

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

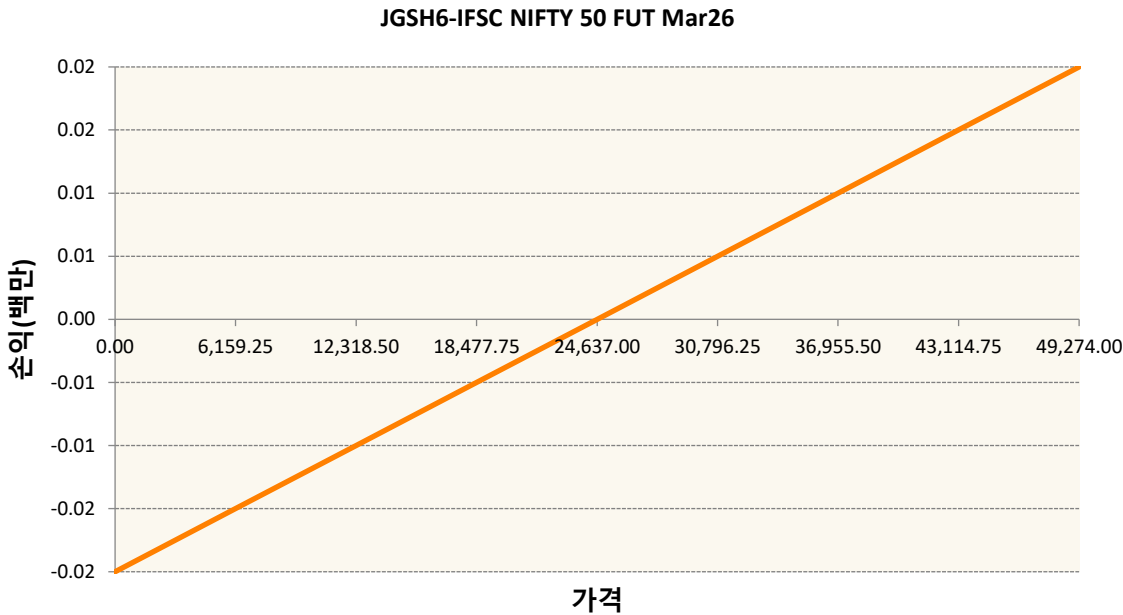
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	638	0	638	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH6	IFSC NIFTY 50 FUT Mar26	51
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

