

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

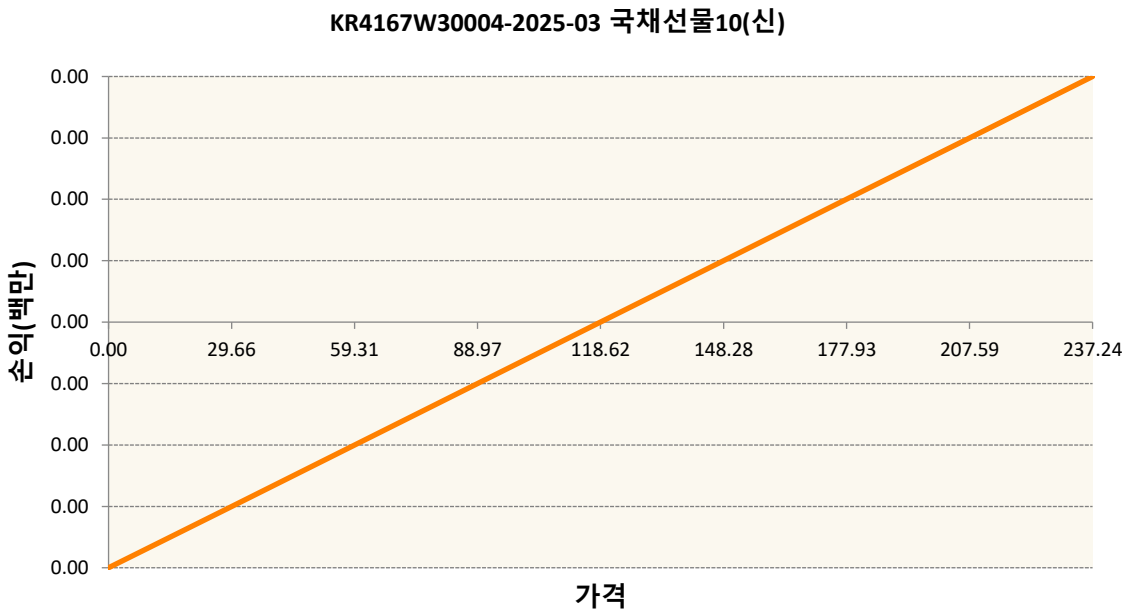
베스트장기채(채권-파생형)

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	228,937	0	228,937	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

5,752

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

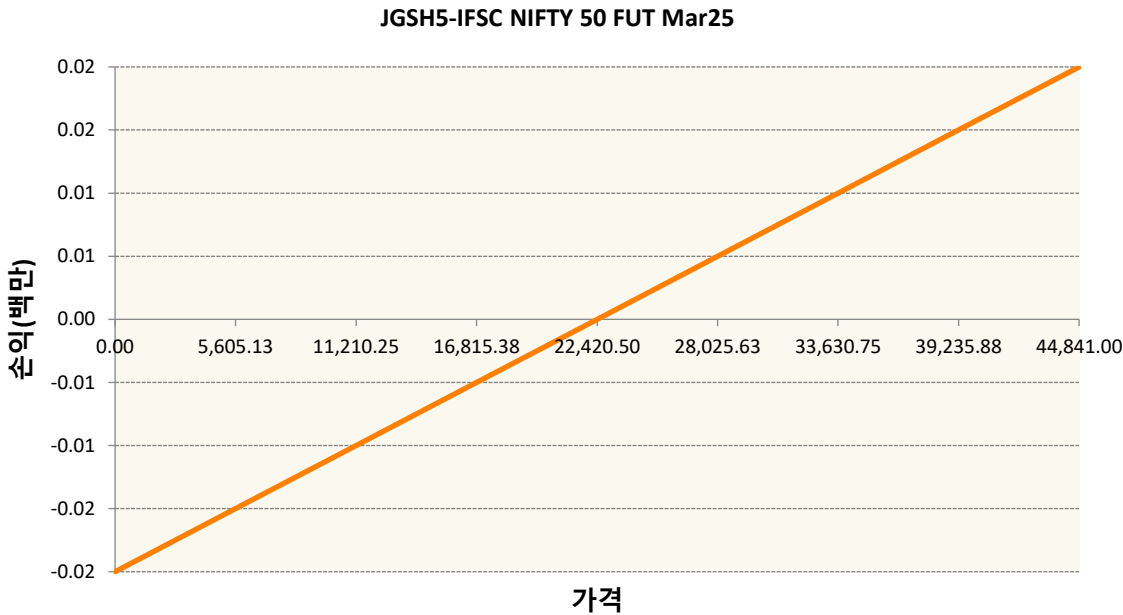
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1	-1	
누계	유가증권	선물	722	0	722	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH5	IFSC NIFTY 50 FUT Mar25	58
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

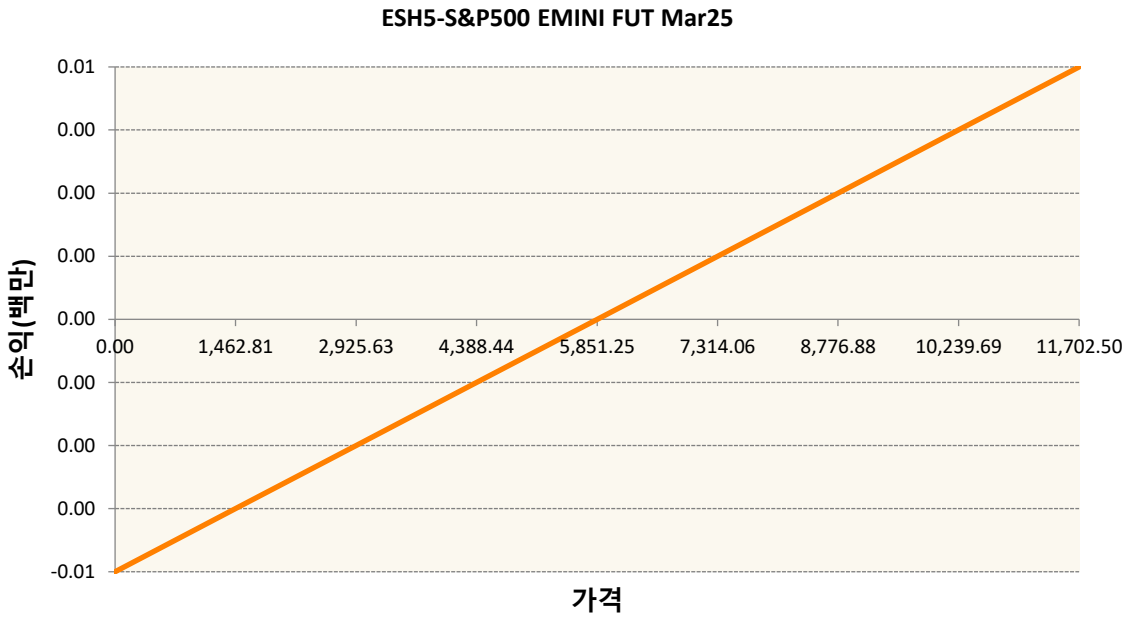
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	841	0	841	

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	2025-03-07
기준일	2025-03-06

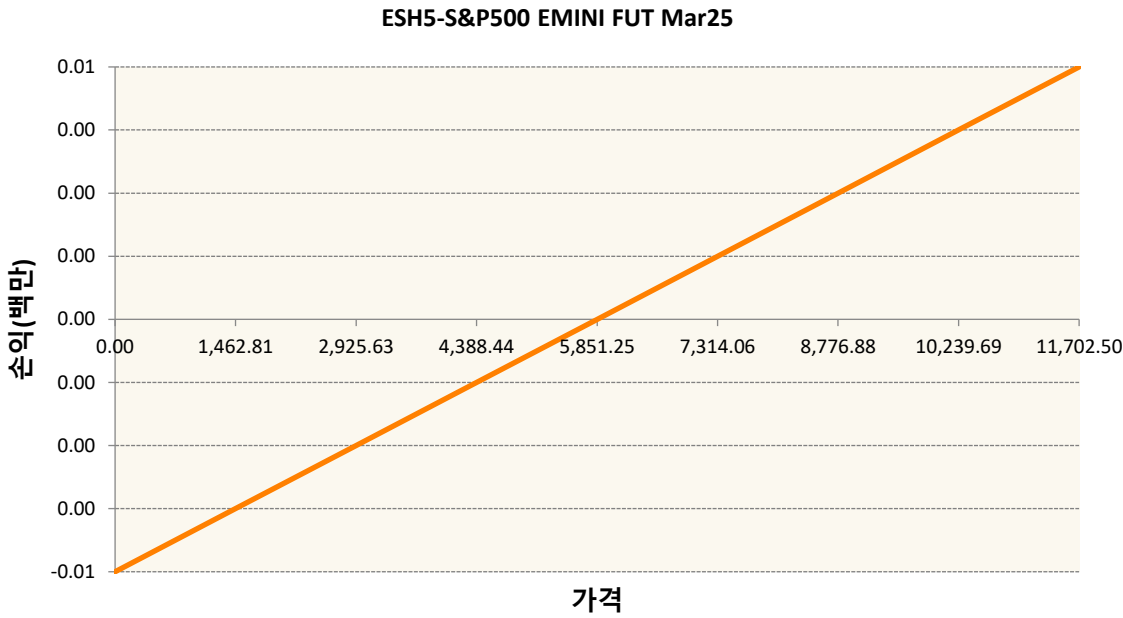
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,548	0	2,548	

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)

280

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

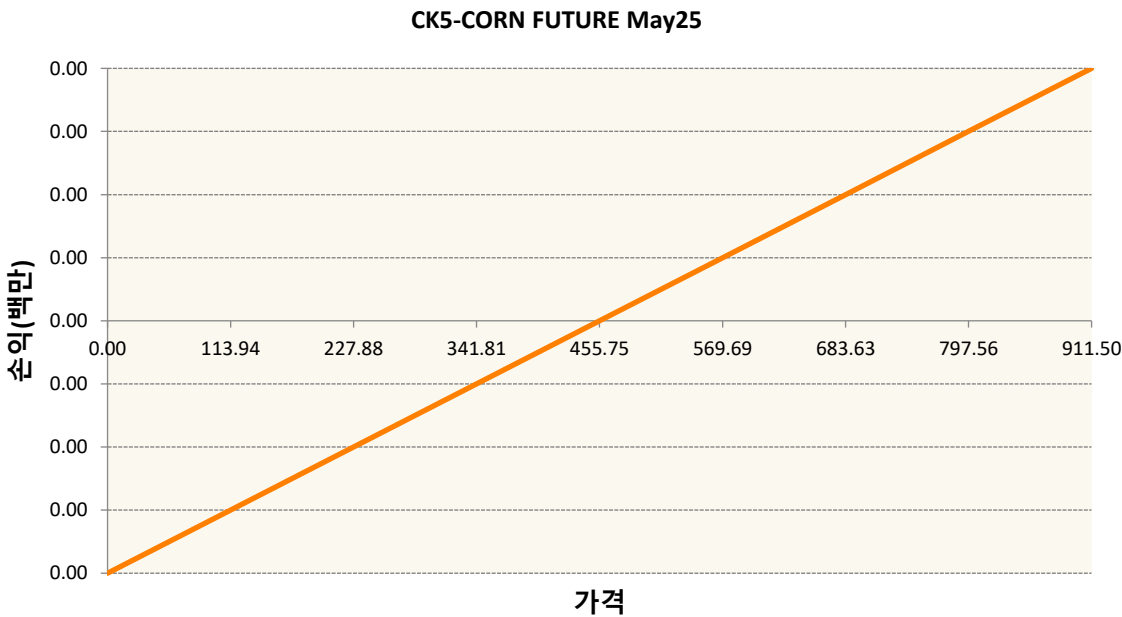
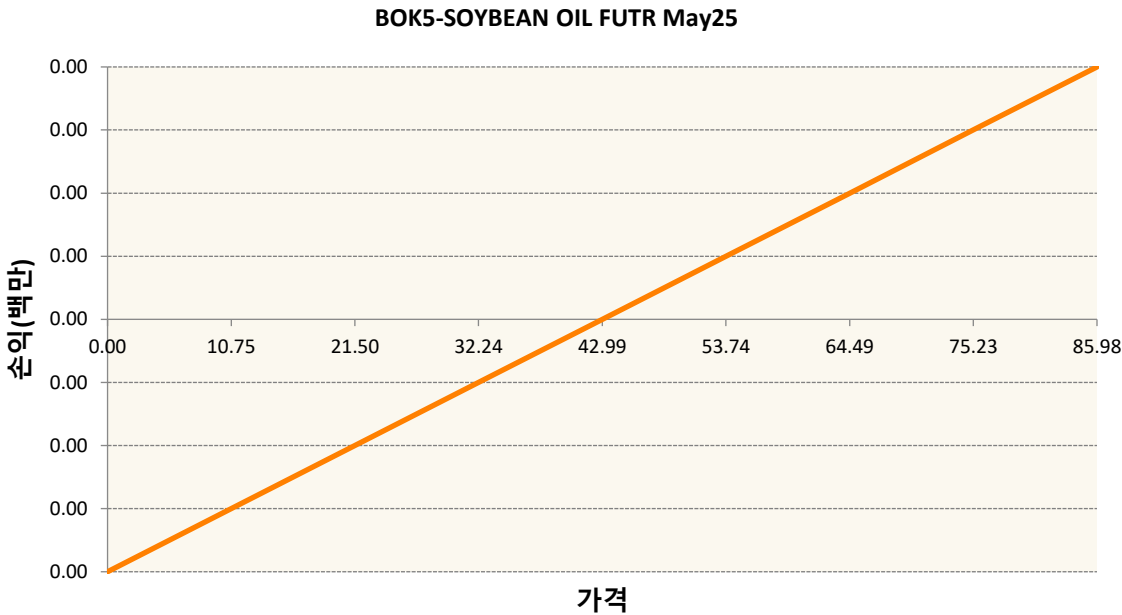
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

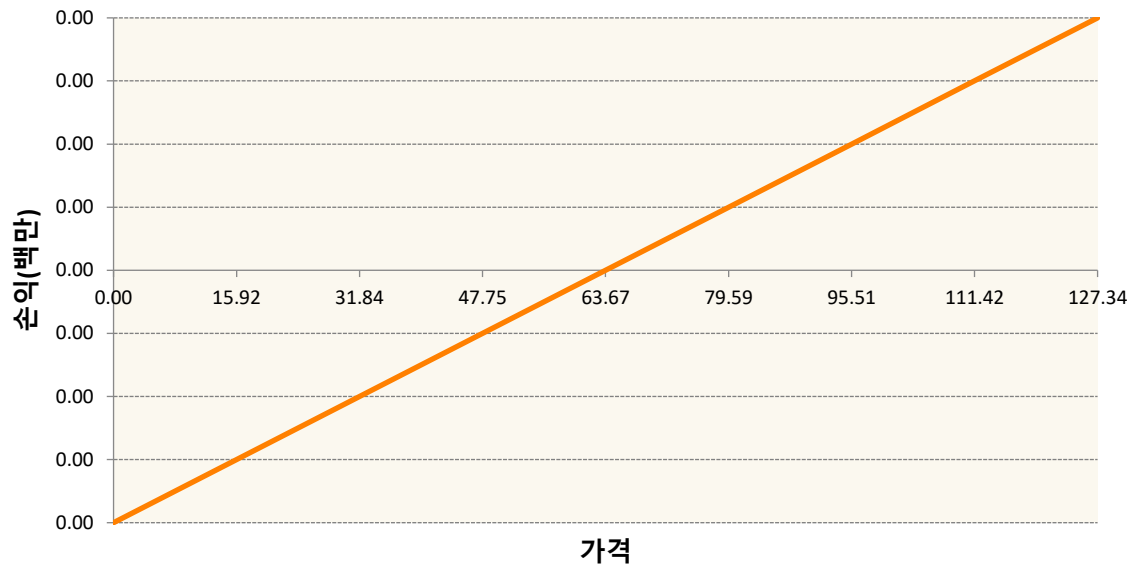
(단위:USD 백만)

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	3,760	0	3,760	
누계	통화	선물	0	375	-375	장내

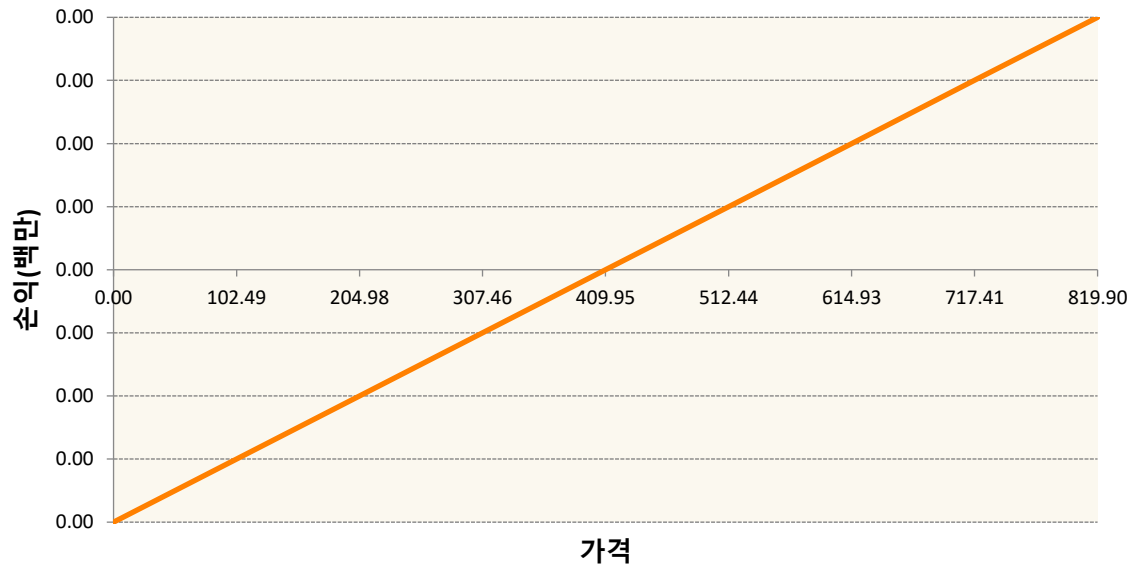
2. 만기시점의 손익구조



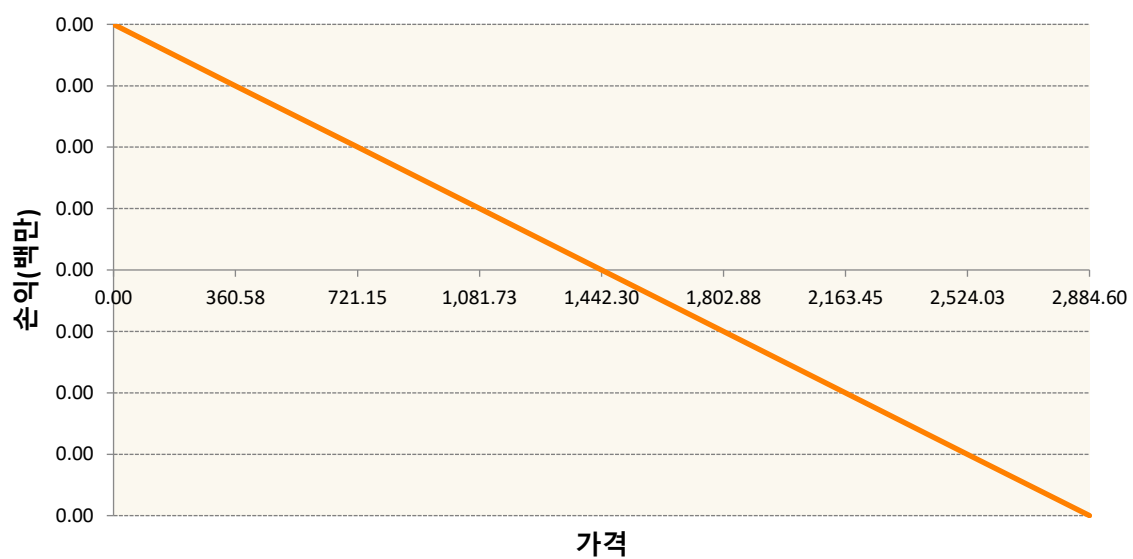
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



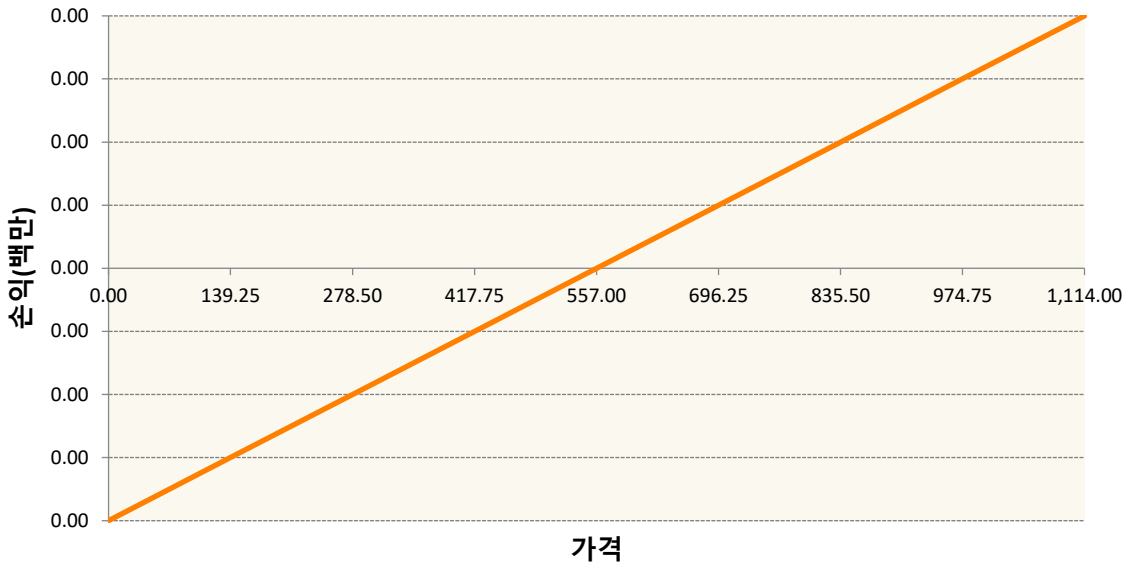
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



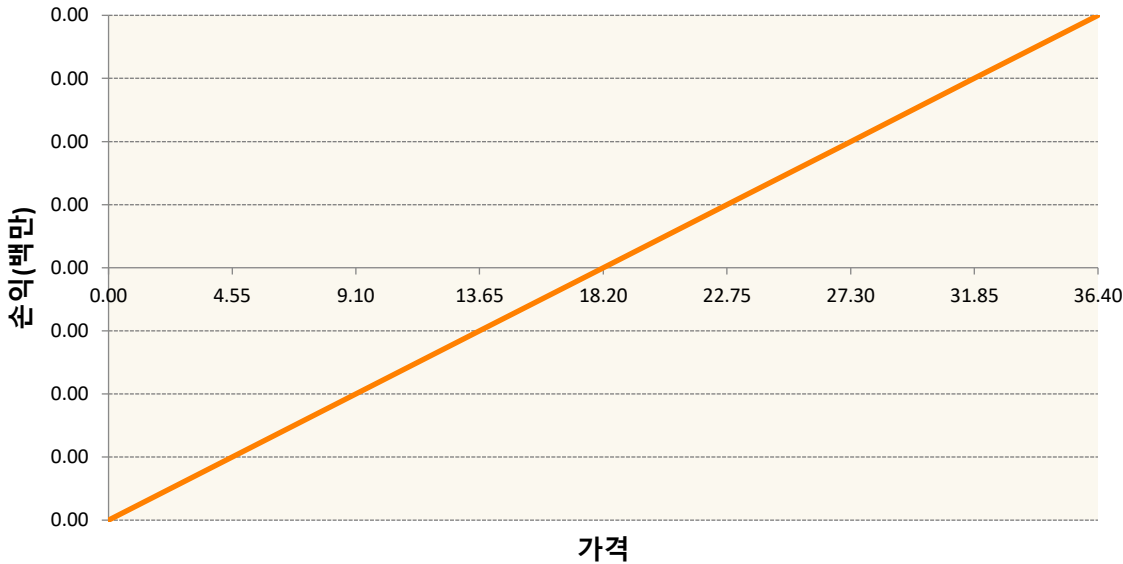
KR4175W30007-2025-03 달러선물



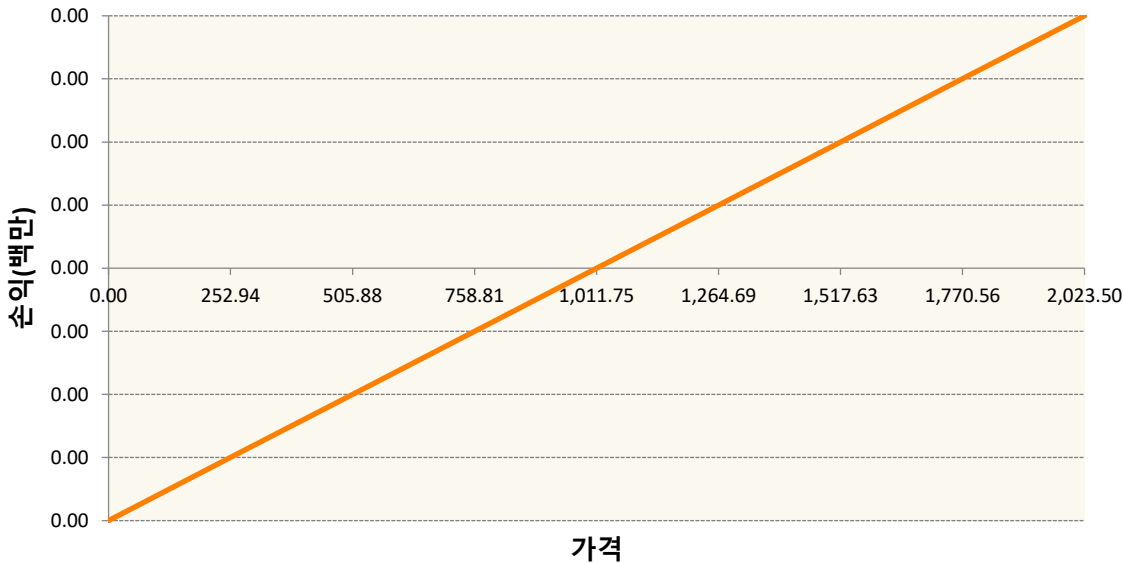
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



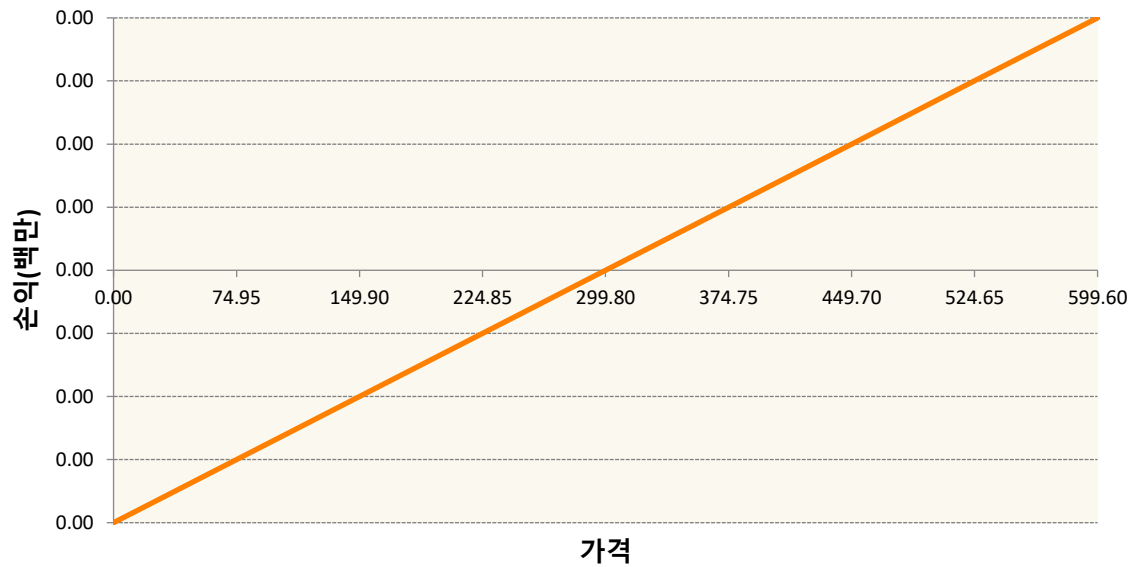
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



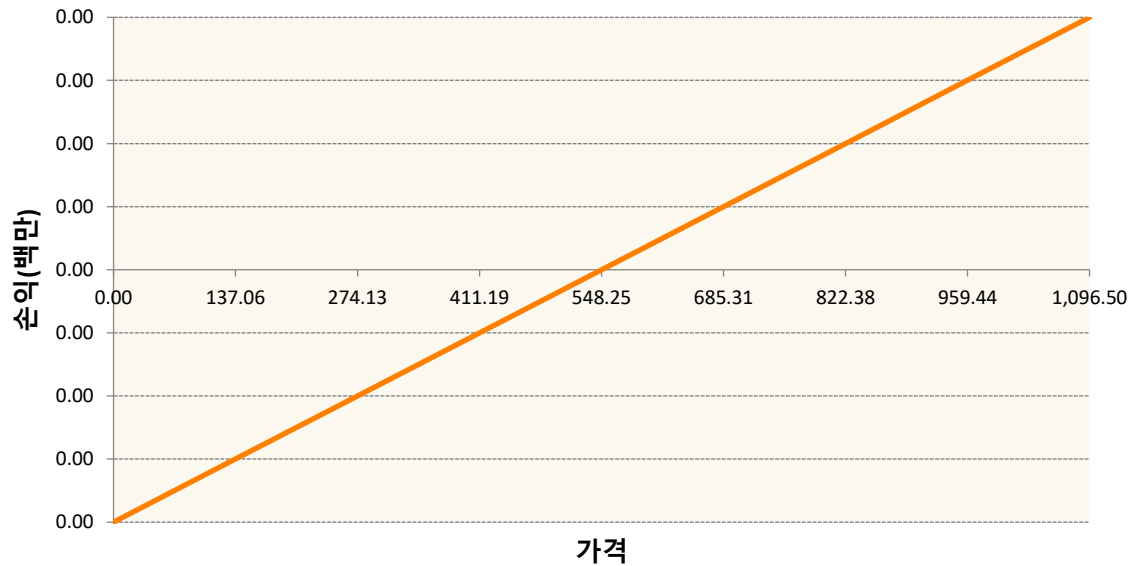
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-03-07
기준일	2025-03-06

