

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

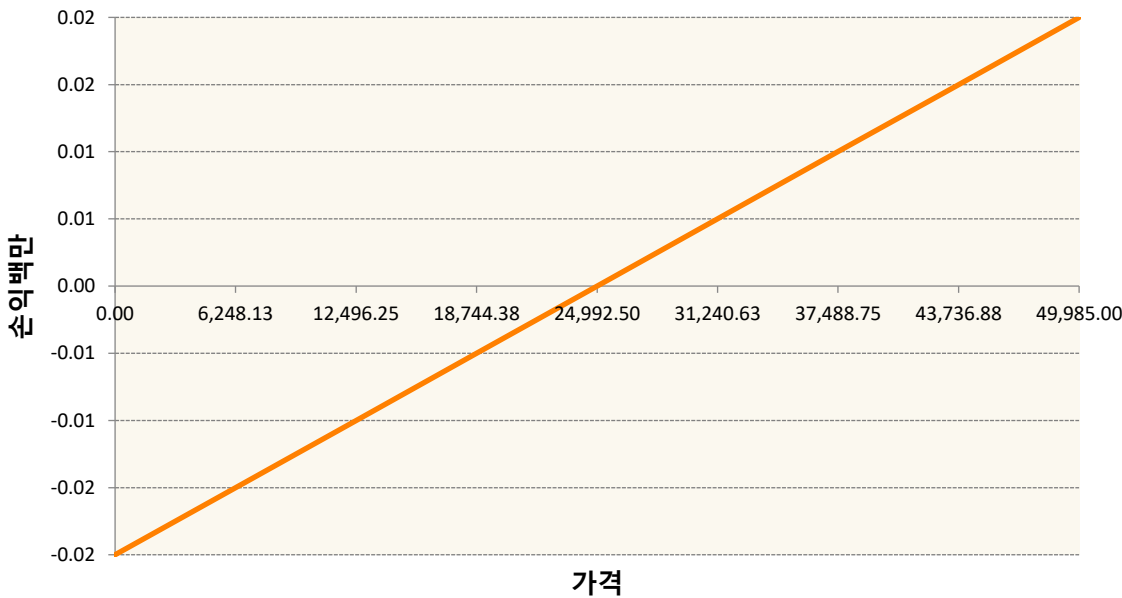
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	647	0	647	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH6 IFSC NIFTY 50 FUT Mar26

52

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

(단위:백만원)

33

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

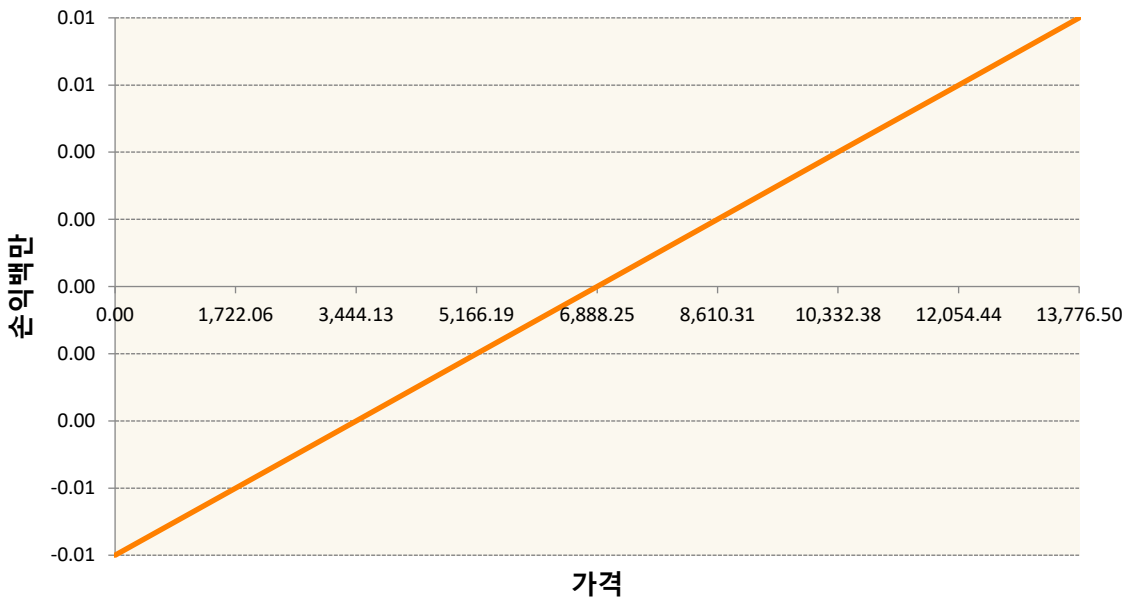
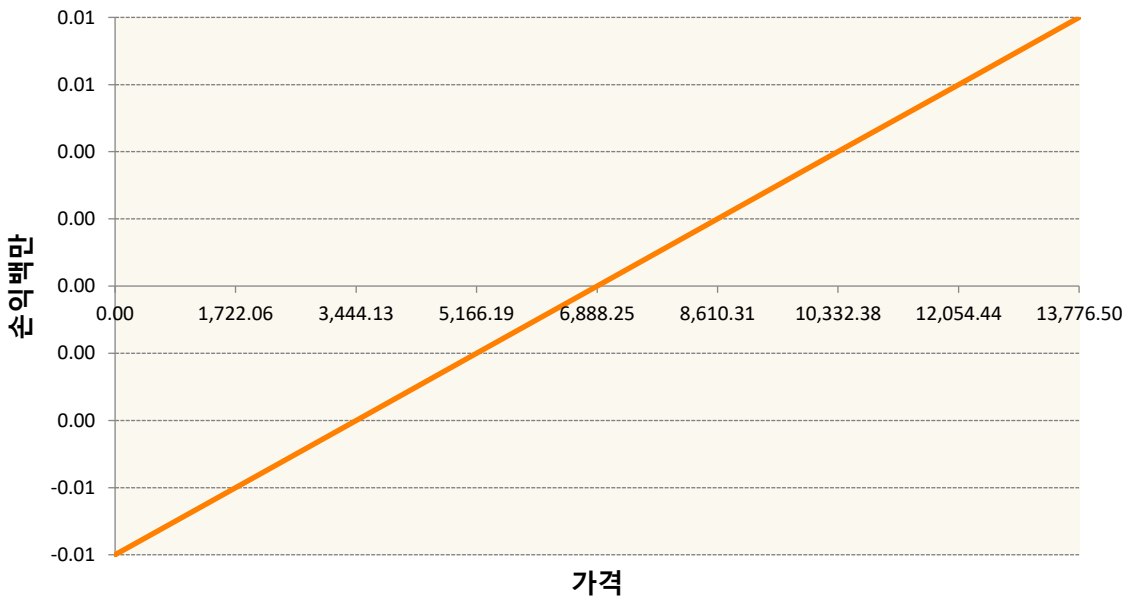
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	509	0	509	

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	2026-03-04
기준일	2026-03-03

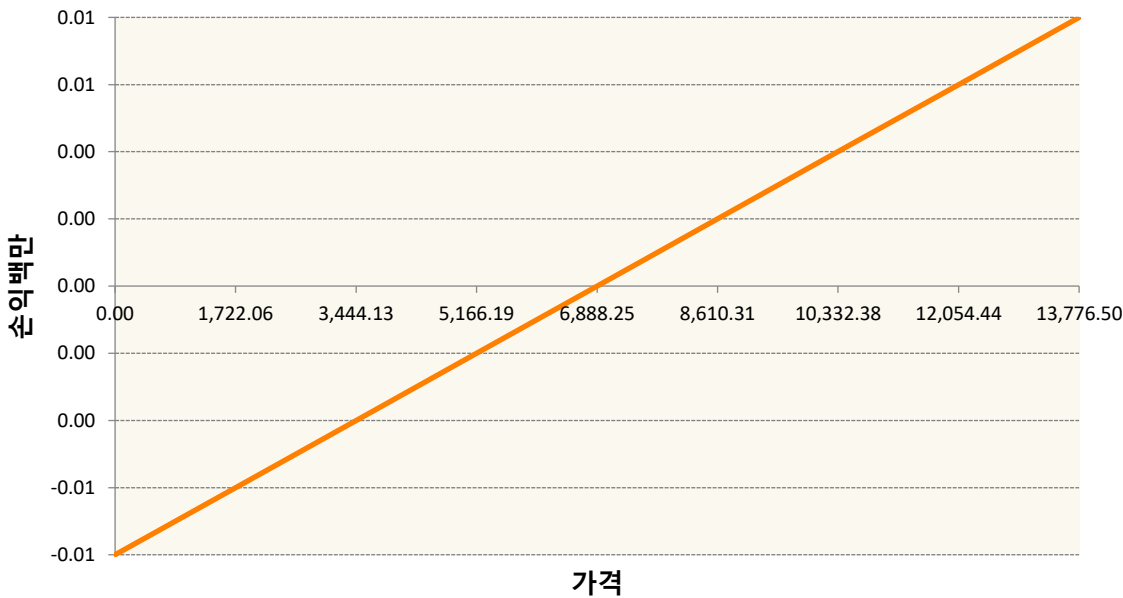
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,527	0	1,527	

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)

104

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

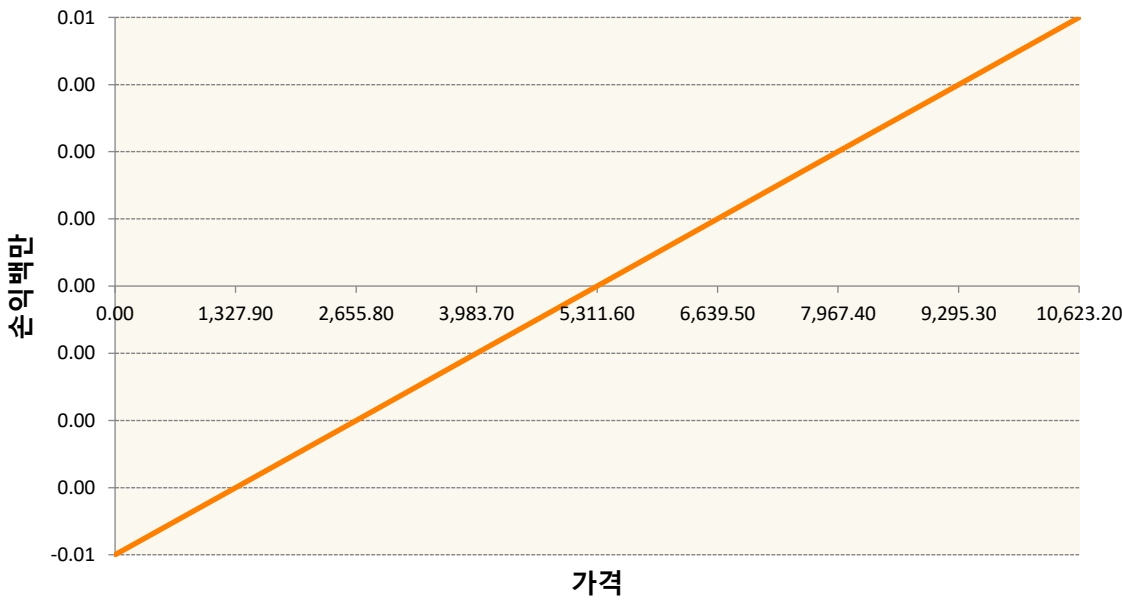
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,316	0	5,316	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 03/06/26 C495 EQUITY	7
G CJ6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	425

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

(단위:백만원)

500

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

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)

AOPLTRAAC PLTR US 03/06/26 C147 EQUITY	166
AOPLTRAAP PLTR US 03/06/26 P147 EQUITY	27

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

(단위:백만원)

690

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

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)

AOTLTUSC91TLT US 03/06/26 C91 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

0

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

(단위:백만원)

1,056

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

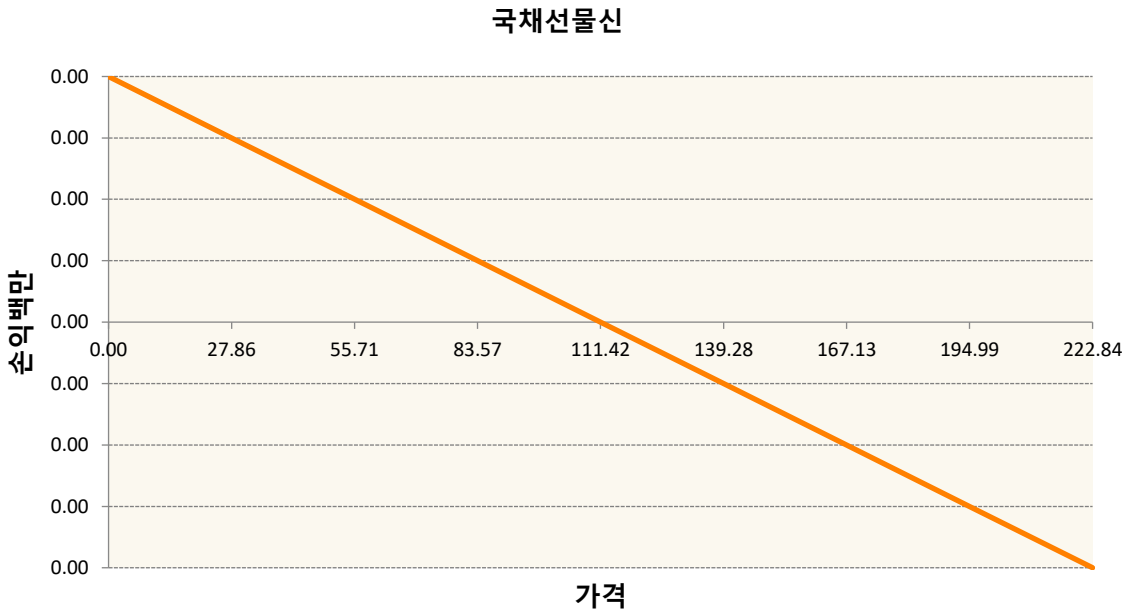
포커스채권(채권-파생형)(종)

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	13,370	-13,370	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A67630009			2026-03 국채선물10(신)				386
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386
-5.33%	-257	-257	-257	-257	-257	-257	-257
-2.67%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	129	129	129	129	129	129	129
5.33%	257	257	257	257	257	257	257
8.00%	386	386	386	386	386	386	386

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

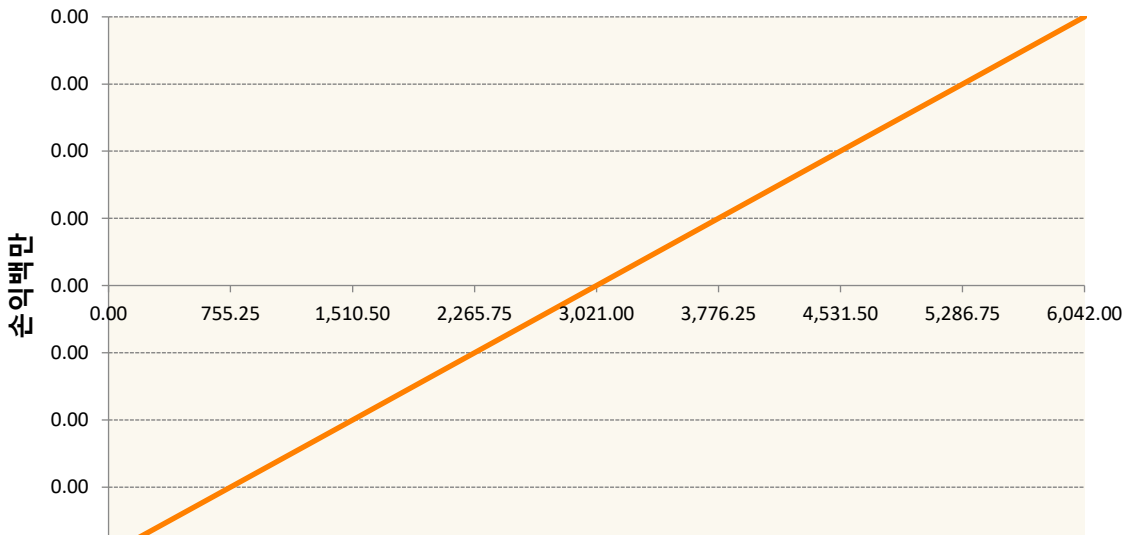
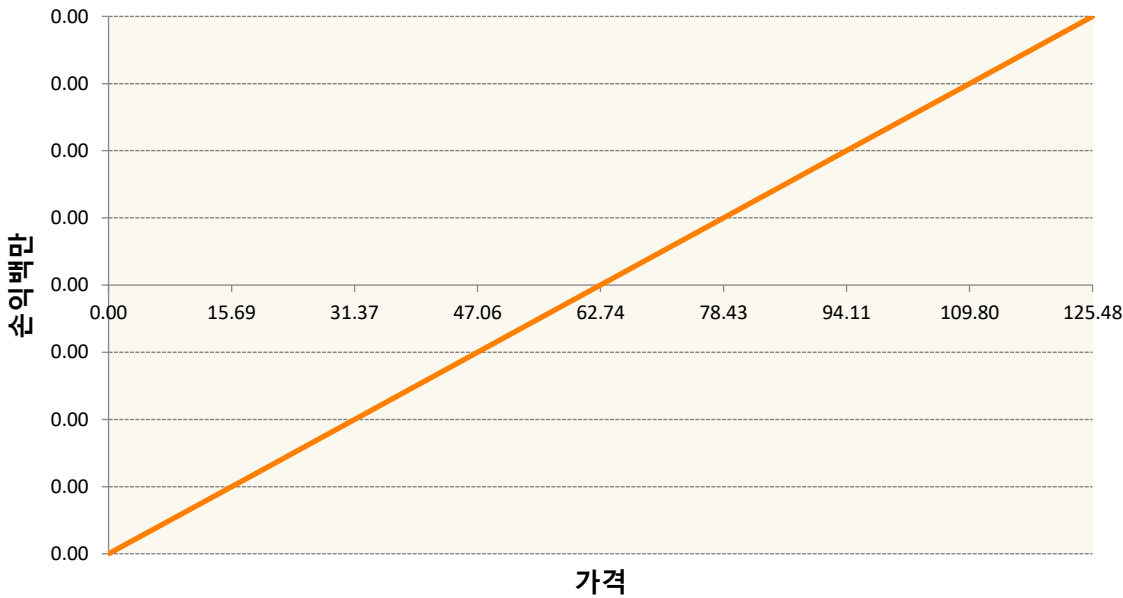
포커스농산물모(채권-파생형)