33

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

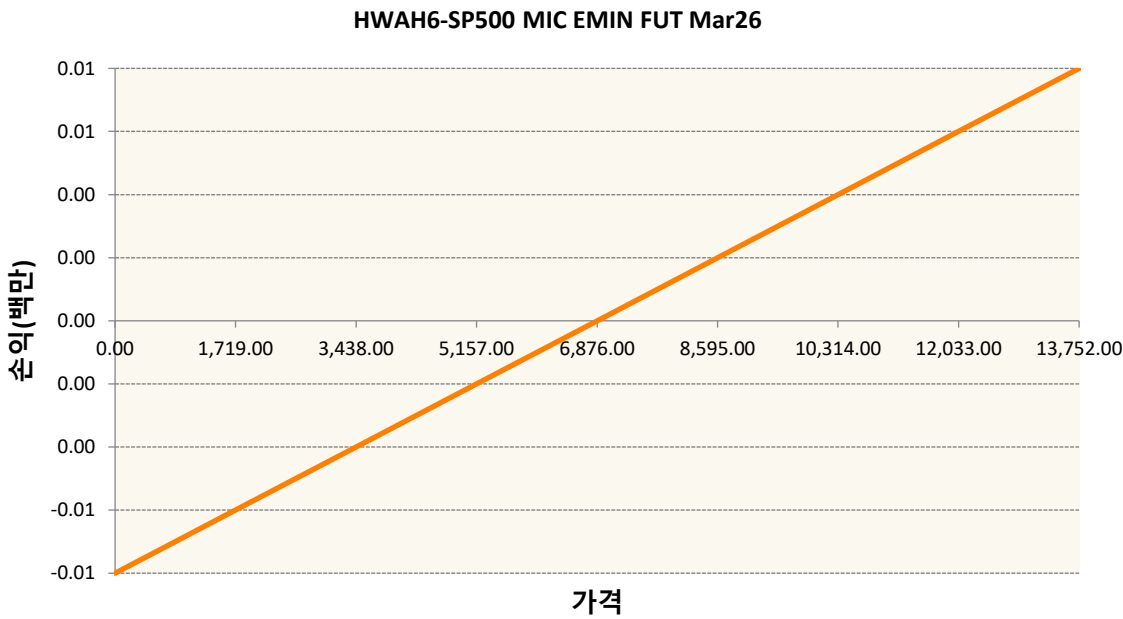
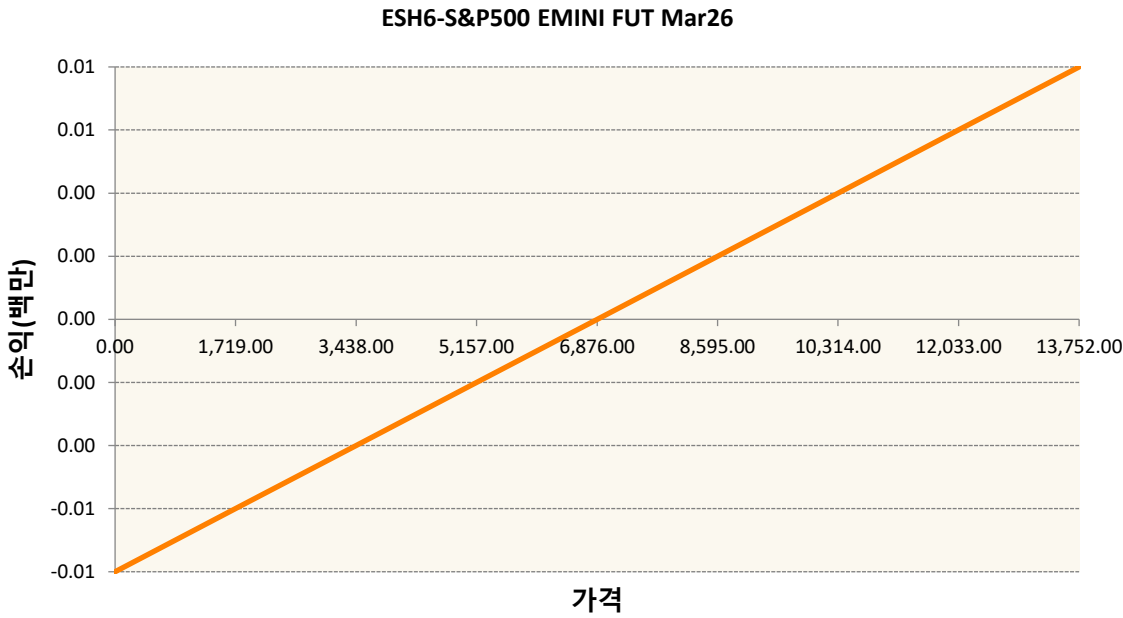
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	508	0	508	

