

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

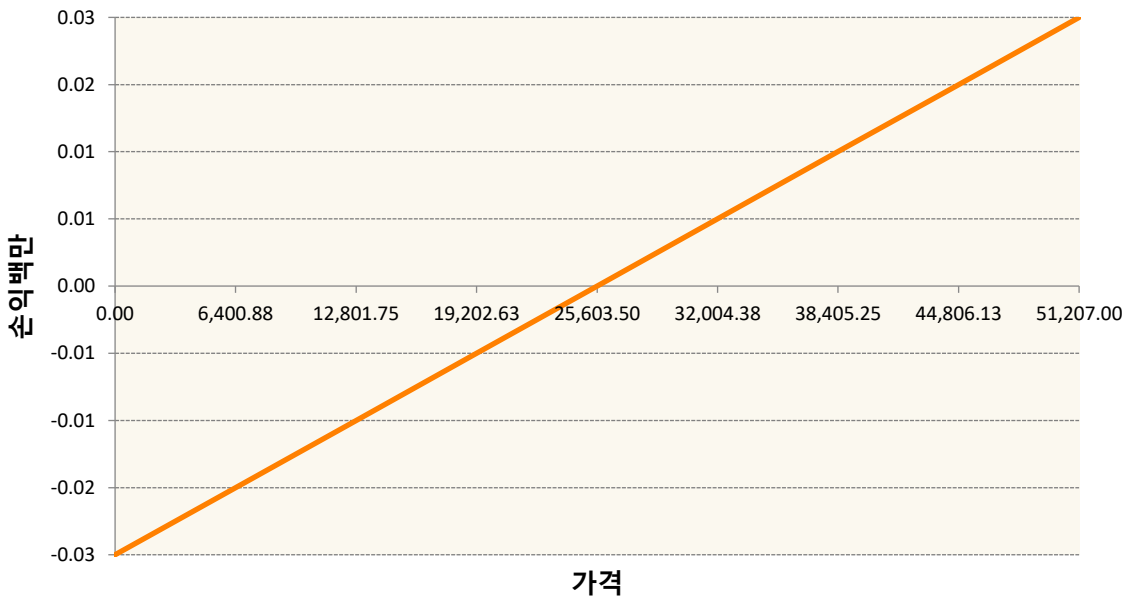
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	664	0	664	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH6 IFSC NIFTY 50 FUT Mar26

53

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

(단위:백만원)

34

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

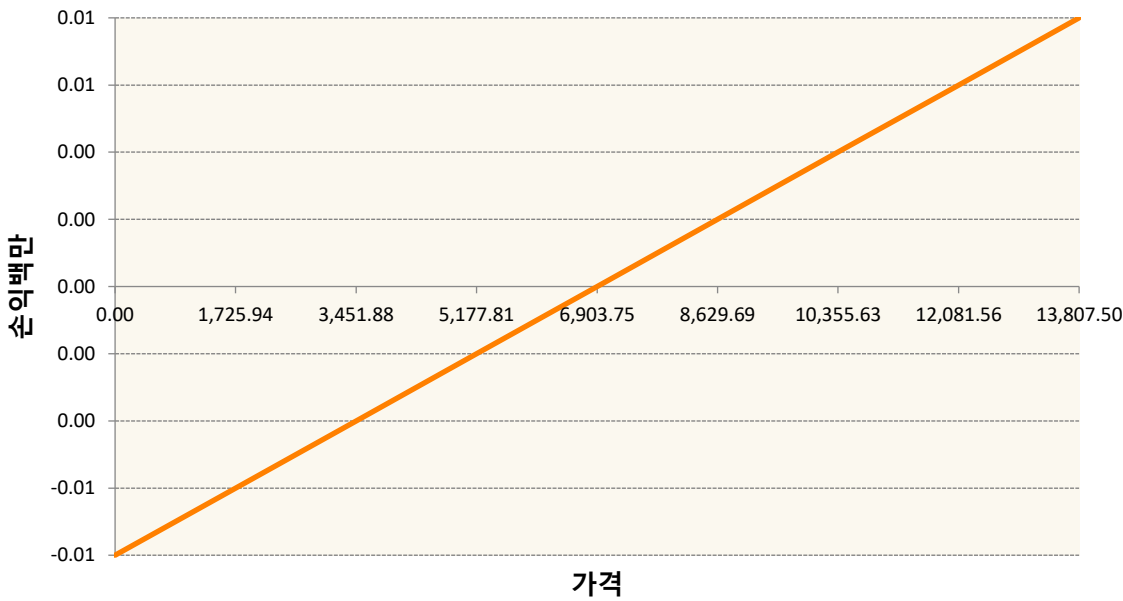
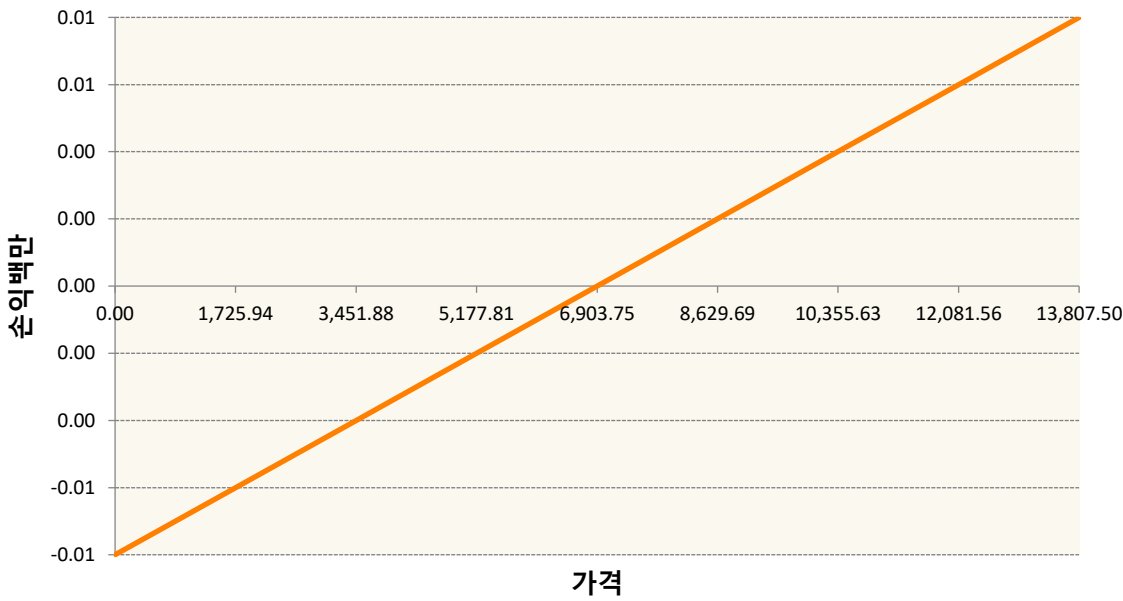
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	153	0	153	장내
누계	지수	선물	510	0	510	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	41
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	45

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

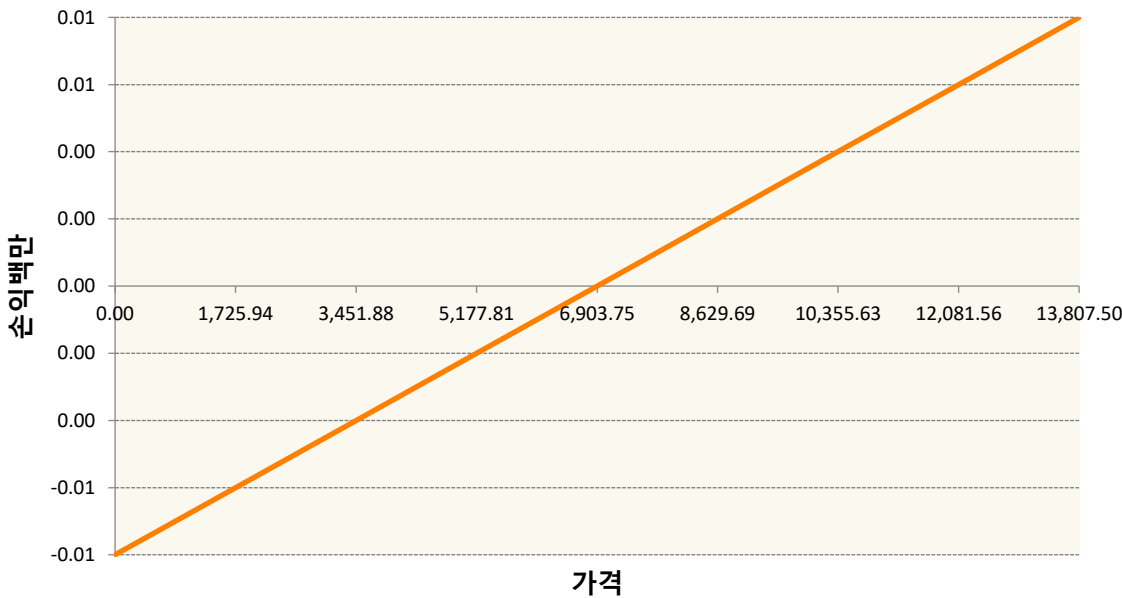
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,530	0	1,530	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	122
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

105

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

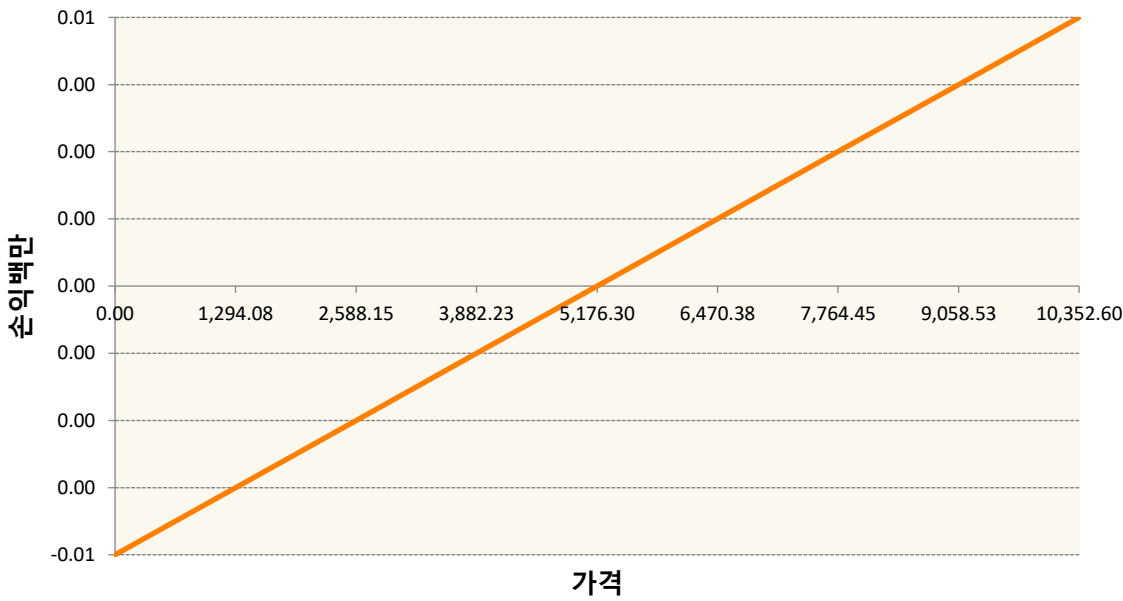
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	5,175	0	5,175	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSUC GLD US 02/27/26 C475 EQUITY	7
G CJ6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	414

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

(단위:백만원)

488

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRACC PLTR US 02/27/26 C144 EQUITY	1
AOPLTRUSC PLTR US 02/27/26 C147 EQUITY	47
AOPLTRUSP1 PLTR US 02/27/26 P147 EQUITY	33

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

(단위:백만원)

296

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSCC!TLT US 02/27/26 C90.5 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

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

(단위:백만원)

1,217

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

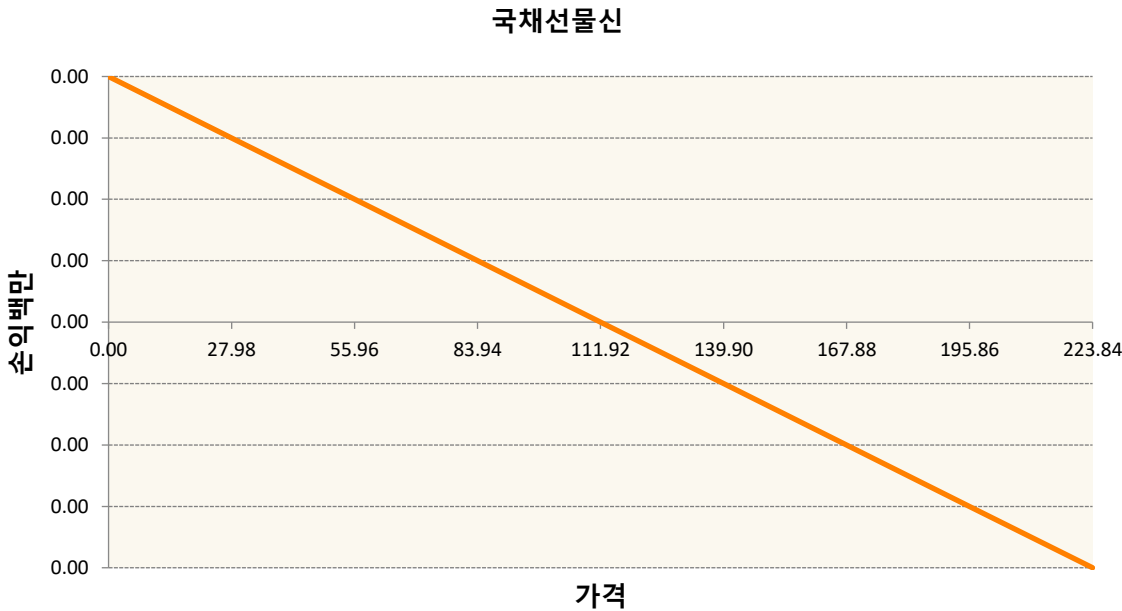
포커스채권(채권-파생형)(종)

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	0	13,430	-13,430	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A67630009			2026-03 국채선물10(신)				381
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-381	-381	-381	-381	-381	-381	-381
-5.33%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-2.67%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	127	127	127	127	127	127	127
5.33%	254	254	254	254	254	254	254
8.00%	381	381	381	381	381	381	381

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

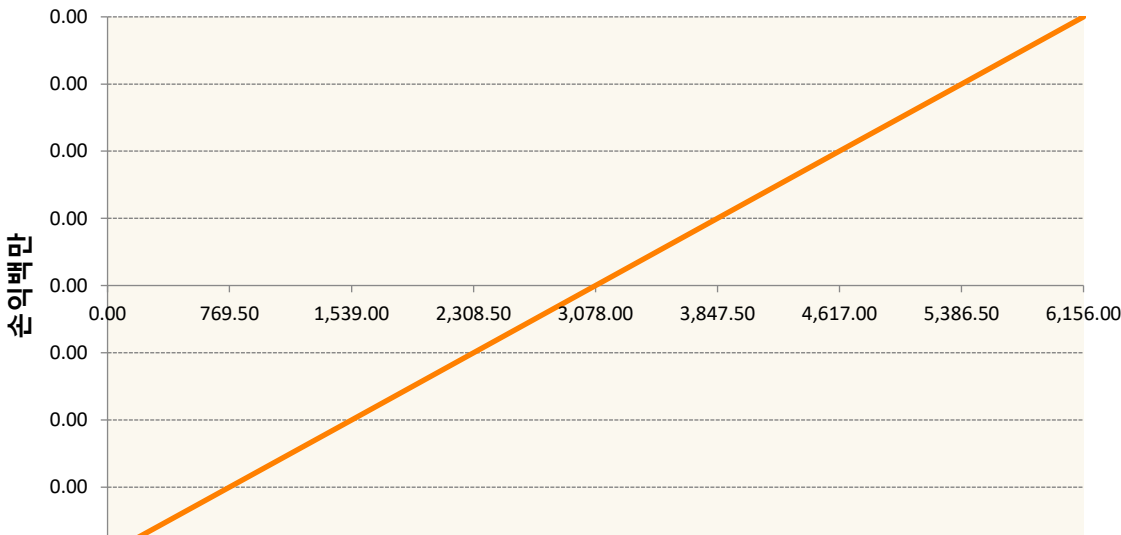
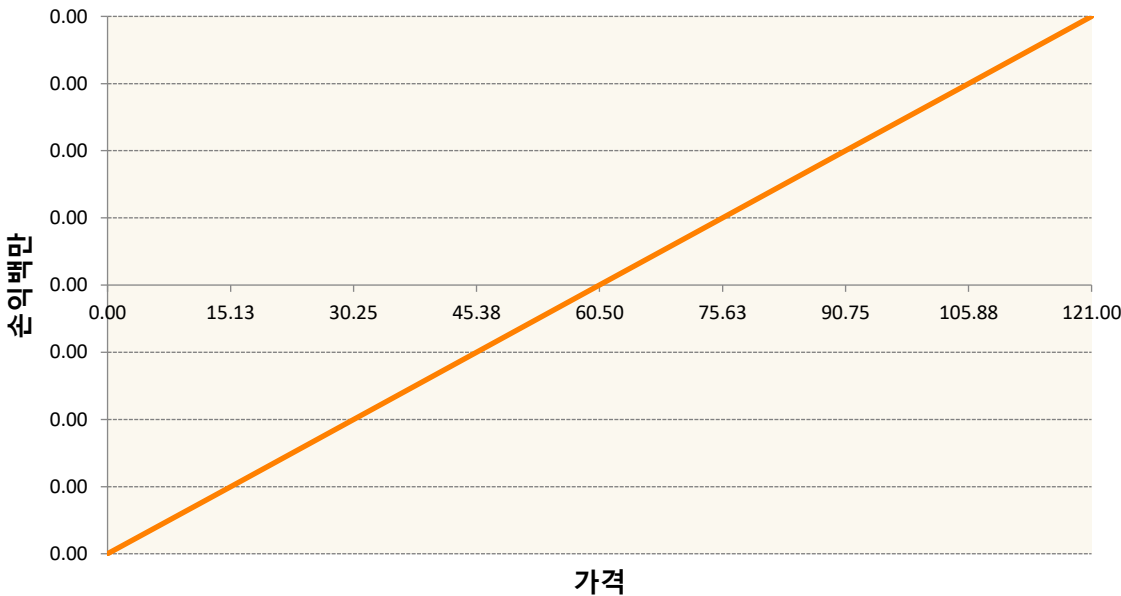
포커스농산물모(채권-파생형)

