

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

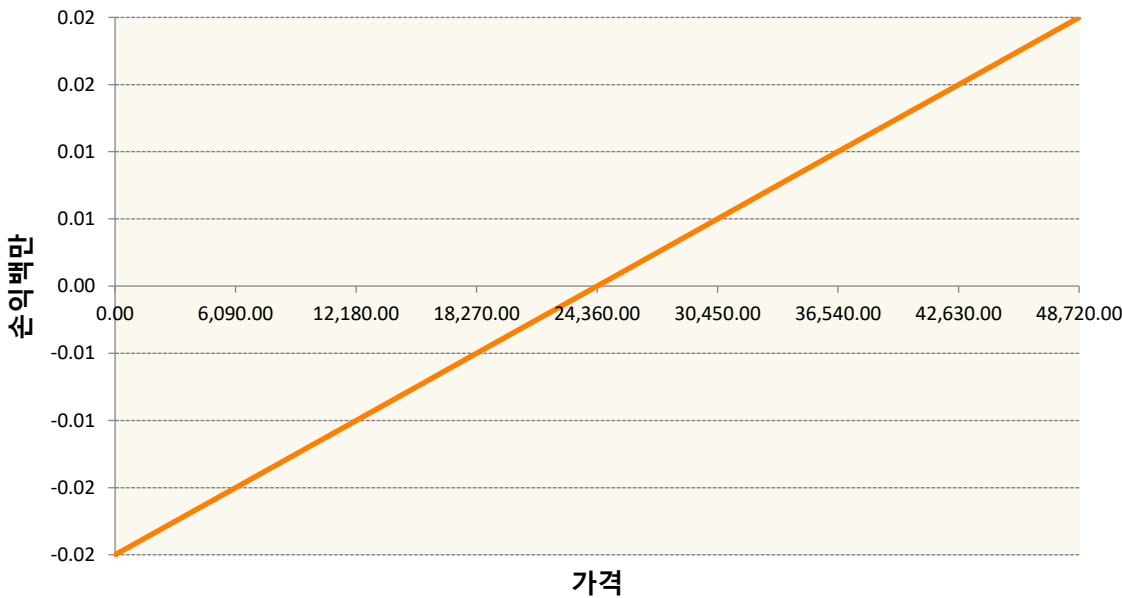
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	631	0	631	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH6 IFSC NIFTY 50 FUT Mar26

50

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

(단위:백만원)

33

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

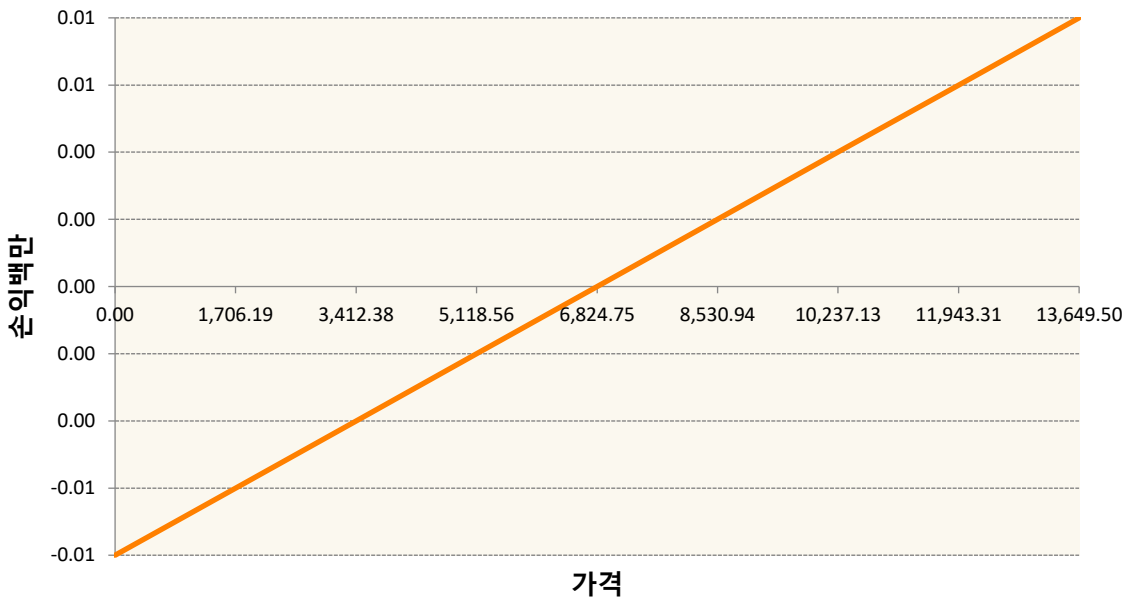
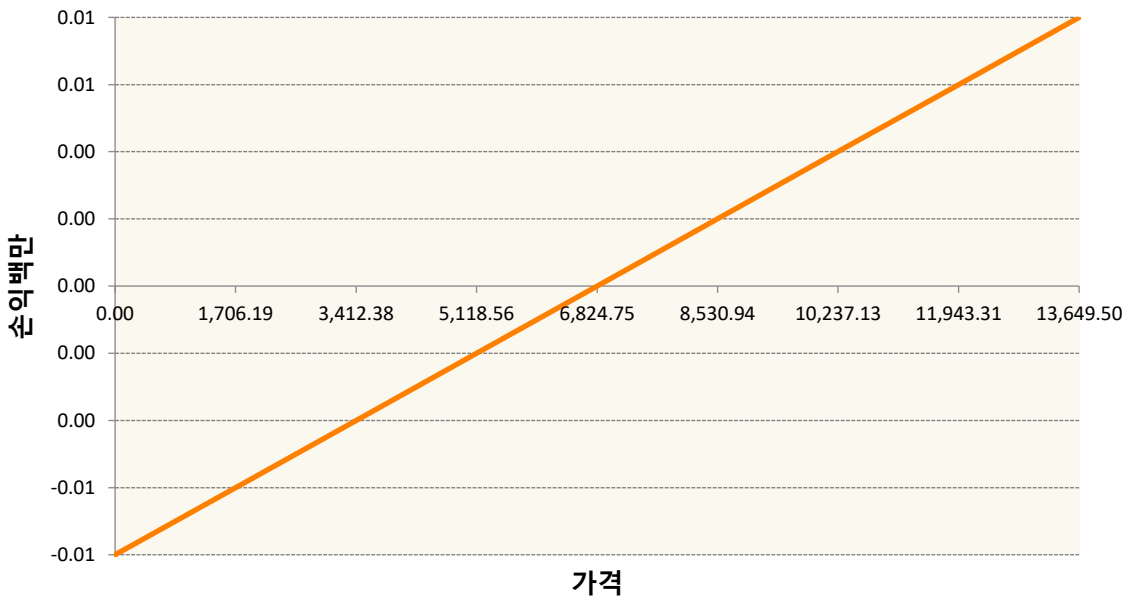
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	101	0	101	장내
누계	지수	선물	504	0	504	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	40
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	41

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

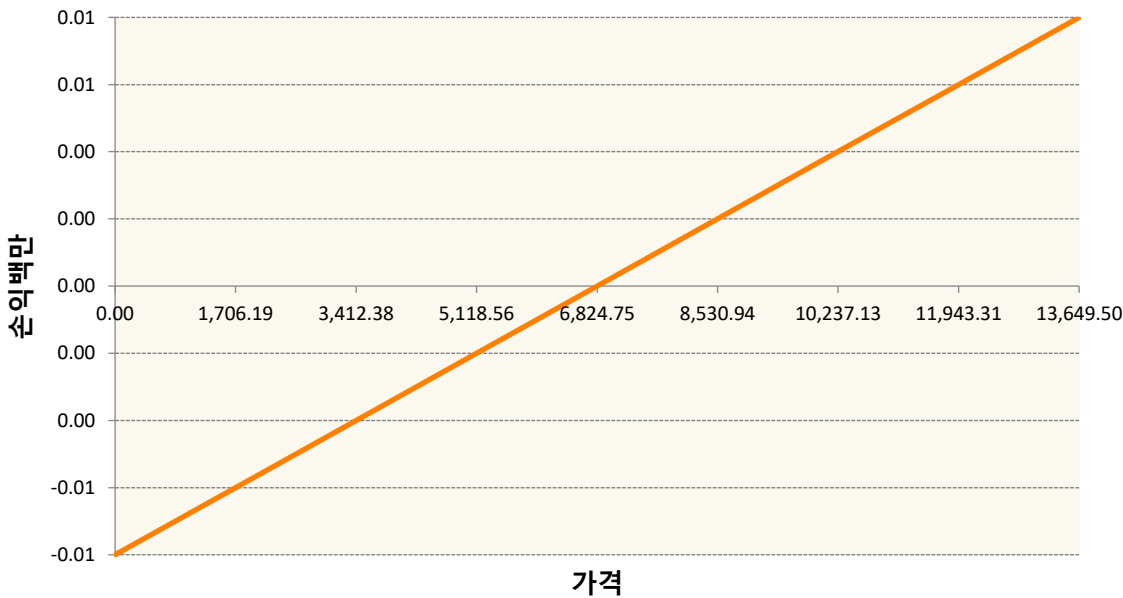
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,513	0	1,513	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	121
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

103

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

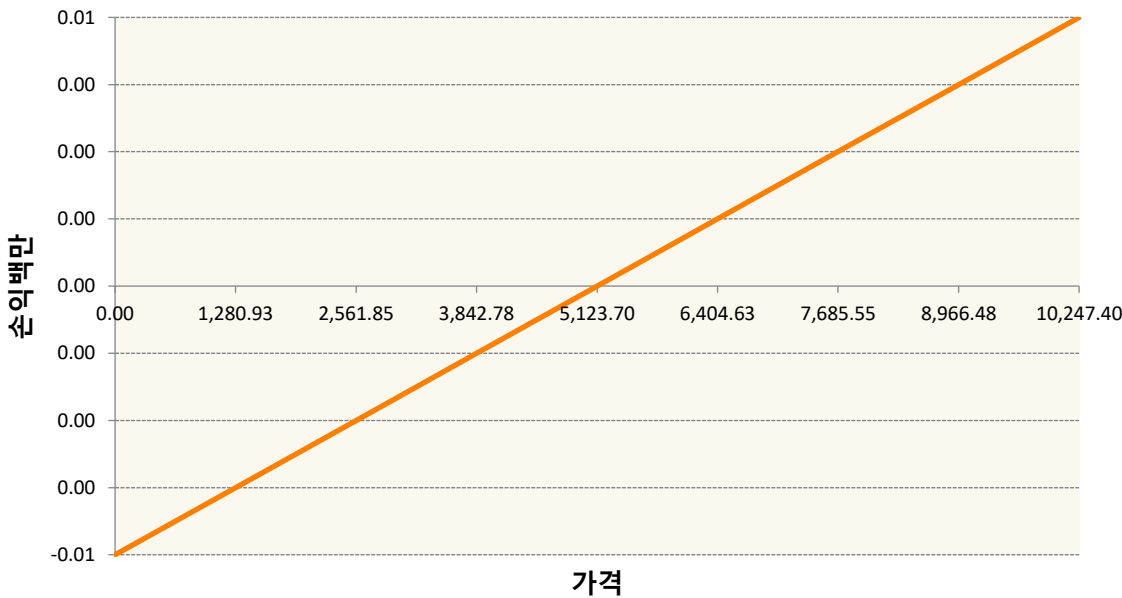
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,124	0	5,124	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 03/06/26 C495 EQUITY	13
GCJ6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	410

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

(단위:백만원)

494

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

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	118
AOPLTRAAP PLTR US 03/06/26 P147 EQUITY	34

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

(단위:백만원)

544

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

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)

1

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

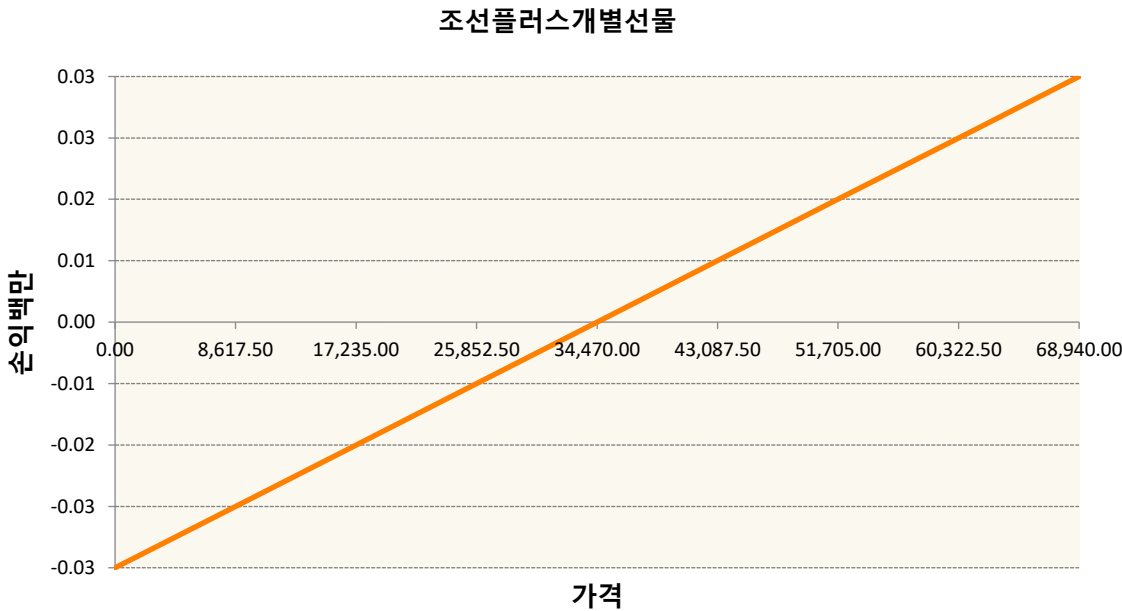
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	13,322	0	13,322	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM7630007			2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물				973
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-973	-973	-973	-973	-973	-973	-973
-5.33%	-649	-649	-649	-649	-649	-649	-649
-2.67%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	324	324	324	324	324	324	324
5.33%	649	649	649	649	649	649	649
8.00%	973	973	973	973	973	973	973

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

(단위:백만원)

829

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

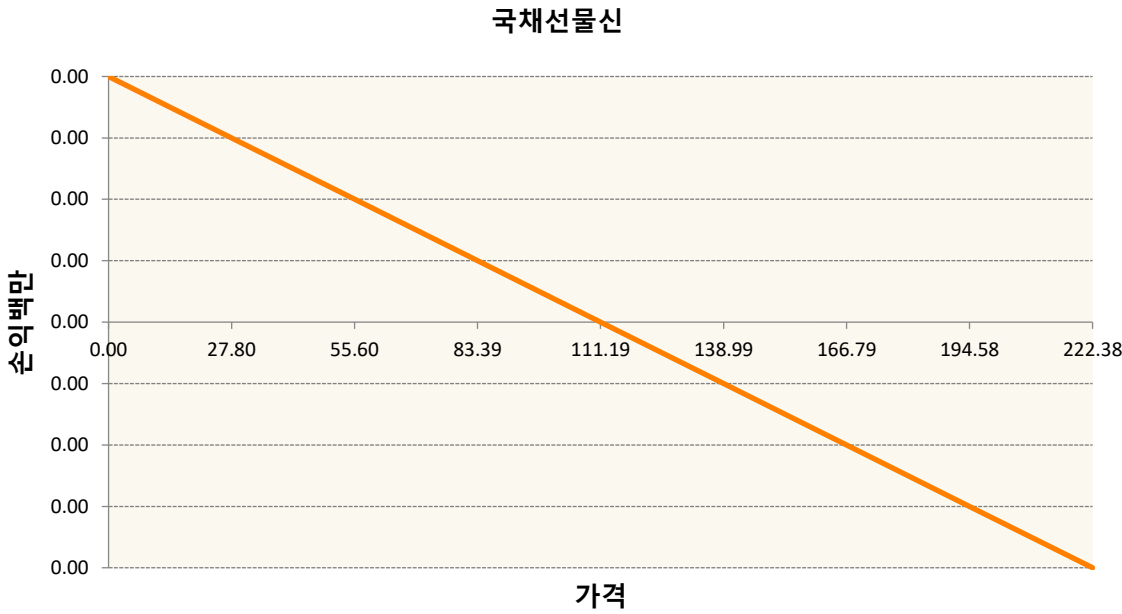
포커스채권(채권-파생형)(종)

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	13,343	-13,343	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%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-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%	258	258	258	258	258	258	258
8.00%	386	386	386	386	386	386	386