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	2026-03-06
기준일	2026-03-05

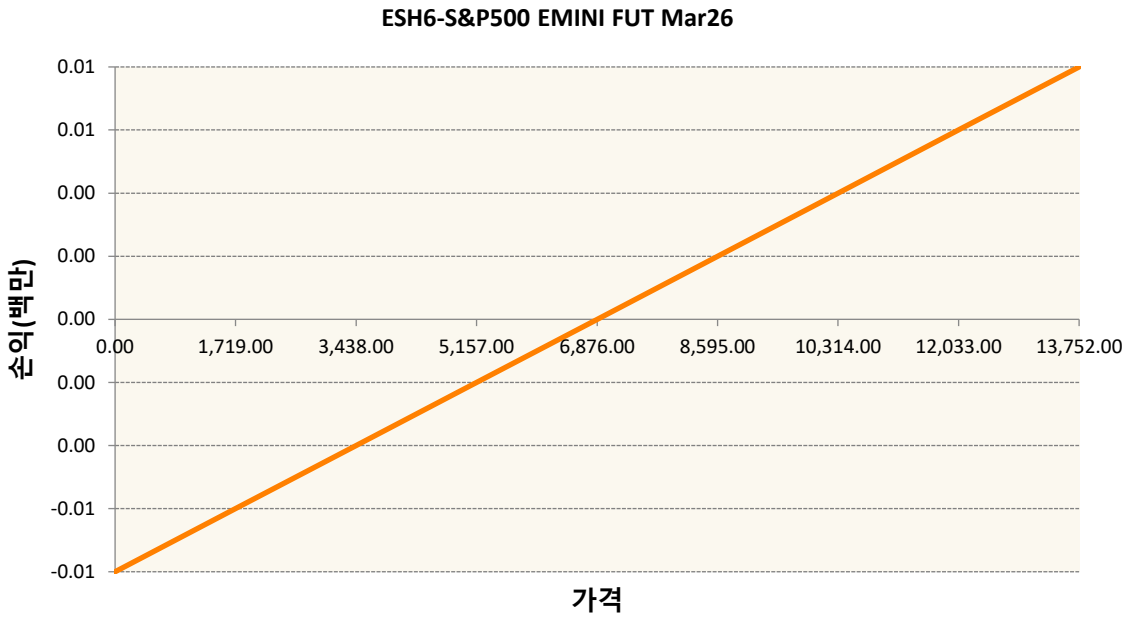
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,525	0	1,525	

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	2026-03-06
기준일	2026-03-05

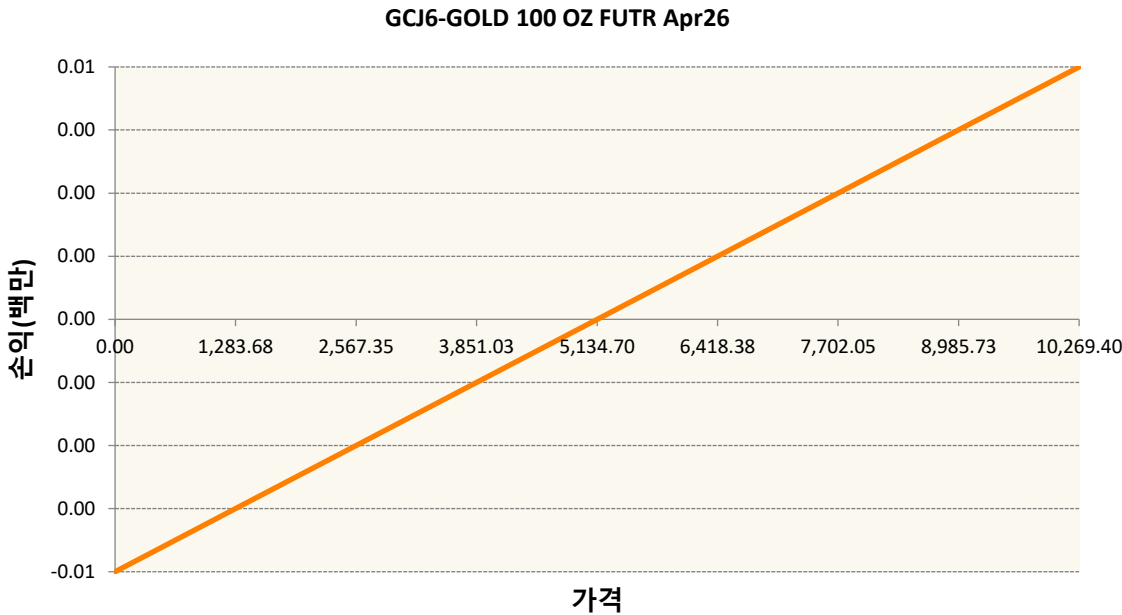
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,135	0	5,135	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 03/06/26 C495 EQUITY	13
GCI6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	411

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

(단위:백만원)

496

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

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	59
AOPLTRAAP PLTR US 03/06/26 P147 EQUITY	48

