

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

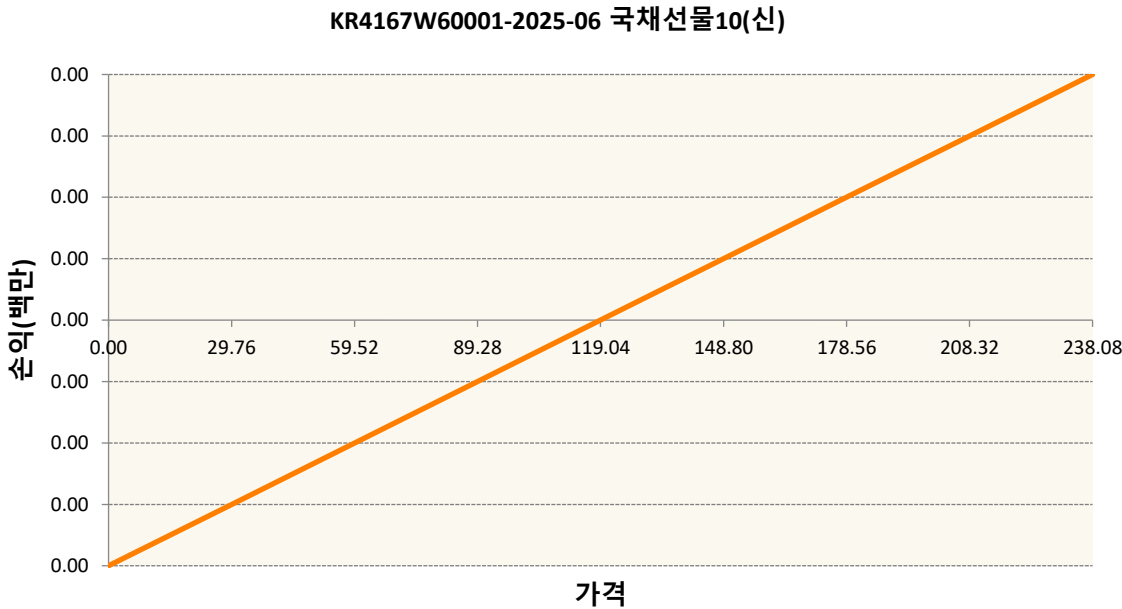
베스트장기채(채권-파생형)

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	238,080	0	238,080	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

5,954

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

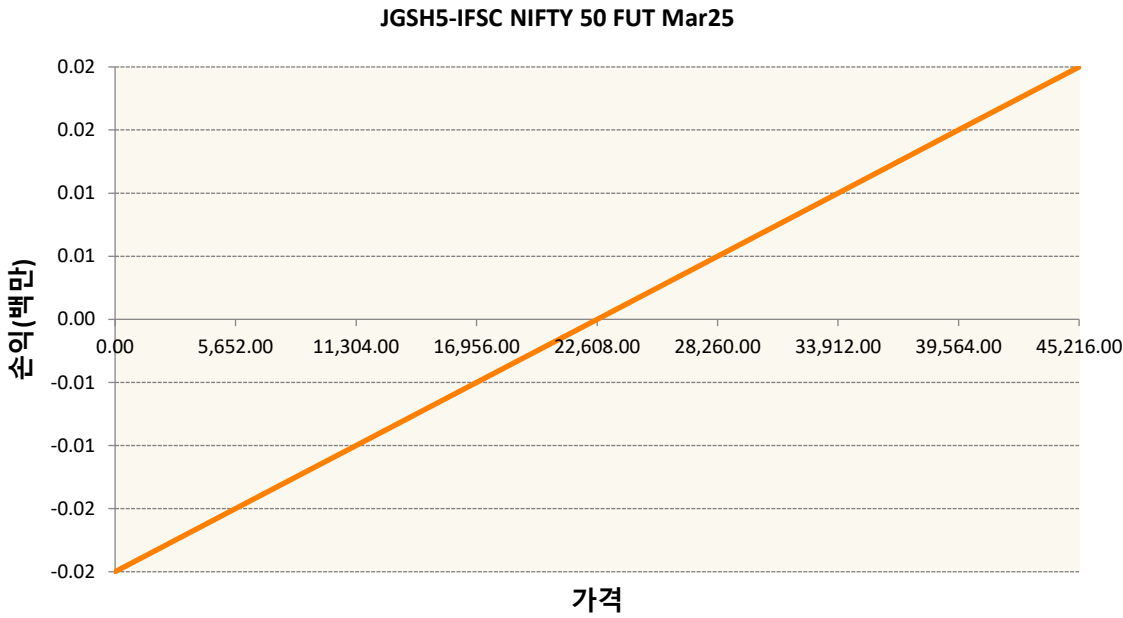
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	728	0	728	

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)

40

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

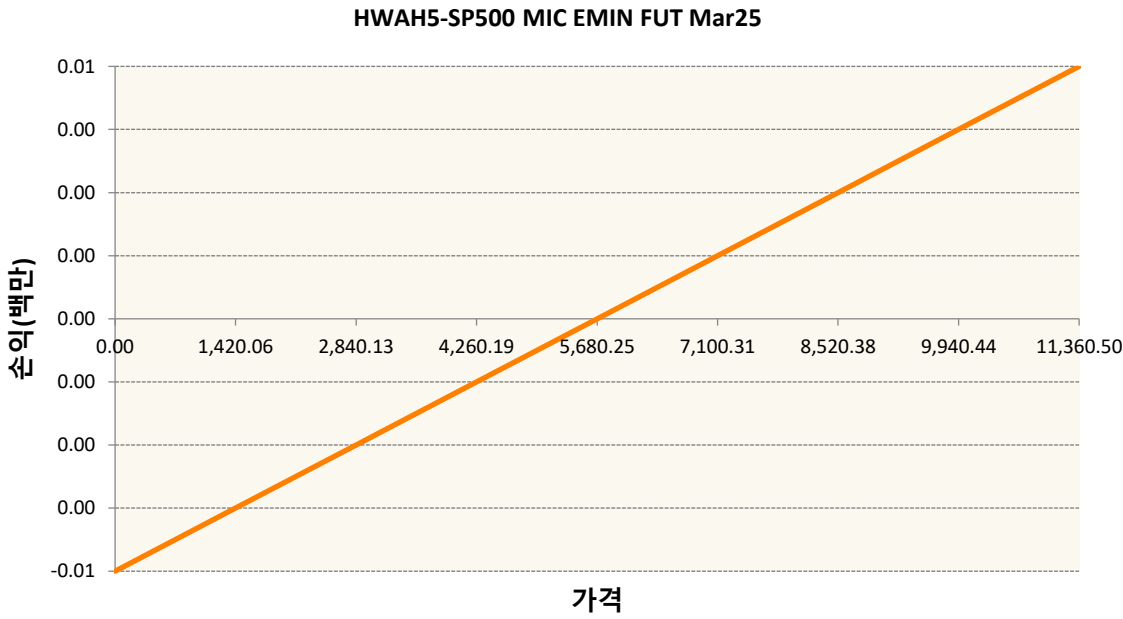
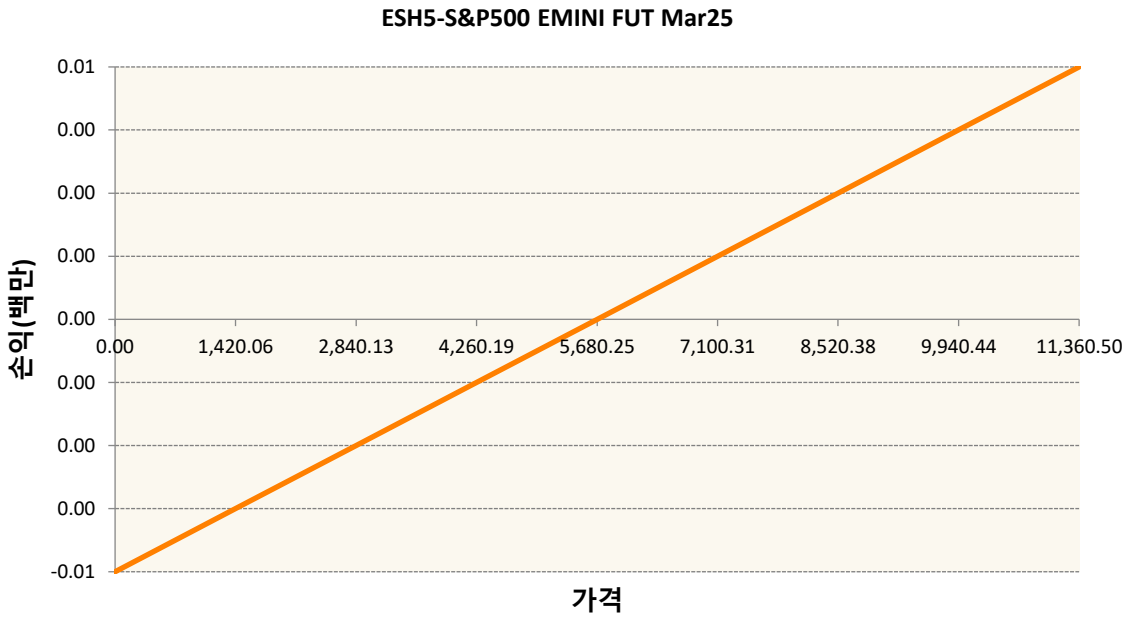
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	408	0	408	
누계	유가증권	선물	165	0	165	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	33
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	53

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

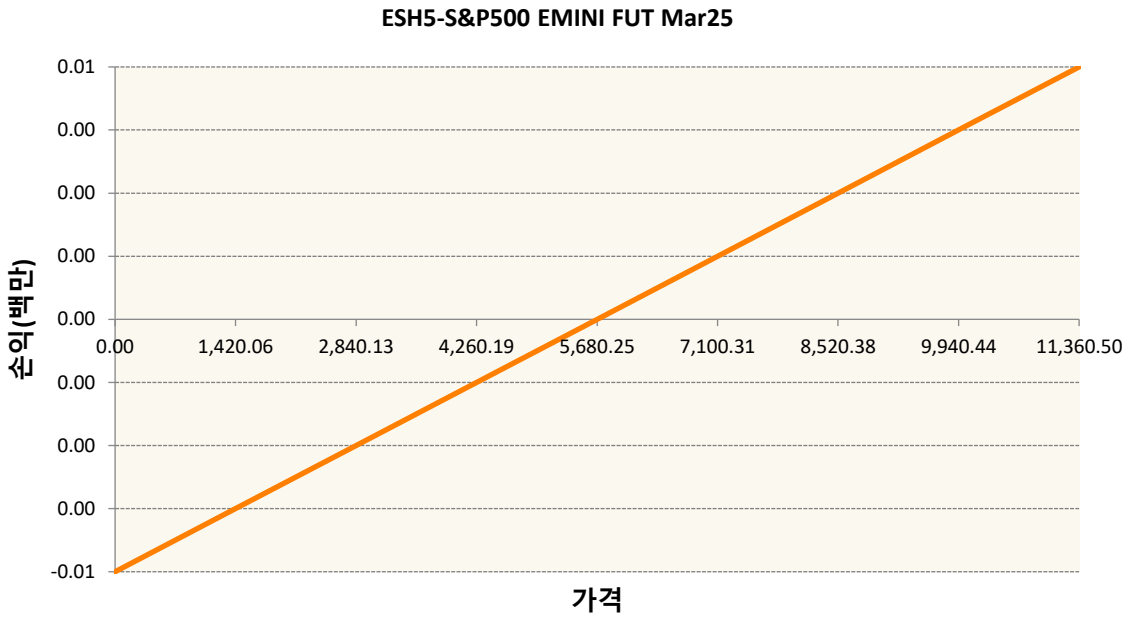
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,473	0	2,473	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	198
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

267

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

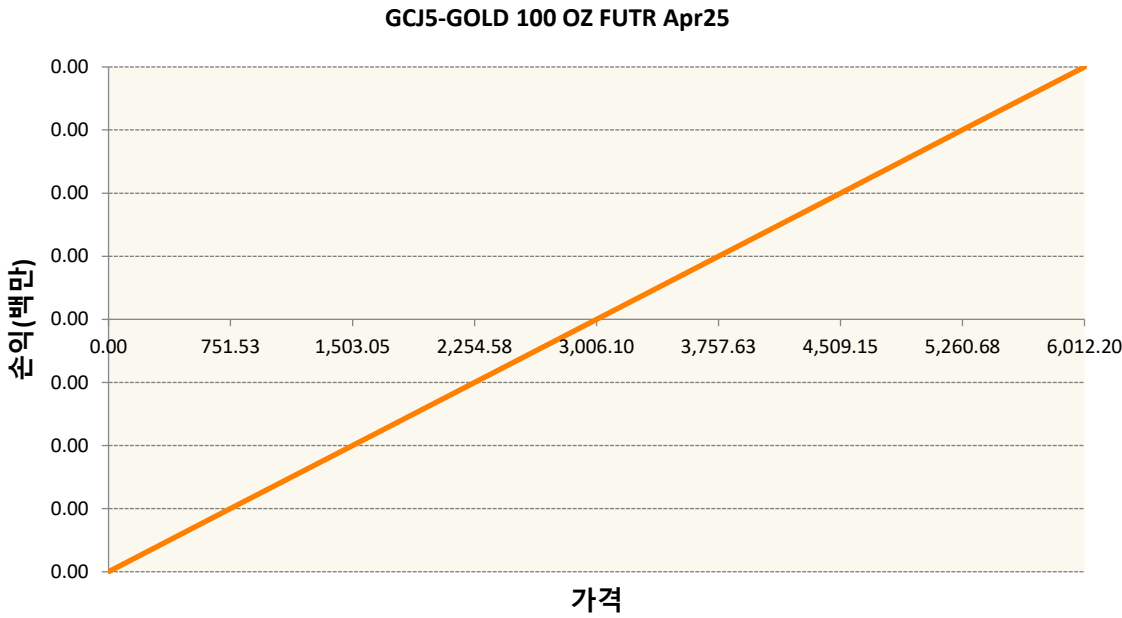
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,744	0	1,744	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 03/21/25 C276 EQUITY	0.43
GCI5 GOLD 100 OZ FUTR Apr25	139

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

(단위:백만원)

102

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

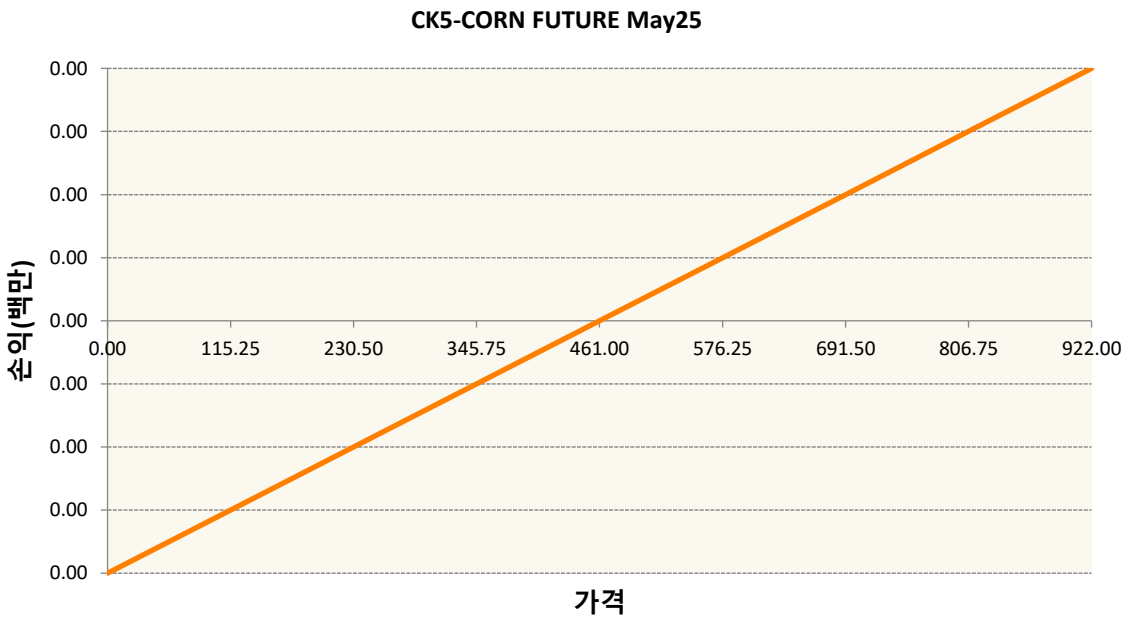
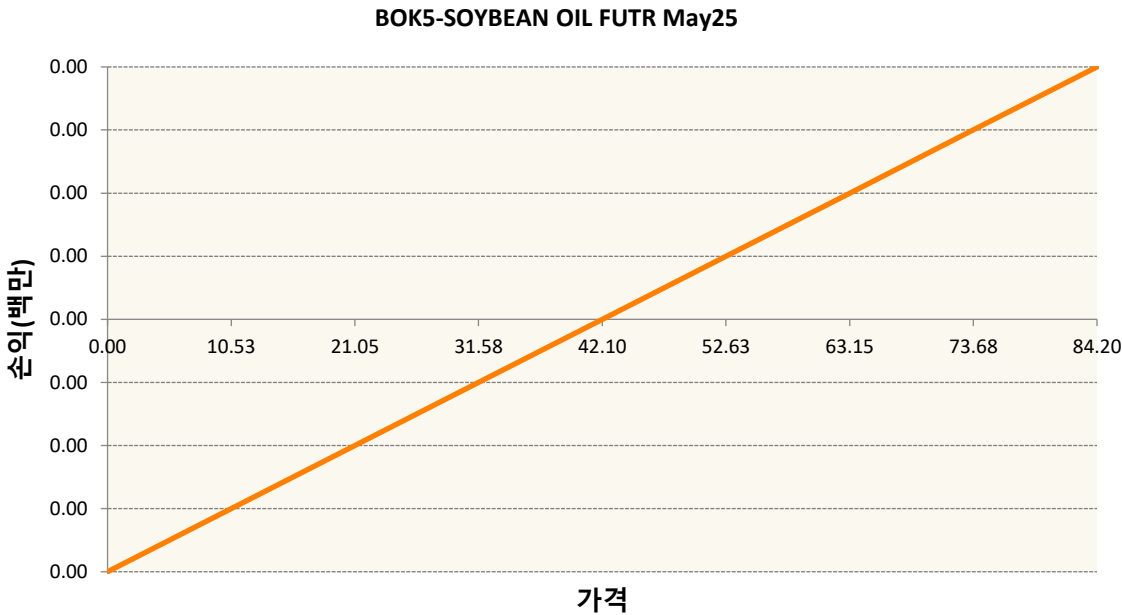
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

