

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

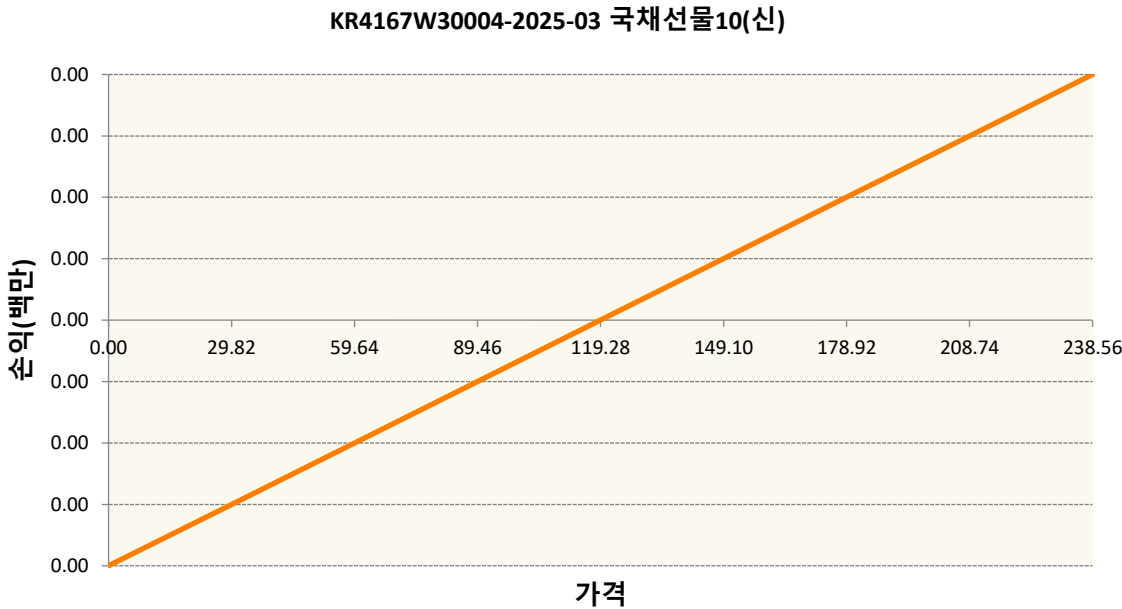
베스트장기채(채권-파생형)

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	236,174	0	236,174	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

5,934

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

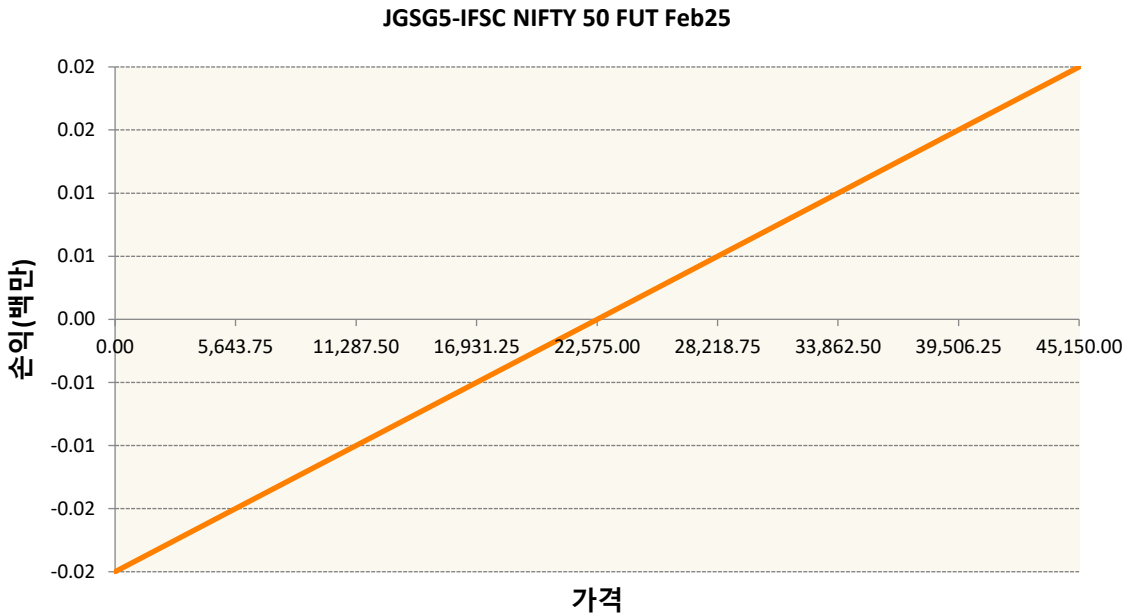
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,280	0	3,280	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSG5	IFSC NIFTY 50 FUT Feb25	262
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

178

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

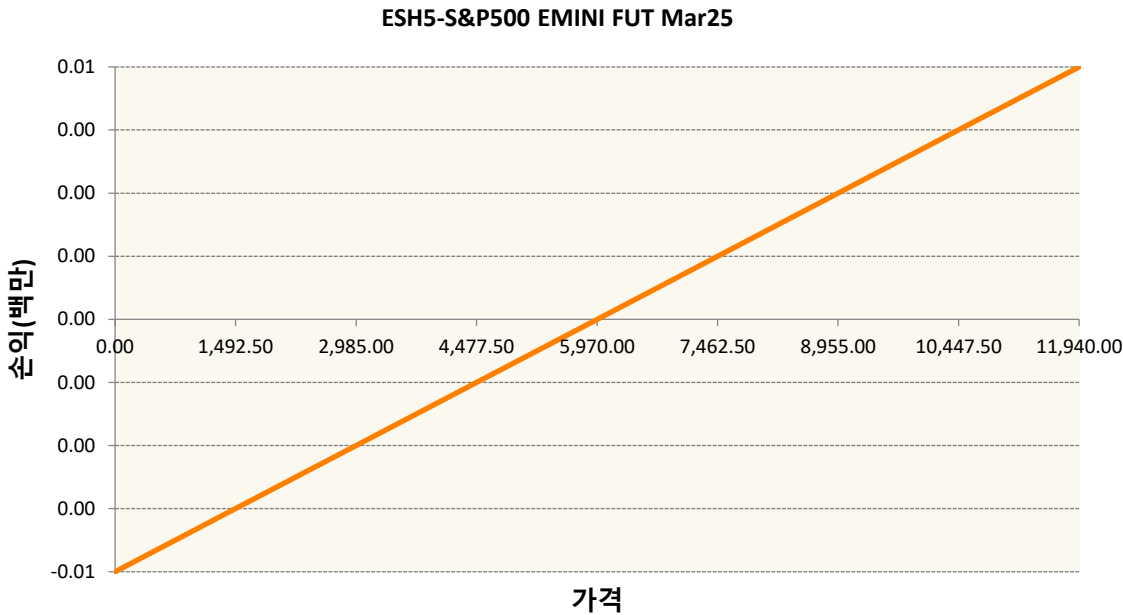
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	858	0	858	

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)

94

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

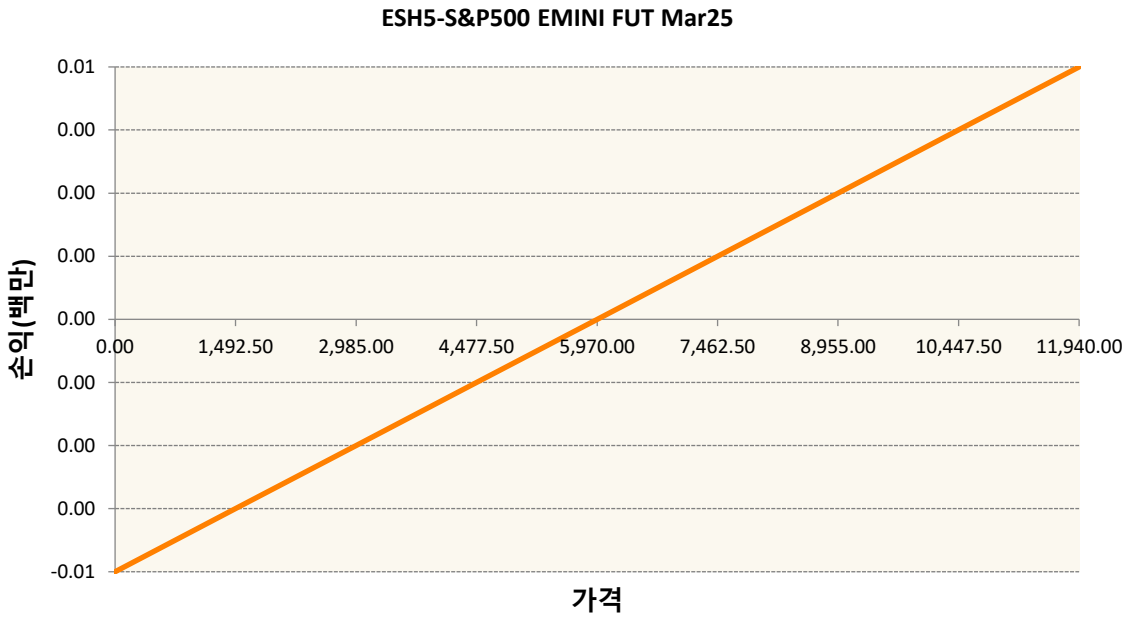
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,599	0	2,599	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	208
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

285

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

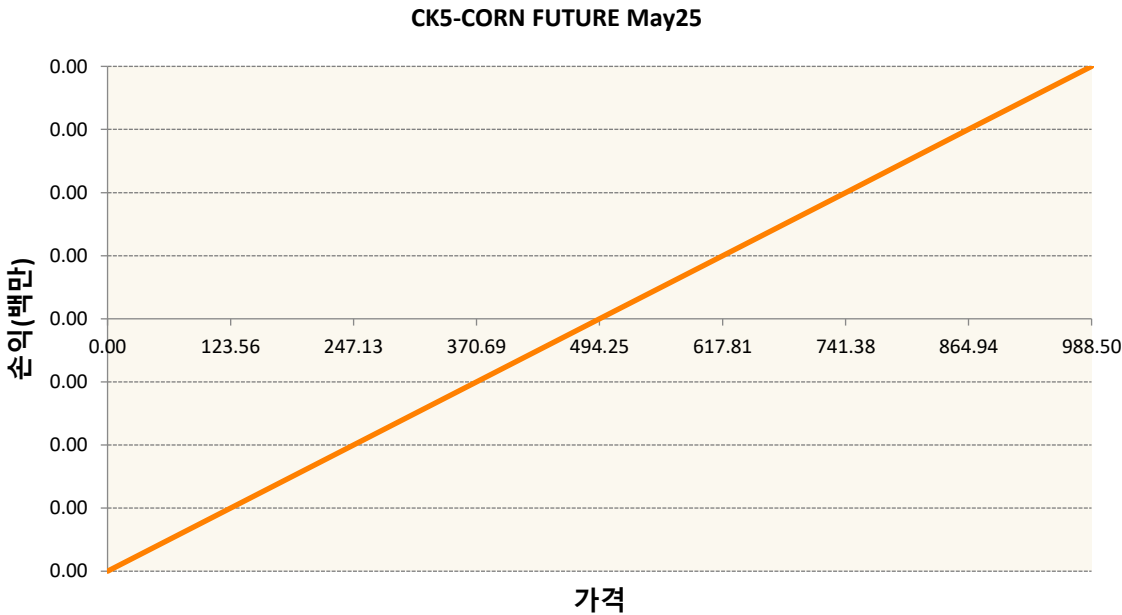
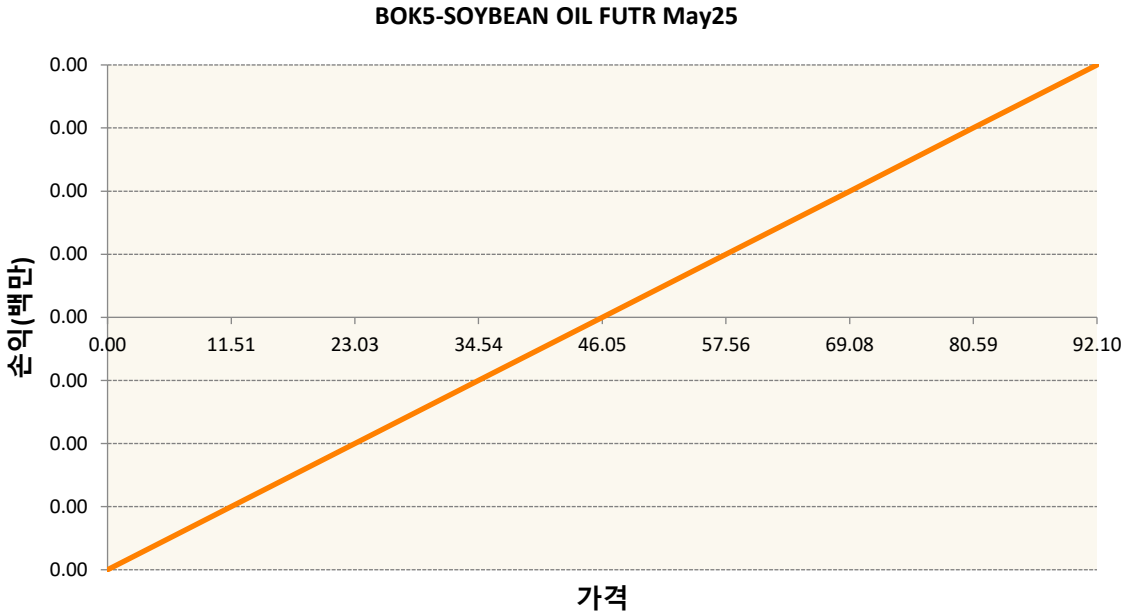
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

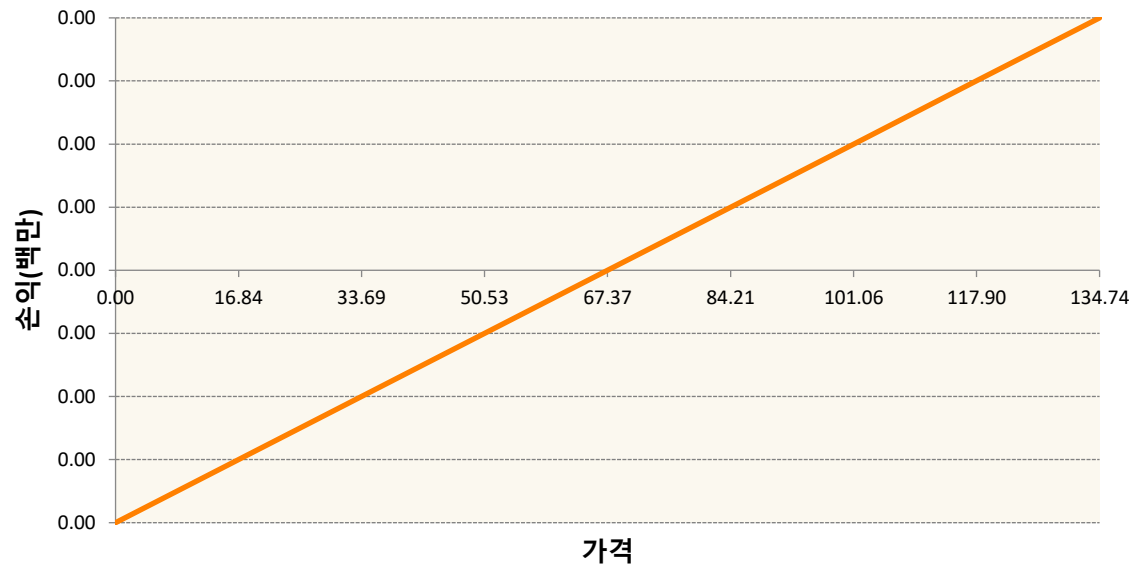
(단위:USD 백만)

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	4,040	0	4,040	
누계	통화	선물	0	573	-573	장내

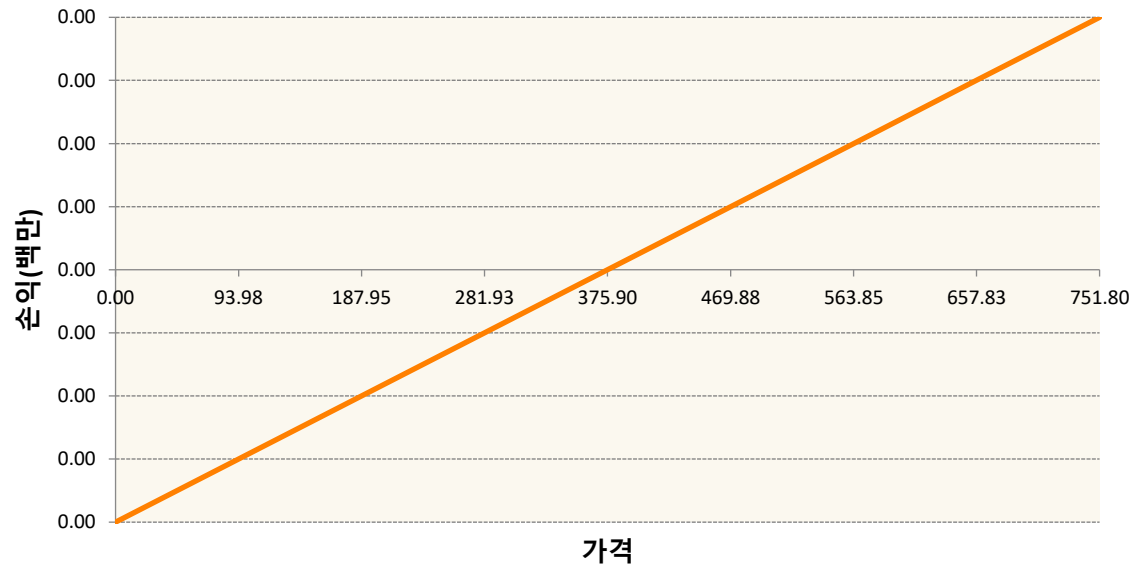
2. 만기시점의 손익구조



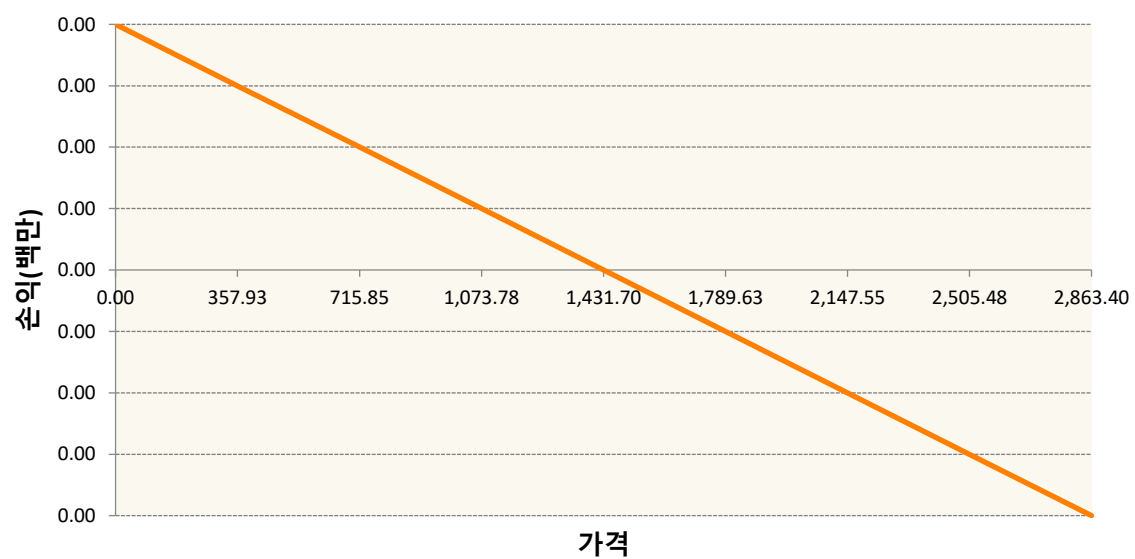
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



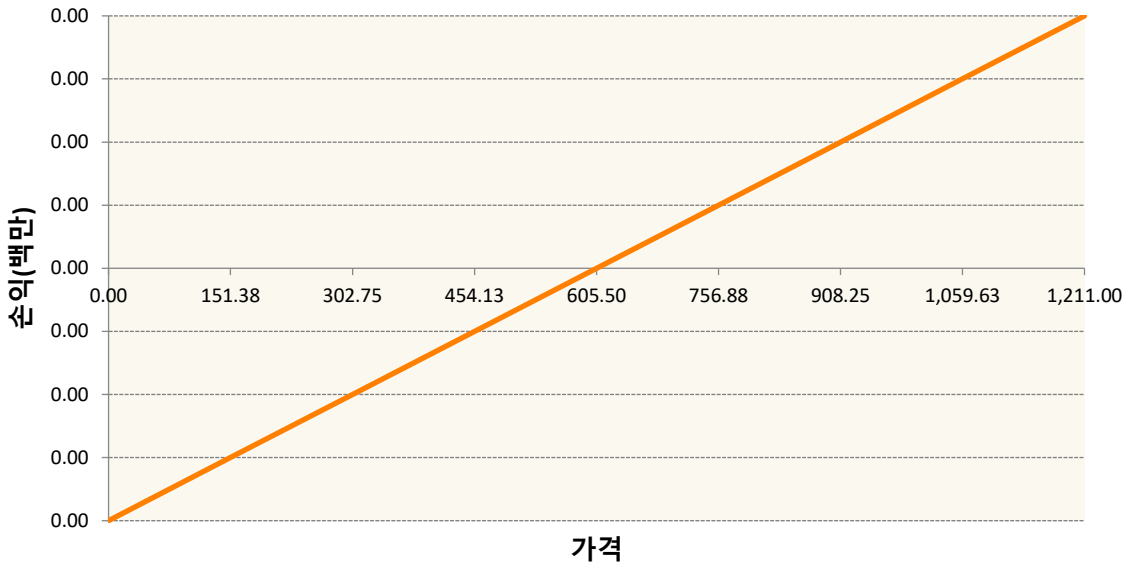
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



