

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

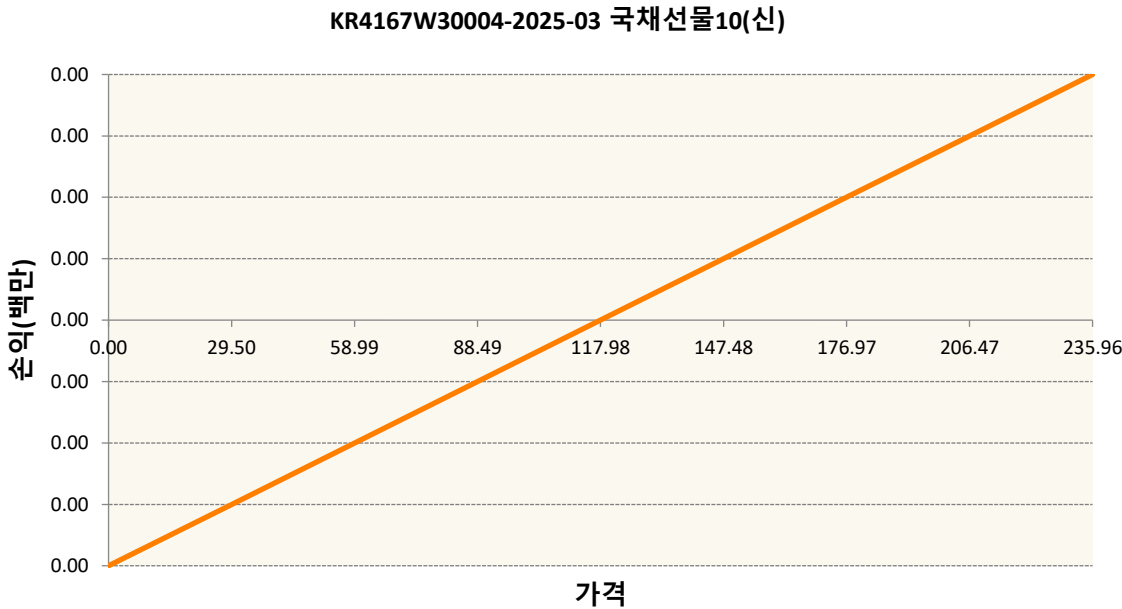
## 베스트장기채(채권-파생형)

### 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   | 267,815 | 0     | 267,815   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 6,760 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

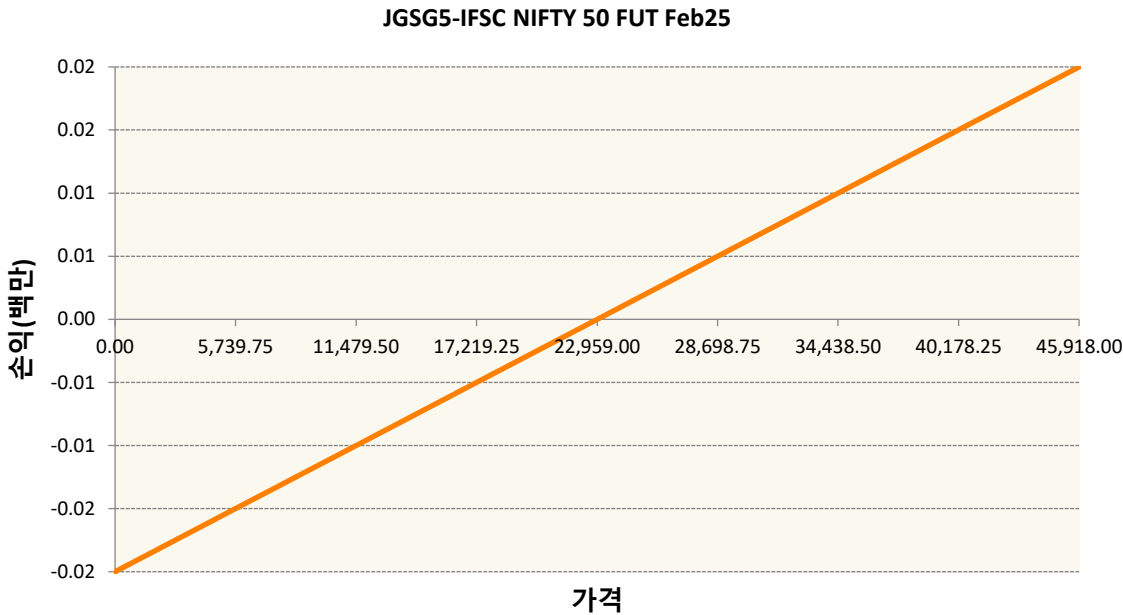
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,336 | 0     | 3,336     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |     |
|-------|-------------------------|-----|
| JGSG5 | IFSC NIFTY 50 FUT Feb25 | 267 |
|-------|-------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 181 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

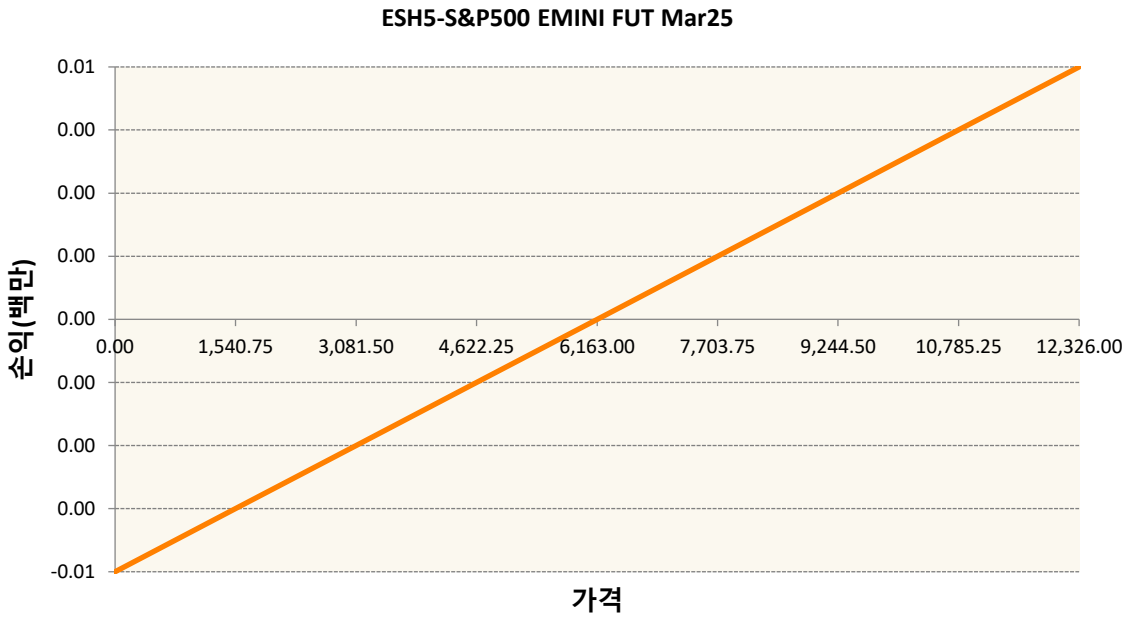
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 886   | 0     | 886       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |    |
|------|------------------------|----|
| ESH5 | S&P500 EMINI FUT Mar25 | 71 |
|------|------------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 97 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

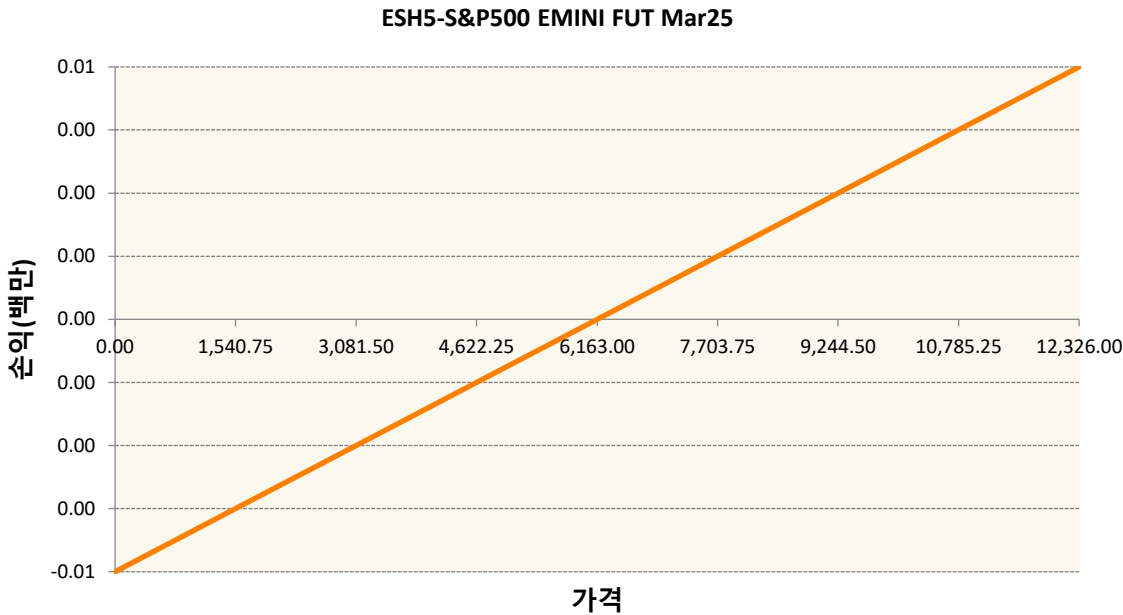
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,683 | 0     | 2,683     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| ESH5 | S&P500 EMINI FUT Mar25 | 215 |
|------|------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 293 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

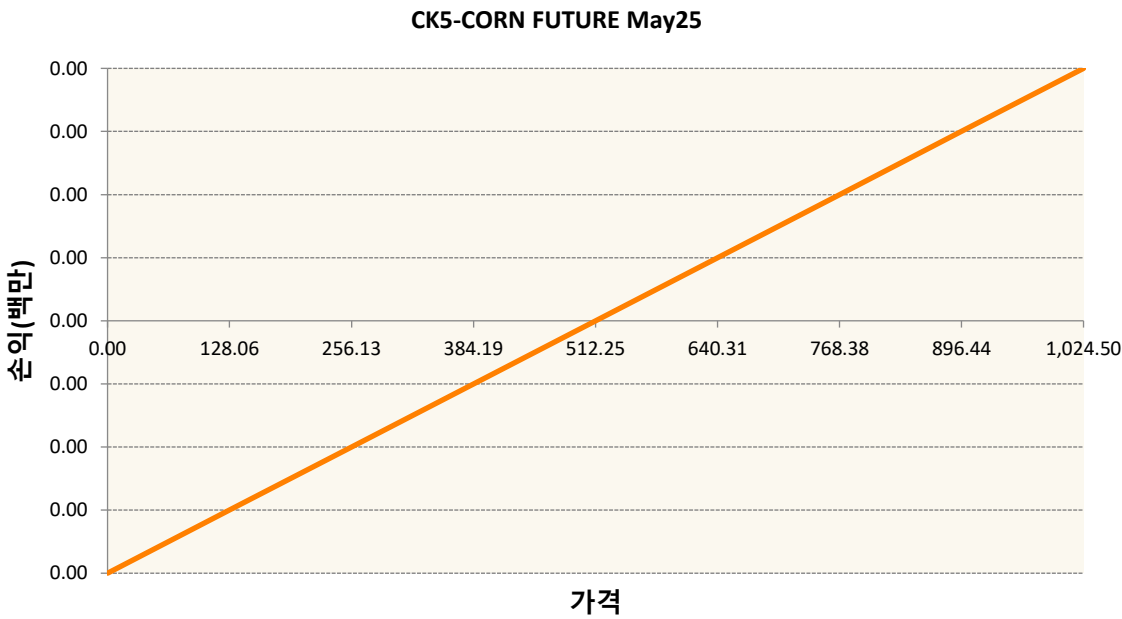
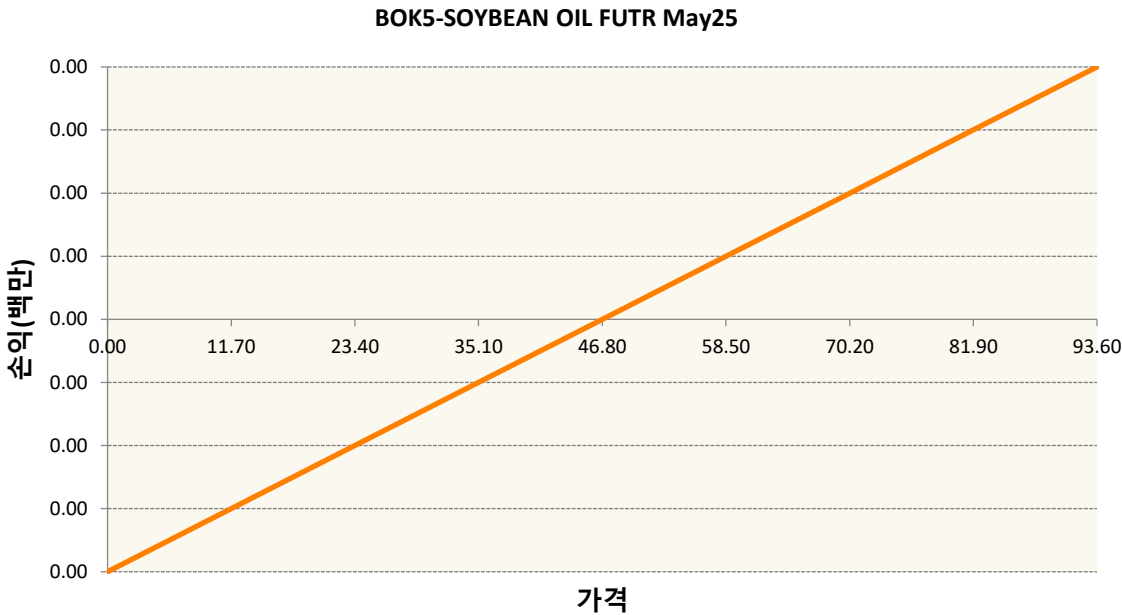
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

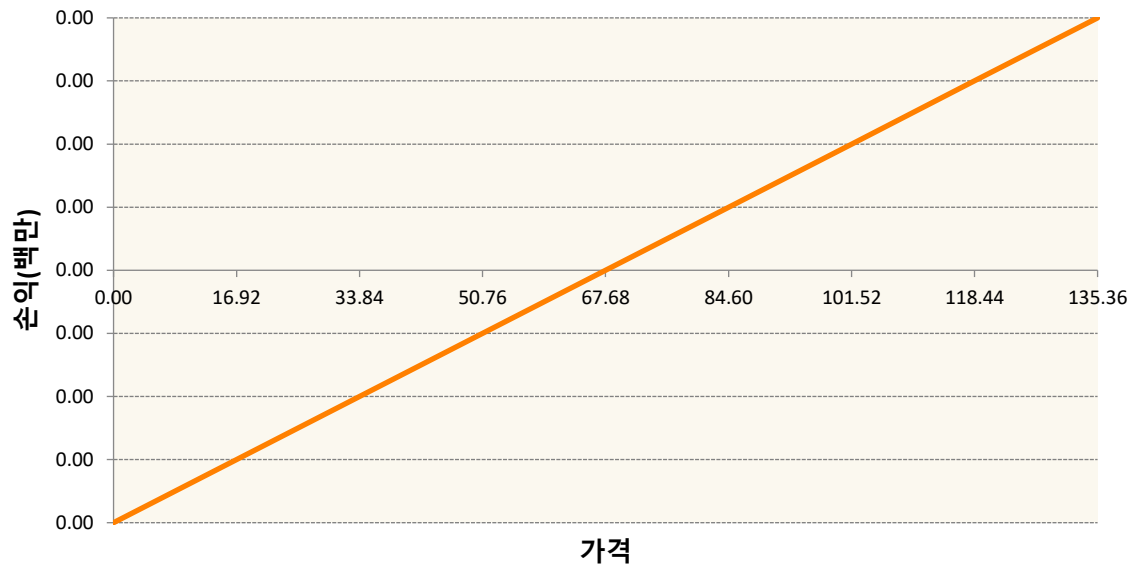
(단위:USD 백만)

| 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   | 4,086 | 0     | 4,086     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 632   | -632      | 장내 |

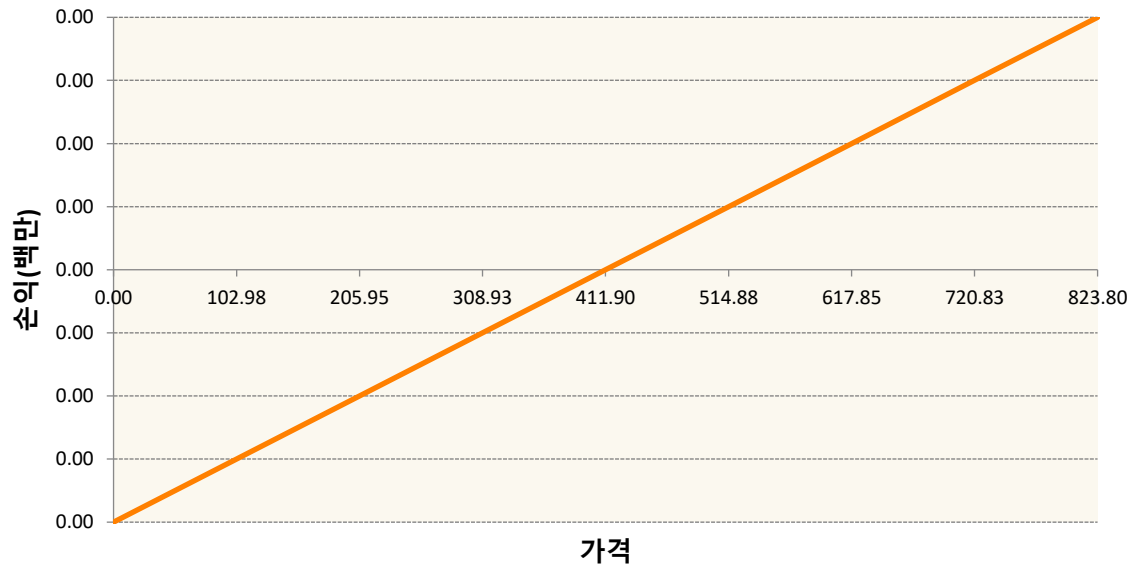
### 2. 만기시점의 손익구조



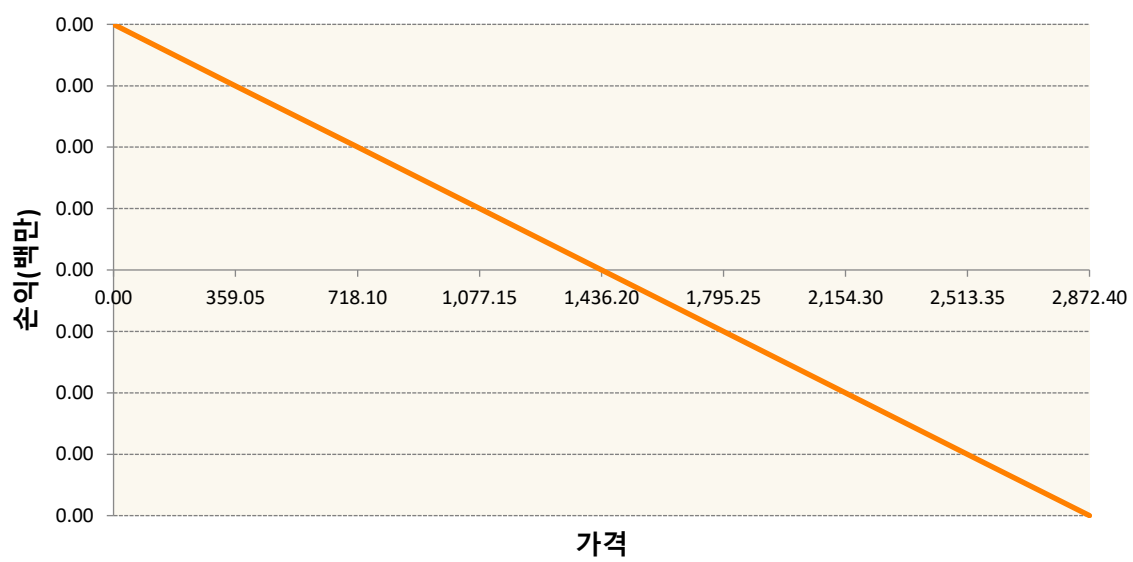
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



