

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

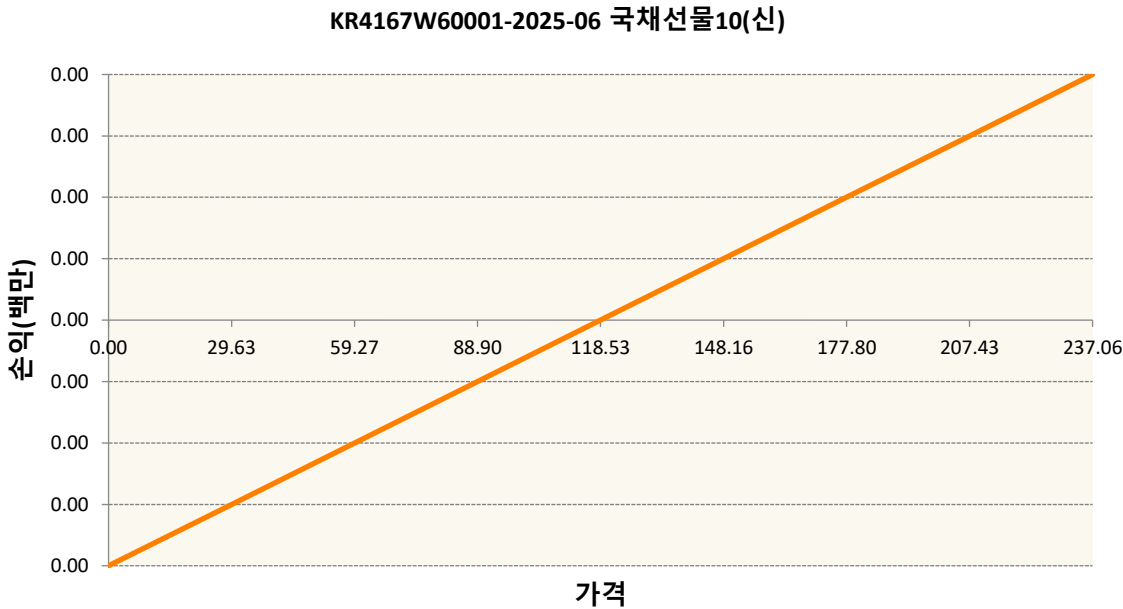
베스트장기채(채권-파생형)

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	237,060	0	237,060	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

5,468

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

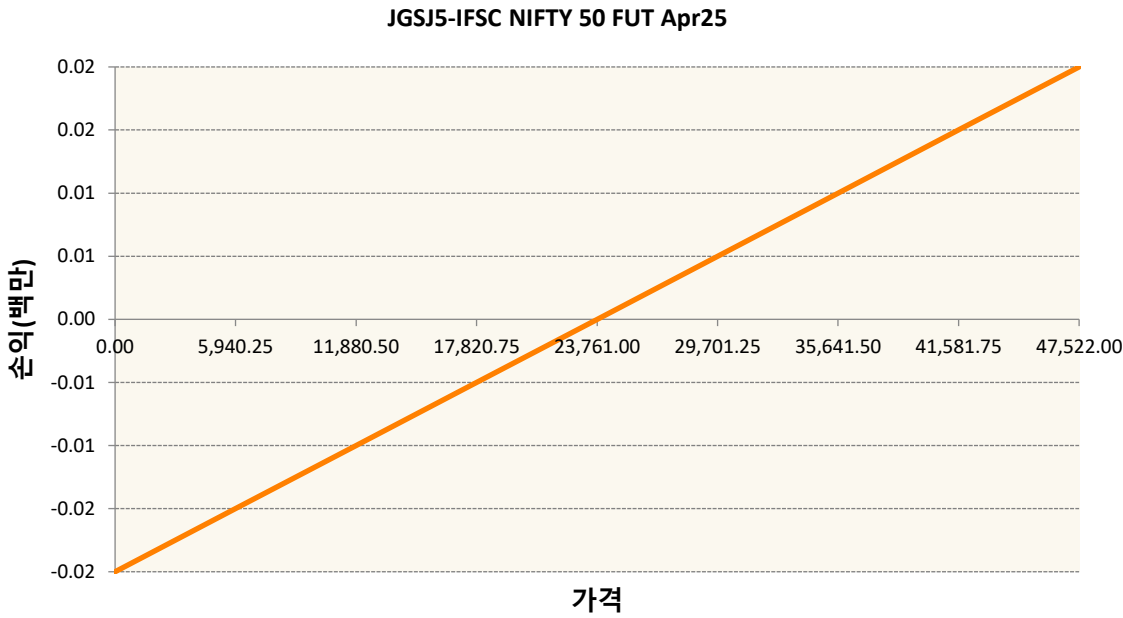
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	766	0	766	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ5	IFSC NIFTY 50 FUT Apr25	61
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

42

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

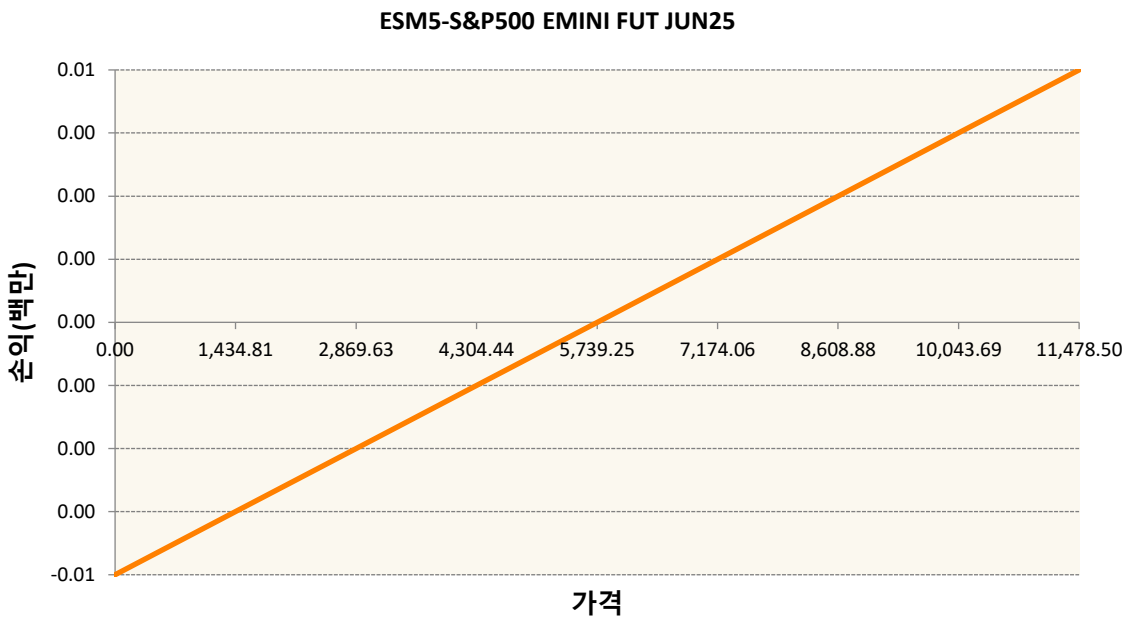
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	420	0	420	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	34
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

23

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

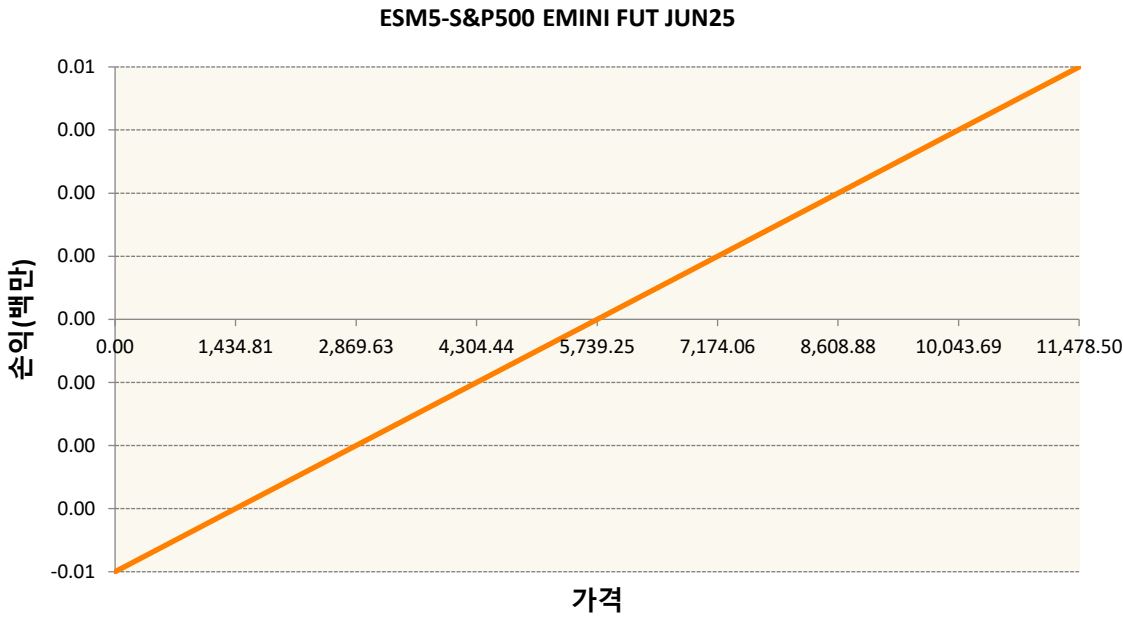
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,518	0	2,518	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	201
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

138

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

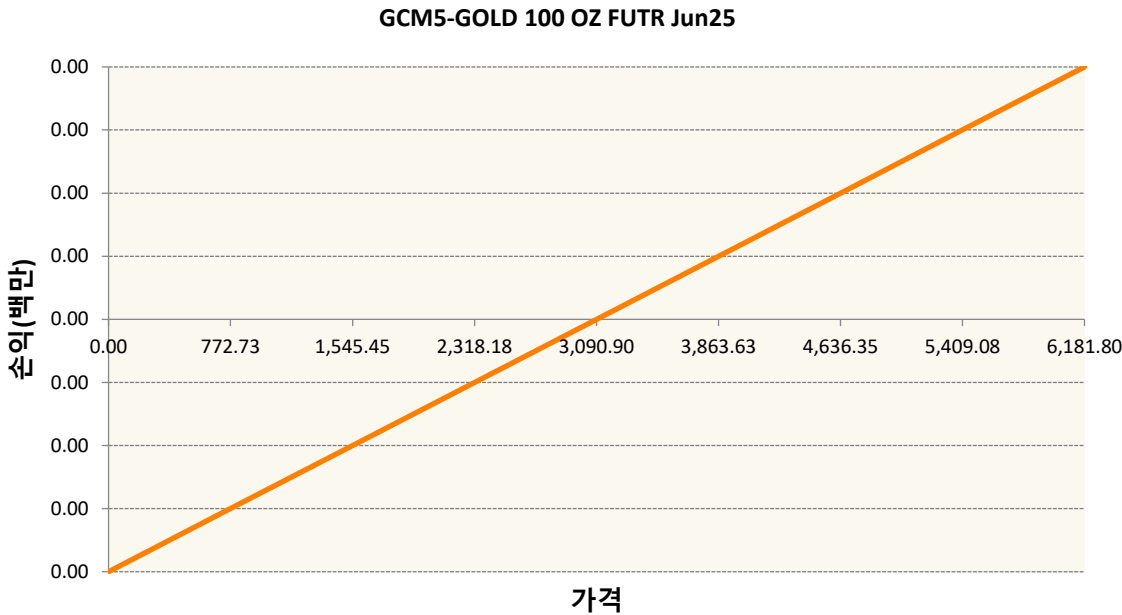
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,815	0	1,815	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 03/28/25 C282 EQUITY	0.3
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	145

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

(단위:백만원)

105

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

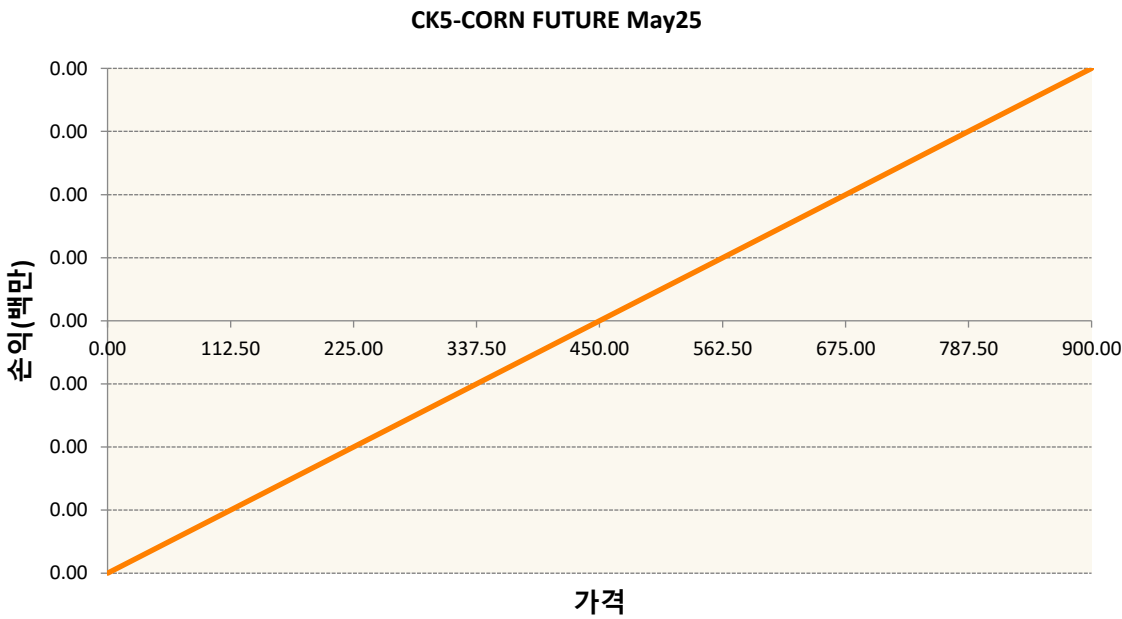
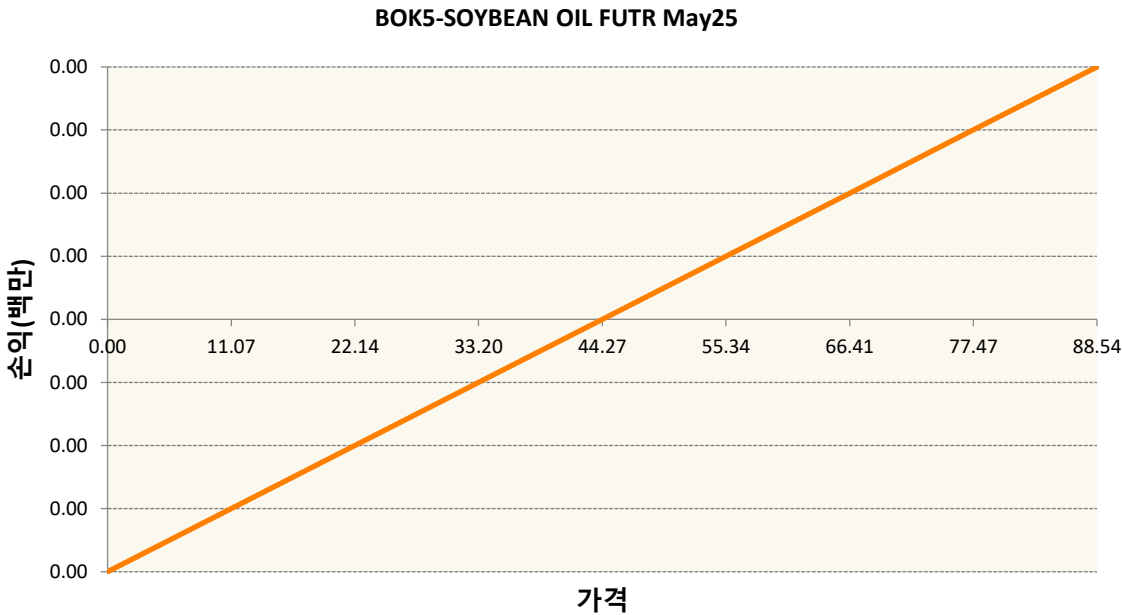
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

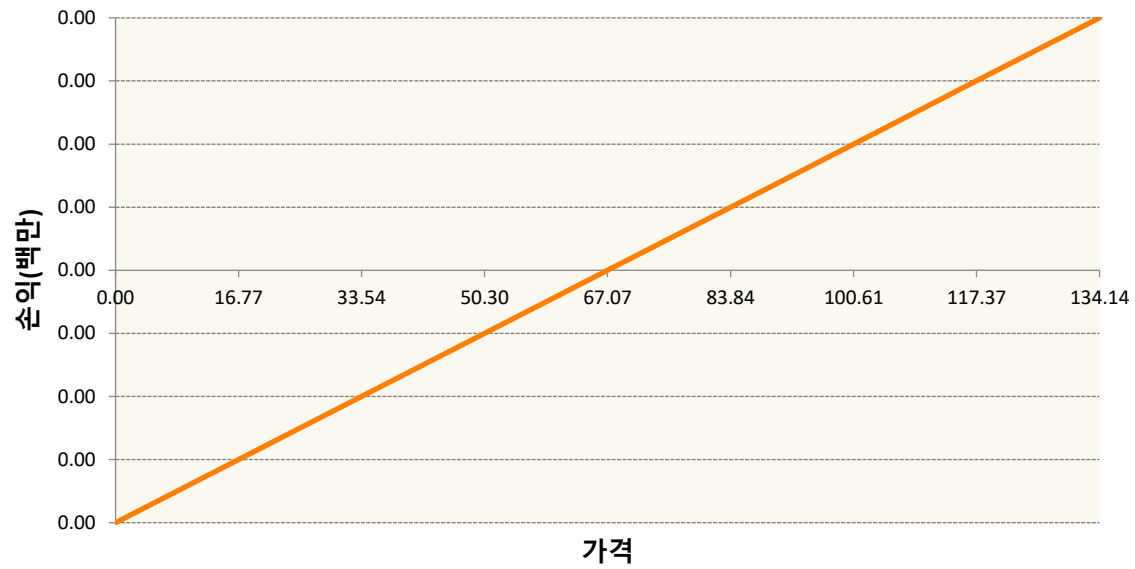
(단위:USD 백만)

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	3,706	0	3,706	
누계	통화	선물	0	381	-381	장내

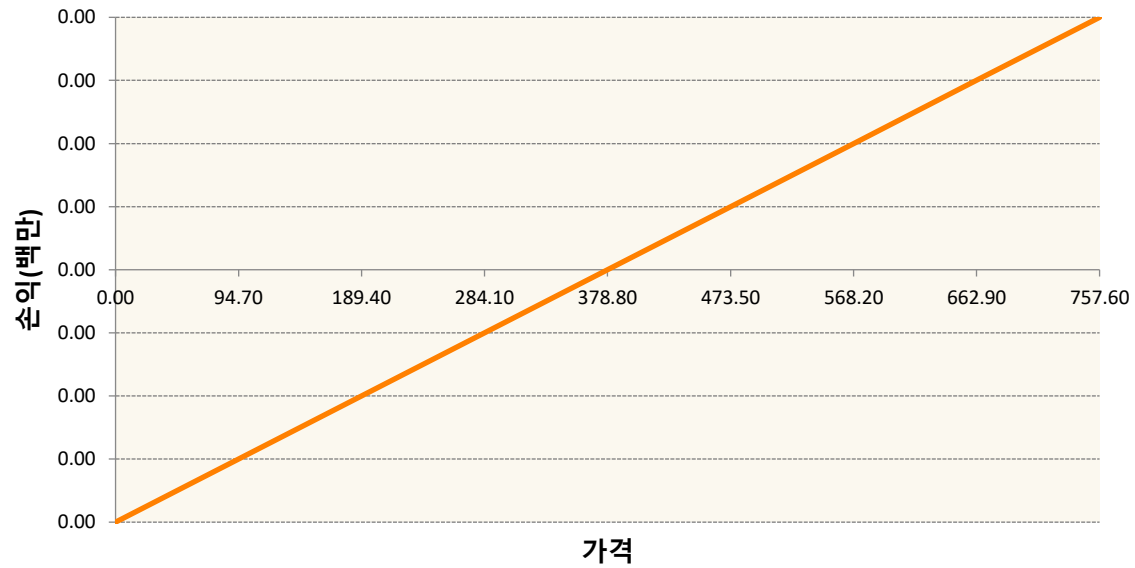
2. 만기시점의 손익구조



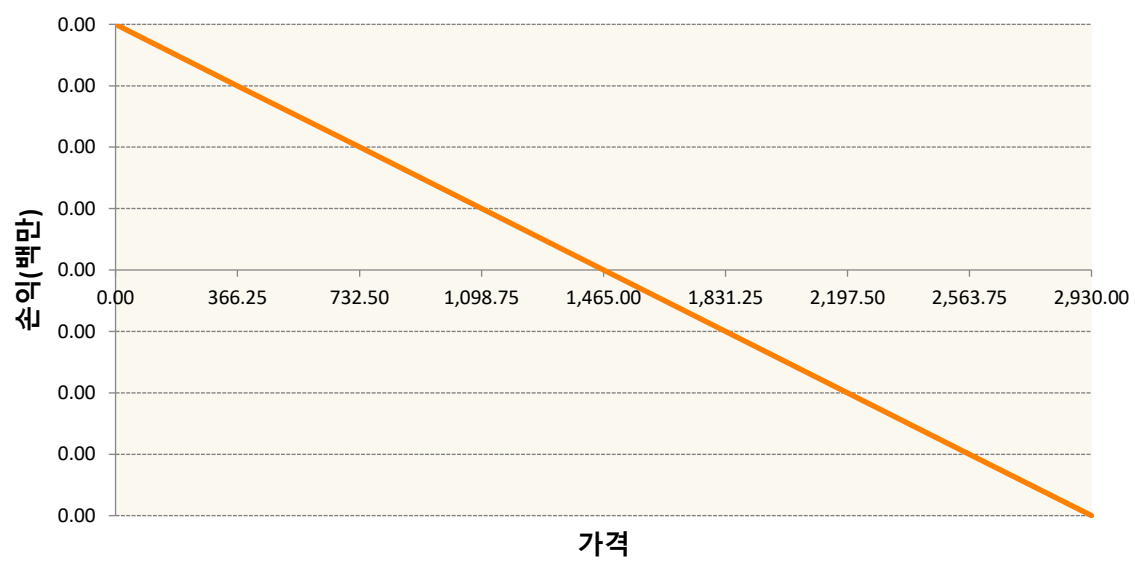
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



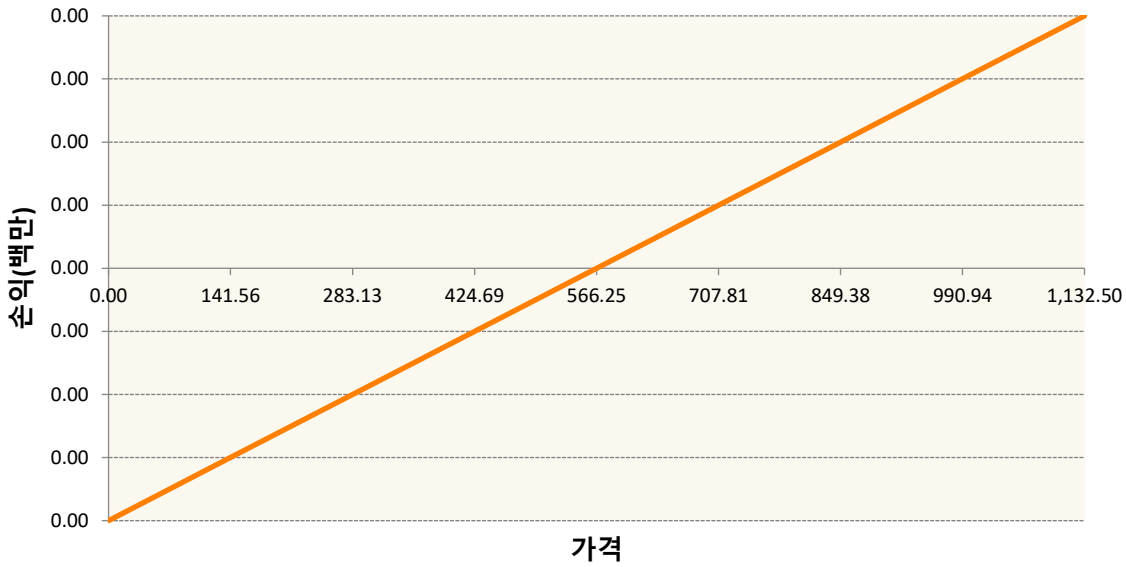
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