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

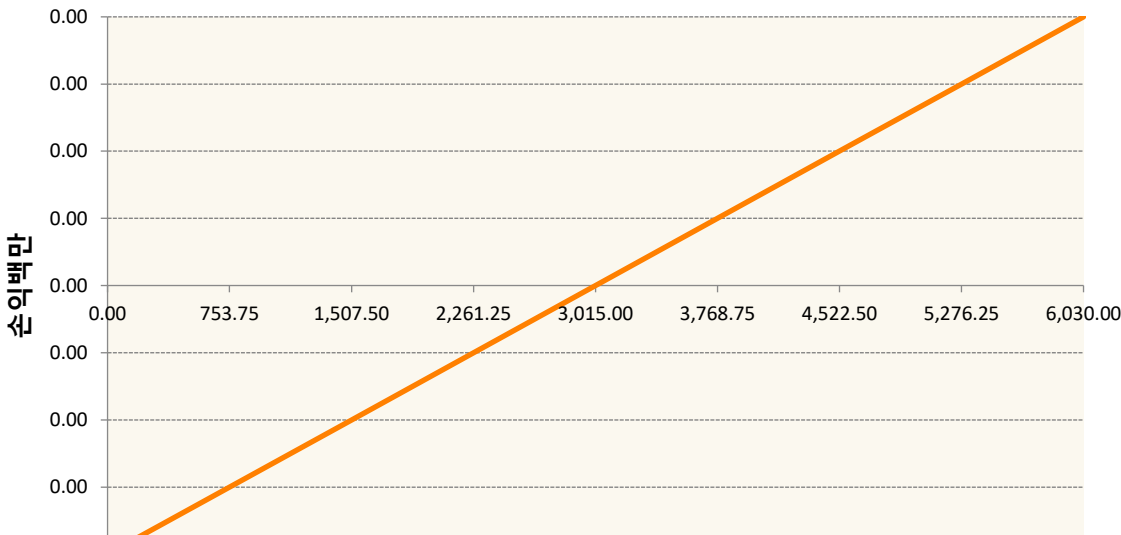
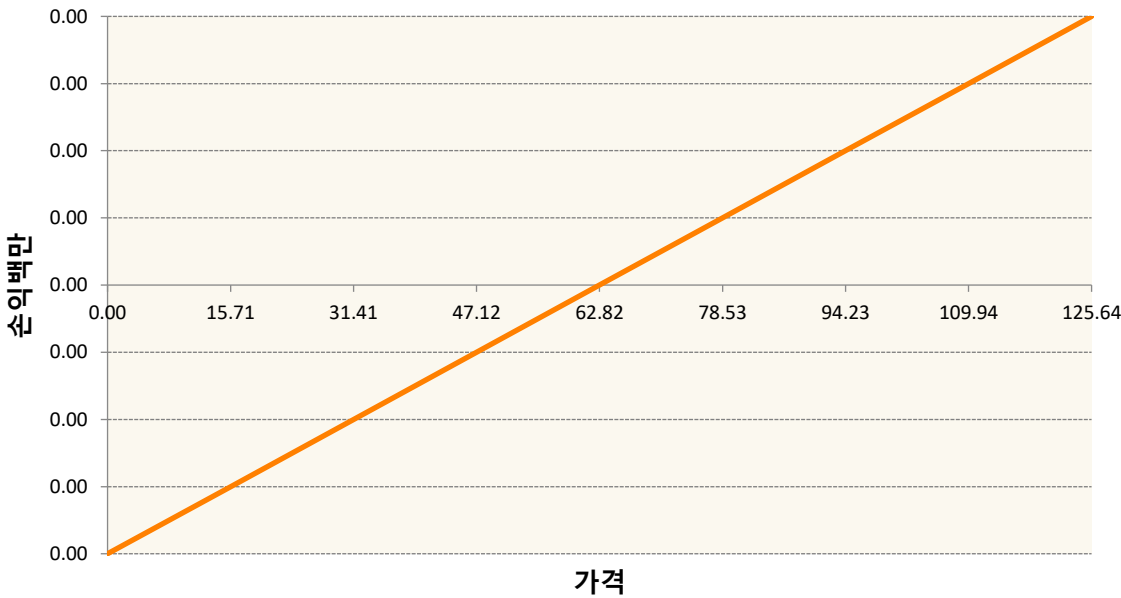
포커스농산물모(채권-파생형)

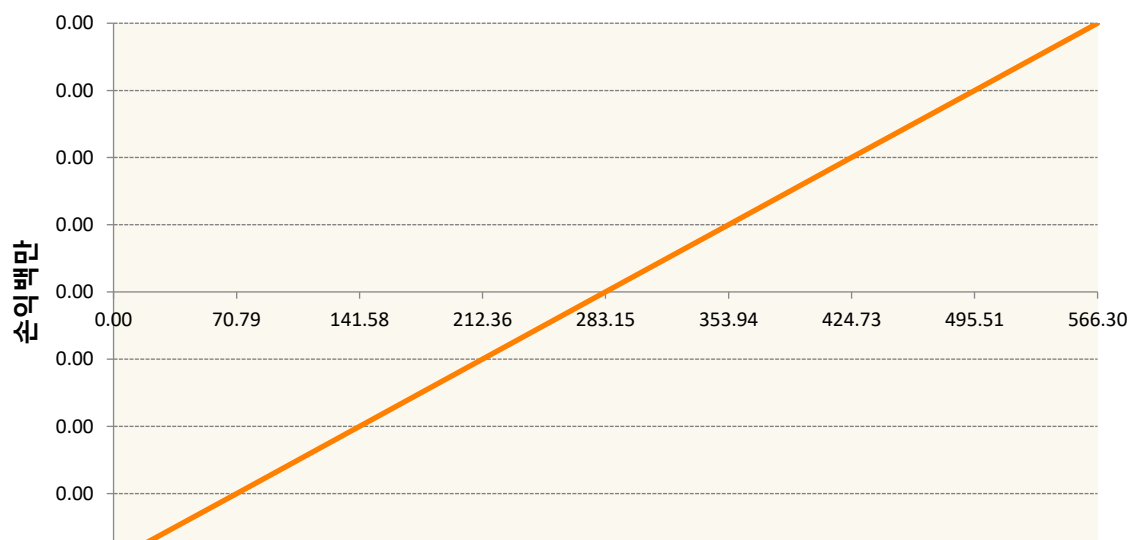
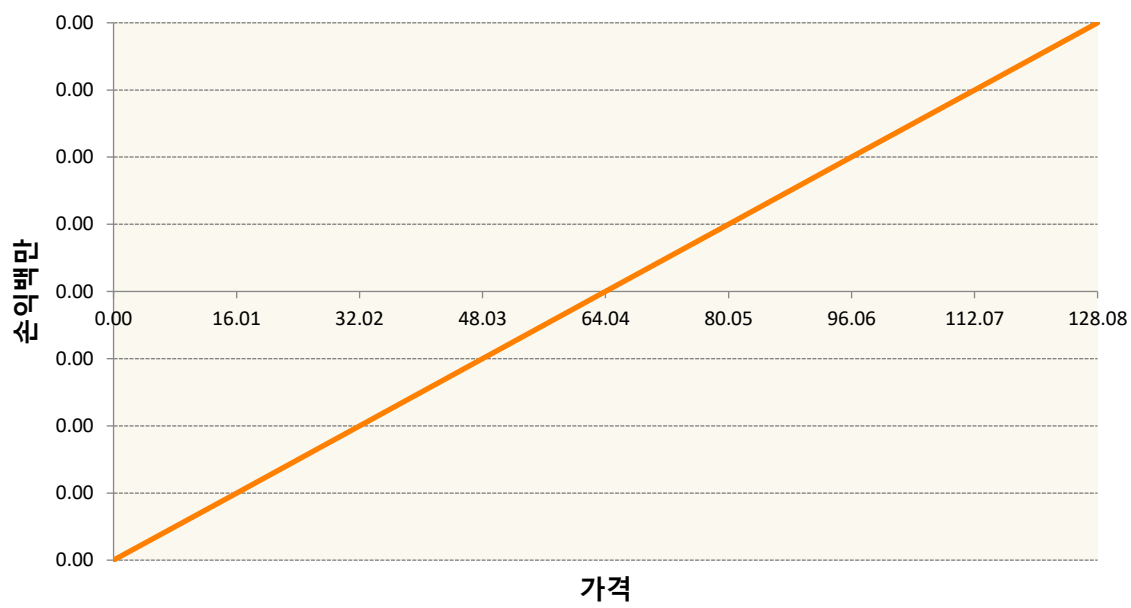
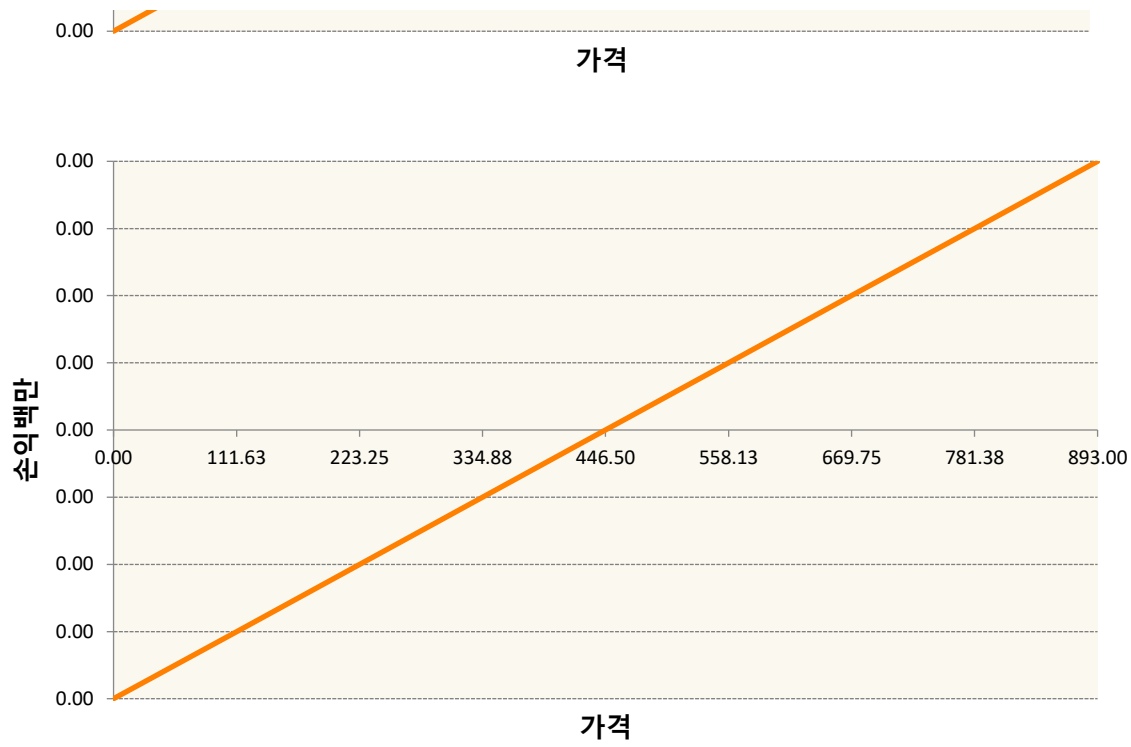
1. 계약금액

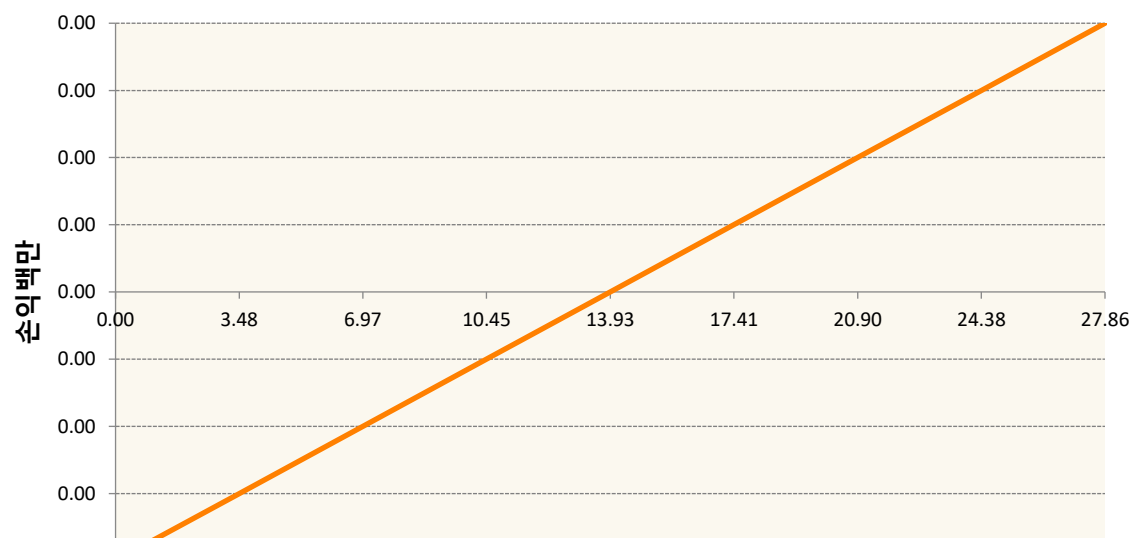
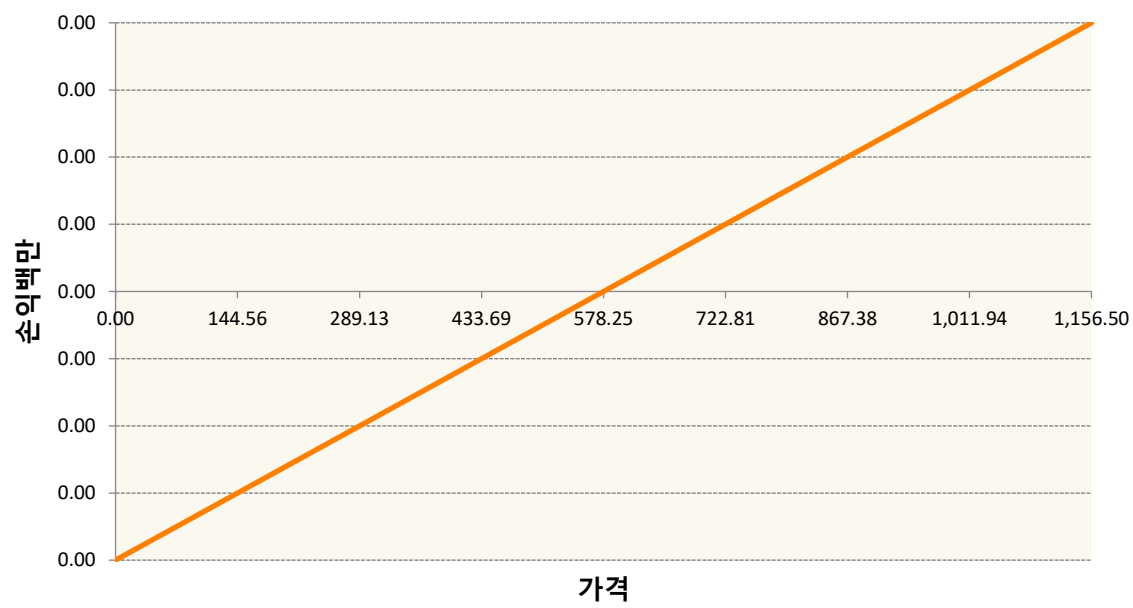
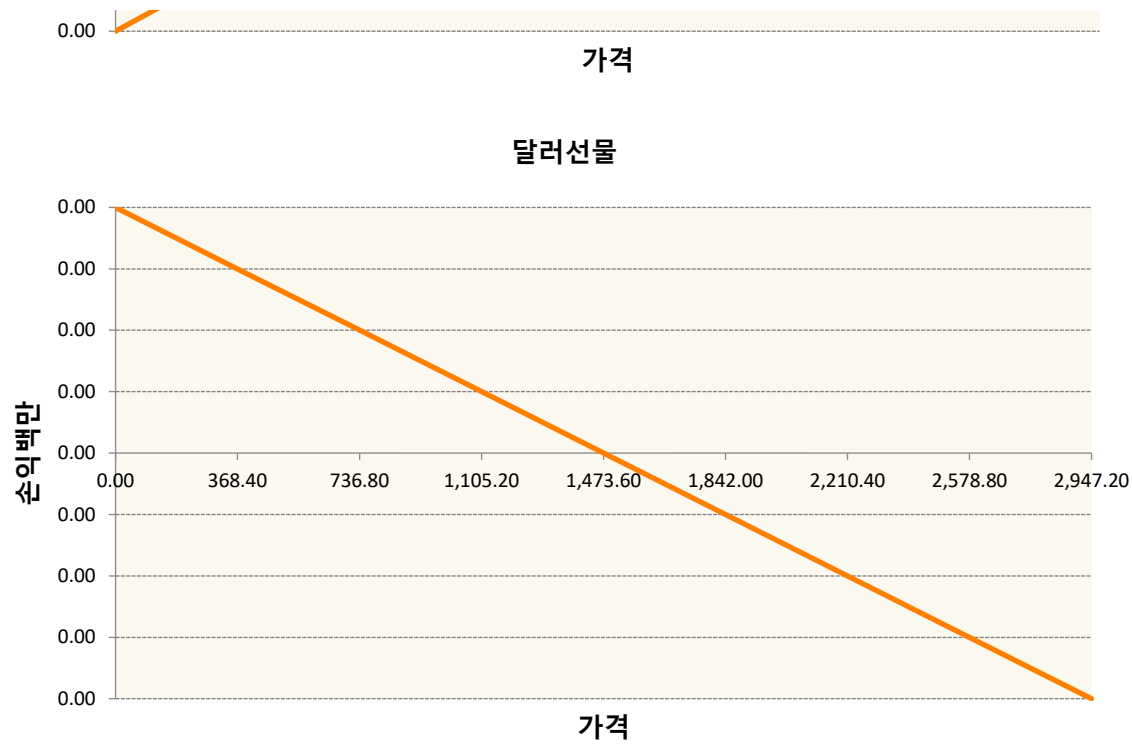
(단위:USD 백만)

