

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

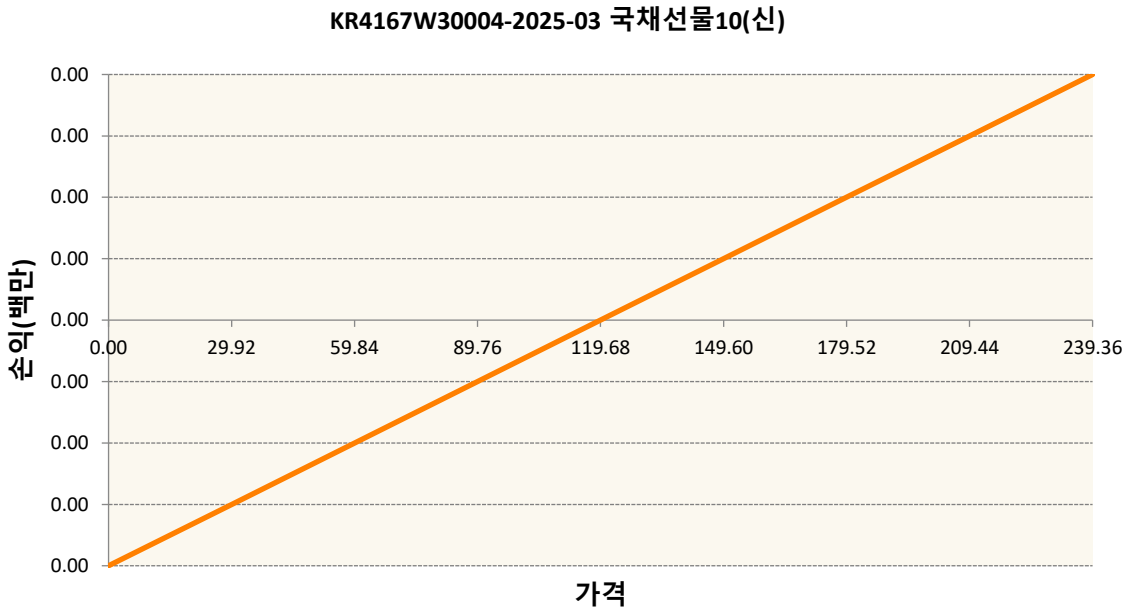
베스트장기채(채권-파생형)

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	230,982	0	230,982	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

5,786

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

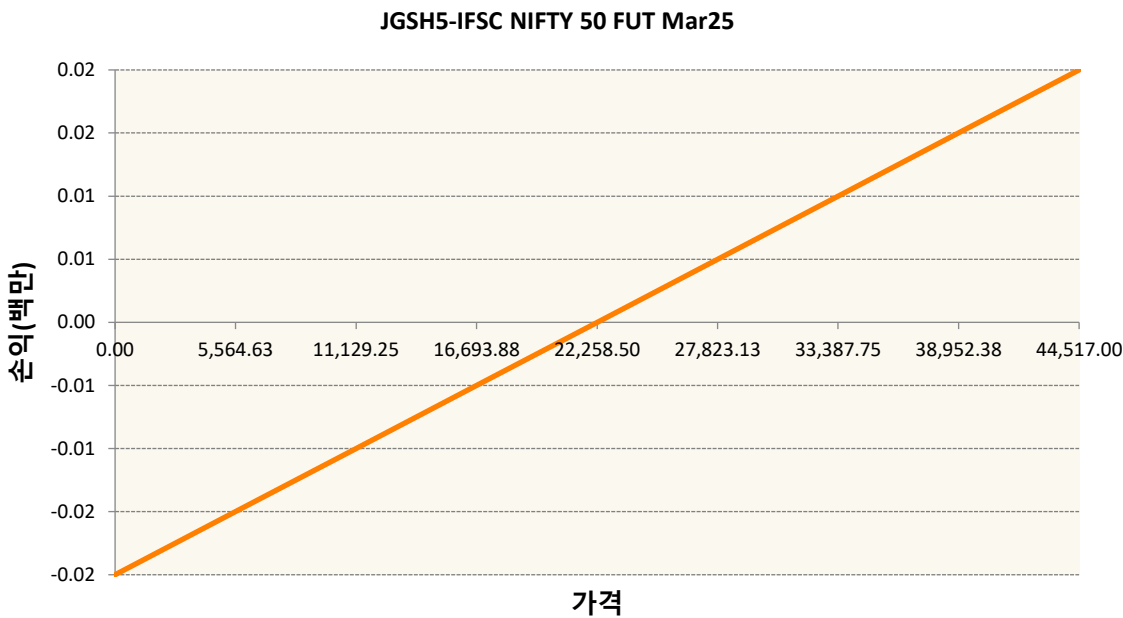
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,314	0	3,314	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH5	IFSC NIFTY 50 FUT Mar25	265
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

180

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

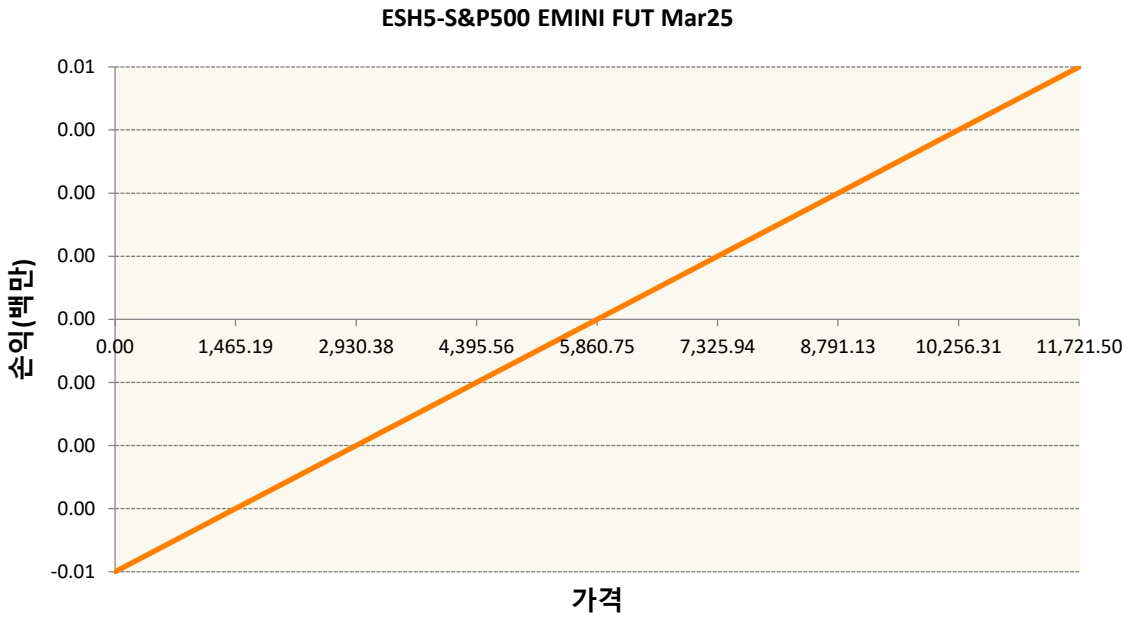
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	842	0	842	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	67
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

93

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

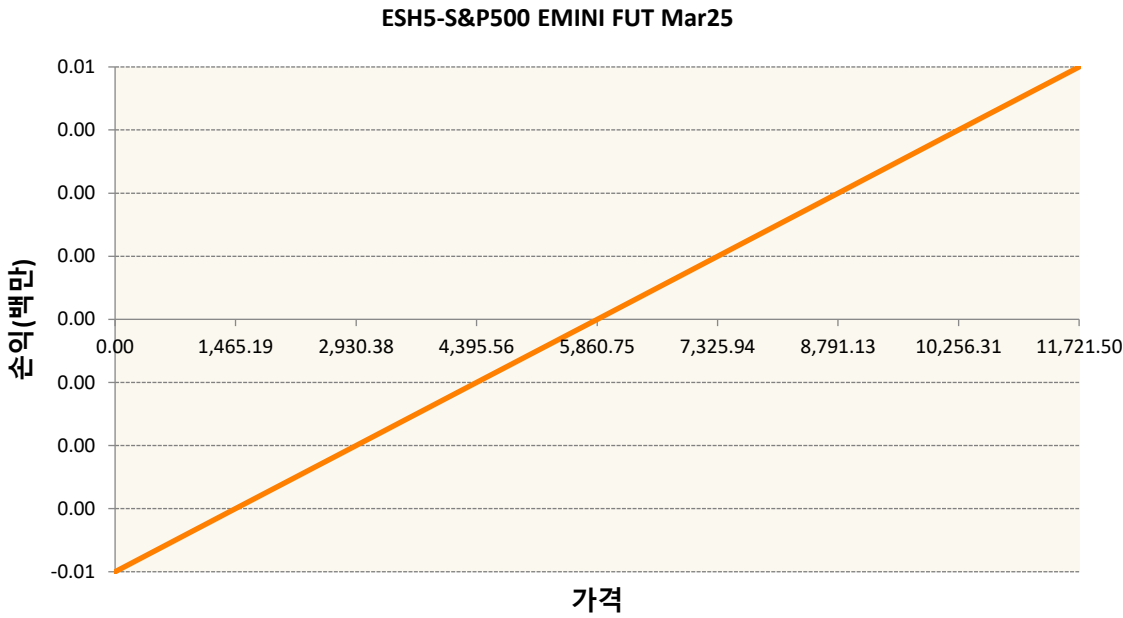
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,552	0	2,552	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	204
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

281

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

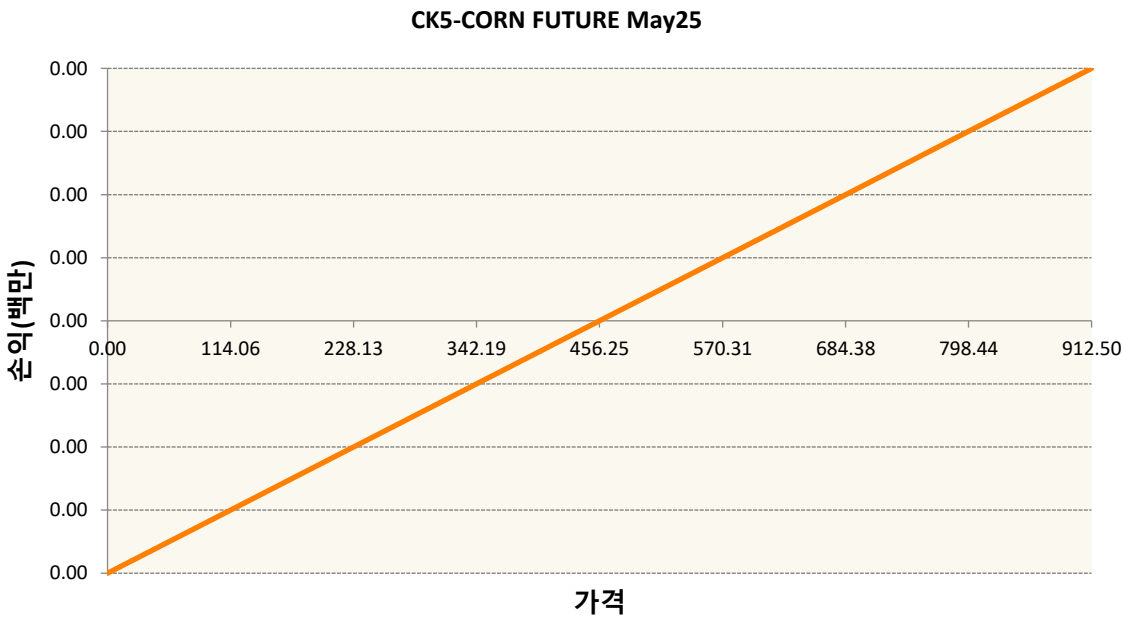
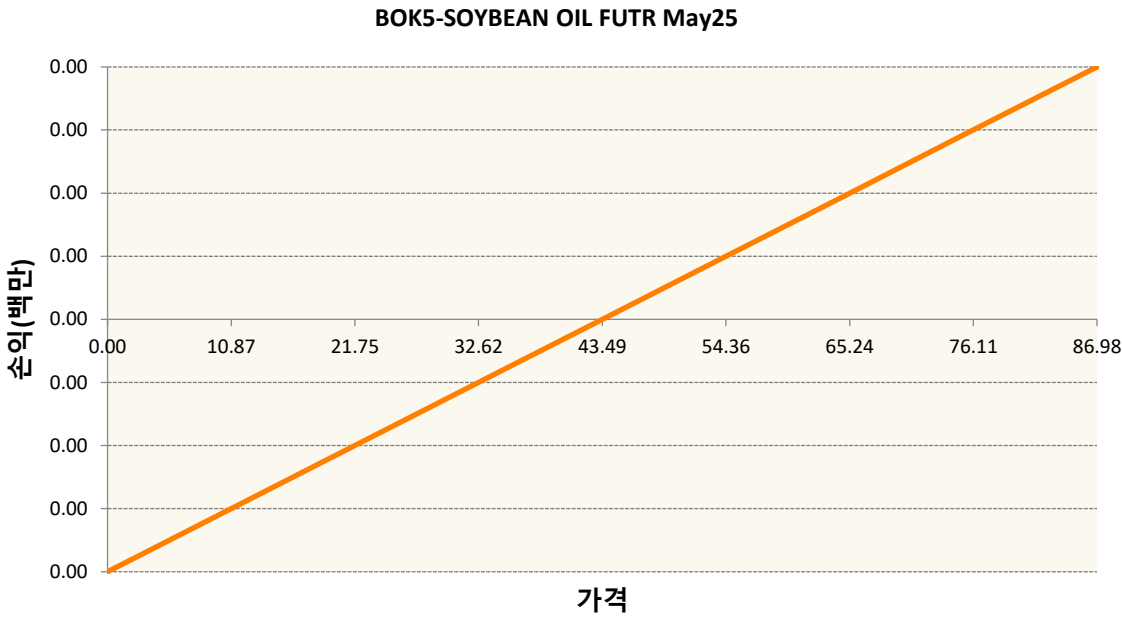
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

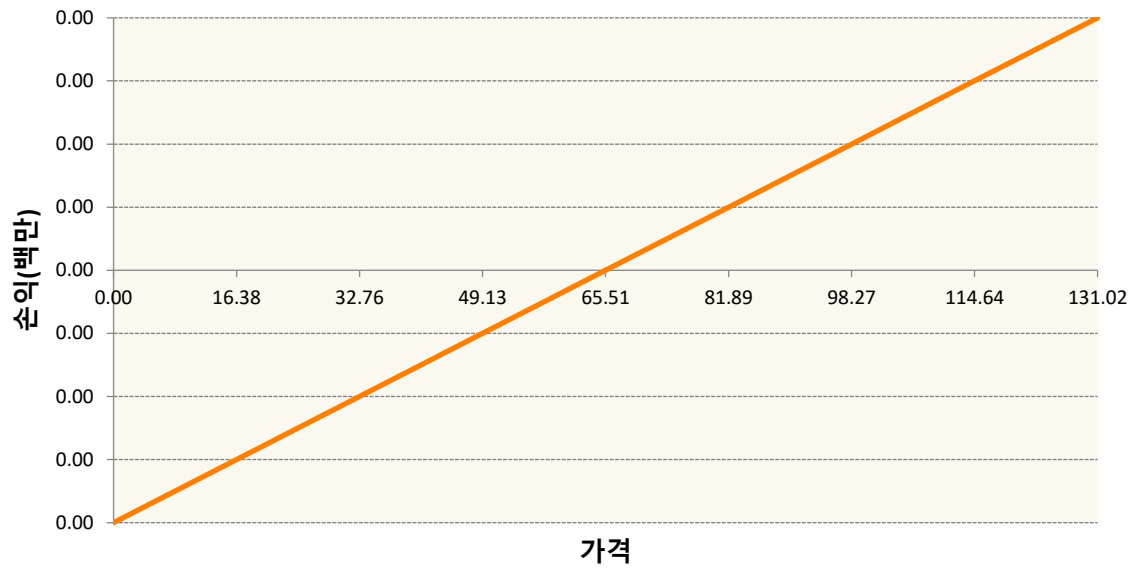
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	73	0	73	장내
누계	유가증권	선물	3,743	0	3,743	
누계	통화	선물	0	438	-438	장내

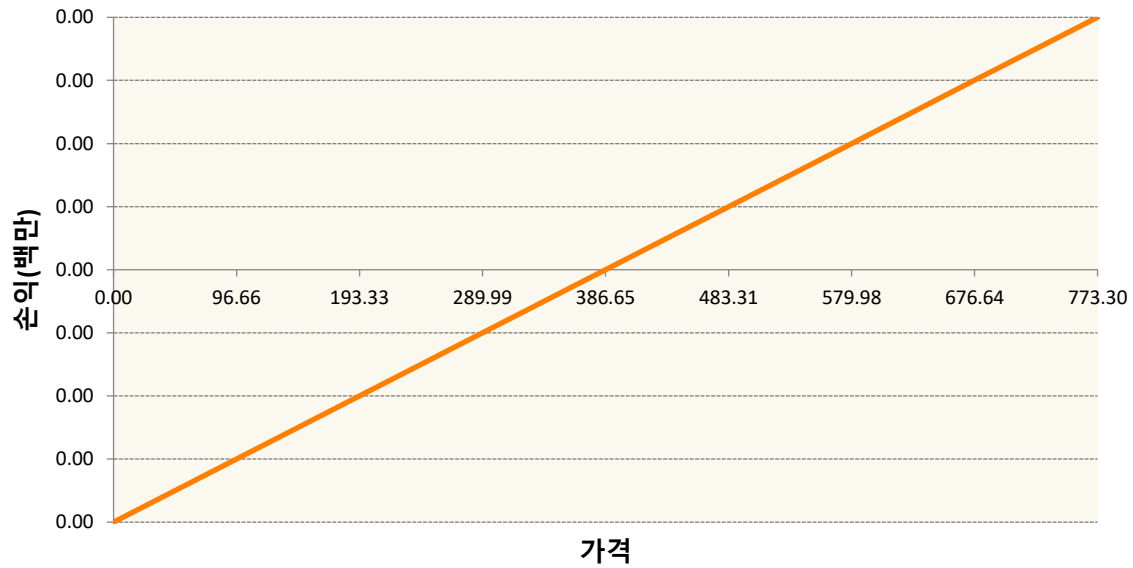
2. 만기시점의 손익구조



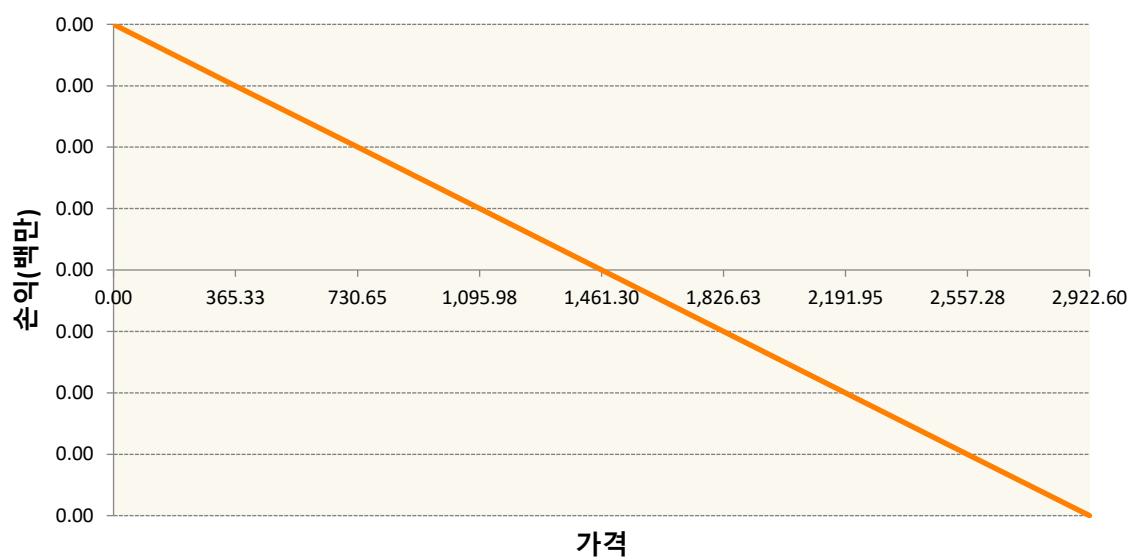
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



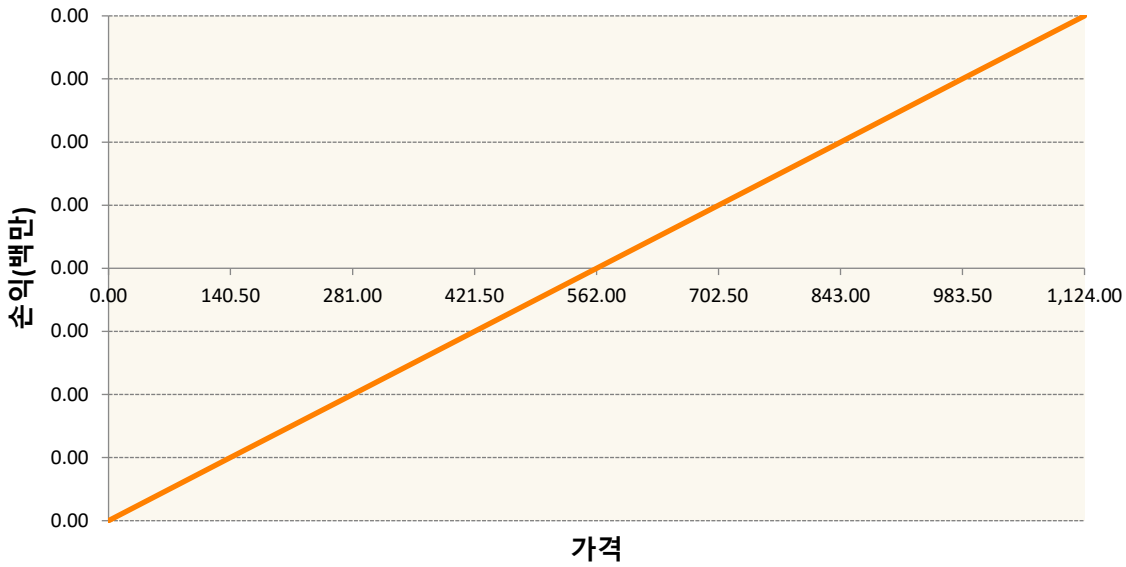
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



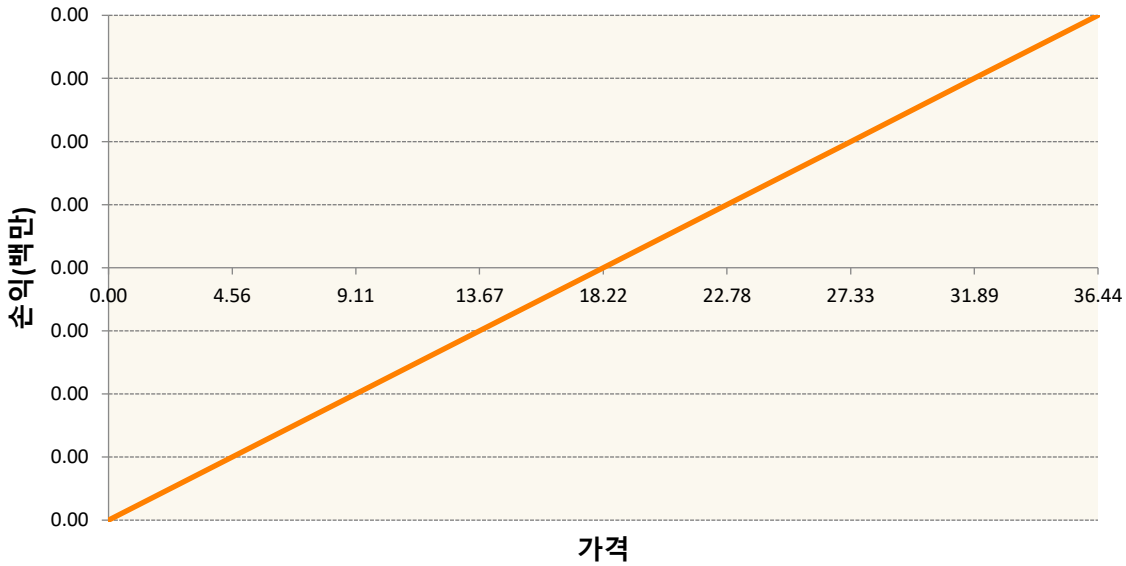
KR4175W30007-2025-03 달러선물



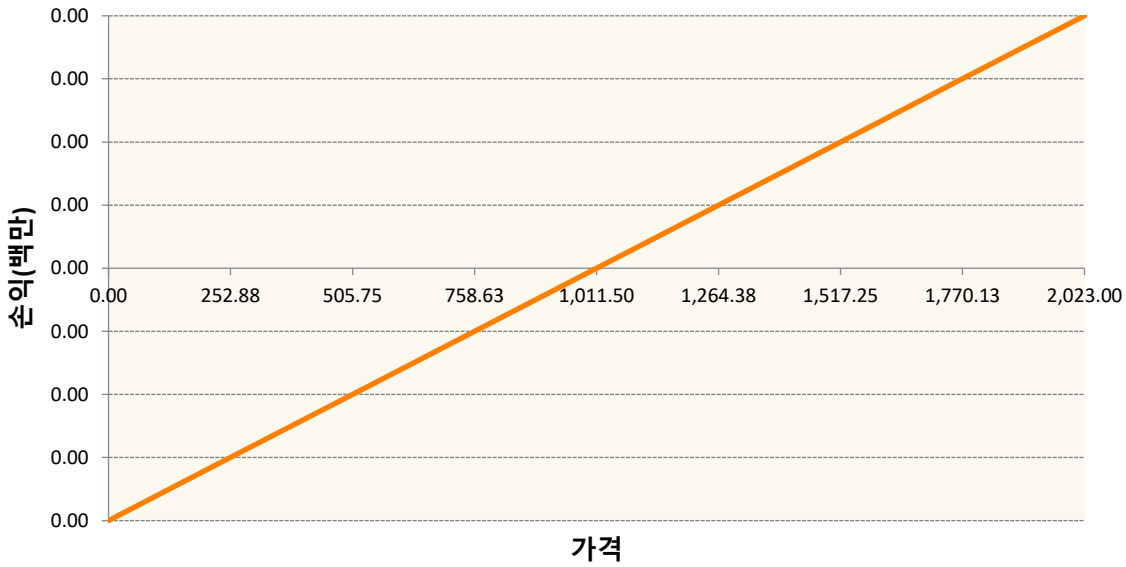
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



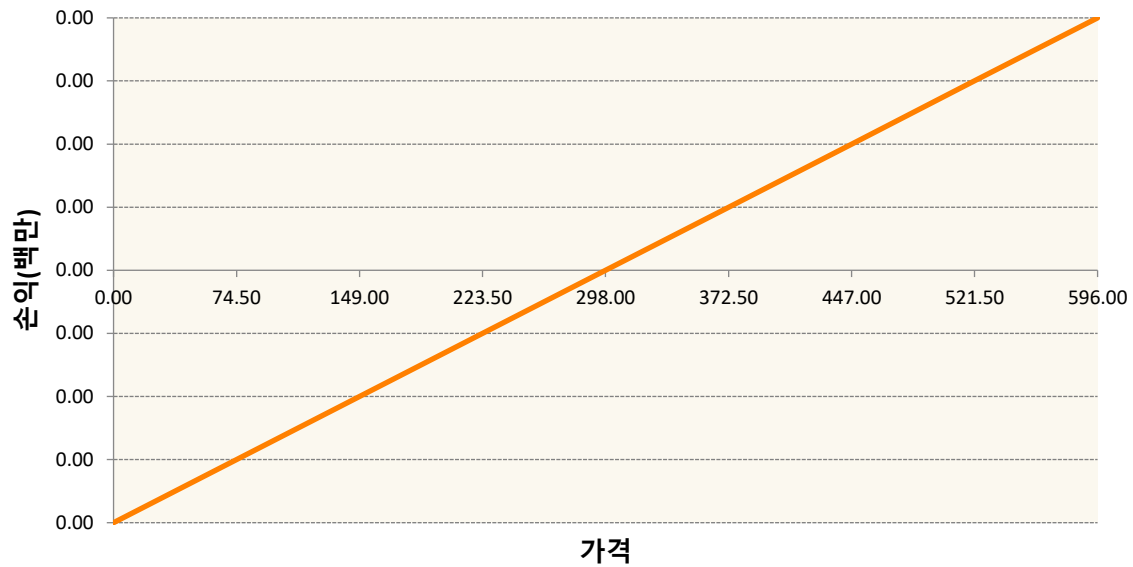
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



