

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

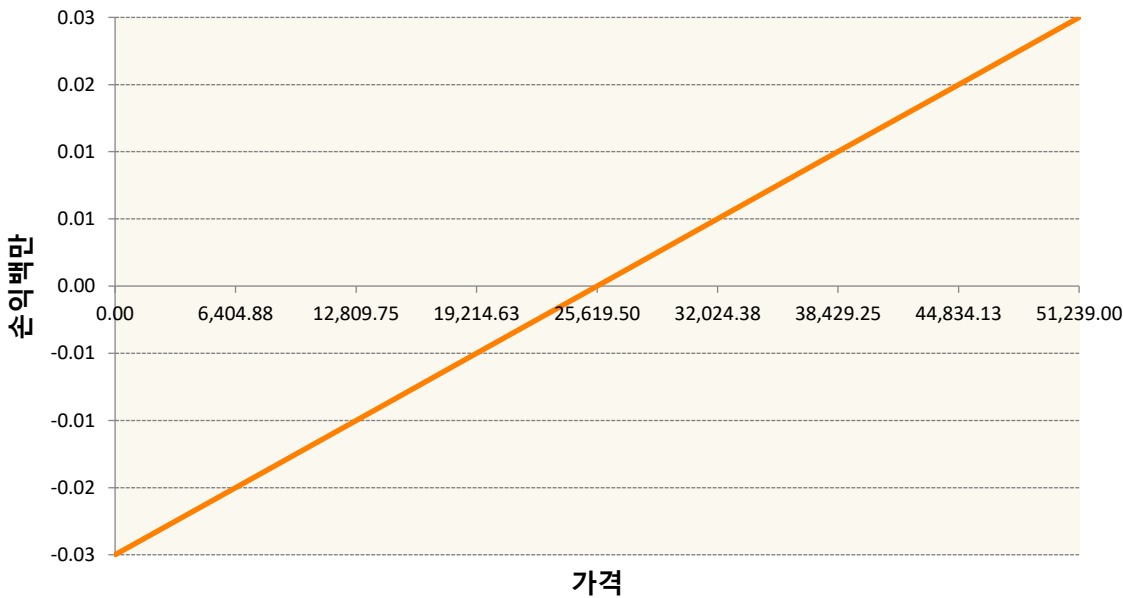
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 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 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

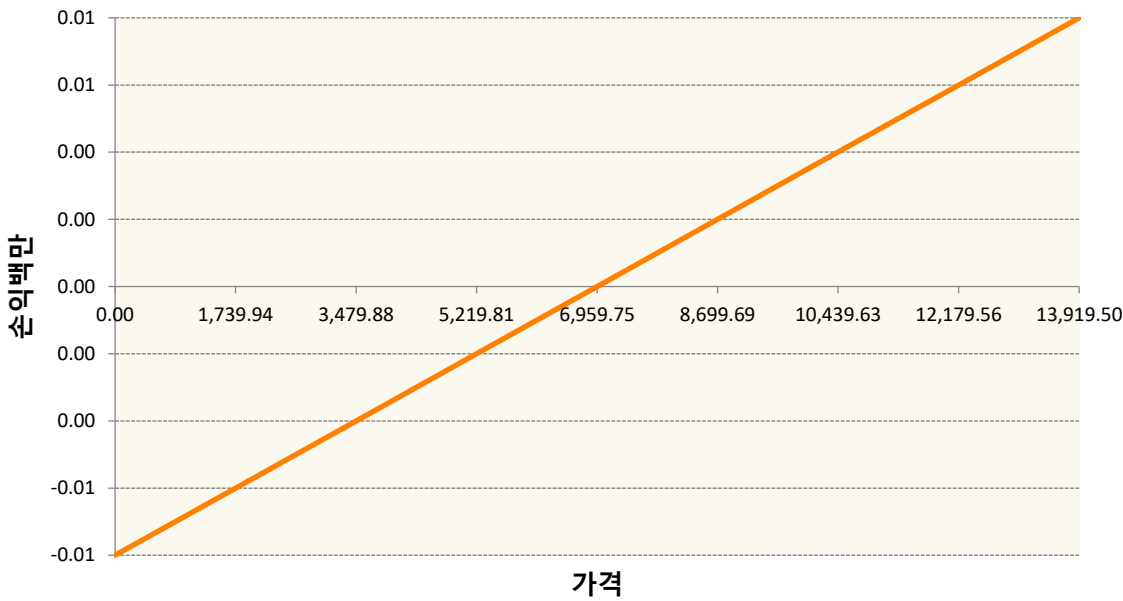
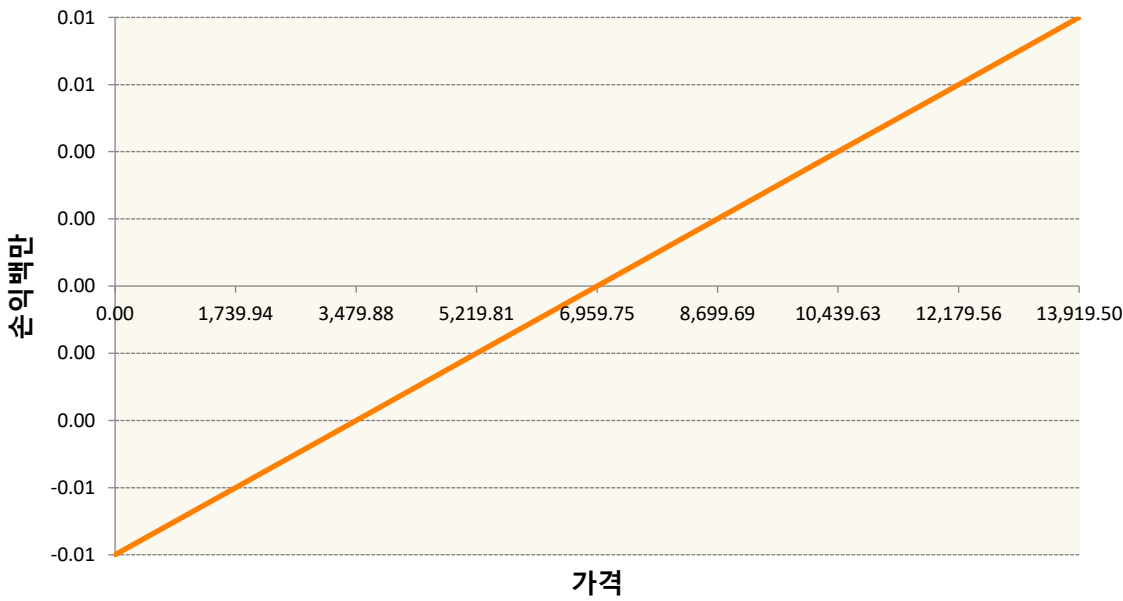
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 103   | 0     | 103       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 514   | 0     | 514       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESH6                      | S&P500 EMINI FUT Mar26   | 41       |
| HWAH6                     | SP500 MIC EMIN FUT Mar26 | 8        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 42       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

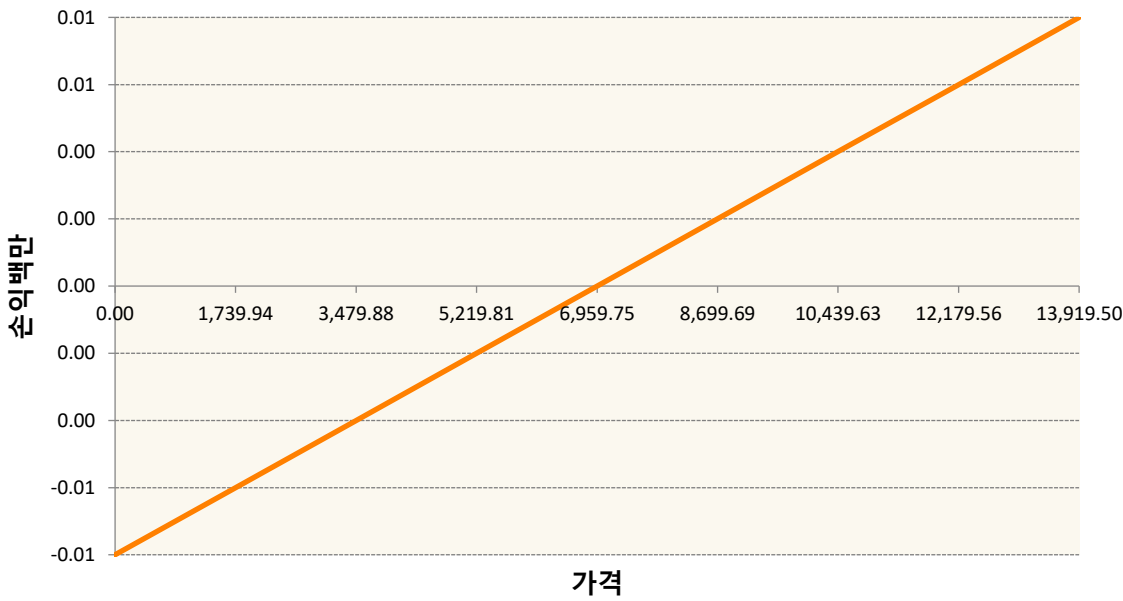
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,542 | 0     | 1,542     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH6      S&P500 EMINI FUT Mar26

123

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

(단위:백만원)

105

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

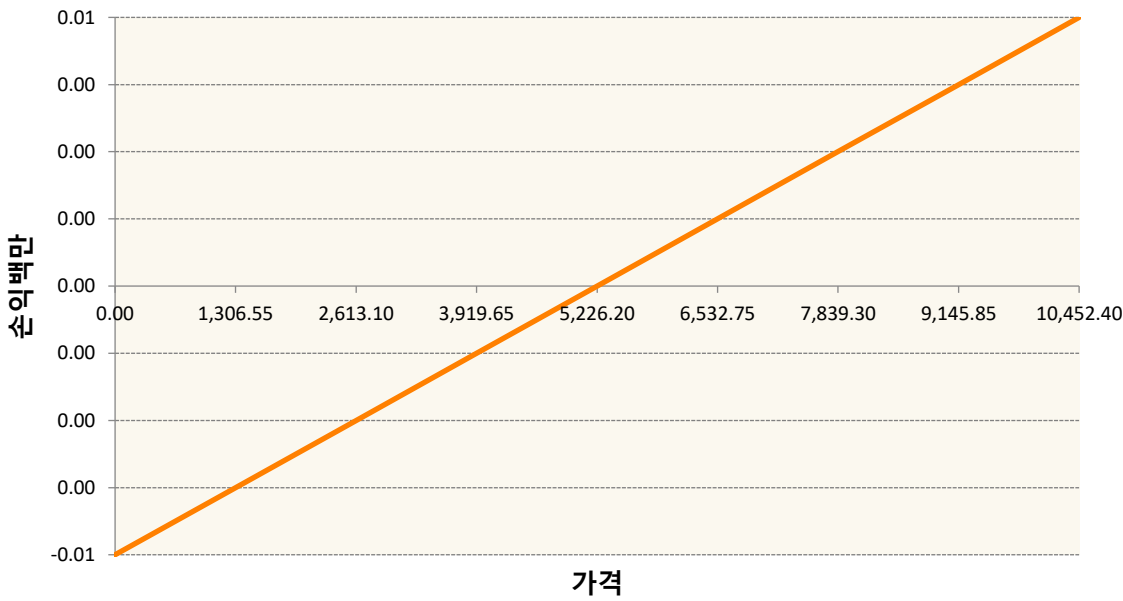
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 5,224 | 0     | 5,224     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSUC GLD US 02/27/26 C475 EQUITY  
GCJ6            GOLD 100 OZ FUTR Apr26

|     |
|-----|
| 9   |
| 418 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 494 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

## 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  | 43 |
| AOPLTRUSP1 PLTR US 02/27/26 P147 EQUITY | 70 |

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

(단위:백만원)

412

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

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

3

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

(단위:백만원)

2



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

(단위:백만원)

1,184

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

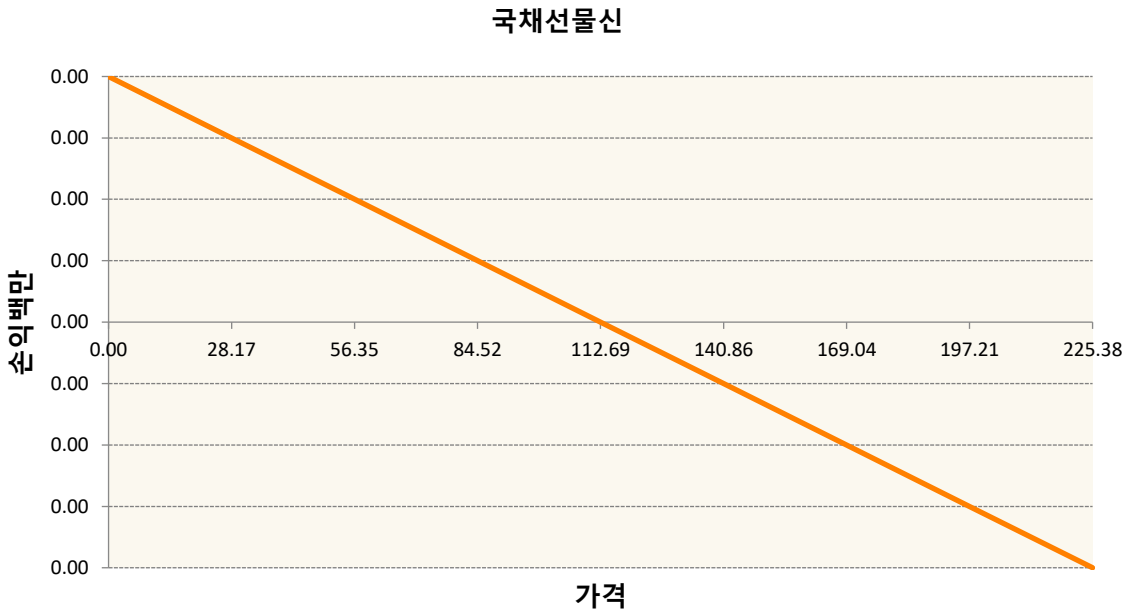
포커스채권(채권-파생형)(종)

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     | 13,523 | -13,523   | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4A67630009 |           |         | 2026-03 국채선물10(신) |      |       |        | 374    |
|--------------|-----------|---------|-------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                   |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%            | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -374      | -374    | -374              | -374 | -374  | -374   | -374   |
| -5.33%       | -250      | -250    | -250              | -250 | -250  | -250   | -250   |
| -2.67%       | -125      | -125    | -125              | -125 | -125  | -125   | -125   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                 | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 125       | 125     | 125               | 125  | 125   | 125    | 125    |
| 5.33%        | 250       | 250     | 250               | 250  | 250   | 250    | 250    |
| 8.00%        | 374       | 374     | 374               | 374  | 374   | 374    | 374    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

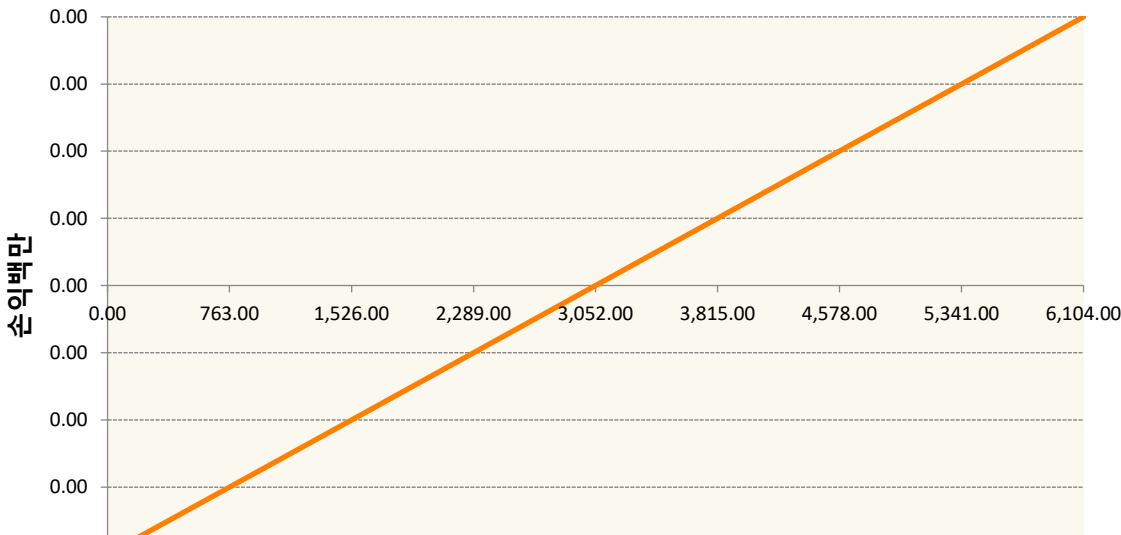
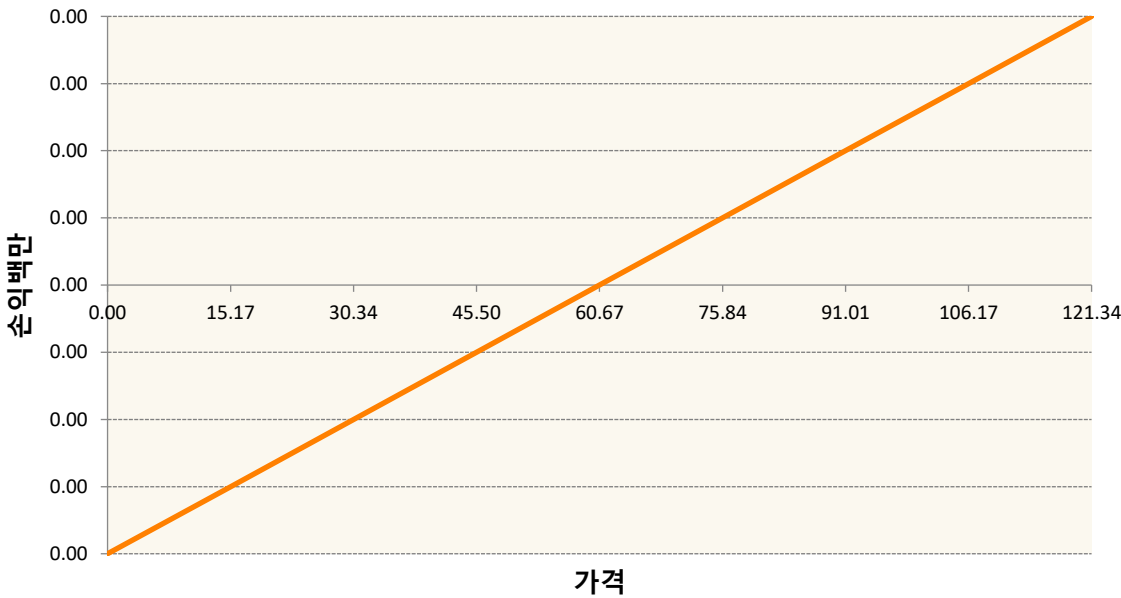
## 포커스농산물모(채권-파생형)

