

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

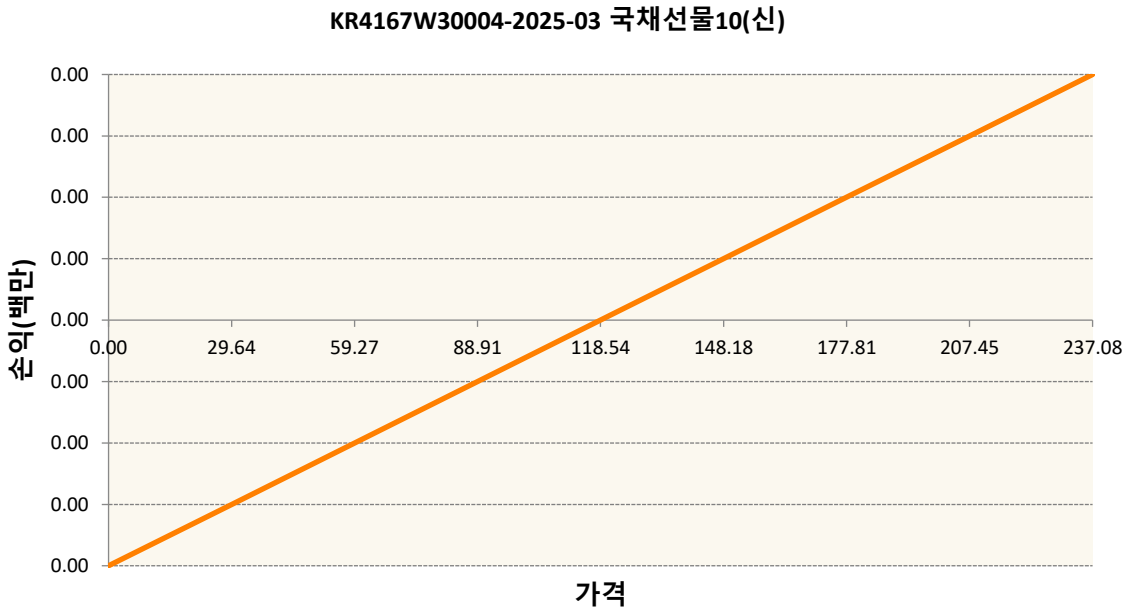
베스트장기채(채권-파생형)

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	269,086	0	269,086	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

6,761

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

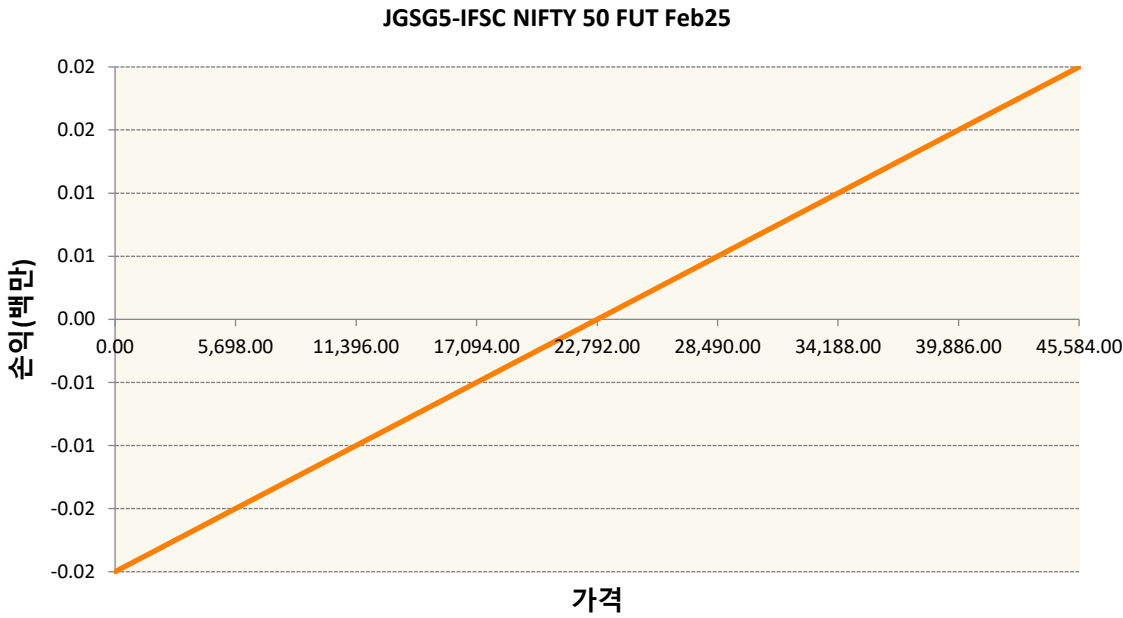
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,312	0	3,312	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSG5	IFSC NIFTY 50 FUT Feb25	265
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

180

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

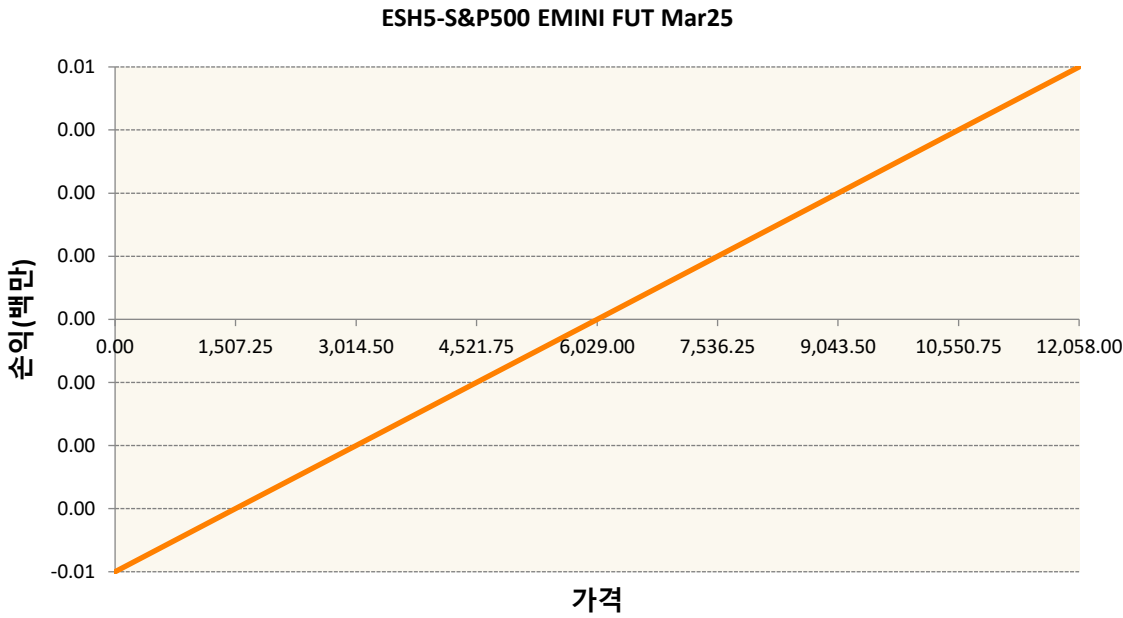
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	867	0	867	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	69
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

95

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

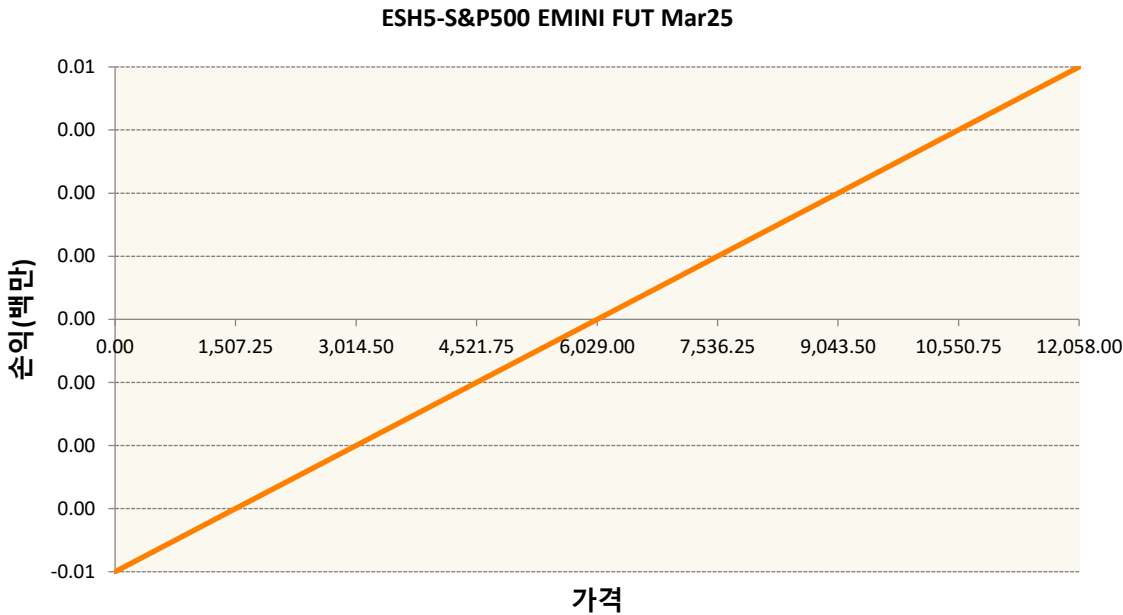
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,624	0	2,624	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	210
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

288

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

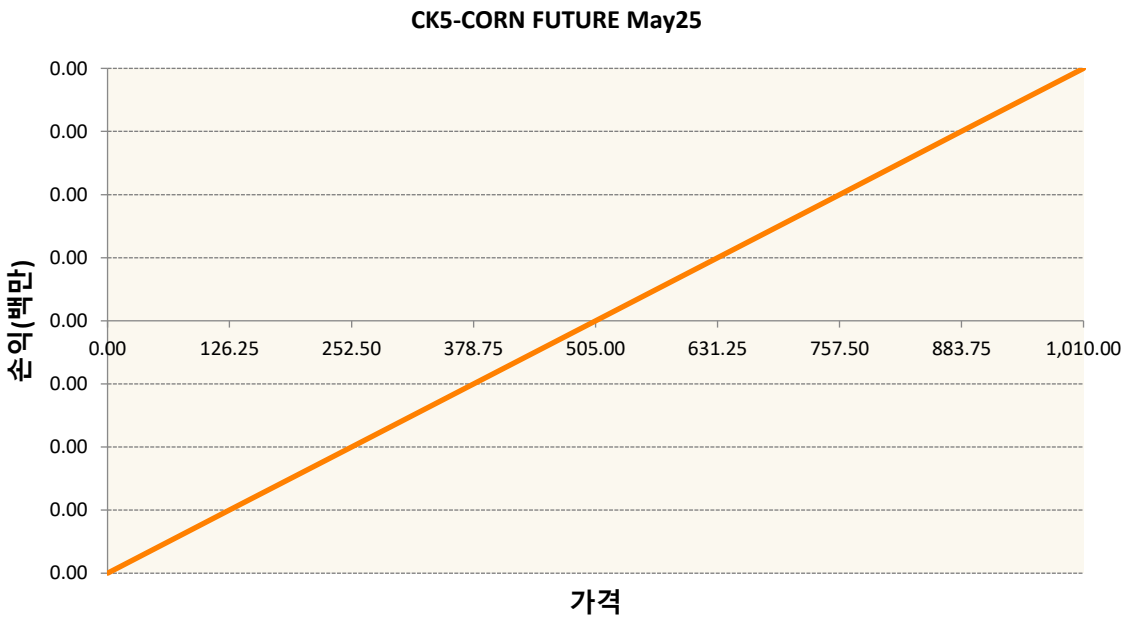
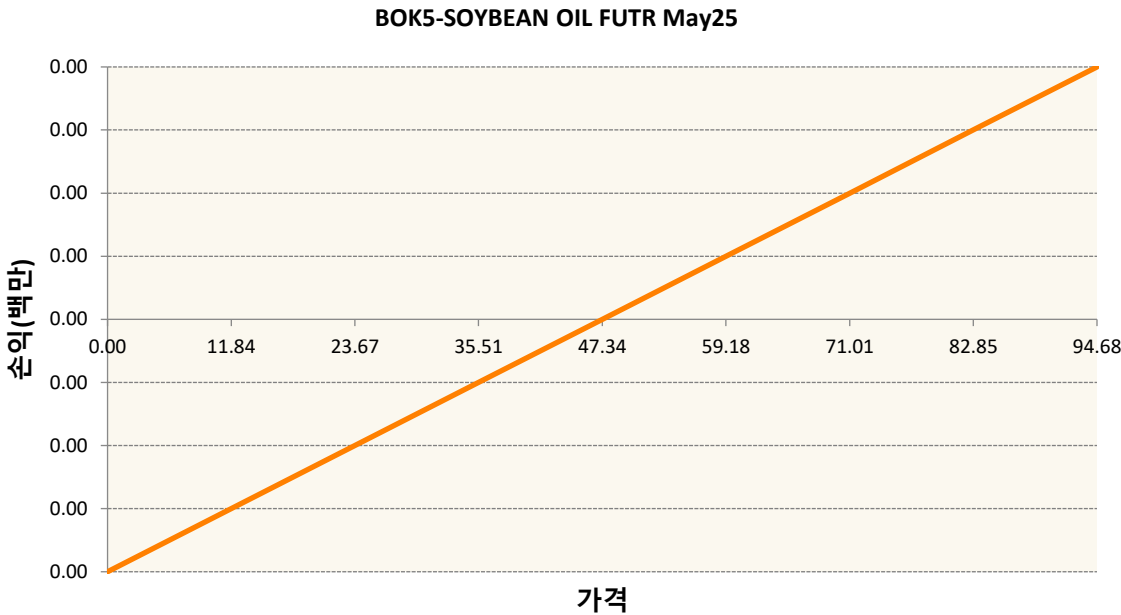
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

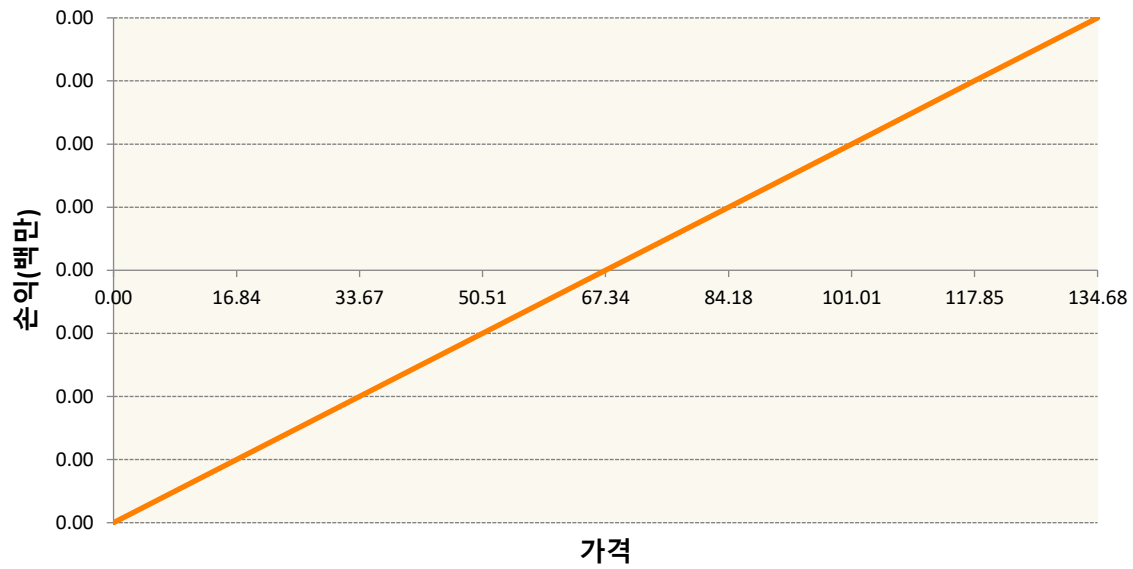
(단위:USD 백만)

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	4,070	0	4,070	
누계	통화	선물	0	627	-627	장내

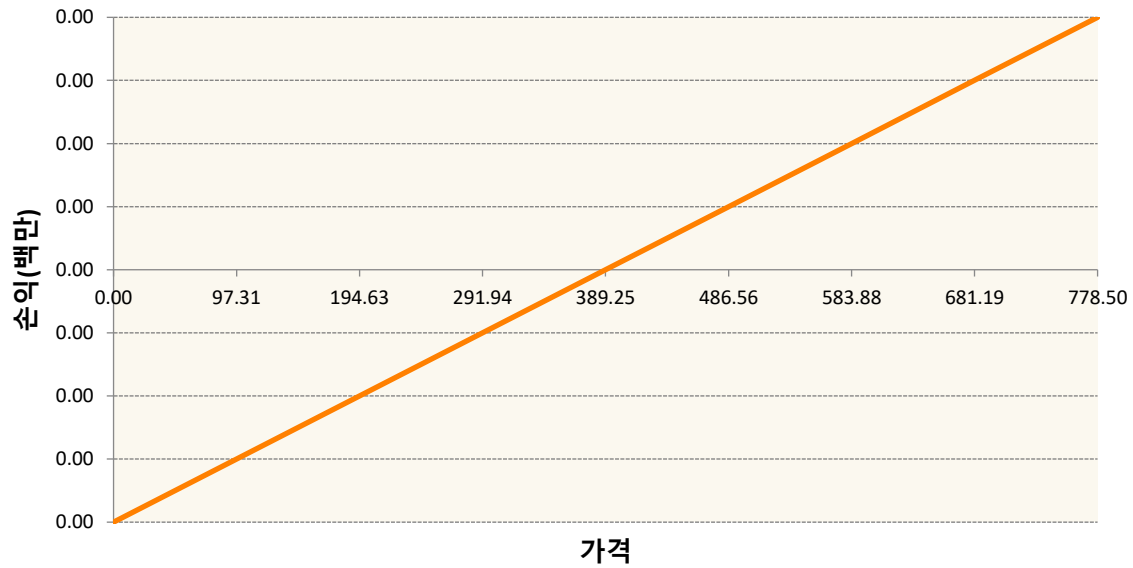
2. 만기시점의 손익구조



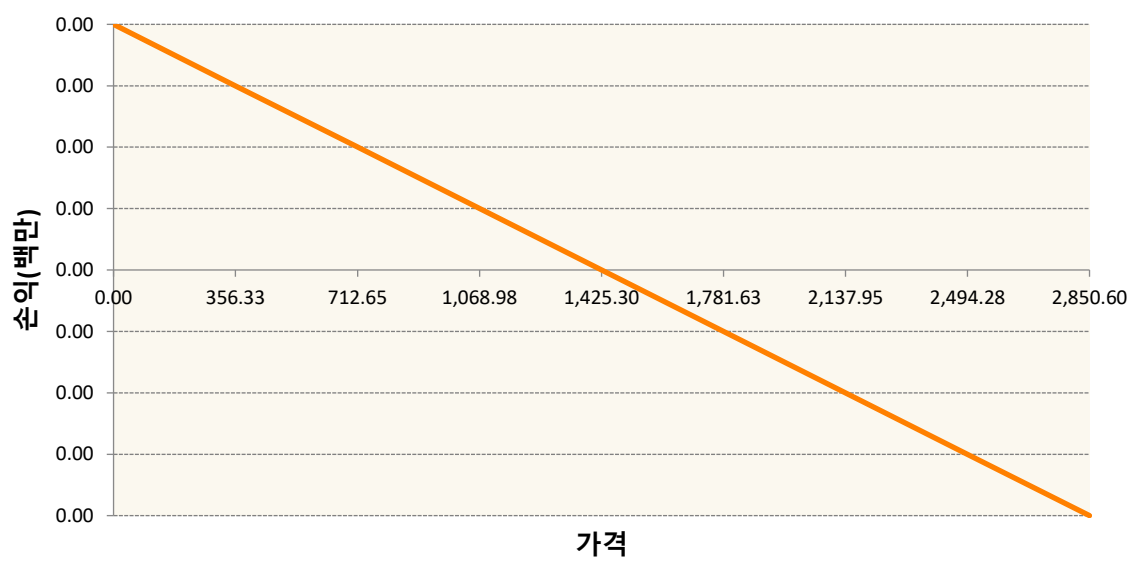
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