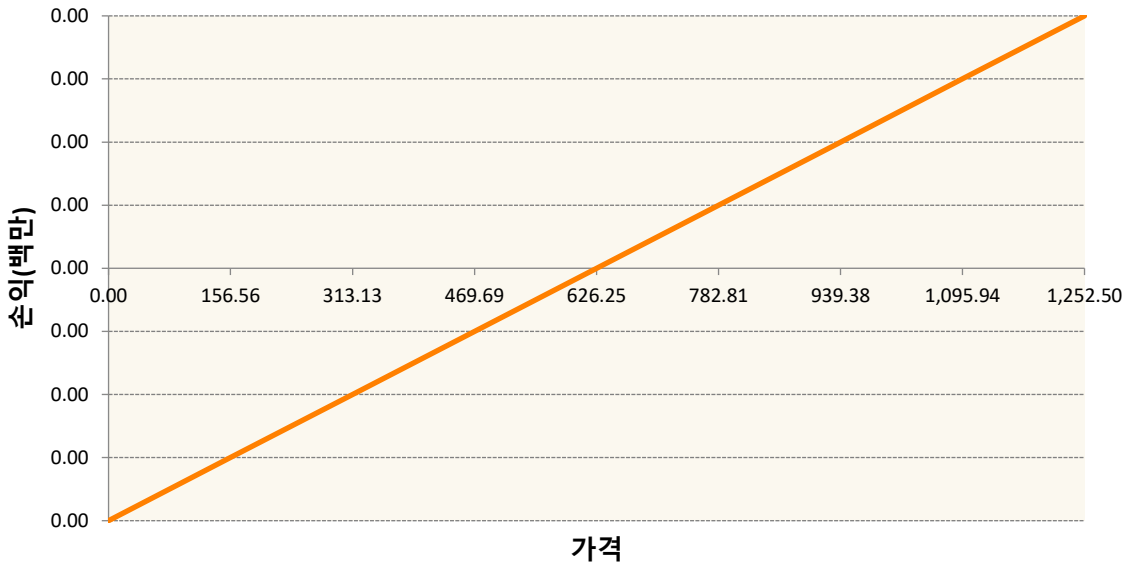
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



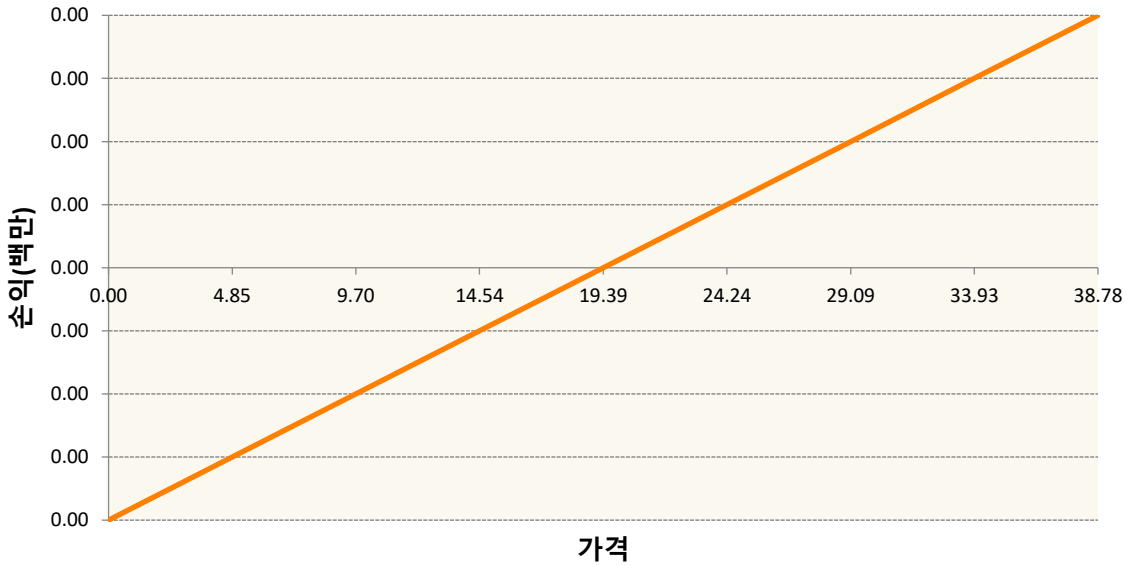
KR4175W30007-2025-03 달러선물



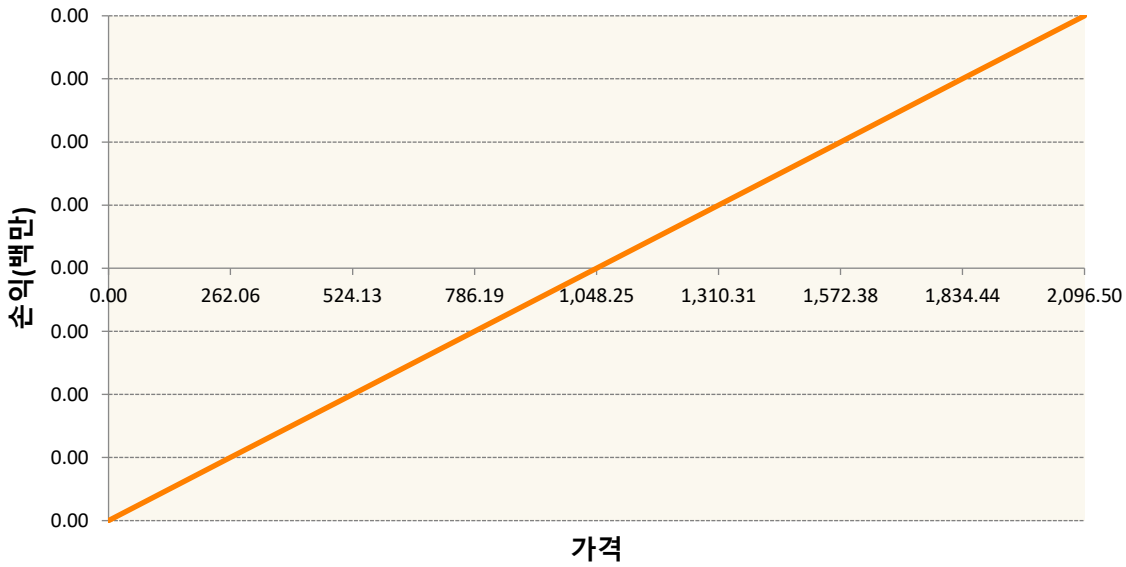
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



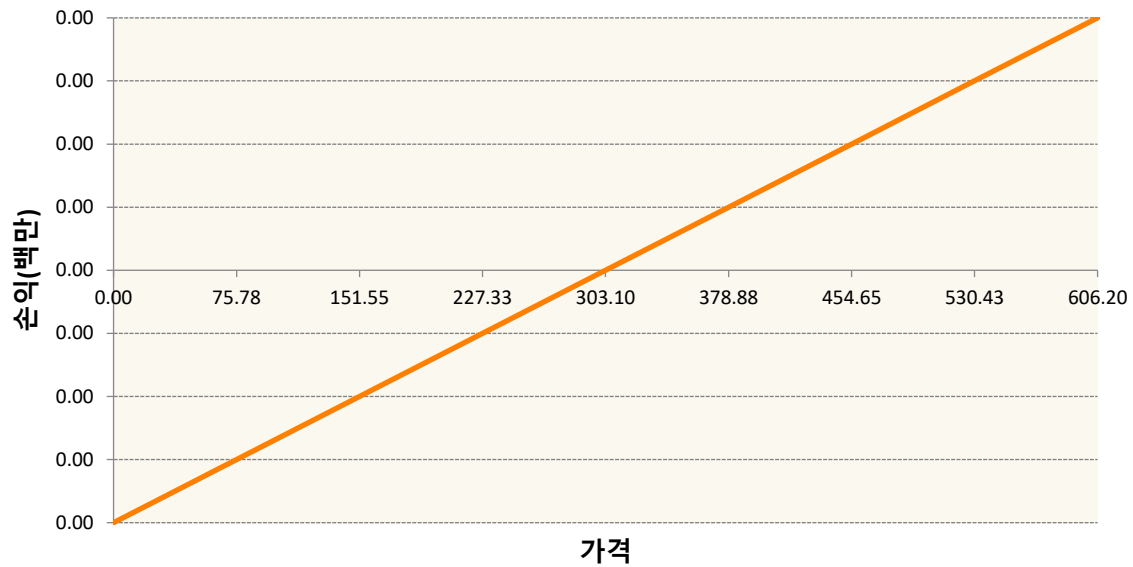
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



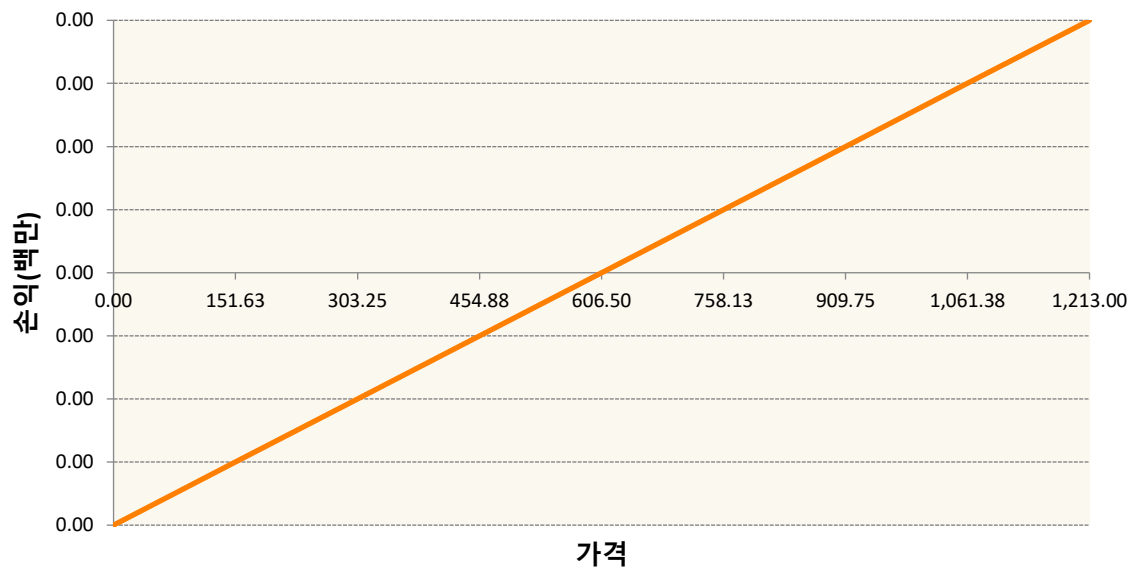
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

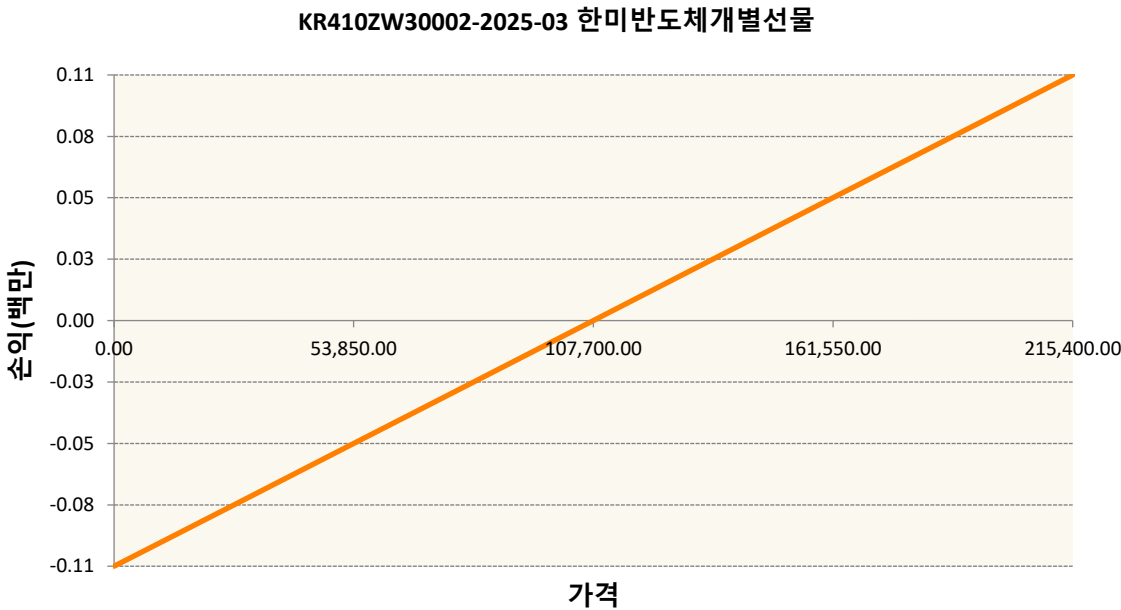
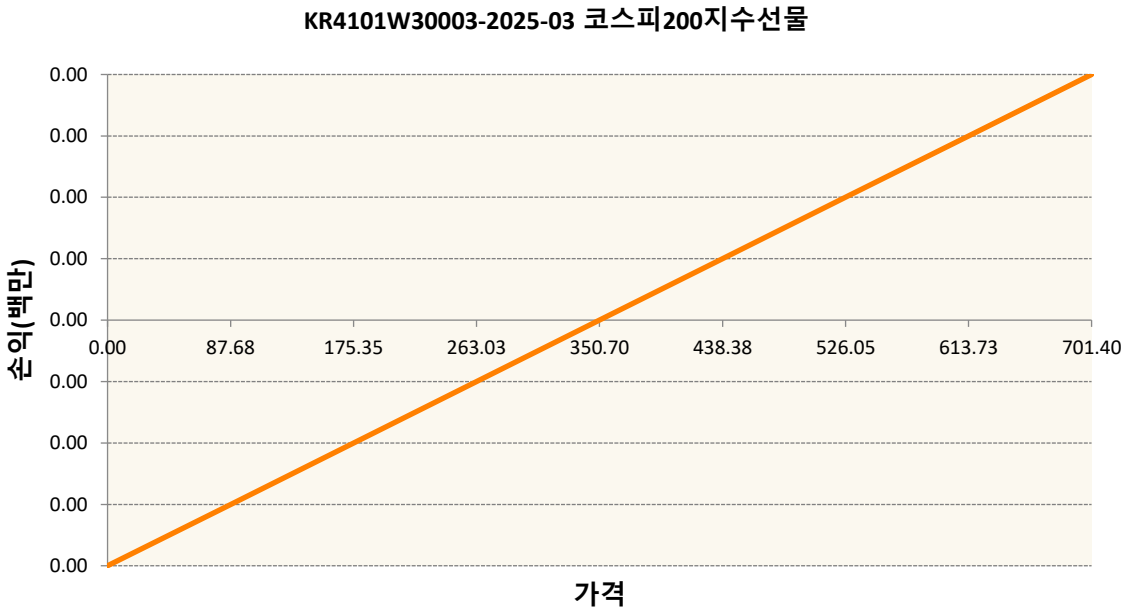
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

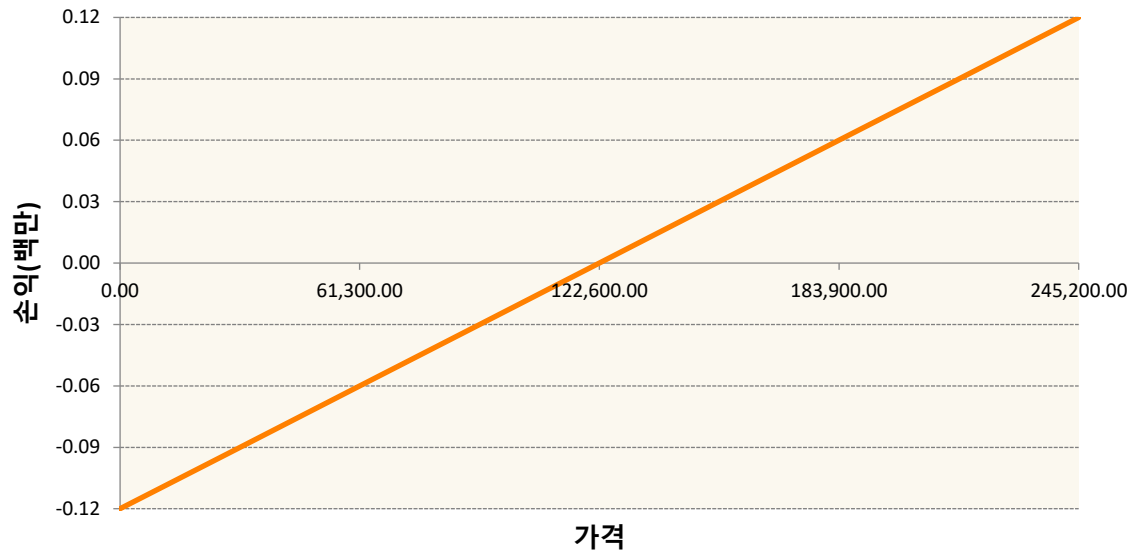
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 153   | 88    | 65        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,257 | 0     | 1,257     | 장내 |

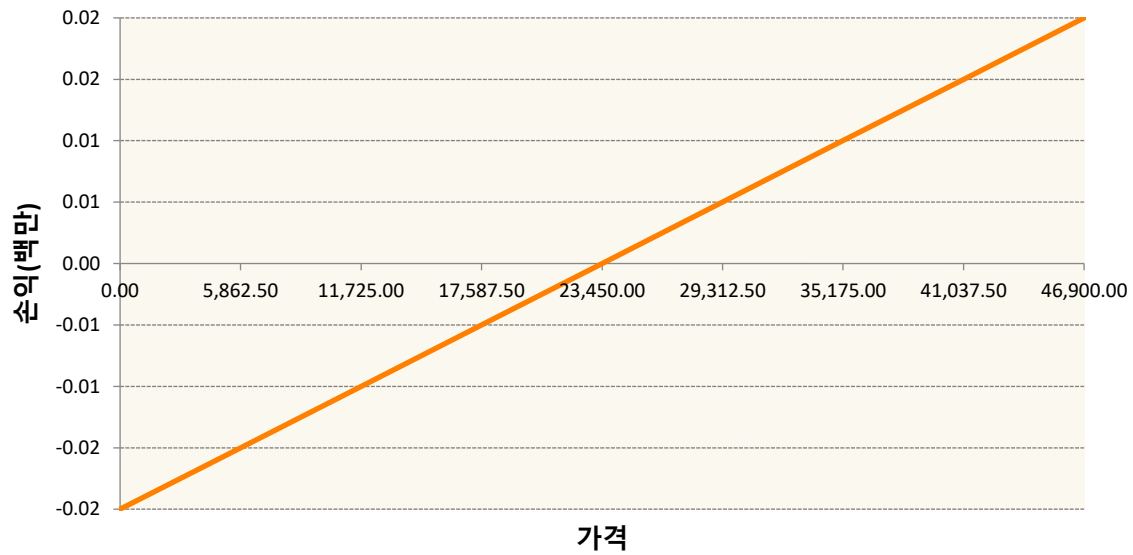
### 2. 만기시점의 손익구조



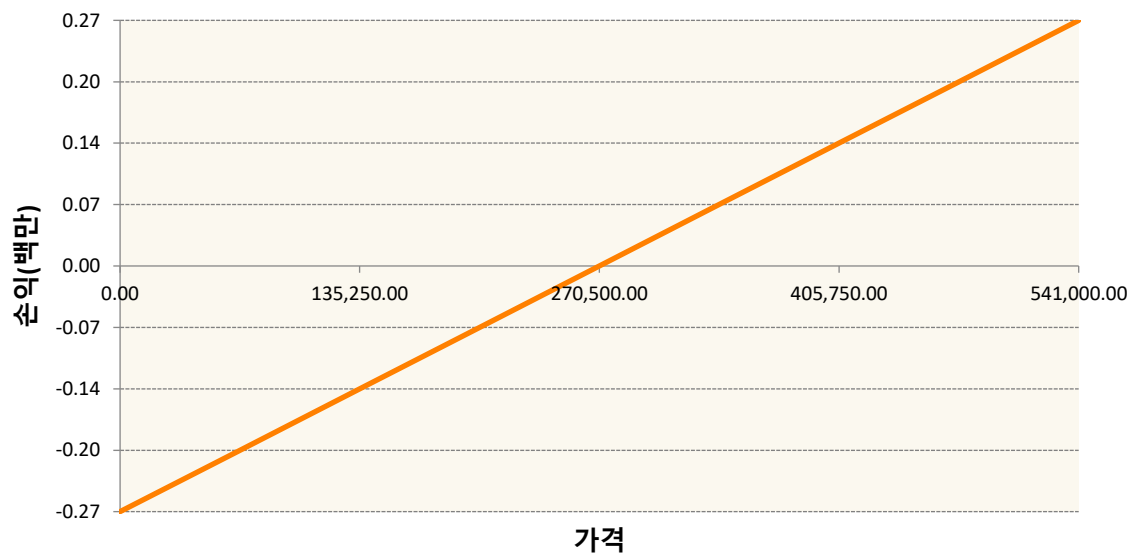
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