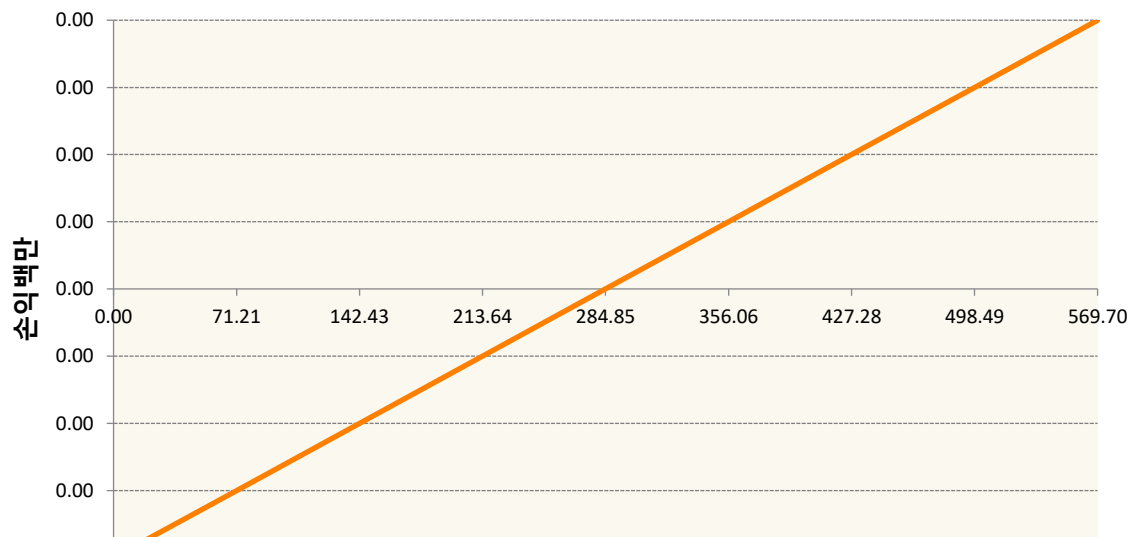
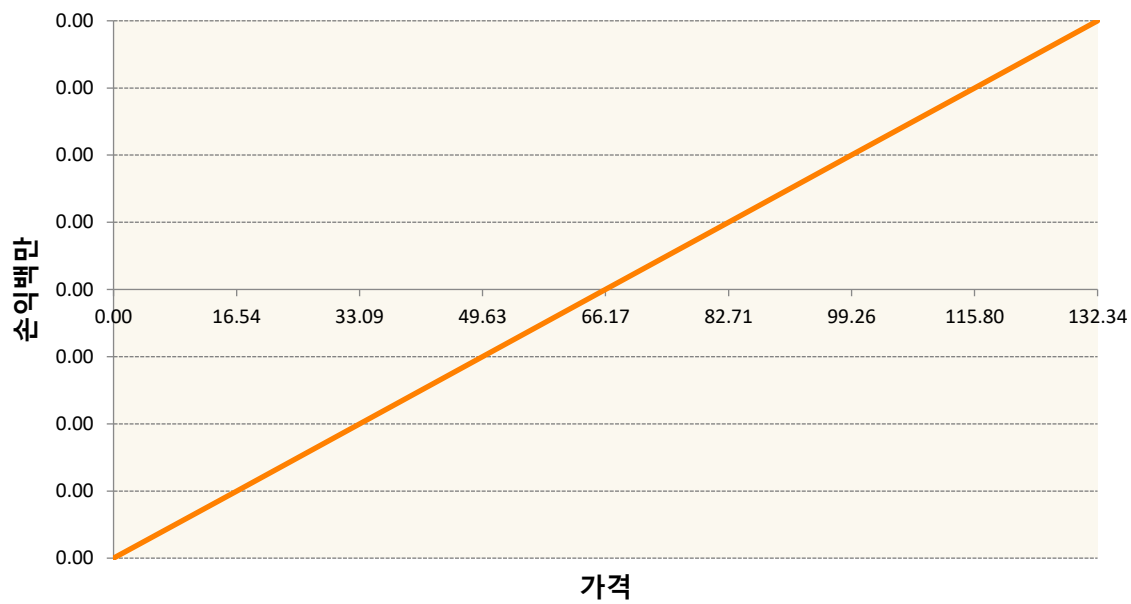
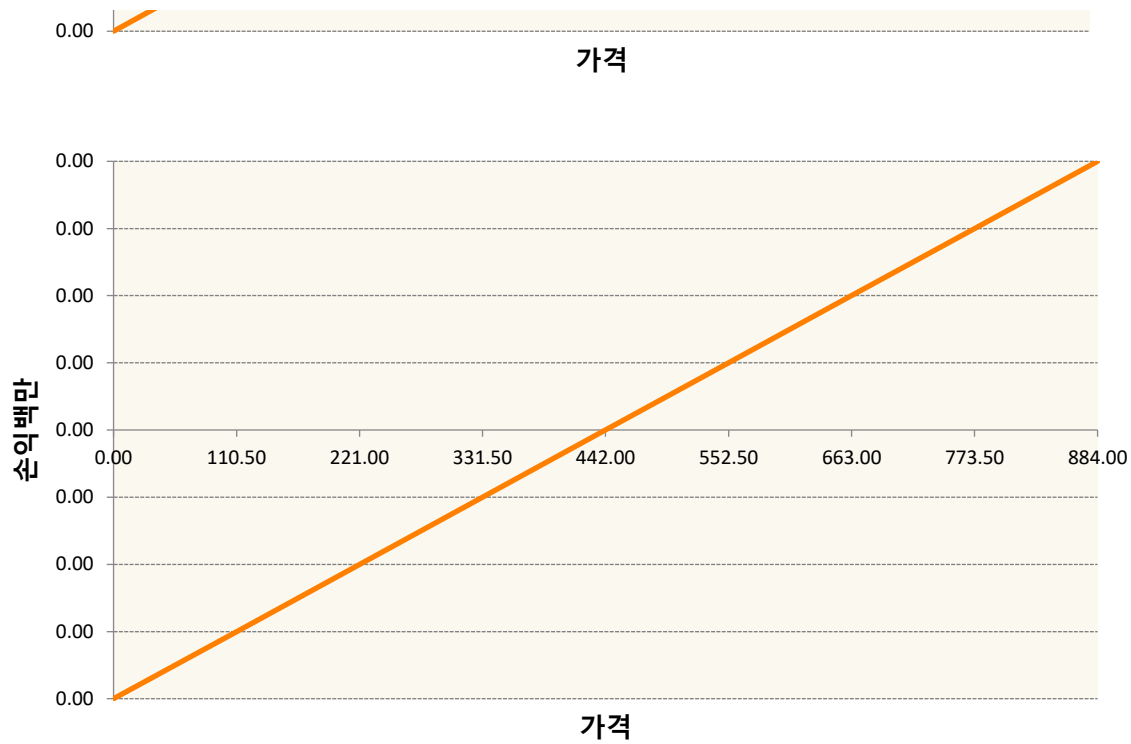
### 1. 계약금액

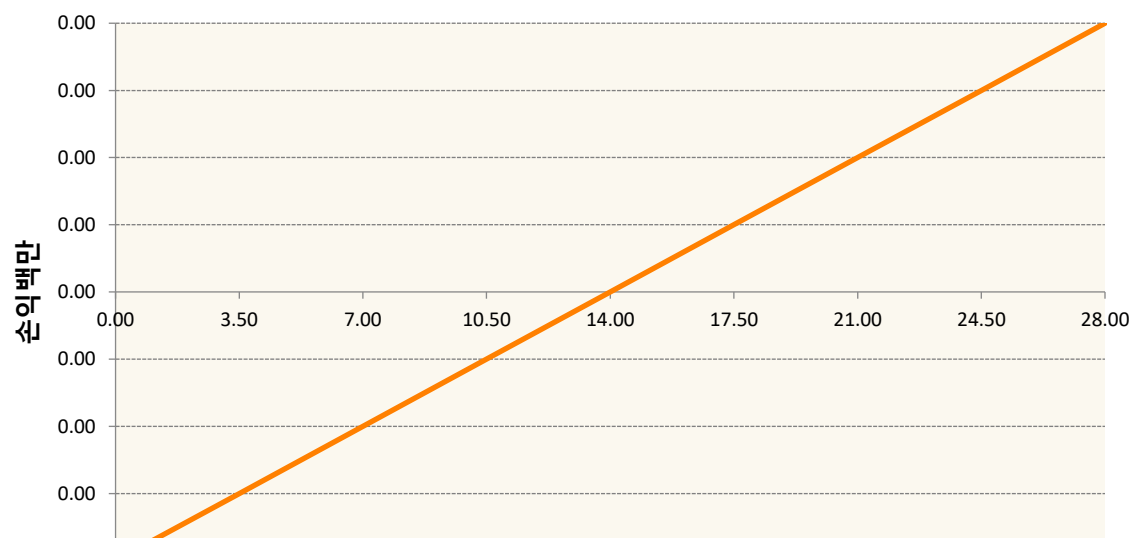
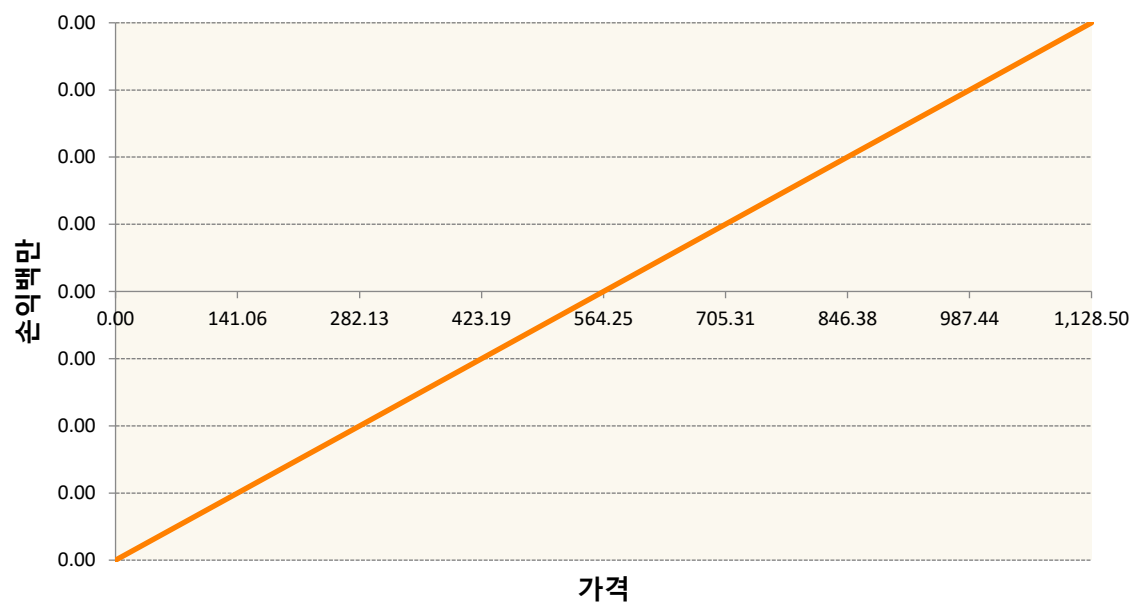
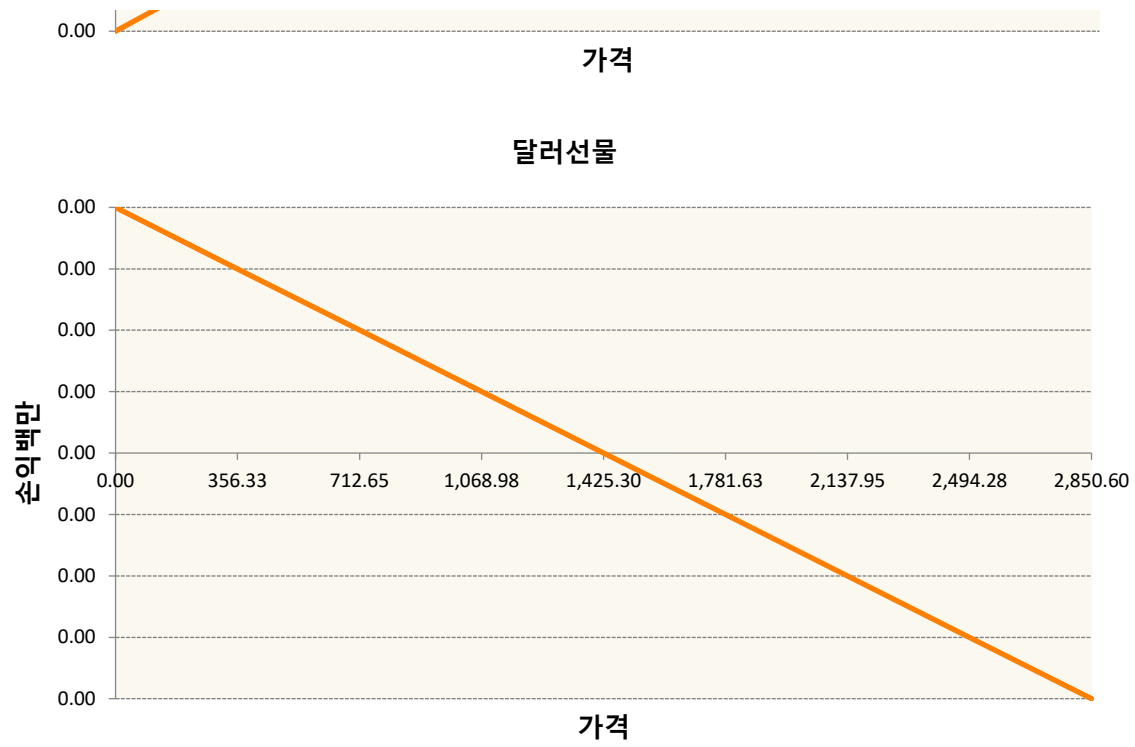
(단위:USD 백만)

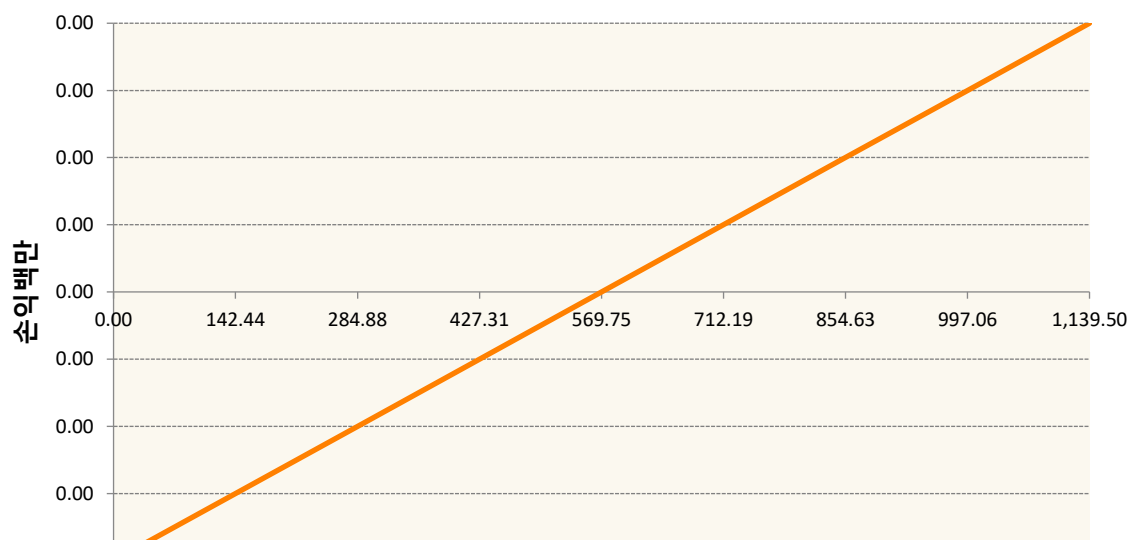
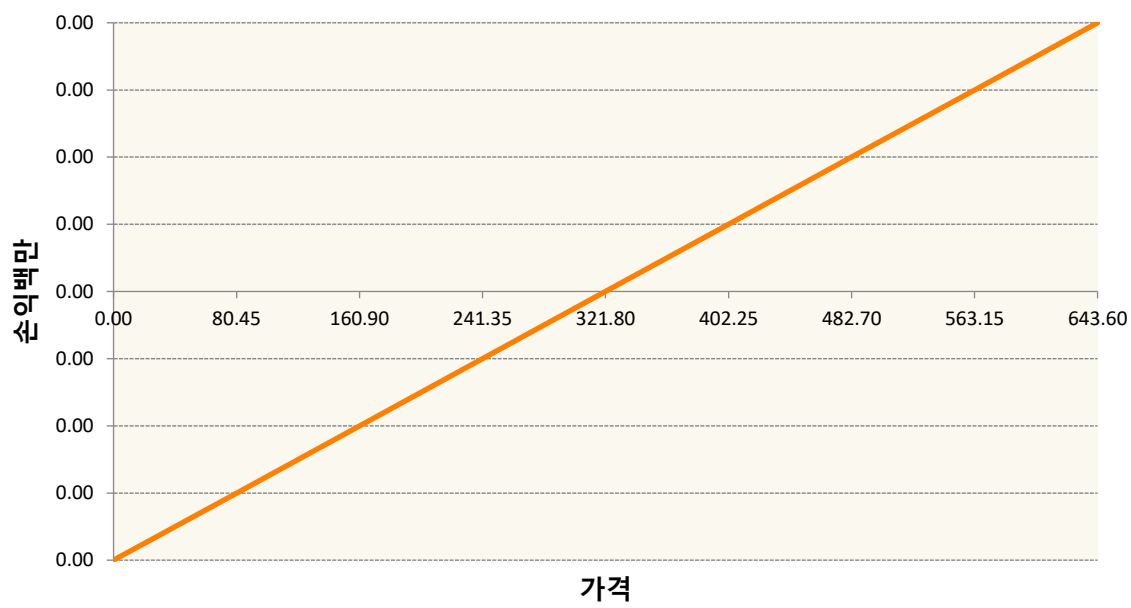
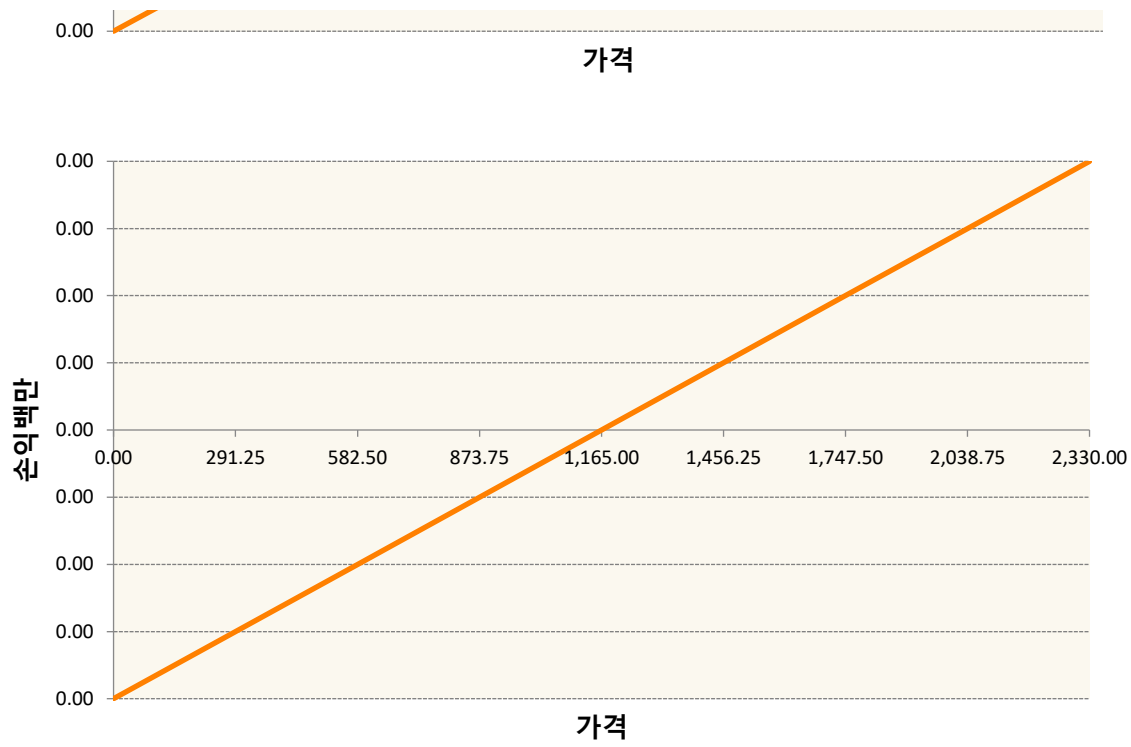
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,239 | 0     | 1,239     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,783 | 0     | 1,783     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 299   | -299      | 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 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