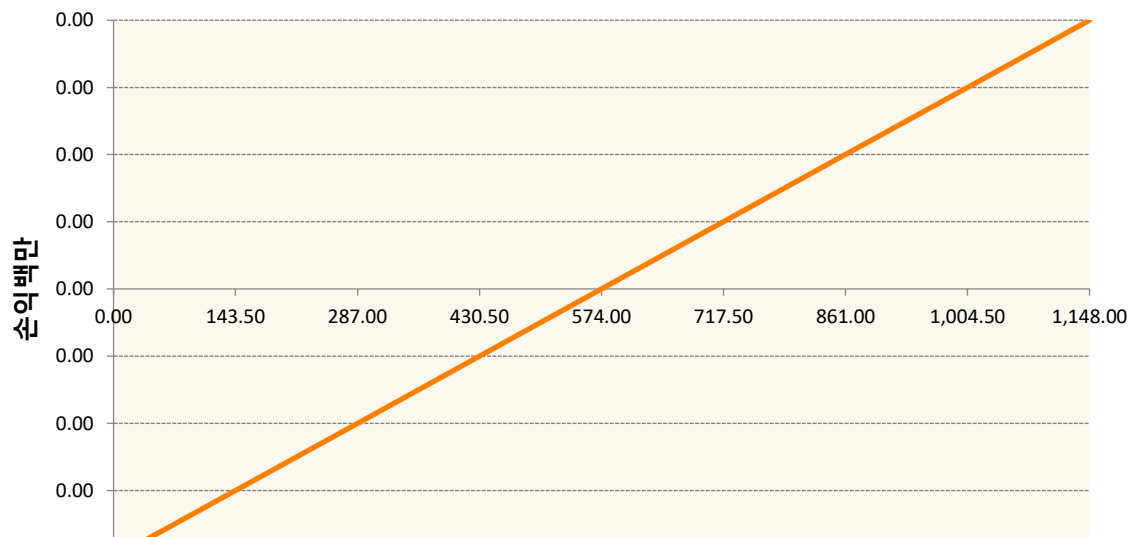
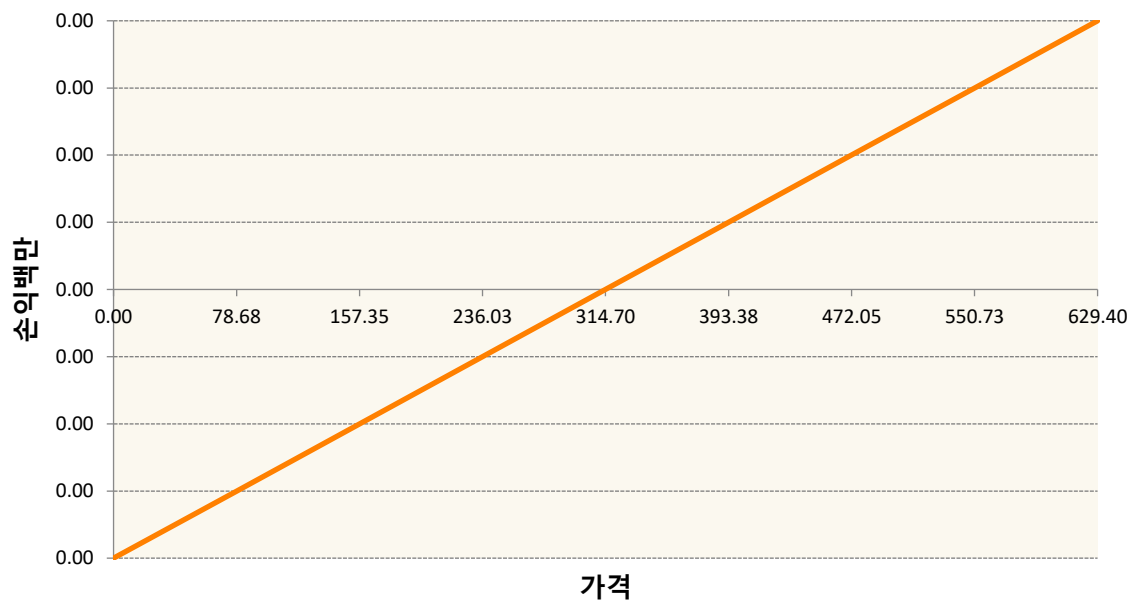
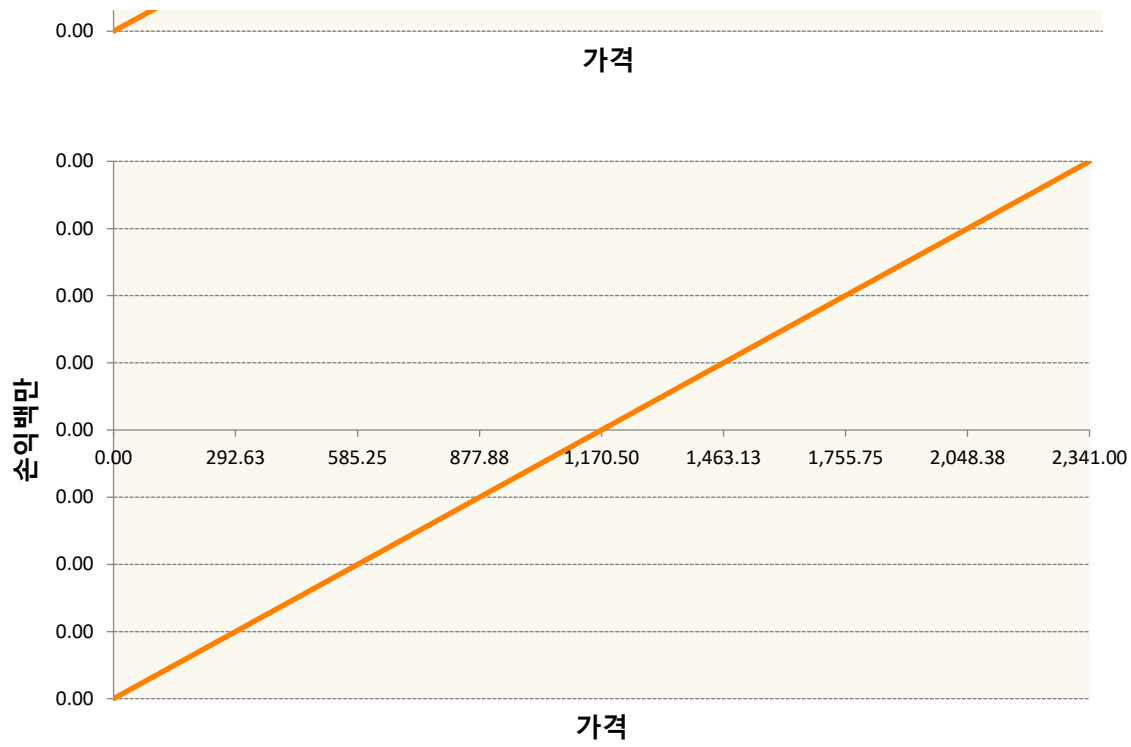
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,258	0	1,258	
누계	유가증권	선물	1,693	0	1,693	
누계	통화	선물	0	309	-309	장내

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	2026-03-05
기준일	2026-03-04

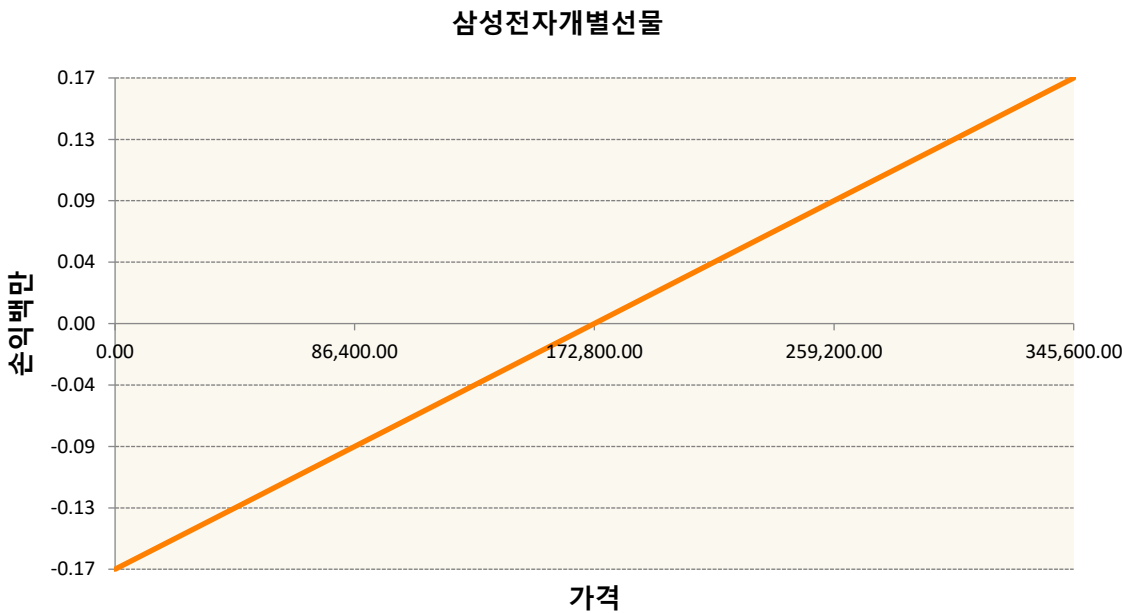
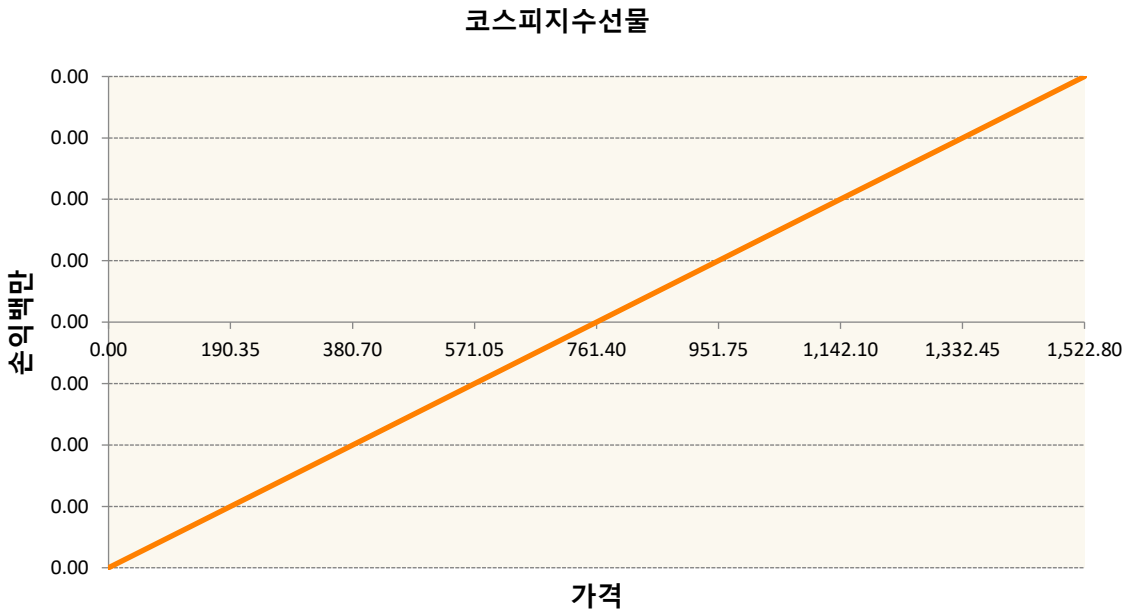
스마트인덱스모

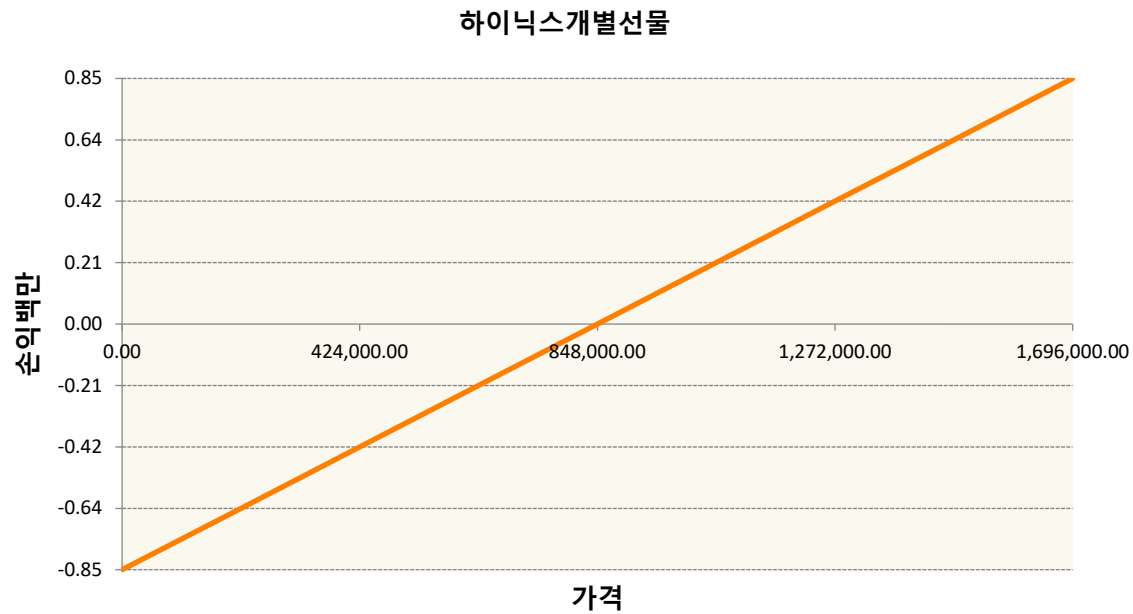
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	756	0	756	장내
누계	유가증권	선물	3,744	0	3,744	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		289
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		3
KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물		7

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

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

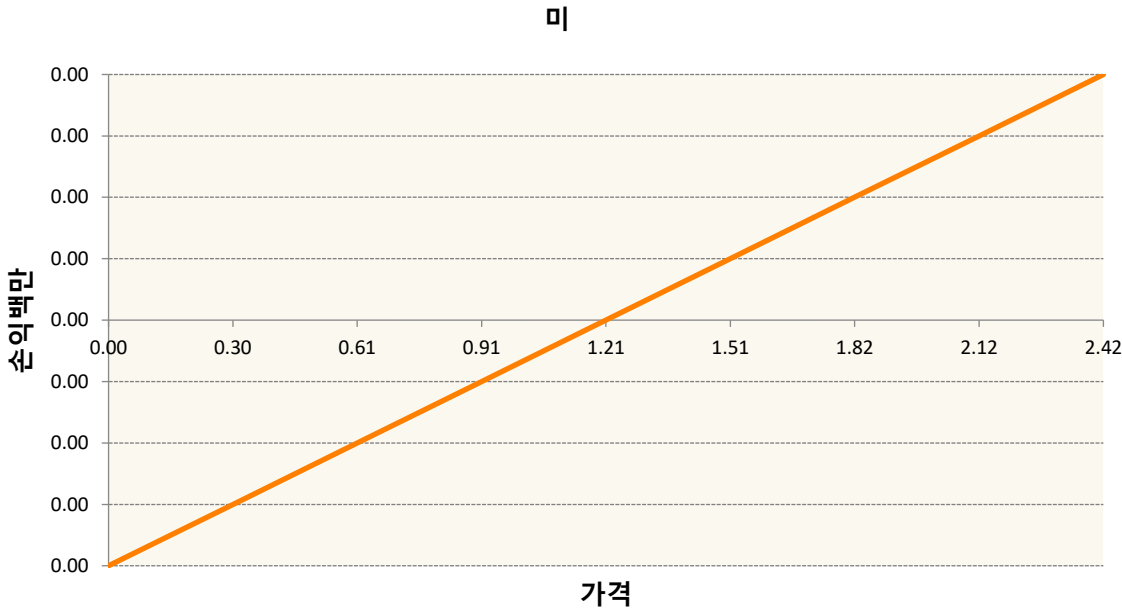
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,589	0	5,589	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

447

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

568

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

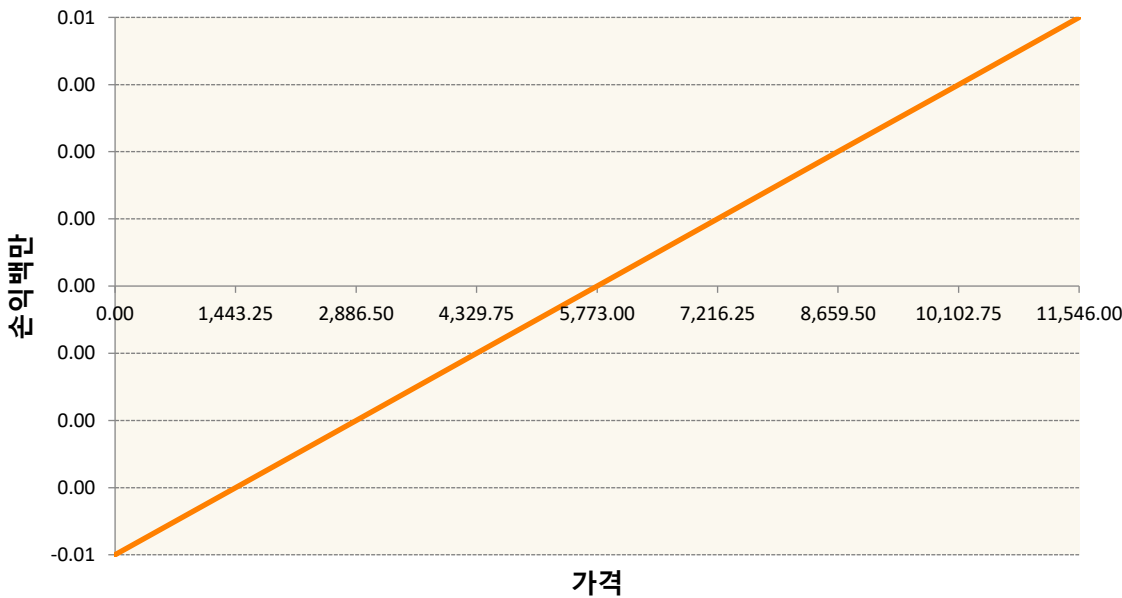
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	900	0	900	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EURO STOXX 50 Mar26	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

59

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

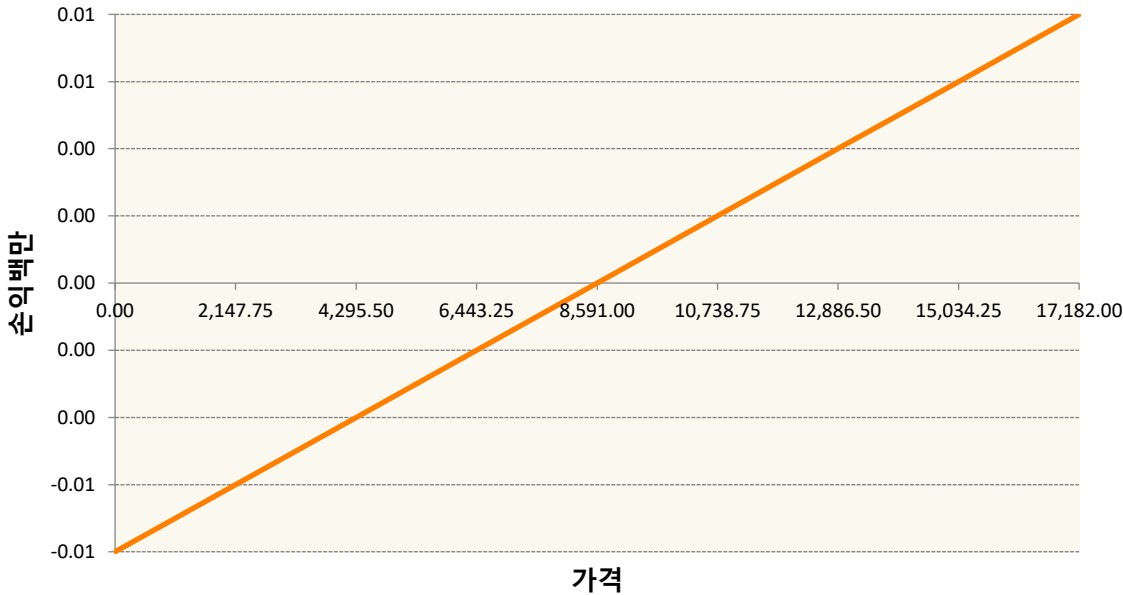
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,563	0	1,563	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH6	HSCEI Futures Mar26	125
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

