

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

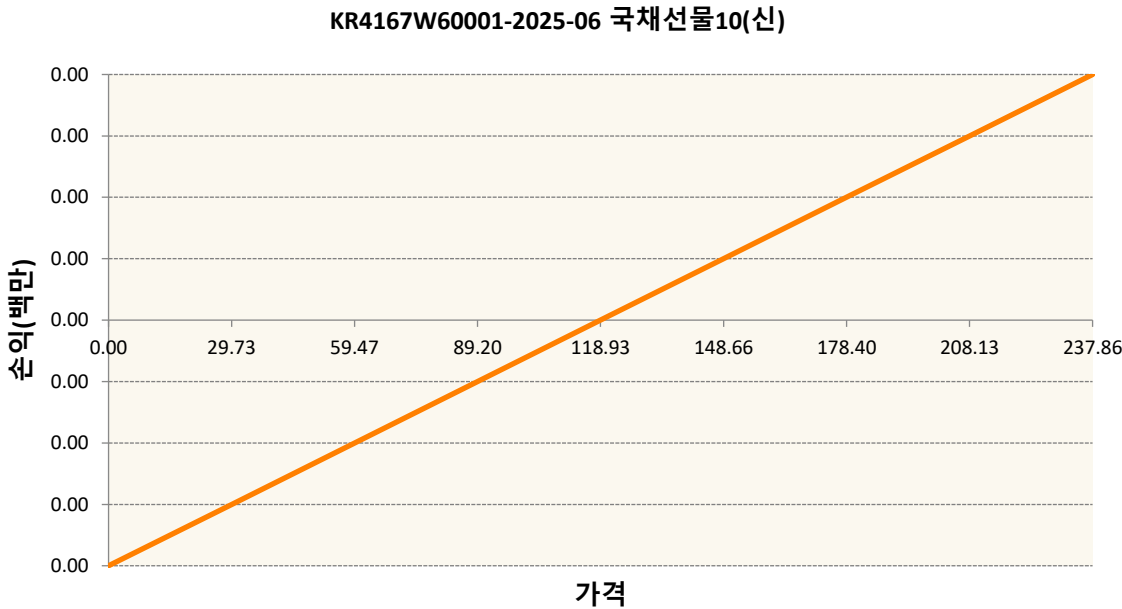
베스트장기채(채권-파생형)

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	237,860	0	237,860	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

5,939

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

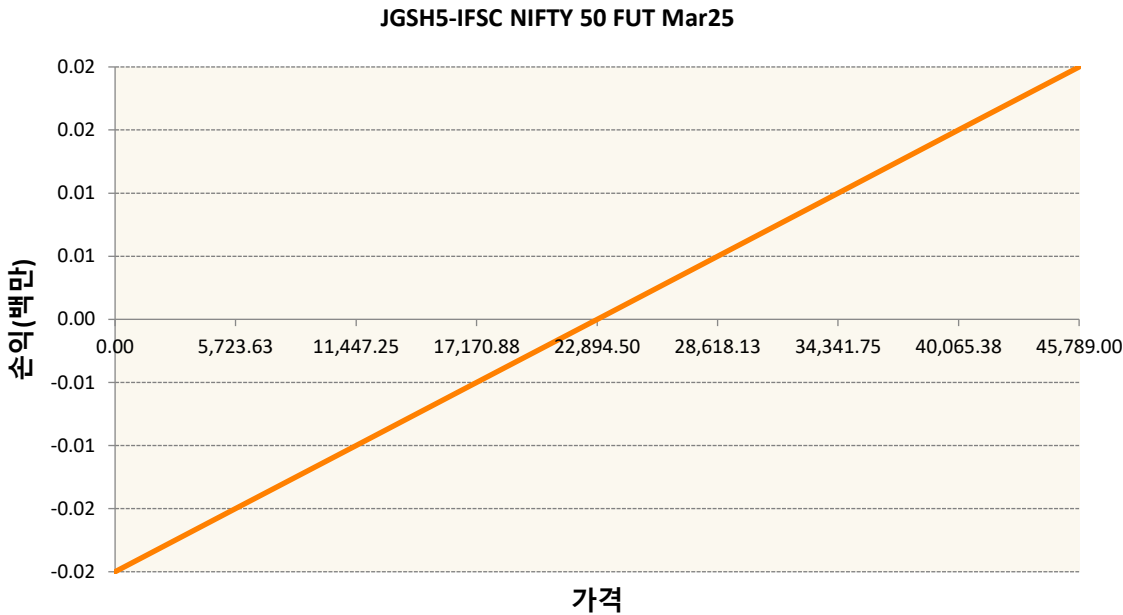
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	737	0	737	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH5	IFSC NIFTY 50 FUT Mar25	59
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

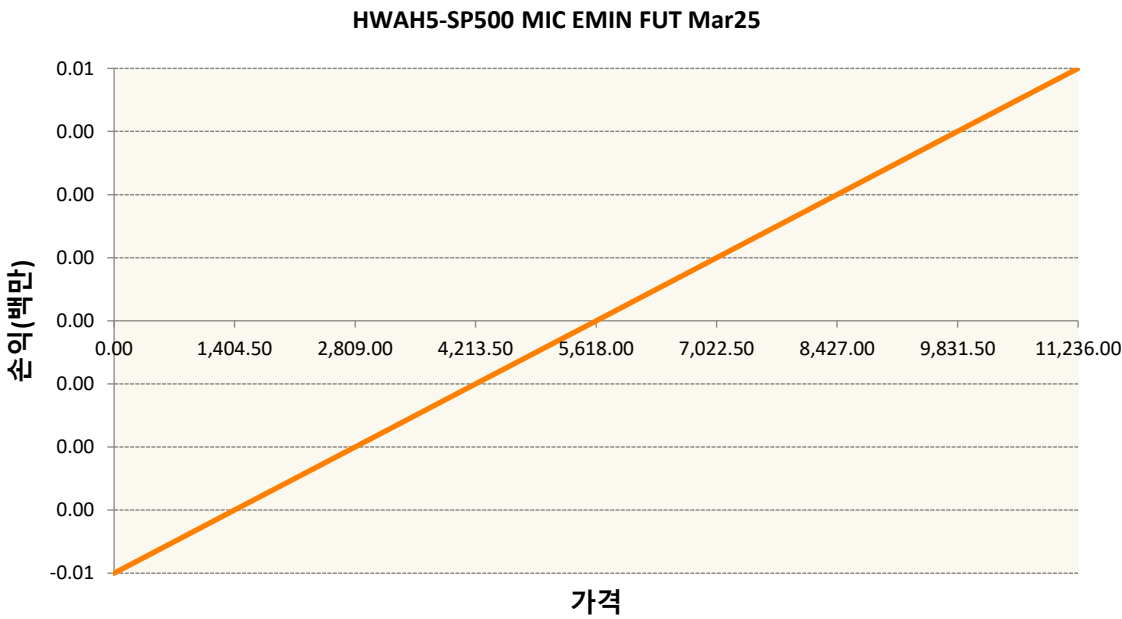
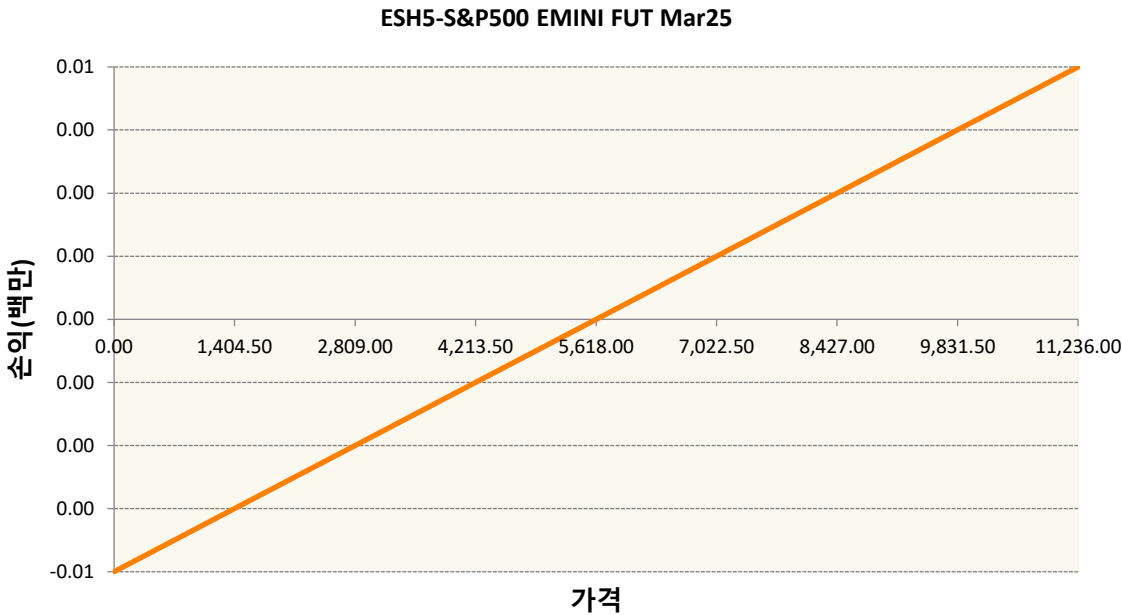
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	403	0	403	
누계	유가증권	선물	164	0	164	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	32
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	52

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

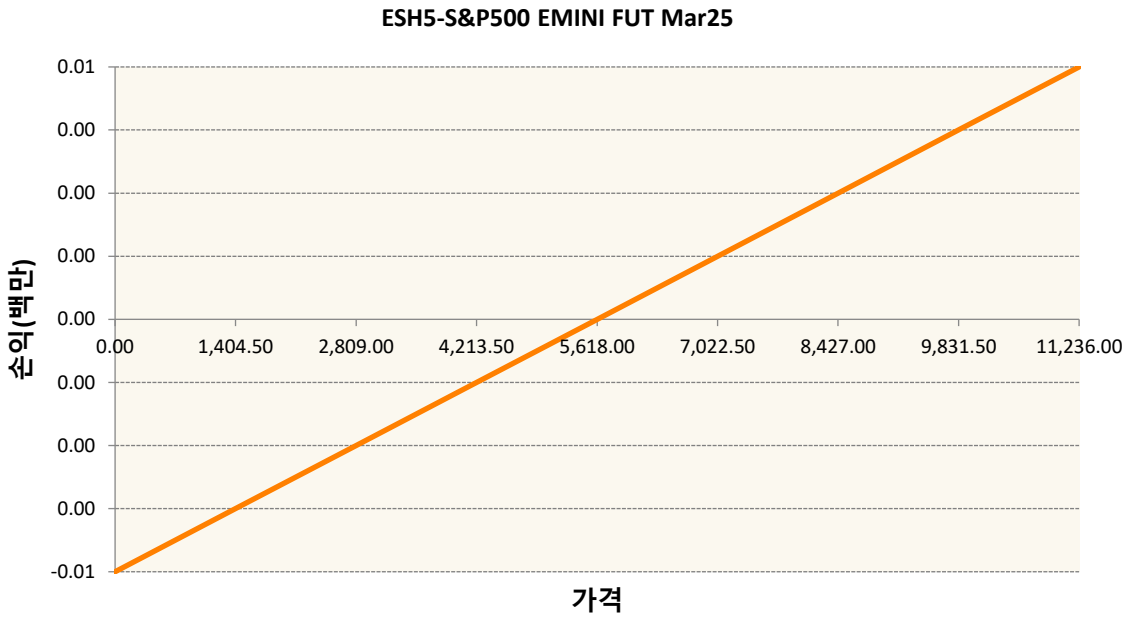
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,446	0	2,446	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	196
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

264

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

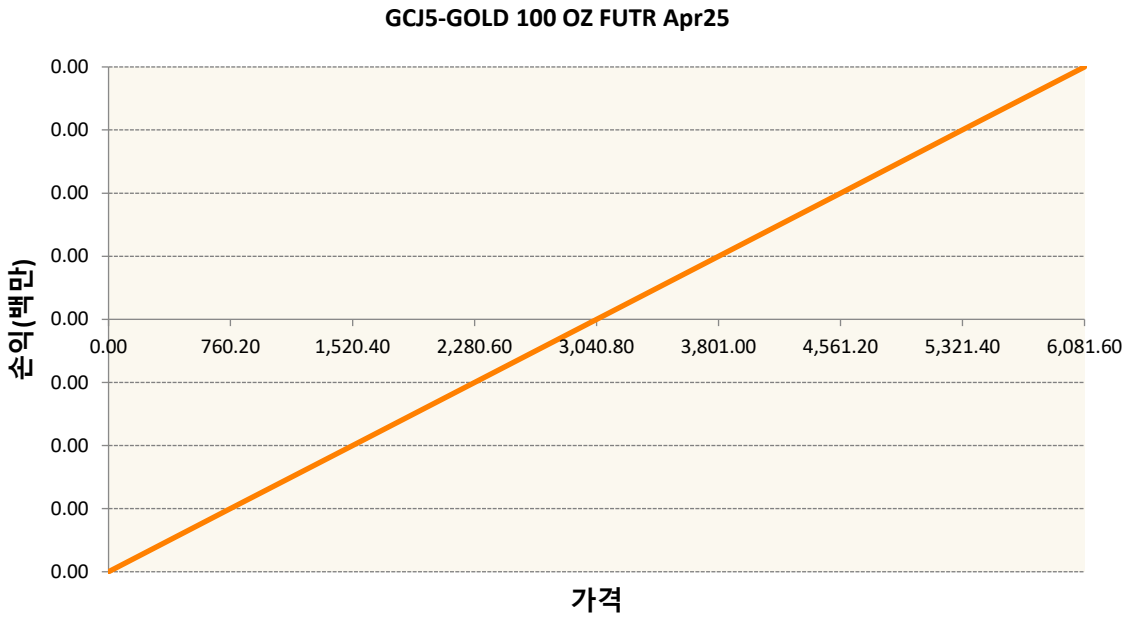
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,764	0	1,764	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 03/21/25 C276 EQUITY	0.21
GCI5 GOLD 100 OZ FUTR Apr25	141

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

(단위:백만원)

103

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

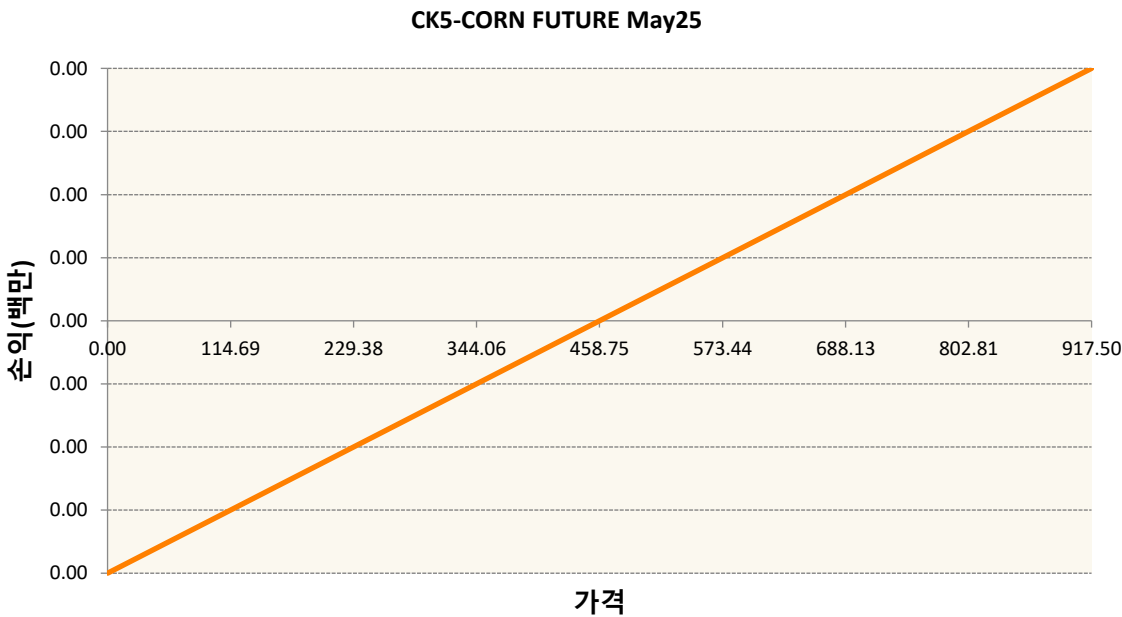
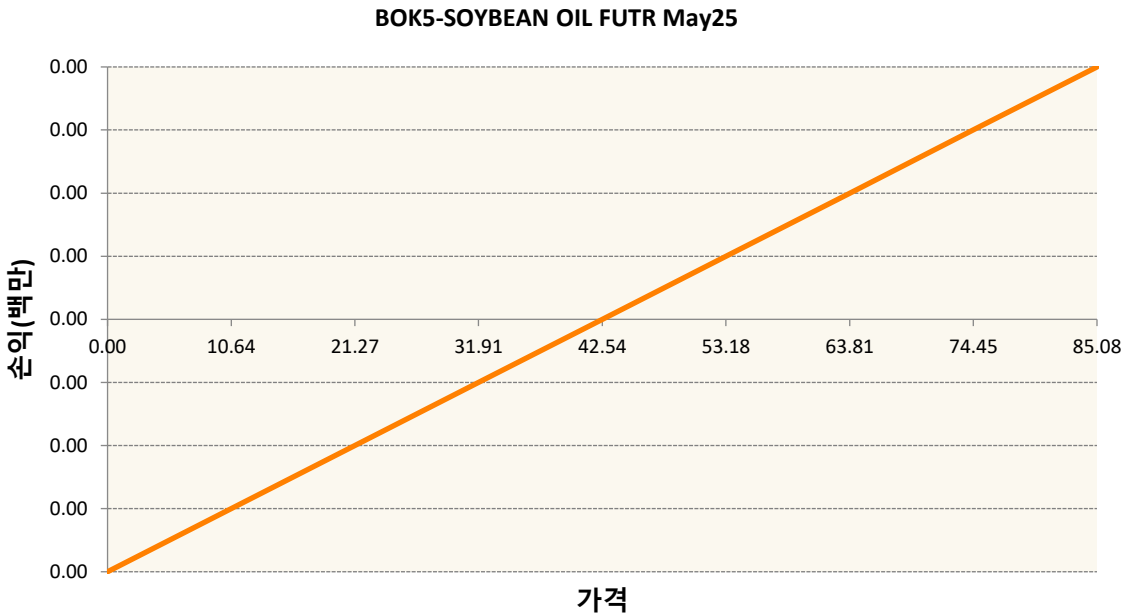
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