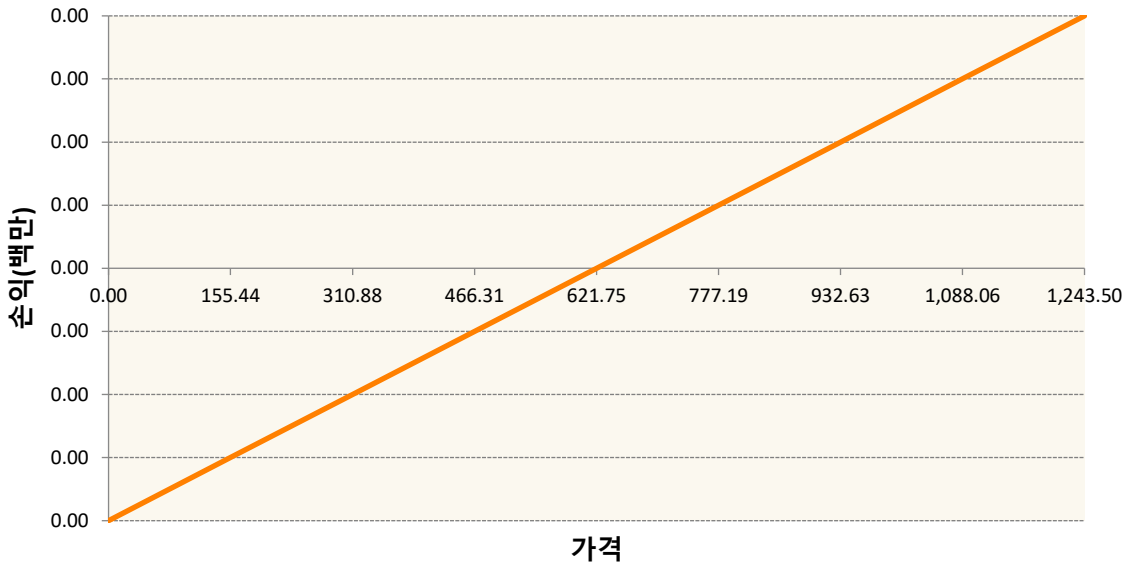
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



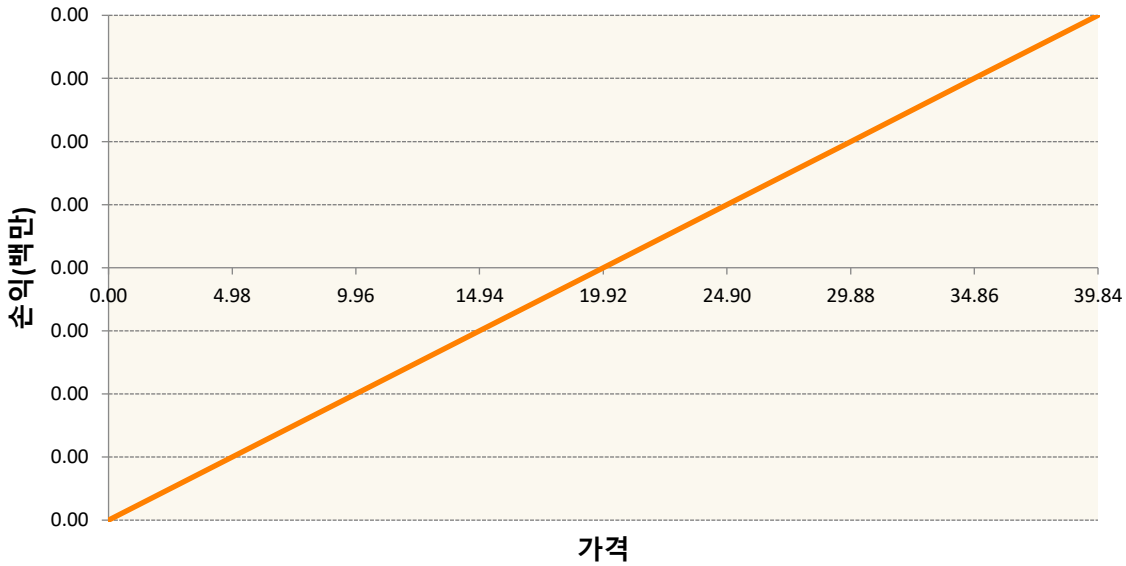
KR4175W30007-2025-03 달러선물



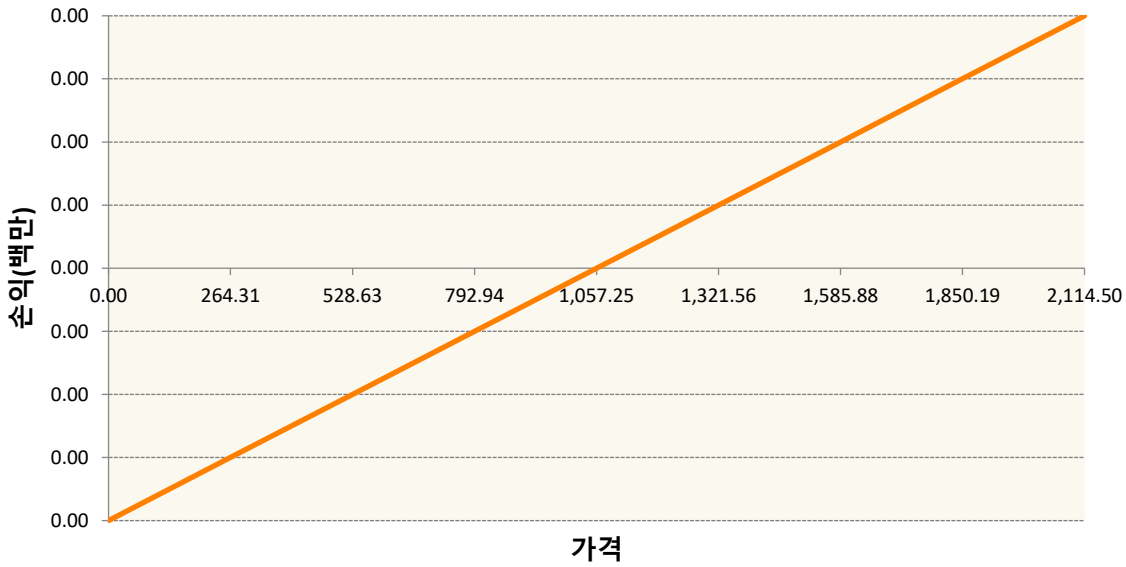
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



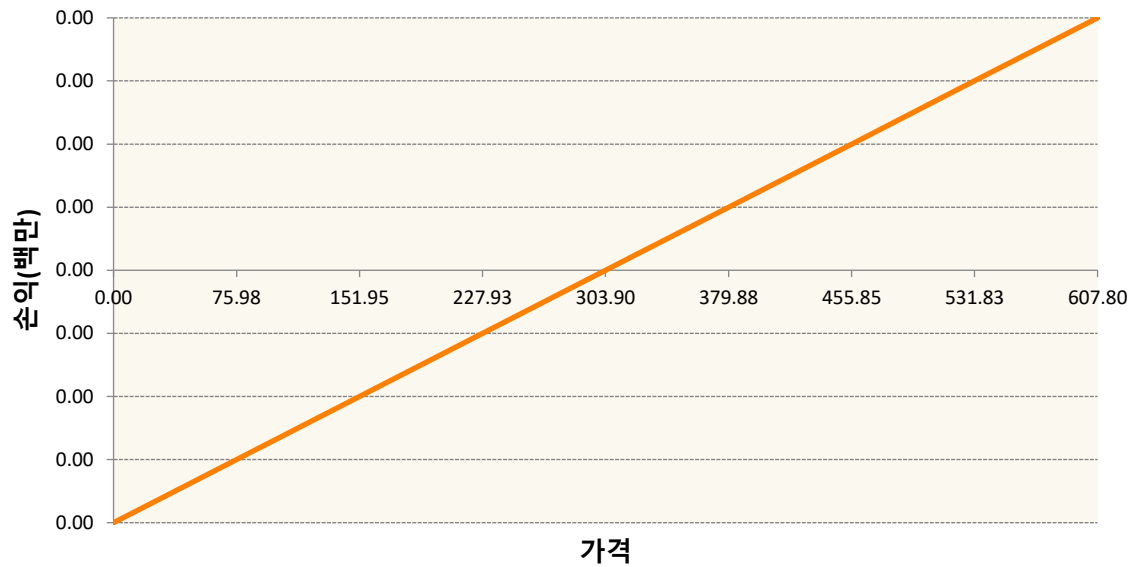
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



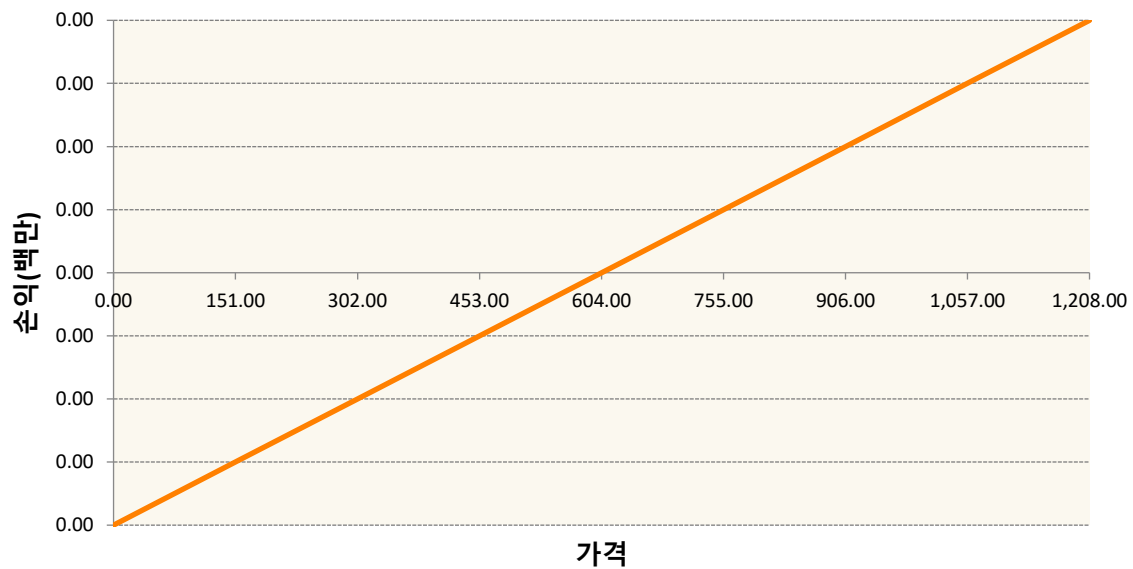
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-02-25
기준일	2025-02-24

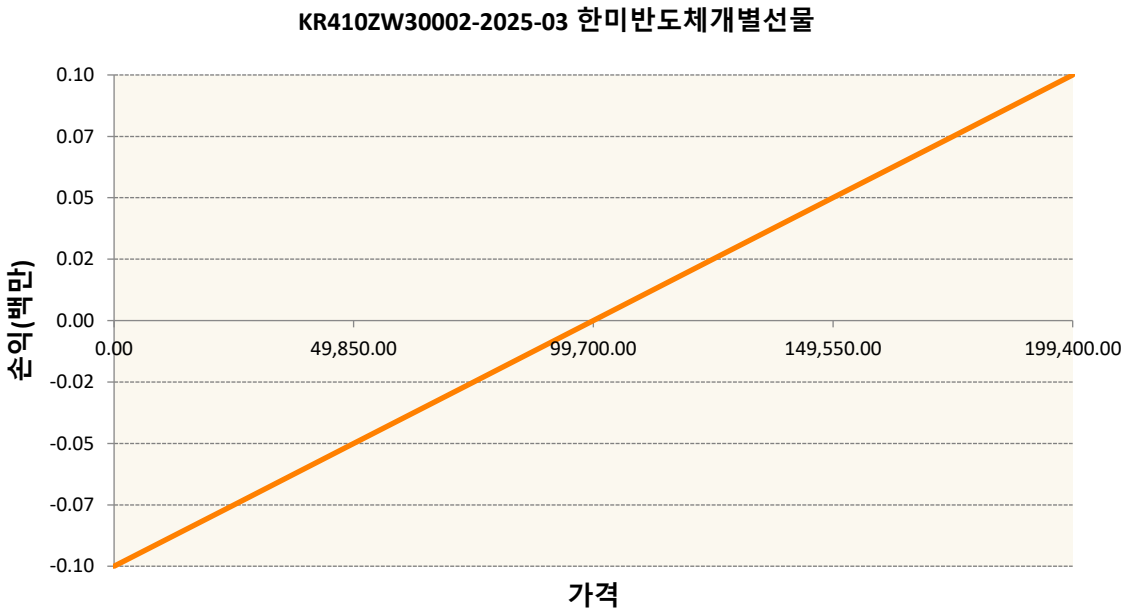
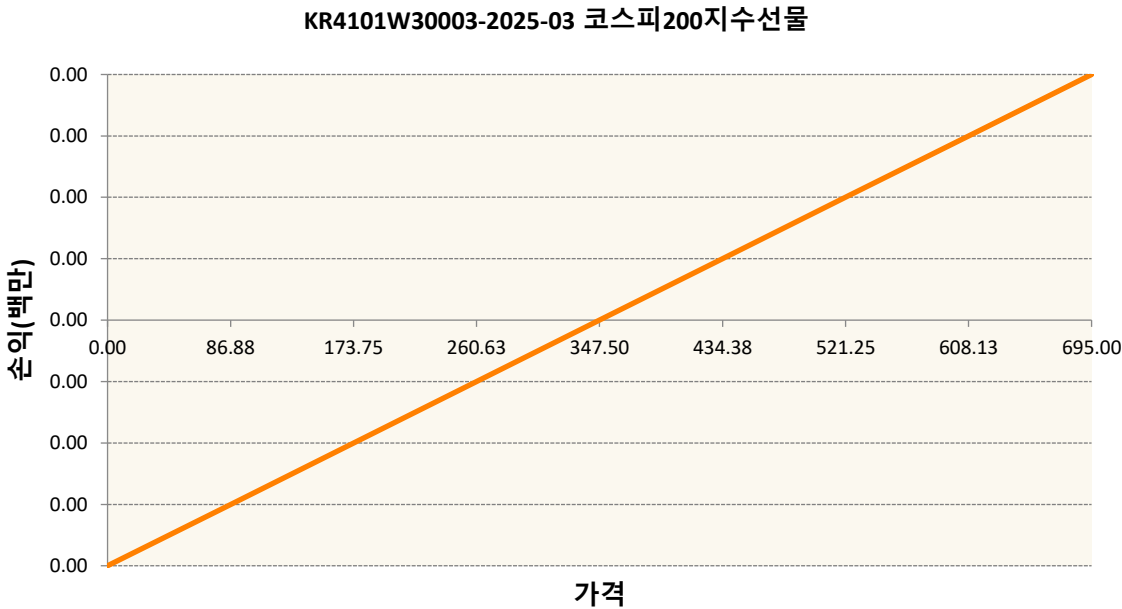
스마트인덱스모

1. 계약금액

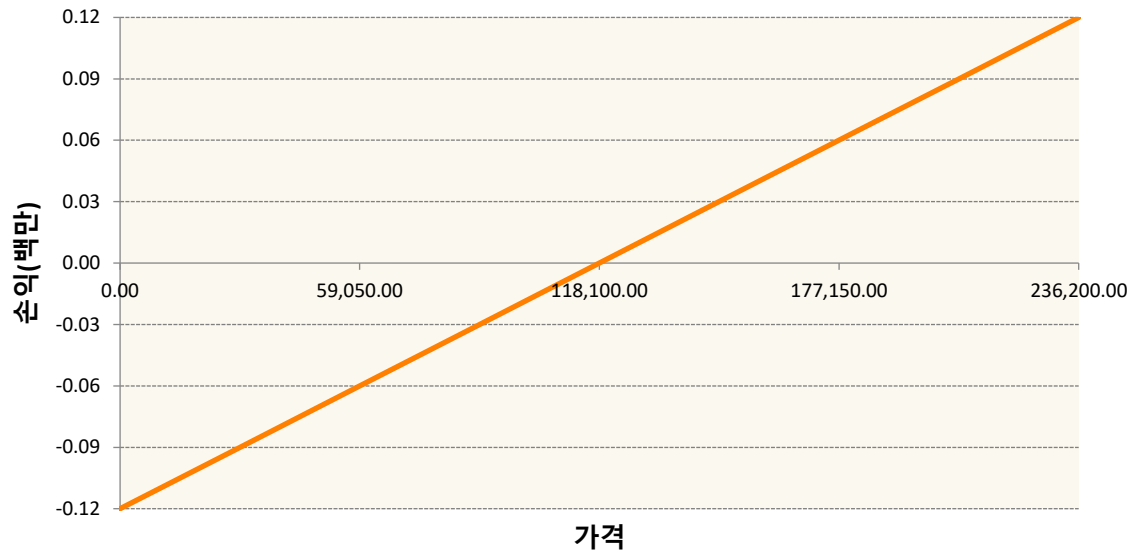
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,321	0	1,321	장내

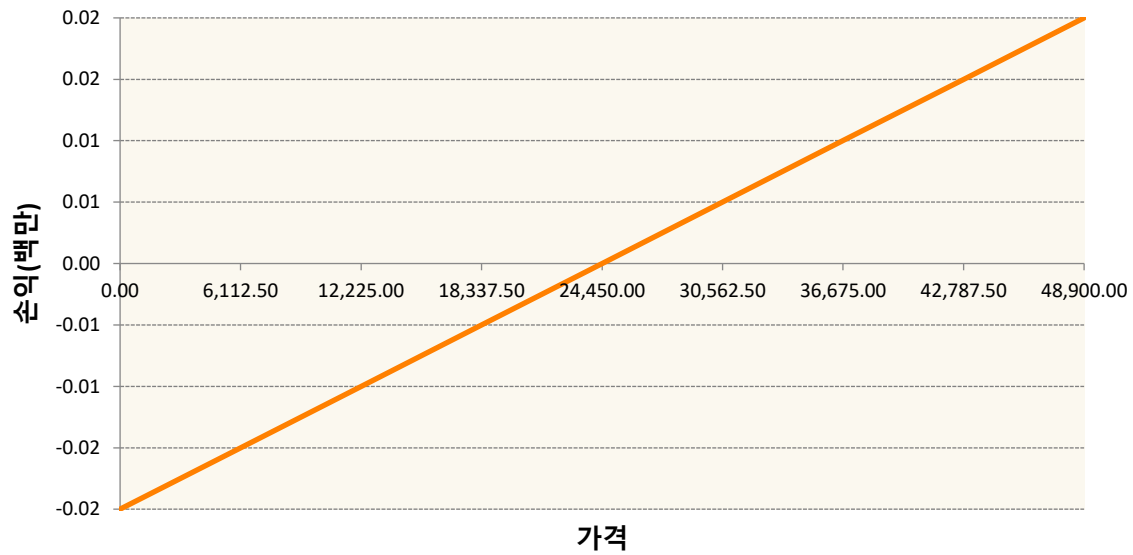
2. 만기시점의 손익구조



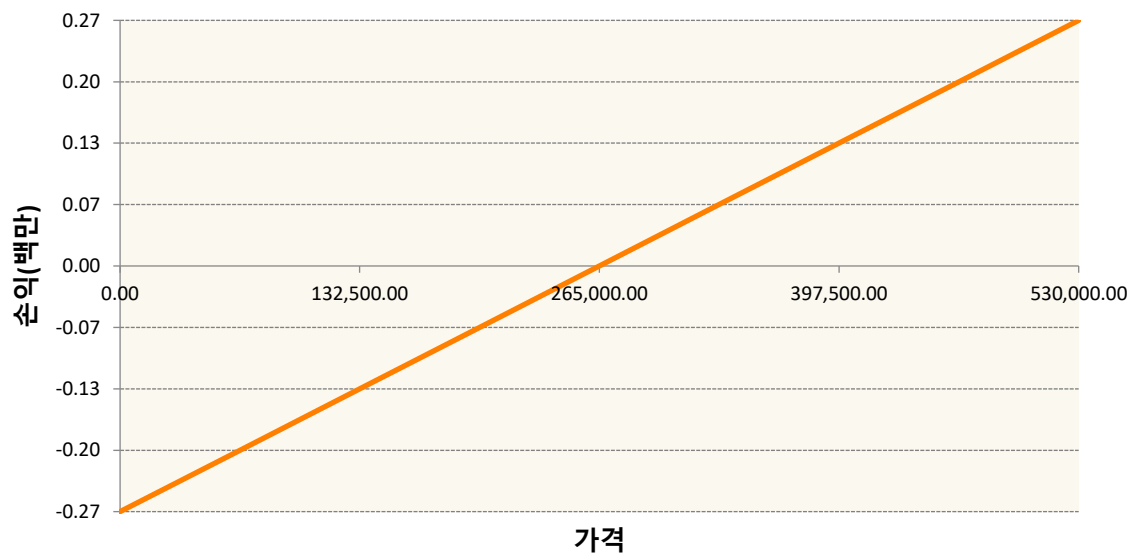
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



