

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

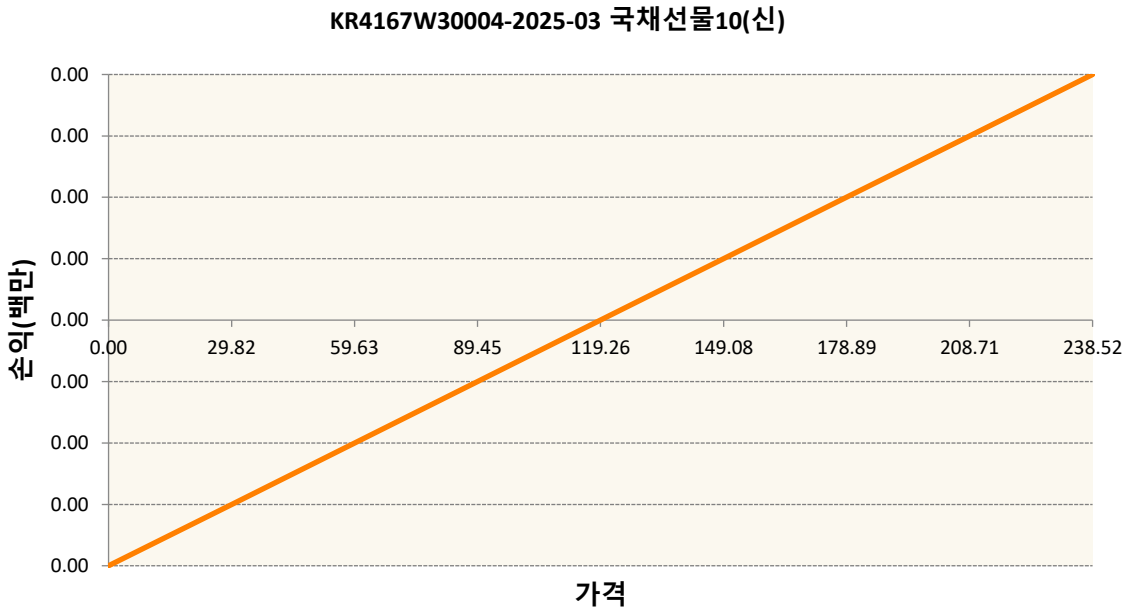
베스트장기채(채권-파생형)

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	236,135	0	236,135	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

5,933

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

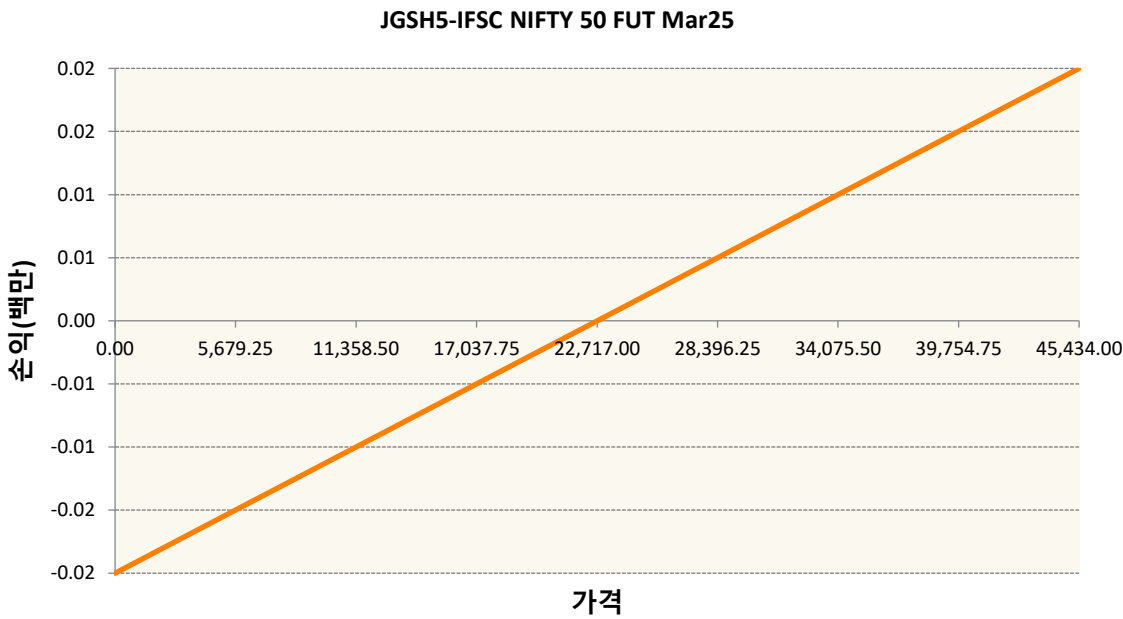
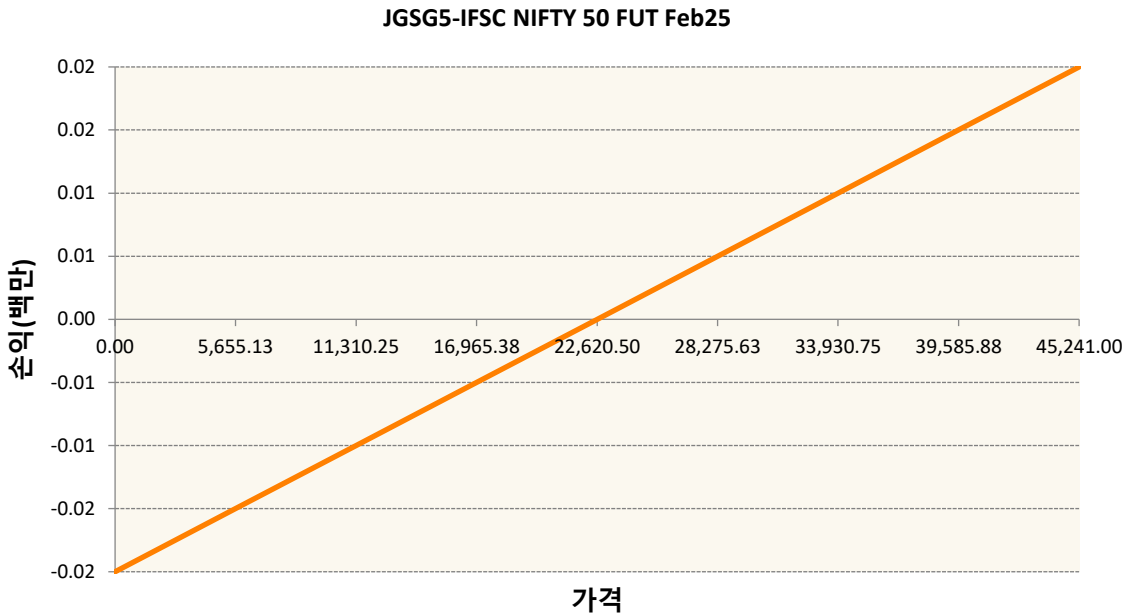
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,285	0	3,285	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
JGSG5	IFSC NIFTY 50 FUT Feb25	210
JGSH5	IFSC NIFTY 50 FUT Mar25	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	178

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

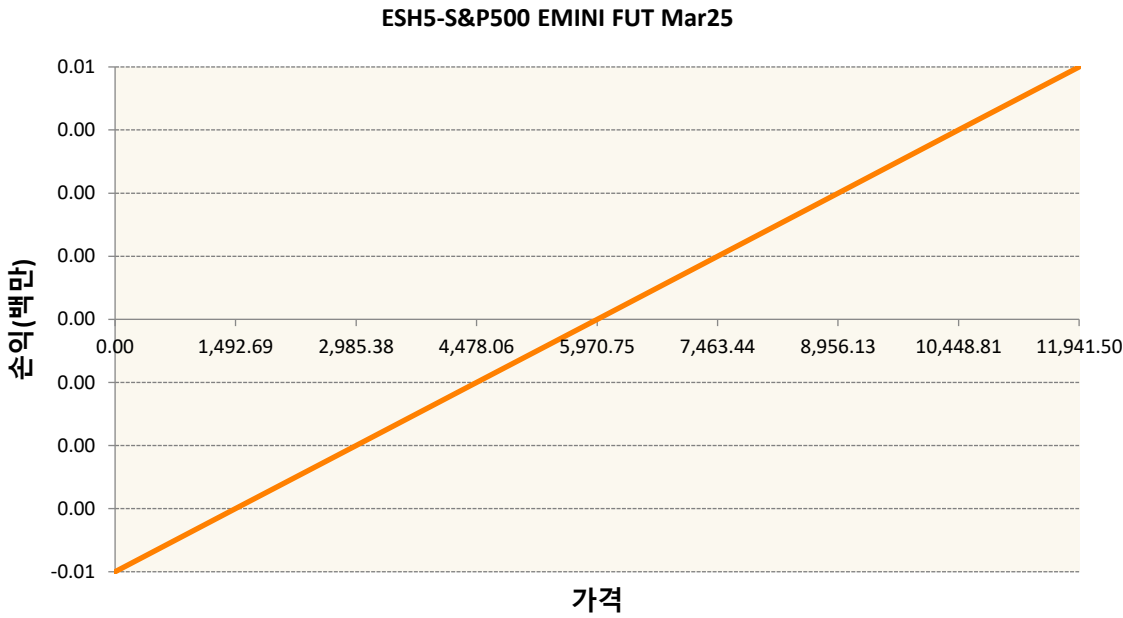
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2025-02-28
기준일	2025-02-27

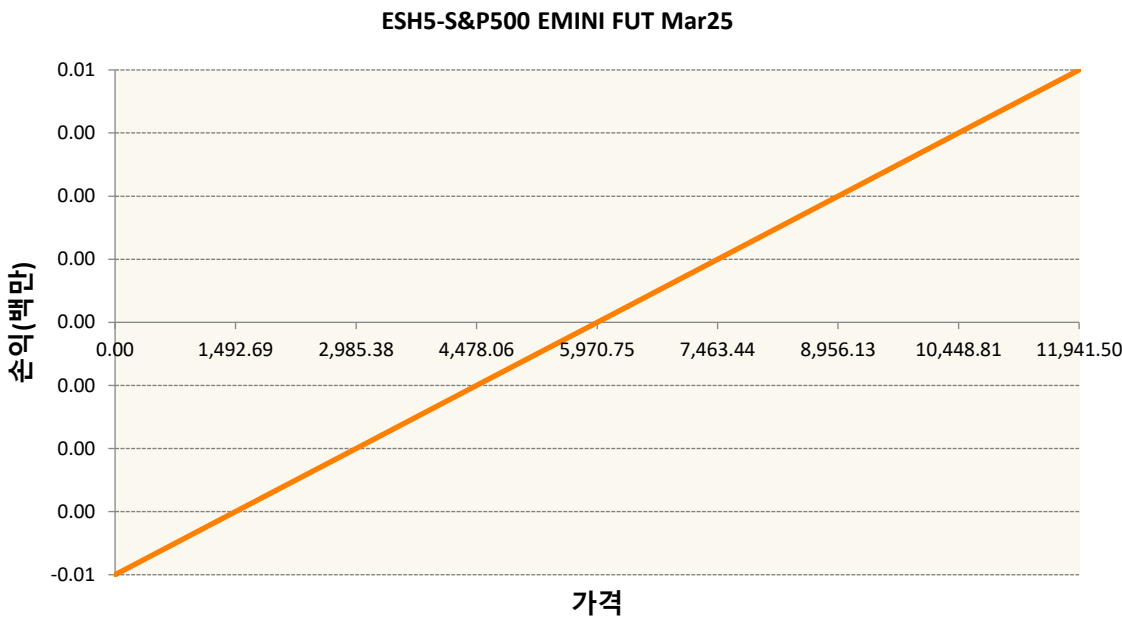
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,600	0	2,600	

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	2025-02-28
기준일	2025-02-27

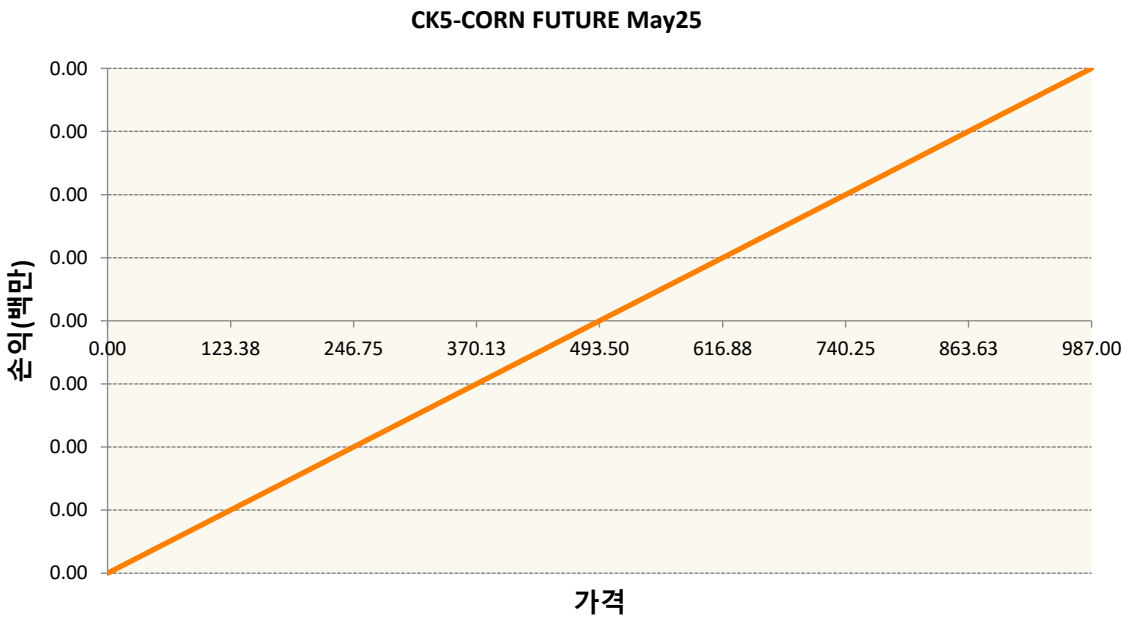
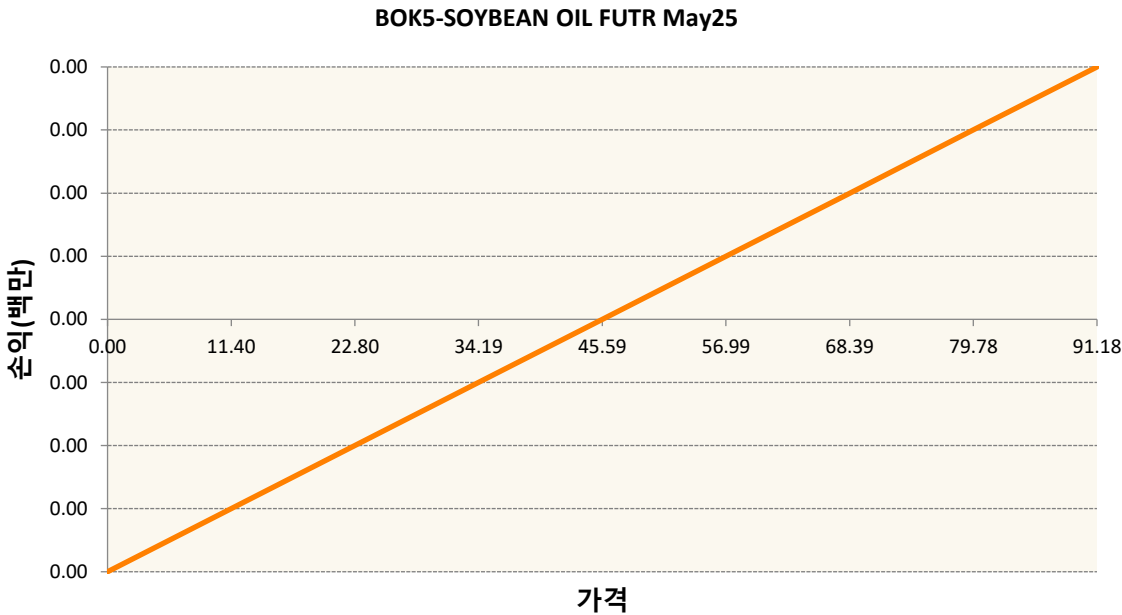
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

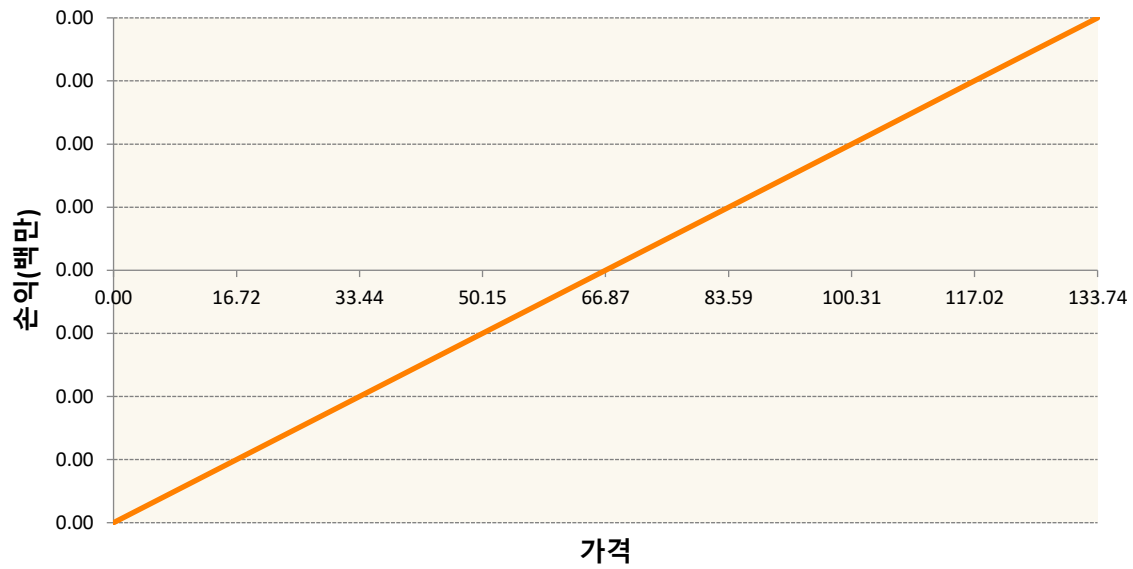
(단위:USD 백만)

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	4,010	0	4,010	
누계	통화	선물	0	576	-576	장내

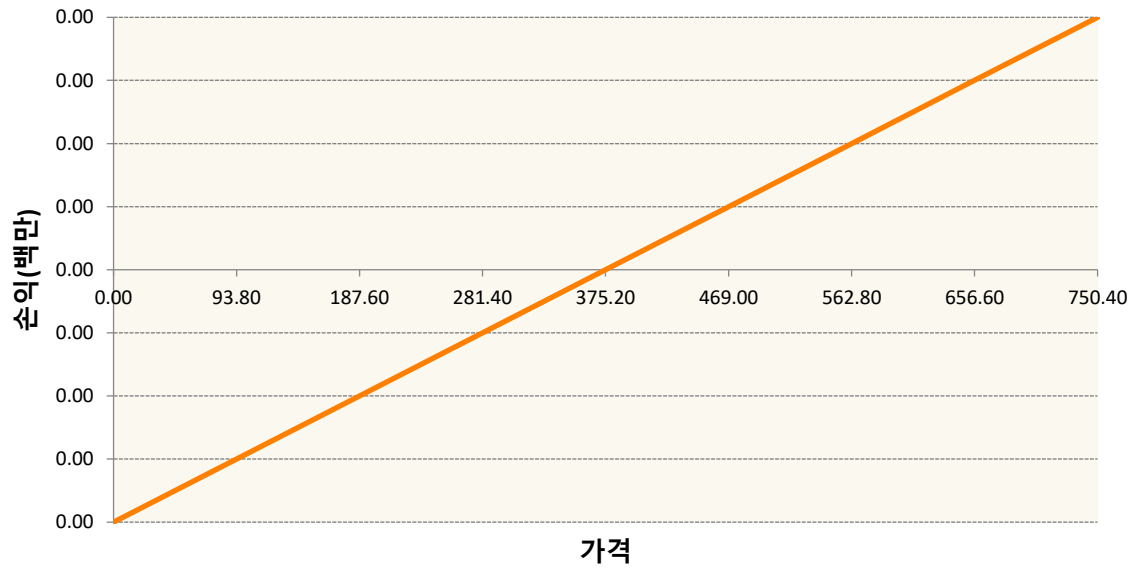
2. 만기시점의 손익구조



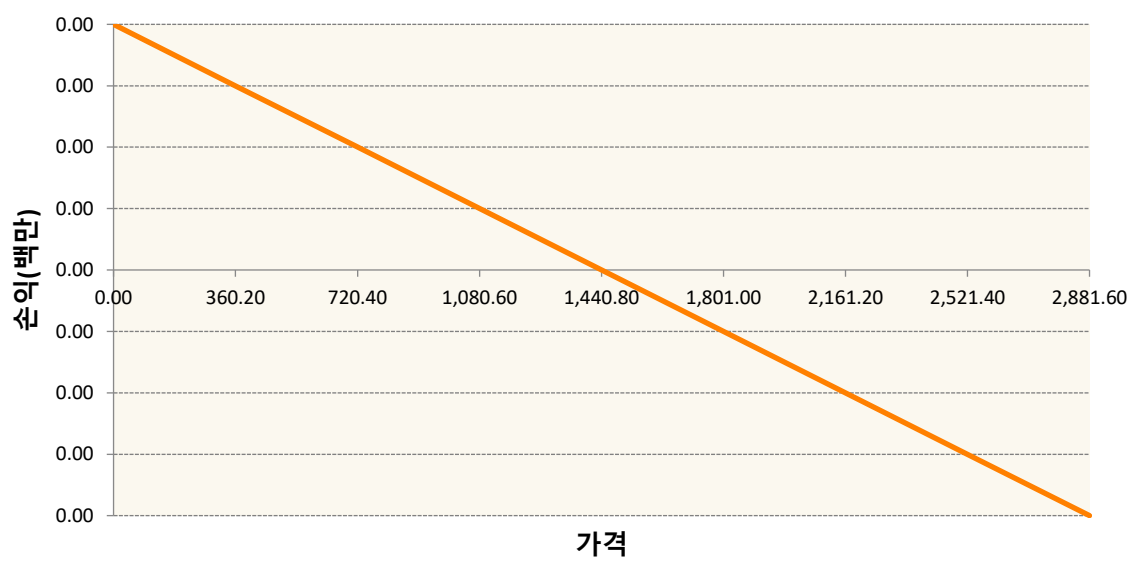
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



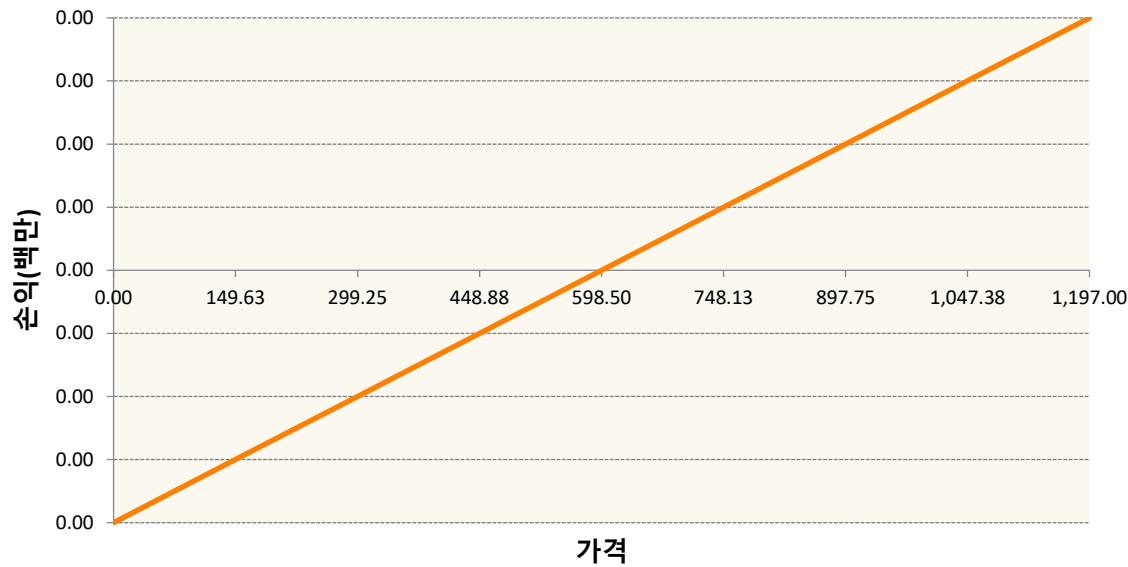
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