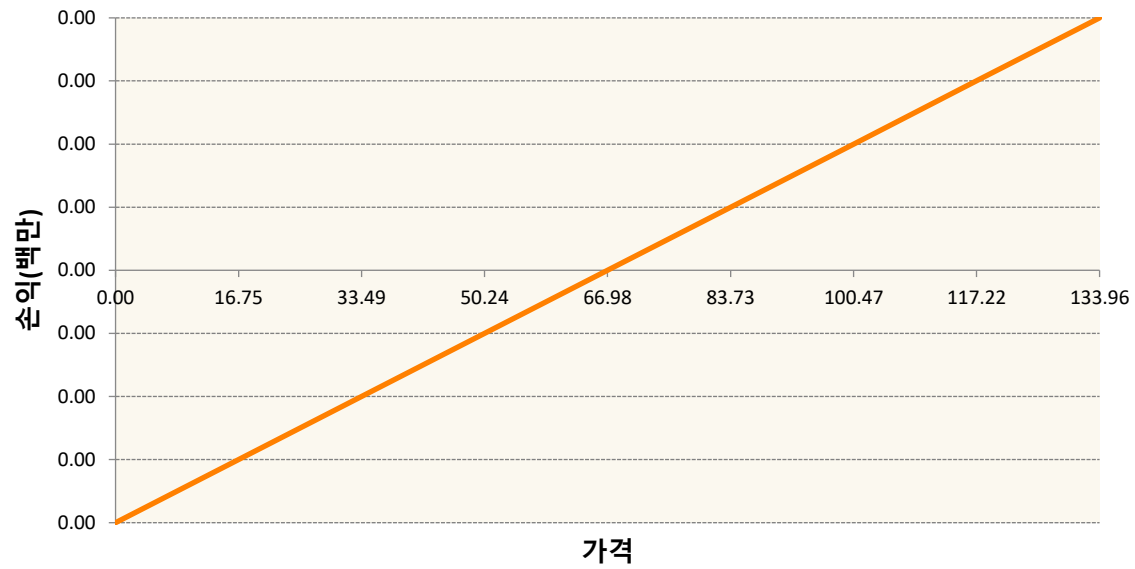
(단위:USD 백만)

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	3,811	0	3,811	
누계	통화	선물	0	377	-377	장내

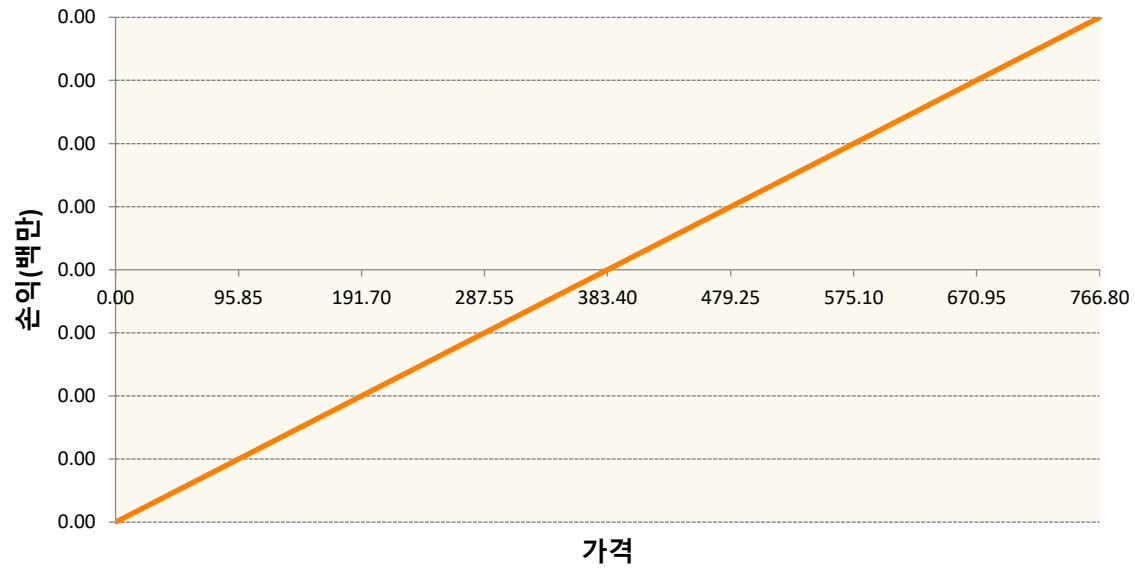
2. 만기시점의 손익구조



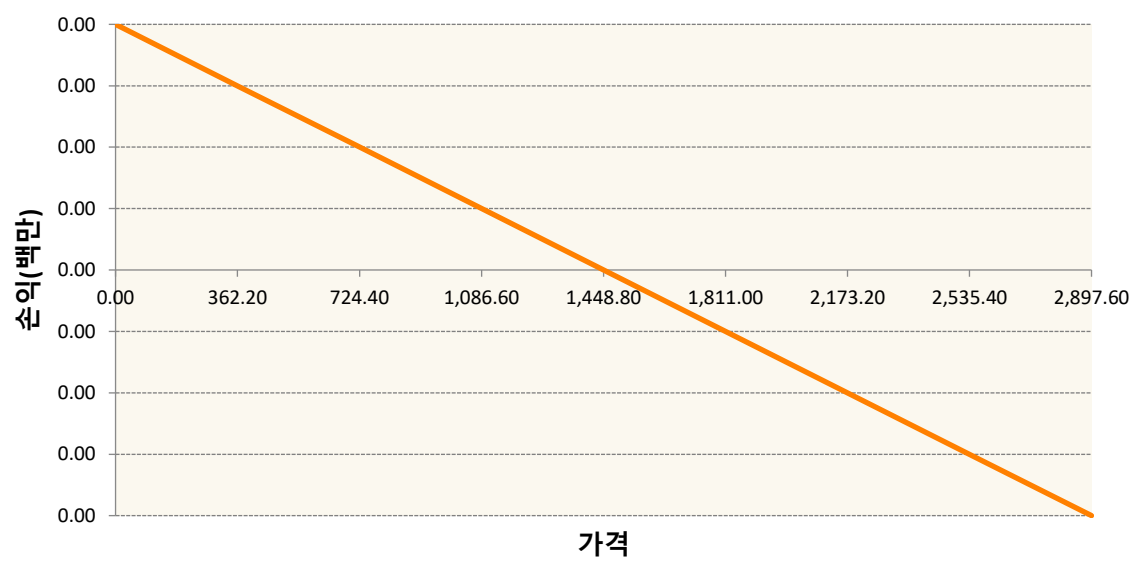
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



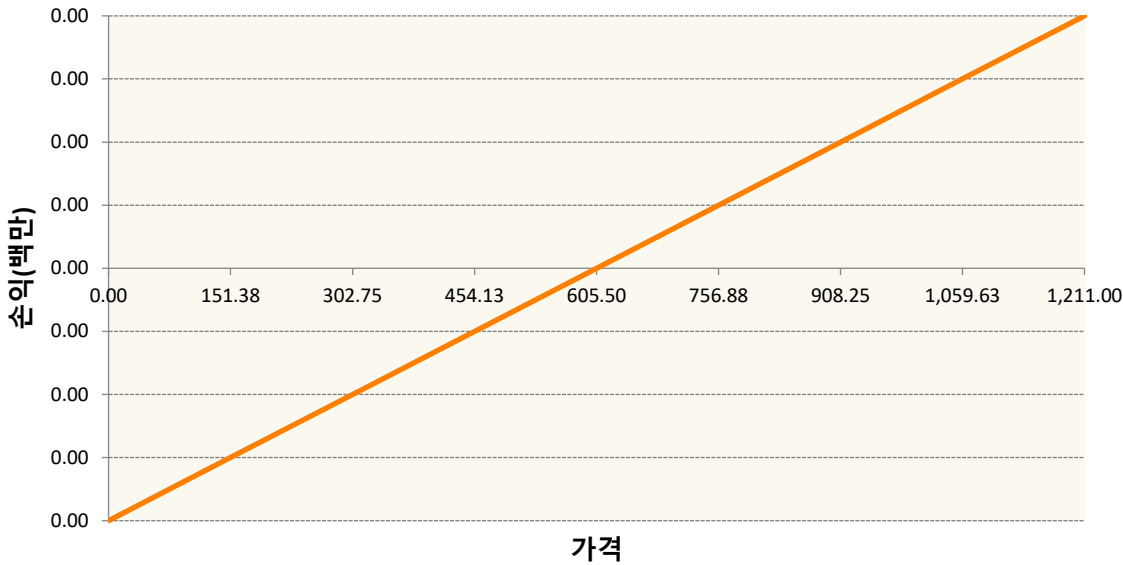
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



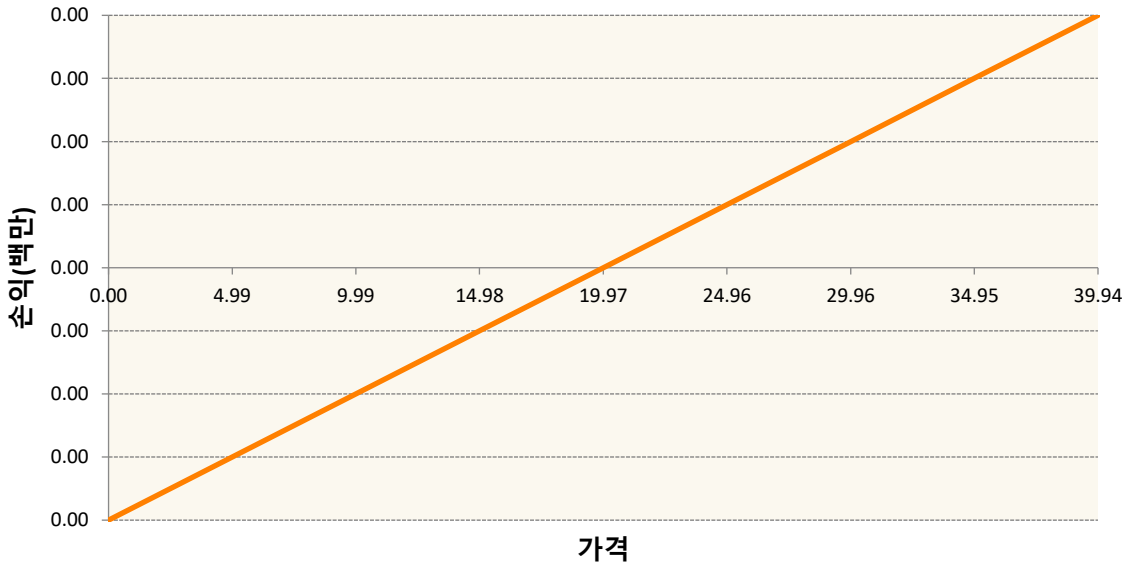
KR4175W40006-2025-04 달러선물



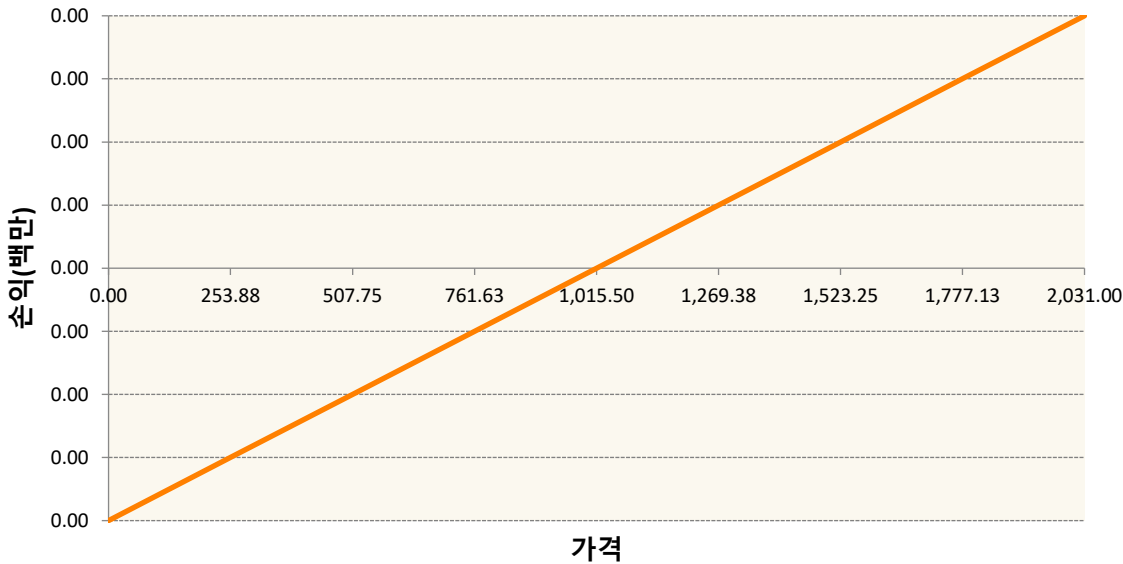
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25