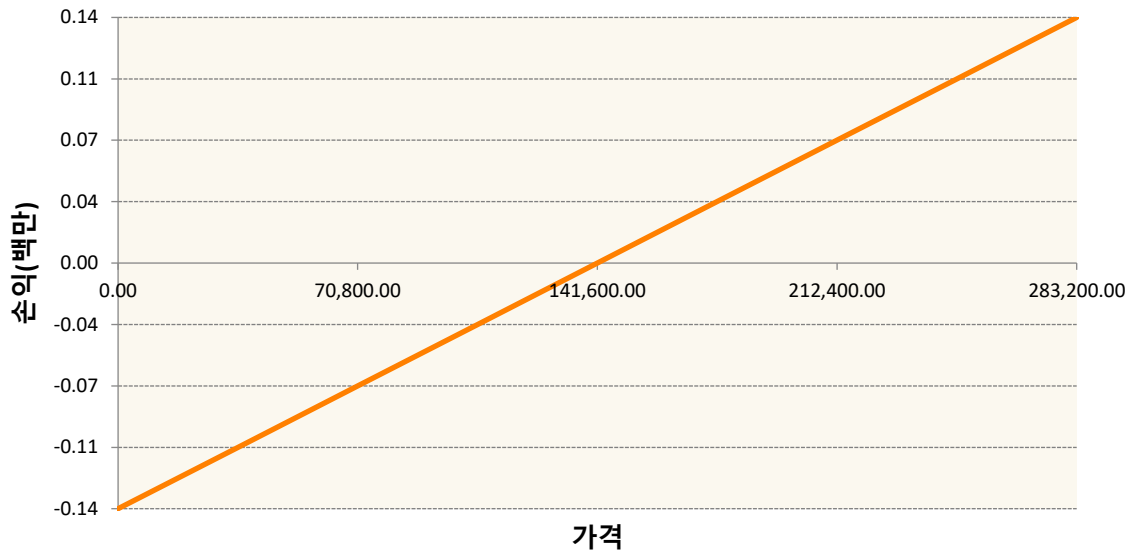
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



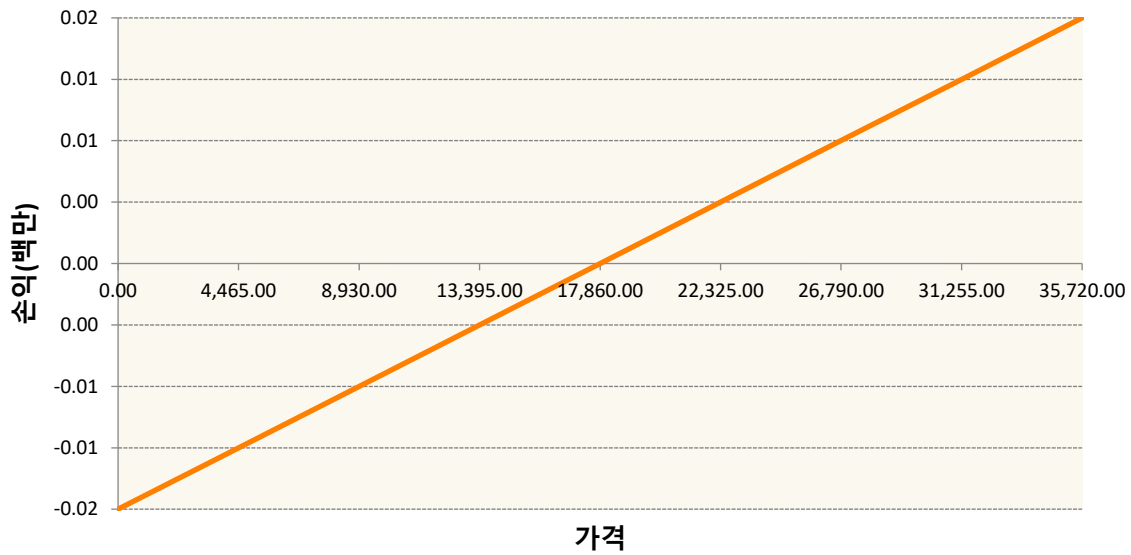
KR41CXW30001-2025-03 한미약품개별선물



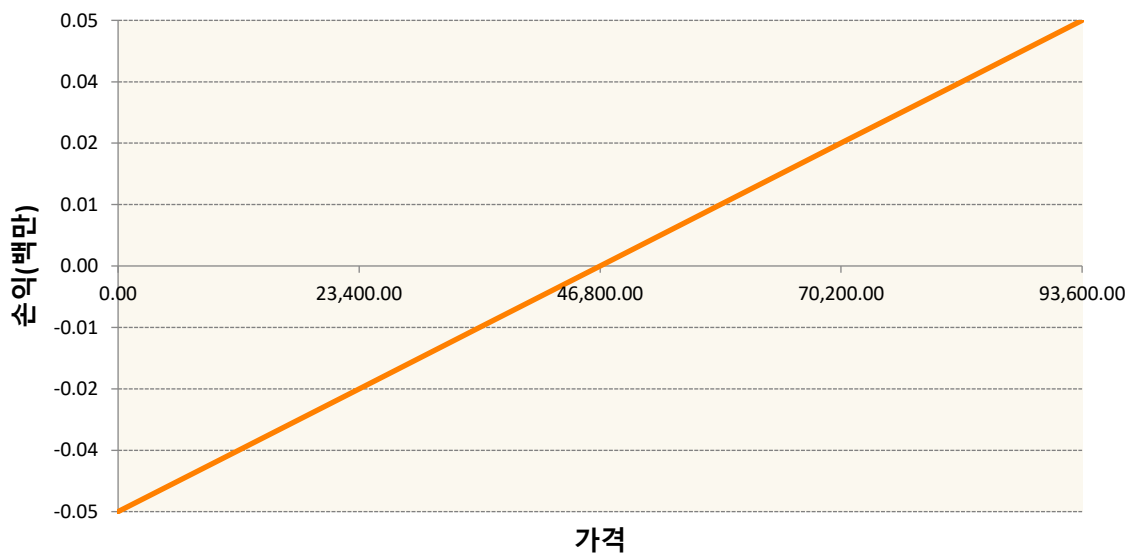
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



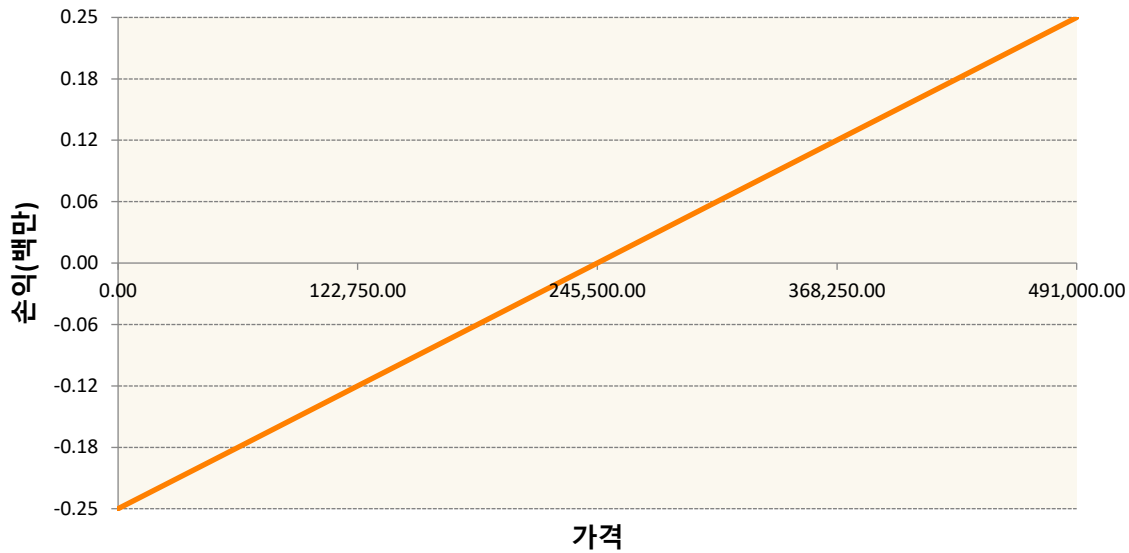
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



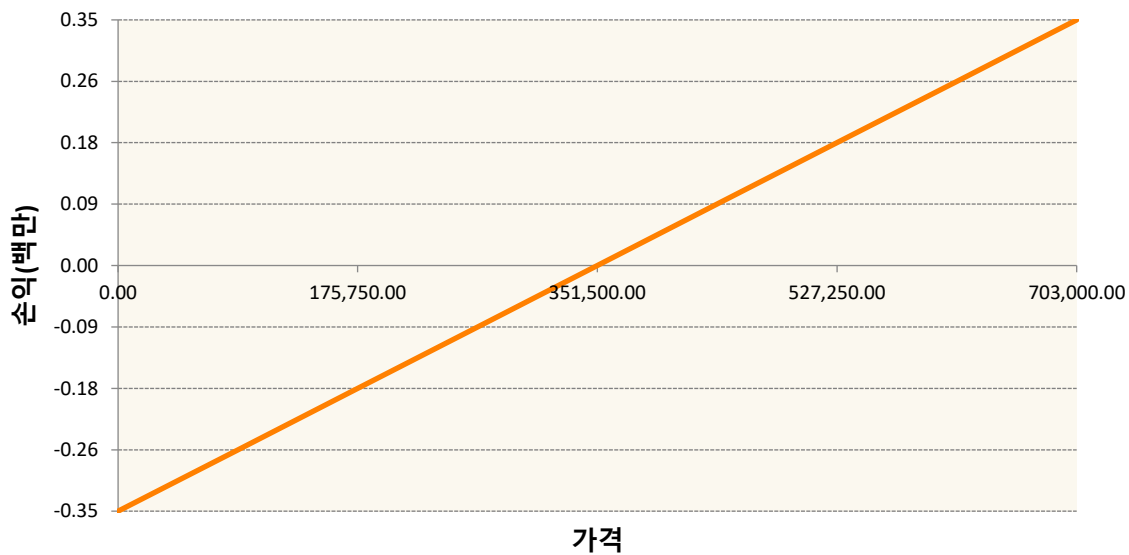
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	70
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	5
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물	4
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물	1
KR41CXW30(2025-03 한미약품개별선물	2
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	3
KR41ETW30(2025-03 삼성엔지니어링개별선물	3
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	1
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	6
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	9

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

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

311

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

480

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

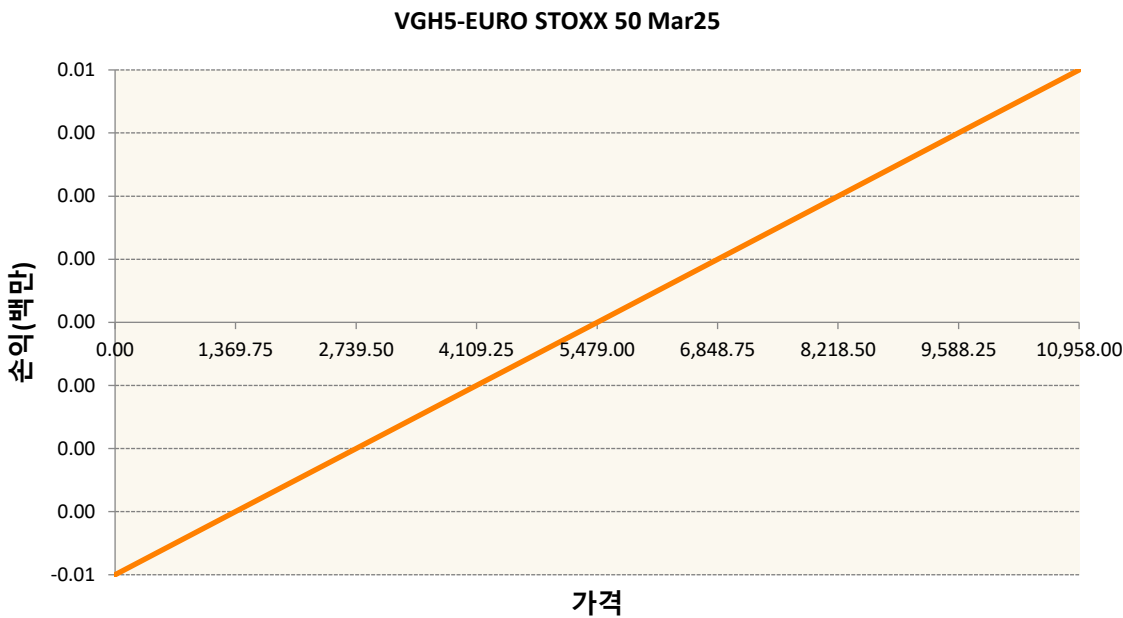
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	991	0	991	

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	2025-02-25
기준일	2025-02-24

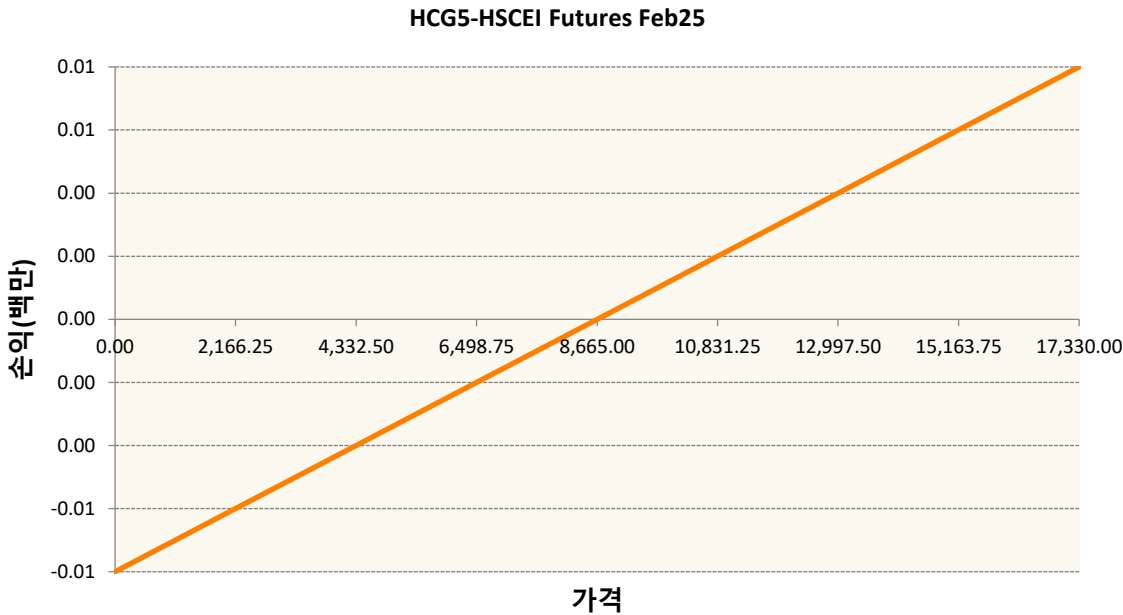
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,832	0	1,832	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG5	HSCEI Futures Feb25	147
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

198

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

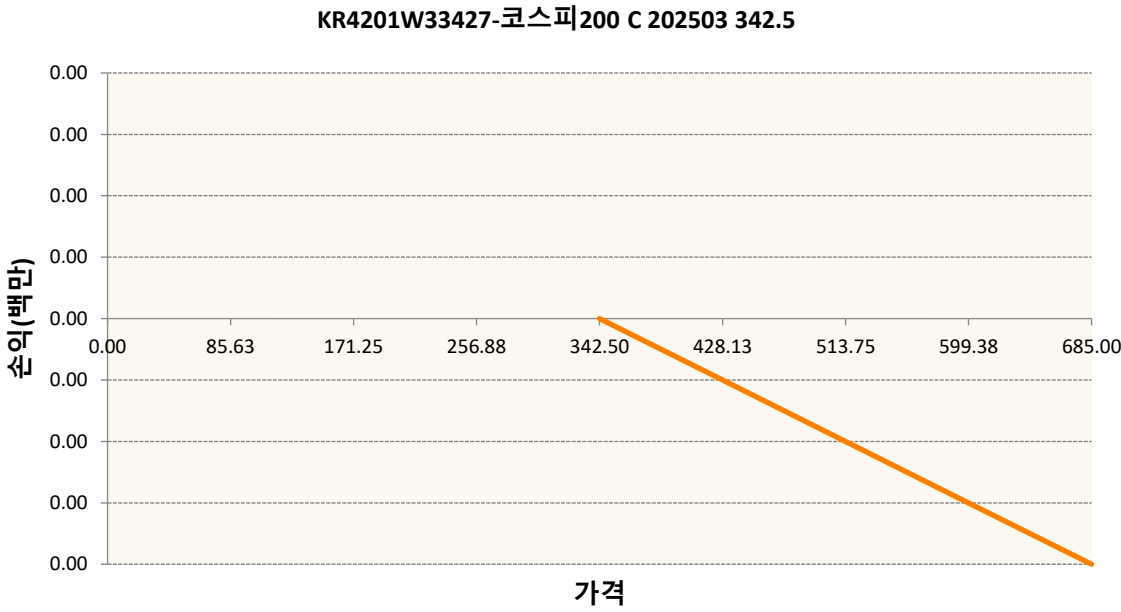
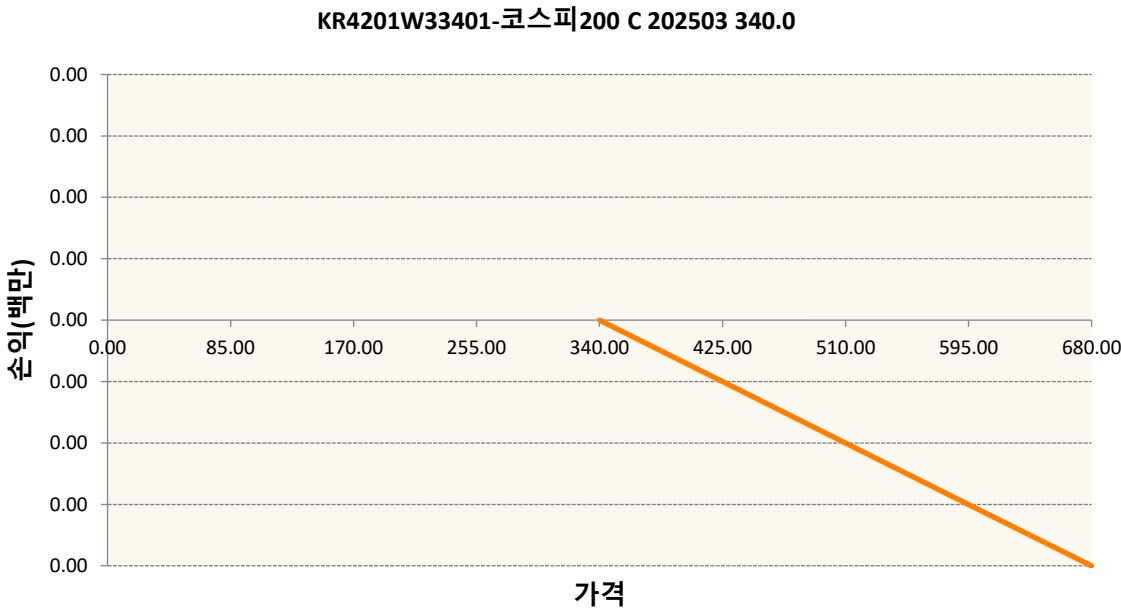
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