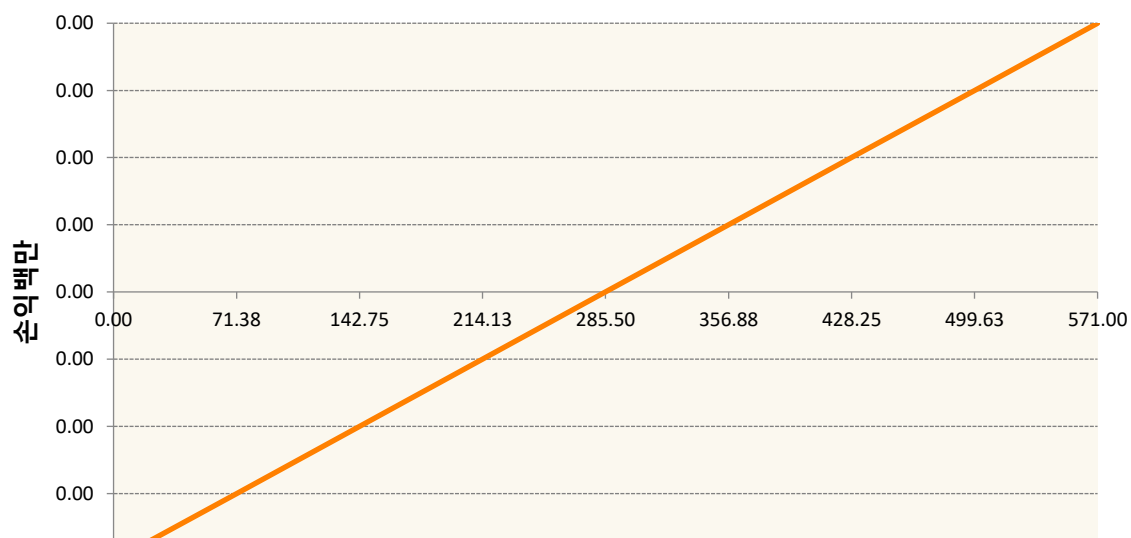
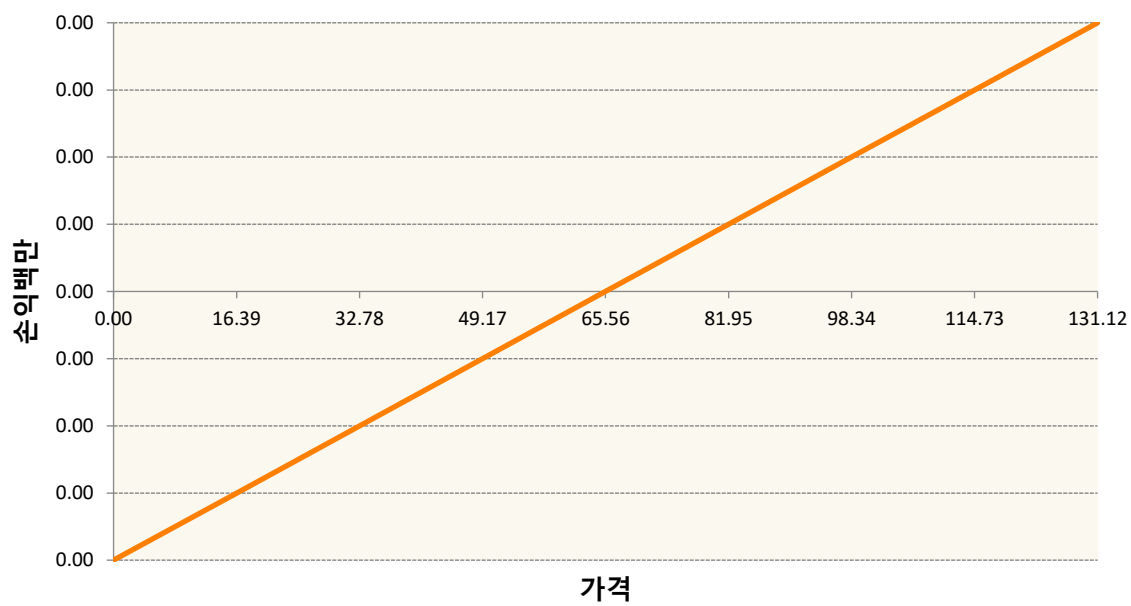
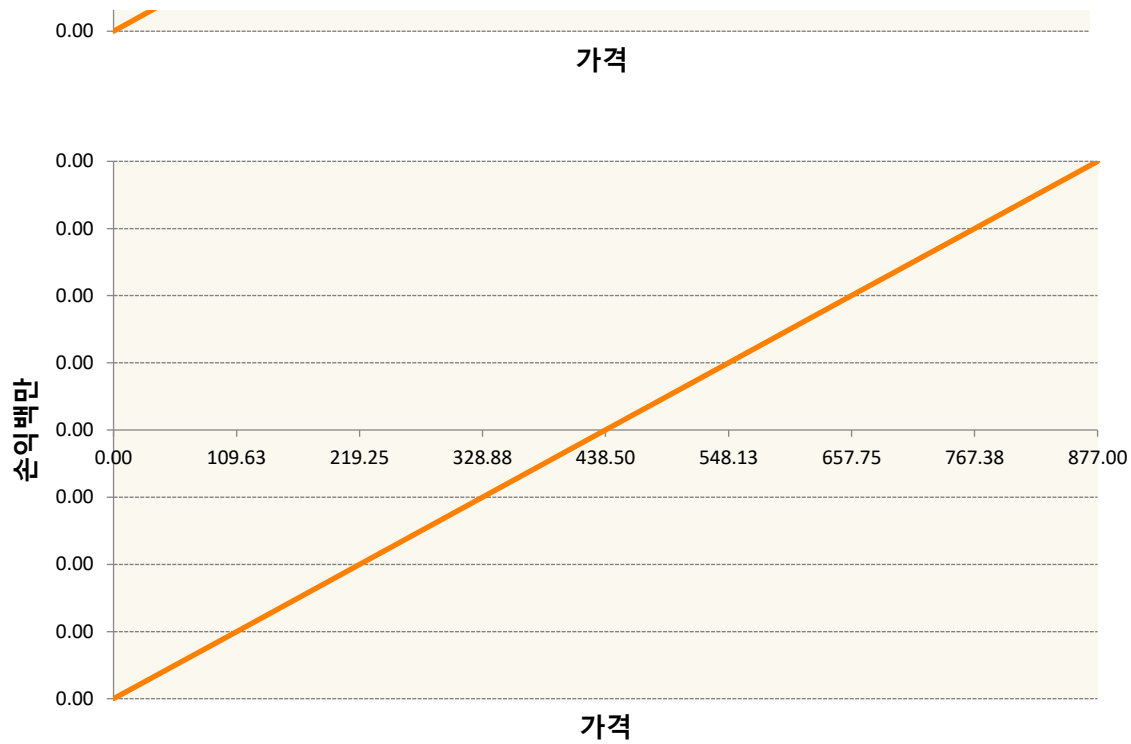
1. 계약금액

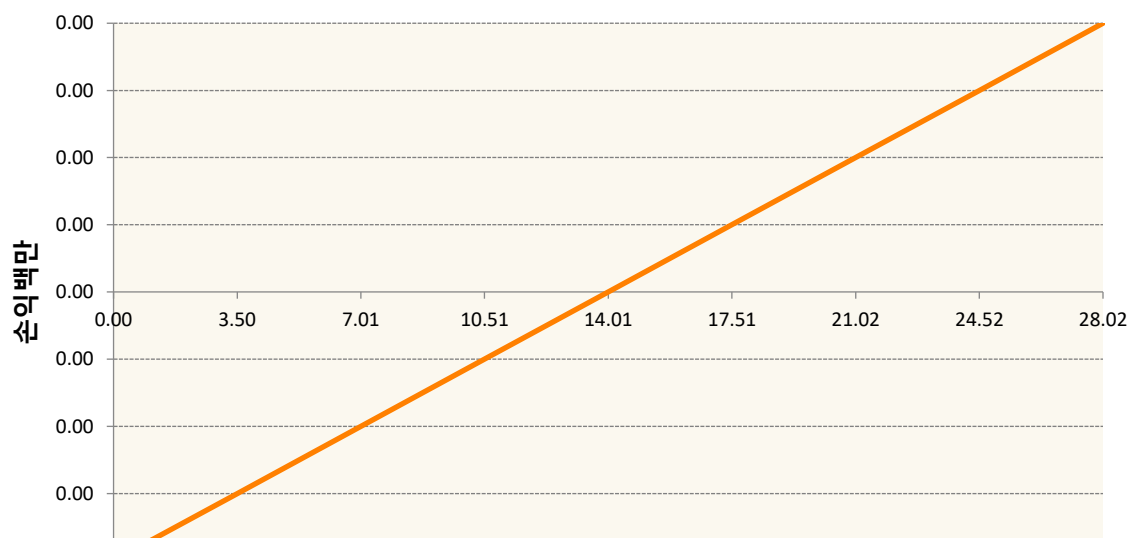
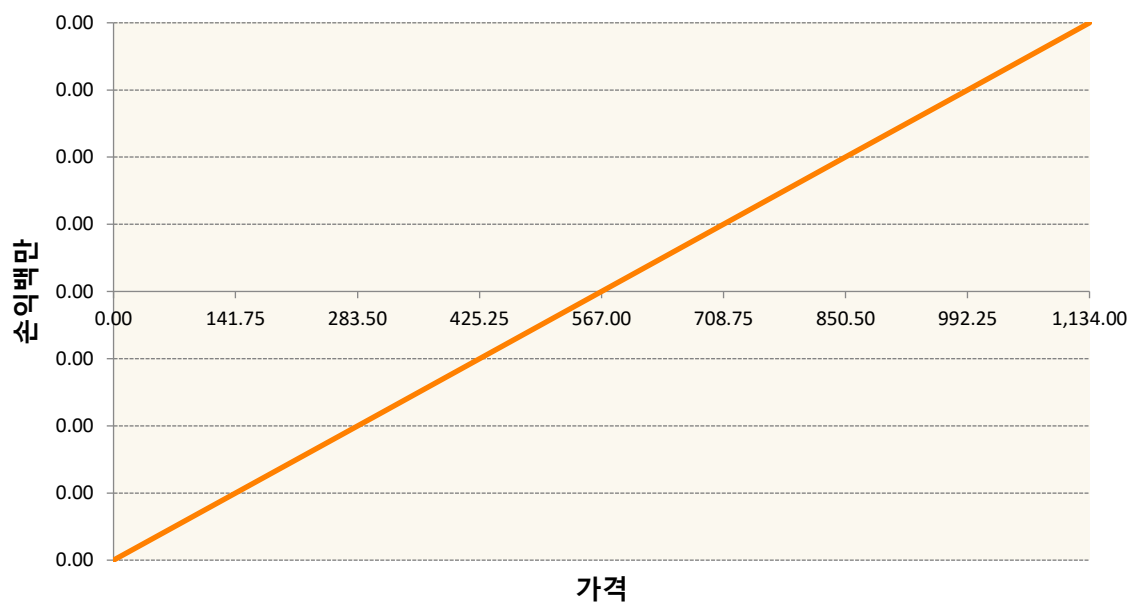
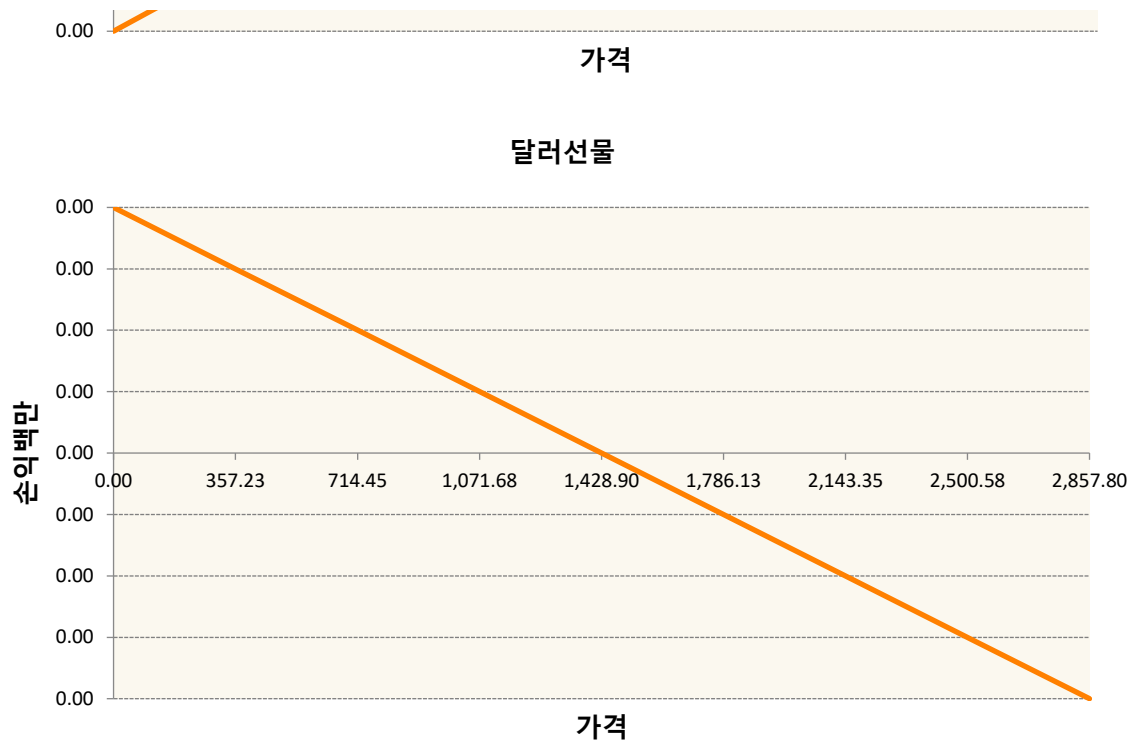
(단위:USD 백만)

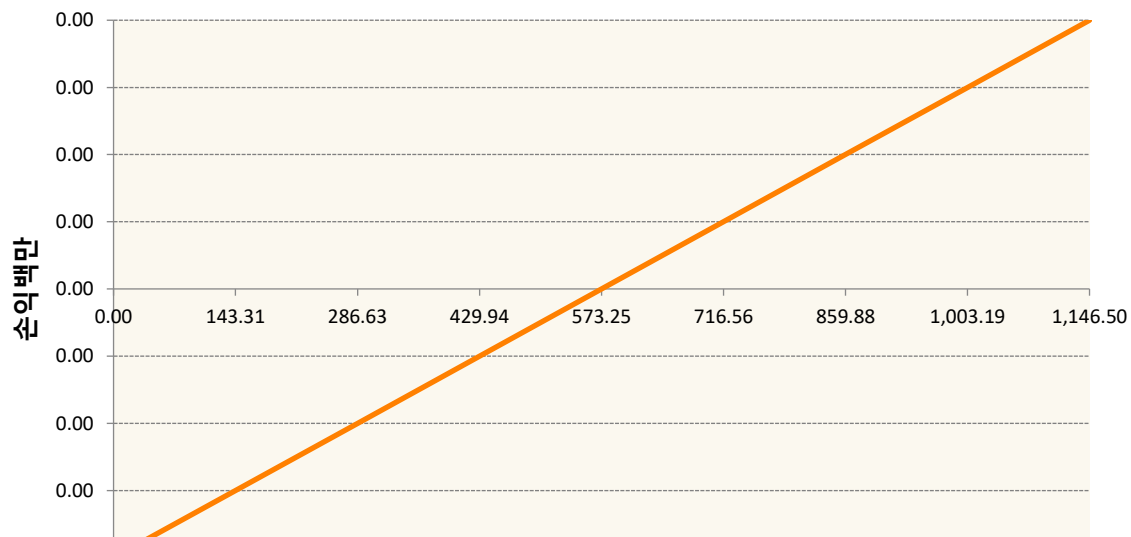
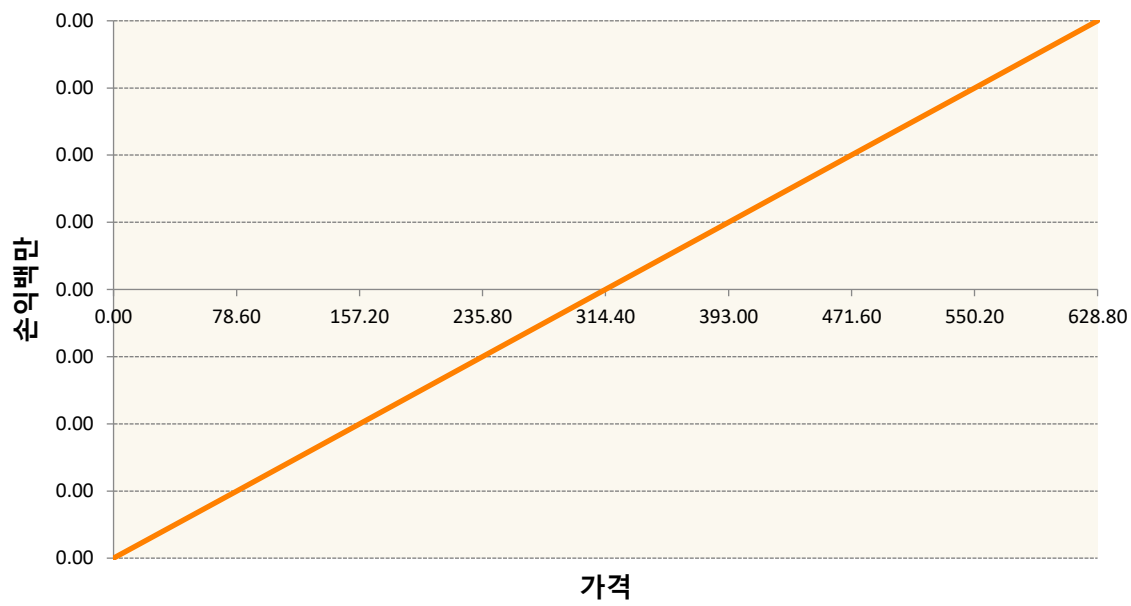
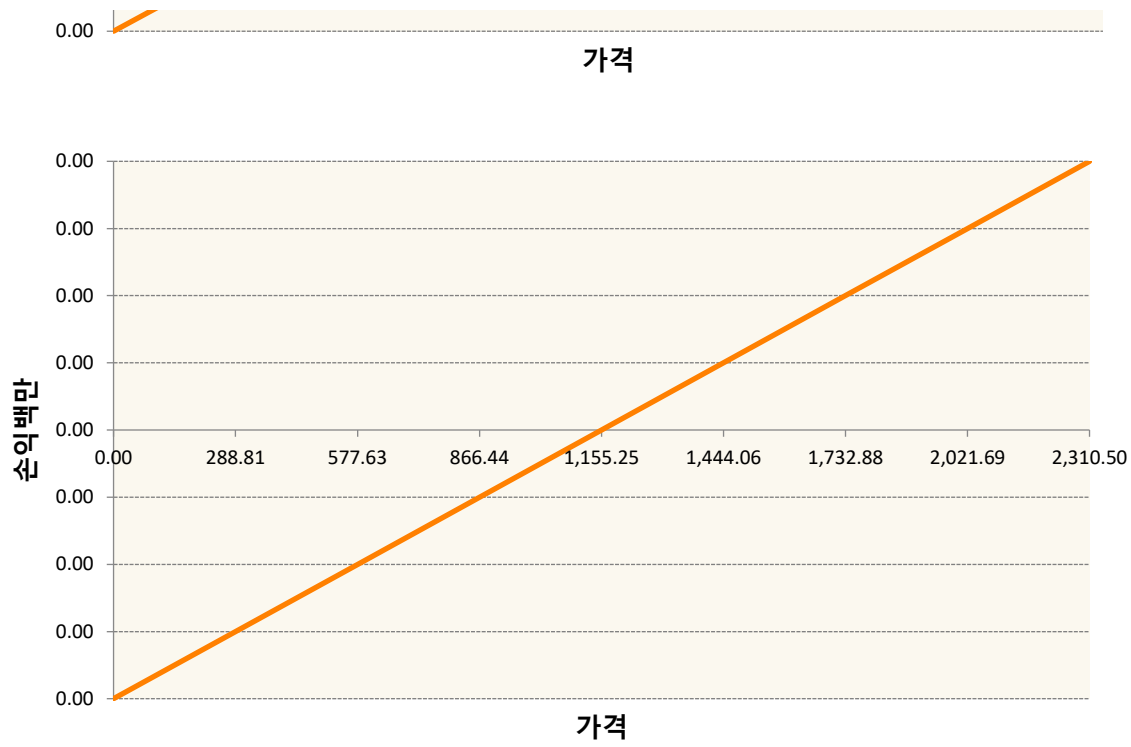
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,236	0	1,236	
누계	유가증권	선물	1,773	0	1,773	
누계	통화	선물	0	300	-300	장내