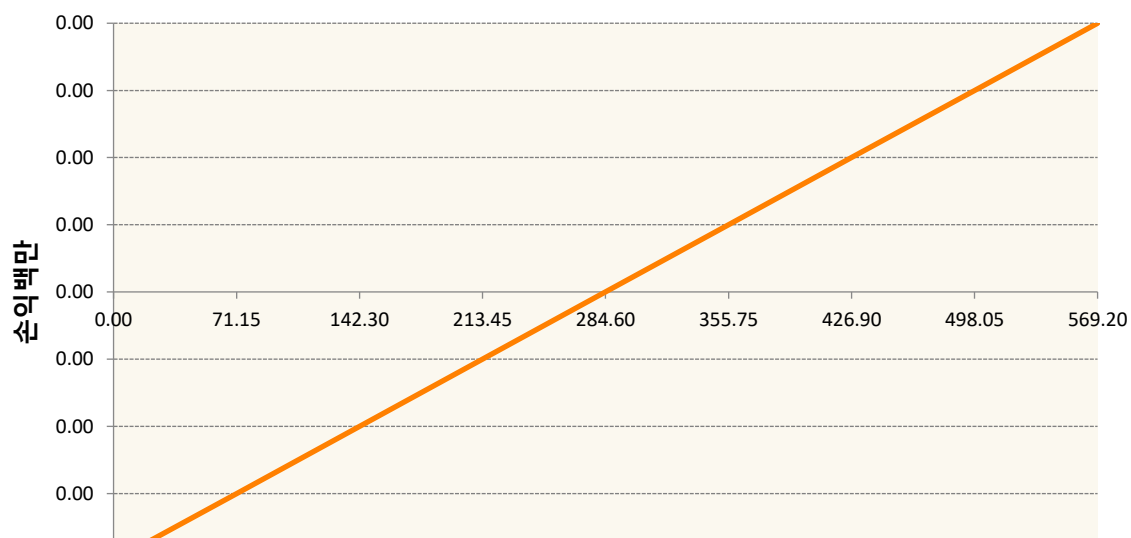
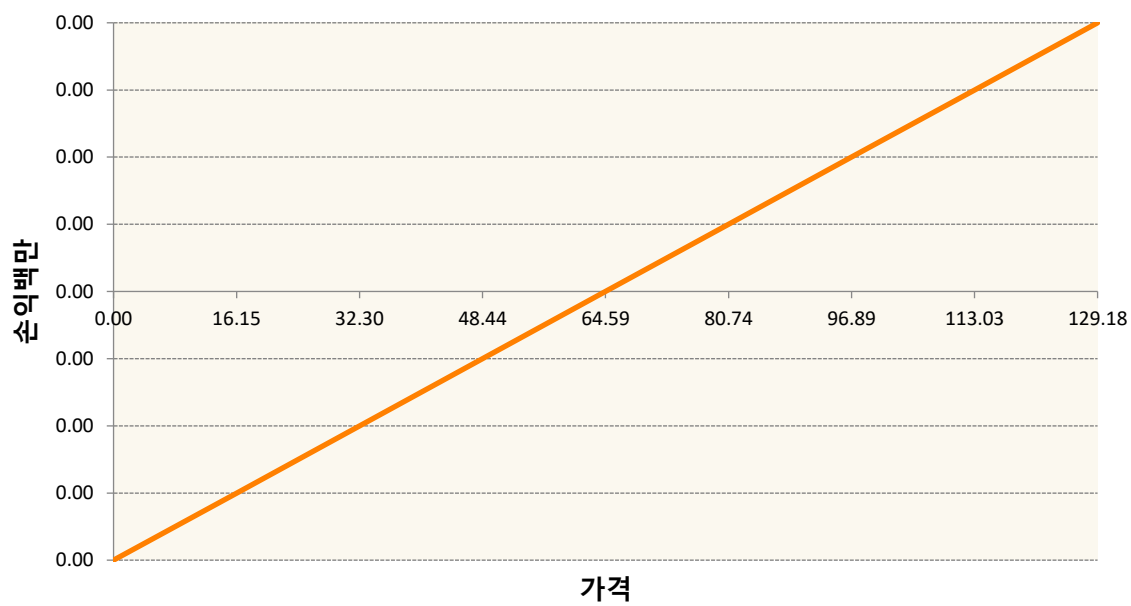
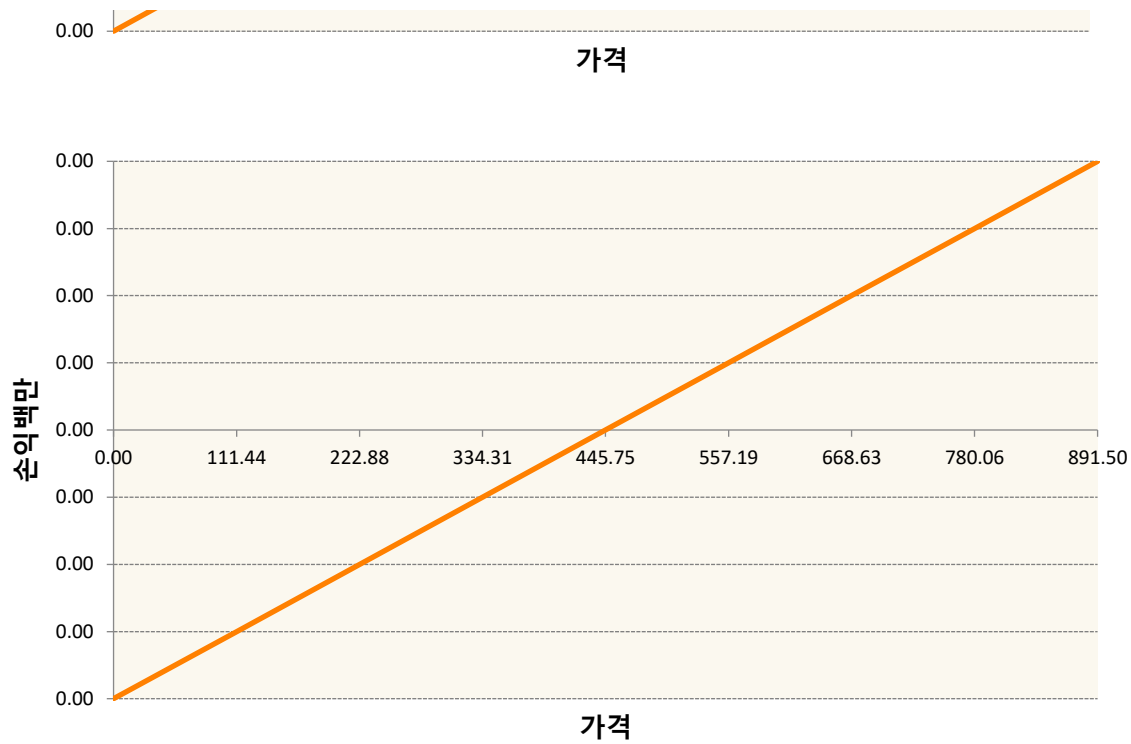
1. 계약금액

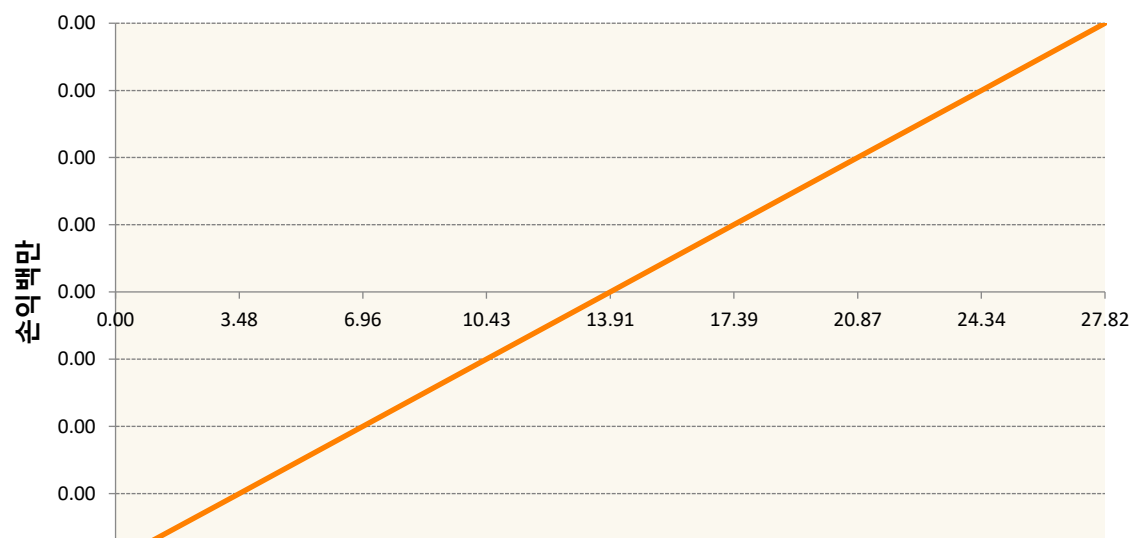
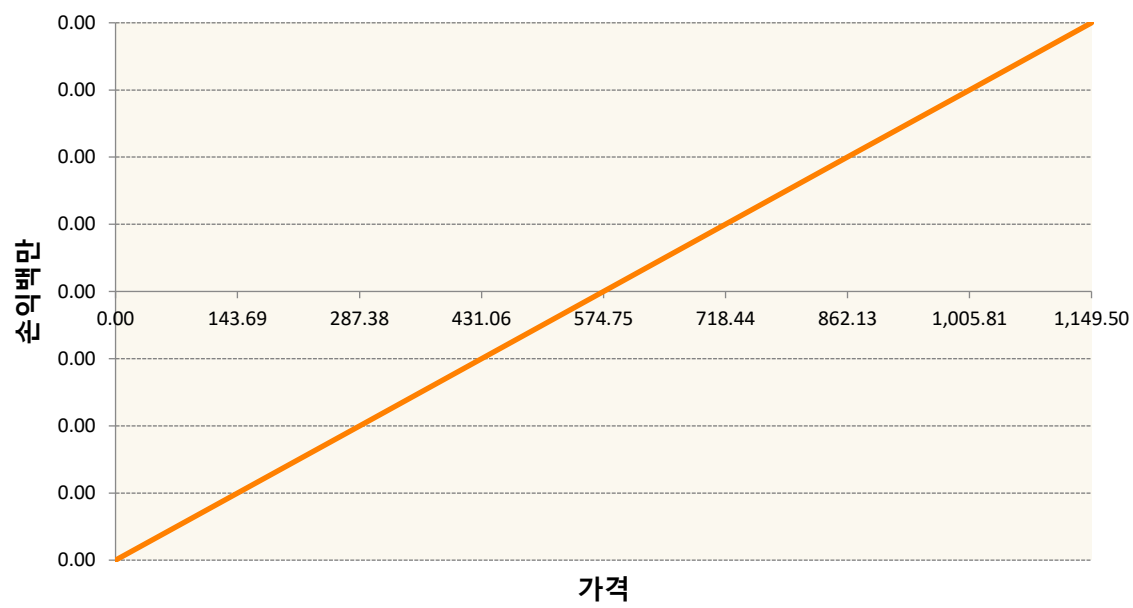
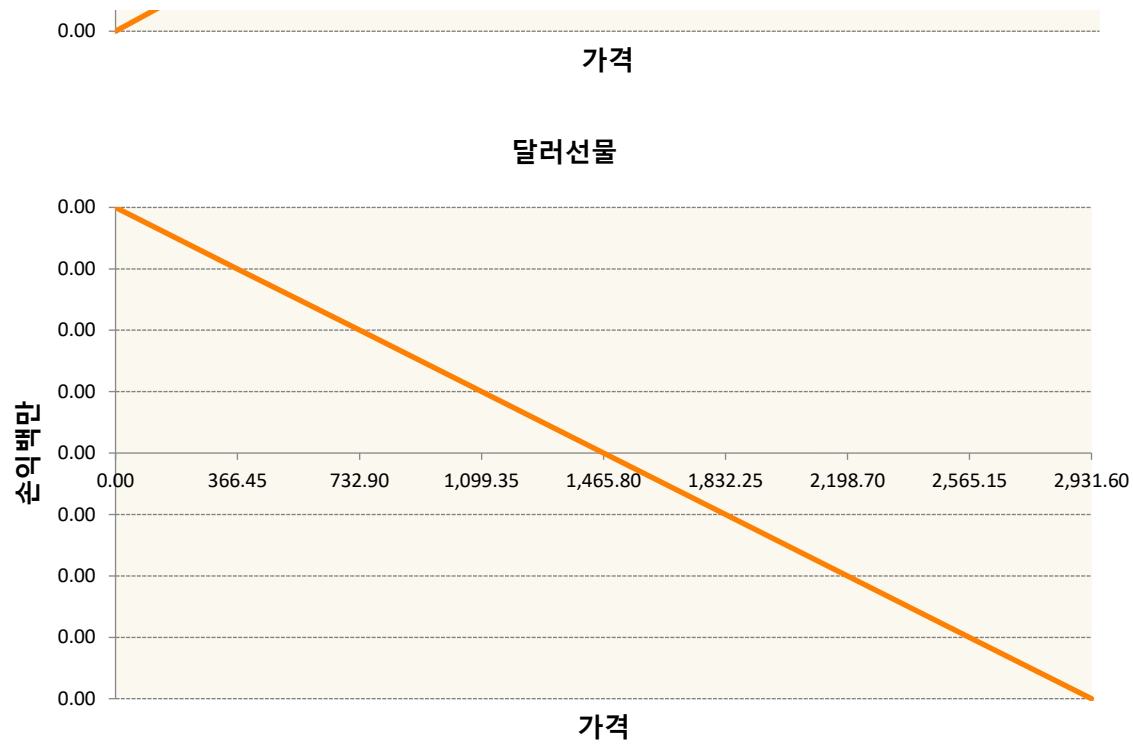
(단위:USD 백만)

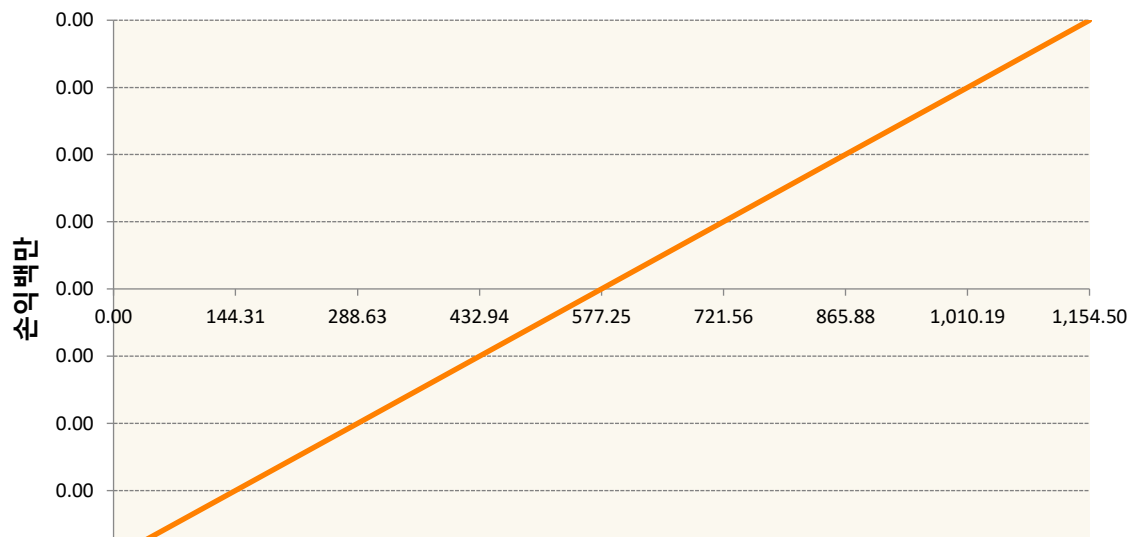
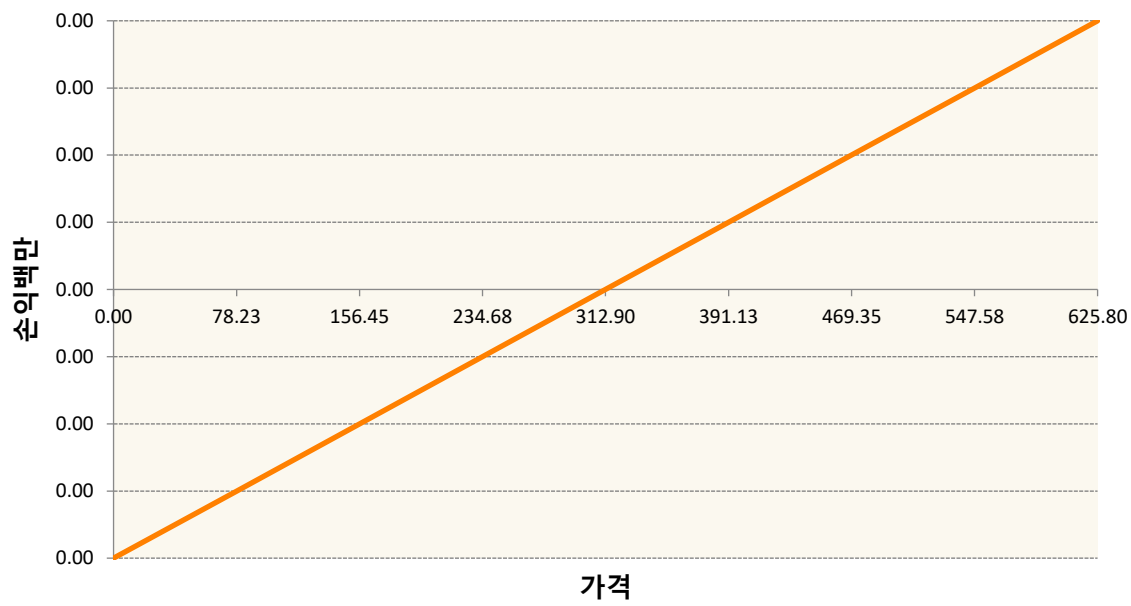
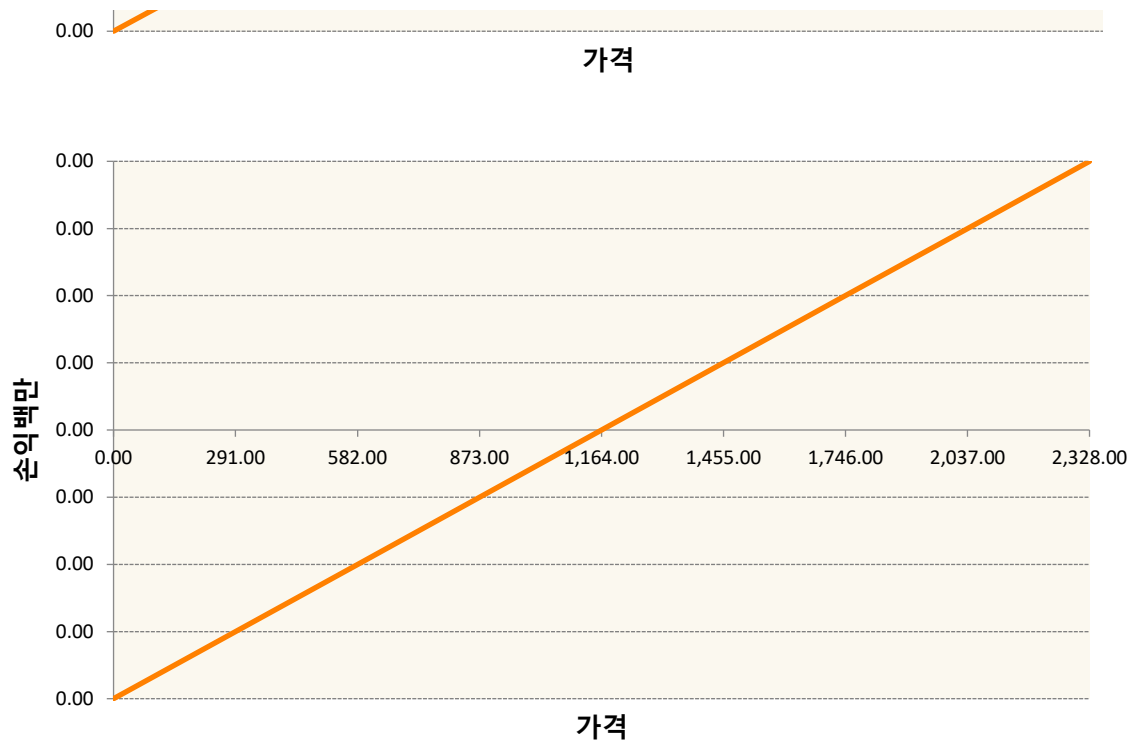
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,258	0	1,258	
누계	유가증권	선물	1,774	0	1,774	
누계	통화	선물	0	308	-308	장내