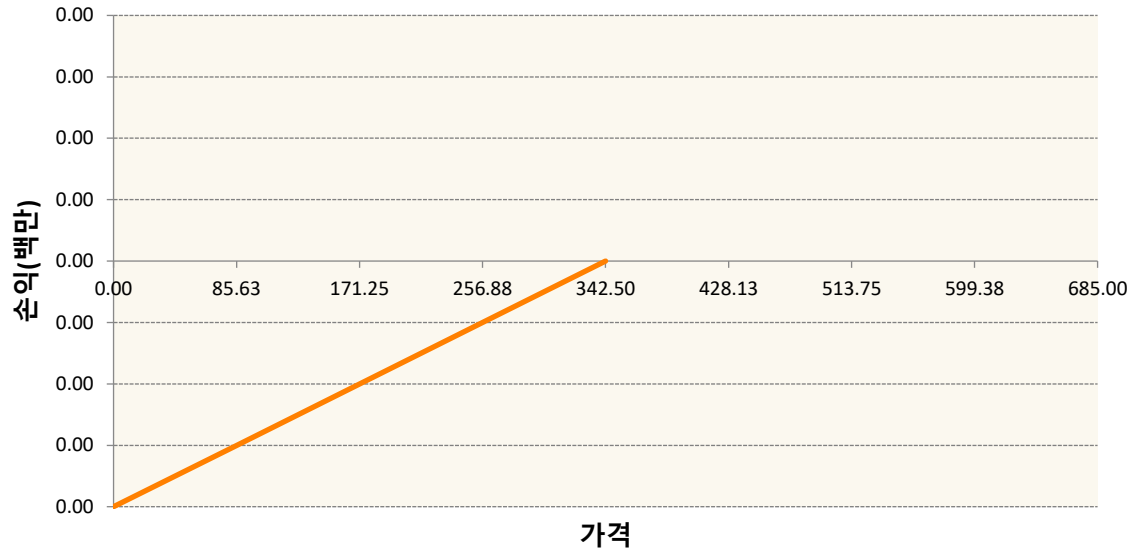
(단위:백만원)

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)

KR4201W33401 코스피200 C 202503 340.0							1,607
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	805	791	774	755	734	711	687
-5.33%	712	682	652	620	588	555	522
-2.67%	482	445	408	372	335	298	262
0%	90	61	31	0	-32	-65	-98
2.67%	-422	-436	-454	-474	-496	-519	-545
5.33%	-991	-996	-1,003	-1,013	-1,025	-1,039	-1,055
8.00%	-1,578	-1,579	-1,582	-1,585	-1,591	-1,598	-1,607
KR4201W33427 코스피200 C 202503 342.5							696
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	315	310	304	296	288	279	270
-5.33%	284	272	260	247	234	220	206
-2.67%	200	184	167	151	135	118	102
0%	44	30	15	0	-15	-31	-46
2.67%	-172	-180	-189	-200	-211	-223	-235
5.33%	-420	-423	-427	-433	-440	-447	-455
8.00%	-680	-681	-682	-684	-688	-692	-696
KR4301W33425 코스피200 P 202503 342.5							355
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-337	-339	-341	-344	-347	-351	-355
-5.33%	-174	-179	-185	-191	-198	-205	-212
-2.67%	-47	-56	-65	-74	-83	-92	-101
0%	23	16	8	0	-8	-16	-25

2.67%	47	44	40	36	31	25	19
5.33%	53	52	50	49	46	44	40
8.00%	53	53	53	52	52	51	49

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

(단위:백만원)

2,801

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

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	669	0	669	

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	2025-02-25
기준일	2025-02-24

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	4,418	0	4,418	

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	2025-02-25
기준일	2025-02-24

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	13,055	0	13,055	
누계	통화	선도	0	12,918	-12,918	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E	554
FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E	255
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E	208
FXW213F24C KRW/USD 28-02-25E	17
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

438

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

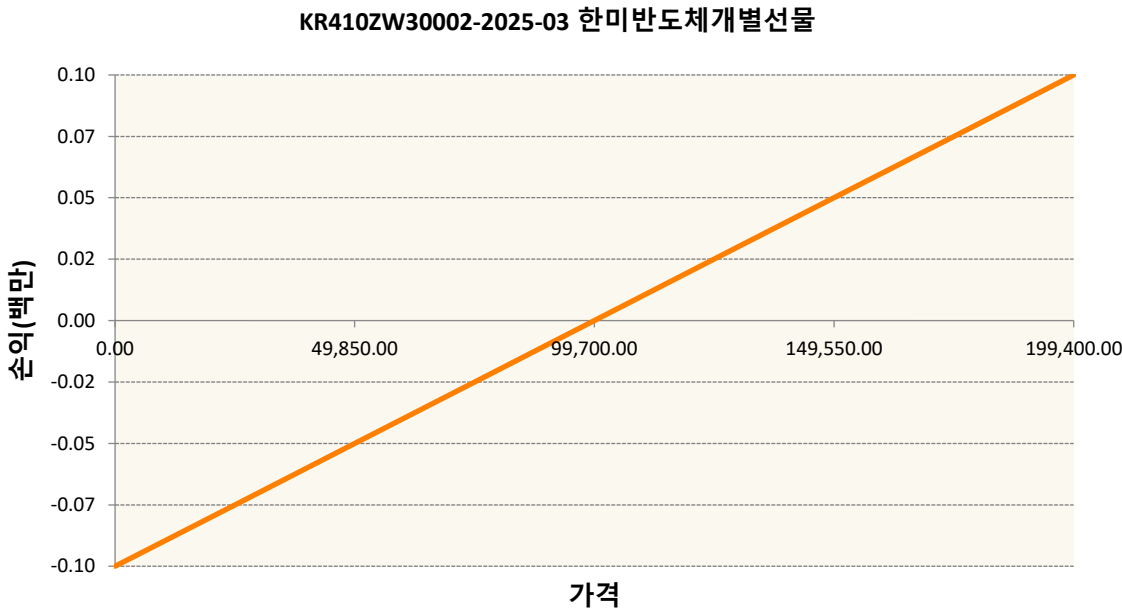
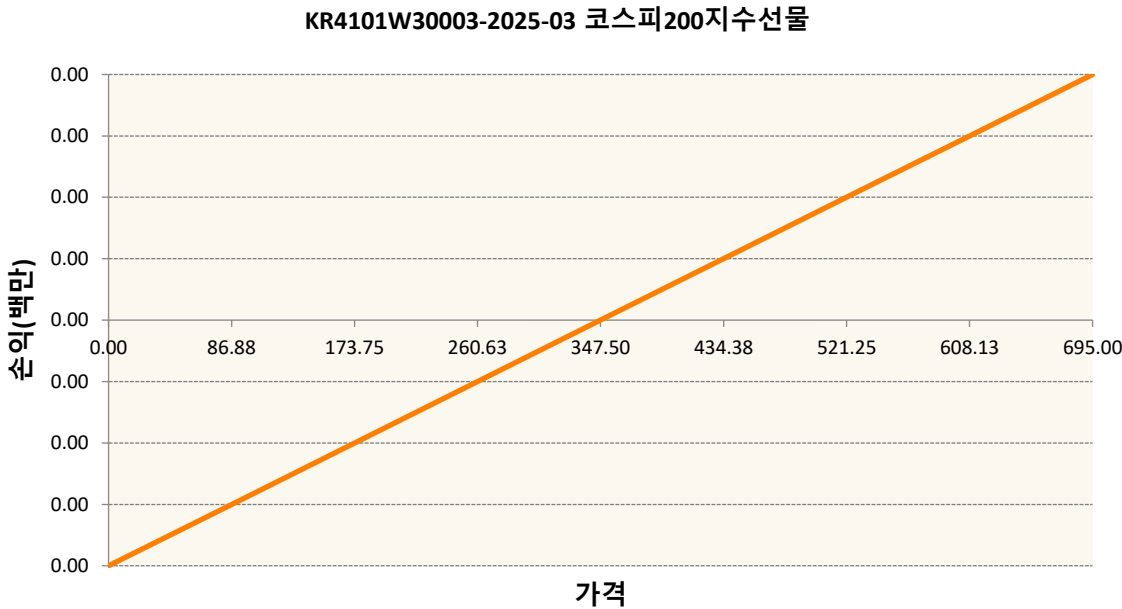
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

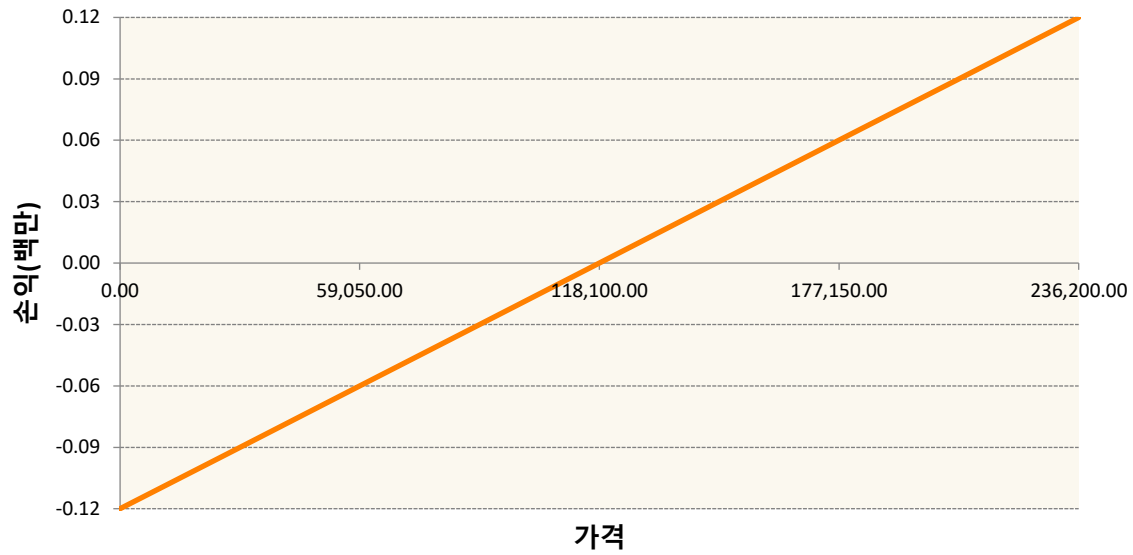
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,240	0	1,240	장내

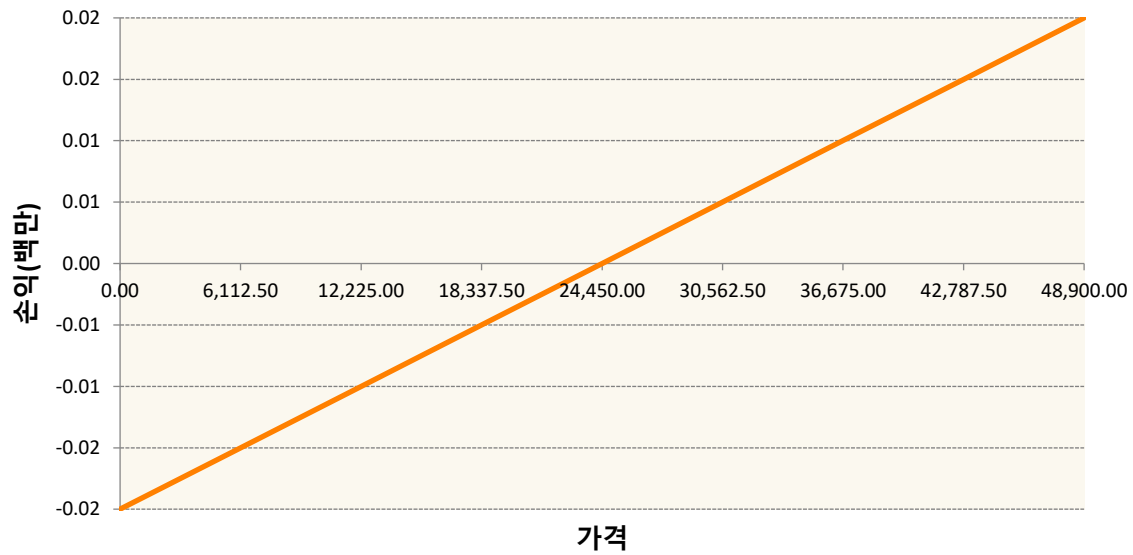
2. 만기시점의 손익구조



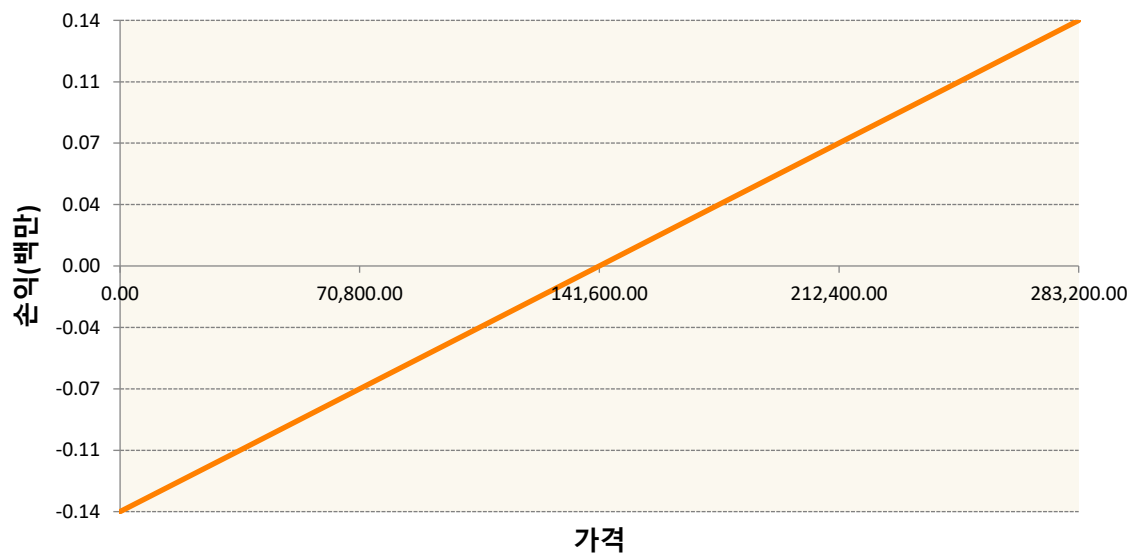
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



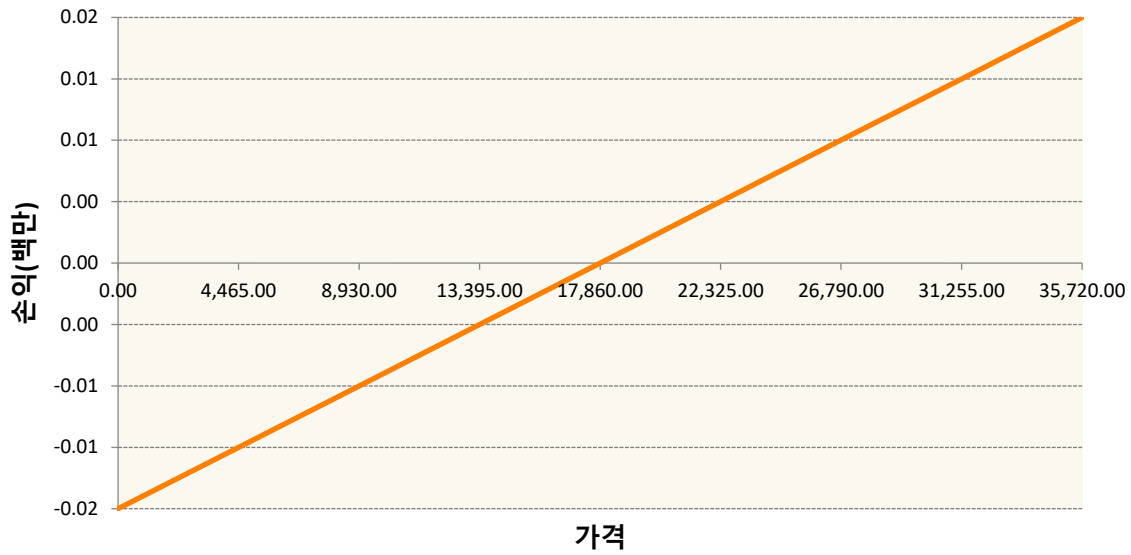
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



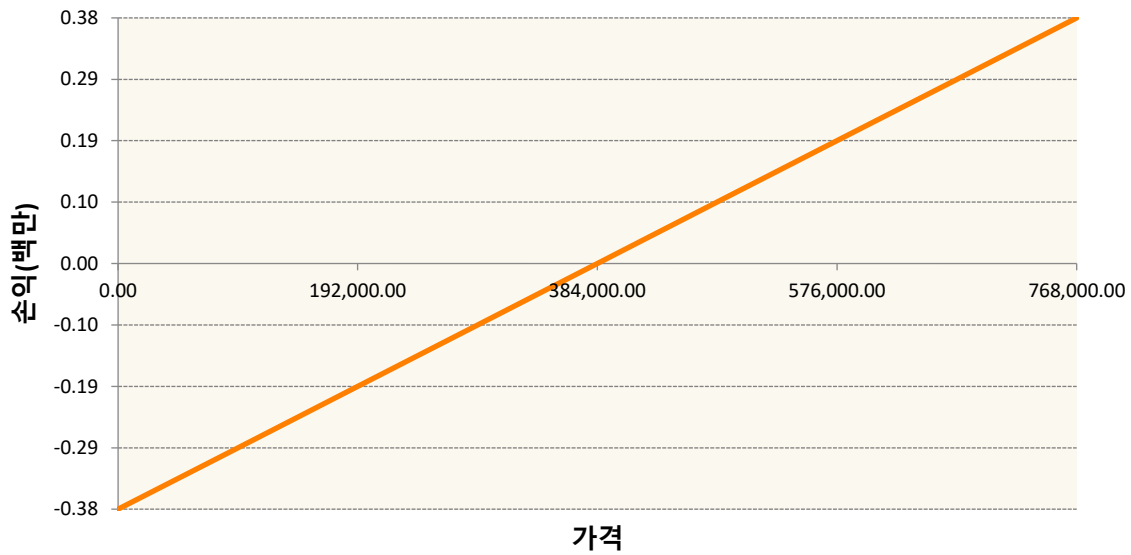
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



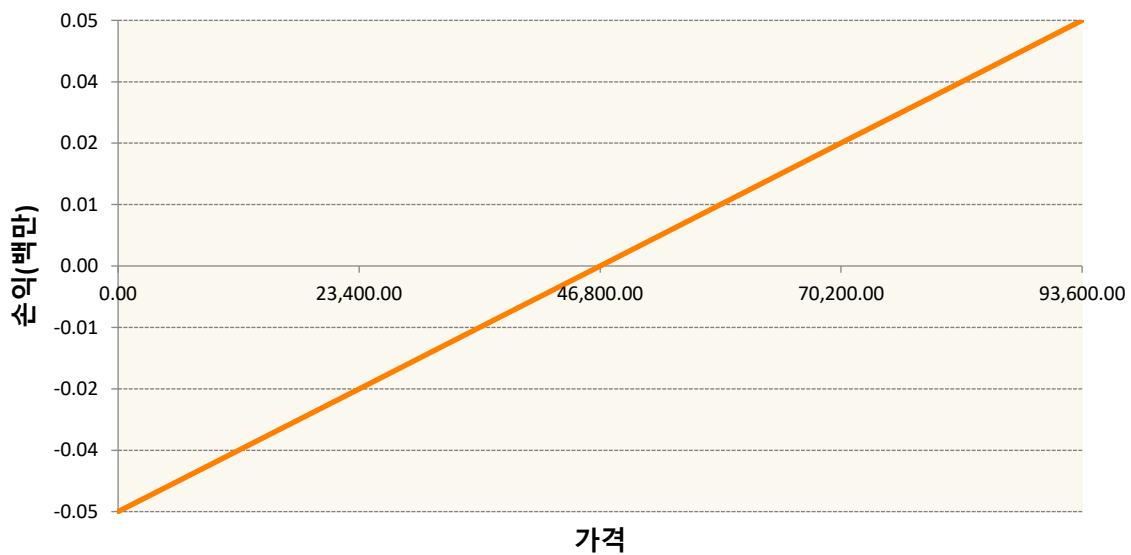
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



