

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

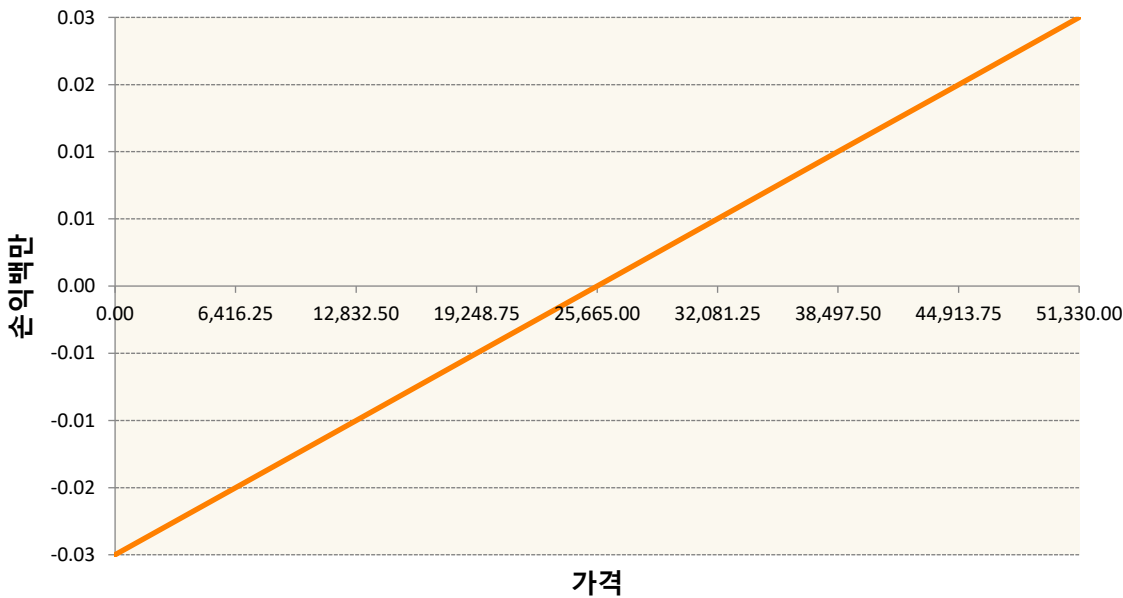
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	665	0	665	

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	2026-03-03
기준일	2026-02-27

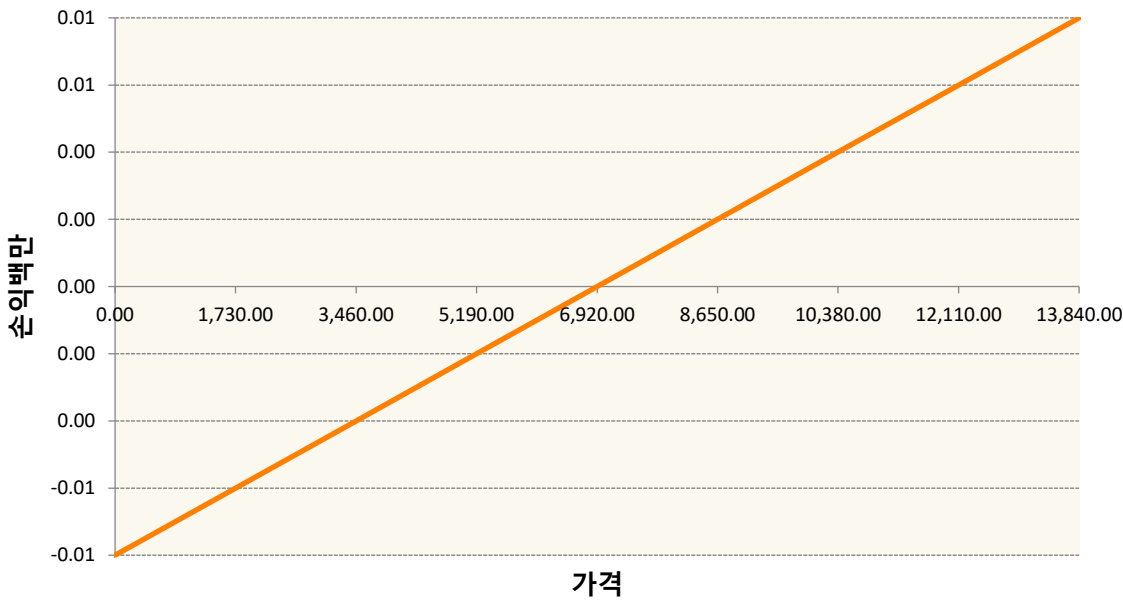
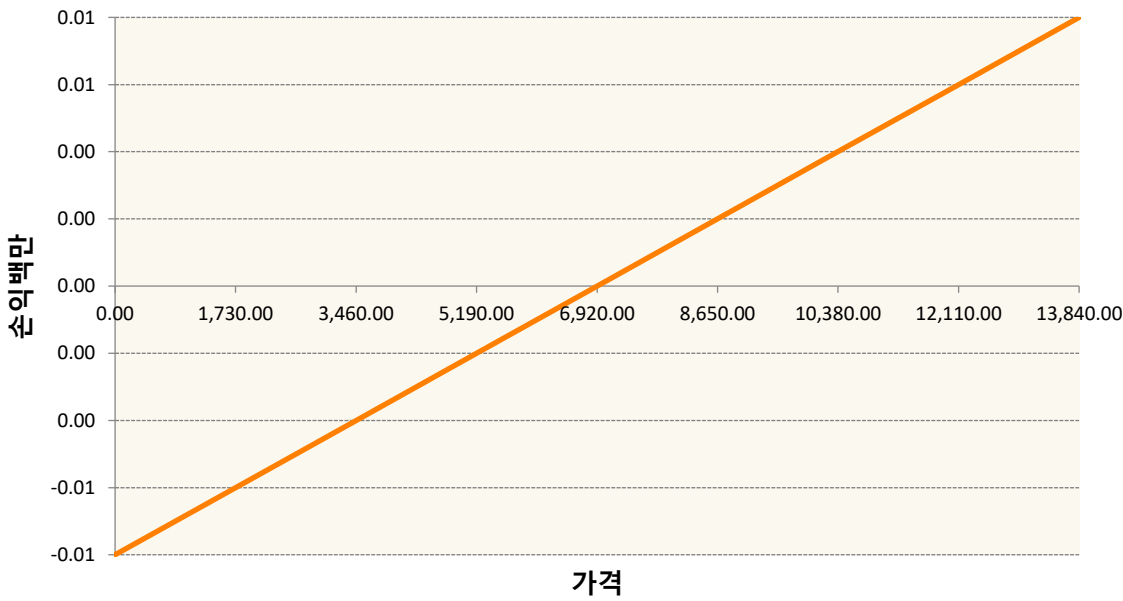
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	102	0	102	장내
누계	지수	선물	511	0	511	

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	2026-03-03
기준일	2026-02-27

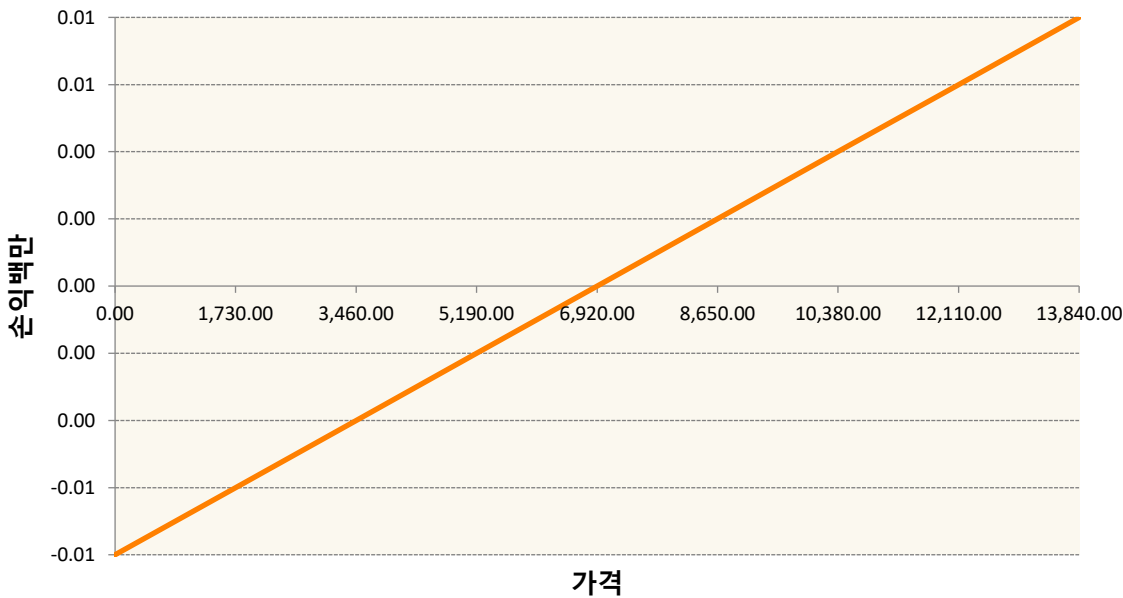
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,534	0	1,534	

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	2026-03-03
기준일	2026-02-27

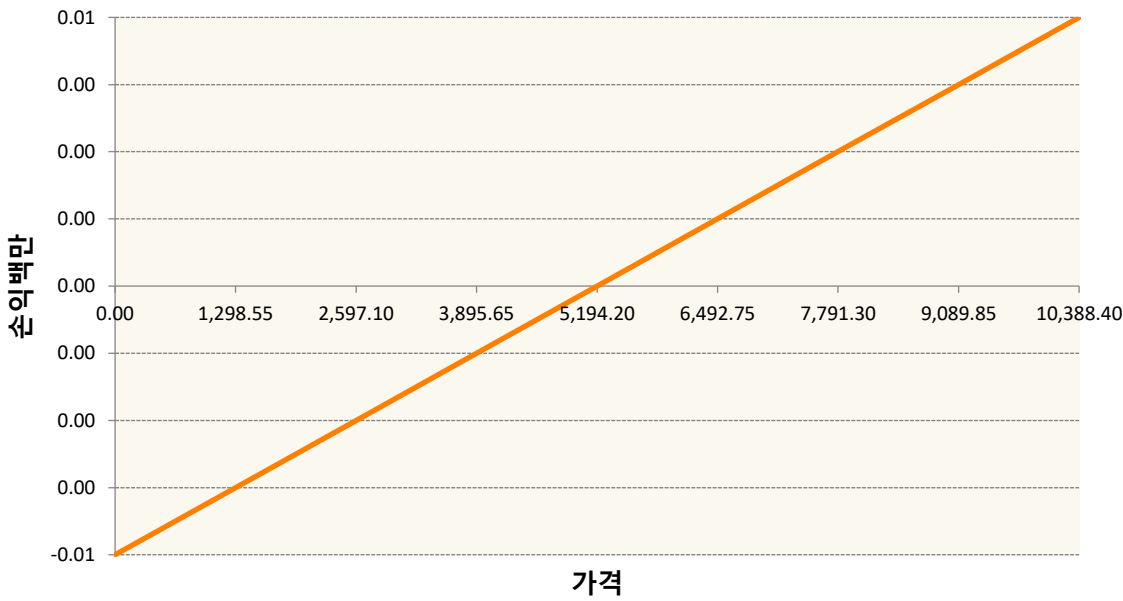
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,194	0	5,194	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSUC GLD US 02/27/26 C475 EQUITY	9
GCJ6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	415

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

(단위:백만원)

492

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

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	48
AOPLTRUSP1 PLTR US 02/27/26 P147 EQUITY	76

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

(단위:백만원)

451

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

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)

1,172

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

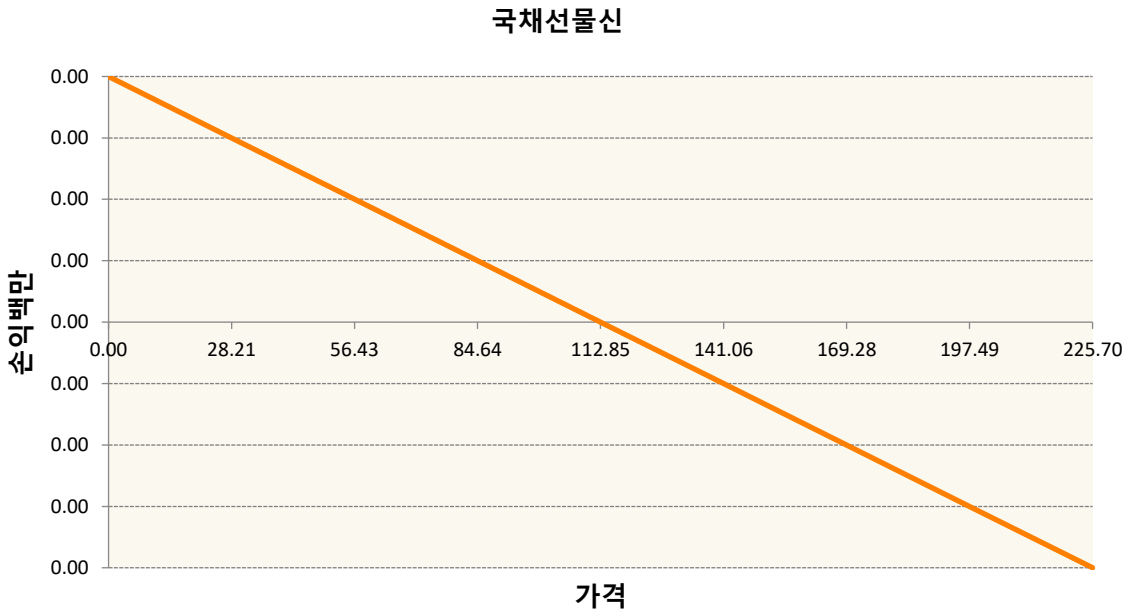
포커스채권(채권-파생형)(종)

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	13,542	-13,542	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A67630009			2026-03 국채선물10(신)				372
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-372	-372	-372	-372	-372	-372	-372
-5.33%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
-2.67%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	124	124	124	124	124	124	124
5.33%	248	248	248	248	248	248	248
8.00%	372	372	372	372	372	372	372

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

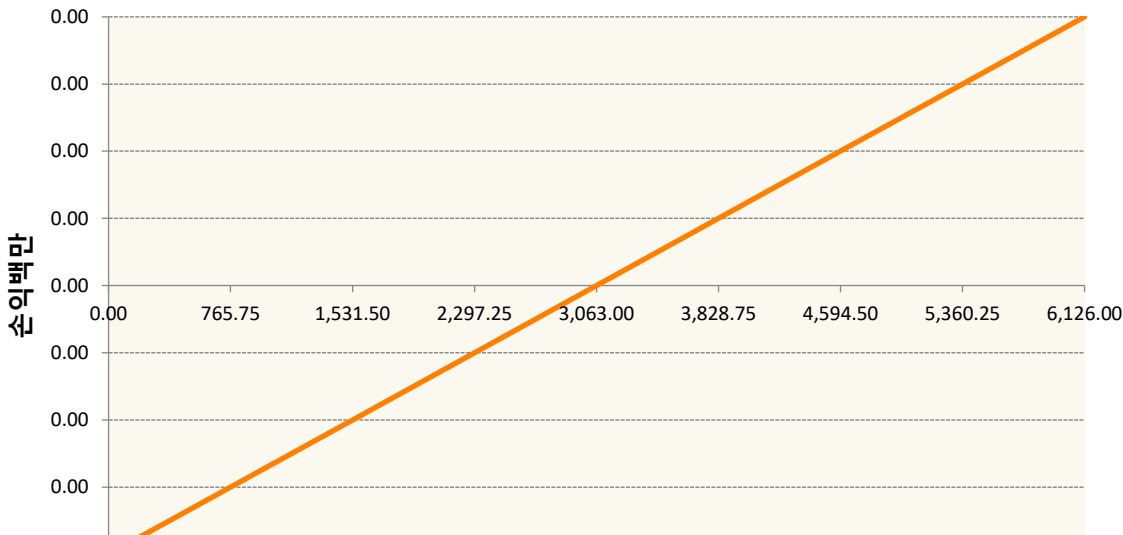
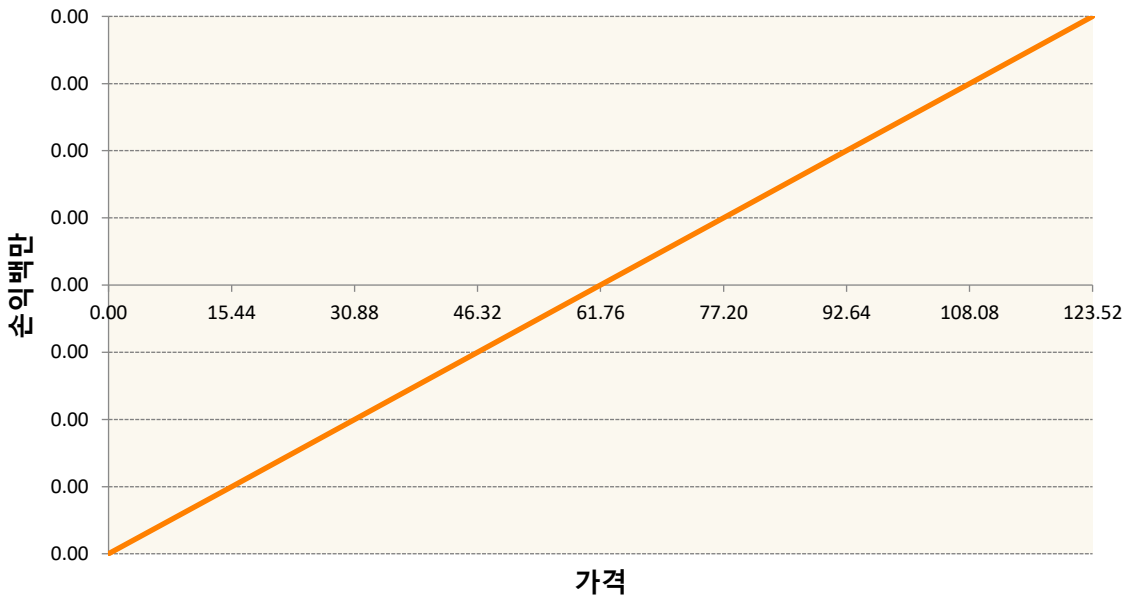
포커스농산물모(채권-파생형)