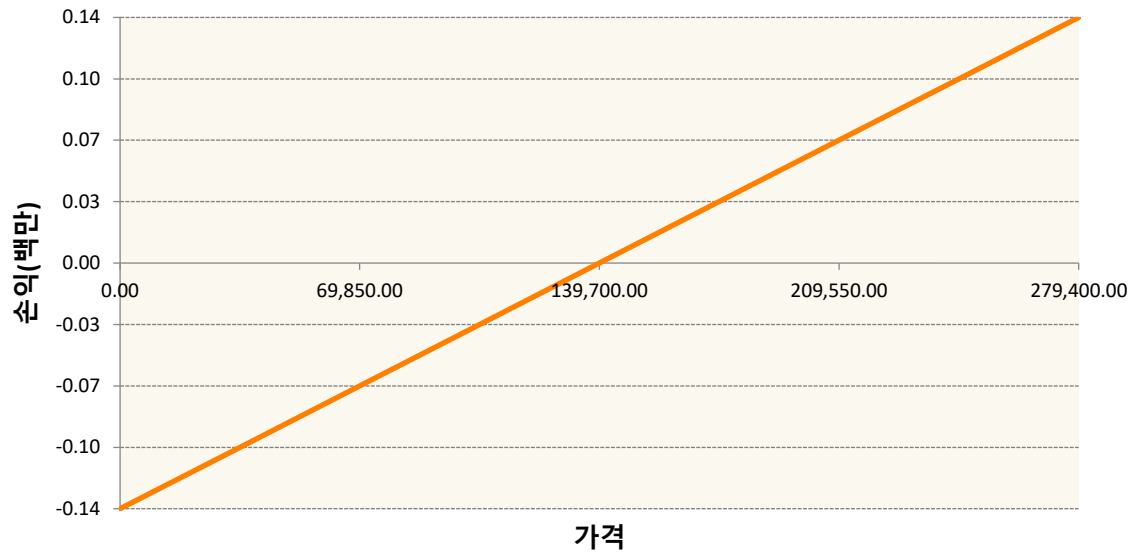
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



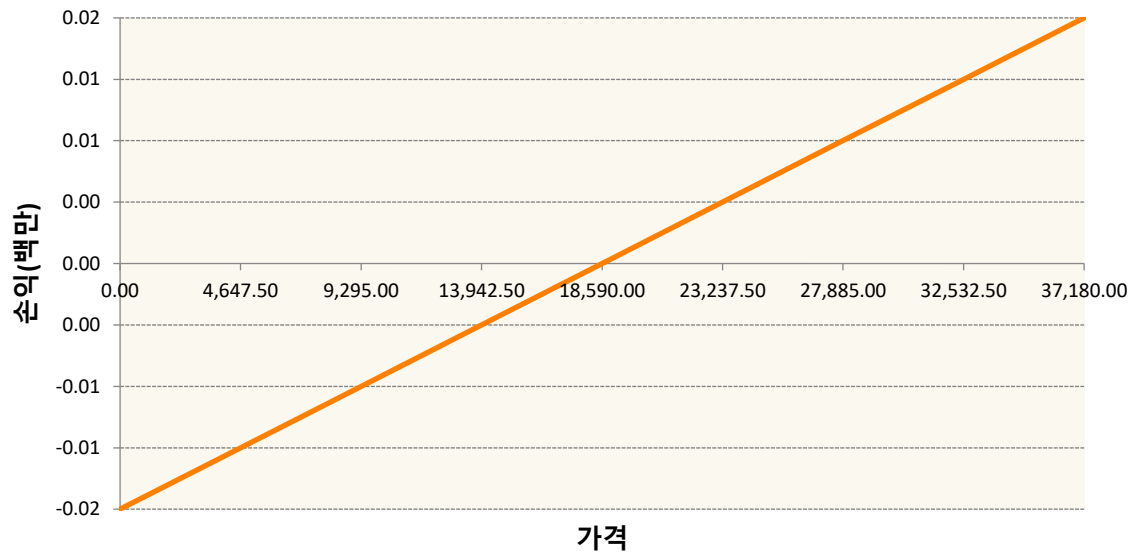
KR41CXW30001-2025-03 한미약품개별선물



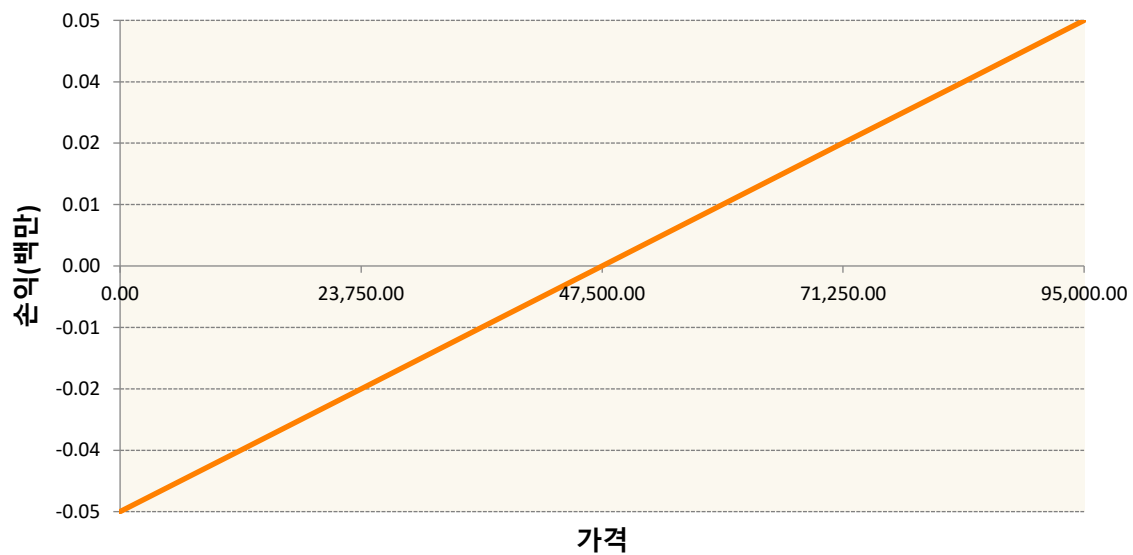
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



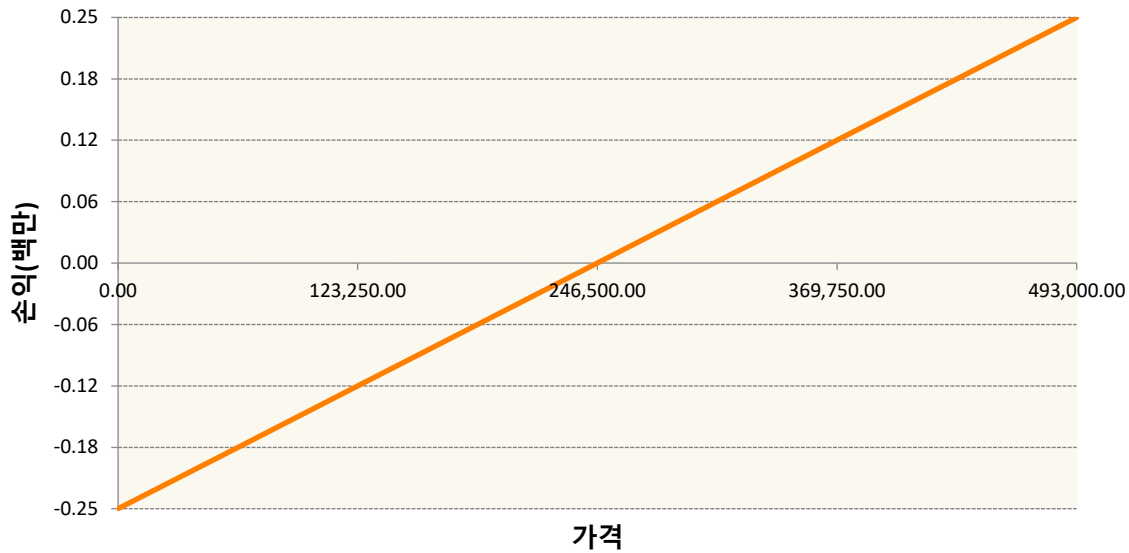
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



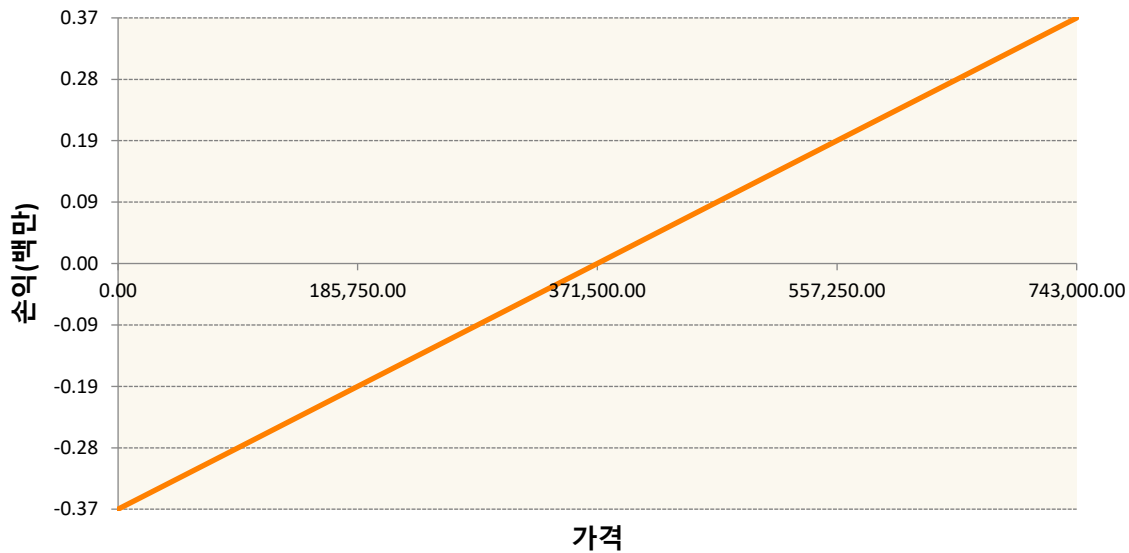
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                  |    |
|----------------------------------|----|
| KR4101W30( 2025-03 코스피200지수선물    | 63 |
| KR410ZW30( 2025-03 한미반도체개별선물     | 6  |
| KR41C6W30( 2025-03 아모레퍼시픽개별선물    | 5  |
| KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물      | 1  |
| KR41CXW30( 2025-03 한미약품개별선물      | 2  |
| KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물       | 3  |
| KR41ETW30( 2025-03 삼성엔지니어링개별선물   | 4  |
| KR41F9W30( 2025-03 SK바이오사이언스개별선물 | 1  |
| KR41FCW30( 2025-03 하이브개별선물       | 6  |
| KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물   | 9  |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

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

304

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

468

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

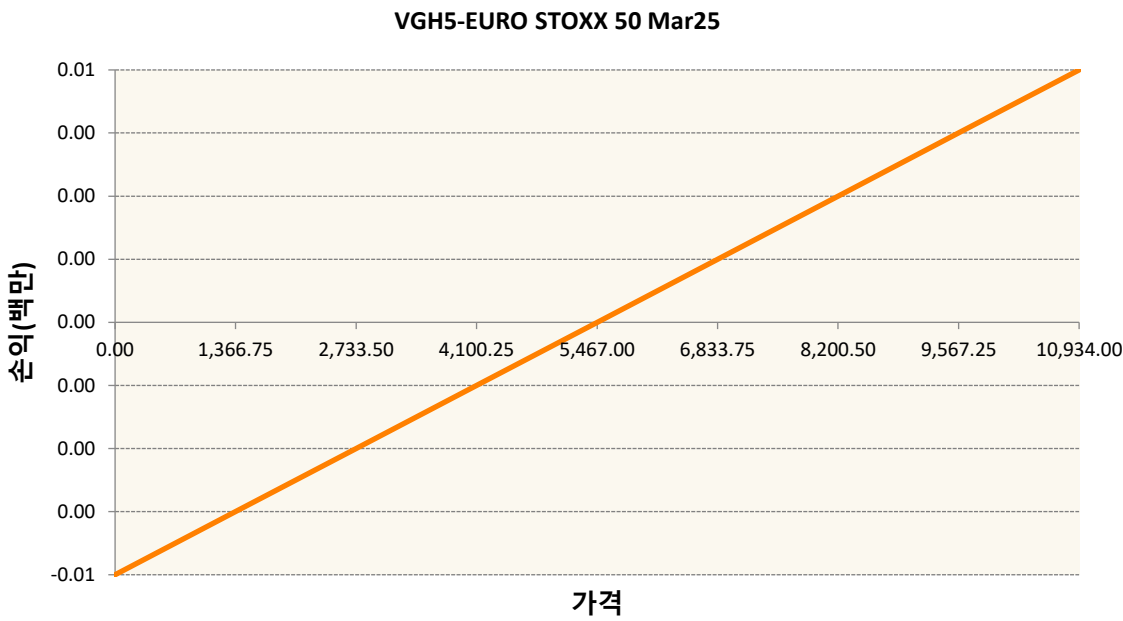
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 989   | 0     | 989       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGH5 | EURO STOXX 50 Mar25 | 79 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 53 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

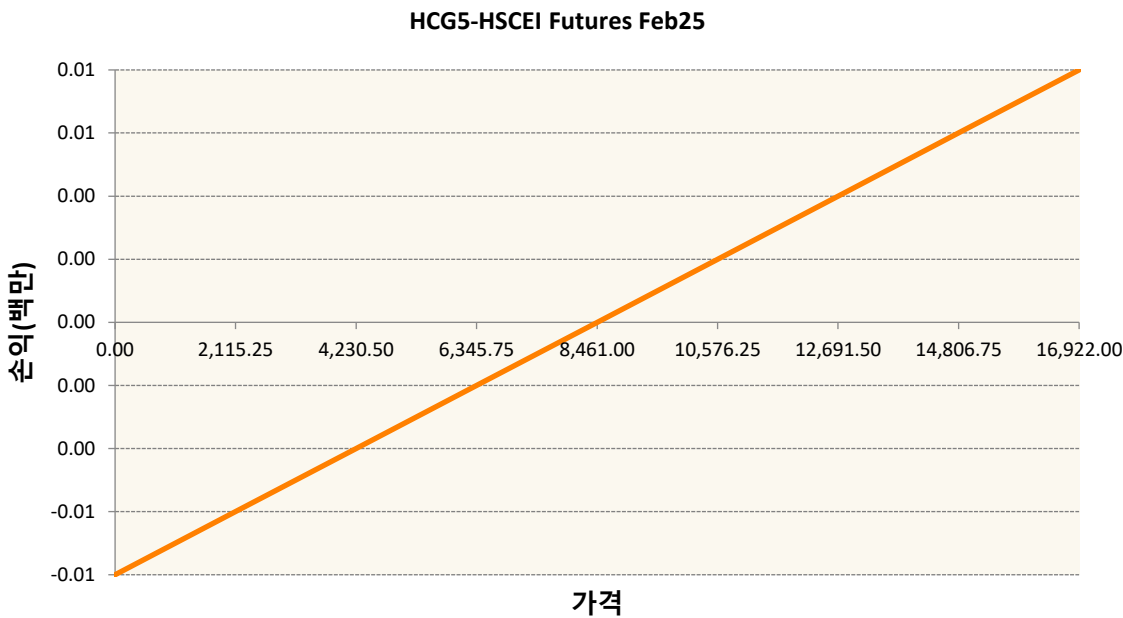
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,790 | 0     | 1,790     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCG5 | HSCEI Futures Feb25 | 143 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 192 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

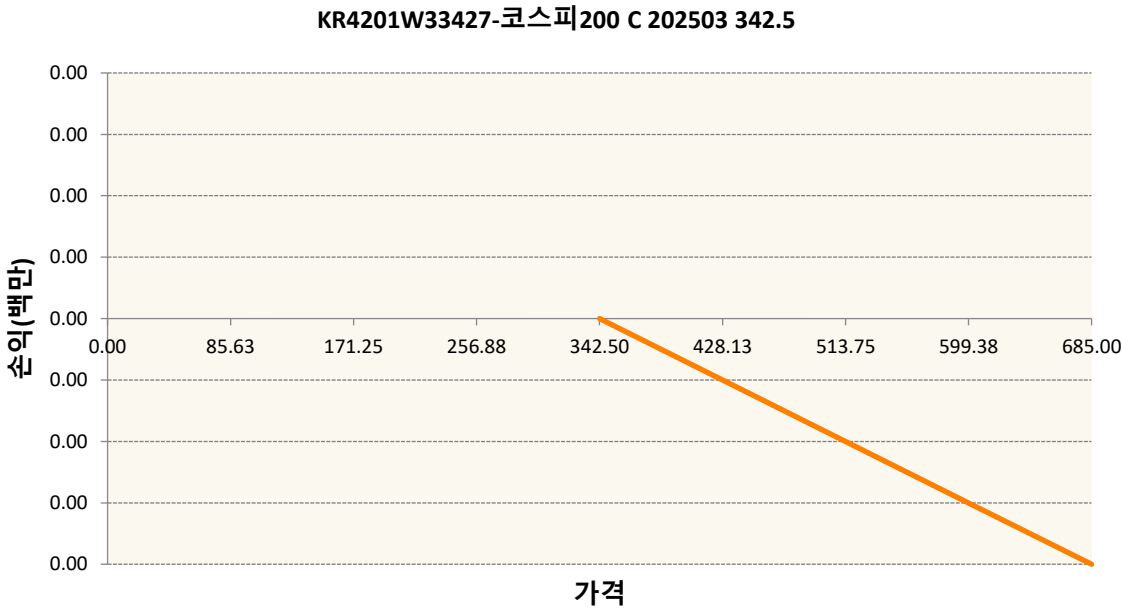
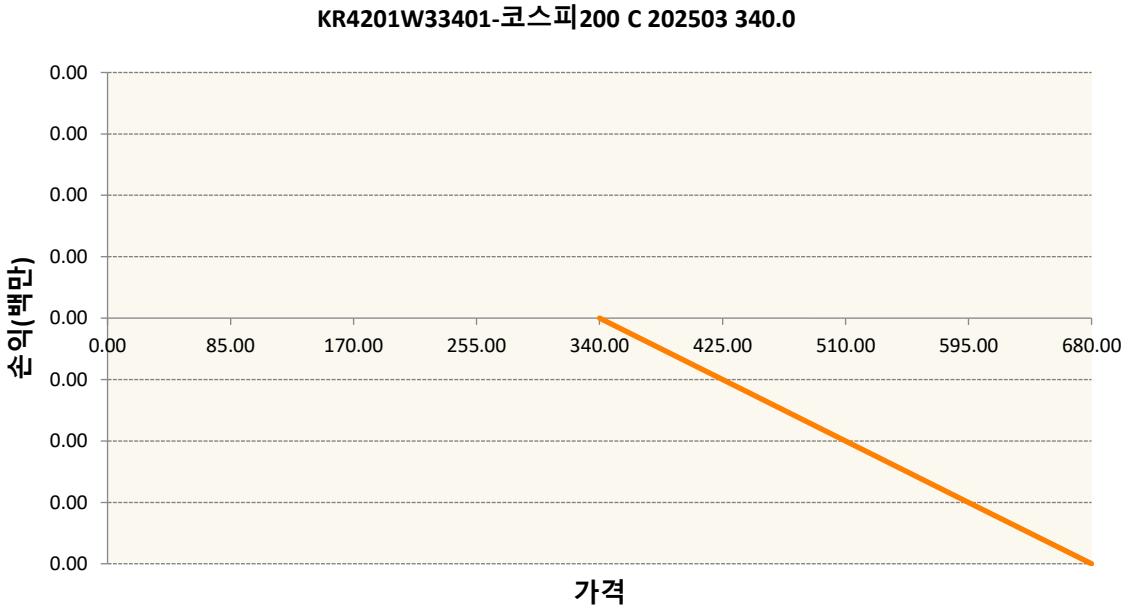
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

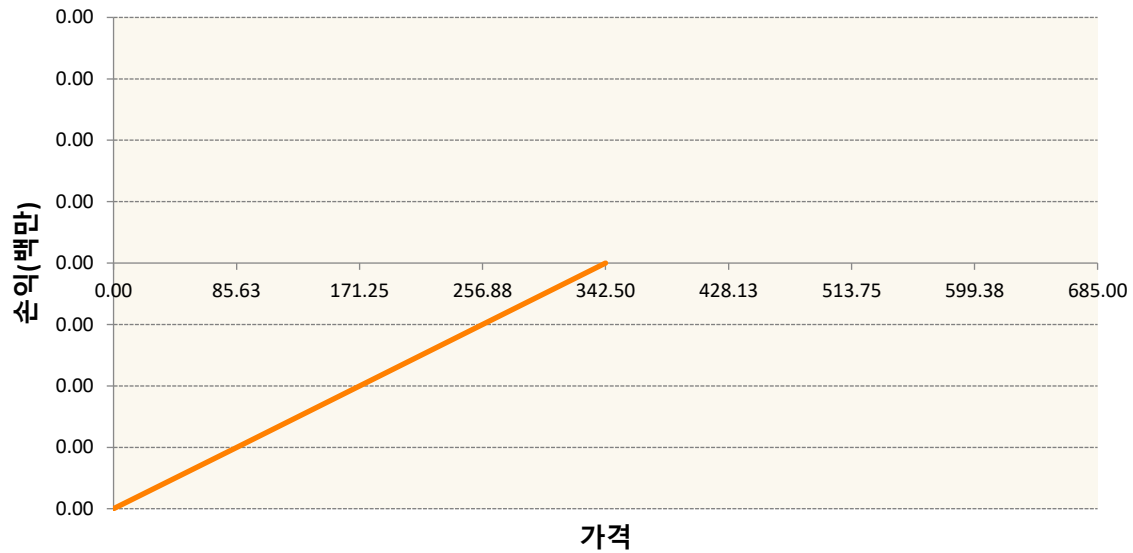
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 37,773 | -37,773   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301W33425-코스피200 P 202503 342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201W33, 코스피200 C 202503 340.0

1,727

KR4201W33, 코스피200 C 202503 342.5

774

KR4301W33, 코스피200 P 202503 342.5

521

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

(단위:백만원)