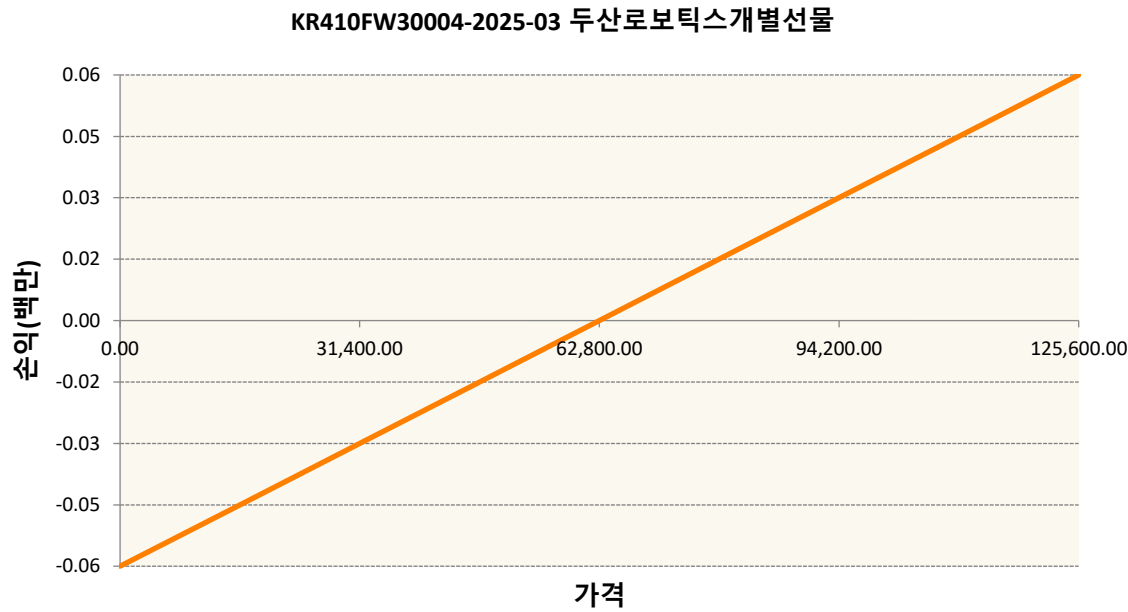
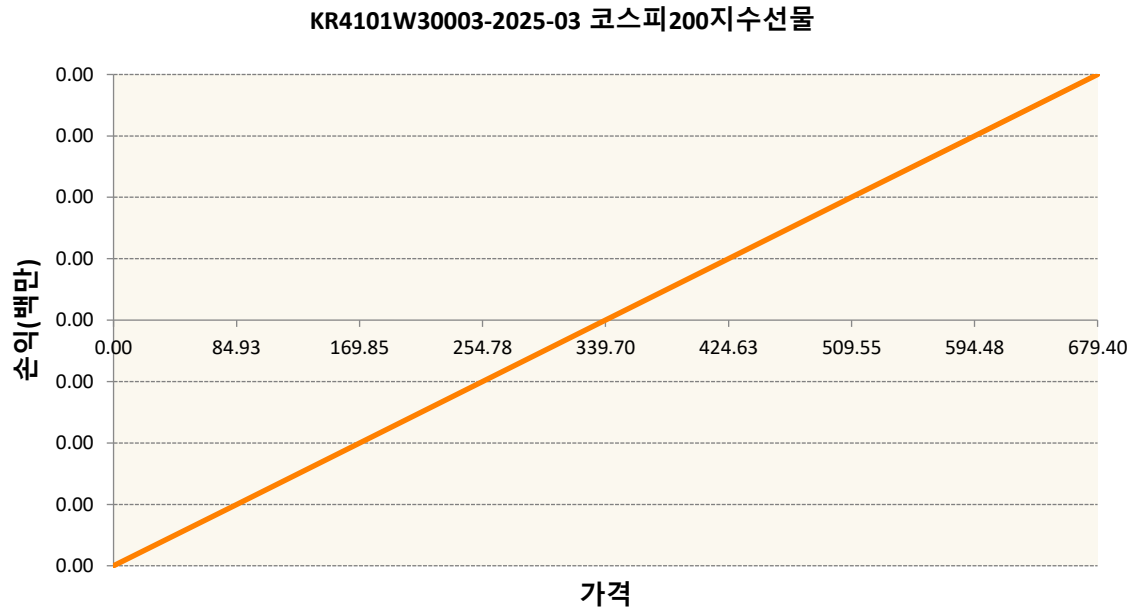
스마트인덱스모

1. 계약금액

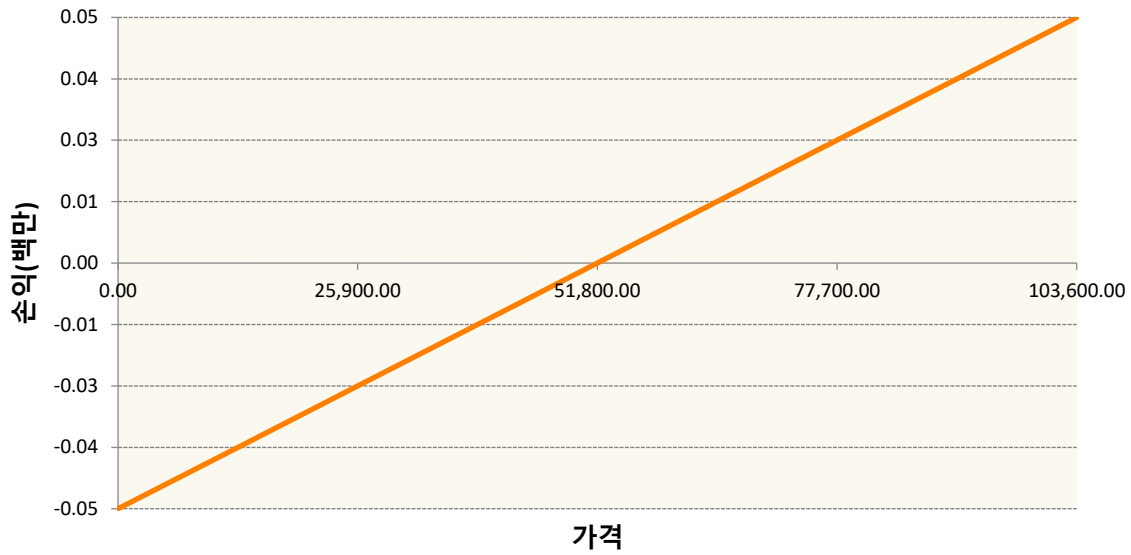
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	18	0	18	장내
누계	유가증권	선물	2,135	0	2,135	장내

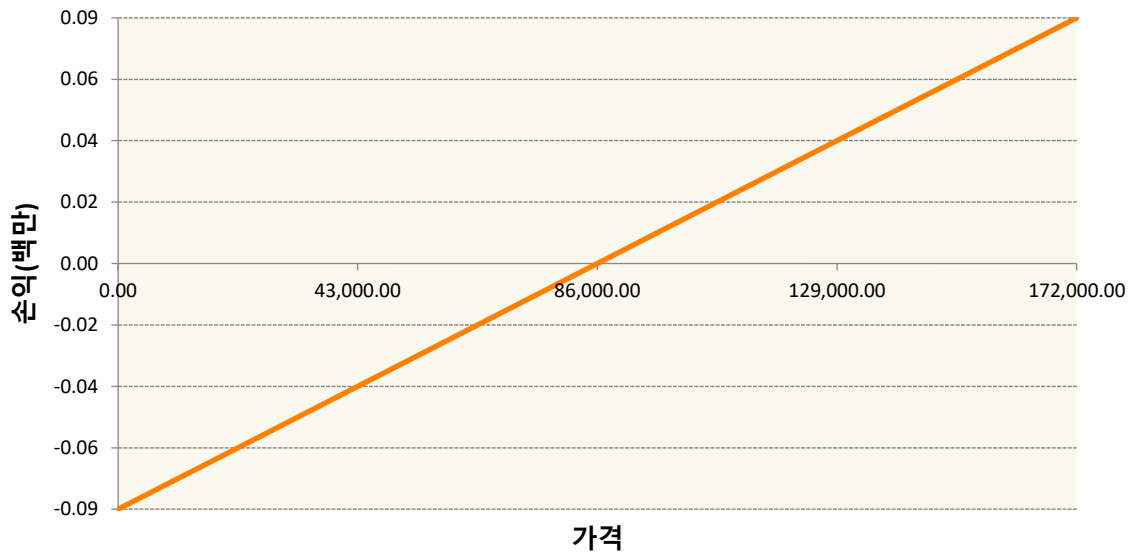
2. 만기시점의 손익구조



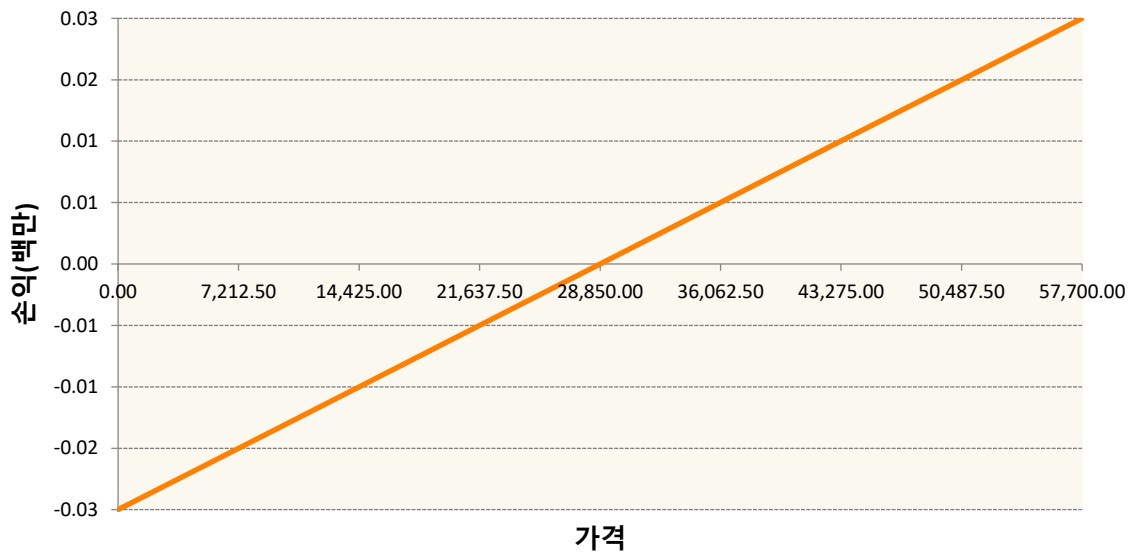
KR410TW30005-2025-03 이수스페셜티케미컬개별선물



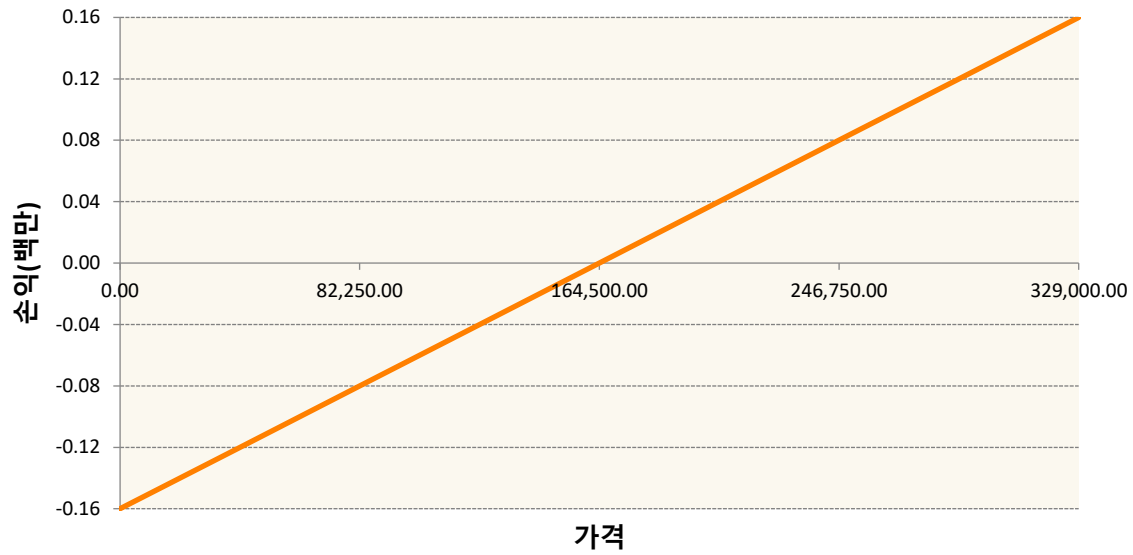
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



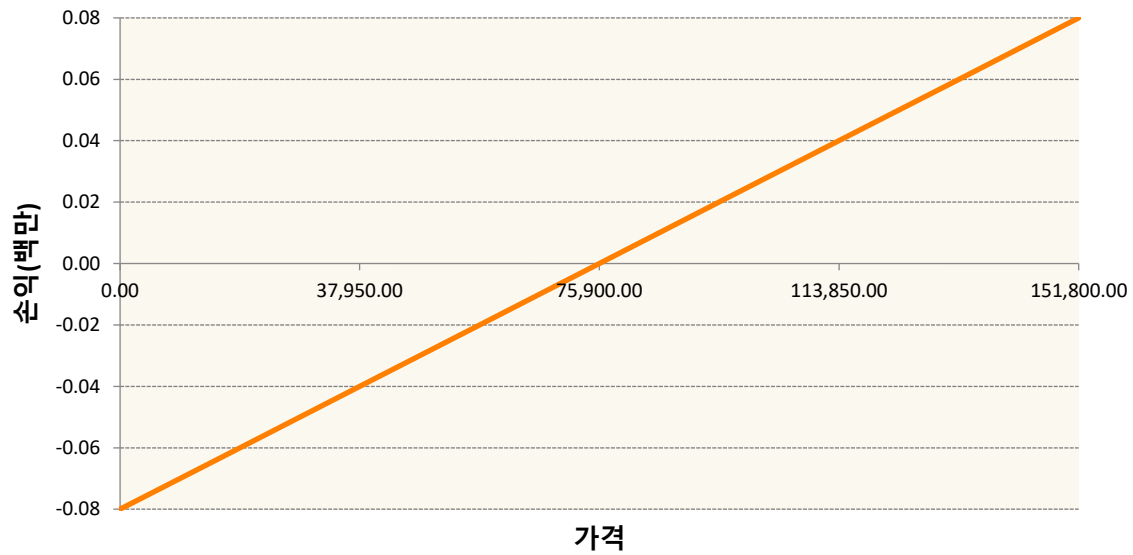
KR4132W30008-2025-03 현대제철개별선물



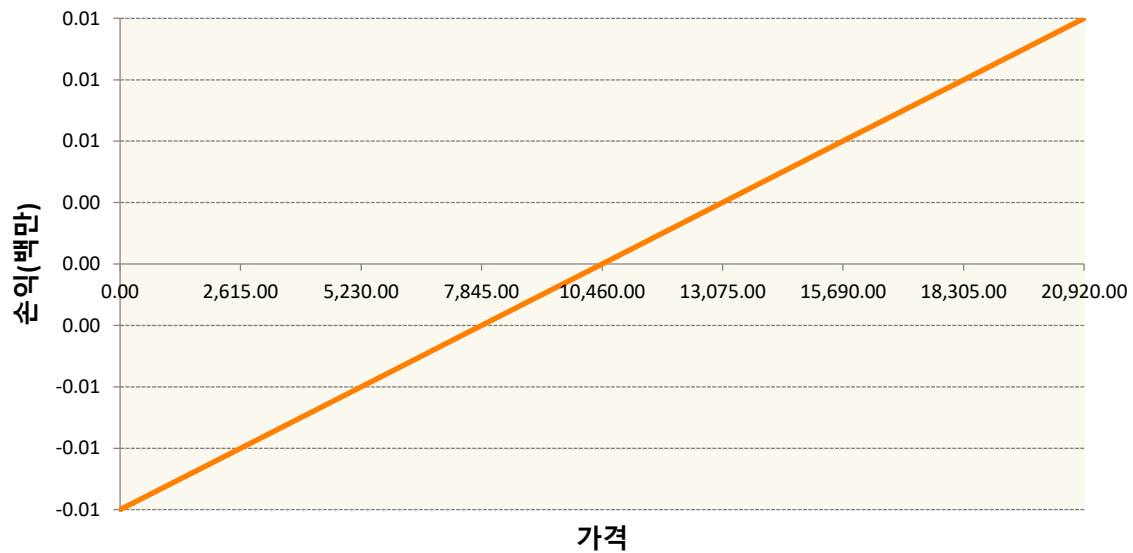
KR41BJW30002-2025-03 엔씨소프트개별선물



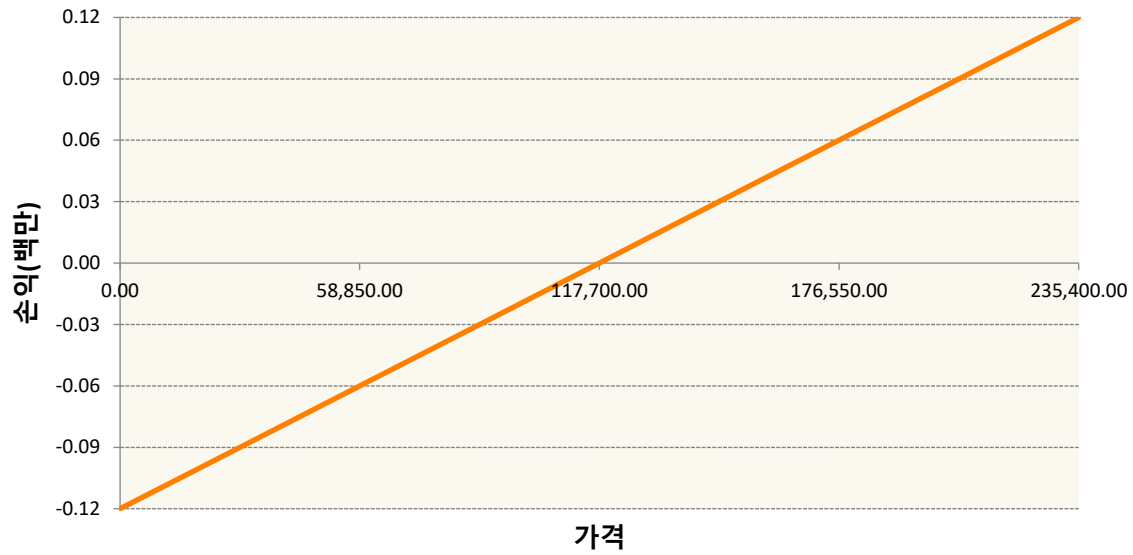
KR41BMW30006-2025-03 한국항공우주개별선물



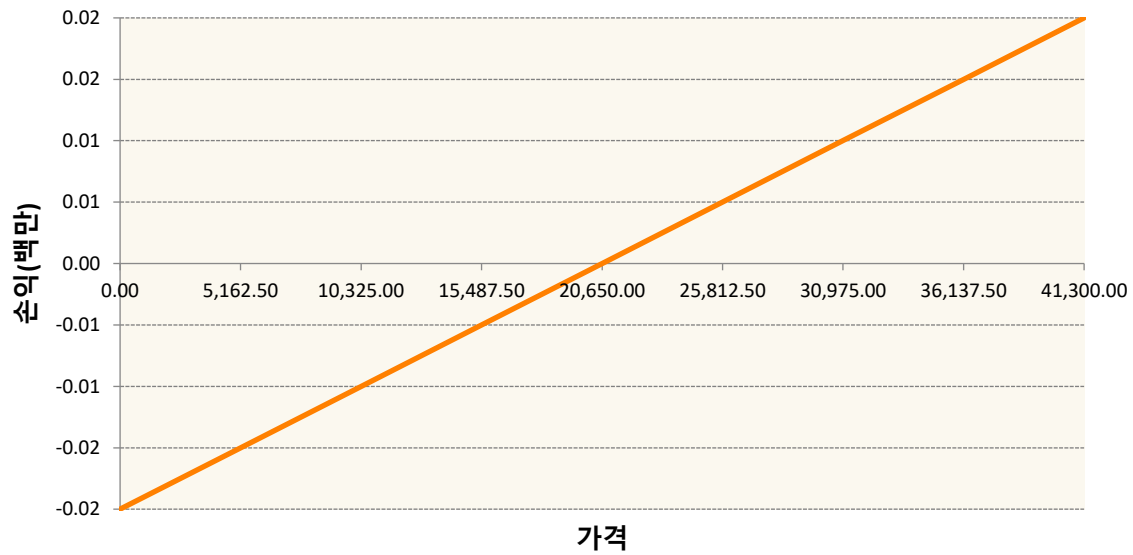
KR41BTW30001-2025-03 BNK금융지주개별선물



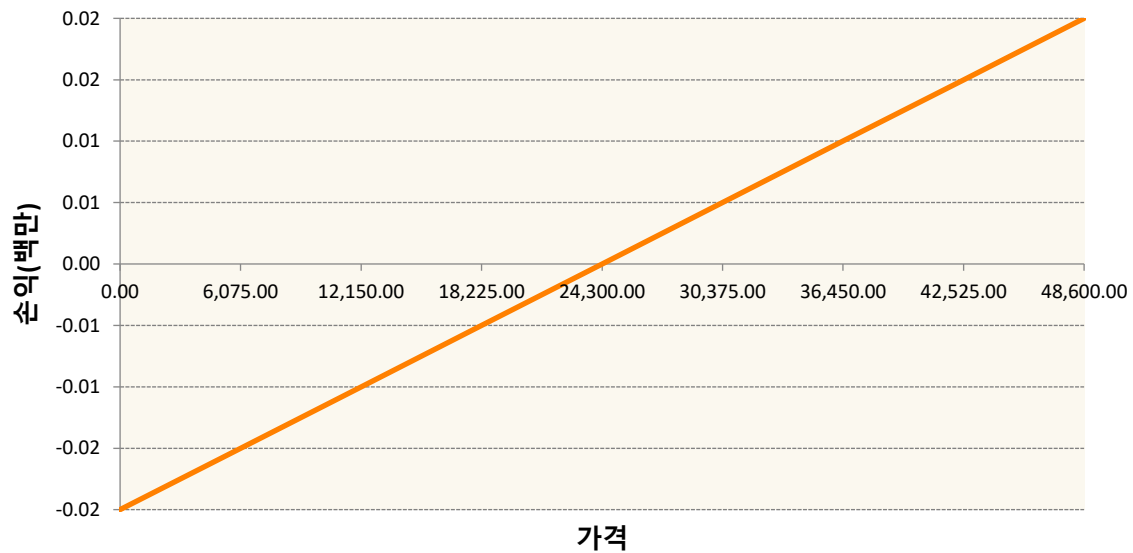
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



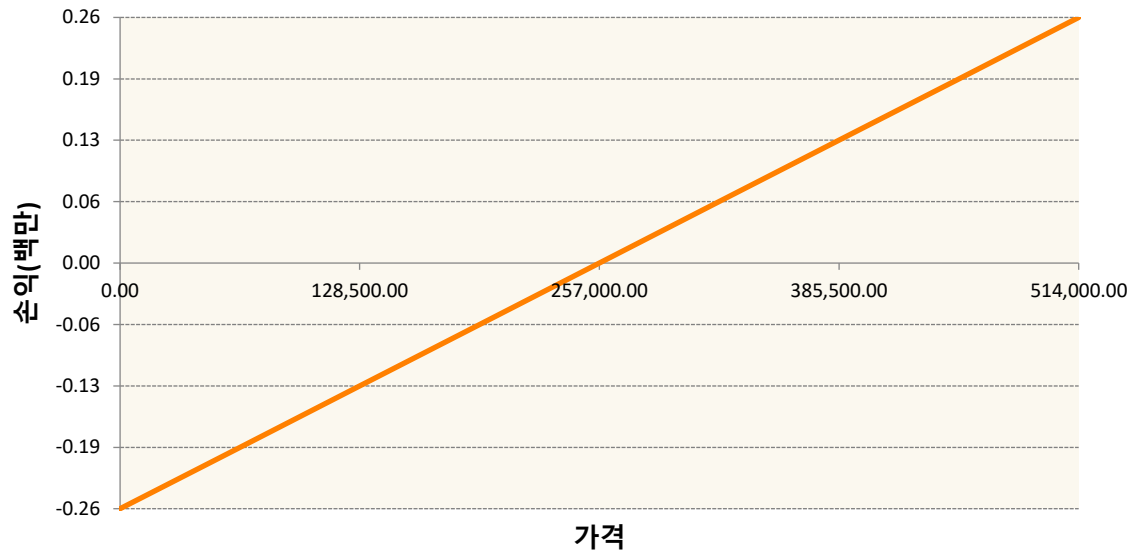
KR41CBW30007-2025-03 한화솔루션개별선물



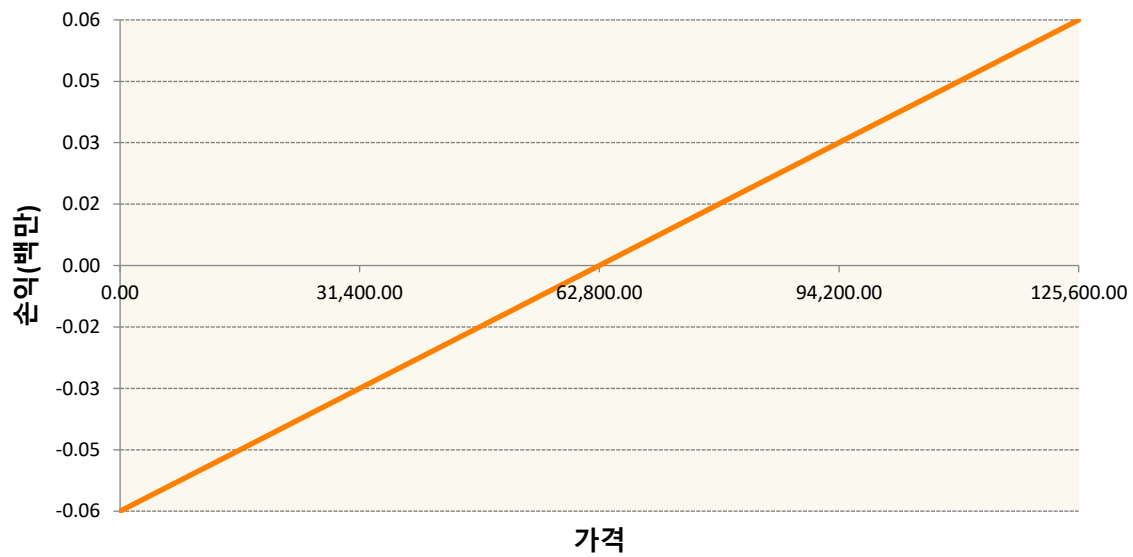
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



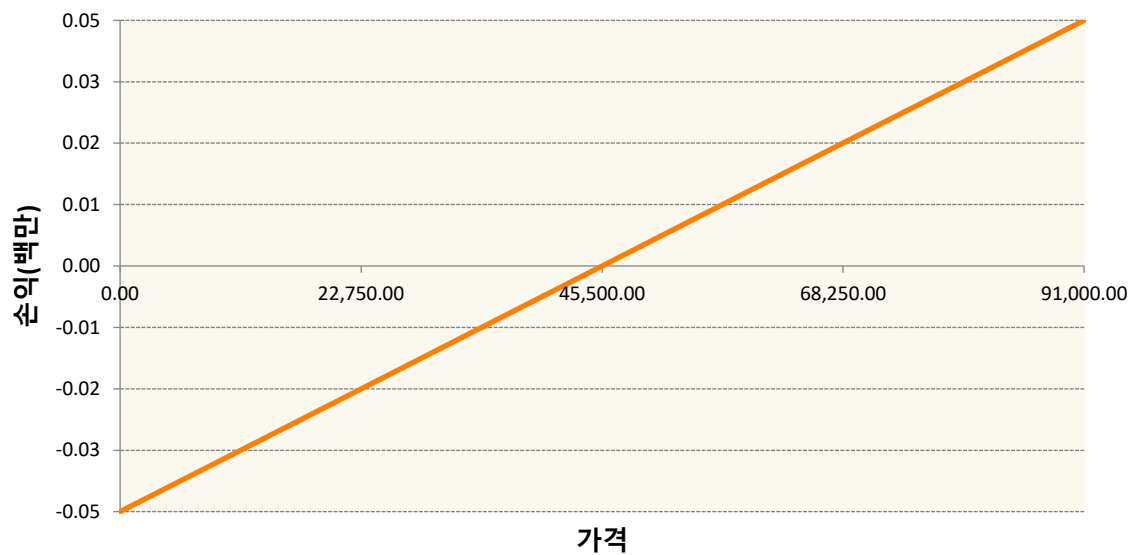
KR41CXW30001-2025-03 한미약품개별선물



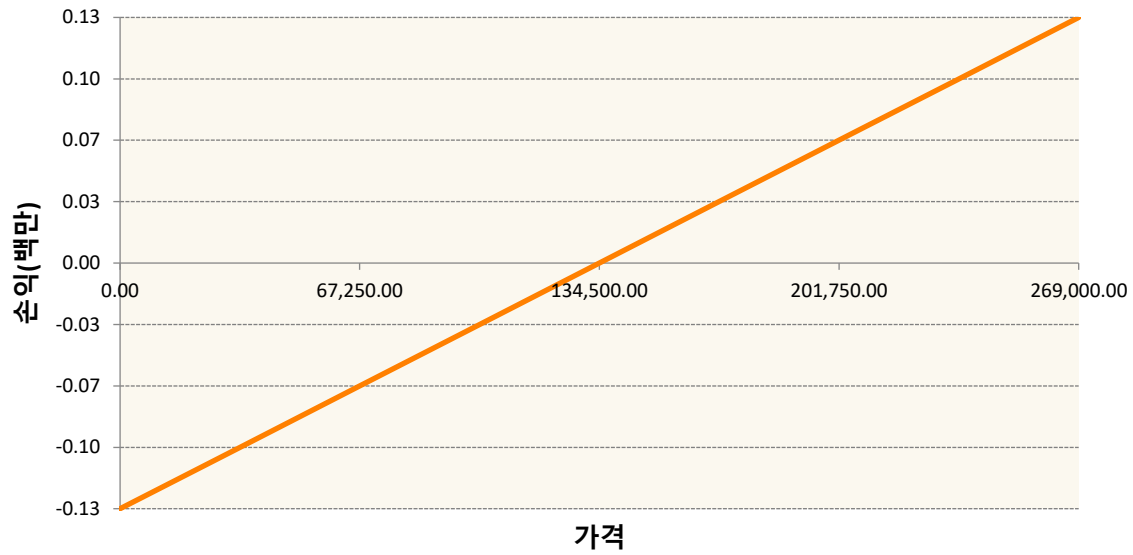
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



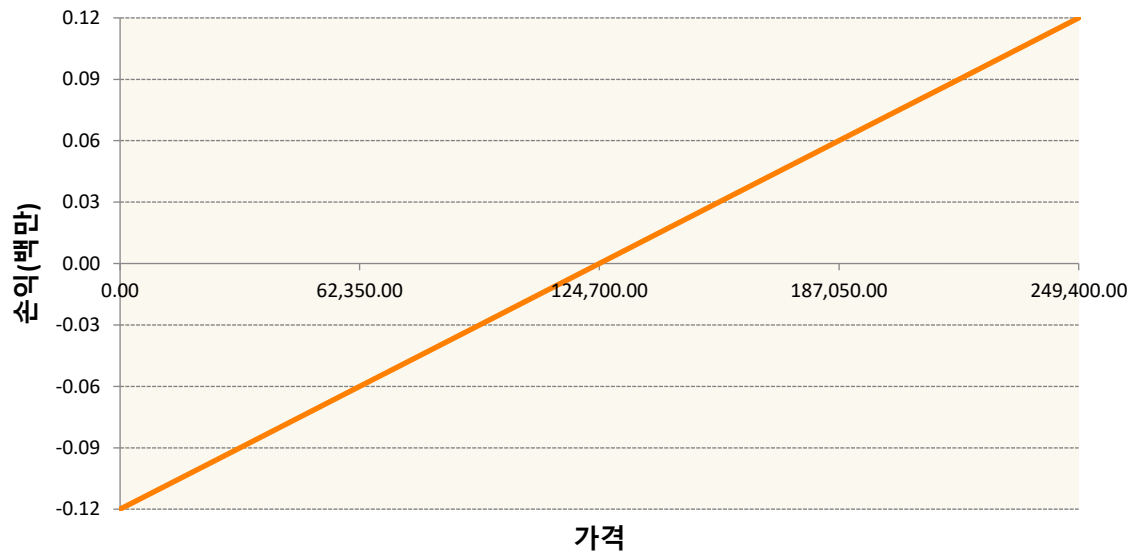
KR41DGW30004-2025-03 영원무역개별선물



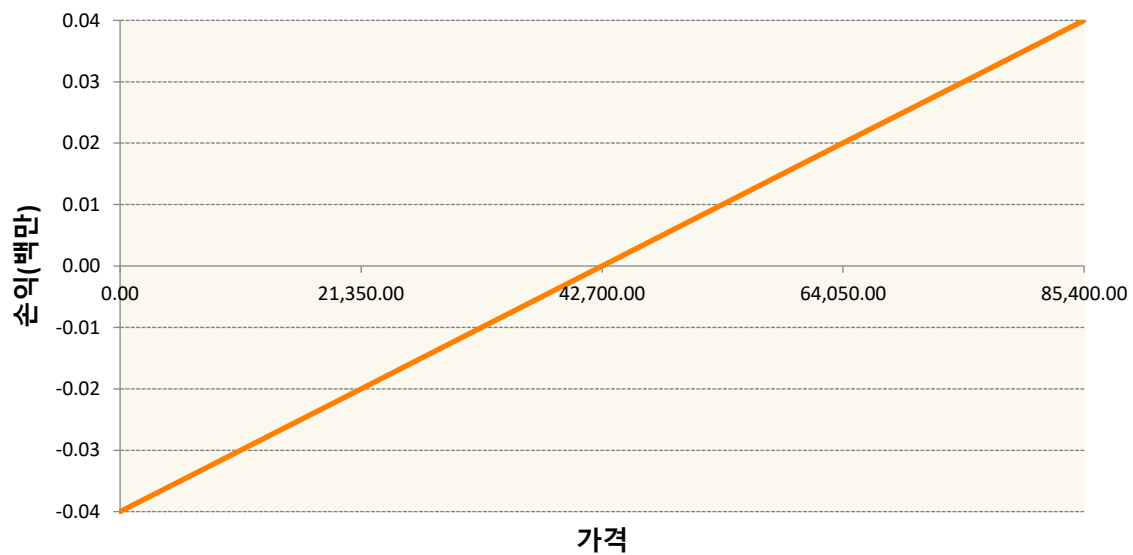
KR41E8W30003-2025-03 포스코퓨처엠개별선물



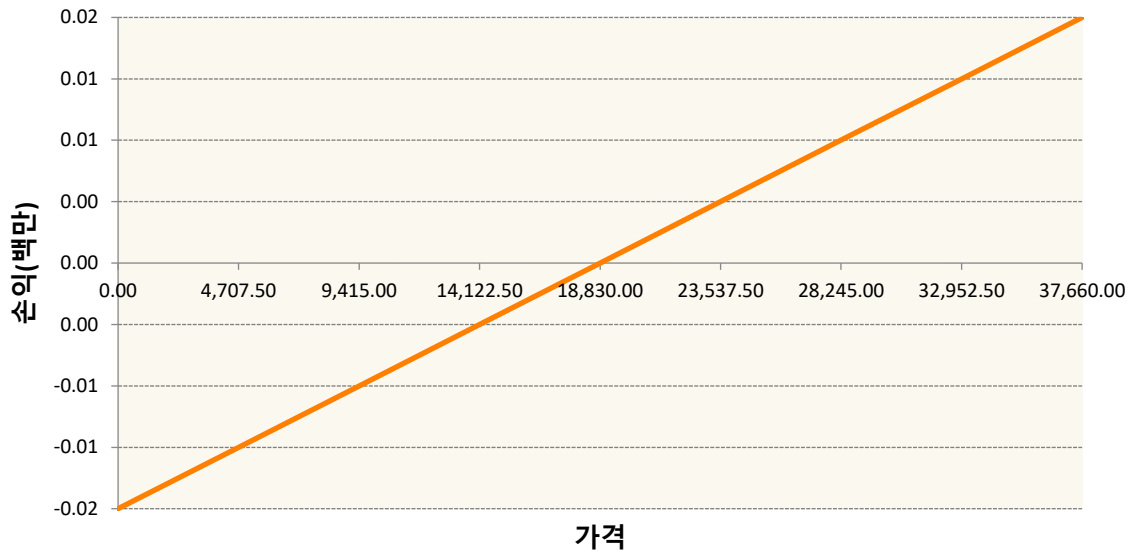
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



