

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

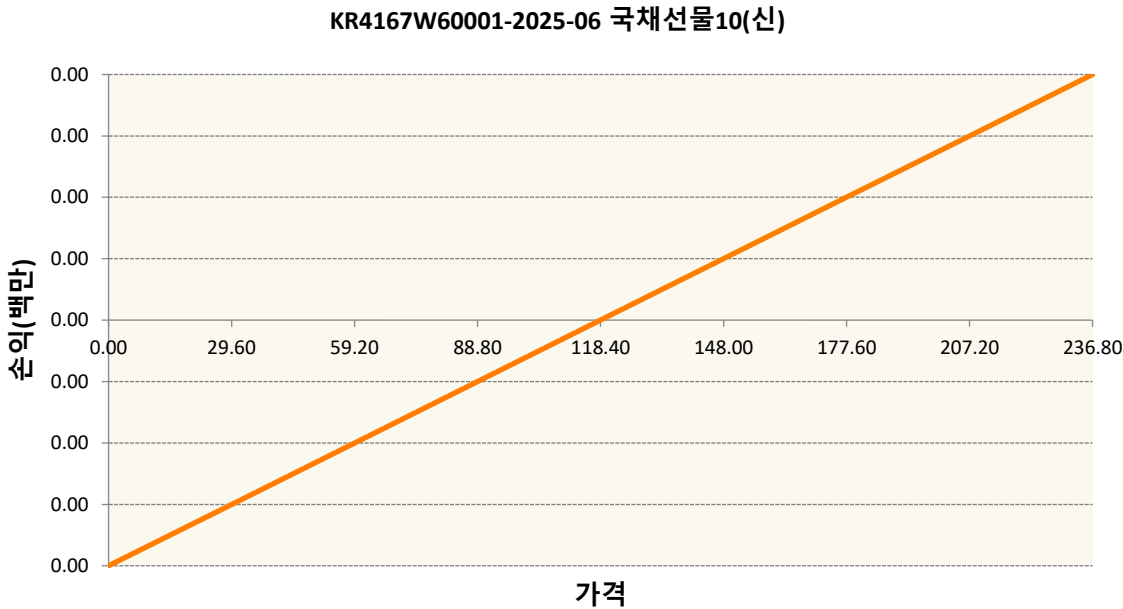
베스트장기채(채권-파생형)

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	236,800	0	236,800	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

5,876

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

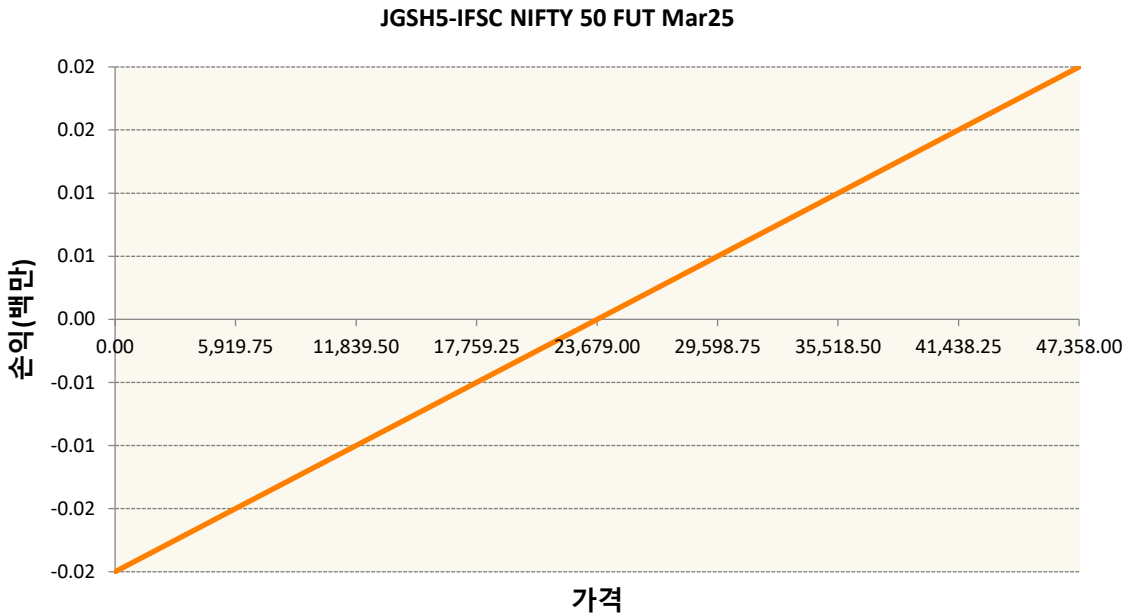
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	762	0	762	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH5	IFSC NIFTY 50 FUT Mar25	61
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

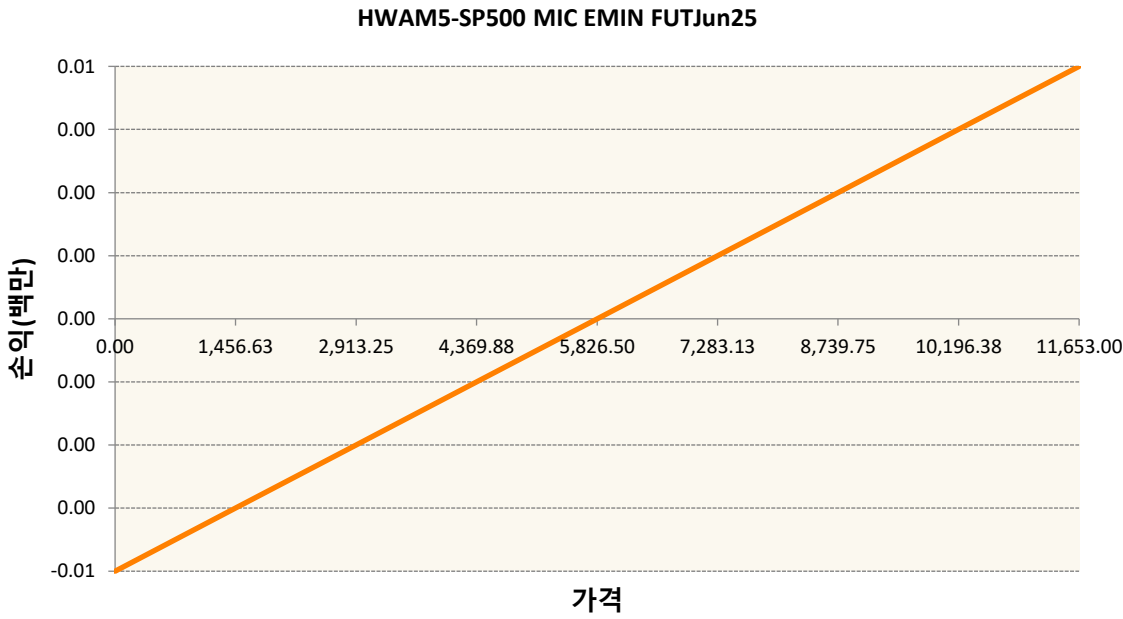
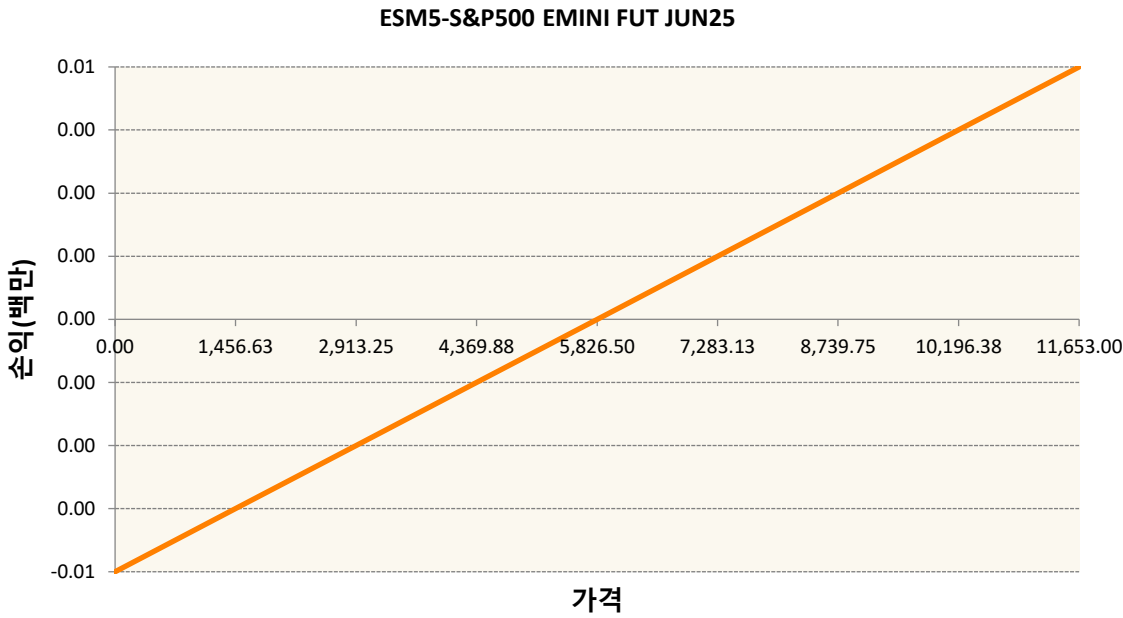
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	426	0	426	
누계	유가증권	선물	85	0	85	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	34
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	28

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

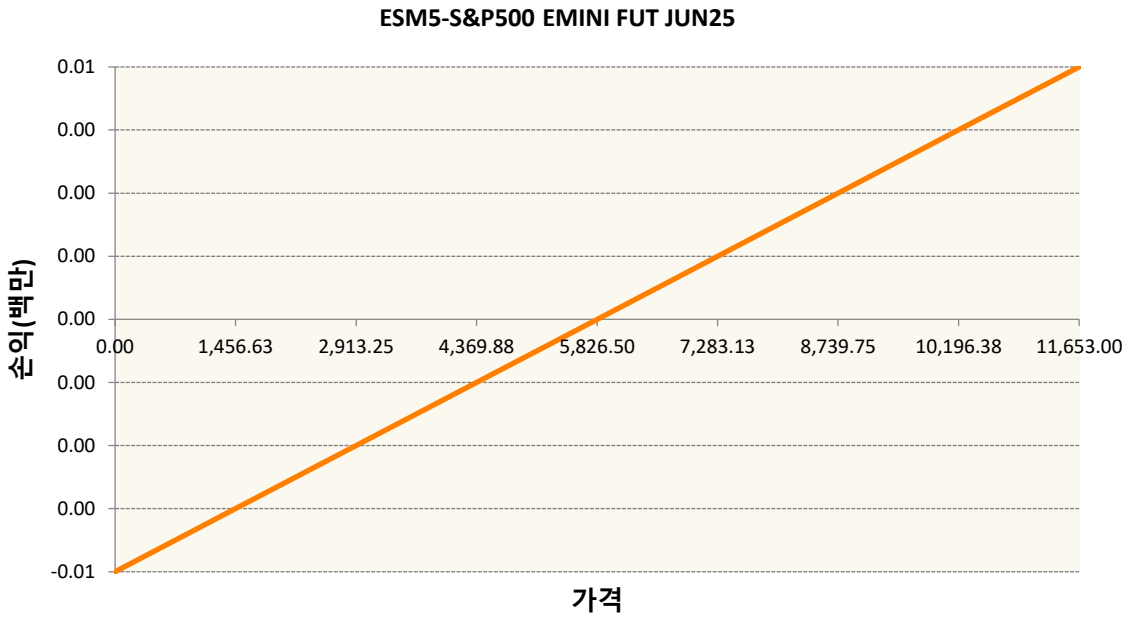
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,557	0	2,557	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	205
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

140

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

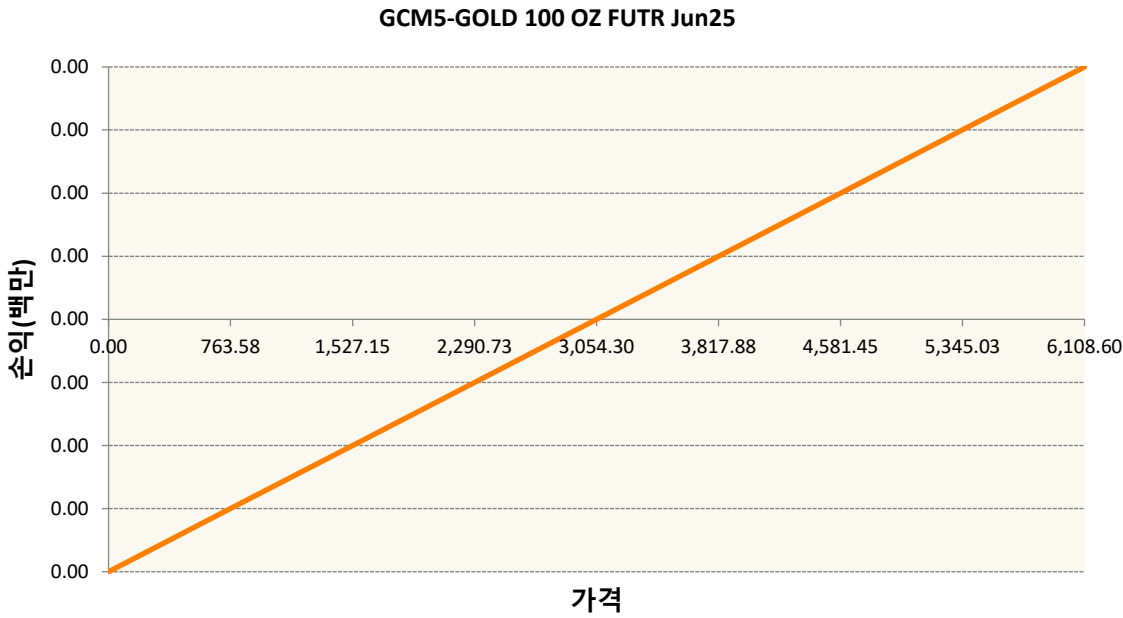
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,793	0	1,793	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 03/28/25 C282 EQUITY	0.48
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	143

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

(단위:백만원)

103

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

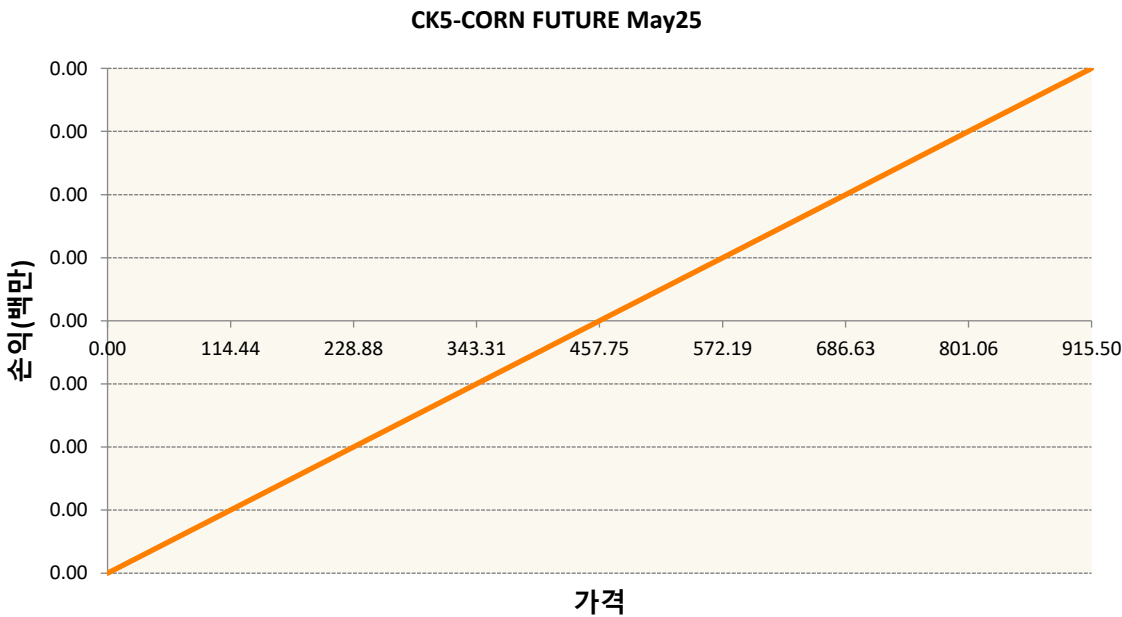
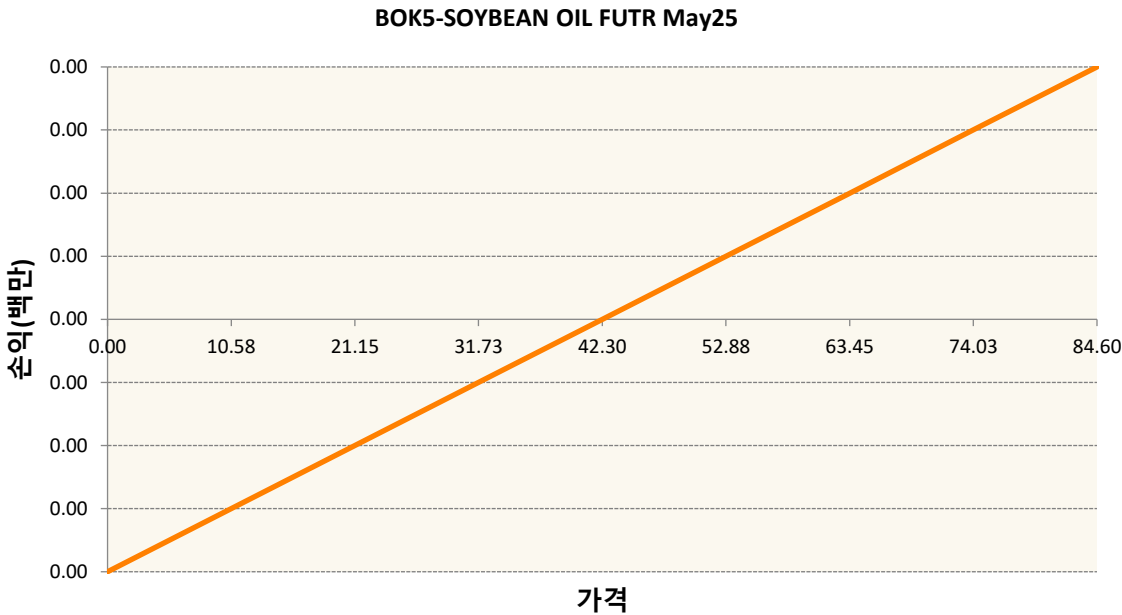
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

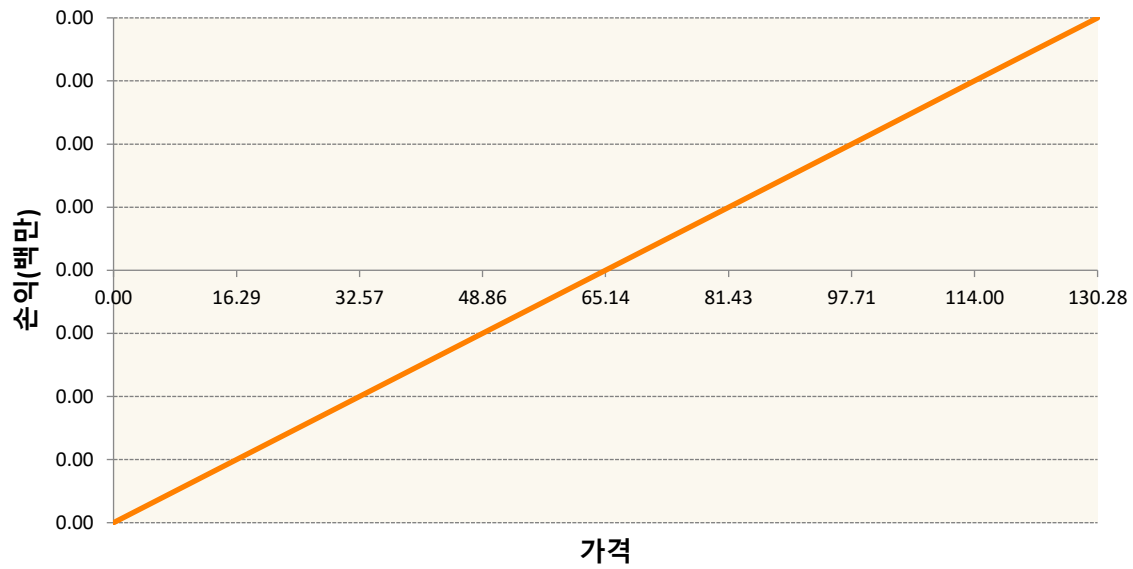
(단위:USD 백만)

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	3,720	0	3,720	
누계	통화	선물	0	381	-381	장내