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	2026-03-04
기준일	2026-03-03

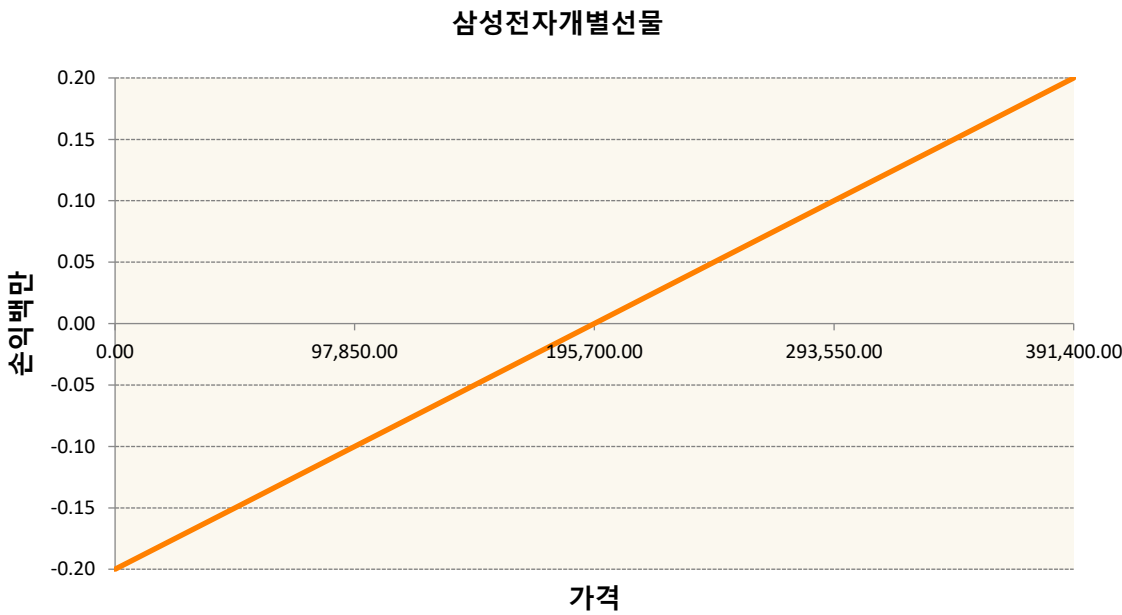
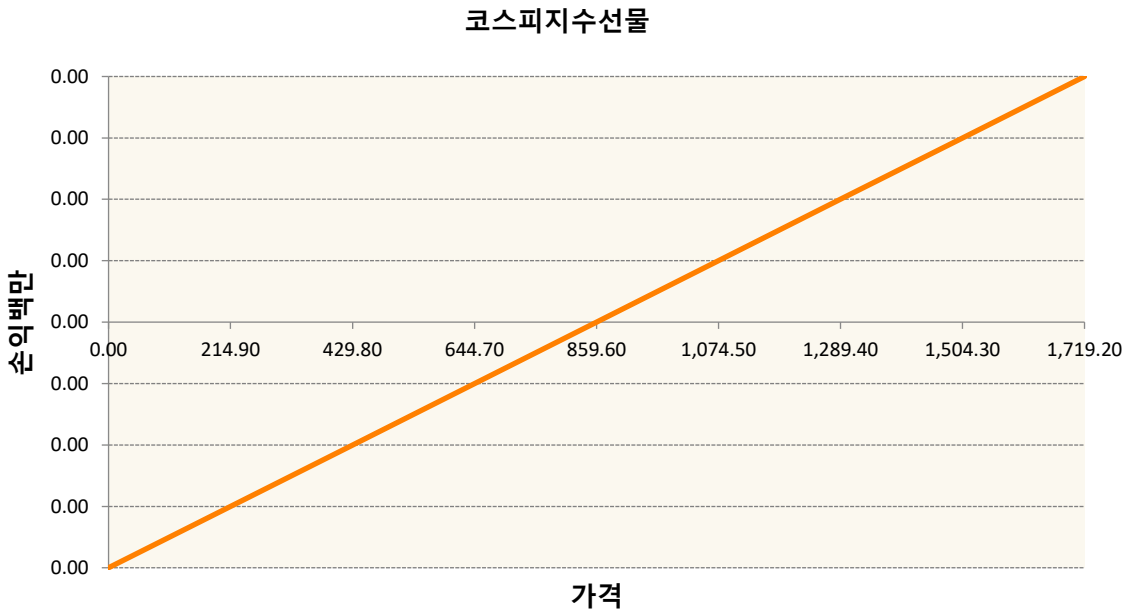
스마트인덱스모

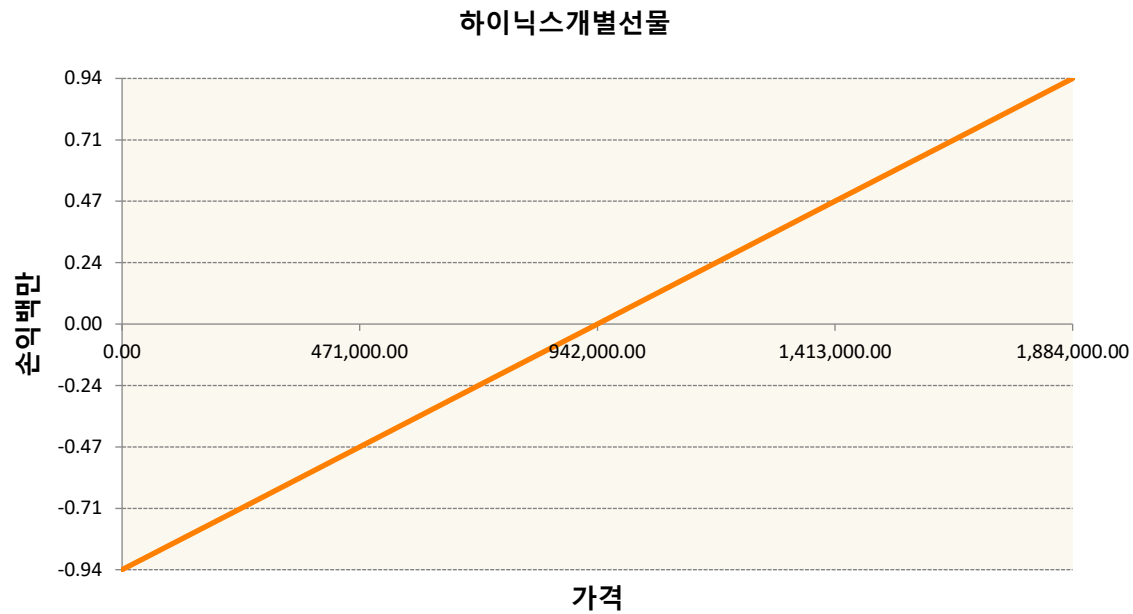
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,366	0	3,366	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		258
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		3
KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물		8

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

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

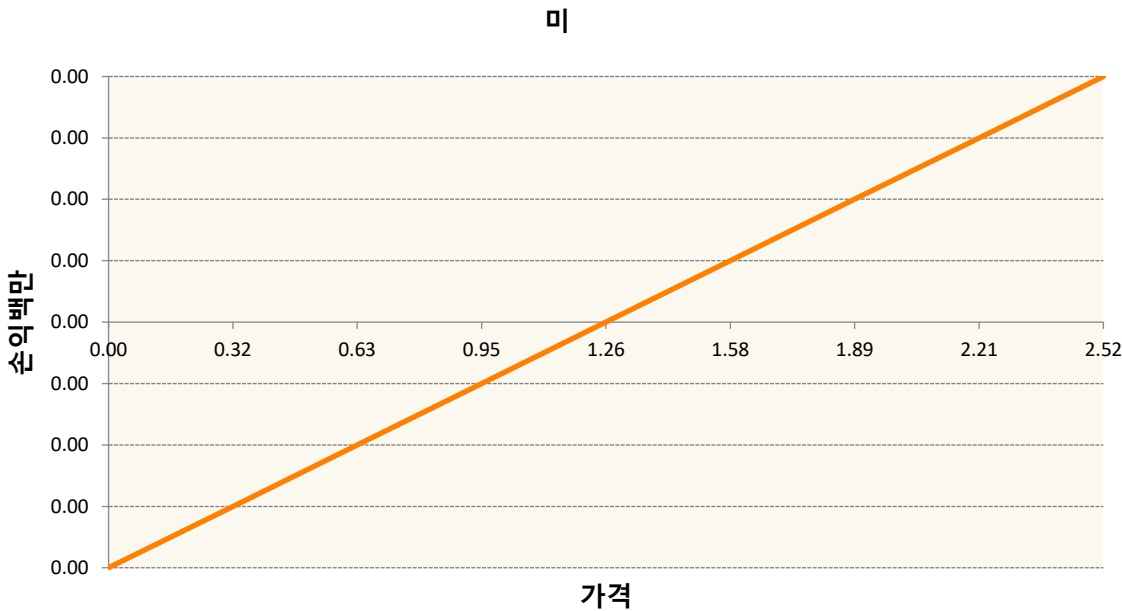
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,820	0	5,820	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

467

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

579

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

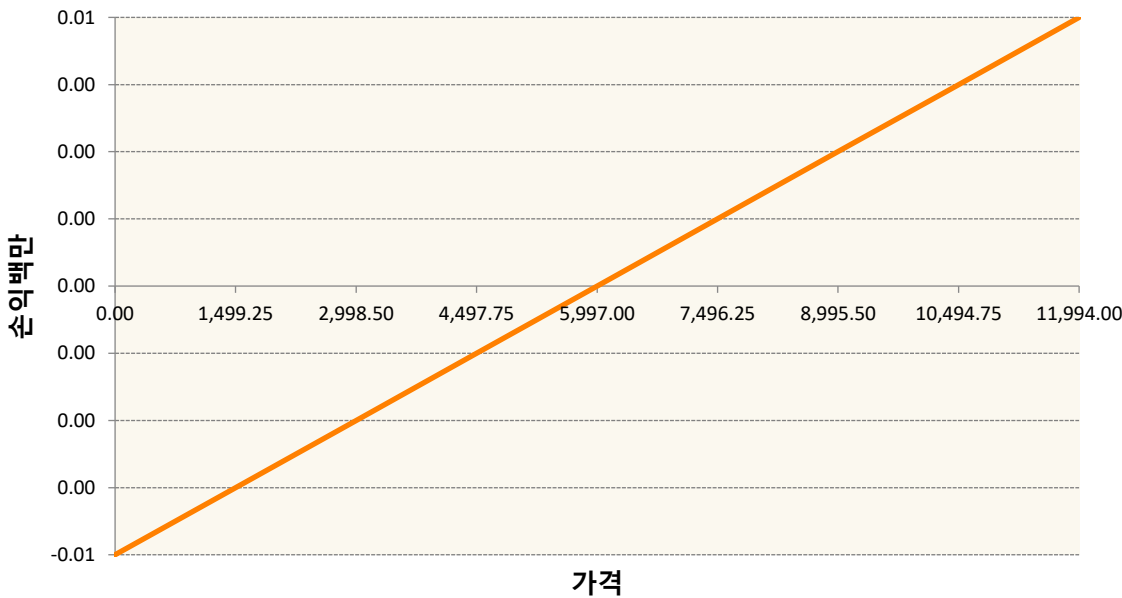
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	934	0	934	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6 EURO STOXX 50 Mar26

75

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

(단위:백만원)

60

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

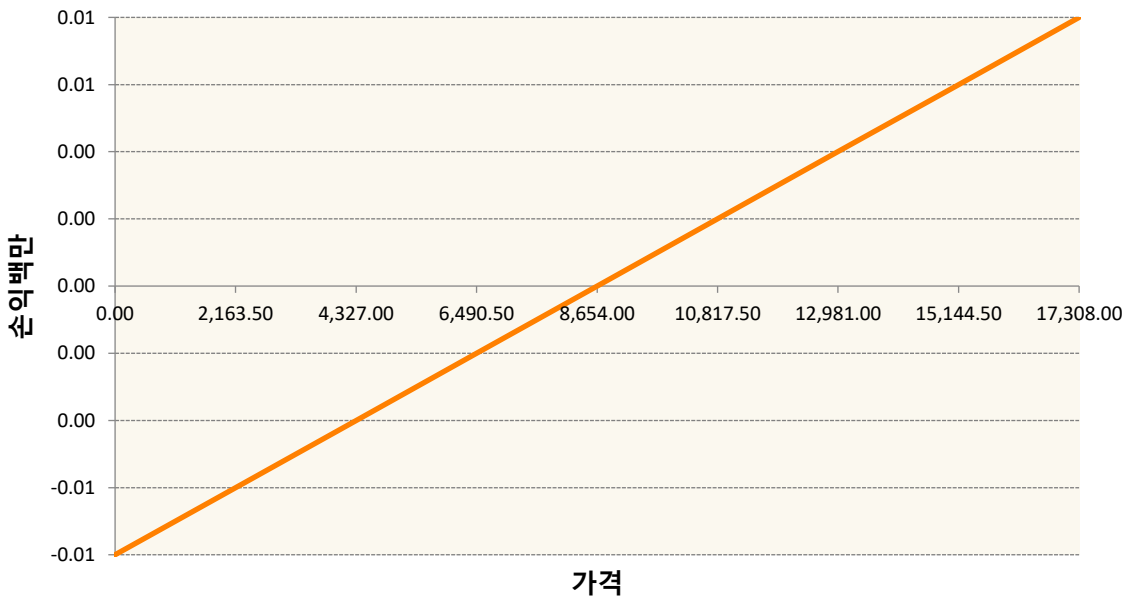
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,654	0	1,654	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH6	HSCEI Futures Mar26	132
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

