

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

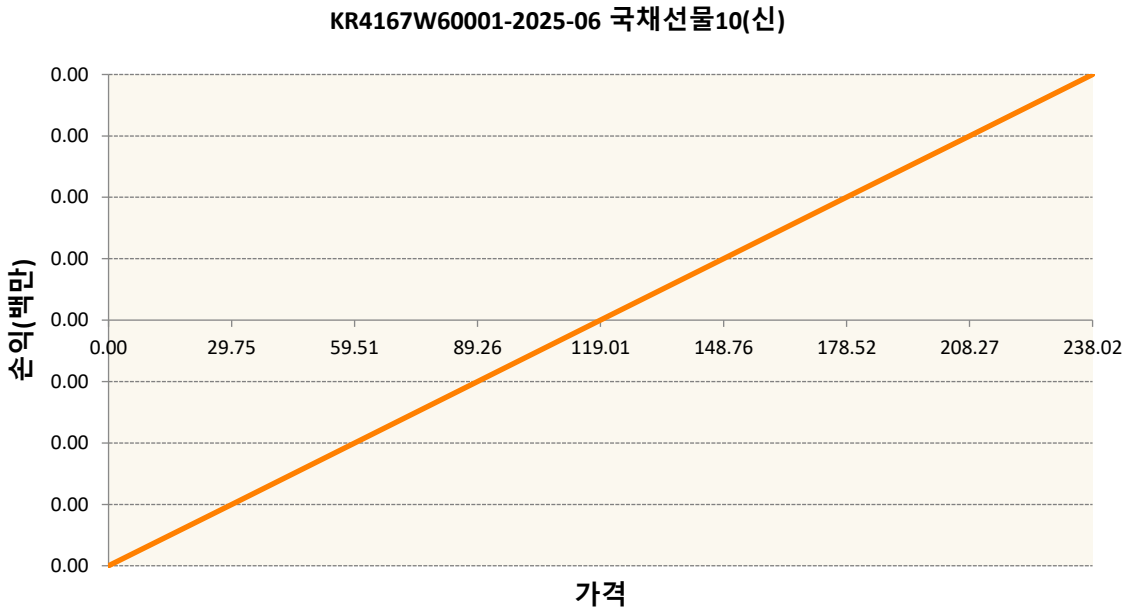
베스트장기채(채권-파생형)

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	238,020	0	238,020	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

5,943

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

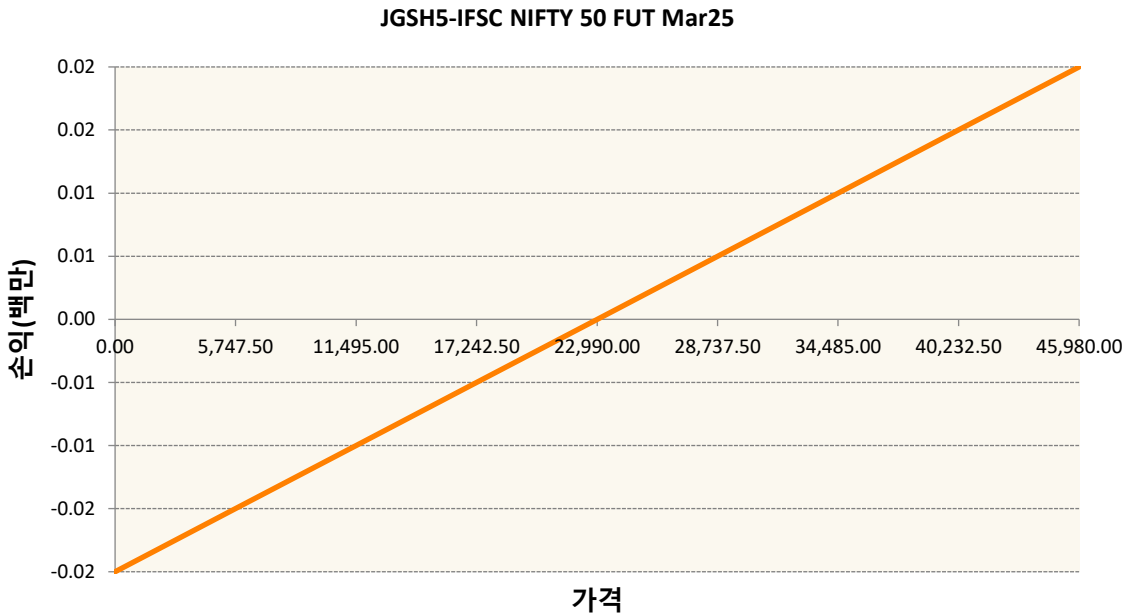
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	740	0	740	

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	2025-03-21
기준일	2025-03-20

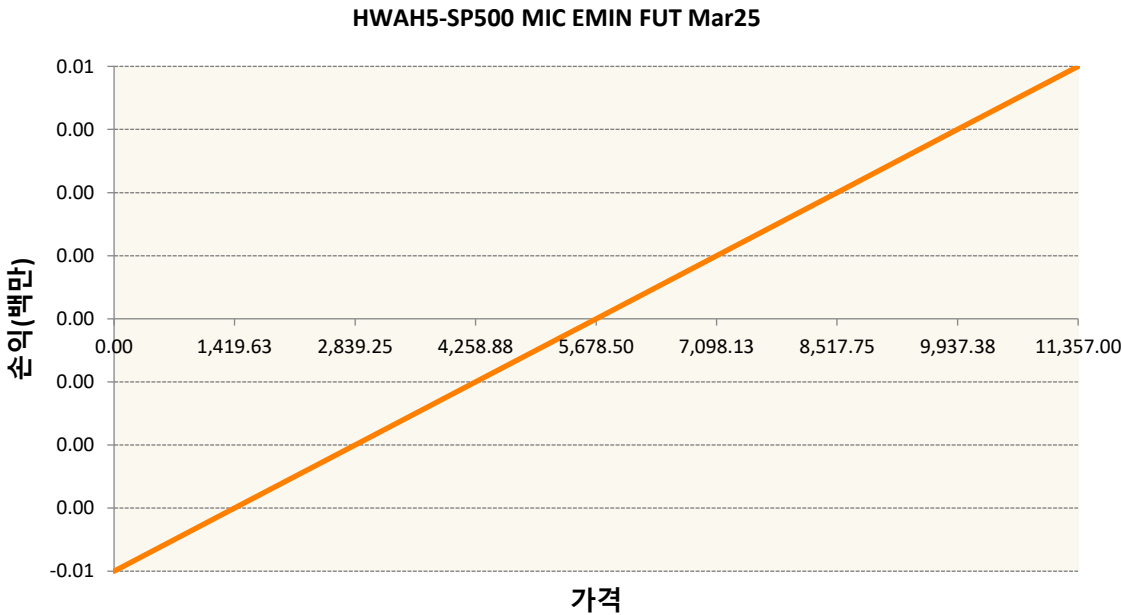
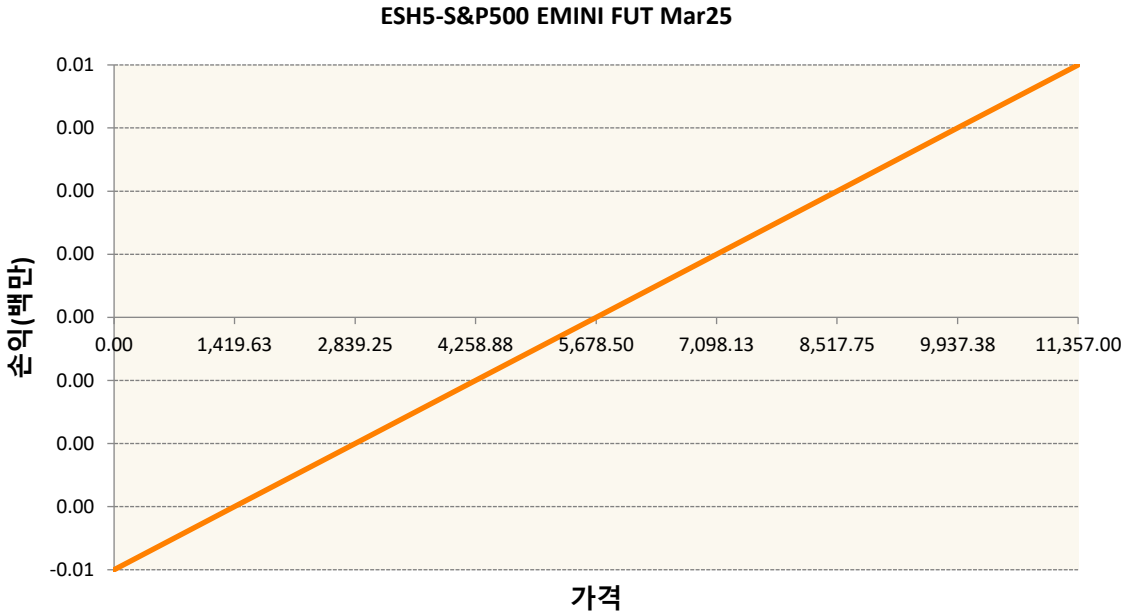
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2025-03-21
기준일	2025-03-20

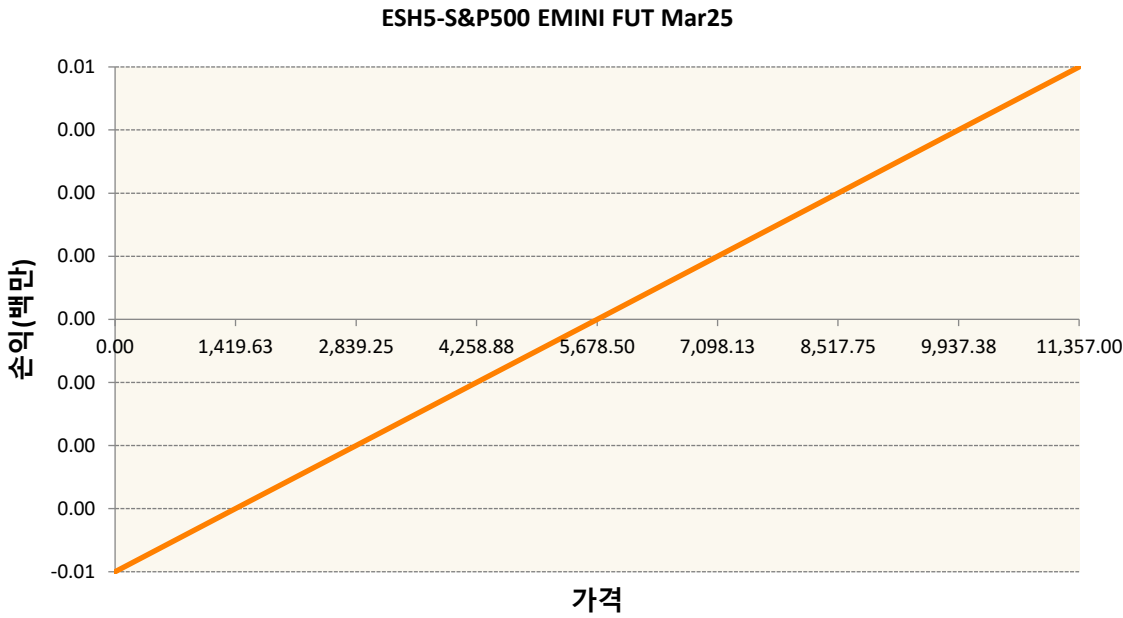
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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)

266

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

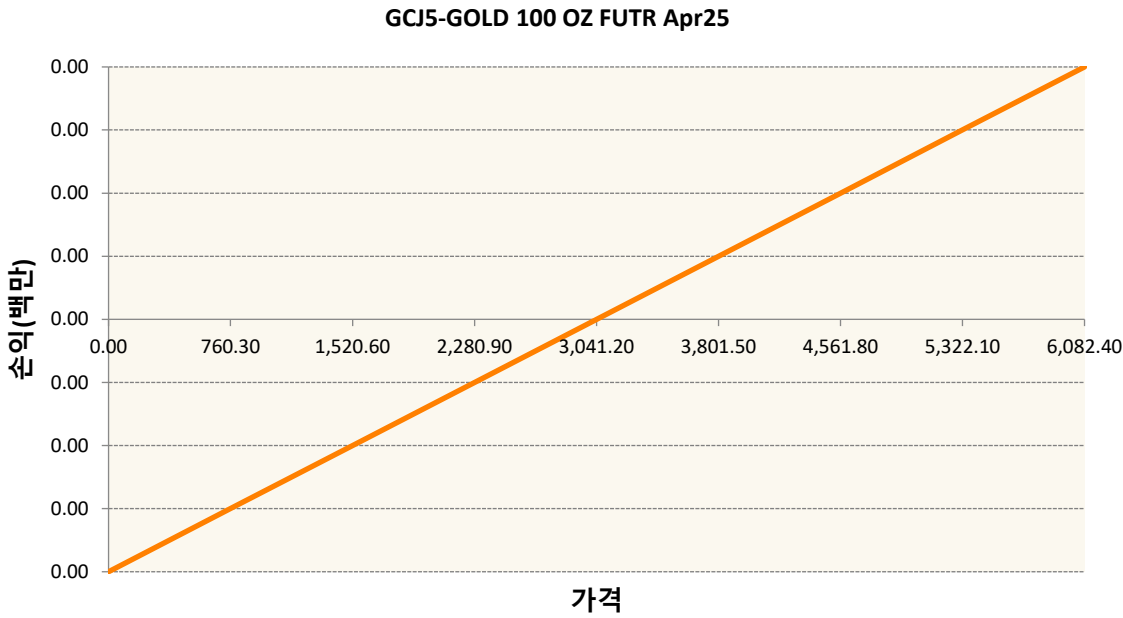
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	0.33
GCI5 GOLD 100 OZ FUTR Apr25	141

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

(단위:백만원)

103

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

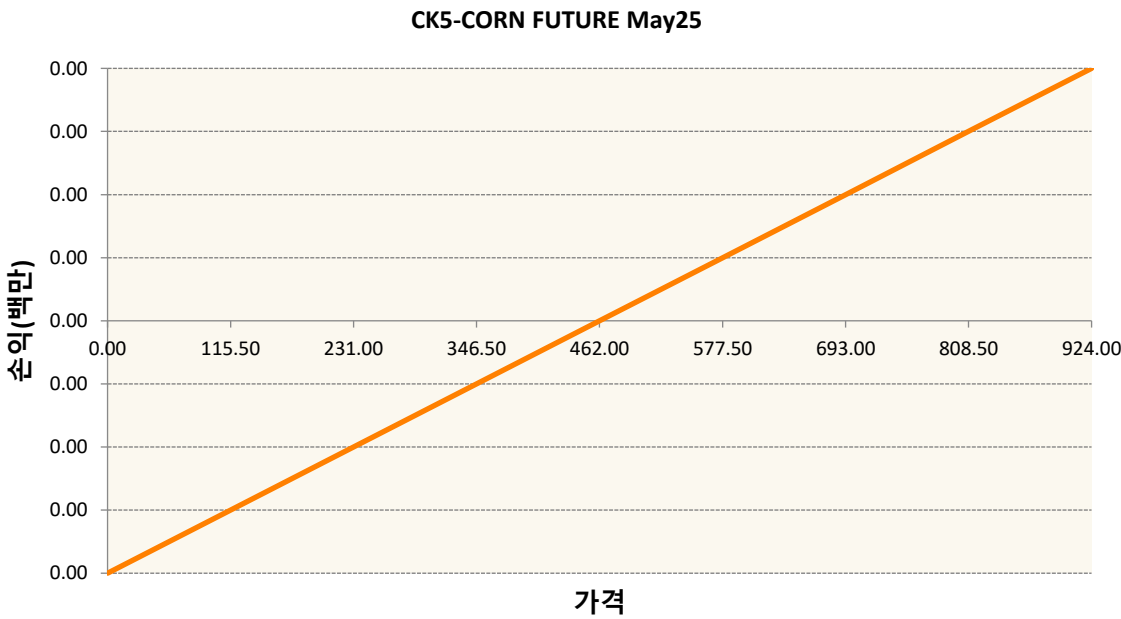
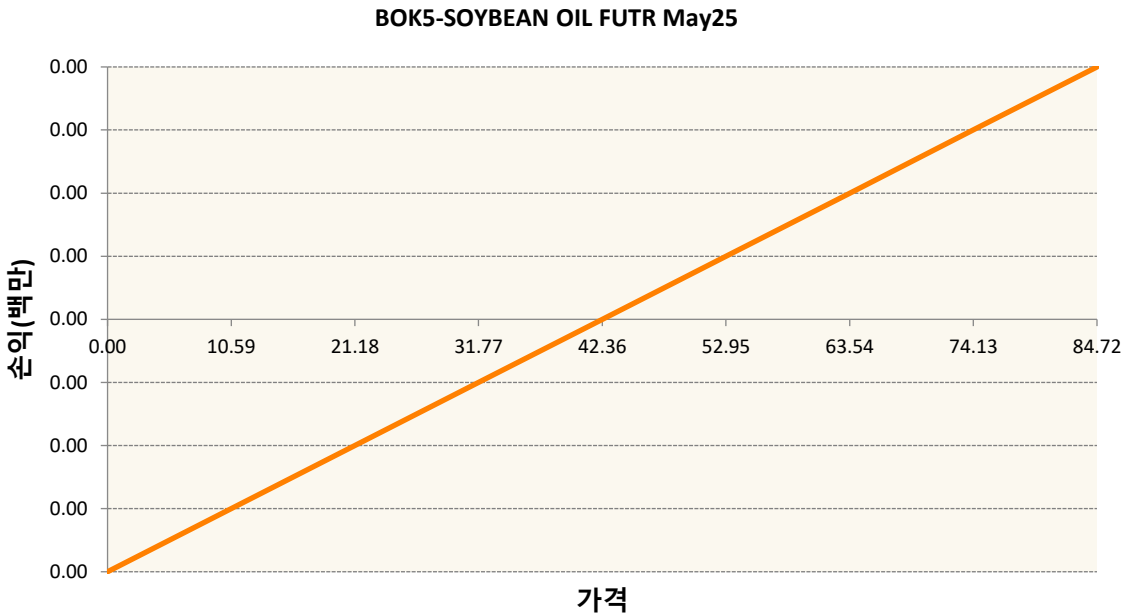
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