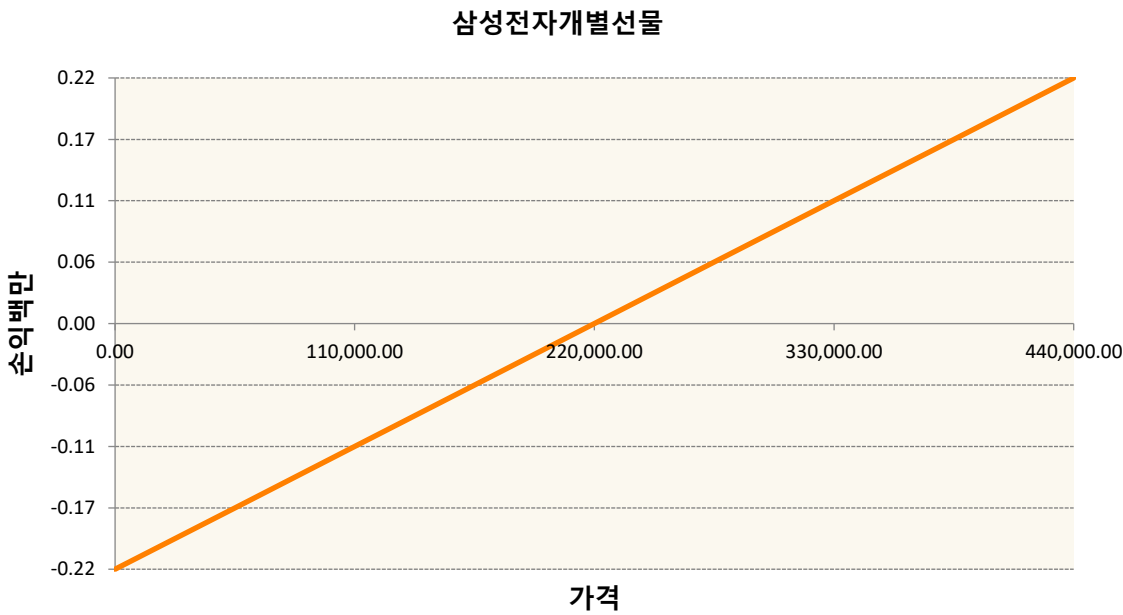
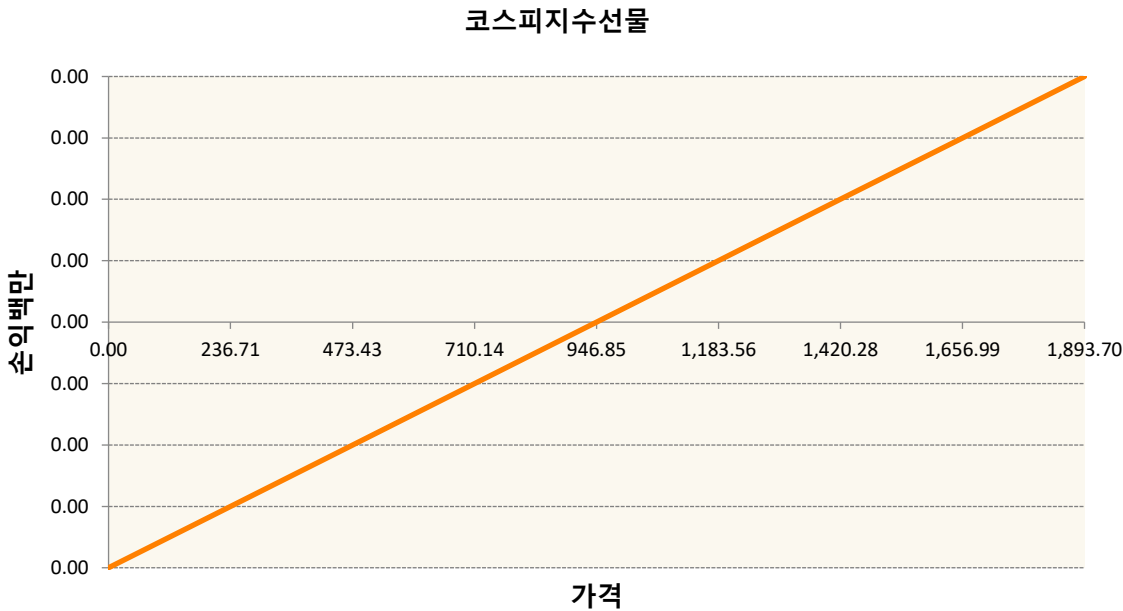
## 스마트인덱스모

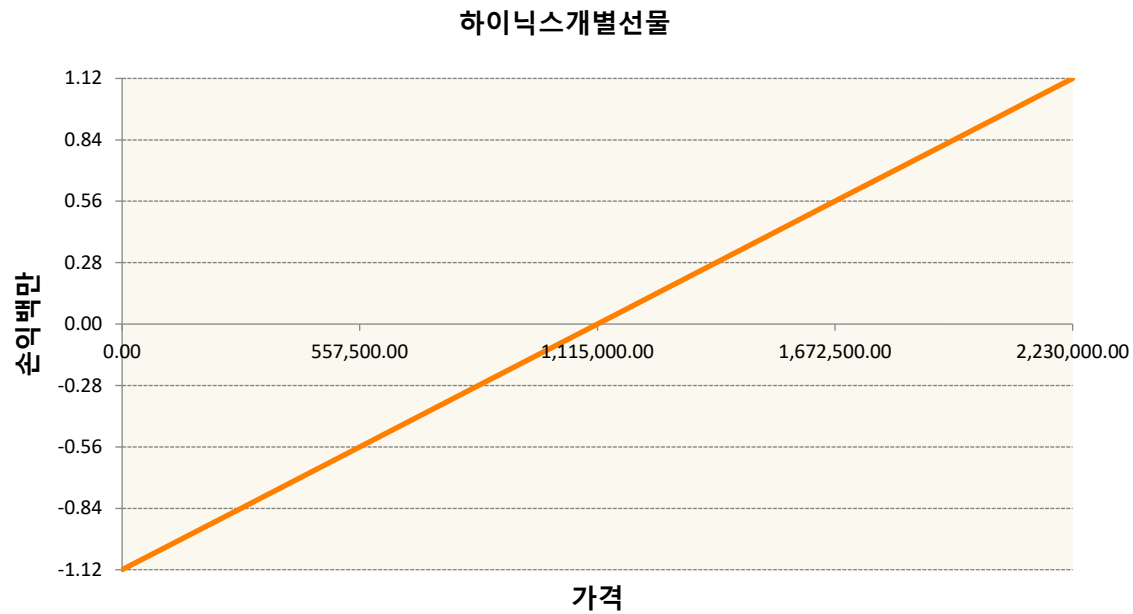
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 228   | 0     | 228       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,481 | 0     | 3,481     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)     |  | (단위:백만원) |
|-------------------------------|--|----------|
| KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물 |  | 265      |
| KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물   |  | 4        |
| KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물 |  | 10       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 7        |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

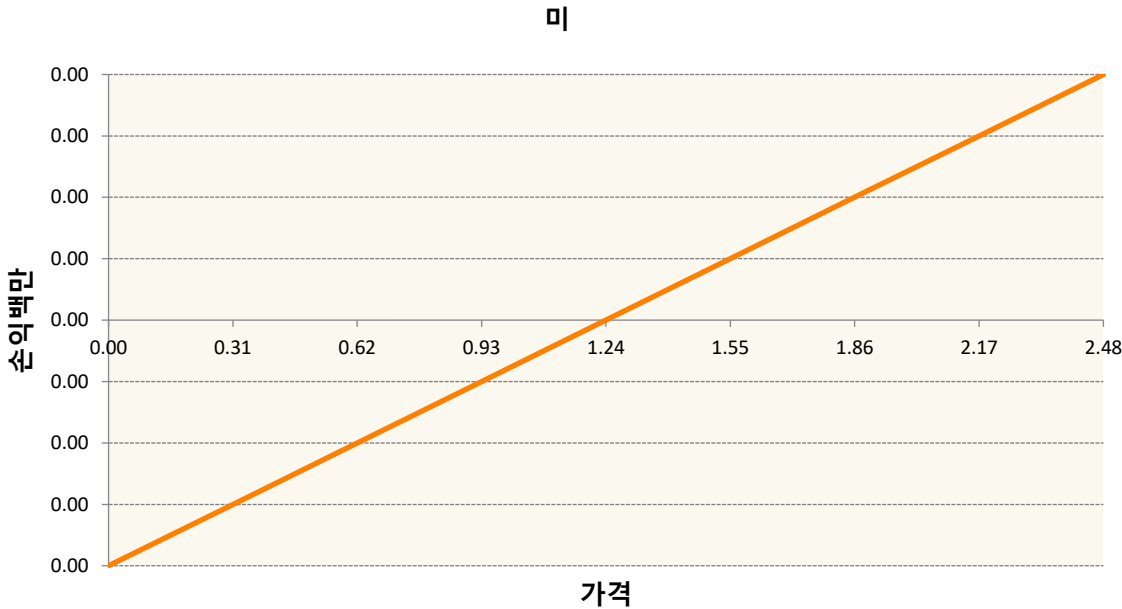
## SOL차이나강소기업CSI500상장

### 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   | 5,728 | 0     | 5,728     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

459

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

569

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

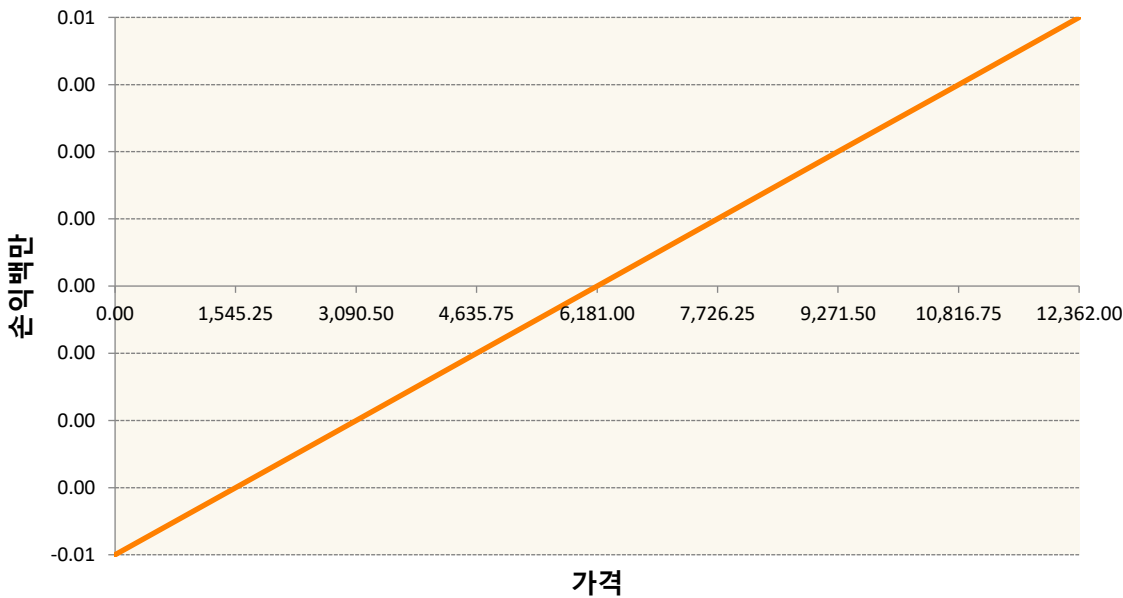
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 961   | 0     | 961       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGH6 | EURO STOXX 50 Mar26 | 77 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 61 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

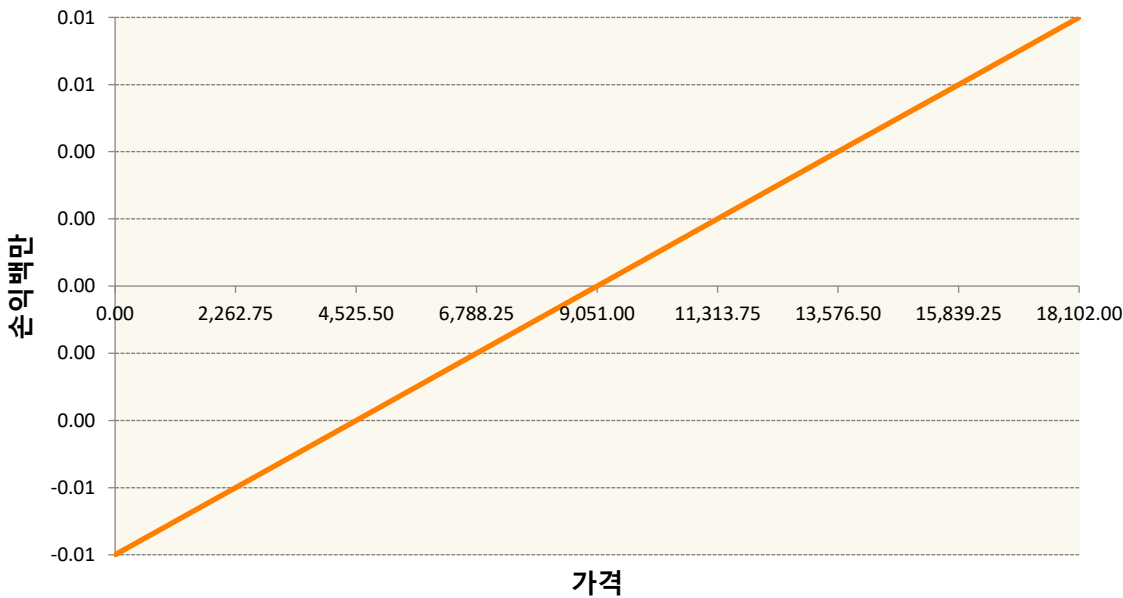
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,815 | 0     | 1,815     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCH6 | HSCEI Futures Mar26 | 145 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 167 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