152

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

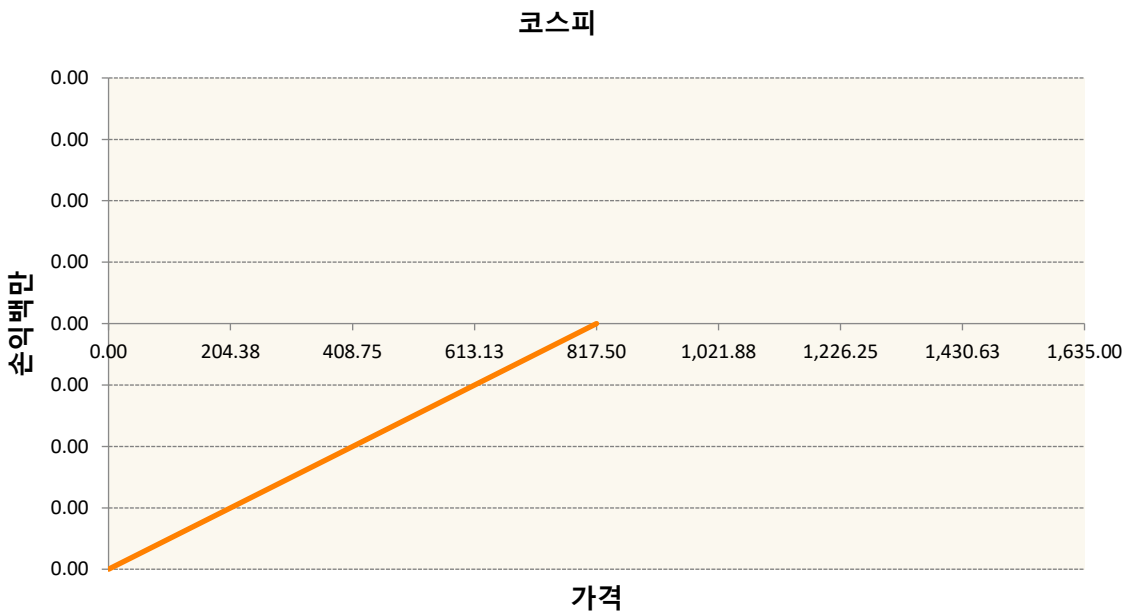
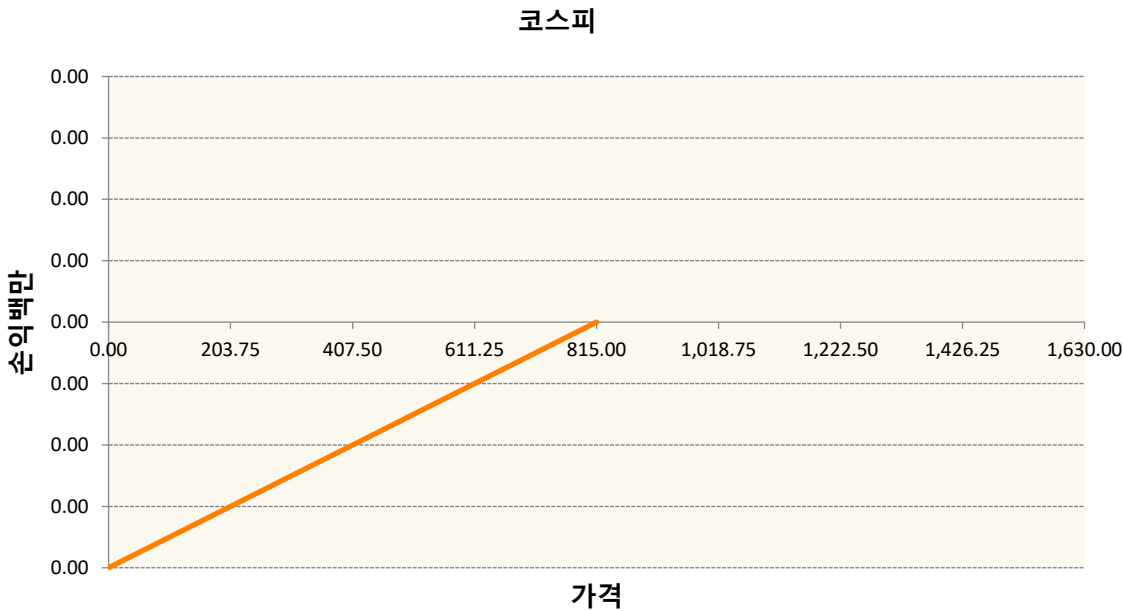
커버드콜모(주식혼합-파생형)

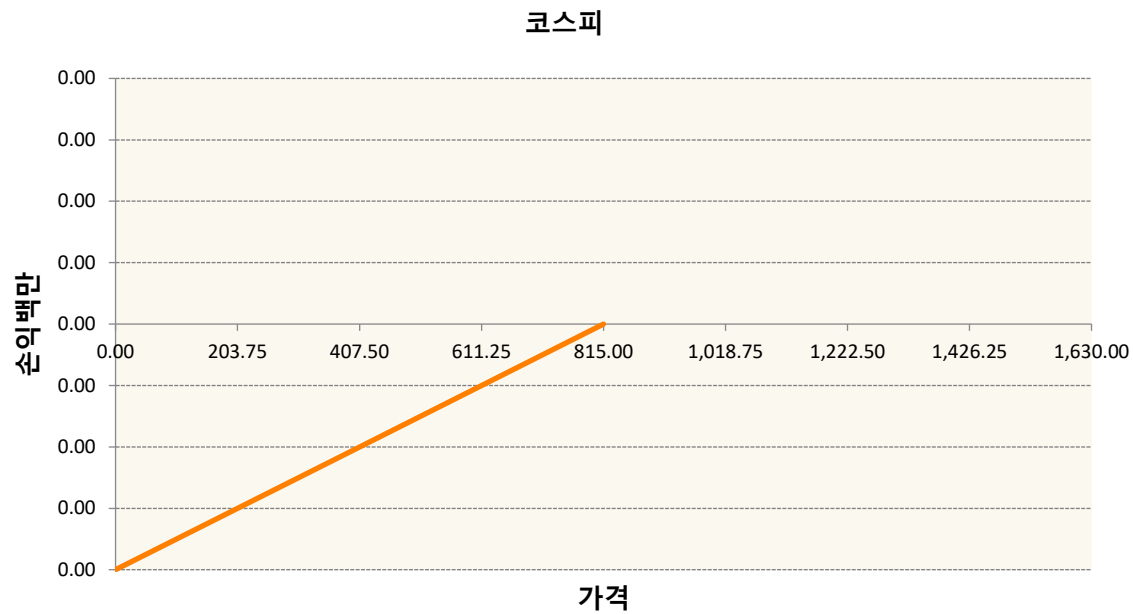
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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 2026-03-04

기준일 2026-03-03

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	2026-03-04
기준일	2026-03-03

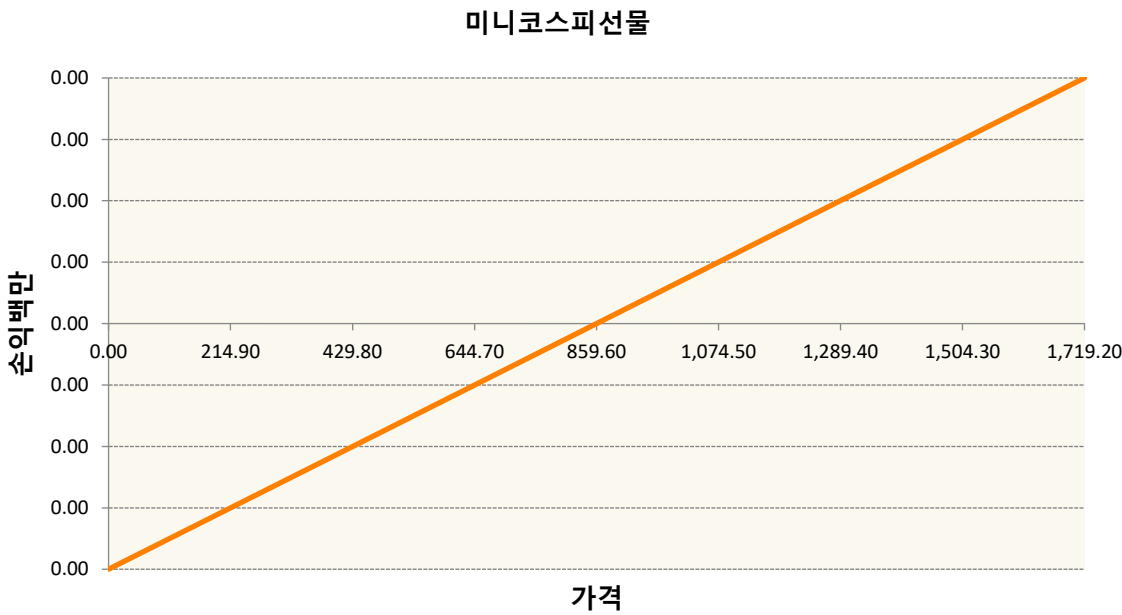
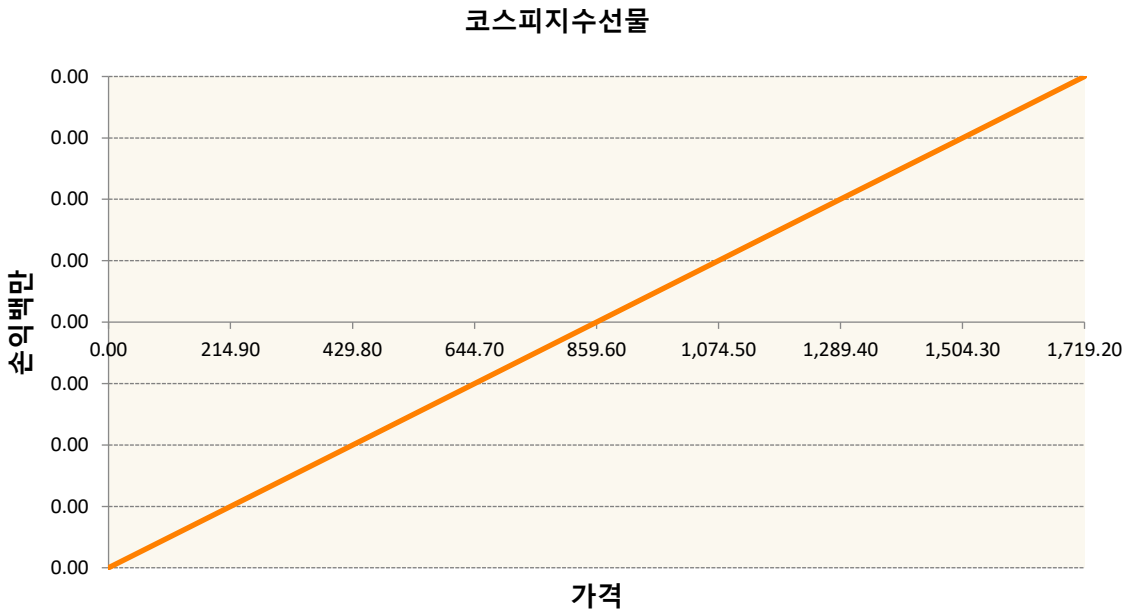
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

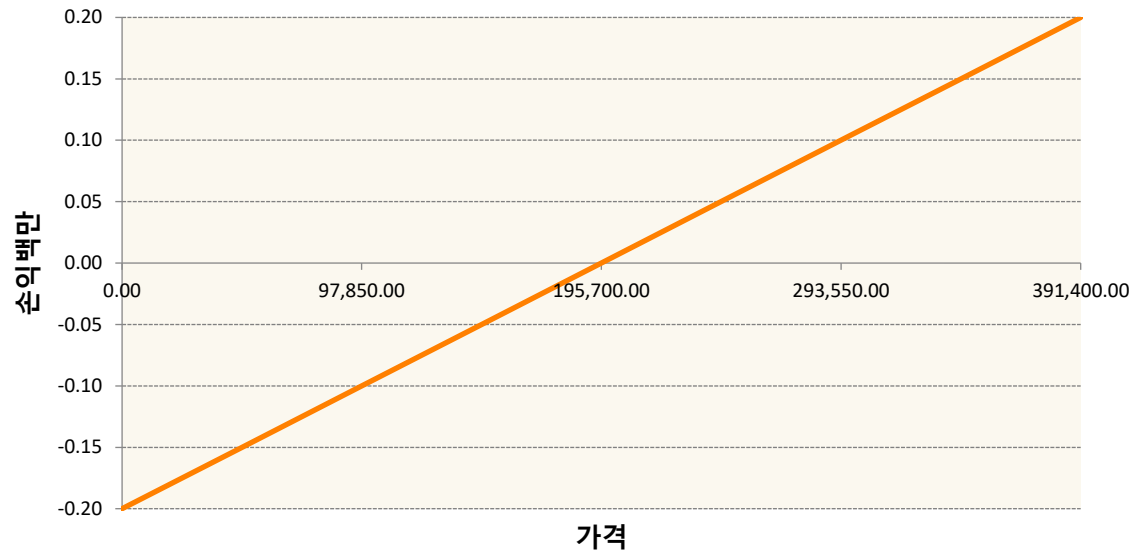
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7,252	0	7,252	장내

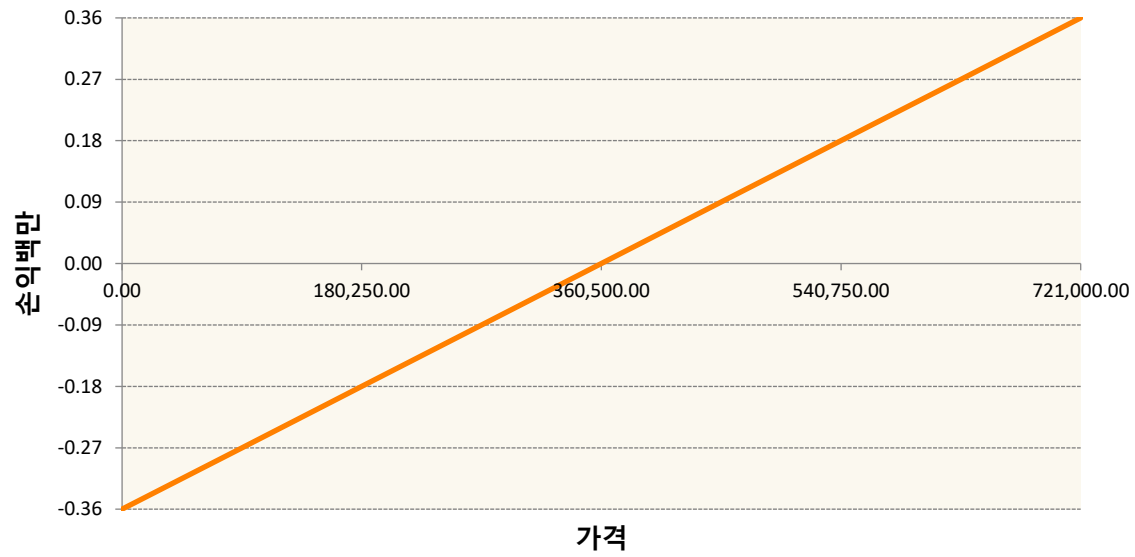
2. 만기시점의 손익구조



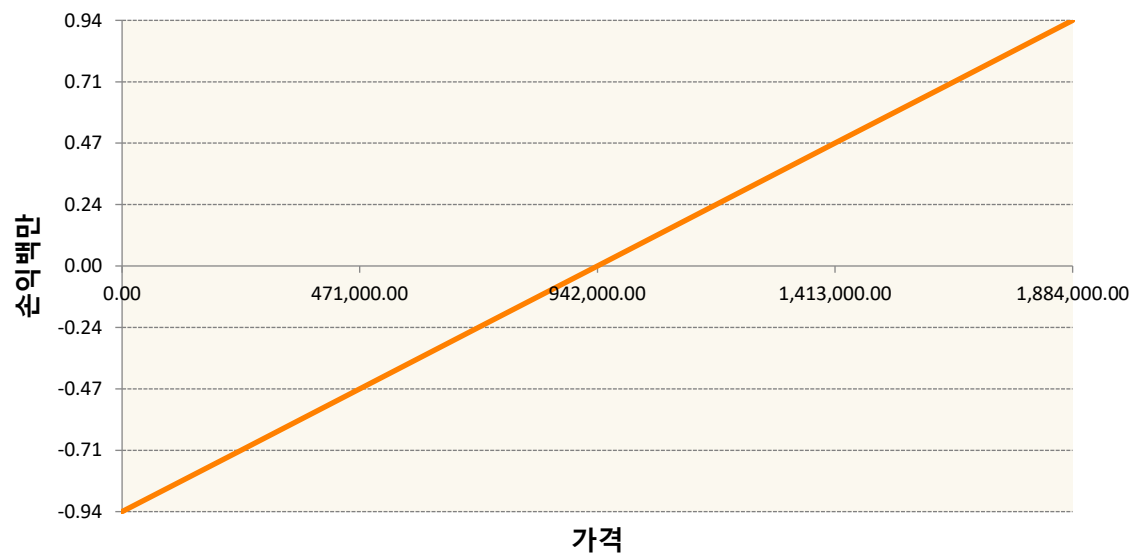
삼성전자개별선물



화학개별선물



하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		86
KR4A056300 2026-03 미니코스피200 선물		96
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		1
KR4A476300 2026-03 LG화학개별선물		7
KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물		5