2. 만기시점의 손익구조









0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

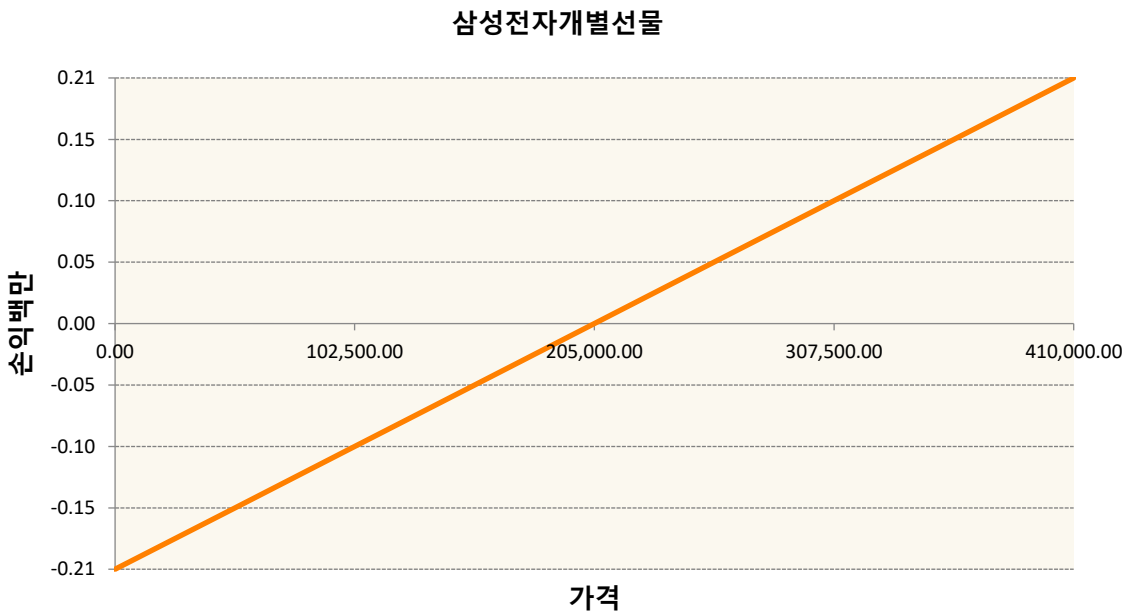
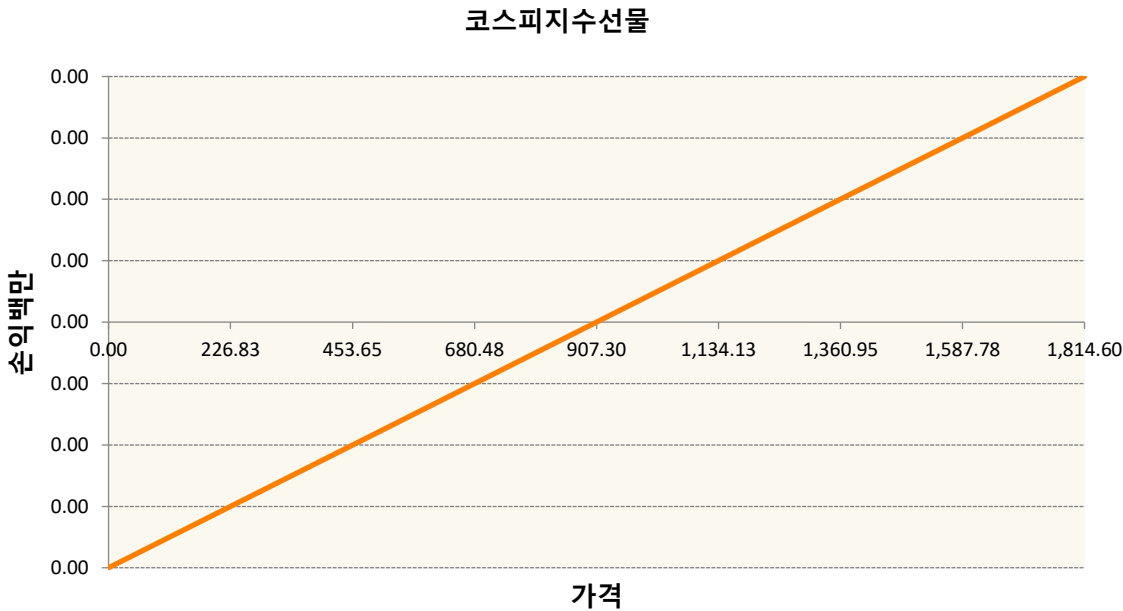
스마트인덱스모

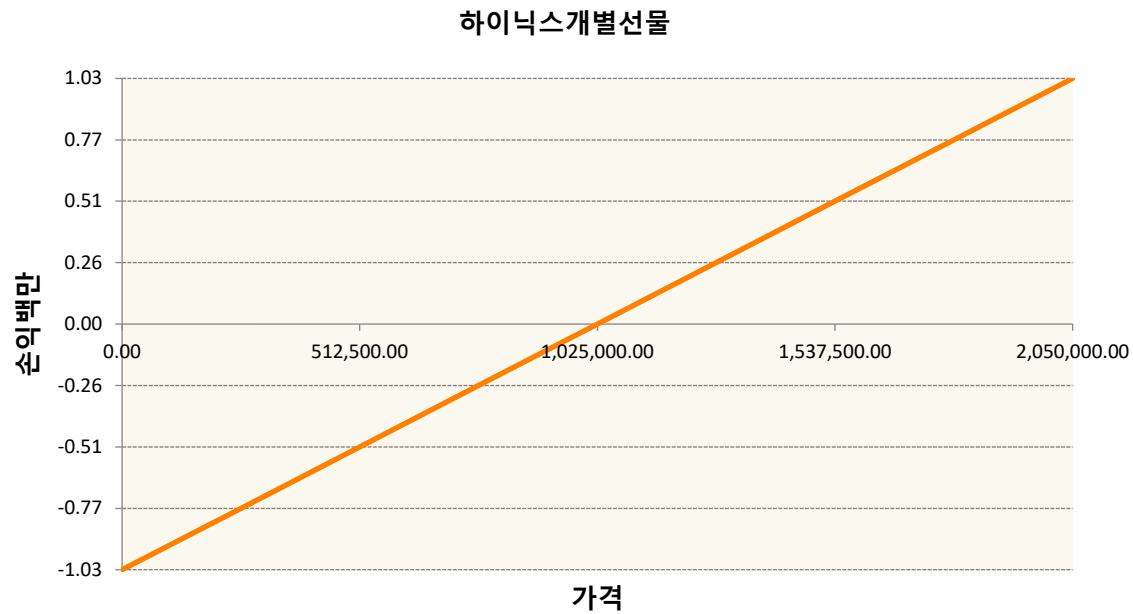
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	111	0	111	장내
누계	유가증권	선물	3,102	0	3,102	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		236
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		3
KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물		9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

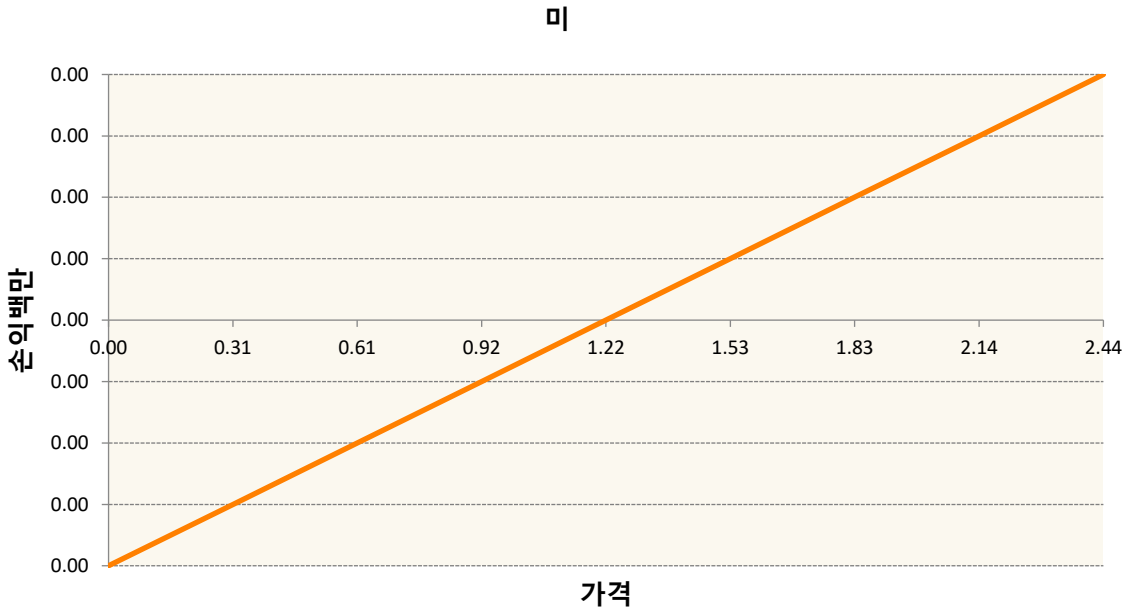
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,635	0	5,635	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

450

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

560

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

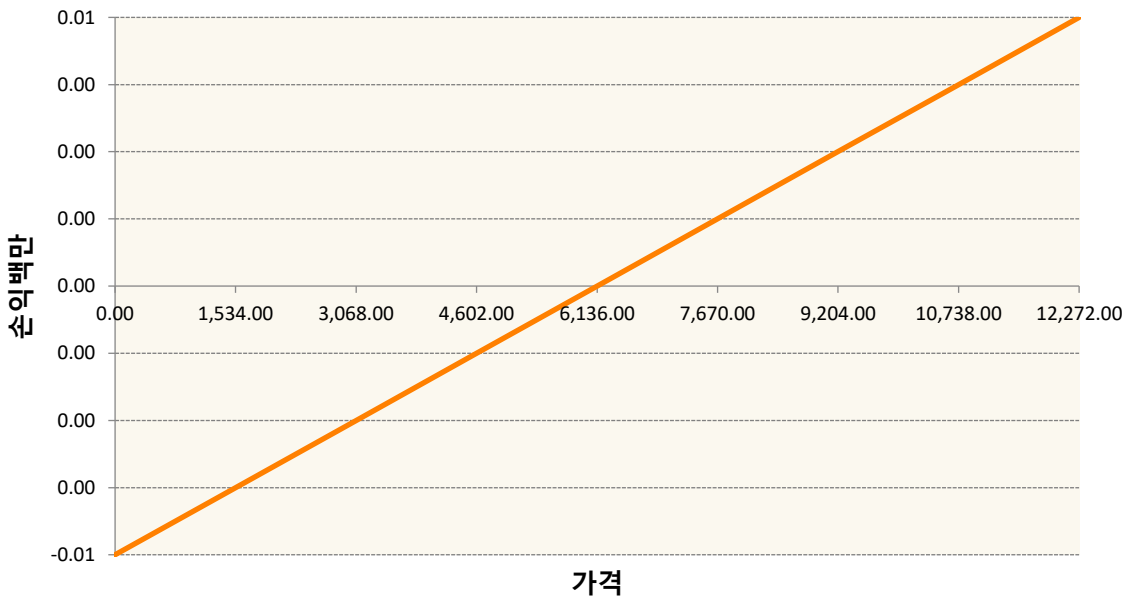
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	955	0	955	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6 EURO STOXX 50 Mar26

76

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

(단위:백만원)

61

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

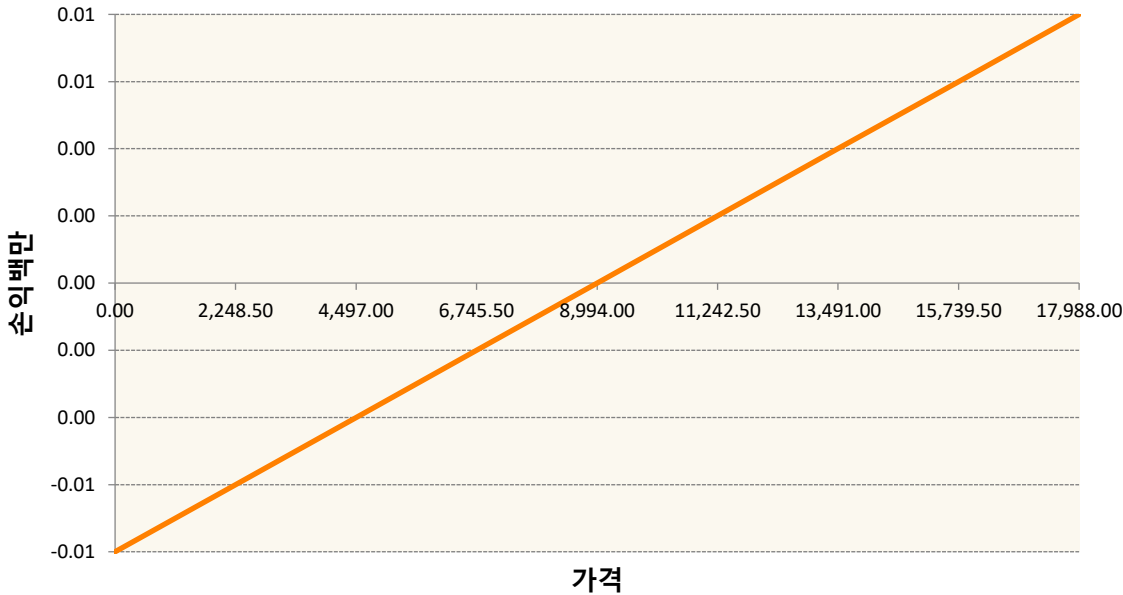
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,891	0	1,891	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG6 HSCEI Futures Feb26

151

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

(단위:백만원)

203

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

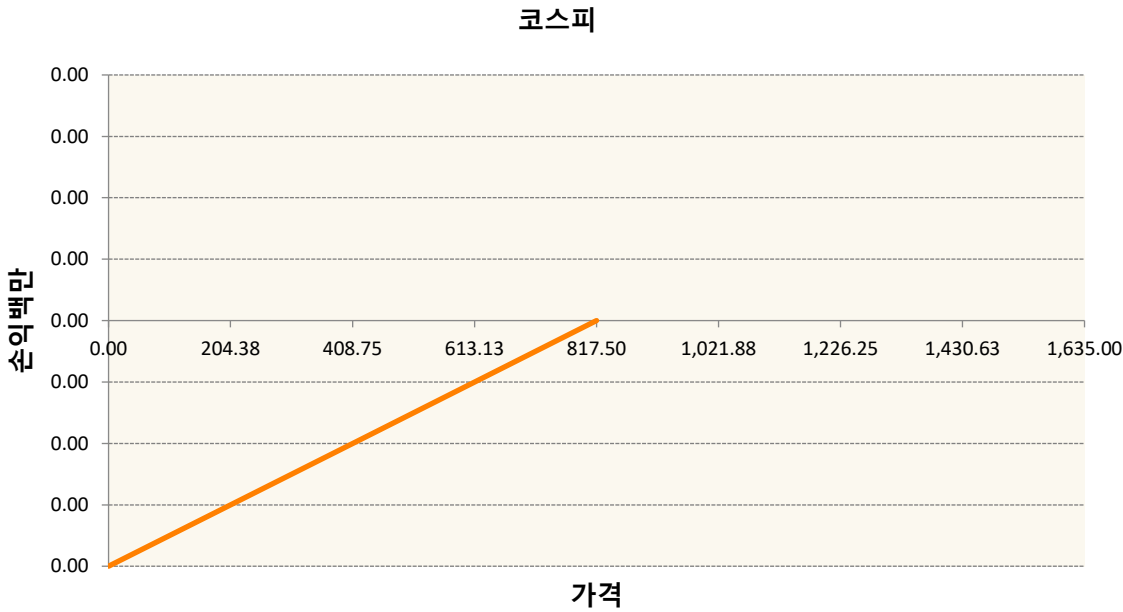
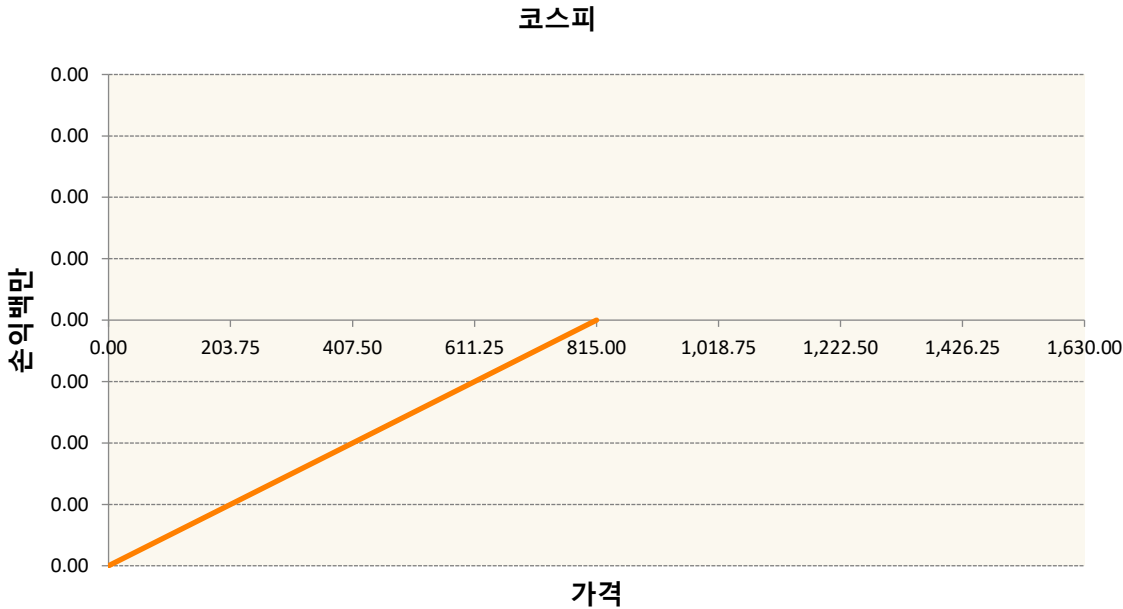
커버드콜모(주식혼합-파생형)