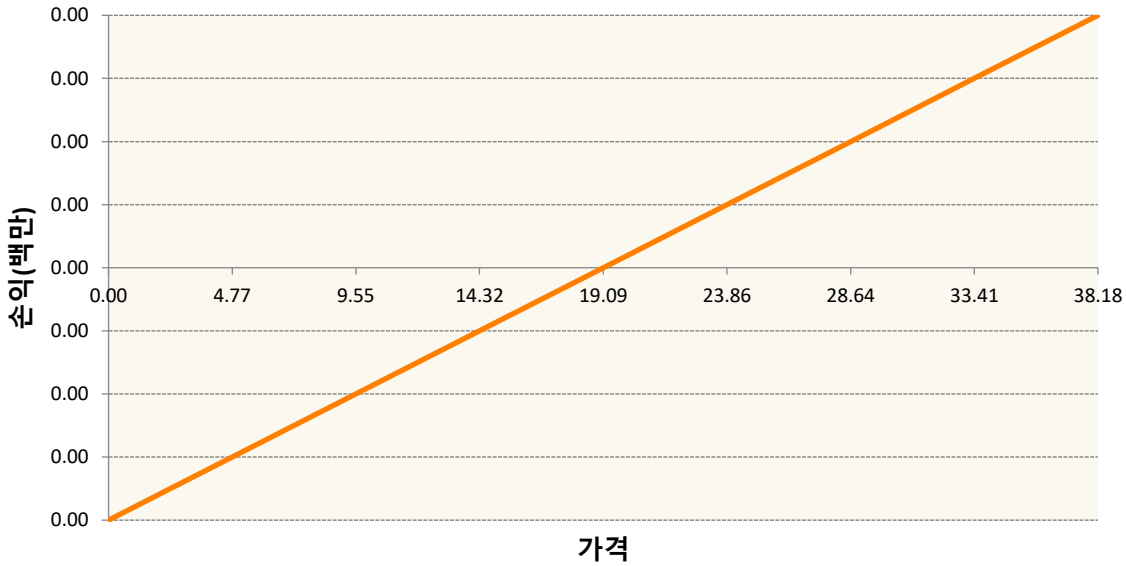
KR4175W40006-2025-04 달러선물



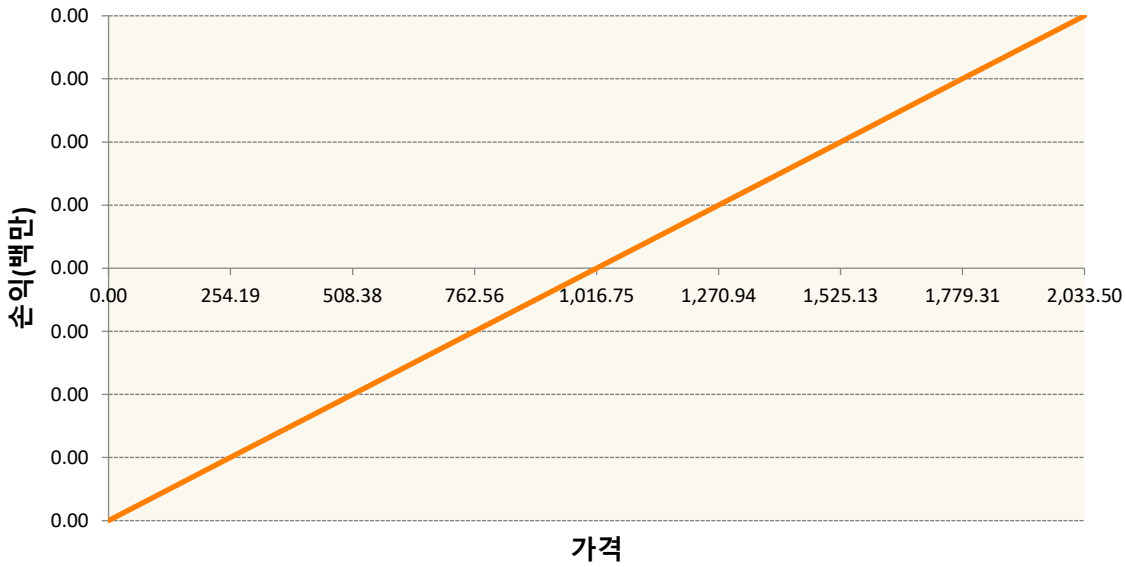
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



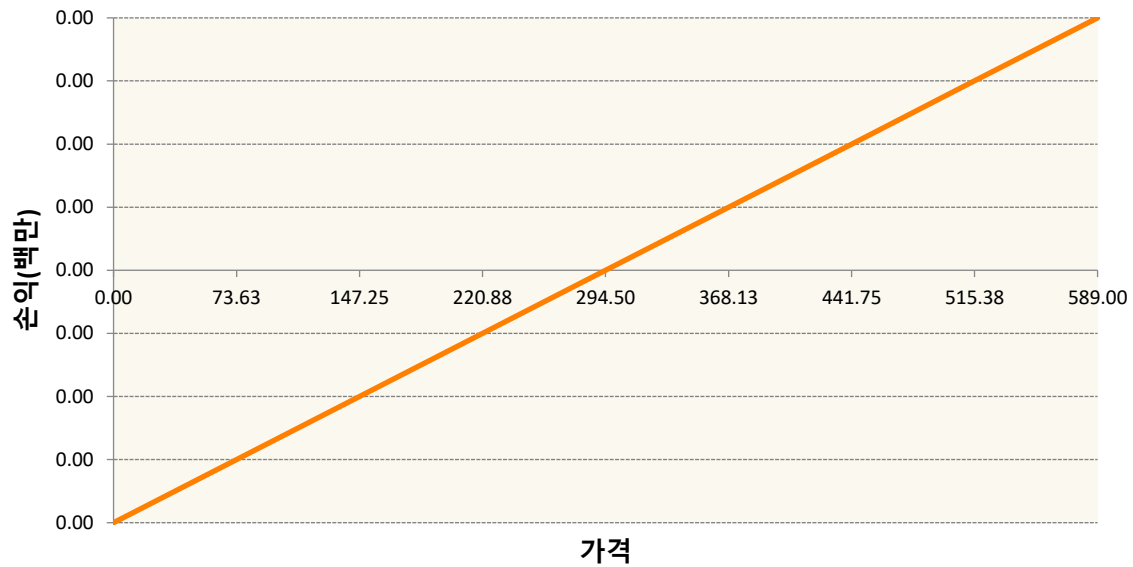
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



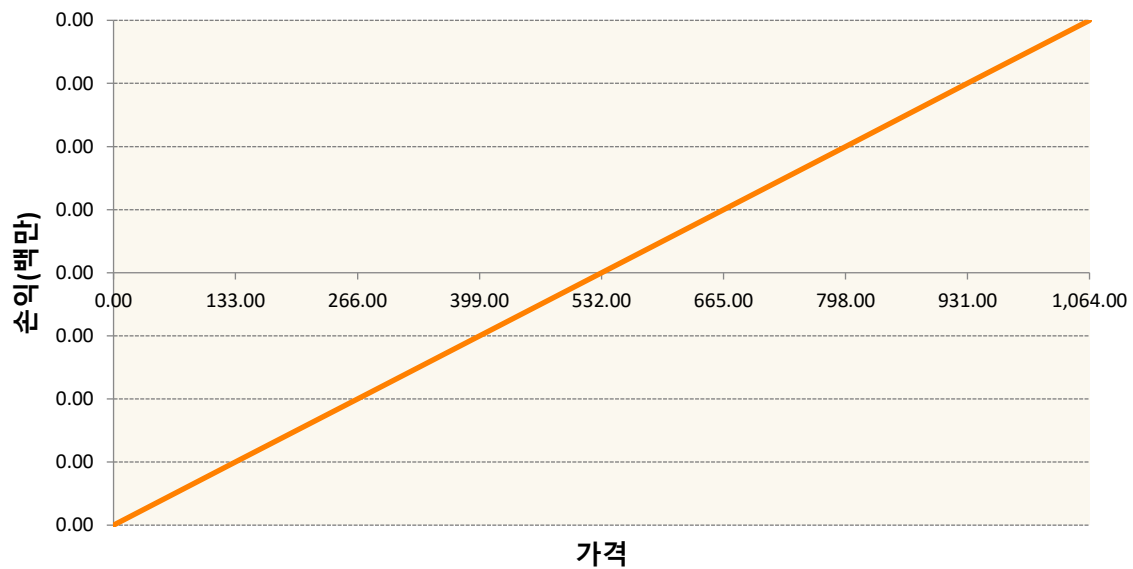
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-03-31
기준일	2025-03-28

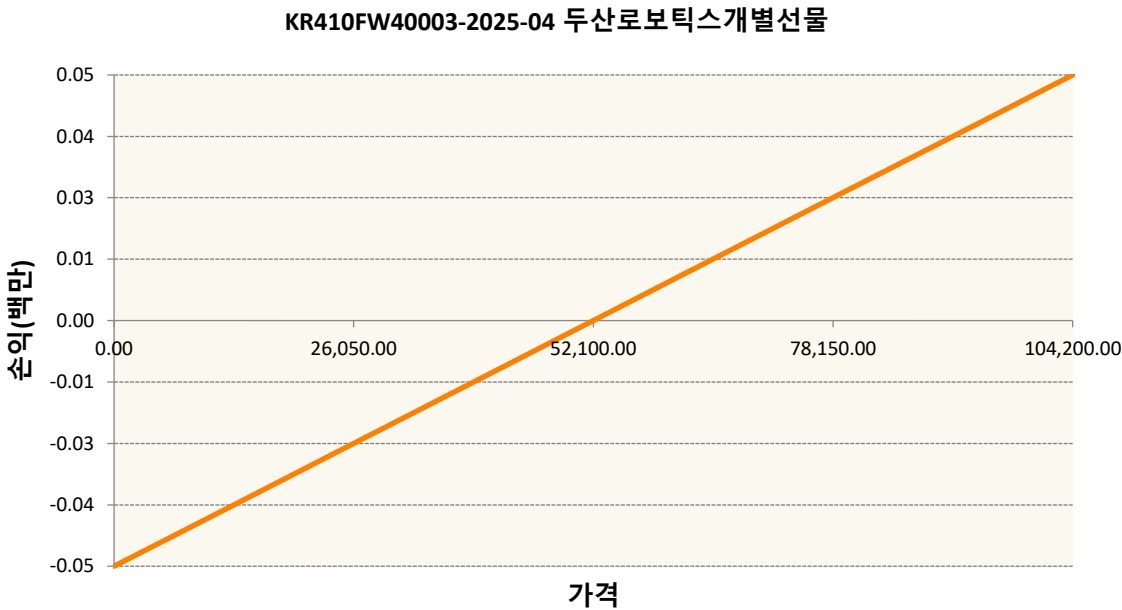
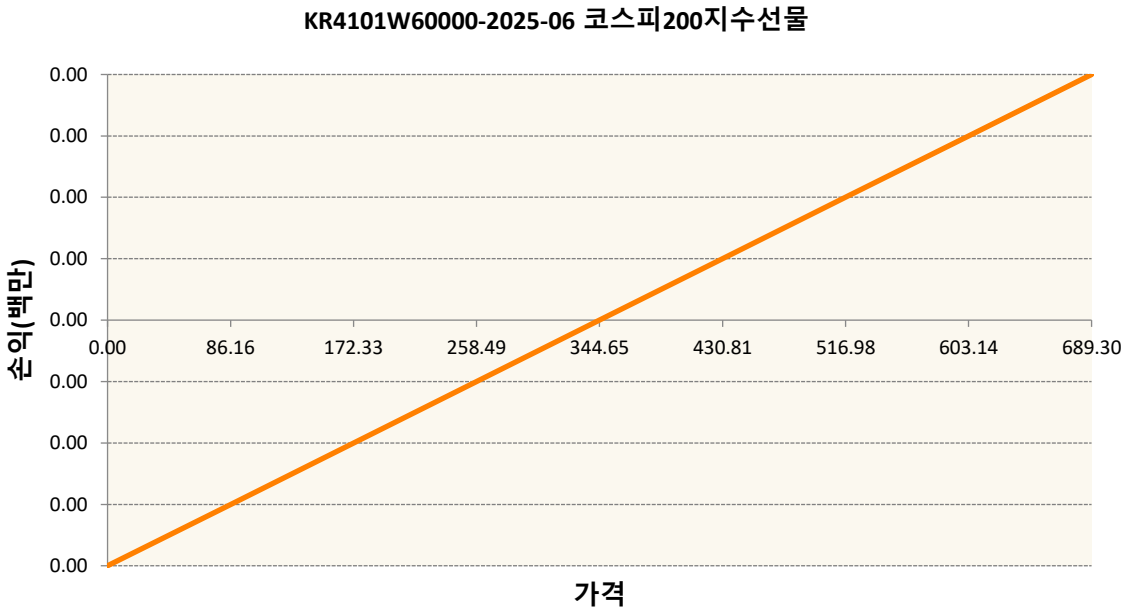
스마트인덱스모

1. 계약금액

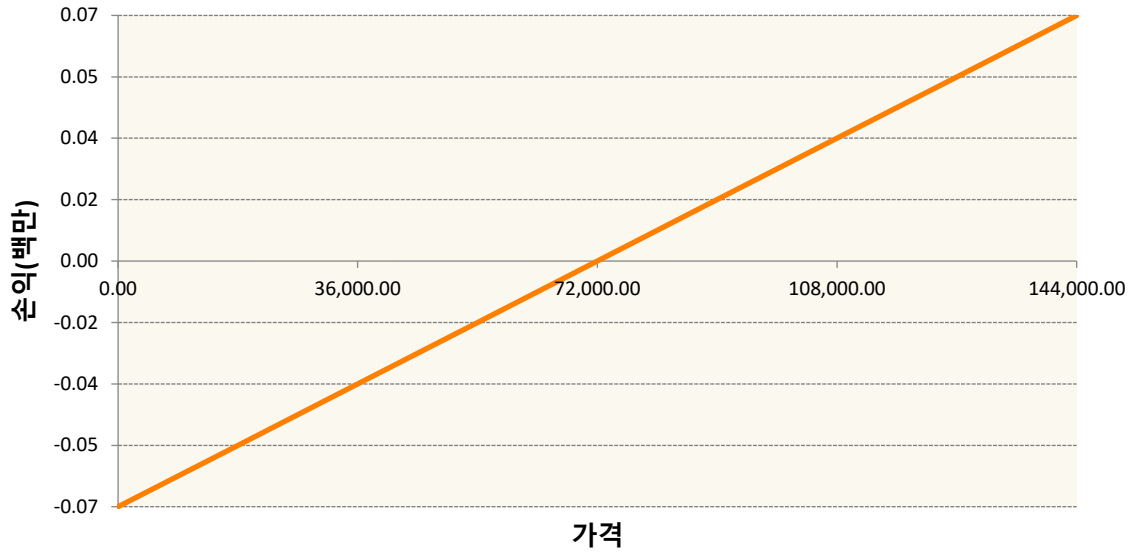
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,106	0	2,106	장내

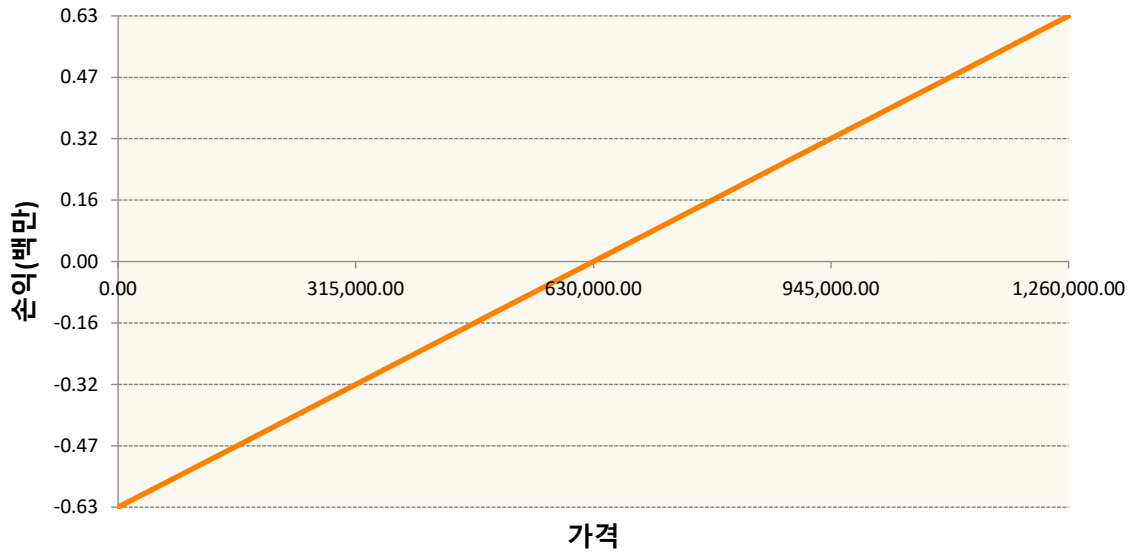
2. 만기시점의 손익구조



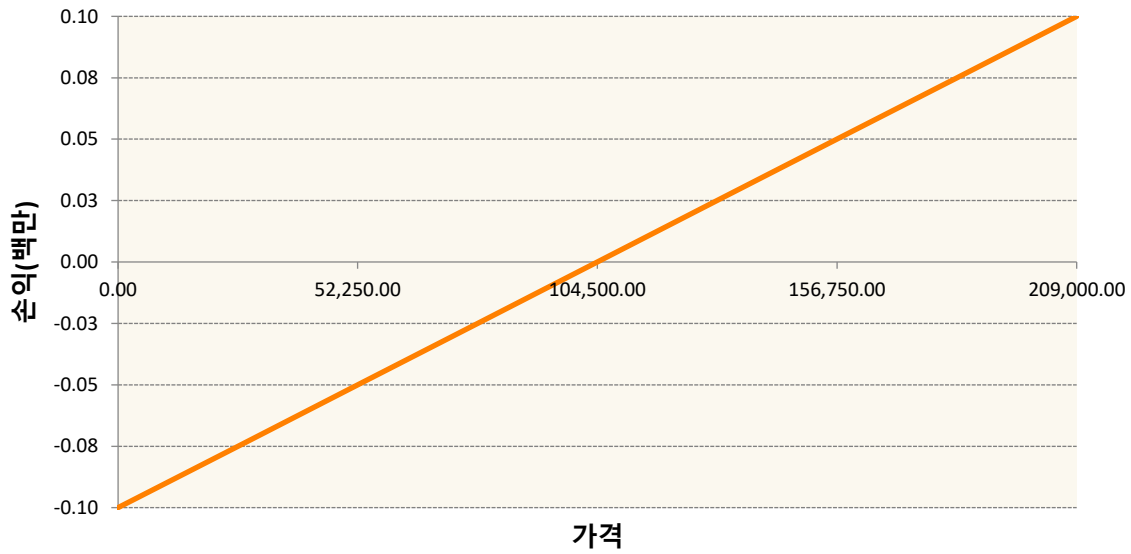
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



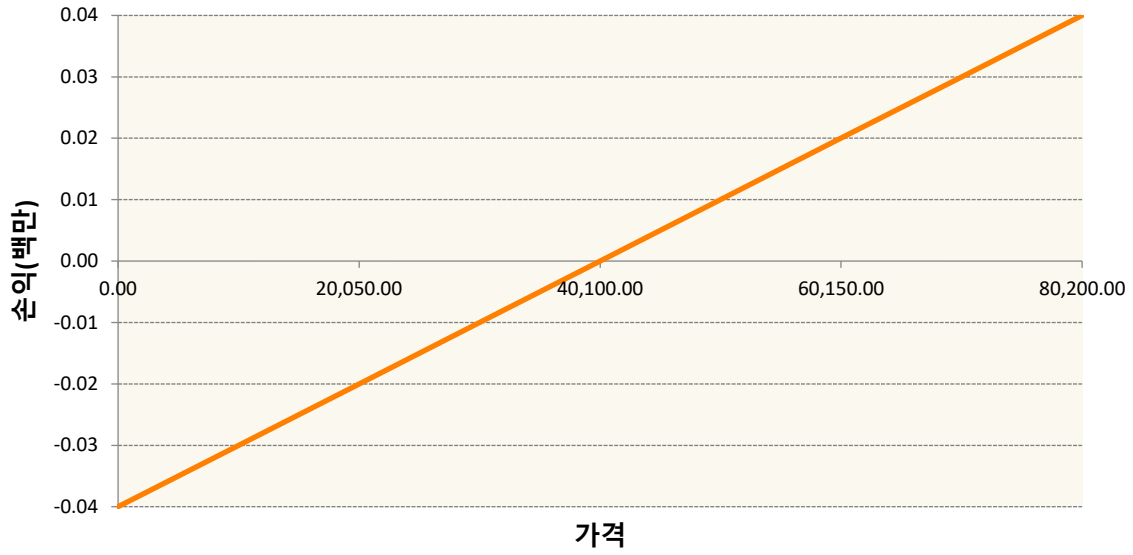
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



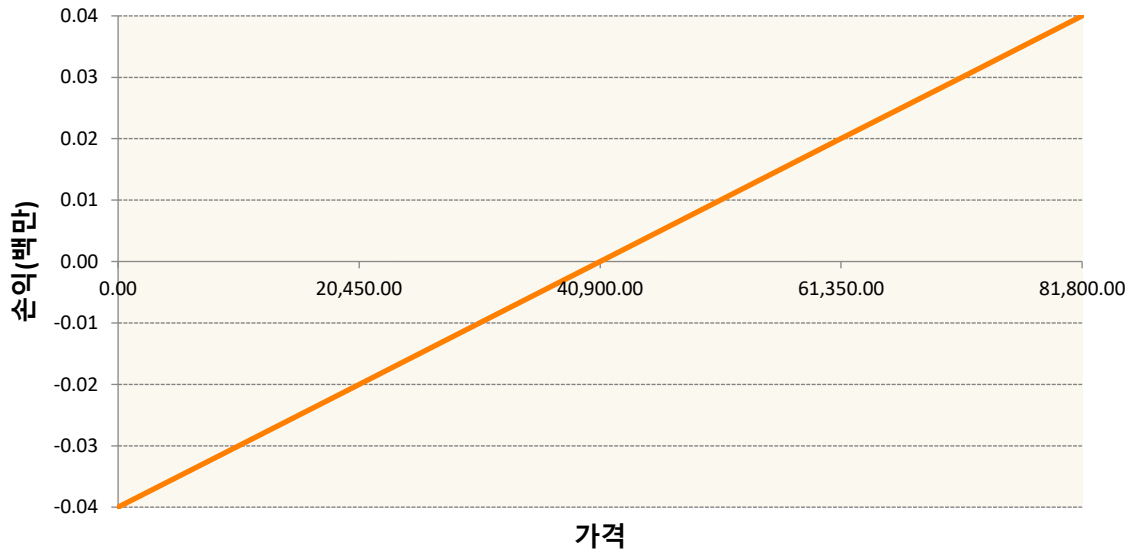
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



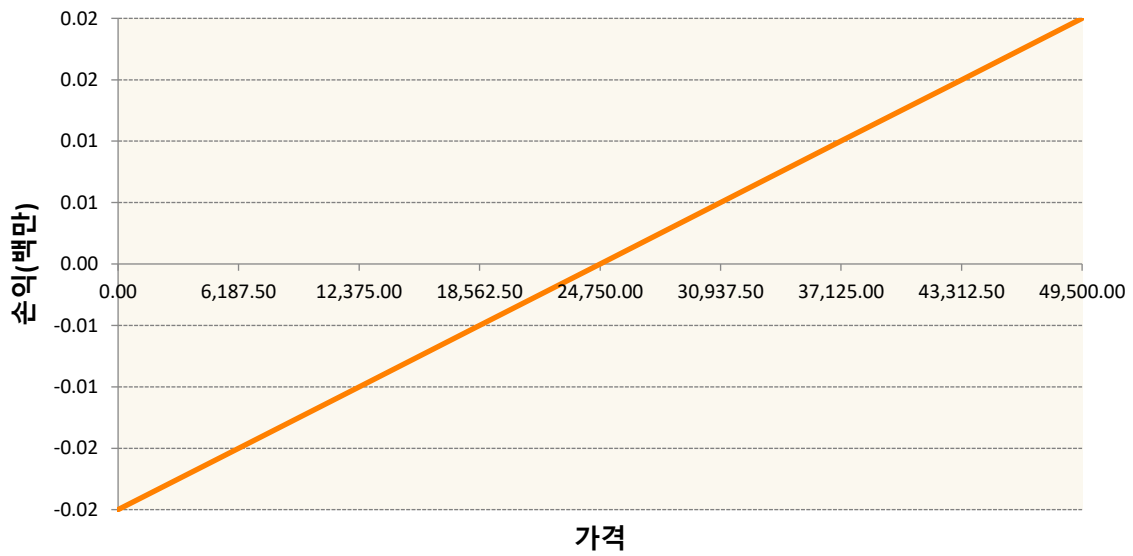
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



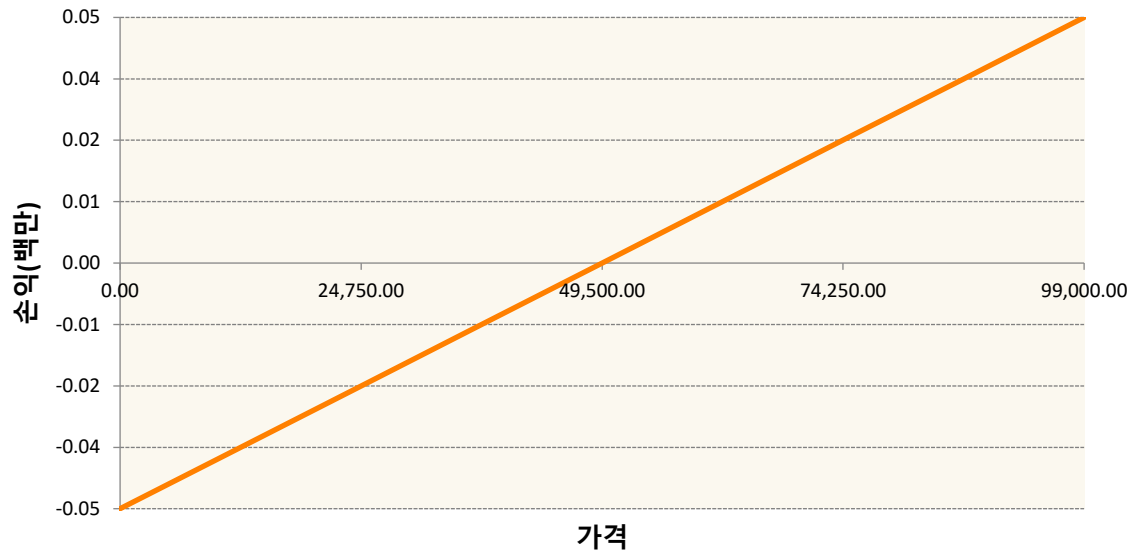
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



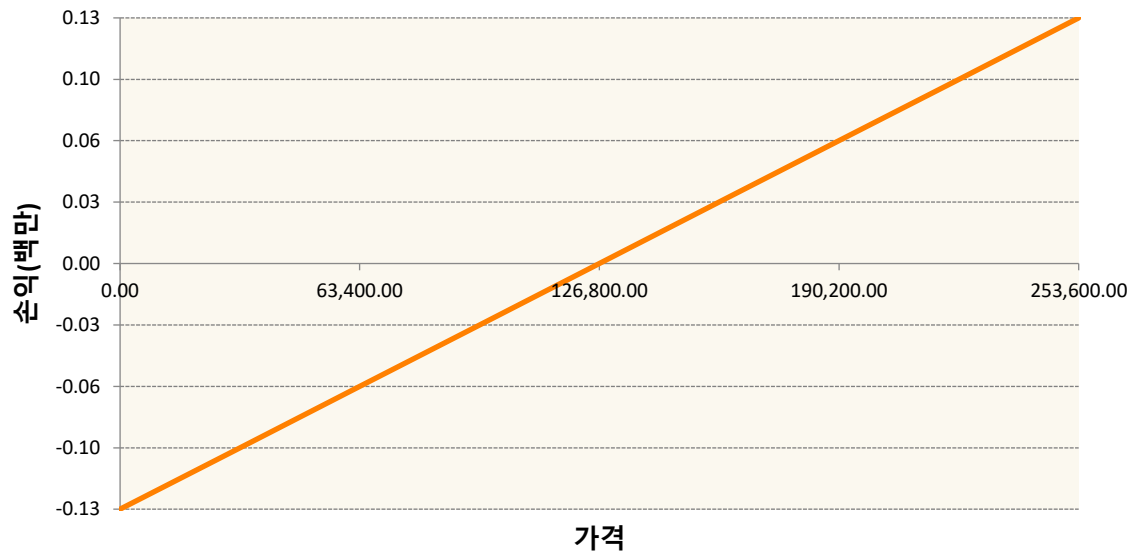
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



