

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

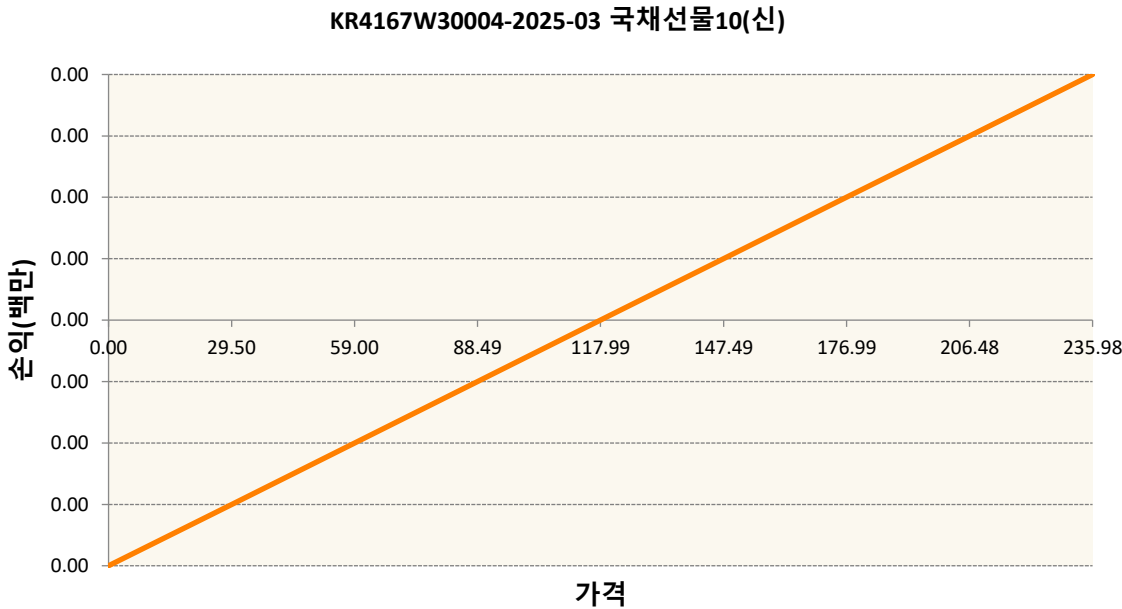
베스트장기채(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	금리	선물	0	0	0	장내
누계	금리	선물	267,837	0	267,837	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

6,802

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

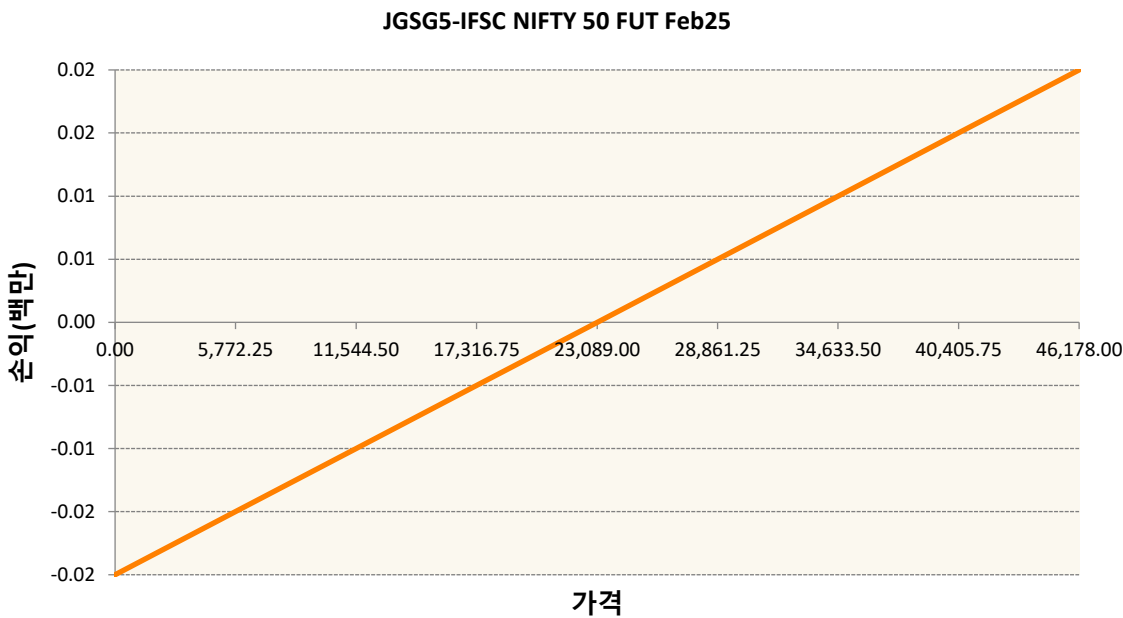
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,354	0	3,354	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSG5	IFSC NIFTY 50 FUT Feb25	268
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

182

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

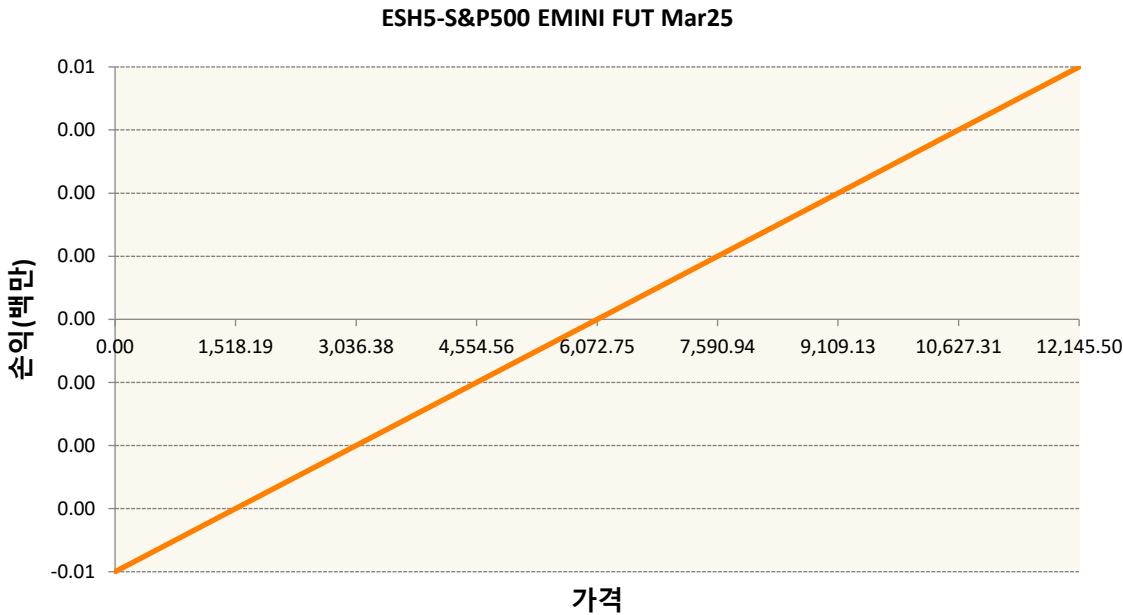
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	873	0	873	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	70
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

96

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

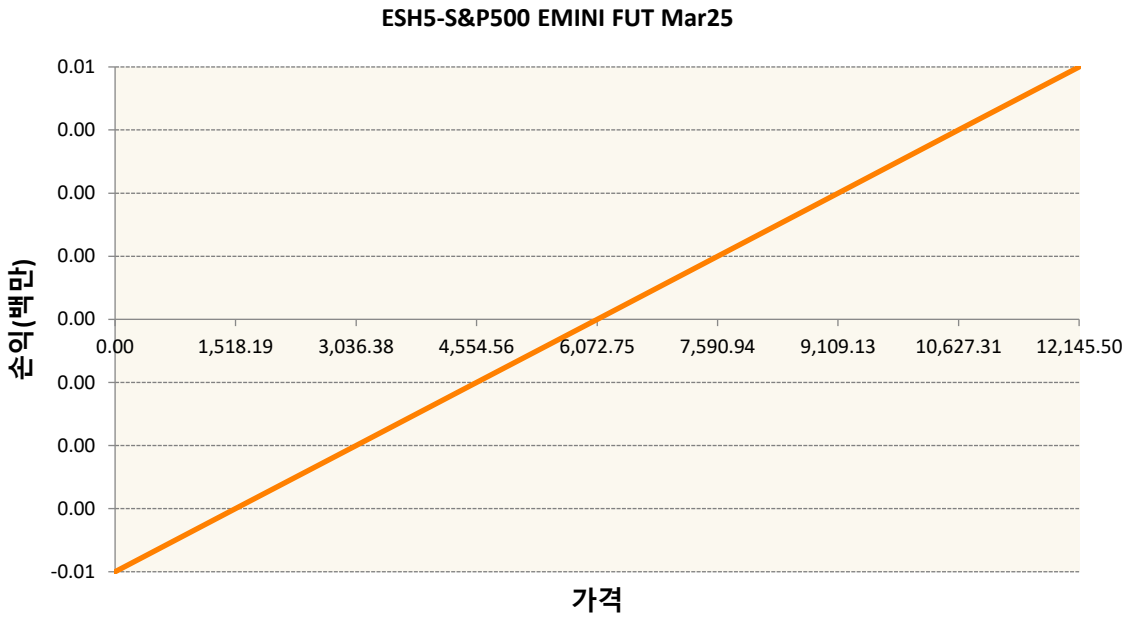
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,644	0	2,644	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	212
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

290

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

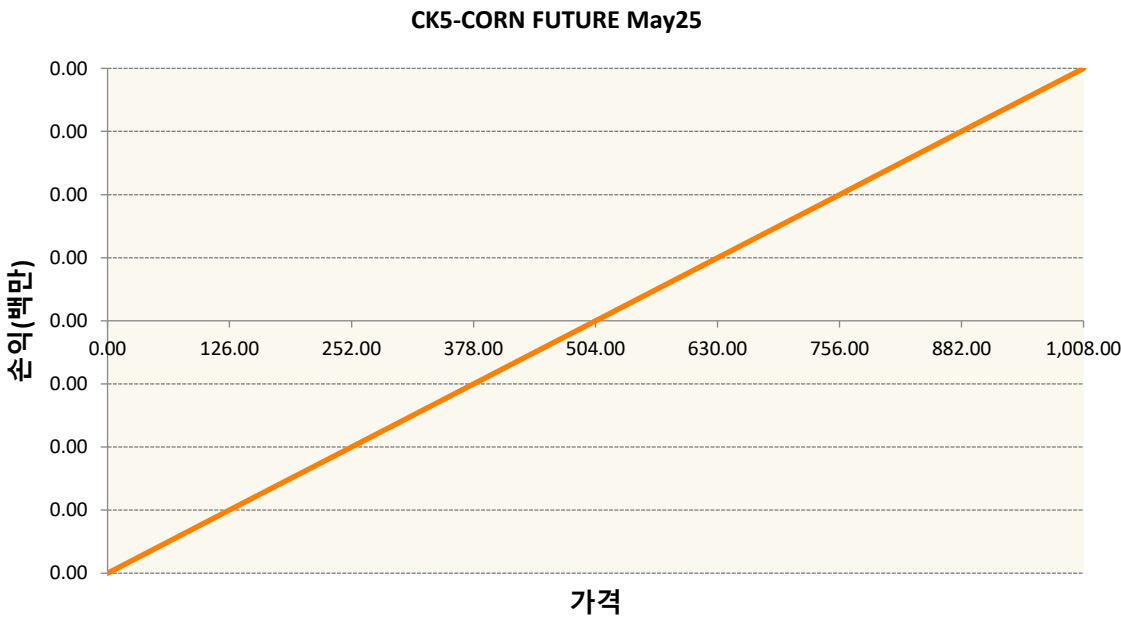
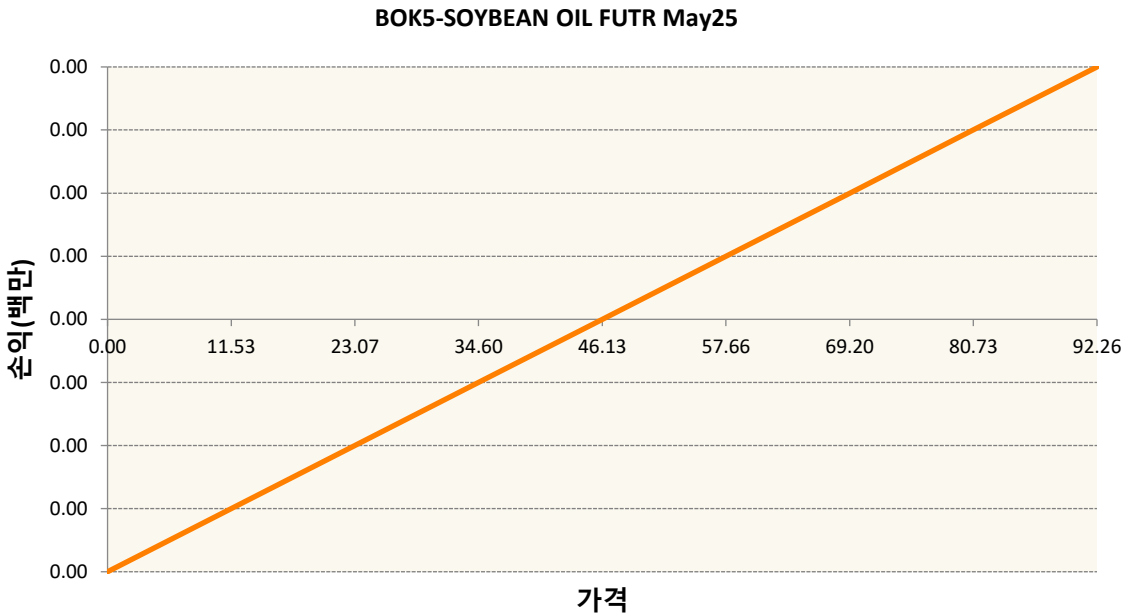
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

