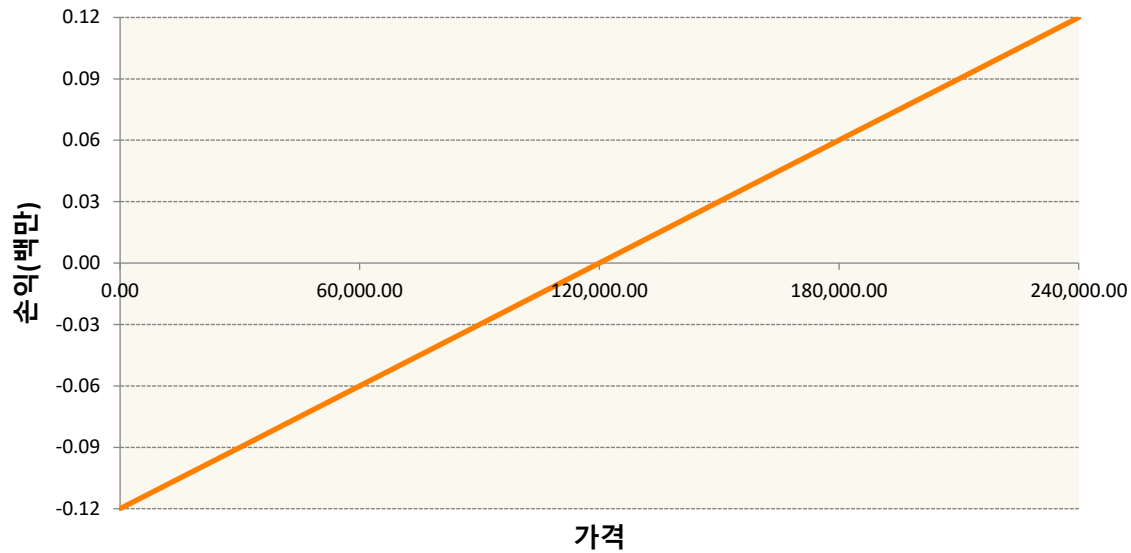
KR41GQW20007-2025-02 녹십자개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



KR41HEW20001-2025-02 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	568
KR410SW20(2025-02 울촌화학개별선물	3
KR4123W20(2025-02 삼성전기개별선물	1
KR41BBW20(2025-02 롯데케미칼개별선물	11
KR41BJW20C 2025-02 엔씨소프트개별선물	22
KR41C3W20(2025-02 금호석유개별선물	14
KR41CNW20 2025-02 포스코DX개별선물	4
KR41CRW20 2025-02 LG생활건강개별선물	10
KR41CXW20(2025-02 한미약품개별선물	18
KR41DAW20 2025-02 농심개별선물	6
KR41DCW20 2025-02 HL만도개별선물	1
KR41ETW20(2025-02 삼성E&A개별선물	3
KR41F9W20(2025-02 SK바이오사이언스개별선물	11
KR41FMW20 2025-02 엘앤에프개별선물	20
KR41G0W20(2025-02 씨에스윈드개별선물	10
KR41GQW2C 2025-02 녹십자개별선물	5
KR41GTW20(2025-02 두산개별선물	19
KR41HEW20(2025-02 키움증권개별선물	16

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

(단위:백만원)