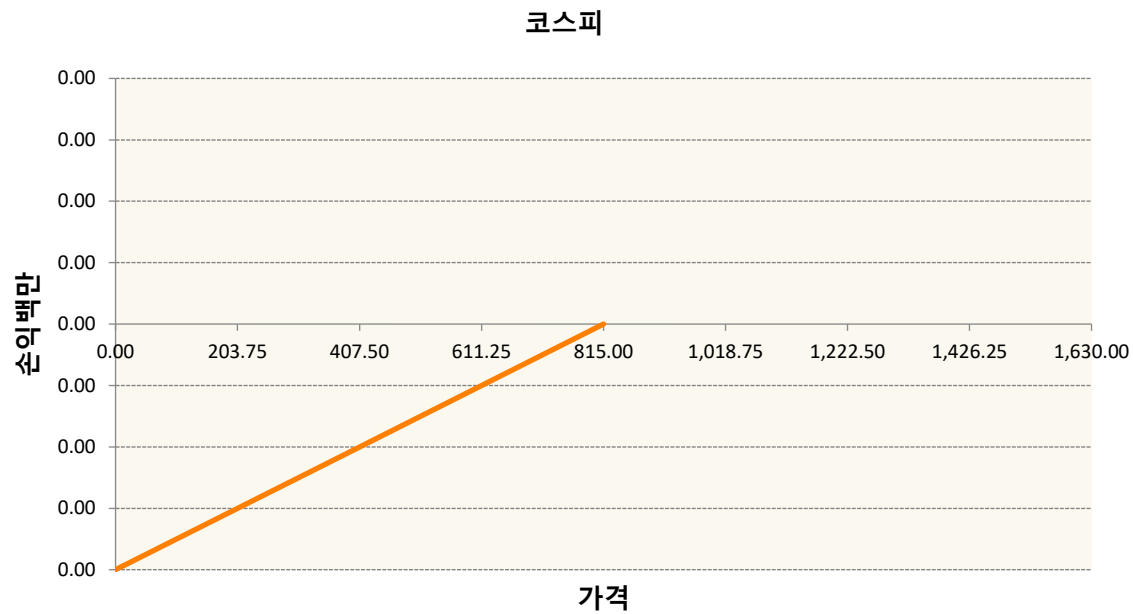
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	898	0	898	장내
누계	유가증권	옵션	0	33,059	-33,059	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)				(단위:백만원)
KR4B016381	코스피200 C 202603	815.0		766
KR4B016381	코스피200 C 202603	817.5		1,341
KR4C016381	코스피200 P 202603	815.0		538

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	0

공시일 2026-02-26

기준일 2026-02-25

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

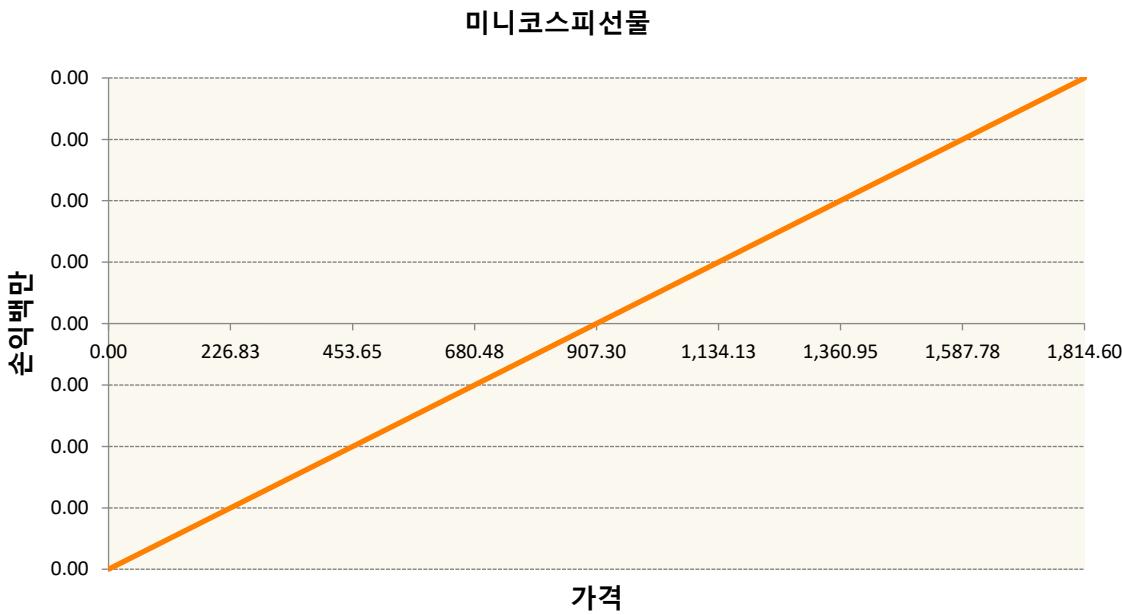
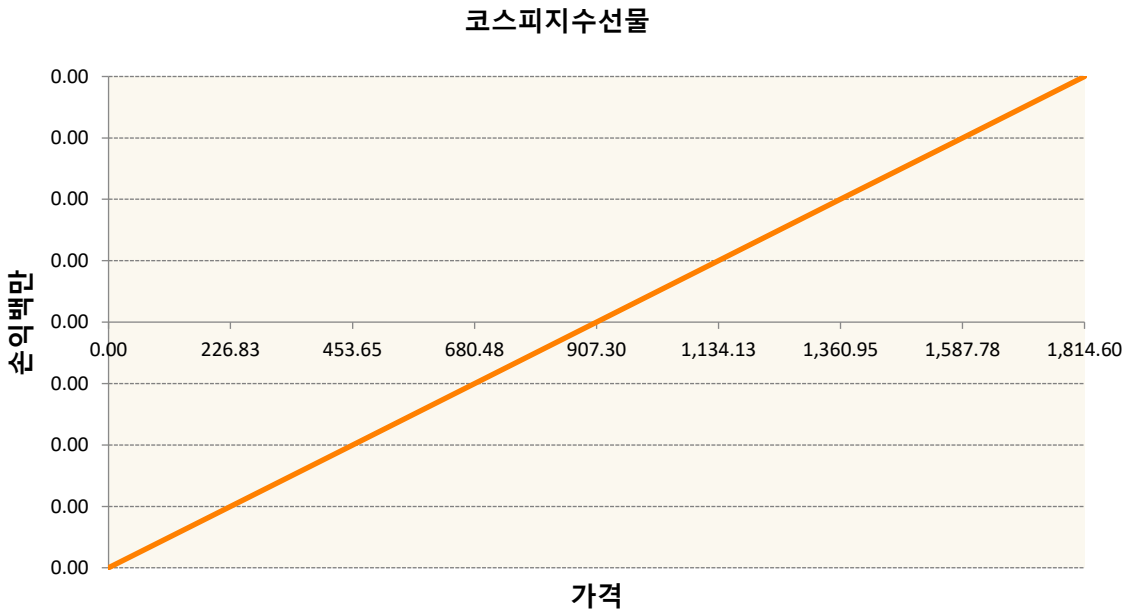
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

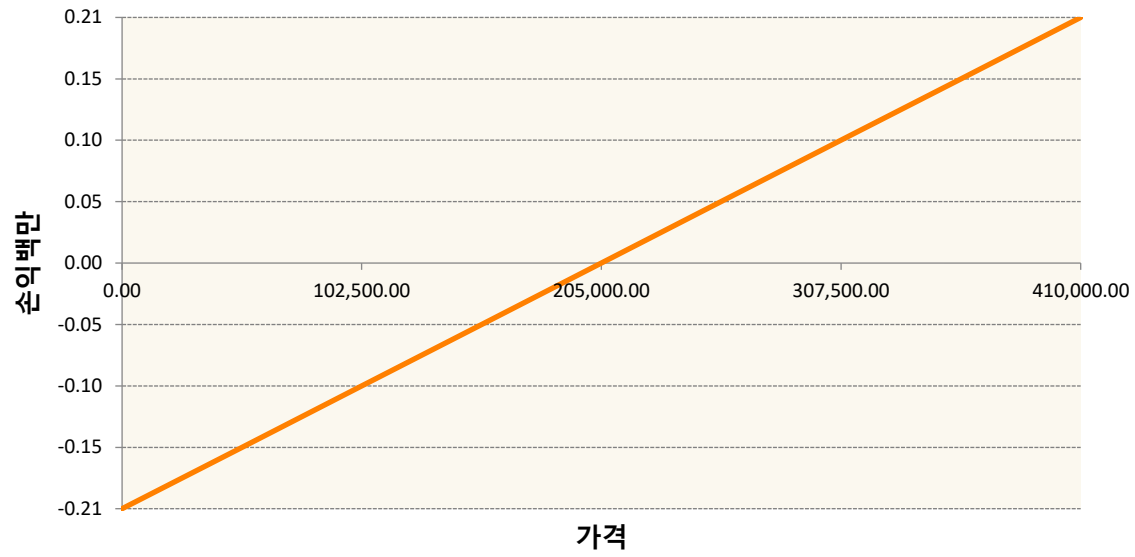
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	286	0	286	장내
누계	유가증권	선물	7,204	40	7,164	장내

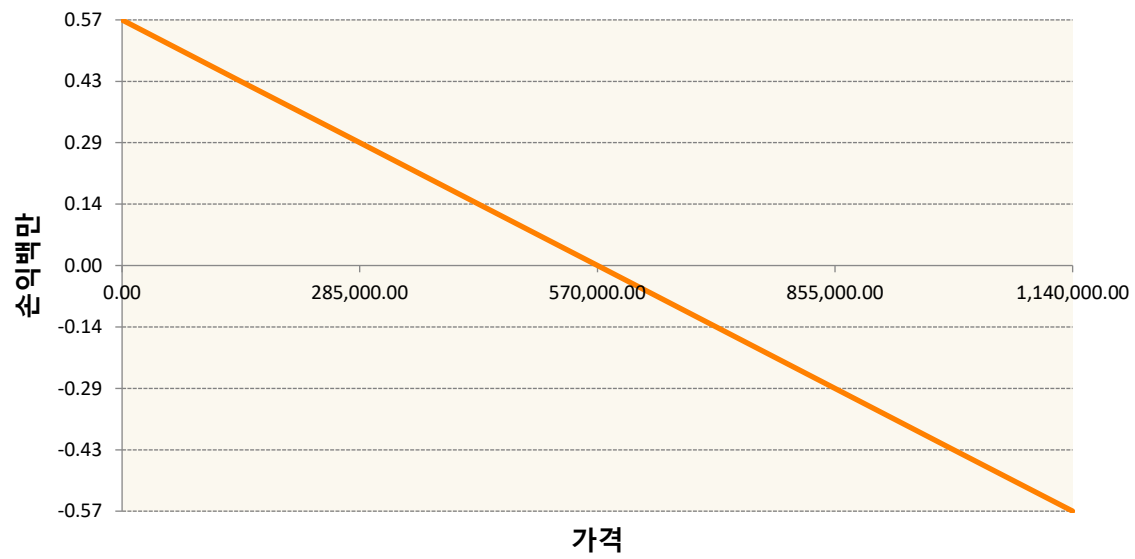
2. 만기시점의 손익구조



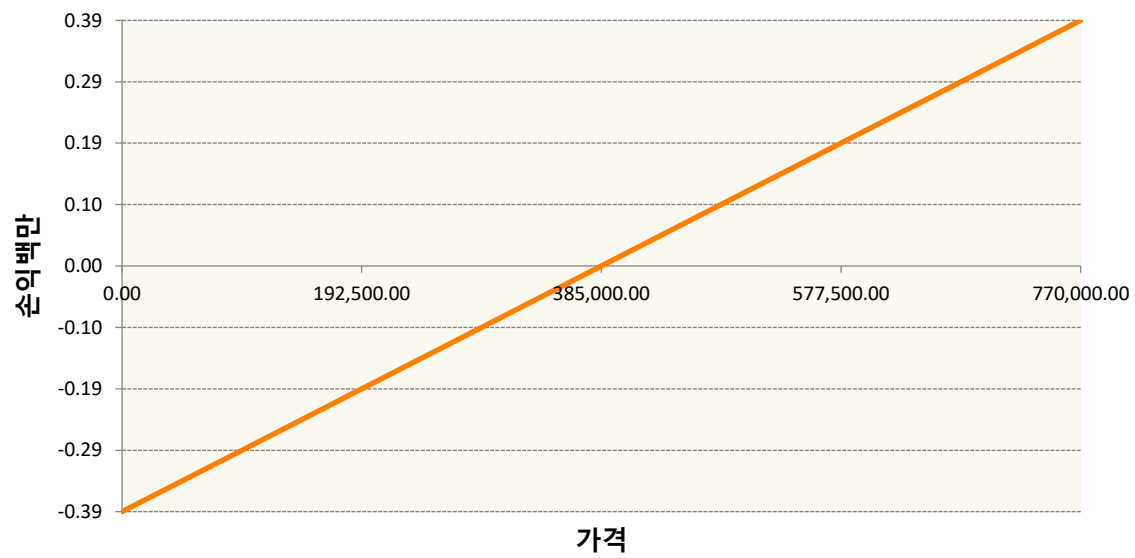
삼성전자개별선물

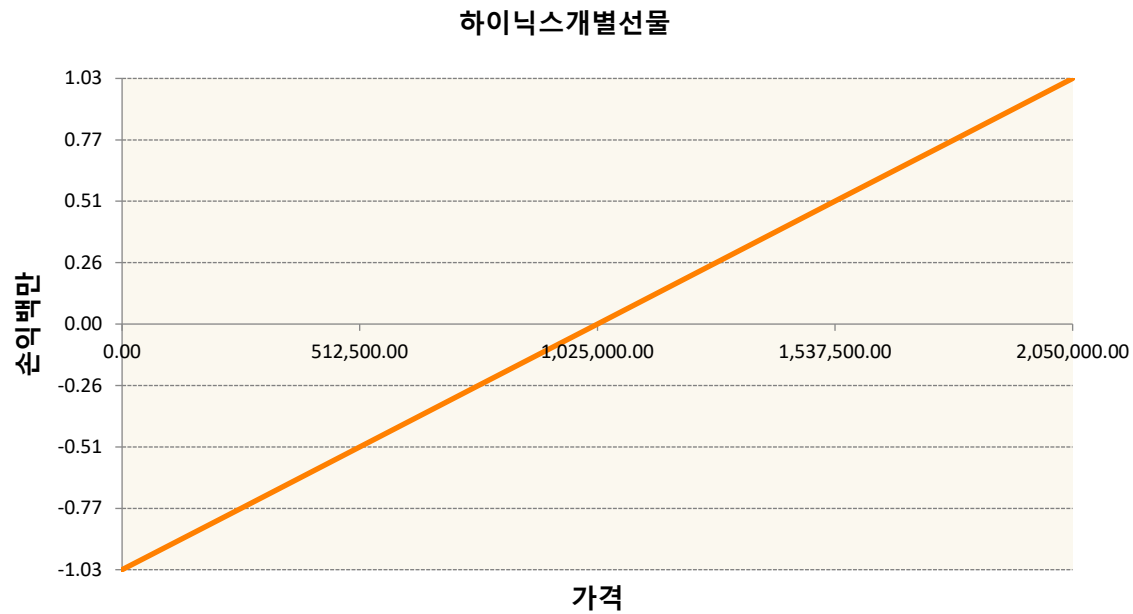


현대차개별선물



화학개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		91
KR4A056300 2026-03 미니코스피200 선물		94
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		1
KR4A166300 2026-03 현대차개별선물		3
KR4A476300 2026-03 LG화학개별선물		7
KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물		5