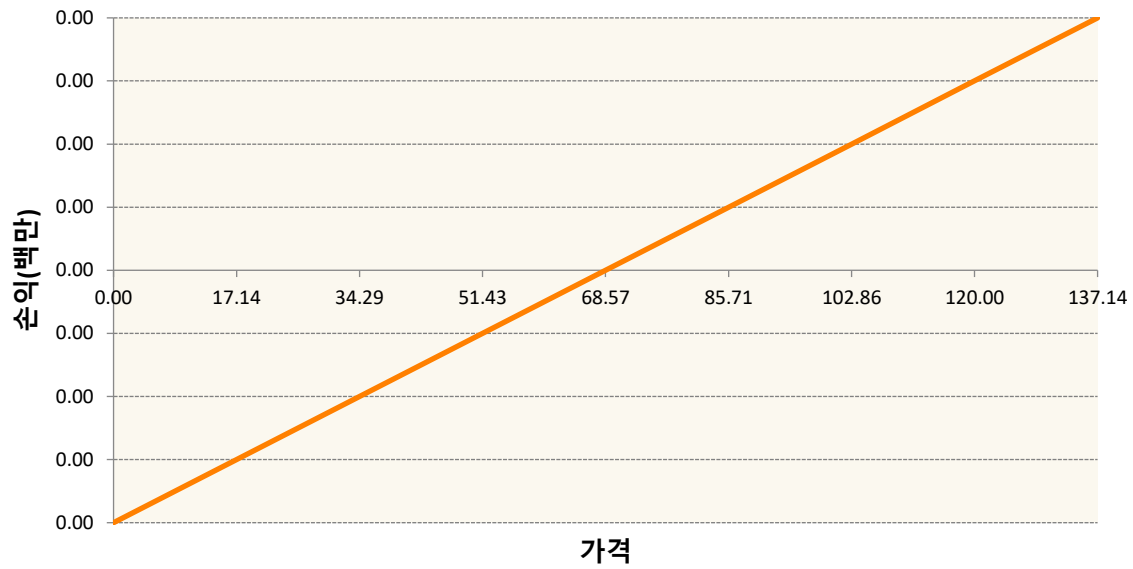
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	638	-638	장내
누계	유가증권	선물	4,034	0	4,034	
누계	통화	선물	0	637	-637	장내

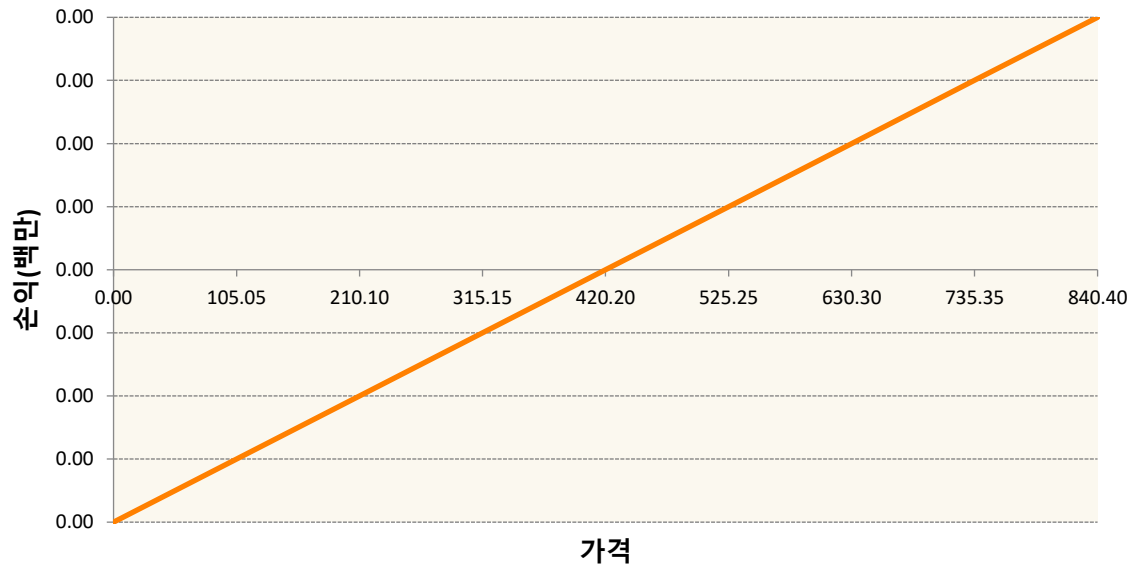
2. 만기시점의 손익구조



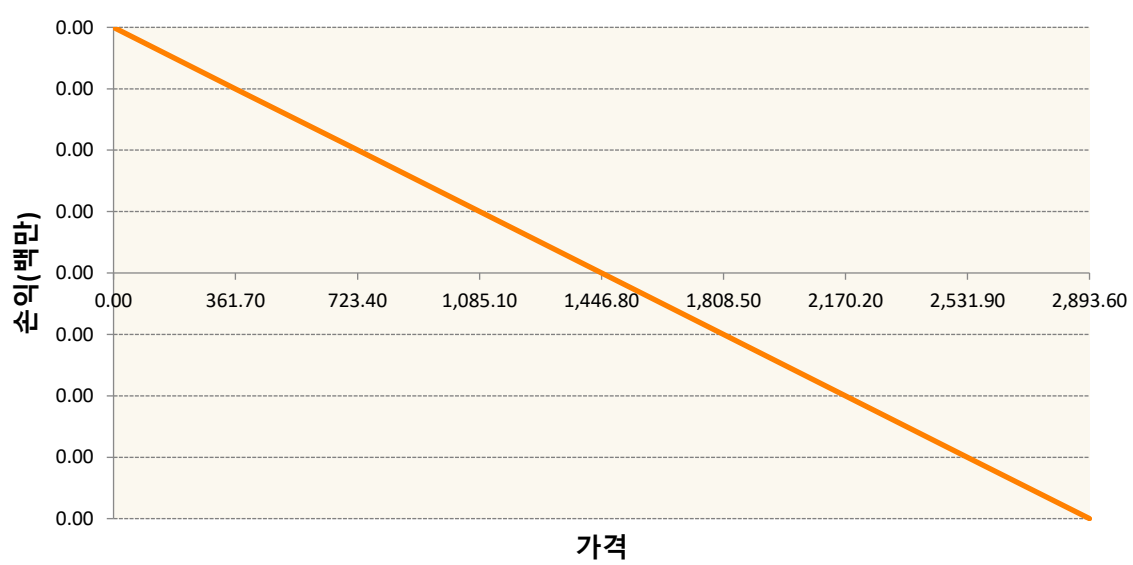
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



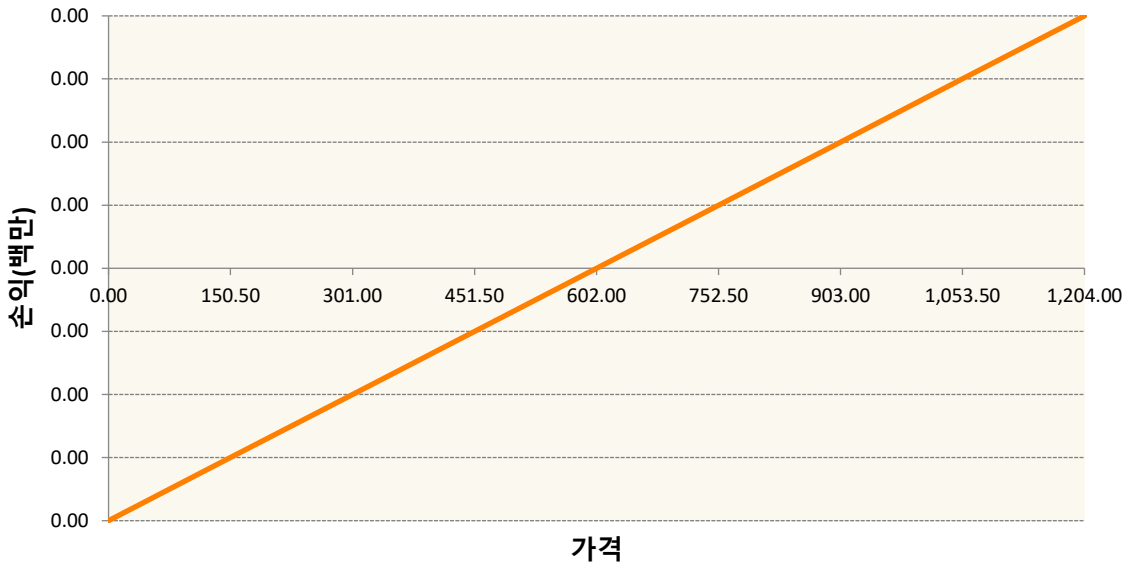
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



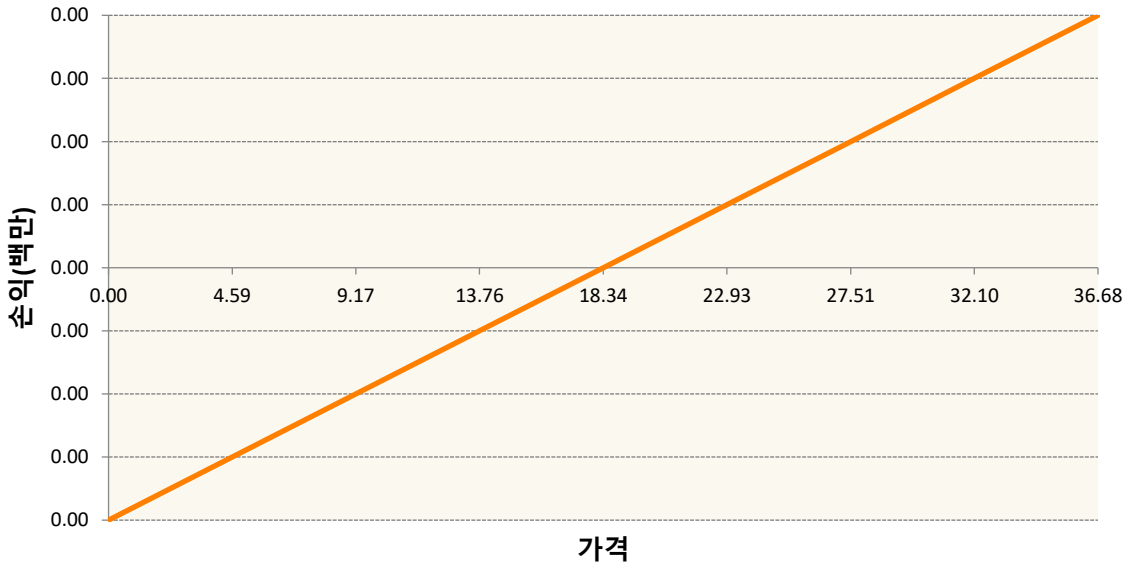
KR4175W30007-2025-03 달러선물



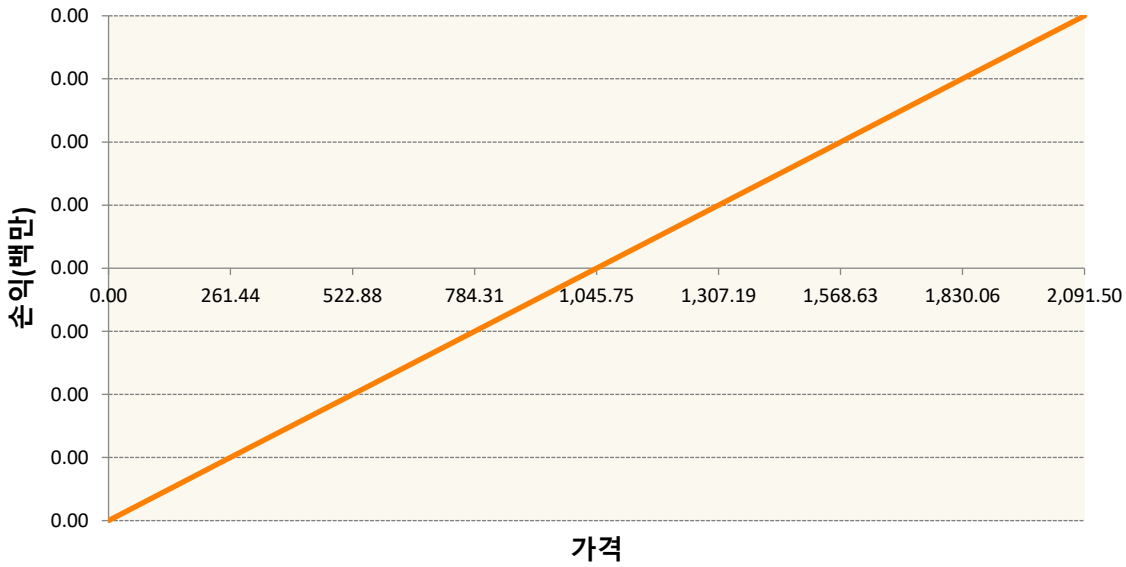
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