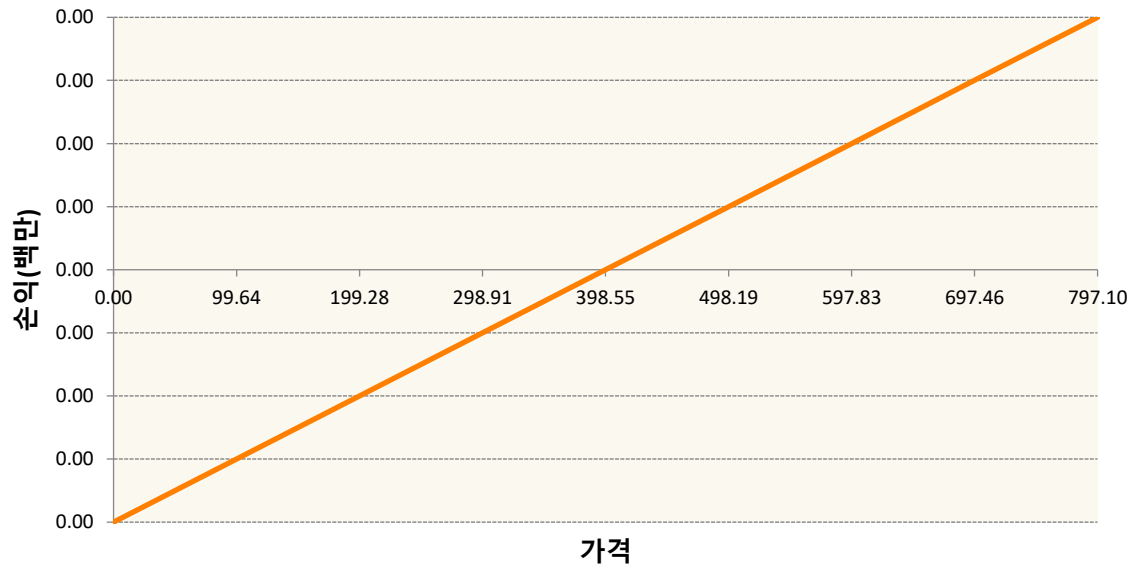
2. 만기시점의 손익구조



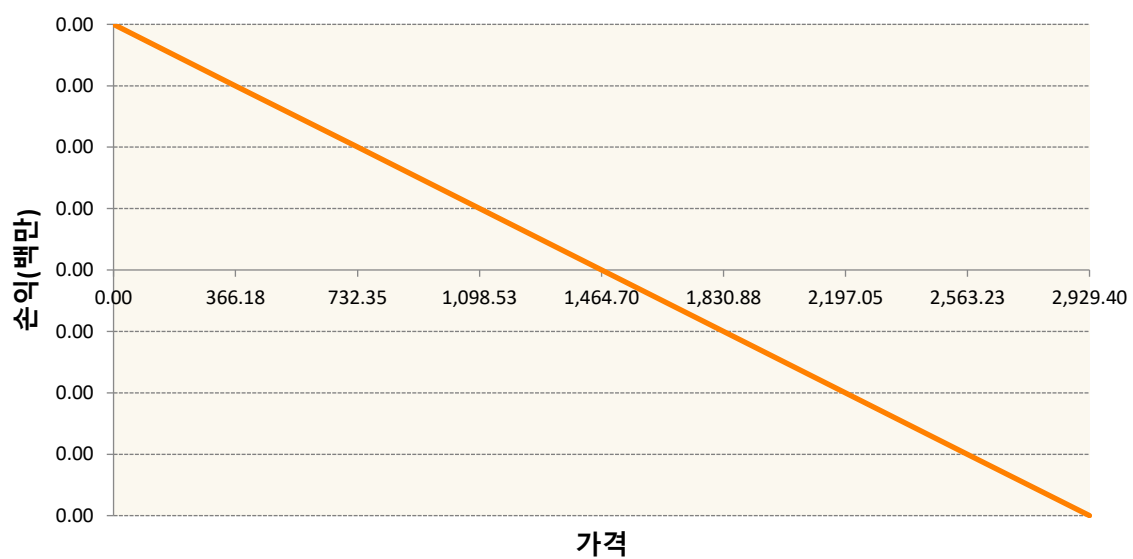
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



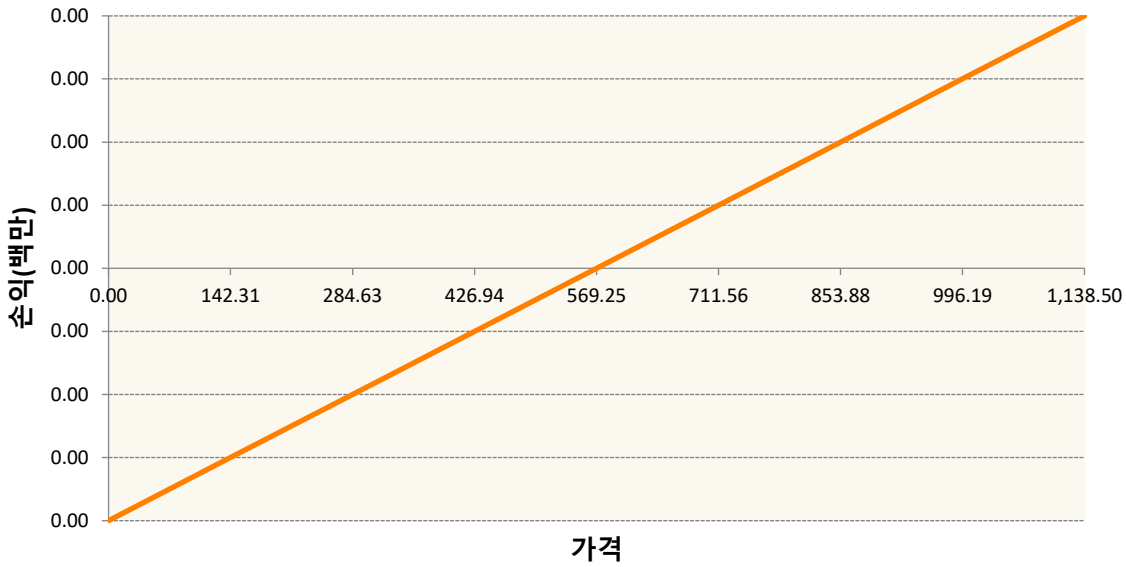
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



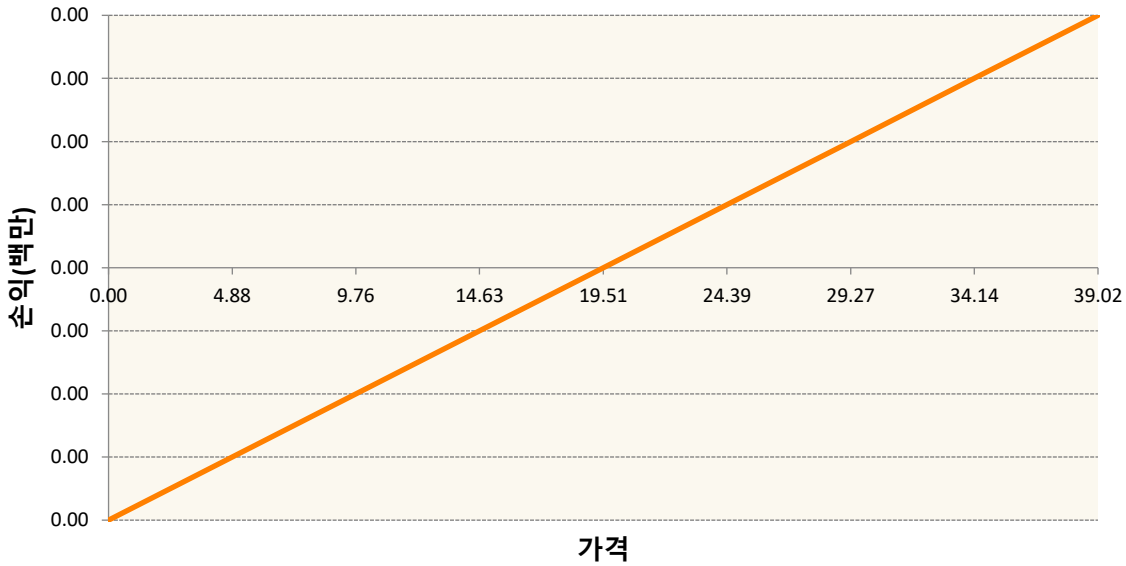
KR4175W40006-2025-04 달러선물



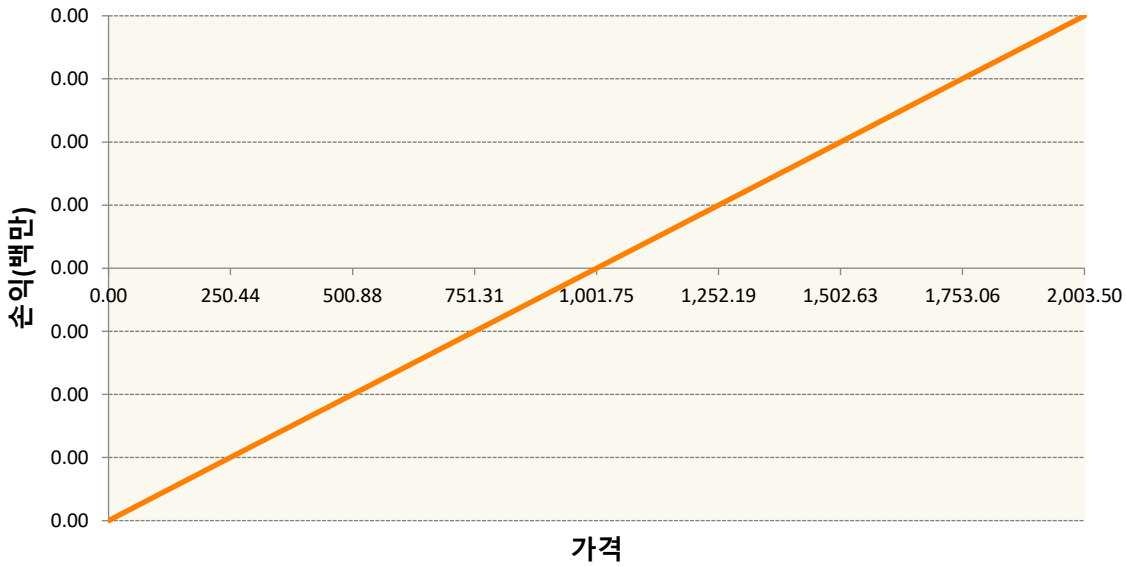
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



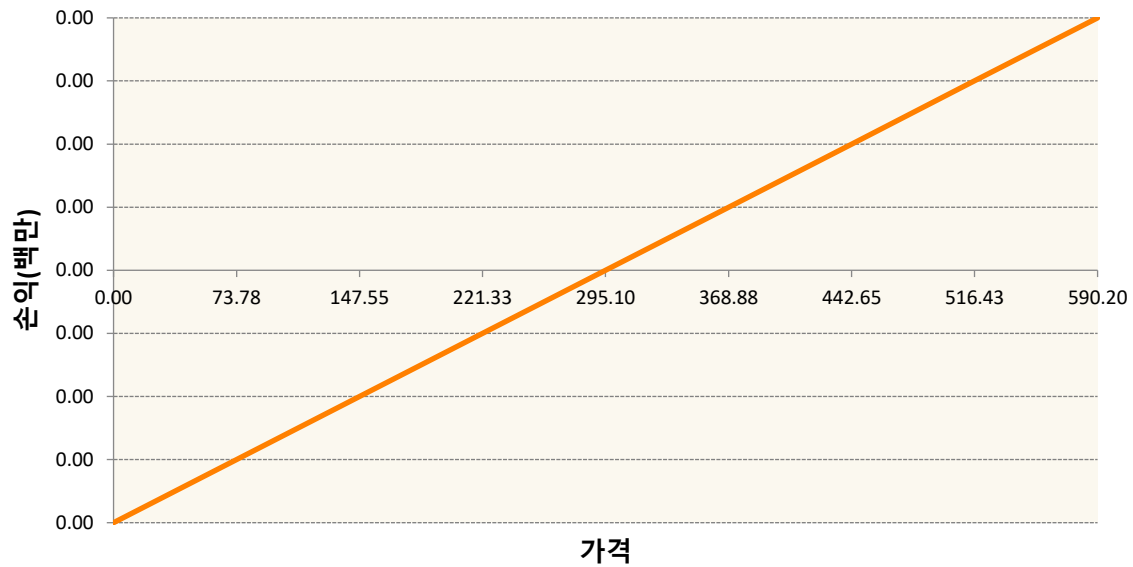
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



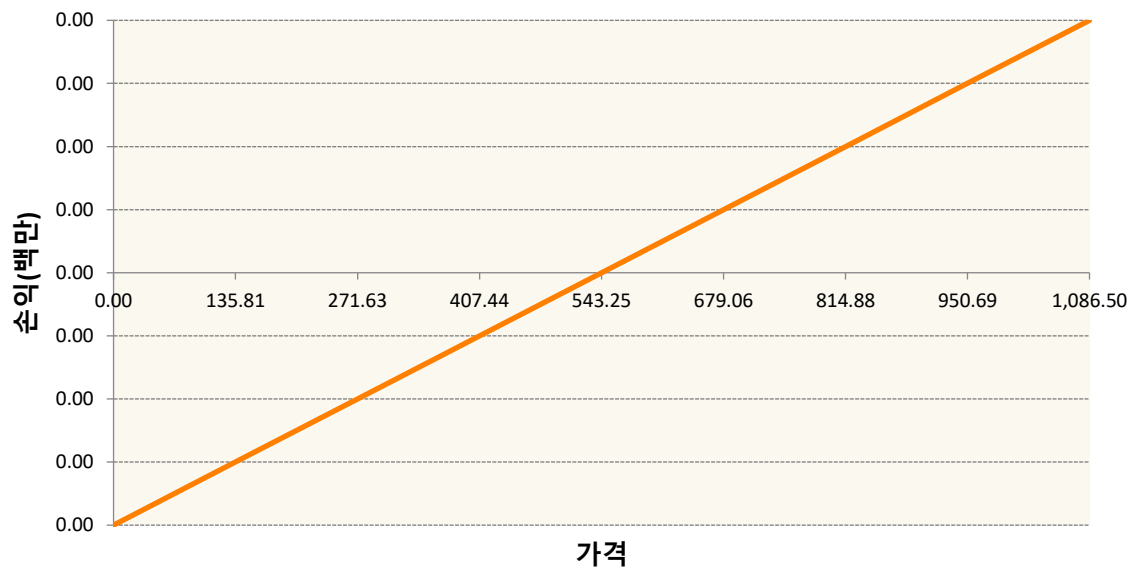
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-03-27
기준일	2025-03-26

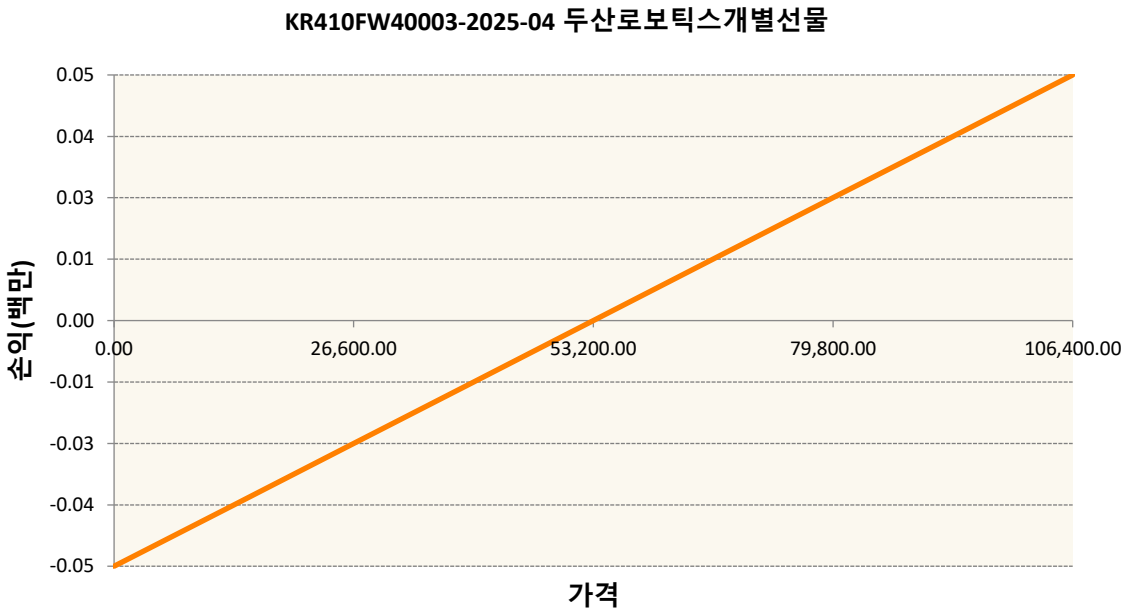
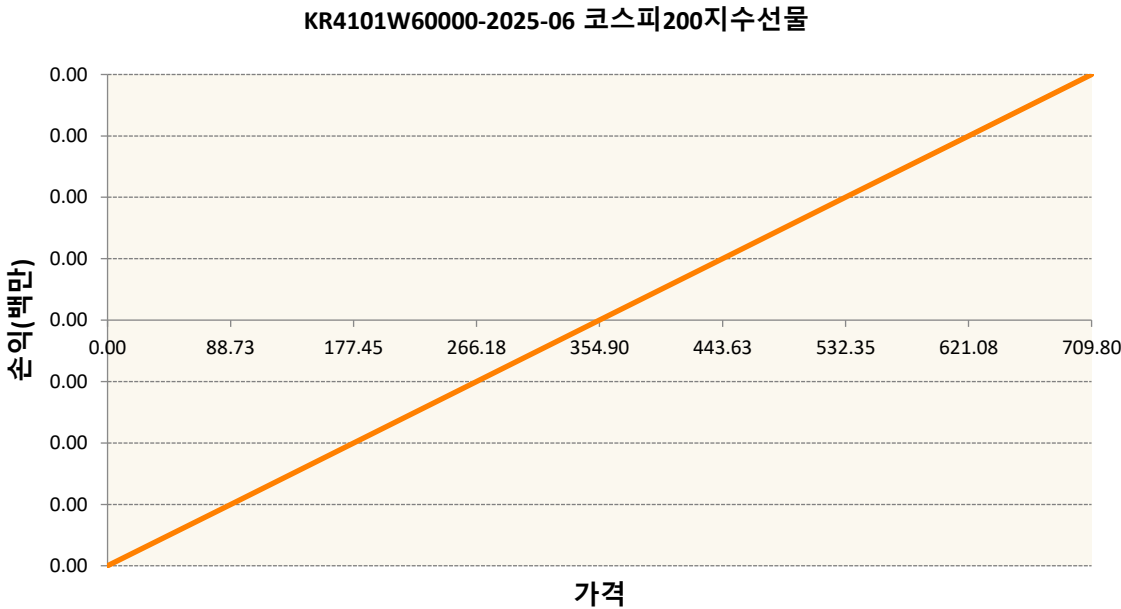
스마트인덱스모

1. 계약금액

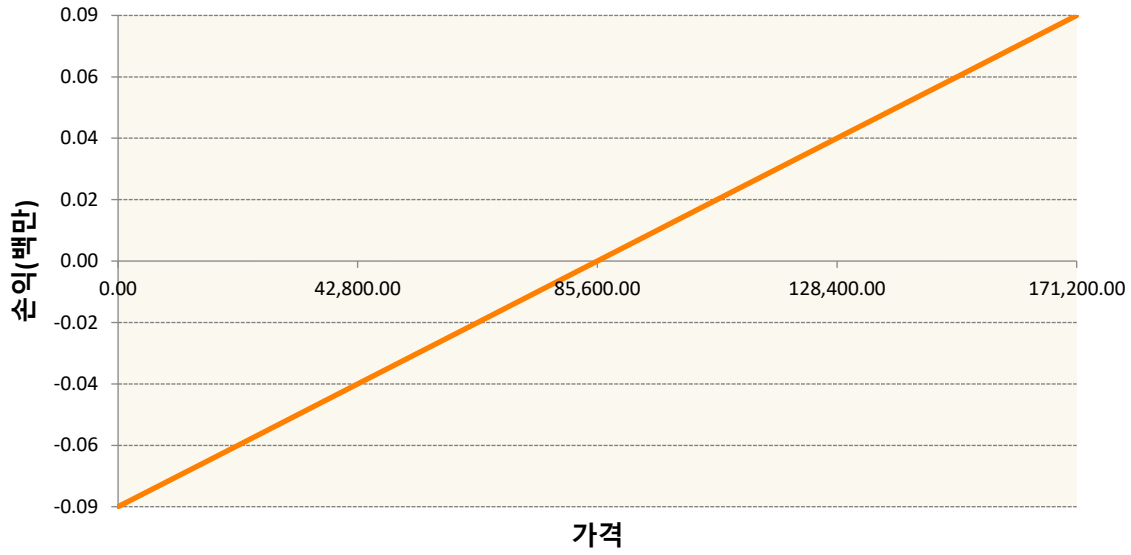
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,142	0	2,142	장내

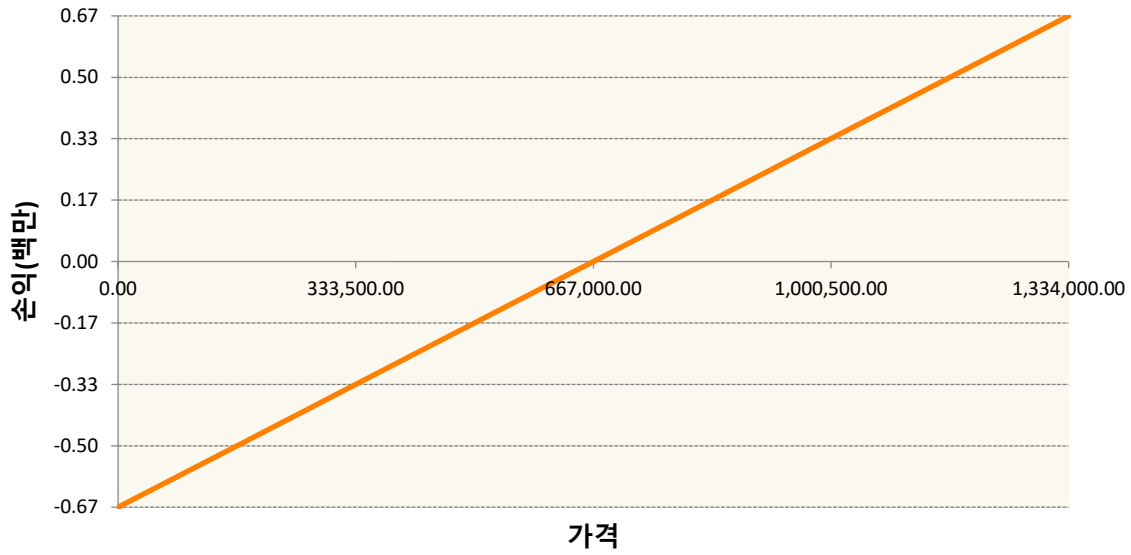
2. 만기시점의 손익구조



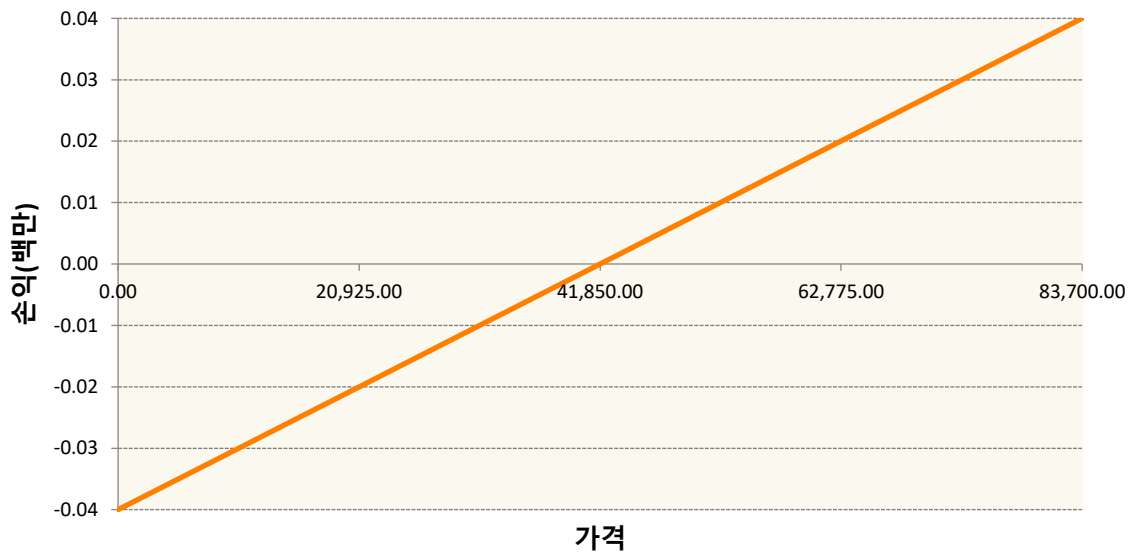
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