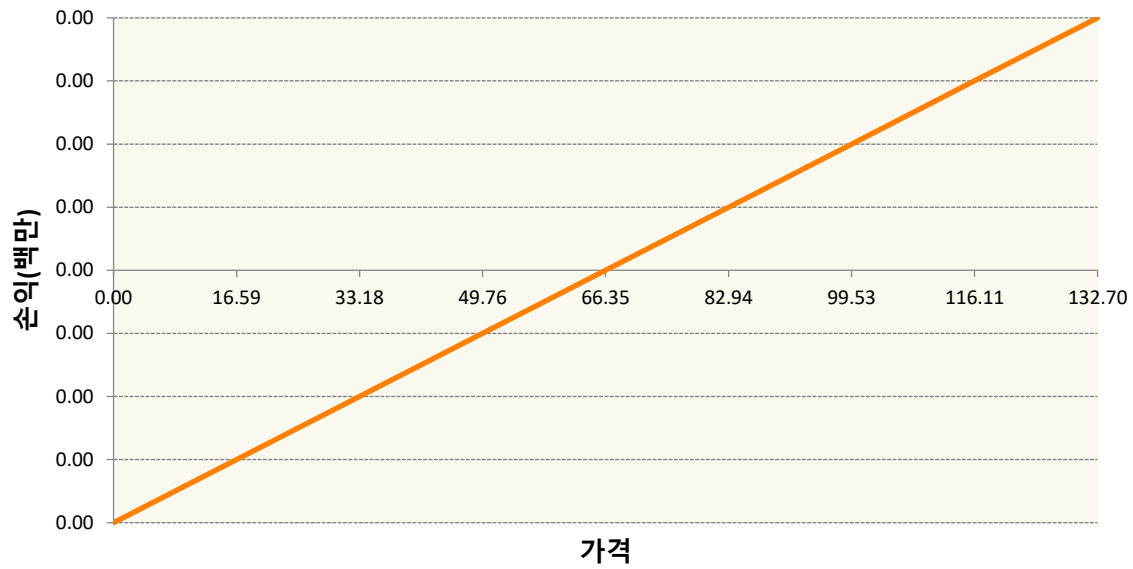
(단위:USD 백만)

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	3,794	0	3,794	
누계	통화	선물	0	379	-379	장내

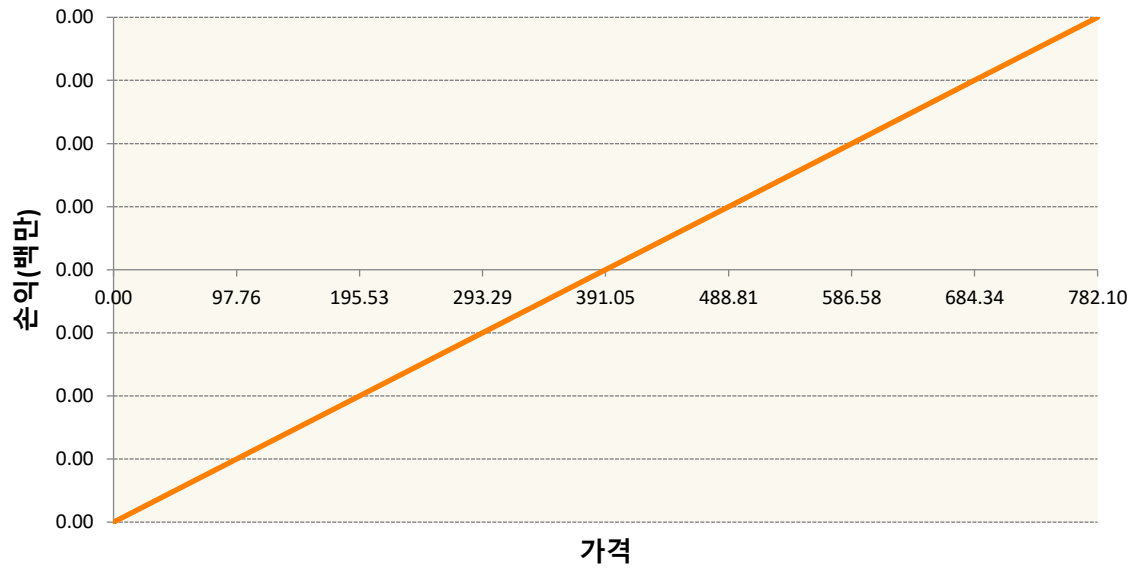
2. 만기시점의 손익구조



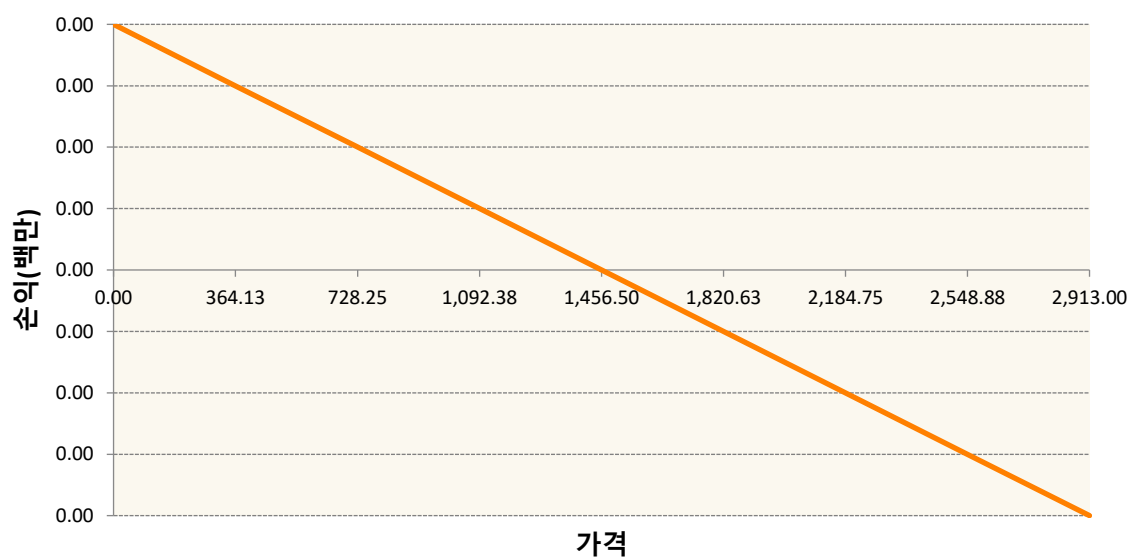
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



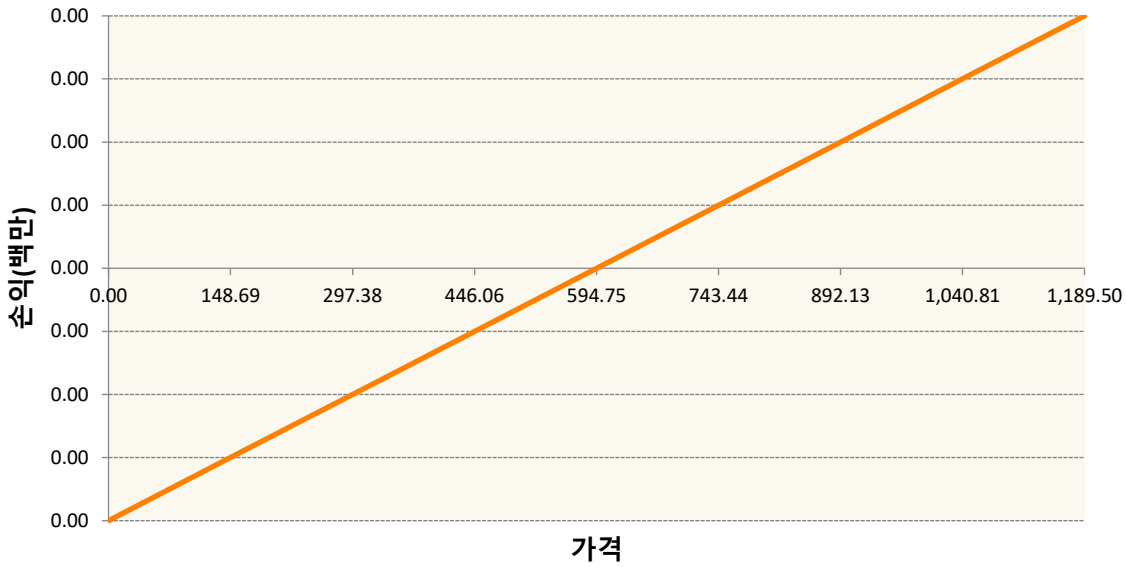
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



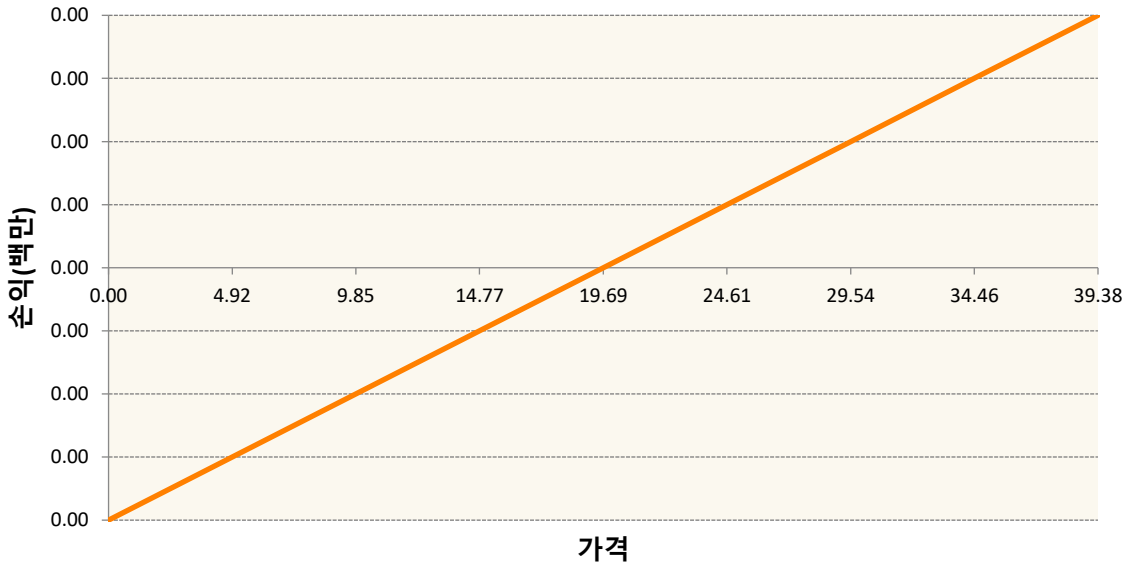
KR4175W40006-2025-04 달러선물



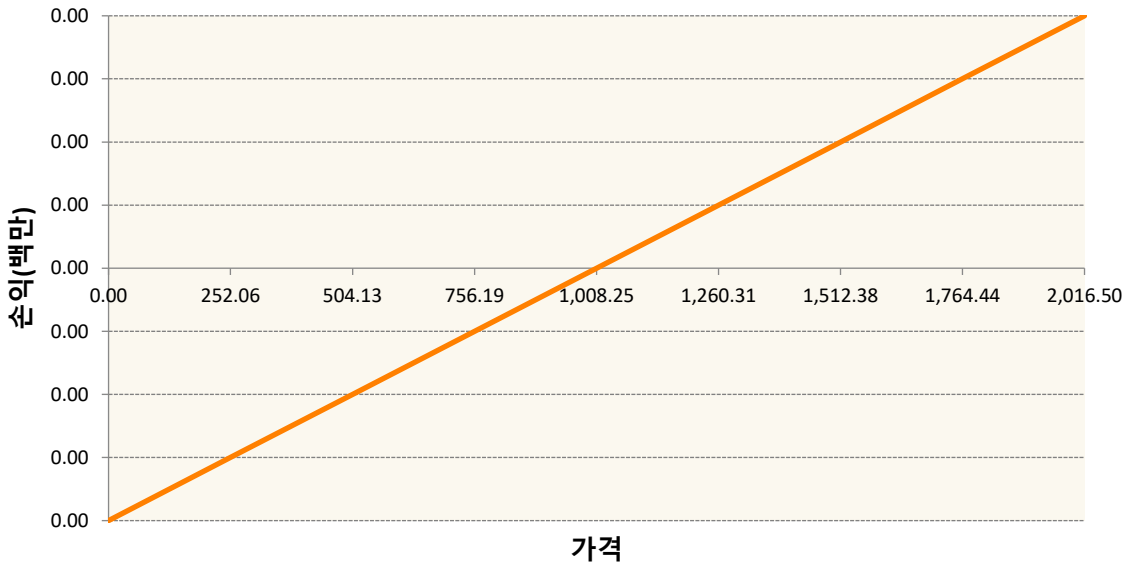
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



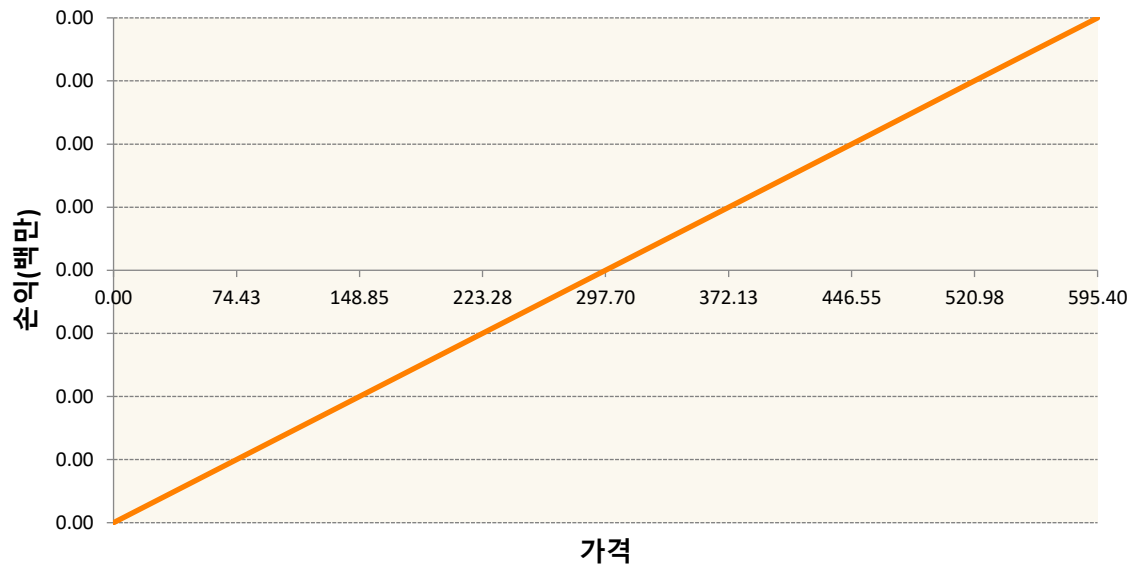
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



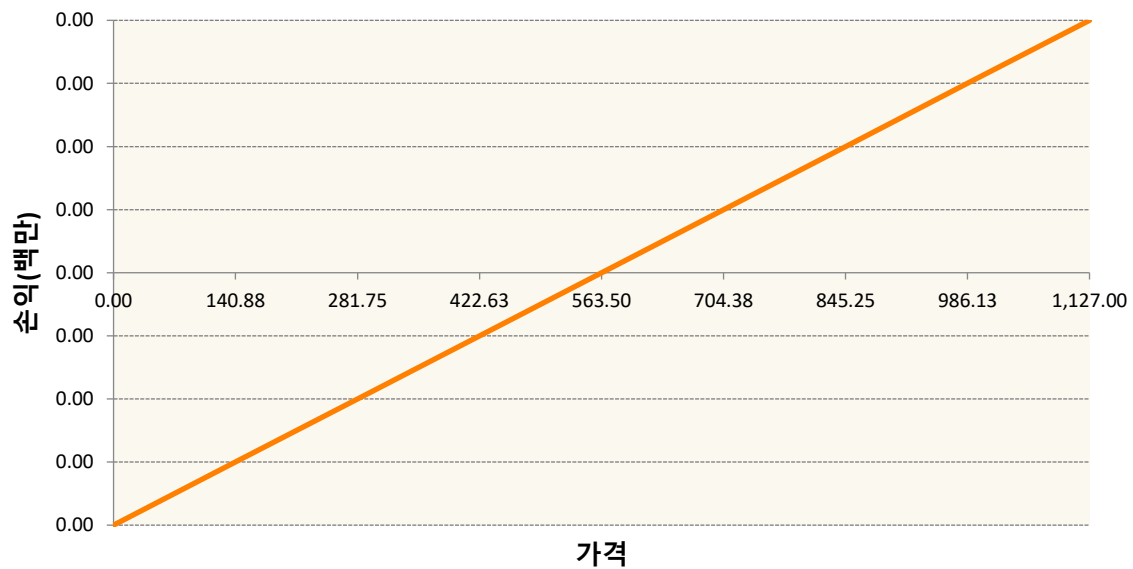
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-03-21
기준일	2025-03-20