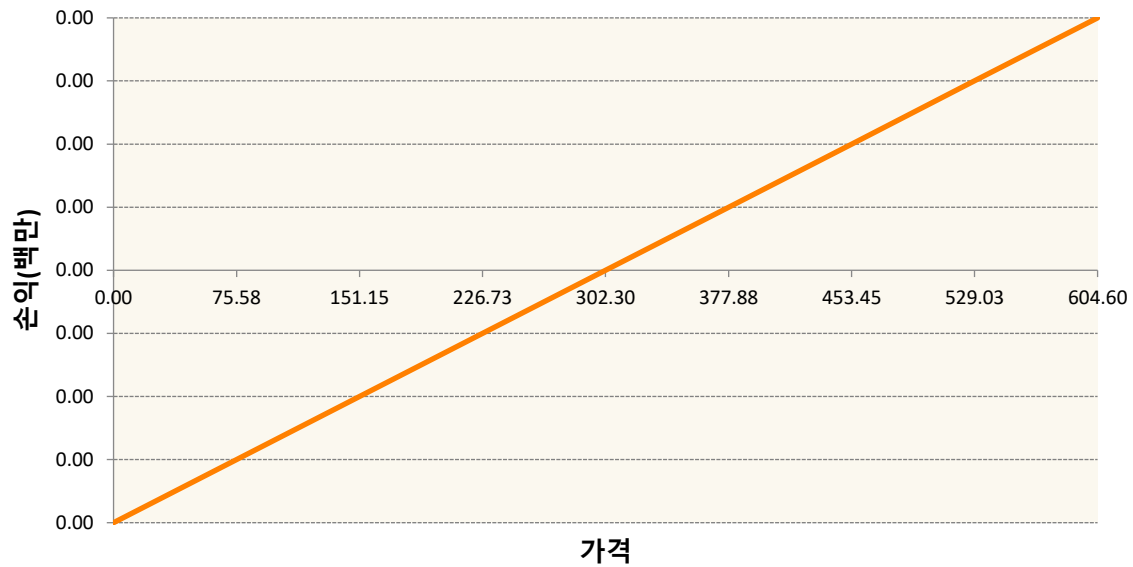
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



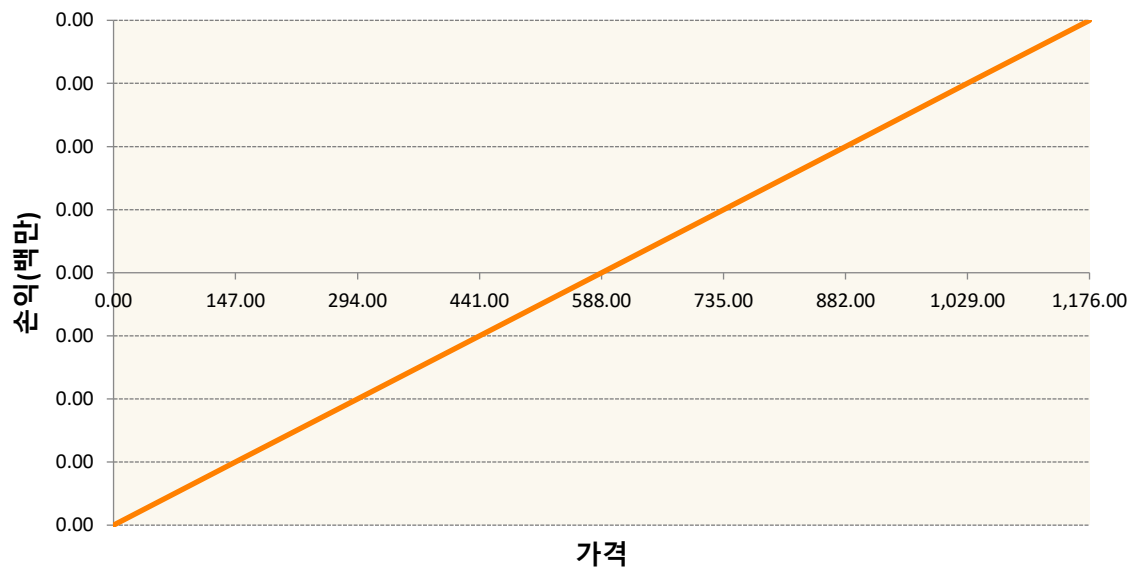
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



SMK5-SOYBEAN MEAL FUTR May 25



WK5-WHEAT FUTURE(CBT) May25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

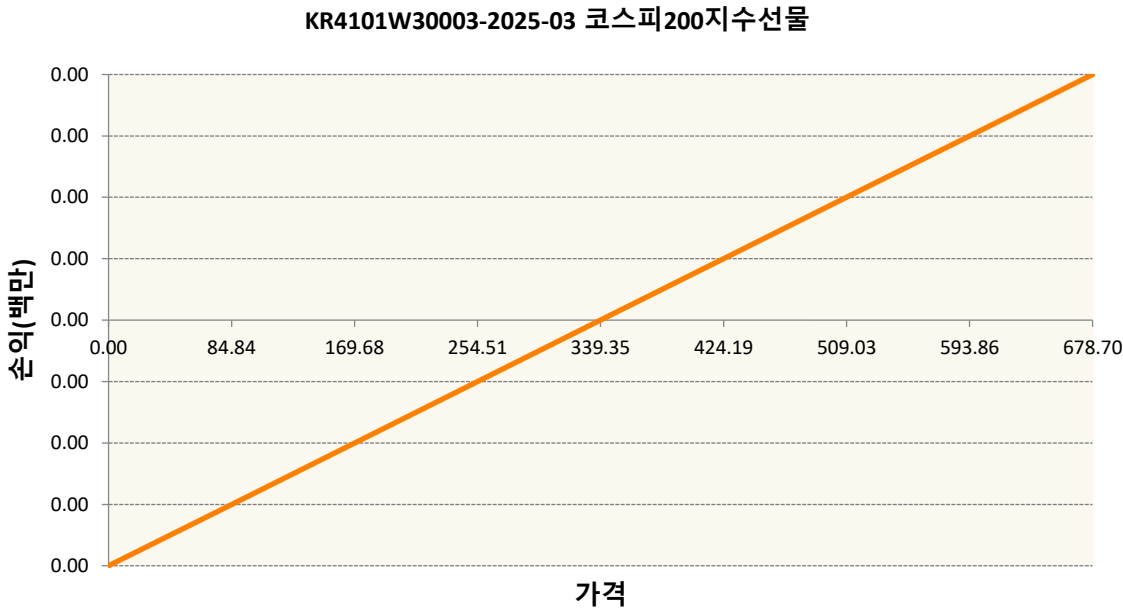
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,698	0	1,698	장내
누계	유가증권	선물	2,291	0	2,291	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물

183

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

(단위:백만원)

226

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,730	0	3,730	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래241219

303

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

497

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

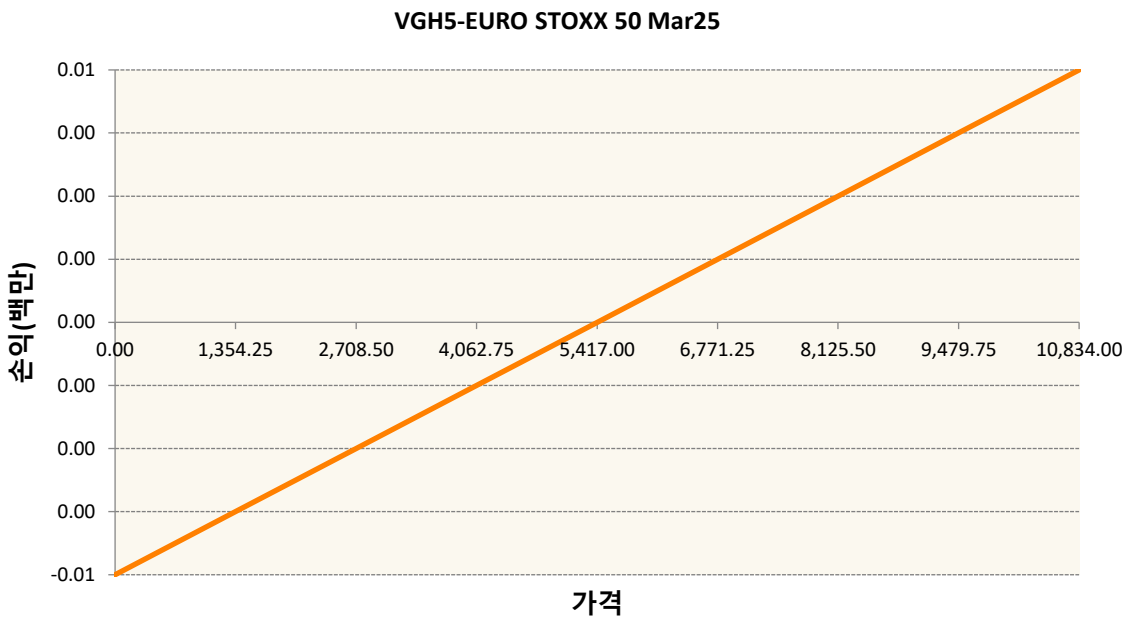
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	980	0	980	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar25	78
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

52

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

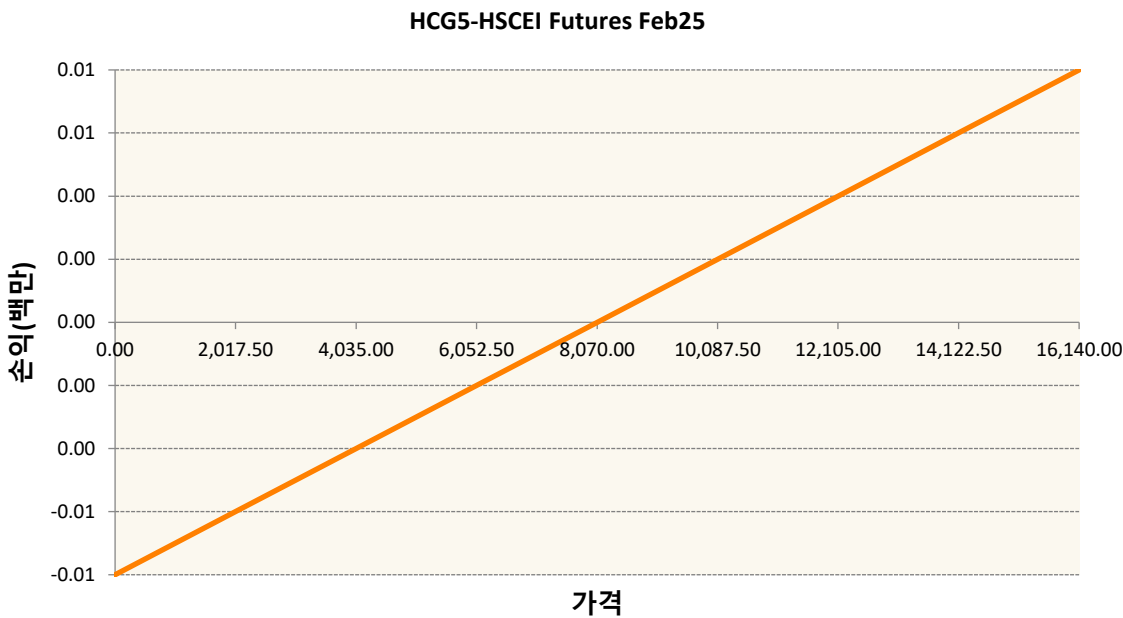
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,708	0	1,708	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG5	HSCEI Futures Feb25	137
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

