

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

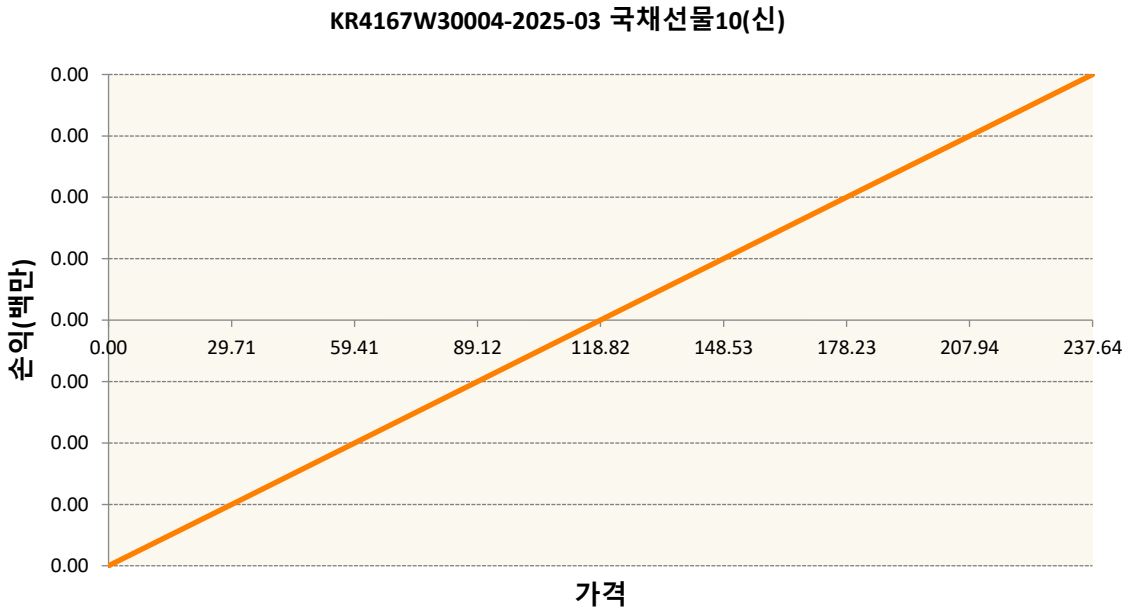
베스트장기채(채권-파생형)

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	240,016	0	240,016	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

6,030

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

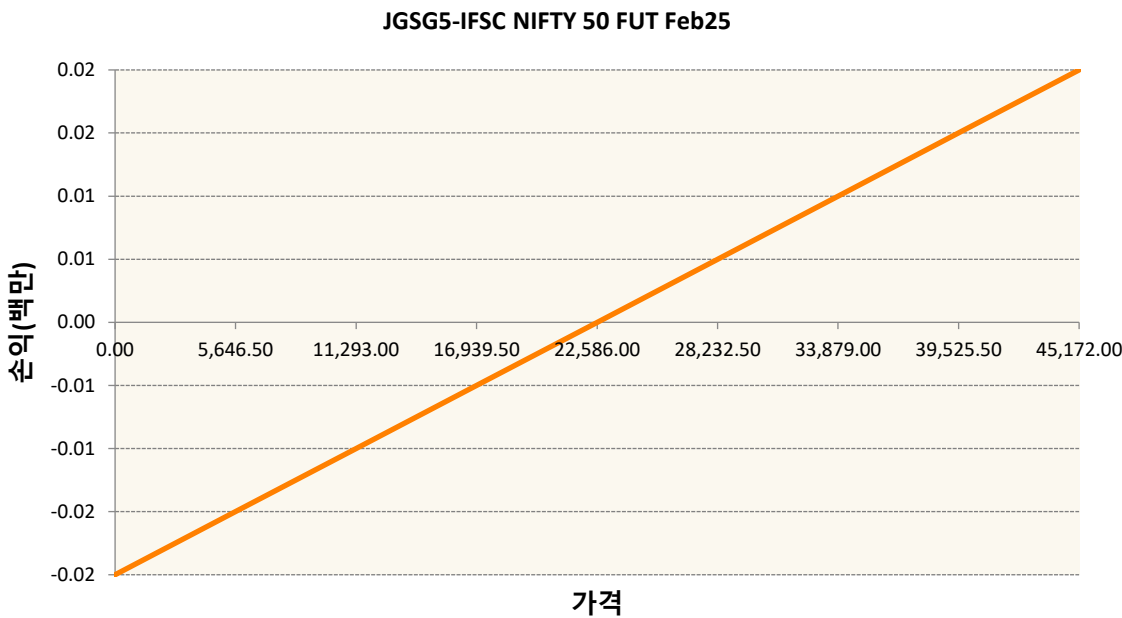
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,283	0	3,283	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSG5	IFSC NIFTY 50 FUT Feb25	263
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

178

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

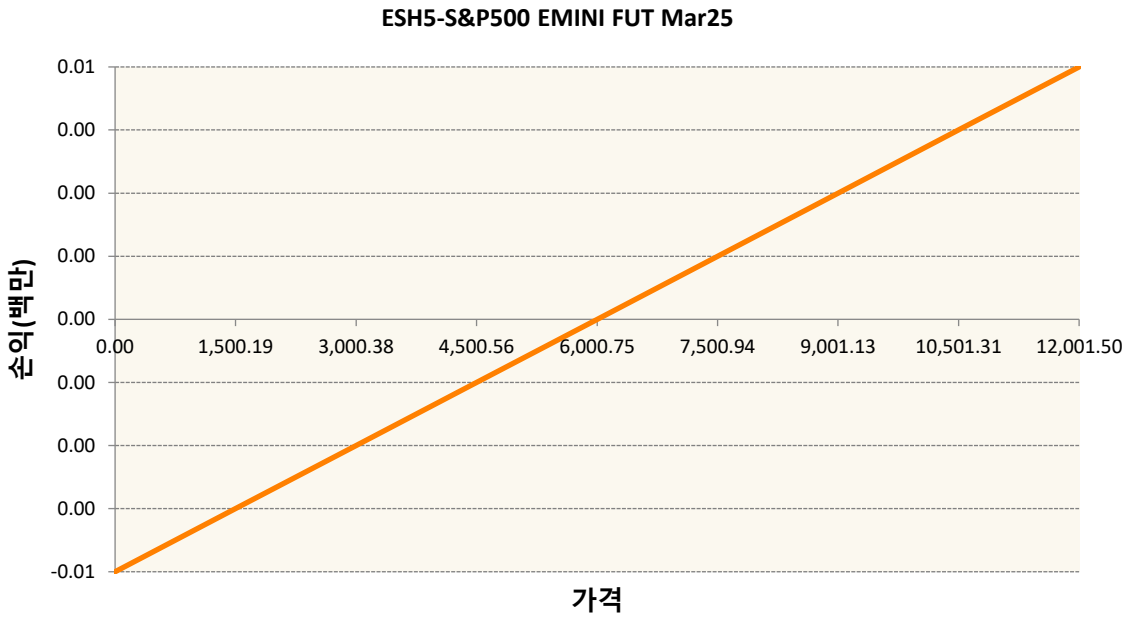
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	863	0	863	

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	2025-02-26
기준일	2025-02-25

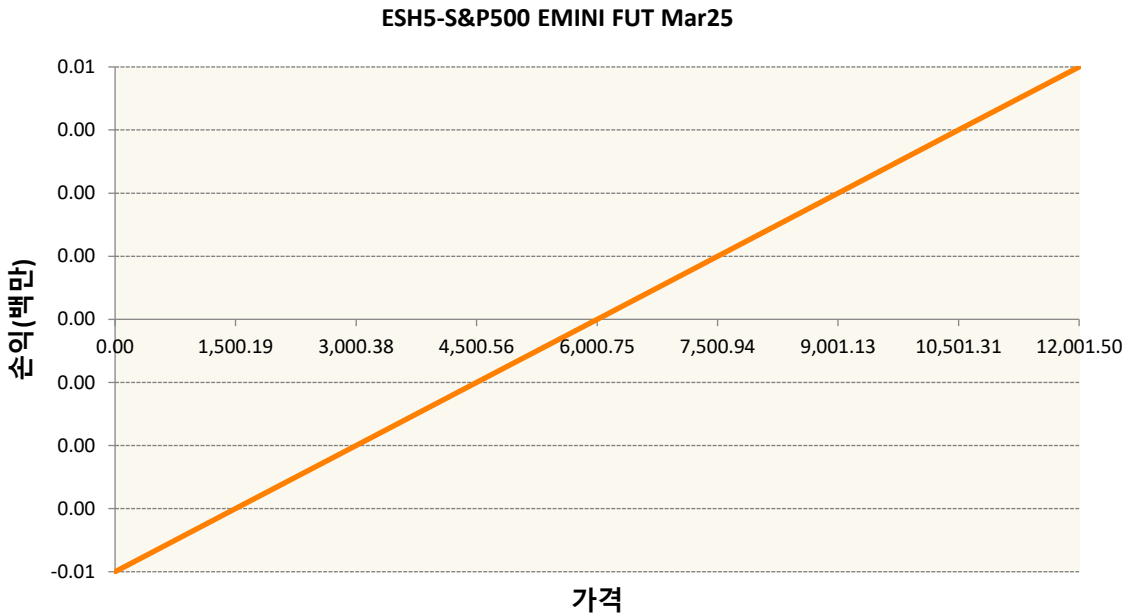
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,612	0	2,612	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	209
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

286

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

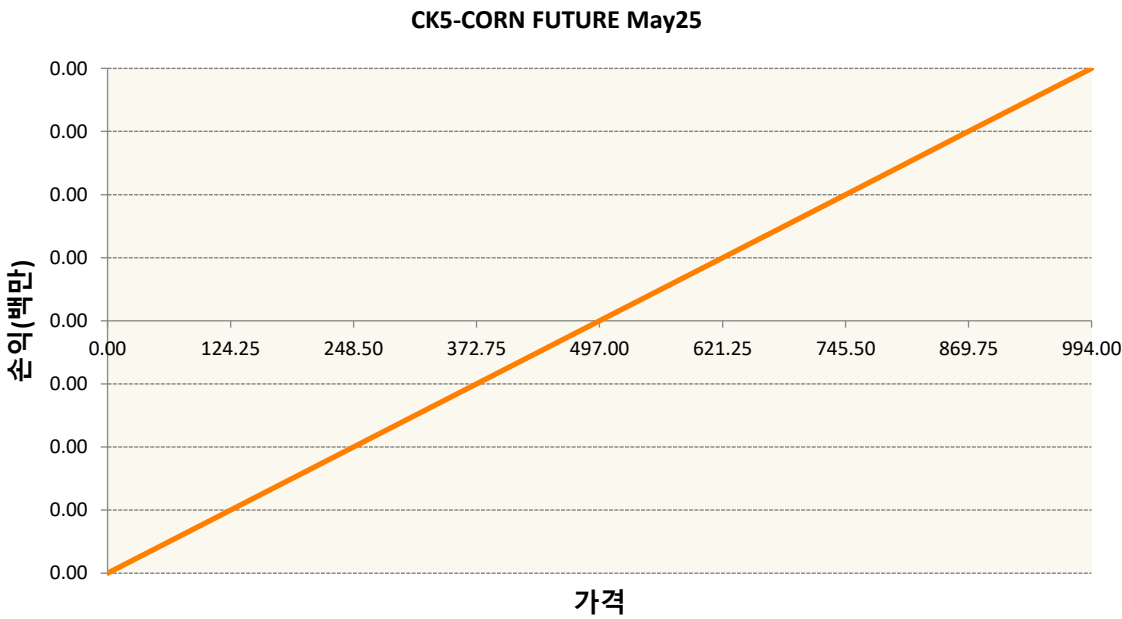
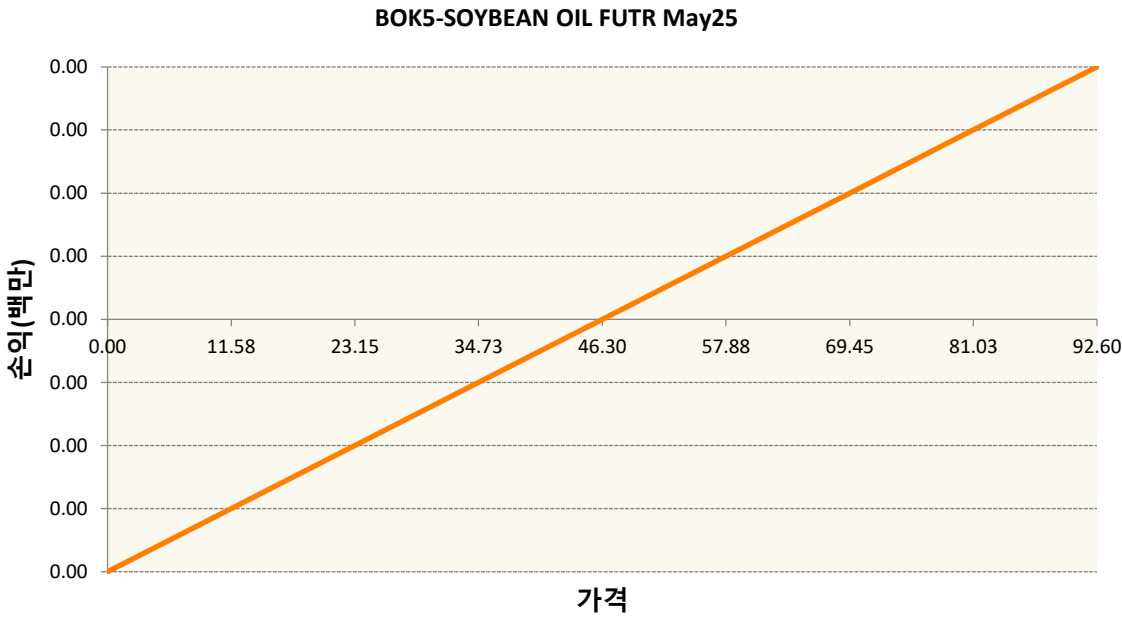
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

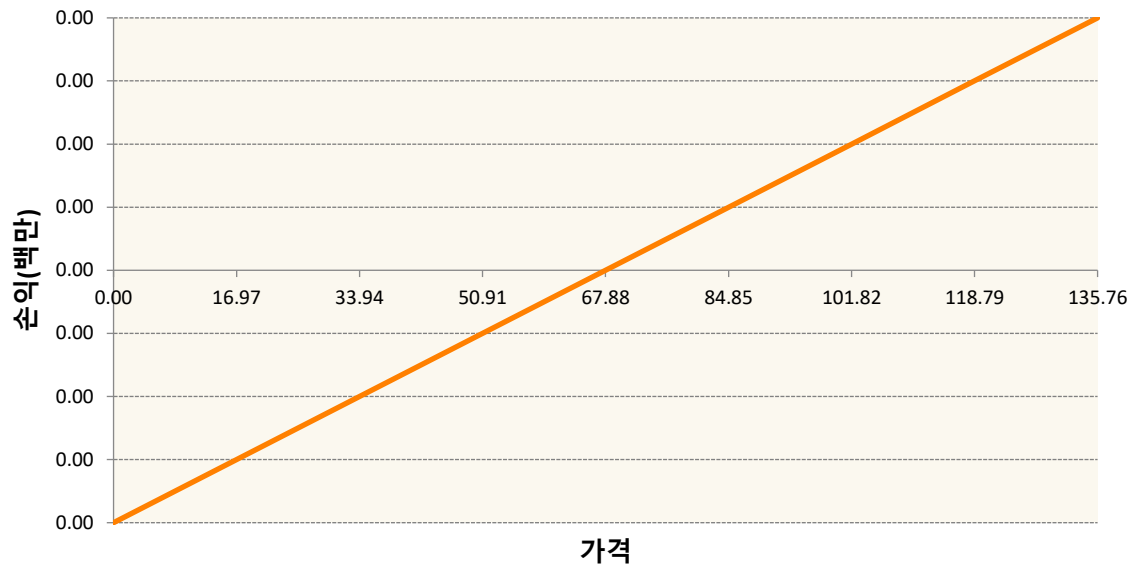
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	57	0	57	장내
누계	유가증권	선물	4,051	0	4,051	
누계	통화	선물	0	572	-572	장내

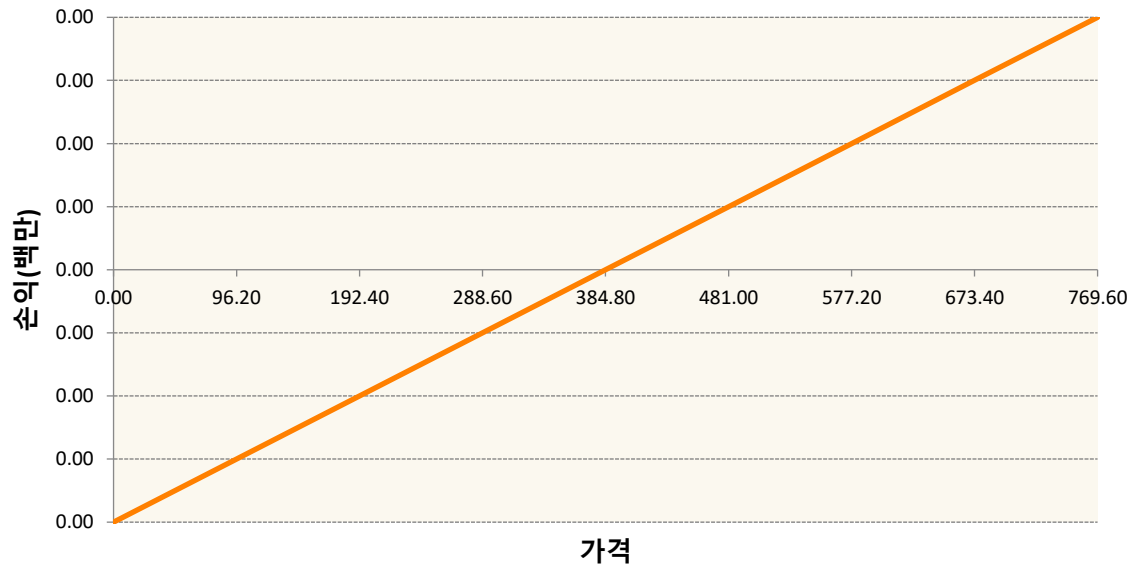
2. 만기시점의 손익구조



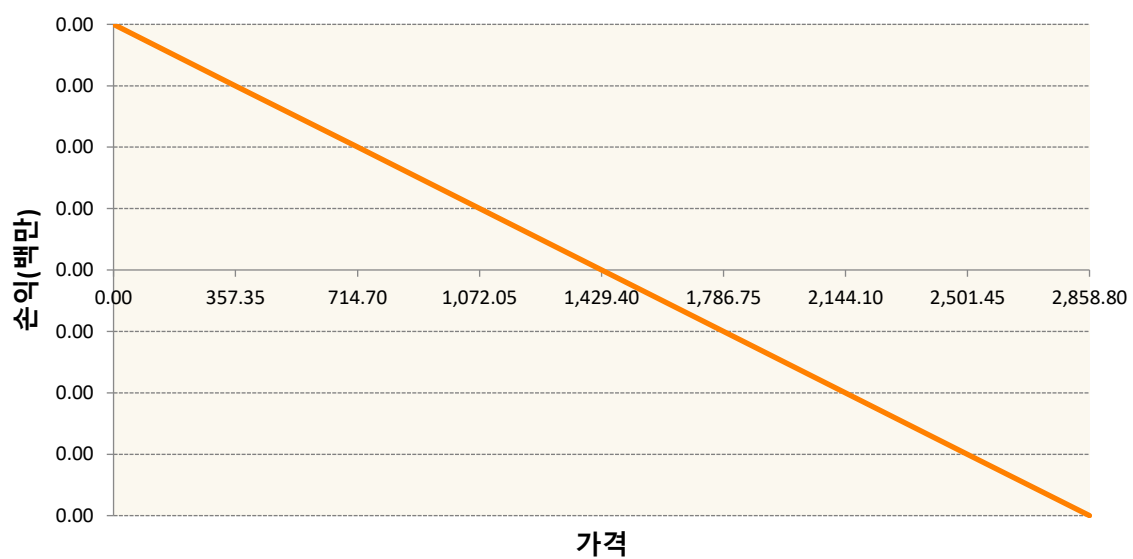
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



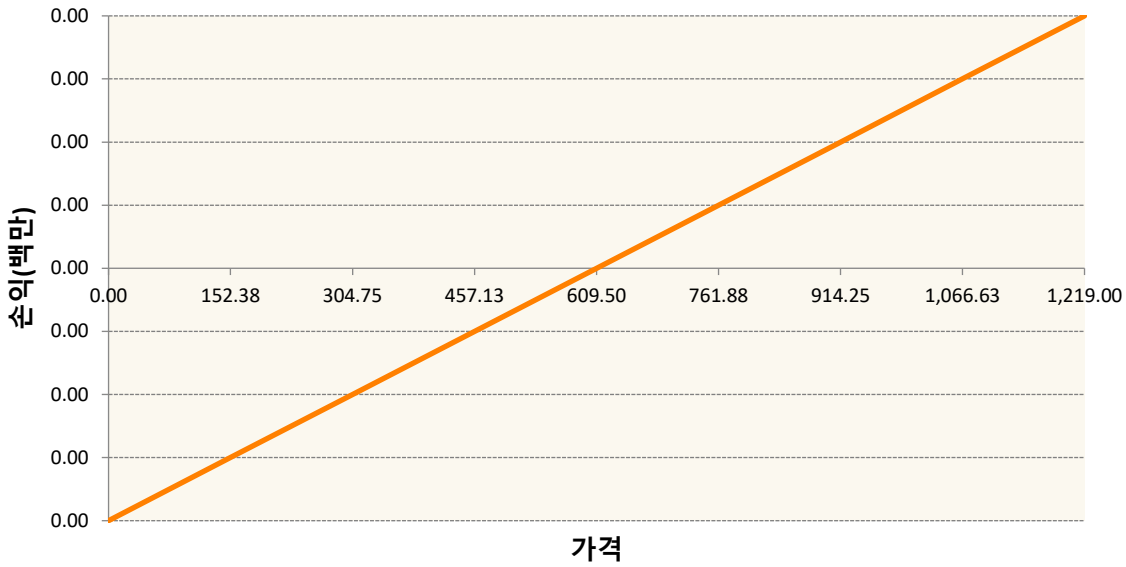
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