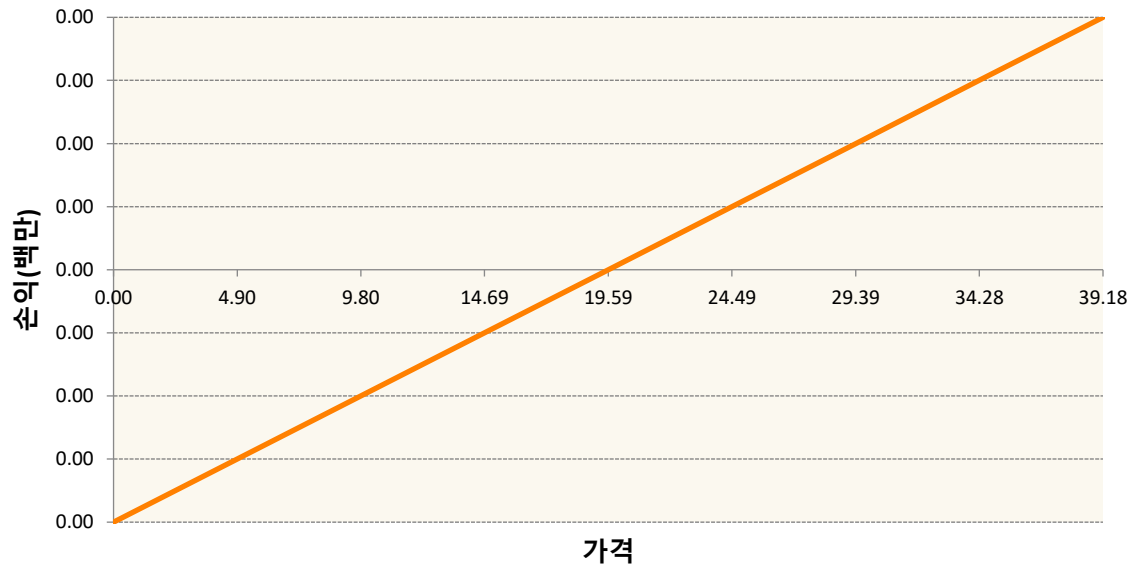
KR4175W30007-2025-03 달러선물



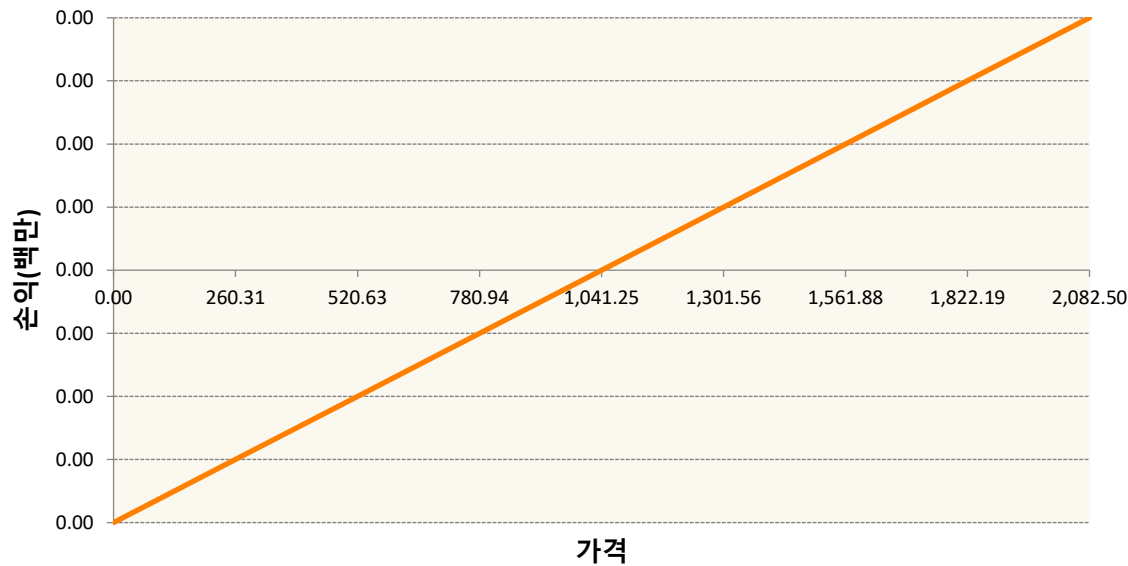
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



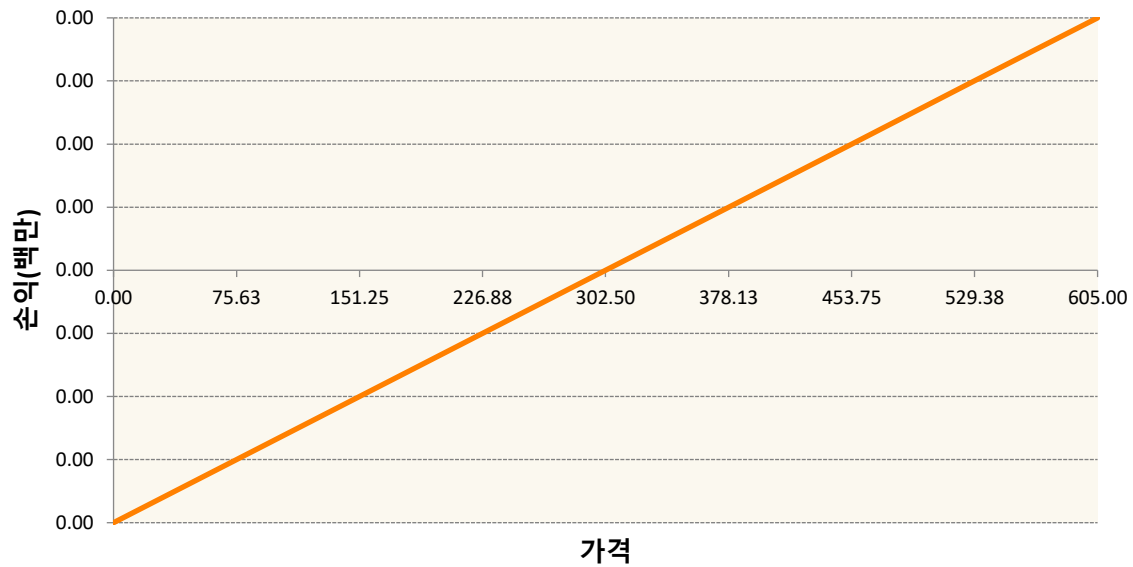
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



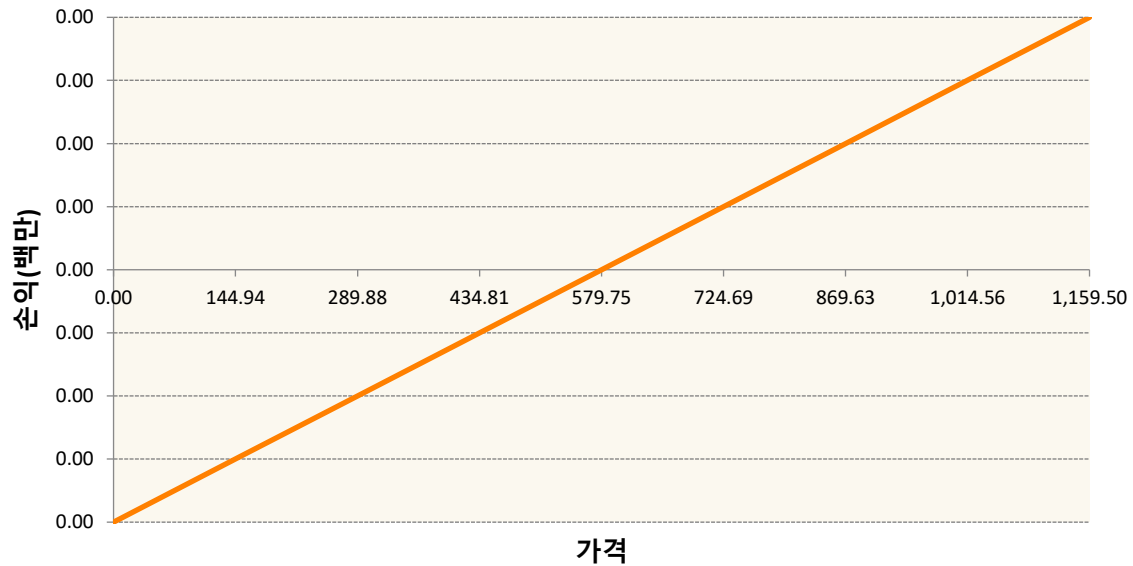
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-02-28
기준일	2025-02-27

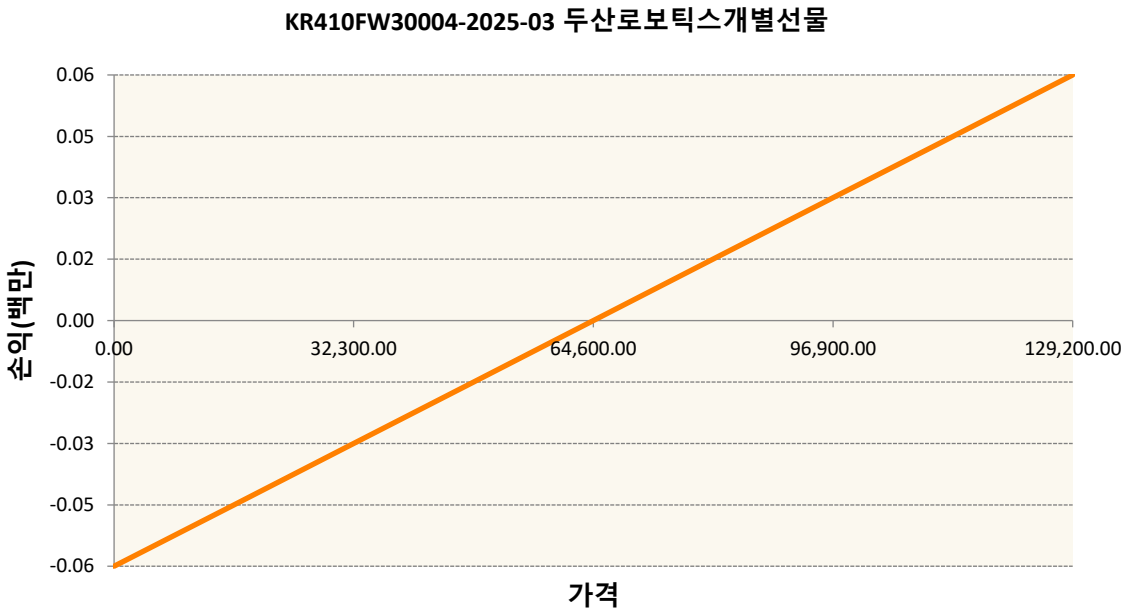
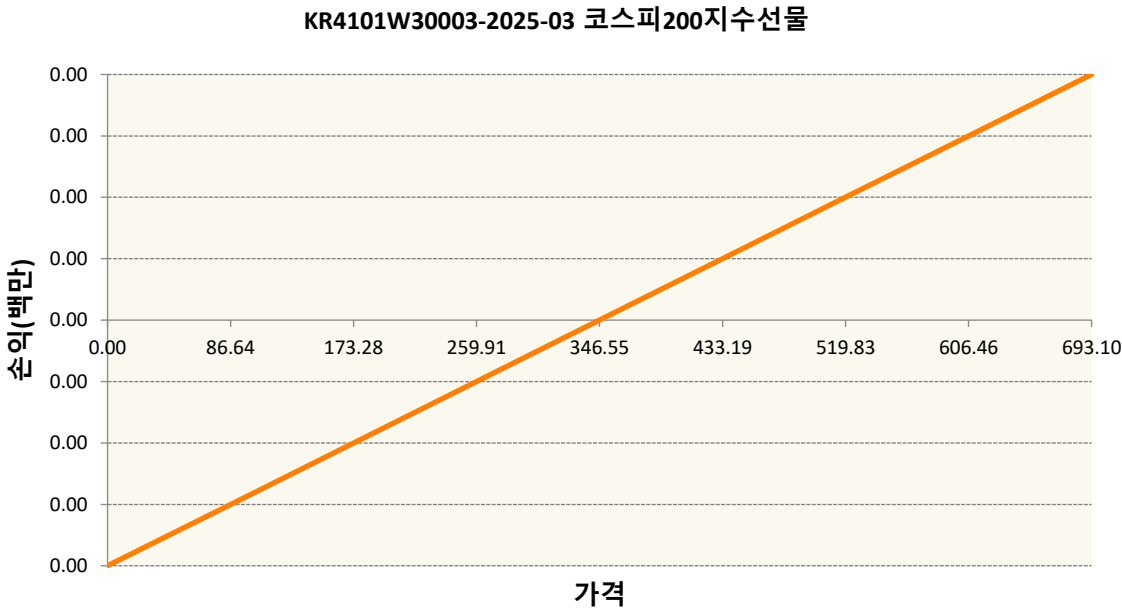
스마트인덱스모

1. 계약금액

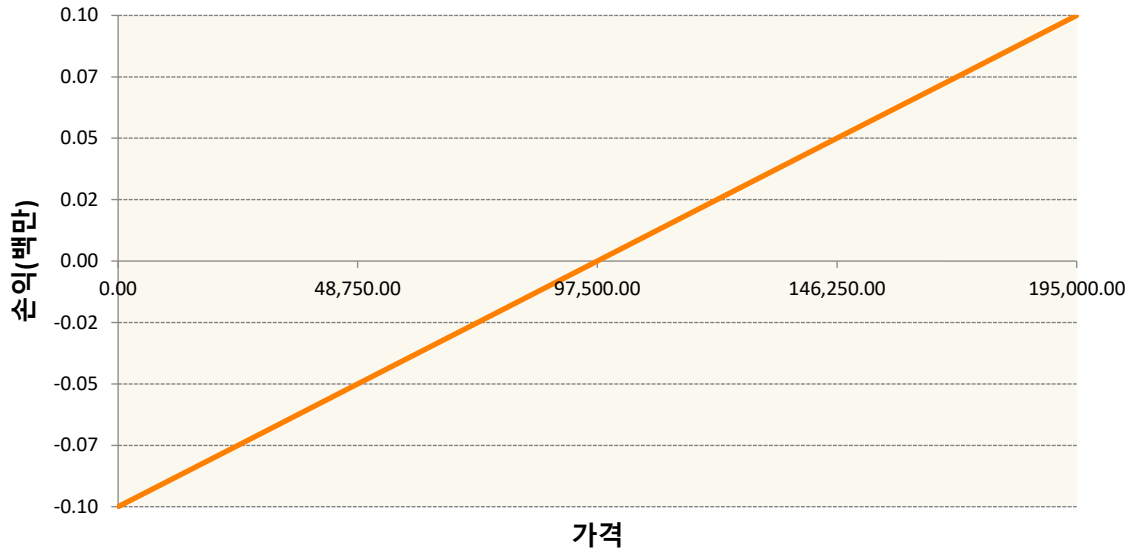
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	169	0	169	장내
누계	유가증권	선물	1,505	0	1,505	장내

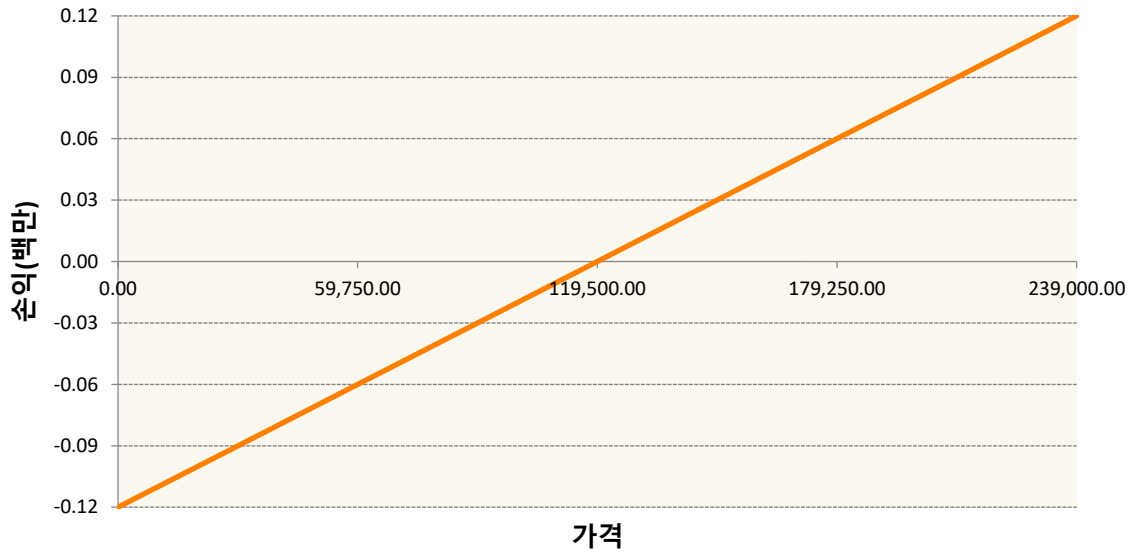
2. 만기시점의 손익구조



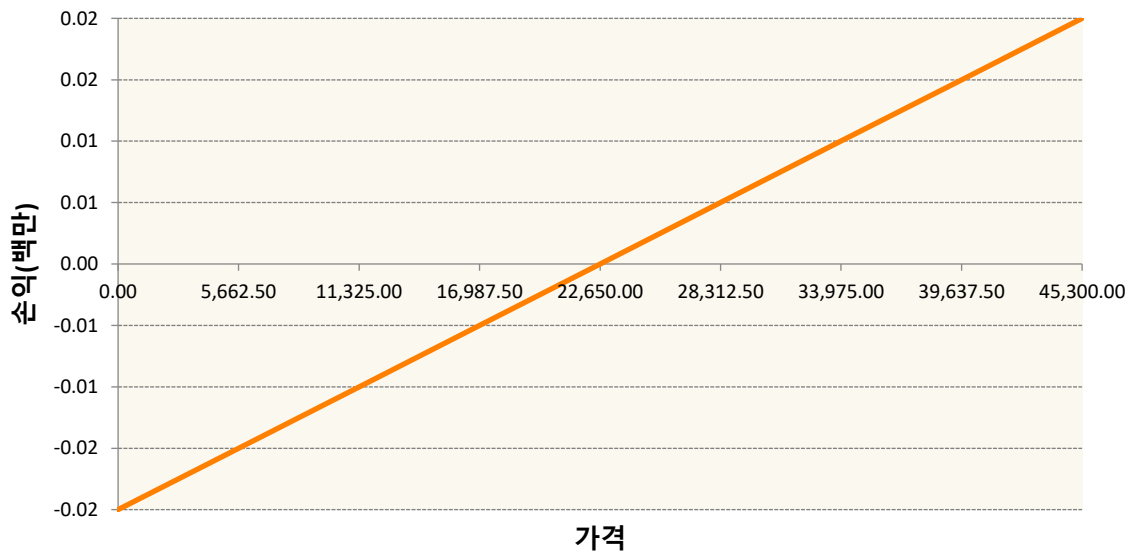
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



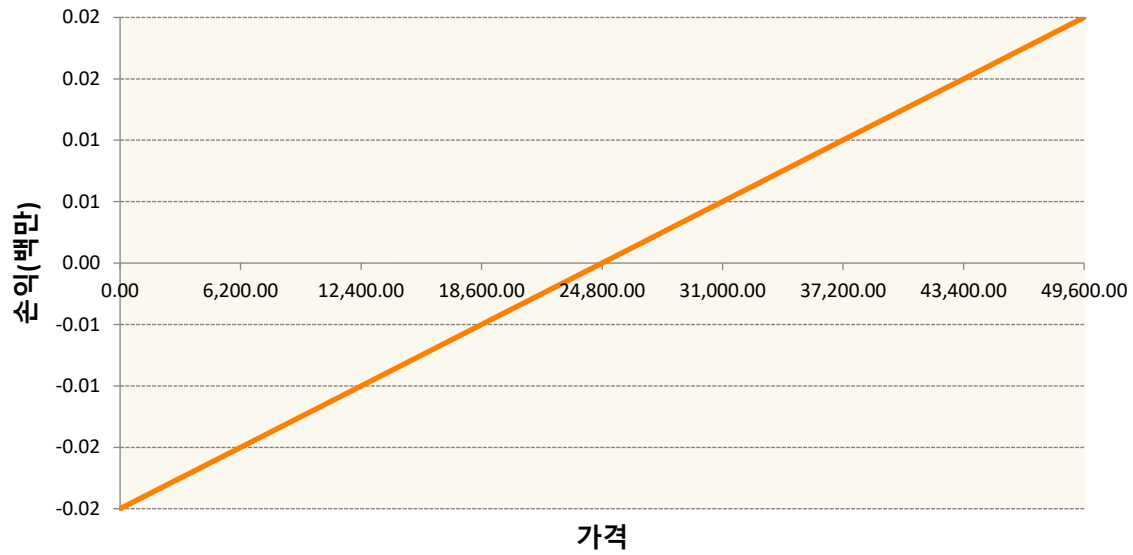
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



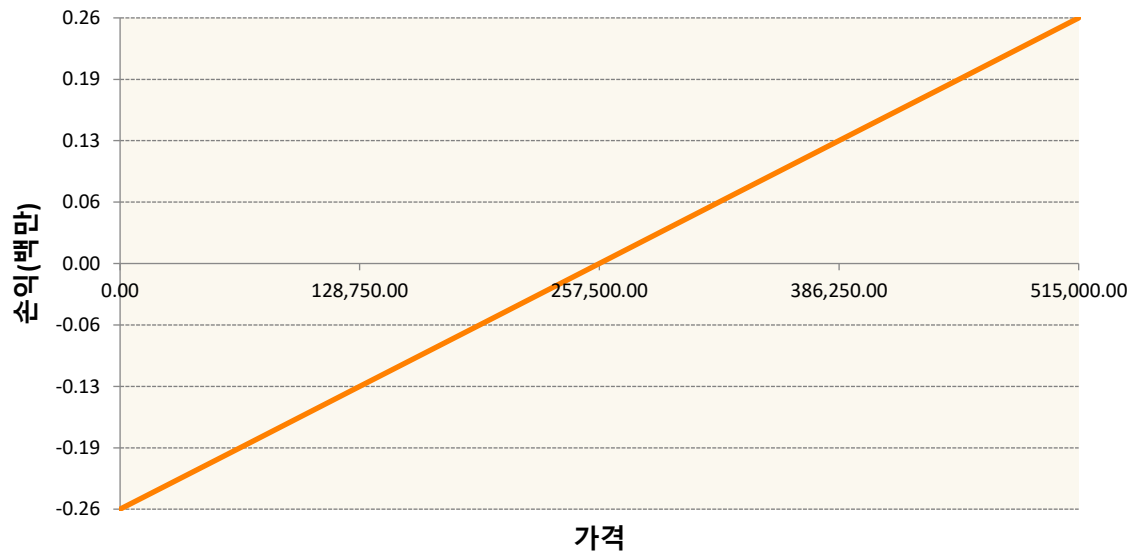
KR41CBW30007-2025-03 한화솔루션개별선물



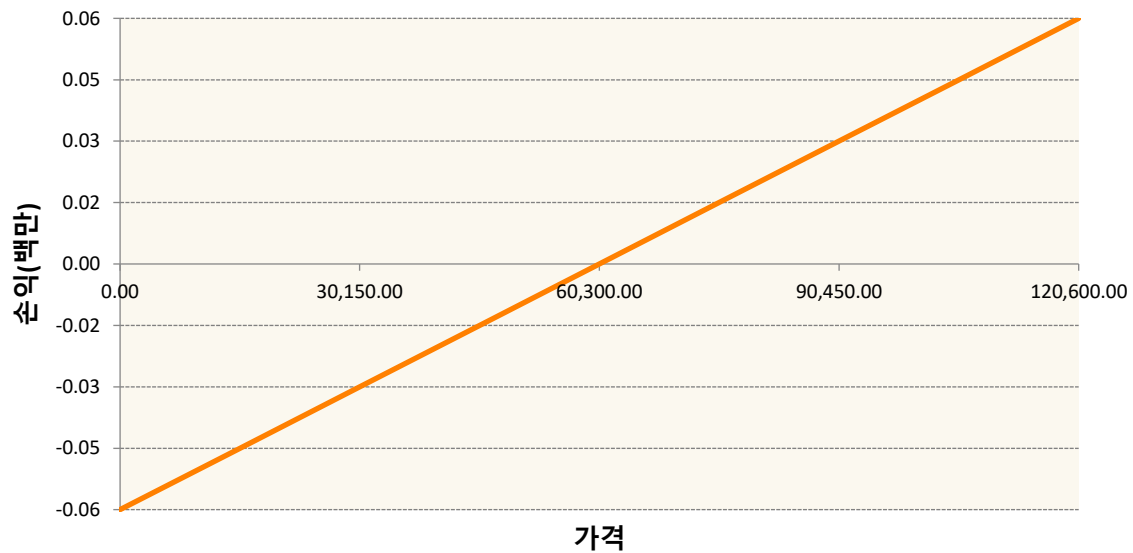
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



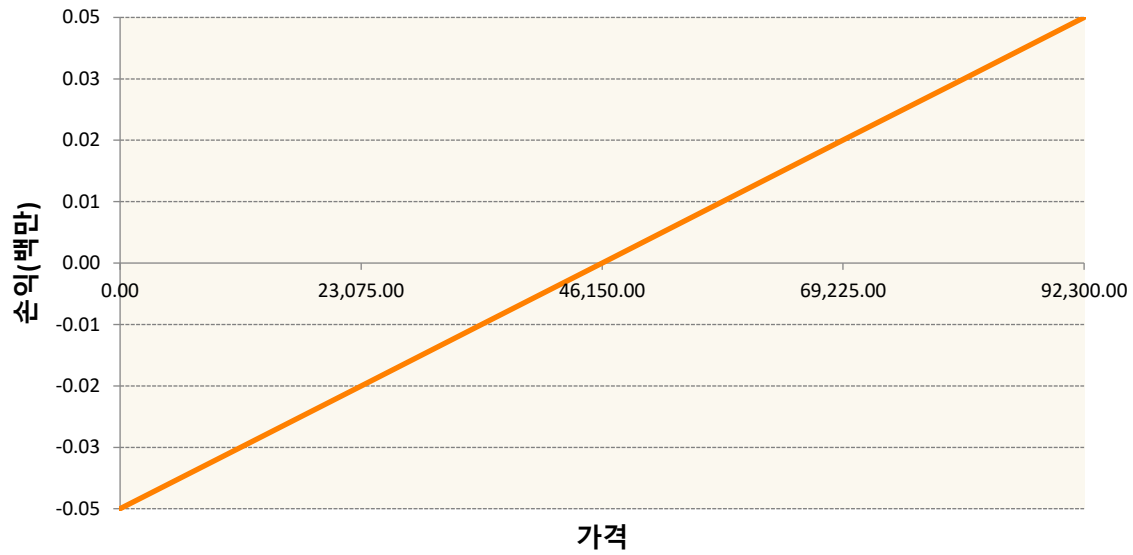
KR41CXW30001-2025-03 한미약품개별선물



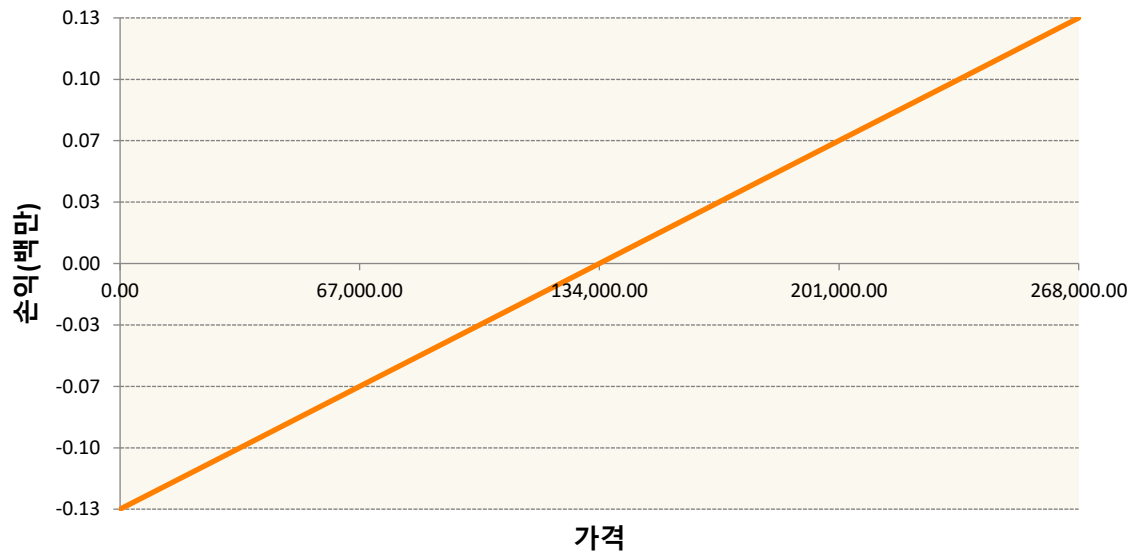
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