183

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

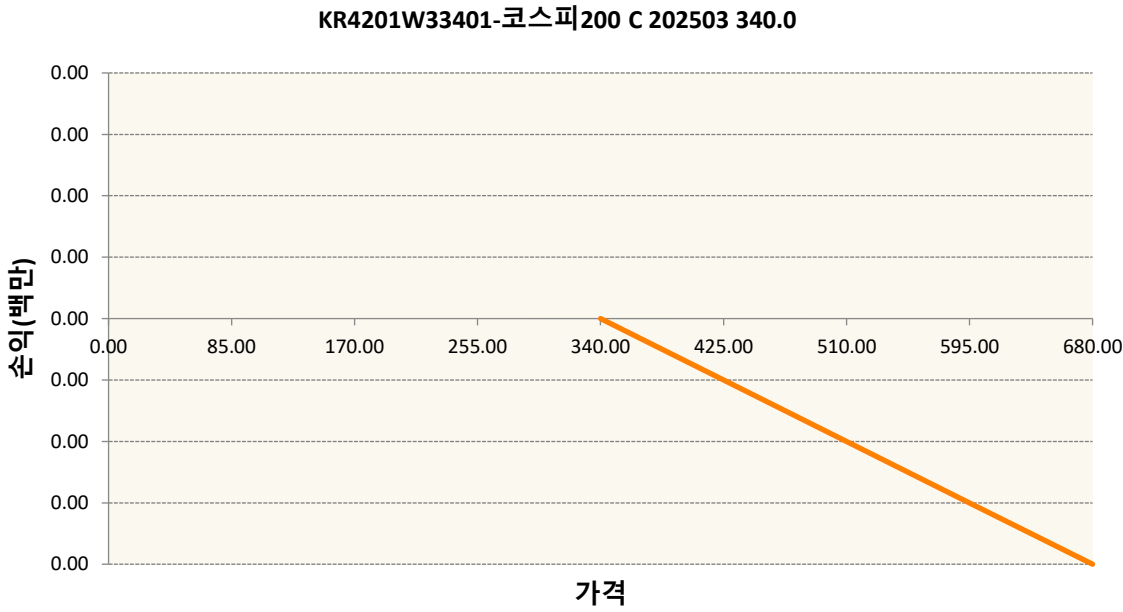
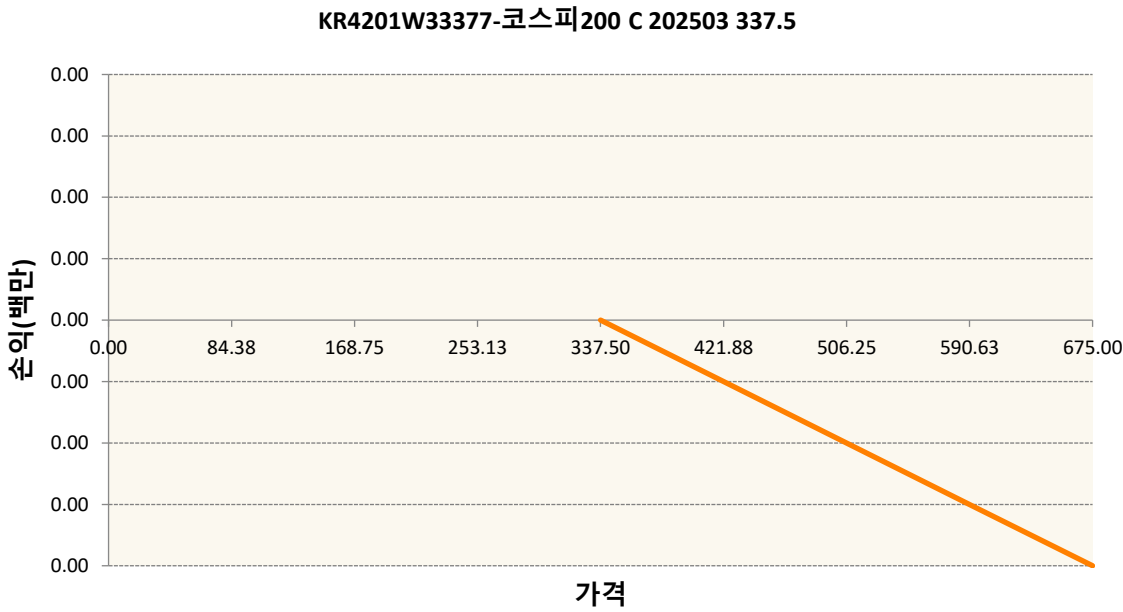
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	25,826	-25,826	장내
누계	유가증권	옵션	0	25,403	-25,403	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201W33377						코스피200 C 202503 337.5		111
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	51	50	49	47	45	43	40	
-5.33%	46	43	41	38	35	32	29	
-2.67%	33	30	26	23	19	16	12	
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11	
2.67%	-21	-24	-27	-30	-33	-36	-40	
5.33%	-60	-61	-63	-66	-68	-71	-73	
8.00%	-102	-103	-104	-106	-107	-109	-111	
KR4201W33401						코스피200 C 202503 340.0		1,498
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	634	619	601	580	555	528	499	
-5.33%	573	543	510	474	437	398	358	
-2.67%	426	380	334	287	240	192	144	
0%	153	102	51	0	-51	-102	-153	
2.67%	-255	-298	-343	-389	-436	-484	-532	
5.33%	-771	-800	-832	-867	-905	-944	-984	
8.00%	-1,354	-1,369	-1,389	-1,412	-1,438	-1,466	-1,498	

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

1,584

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	675	0	675	

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	2025-02-14
기준일	2025-02-13

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	4,460	0	4,460	

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	2025-02-14
기준일	2025-02-13

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	13,177	0	13,177	
누계	통화	선도	0	13,100	-13,100	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E		562
FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E		258
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E		211
FXW213F24C KRW/USD 28-02-25E		17
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	446

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

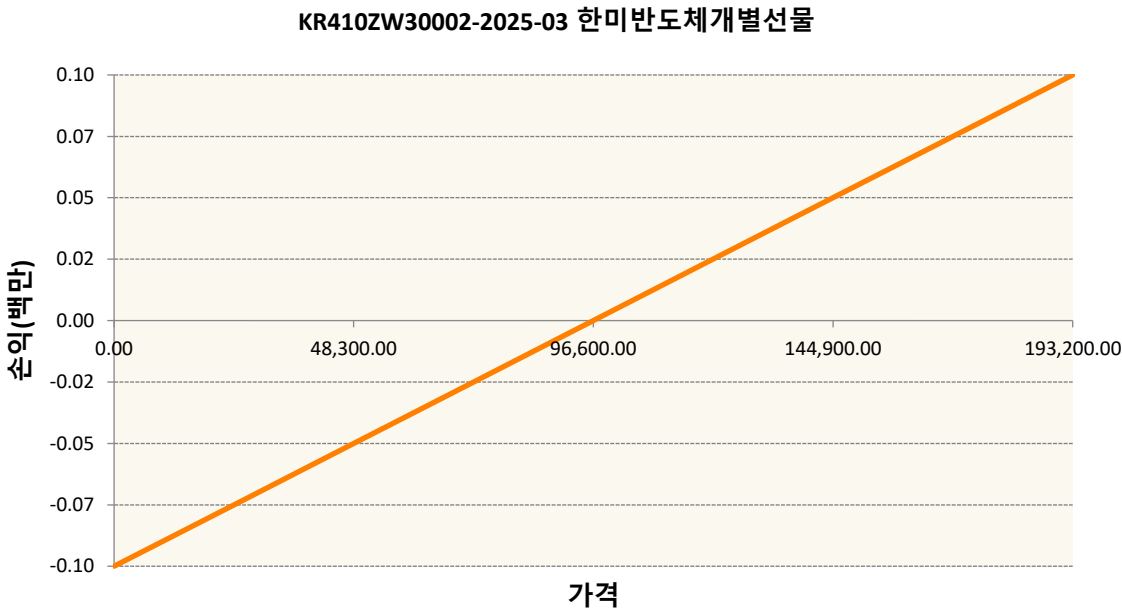
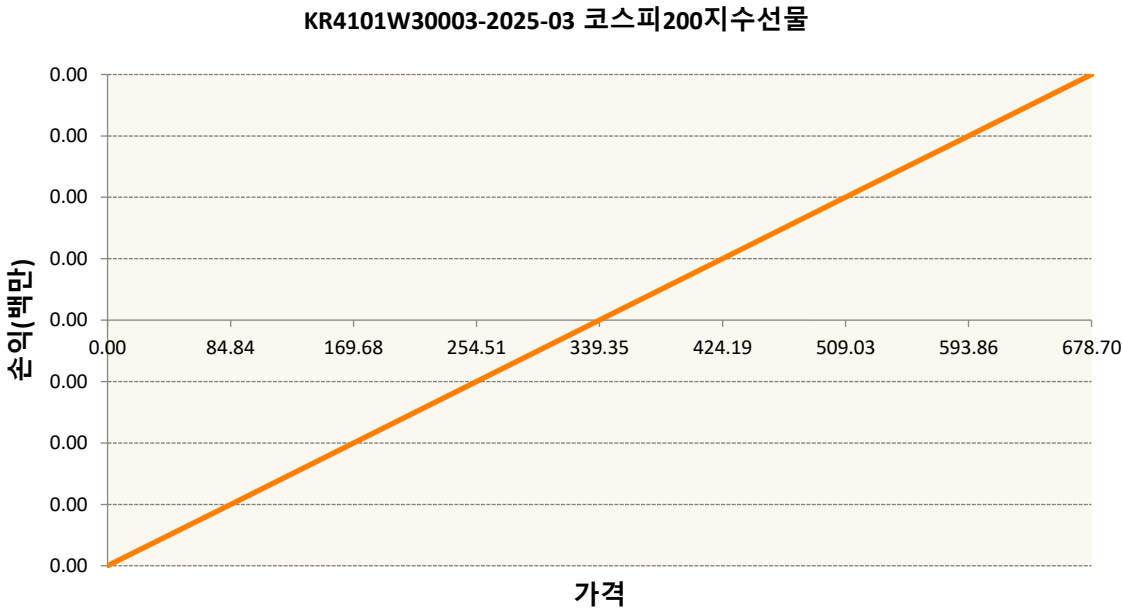
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

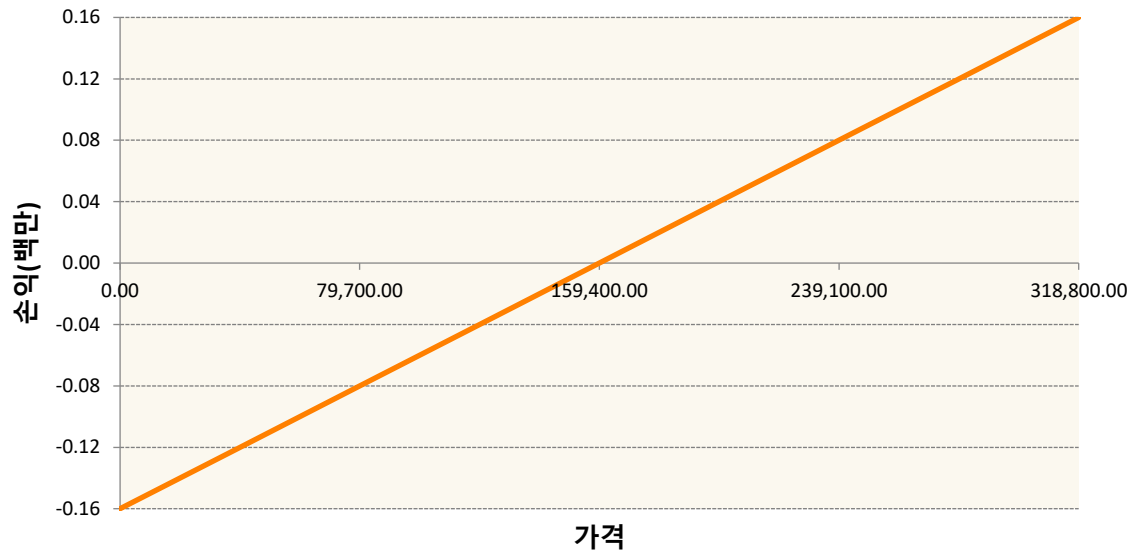
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	46	0	46	장내
누계	유가증권	선물	837	0	837	장내

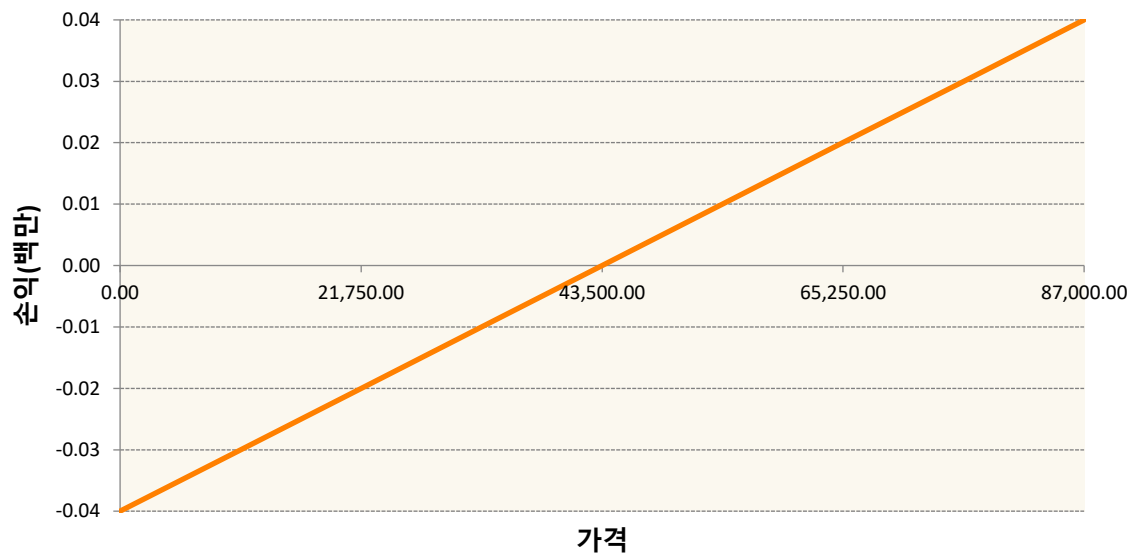
2. 만기시점의 손익구조



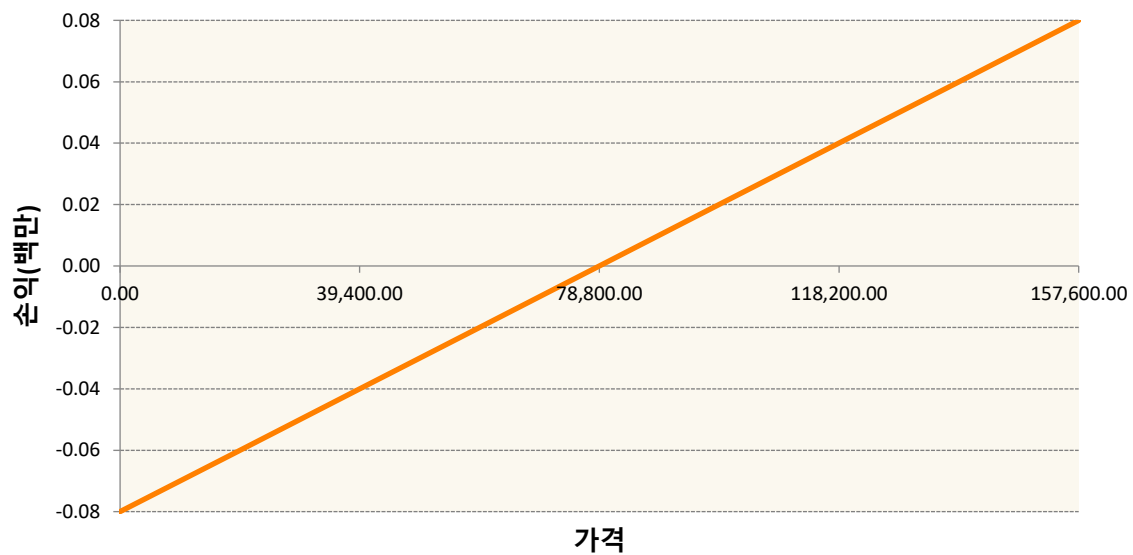
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