1,135

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

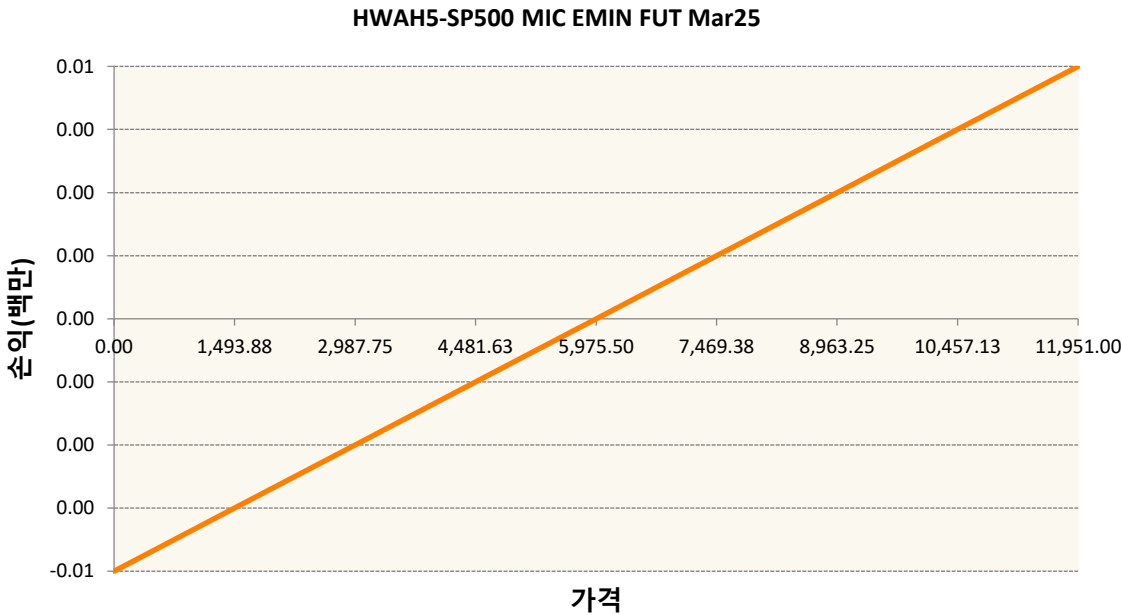
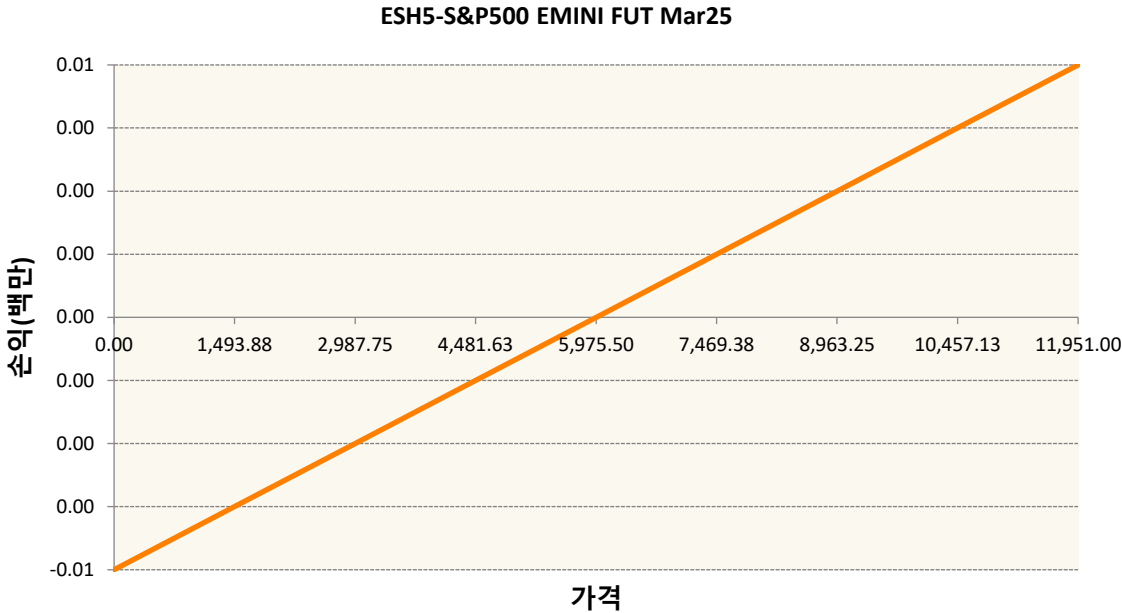
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	26,486	0	26,486	
누계	유가증권	선물	1,301	0	1,301	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,119
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,961