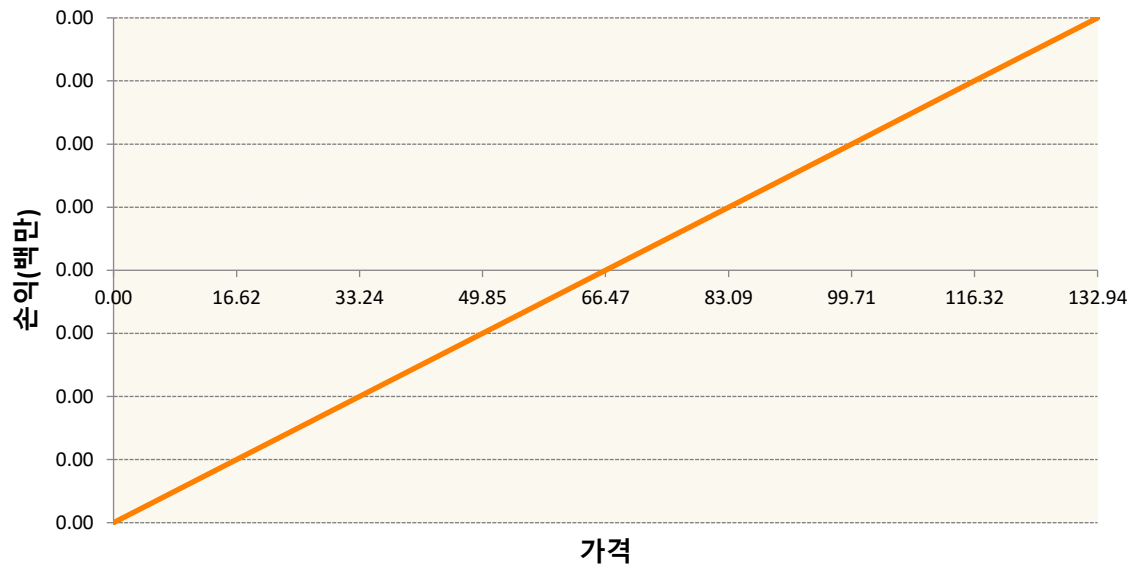
(단위:USD 백만)

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	3,802	0	3,802	
누계	통화	선물	0	377	-377	장내

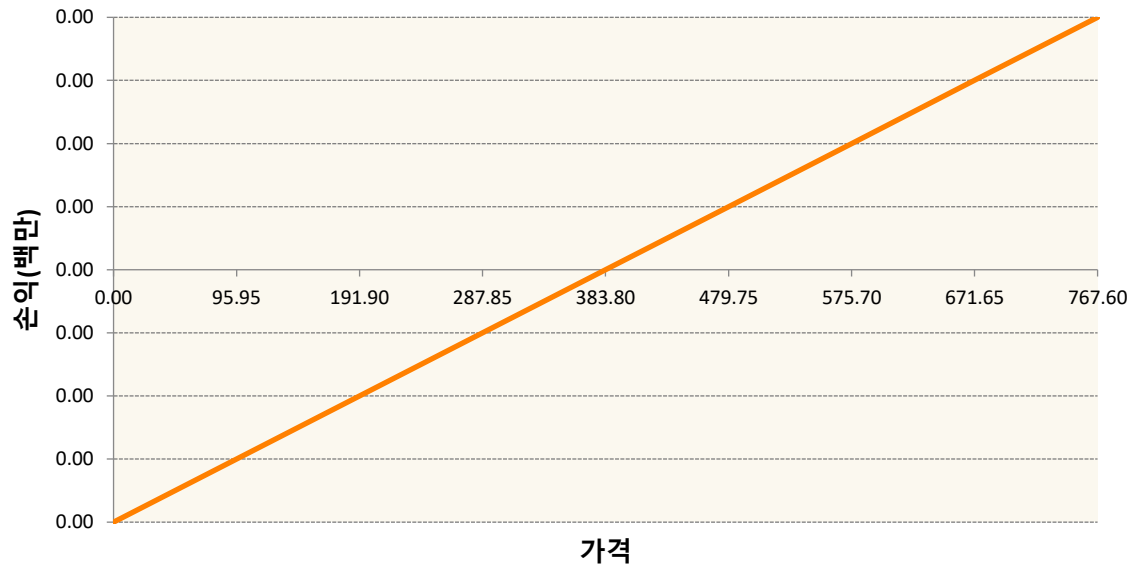
2. 만기시점의 손익구조



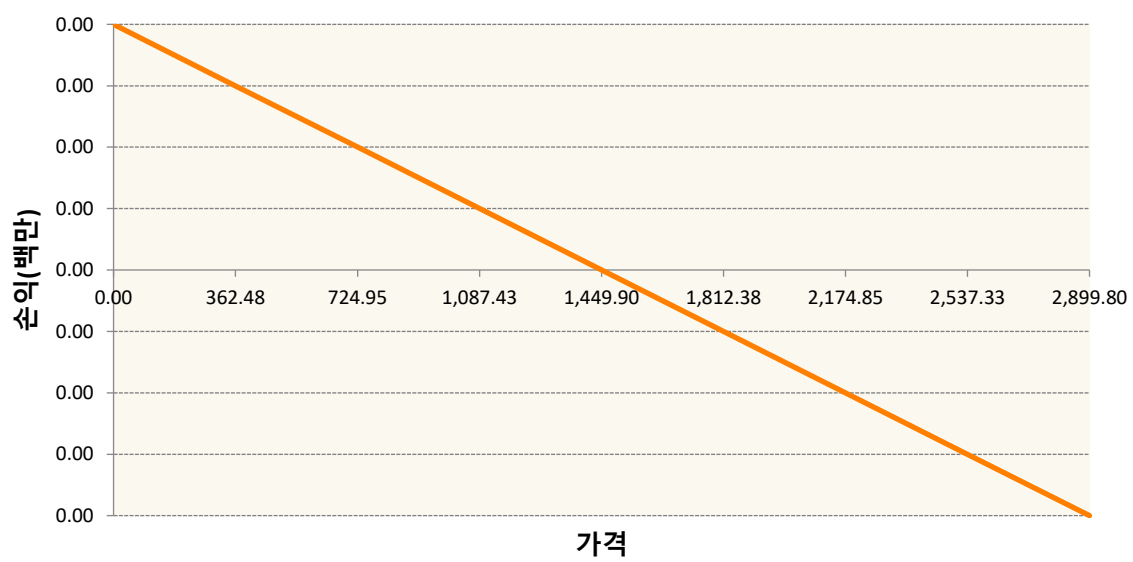
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



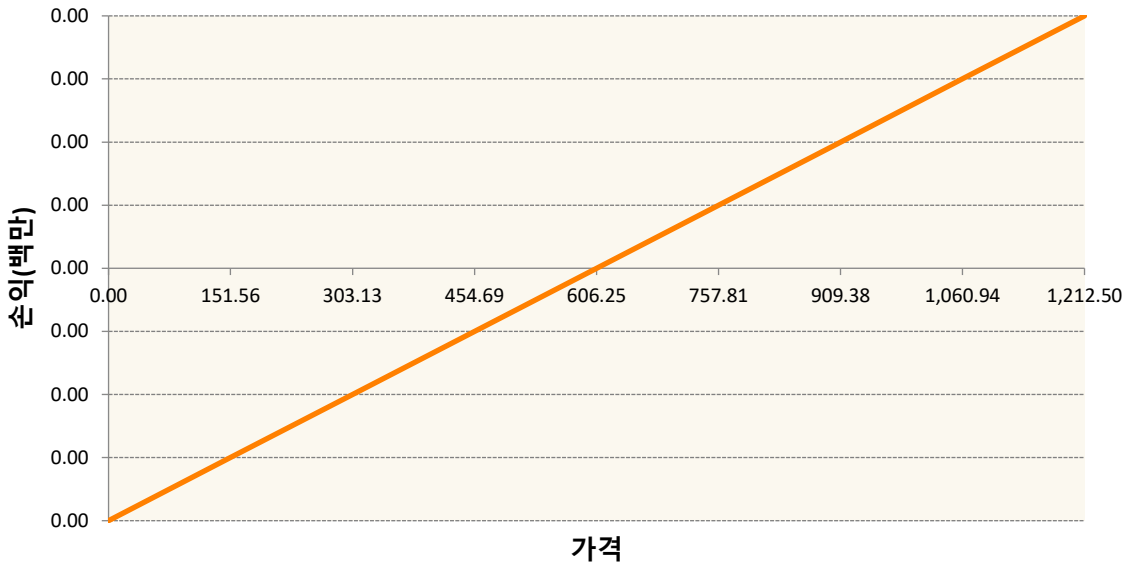
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



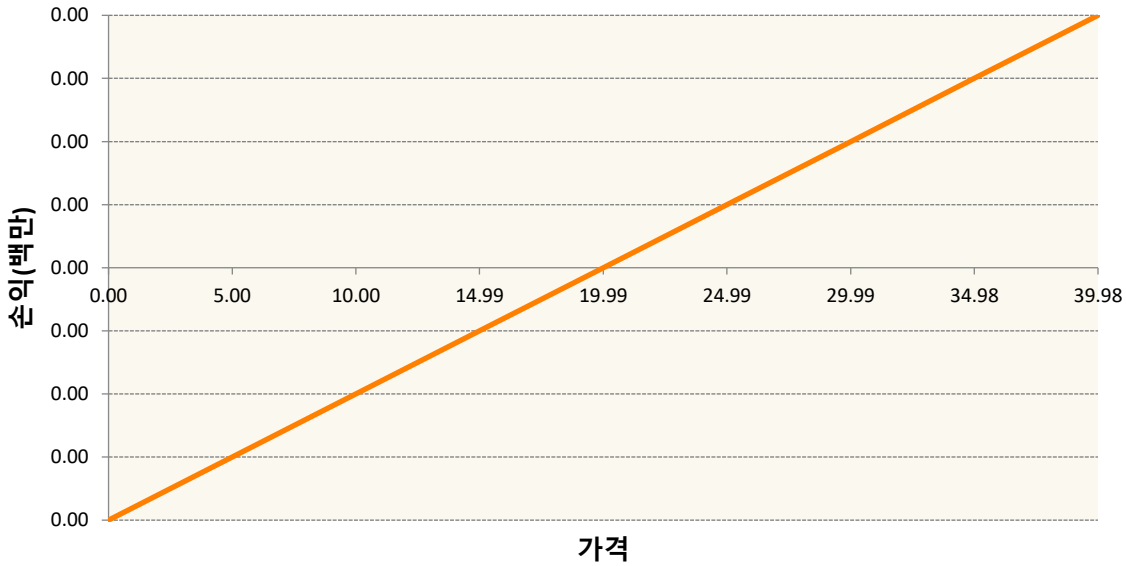
KR4175W40006-2025-04 달러선물



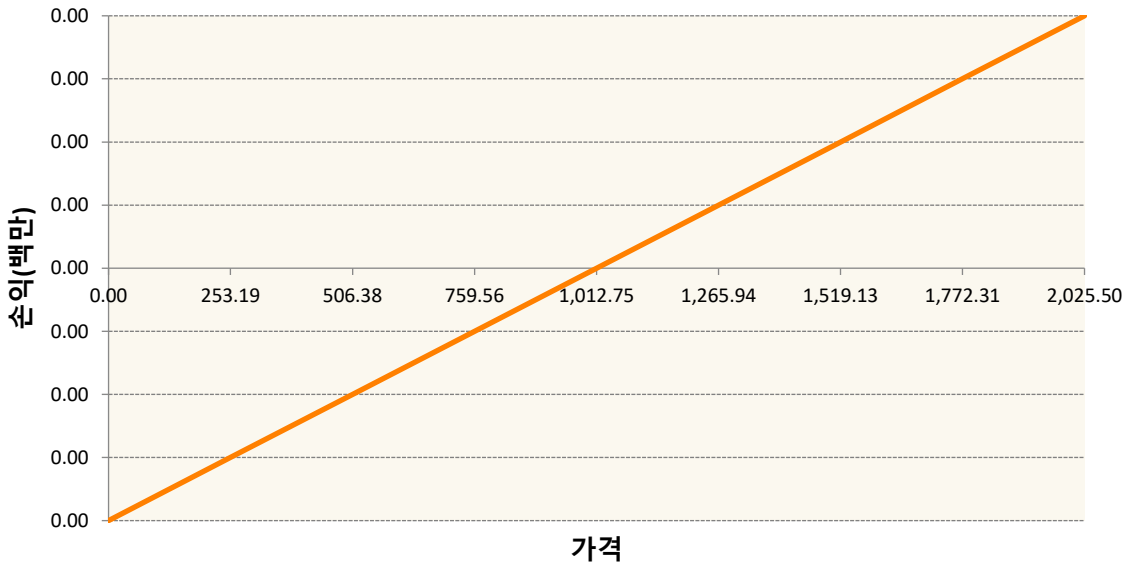
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



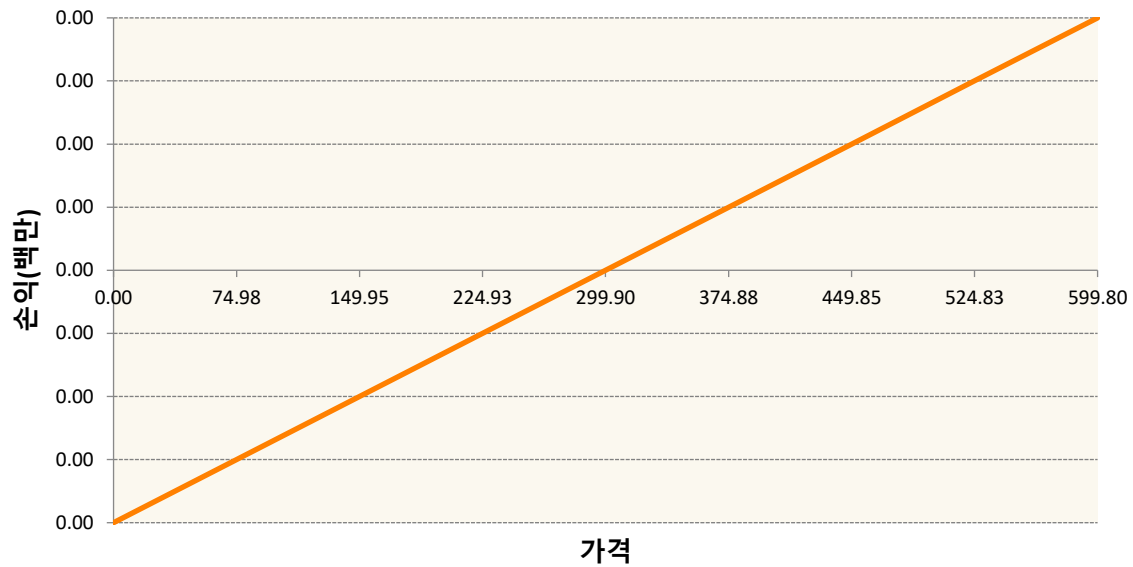
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



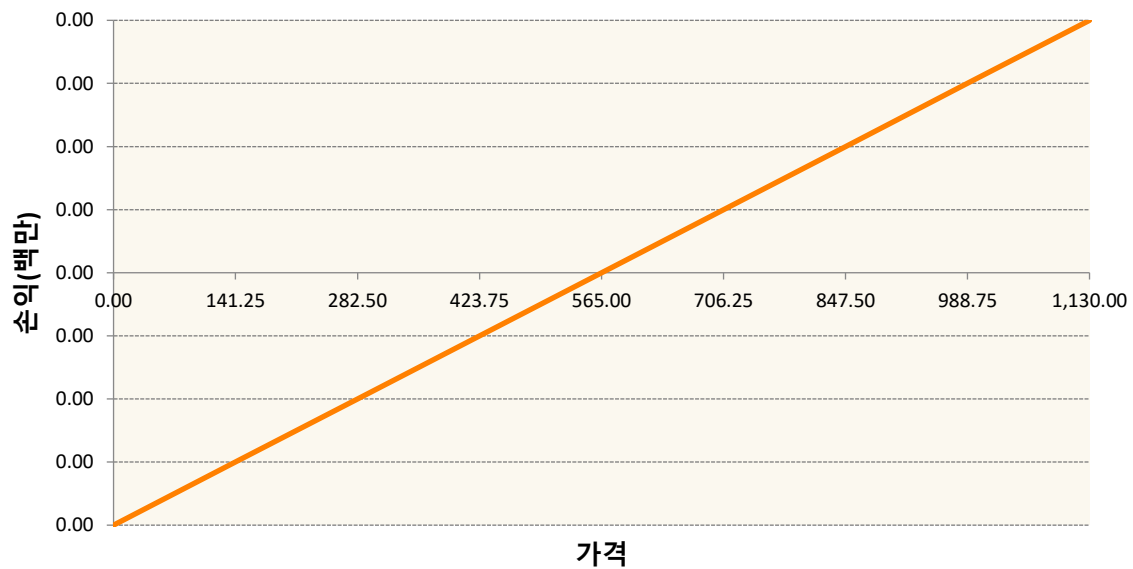
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-03-20
기준일	2025-03-19