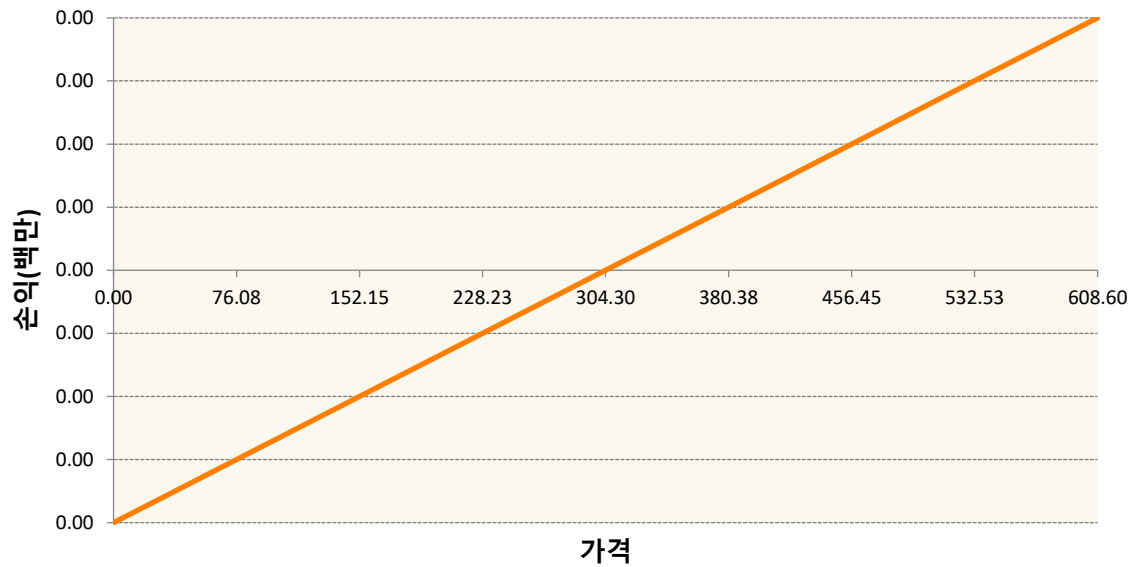


SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25

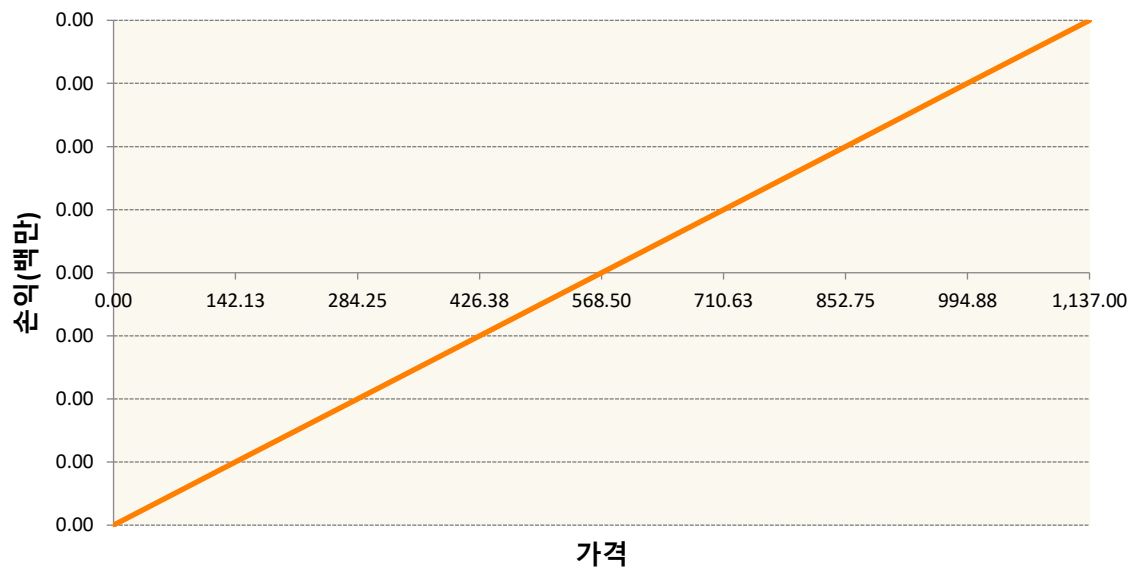


SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-03-19
기준일	2025-03-18

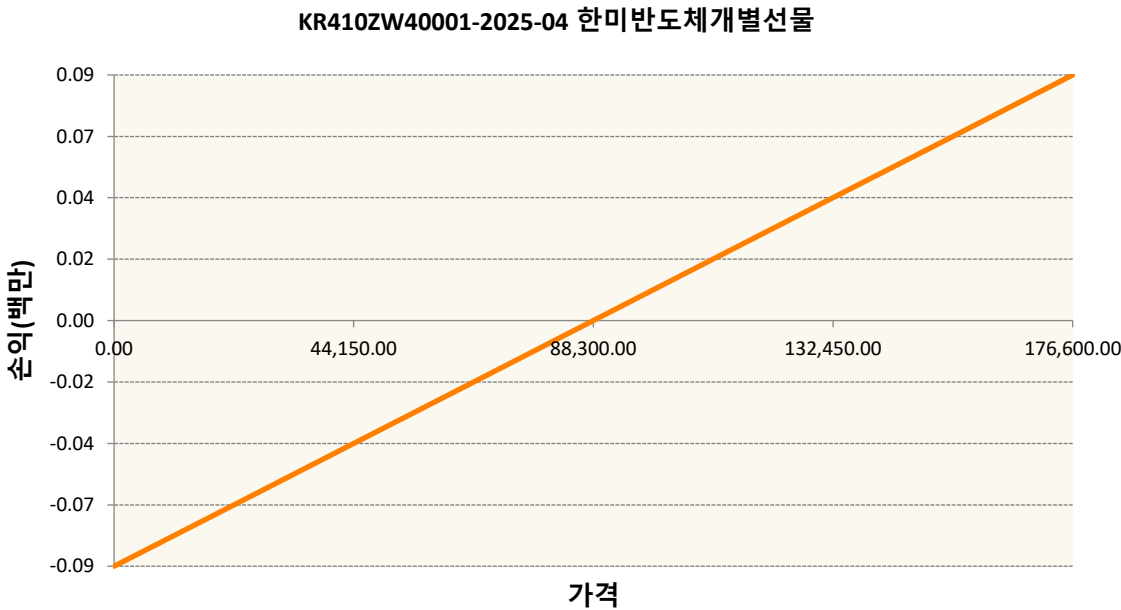
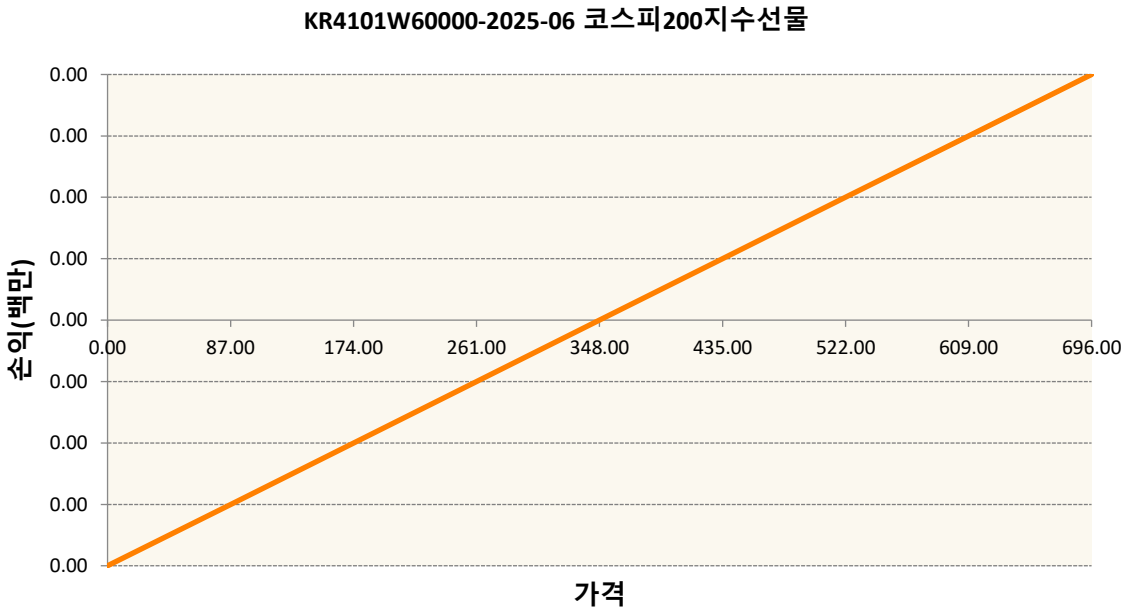
스마트인덱스모

1. 계약금액

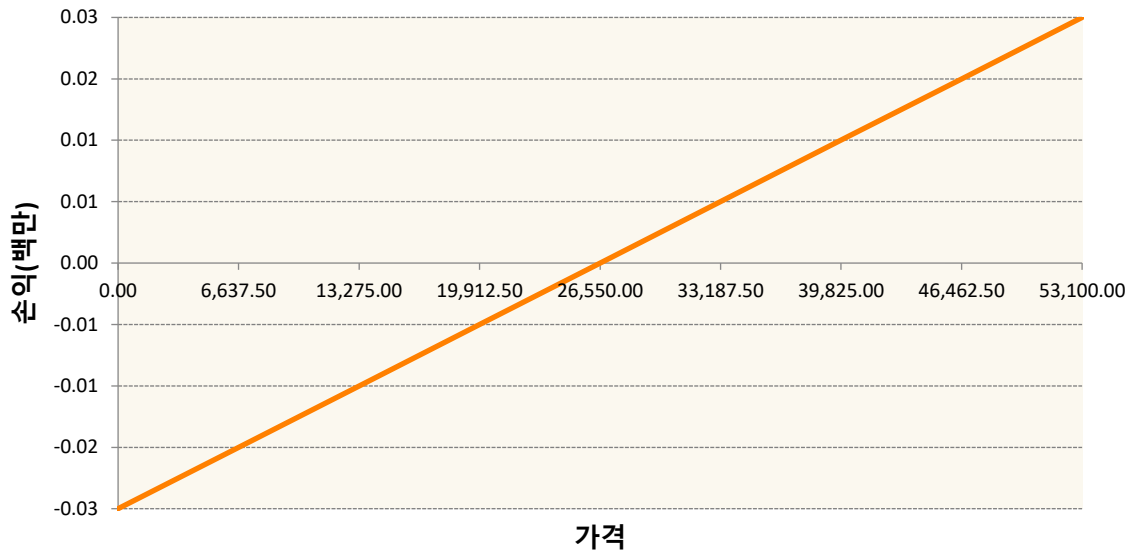
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	88	0	88	장내
누계	유가증권	선물	1,610	0	1,610	장내

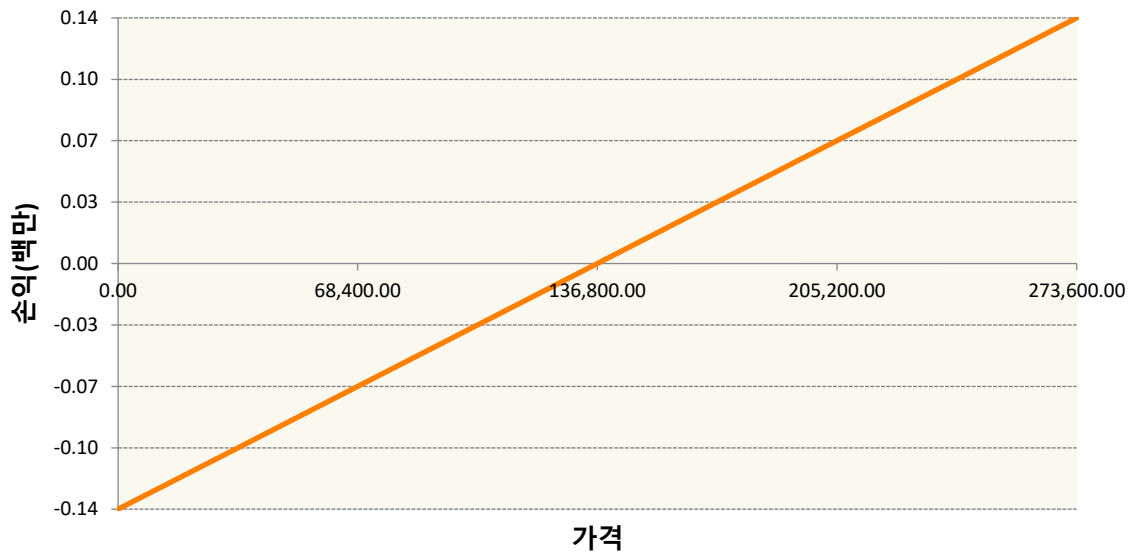
2. 만기시점의 손익구조



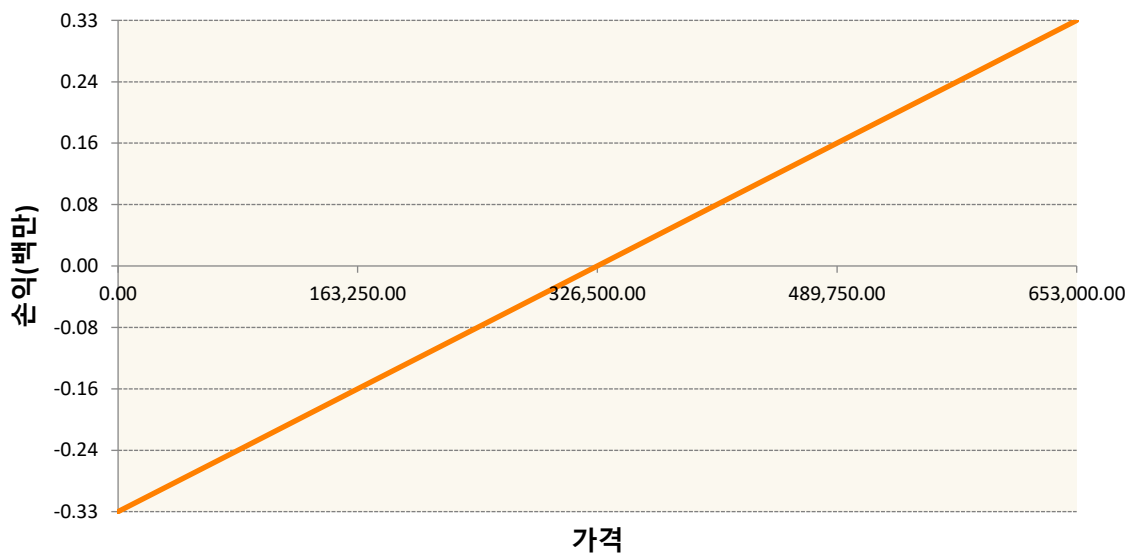
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



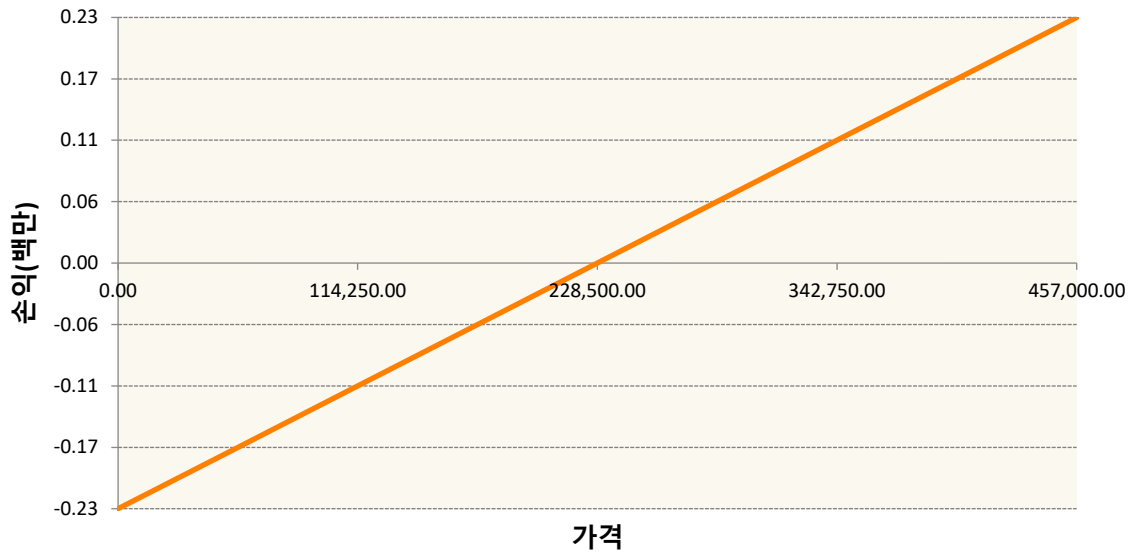
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



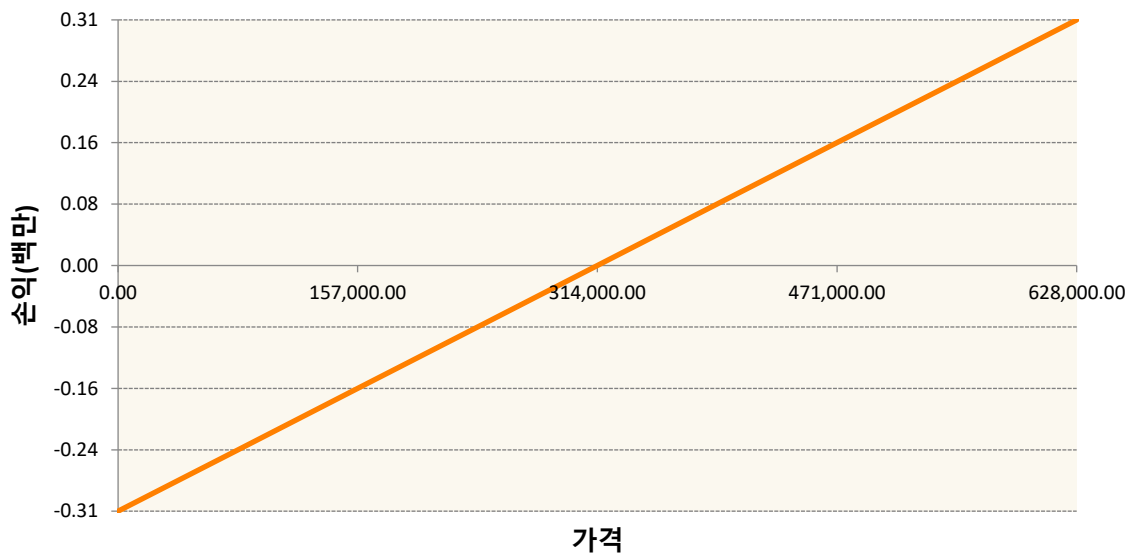
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	90
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	4
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	2
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물	14
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물	6
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	8

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

(단위:백만원)

210

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

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	314
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

486

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

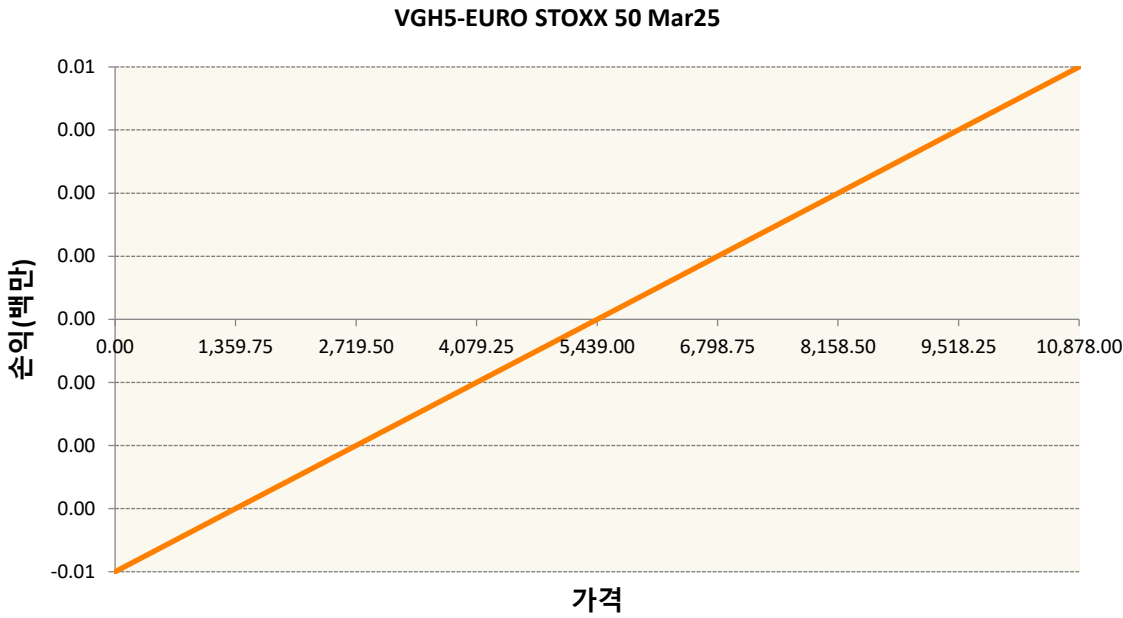
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	906	0	906	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar25	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