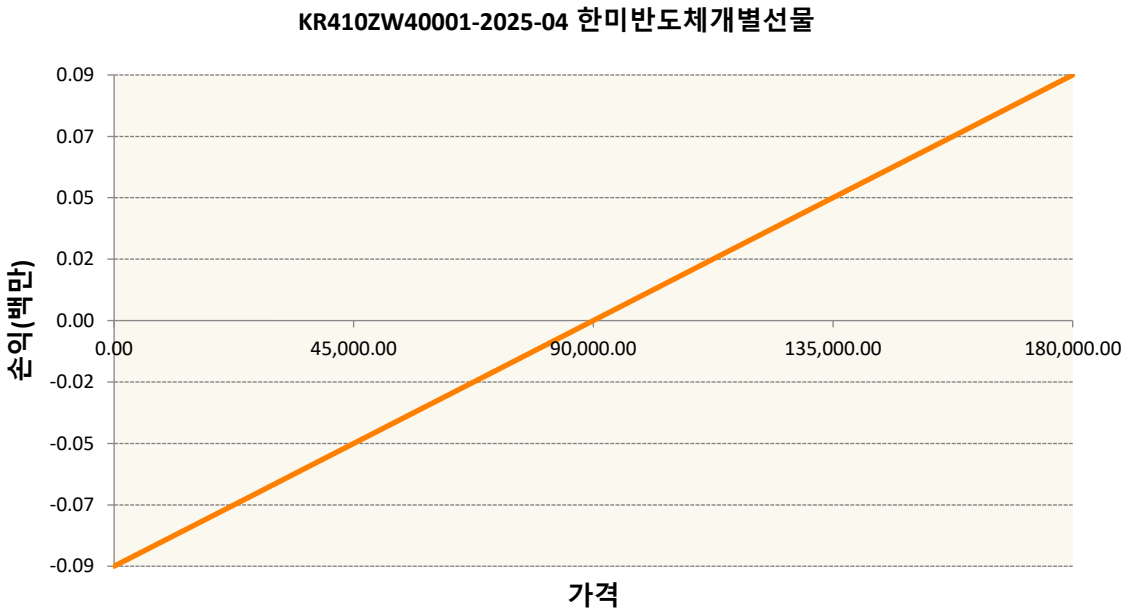
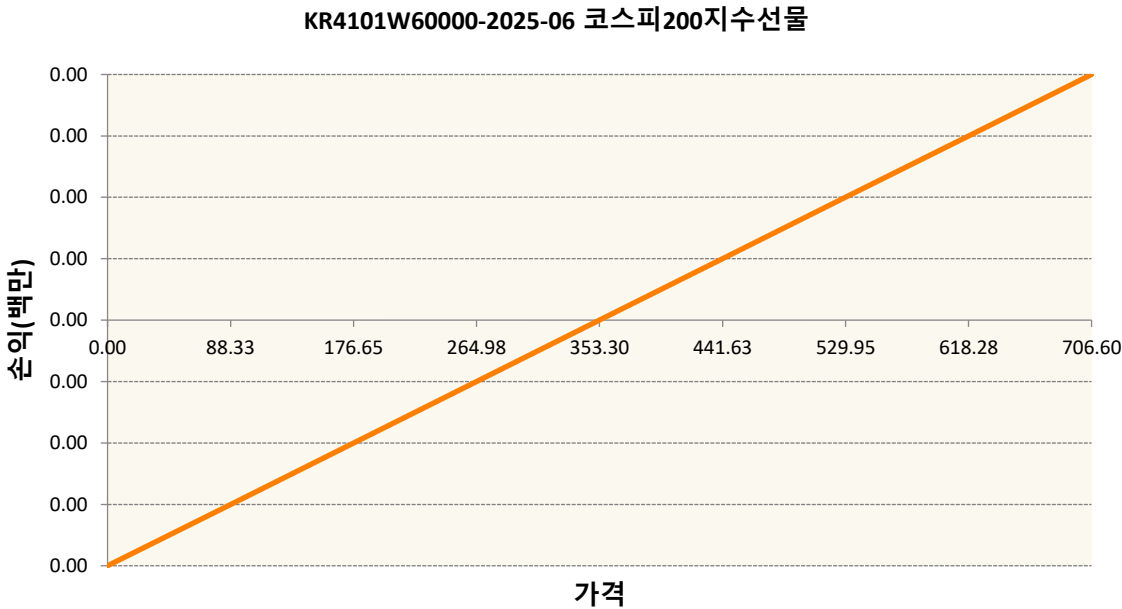
스마트인덱스모

1. 계약금액

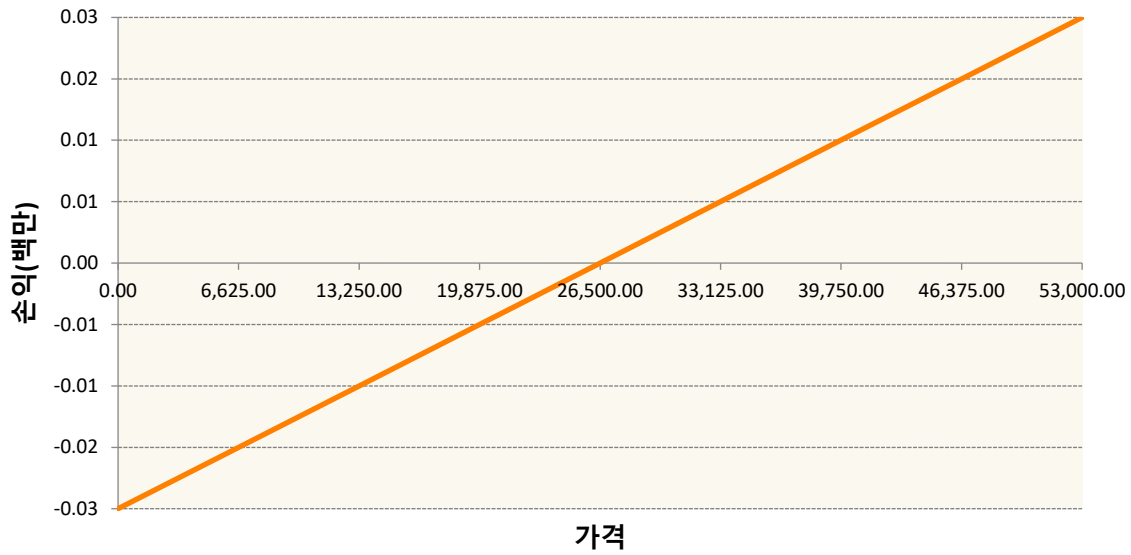
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	16	0	16	장내
누계	유가증권	선물	1,647	0	1,647	장내

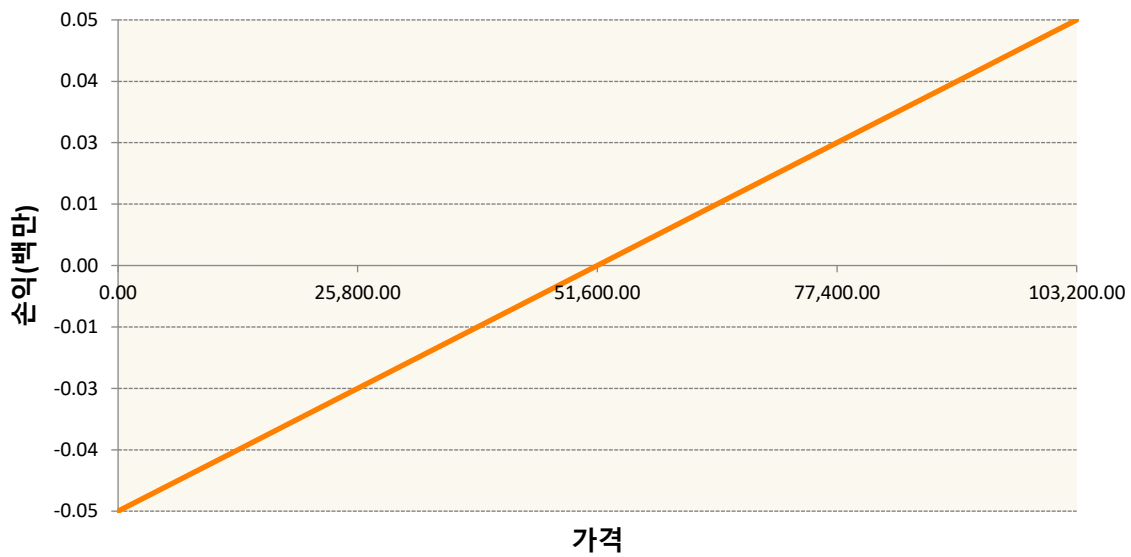
2. 만기시점의 손익구조



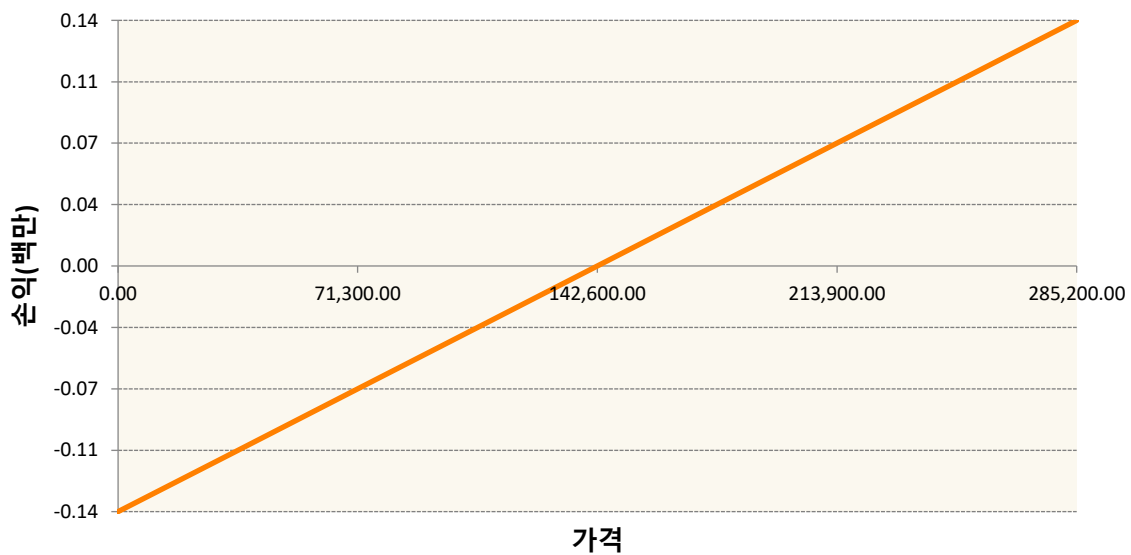
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



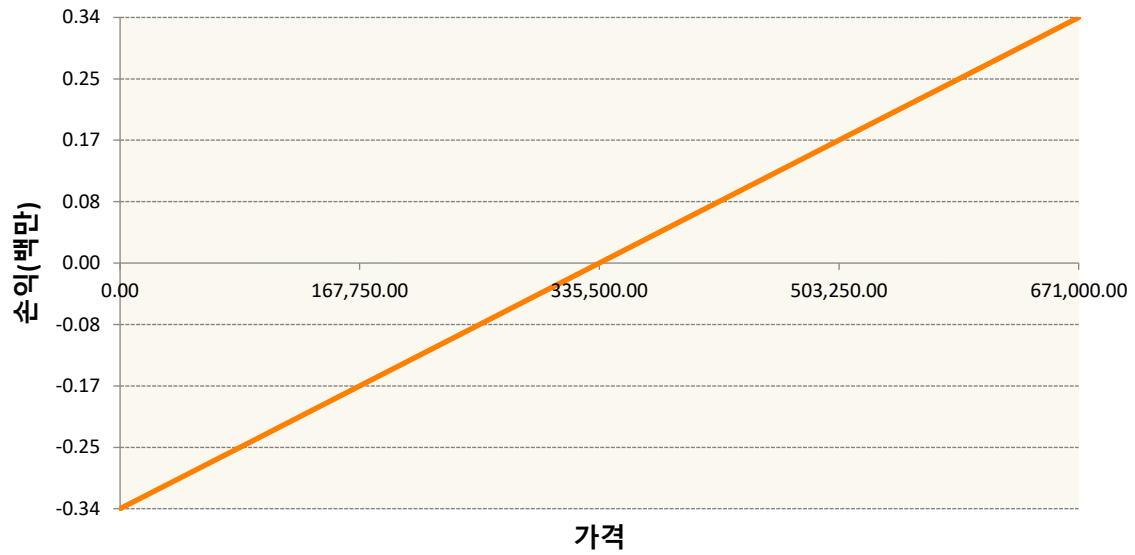
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



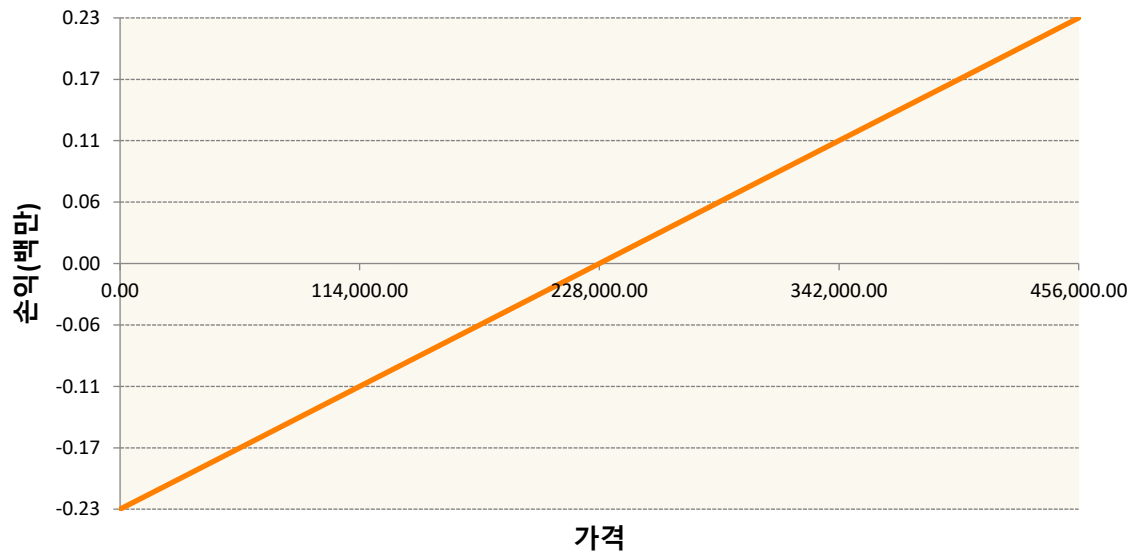
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



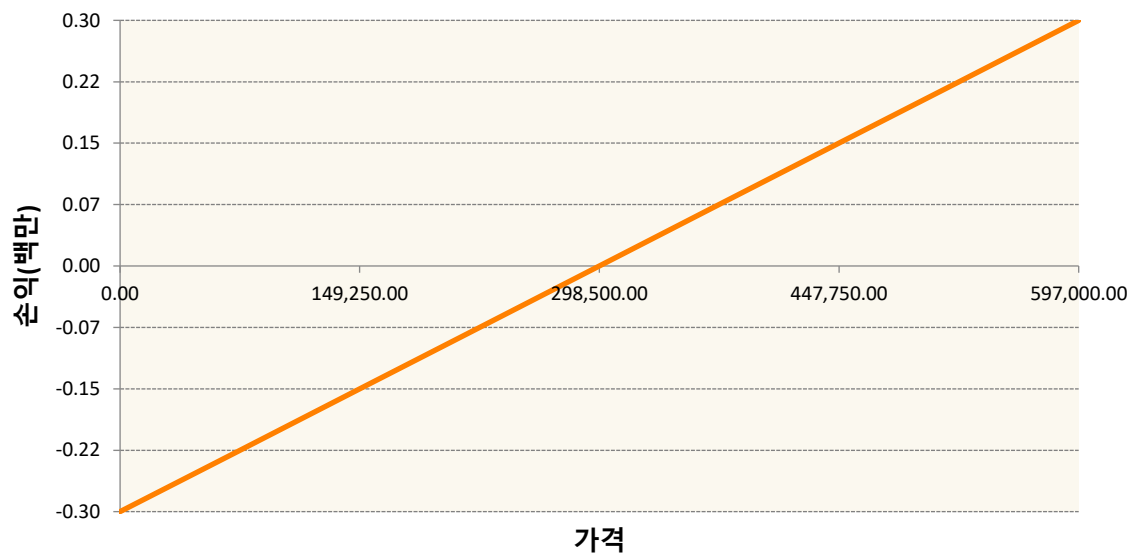
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		92
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물		5
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물		2
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물		1
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)
	215

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	3,904	0	3,904	장외
누계	지수	스왑	3,904	0	3,904	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래250320

311

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

479

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

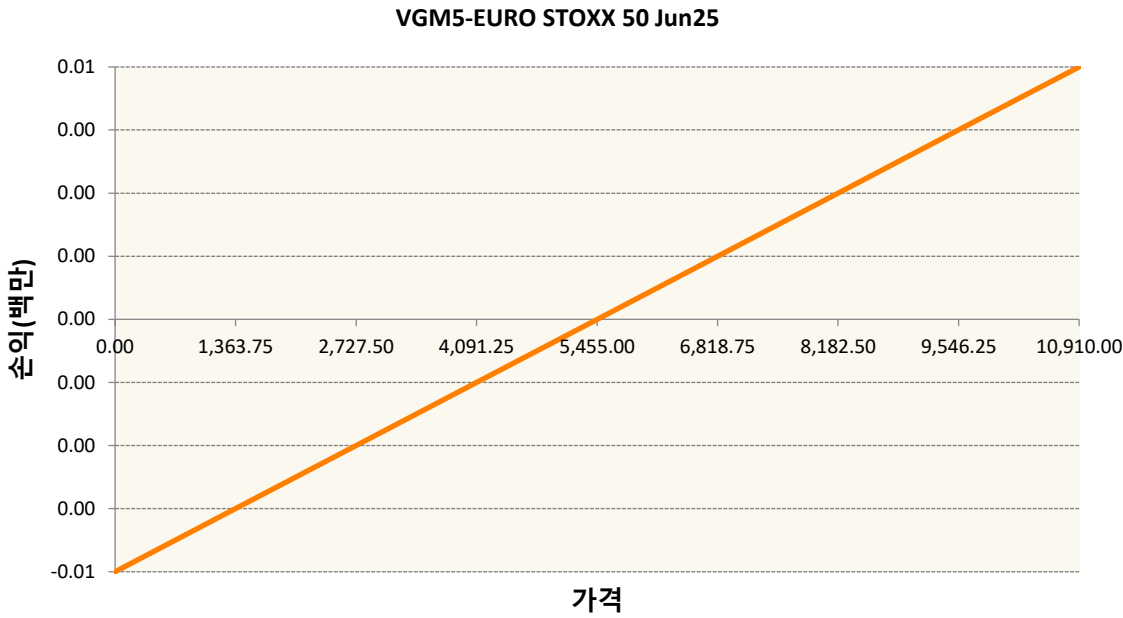
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	954	0	954	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