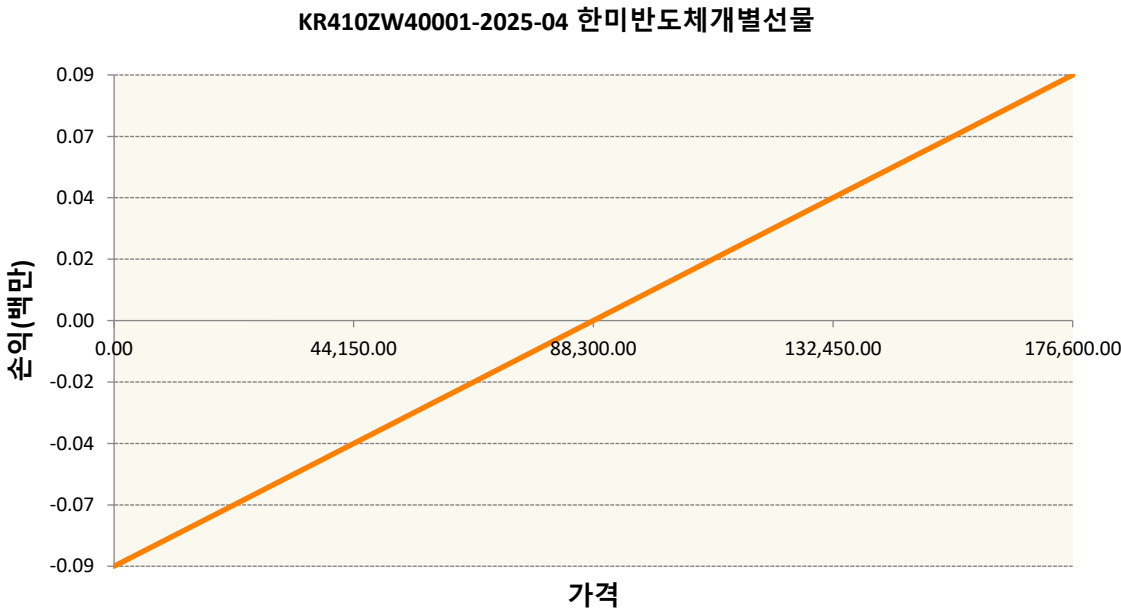
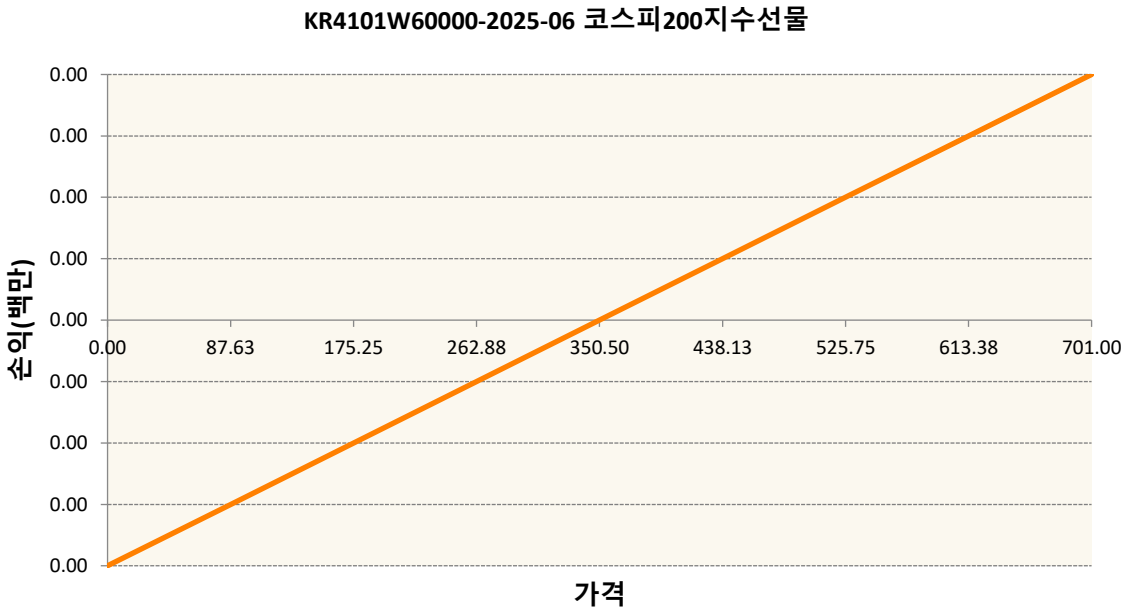
스마트인덱스모

1. 계약금액

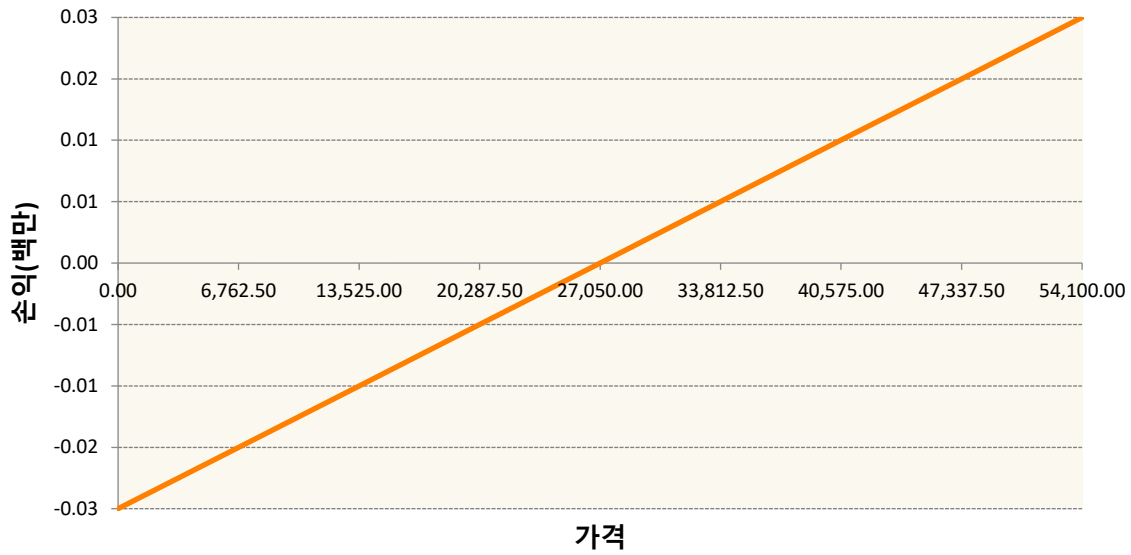
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,621	0	1,621	장내

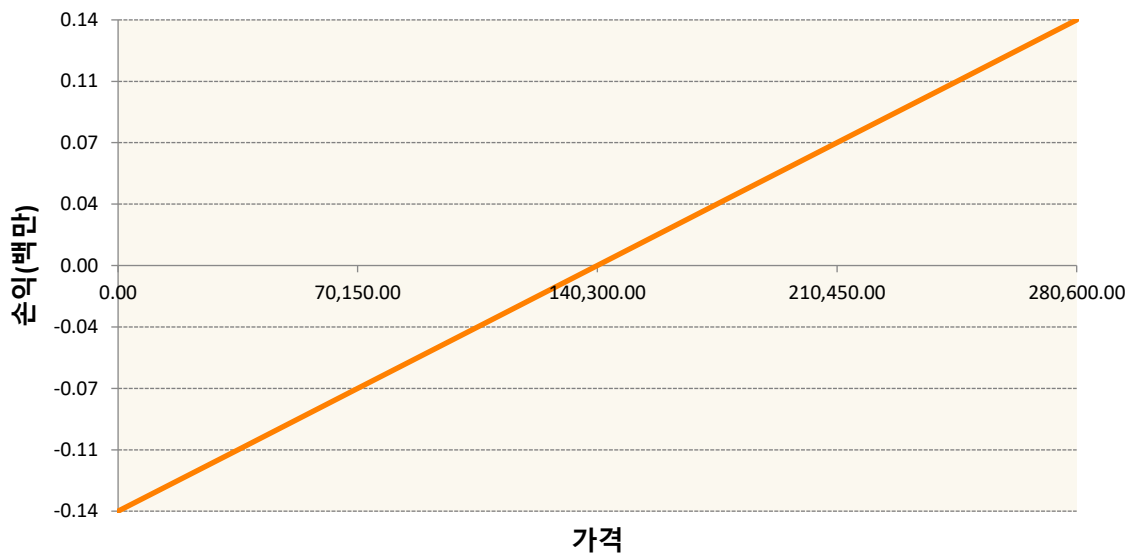
2. 만기시점의 손익구조



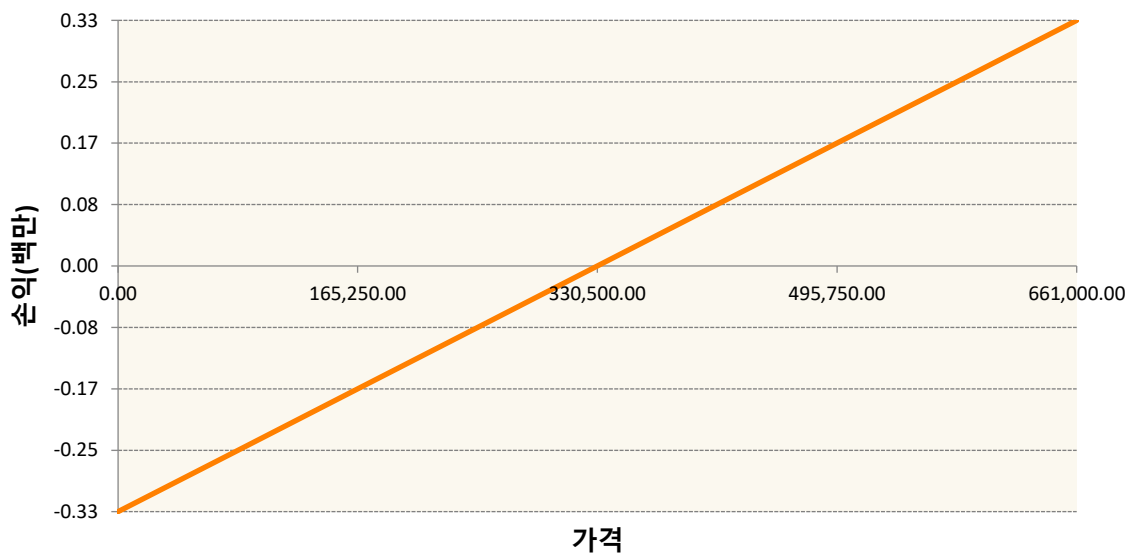
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



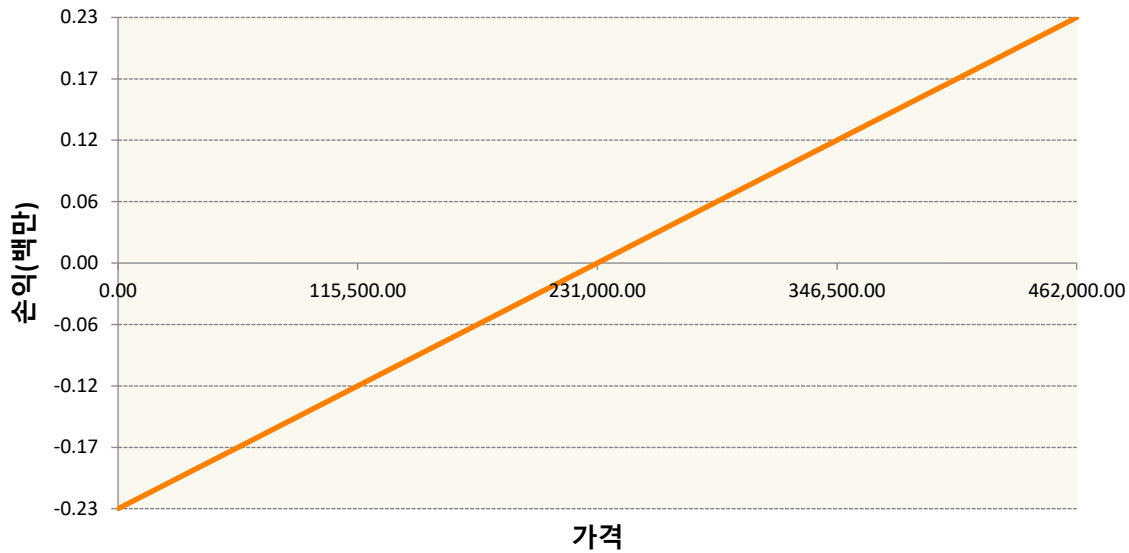
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



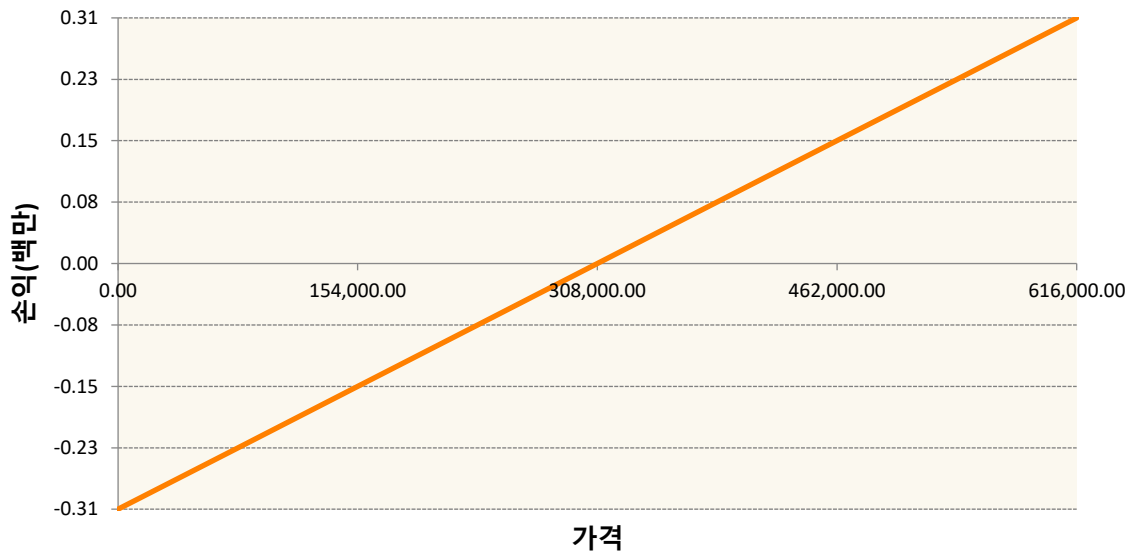
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	91
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	4
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	2
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물	5
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물	14
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물	6
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	8

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

(단위:백만원)

212

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

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	316
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

488

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

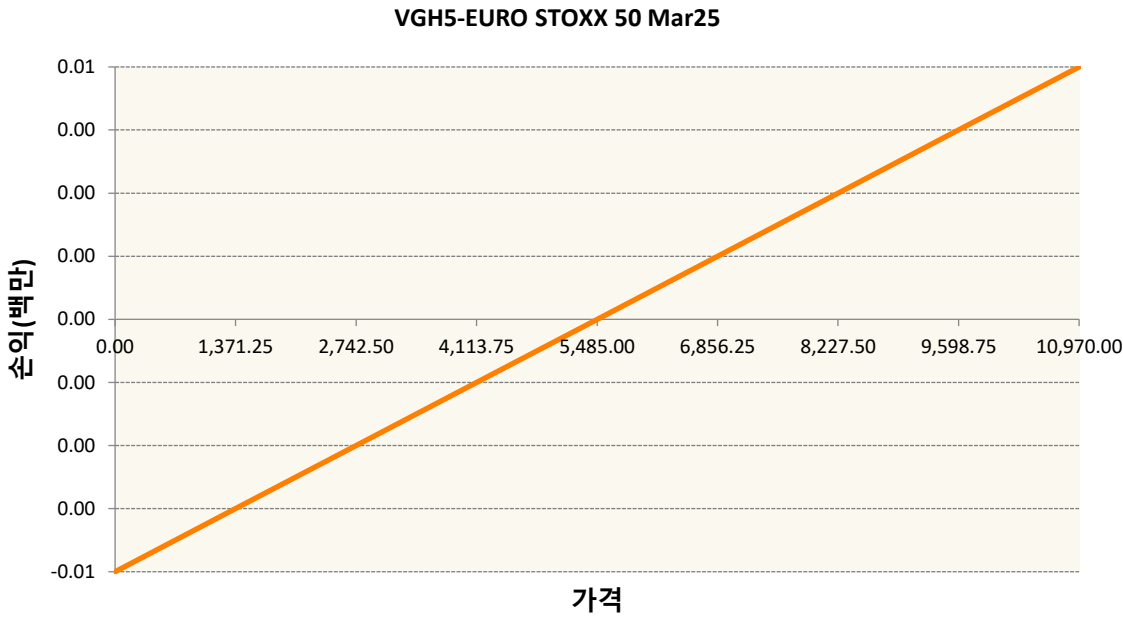
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	914	0	914	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH5	EURO STOXX 50 Mar25	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

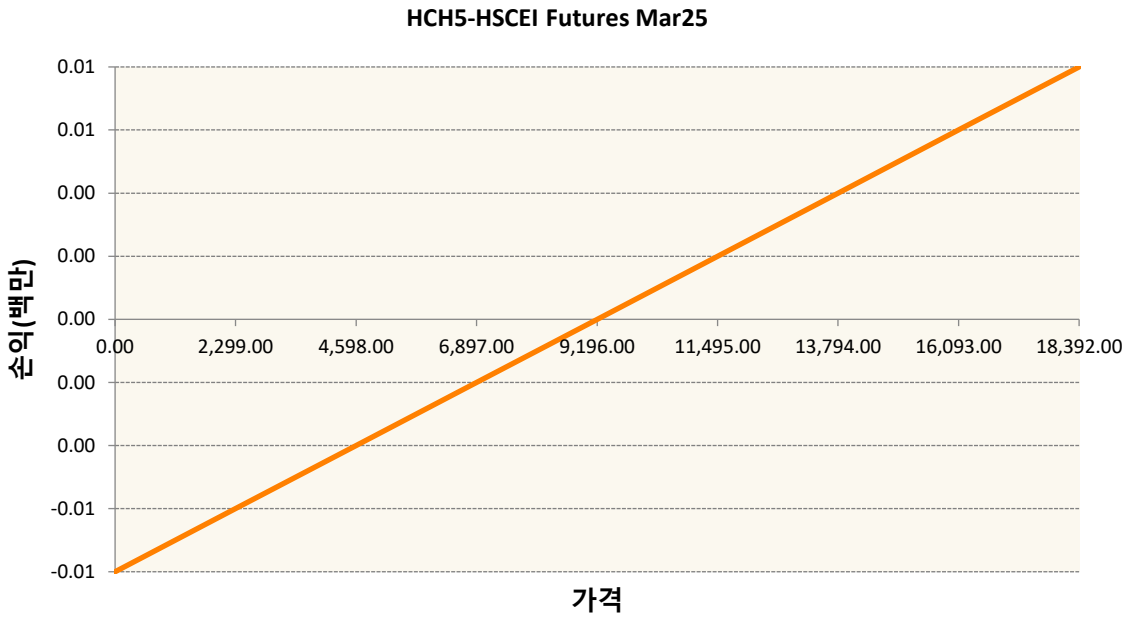
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	3,072	0	3,072	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH5	HSCEI Futures Mar25	246
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