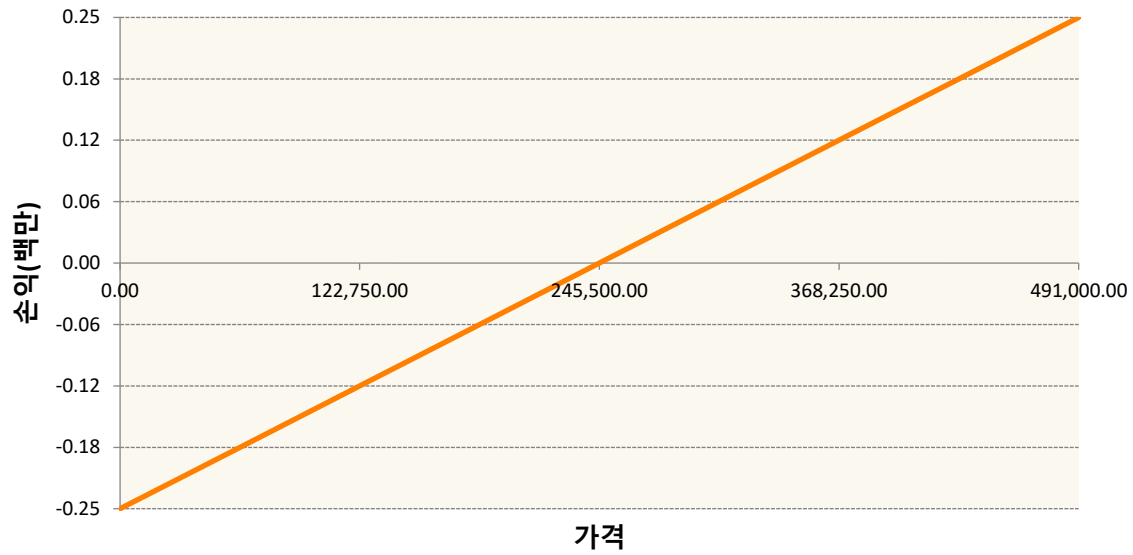
KR41F5W30008-2025-03 LG에너지솔루션개별선물



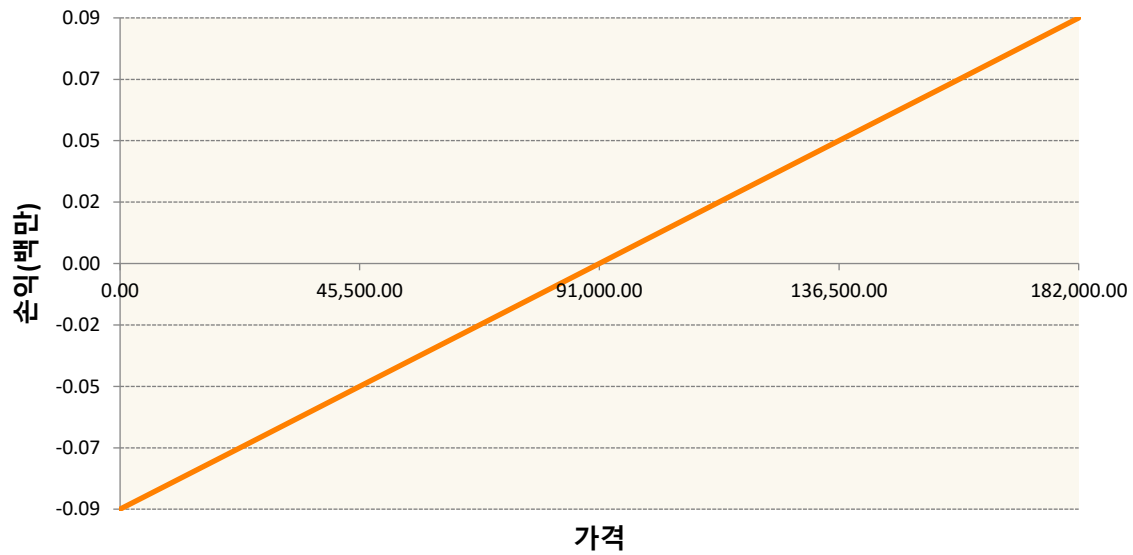
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



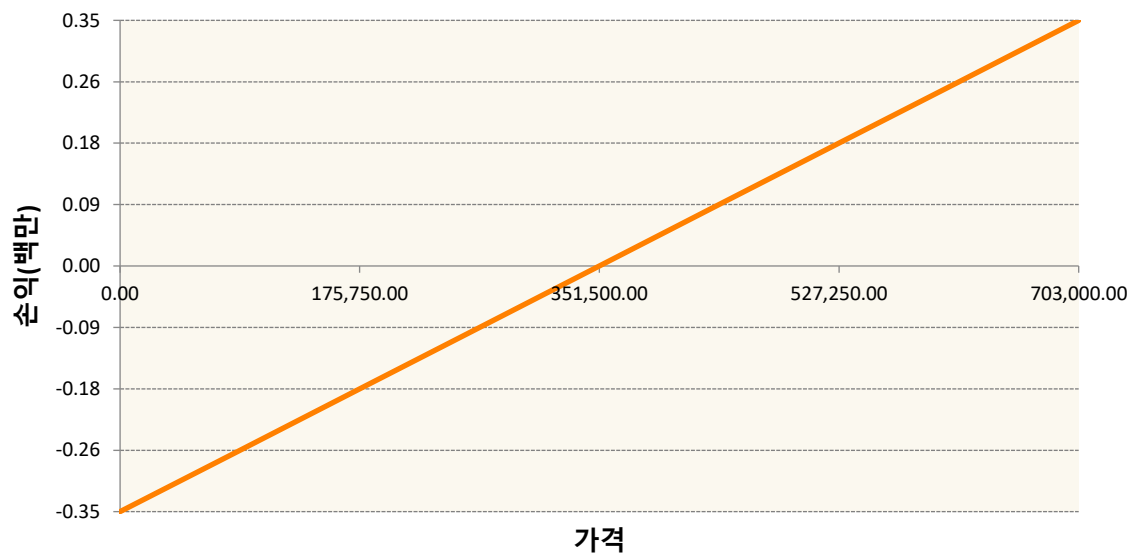
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



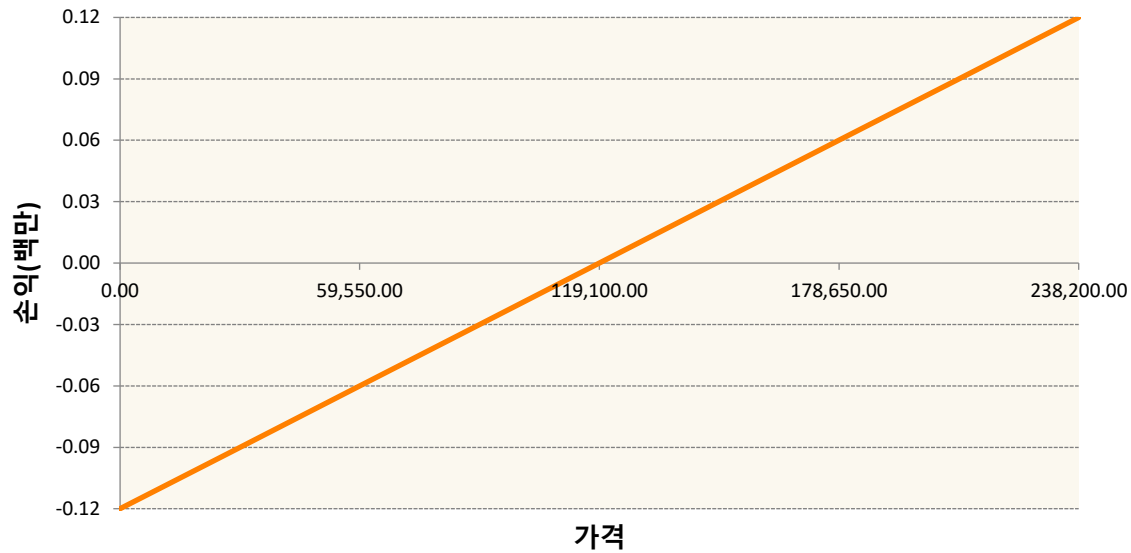
KR41FMW30007-2025-03 엘앤에프개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



KR41HEW30000-2025-03 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	76
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)

154

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

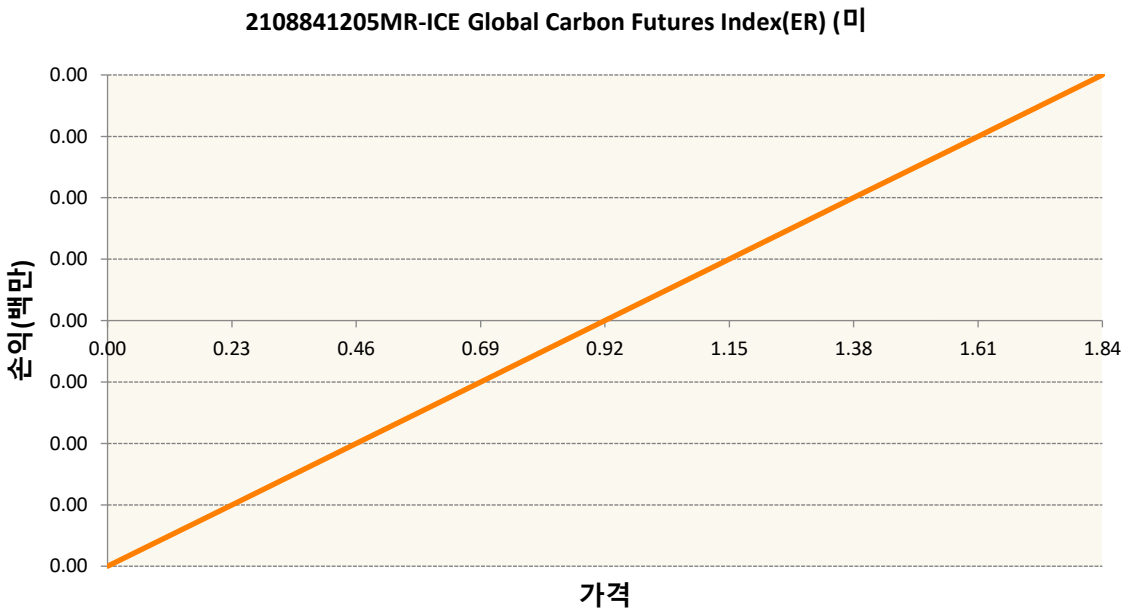
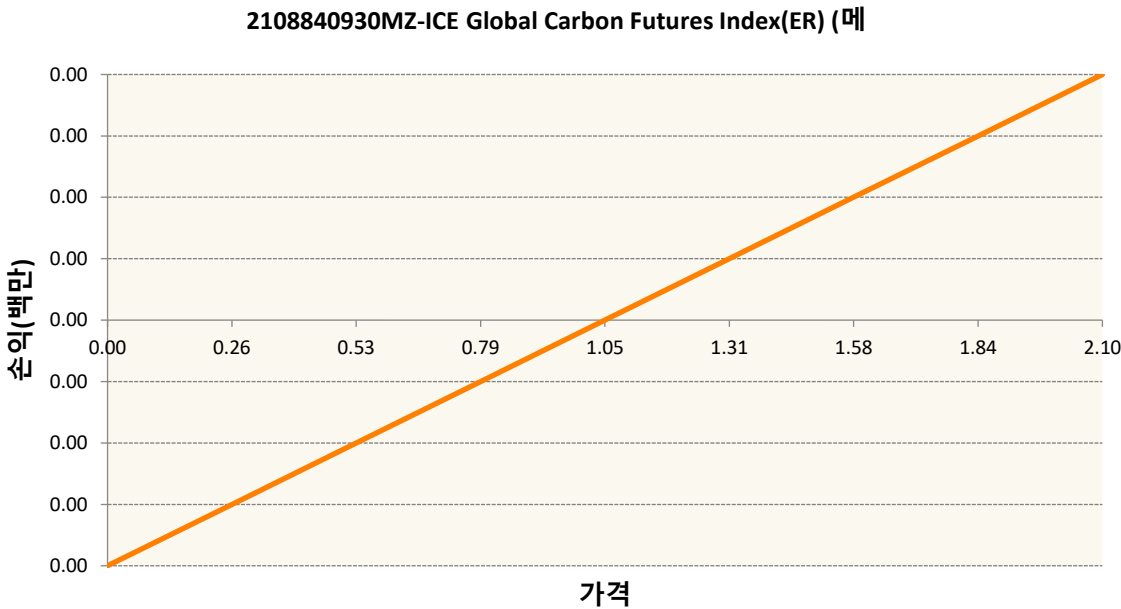
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,367	0	9,367	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	189
2108841205	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	564

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	837

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

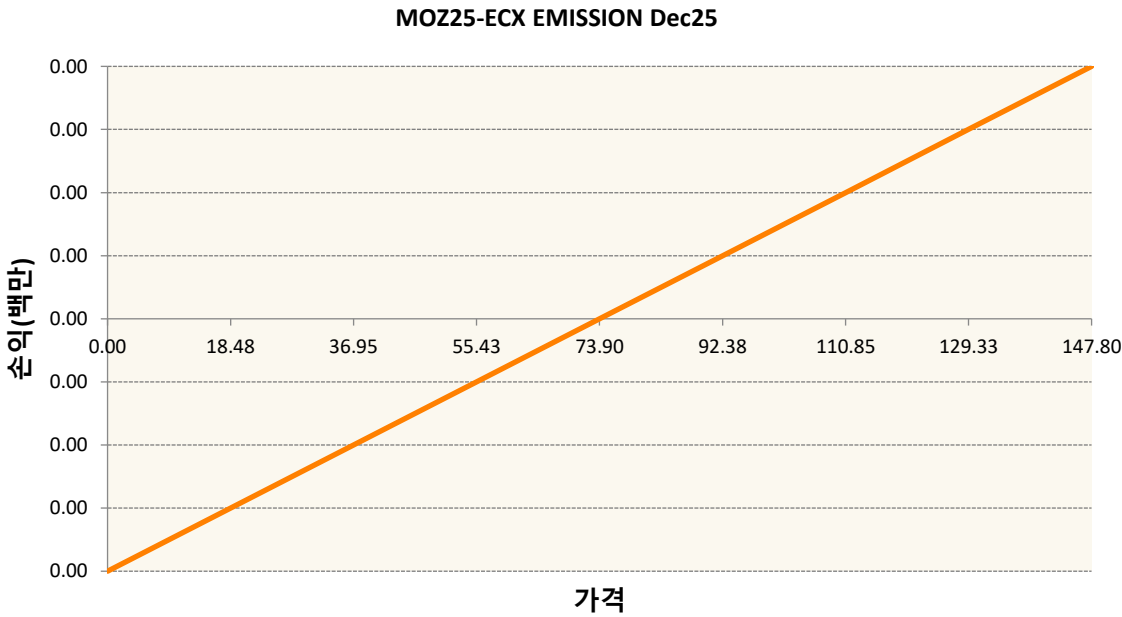
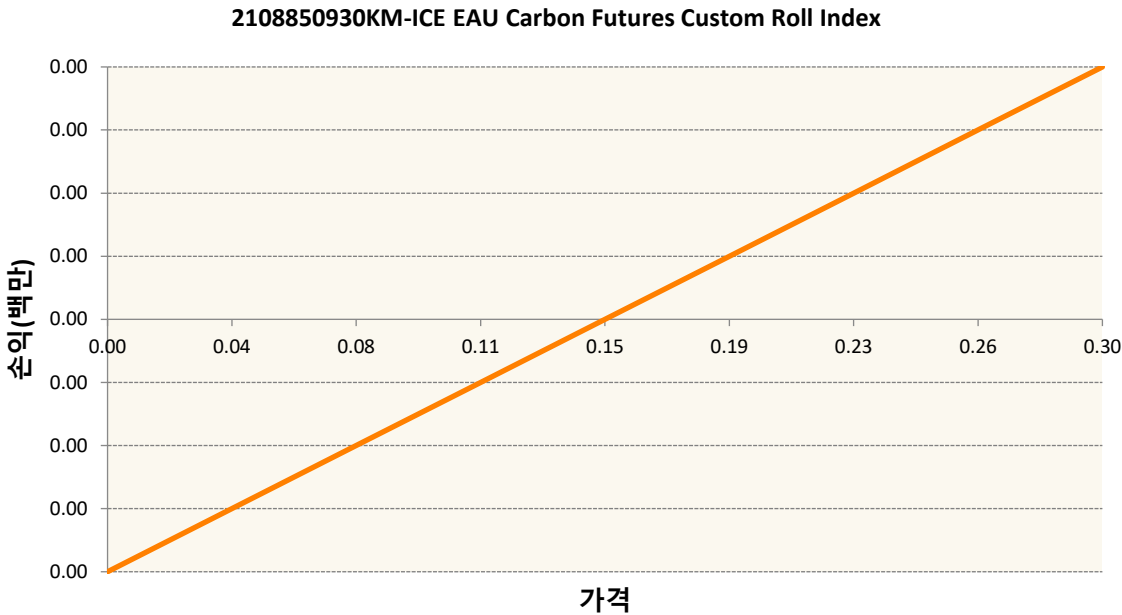
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,199	0	9,199	
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		732

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

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	7

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

(단위:백만원)

41

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)	23
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	28
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	6

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

(단위:백만원)

131

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

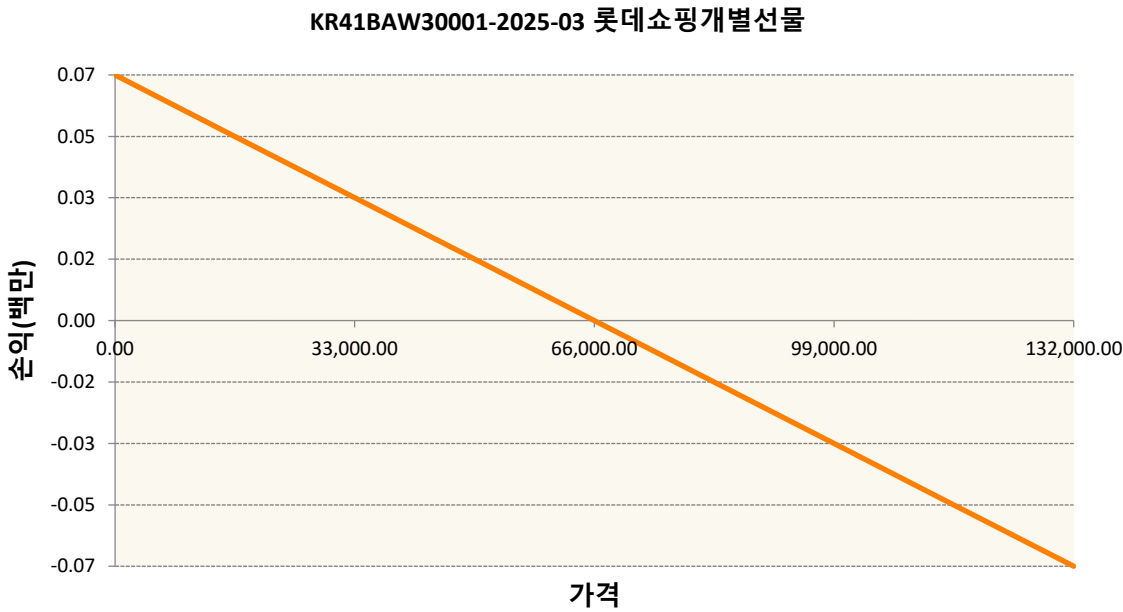
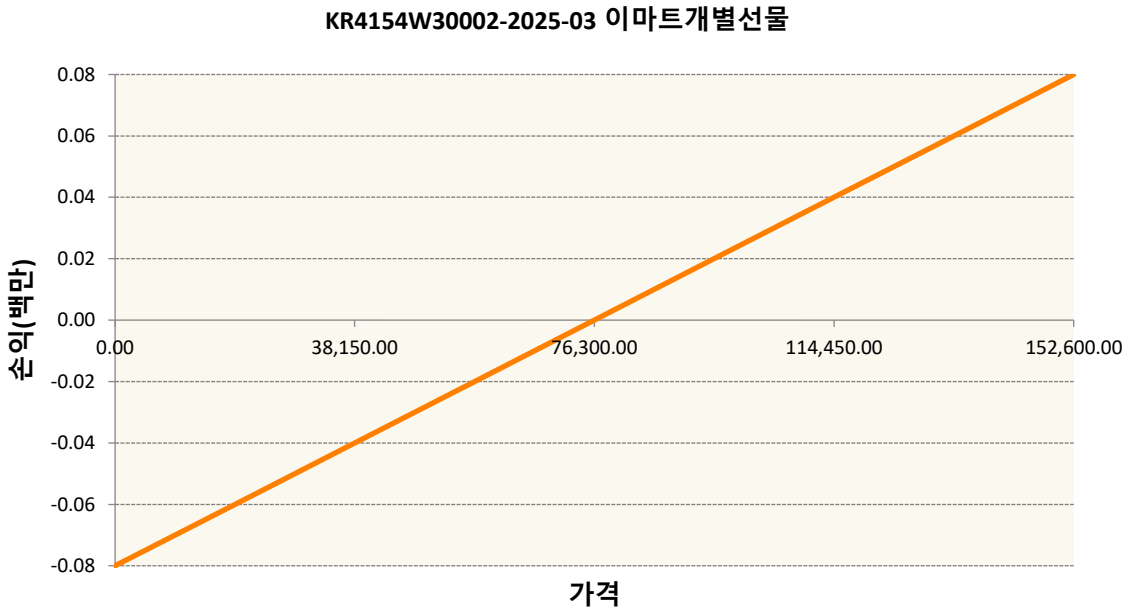
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