52

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

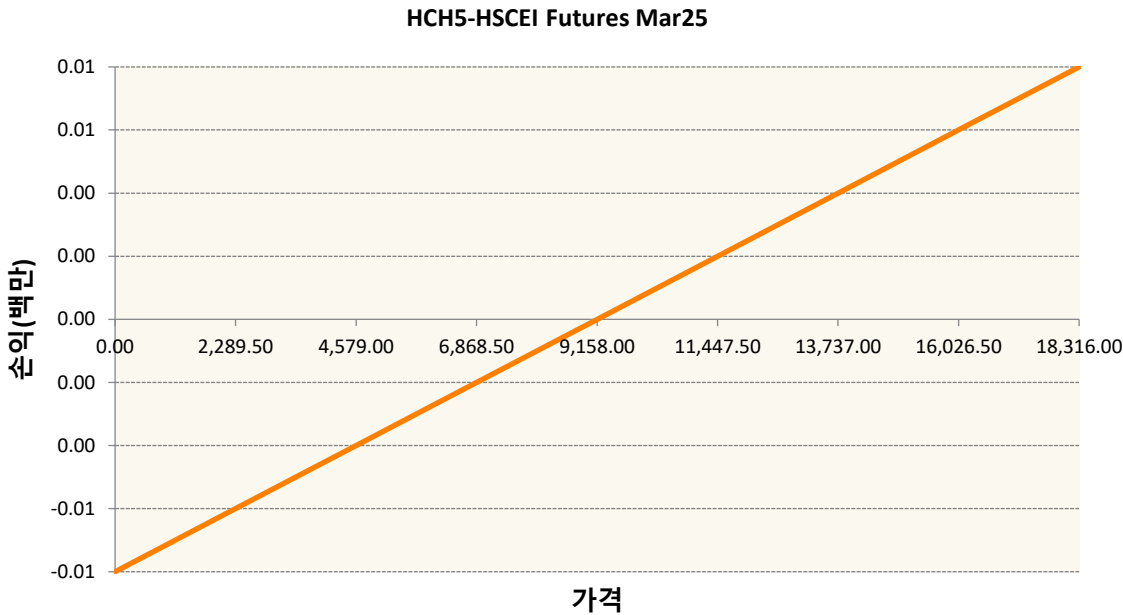
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	3,060	0	3,060	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH5	HSCEI Futures Mar25	245
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

336

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

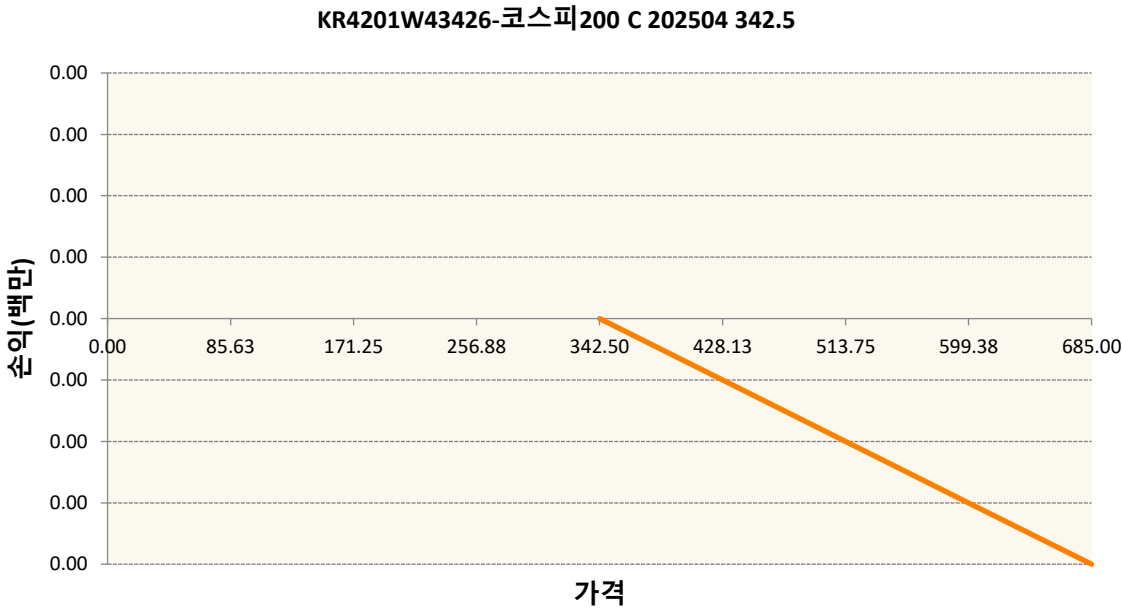
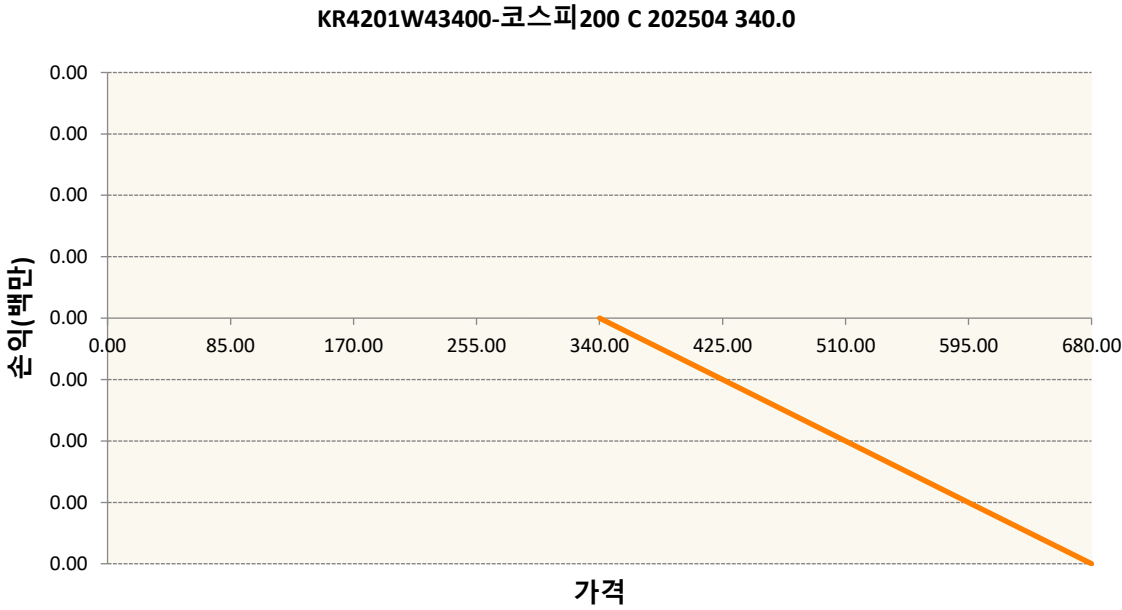
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	245	0	245	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,130	-37,130	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph displays a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 680.00 with major ticks every 85.00. The y-axis represents Net Income, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A single orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (340, 0), indicating that net income is zero at a price of 340.00.

The graph illustrates the relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 685.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -10.00 to 10.00. An orange line represents the profit function, starting at the origin (0,0) and ending at (342.50, 0). This indicates that the profit is zero at a price of 342.50.

가격 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
0.00	0.00
342.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201W43400 코스피200 C 202504 340.0							996
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	582	568	553	537	520	502	483
-5.33%	494	472	450	427	404	382	359
-2.67%	317	294	271	248	224	201	178
0%	52	36	18	0	-19	-39	-59
2.67%	-271	-279	-289	-300	-313	-327	-342
5.33%	-621	-624	-628	-633	-640	-649	-659
8.00%	-979	-980	-981	-983	-986	-991	-996
KR4201W43426 코스피200 C 202504 342.5							1,288
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	691	676	659	640	619	598	575
-5.33%	599	572	544	516	487	458	429
-2.67%	398	367	336	304	273	241	210
0%	77	52	27	0	-27	-56	-84
2.67%	-333	-347	-362	-380	-399	-420	-442
5.33%	-788	-793	-801	-810	-821	-834	-849
8.00%	-1,259	-1,260	-1,263	-1,267	-1,272	-1,280	-1,288

KR4301W43408

코스피200 P 202504 340.0

131

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-114	-116	-119	-121	-125	-128	-131
-5.33%	-51	-55	-59	-64	-68	-72	-77
-2.67%	-10	-14	-19	-23	-28	-32	-37
0%	9	6	3	0	-3	-7	-11
2.67%	15	14	13	11	9	7	4
5.33%	16	16	16	15	14	13	12
8.00%	17	17	17	16	16	15	15

KR4301W43424

코스피200 P 202504 342.5

193

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-173	-176	-178	-182	-185	-189	-193
-5.33%	-82	-88	-93	-98	-104	-110	-115
-2.67%	-19	-25	-31	-37	-44	-50	-56
0%	14	10	5	0	-5	-11	-16
2.67%	26	24	22	19	15	12	8
5.33%	29	28	27	26	25	23	20
8.00%	29	29	29	29	28	27	26

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

(단위:백만원)

2,698

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

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	685	0	685	

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	2025-03-21
기준일	2025-03-20

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	73	-73	
누계	유가증권	수익증권	4,452	0	4,452	

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	2025-03-21
기준일	2025-03-20

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	13,082	0	13,082	
누계	통화	선도	365	12,984	-12,619	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213ECT(KRW/USD 31-03-25E		260
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E		212
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E		216
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E		350
FXW213F3C(USD/KRW 31-03-25E		29
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	464

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

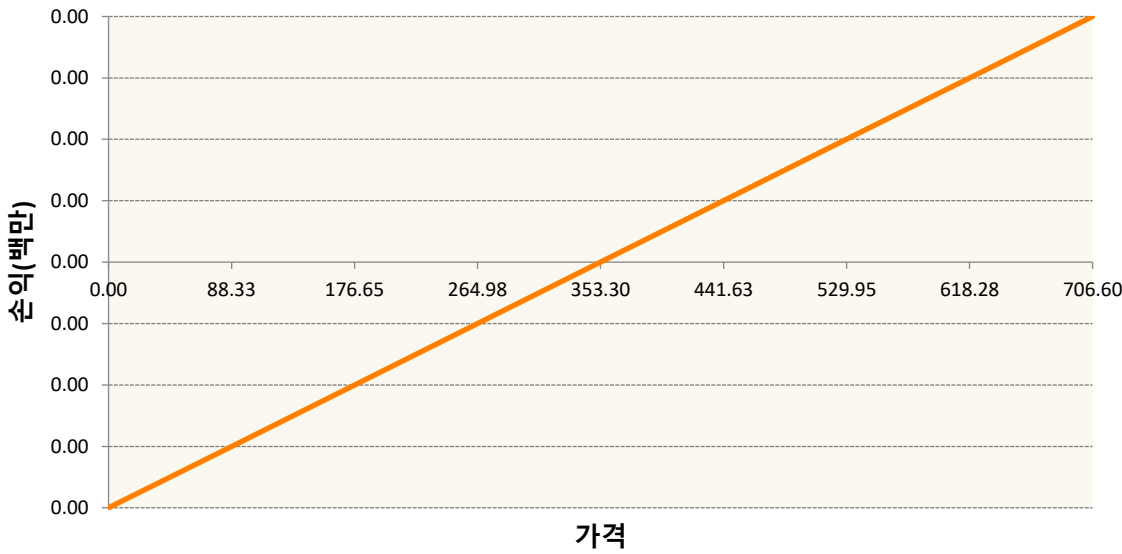
1. 계약금액

(단위:백만원)

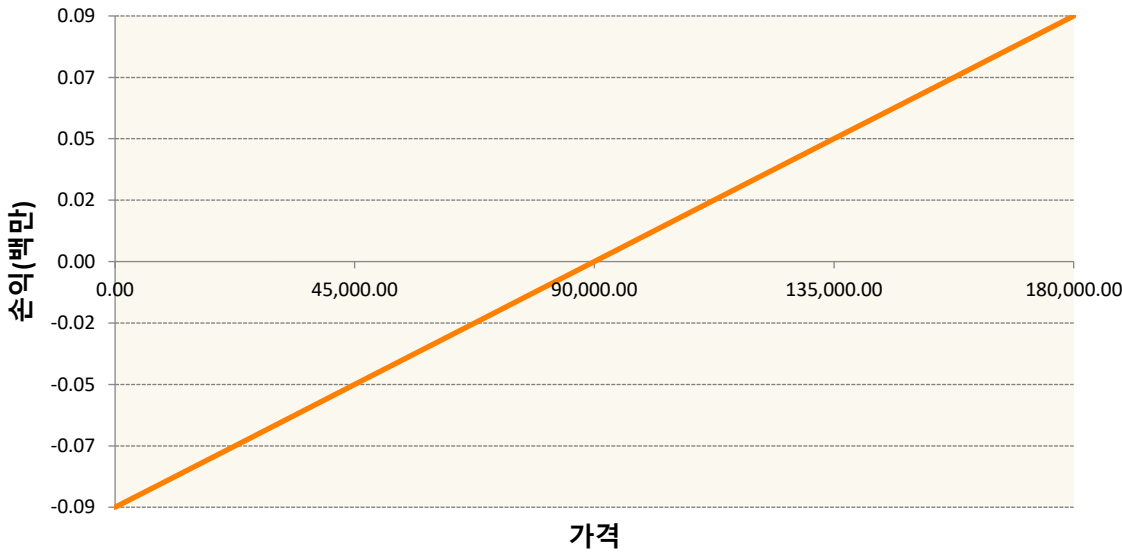
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7	0	7	장내
누계	유가증권	선물	861	0	861	장내

2. 만기시점의 손익구조

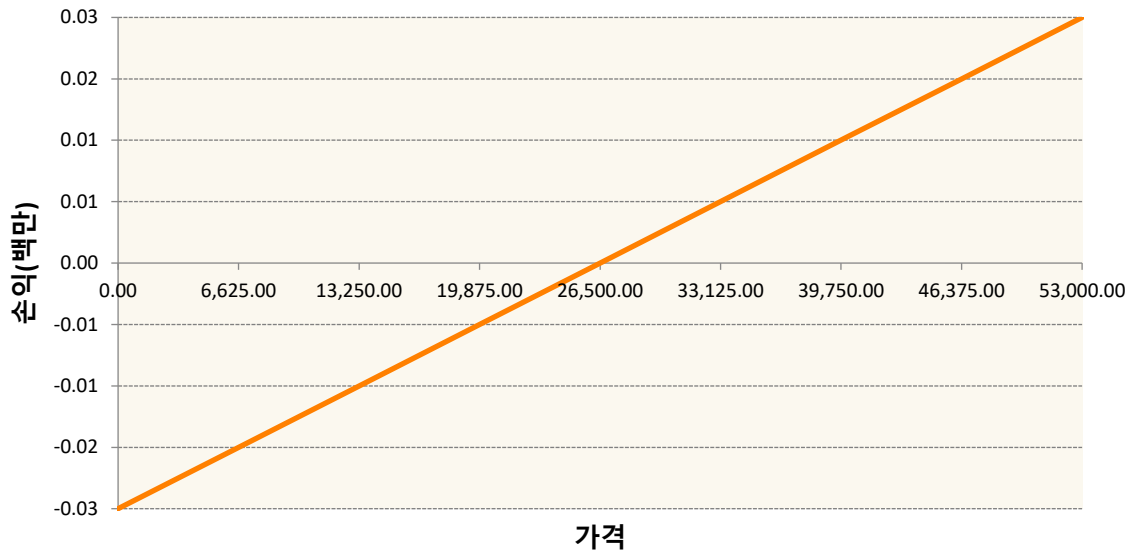
KR4101W60000-2025-06 코스피200지수선물



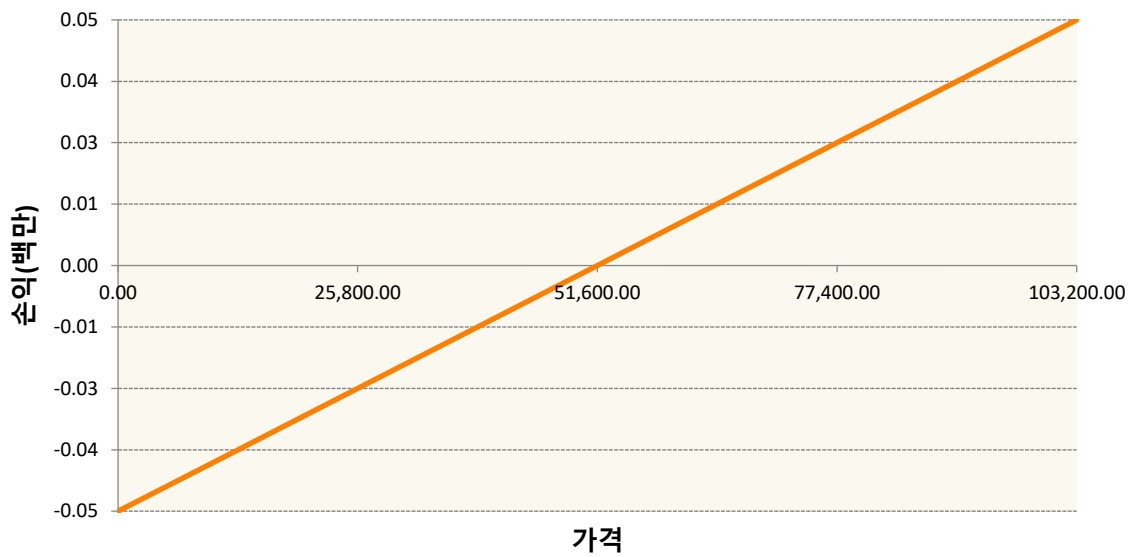
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



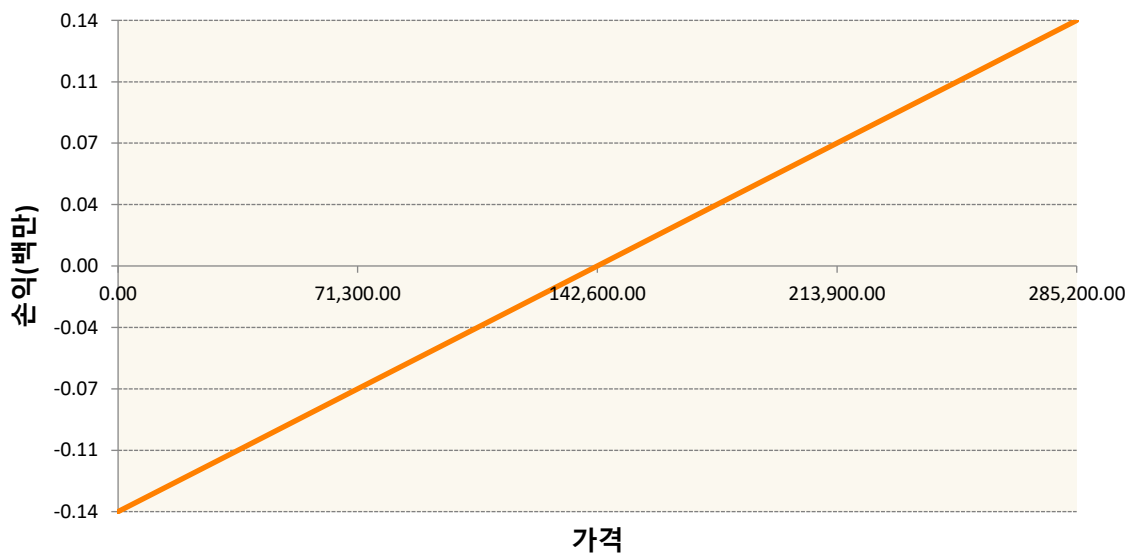
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