337

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

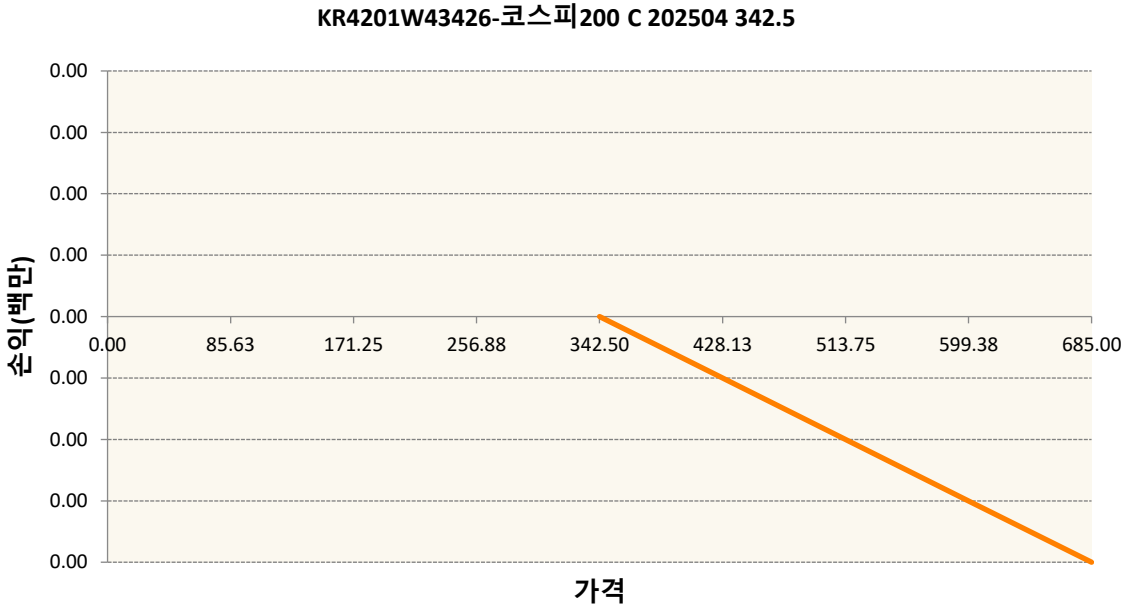
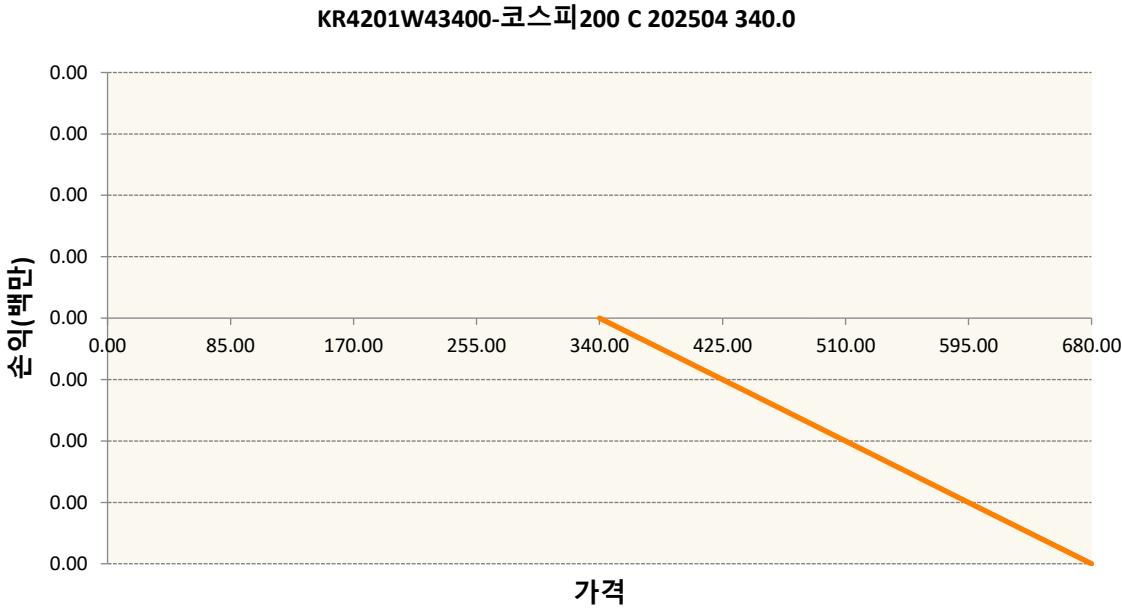
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	165	0	165	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,386	-37,386	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		977
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	529	517	503	488	471	454	436		
-5.33%	457	436	414	392	369	346	323		
-2.67%	304	279	255	230	205	181	156		
0%	61	42	21	0	-22	-44	-66		
2.67%	-249	-260	-273	-287	-302	-319	-337		
5.33%	-594	-598	-604	-612	-621	-632	-644		
8.00%	-951	-953	-955	-958	-963	-969	-977		
KR4201W43426							코스피200 C 202504 342.5		1,248
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	618	605	590	572	553	533	511
-5.33%	545	520	493	466	438	409	380
-2.67%	375	343	310	278	245	213	180
0%	87	59	30	0	-30	-61	-92
2.67%	-298	-316	-336	-357	-380	-405	-430
5.33%	-741	-749	-759	-771	-786	-802	-821
8.00%	-1,206	-1,209	-1,213	-1,219	-1,227	-1,236	-1,248
KR4301W43408 코스피200 P 202504 340.0							143

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-122	-125	-128	-131	-135	-139	-143
-5.33%	-59	-63	-68	-73	-78	-83	-88
-2.67%	-13	-18	-24	-29	-34	-40	-45
0%	13	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	25	22	20	16	13	9	6
5.33%	29	28	26	25	23	20	17
8.00%	30	29	29	28	27	26	24

KR4301W43424 코스피200 P 202504 342.5							207
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-182	-185	-189	-193	-197	-202	-207
-5.33%	-91	-97	-103	-109	-116	-122	-129
-2.67%	-22	-30	-37	-44	-52	-59	-67
0%	20	13	7	0	-7	-14	-21
2.67%	40	36	31	26	21	16	10
5.33%	47	45	43	40	37	33	29
8.00%	49	48	47	46	44	42	40

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

(단위:백만원)

2,649

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

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	2025-03-20
기준일	2025-03-19

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	2025-03-20
기준일	2025-03-19

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	12,990	0	12,990	
누계	통화	선도	363	12,935	-12,572	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	2025-03-20
기준일	2025-03-19

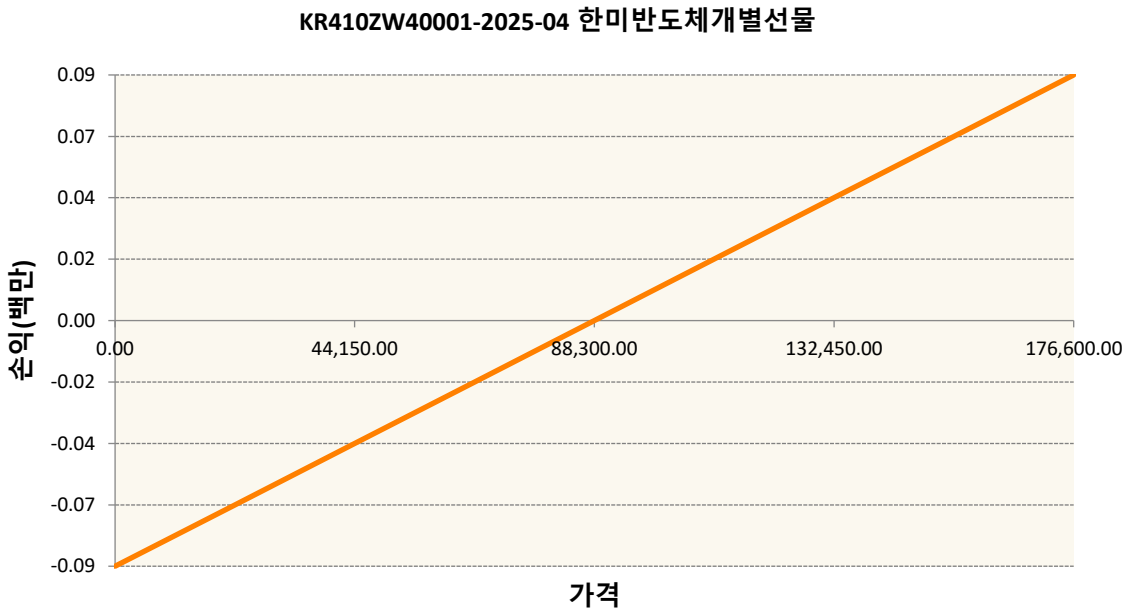
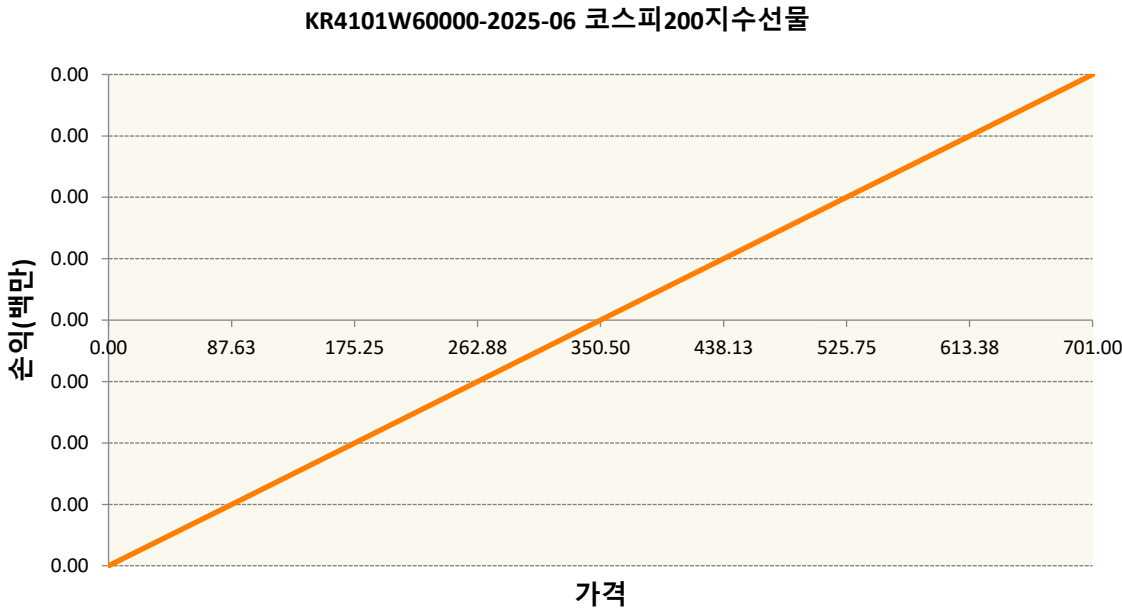
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

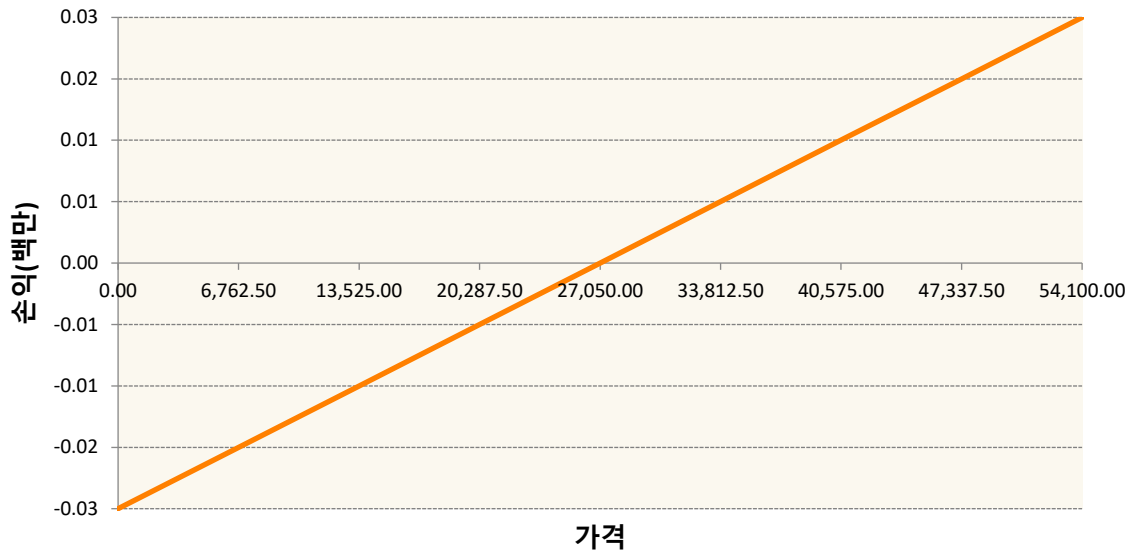
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	849	0	849	장내

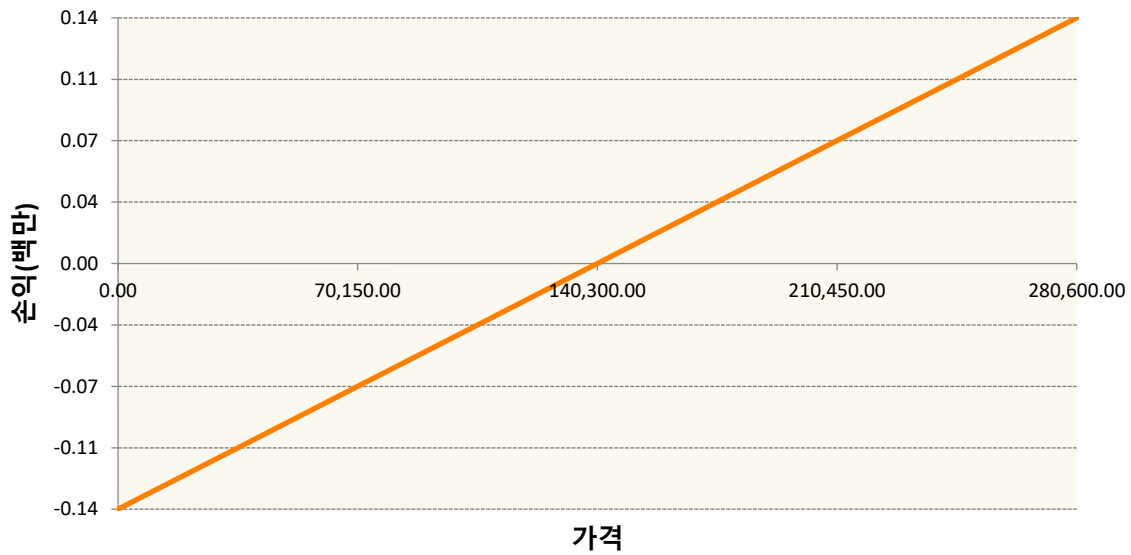
2. 만기시점의 손익구조



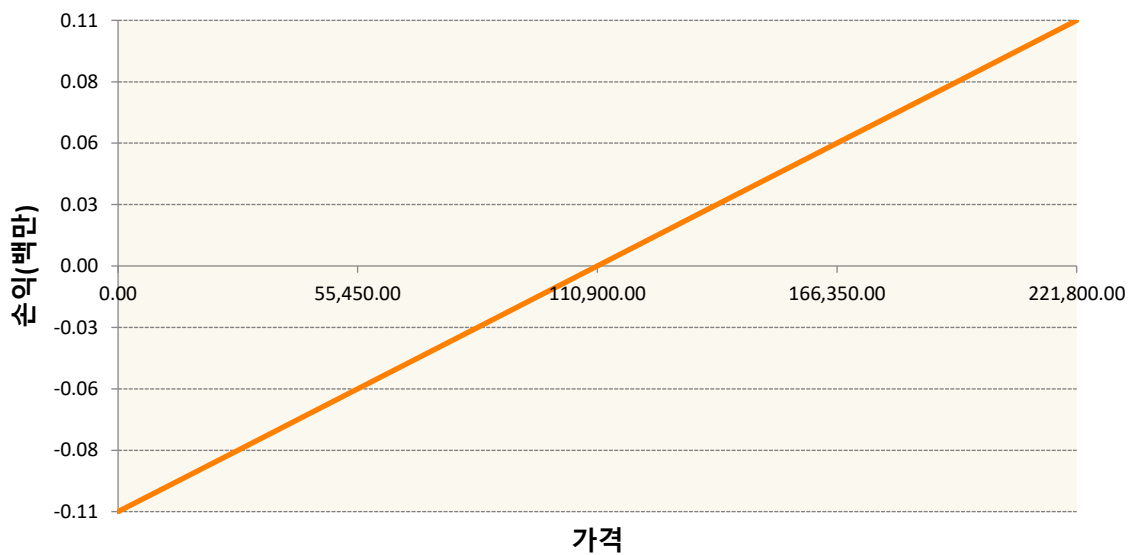
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



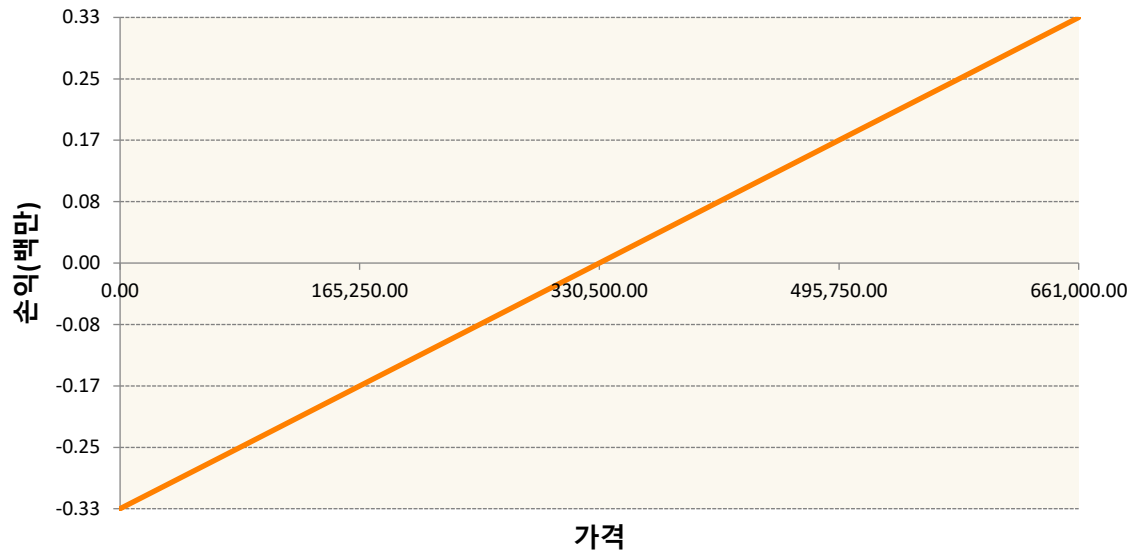
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