144

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

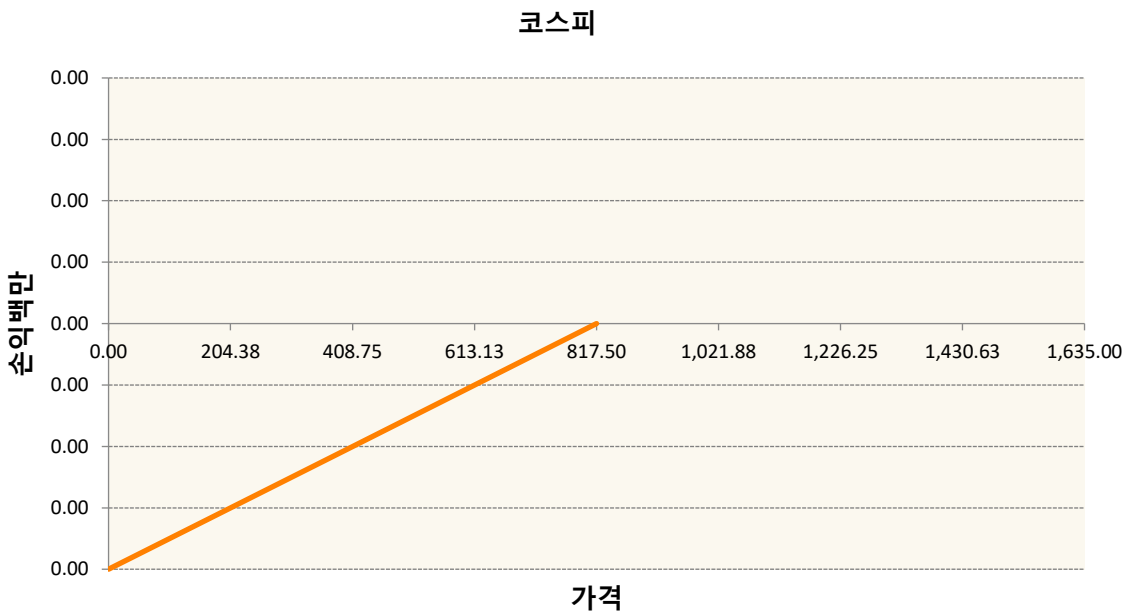
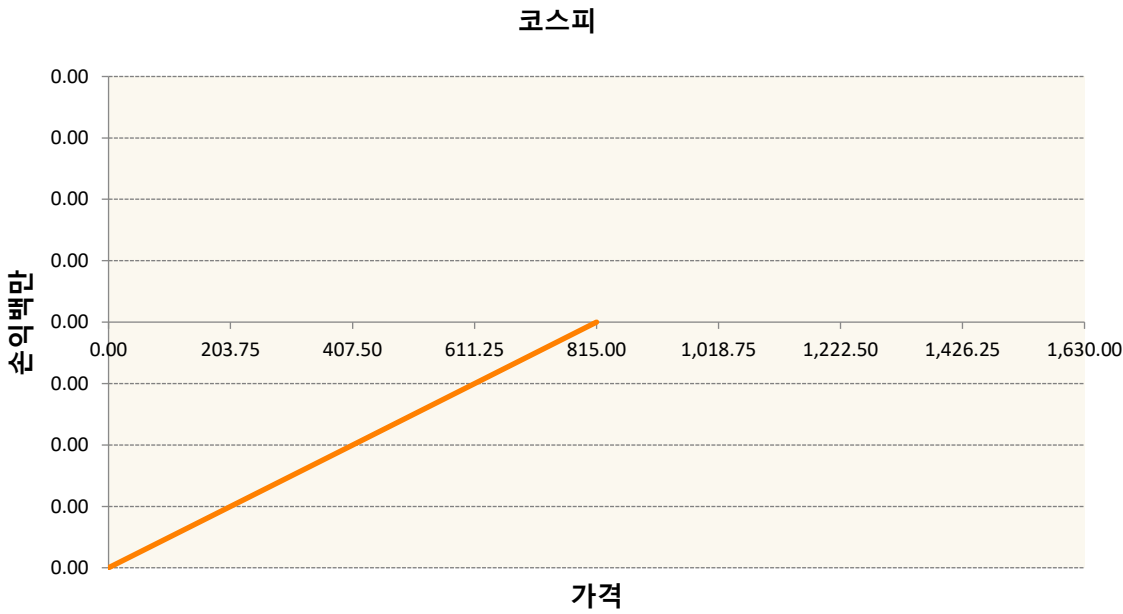
커버드콜모(주식혼합-파생형)

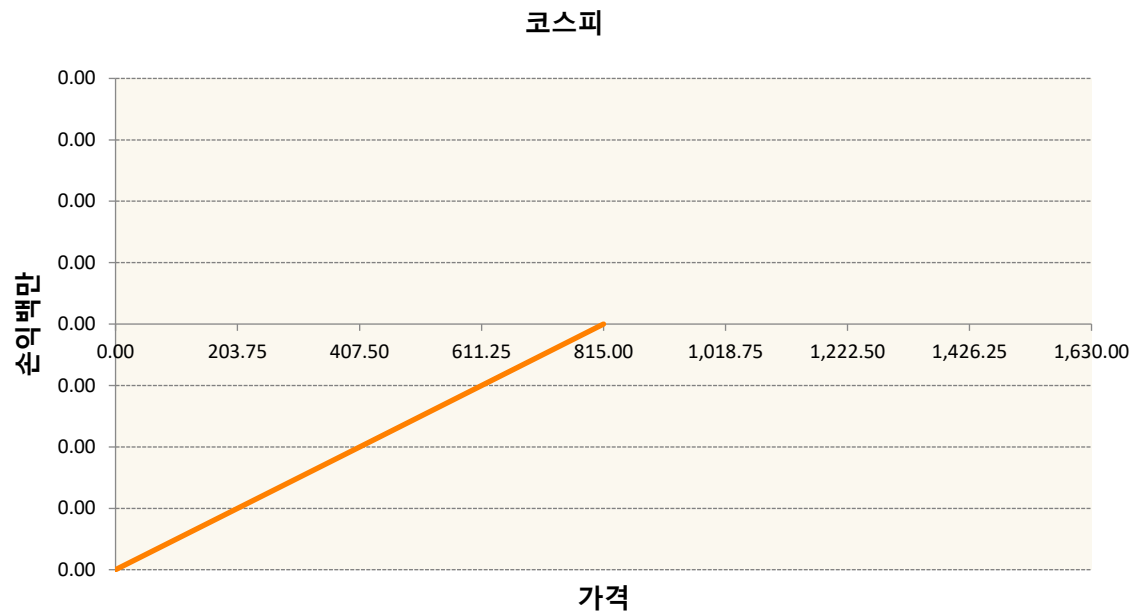
1. 계약금액

(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 2026-03-05

기준일 2026-03-04

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	2026-03-05
기준일	2026-03-04

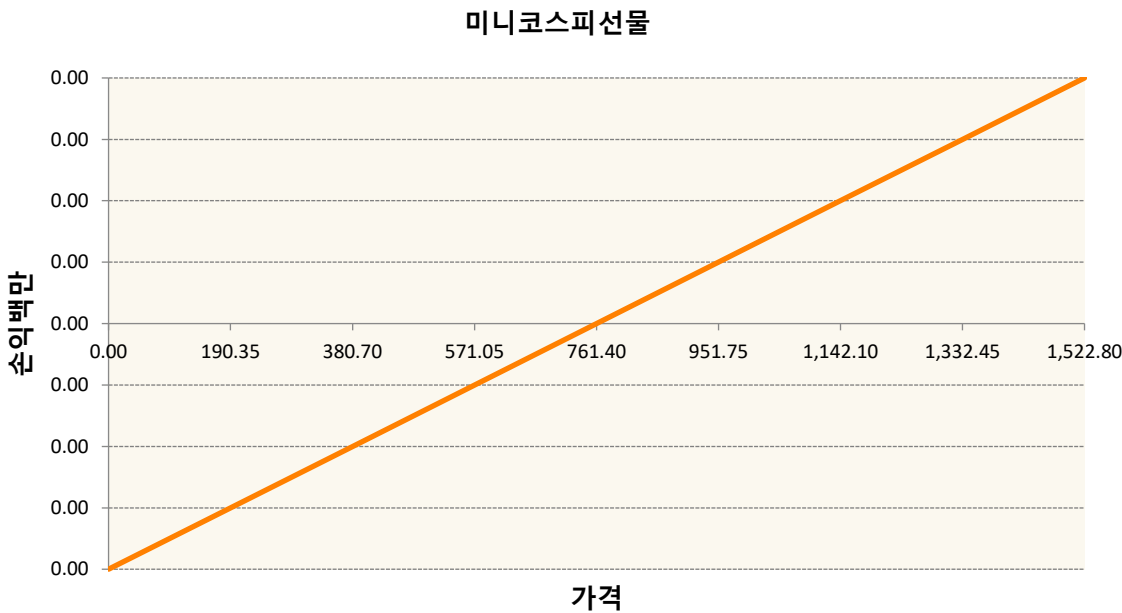
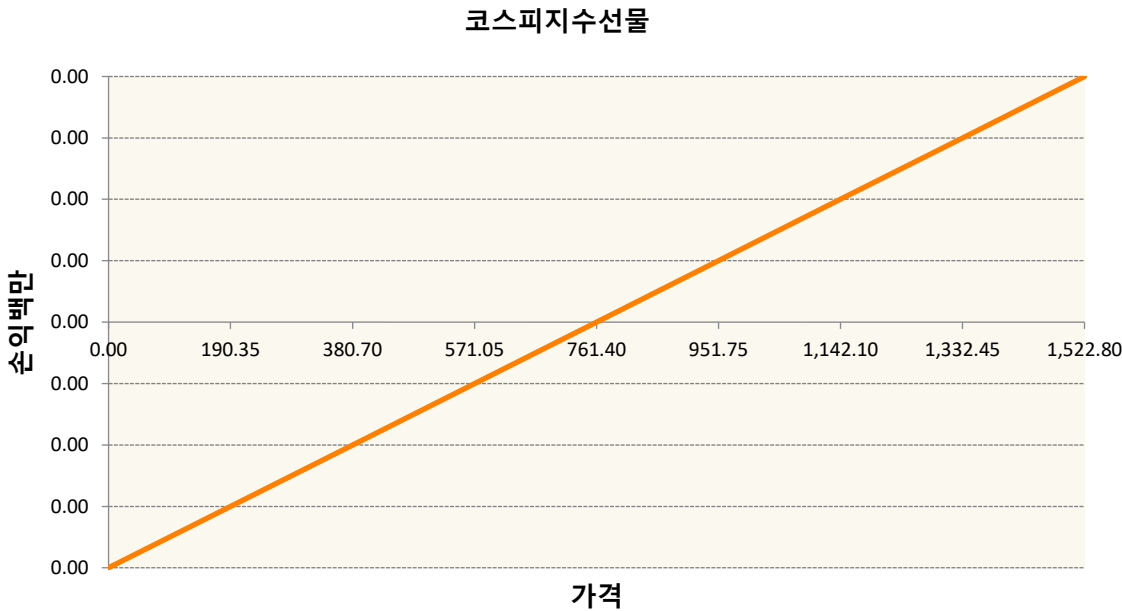
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

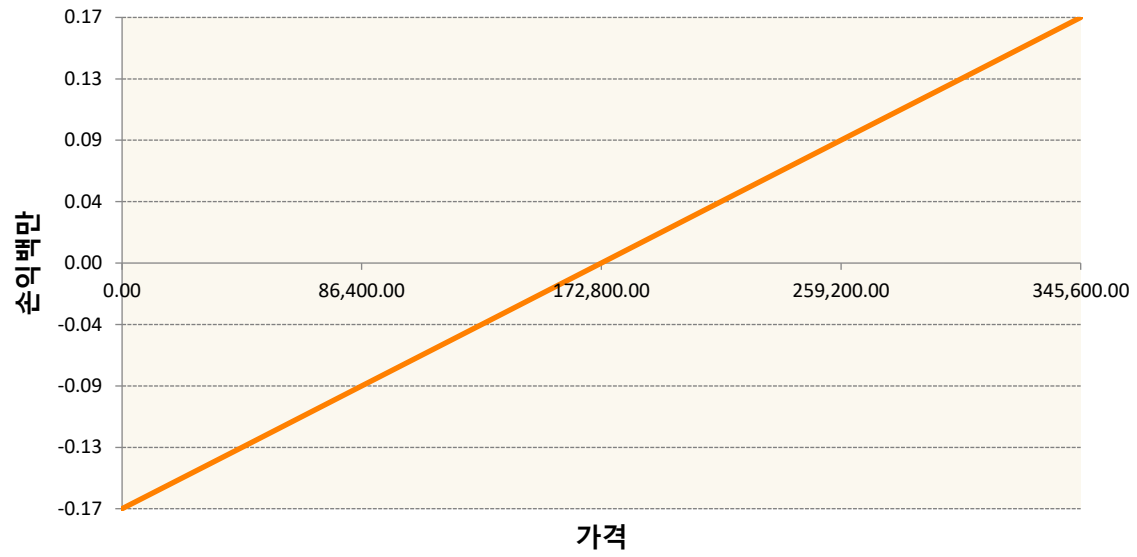
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	397	-397	장내
누계	유가증권	선물	6,040	0	6,040	장내

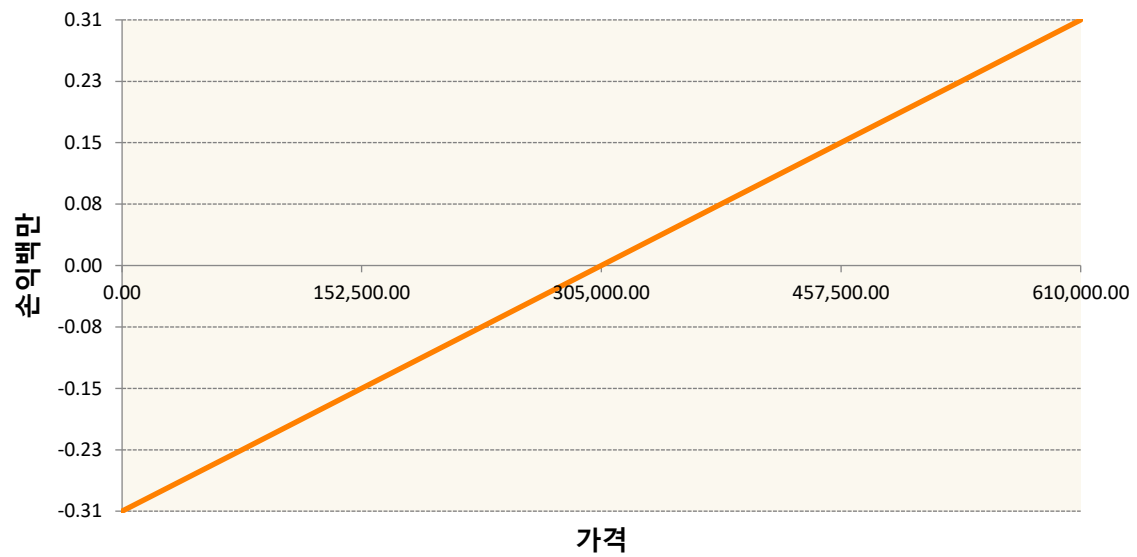
2. 만기시점의 손익구조



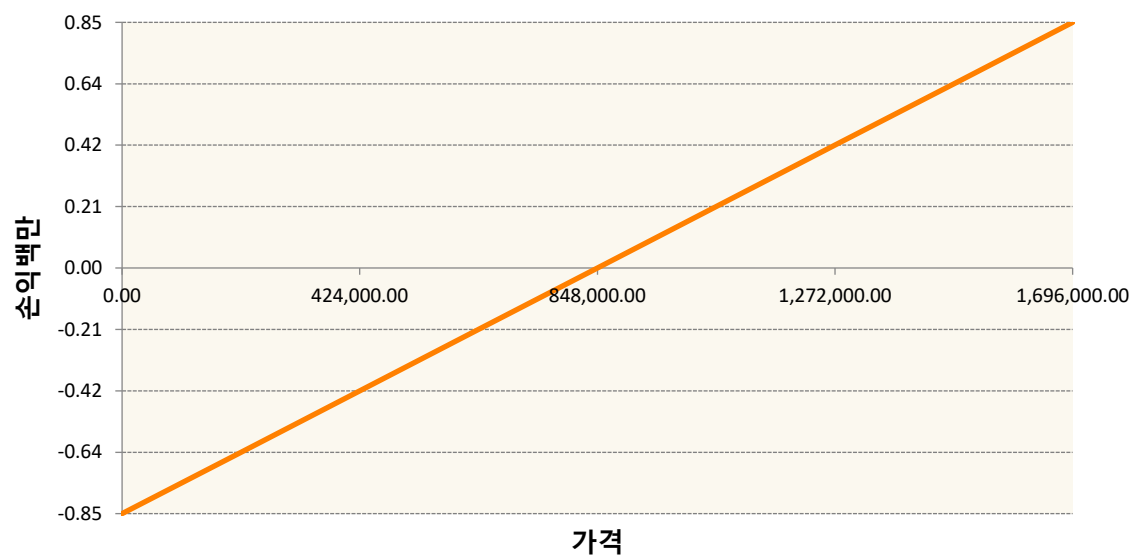
삼성전자개별선물



화학개별선물



하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		76
KR4A056300 2026-03 미니코스피200 선물		79
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		1
KR4A476300 2026-03 LG화학개별선물		6
KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물		4