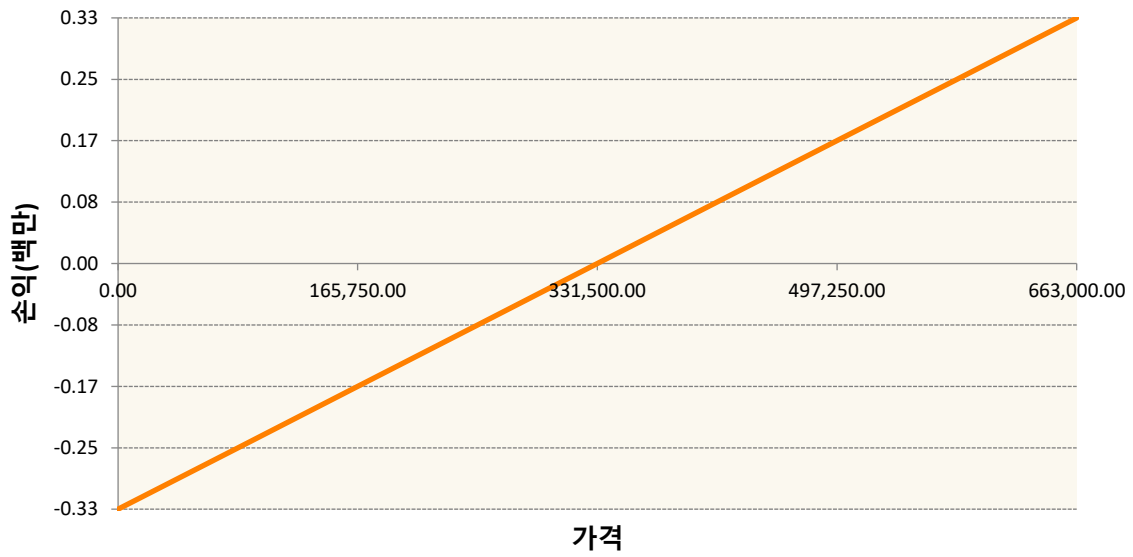
KR41ERW30009-2025-03 DL이앤씨개별선물



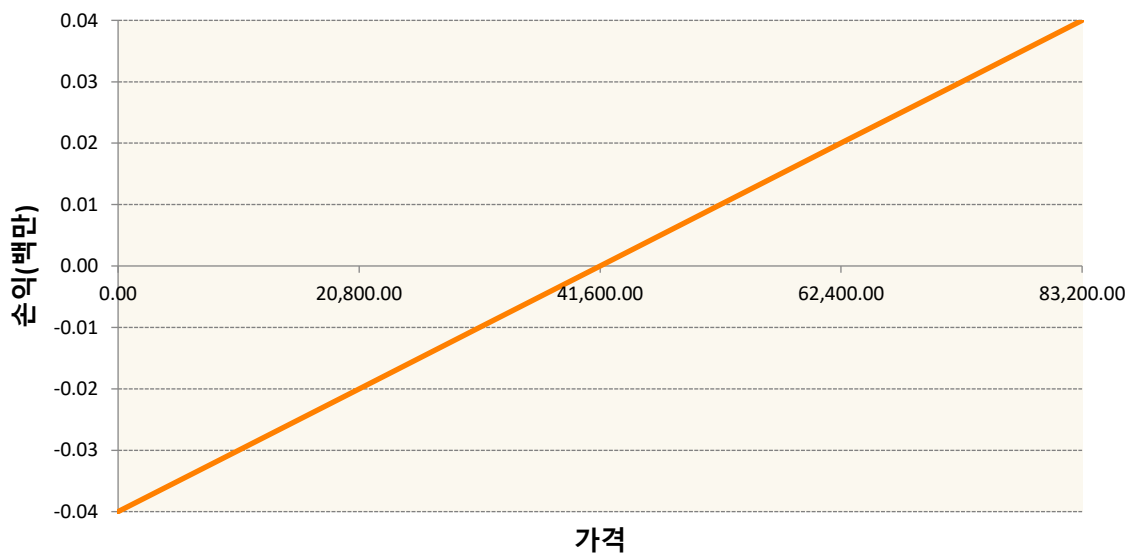
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



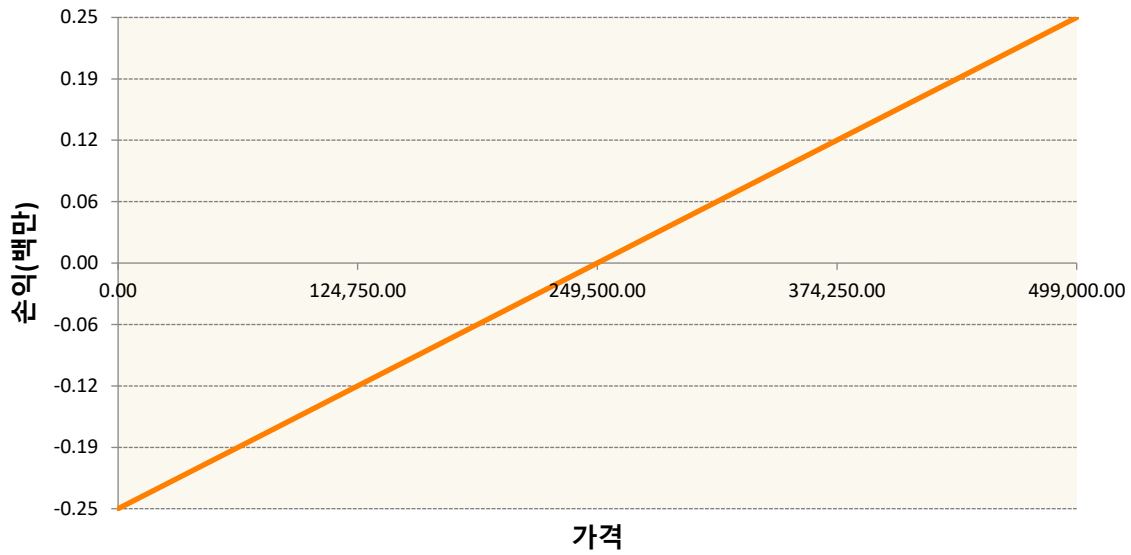
KR41F5W30008-2025-03 LG에너지솔루션개별선물



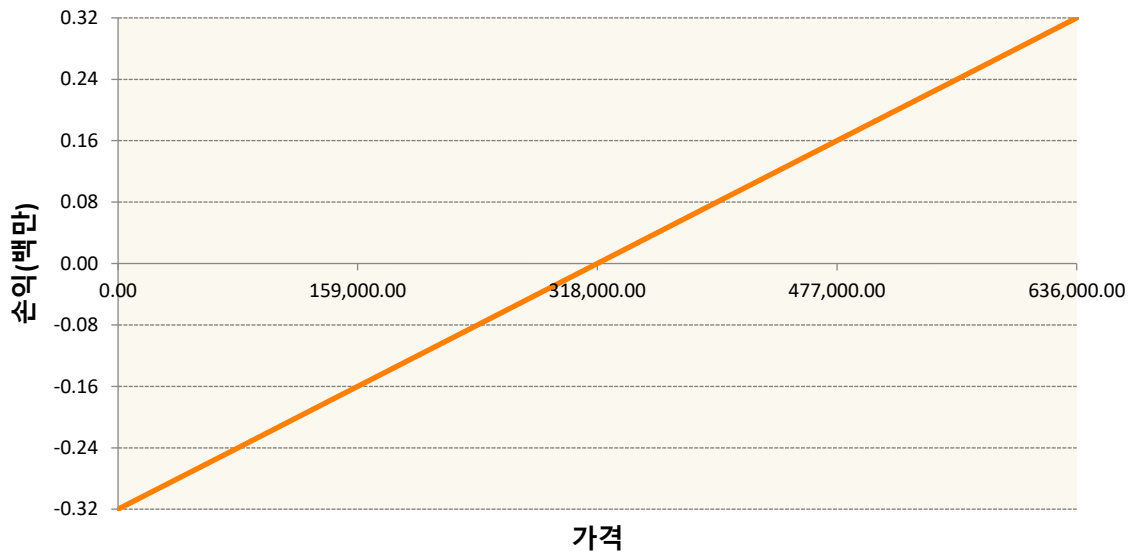
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



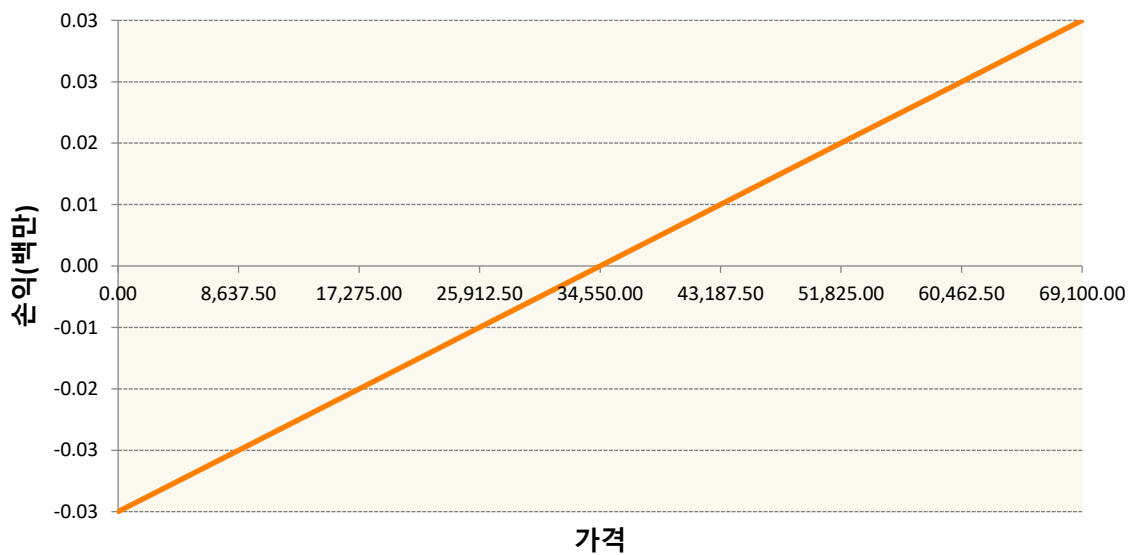
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



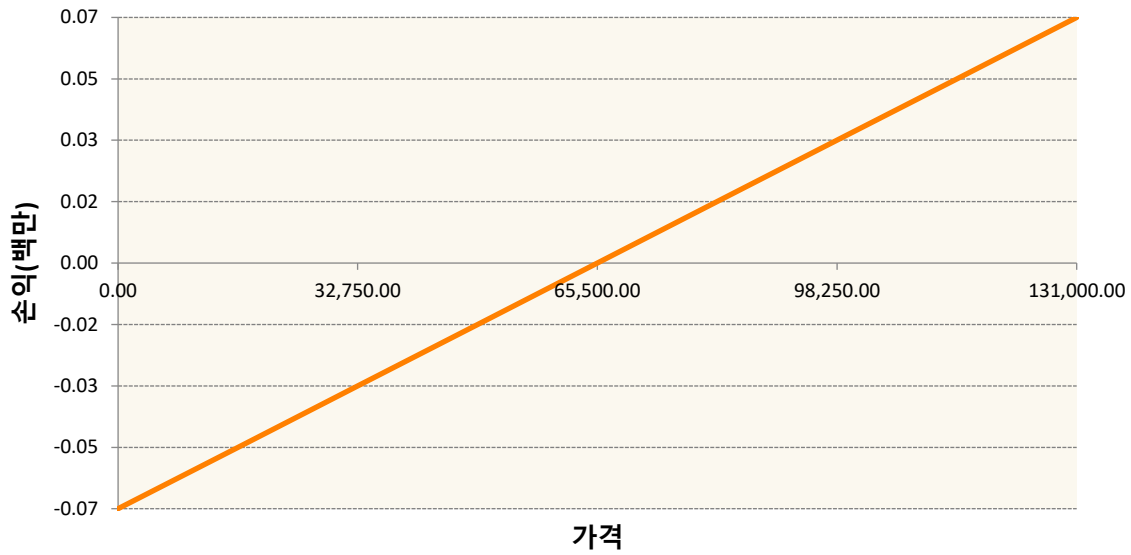
KR41FDW30006-2025-03 HD현대중공업개별선물



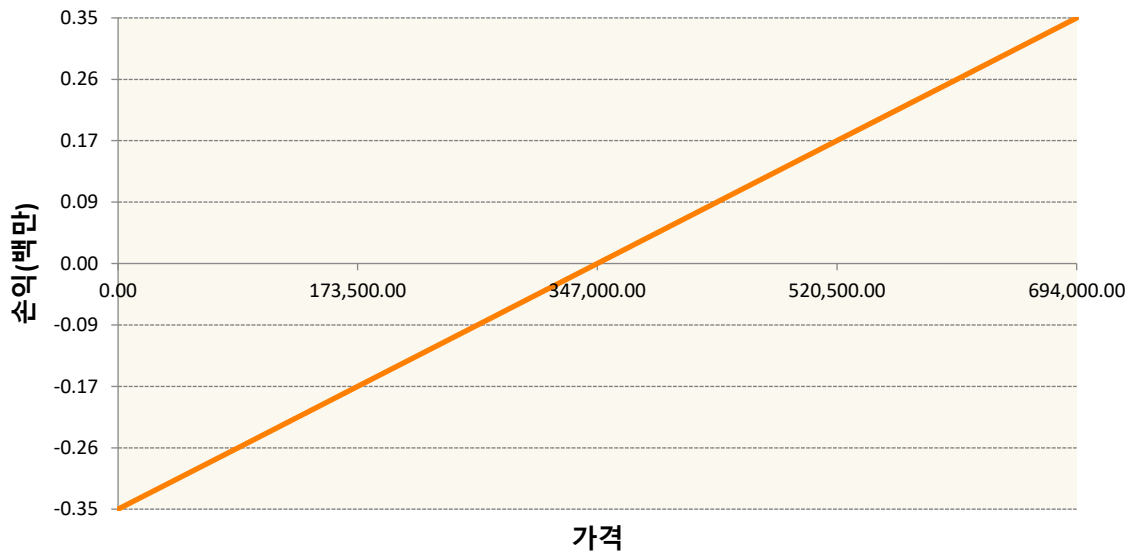
KR41G0W30008-2025-03 씨에스윈드개별선물



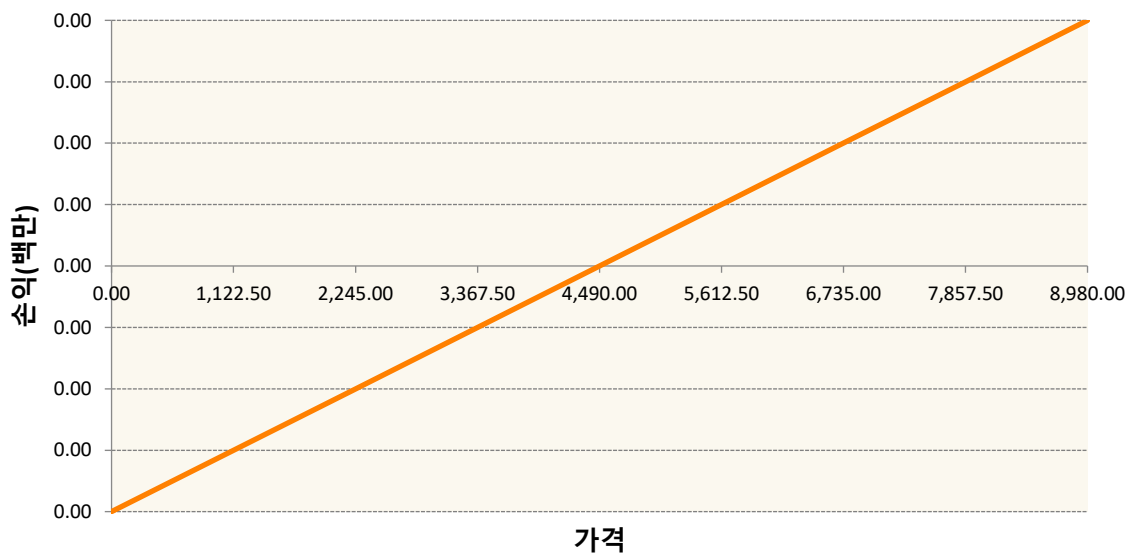
KR41G3W30002-2025-03 한전기술개발선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개발선물



KR41GKW30009-2025-03 KG모빌리티개발선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	82
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	1
KR410TW30(2025-03 이수스페셜티케미컬개별선물	1
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	4
KR4132W30(2025-03 현대제철개별선물	3
KR41BJW30C 2025-03 엔씨소프트개별선물	3
KR41BMW30C 2025-03 한국항공우주개별선물	6
KR41BTW30(2025-03 BNK금융지주개별선물	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	0.25
KR41DGW30 2025-03 영원무역개별선물	1
KR41E8W30(2025-03 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	3
KR41ERW30(2025-03 DL이앤씨개별선물	2
KR41ETW30(2025-03 삼성엔지니어링개별선물	4
KR41F5W30(2025-03 LG에너지솔루션개별선물	14
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	1
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	6
KR41FDW30(2025-03 HD현대중공업개별선물	8
KR41G0W30 2025-03 씨에스윈드개별선물	1
KR41G3W30 2025-03 한전기술개별선물	1
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	9
KR41GKW30 2025-03 KG모빌리티개별선물	0.47

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

327

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

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	305
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

476

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

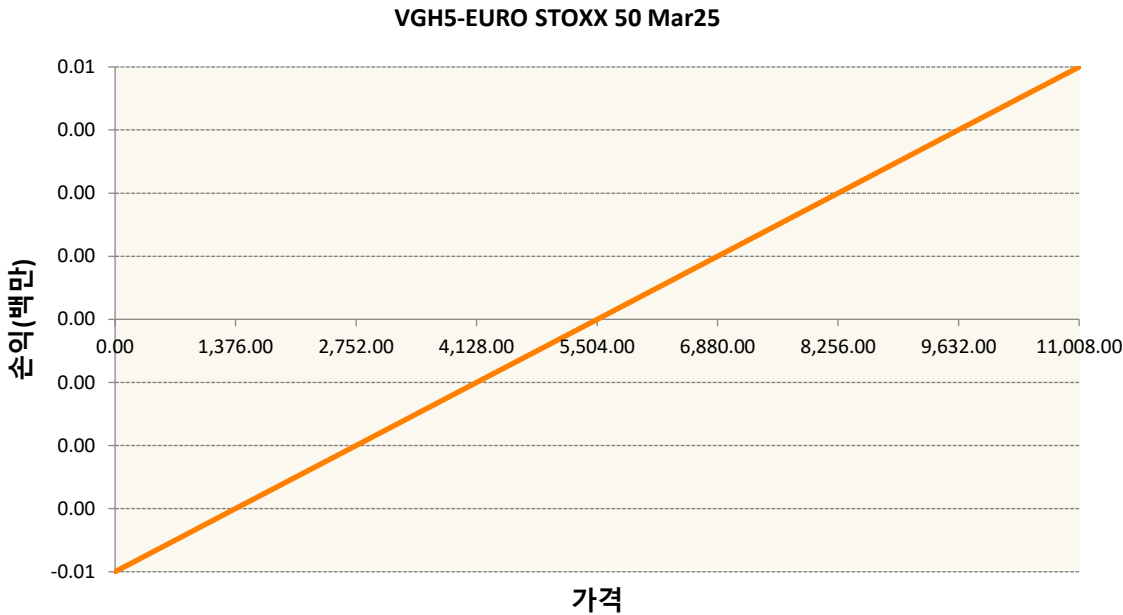
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	999	0	999	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

55

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

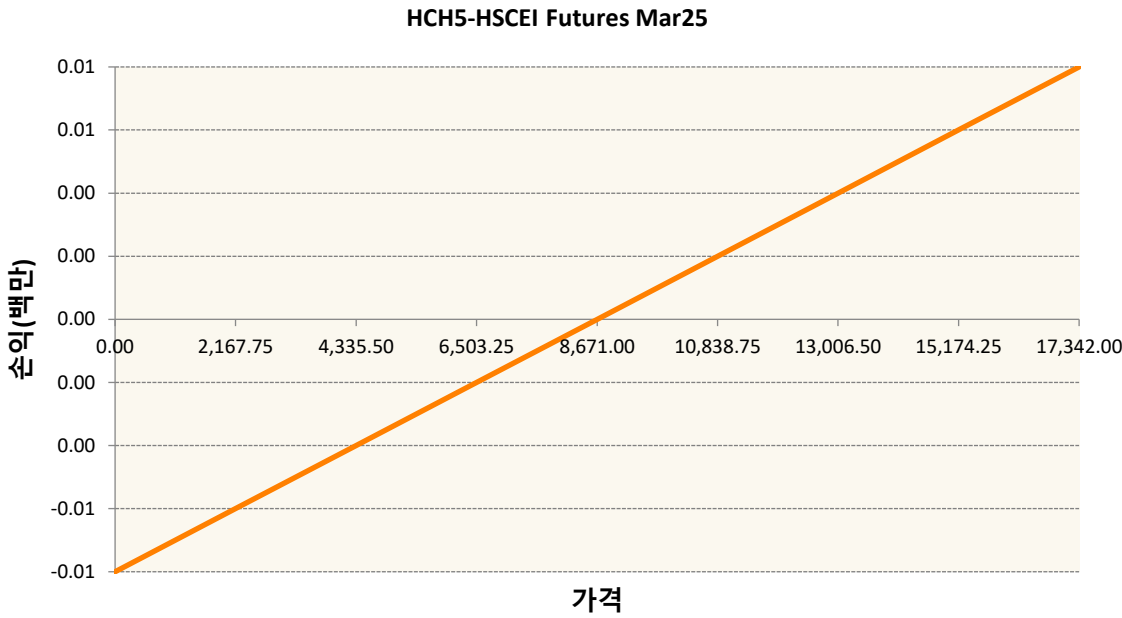
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,922	0	1,922	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH5	HSCEI Futures Mar25	154
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

210

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

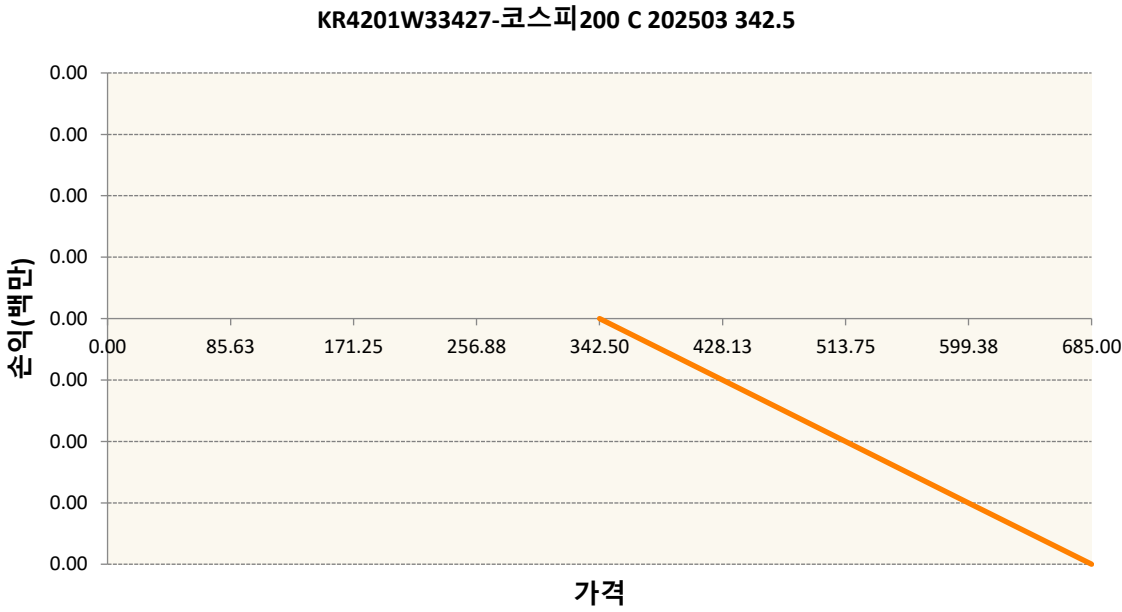
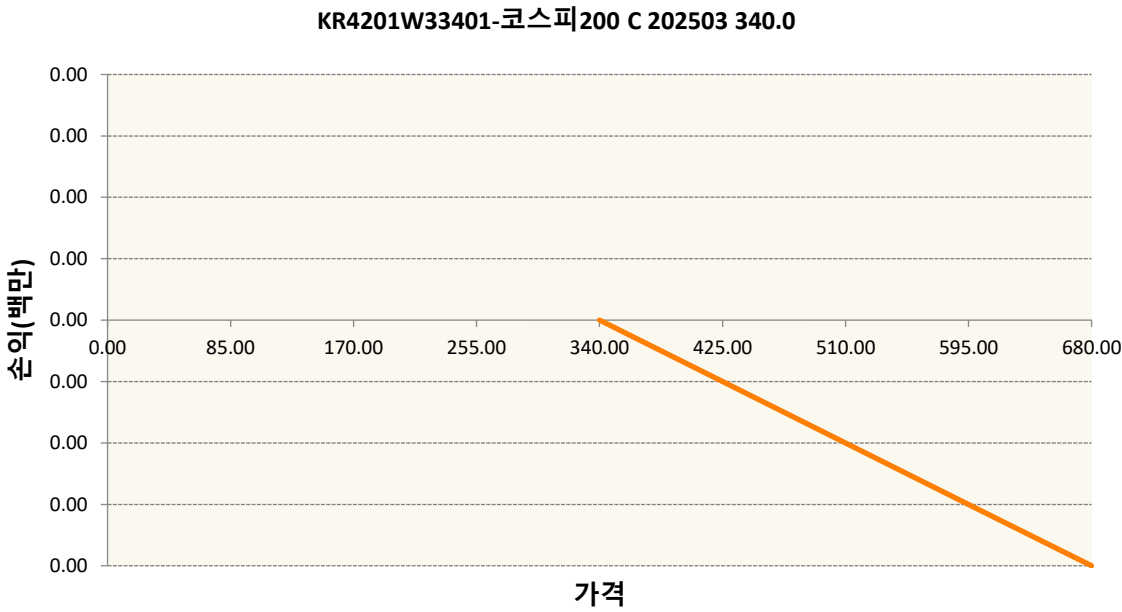
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

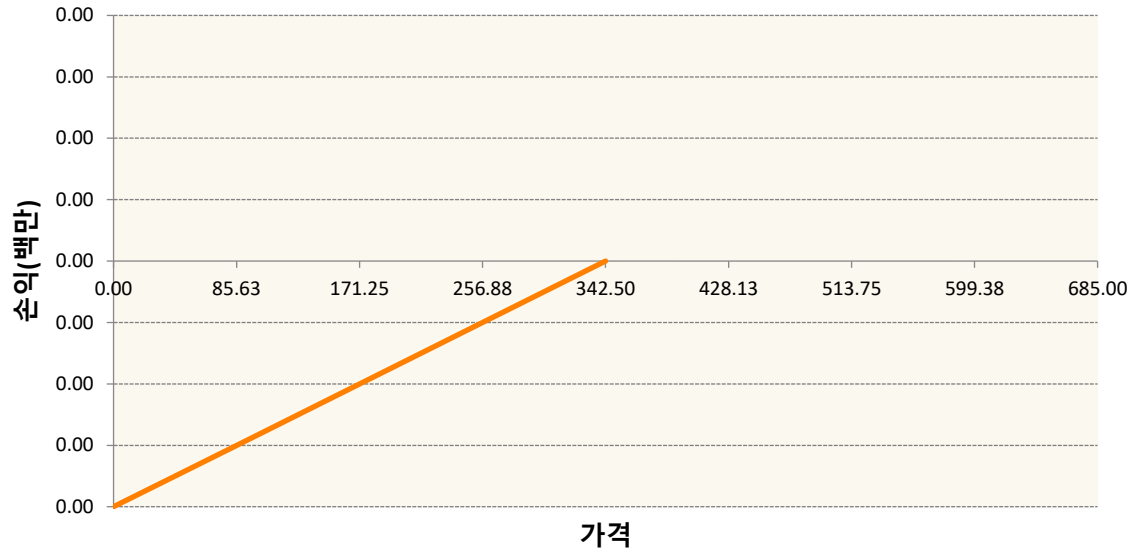
(단위:백만원)

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							1,426
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	293	292	292	291	290	288	285
-5.33%	290	287	282	277	270	262	252
-2.67%	252	238	222	205	188	169	150
0%	71	47	24	0	-24	-47	-71
2.67%	-328	-342	-358	-374	-392	-410	-429
5.33%	-856	-859	-864	-870	-878	-887	-897
8.00%	-1,415	-1,415	-1,416	-1,417	-1,419	-1,422	-1,426
KR4201W33427 코스피200 C 202503 342.5							598
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	98	98	98	98	97	97	96
-5.33%	98	97	96	94	92	89	86
-2.67%	88	83	78	72	65	58	51
0%	31	21	10	0	-10	-21	-31
2.67%	-121	-129	-137	-146	-155	-164	-174
5.33%	-344	-347	-350	-354	-359	-364	-370
8.00%	-591	-591	-592	-593	-594	-596	-598
KR4301W33425 코스피200 P 202503 342.5							460
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-460	-460	-460	-460	-460	-460	-460
-5.33%	-288	-288	-288	-289	-290	-291	-292
-2.67%	-119	-121	-124	-127	-131	-134	-138
0%	18	12	6	0	-6	-12	-19

2.67%	84	80	75	70	65	59	54
5.33%	97	96	95	93	91	89	86
8.00%	98	98	98	98	97	97	96

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

(단위:백만원)

2,827

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	674	0	674	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

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	4,454	0	4,454	

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	2025-03-07
기준일	2025-03-06

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	285	-285	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	12,877	0	12,877	
누계	통화	선도	0	12,837	-12,837	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213ECT(KRW/USD 31-03-25E		257
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E		210
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E		213
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E		346
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	441