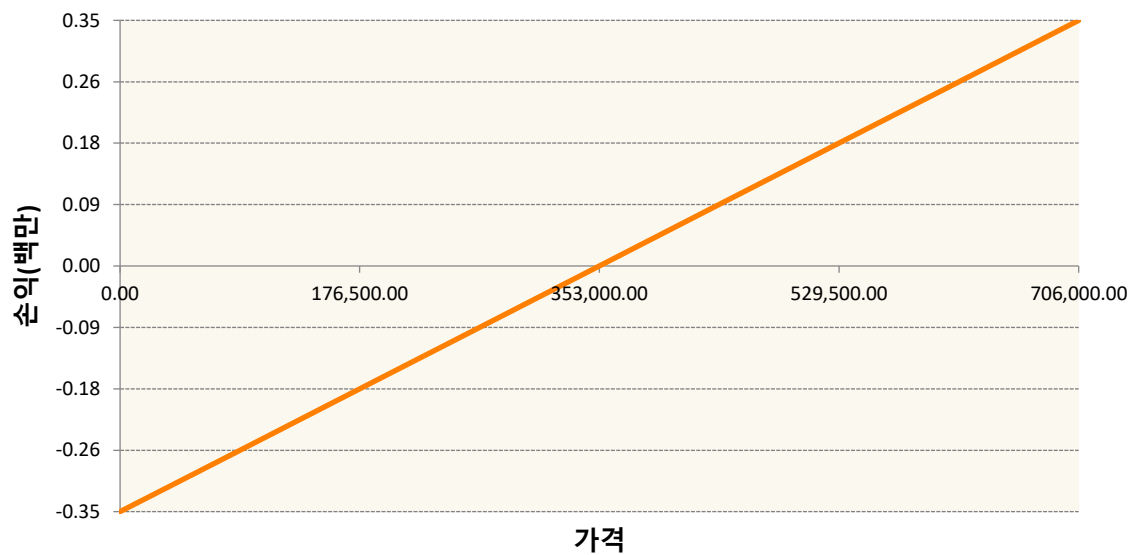
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



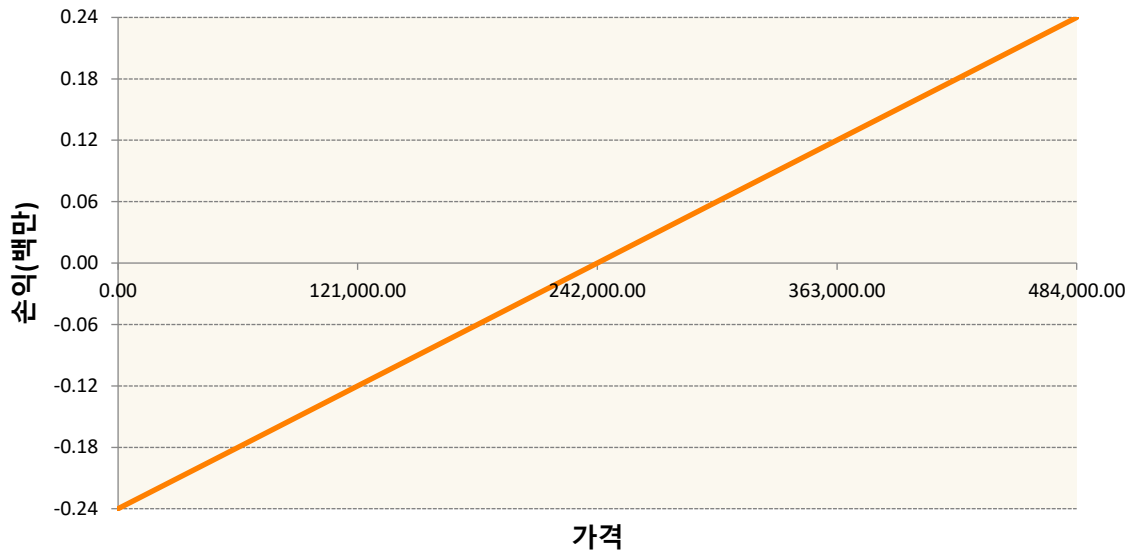
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



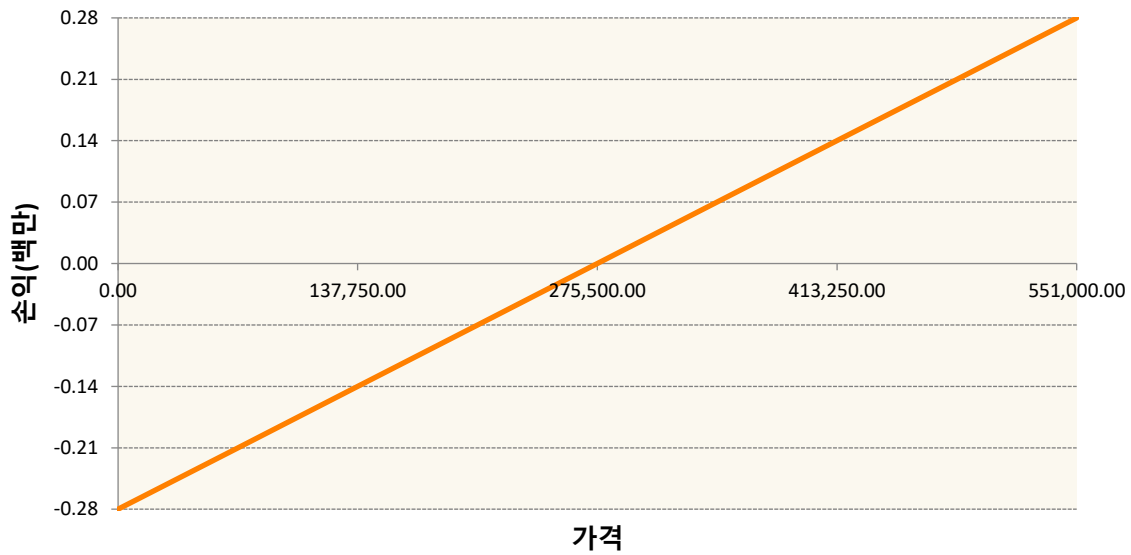
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



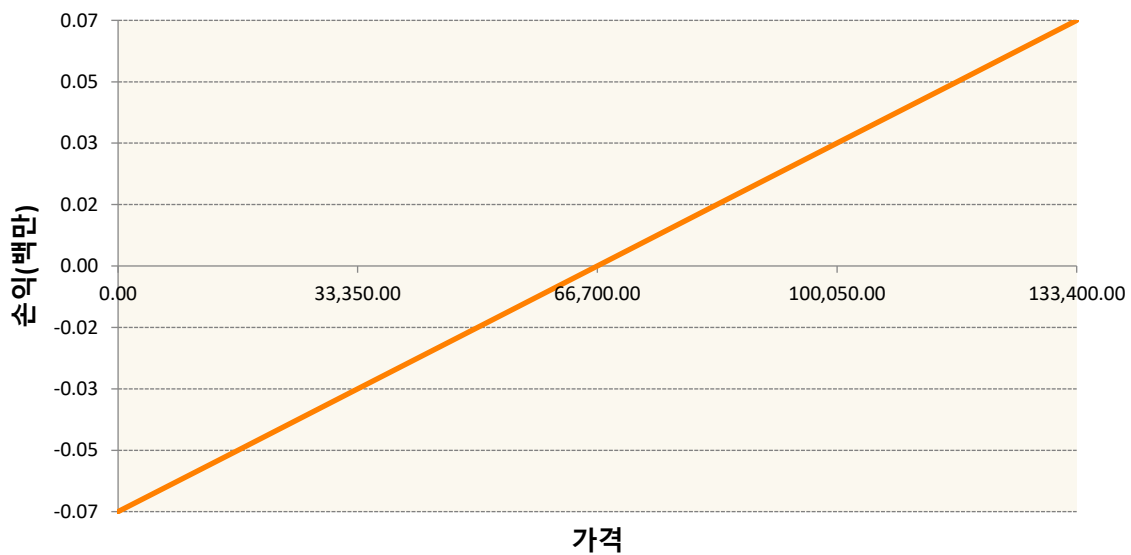
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



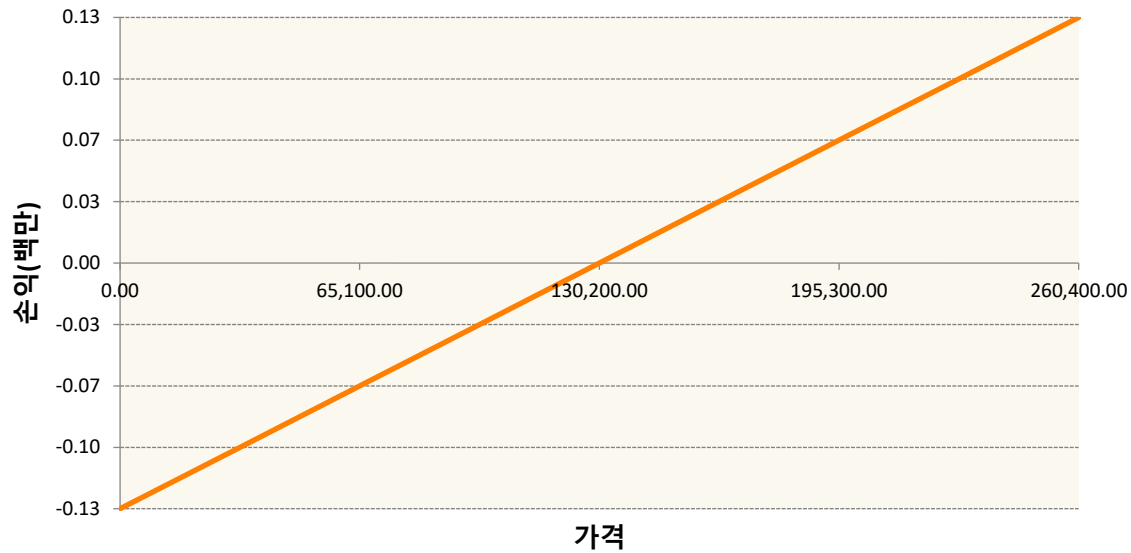
KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



KR41HEW40009-2025-04 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	76
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	4
KR41BHW40 2025-04 한화에어로스페이스개별선물	23
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	4
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물	1
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물	15
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	1
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	1
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물	15
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물	6
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	7
KR41FVW40(2025-04 한화오션개별선물	7
KR41HEW40(2025-04 키움증권개별선물	2

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

(단위:백만원)

361

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

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	2025-03-31
기준일	2025-03-28

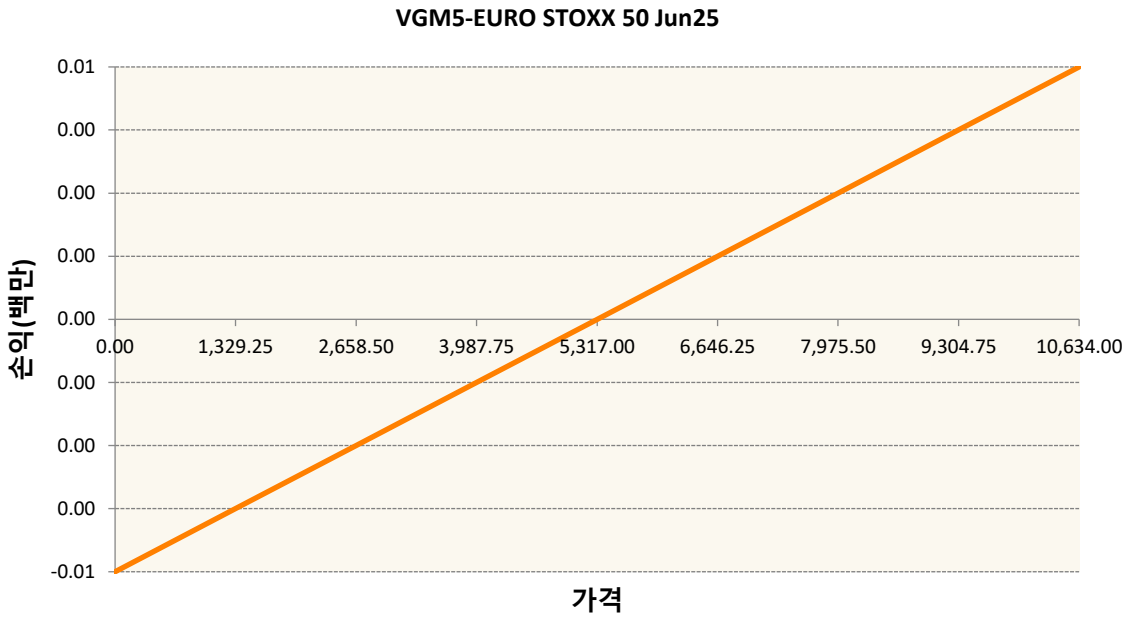
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	930	0	930	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	74
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

51

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

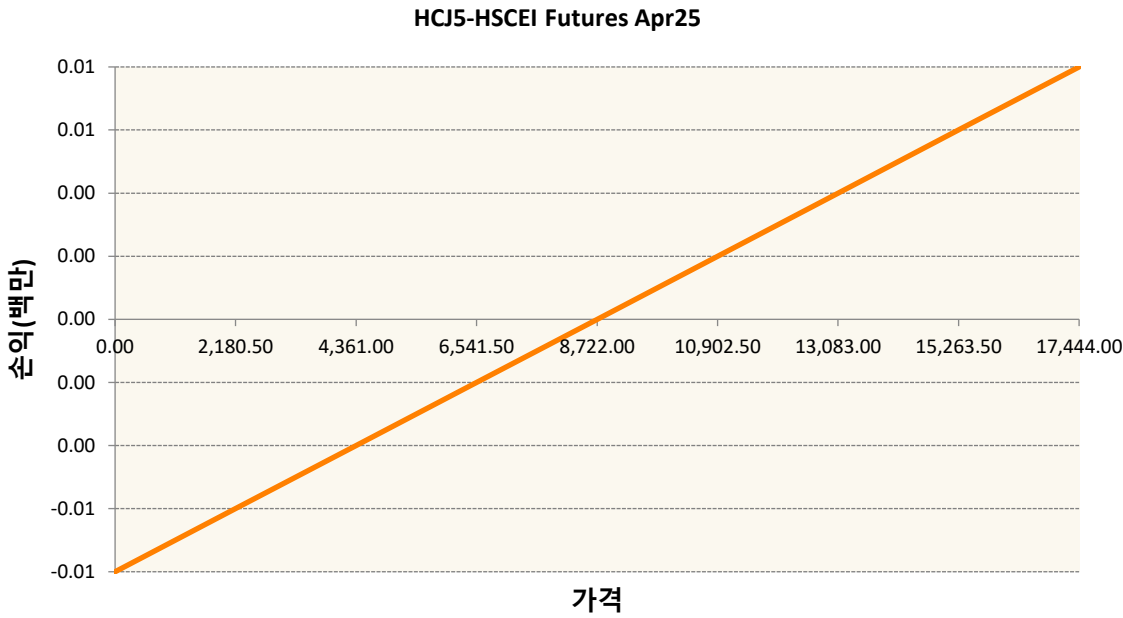
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	3,205	0	3,205	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ5	HSCEI Futures Apr25	256
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

354

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

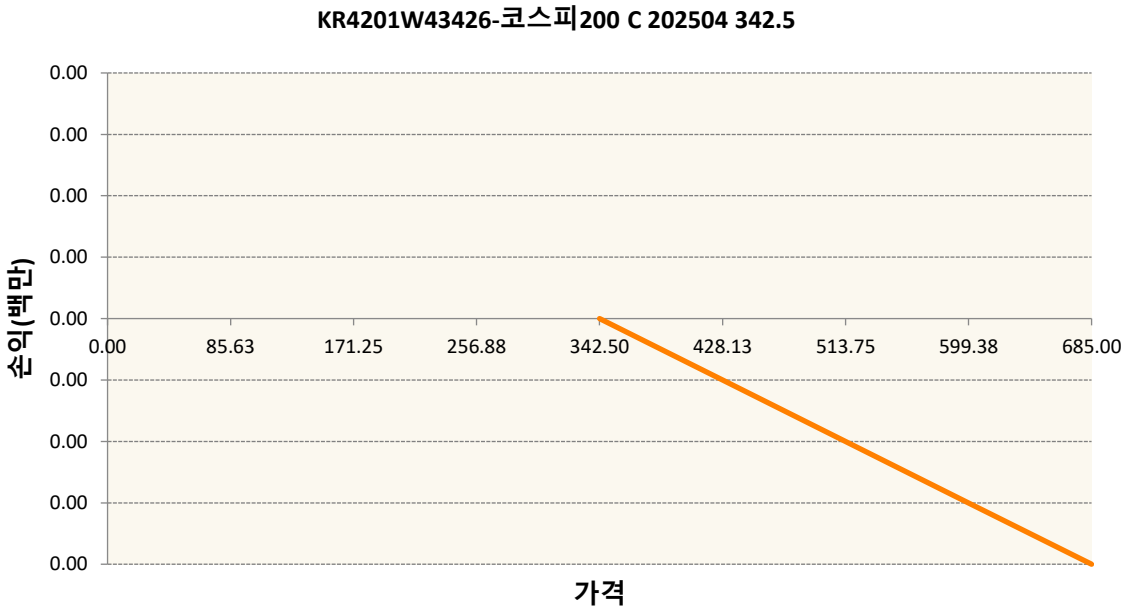
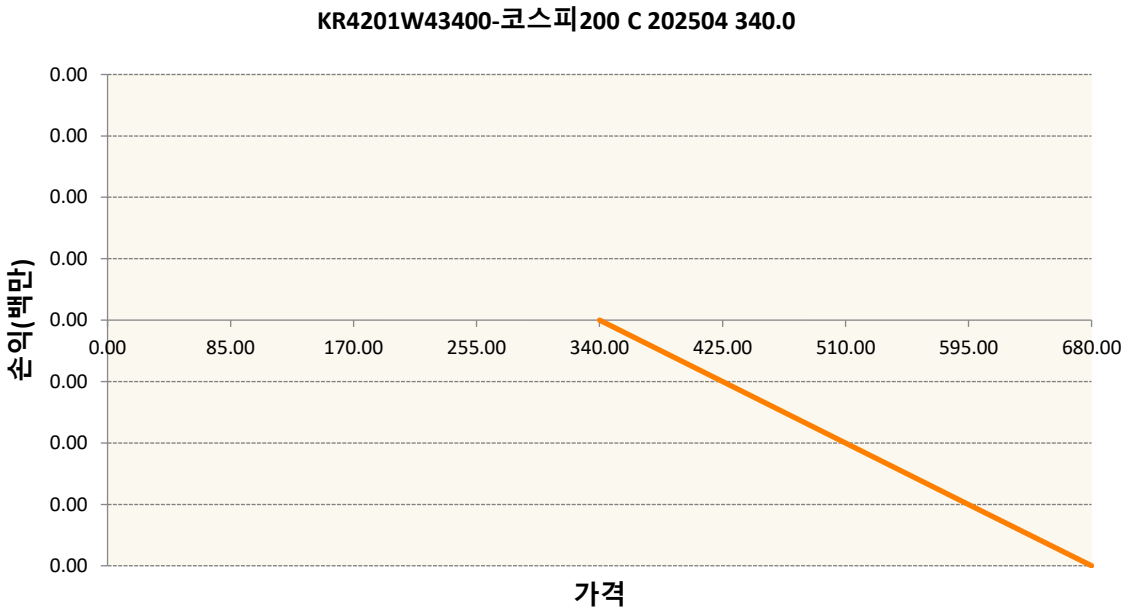
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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)

KR4201W43400코스피200 C 202504 340.0							894
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	284	283	280	277	272	267	260
-5.33%	272	264	256	246	235	224	211
-2.67%	212	196	179	163	146	129	111
0%	55	36	18	0	-18	-37	-55
2.67%	-208	-219	-231	-245	-258	-273	-288
5.33%	-532	-536	-542	-548	-556	-564	-574
8.00%	-877	-878	-880	-882	-885	-889	-894
KR4201W43426코스피200 C 202504 342.5							1,125
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	307	306	303	300	296	290	283
-5.33%	297	290	281	271	259	246	232
-2.67%	241	223	204	184	163	142	120
0%	74	49	25	0	-25	-49	-74
2.67%	-237	-254	-274	-293	-314	-335	-357
5.33%	-646	-654	-663	-674	-687	-700	-715
8.00%	-1,095	-1,097	-1,100	-1,104	-1,110	-1,117	-1,125
KR4301W43408 코스피200 P 202504 340.0							171

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-167	-168	-168	-169	-169	-170	-171
-5.33%	-94	-95	-97	-99	-101	-103	-106
-2.67%	-31	-34	-37	-41	-44	-47	-51
0%	11	7	4	0	-4	-7	-11
2.67%	29	27	24	22	19	16	13
5.33%	34	33	32	31	29	28	26
8.00%	34	34	34	34	33	32	32
KR4301W43424 코스피200 P 202504 342.5							242

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-238	-238	-238	-239	-240	-241	-242
-5.33%	-139	-140	-142	-144	-146	-149	-151
-2.67%	-49	-53	-57	-61	-65	-69	-74
0%	15	10	5	0	-5	-10	-15
2.67%	47	43	40	36	31	27	23
5.33%	57	55	54	51	49	46	44
8.00%	58	58	57	57	56	55	53

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

(단위:백만원)

2,617

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

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	555	0	555	

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	2025-03-31
기준일	2025-03-28

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	4,467	0	4,467	

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	2025-03-31
기준일	2025-03-28

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	12,979	0	12,979	
누계	통화	선도	367	15,956	-15,589	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213ECT(KRW/USD 31-03-25E		262
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E		214
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E		217
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E		352
FXW213F3C(USD/KRW 31-03-25E		29
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E		232
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	563

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

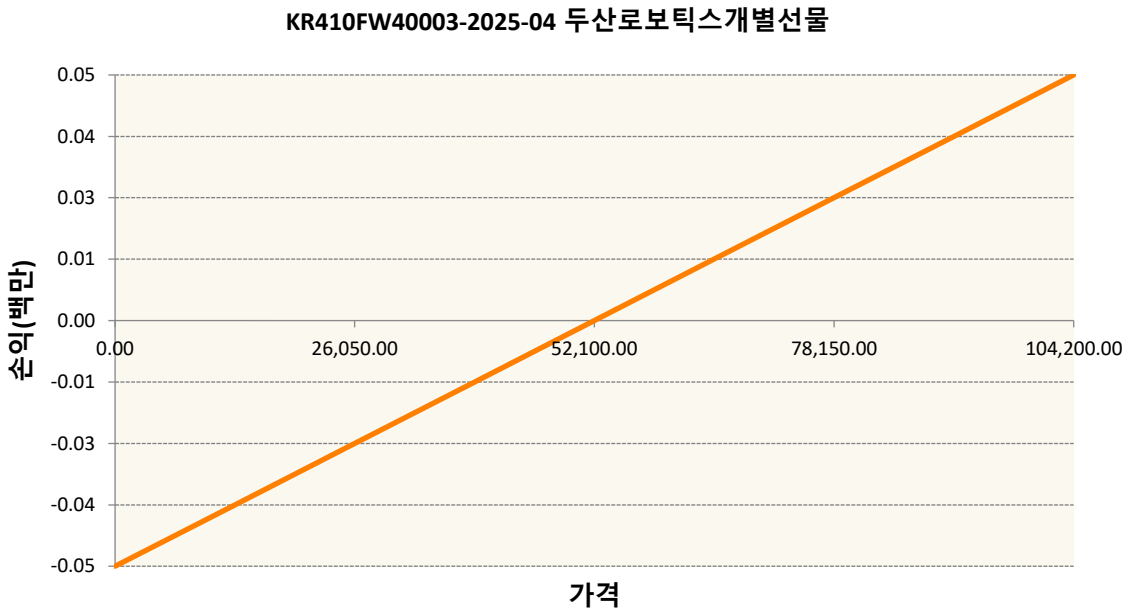
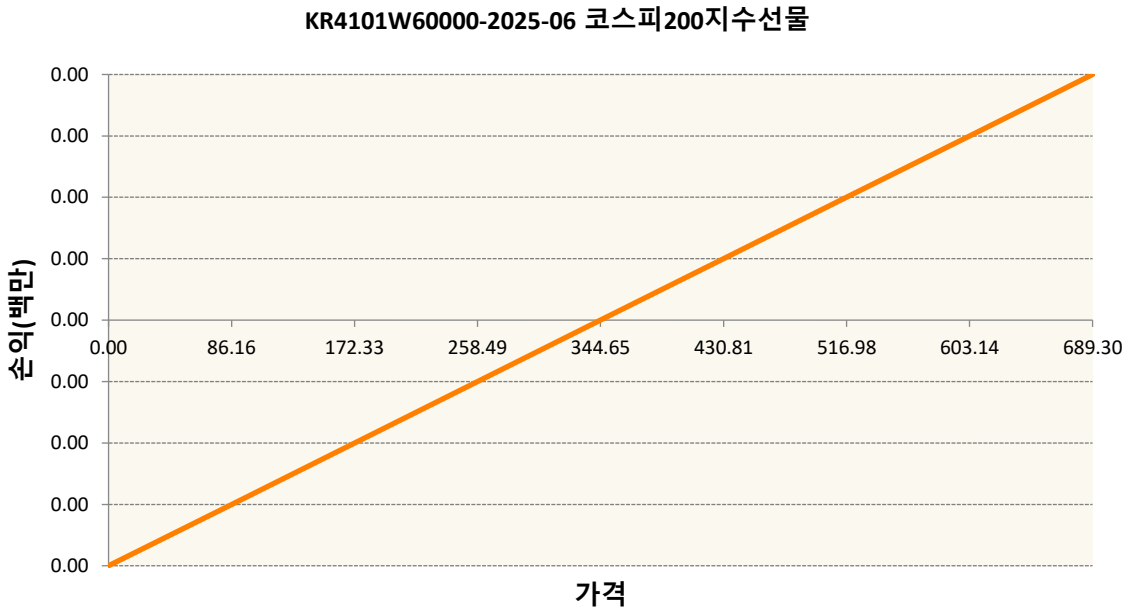
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