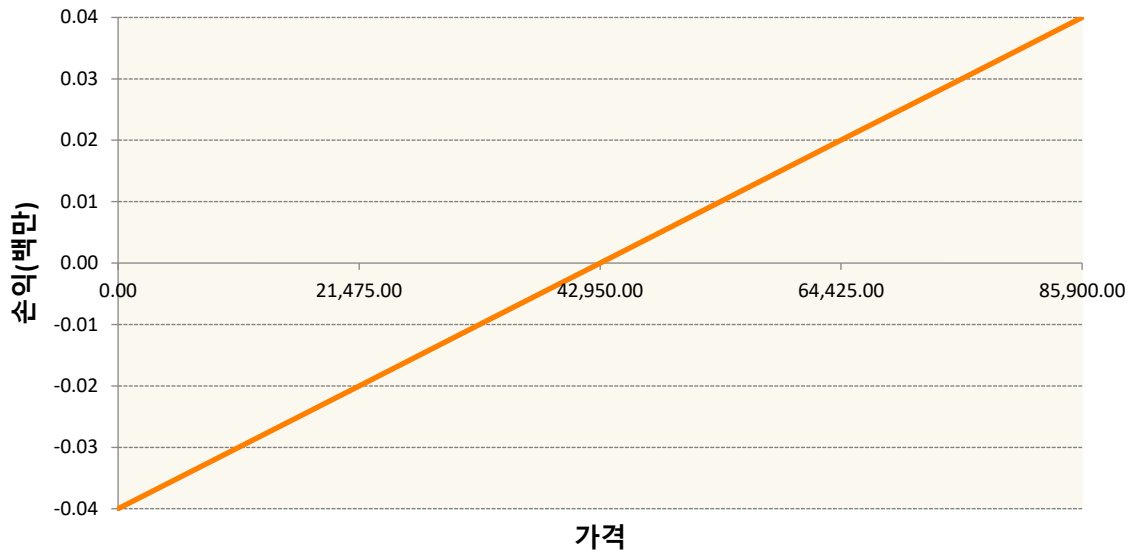
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



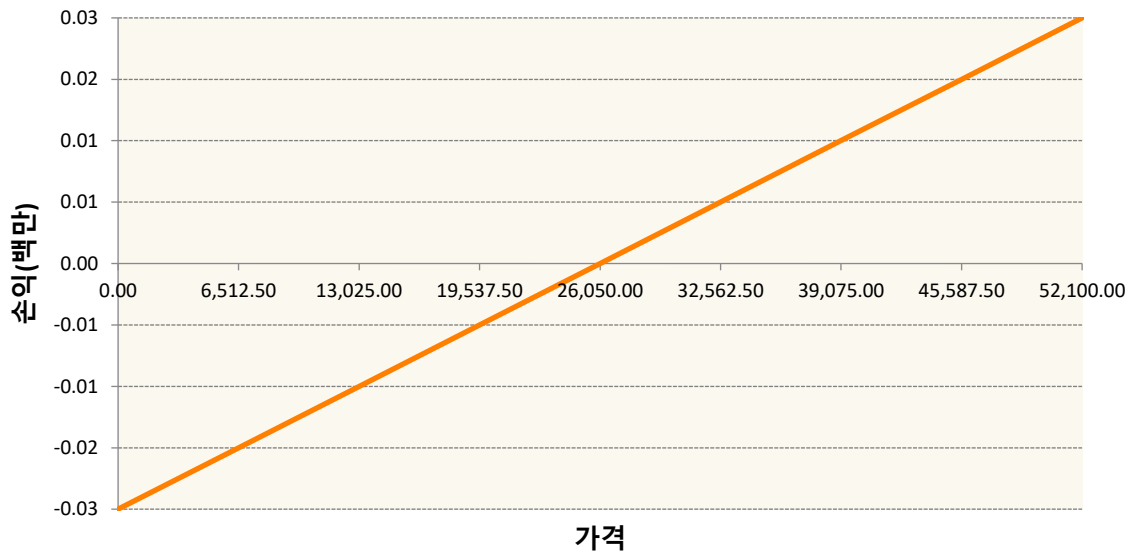
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



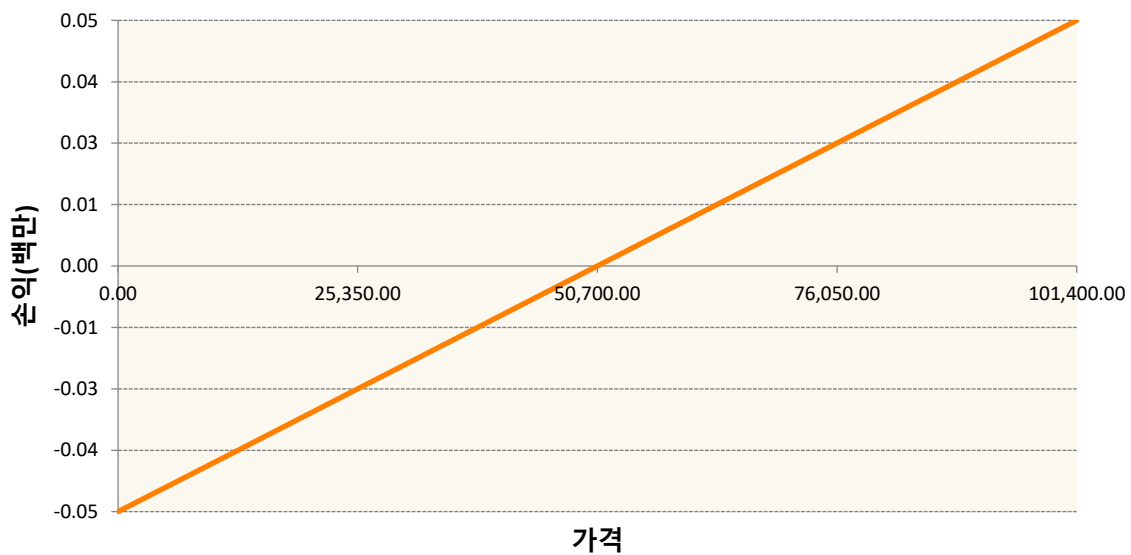
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



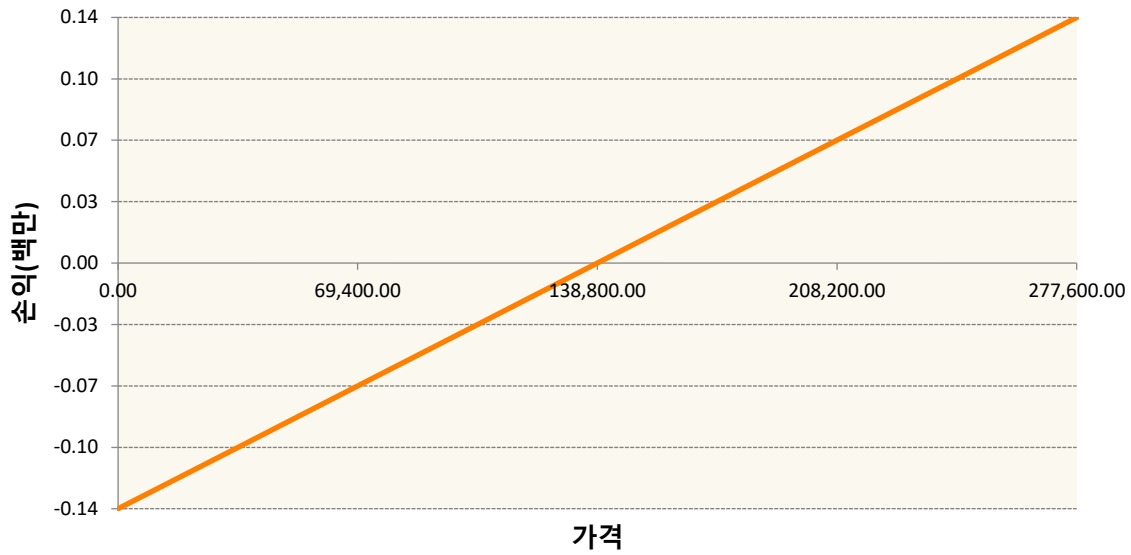
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



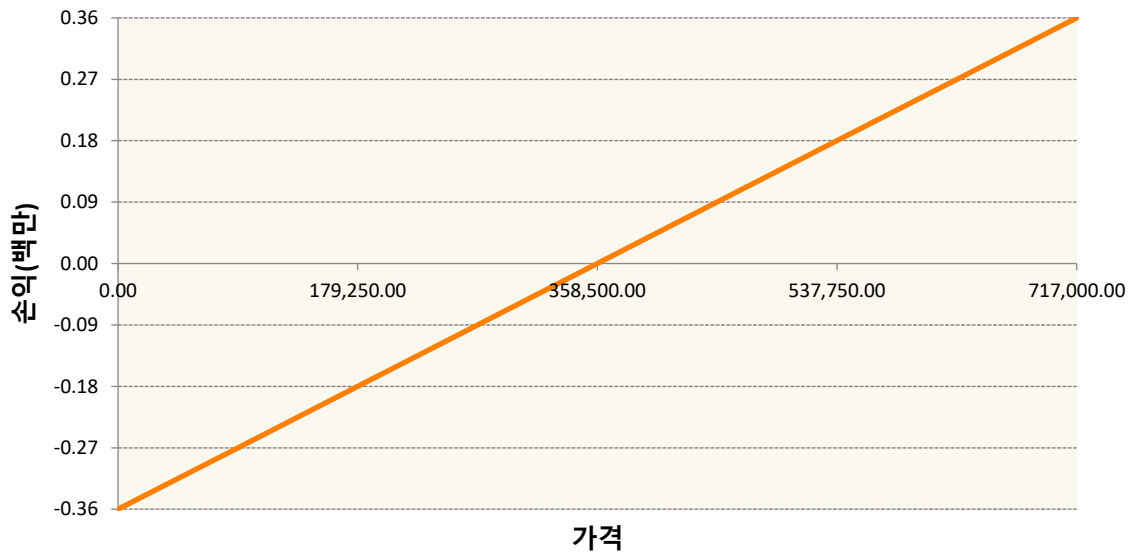
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



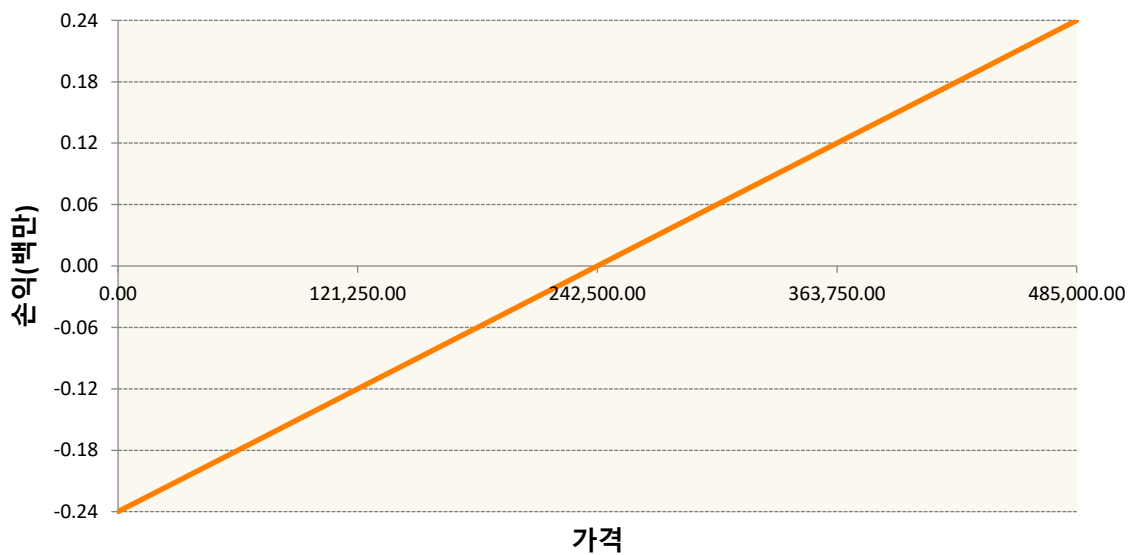
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



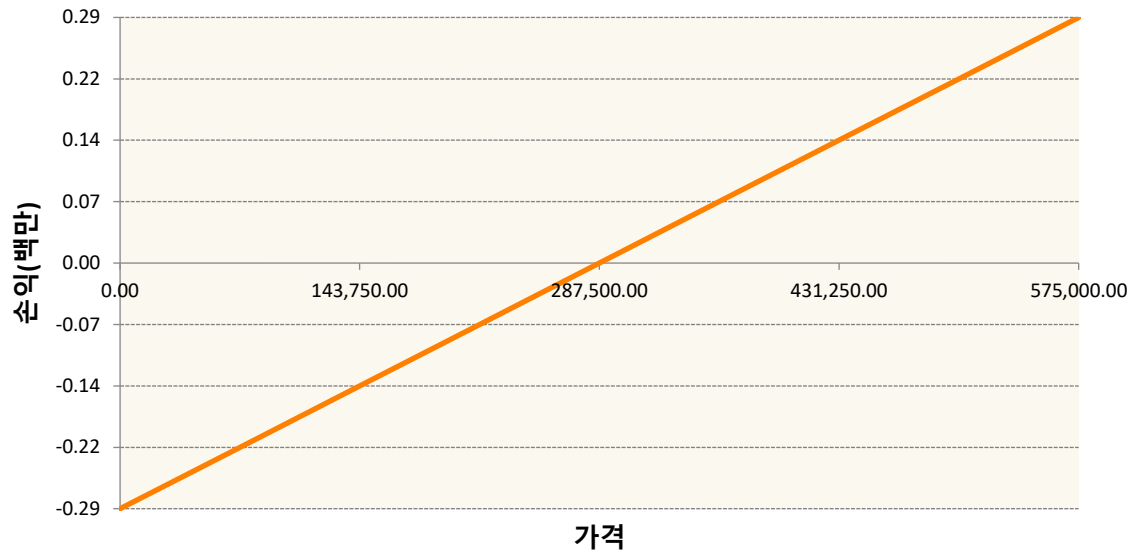
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



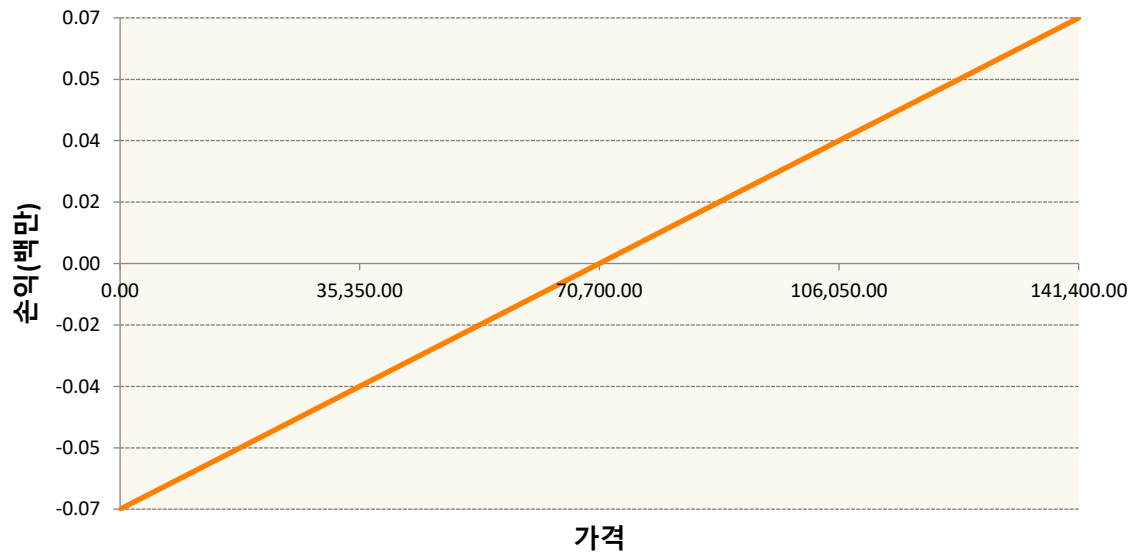
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



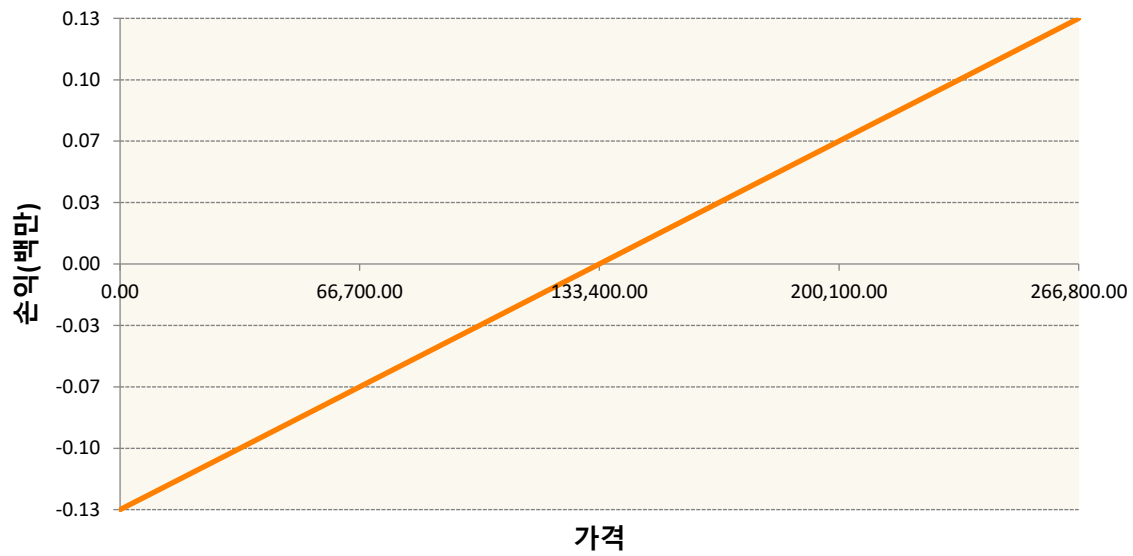
KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



KR41HEW40009-2025-04 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		78
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물		1
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물		4
KR41BHW40 2025-04 한화에어로스페이스개별선물		25
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물		1
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물		16
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물		2
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물		1
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물		5
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물		15
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물		6
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물		8
KR41FVW40(2025-04 한화오션개별선물		7
KR41HEW40(2025-04 키움증권개별선물		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	365

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

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	3,904	0	3,904	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래250320

302

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

465

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

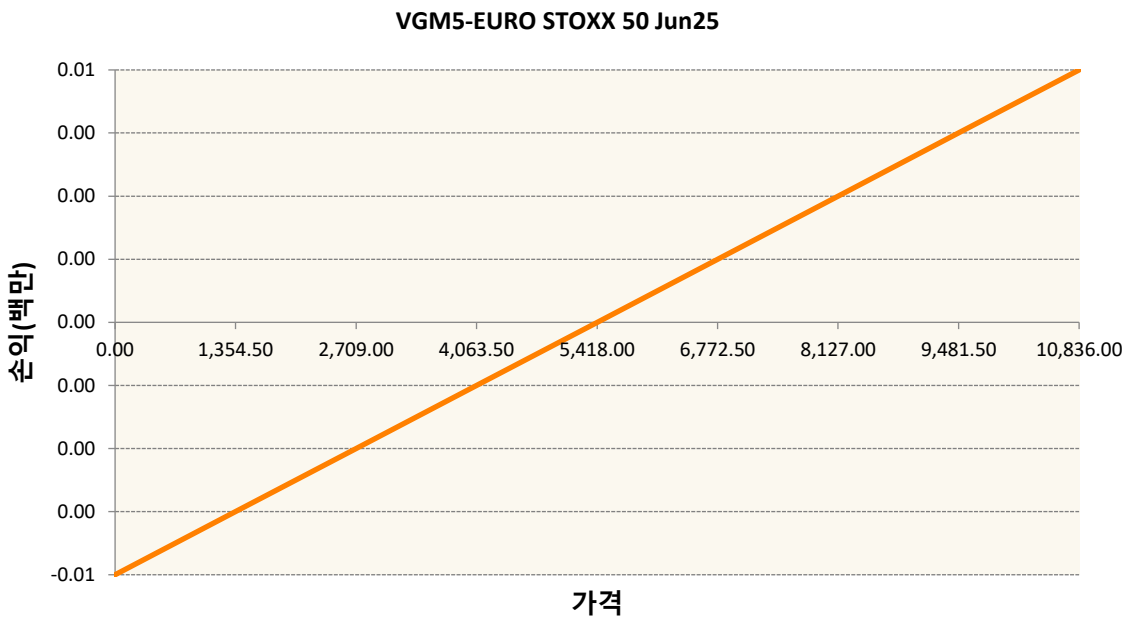
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	947	0	947	