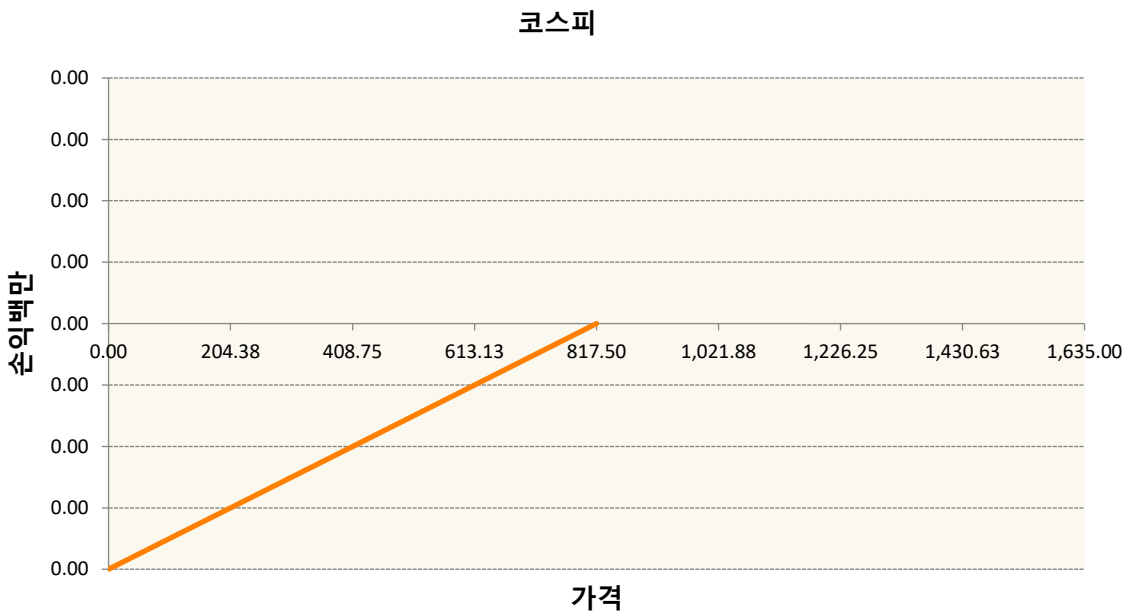
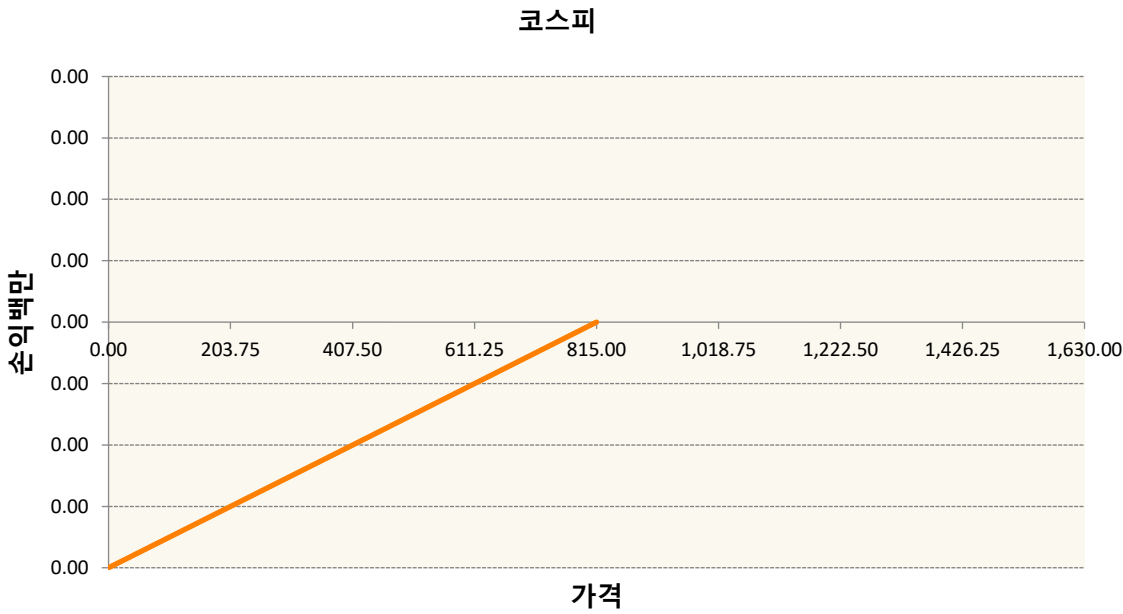
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

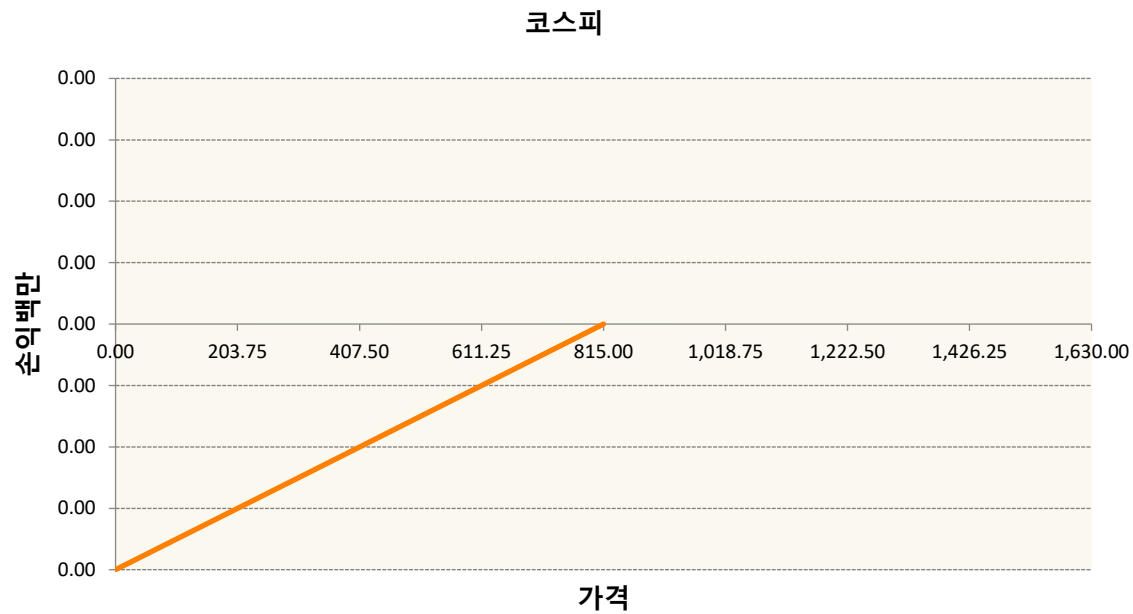
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 1,079 | 0      | 1,079     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 31,833 | -31,833   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                 |       |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-----------------|-------|--|----------|
| KR4B016381                | 코스피200 C 202603 | 815.0 |  | 766      |
| KR4B016381                | 코스피200 C 202603 | 817.5 |  | 1,259    |
| KR4C016381                | 코스피200 P 202603 | 815.0 |  | 522      |

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

공시일 2026-02-27

기준일 2026-02-26

## 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 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

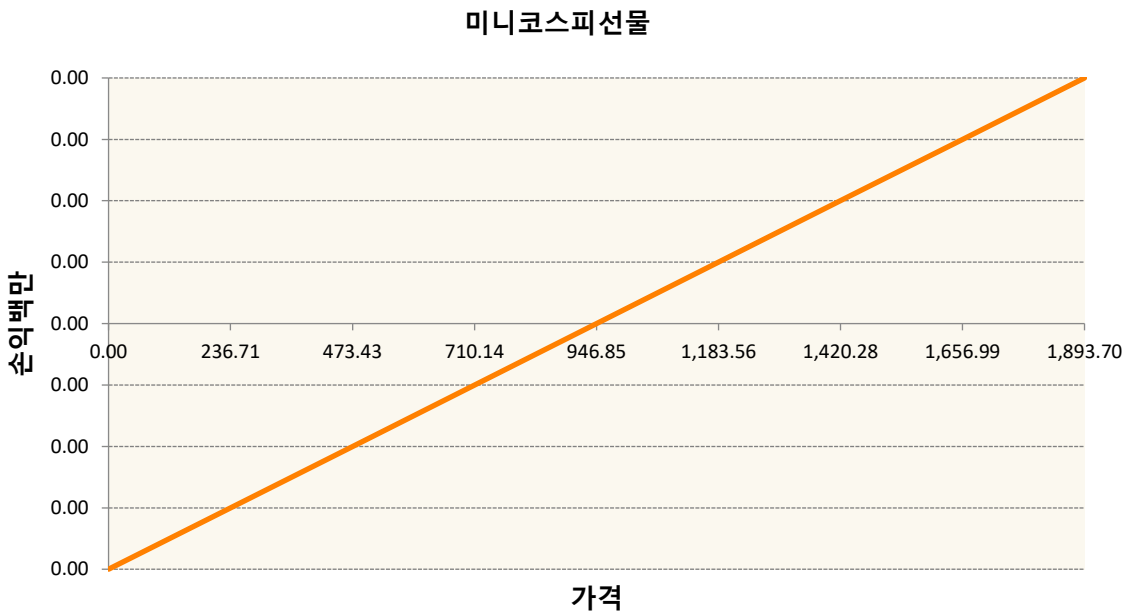
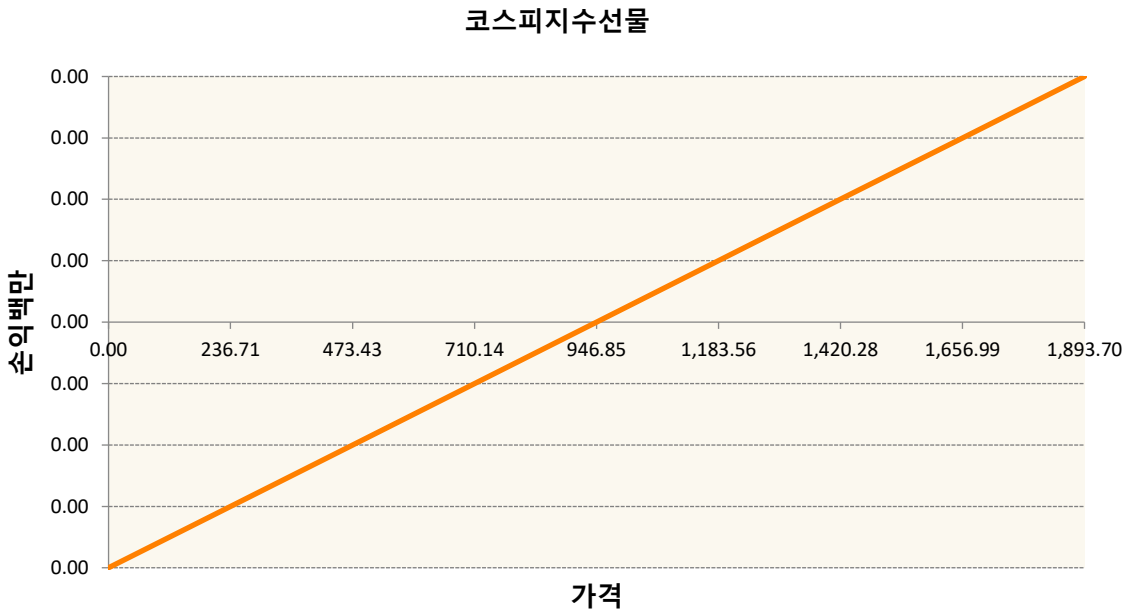
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

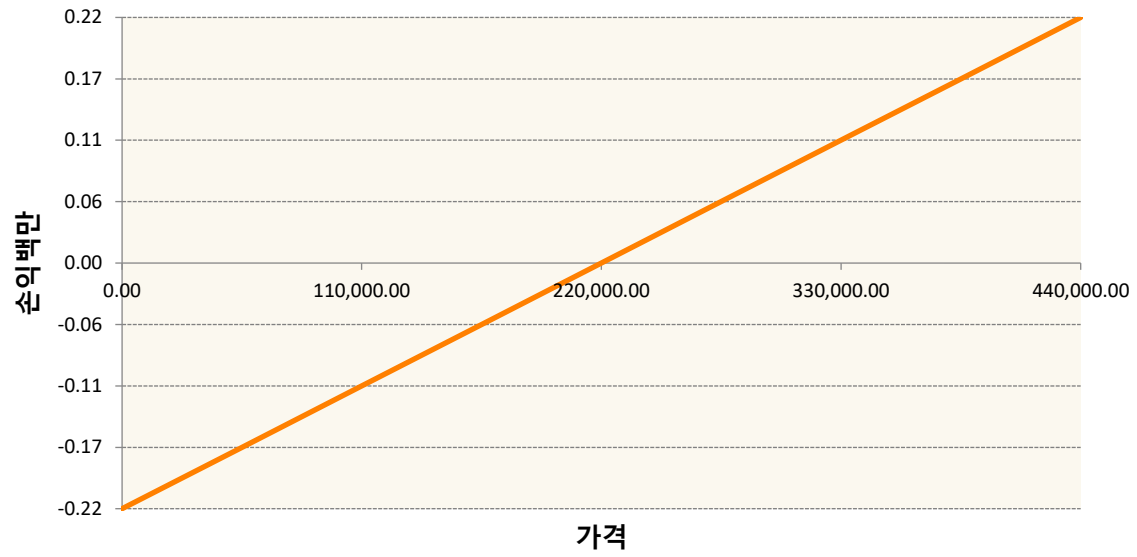
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 228   | 237   | -9        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 7,518 | 0     | 7,518     | 장내 |

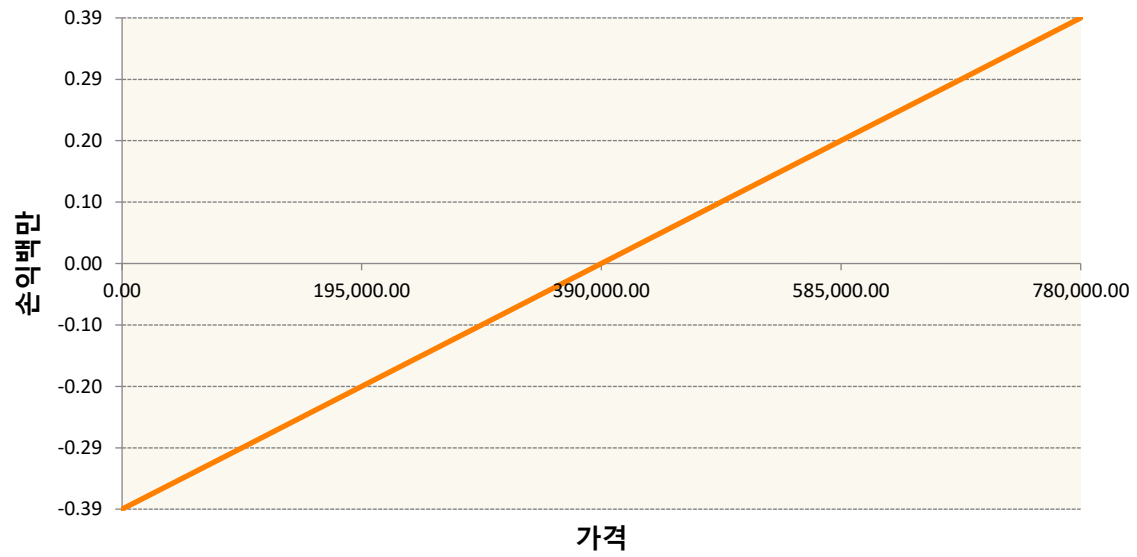
### 2. 만기시점의 손익구조



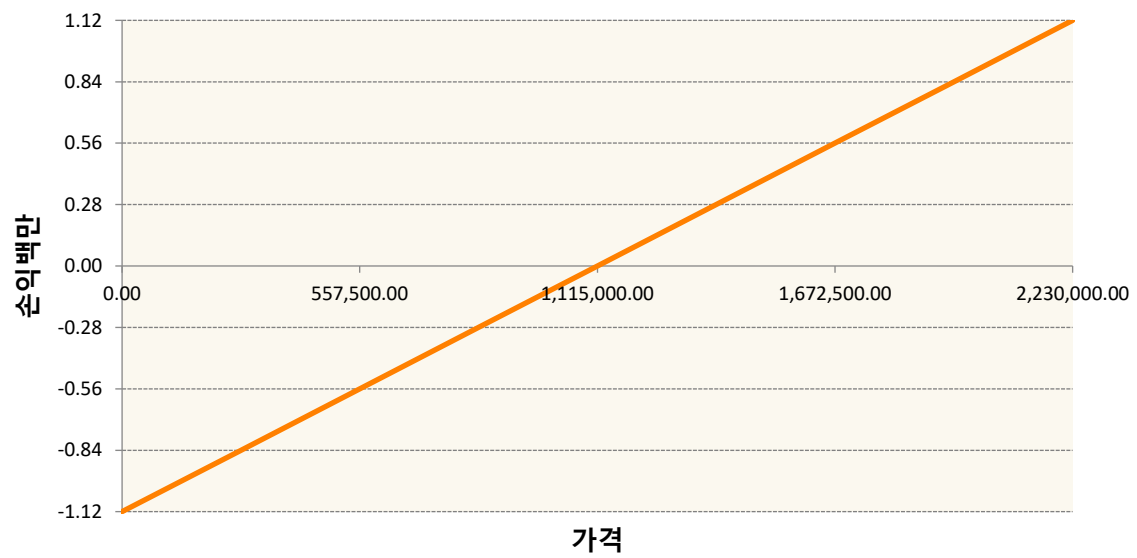
삼성전자개별선물



화학개별선물



하이닉스개별선물



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)      |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------|--|----------|
| KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물  |  | 95       |
| KR4A056300 2026-03 미니코스피200 선물 |  | 98       |
| KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물    |  | 2        |
| KR4A476300 2026-03 LG화학개별선물    |  | 7        |
| KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물  |  | 5        |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

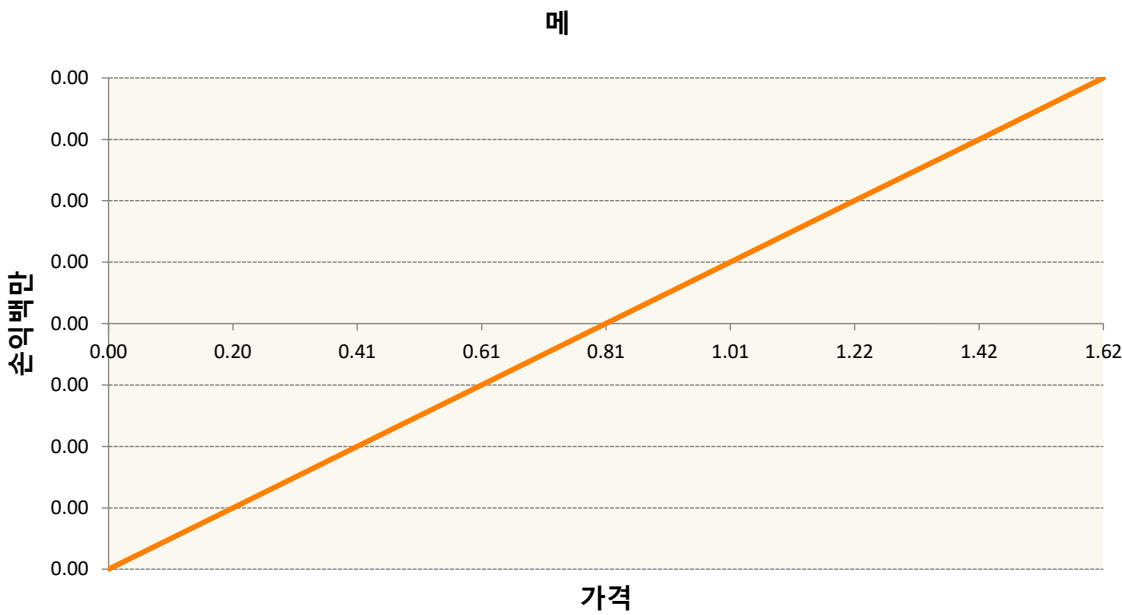
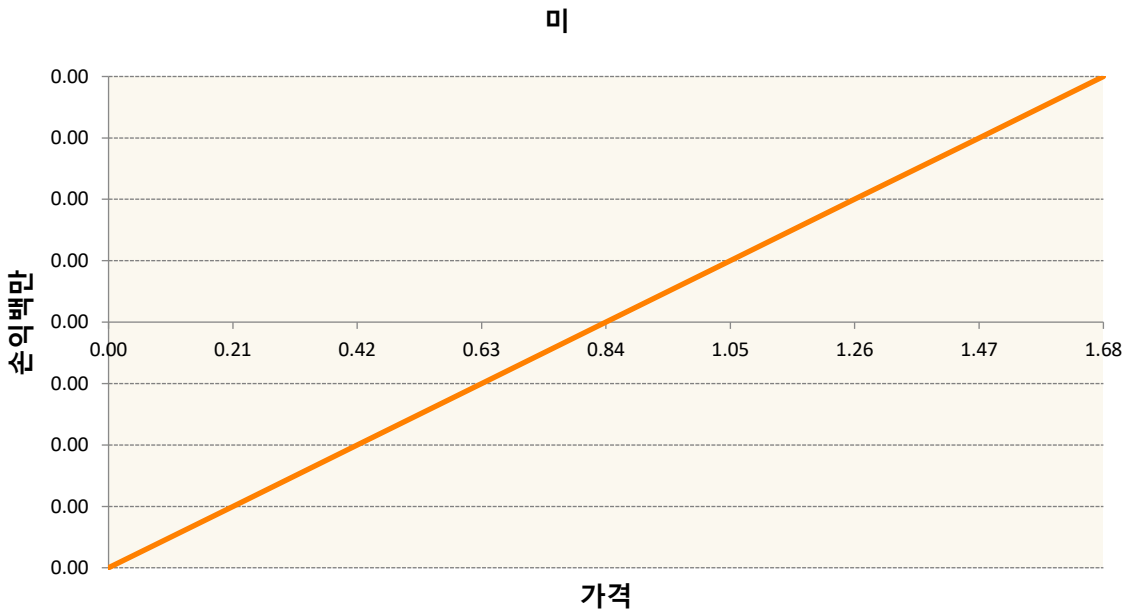
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 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   | 6,124 | 0     | 6,124     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 392      |
| 2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 98       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 525      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