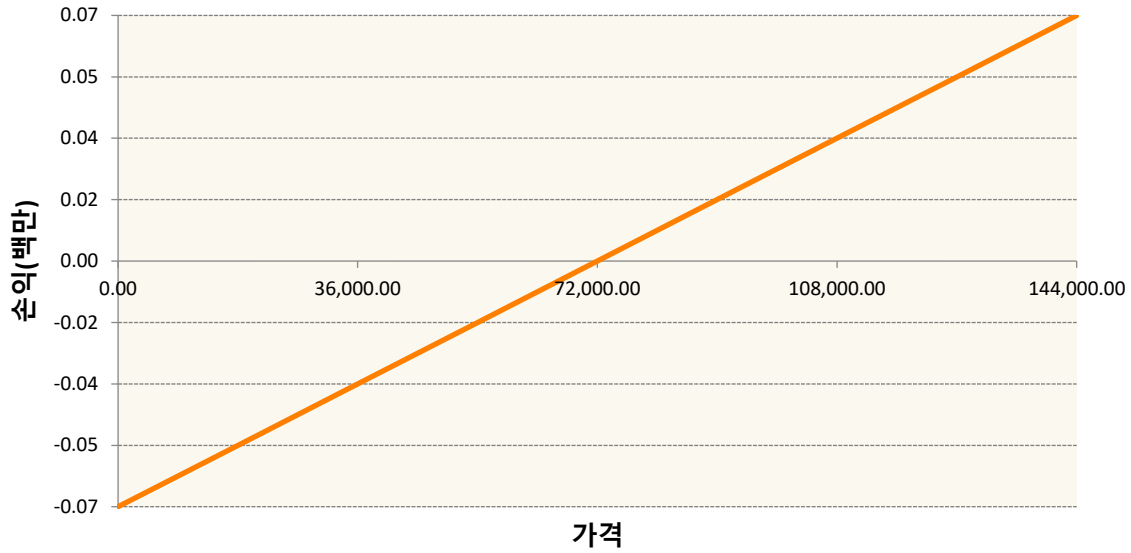
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,131	0	1,131	장내

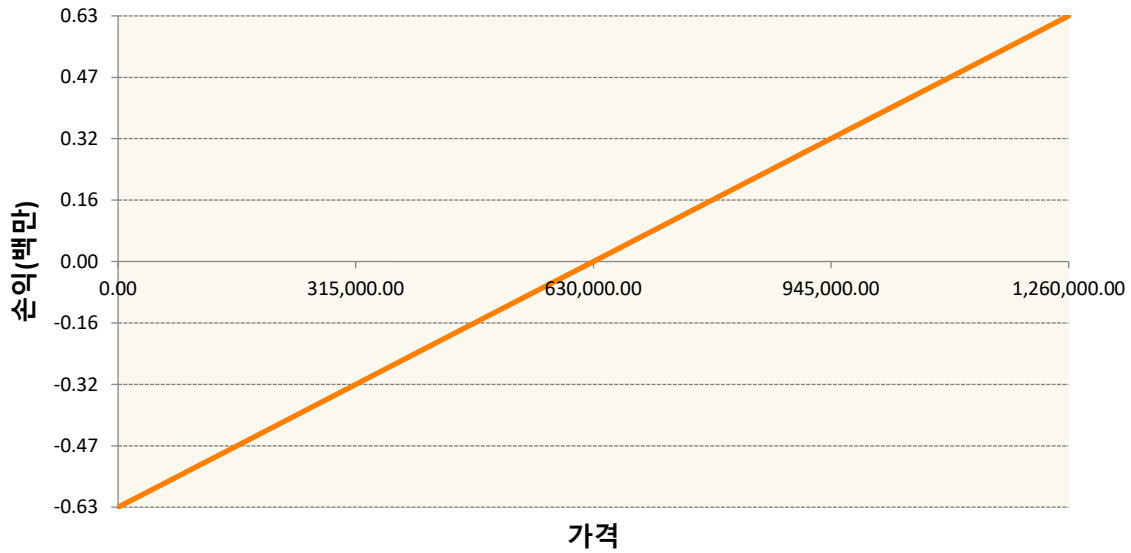
2. 만기시점의 손익구조



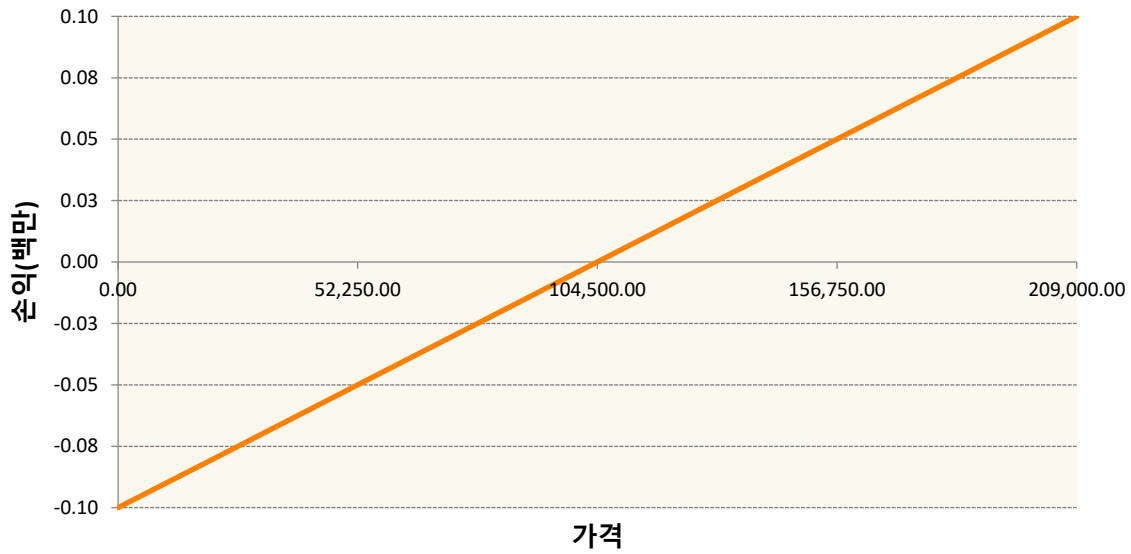
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



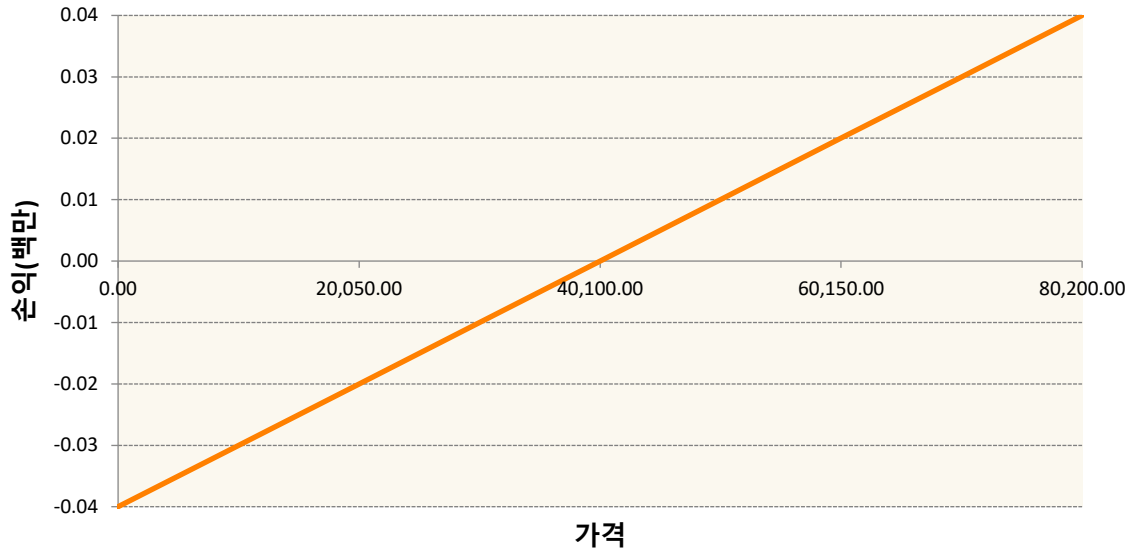
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



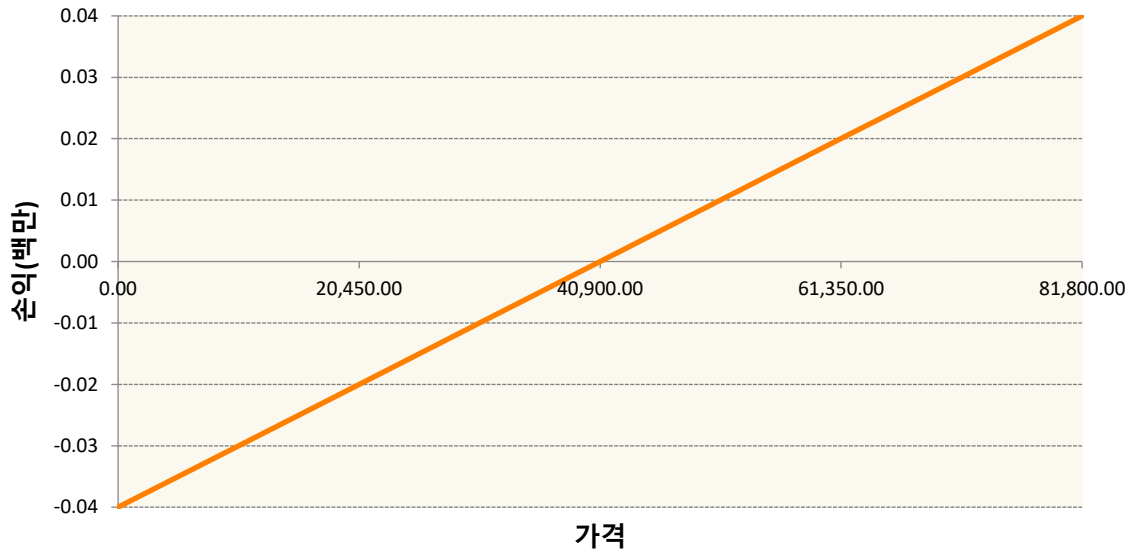
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



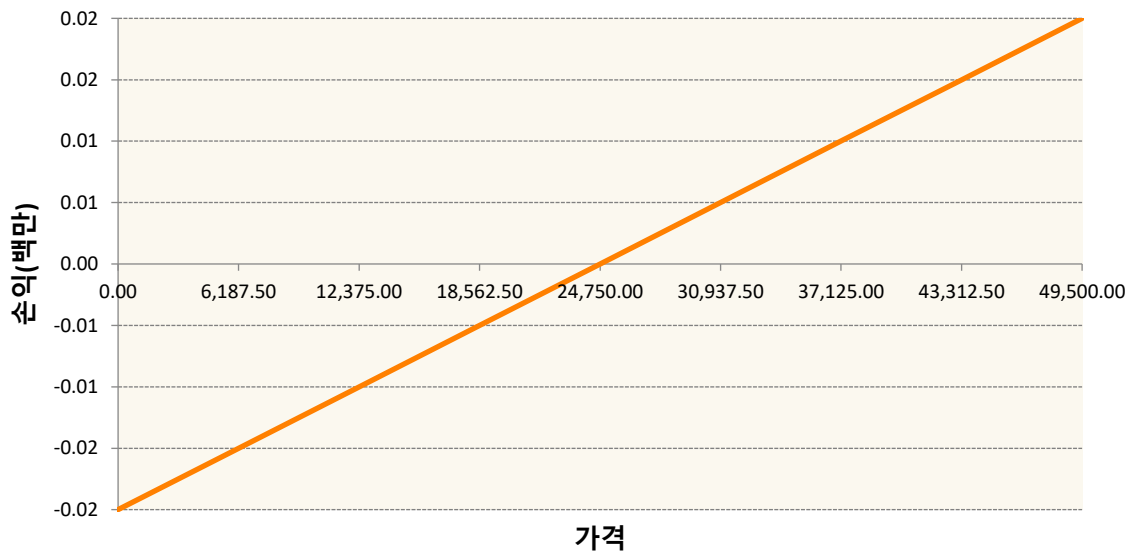
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



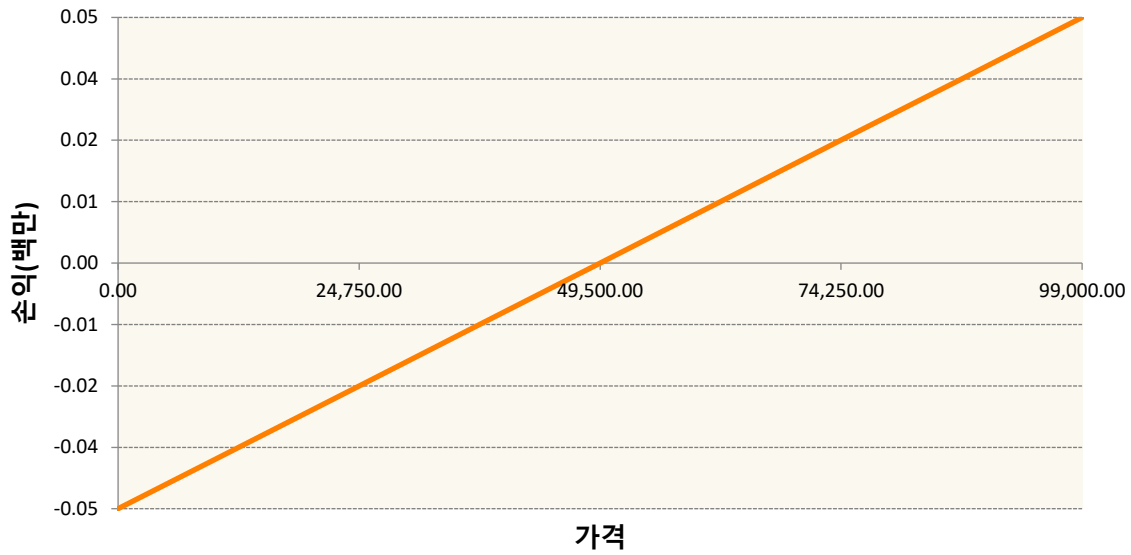
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



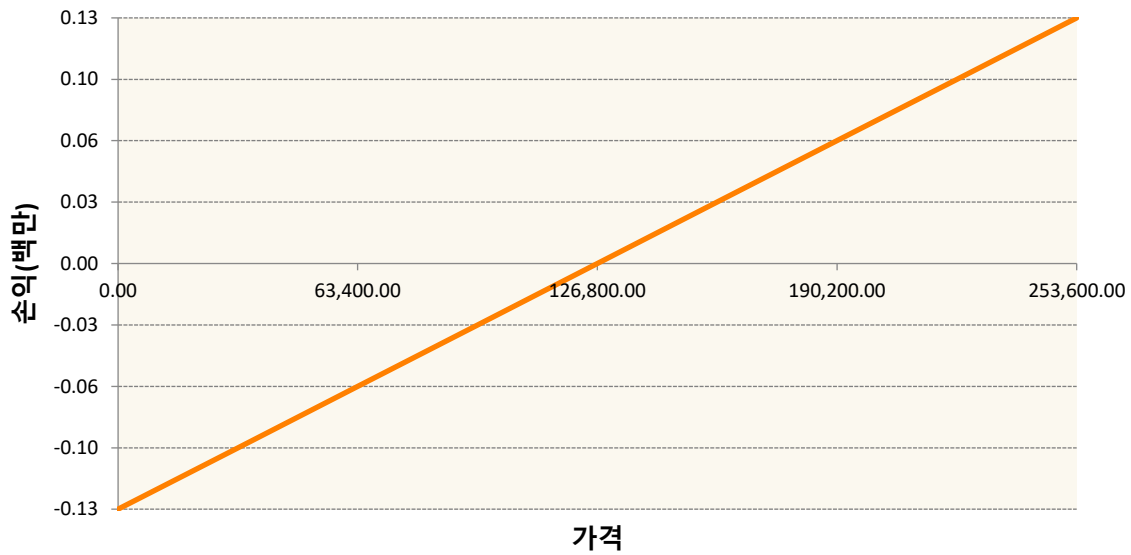
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



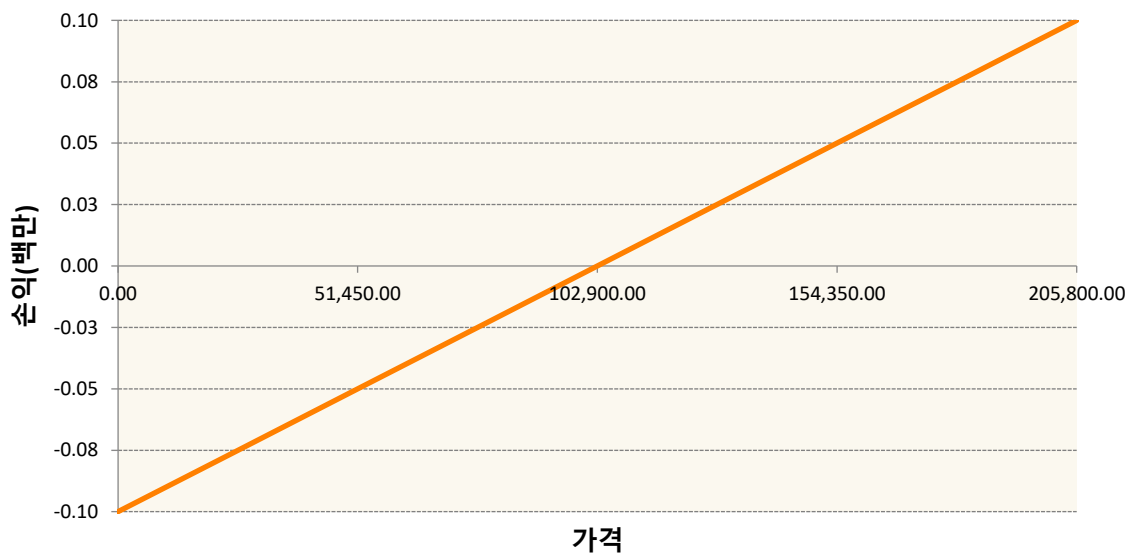
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



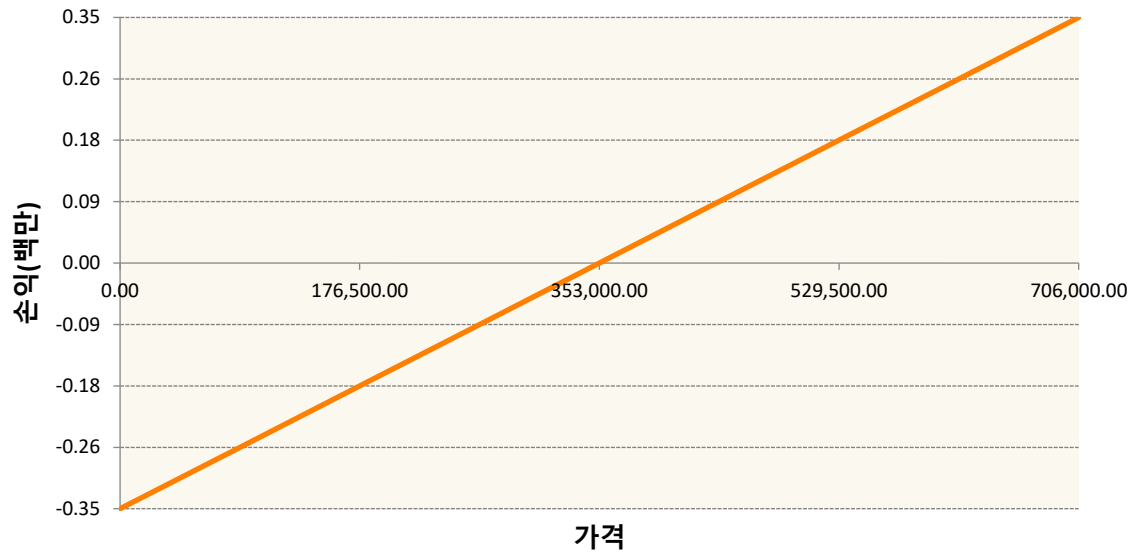
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



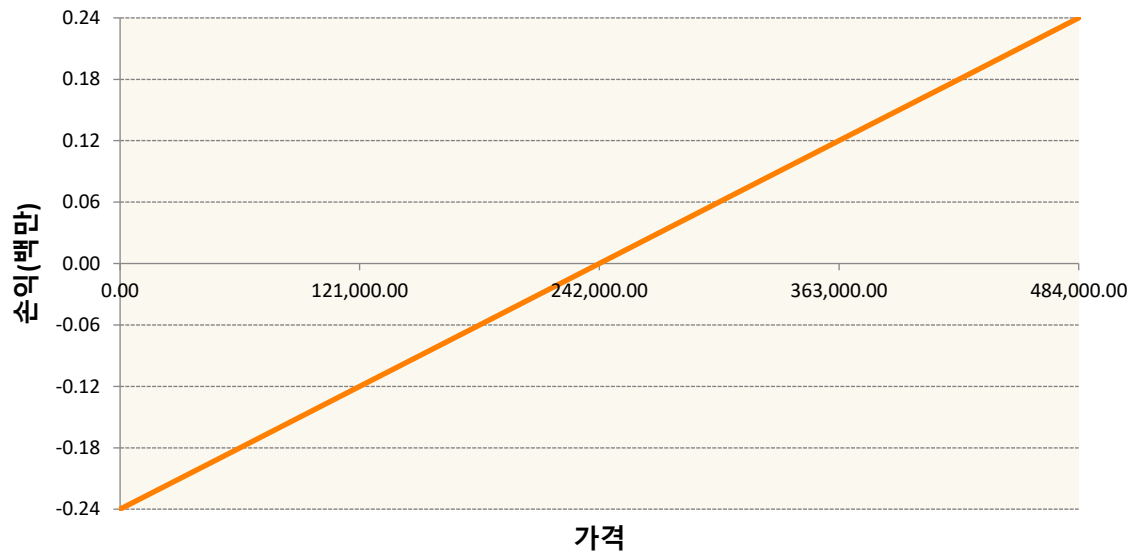
KR41EYW40004-2025-04 에코프로비엠개별선물



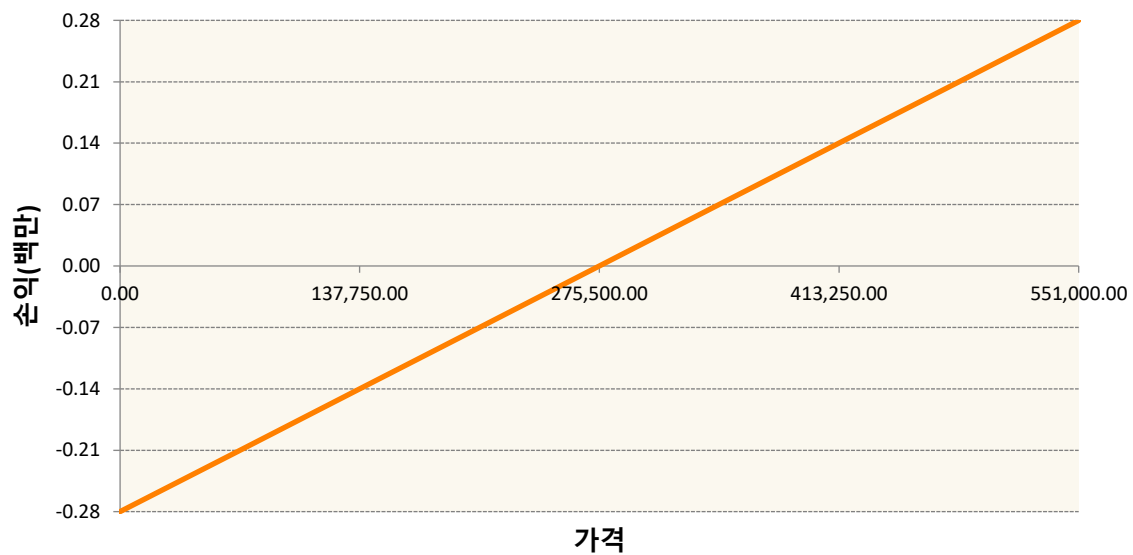
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



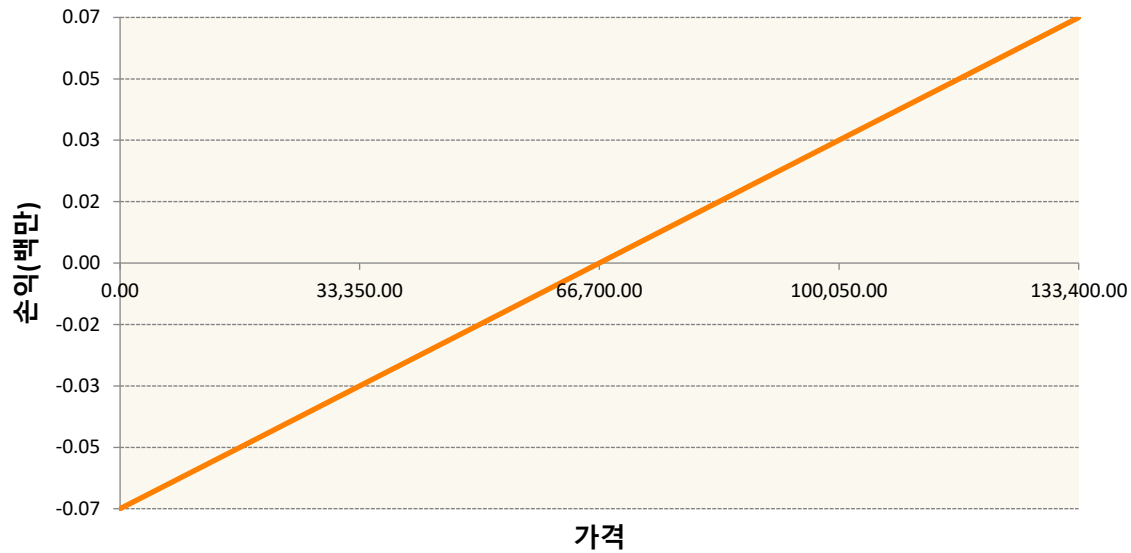
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