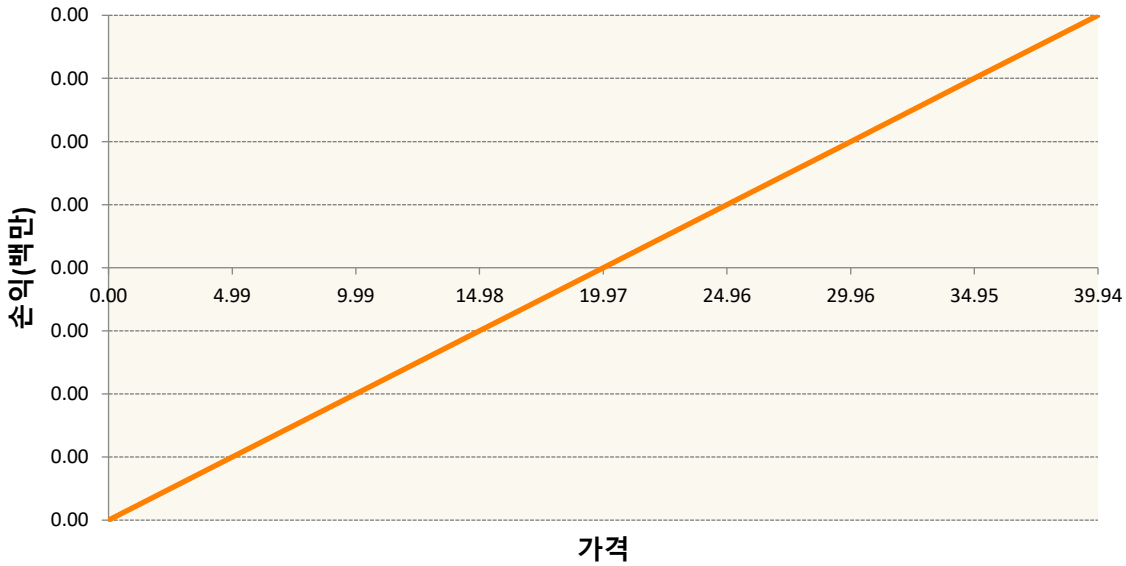
KR4175W30007-2025-03 달러선물



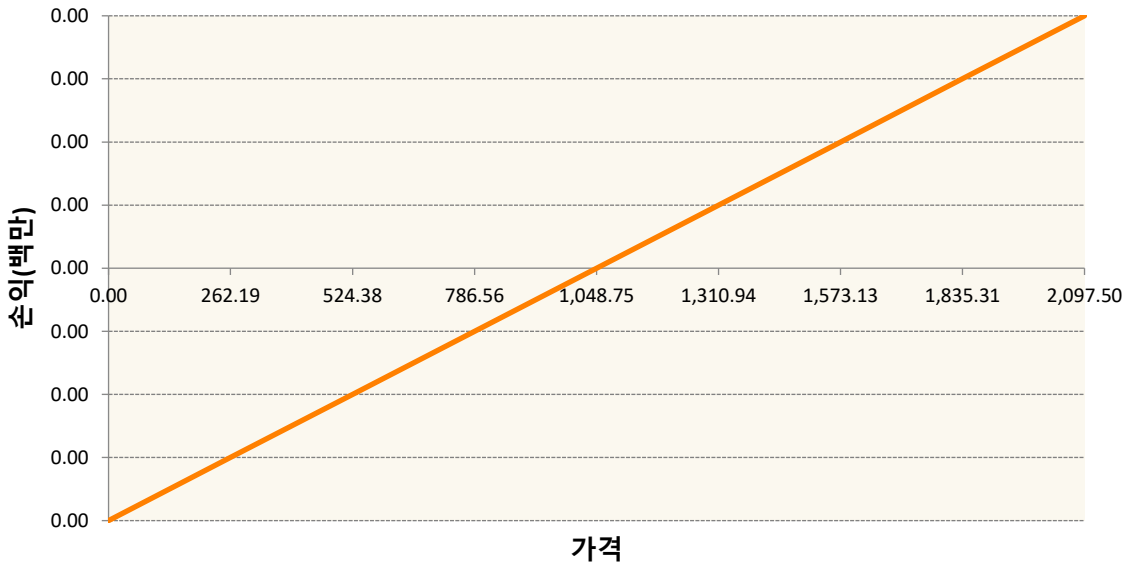
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



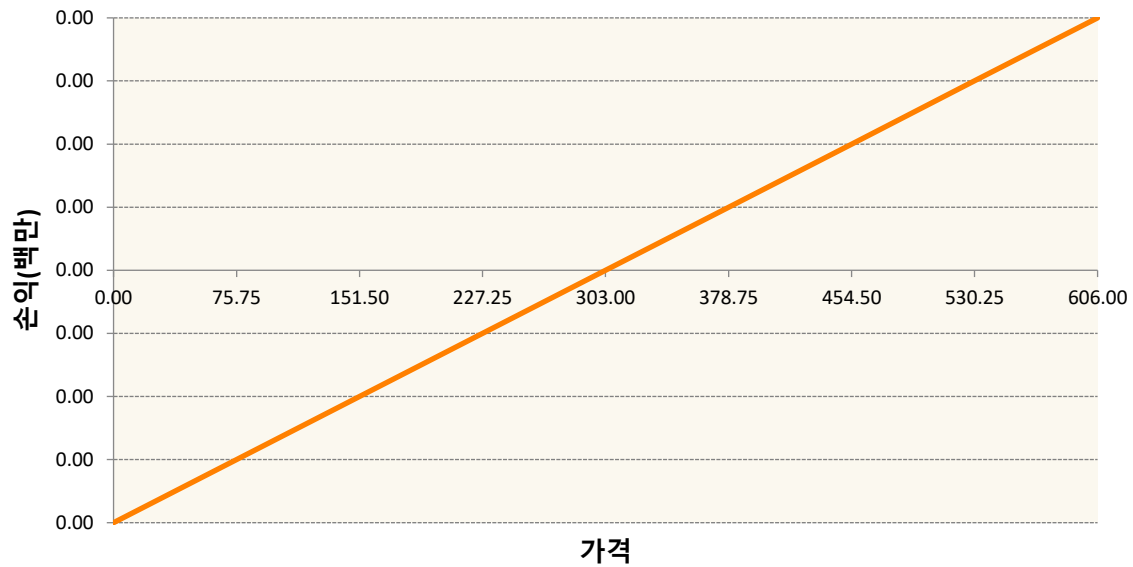
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



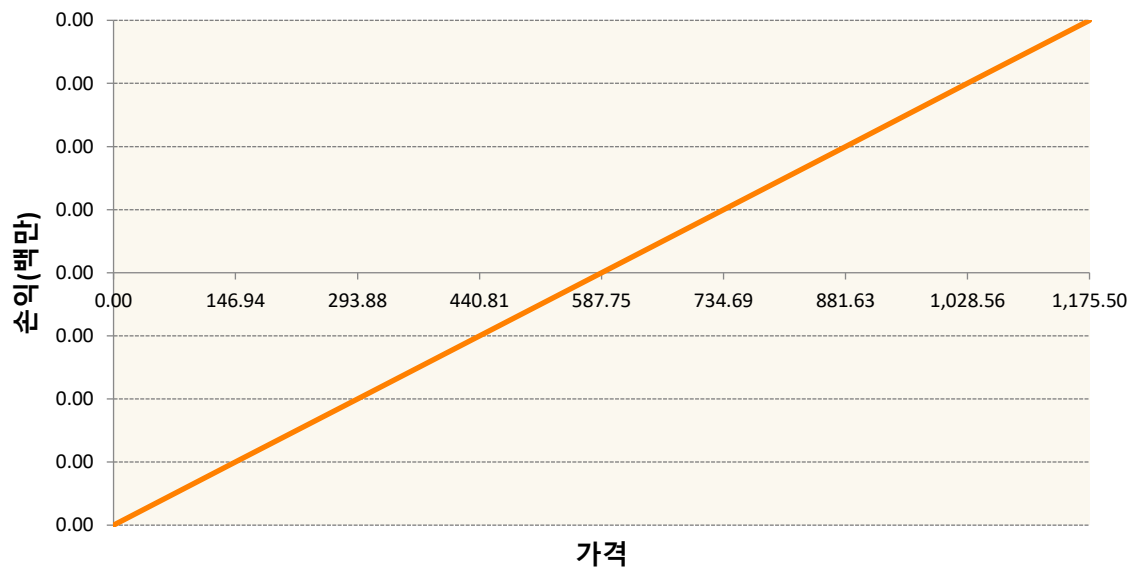
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-02-27
기준일	2025-02-26

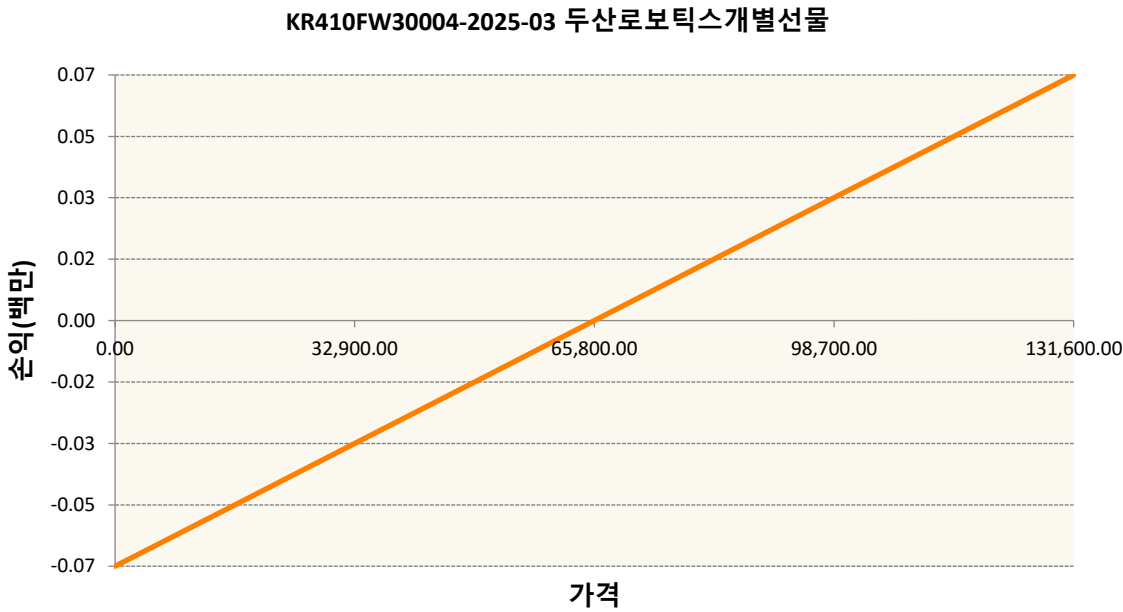
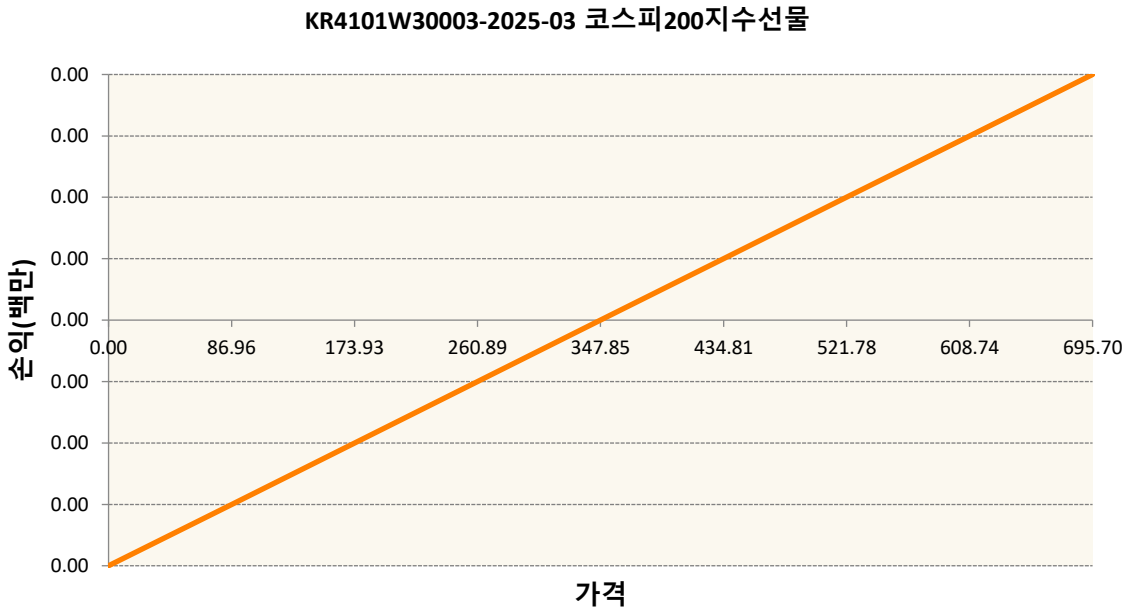
스마트인덱스모

1. 계약금액

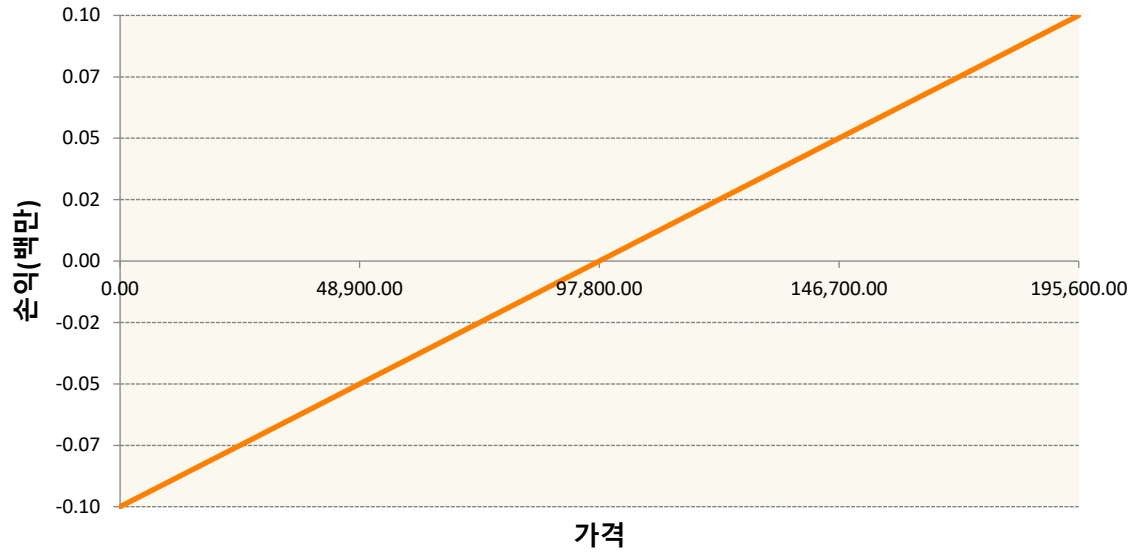
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3	0	3	장내
누계	유가증권	선물	1,345	0	1,345	장내

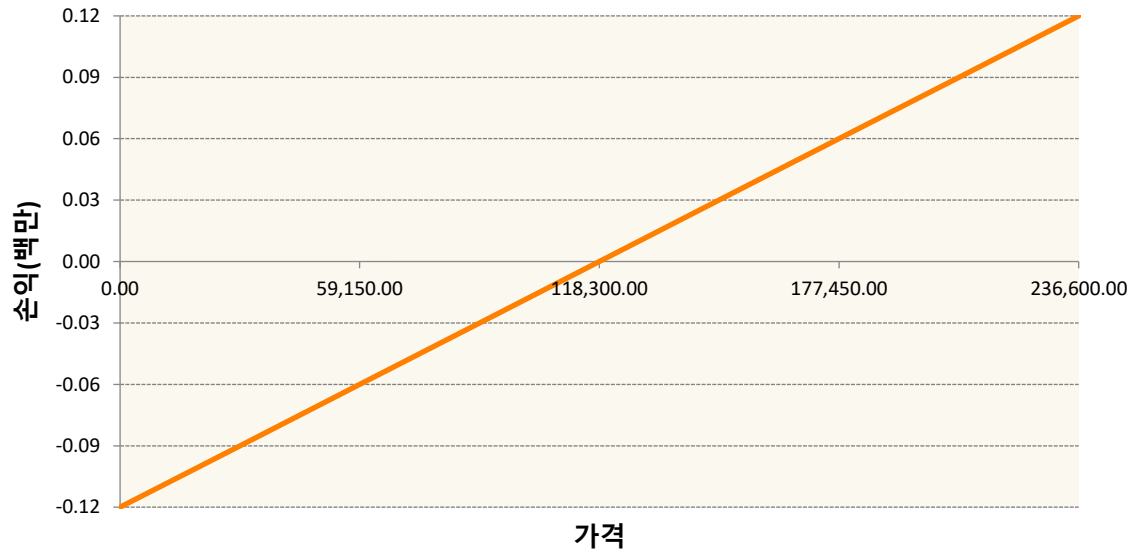
2. 만기시점의 손익구조



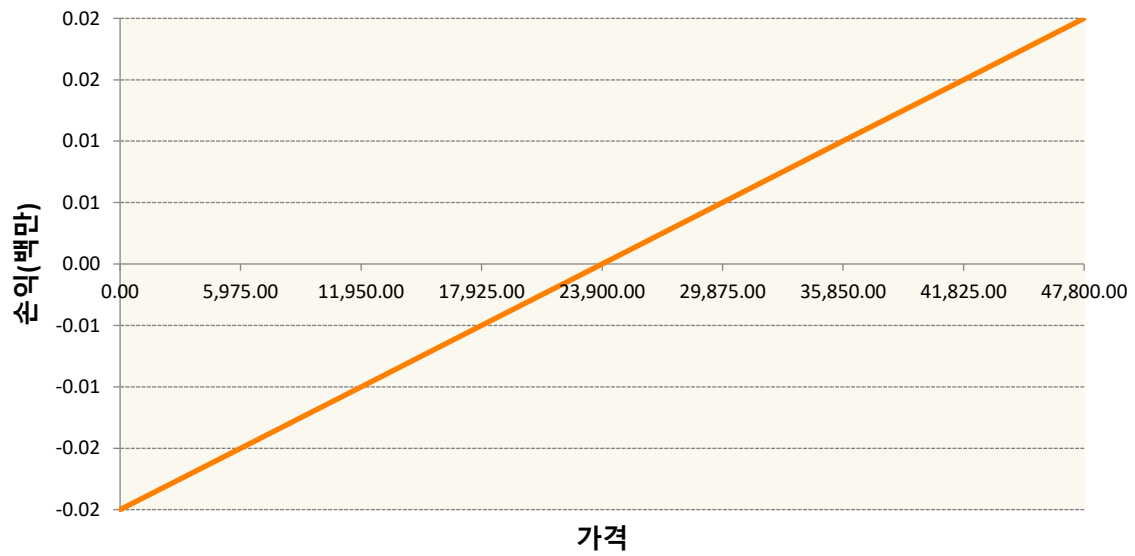
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



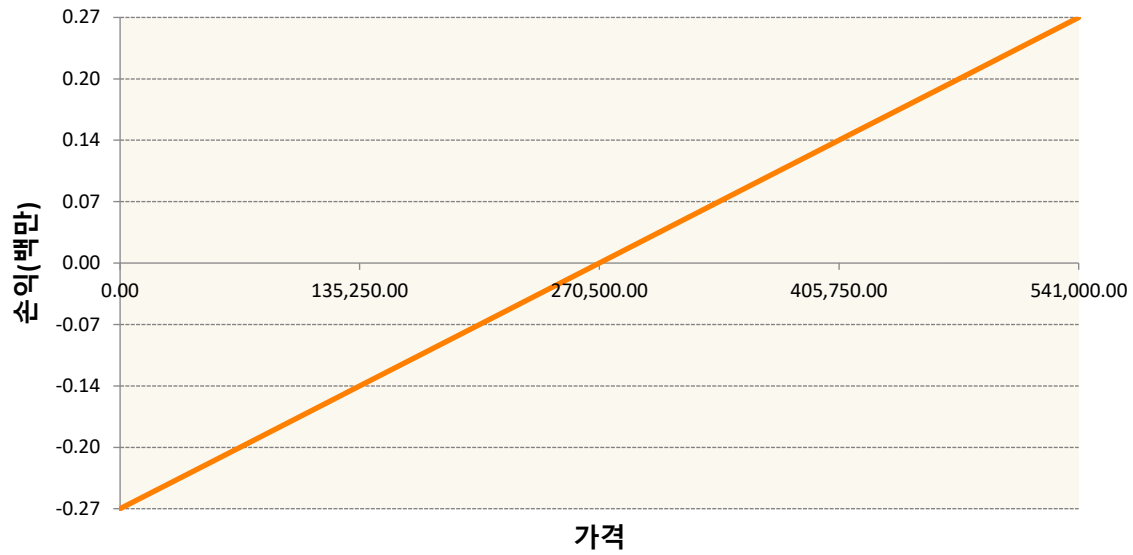
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



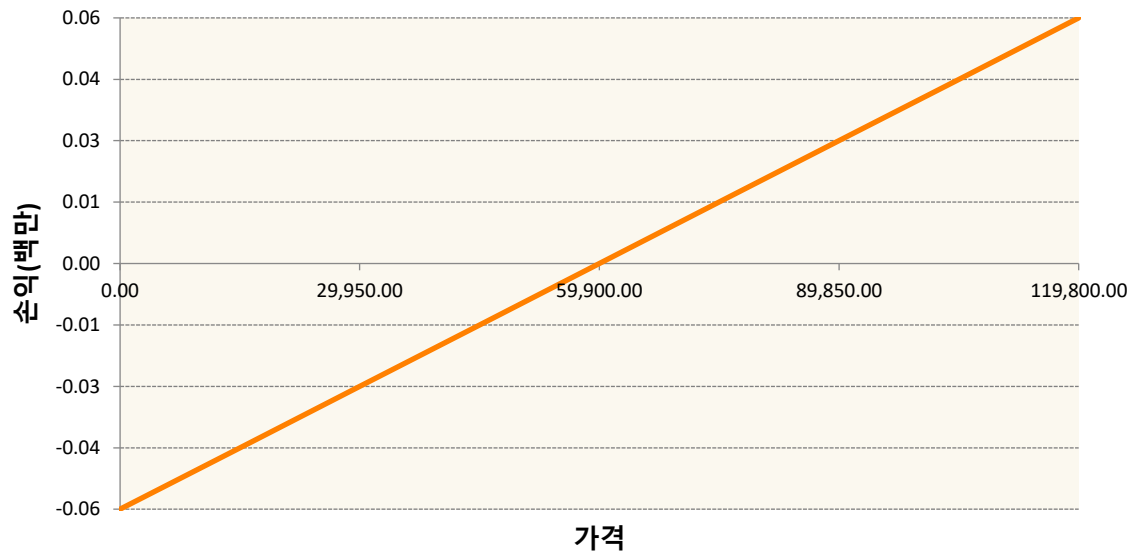
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