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

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

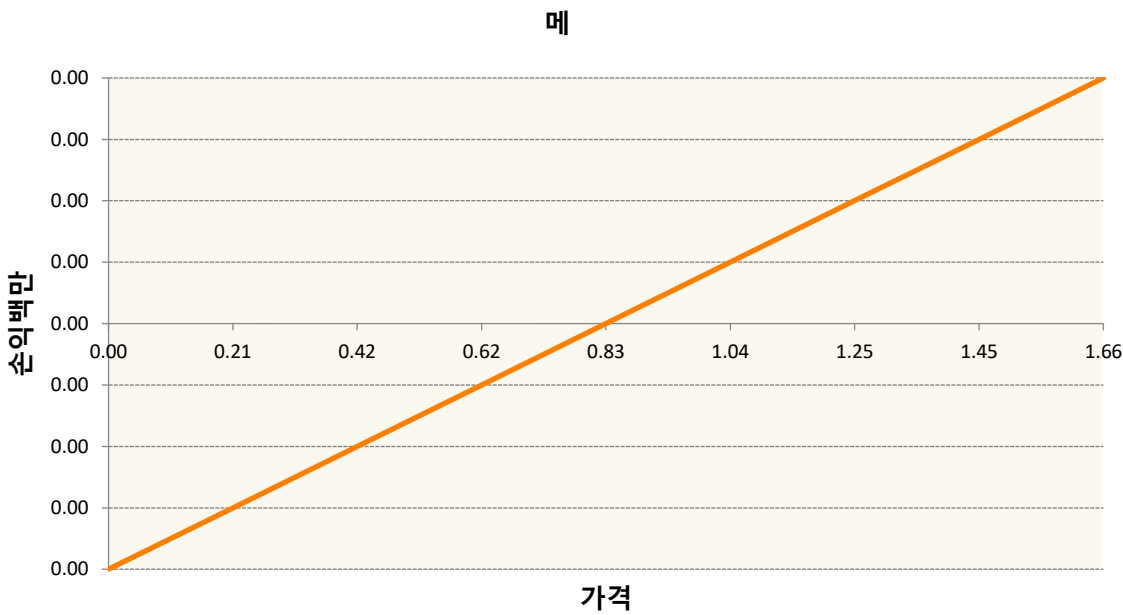
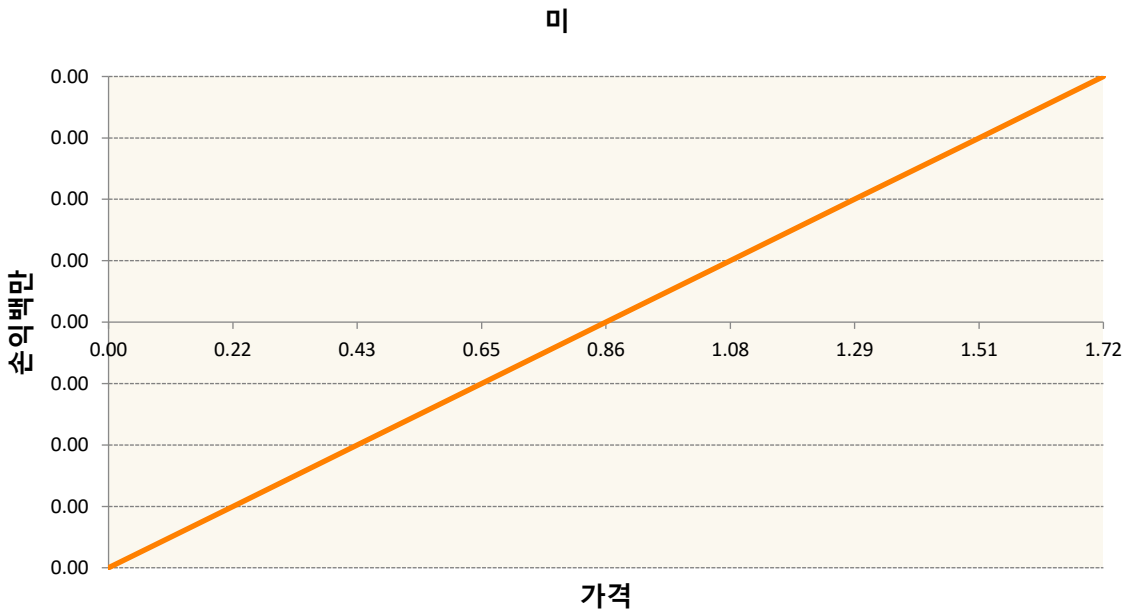
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,271	0	6,271	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		401
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	540

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

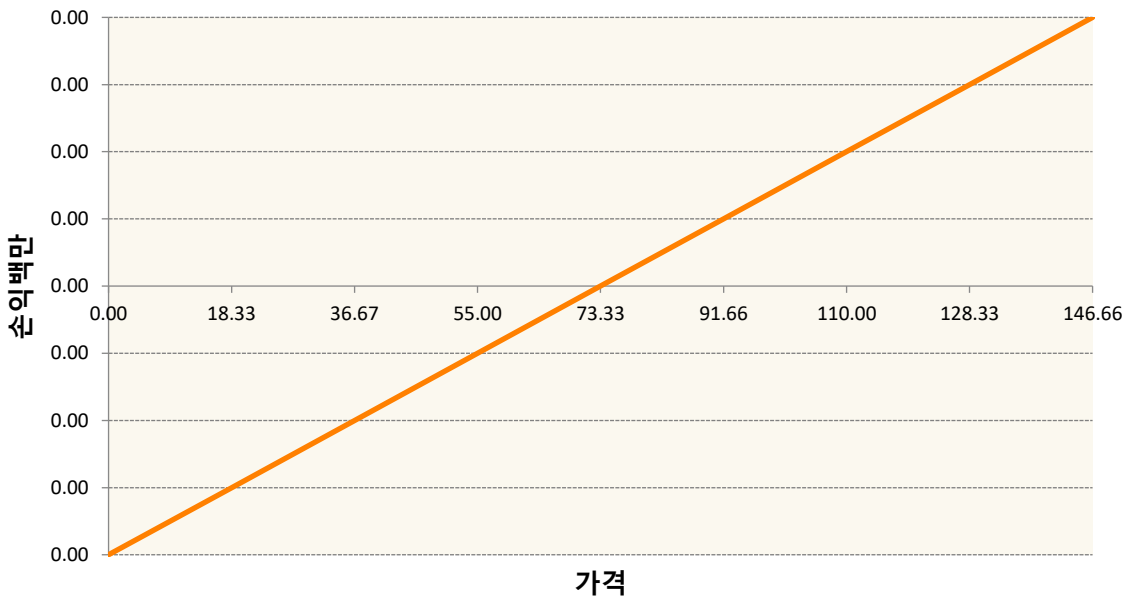
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,859	0	4,859	
누계	통화	선도	273	2,448	-2,176	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G2P(EUR/KRW 31-03-26E	22
FXW213G2R(KRW/EUR 31-03-26E	196
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	389

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

(단위:백만원)

679

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

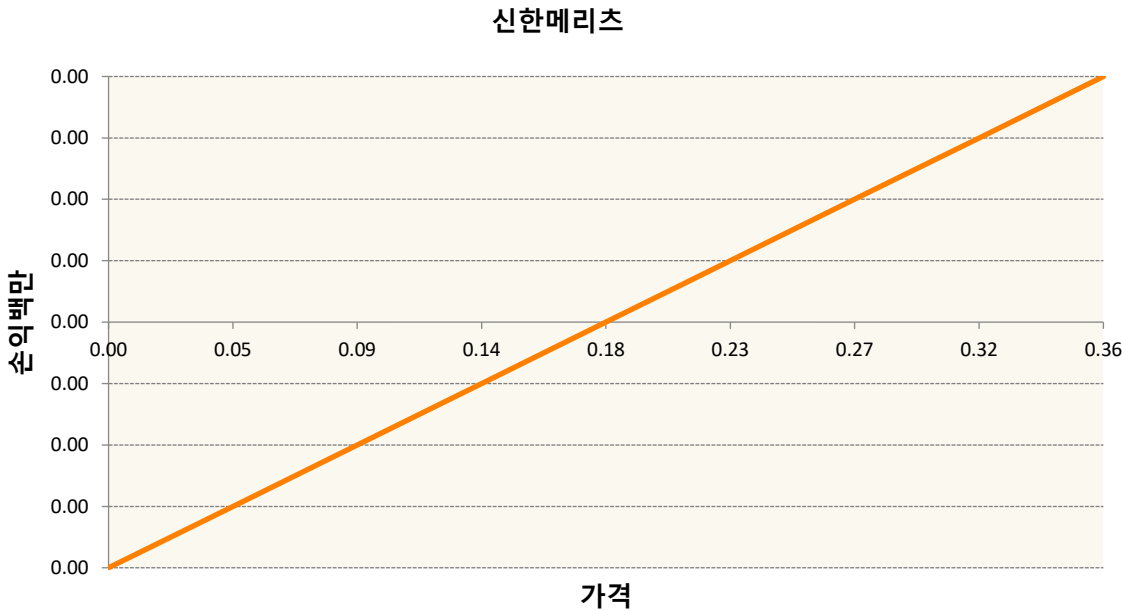
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,215	0	3,215	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	23
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	16
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	16
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	39

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

(단위:백만원)

170

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

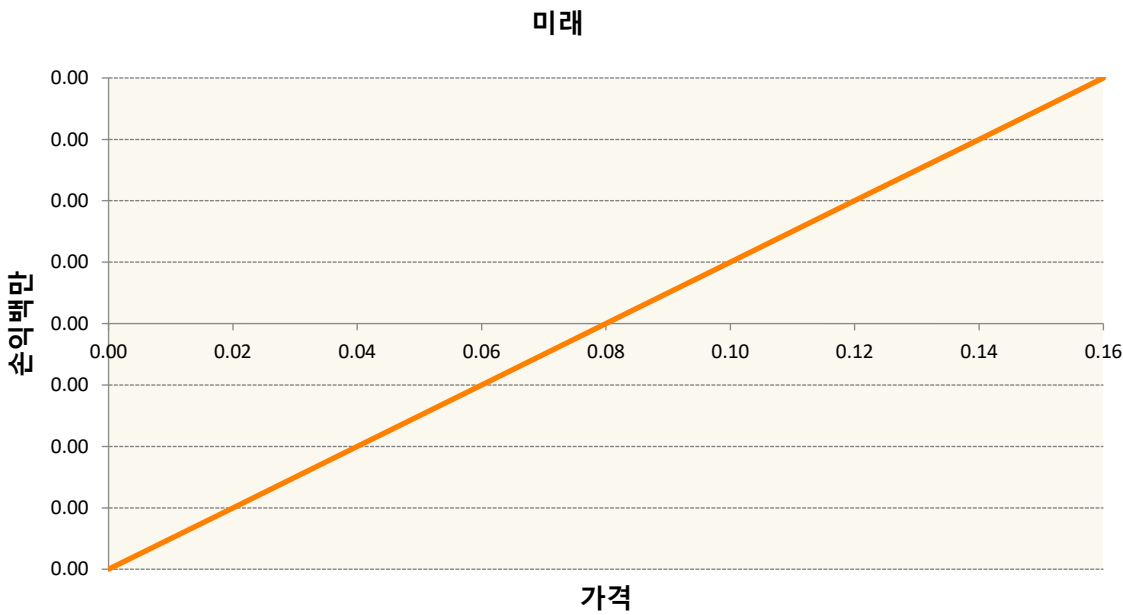
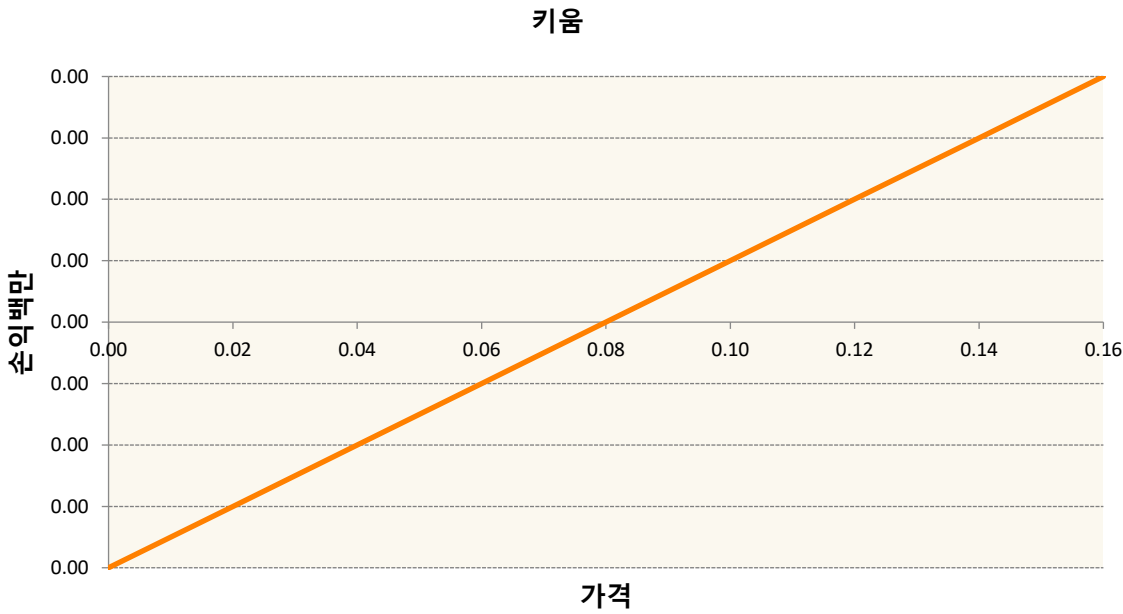
SOL차이나육성산업엑티브상장지

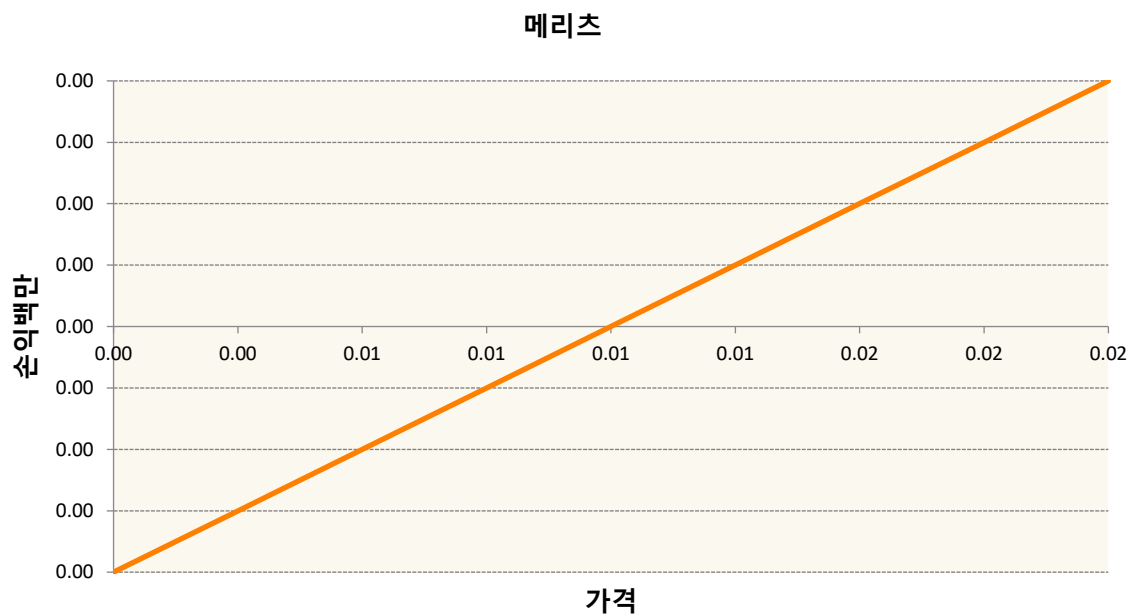
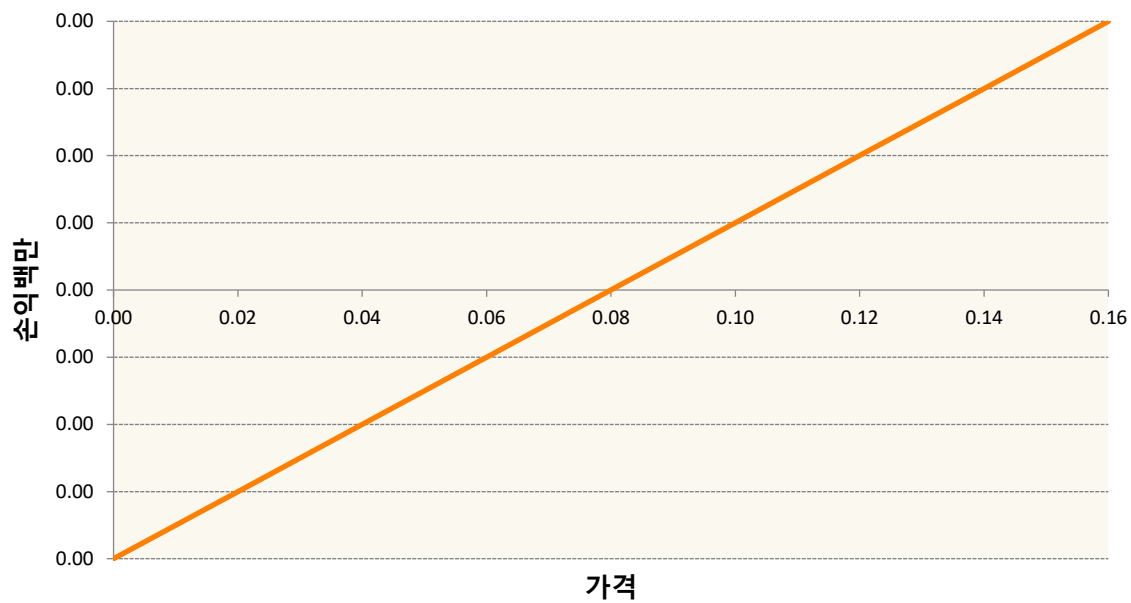
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	887	0	887	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)

6
37
19
18

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

(단위:백만원)