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

(단위:백만원)

379

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

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

2

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

(단위:백만원)

1

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

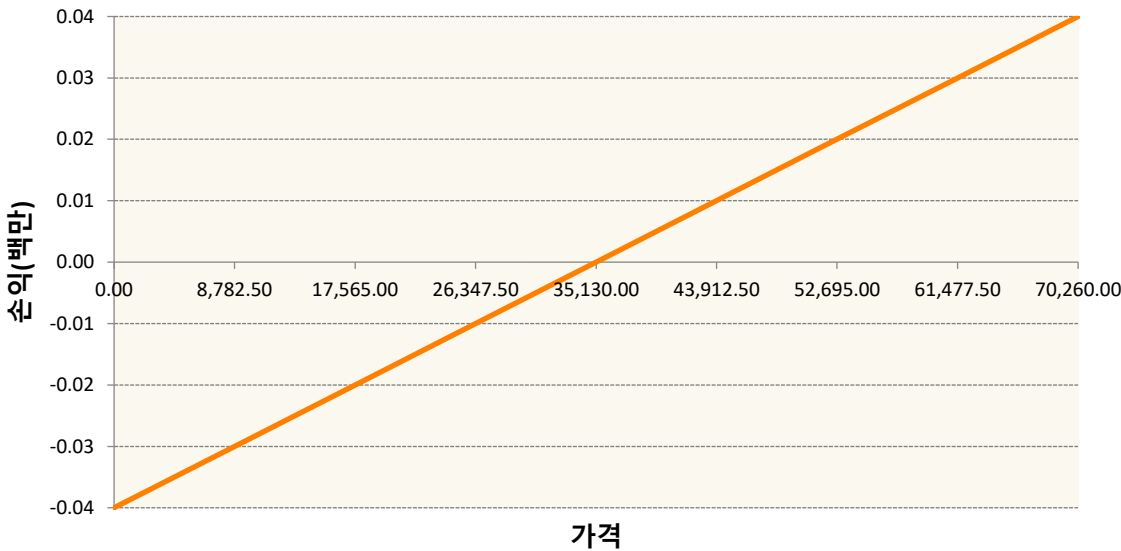
1. 계약금액

(단위:백만원)

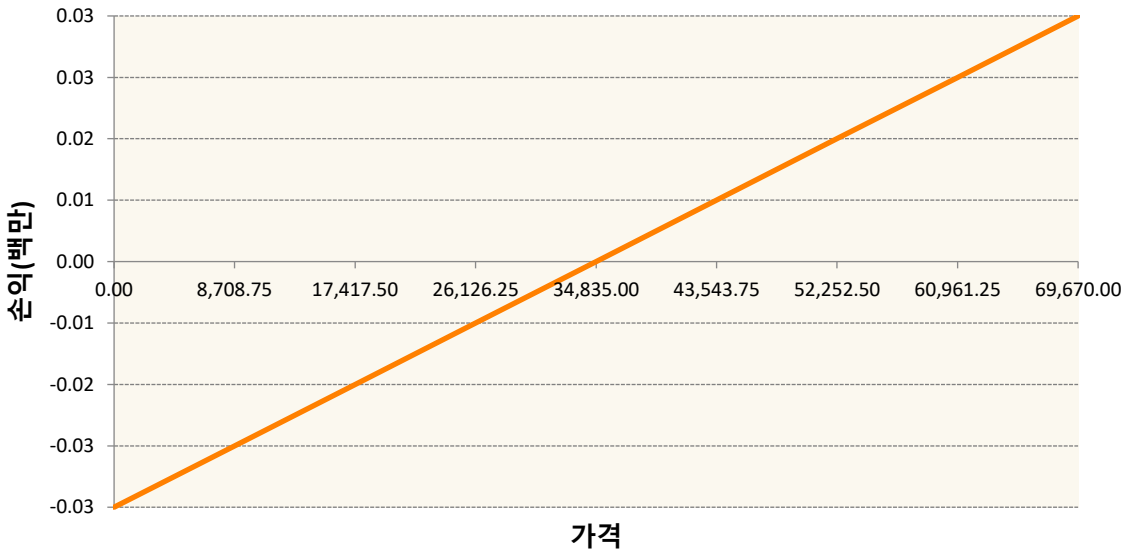
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,077	2,839	-762	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	12,508	0	12,508	장내
누계	유가증권	스왑	3	0	3	장외