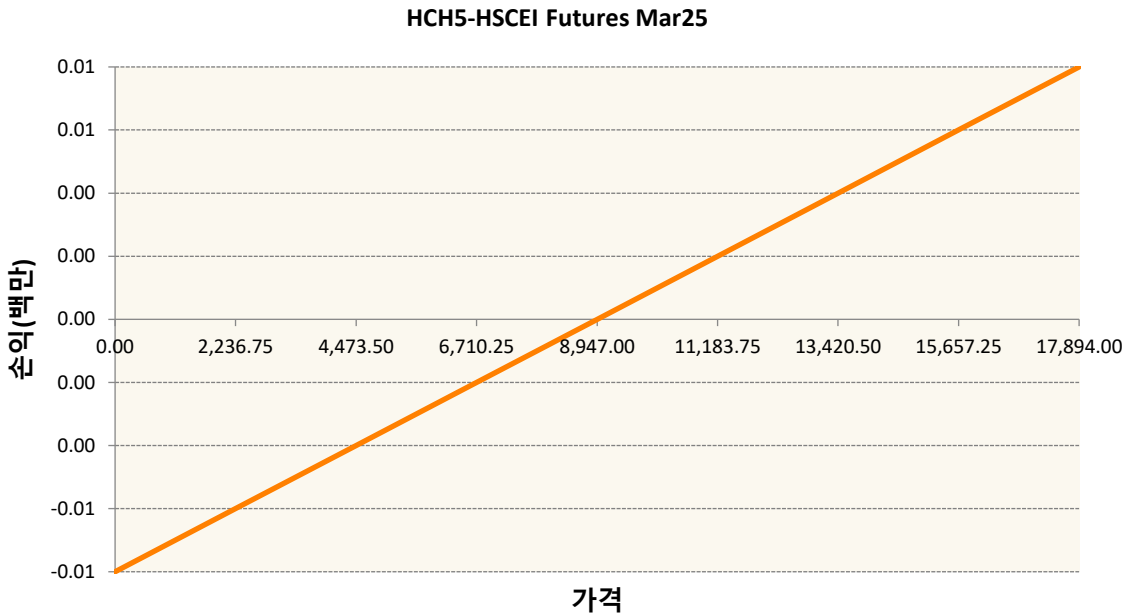
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,905	0	2,905	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH5	HSCEI Futures Mar25	232
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

318

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

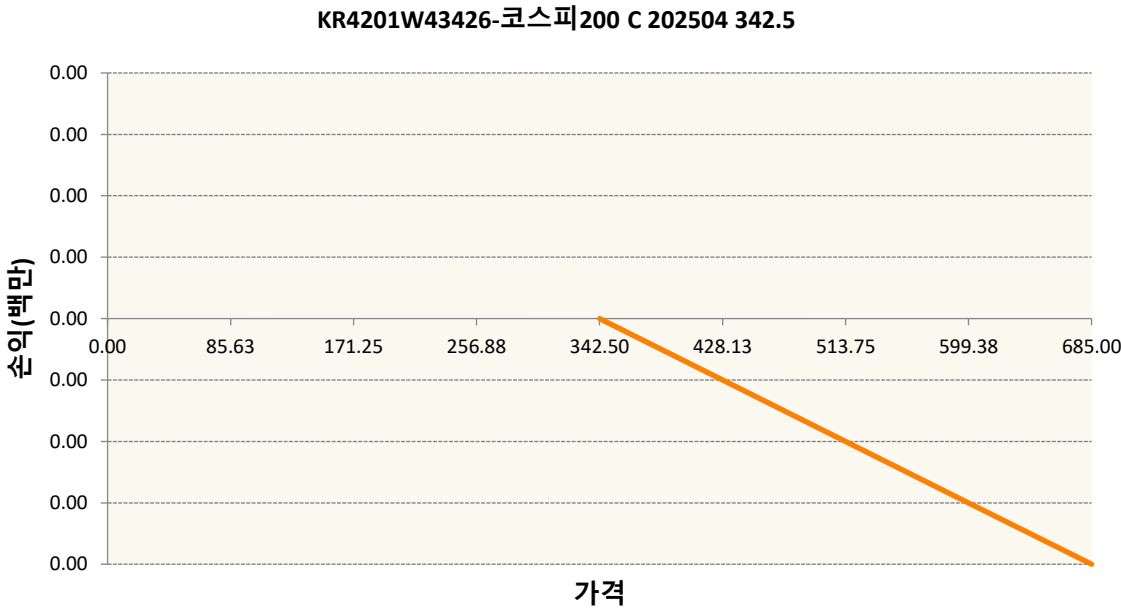
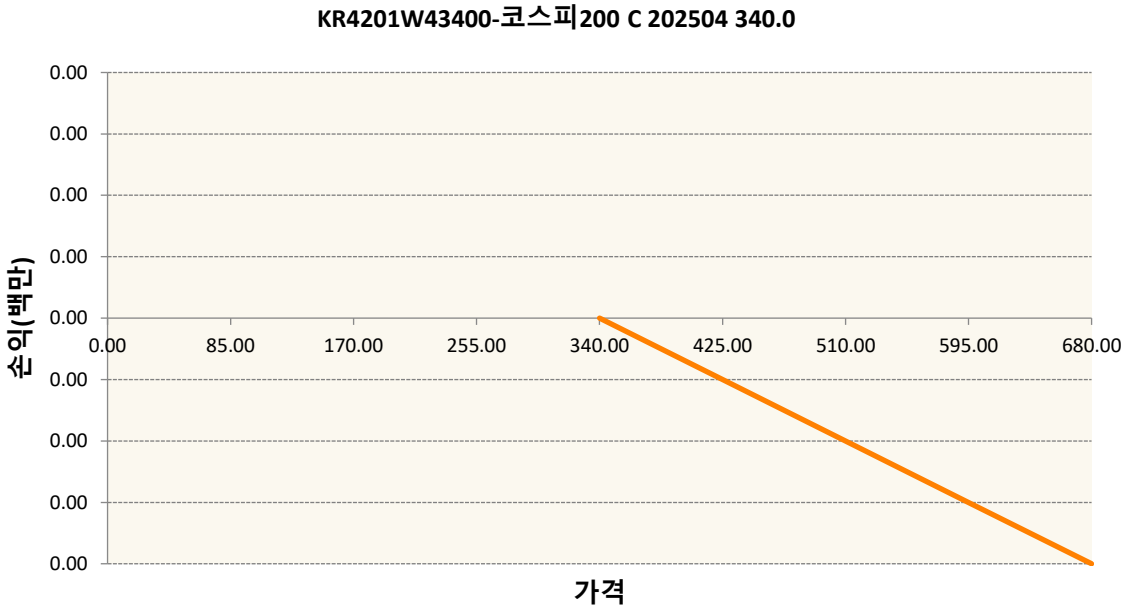
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	83	0	83	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,556	-37,556	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 680.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line is plotted, starting at (0, 0) and ending at (340, 0). This indicates that the profit is zero for all prices in the range from 0 to 340 million won.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
340.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 685.00. The y-axis, labeled '순이익 (백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the net income function, starting at the origin (0, 0) and ending at (342.50, 0.00). This indicates that net income is zero at a price of 342.50.

가격 (Price)	순이익 (백만) (Net Income in millions)
0.00	0.00
85.63	0.00
171.25	0.00
256.88	0.00
342.50	0.00
428.13	0.00
513.75	0.00
599.38	0.00
685.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201W43400							코스피200 C 202504 340.0		943	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	466	456	444	430	415	399	382			
-5.33%	411	391	370	349	327	305	283			
-2.67%	284	259	233	208	183	157	132			
0%	70	47	24	0	-24	-48	-73			
2.67%	-219	-234	-250	-268	-287	-306	-327			
5.33%	-553	-560	-569	-580	-592	-605	-620			
8.00%	-906	-909	-913	-918	-925	-933	-943			
KR4201W43426							코스피200 C 202504 342.5		1,197	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	539	529	515	500	483	464	443
-5.33%	484	461	437	411	384	357	329
-2.67%	346	314	281	249	216	183	150
0%	97	65	33	0	-33	-66	-99
2.67%	-258	-280	-305	-330	-357	-385	-414
5.33%	-682	-693	-708	-724	-743	-763	-785
8.00%	-1,139	-1,143	-1,150	-1,158	-1,169	-1,182	-1,197

KR4301W43408

코스피200 P 202504 340.0

154

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-140	-141	-143	-146	-148	-151	-154
-5.33%	-71	-74	-78	-82	-86	-90	-94
-2.67%	-18	-23	-28	-33	-38	-43	-47
0%	13	9	4	0	-5	-9	-14
2.67%	27	24	21	18	15	12	8
5.33%	31	30	29	27	25	23	21
8.00%	32	31	31	30	30	28	27

KR4301W43424

코스피200 P 202504 342.5

222

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-206	-208	-210	-212	-215	-218	-222
-5.33%	-109	-113	-118	-123	-128	-133	-138
-2.67%	-31	-38	-44	-50	-57	-63	-70
0%	19	13	6	0	-6	-13	-19
2.67%	43	39	34	30	25	20	14
5.33%	51	49	47	45	41	38	34
8.00%	53	53	52	51	49	47	45

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

(단위:백만원)

2,571

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

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	680	0	680	

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	2025-03-19
기준일	2025-03-18

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	4,494	0	4,494	

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	2025-03-19
기준일	2025-03-18

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	12,992	0	12,992	
누계	통화	선도	363	12,931	-12,568	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
FXW213ECT(KRW/USD 31-03-25E	259
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E	212
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E	215
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E	349
FXW213F3C(USD/KRW 31-03-25E	29
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	463

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

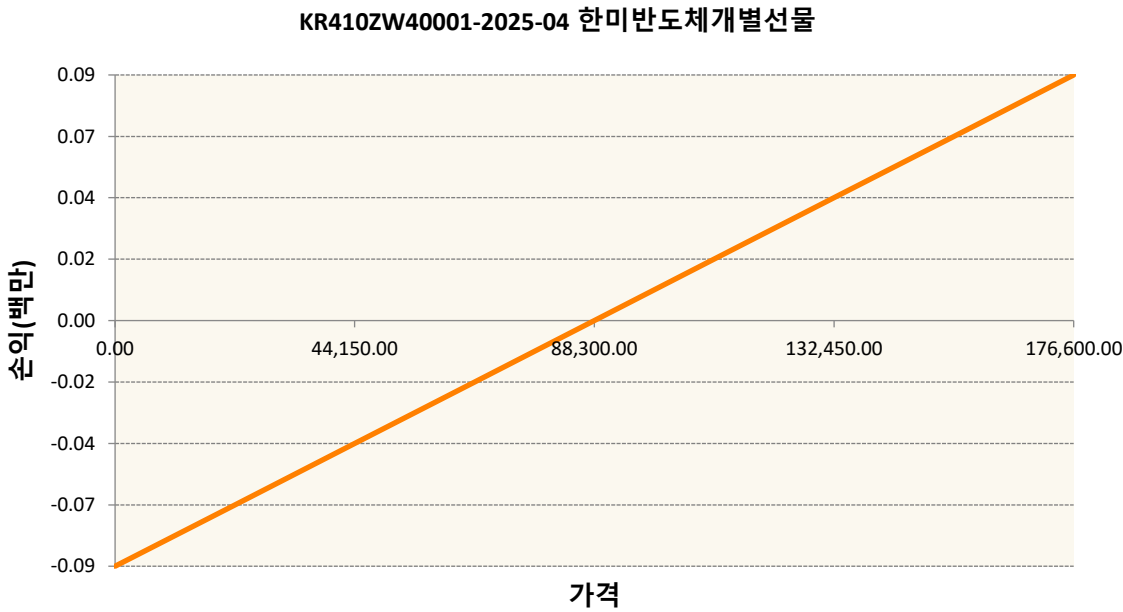
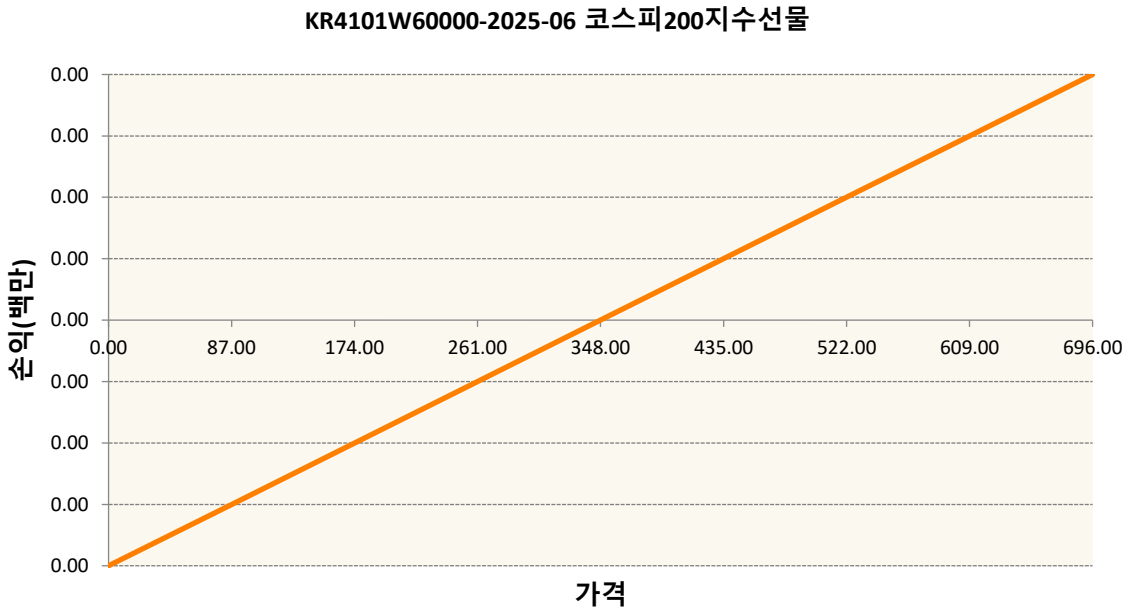
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

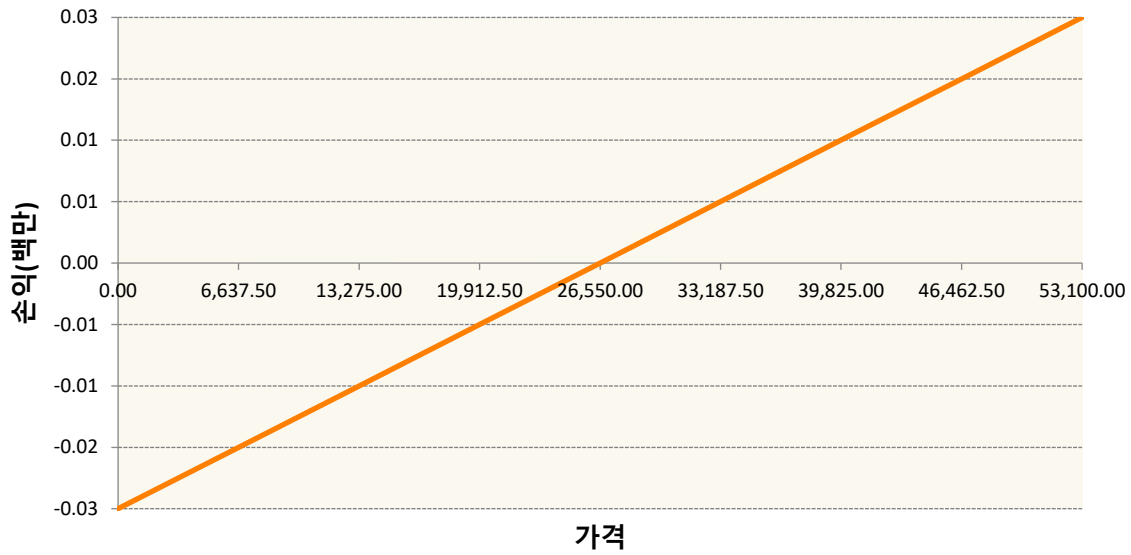
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	843	0	843	장내