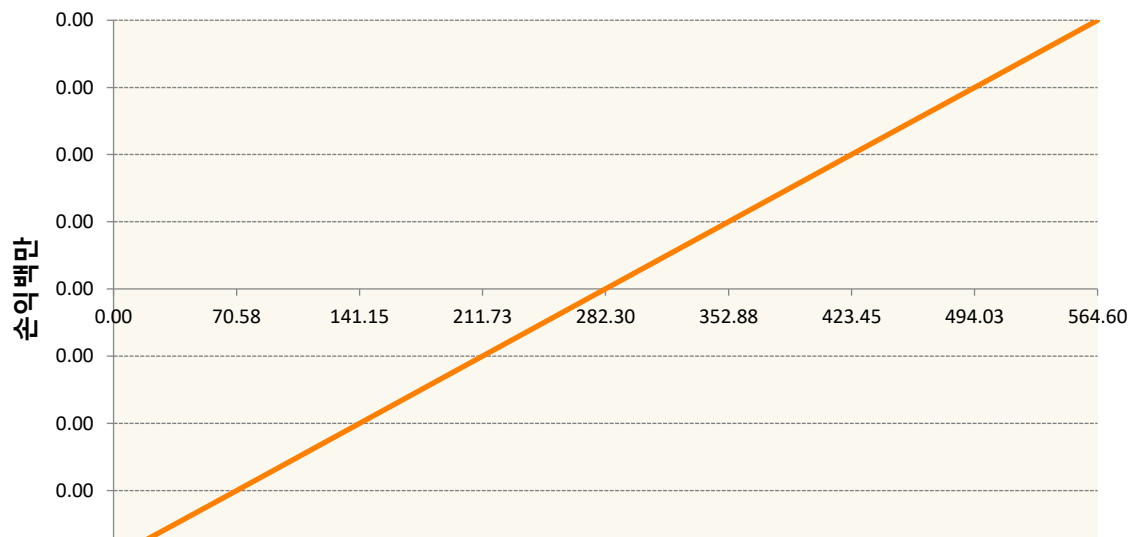
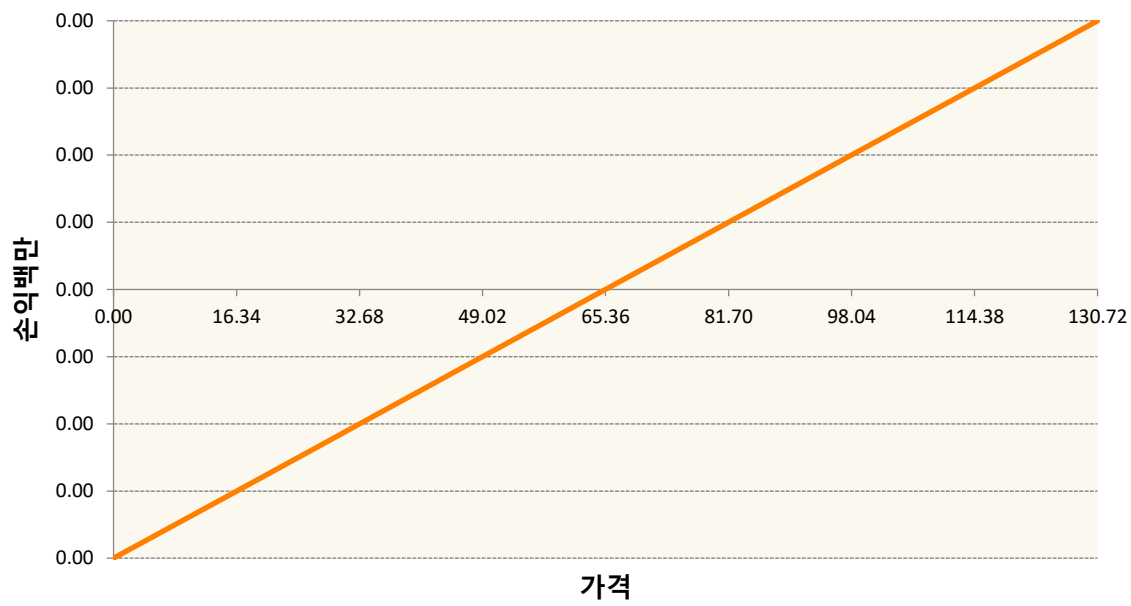
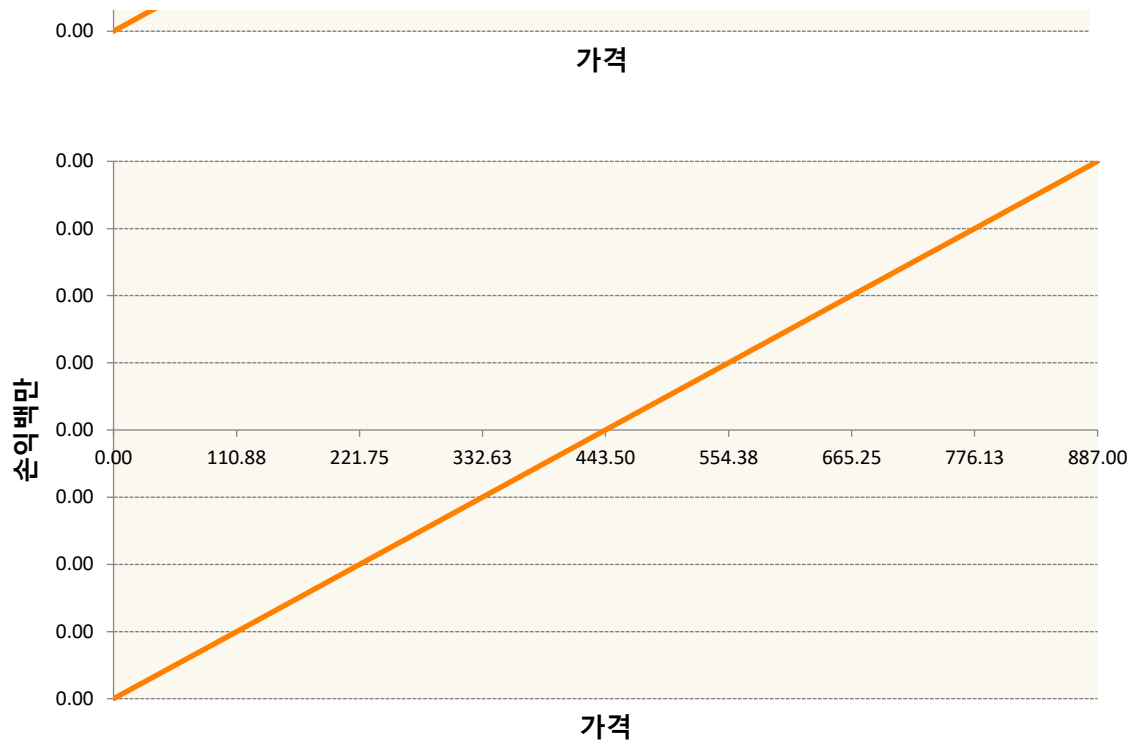
1. 계약금액

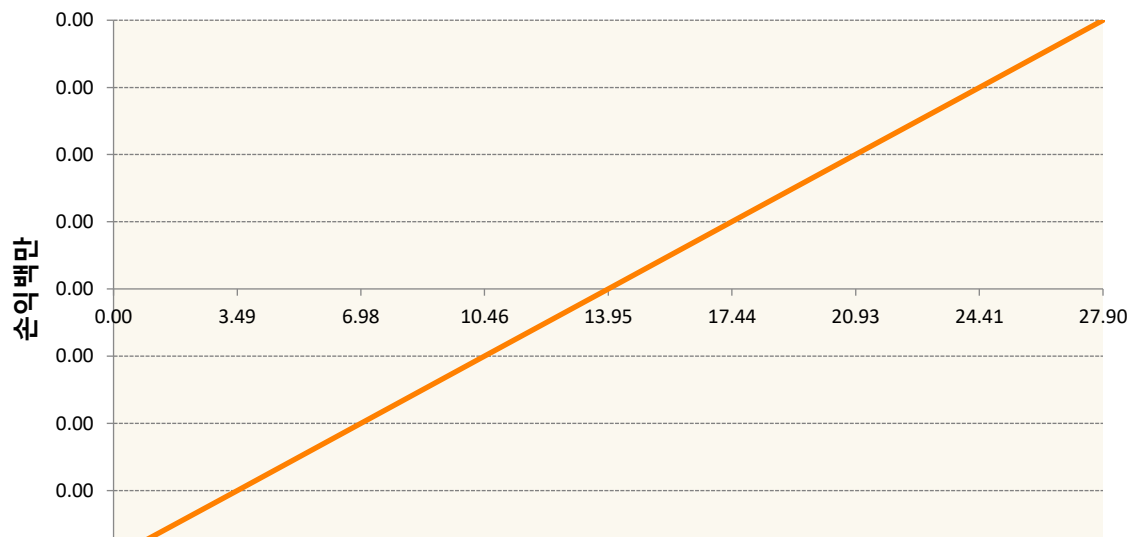
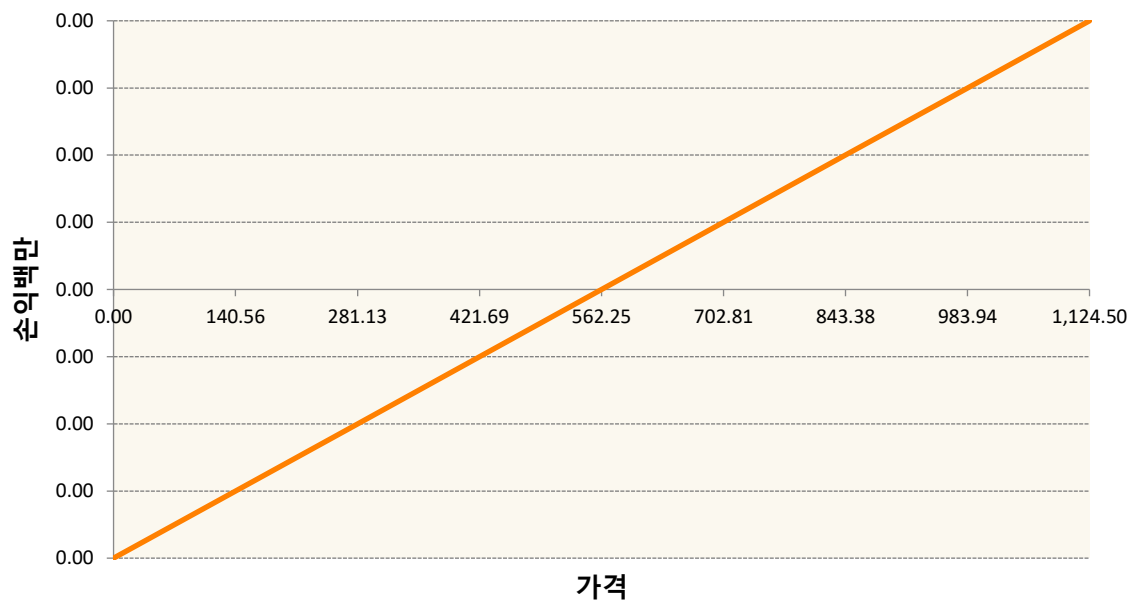
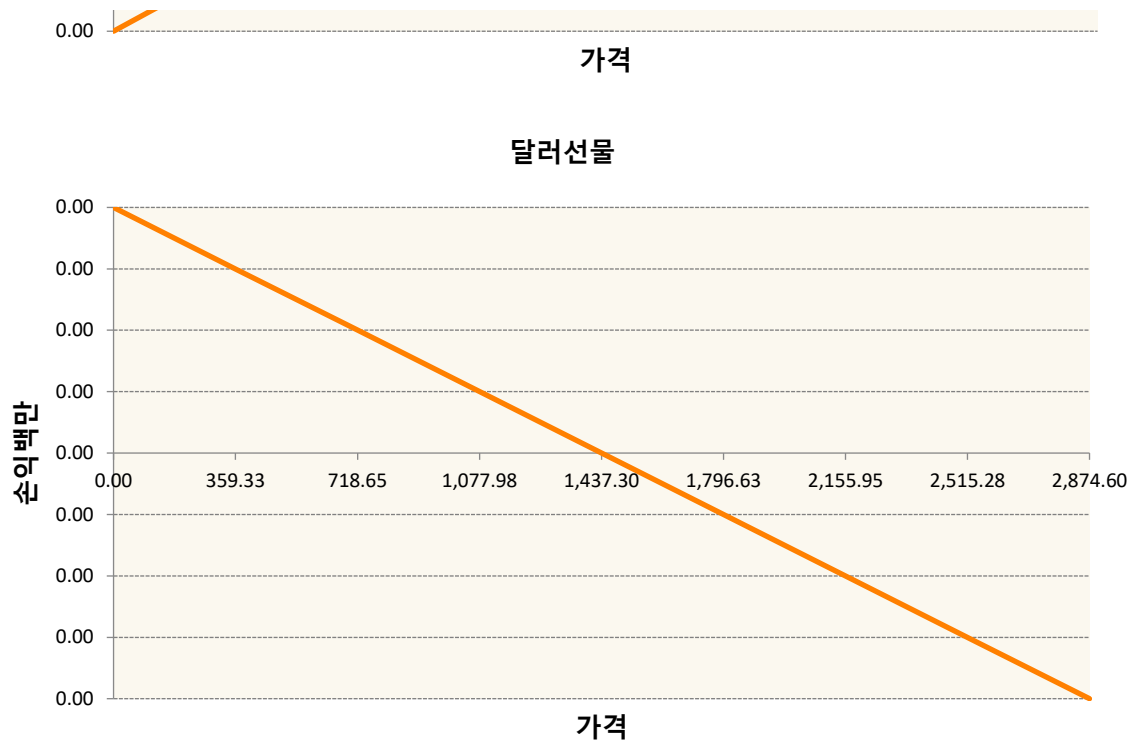
(단위:USD 백만)

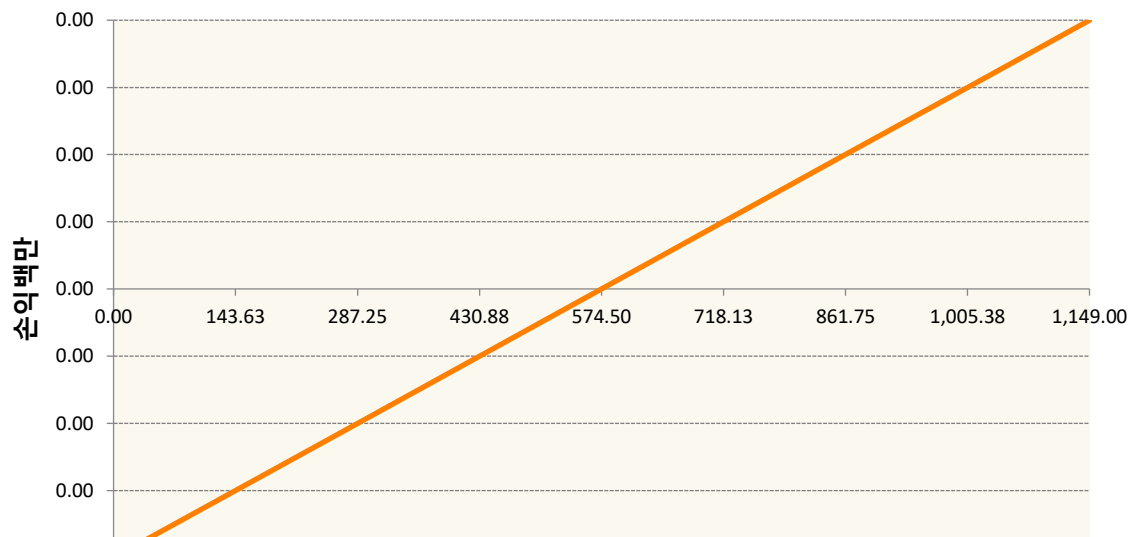
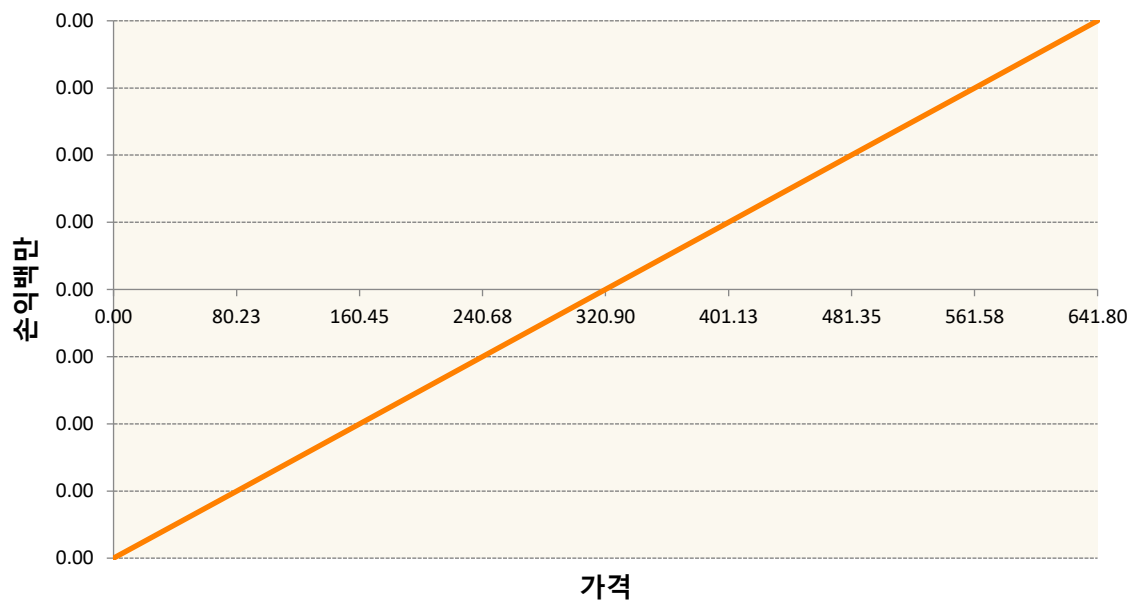
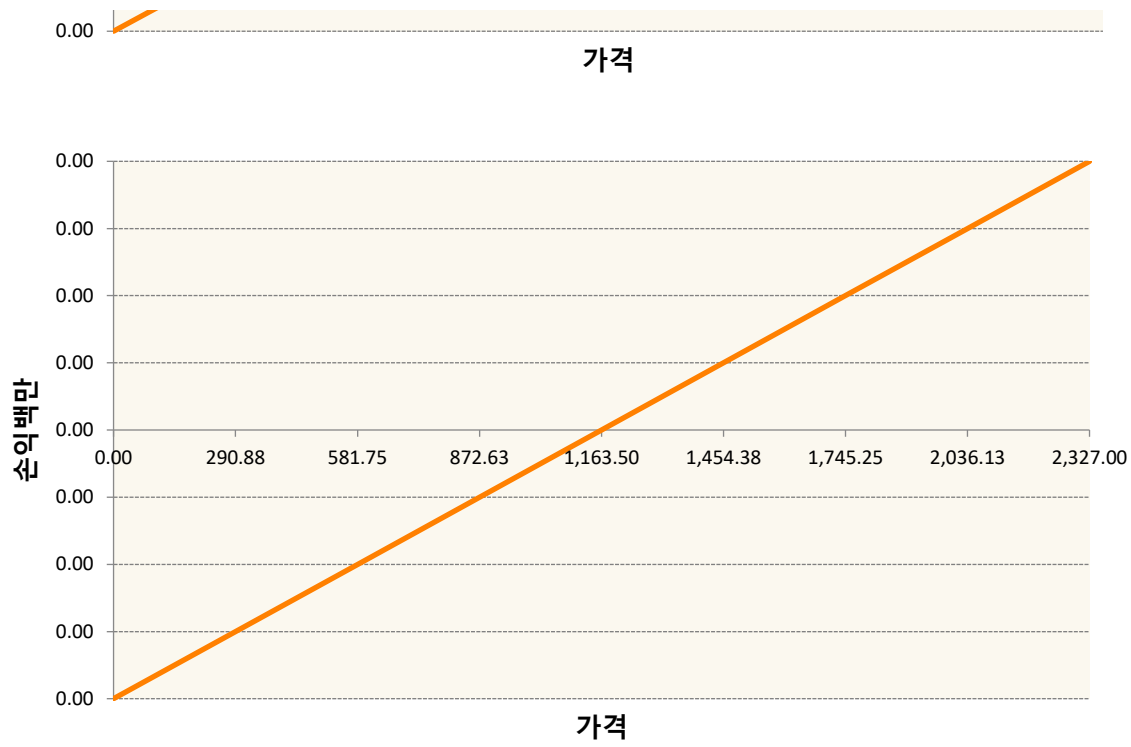
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,249	0	1,249	
누계	유가증권	선물	1,776	0	1,776	
누계	통화	선물	0	302	-302	장내