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

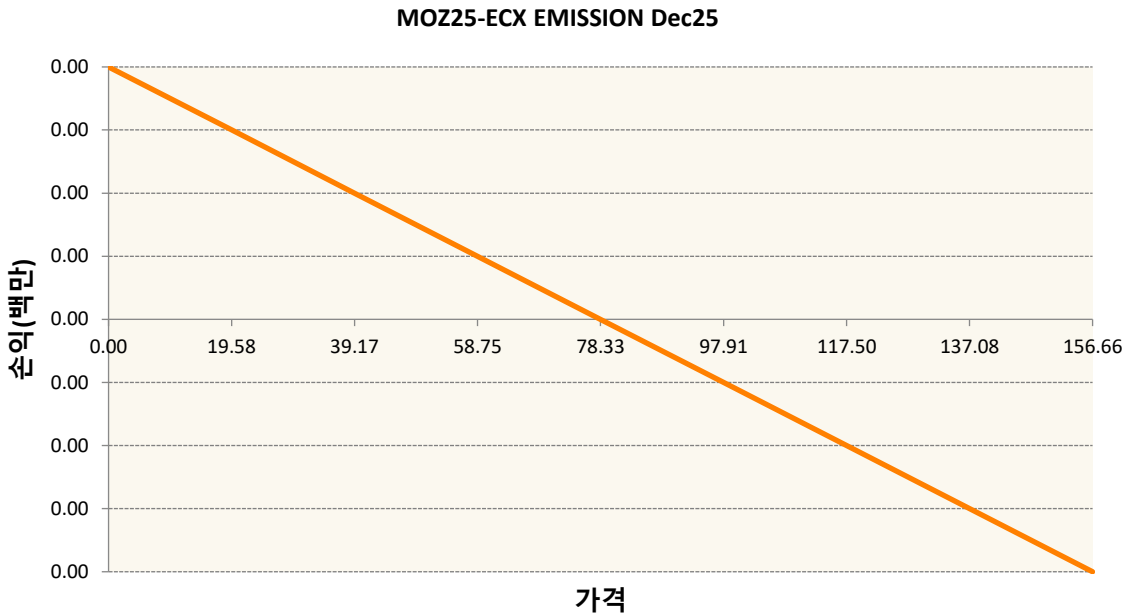
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-75	3,722	-3,797	
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	6
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	9
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	92
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	298

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

(단위:백만원)

563

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

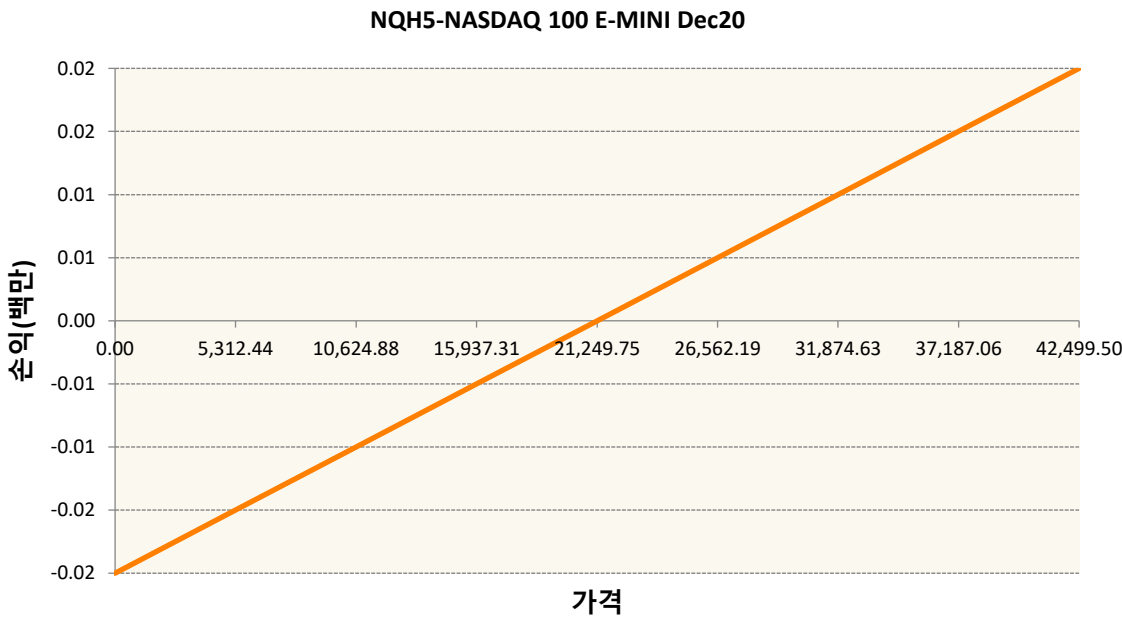
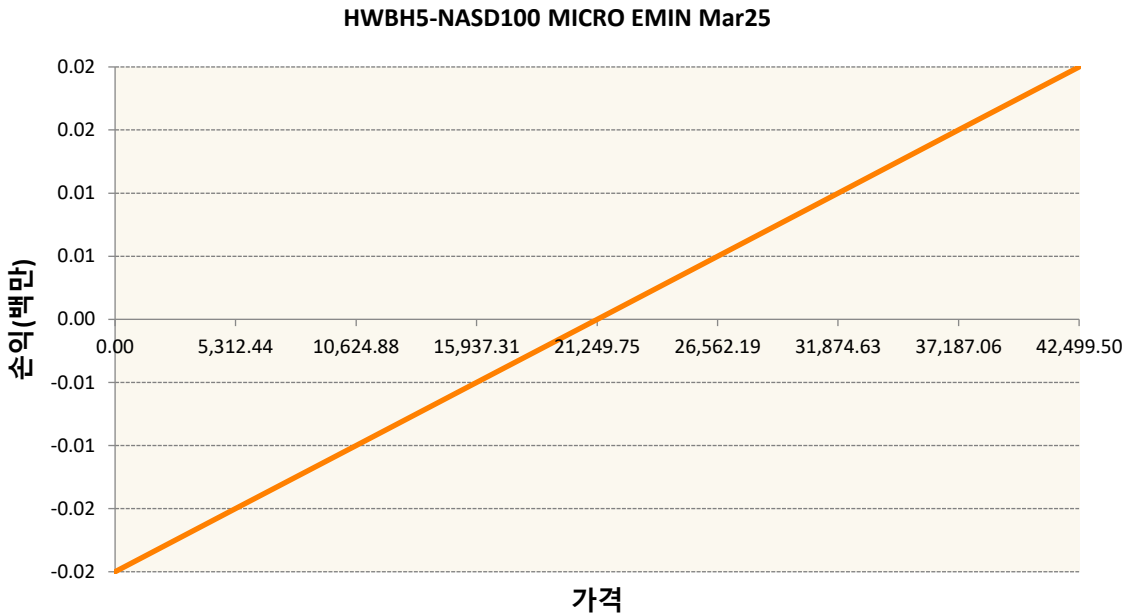
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,597	0	13,597	
누계	유가증권	선물	865	0	865	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	69
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,088

