

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

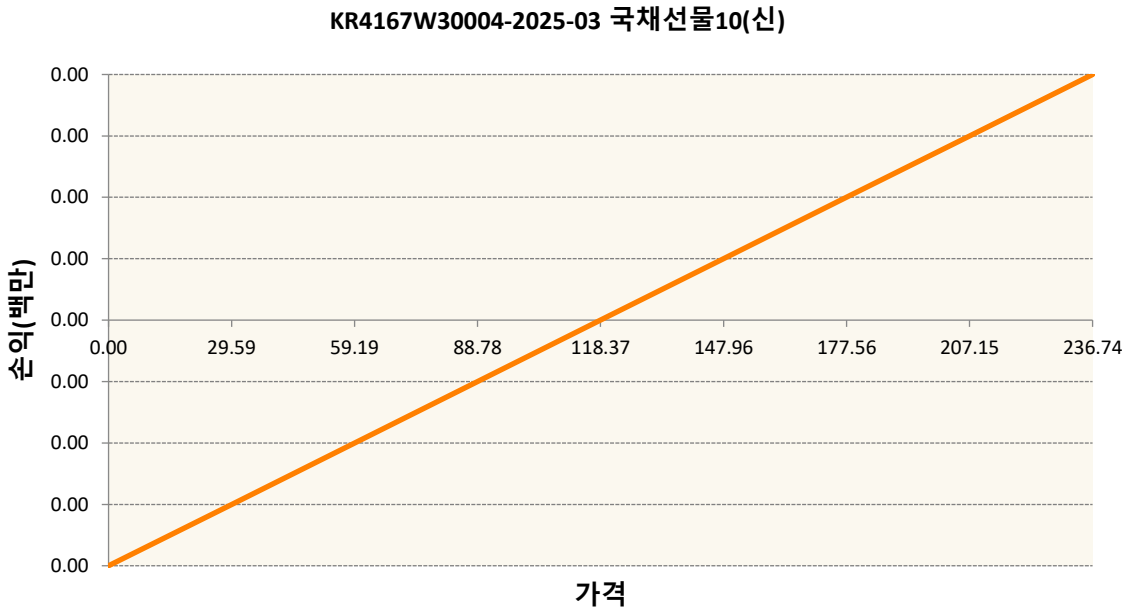
베스트장기채(채권-파생형)

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	249,761	0	249,761	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

6,479

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

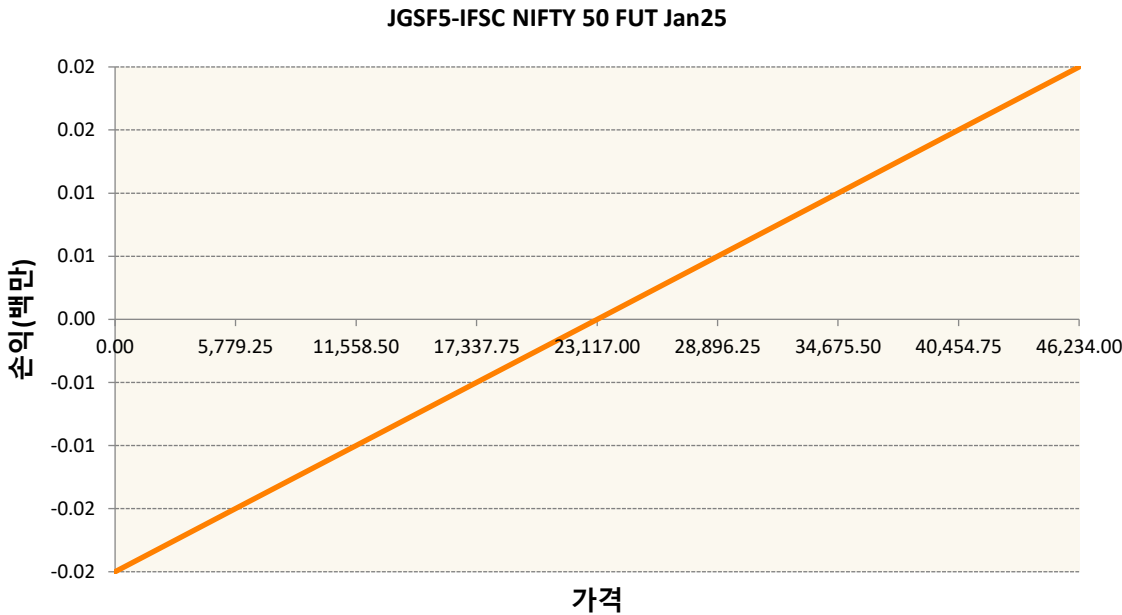
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,389	0	3,389	

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)

183

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

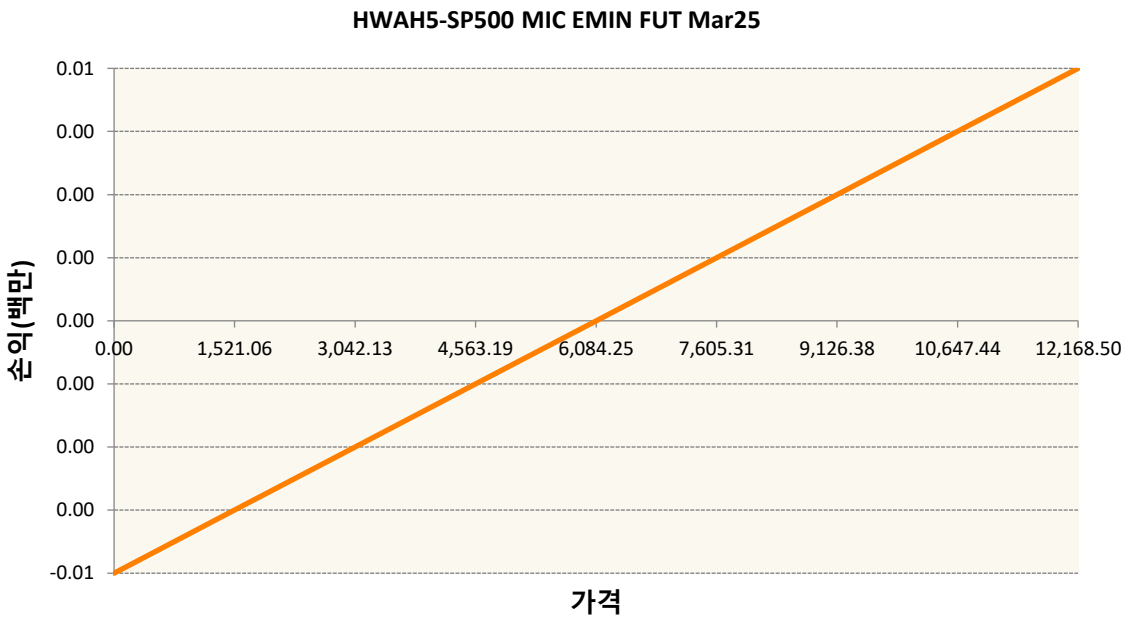
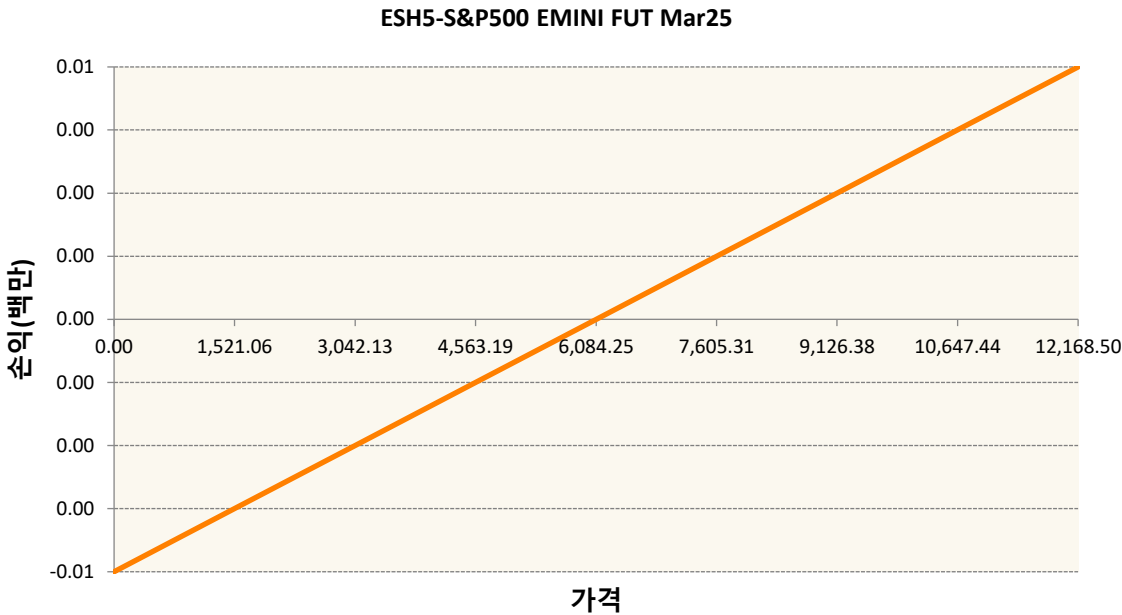
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	875	0	875	
누계	유가증권	선물	87	0	87	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	2025-01-23
기준일	2025-01-22

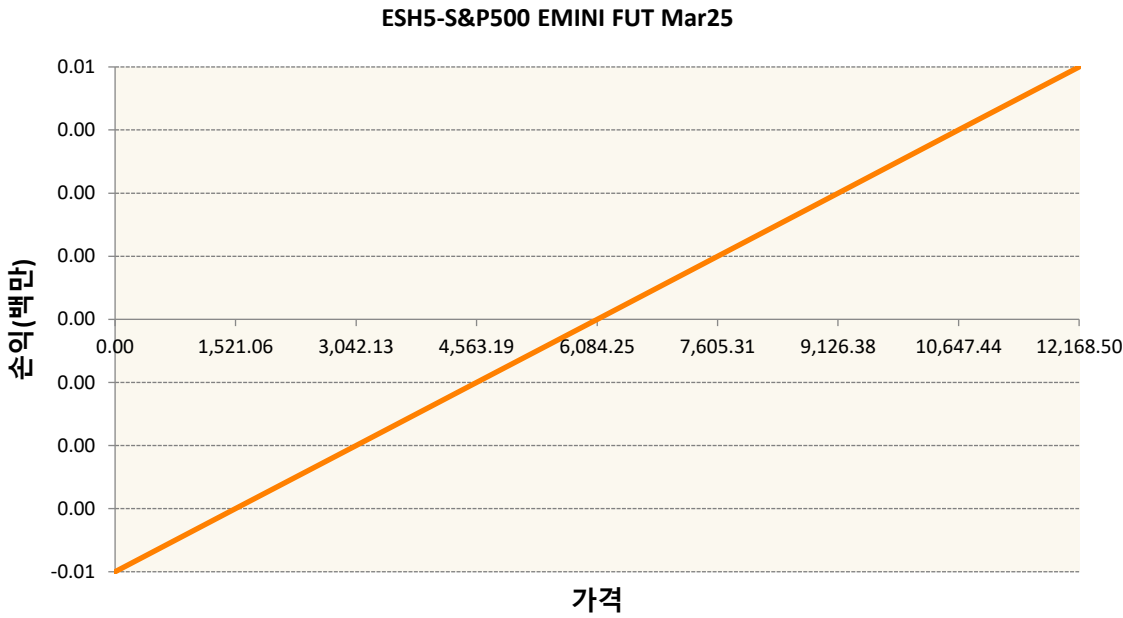
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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	2,649	0	2,649	
누계	통화	선도	100	101	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	212
FXW213F1G(KRW/USD 07-02-25E		8
FXW213F1L0JPY/KRW 07-02-25E		8

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

(단위:백만원)

298

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

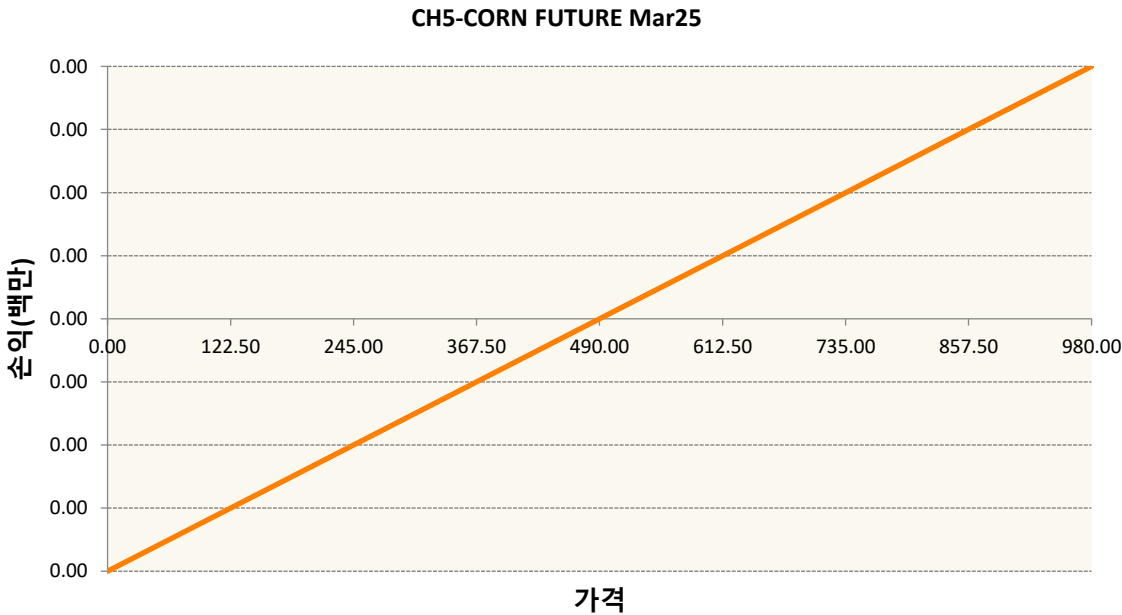
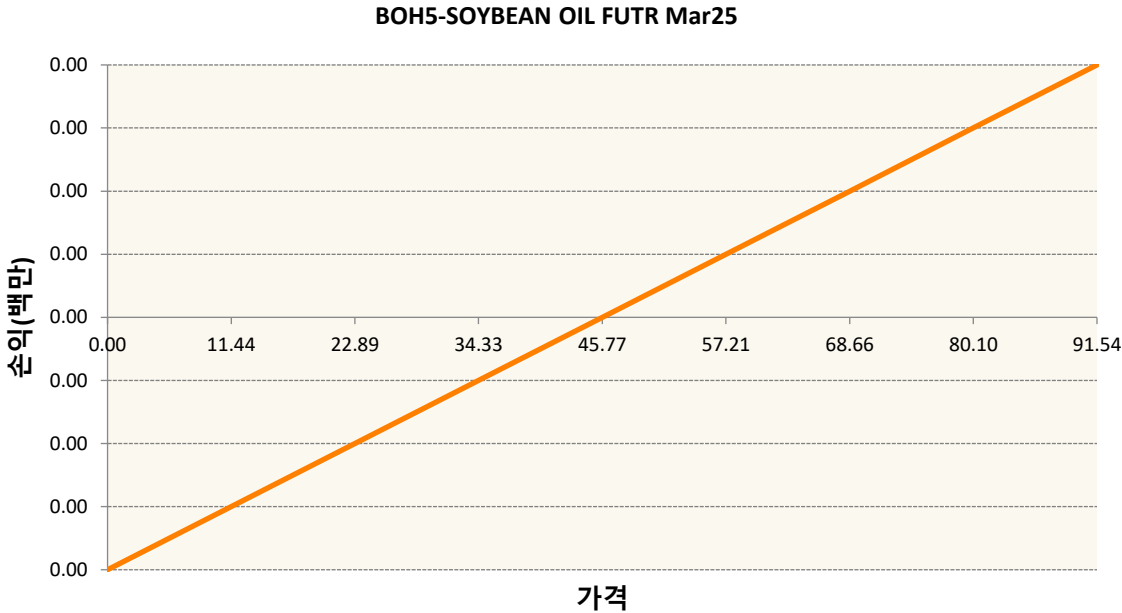
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

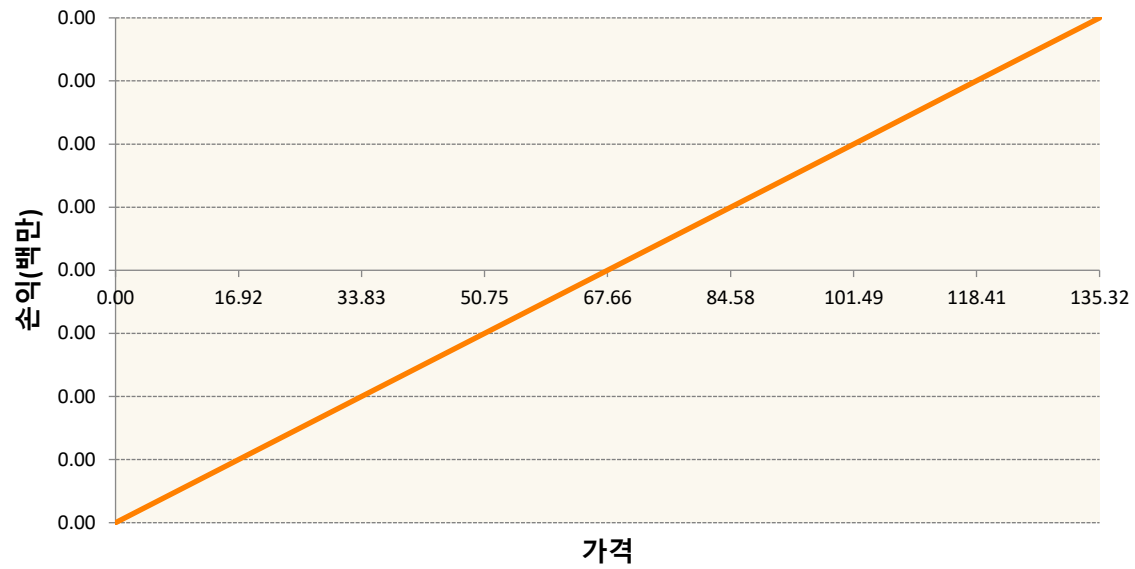
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	72	-72	장내
누계	유가증권	선물	3,919	0	3,919	
누계	통화	선물	0	488	-488	장내