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

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

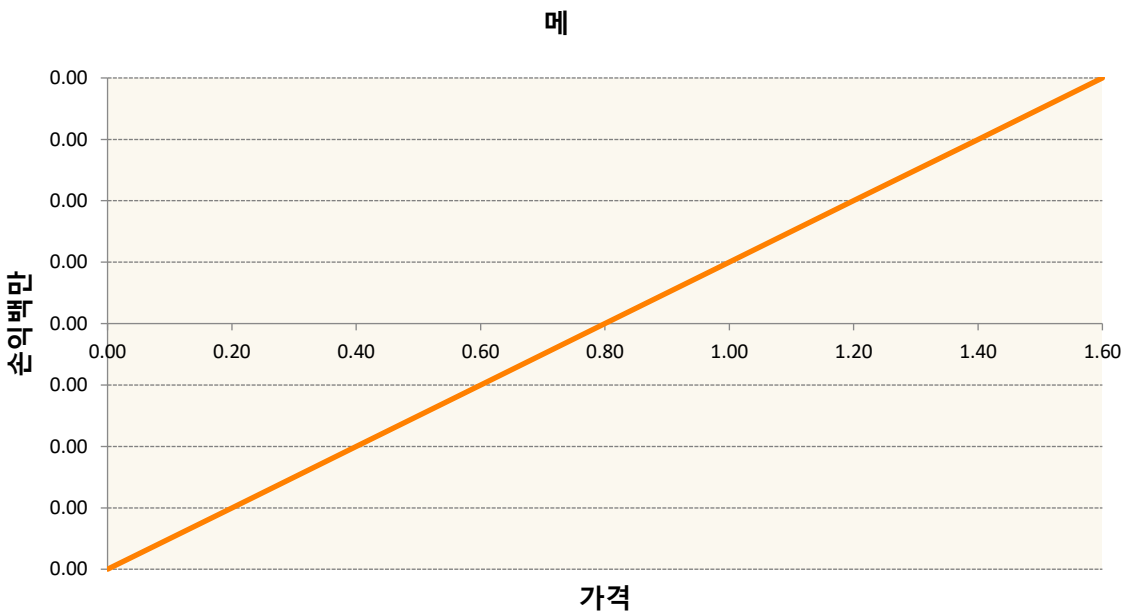
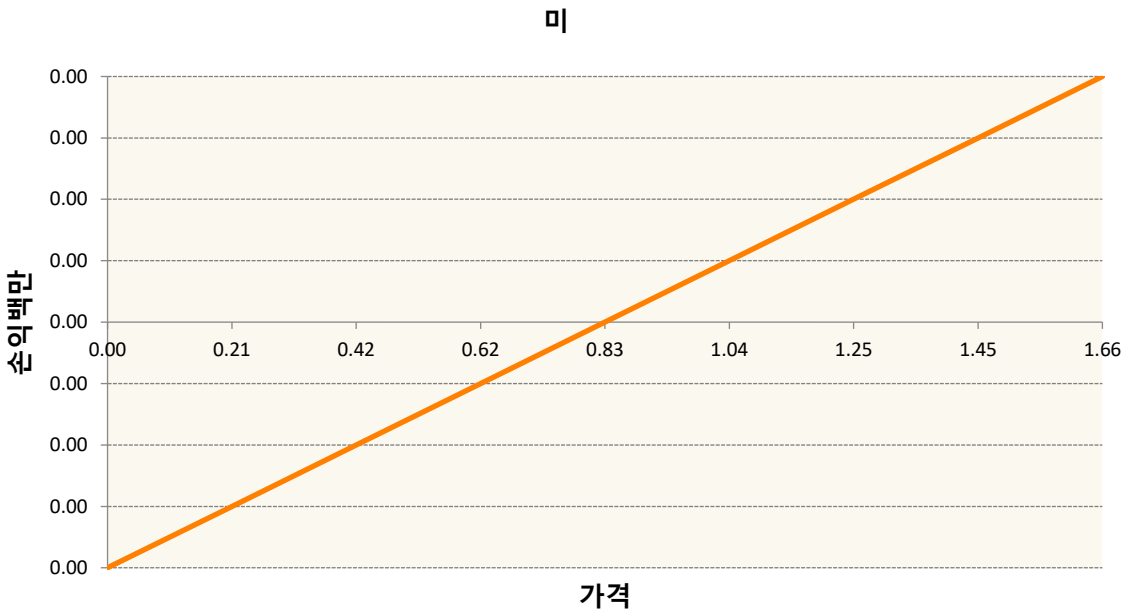
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,050	0	6,050	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		386
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		97

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	517

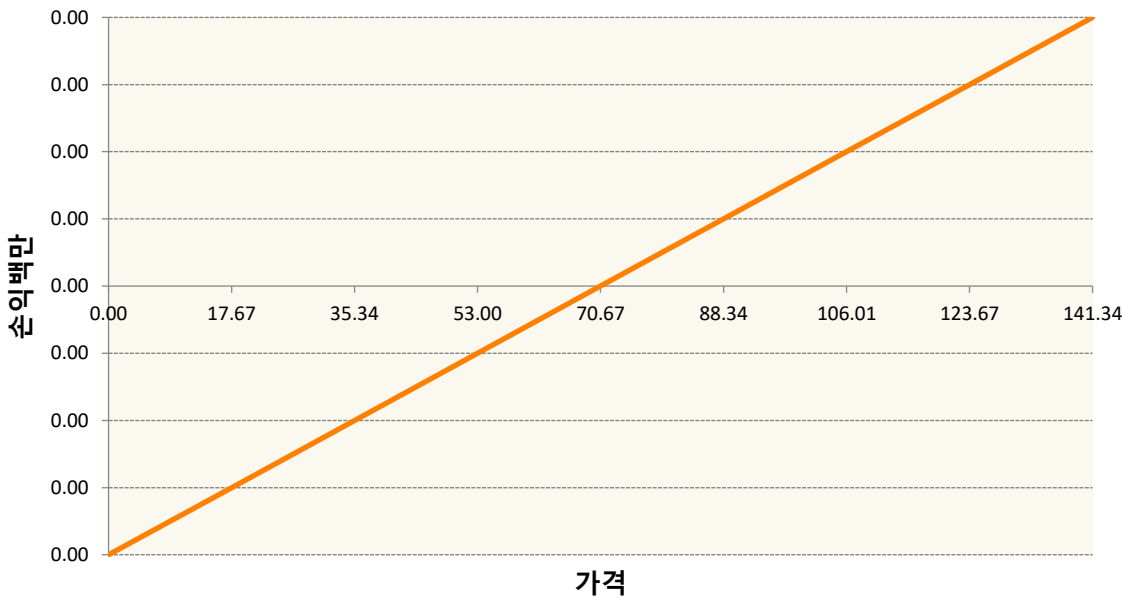
공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			4,694	0	4,694	
누계	통화	선도	876	5,561	-4,685	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213G1V\ KRW/EUR 27-02-26E		252
FXW213G22\ EUR/KRW 27-02-26E		27
FXW213G29\ EUR/KRW 27-02-26E		13
FXW213G2L\ EUR/KRW 27-02-26E		8
FXW213G2P\ EUR/KRW 31-03-26E		21
FXW213G2R\ KRW/EUR 31-03-26E		193
MOZ26 ECX EMISSION Dec26		376

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	853

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

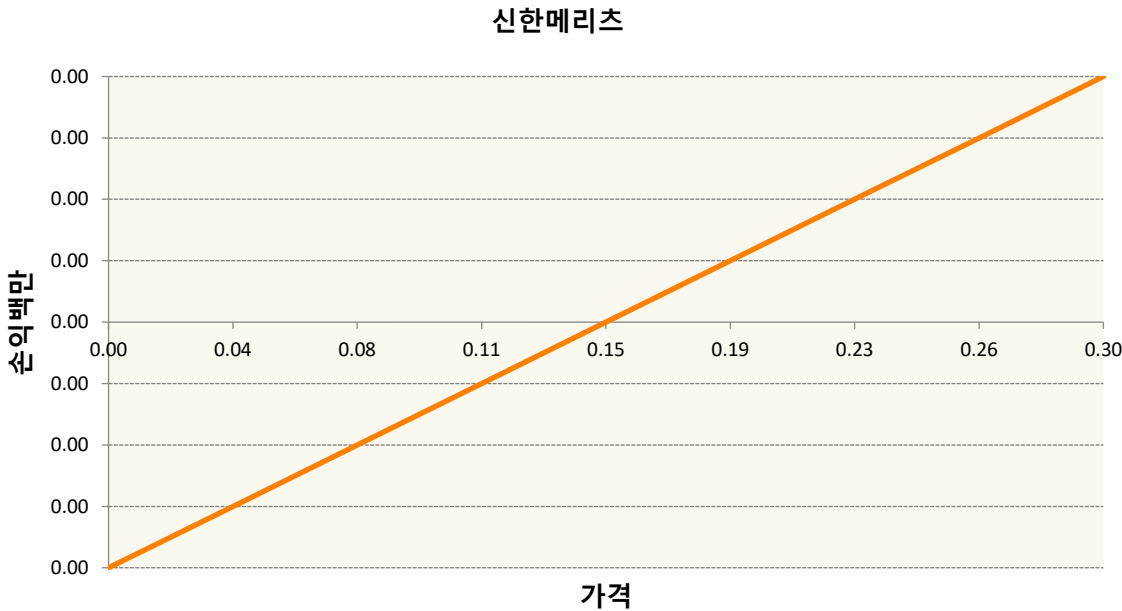
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	1,104	0	1,104	장외
누계	지수	스왑	3,133	0	3,133	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	13
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	13
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	33

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

(단위:백만원)

143

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

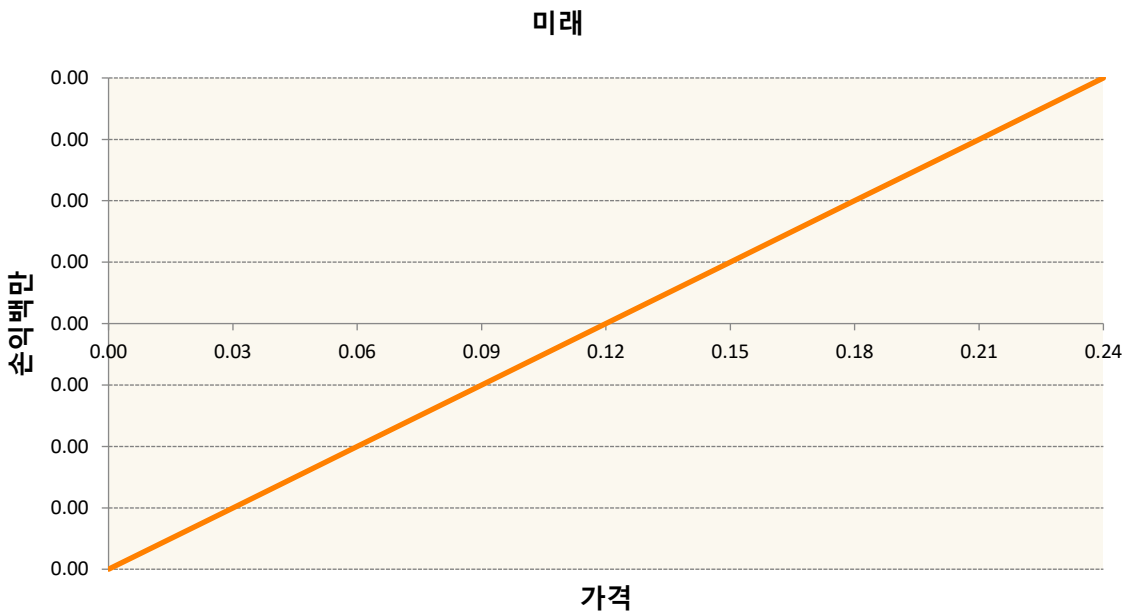
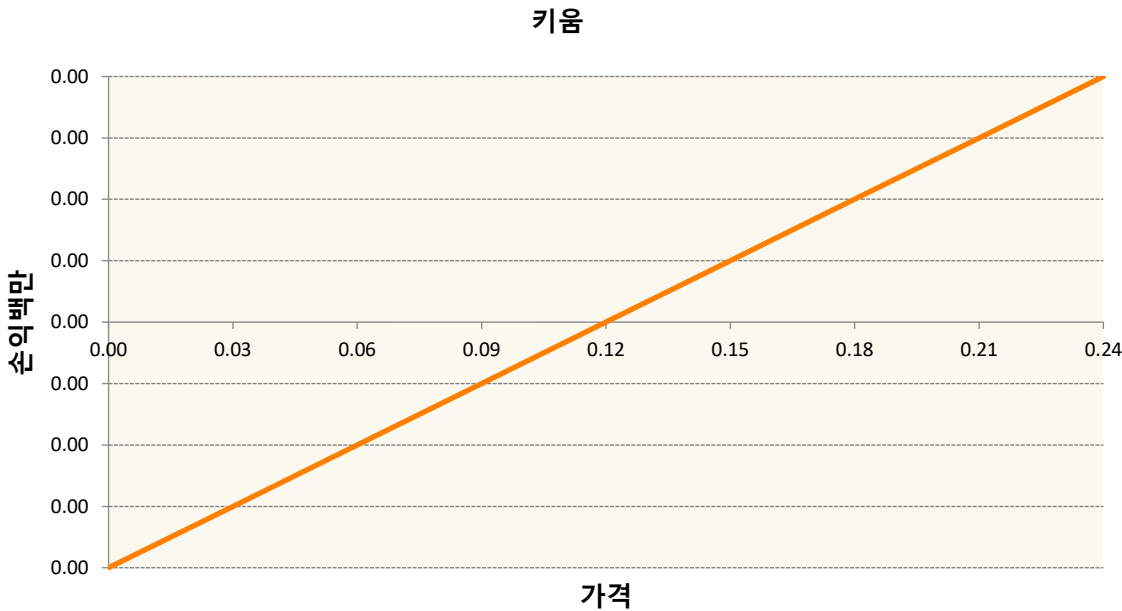
SOL차이나육성산업액티브상장지

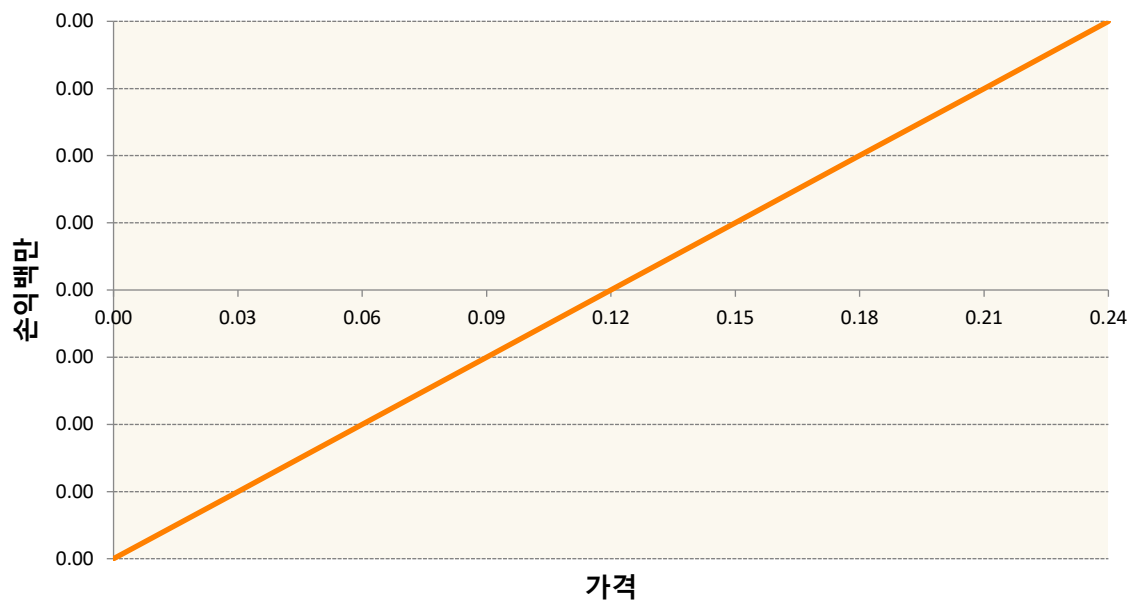
1. 계약금액

(단위:백만원)

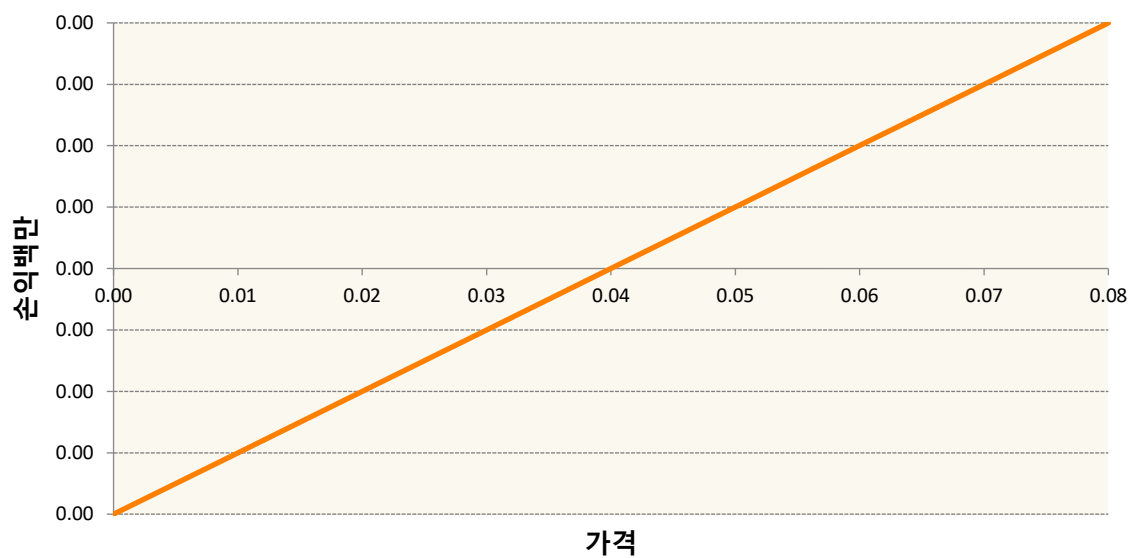
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	1,718	0	1,718	장외

2. 만기시점의 손익구조





메리츠



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)	8
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래)	51
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	26
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	55

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

(단위:백만원)