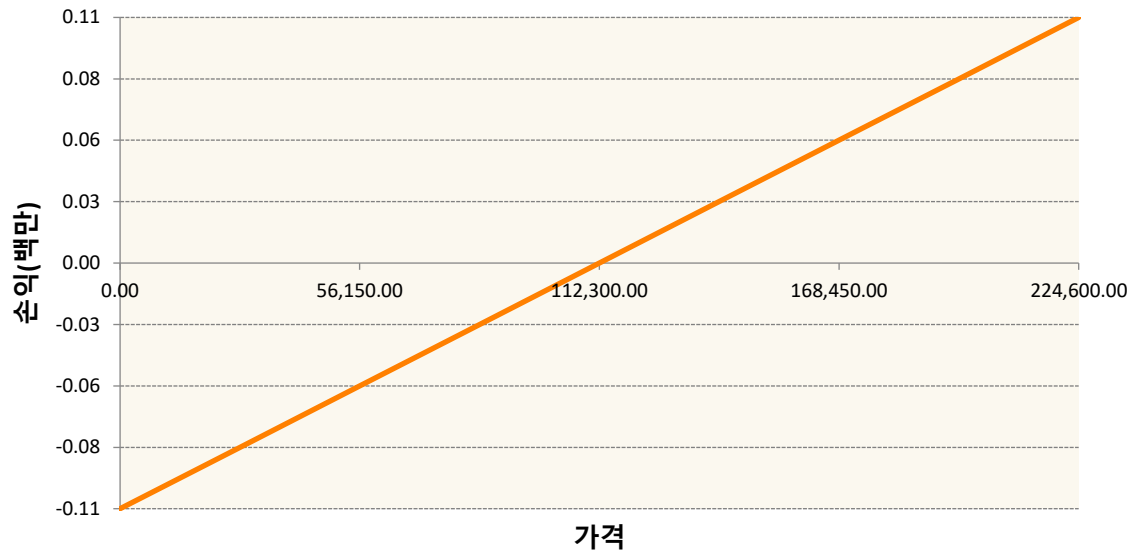
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



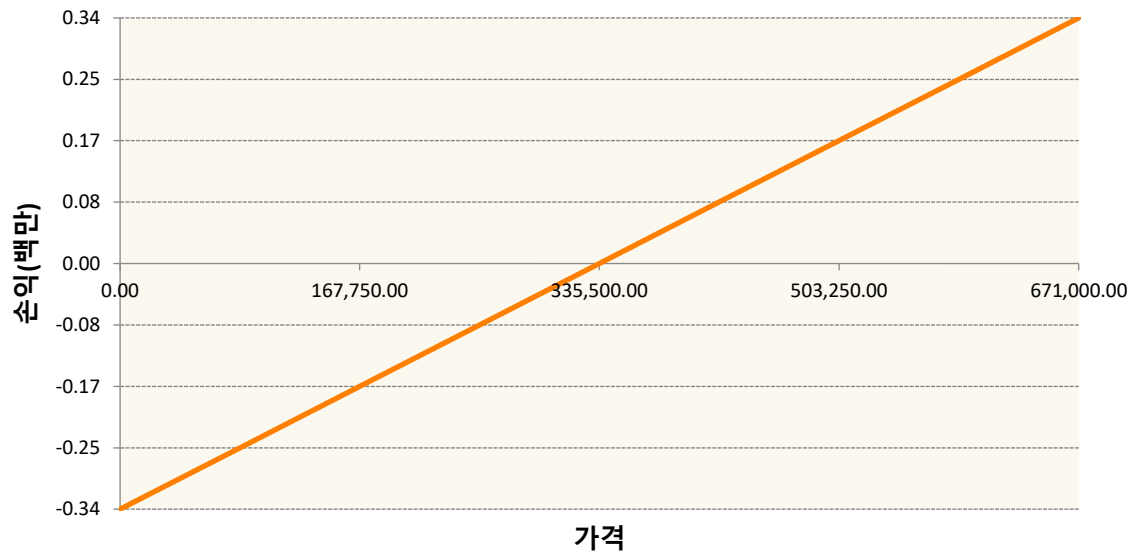
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



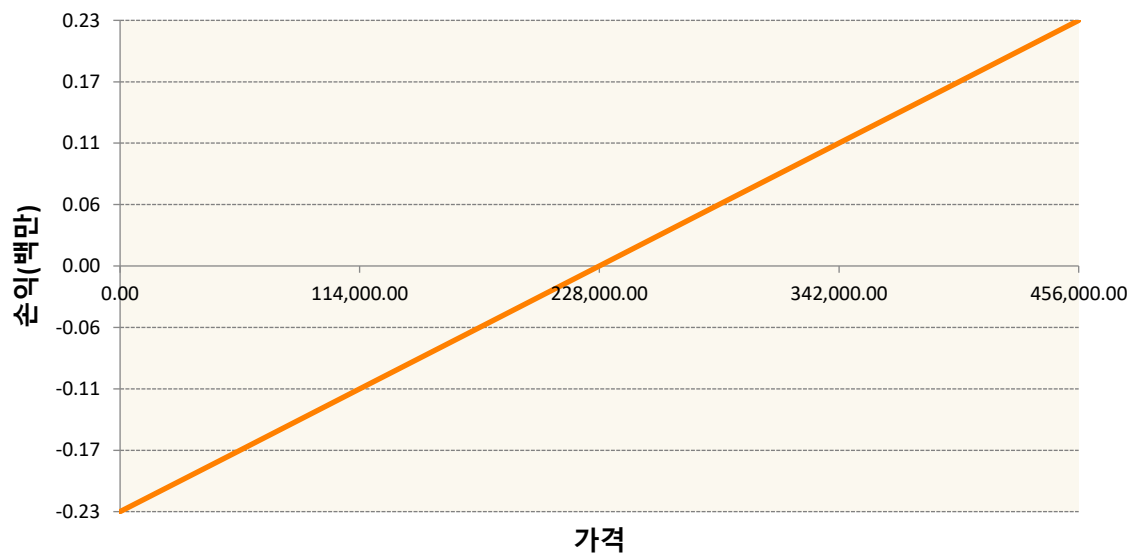
KR41EYW40004-2025-04 에코프로비엠개별선물



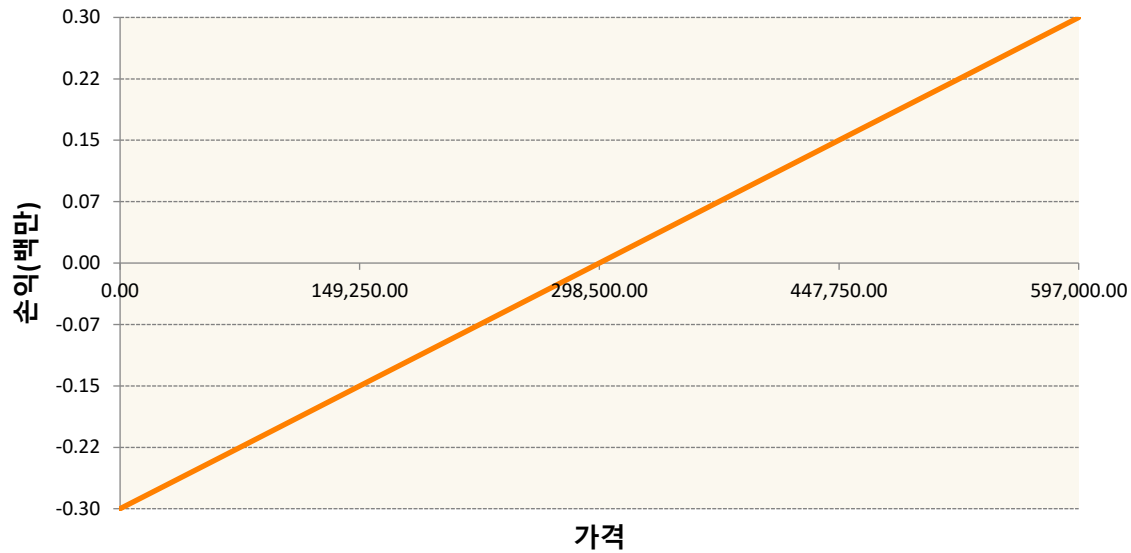
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



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
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	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)

113

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

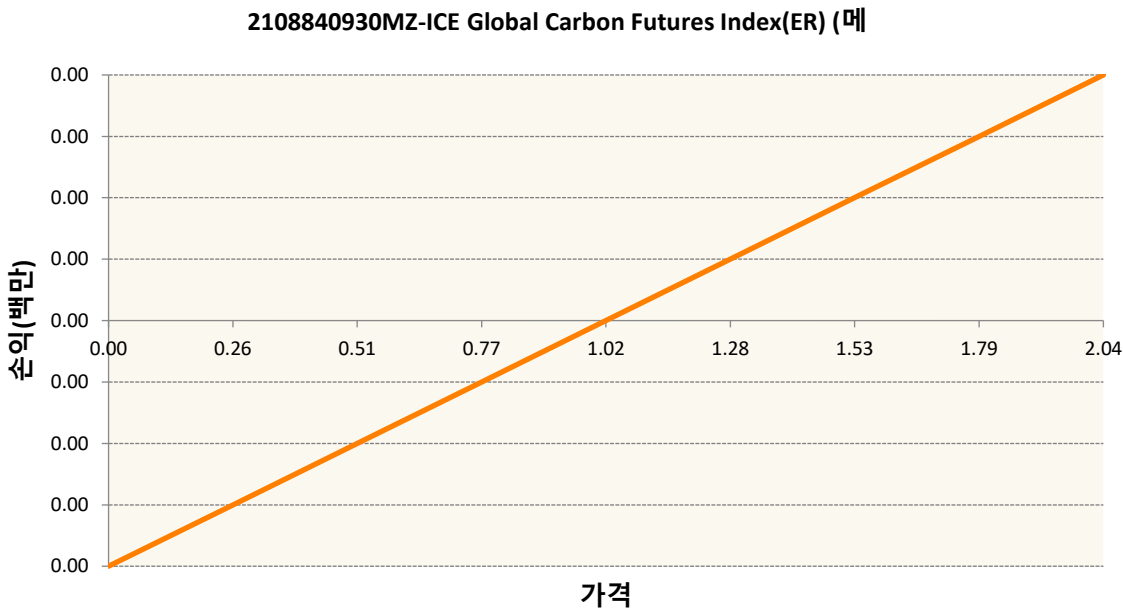
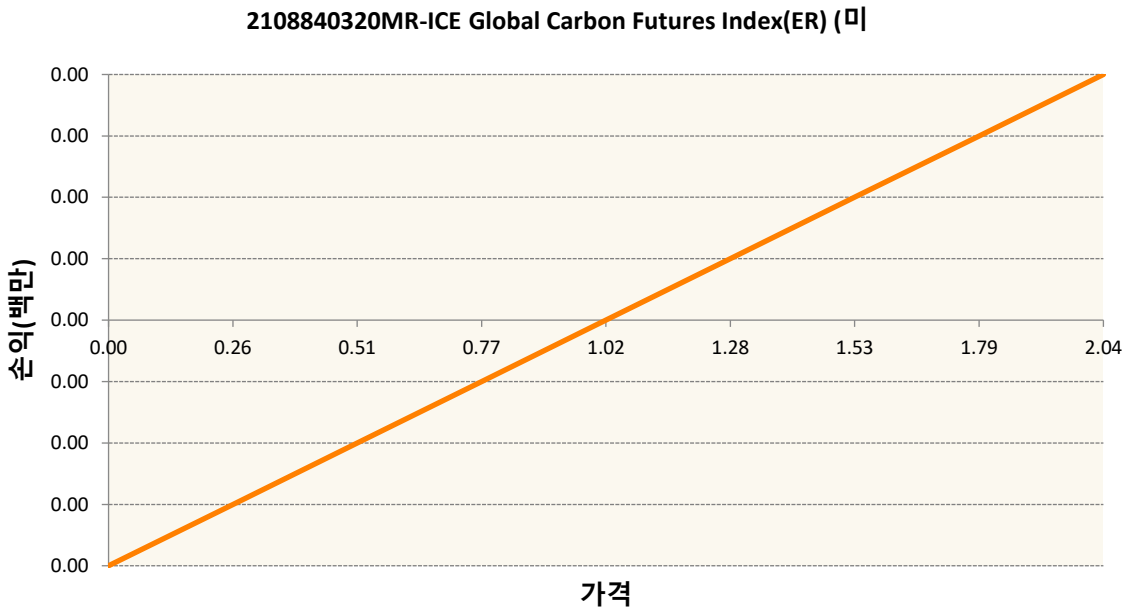
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	9,839	2,460	7,378	
누계	유가증권	선물	10,035	0	10,035	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	601
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	201

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	903

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

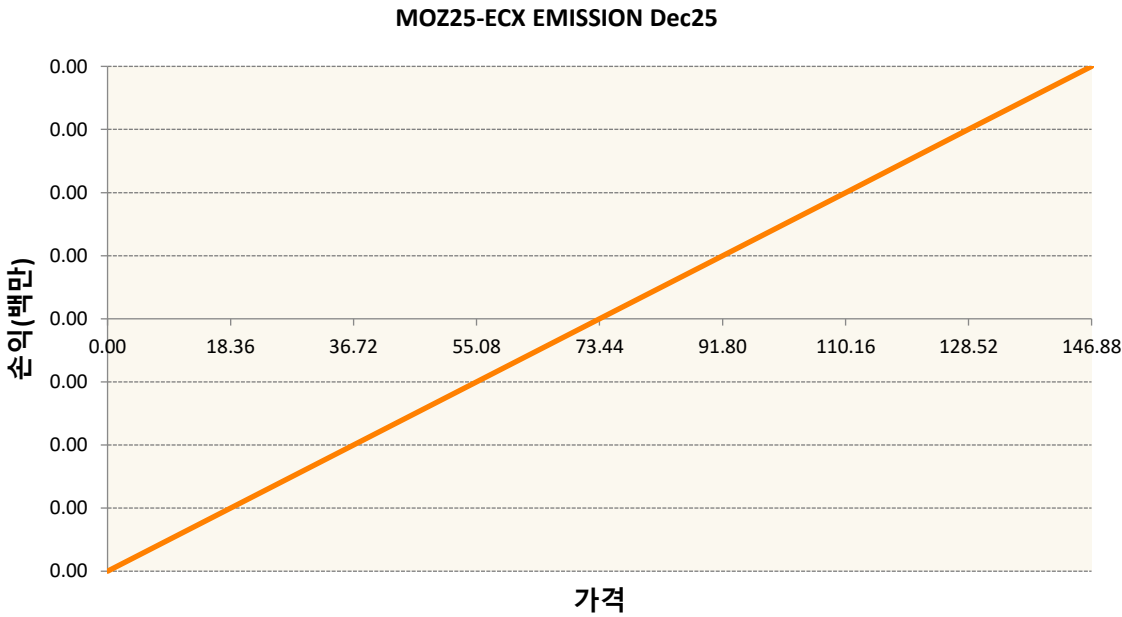
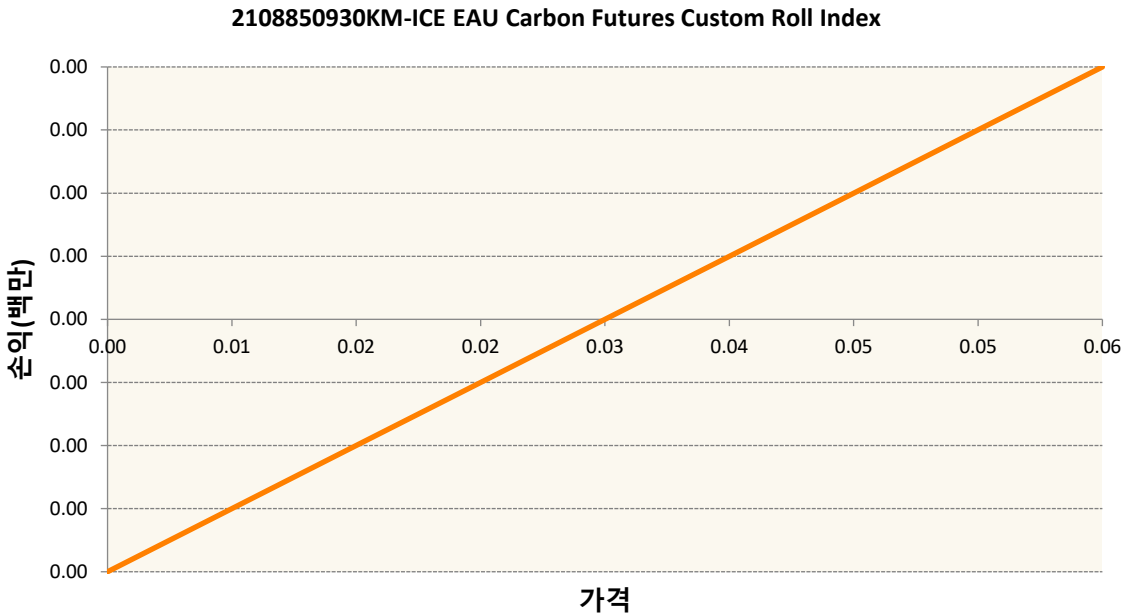
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	36	0	36	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,613	0	5,613	
누계	통화	선도	0	1,044	-1,044	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		1
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E		84
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		448

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	824

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	63	-63	장외
누계	지수	스왑	4,362	0	4,362	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)	0.2
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	0.2
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	0.3
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	0.3

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

(단위:백만원)

2

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	1,145	0	1,145	장외
누계	지수	스왑	8,845	0	8,845	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.44

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

(단위:백만원)