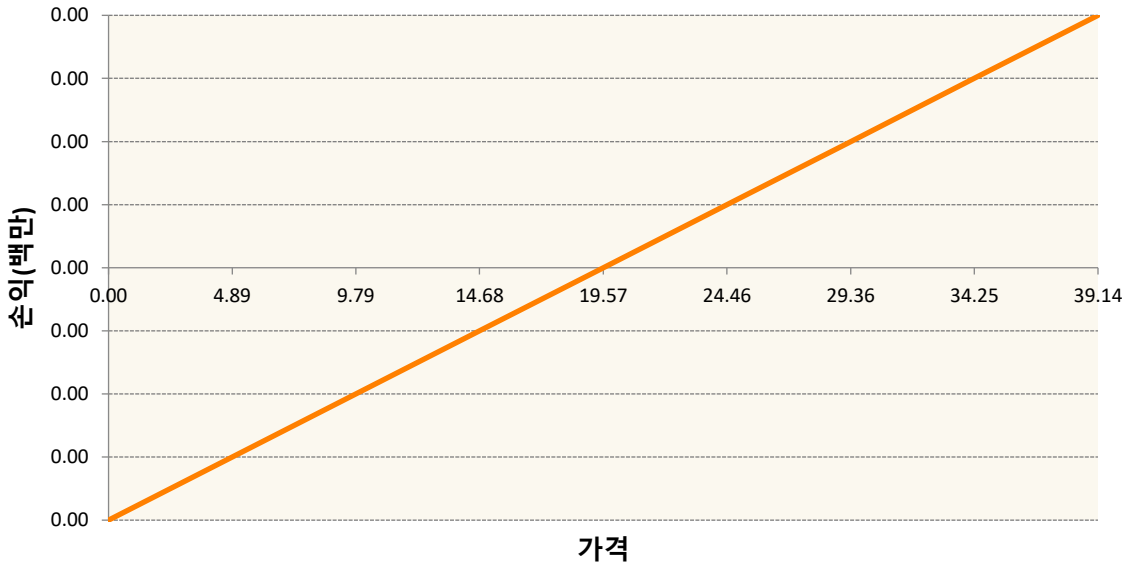
KR4175W30007-2025-03 달러선물



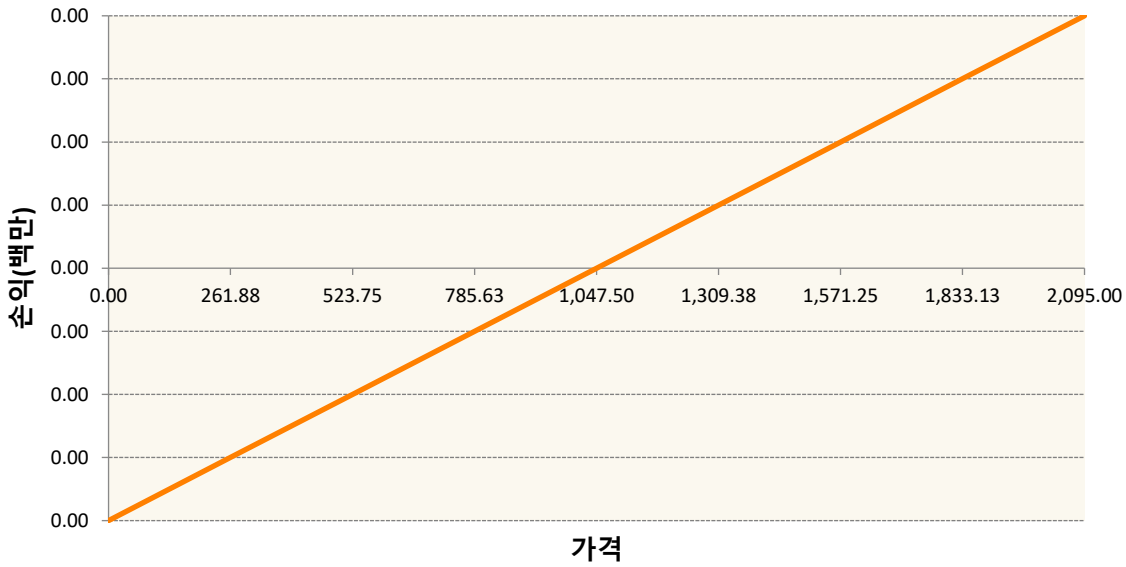
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



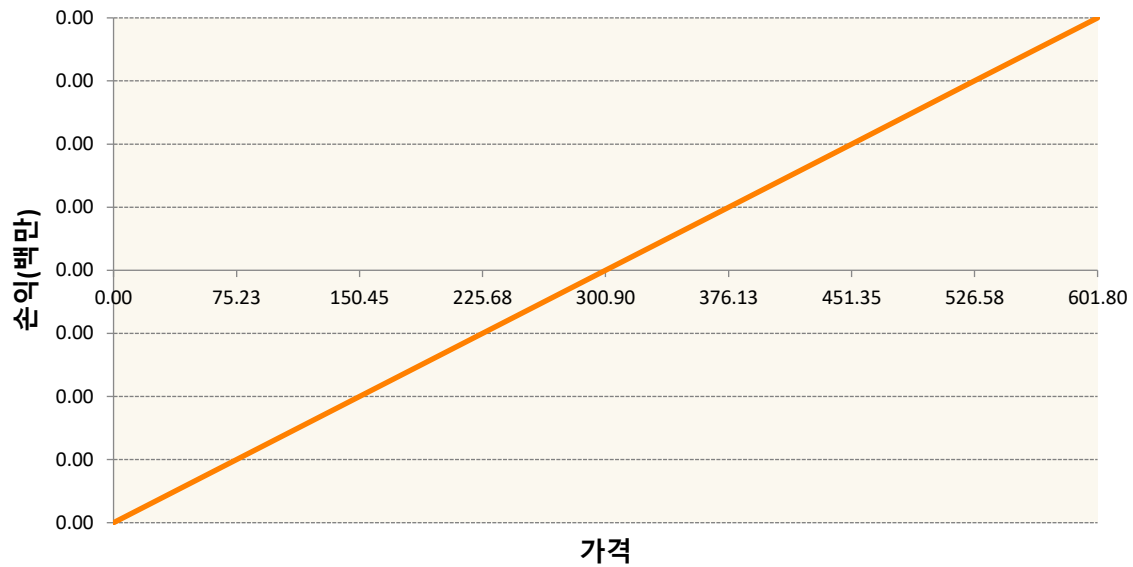
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



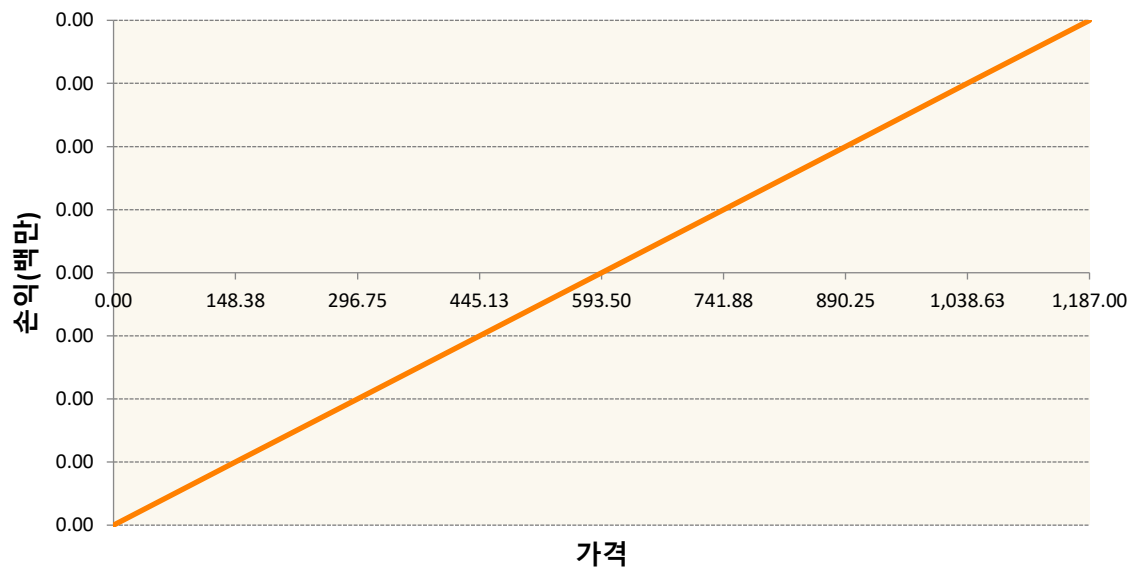
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-02-26
기준일	2025-02-25

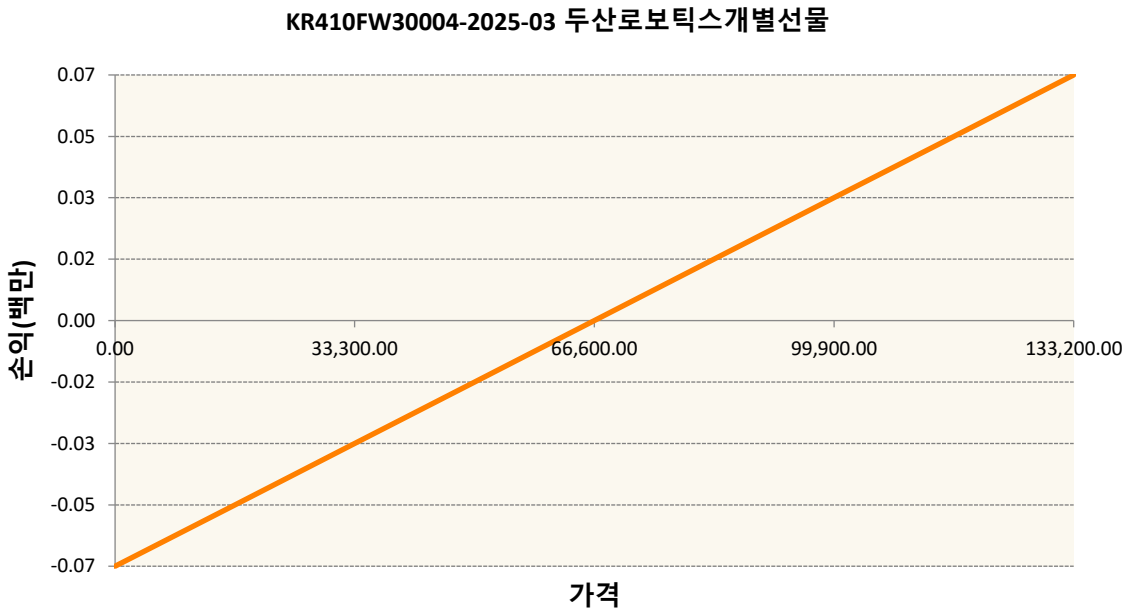
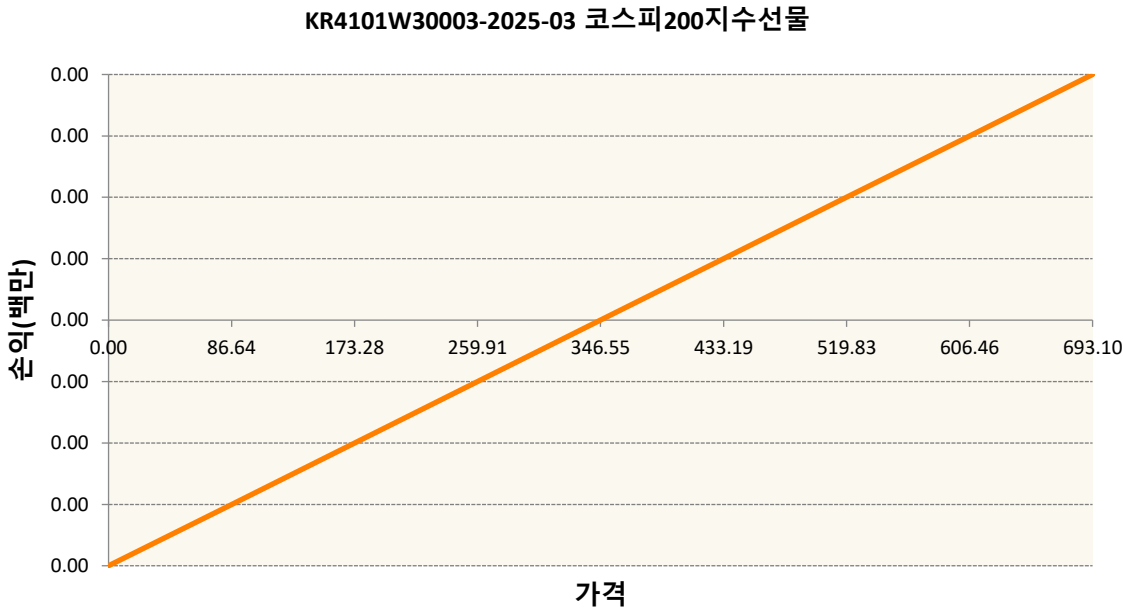
스마트인덱스모

1. 계약금액

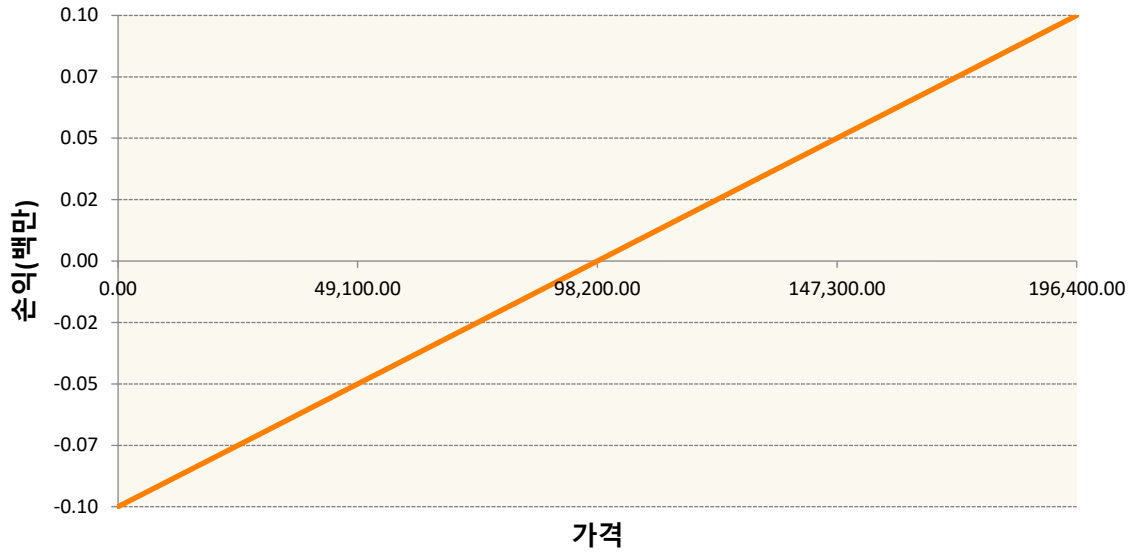
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,334	0	1,334	장내

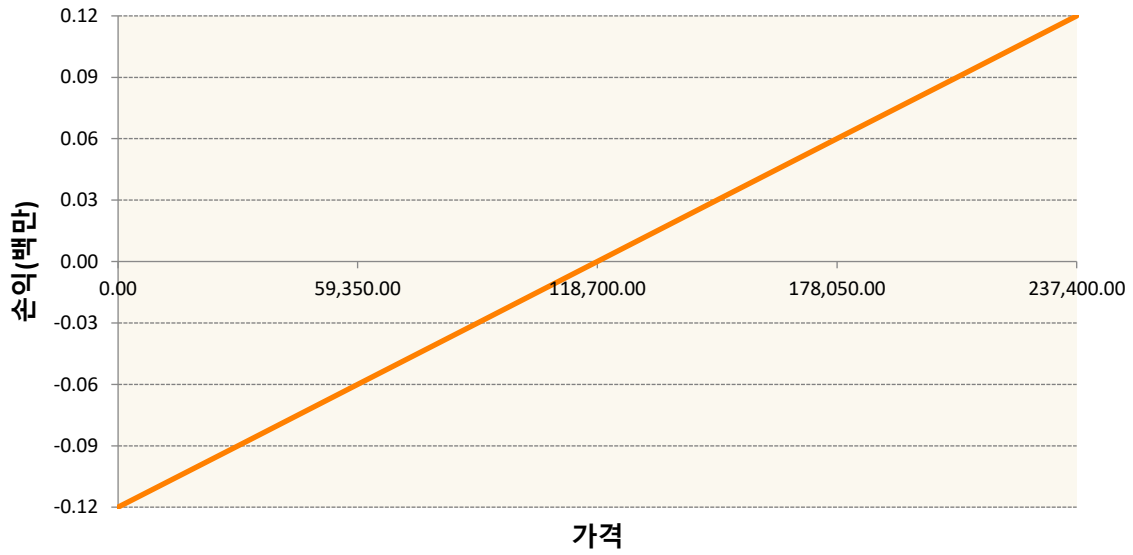
2. 만기시점의 손익구조



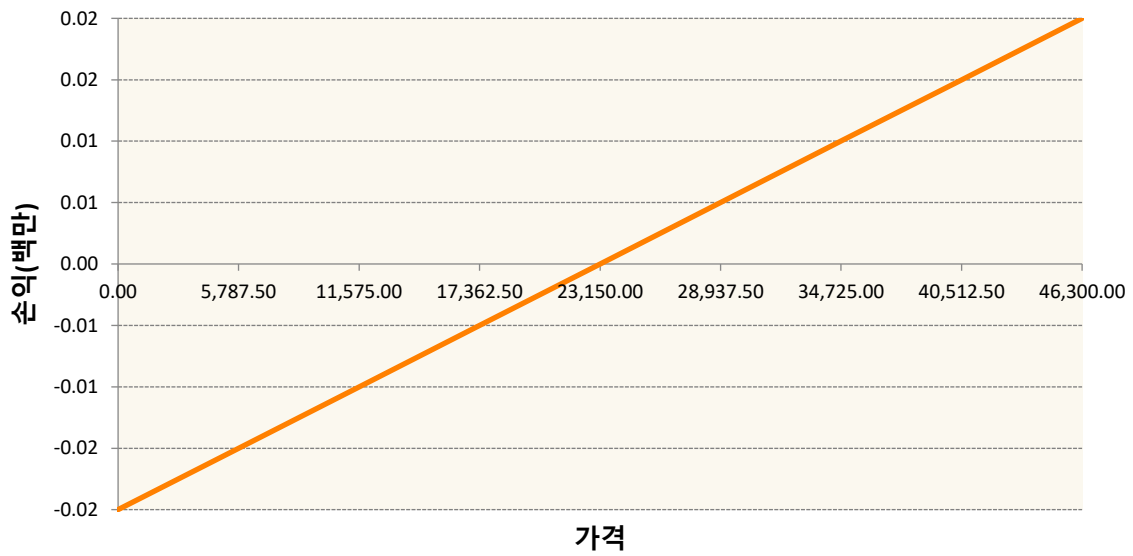
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



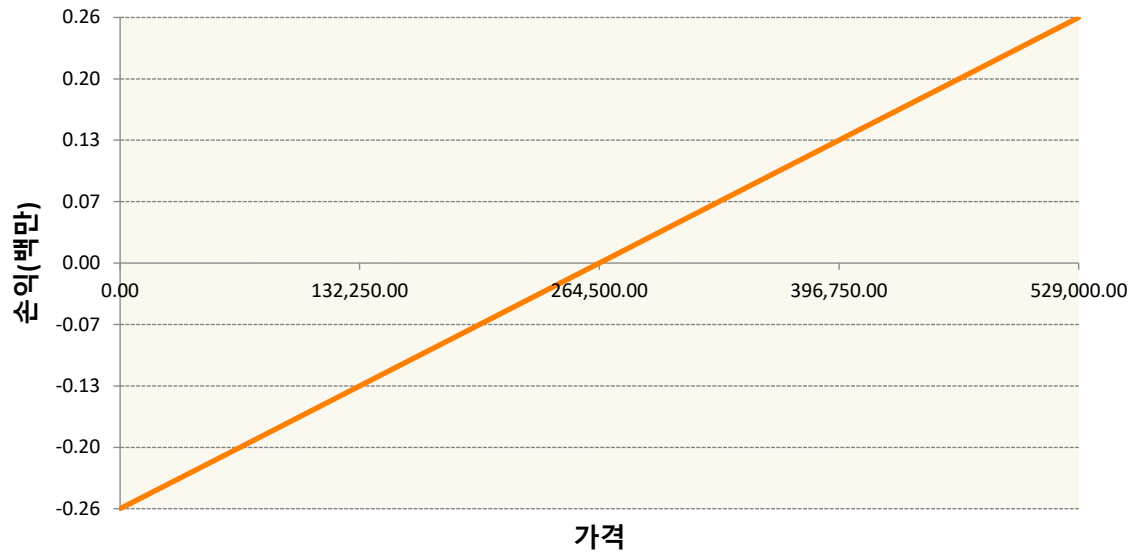
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



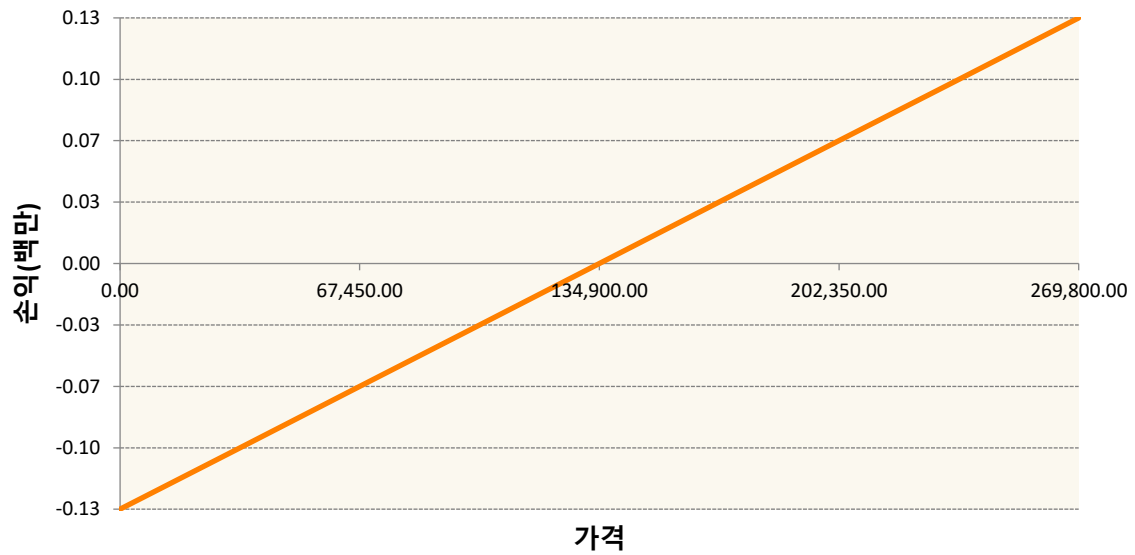
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