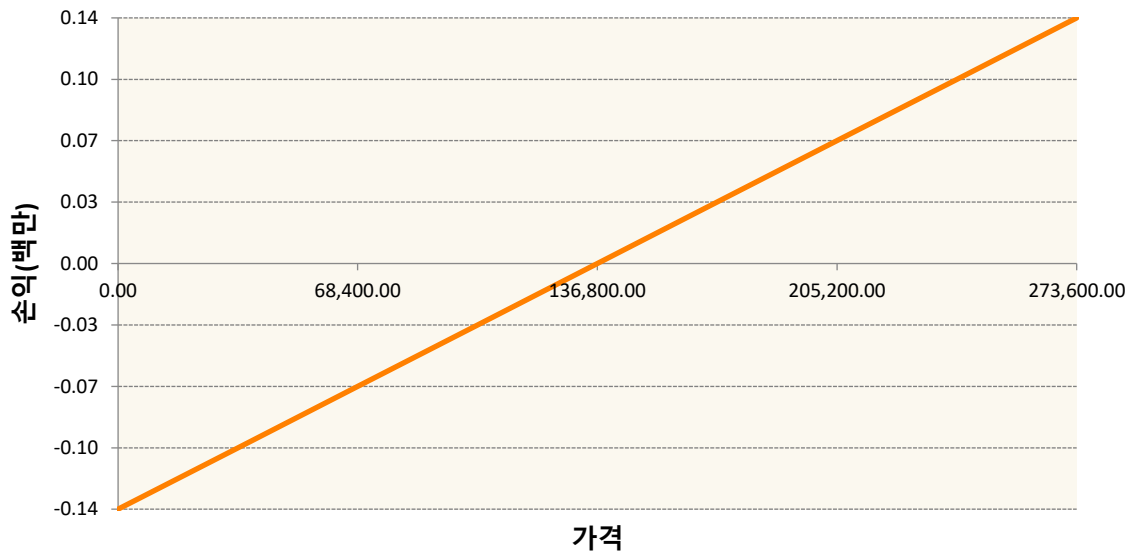
2. 만기시점의 손익구조



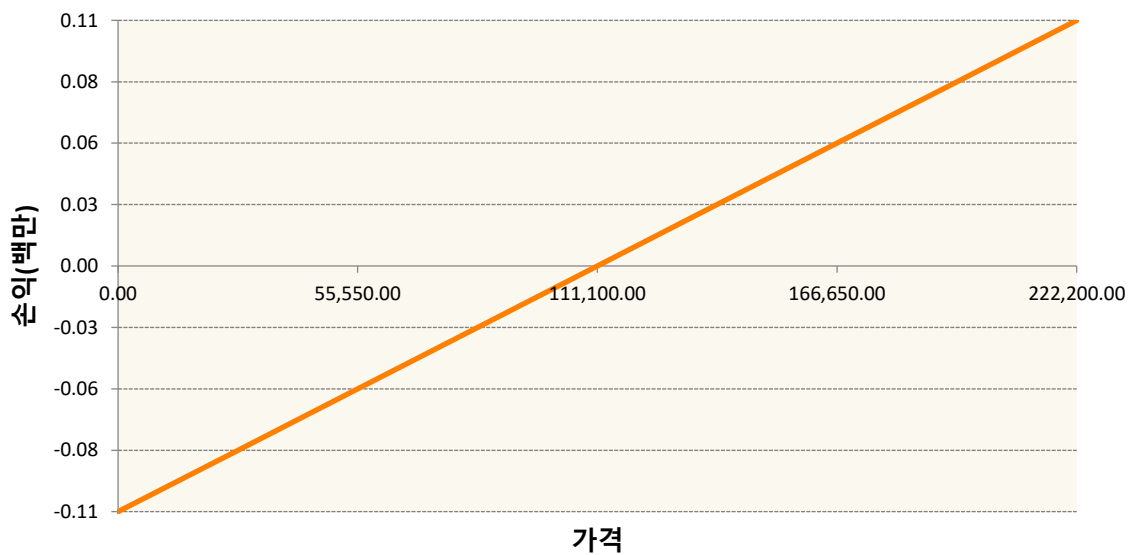
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



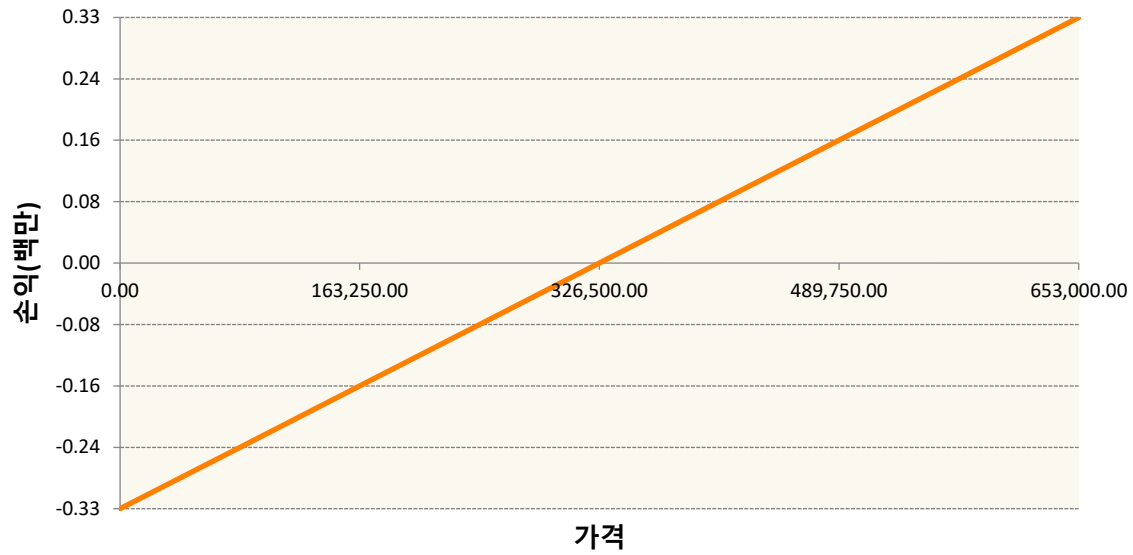
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



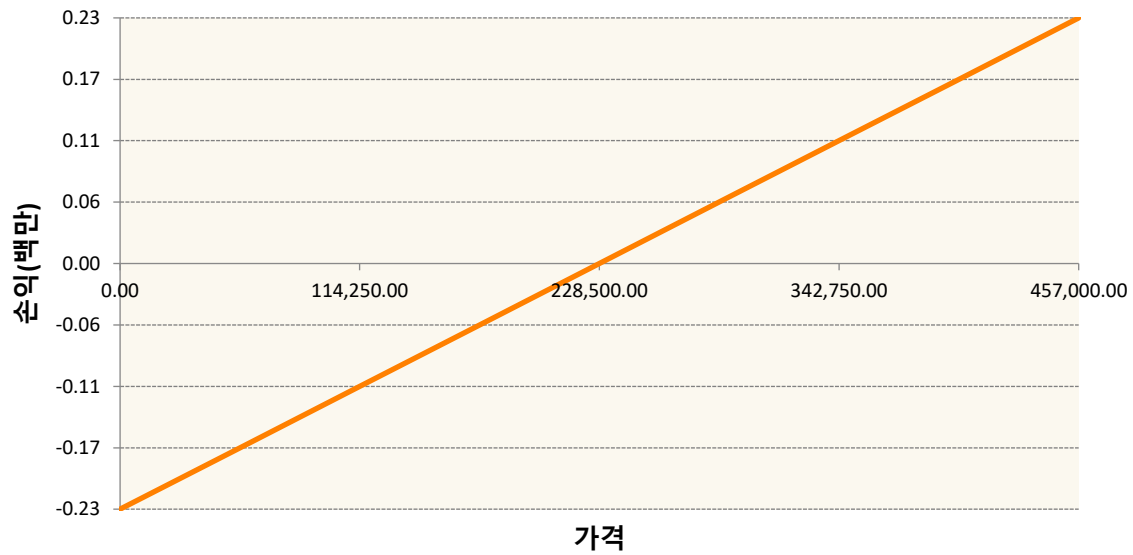
KR41EYW40004-2025-04 에코프로비엠개별선물



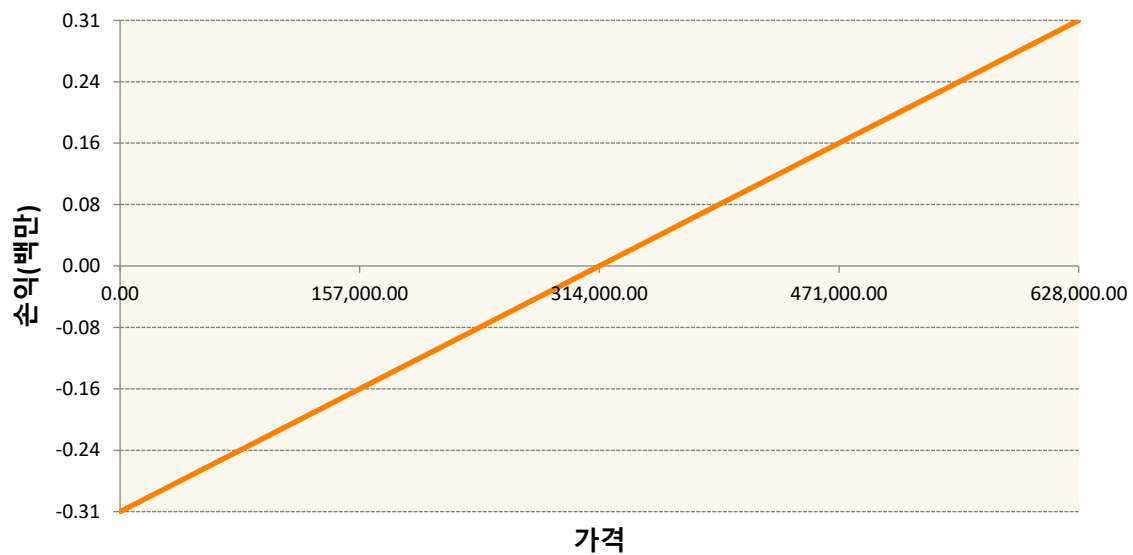
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		49
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물		2
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물		1
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물		2
KR41EYW40(2025-04 에코프로비엠개별선물		3
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물		6
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물		2
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물		4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	111

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

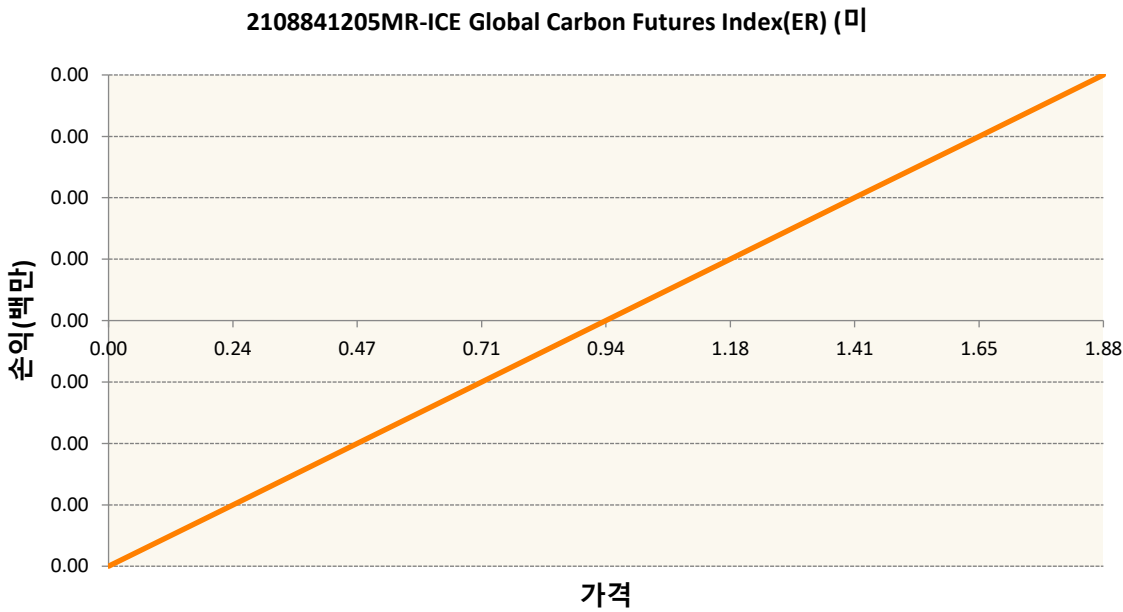
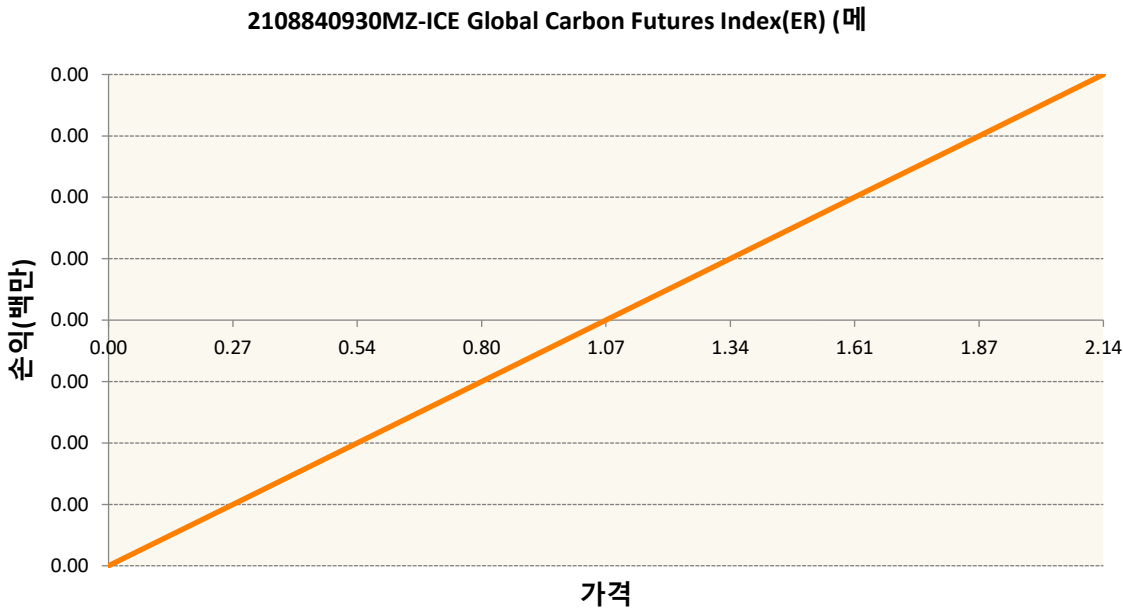
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)
	856

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

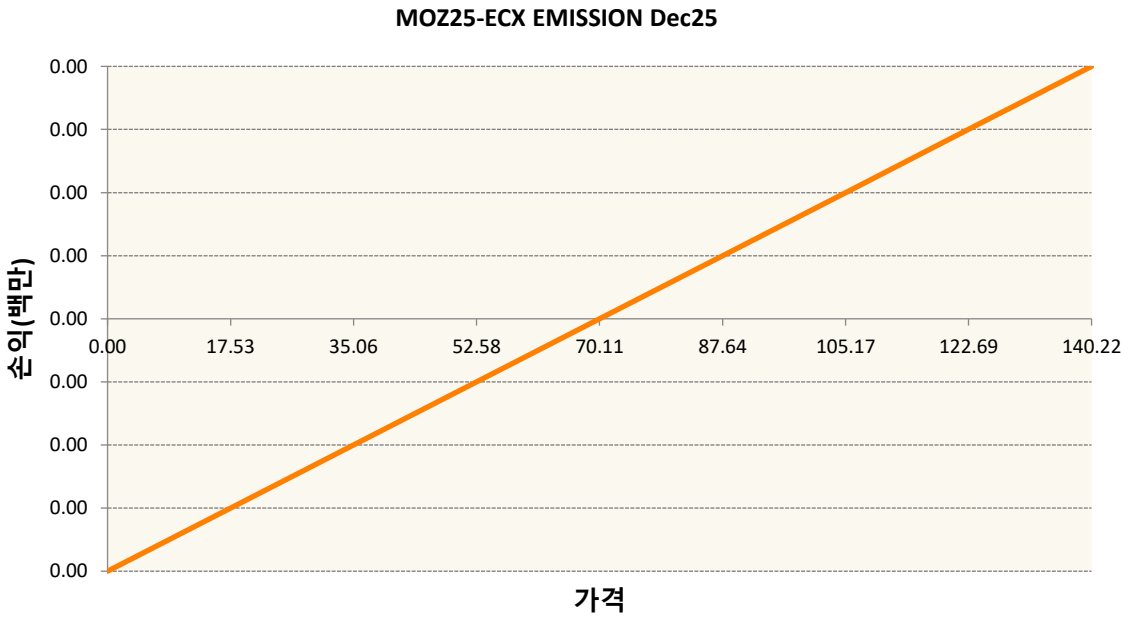
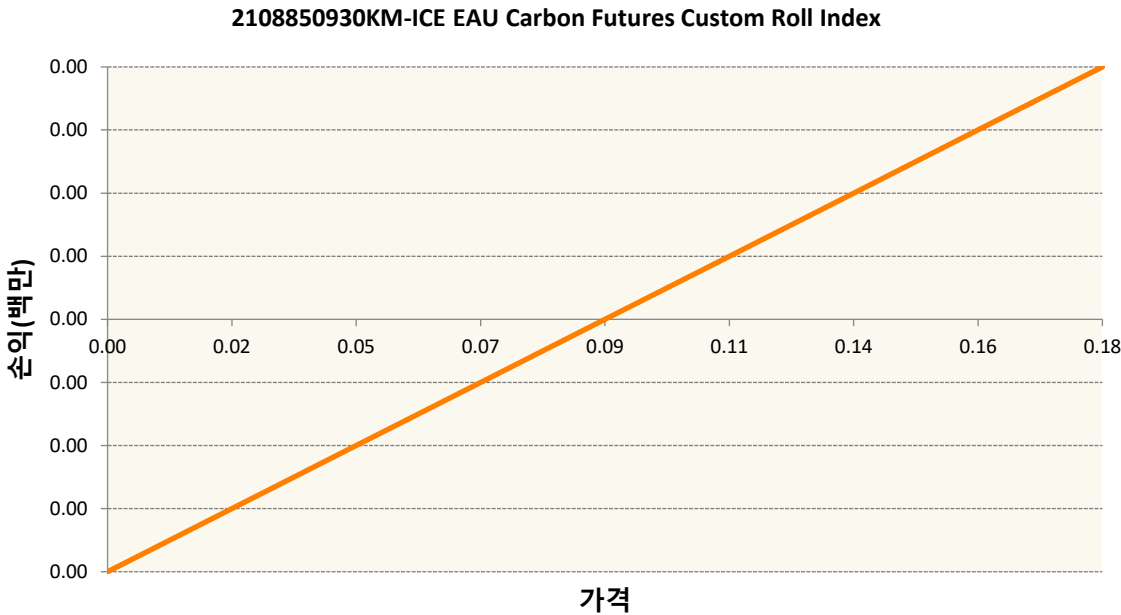
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,362	0	5,362	
누계	통화	선도	0	1,041	-1,041	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	2
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	83
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	426

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

786

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

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)

12

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,700	0	7,700	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	25
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	29
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	21
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	6

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

(단위:백만원)