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	2026-03-03
기준일	2026-02-27

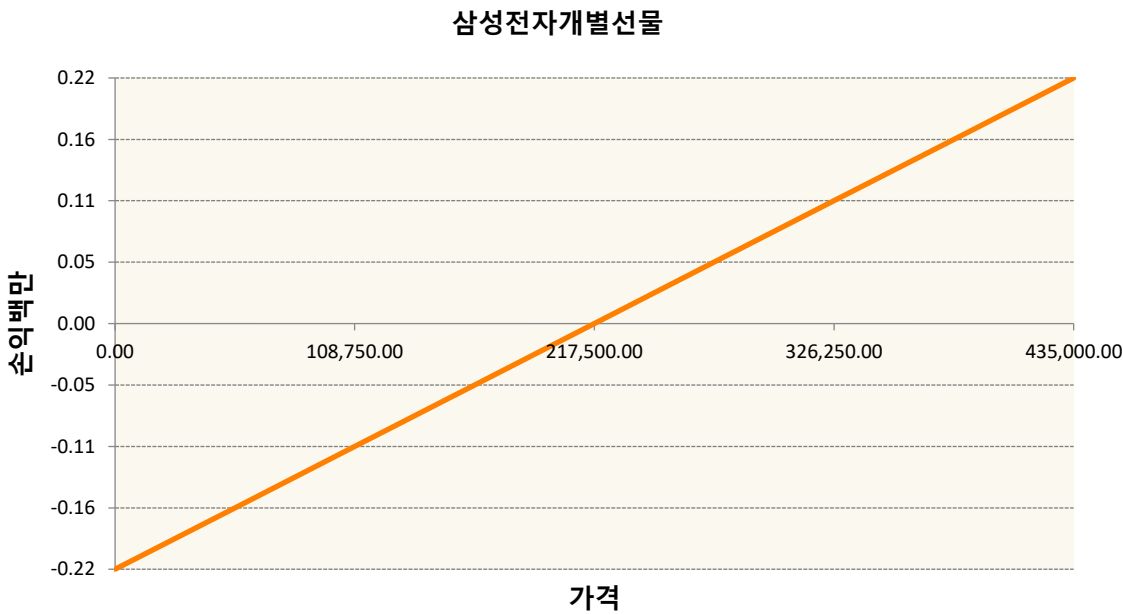
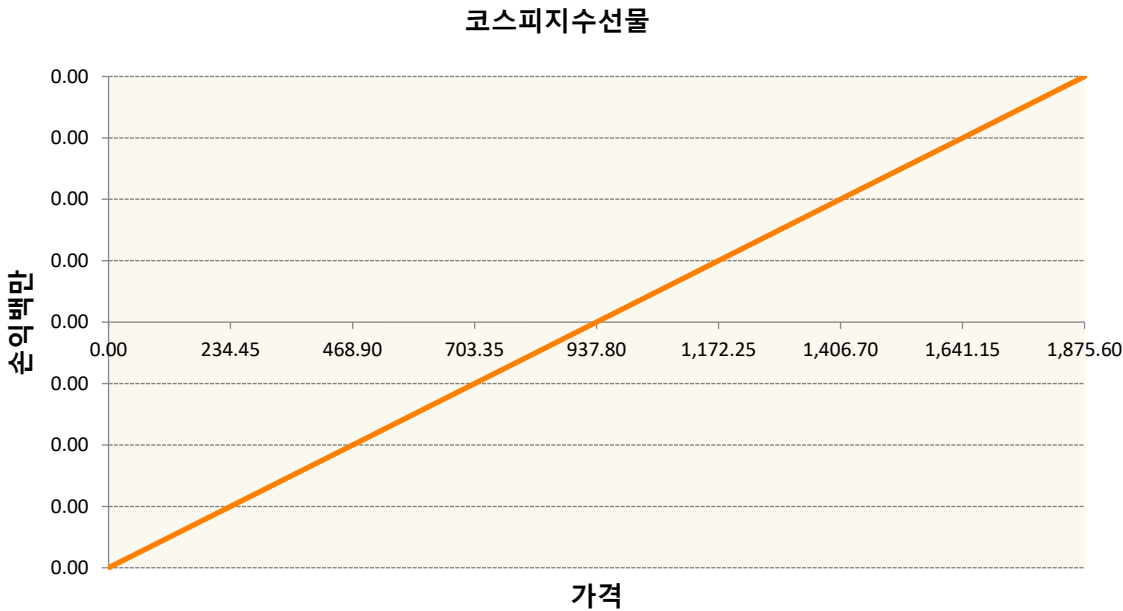
스마트인덱스모

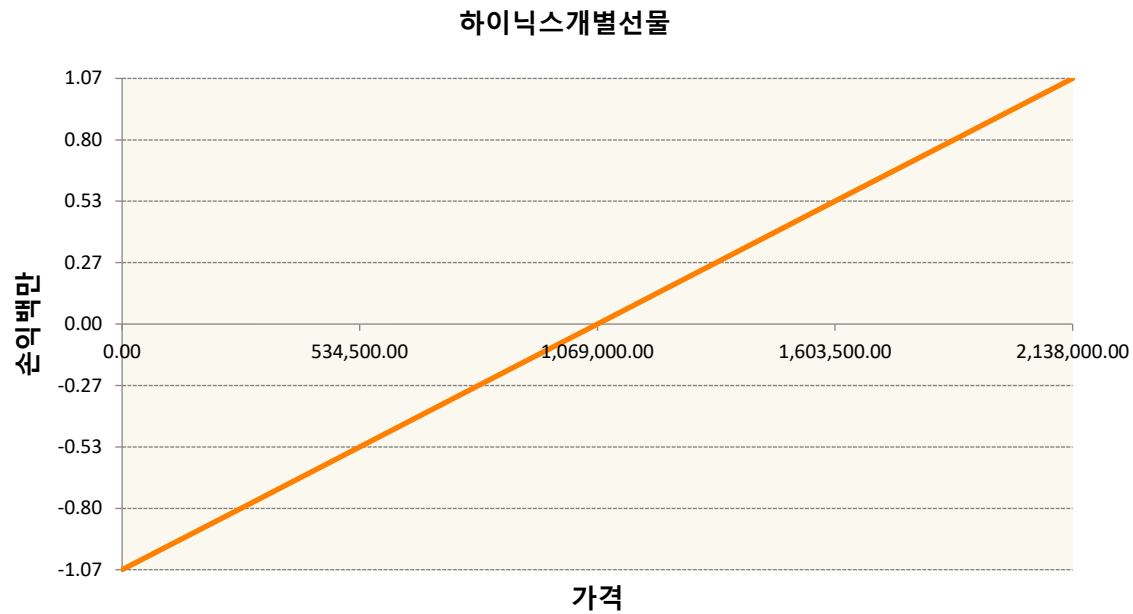
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	237	0	237	장내
누계	유가증권	선물	3,678	0	3,678	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		281
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		3
KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물		9

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

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

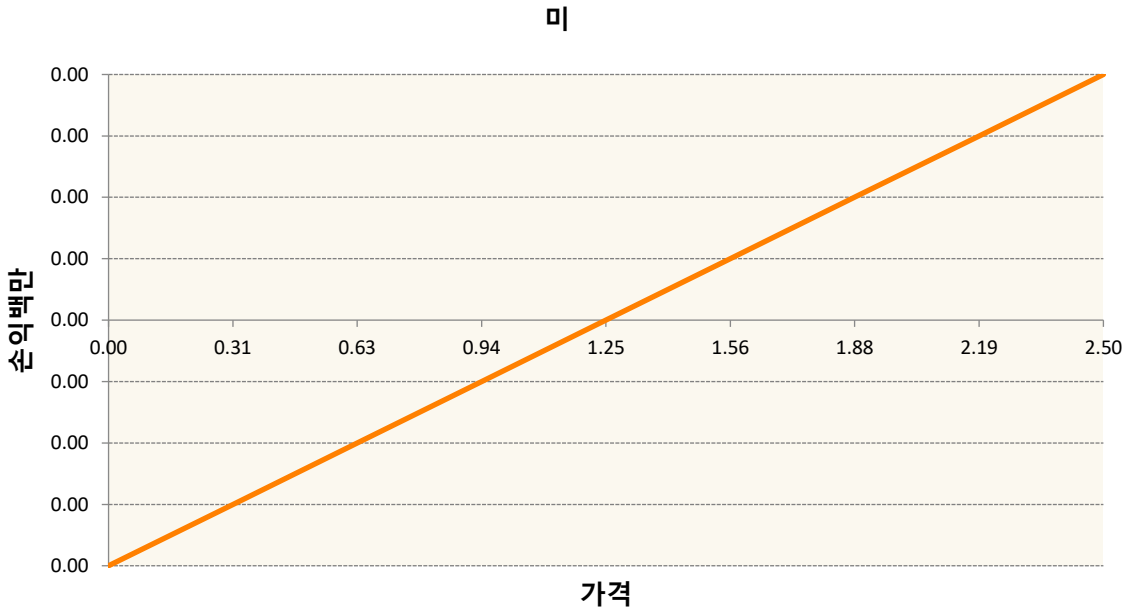
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,774	0	5,774	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

463

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

573

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

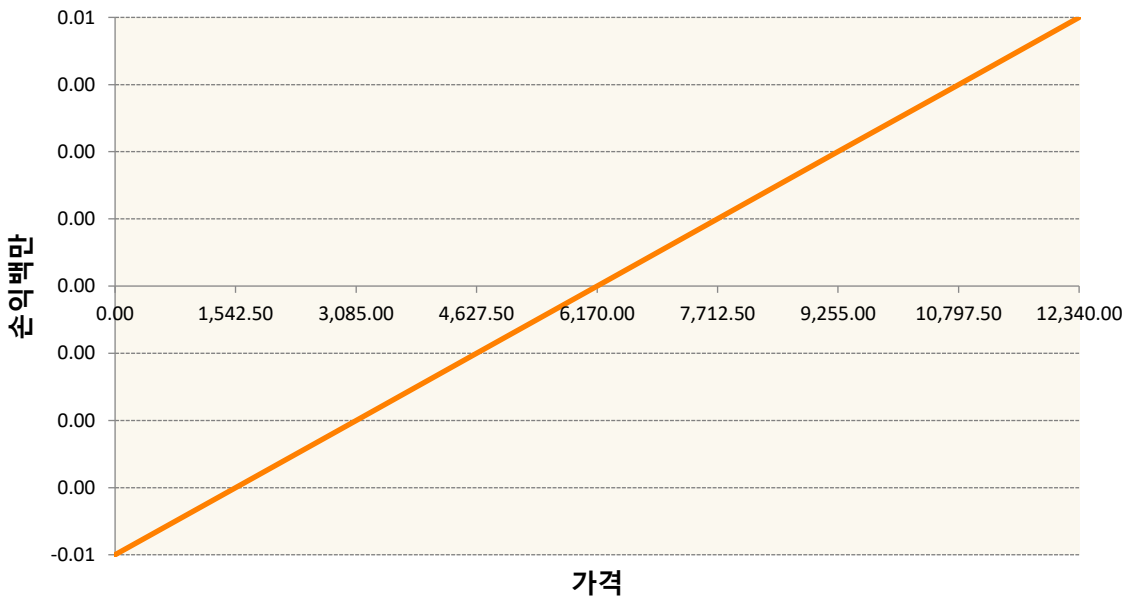
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	960	0	960	

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	2026-03-03
기준일	2026-02-27

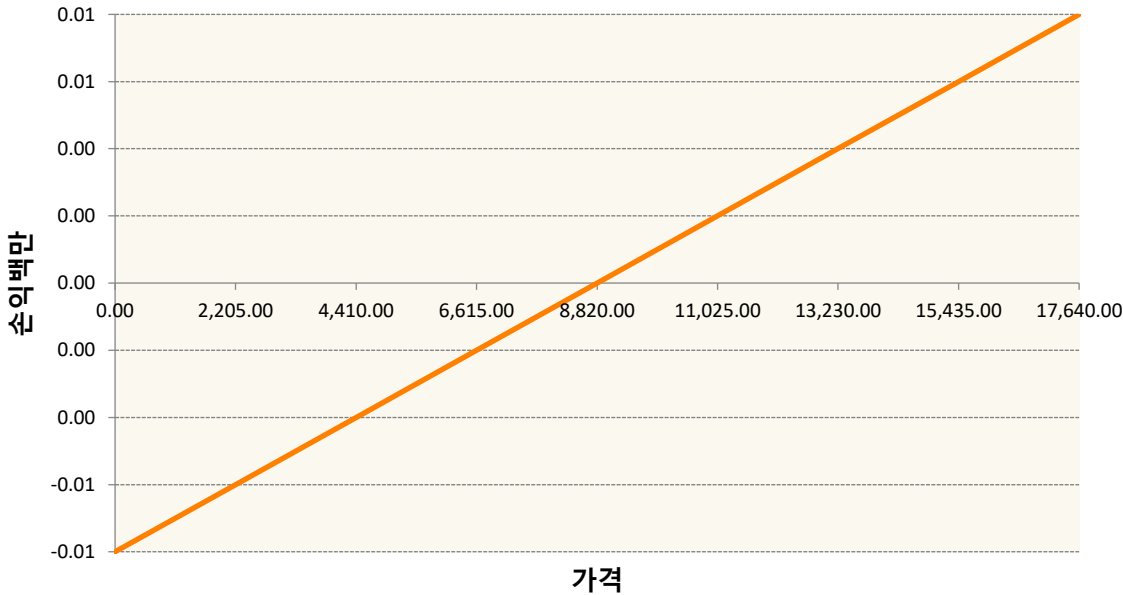
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,768	0	1,768	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH6	HSCEI Futures Mar26	141
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