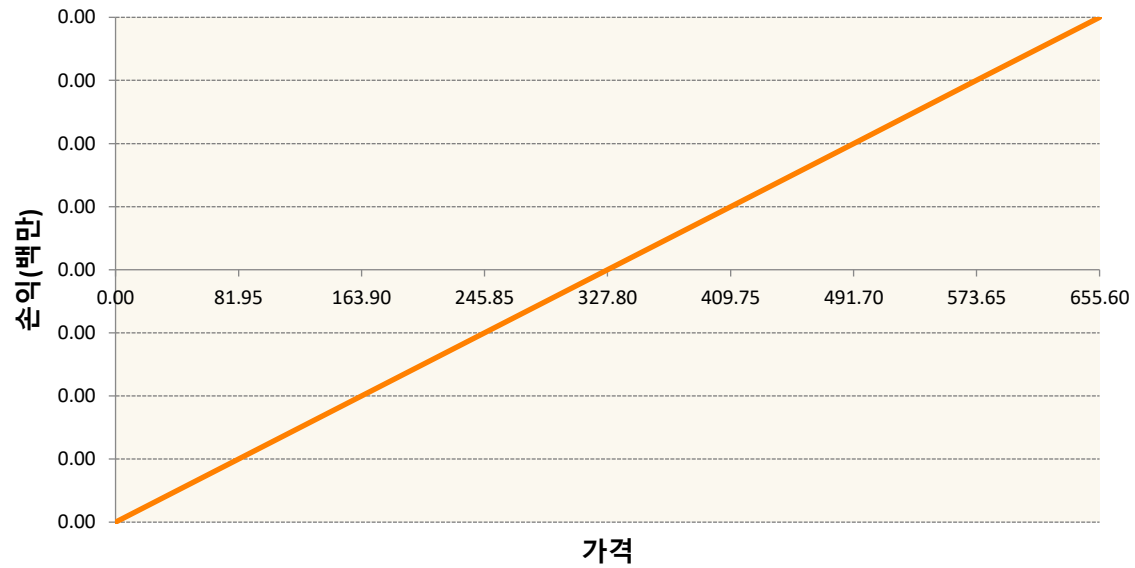
2. 만기시점의 손익구조



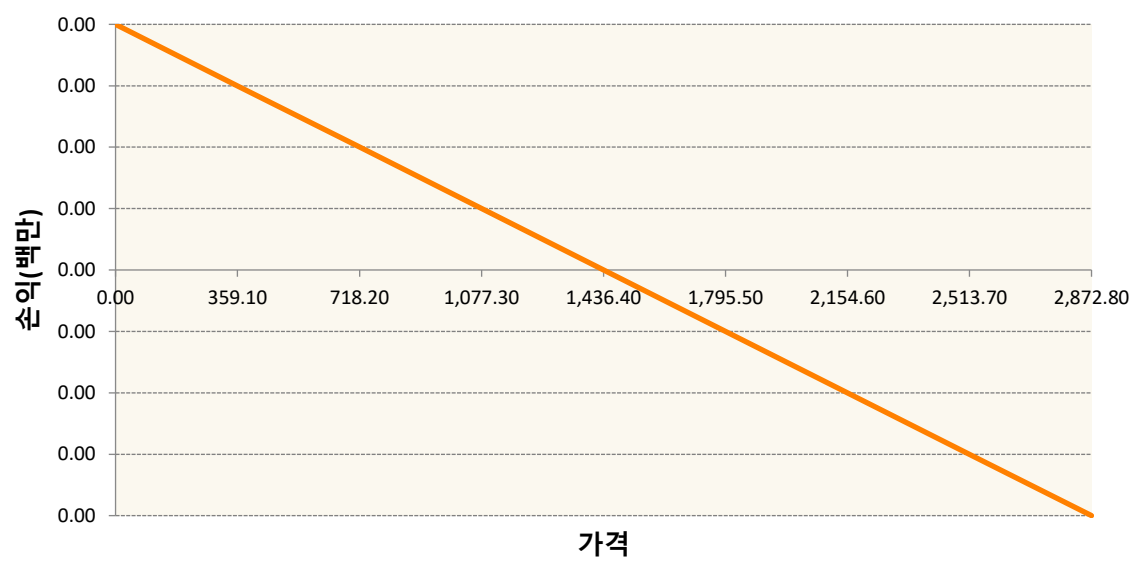
CTH5-COTTON NO.2 FUTR Mar25



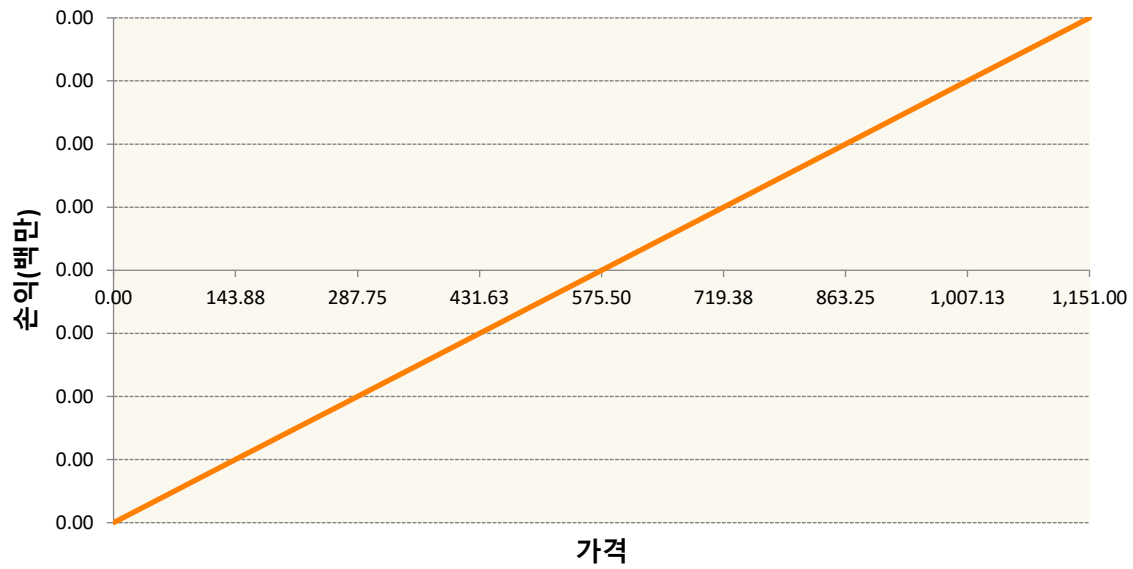
KCH5-COFFEE 'C' FUTURE Mar25



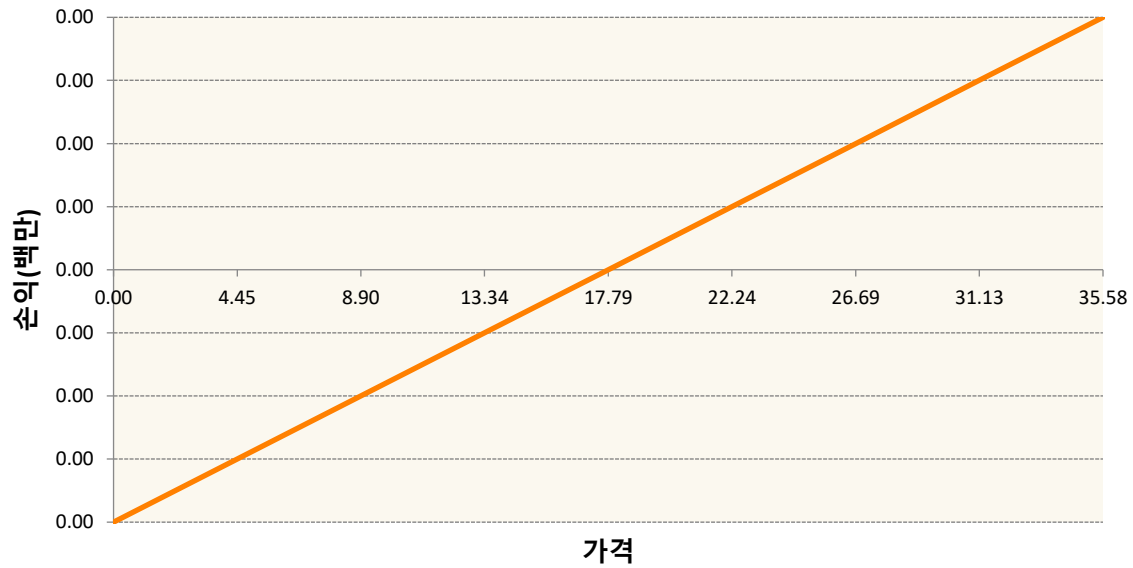
KR4175W20008-2025-02 달러선물



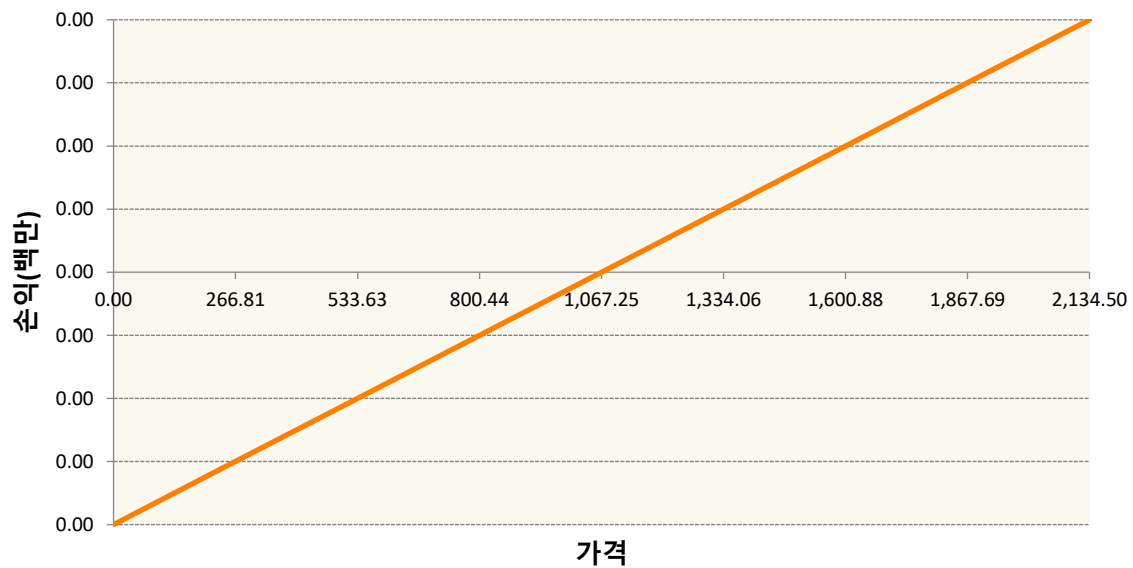
KWH5-KC HRW WHEAT FUT Mar25



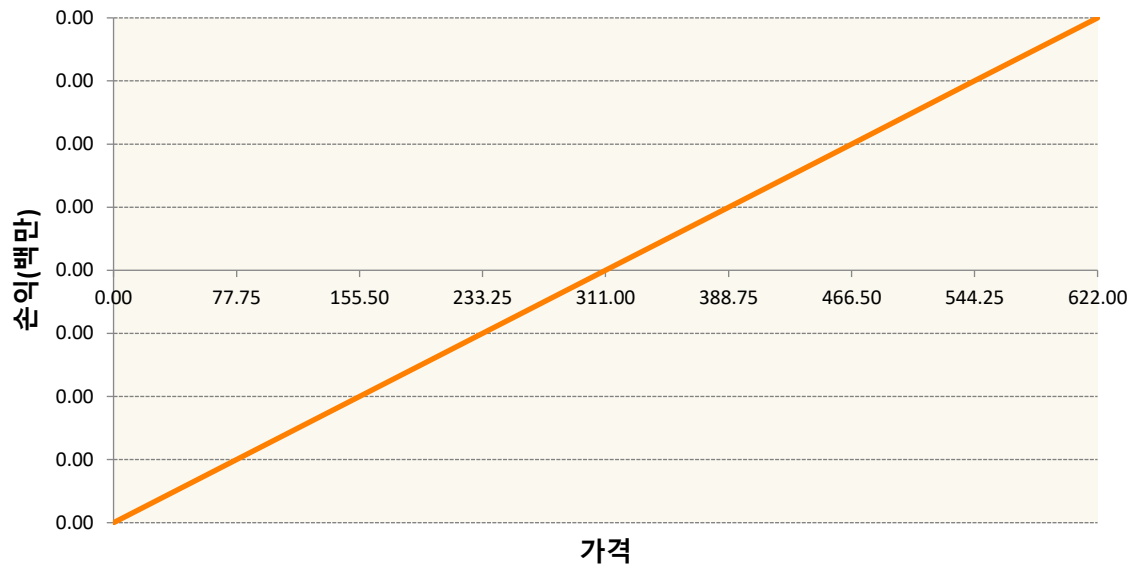
SBH5-Sugar #11 (WORLD) Mar25



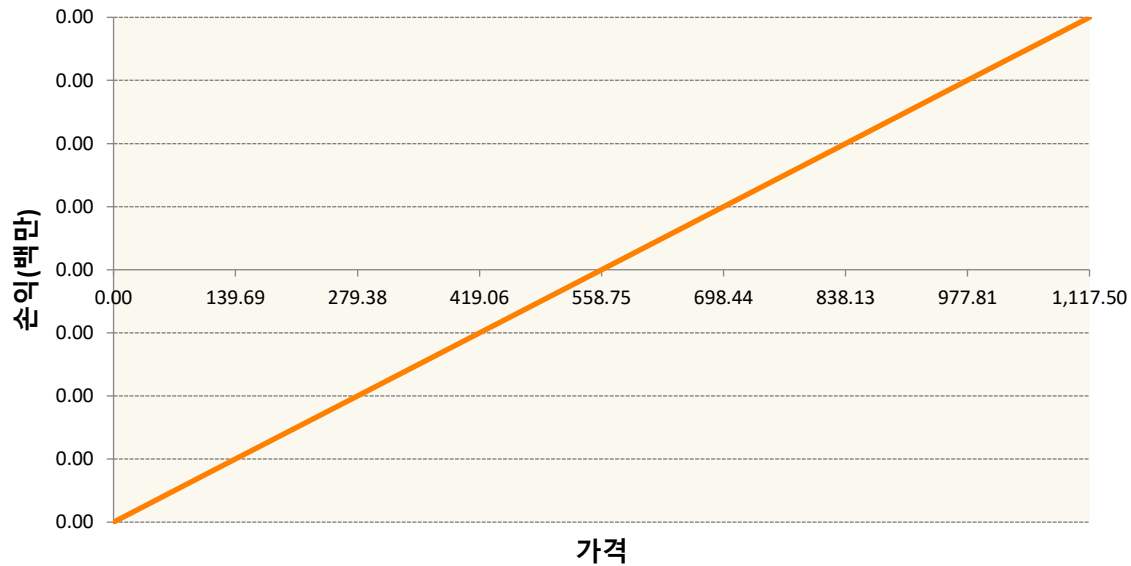
SH5-SOYBEAN FUTURE Mar25



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	2025-01-23
기준일	2025-01-22

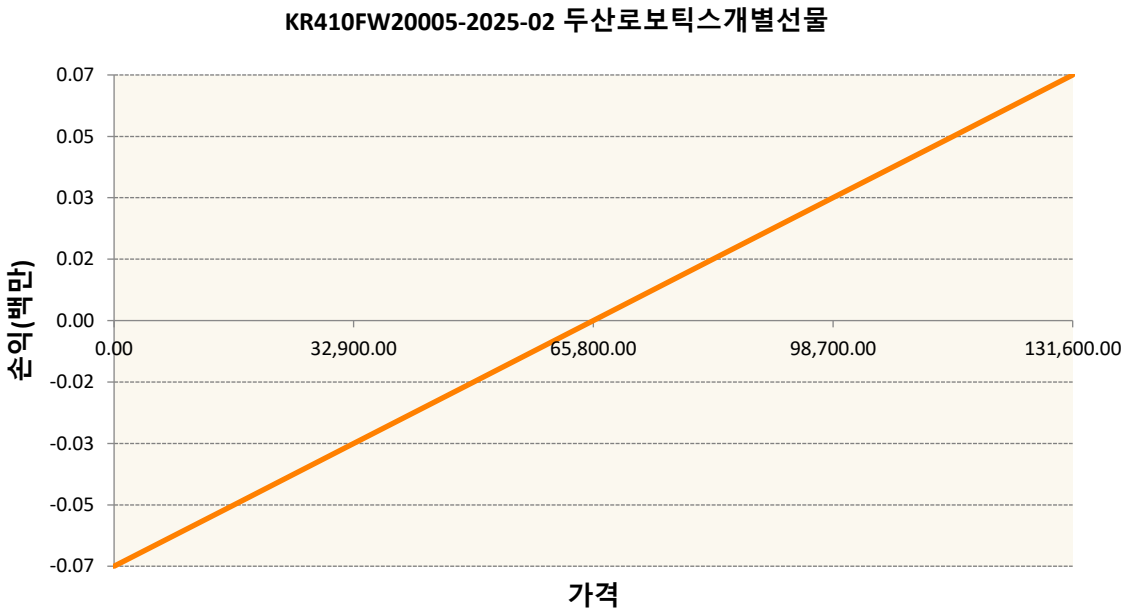
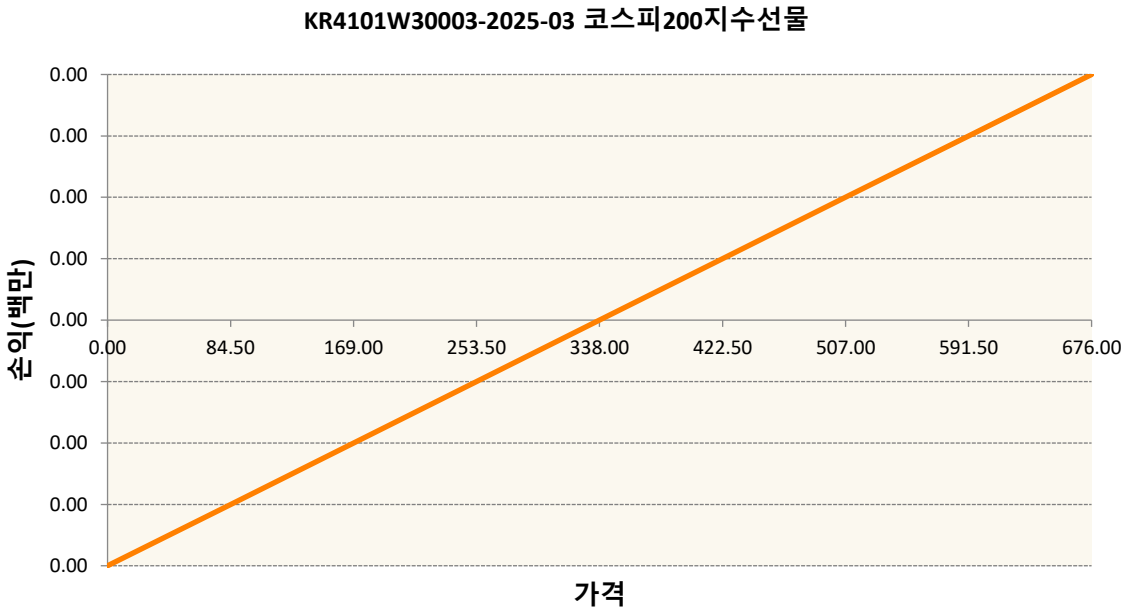
스마트인덱스모

1. 계약금액

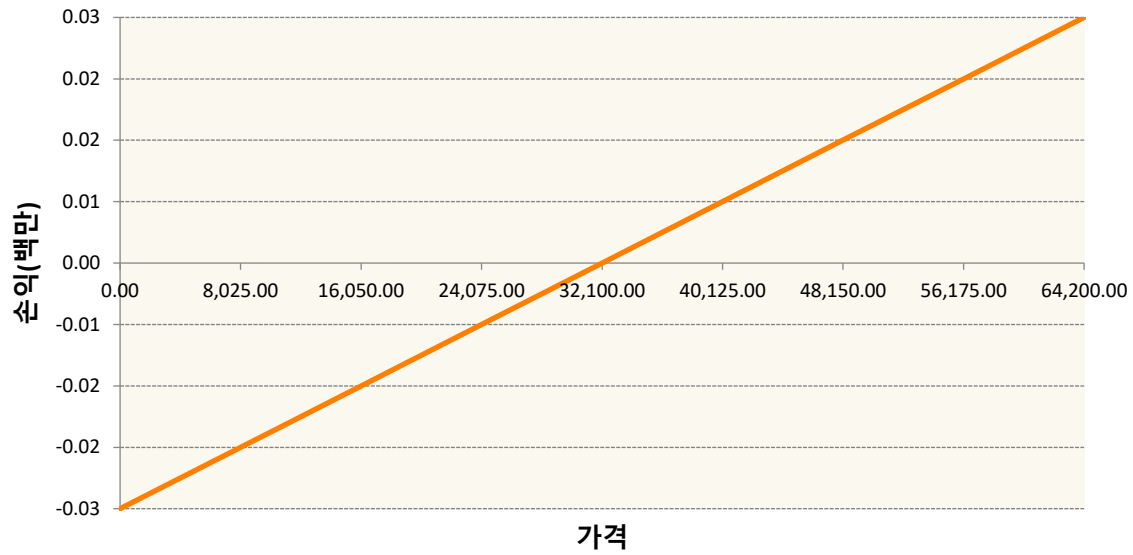
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	19	0	19	장내
누계	유가증권	선물	1,619	0	1,619	장내

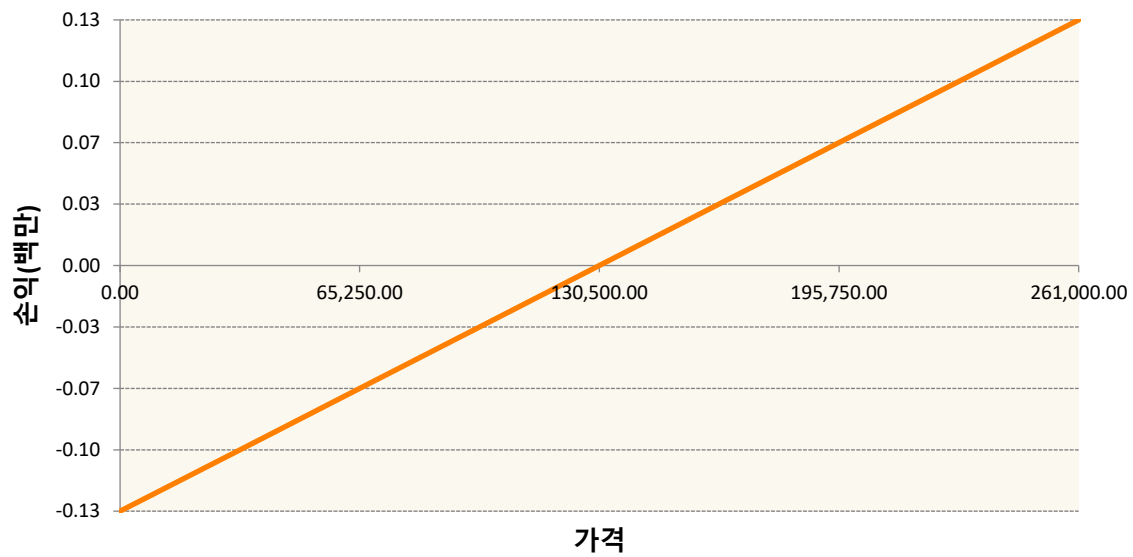
2. 만기시점의 손익구조



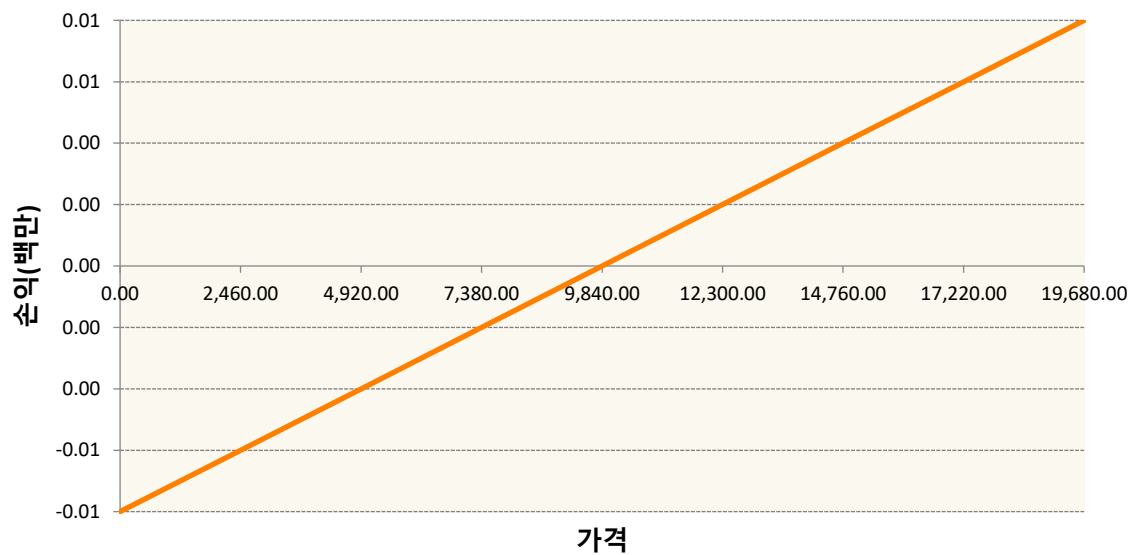
KR410SW20008-2025-02 울촌화학개별선물



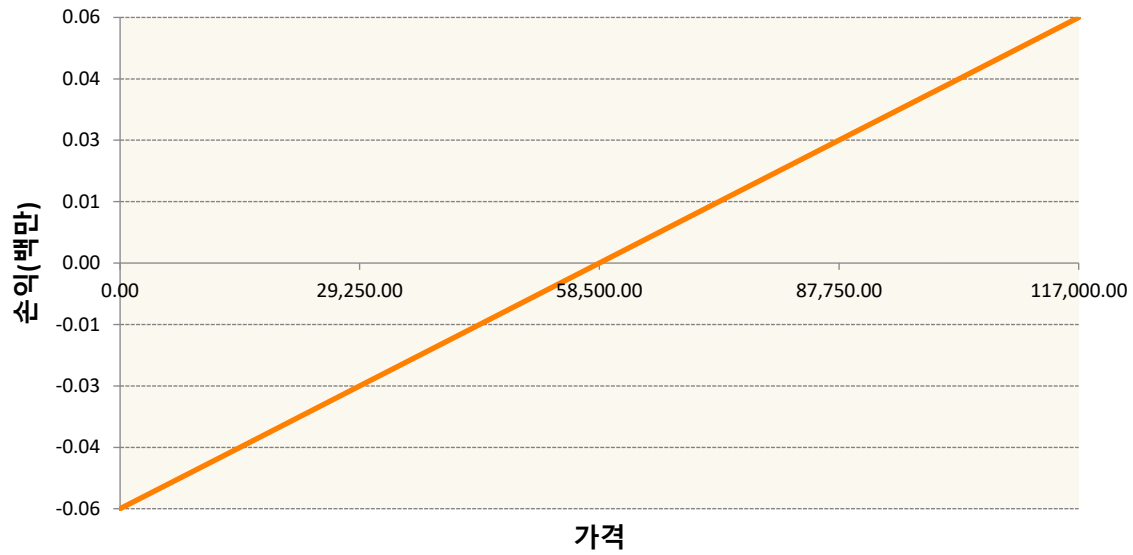
KR4123W20008-2025-02 삼성전기개별선물



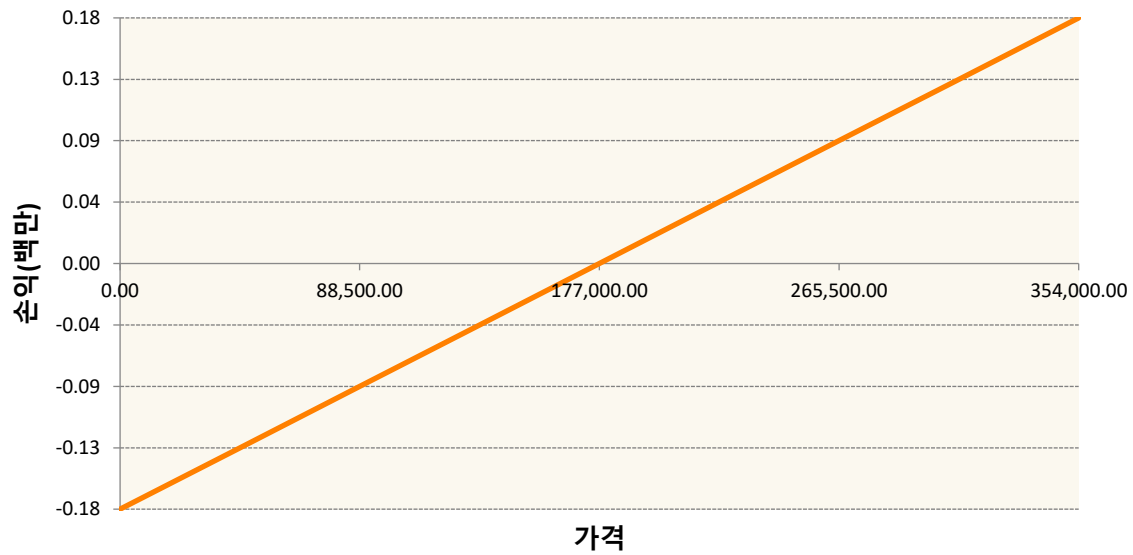
KR41B0W20004-2025-02 LG유플러스개별선물



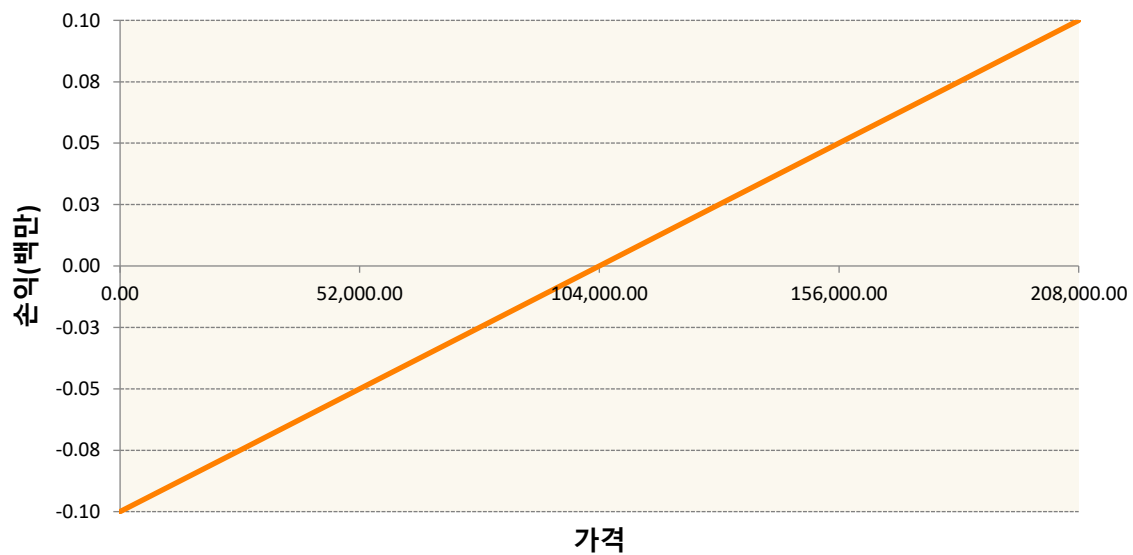
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



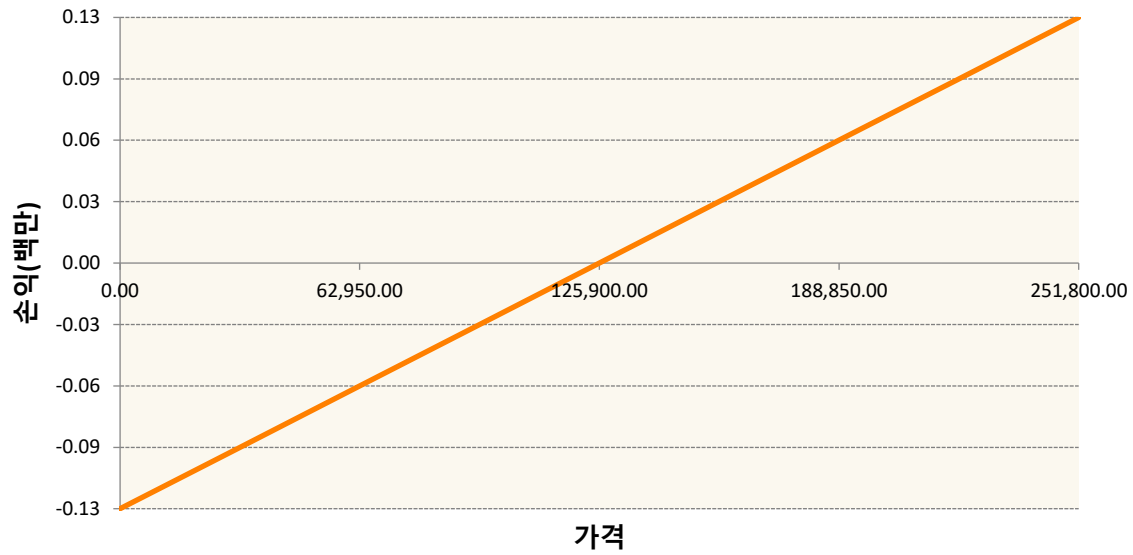
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



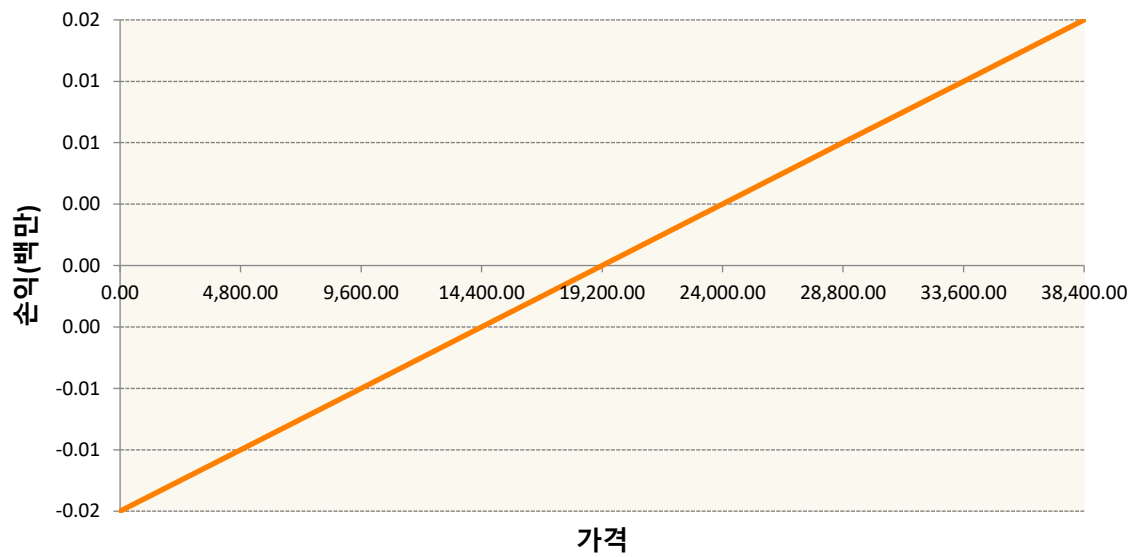
KR41C3W20007-2025-02 금호석유개별선물



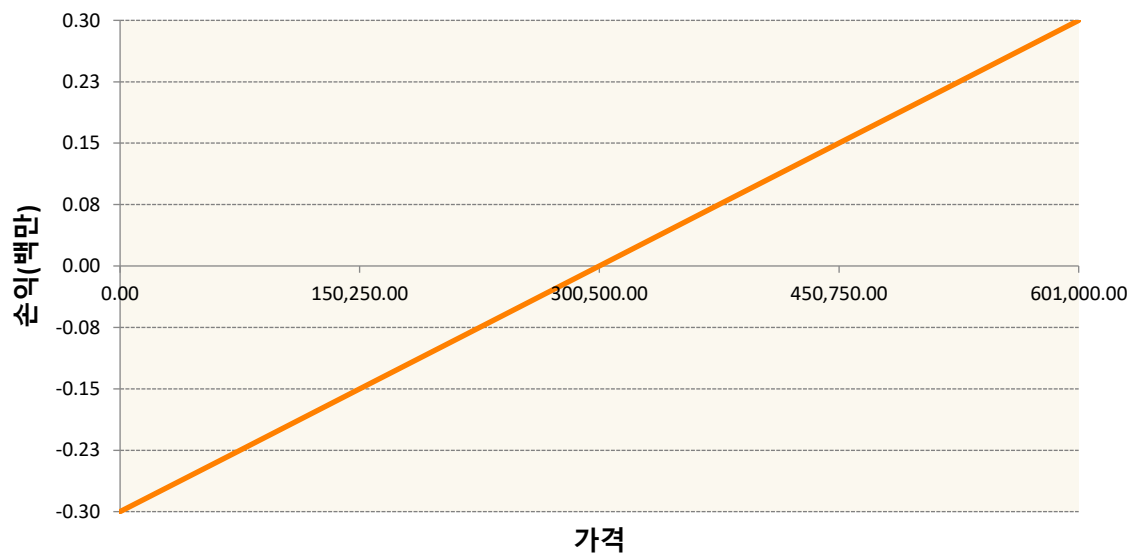
KR41C6W20000-2025-02 아모레퍼시픽개별선물



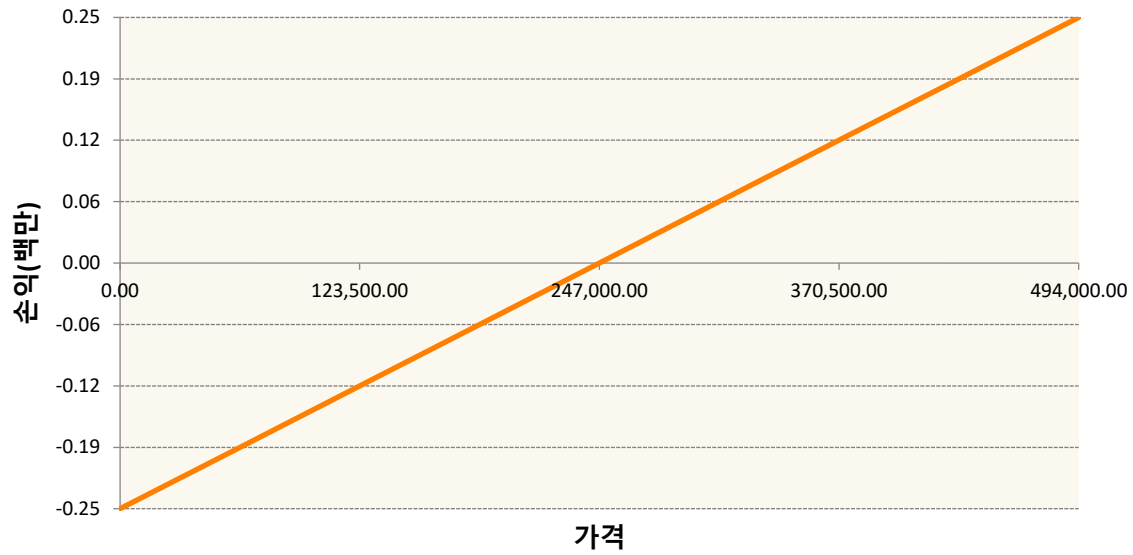
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



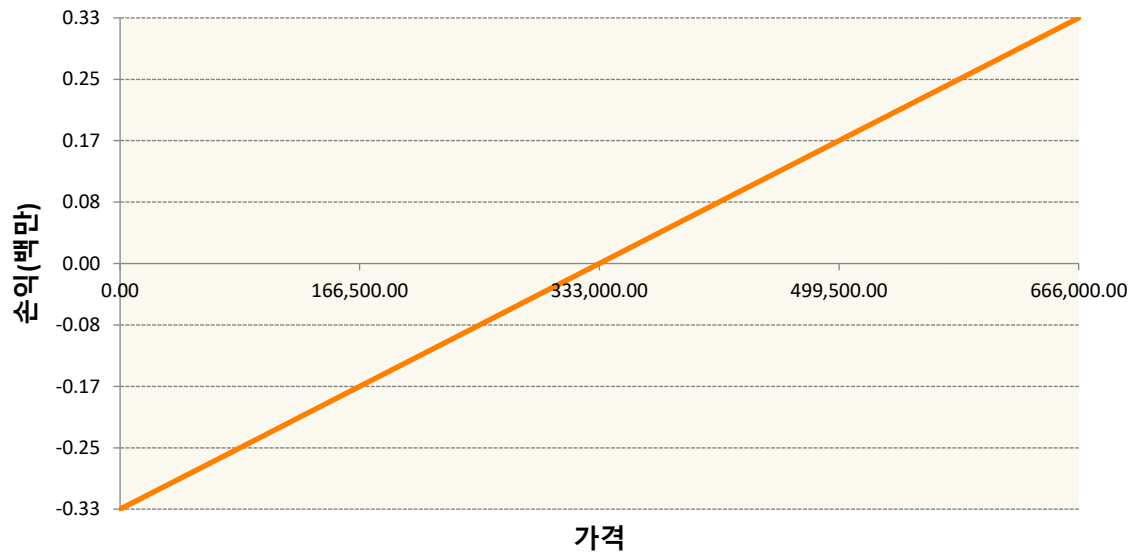
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



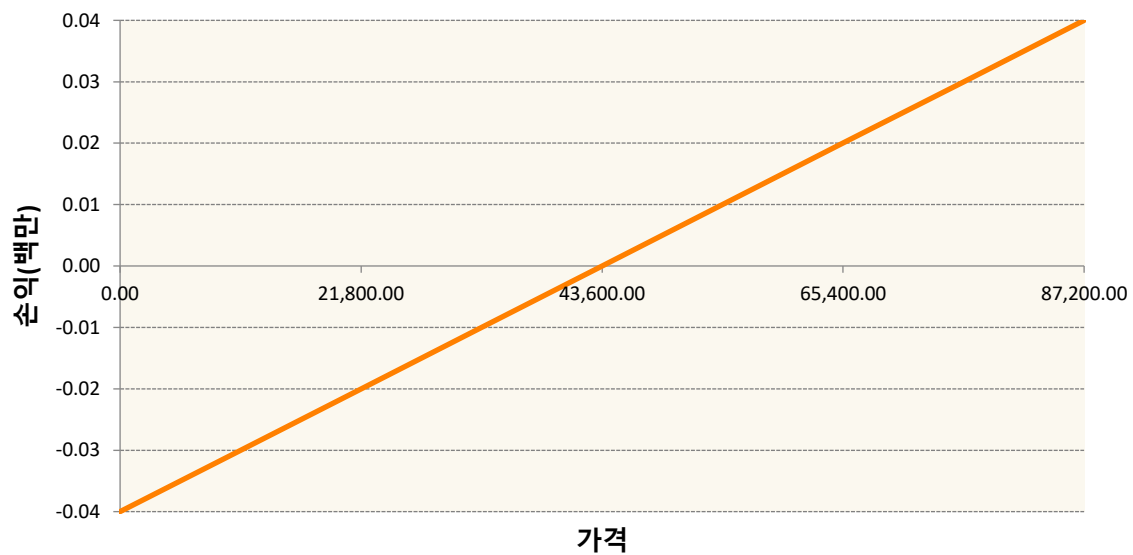
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



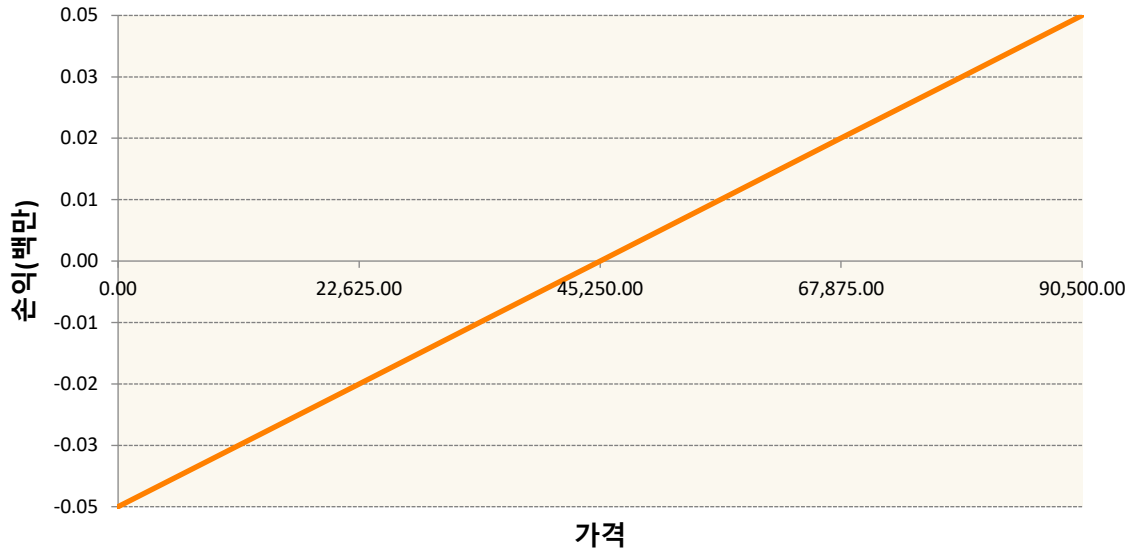
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