139

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

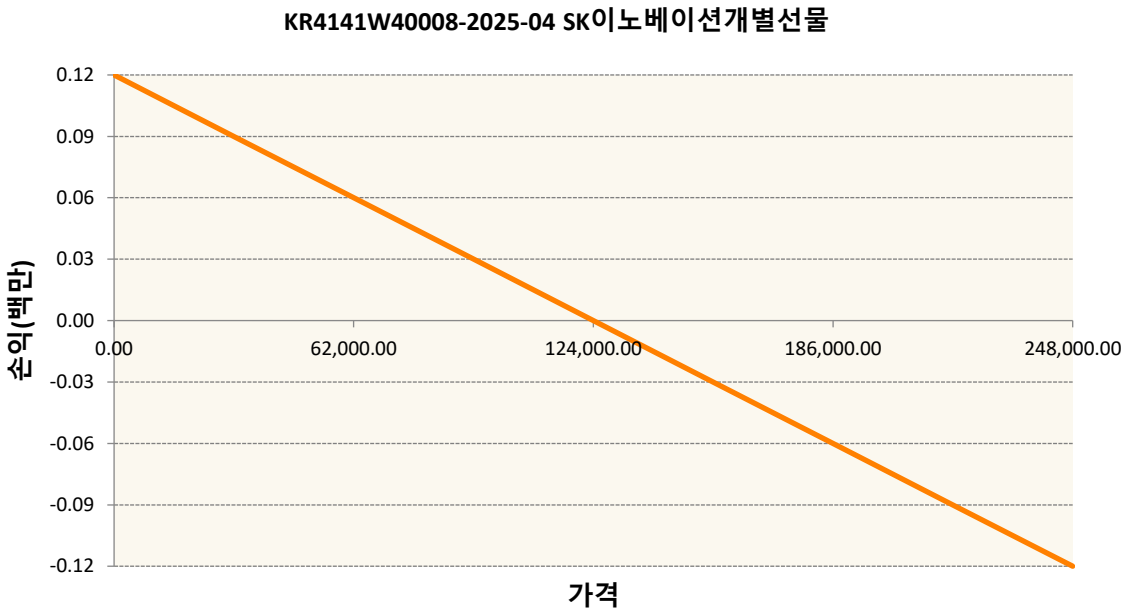
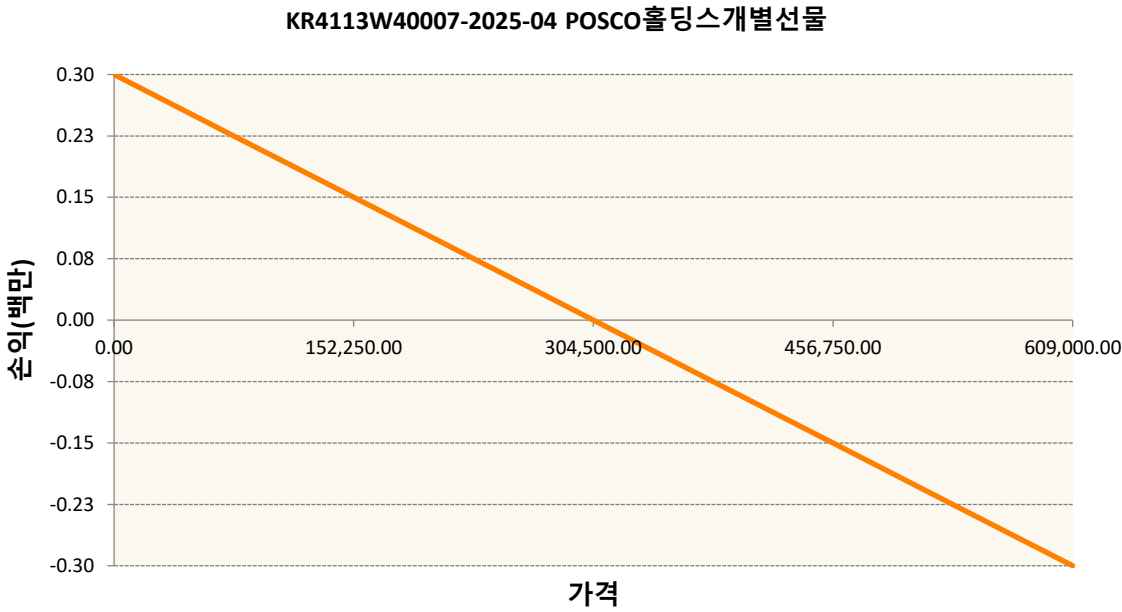
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

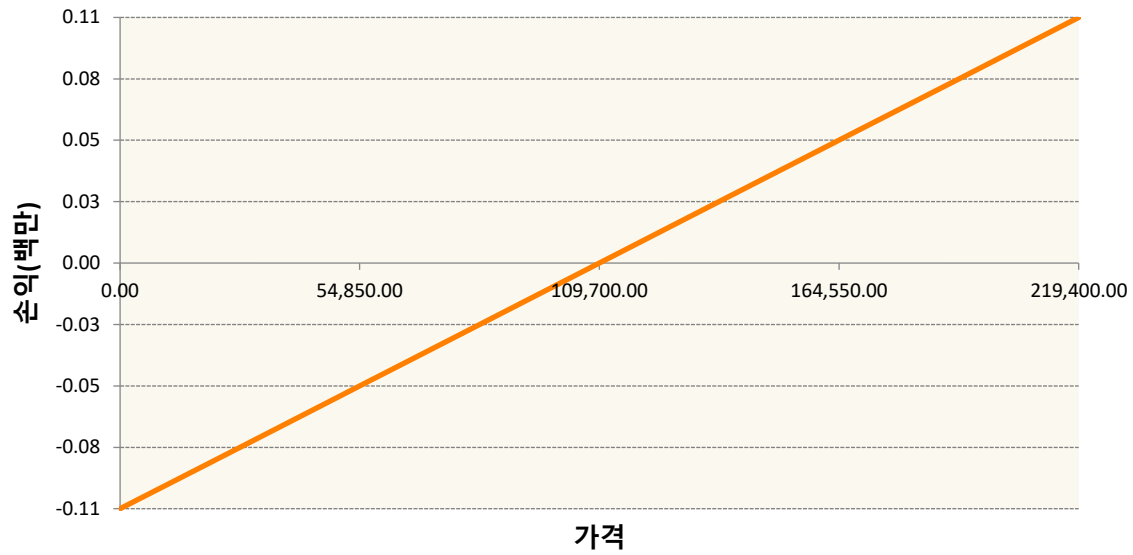
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3	-3	장내
누계	유가증권	선물	5	20	-14	장내

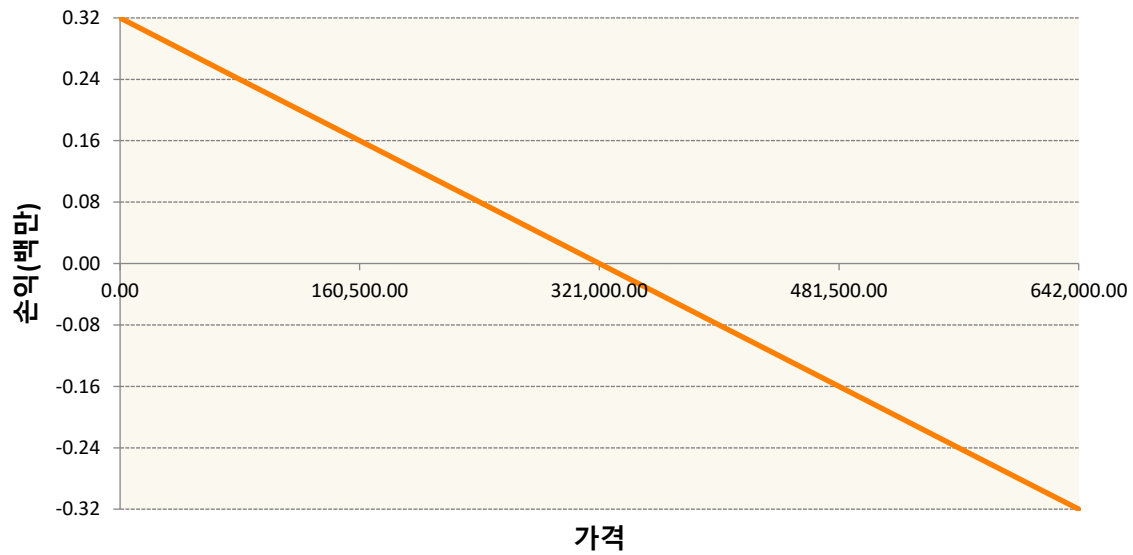
2. 만기시점의 손익구조



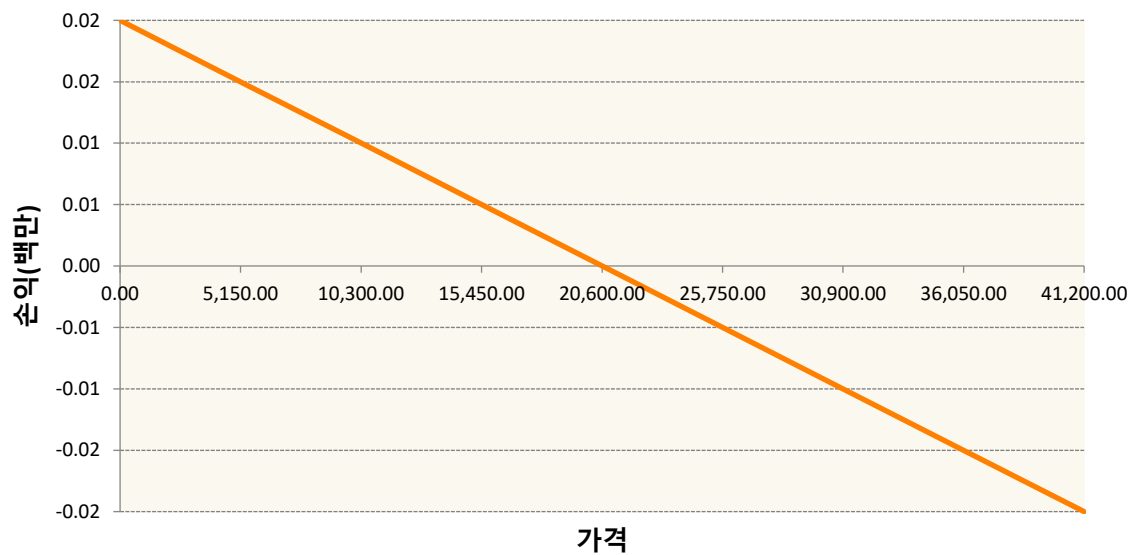
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



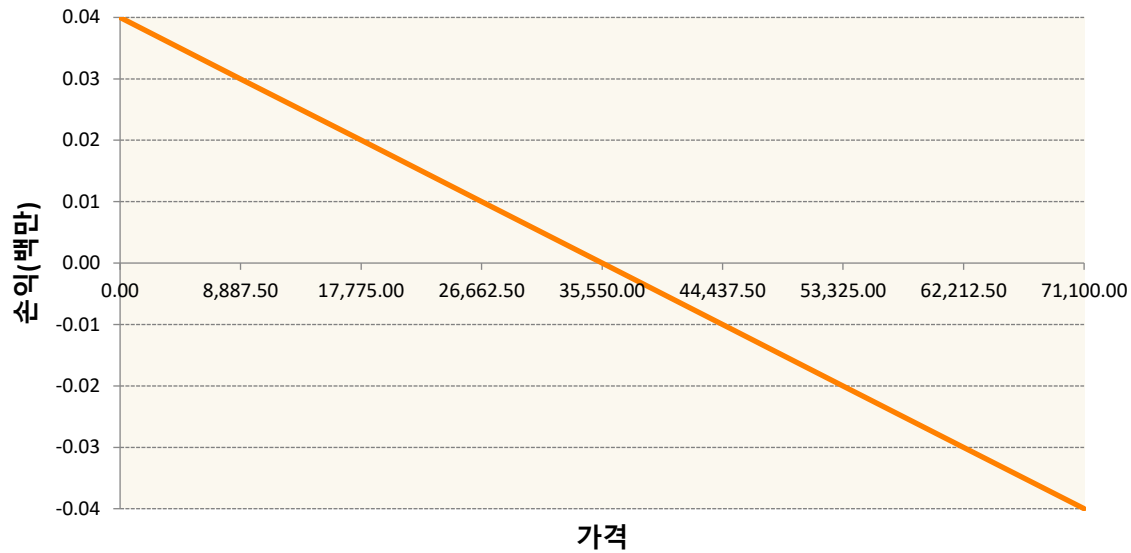
KR41CRW40002-2025-04 LG생활건강개별선물



KR41ETW40004-2025-04 삼성E&A개별선물



KR41GYW40009-2025-04 에스엘개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4113W40(2025-04 POSCO홀딩스개별선물	0.24
KR4141W40(2025-04 SK이노베이션개별선물	0.3
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	0.44
KR41CRW40 2025-04 LG생활건강개별선물	1
KR41ETW40(2025-04 삼성E&A개별선물	0.23
KR41GYW40 2025-04 에스엘개별선물	0.31

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

(단위:백만원)

5

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

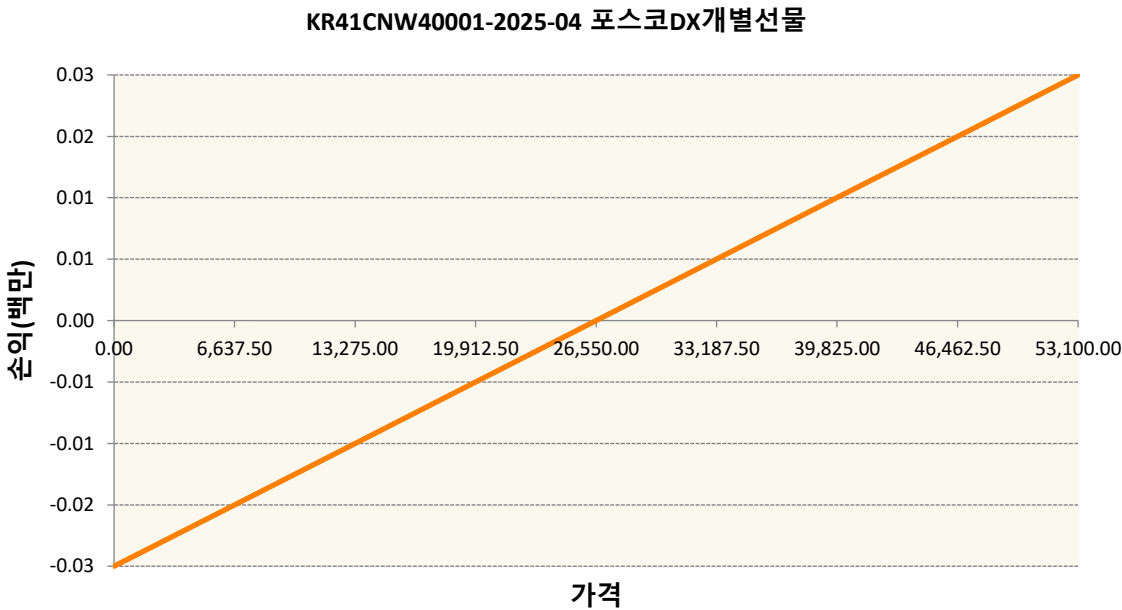
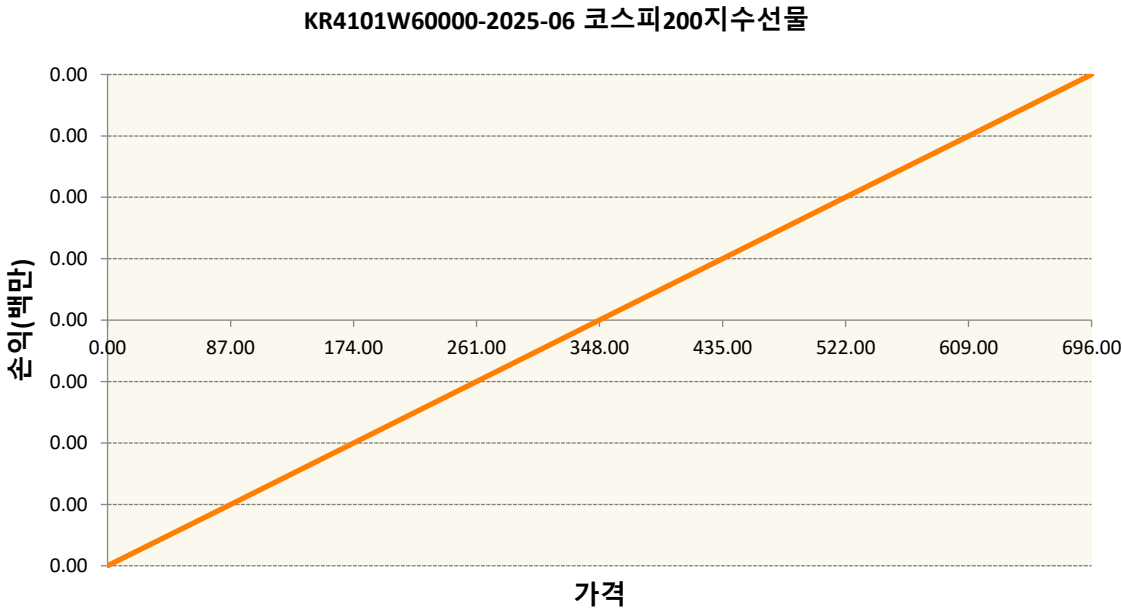
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