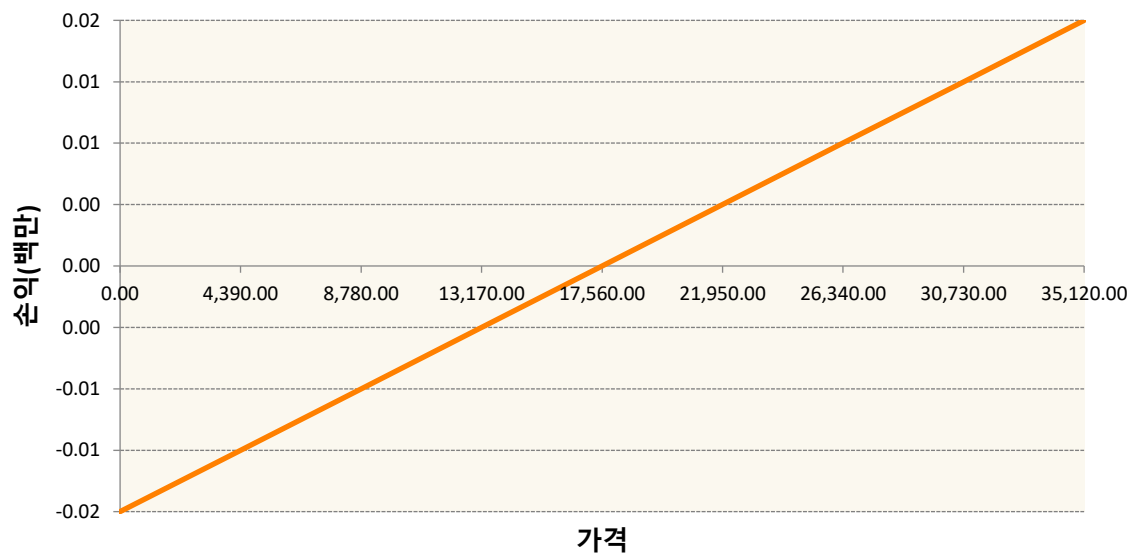
KR41CXW30001-2025-03 한미약품개별선물



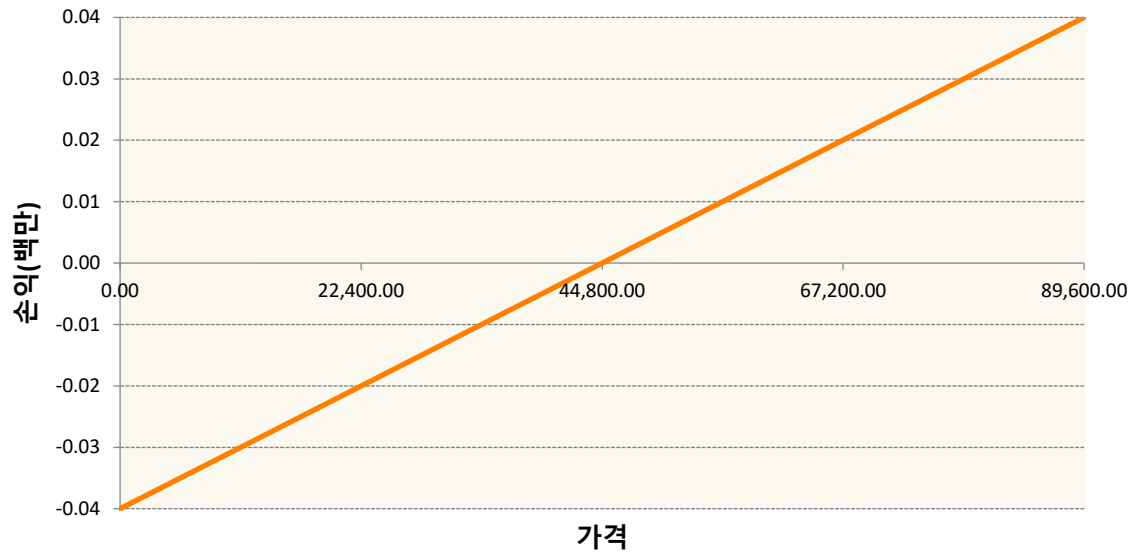
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



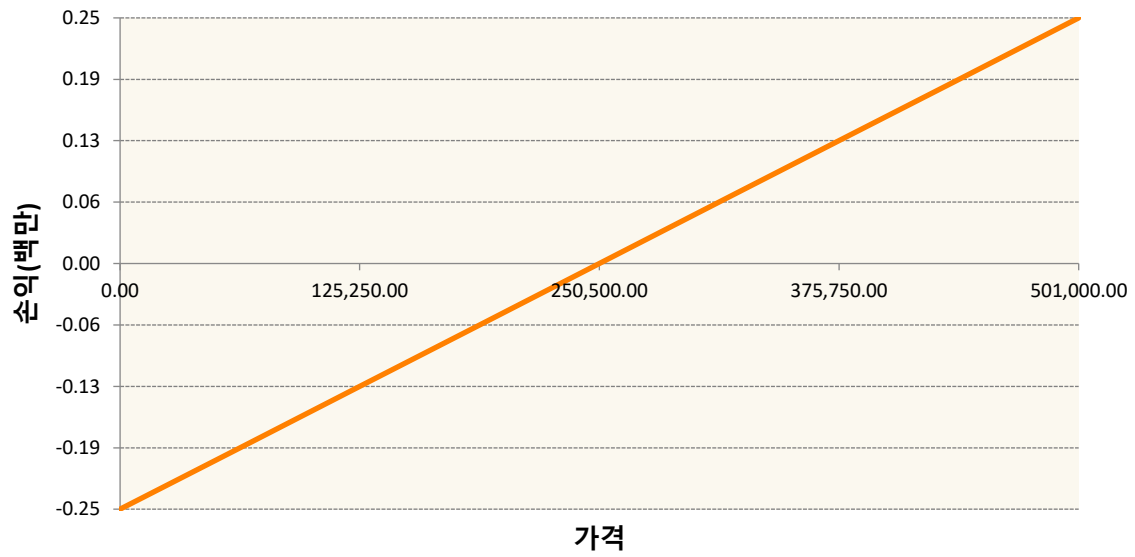
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



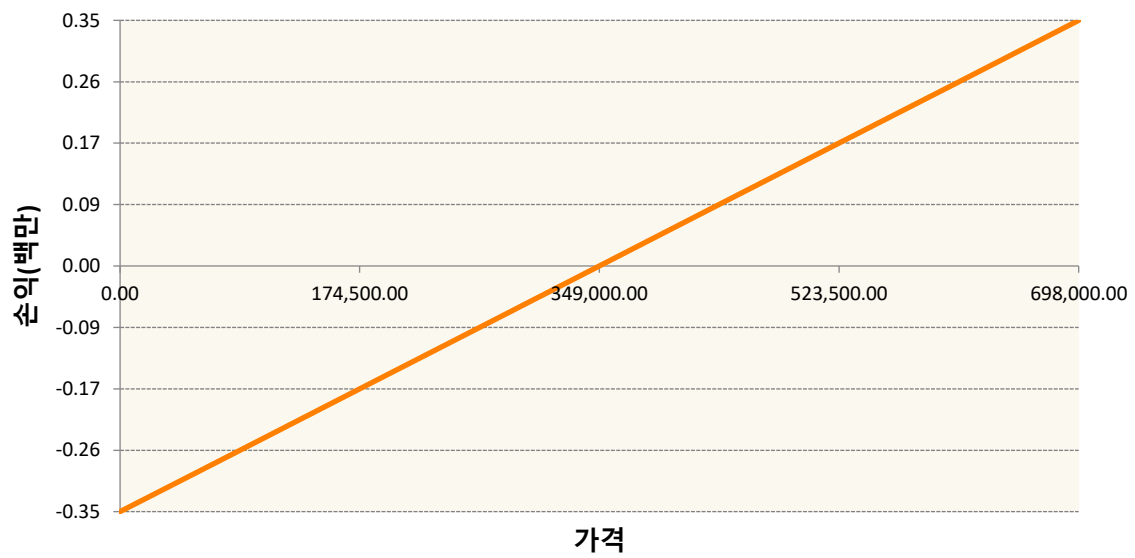
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물		69
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물		2
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

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	191

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

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)

479

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

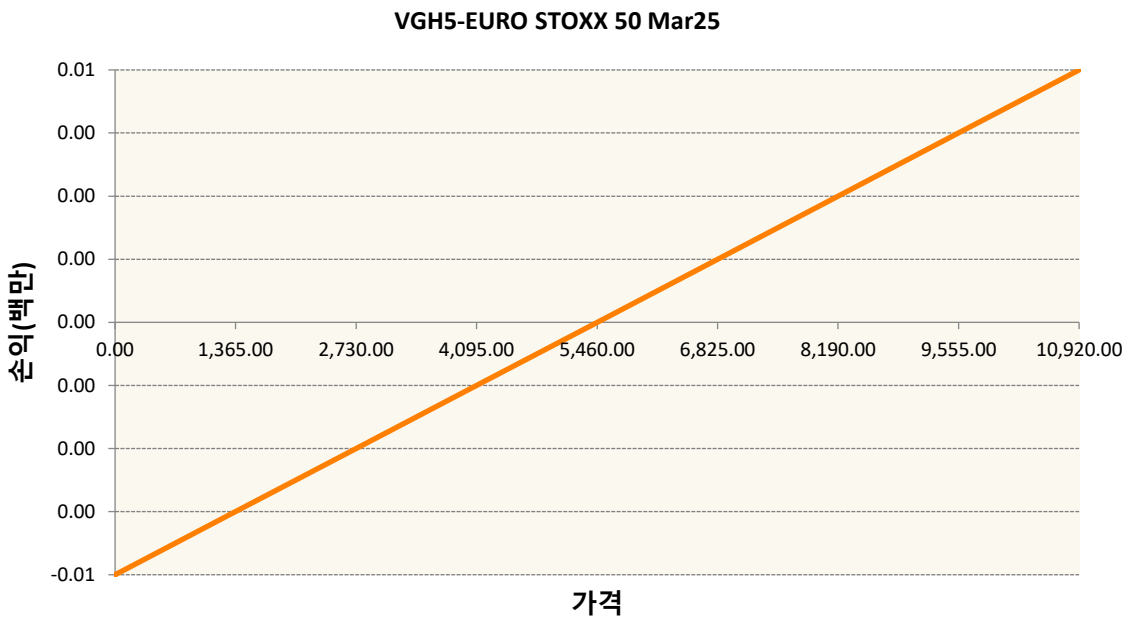
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	987	0	987	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

52

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

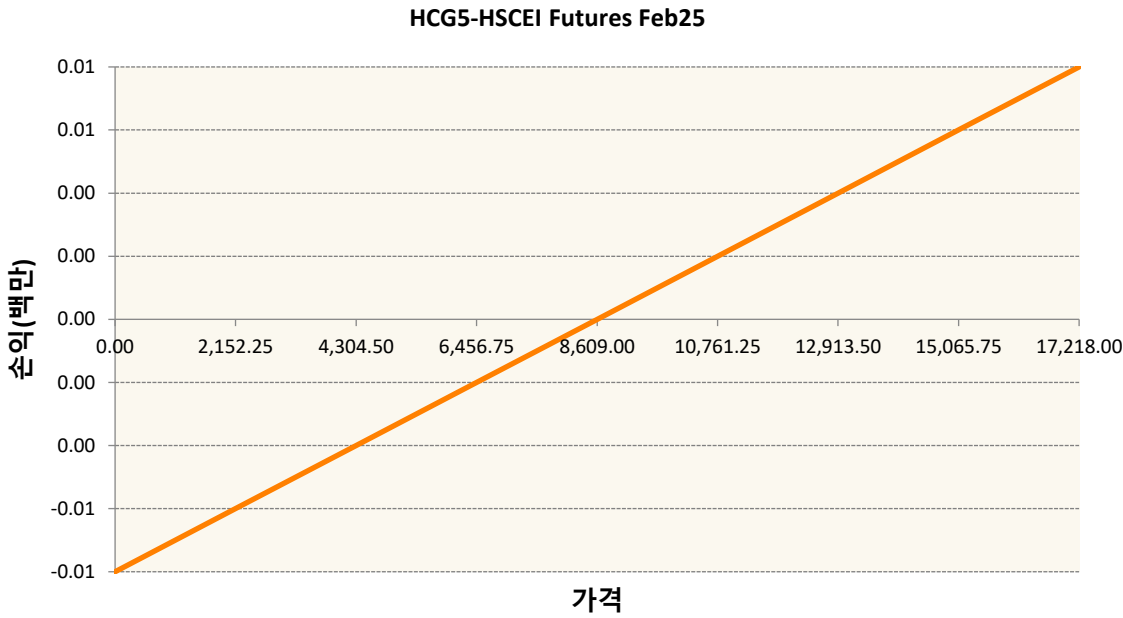
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,820	0	1,820	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG5	HSCEI Futures Feb25	146
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

196

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

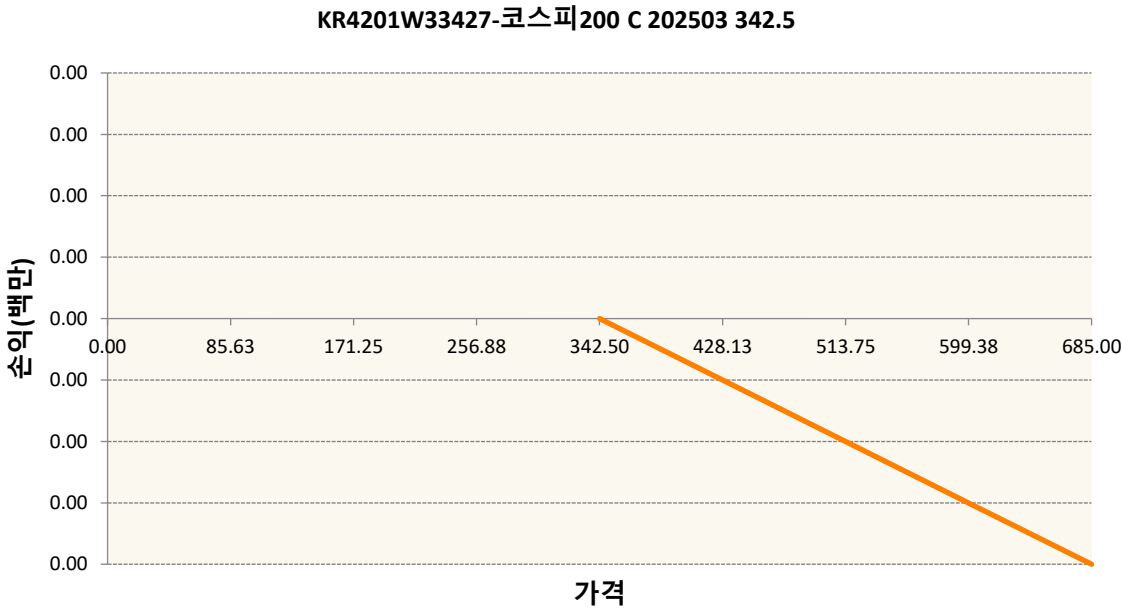
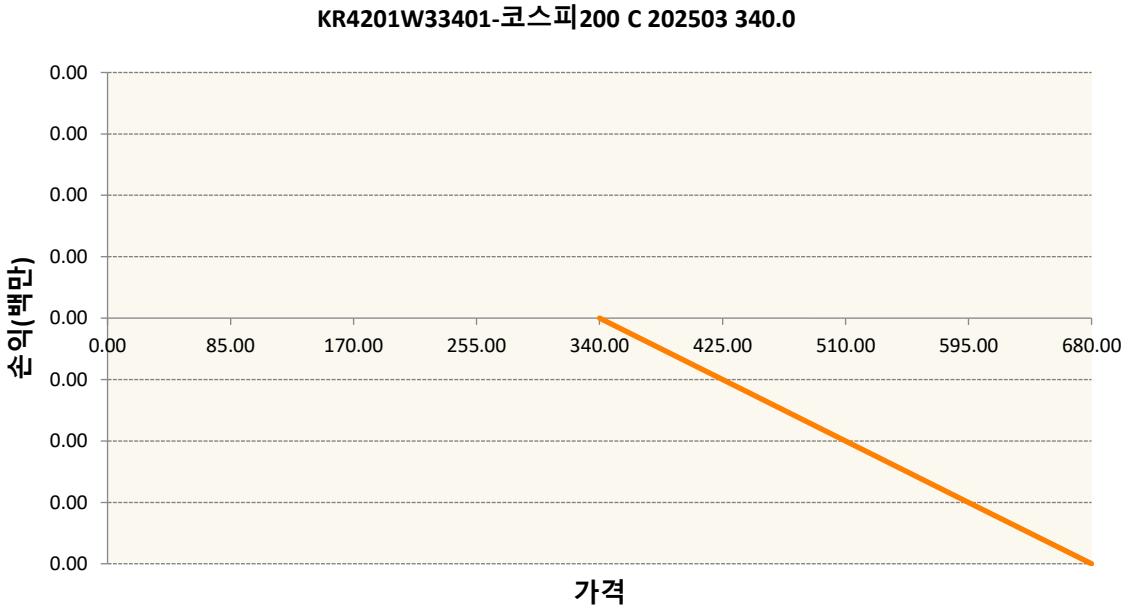
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

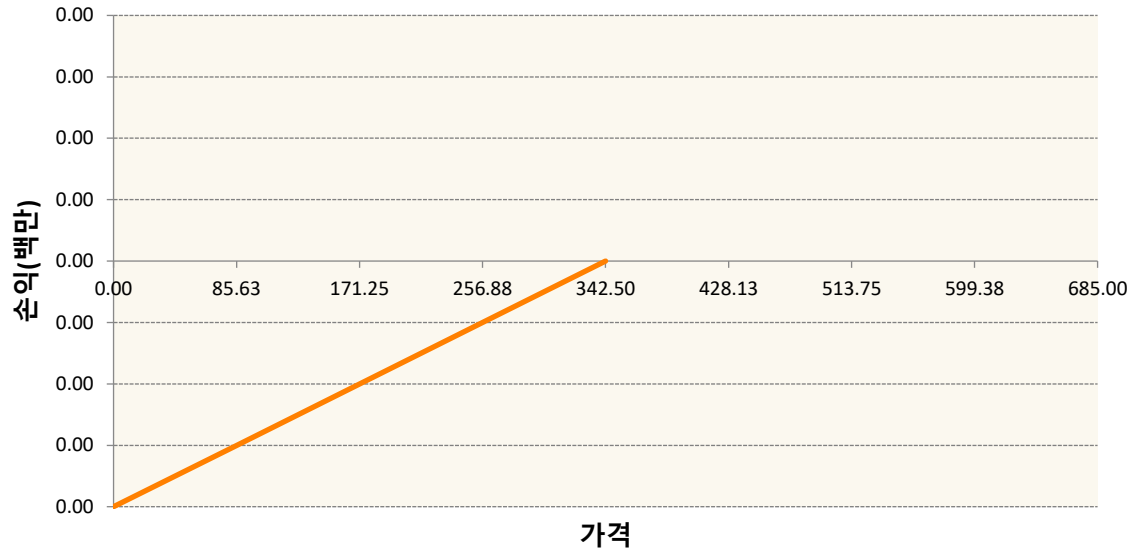
(단위:백만원)

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								1,564
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	702	691	678	663	646	627	606	
-5.33%	635	610	583	555	526	497	466	
-2.67%	447	411	376	340	305	269	234	
0%	95	64	32	0	-33	-66	-100	
2.67%	-392	-409	-429	-451	-474	-500	-526	
5.33%	-950	-956	-965	-976	-989	-1,005	-1,022	
8.00%	-1,531	-1,533	-1,536	-1,540	-1,546	-1,554	-1,564	
KR4201W33427 코스피200 C 202503 342.5								675
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	270	267	262	257	250	243	235	
-5.33%	249	239	229	218	206	194	182	
-2.67%	182	167	152	136	121	105	90	
0%	46	31	15	0	-15	-31	-47	
2.67%	-157	-167	-177	-188	-200	-213	-226	
5.33%	-399	-403	-408	-414	-421	-430	-439	
8.00%	-656	-657	-659	-662	-665	-669	-675	
KR4301W33425 코스피200 P 202503 342.5								378
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-364	-365	-367	-369	-371	-374	-378	
-5.33%	-197	-201	-206	-211	-217	-223	-230	
-2.67%	-59	-67	-76	-84	-93	-101	-110	
0%	25	17	8	0	-9	-17	-26	

2.67%	58	54	49	43	38	31	25
5.33%	66	64	63	60	58	54	50
8.00%	67	67	66	65	64	63	61

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

(단위:백만원)

2,772

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

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	674	0	674	

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	2025-02-26
기준일	2025-02-25

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	4,450	0	4,450	

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	2025-02-26
기준일	2025-02-25

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	13,150	0	13,150	
누계	통화	선도	0	12,945	-12,945	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E		555
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)
	439