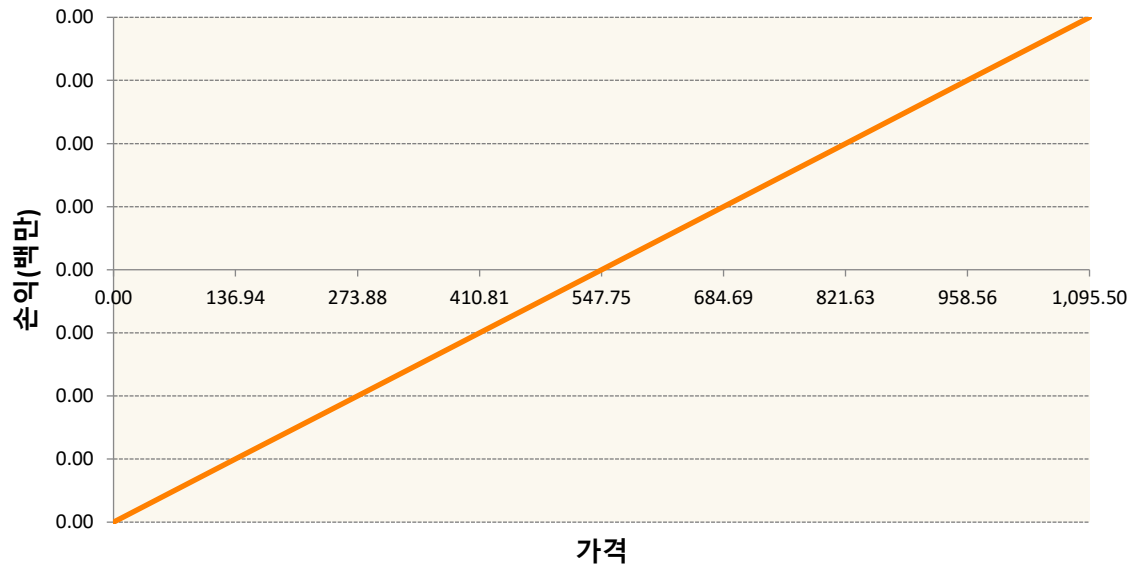
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-03-05
기준일	2025-03-04

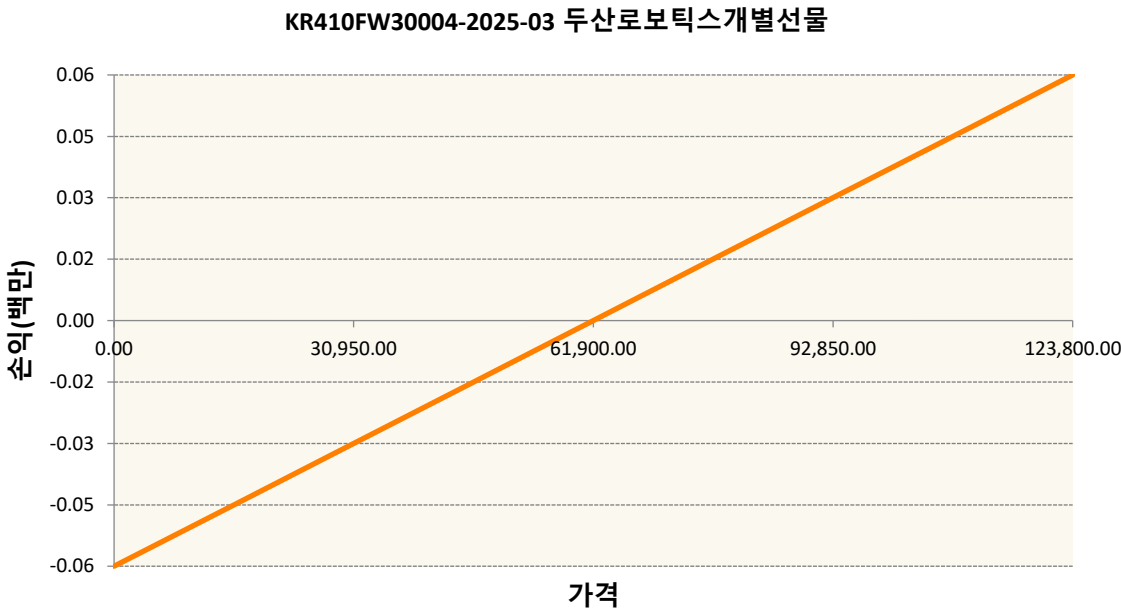
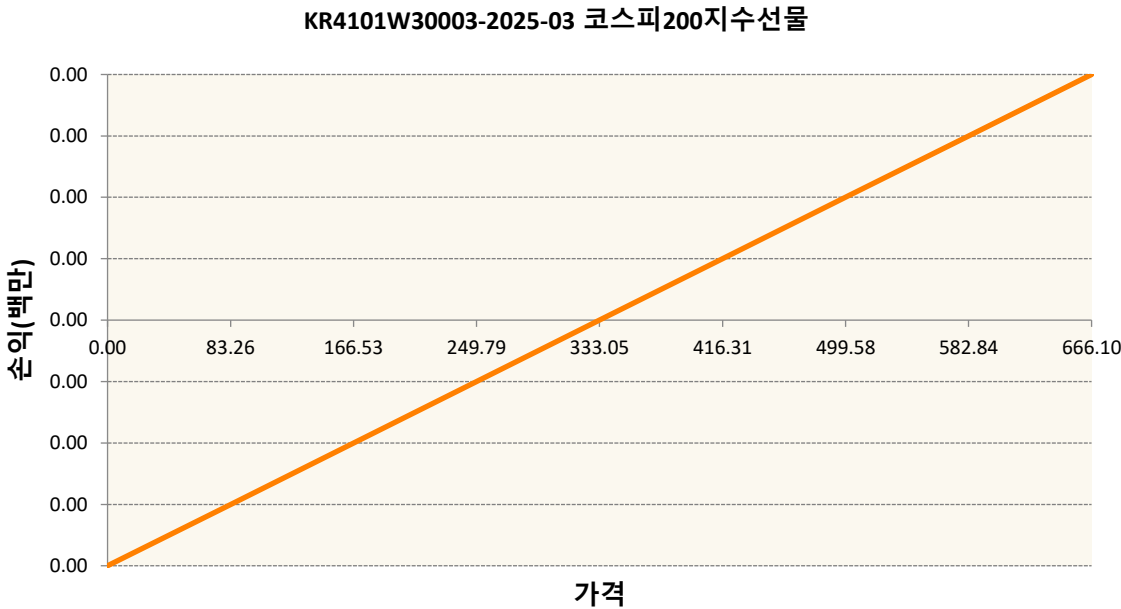
스마트인덱스모

1. 계약금액

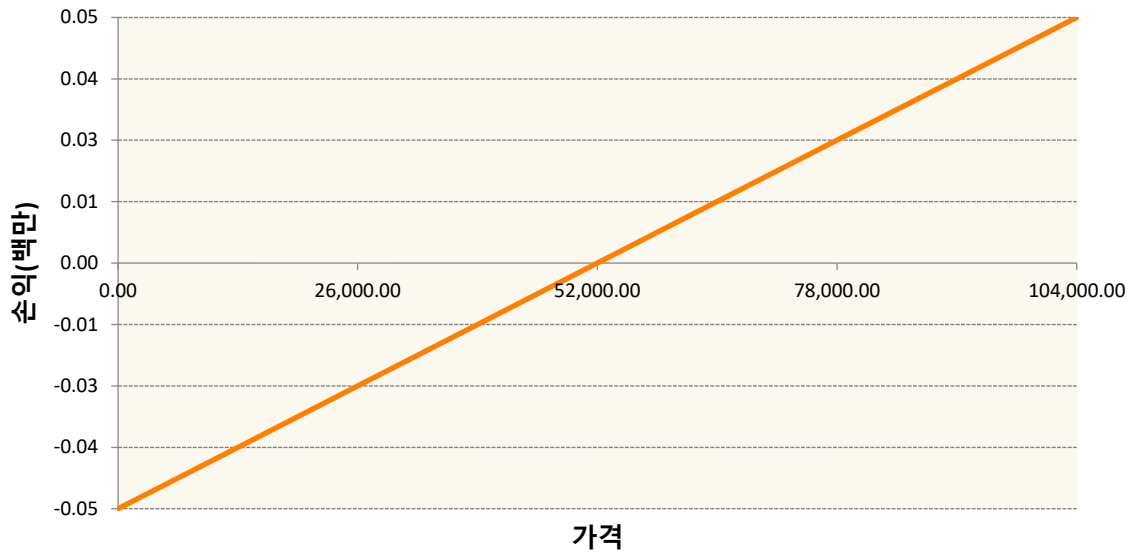
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	212	0	212	장내
누계	유가증권	선물	1,760	0	1,760	장내

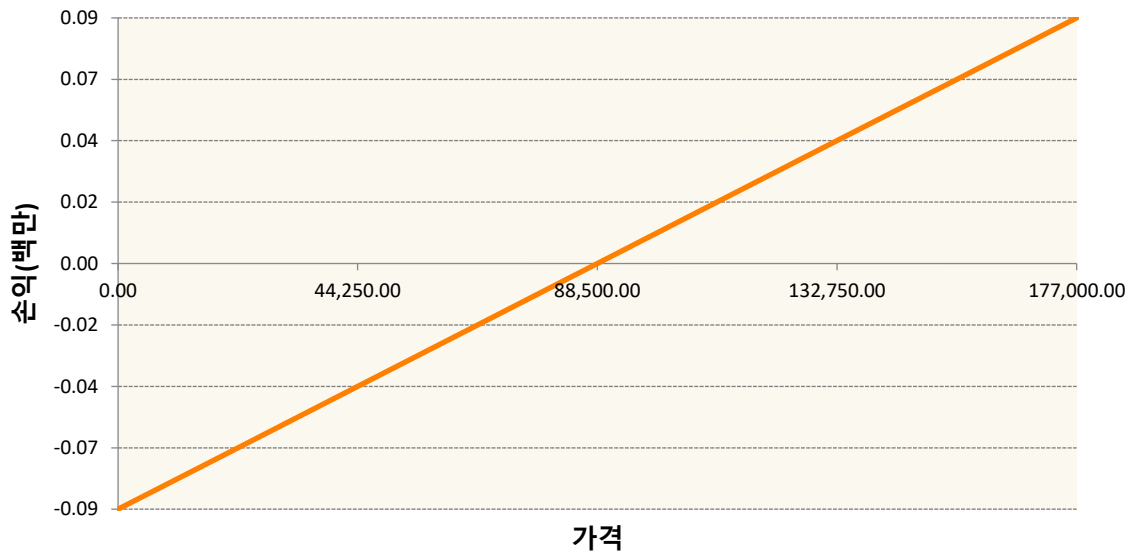
2. 만기시점의 손익구조



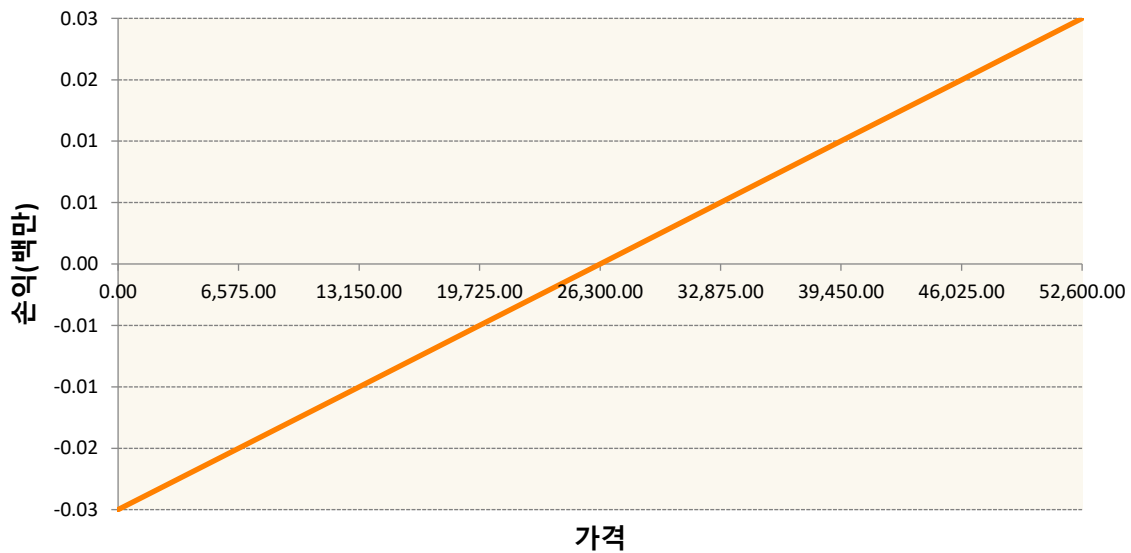
KR410TW30005-2025-03 이수스페셜티케미컬개별선물



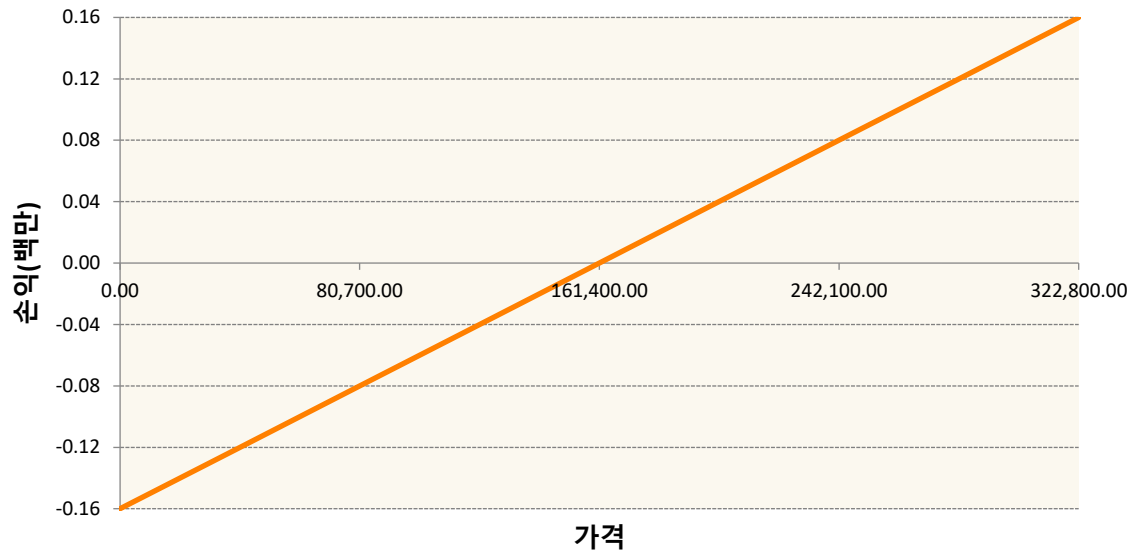
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



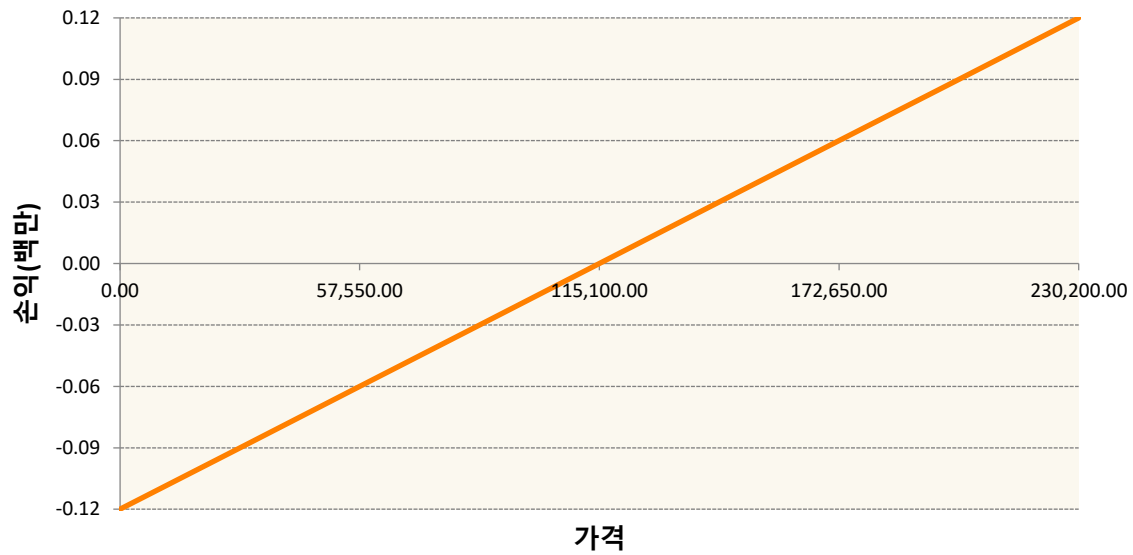
KR4132W30008-2025-03 현대제철개별선물



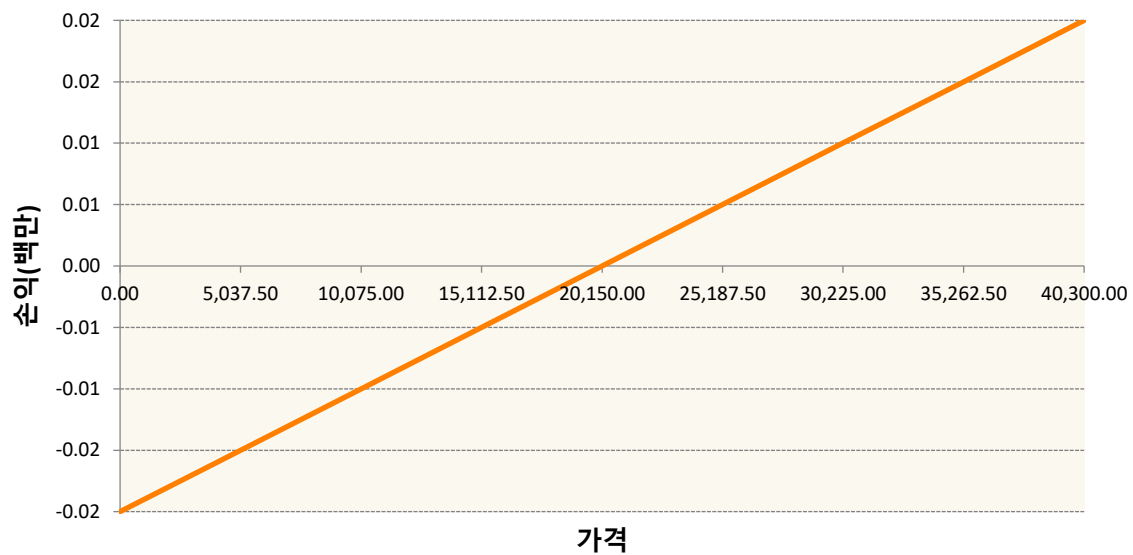
KR41BJW30002-2025-03 엔씨소프트개별선물



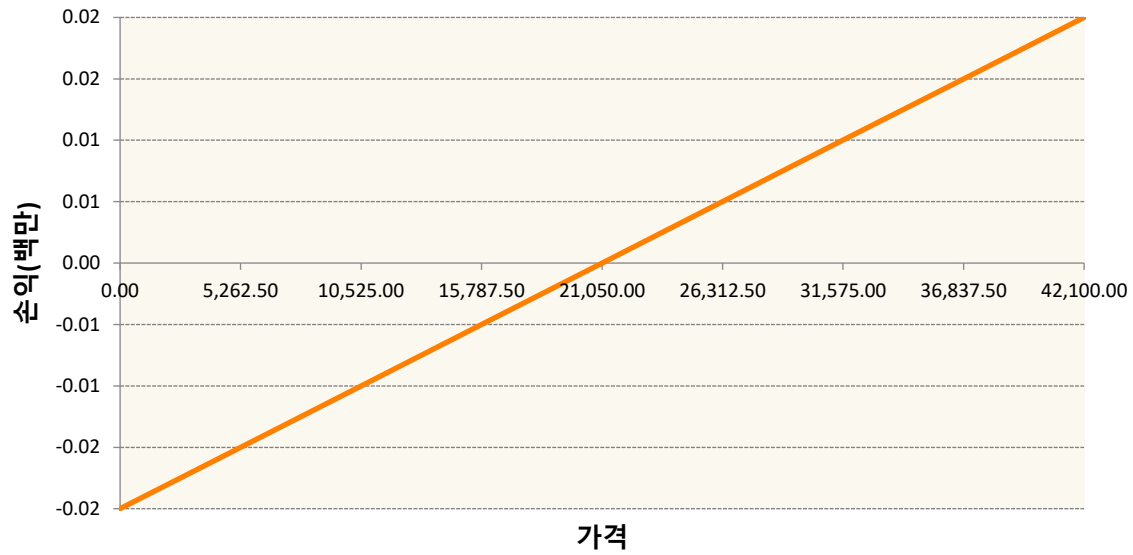
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



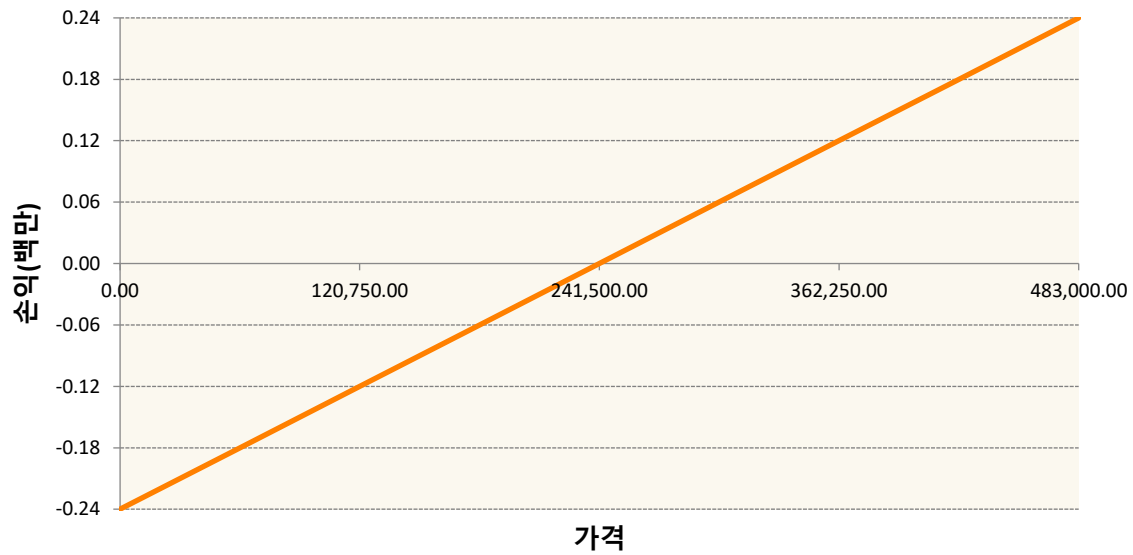
KR41CBW30007-2025-03 한화솔루션개별선물



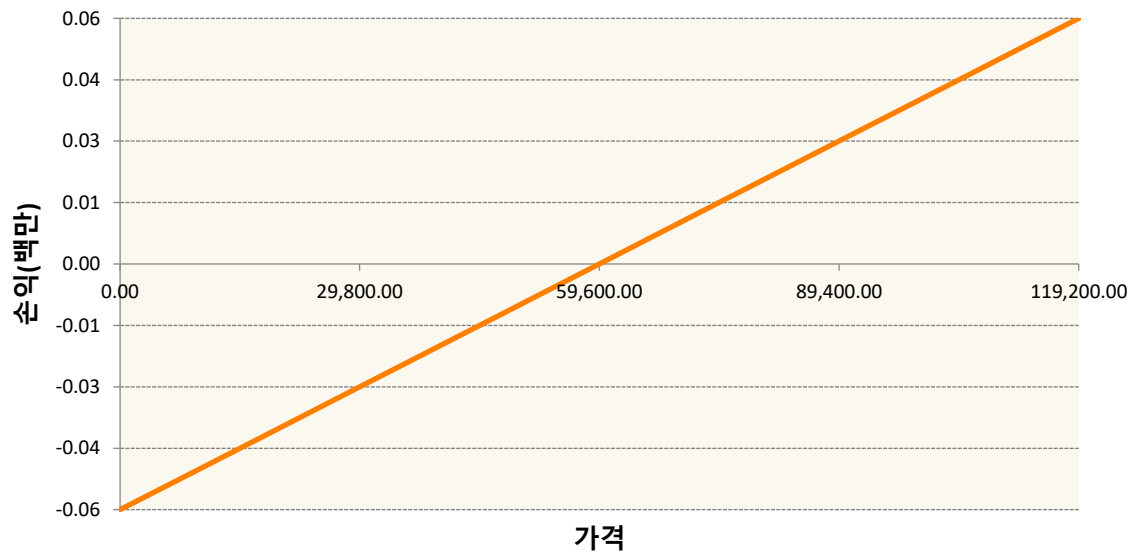
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



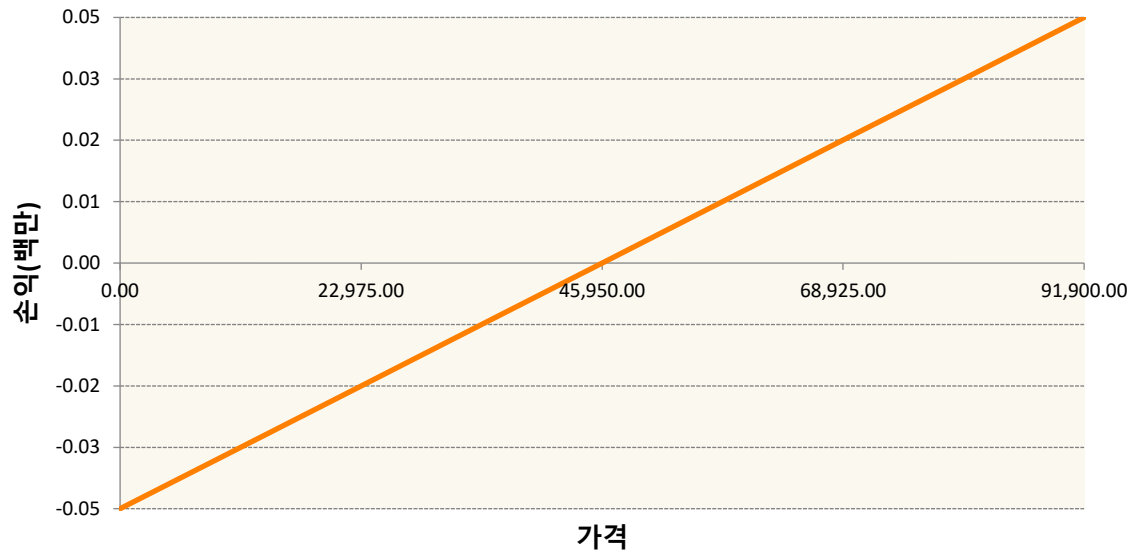
KR41CXW30001-2025-03 한미약품개별선물



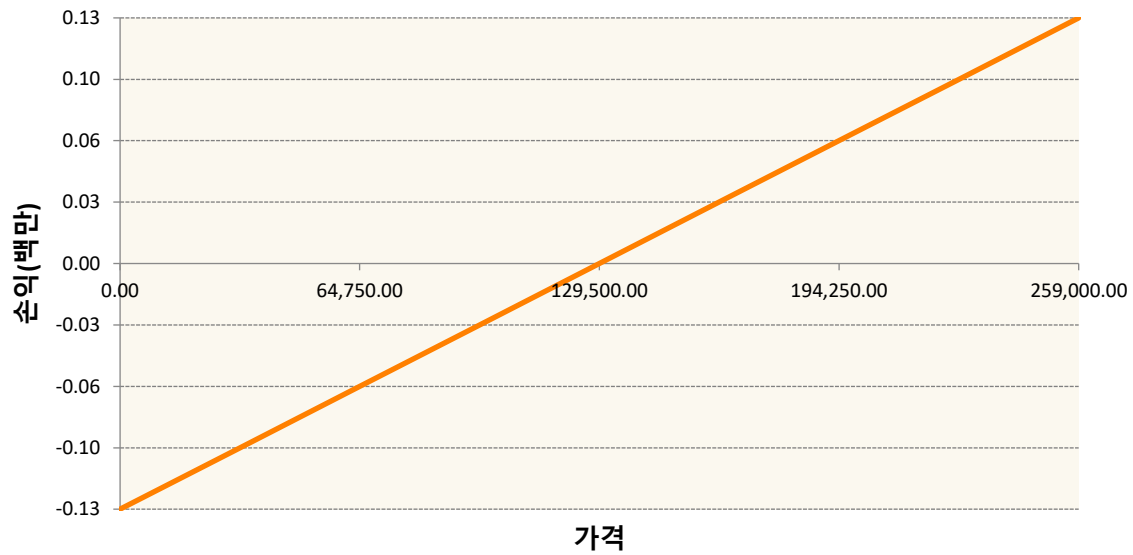
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