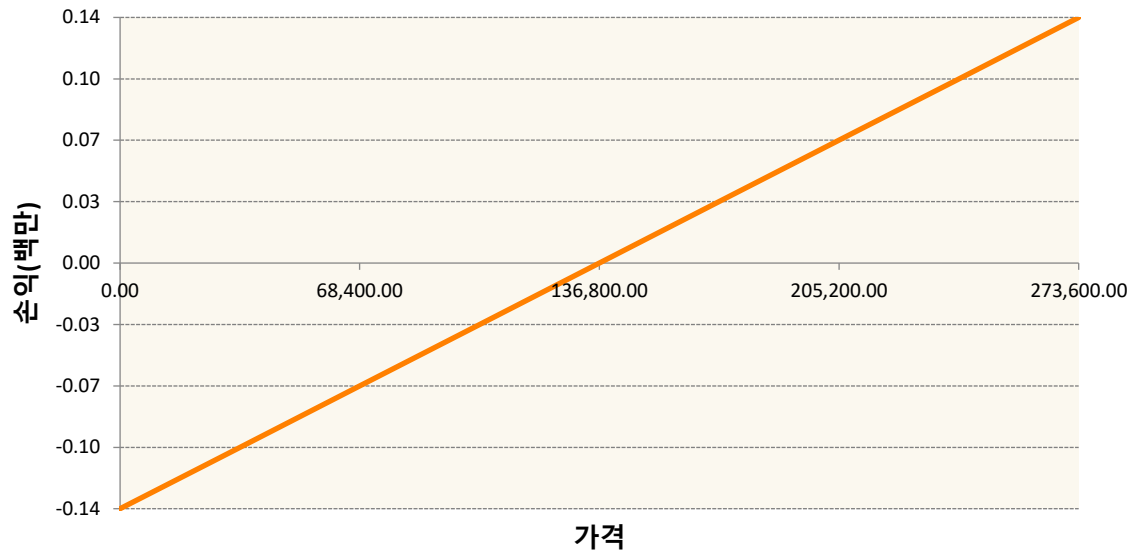
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	170	0	170	장내
누계	유가증권	선물	9,861	0	9,861	장내

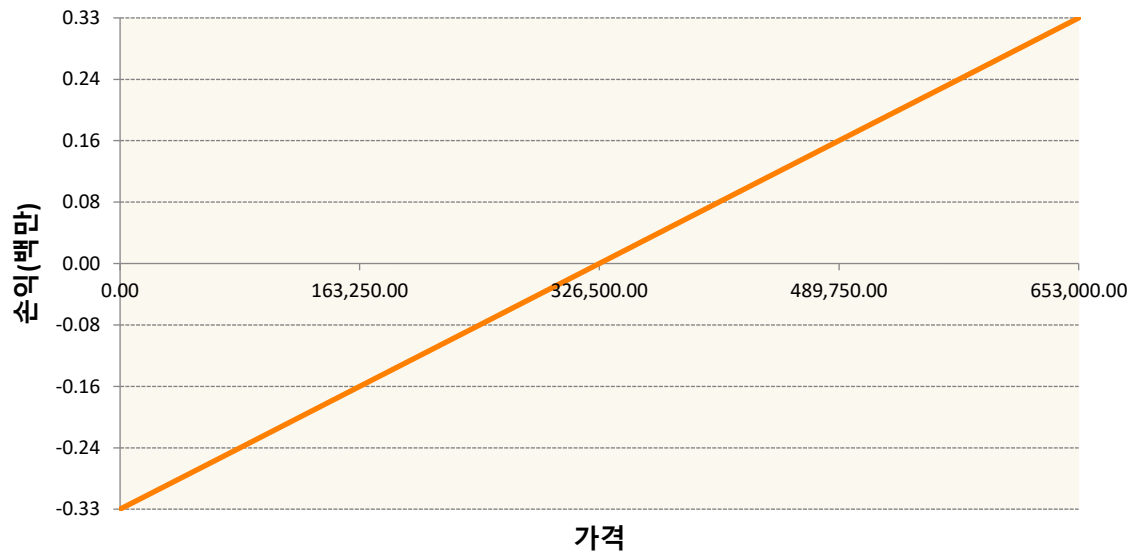
2. 만기시점의 손익구조



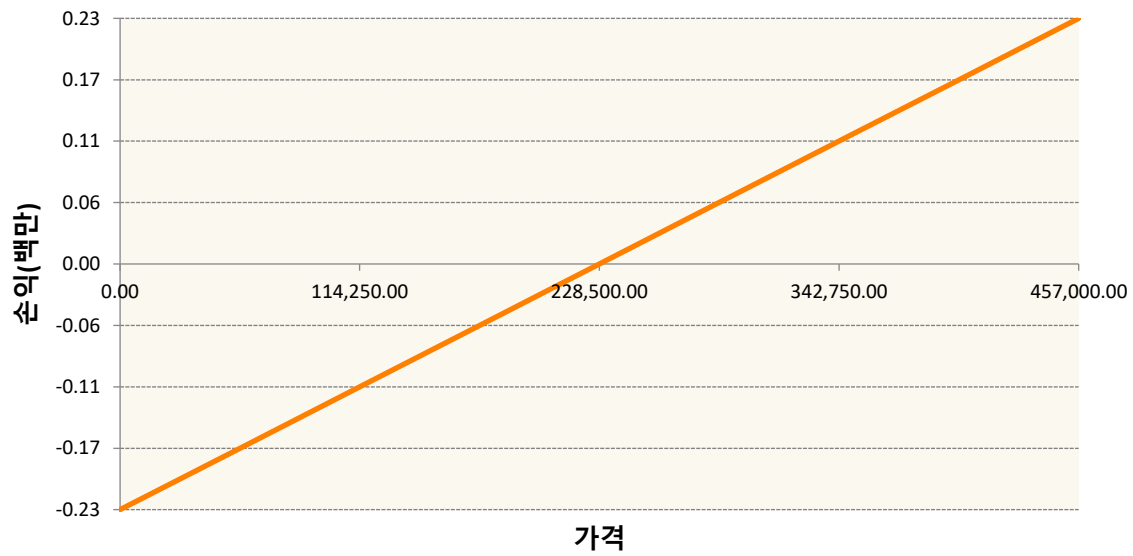
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		599
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물		13
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물		17
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물		113
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물		46

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,193

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

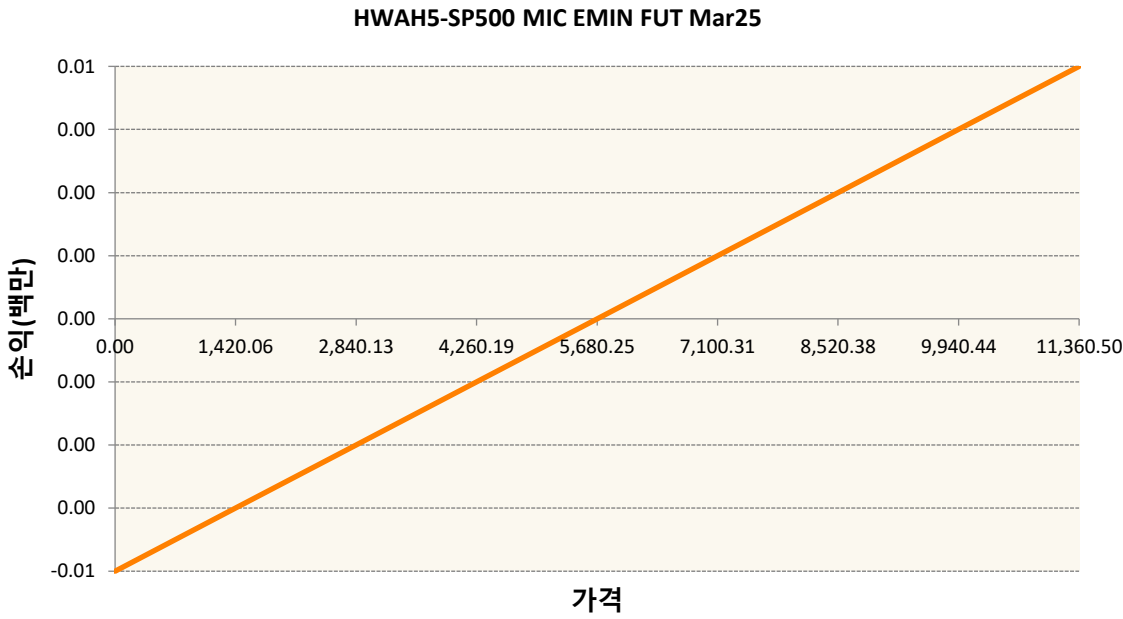
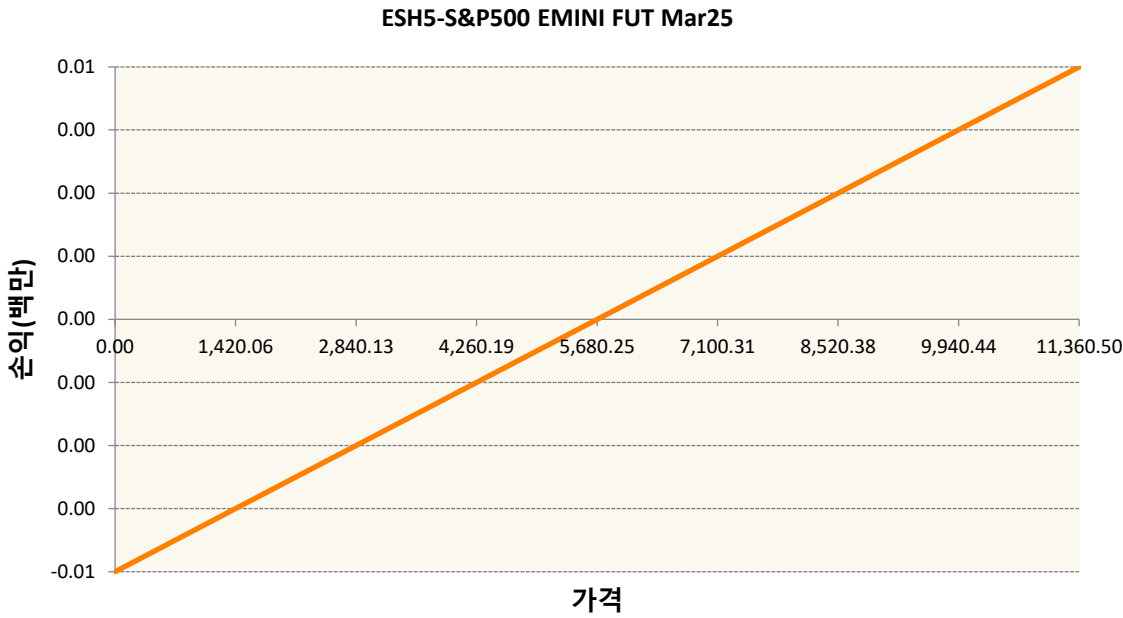
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	27,637	0	27,637	
누계	유가증권	선물	1,194	0	1,194	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,211
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	96

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,047

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

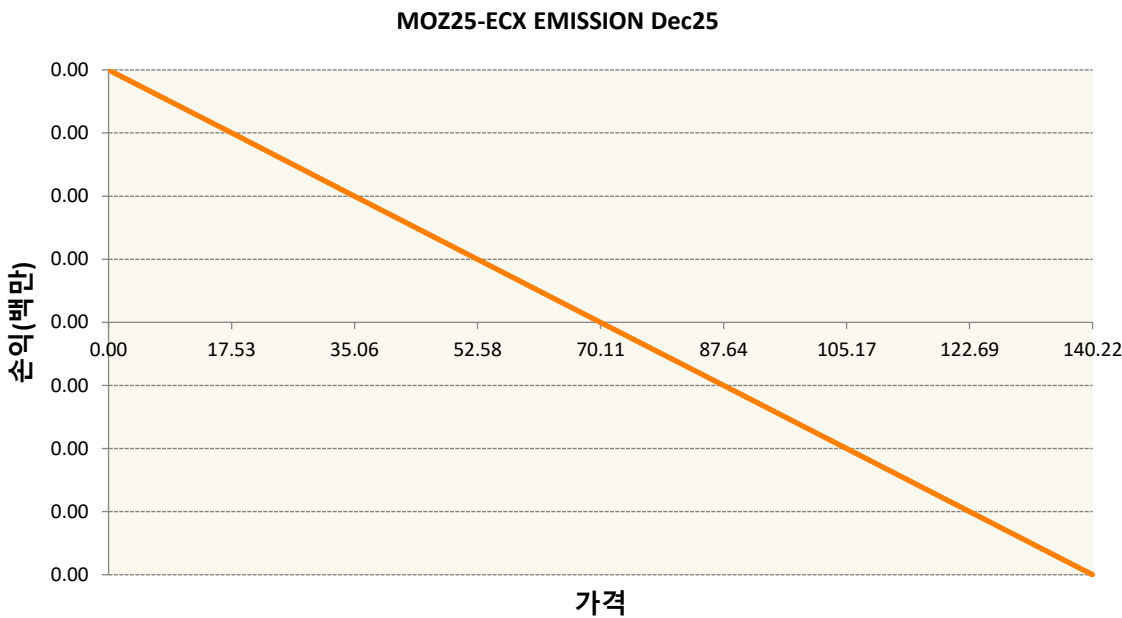
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-31	5,597	-5,628	
누계	통화	선도	0	1,164	-1,164	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	34
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	59
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	448

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

(단위:백만원)

828

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

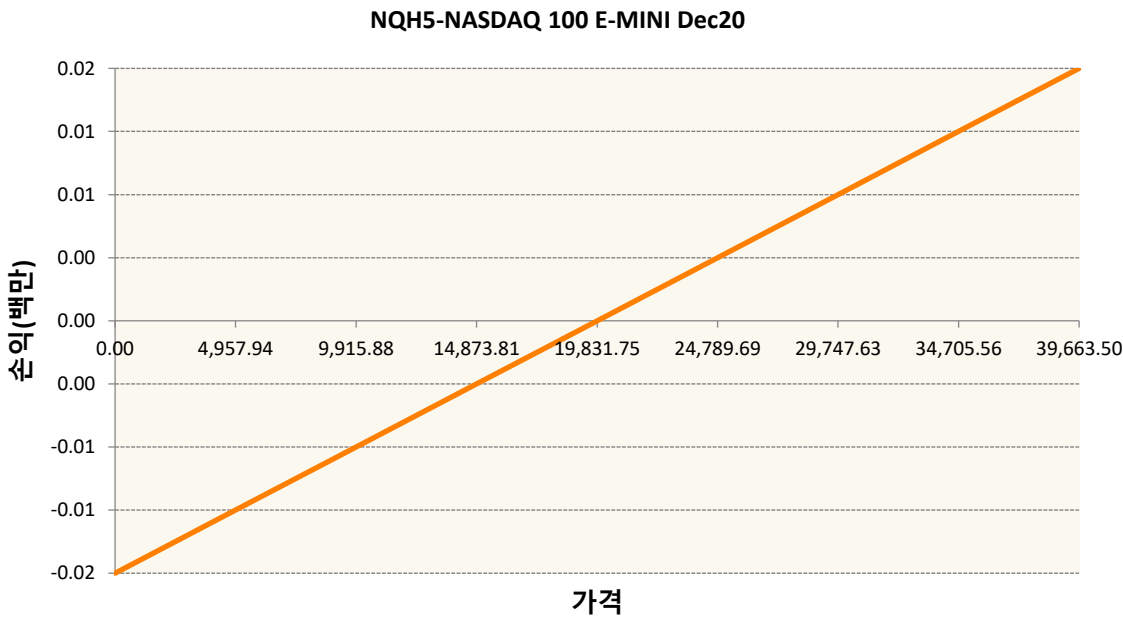
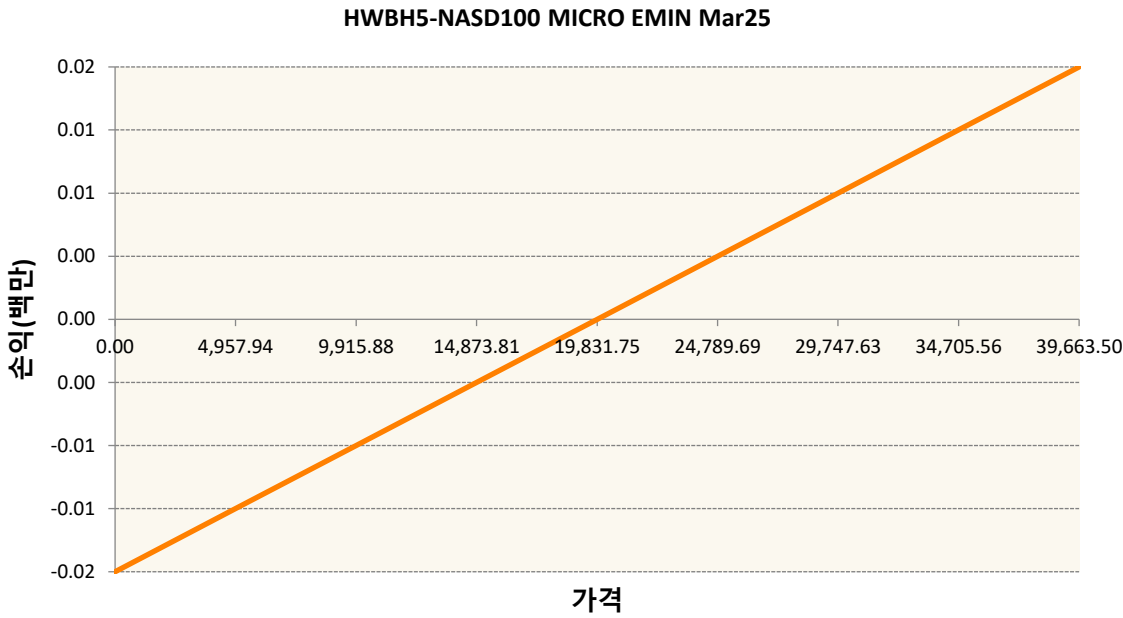
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,832	0	13,832	
누계	유가증권	선물	343	0	343	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN Mar25	27
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,107

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

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

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	742
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,203
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,271
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,883