3,686

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

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 | 672   | 0     | 672       |    |

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 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

## 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 | 4,440 | 0     | 4,440     |    |

### 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 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

## 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 | 13,120 | 0      | 13,120    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 13,013 | -13,013   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E | 558 |
| FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E | 257 |
| FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E | 209 |
| FXW213F24C KRW/USD 28-02-25E | 17  |
| IE00BD8RGM75                 |     |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

441

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

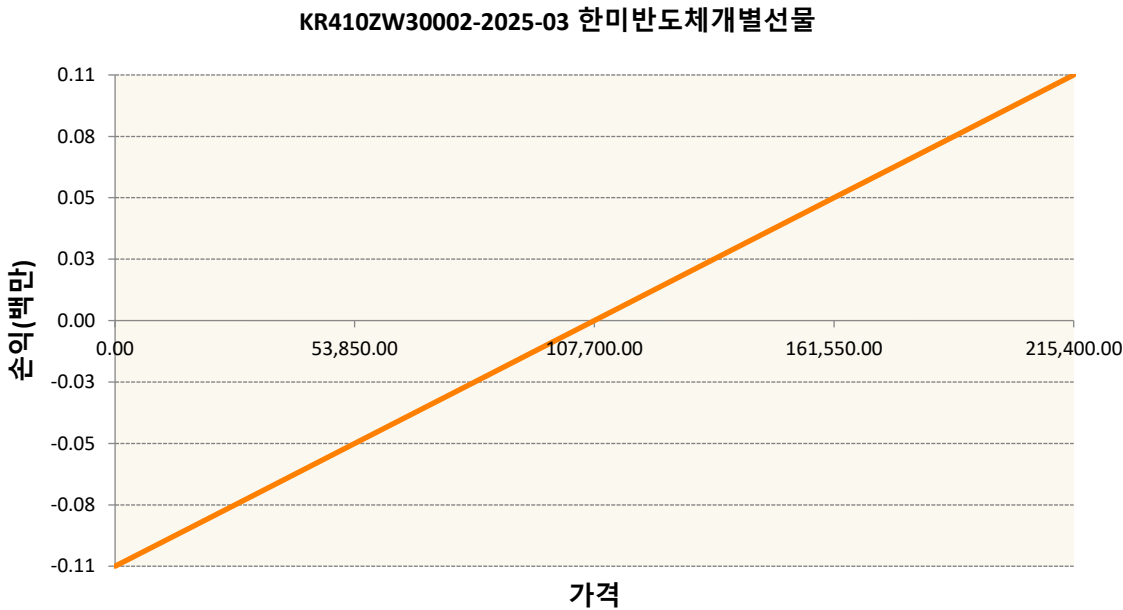
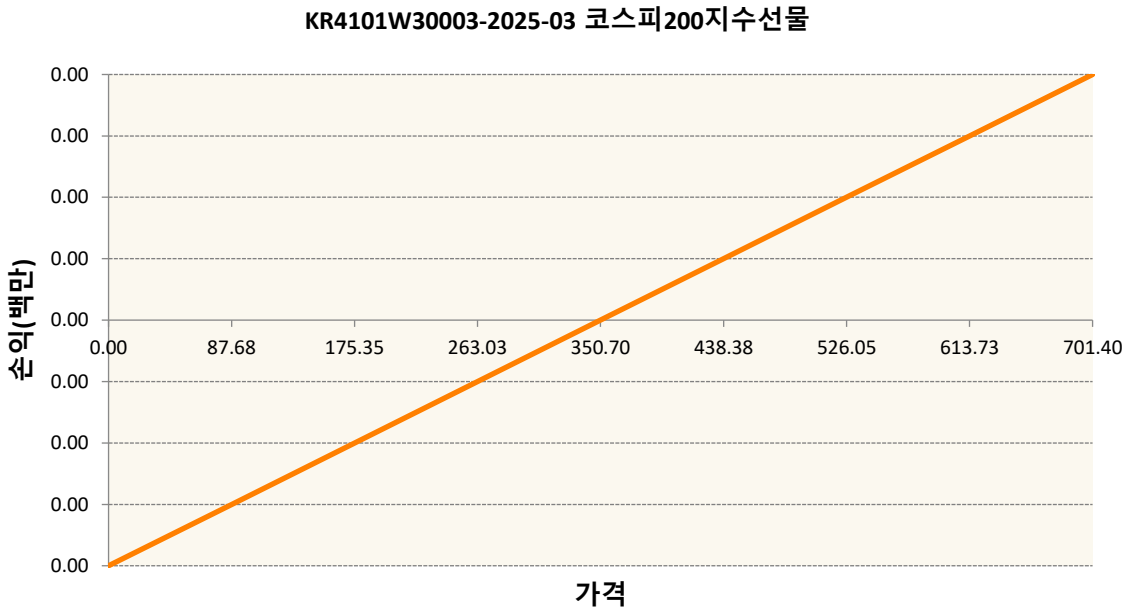
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

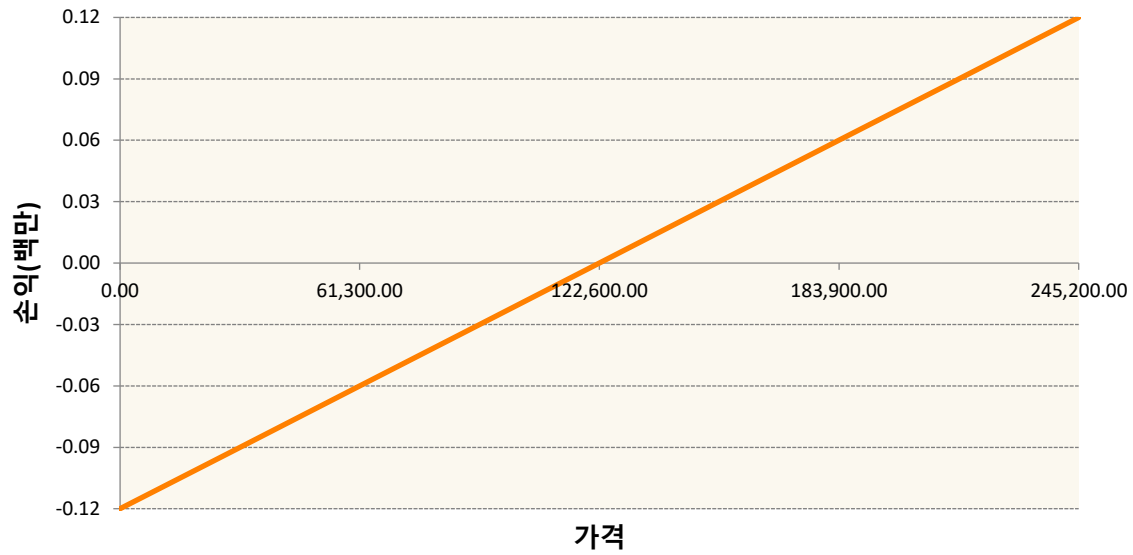
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 7     | 0     | 7         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,253 | 0     | 1,253     | 장내 |

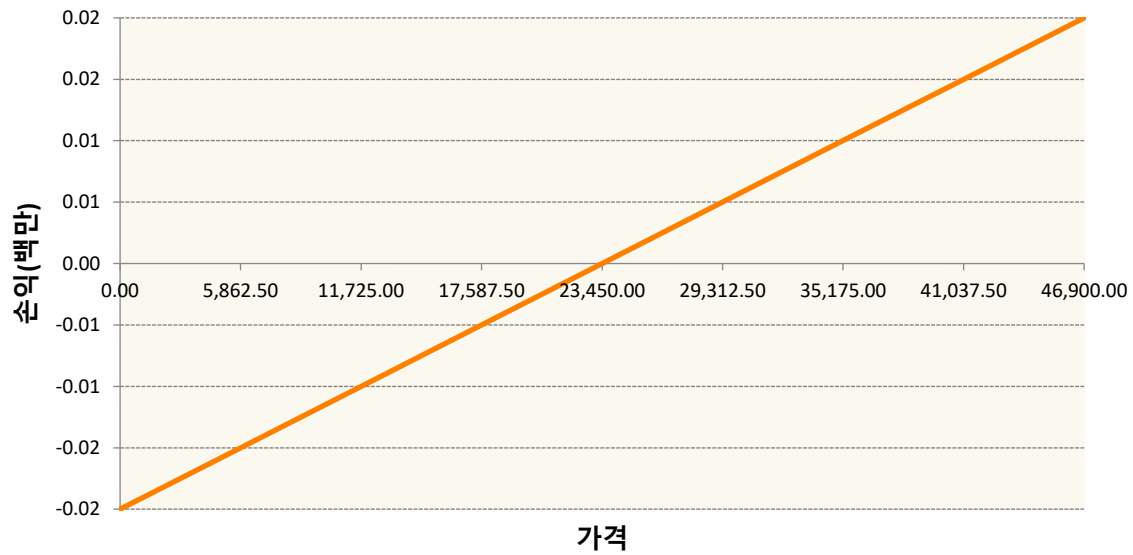
2. 만기시점의 손익구조



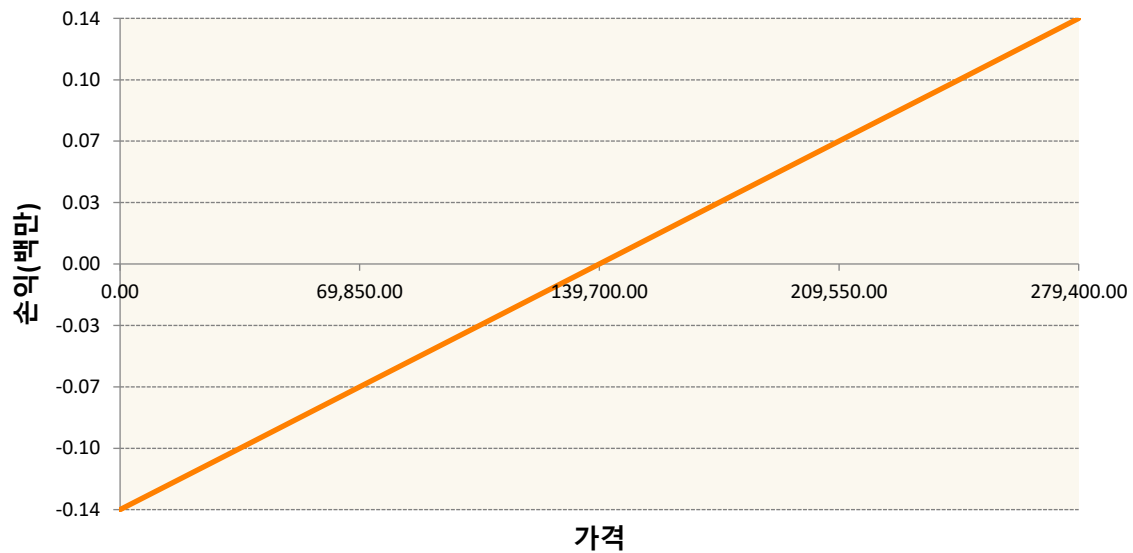
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



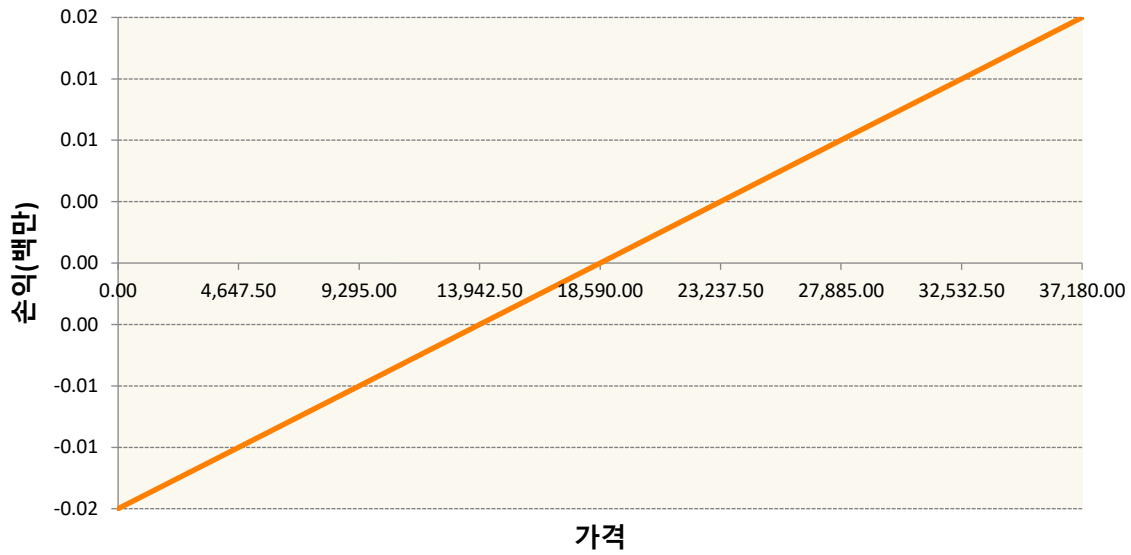
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



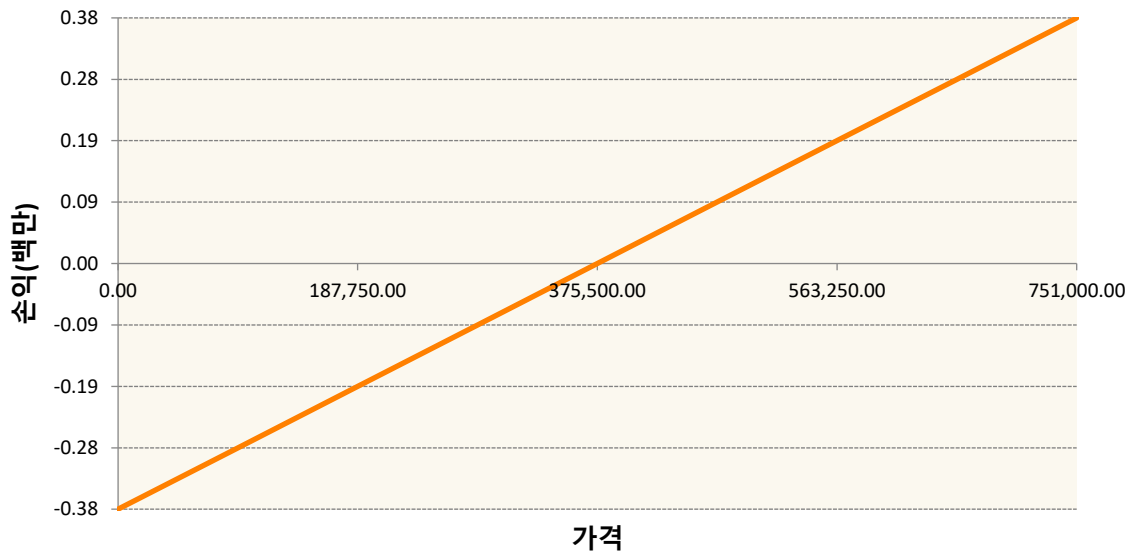
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



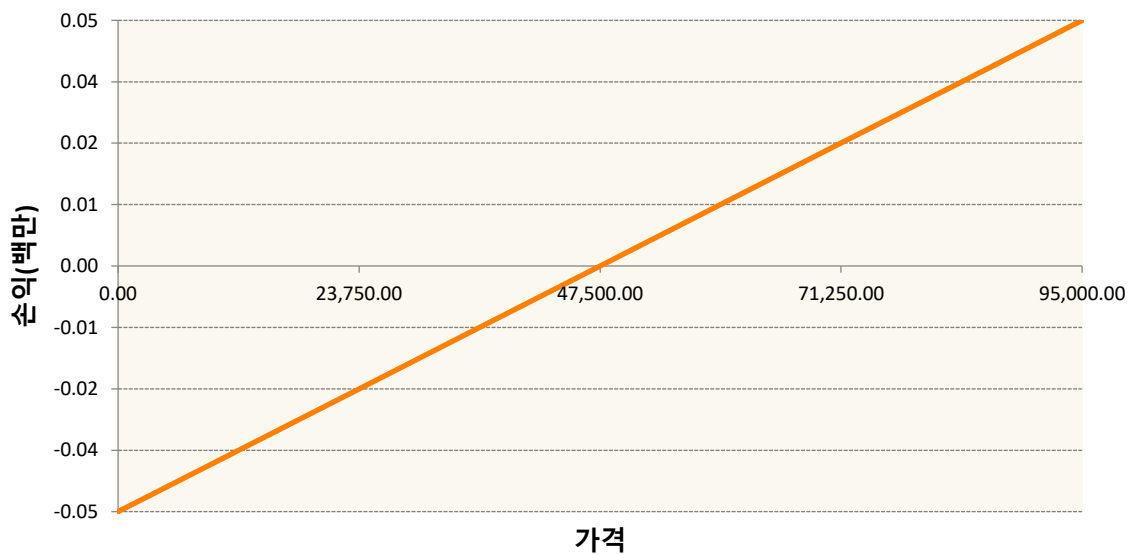
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



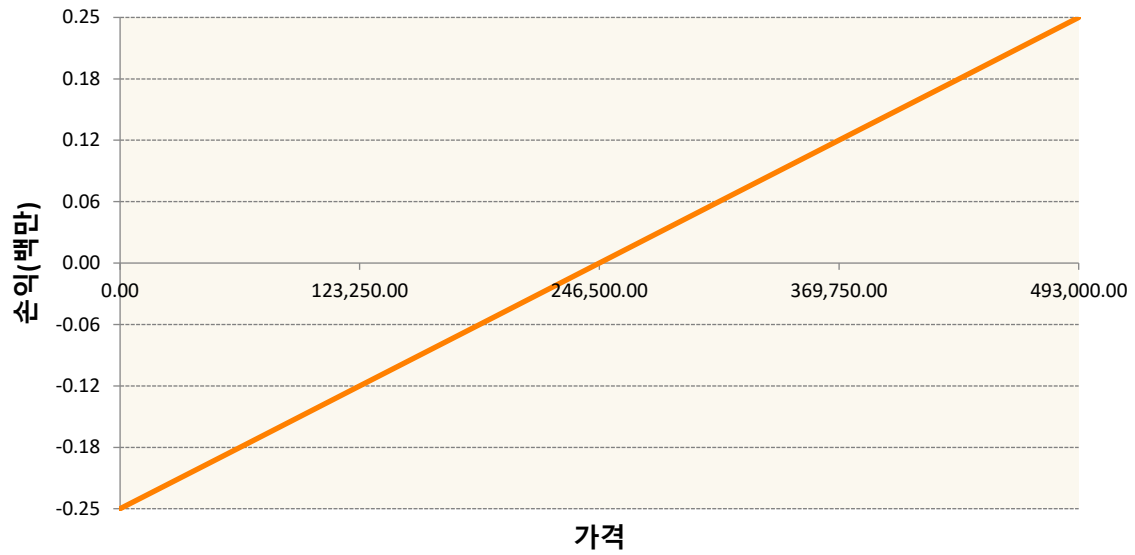
KR41F5W30008-2025-03 LG에너지솔루션개별선물



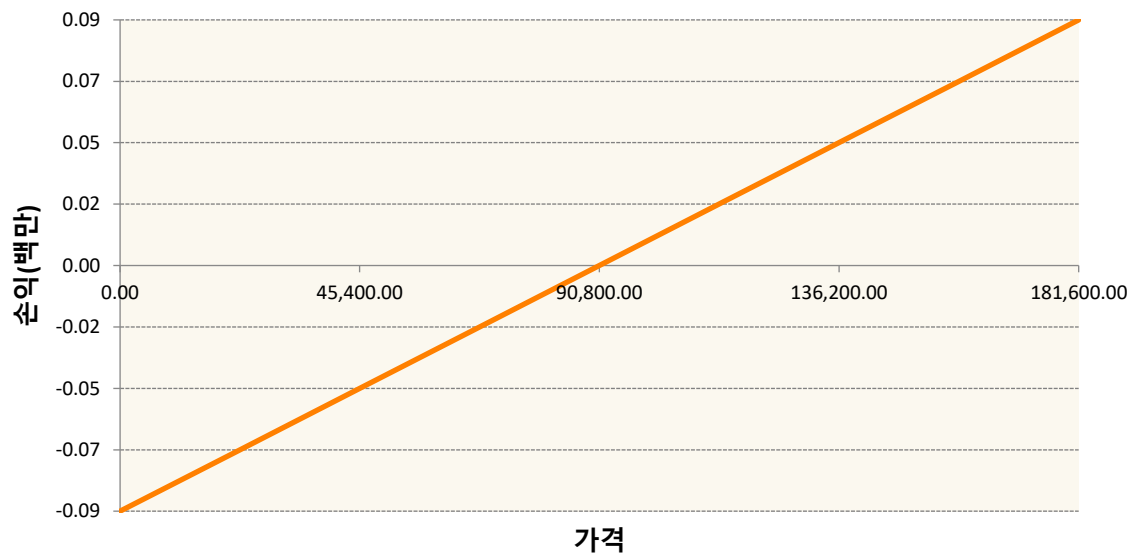
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