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

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

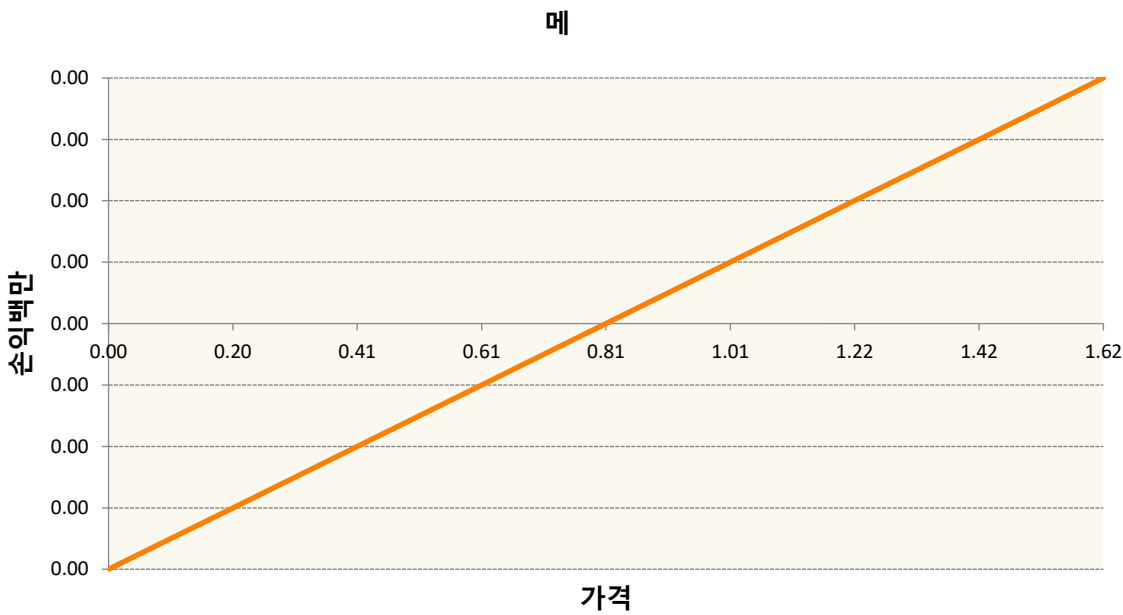
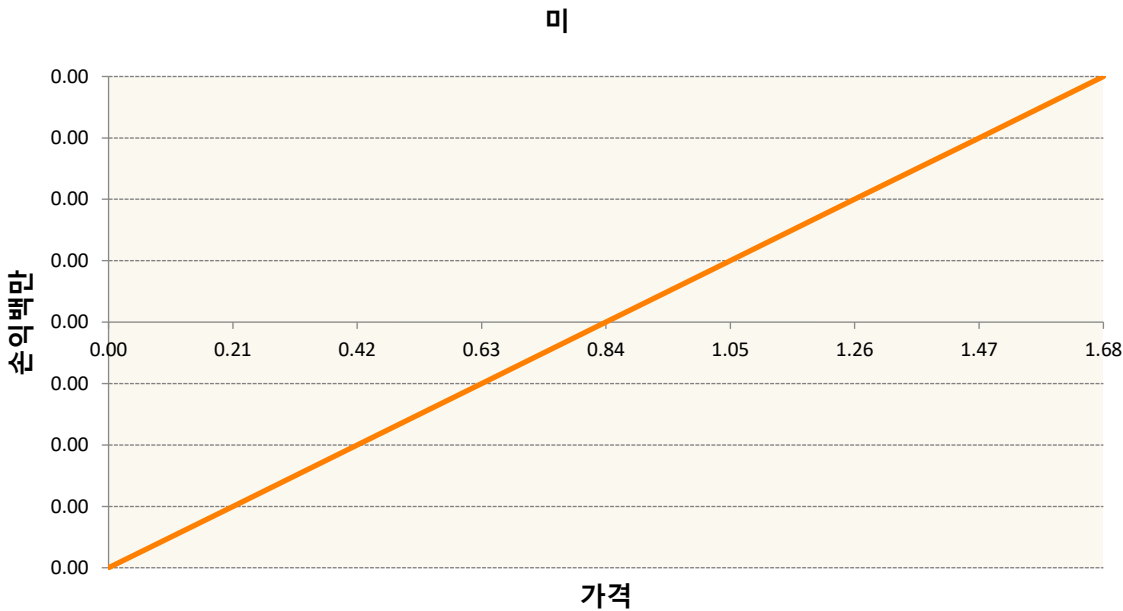
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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		391
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	524

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

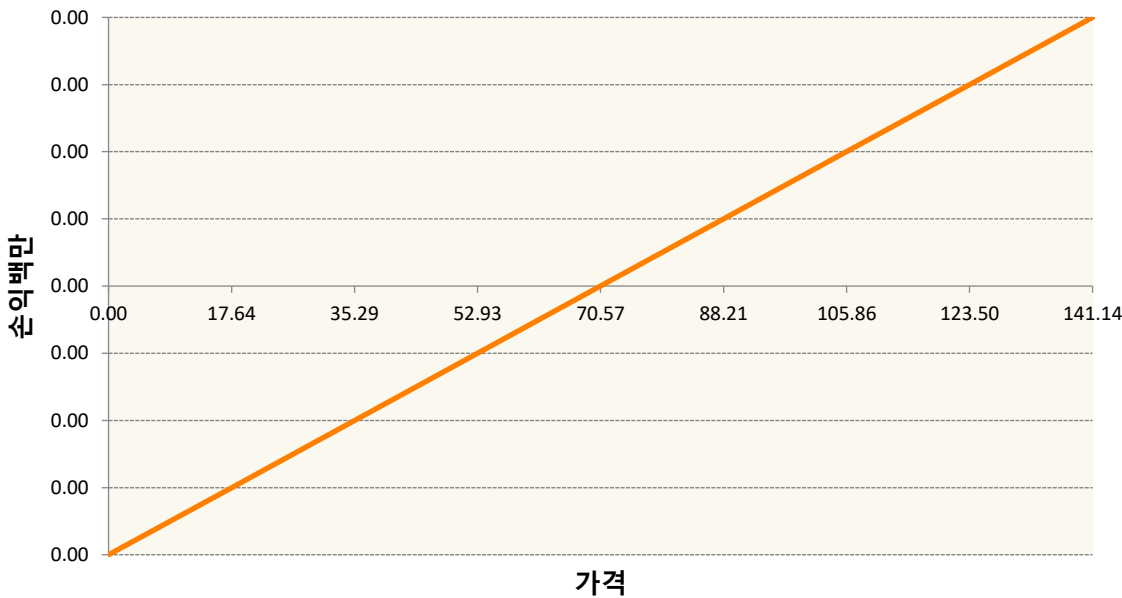
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,676	0	4,676	
누계	통화	선도	272	2,442	-2,170	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G2P(EUR/KRW 31-03-26E	22
FXW213G2R(KRW/EUR 31-03-26E	195
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	374

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

(단위:백만원)

657

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

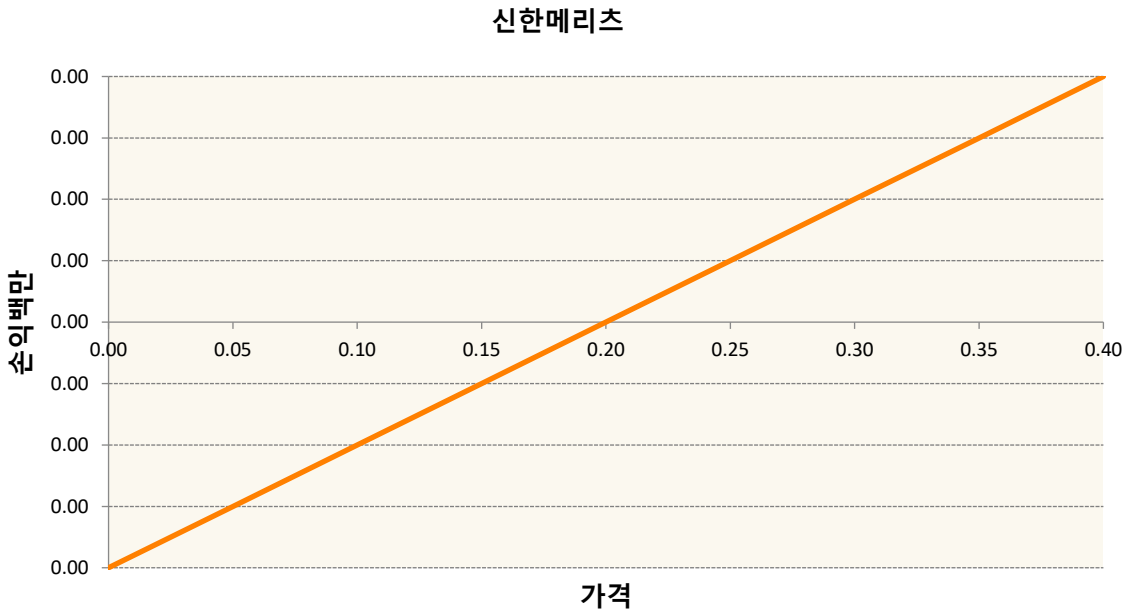
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,270	0	3,270	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	26
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	18
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	18
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	44

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

(단위:백만원)

192

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

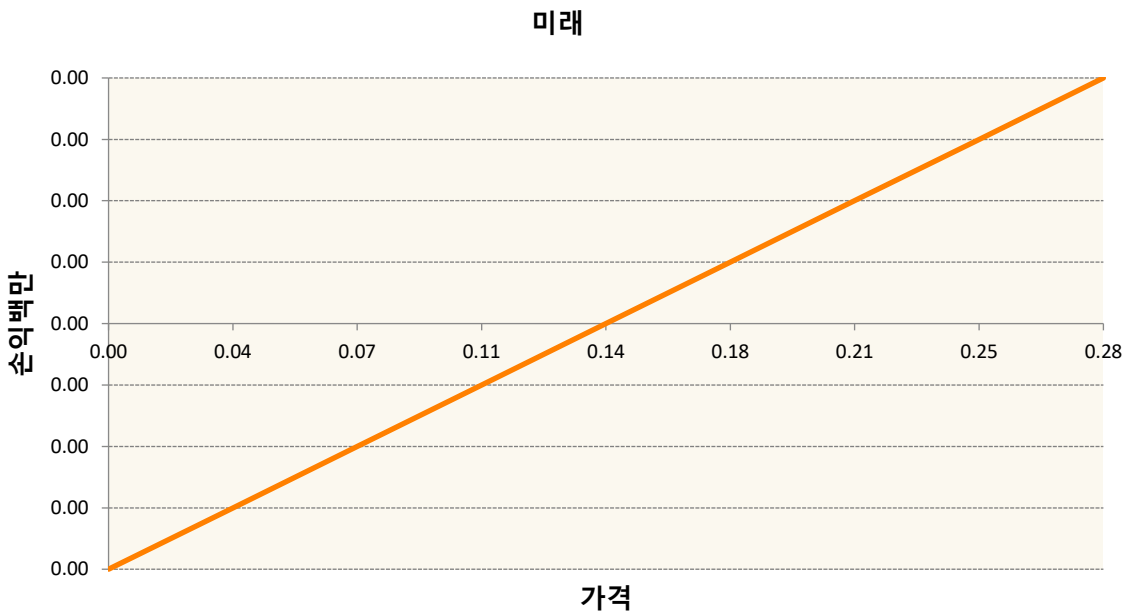
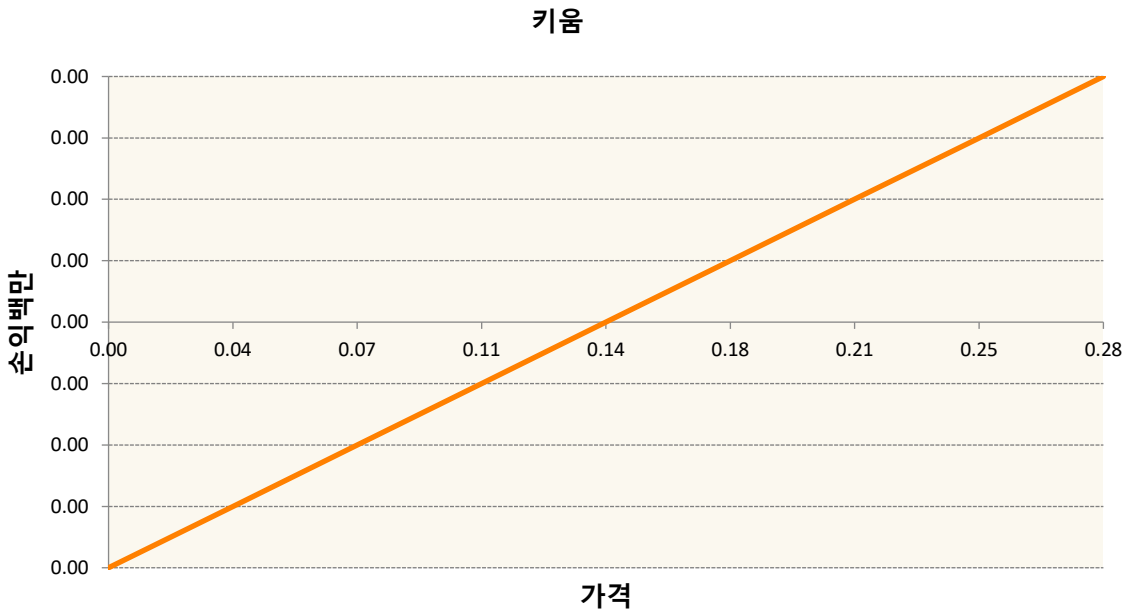
SOL차이나육성산업엑티브상장지

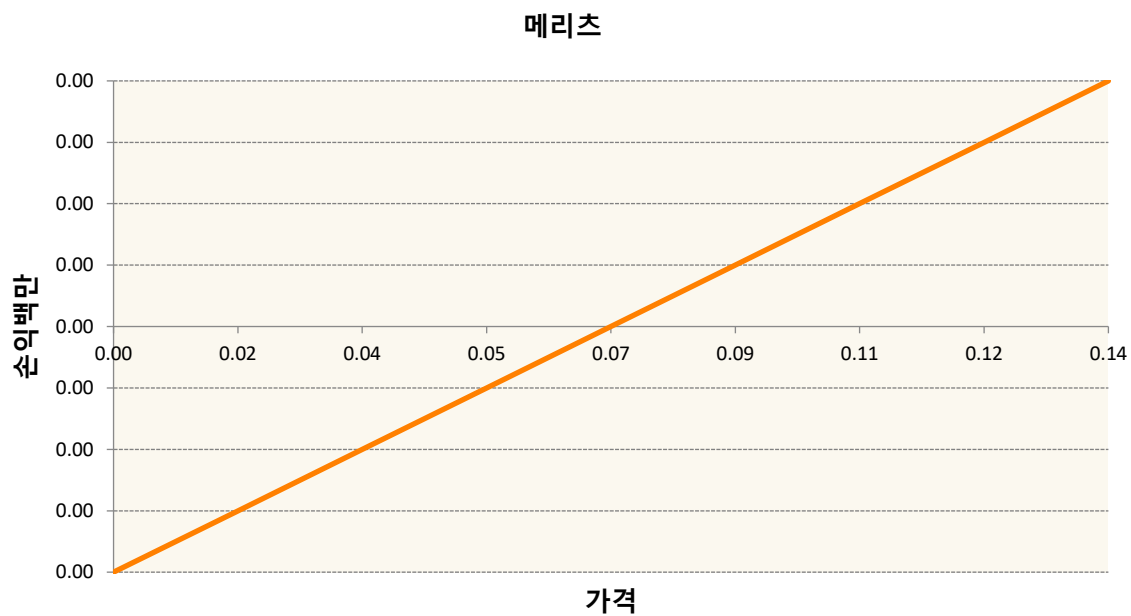
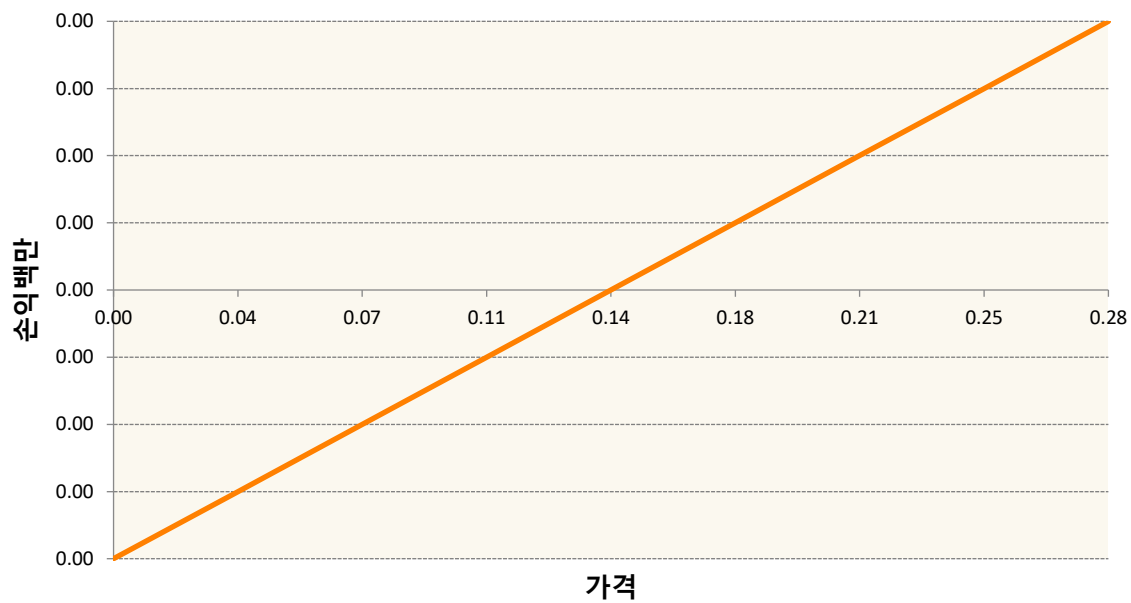
1. 계약금액

(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)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)

9
61
32
83

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

(단위:백만원)