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	2025-03-27
기준일	2025-03-26

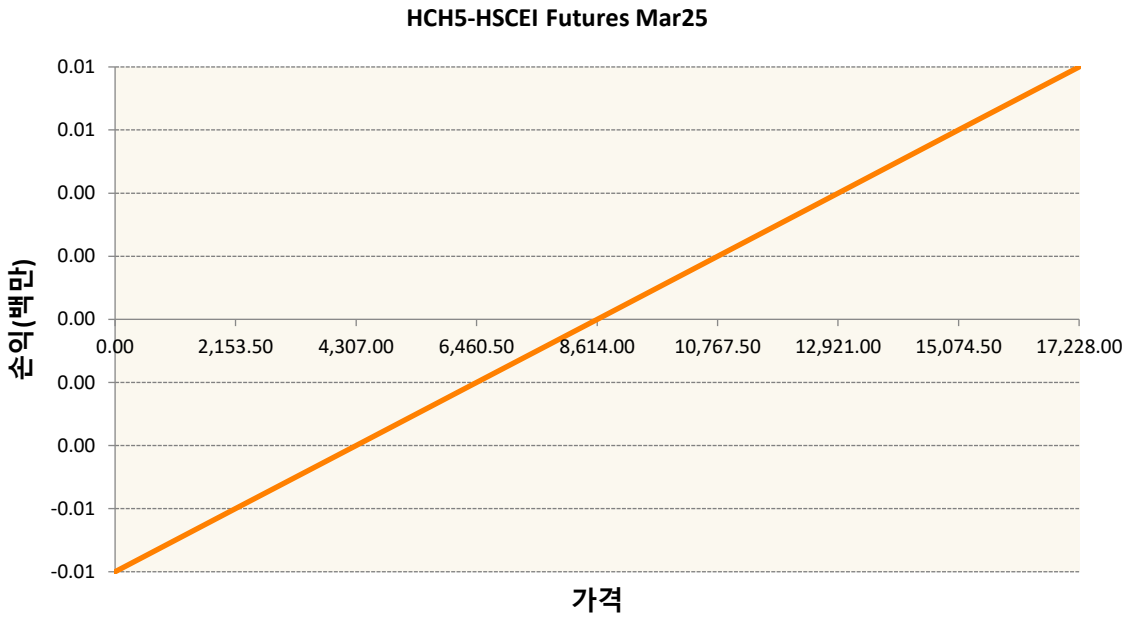
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,876	0	2,876	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH5	HSCEI Futures Mar25	230
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

318

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

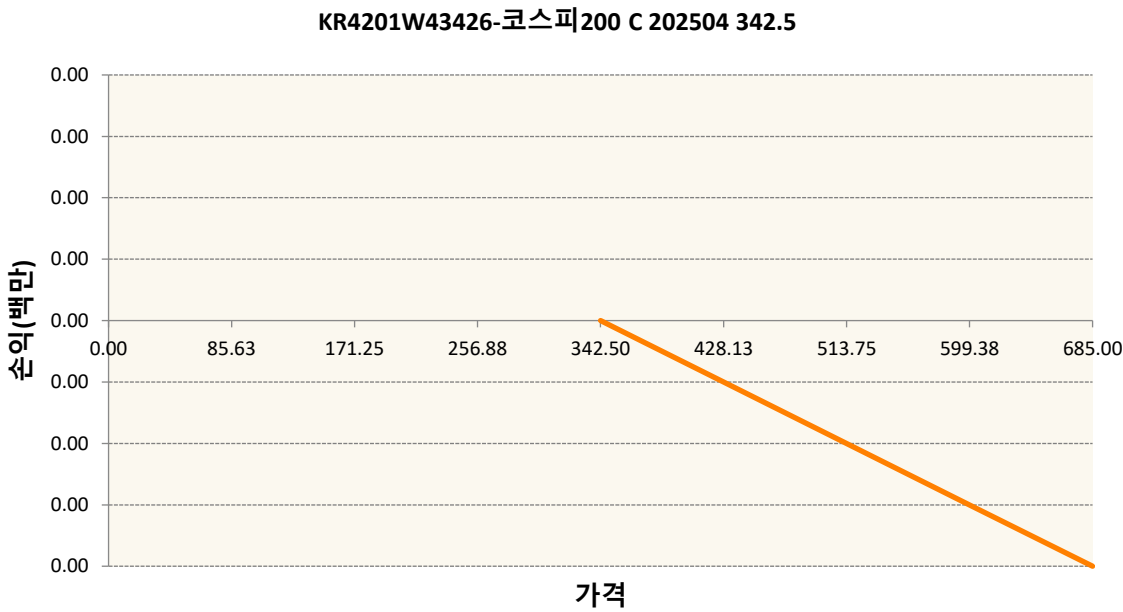
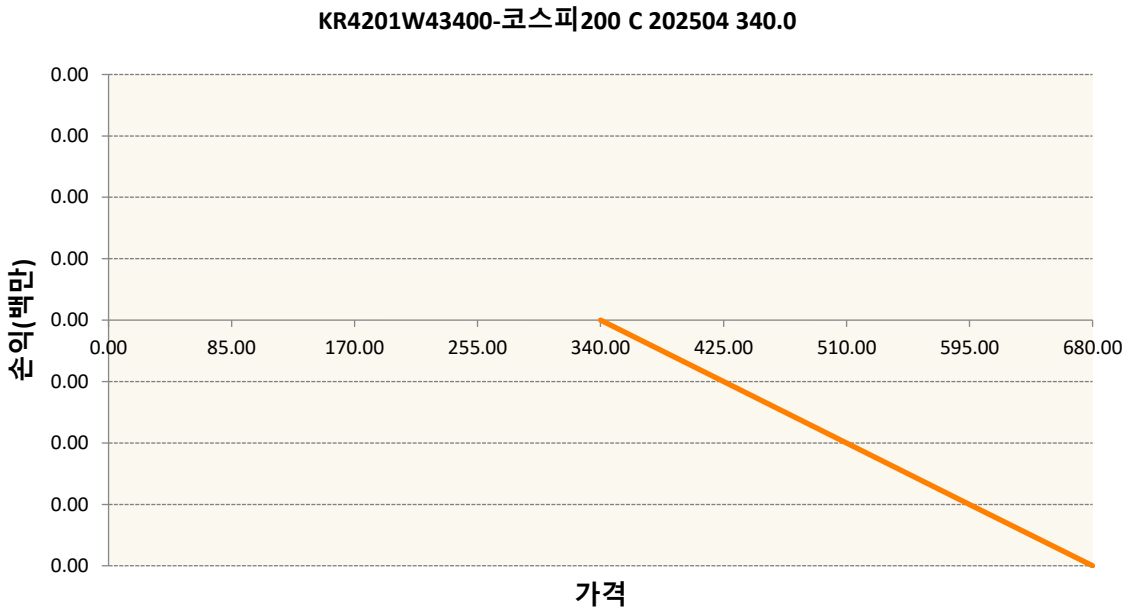
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	170	0	170	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,788	-36,788	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 profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 685.00. The y-axis is labeled '이익(백만 원)' (Profit in millions of won) and ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at (0, 0) and ends at (342.50, 0.00), indicating that profit is zero at this price point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions of won)
0.00	0.00
342.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201W43400							코스피200 C 202504 340.0		1,034
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	605	594	583	570	556	542	527		
-5.33%	518	500	481	462	442	423	404		
-2.67%	325	307	289	270	251	232	213		
0%	34	24	13	0	-13	-28	-43		
2.67%	-309	-312	-317	-323	-330	-338	-347		
5.33%	-667	-668	-669	-671	-674	-678	-683		
8.00%	-1,029	-1,029	-1,029	-1,029	-1,030	-1,032	-1,034		
KR4201W43426							코스피200 C 202504 342.5		1,336
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	707	696	683	669	653	636	619
-5.33%	621	599	575	552	528	503	479
-2.67%	407	381	355	330	304	278	252
0%	53	37	19	0	-20	-41	-63
2.67%	-384	-390	-399	-408	-420	-433	-448
5.33%	-852	-853	-856	-860	-865	-871	-879
8.00%	-1,326	-1,326	-1,327	-1,328	-1,330	-1,332	-1,336

KR4301W43408

코스피200 P 202504 340.0

120

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-104	-106	-108	-111	-114	-117	-120
-5.33%	-44	-48	-52	-56	-61	-65	-69
-2.67%	-8	-12	-16	-20	-24	-28	-32
0%	7	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	11	11	10	8	7	5	3
5.33%	12	12	12	11	11	10	9
8.00%	12	12	12	12	12	12	11

KR4301W43424

코스피200 P 202504 342.5

177

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-160	-163	-166	-169	-173	-177
-5.33%	-72	-77	-82	-87	-93	-98	-103
-2.67%	-15	-21	-26	-32	-38	-43	-49
0%	12	8	4	0	-4	-9	-14
2.67%	20	19	17	15	12	9	6
5.33%	22	21	21	20	19	17	16
8.00%	22	22	22	21	21	20	20

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

(단위:백만원)

2,822

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

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	556	0	556	

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	2025-03-27
기준일	2025-03-26

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	4,471	0	4,471	

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	2025-03-27
기준일	2025-03-26

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	13,136	0	13,136	
누계	통화	선도	367	13,050	-12,683	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213ECT(KRW/USD 31-03-25E		262
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E		213
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E		217
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E		352
FXW213F3C(USD/KRW 31-03-25E		29
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	465

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

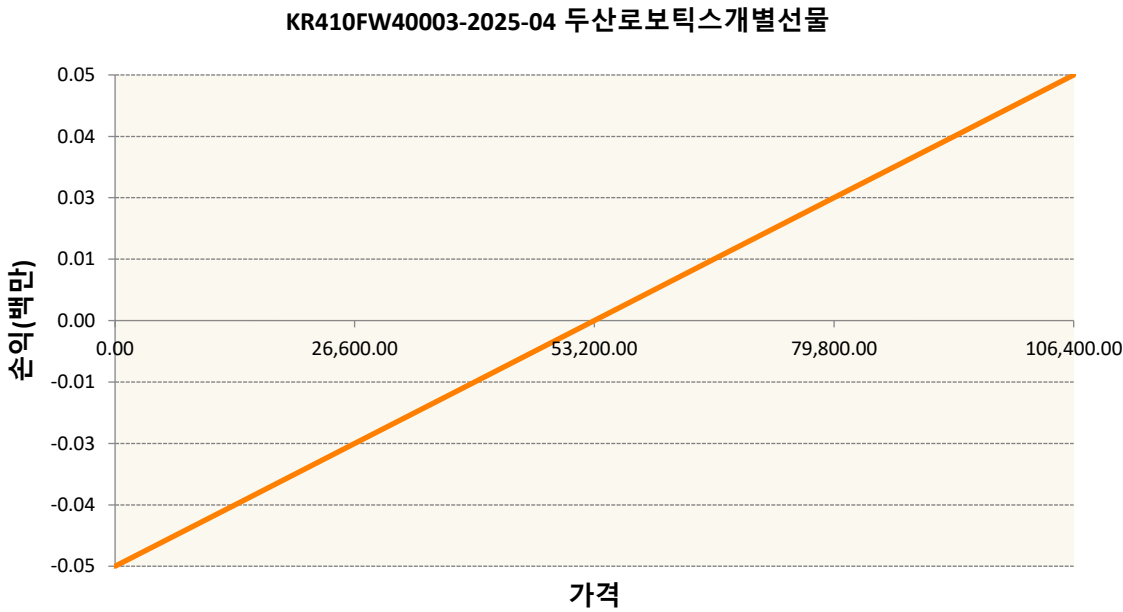
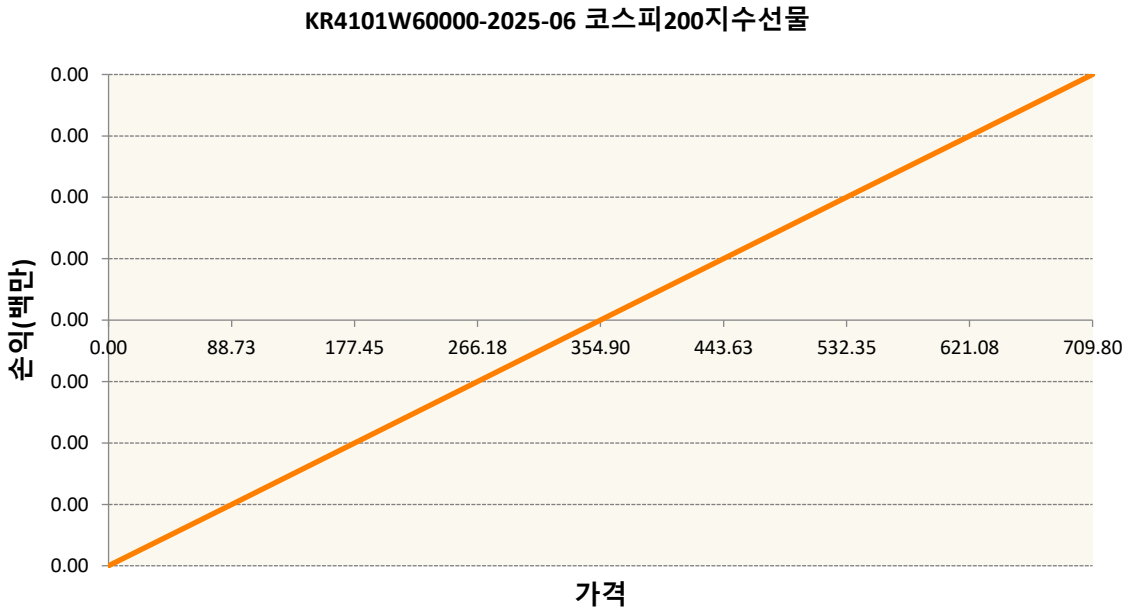
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

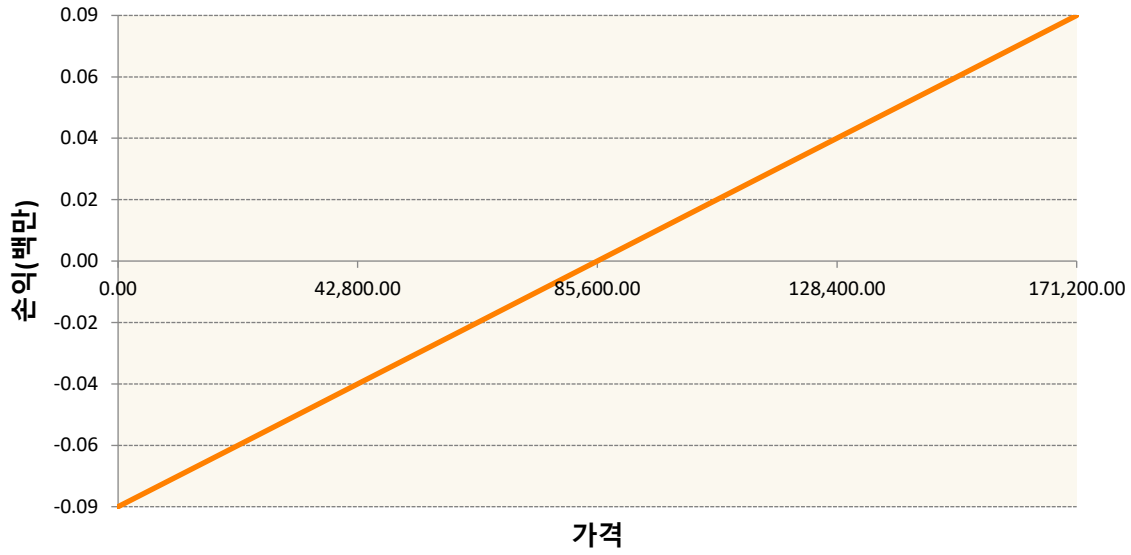
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,154	0	1,154	장내

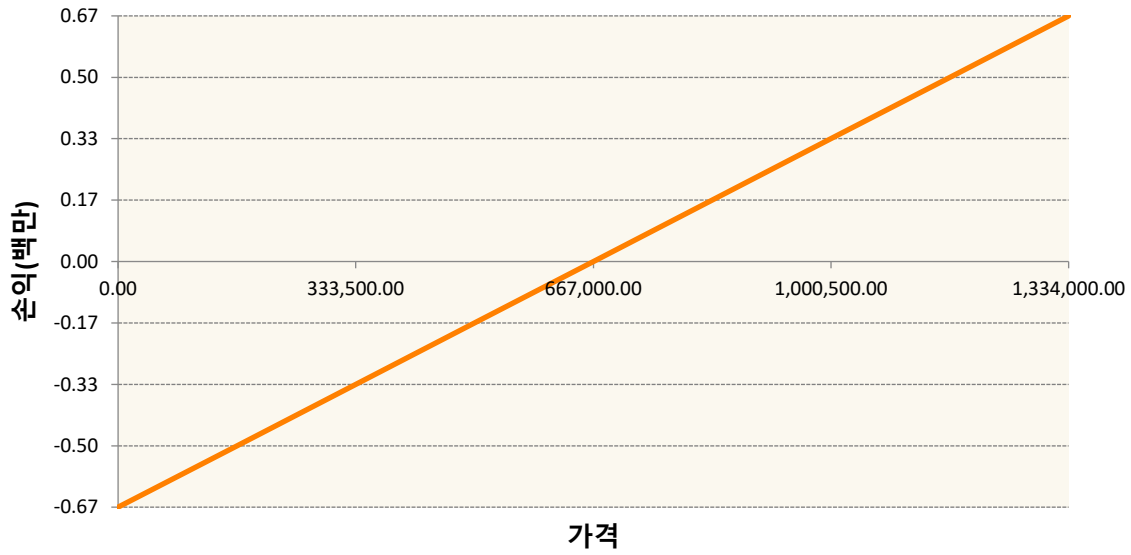
2. 만기시점의 손익구조



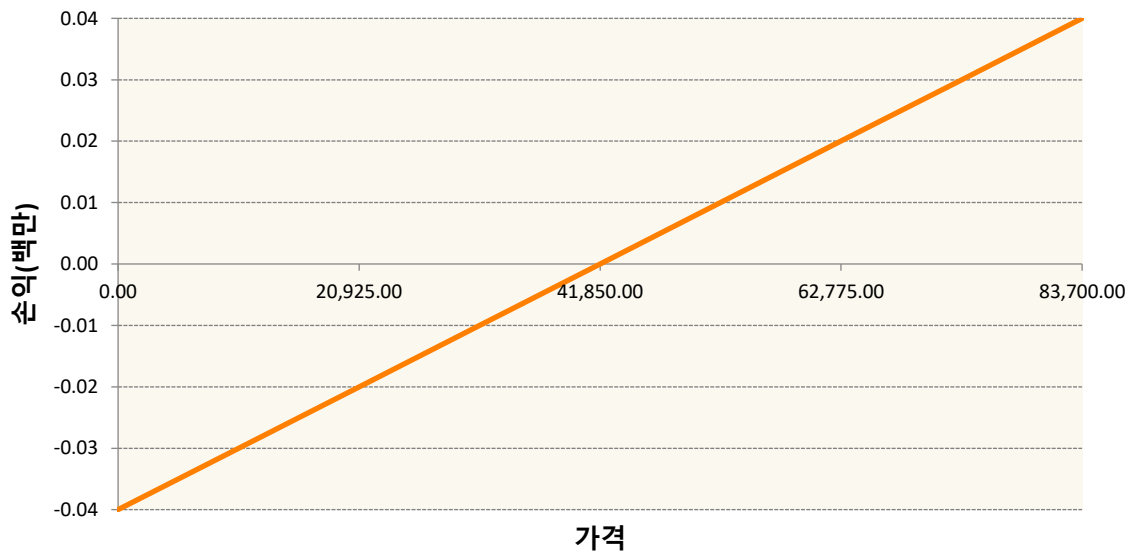
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



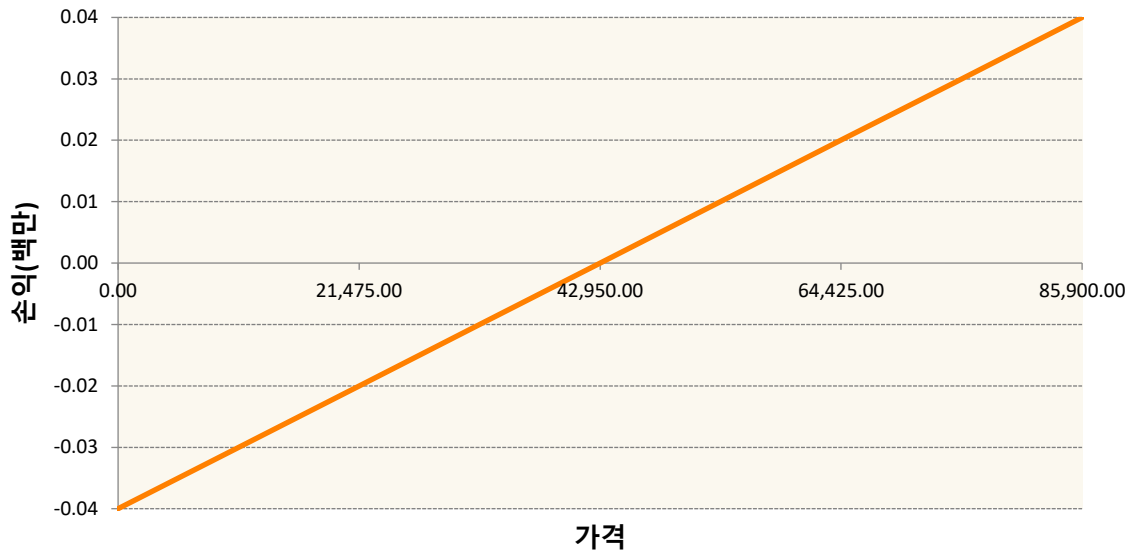
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



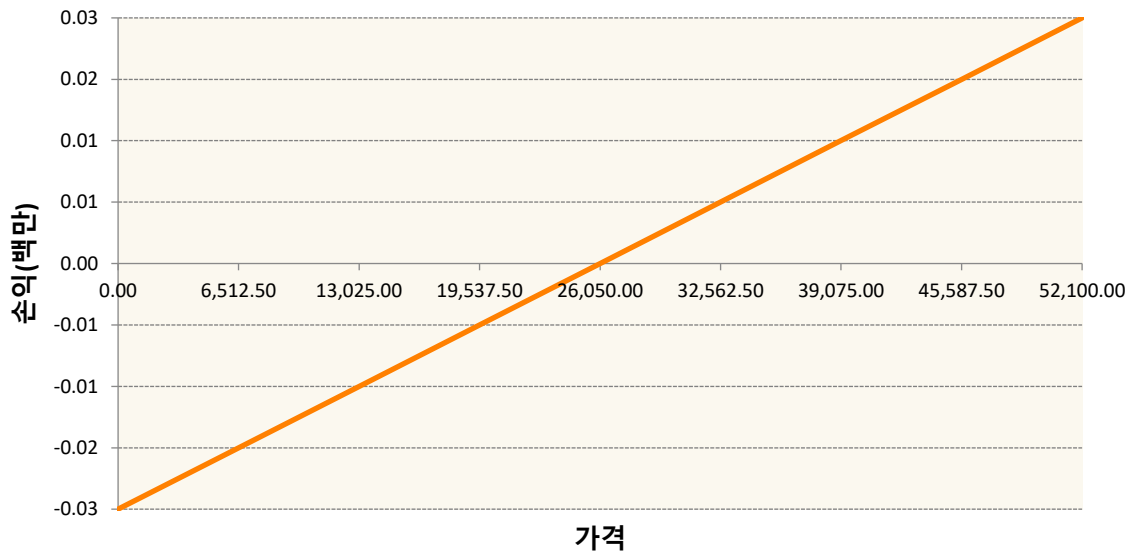
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