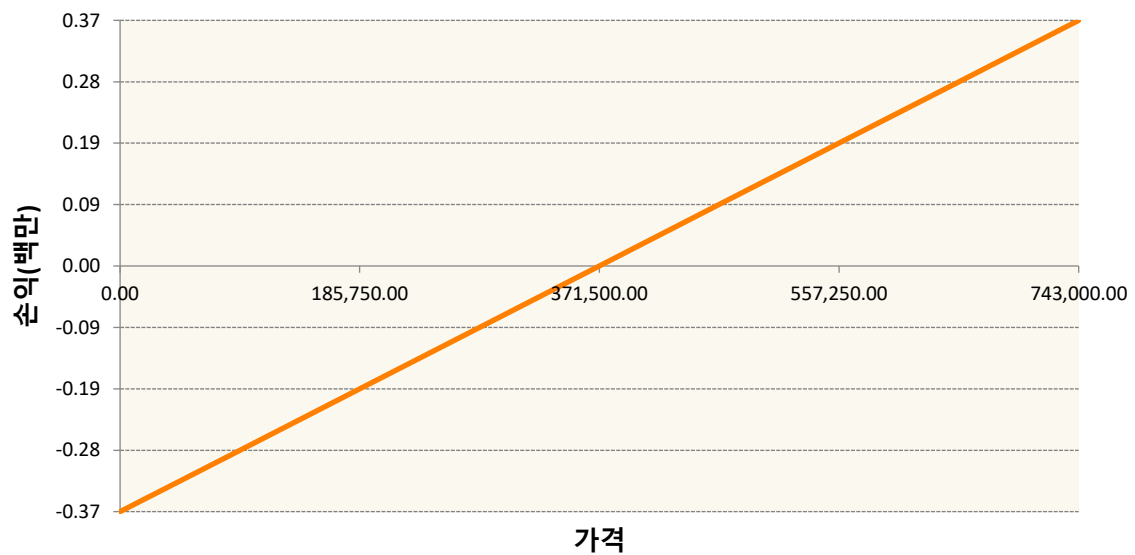
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



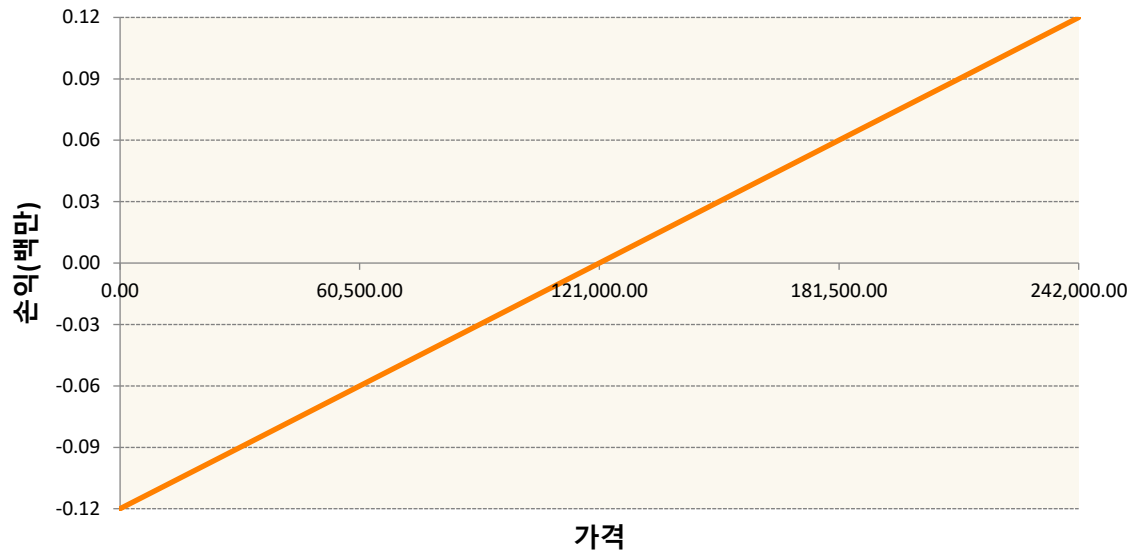
KR41FMW30007-2025-03 엘앤에프개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



### KR41HEW30000-2025-03 키움증권개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                  |    |
|----------------------------------|----|
| KR4101W30( 2025-03 코스피200지수선물    | 77 |
| KR410ZW30( 2025-03 한미반도체개별선물     | 2  |
| KR41C6W30( 2025-03 아모레퍼시픽개별선물    | 2  |
| KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물      | 1  |
| KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물       | 1  |
| KR41ETW30( 2025-03 삼성엔지니어링개별선물   | 1  |
| KR41F5W30( 2025-03 LG에너지솔루션개별선물  | 7  |
| KR41F9W30( 2025-03 SK바이오사이언스개별선물 | 1  |
| KR41FCW30( 2025-03 하이브개별선물       | 3  |
| KR41FMW30 2025-03 엘앤에프개별선물       | 1  |
| KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물   | 4  |
| KR41HEW30( 2025-03 키움증권개별선물      | 1  |

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

(단위:백만원)

156

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

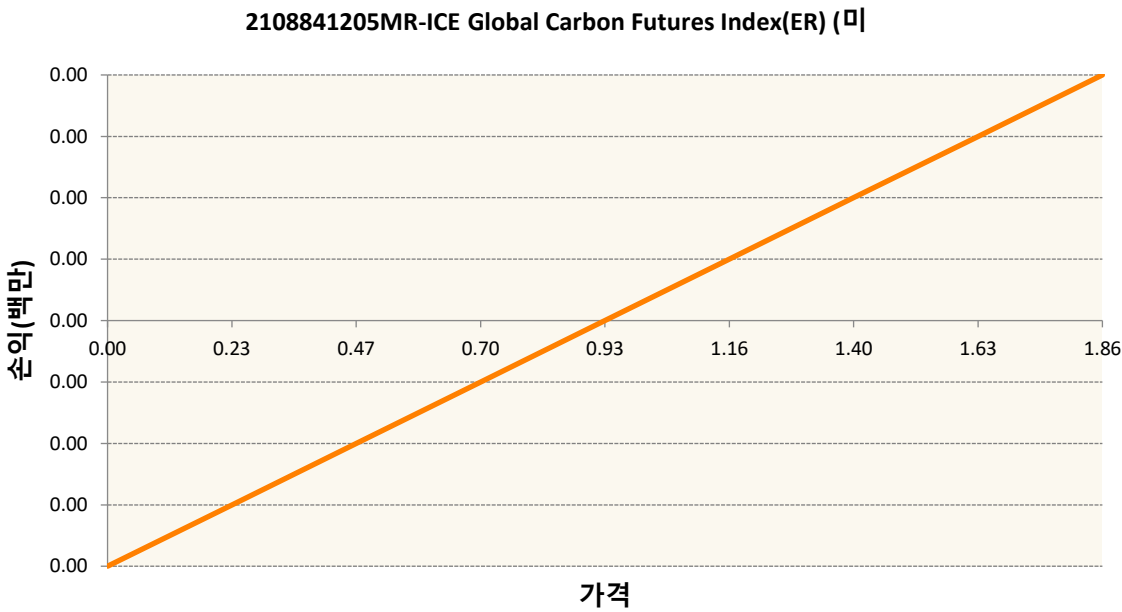
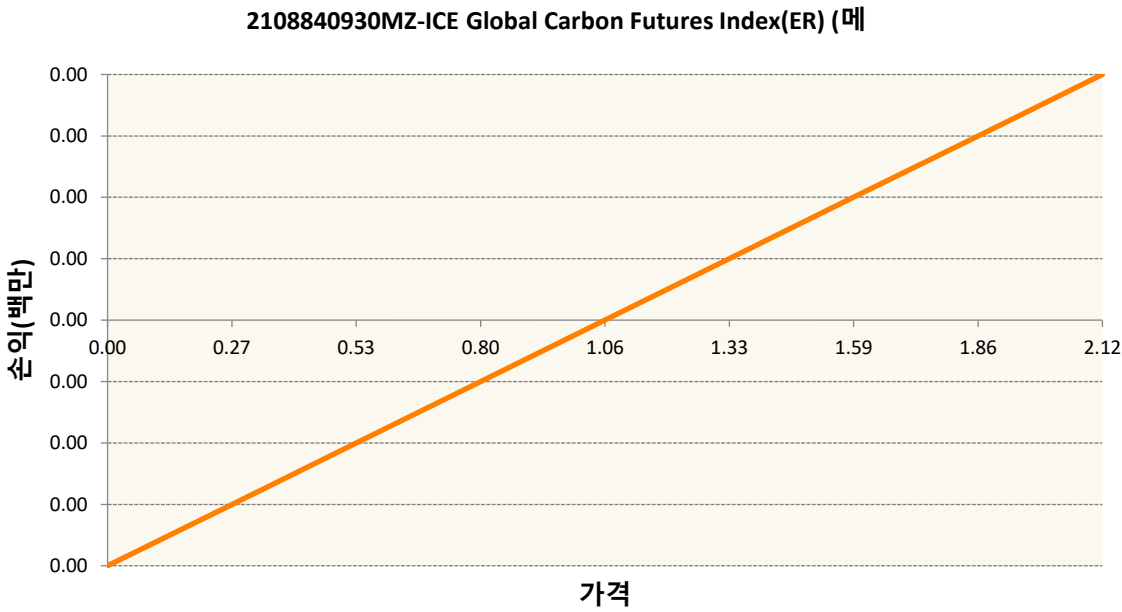
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 9,466 | 0     | 9,466     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840930IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 190      |
| 2108841205IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 568      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 843      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

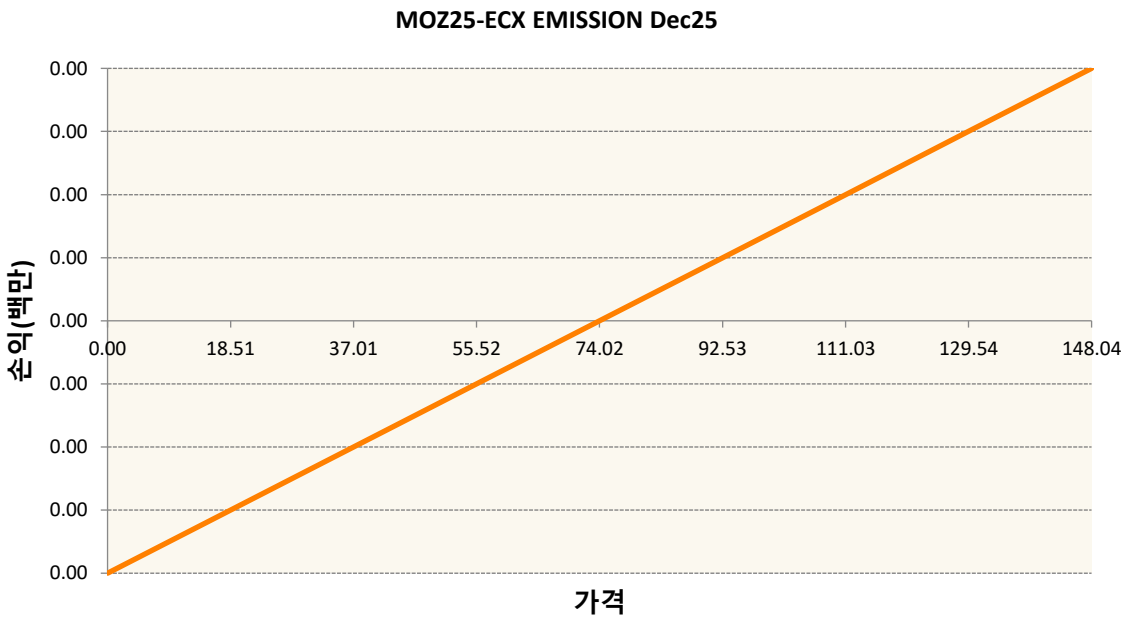
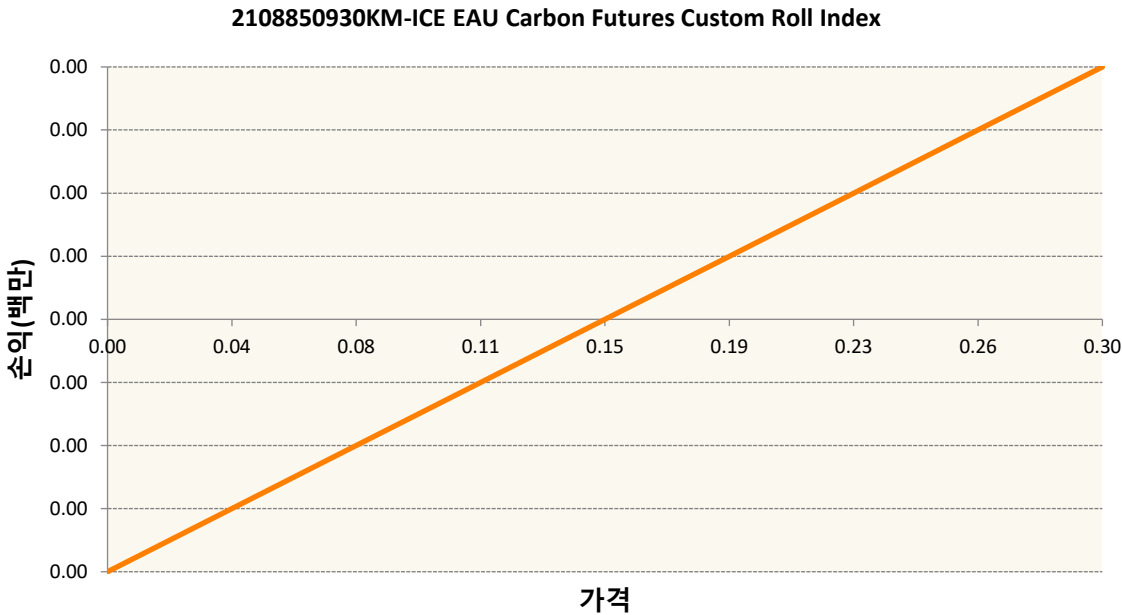
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 9,214 | 0     | 9,214     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,575 | -1,575    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|--|----------|
| 2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index |  | 4        |
| FXW213F1PC KRW/EUR 28-02-25E                        |  | 40       |
| FXW213F1PC KRW/EUR 28-02-25E                        |  | 86       |
| MOZ25        ECX EMISSION Dec25                     |  | 733      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,329    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

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)

36

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

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)  | 13 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(메리츠) | 15 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)  | 11 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 3  |

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

(단위:백만원)

70

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

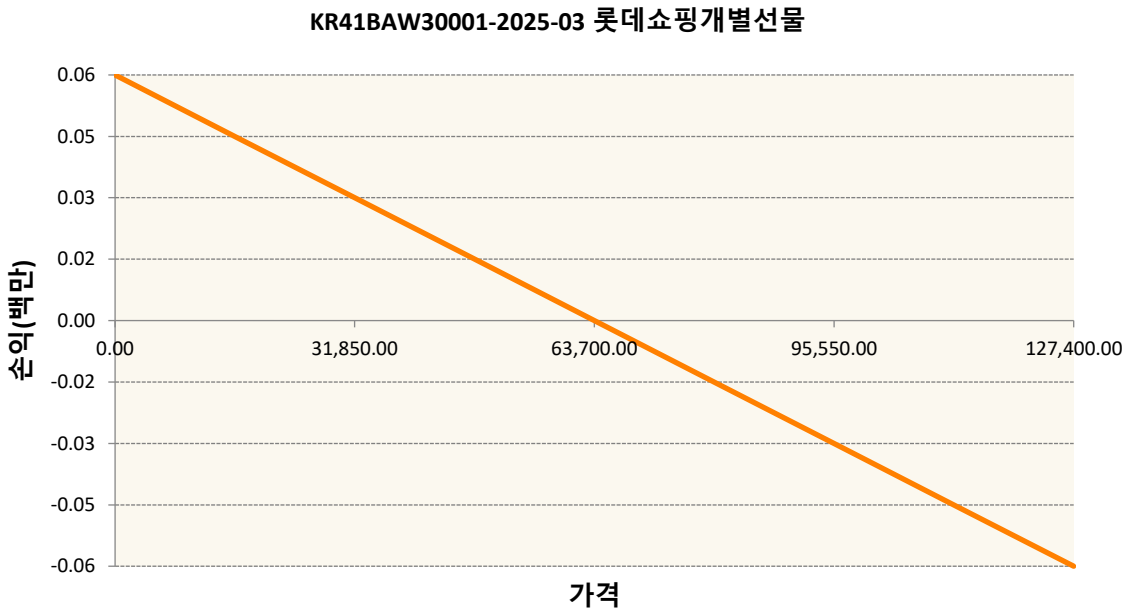
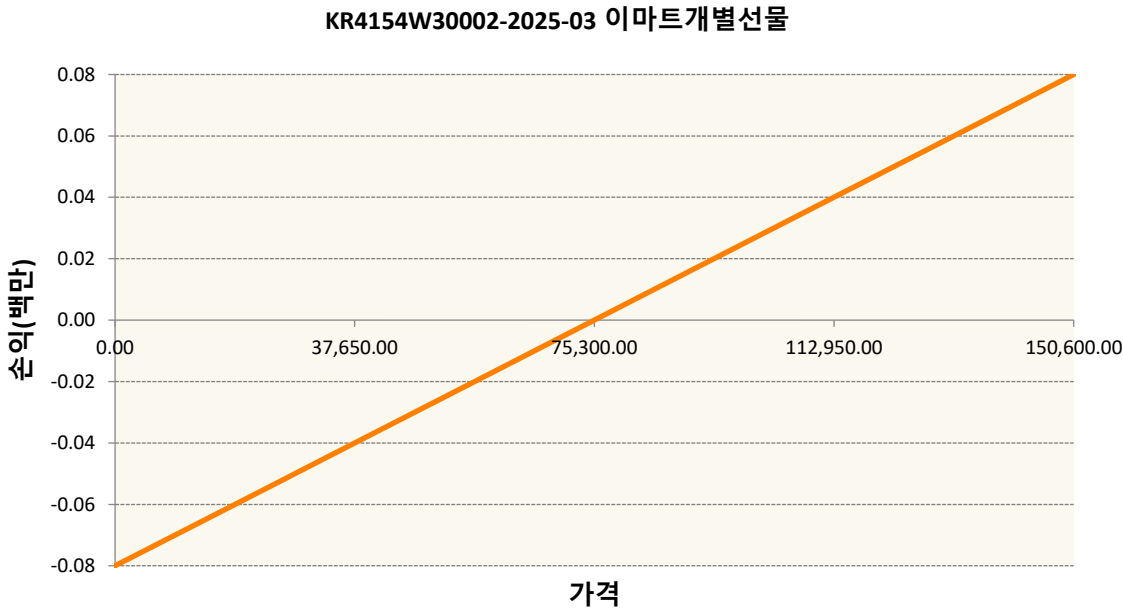
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

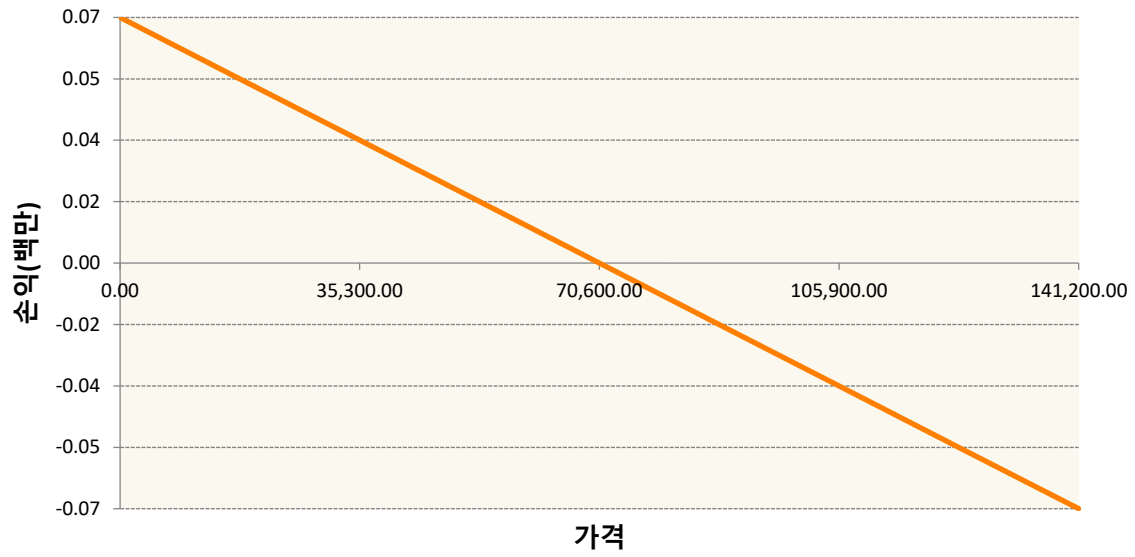
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 6     | 28    | -22       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 31    | 54    | -23       | 장내 |