148

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

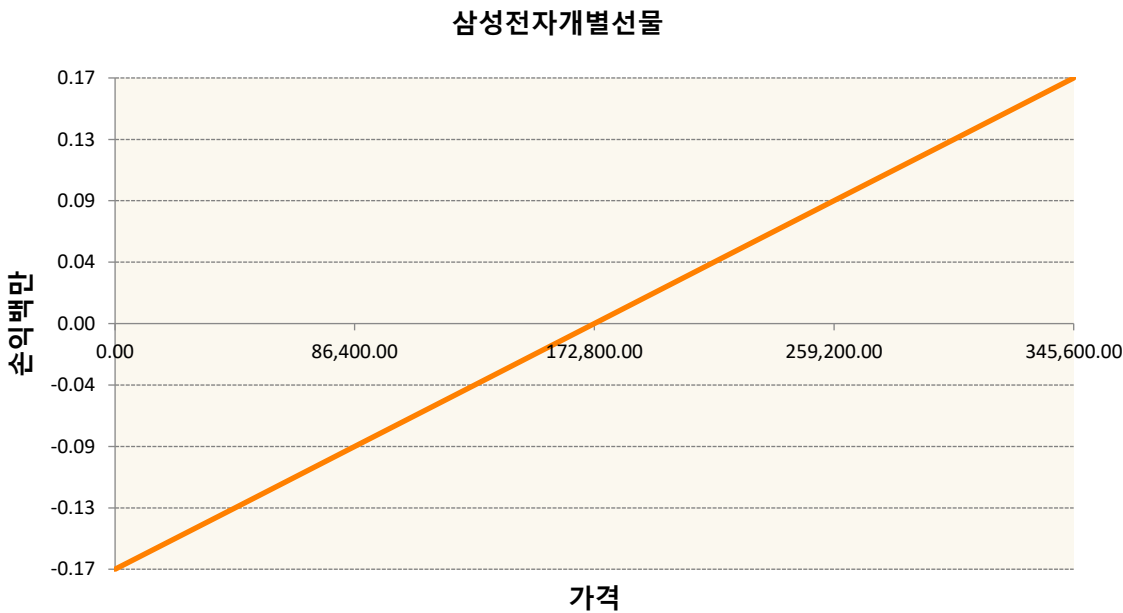
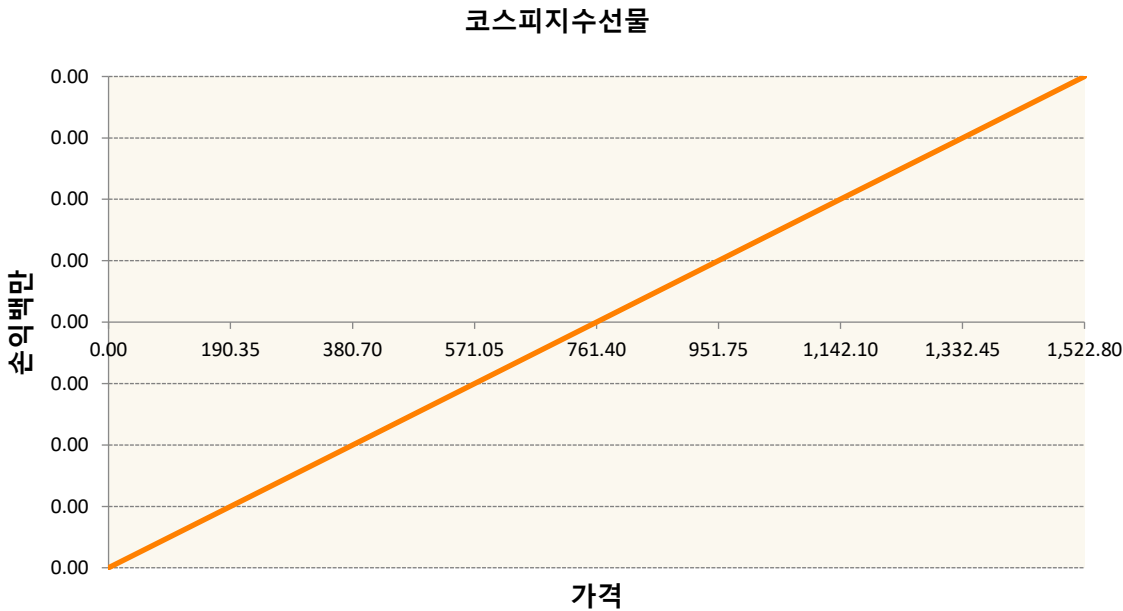
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

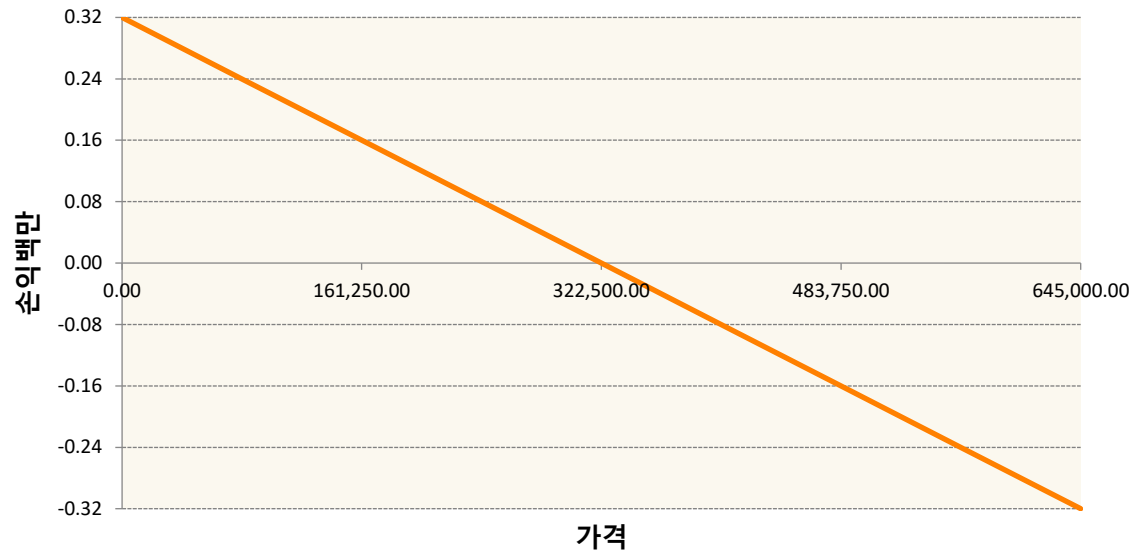
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,752	976	1,776	장내
누계	유가증권	선물	11,269	4,523	6,746	장내

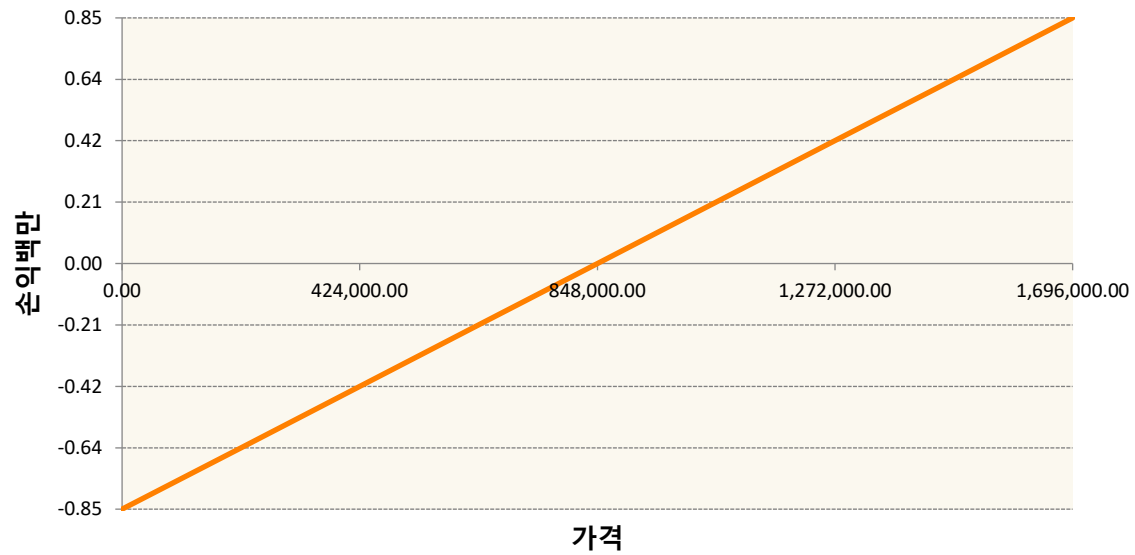
2. 만기시점의 손익구조



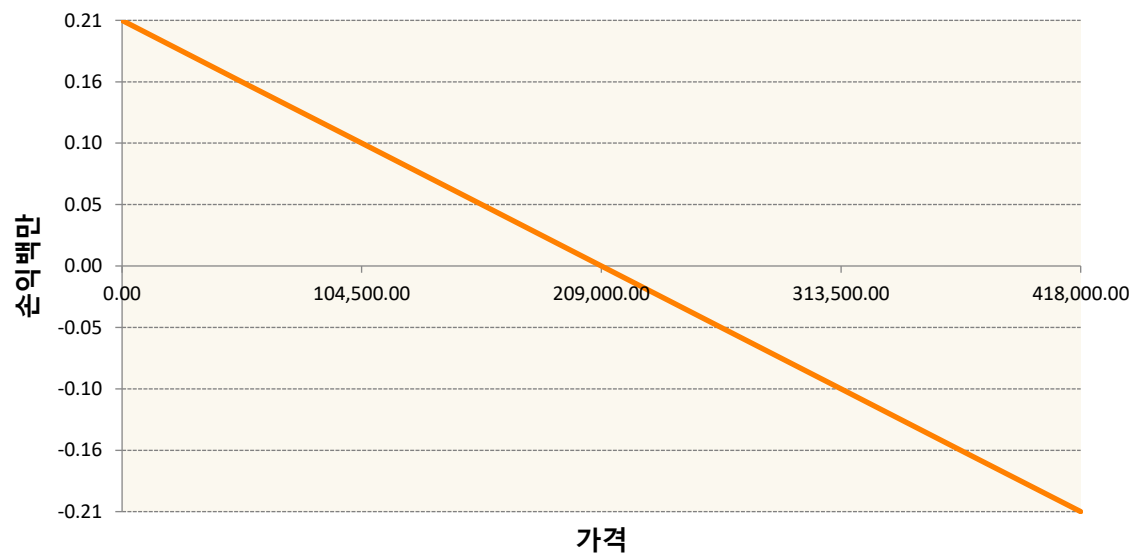
홀딩스개별선물



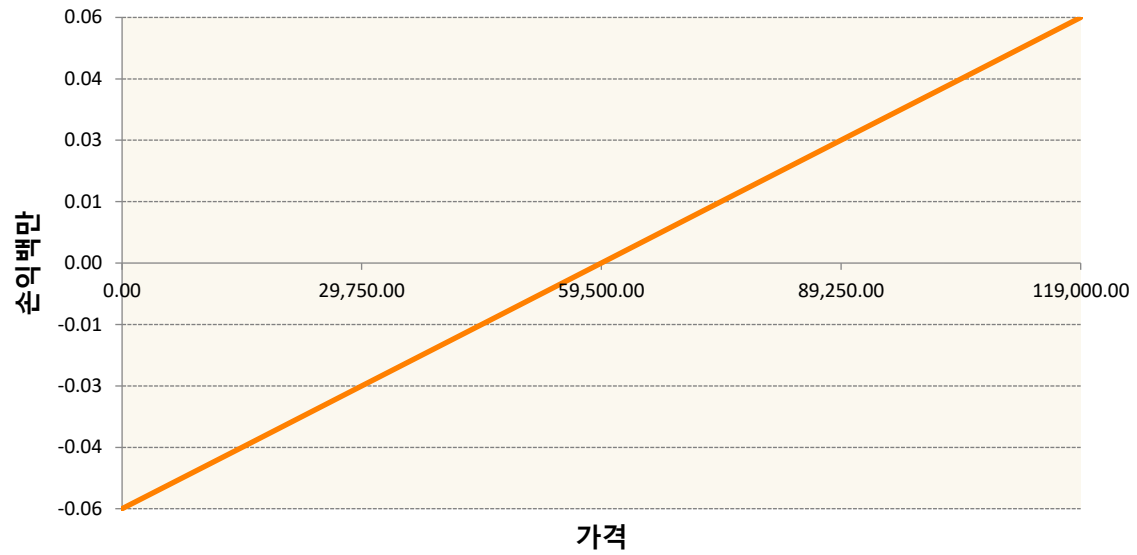
하이닉스개별선물



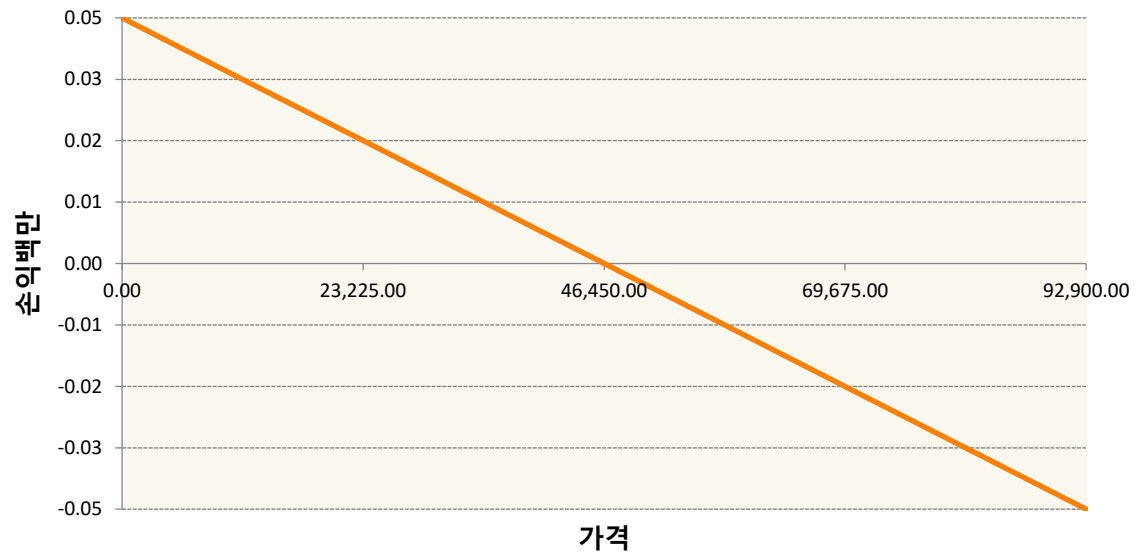
개별선물



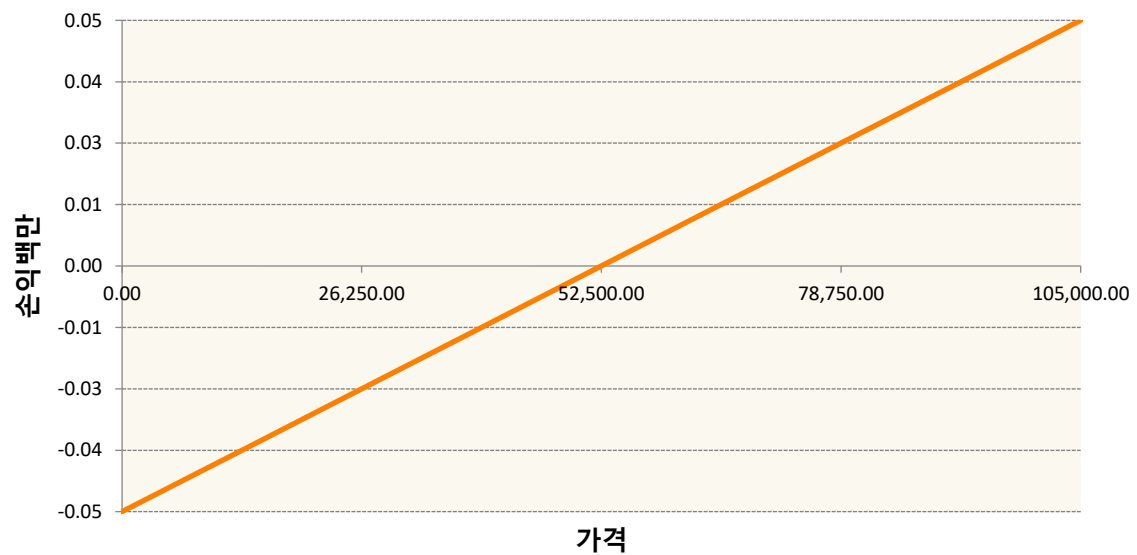
포스코인터내셔널개별선물



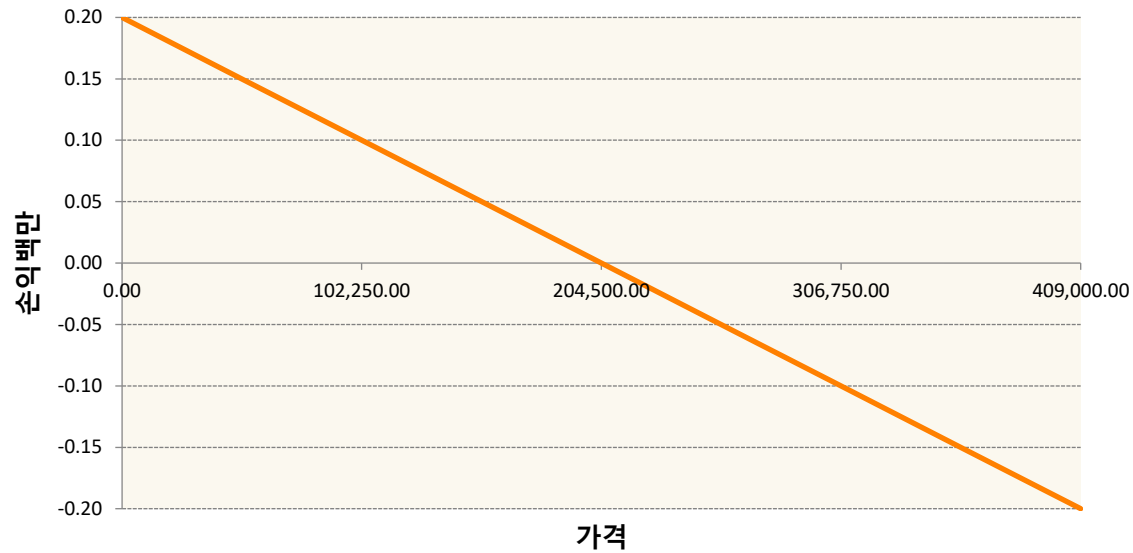
카카오개별선물



카카오페이개별선물



현대로템개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01630008 2026-03 코스피200지수선물								515
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-515	-515	-515	-515	-515	-515	-515	-515
-5.33%	-343	-343	-343	-343	-343	-343	-343	-343
-2.67%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	172	172	172	172	172	172	172	172
5.33%	343	343	343	343	343	343	343	343
8.00%	515	515	515	515	515	515	515	515
KR4A11630006 2026-03 삼성전자개별선물								260
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
-2.67%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	87	87	87	87	87	87	87	87
5.33%	173	173	173	173	173	173	173	173
8.00%	260	260	260	260	260	260	260	260
KR4A13630004 2026-03 POSCO홀딩스개별선물								50
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	50	50	50	50	50	50	50	50
-5.33%	33	33	33	33	33	33	33	33
-2.67%	17	17	17	17	17	17	17	17
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50

KR4A50630008	2026-03 SK하이닉스개별선물	73
--------------	--------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	73	73	73	73	73	73	73

KR4A56630002	2026-03 NAVER개별선물	122
--------------	-------------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	122	122	122	122	122	122	122
-5.33%	81	81	81	81	81	81	81
-2.67%	41	41	41	41	41	41	41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122

KR4AB7630000	2026-03 포스코인터내셔널개별선물	49
--------------	----------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	49	49	49	49	49	49	49

KR4ACF630008	2026-03 카카오개별선물	120
--------------	-----------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	120	120	120	120	120	120	120
-5.33%	80	80	80	80	80	80	80
-2.67%	40	40	40	40	40	40	40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
8.00%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120

KR4AF7630001	2026-03 카카오페이가별선물	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

KR4AG6630000

2026-03 현대로템개별선물

70

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	70	70	70	70	70	70	70
-5.33%	47	47	47	47	47	47	47
-2.67%	23	23	23	23	23	23	23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70

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

(단위:백만원)