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

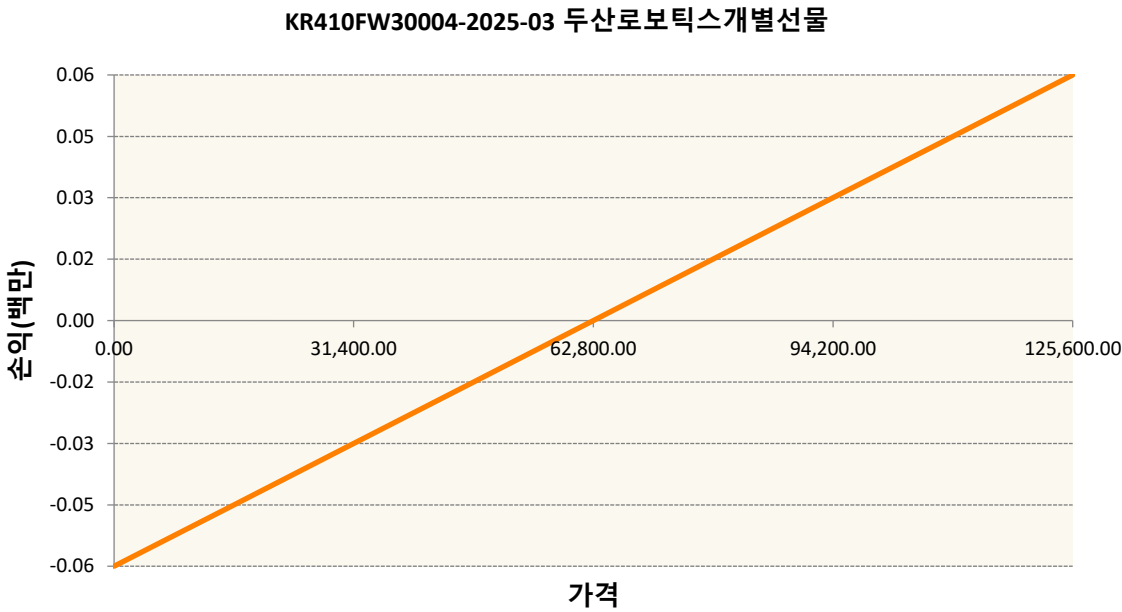
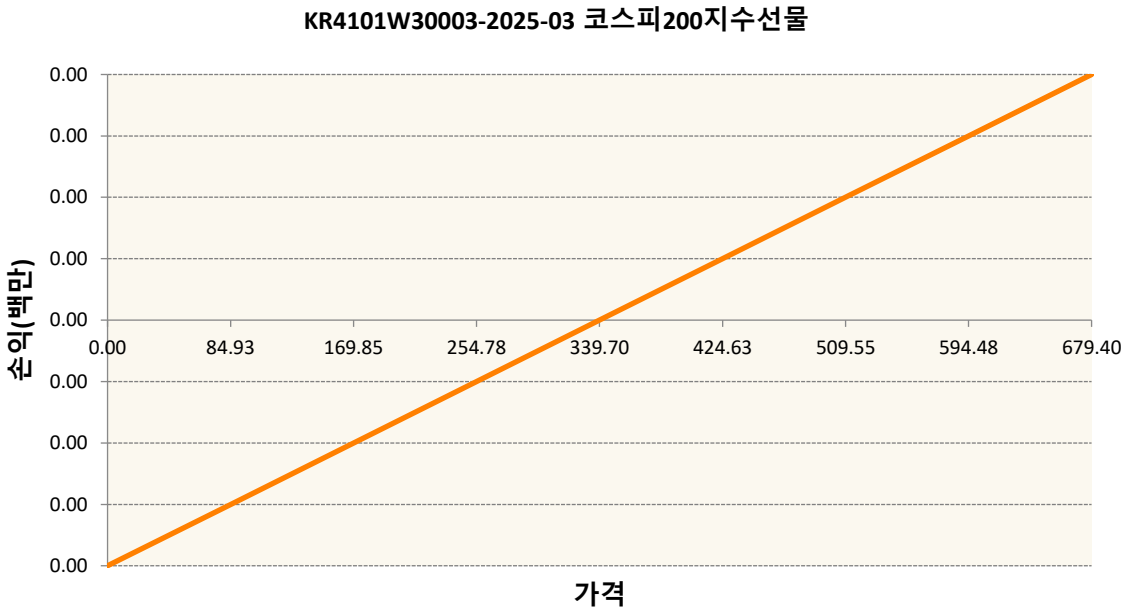
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

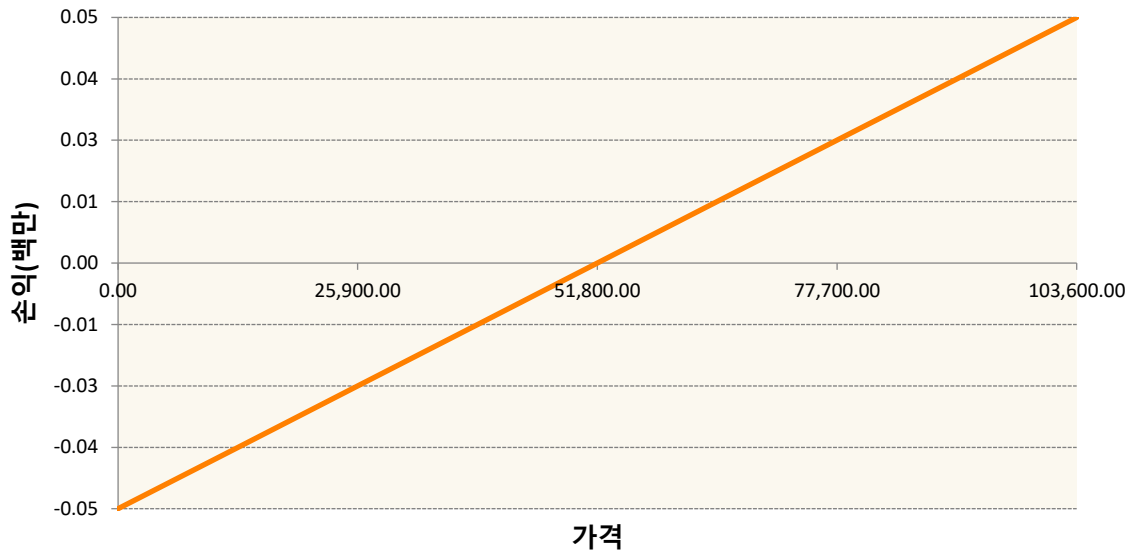
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7	0	7	장내
누계	유가증권	선물	1,472	0	1,472	장내

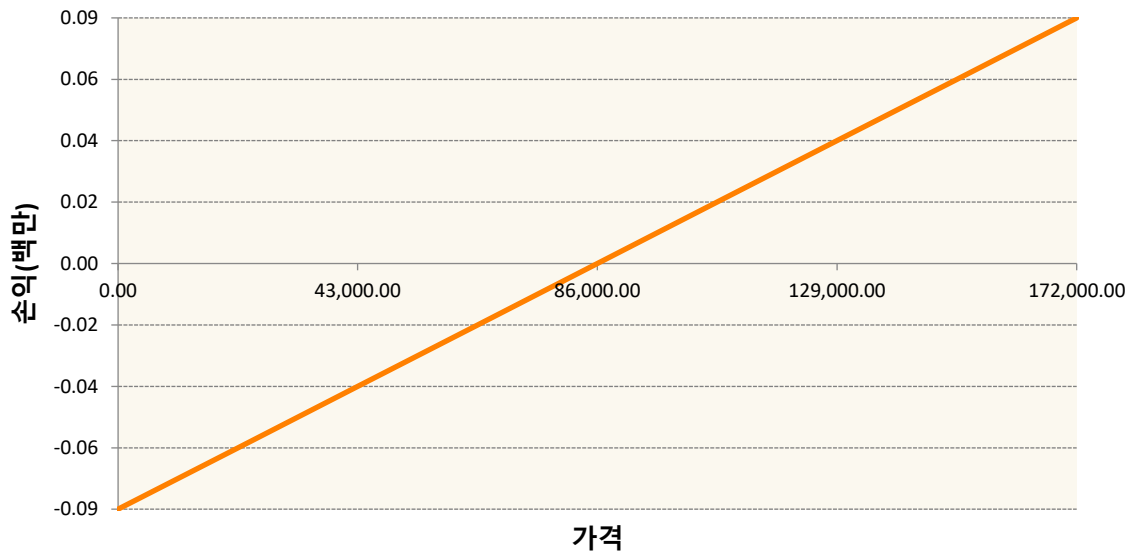
2. 만기시점의 손익구조



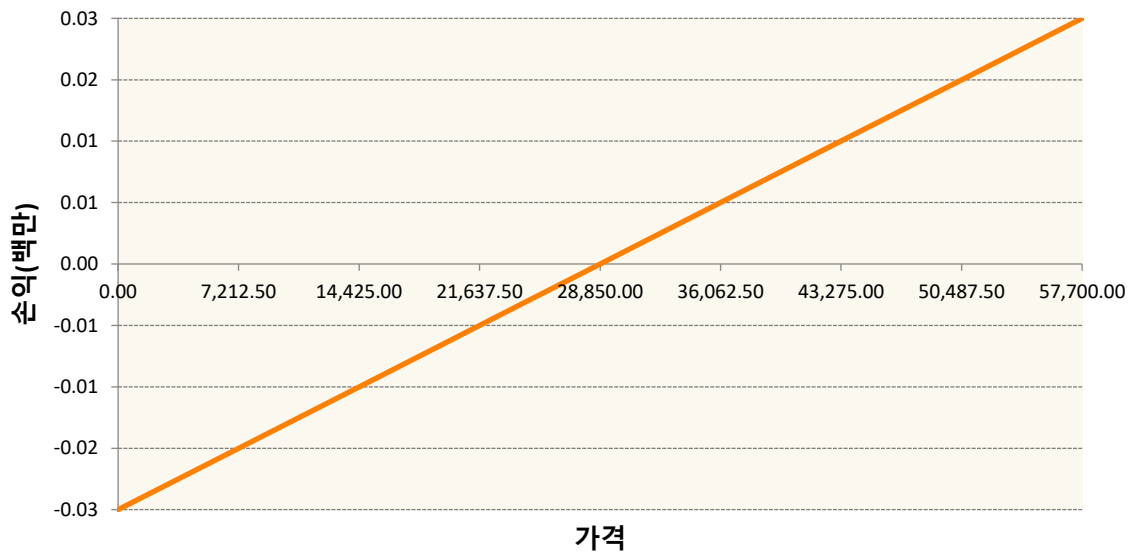
KR410TW30005-2025-03 이수스페셜티케미컬개별선물



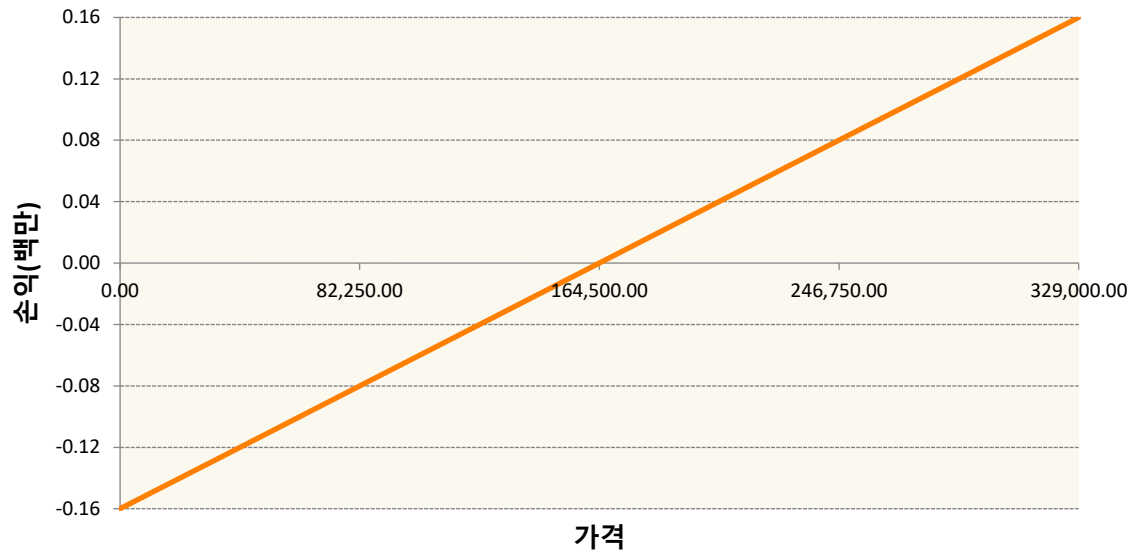
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



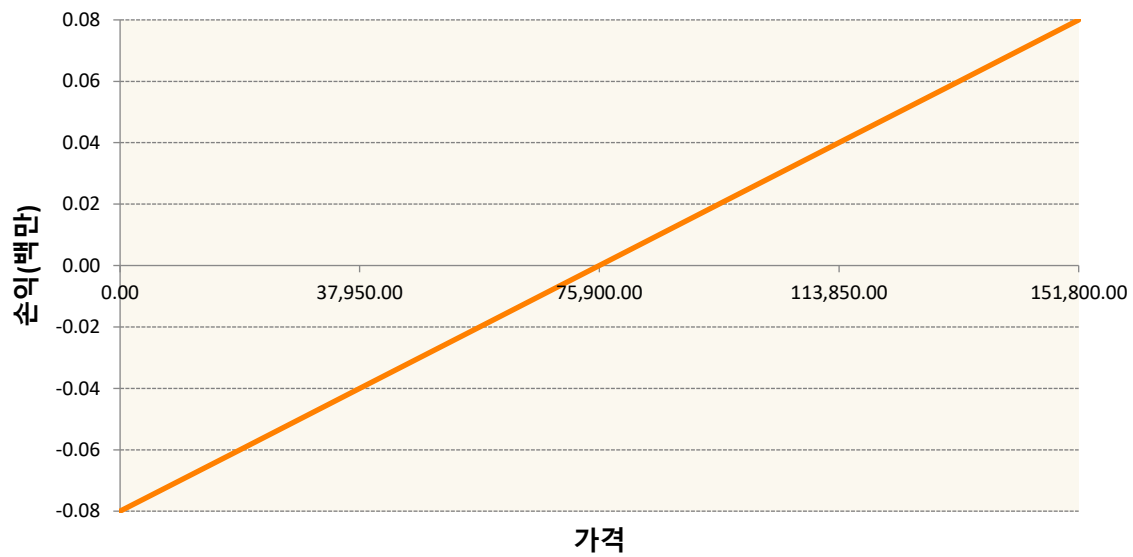
KR4132W30008-2025-03 현대제철개별선물



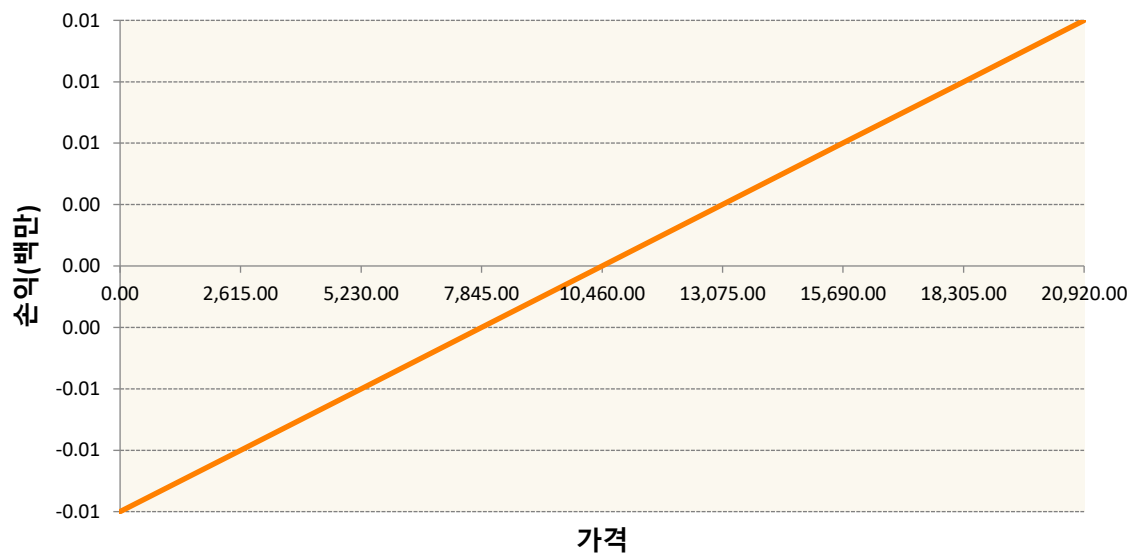
KR41BJW30002-2025-03 엔씨소프트개별선물



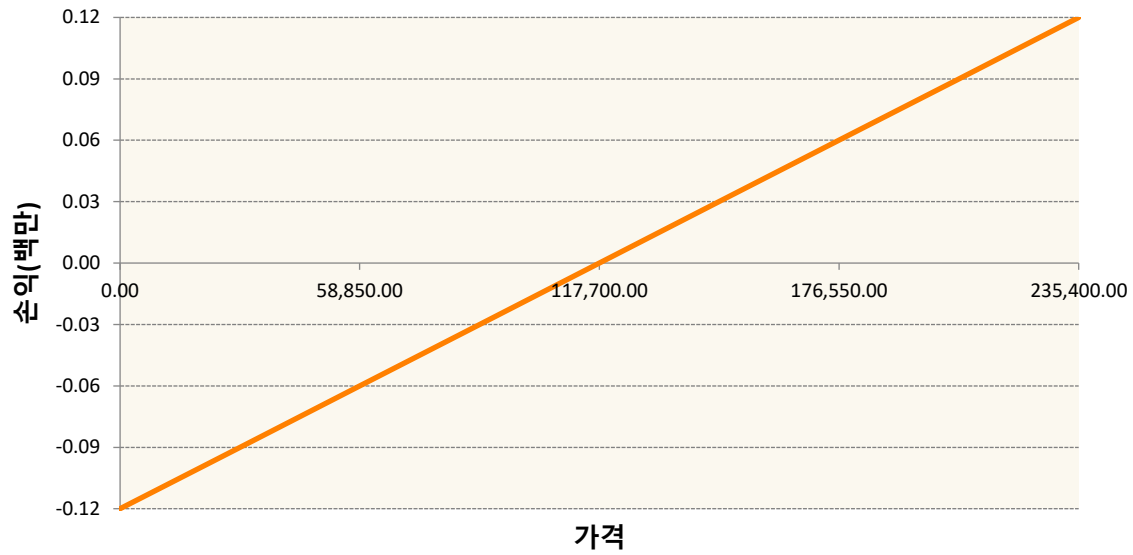
KR41BMW30006-2025-03 한국항공우주개별선물



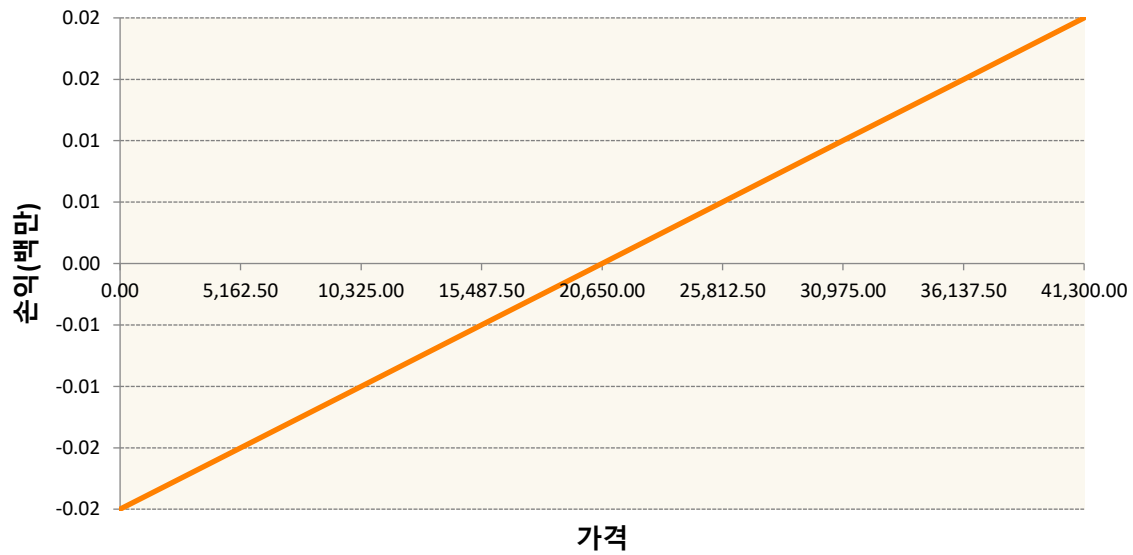
KR41BTW30001-2025-03 BNK금융지주개별선물



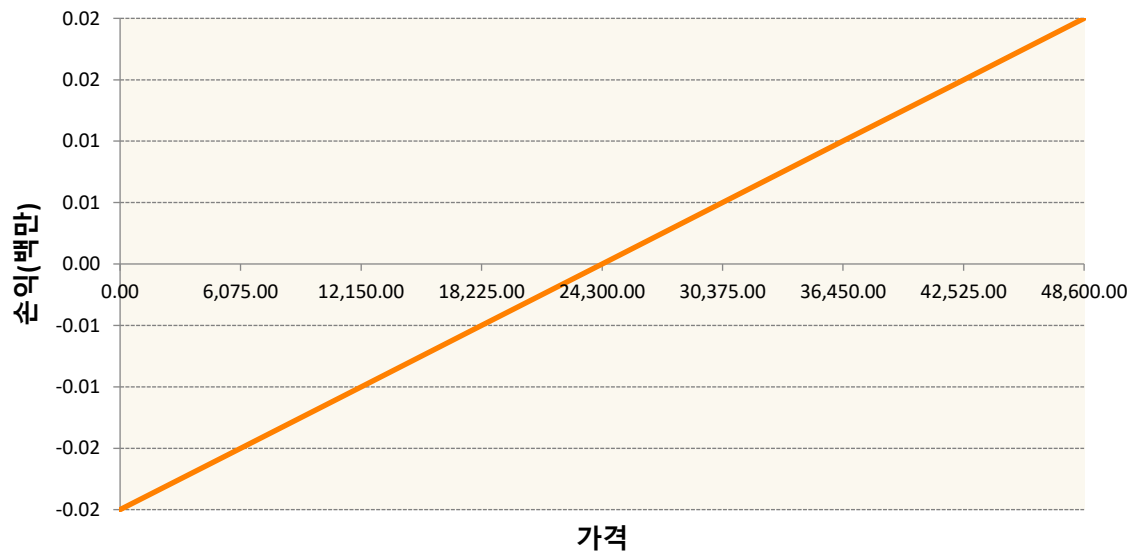
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



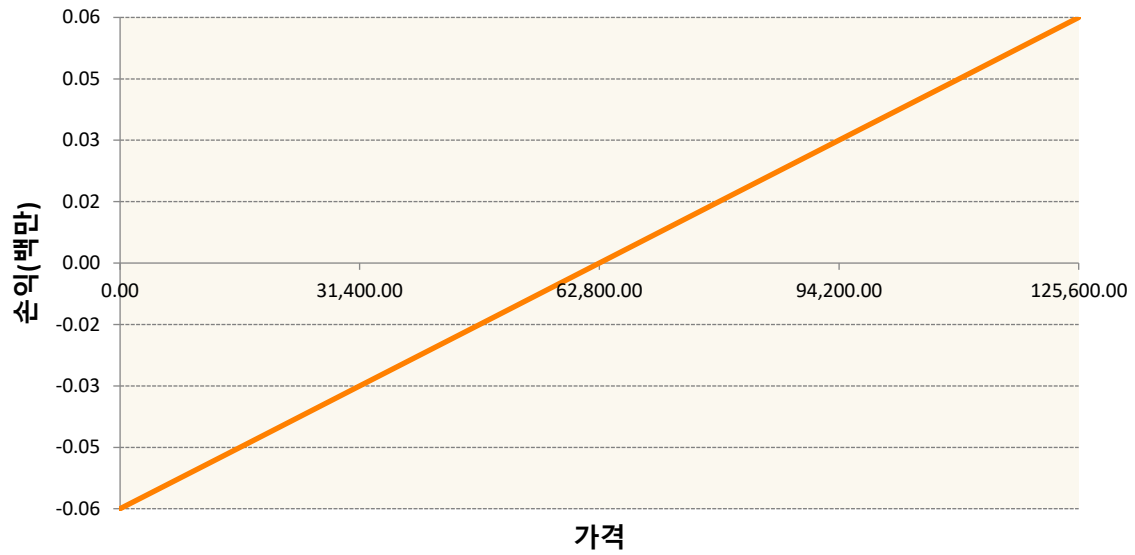
KR41CBW30007-2025-03 한화솔루션개별선물



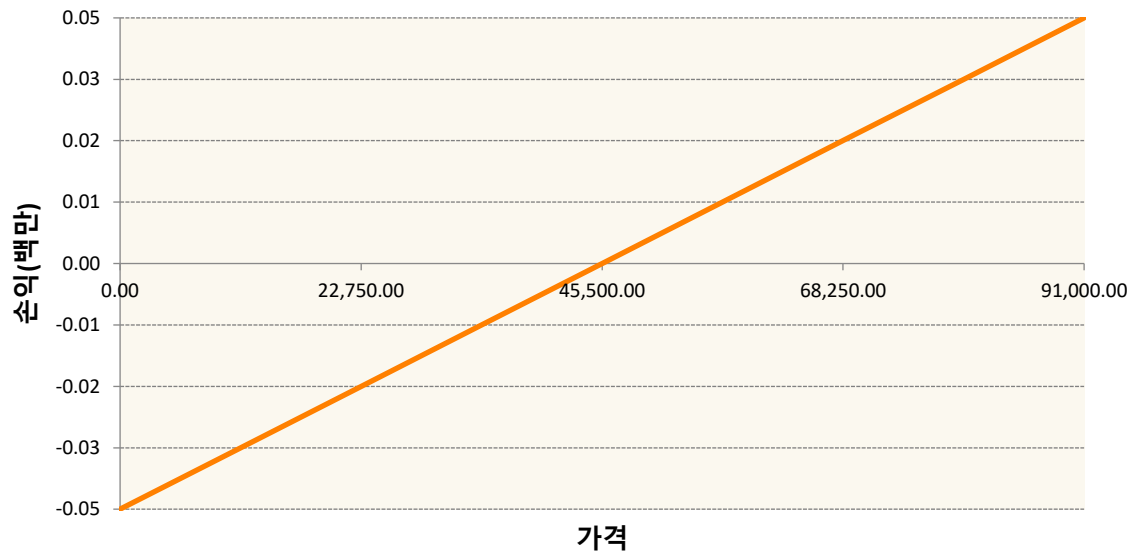
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



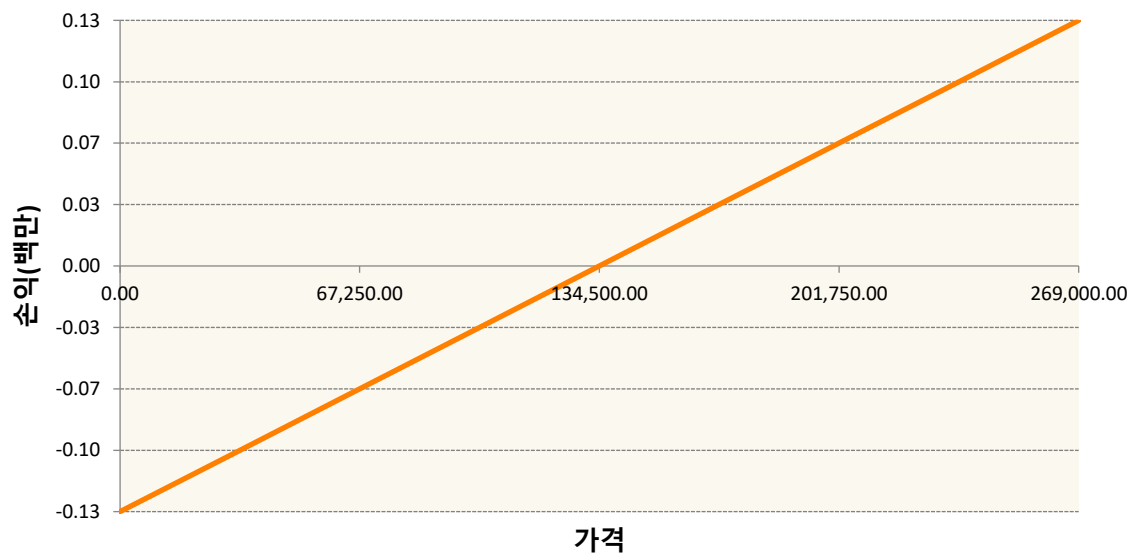
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



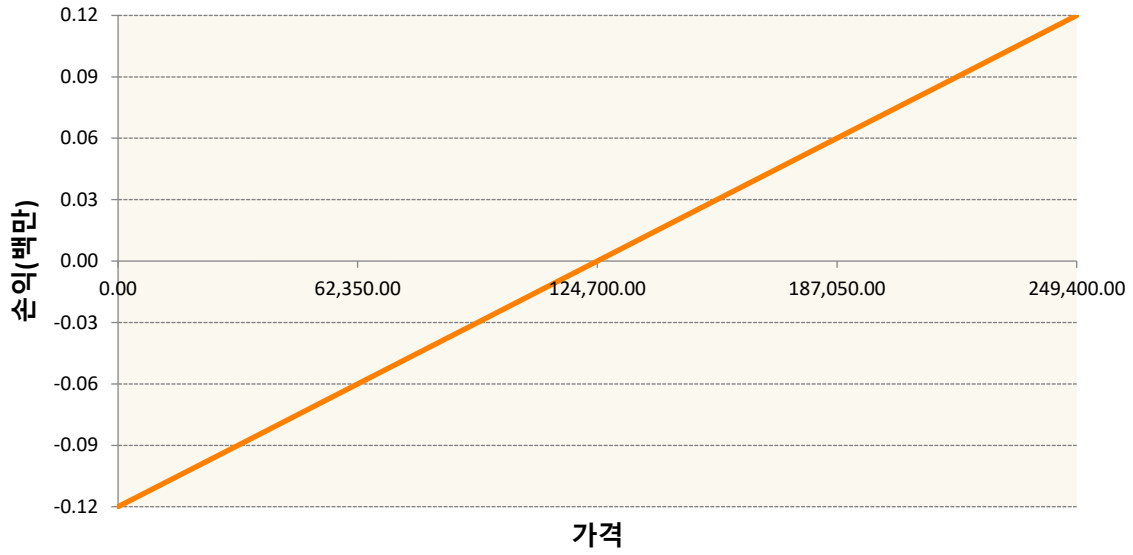
KR41DGW30004-2025-03 영원무역개별선물



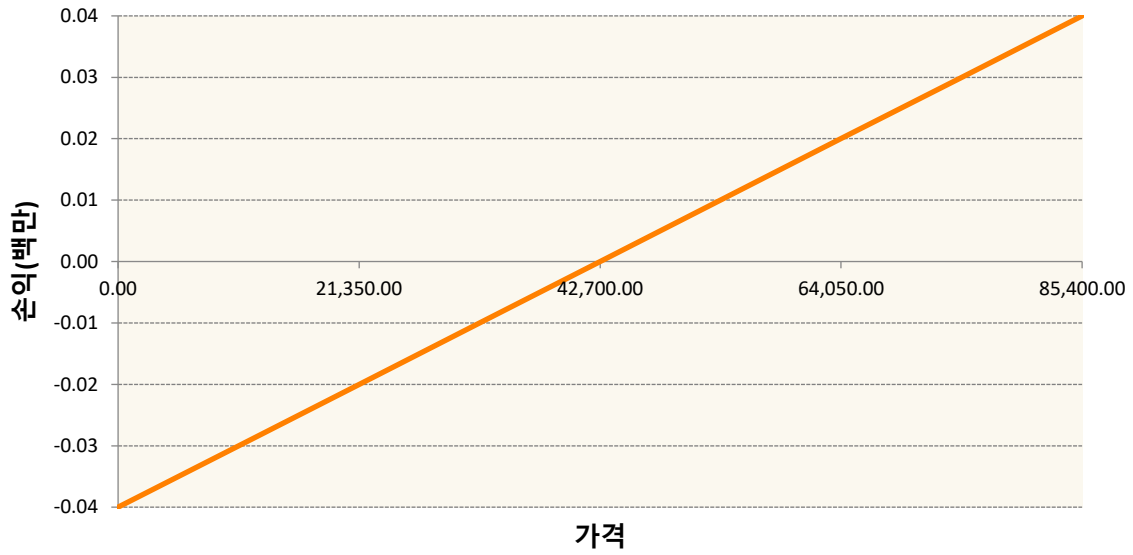
KR41E8W30003-2025-03 포스코퓨처엠개별선물



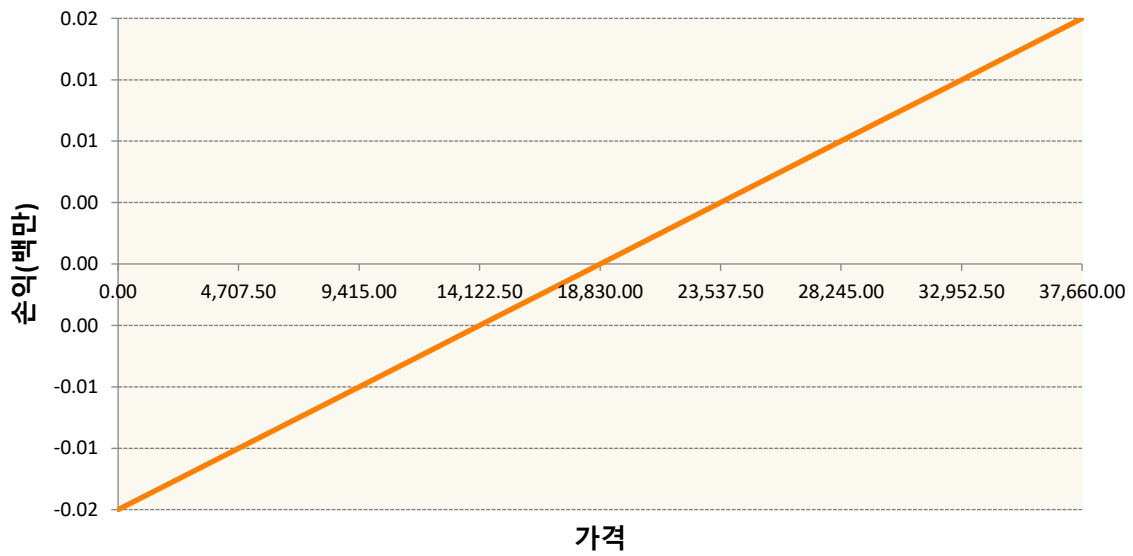
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