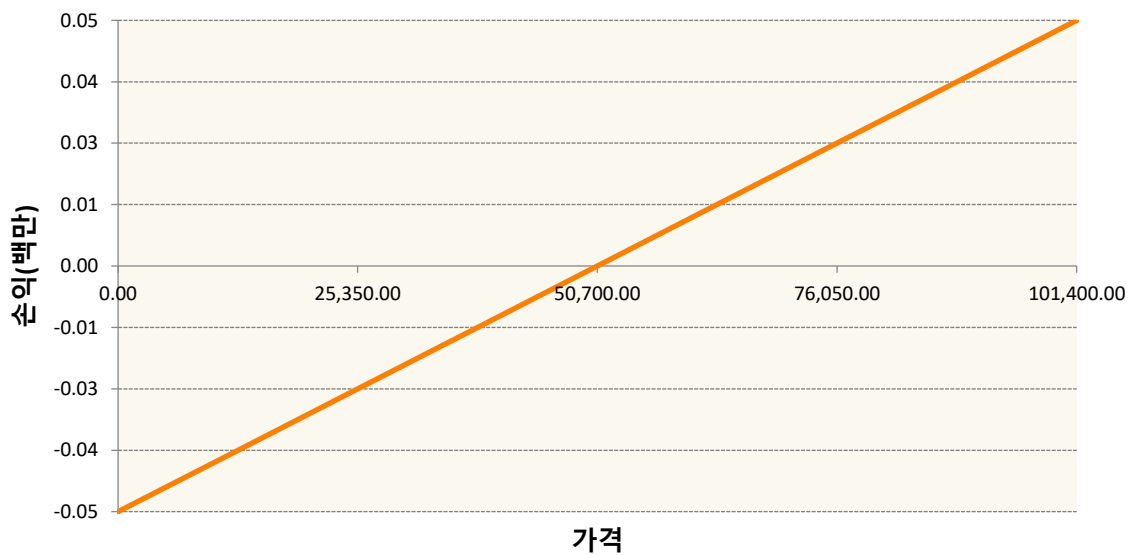
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



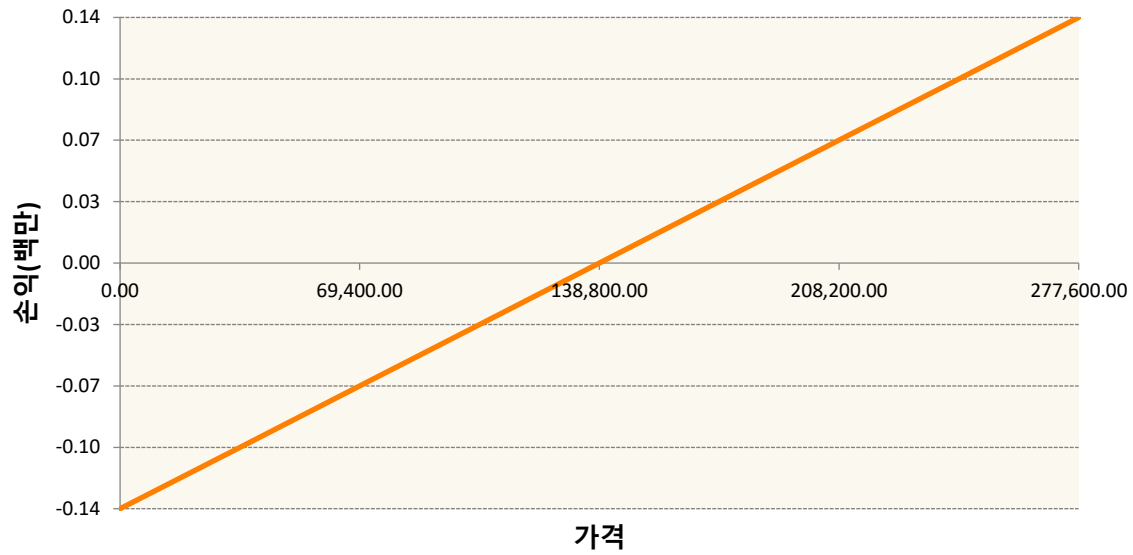
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



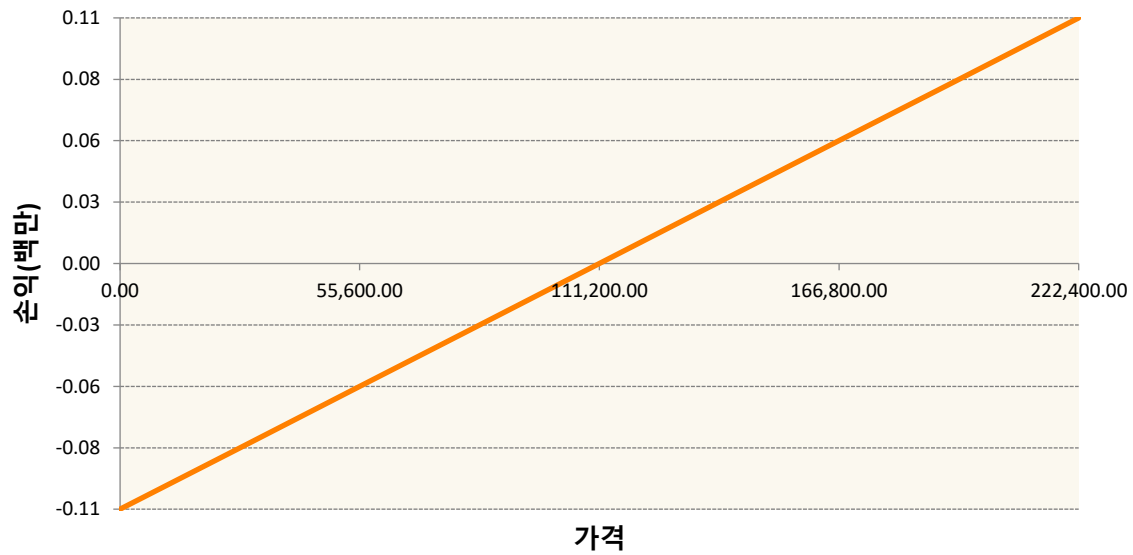
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



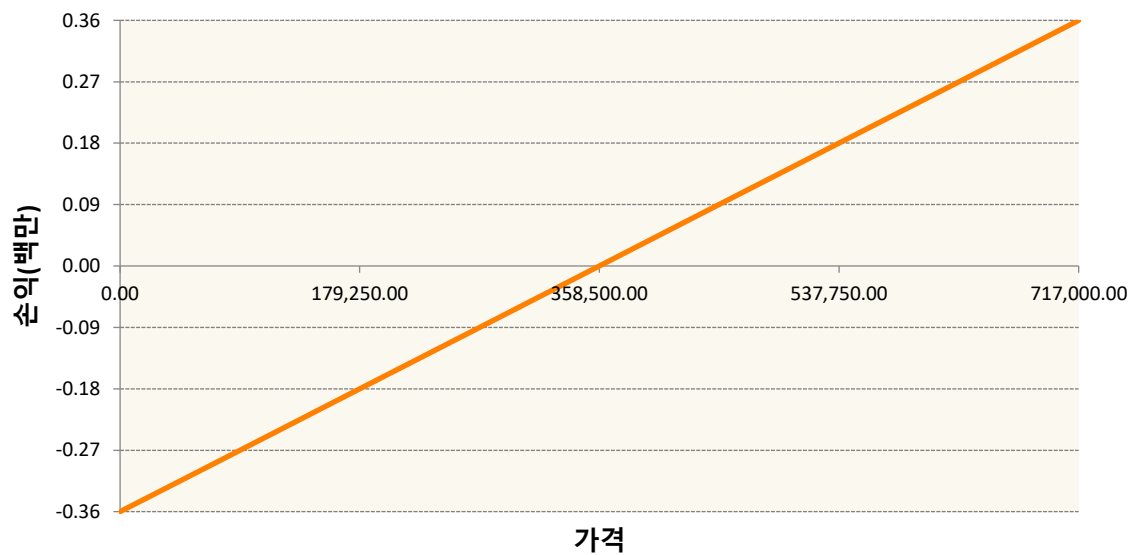
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



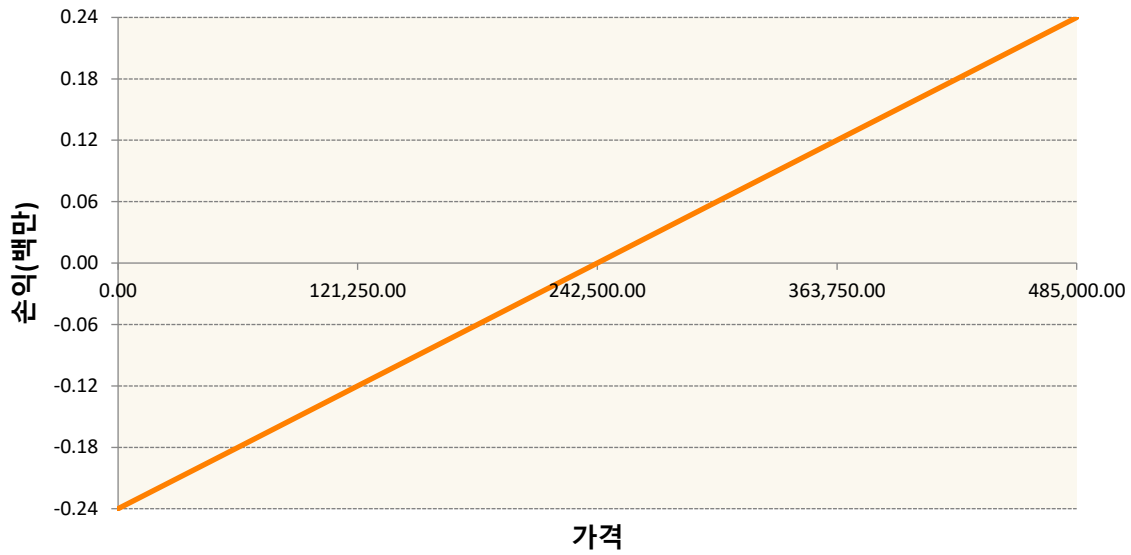
KR41EYW40004-2025-04 에코프로비엠개별선물



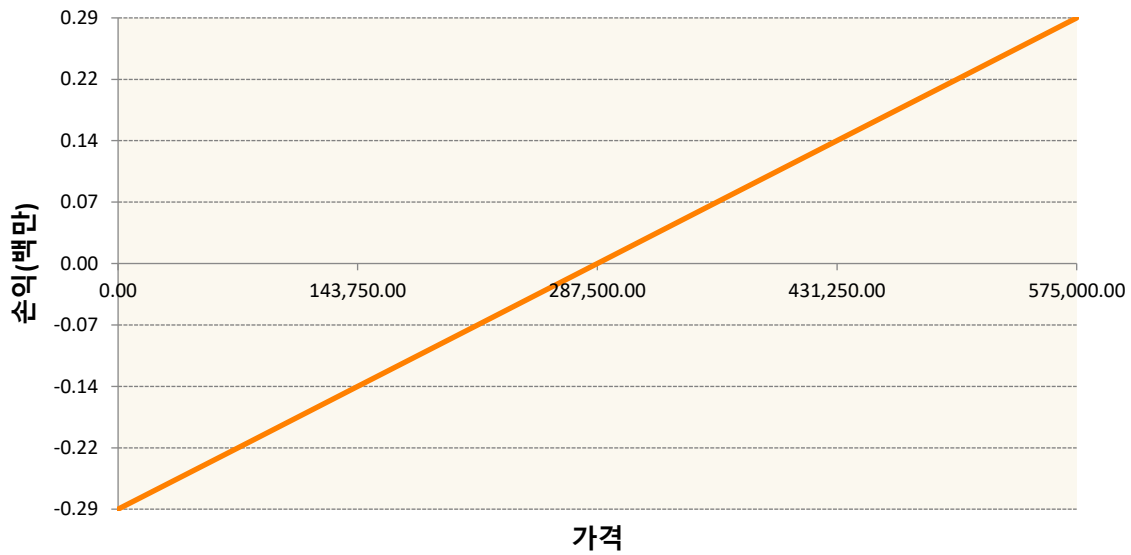
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



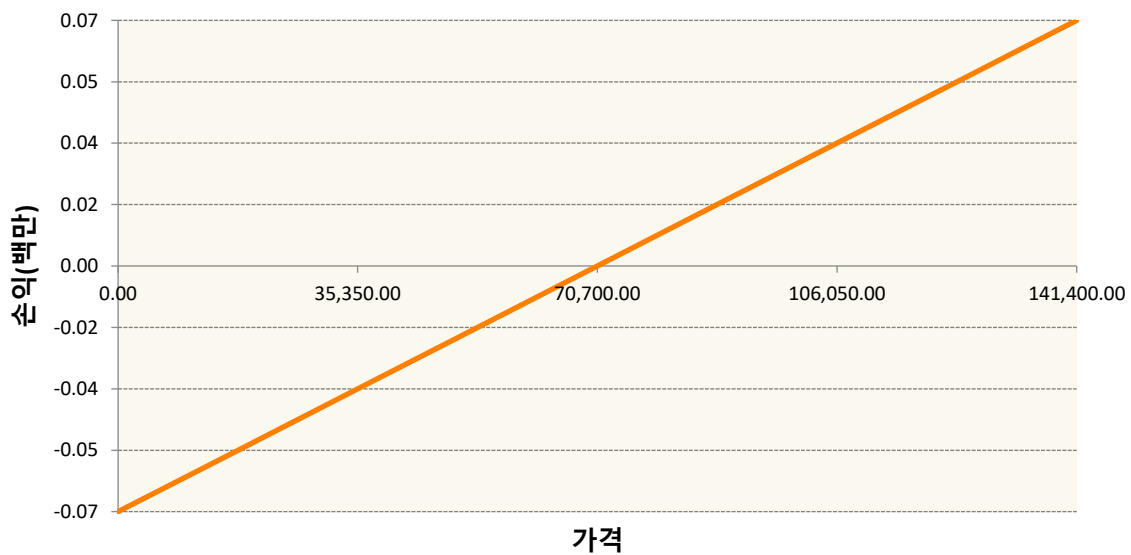
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



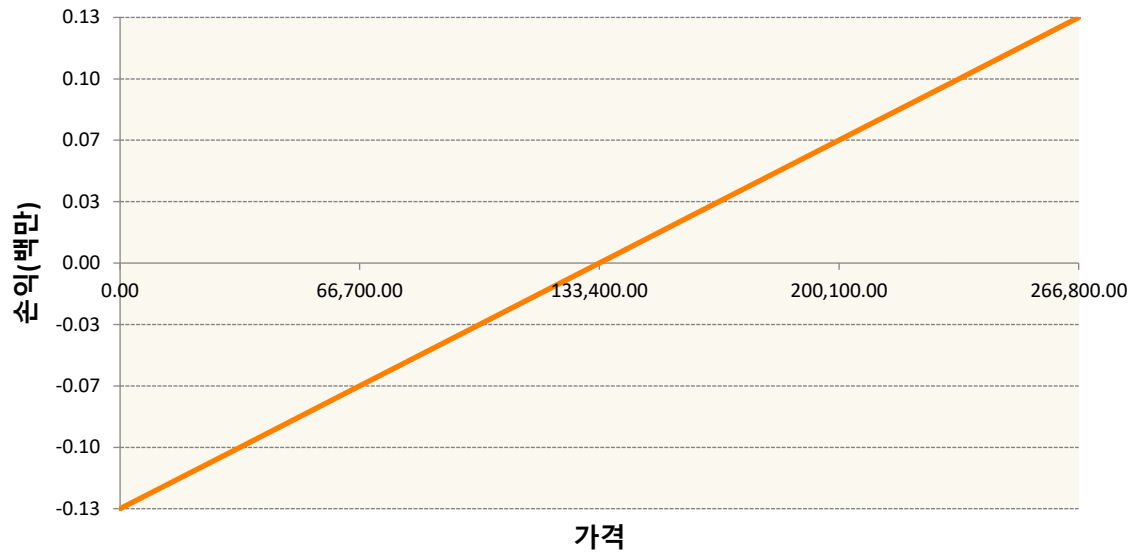
KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



KR41HEW40009-2025-04 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	50
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	2
KR41BHW40 2025-04 한화에어로스페이스개별선물	11
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물	1
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물	7
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	3
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	3
KR41FVW40(2025-04 한화오션개별선물	3
KR41HEW40(2025-04 키움증권개별선물	1

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

(단위:백만원)

186

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

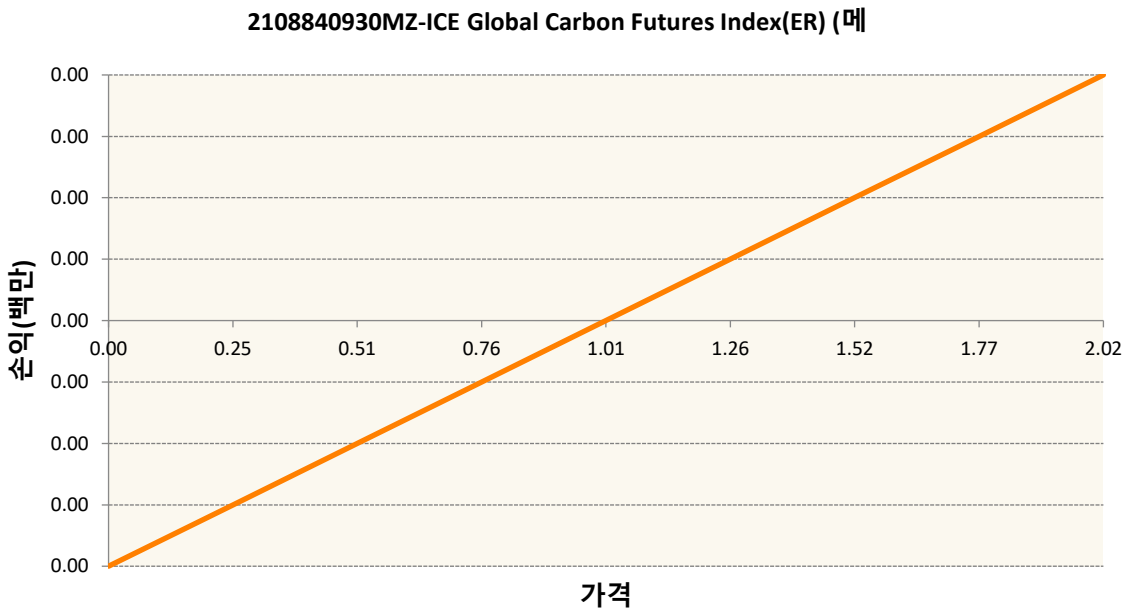
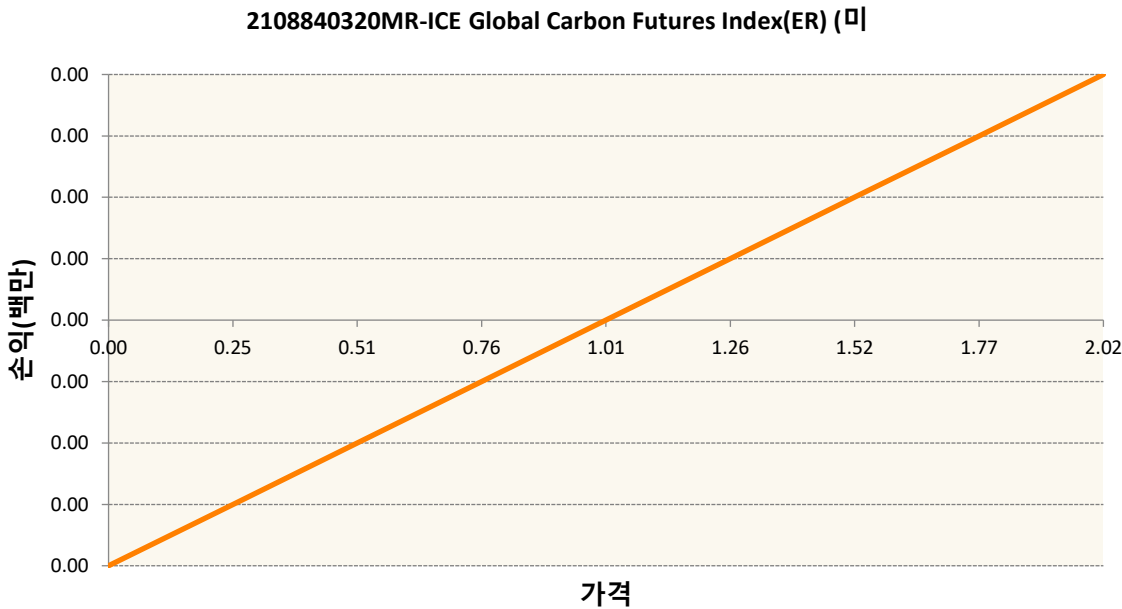
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,937	0	9,937	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	594
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	199

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	892

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

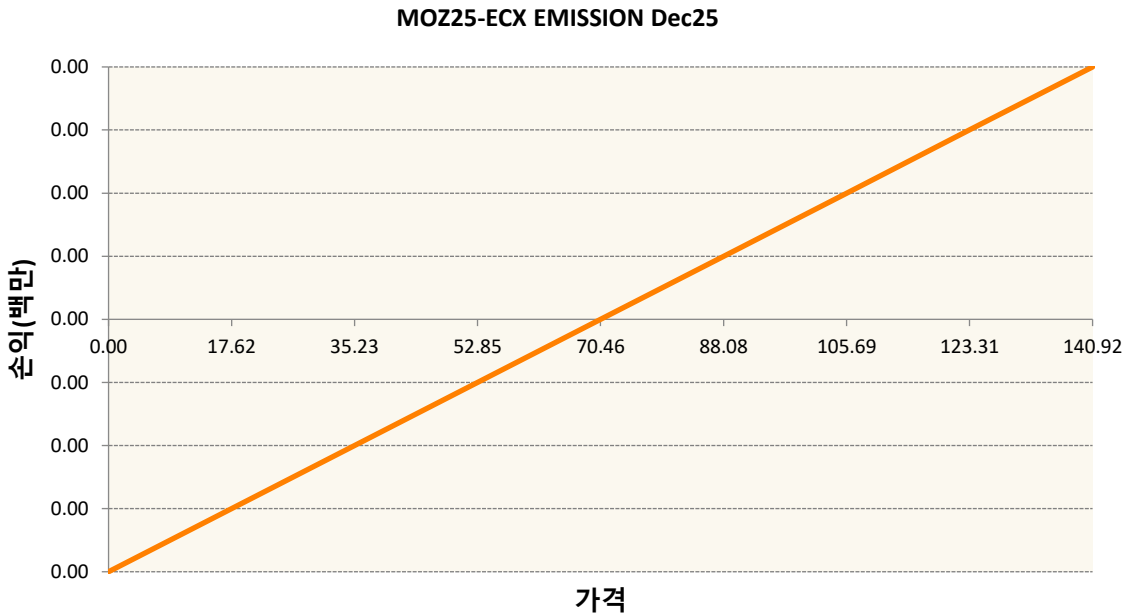
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,355	0	5,355	
누계	통화	선도	0	1,039	-1,039	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	0.36
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	83
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	429