2,111

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

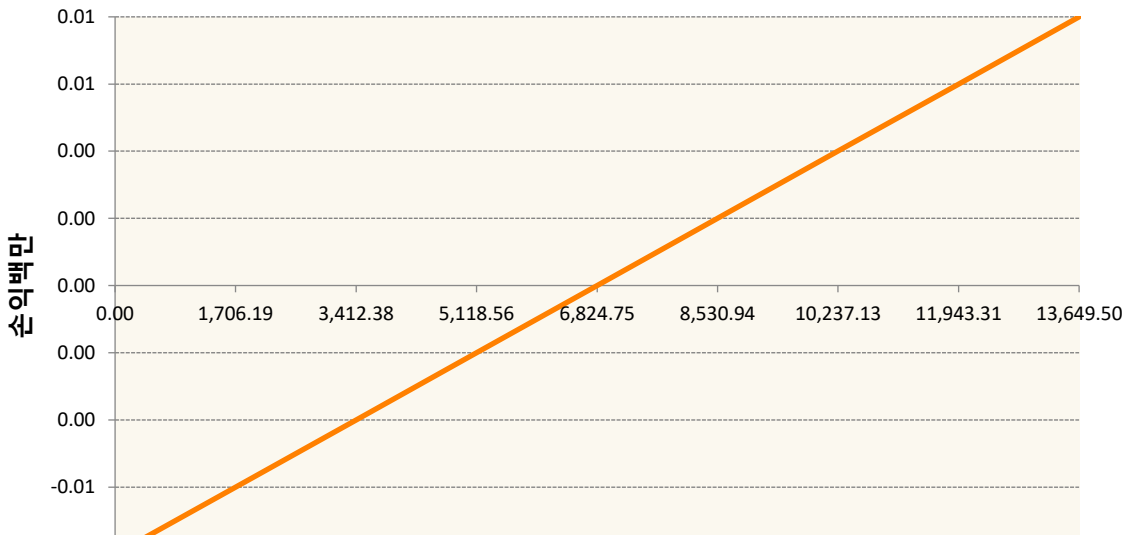
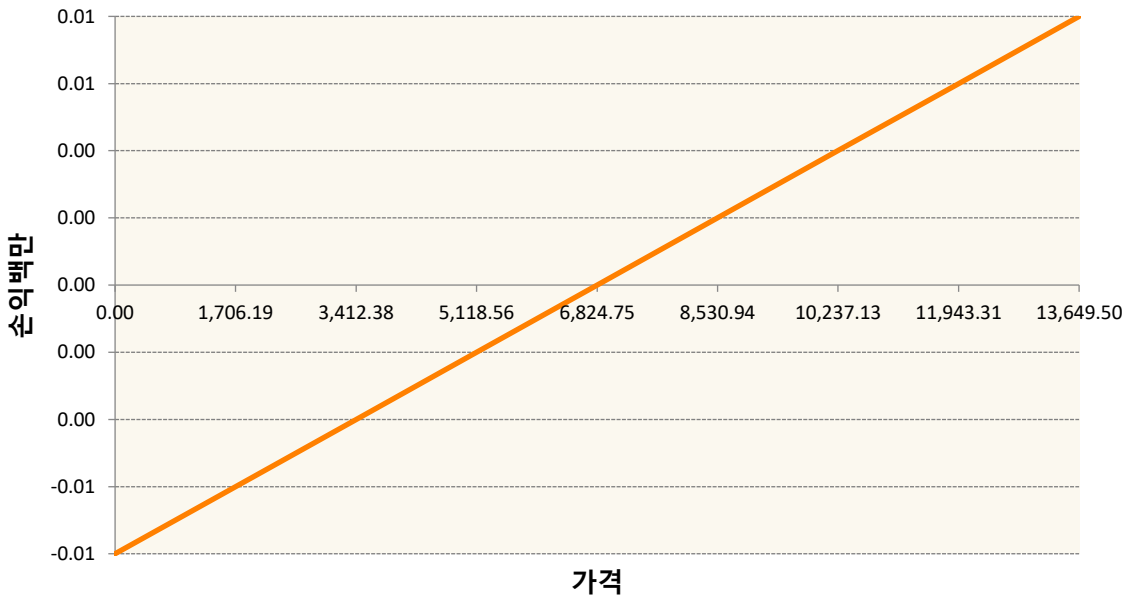
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

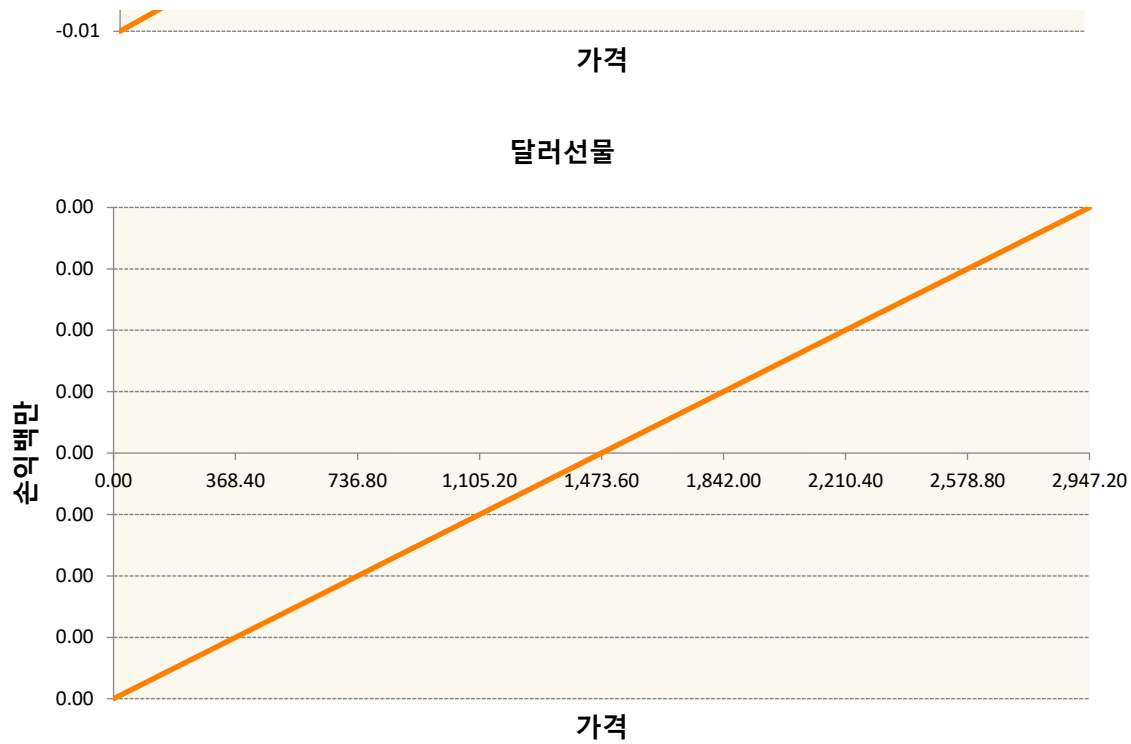
1. 계약금액

(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	101	0	101	장내
누계	지수	선물	52,827	0	52,827	
누계	통화	선물	12,231	0	12,231	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26		4,226
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26		8
KR4A756300 2026-03 달러선물			978

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,617

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

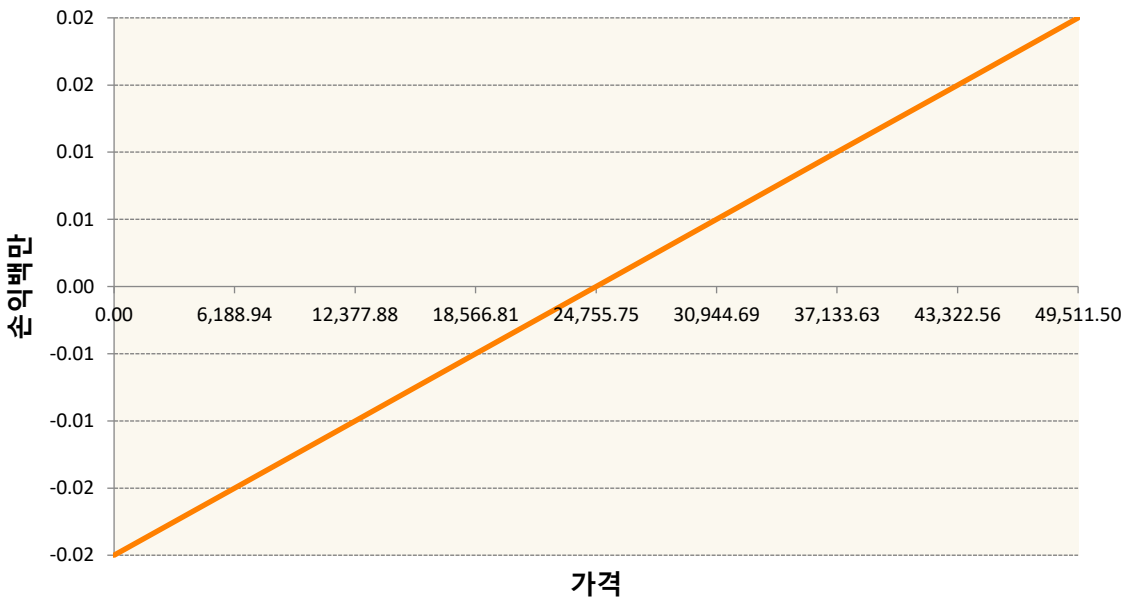
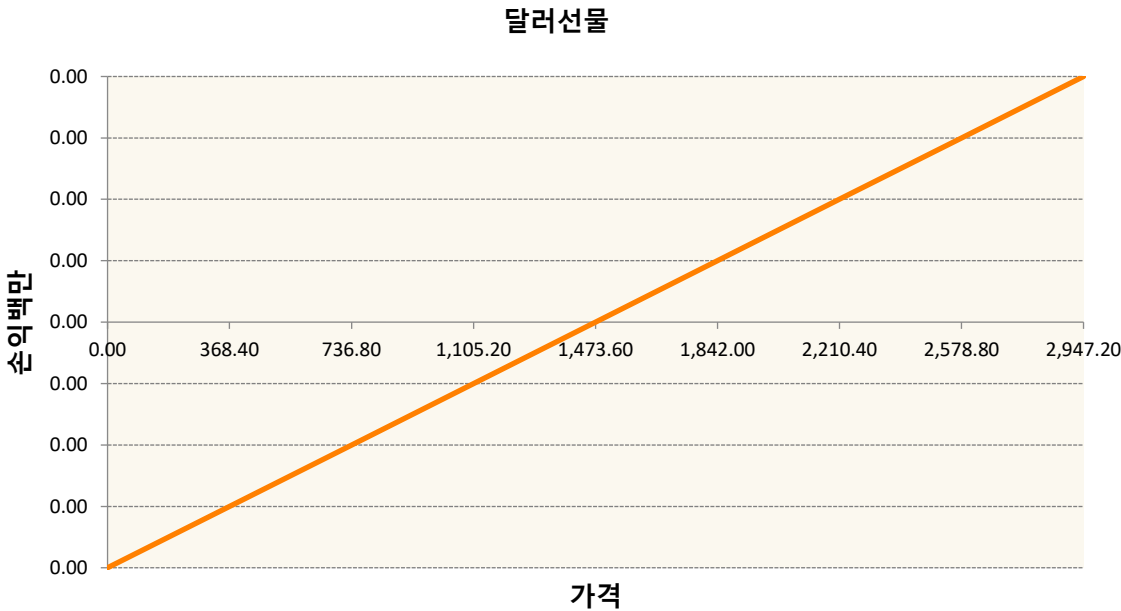
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	22,650	0	22,650	장내
누계	통화	선물	4,937	0	4,937	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A756300 2026-03 달러선물		395
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,812

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,971

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

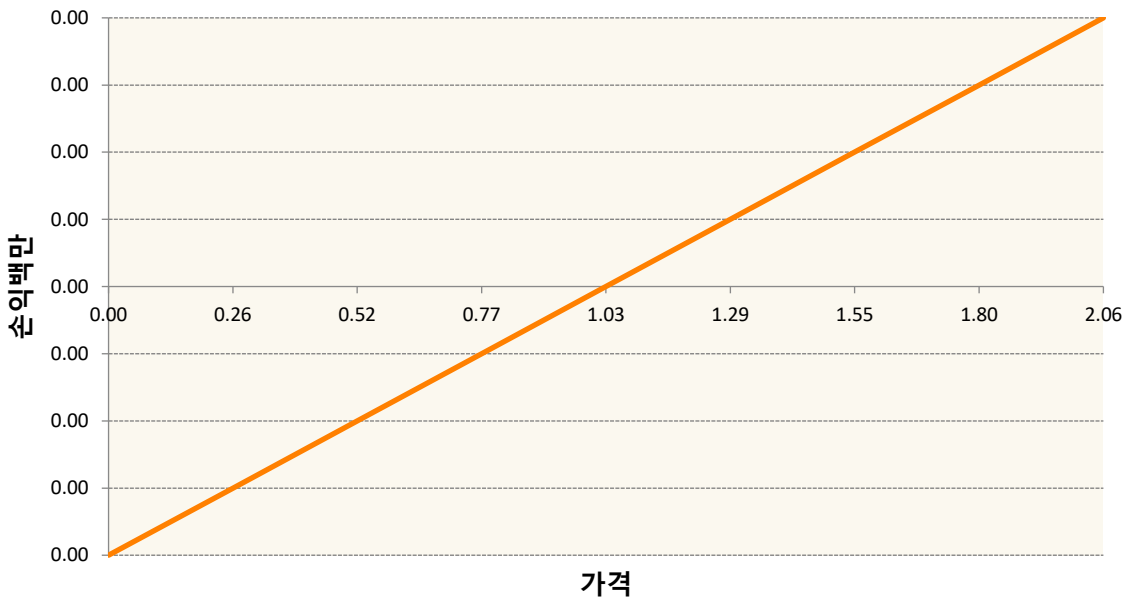
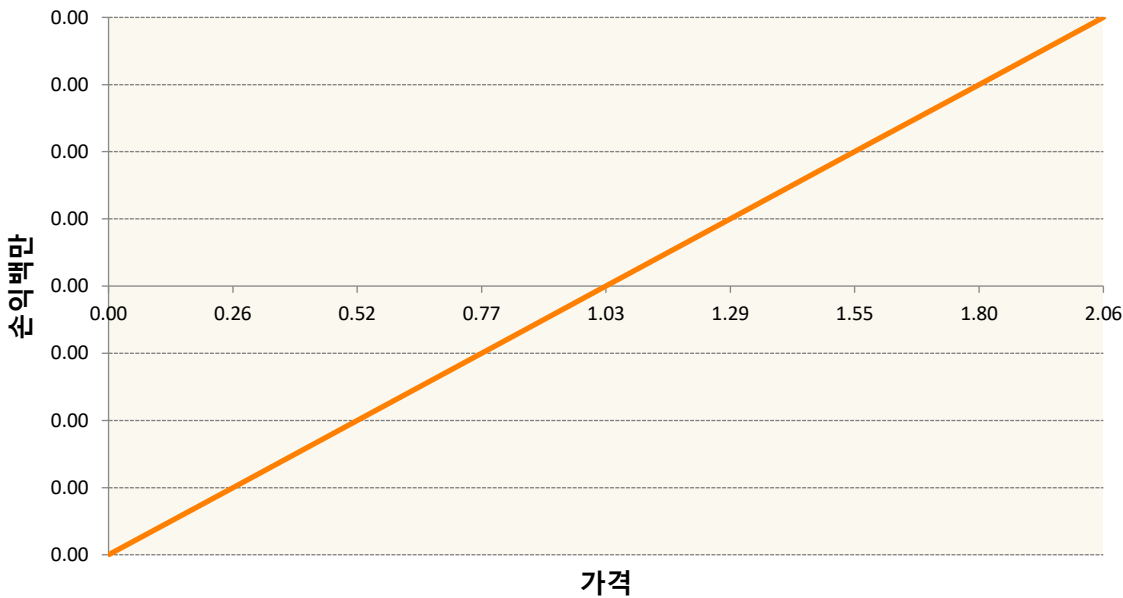
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