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,009

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

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	205,238	0	205,238	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	710
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,510
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,415
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,954

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

(단위:백만원)

9,458

공시일	2025-01-20
기준일	2025-01-17

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	2025-01-20
기준일	2025-01-17

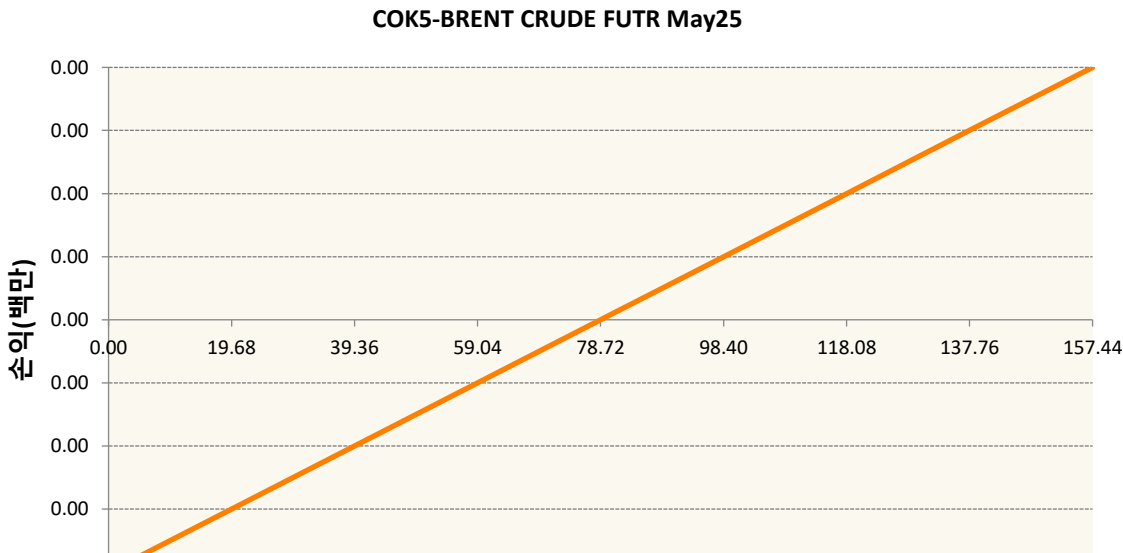
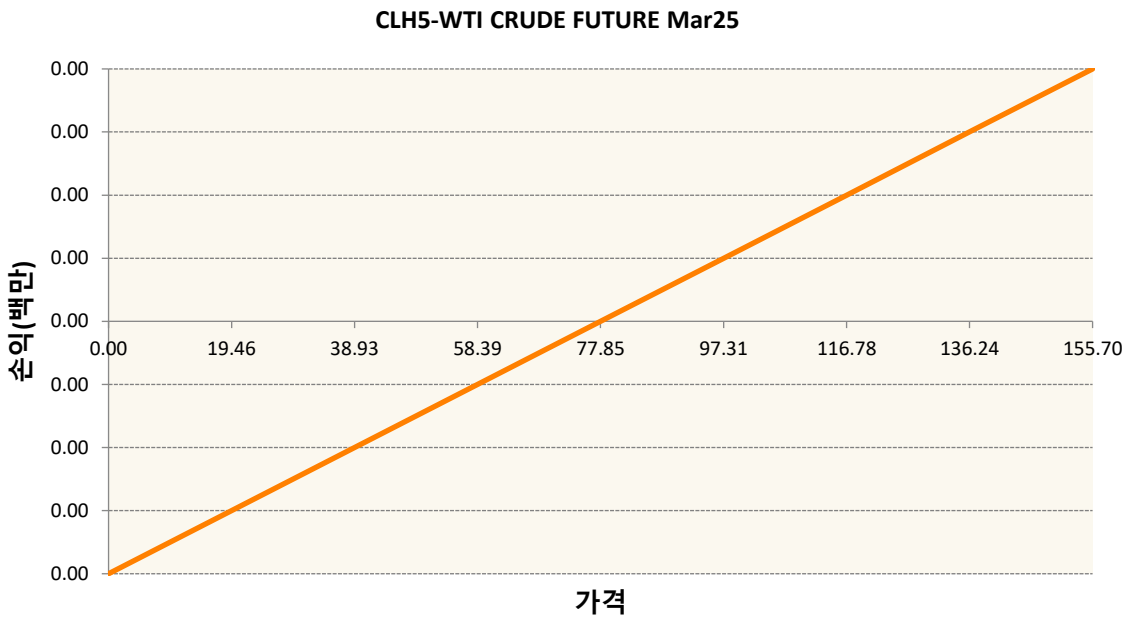
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