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

(단위:백만원)

790

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

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	4,362	0	4,362	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	2025-03-27
기준일	2025-03-26

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	8,845	0	8,845	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	13
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

60

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

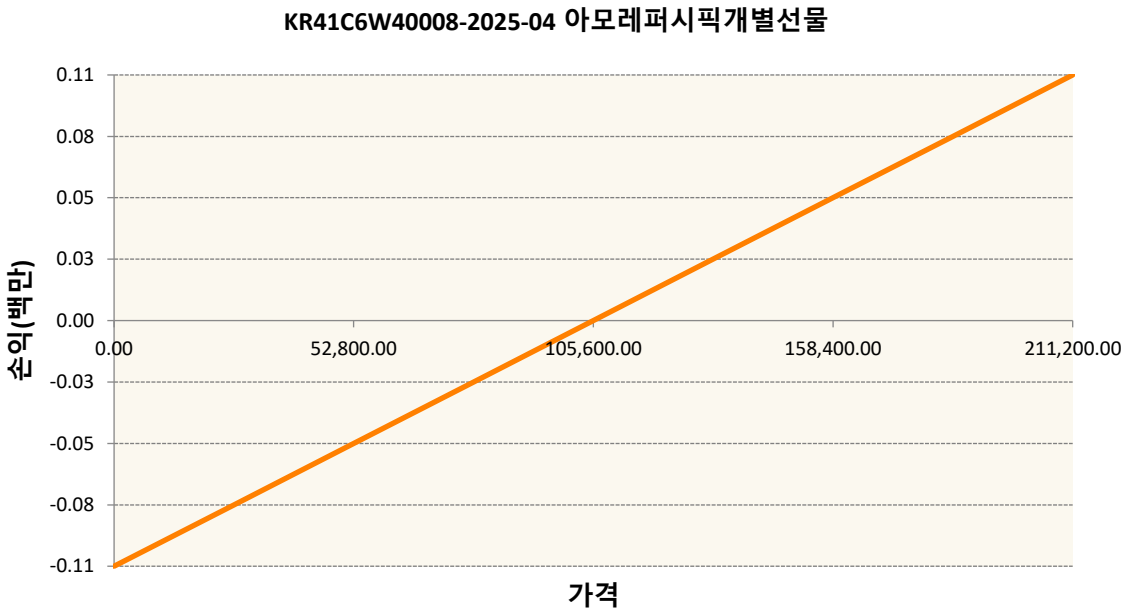
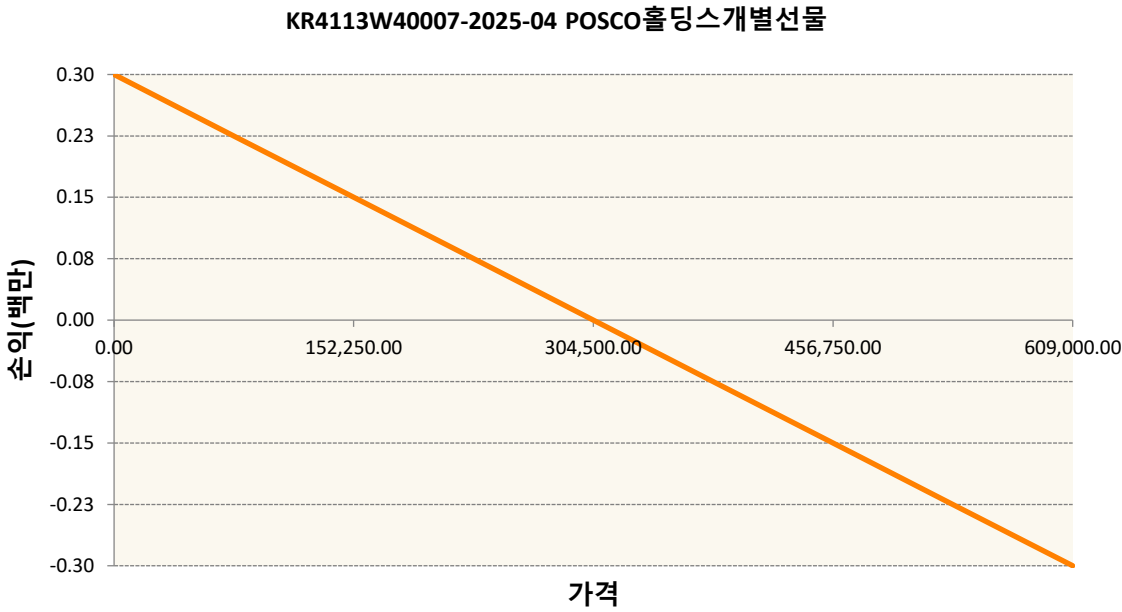
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

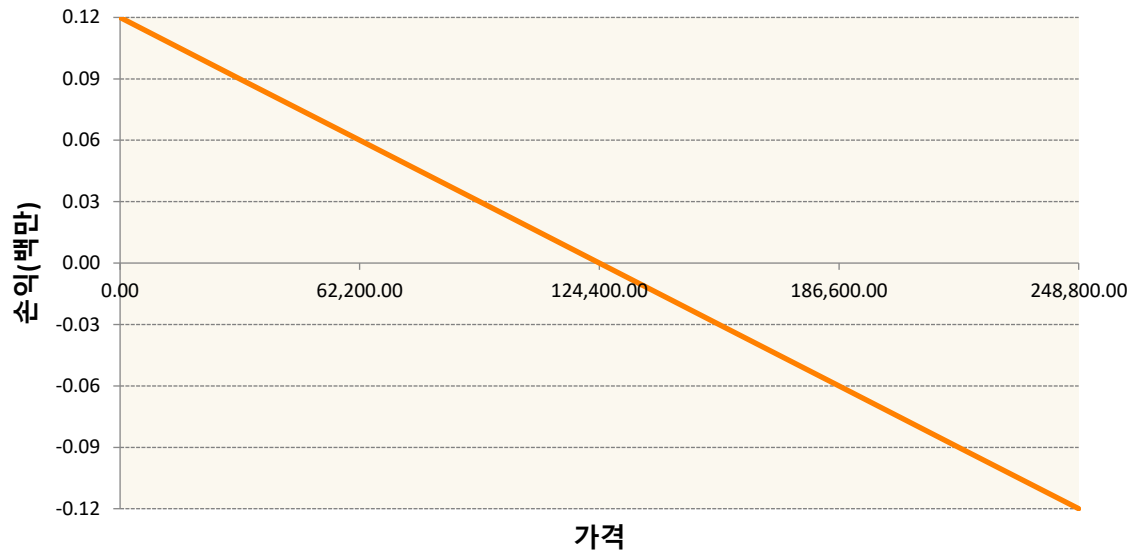
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5	38	-33	장내

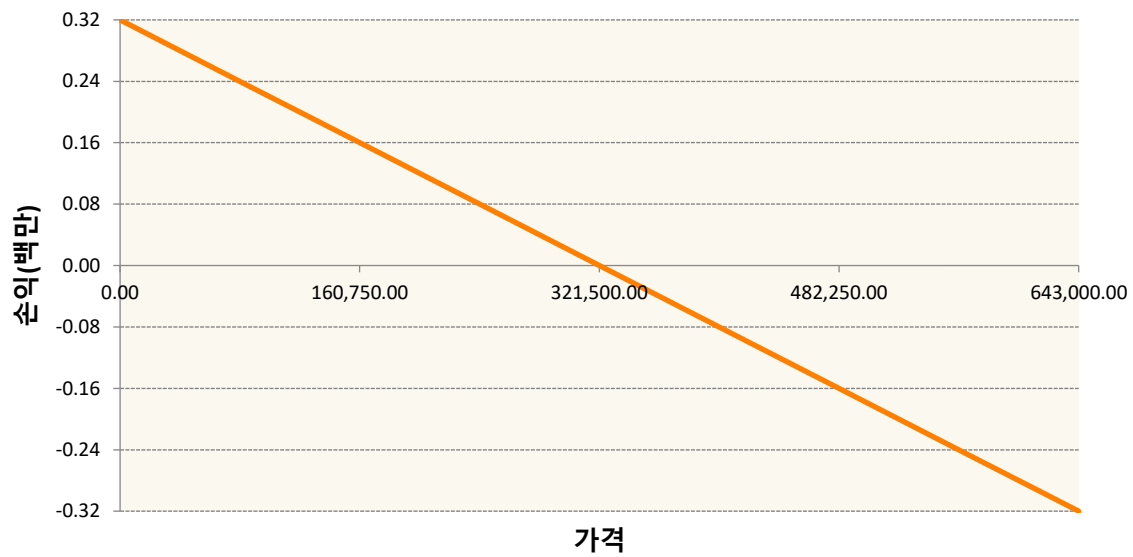
2. 만기시점의 손익구조



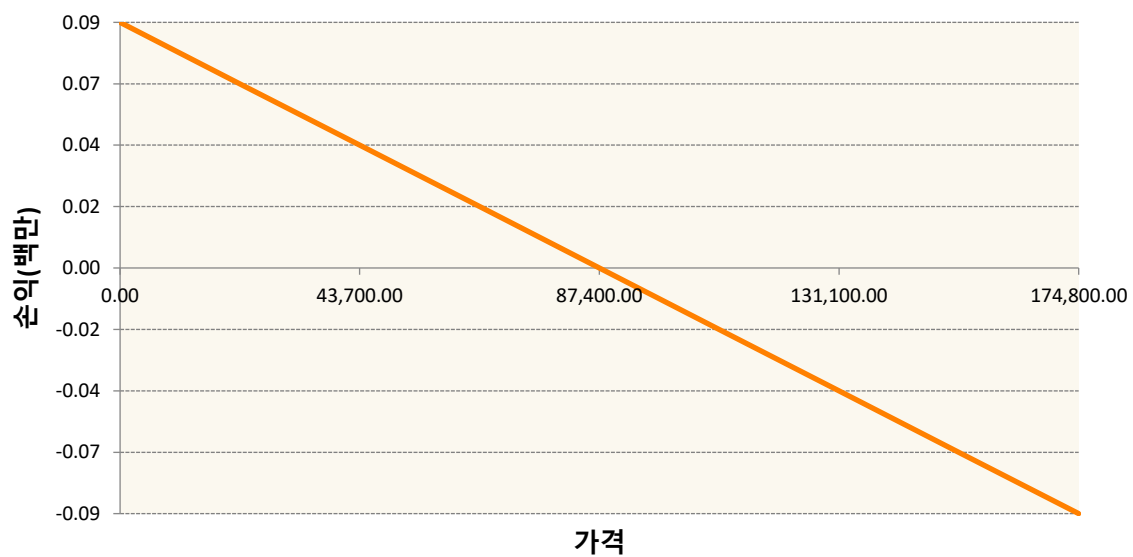
KR41C8W40004-2025-04 삼성물산개별선물



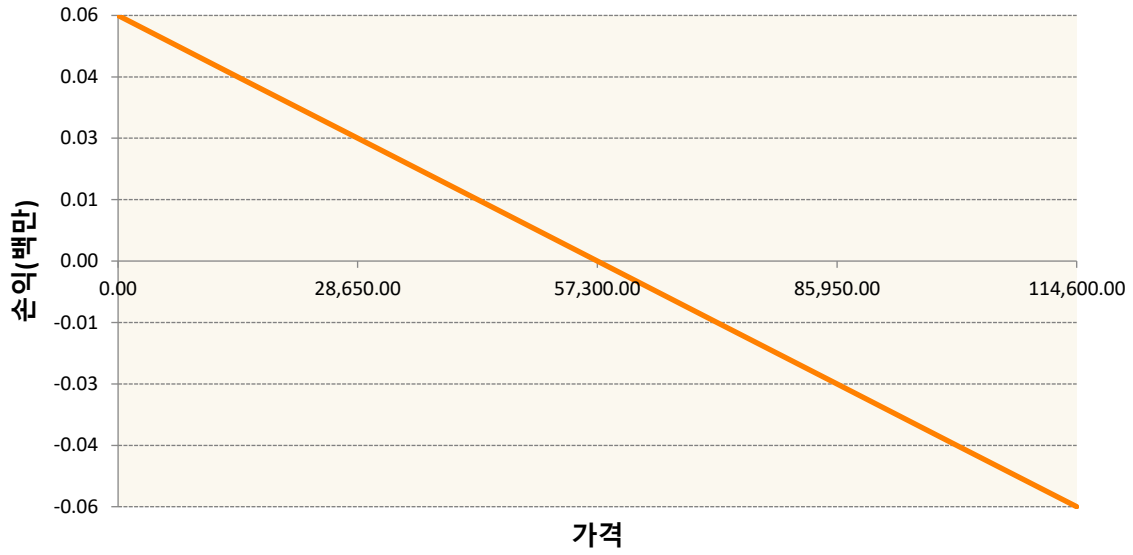
KR41CRW40002-2025-04 LG생활건강개별선물



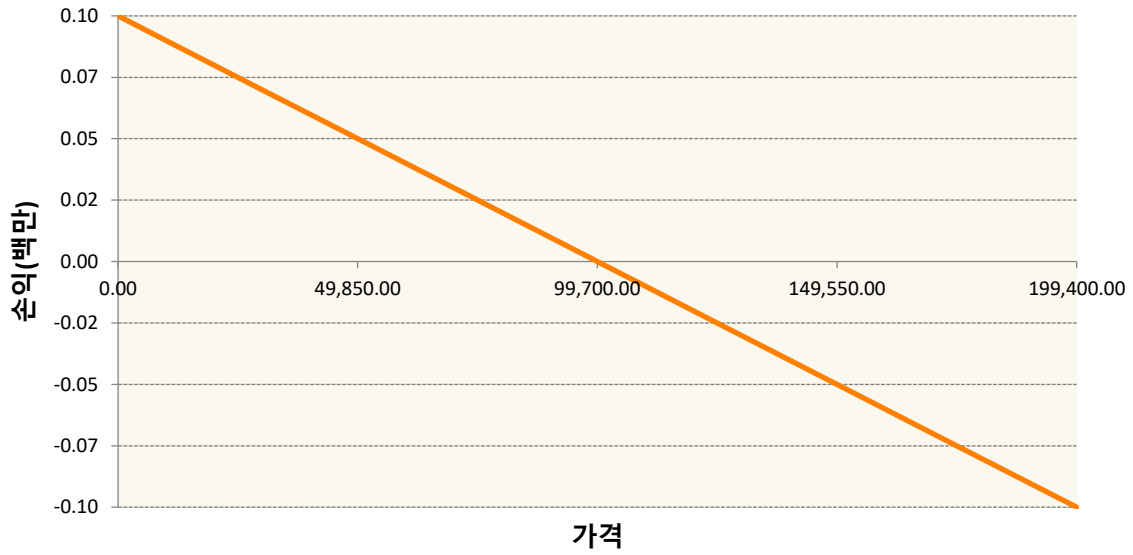
KR41CWW40002-2025-04 코웨이개별선물



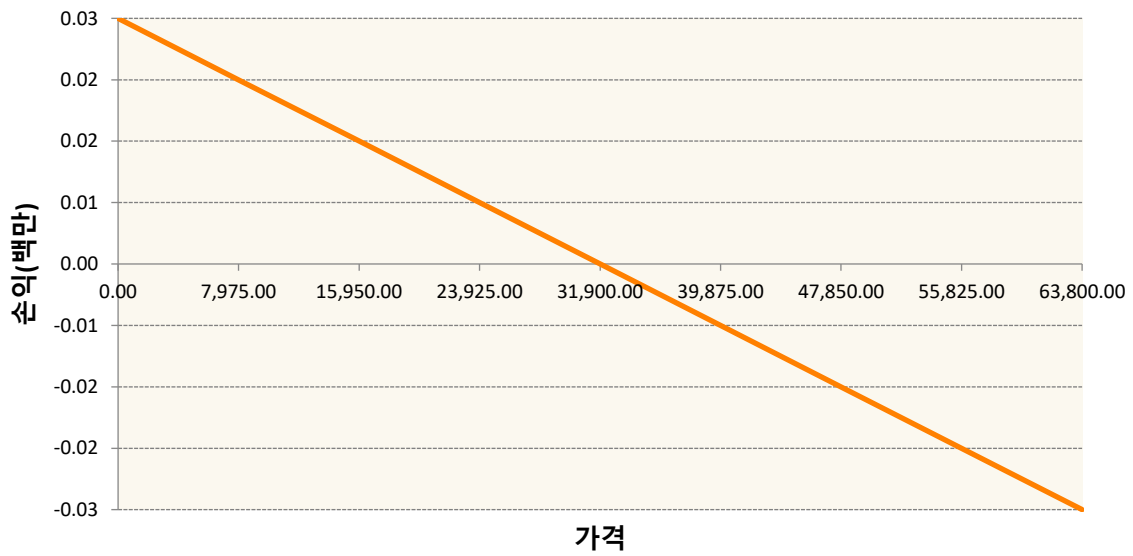
KR41DTW40006-2025-04 CJ ENM개별선물



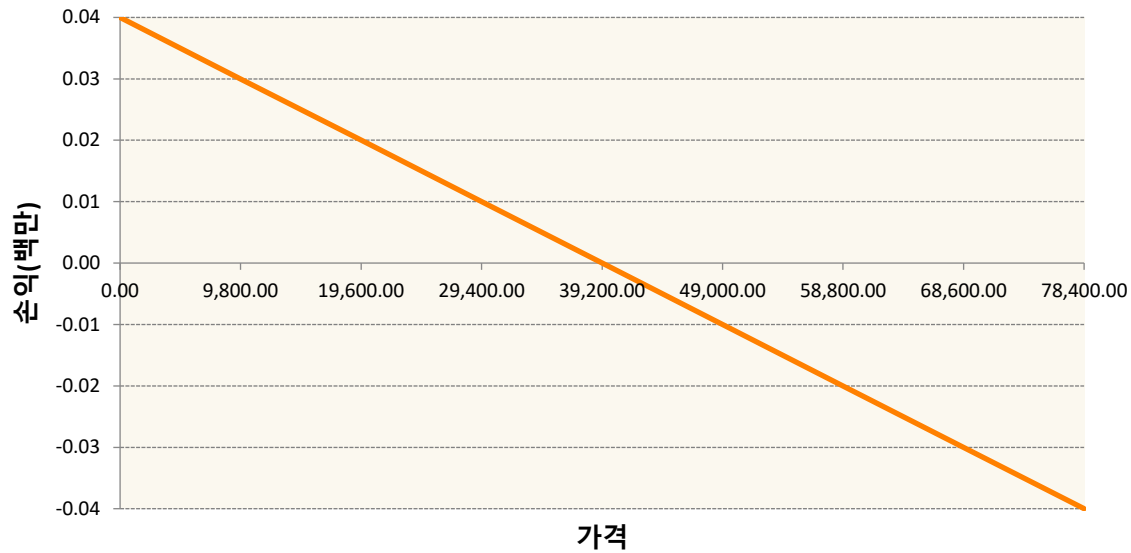
KR41FEW40003-2025-04 SK스퀘어개별선물



KR41FLW40008-2025-04 펄어비스개별선물



KR41GYW40009-2025-04 에스엘개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4113W40(2025-04 POSCO홀딩스개별선물	0.24
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	0.42
KR41C8W40(2025-04 삼성물산개별선물	0.3
KR41CRW40(2025-04 LG생활건강개별선물	1
KR41CWW40(2025-04 코웨이개별선물	0.49
KR41DTW40(2025-04 CJ ENM개별선물	0.28
KR41FEW40(2025-04 SK스퀘어개별선물	0.32
KR41FLW40(2025-04 펄어비스개별선물	0.41
KR41GYW40 2025-04 에스엘개별선물	1

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

(단위:백만원)

8

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

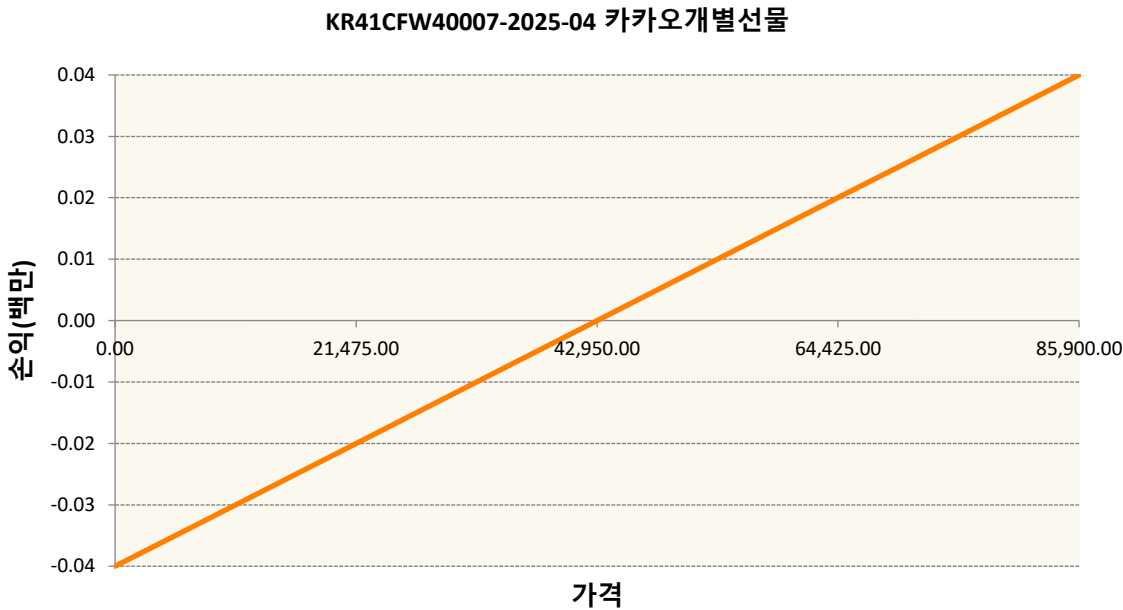
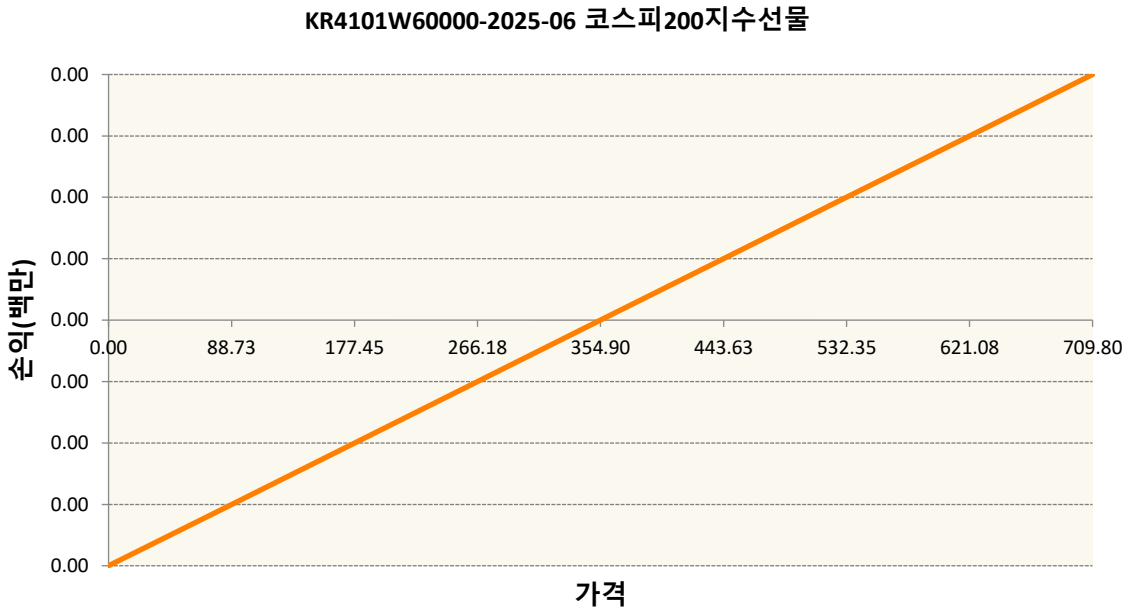
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