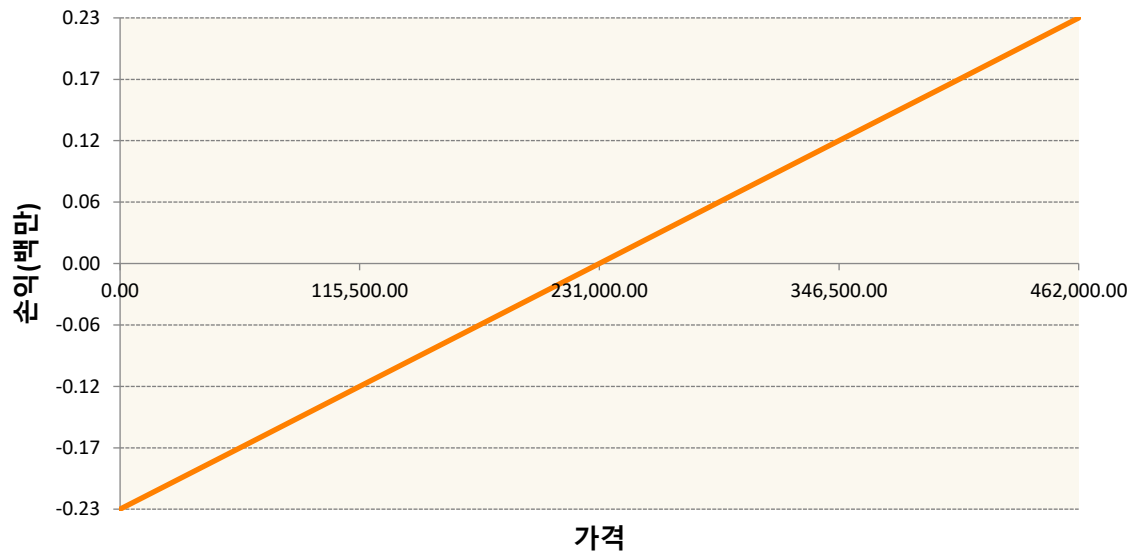
KR41EYW40004-2025-04 에코프로비엠개별선물



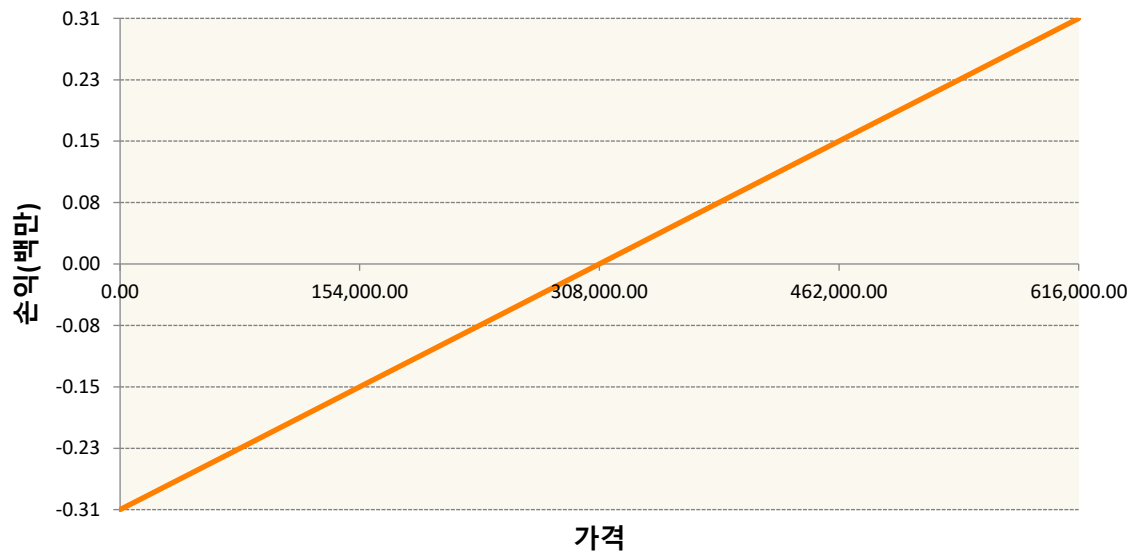
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



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		3

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

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

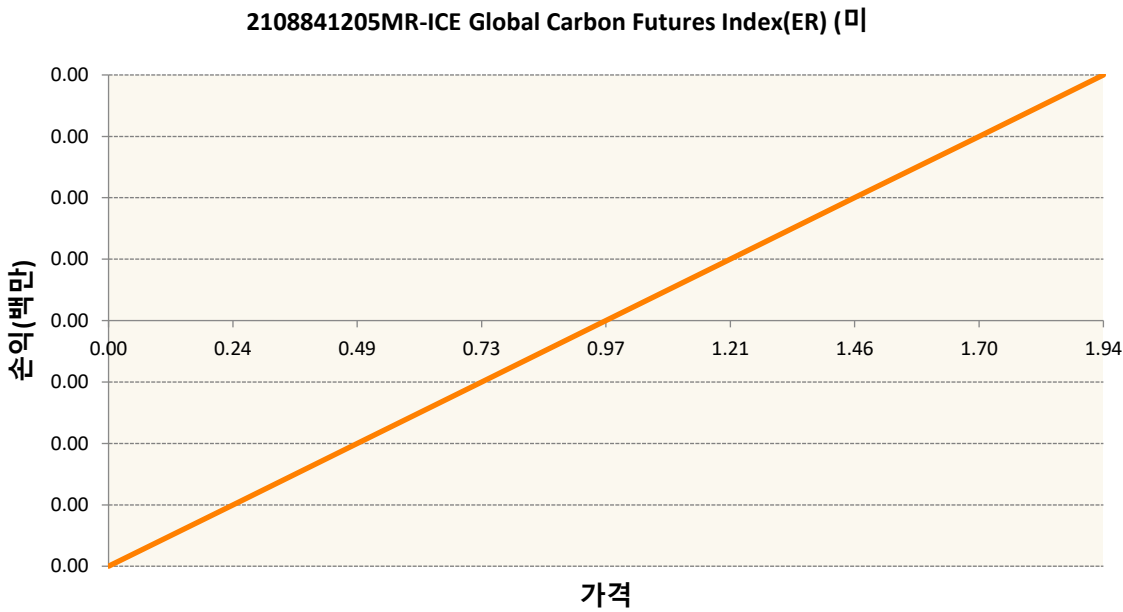
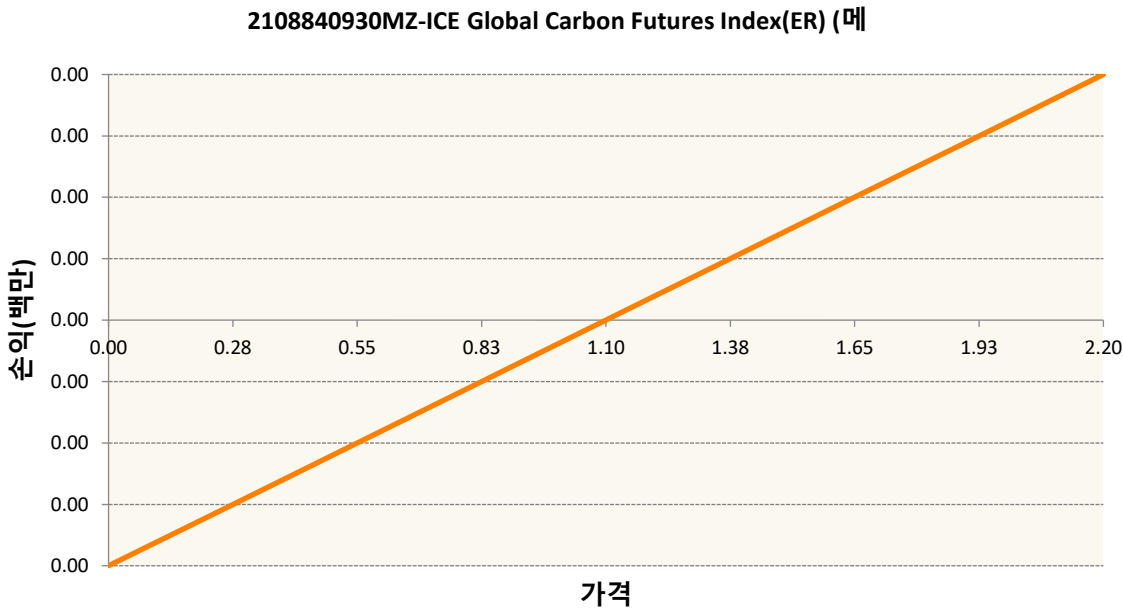
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840930IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		197
2108841205IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		590

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	884

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

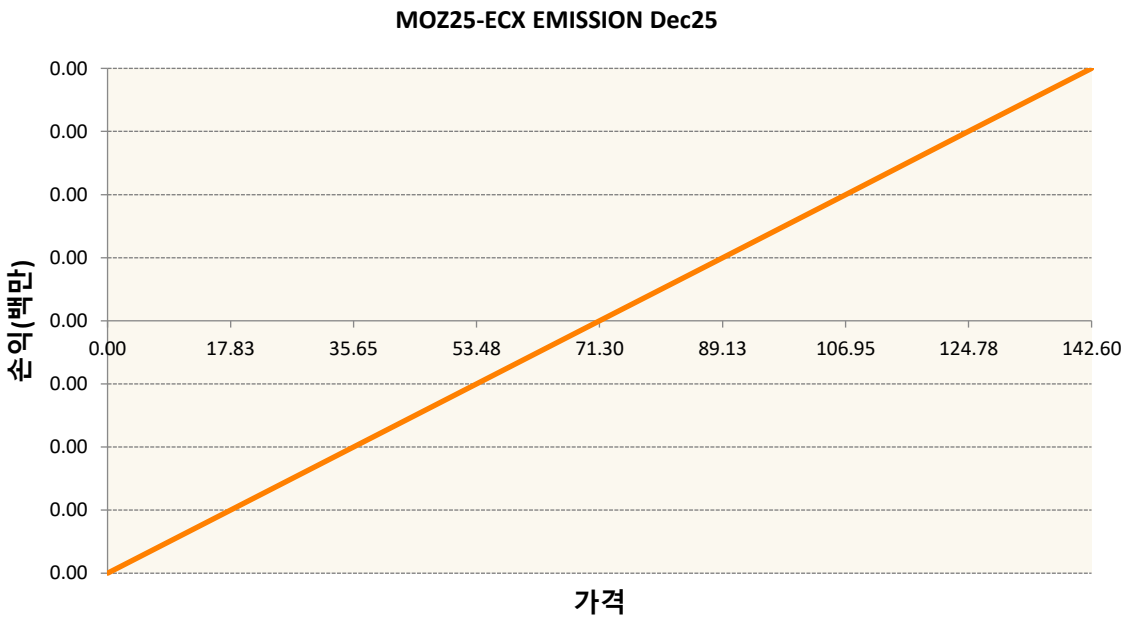
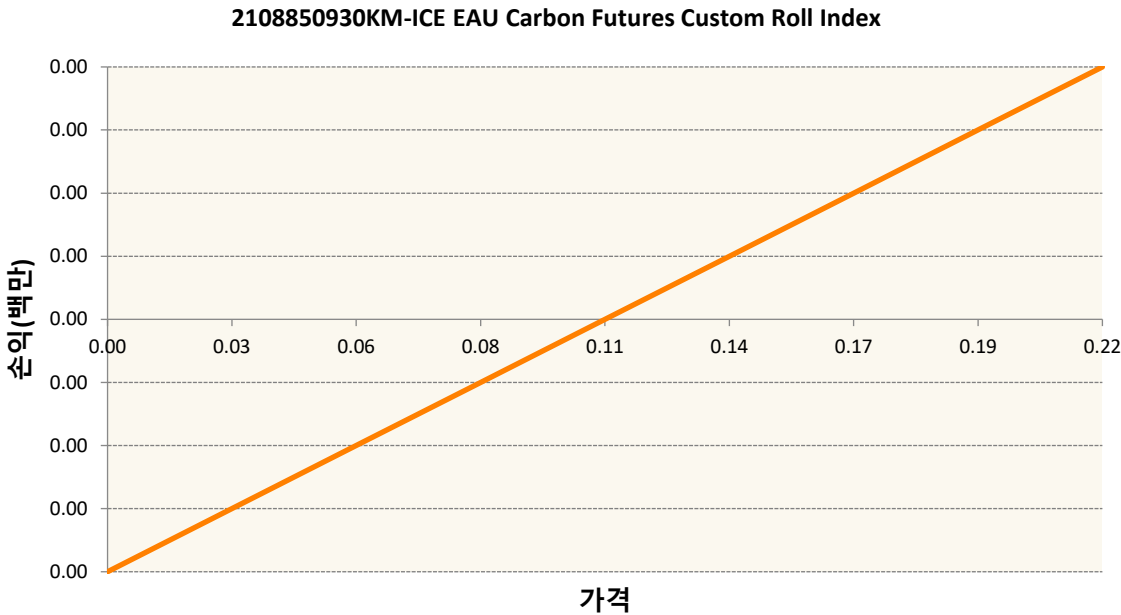
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,465	0	5,465	
누계	통화	선도	0	1,043	-1,043	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	3
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	83
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	434

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

800

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

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)

9

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

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)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	31
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	6

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

(단위:백만원)

146

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

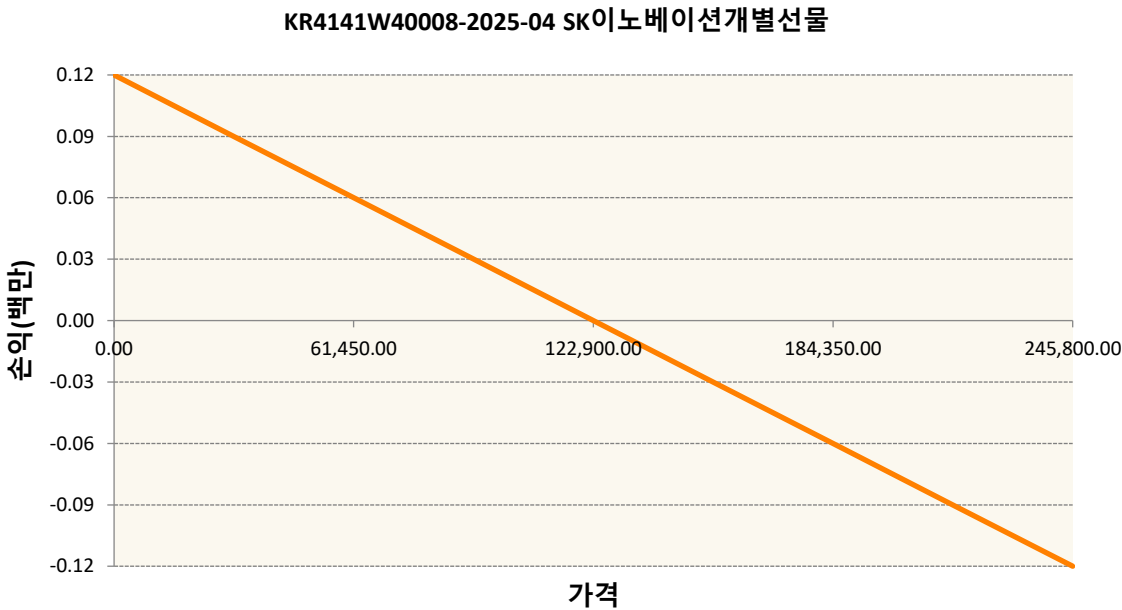
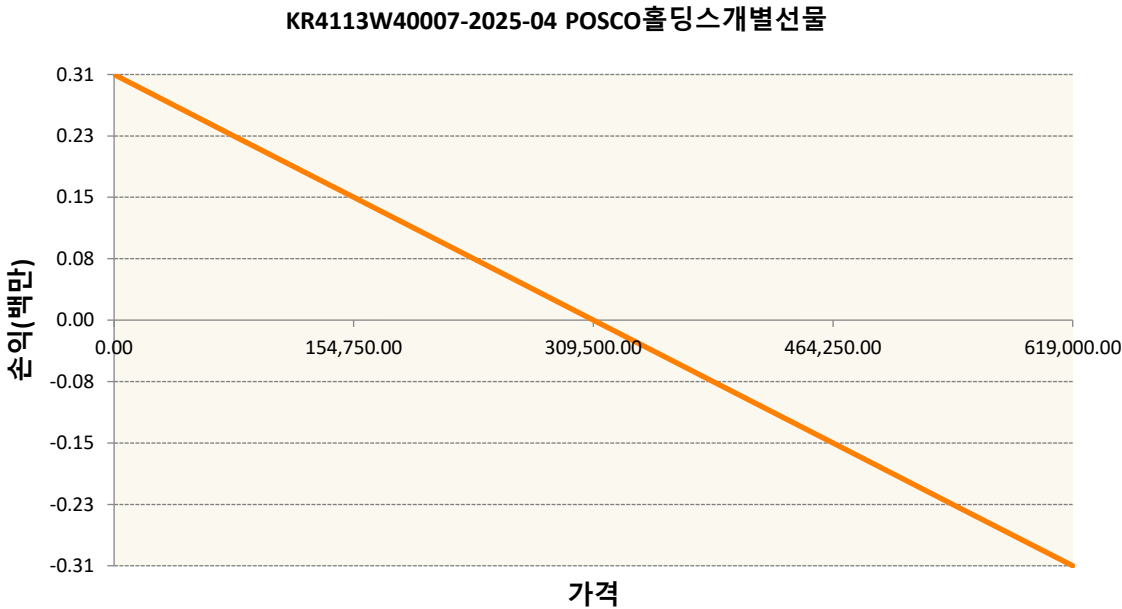
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

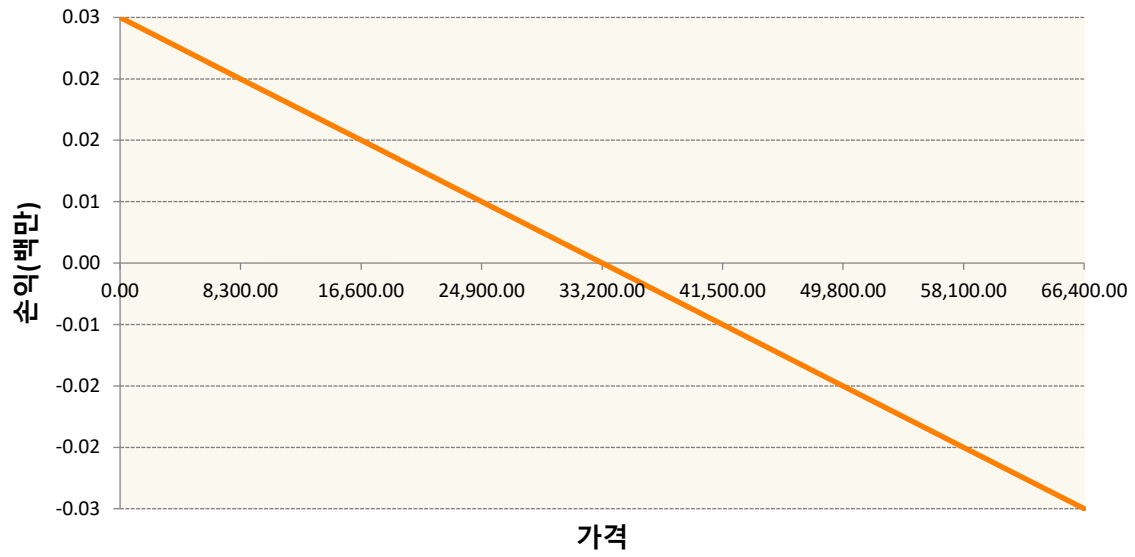
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	12	-12	장내
누계	유가증권	선물	5	32	-27	장내