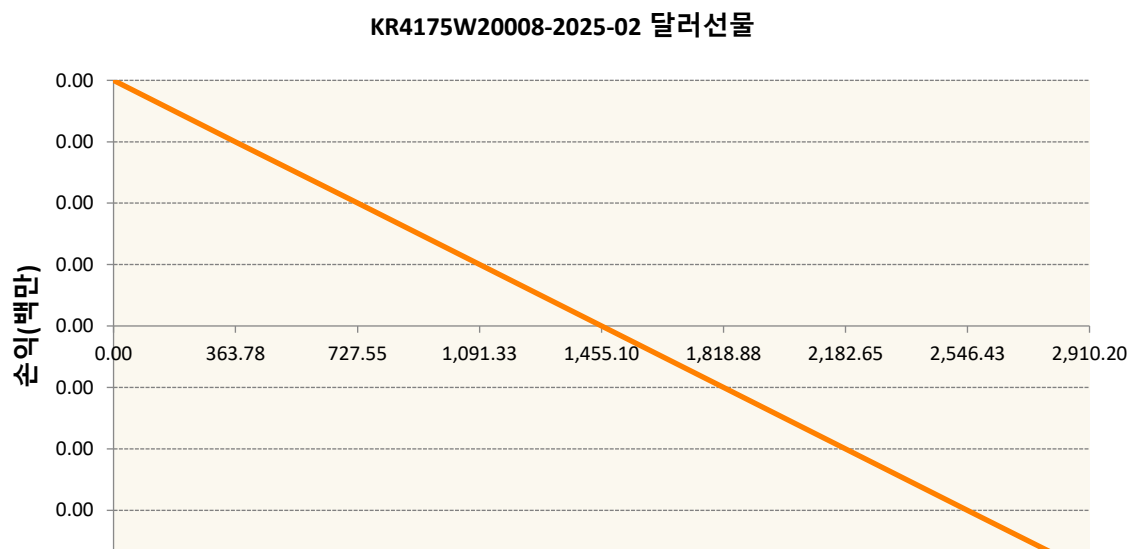
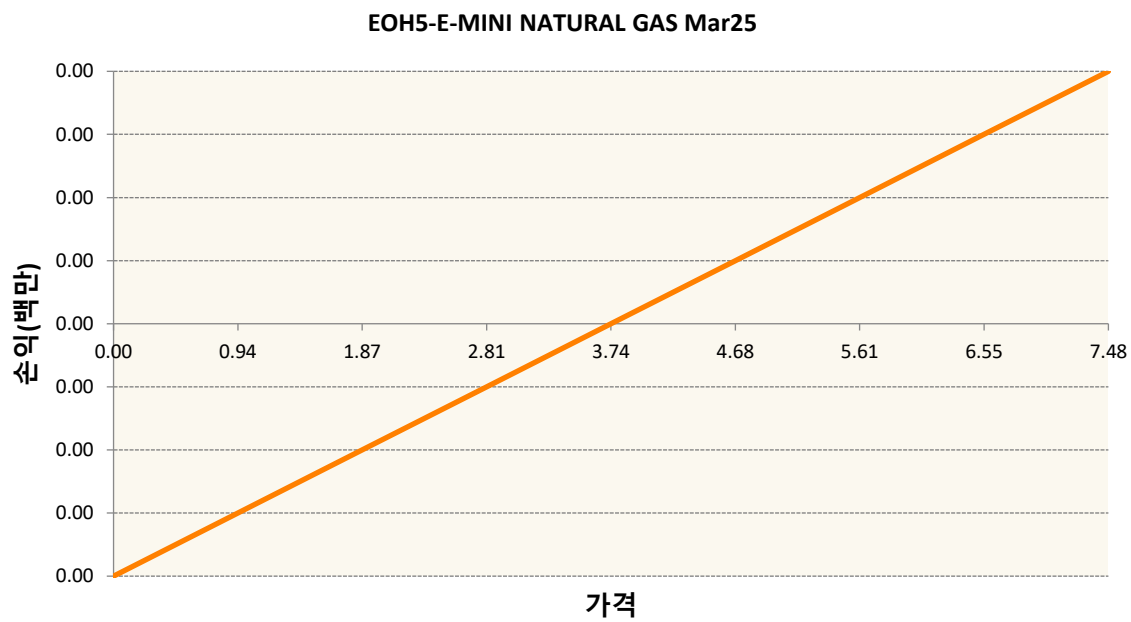