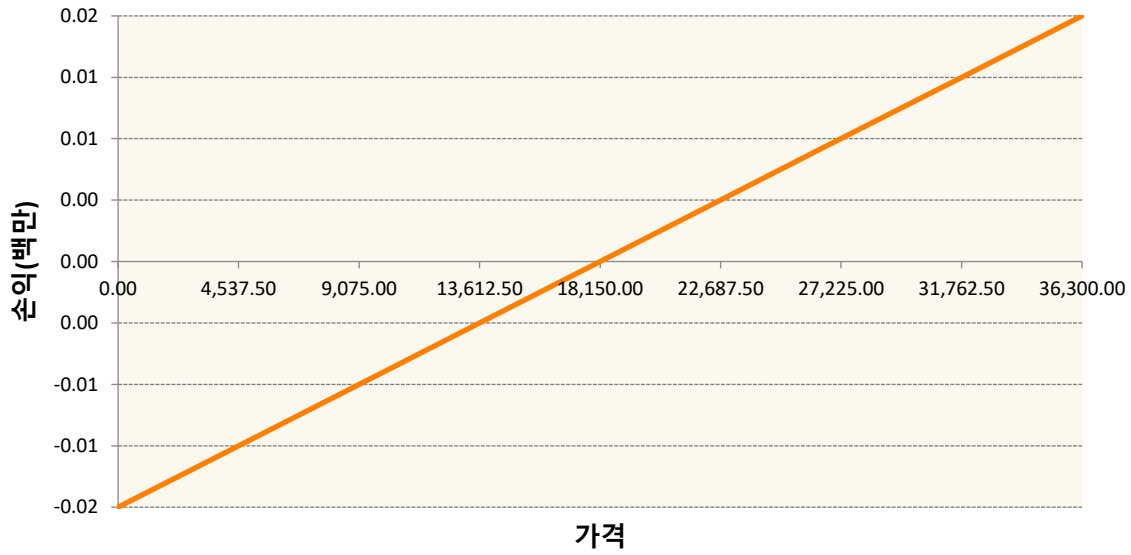
KR41DCW20004-2025-02 HL만도개별선물



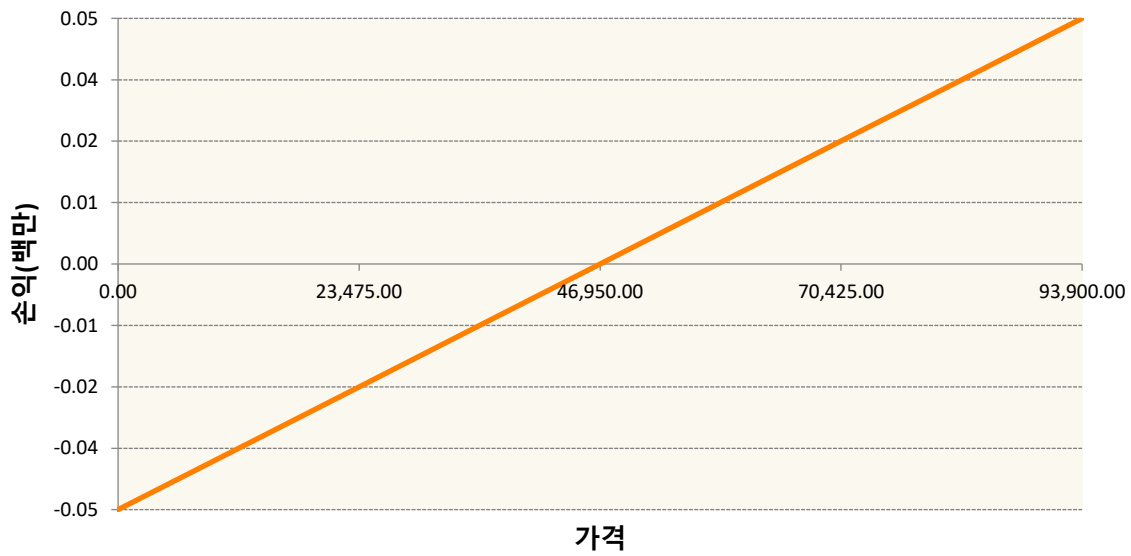
KR41E5W20000-2025-02 넷마블개별선물



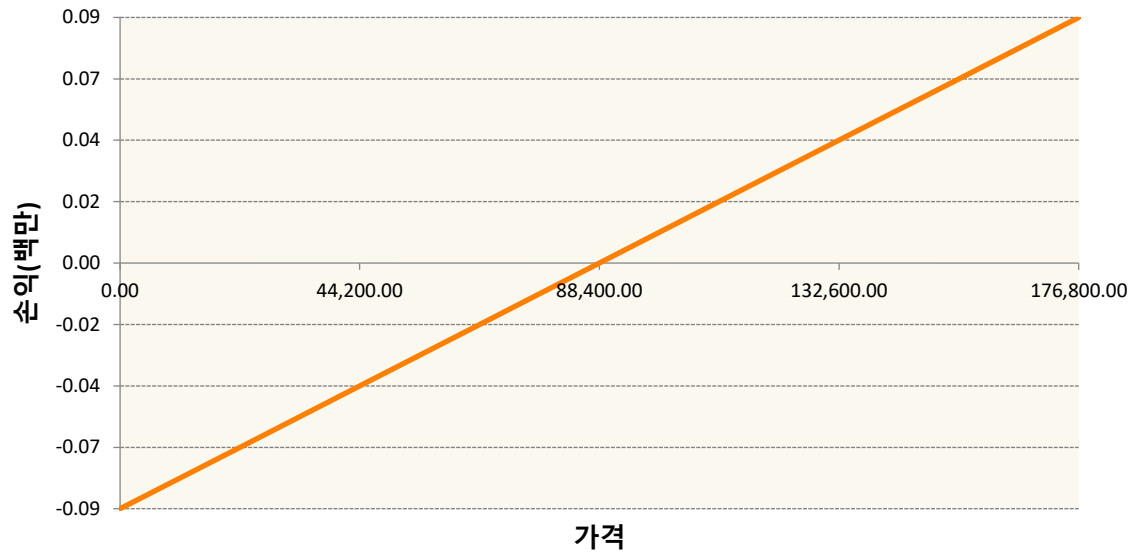
KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



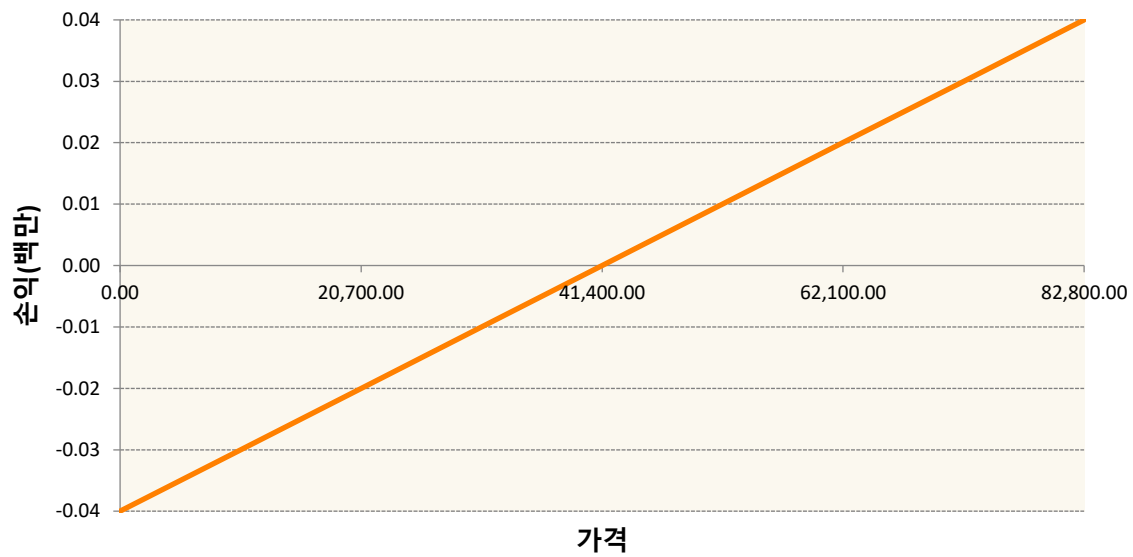
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



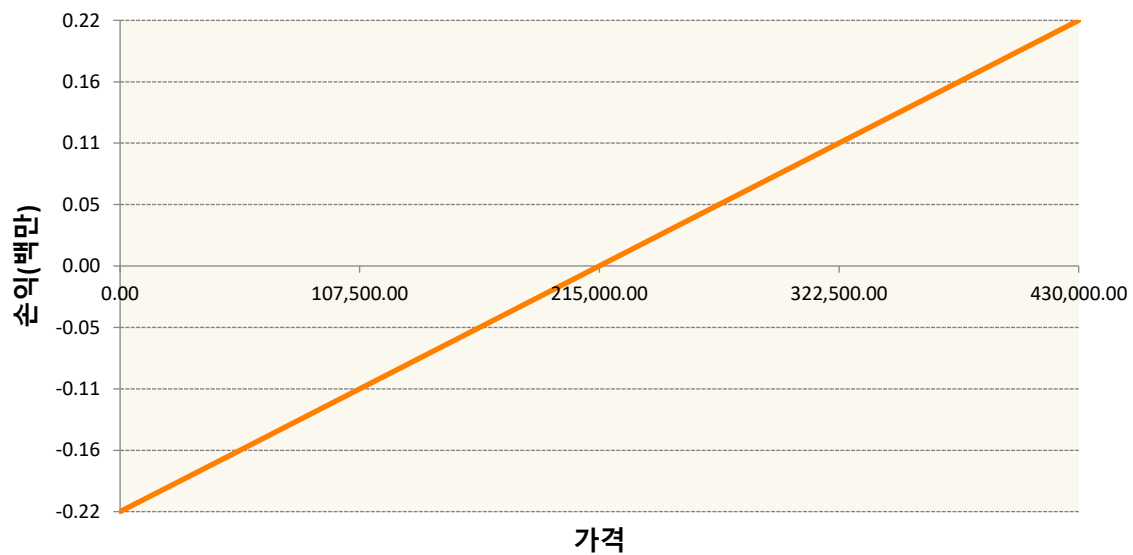
KR41FMW20008-2025-02 엘앤티에프개별선물



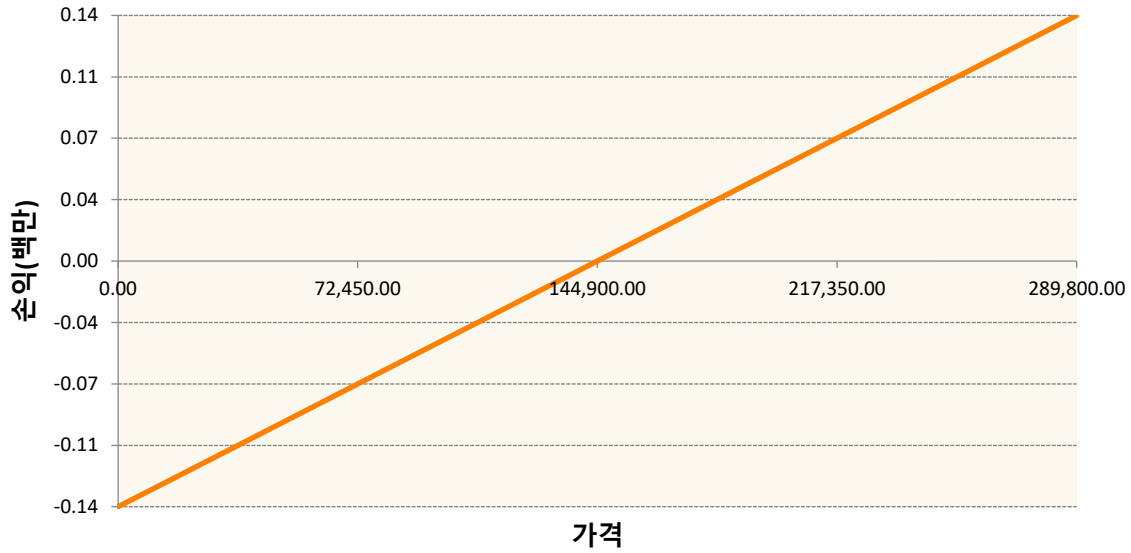
KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



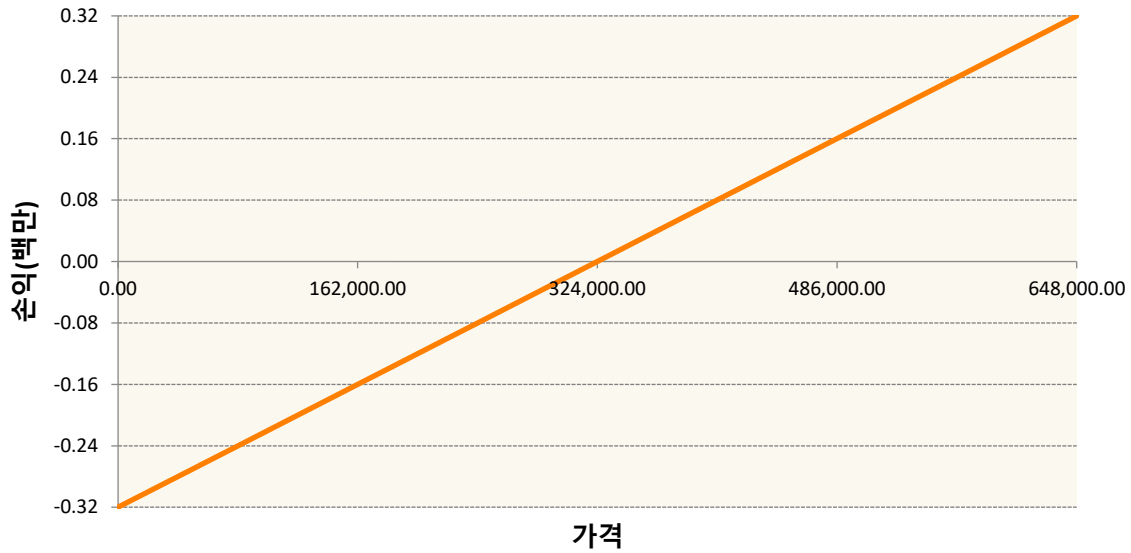
KR41GLW20008-2025-02 LS ELECTRIC개별선물



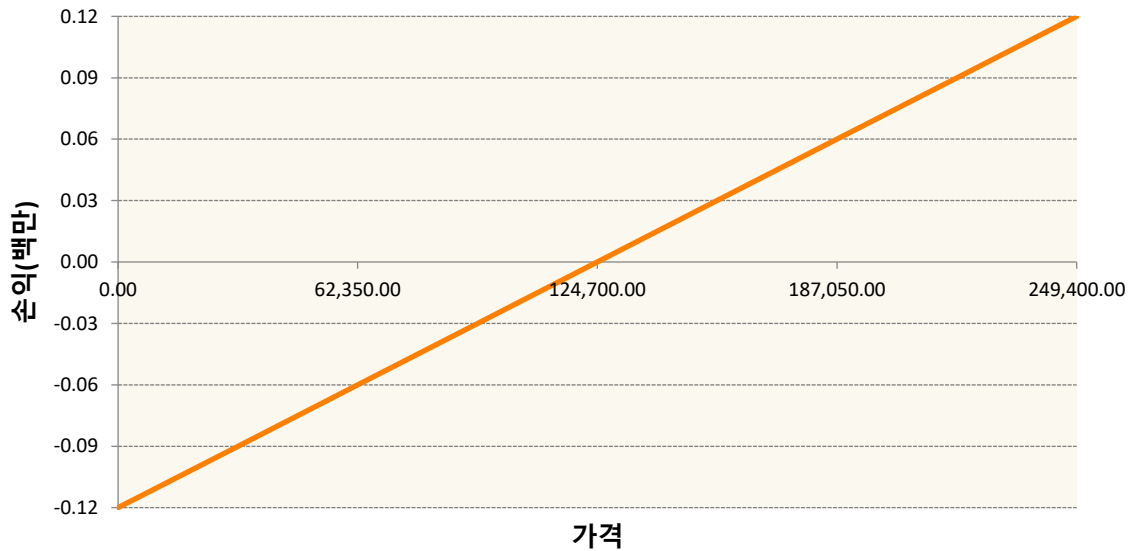
KR41GQW20007-2025-02 녹십자개별선물



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	0.39
KR4123W20(2025-02 삼성전기개별선물	9
KR41B0W20(2025-02 LG유플러스개별선물	3
KR41BBW20(2025-02 롯데케미칼개별선물	1
KR41BJW20C 2025-02 엔씨소프트개별선물	4
KR41C3W20(2025-02 금호석유개별선물	2
KR41C6W20(2025-02 아모레퍼시픽개별선물	5
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
KR41E5W20(2025-02 넷마블개별선물	2
KR41ETW20(2025-02 삼성E&A개별선물	3
KR41F9W20(2025-02 SK바이오사이언스개별선물	1
KR41FMW20 2025-02 엘앤에프개별선물	3
KR41G0W20 2025-02 씨에스윈드개별선물	1
KR41GLW20(2025-02 LS ELECTRIC개별선물	4
KR41GQW2C 2025-02 녹십자개별선물	1
KR41GTW20(2025-02 두산개별선물	3
KR41HEW20(2025-02 키움증권개별선물	2

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

226

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

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

288

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

488

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

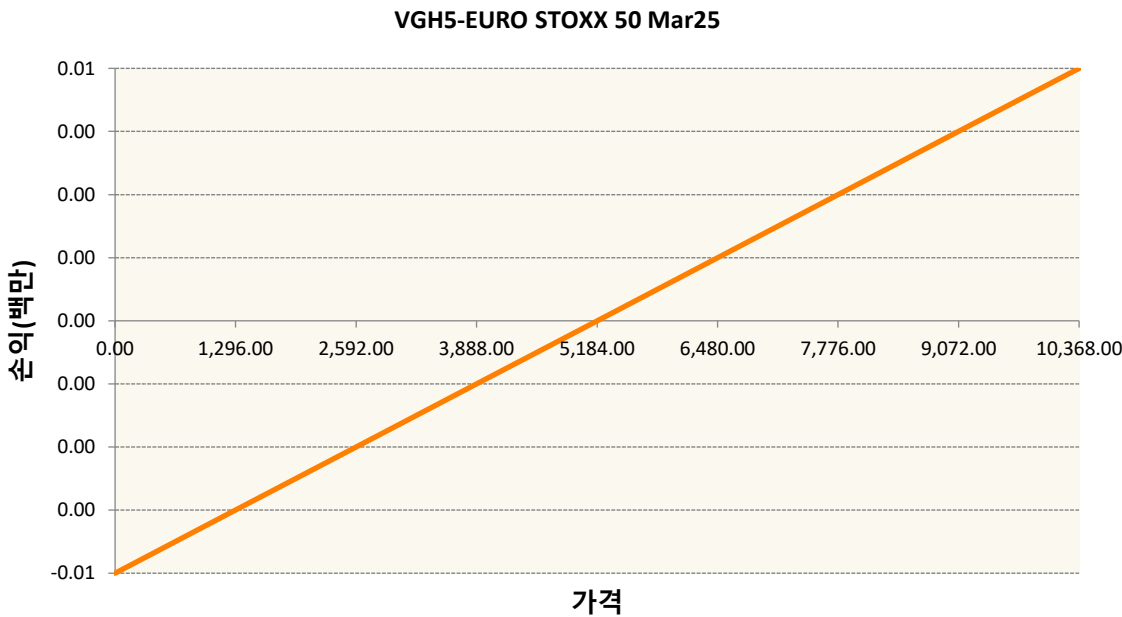
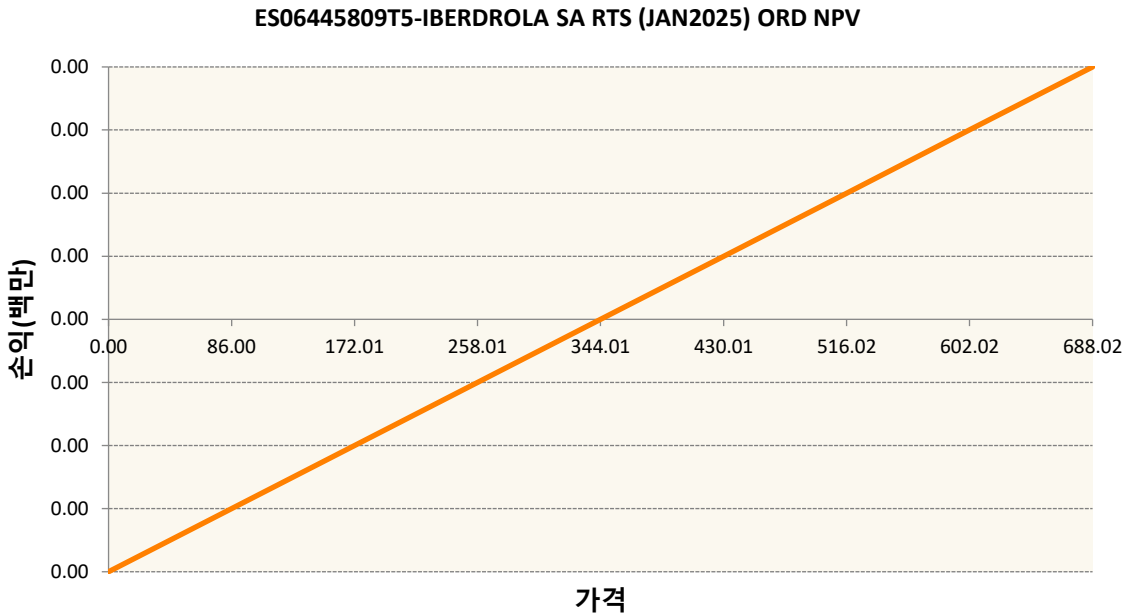
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	939	0	939	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ES06445809`IBERDROLA SA RTS (JAN2025) ORD NPV		0.11
VGH5 EURO STOXX 50 Mar25		75

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	50

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

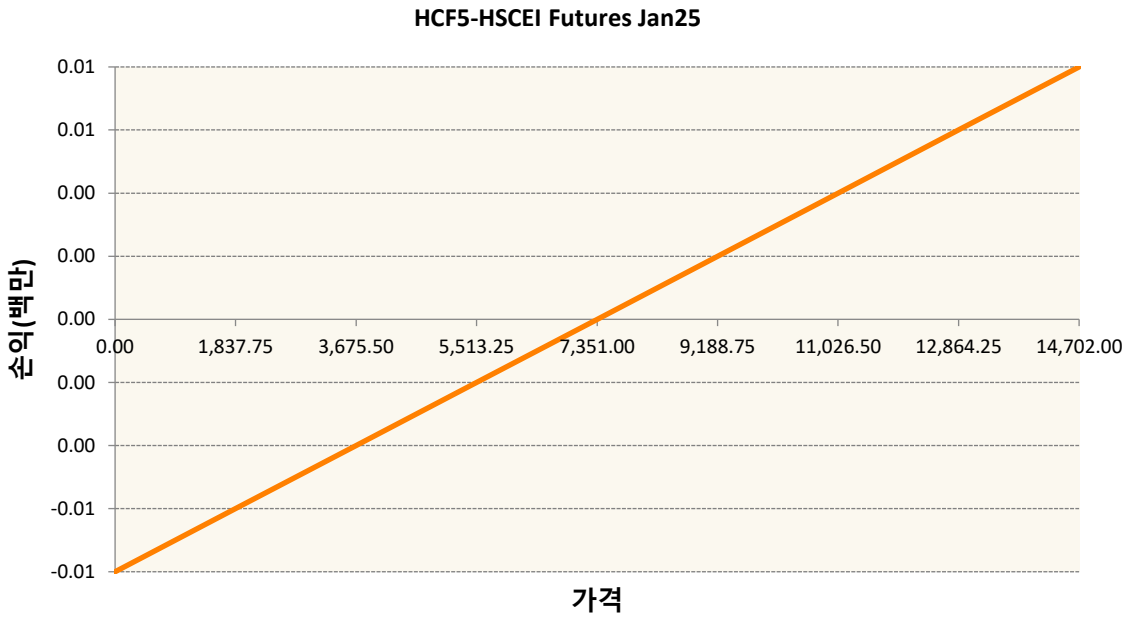
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,516	0	1,516	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF5	HSCEI Futures Jan25	121
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

162

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

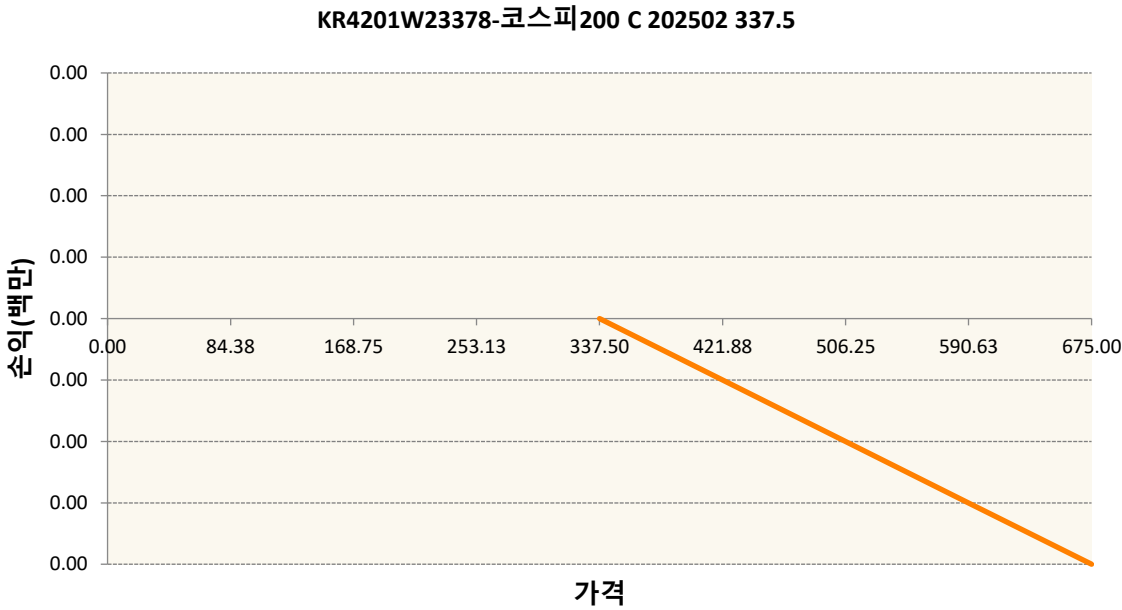
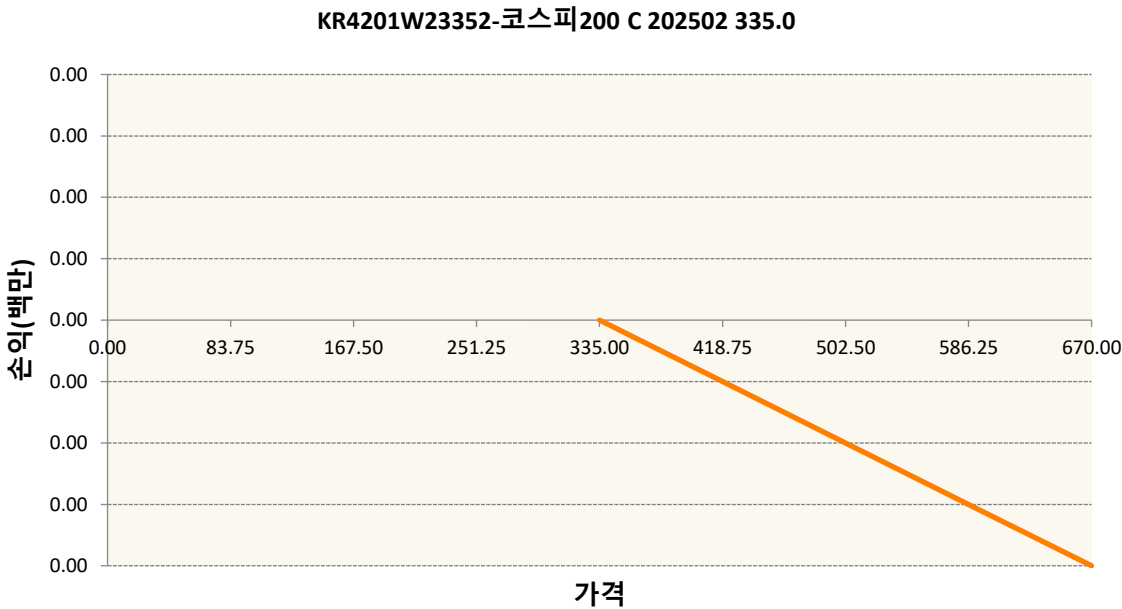
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

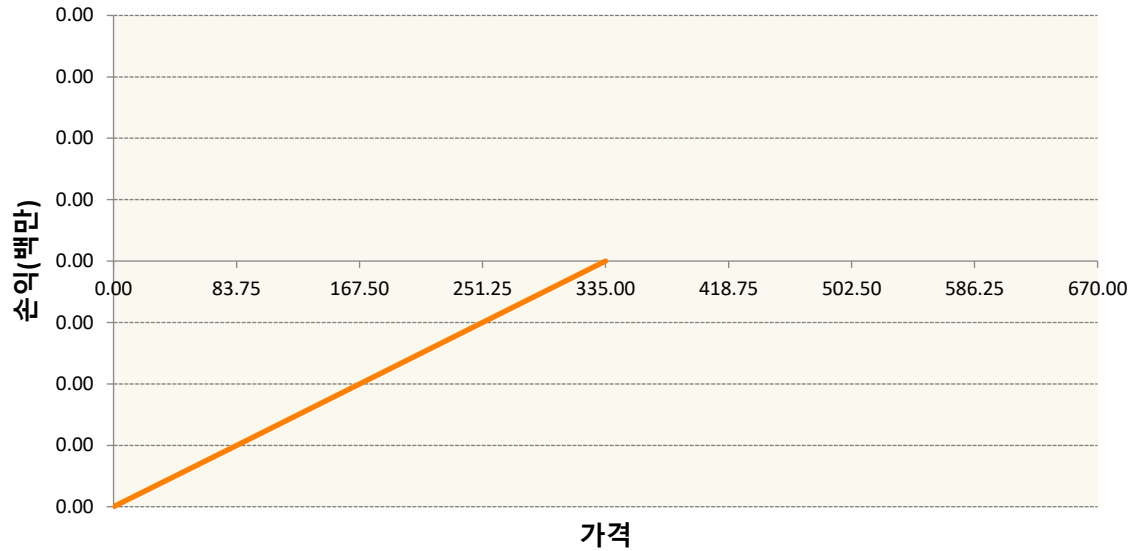
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	331	0	331	장내
누계	유가증권	옵션	0	38,069	-38,069	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301W23350-코스피200 P 202502 335.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201W23352 코스피200 C 202502 335.0							1,682
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	720	707	689	669	646	620	592
-5.33%	652	621	588	553	516	478	439
-2.67%	475	430	384	337	291	244	197
0%	143	95	48	0	-48	-96	-144
2.67%	-344	-379	-417	-456	-497	-538	-581
5.33%	-939	-958	-981	-1,007	-1,036	-1,067	-1,100
8.00%	-1,588	-1,596	-1,607	-1,621	-1,639	-1,659	-1,682
KR4201W23378 코스피200 C 202502 337.5							400
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	155	152	148	144	139	134	128
-5.33%	142	136	128	121	112	104	95
-2.67%	107	97	86	75	64	52	41
0%	36	24	12	0	-12	-24	-36
2.67%	-74	-84	-94	-105	-115	-126	-138
5.33%	-214	-220	-227	-235	-243	-251	-260
8.00%	-372	-374	-378	-382	-387	-393	-400
KR4301W23350 코스피200 P 202502 335.0							383
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-349	-353	-358	-363	-369	-376	-383
-5.33%	-187	-195	-204	-213	-223	-233	-244
-2.67%	-54	-66	-78	-91	-103	-115	-128
0%	38	25	13	0	-13	-26	-38

2.67%	89	79	69	59	48	37	25
5.33%	111	105	99	92	85	76	67
8.00%	118	116	113	109	104	99	93

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

(단위:백만원)

2,491

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

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	2025-01-23
기준일	2025-01-22

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	2025-01-23
기준일	2025-01-22

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	13,082	-13,082	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213EAW KRW/USD 31-01-25E	213
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E	558
FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E	256
FXW213F17C KRW/USD 31-01-25E	20
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