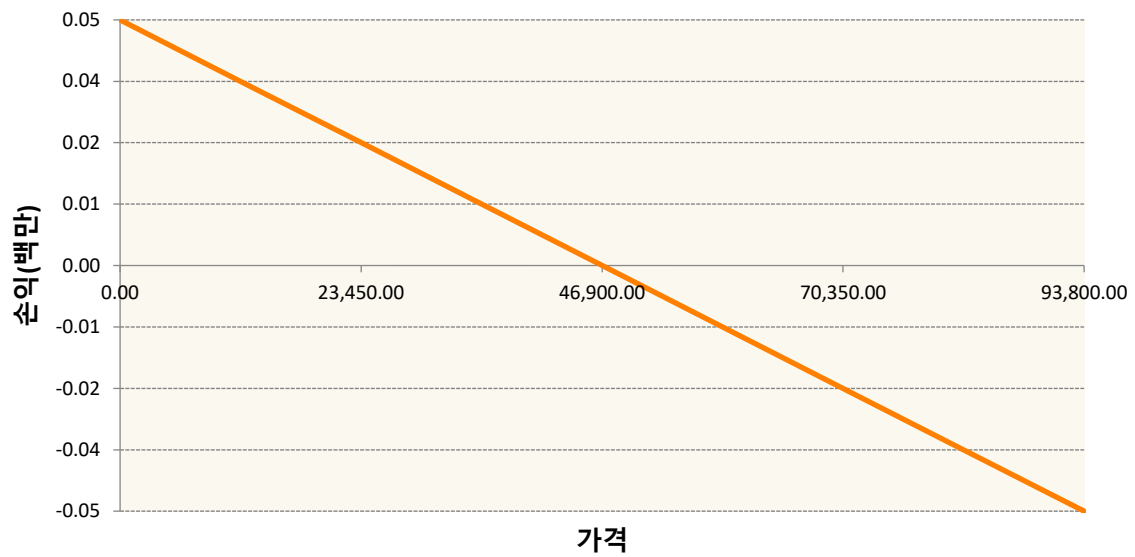
2. 만기시점의 손익구조



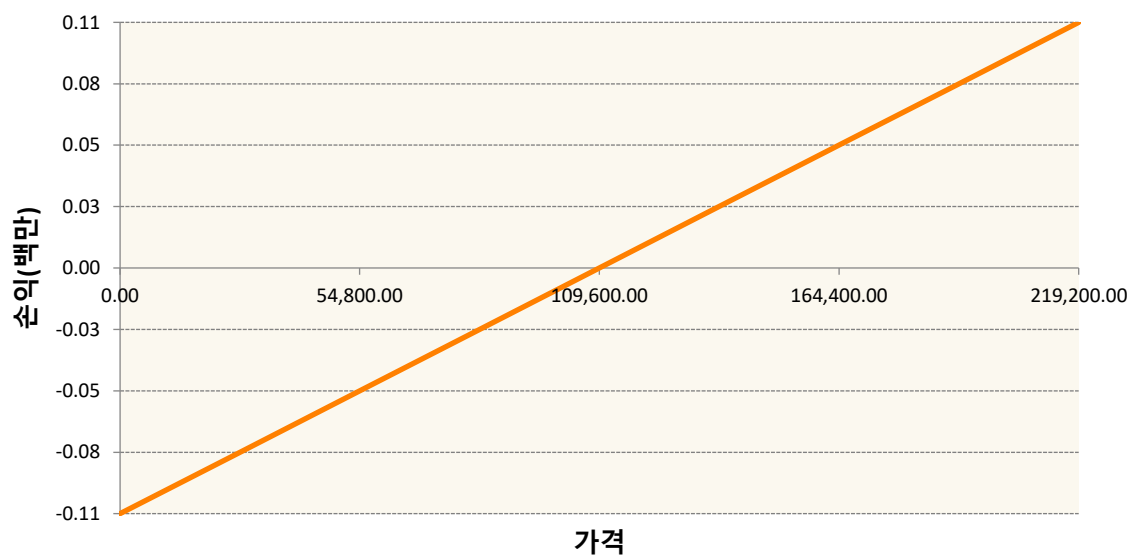
KR41BNW40003-2025-04 현대건설개별선물



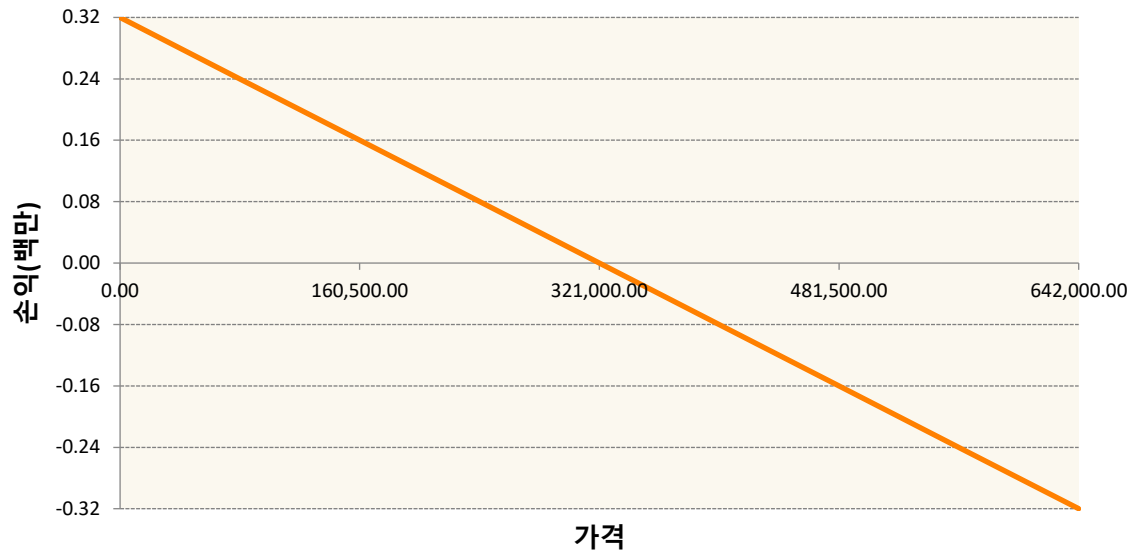
KR41BPW40008-2025-04 현대위아개별선물



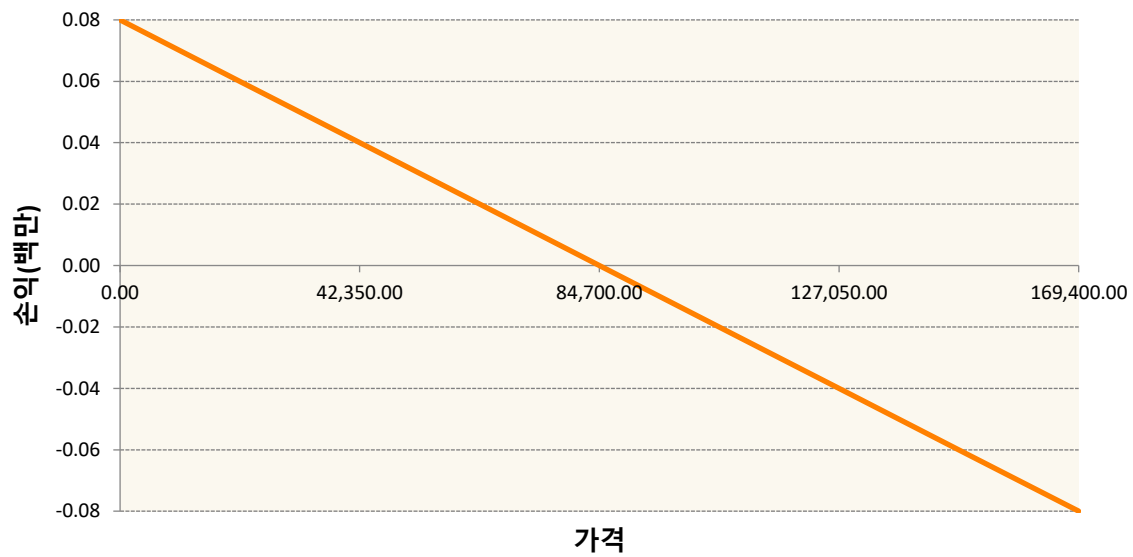
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



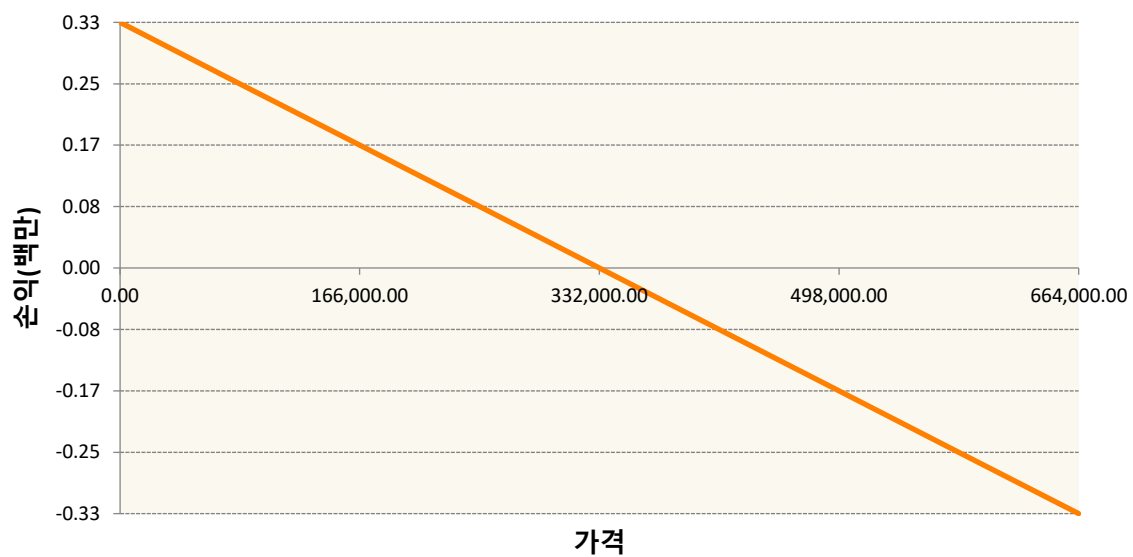
KR41CRW40002-2025-04 LG생활건강개별선물



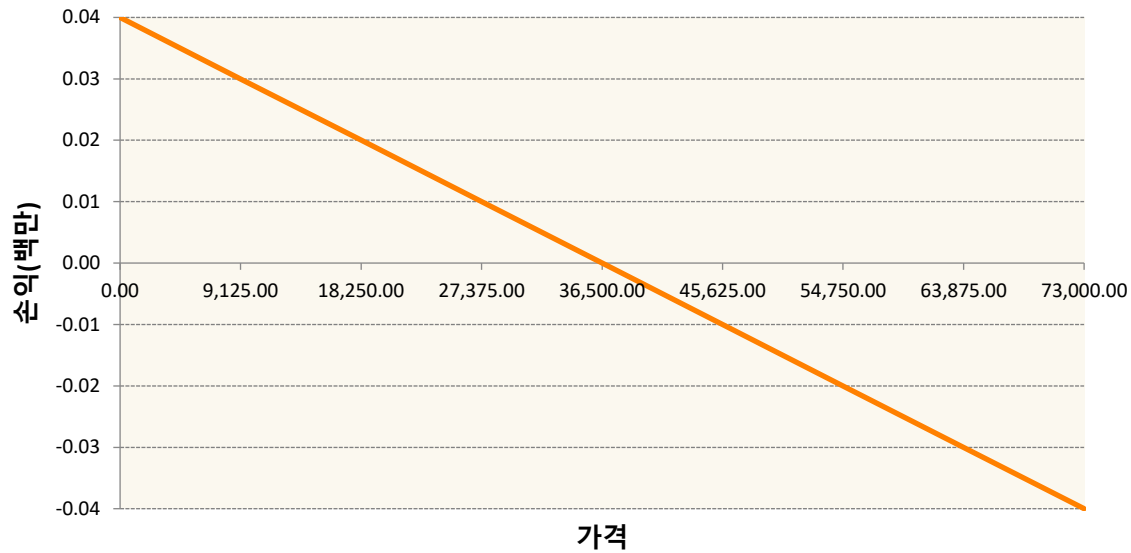
KR41CWW40002-2025-04 코웨이개별선물



KR41GGW40006-2025-04 휴젤개별선물



KR41GYW40009-2025-04 에스엘개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4113W40(2025-04 POSCO홀딩스개별선물	0.25
KR4141W40(2025-04 SK이노베이션개별선물	0.29
KR41BNW40 2025-04 현대건설개별선물	0.29
KR41BPW40(2025-04 현대위아개별선물	0.3
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	0.44
KR41CRW40(2025-04 LG생활건강개별선물	1
KR41CWW4(2025-04 코웨이개별선물	0.34
KR41GGW40 2025-04 휴젤개별선물	0.27
KR41GYW40 2025-04 에스엘개별선물	0.32

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

(단위:백만원)

7

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

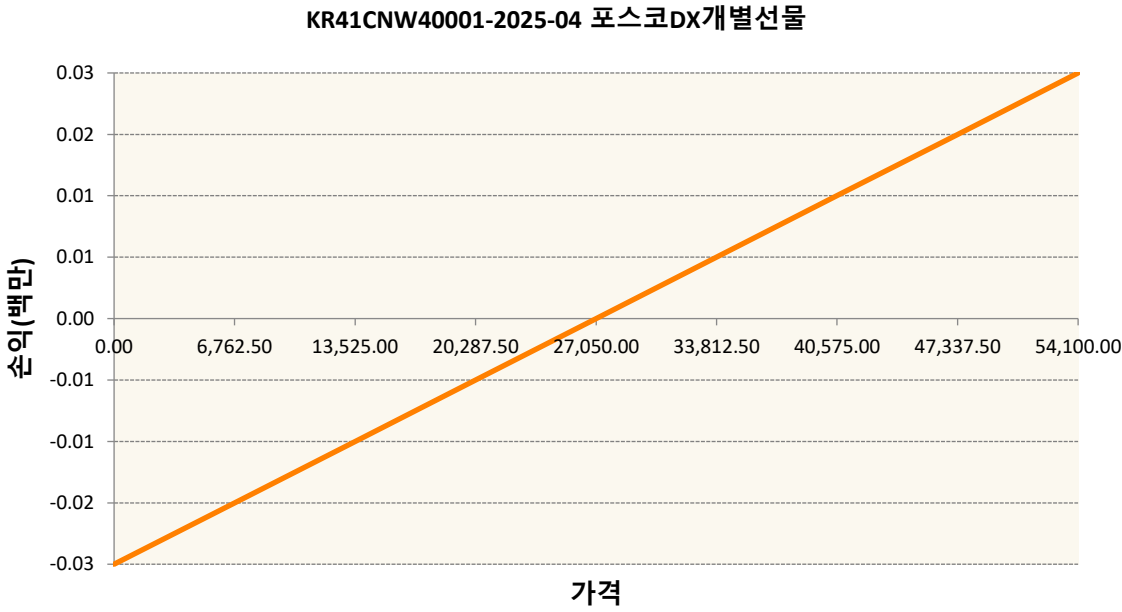
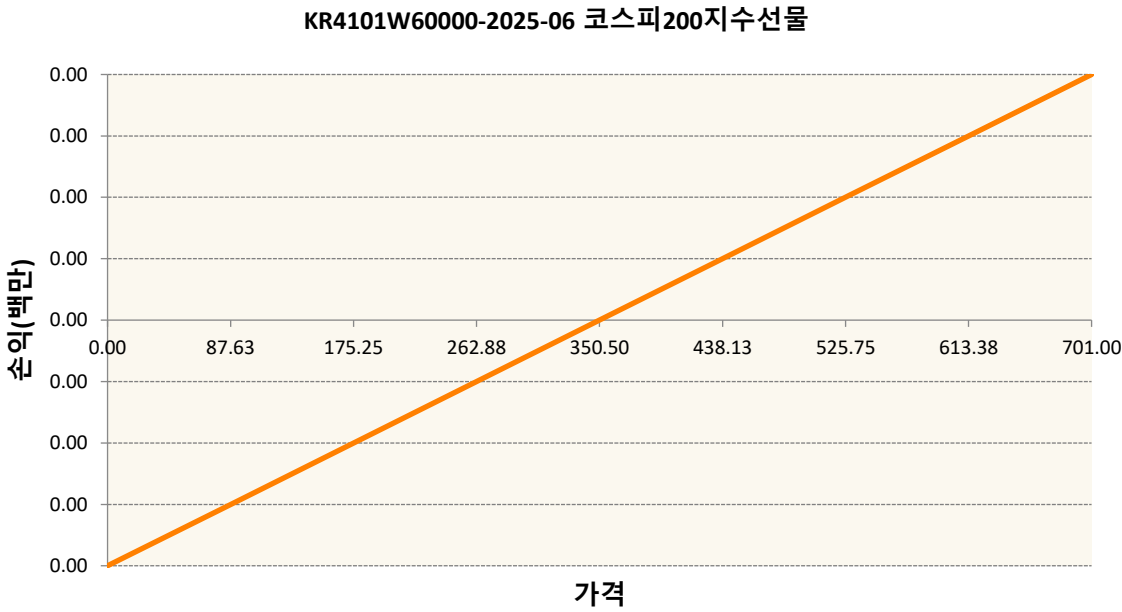
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