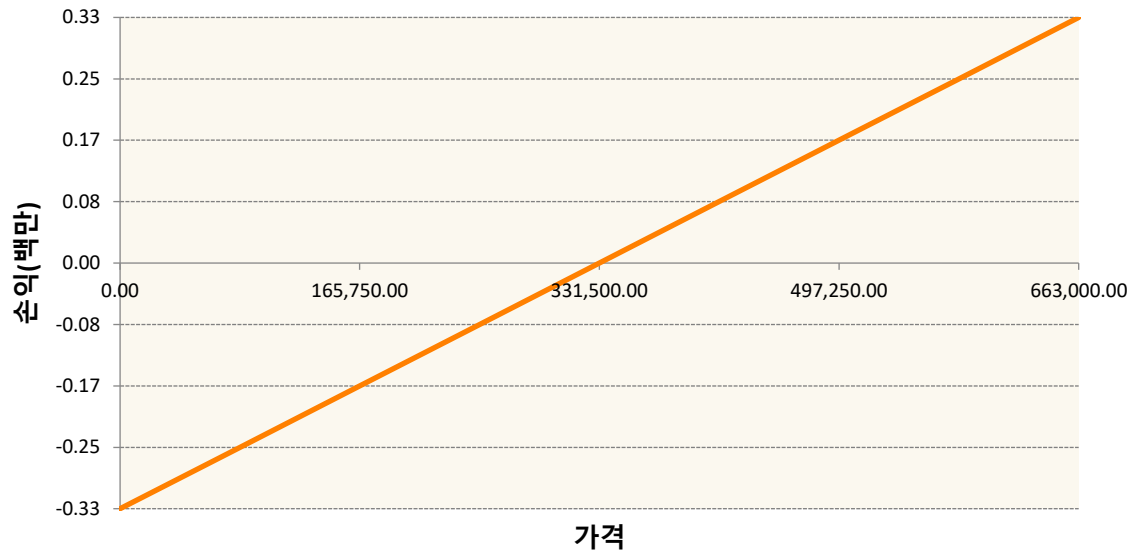
KR41ERW30009-2025-03 DL이앤씨개별선물



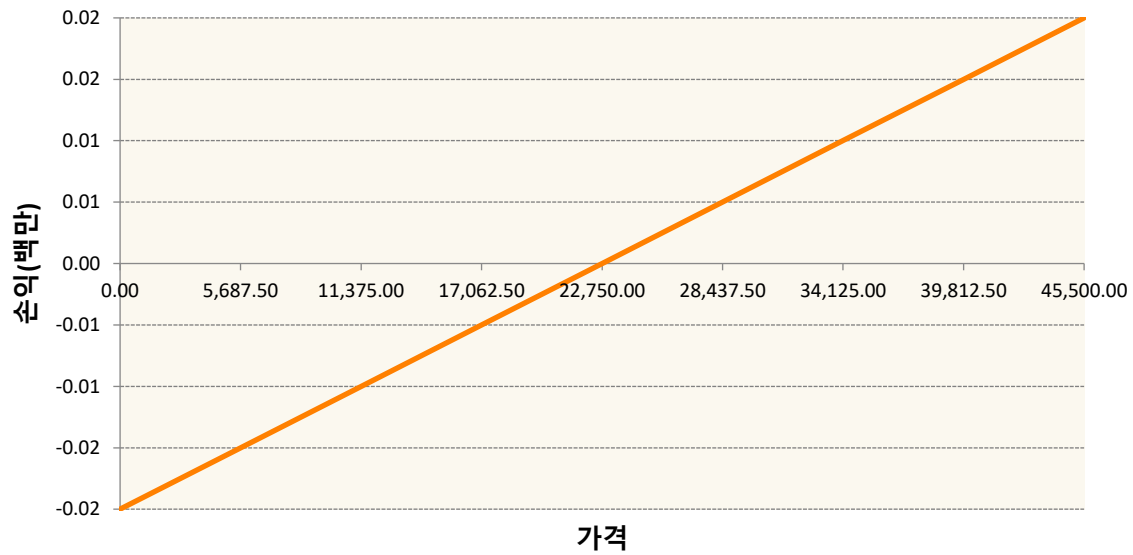
KR41ETW30005-2025-03 삼성엔지니어링개별선물



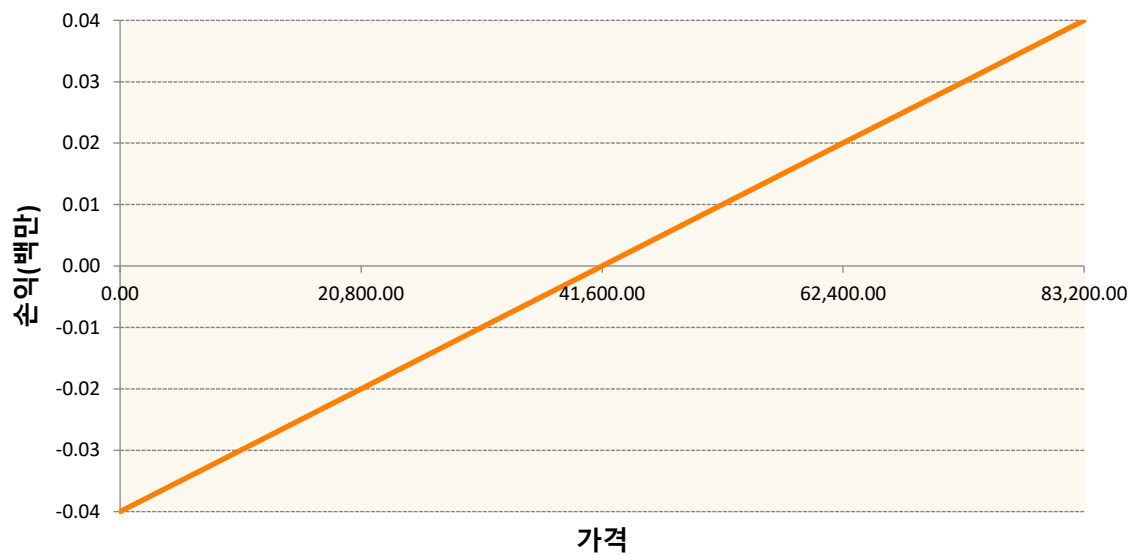
KR41F5W30008-2025-03 LG에너지솔루션개별선물



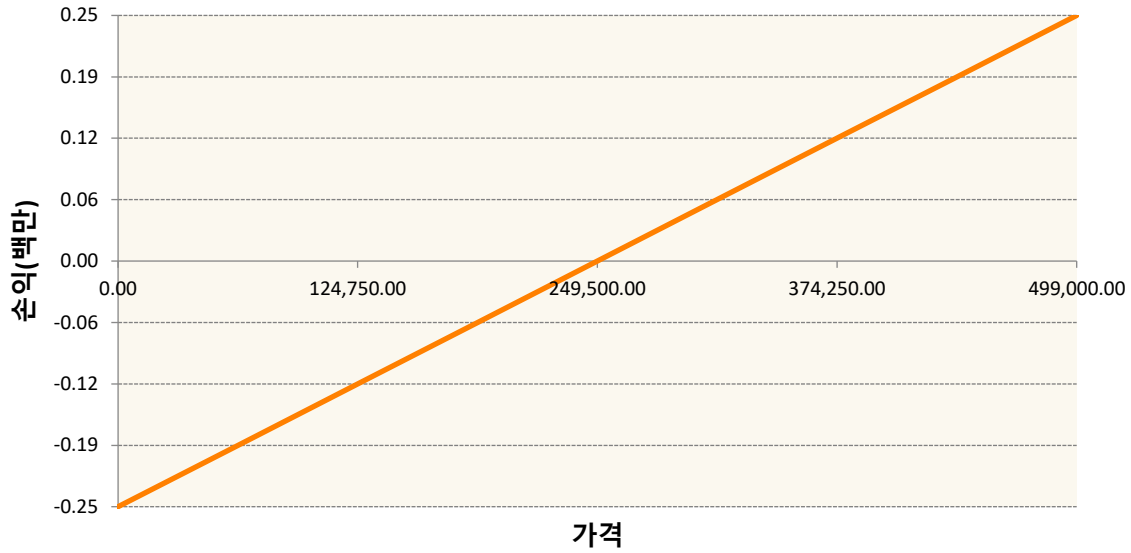
KR41F6W30006-2025-03 카카오뱅크개별선물



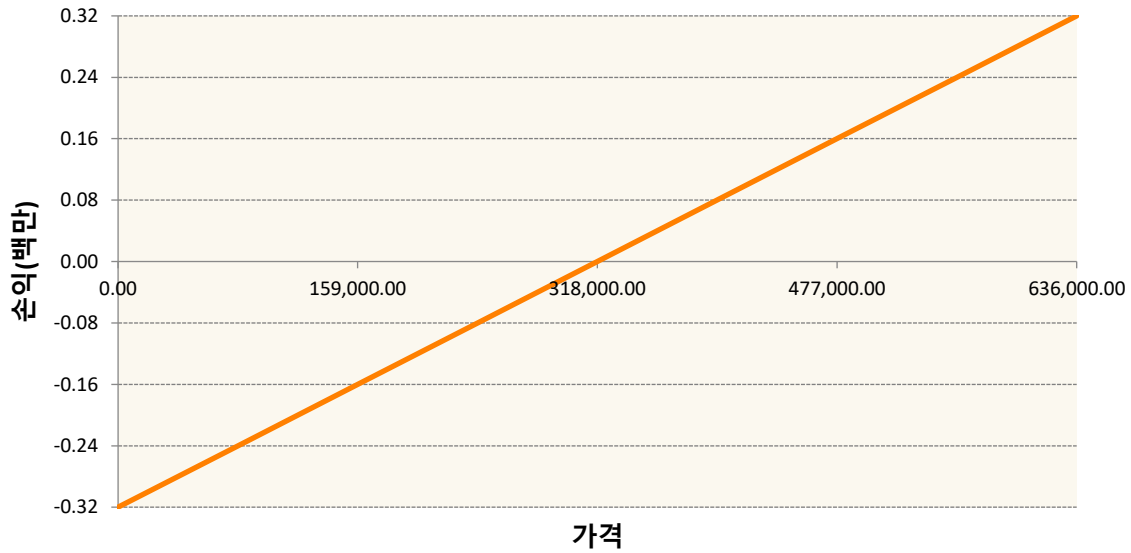
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



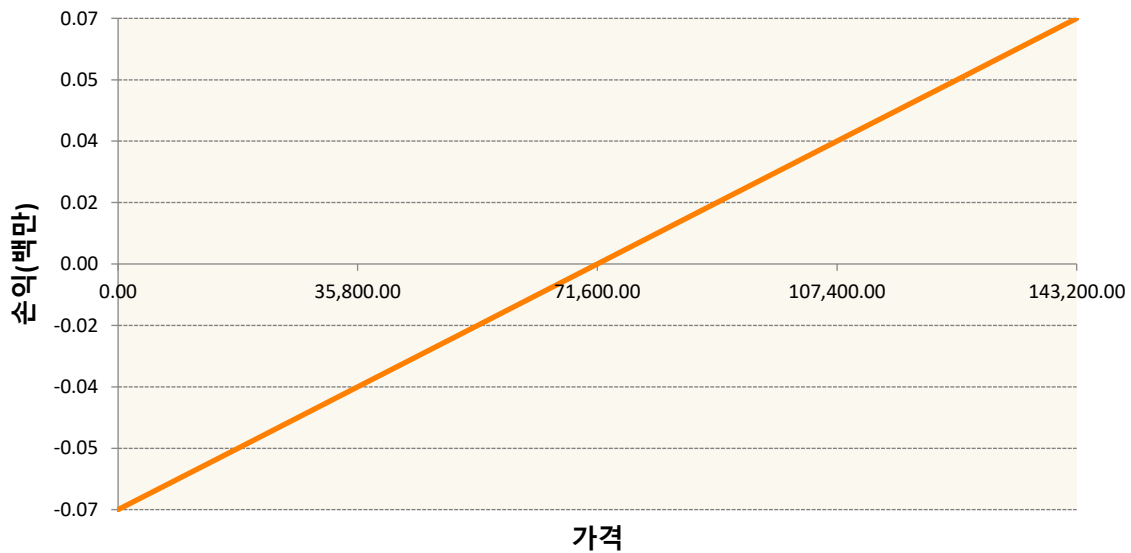
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



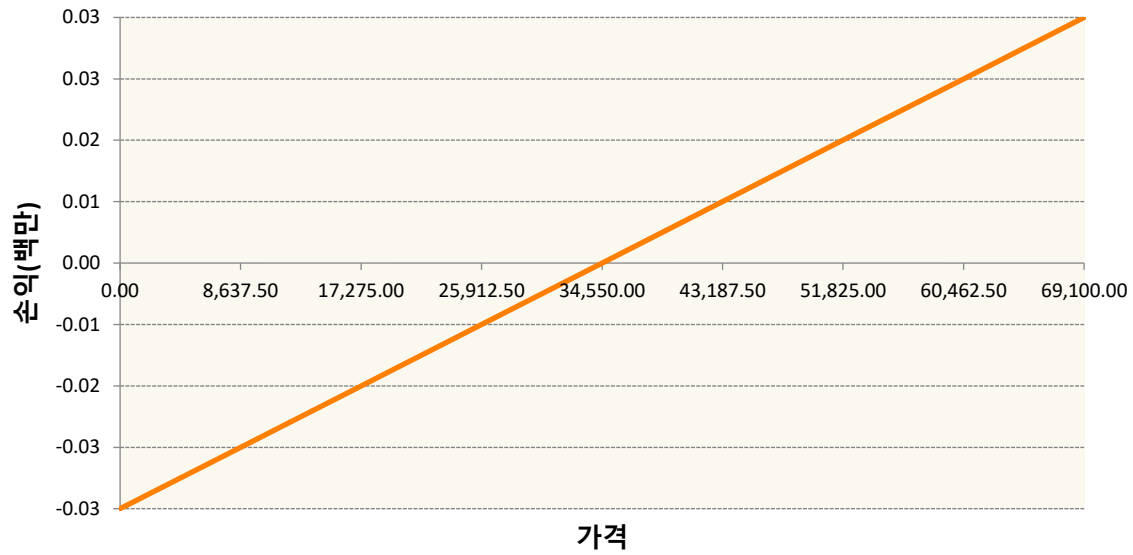
KR41FDW30006-2025-03 HD현대중공업개별선물



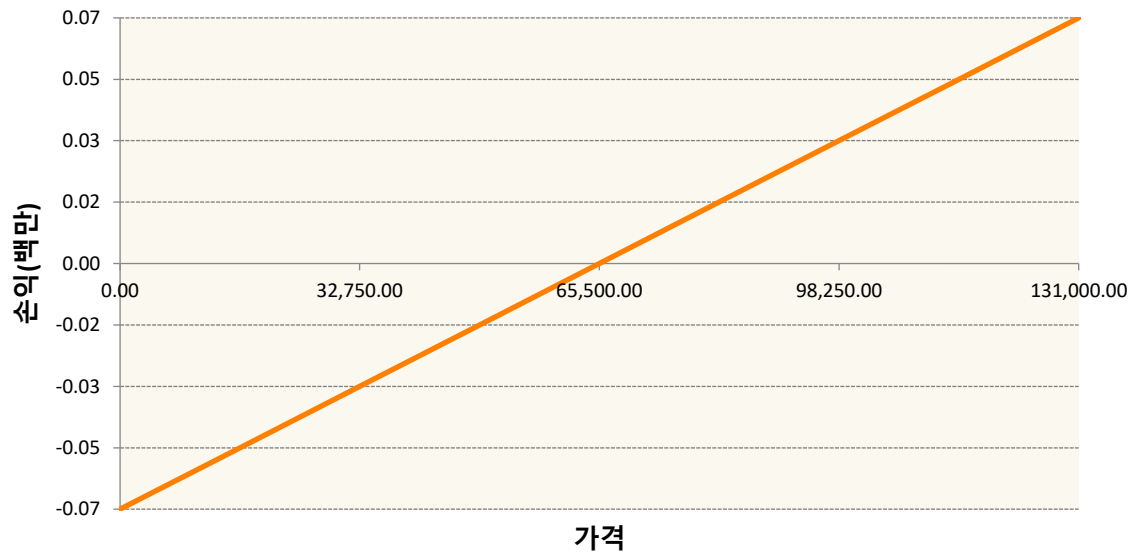
KR41FMW30007-2025-03 엘앤에프개별선물



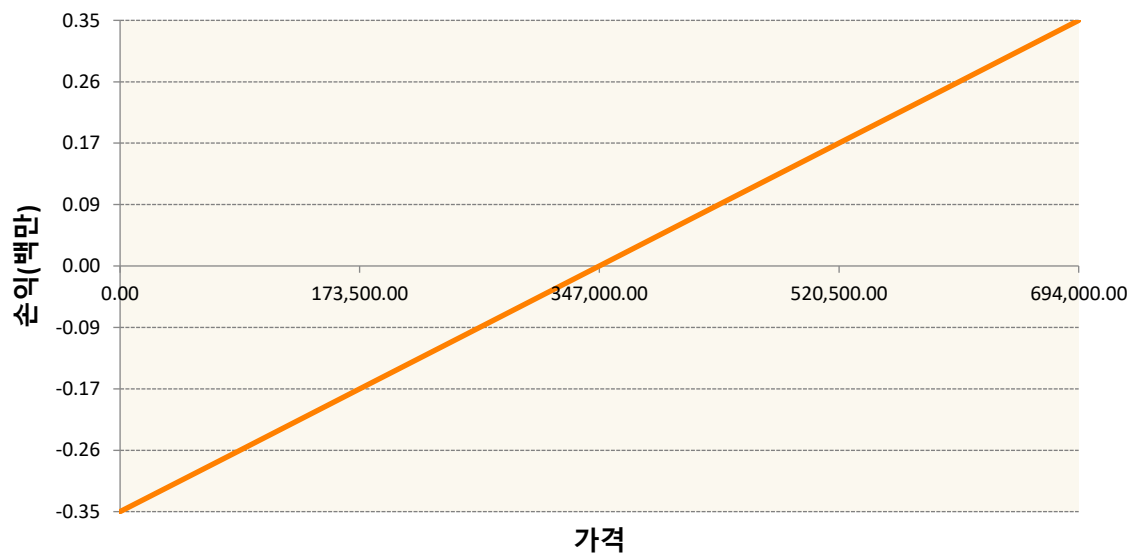
KR41G0W30008-2025-03 씨에스원드개별선물



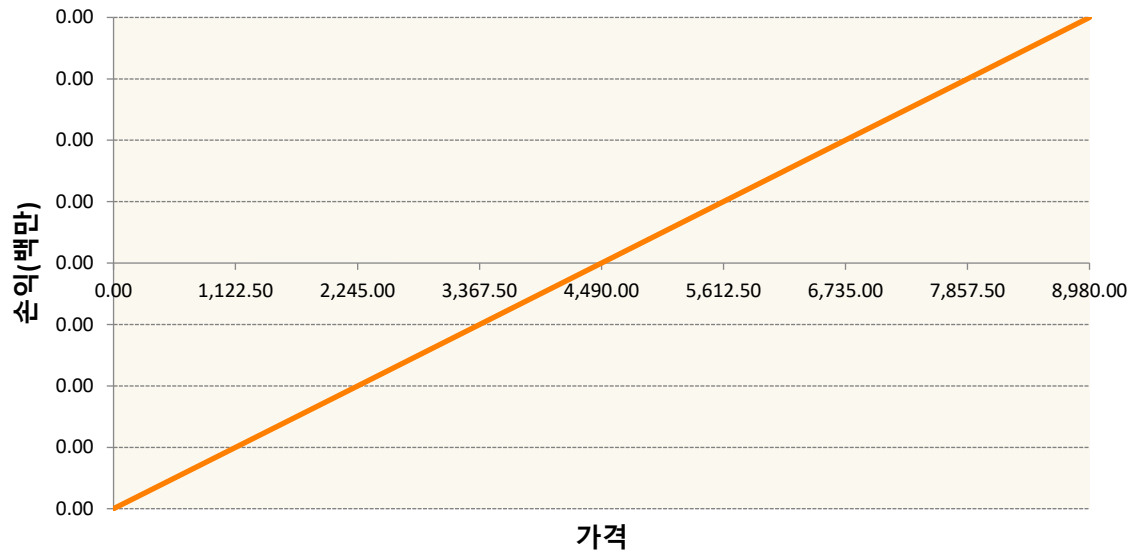
KR41G3W30002-2025-03 한전기술개별선물



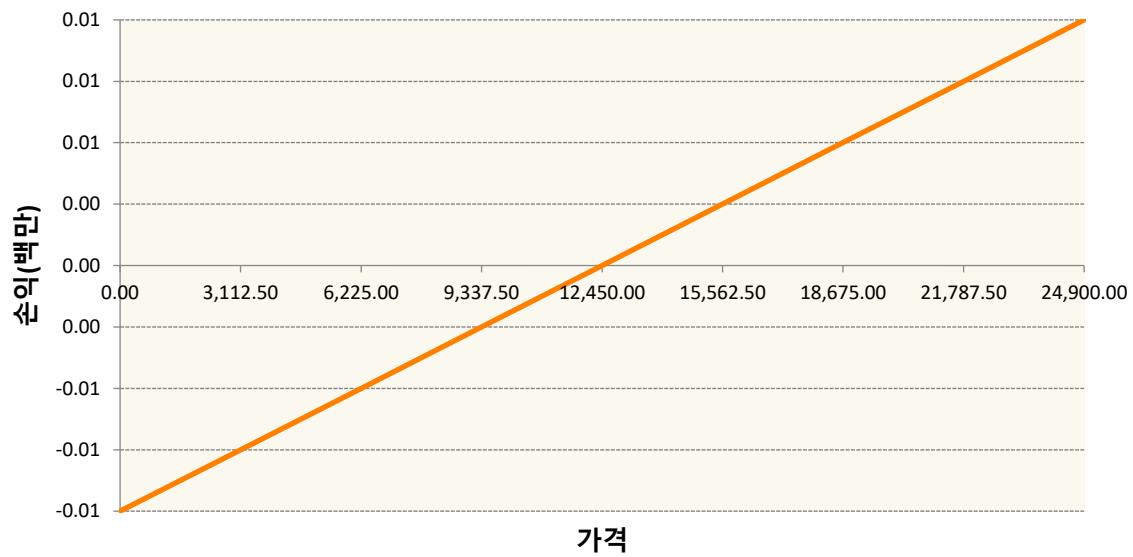
KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



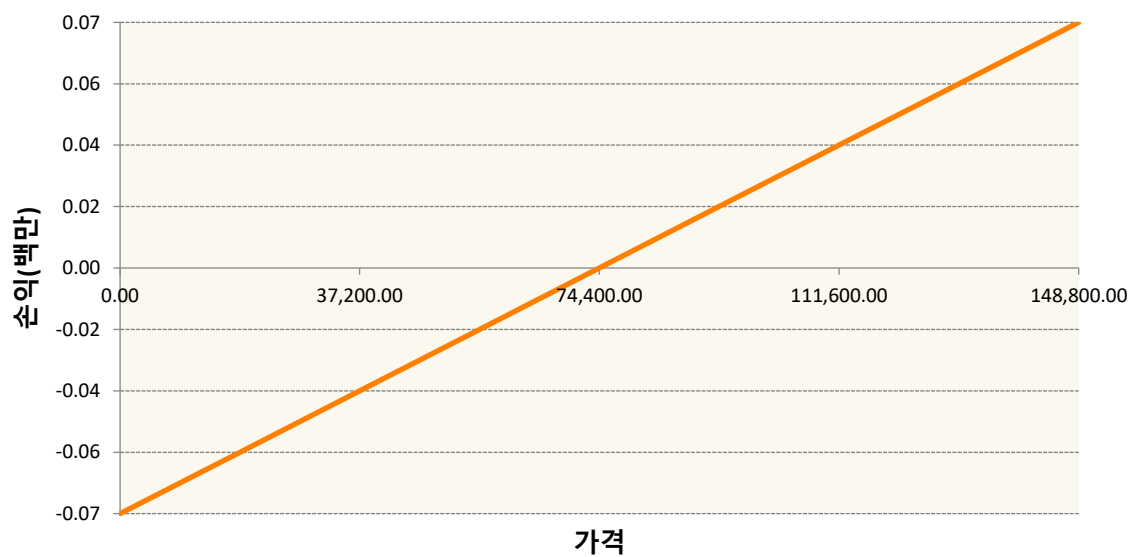
KR41GKW30009-2025-03 KG모빌리티개별선물



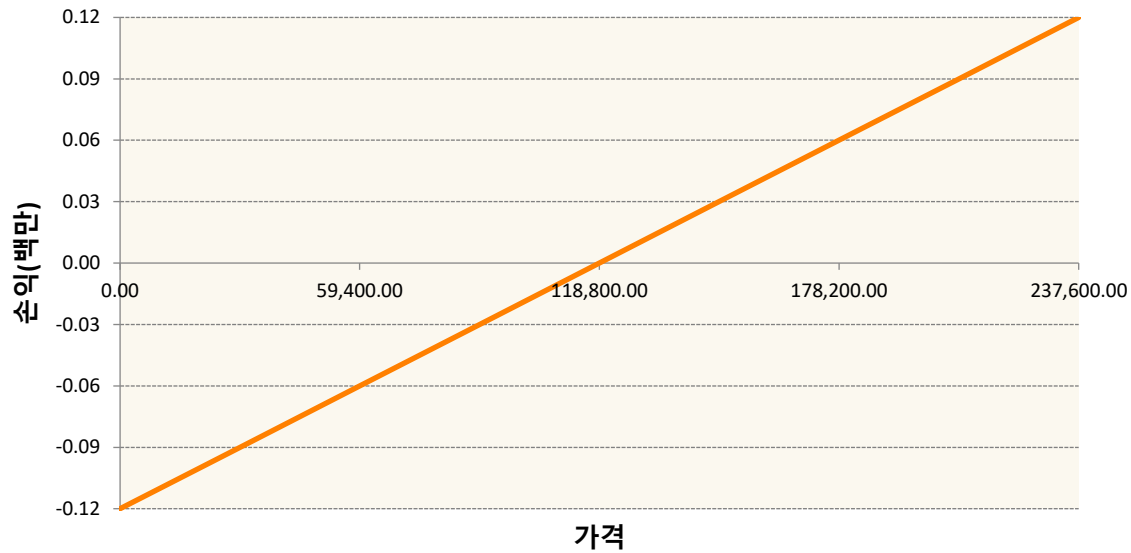
KR41GNW30003-2025-03 금양개별선물



KR41GZW30007-2025-03 에코프로머티개별선물



KR41HEW30000-2025-03 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	75
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
KR41BMW30C 2025-03 한국항공우주개별선물	3
KR41BTW30(2025-03 BNK금융지주개별선물	1
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물	2
KR41CBW30(2025-03 한화솔루션개별선물	1
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물	1
KR41DEW30(2025-03 한국콜마개별선물	1
KR41DGW30 2025-03 영원무역개별선물	0.47
KR41E8W30(2025-03 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	1
KR41ERW30(2025-03 DL이앤씨개별선물	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	4
KR41FMW30 2025-03 엘앤에프개별선물	1
KR41G0W30(2025-03 씨에스윈드개별선물	0.41
KR41G3W30(2025-03 한전기술개별선물	1
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	4
KR41GKW30 2025-03 KG모빌리티개별선물	0.19

KR41GNW30 2025-03 금양개별선물
KR41GZW30 2025-03 에코프로머티개별선물
KR41HEW30 2025-03 키움증권개별선물

0.23
1
1

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

(단위:백만원)

203

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

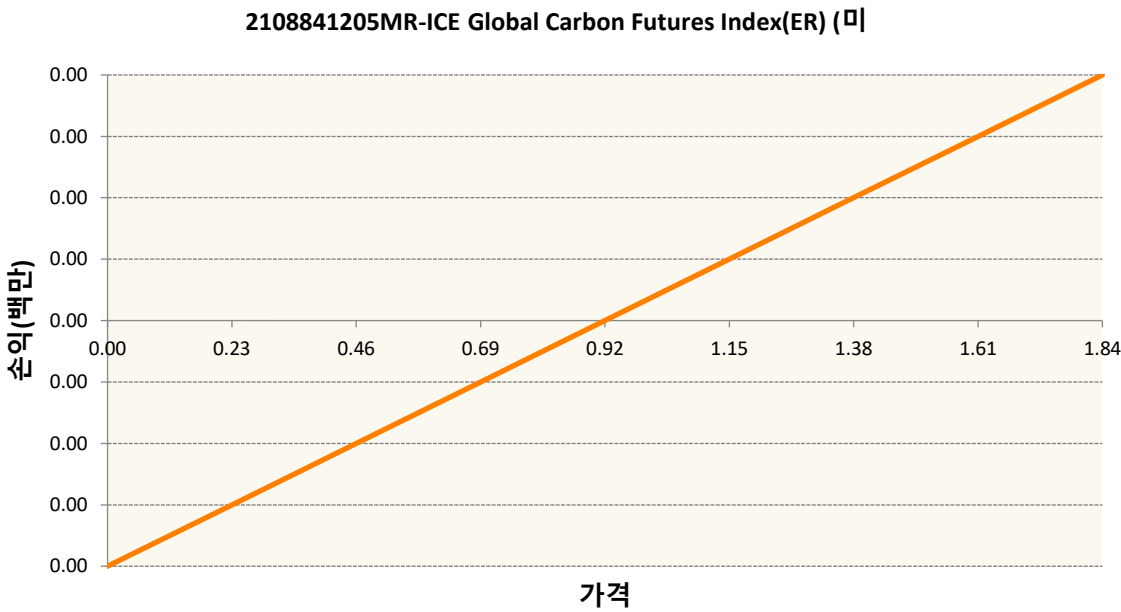
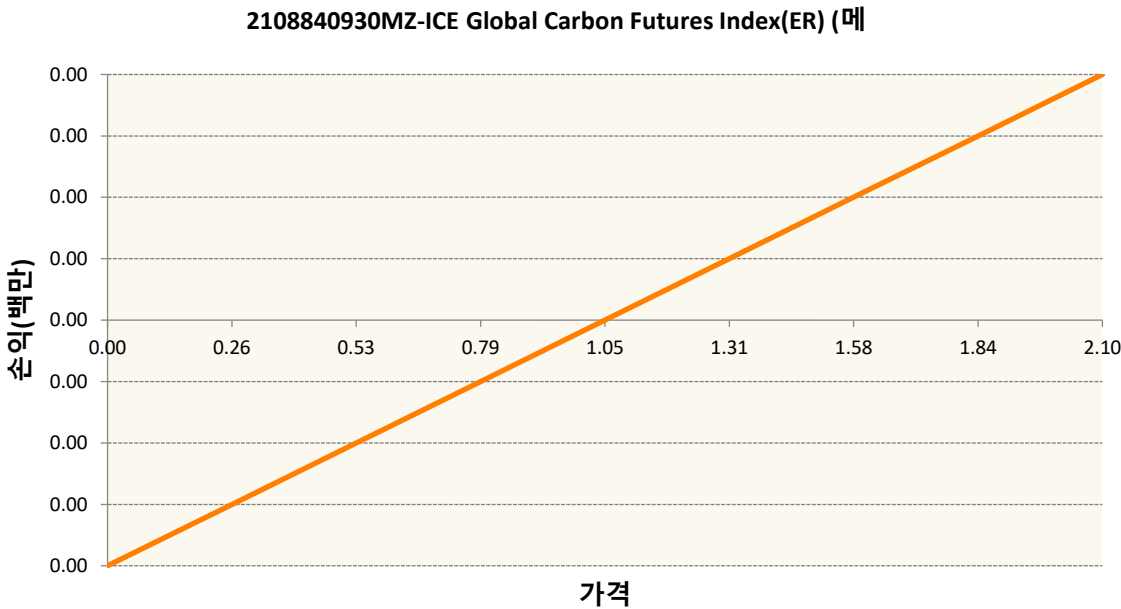
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	187
2108841205	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	560