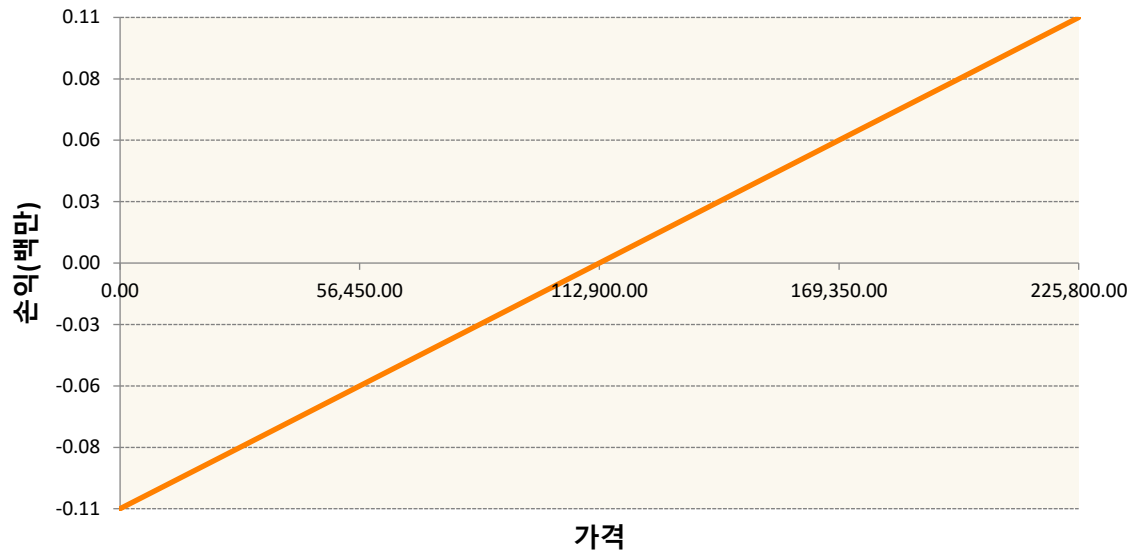
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



KR41FMW30007-2025-03 엘앤에프개별선물



KR41HEW30000-2025-03 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물
KR41FMW30 2025-03 엘앤에프개별선물
KR41HEW30 2025-03 키움증권개별선물

61
2
2
1
1
1

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

(단위:백만원)

93

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

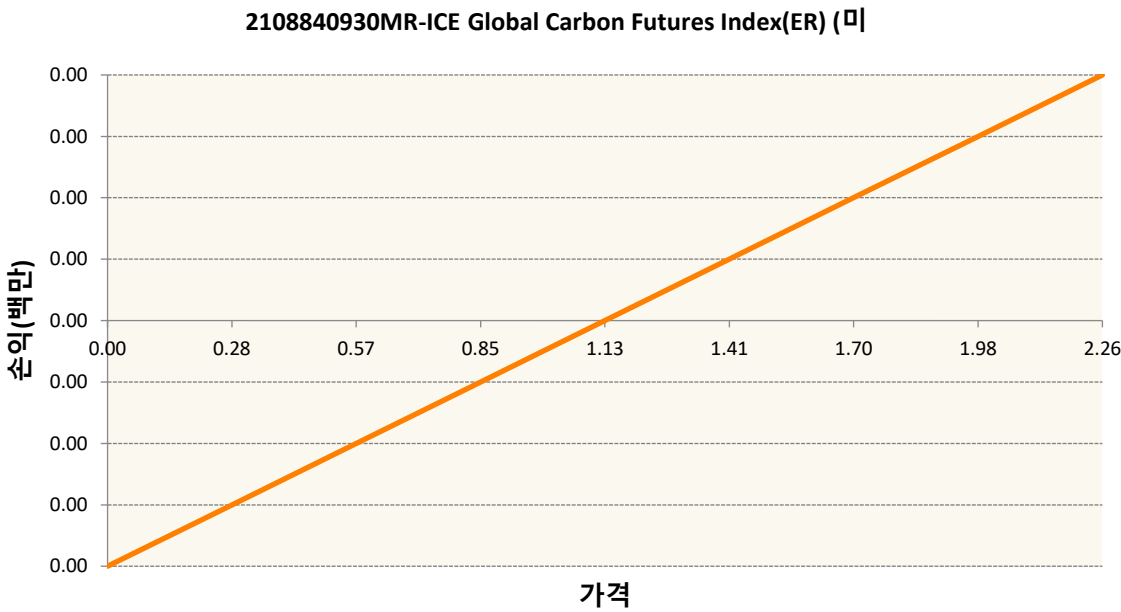
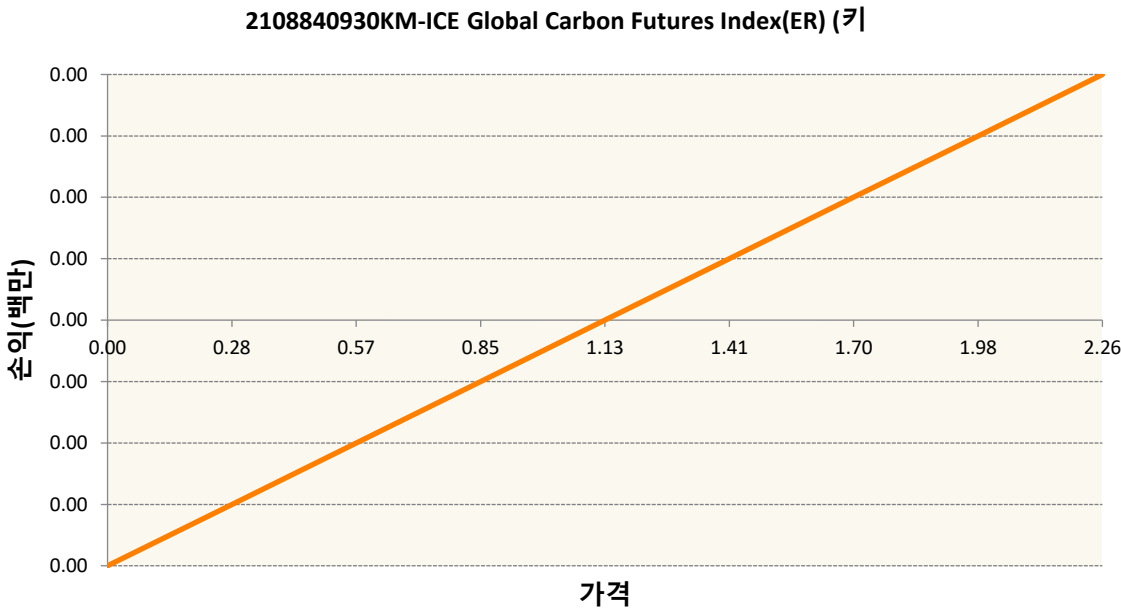
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

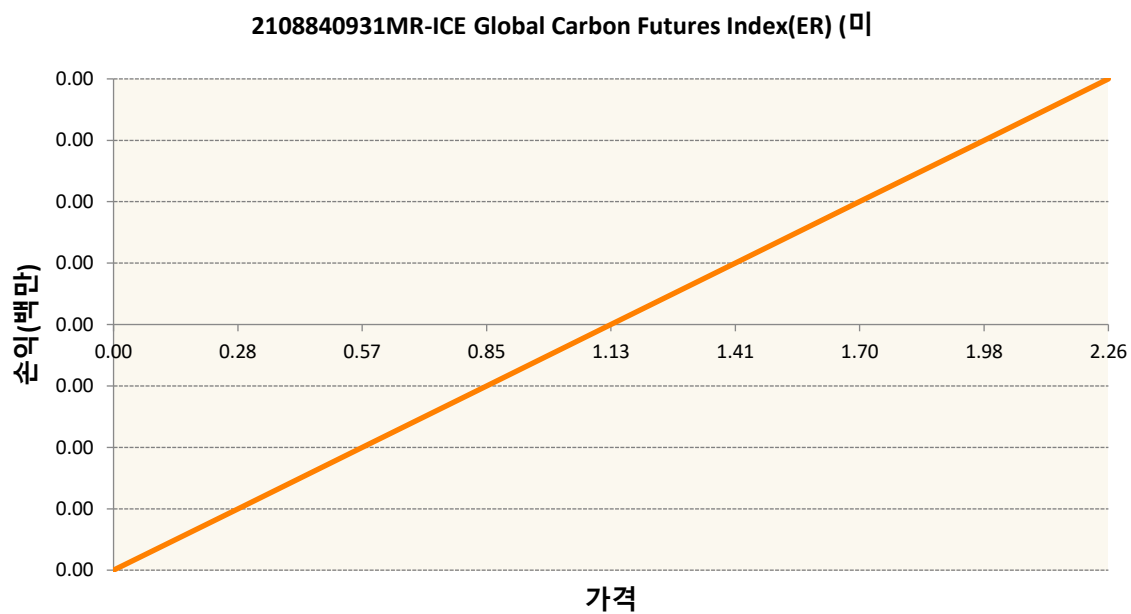
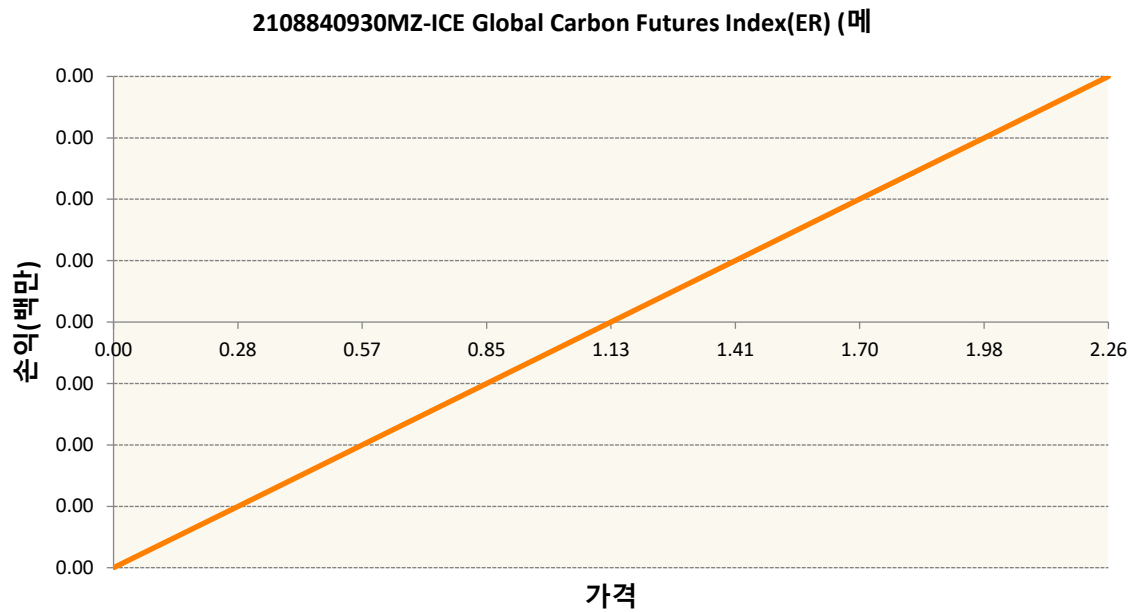
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	12,631	0	12,631	

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (키		100
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		504
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		202
2108840931ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		202