2. 만기시점의 손익구조

KR4AM7630007-2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AM7630007		2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물					1,000
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000
-5.33%	-666	-666	-666	-666	-666	-666	-666
-2.67%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	333	333	333	333	333	333	333
5.33%	666	666	666	666	666	666	666
8.00%	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000

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

1,292

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

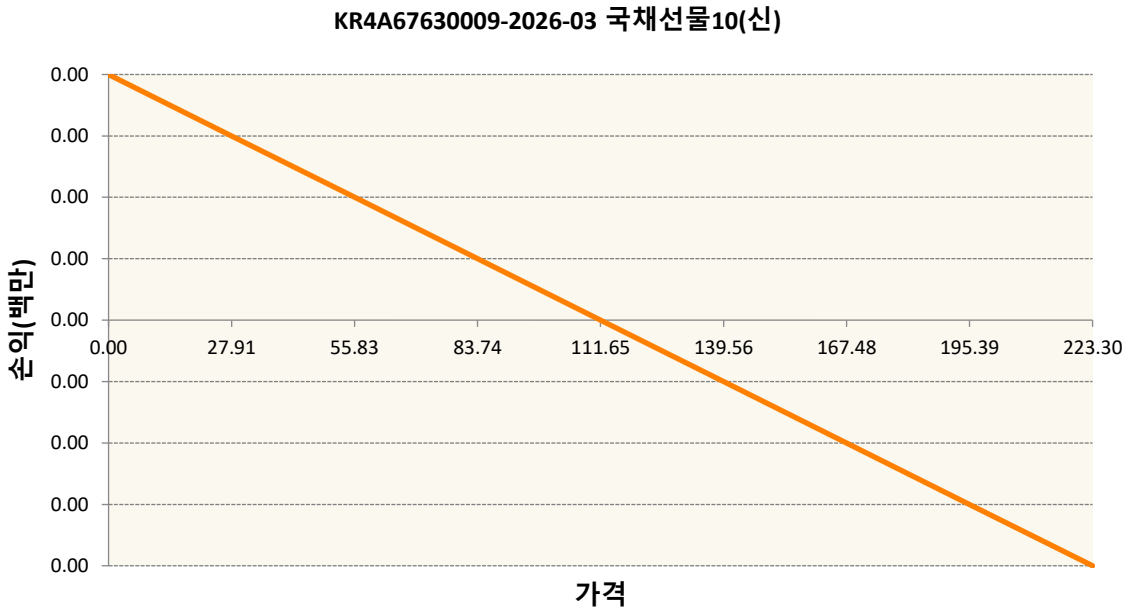
포커스채권(채권-파생형)(종)

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	13,398	-13,398	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A67630009			2026-03 국채선물10(신)				382
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-382	-382	-382	-382	-382	-382	-382
-5.33%	-255	-255	-255	-255	-255	-255	-255
-2.67%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	127	127	127	127	127	127	127
5.33%	255	255	255	255	255	255	255
8.00%	382	382	382	382	382	382	382