257

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

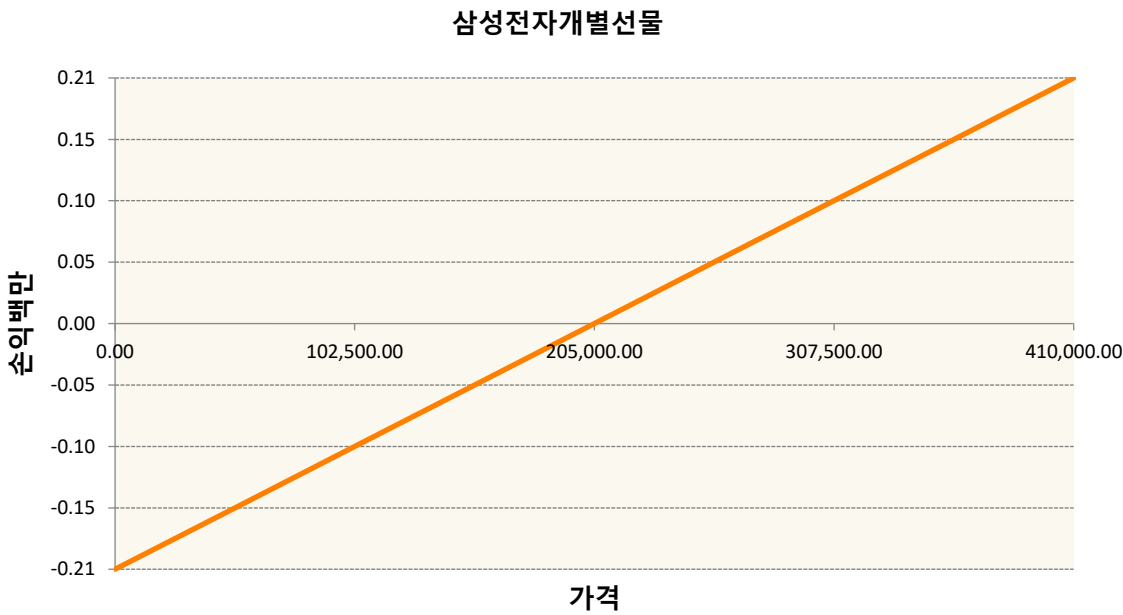
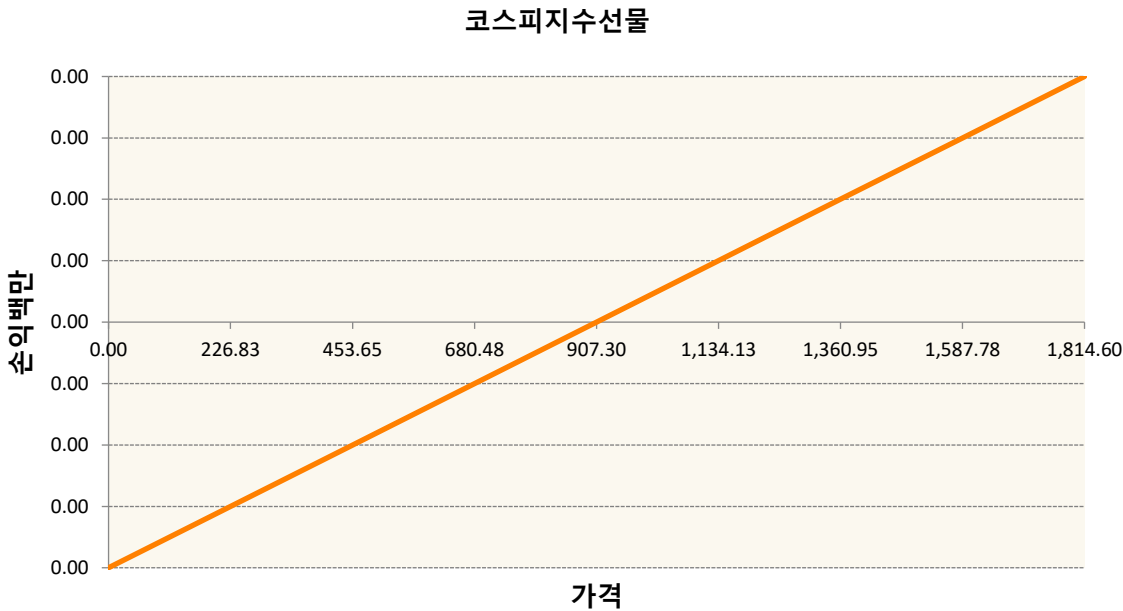
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

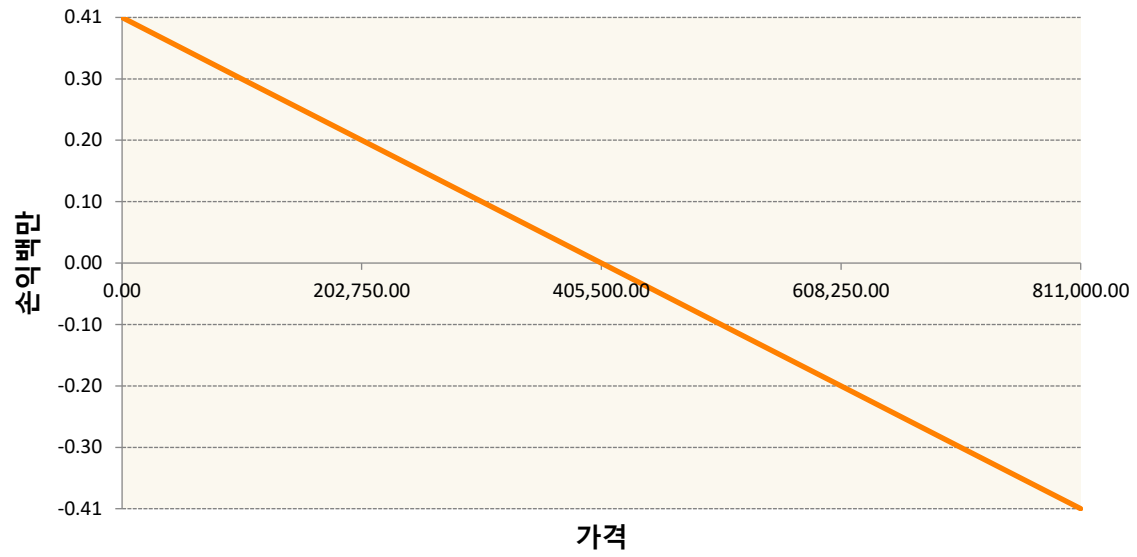
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,317	0	1,317	장내
누계	유가증권	선물	8,714	4,451	4,263	장내

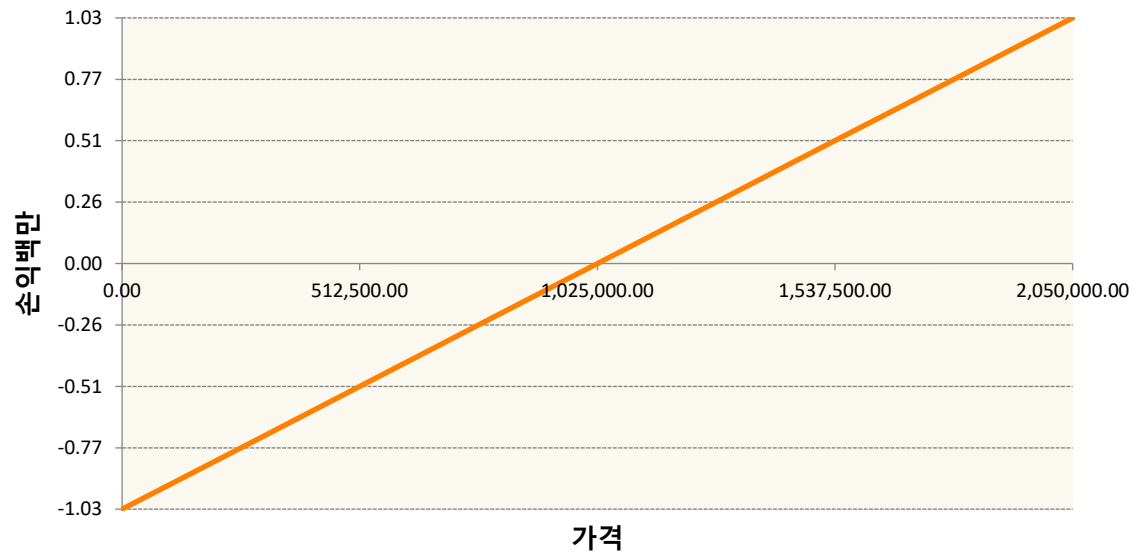
2. 만기시점의 손익구조



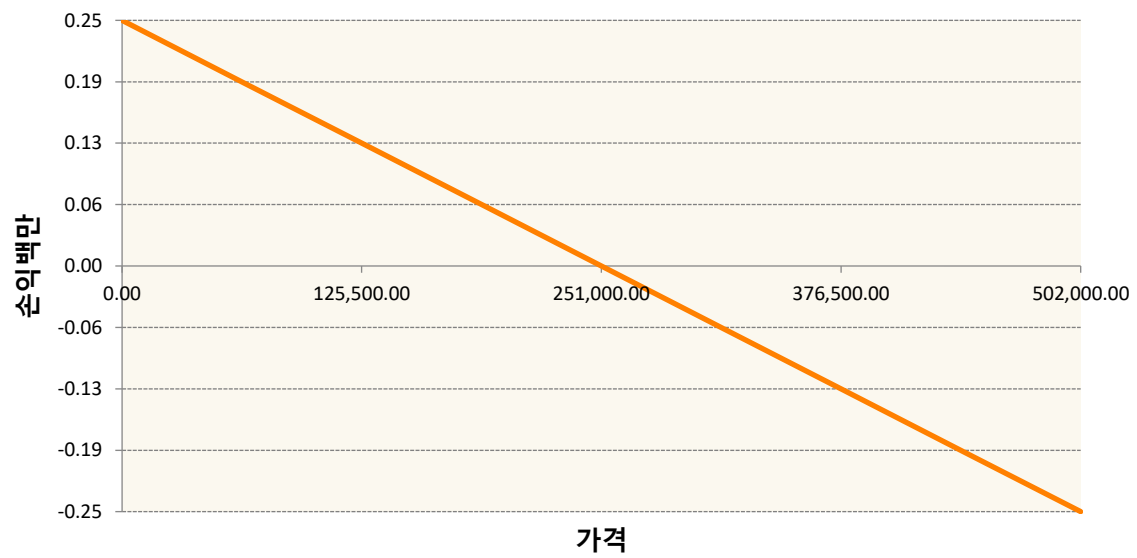
홀딩스개별선물



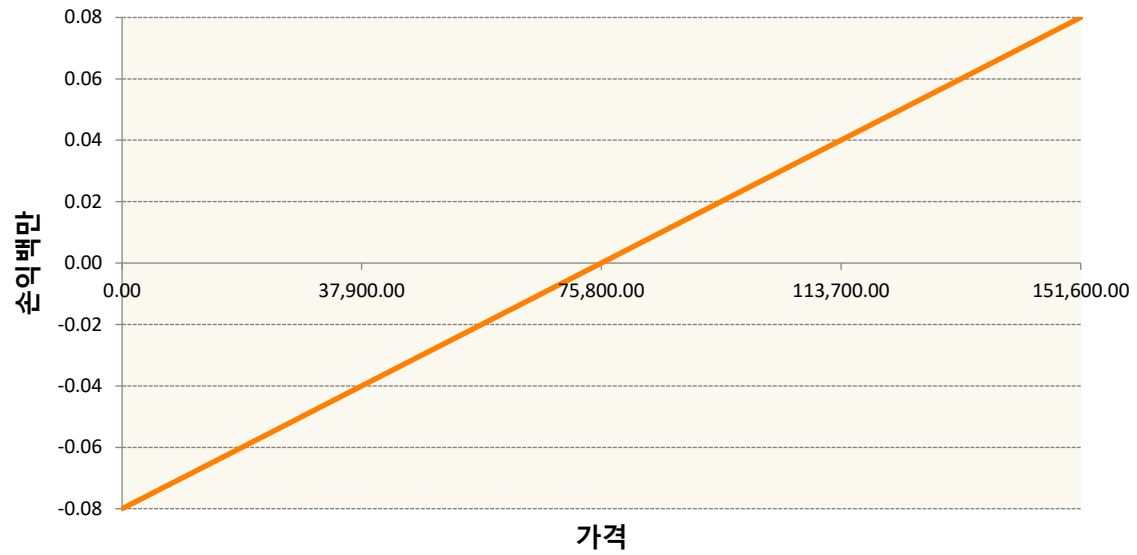
하이닉스개별선물



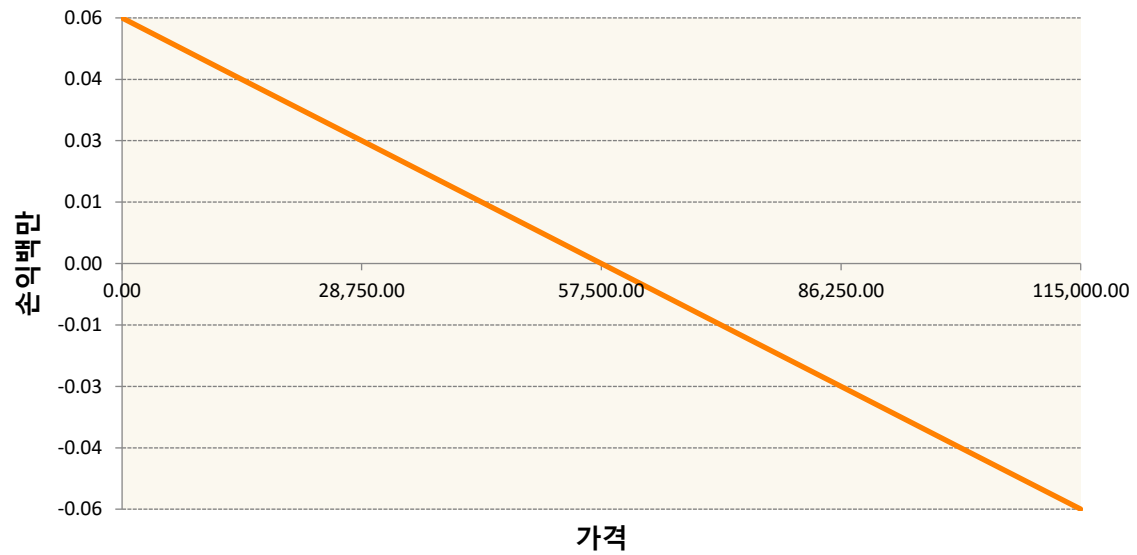
개별선물



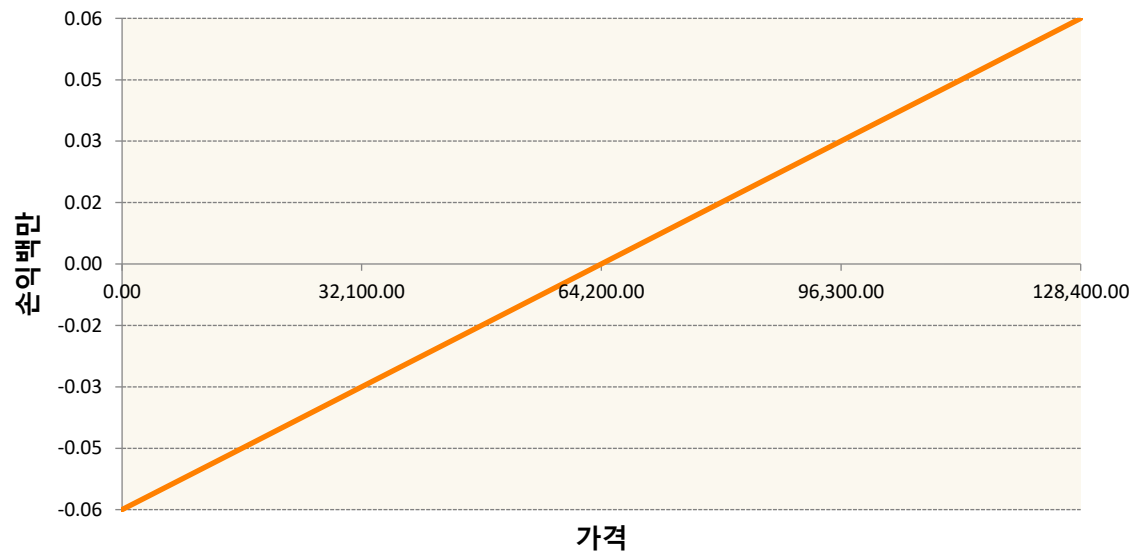
포스코인터내셔널개별선물



카카오개별선물



카카오페이개별선물



(단위:백만원)

KR4A01630008							2026-03 코스피200지수선물		235		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235				
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157				
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	78	78	78	78	78	78	78				
5.33%	157	157	157	157	157	157	157				
8.00%	235	235	235	235	235	235	235				
KR4A11630006							2026-03 삼성전자개별선물		307		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307				
-5.33%	-204	-204	-204	-204	-204	-204	-204				
-2.67%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	102	102	102	102	102	102	102				
5.33%	204	204	204	204	204	204	204				
8.00%	307	307	307	307	307	307	307				
KR4A13630004							2026-03 POSCO홀딩스개별선물		63		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	63	63	63	63	63	63	63				
-5.33%	42	42	42	42	42	42	42				
-2.67%	21	21	21	21	21	21	21				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21				
5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42				
8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63				
KR4A50630008							2026-03 SK하이닉스개별선물		88		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88				
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59				
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	29	29	29	29	29	29	29				
5.33%	59	59	59	59	59	59	59				
8.00%	88	88	88	88	88	88	88				
KR4A56630002							2026-03 NAVER개별선물		148		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	148	148	148	148	148	148	148
-5.33%	99	99	99	99	99	99	99
-2.67%	49	49	49	49	49	49	49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
8.00%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
KR4AB7630000 2026-03 포스코인터내셔널개별선물							62
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62
KR4ACF630008 2026-03 카카오개별선물							146
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	146	146	146	146	146	146	146
-5.33%	98	98	98	98	98	98	98
-2.67%	49	49	49	49	49	49	49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
5.33%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
KR4AF7630001 2026-03 카카오페이개별선물							1
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

1,509

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

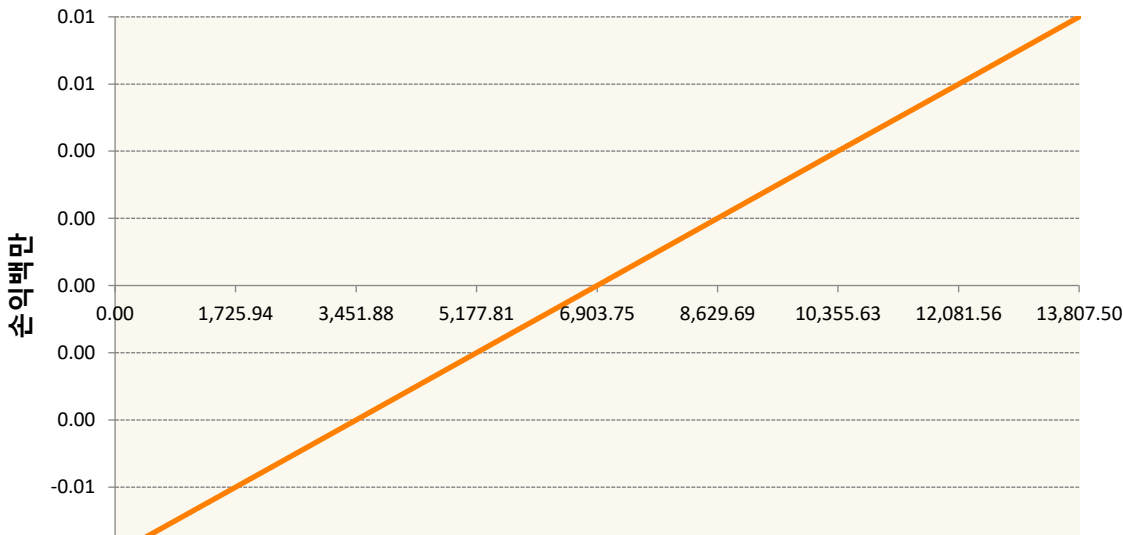
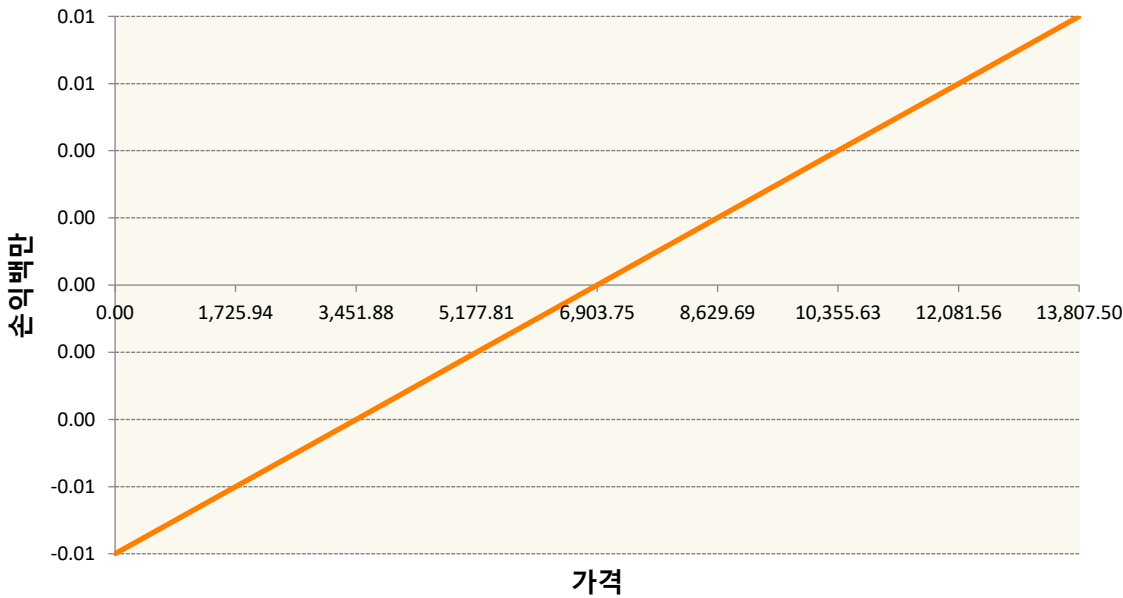
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