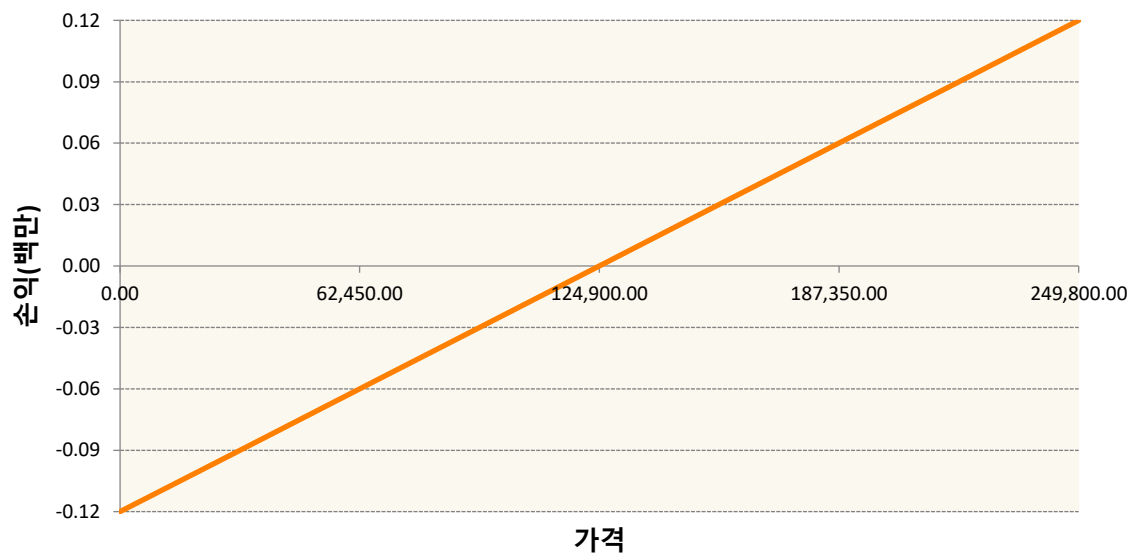
KR41DGW30004-2025-03 영원무역개별선물



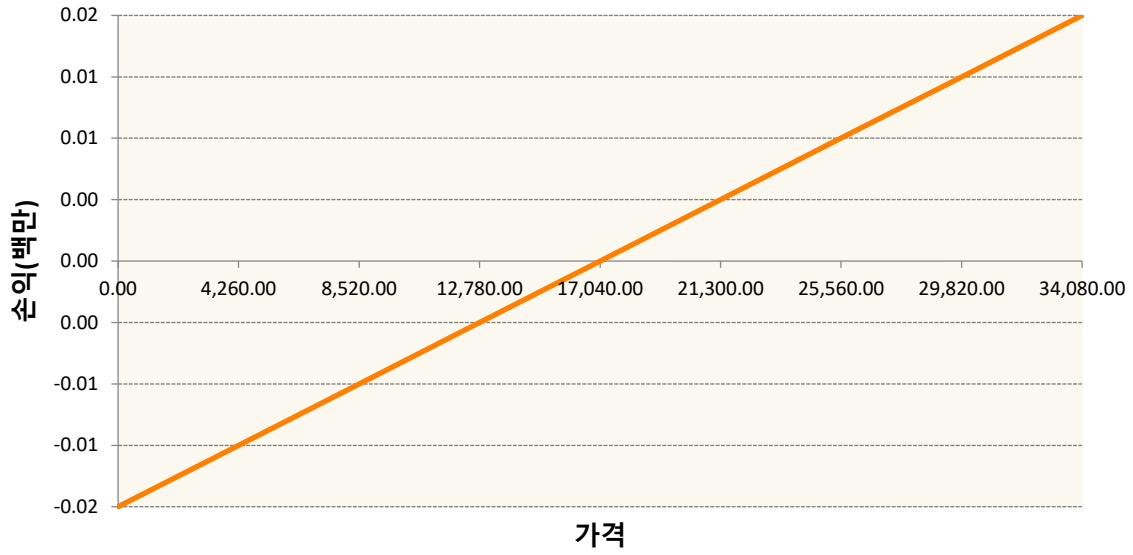
KR41E8W30003-2025-03 포스코퓨처엠개별선물



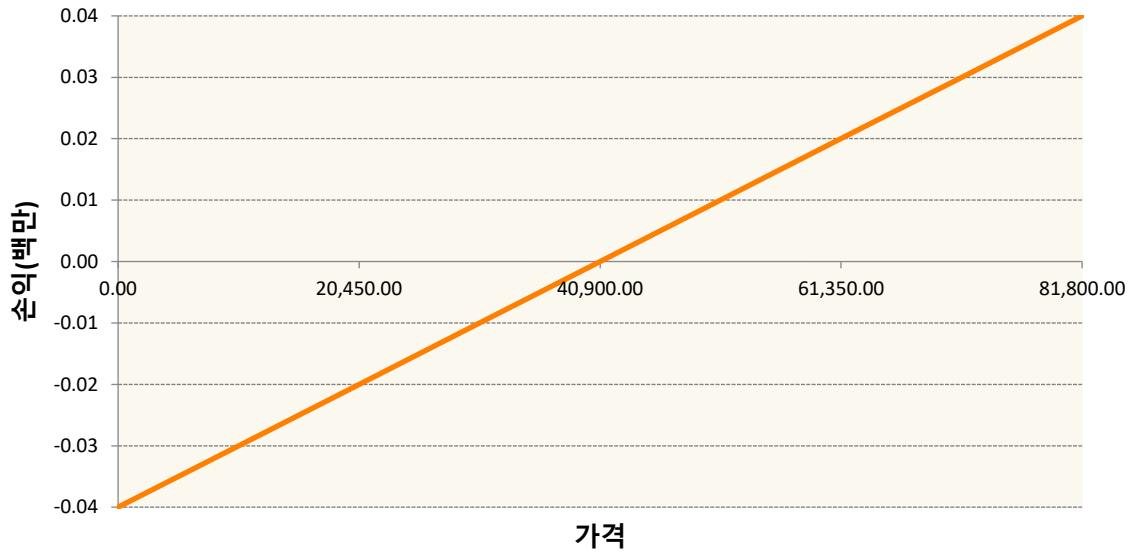
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



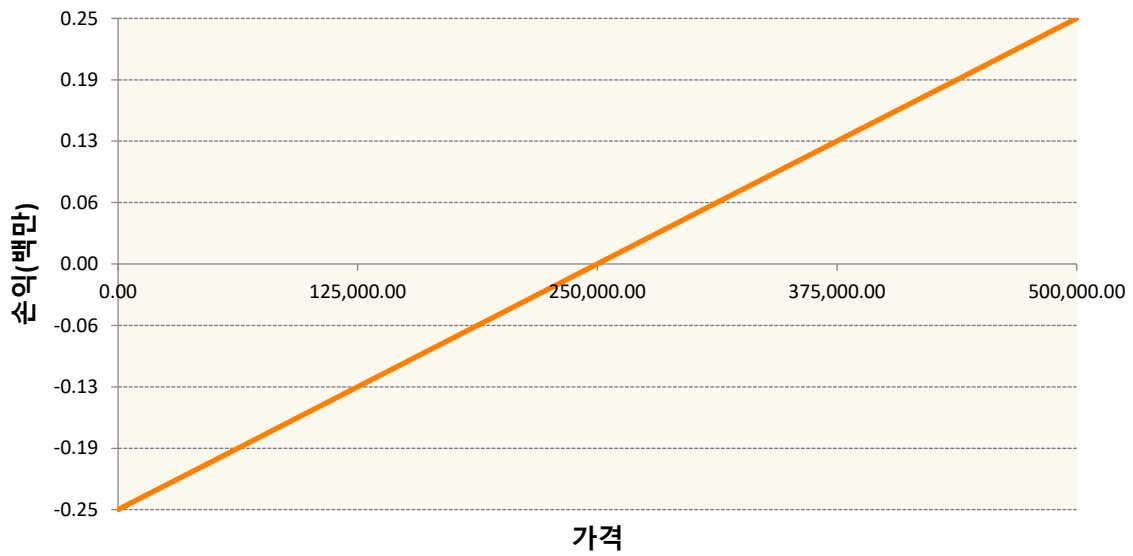
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



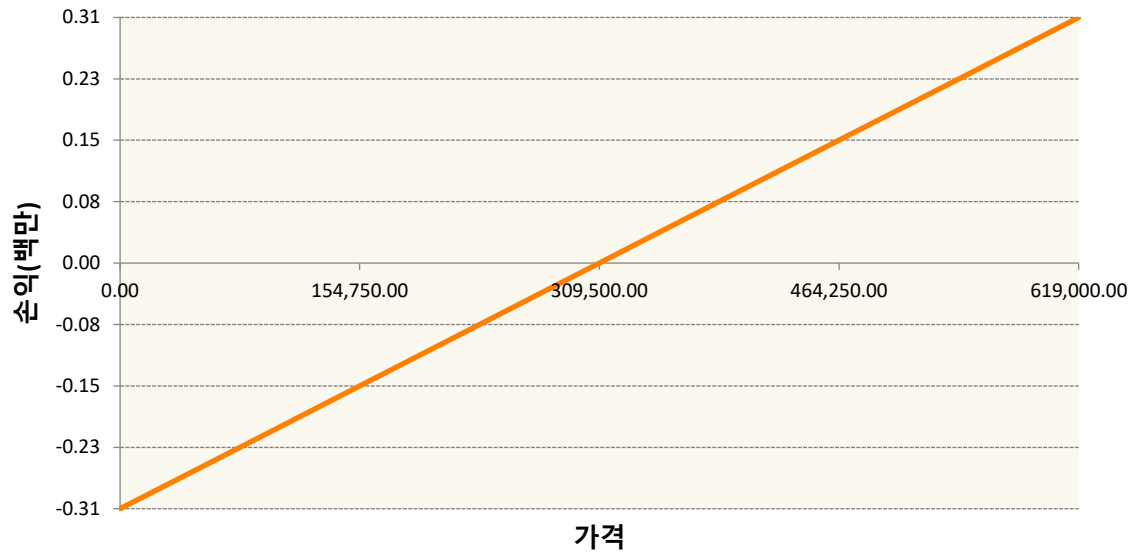
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



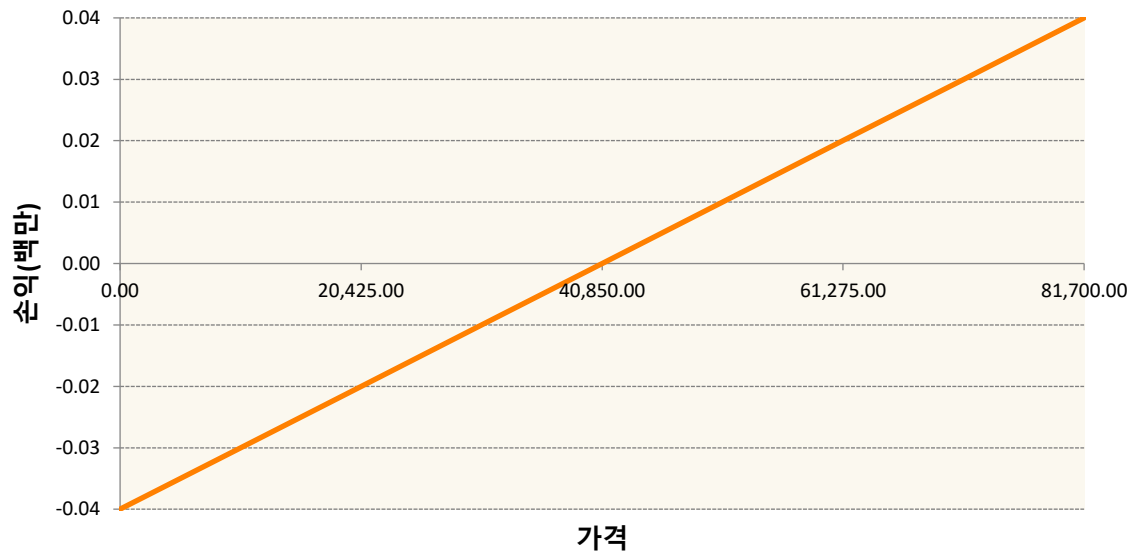
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



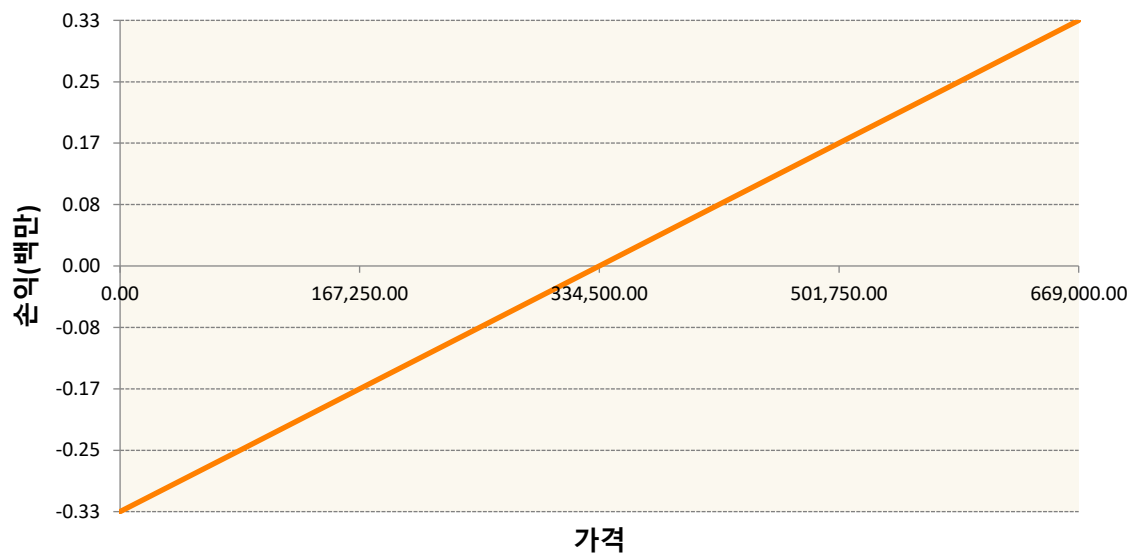
KR41FDW30006-2025-03 HD현대중공업개별선물



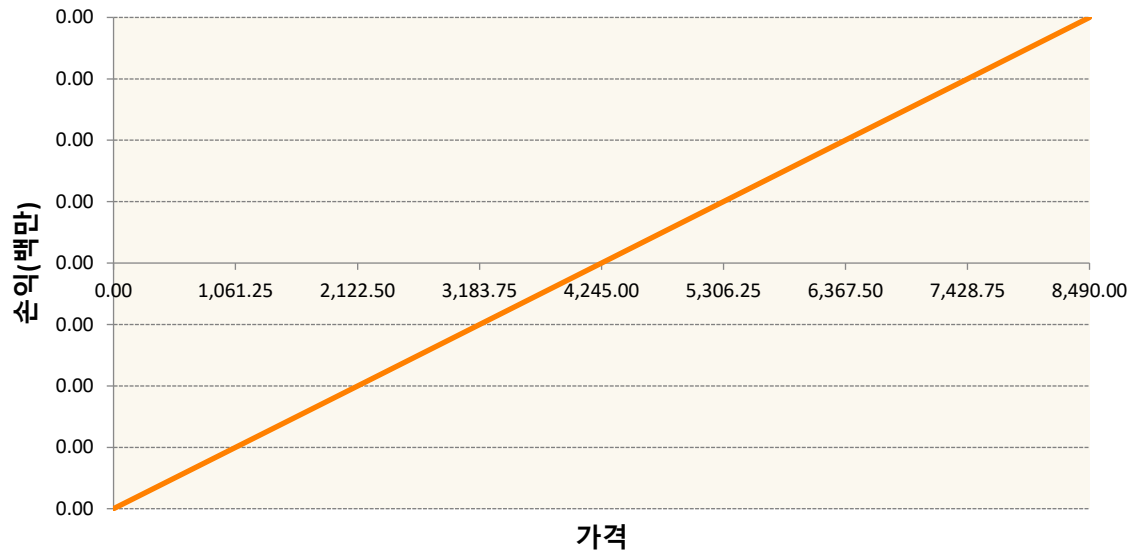
KR41G0W30008-2025-03 씨에스원드개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



KR41GKW30009-2025-03 KG모빌리티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	80
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	1
KR410TW30(2025-03 이수스페셜티케미컬개별선물	1
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	5
KR4132W30(2025-03 현대제철개별선물	3
KR41BJW30(2025-03 엔씨소프트개별선물	3
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물	4
KR41CBW30(2025-03 한화솔루션개별선물	3
KR41CNW30(2025-03 포스코DX개별선물	1
KR41CXW30(2025-03 한미약품개별선물	2
KR41DEW30(2025-03 한국콜마개별선물	0.24
KR41DGW30(2025-03 영원무역개별선물	1
KR41E8W30(2025-03 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41EJW30(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 씨에스윈드개별선물	1
KR41GHW30(2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	8
KR41GKW30(2025-03 KG모빌리티개별선물	0.44

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

(단위:백만원)

264

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

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	301
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

468

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

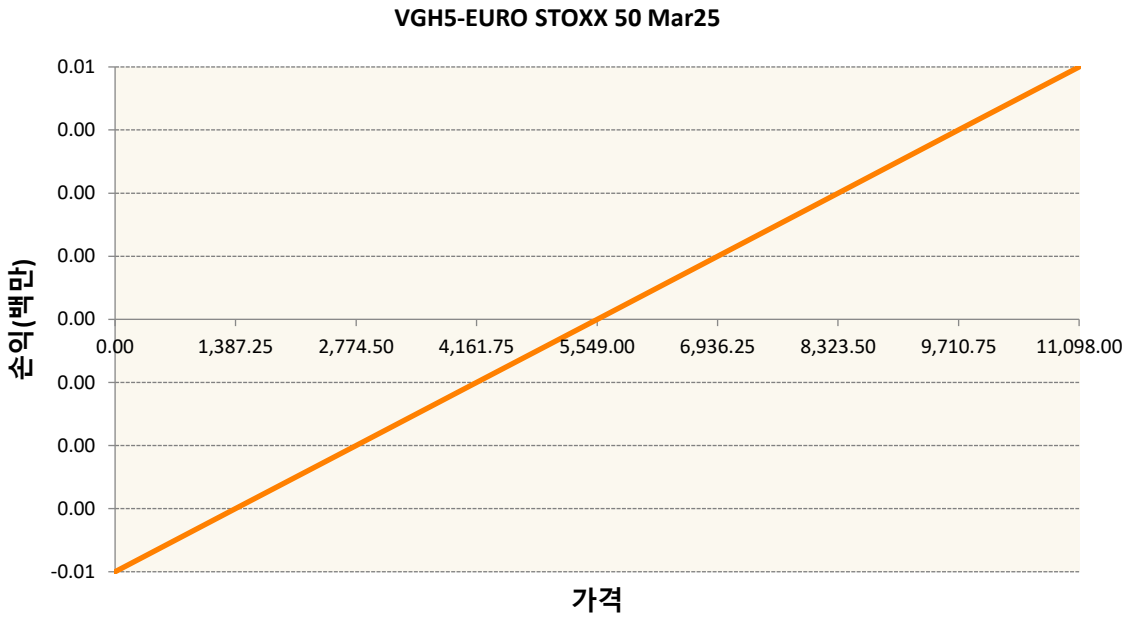
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,005	0	1,005	

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	2025-03-05
기준일	2025-03-04

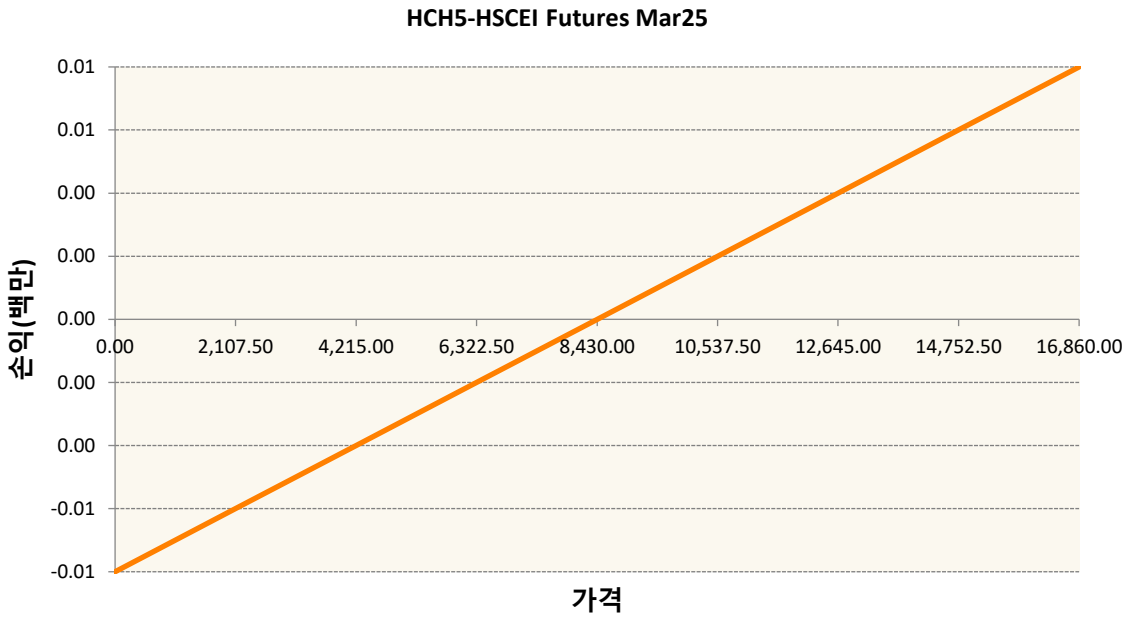
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,868	0	1,868	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH5	HSCEI Futures Mar25	149
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

203

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

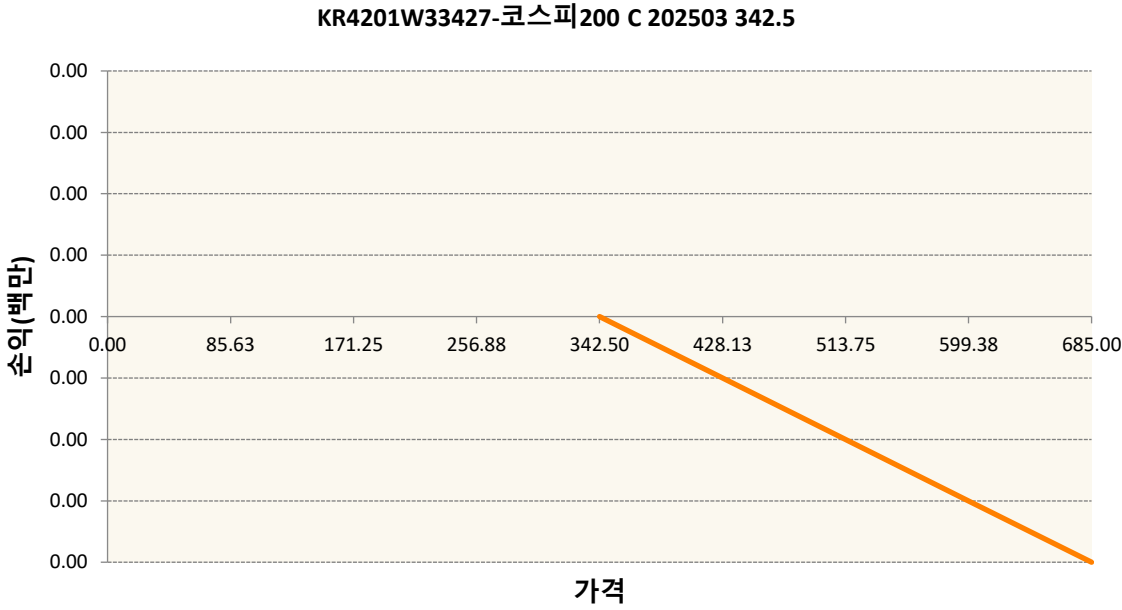
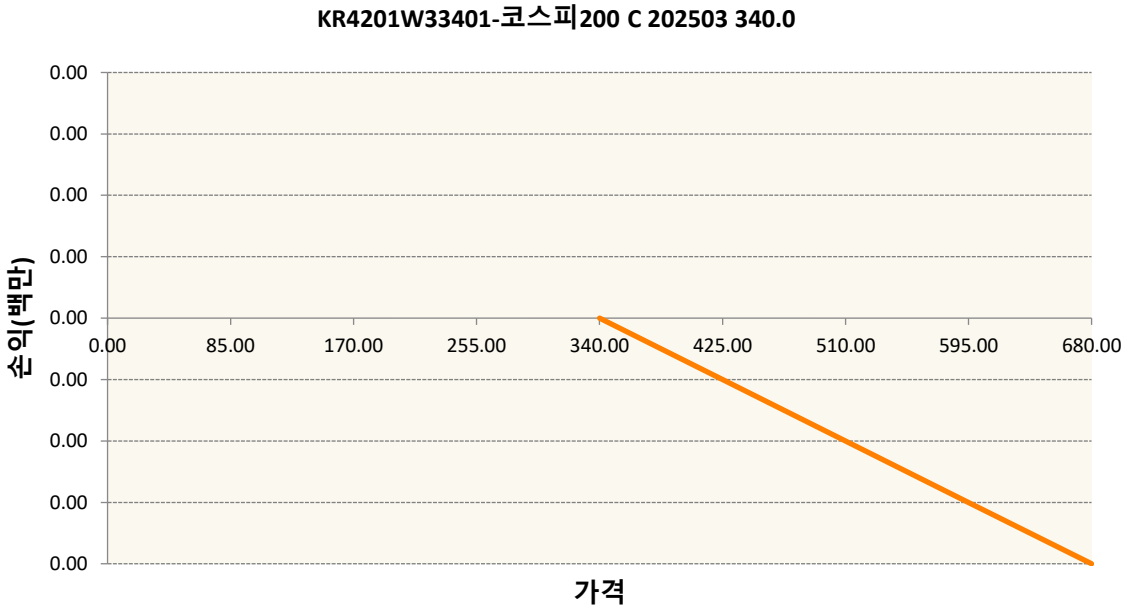
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