340

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

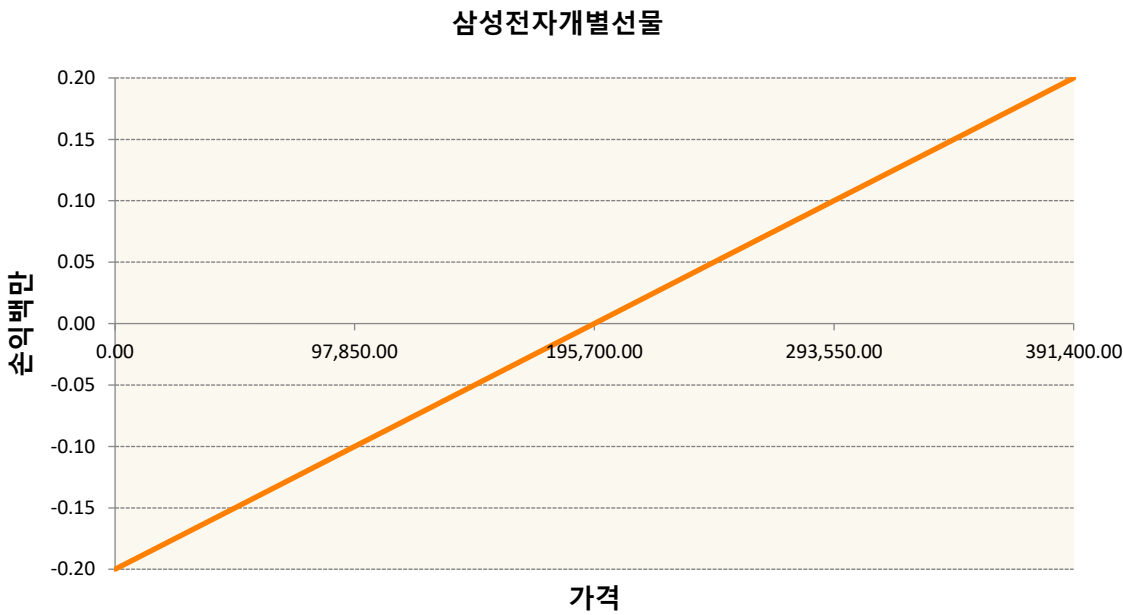
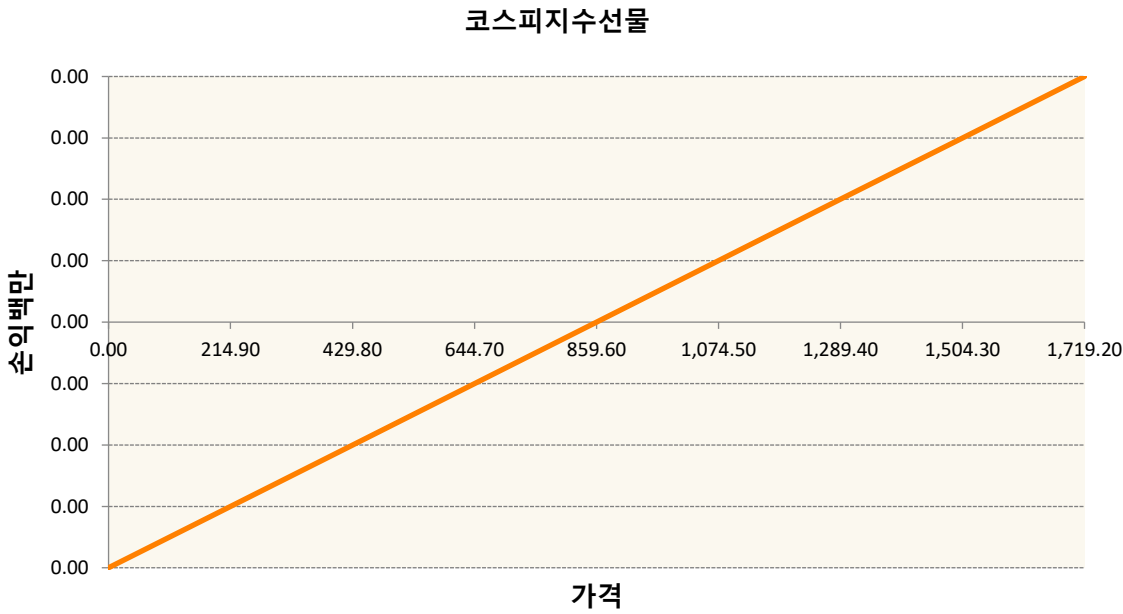
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

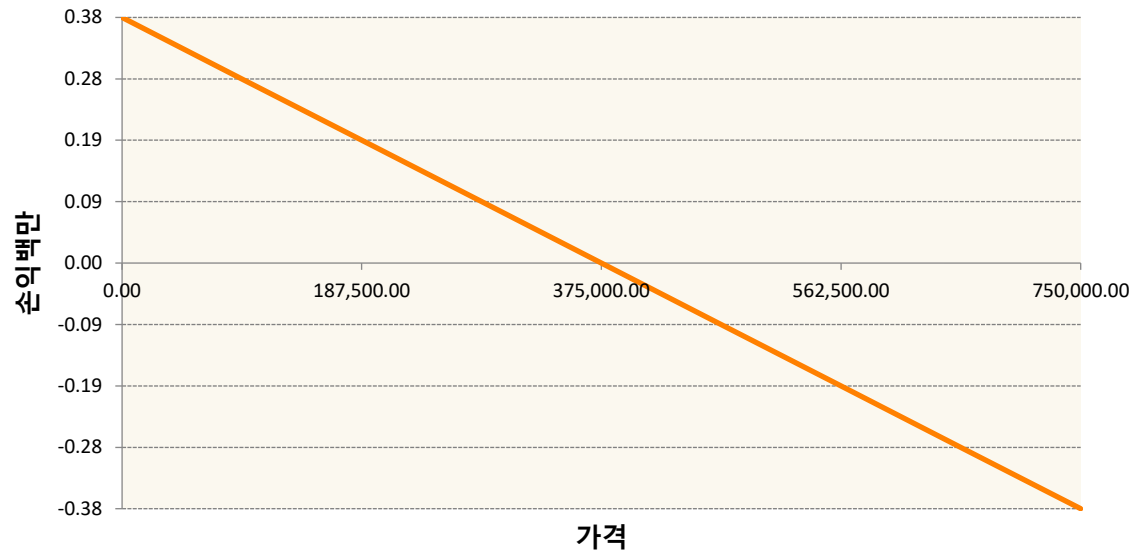
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,511	0	1,511	장내
누계	유가증권	선물	9,739	4,238	5,501	장내

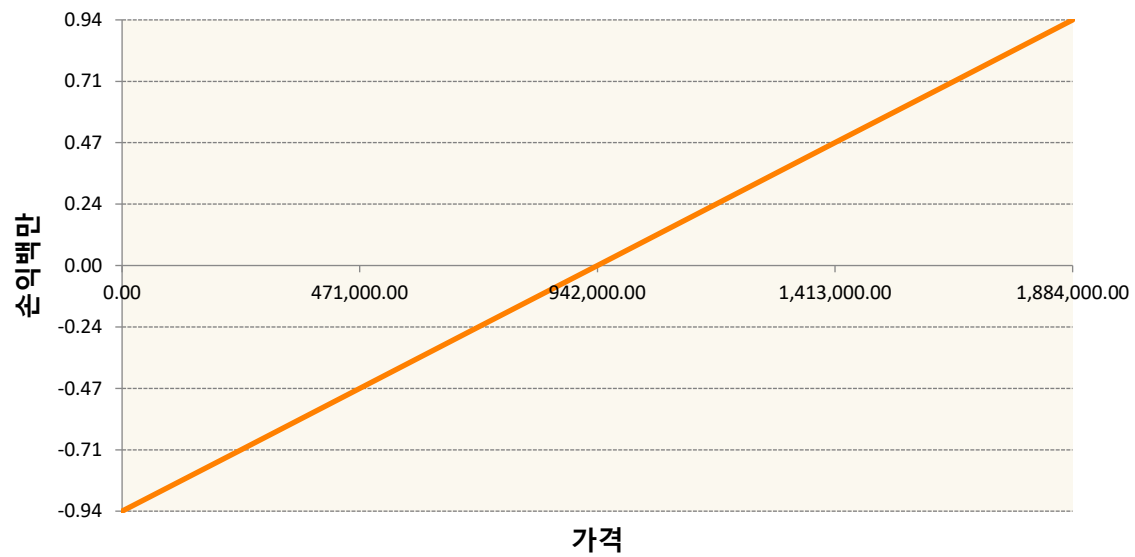
2. 만기시점의 손익구조



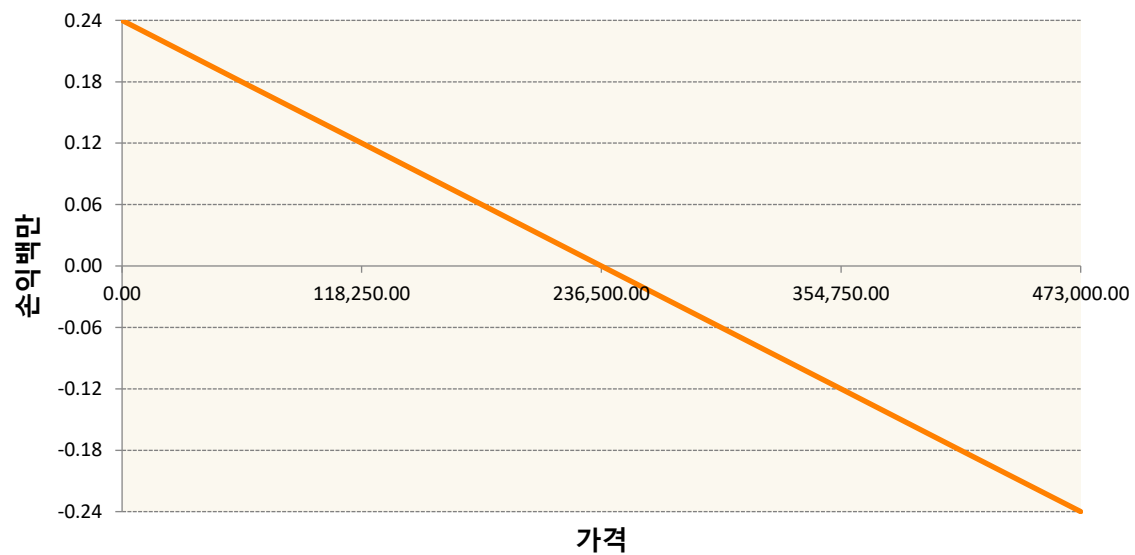
홀딩스개별선물



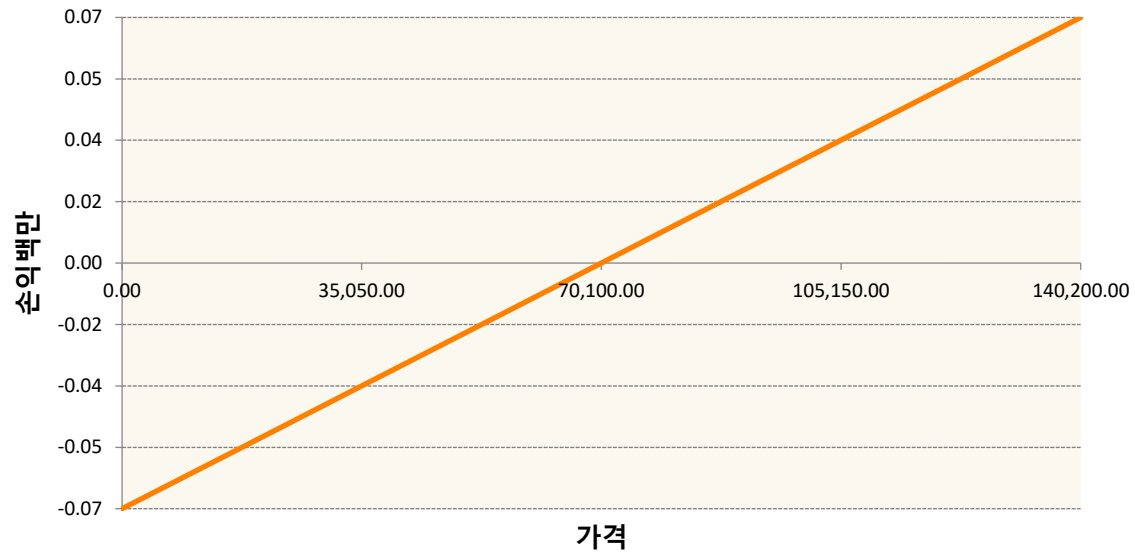
하이닉스개별선물



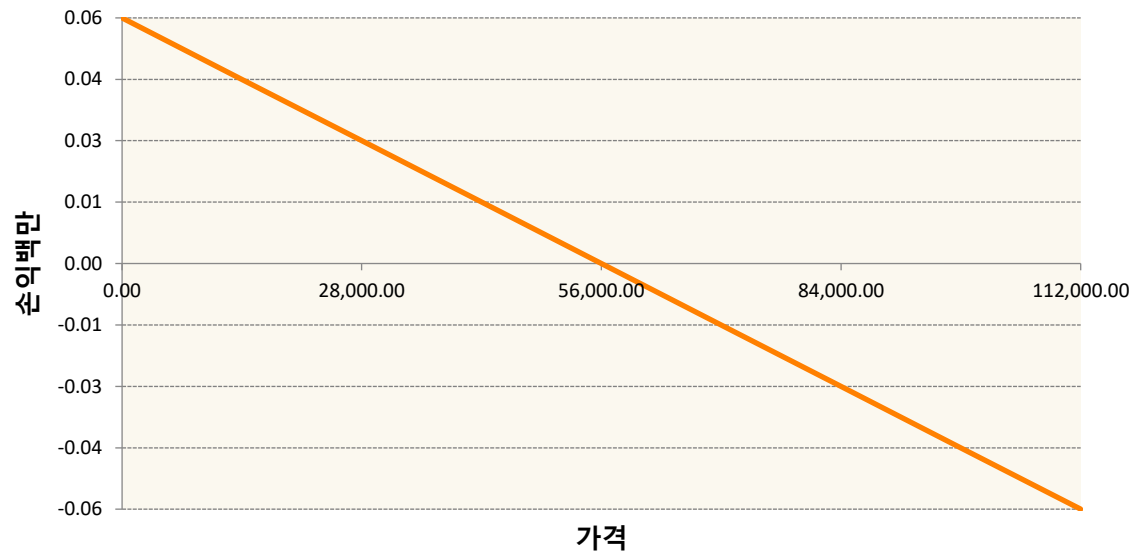
개별선물



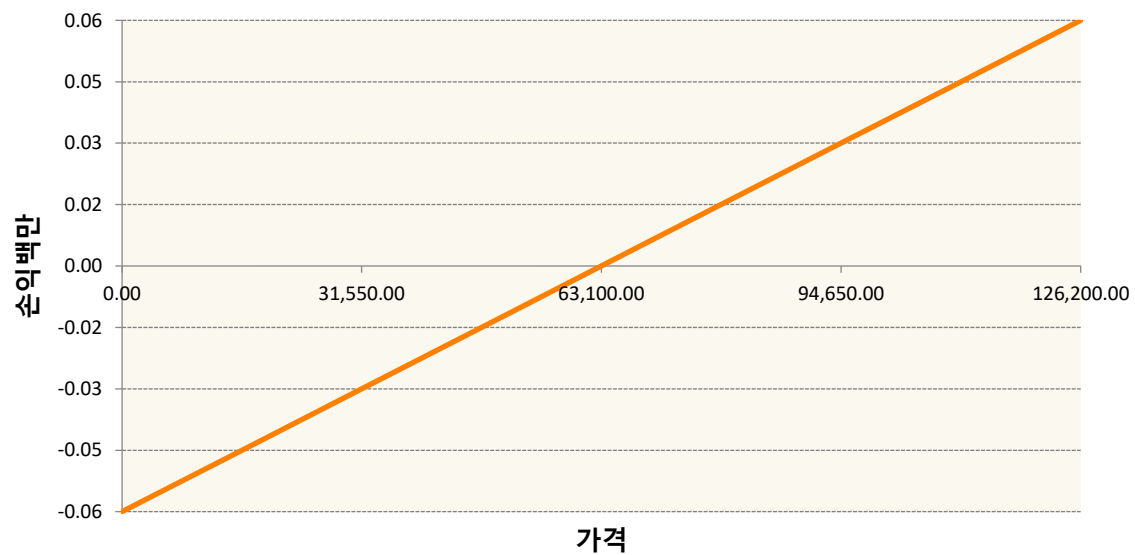
포스코인터내셔널개별선물



카카오개별선물



카카오페이개별선물



(단위:백만원)

KR4A01630008							2026-03 코스피200지수선물		344	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344			
-5.33%	-229	-229	-229	-229	-229	-229	-229			
-2.67%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	115	115	115	115	115	115	115			
5.33%	229	229	229	229	229	229	229			
8.00%	344	344	344	344	344	344	344			
KR4A11630006							2026-03 삼성전자개별선물		294	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294			
-5.33%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196			
-2.67%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	98	98	98	98	98	98	98			
5.33%	196	196	196	196	196	196	196			
8.00%	294	294	294	294	294	294	294			
KR4A13630004							2026-03 POSCO홀딩스개별선물		58	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58			
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39			
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19			
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39			
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58			
KR4A50630008							2026-03 SK하이닉스개별선물		81	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81			
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54			
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	27	27	27	27	27	27	27			
5.33%	54	54	54	54	54	54	54			
8.00%	81	81	81	81	81	81	81			
KR4A56630002							2026-03 NAVER개별선물		138	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	138	138	138	138	138	138	138
-5.33%	92	92	92	92	92	92	92
-2.67%	46	46	46	46	46	46	46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
KR4AB7630000 2026-03 포스코인터내셔널개별선물							58
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	58	58	58	58	58	58	58
KR4ACF630008 2026-03 카카오개별선물							143
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	143	143	143	143	143	143	143
-5.33%	96	96	96	96	96	96	96
-2.67%	48	48	48	48	48	48	48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
8.00%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
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)