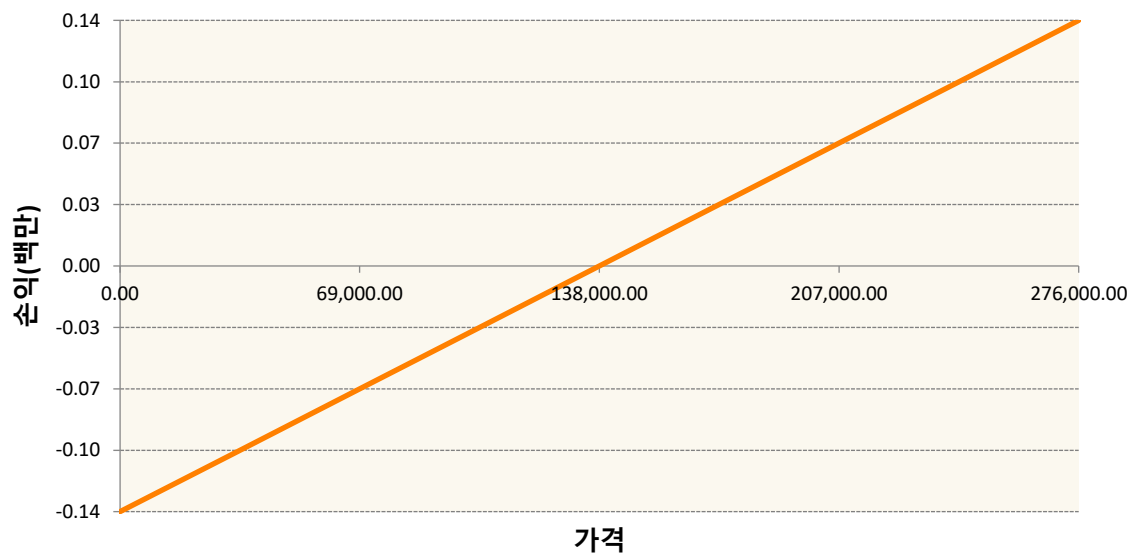
KR41CXW30001-2025-03 한미약품개별선물



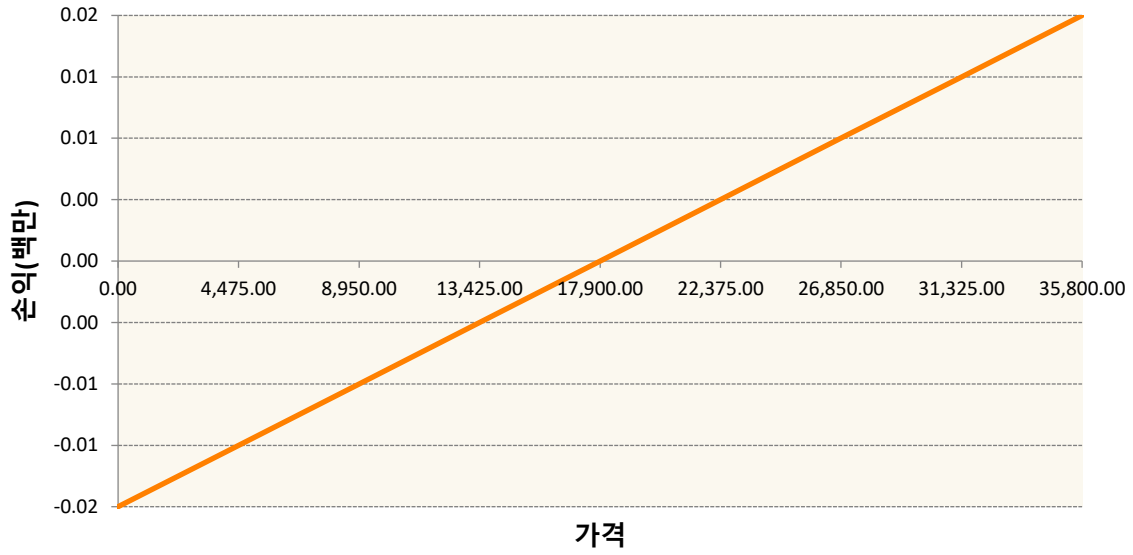
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



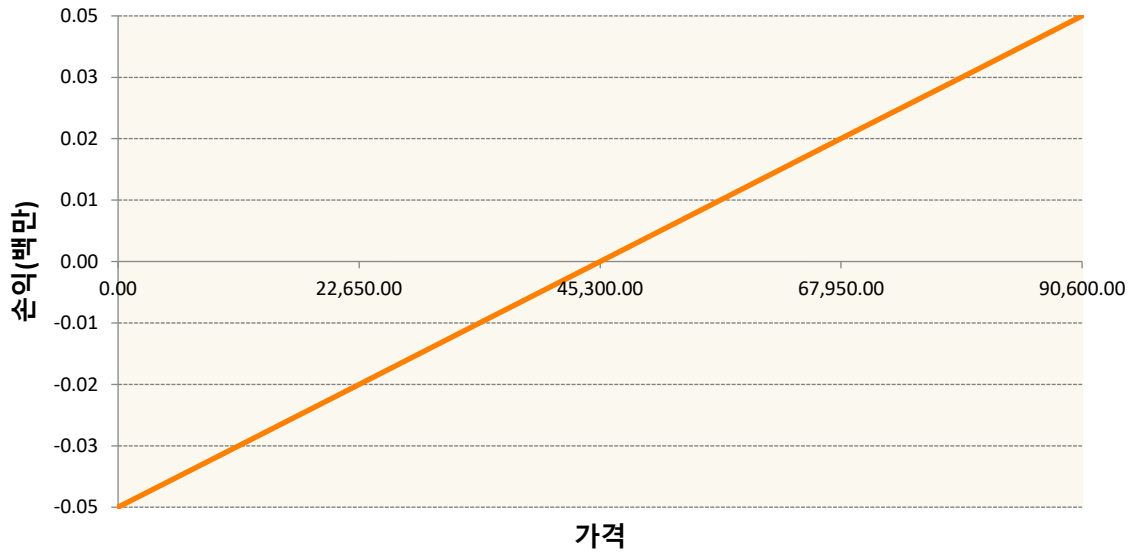
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



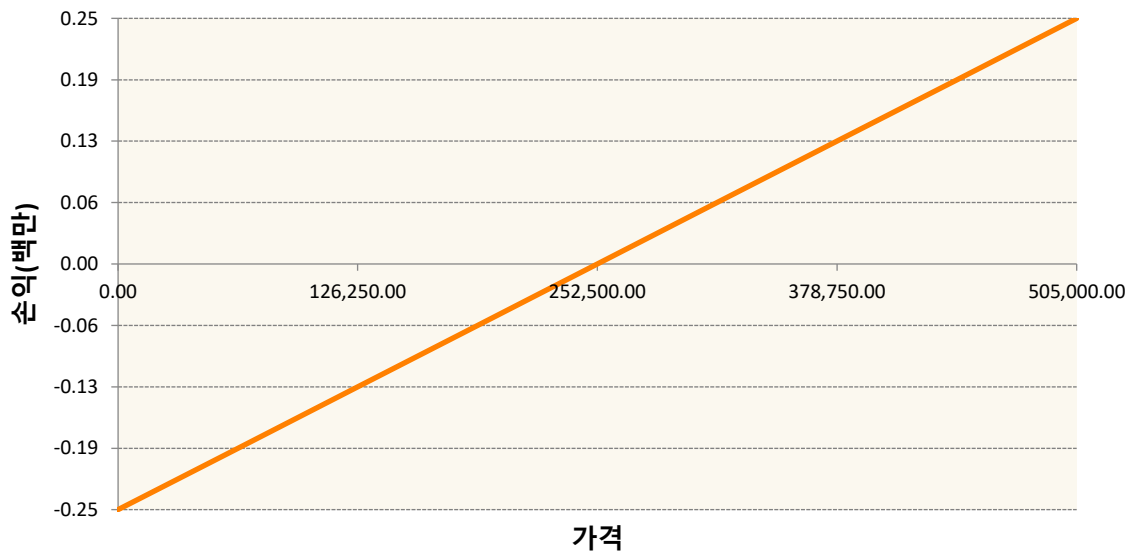
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



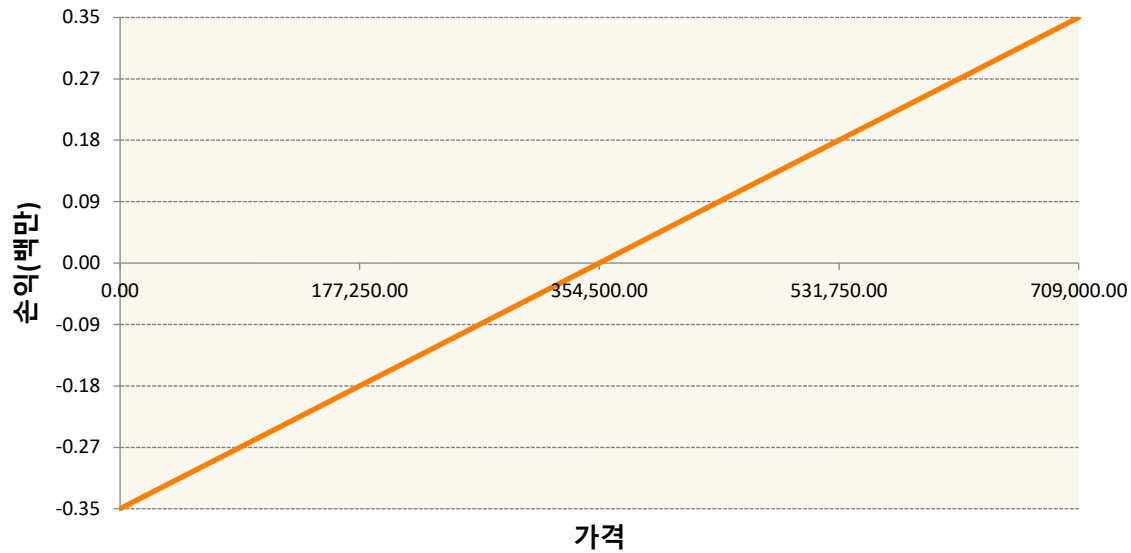
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	70
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
KR41DEW30(2025-03 한국콜마개별선물	0.24
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)

193

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

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

307

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

474

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

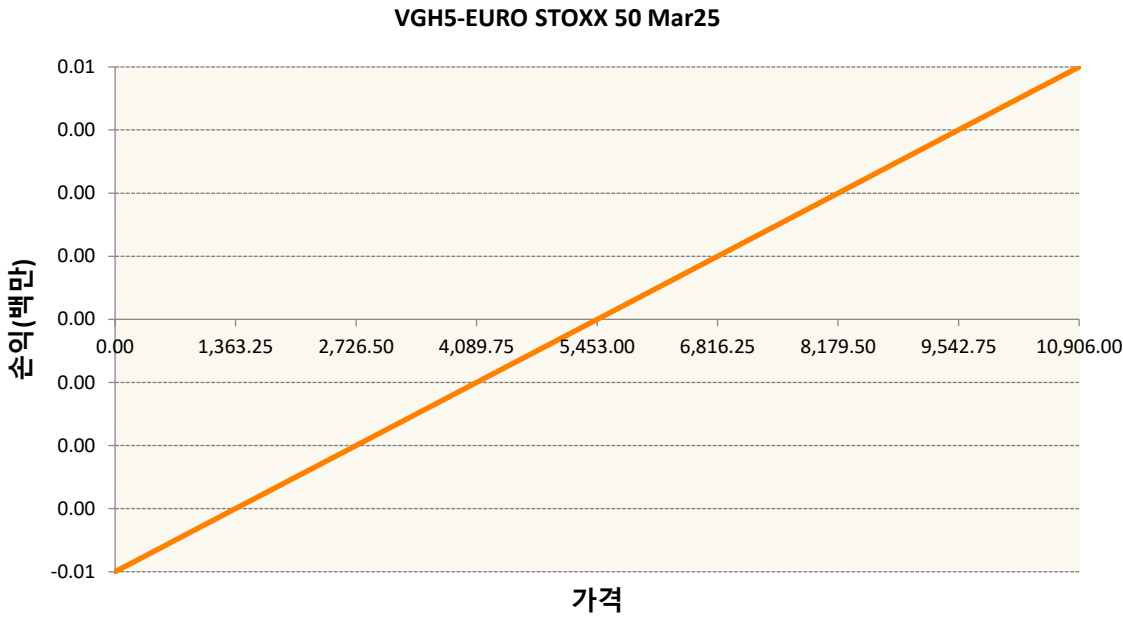
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	986	0	986	

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	2025-02-27
기준일	2025-02-26

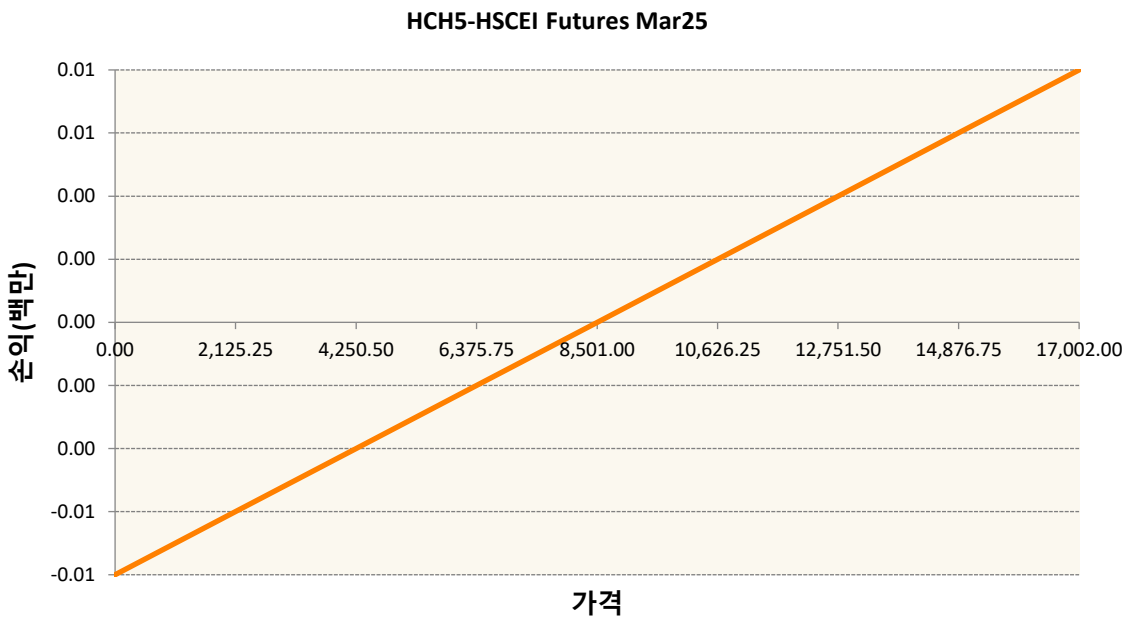
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,803	0	1,803	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH5	HSCEI Futures Mar25	144
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

195

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

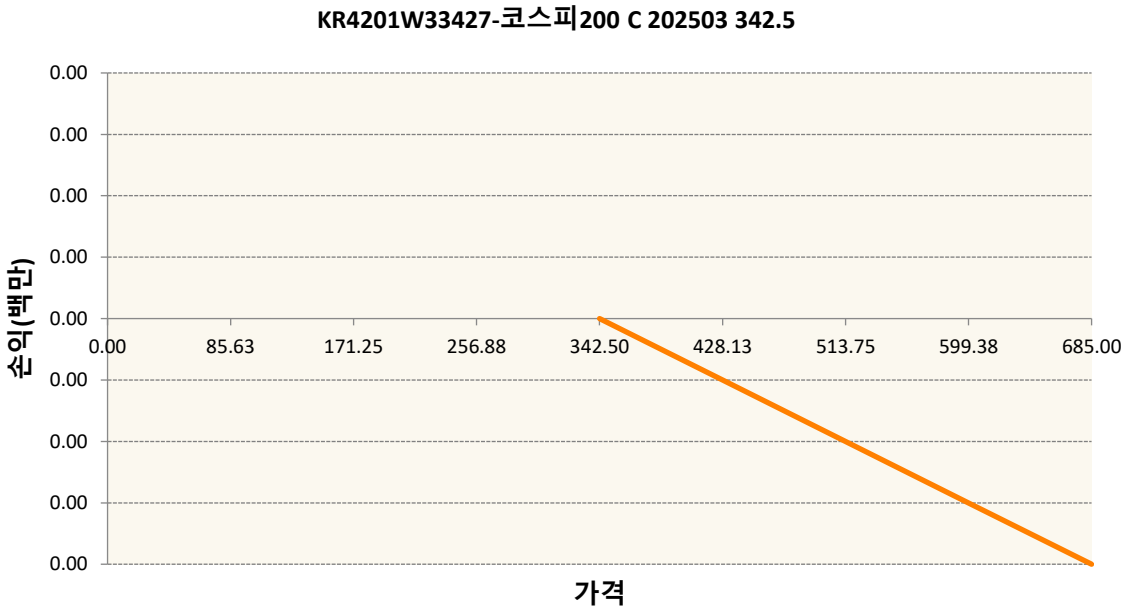
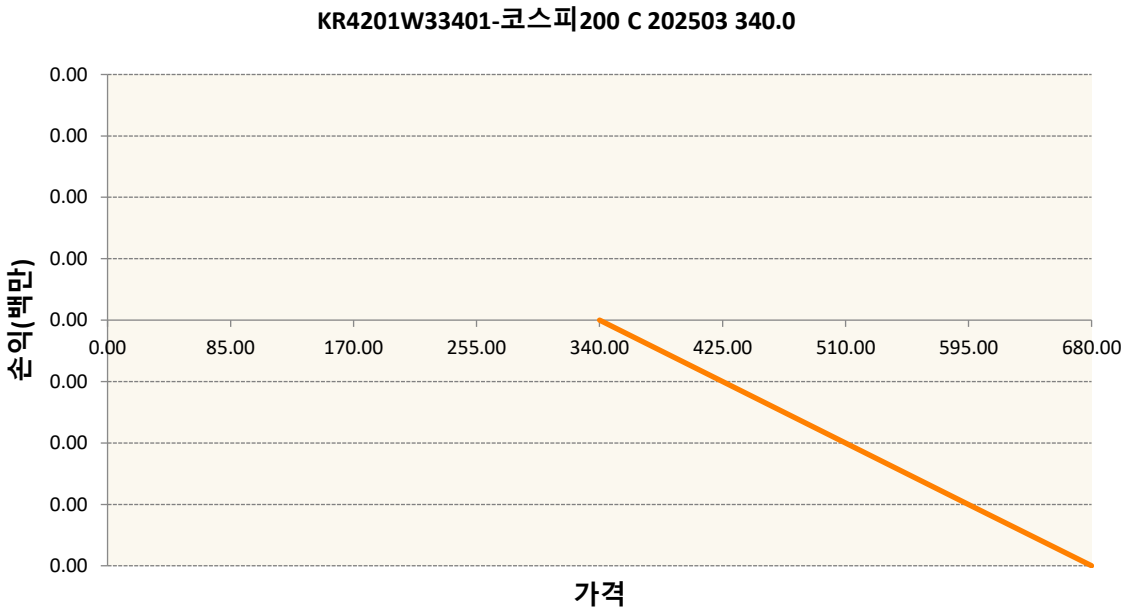
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

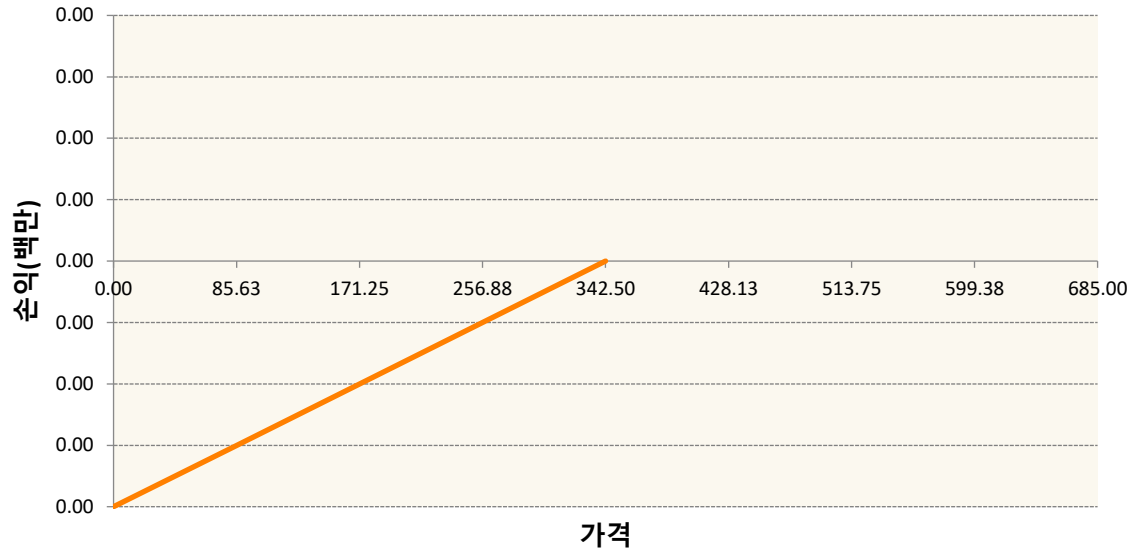
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	743	0	743	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,006	-37,006	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301W33425-코스피200 P 202503 342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201W33401 코스피200 C 202503 340.0							1,569
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	748	737	723	707	689	670	649
-5.33%	670	644	617	589	560	531	501
-2.67%	460	426	392	358	324	290	256
0%	84	57	29	0	-30	-60	-91
2.67%	-416	-429	-445	-463	-483	-504	-527
5.33%	-973	-977	-983	-992	-1,002	-1,014	-1,028
8.00%	-1,546	-1,547	-1,549	-1,552	-1,556	-1,562	-1,569
KR4201W33427 코스피200 C 202503 342.5							677
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	289	285	280	274	268	260	252
-5.33%	264	254	243	232	220	208	196
-2.67%	189	174	159	144	129	114	99
0%	41	28	14	0	-14	-28	-43
2.67%	-169	-176	-185	-194	-204	-215	-226
5.33%	-411	-413	-417	-422	-428	-434	-442
8.00%	-664	-665	-666	-668	-670	-673	-677
KR4301W33425 코스피200 P 202503 342.5							356
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-331	-334	-337	-341	-346	-351	-356
-5.33%	-172	-178	-186	-193	-202	-210	-219
-2.67%	-47	-57	-67	-77	-88	-98	-108
0%	28	19	10	0	-10	-20	-30

2.67%	60	55	49	43	36	28	20
5.33%	70	68	65	62	58	54	49
8.00%	72	71	71	69	68	65	62

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

(단위:백만원)

2,765

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

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	2025-02-27
기준일	2025-02-26

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	4,456	0	4,456	

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	2025-02-27
기준일	2025-02-26

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	13,168	0	13,168	
누계	통화	선도	0	19,920	-19,920	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E	556
FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E	256
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E	209
FXW213F24C KRW/USD 28-02-25E	17
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E	212
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E	344
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