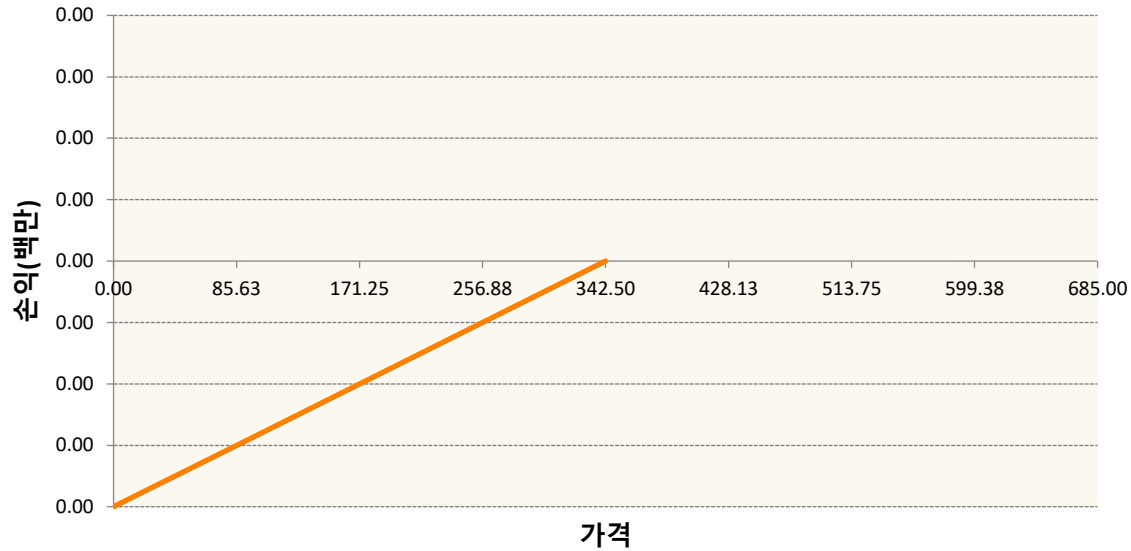
(단위:백만원)

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							1,170
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	177	177	176	176	174	172	170
-5.33%	176	174	171	167	161	154	145
-2.67%	159	150	138	125	110	93	76
0%	72	49	25	0	-25	-50	-76
2.67%	-175	-202	-229	-256	-283	-310	-338
5.33%	-596	-612	-629	-648	-668	-689	-710
8.00%	-1,115	-1,120	-1,126	-1,134	-1,145	-1,156	-1,170
KR4201W33427 코스피200 C 202503 342.5							479
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	59	58	58	57	57
-5.33%	58	58	57	56	54	52	49
-2.67%	54	51	47	43	37	31	25
0%	28	19	10	0	-10	-21	-31
2.67%	-59	-71	-84	-96	-108	-121	-133
5.33%	-226	-235	-244	-254	-264	-274	-285
8.00%	-448	-451	-455	-460	-466	-472	-479
KR4301W33425 코스피200 P 202503 342.5							472
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-472	-472
-5.33%	-302	-302	-303	-303	-304	-306	-307
-2.67%	-135	-137	-139	-142	-145	-149	-153
0%	18	12	6	0	-7	-13	-20

2.67%	128	120	112	104	96	88	80
5.33%	180	175	169	163	156	150	143
8.00%	195	193	191	188	184	180	176

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

(단위:백만원)

2,146

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

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	688	0	688	

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	2025-03-05
기준일	2025-03-04

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	4,544	0	4,544	

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	2025-03-05
기준일	2025-03-04

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	13,427	0	13,427	
누계	통화	선도	0	13,010	-13,010	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213ECT(KRW/USD 31-03-25E		261
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E		213
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E		216
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E		351
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	447

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

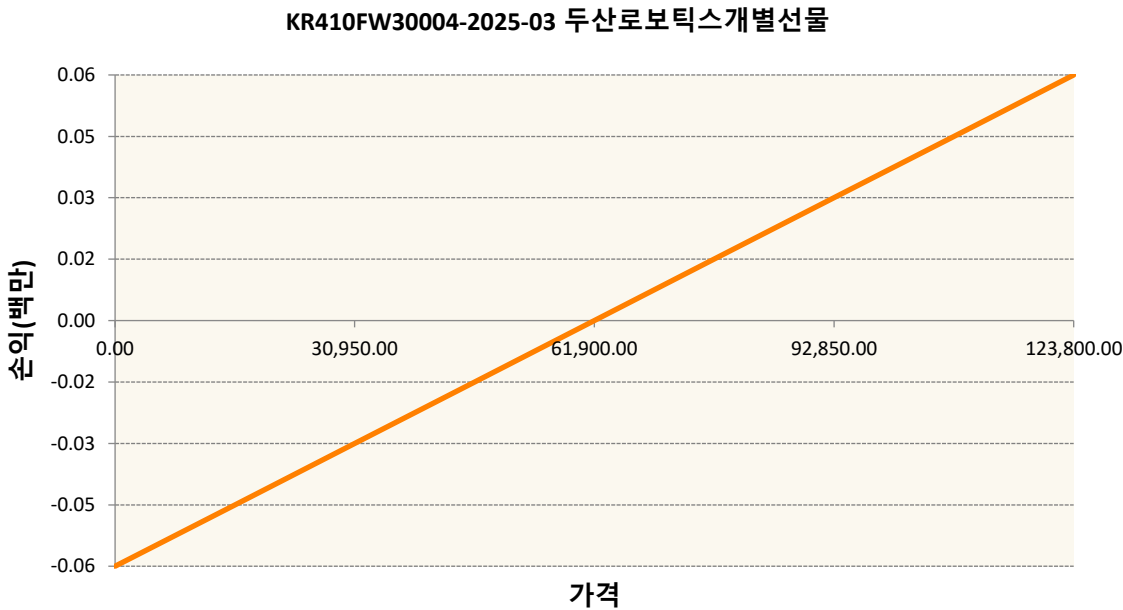
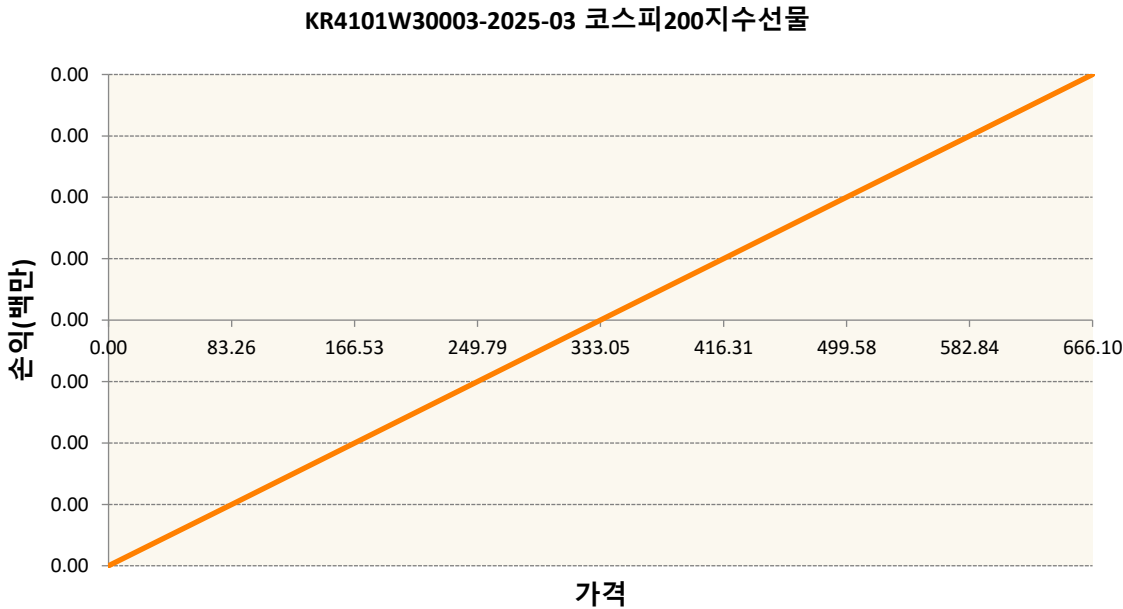
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

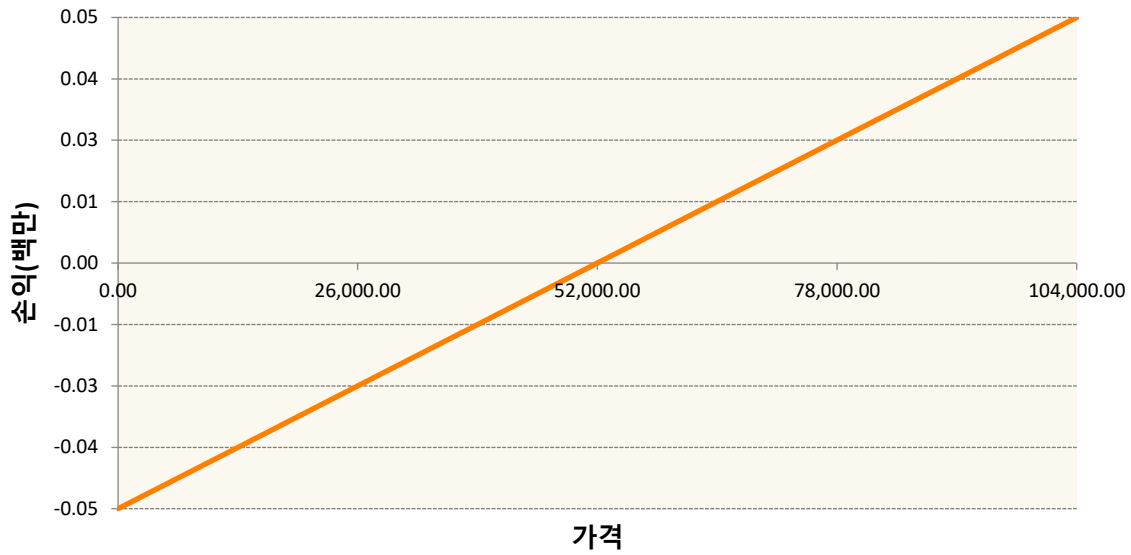
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	111	0	111	장내
누계	유가증권	선물	1,381	0	1,381	장내

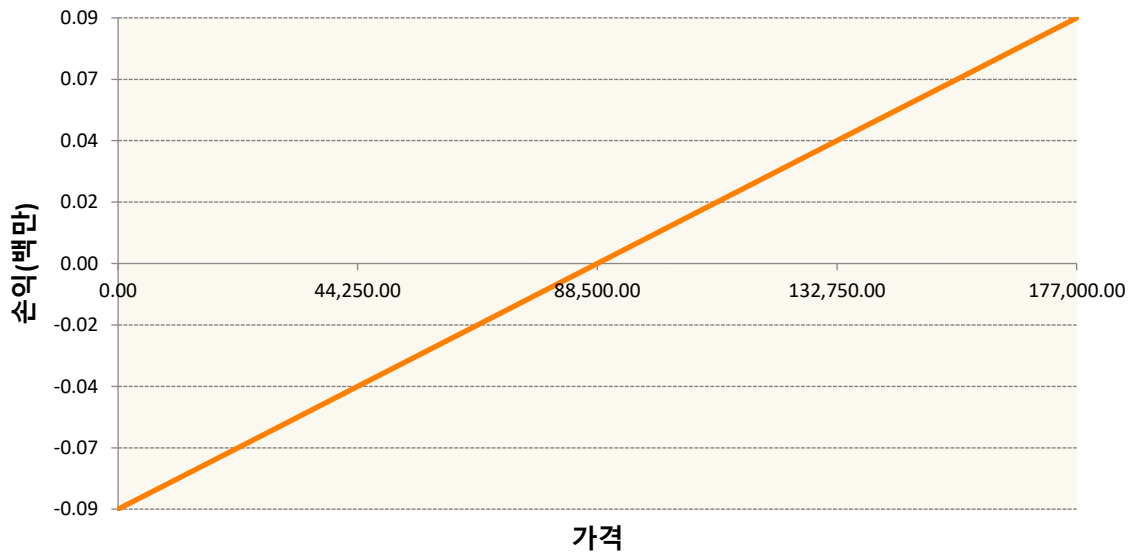
2. 만기시점의 손익구조



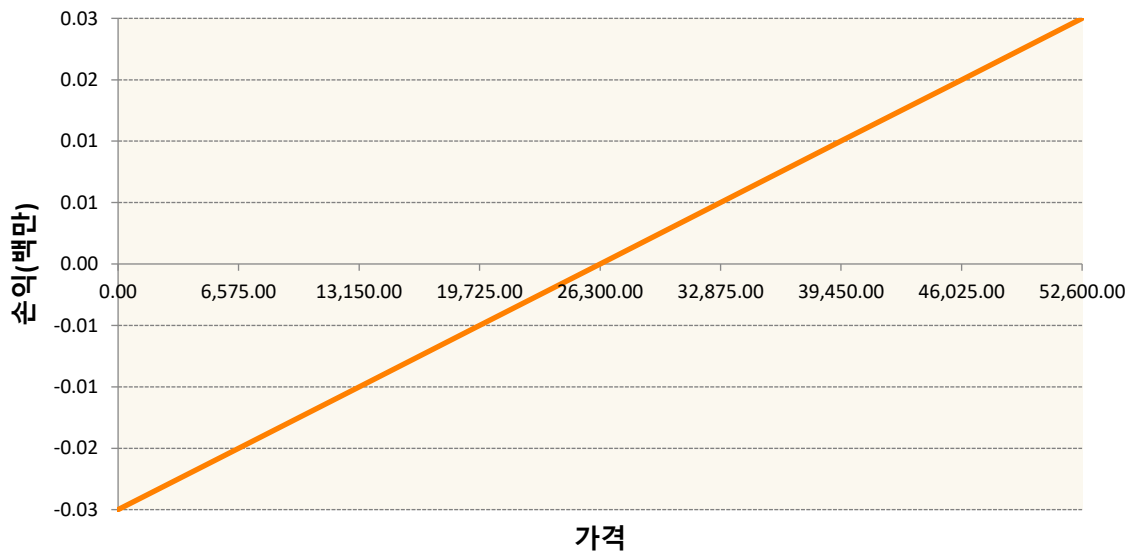
KR410TW30005-2025-03 이수스페셜티케미컬개별선물



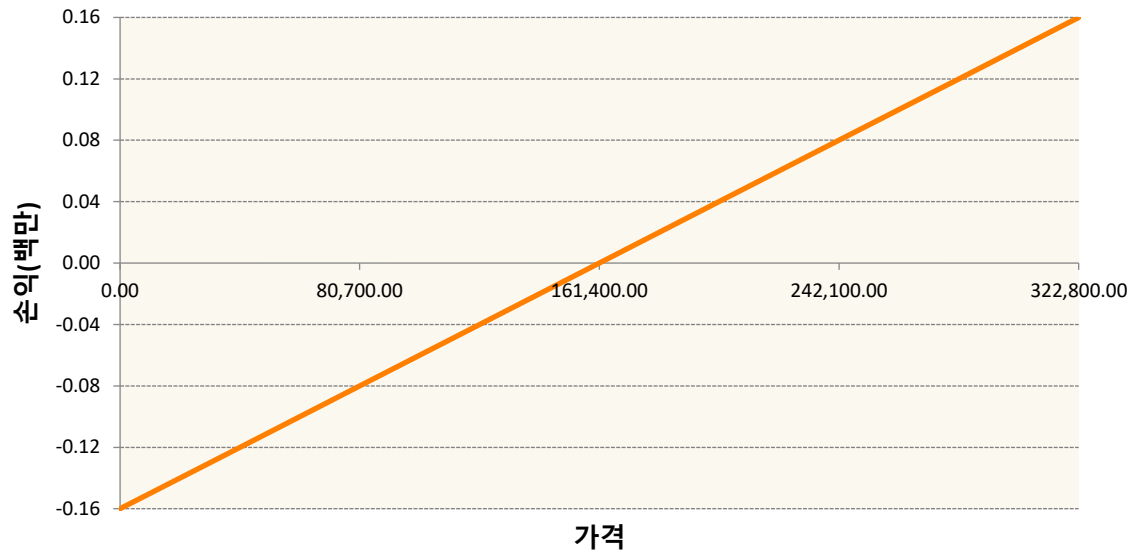
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



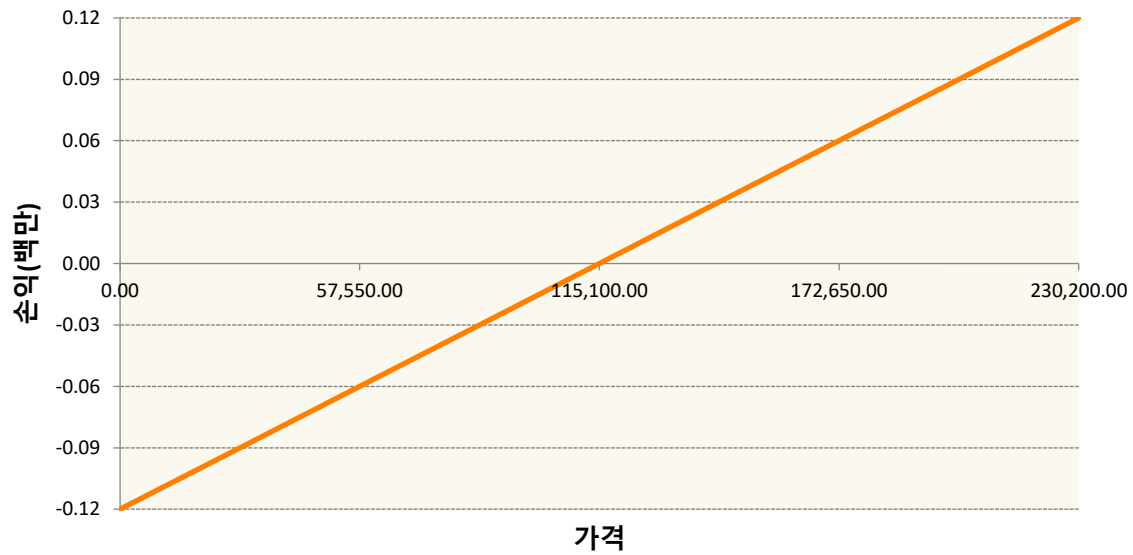
KR4132W30008-2025-03 현대제철개별선물



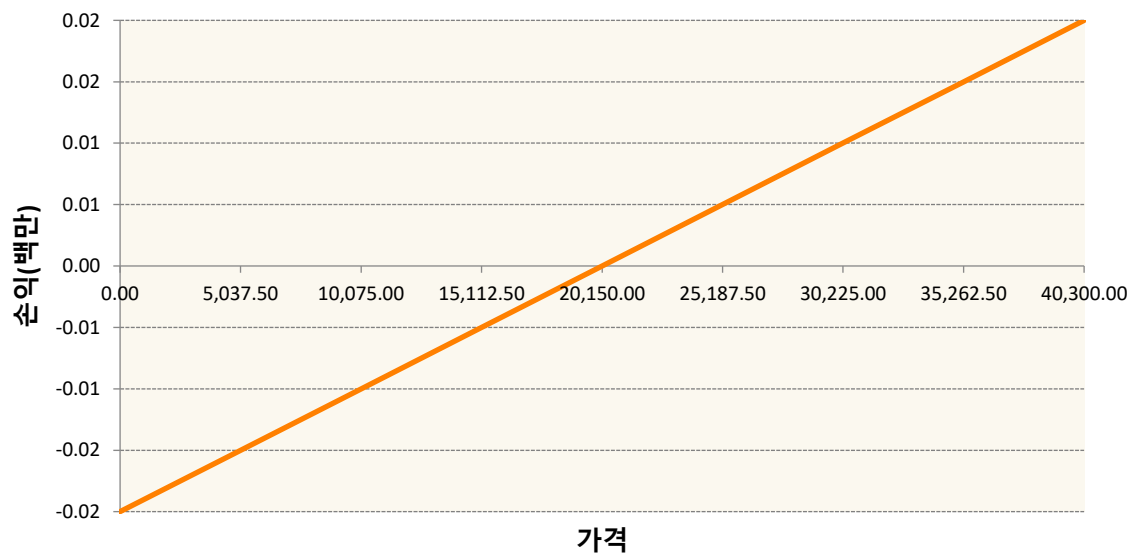
KR41BJW30002-2025-03 엔씨소프트개별선물



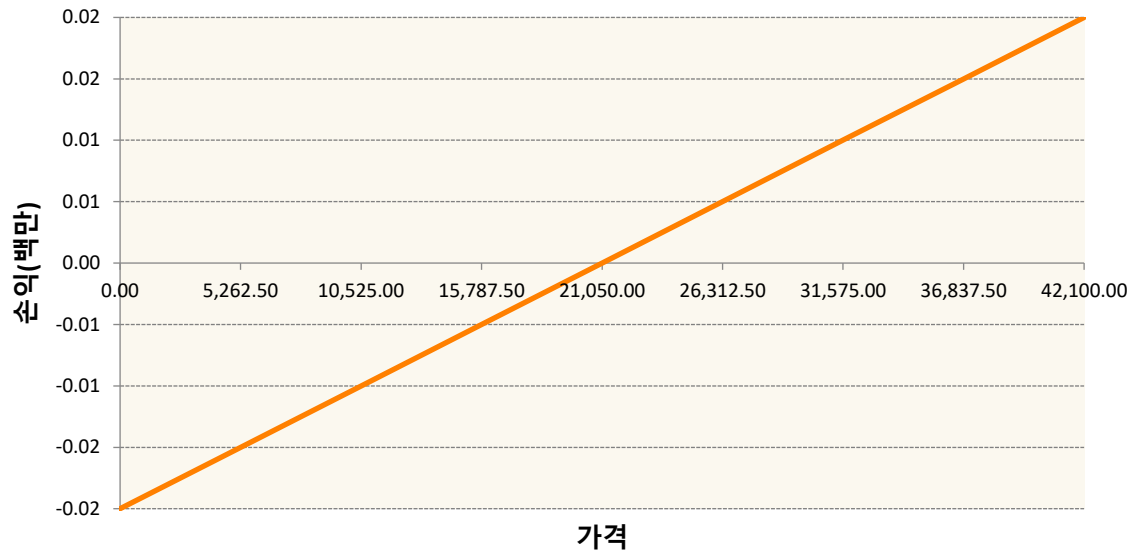
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



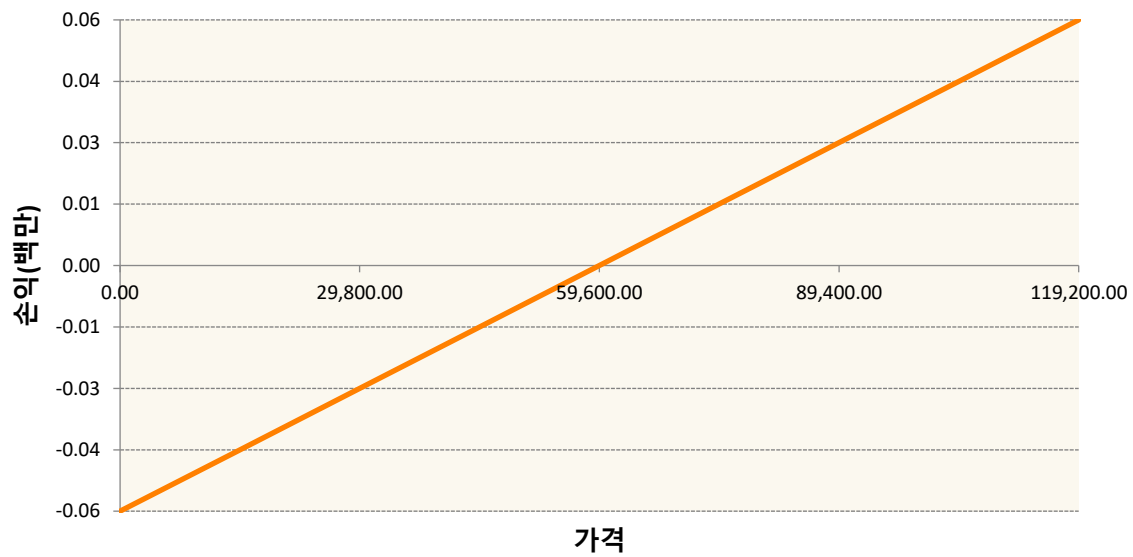
KR41CBW30007-2025-03 한화솔루션개별선물



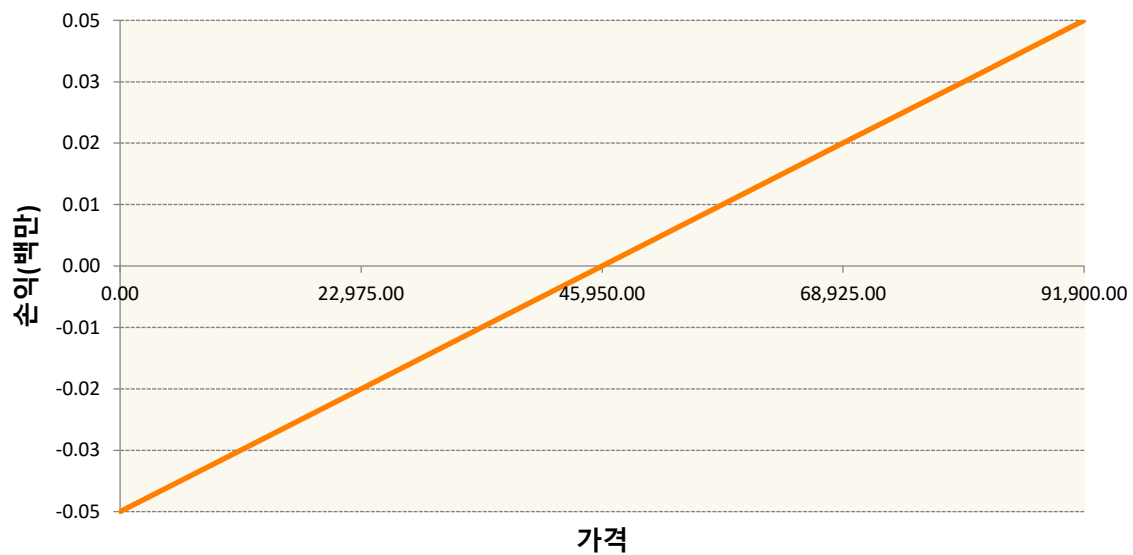
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



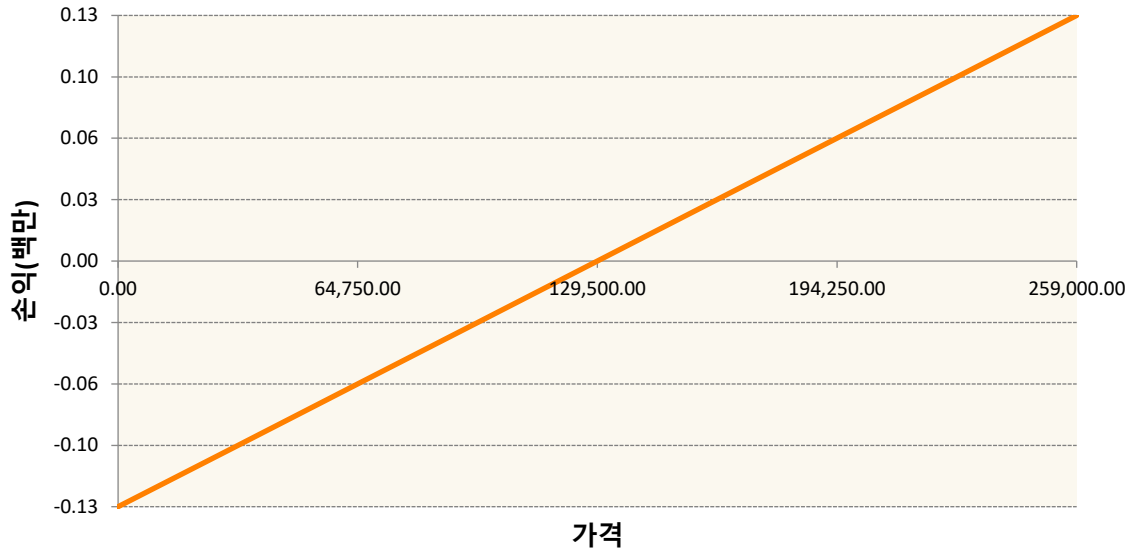
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