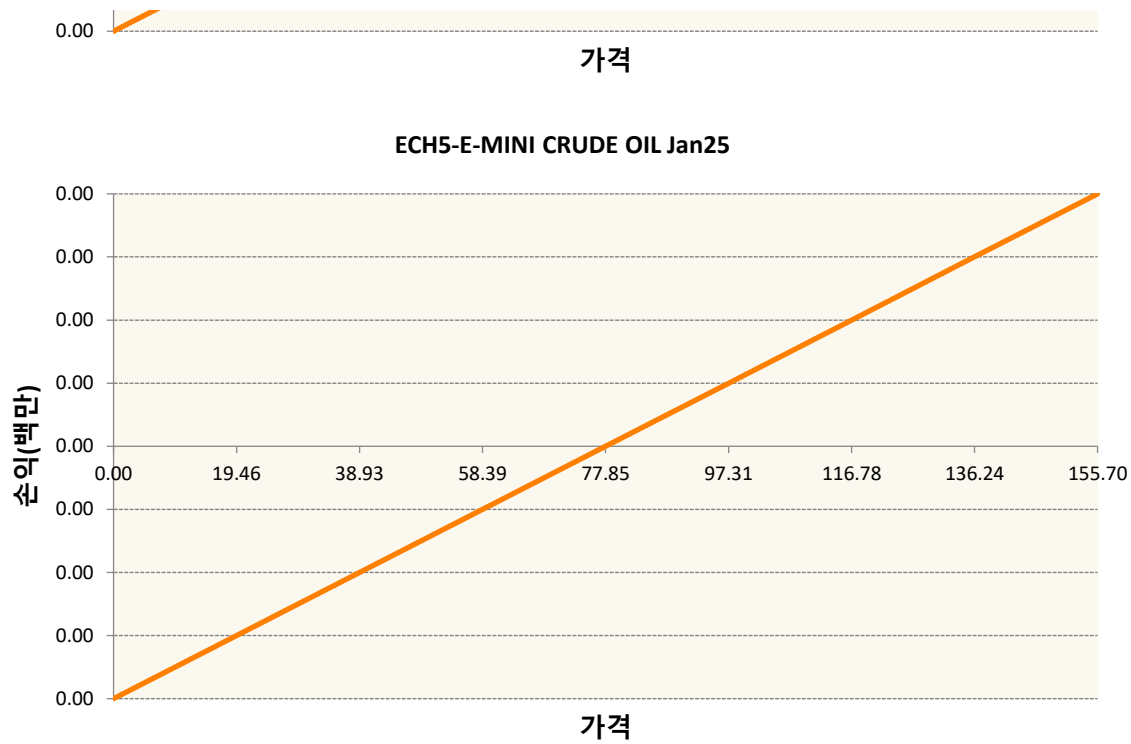
1. 계약금액