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

(단위:백만원)

8,631

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

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	17
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	17
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	17
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	17

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

(단위:백만원)

80

공시일	2025-03-19
기준일	2025-03-18

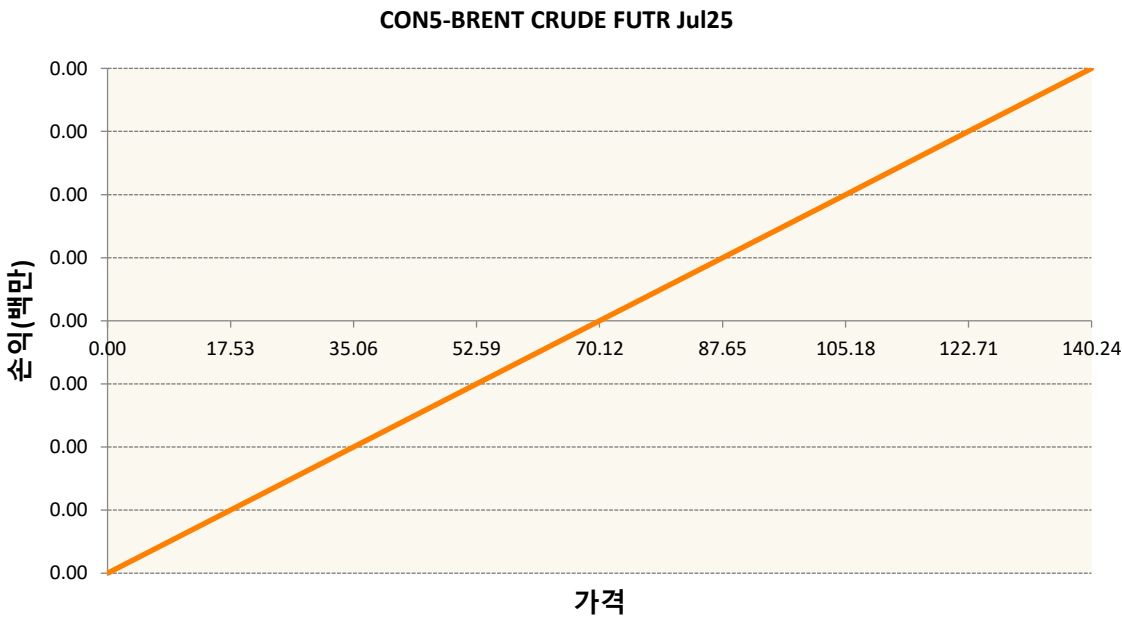
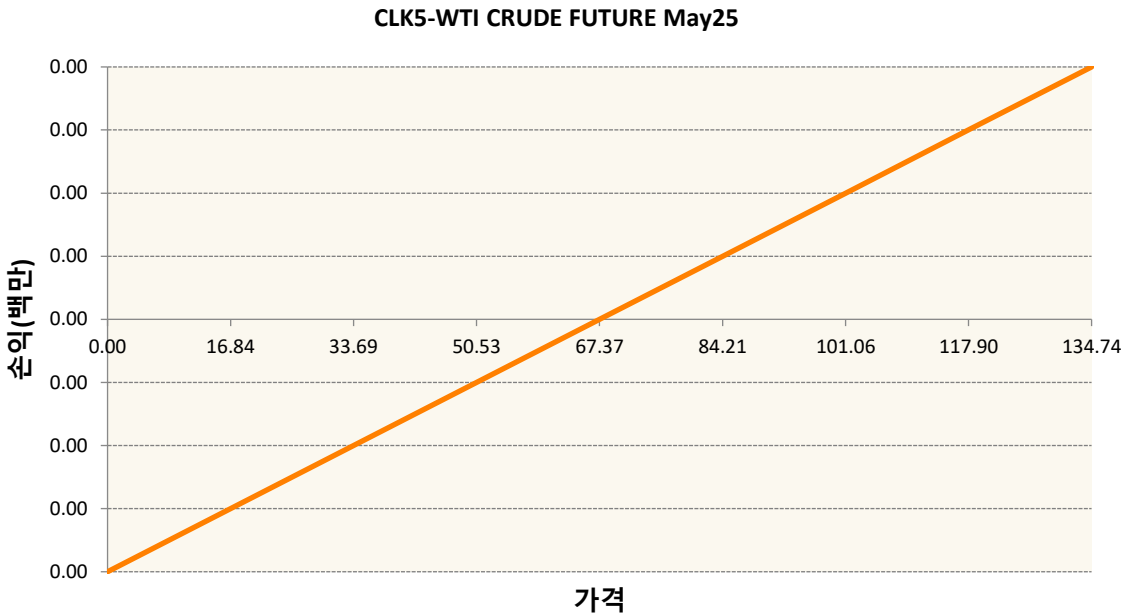
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

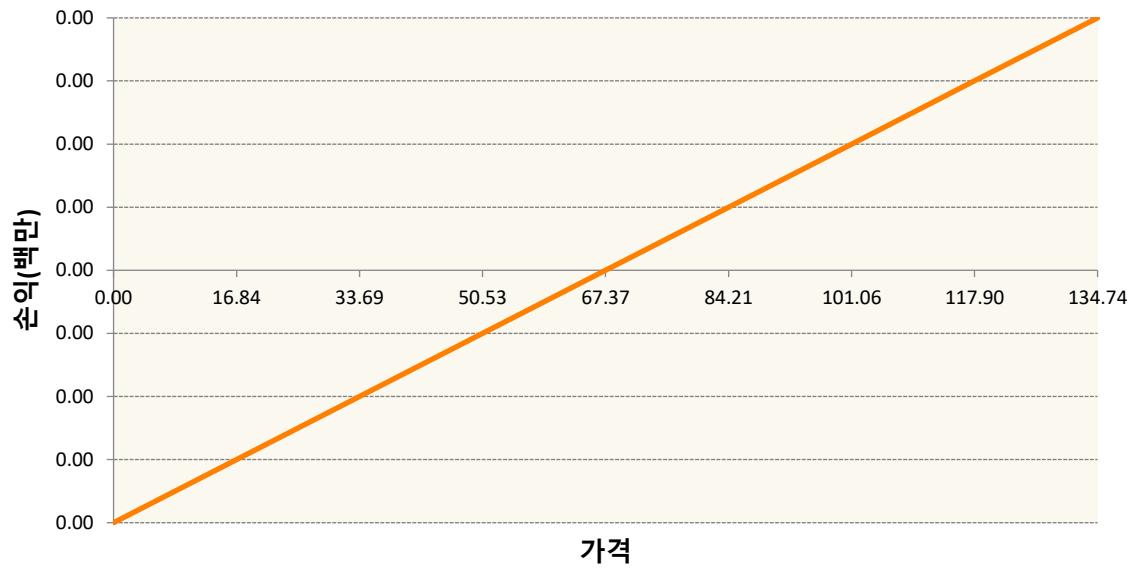
(단위:백만원)

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	830	0	830	
누계	통화	선물	0	159	-159	장내

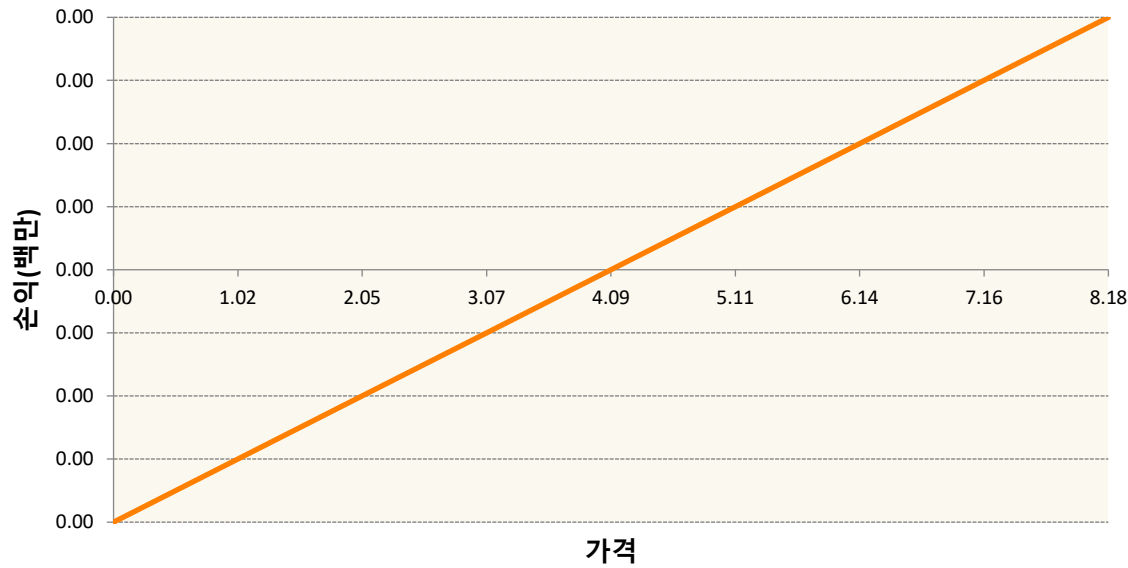
2. 만기시점의 손익구조



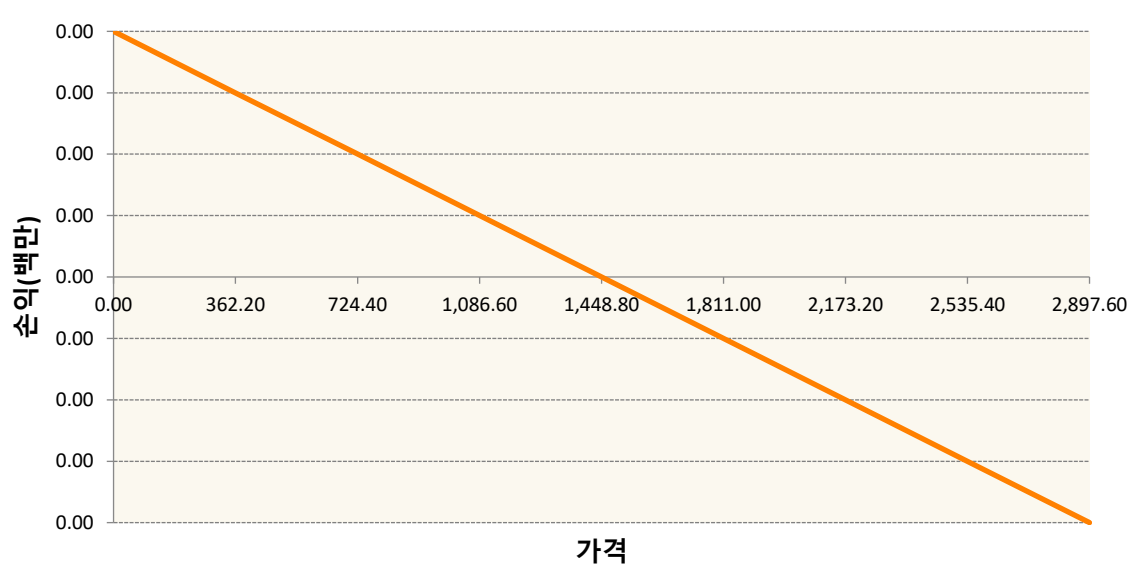
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



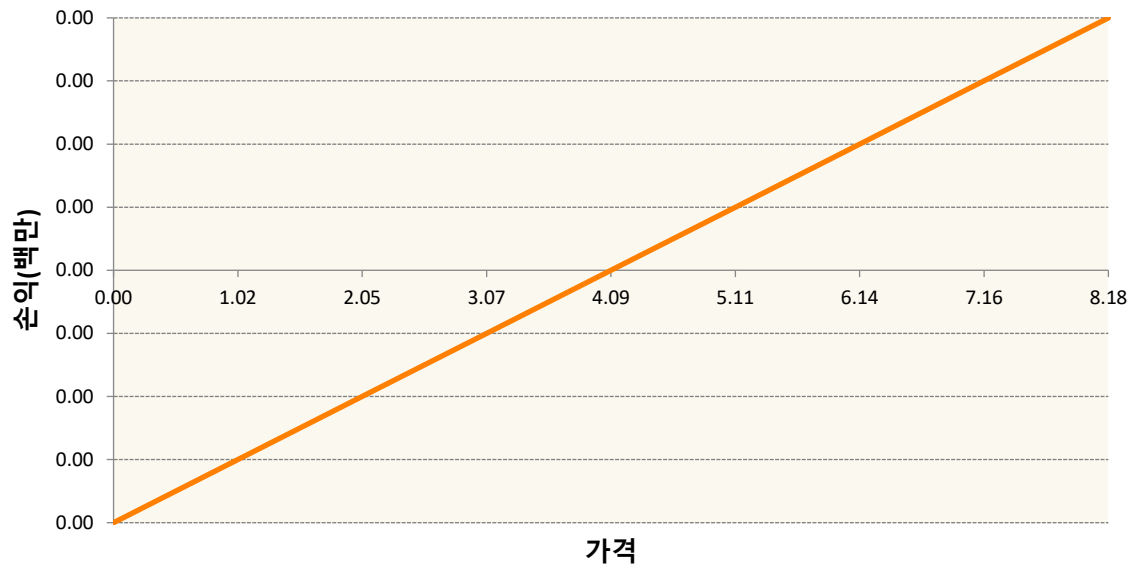
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



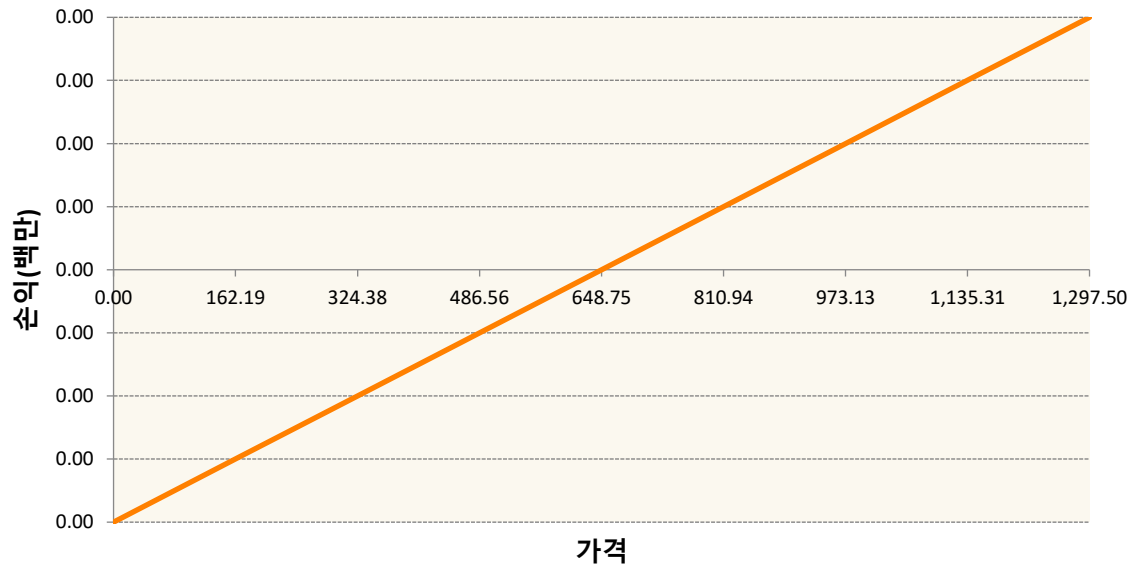
KR4175W40006-2025-04 달러선물



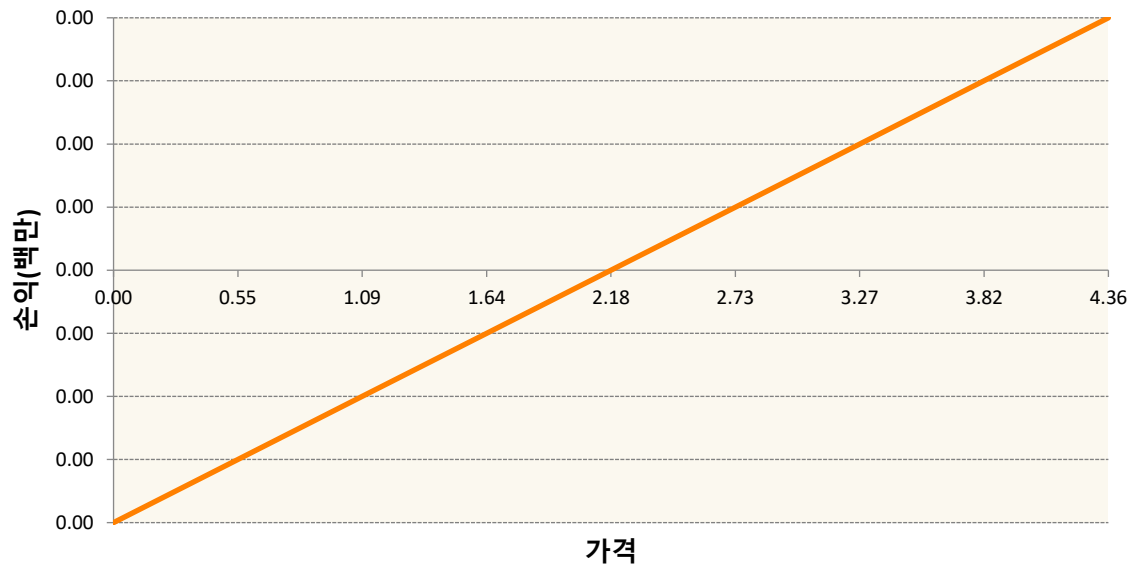
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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
CON5	BRENT CRUDE FUTR Jul25	16
ECK5	E-mini Crude Oil May 25	4
EOK5	E-MINI NATURAL GAS May 25	6
KR4175W40	(2025-04 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)

145