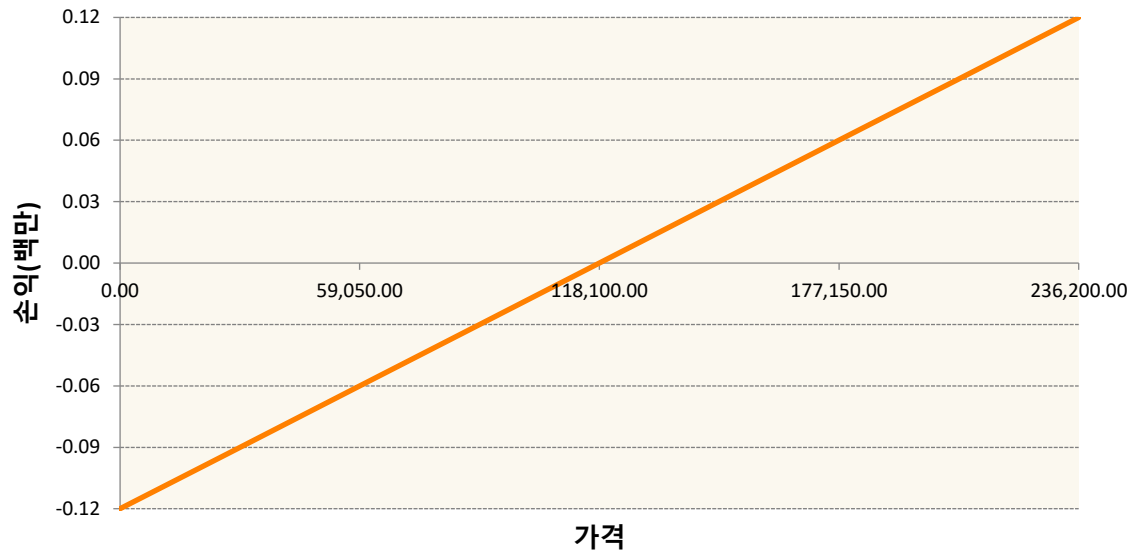
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2	-2	장내
누계	유가증권	선물	31	46	-16	장내

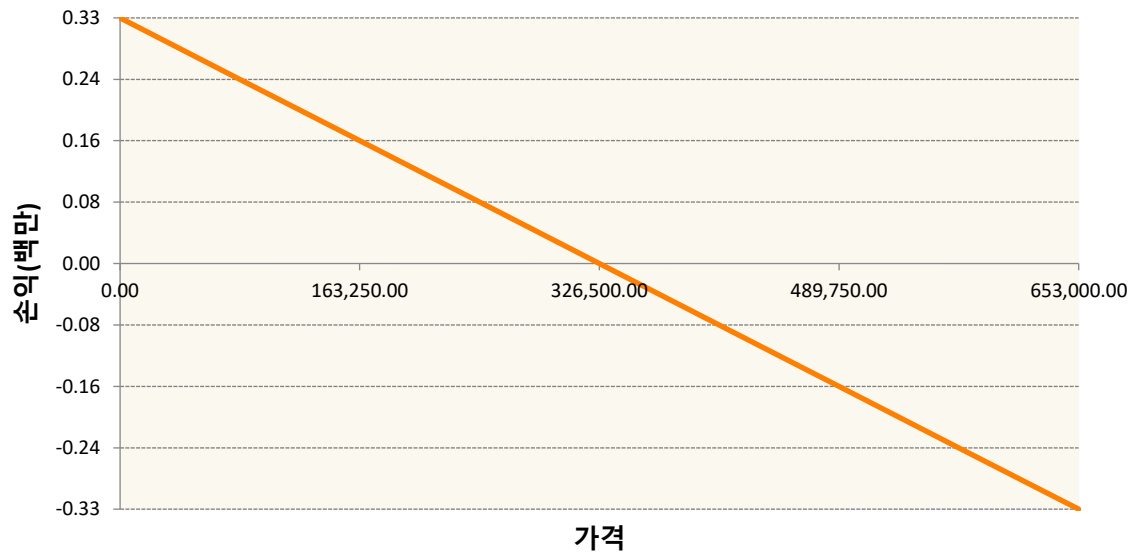
2. 만기시점의 손익구조



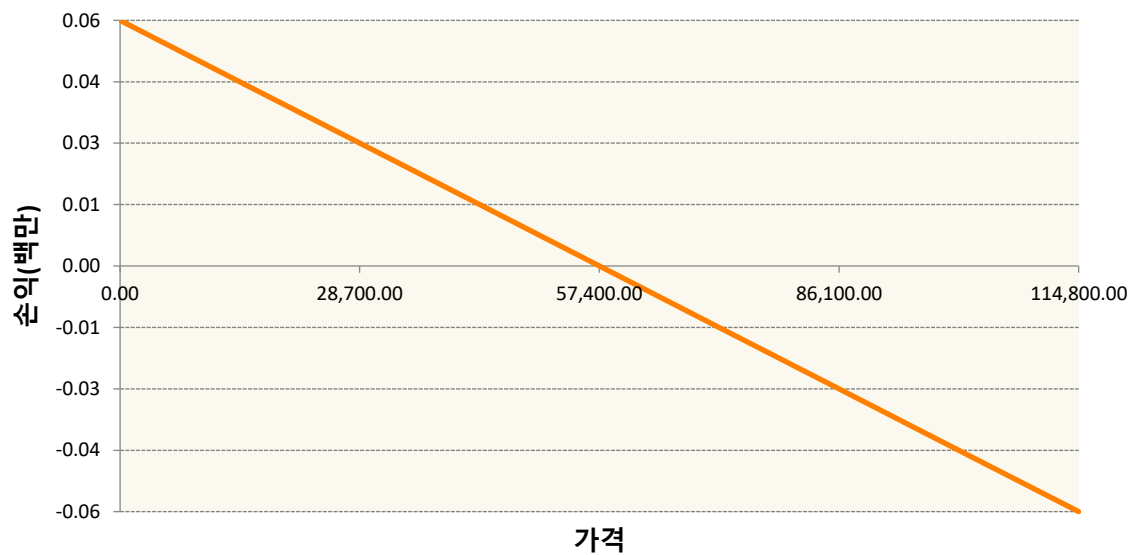
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



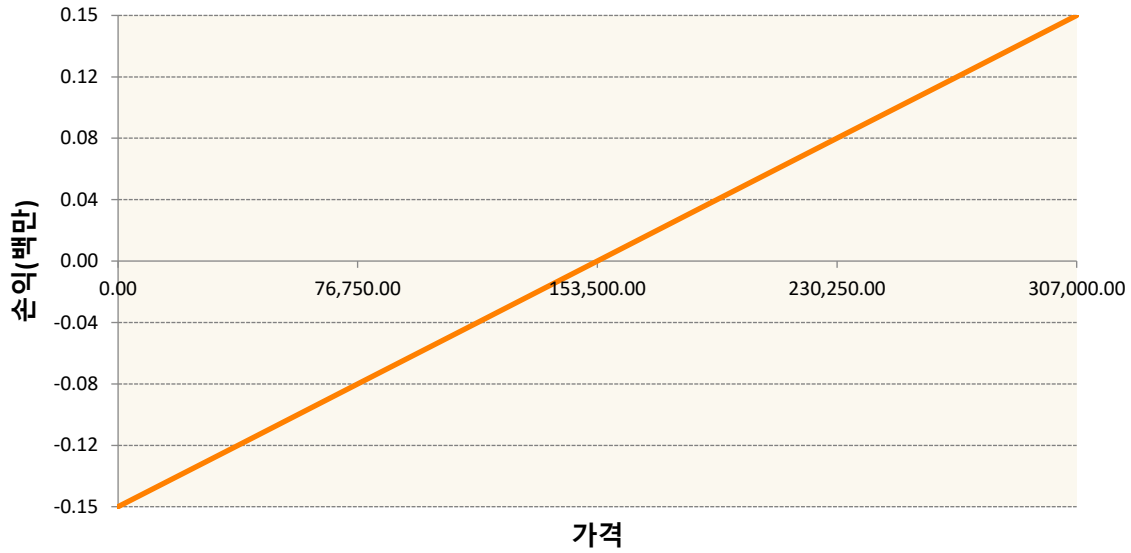
KR41CRW30003-2025-03 LG생활건강개별선물



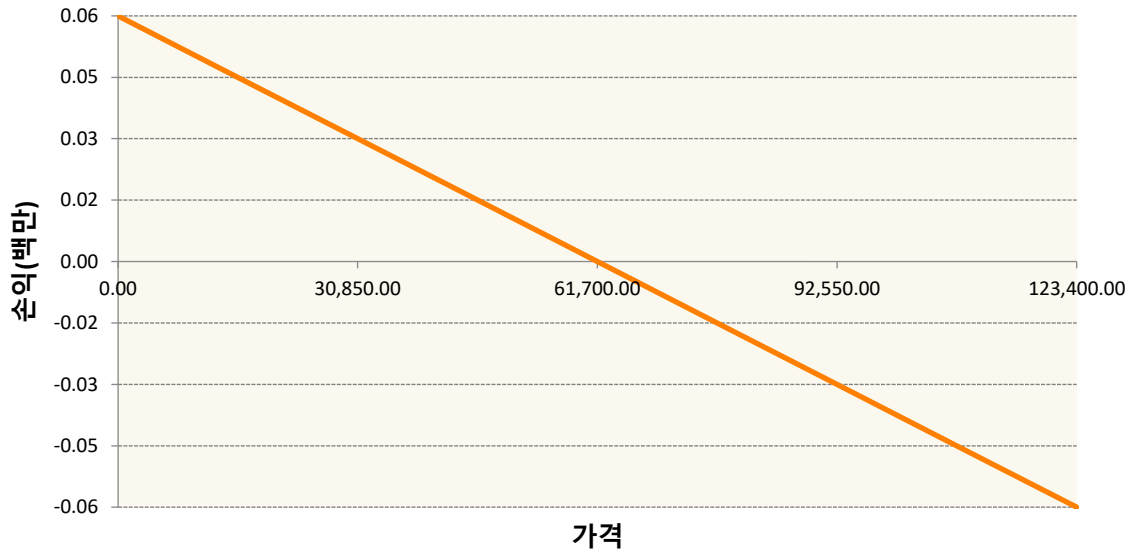
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



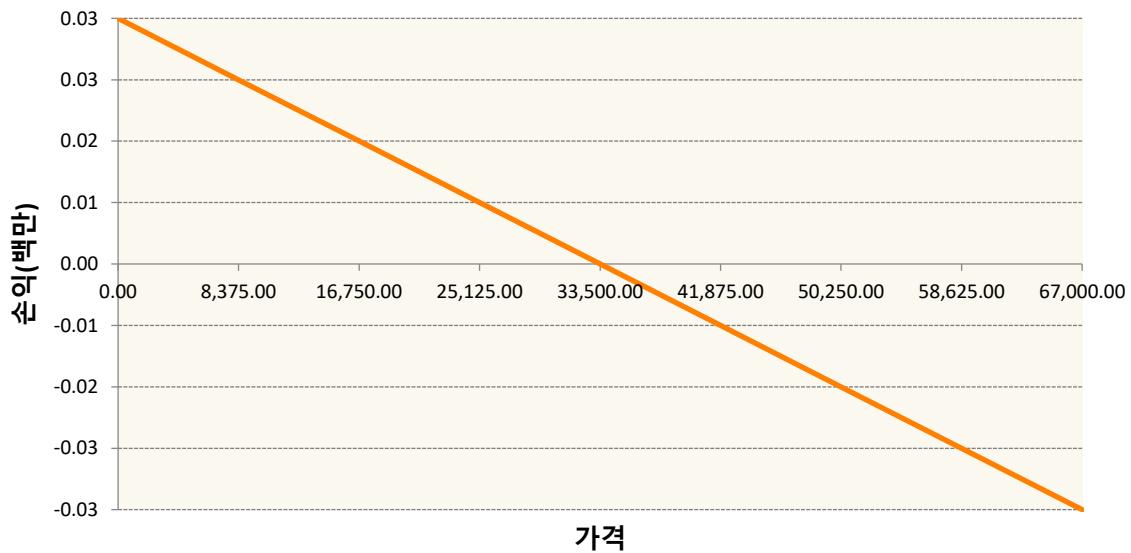
KR41DKW30006-2025-03 코스맥스개별선물



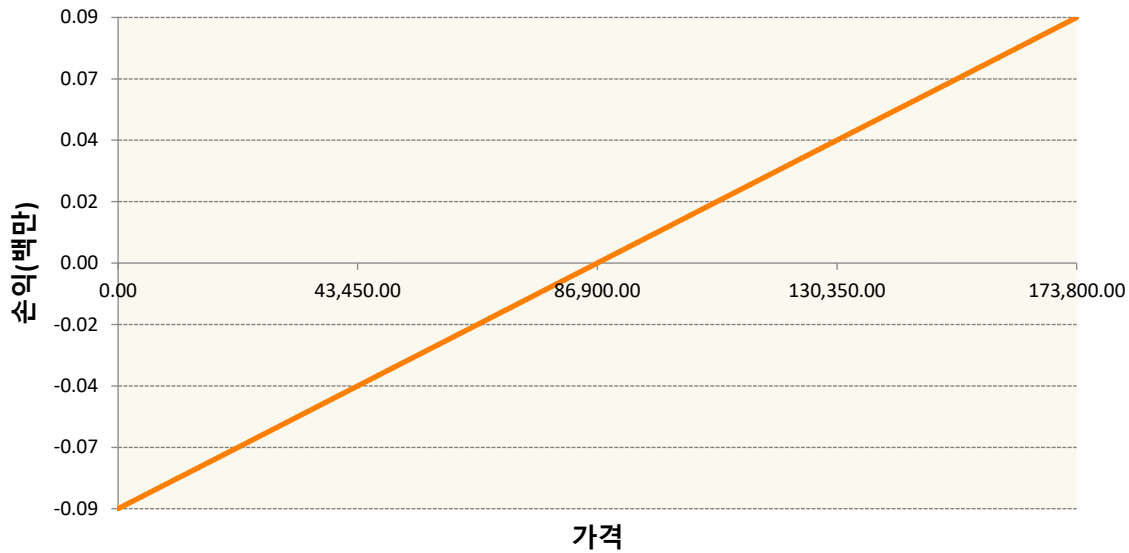
KR41DTW30007-2025-03 CJ ENM개별선물



KR41FLW30009-2025-03 펄어비스개별선물



KR41G6W30005-2025-03 현대로템개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4154W30(2025-03 이마트개별선물	0.37
KR41BAW30(2025-03 롯데쇼핑개별선물	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	1
KR41FLW30(2025-03 펄어비스개별선물	0.29
KR41G6W30(2025-03 현대로템개별선물	0.49

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

(단위:백만원)

14

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

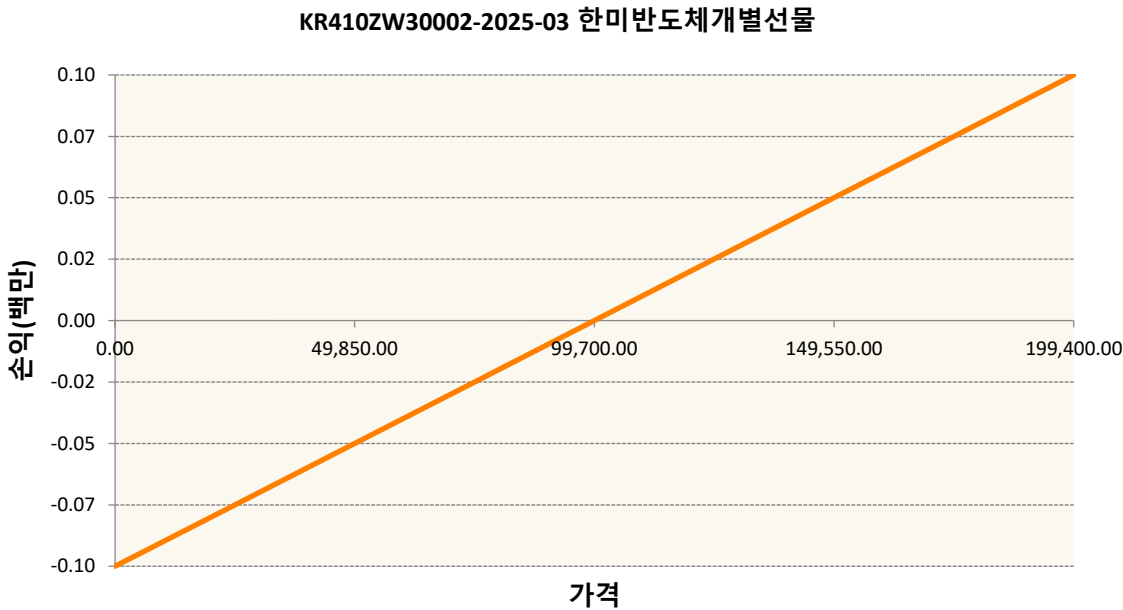
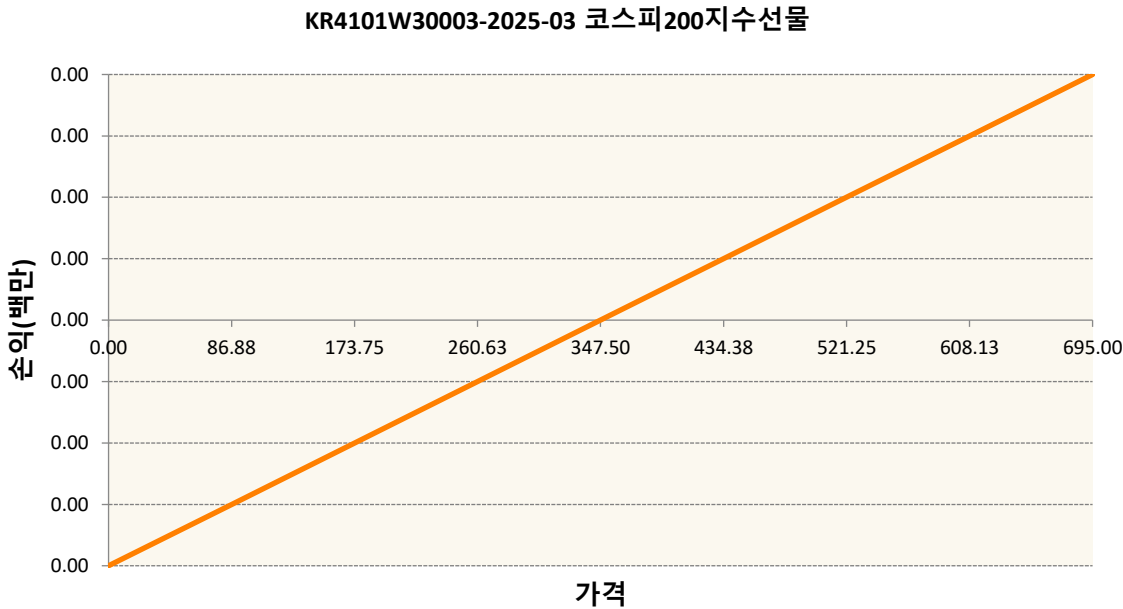
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