163

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

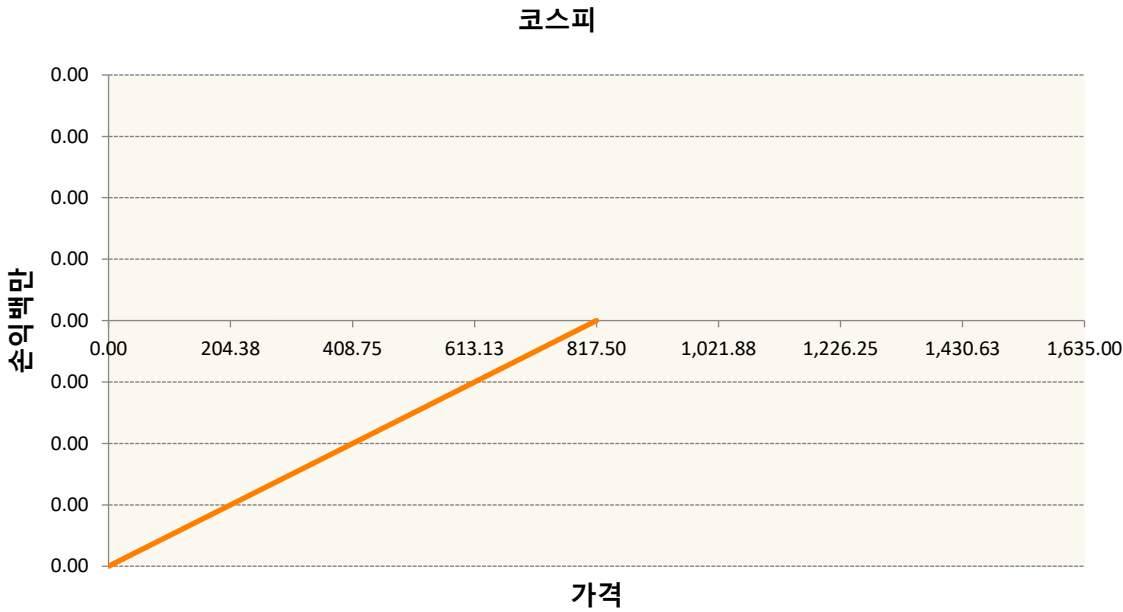
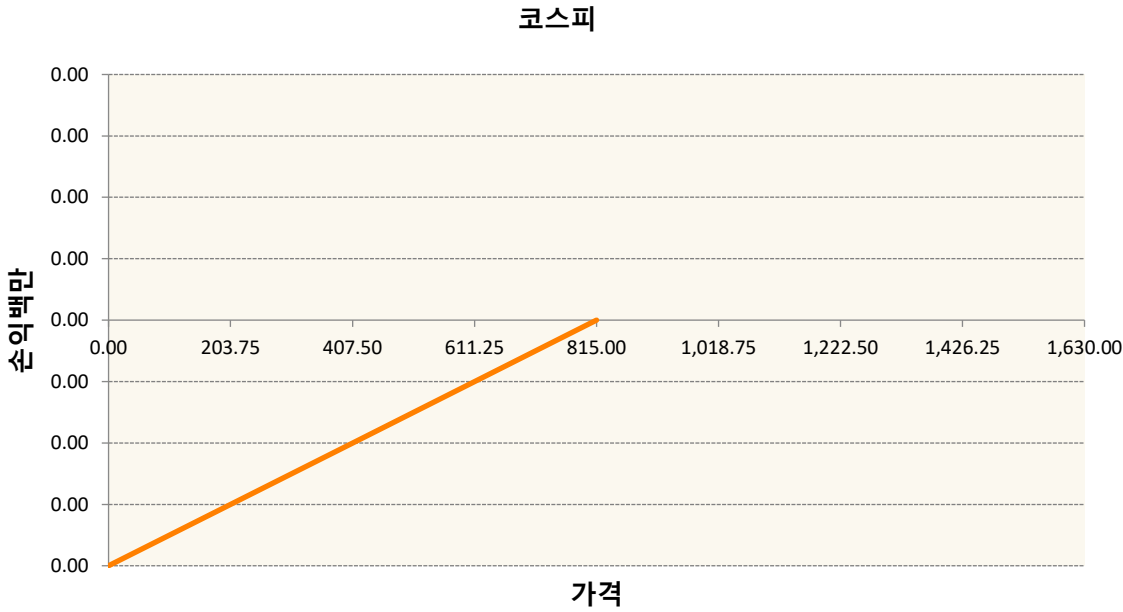
커버드콜모(주식혼합-파생형)

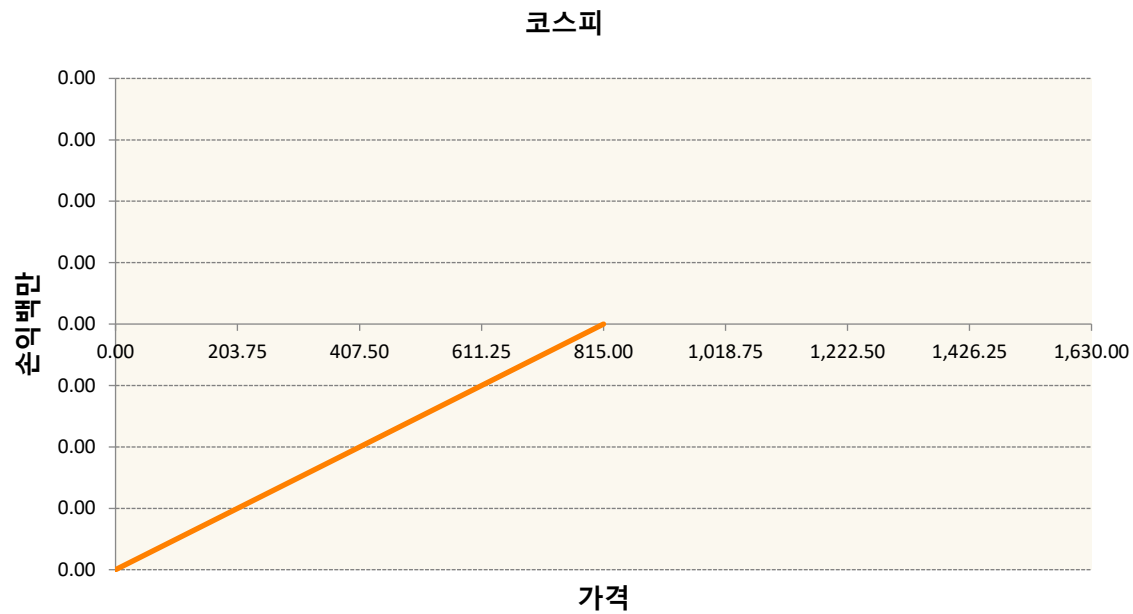
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	515	0	515	장내
누계	유가증권	옵션	0	31,220	-31,220	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)				(단위:백만원)
KR4B016381	코스피200 C 202603	815.0		766
KR4B016381	코스피200 C 202603	817.5		1,210
KR4C016381	코스피200 P 202603	815.0		522

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

공시일 2026-03-03

기준일 2026-02-27

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	2026-03-03
기준일	2026-02-27

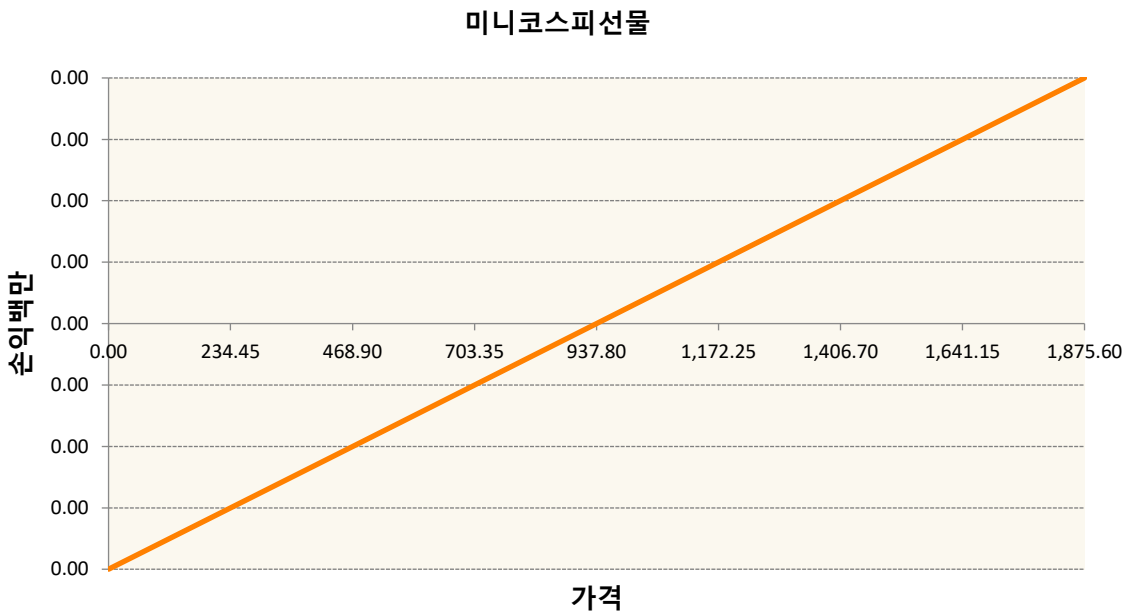
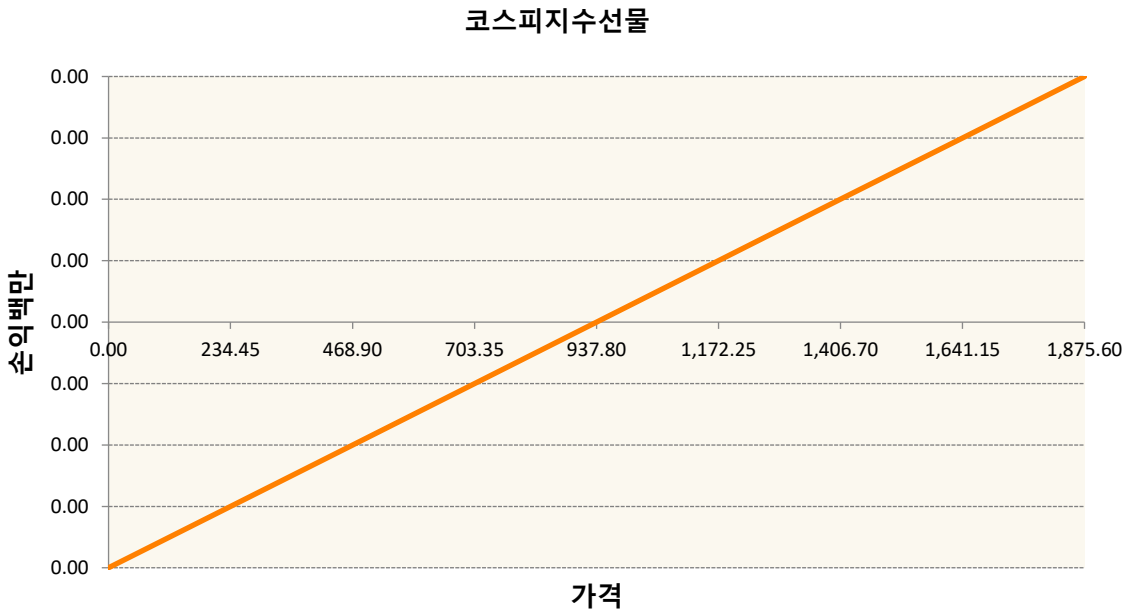
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

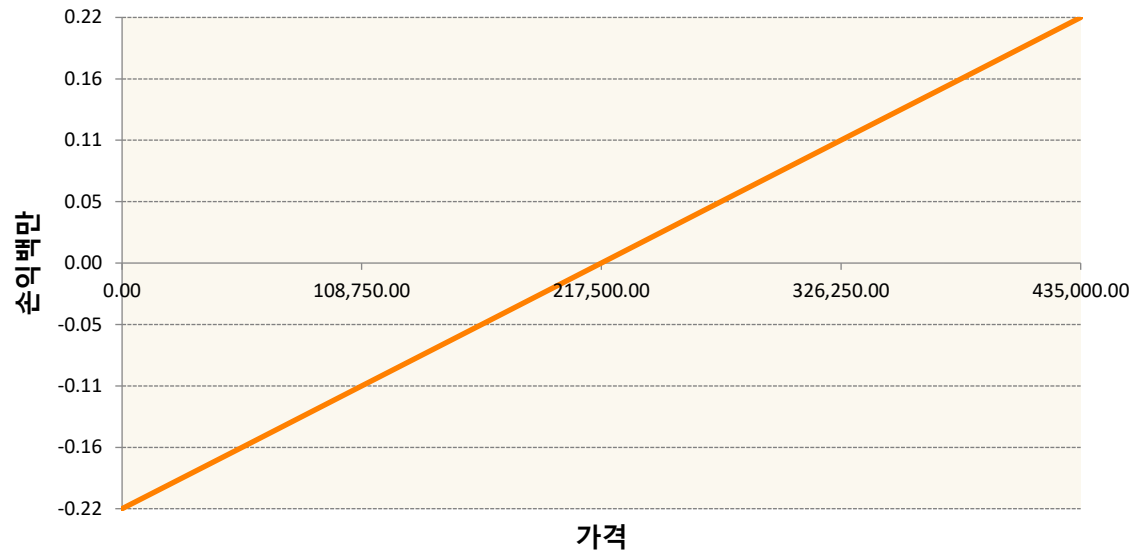
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	472	41	431	장내
누계	유가증권	선물	7,920	41	7,879	장내

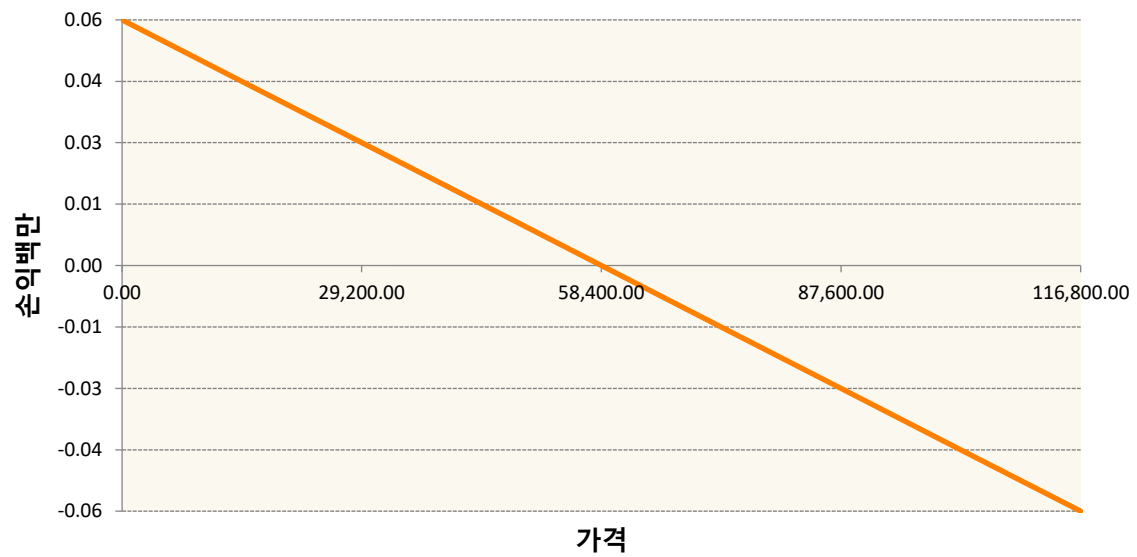
2. 만기시점의 손익구조



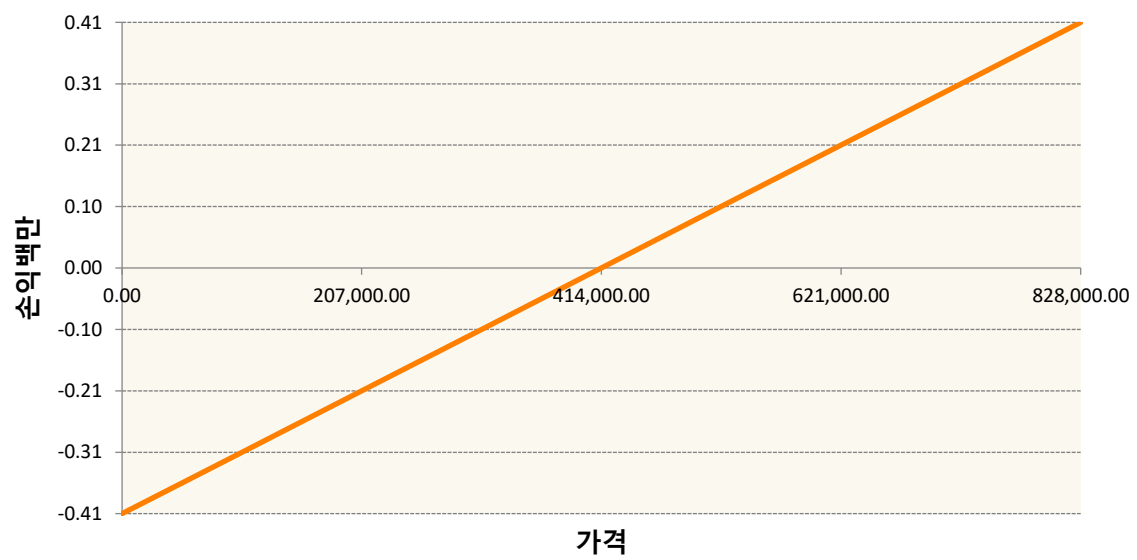
삼성전자개별선물

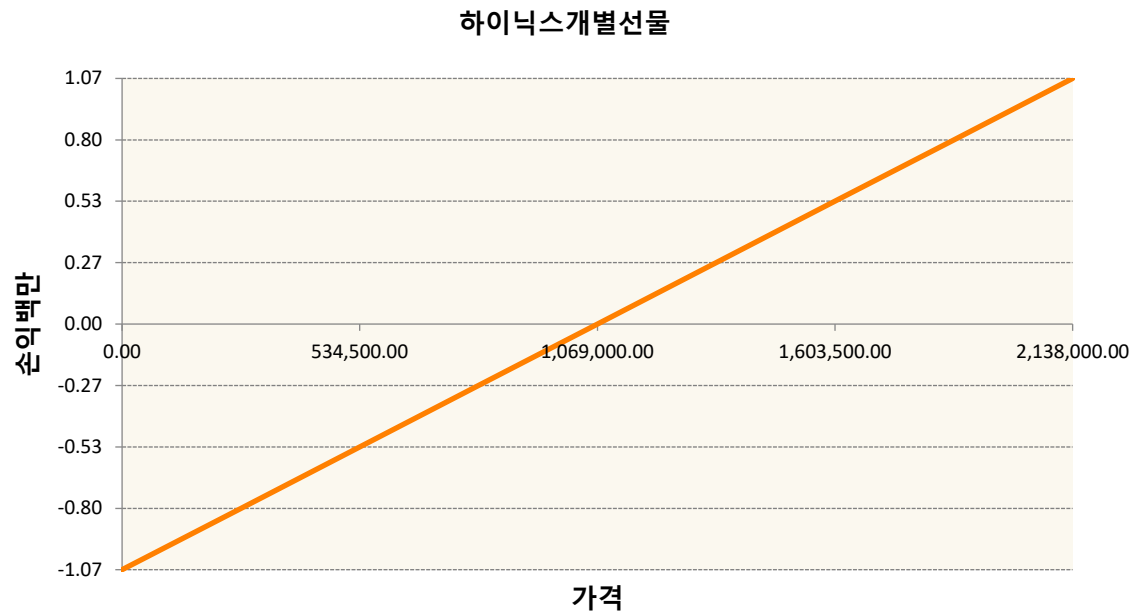


한국전력개별선물



화학개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		94
KR4A056300 2026-03 미니코스피200 선물		105
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		2
KR4A156300 2026-03 한국전력개별선물		3
KR4A476300 2026-03 LG화학개별선물		8
KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물		5