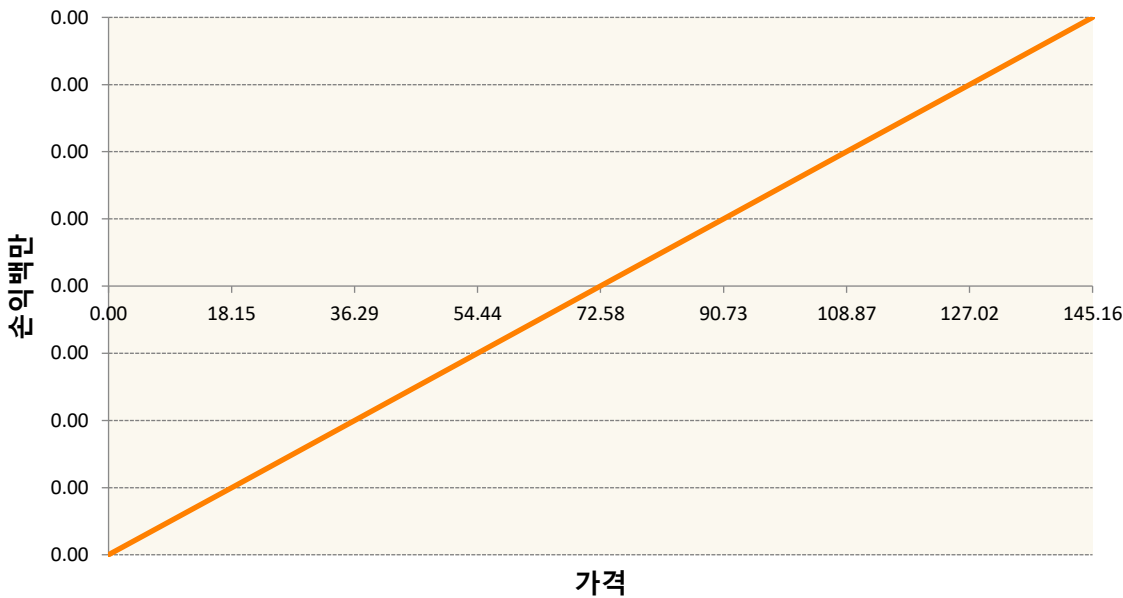
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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 |      |      | 4,821 | 0     | 4,821     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 875   | 5,555 | -4,680    | 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    | 386 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 868 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

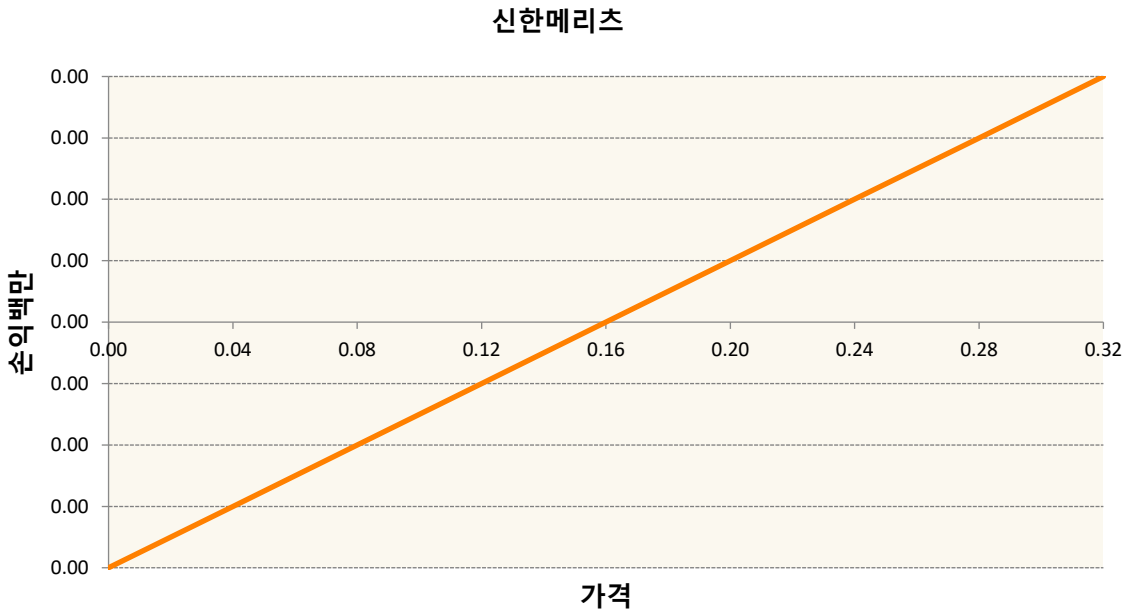
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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   | 3,161 | 0     | 3,161     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                |    |
|------------------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 21 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 14 |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 15 |
| SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)            | 36 |

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

(단위:백만원)

156

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

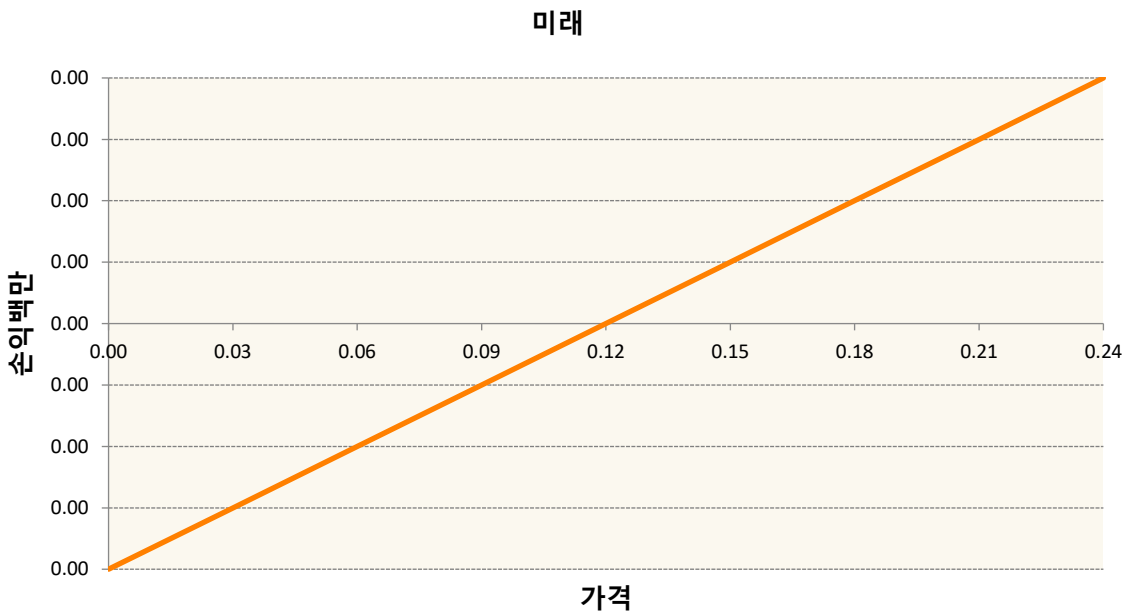
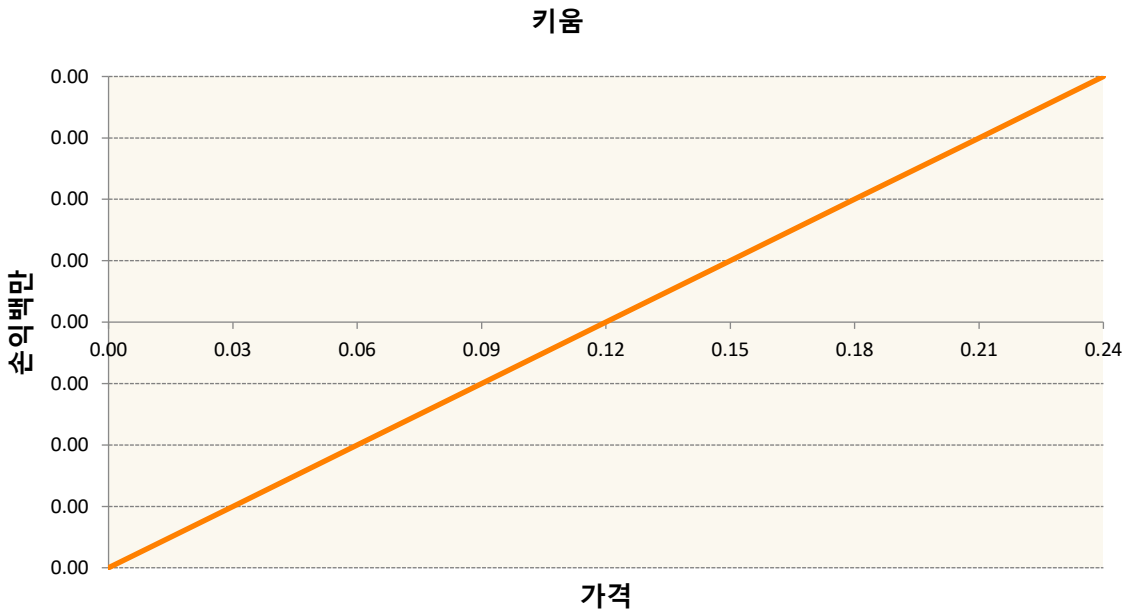
SOL차이나육성산업엑티브상장지

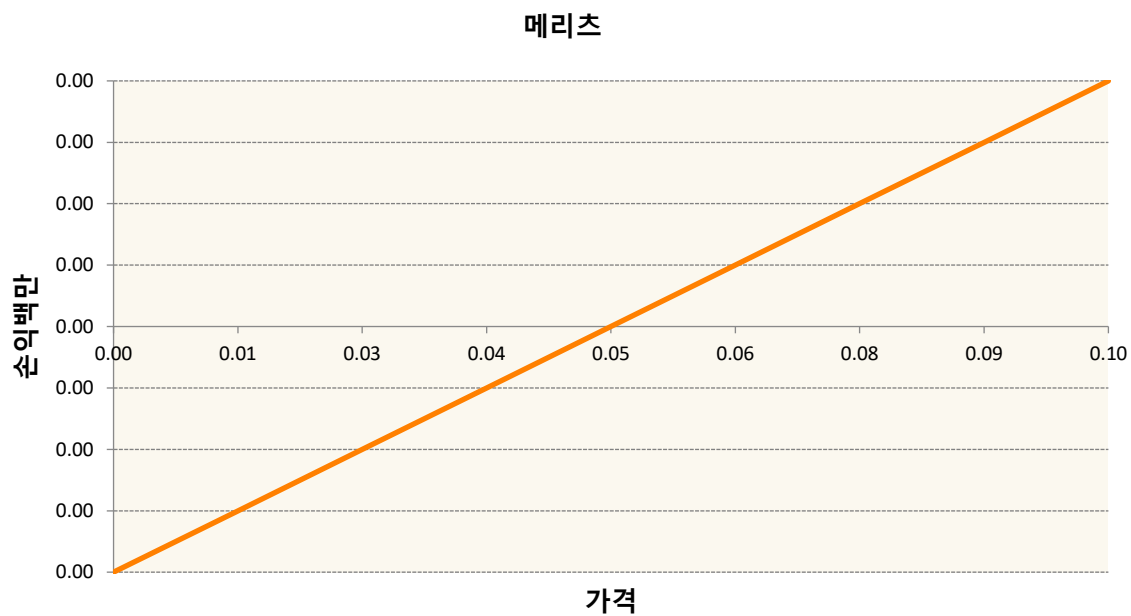
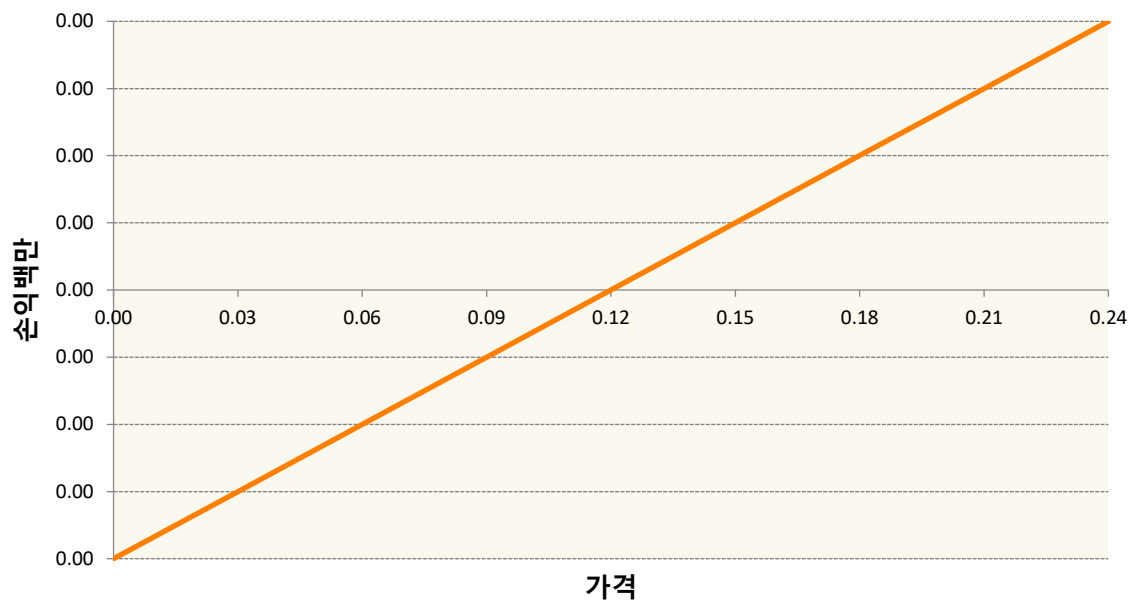
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 1,873 | 0     | 1,873     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                           |    |
|-------------------------------------------|----|
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)  | 8  |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래) | 55 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)  | 28 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠) | 65 |

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

(단위:백만원)

288

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

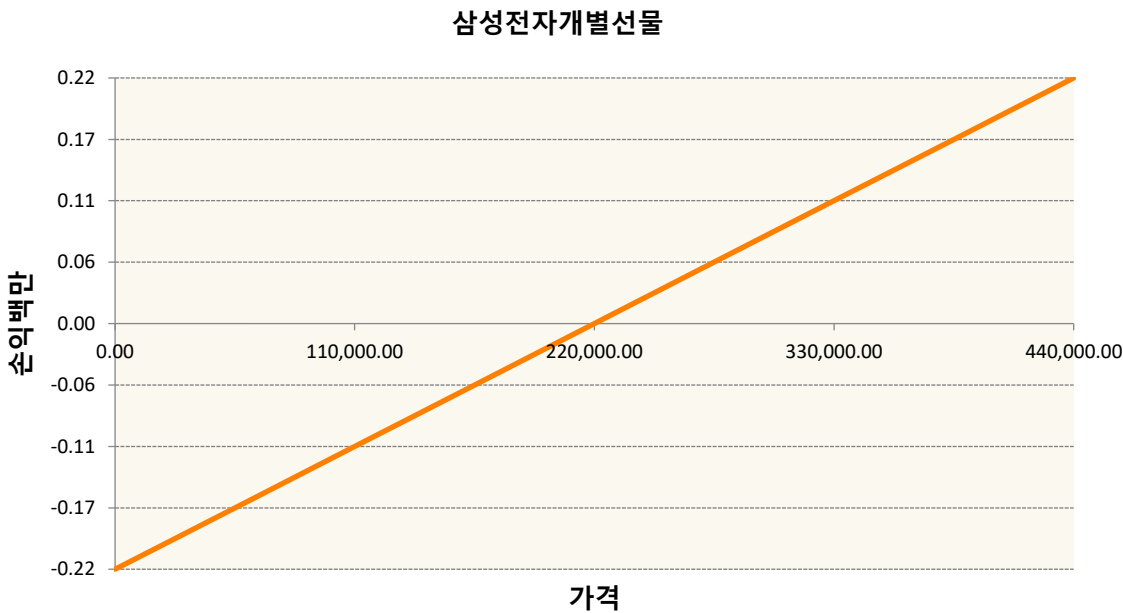
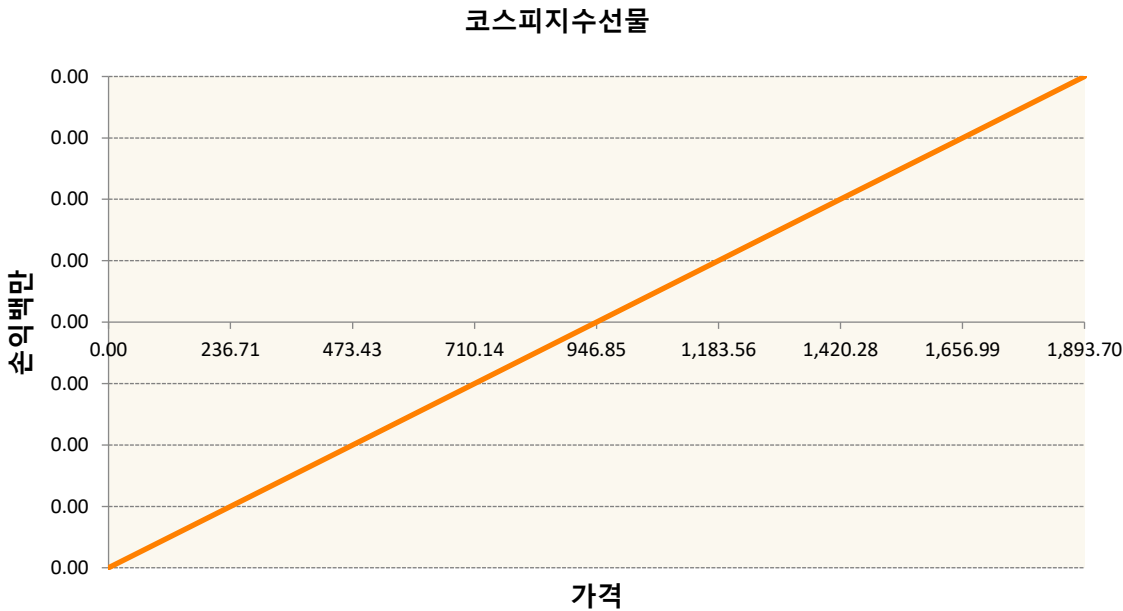
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