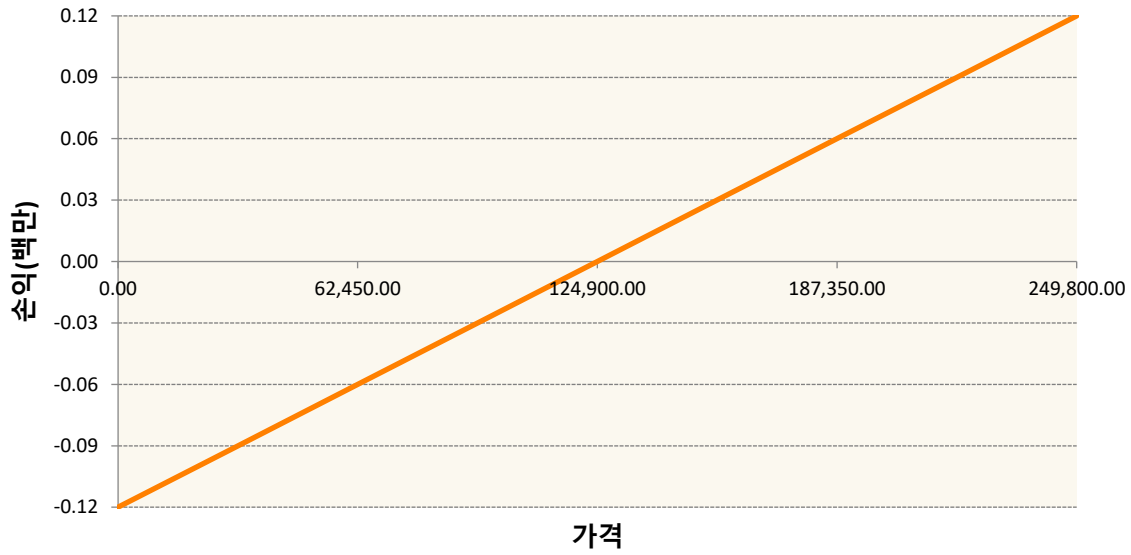
KR41DGW30004-2025-03 영원무역개별선물



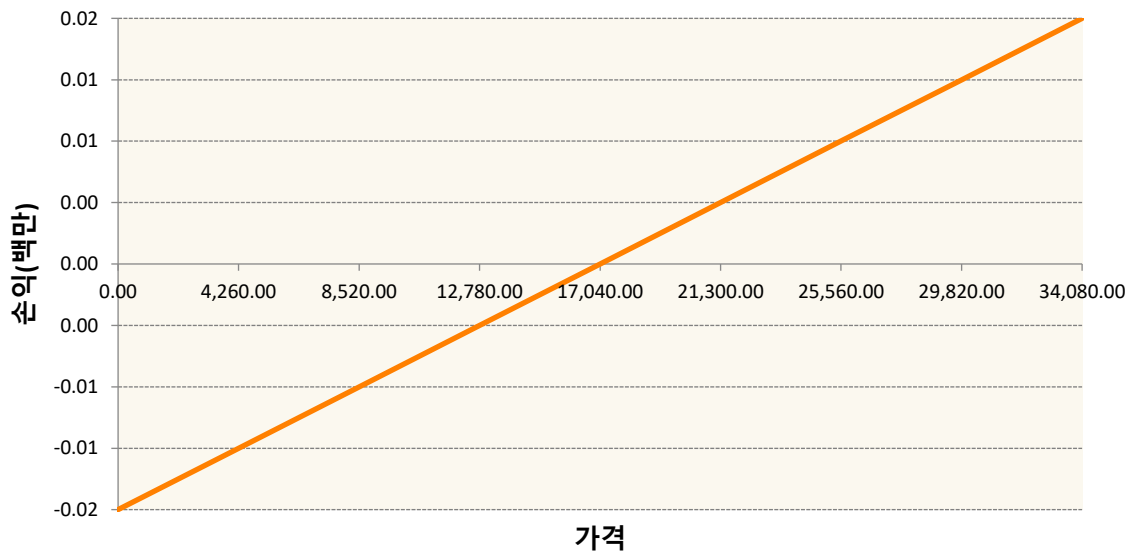
KR41E8W30003-2025-03 포스코퓨처엠개별선물



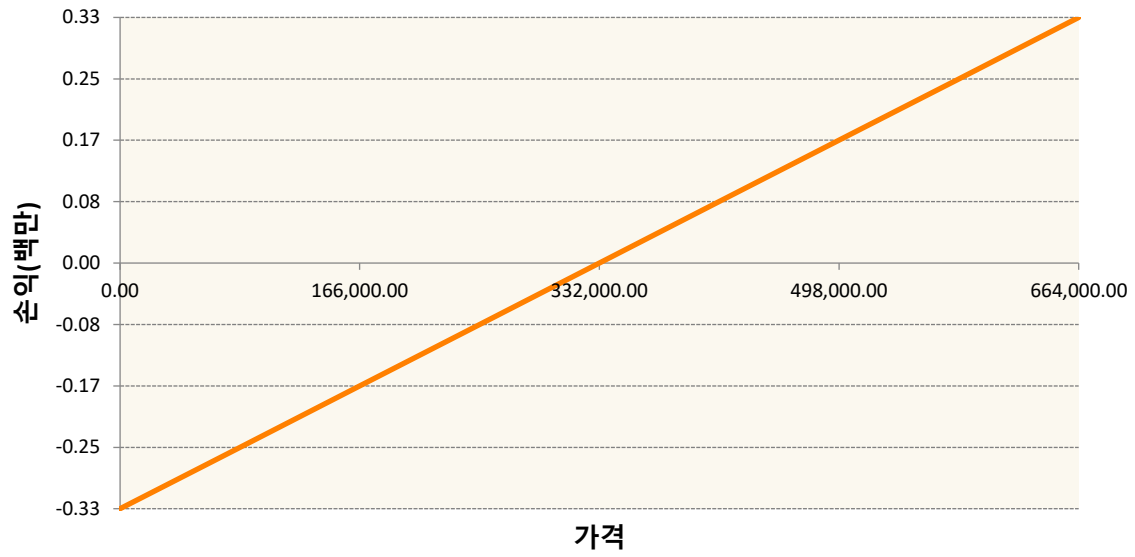
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



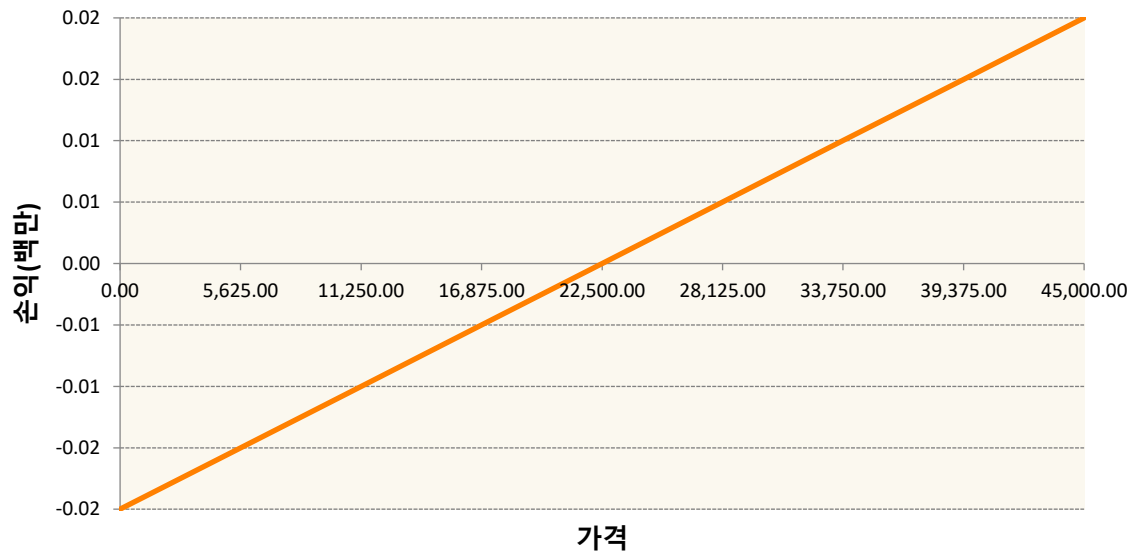
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



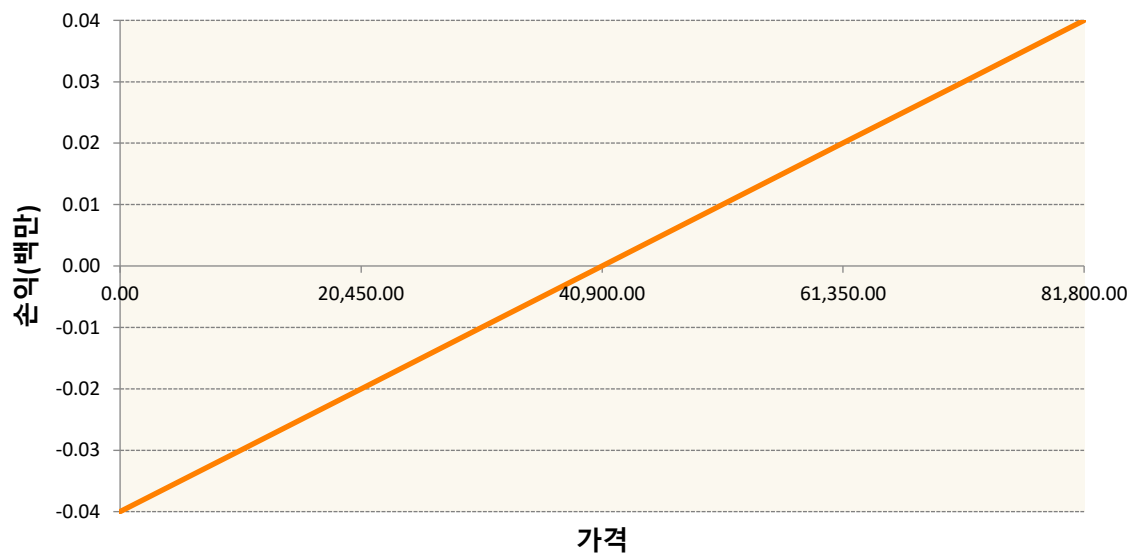
KR41F5W30008-2025-03 LG에너지솔루션개별선물



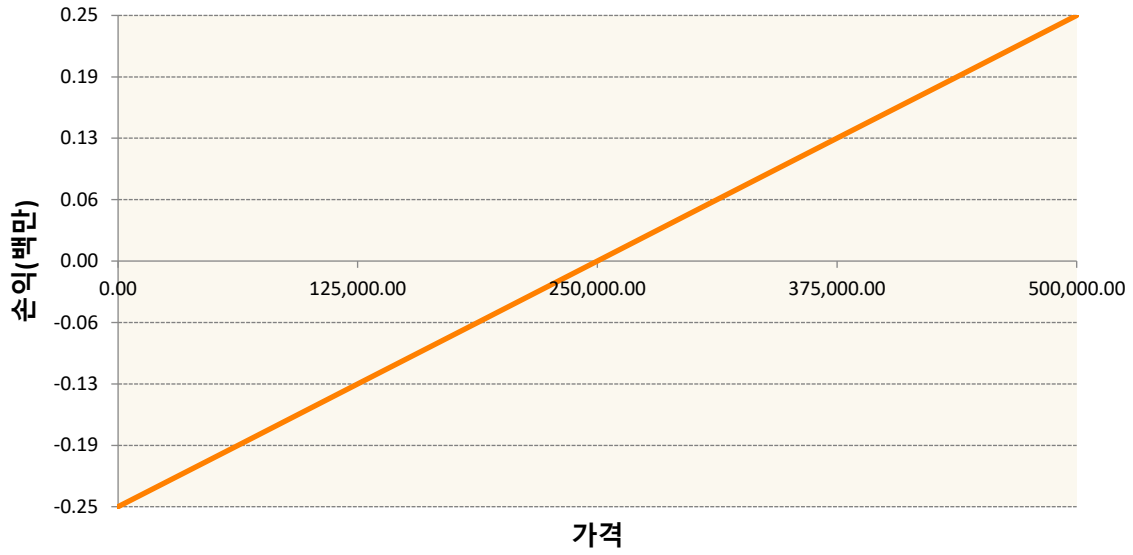
KR41F6W30006-2025-03 카카오뱅크개별선물



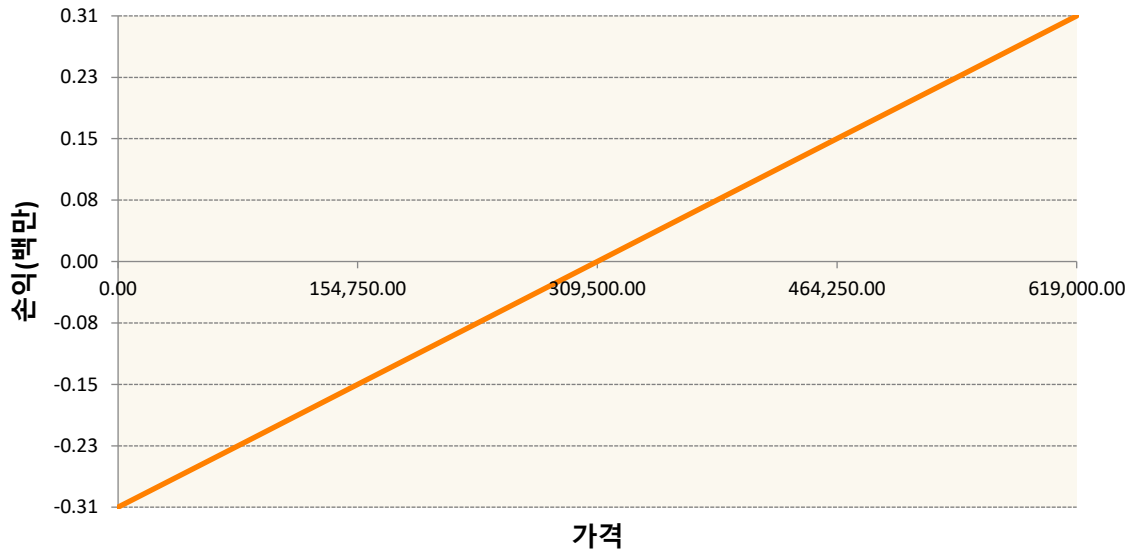
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



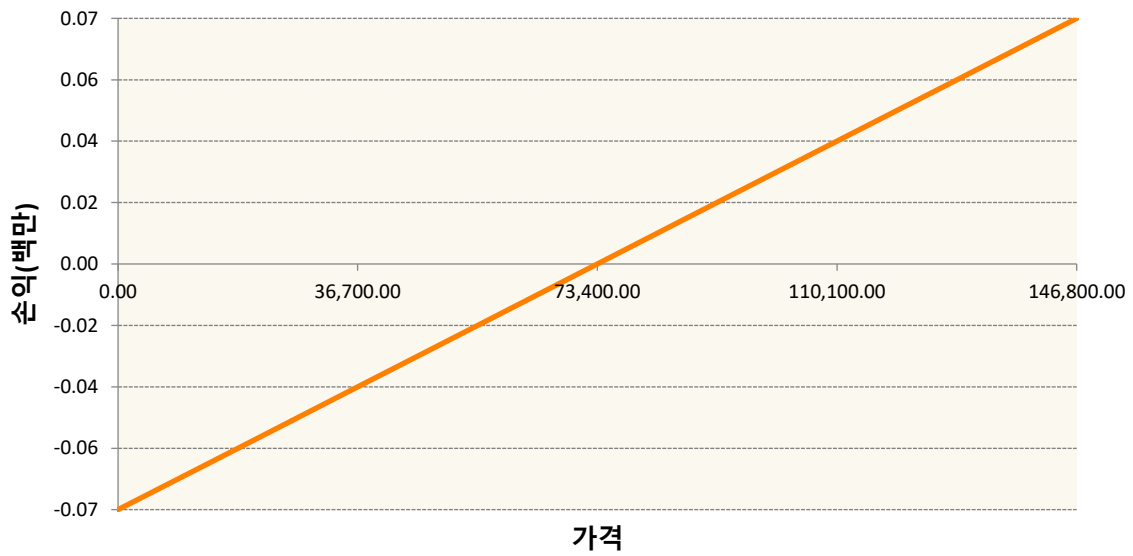
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



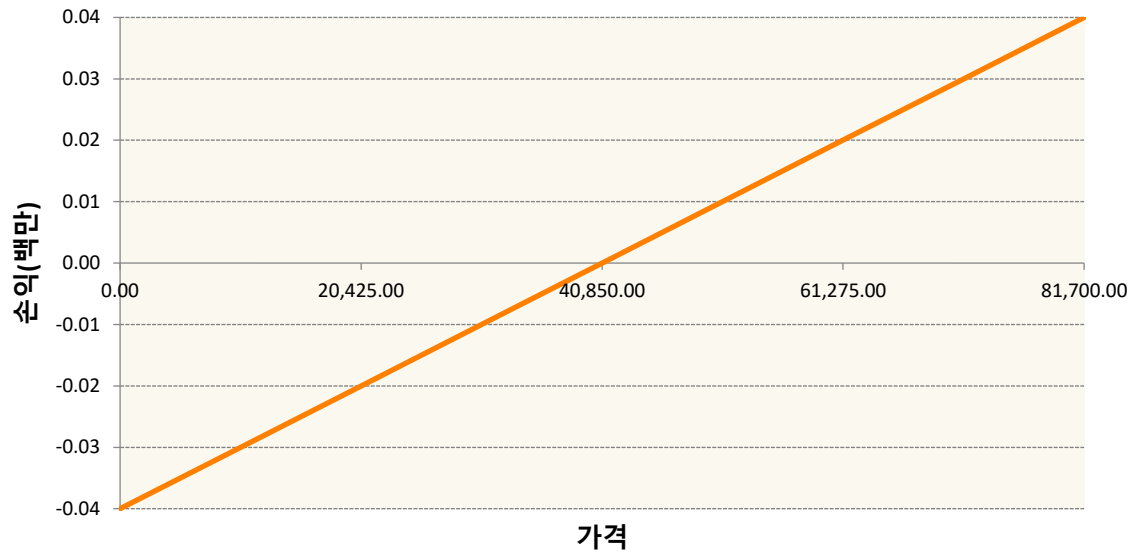
KR41FDW30006-2025-03 HD현대중공업개별선물



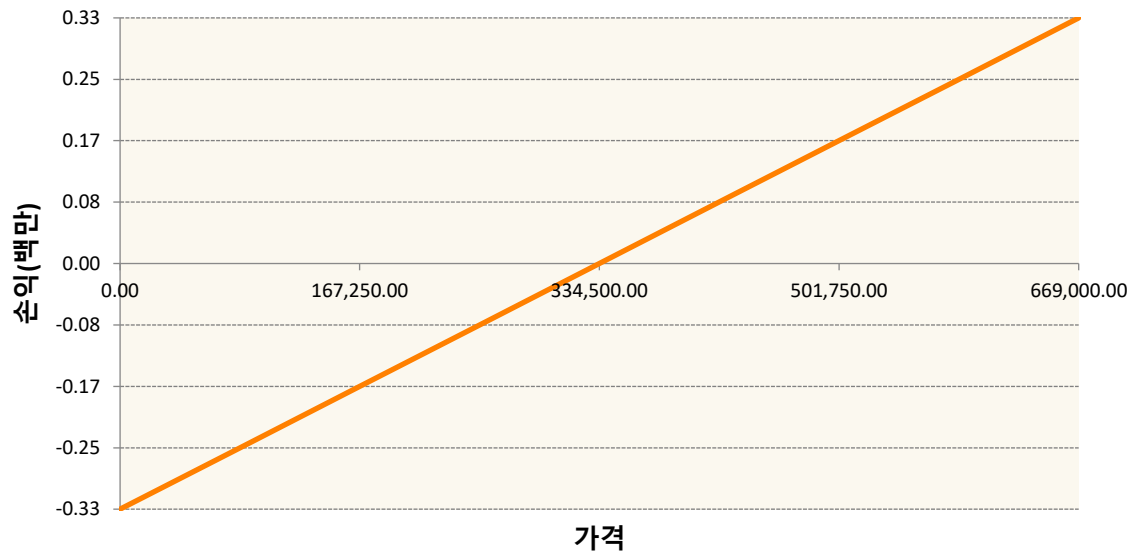
KR41FMW30007-2025-03 엘앤에프개별선물



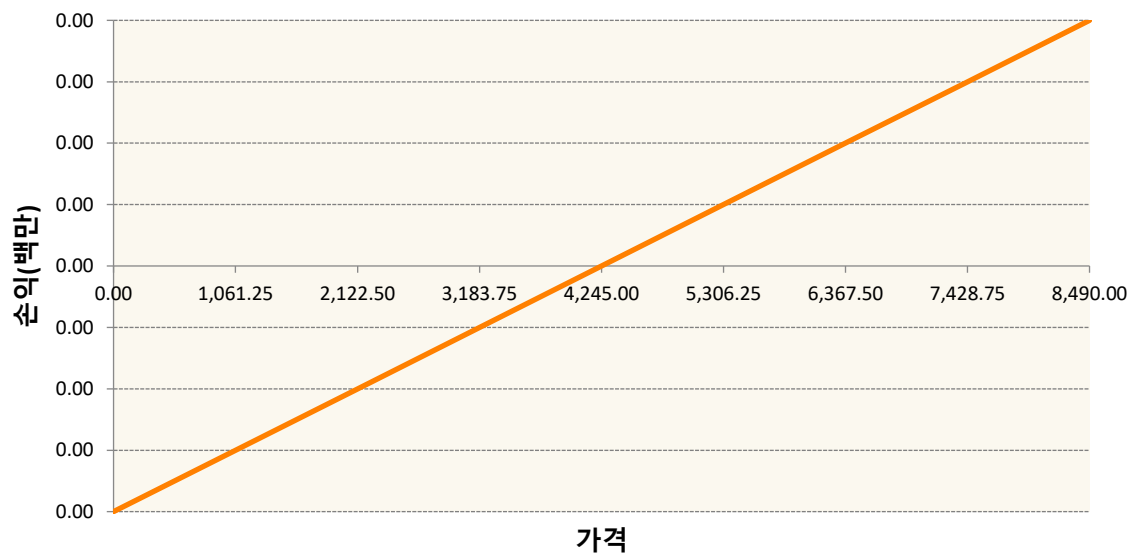
KR41G0W30008-2025-03 씨에스원드개별선물



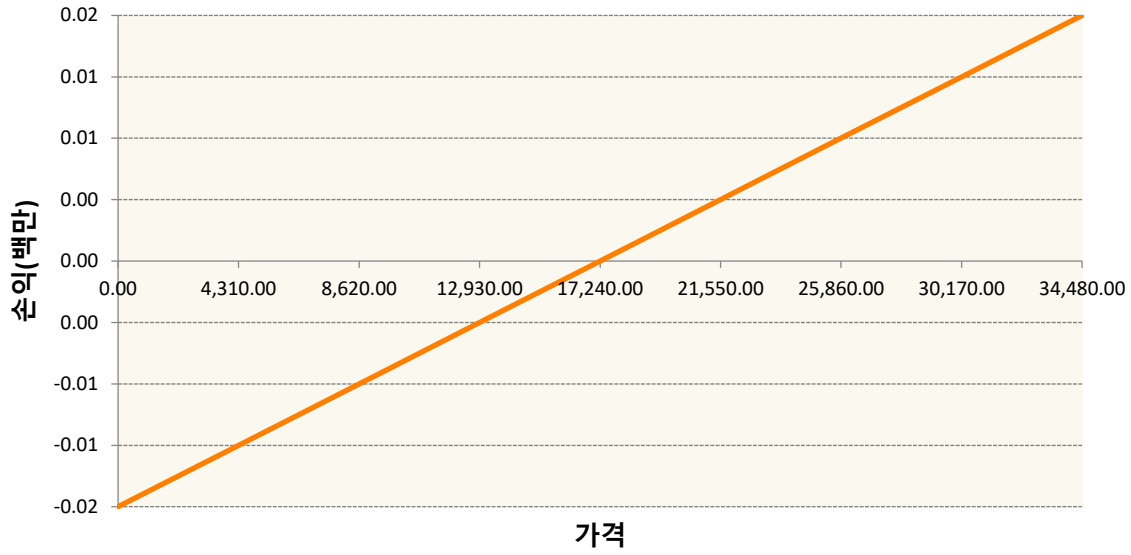
KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



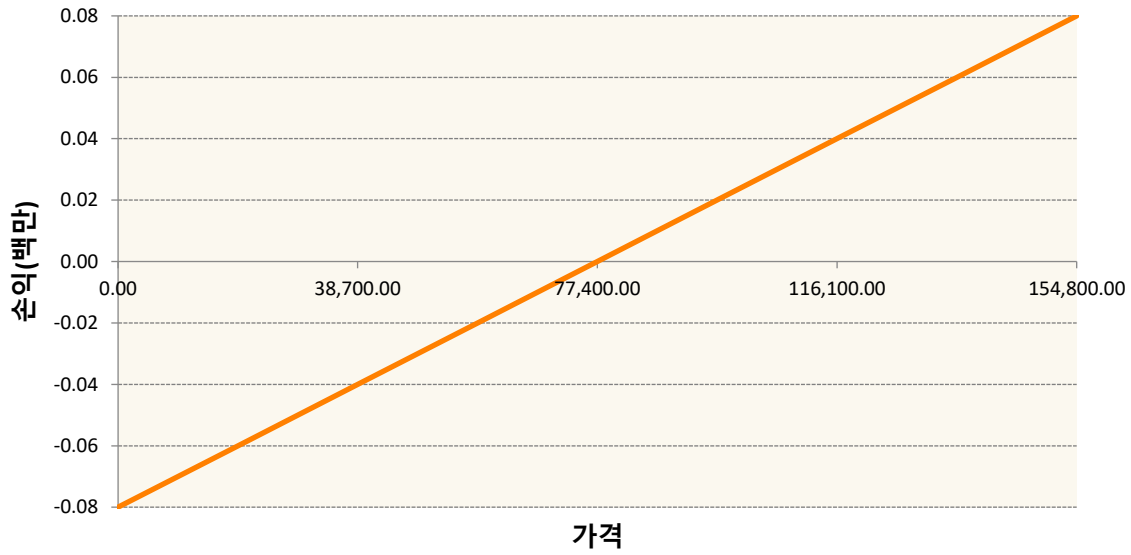
KR41GKW30009-2025-03 KG모빌리티개별선물



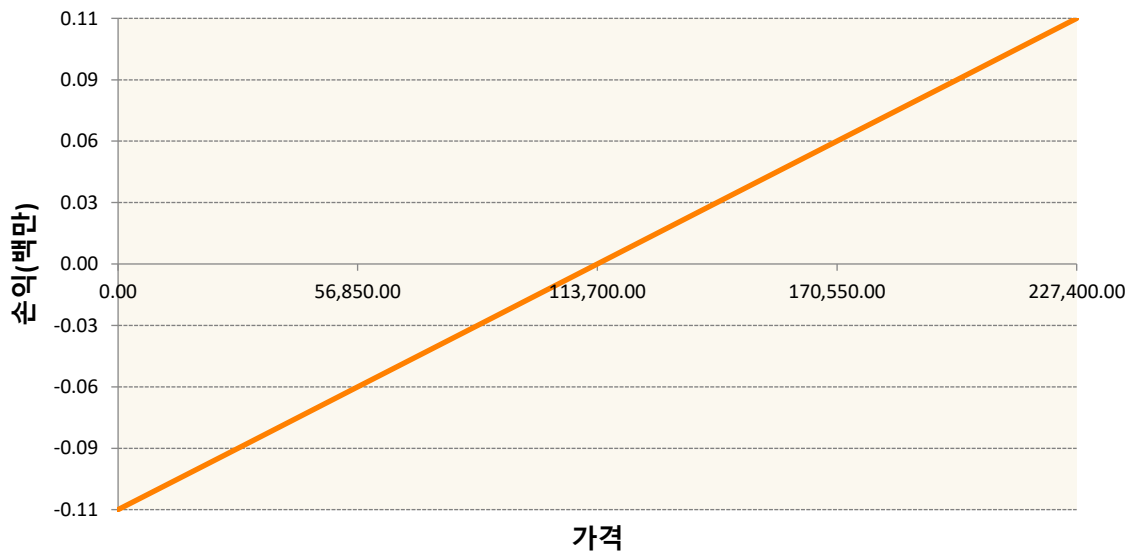
KR41GNW30003-2025-03 금양개별선물



KR41GZW30007-2025-03 에코프로머티개별선물



KR41HEW30000-2025-03 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	73
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	1
KR410TW30(2025-03 이수스페셜티케미컬개별선물	0.5
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	2
KR4132W30(2025-03 현대제철개별선물	1
KR41BJW30C 2025-03 엔씨소프트개별선물	1
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
KR41E8W30(2025-03 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	1
KR41ETW30(2025-03 삼성엔지니어링개별선물	1
KR41F5W30(2025-03 LG에너지솔루션개별선물	6
KR41F6W30(2025-03 카카오뱅크개별선물	4
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	1
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	3
KR41FDW30(2025-03 HD현대중공업개별선물	3
KR41FMW30 2025-03 엘앤에프개별선물	1
KR41G0W30(2025-03 씨에스윈드개별선물	0.49
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	3
KR41GKW30 2025-03 KG모빌리티개별선물	0.18
KR41GNW3C 2025-03 금양개별선물	0.32
KR41GZW30 2025-03 에코프로머티개별선물	1
KR41HEW30(2025-03 키움증권개별선물	1