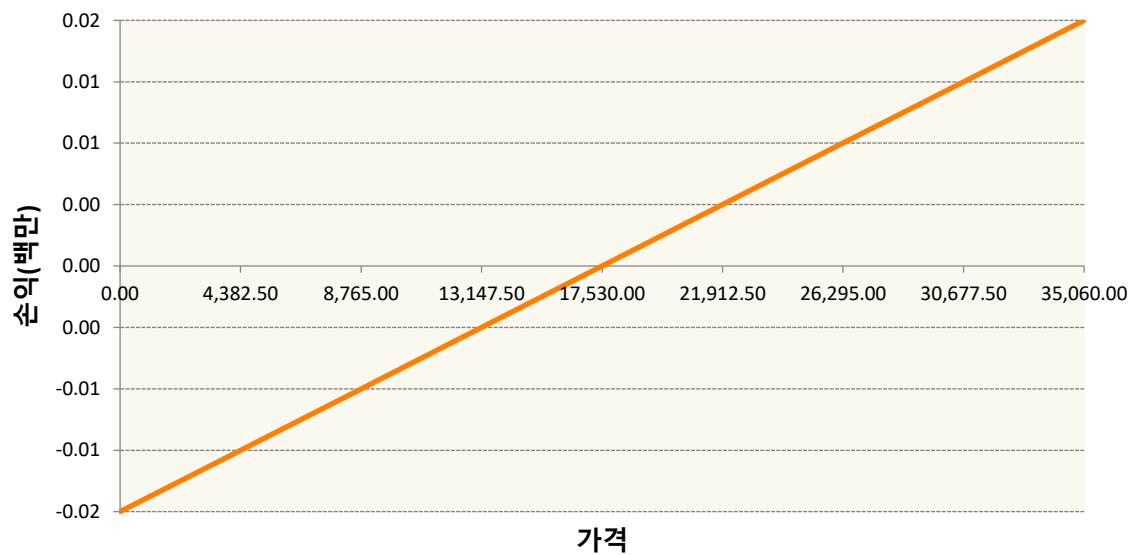
KR41DGW30004-2025-03 영원무역개별선물



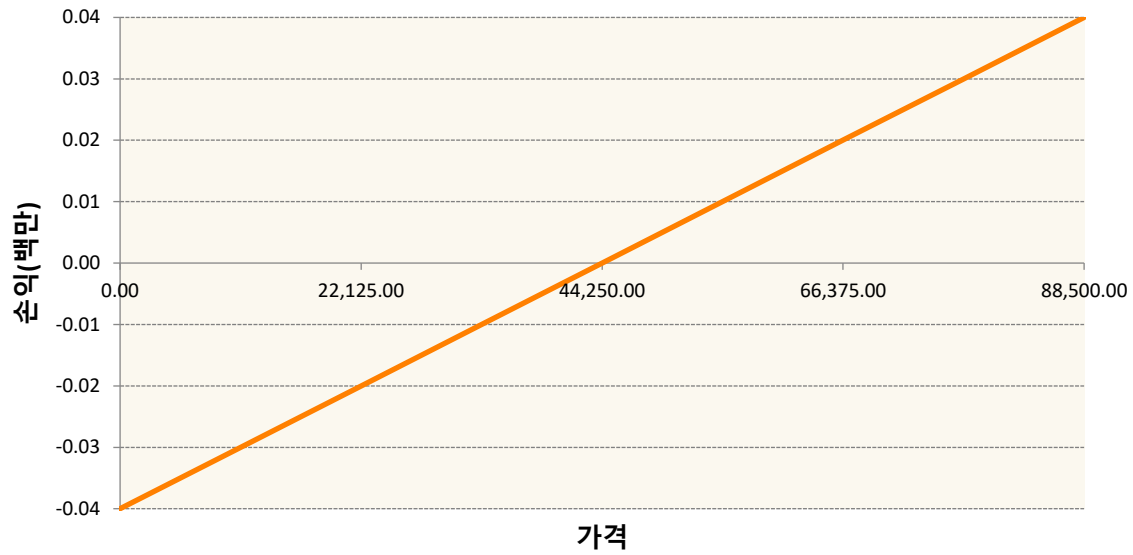
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



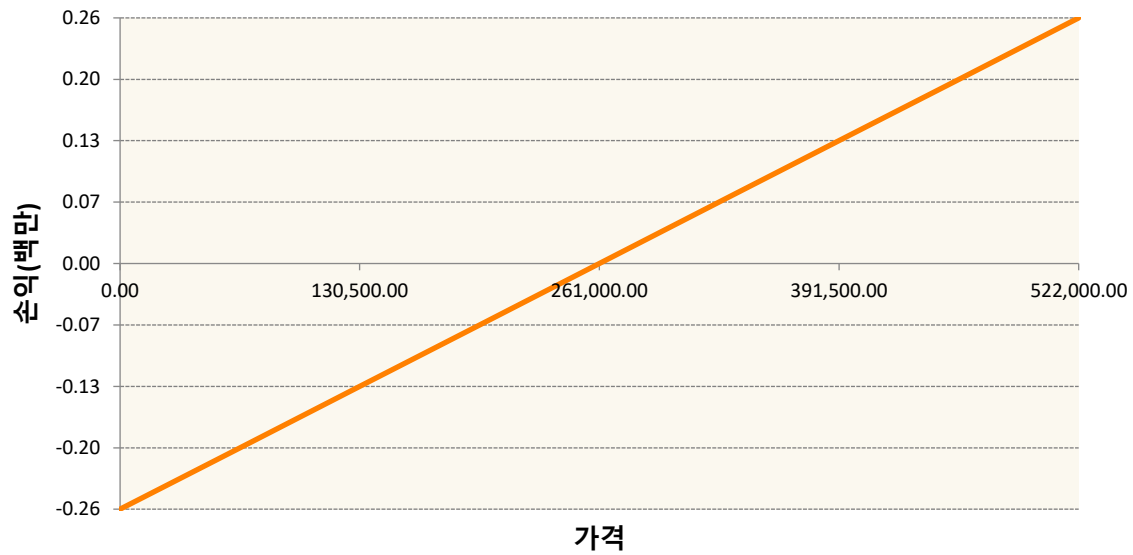
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



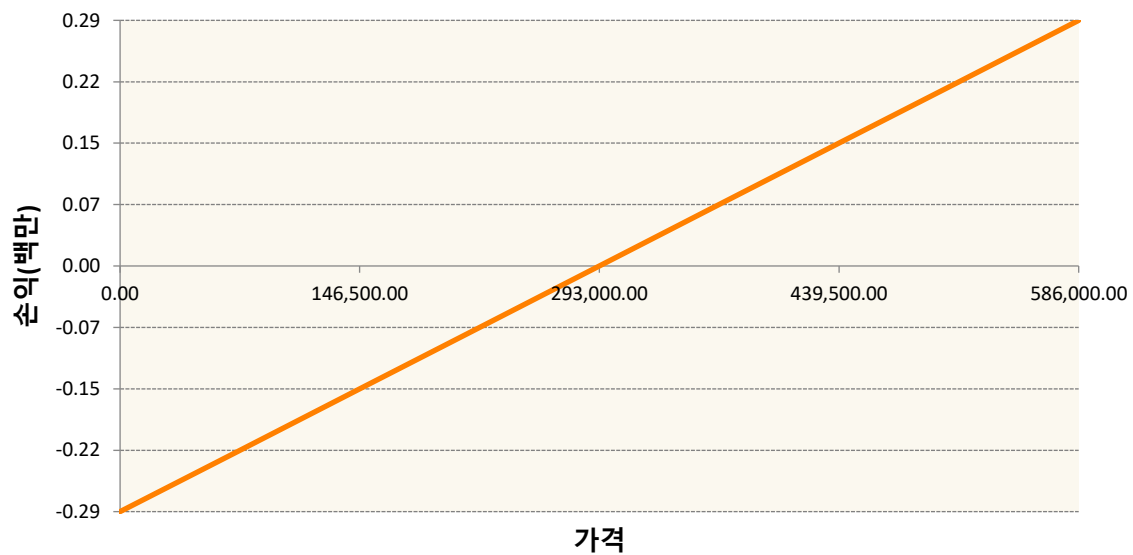
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



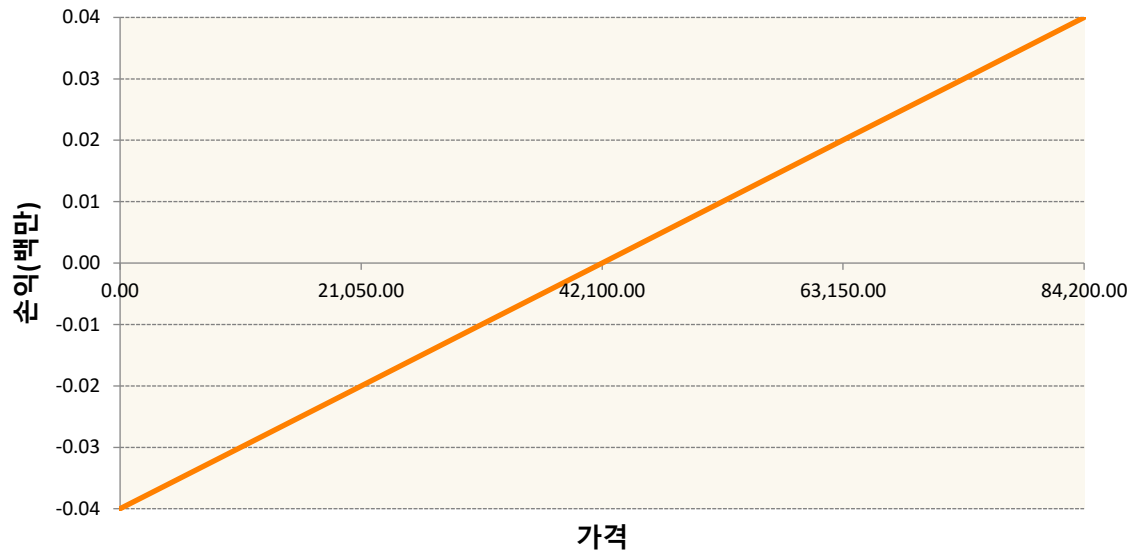
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



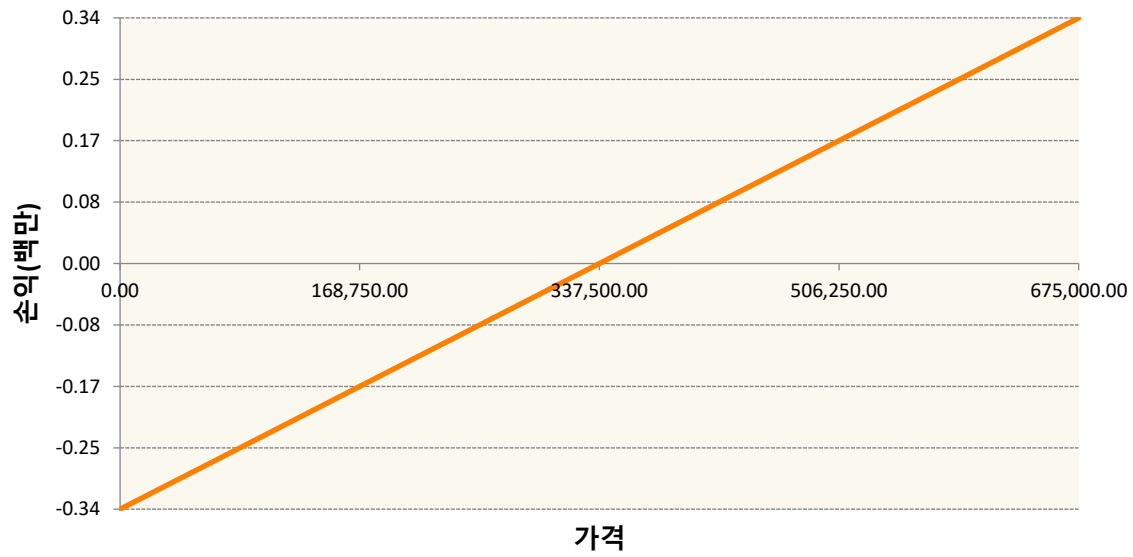
KR41FDW30006-2025-03 HD현대중공업개별선물



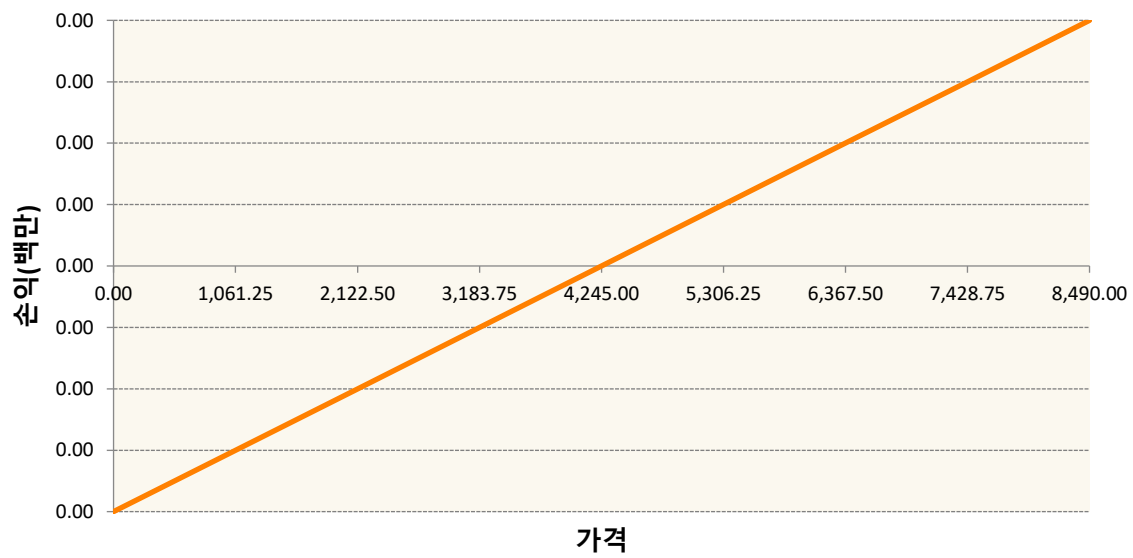
KR41GOW30008-2025-03 씨에스원드개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



KR41GKW30009-2025-03 KG모빌리티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	69
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	5
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물	4
KR41CBW30(2025-03 한화솔루션개별선물	3
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물	2
KR41CXW30(2025-03 한미약품개별선물	2
KR41DEW30(2025-03 한국콜마개별선물	0.24
KR41DGW30 2025-03 영원무역개별선물	1
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	3
KR41ETW30(2025-03 삼성엔지니어링개별선물	3
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	1
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	6
KR41FDW30(2025-03 HD현대중공업개별선물	8
KR41G0W30 2025-03 씨에스원드개별선물	1
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	8
KR41GKW30 2025-03 KG모빌리티개별선물	0.44

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	227

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

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

310

* 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	2025-02-28
기준일	2025-02-27

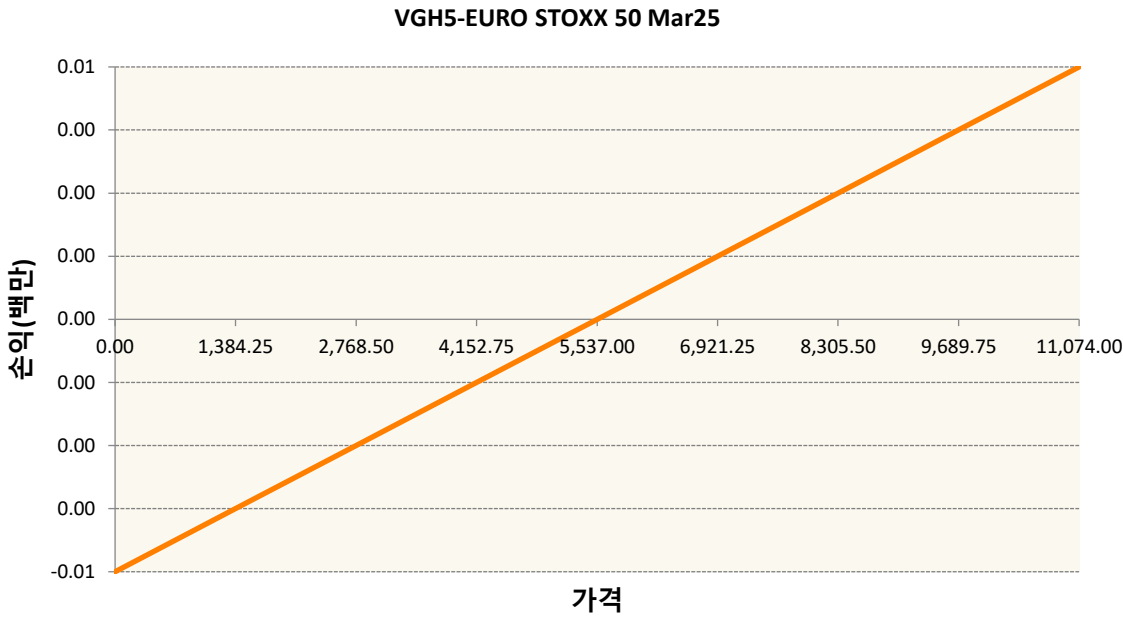
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,002	0	1,002	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar25	80
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

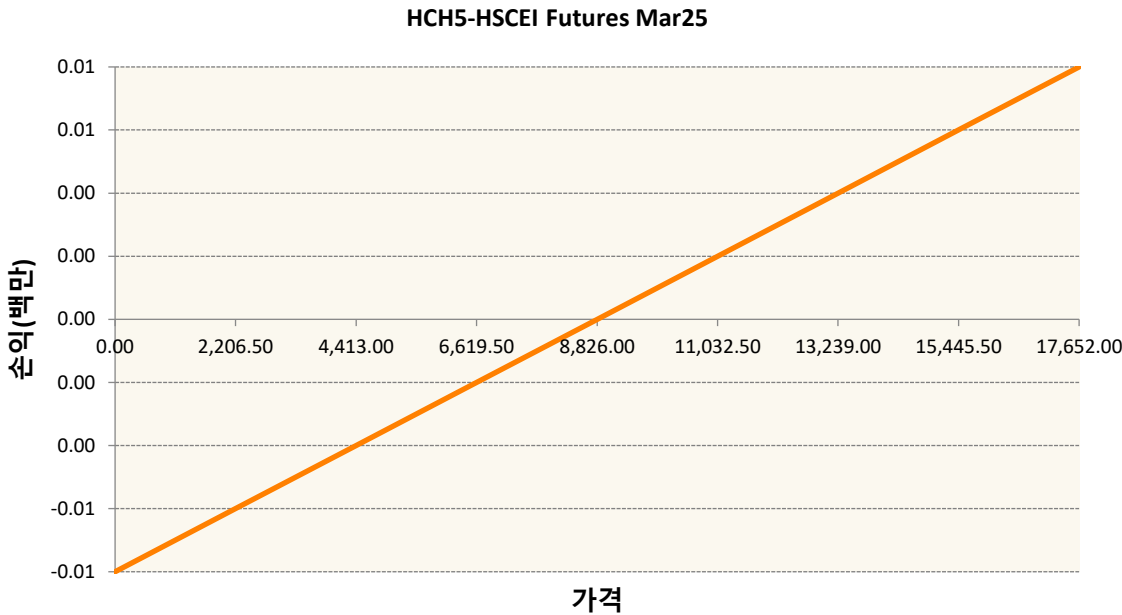
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,872	0	1,872	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH5	HSCEI Futures Mar25	150
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

203

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

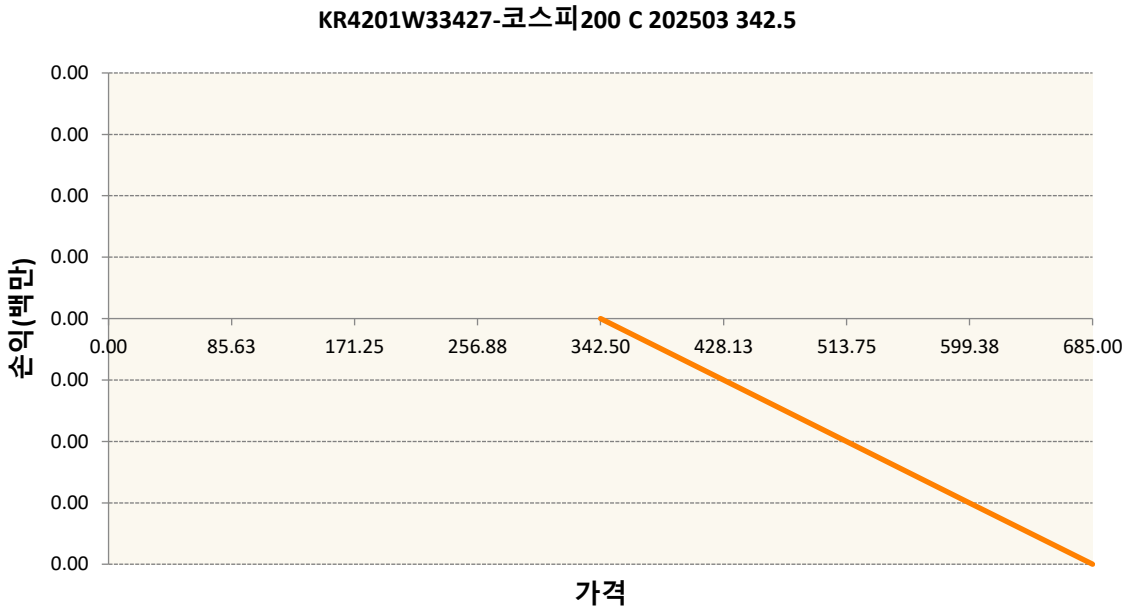
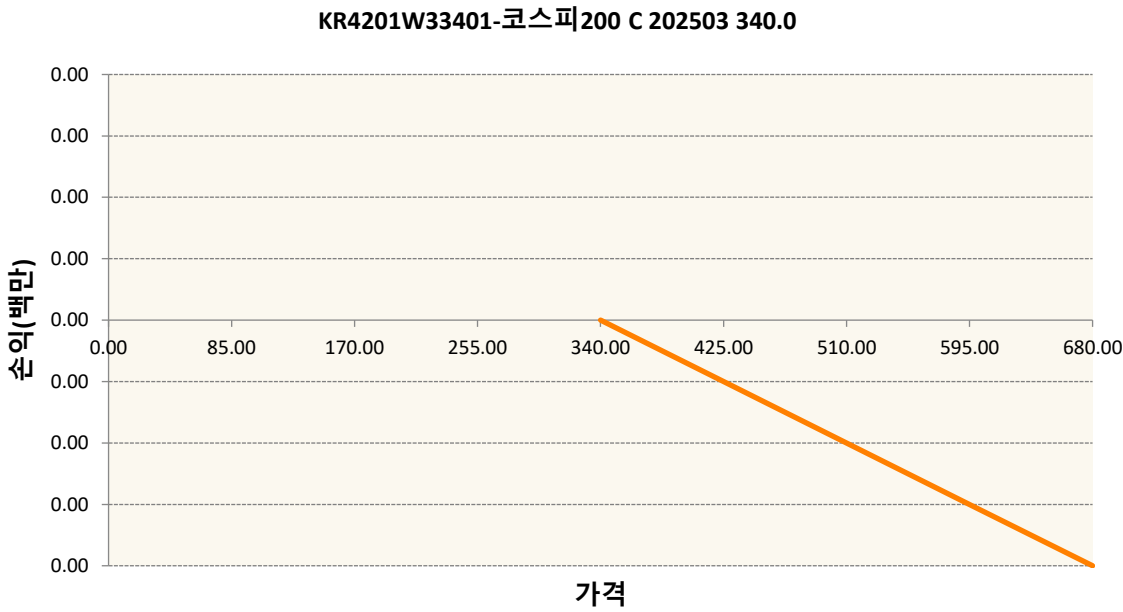
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