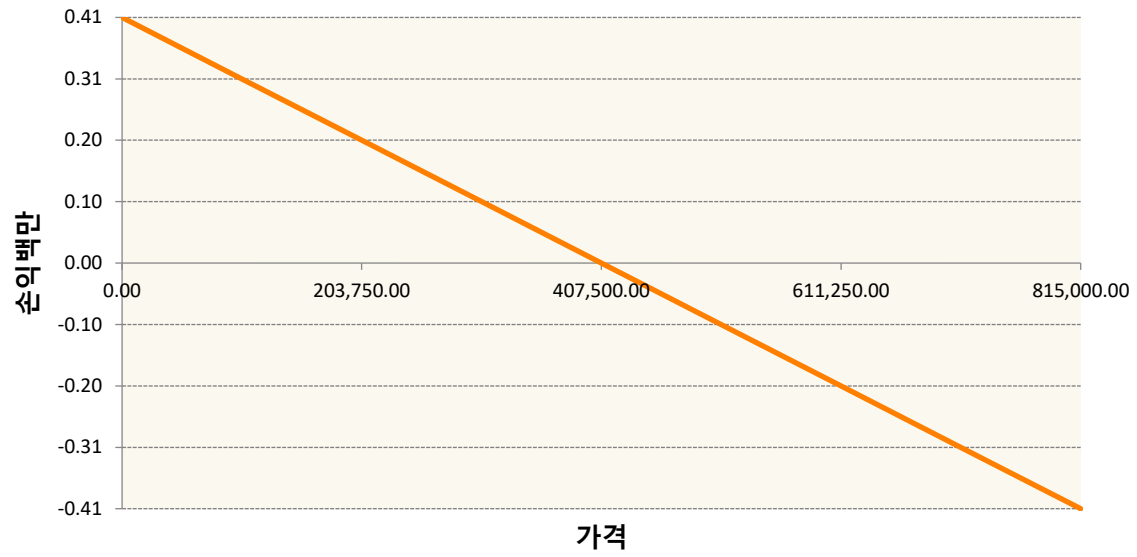
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 236   | -236      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 8,988 | 4,654 | 4,333     | 장내 |

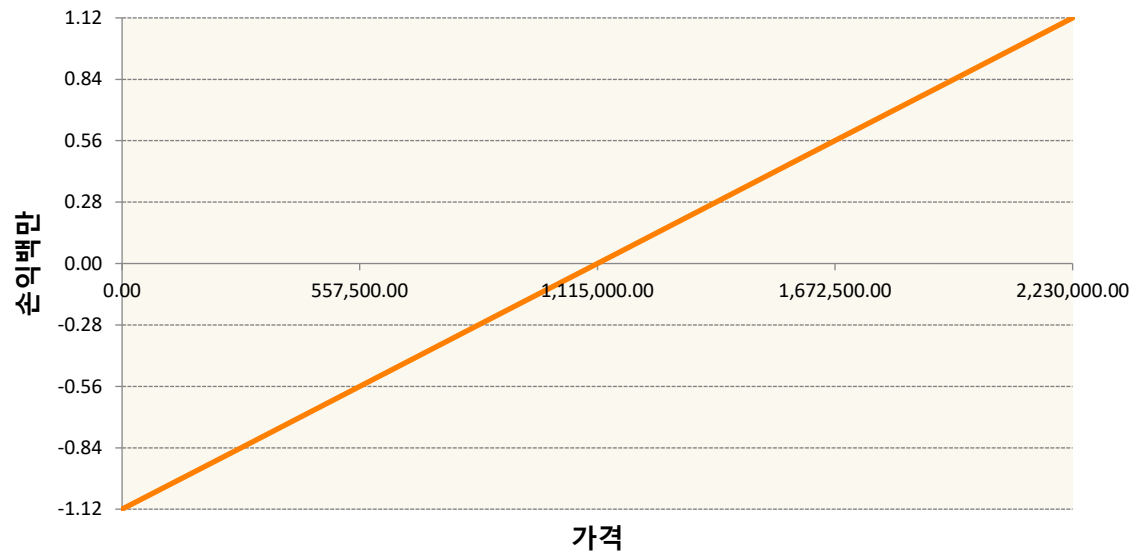
2. 만기시점의 손익구조



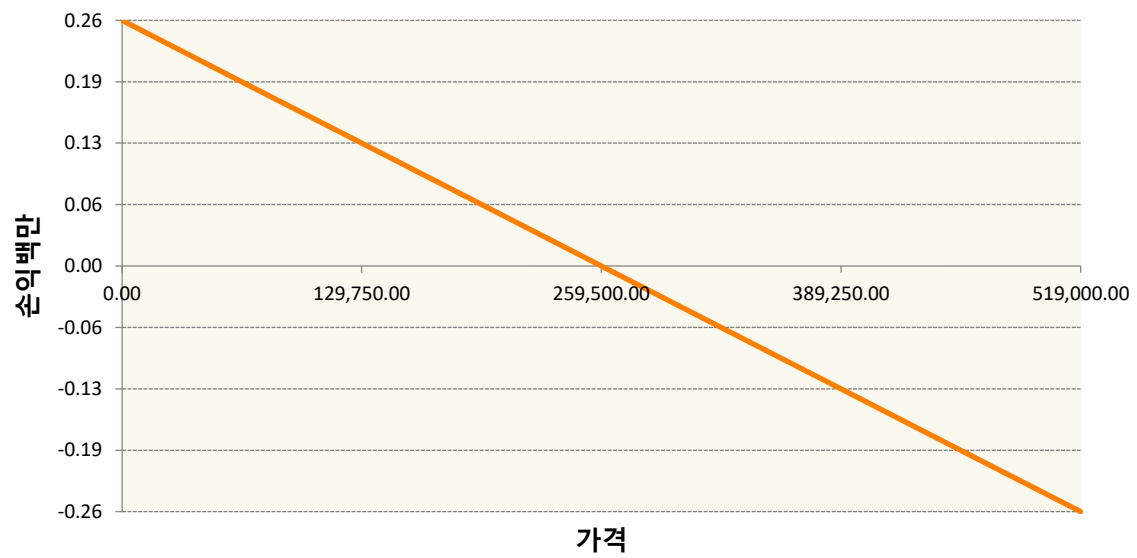
홀딩스개별선물



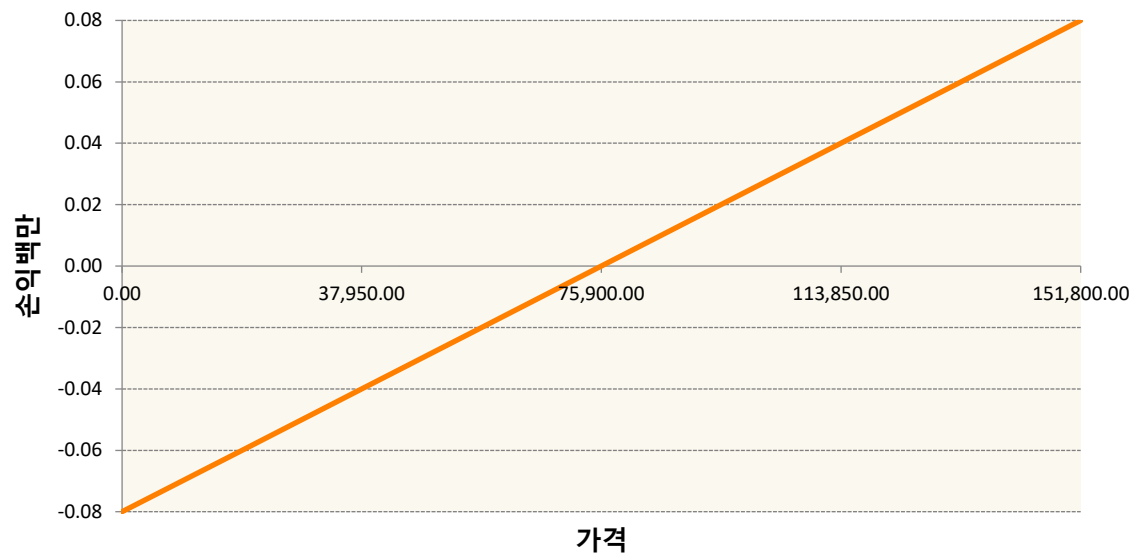
하이닉스개별선물



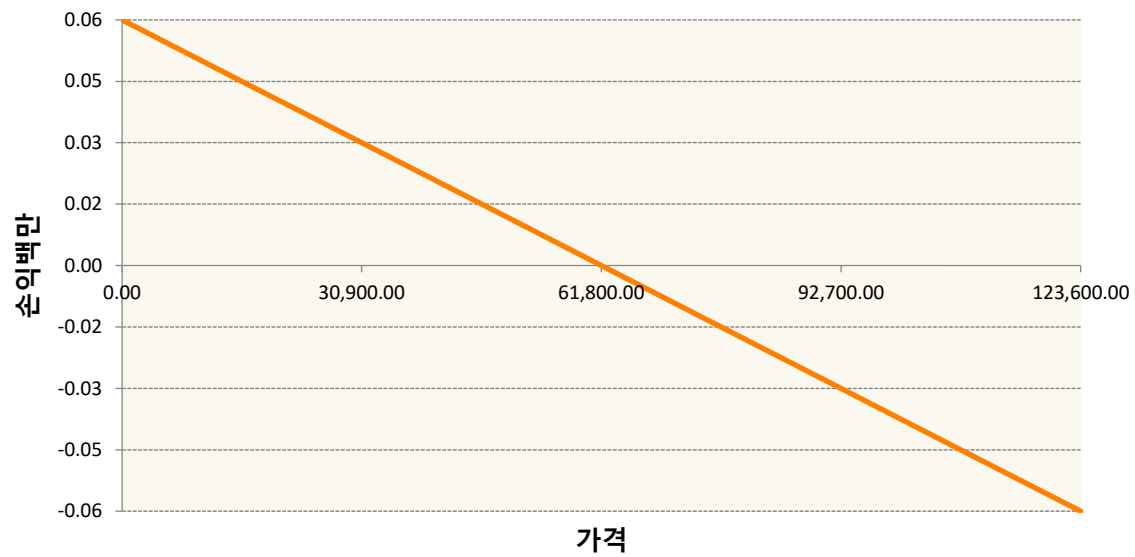
개별선물



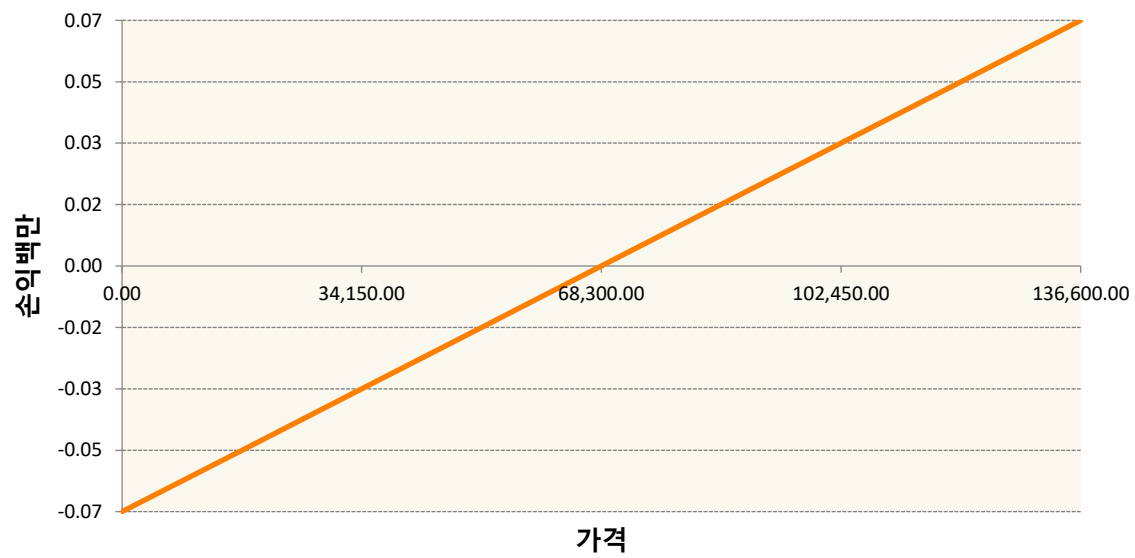
포스코인터내셔널개별선물



카카오개별선물



카카오페이개별선물



(단위:백만원)

|              |         |         |        |      |       |        |                      |  |     |  |  |
|--------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|----------------------|--|-----|--|--|
| KR4A01630008 |         |         |        |      |       |        | 2026-03 코스피200지수선물   |  | 227 |  |  |
| 기초자산의 변동성    |         |         |        |      |       |        |                      |  |     |  |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |  |     |  |  |
| -8.00%       | -227    | -227    | -227   | -227 | -227  | -227   | -227                 |  |     |  |  |
| -5.33%       | -151    | -151    | -151   | -151 | -151  | -151   | -151                 |  |     |  |  |
| -2.67%       | -76     | -76     | -76    | -76  | -76   | -76    | -76                  |  |     |  |  |
| 0%           | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    |  |     |  |  |
| 2.67%        | 76      | 76      | 76     | 76   | 76    | 76     | 76                   |  |     |  |  |
| 5.33%        | 151     | 151     | 151    | 151  | 151   | 151    | 151                  |  |     |  |  |
| 8.00%        | 227     | 227     | 227    | 227  | 227   | 227    | 227                  |  |     |  |  |
| KR4A11630006 |         |         |        |      |       |        | 2026-03 삼성전자개별선물     |  | 329 |  |  |
| 기초자산의 변동성    |         |         |        |      |       |        |                      |  |     |  |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |  |     |  |  |
| -8.00%       | -329    | -329    | -329   | -329 | -329  | -329   | -329                 |  |     |  |  |
| -5.33%       | -219    | -219    | -219   | -219 | -219  | -219   | -219                 |  |     |  |  |
| -2.67%       | -110    | -110    | -110   | -110 | -110  | -110   | -110                 |  |     |  |  |
| 0%           | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    |  |     |  |  |
| 2.67%        | 110     | 110     | 110    | 110  | 110   | 110    | 110                  |  |     |  |  |
| 5.33%        | 219     | 219     | 219    | 219  | 219   | 219    | 219                  |  |     |  |  |
| 8.00%        | 329     | 329     | 329    | 329  | 329   | 329    | 329                  |  |     |  |  |
| 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   |  | 95  |  |  |
| 기초자산의 변동성    |         |         |        |      |       |        |                      |  |     |  |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |  |     |  |  |
| -8.00%       | -95     | -95     | -95    | -95  | -95   | -95    | -95                  |  |     |  |  |
| -5.33%       | -63     | -63     | -63    | -63  | -63   | -63    | -63                  |  |     |  |  |
| -2.67%       | -32     | -32     | -32    | -32  | -32   | -32    | -32                  |  |     |  |  |
| 0%           | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    |  |     |  |  |
| 2.67%        | 32      | 32      | 32     | 32   | 32    | 32     | 32                   |  |     |  |  |
| 5.33%        | 63      | 63      | 63     | 63   | 63    | 63     | 63                   |  |     |  |  |
| 8.00%        | 95      | 95      | 95     | 95   | 95    | 95     | 95                   |  |     |  |  |
| KR4A56630002 |         |         |        |      |       |        | 2026-03 NAVER개별선물    |  | 152 |  |  |
| 기초자산의 변동성    |         |         |        |      |       |        |                      |  |     |  |  |

|                                   |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격                                | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                            | 152     | 152     | 152    | 152  | 152   | 152    | 152    |
| -5.33%                            | 102     | 102     | 102    | 102  | 102   | 102    | 102    |
| -2.67%                            | 51      | 51      | 51     | 51   | 51    | 51     | 51     |
| 0%                                | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                             | -51     | -51     | -51    | -51  | -51   | -51    | -51    |
| 5.33%                             | -102    | -102    | -102   | -102 | -102  | -102   | -102   |
| 8.00%                             | -152    | -152    | -152   | -152 | -152  | -152   | -152   |
| 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      |         |         |        |      |       |        | 157    |
| 기초자산의 변동성                         |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                                | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                            | 157     | 157     | 157    | 157  | 157   | 157    | 157    |
| -5.33%                            | 104     | 104     | 104    | 104  | 104   | 104    | 104    |
| -2.67%                            | 52      | 52      | 52     | 52   | 52    | 52     | 52     |
| 0%                                | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                             | -52     | -52     | -52    | -52  | -52   | -52    | -52    |
| 5.33%                             | -104    | -104    | -104   | -104 | -104  | -104   | -104   |
| 8.00%                             | -157    | -157    | -157   | -157 | -157  | -157   | -157   |
| 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)