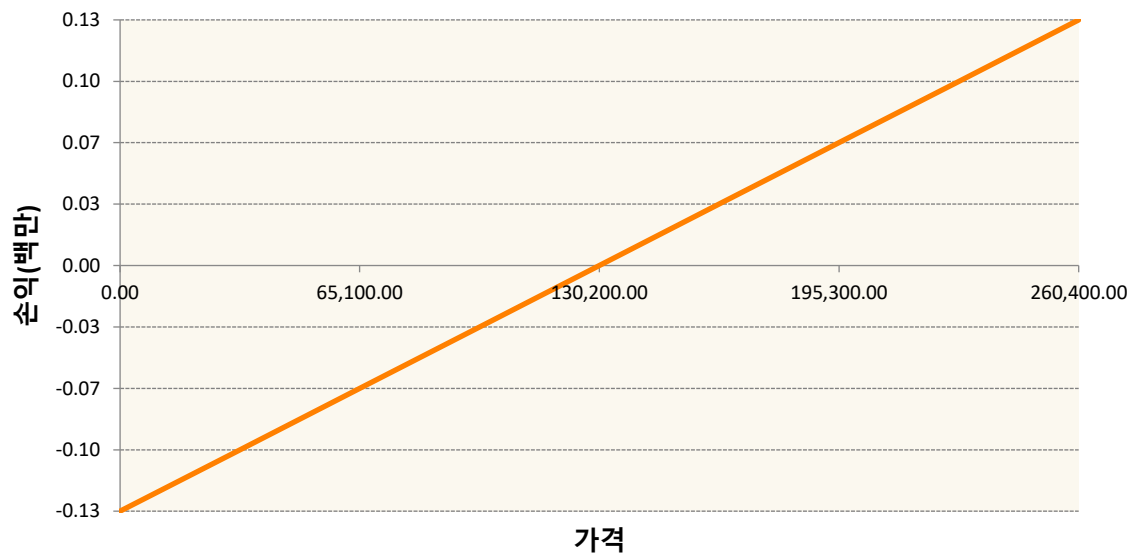
KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



KR41HEW40009-2025-04 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	48
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	2
KR41BHW40 2025-04 한화에어로스페이스개별선물	10
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	2
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	2
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물	6

KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물
KR41FVW40(2025-04 한화오션개별선물
KR41HEW40(2025-04 키움증권개별선물

	3
	3
	3
	1

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

(단위:백만원)

183

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

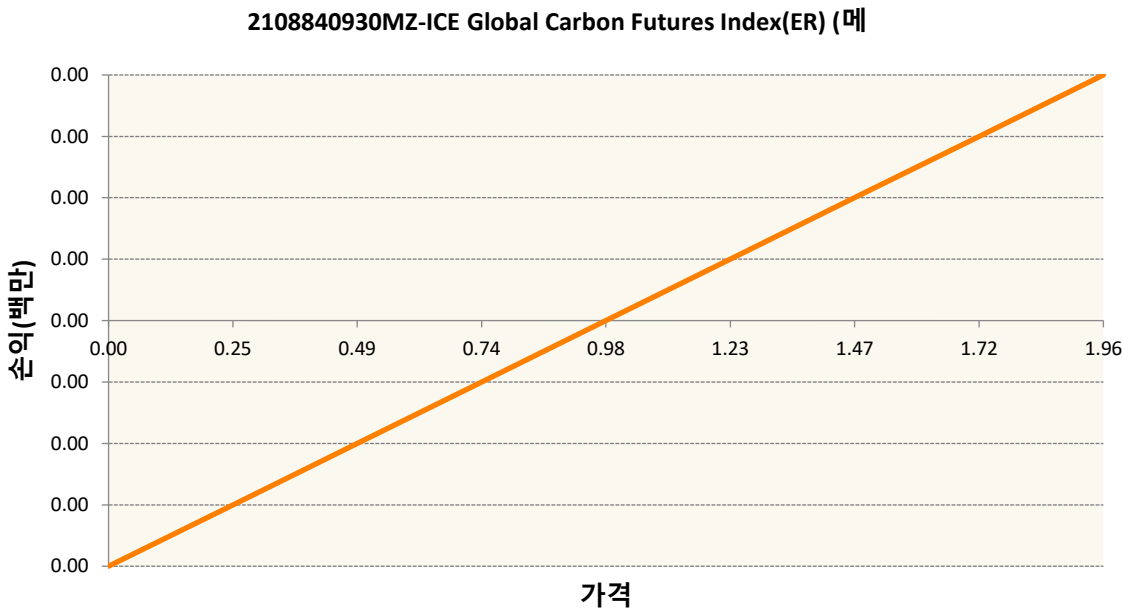
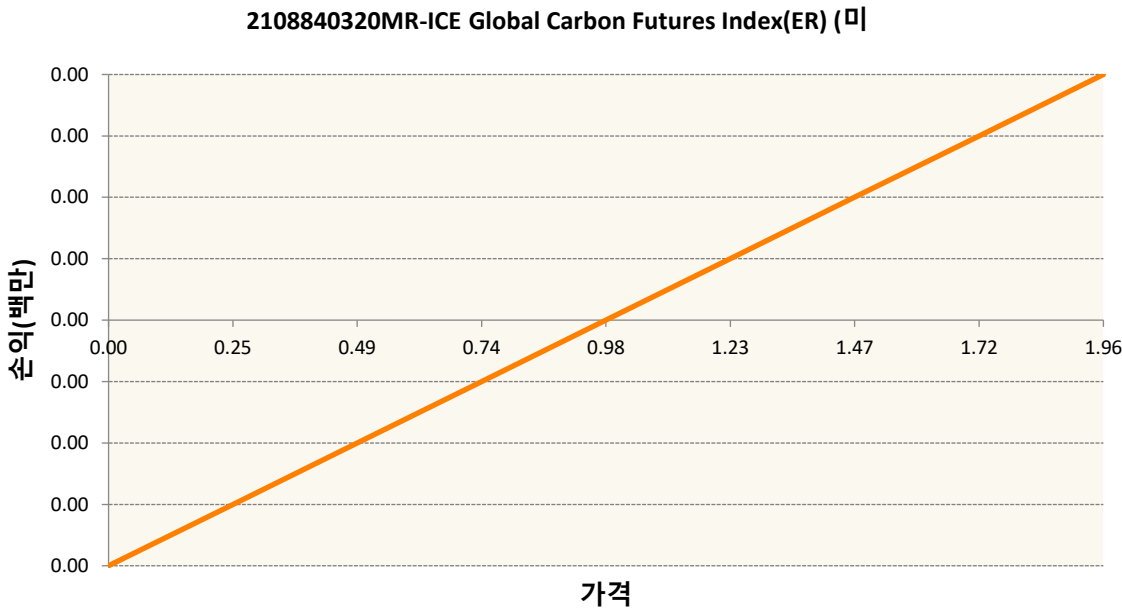
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,642	0	9,642	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	579
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	194

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	871

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

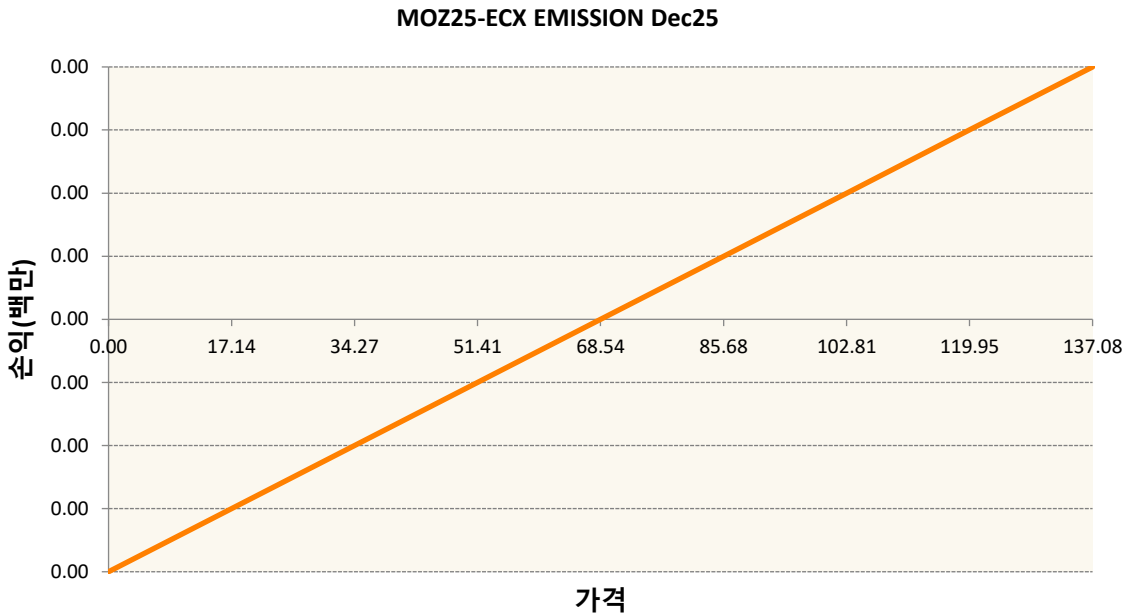
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,189	0	5,189	
누계	통화	선도	0	2,197	-2,197	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	1
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E	83
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	14
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	79
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	416

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

(단위:백만원)

824

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

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)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	3

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

(단위:백만원)

15

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

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	8,845	0	8,845	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	11
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

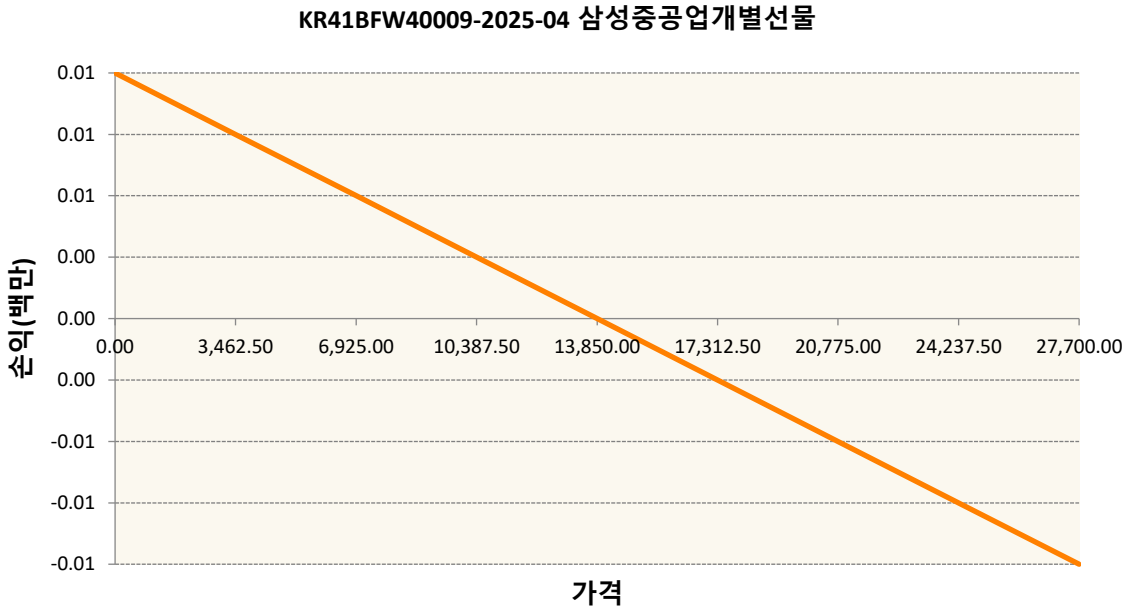
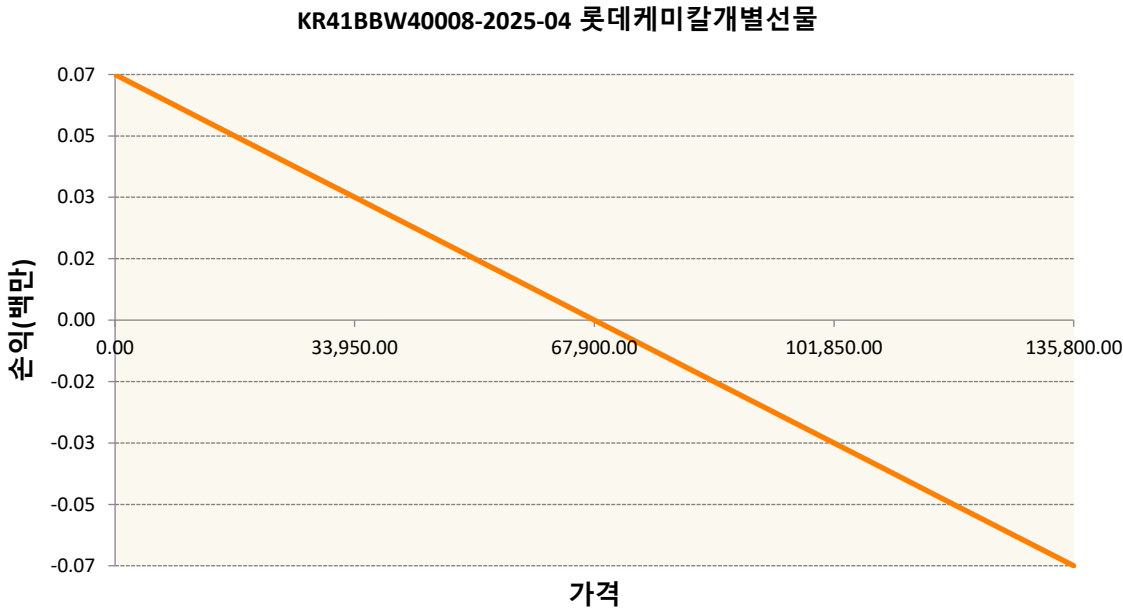
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

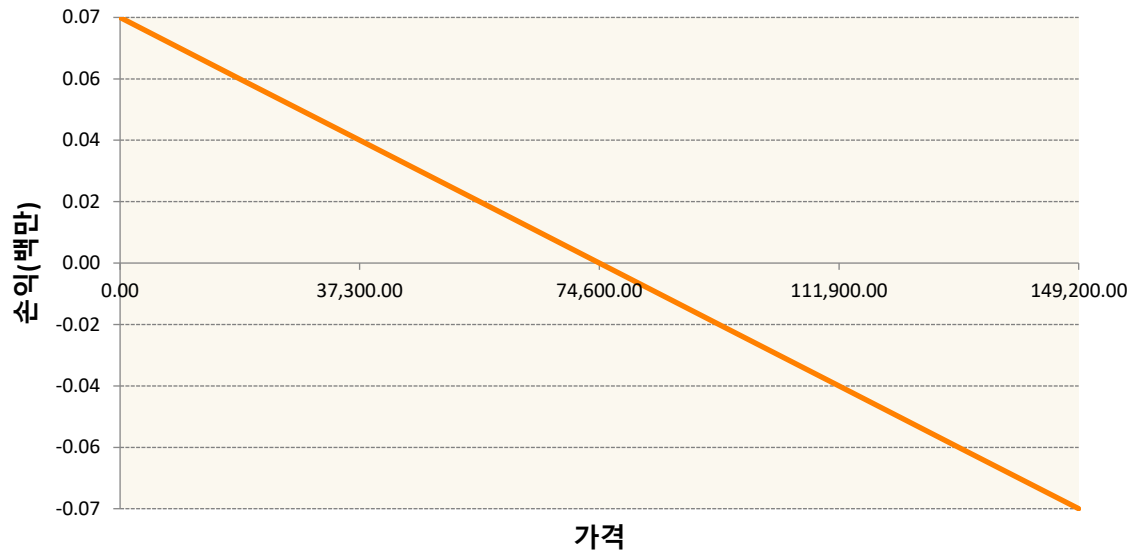
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2	40	-38	장내
누계	유가증권	선물	7	78	-71	장내

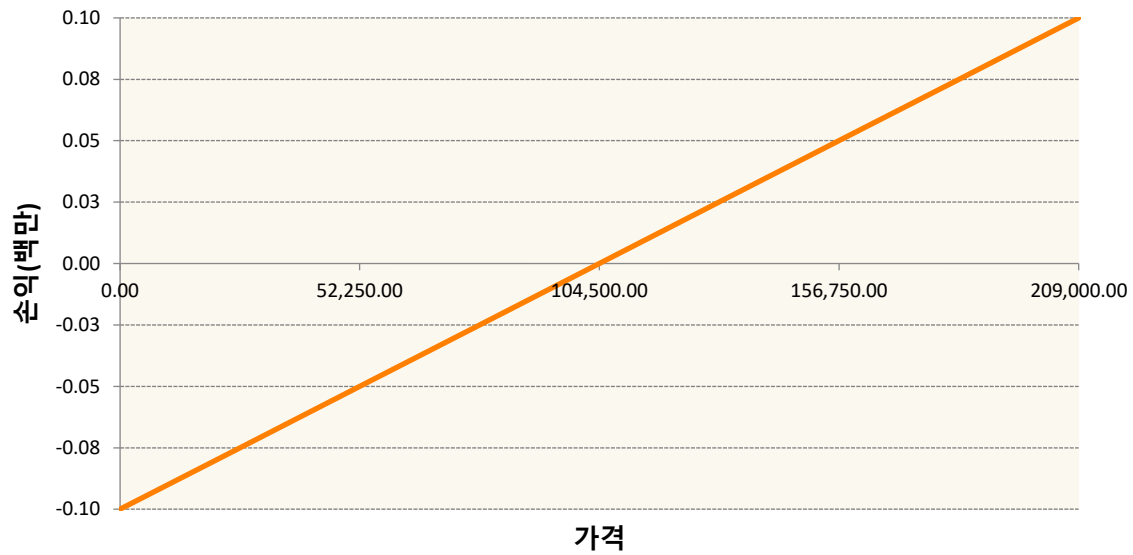
2. 만기시점의 손익구조



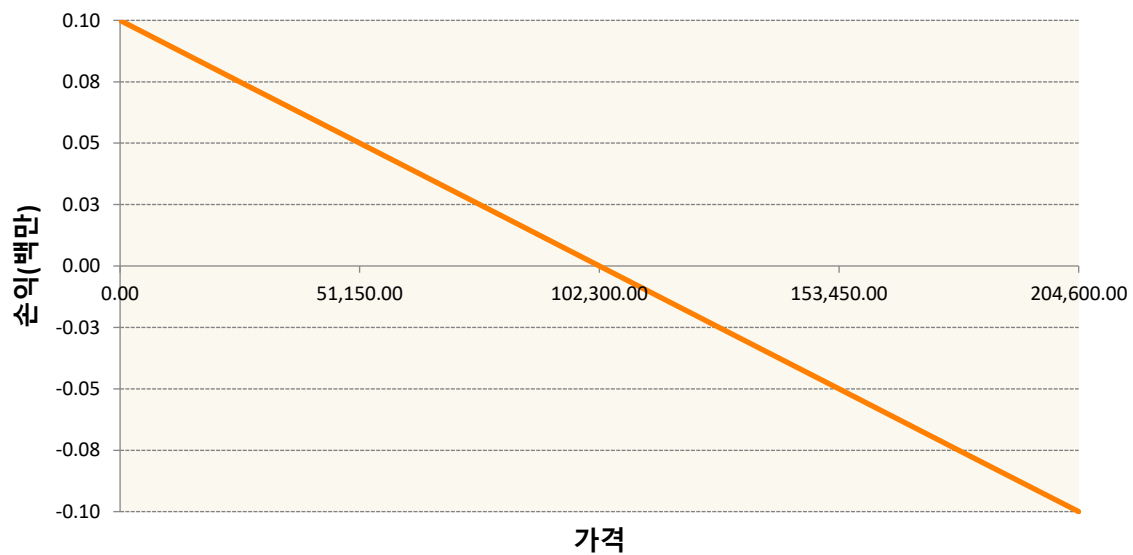
KR41BMW40005-2025-04 한국항공우주개별선물



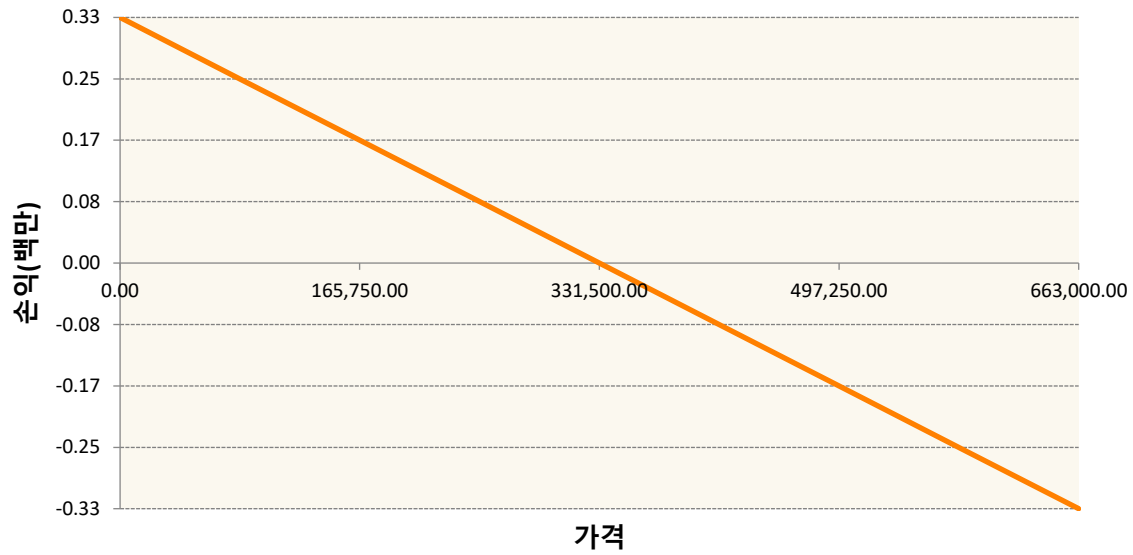
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