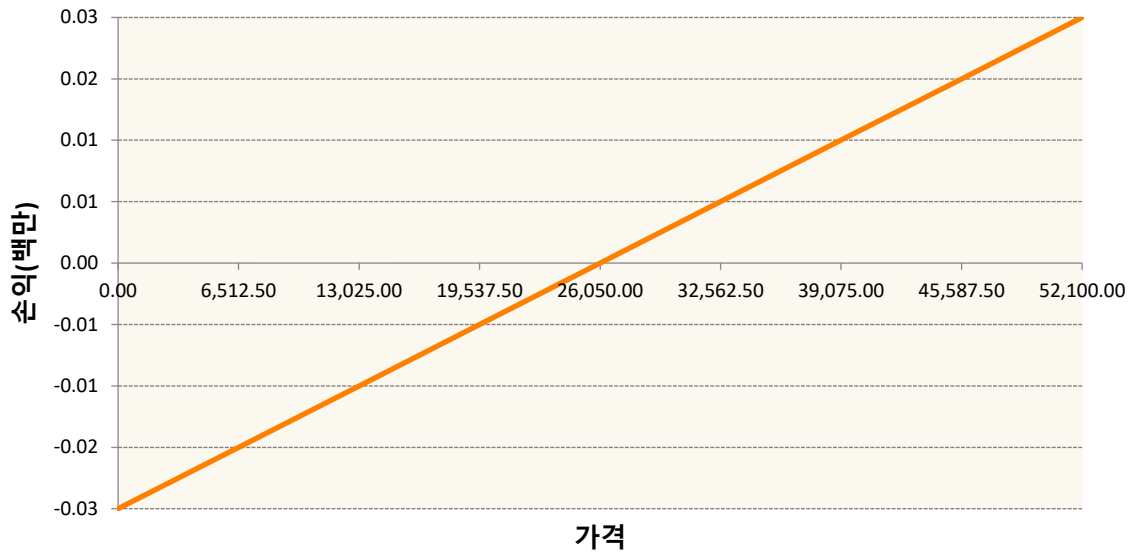
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	89	0	89	장내
누계	유가증권	선물	10,973	0	10,973	장내

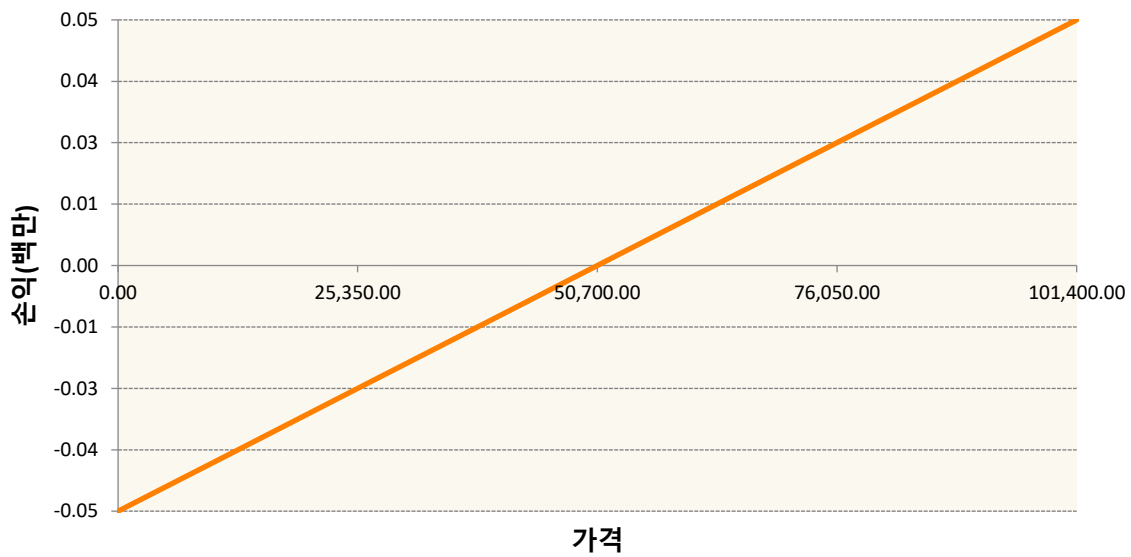
2. 만기시점의 손익구조



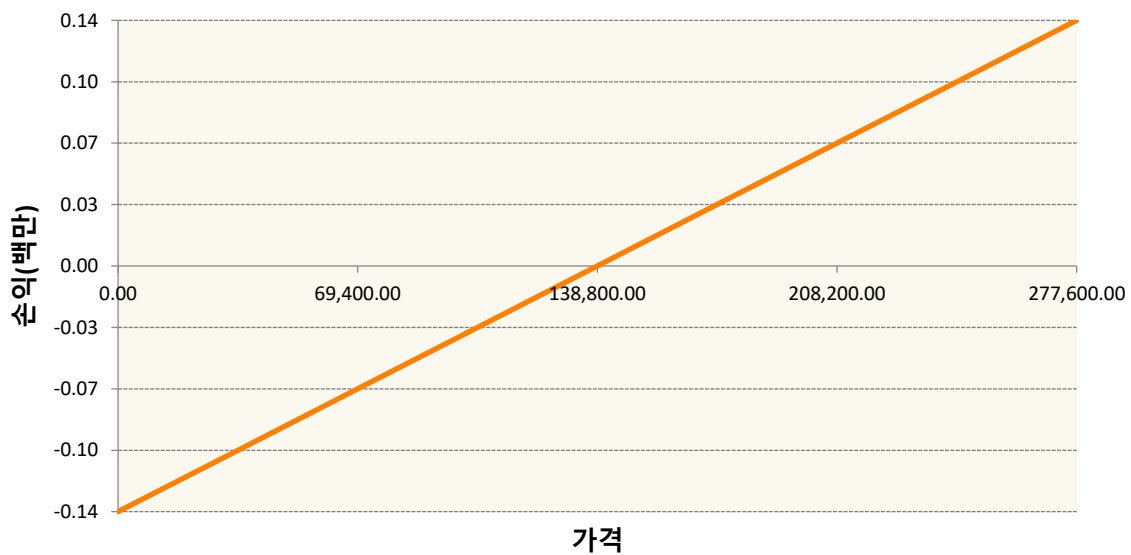
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



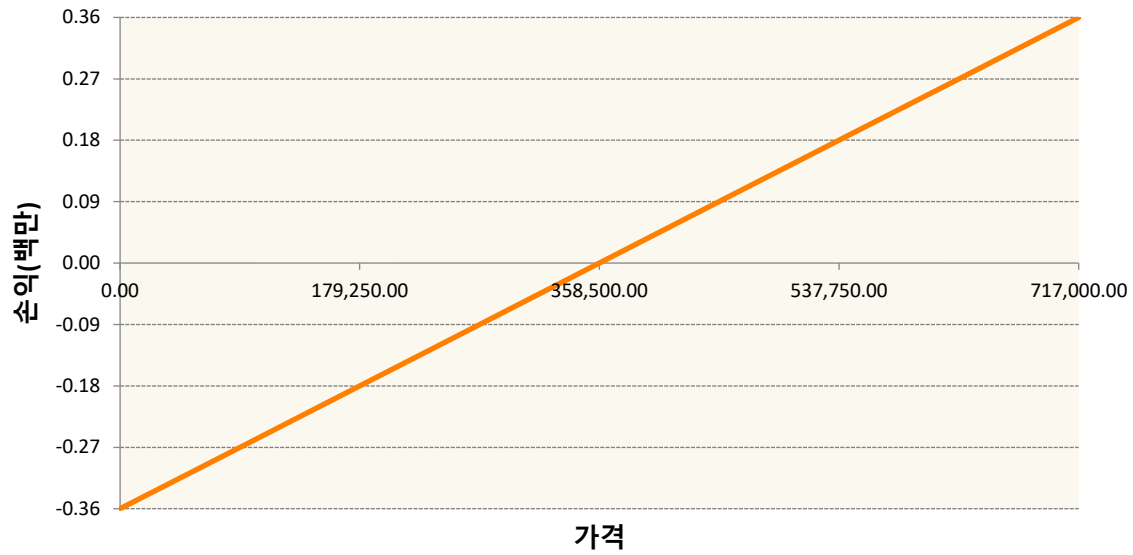
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



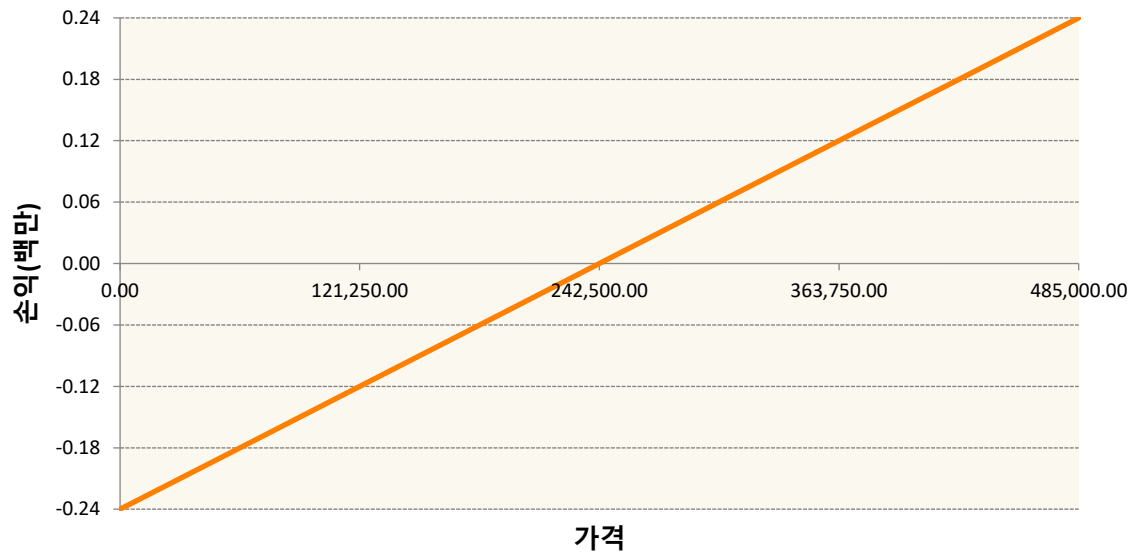
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



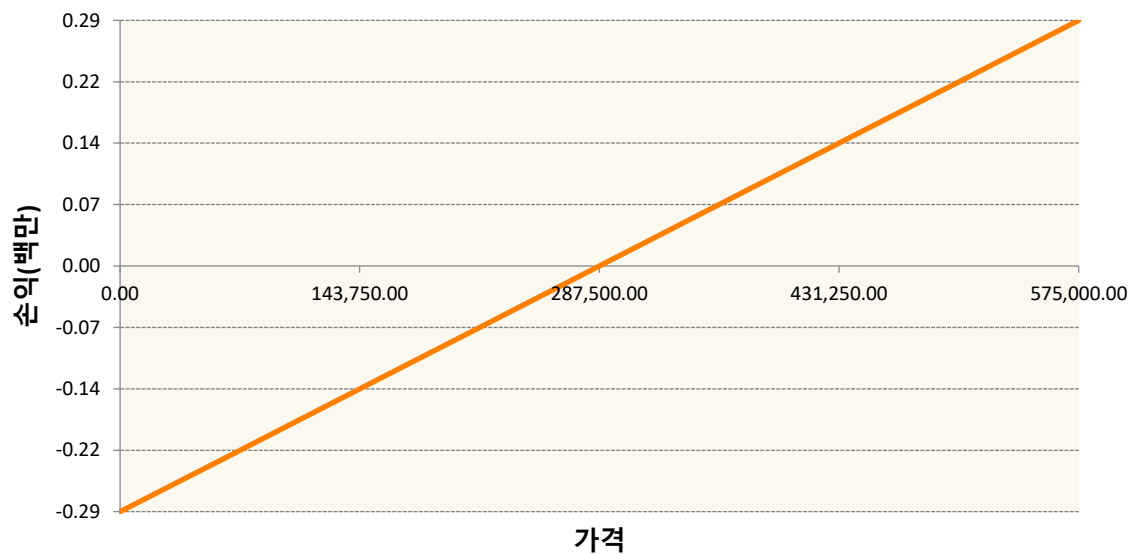
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		603
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물		4
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물		13
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물		3
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물		18
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물		124
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물		49
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물		63

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,400

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

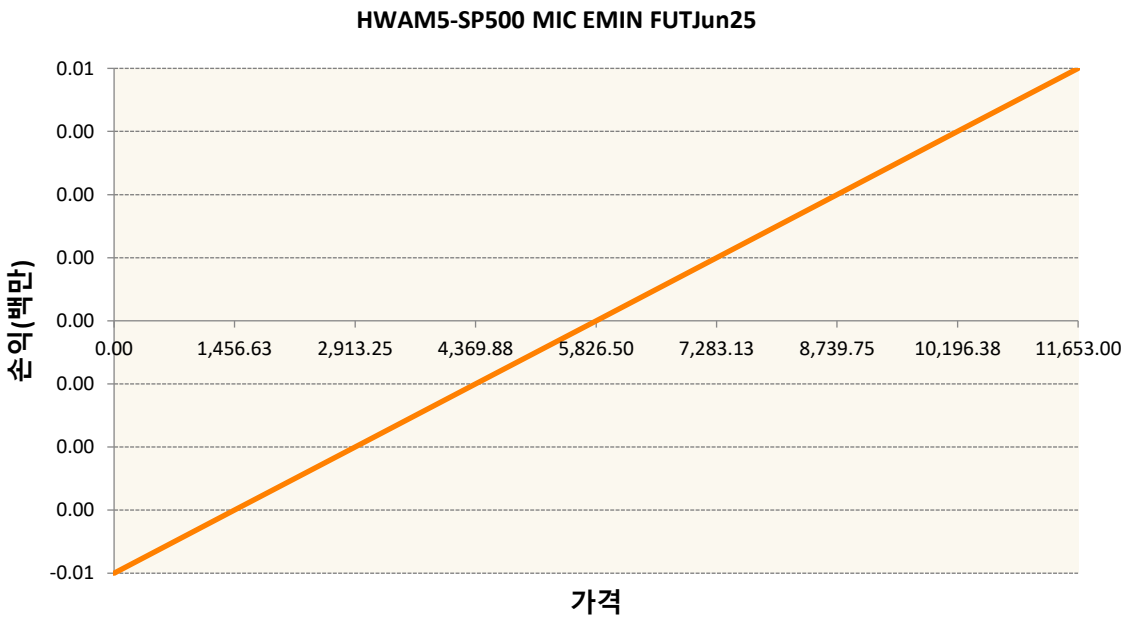
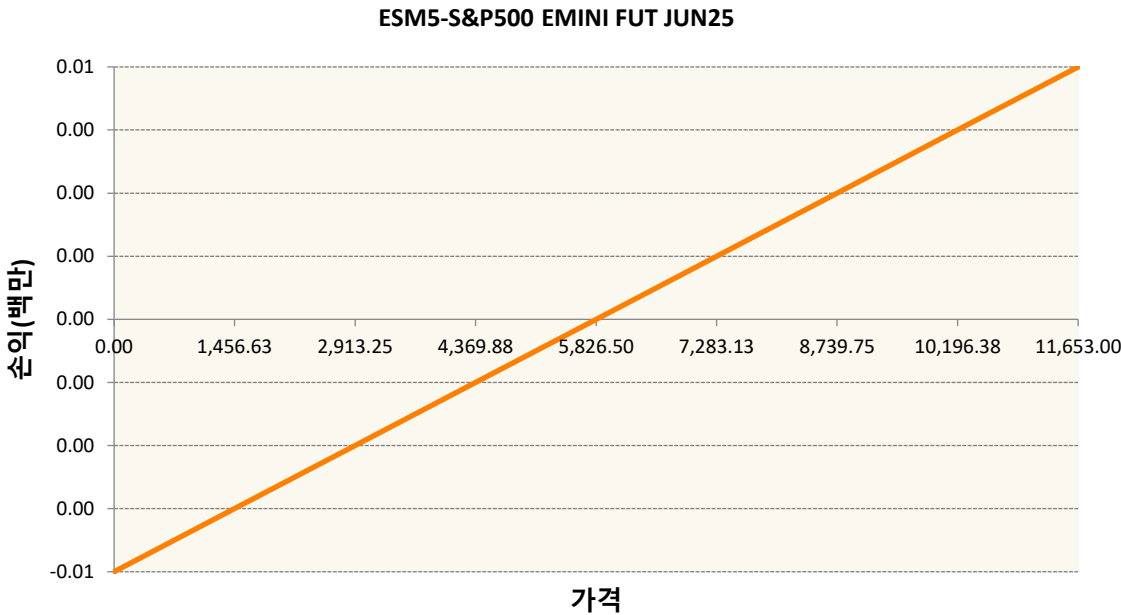
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	28,479	0	28,479	
누계	유가증권	선물	1,233	0	1,233	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,278
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,627

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

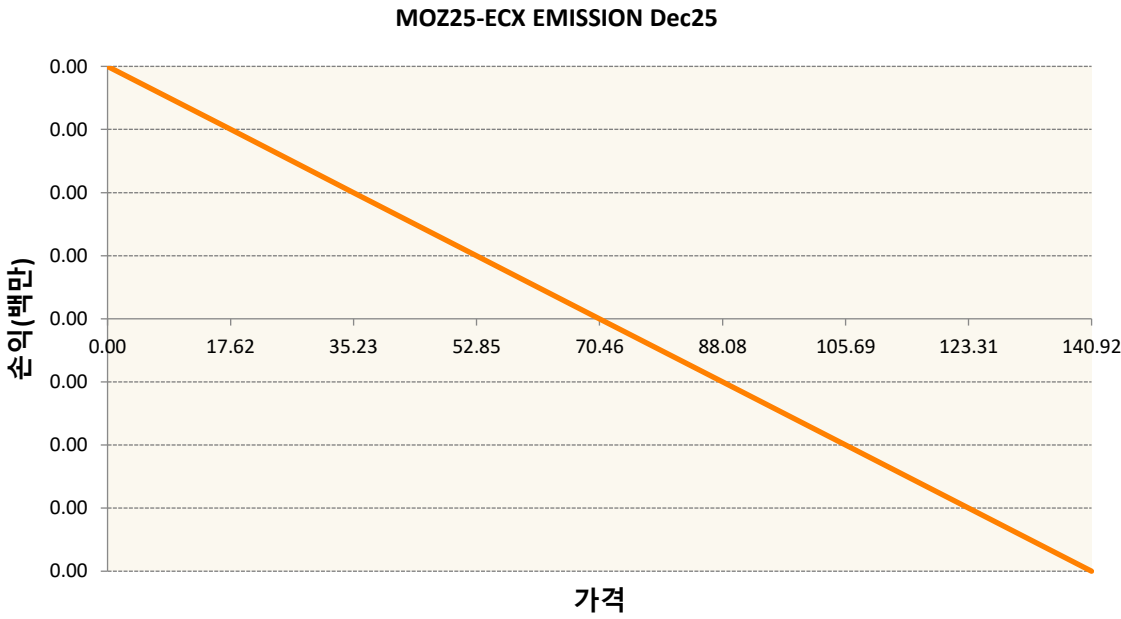
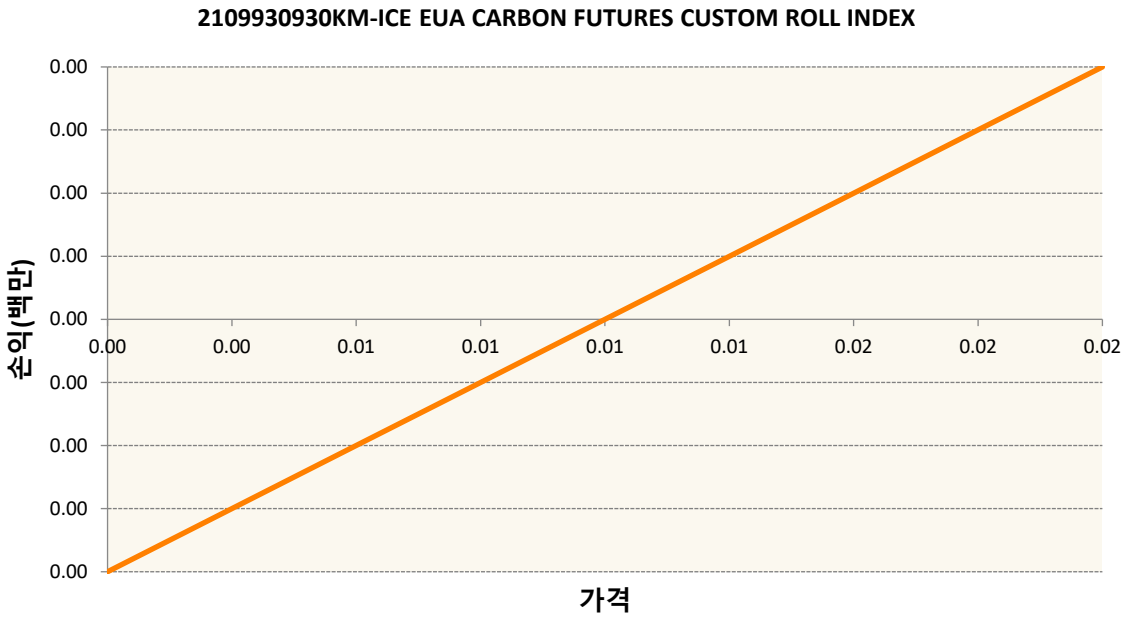
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4	5,534	-5,530	
누계	통화	선도	0	1,162	-1,162	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.35
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	34
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	59
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	443