673

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

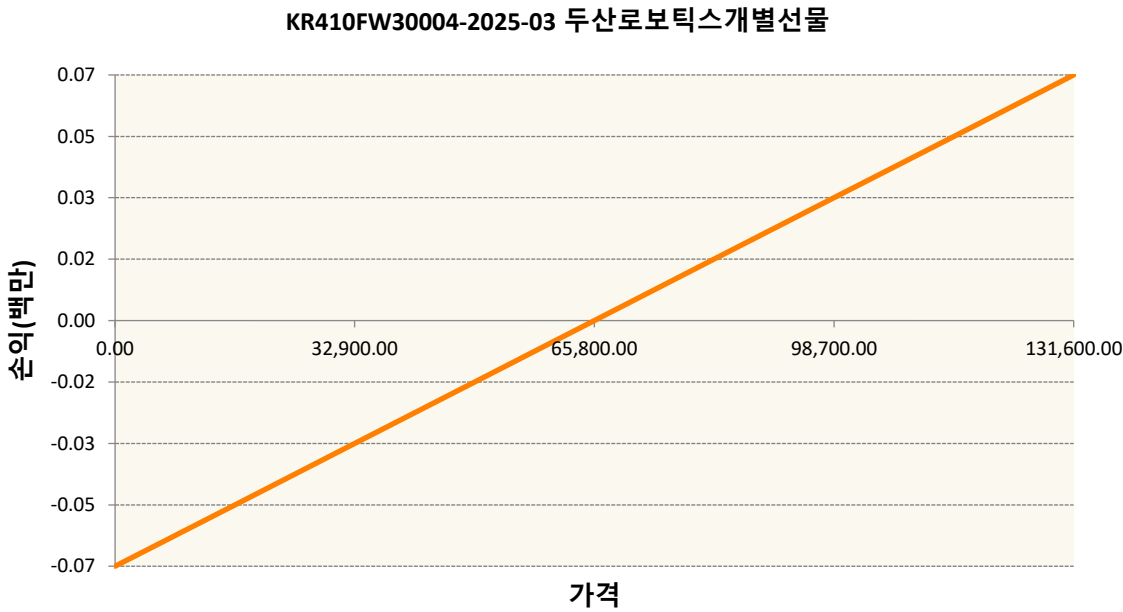
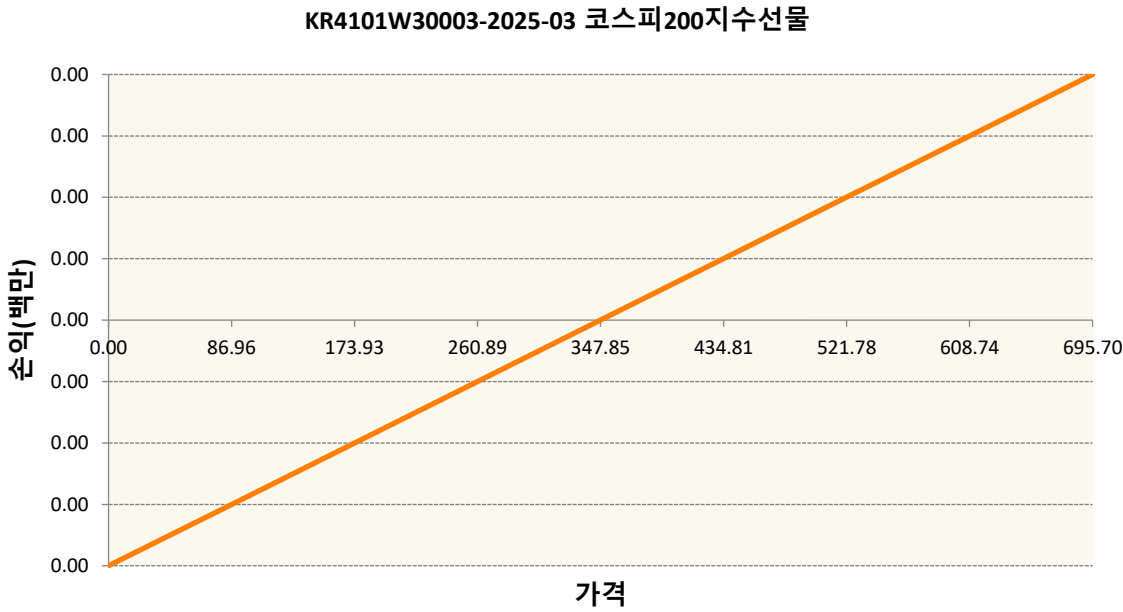
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

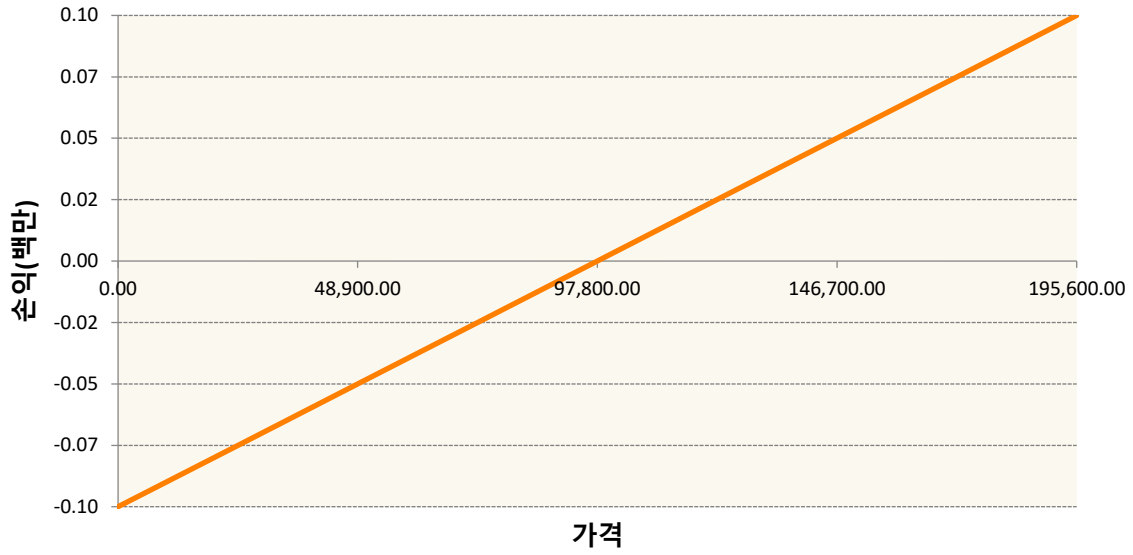
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6	0	6	장내
누계	유가증권	선물	1,252	0	1,252	장내

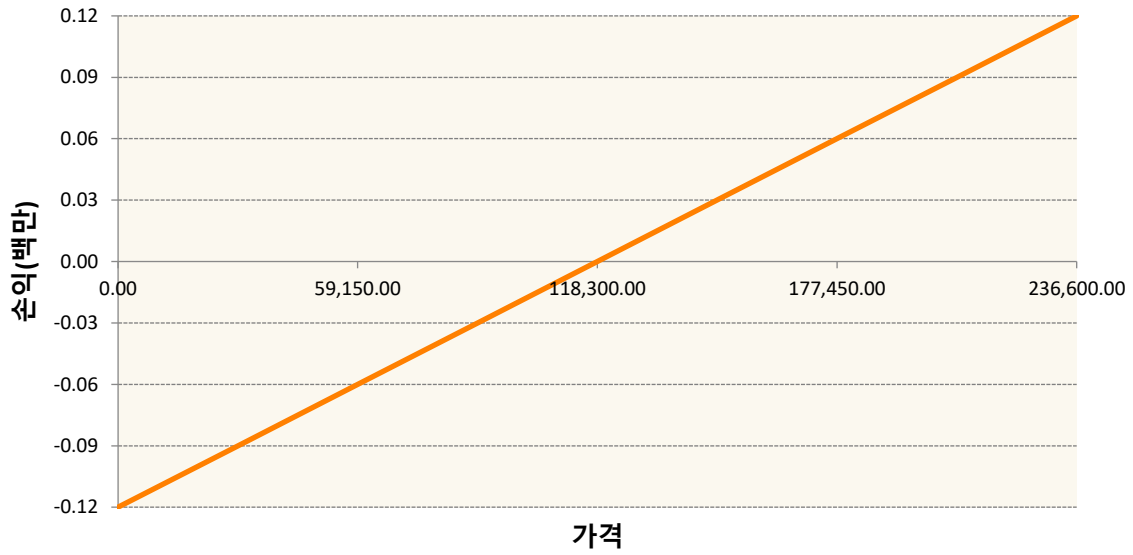
2. 만기시점의 손익구조



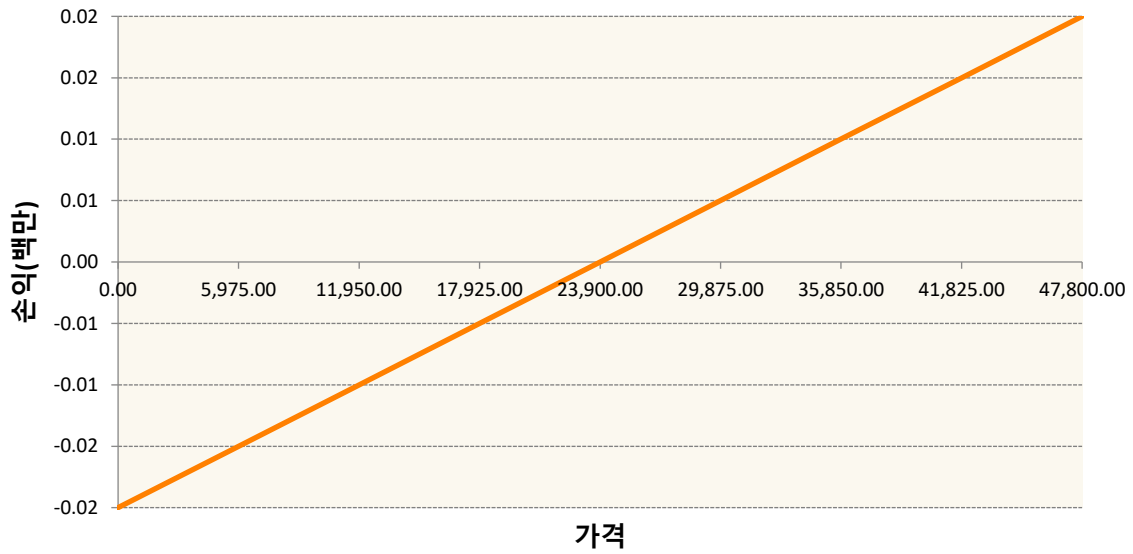
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



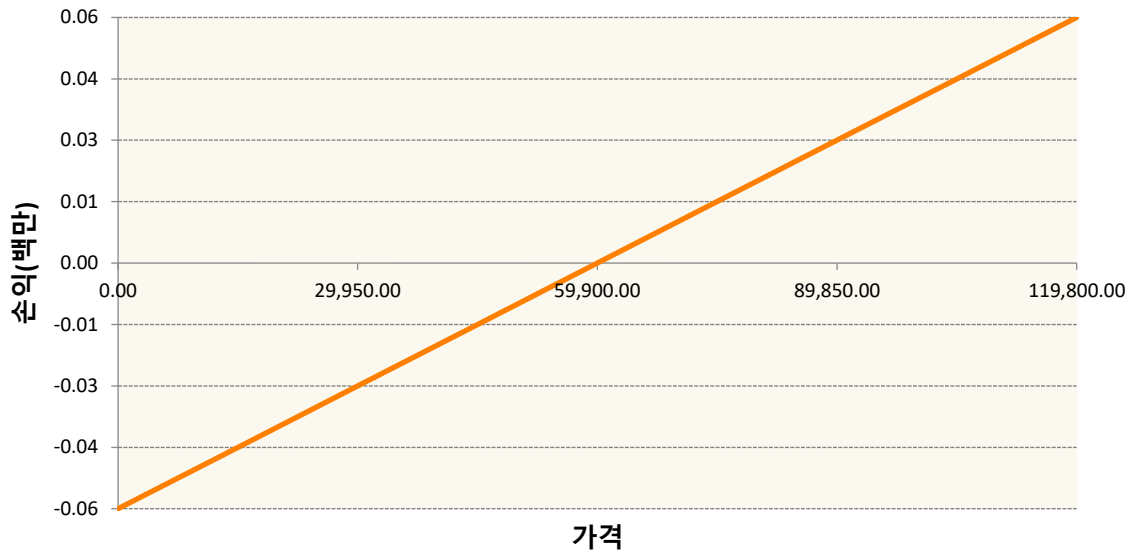
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



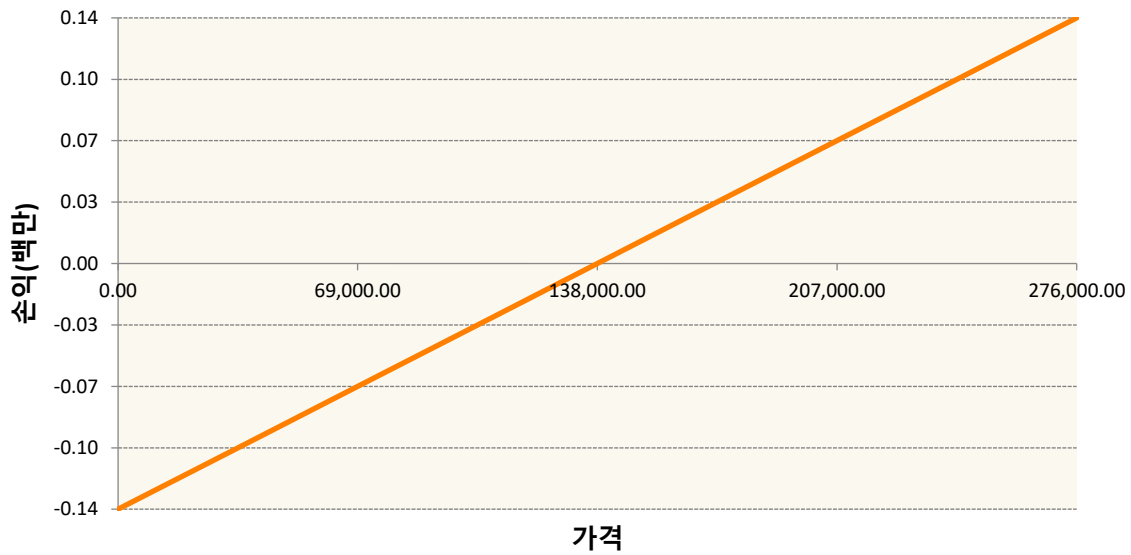
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



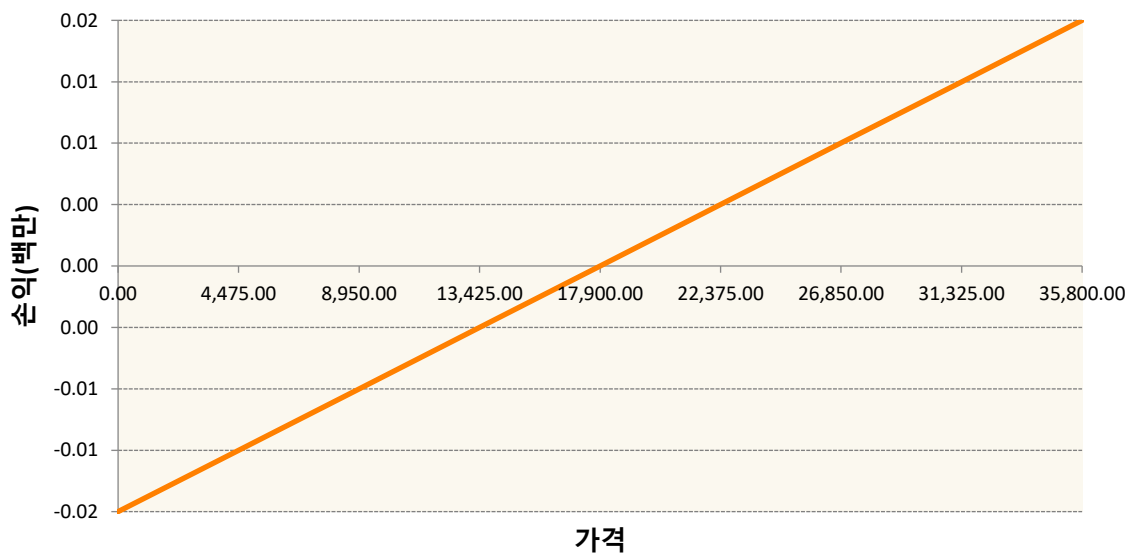
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



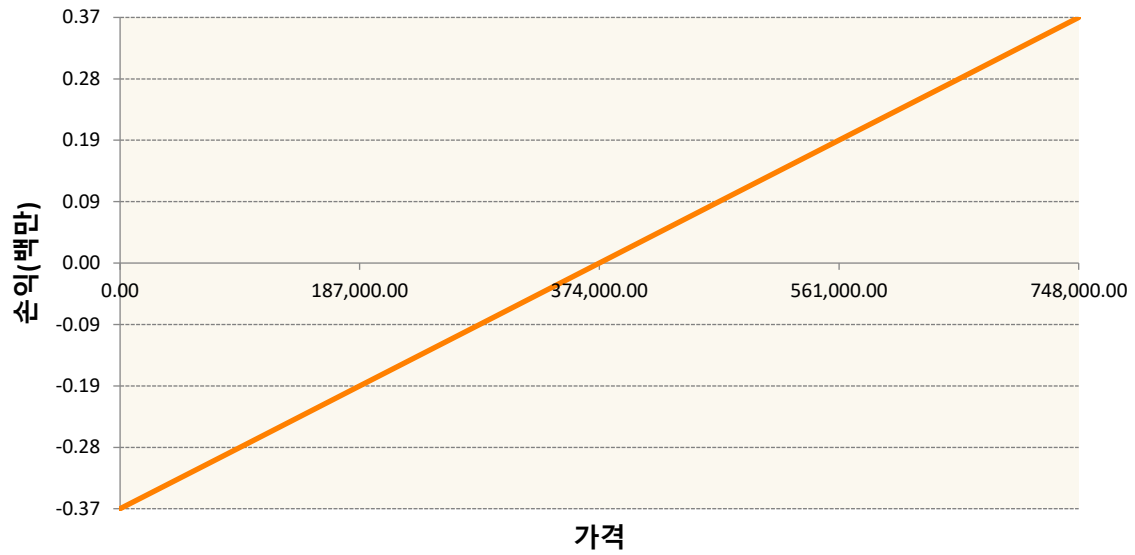
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



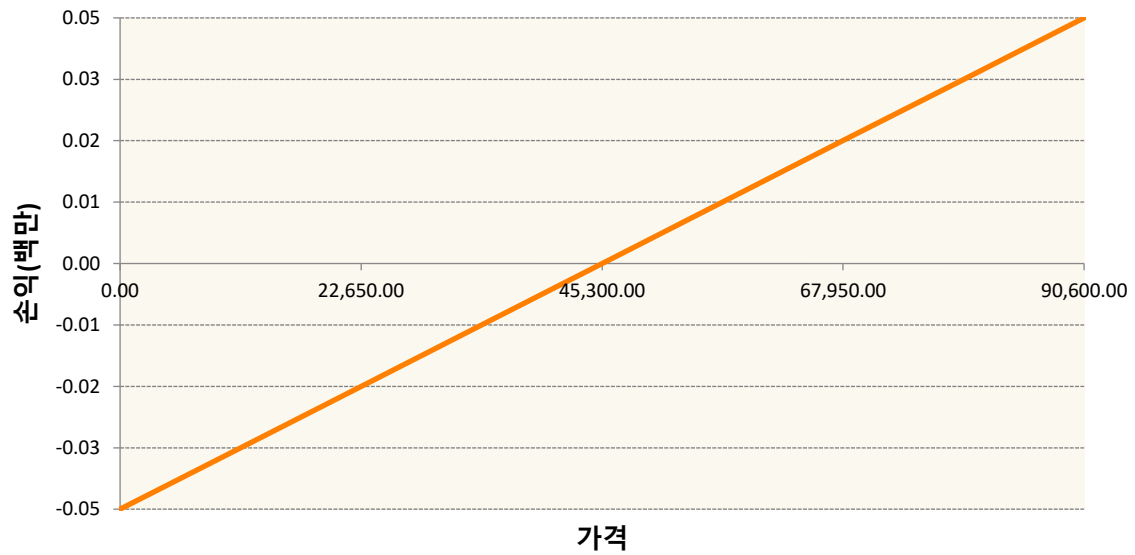
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



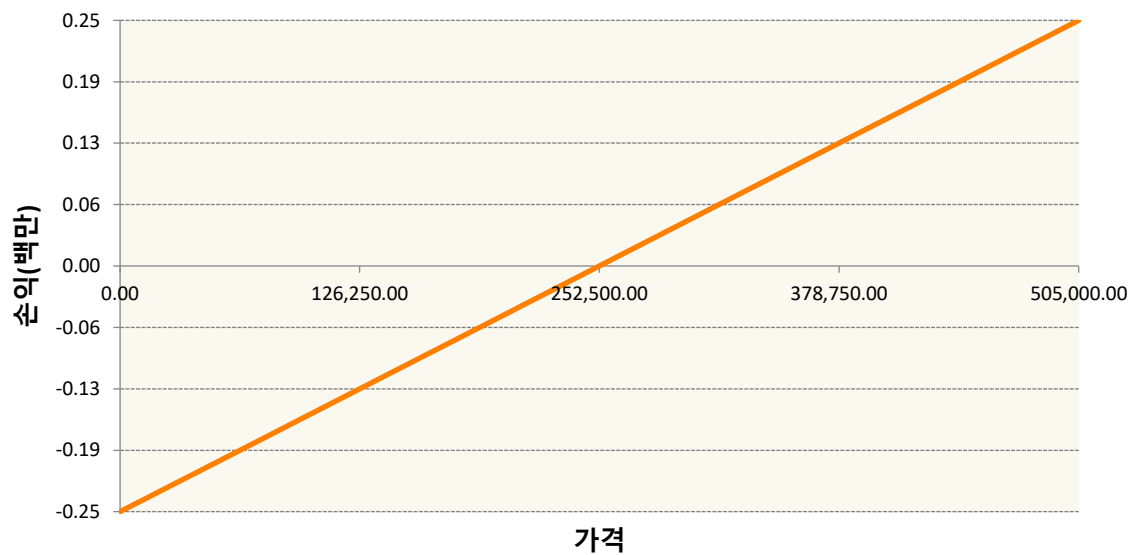
KR41F5W30008-2025-03 LG에너지솔루션개별선물



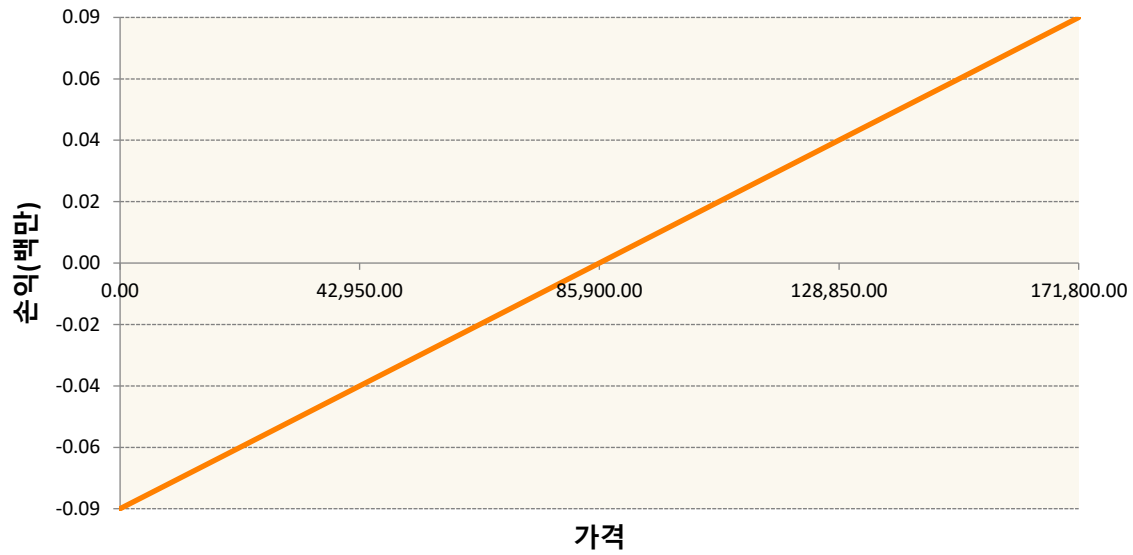
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