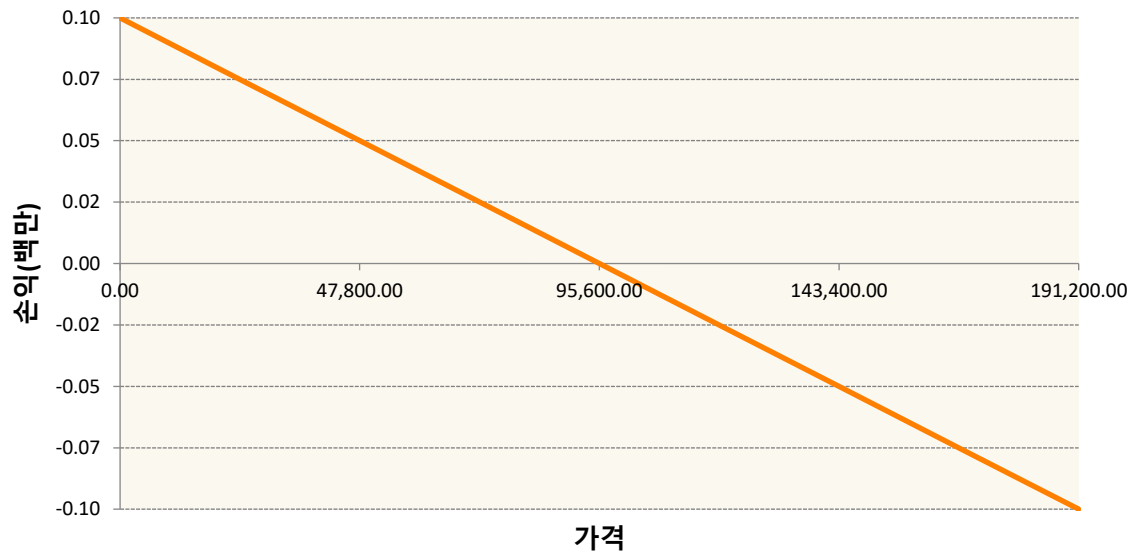
2. 만기시점의 손익구조



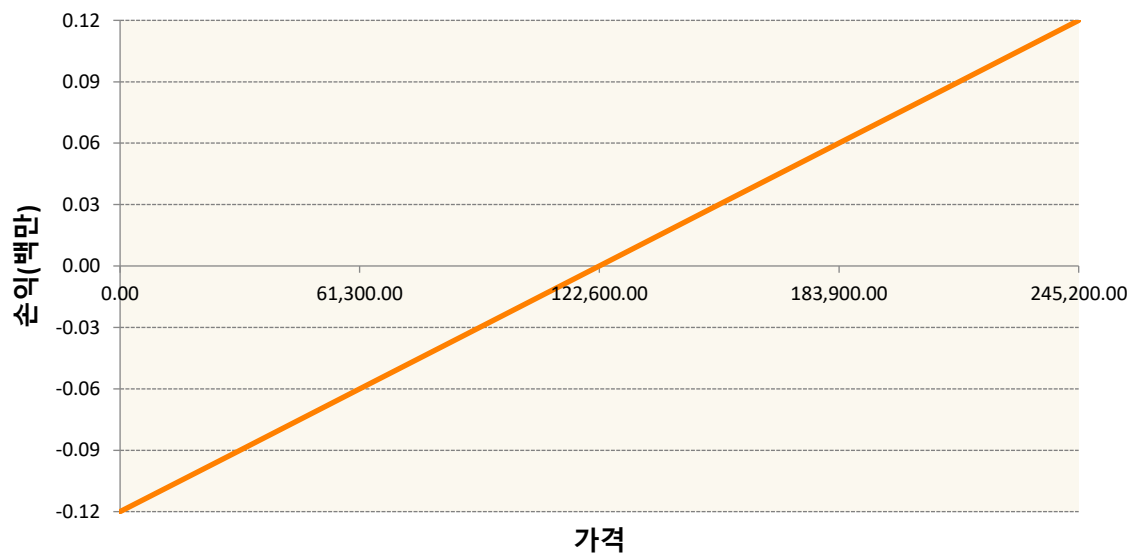
KR41BBW30009-2025-03 롯데케미칼개별선물



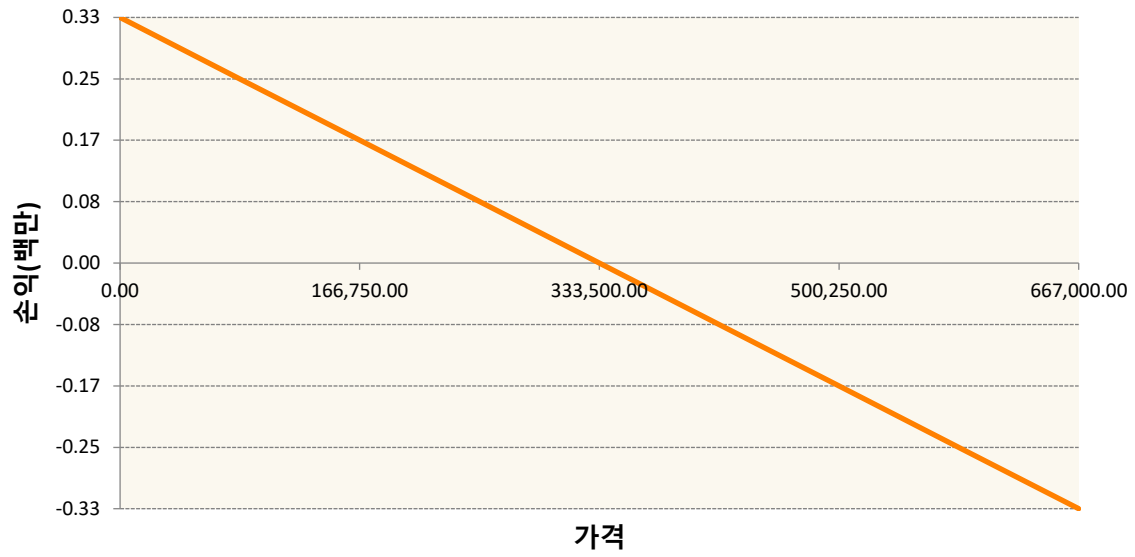
KR41BDW30005-2025-03 삼성생명개별선물



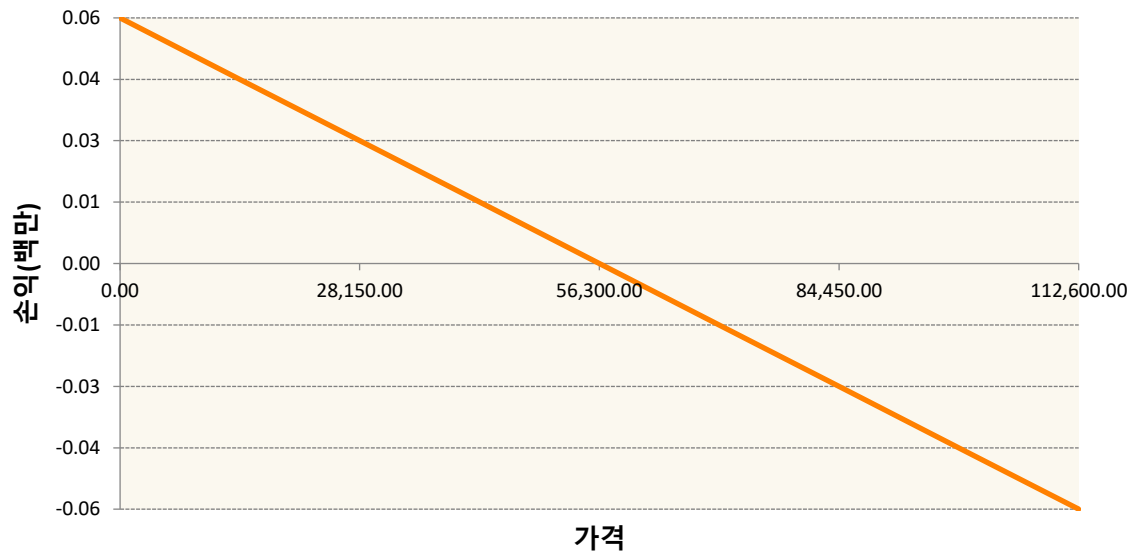
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



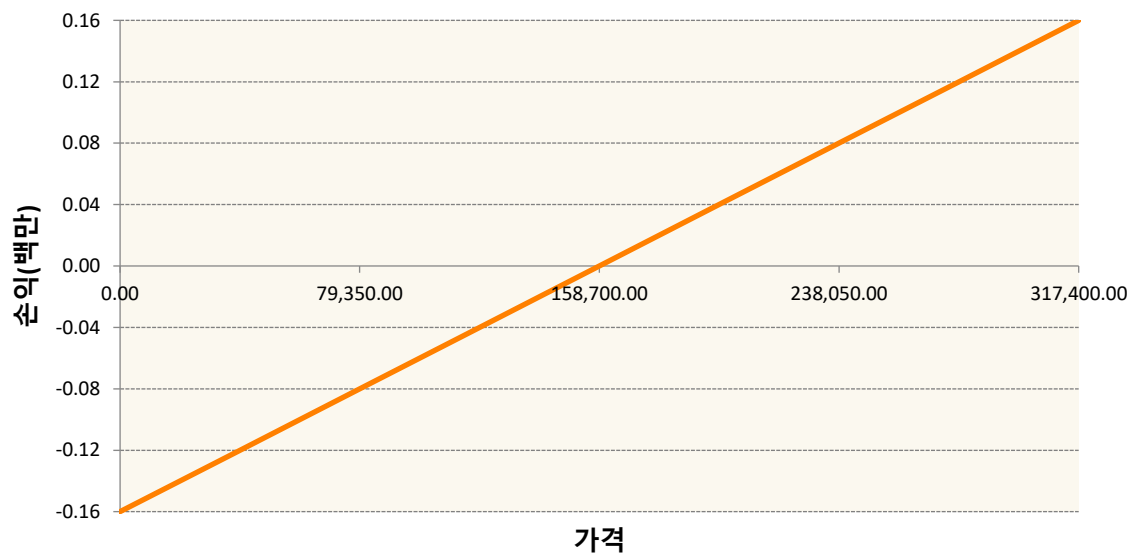
KR41CRW30003-2025-03 LG생활건강개별선물



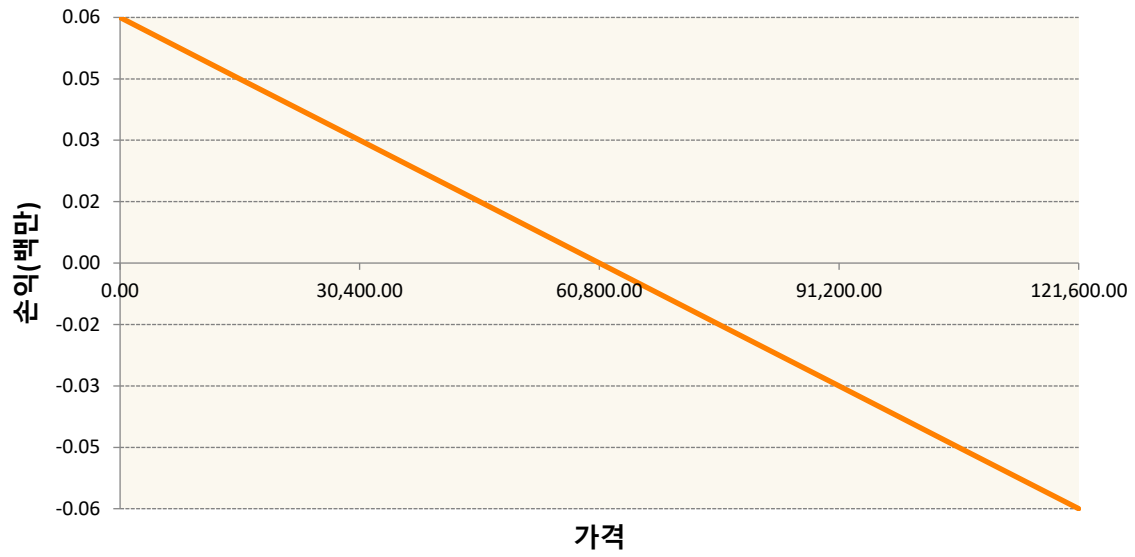
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



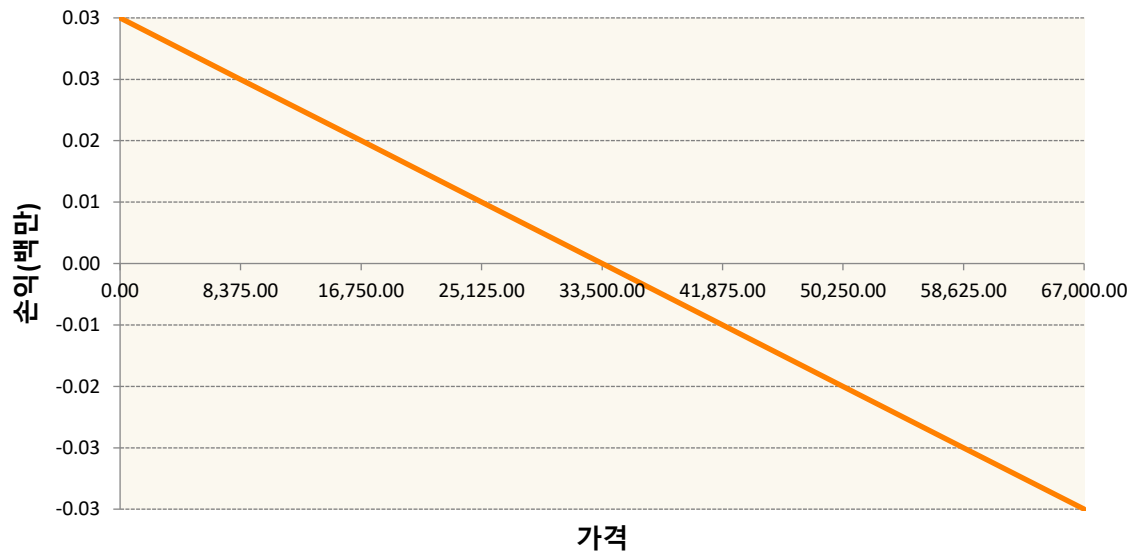
KR41DKW30006-2025-03 코스맥스개별선물



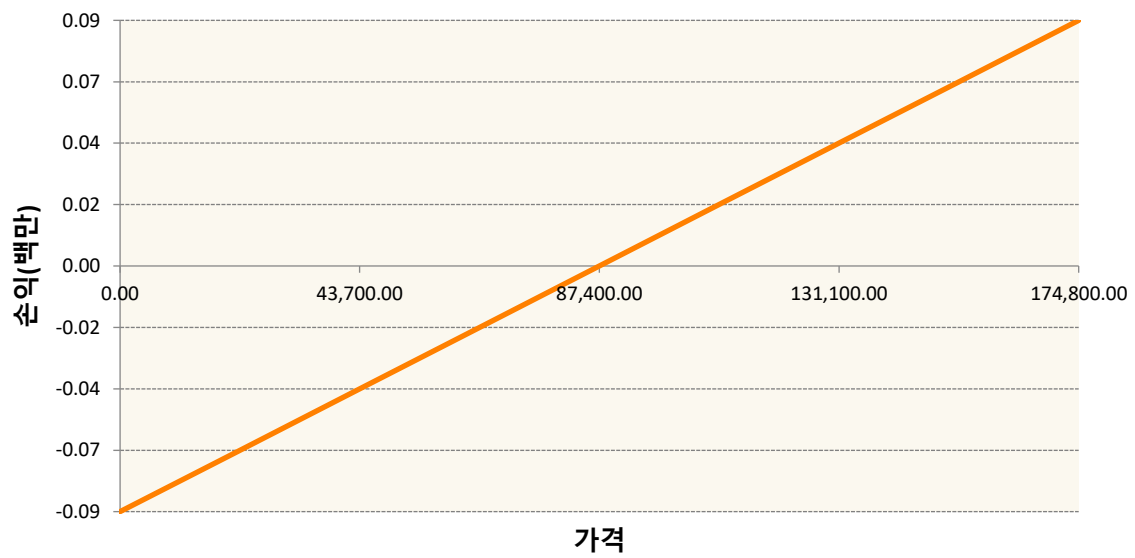
KR41DTW30007-2025-03 CJ ENM개별선물



KR41FLW30009-2025-03 풀어비스개별선물



KR41G6W30005-2025-03 현대로템개별선물



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)     |  | (단위:백만원) |
|-------------------------------|--|----------|
| KR4154W30( 2025-03 이마트개별선물    |  | 0.36     |
| KR41BAW30( 2025-03 롯데쇼핑개별선물   |  | 1        |
| KR41BBW30( 2025-03 롯데케미칼개별선물  |  | 0.23     |
| KR41BDW30 2025-03 삼성생명개별선물    |  | 1        |
| KR41C6W30( 2025-03 아모레퍼시픽개별선물 |  | 1        |
| KR41CRW30( 2025-03 LG생활건강개별선물 |  | 1        |
| KR41DEW30( 2025-03 한국콜마개별선물   |  | 1        |
| KR41DKW30 2025-03 코스맥스개별선물    |  | 1        |
| KR41DTW30( 2025-03 CJ ENM개별선물 |  | 0.34     |
| KR41FLW30( 2025-03 펄어비스개별선물   |  | 0.29     |
| KR41G6W30( 2025-03 현대로템개별선물   |  | 0.49     |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 15       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

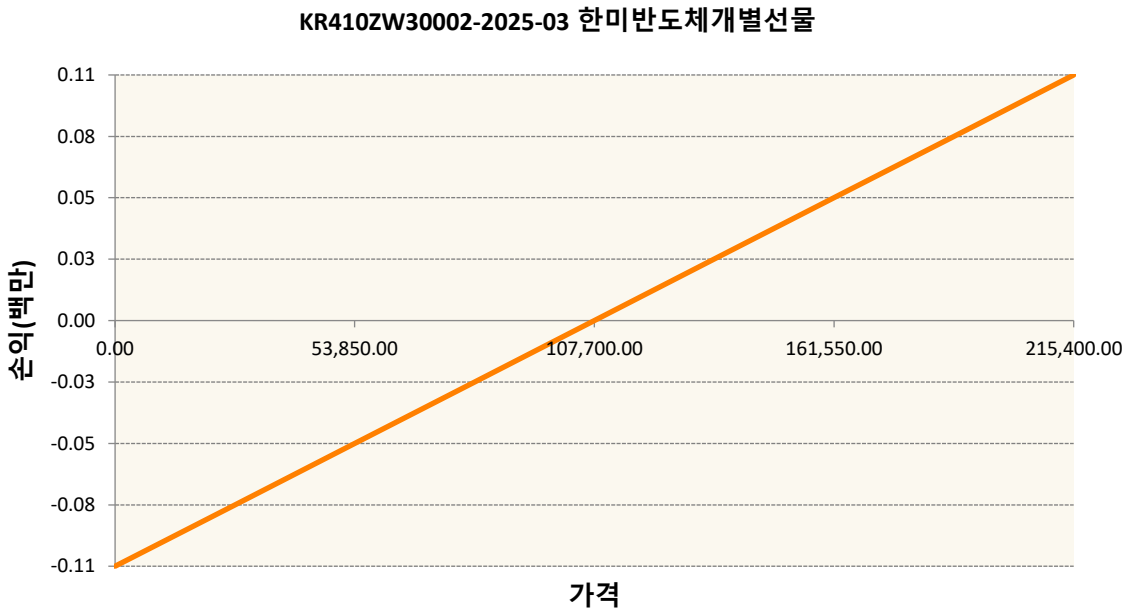
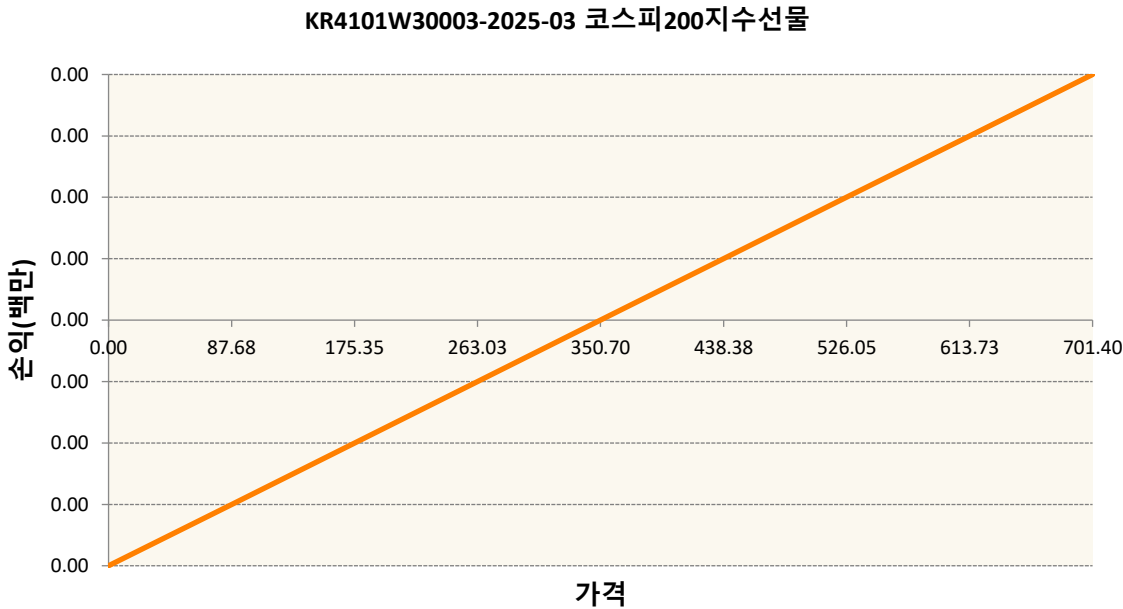
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