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	838

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

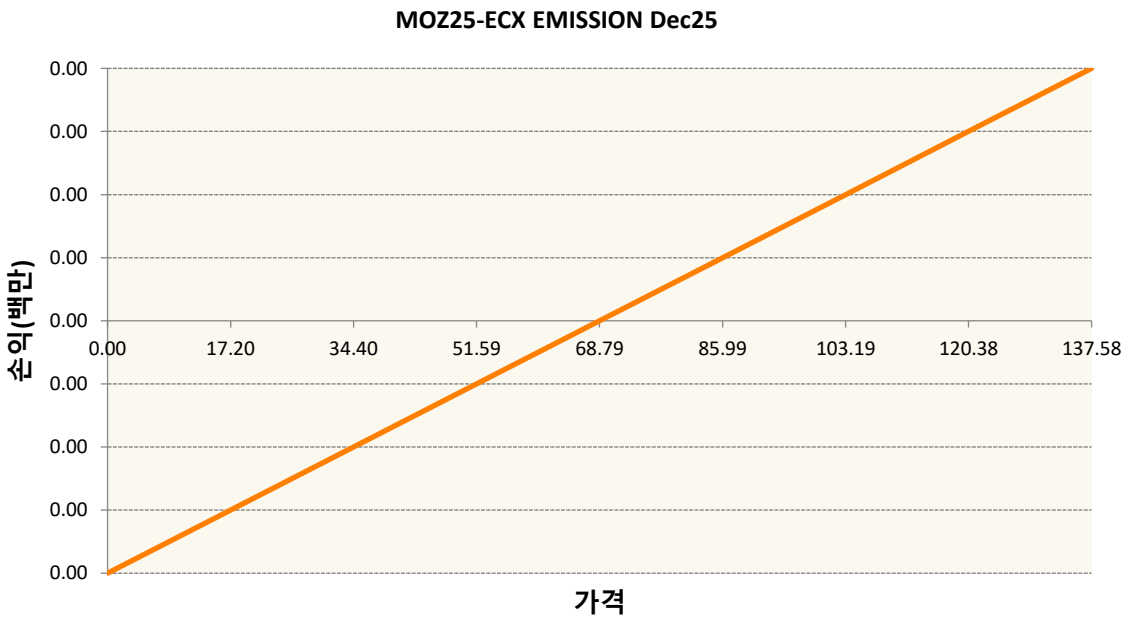
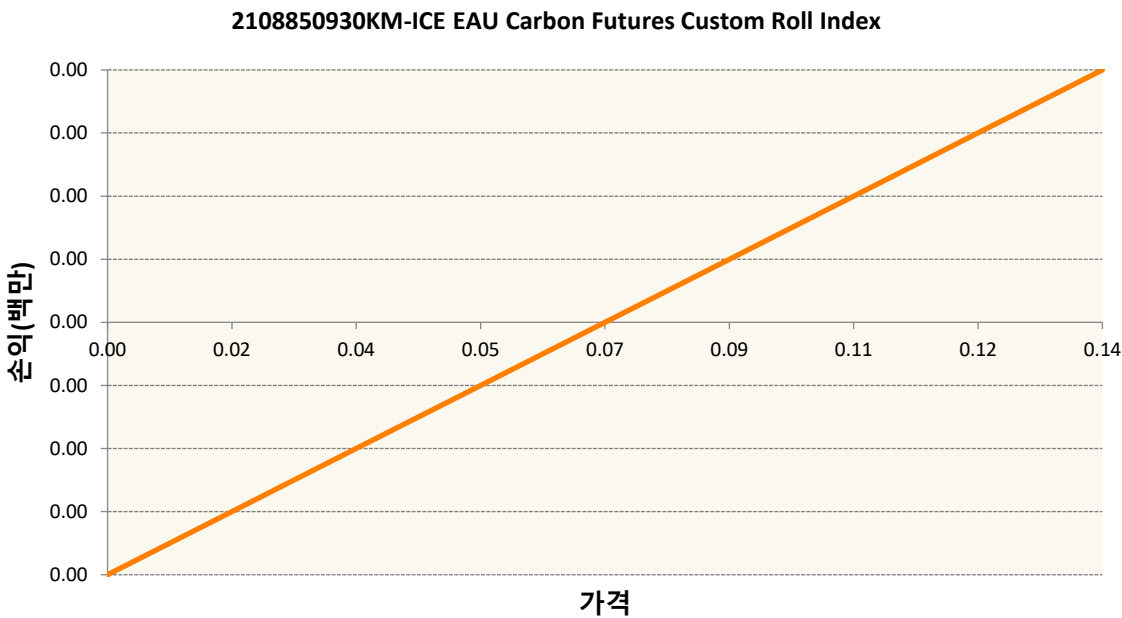
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	8,534	0	8,534	
누계	통화	선도	0	1,024	-1,024	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	2
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	82
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	681

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

1,221

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	6

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

(단위:백만원)

36

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

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

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

(단위:백만원)

131

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

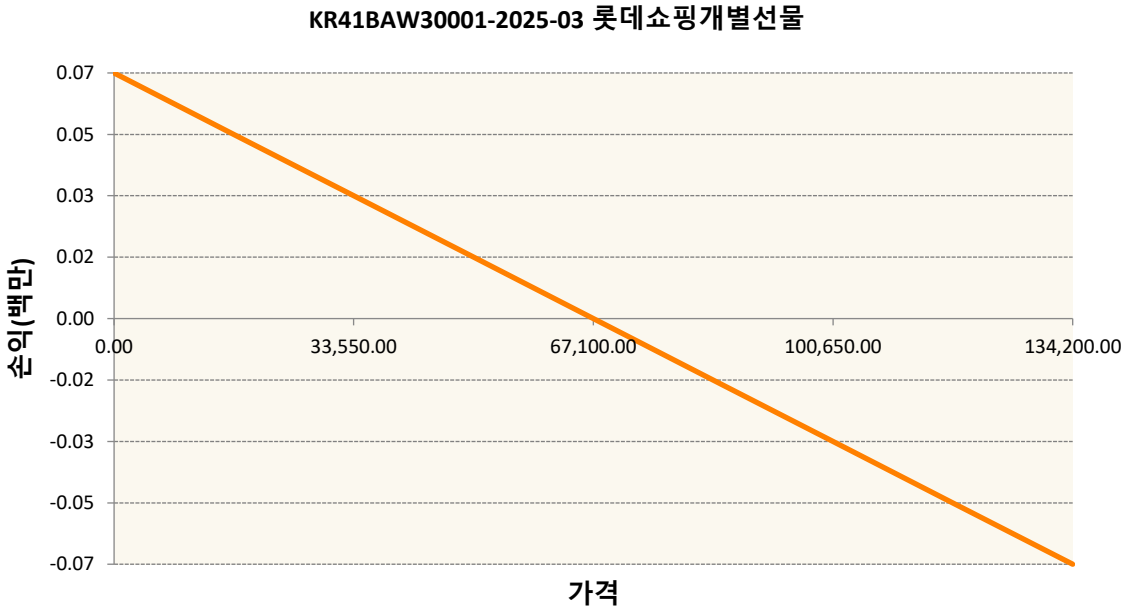
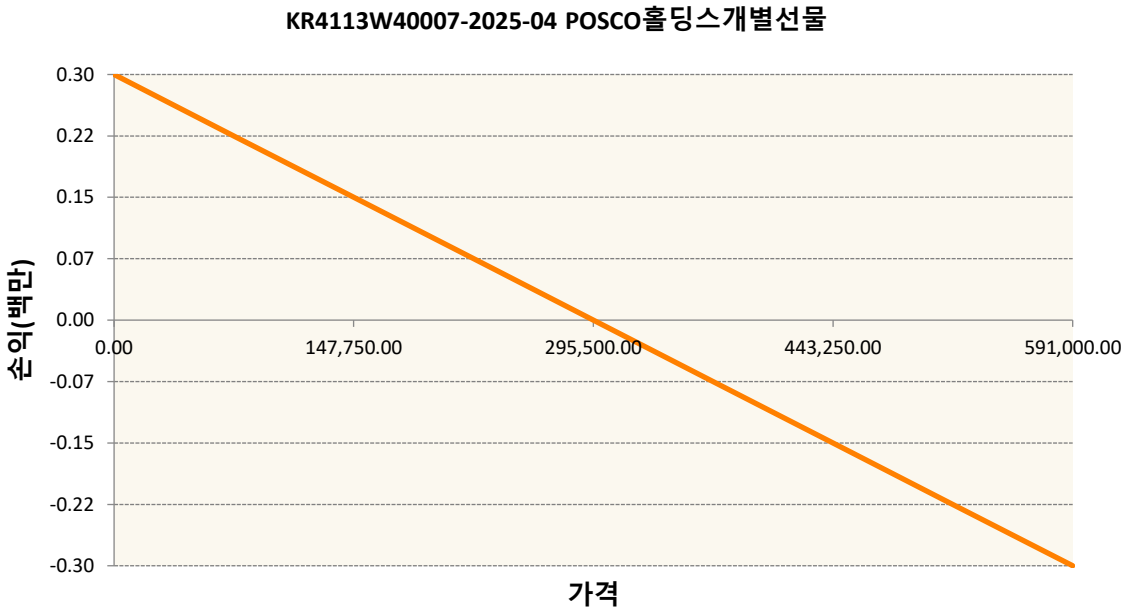
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

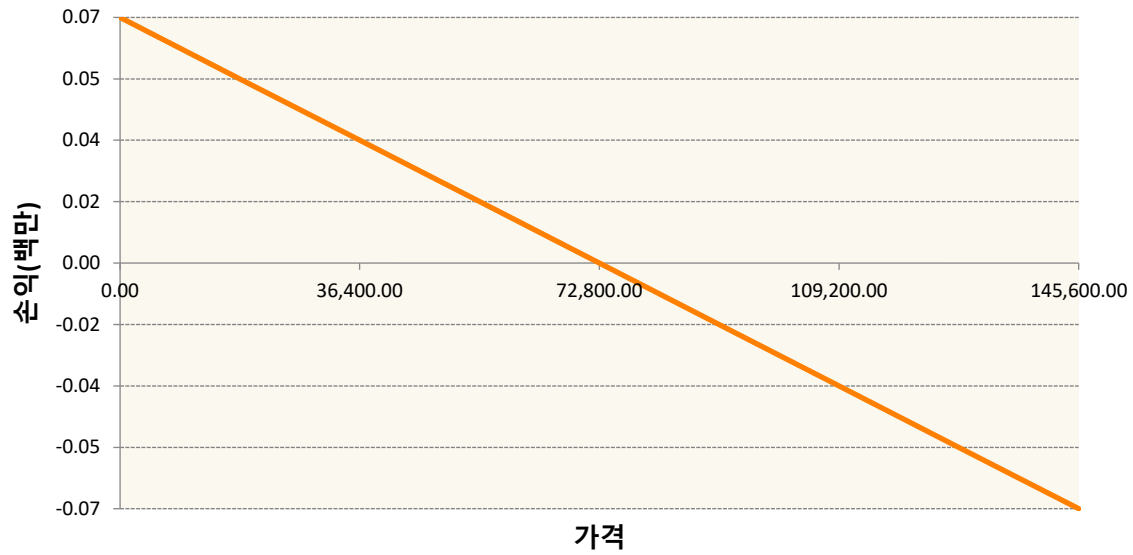
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	11	19	-8	장내
누계	유가증권	선물	31	57	-26	장내

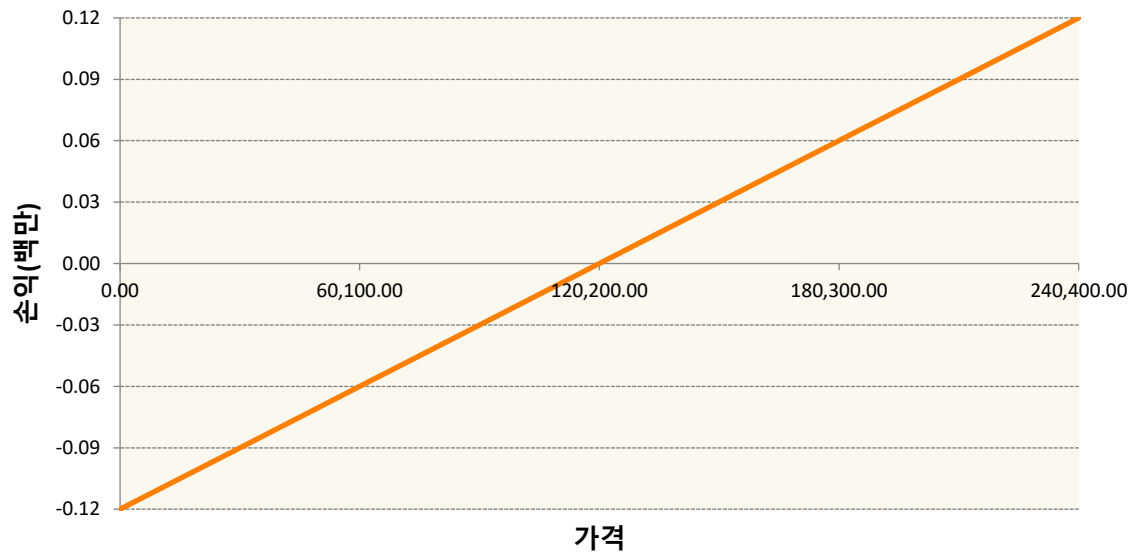
2. 만기시점의 손익구조



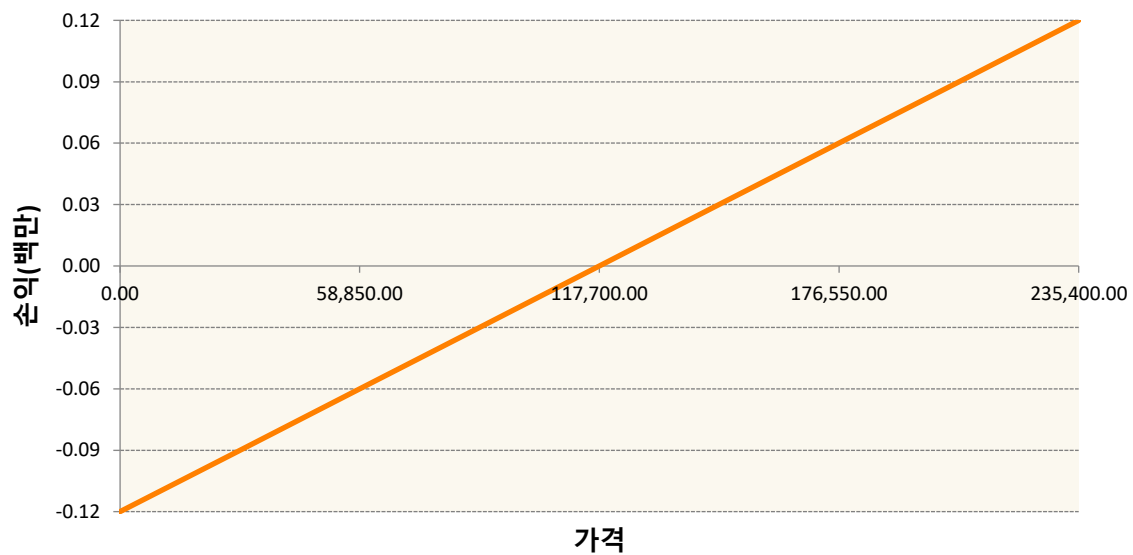
KR41BBW30009-2025-03 롯데케미칼개별선물



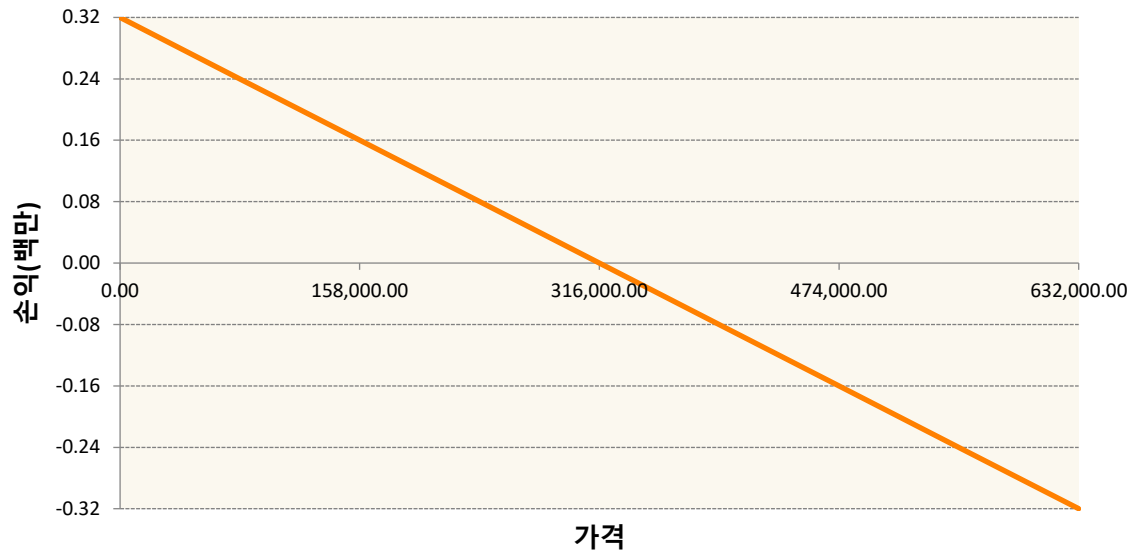
KR41C3W30006-2025-03 금호석유개별선물



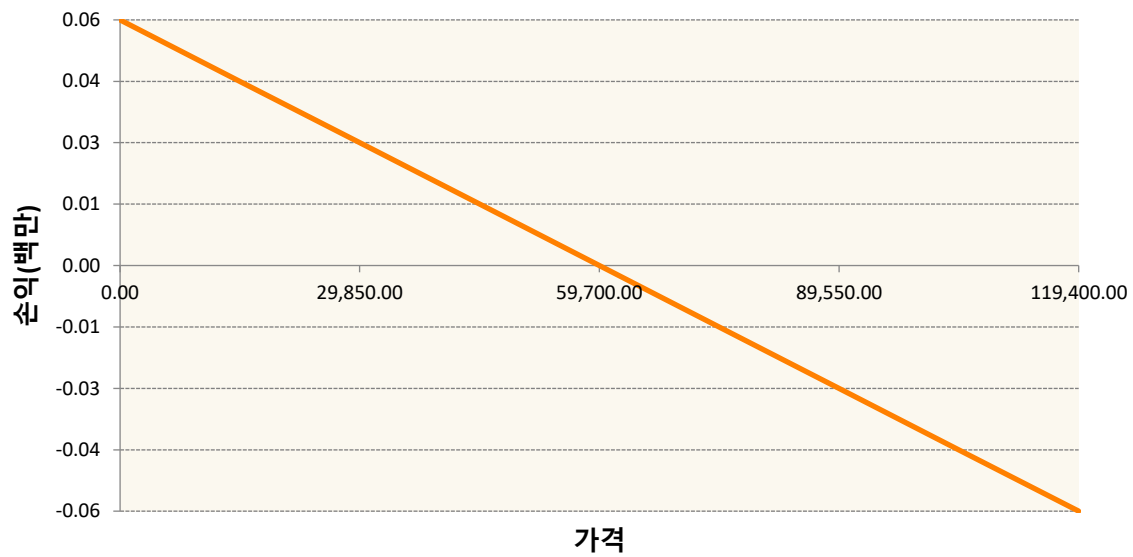
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



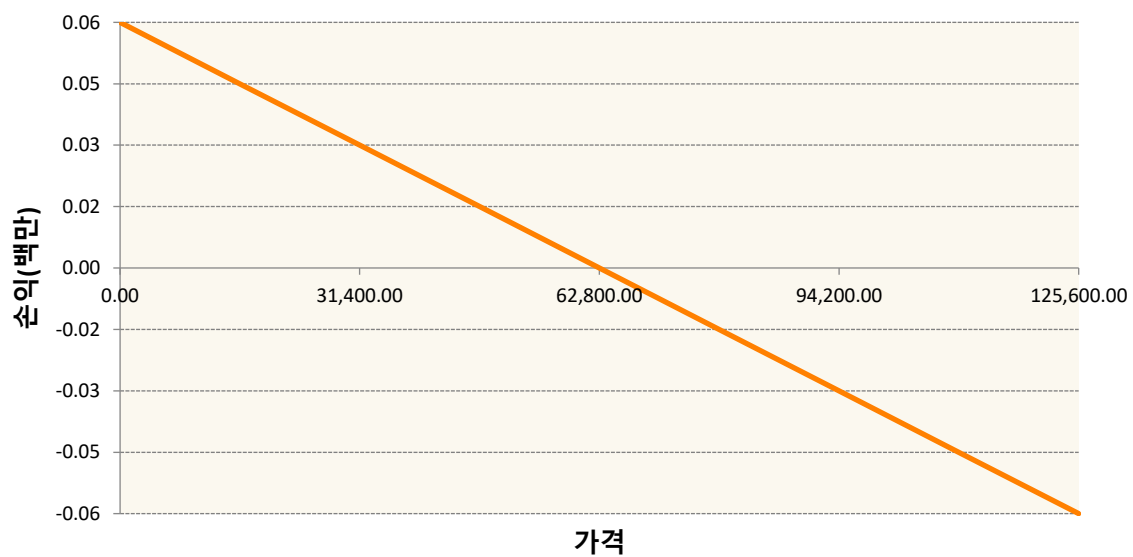
KR41CRW30003-2025-03 LG생활건강개별선물



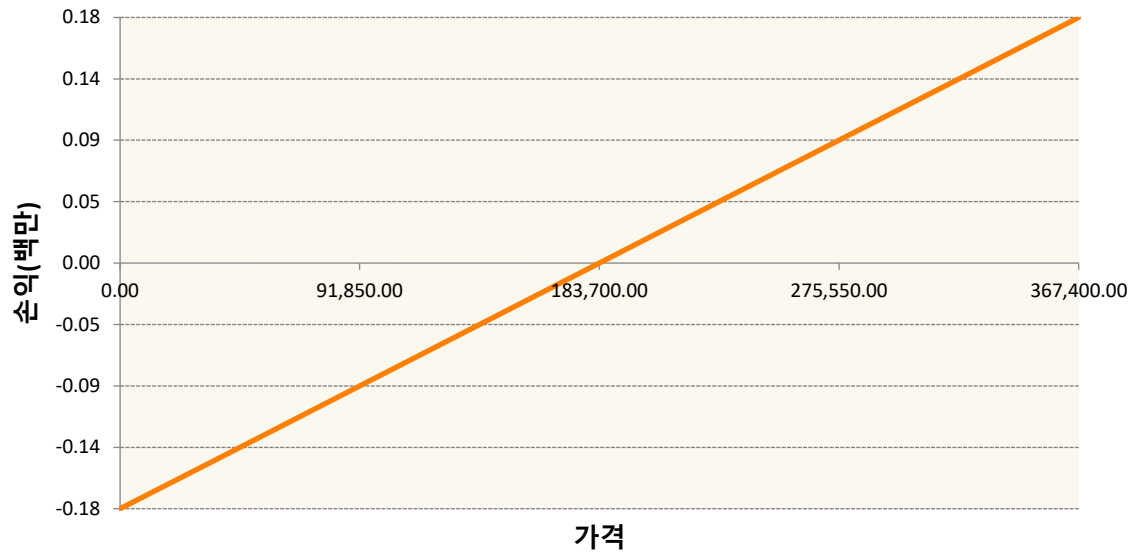
KR41D8W30004-2025-03 현대백화점개별선물



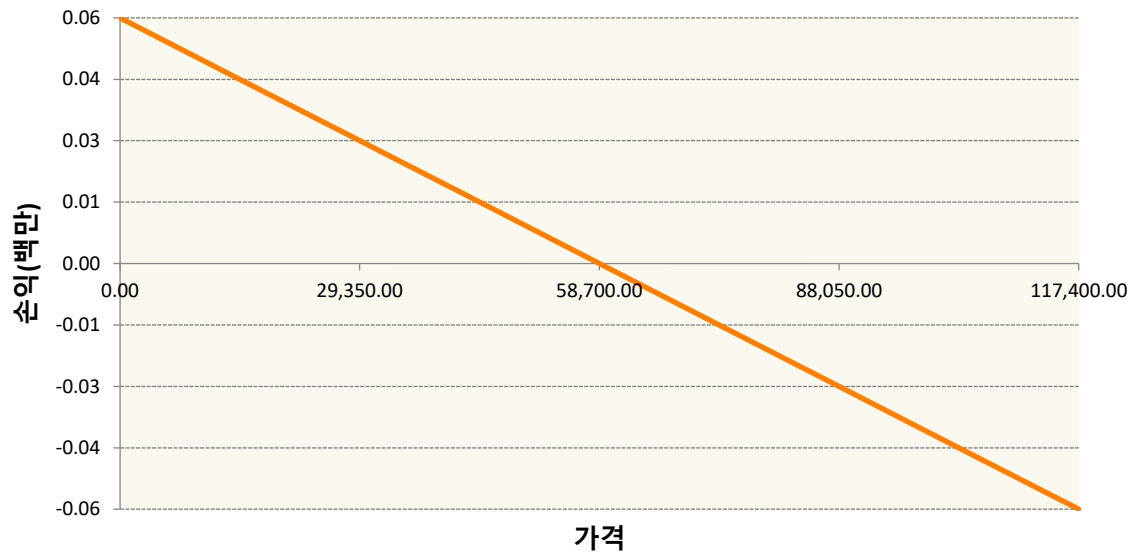
KR41DEW30009-2025-03 한국콜마개별선물



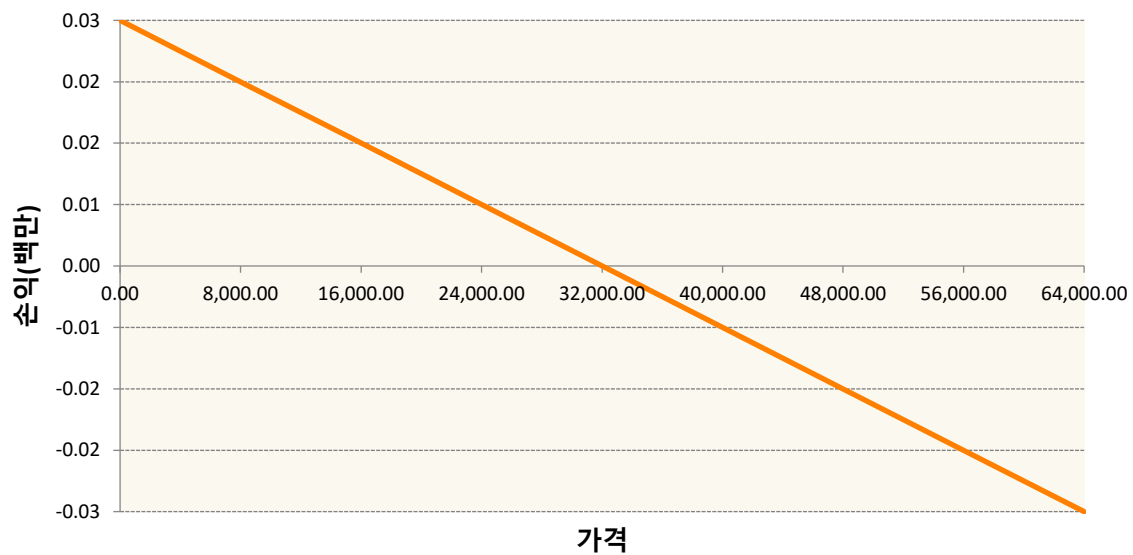
KR41DKW30006-2025-03 코스맥스개별선물



KR41DTW30007-2025-03 CJ ENM개별선물



KR41FLW30009-2025-03 펄어비스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4113W40(2025-04 POSCO홀딩스개별선물	0.47
KR41BAW30(2025-03 롯데쇼핑개별선물	0.38
KR41BBW30(2025-03 롯데케미칼개별선물	1
KR41C3W30(2025-03 금호석유개별선물	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	0.33
KR41FLW30(2025-03 펄어비스개별선물	0.28

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

16

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

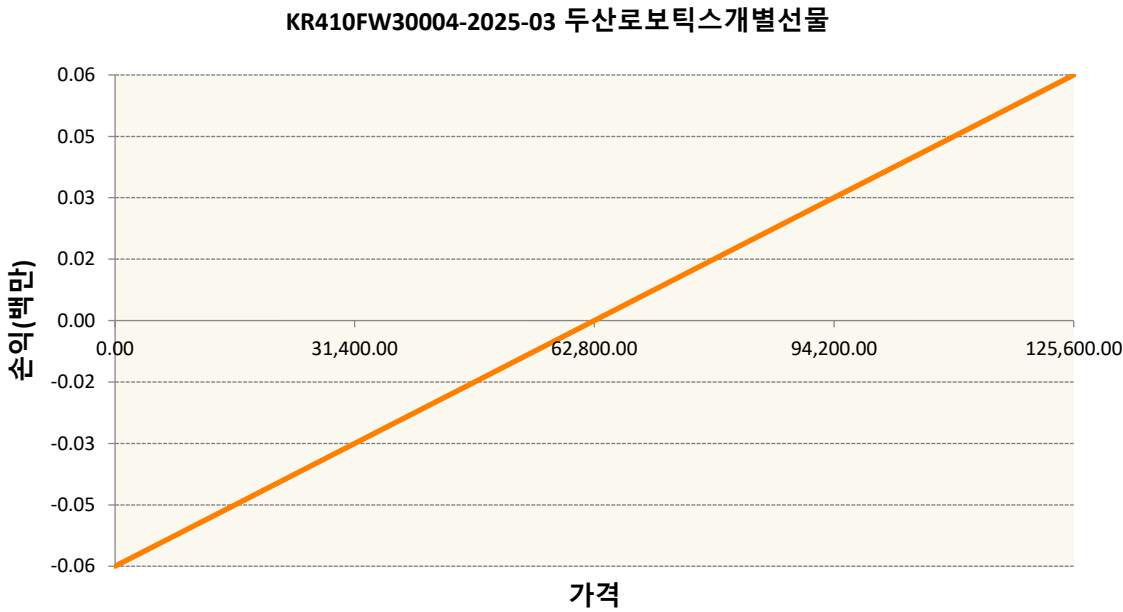
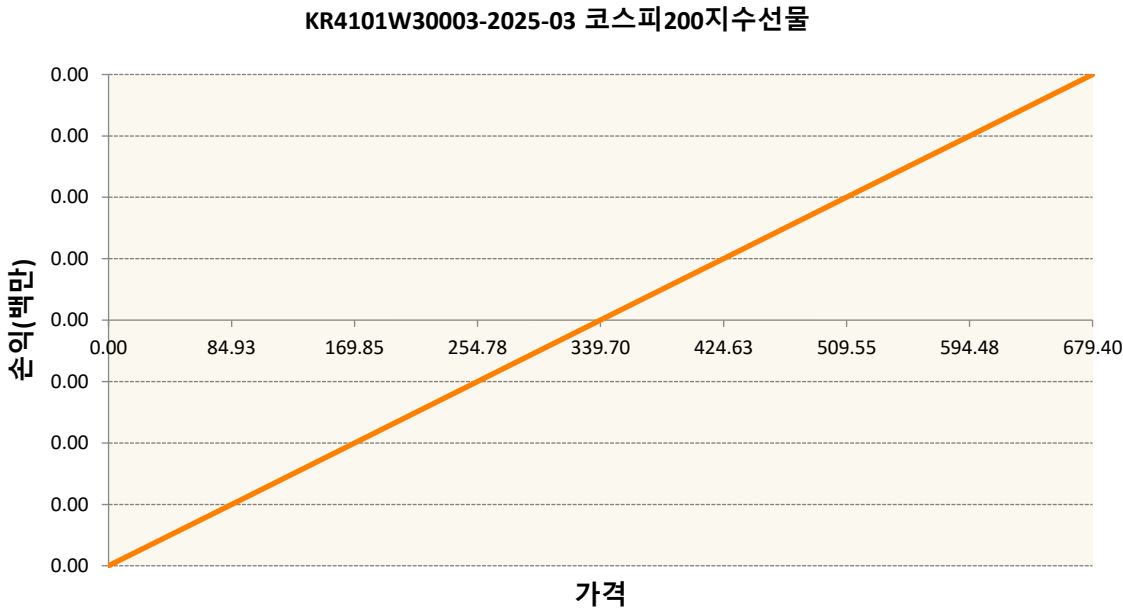
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