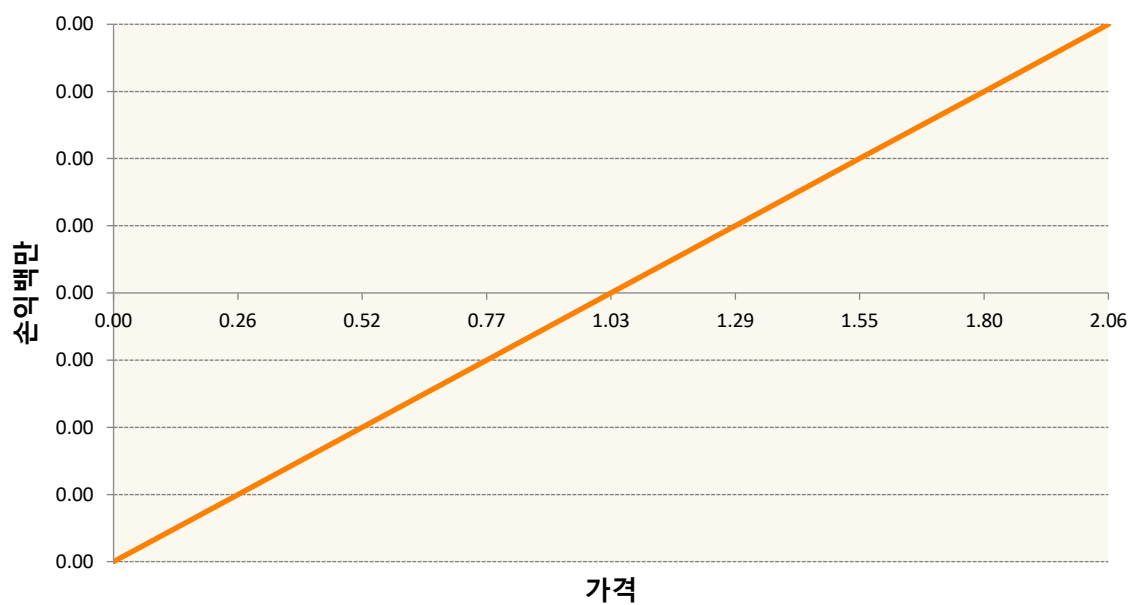
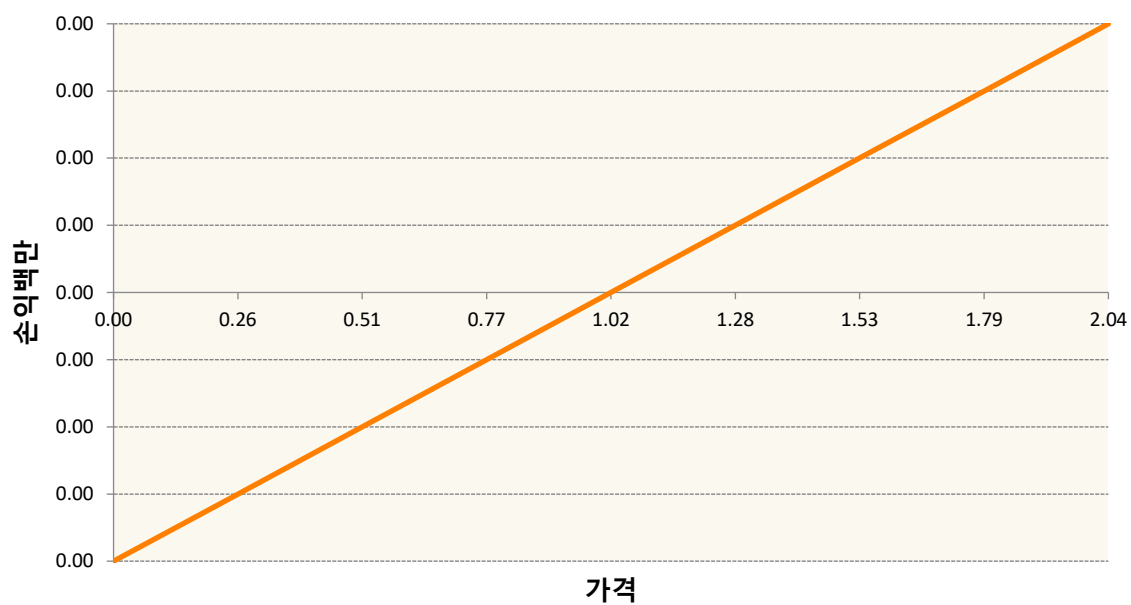
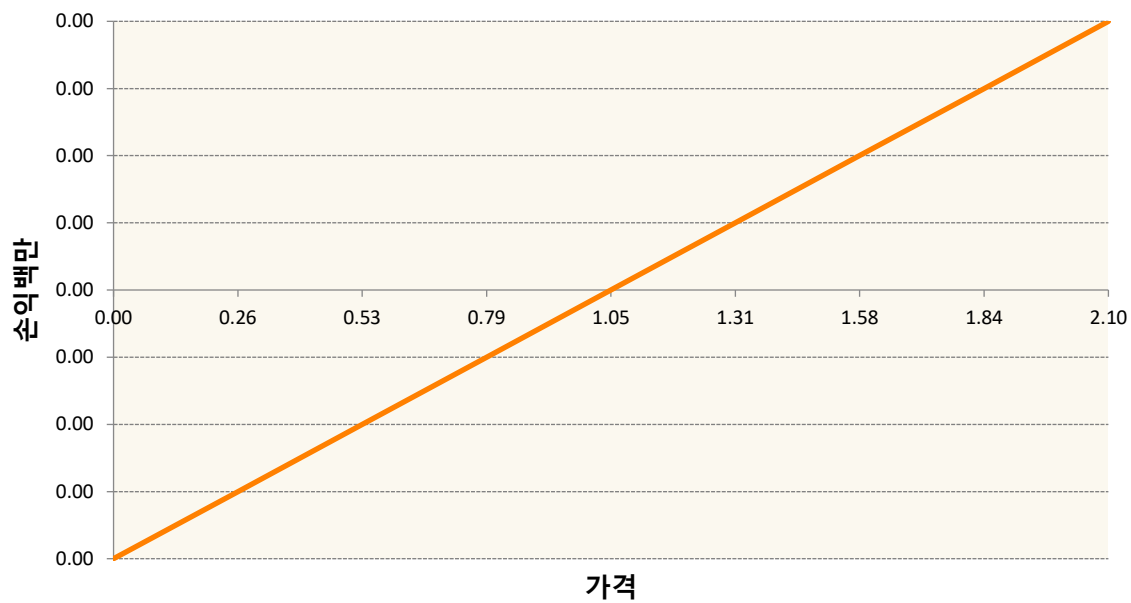
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	390,053	0	390,053	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,474
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,796
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		154
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		10,199
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,622

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	14,044

공시일	2026-03-05
기준일	2026-03-04

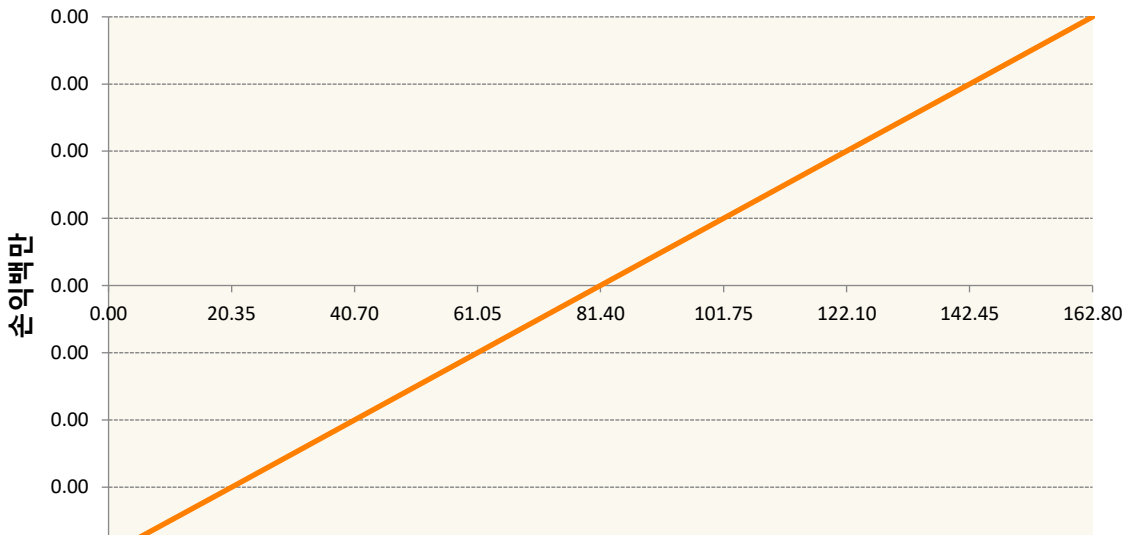
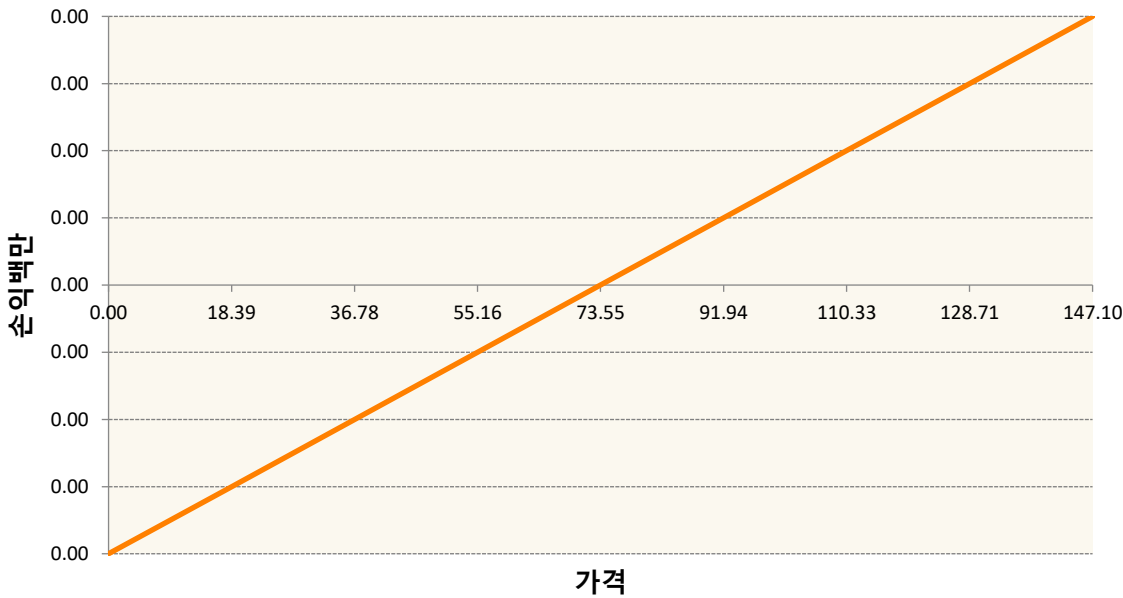
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

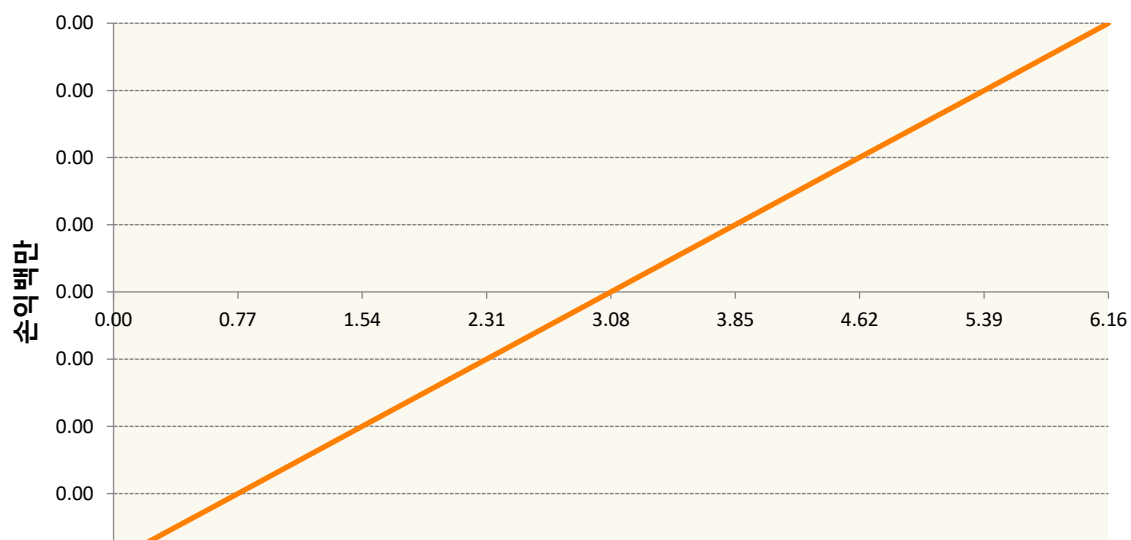
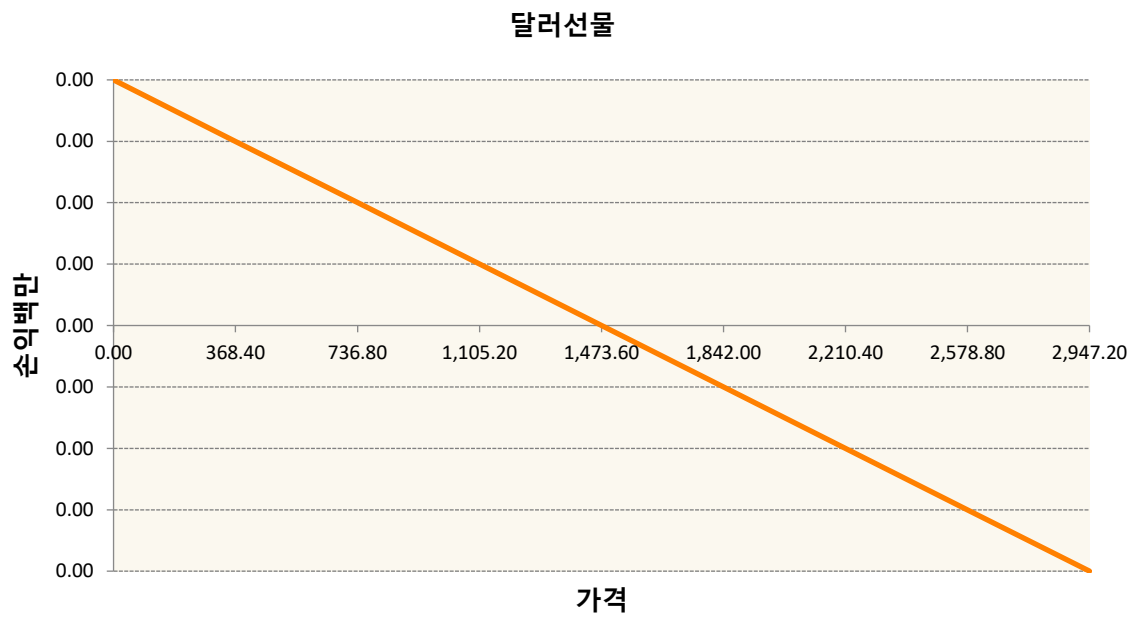
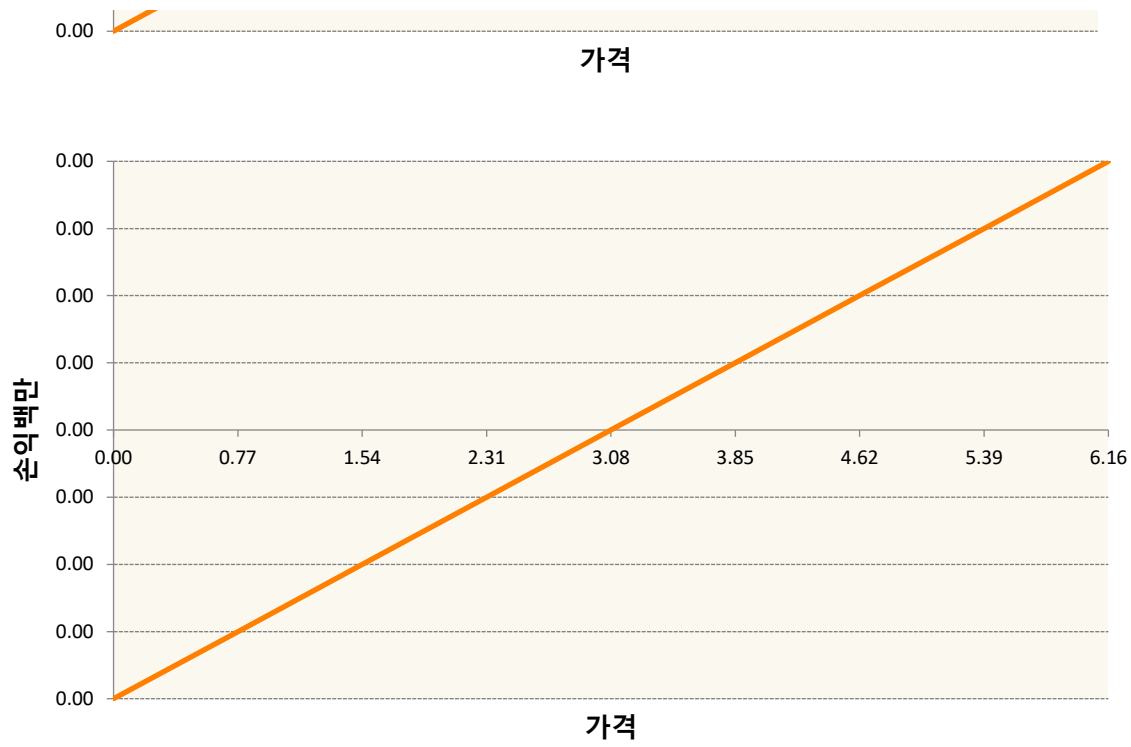
1. 계약금액

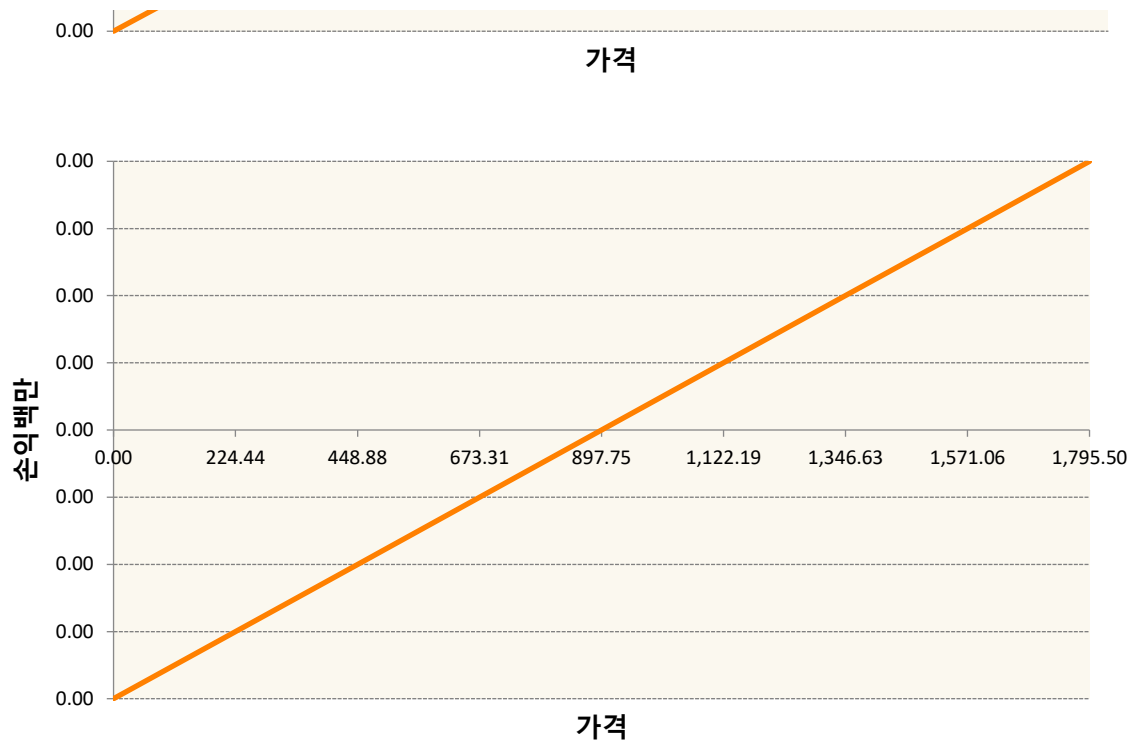
(단위:백만원)

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	30	-30	장내
누계	실물자산	선물	175	0	175	
누계	유가증권	선물	358	0	358	
누계	통화	선물	0	147	-147	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK6	WTI CRUDE FUTURE May26	9
COK6	BRENT CRUDE FUTR May26	19
EOK6	E-MINI NATURAL GAS May 26	1
KR4A756300	2026-03 달러선물	12
NGK26	NATURAL GAS FUTR May 26	4
QSK6	Low Su Gasoil G May 26	10

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

(단위:백만원)

92