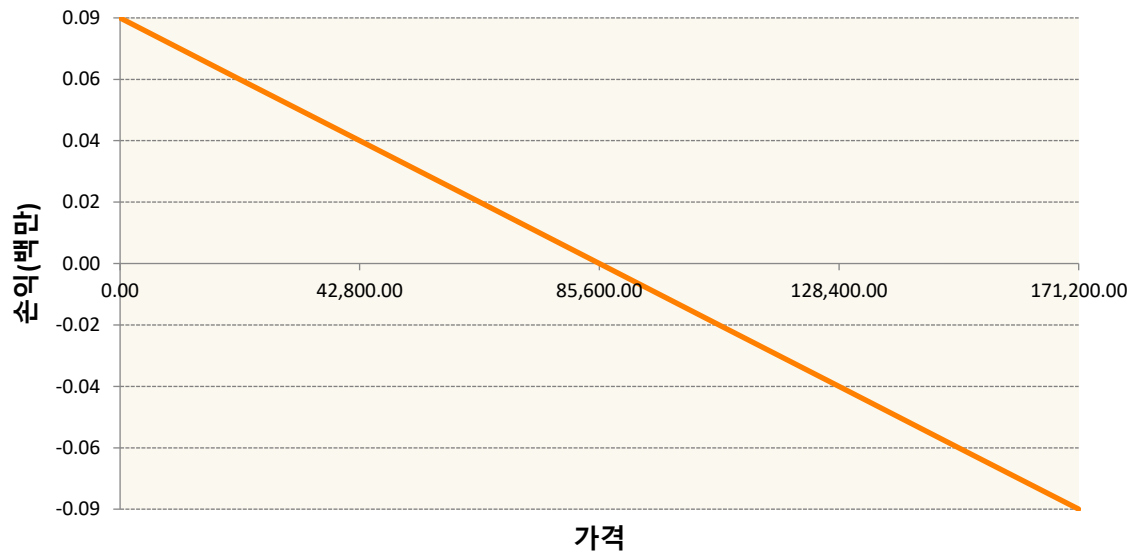
KR41CDW40002-2025-04 HD현대미포개별선물



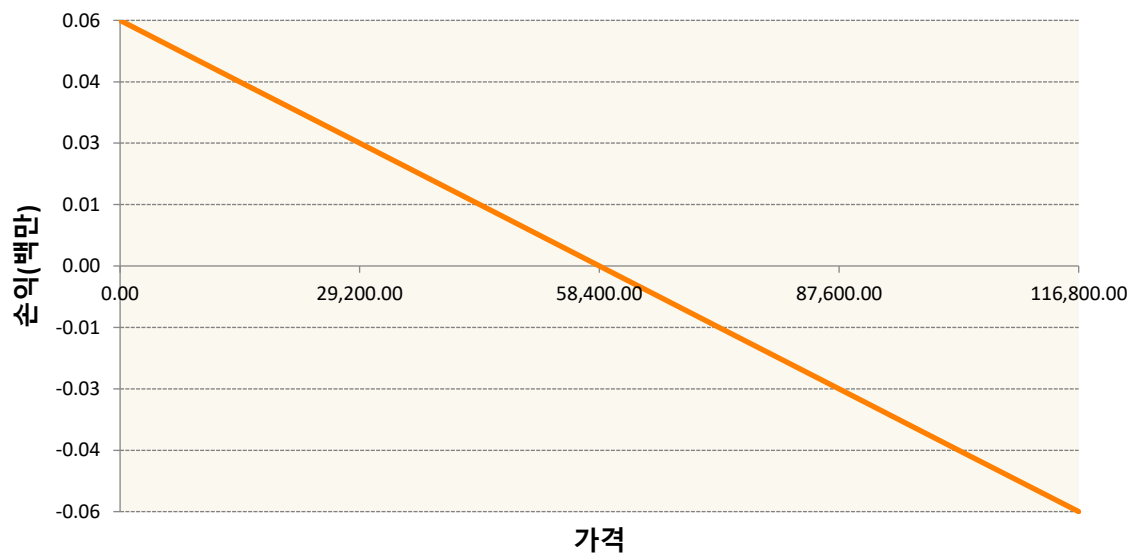
KR41CRW40002-2025-04 LG생활건강개별선물



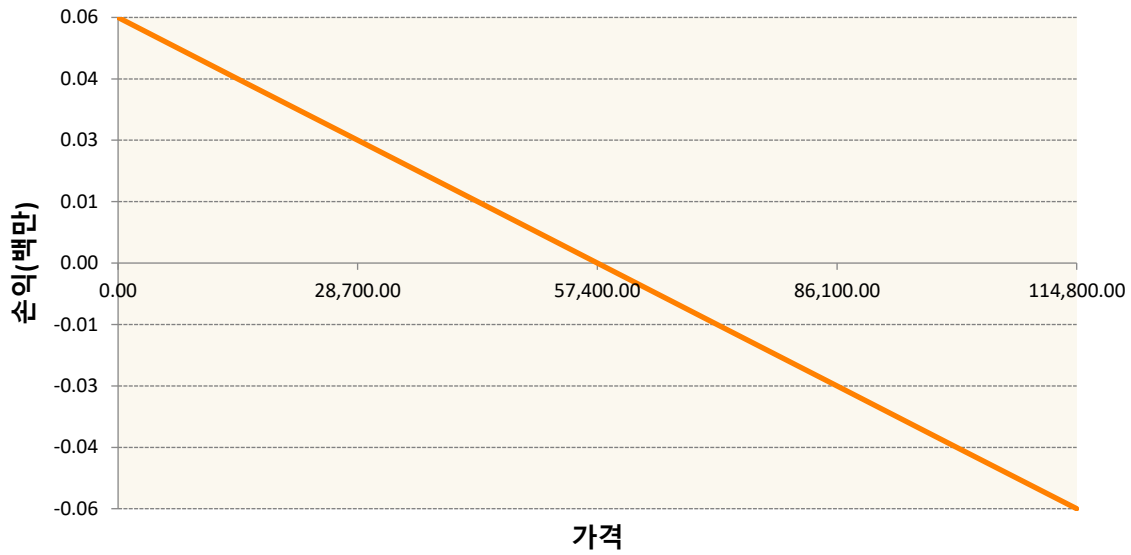
KR41CWW40002-2025-04 코웨이개별선물



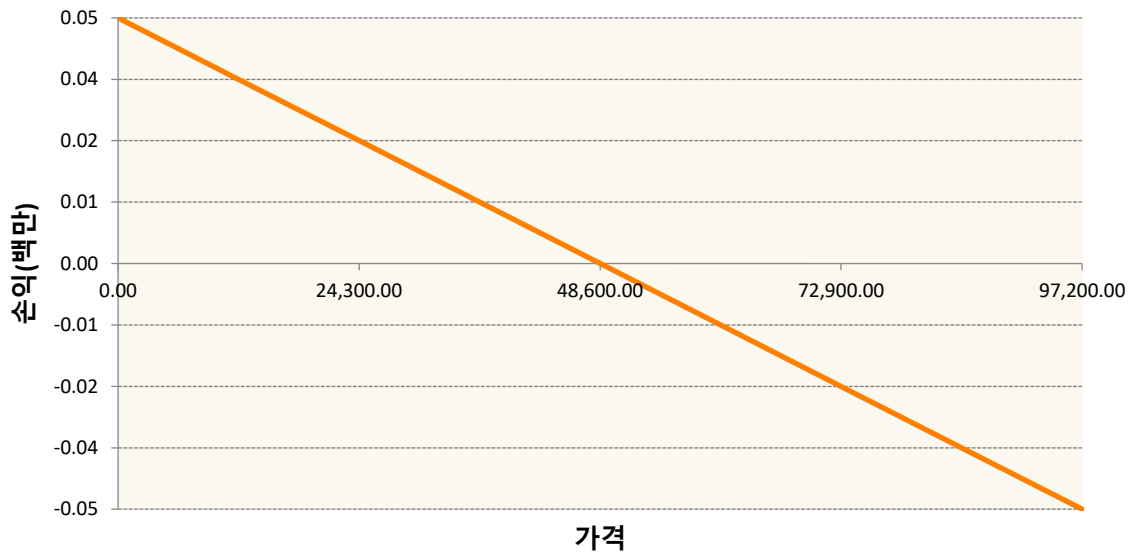
KR41D8W40003-2025-04 현대백화점개별선물



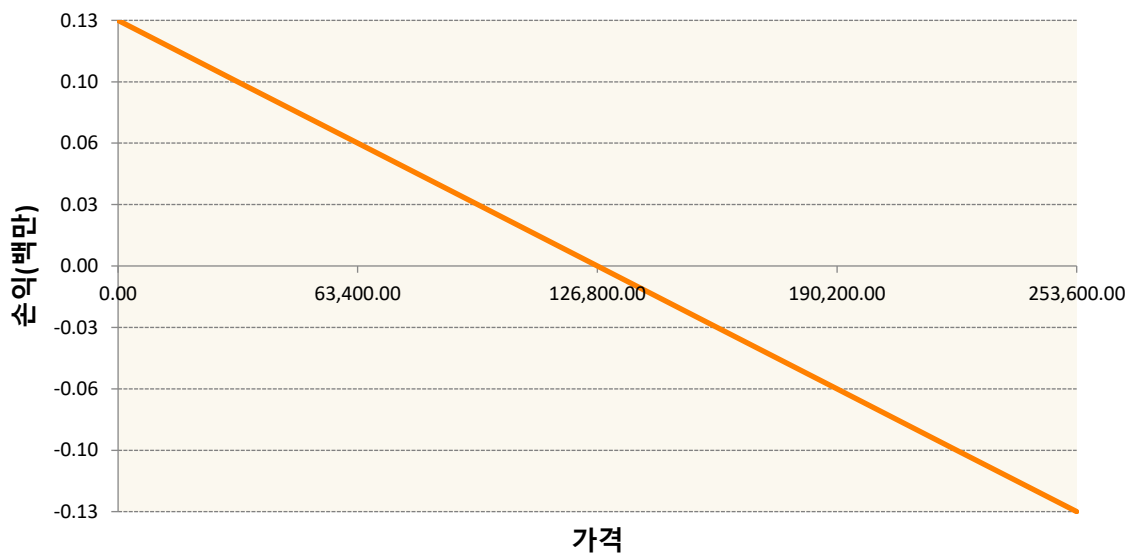
KR41DTW40006-2025-04 CJ ENM개별선물



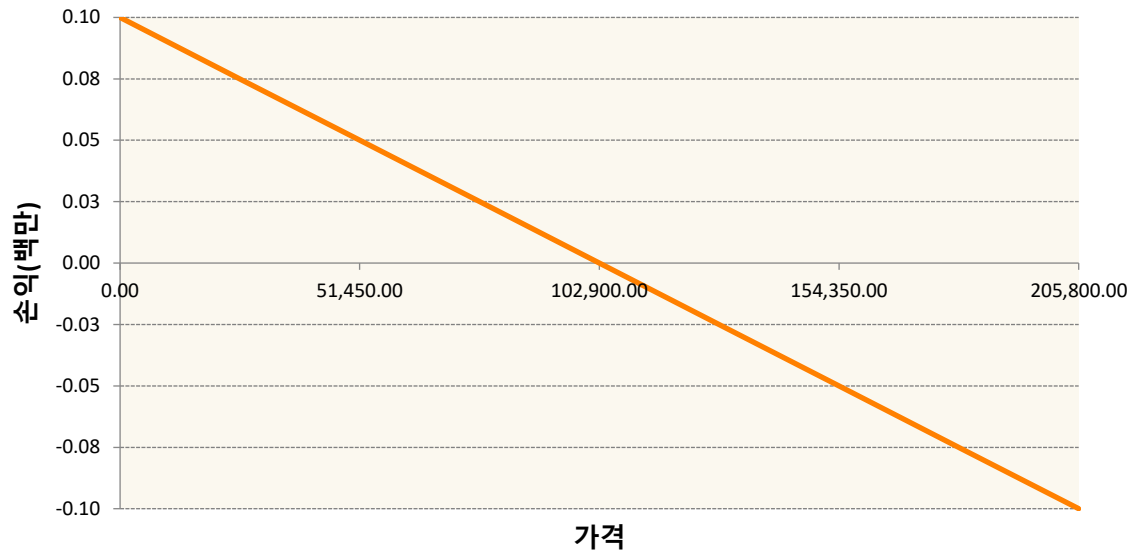
KR41DWW40000-2025-04 두산밥캣개별선물



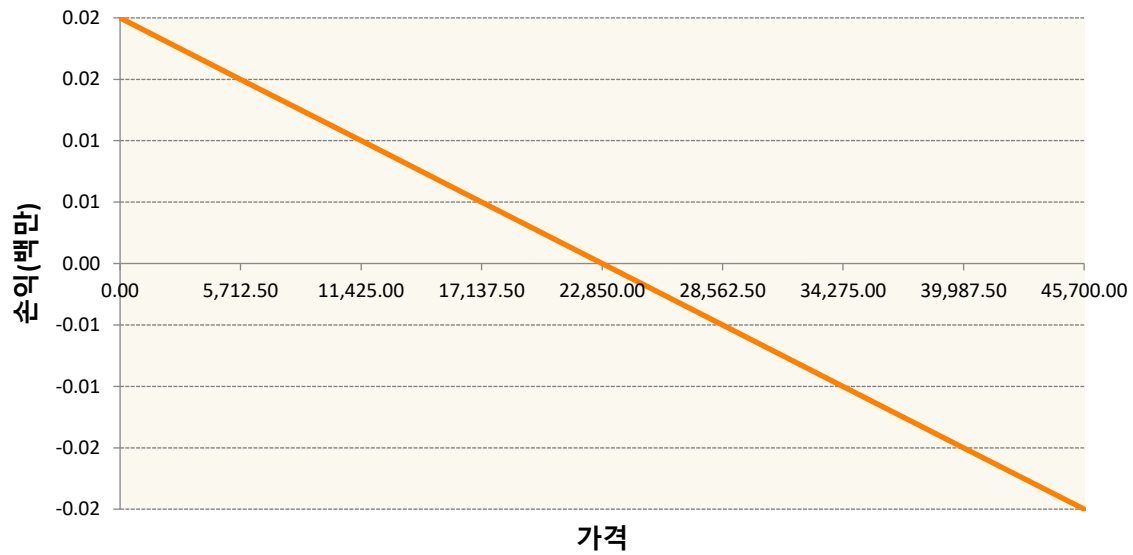
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



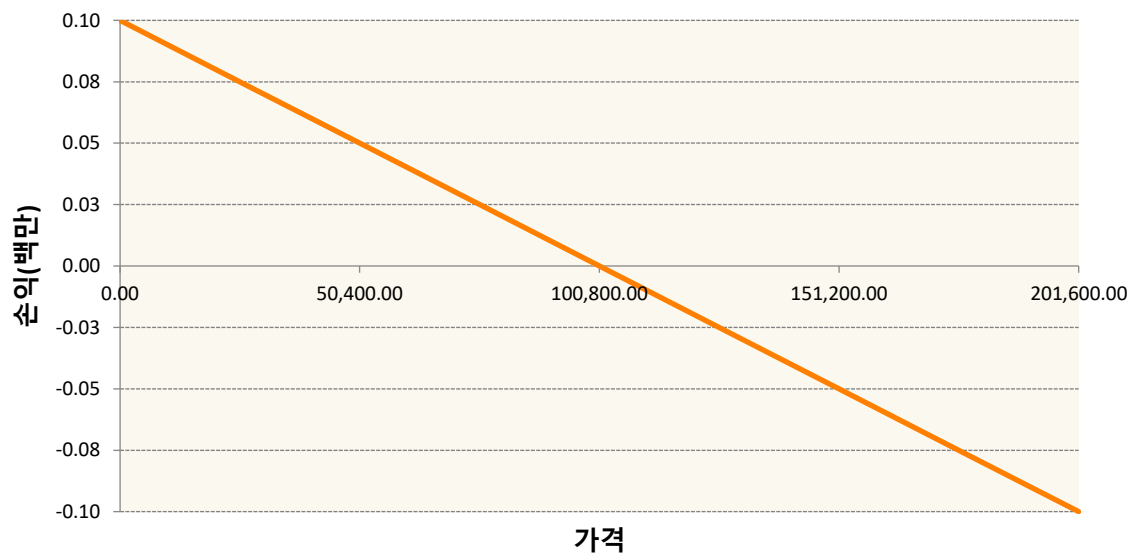
KR41EYW40004-2025-04 에코프로비엠개별선물



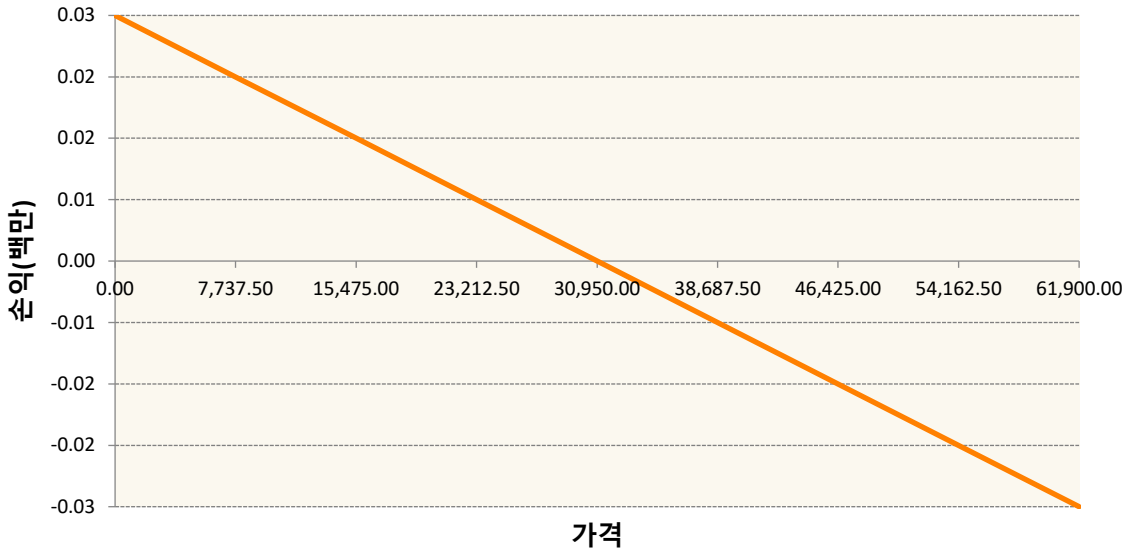
KR41F6W40005-2025-04 카카오뱅크개별선물



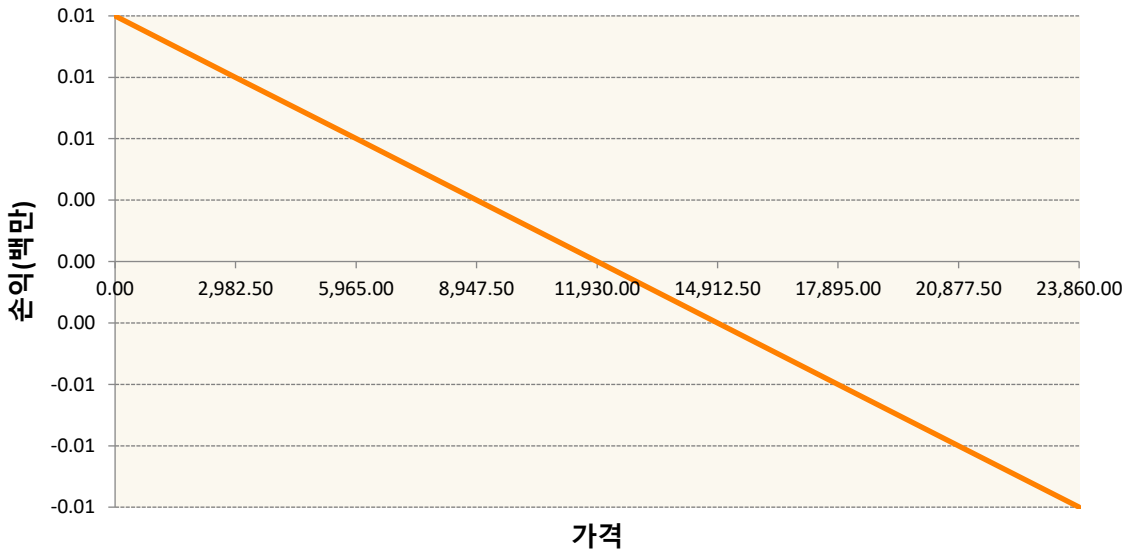
KR41FFW40000-2025-04 SK바이오팜개별선물



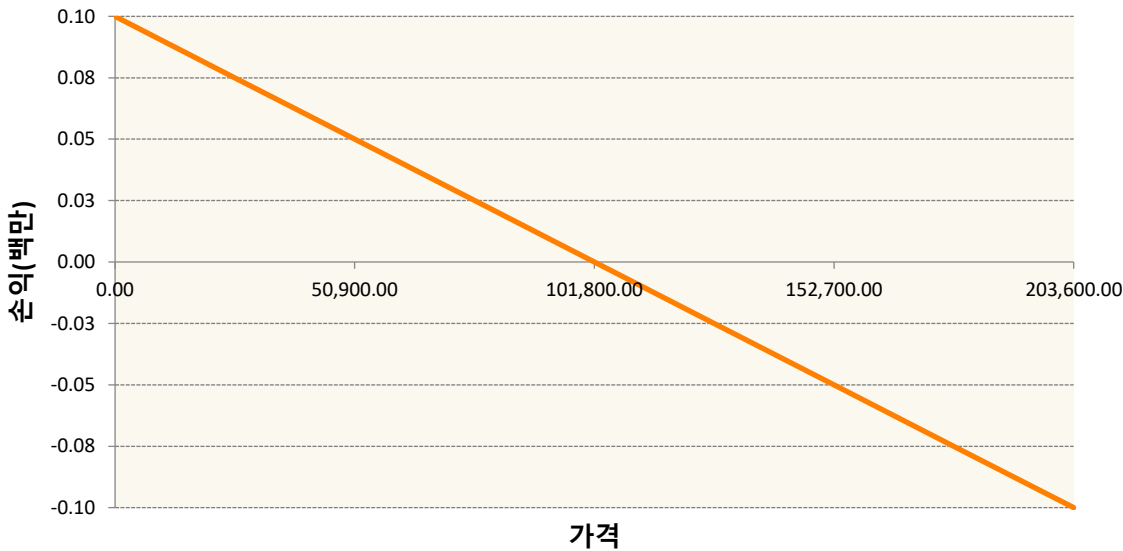
KR41FLW40008-2025-04 풀어비스개별선물



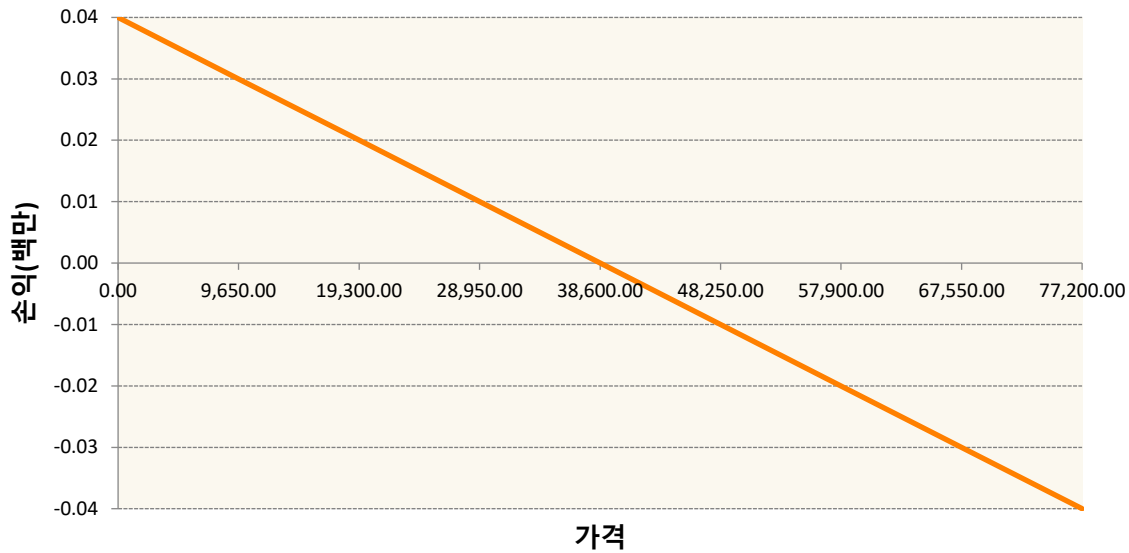
KR41FWW40005-2025-04 대한전선개별선물



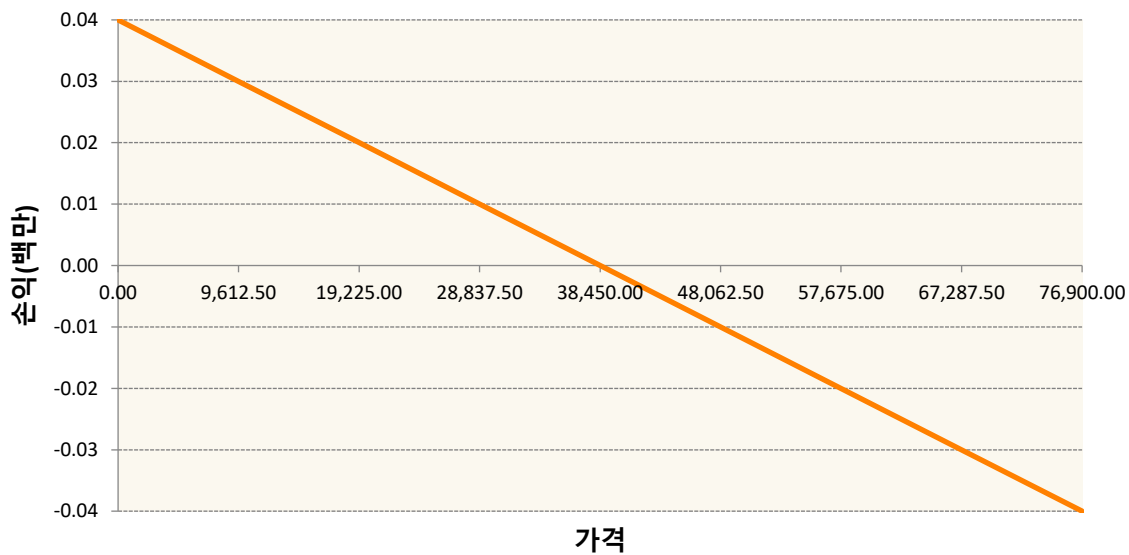
KR41G6W40004-2025-04 현대로템개별선물



KR41GYW40009-2025-04 에스엘개별선물



KR41HJW40008-2025-04 휠라홀딩스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR41BBW40(2025-04 롯데케미칼개별선물	0.16
KR41BFW40(2025-04 삼성중공업개별선물	0.44
KR41BMW4C 2025-04 한국항공우주개별선물	0.12
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	1
KR41CDW40 2025-04 HD현대미포개별선물	0.33
KR41CRW40 2025-04 LG생활건강개별선물	1
KR41CWW4(2025-04 코웨이개별선물	0.48
KR41D8W40 2025-04 현대백화점개별선물	0.28
KR41DTW40(2025-04 CJ ENM개별선물	0.37
KR41DWW4(2025-04 두산밥캣개별선물	0.27
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물	0.2
KR41EYW40(2025-04 에코프로비엠개별선물	0.25

KR41F6W40(2025-04 카카오뱅크개별선물	0.05
KR41FFW40(2025-04 SK바이오팜개별선물	0.32
KR41FLW40(2025-04 펄어비스개별선물	0.47
KR41FWW40 2025-04 대한전선개별선물	0.3
KR41G6W40(2025-04 현대로템개별선물	0.33
KR41GYW40 2025-04 에스엘개별선물	0.49
KR41HJW40(2025-04 휠라홀딩스개별선물	0.31

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

(단위:백만원)

15

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

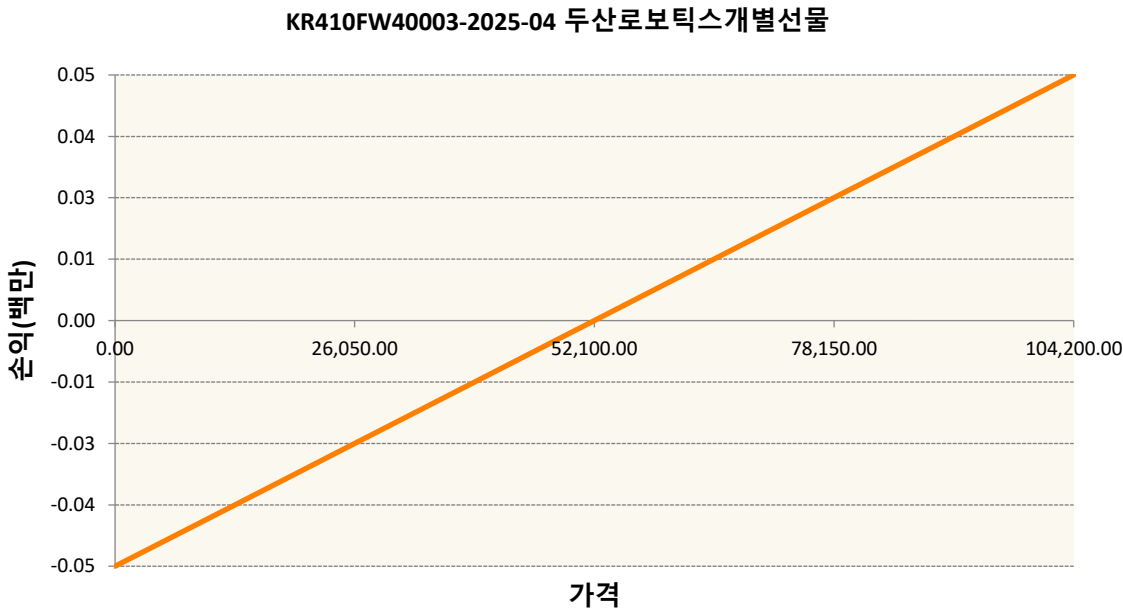
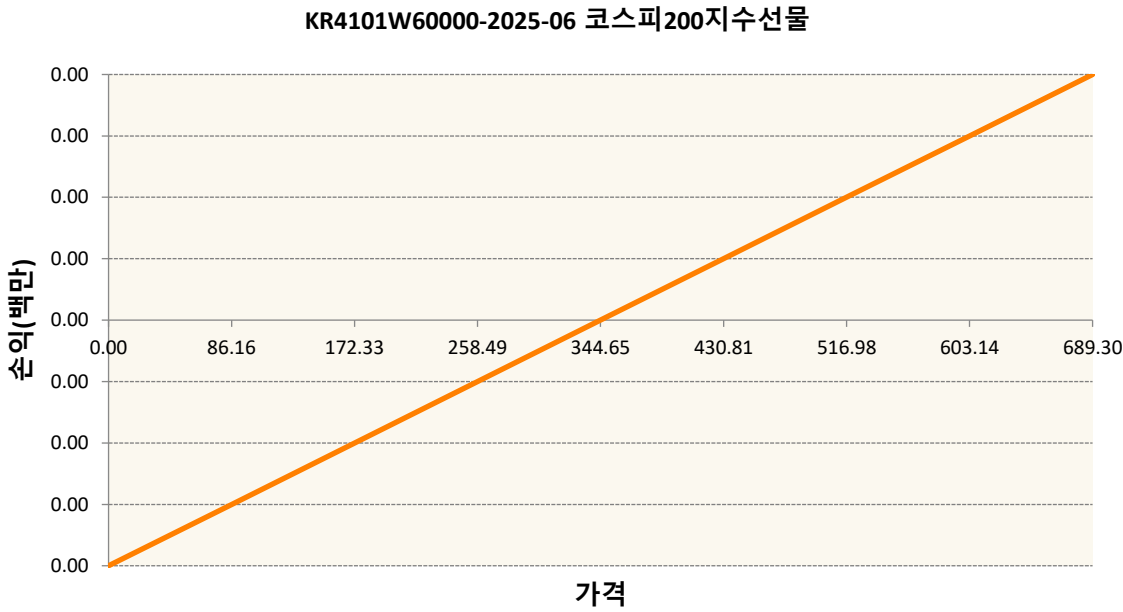
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