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

189

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

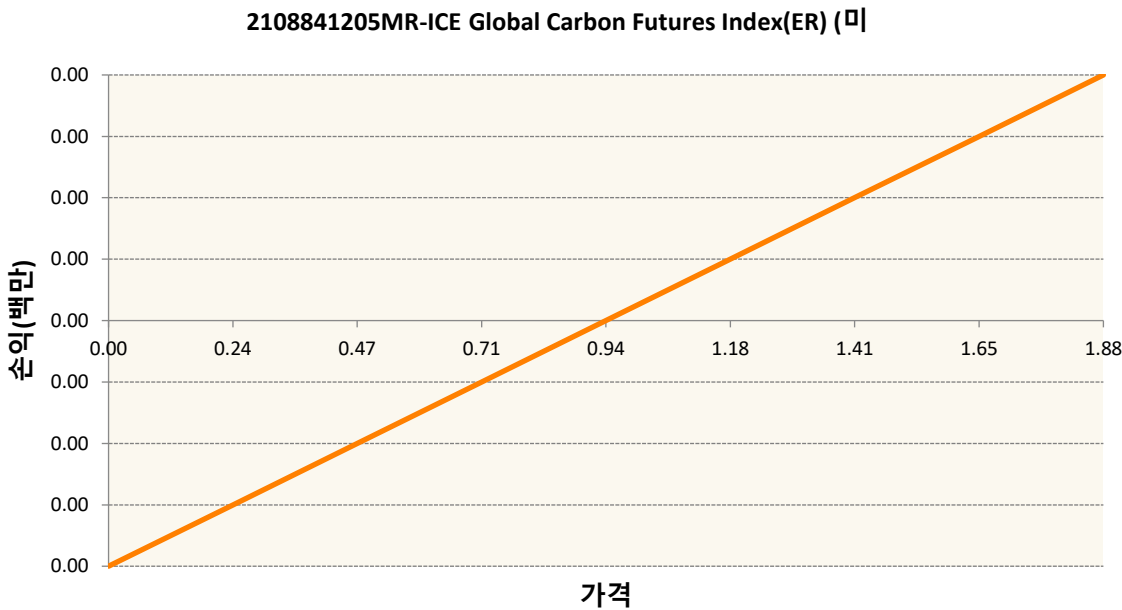
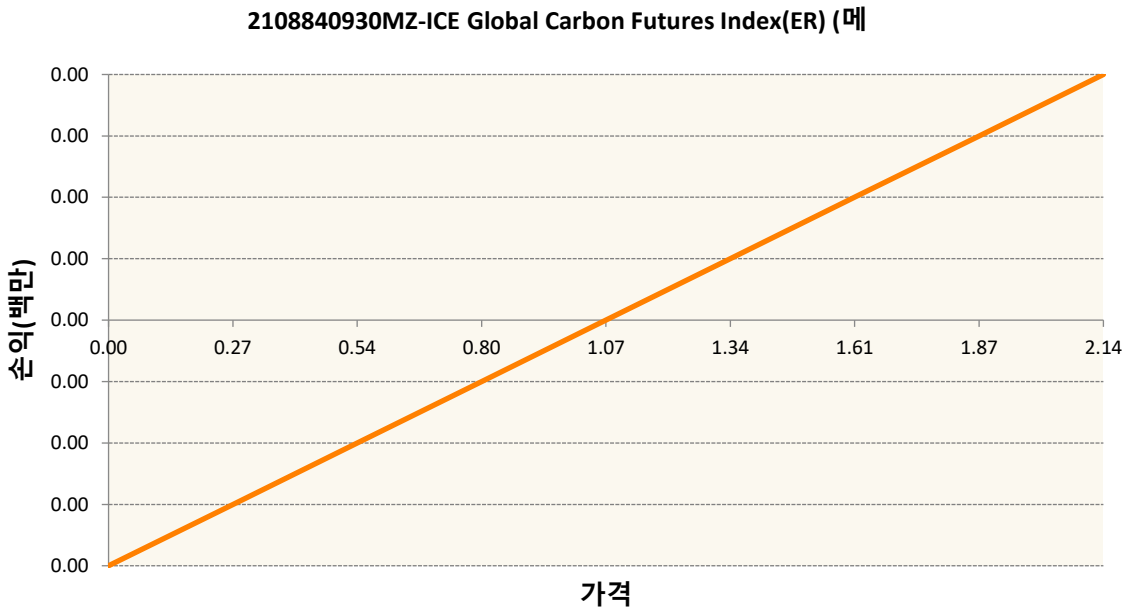
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,565	0	9,565	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		192
2108841205IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		574

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	854

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

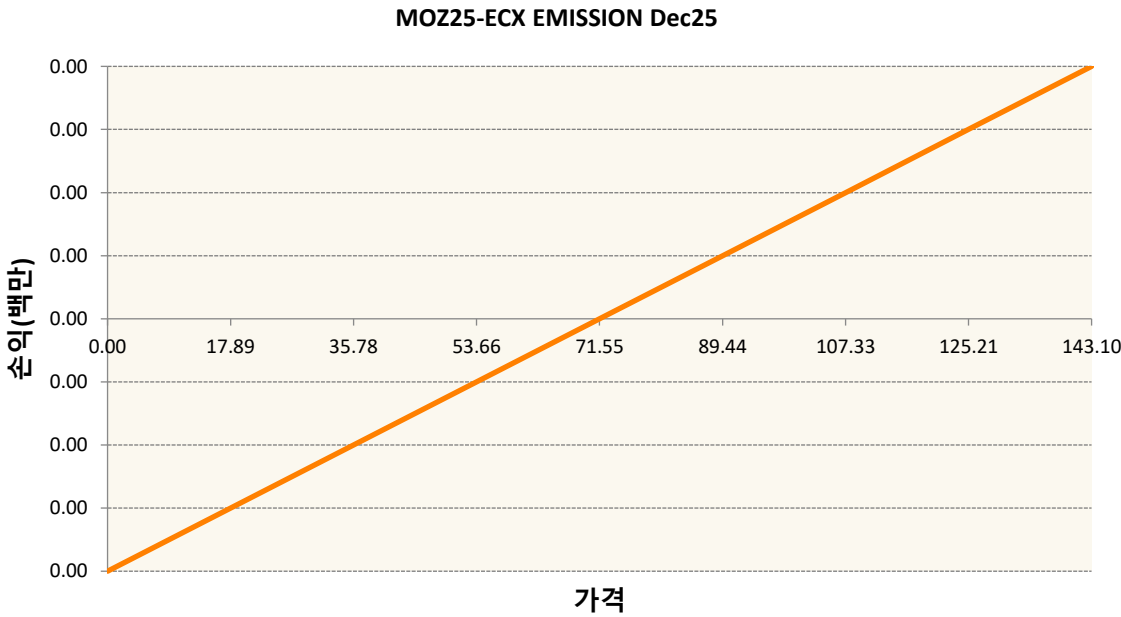
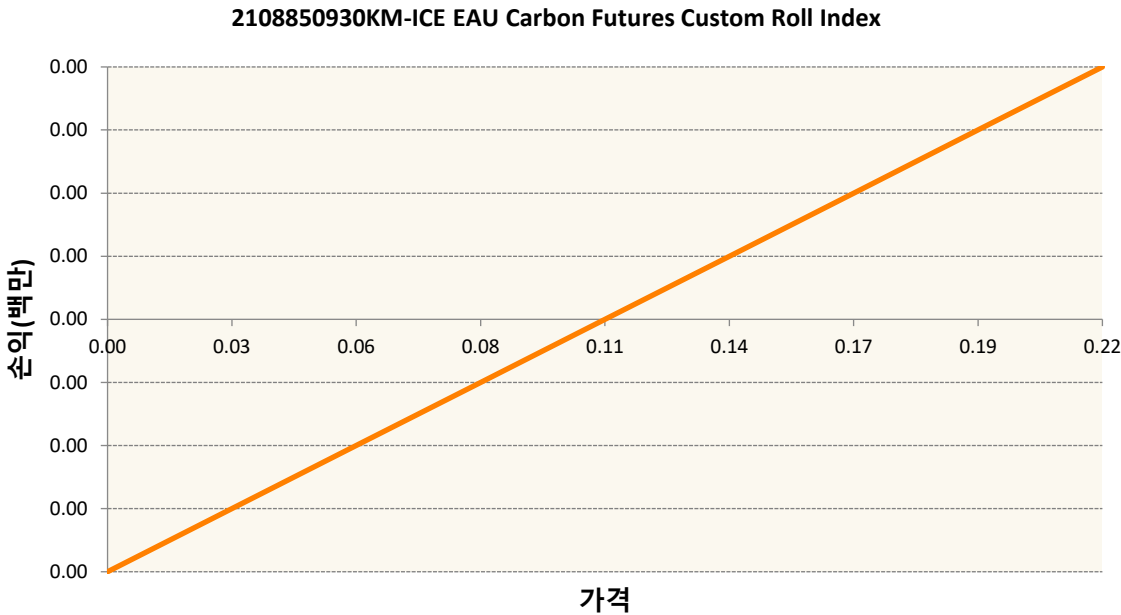
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,900	0	8,900	
누계	통화	선도	0	1,006	-1,006	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	3
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	81
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	709

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

1,268

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

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)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	4

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

(단위:백만원)

23

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

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)	21
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	25
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	5

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

(단위:백만원)

116

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

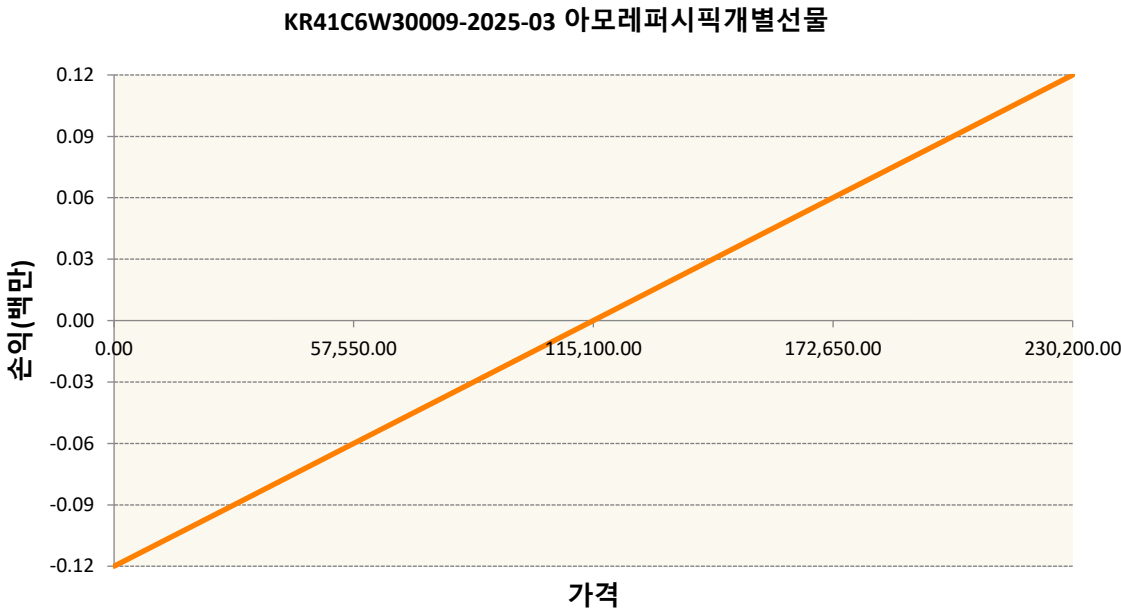
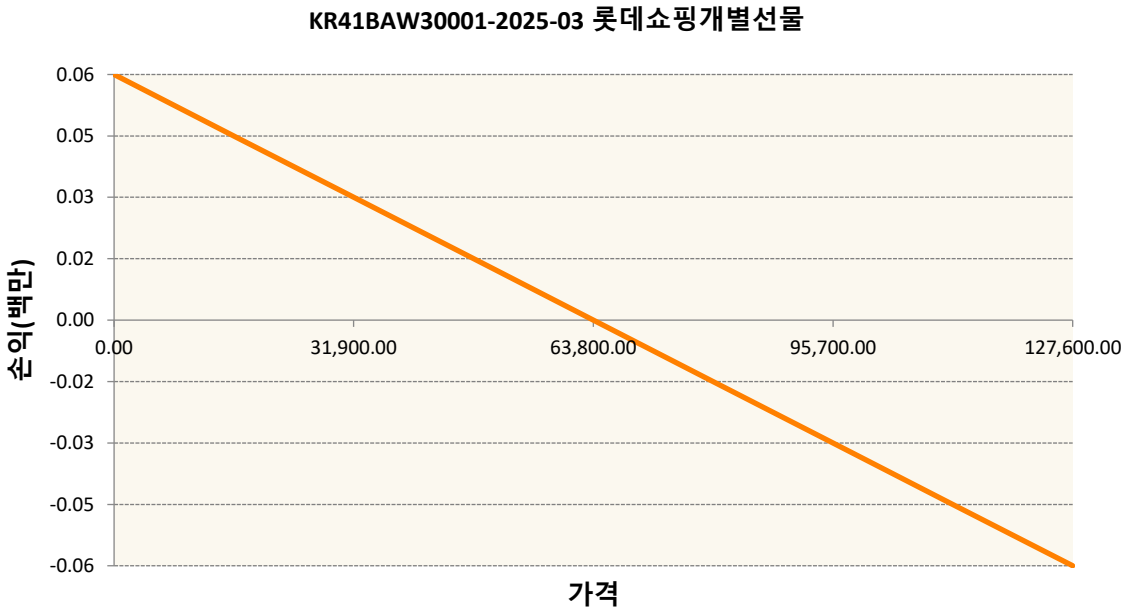
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

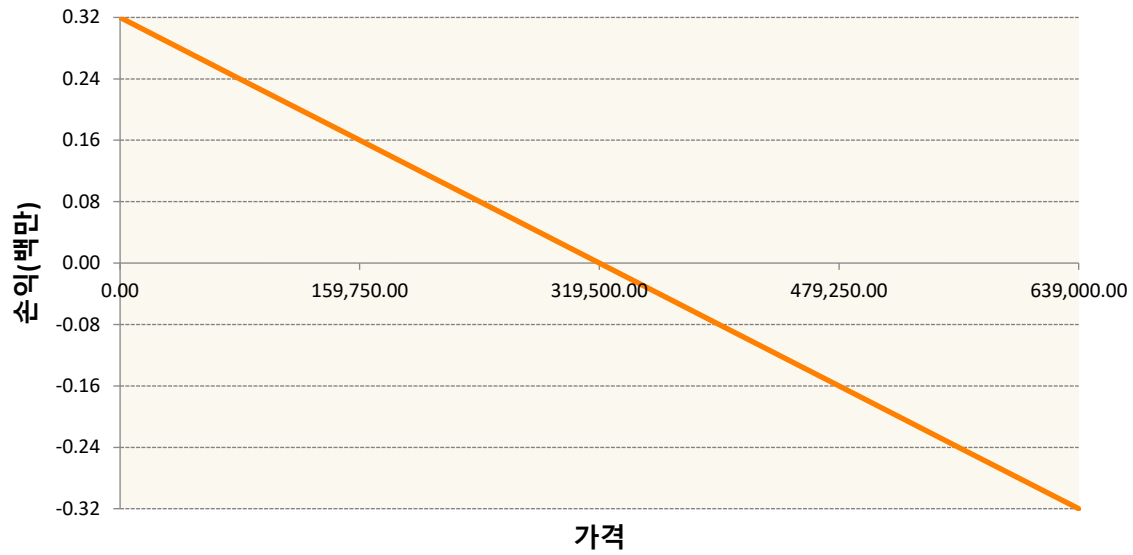
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4	0	4	장내
누계	유가증권	선물	21	38	-17	장내

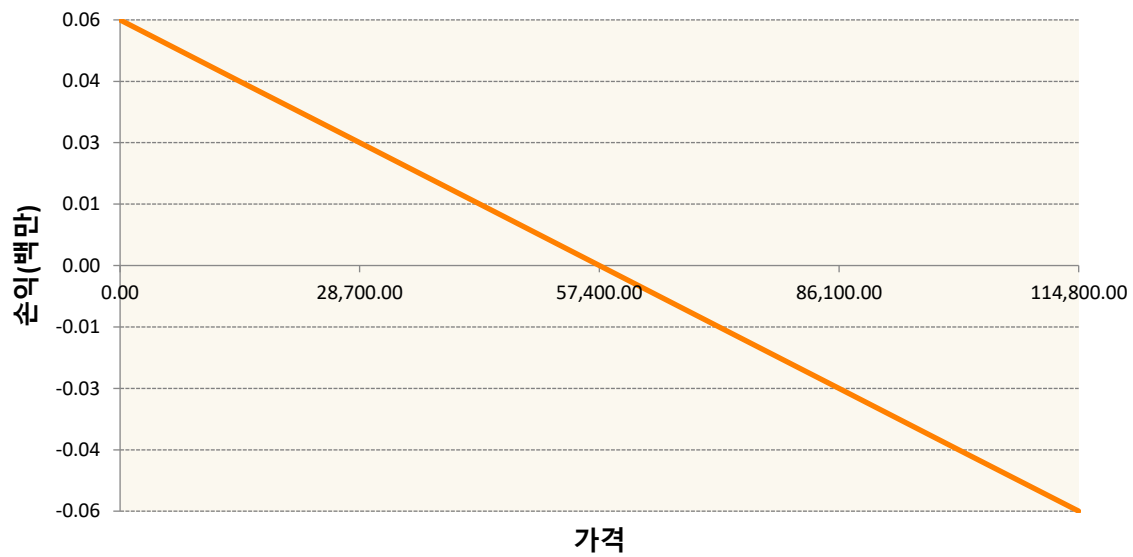
2. 만기시점의 손익구조



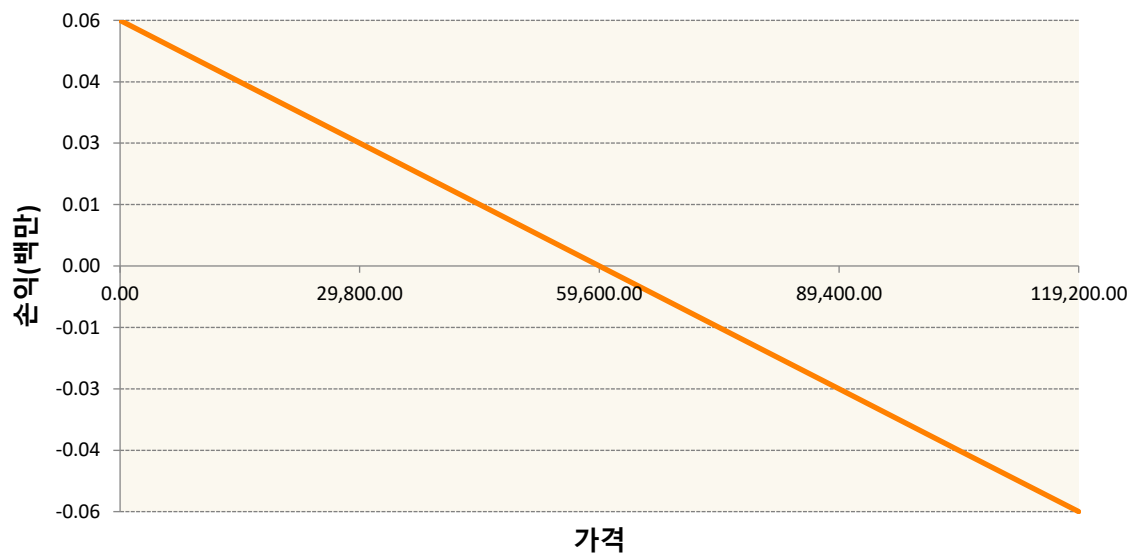
KR41CRW30003-2025-03 LG생활건강개별선물



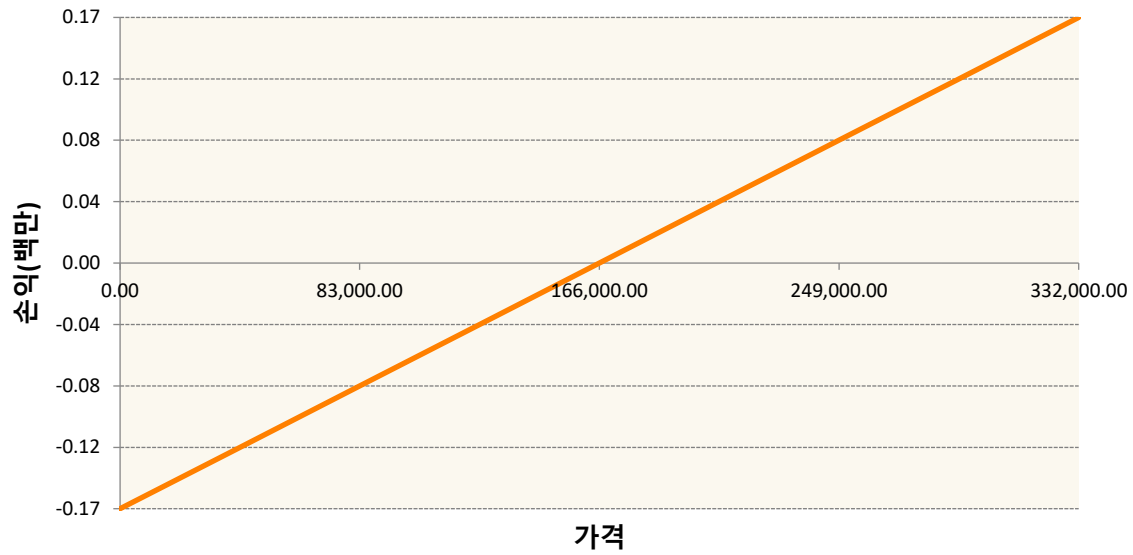
KR41D8W30004-2025-03 현대백화점개별선물



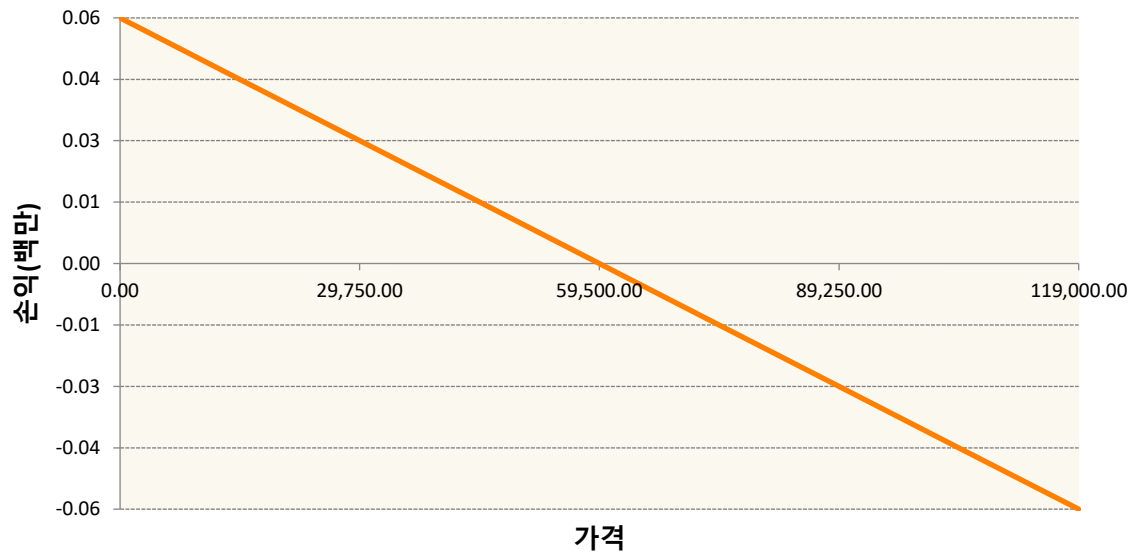
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



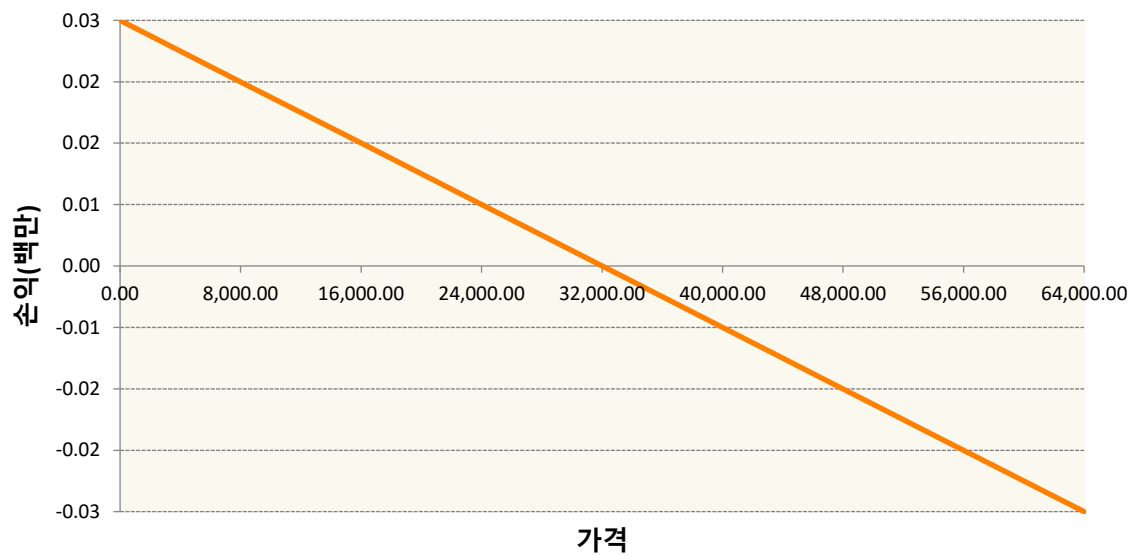
KR41DKW30006-2025-03 코스맥스개별선물



KR41DTW30007-2025-03 CJ ENM개별선물



KR41FLW30009-2025-03 펄어비스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR41BAW30	2025-03 롯데쇼핑개별선물	0.36
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	0.33
KR41FLW30	2025-03 펄어비스개별선물	0.28