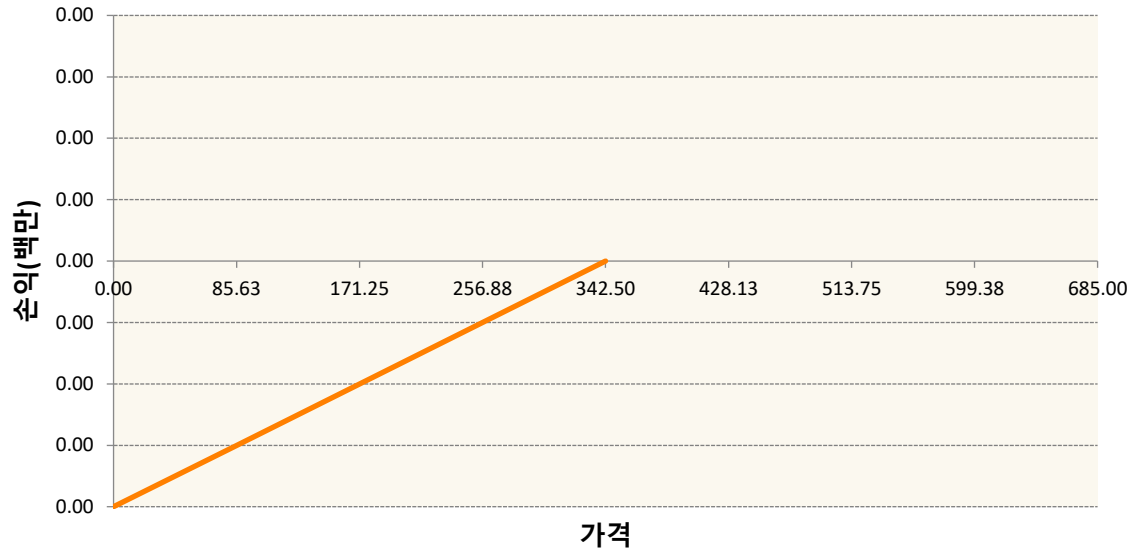
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301W33425-코스피200 P 202503 342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201W33401 코스피200 C 202503 340.0							1,518
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	622	615	606	594	581	566	550
-5.33%	573	553	531	508	483	458	431
-2.67%	414	382	350	318	286	254	222
0%	89	60	30	0	-31	-61	-93
2.67%	-381	-397	-415	-435	-456	-479	-504
5.33%	-924	-930	-937	-947	-959	-972	-988
8.00%	-1,491	-1,493	-1,495	-1,498	-1,503	-1,510	-1,518
KR4201W33427 코스피200 C 202503 342.5							651
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	235	233	230	226	221	215	209
-5.33%	220	213	205	196	186	176	165
-2.67%	166	153	139	126	112	98	84
0%	42	28	14	0	-14	-29	-43
2.67%	-151	-160	-170	-180	-191	-202	-214
5.33%	-386	-389	-394	-399	-406	-413	-421
8.00%	-636	-637	-638	-640	-643	-647	-651
KR4301W33425 코스피200 P 202503 342.5							382
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-364	-365	-367	-370	-373	-377	-382
-5.33%	-199	-204	-209	-215	-222	-229	-237
-2.67%	-61	-70	-79	-89	-98	-108	-117
0%	29	20	10	0	-10	-20	-30

2.67%	71	65	58	51	44	36	27
5.33%	84	82	79	75	71	66	60
8.00%	87	86	85	84	82	79	76

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

(단위:백만원)

2,727

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

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	681	0	681	

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	2025-02-28
기준일	2025-02-27

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	4,497	0	4,497	

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	2025-02-28
기준일	2025-02-27

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	13,287	0	13,287	
누계	통화	선도	0	20,058	-20,058	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213EBTC KRW/USD 28-02-25E	560
FXW213ECTC KRW/USD 31-03-25E	257
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E	210
FXW213F24C KRW/USD 28-02-25E	17
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E	214
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E	346
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

677

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

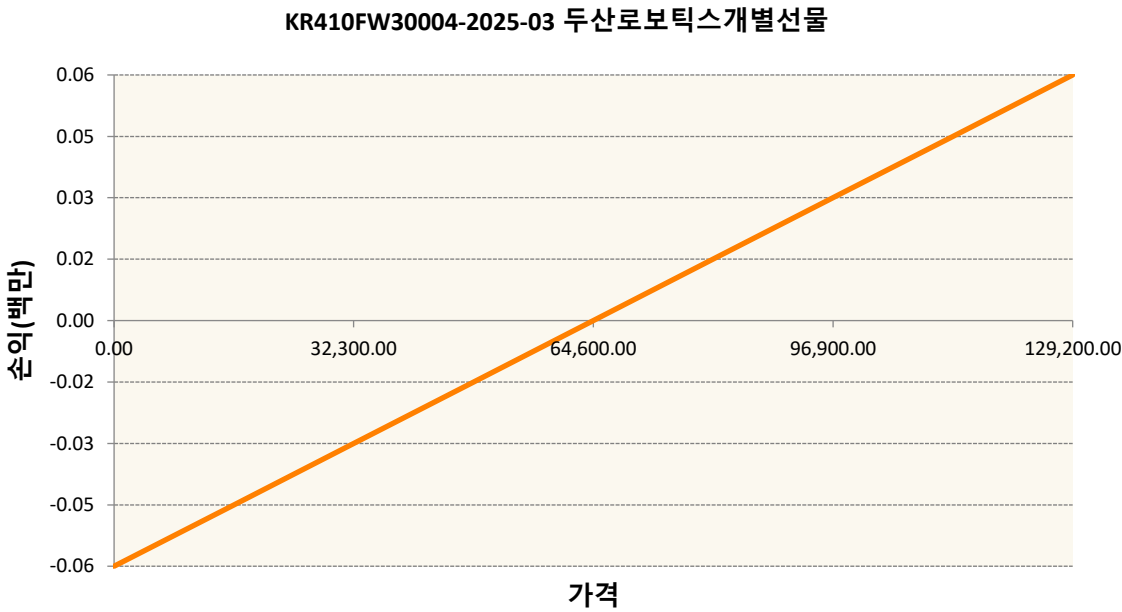
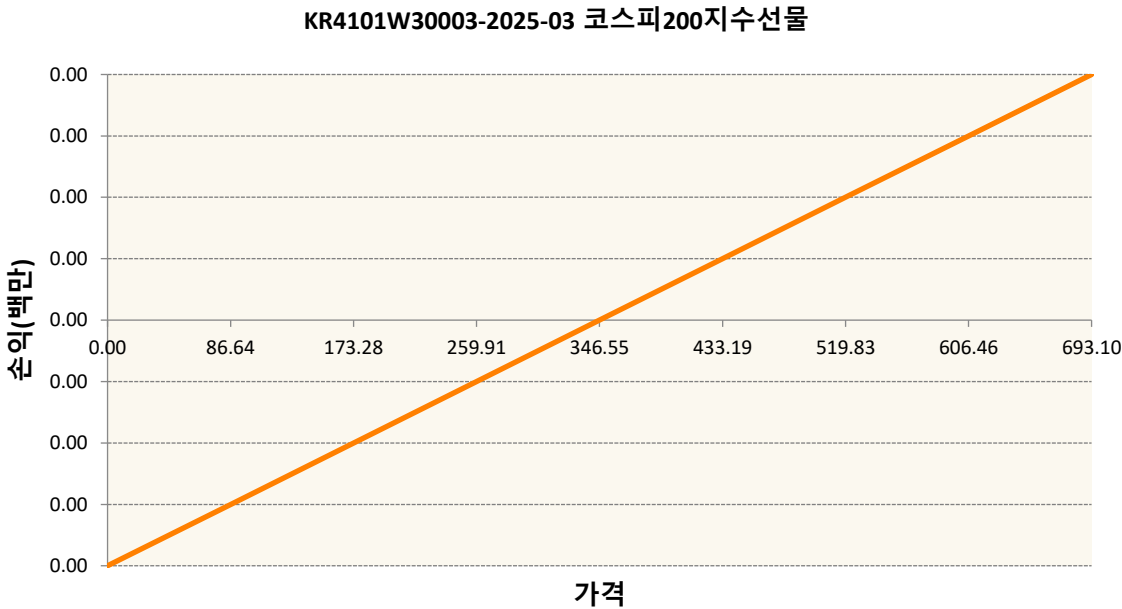
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

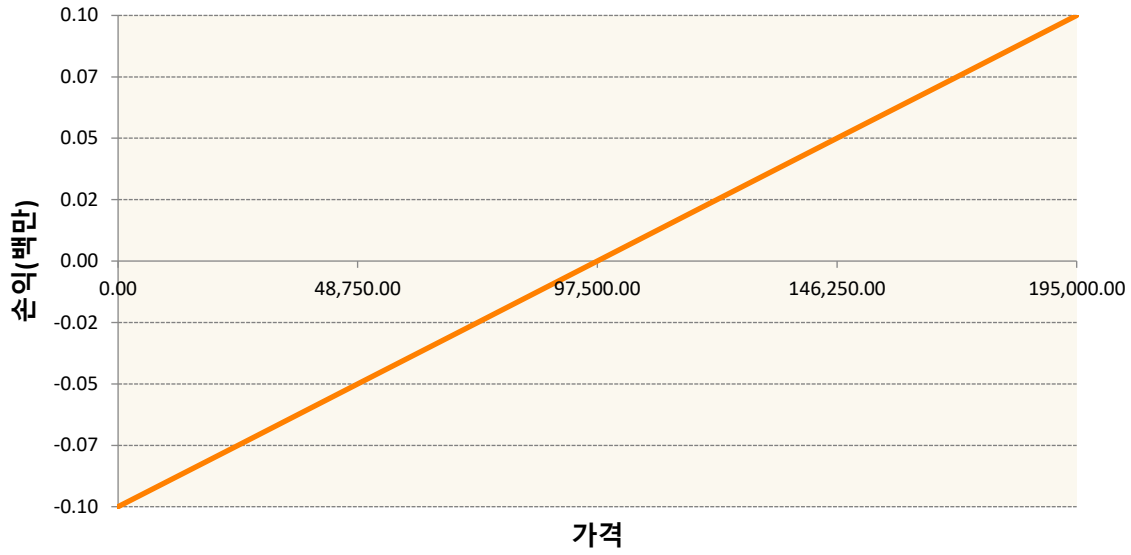
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	76	0	76	장내
누계	유가증권	선물	1,321	0	1,321	장내

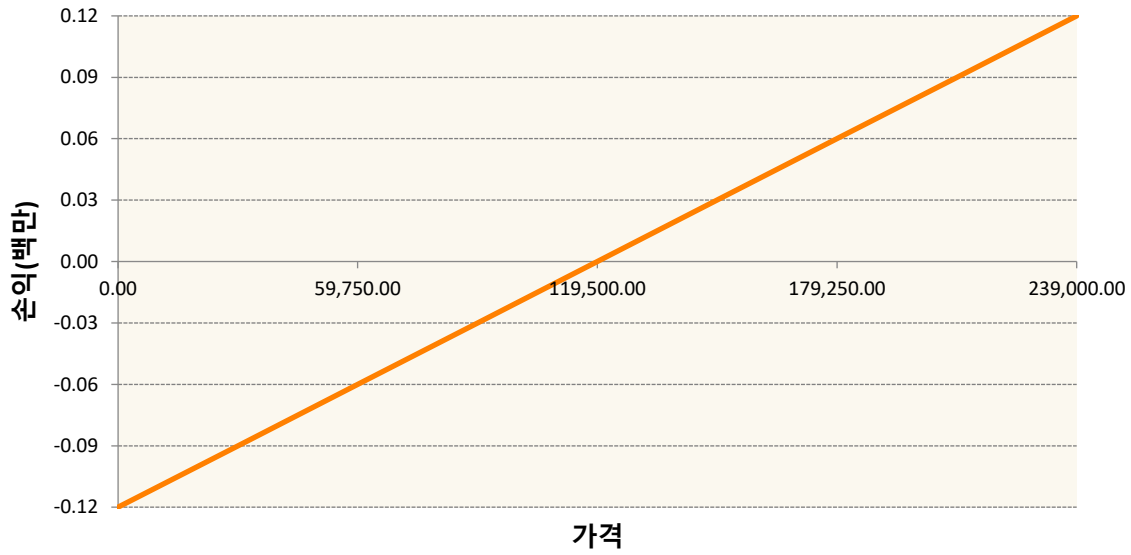
2. 만기시점의 손익구조



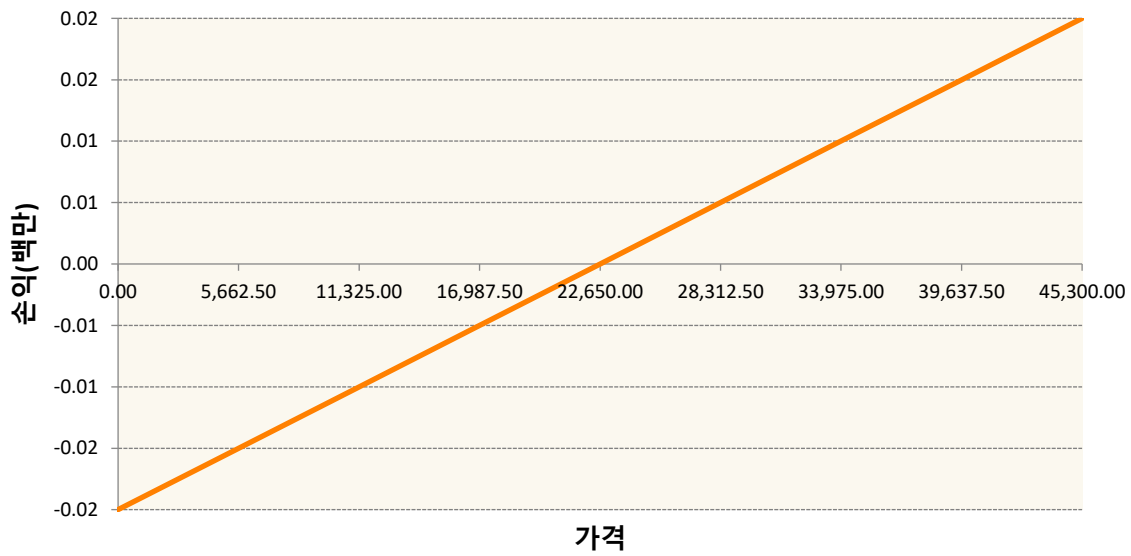
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



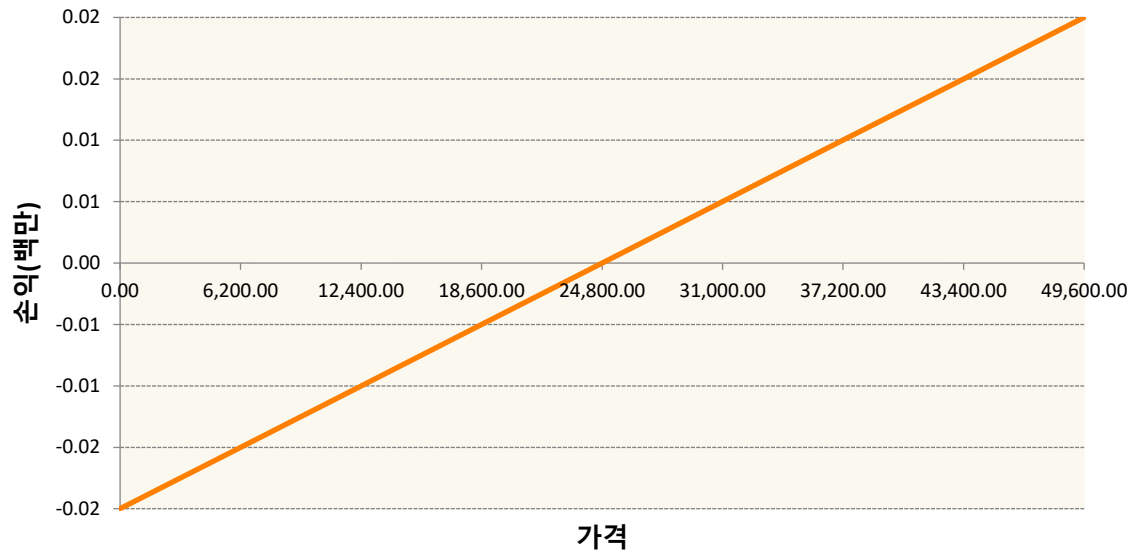
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



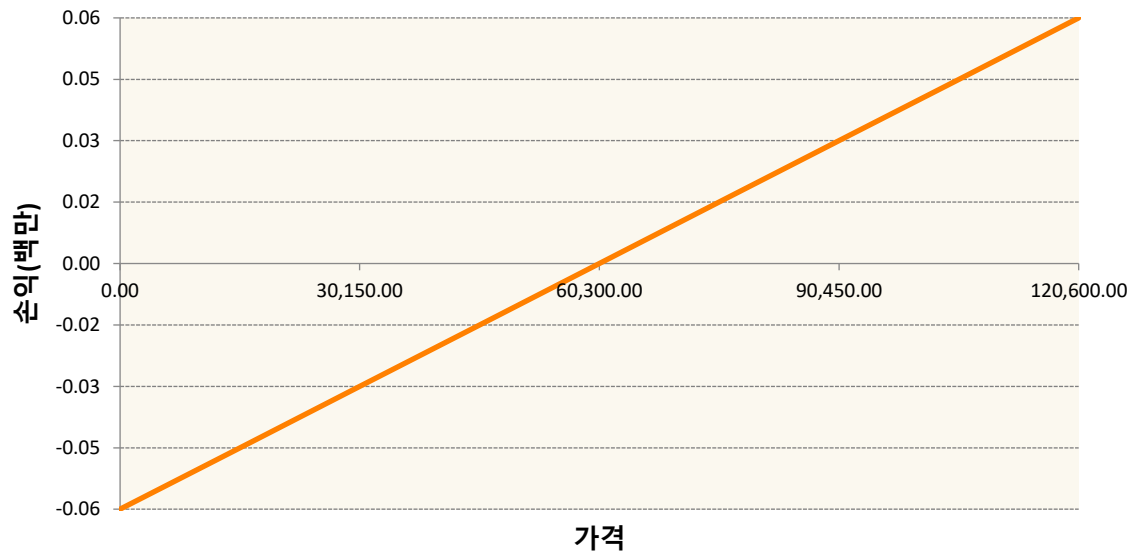
KR41CBW30007-2025-03 한화솔루션개별선물



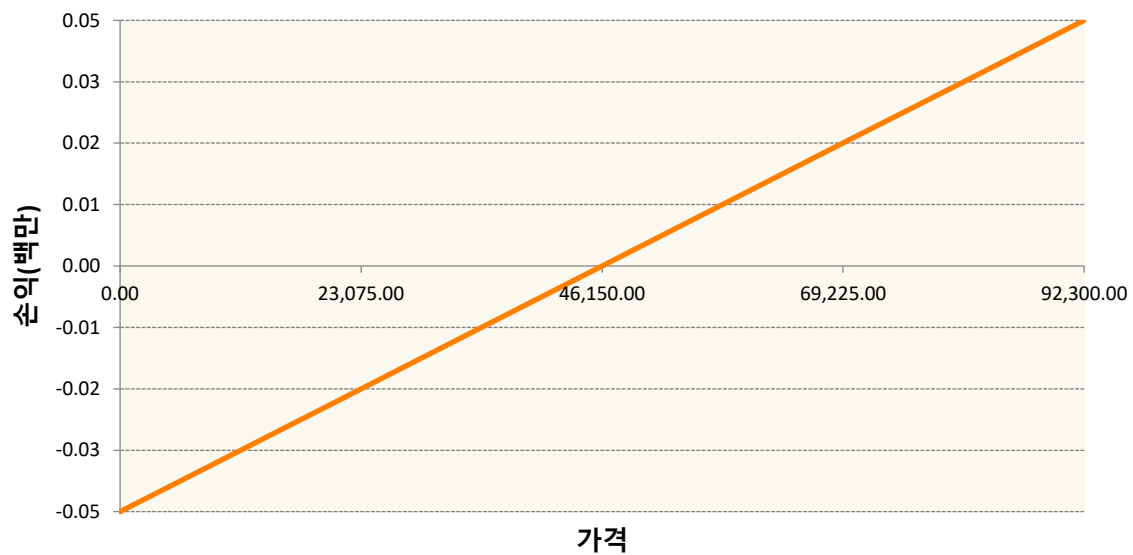
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



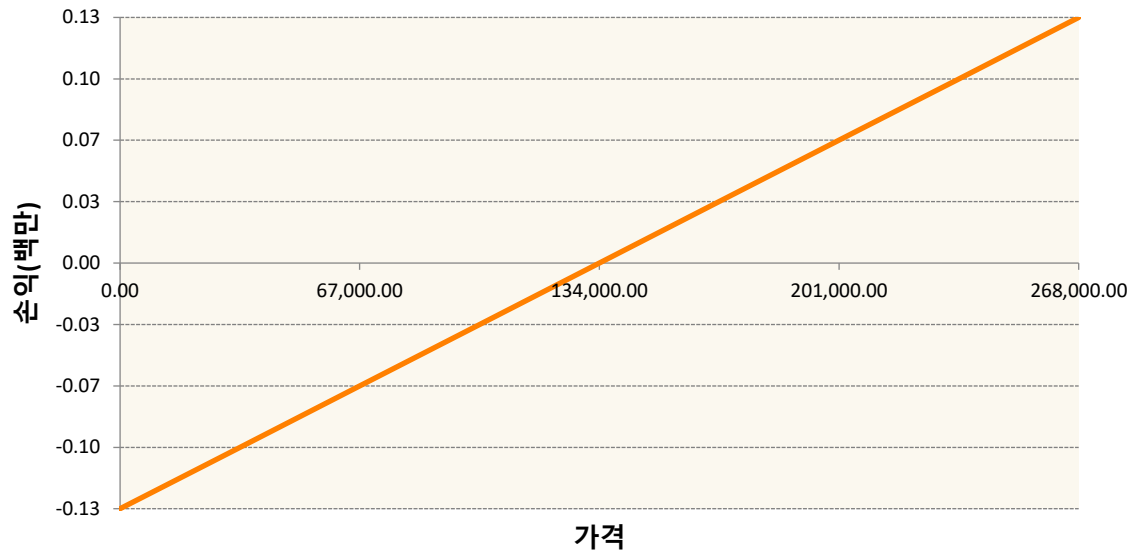
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



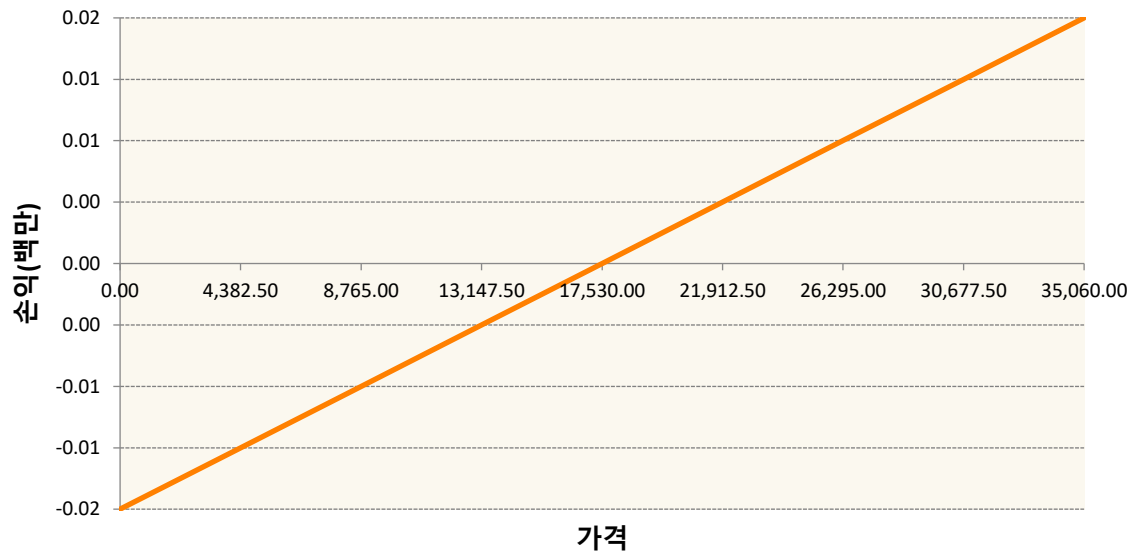
KR41DGW30004-2025-03 영원무역개별선물



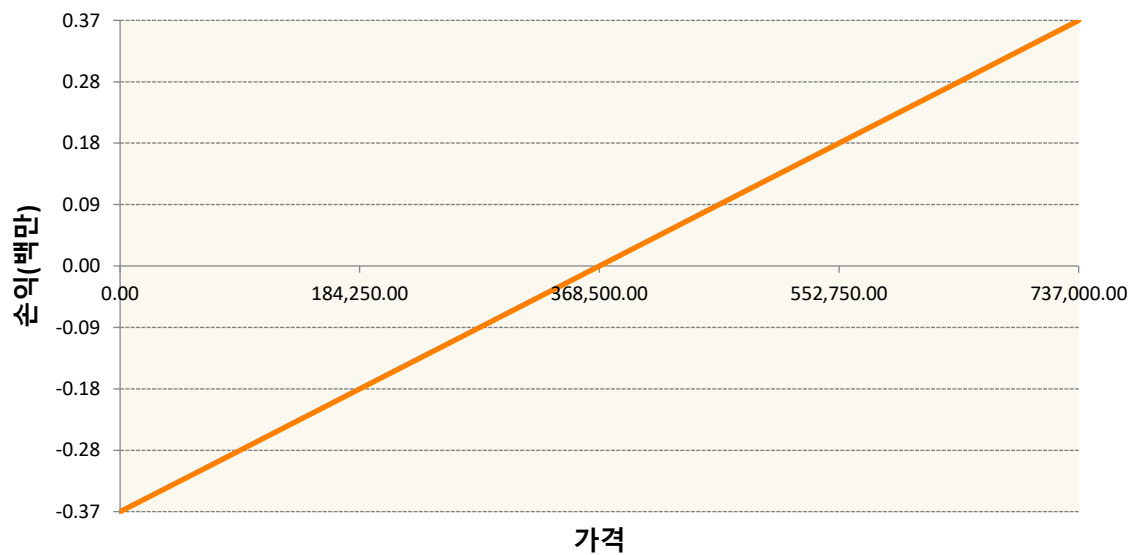
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