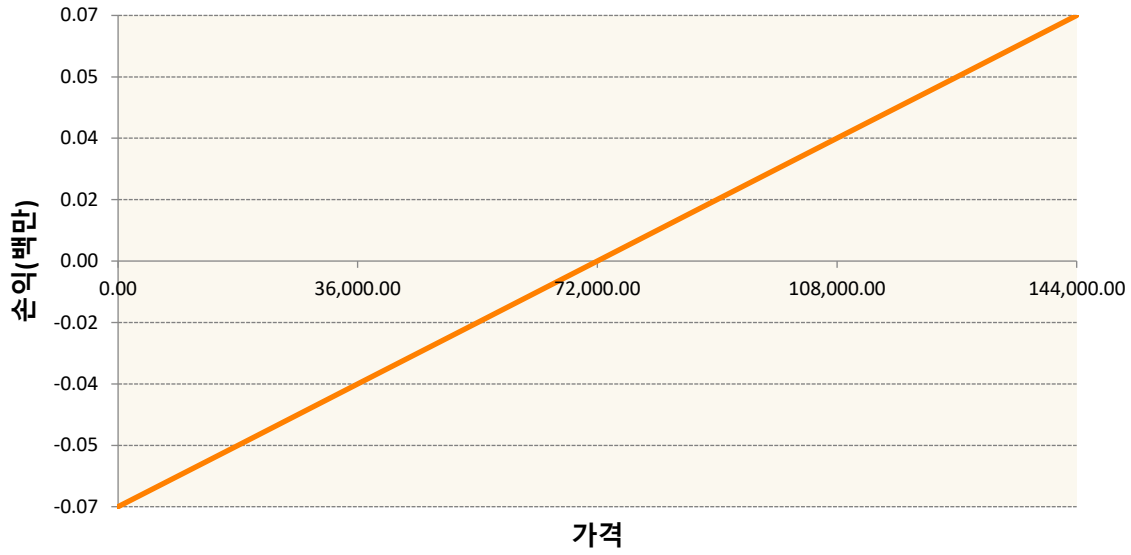
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,978	0	11,978	장내

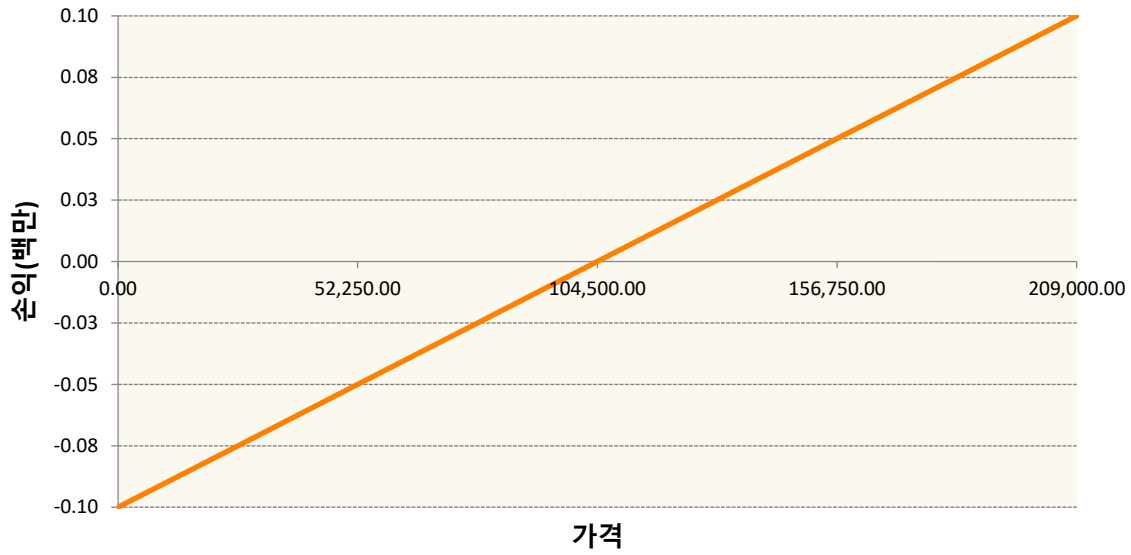
2. 만기시점의 손익구조



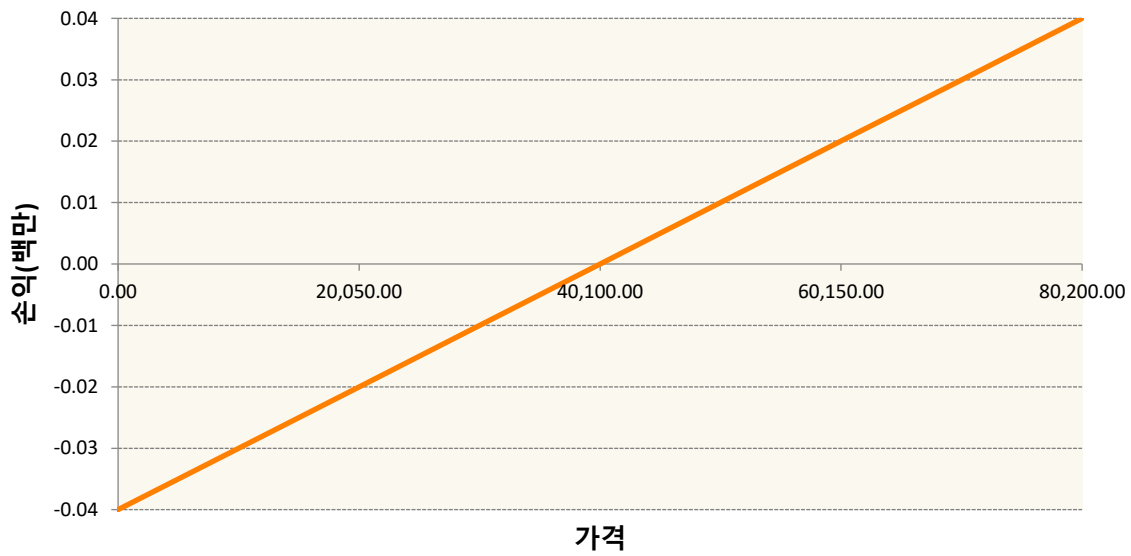
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



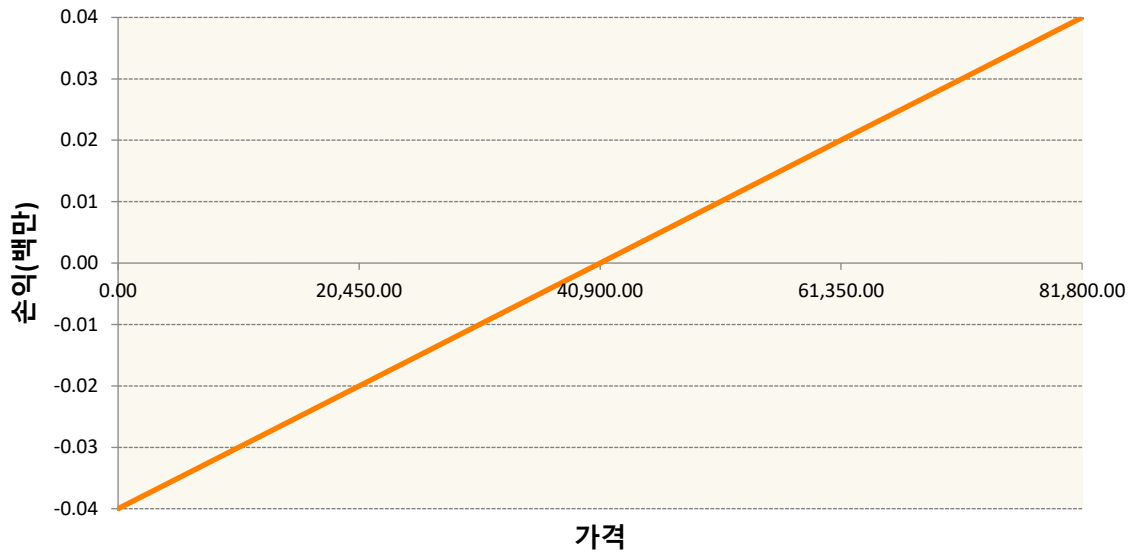
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



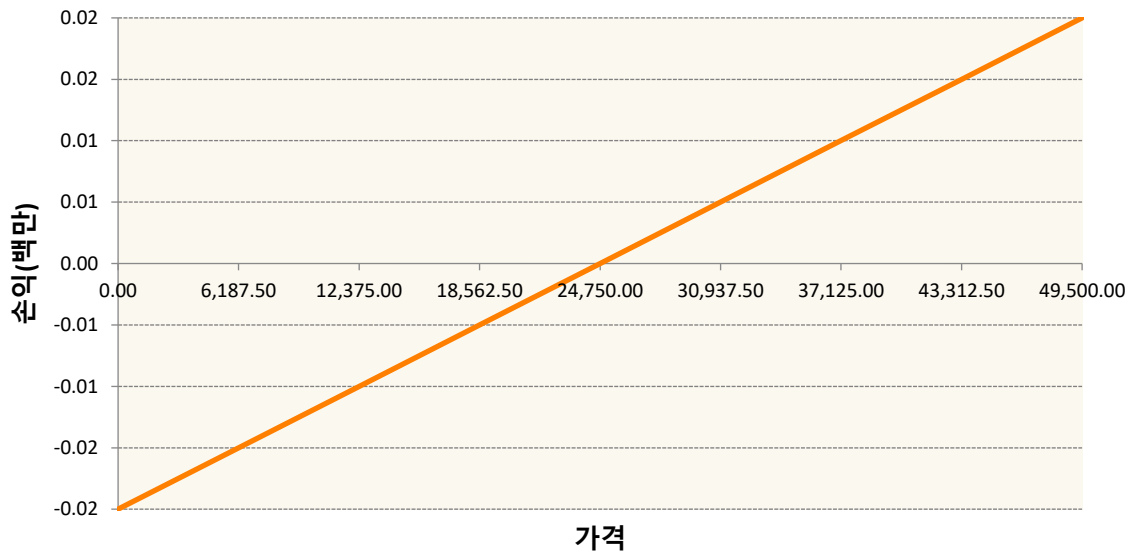
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



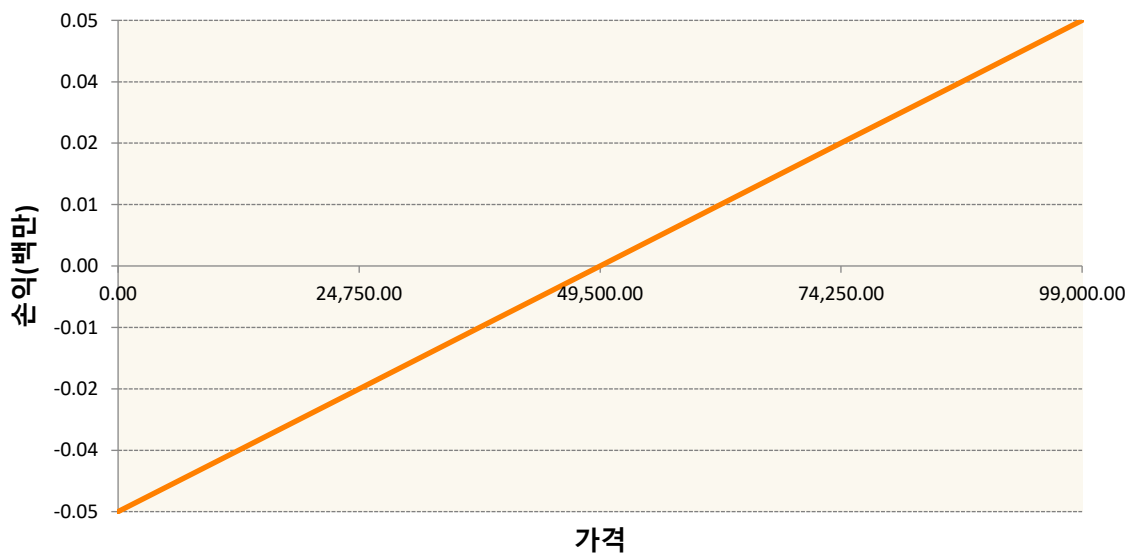
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



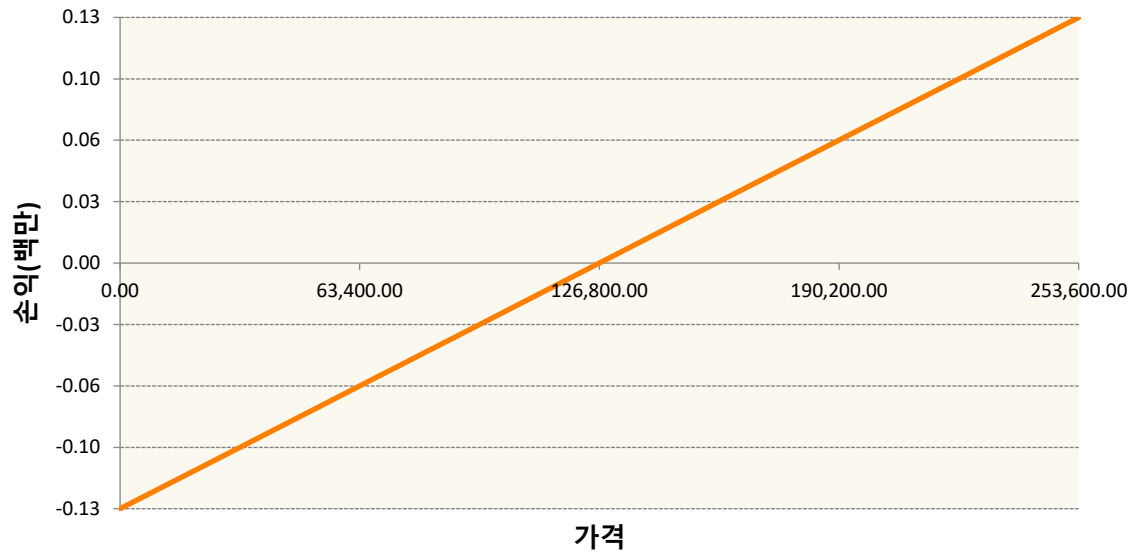
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



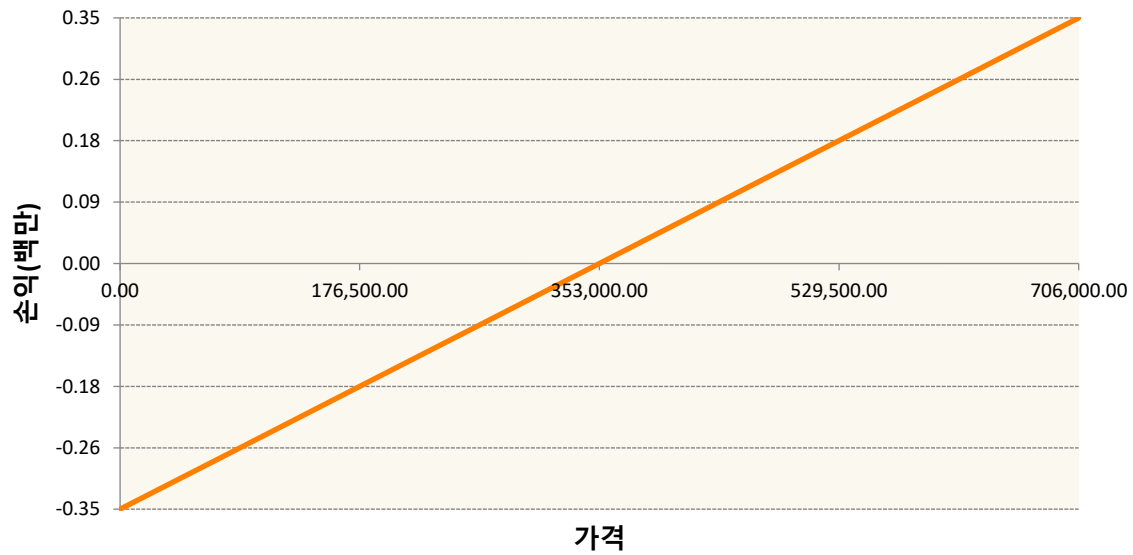
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



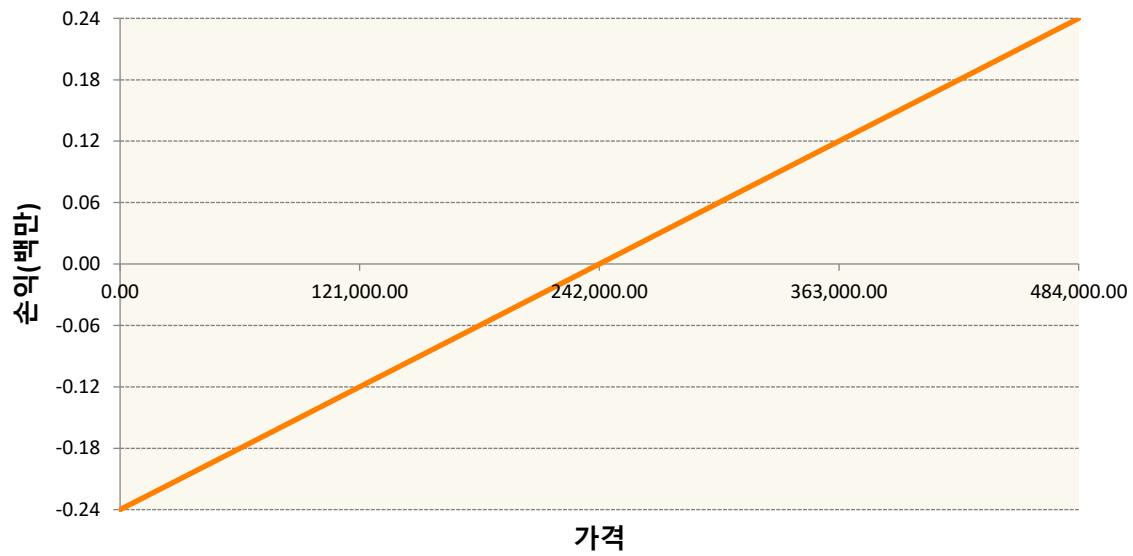
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



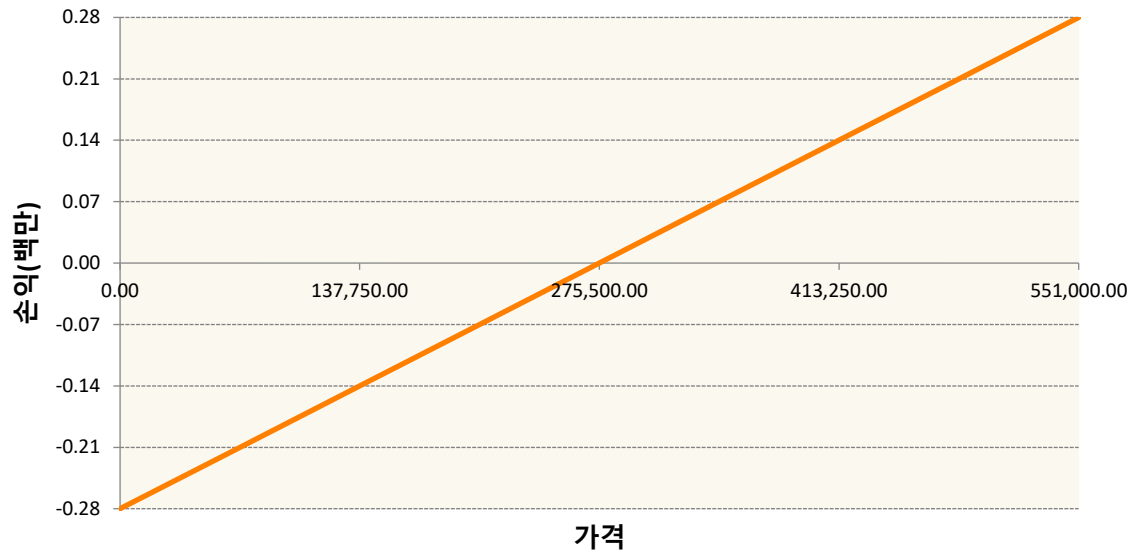
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



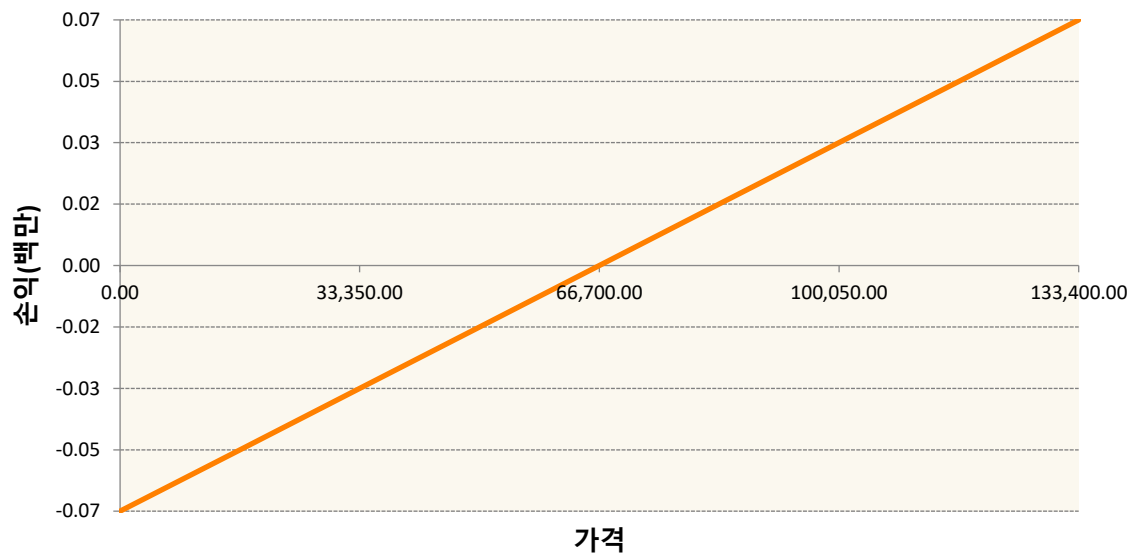
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	586
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	3
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	30
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	5
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물	11
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물	4
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	12
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	3
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물	16
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물	123
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물	49
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	61

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

(단위:백만원)

1,689

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

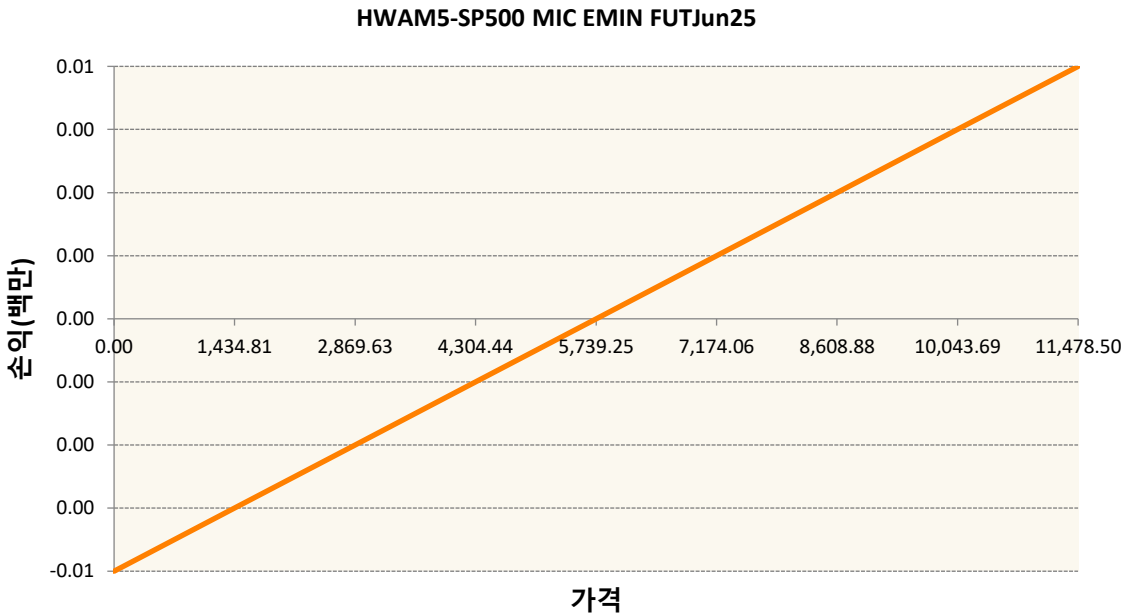
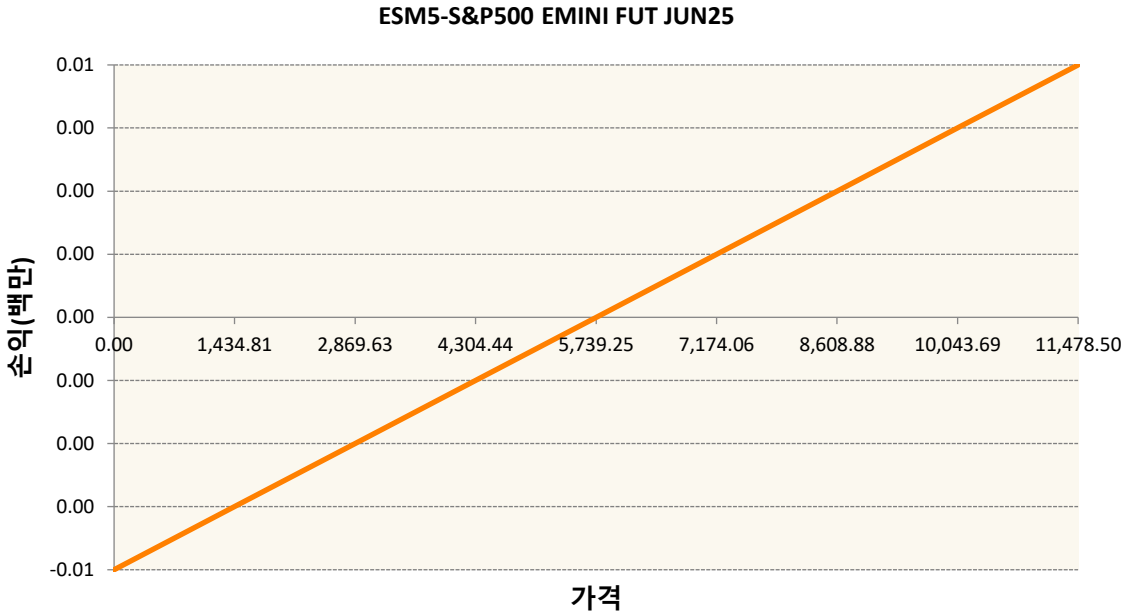
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	28,051	0	28,051	
누계	유가증권	선물	1,214	0	1,214	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,244
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	97