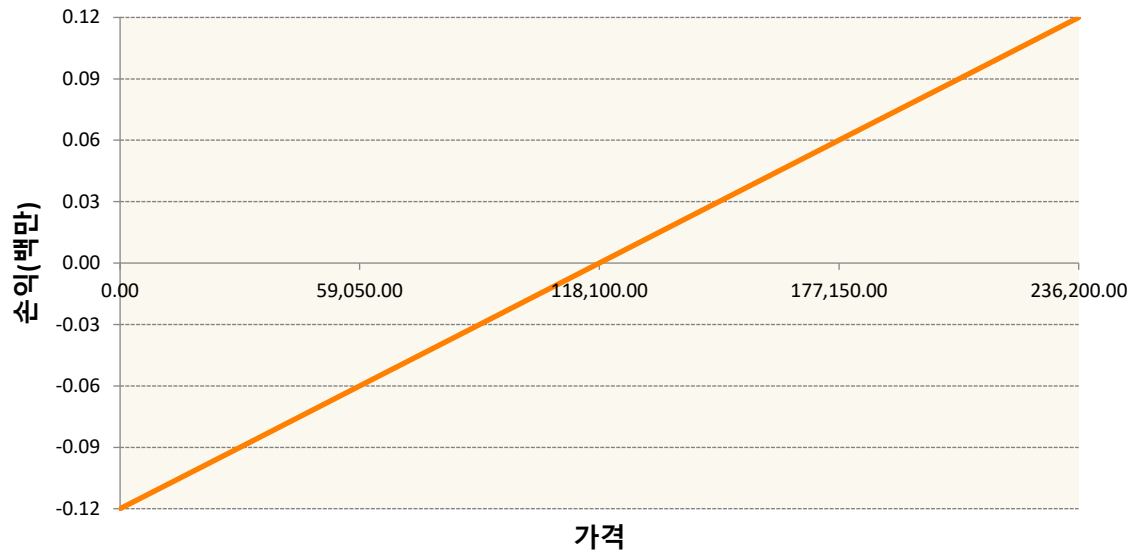
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,303	-1,303	장내
누계	유가증권	선물	11,355	0	11,355	장내

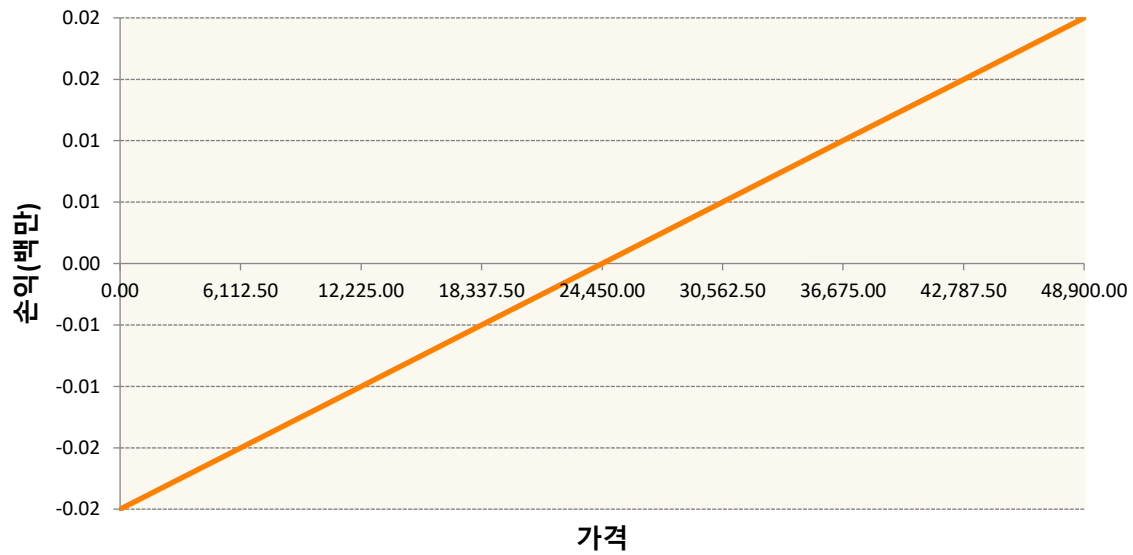
2. 만기시점의 손익구조



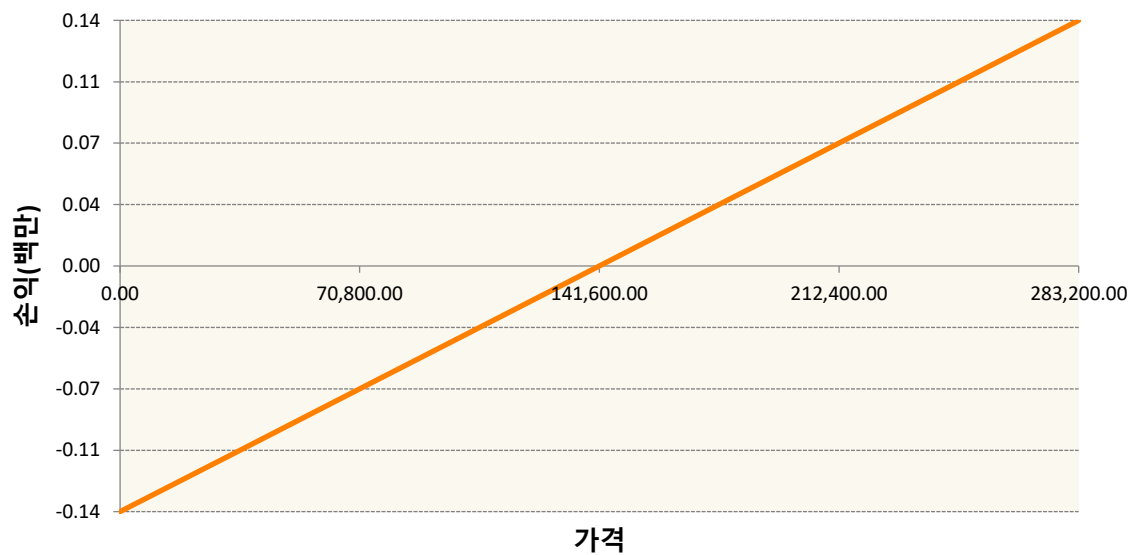
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



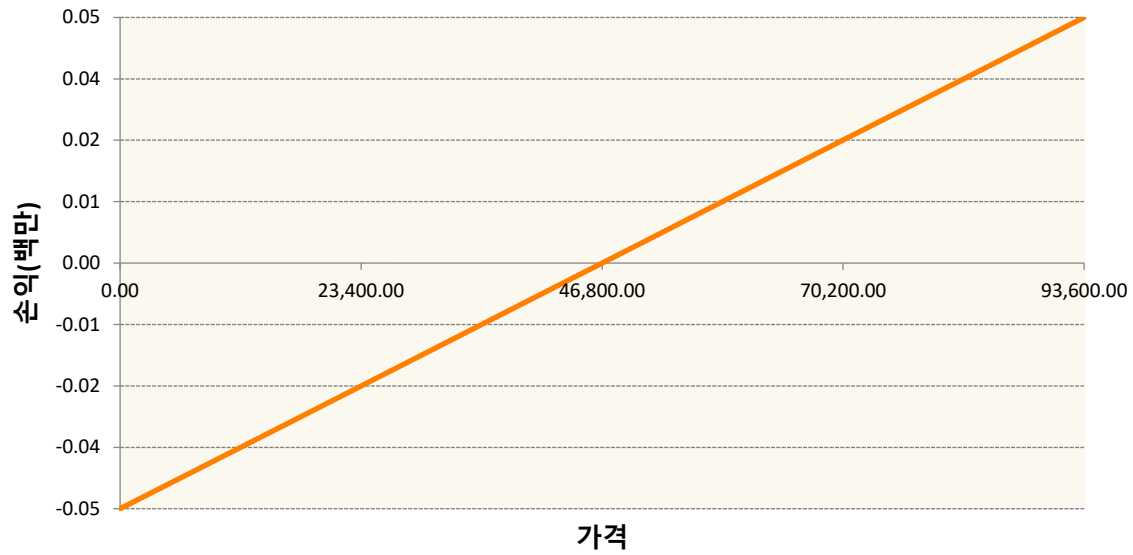
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



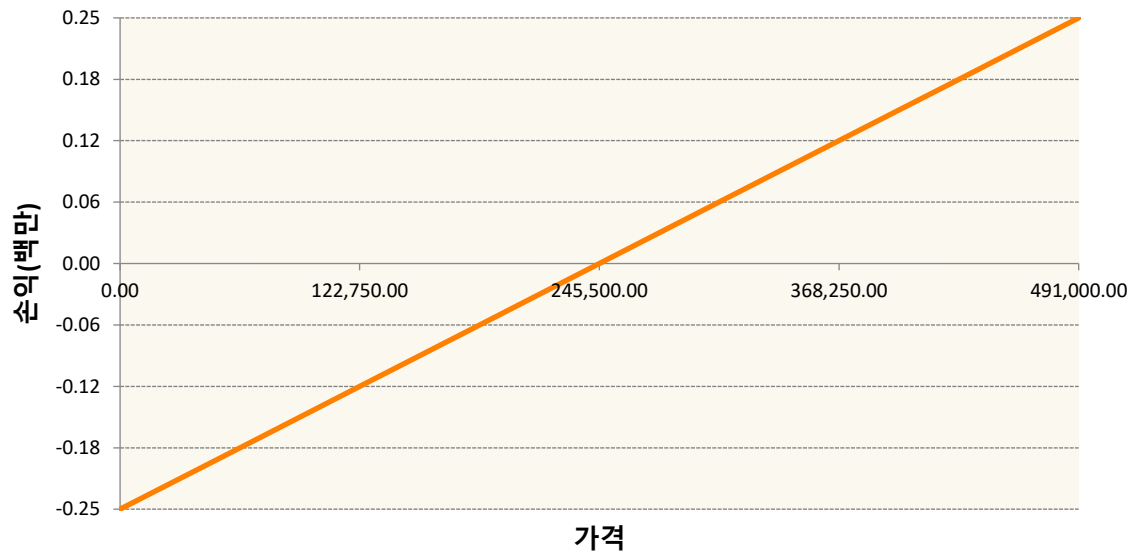
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



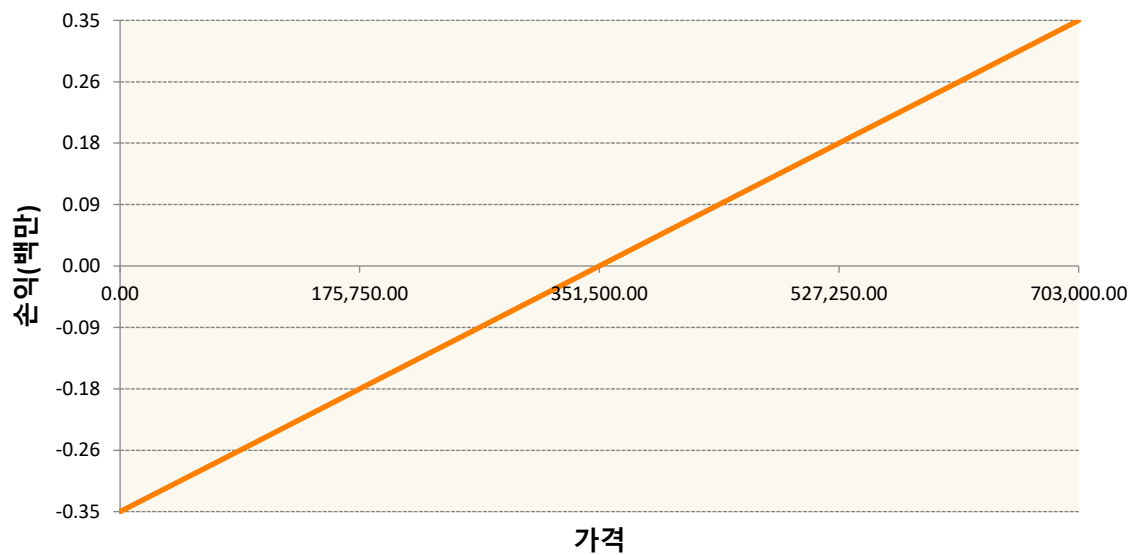
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물		660
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물		41
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물		36
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물		12
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물		27
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물		12
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물		50
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물		70

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,535

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

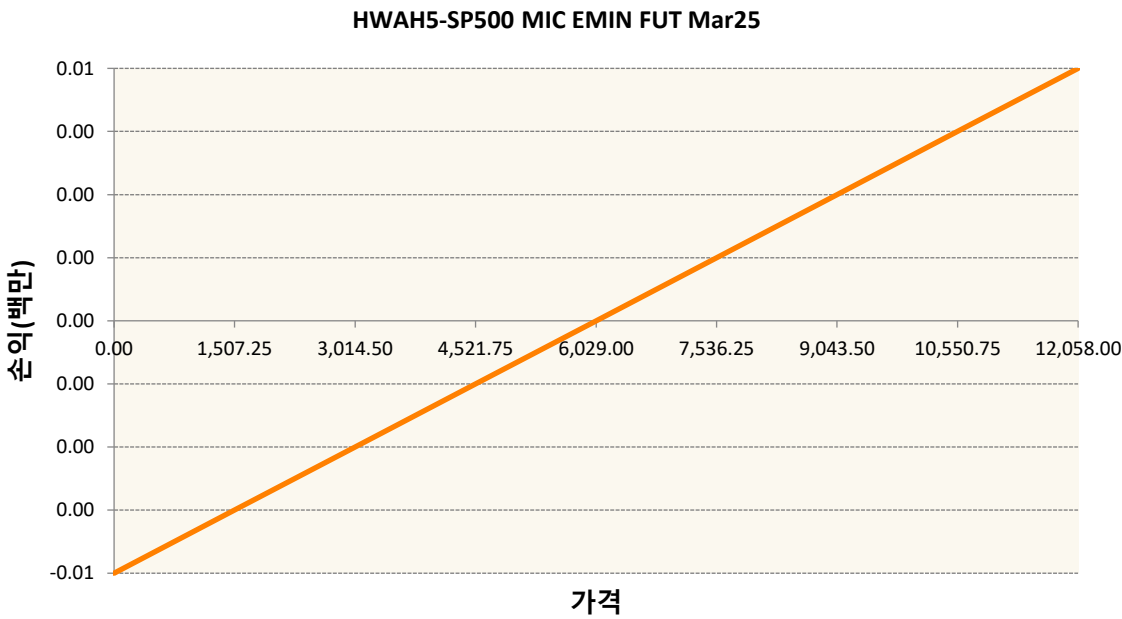
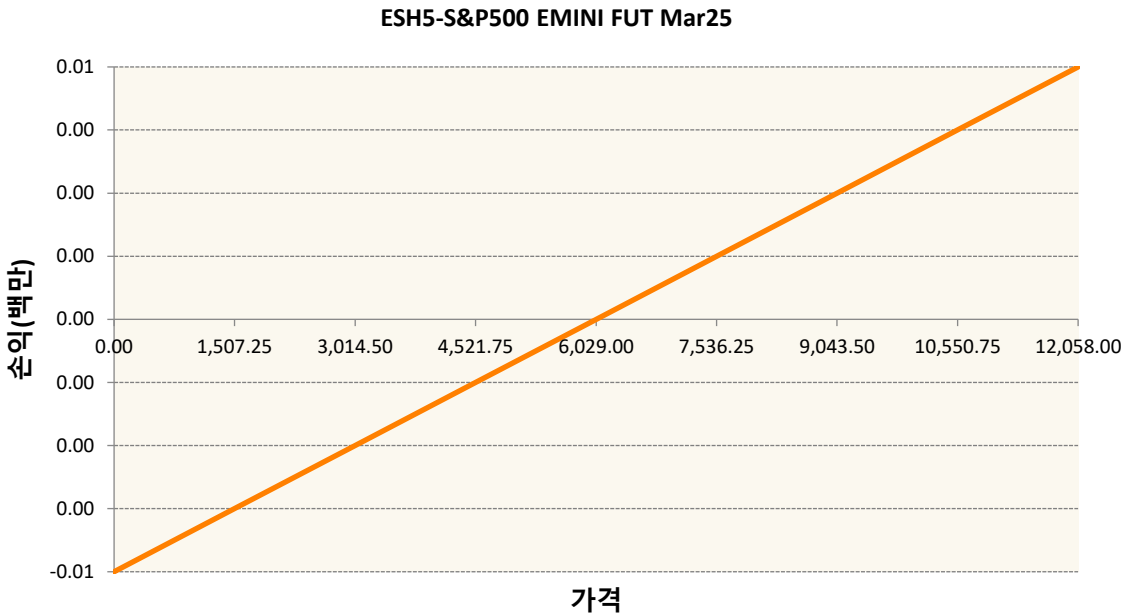
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	30,204	0	30,204	
누계	유가증권	선물	1,267	0	1,267	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,416
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,378

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

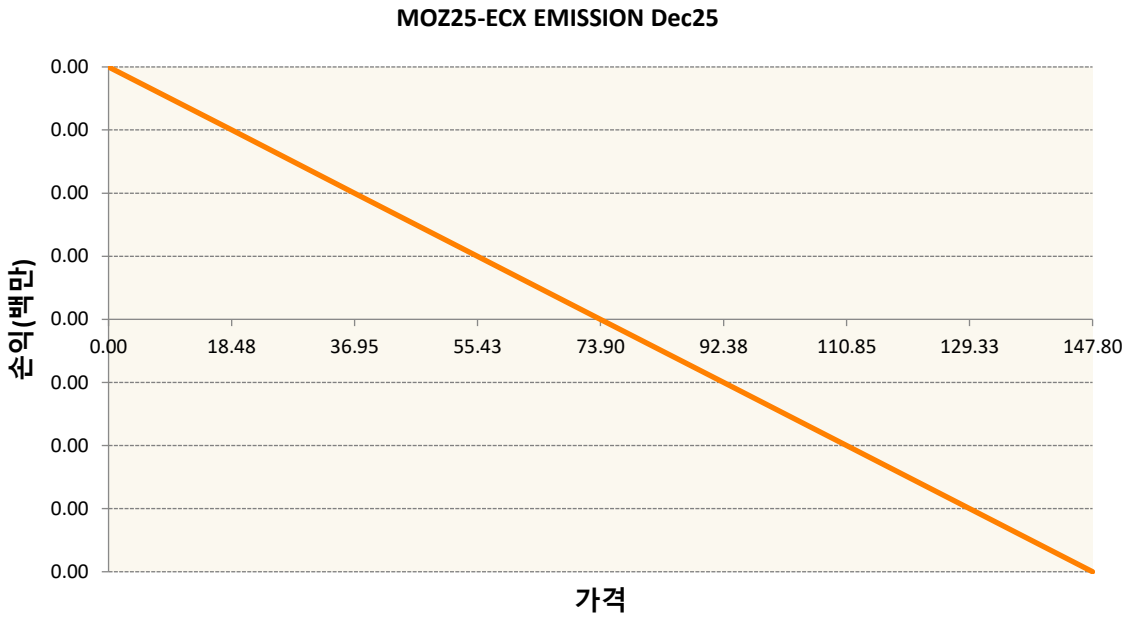
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,977	-5,028	
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	398

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

(단위:백만원)