10

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

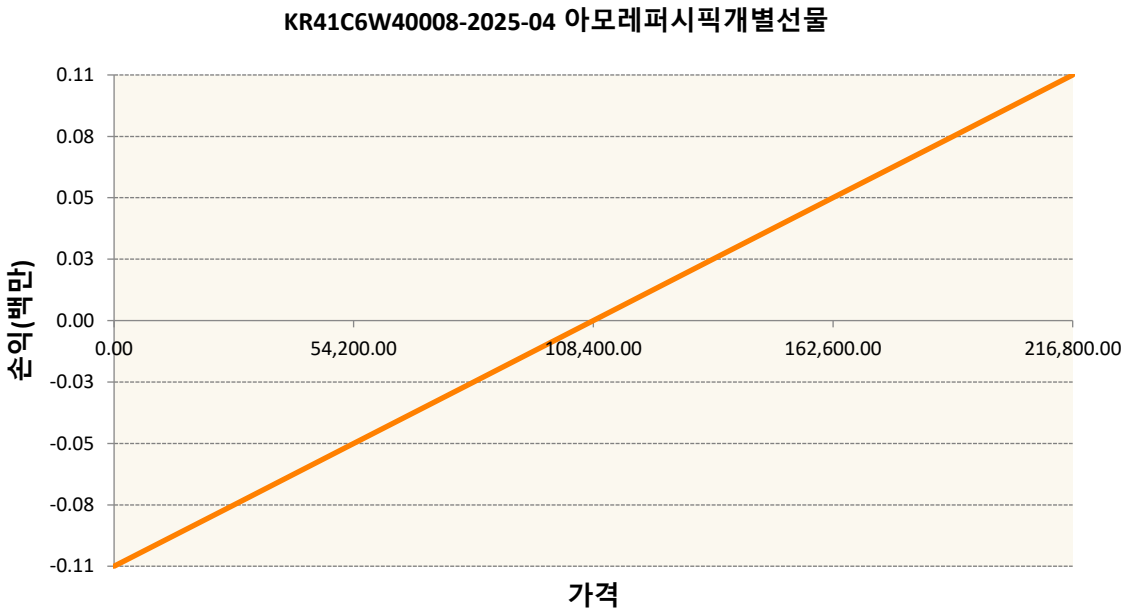
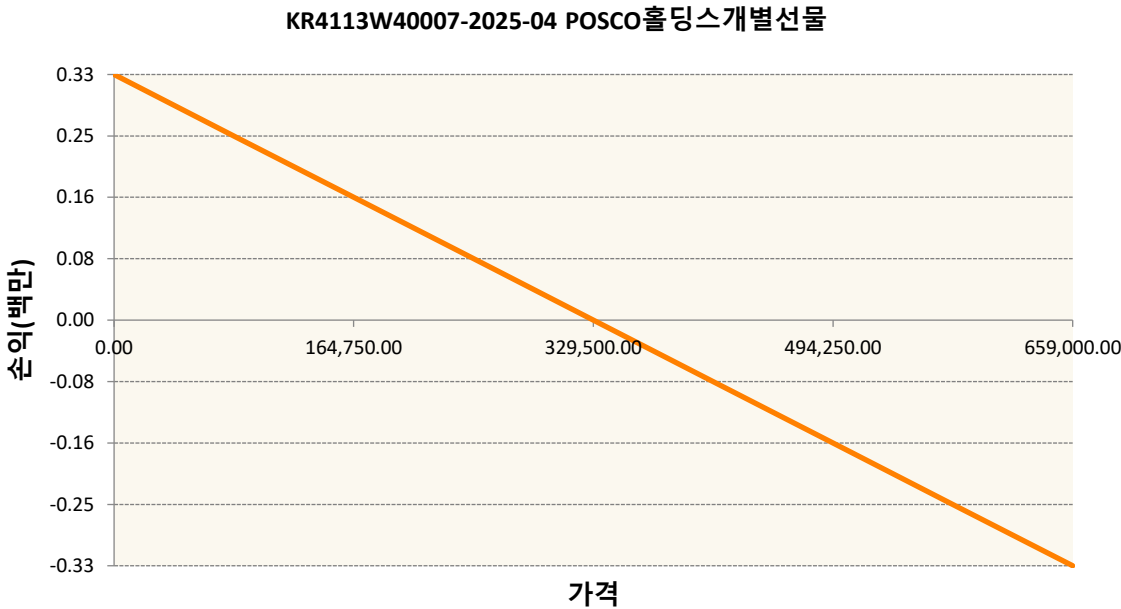
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

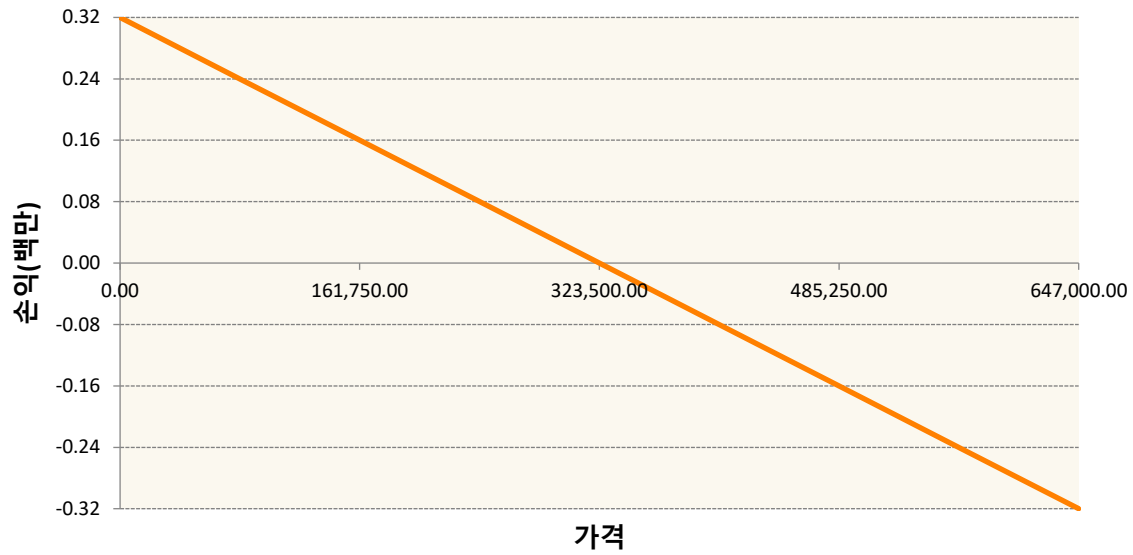
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5	18	-13	장내

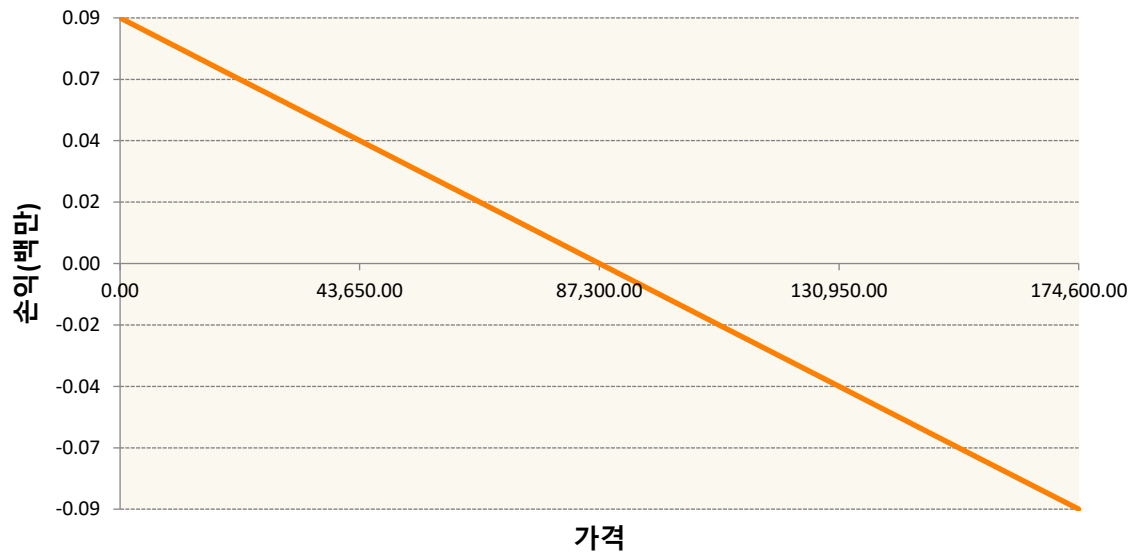
2. 만기시점의 손익구조



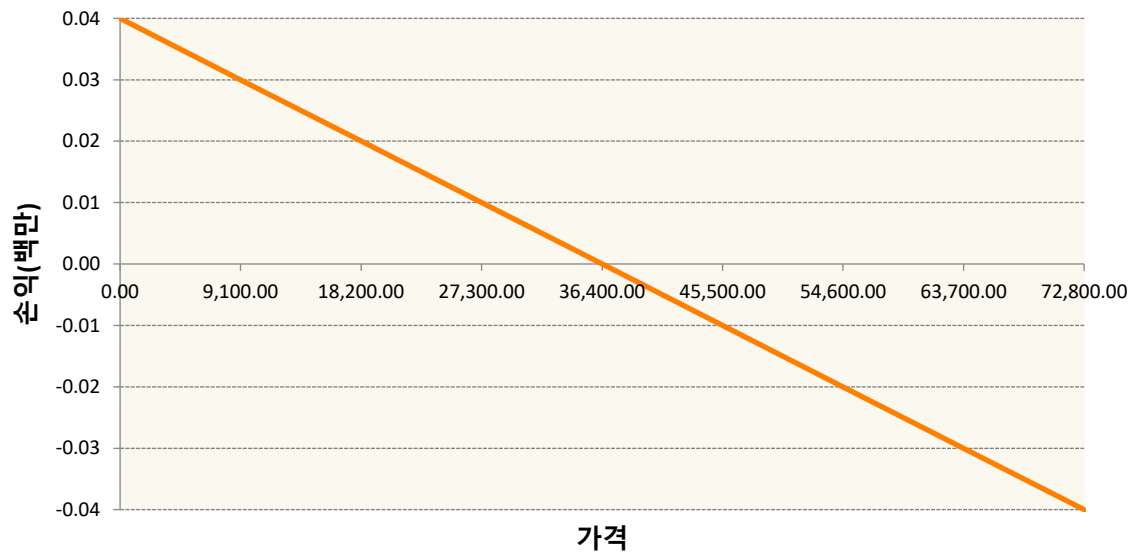
KR41CRW40002-2025-04 LG생활건강개별선물



KR41CWW40002-2025-04 코웨이개별선물



KR41GYW40009-2025-04 에스엘개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4113W40(2025-04 POSCO홀딩스개별선물		0.26
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물		0.43
KR41CRW40(2025-04 LG생활건강개별선물		1
KR41CWW4(2025-04 코웨이개별선물		0.35
KR41GYW40 2025-04 에스엘개별선물		0.32

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

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

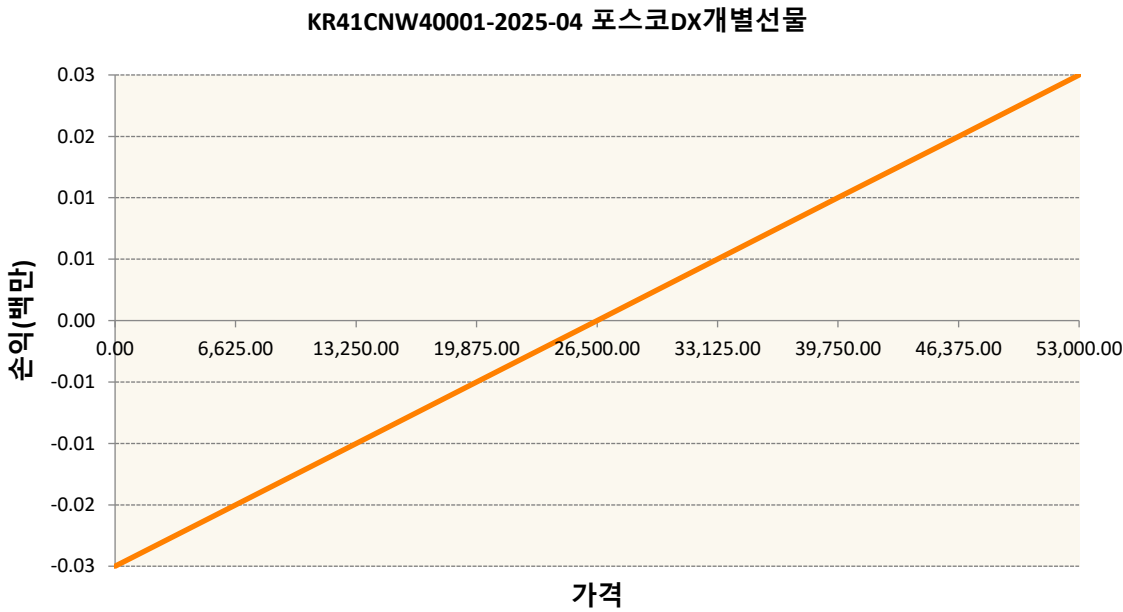
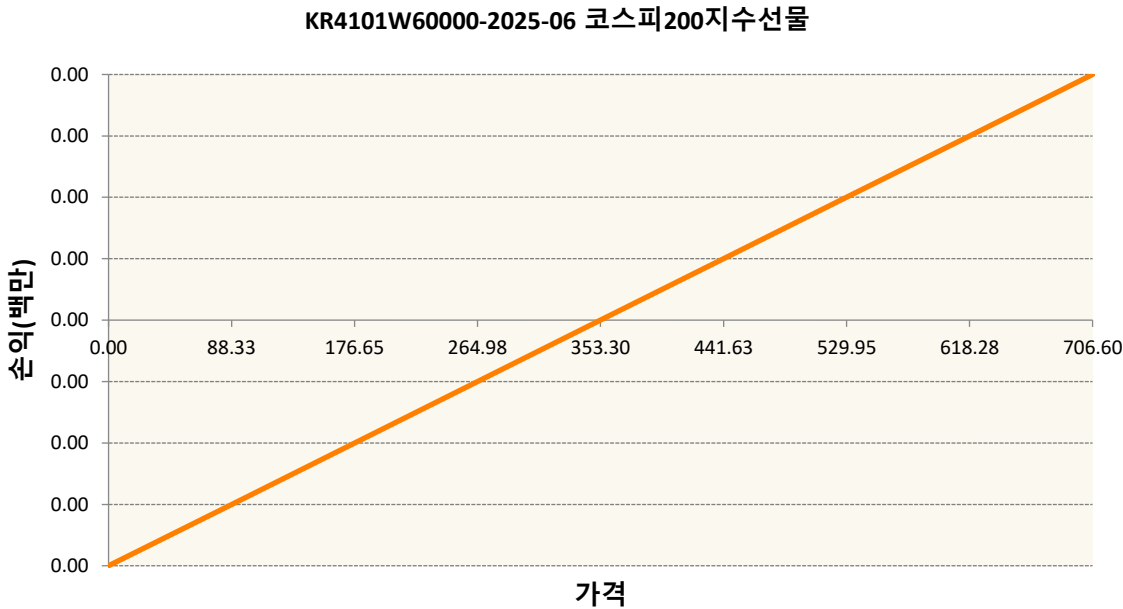
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

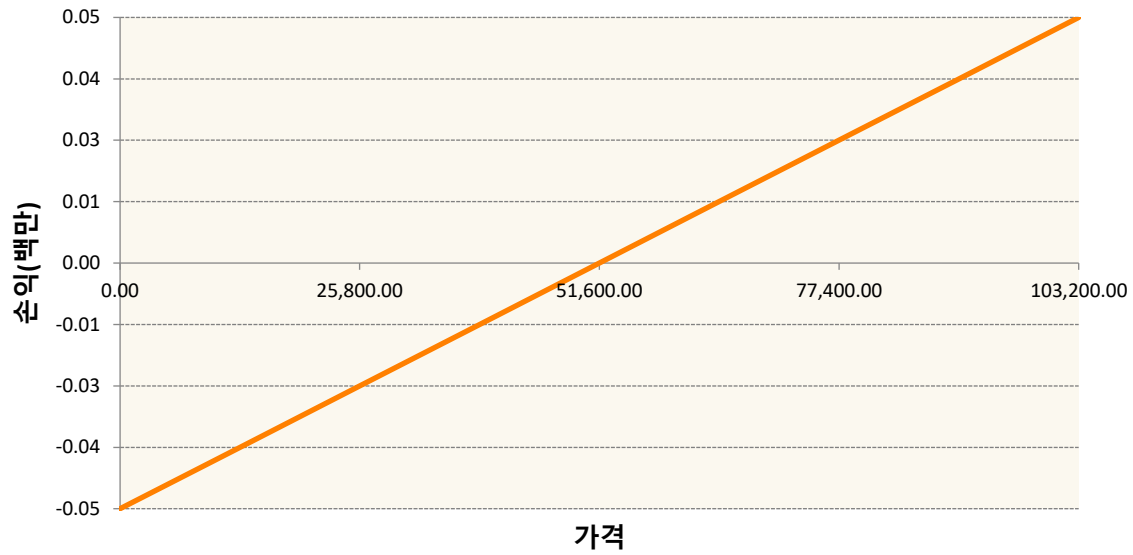
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	740	0	740	장내
누계	유가증권	선물	10,884	0	10,884	장내