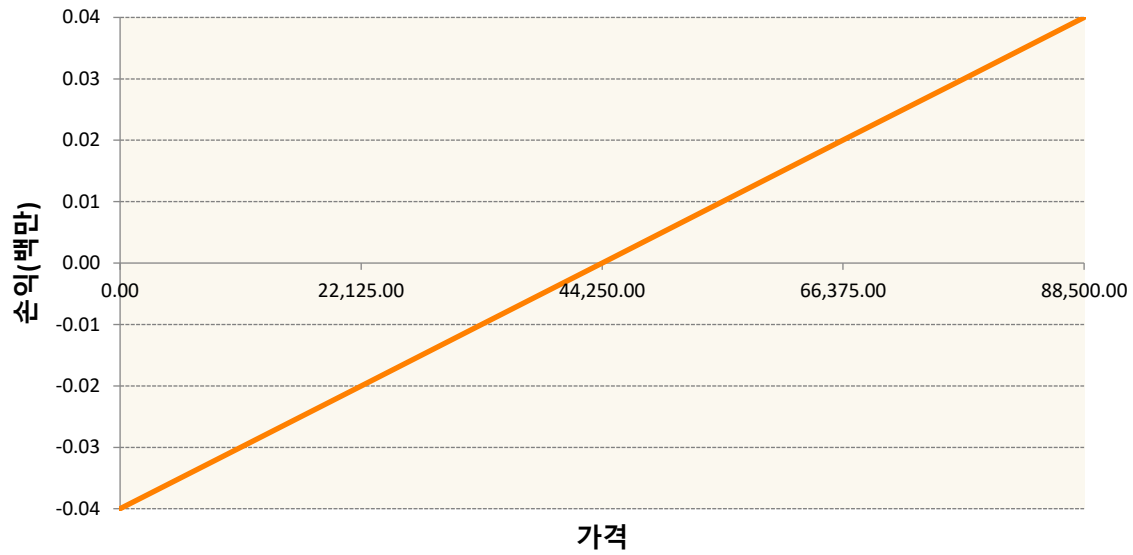
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



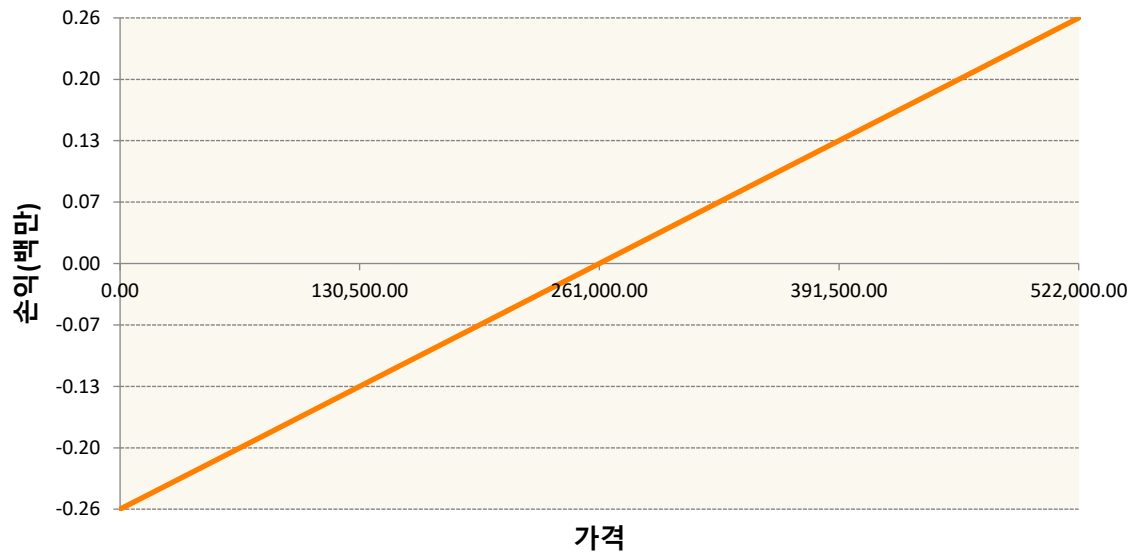
KR41F5W30008-2025-03 LG에너지솔루션개별선물



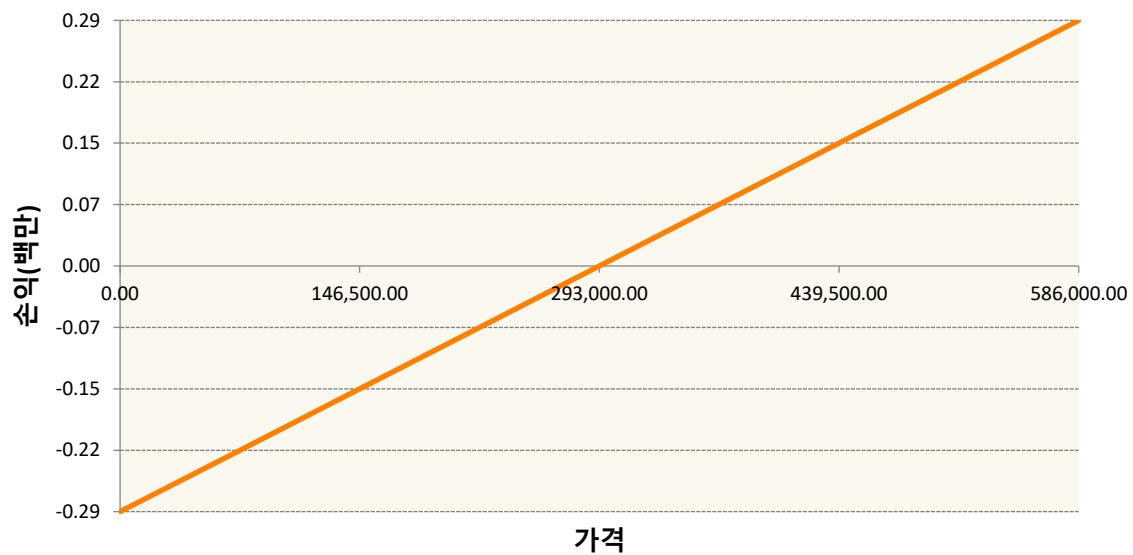
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



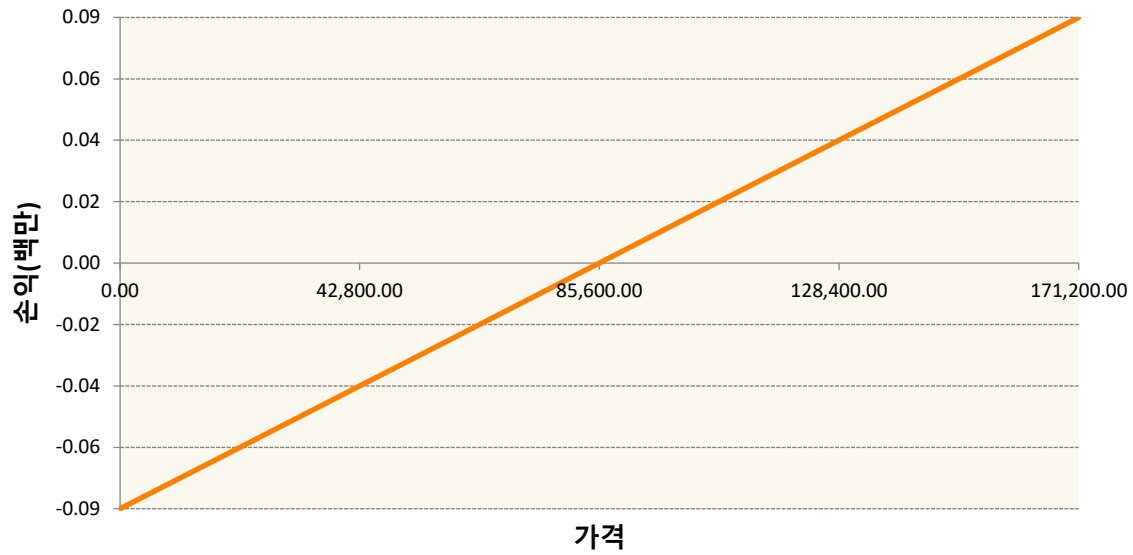
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



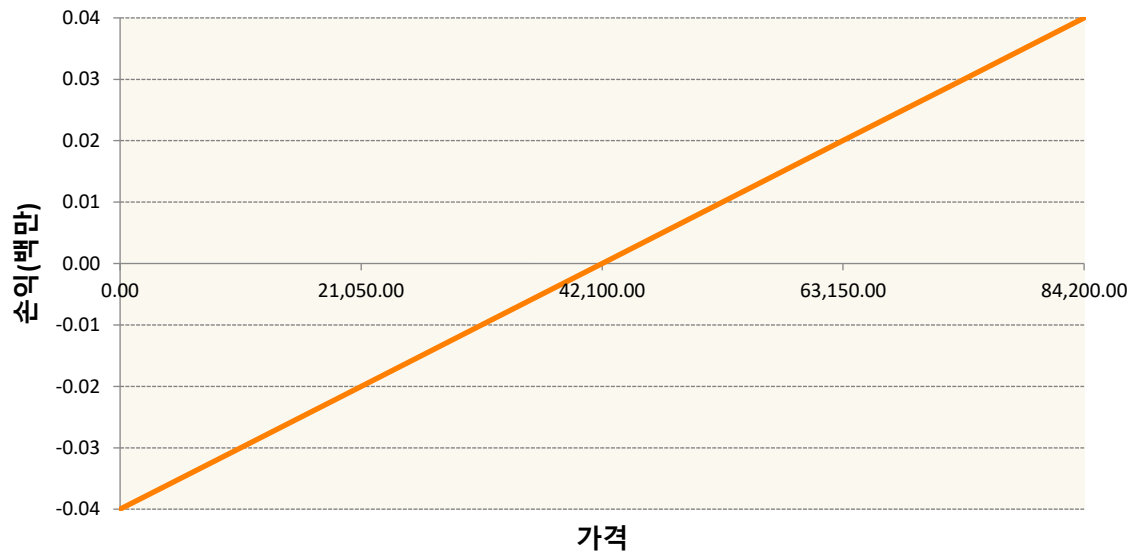
KR41FDW30006-2025-03 HD현대중공업개별선물



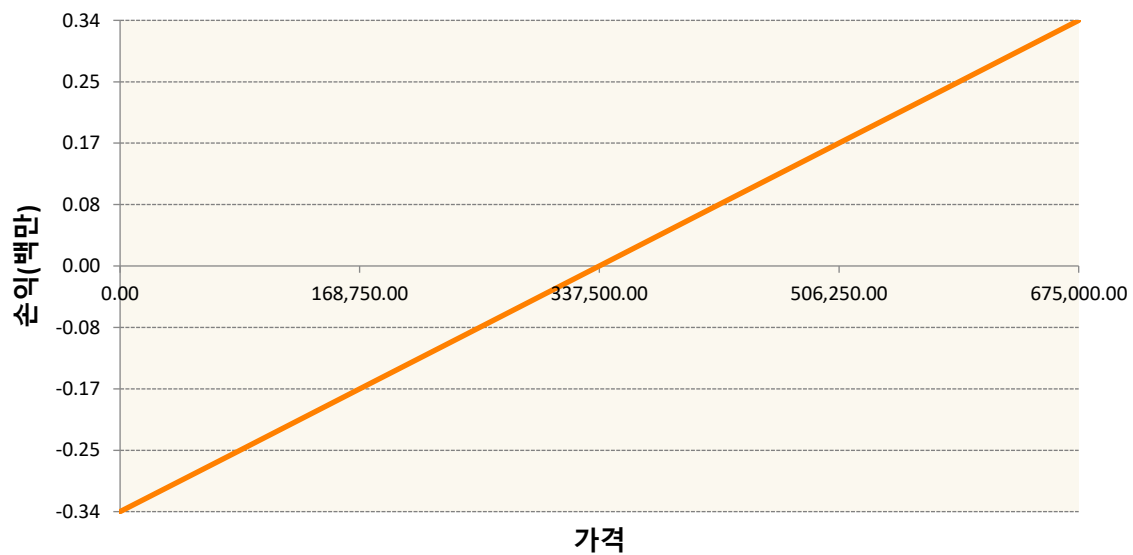
KR41FMW30007-2025-03 엘애프개별선물



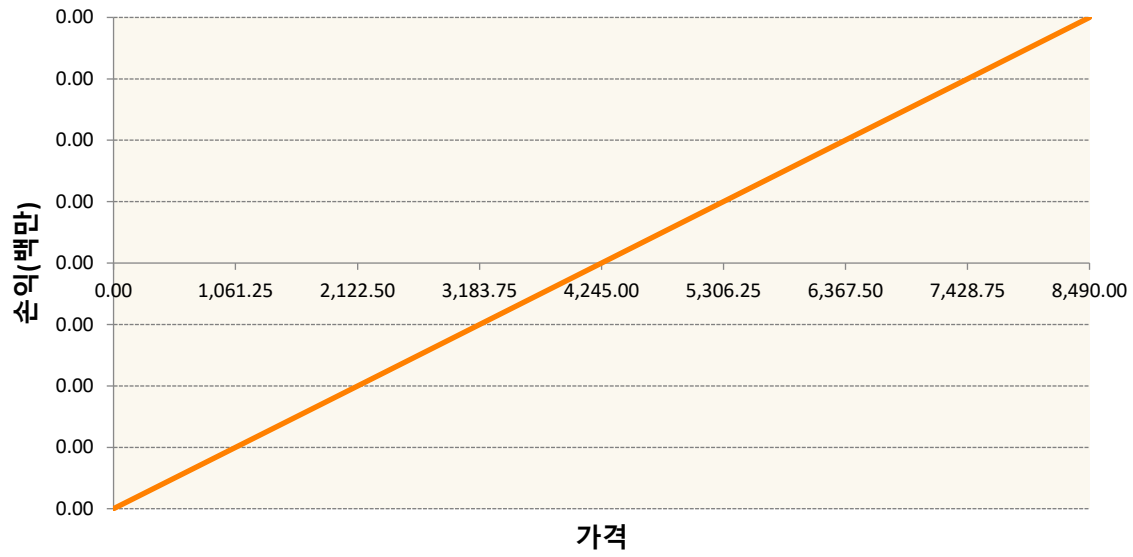
KR41G0W30008-2025-03 씨에스원드개별선물



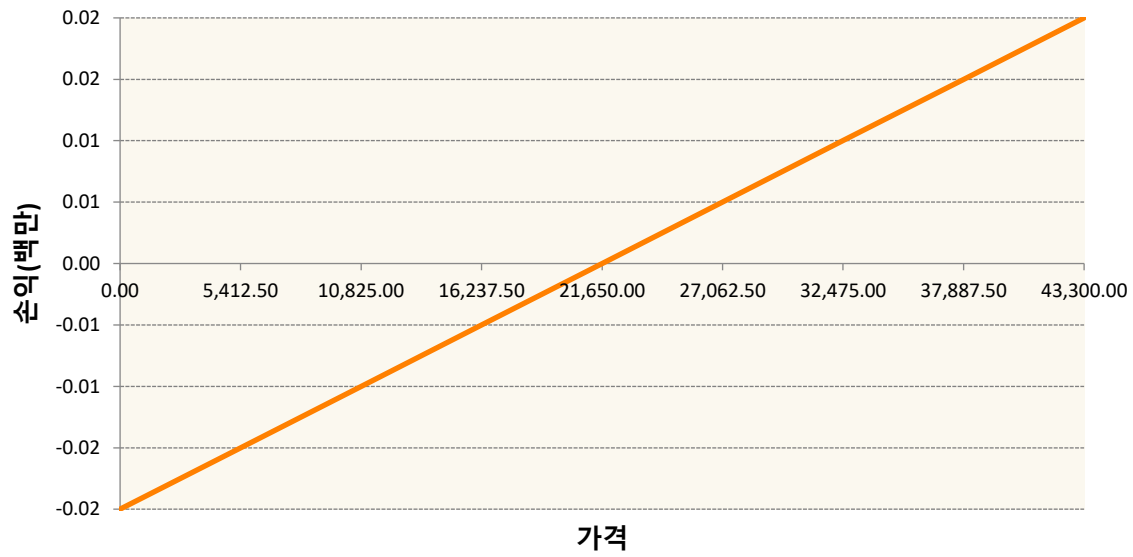
KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



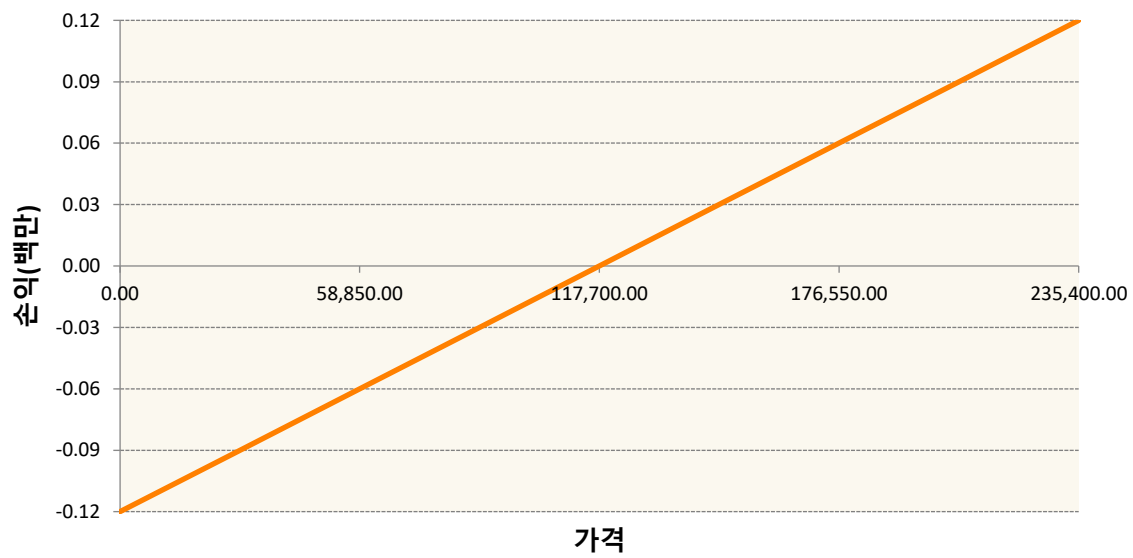
KR41GKW30009-2025-03 KG모빌리티개별선물



KR41GNW30003-2025-03 금양개별선물



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
KR41CBW30(2025-03 한화솔루션개별선물	1
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물	1
KR41DEW30(2025-03 한국콜마개별선물	0.48
KR41DGW30 2025-03 영원무역개별선물	0.48
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	1
KR41ETW30(2025-03 삼성엔지니어링개별선물	1
KR41F5W30(2025-03 LG에너지솔루션개별선물	6
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	1
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	3
KR41FDW30(2025-03 HD현대중공업개별선물	3
KR41FMW30 2025-03 엘앤에프개별선물	1
KR41G0W30(2025-03 씨에스원드개별선물	1
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	4
KR41GKW30 2025-03 KG모빌리티개별선물	0.18
KR41GNW30 2025-03 금양개별선물	0.4
KR41HEW30(2025-03 키움증권개별선물	1

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

172

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

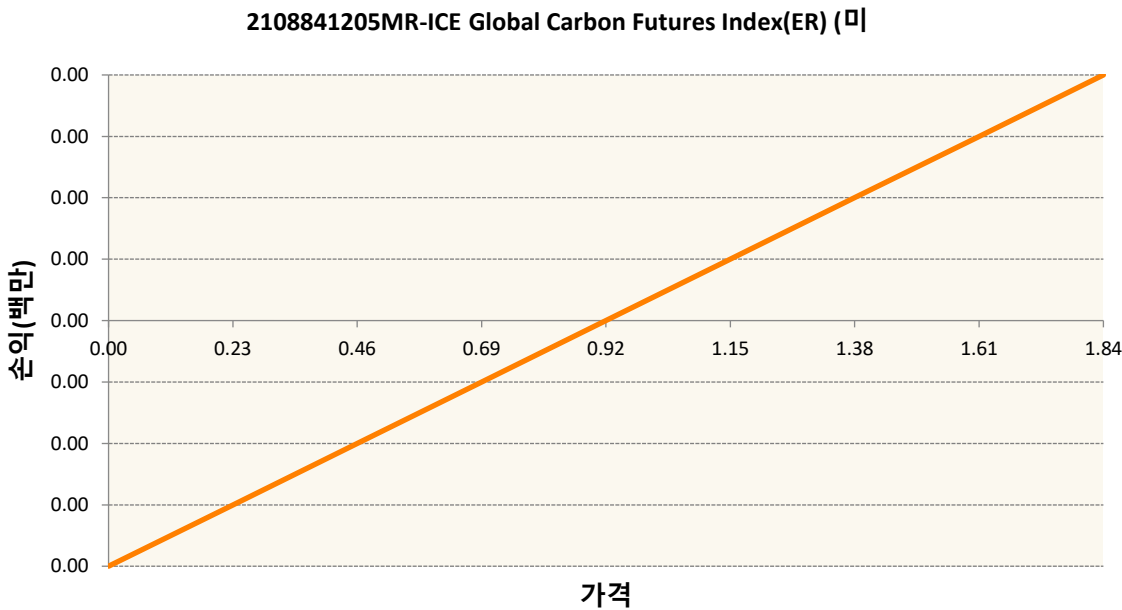
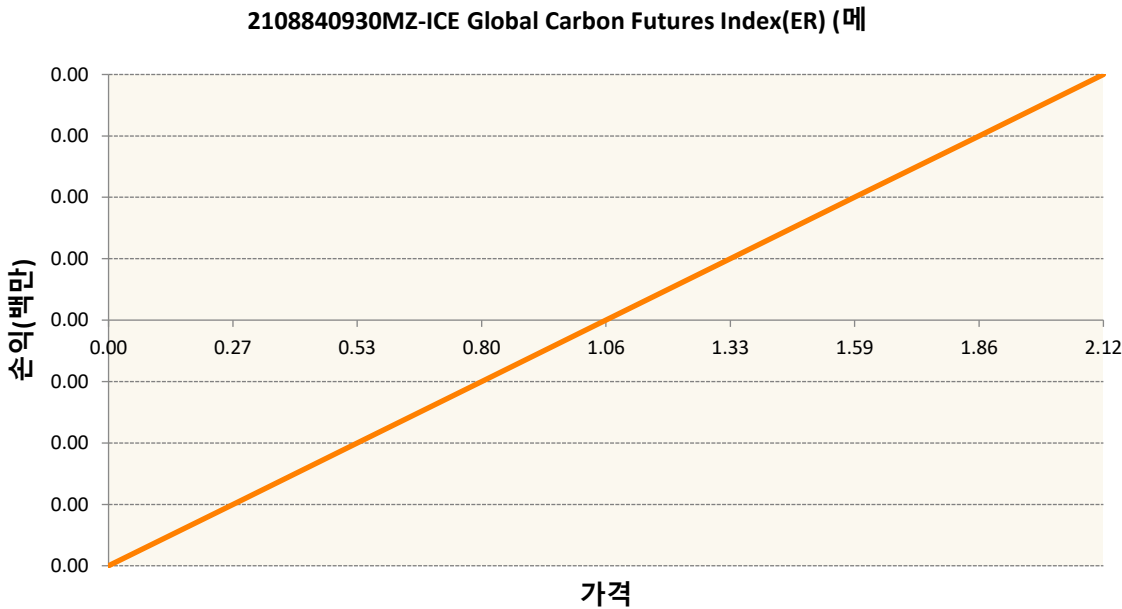
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,390	0	9,390	