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,599

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

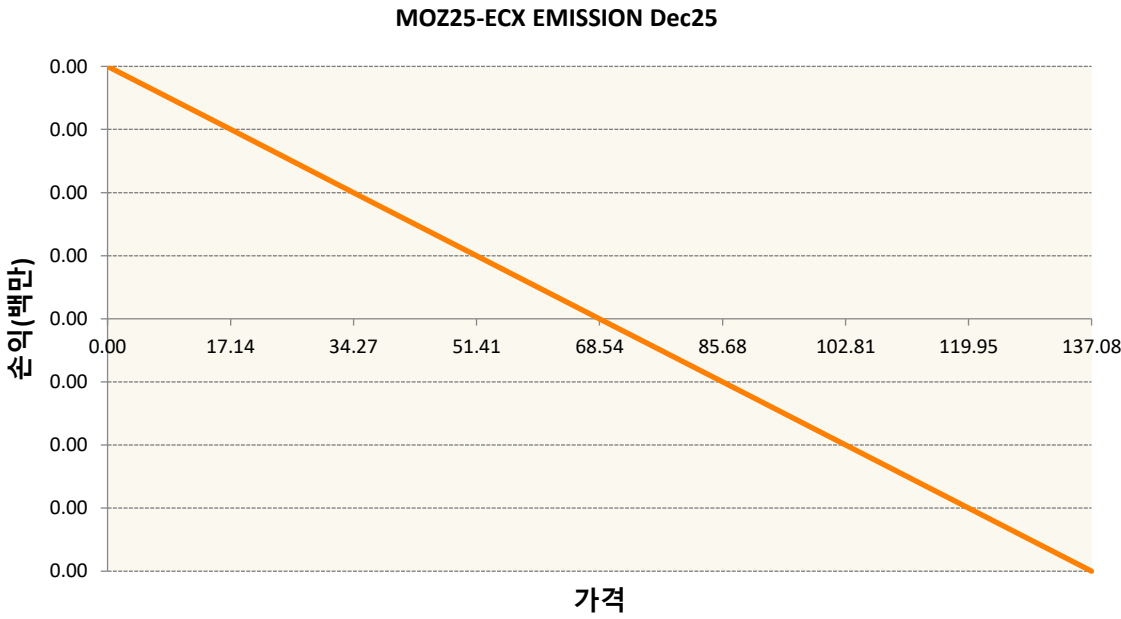
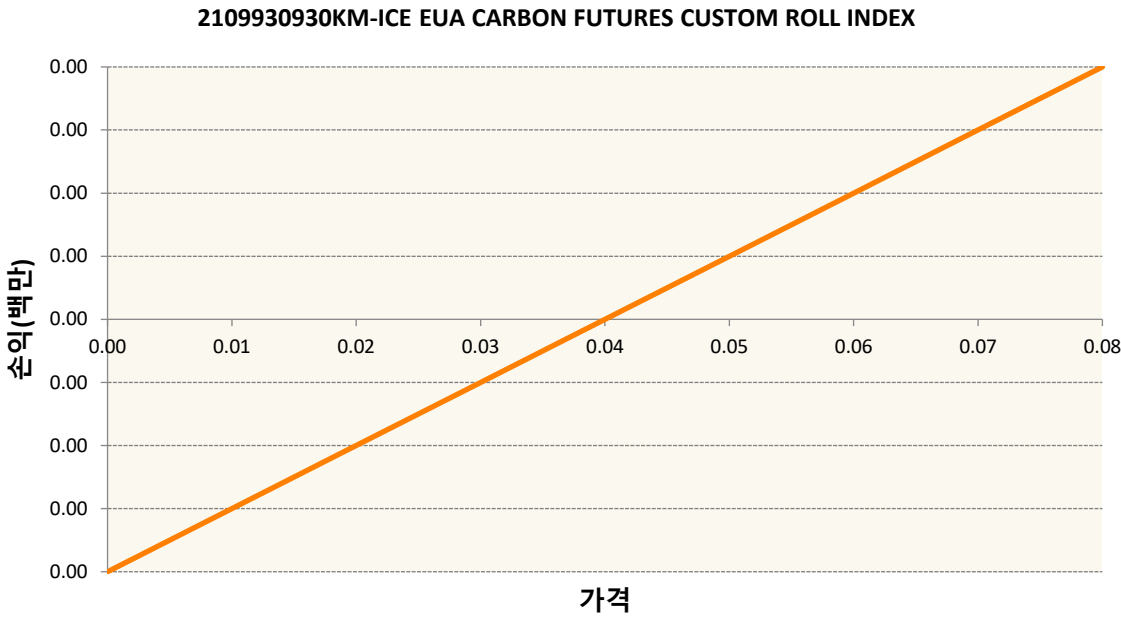
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	15	6,117	-6,102	
누계	통화	선도	0	2,302	-2,302	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		1
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E		34
FXW213F2SC KRW/EUR 31-03-25E		59
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E		5
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E		87
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		489

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	956

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

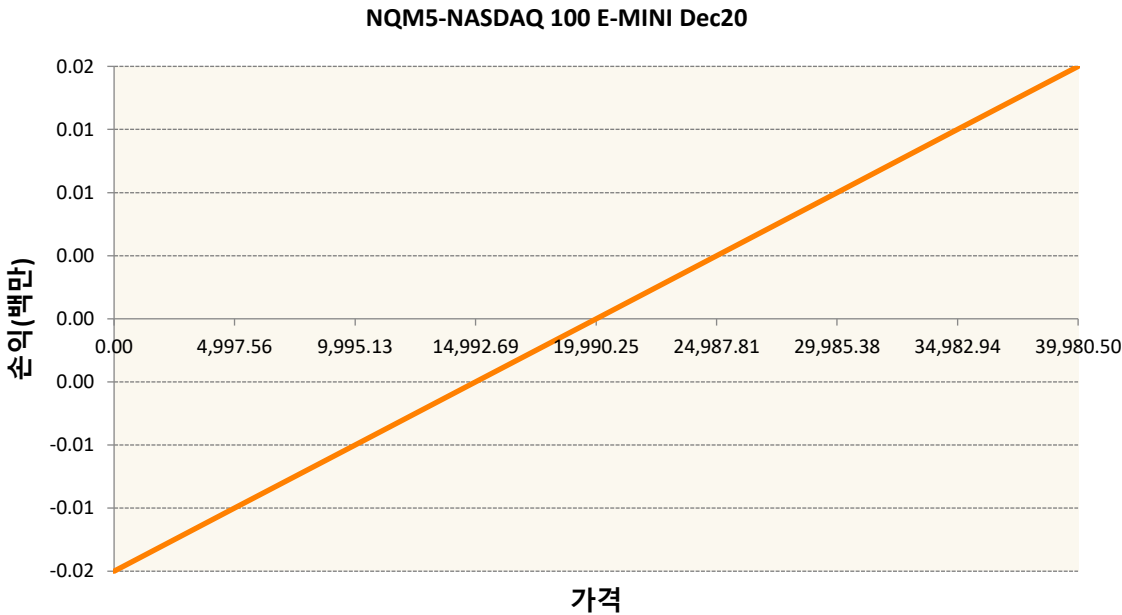
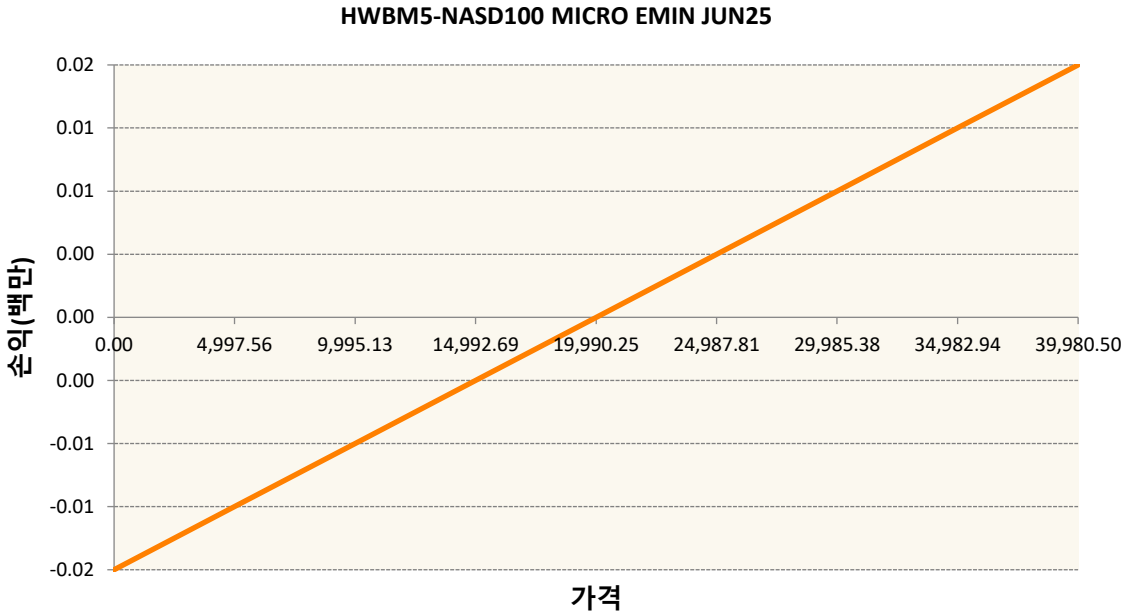
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,999	0	13,999	
누계	유가증권	선물	526	0	526	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		42
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,120

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,089

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	133,737	0	133,737	장외
누계	지수	스왑	227,910	0	227,910	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,468
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	737
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,741
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,201

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

(단위:백만원)

8,571

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

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	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4

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

(단위:백만원)

20

공시일	2025-03-31
기준일	2025-03-28

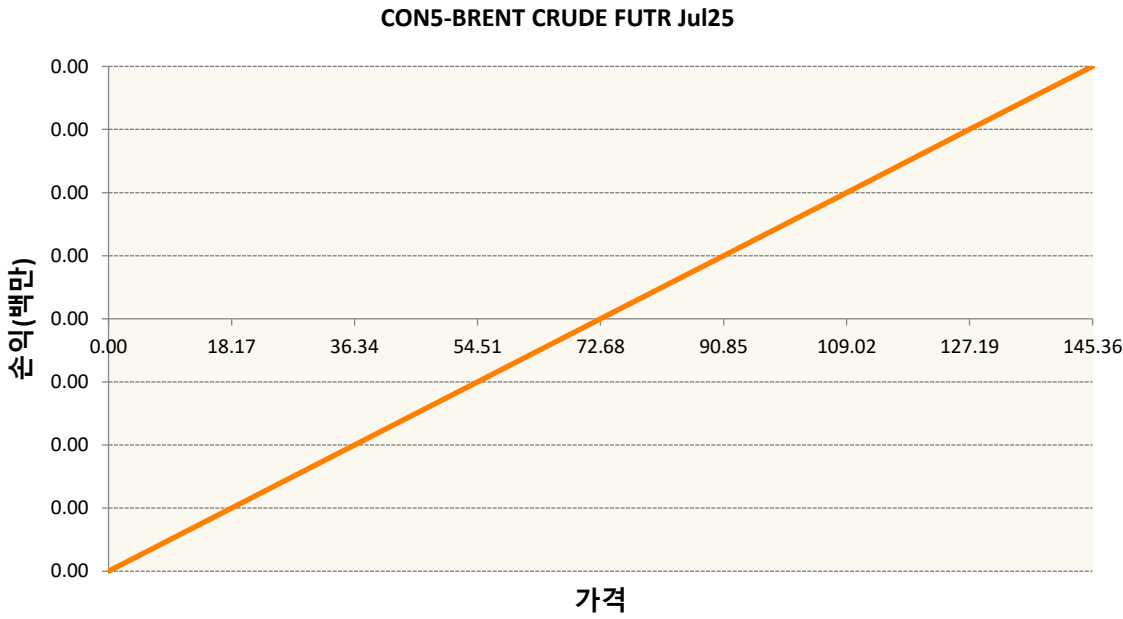
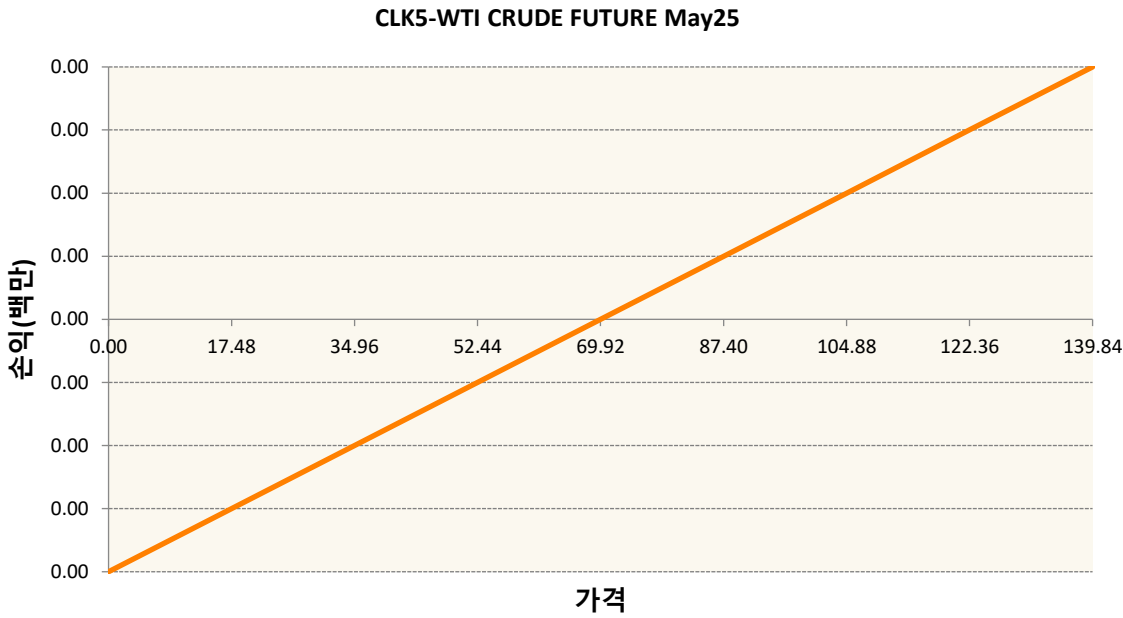
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

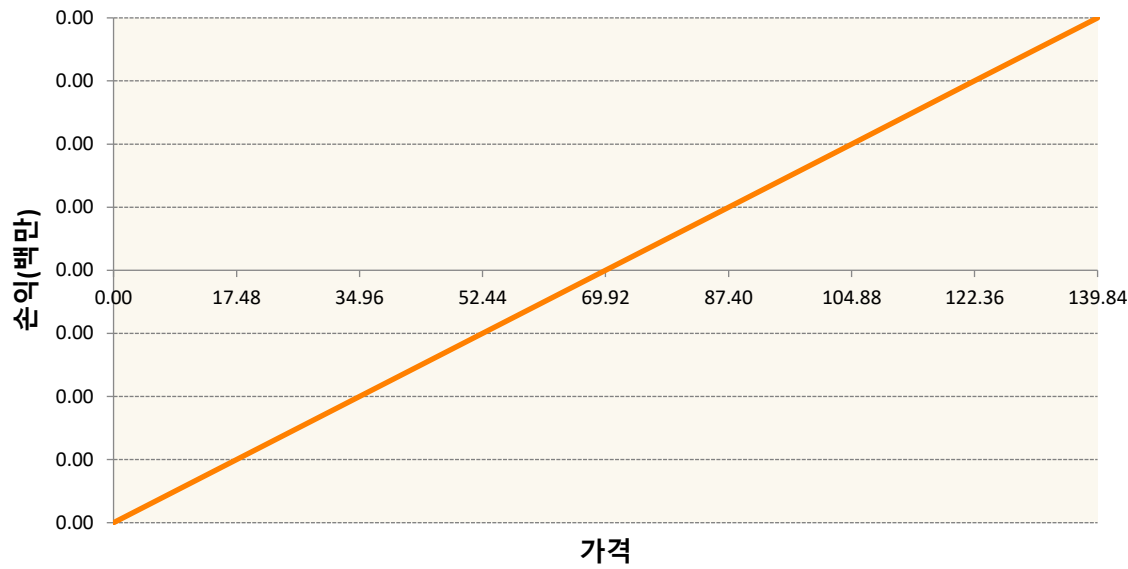
(단위:백만원)

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	841	0	841	
누계	통화	선물	0	147	-147	장내

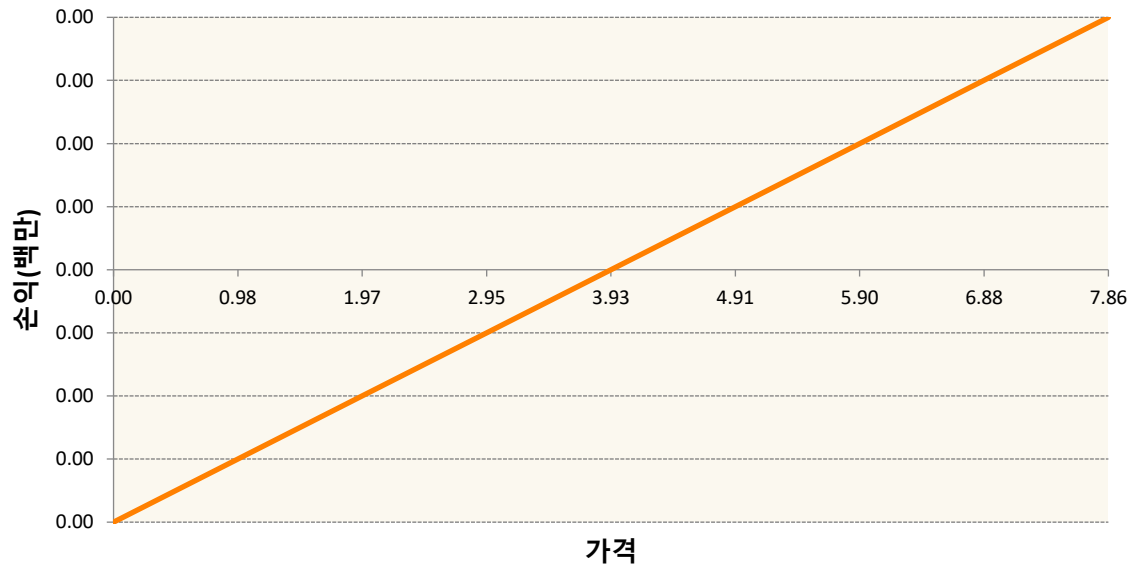
2. 만기시점의 손익구조



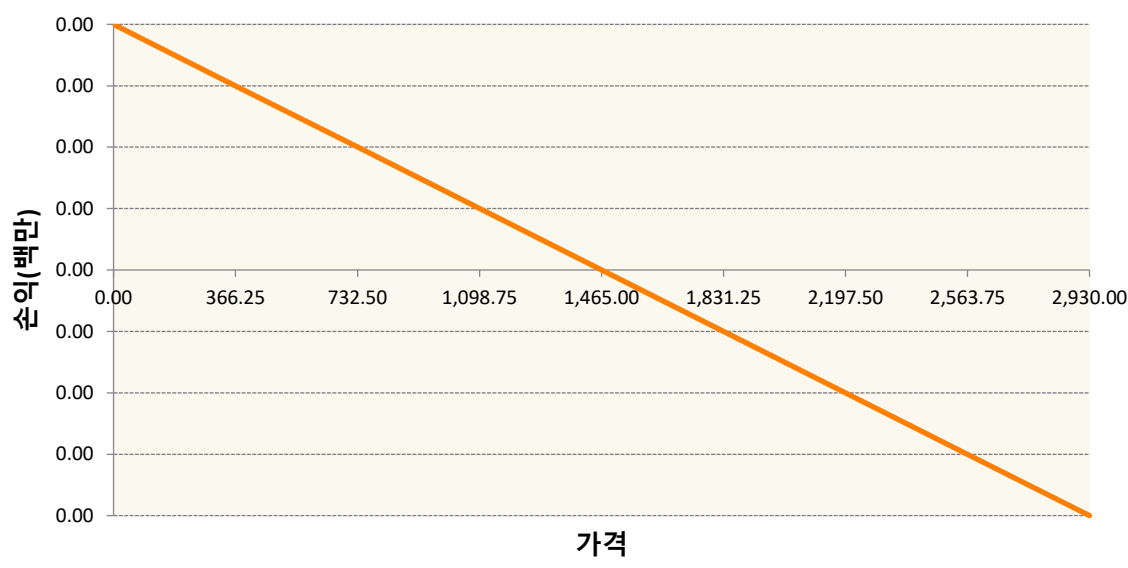
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



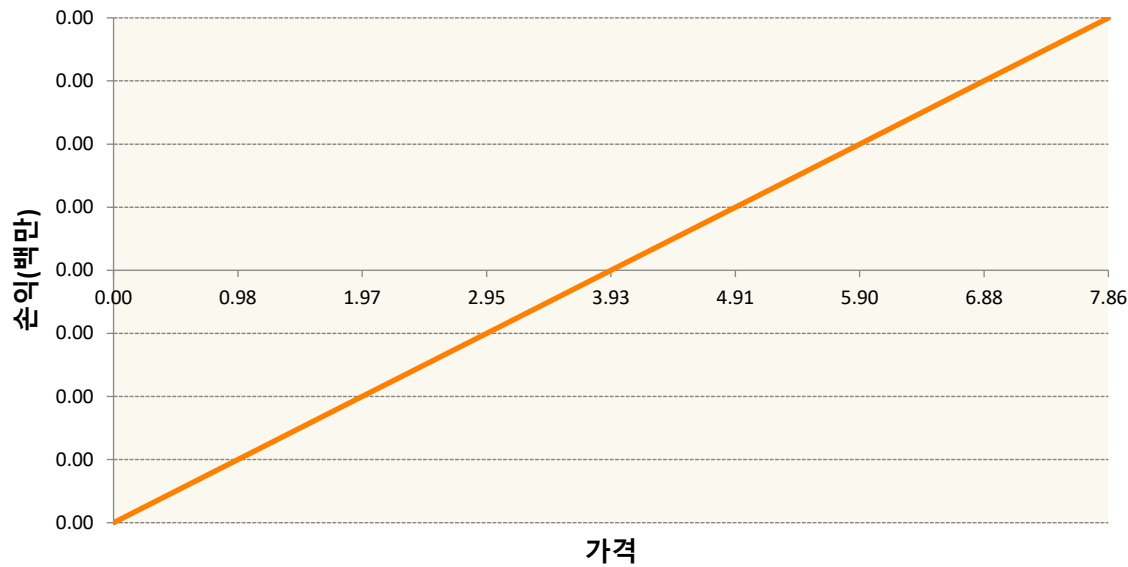
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



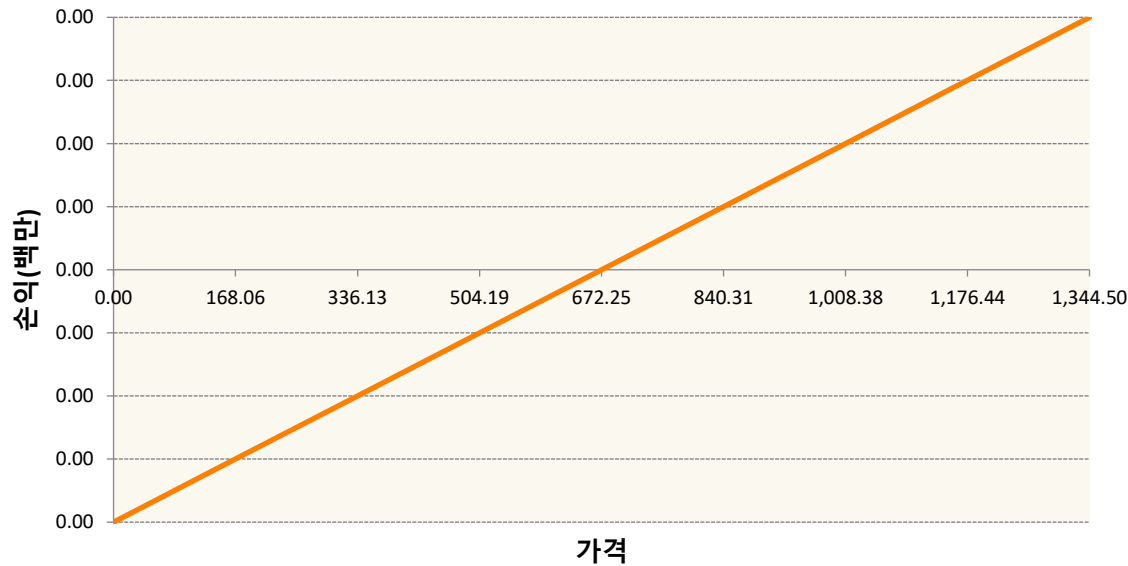
KR4175W40006-2025-04 달러선물



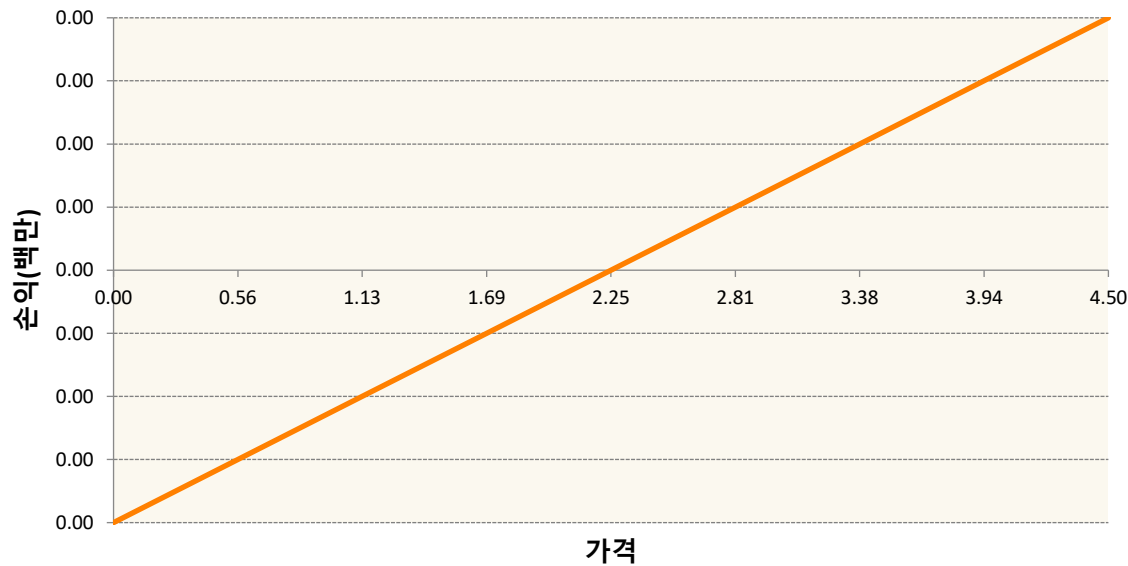
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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)

144