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

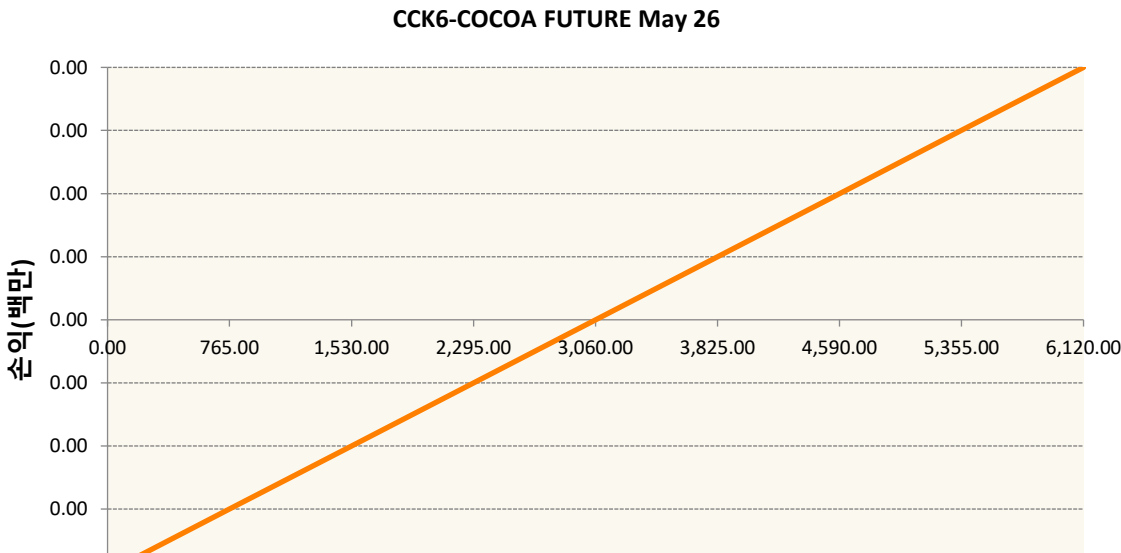
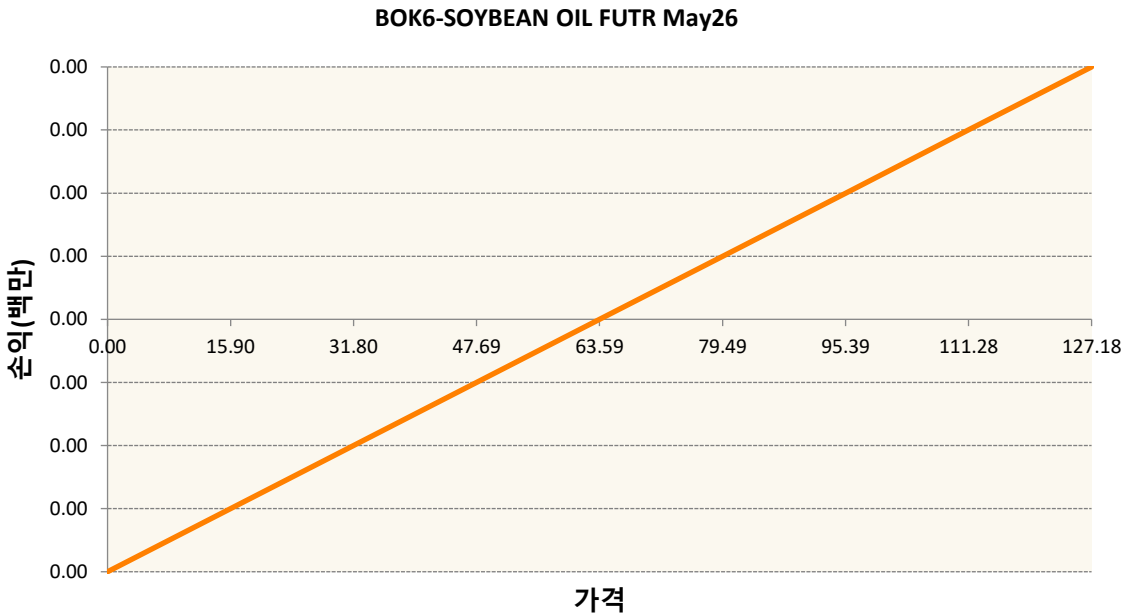
포커스농산물모(채권-파생형)