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)
	838

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

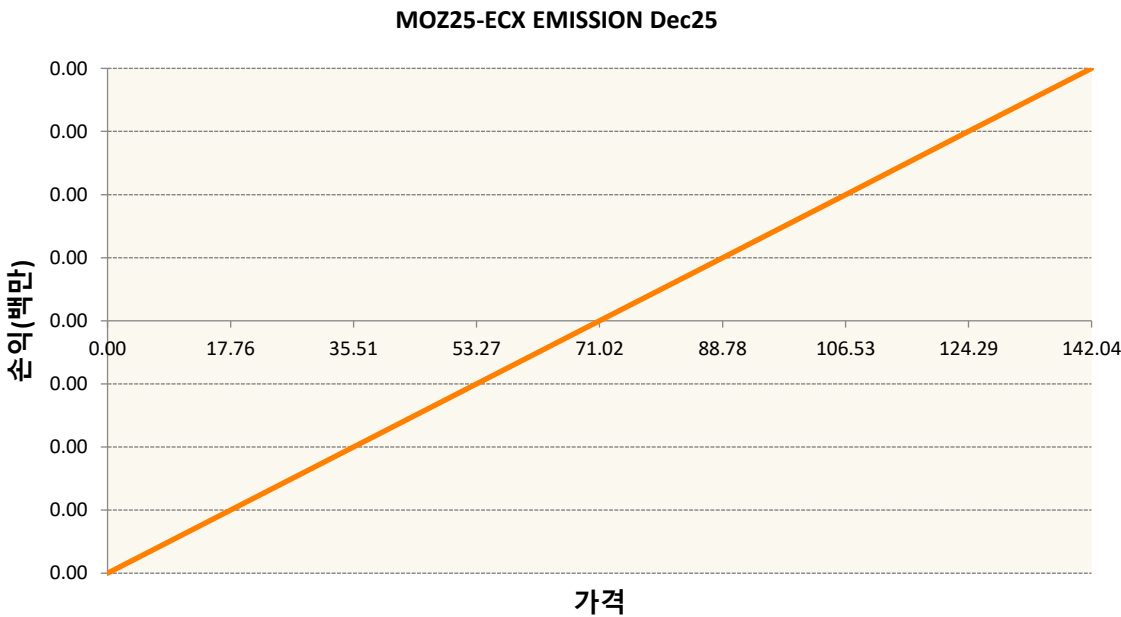
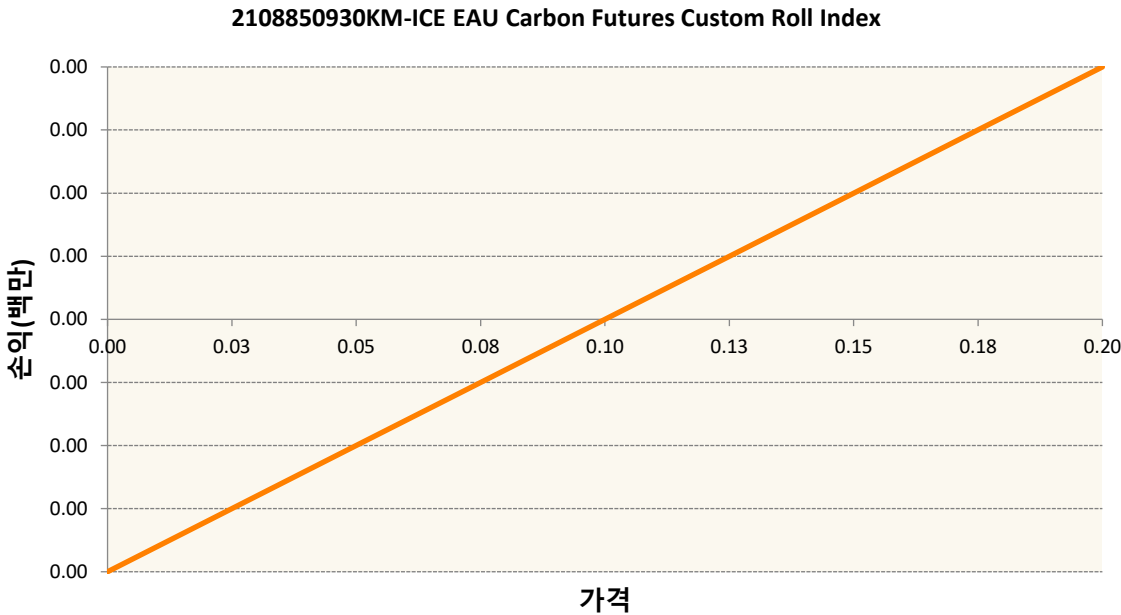
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,826	0	8,826	
누계	통화	선도	0	2,580	-2,580	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		703

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,323

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

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)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	1
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	2

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

(단위:백만원)

11

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

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)	31
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	37
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	8

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

(단위:백만원)

175

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

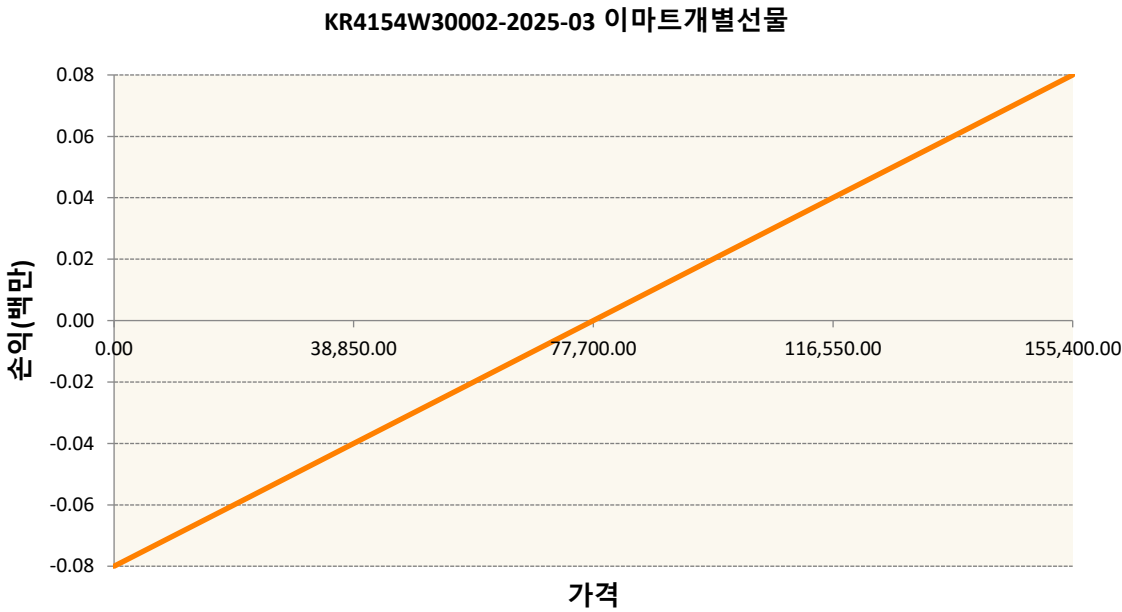
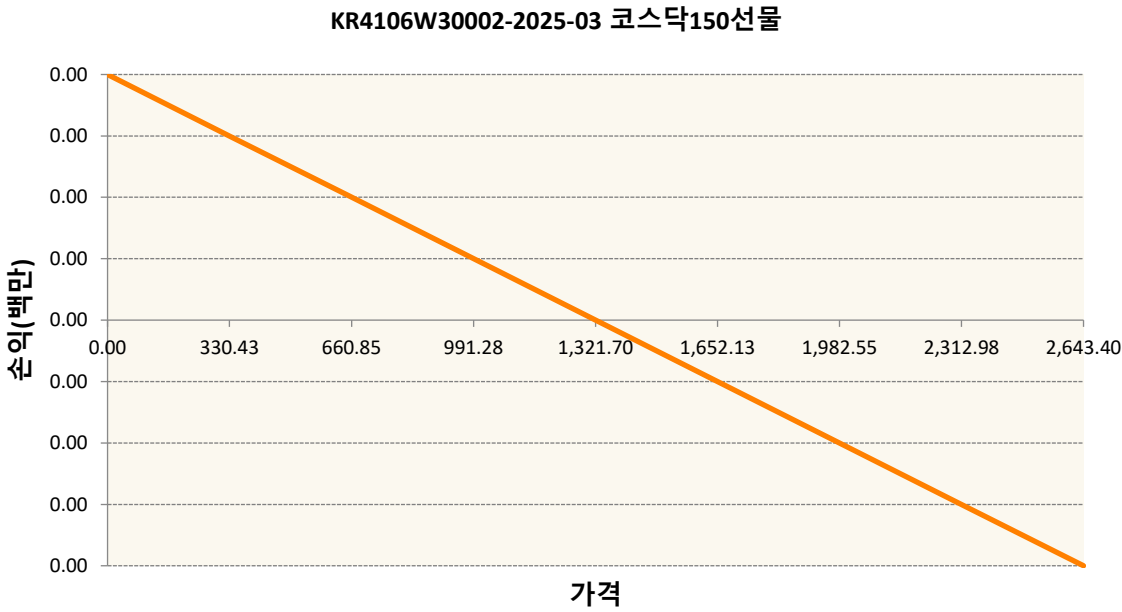
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

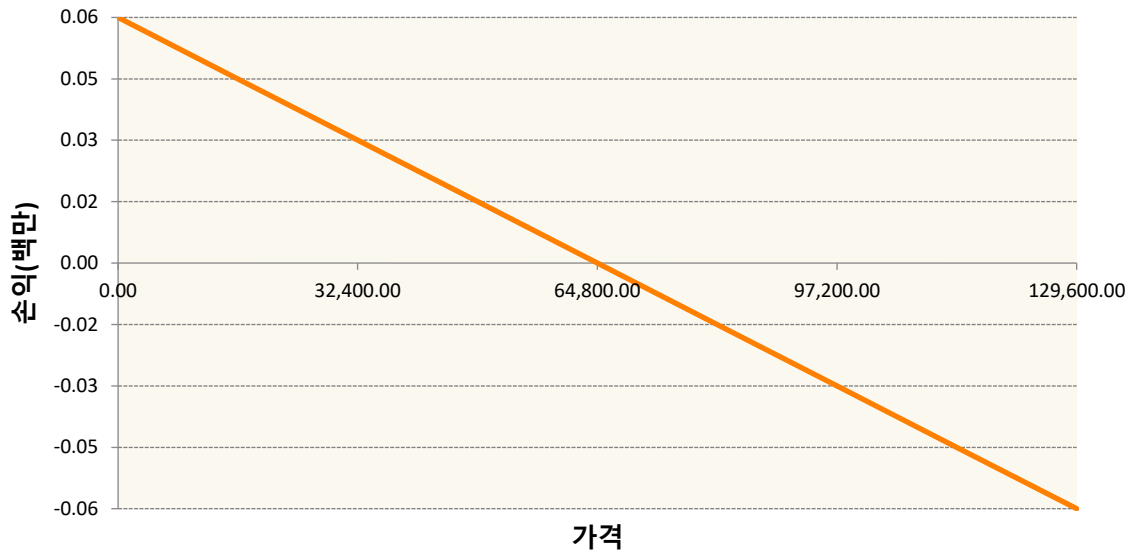
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4	0	4	장내
누계	유가증권	선물	31	76	-44	장내

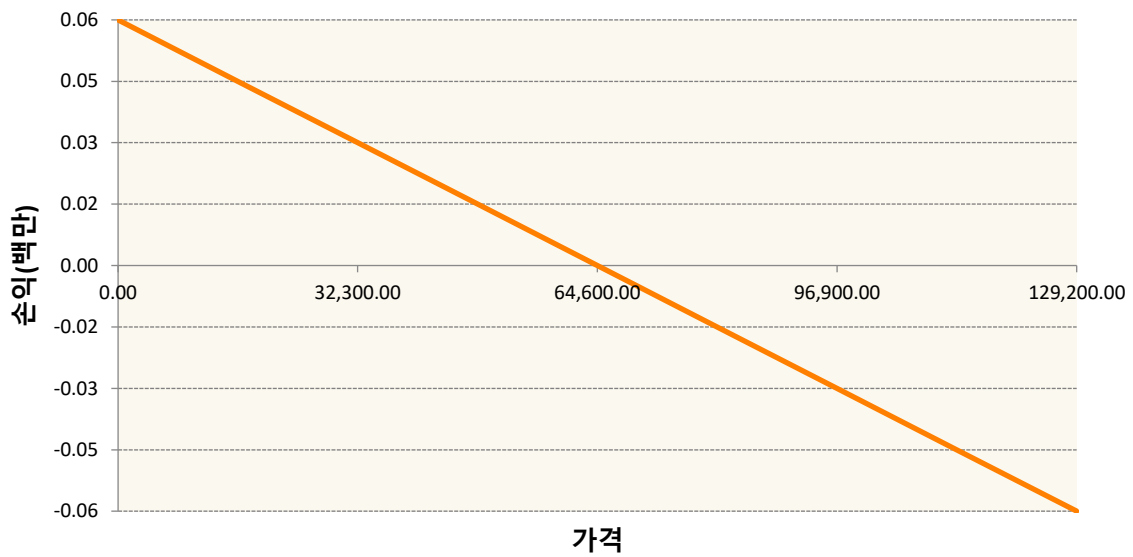
2. 만기시점의 손익구조



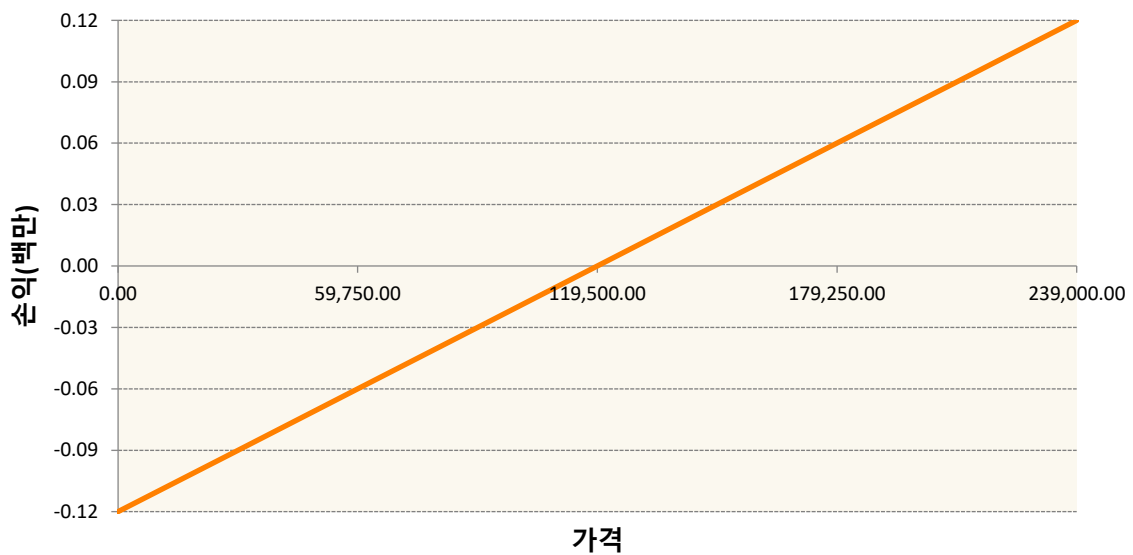
KR41BAW30001-2025-03 롯데쇼핑개별선물



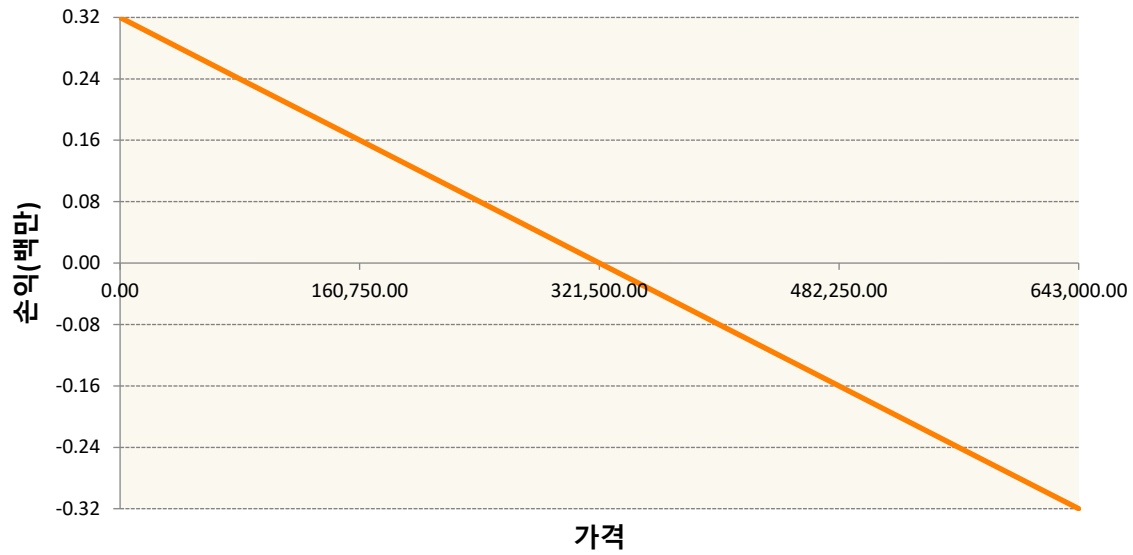
KR41BMW30006-2025-03 한국항공우주개별선물



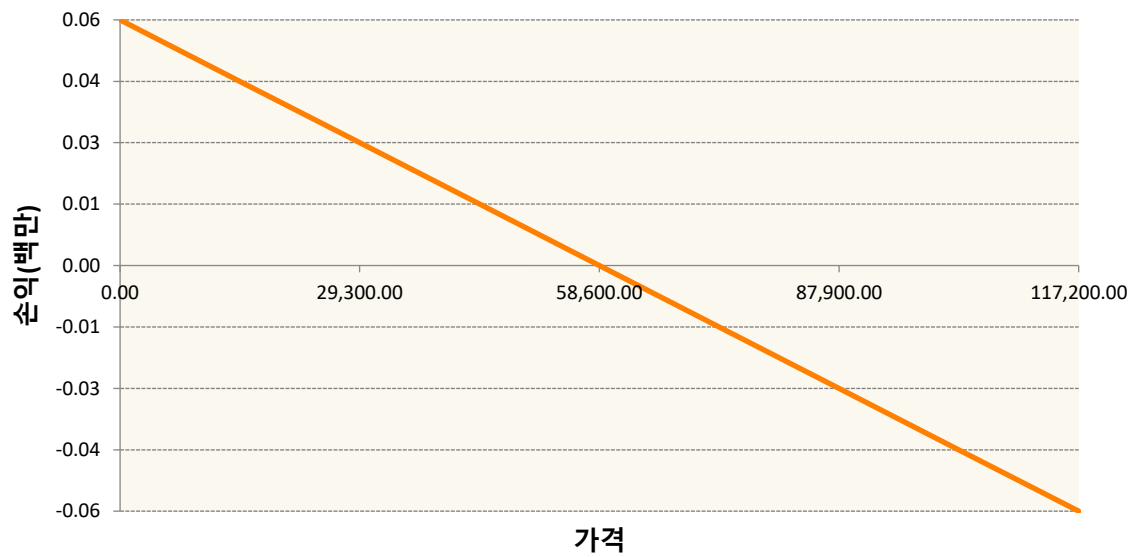
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



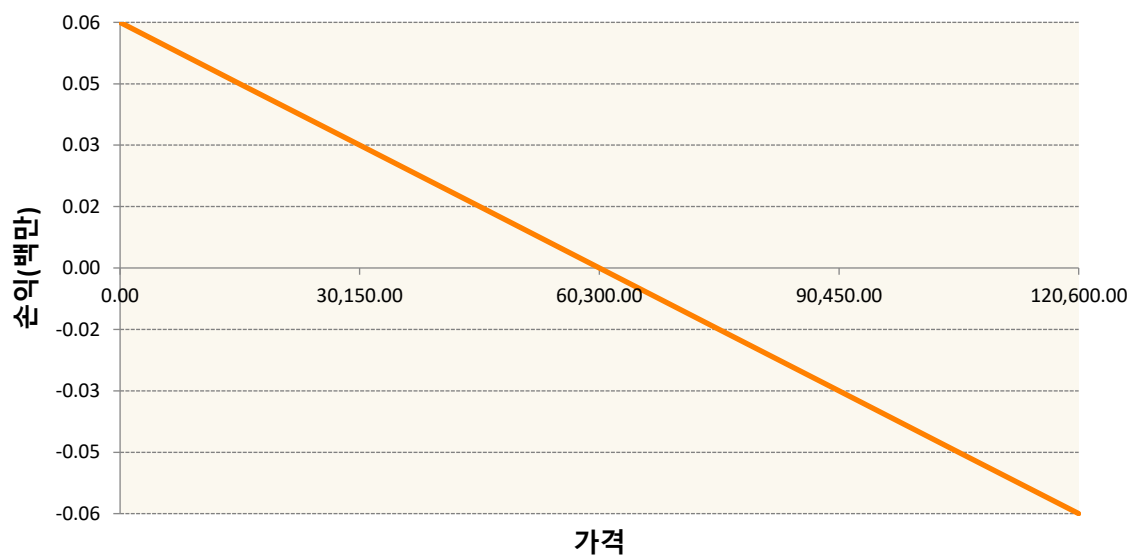
KR41CRW30003-2025-03 LG생활건강개별선물



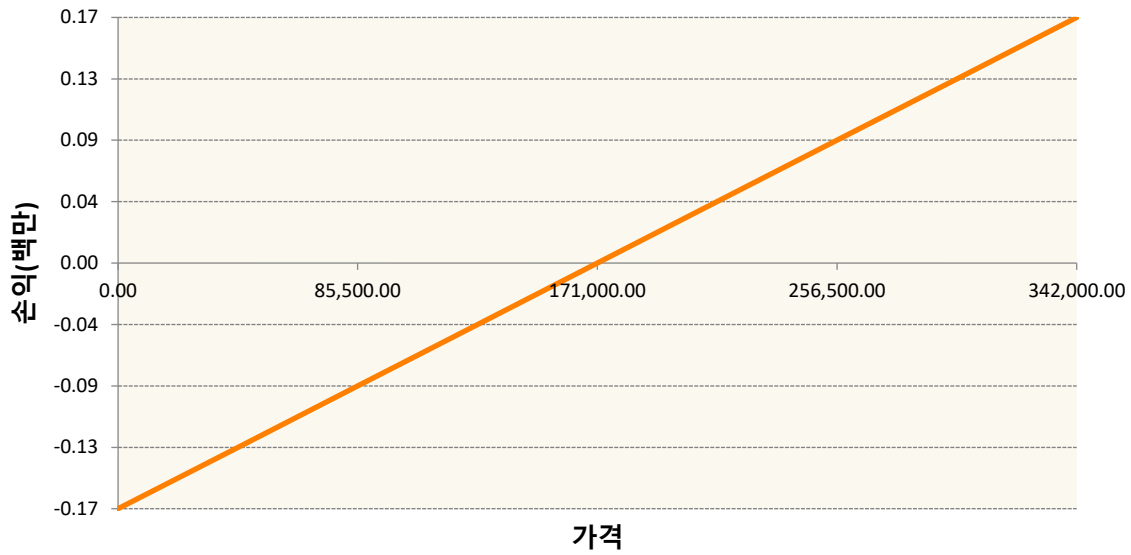
KR41D8W30004-2025-03 현대백화점개별선물



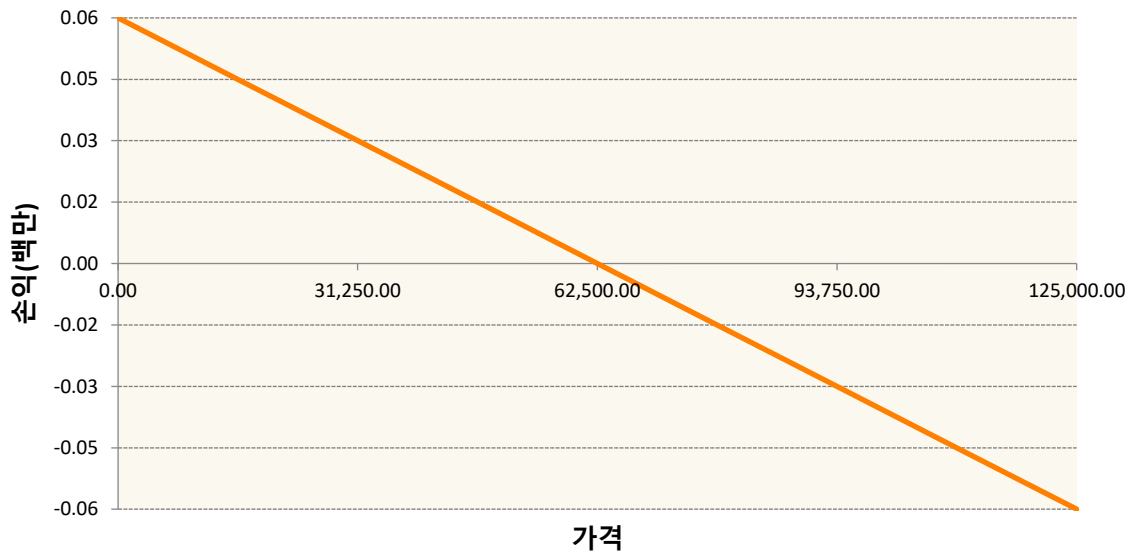
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



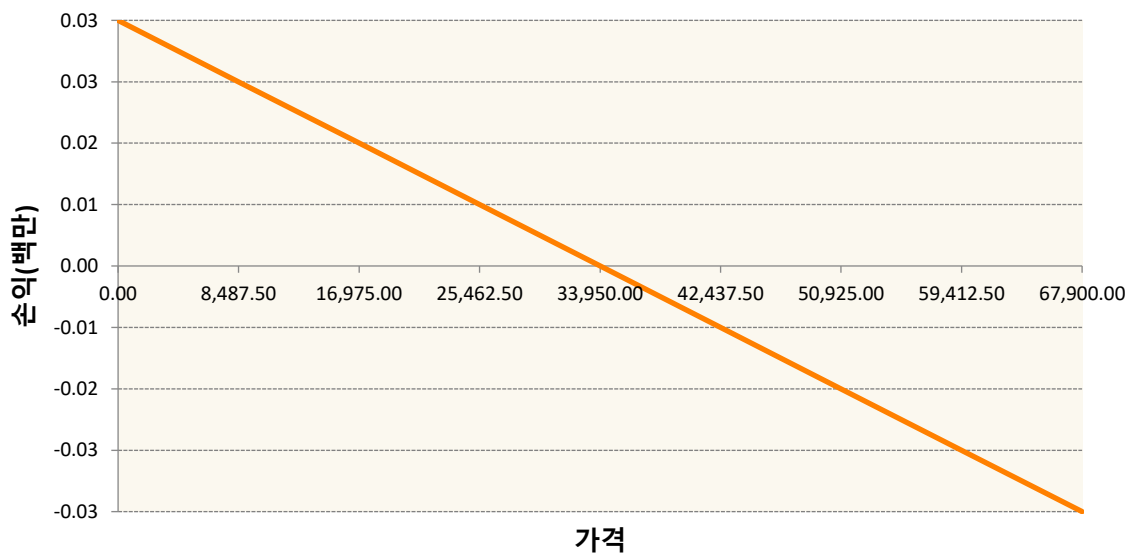
KR41DKW30006-2025-03 코스맥스개별선물



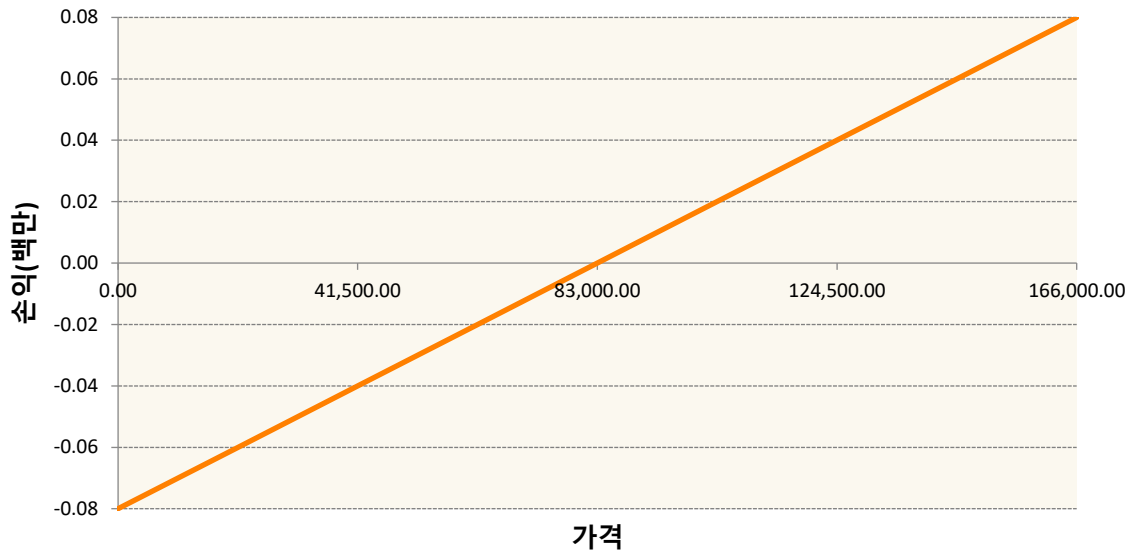
KR41DTW30007-2025-03 CJ ENM개별선물



KR41FLW30009-2025-03 펄어비스개별선물



KR41G6W30005-2025-03 현대로템개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4106W30(2025-03 코스닥150선물	2
KR4154W30(2025-03 이마트개별선물	0.37
KR41BAW30(2025-03 롯데쇼핑개별선물	0.36
KR41BMW30(2025-03 한국항공우주개별선물	1
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	0.3
KR41G6W30(2025-03 현대로템개별선물	0.4