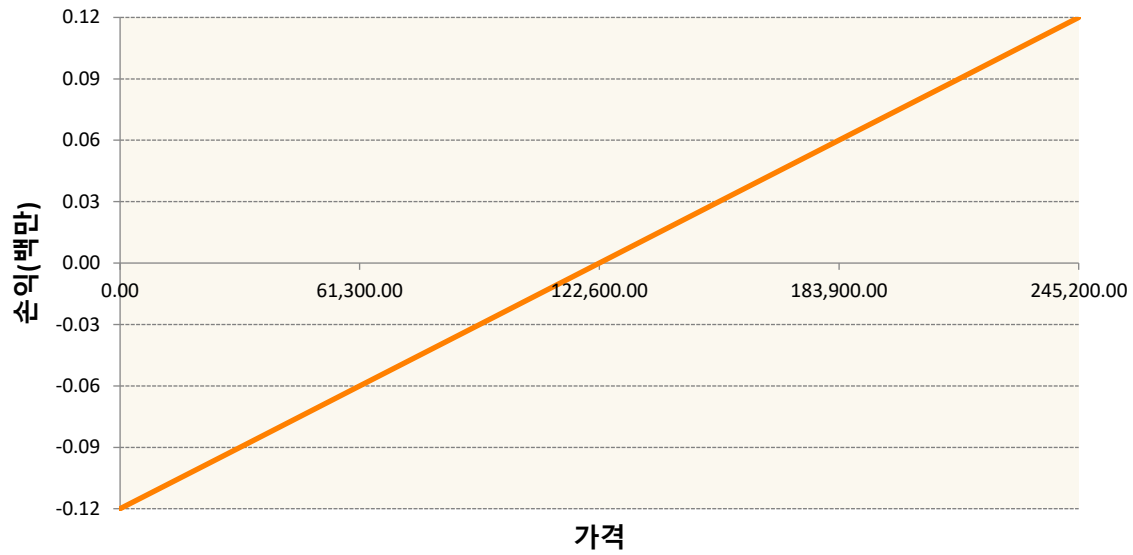
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 4,052  | 0     | 4,052     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 14,967 | 0     | 14,967    | 장내 |

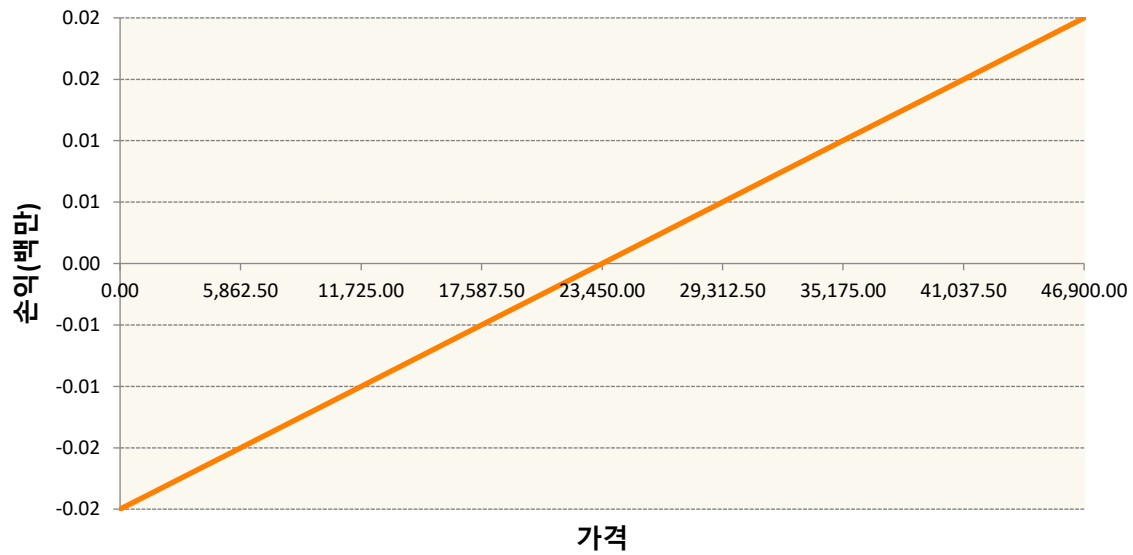
2. 만기시점의 손익구조



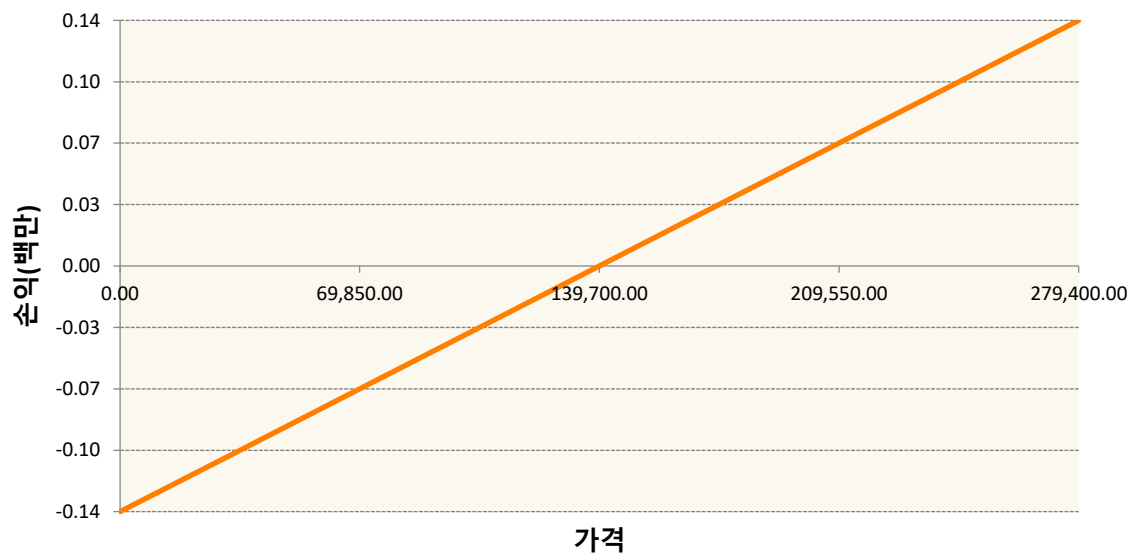
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



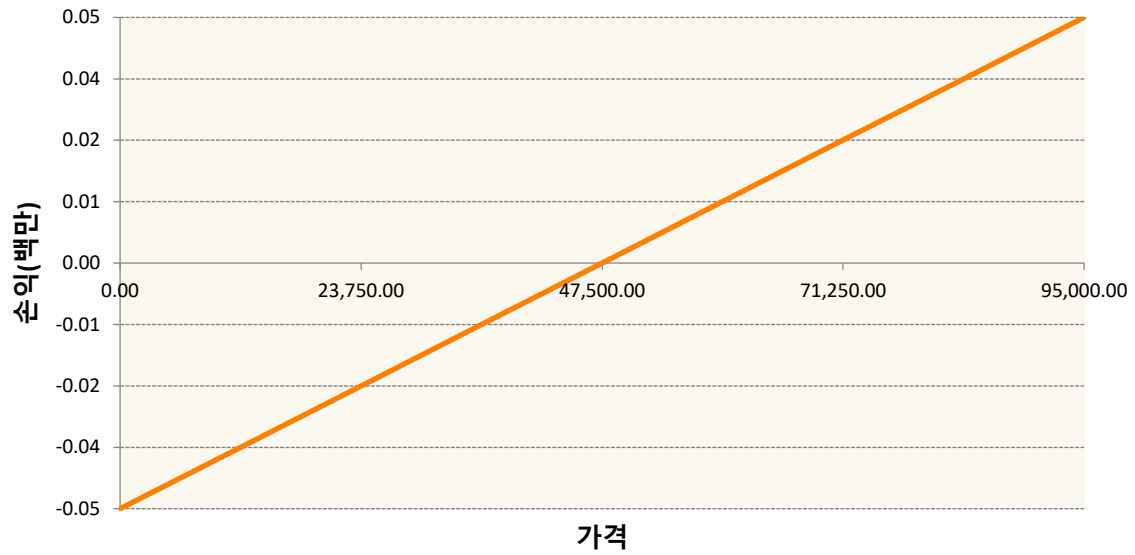
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



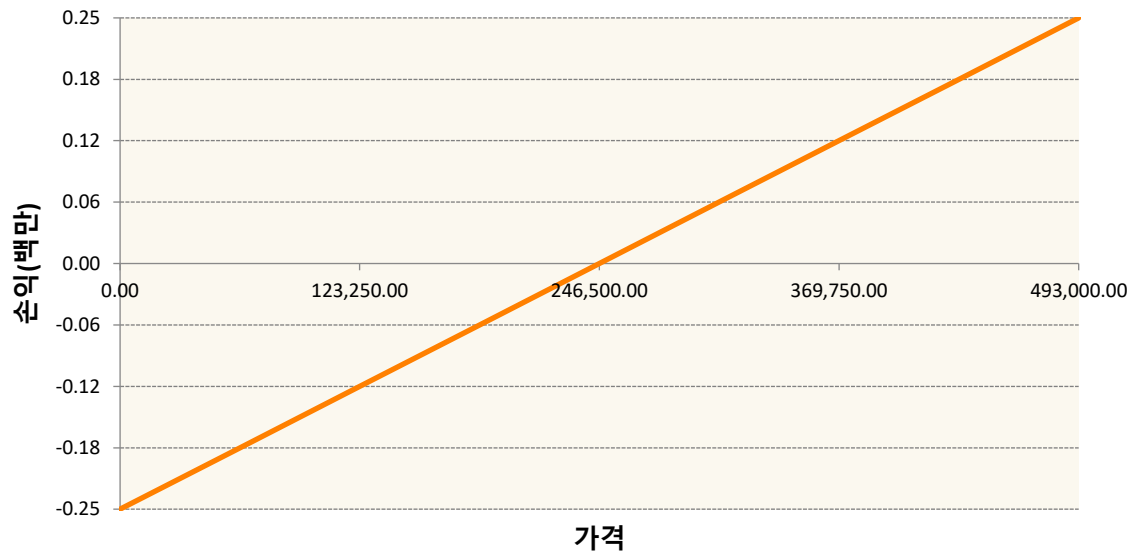
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



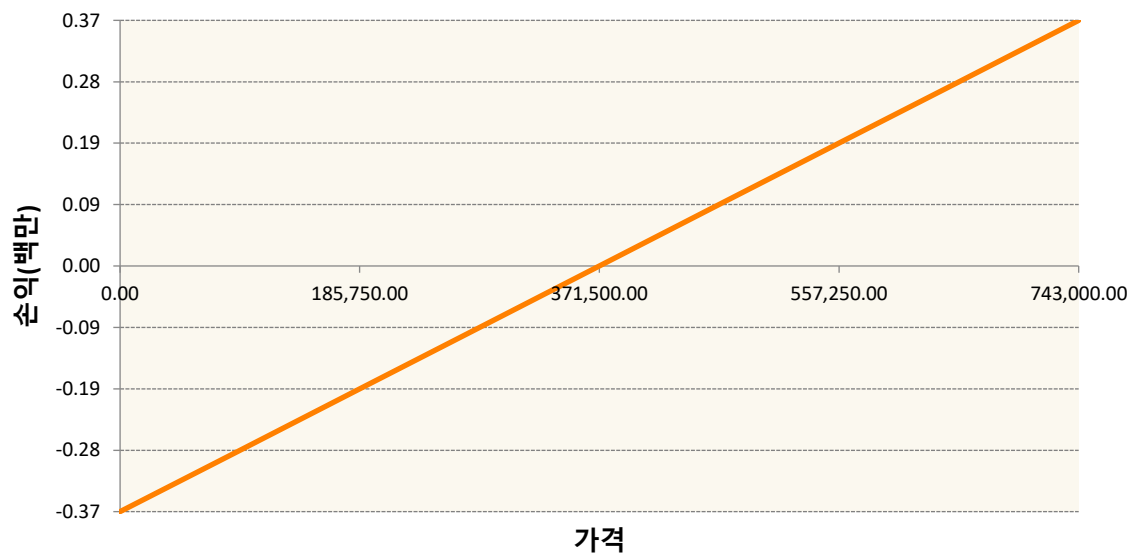
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|                                  |     |
|----------------------------------|-----|
| KR4101W30( 2025-03 코스피200지수선물    | 947 |
| KR410ZW30( 2025-03 한미반도체개별선물     | 45  |
| KR41C6W30( 2025-03 아모레퍼시픽개별선물    | 31  |
| KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물      | 11  |
| KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물       | 27  |
| KR41F9W30( 2025-03 SK바이오사이언스개별선물 | 12  |
| KR41FCW30( 2025-03 하이브개별선물       | 50  |
| KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물   | 74  |

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

1,894

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

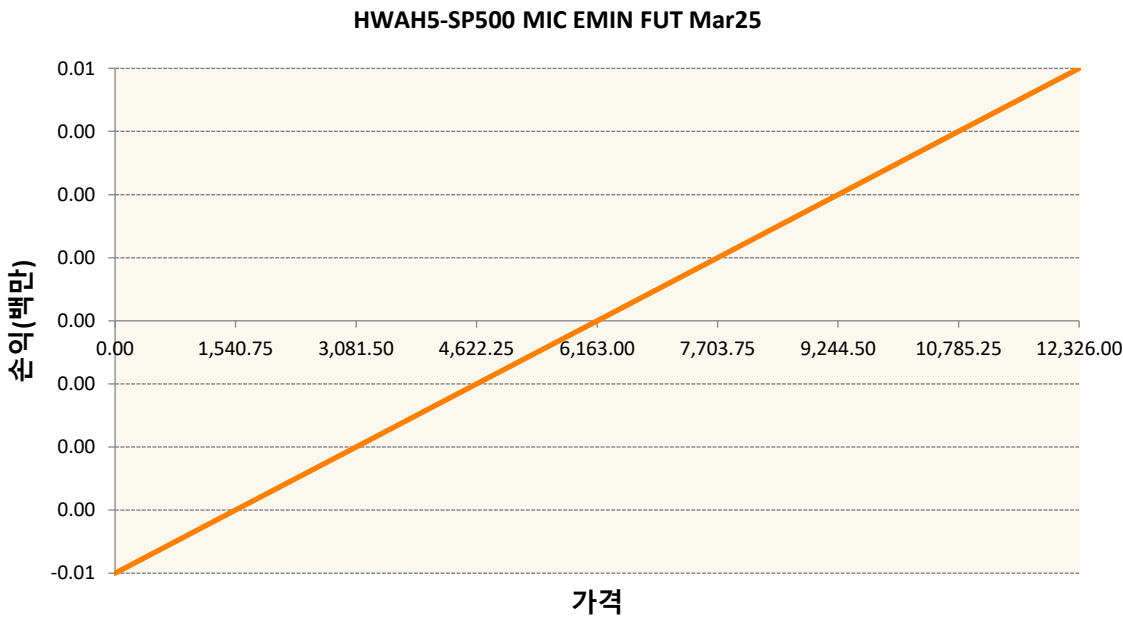
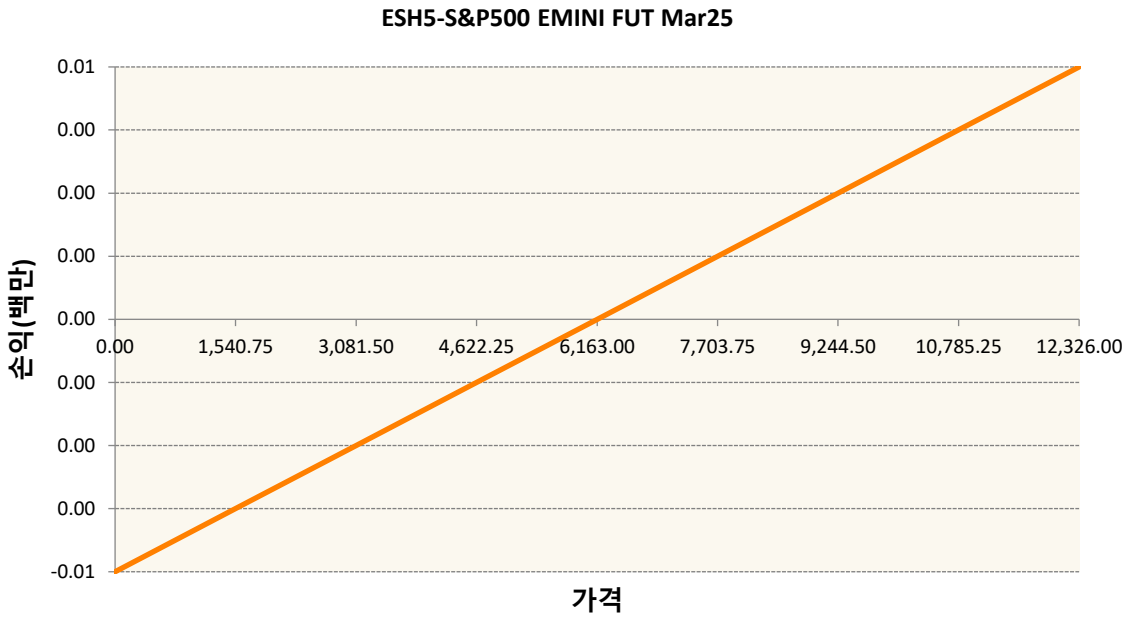
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 30,871 | 0     | 30,871    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,295  | 0     | 1,295     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESH5                      | S&P500 EMINI FUT Mar25   | 2,470    |
| HWAH5                     | SP500 MIC EMIN FUT Mar25 | 104      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 3,440    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

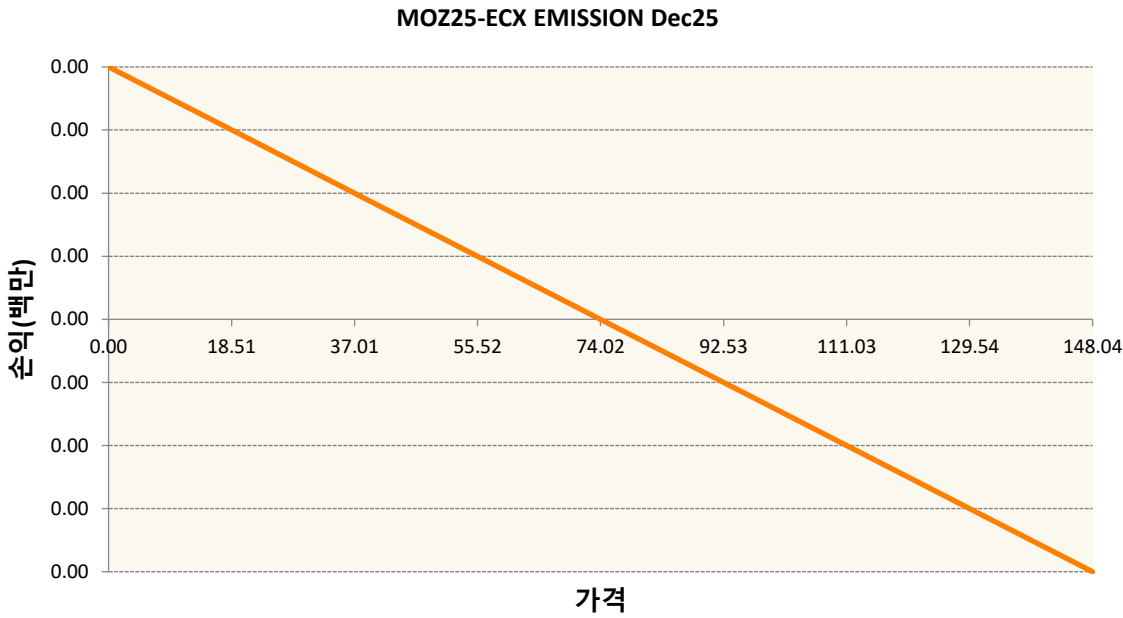
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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   | -51   | 4,939 | -4,990    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 694   | -694      | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |     |
|-----------------------------------------------------|-----|
| 2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 4   |
| FXW213F1PC KRW/EUR 28-02-25E                        | 55  |
| MOZ25 ECX EMISSION Dec25                            | 395 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 712 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