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	11

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

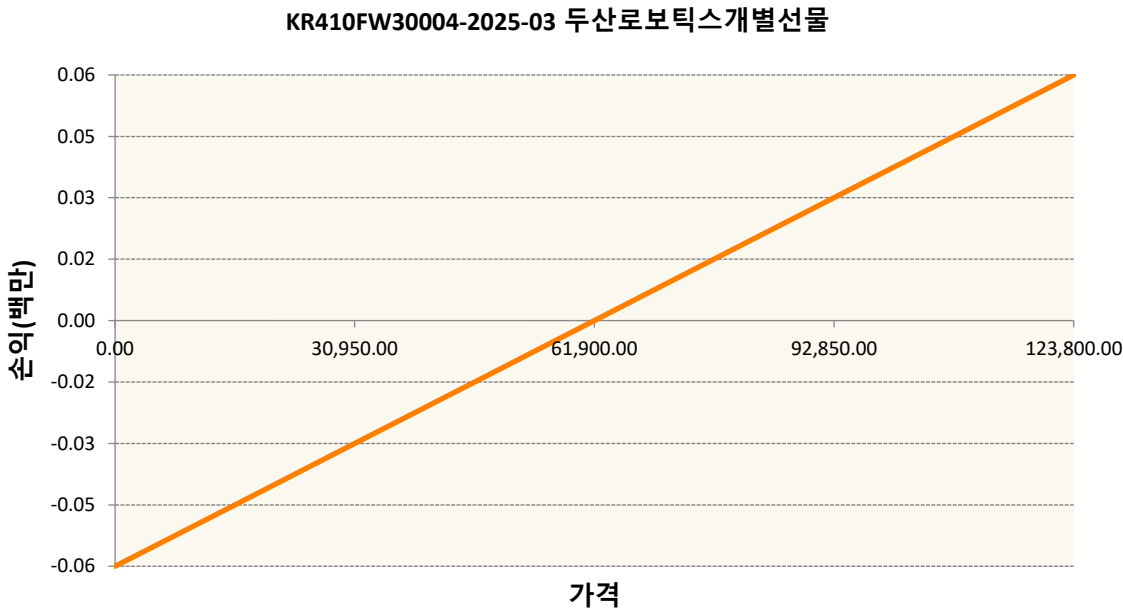
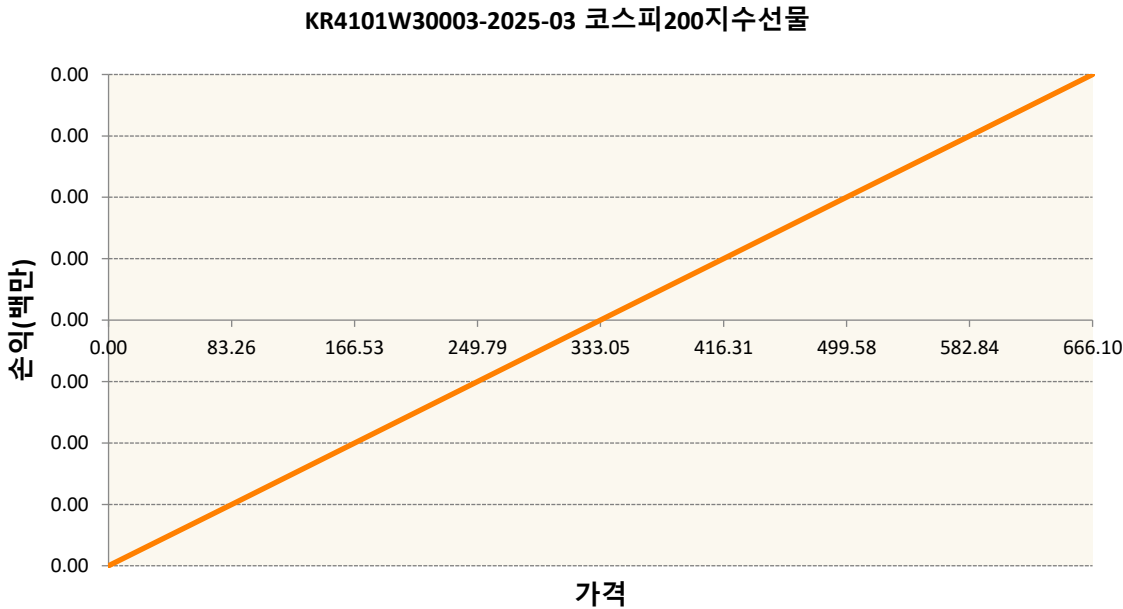
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

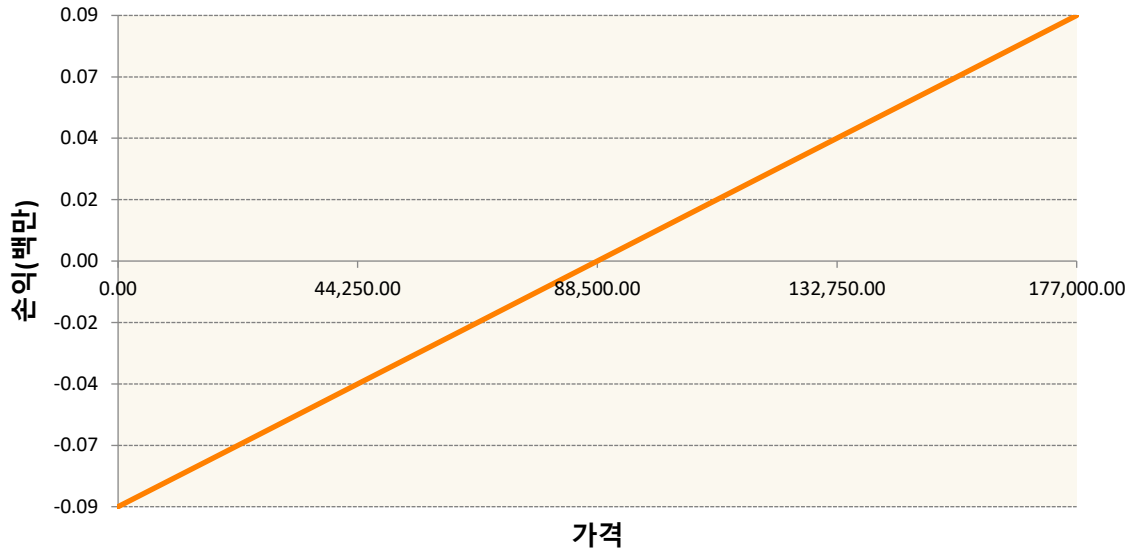
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	231	0	231	장내
누계	유가증권	선물	12,480	0	12,480	장내

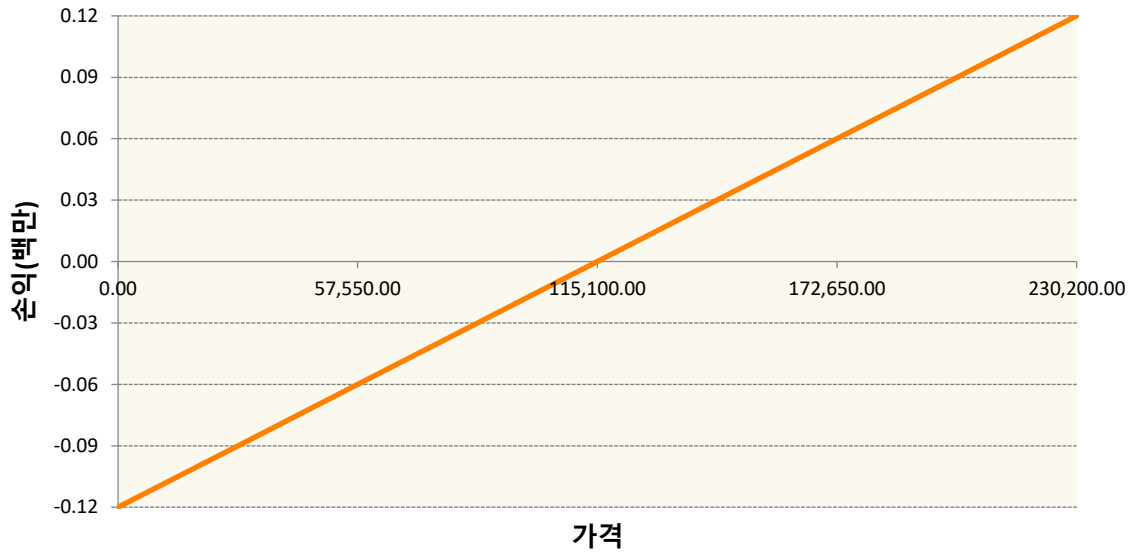
2. 만기시점의 손익구조



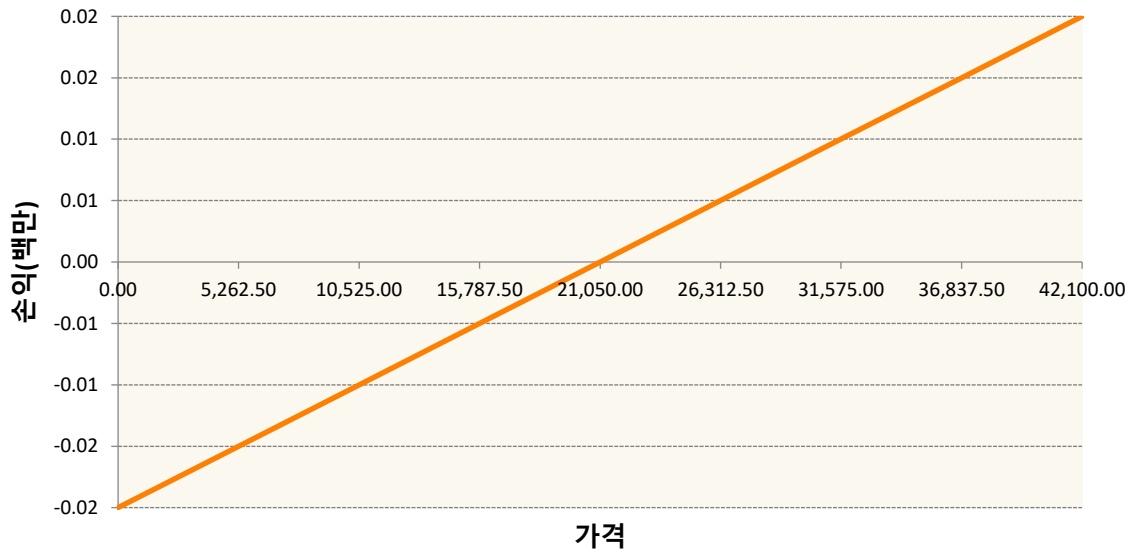
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



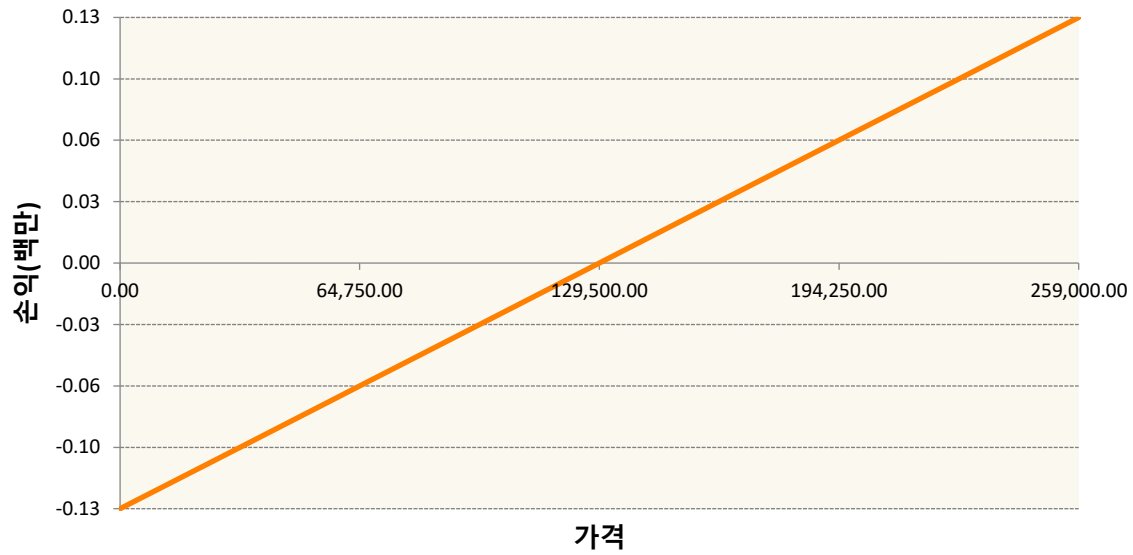
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



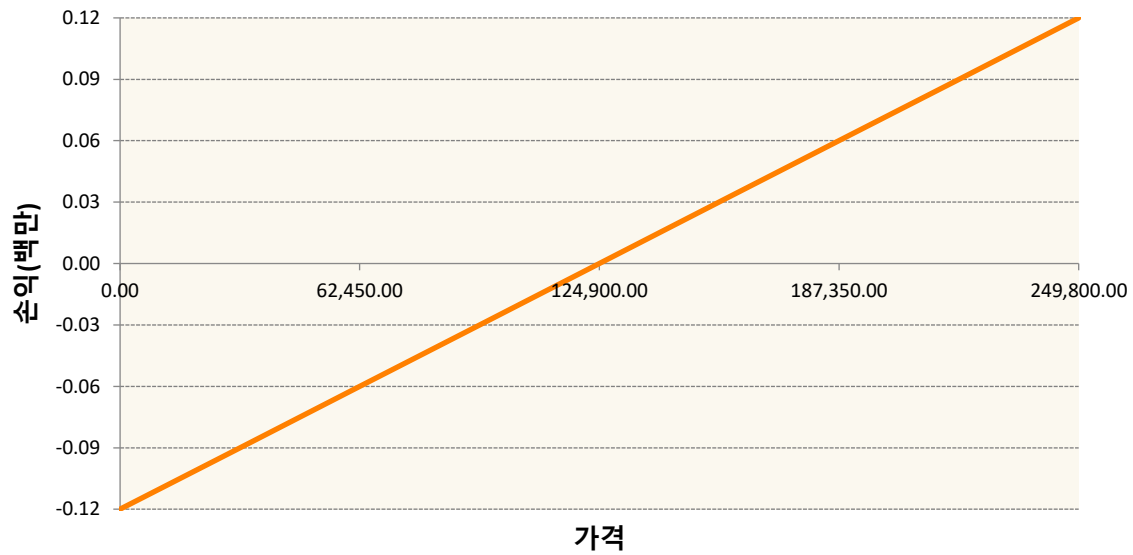
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



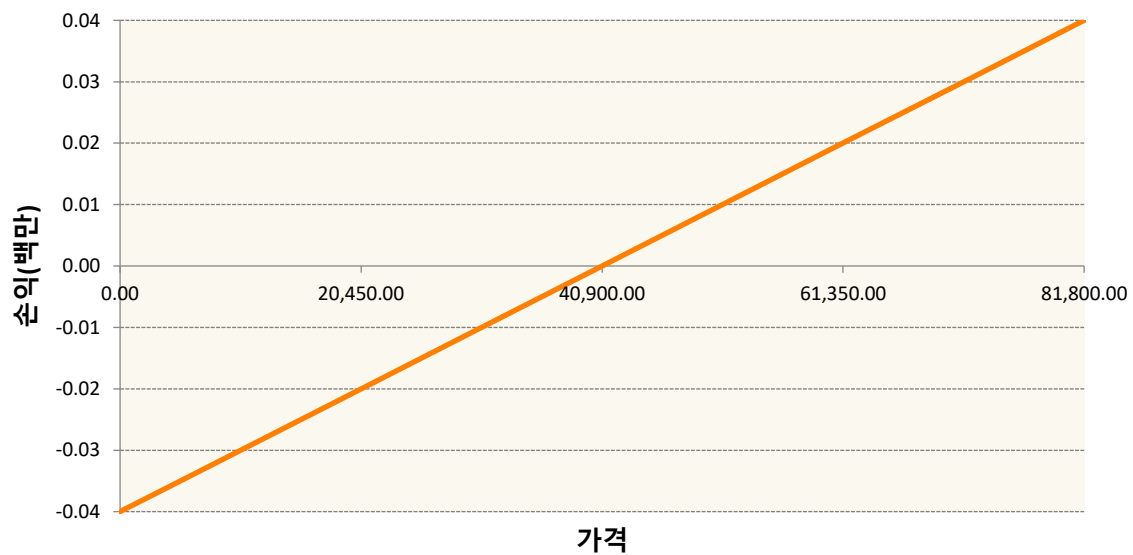
KR41E8W30003-2025-03 포스코퓨처엠개별선물



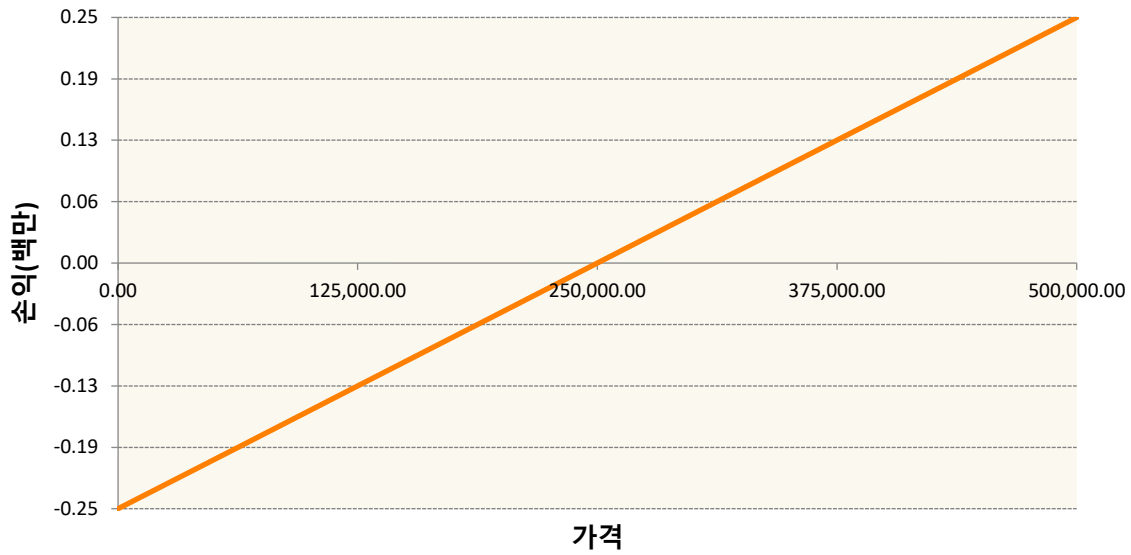
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



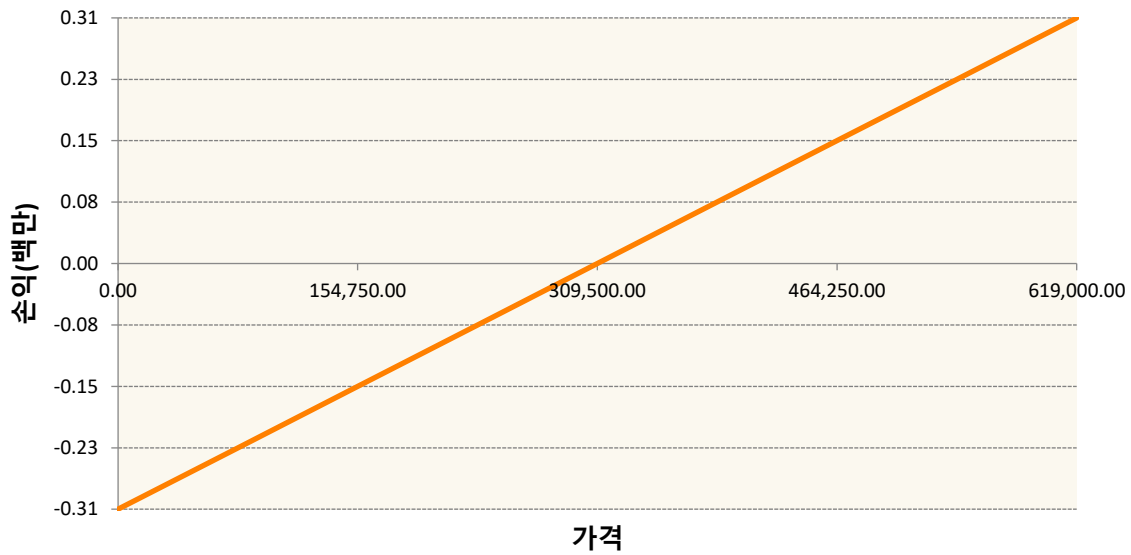
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



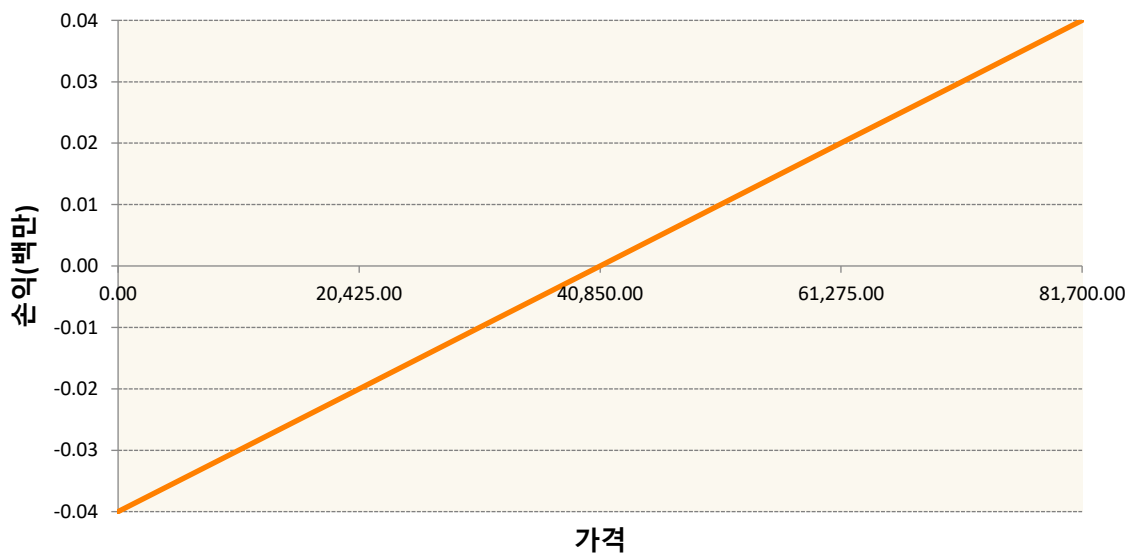
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



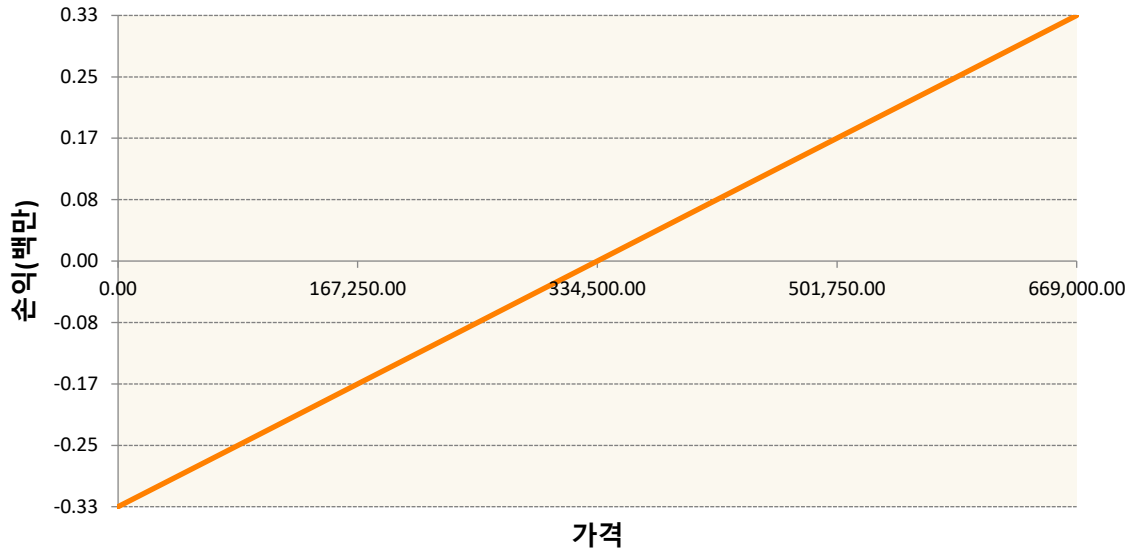
KR41FDW30006-2025-03 HD현대중공업개별선물



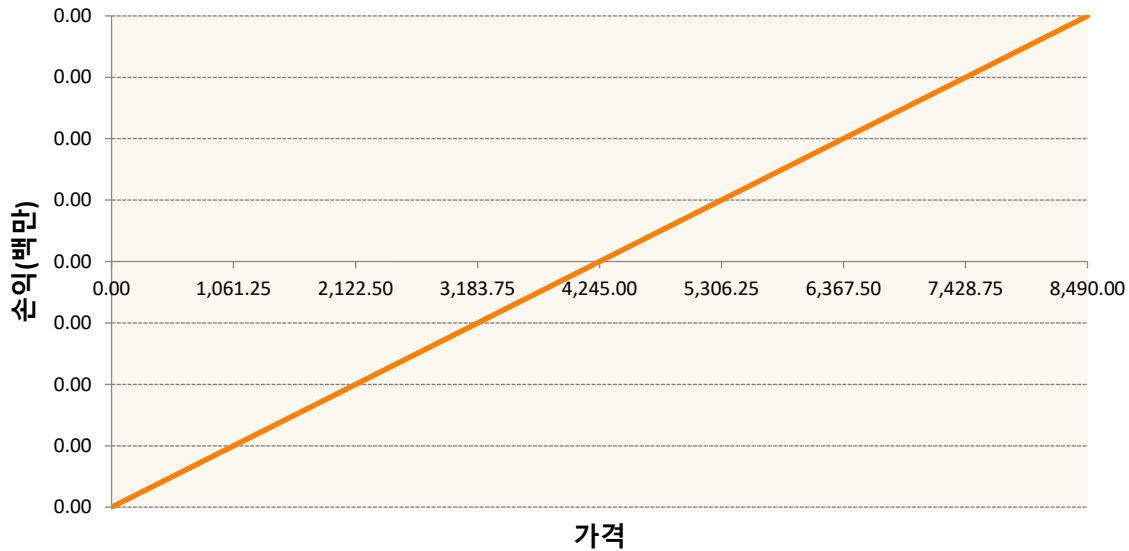
KR41G0W30008-2025-03 씨에스원드개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



KR41GKW30009-2025-03 KG모빌리티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	666
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	12
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	37
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물	35
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물	10
KR41E8W30(2025-03 포스코퓨처엠개별선물	16
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	24
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	10
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	51
KR41FDW30(2025-03 HD현대중공업개별선물	68
KR41G0W30 2025-03 씨에스윈드개별선물	2
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	67

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

(단위:백만원)