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

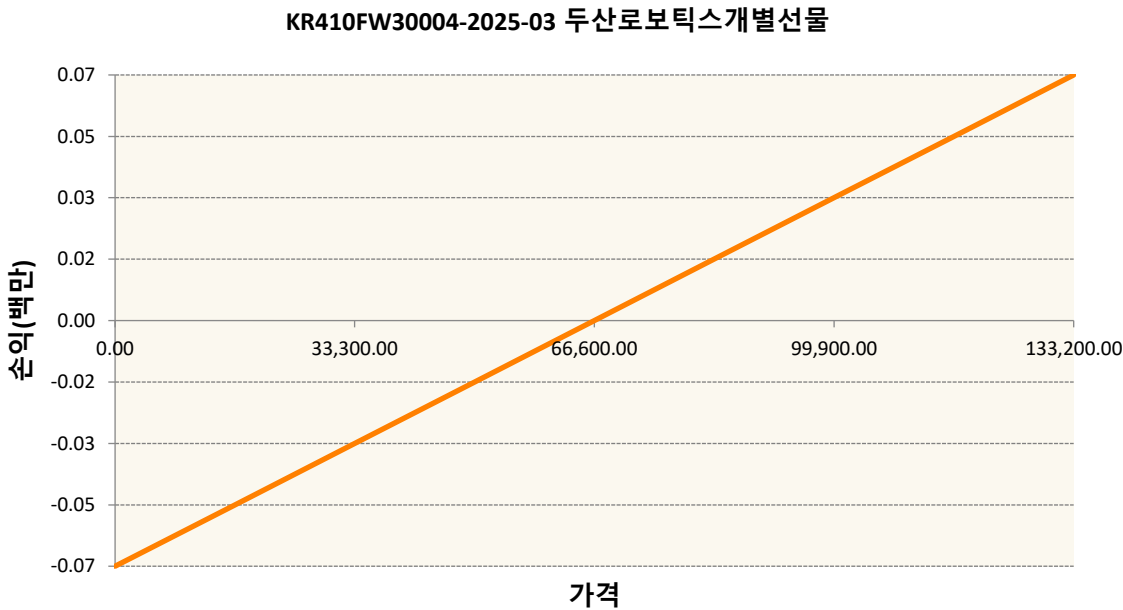
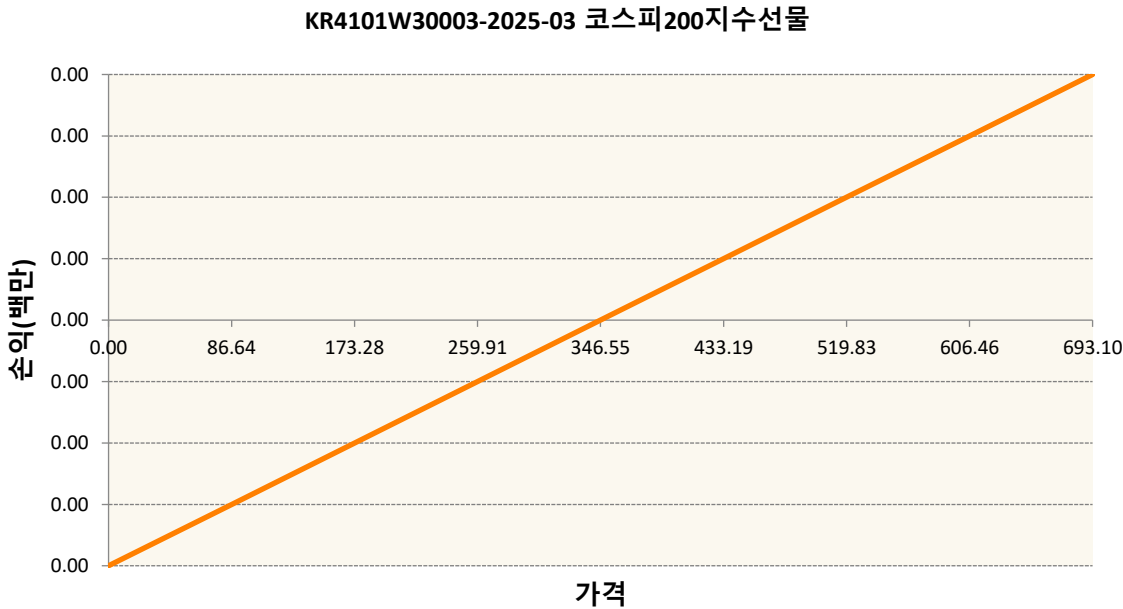
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

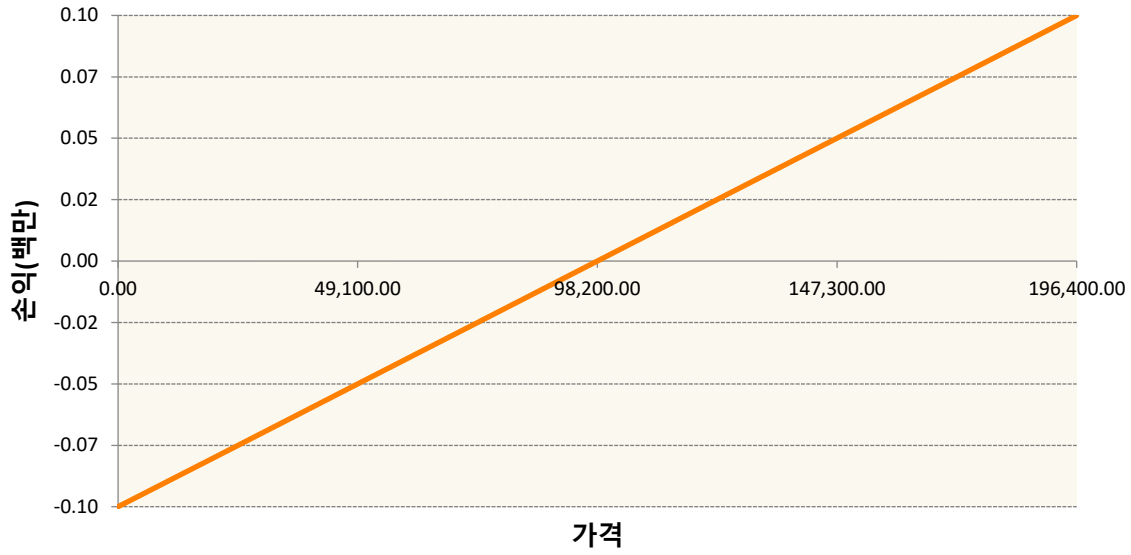
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,241	0	1,241	장내

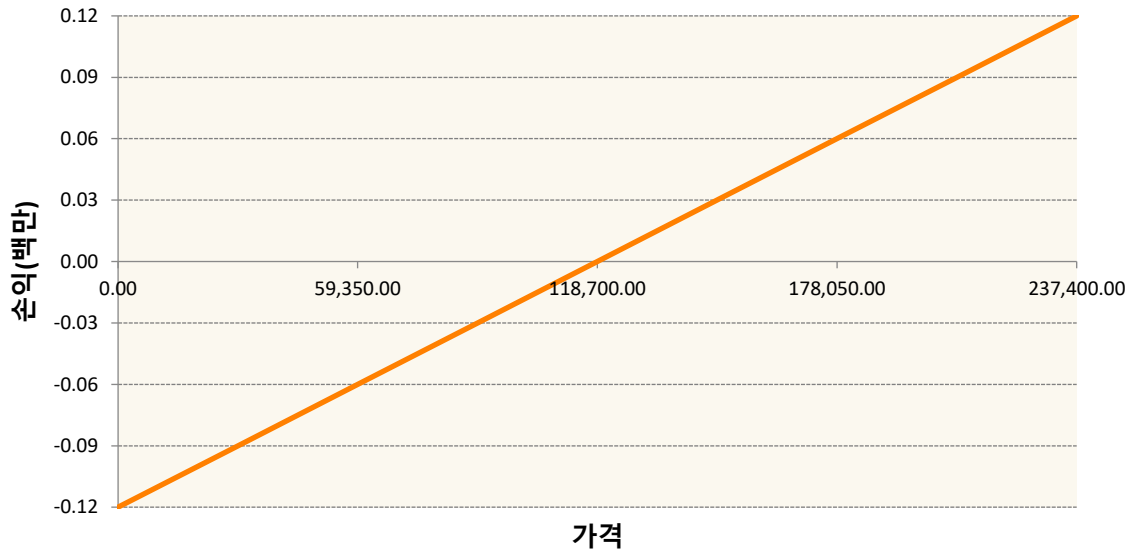
2. 만기시점의 손익구조



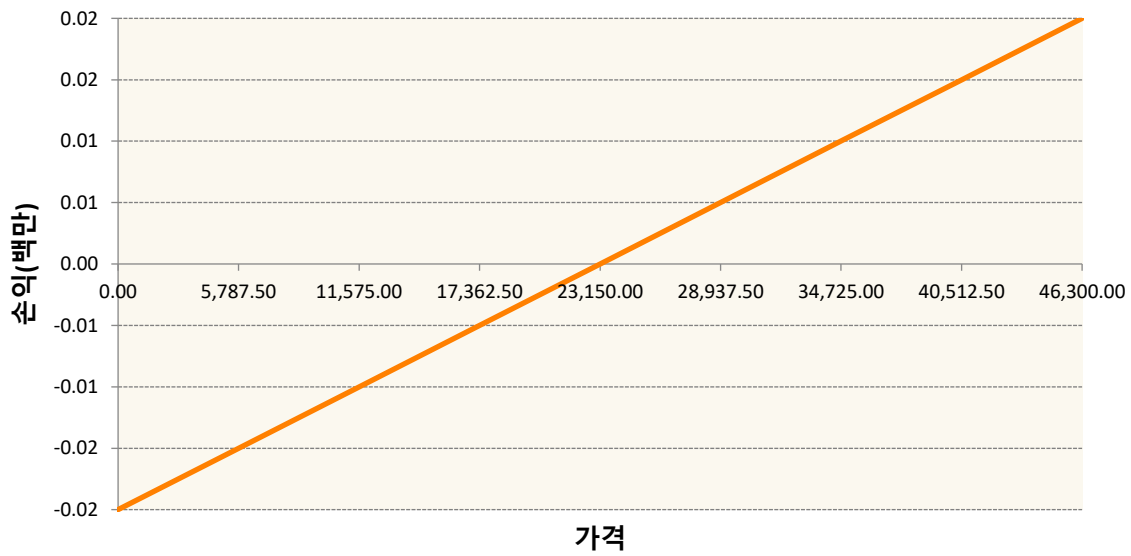
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



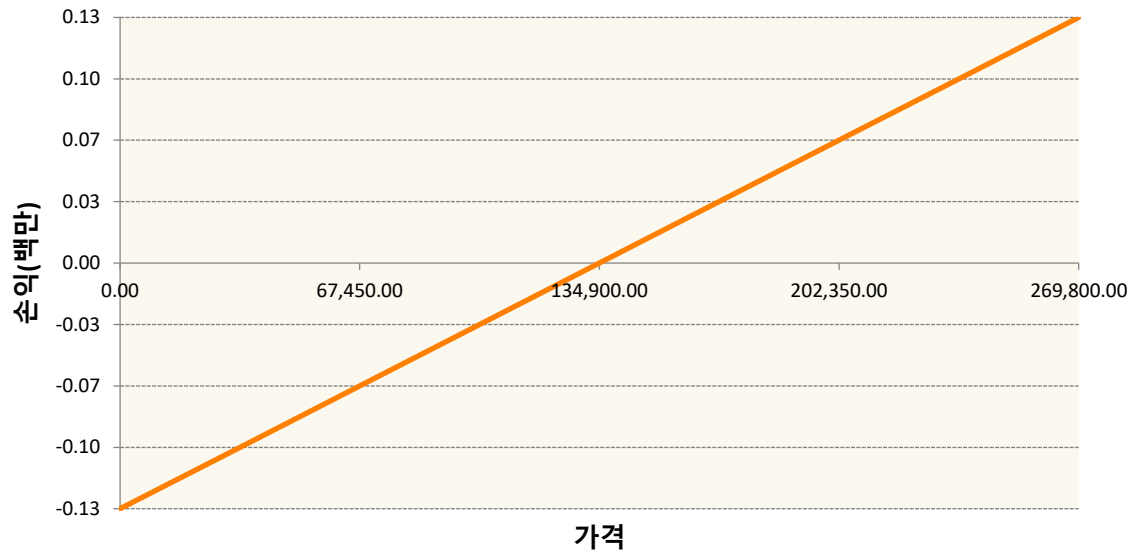
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



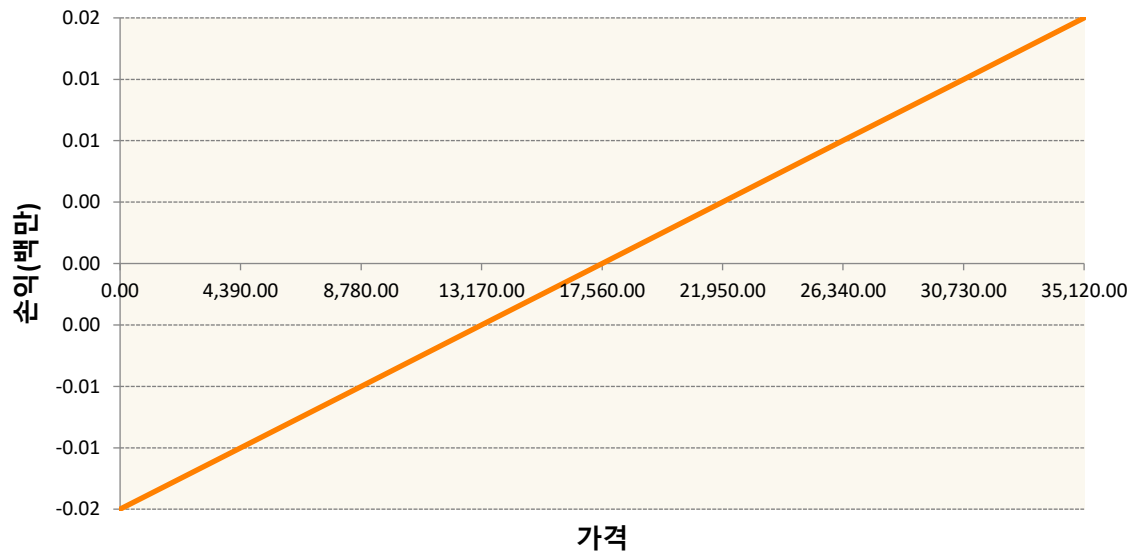
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



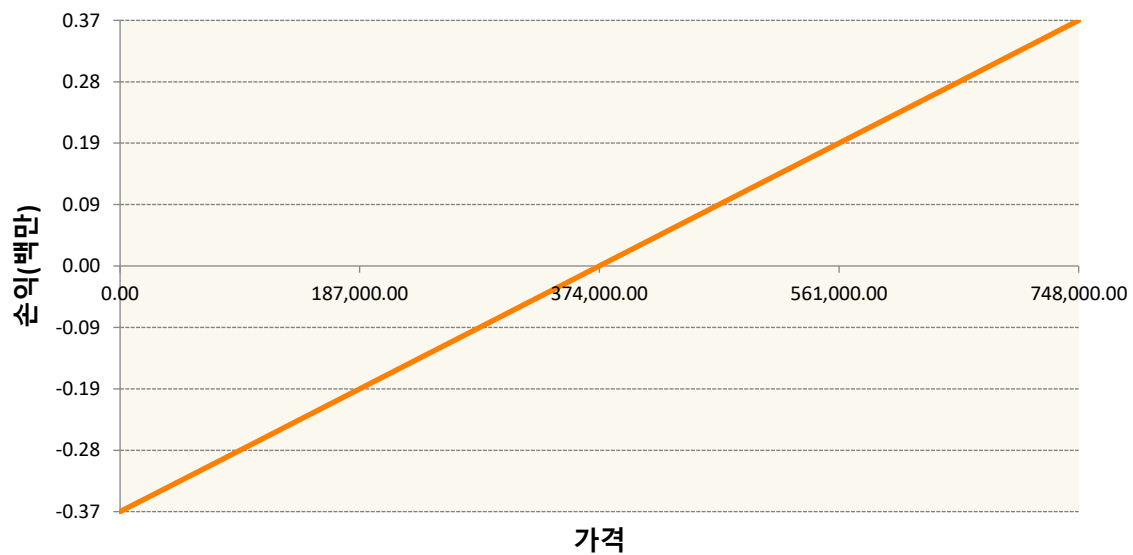
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



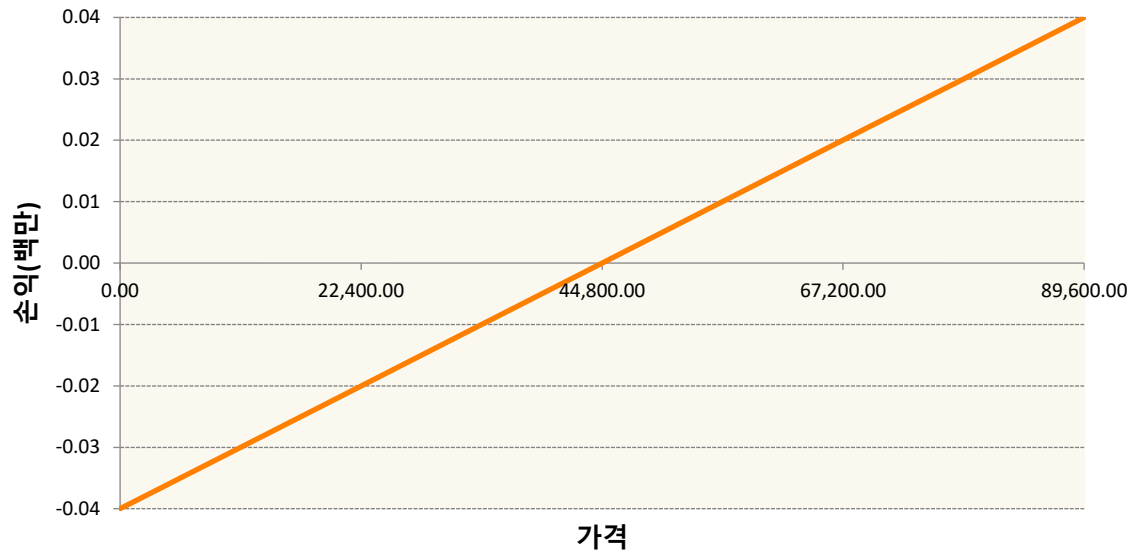
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



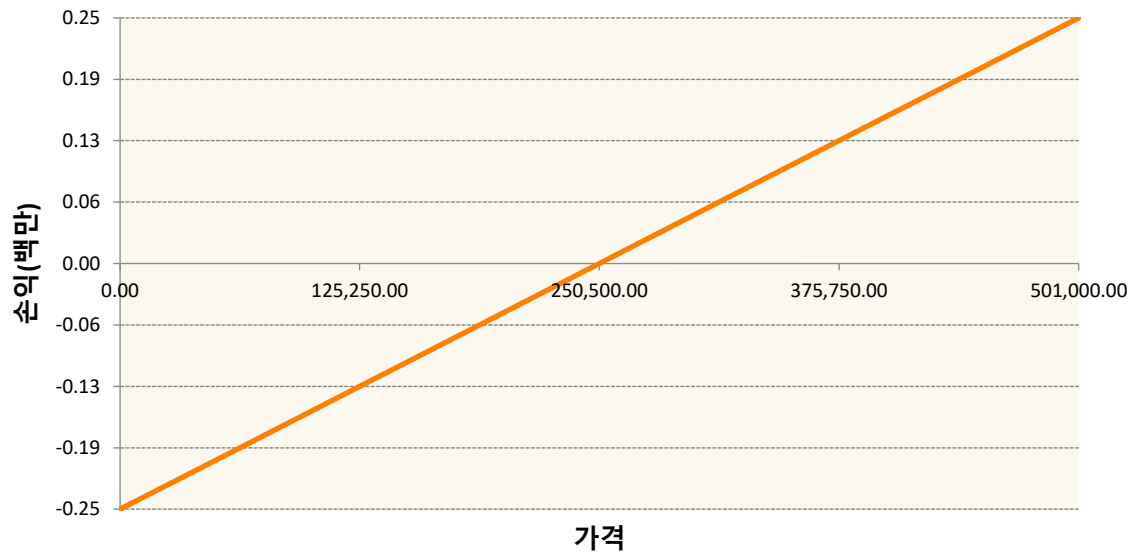
KR41F5W30008-2025-03 LG에너지솔루션개별선물



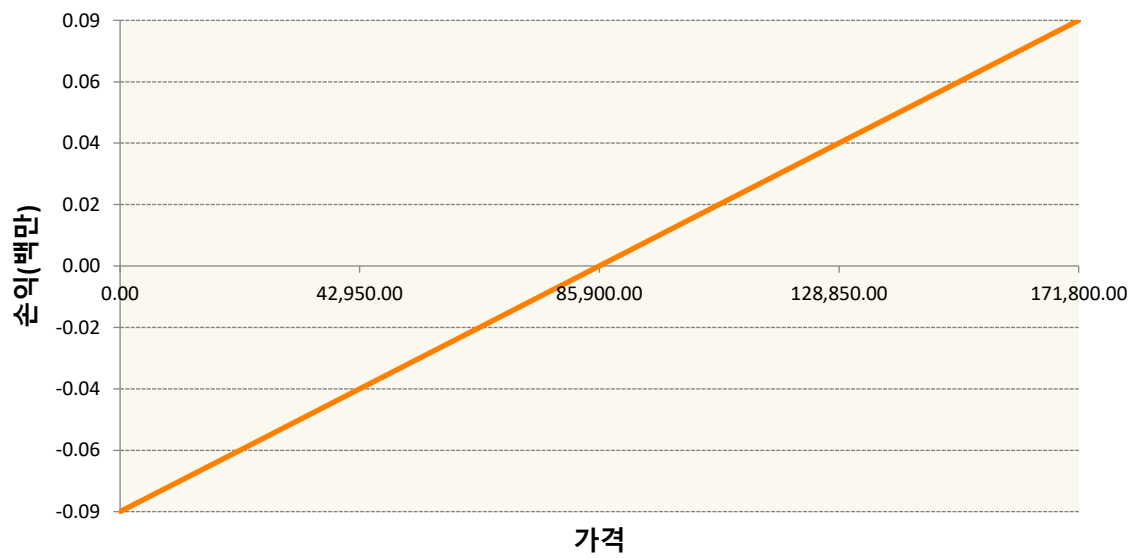
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