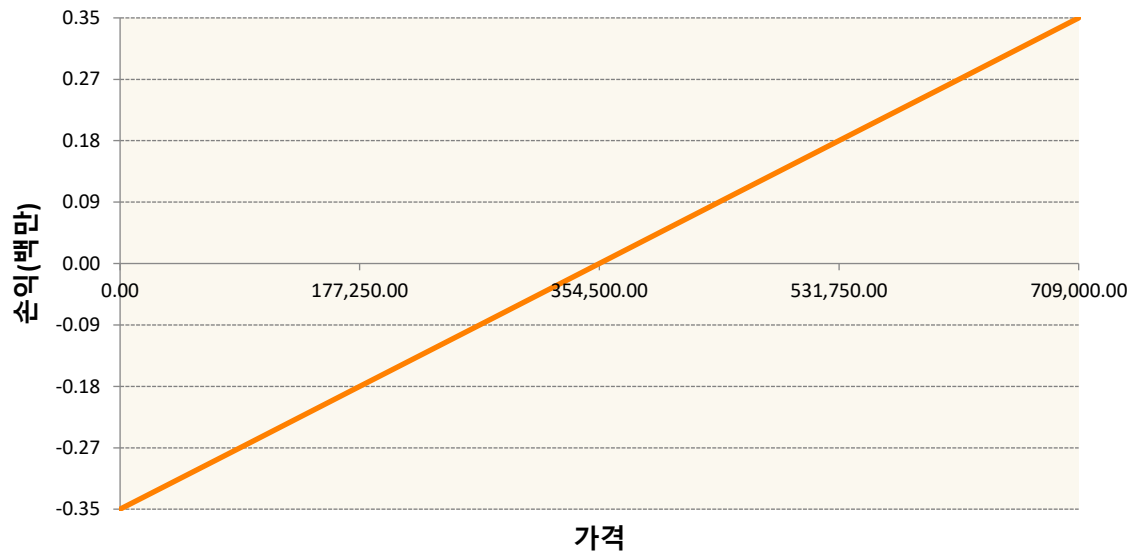
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



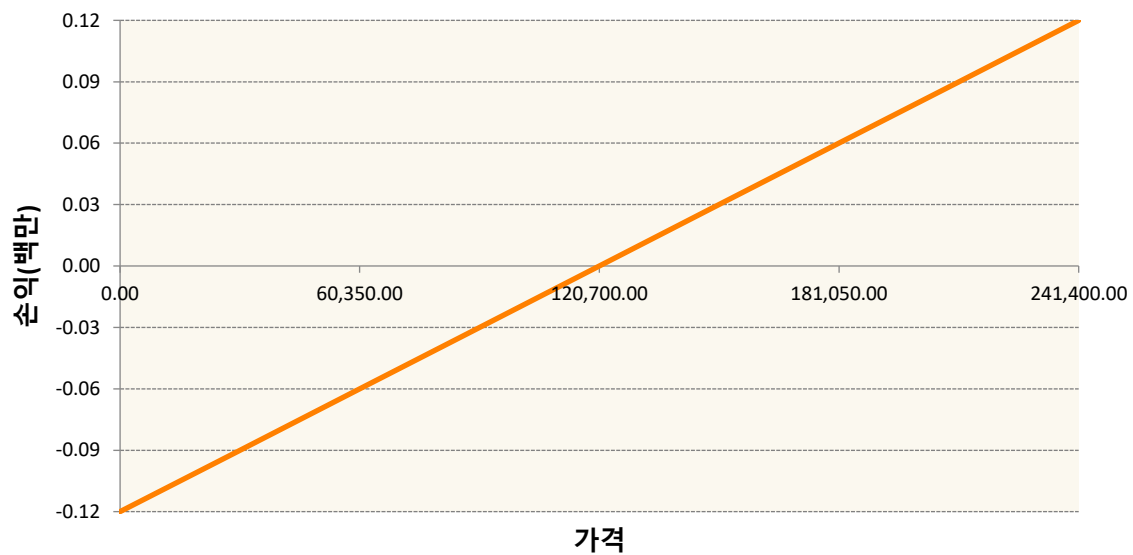
KR41FMW30007-2025-03 엘애프개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



KR41HEW30000-2025-03 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물		77
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물		1
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물		2
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물		2
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물		1
KR41DEW30(2025-03 한국콜마개별선물		0.48
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)
	157

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

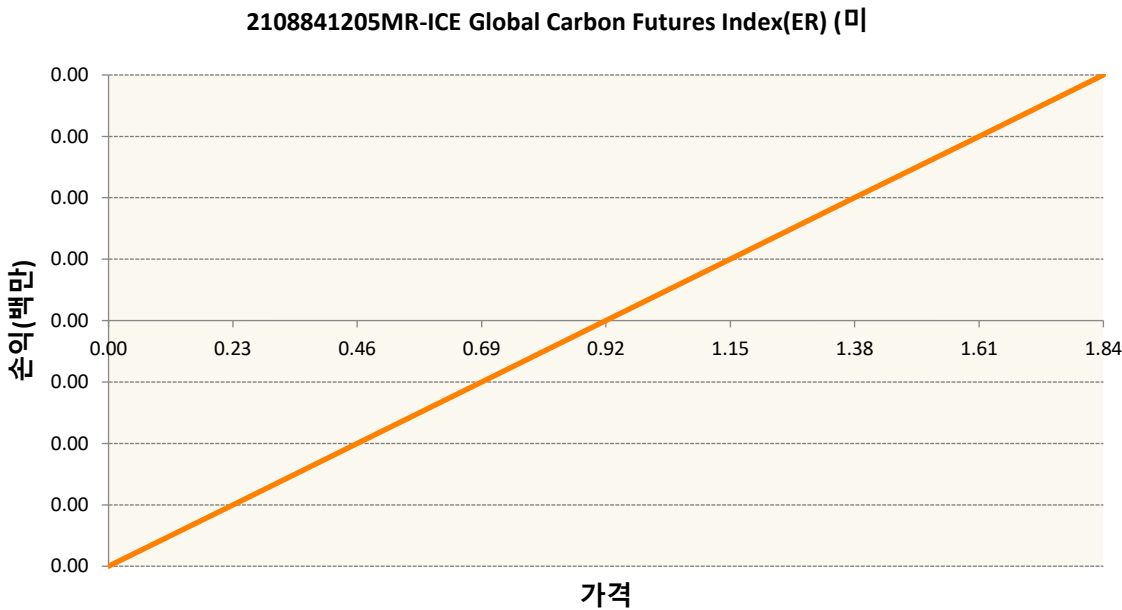
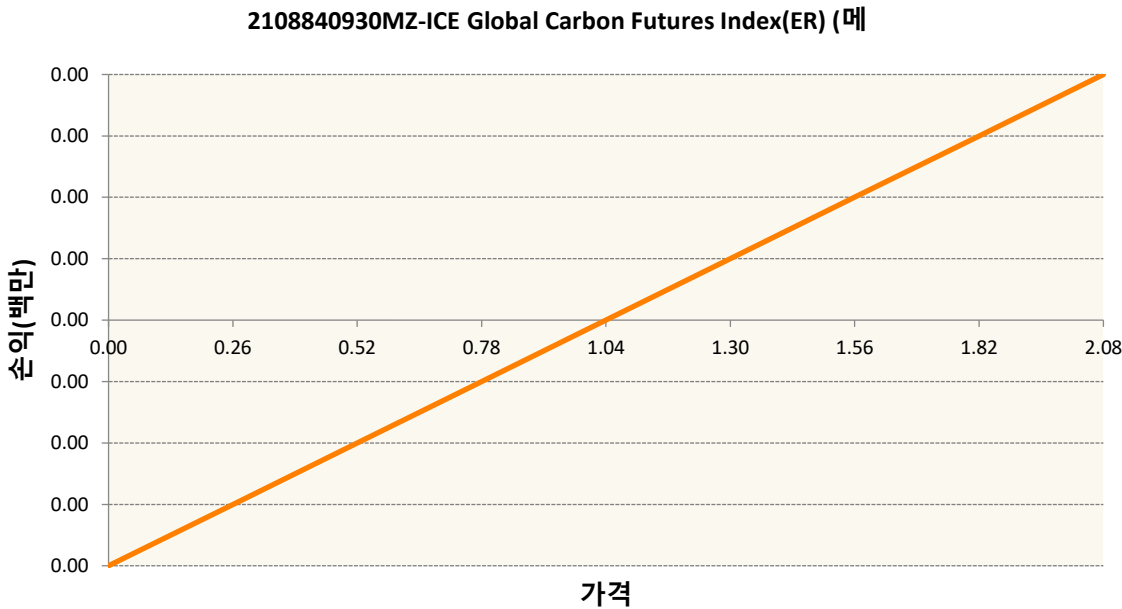
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,345	0	9,345	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		187
2108841205IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		559

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	829

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

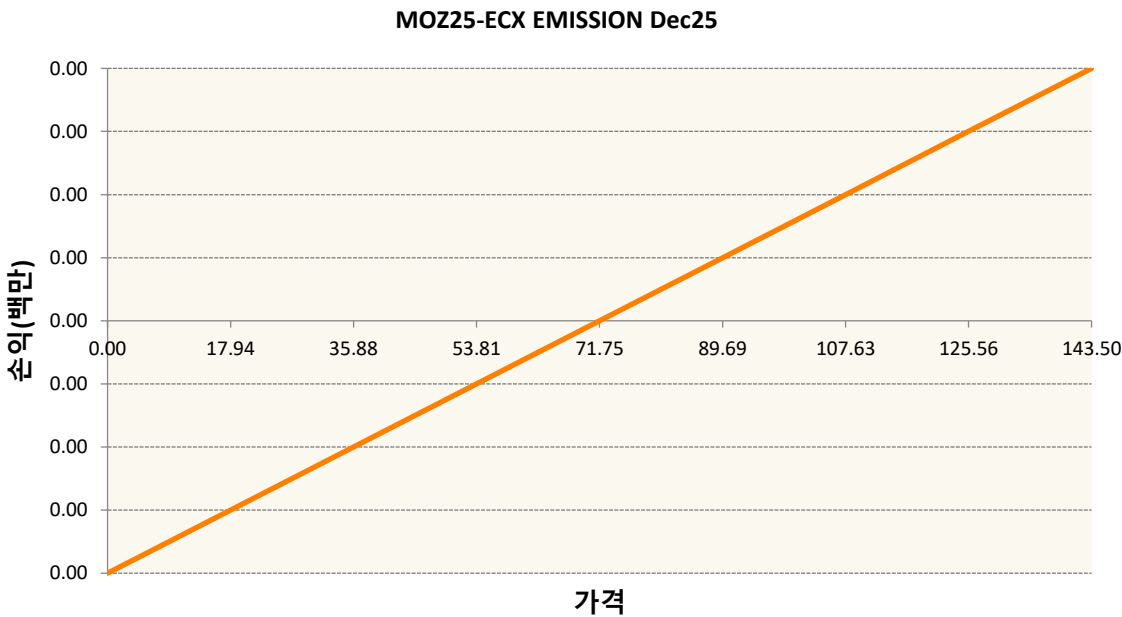
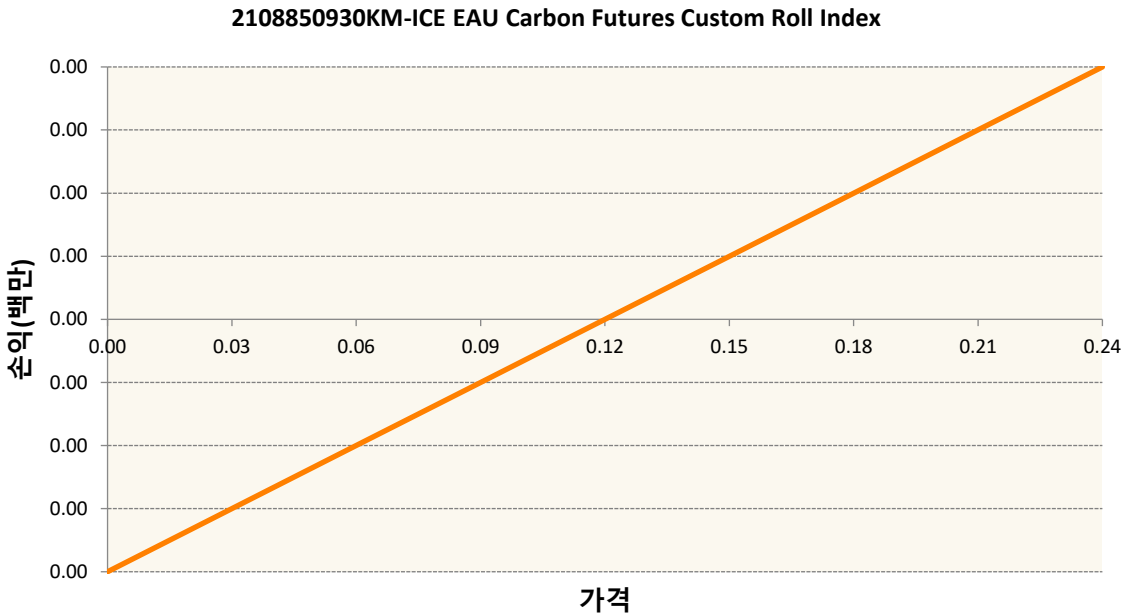
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,922	0	8,922	
누계	통화	선도	0	2,567	-2,567	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		3
FXW213F1PC KRW/EUR 28-02-25E		40
FXW213F1PC KRW/EUR 28-02-25E		87
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E		79
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		711

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,335

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

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)

33

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

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)	25
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	30
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)

142

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

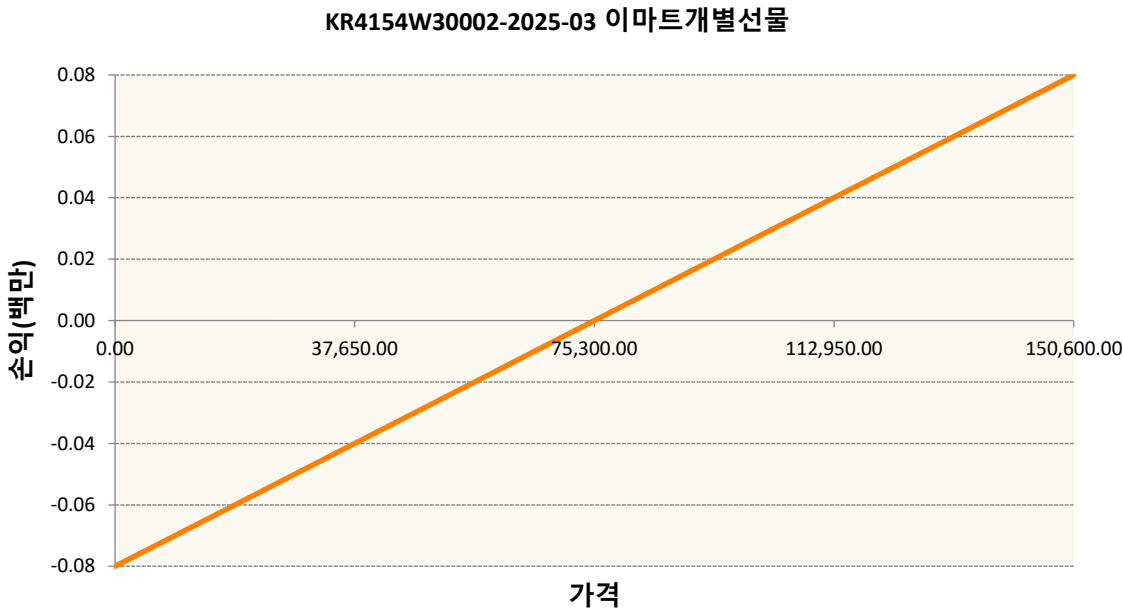
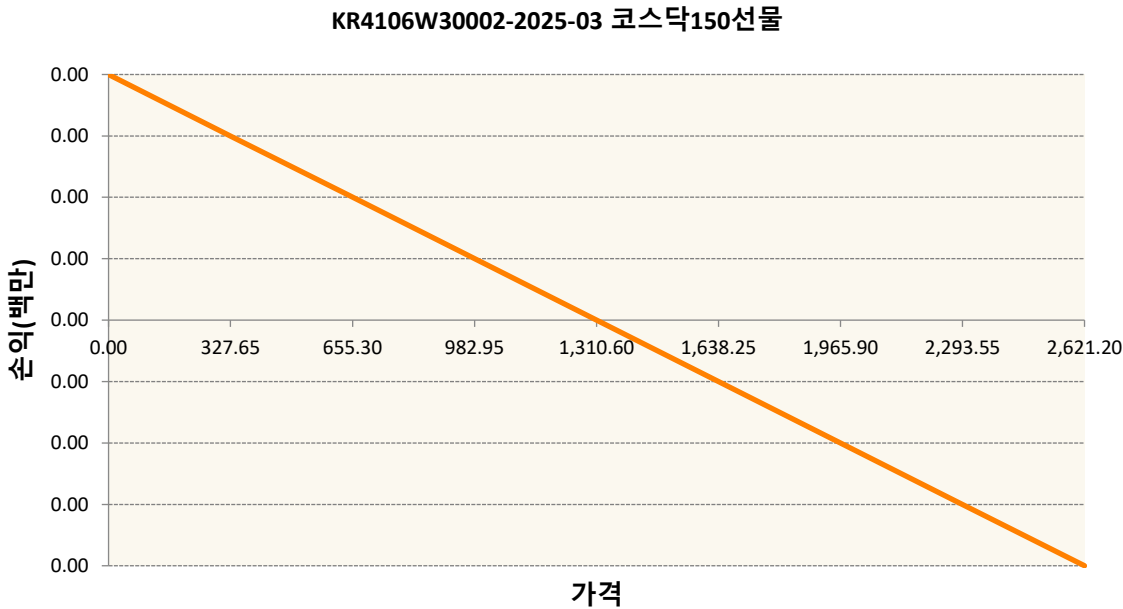
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

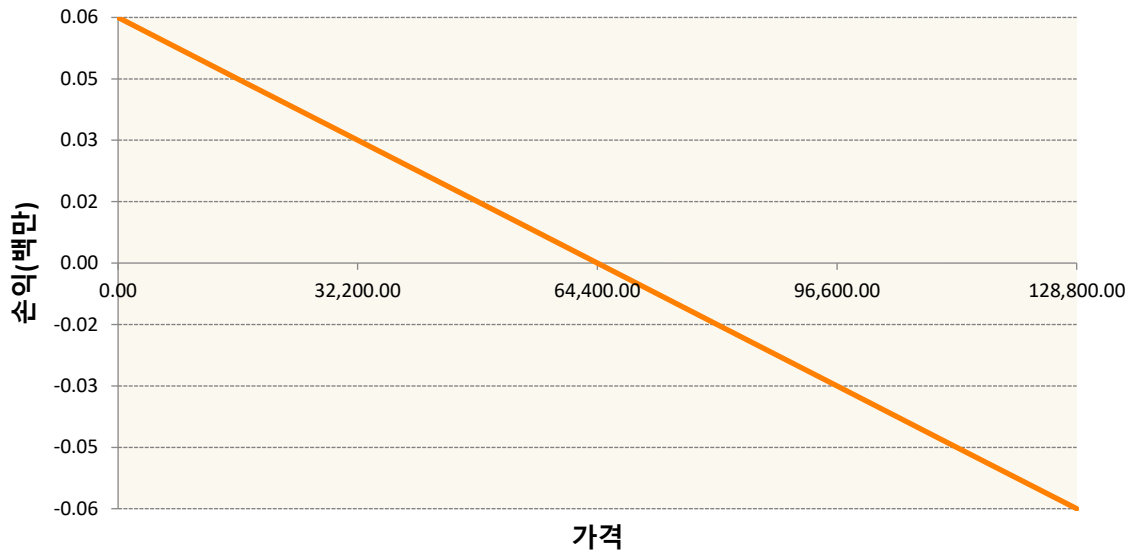
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5	3	2	장내
누계	유가증권	선물	34	66	-32	장내