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,099

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

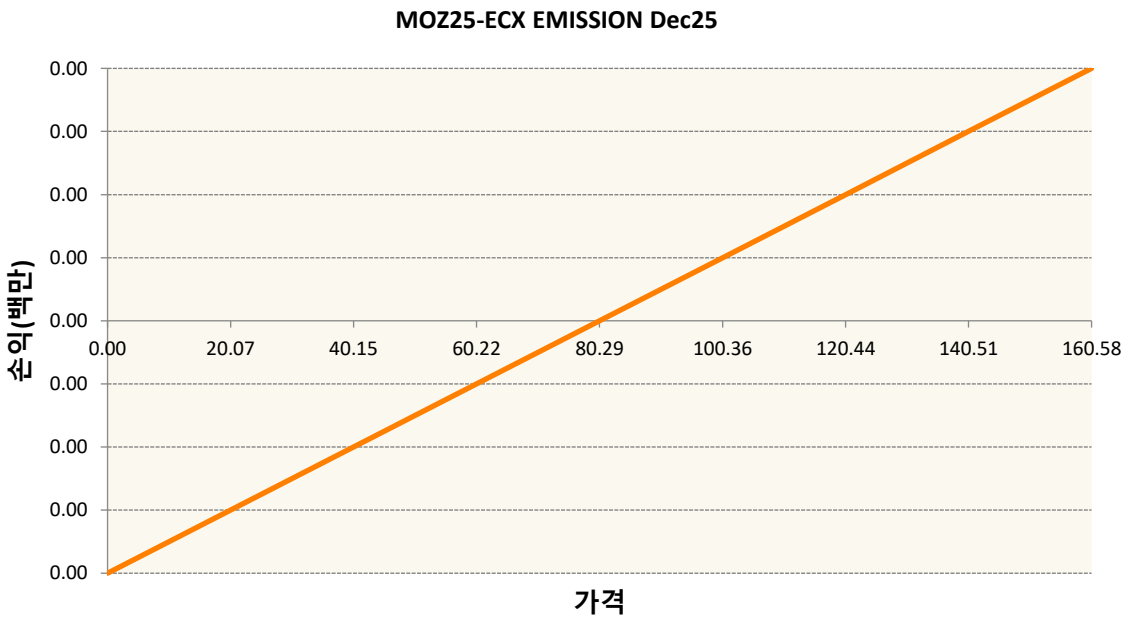
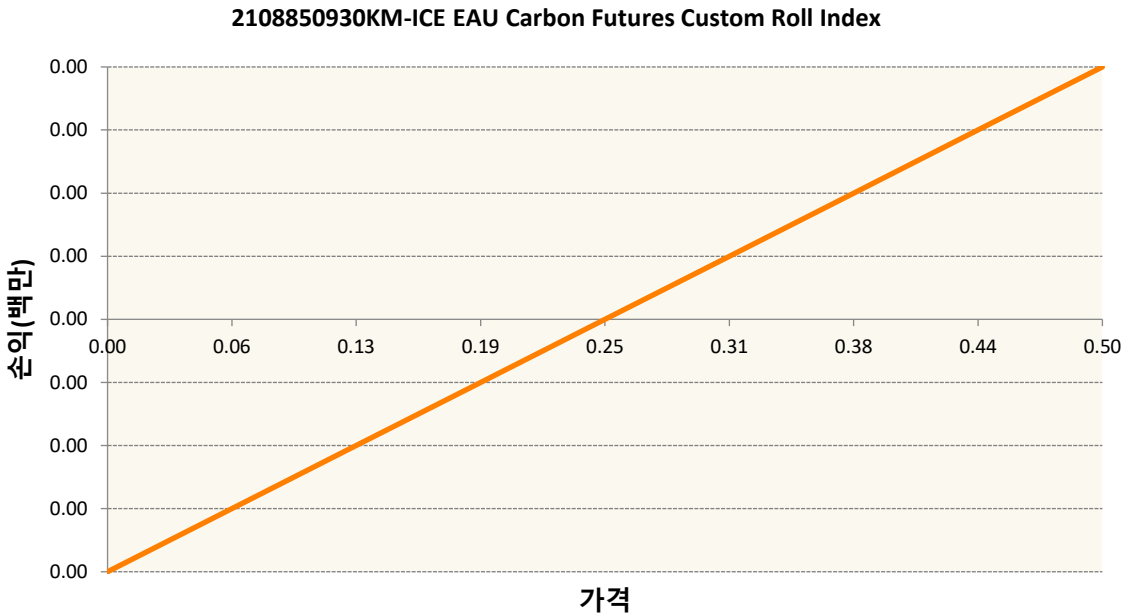
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	10,038	0	10,038	
누계	통화	선도	0	1,586	-1,586	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	7
FXW213F1PC KRW/EUR 28-02-25E	40
FXW213F1PC KRW/EUR 28-02-25E	87
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	796

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

1,434

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,425	0	4,425	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	6

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

(단위:백만원)

32

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,700	0	7,700	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	4

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

(단위:백만원)

82

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

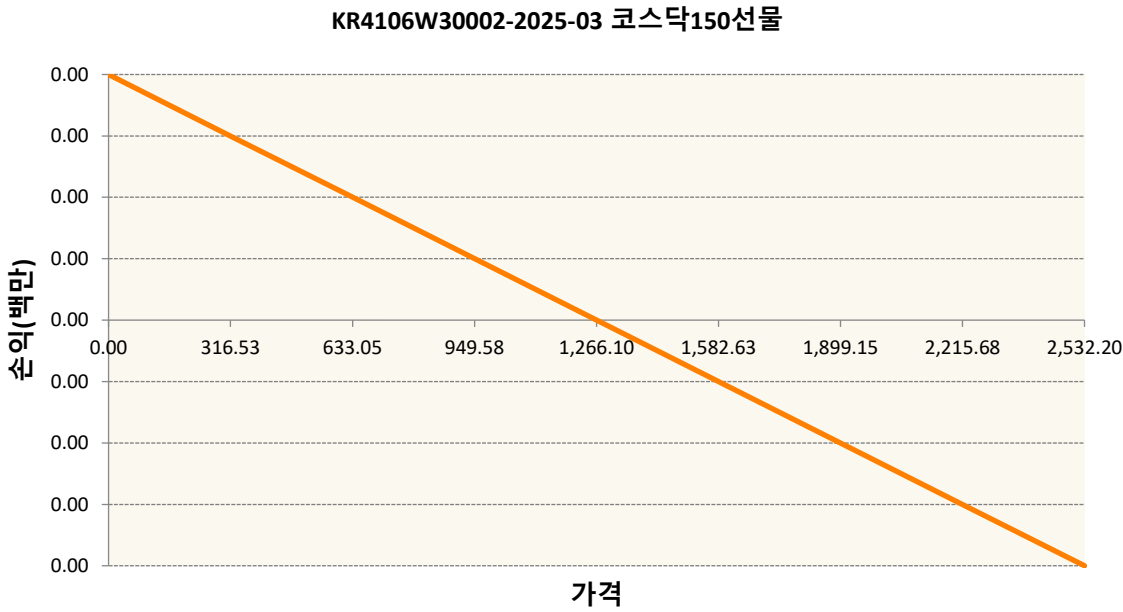
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	13	-13	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4106W30(2025-03 코스닥150선물

1

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

(단위:백만원)

2

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

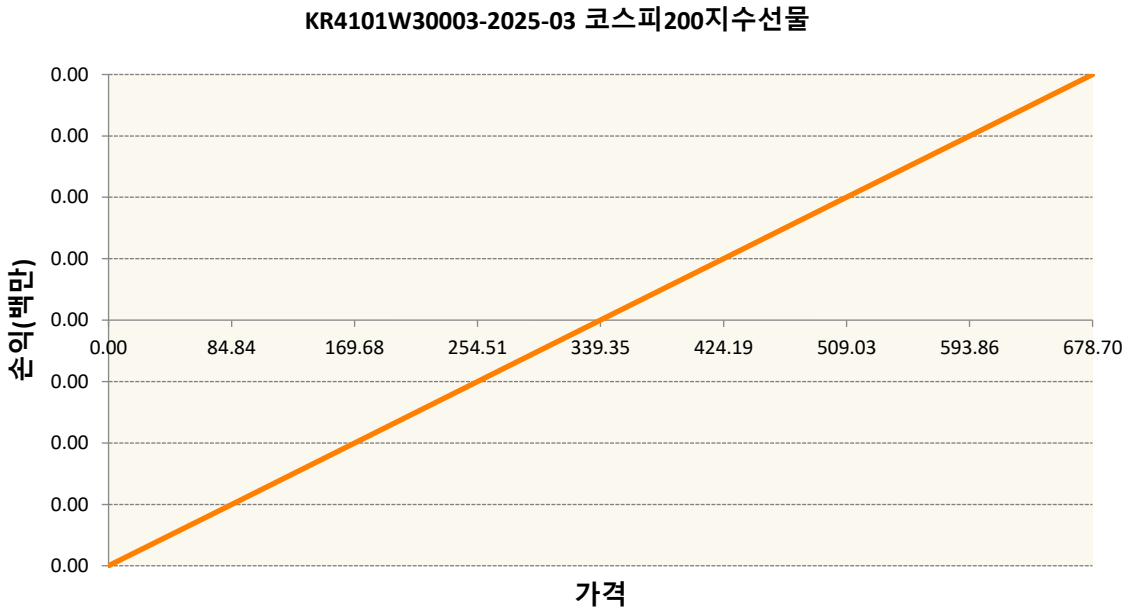
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	9,754	0	9,754	장내
누계	유가증권	선물	16,968	0	16,968	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물

1,357

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

(단위:백만원)

1,677

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

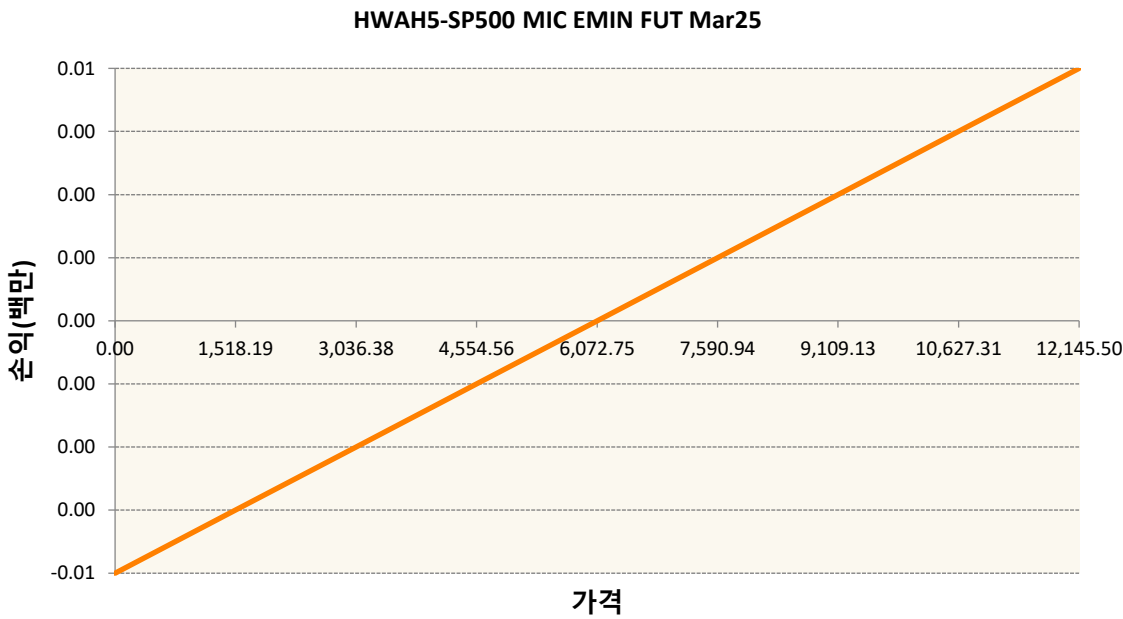
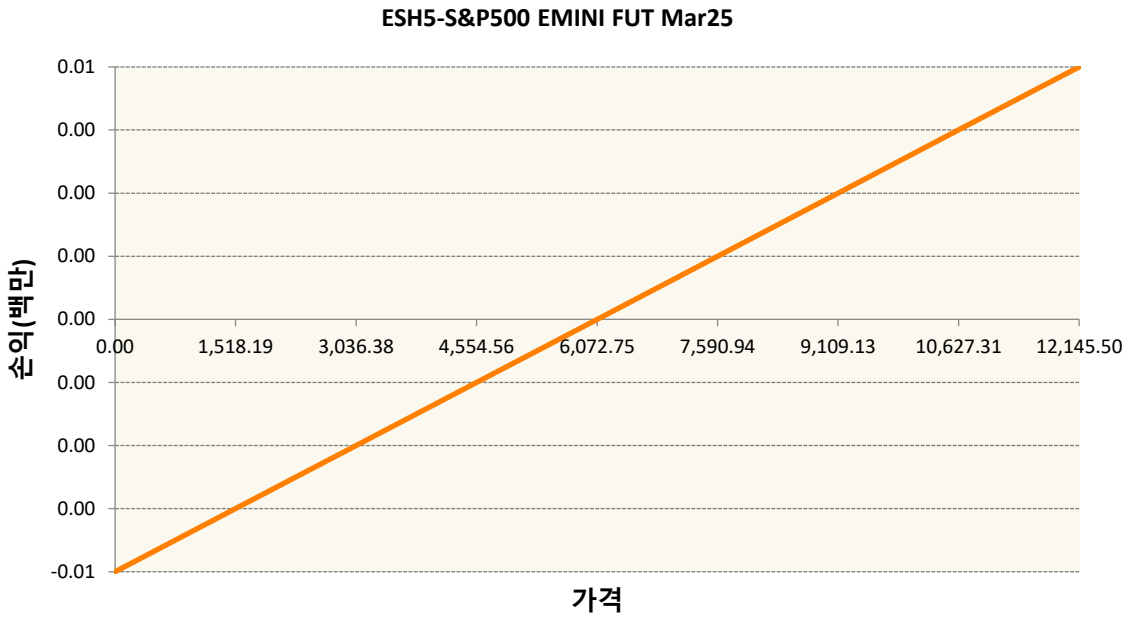
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	29,550	0	29,550	
누계	유가증권	선물	1,058	0	1,058	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,364
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	85