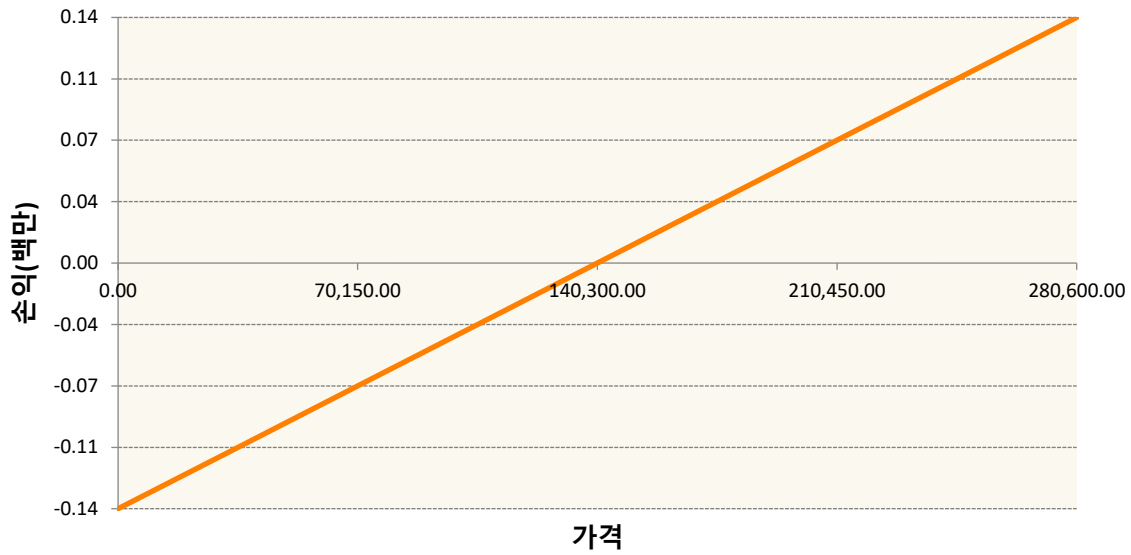
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	124	0	124	장내
누계	유가증권	선물	10,070	0	10,070	장내

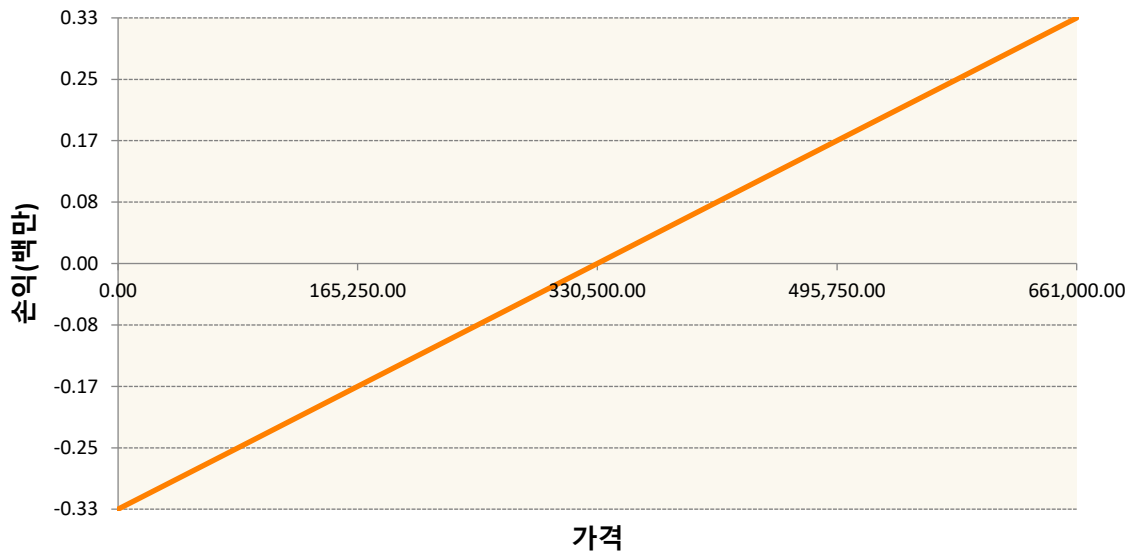
2. 만기시점의 손익구조



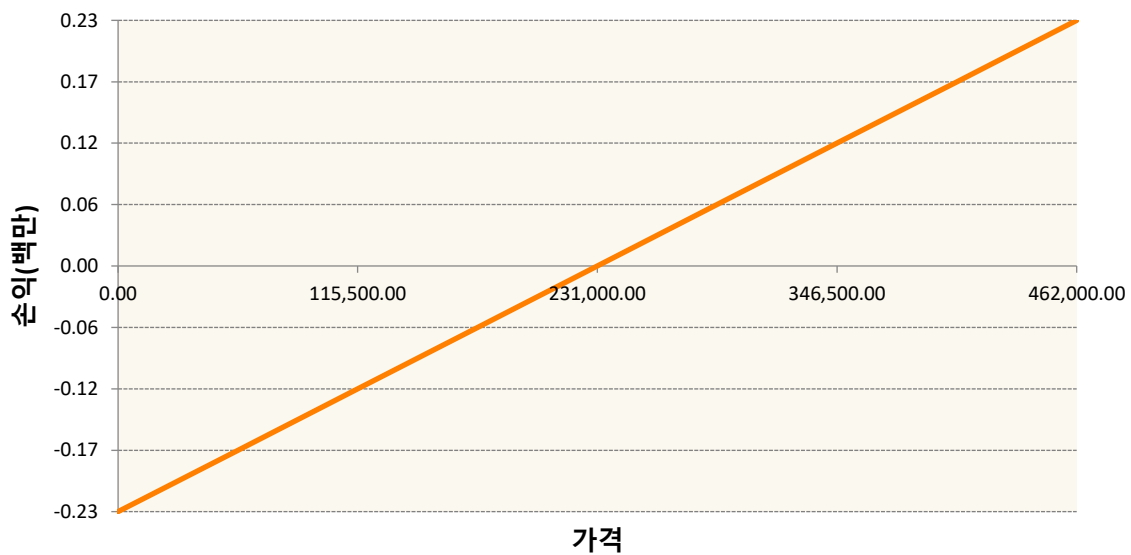
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



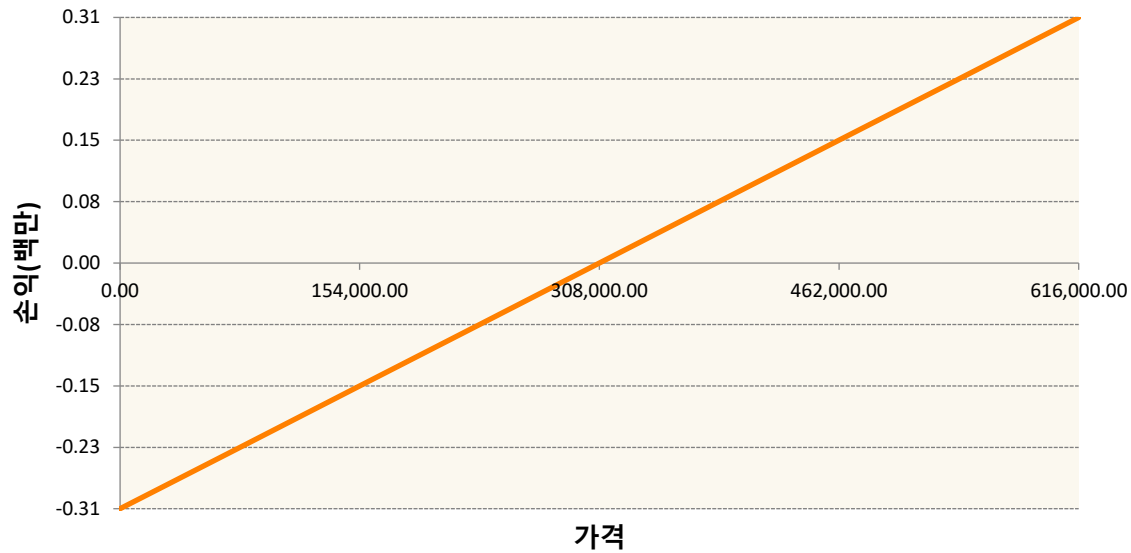
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물

603
13
18
115
47
10

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

(단위:백만원)

1,230

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

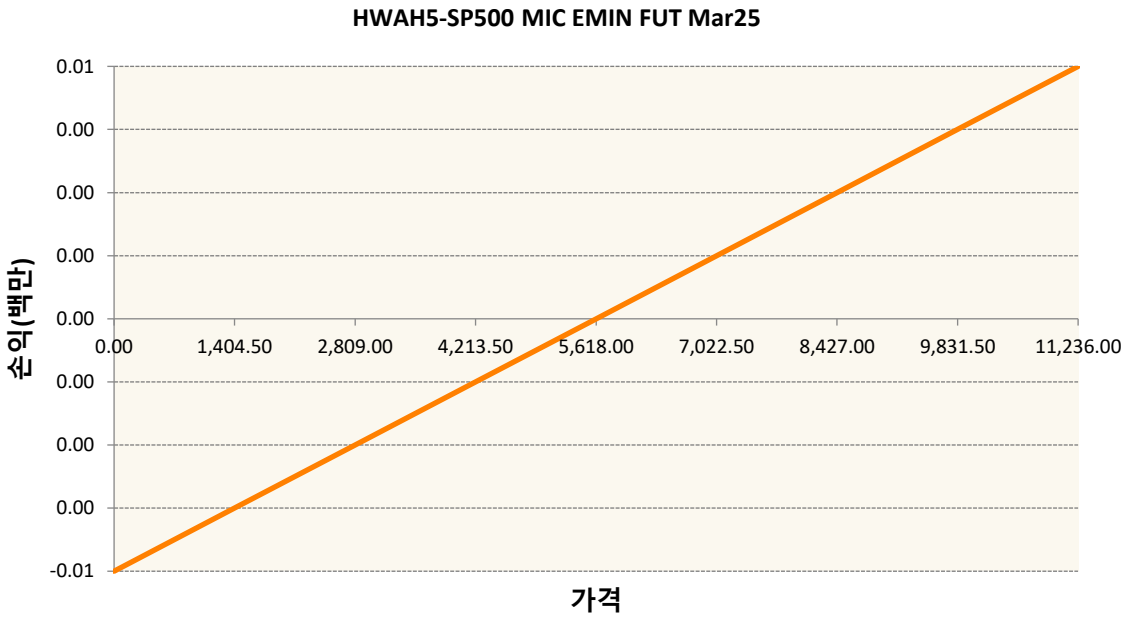
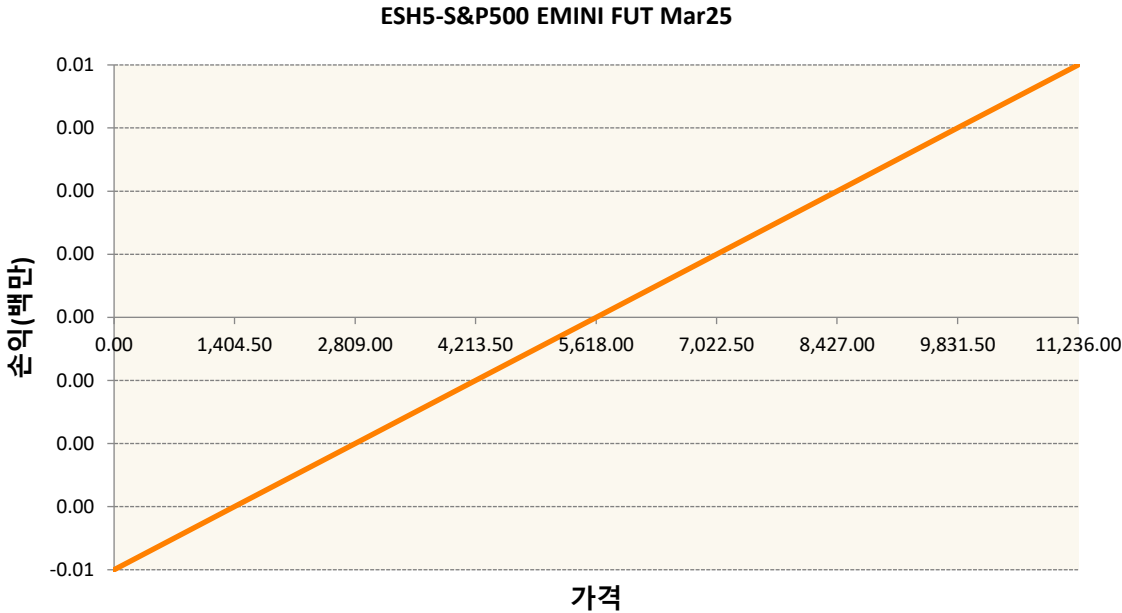
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	27,333	0	27,333	
누계	유가증권	선물	1,181	0	1,181	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH5	S&P500 EMINI FUT Mar25	2,187
HWAH5	SP500 MIC EMIN FUT Mar25	94

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,009

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

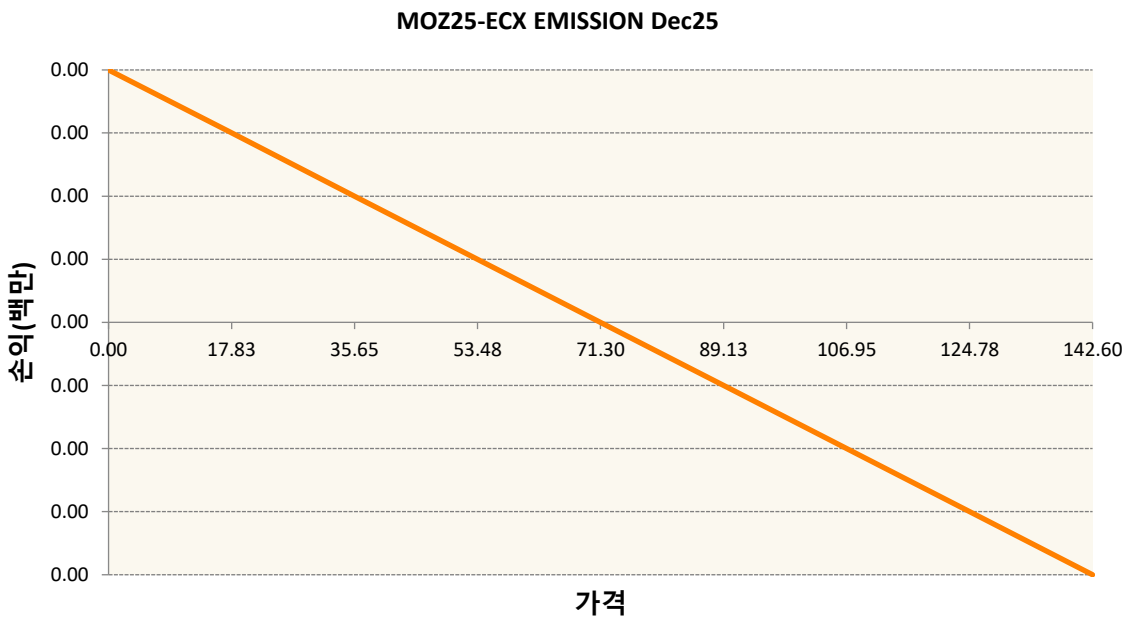
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,306	-5,343	
누계	통화	선도	0	1,167	-1,167	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	3
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	35
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	59
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	424

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

(단위:백만원)

789

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

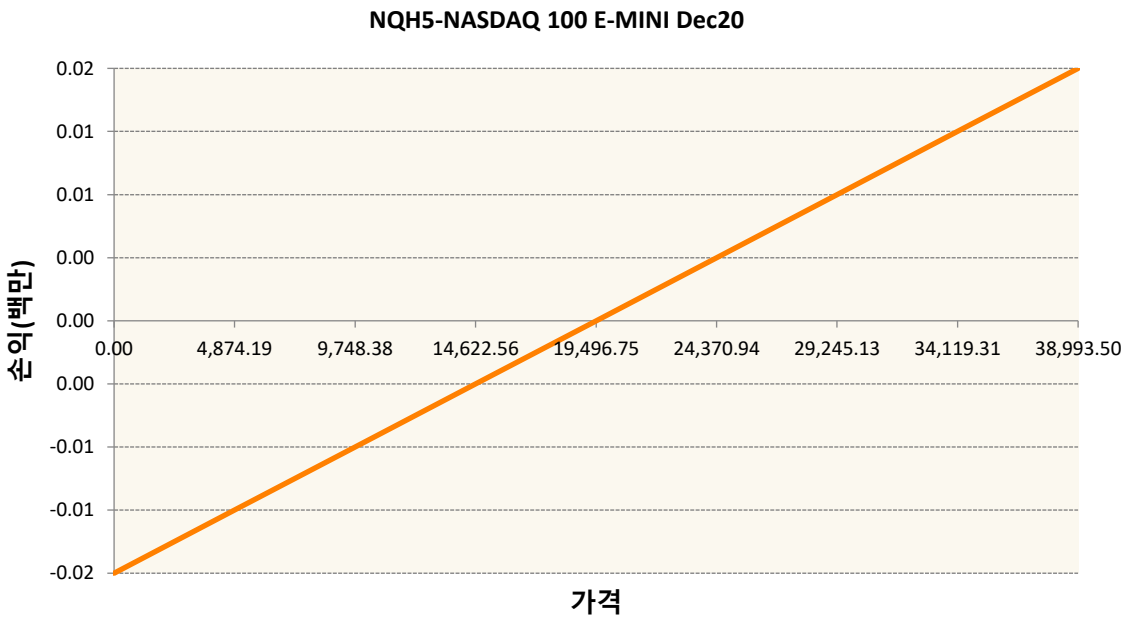
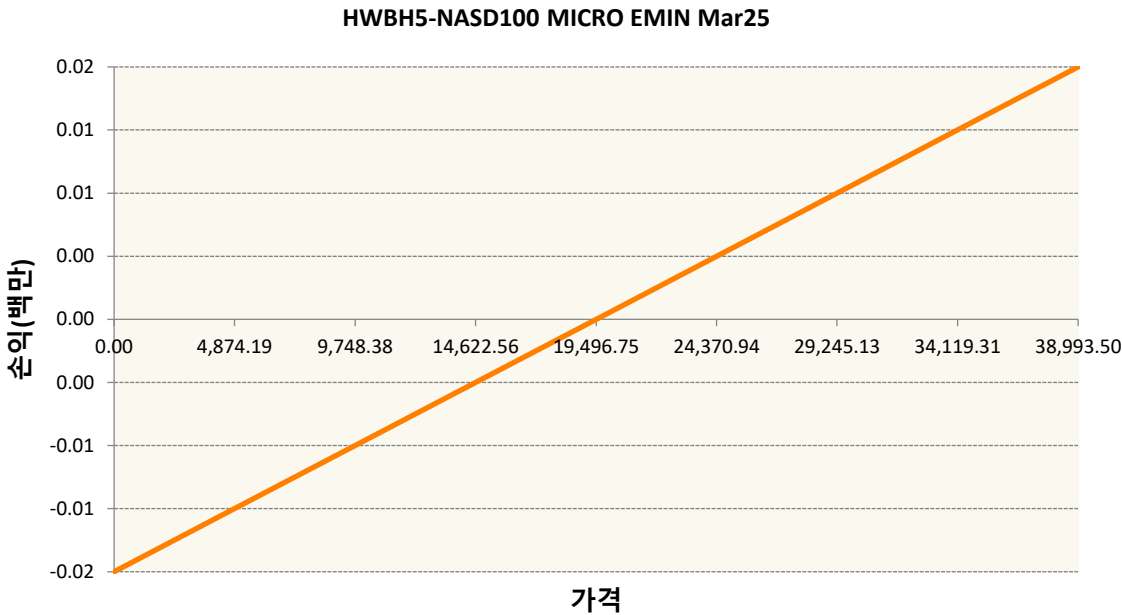
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,598	0	13,598	
누계	유가증권	선물	337	0	337	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH5	NASD100 MICRO EMIN	Mar25	27
NQH5	NASDAQ 100 E-MINI	Dec20	1,088