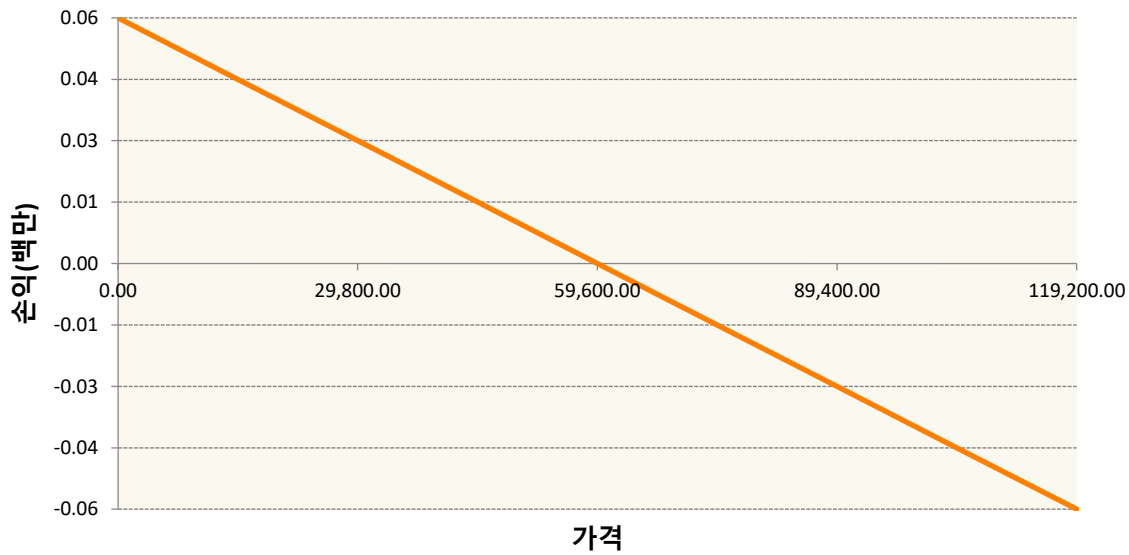
2. 만기시점의 손익구조



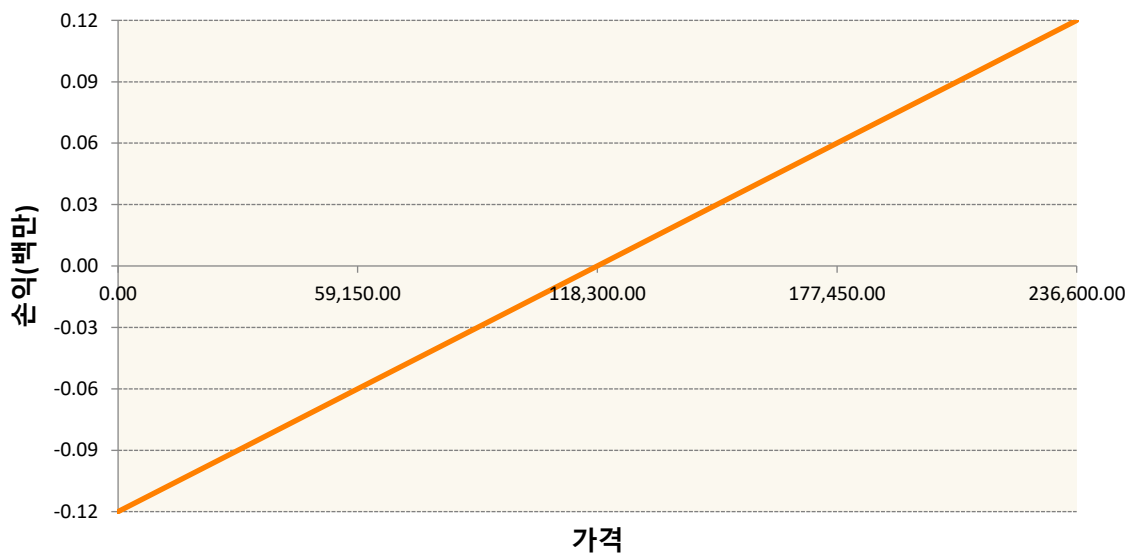
KR41BAW30001-2025-03 롯데쇼핑개별선물



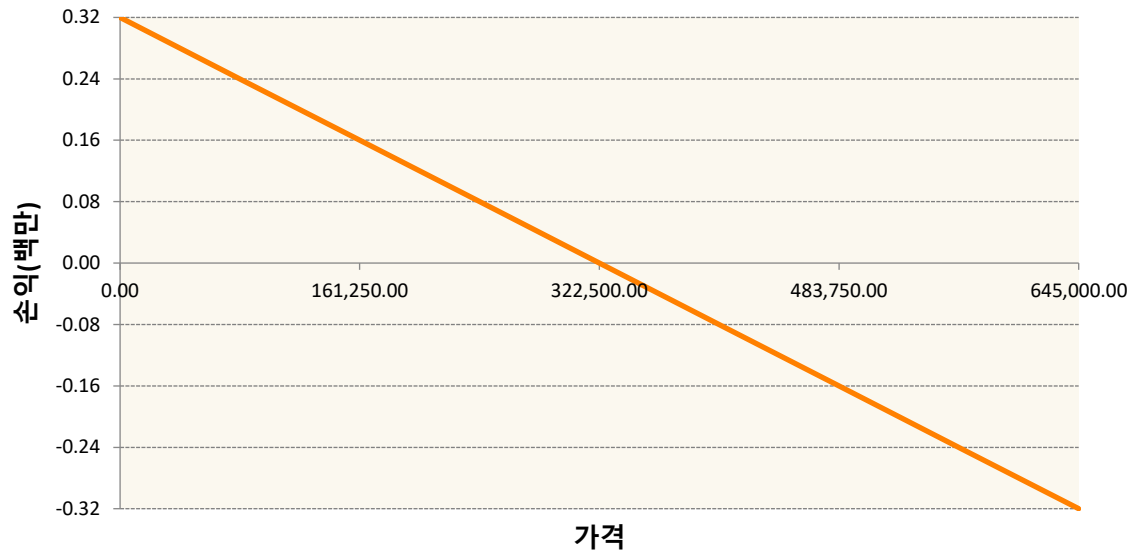
KR41BMW30006-2025-03 한국항공우주개별선물



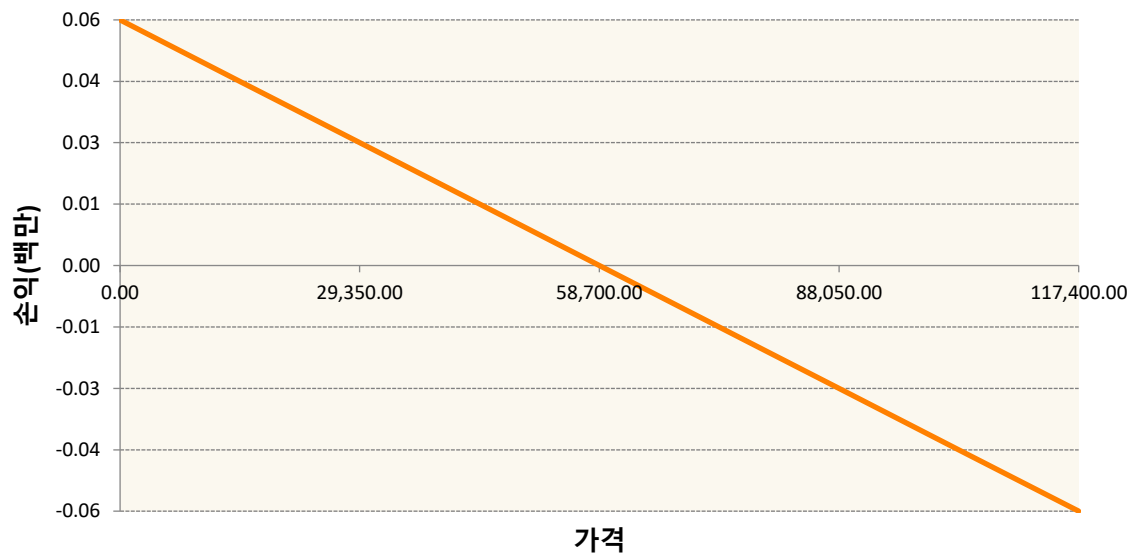
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



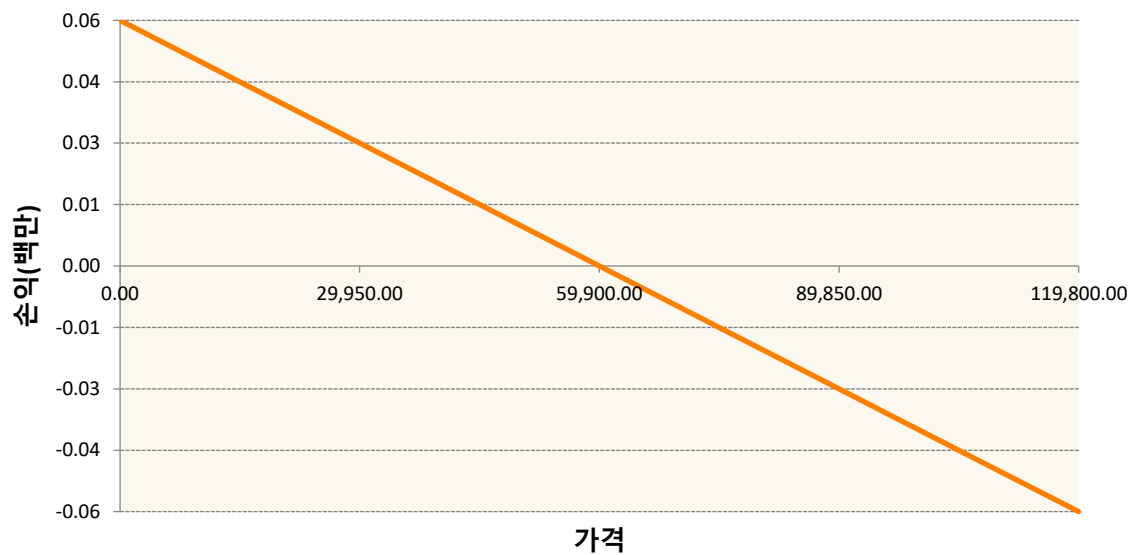
KR41CRW30003-2025-03 LG생활건강개별선물



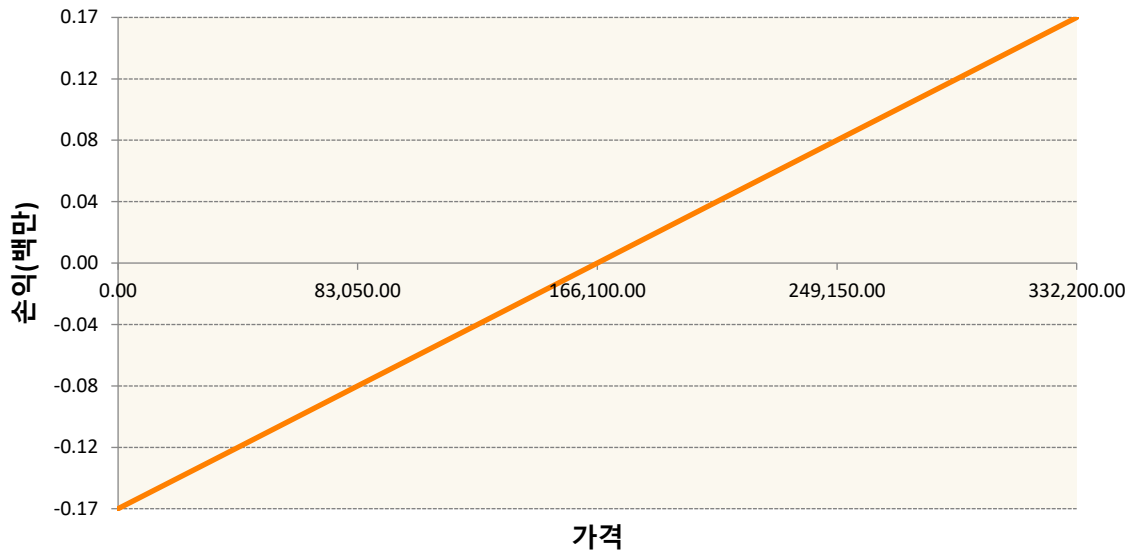
KR41D8W30004-2025-03 현대백화점개별선물



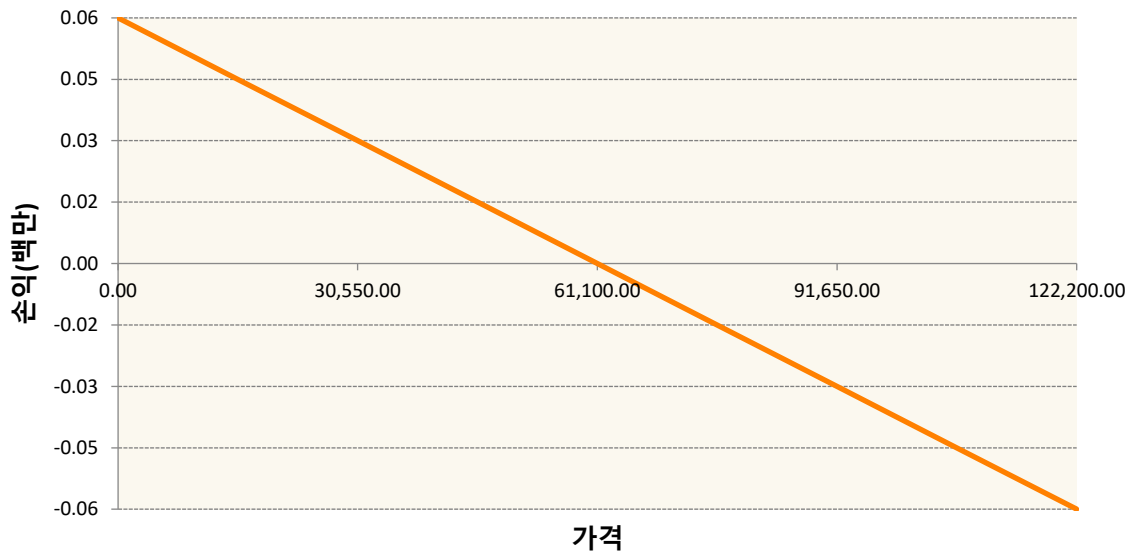
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



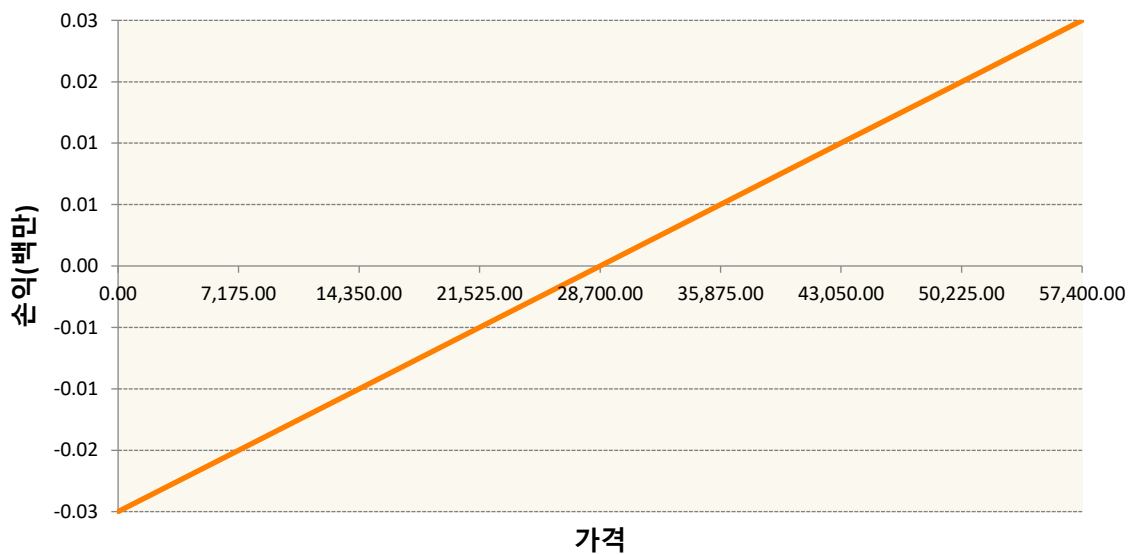
KR41DKW30006-2025-03 코스맥스개별선물

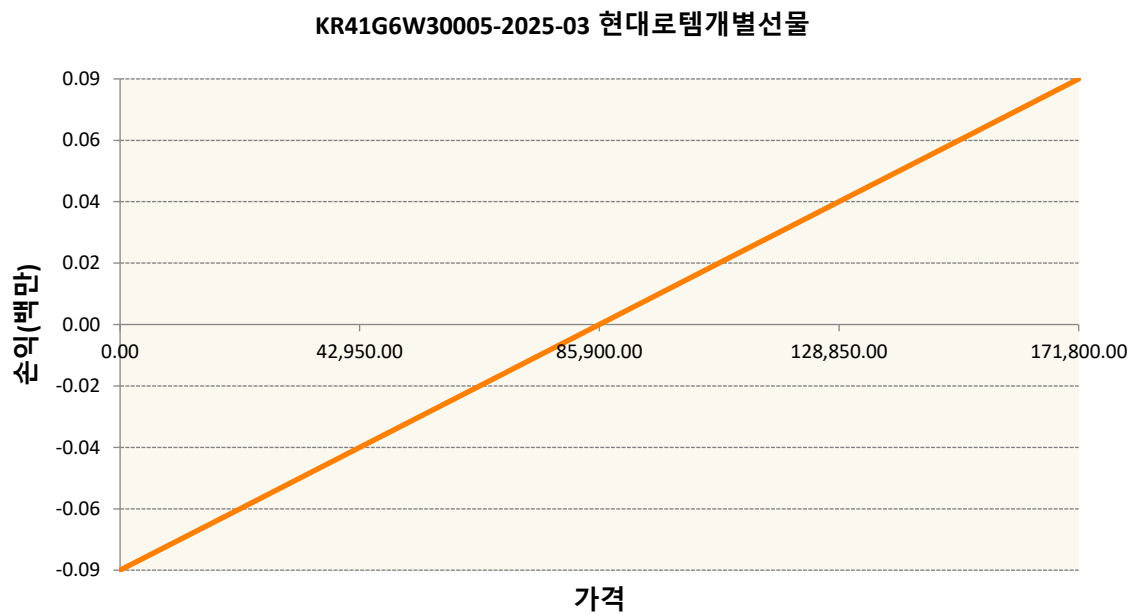
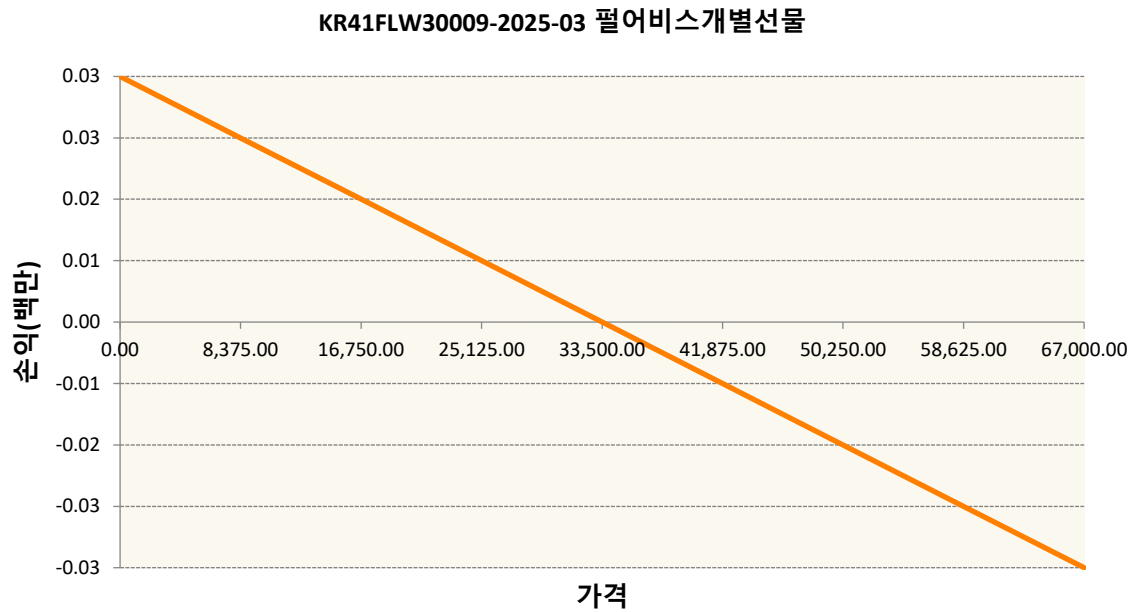


KR41DTW30007-2025-03 CJ ENM개별선물



KR41ENW30008-2025-03 동진세미캠개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4106W30(2025-03 코스닥150선물		1
KR4154W30(2025-03 이마트개별선물		0.36
KR41BAW30(2025-03 롯데쇼핑개별선물		1
KR41BMW30(2025-03 한국항공우주개별선물		0.48
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
KR41ENW30(2025-03 동진세미캠개별선물		0.23
KR41FLW30(2025-03 펄어비스개별선물		0.29

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

(단위:백만원)

17

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

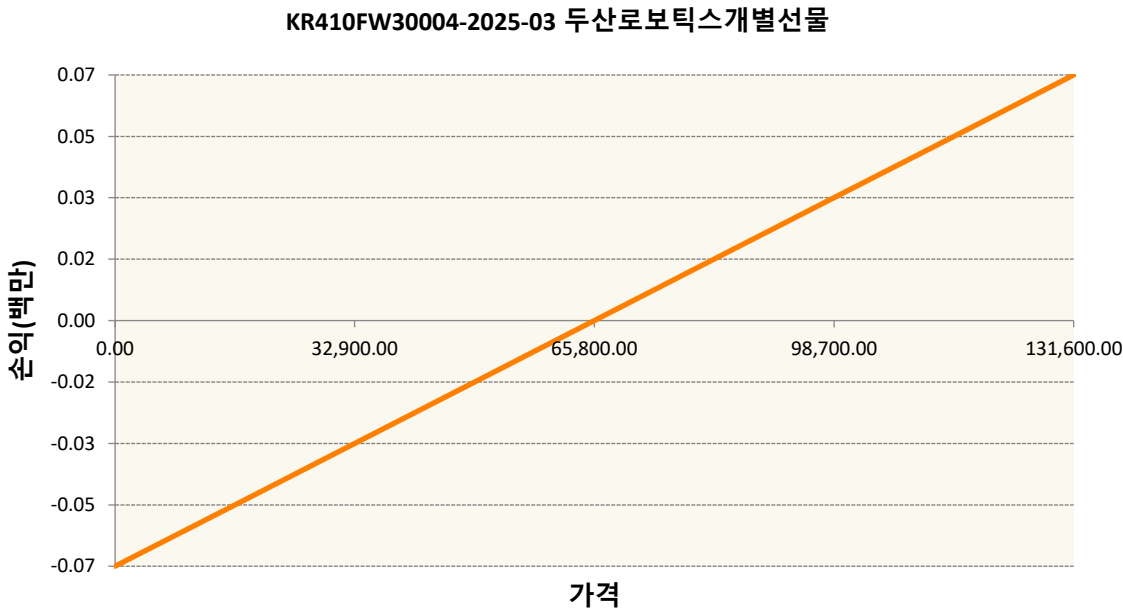
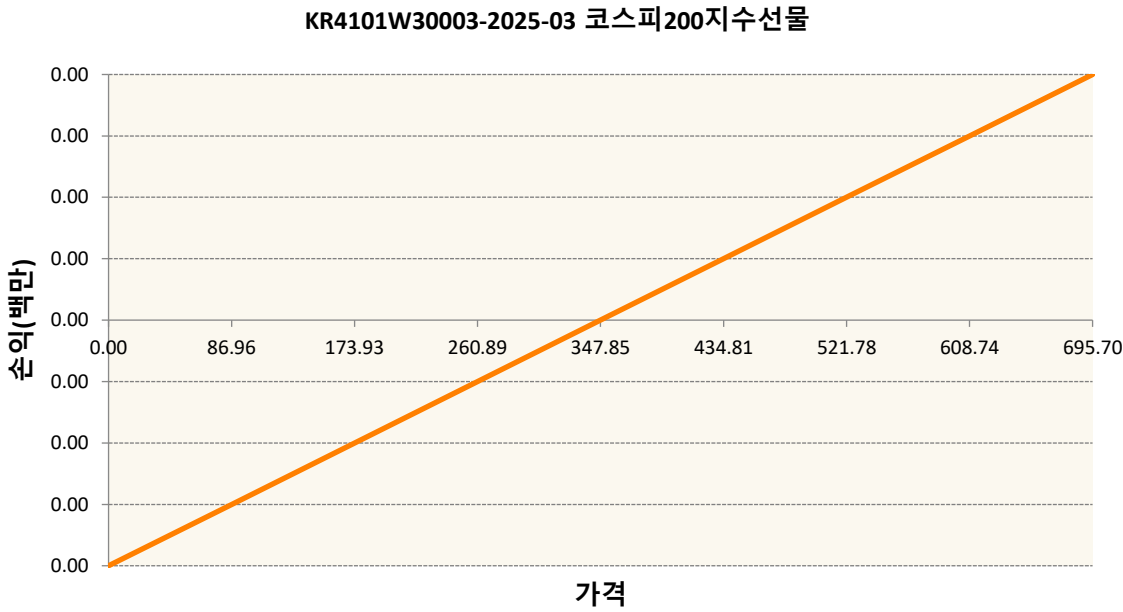
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