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

(단위:백만원)

18

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

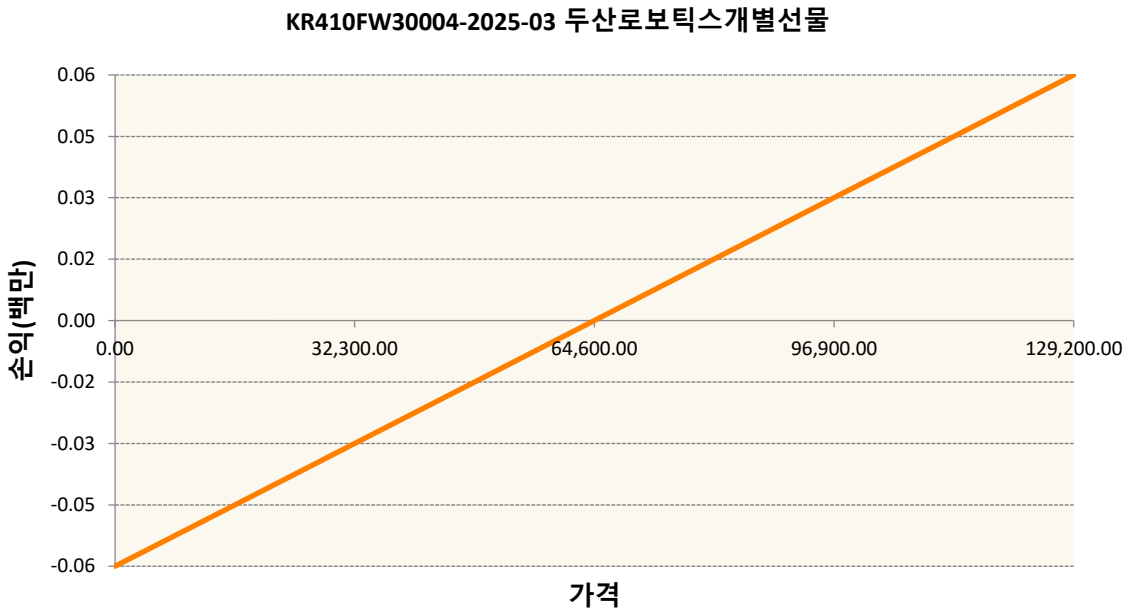
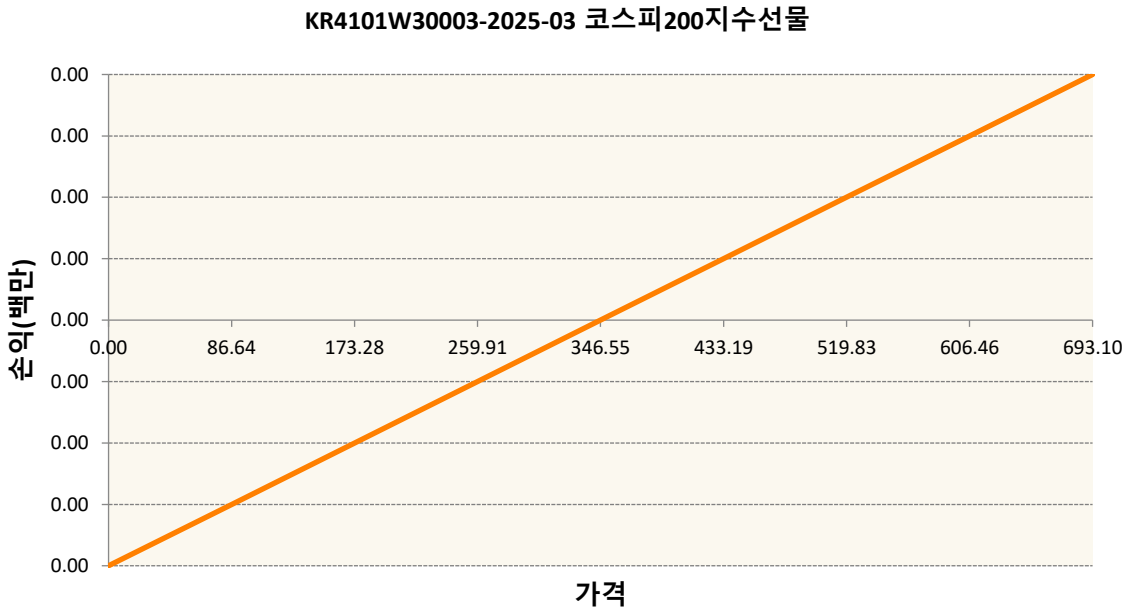
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

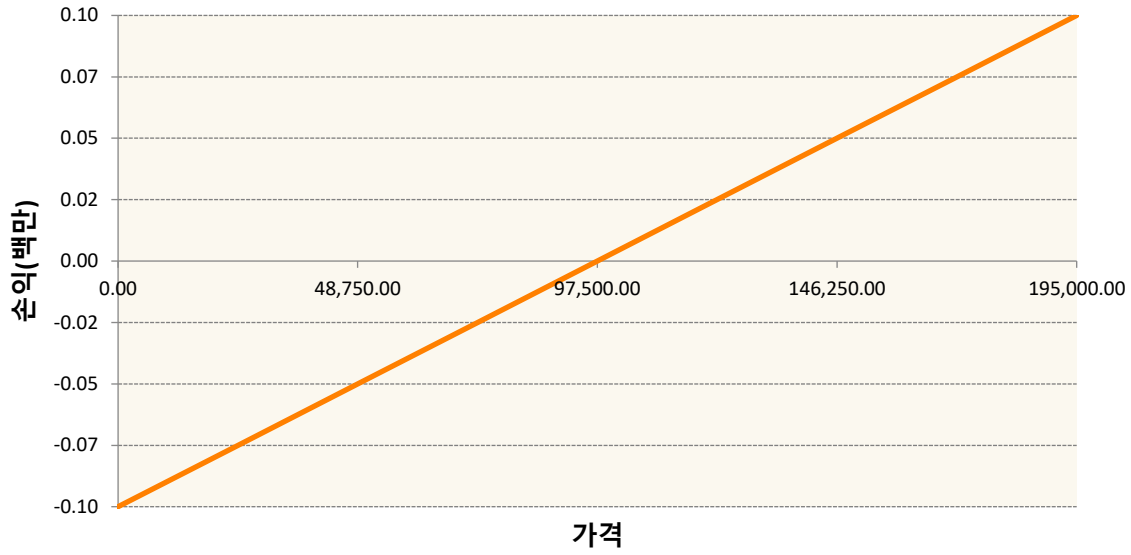
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,973	0	2,973	장내
누계	유가증권	선물	13,564	0	13,564	장내

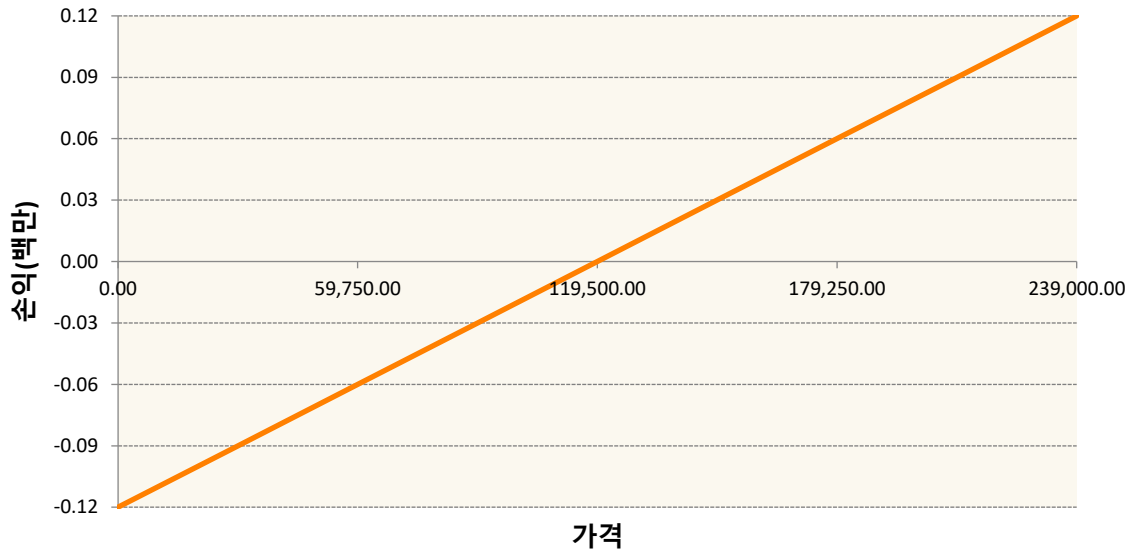
2. 만기시점의 손익구조



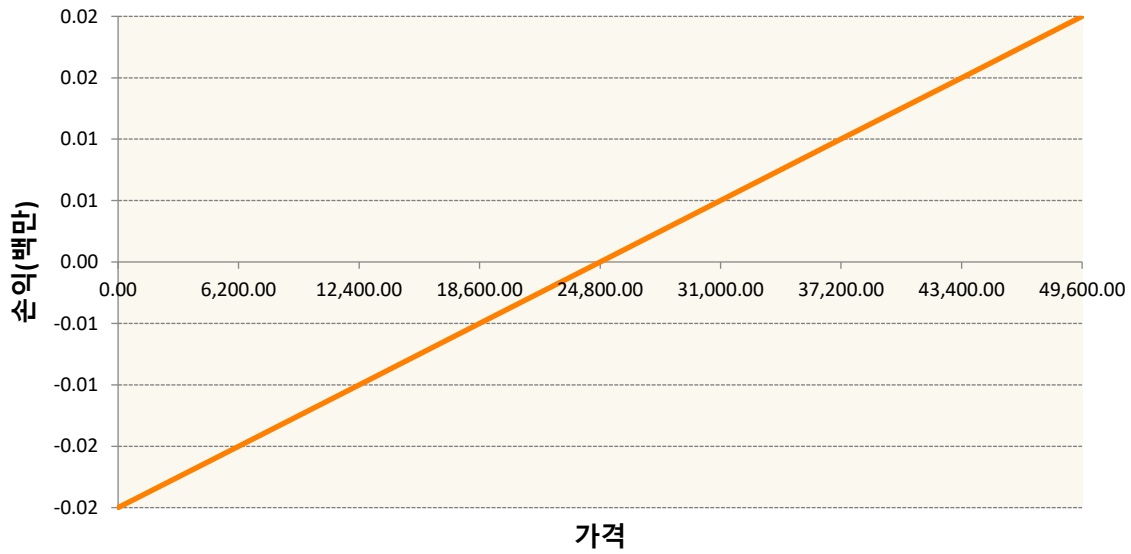
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



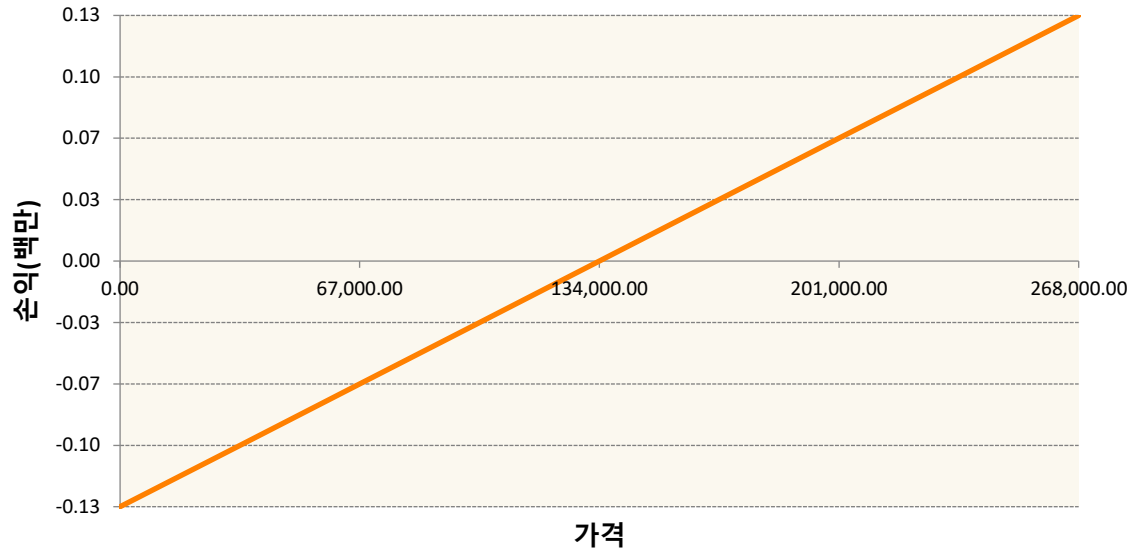
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



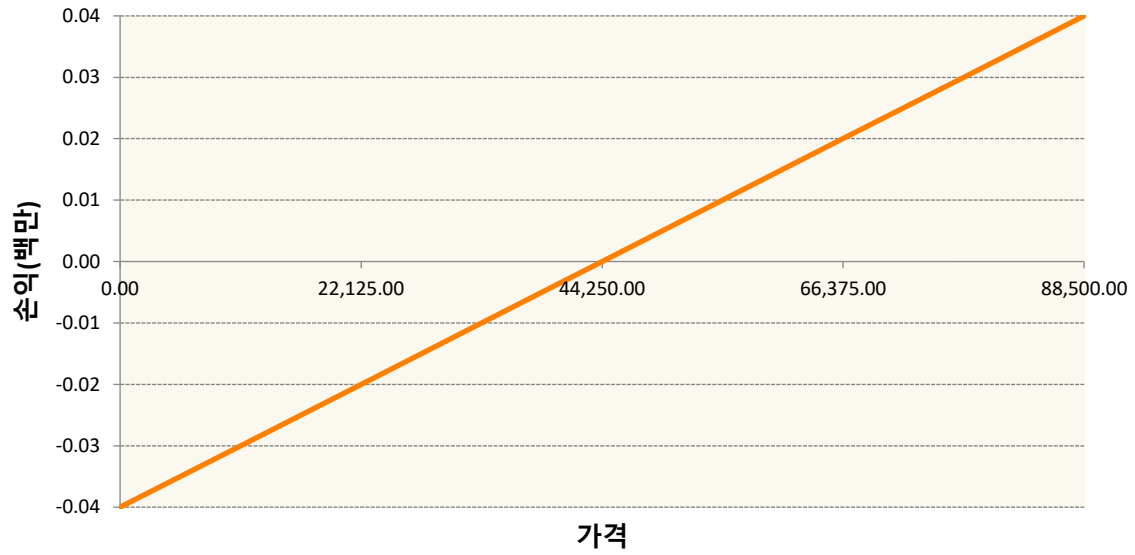
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



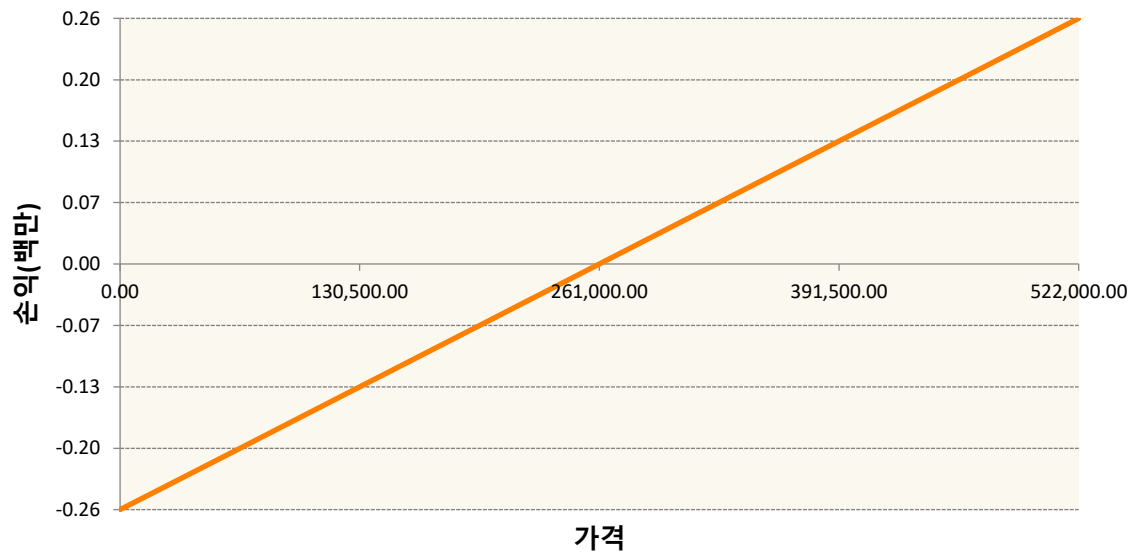
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



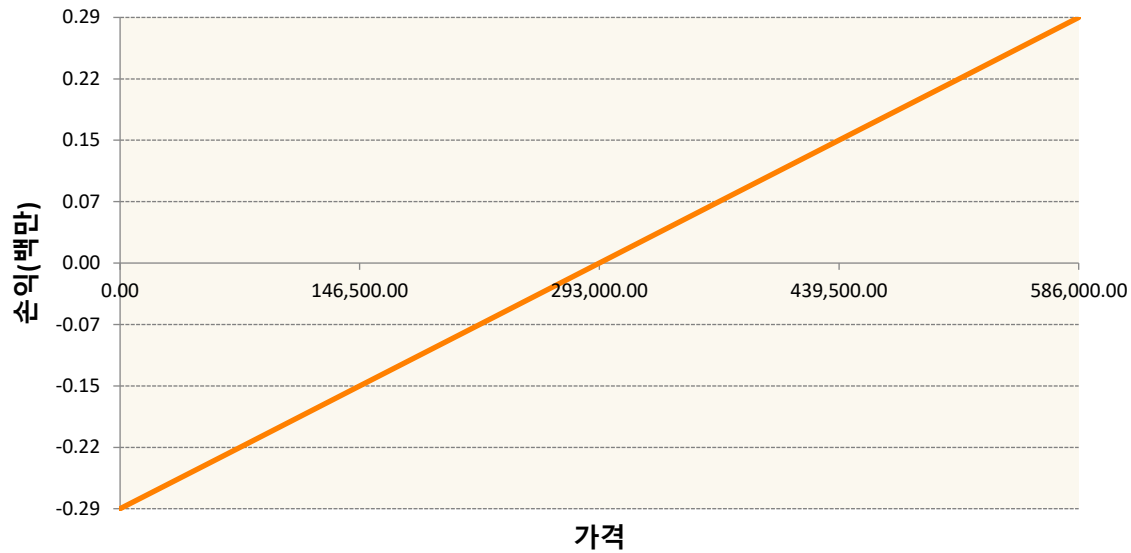
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



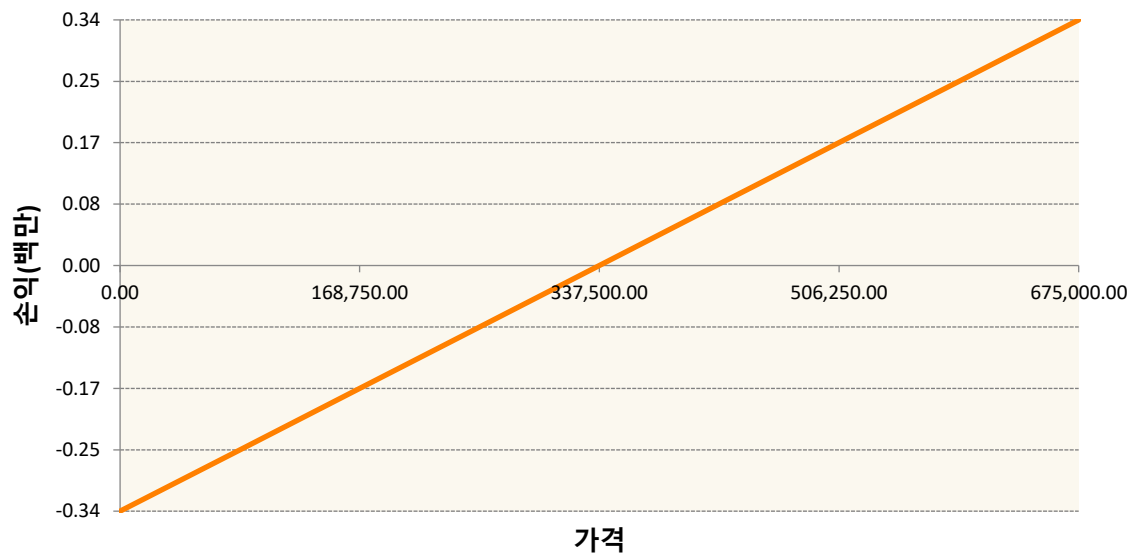
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



KR41FDW30006-2025-03 HD현대중공업개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	762
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	12
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	40
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물	36
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물	12
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	26
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	11
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	53
KR41FDW30(2025-03 HD현대중공업개별선물	64
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	68

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

(단위:백만원)

1,863

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

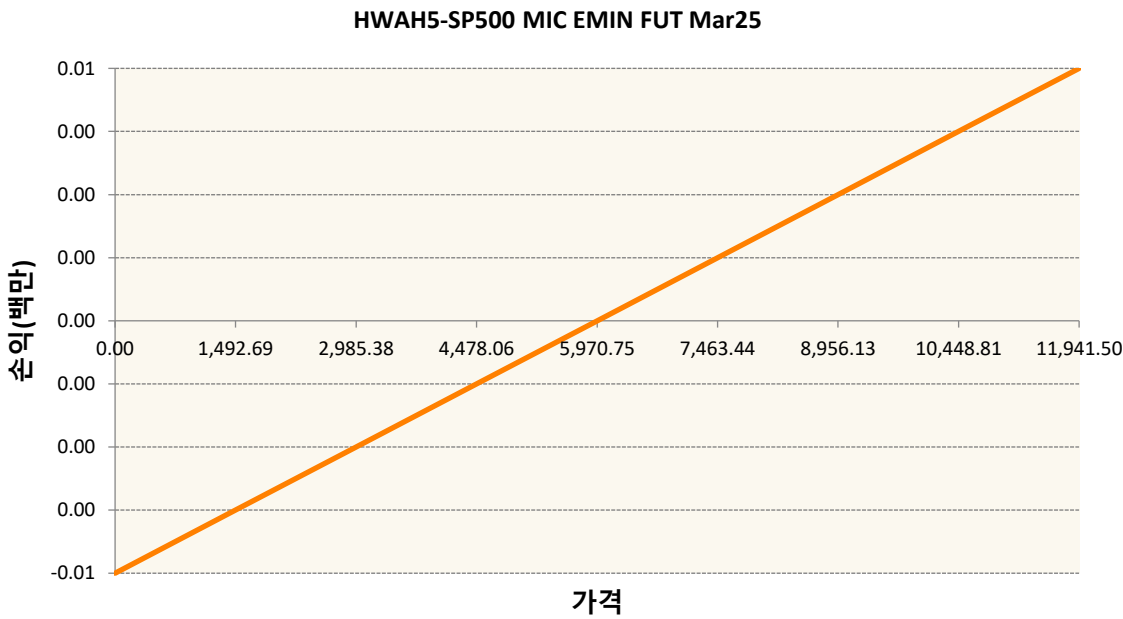
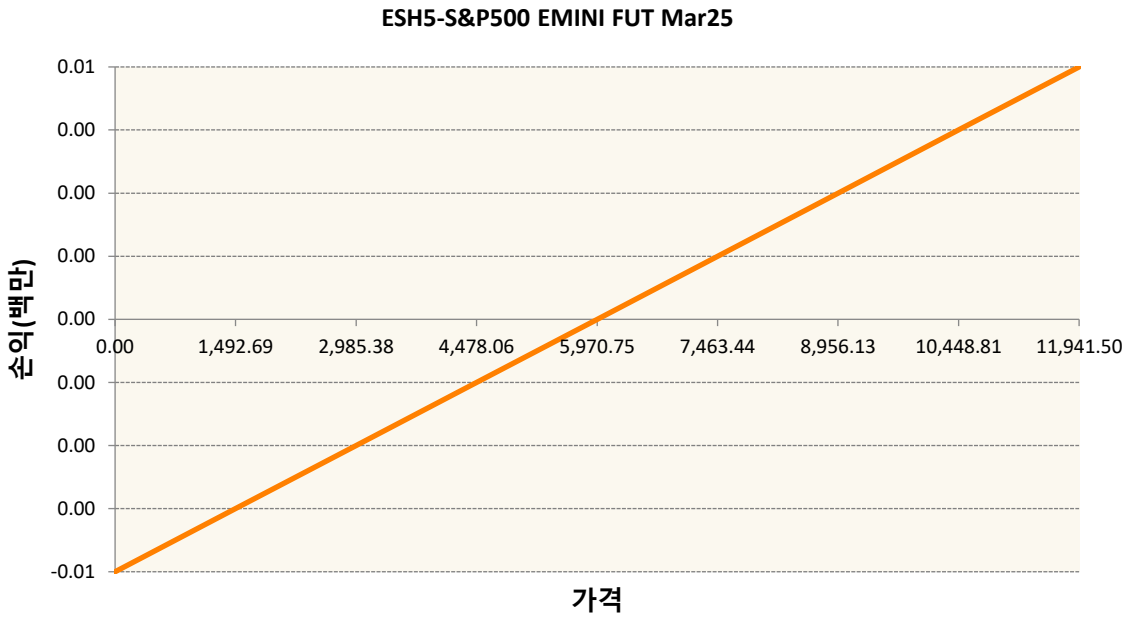
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	29,917	0	29,917	
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)
	3,347