1,602

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

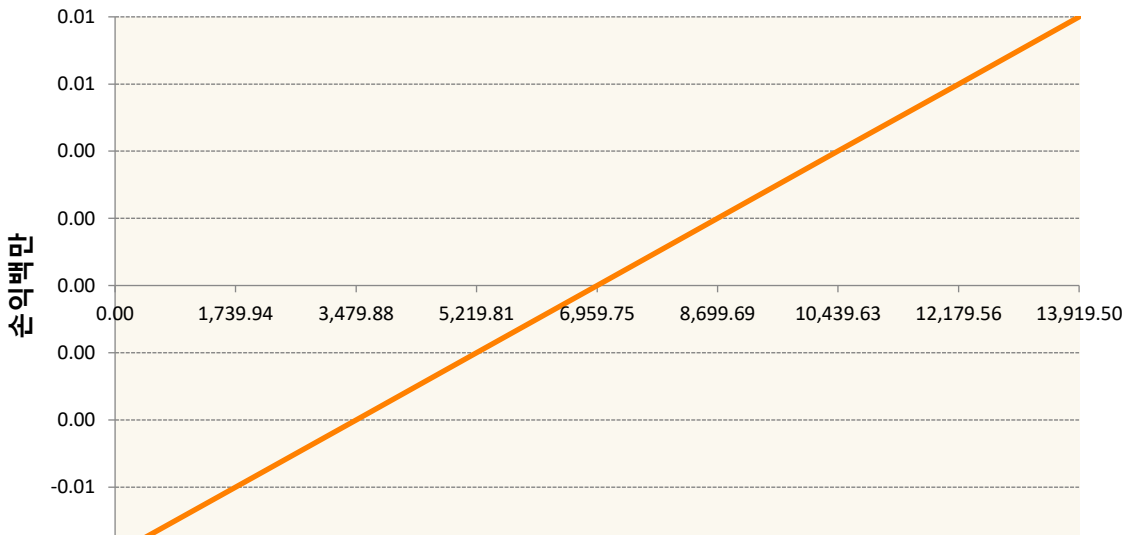
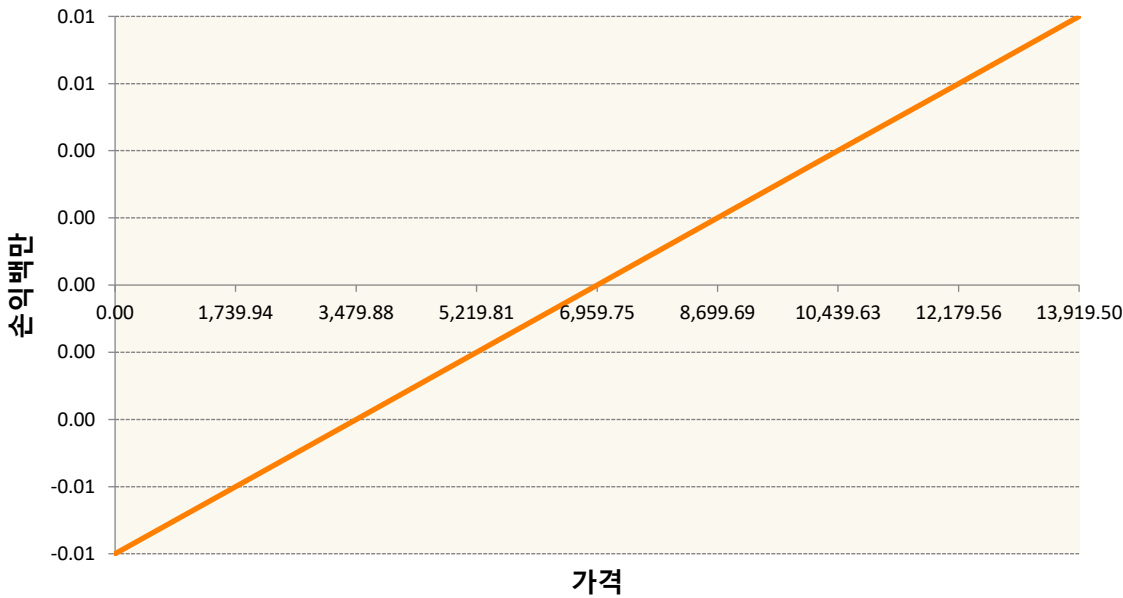
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

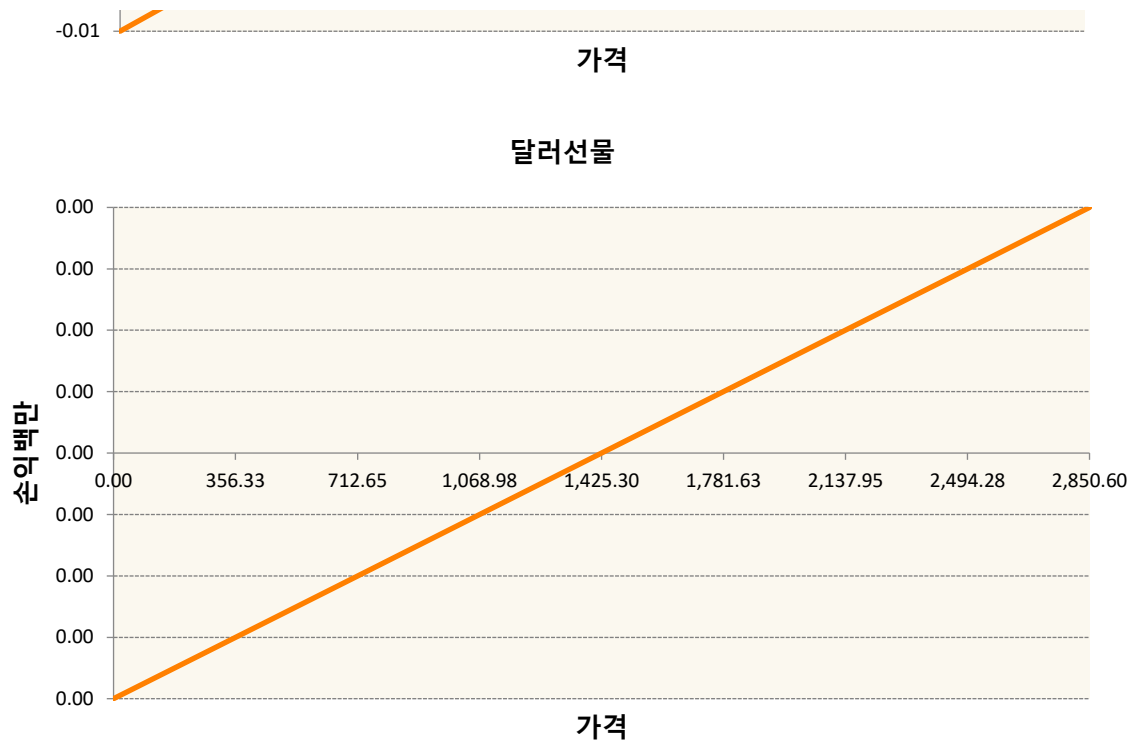
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 지수   | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 617    | 0     | 617       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 53,840 | 0     | 53,840    |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 11,830 | 0     | 11,830    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|            |                          |       |
|------------|--------------------------|-------|
| ESH6       | S&P500 EMINI FUT Mar26   | 4,307 |
| HWAH6      | SP500 MIC EMIN FUT Mar26 | 49    |
| KR4A756300 | 2026-03 달러선물             | 946   |

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

|       |
|-------|
| 3,724 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

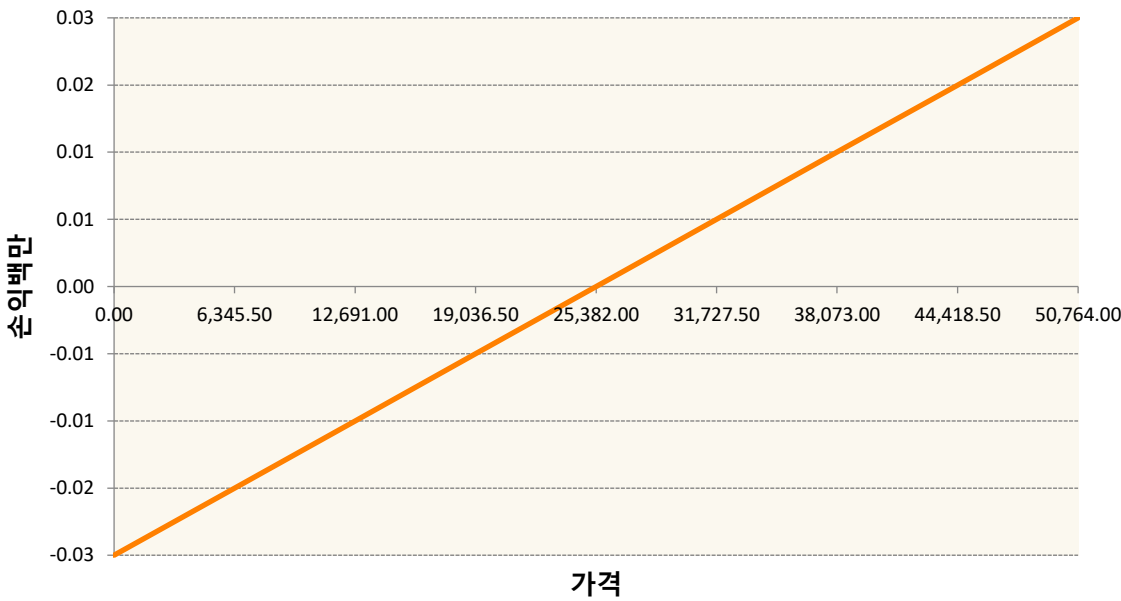
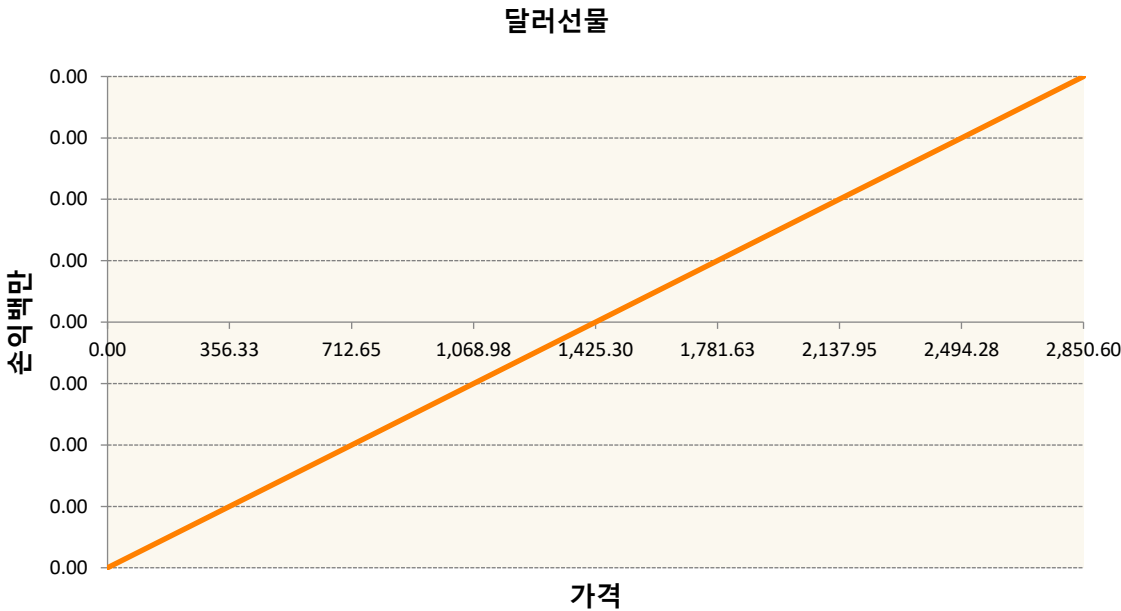
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 23,215 | 0     | 23,215    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선물   | 4,775  | 0     | 4,775     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| KR4A756300 2026-03 달러선물   |                         | 382      |
| NQH6                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20 | 1,857    |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

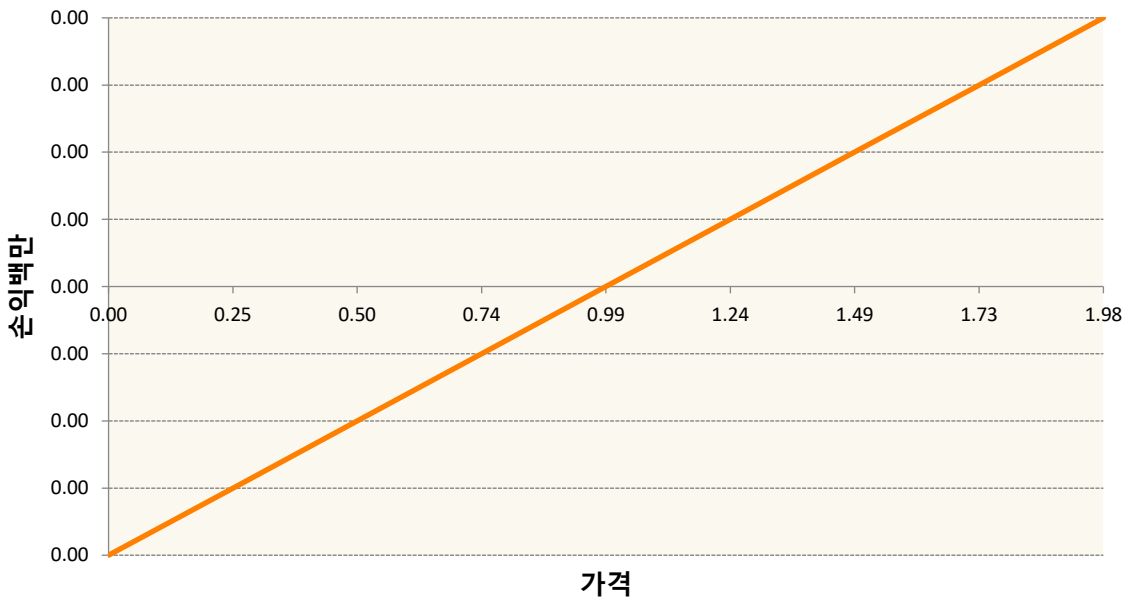
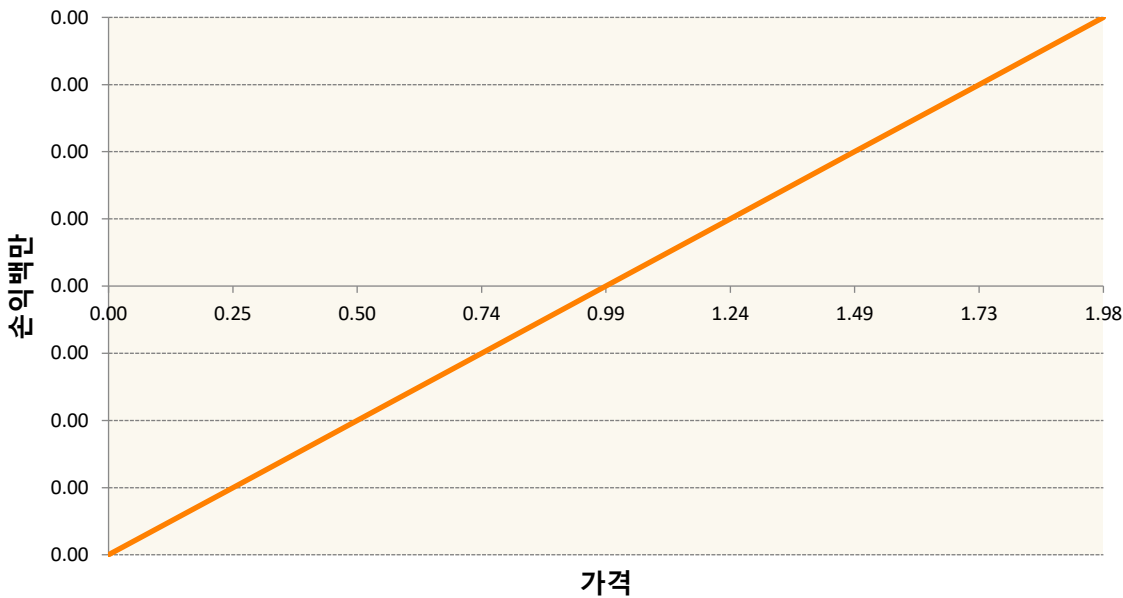
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