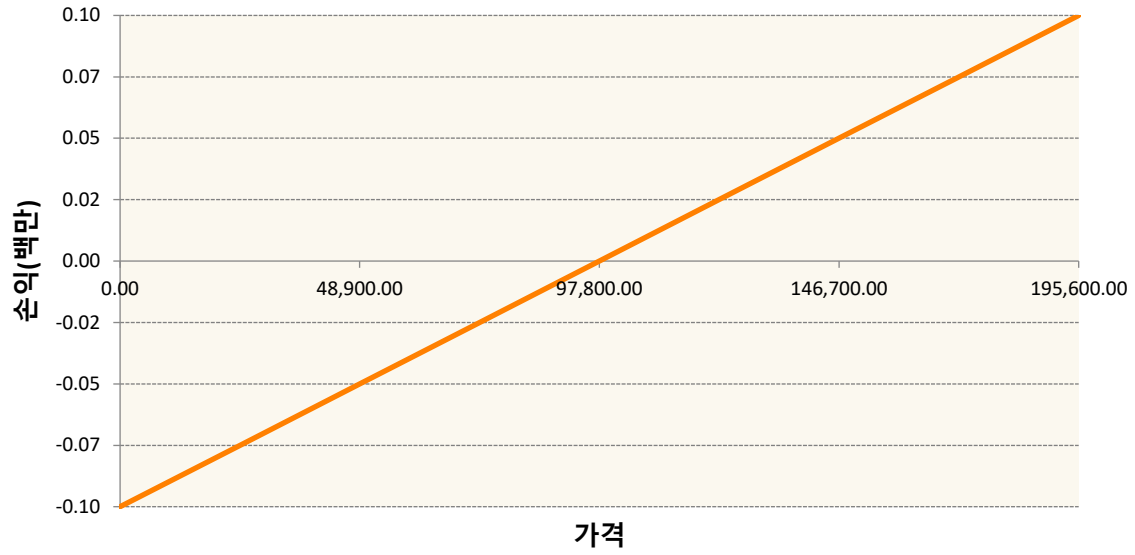
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	867	870	-3	장내
누계	유가증권	선물	10,651	0	10,651	장내

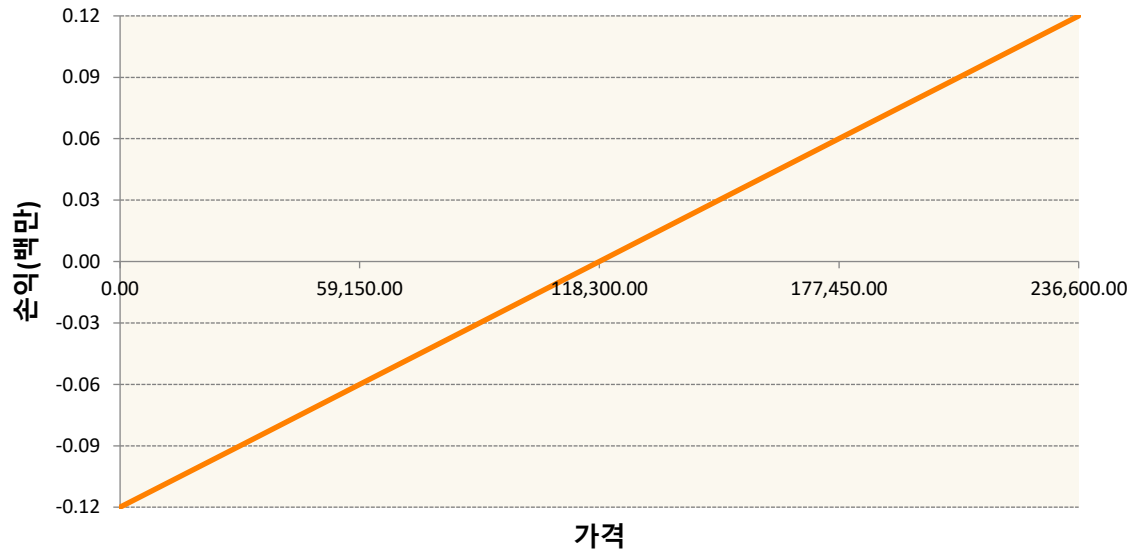
2. 만기시점의 손익구조



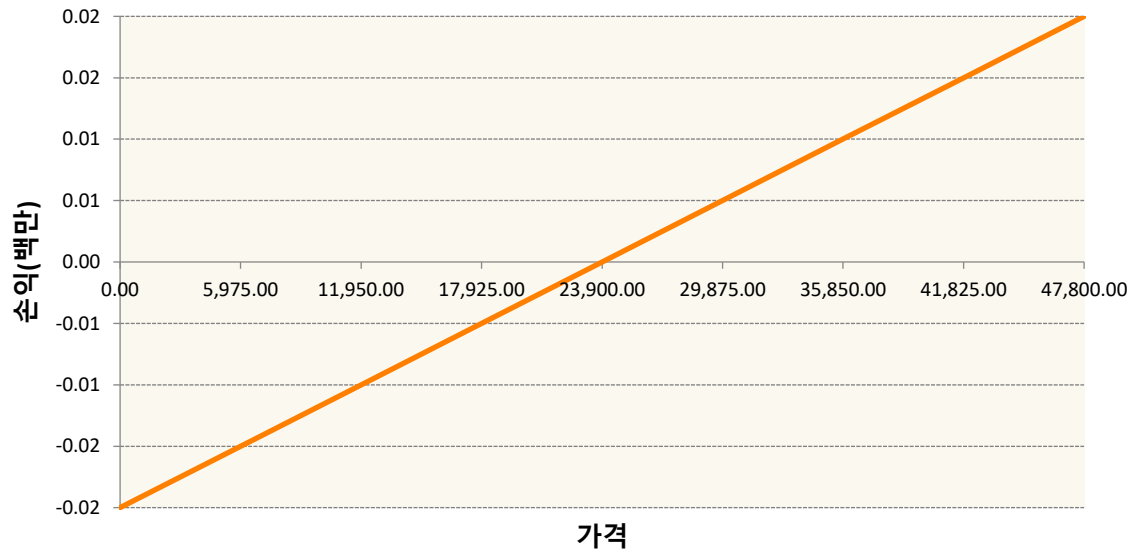
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



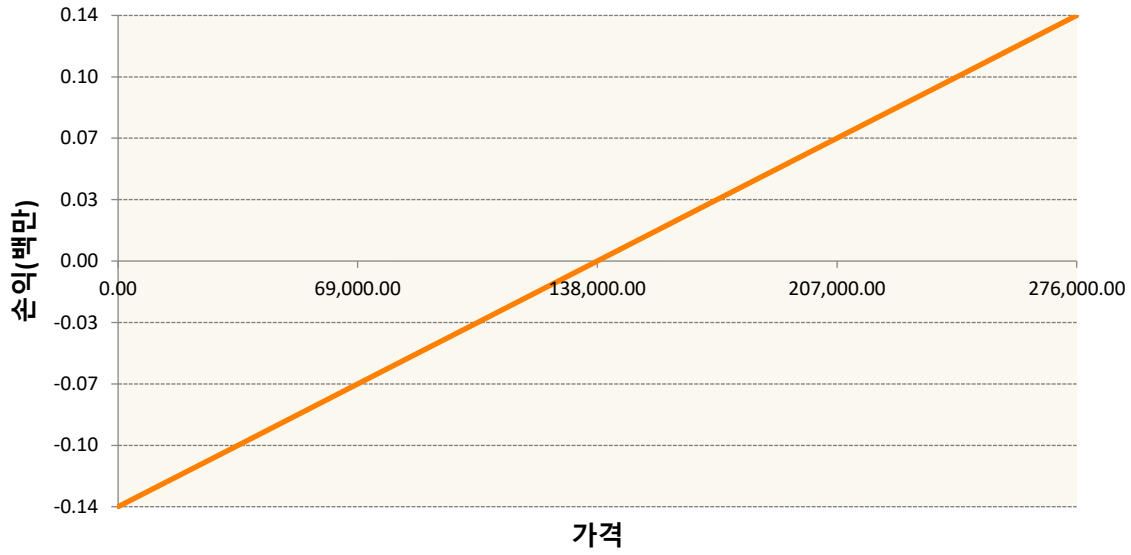
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



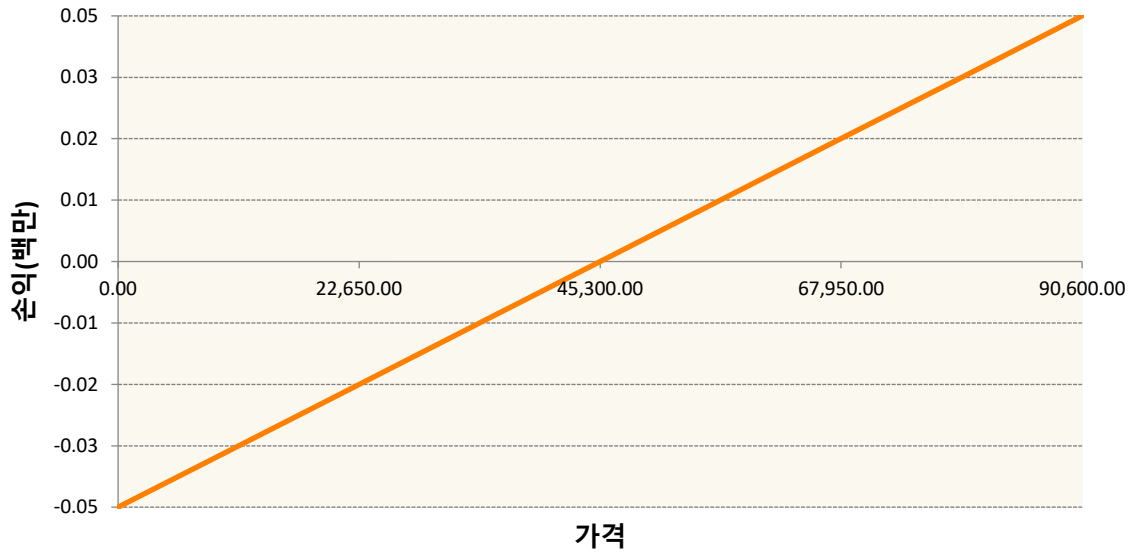
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



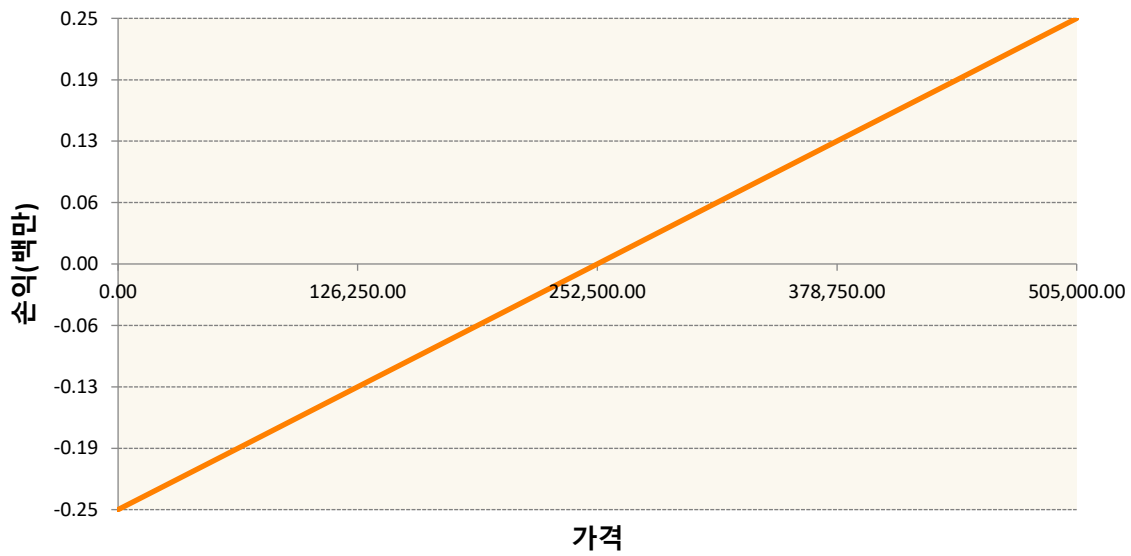
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



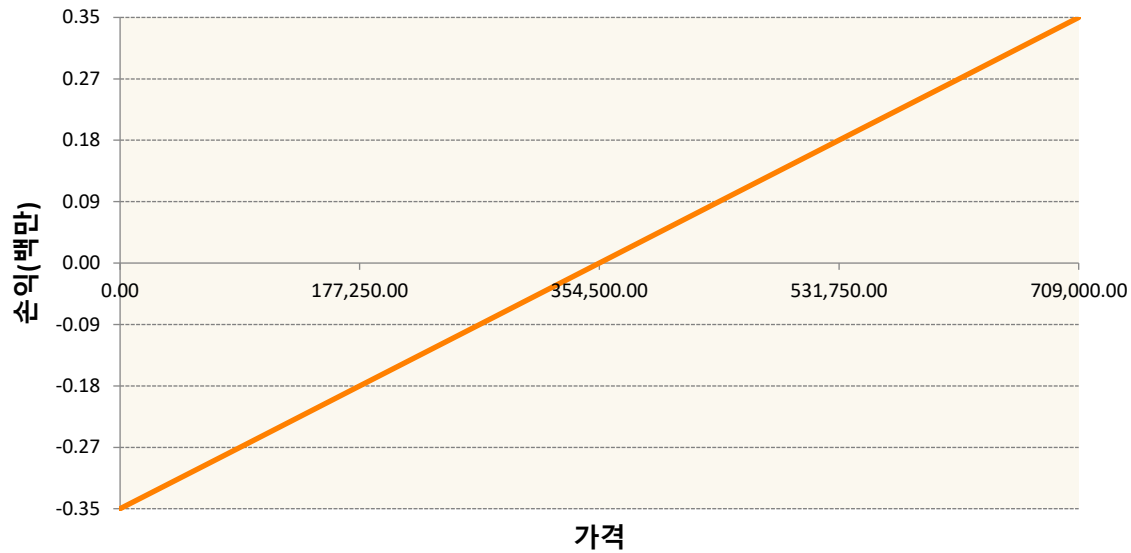
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	591
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	13
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	41
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물	36
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물	12
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	26
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	11
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	51
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	71

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

(단위:백만원)

1,507

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

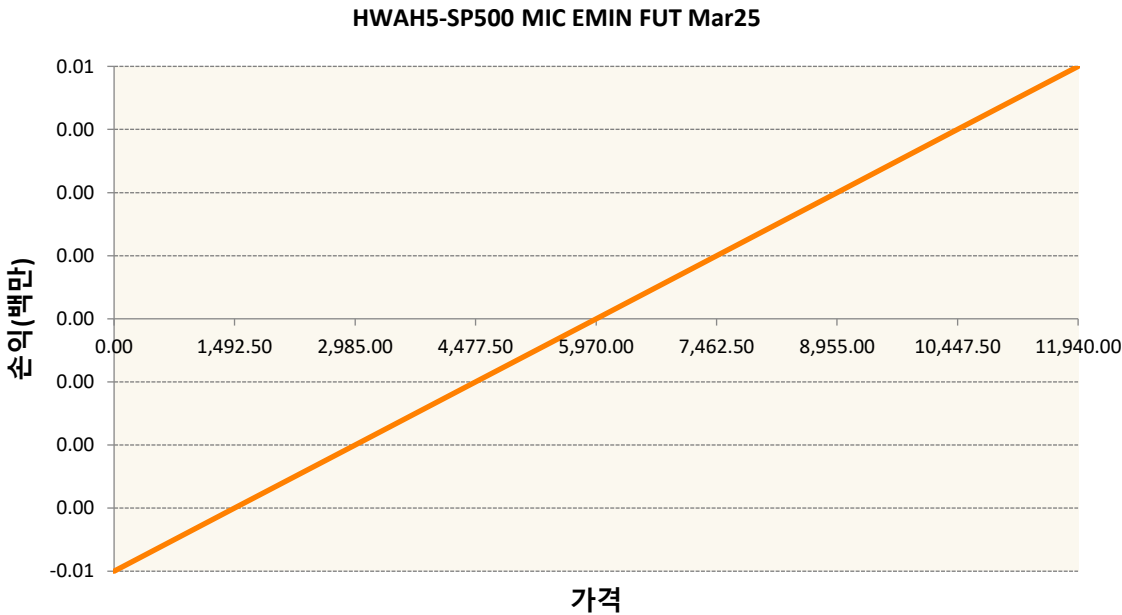
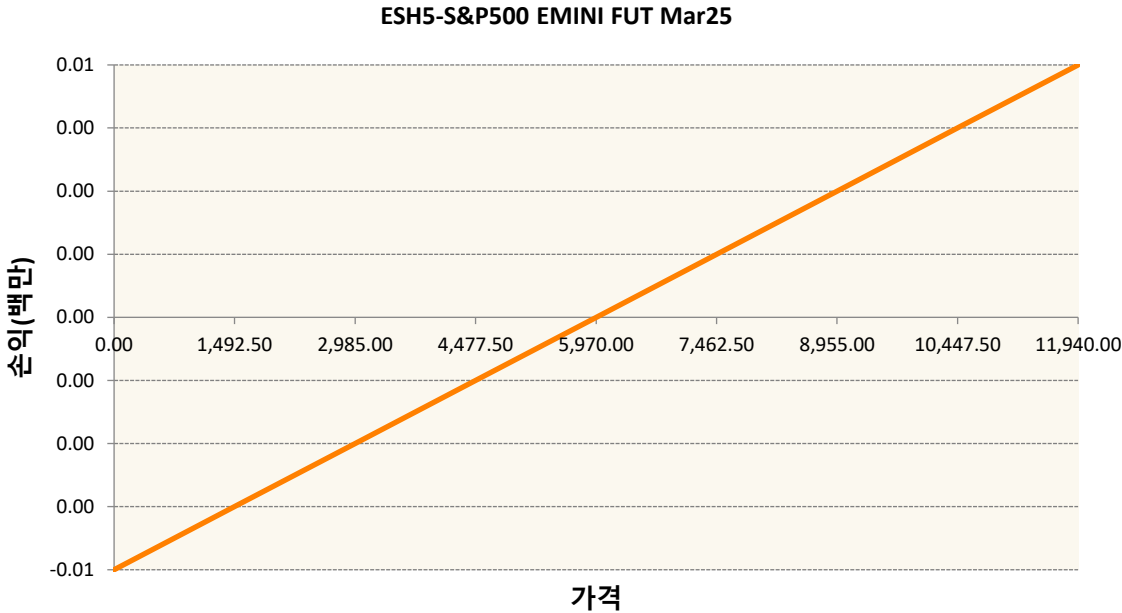
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	29,913	0	29,913	
누계	유가증권	선물	1,255	0	1,255	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,393
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,346

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

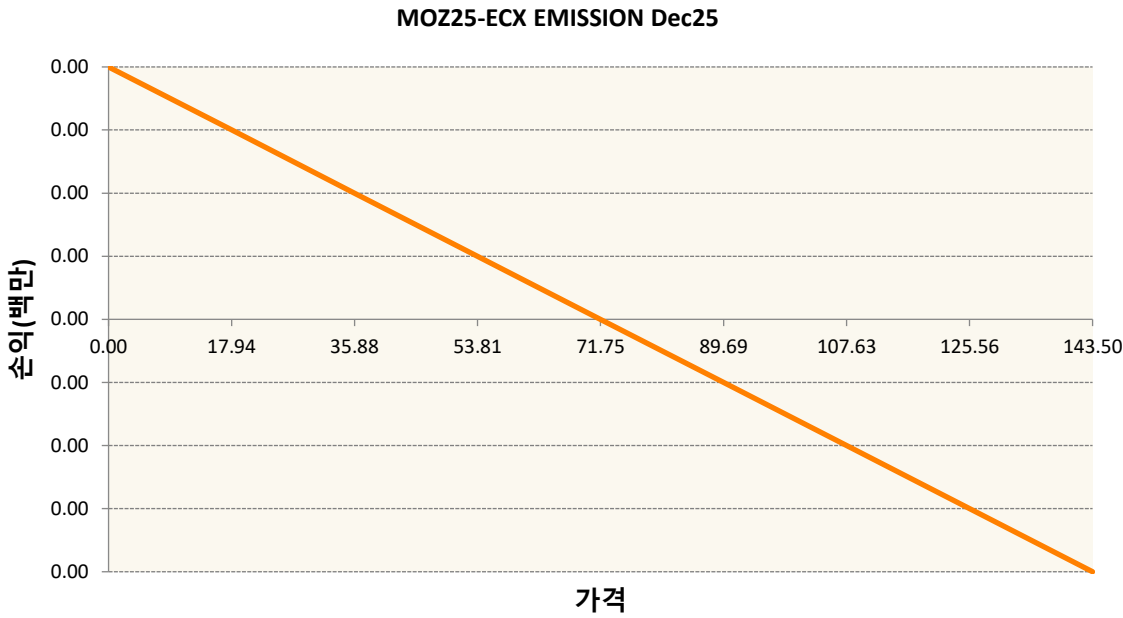
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-41	5,565	-5,606	
누계	통화	선도	0	1,800	-1,800	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3
FXW213F1PC KRW/EUR 28-02-25E	56
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	33
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	56
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	445