718

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

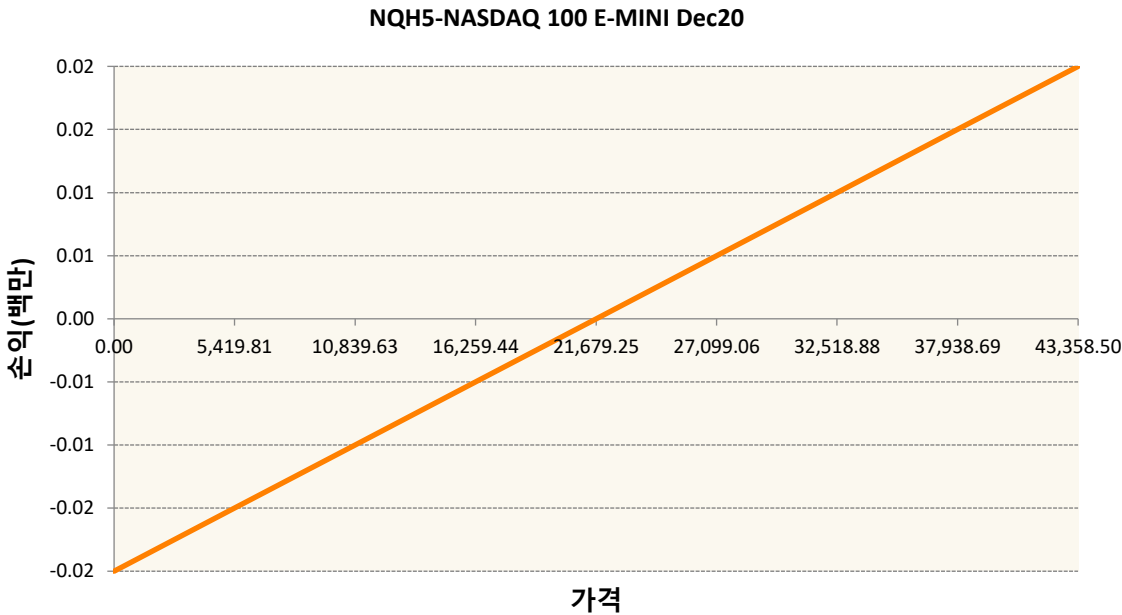
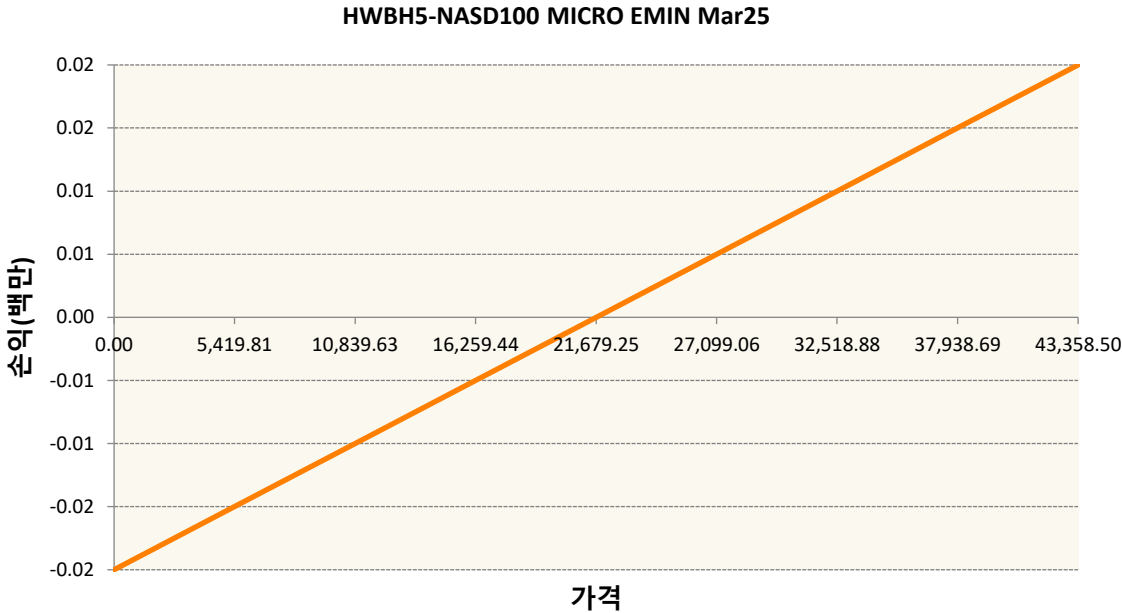
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	15,118	0	15,118	
누계	유가증권	선물	691	0	691	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	55
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,209

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,114

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

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	217,733	0	217,733	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	719
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,976
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,816
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,168

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

(단위:백만원)

9,435

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

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	6
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	6
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	6
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	6

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

(단위:백만원)

27

공시일	2025-02-25
기준일	2025-02-24

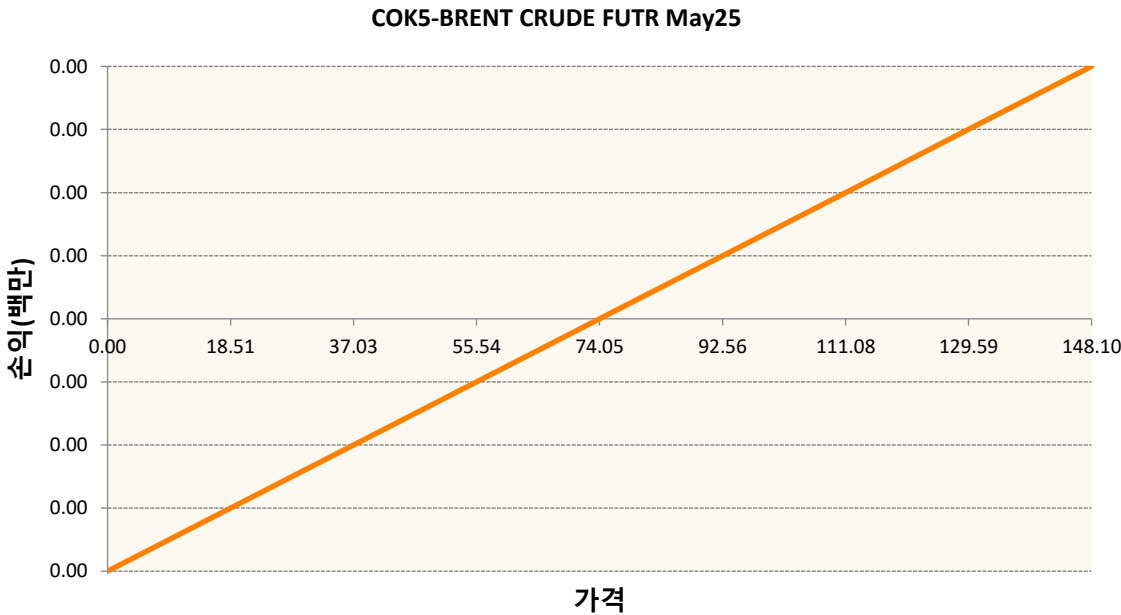
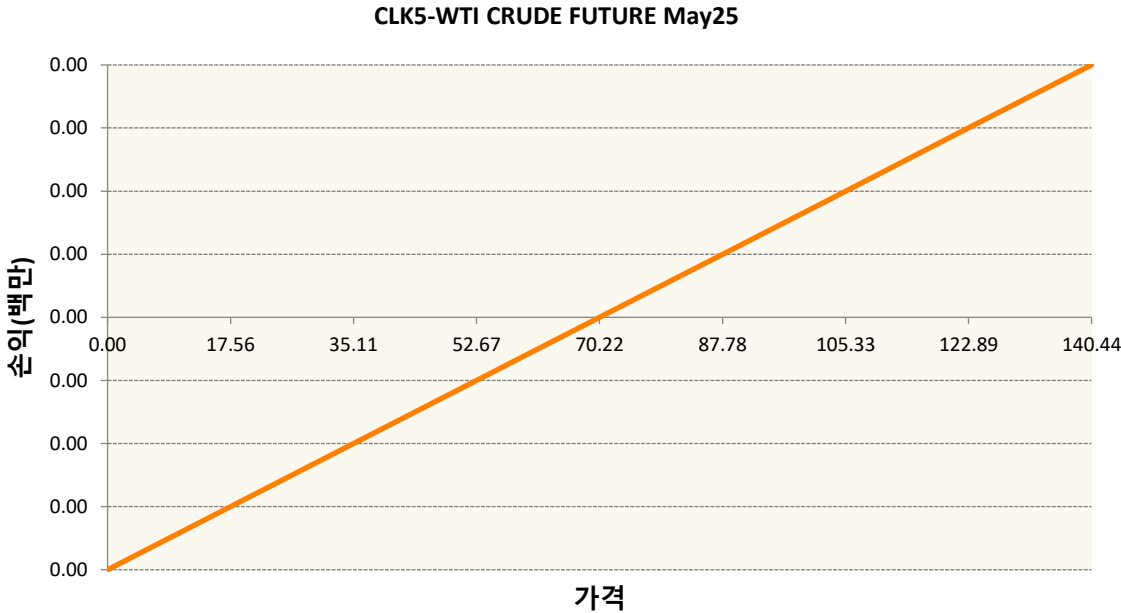
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

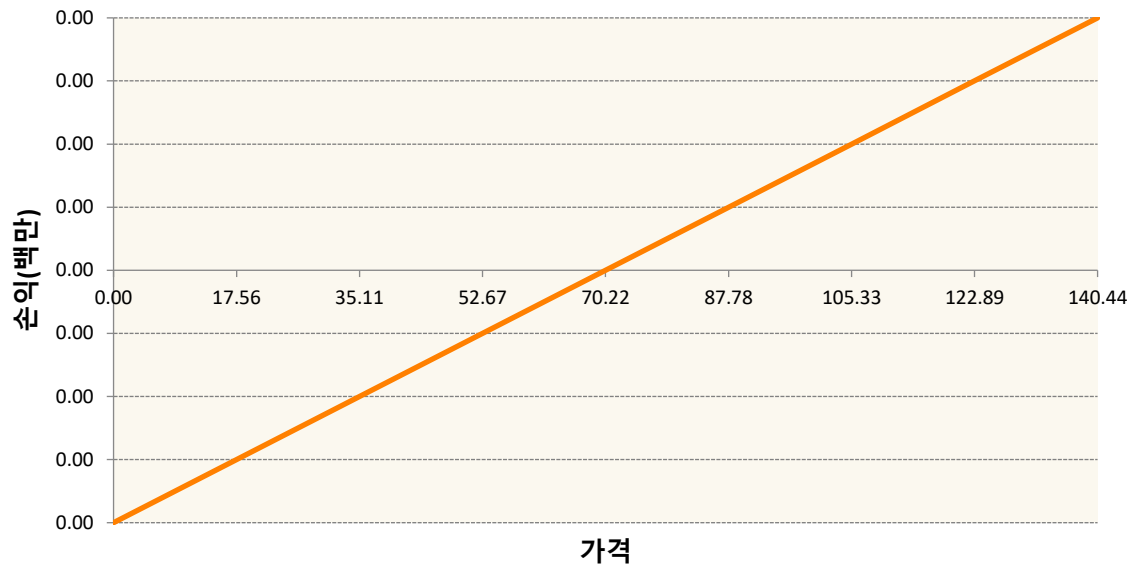
(단위:백만원)

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	897	0	897	
누계	통화	선물	0	185	-185	장내

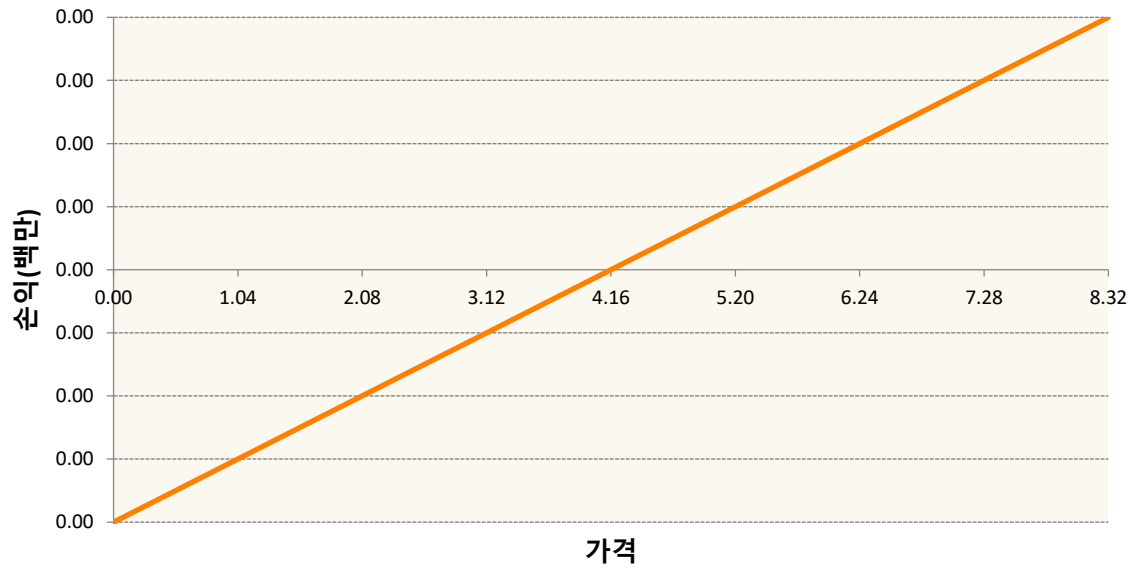
2. 만기시점의 손익구조



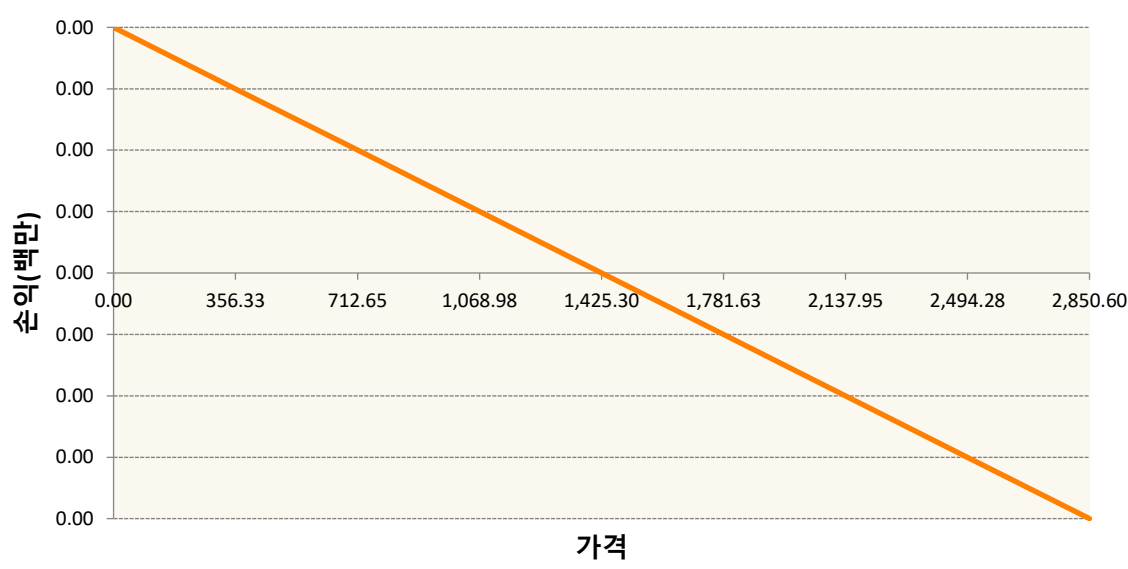
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



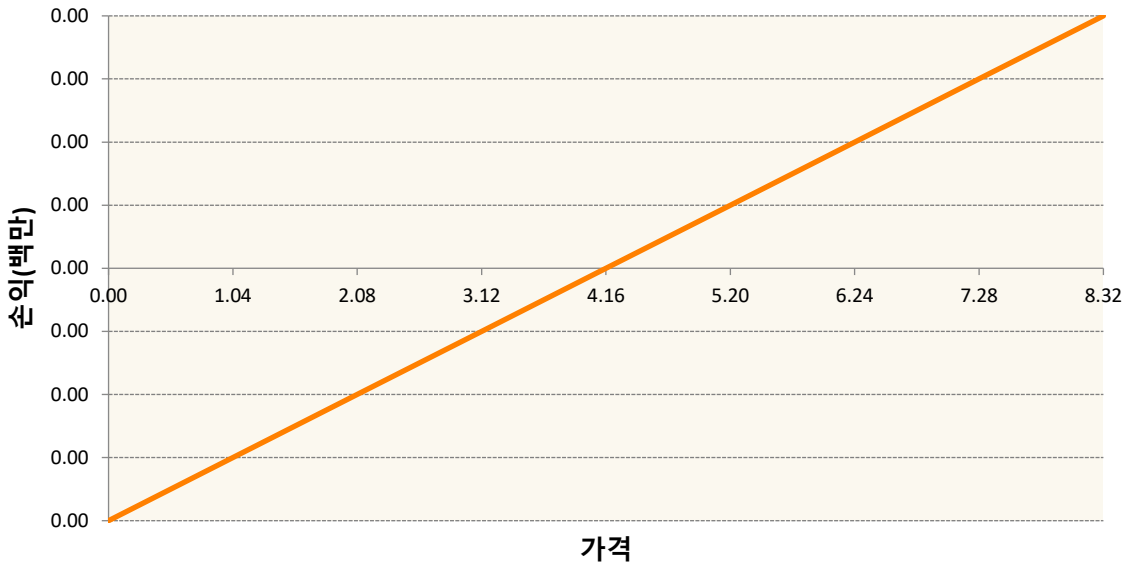
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



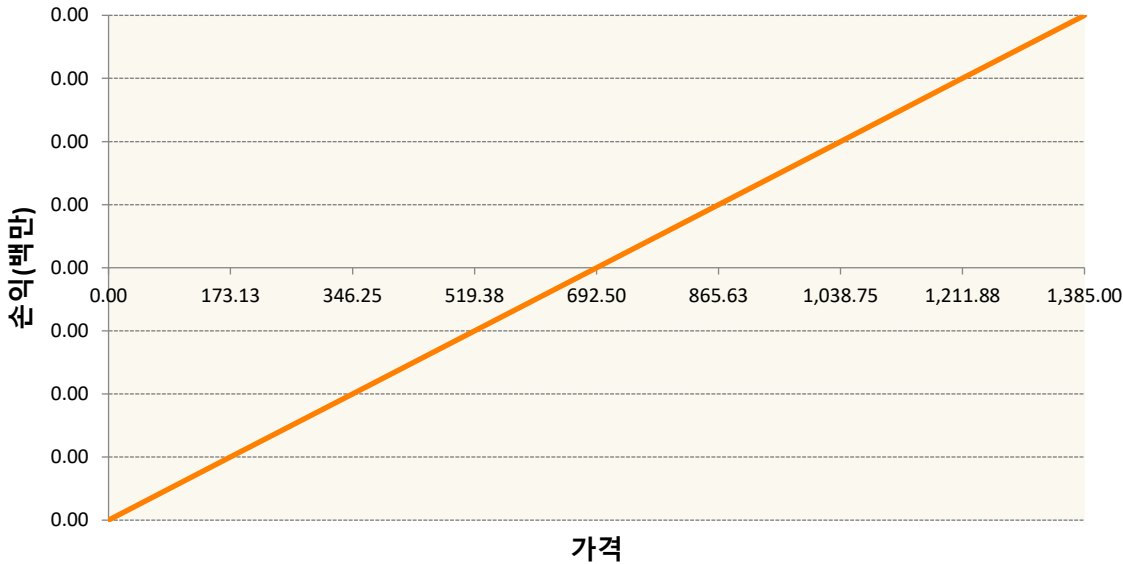
KR4175W30007-2025-03 달러선물



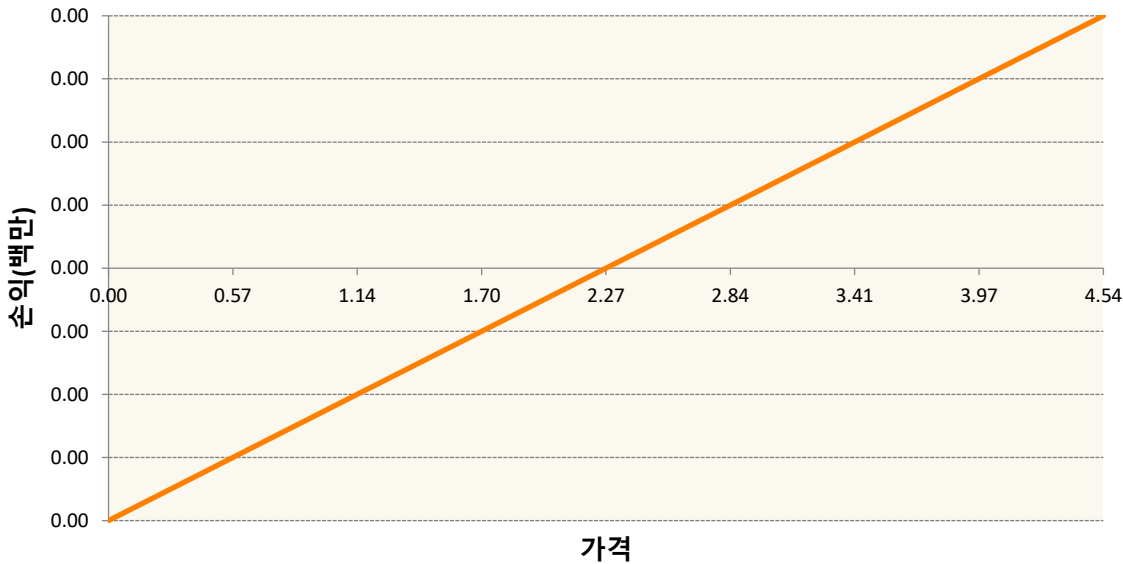
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	17
ECK5	E-mini Crude Oil May 25	4
EOK5	E-MINI NATURAL GAS May 25	8
KR4175W30(	2025-03 달러선물	15
NGK25	NATURAL GAS FUTR May 25	14
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