437

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

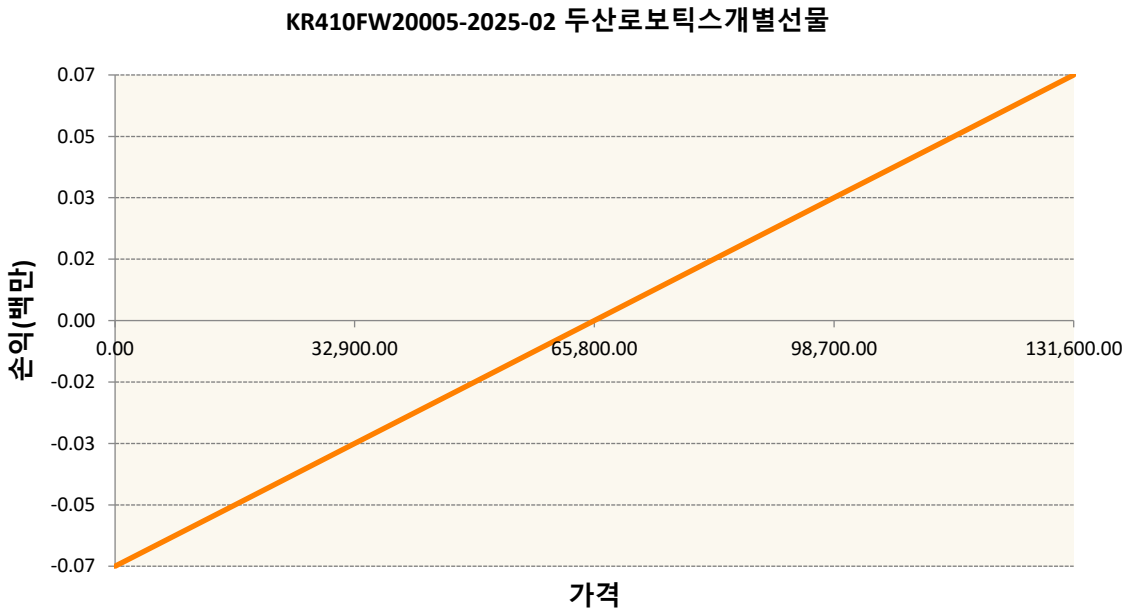
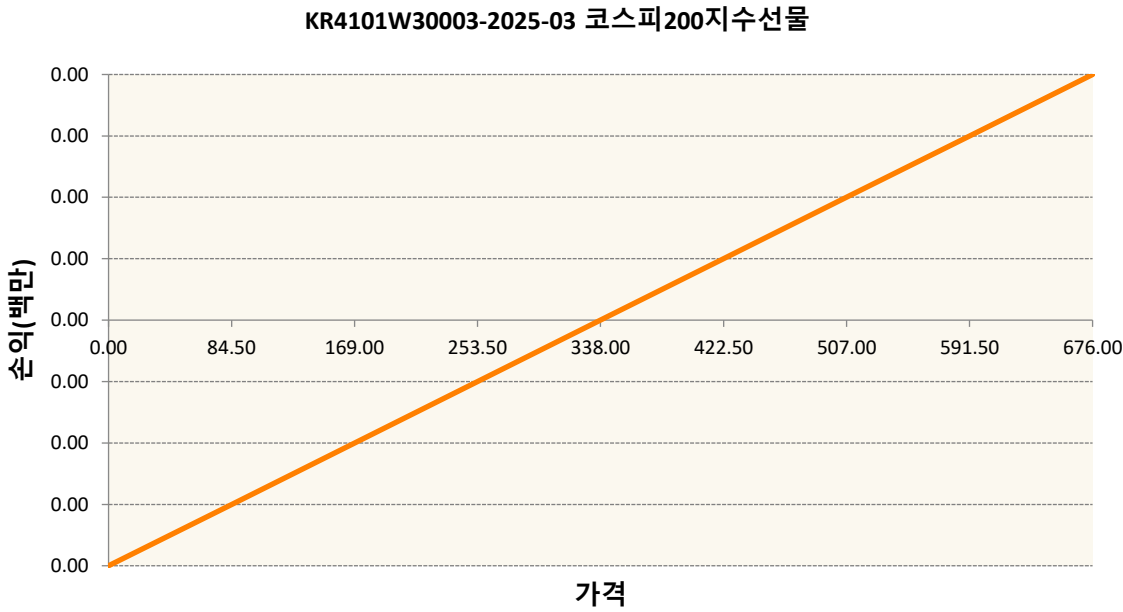
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

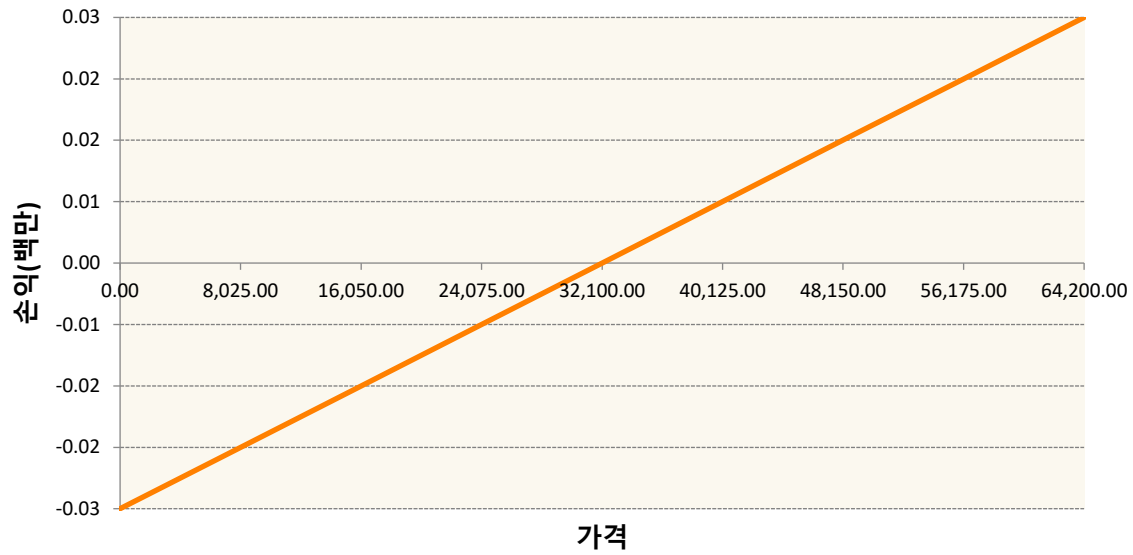
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	77	0	77	장내
누계	유가증권	선물	1,155	0	1,155	장내

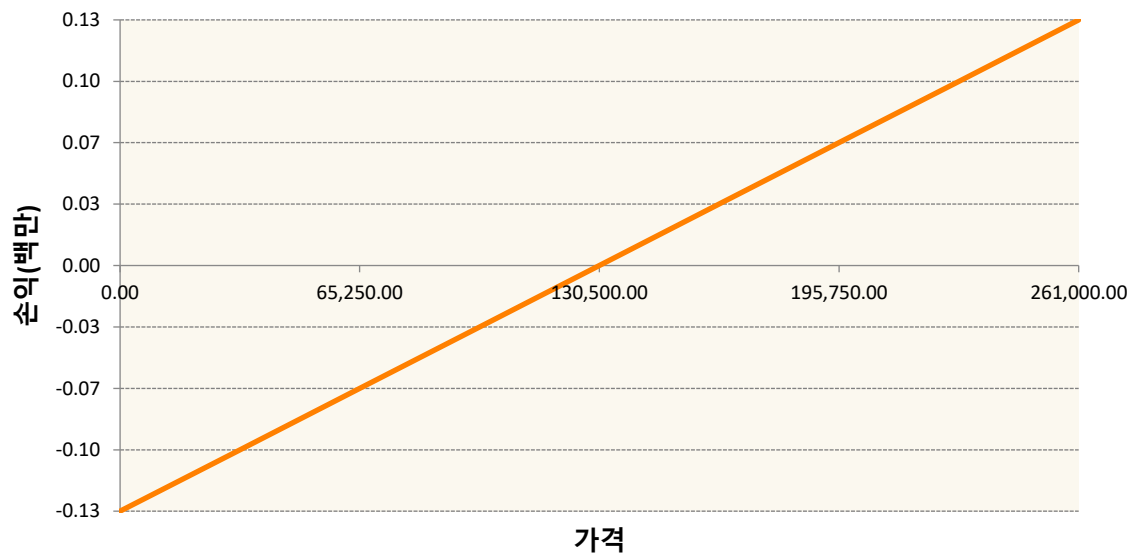
2. 만기시점의 손익구조



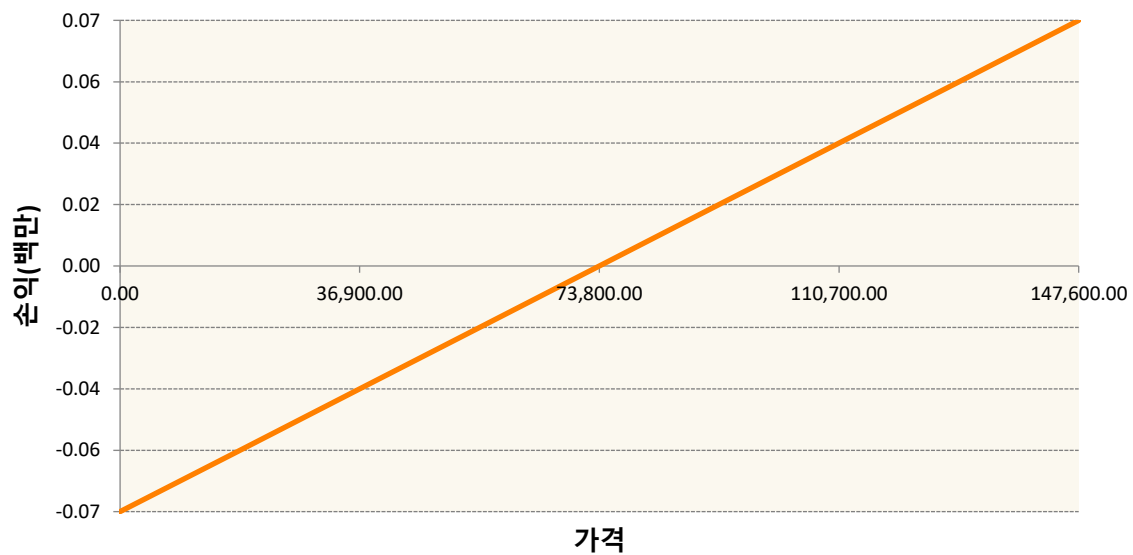
KR410SW20008-2025-02 울촌화학개별선물



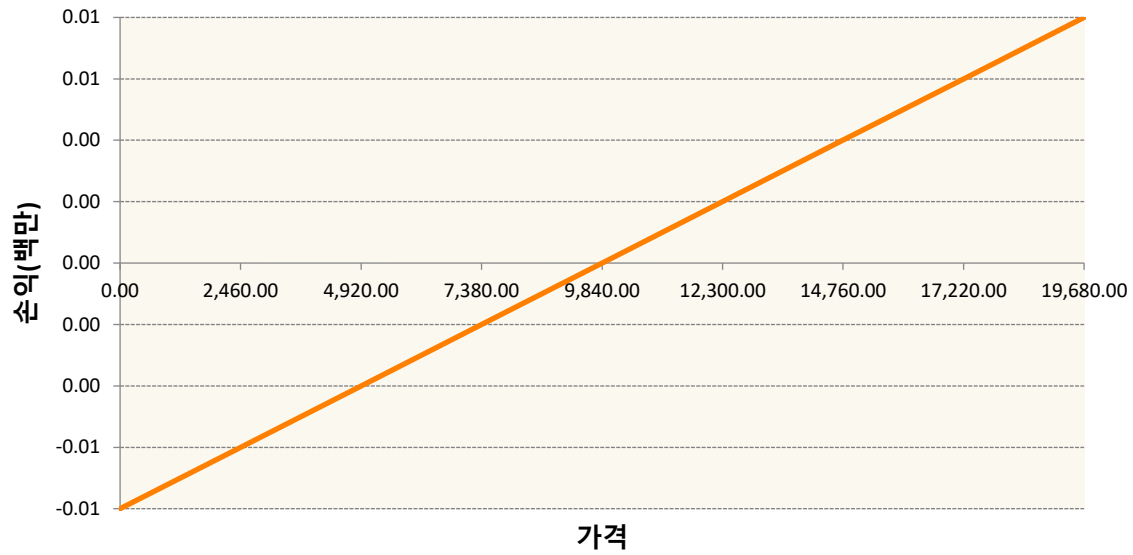
KR4123W20008-2025-02 삼성전기개별선물



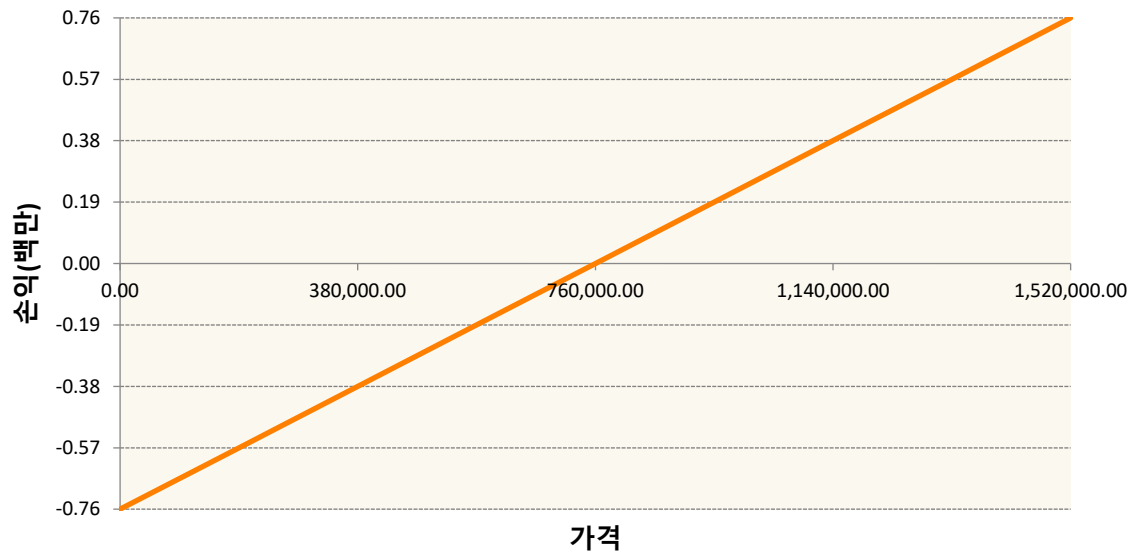
KR4134W20005-2025-02 LG개별선물



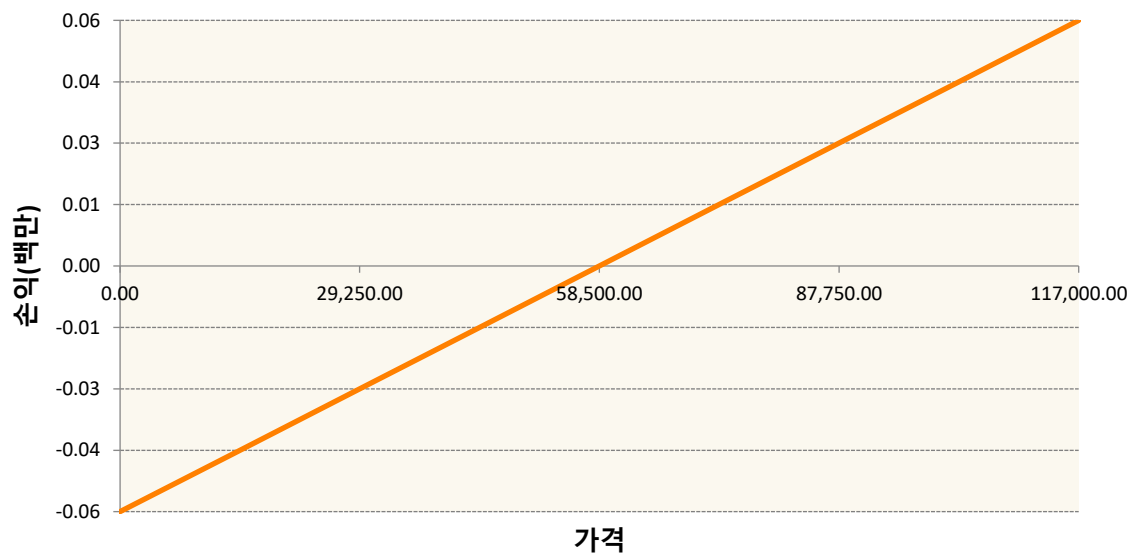
KR41B0W20004-2025-02 LG유플러스개별선물



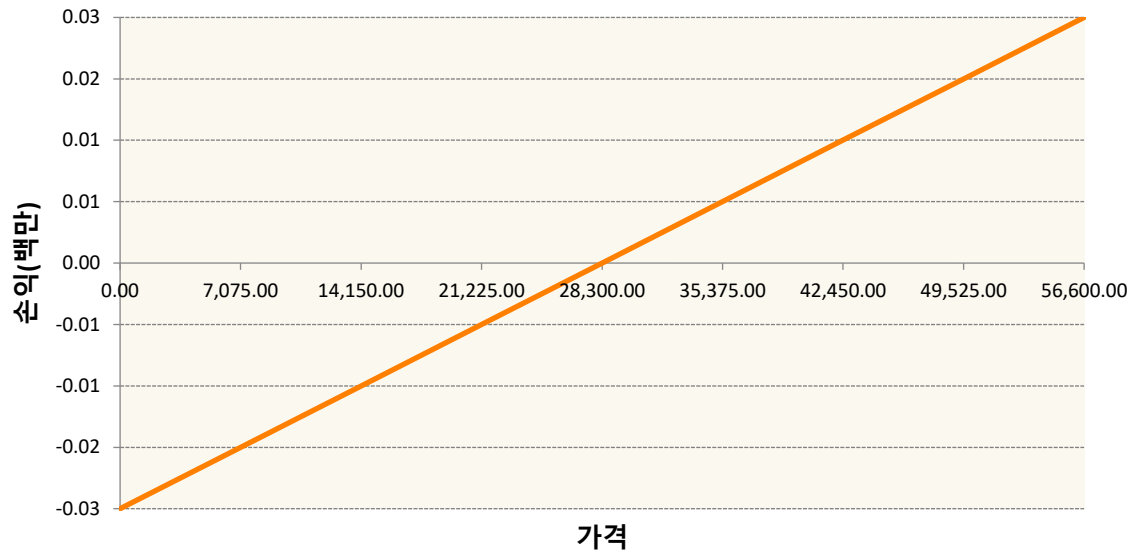
KR41B3W20008-2025-02 고려아연개별선물



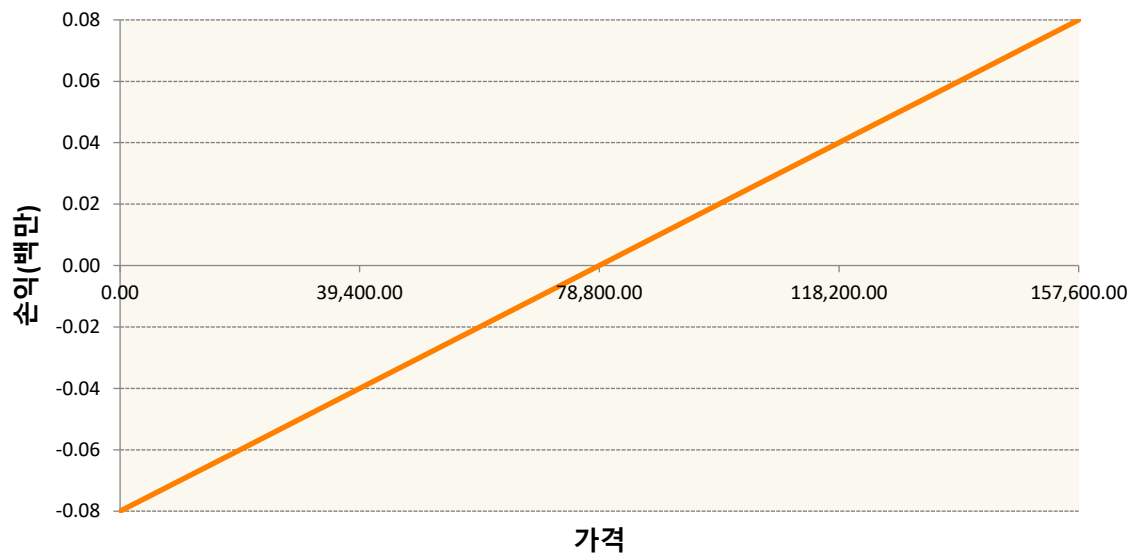
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



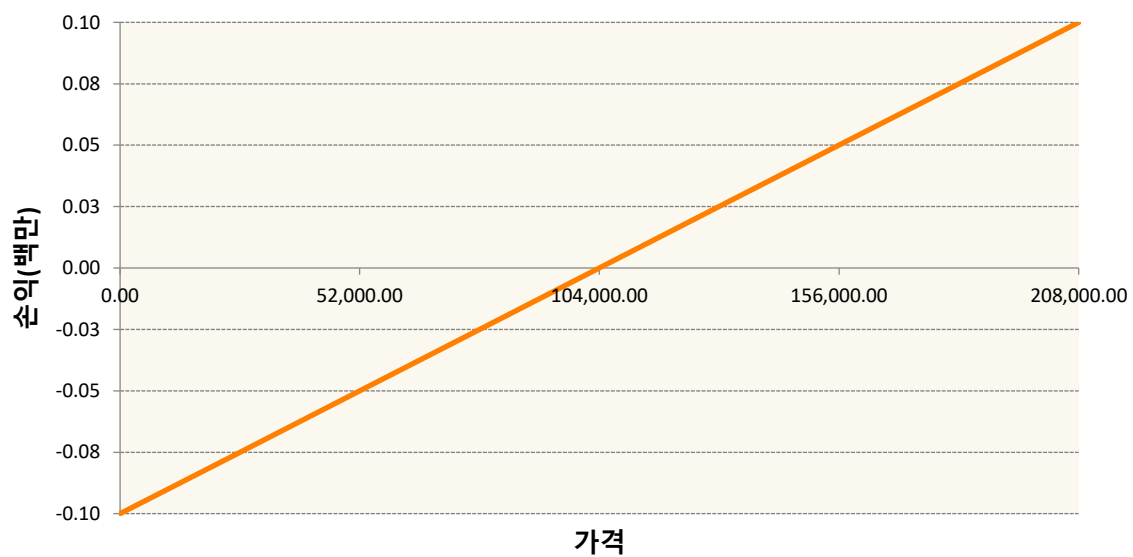
KR41BNW20005-2025-02 현대건설개별선물



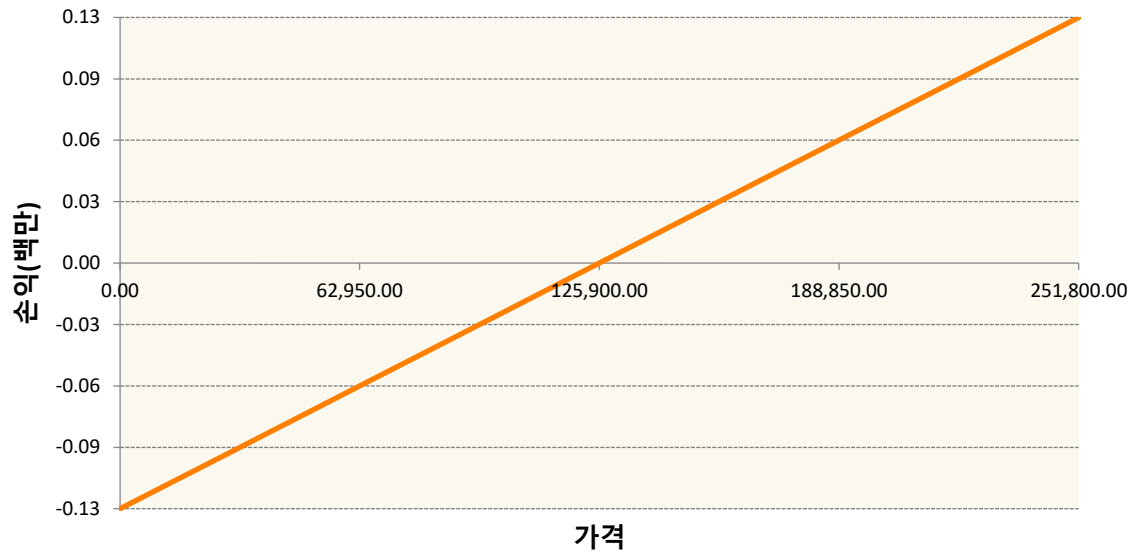
KR41C0W20003-2025-02 OCI홀딩스개별선물



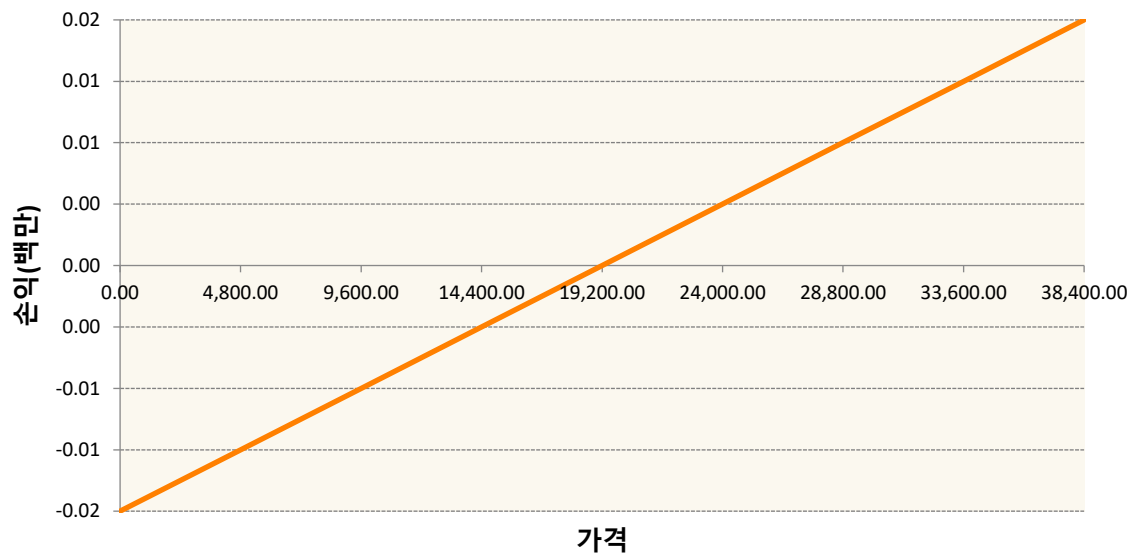
KR41C3W20007-2025-02 금호석유개별선물



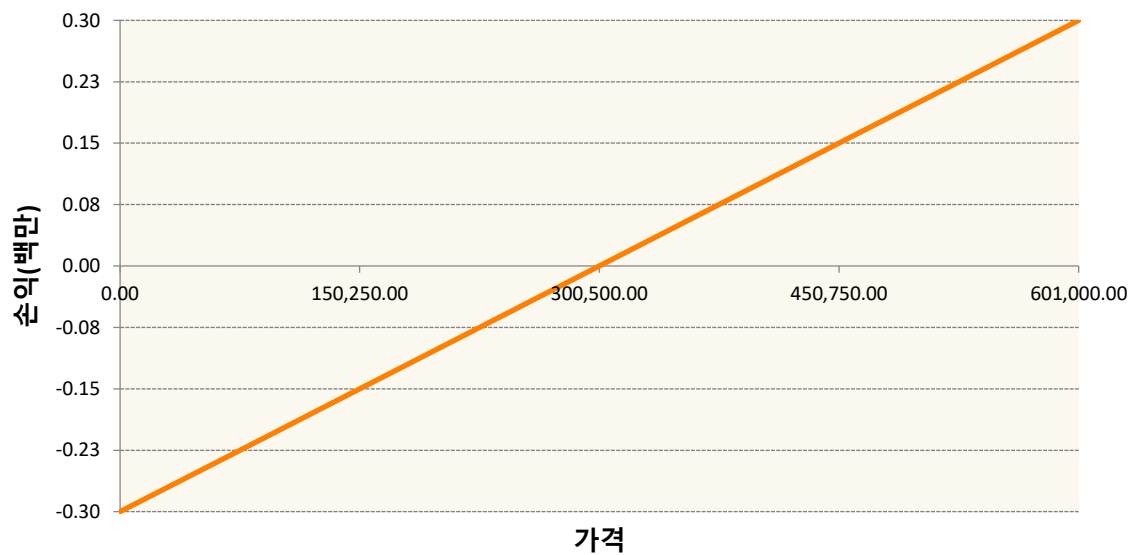
KR41C6W20000-2025-02 아모레퍼시픽개별선물



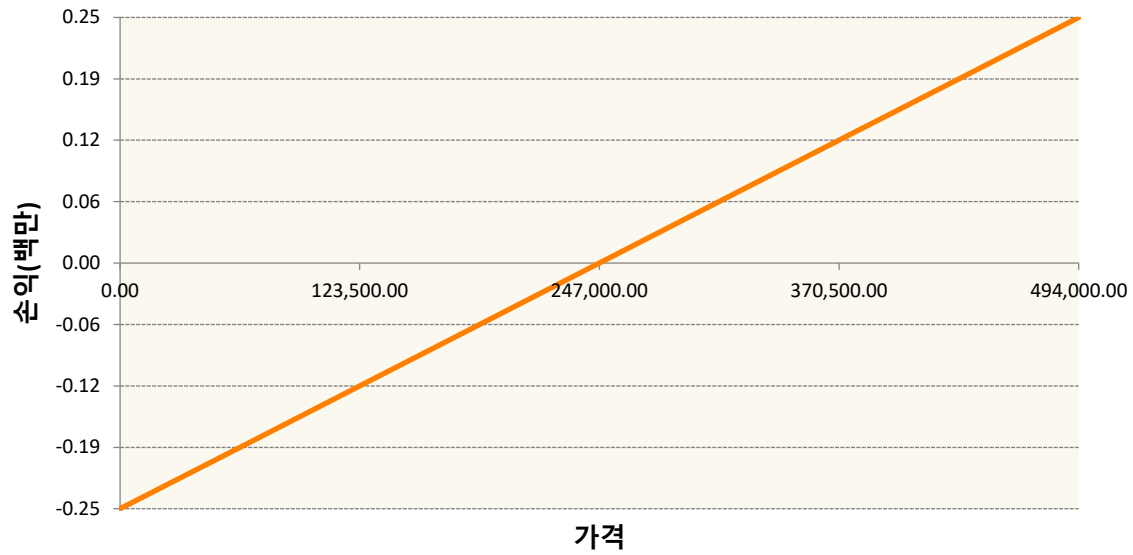
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



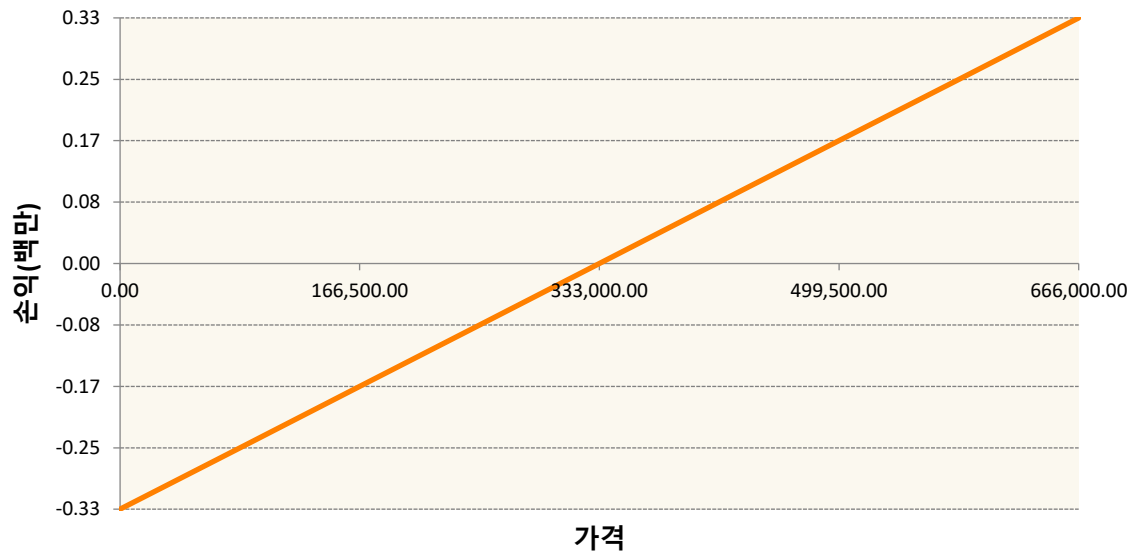
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