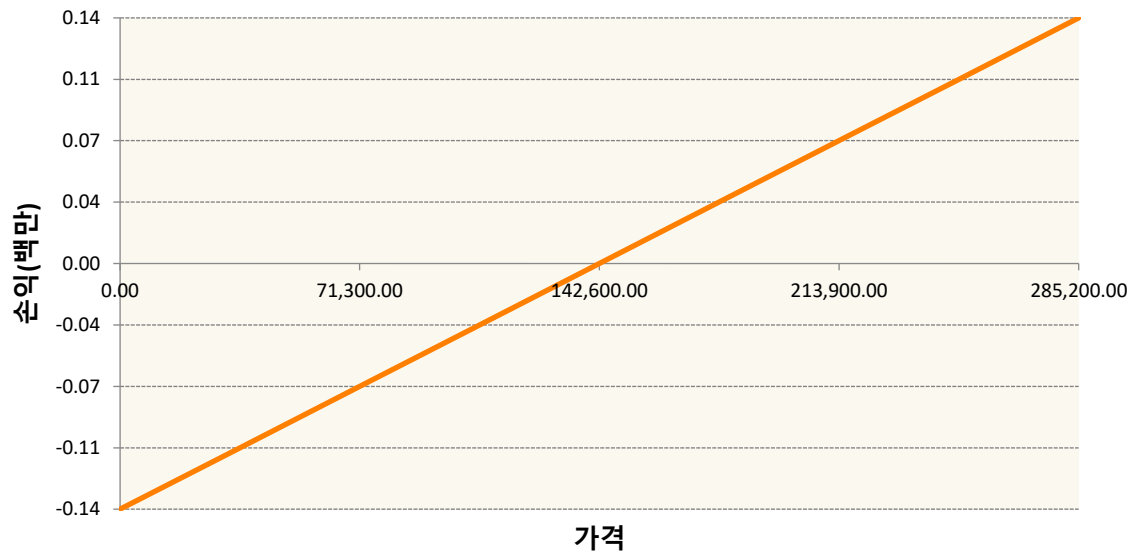
2. 만기시점의 손익구조



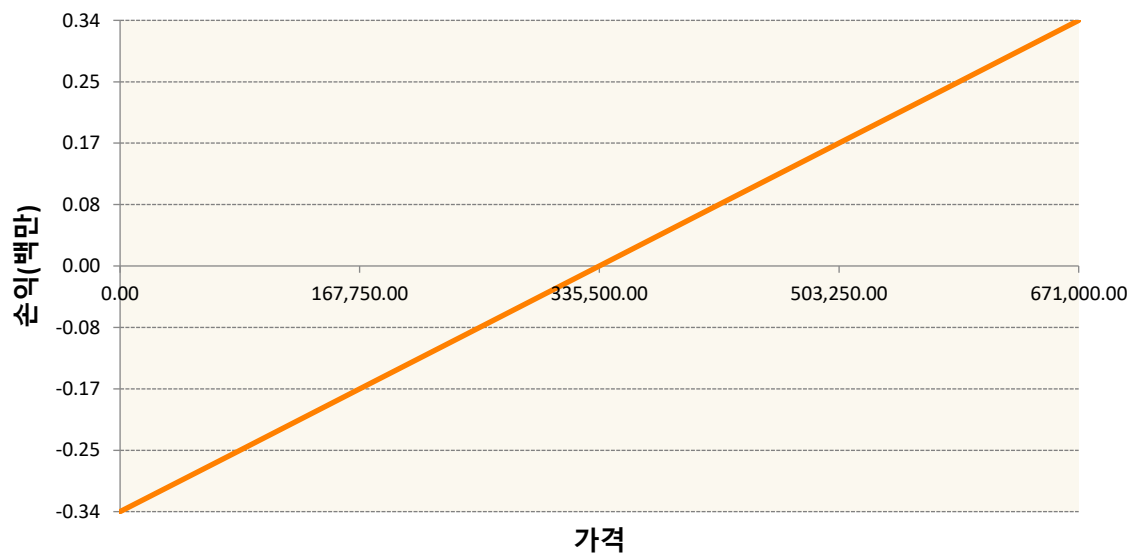
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



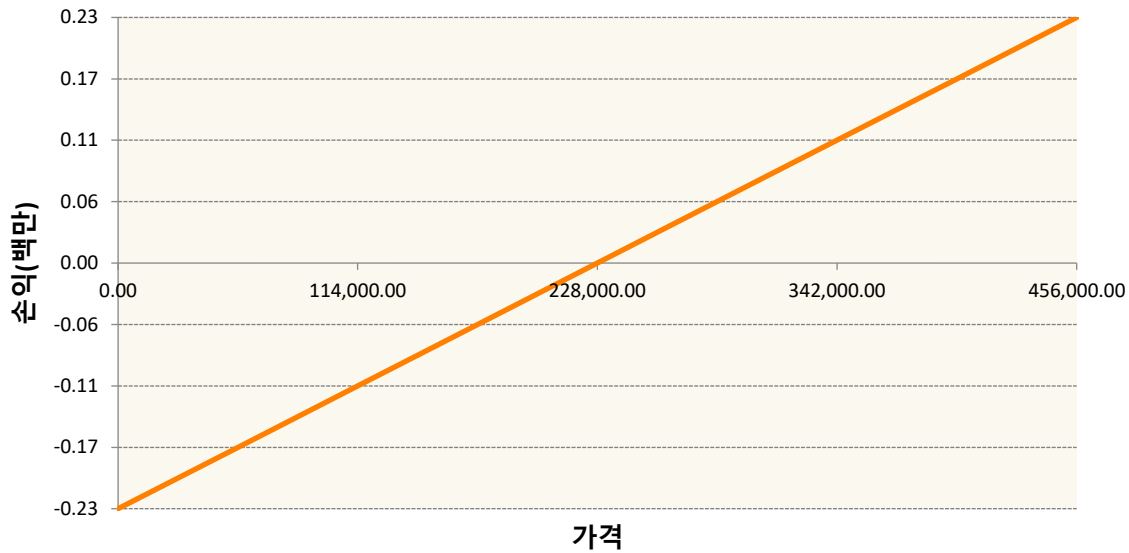
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



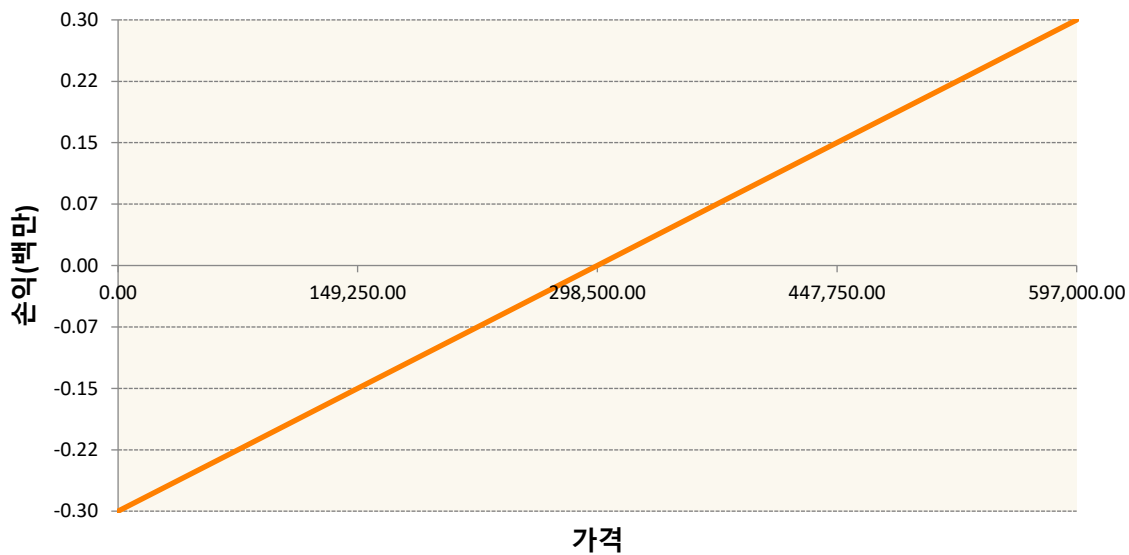
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	608
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	13
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	3
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물	18
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물	116
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물	46
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	66

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

(단위:백만원)

1,383

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

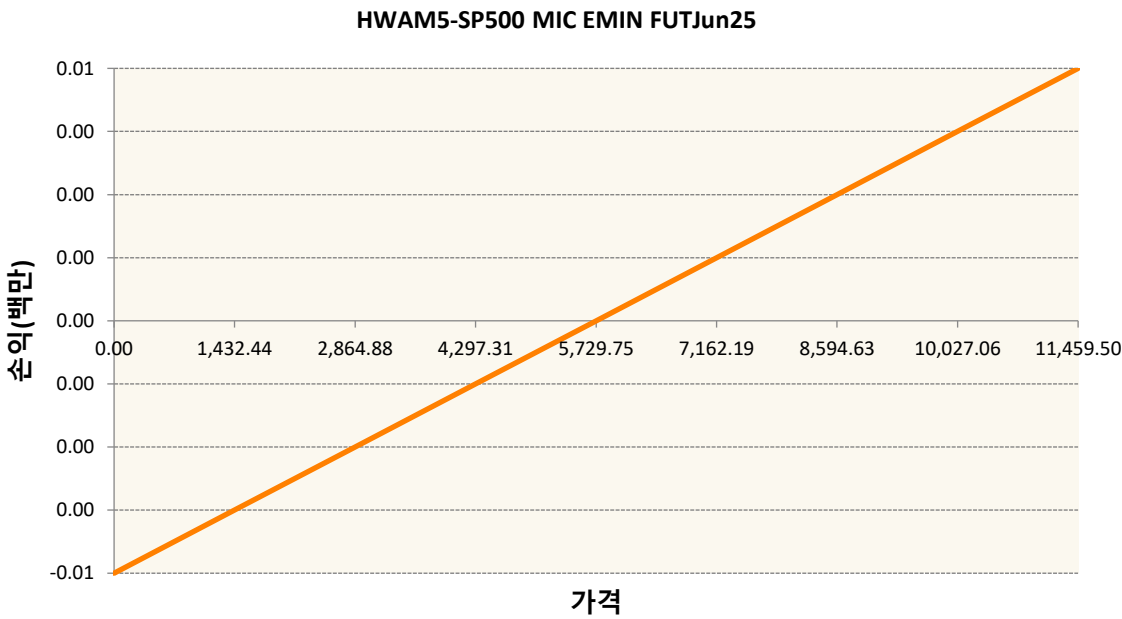
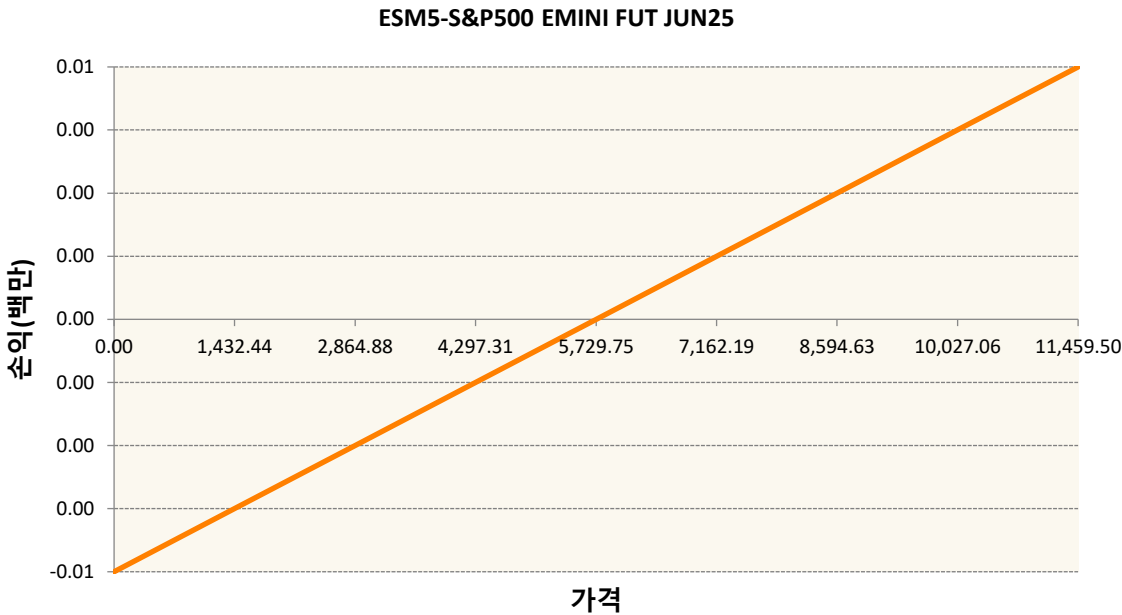
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	28,003	0	28,003	
누계	유가증권	선물	1,212	0	1,212	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,240
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	97

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,572

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

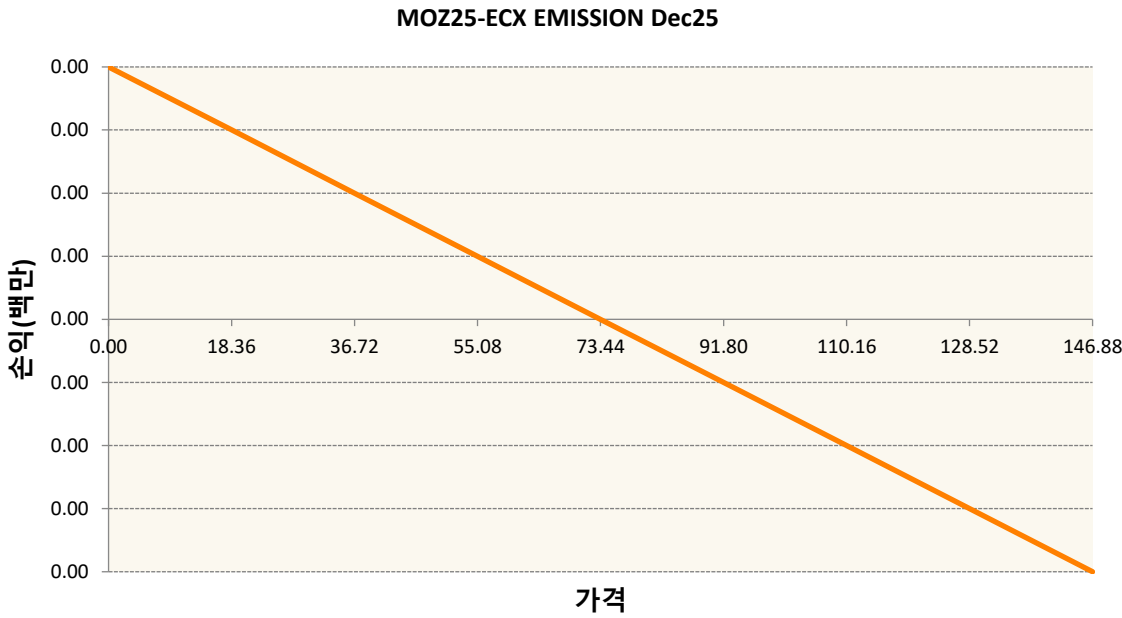
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	-38	0	-38	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	-11	4,860	-4,871	
누계	통화	선도	0	1,168	-1,168	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	35
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	59
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	389

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

(단위:백만원)

727

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

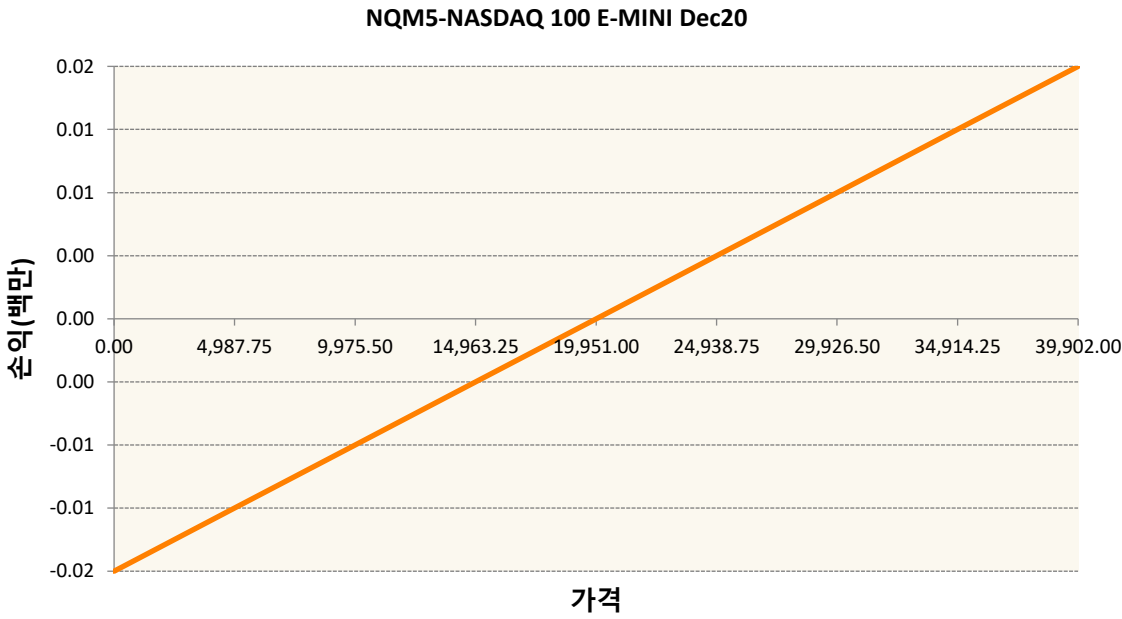
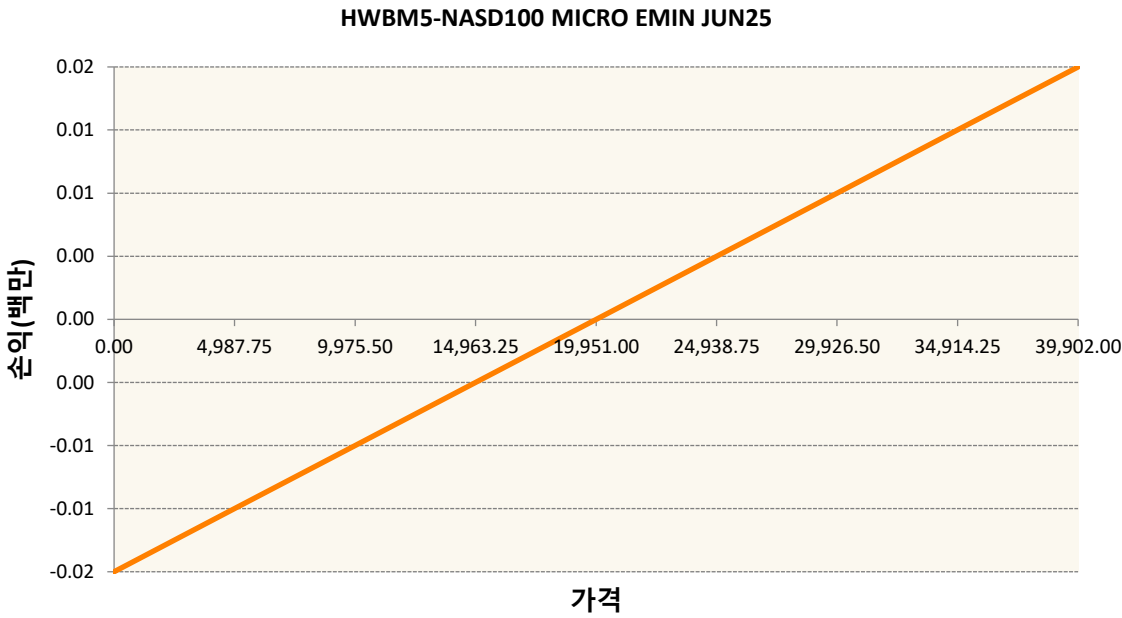
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,971	0	13,971	
누계	유가증권	선물	349	0	349	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		28
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,118