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

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

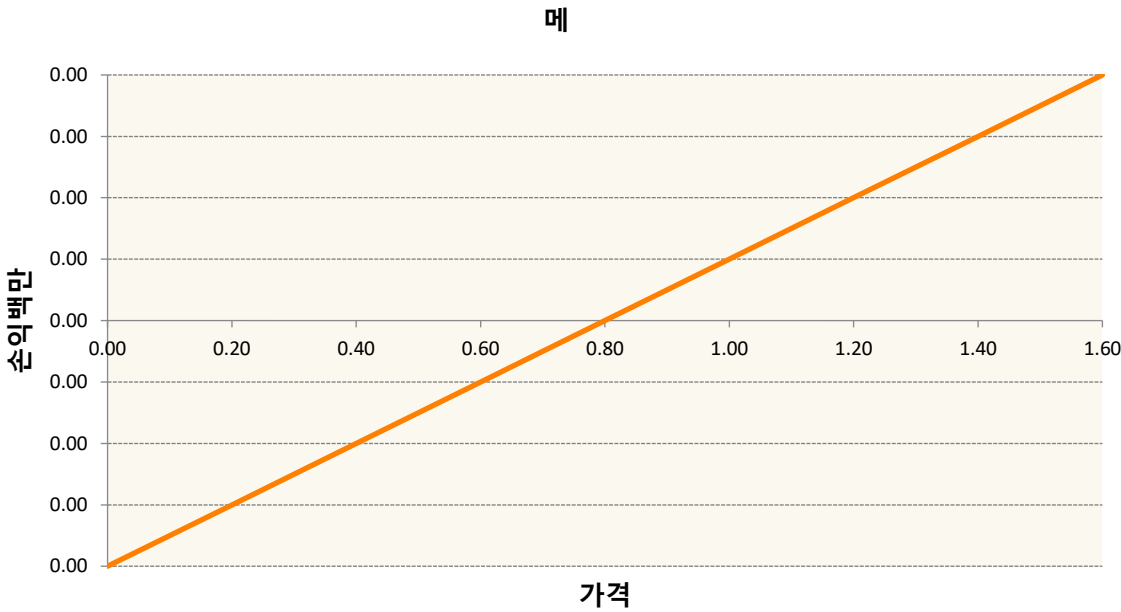
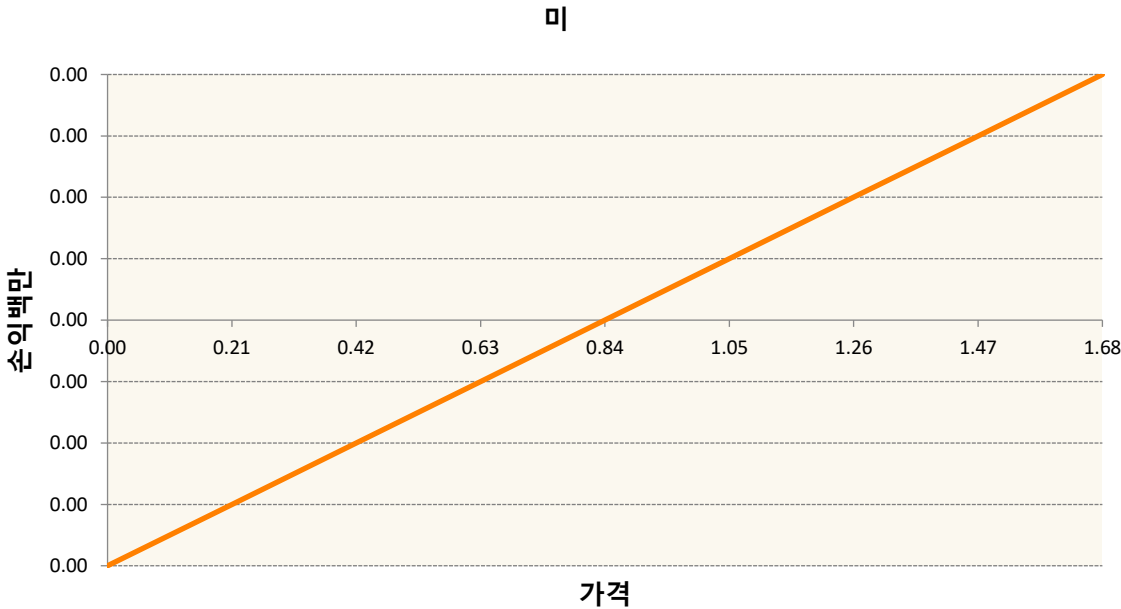
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,108	0	6,108	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		389
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	522

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

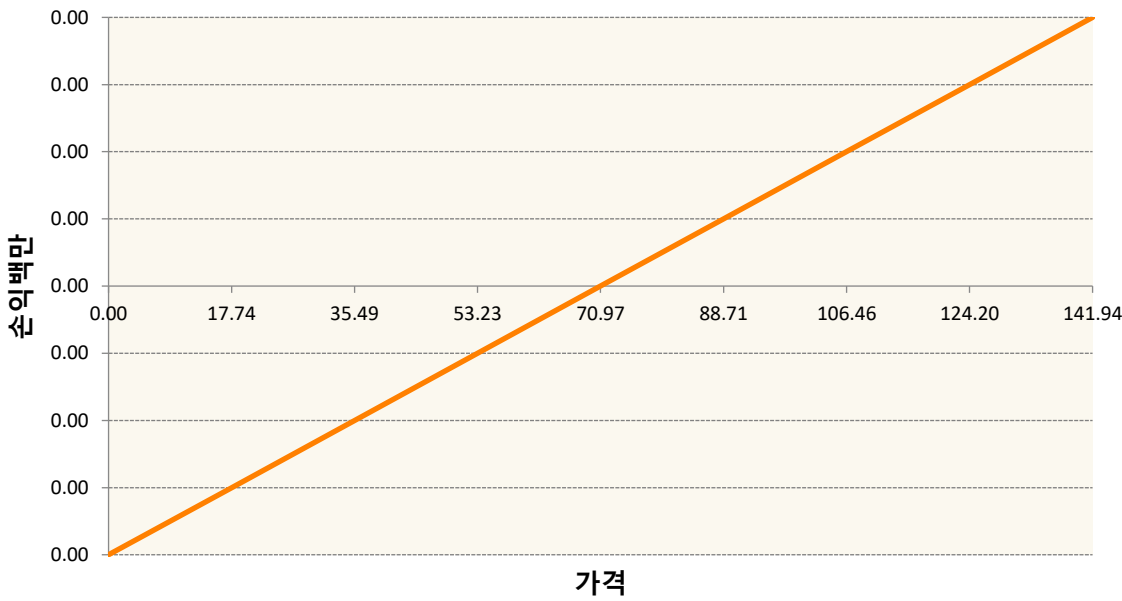
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,708	0	4,708	
누계	통화	선도	270	2,427	-2,157	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G2P(EUR/KRW 31-03-26E	22
FXW213G2R(KRW/EUR 31-03-26E	194
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	377

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

(단위:백만원)

660

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

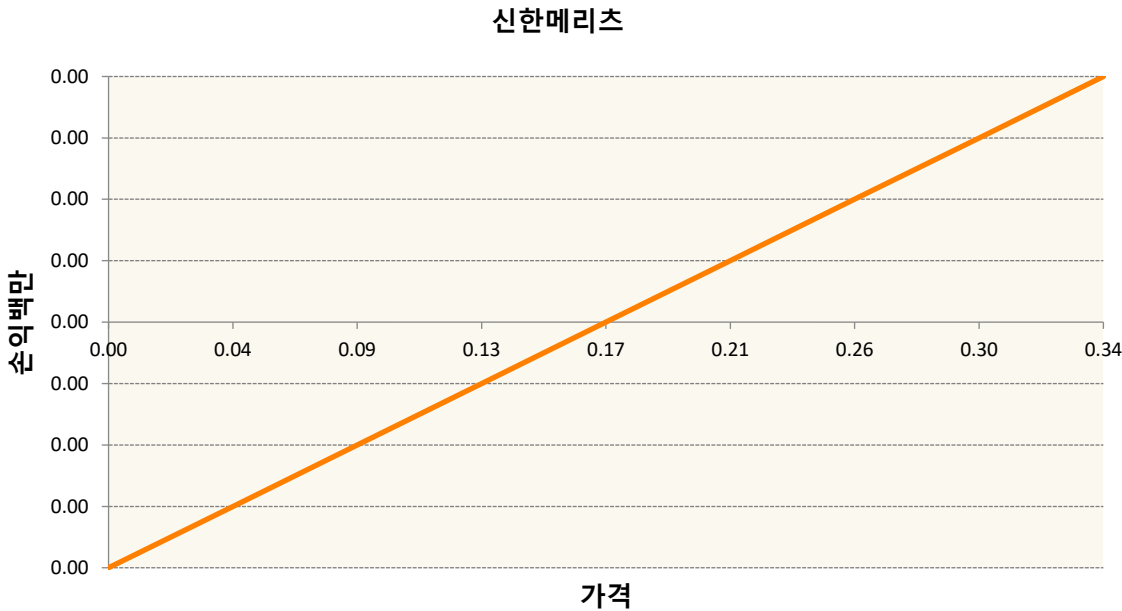
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,188	0	3,188	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	22
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	15
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	15
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	37

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

(단위:백만원)

158

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

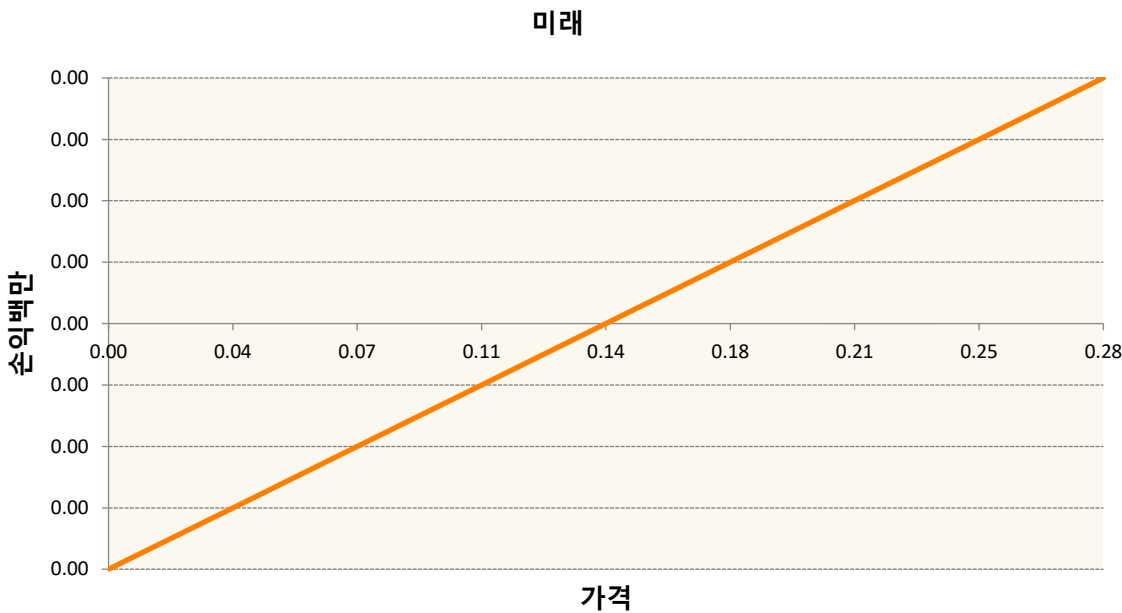
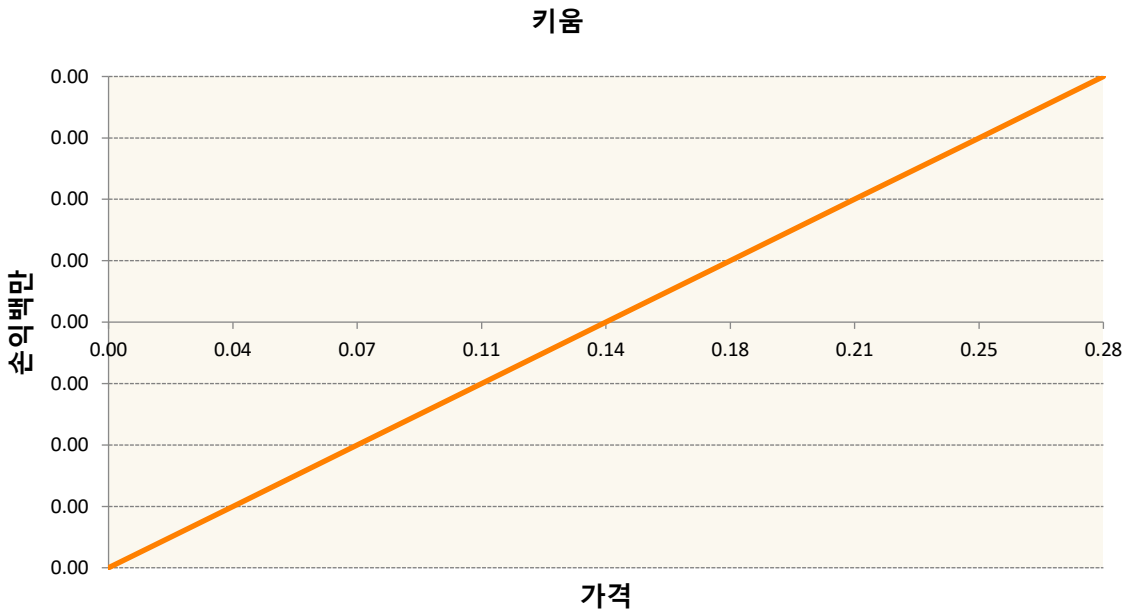
SOL차이나육성산업엑티브상장지

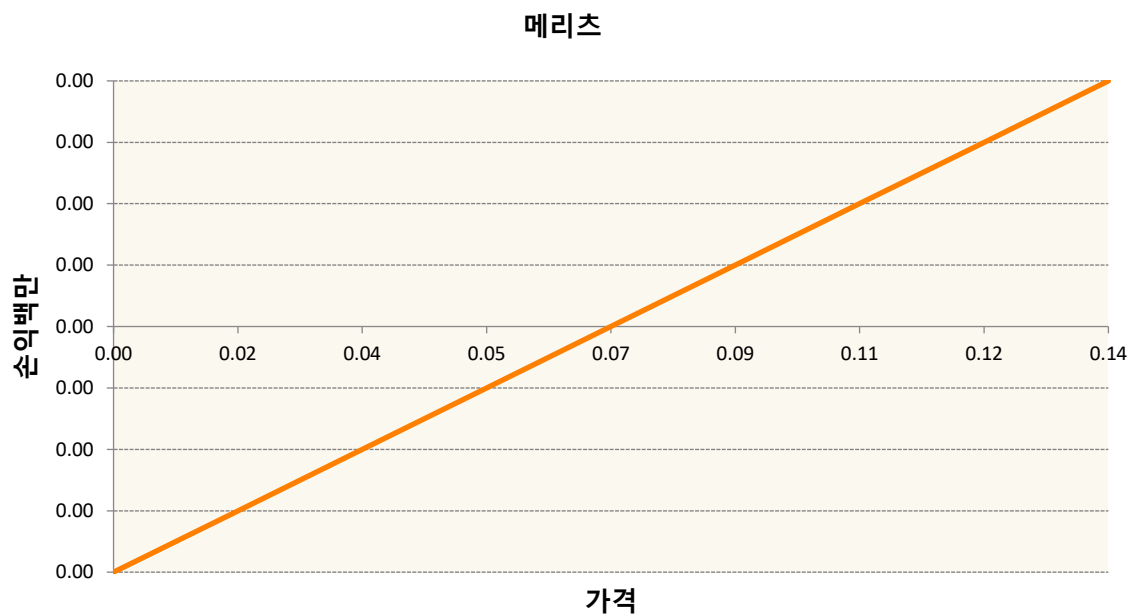
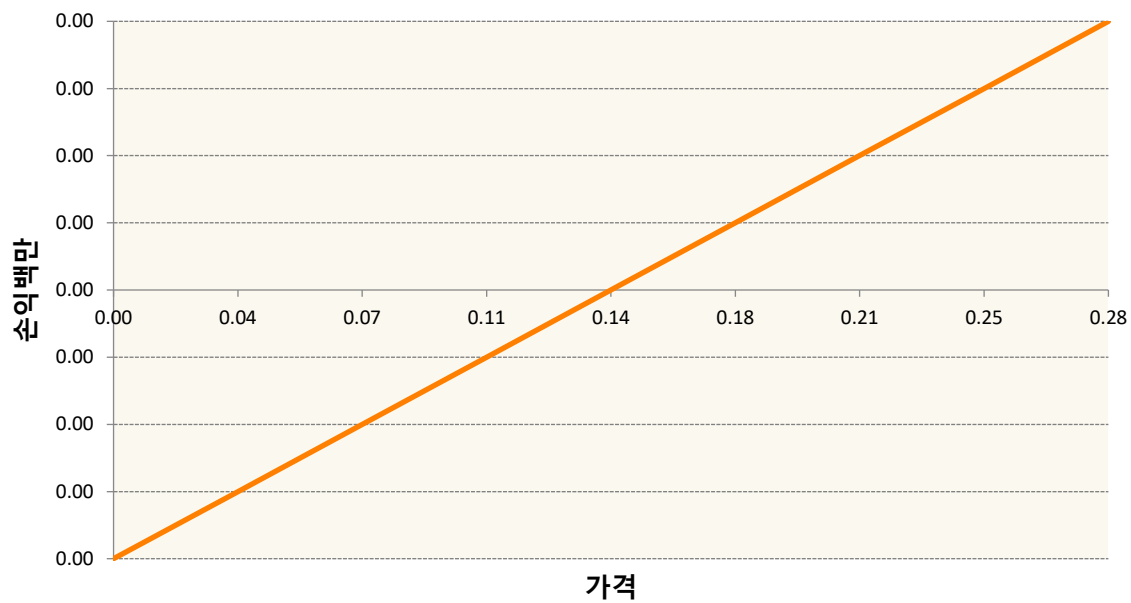
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,366	0	2,366	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)		9
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래)		62
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)		32
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)		85