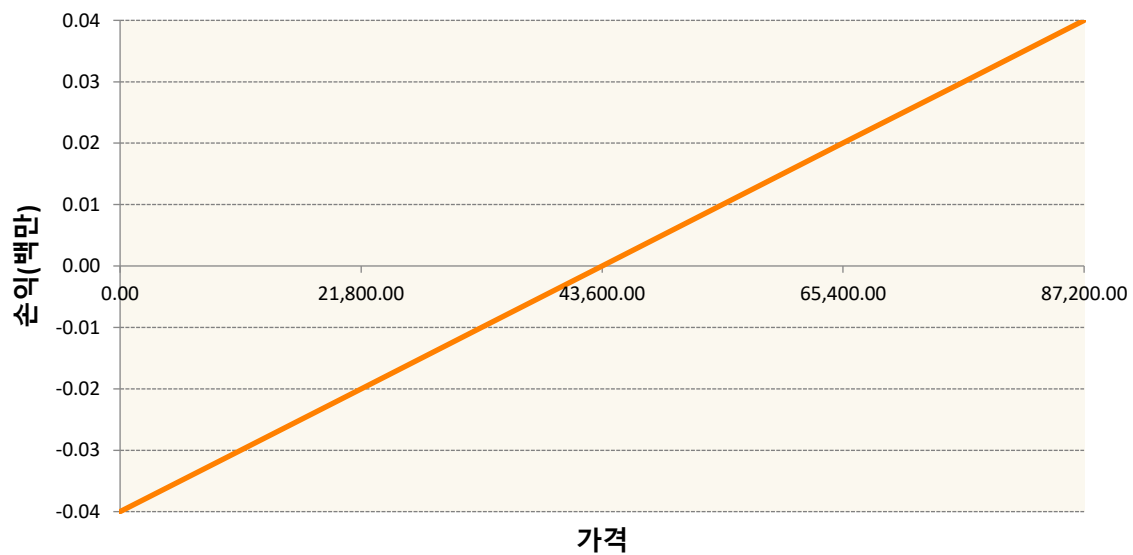
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



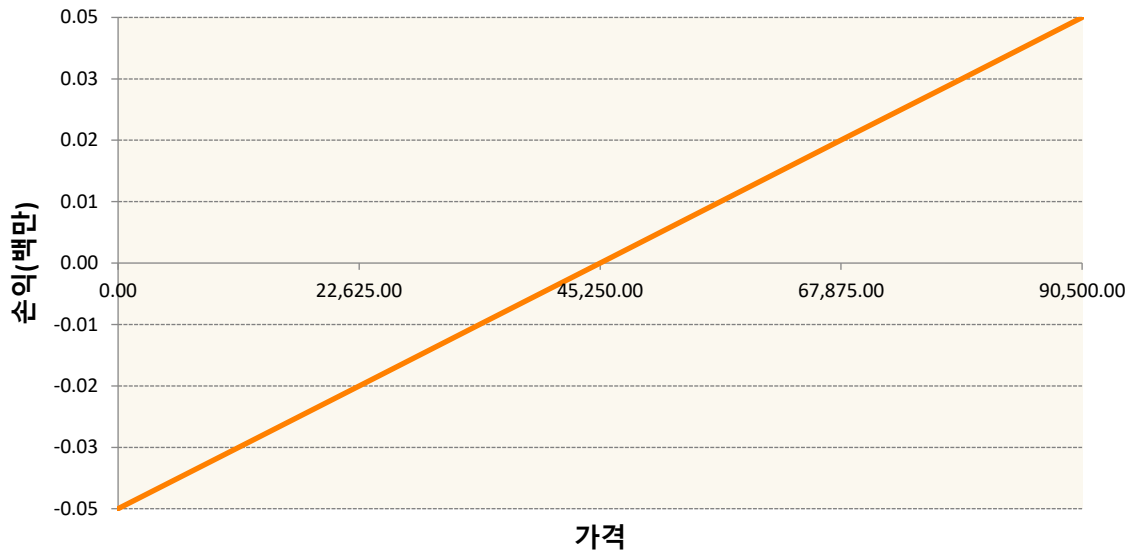
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



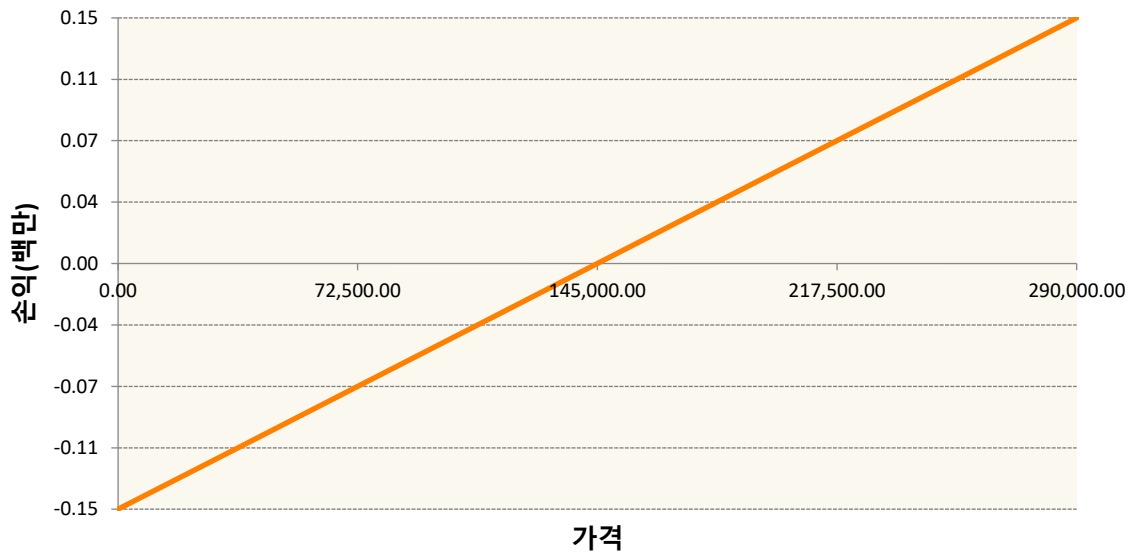
KR41DCW20004-2025-02 HL만도개별선물



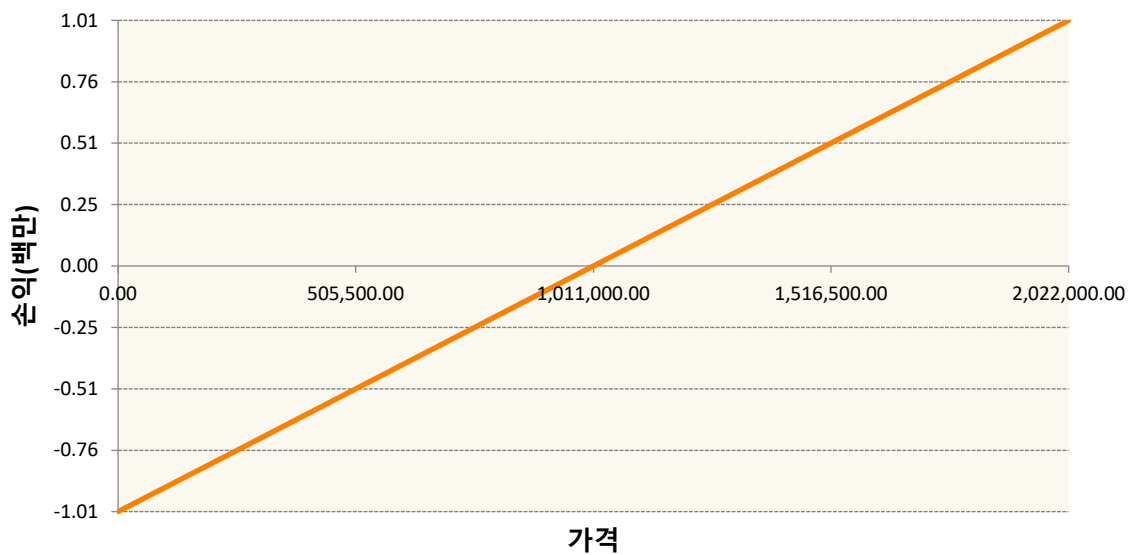
KR41E5W20000-2025-02 넷마블개별선물



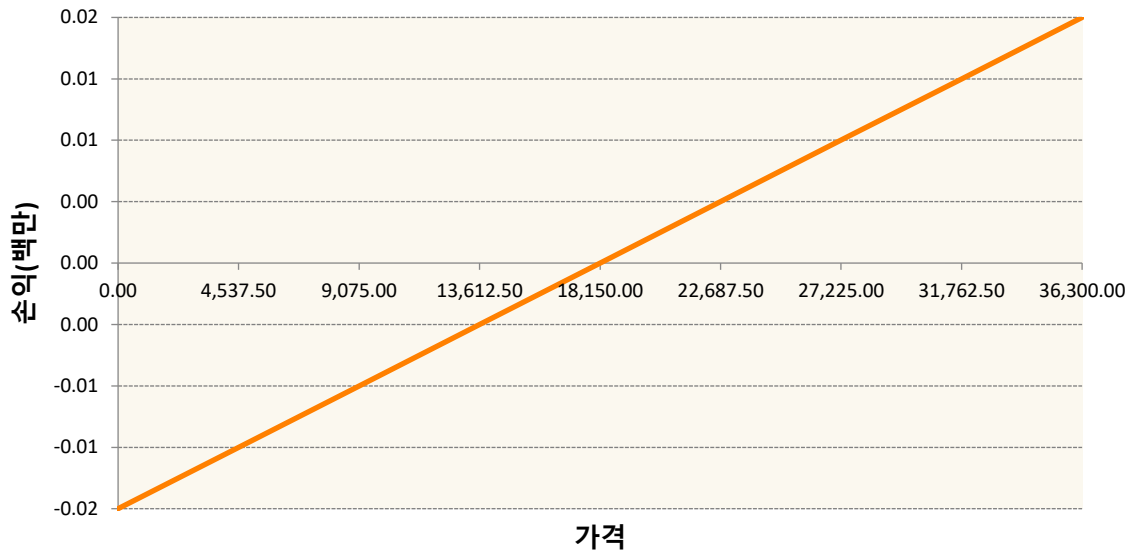
KR41E8W20004-2025-02 포스코퓨처엠개별선물



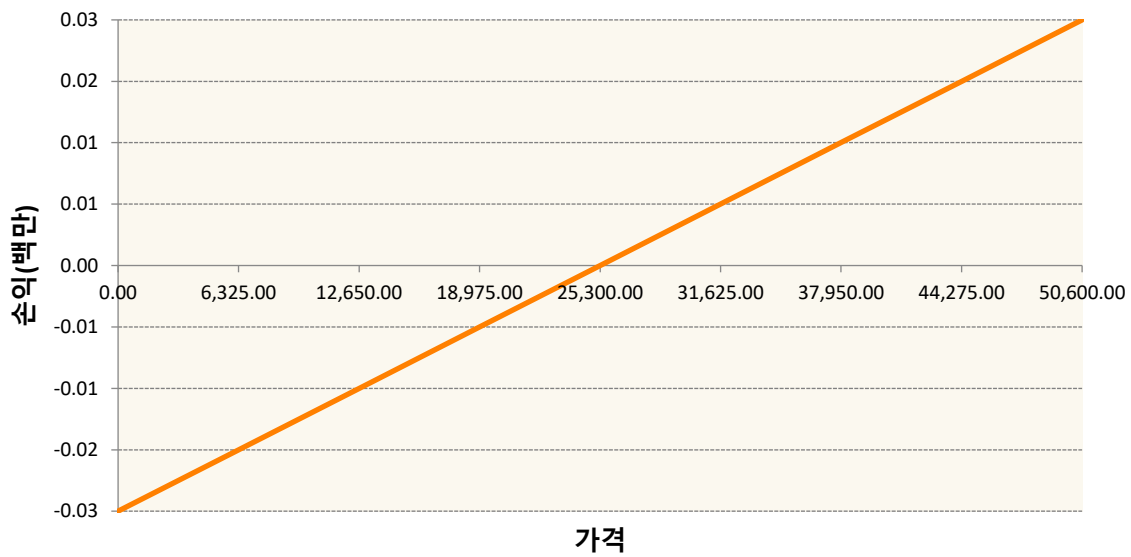
KR41ESW20008-2025-02 삼성바이오로직스개별선물



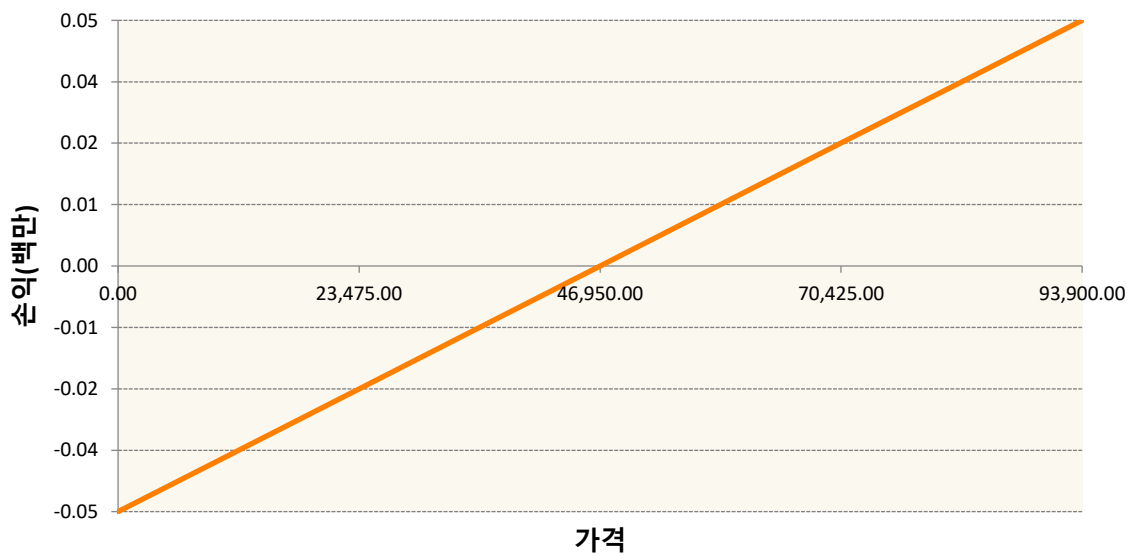
KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



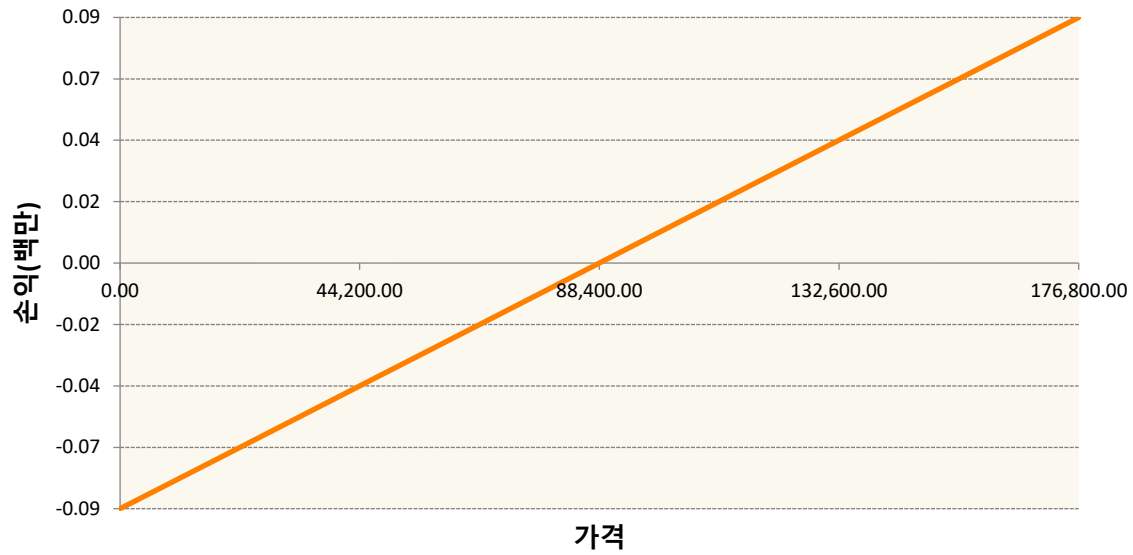
KR41F7W20005-2025-02 카카오페이개별선물



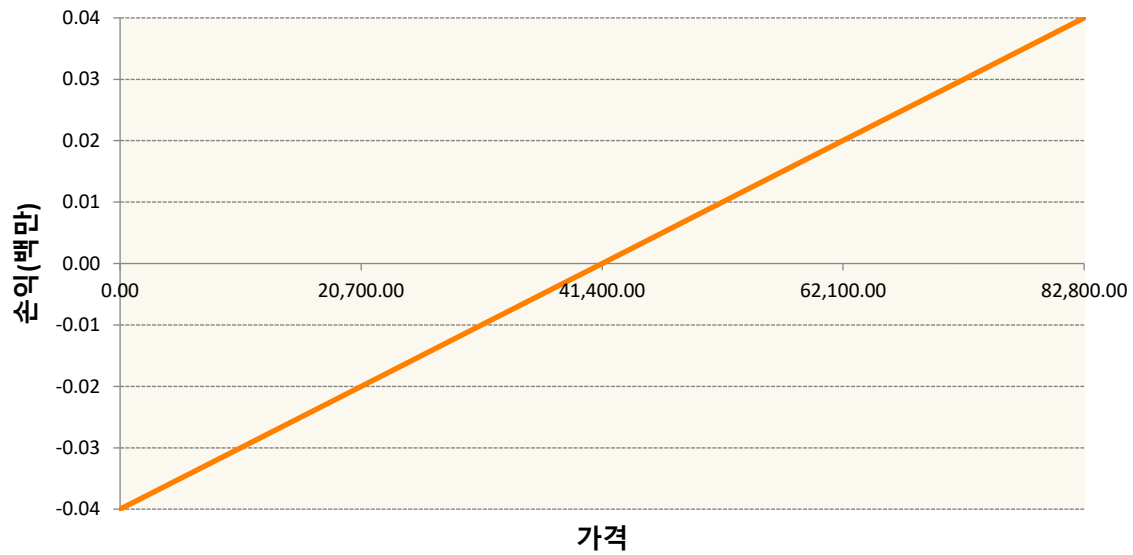
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



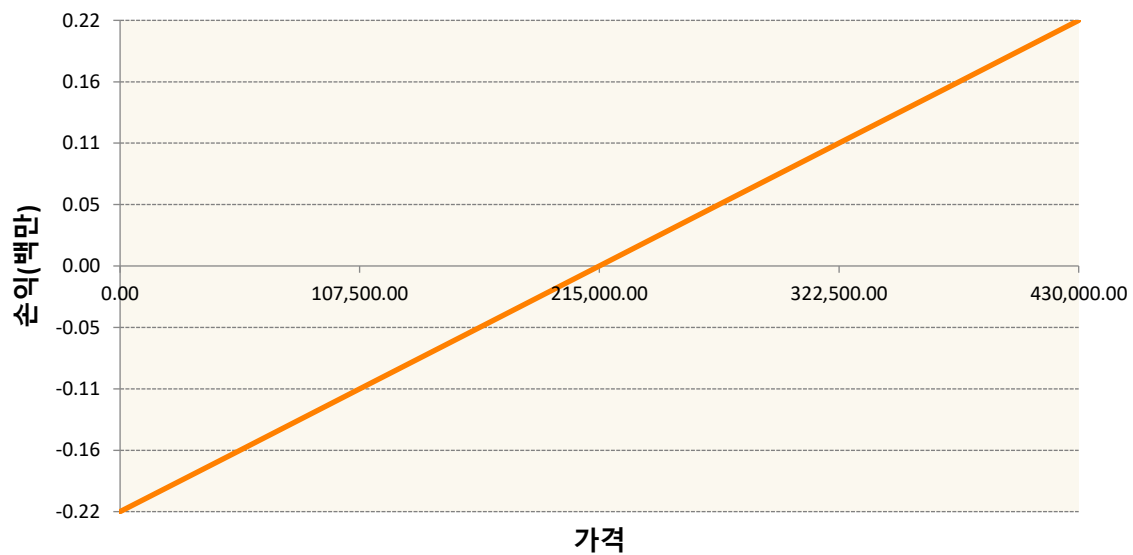
KR41FMW20008-2025-02 엘앤티에프개별선물



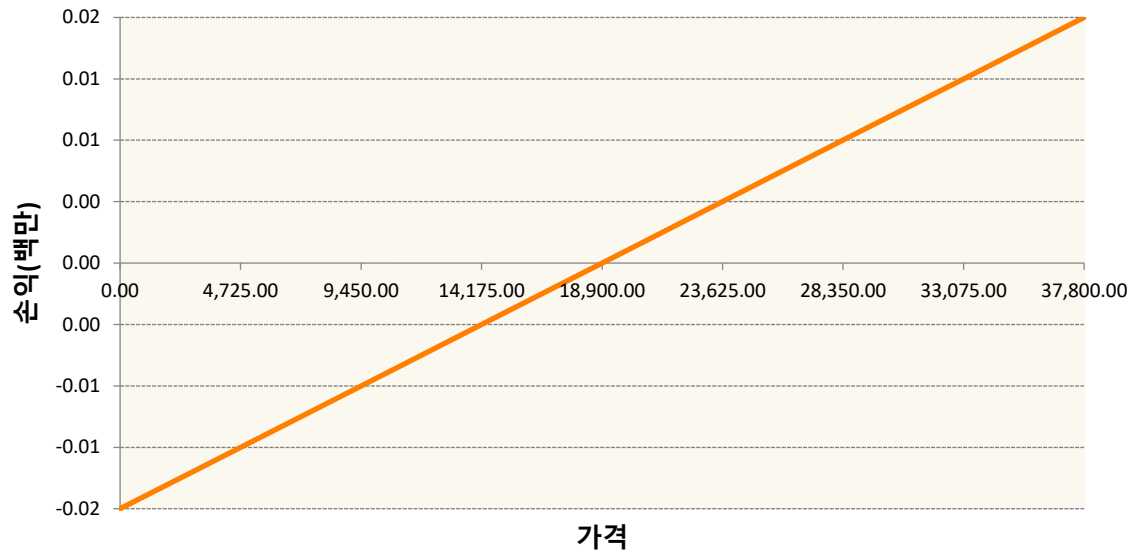
KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



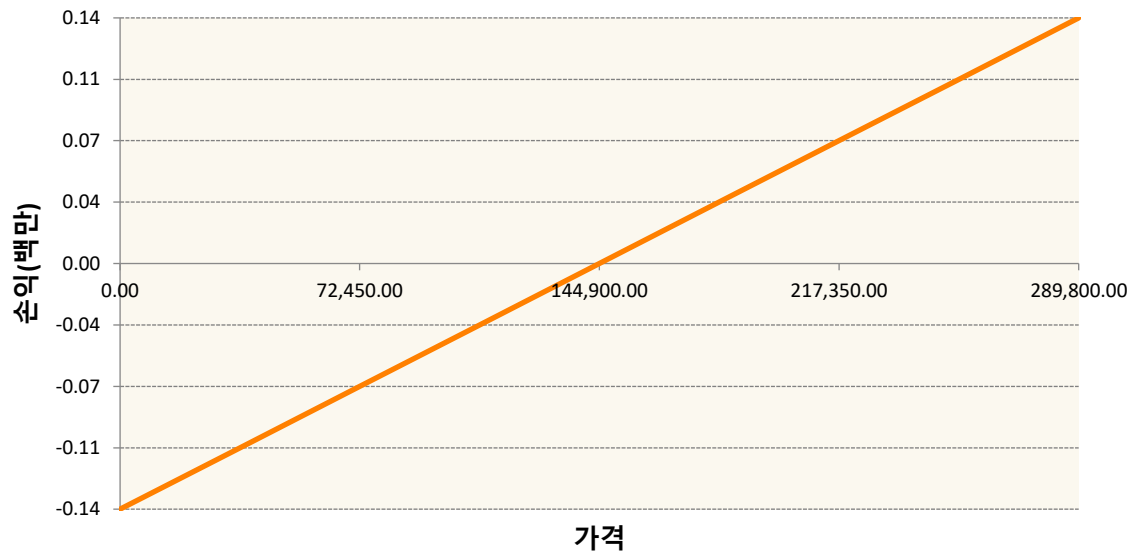
KR41GLW20008-2025-02 LS ELECTRIC개별선물



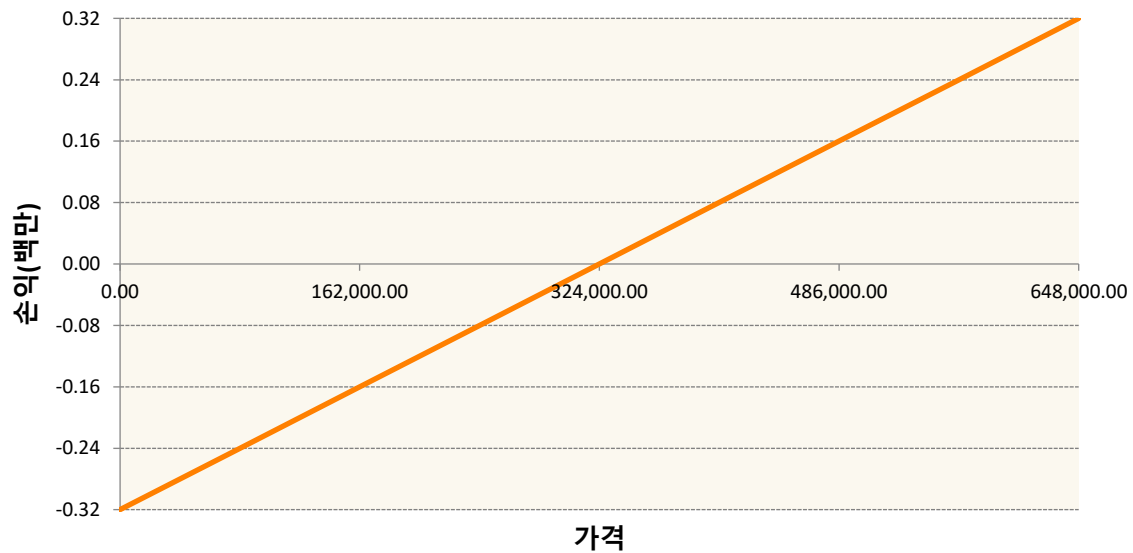
KR41GNW20004-2025-02 금양개별선물



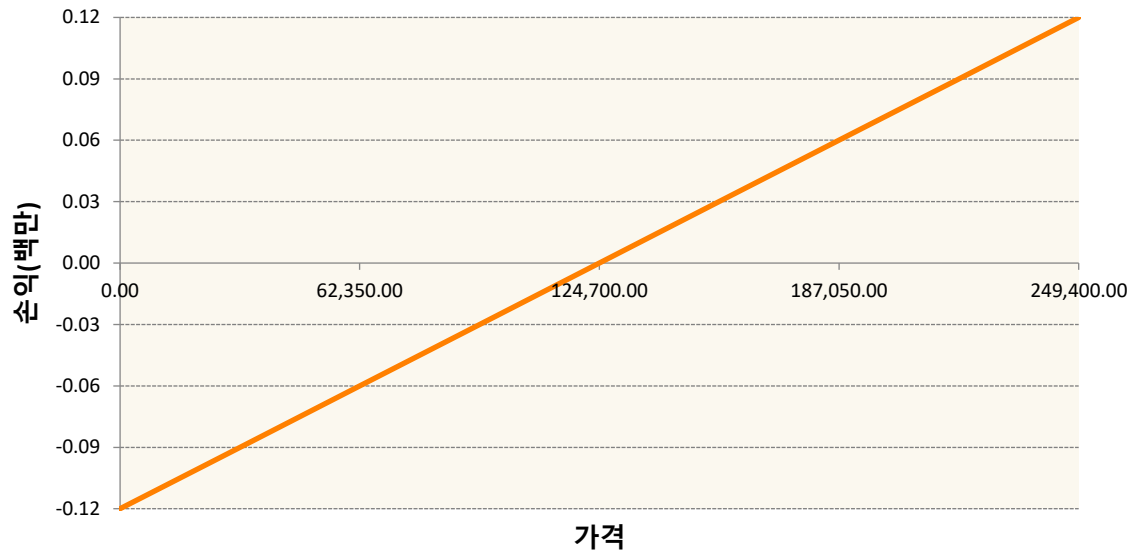
KR41GQW20007-2025-02 녹십자개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



KR41HEW20001-2025-02 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	61
KR410FW20(2025-02 두산로보틱스개별선물	1
KR410SW20(2025-02 울촌화학개별선물	0.15
KR4123W20(2025-02 삼성전기개별선물	4
KR4134W20(2025-02 LG개별선물	1
KR41B0W20(2025-02 LG유플러스개별선물	1
KR41B3W20(2025-02 고려아연개별선물	2
KR41BBW20(2025-02 롯데케미칼개별선물	1
KR41BNW20 2025-02 현대건설개별선물	1
KR41C0W20(2025-02 OCI홀딩스개별선물	1
KR41C3W20(2025-02 금호석유개별선물	1
KR41C6W20(2025-02 아모레퍼시픽개별선물	2
KR41CNW20 2025-02 포스코DX개별선물	0.48
KR41CRW20(2025-02 LG생활건강개별선물	1
KR41CXW20(2025-02 한미약품개별선물	1
KR41DAW20 2025-02 농심개별선물	0.27
KR41DCW20 2025-02 HL만도개별선물	1
KR41E5W20(2025-02 넷마블개별선물	1
KR41E8W20(2025-02 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41ESW20(2025-02 삼성바이오로직스개별선물	4
KR41ETW20(2025-02 삼성E&A개별선물	1
KR41F7W20(2025-02 카카오페이개별선물	0.14
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	0.35

KR41GQW20 2025-02 녹십자개별선물
KR41GTW20 2025-02 두산개별선물
KR41HEW20 2025-02 키움증권개별선물

0.35
1
1

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

(단위:백만원)