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

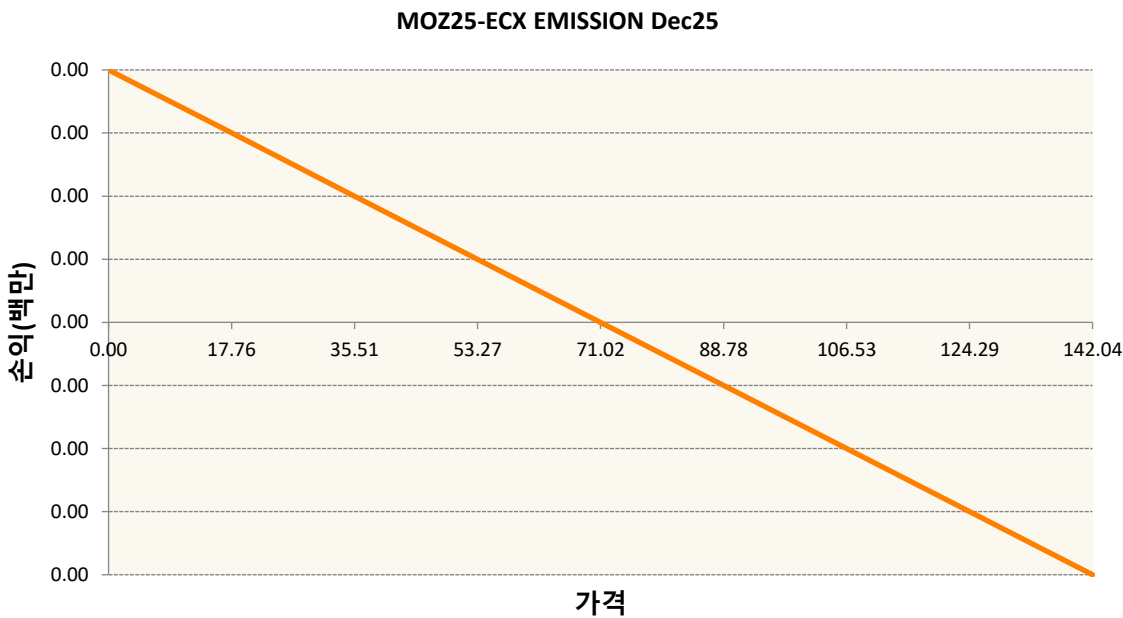
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-37	5,622	-5,659	
누계	통화	선도	0	1,809	-1,809	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	450

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

(단위:백만원)

854

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

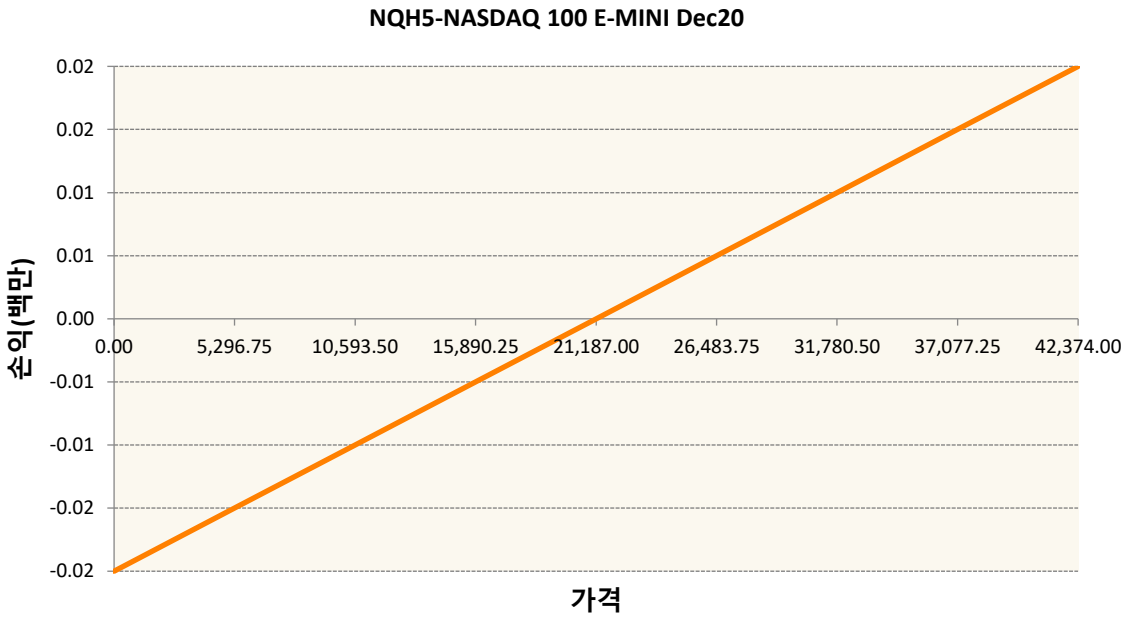
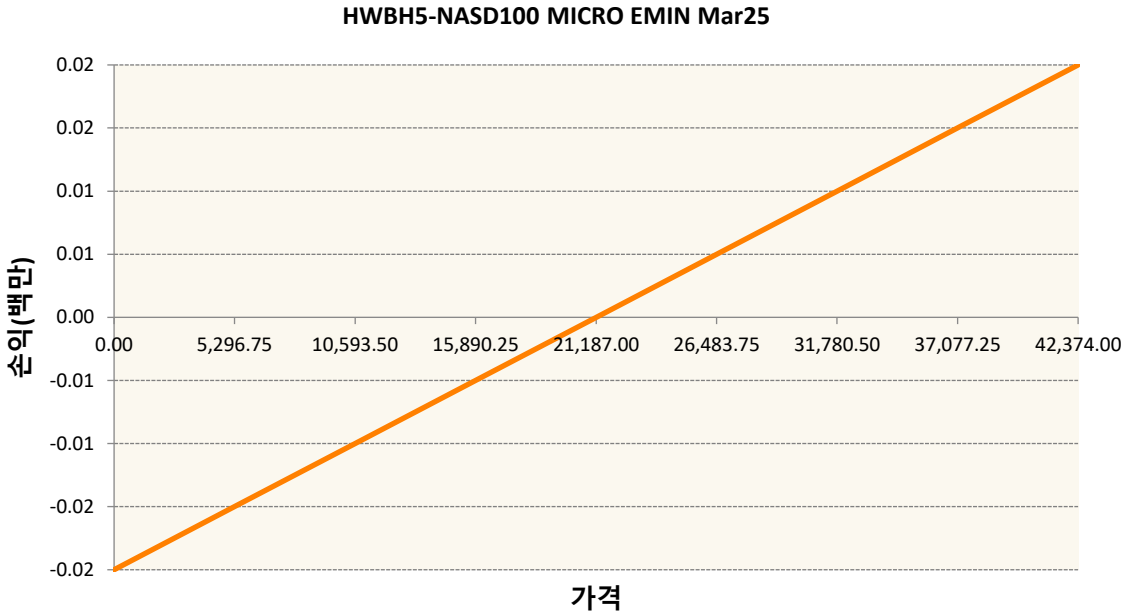
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,778	0	14,778	
누계	유가증권	선물	676	0	676	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	54
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,182

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,085

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	84,385	0	84,385	장외
누계	지수	스왑	218,476	0	218,476	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	734
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,120
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,234
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,804

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

(단위:백만원)

9,289

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

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)

35

공시일	2025-02-28
기준일	2025-02-27

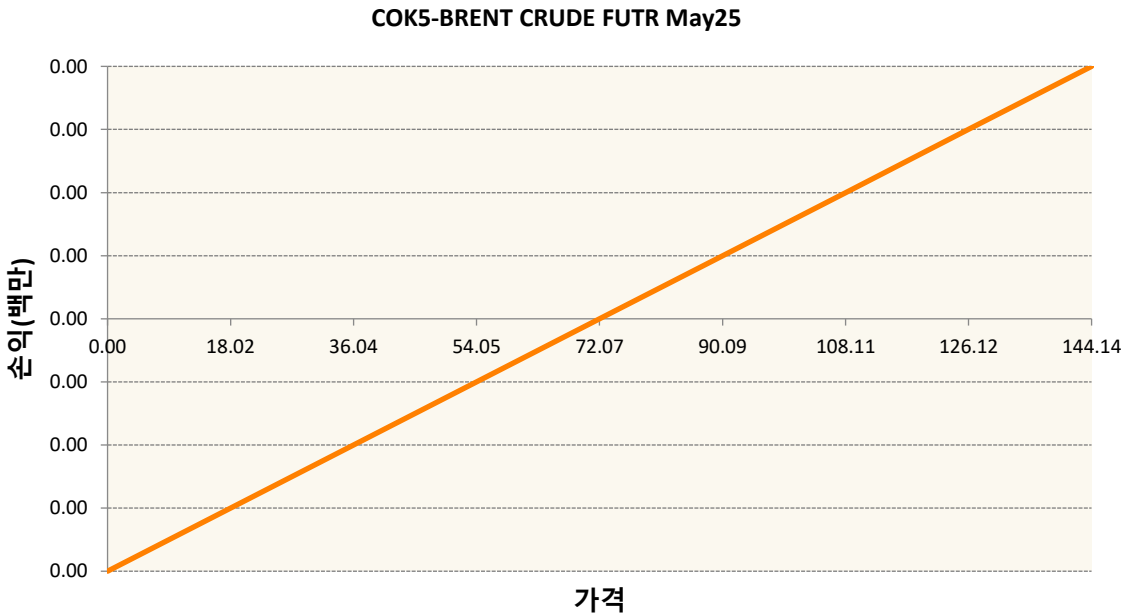
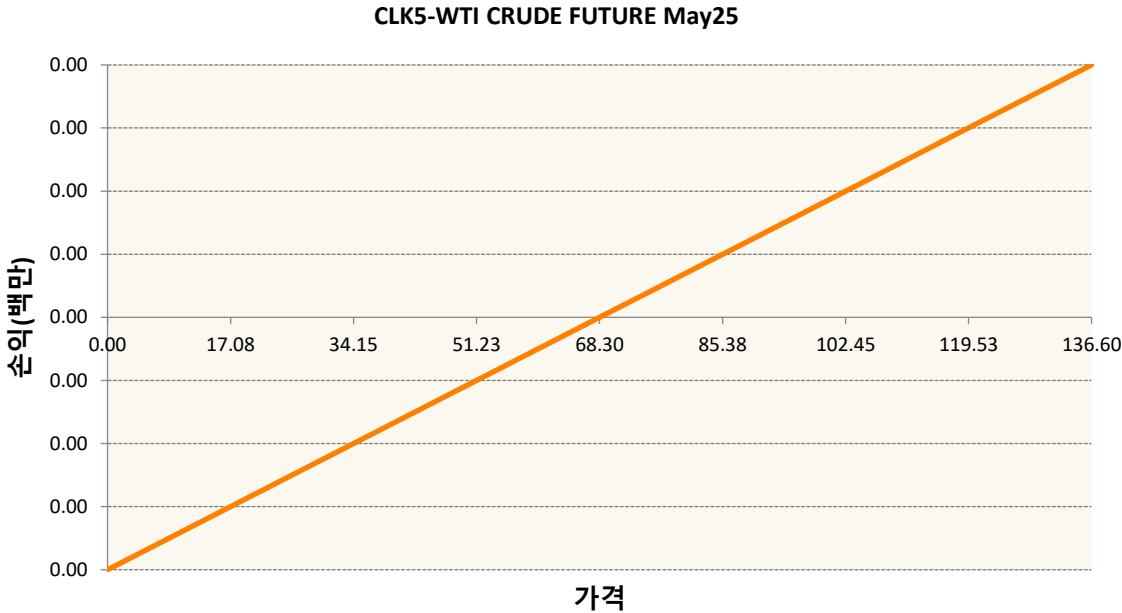
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

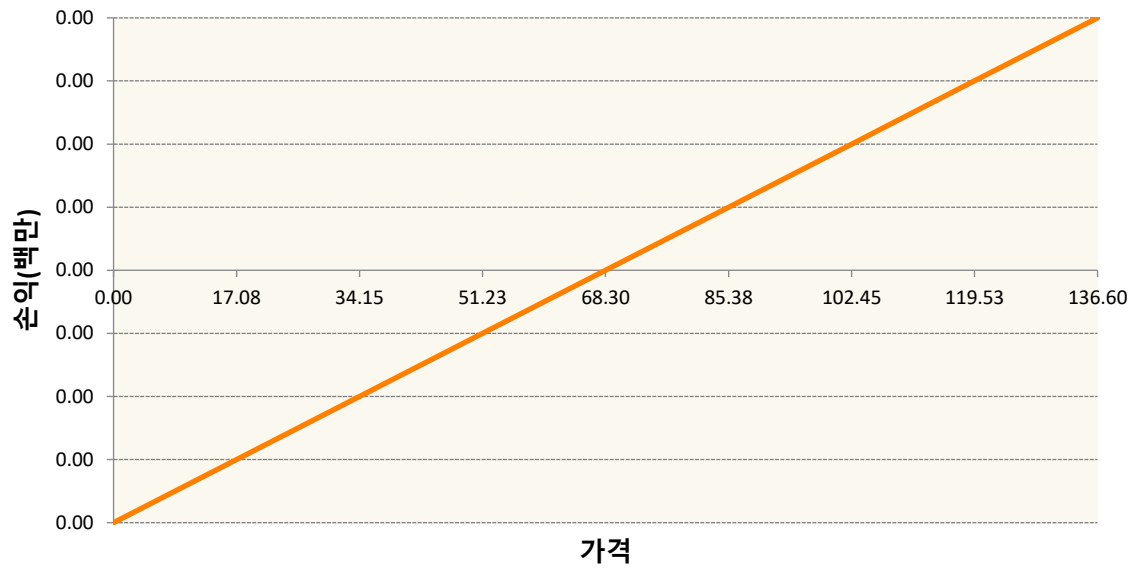
(단위:백만원)

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	869	0	869	
누계	통화	선물	0	158	-158	장내

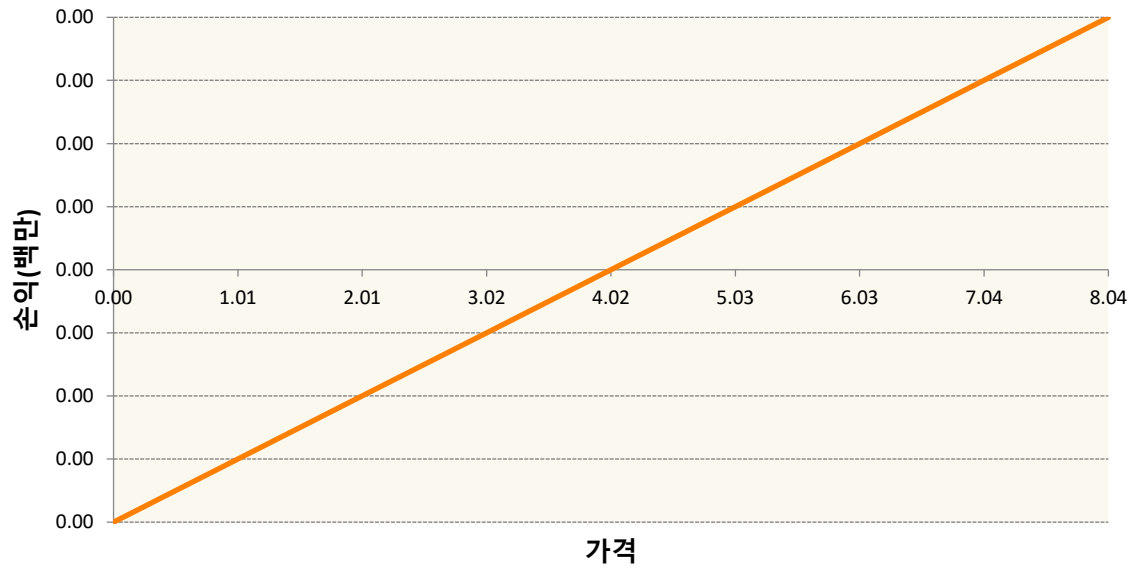
2. 만기시점의 손익구조



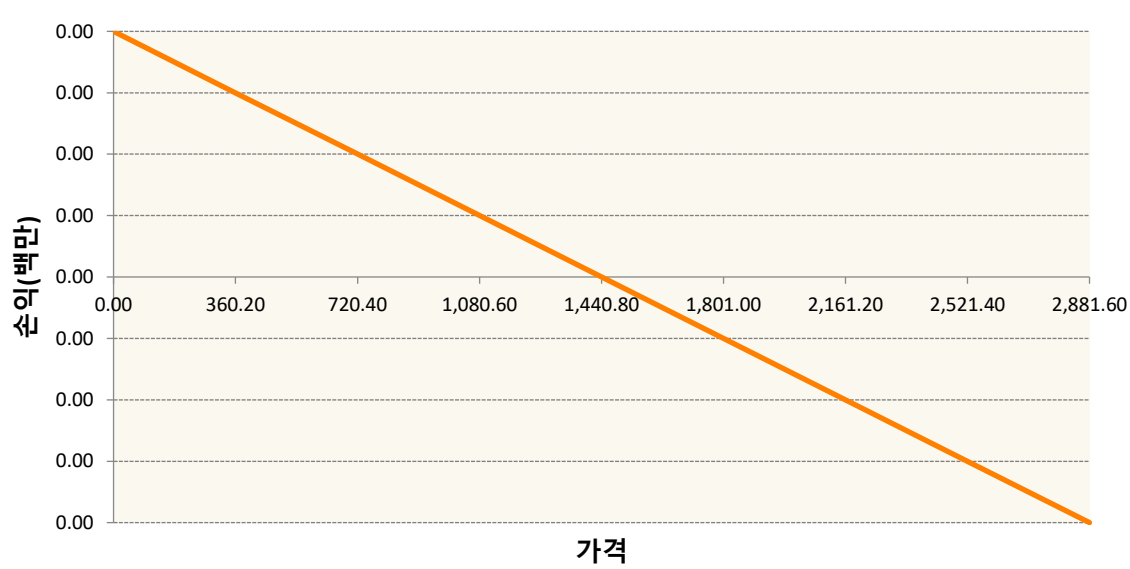
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



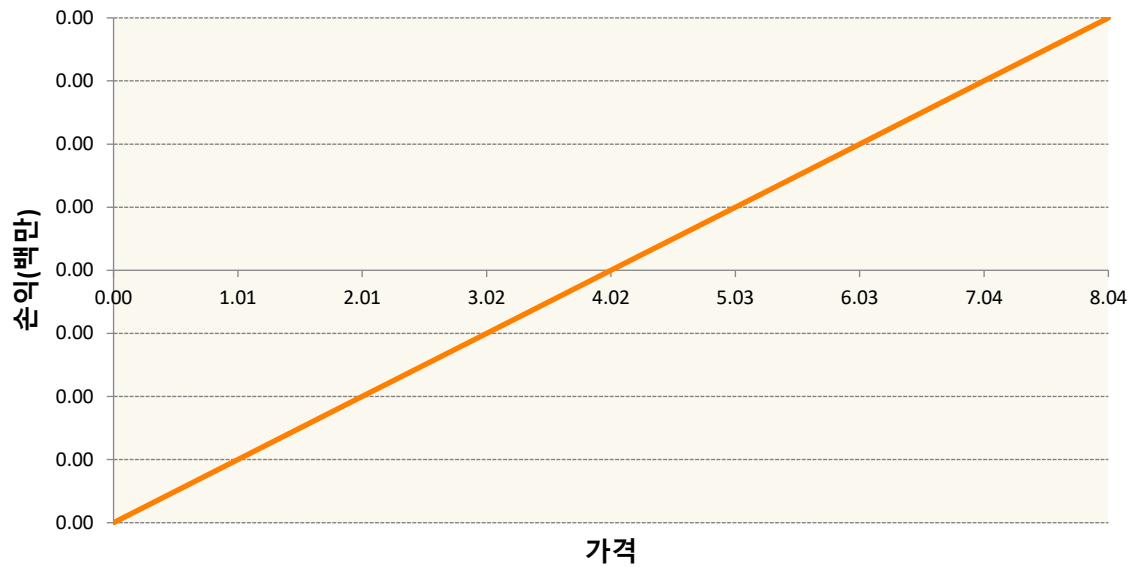
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



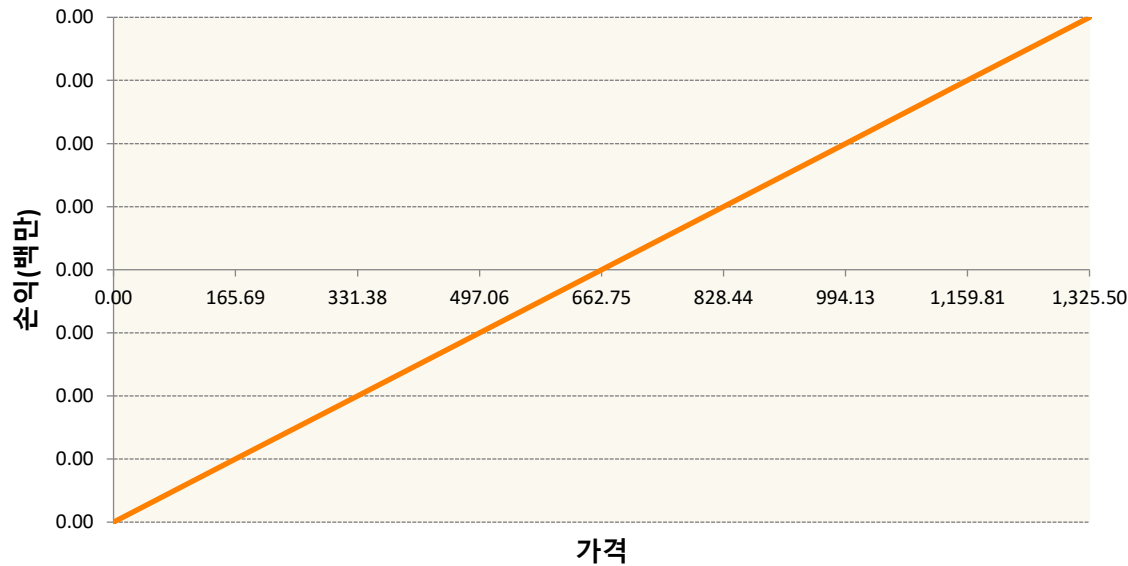
KR4175W30007-2025-03 달러선물



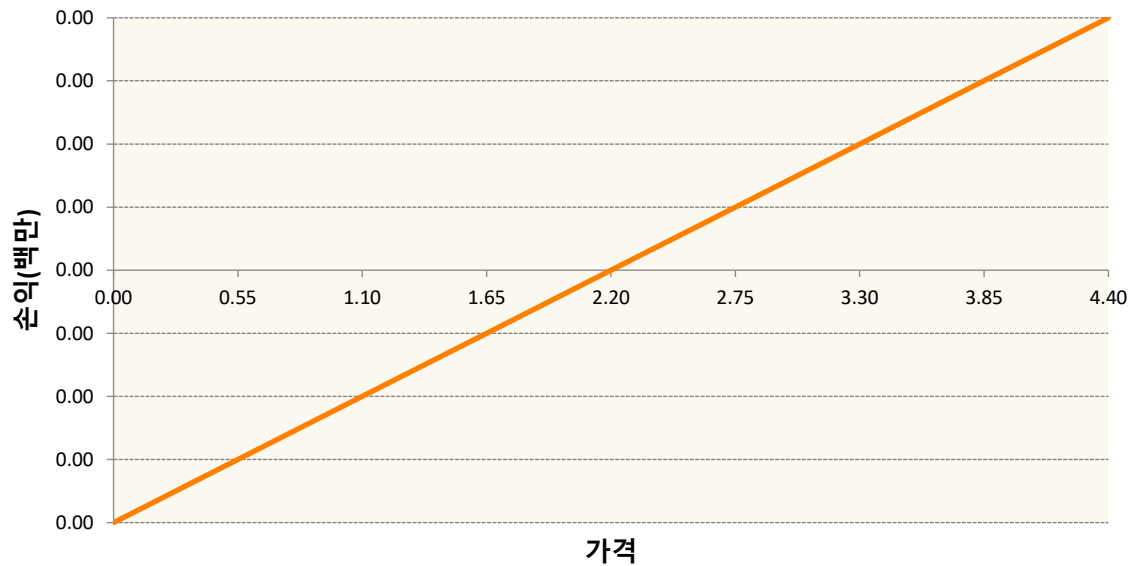
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	13
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)

151