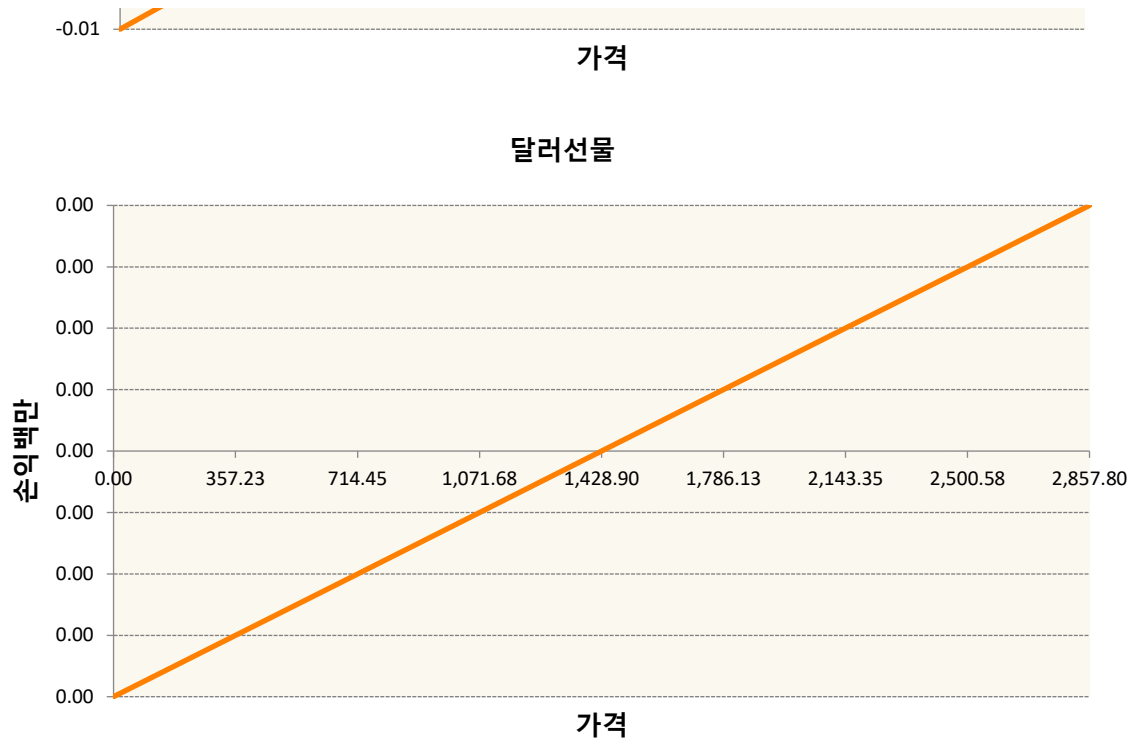
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	3,858	0	3,858	장내
누계	유가증권	선물	612	0	612	장내
누계	지수	선물	53,422	0	53,422	
누계	통화	선물	11,860	0	11,860	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	4,274
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	49
KR4A756300	2026-03 달러선물	949

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

3,704

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

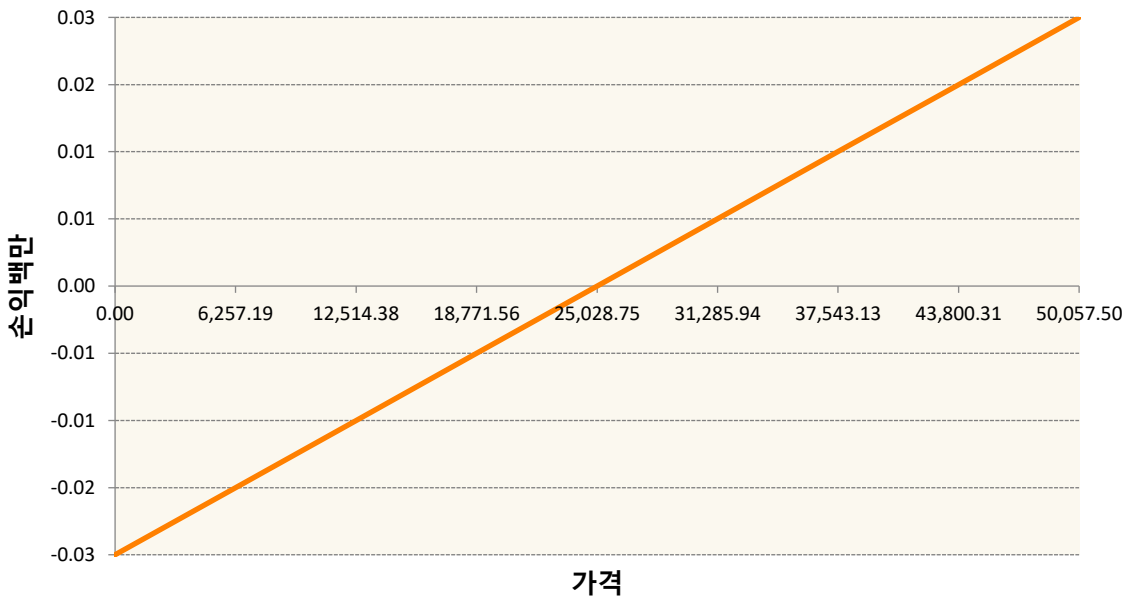
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

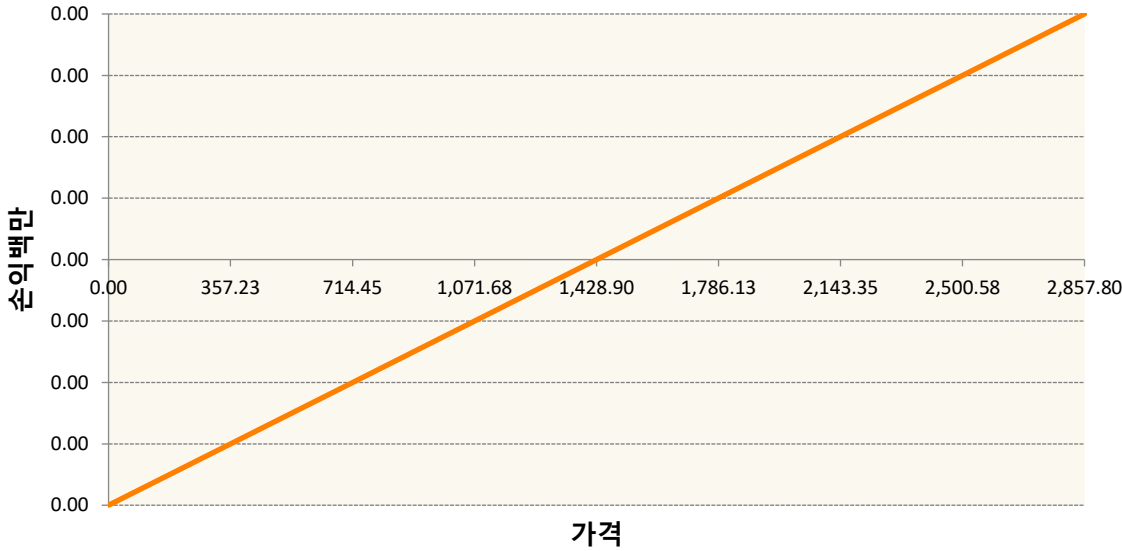
(단위:백만원)

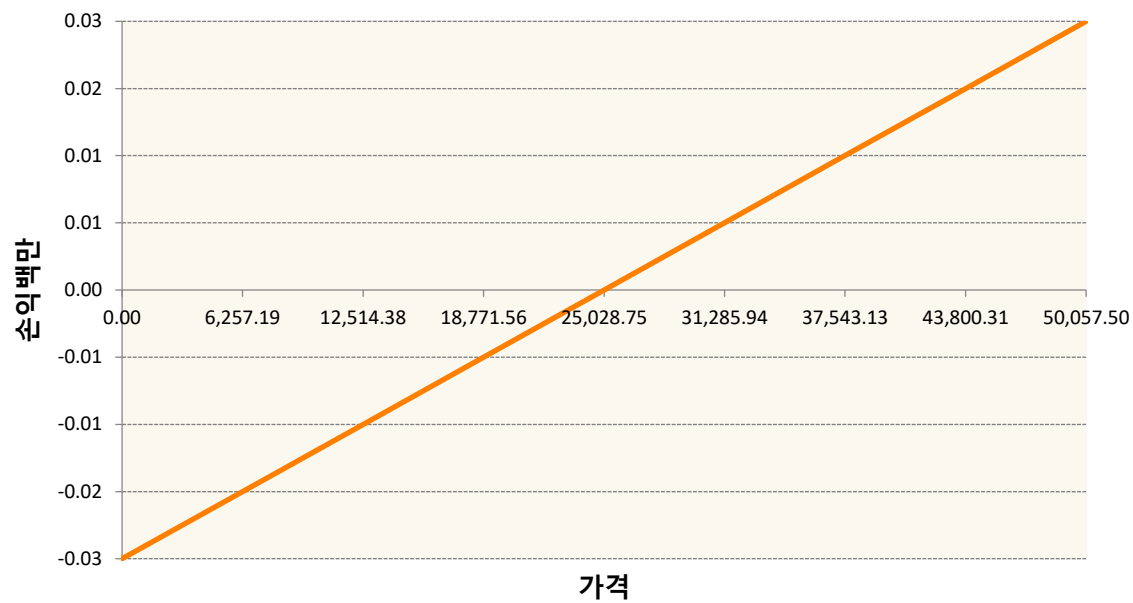
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	1,715	0	1,715	장내
누계	지수	선물	23,199	0	23,199	장내
누계	통화	선물	4,787	0	4,787	장내

2. 만기시점의 손익구조



달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN Mar26		24
KR4A756300	2026-03 달러선물		383
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,832

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,019

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

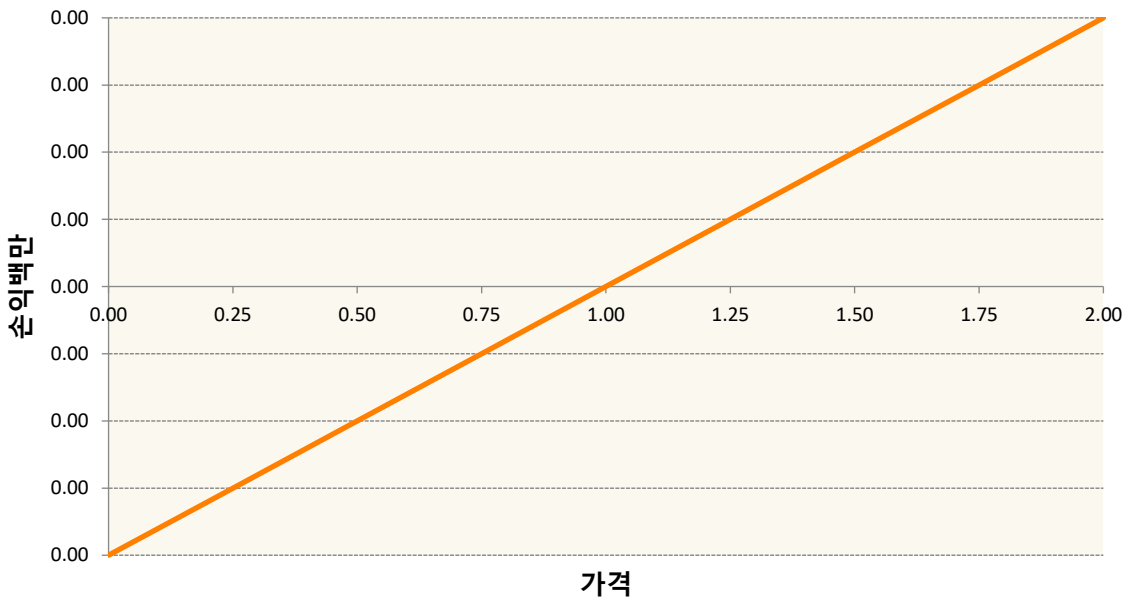
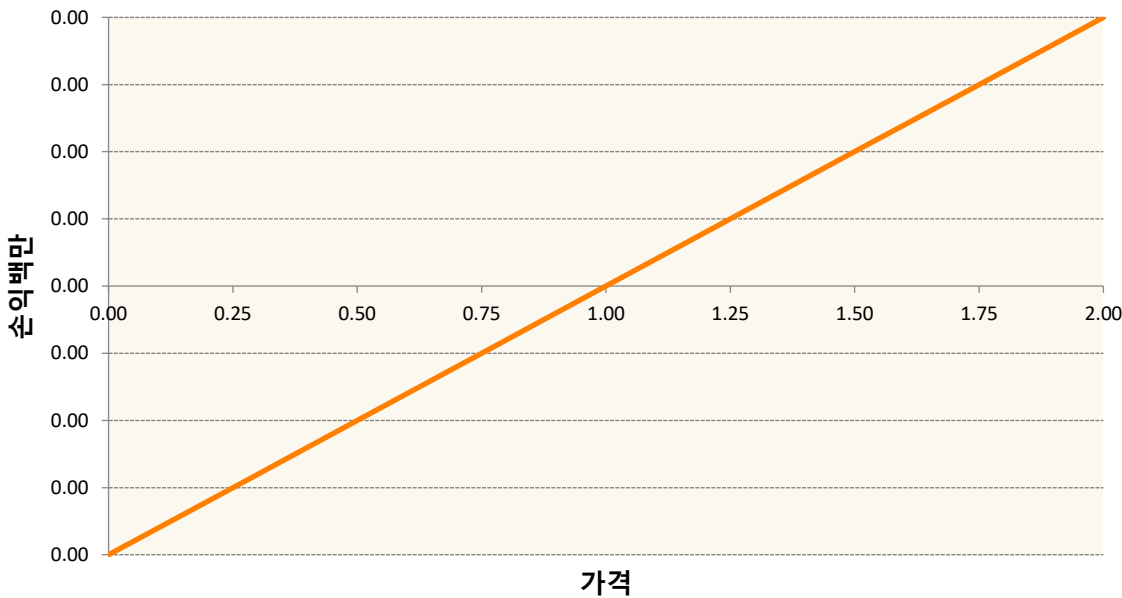
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