152

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

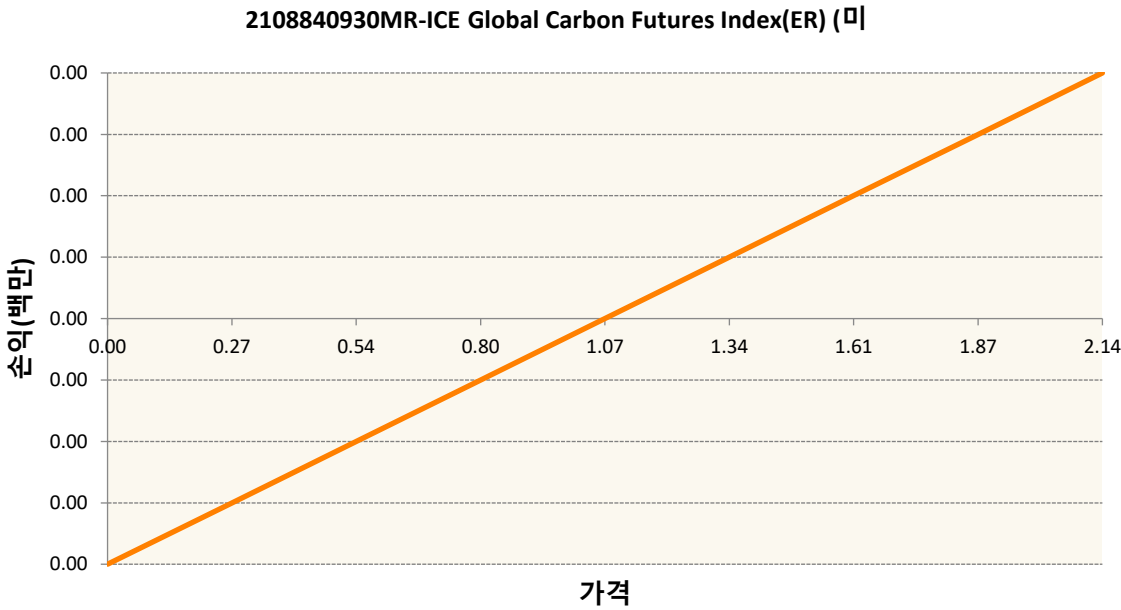
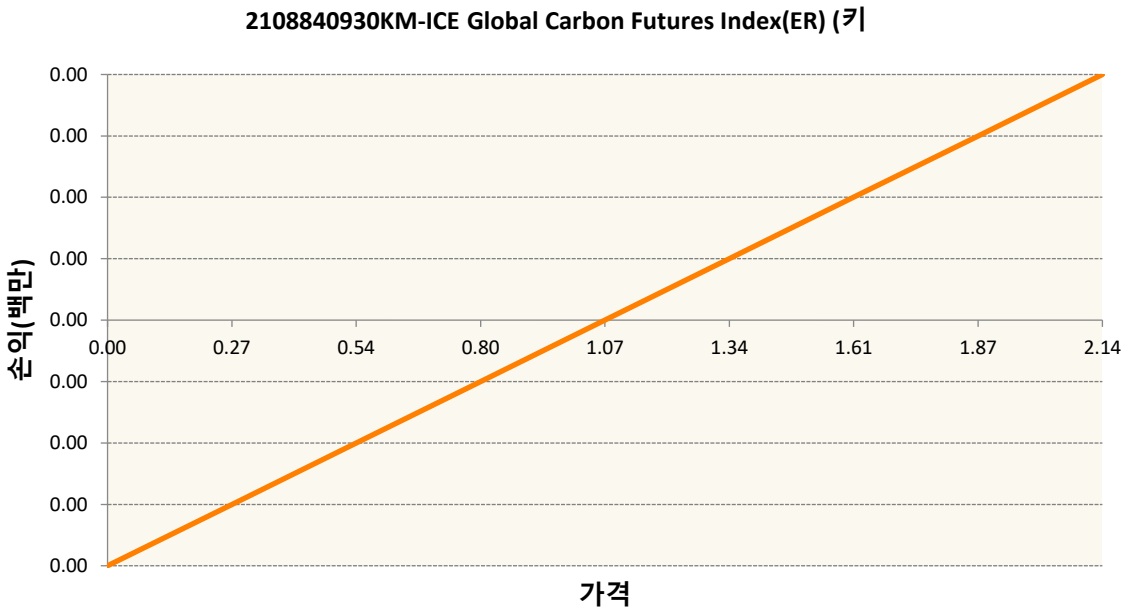
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

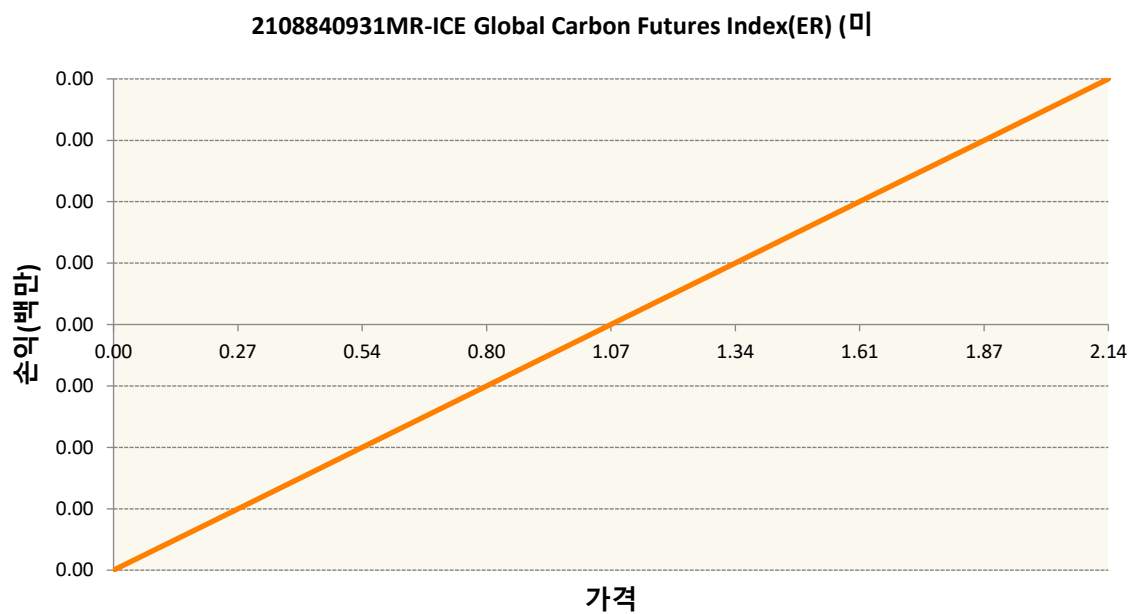
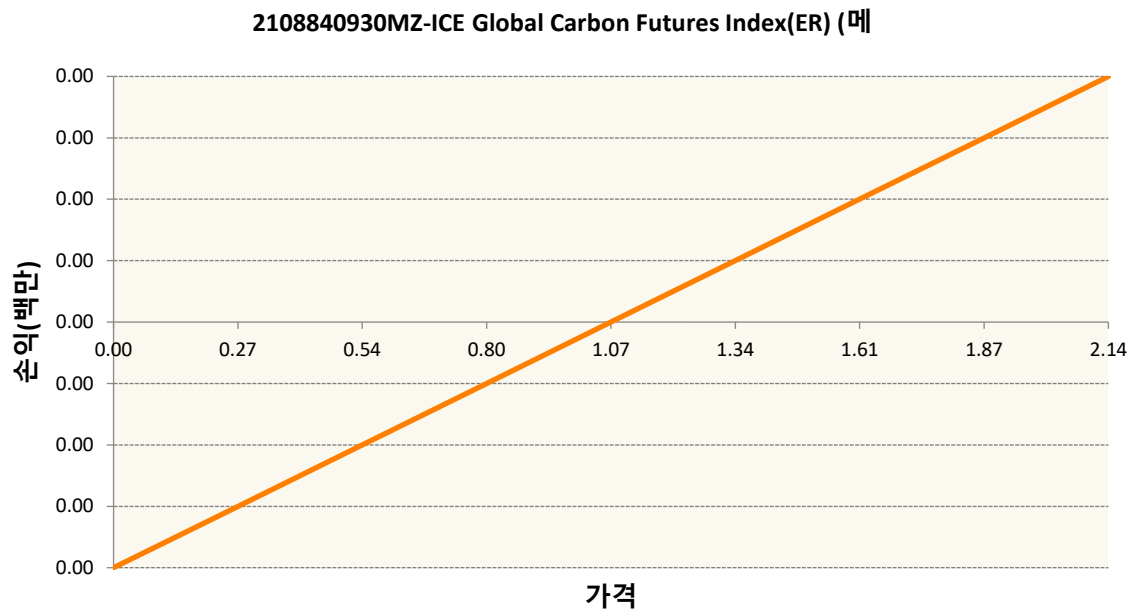
1. 계약금액

(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)
		1,030

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

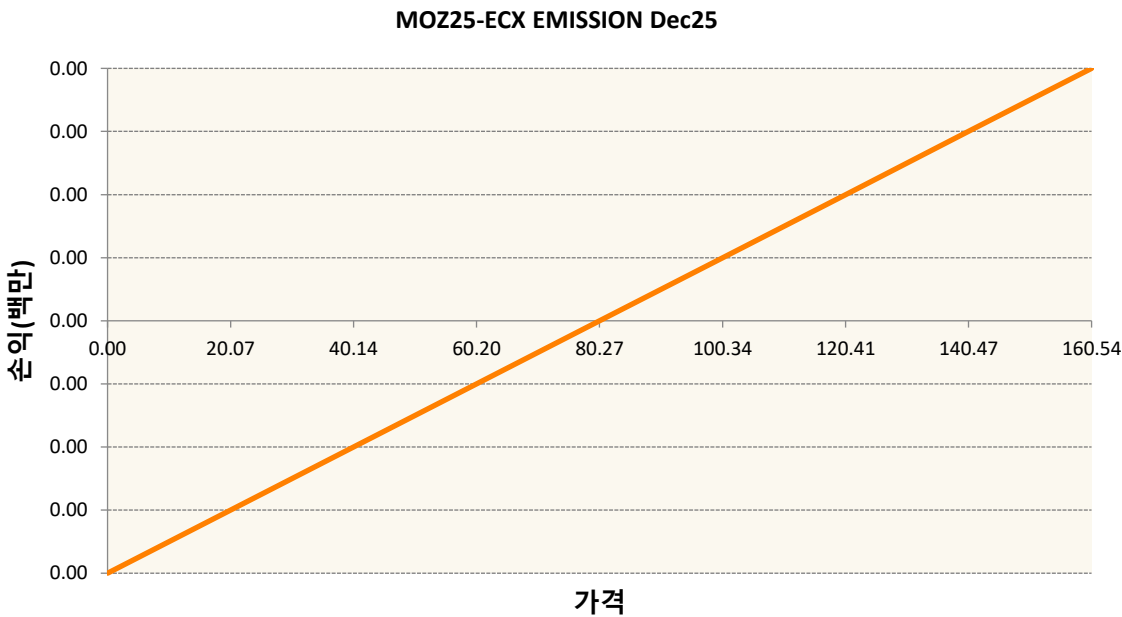
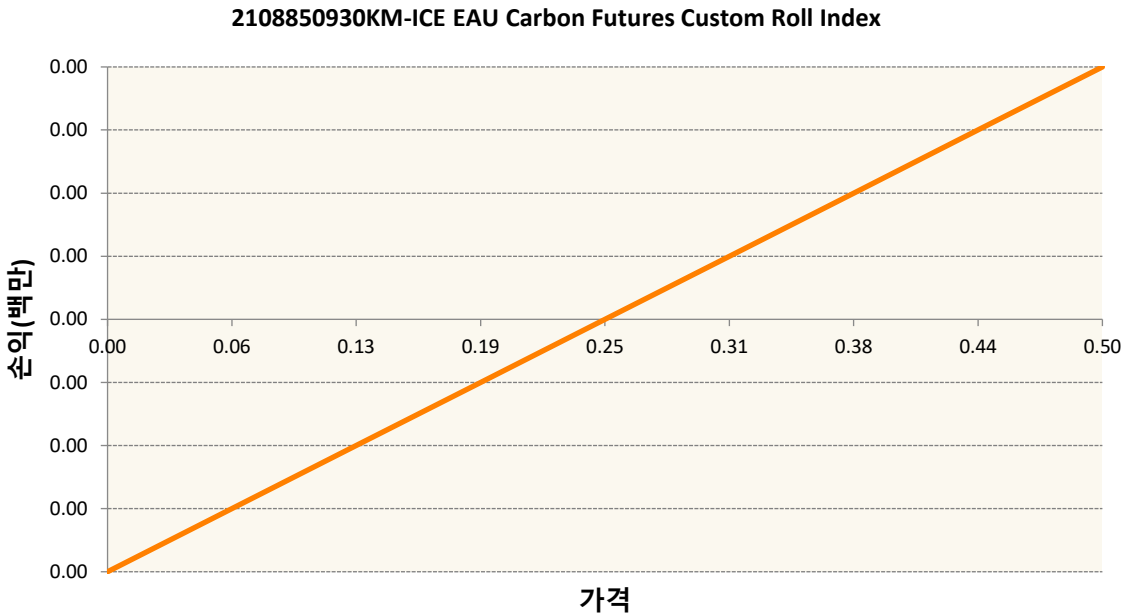
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	10,142	0	10,142	
누계	통화	선도	0	2,044	-2,044	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	7
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	164
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	805

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

1,452

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

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)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	8

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

(단위:백만원)

43

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

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)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.34

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

(단위:백만원)

8

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

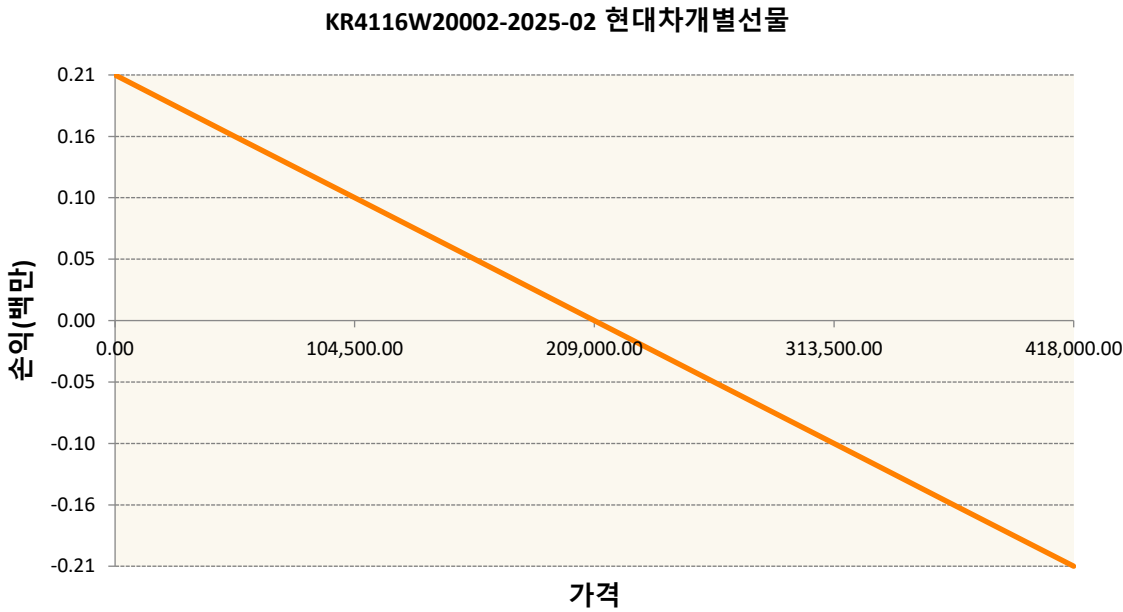
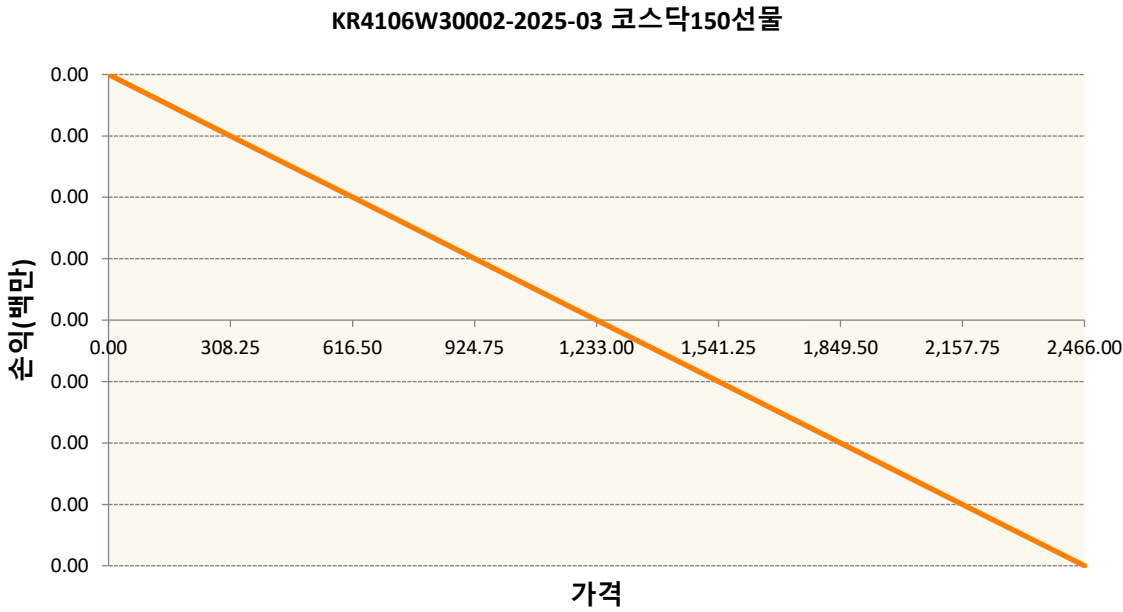
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

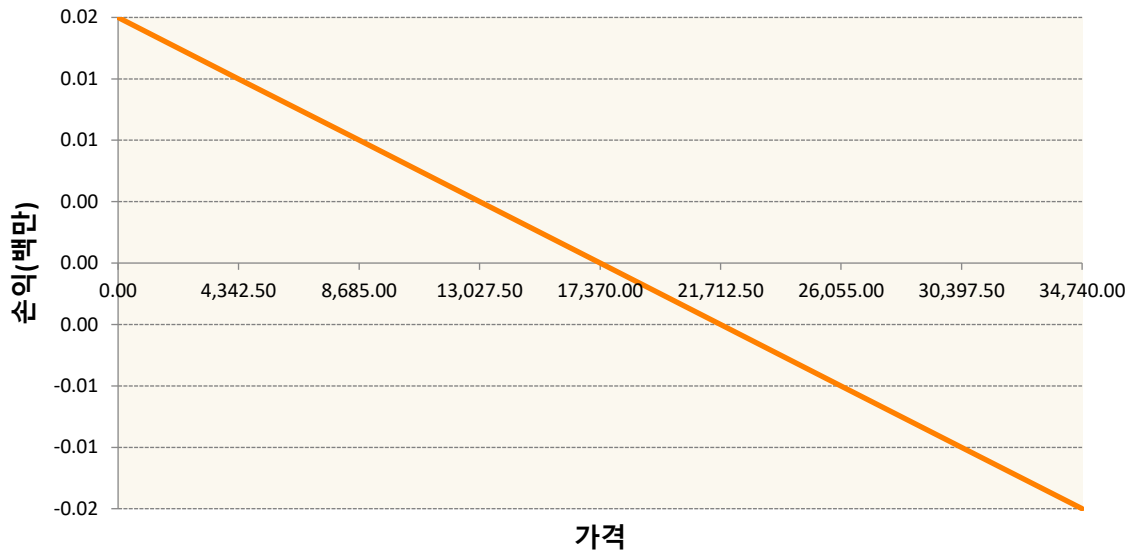
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3	3	0	장내
누계	유가증권	선물	11	75	-64	장내

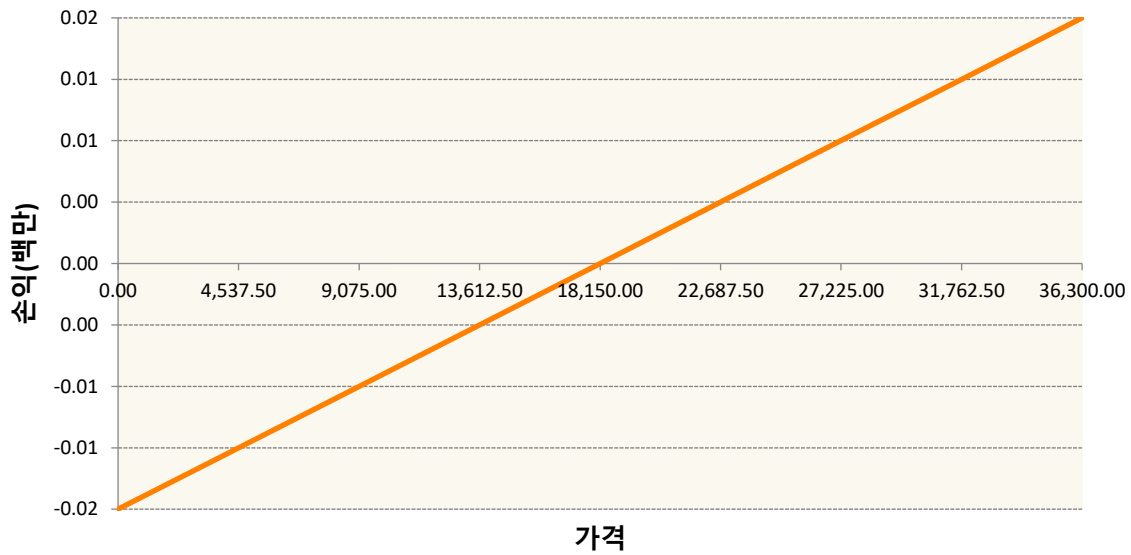
2. 만기시점의 손익구조



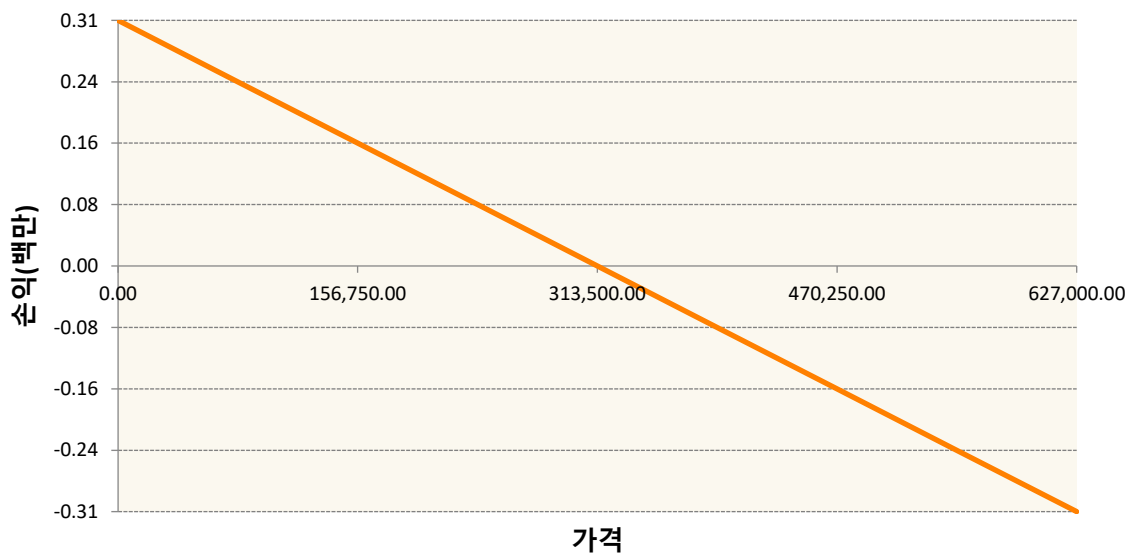
KR4151W20009-2025-02 GS건설개별선물



KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



KR41FDW20007-2025-02 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4106W30(2025-03 코스닥150선물		4
KR4116W20(2025-02 현대차개별선물		1
KR4151W20(2025-02 GS건설개별선물		1
KR41ETW20(2025-02 삼성E&A개별선물		1
KR41FDW20(2025-02 HD현대중공업개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

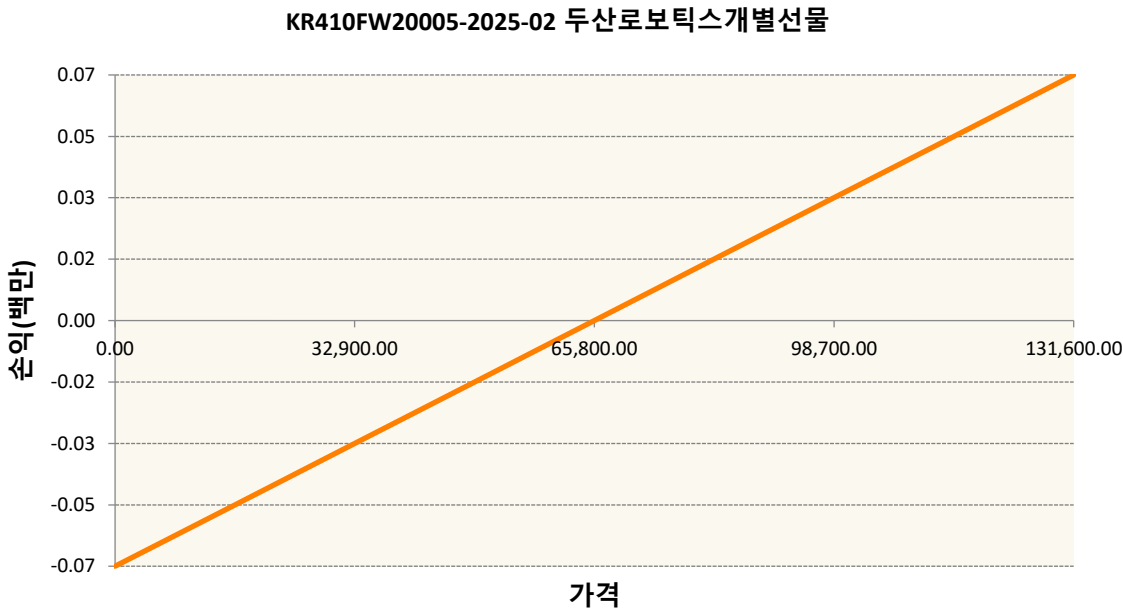
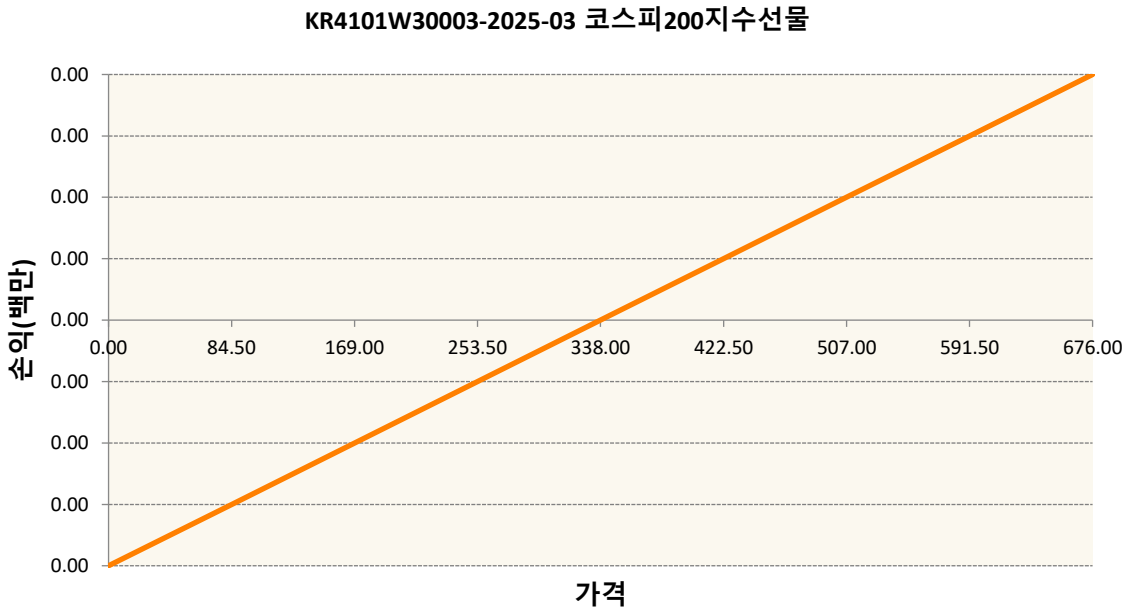
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

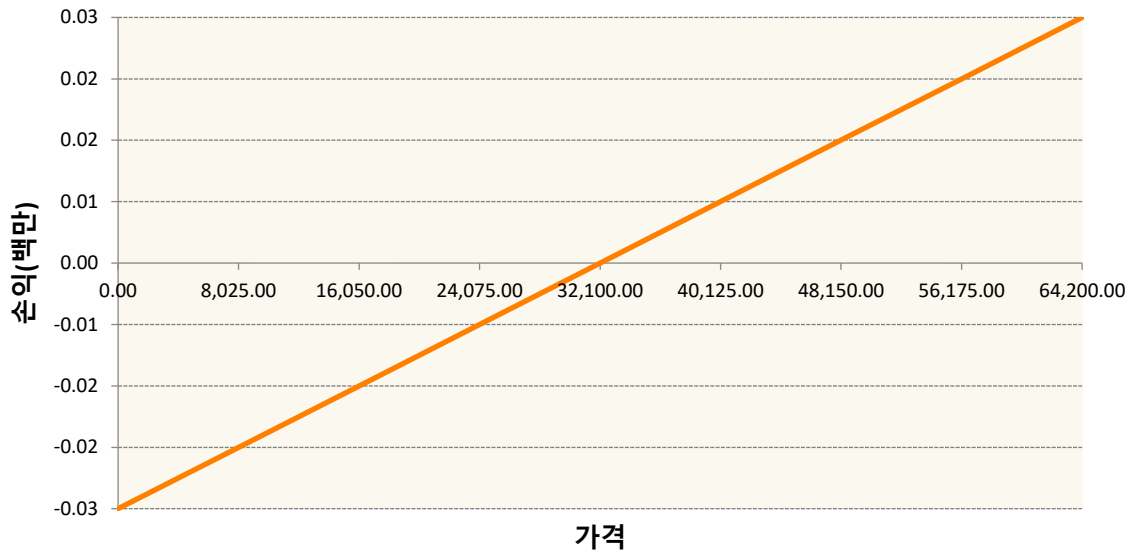
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	201	1,682	-1,481	장내
누계	유가증권	선물	11,191	0	11,191	장내