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	347

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

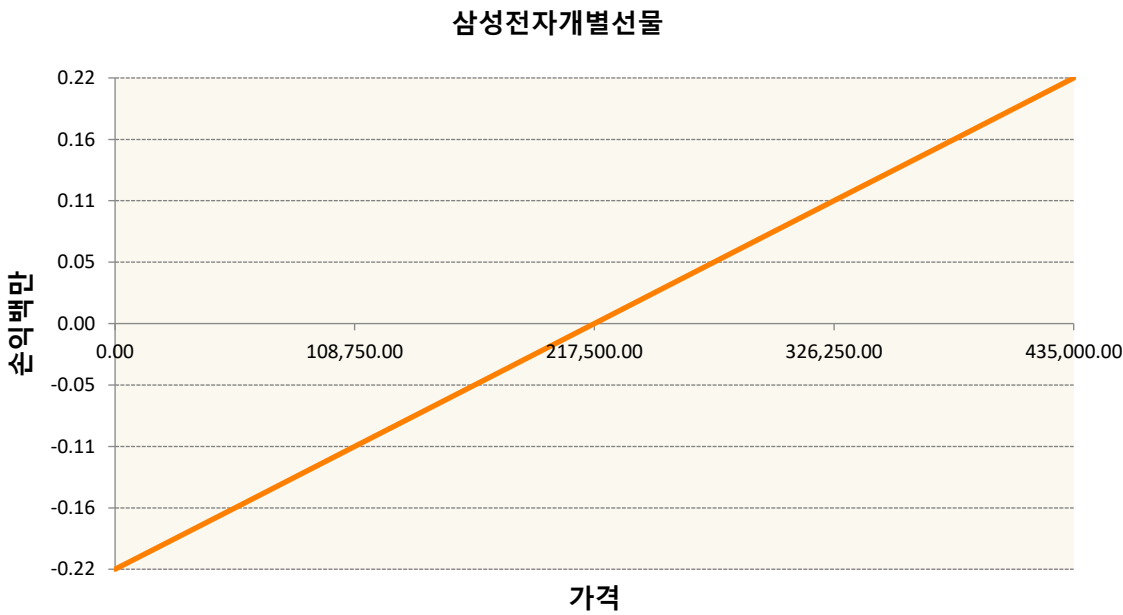
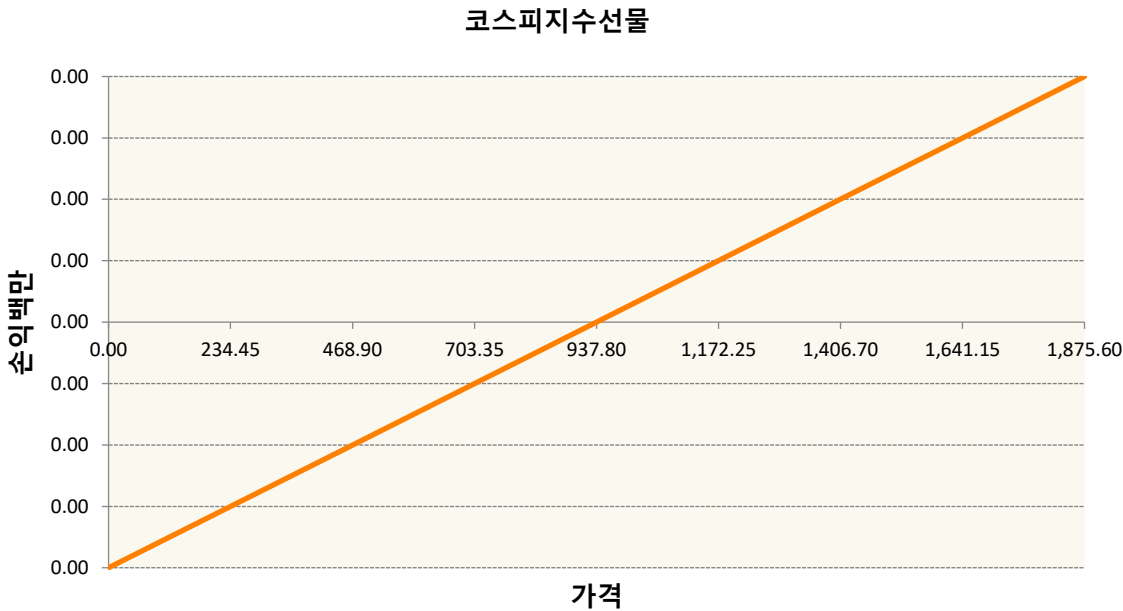
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

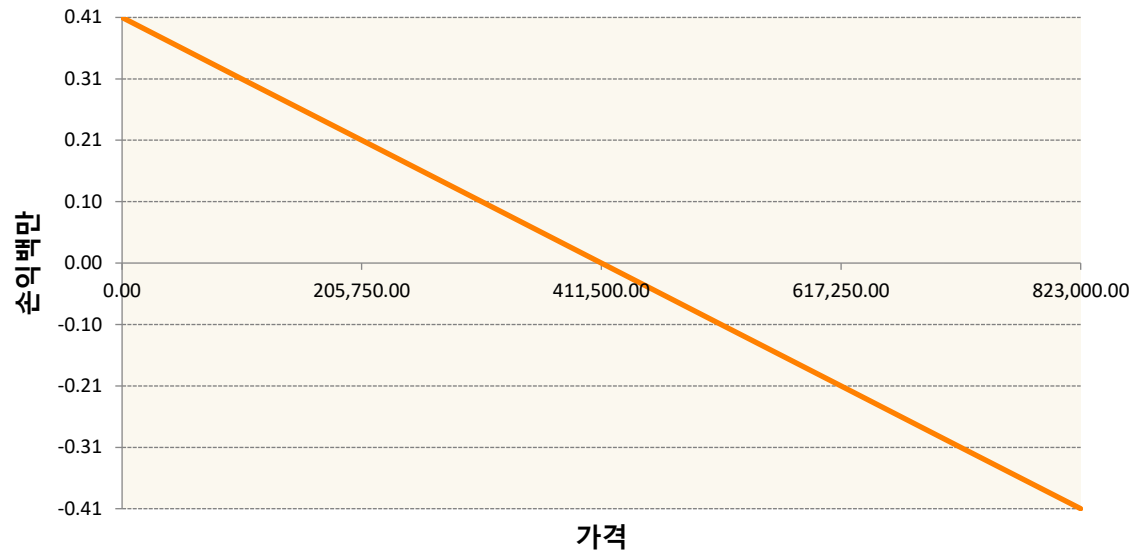
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	237	0	237	장내
누계	유가증권	선물	9,056	4,665	4,391	장내

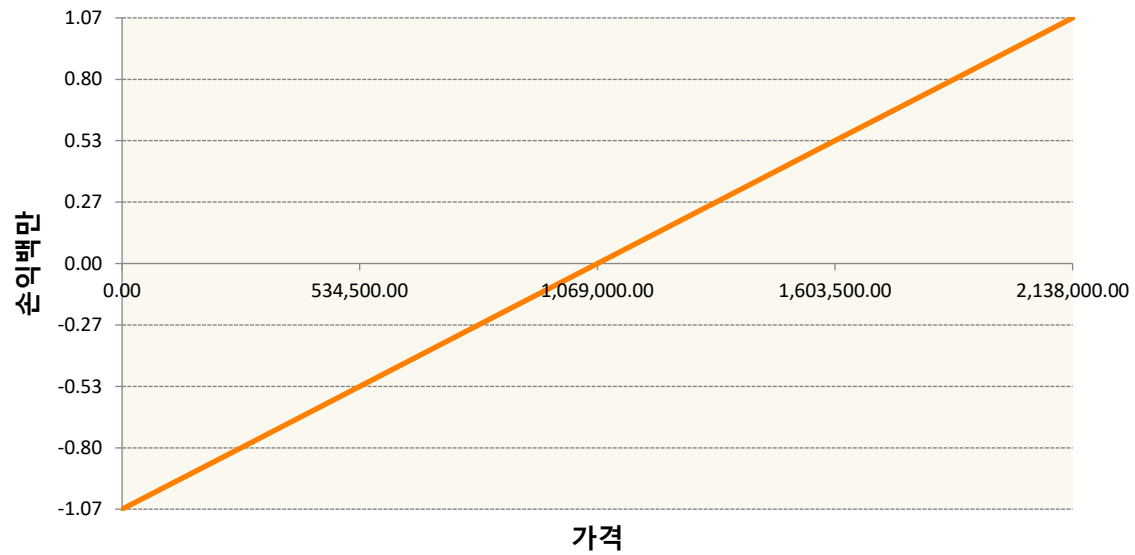
2. 만기시점의 손익구조



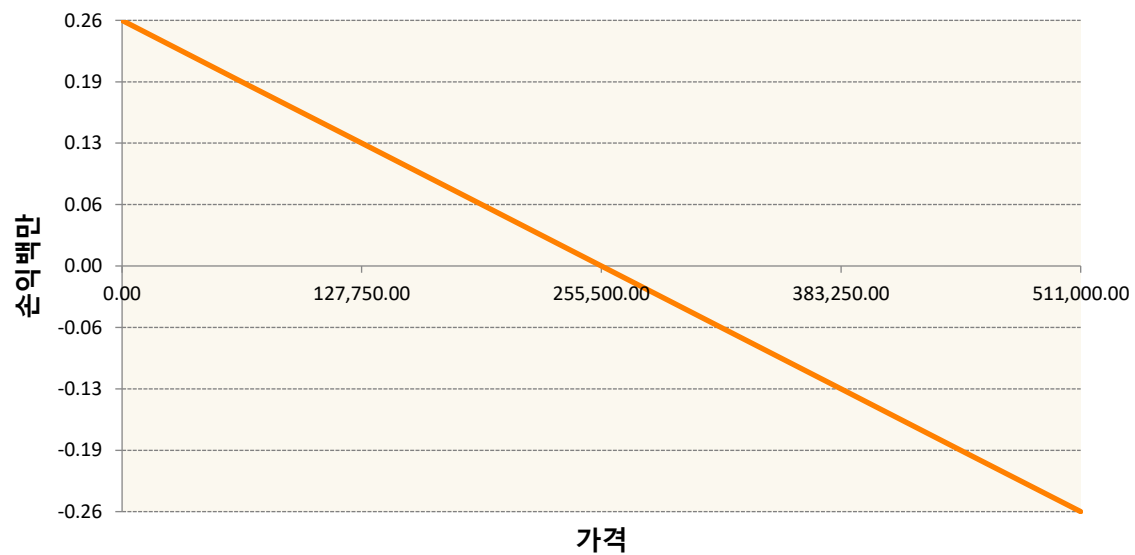
홀딩스개별선물



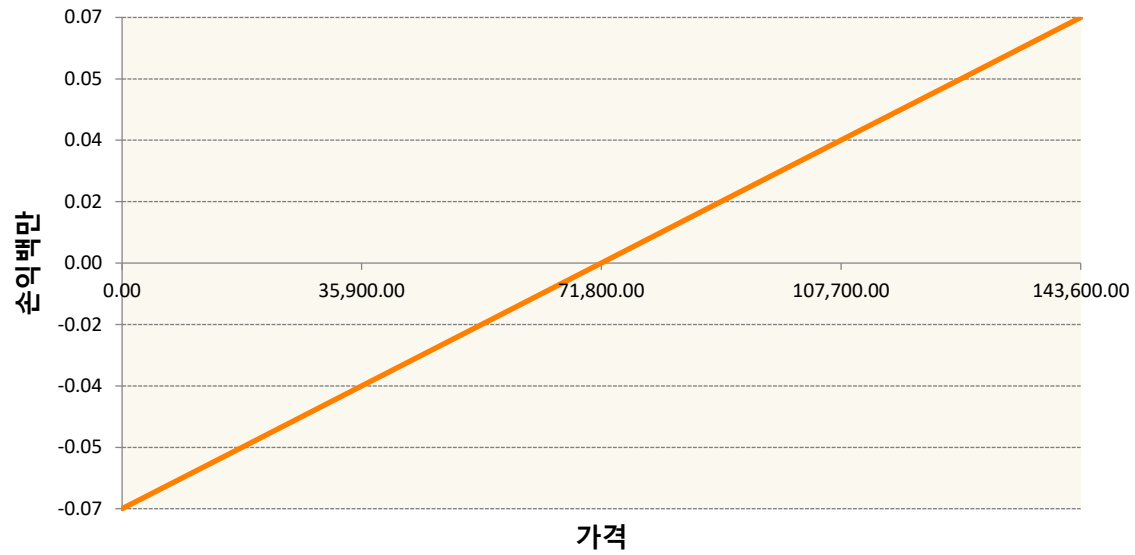
하이닉스개별선물



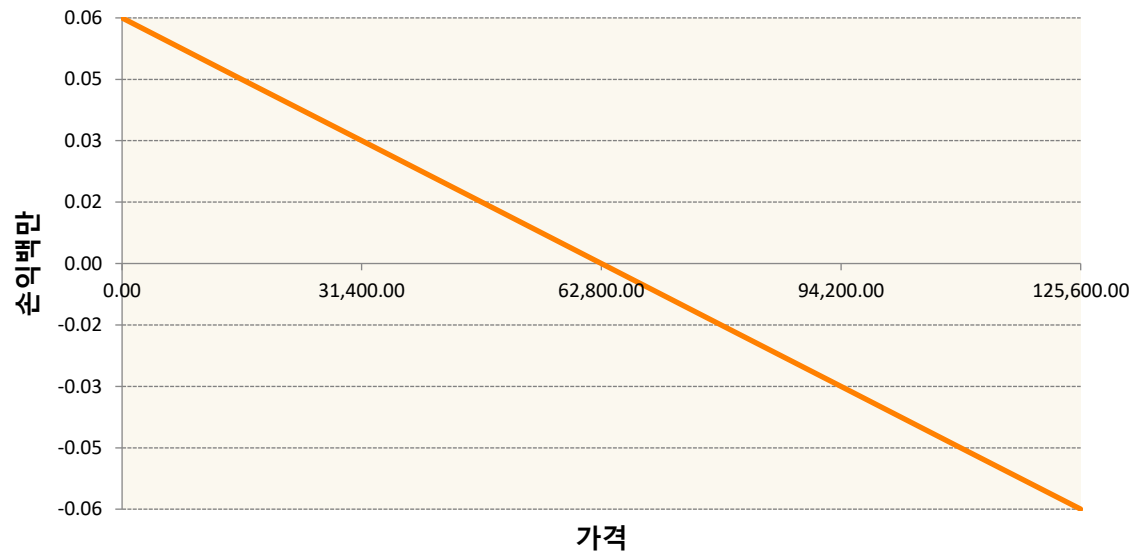
개별선물



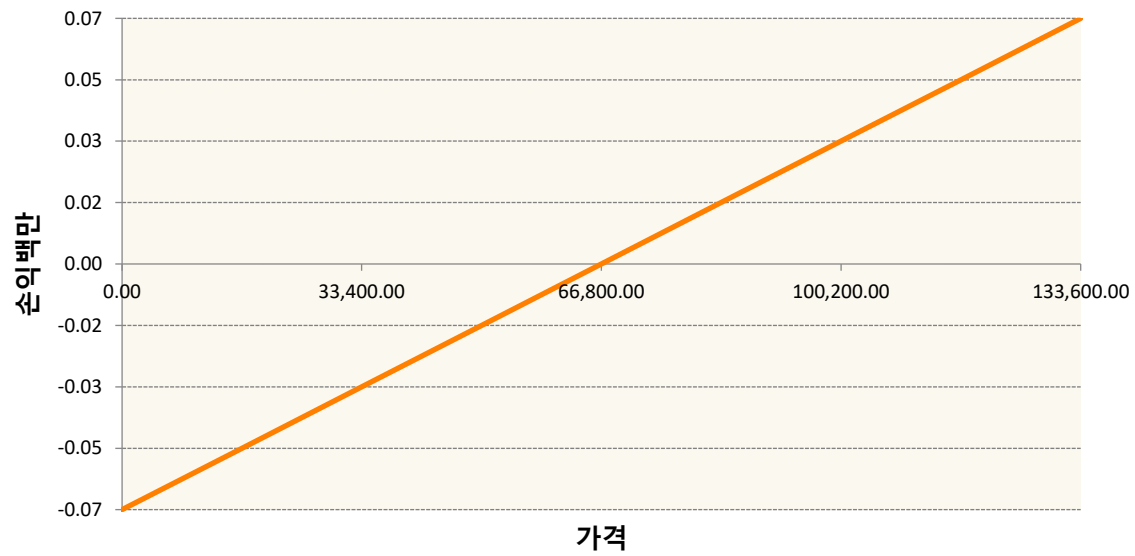
포스코인터내셔널개별선물



카카오개별선물



카카오페이개별선물



(단위:백만원)

KR4A01630008							2026-03 코스피200지수선물		243	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243			
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162			
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	81	81	81	81	81	81	81			
5.33%	162	162	162	162	162	162	162			
8.00%	243	243	243	243	243	243	243			
KR4A11630006							2026-03 삼성전자개별선물		326	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-326	-326	-326	-326	-326	-326	-326			
-5.33%	-218	-218	-218	-218	-218	-218	-218			
-2.67%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	109	109	109	109	109	109	109			
5.33%	218	218	218	218	218	218	218			
8.00%	326	326	326	326	326	326	326			
KR4A13630004							2026-03 POSCO홀딩스개별선물		64	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	64	64	64	64	64	64	64			
-5.33%	43	43	43	43	43	43	43			
-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%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43			
8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64			
KR4A50630008							2026-03 SK하이닉스개별선물		92	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92			
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61			
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	31	31	31	31	31	31	31			
5.33%	61	61	61	61	61	61	61			
8.00%	92	92	92	92	92	92	92			
KR4A56630002							2026-03 NAVER개별선물		149	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	149	149	149	149	149	149	149
-5.33%	99	99	99	99	99	99	99
-2.67%	50	50	50	50	50	50	50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
KR4AB7630000 2026-03 포스코인터내셔널개별선물							59
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	40	40	40	40	40	40	40
8.00%	59	59	59	59	59	59	59
KR4ACF630008 2026-03 카카오개별선물							159
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	159	159	159	159	159	159	159
-5.33%	106	106	106	106	106	106	106
-2.67%	53	53	53	53	53	53	53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
8.00%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
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)