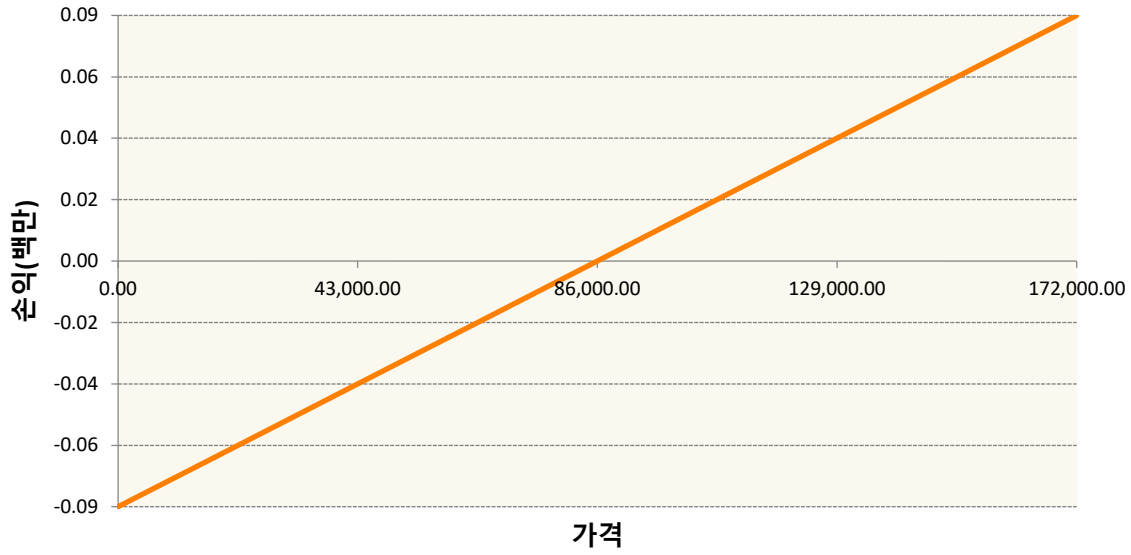
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	151	424	-273	장내
누계	유가증권	선물	14,538	0	14,538	장내

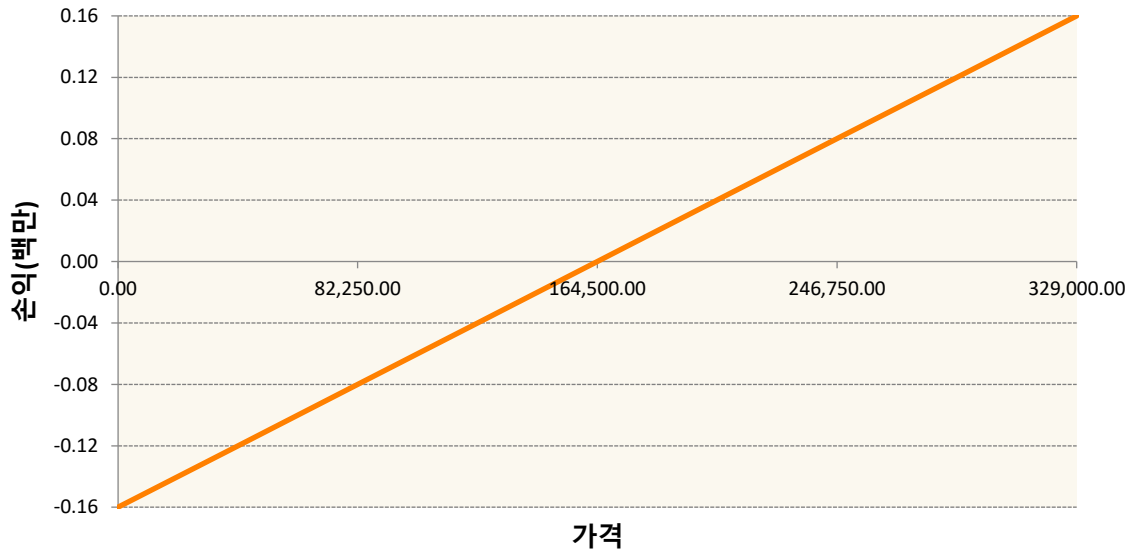
2. 만기시점의 손익구조



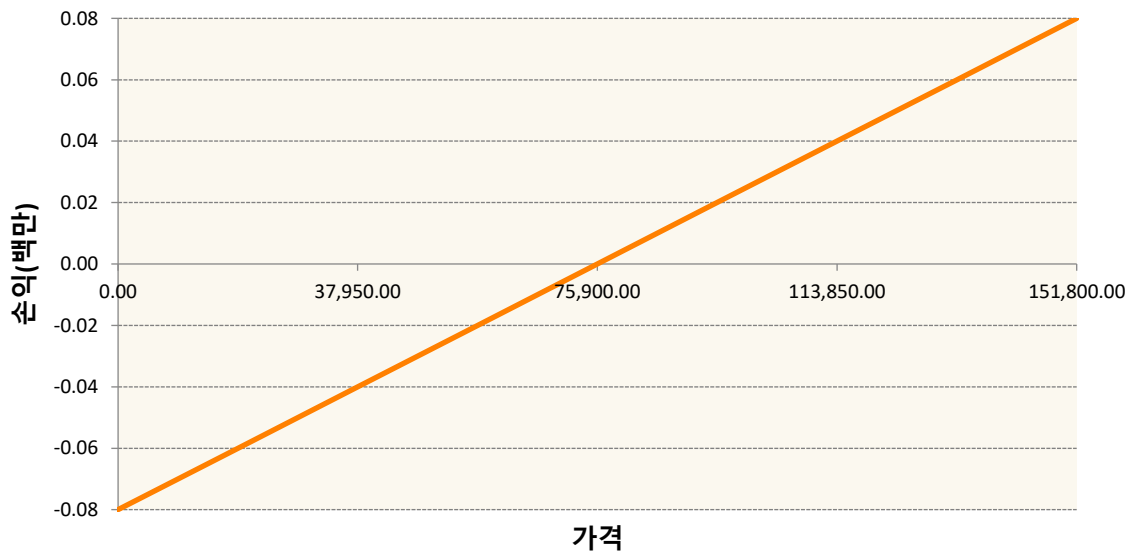
KR410ZW30002-2025-03 한미반도체개별선물



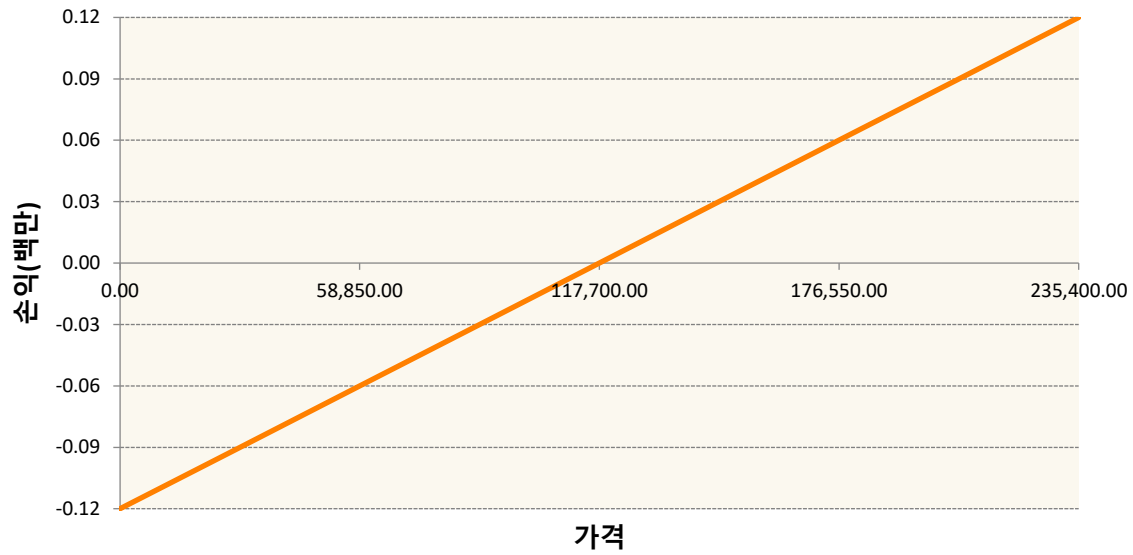
KR41BJW30002-2025-03 엔씨소프트개별선물



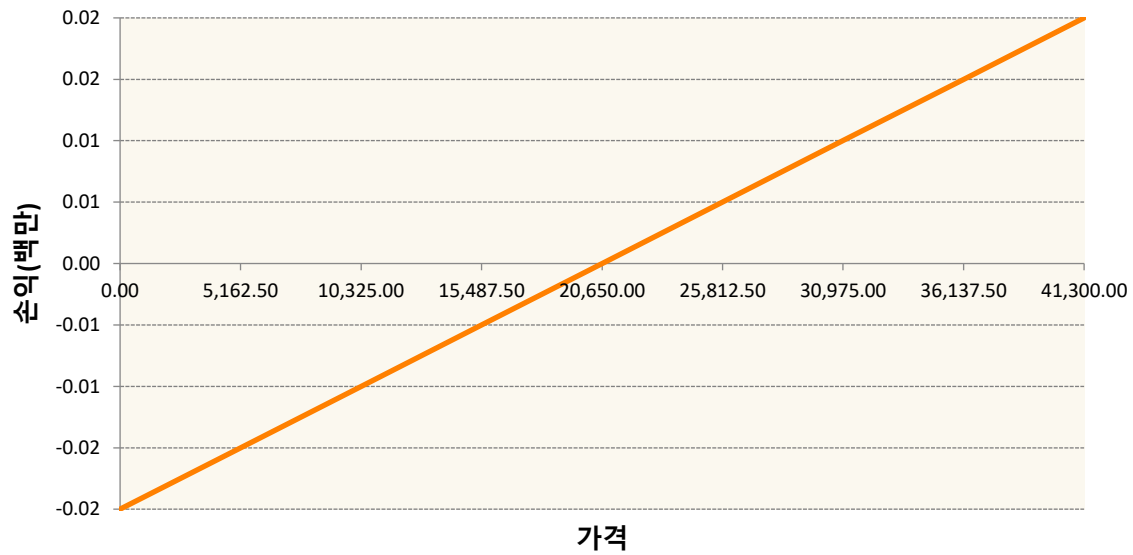
KR41BMW30006-2025-03 한국항공우주개별선물



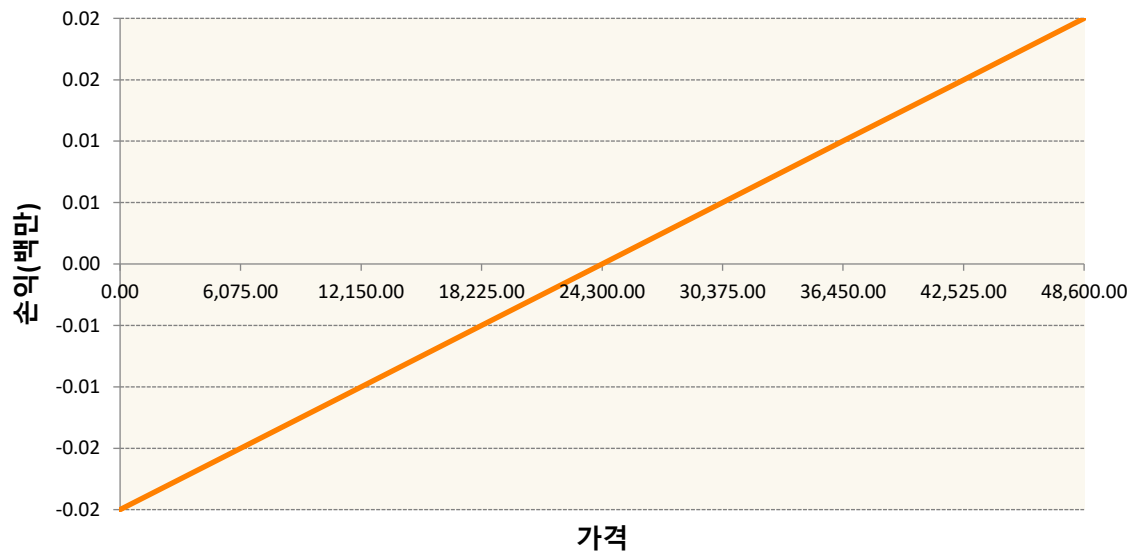
KR41C6W30009-2025-03 아모레퍼시픽개별선물



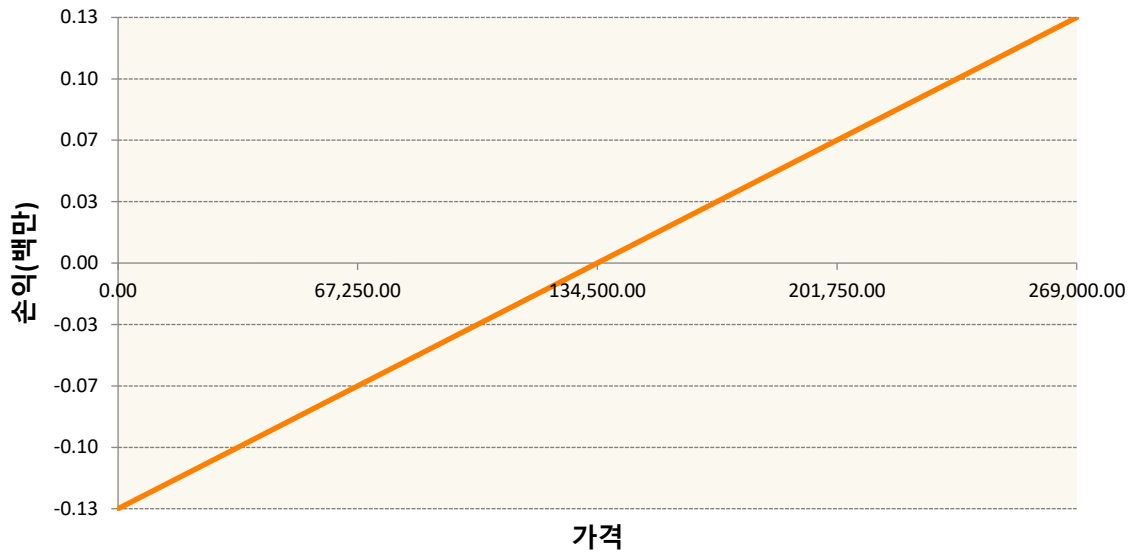
KR41CBW30007-2025-03 한화솔루션개별선물



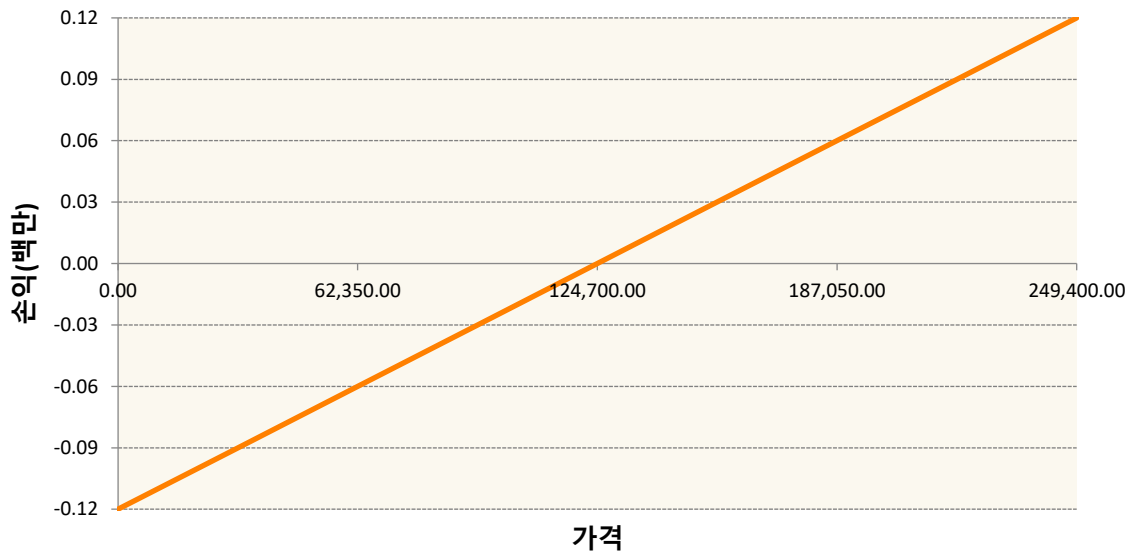
KR41CNW30002-2025-03 포스코DX개별선물



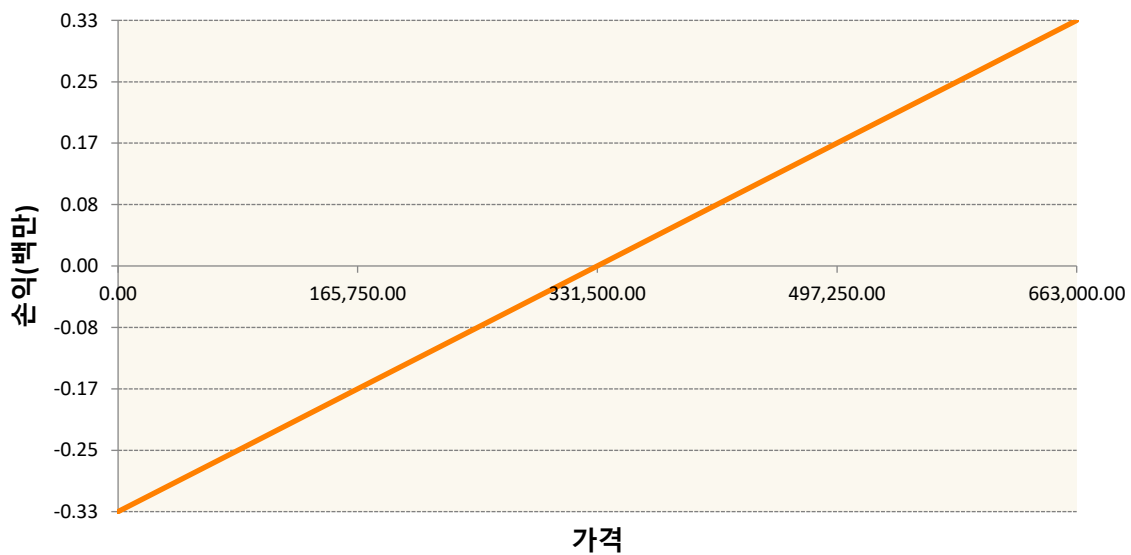
KR41E8W30003-2025-03 포스코퓨처엠개별선물



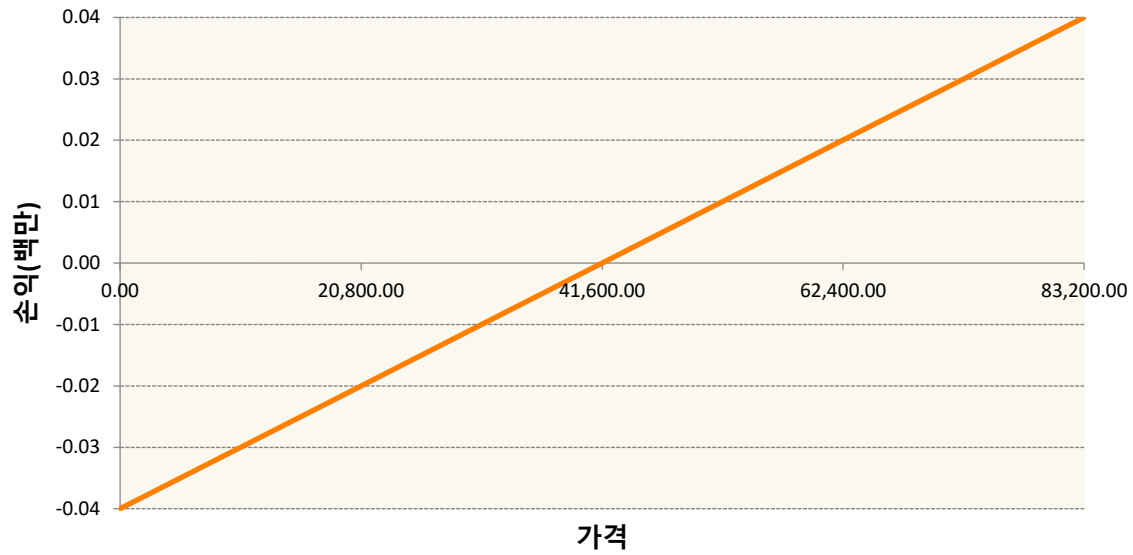
KR41EJW30006-2025-03 SKC개별선물



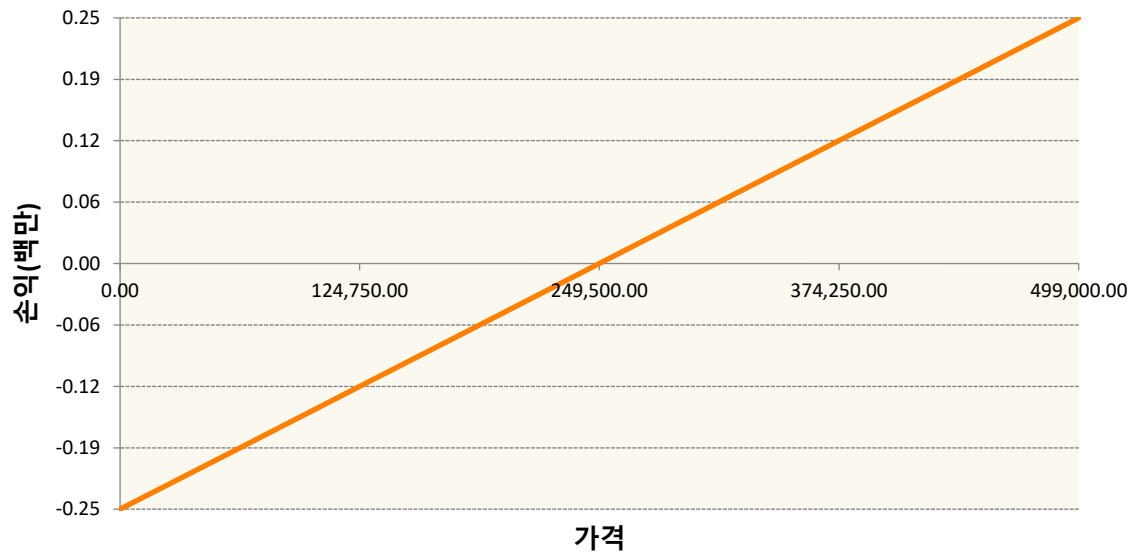
KR41F5W30008-2025-03 LG에너지솔루션개별선물



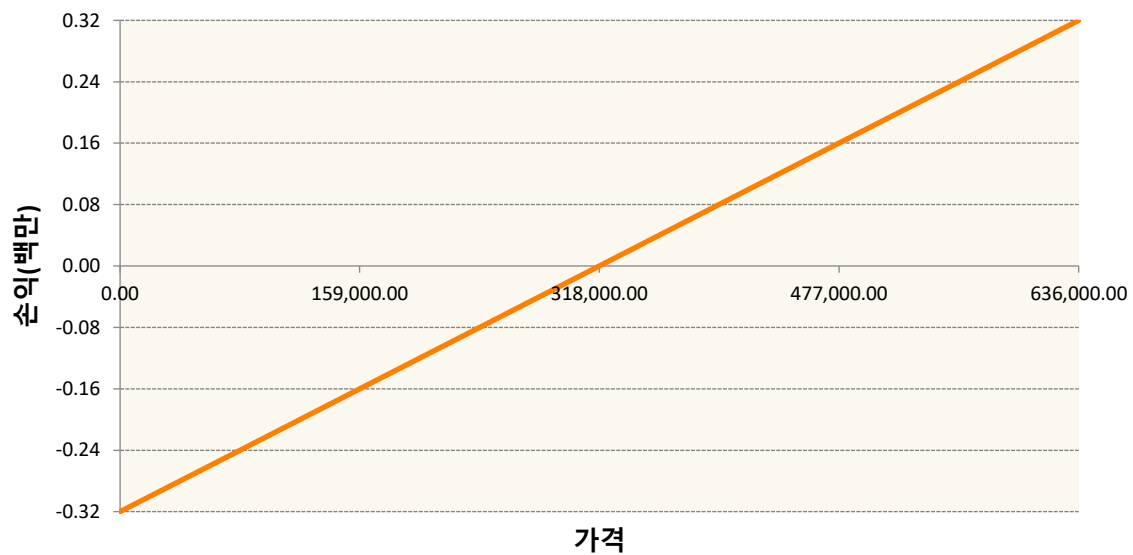
KR41F9W30000-2025-03 SK바이오사이언스개별선물



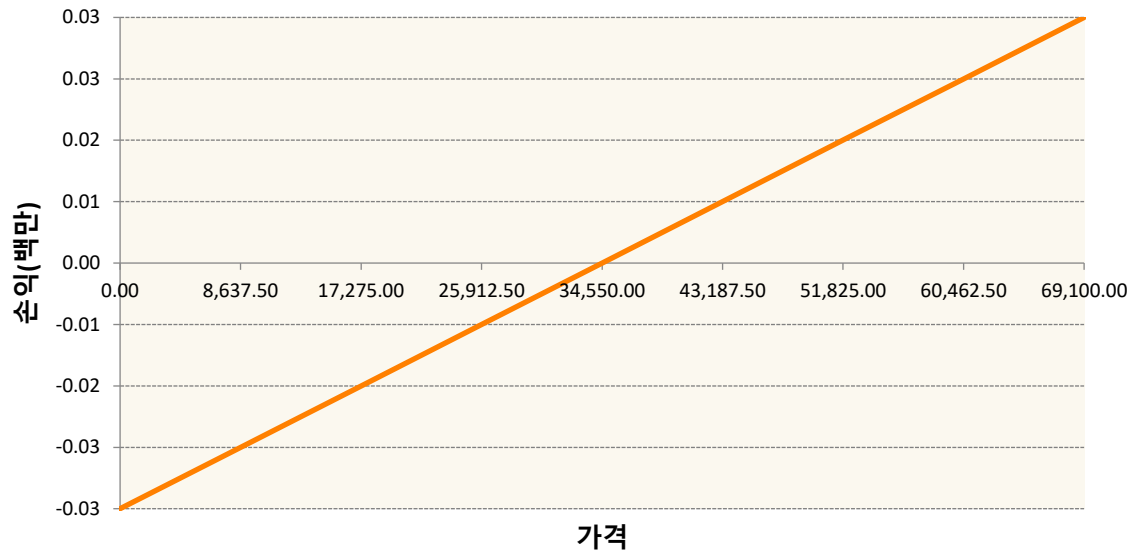
KR41FCW30008-2025-03 하이브개별선물



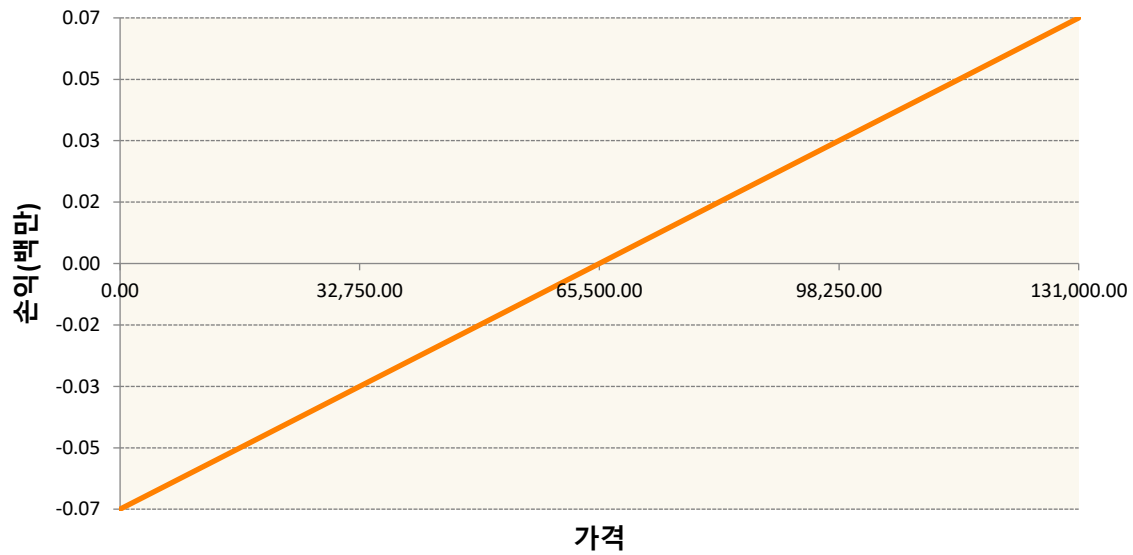
KR41FDW30006-2025-03 HD현대중공업개별선물



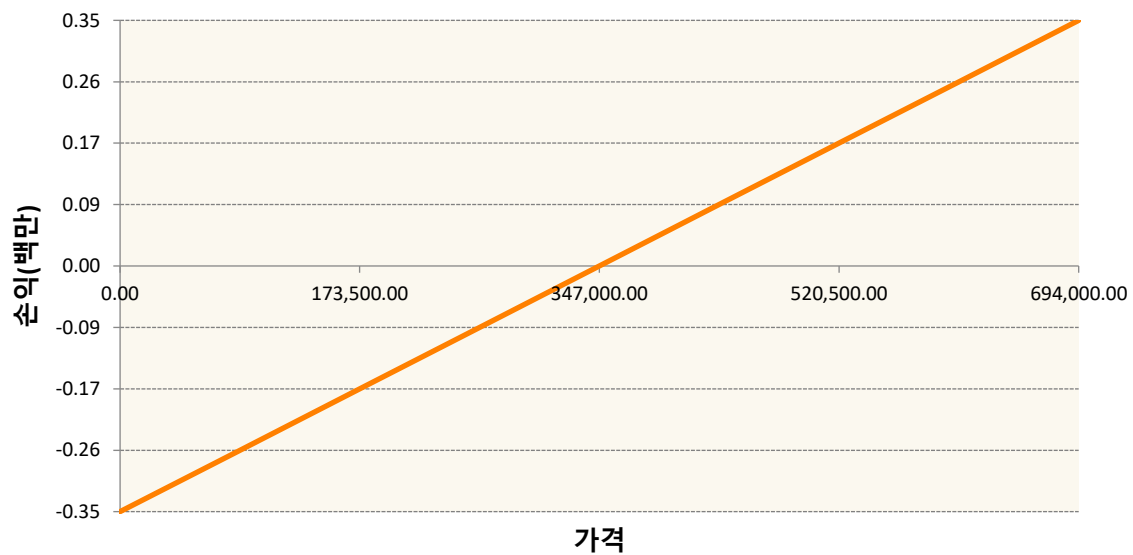
KR41G0W30008-2025-03 씨에스원드개별선물



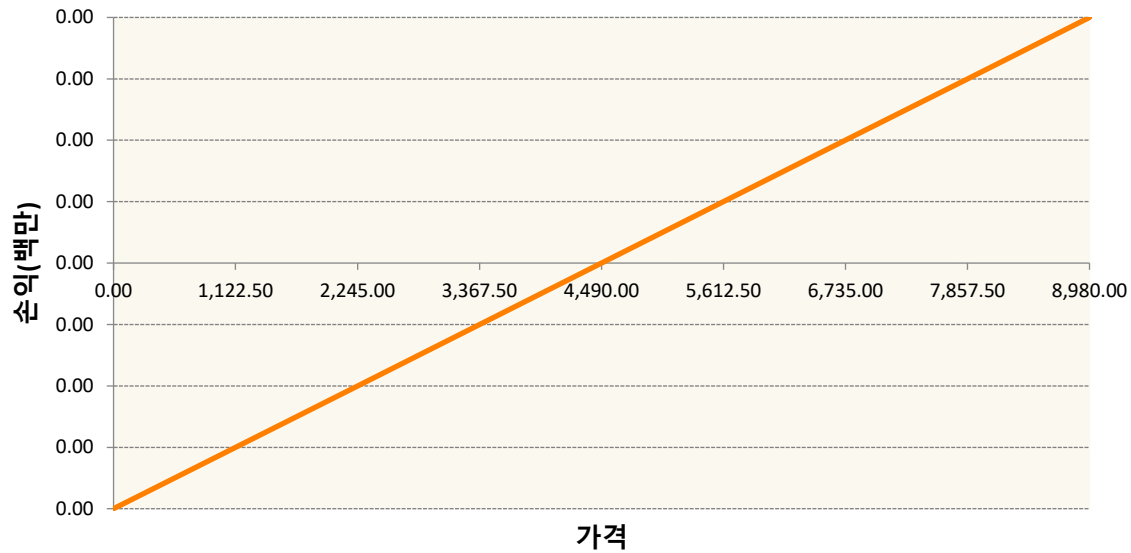
KR41G3W30002-2025-03 한전기술개별선물



KR41GHW30005-2025-03 HD현대일렉트릭개별선물



KR41GKW30009-2025-03 KG모빌리티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W30(2025-03 코스피200지수선물	645
KR410FW30(2025-03 두산로보틱스개별선물	12
KR410ZW30(2025-03 한미반도체개별선물	36
KR41BJW30C 2025-03 엔씨소프트개별선물	28
KR41BMW30C 2025-03 한국항공우주개별선물	7
KR41C6W30(2025-03 아모레퍼시픽개별선물	36
KR41CBW30(2025-03 한화솔루션개별선물	7
KR41CNW30 2025-03 포스코DX개별선물	12
KR41E8W30(2025-03 포스코퓨처엠개별선물	17
KR41EJW300 2025-03 SKC개별선물	24
KR41F5W30(2025-03 LG에너지솔루션개별선물	115
KR41F9W30(2025-03 SK바이오사이언스개별선물	10
KR41FCW30(2025-03 하이브개별선물	51
KR41FDW30(2025-03 HD현대중공업개별선물	70
KR41G0W30(2025-03 씨에스윈드개별선물	8
KR41G3W30 2025-03 한전기술개별선물	12
KR41GHW30 2025-03 HD현대일렉트릭개별선물	69
KR41GKW30 2025-03 KG모빌리티개별선물	4