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,290

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

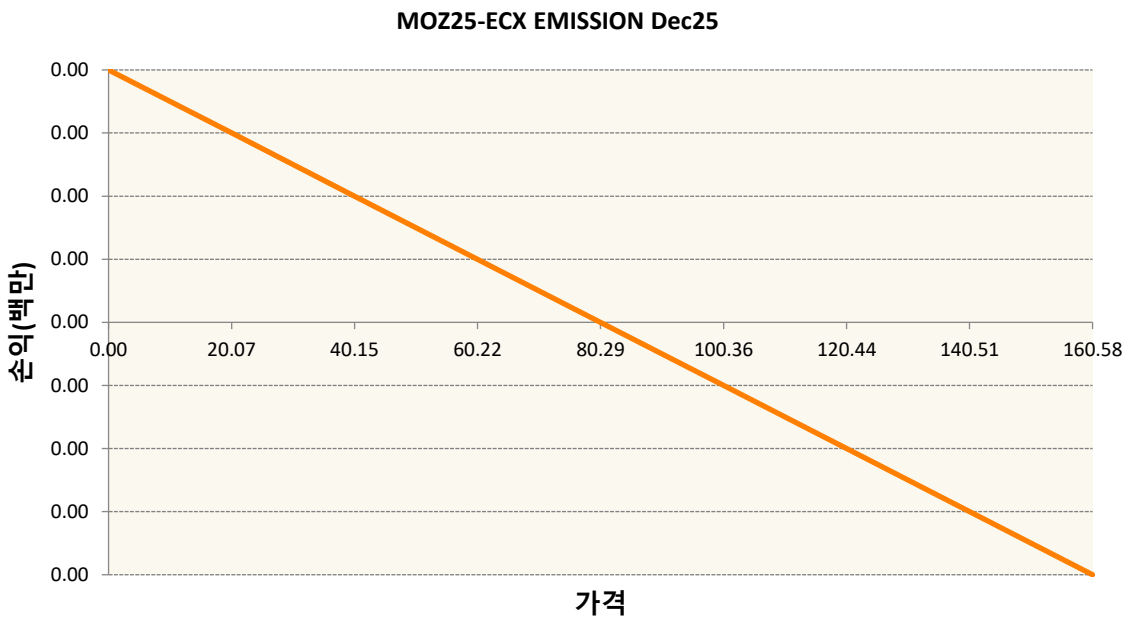
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	-85	3,596	-3,681	
누계	통화	선도	0	699	-699	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	7
FXW213F1PC KRW/EUR 28-02-25E	56
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	288

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

(단위:백만원)

528

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

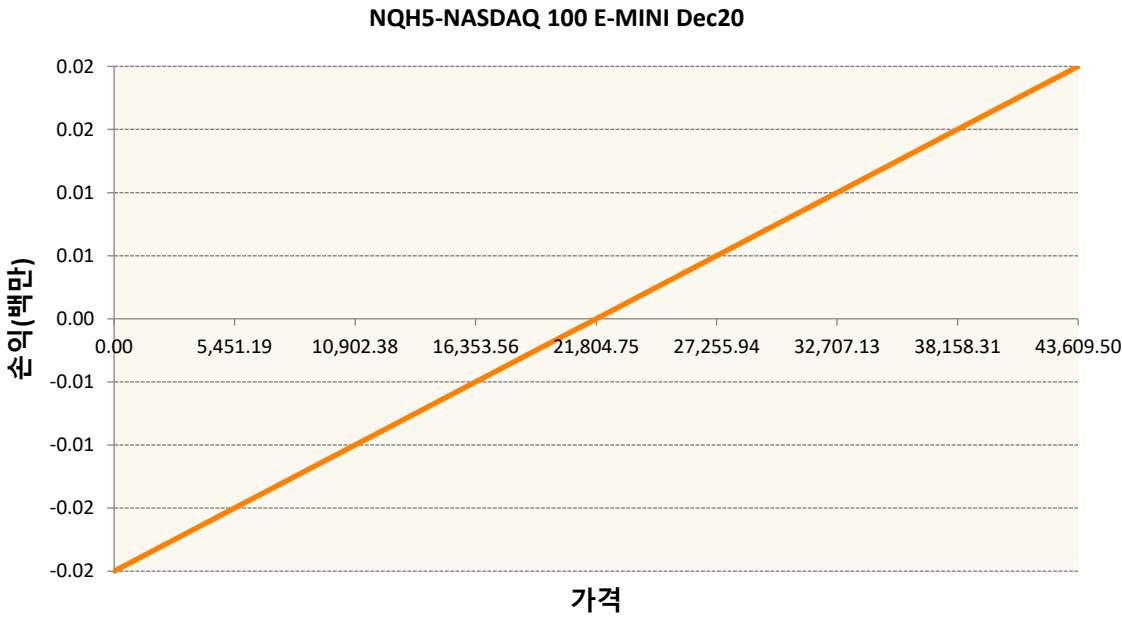
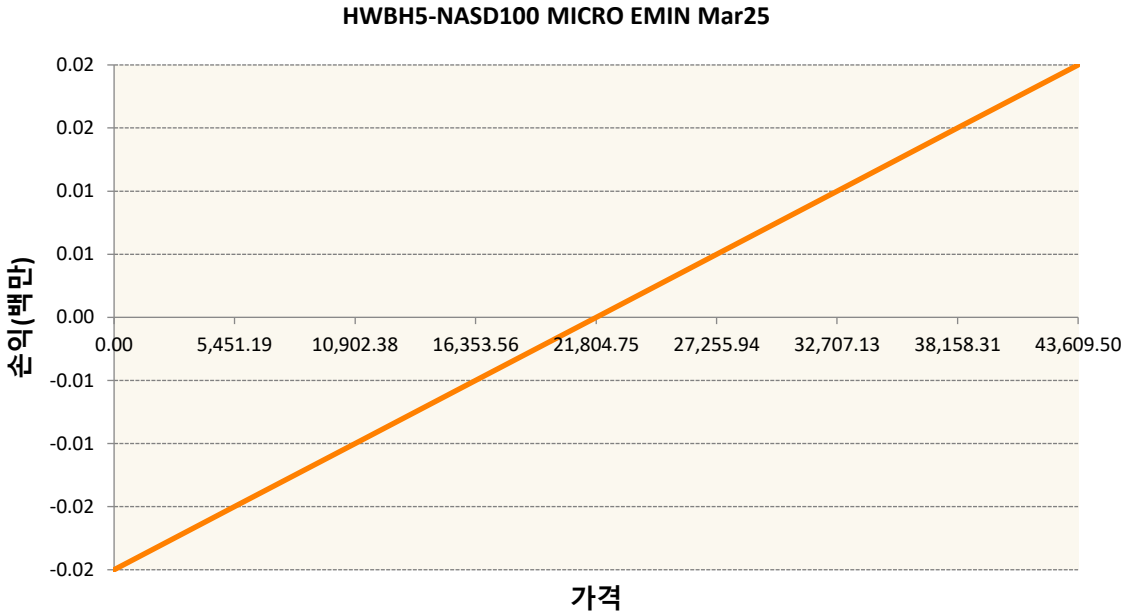
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	15,207	0	15,207	
누계	유가증권	선물	318	0	318	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	25
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,217

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,096

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	214,470	0	214,470	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	714
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,970
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,933
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,775

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

(단위:백만원)

9,557

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,635	0	5,635	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	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)
	15

공시일	2025-02-14
기준일	2025-02-13

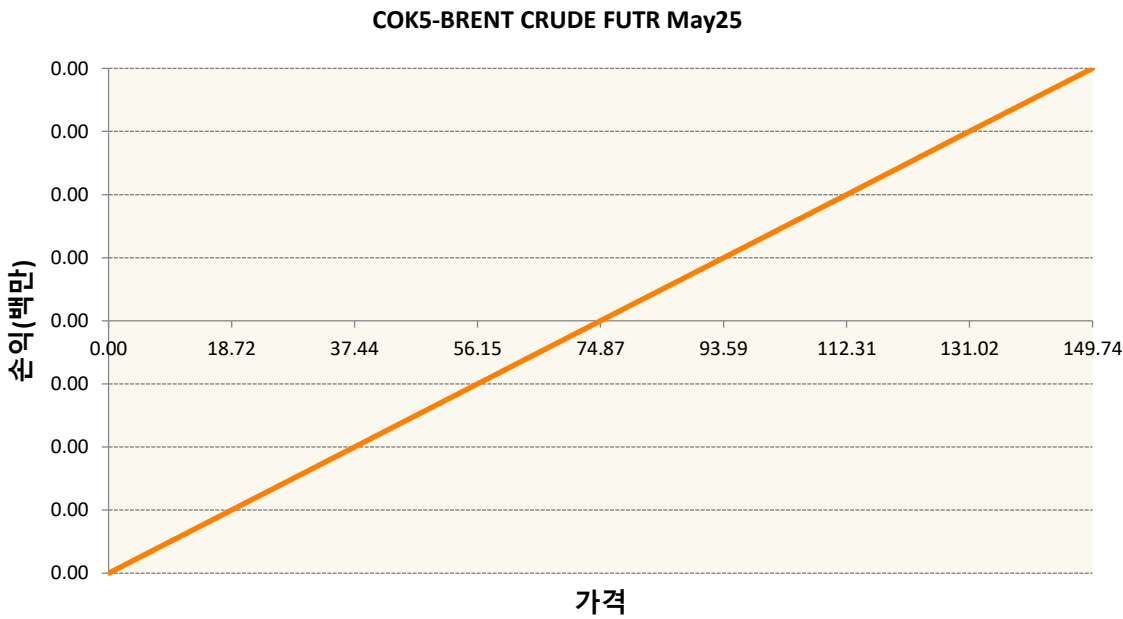
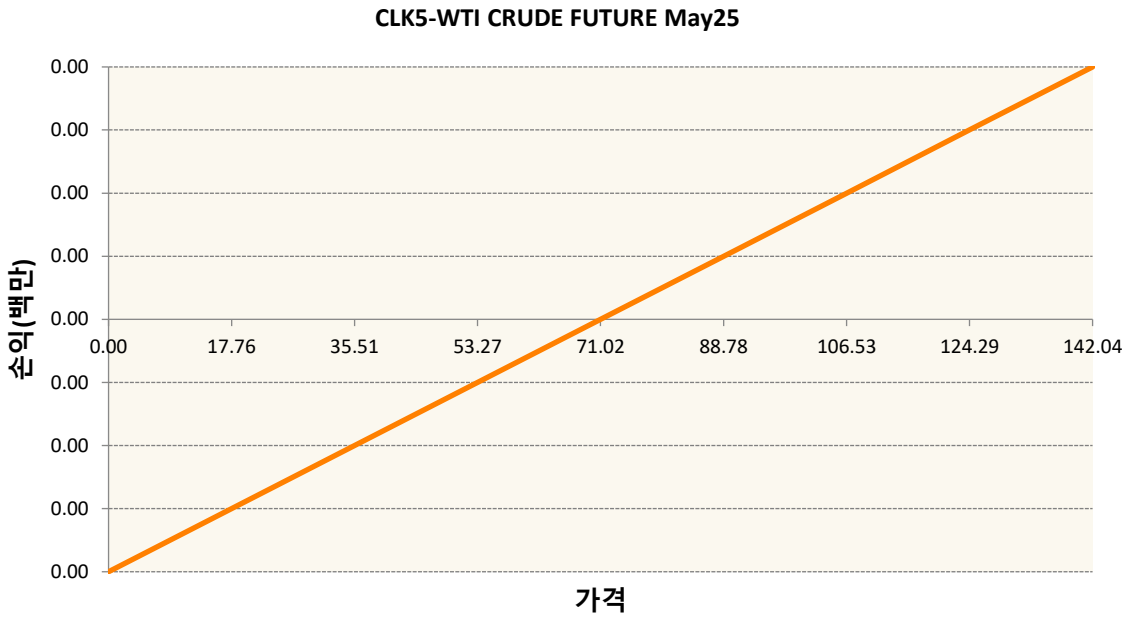
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