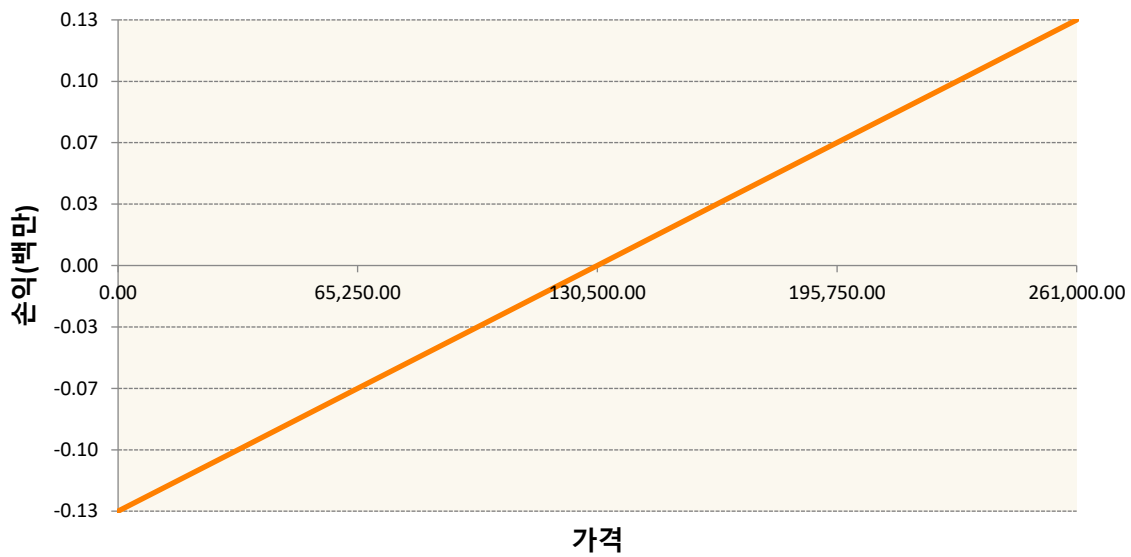
2. 만기시점의 손익구조



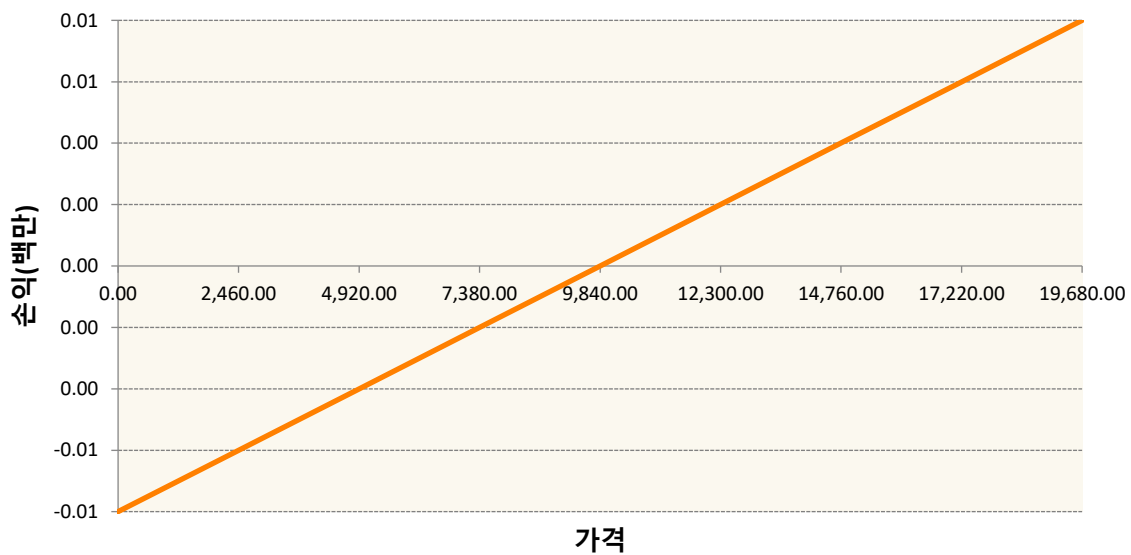
KR410SW20008-2025-02 울촌화학개별선물



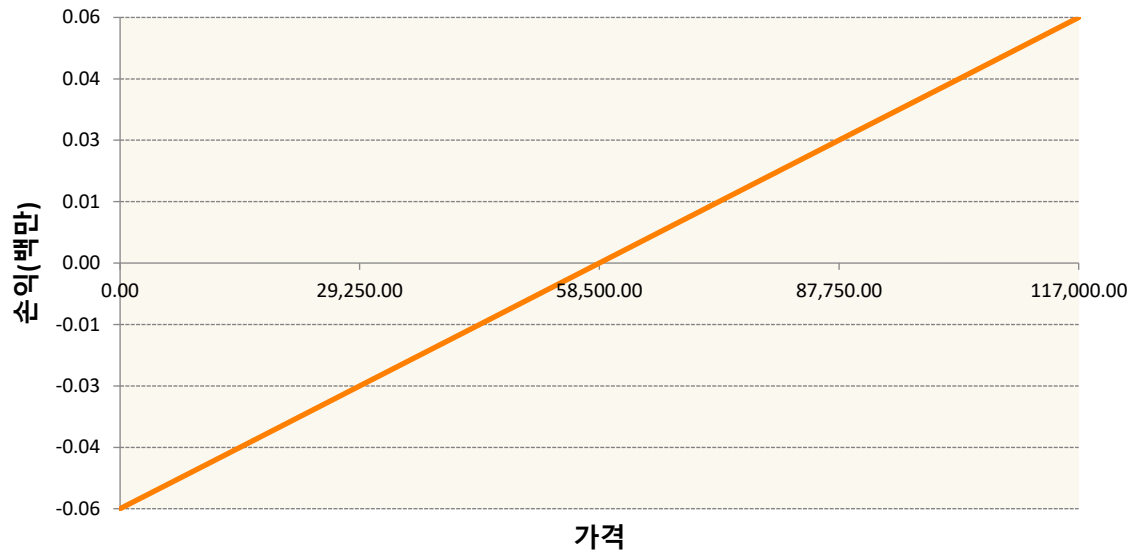
KR4123W20008-2025-02 삼성전기개별선물



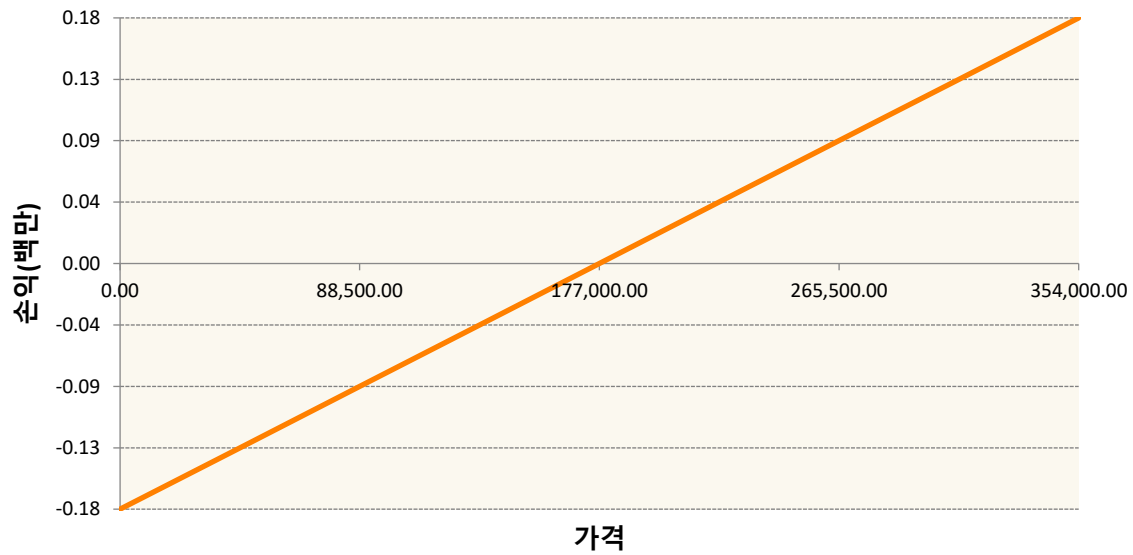
KR41B0W20004-2025-02 LG유플러스개별선물



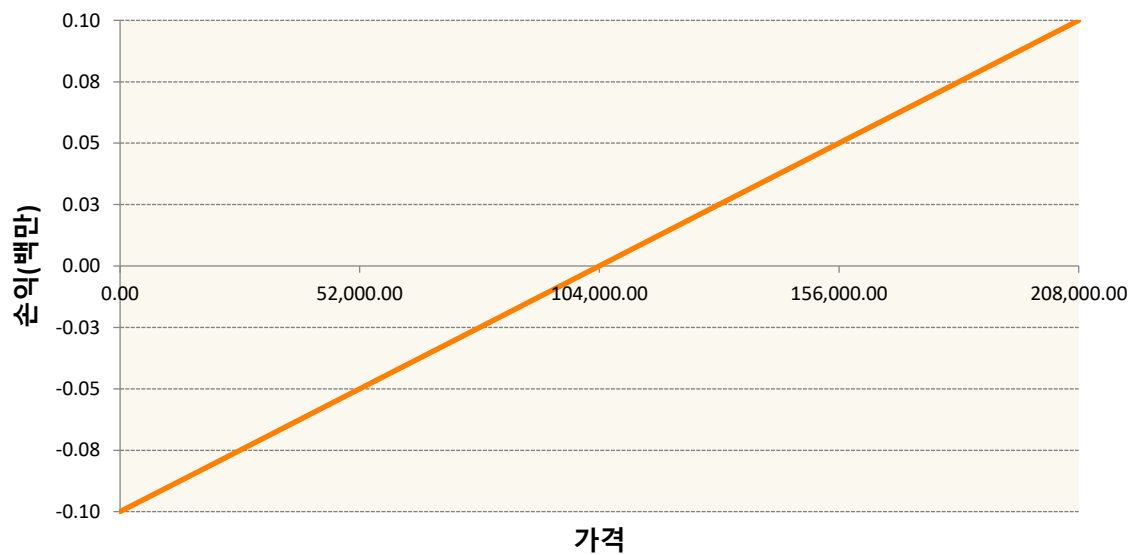
KR41BBW20000-2025-02 롯데케미칼개별선물



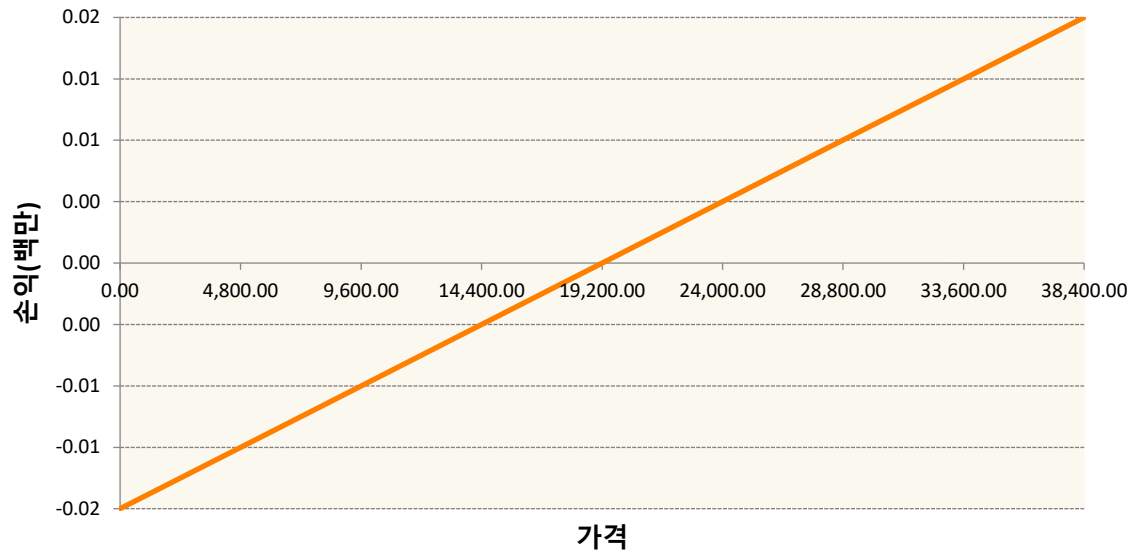
KR41BJW20003-2025-02 엔씨소프트개별선물



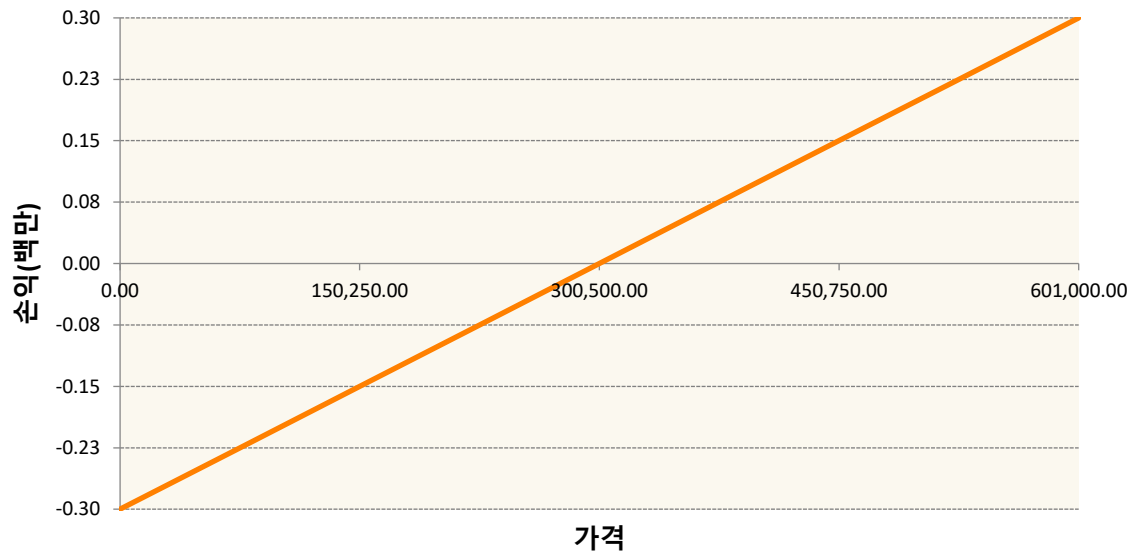
KR41C3W20007-2025-02 금호석유개별선물



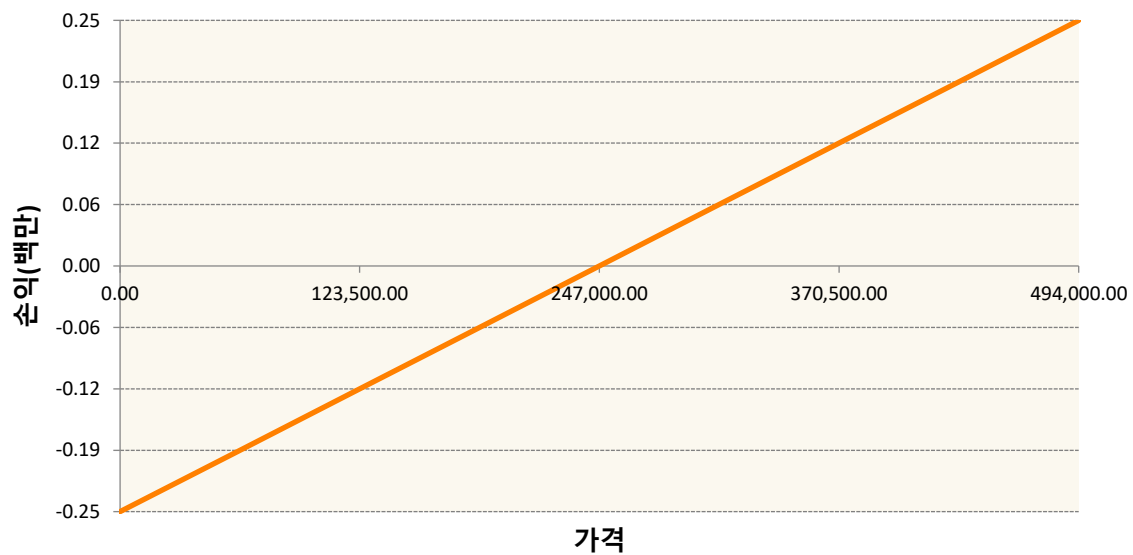
KR41CNW20003-2025-02 포스코DX개별선물



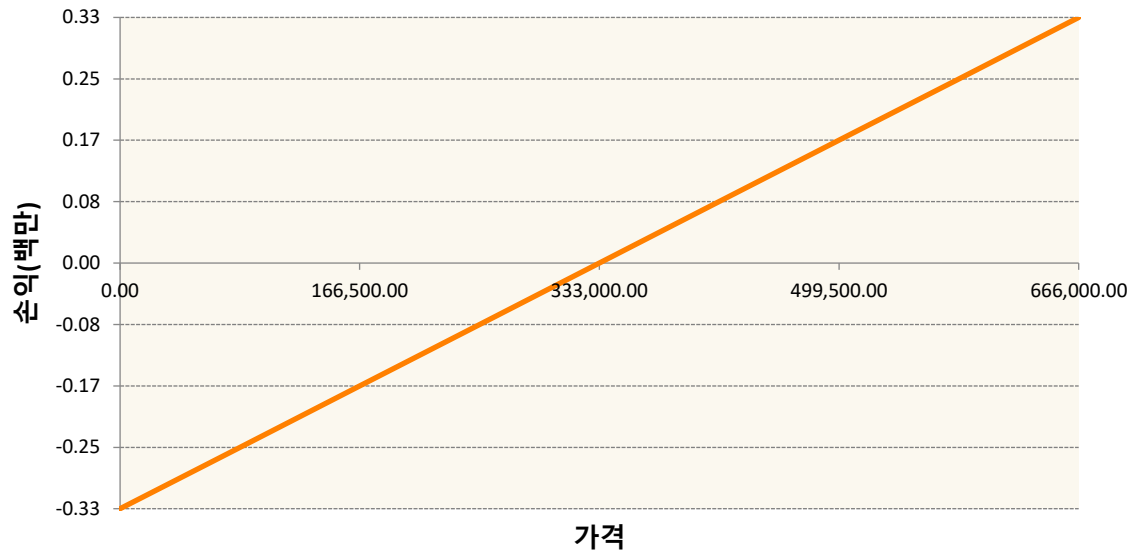
KR41CRW20004-2025-02 LG생활건강개별선물



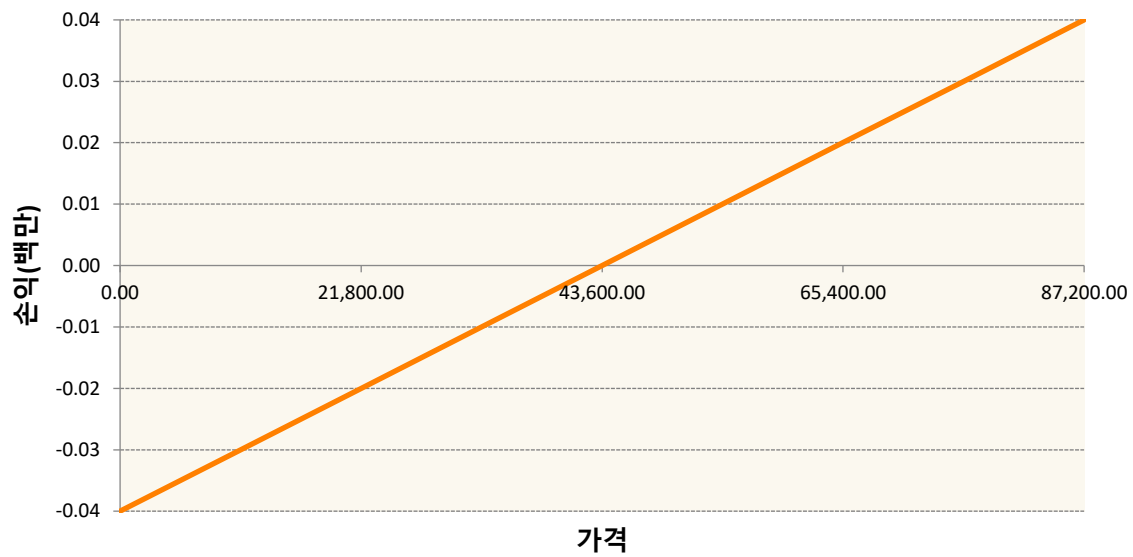
KR41CXW20002-2025-02 한미약품개별선물



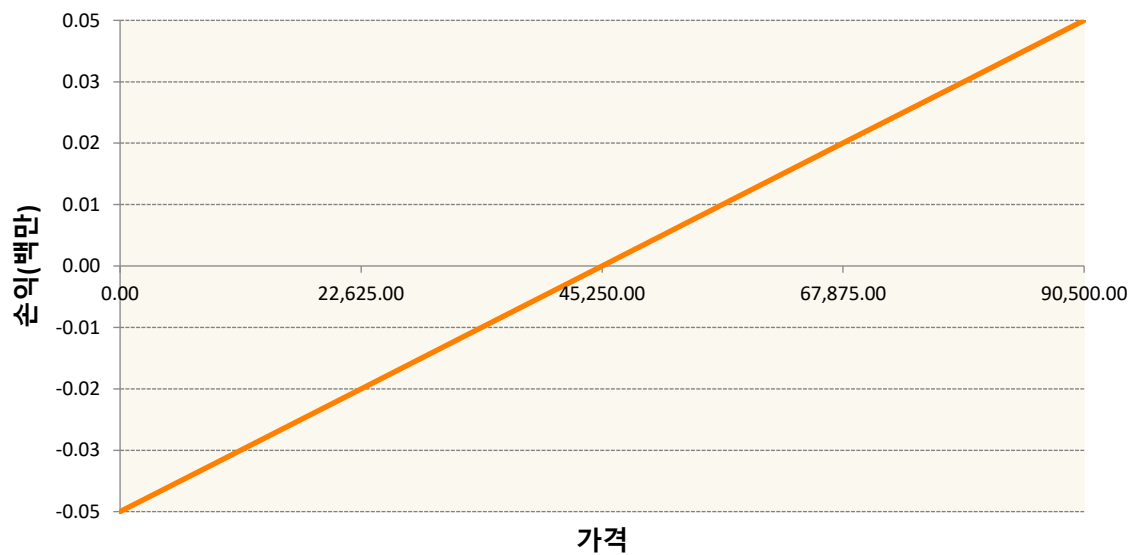
KR41DAW20008-2025-02 농심개별선물



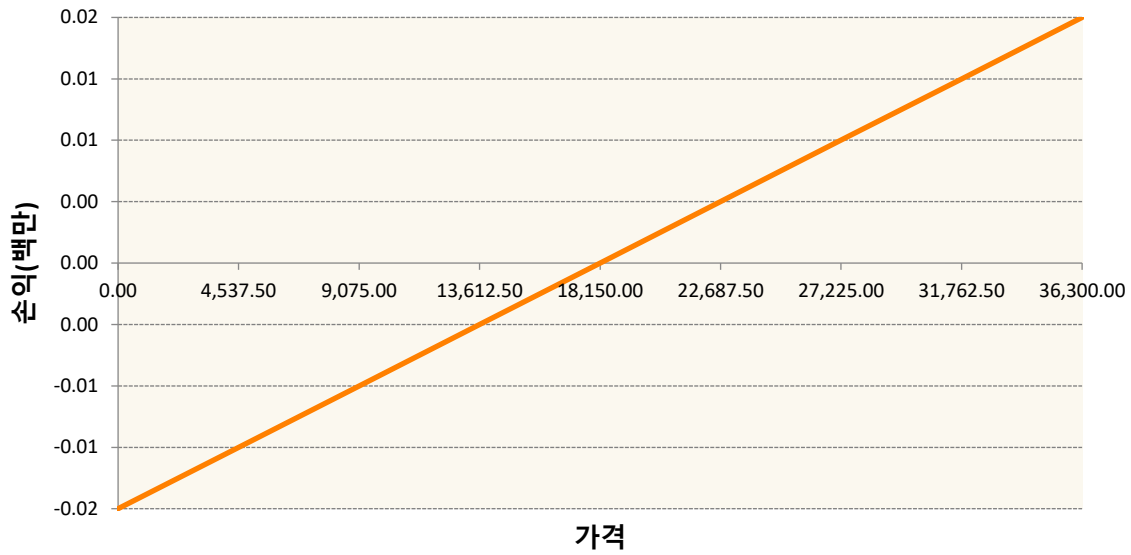
KR41DCW20004-2025-02 HL만도개별선물



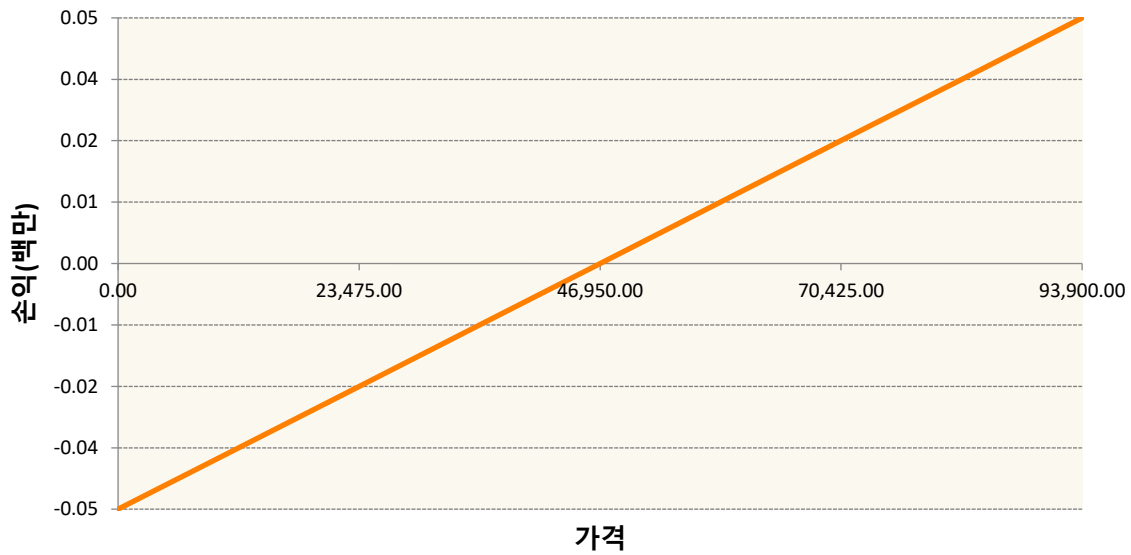
KR41E5W20000-2025-02 넷마블개별선물



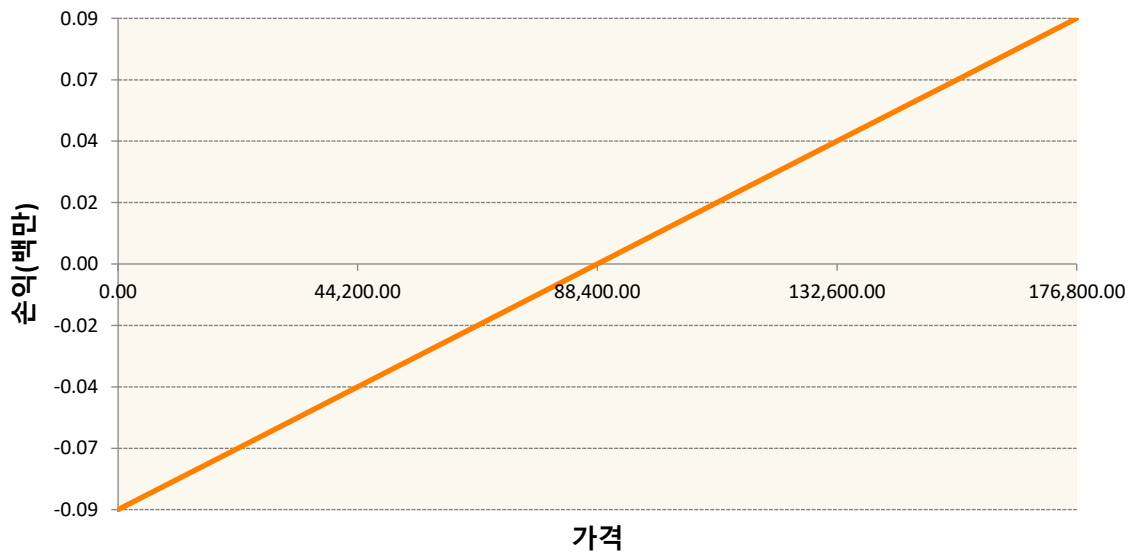
KR41ETW20006-2025-02 삼성E&A개별선물



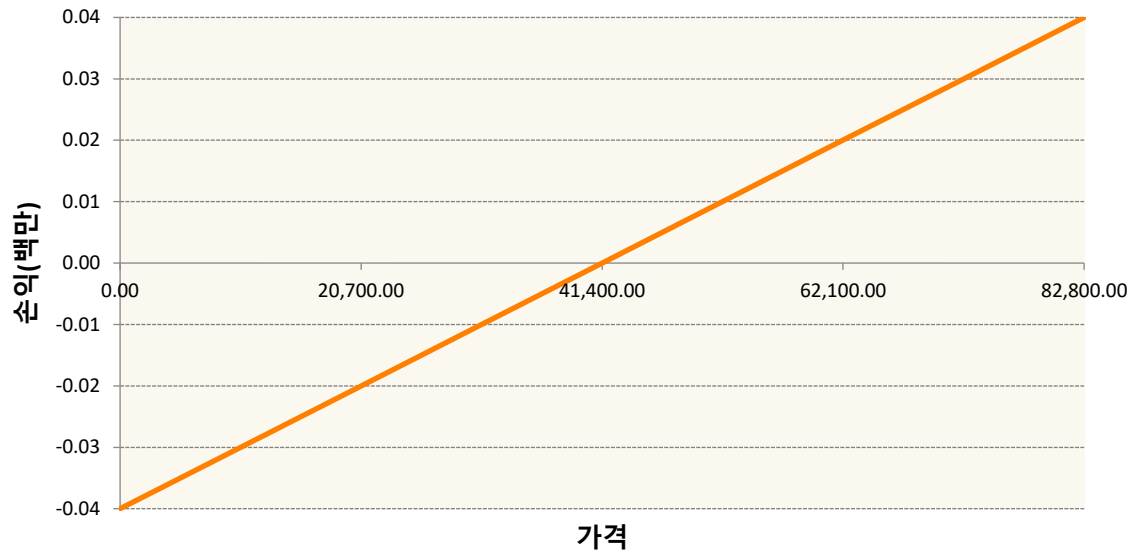
KR41F9W20001-2025-02 SK바이오사이언스개별선물



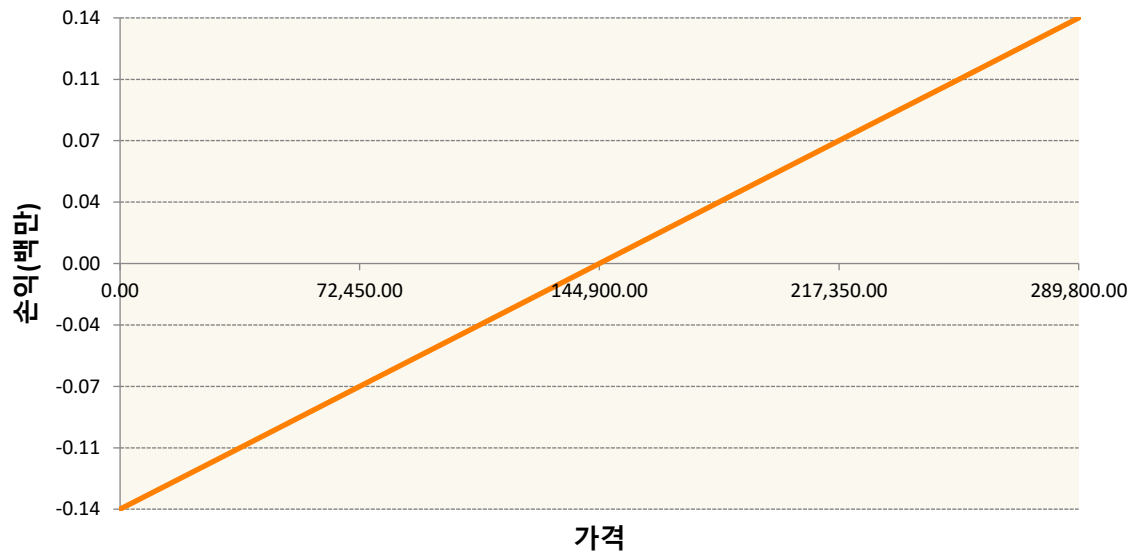
KR41FMW20008-2025-02 엘앤에프개별선물



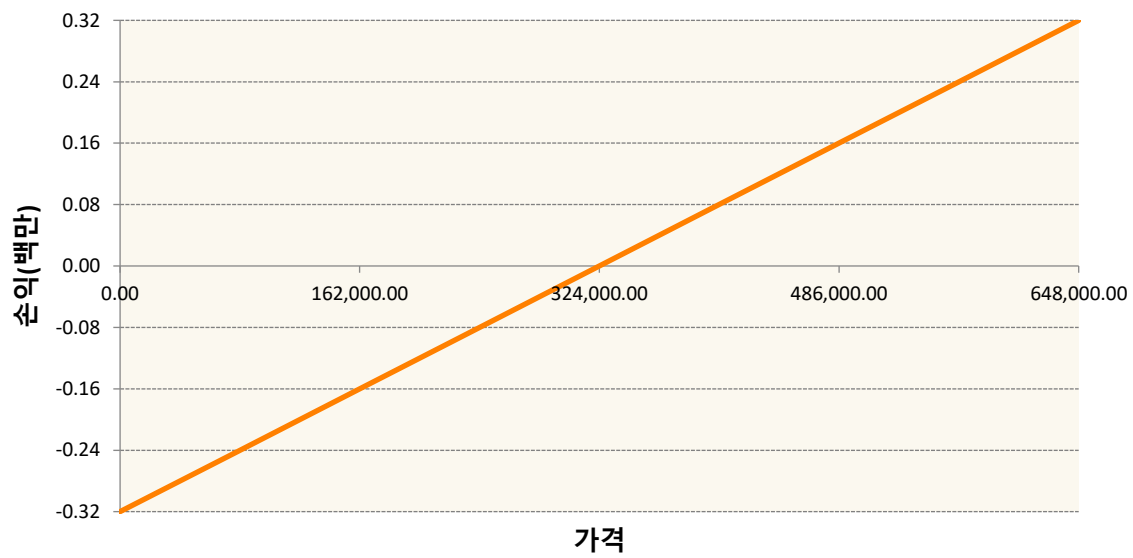
KR41G0W20009-2025-02 씨에스원드개별선물



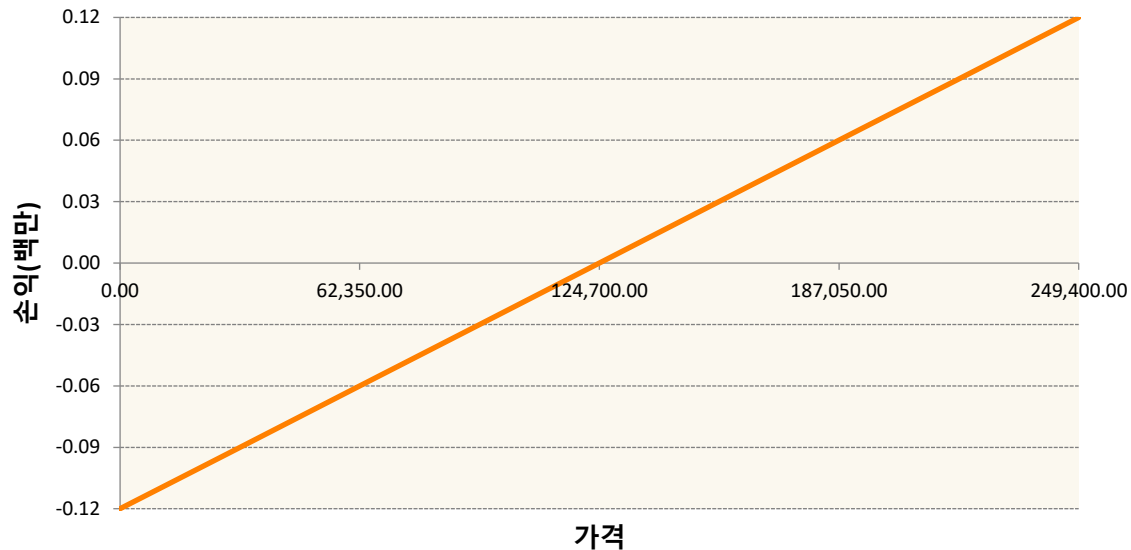
KR41GQW20007-2025-02 녹십자개별선물



KR41GTW20001-2025-02 두산개별선물



KR41HEW20001-2025-02 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	642
KR410FW20(2025-02 두산로보틱스개별선물	1
KR410SW20(2025-02 울촌화학개별선물	3
KR4123W20(2025-02 삼성전기개별선물	1
KR41B0W20(2025-02 LG유플러스개별선물	27
KR41BBW20(2025-02 롯데케미칼개별선물	11
KR41BJW20C 2025-02 엔씨소프트개별선물	21
KR41C3W20(2025-02 금호석유개별선물	16
KR41CNW20 2025-02 포스코DX개별선물	9
KR41CRW20(2025-02 LG생활건강개별선물	10
KR41CXW20(2025-02 한미약품개별선물	18
KR41DAW20 2025-02 농심개별선물	10
KR41DCW20 2025-02 HL만도개별선물	1
KR41E5W20(2025-02 넷마블개별선물	12
KR41ETW20(2025-02 삼성E&A개별선물	28
KR41F9W20(2025-02 SK바이오사이언스개별선물	12
KR41FMW20 2025-02 엘앤에프개별선물	21
KR41G0W20(2025-02 씨에스원드개별선물	10
KR41GQW2C 2025-02 녹십자개별선물	5
KR41GTW20(2025-02 두산개별선물	22
KR41HEW20(2025-02 키움증권개별선물	16