1,624

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

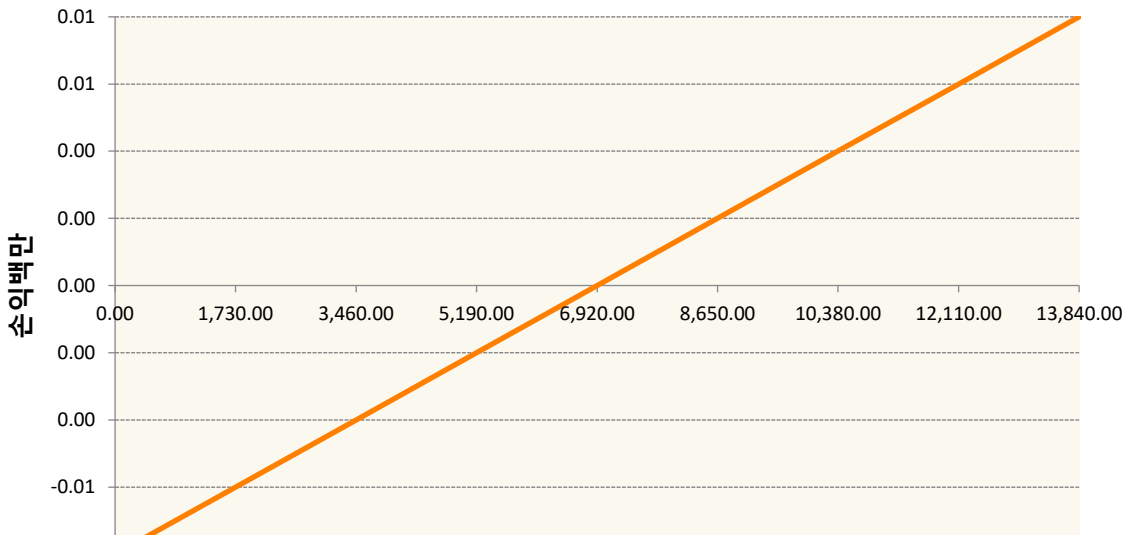
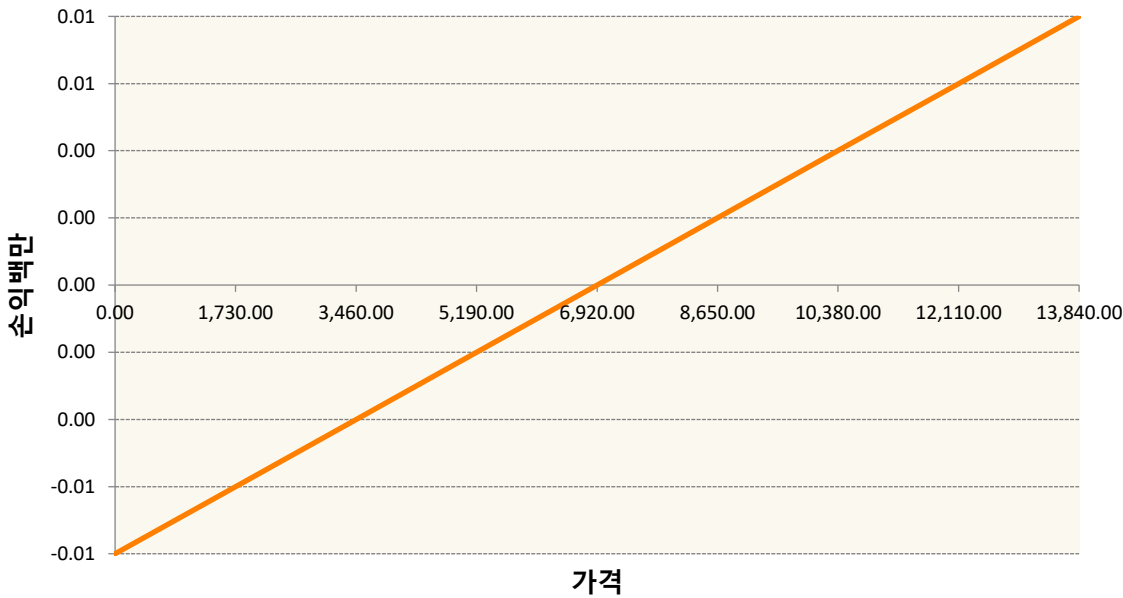
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

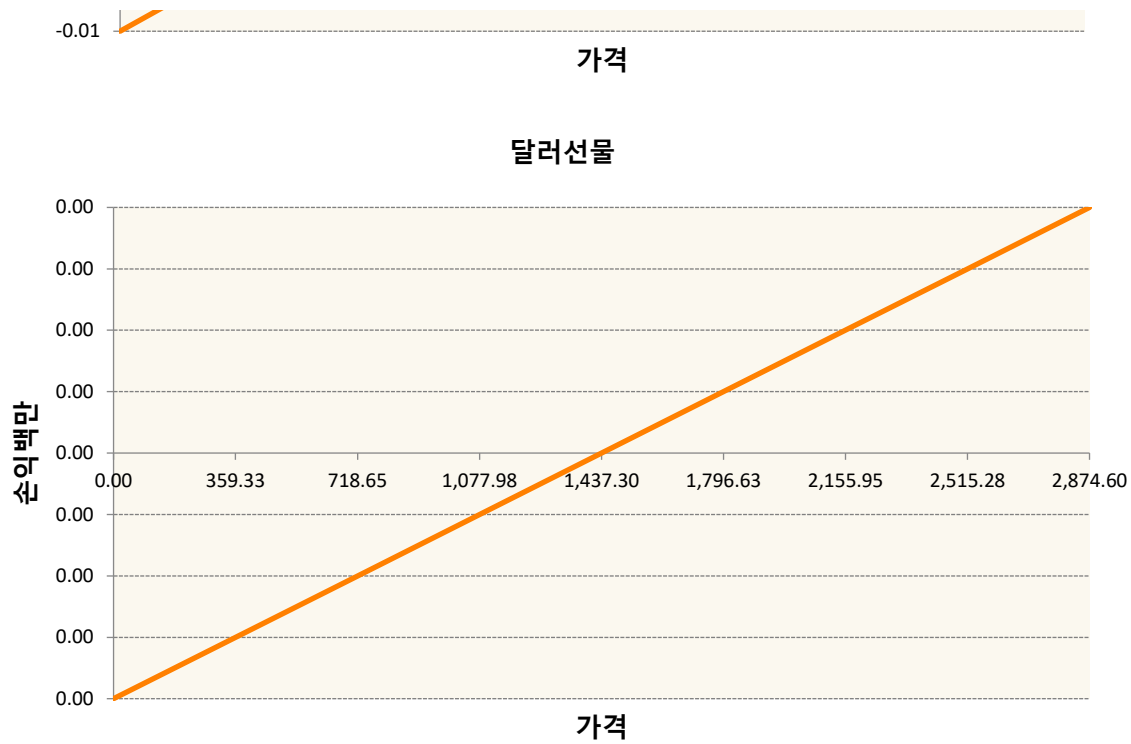
1. 계약금액

(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	614	0	614	장내
누계	지수	선물	53,549	0	53,549	
누계	통화	선물	11,930	0	11,930	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	4,284
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	49
KR4A756300	2026-03 달러선물	954

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

3,704

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

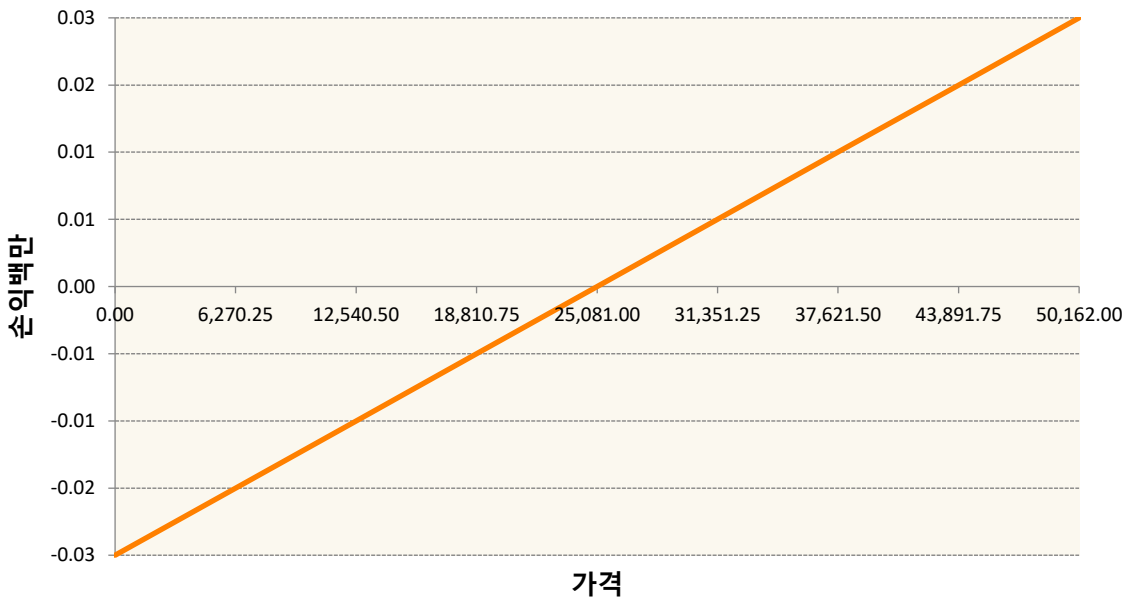
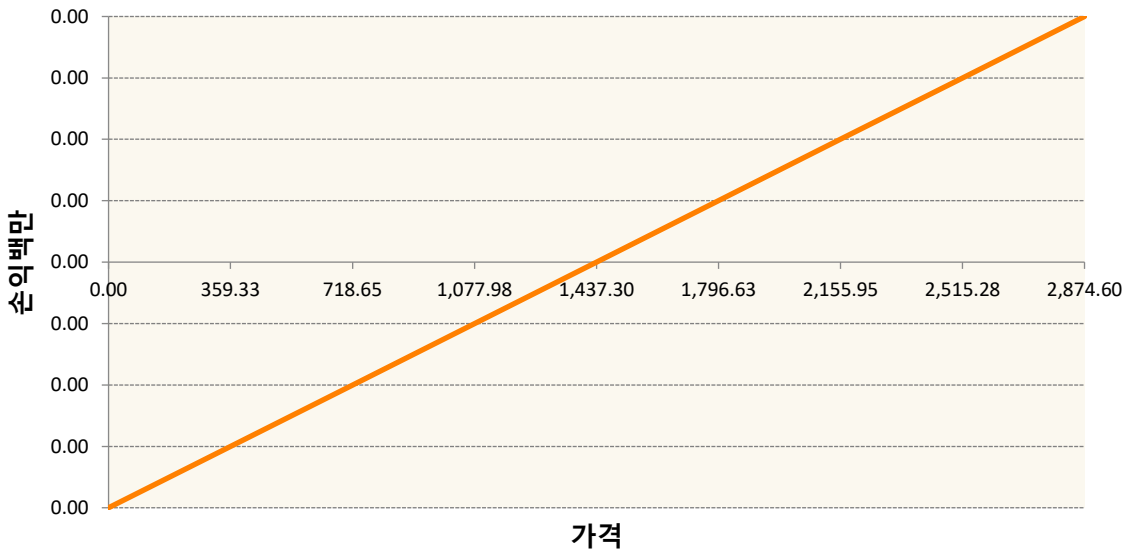
1. 계약금액

(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	22,949	0	22,949	장내
누계	통화	선물	4,815	0	4,815	장내

2. 만기시점의 손익구조

달러선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A756300 2026-03 달러선물		385
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,836

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,998

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

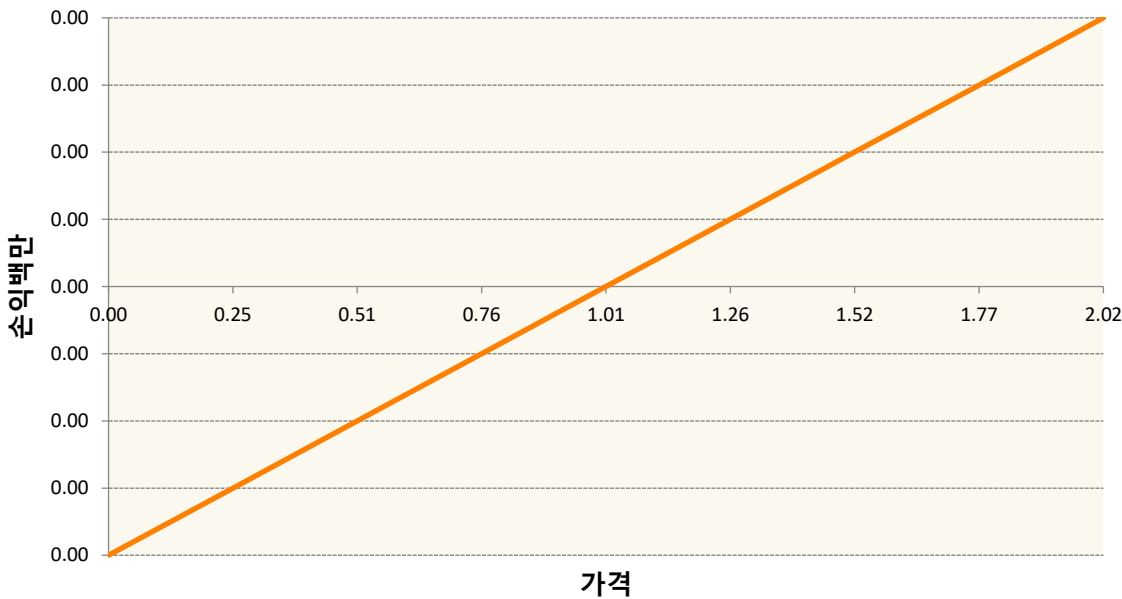
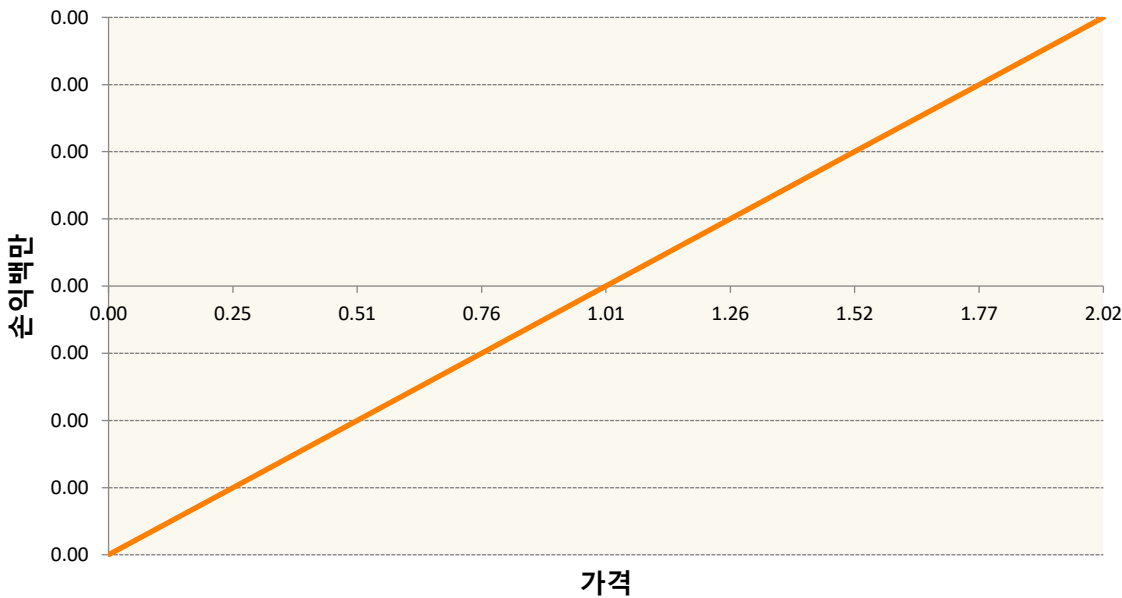
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