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

(단위:백만원)

2,187

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

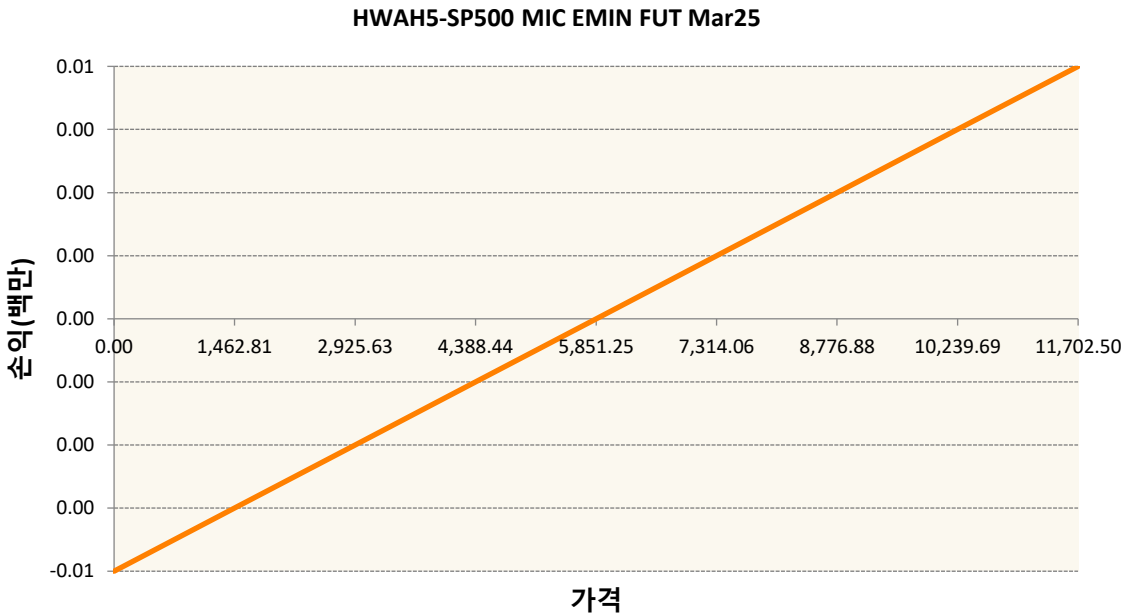
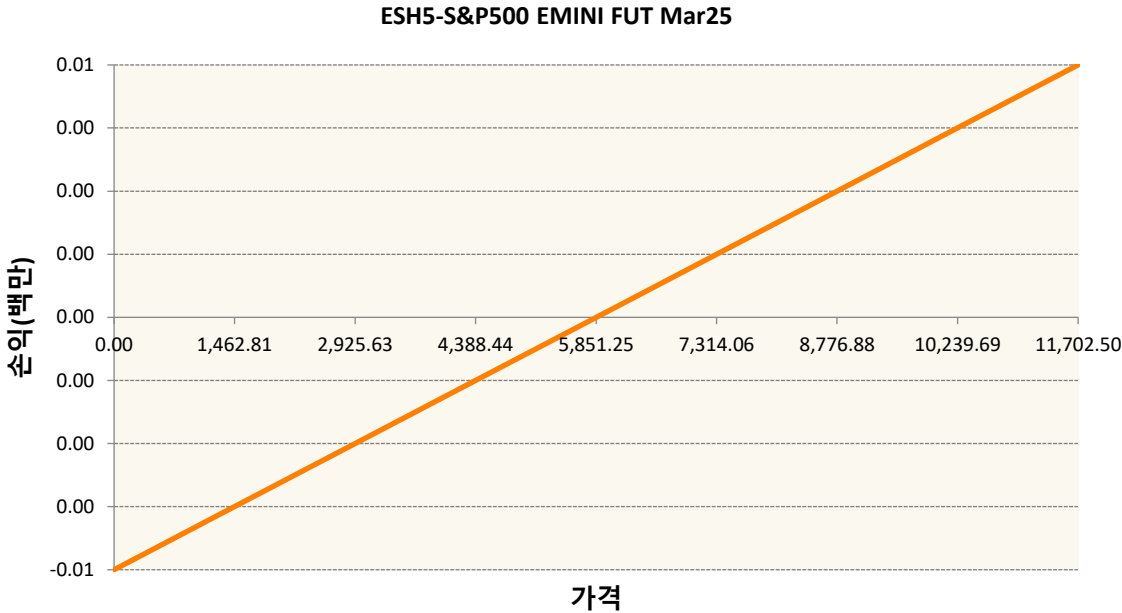
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	29,323	0	29,323	
누계	유가증권	선물	1,230	0	1,230	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,346
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,290

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

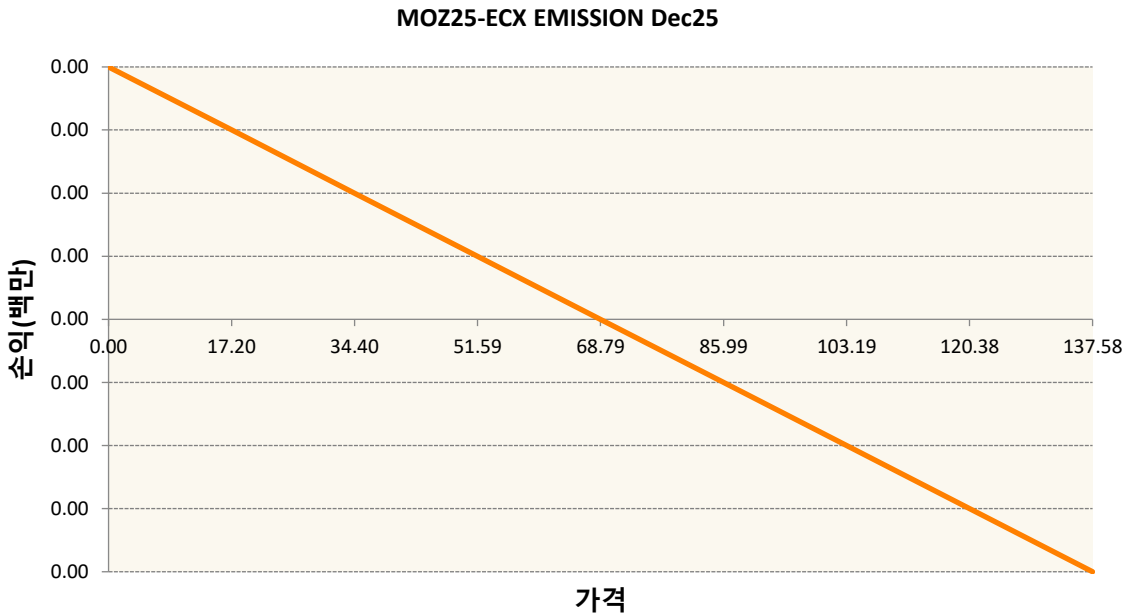
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-24	6,022	-6,046	
누계	통화	선도	0	1,145	-1,145	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	34
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	58
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	482

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

(단위:백만원)

883

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

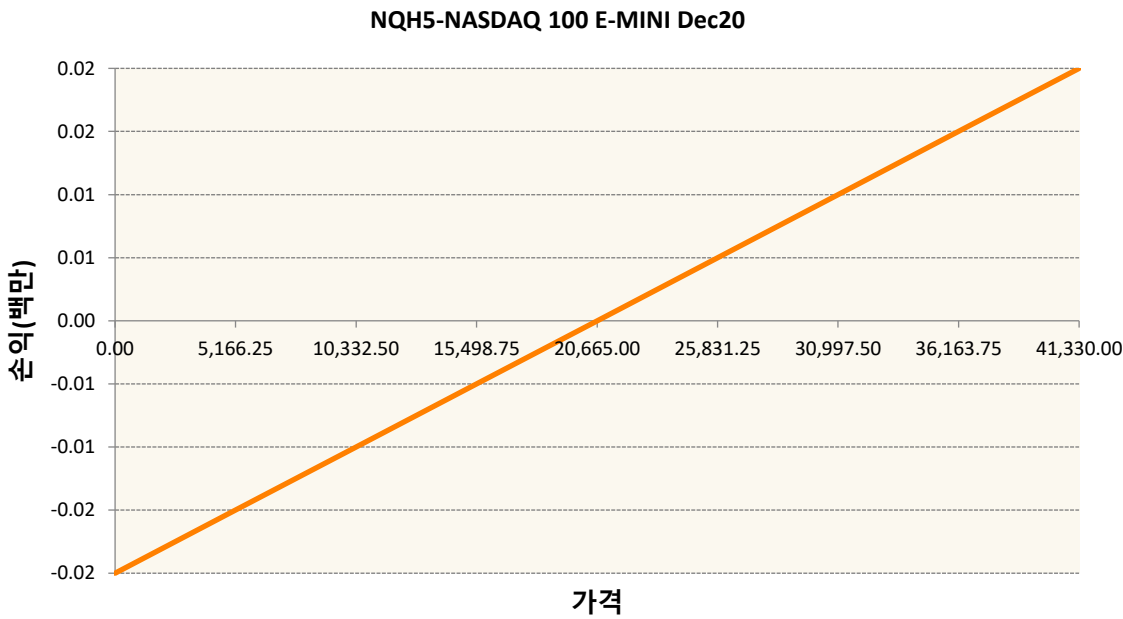
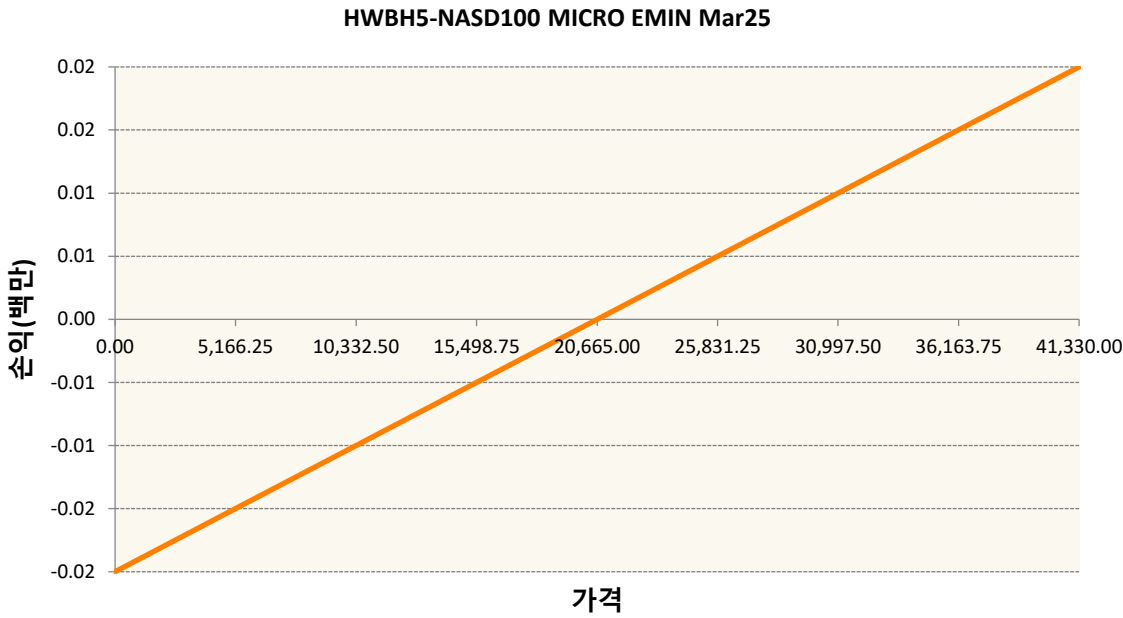
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,417	0	14,417	
누계	유가증권	선물	358	0	358	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	29
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,153

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,059

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

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	734
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,119
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,233
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,803

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

(단위:백만원)

8,839

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

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	12
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12

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

(단위:백만원)

55

공시일	2025-03-07
기준일	2025-03-06

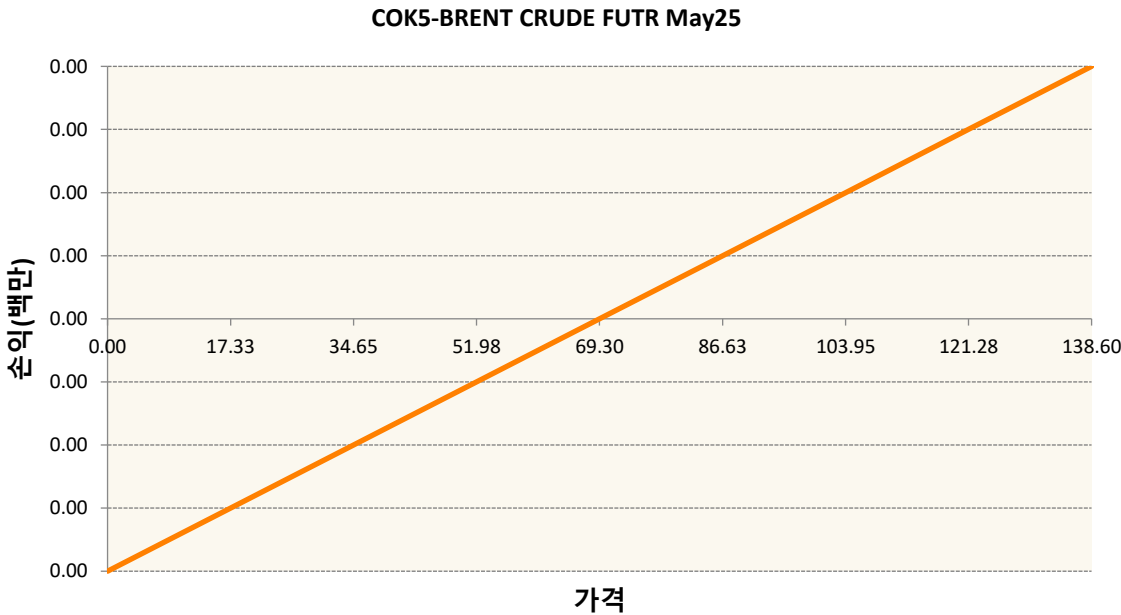
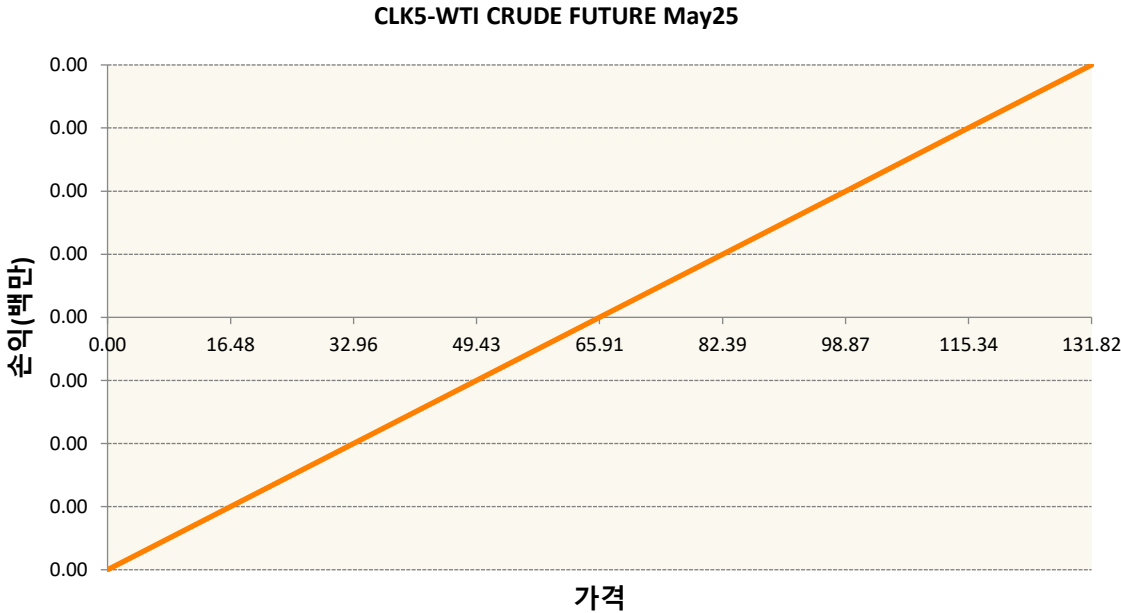
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

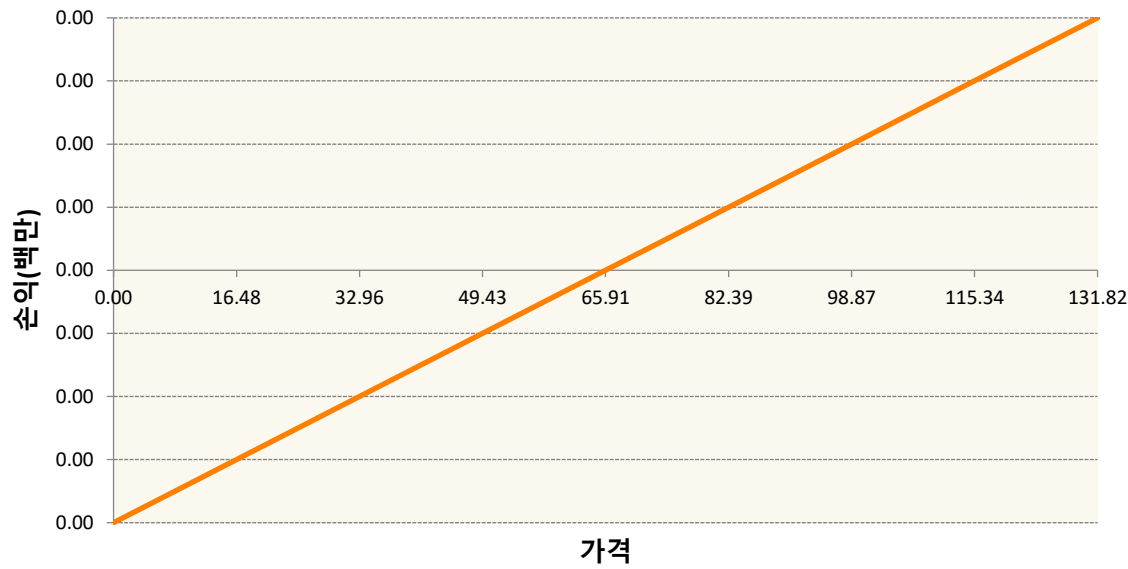
(단위:백만원)

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	849	0	849	
누계	통화	선물	0	159	-159	장내

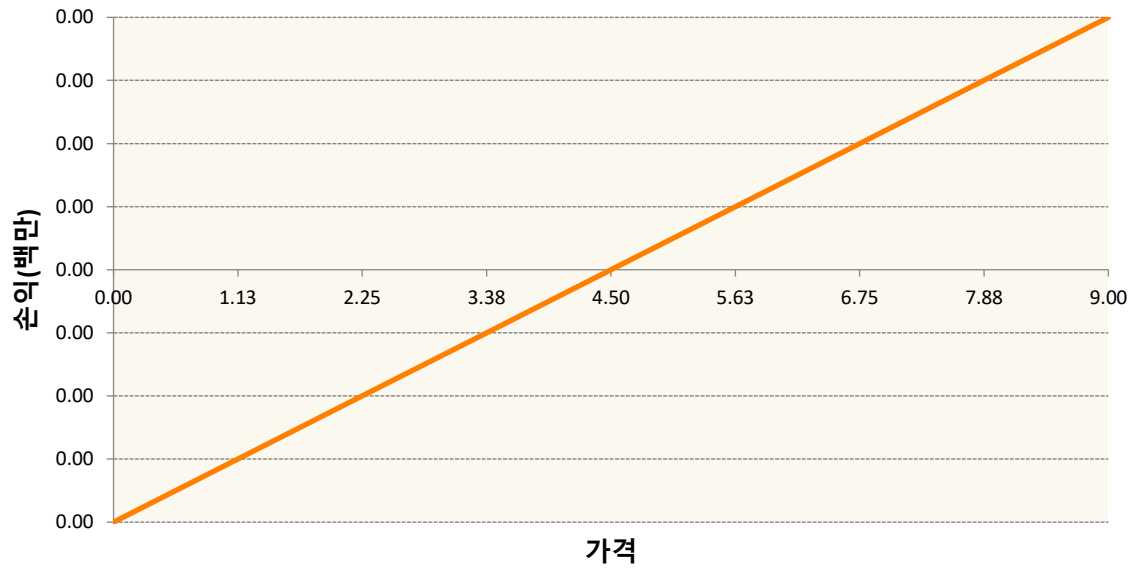
2. 만기시점의 손익구조



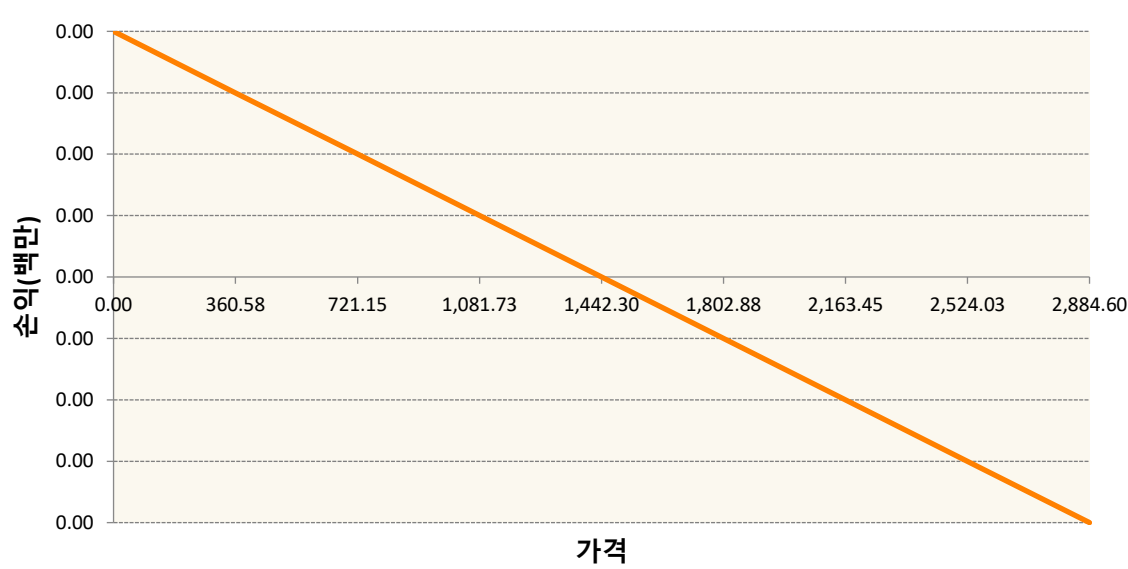
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



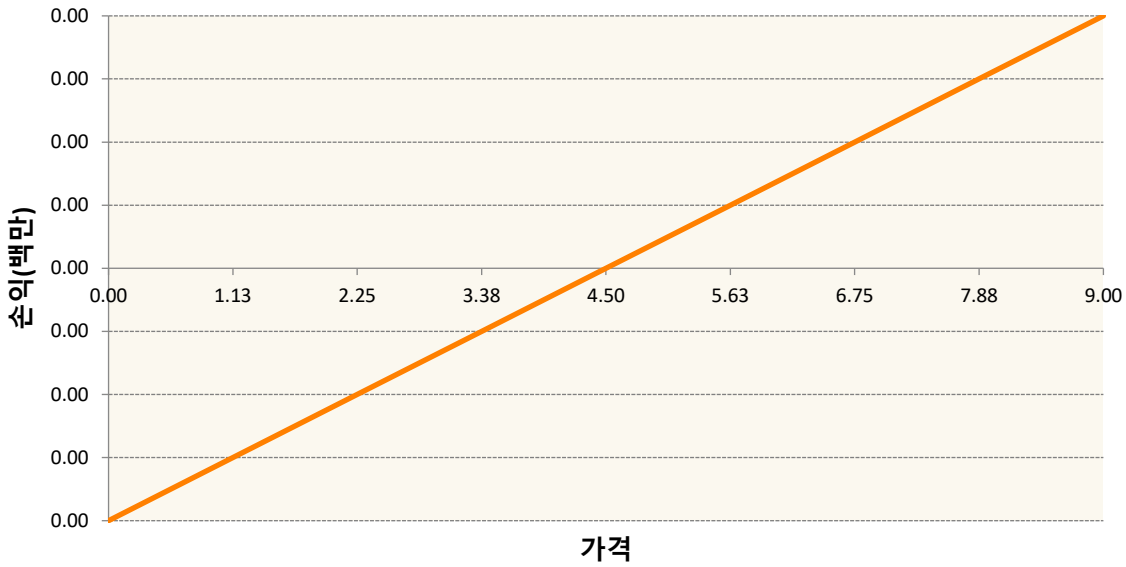
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



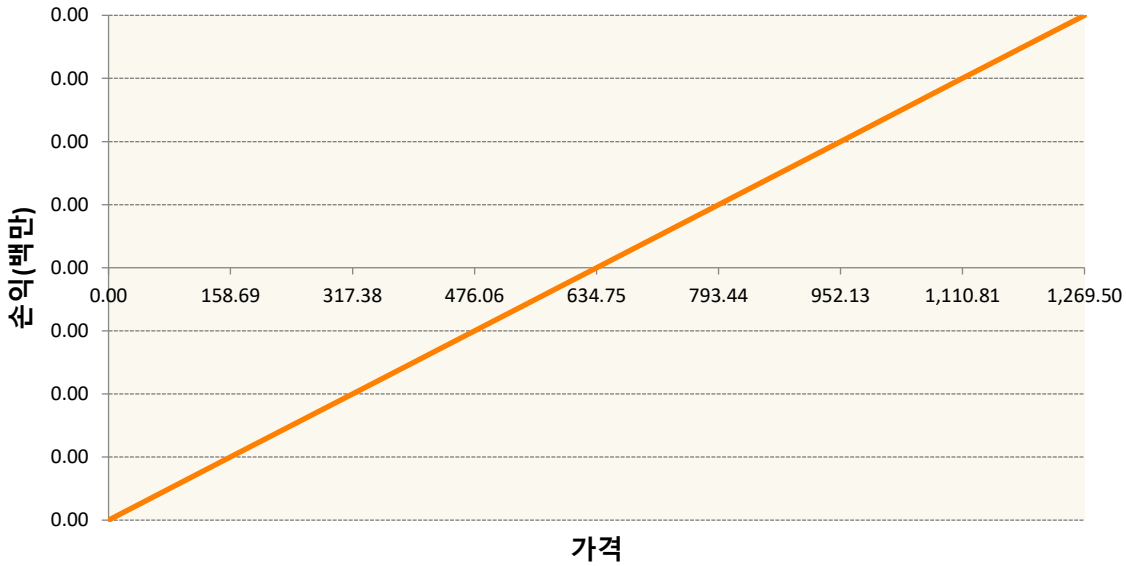
KR4175W30007-2025-03 달러선물



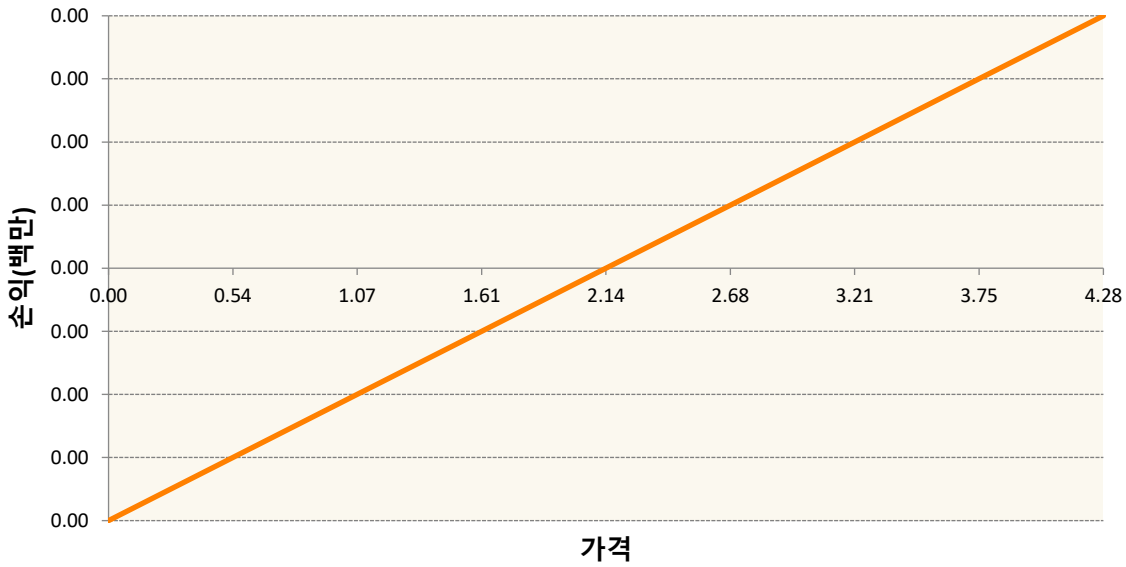
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	16
ECK5	E-mini Crude Oil May 25	4
EOK5	E-MINI NATURAL GAS May 25	7
KR4175W30(	2025-03 달러선물	13
NGK25	NATURAL GAS FUTR May 25	16
QSK5	Low Su Gasoil G May 25	7
XBK5	GASOLINE RBOB FUT May 25	10

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

151