1,762

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

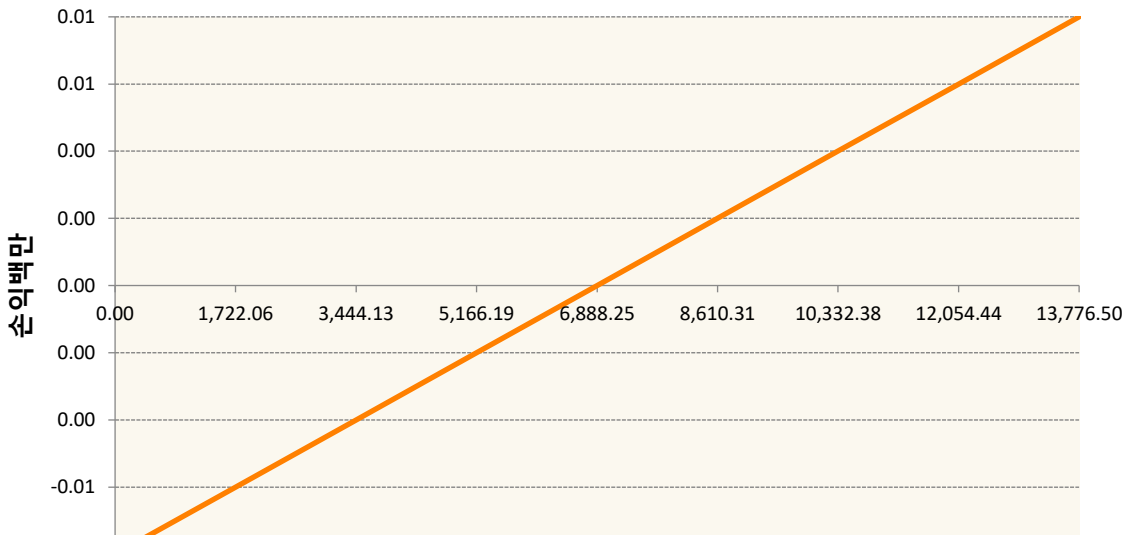
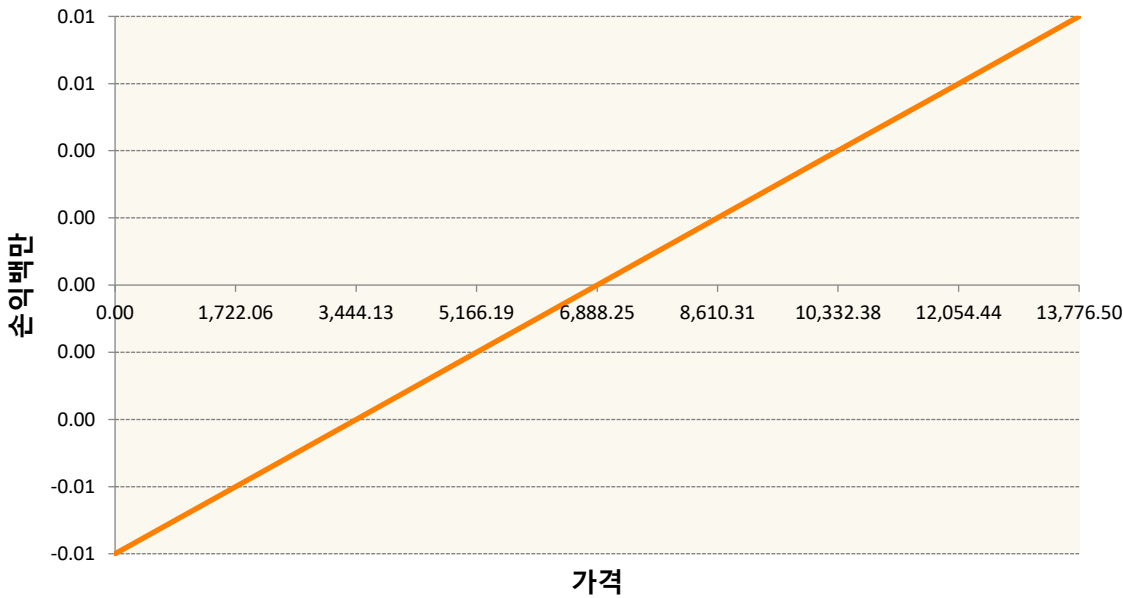
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

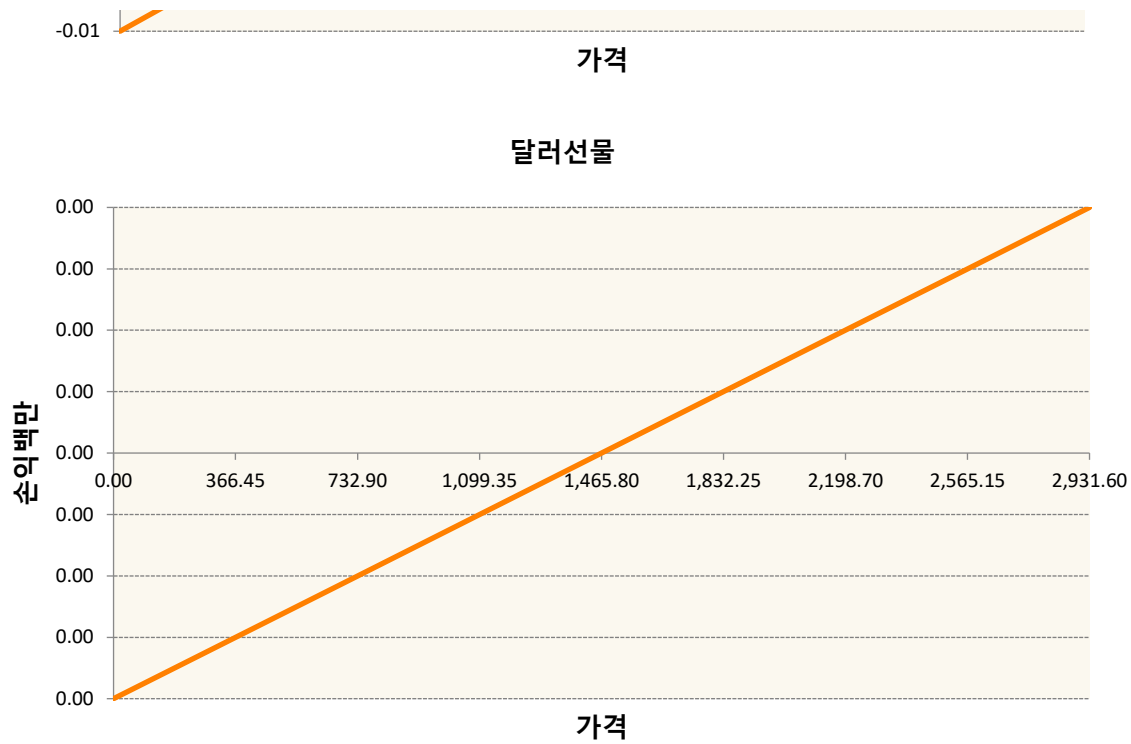
1. 계약금액

(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	102	0	102	장내
누계	지수	선물	53,316	0	53,316	
누계	통화	선물	12,166	0	12,166	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26		4,265
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26		8
KR4A756300 2026-03 달러선물			973

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,649

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

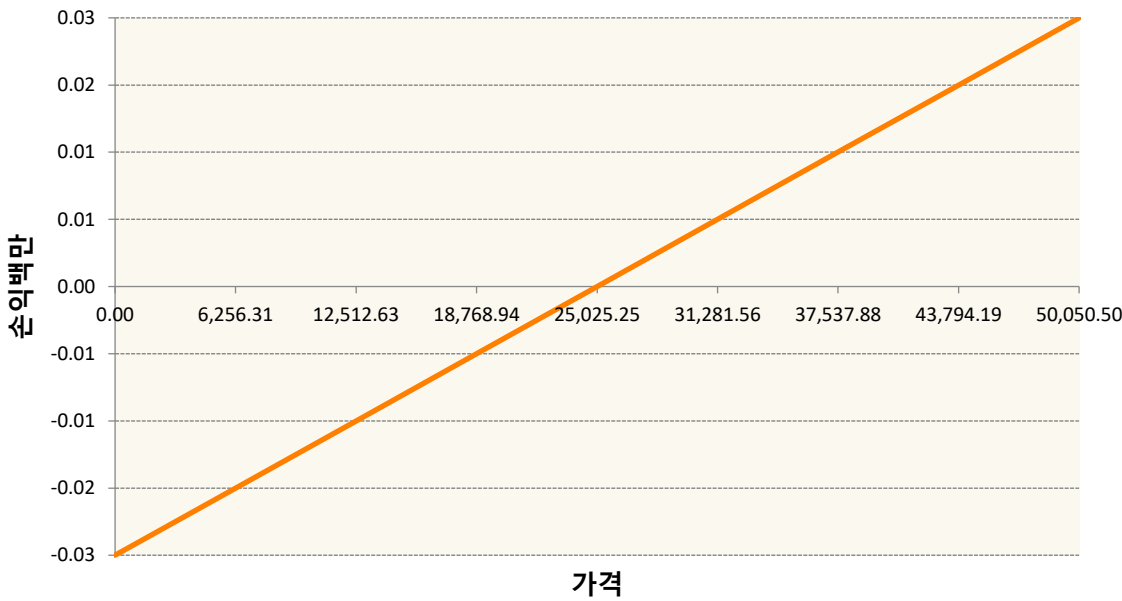
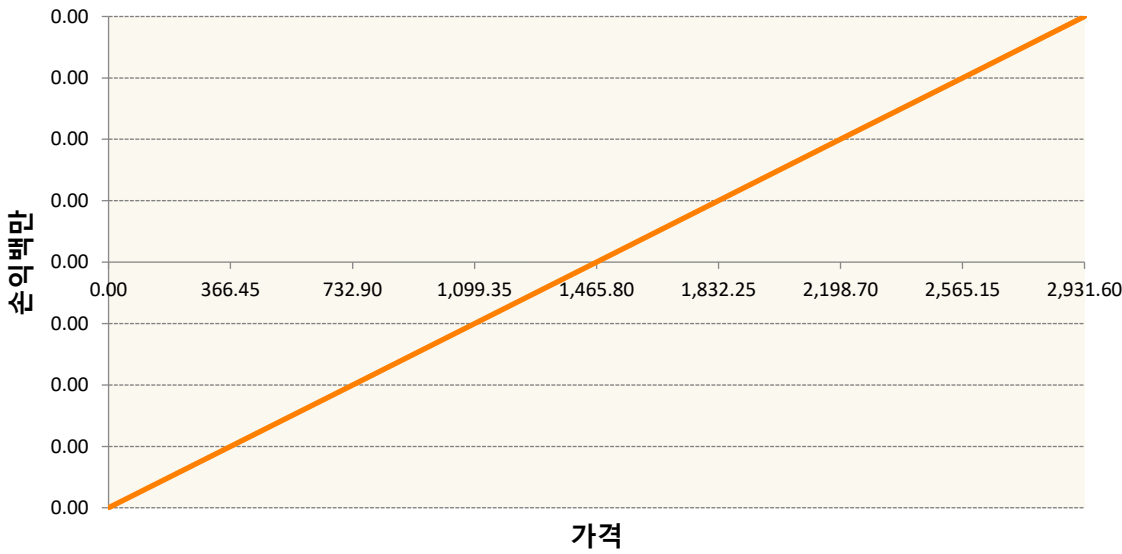
1. 계약금액

(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	22,897	0	22,897	장내
누계	통화	선물	4,910	0	4,910	장내

2. 만기시점의 손익구조

달러선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A756300 2026-03 달러선물		393
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,832

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,992

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

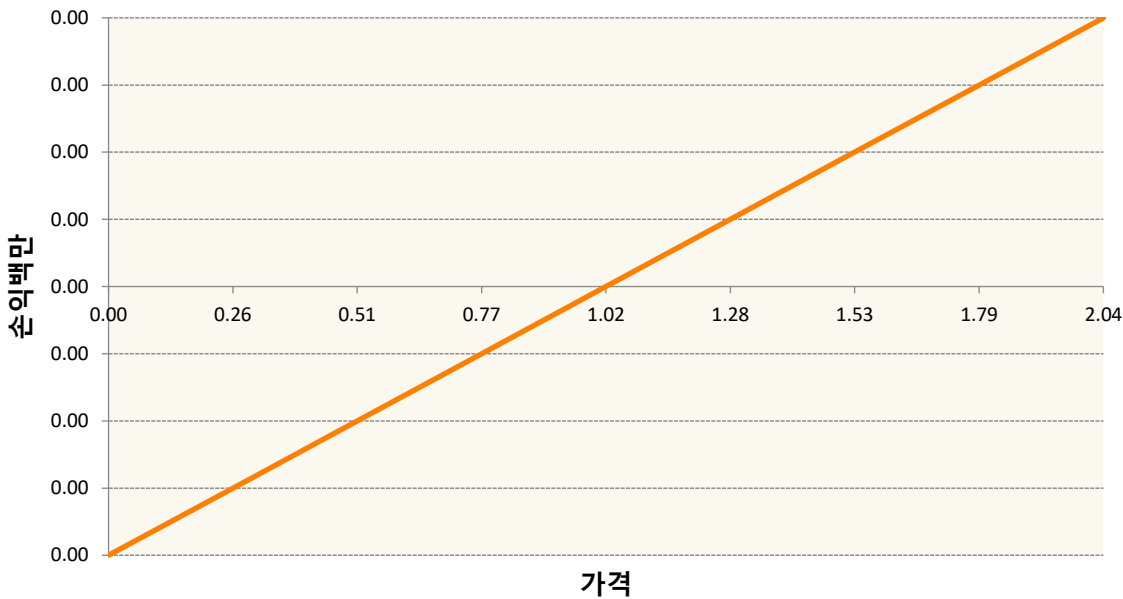
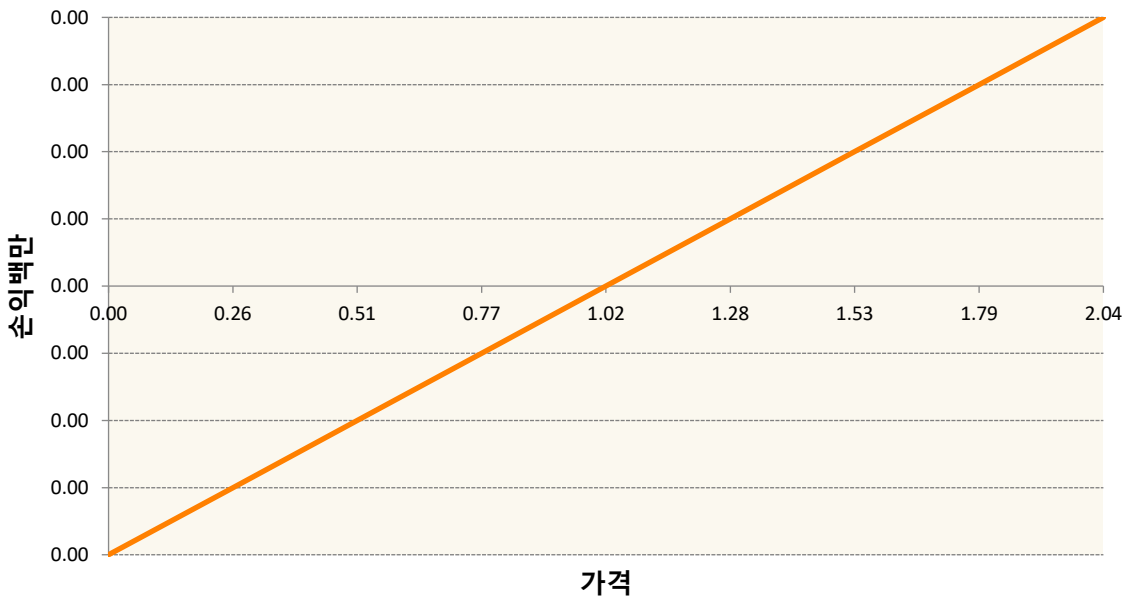
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