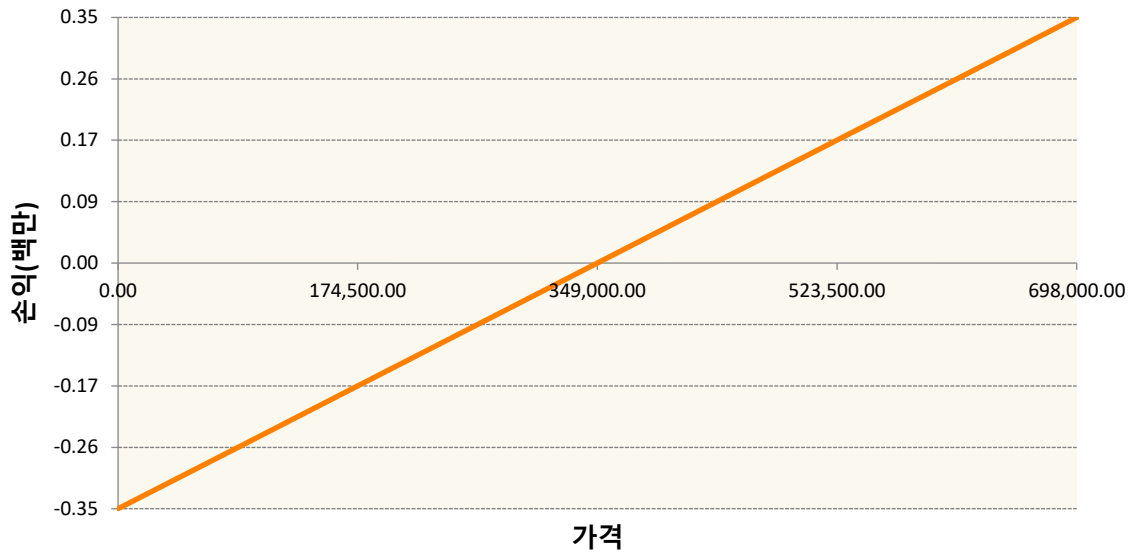
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



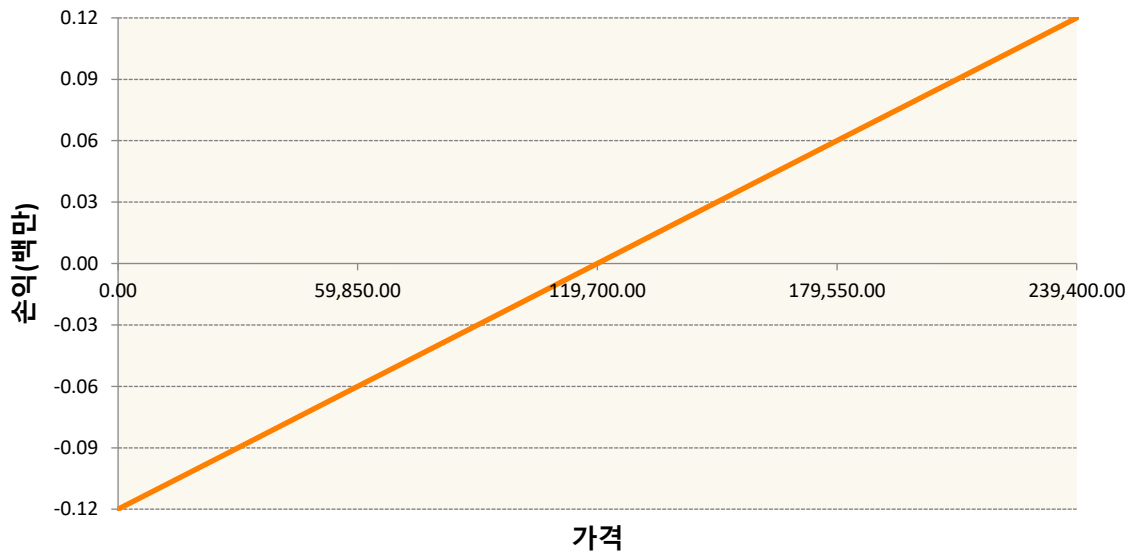
KR41FMW30007-2025-03 엘앤에프개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



KR41HEW30000-2025-03 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	76
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	1
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

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

(단위:백만원)

155

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

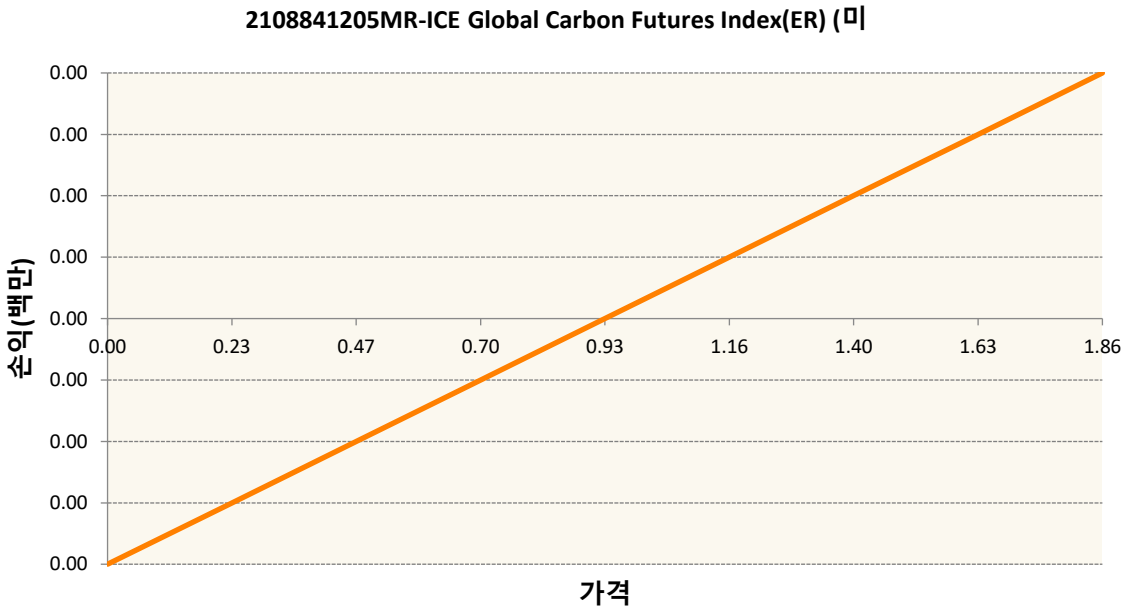
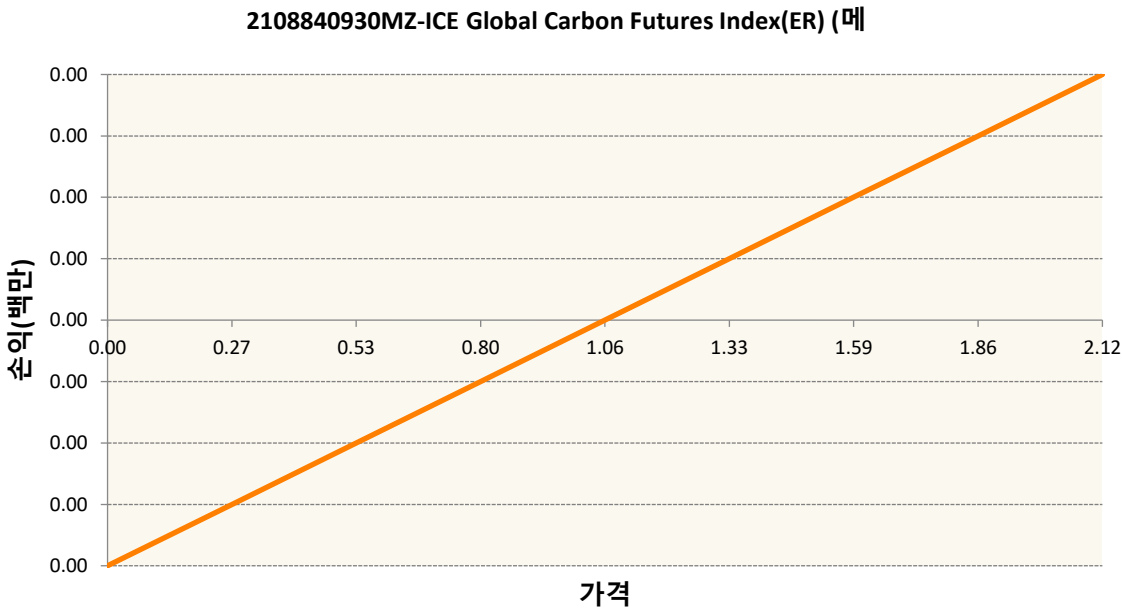
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	189
2108841205	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	565

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	839

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

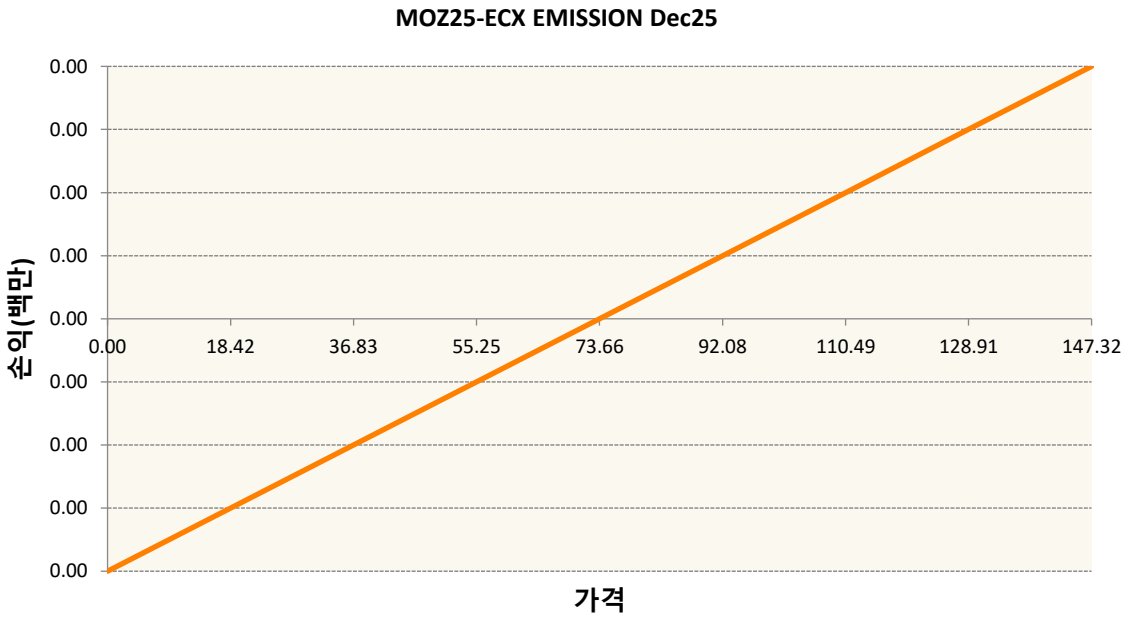
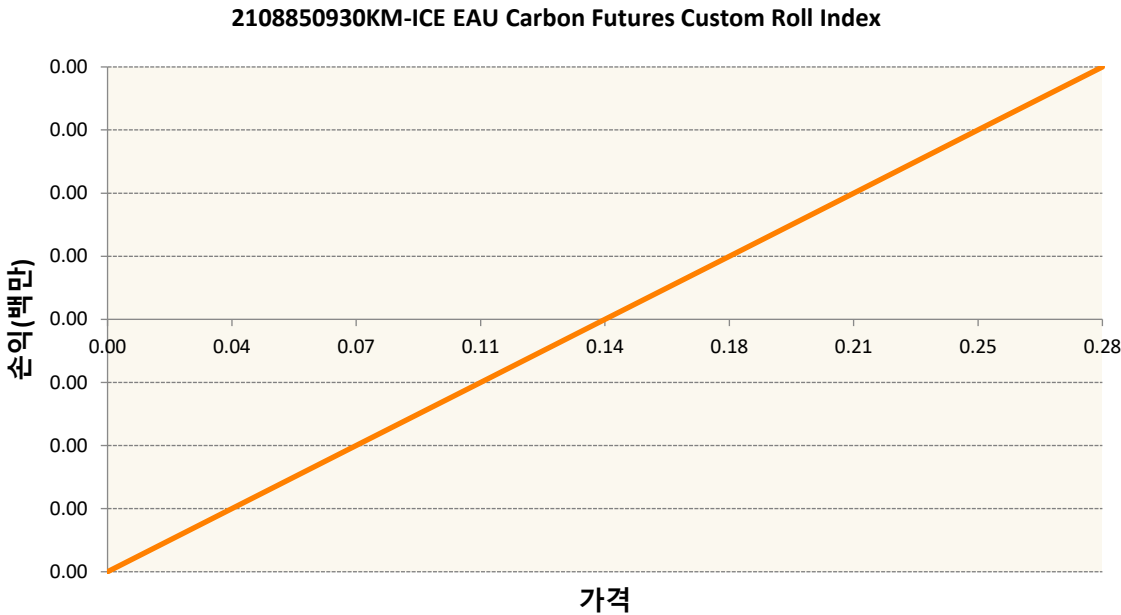
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	9,166	0	9,166	
누계	통화	선도	0	1,574	-1,574	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		729

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,324

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

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	2025-02-26
기준일	2025-02-25

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)	24
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	29
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	21
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	6

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

(단위:백만원)

136

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

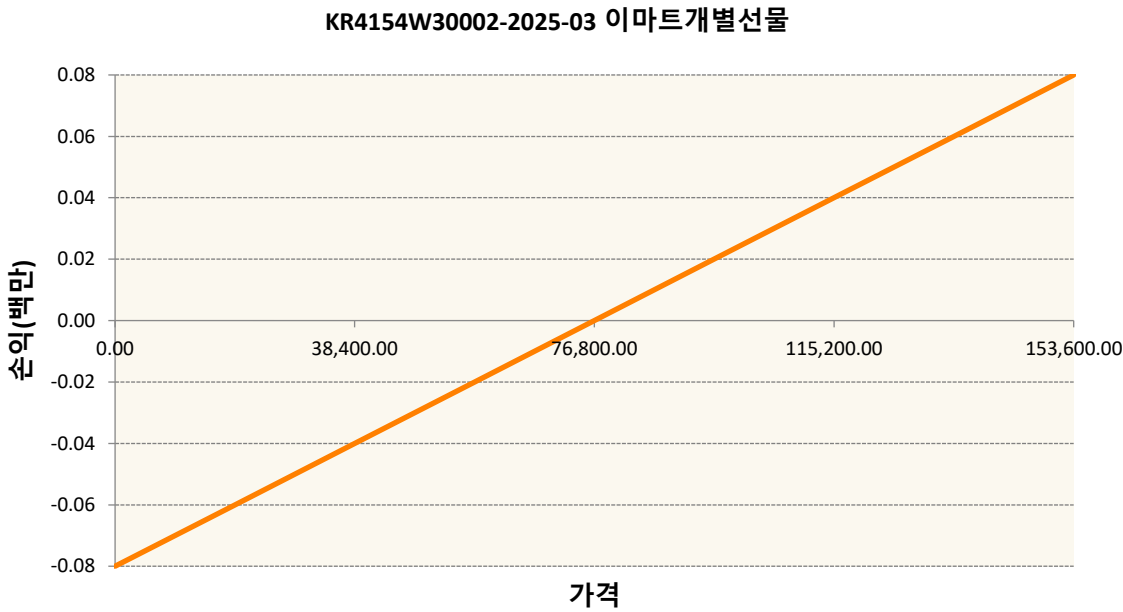
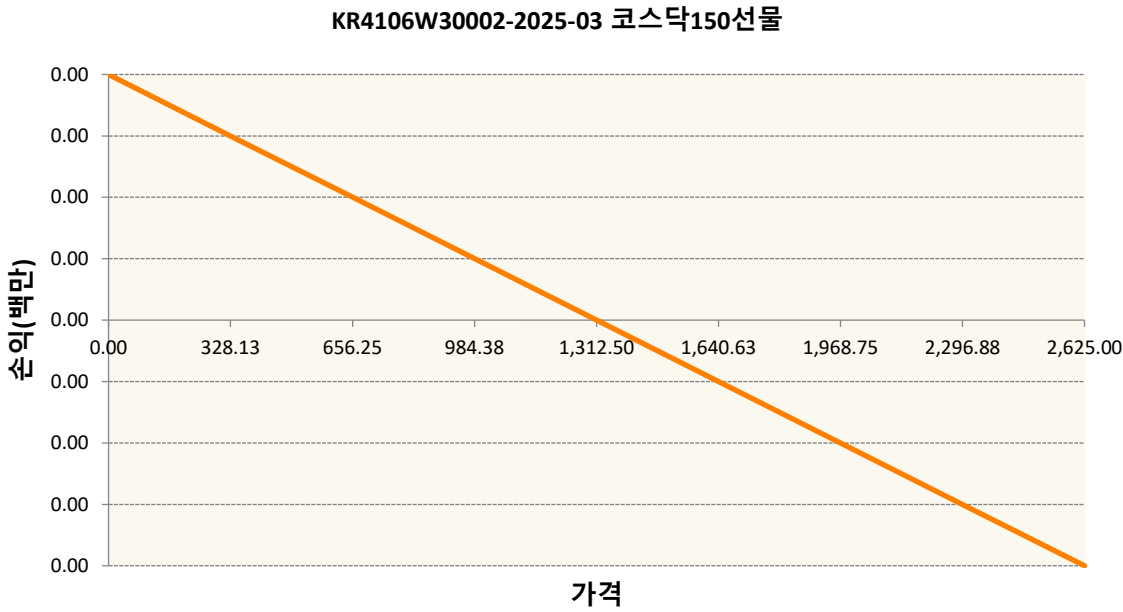
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

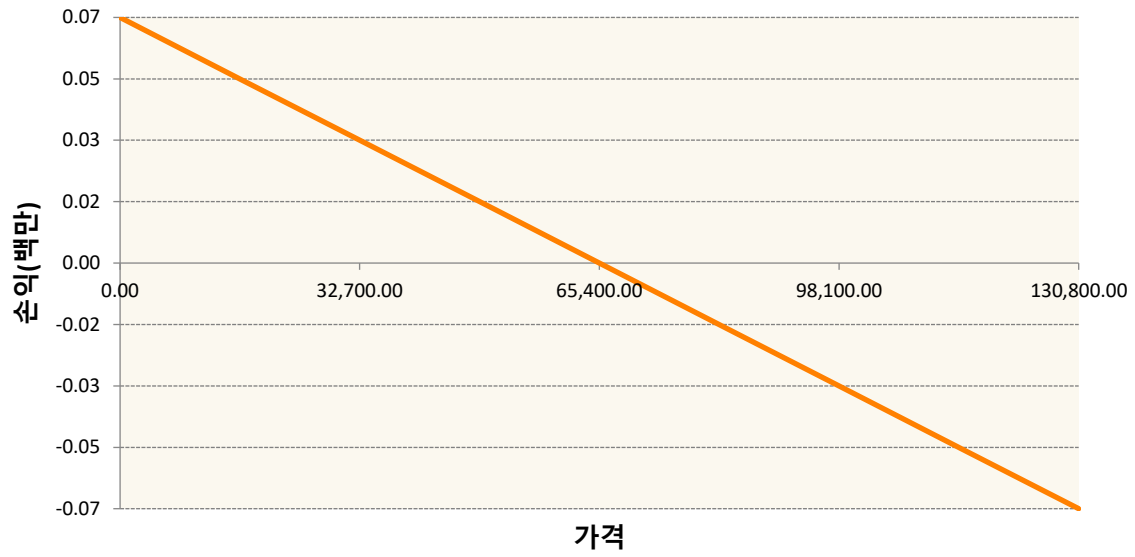
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3	12	-10	장내
누계	유가증권	선물	28	66	-38	장내