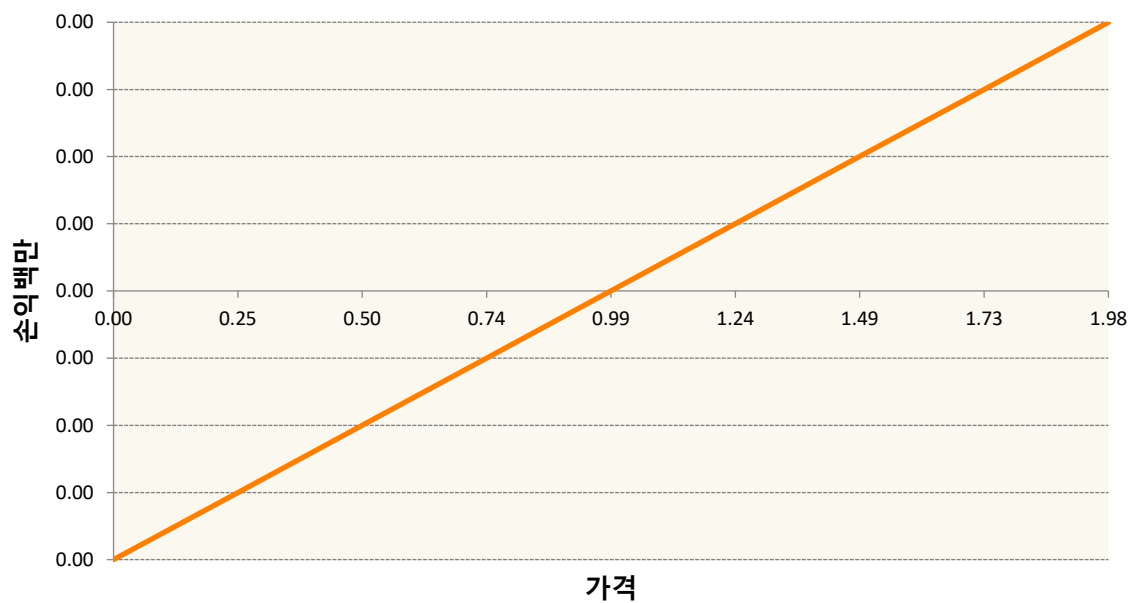
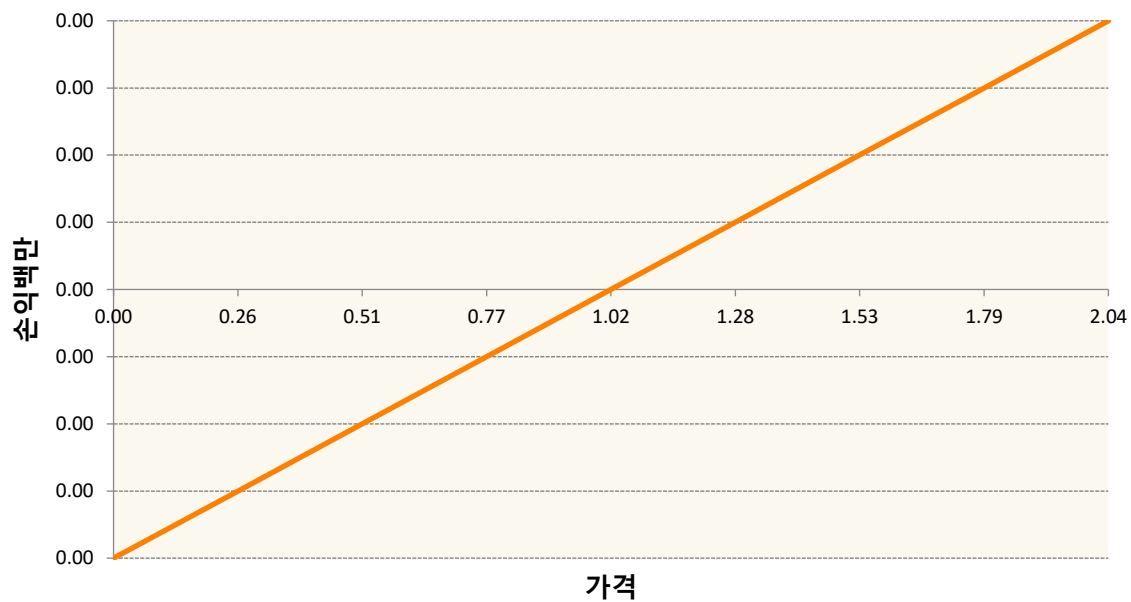
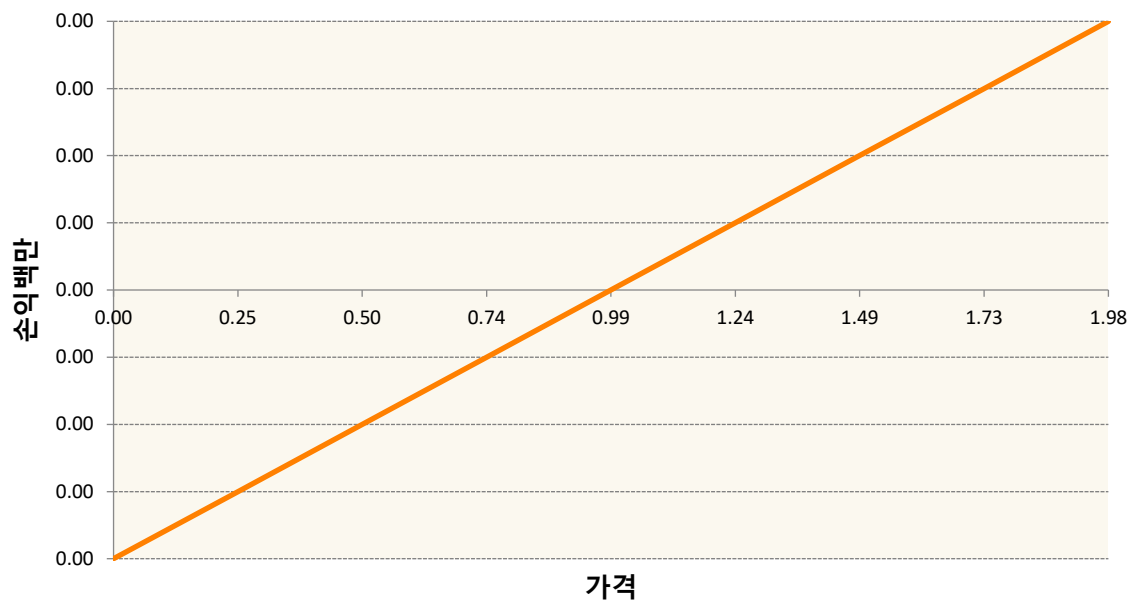
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 376,679 | 0     | 376,679   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|--|----------|
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 8,200    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 8,344    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 3,673    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 149      |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 9,870    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 13,664   |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-02-27 |
| 기준일 | 2026-02-26 |

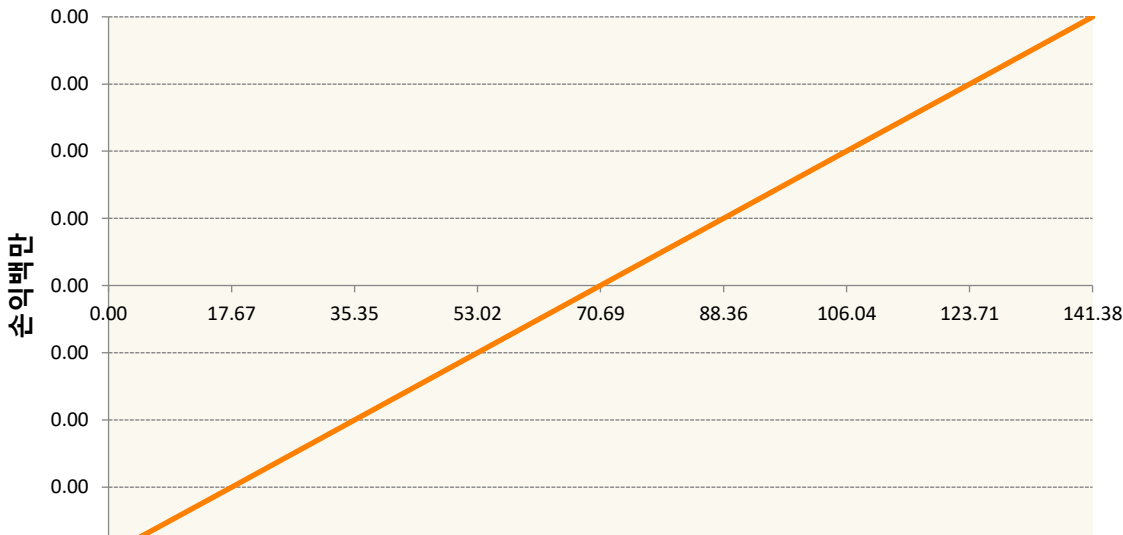
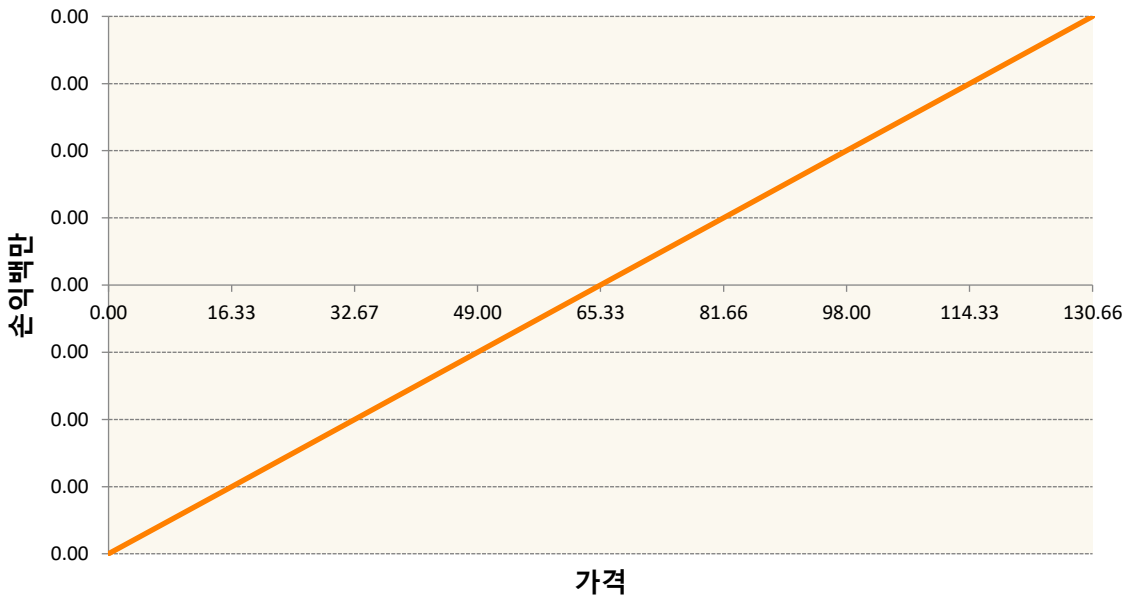
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

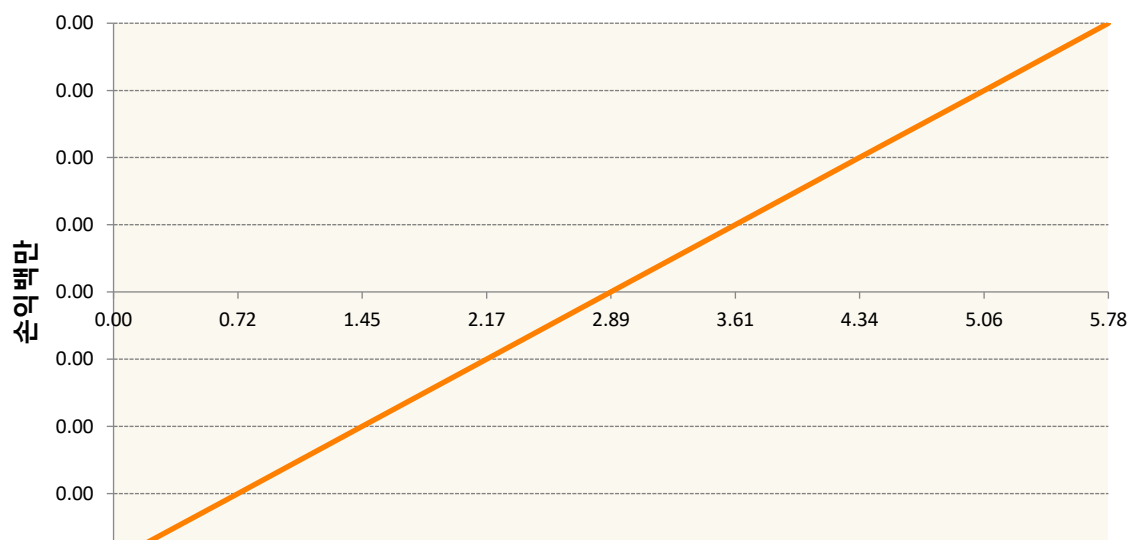
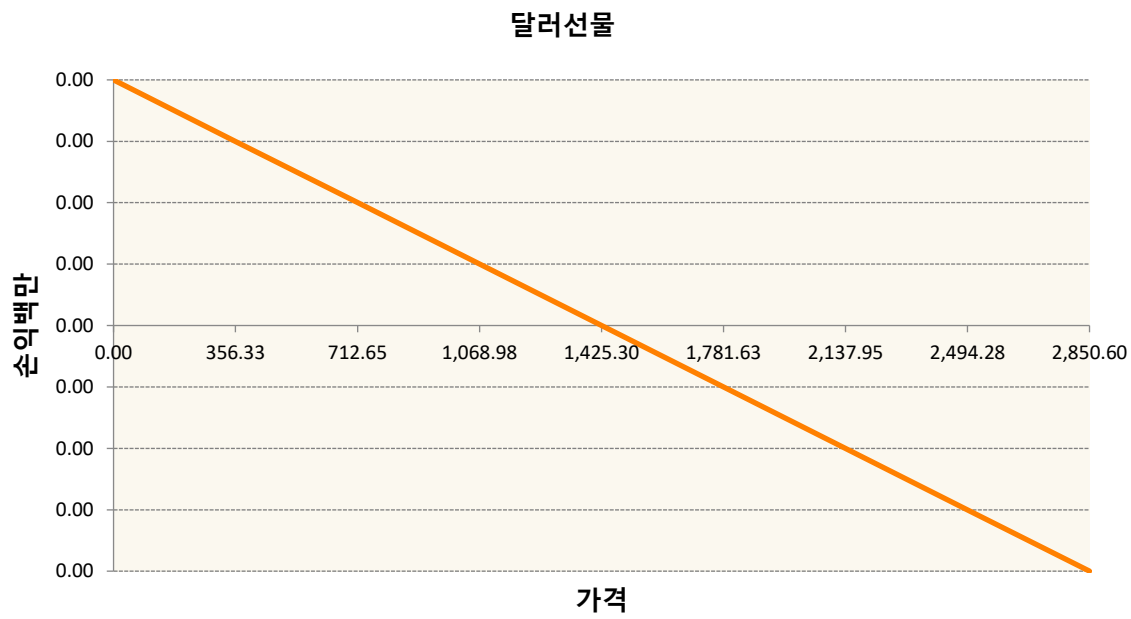
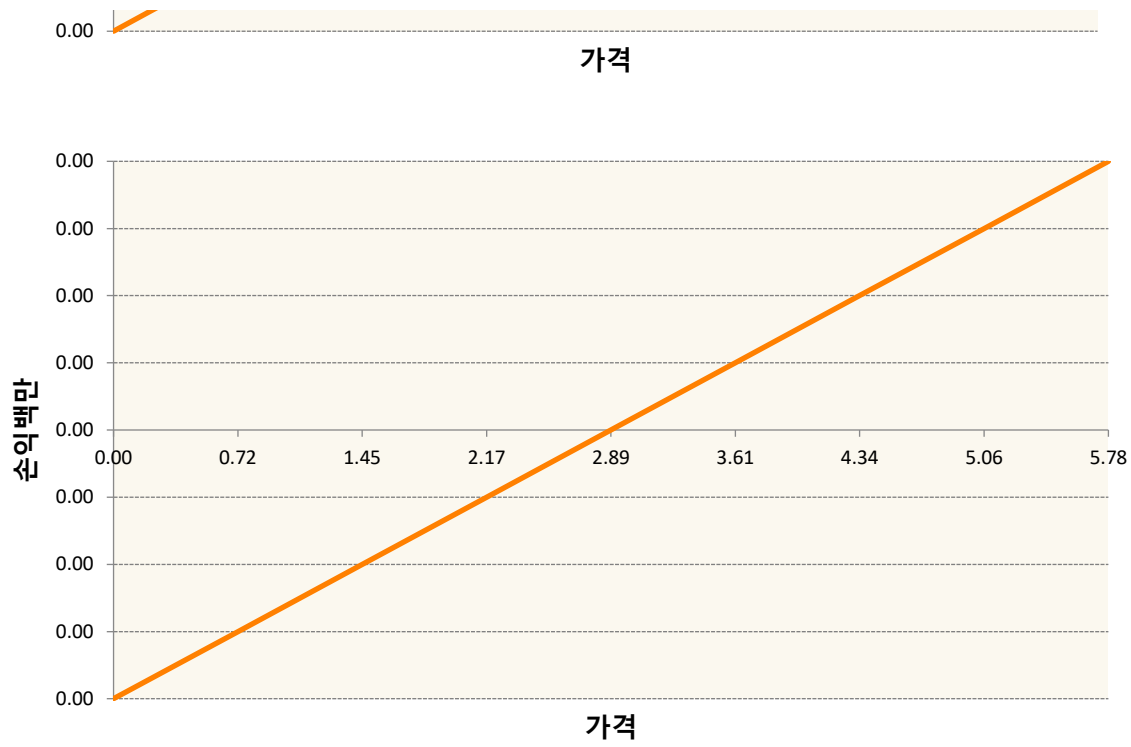
### 1. 계약금액

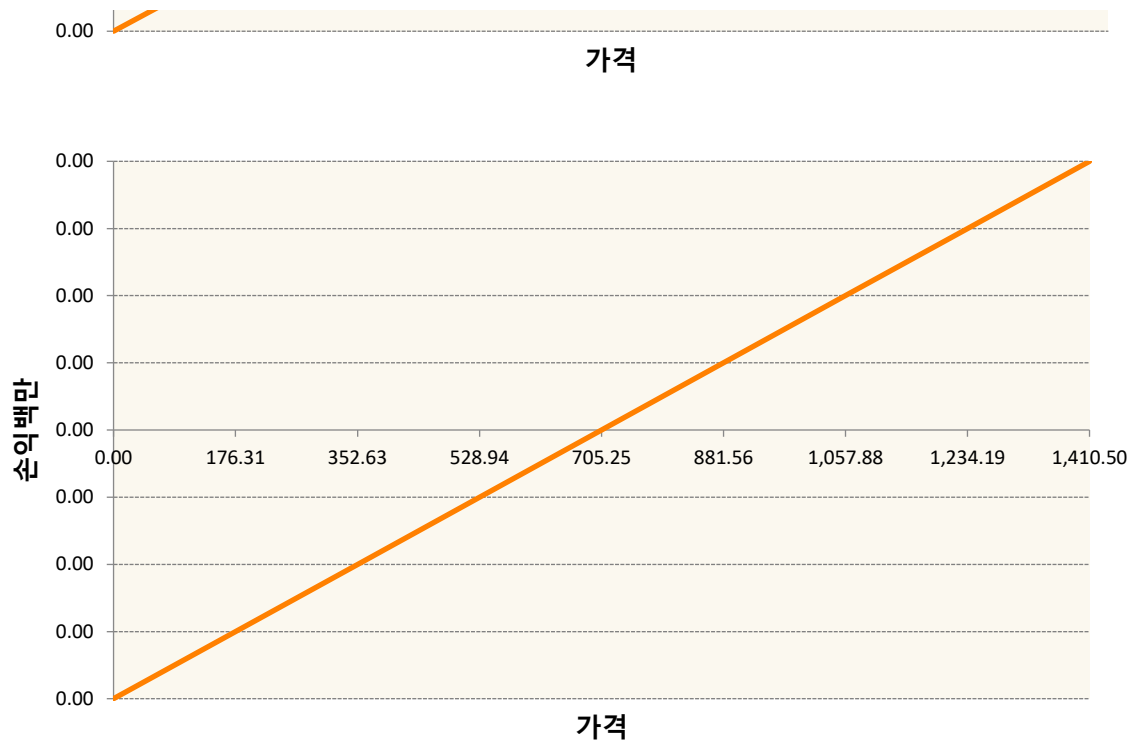
(단위:백만원)

| 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   | 186   | 0     | 186       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 334   | 0     | 334       |    |
| 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 | 3  |
| 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