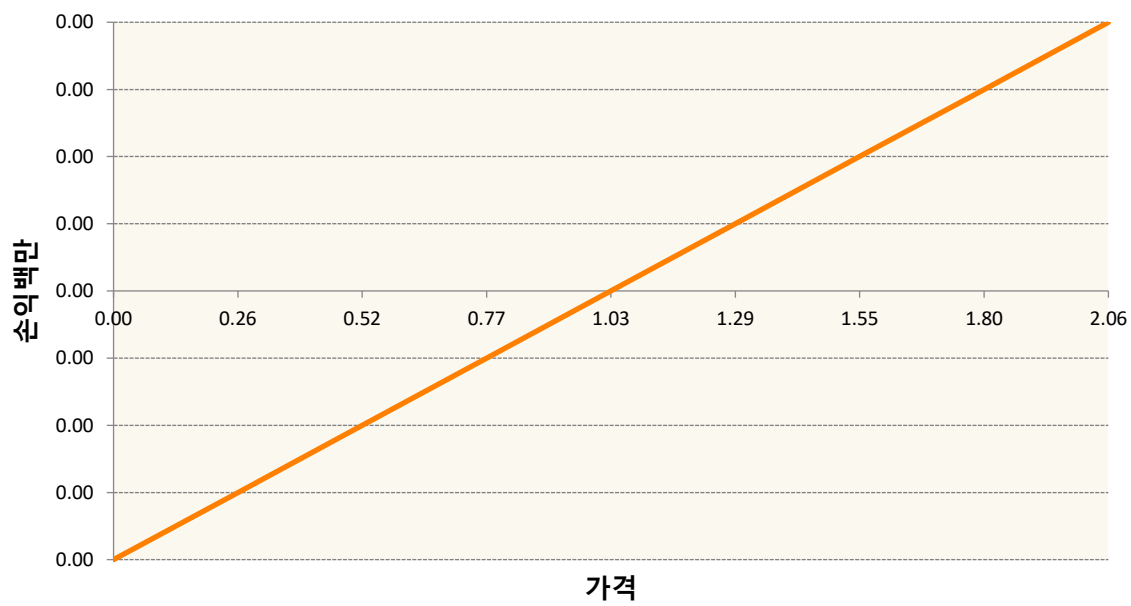
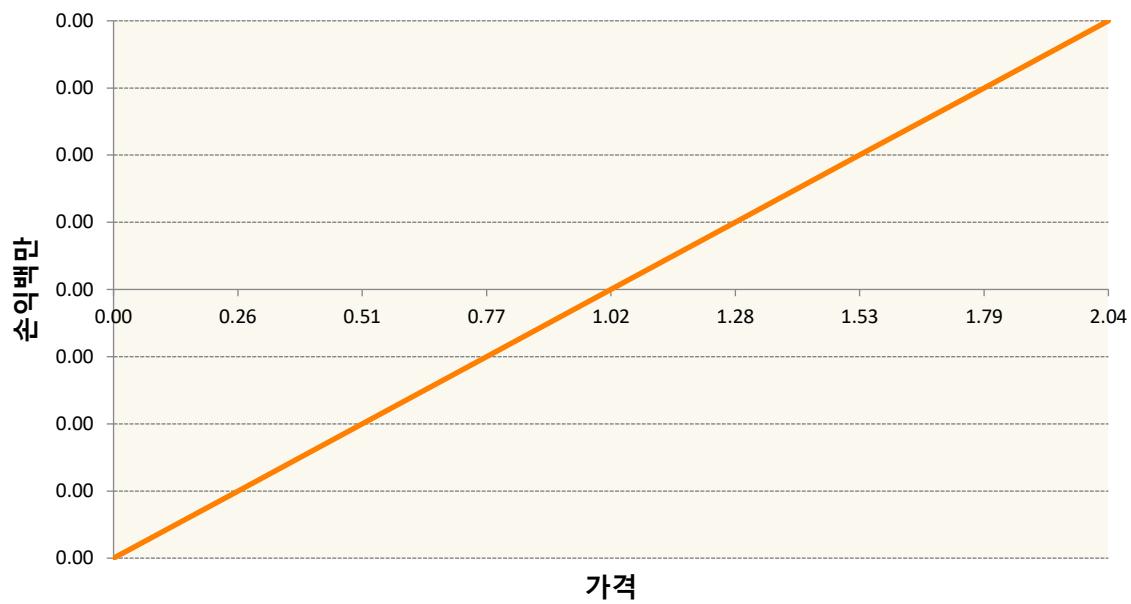
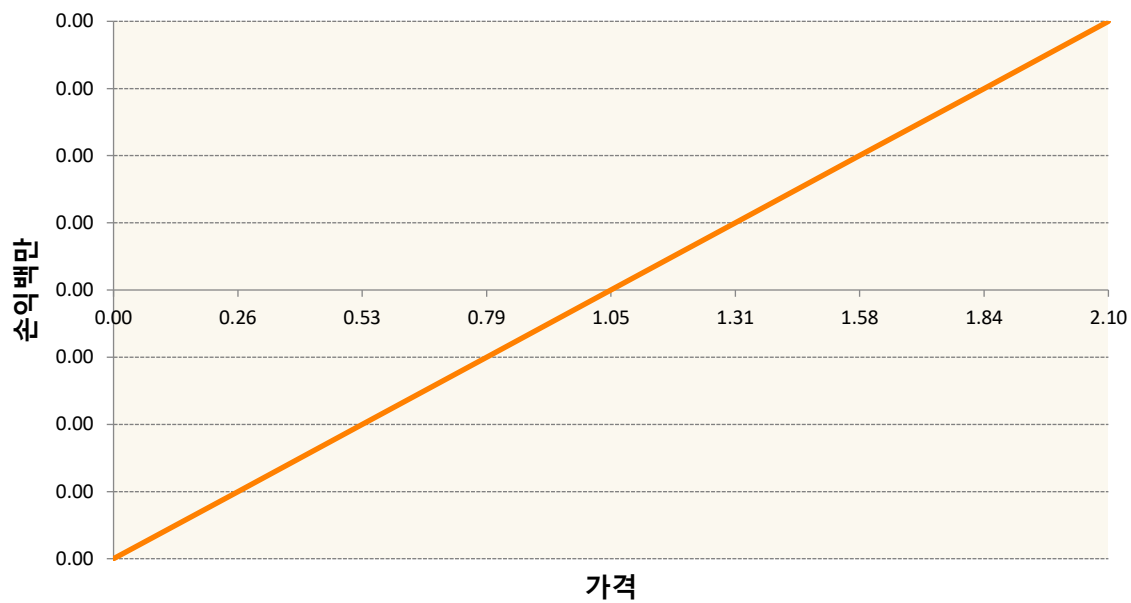
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	388,561	0	388,561	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,425
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,774
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		153
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		10,140
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,572

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	14,039

공시일	2026-03-04
기준일	2026-03-03

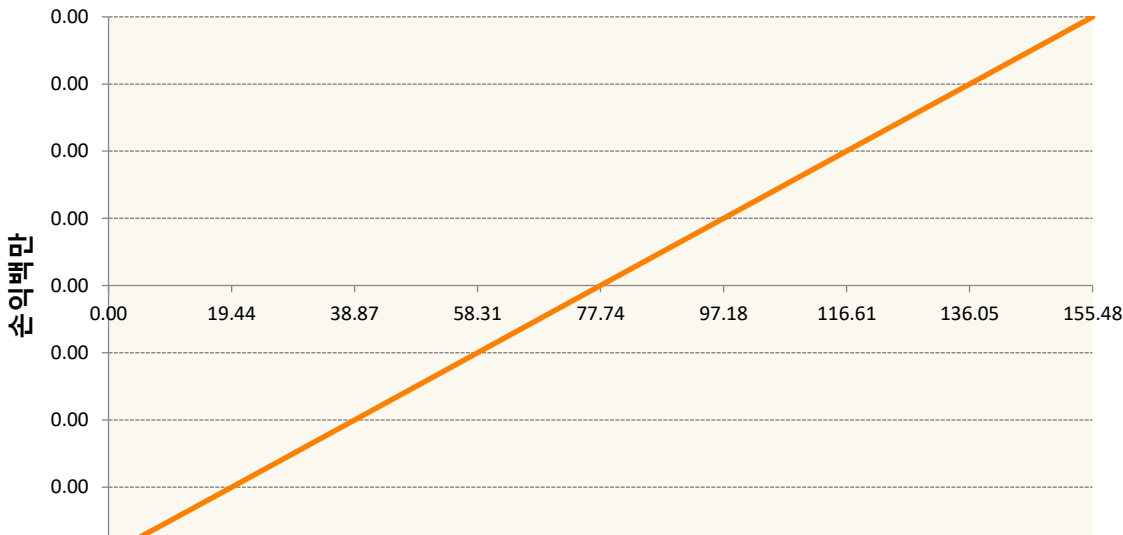
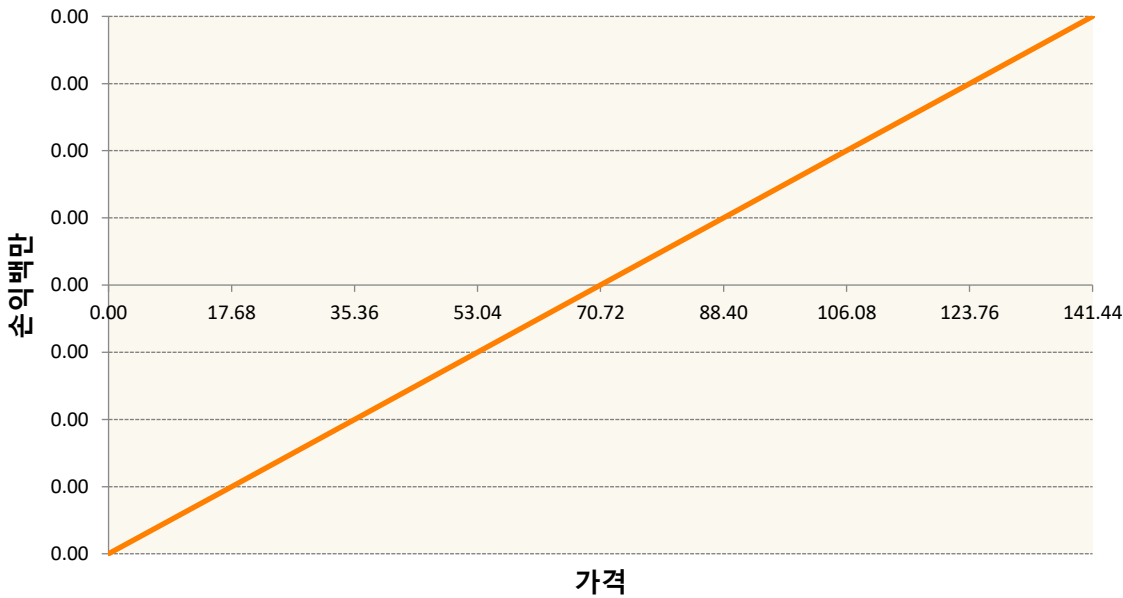
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

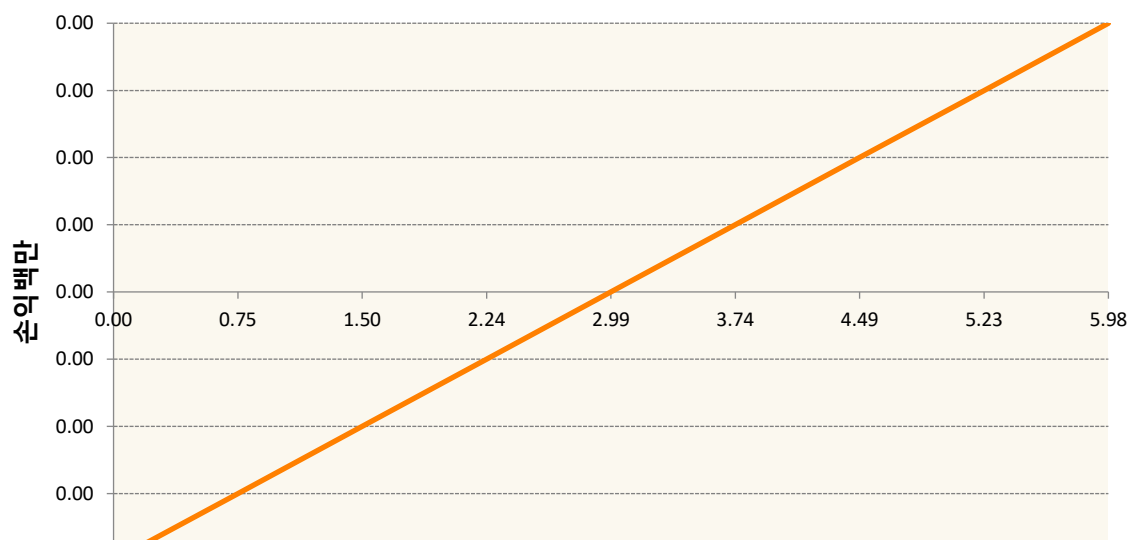
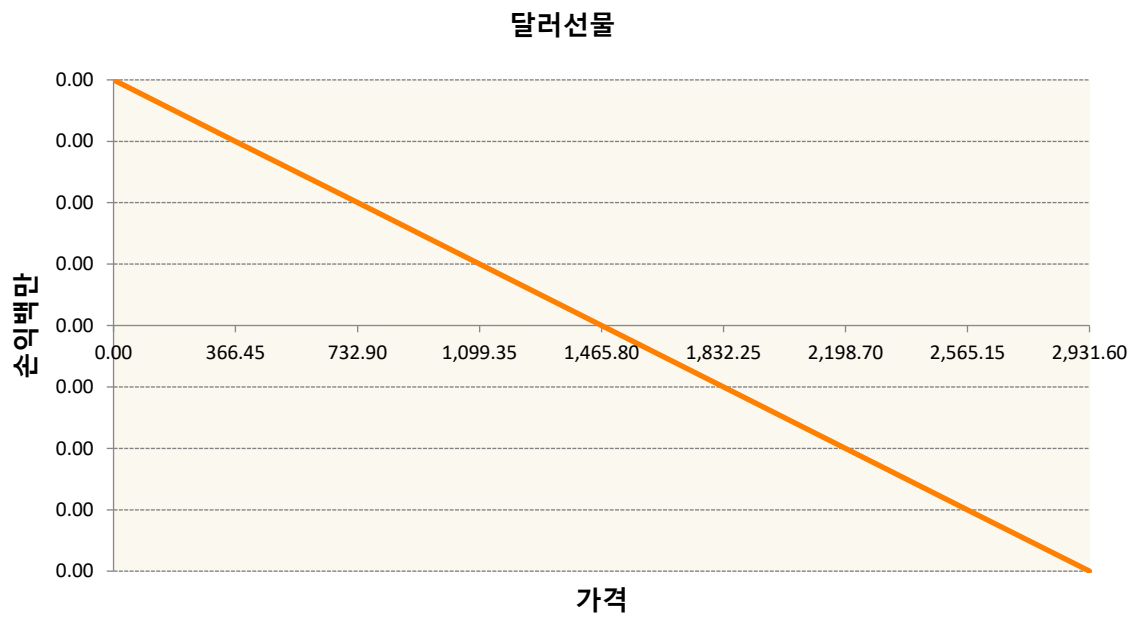
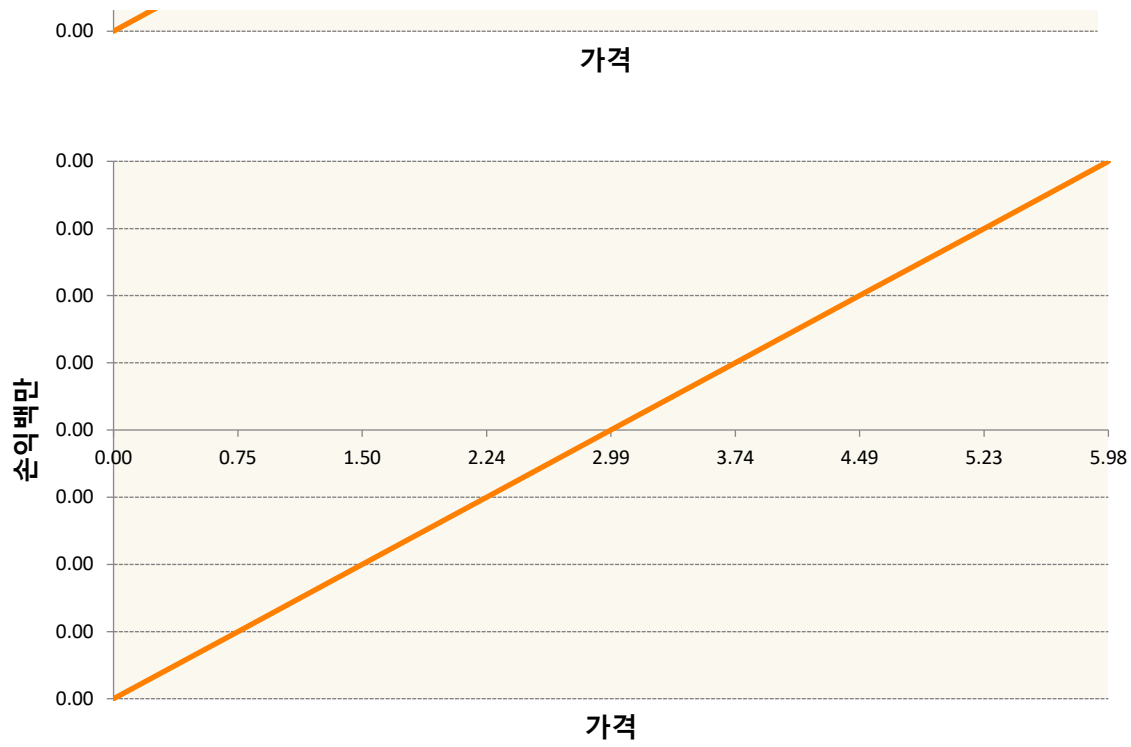
1. 계약금액

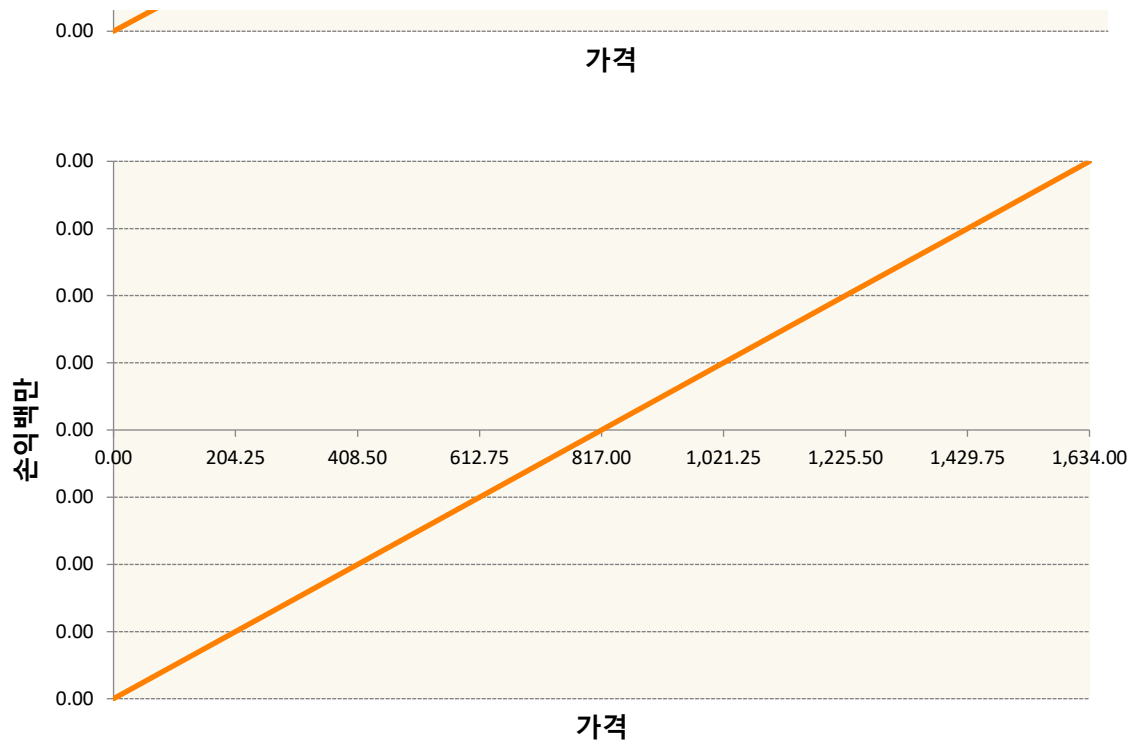
(단위:백만원)

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	162	0	162	
누계	유가증권	선물	353	0	353	
누계	통화	선물	0	117	-117	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK6	WTI CRUDE FUTURE May26	8
COK6	BRENT CRUDE FUTR May26	18
EOK6	E-MINI NATURAL GAS May 26	2
KR4A756300	2026-03 달러선물	9
NGK26	NATURAL GAS FUTR May 26	3
QSK6	Low Su Gasoil G May 26	9

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

(단위:백만원)

85