1,784

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

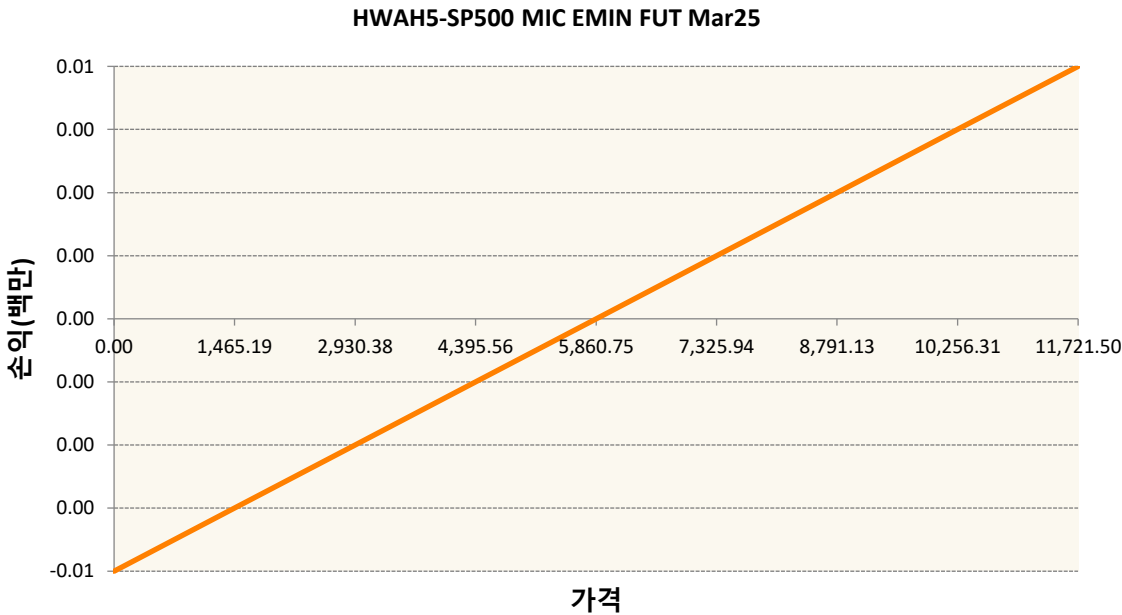
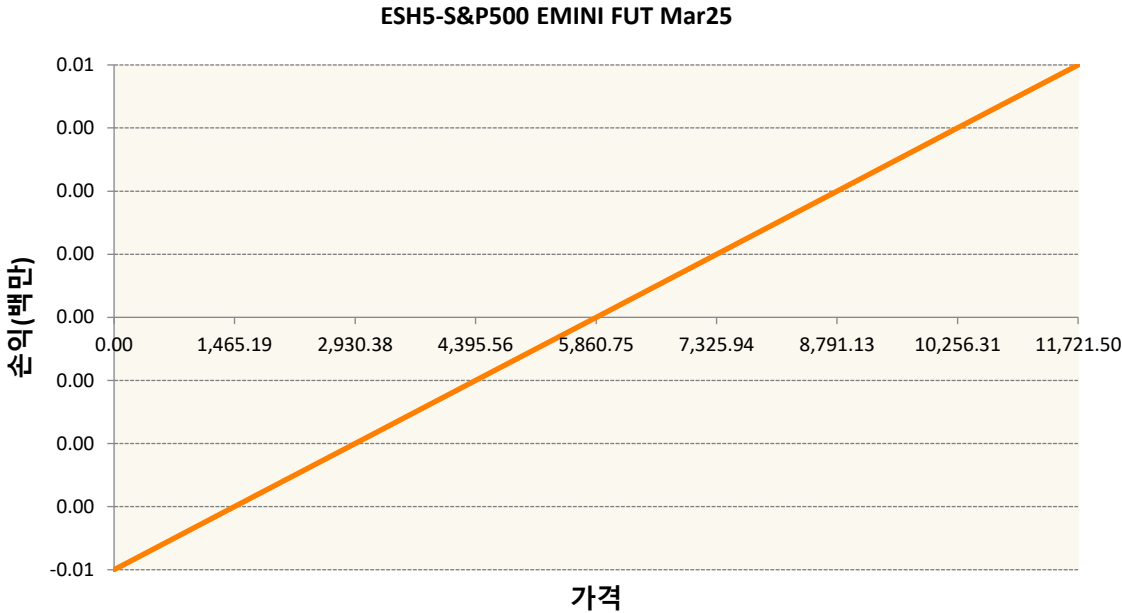
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	29,363	0	29,363	
누계	유가증권	선물	1,232	0	1,232	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,349
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,294

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

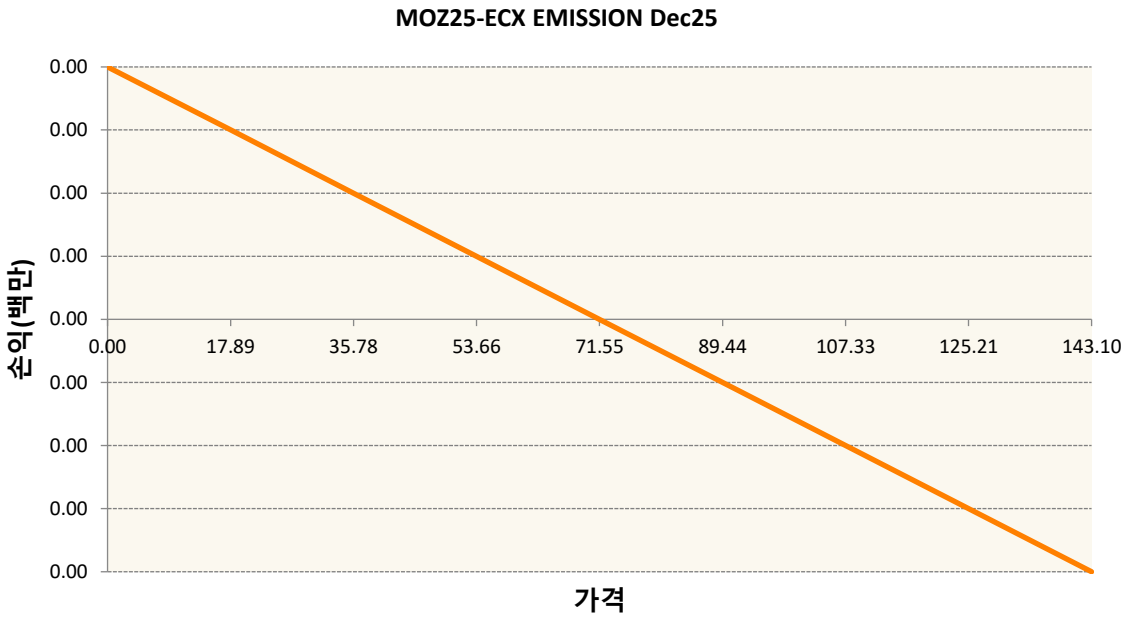
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,389	-5,426	
누계	통화	선도	0	1,126	-1,126	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	33
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	57
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	431

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

(단위:백만원)

795

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

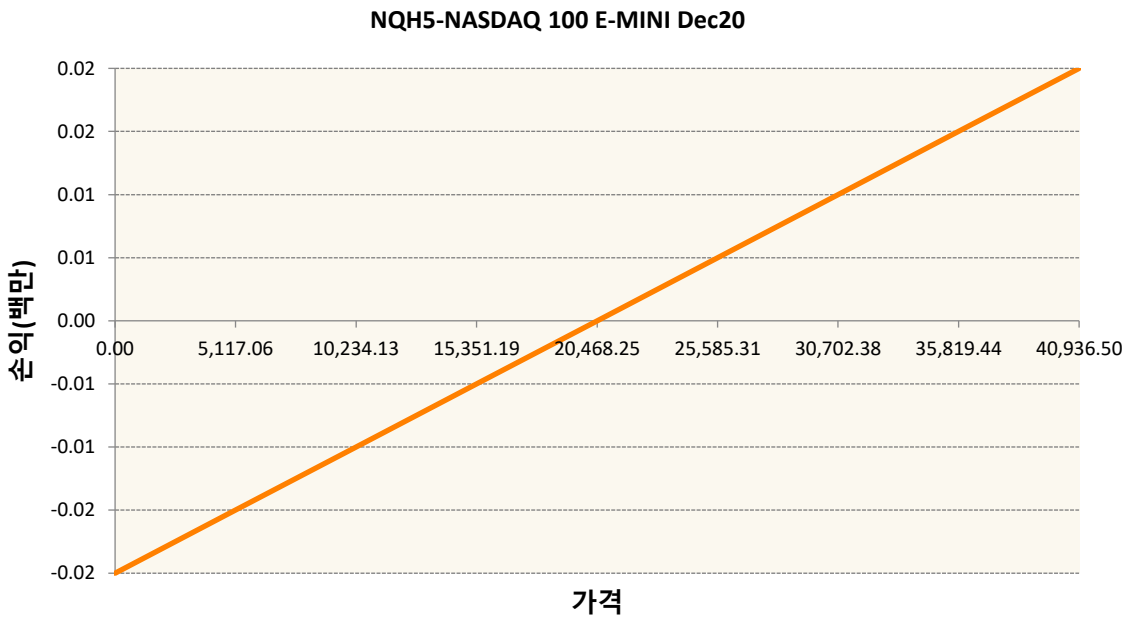
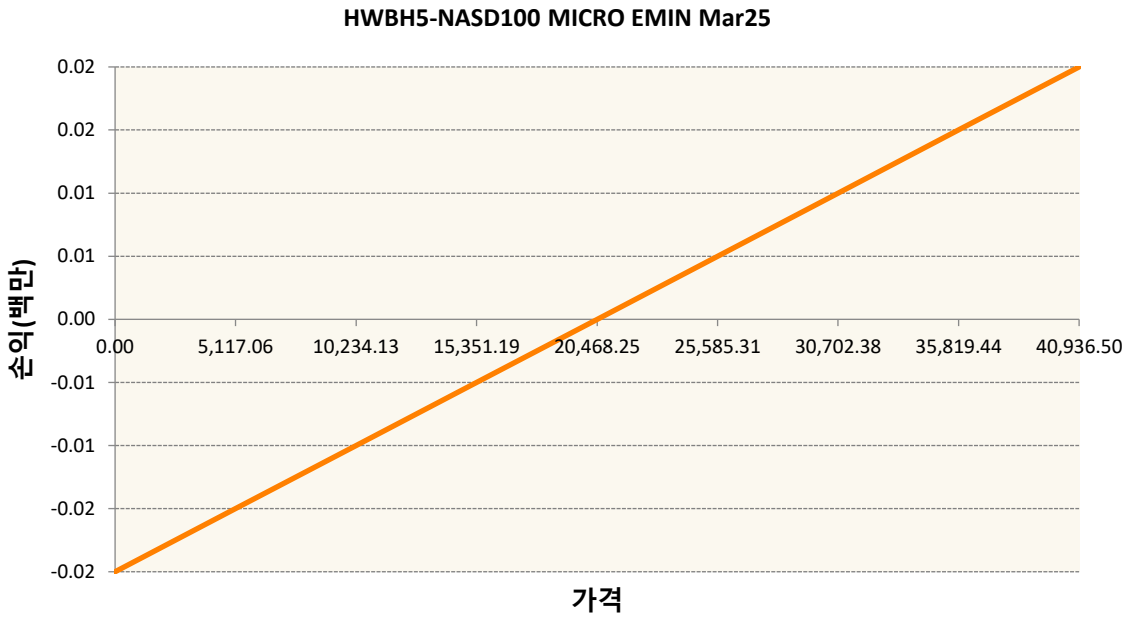
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,271	0	14,271	
누계	유가증권	선물	354	0	354	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	28
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,142

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,044

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

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	218,476	0	218,476	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0000 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	746
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,242
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,289
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,920

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

(단위:백만원)

9,142

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

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	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13

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

(단위:백만원)

56

공시일	2025-03-05
기준일	2025-03-04

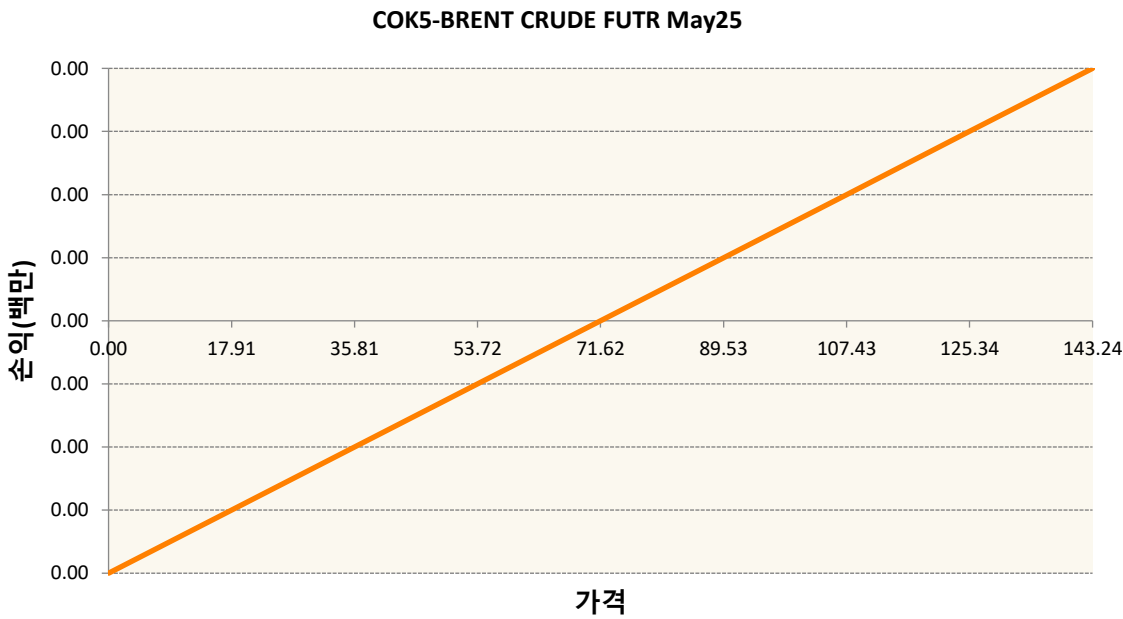
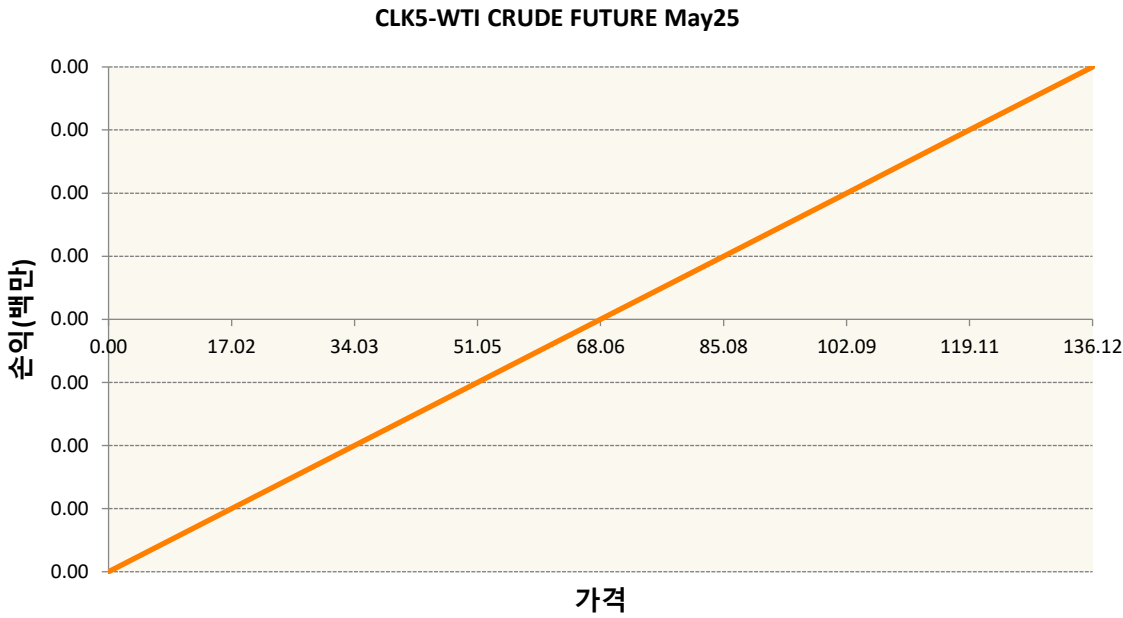
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

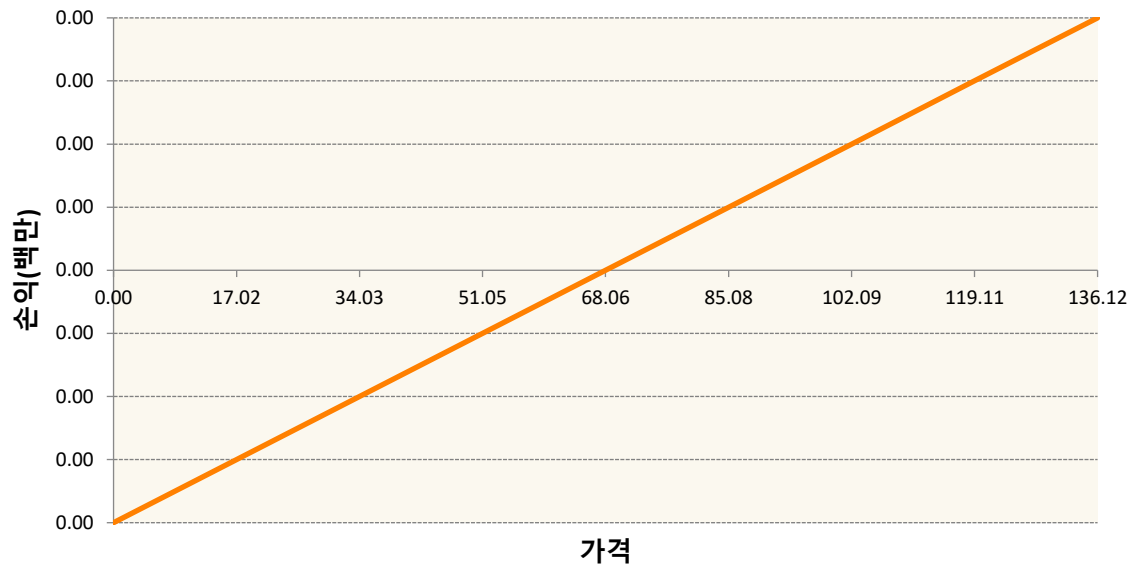
(단위:백만원)

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	847	0	847	
누계	통화	선물	0	161	-161	장내

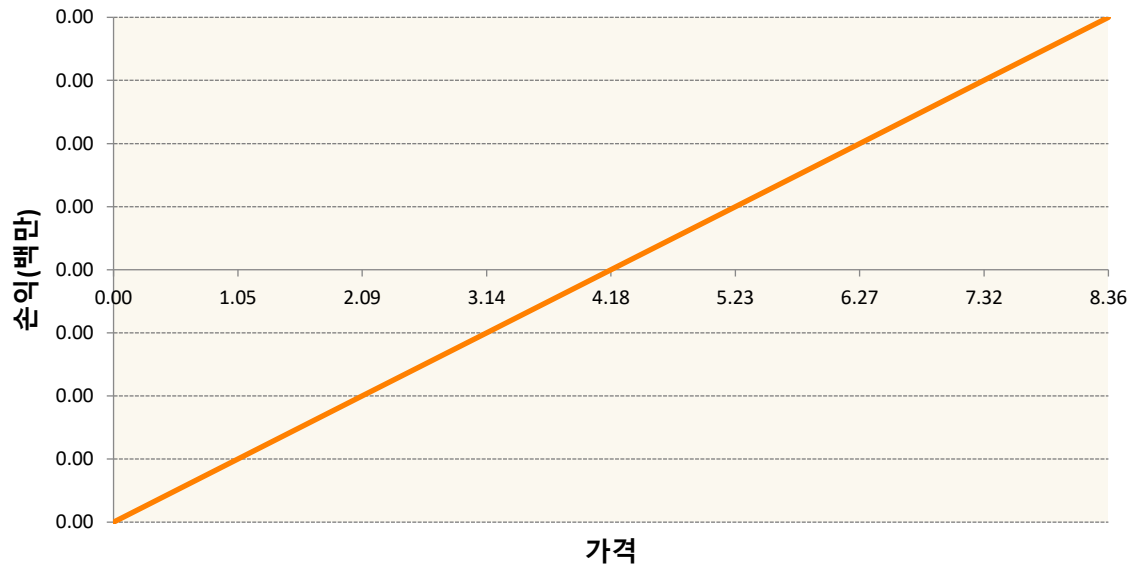
2. 만기시점의 손익구조



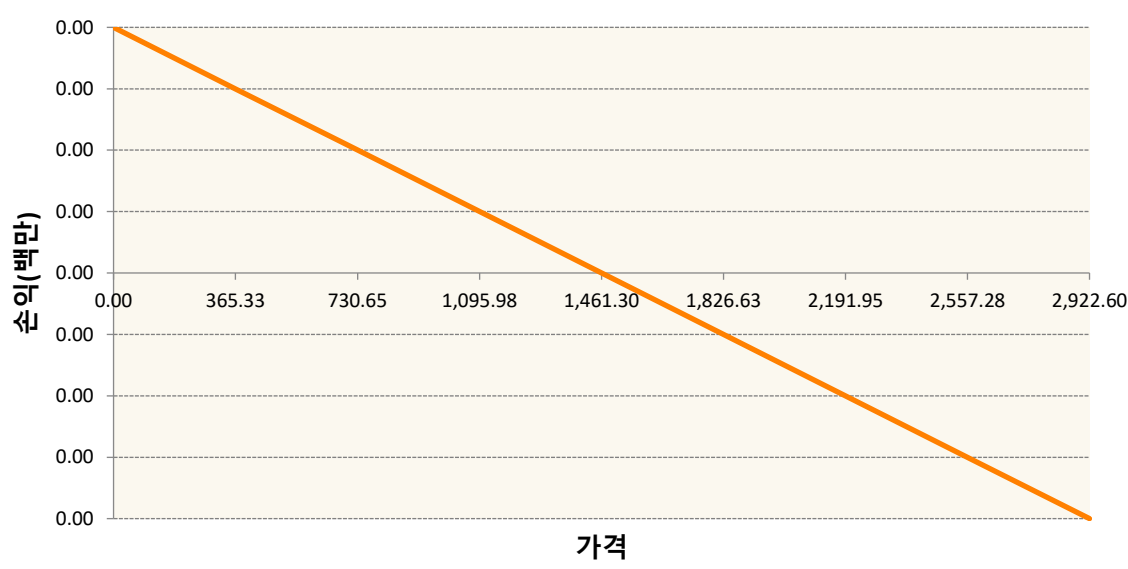
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



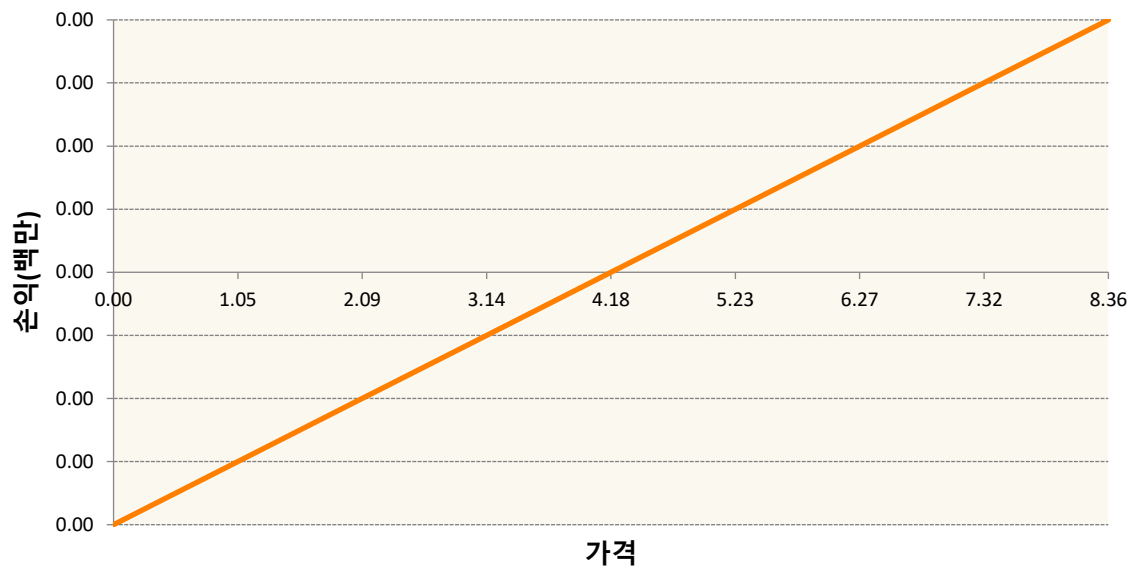
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



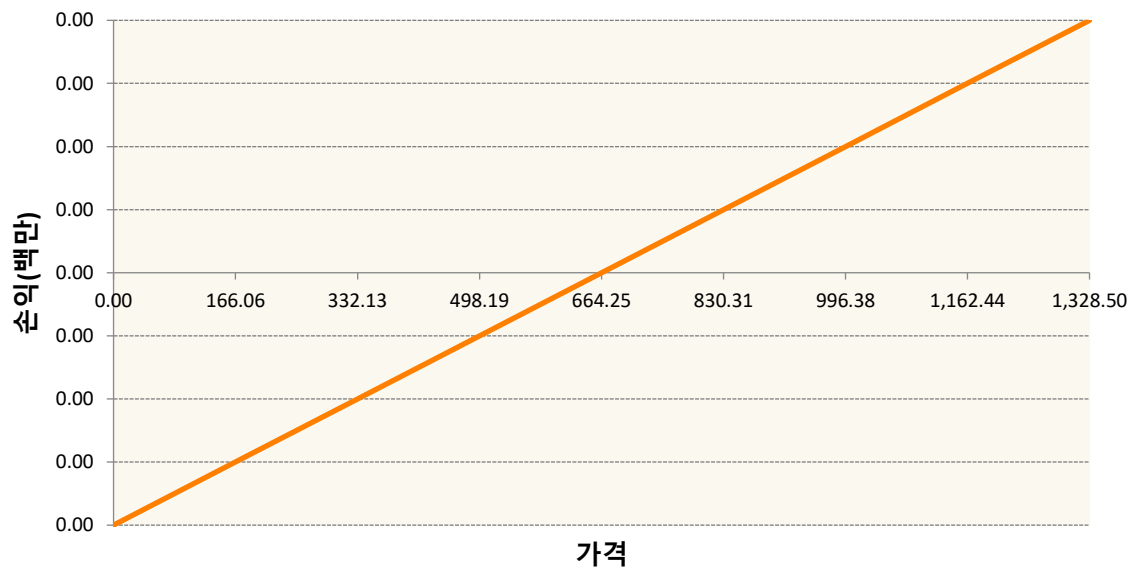
KR4175W30007-2025-03 달러선물



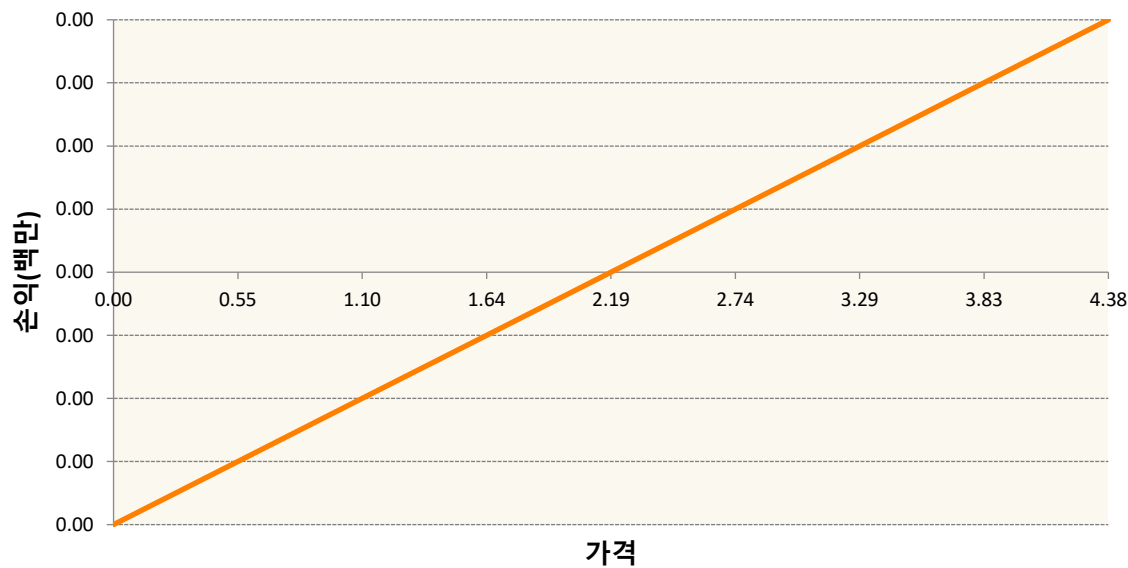
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	6
KR4175W30(	2025-03 달러선물	13
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)

147