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,058

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

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	747
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,250
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,292
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,928

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

(단위:백만원)

8,617

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	2,417	0	2,417	장외
누계	지수	스왑	6,643	0	6,643	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3

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

(단위:백만원)

12

공시일	2025-03-21
기준일	2025-03-20

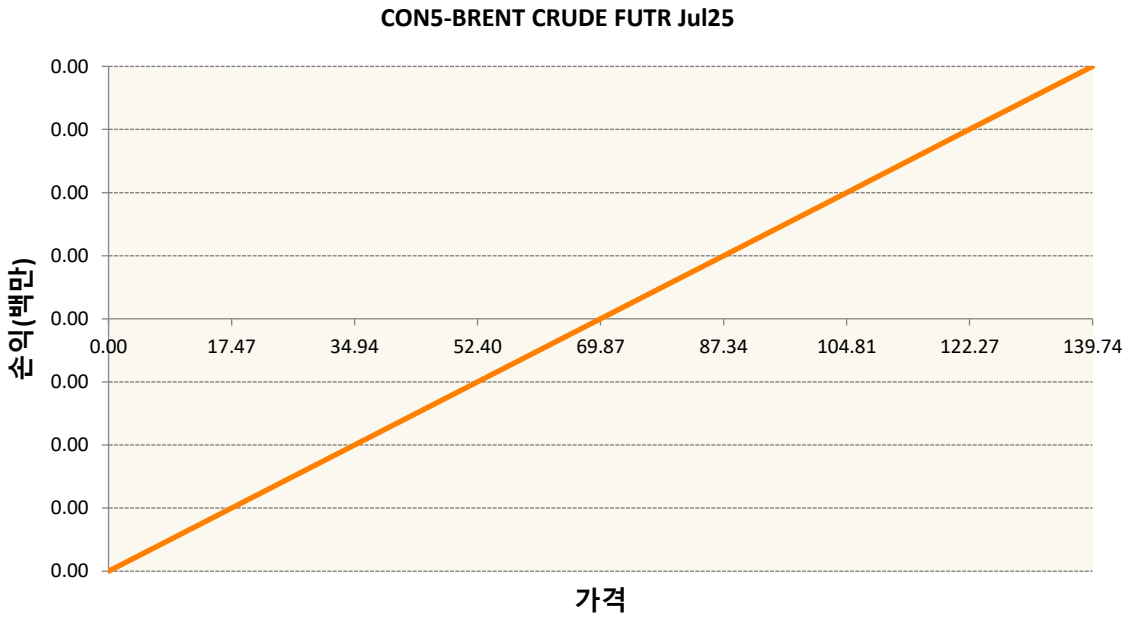
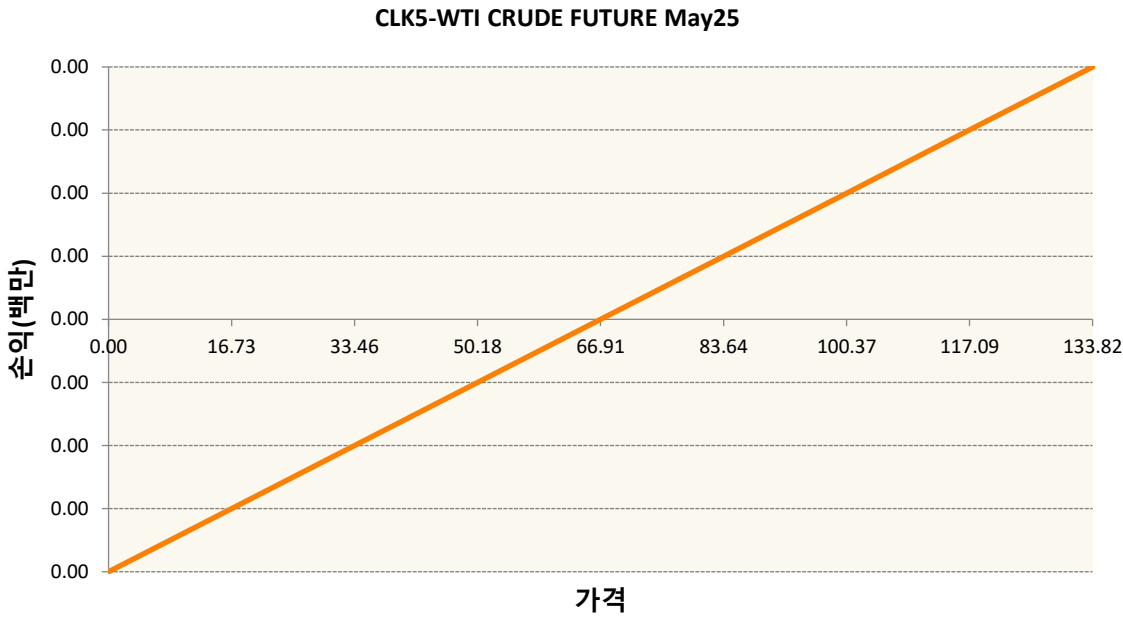
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

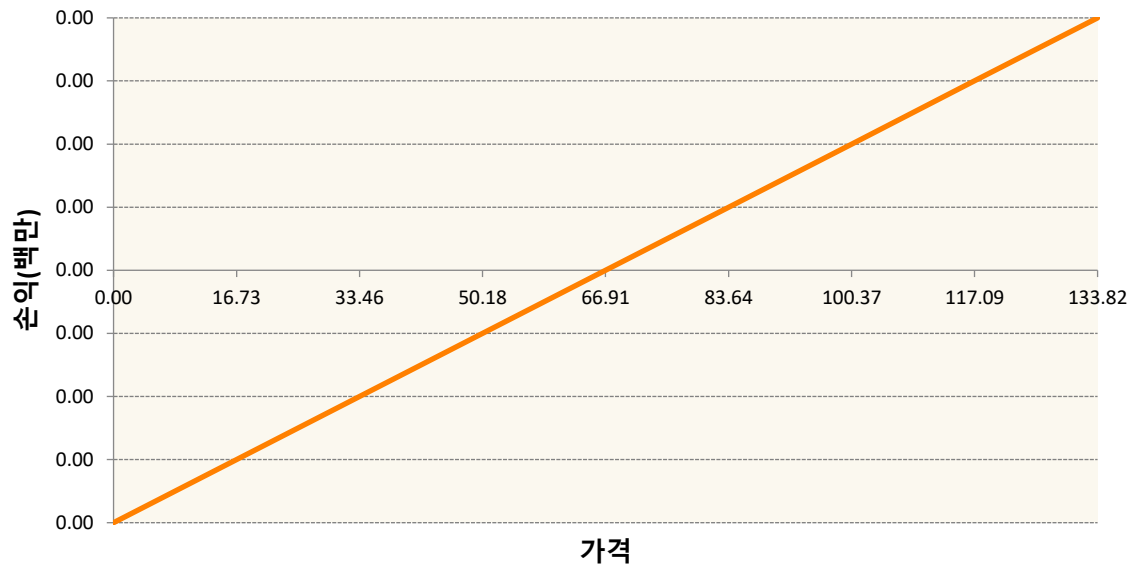
(단위:백만원)

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	842	0	842	
누계	통화	선물	0	146	-146	장내

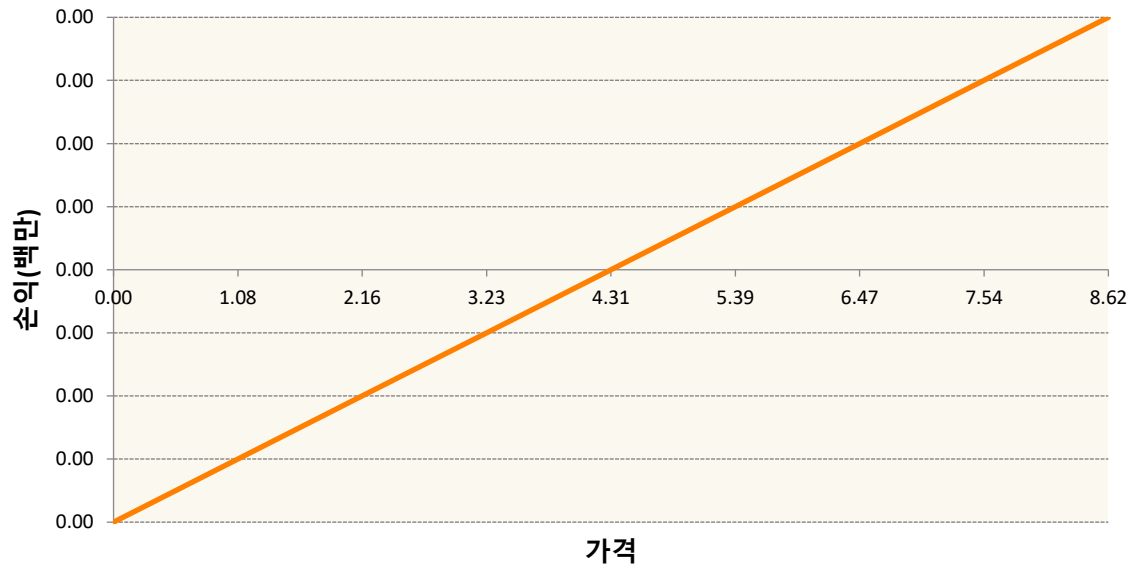
2. 만기시점의 손익구조



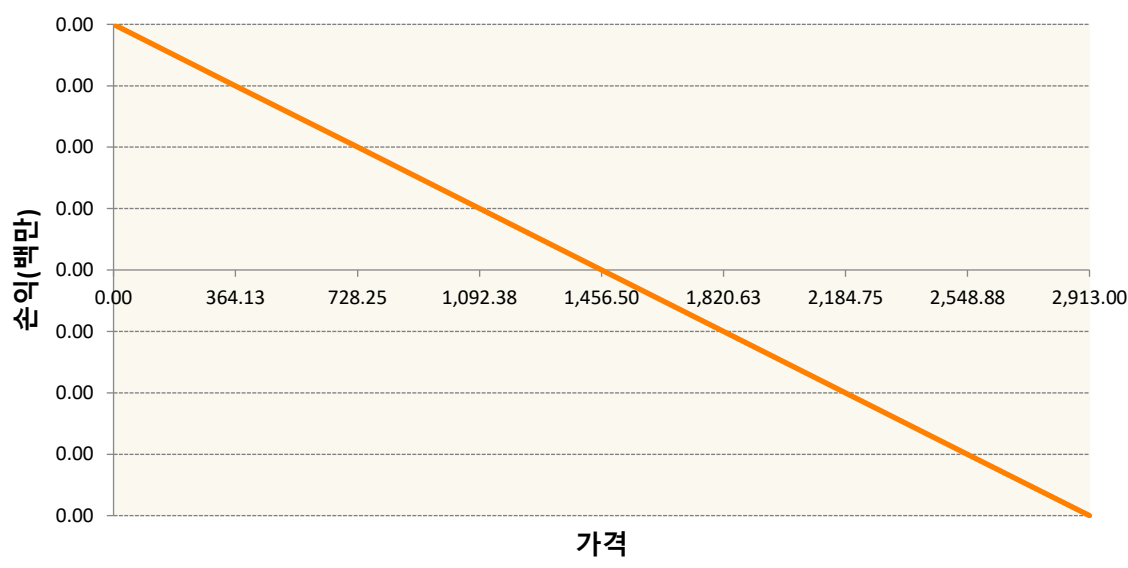
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



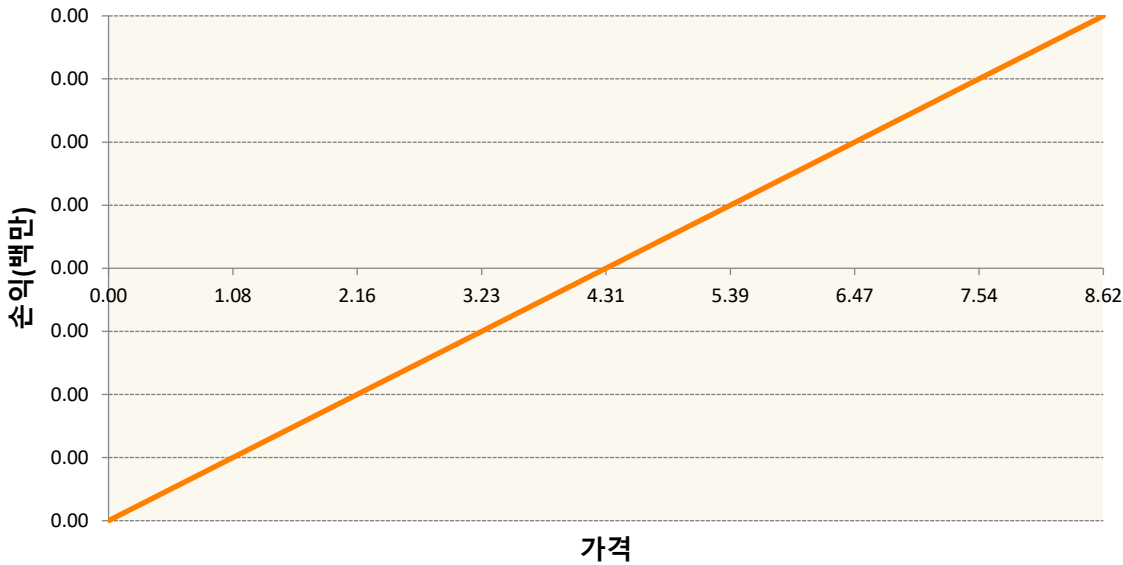
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



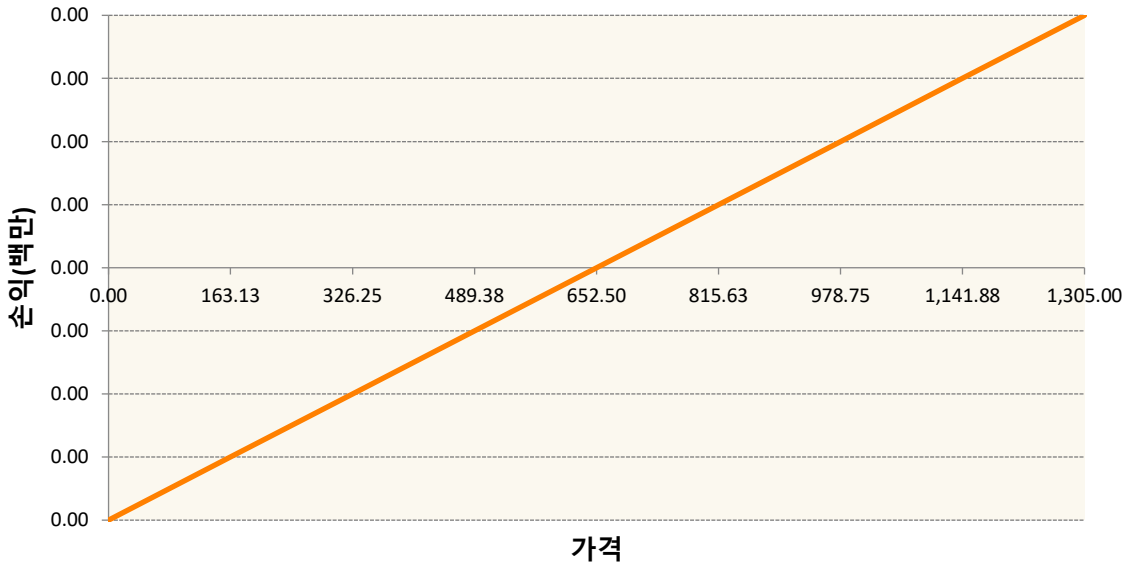
KR4175W40006-2025-04 달러선물



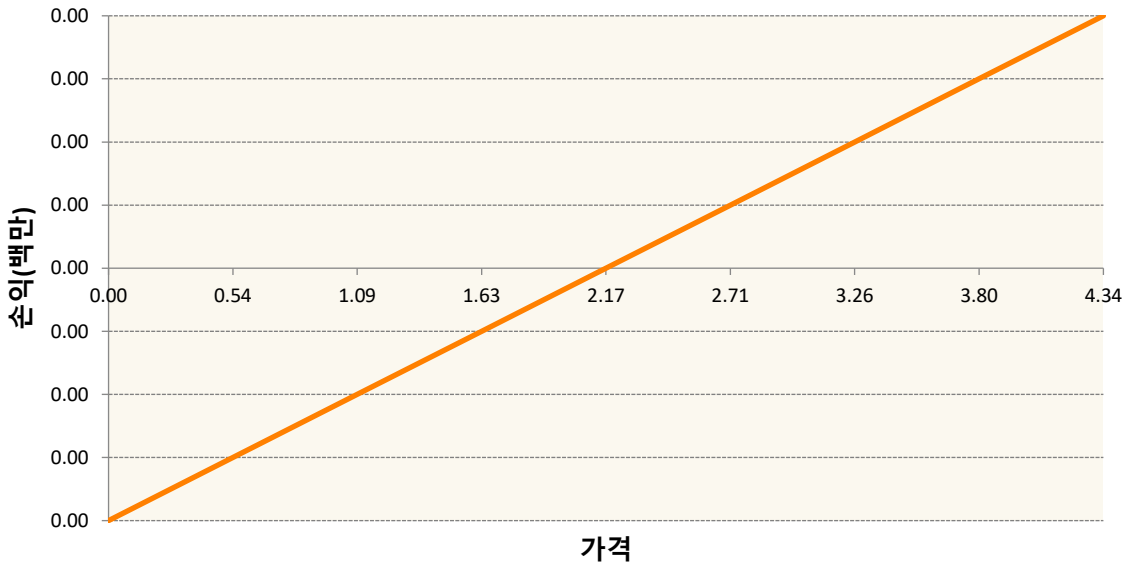
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	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)

148