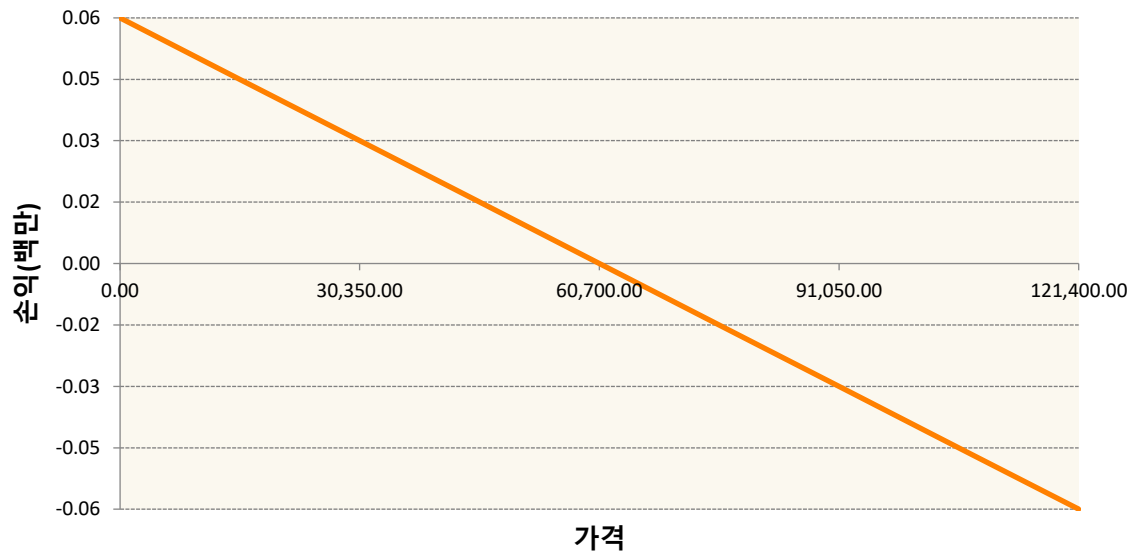
2. 만기시점의 손익구조



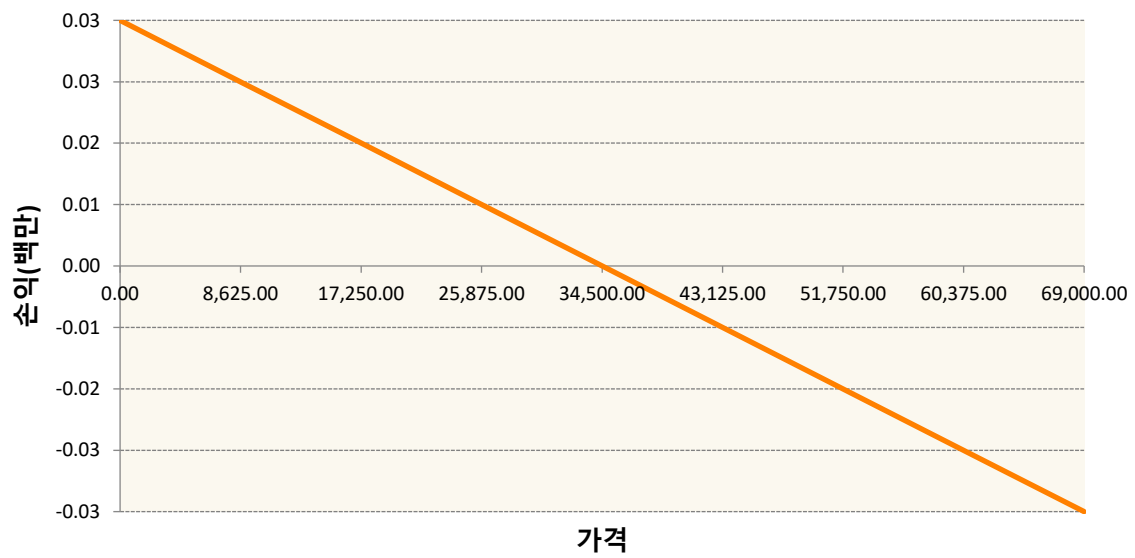
KR41BAW30001-2025-03 롯데쇼핑개별선물



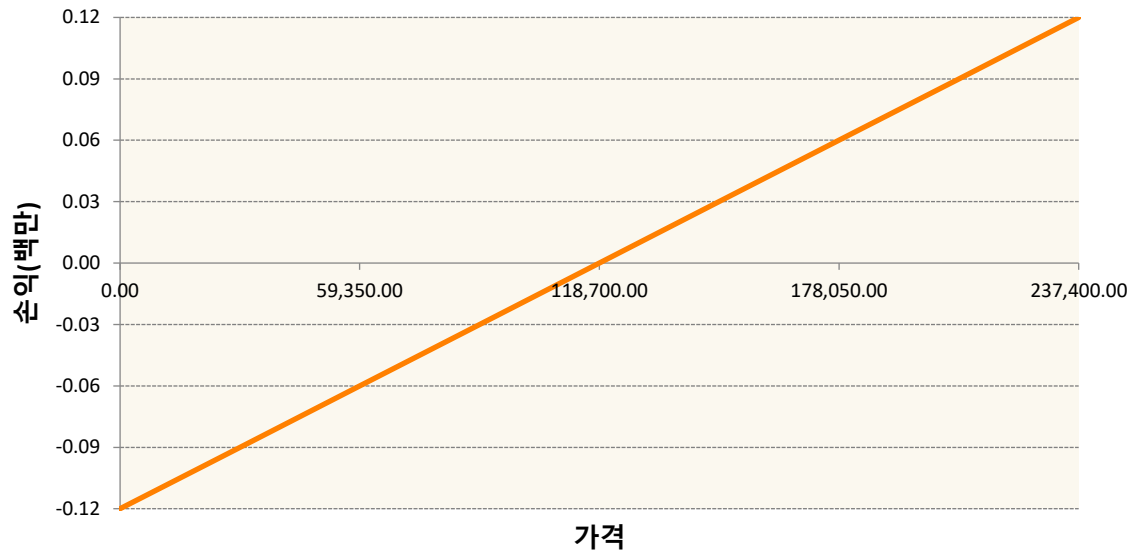
KR41BMW30006-2025-03 한국항공우주개별선물



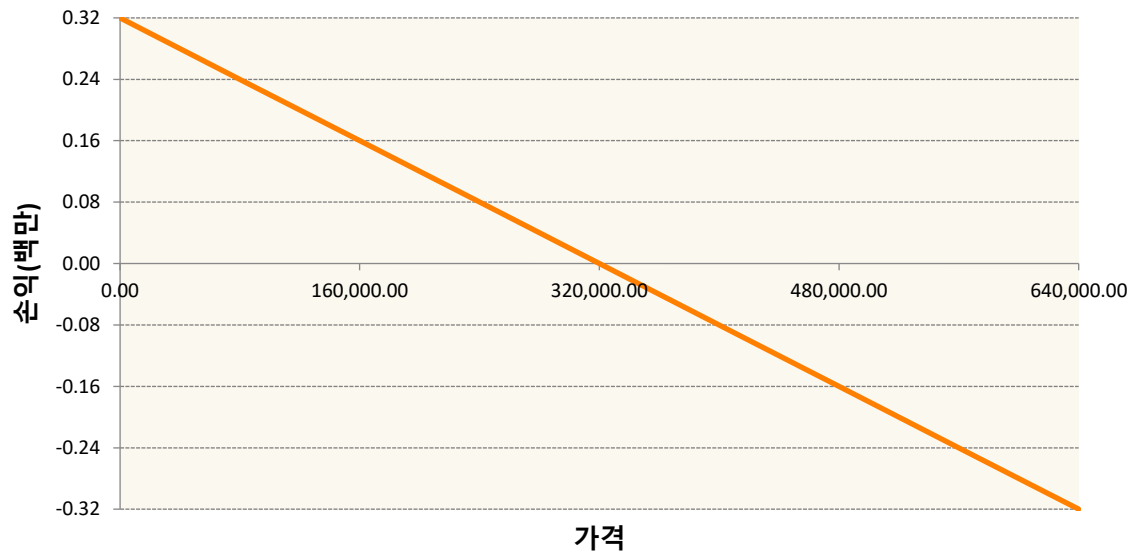
KR41BNW30004-2025-03 현대건설개별선물



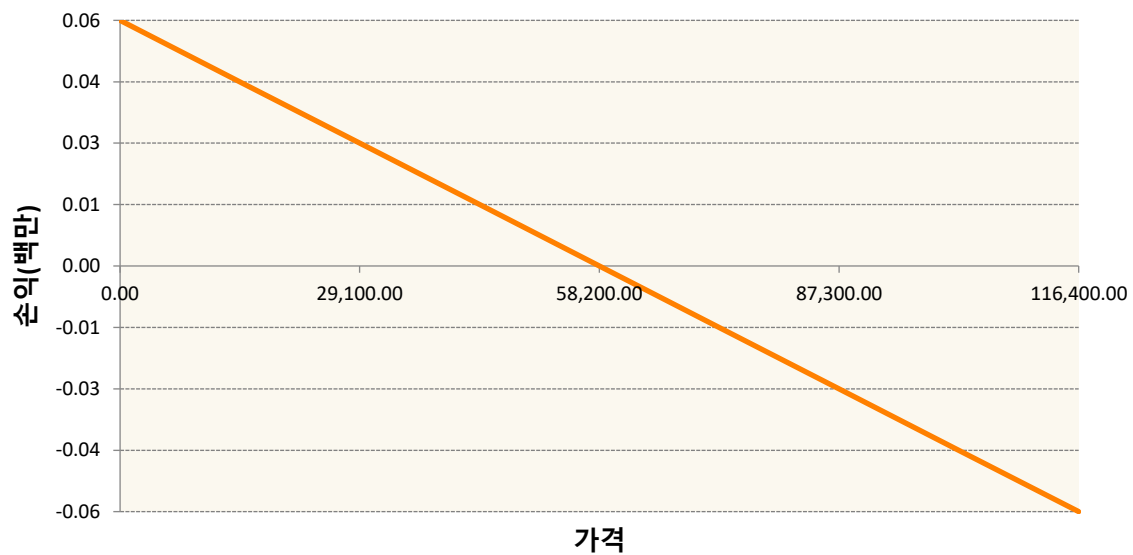
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



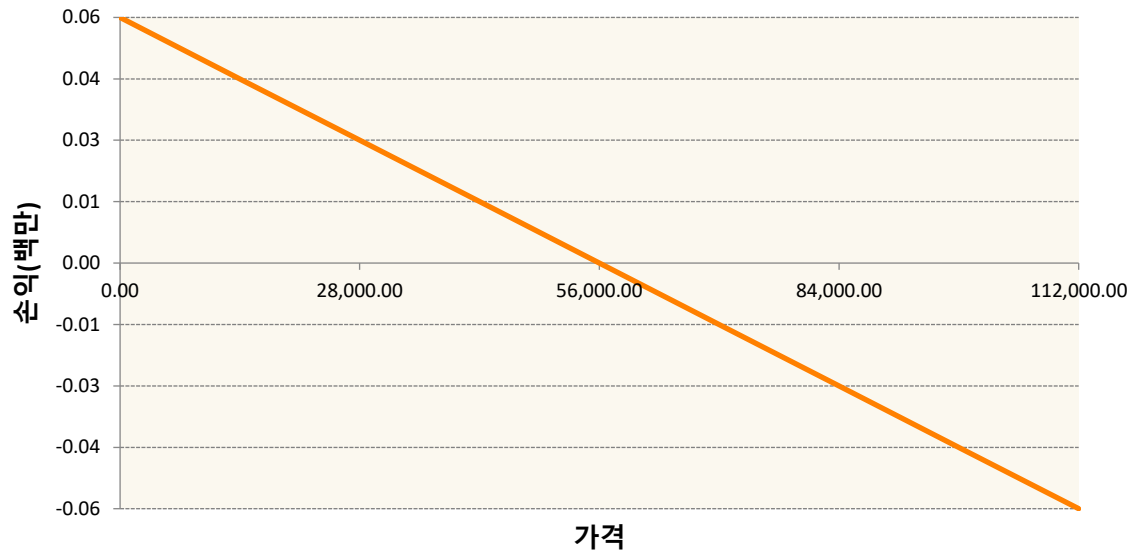
KR41CRW30003-2025-03 LG생활건강개별선물



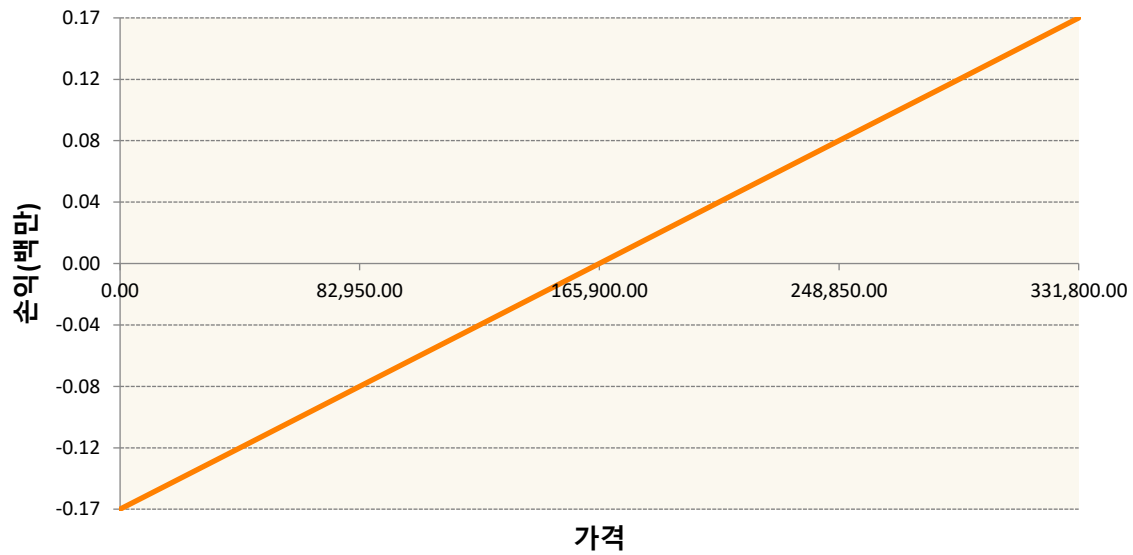
KR41D8W30004-2025-03 현대백화점개별선물



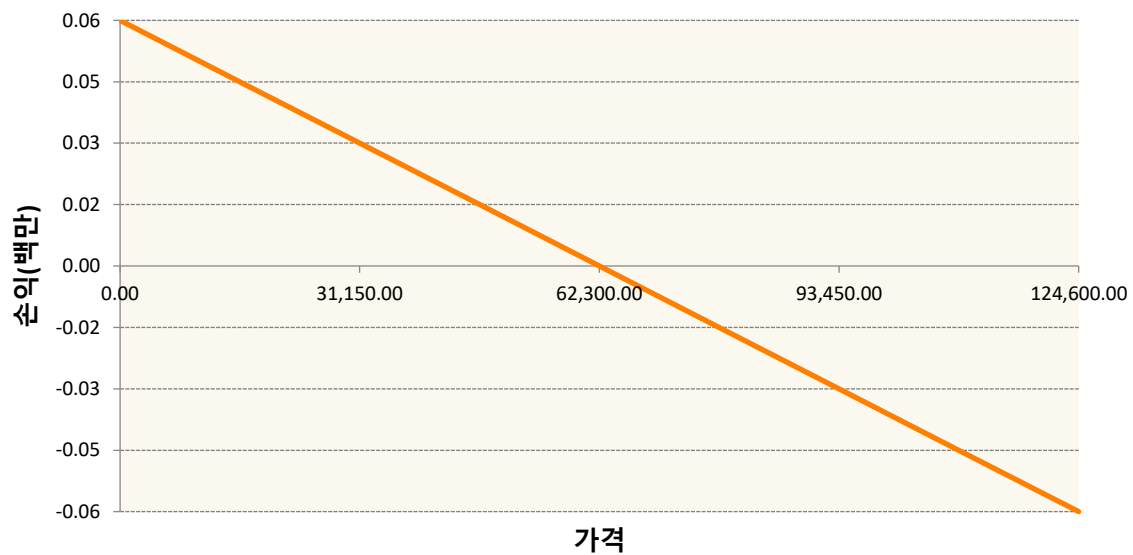
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물

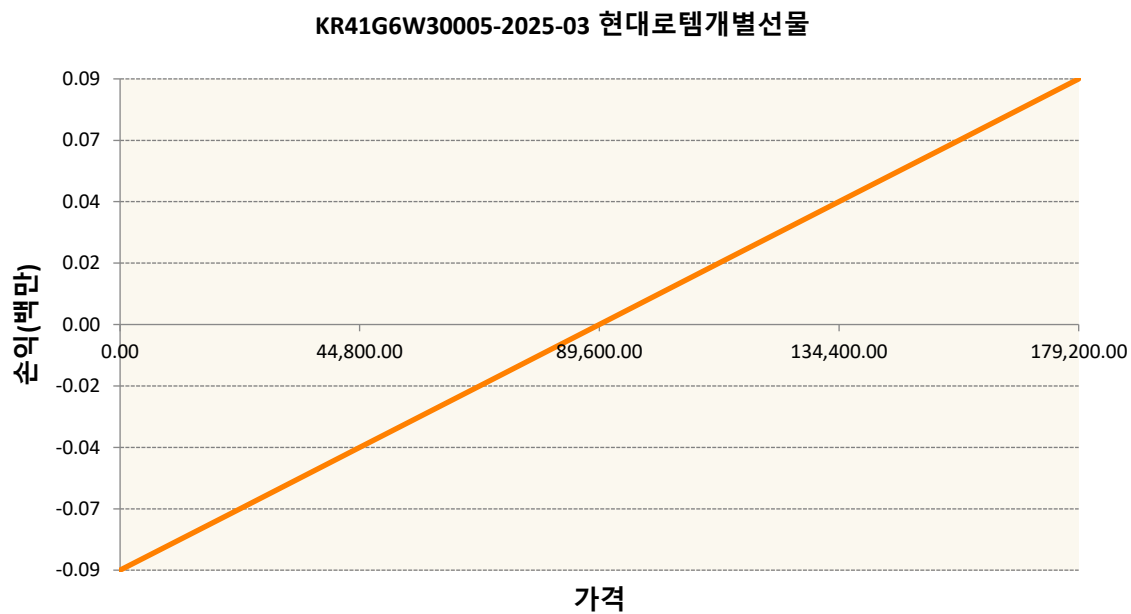
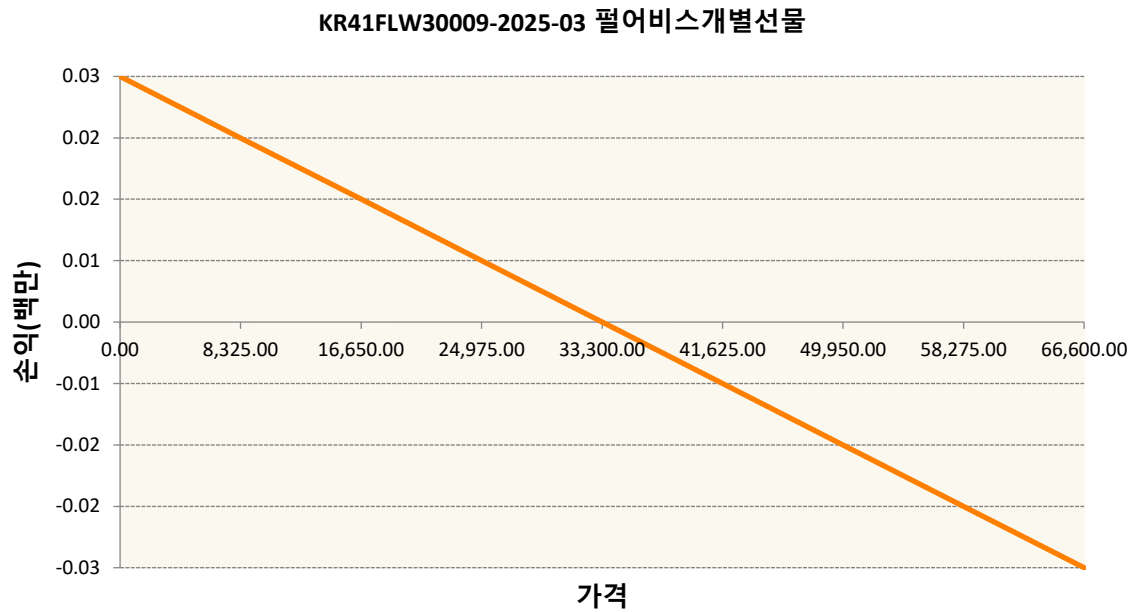


KR41DKW30006-2025-03 코스맥스개별선물



KR41DTW30007-2025-03 CJ ENM개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4106W30(2025-03 코스닥150선물		1
KR4154W30(2025-03 이마트개별선물		0.37
KR41BAW30(2025-03 롯데쇼핑개별선물		1
KR41BMW30(2025-03 한국항공우주개별선물		0.24
KR41BNW30(2025-03 현대건설개별선물		0.28
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물		1
KR41CRW30(2025-03 LG생활건강개별선물		1
KR41D8W30(2025-03 현대백화점개별선물		0.05
KR41DEW30(2025-03 한국콜마개별선물		1
KR41DKW30(2025-03 코스맥스개별선물		1
KR41DTW30(2025-03 CJ ENM개별선물		1
KR41FLW30(2025-03 펄어비스개별선물		0.29

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

(단위:백만원)

16

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

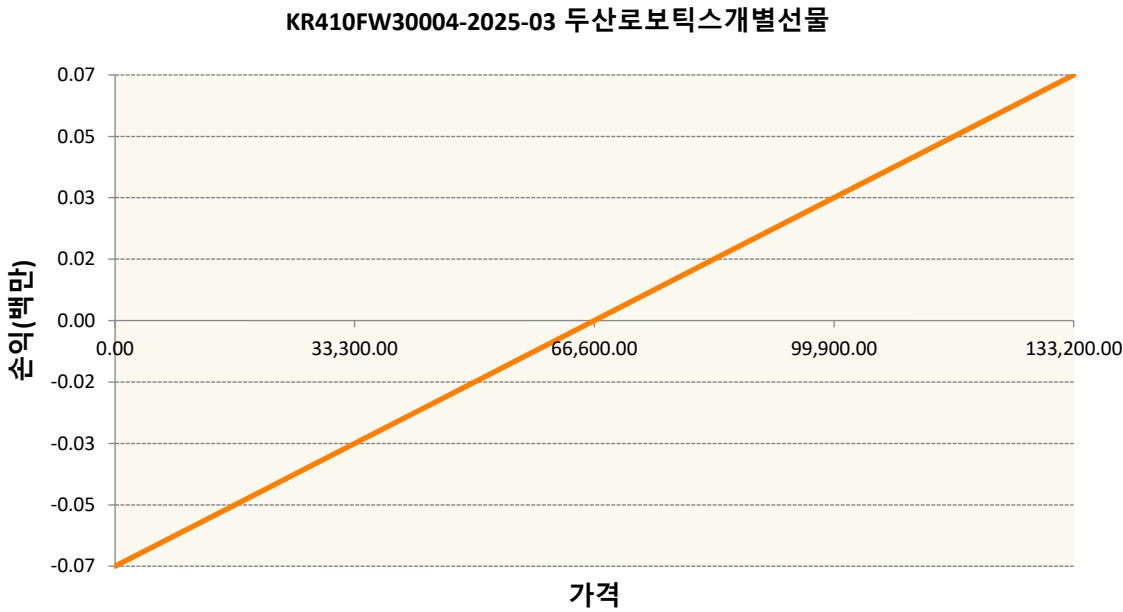
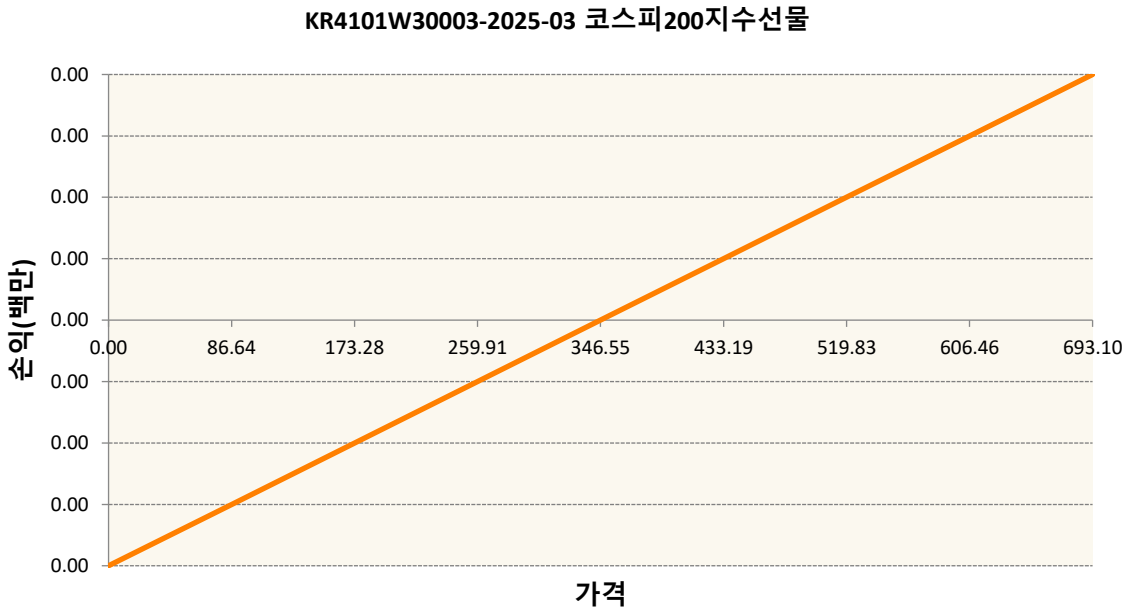
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