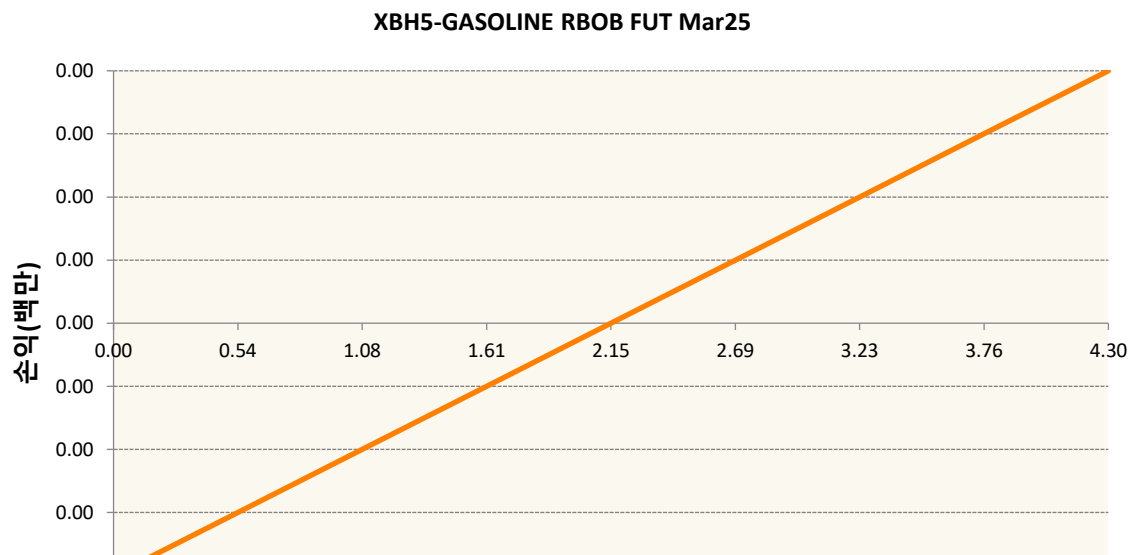
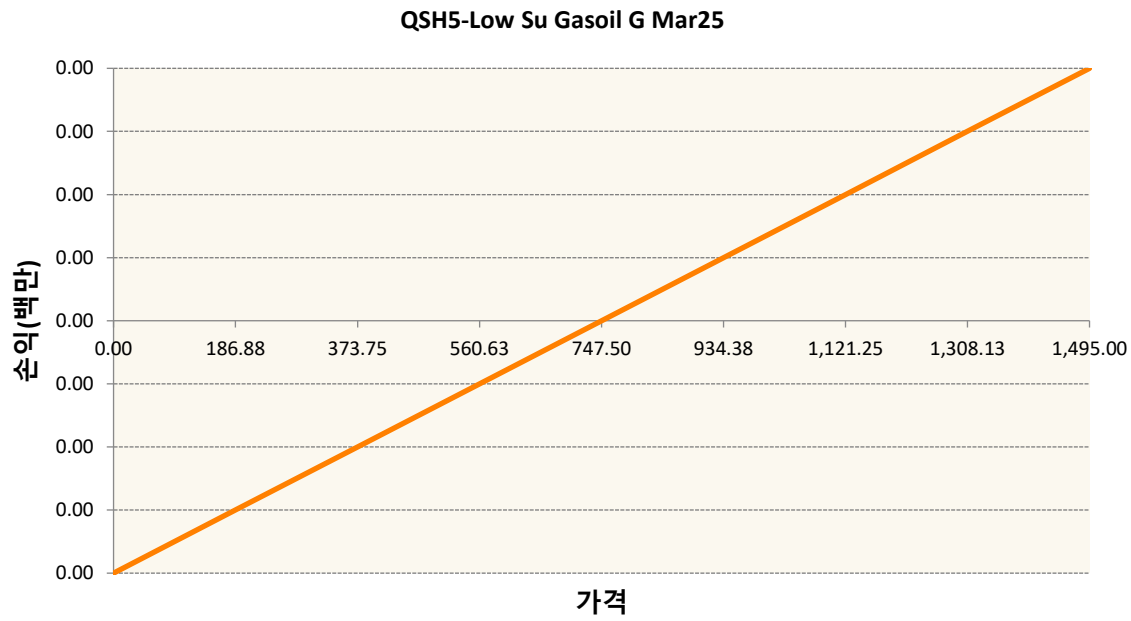
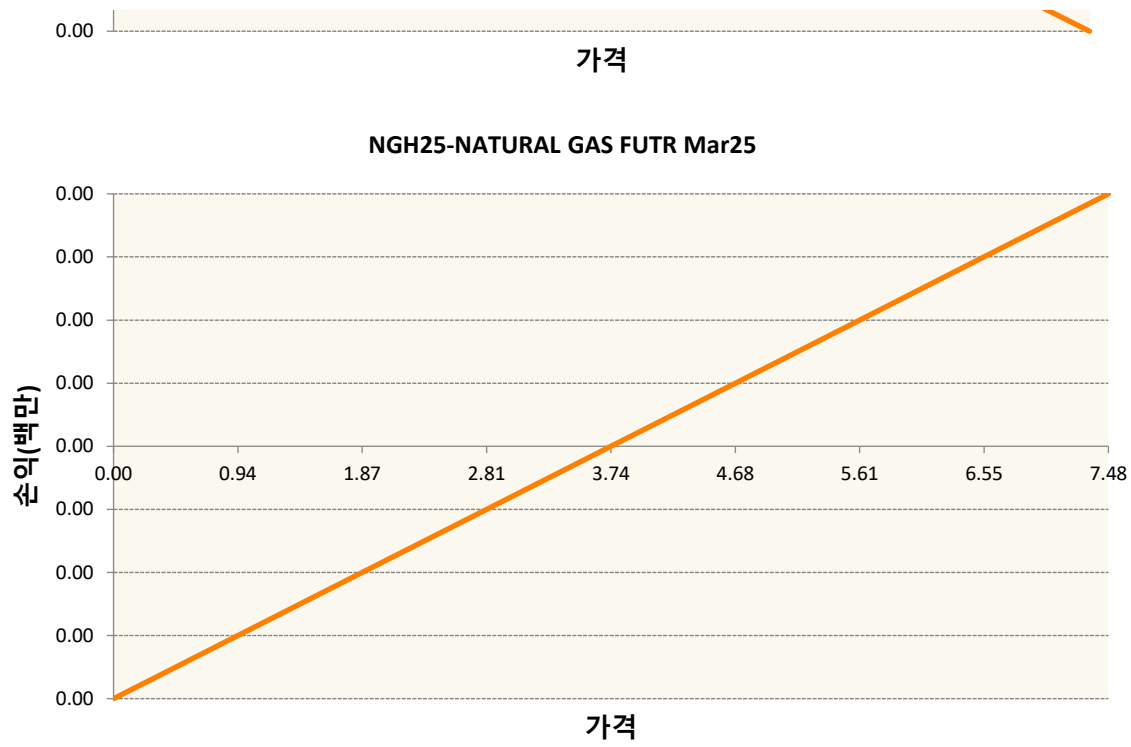
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	선물	유가증권	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	선물	유가증권	112	0	112	
누계	유가증권	선물	808	0	808	
누계	통화	선물	0	204	-204	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar25	9
COK5	BRENT CRUDE FUTR May25	19
ECH5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	4
EOH5	E-MINI NATURAL GAS Mar25	5
KR4175W20(2025-02 달러선물		16
NGH25	NATURAL GAS FUTR Mar25	17
QSH5	Low Su Gasoil G Mar25	9
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar25	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	167