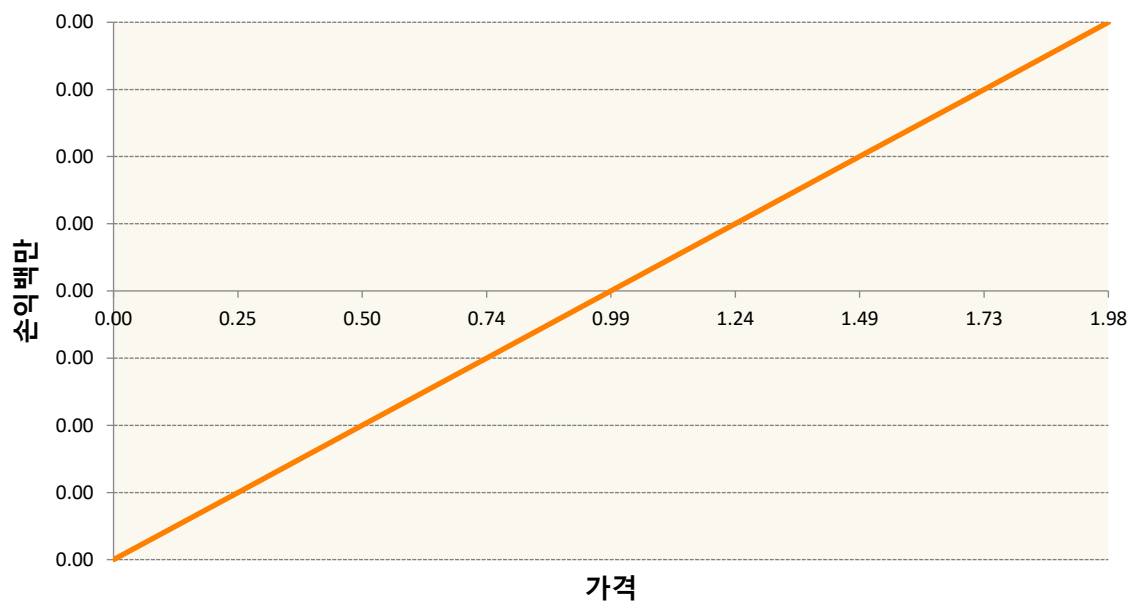
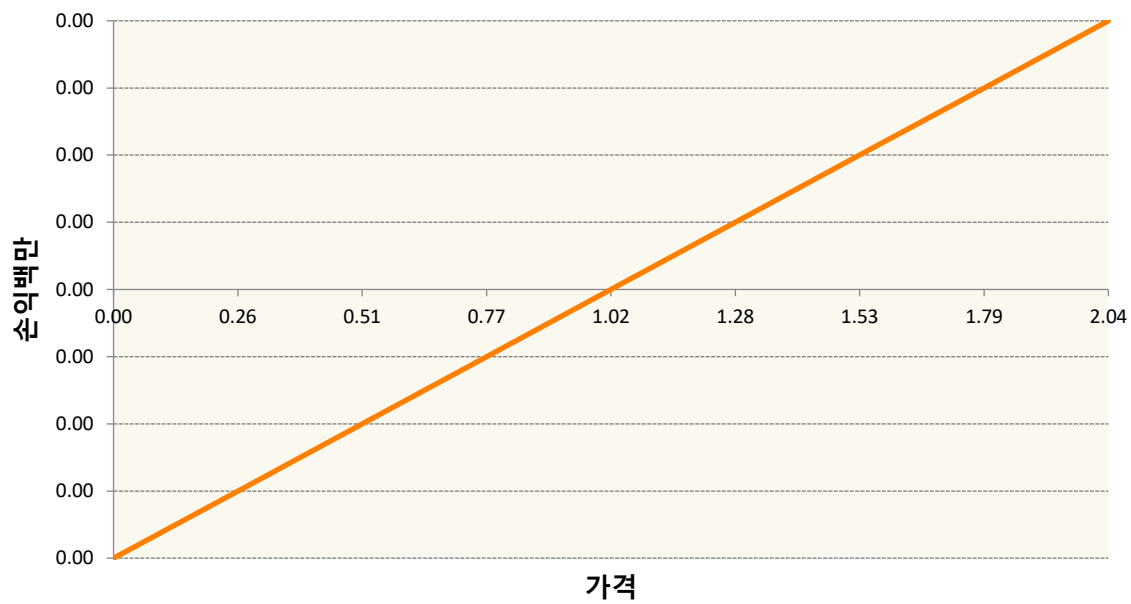
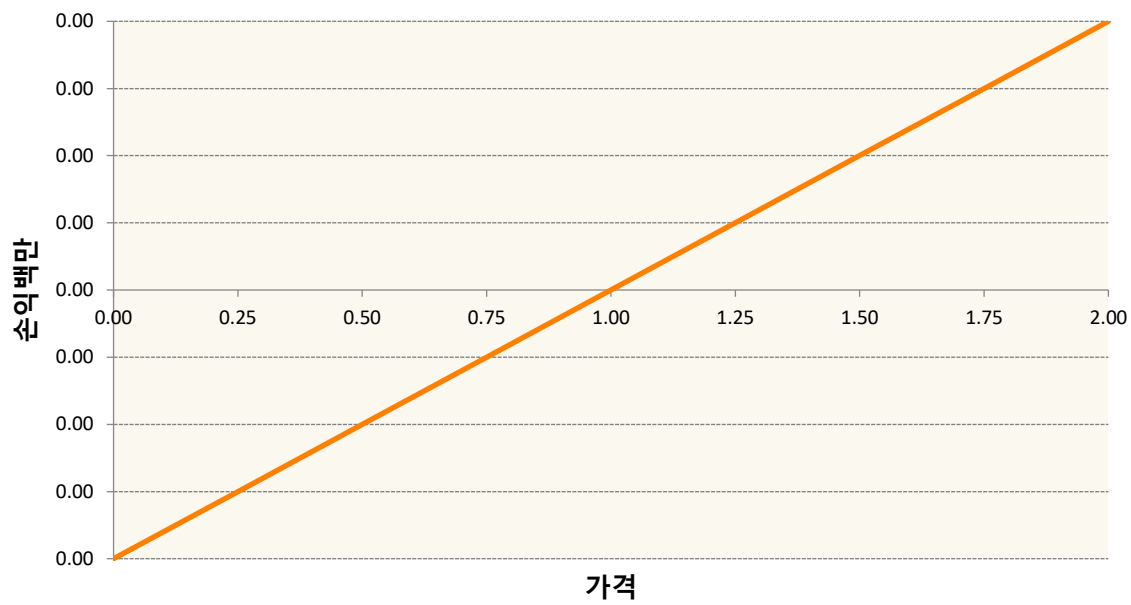
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	379,219	0	379,219	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,214
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,358
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,679
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		149
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,887

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,702

공시일	2026-02-26
기준일	2026-02-25

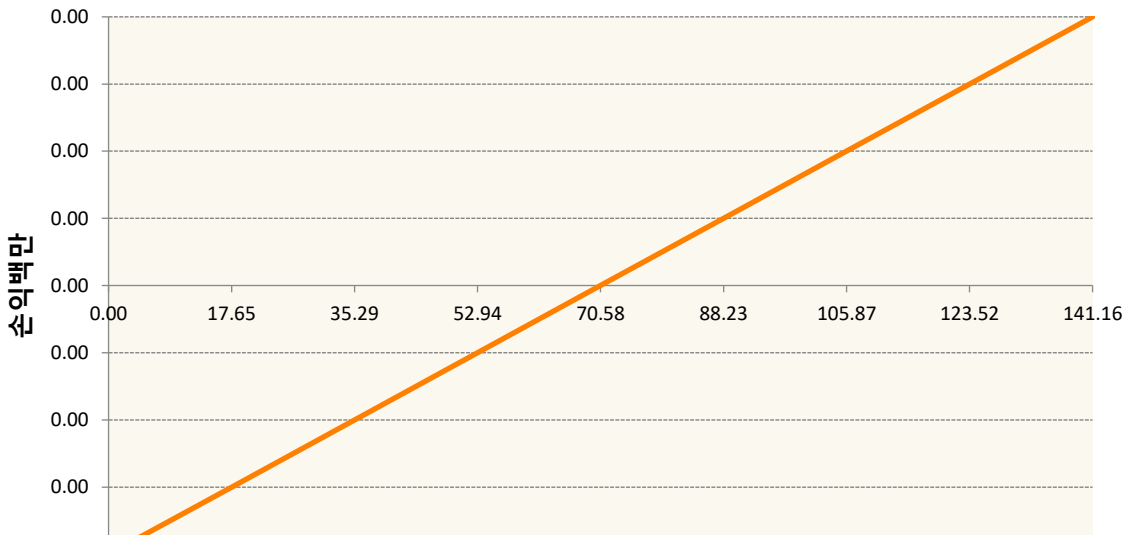
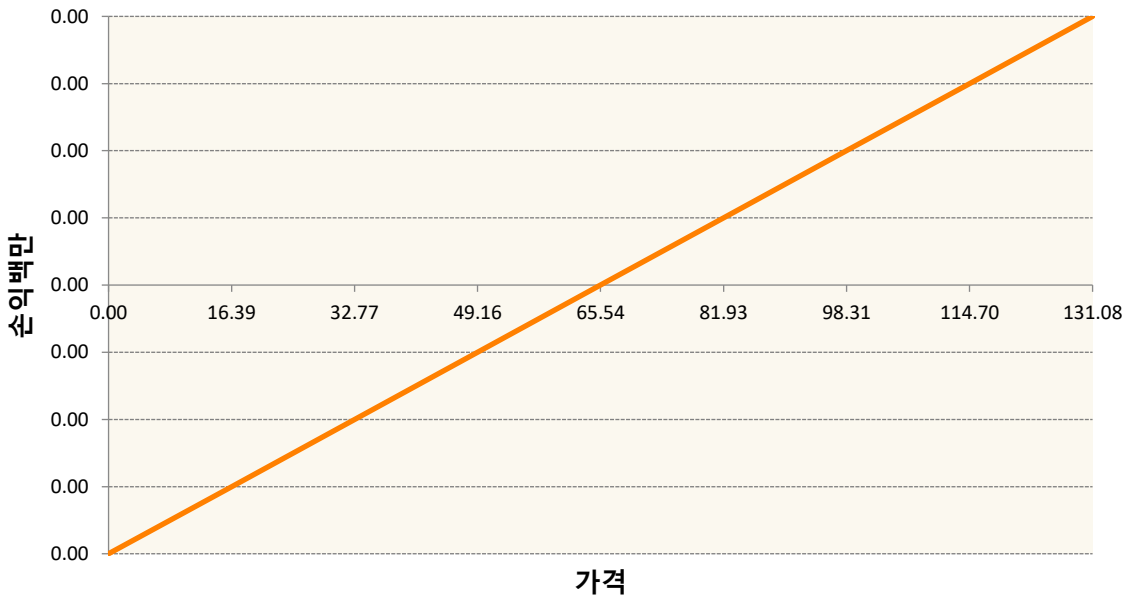
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

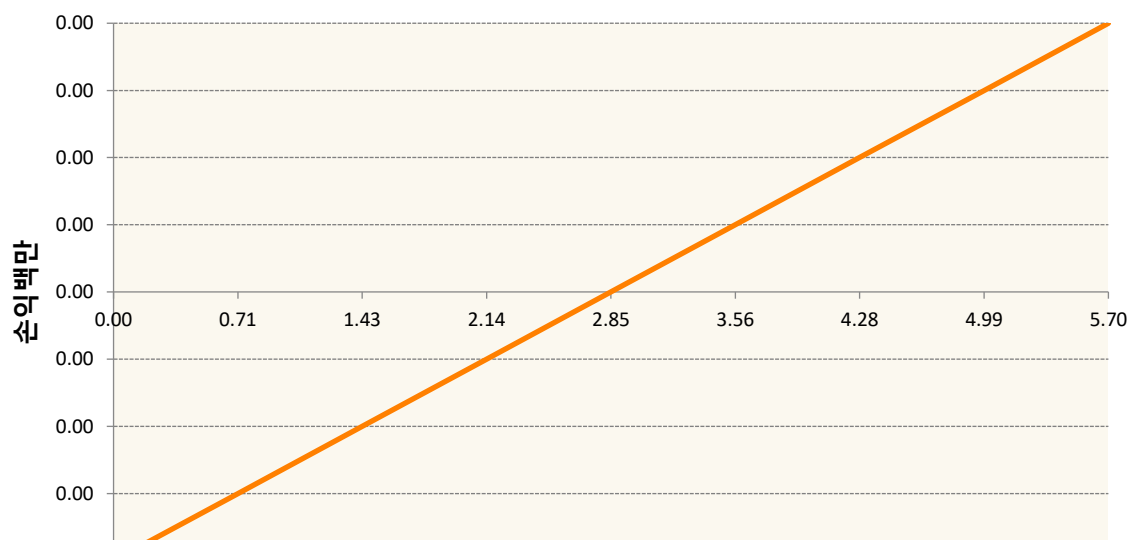
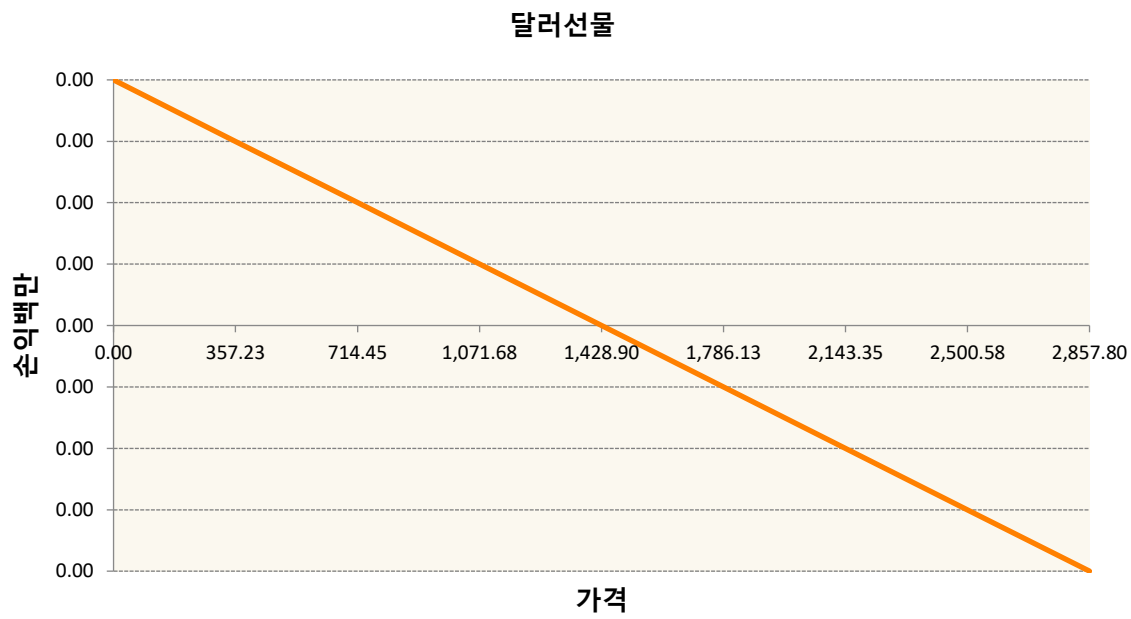
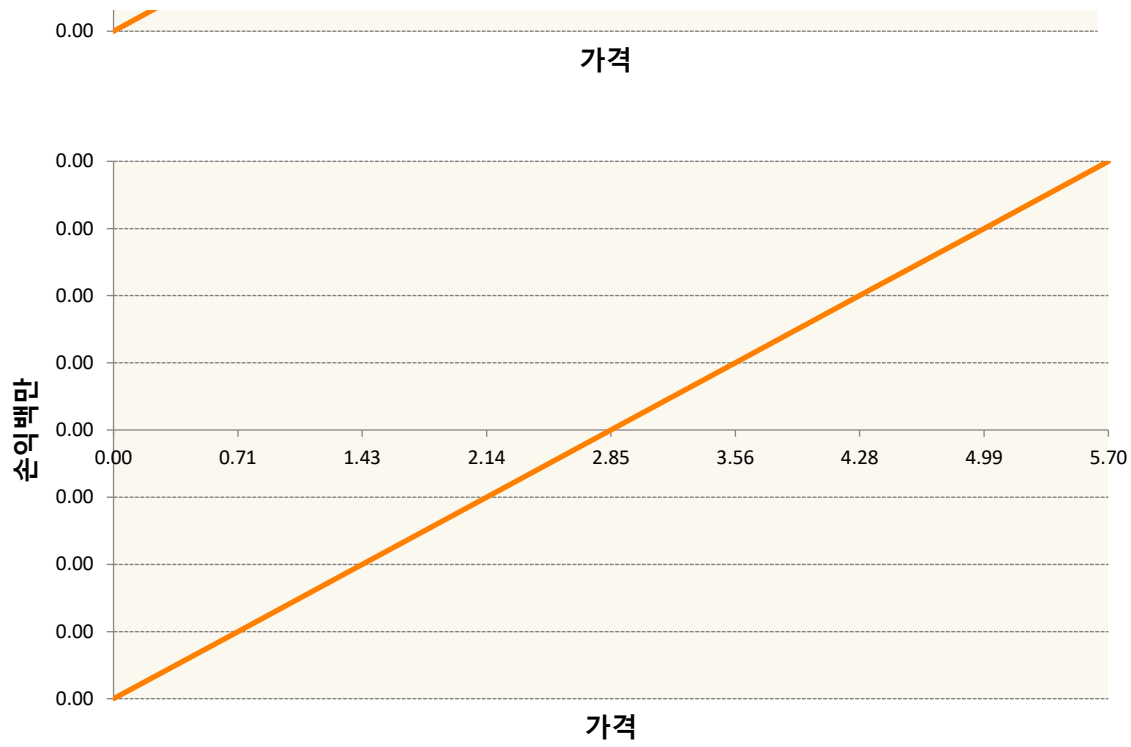
1. 계약금액

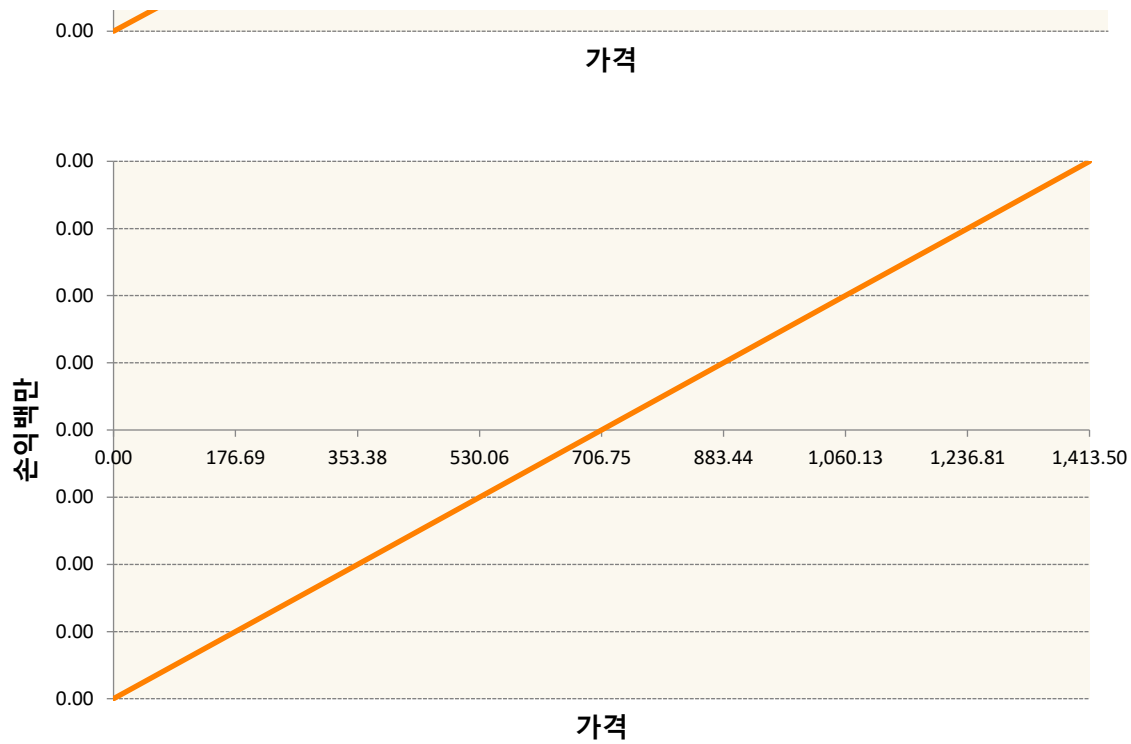
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	185	0	185	
누계	유가증권	선물	333	0	333	
누계	통화	선물	0	114	-114	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK6	WTI CRUDE FUTURE May26	8
COK6	BRENT CRUDE FUTR May26	17
EOK6	E-MINI NATURAL GAS May 26	2
KR4A756300	2026-03 달러선물	9
NGK26	NATURAL GAS FUTR May 26	7
QSK6	Low Su Gasoil G May 26	8

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

(단위:백만원)

97