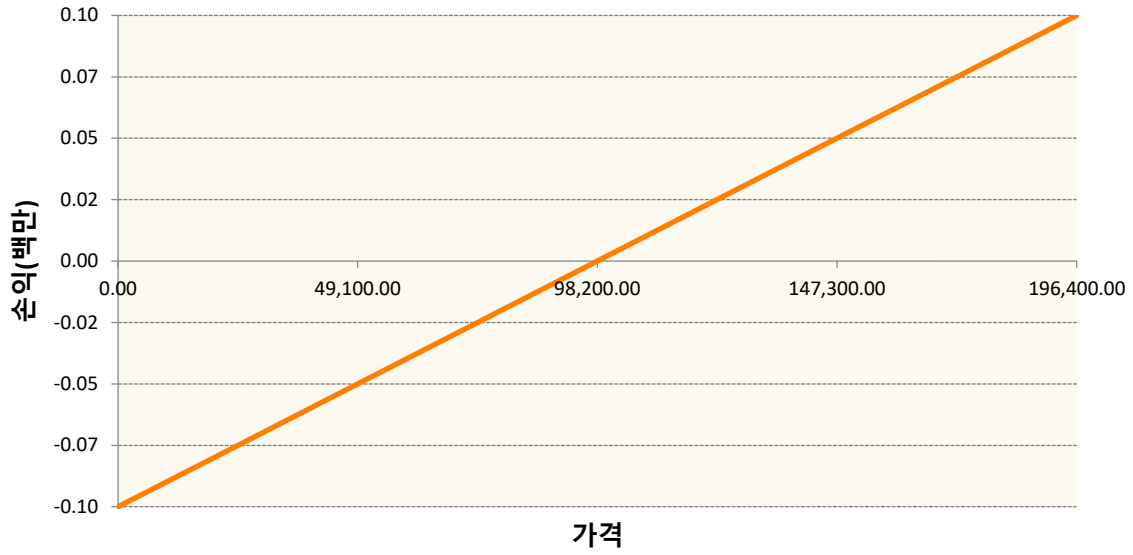
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	866	-866	장내
누계	유가증권	선물	10,597	0	10,597	장내

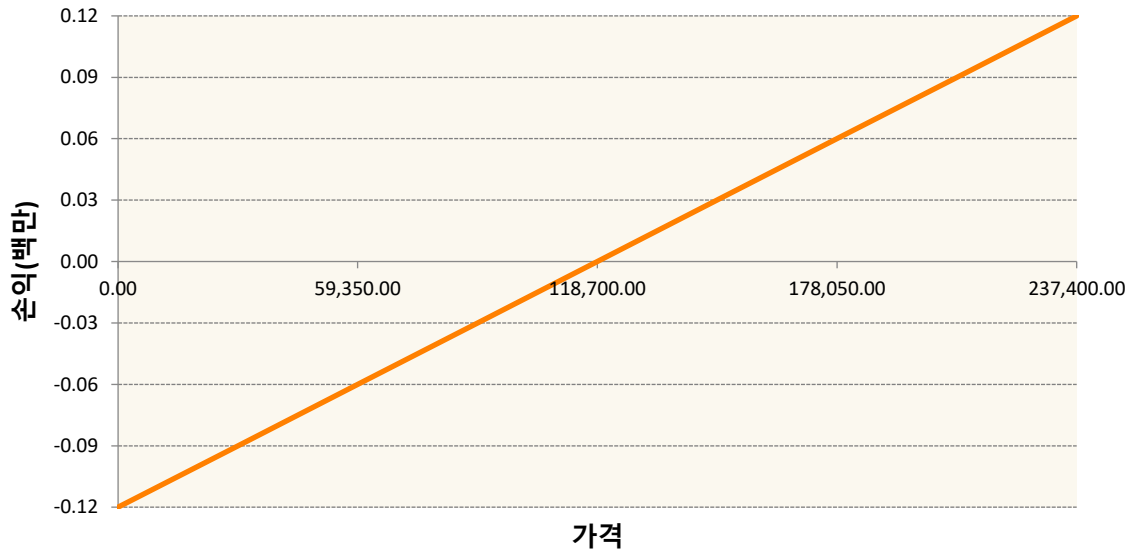
2. 만기시점의 손익구조



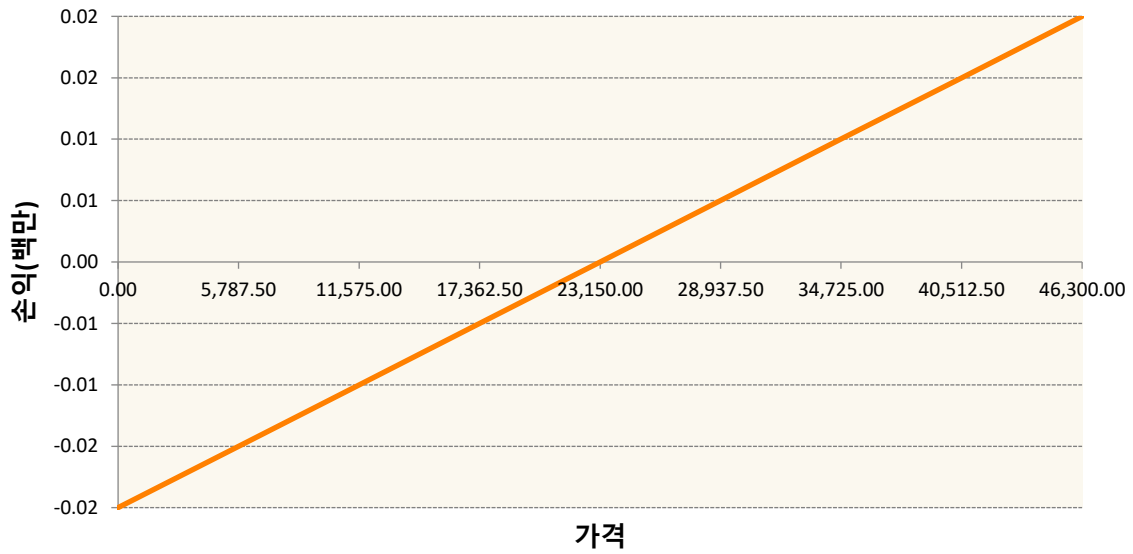
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



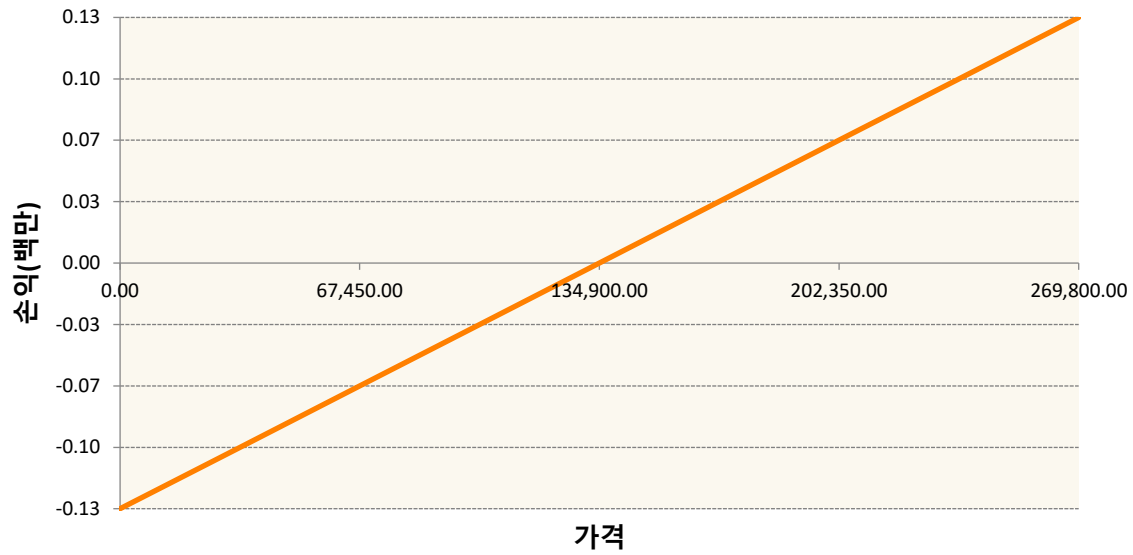
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



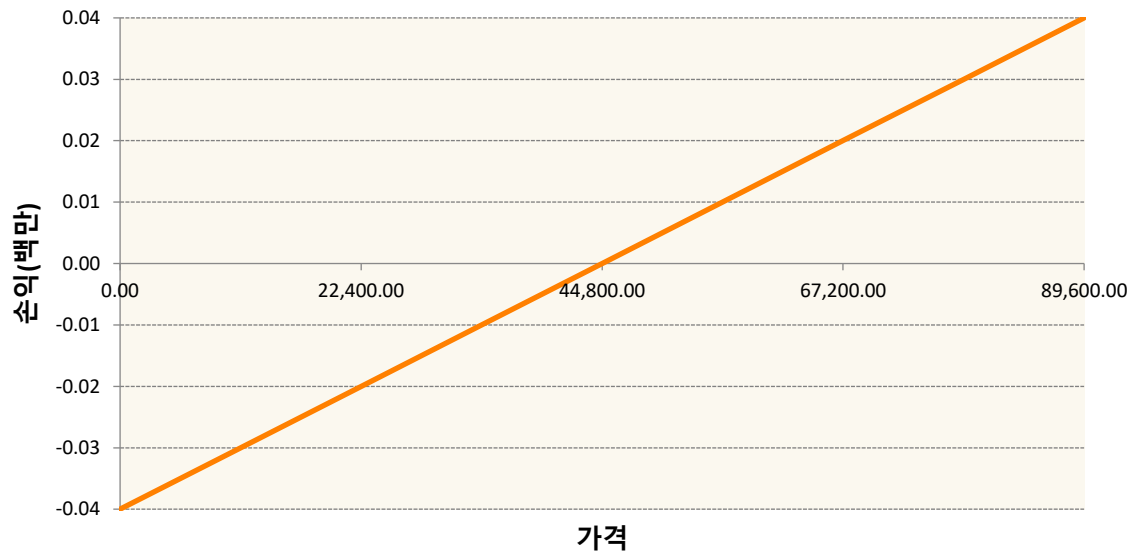
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



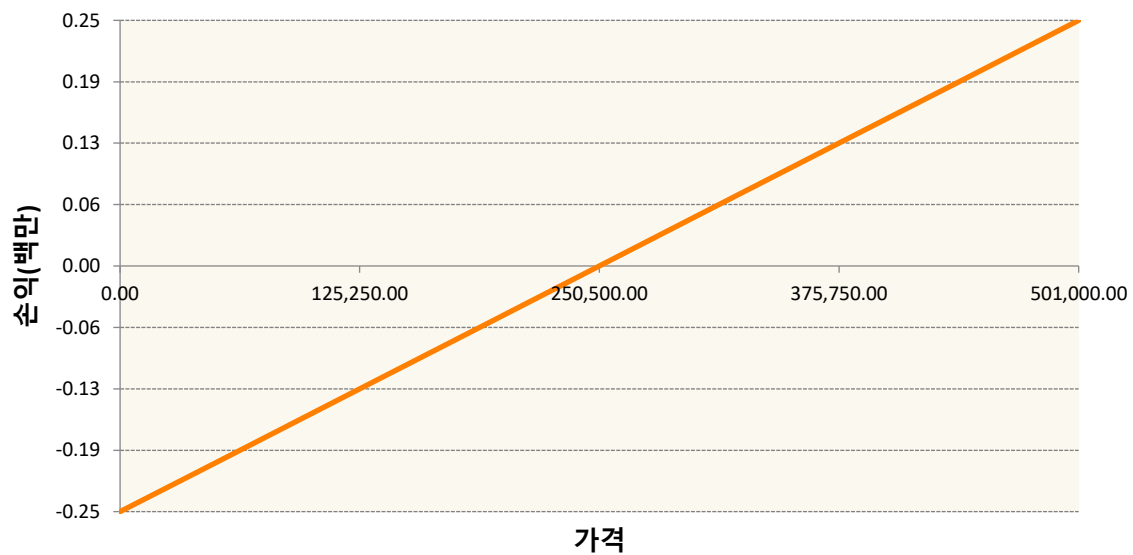
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



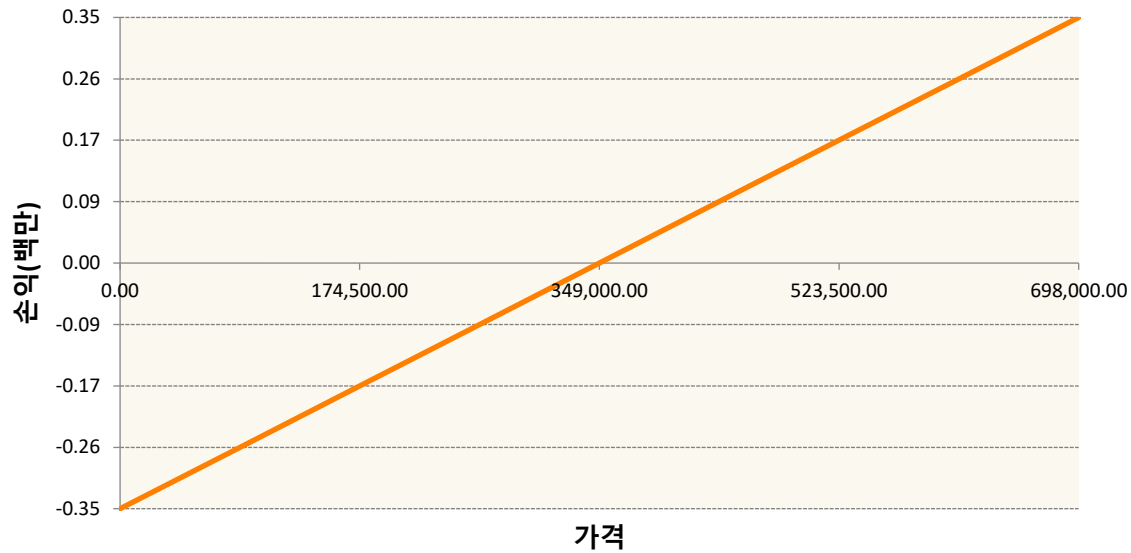
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	589
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	13
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	41
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물	36
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물	11
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	26
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	11
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	51
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	70

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

(단위:백만원)

1,498

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

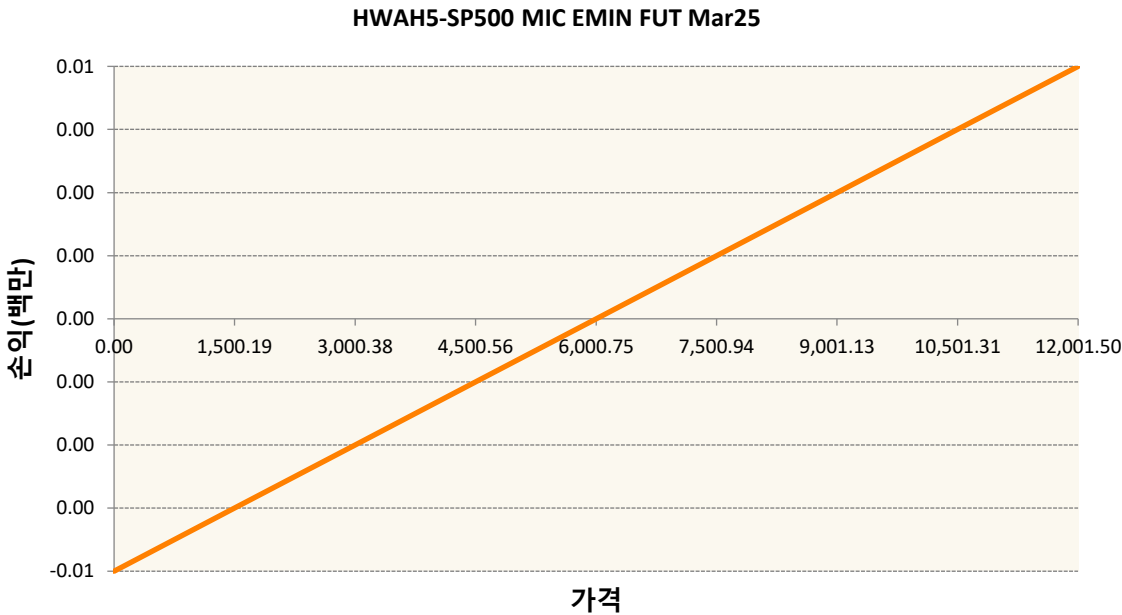
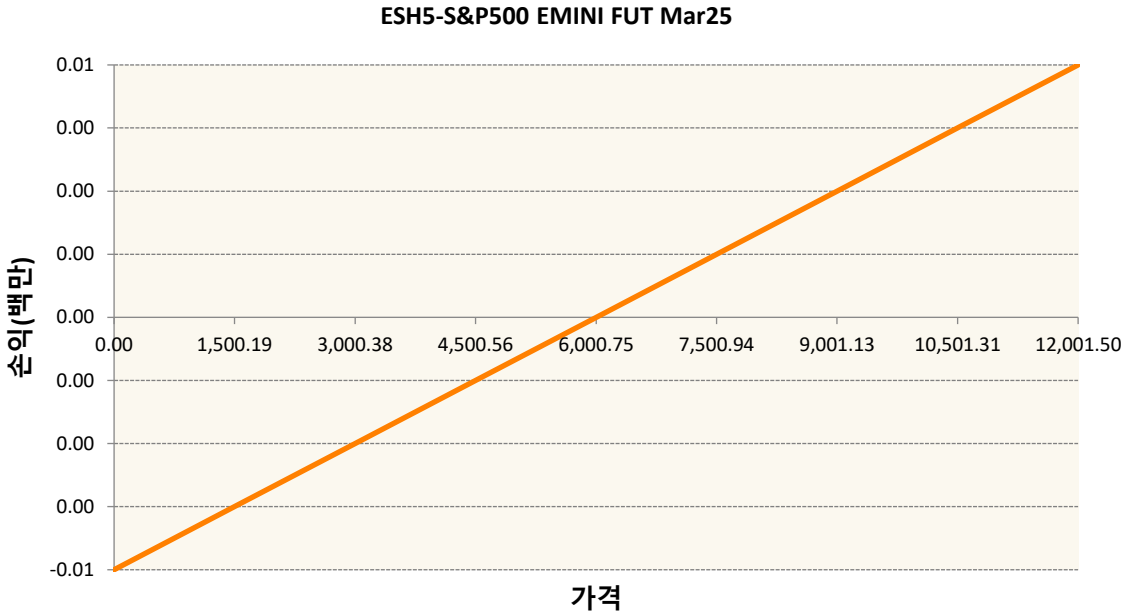
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	30,065	0	30,065	
누계	유가증권	선물	1,262	0	1,262	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,405
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,362

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

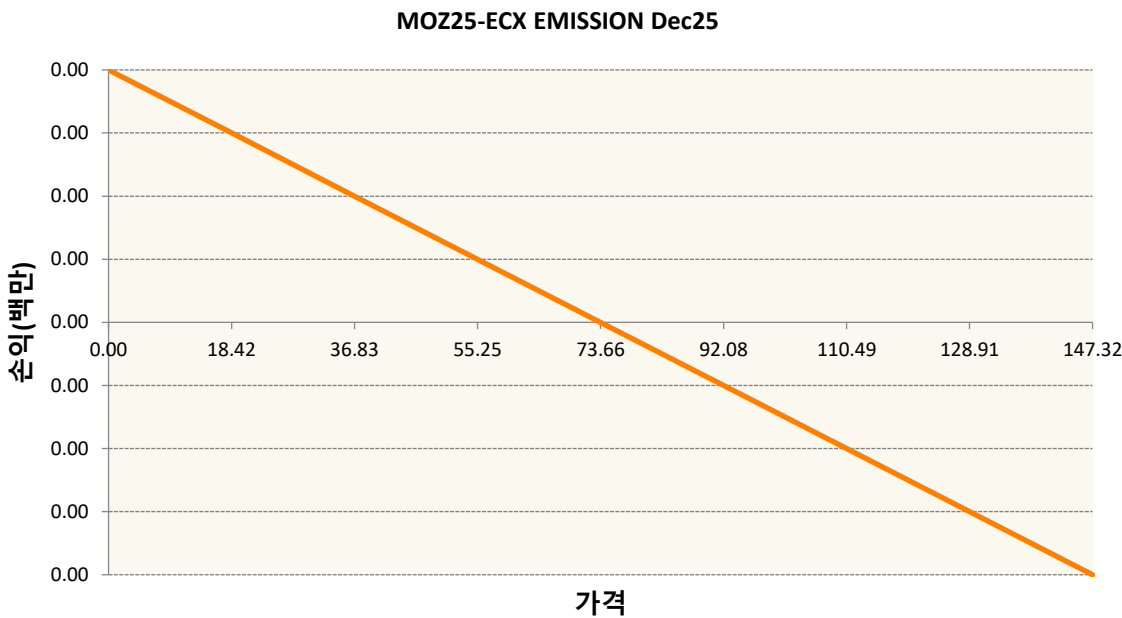
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,104	-5,155	
누계	통화	선도	0	693	-693	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	408

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

(단위:백만원)