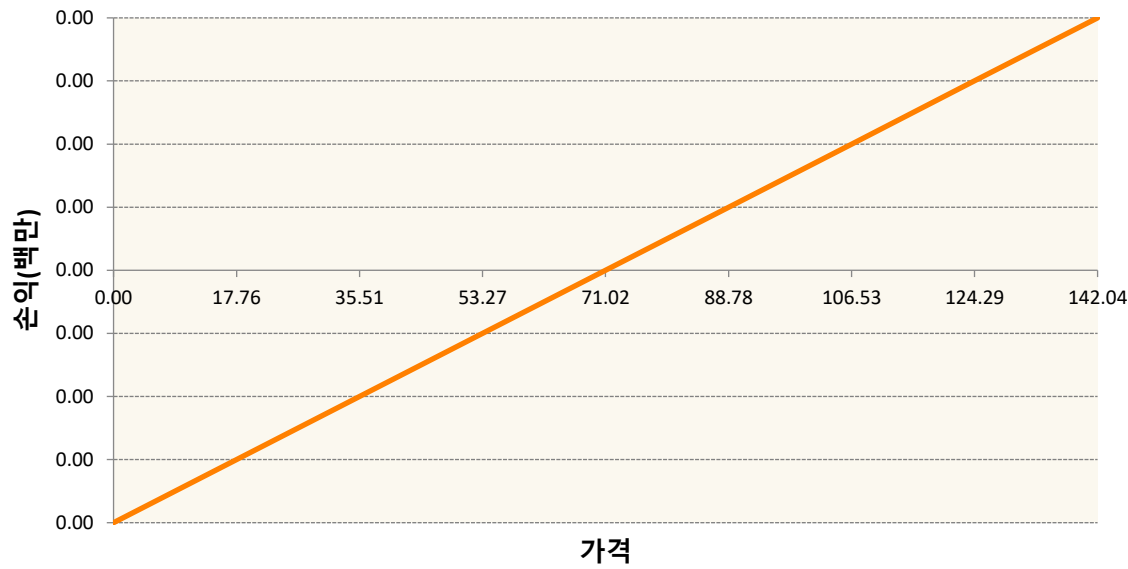
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	145	-145	장내
누계	유가증권	선물	857	0	857	
누계	통화	선물	0	159	-159	장내

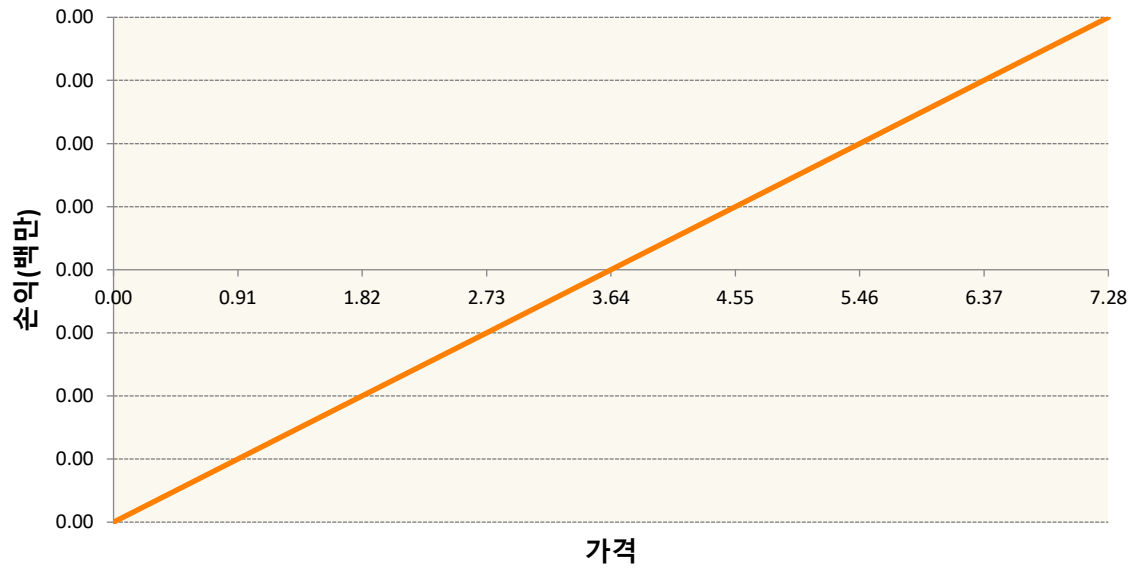
2. 만기시점의 손익구조



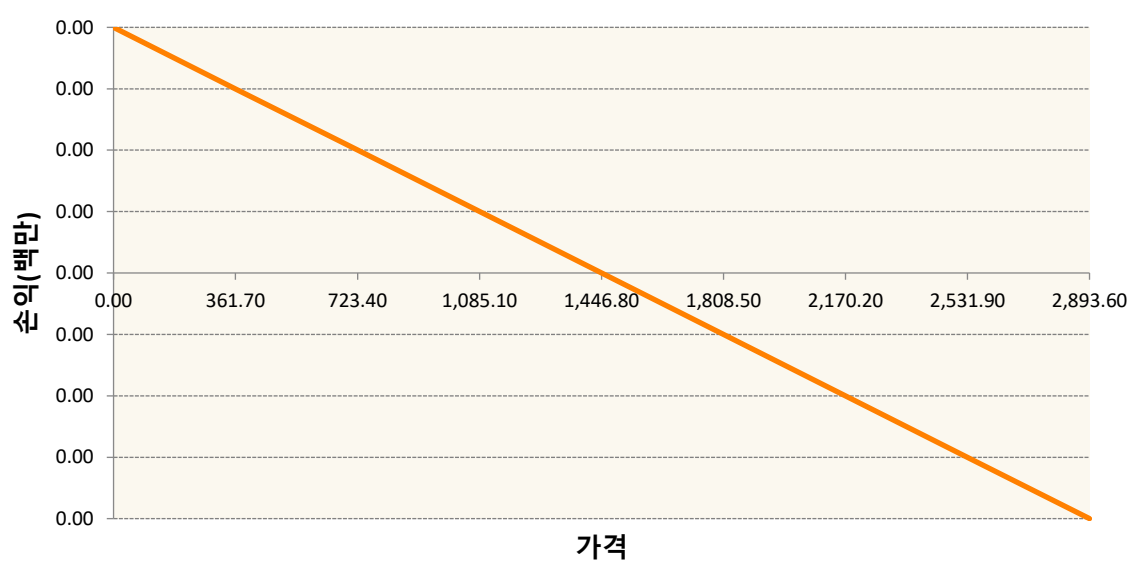
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



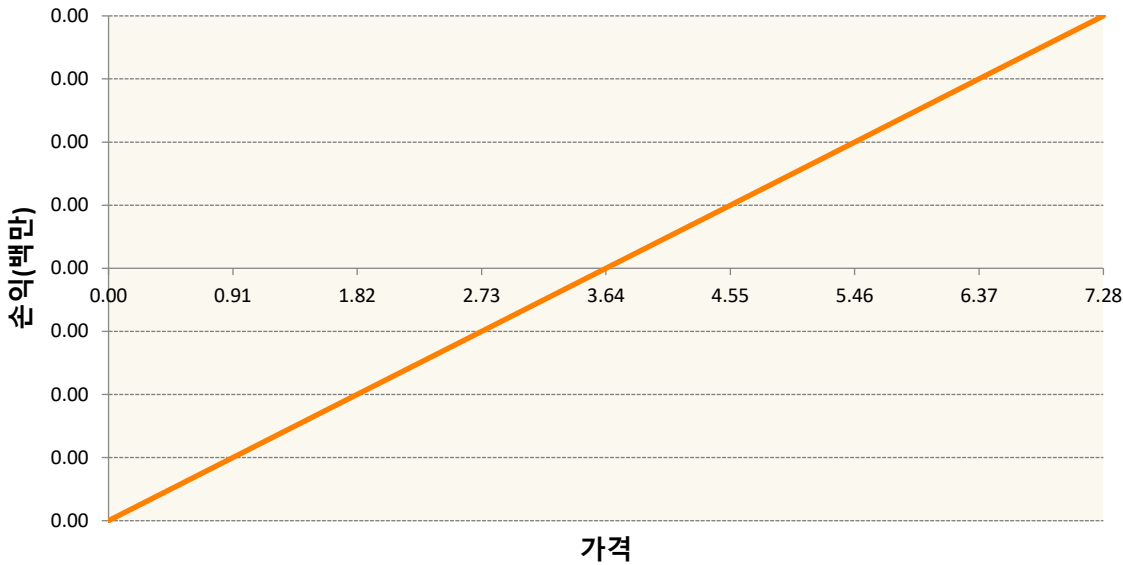
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



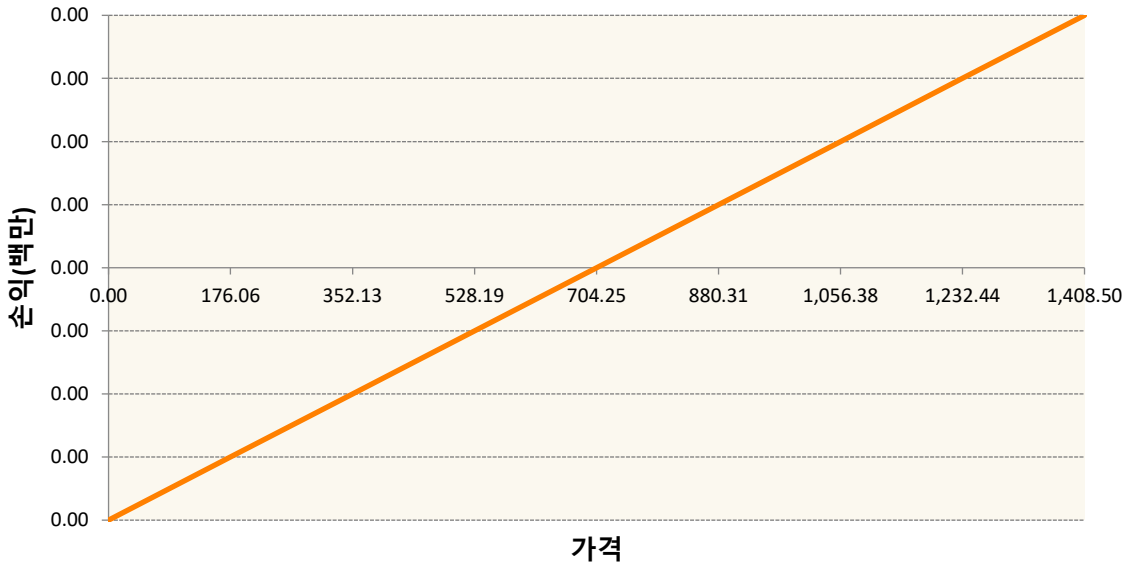
KR4175W30007-2025-03 달러선물



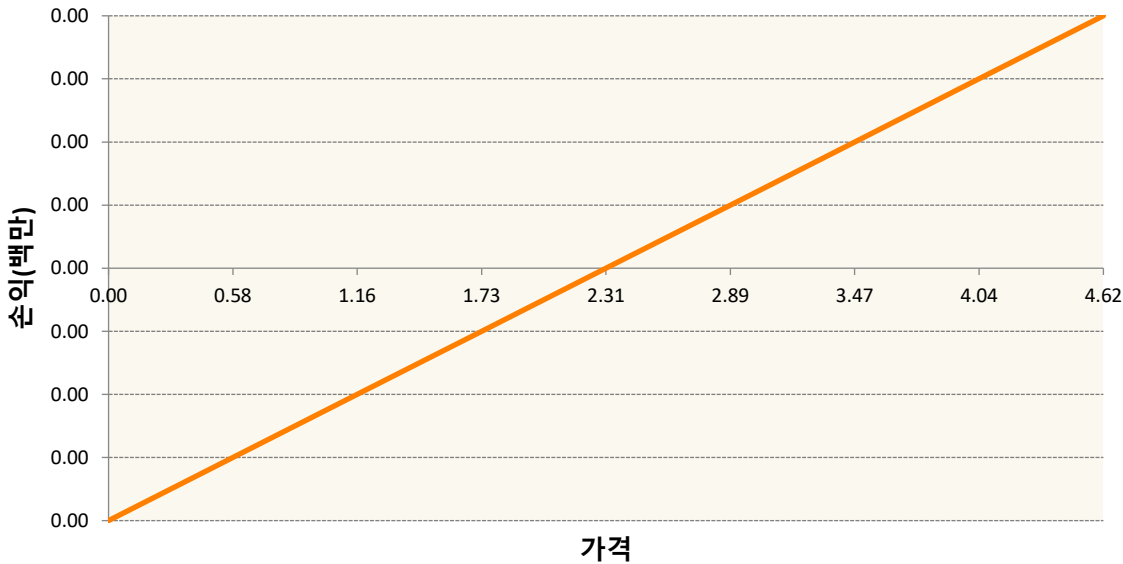
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



QSK5-Low Su Gasoil G May 25



XBK5-GASOLINE RBOB FUT May 25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK5	WTI CRUDE FUTURE May25	8
COK5	BRENT CRUDE FUTR May25	18
ECK5	E-mini Crude Oil May 25	4
EOK5	E-MINI NATURAL GAS May 25	6
KR4175W30(	2025-03 달러선물	13
NGK25	NATURAL GAS FUTR May 25	13
QSK5	Low Su Gasoil G May 25	8
XBK5	GASOLINE RBOB FUT May 25	11

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

145