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

(단위:백만원)

846

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

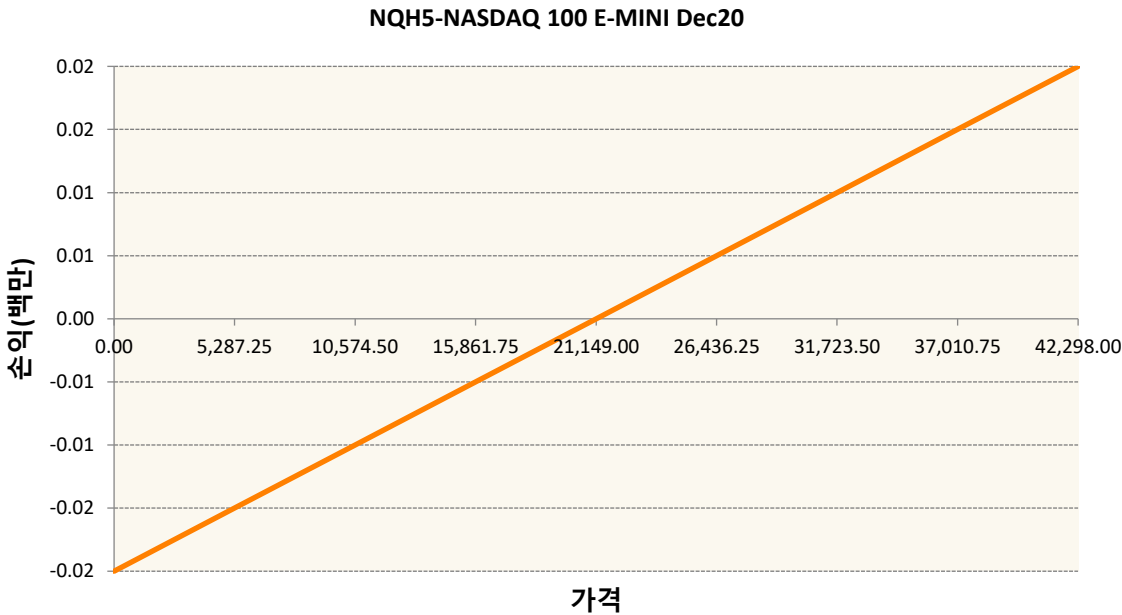
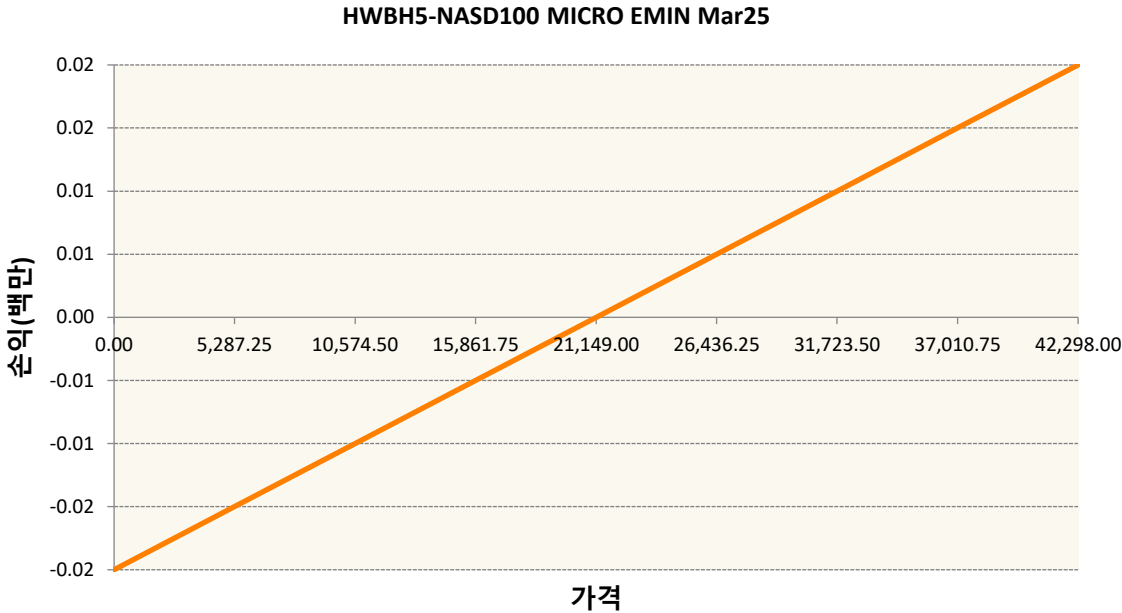
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,754	0	14,754	
누계	유가증권	선물	675	0	675	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25		54
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,180

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,088

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

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	728
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,064
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,903
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,208

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

(단위:백만원)

9,422

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

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	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	41

공시일	2025-02-27
기준일	2025-02-26

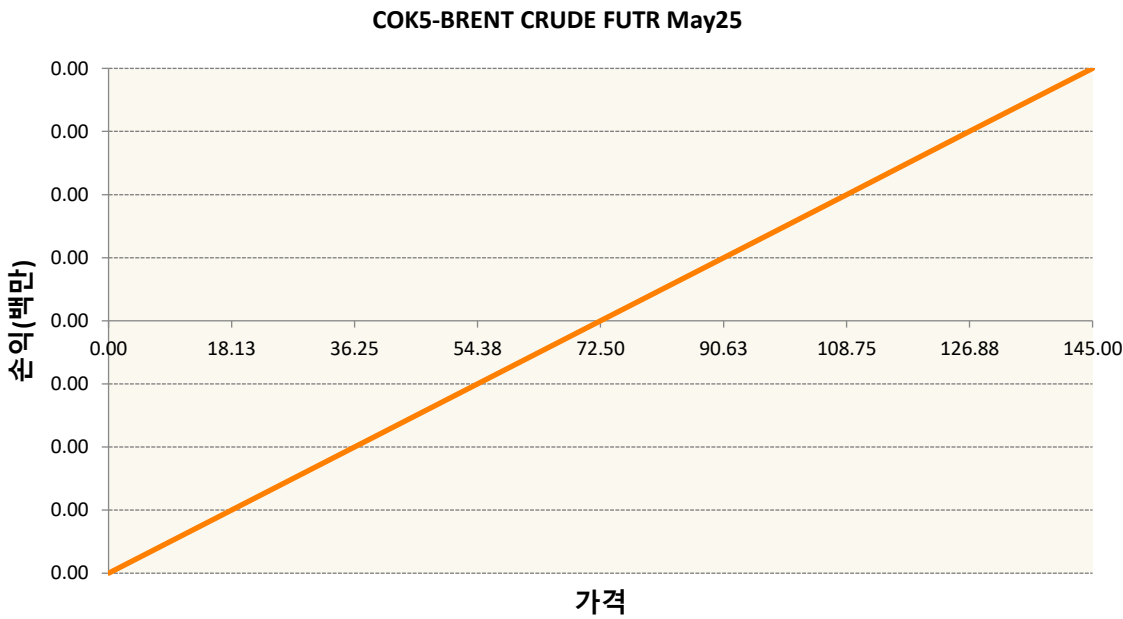
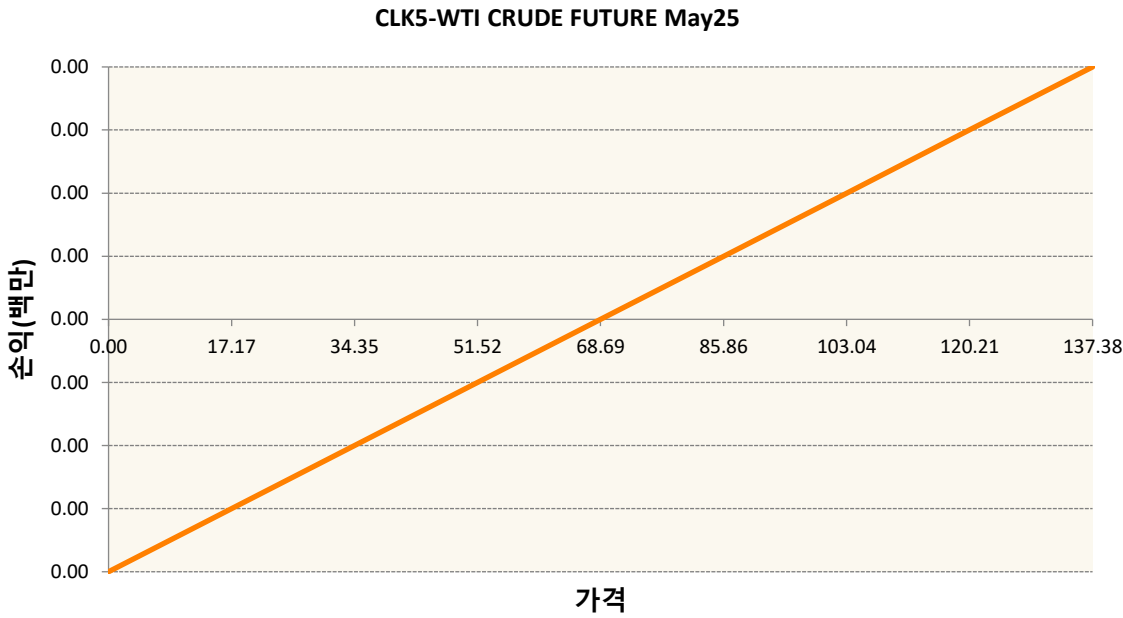
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

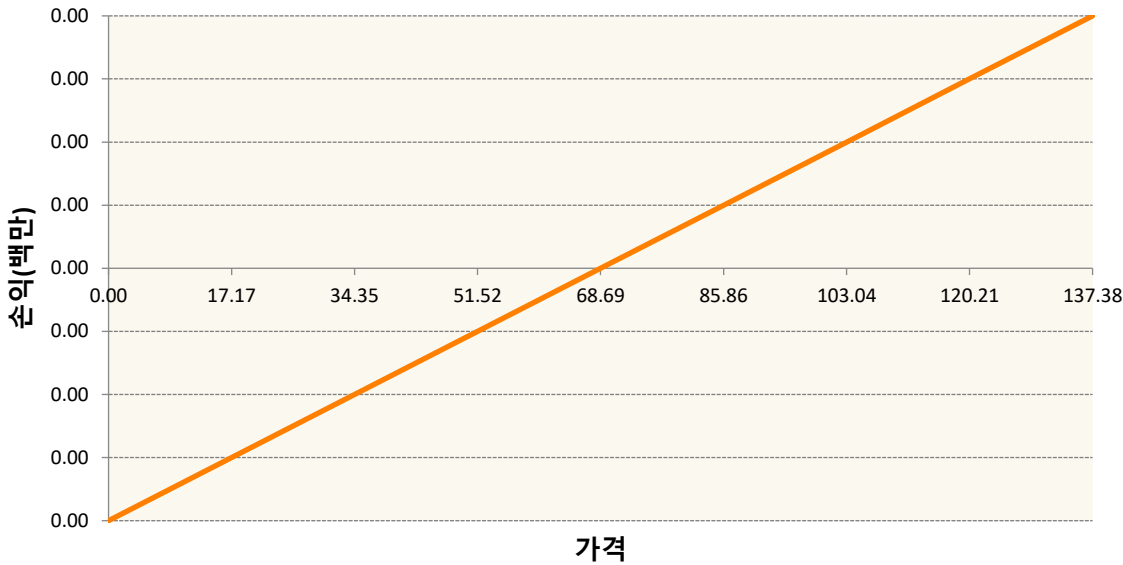
(단위:백만원)

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	884	0	884	
누계	통화	선물	0	172	-172	장내

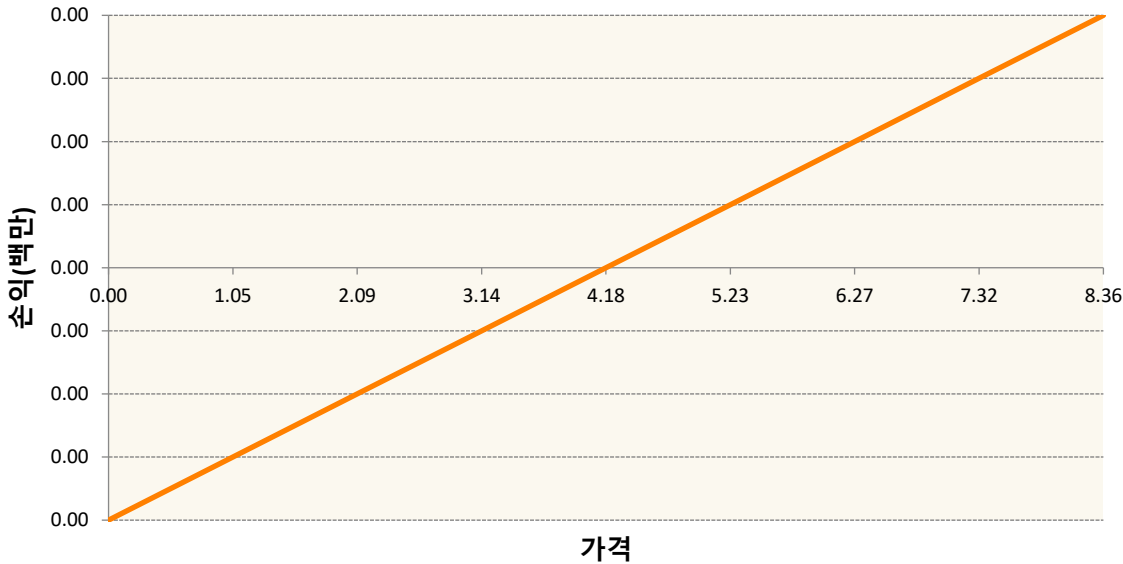
2. 만기시점의 손익구조



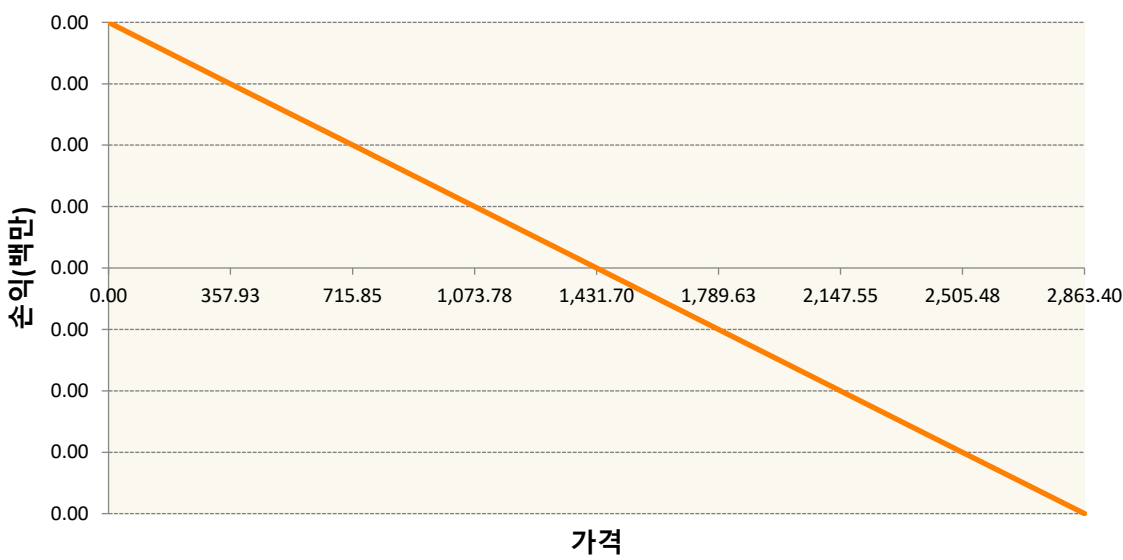
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



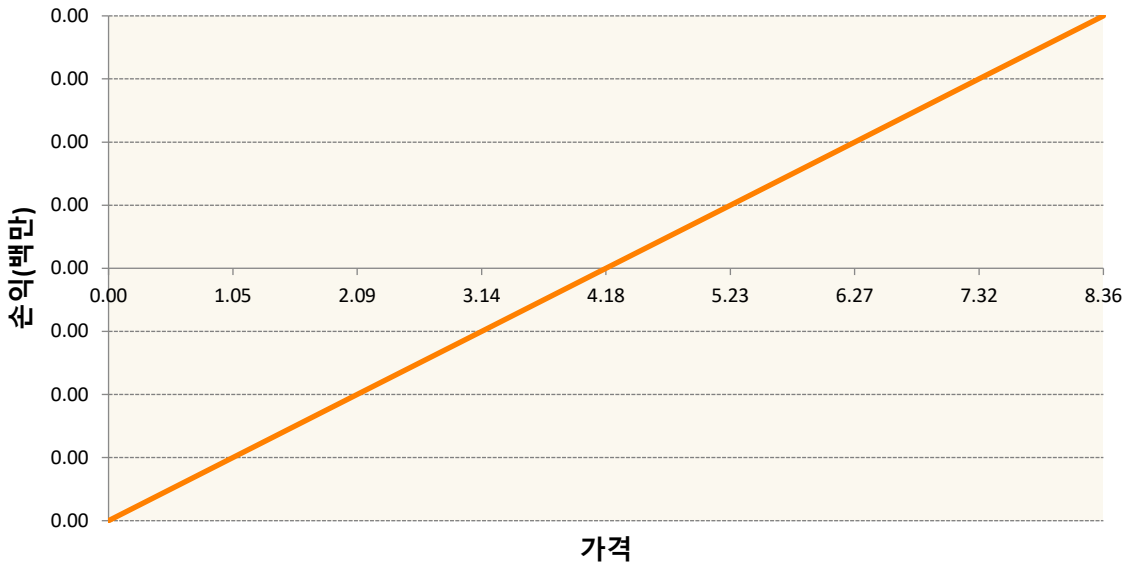
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



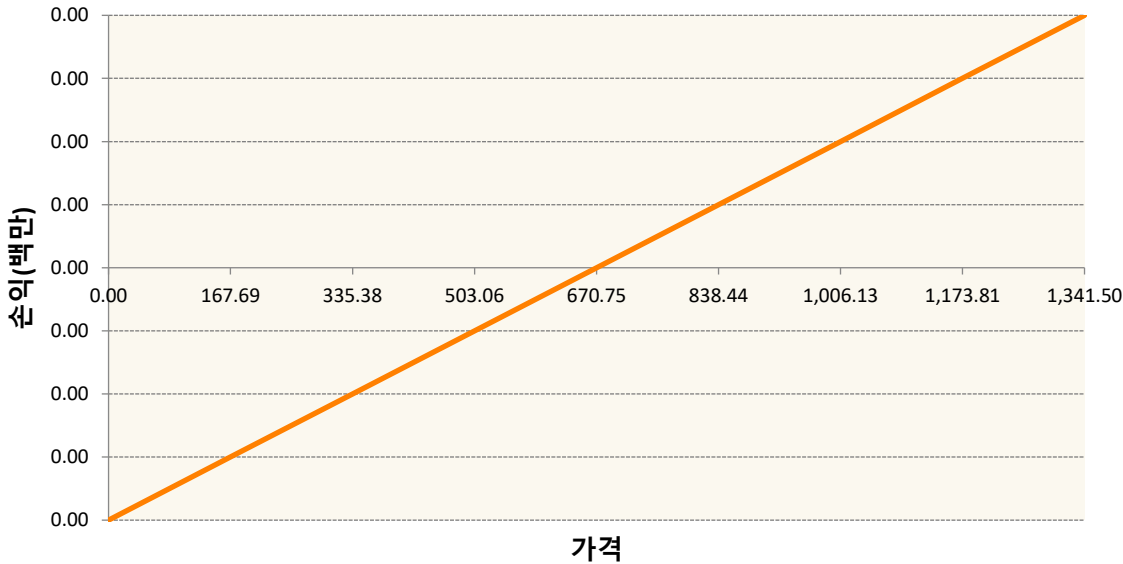
KR4175W30007-2025-03 달러선물



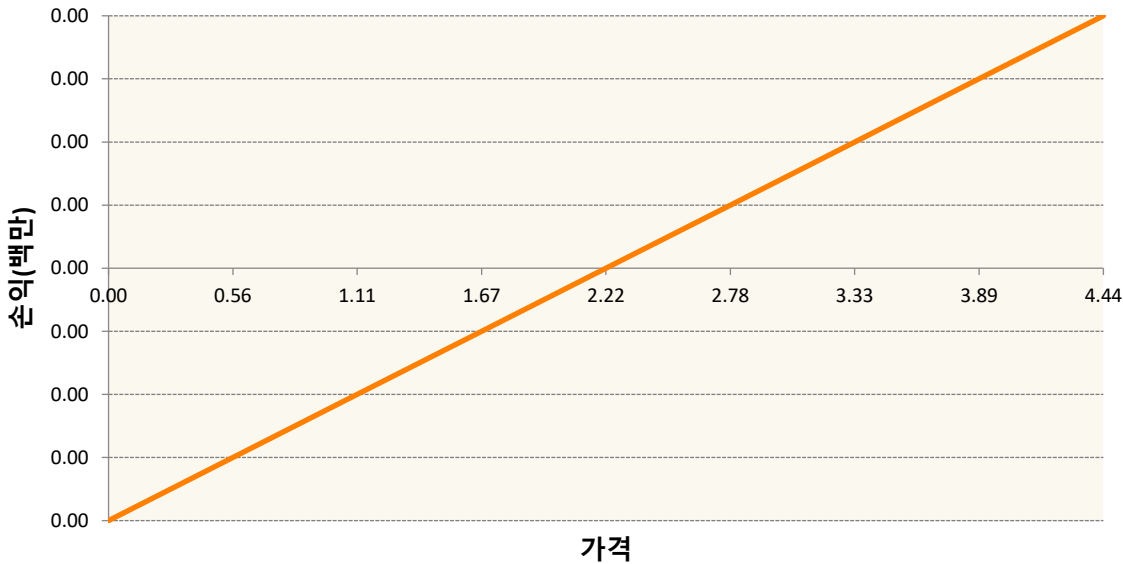
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	17
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	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)

155