735

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

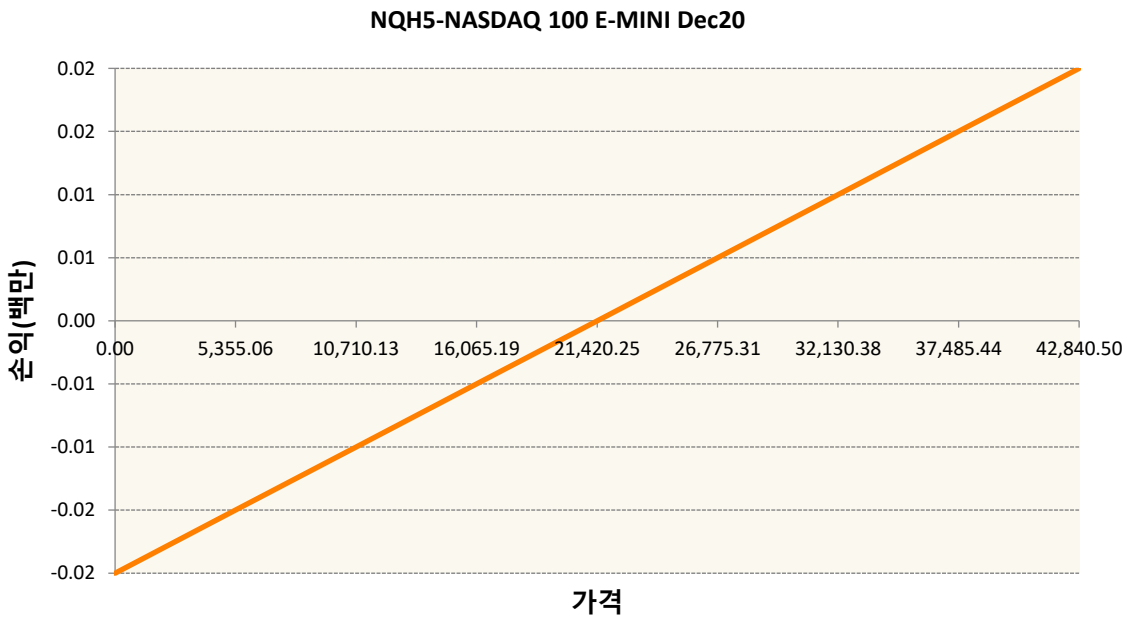
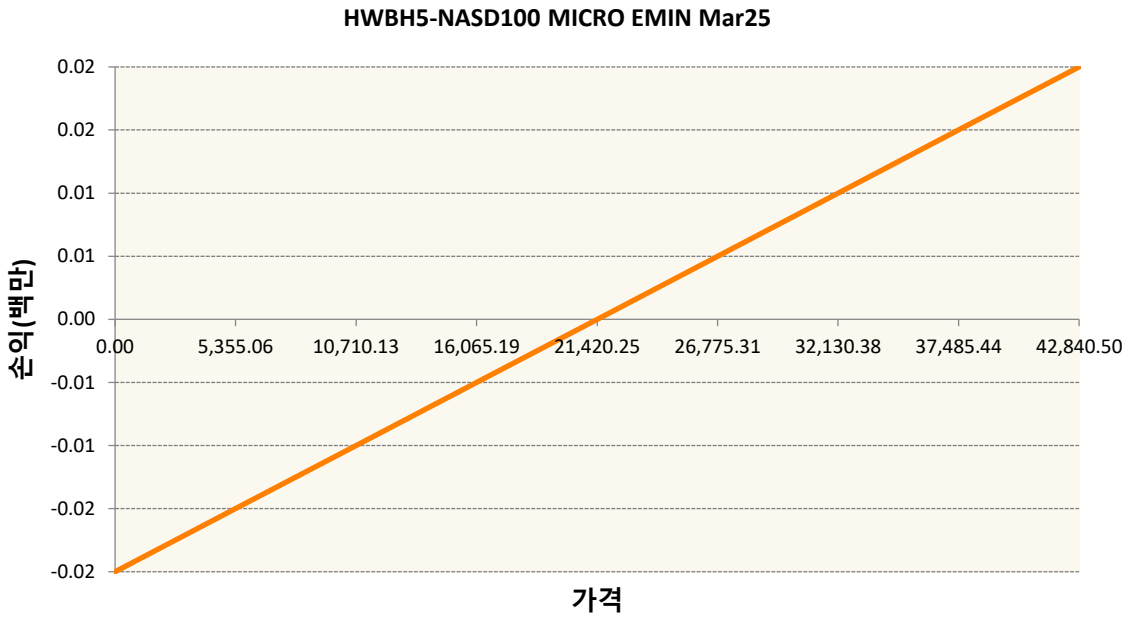
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,940	0	14,940	
누계	유가증권	선물	683	0	683	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	55
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,195

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,103

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

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	722
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,004
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,844
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,181

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

(단위:백만원)

9,330

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

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	8
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8

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

(단위:백만원)

33

공시일	2025-02-26
기준일	2025-02-25

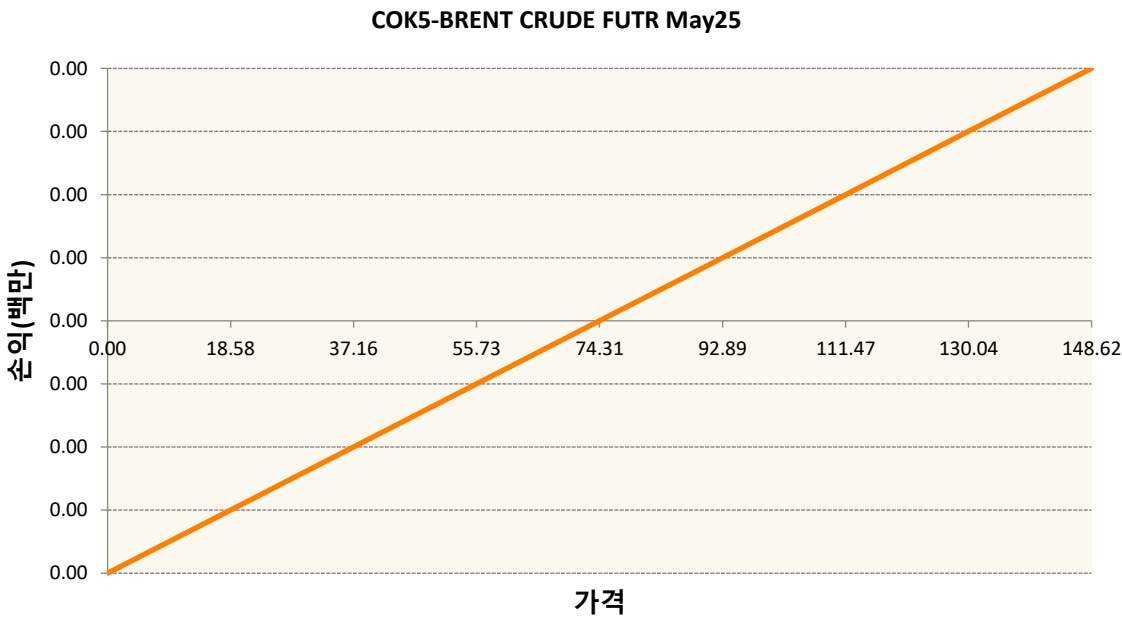
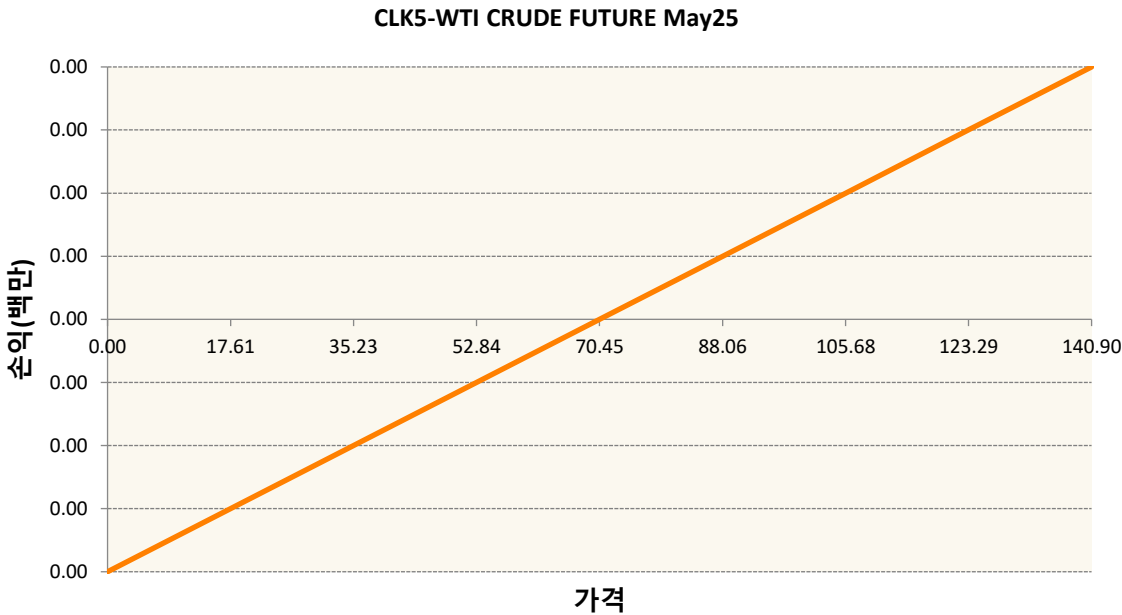
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

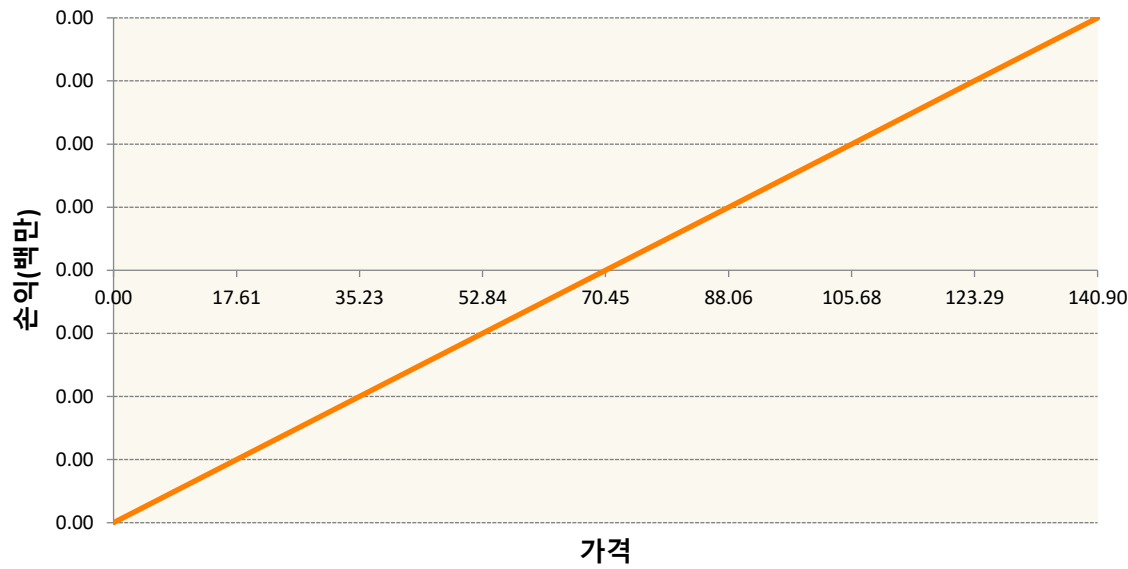
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	14	0	14	장내
누계	유가증권	선물	888	0	888	
누계	통화	선물	0	172	-172	장내

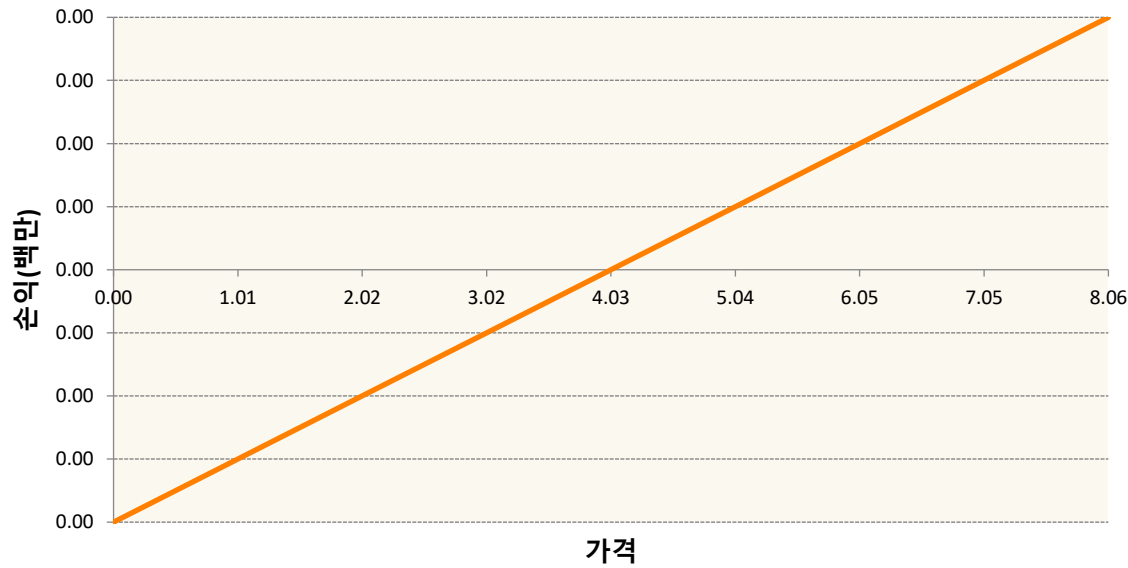
2. 만기시점의 손익구조



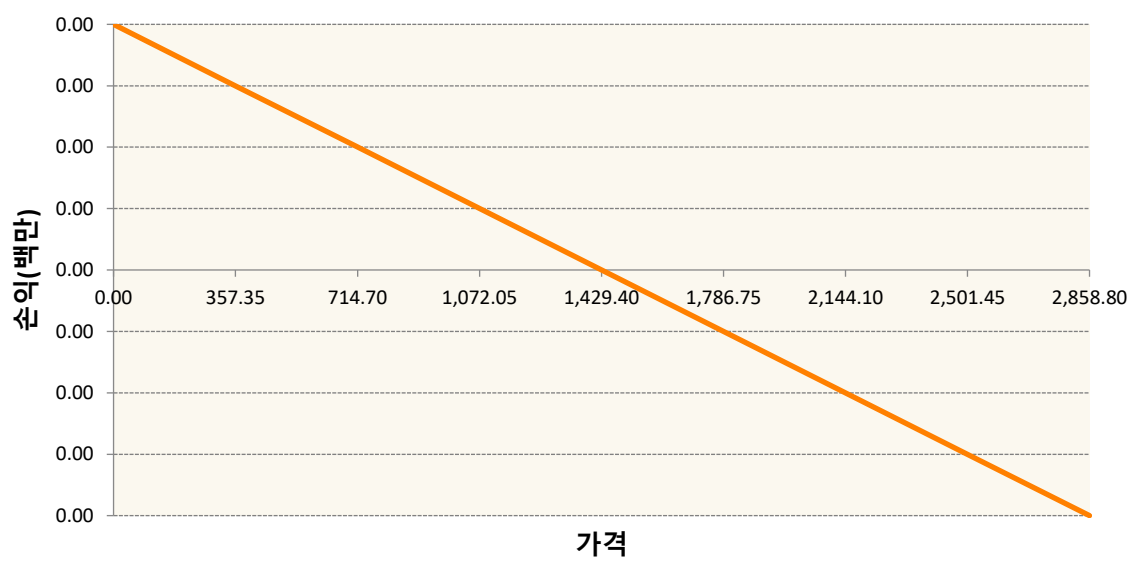
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



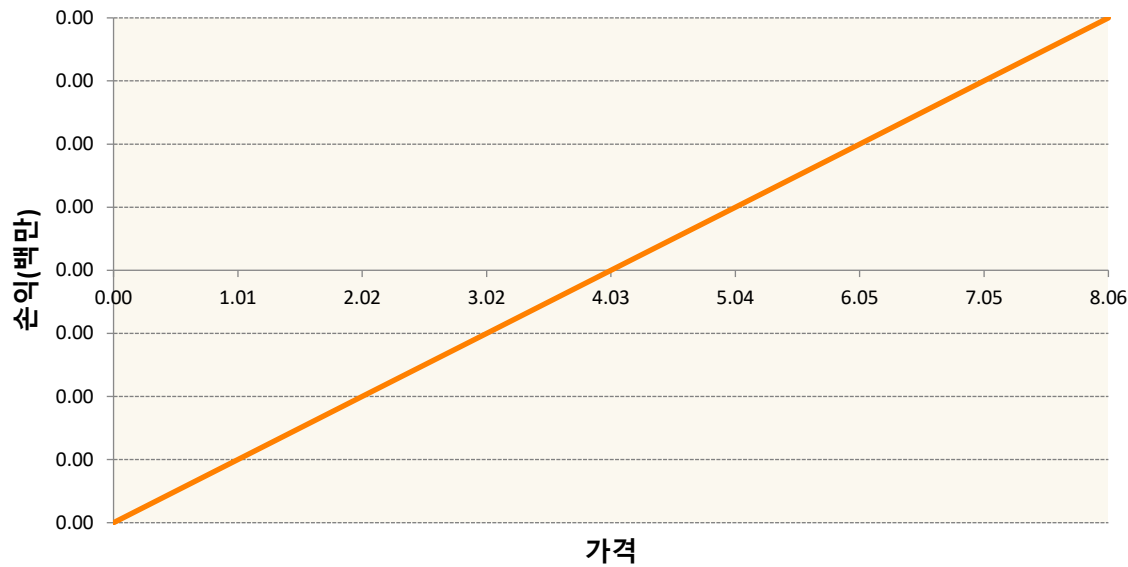
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



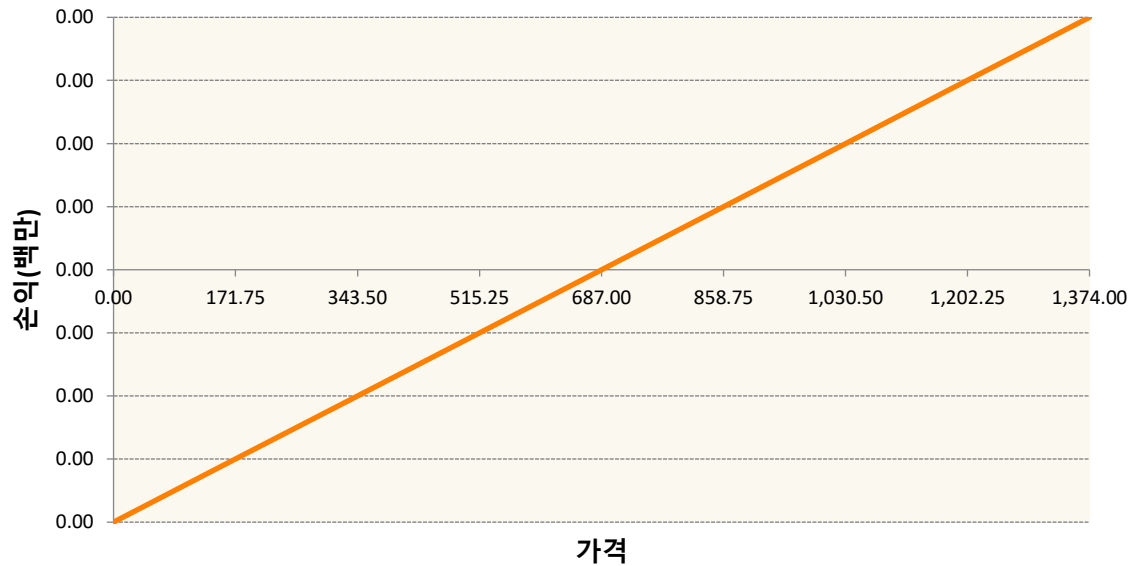
KR4175W30007-2025-03 달러선물



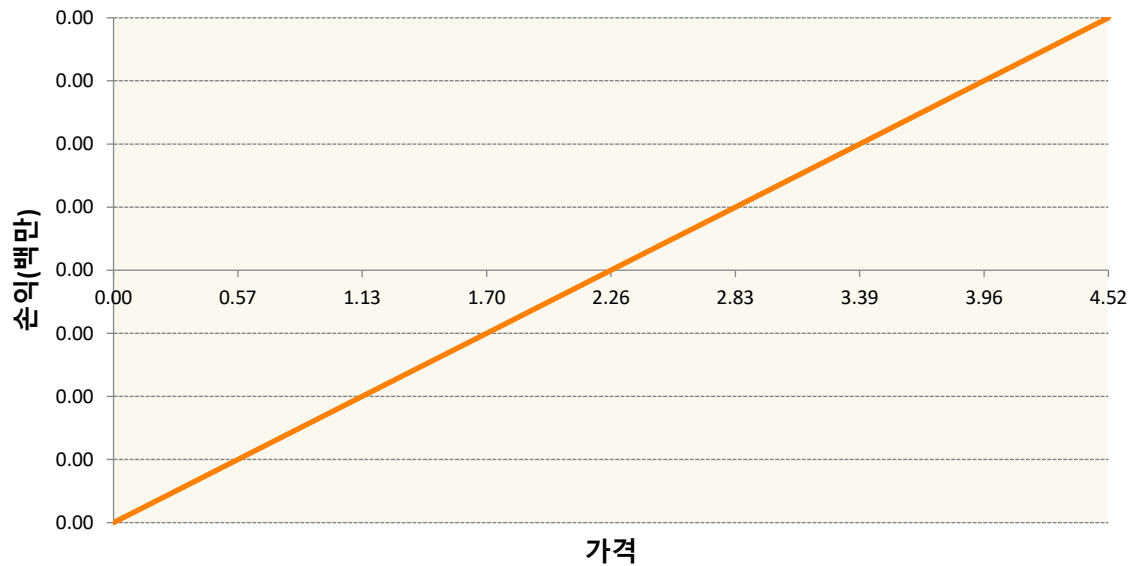
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	8
KR4175W30(	2025-03 달러선물	14
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)

154