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,029

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

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	744
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,216
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,277
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,896

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

(단위:백만원)

8,646

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

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	20
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	20
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	20
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	20

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

(단위:백만원)

92

공시일	2025-03-20
기준일	2025-03-19

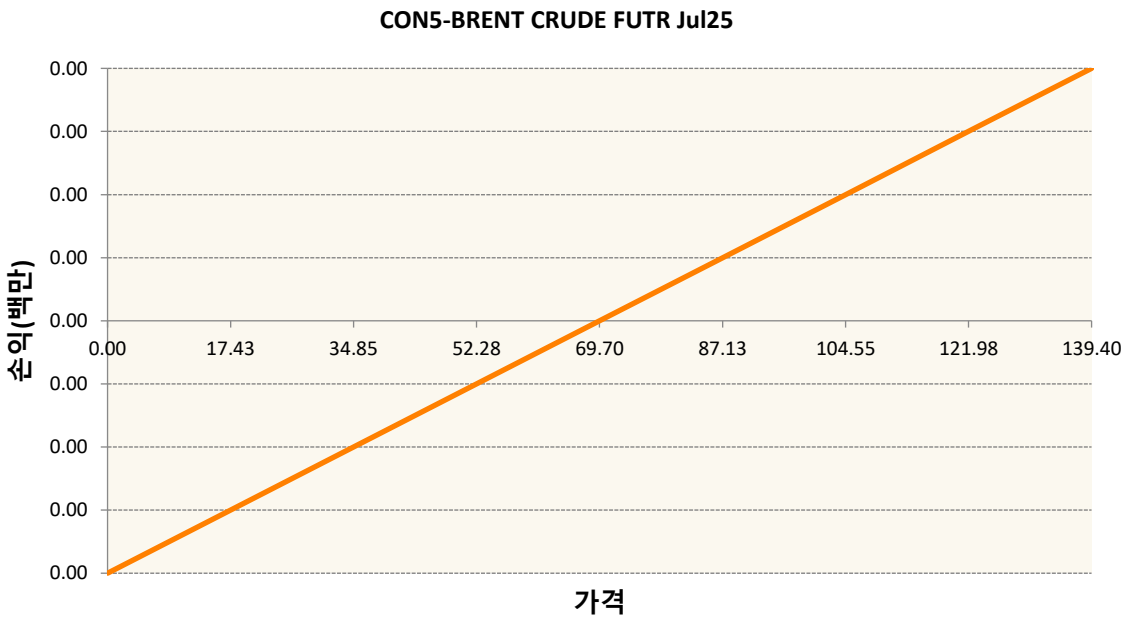
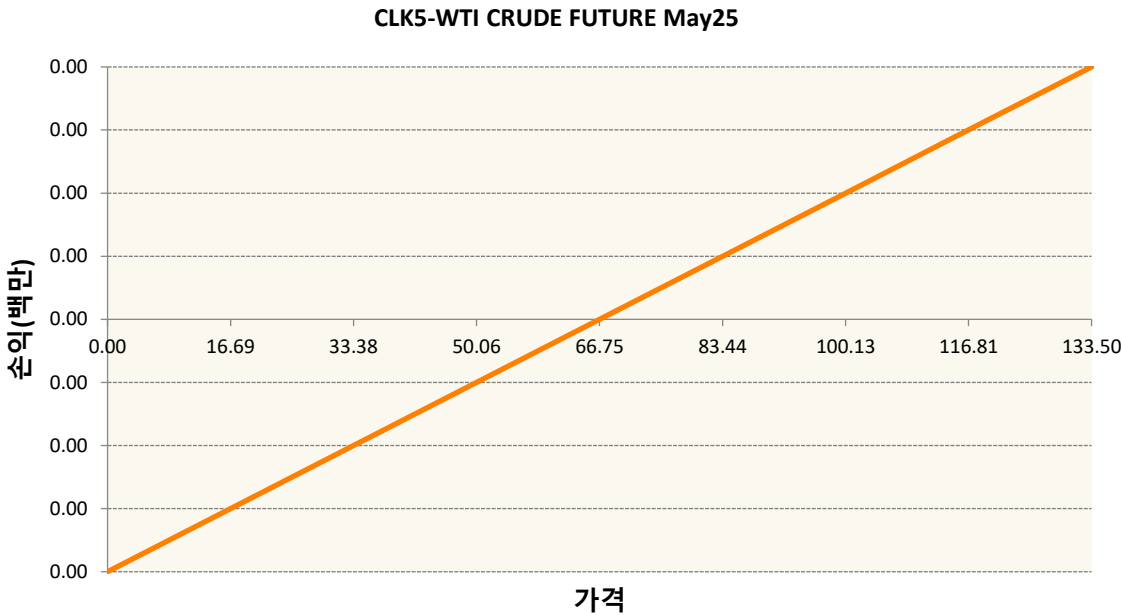
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

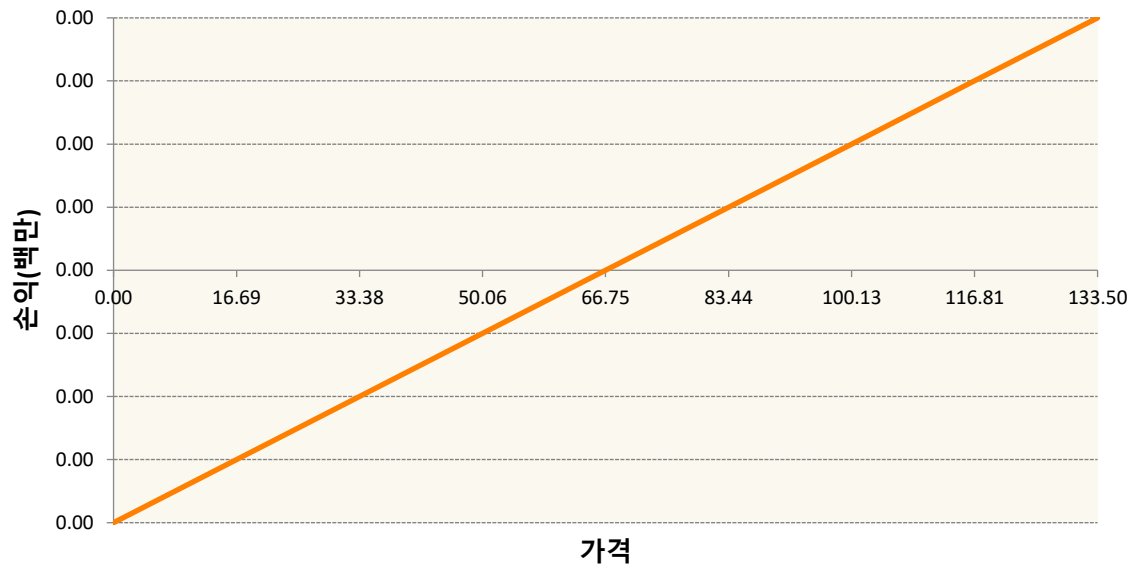
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	15	0	15	장내
누계	유가증권	선물	828	0	828	
누계	통화	선물	0	145	-145	장내

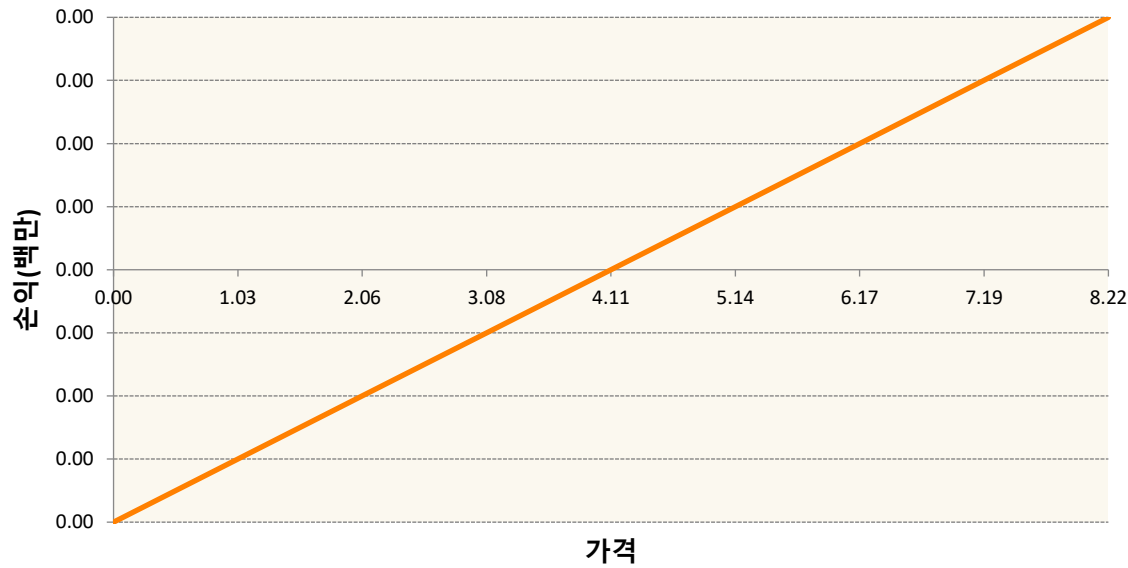
2. 만기시점의 손익구조



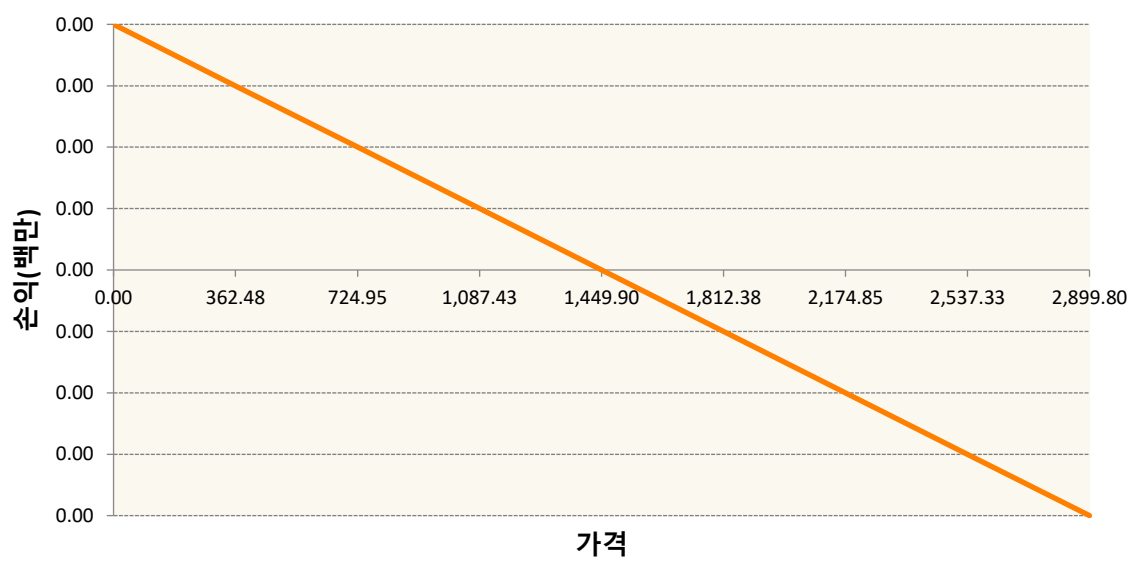
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



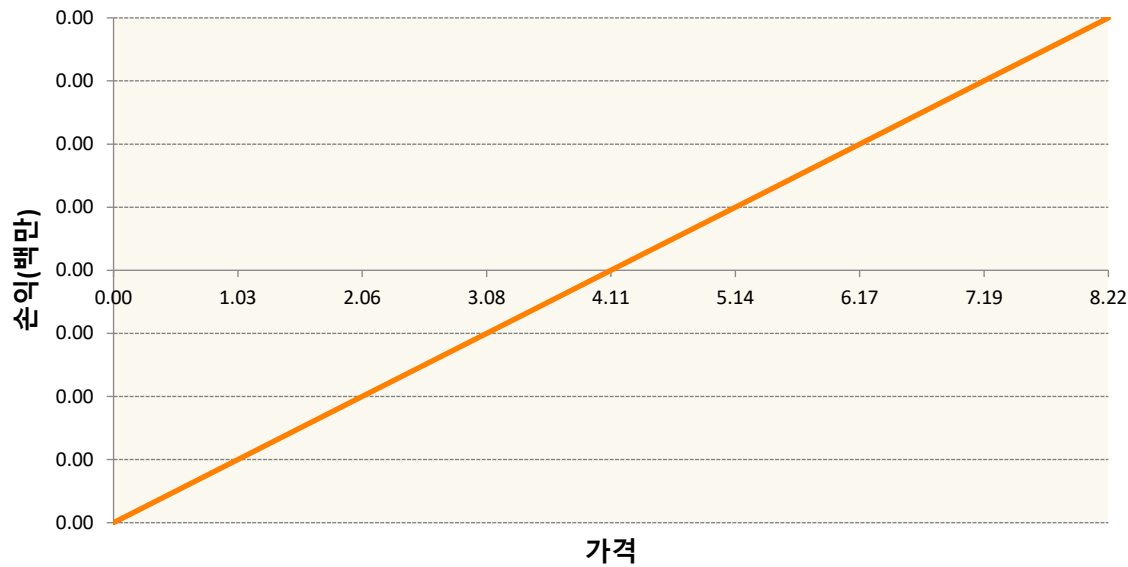
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



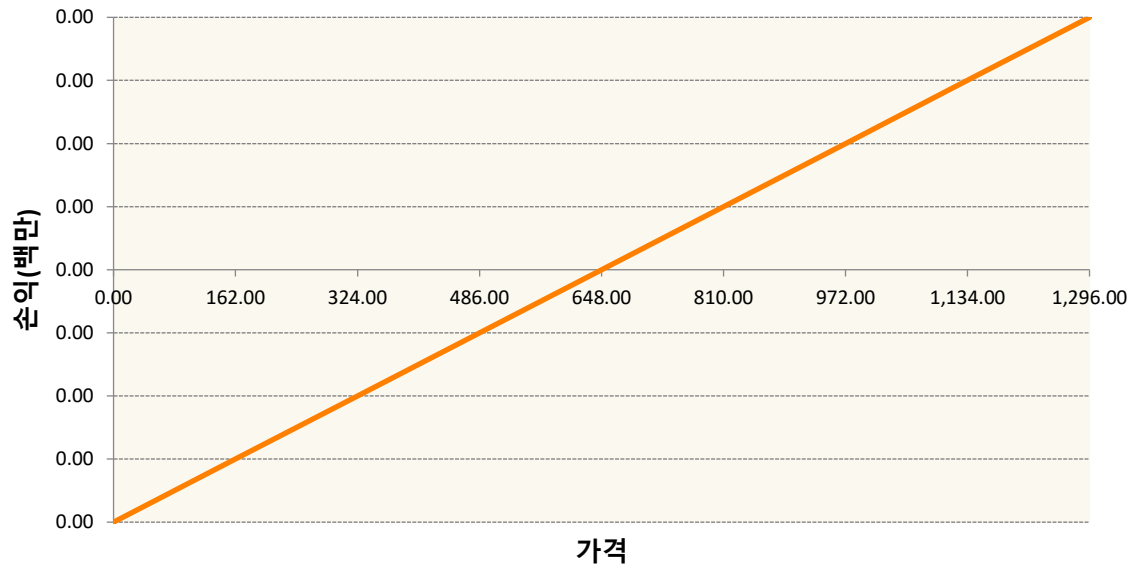
KR4175W40006-2025-04 달러선물



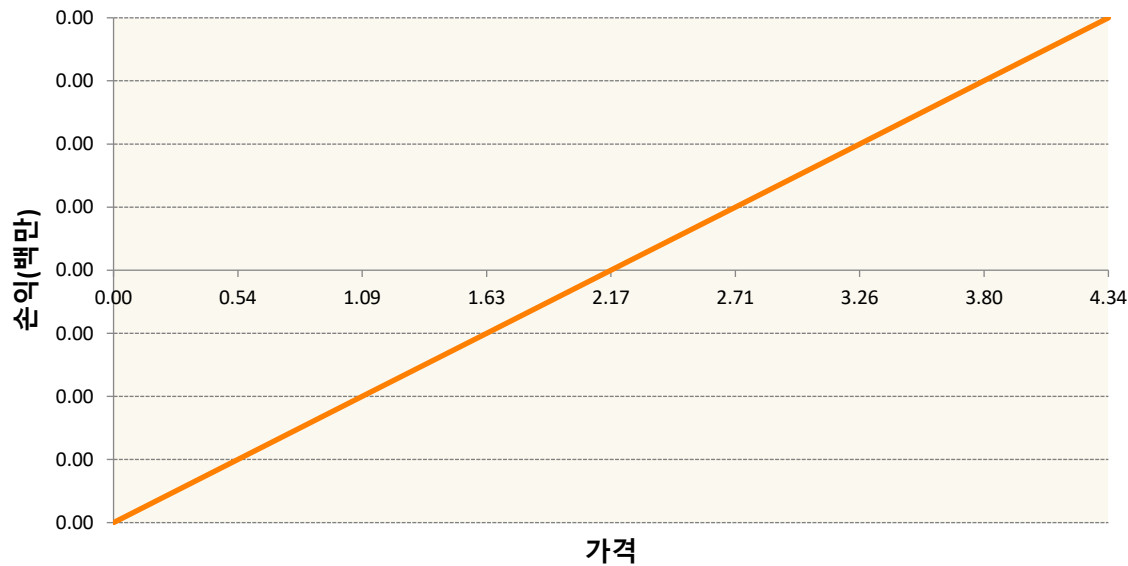
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	12
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)

144