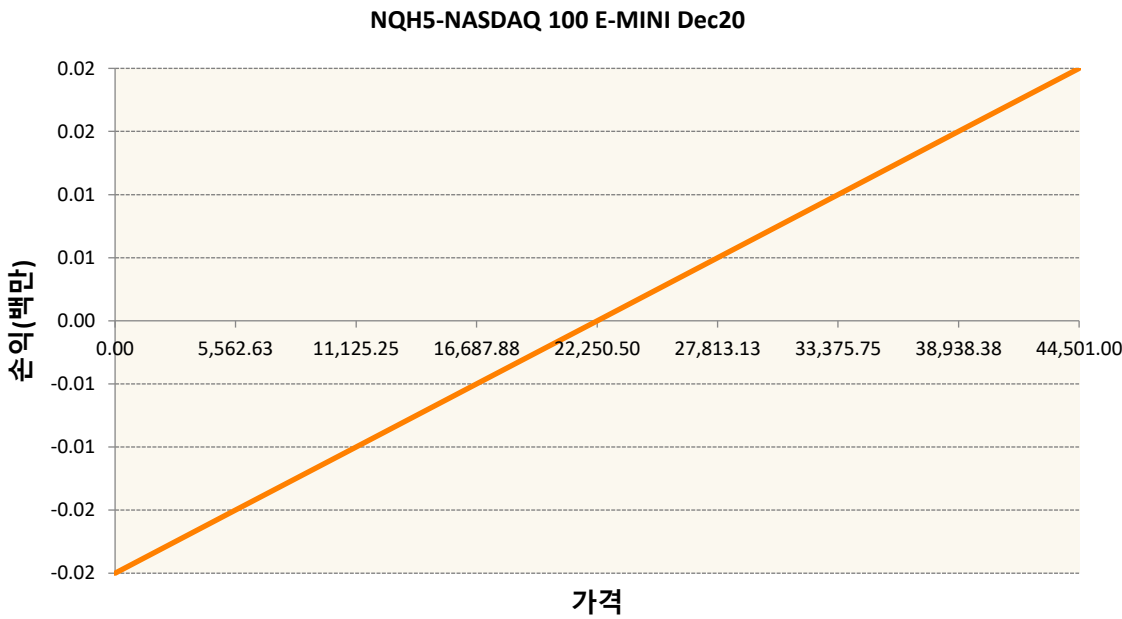
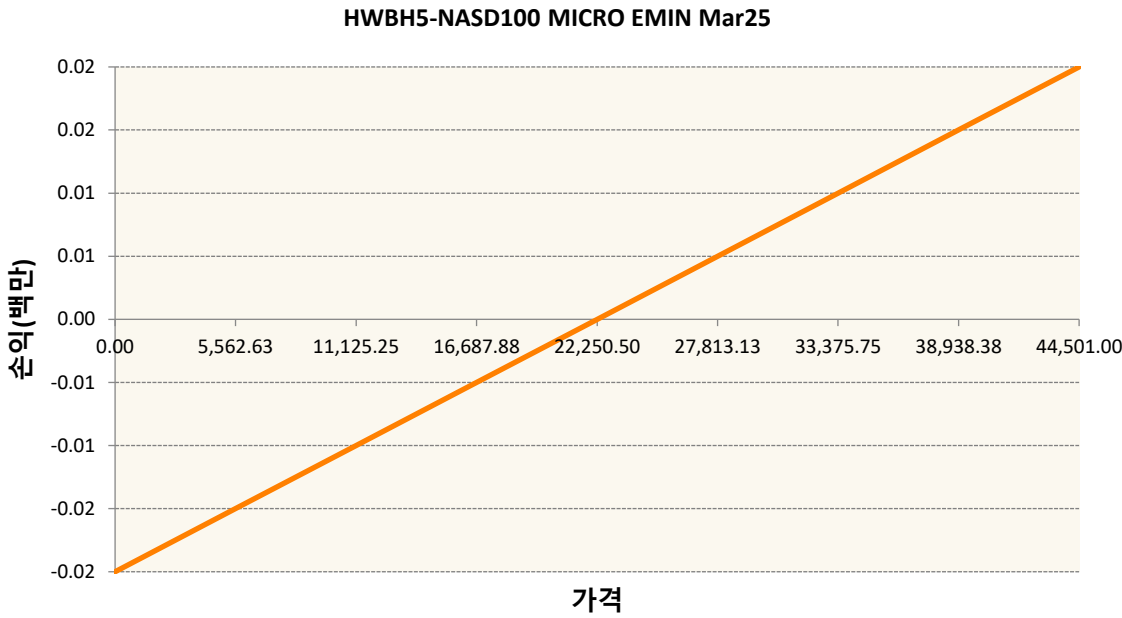
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 15,513 | 0     | 15,513    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 710    | 0     | 710       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBH5                     | NASD100 MICRO EMIN Mar25 |  | 57       |
| NQH5                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 1,241    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 1,137    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

## 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 | 717   |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 2,980 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 6,957 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 6,798 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 9,345 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

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)

|    |
|----|
| 10 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-02-21 |
| 기준일 | 2025-02-20 |

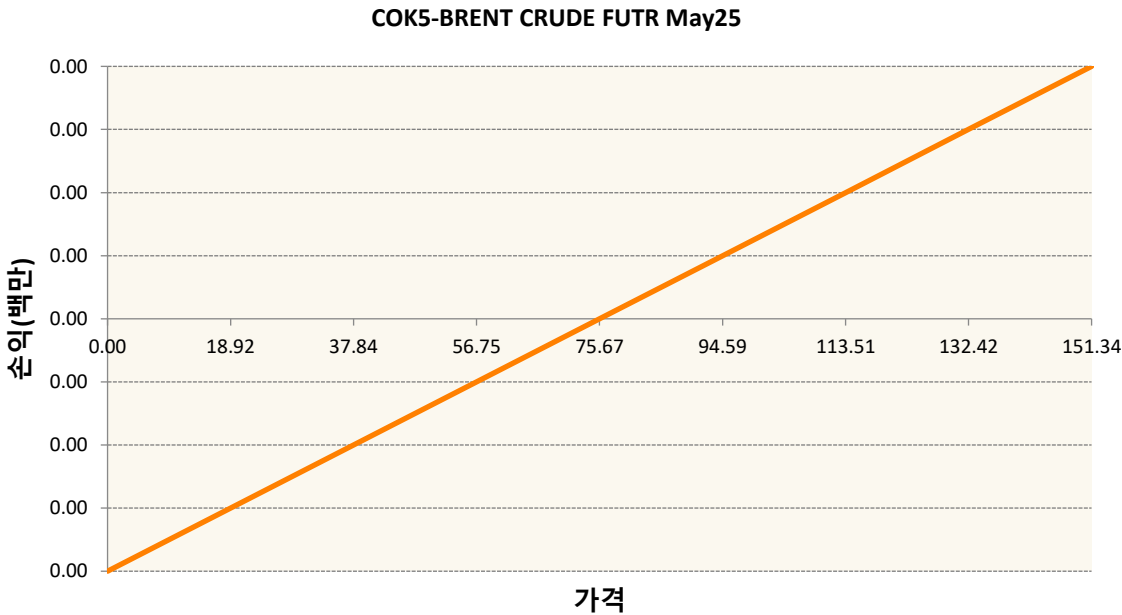
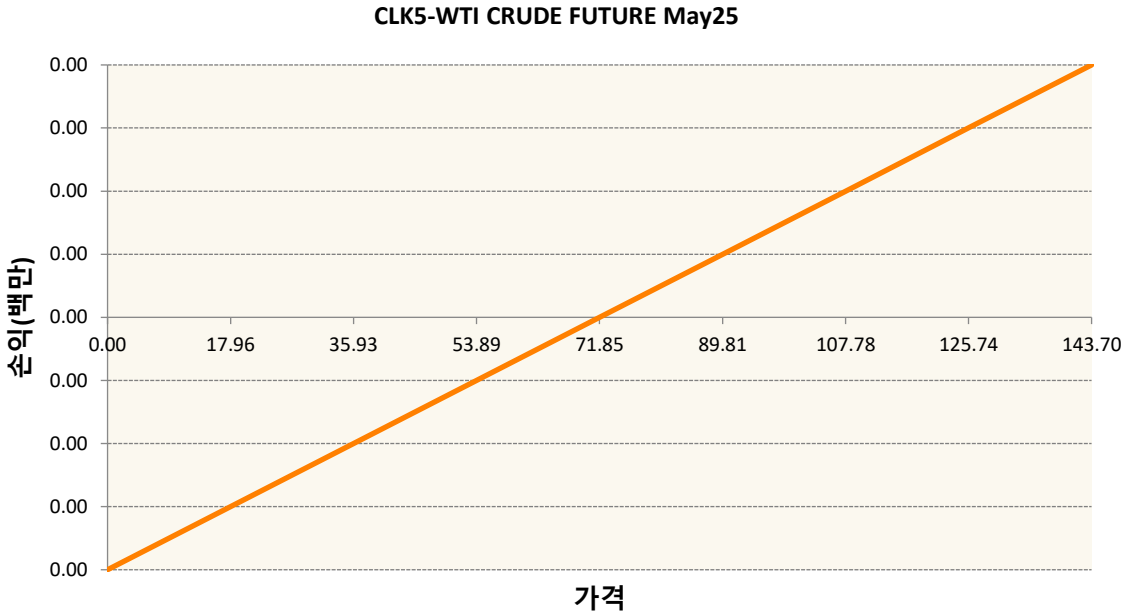
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

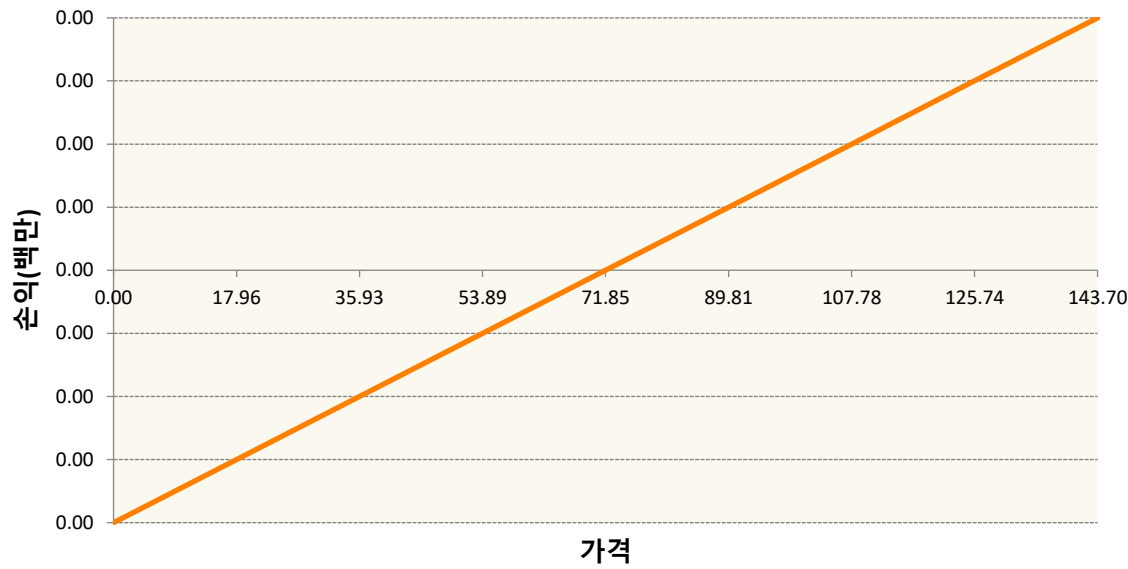
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 900   | 0     | 900       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 187   | -187      | 장내 |

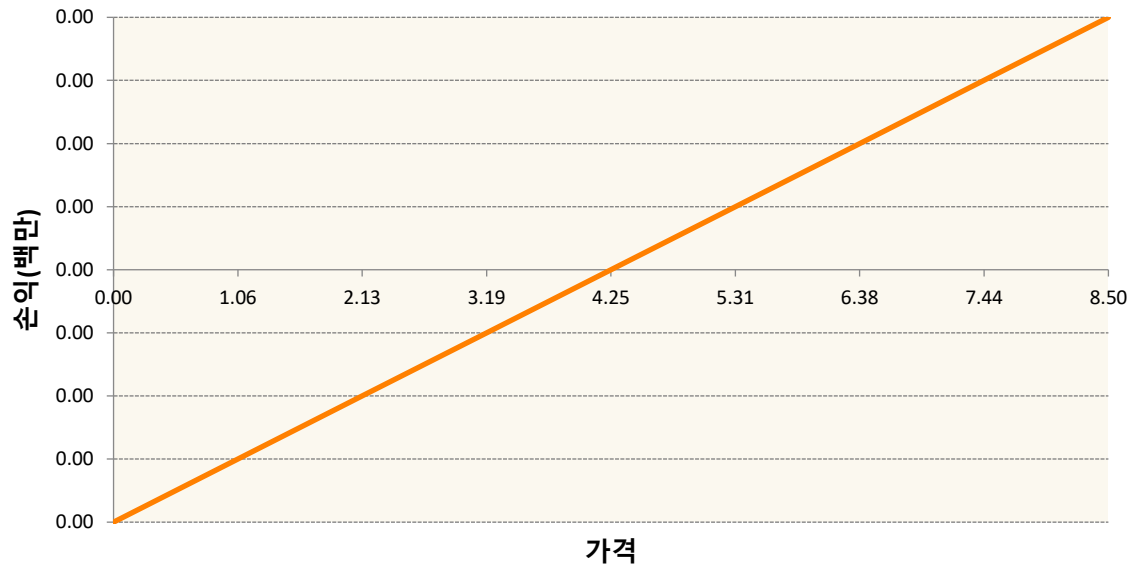
### 2. 만기시점의 손익구조



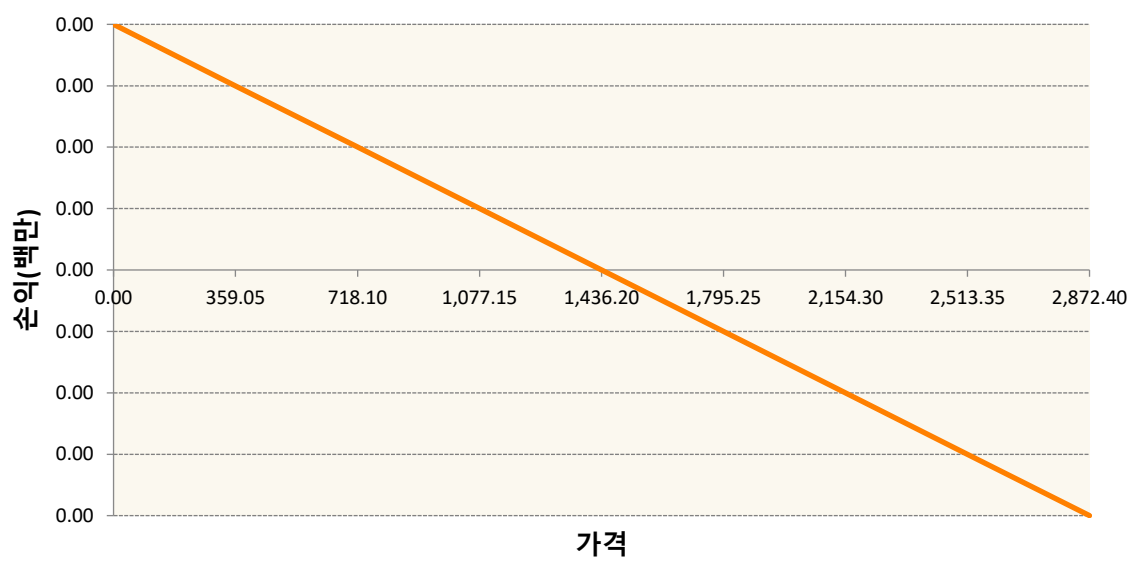
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



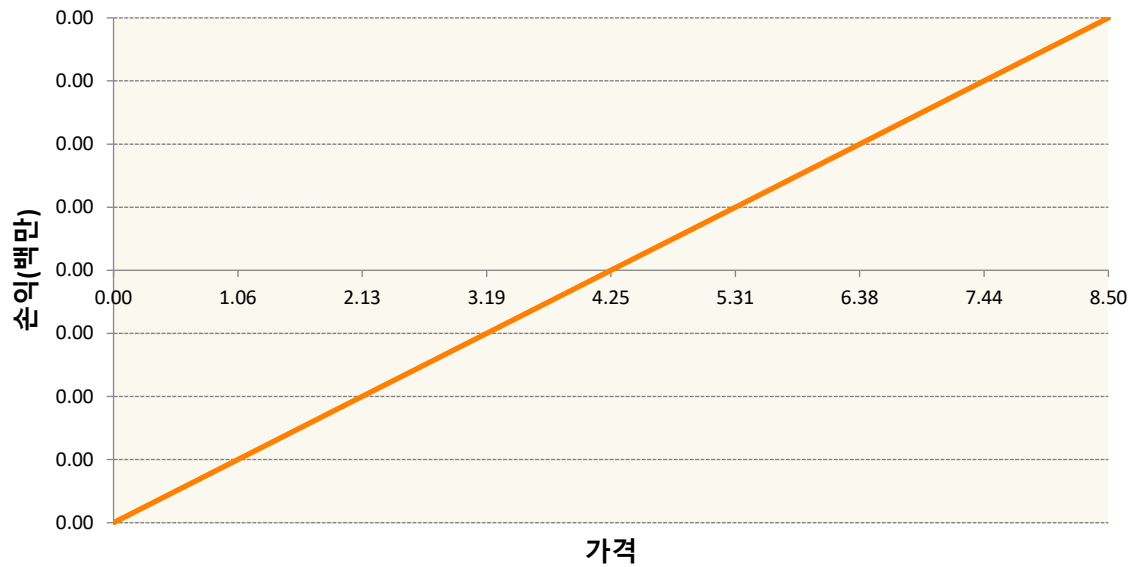
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



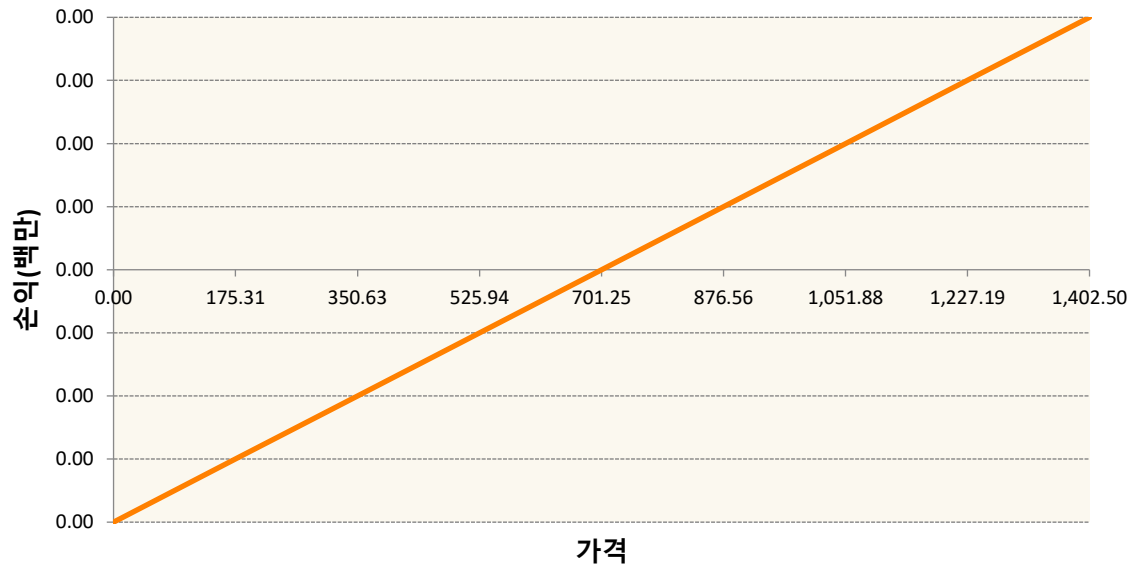
KR4175W30007-2025-03 달러선물



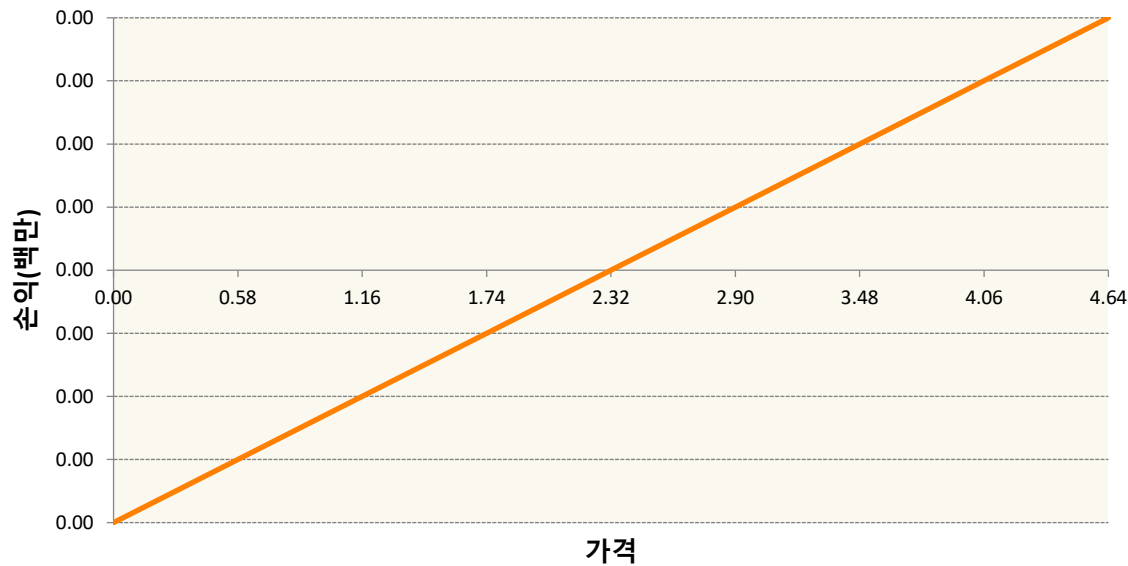
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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 | 7  |
| KR4175W30( | 2025-03 달러선물              | 15 |
| NGK25      | NATURAL GAS FUTR May 25   | 15 |
| QSK5       | Low Su Gasoil G May 25    | 8  |
| XBK5       | GASOLINE RBOB FUT May 25  | 11 |

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

156