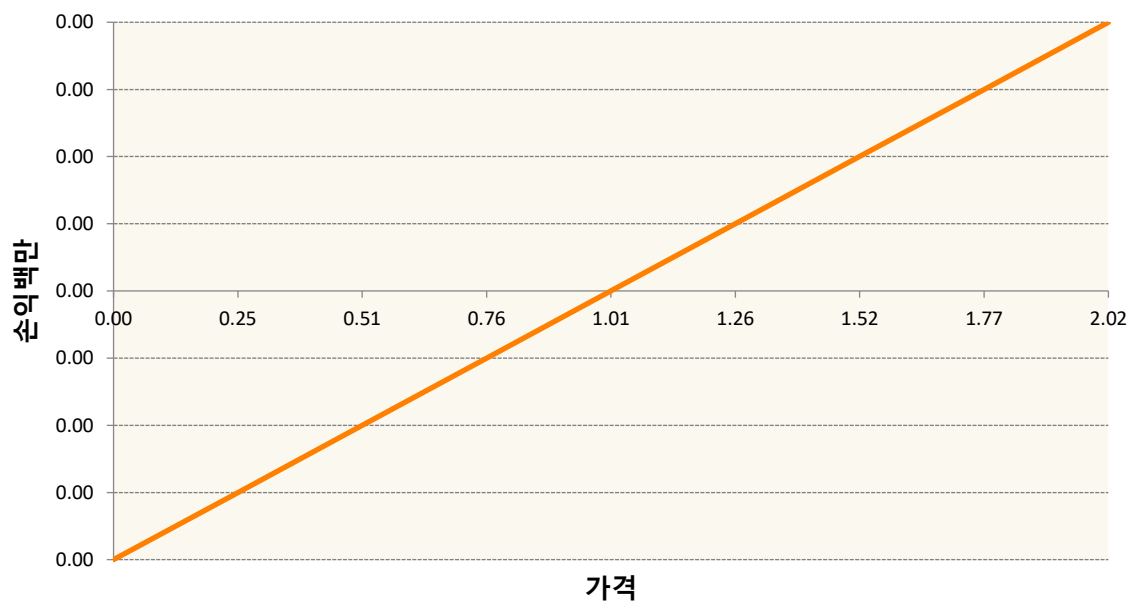
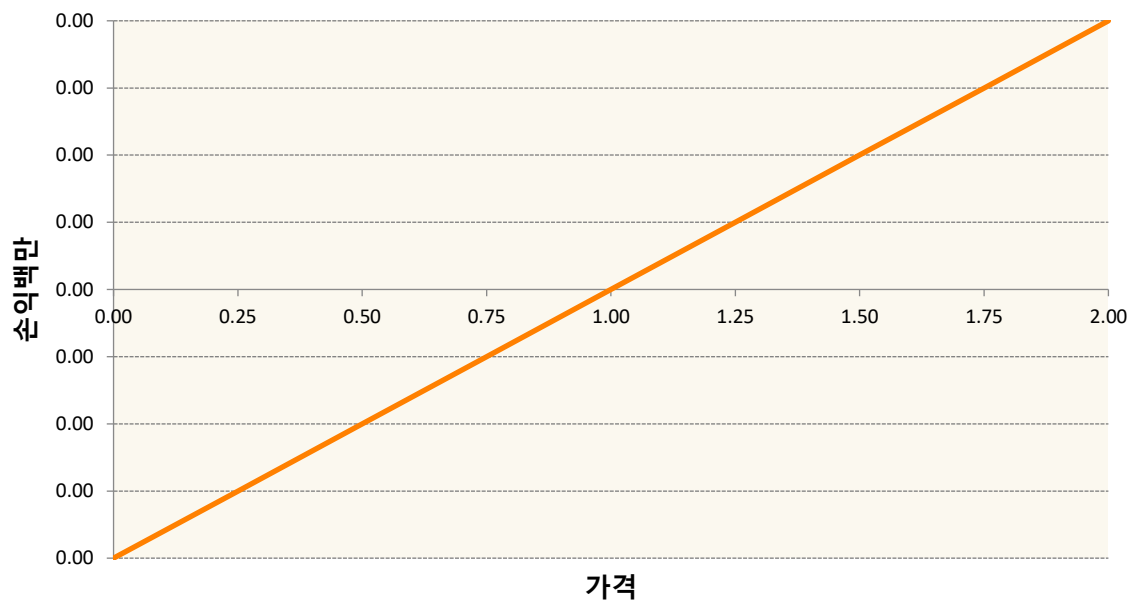
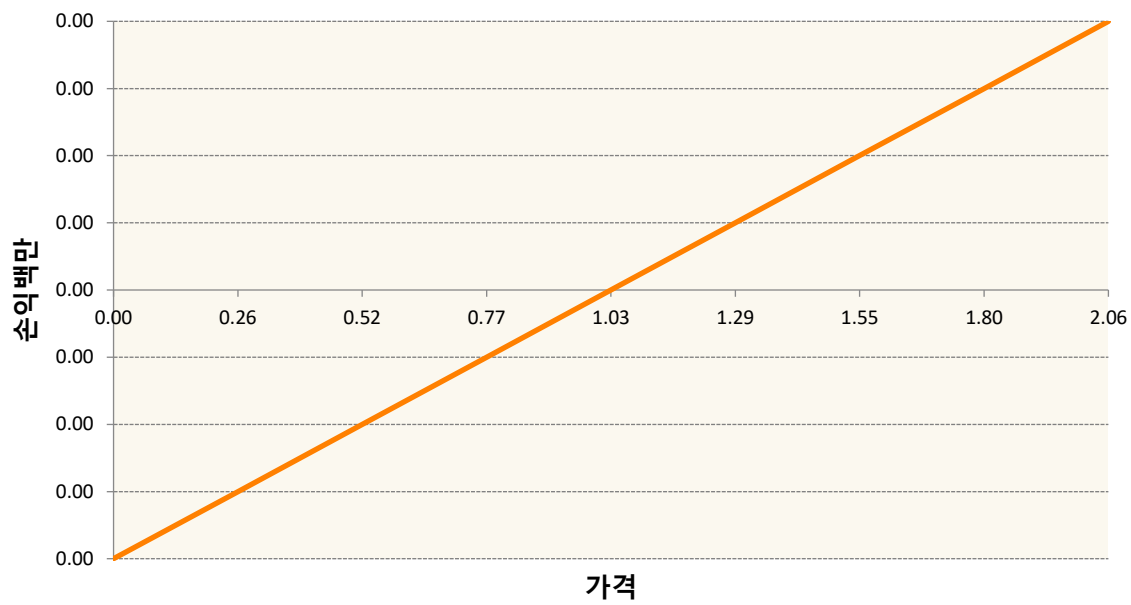
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	382,456	0	382,456	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,305
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,720
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		151
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,996
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,450

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,838

공시일	2026-03-03
기준일	2026-02-27

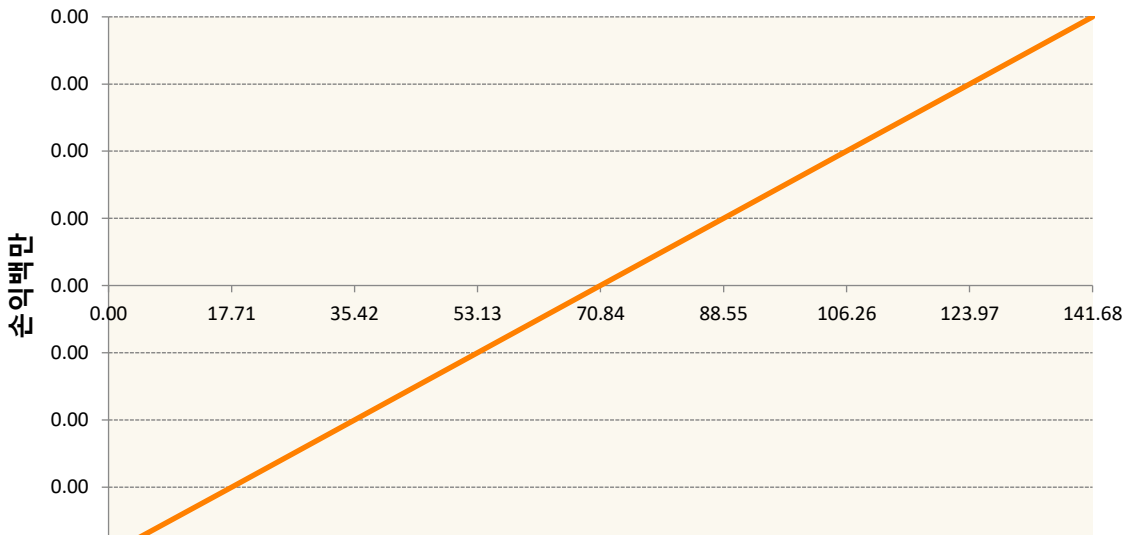
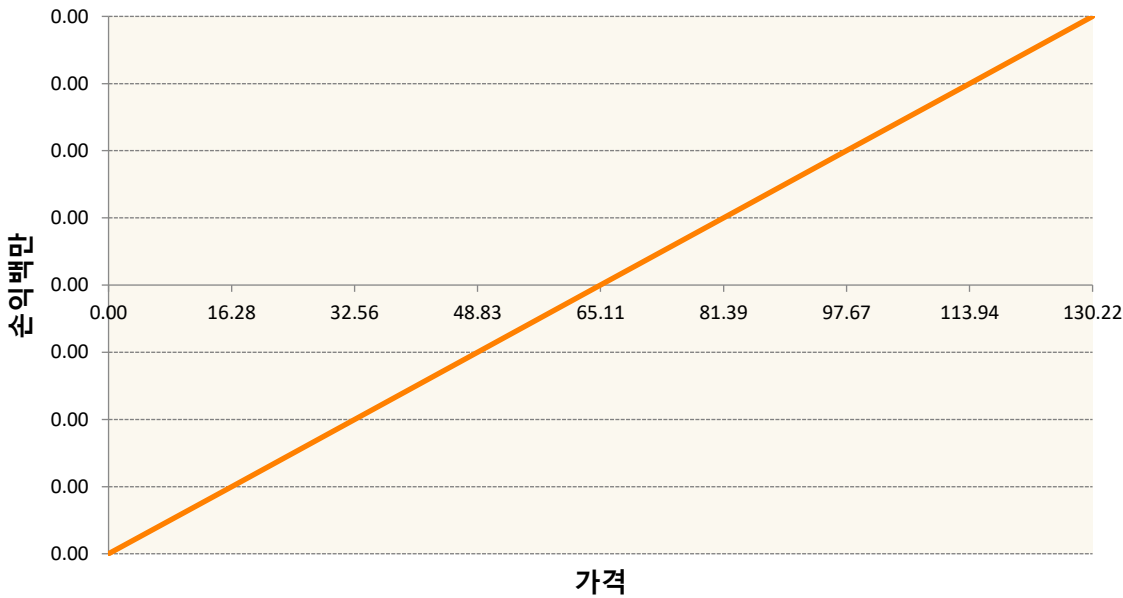
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

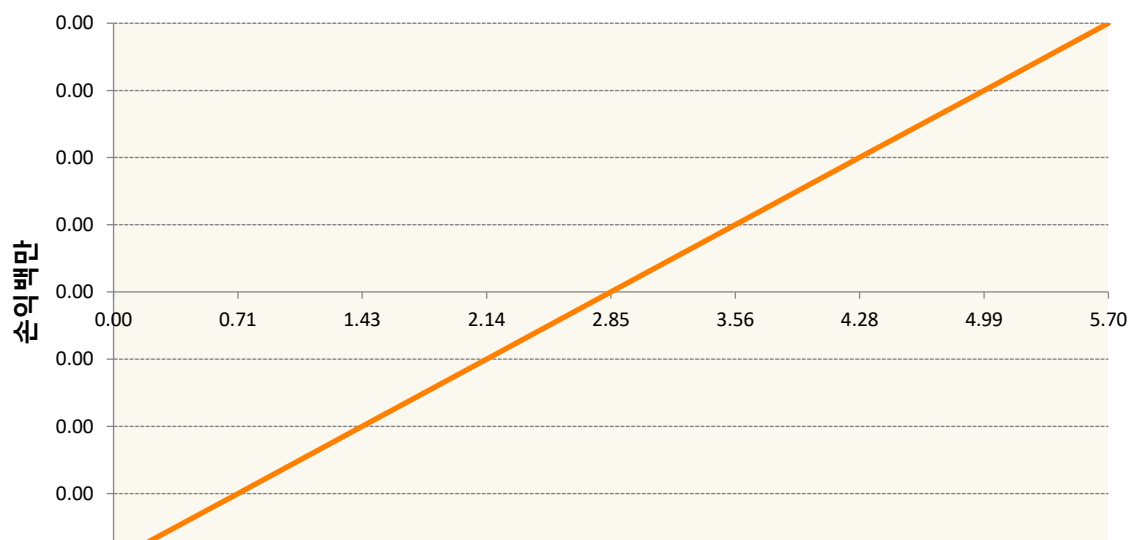
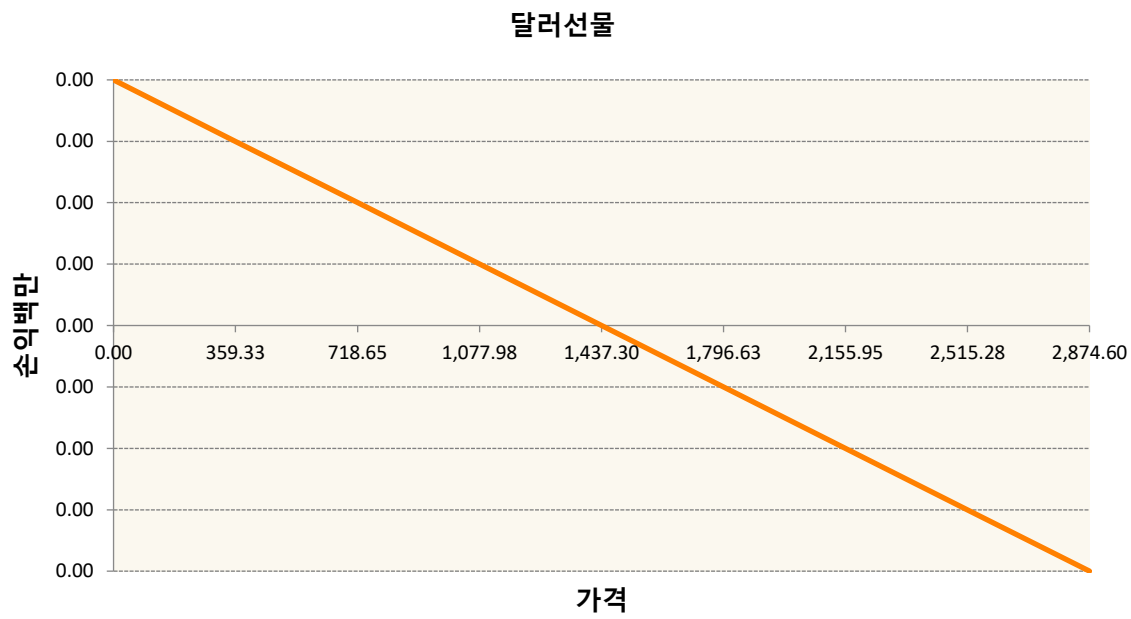
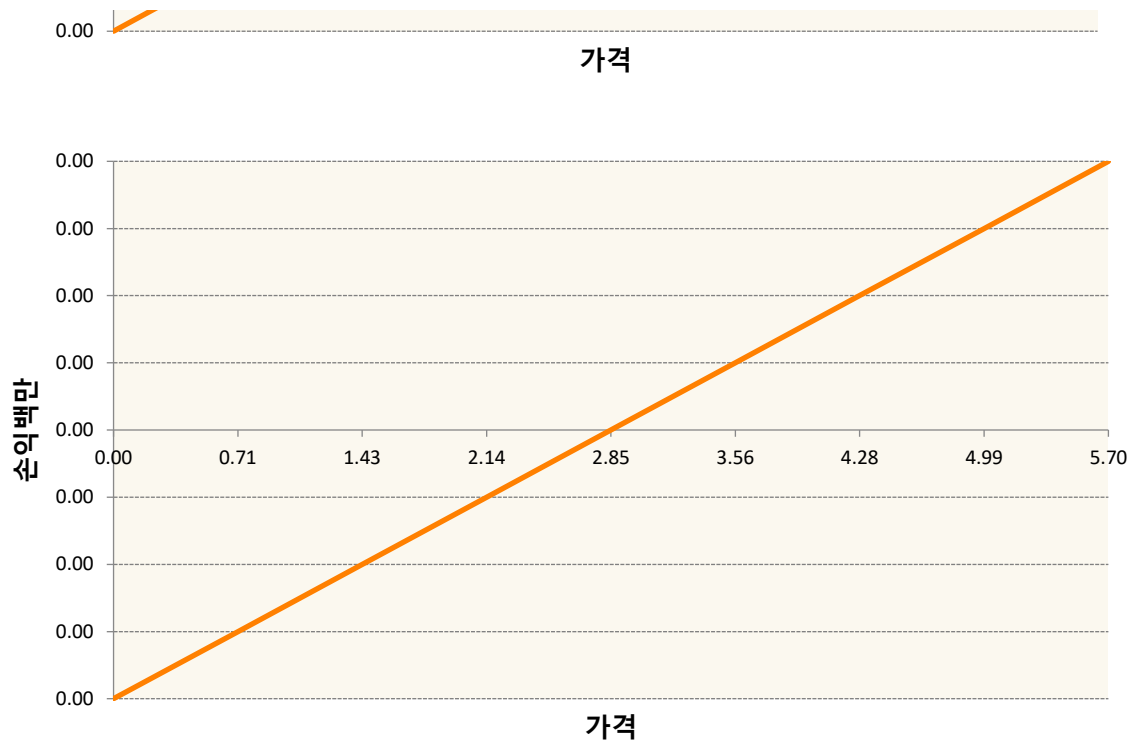
1. 계약금액

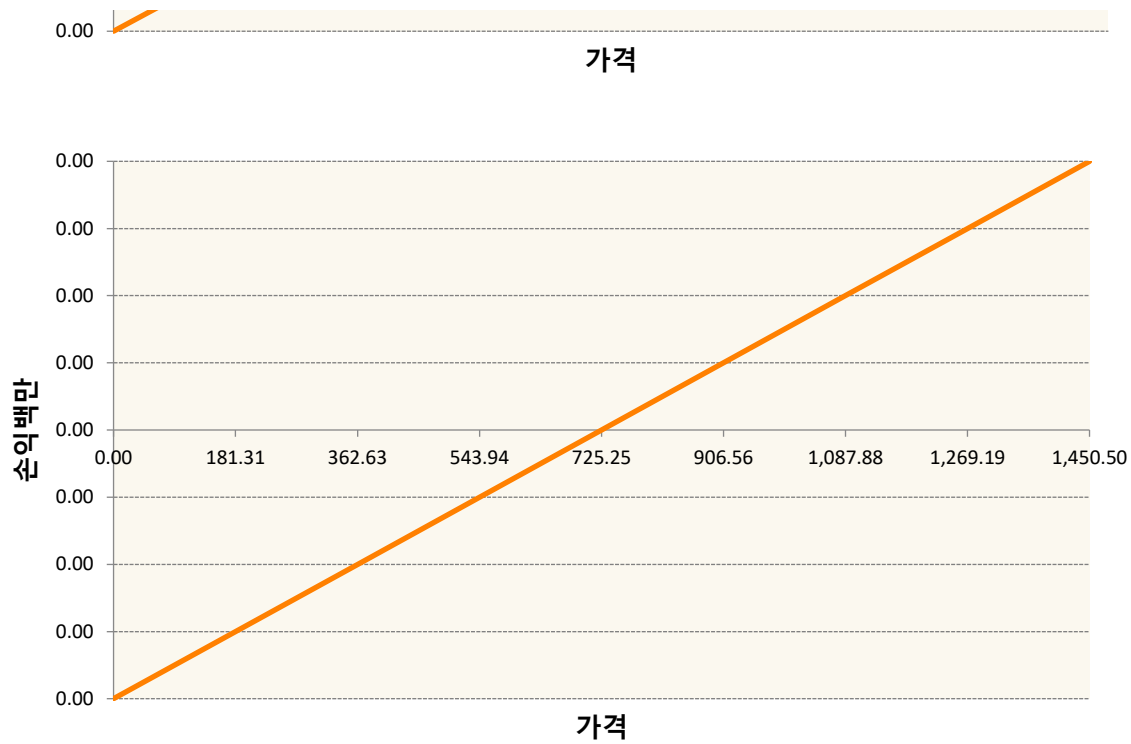
(단위:백만원)

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	188	0	188	
누계	유가증권	선물	323	0	323	
누계	통화	선물	0	115	-115	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)

95