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

820

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

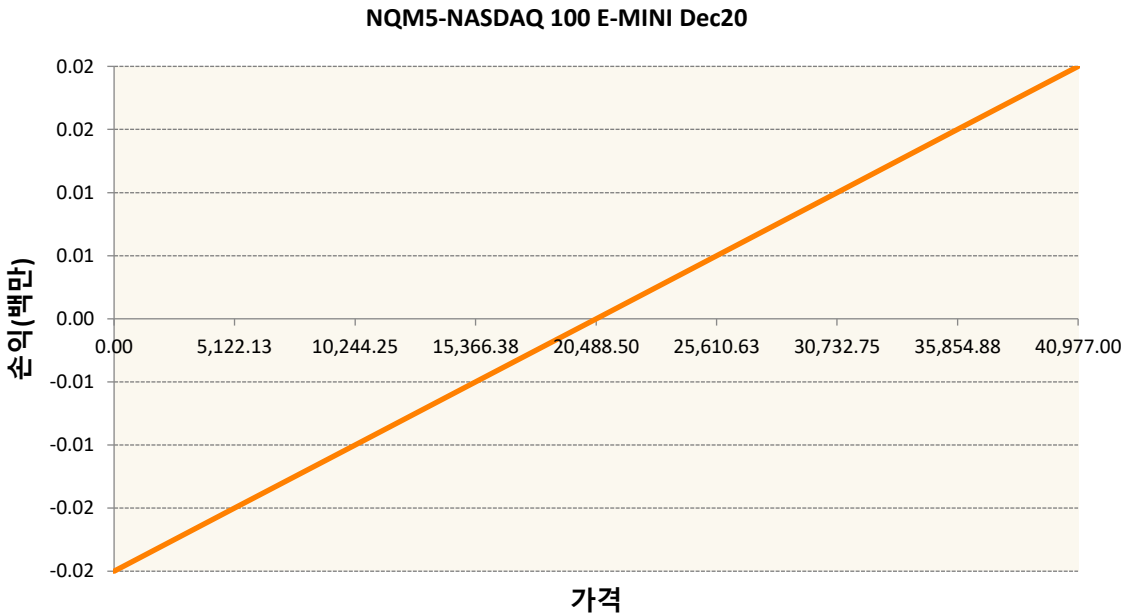
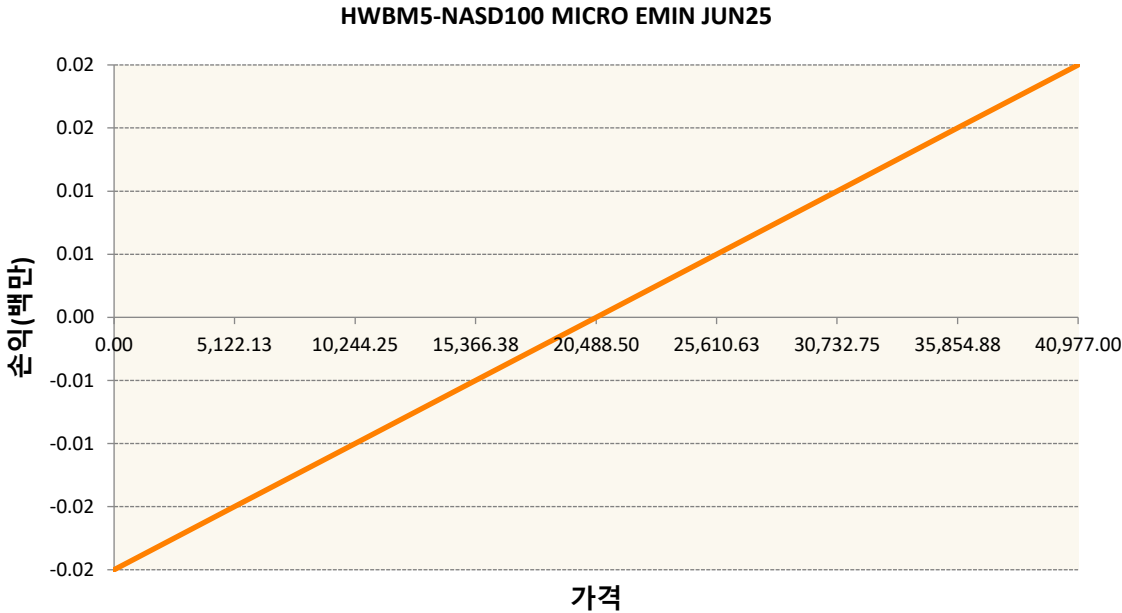
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,350	0	14,350	
누계	유가증권	선물	539	0	539	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		43
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,148

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,116

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

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	7,219
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,278
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,898

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

(단위:백만원)

8,558

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

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	6,643	0	6,643	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9

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

(단위:백만원)

39

공시일	2025-03-27
기준일	2025-03-26

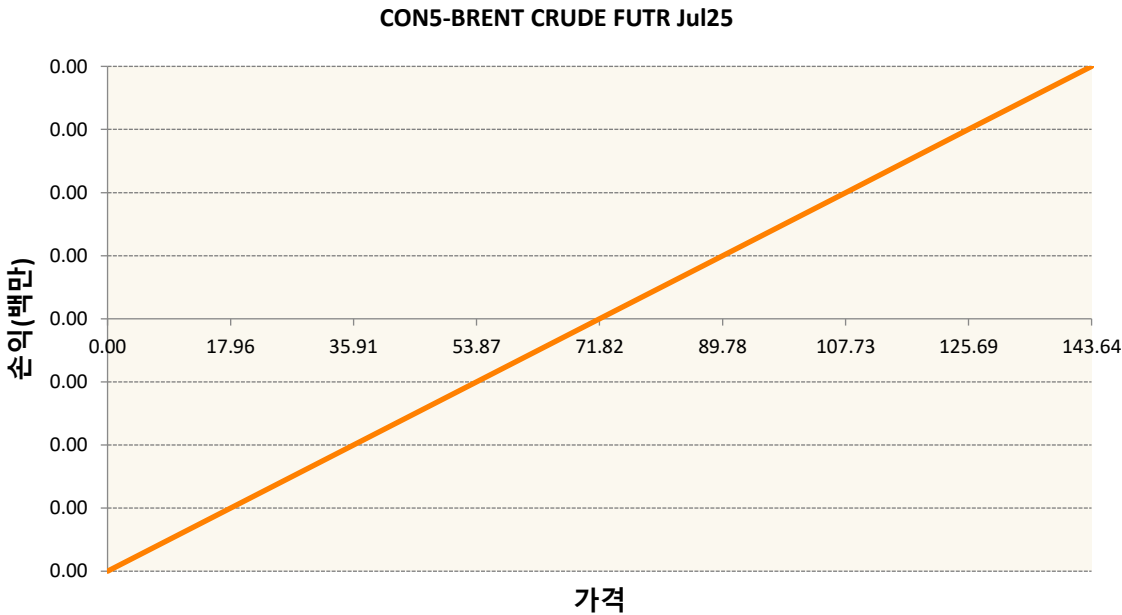
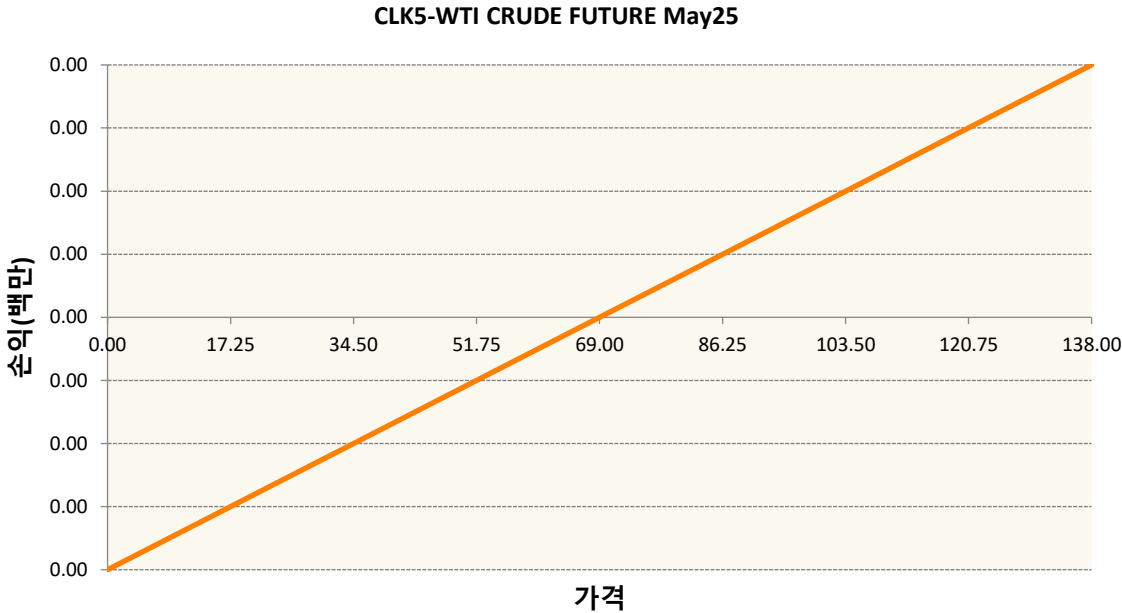
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

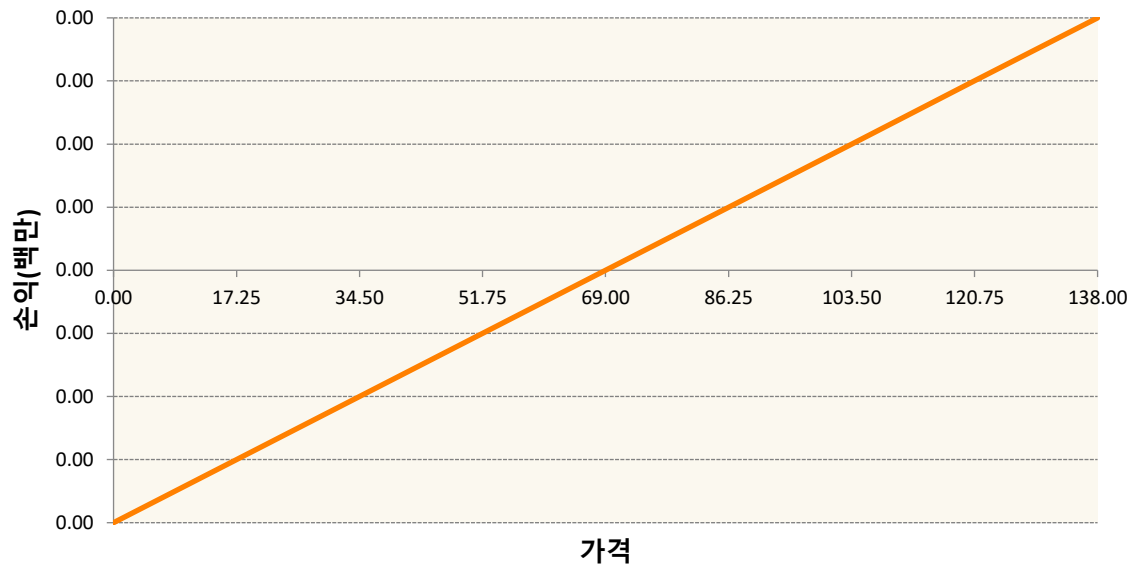
(단위:백만원)

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	146	-146	장내

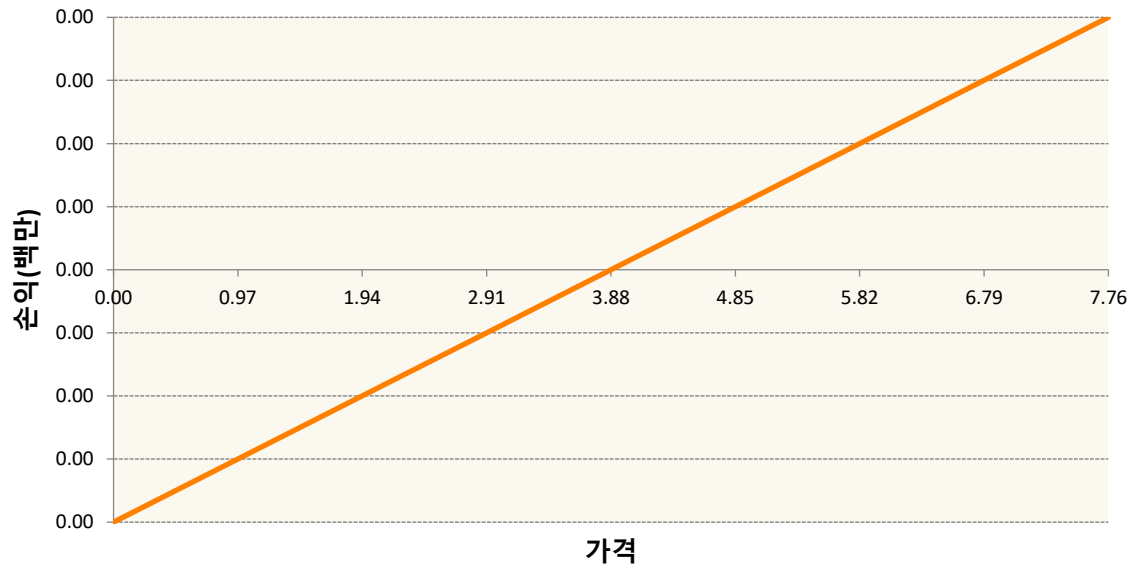
2. 만기시점의 손익구조



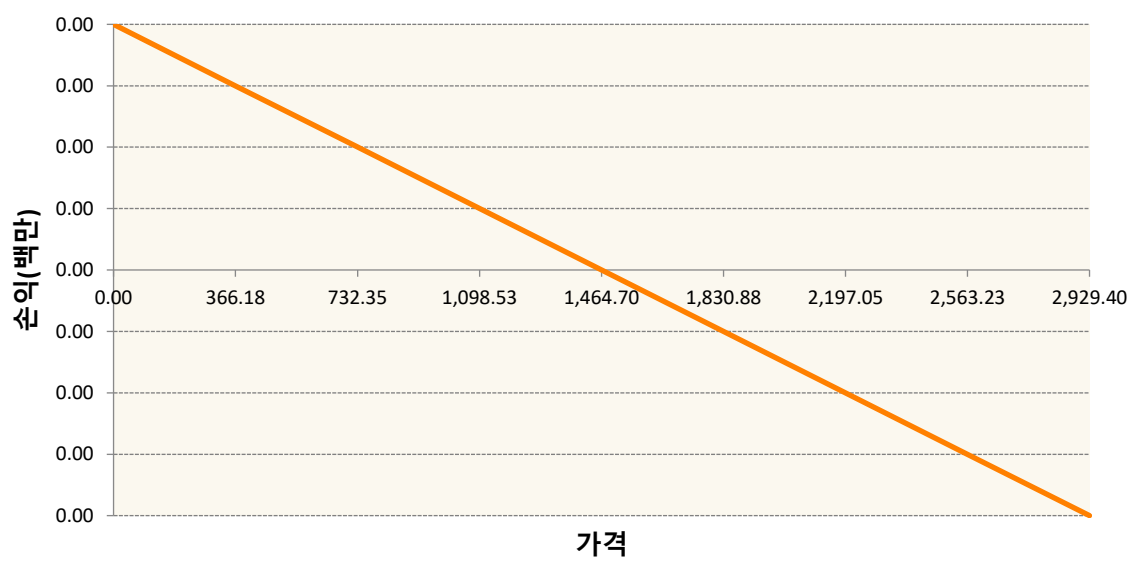
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



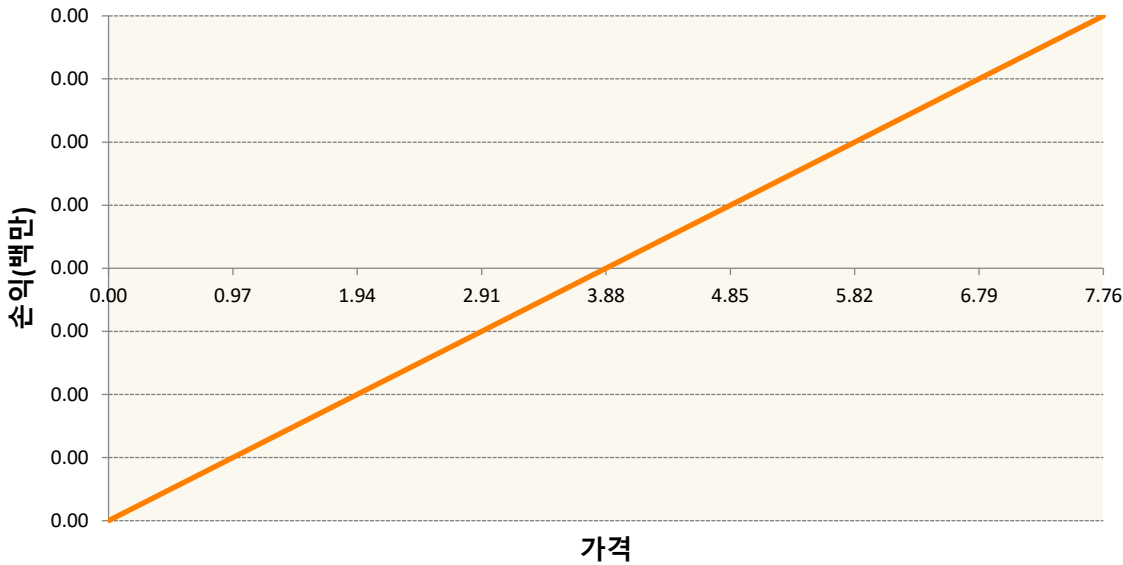
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



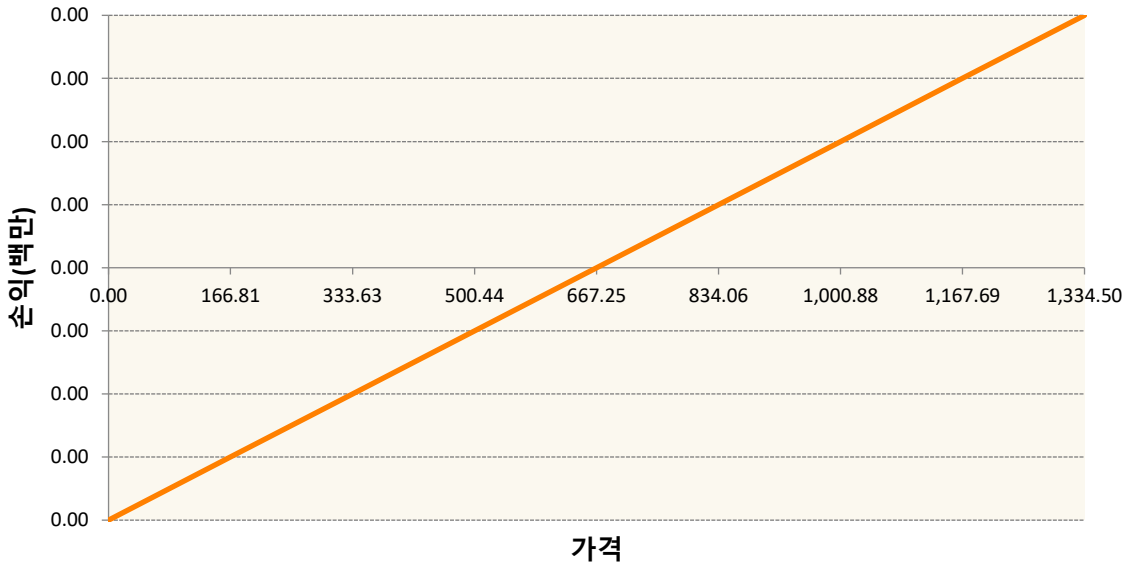
KR4175W40006-2025-04 달러선물



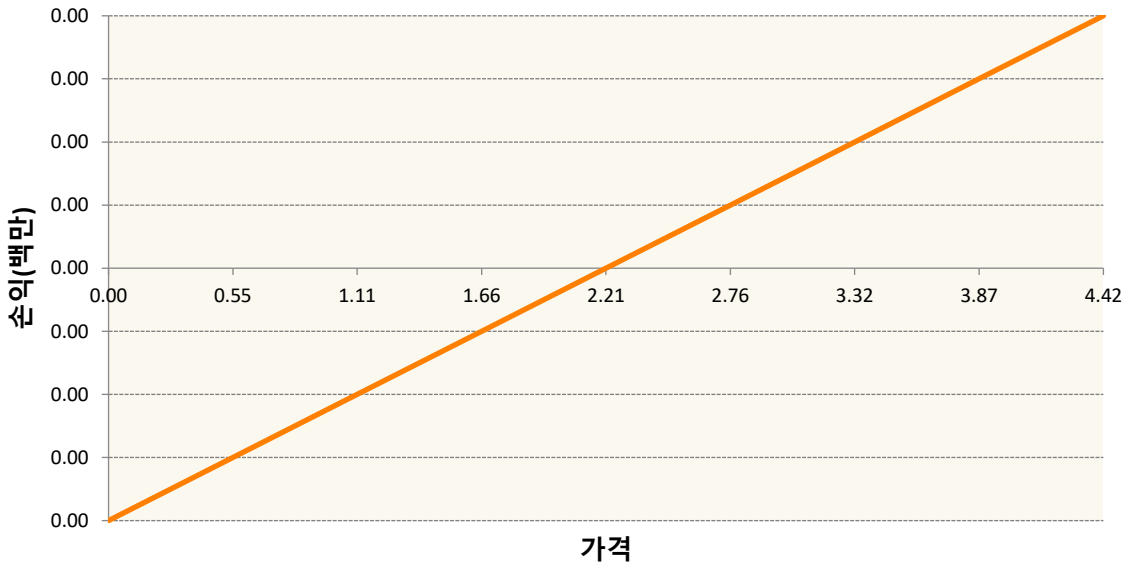
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	17
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)

142