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

(단위:백만원)

1,369

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

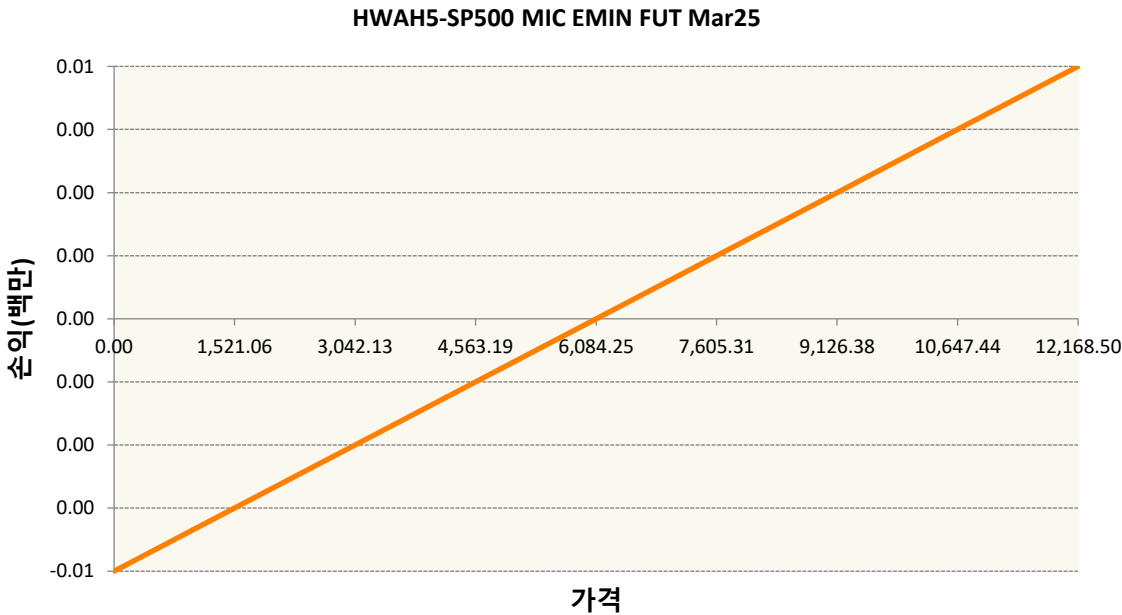
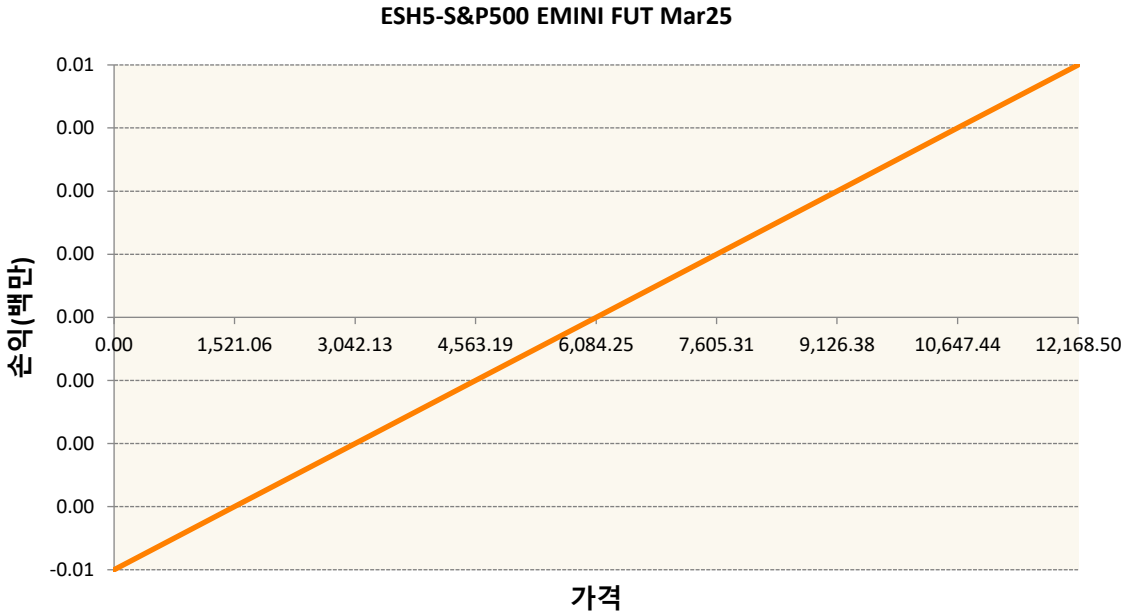
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	28,713	0	28,713	
누계	유가증권	선물	1,236	0	1,236	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,297
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,204

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

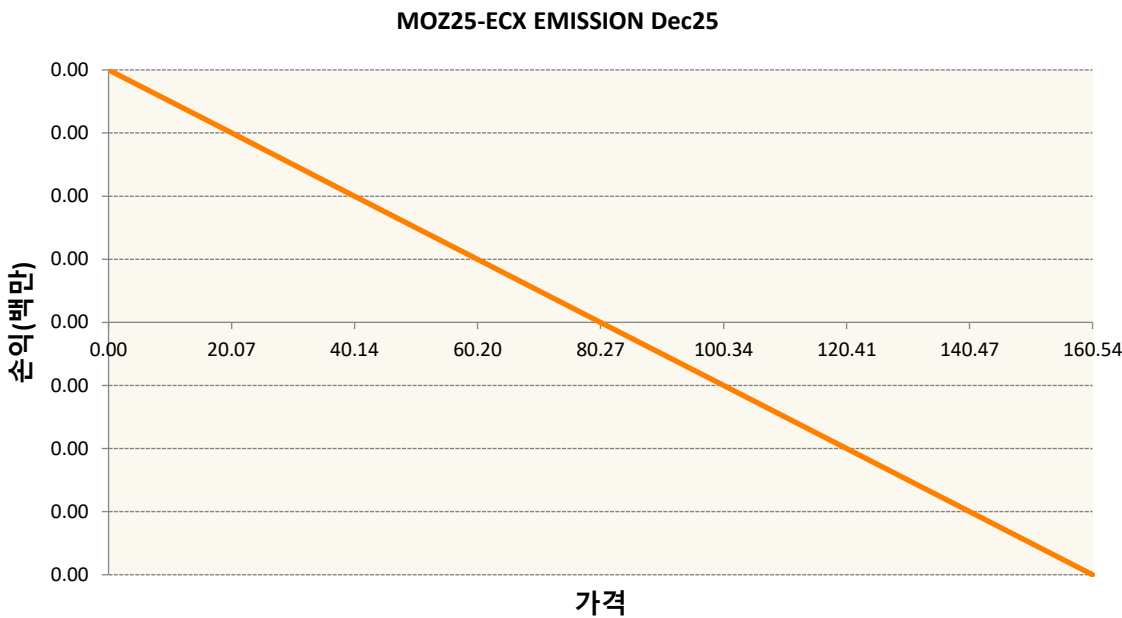
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-85	3,426	-3,511	
누계	통화	선도	0	1,261	-1,261	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	9
FXW213ECS(KRW/EUR 31-01-25E	92
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	274

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

(단위:백만원)

524

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

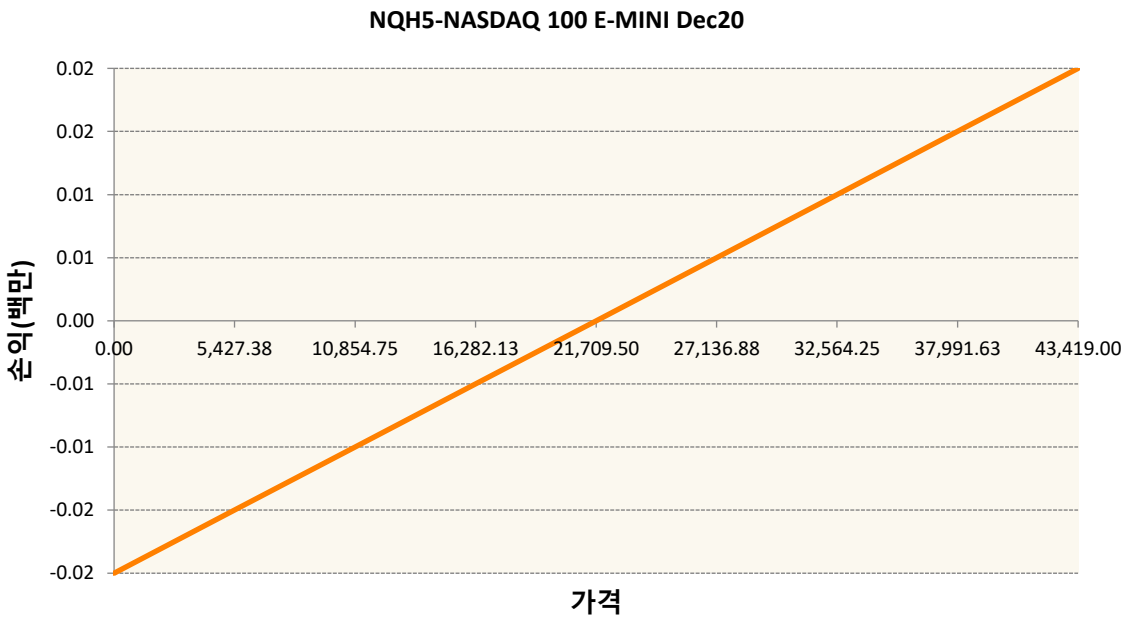
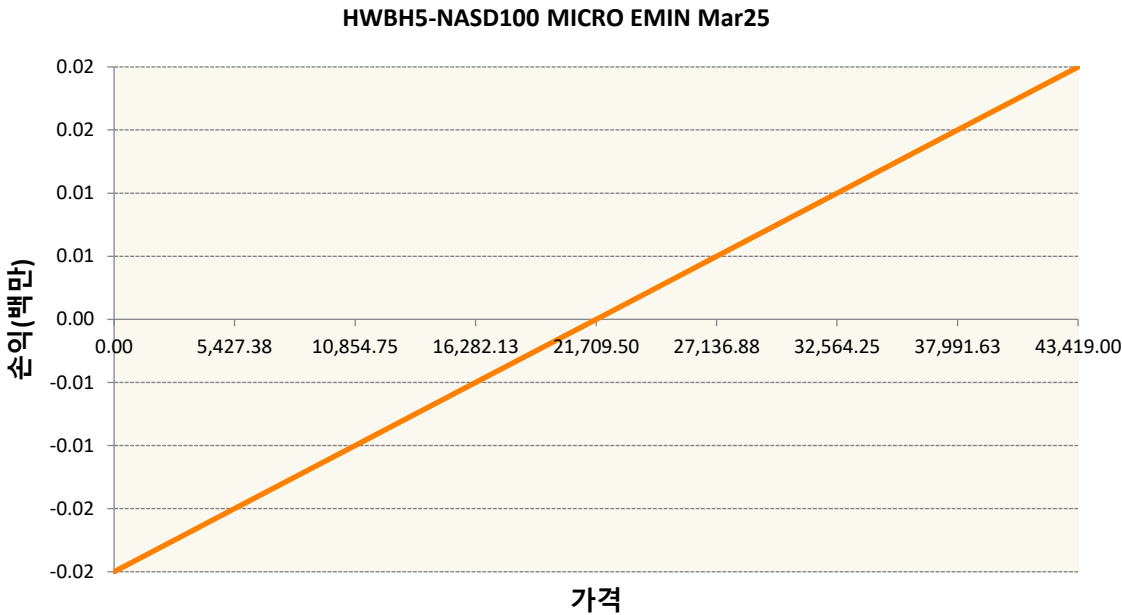
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	15,140	0	15,140	
누계	유가증권	선물	883	0	883	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	71
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,211

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,120

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

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	706
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,465
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,371
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,933

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

(단위:백만원)

9,366

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

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	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3

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

(단위:백만원)

12

공시일	2025-01-23
기준일	2025-01-22

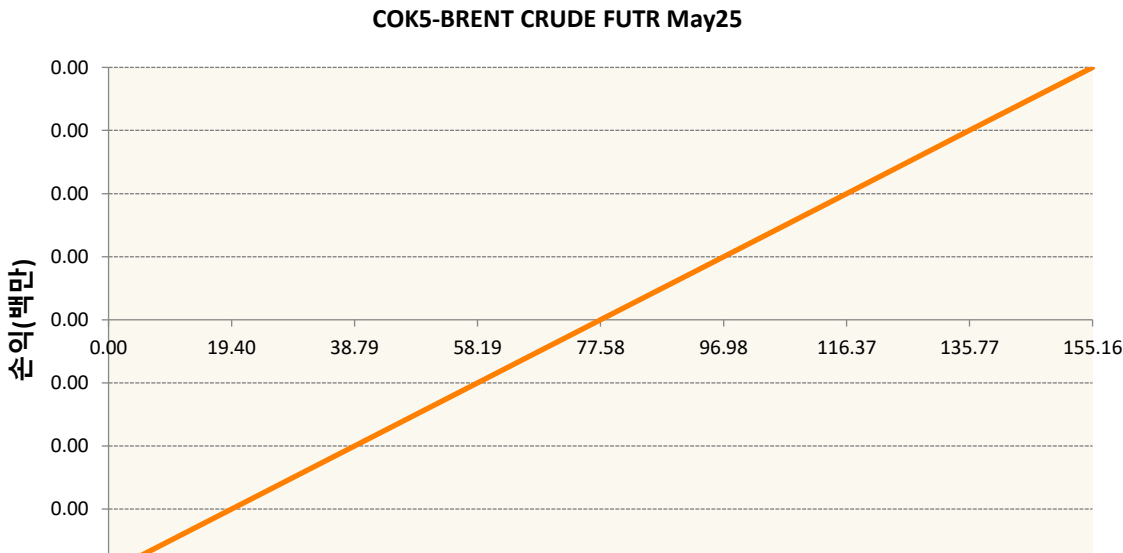
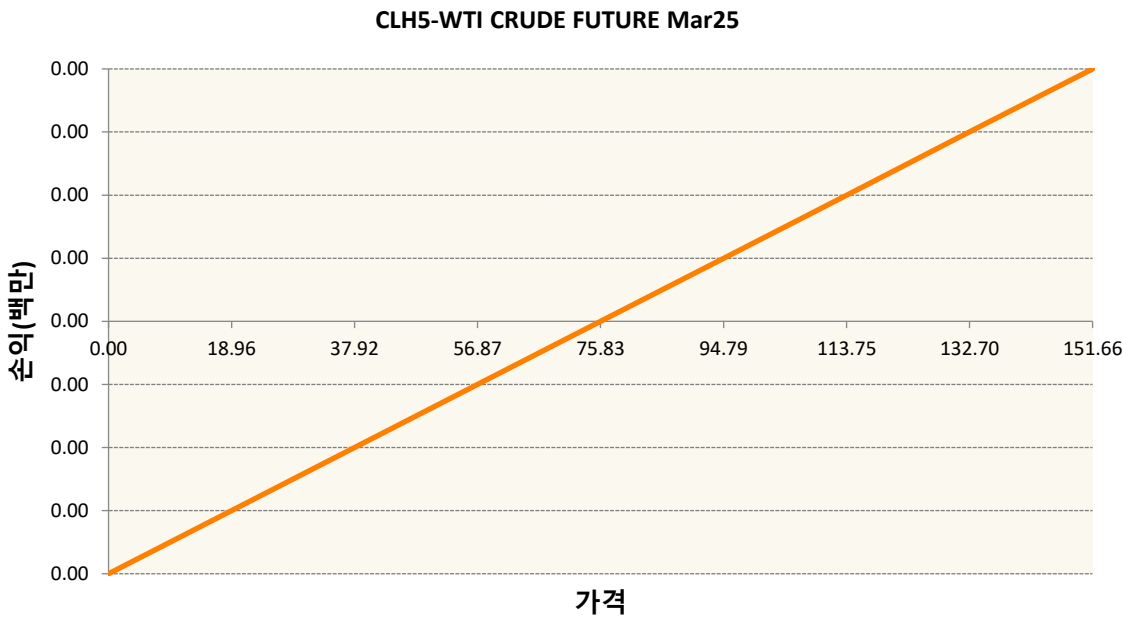
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

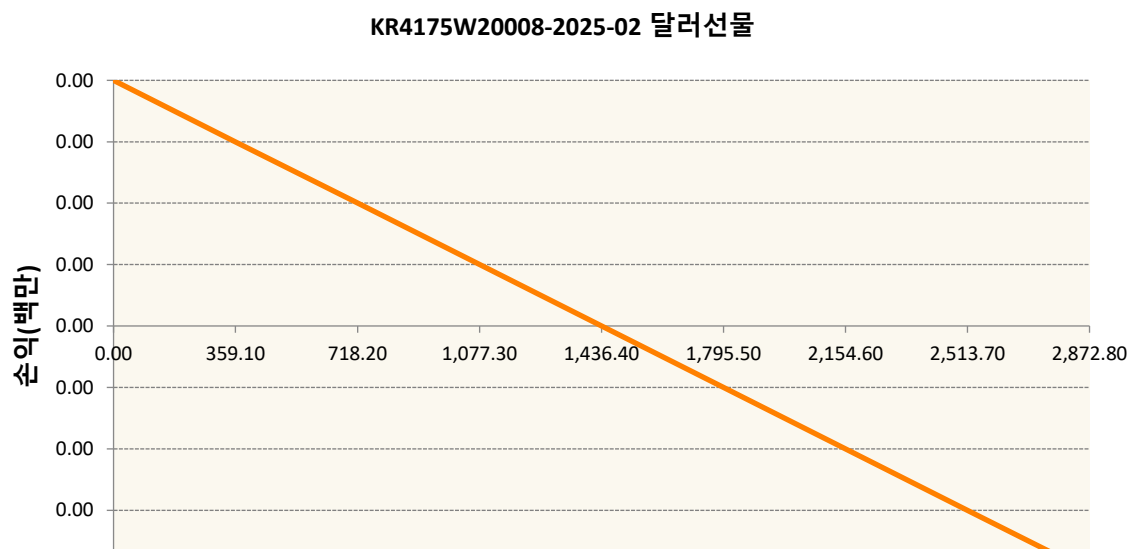
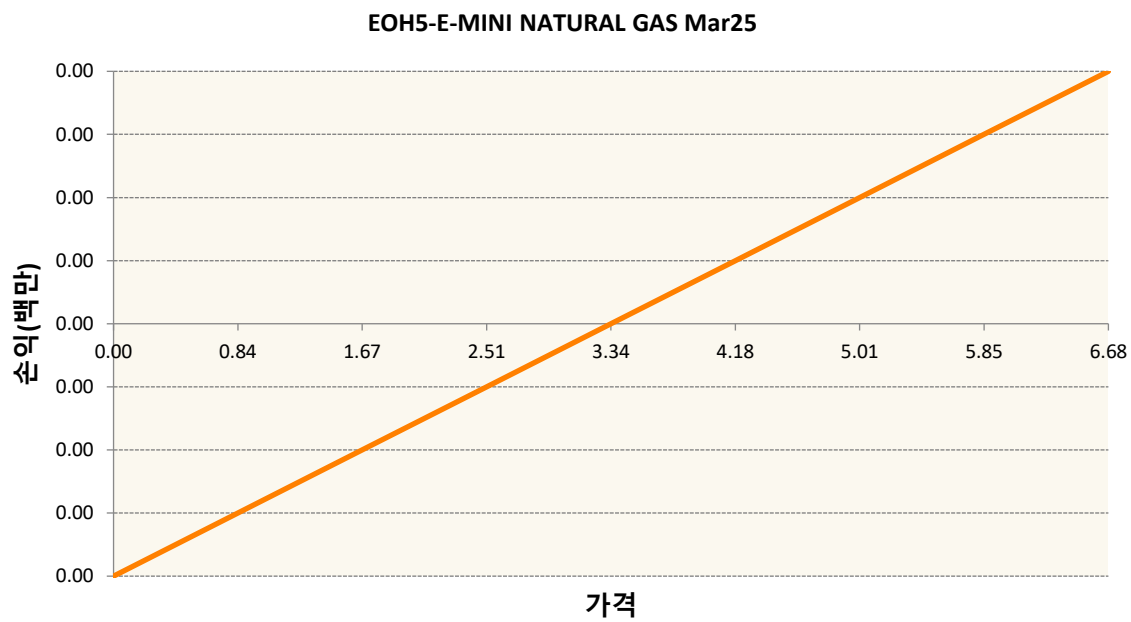
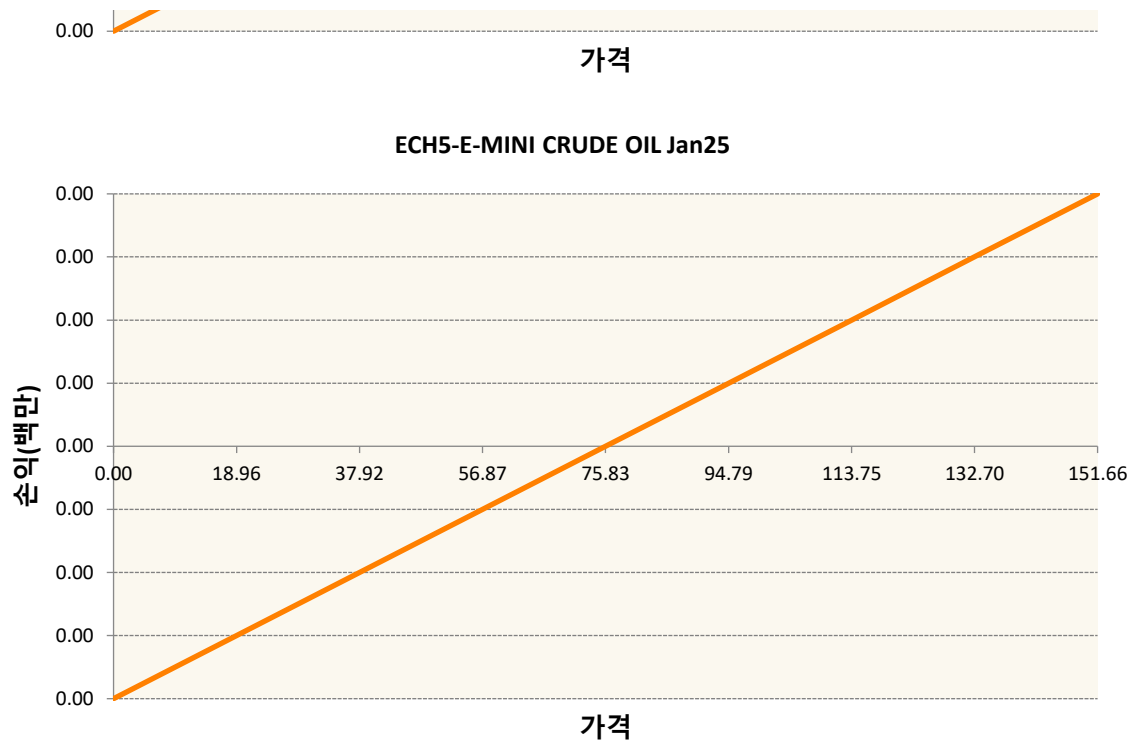
1. 계약금액

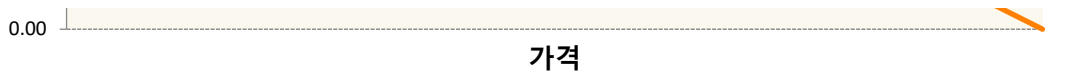
(단위:백만원)

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	29	0	29	장내
누계	선물	유가증권	109	0	109	
누계	유가증권	선물	779	0	779	
누계	통화	선물	0	172	-172	장내

2. 만기시점의 손익구조

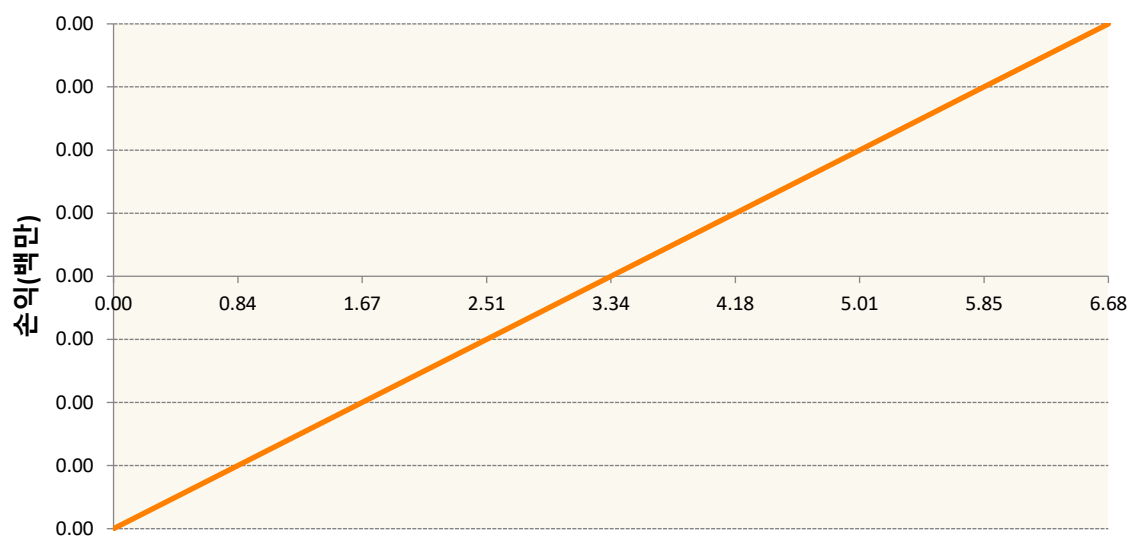






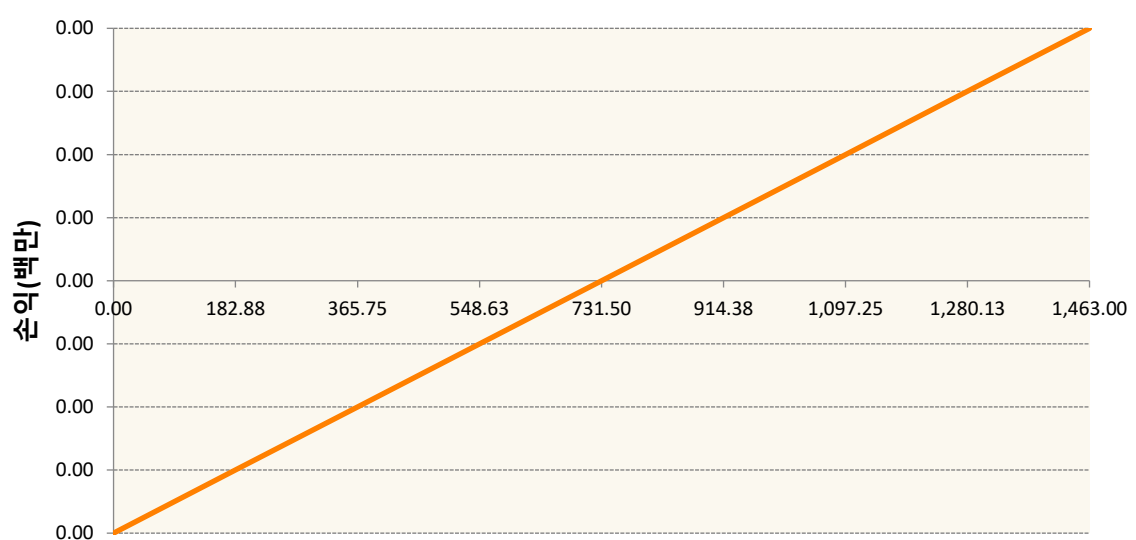
가격

NGH25-NATURAL GAS FUTR Mar25



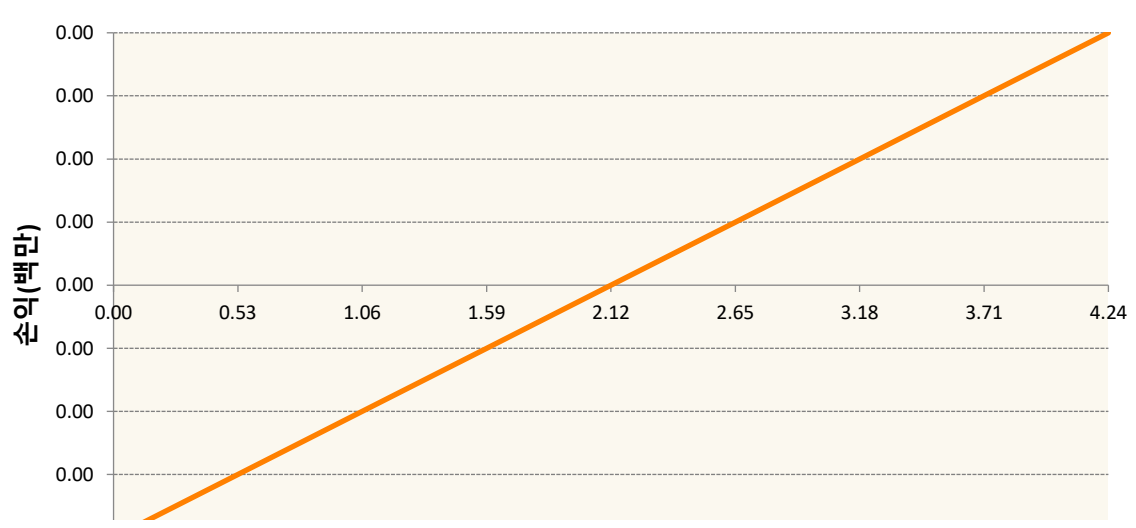
가격

QSH5-Low Su Gasoil G Mar25



가격

XBH5-GASOLINE RBOB FUT Mar25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLH5	WTI CRUDE FUTURE Mar25	9
COK5	BRENT CRUDE FUTR May25	18
ECH5	E-MINI CRUDE OIL Jan25	4
EOH5	E-MINI NATURAL GAS Mar25	6
KR4175W20(2025-02 달러선물		14
NGH25	NATURAL GAS FUTR Mar25	15
QSH5	Low Su Gasoil G Mar25	8
XBH5	GASOLINE RBOB FUT Mar25	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	159