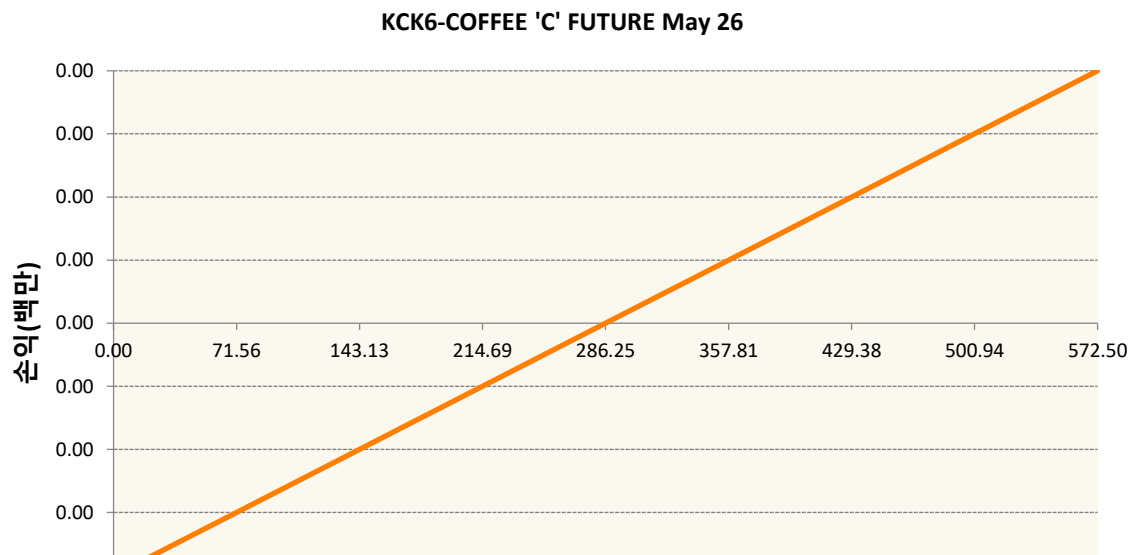
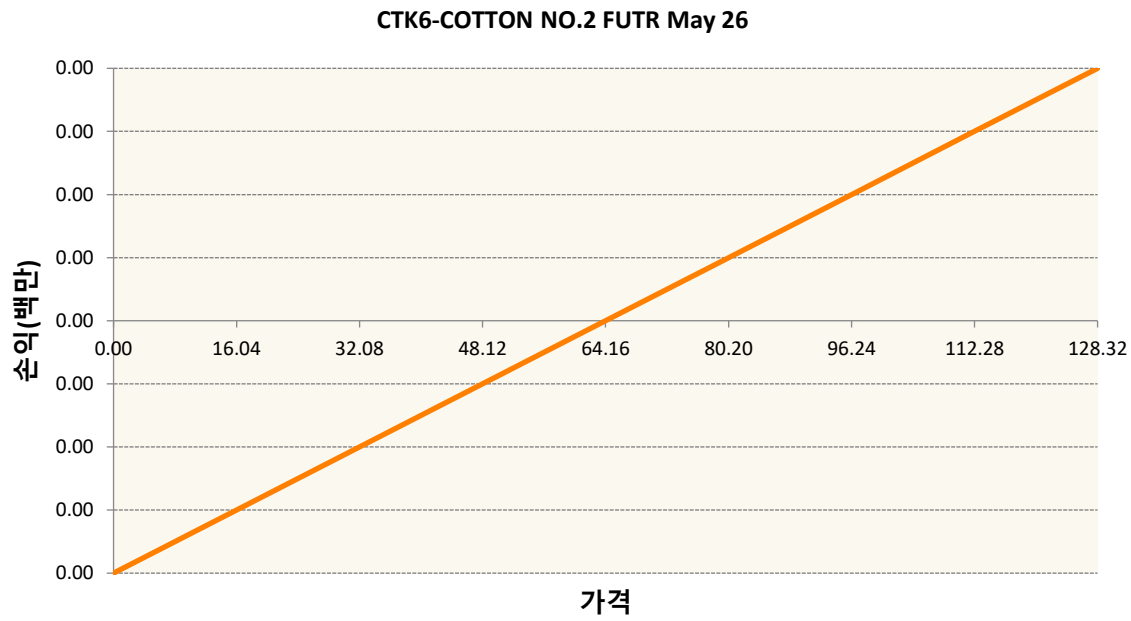
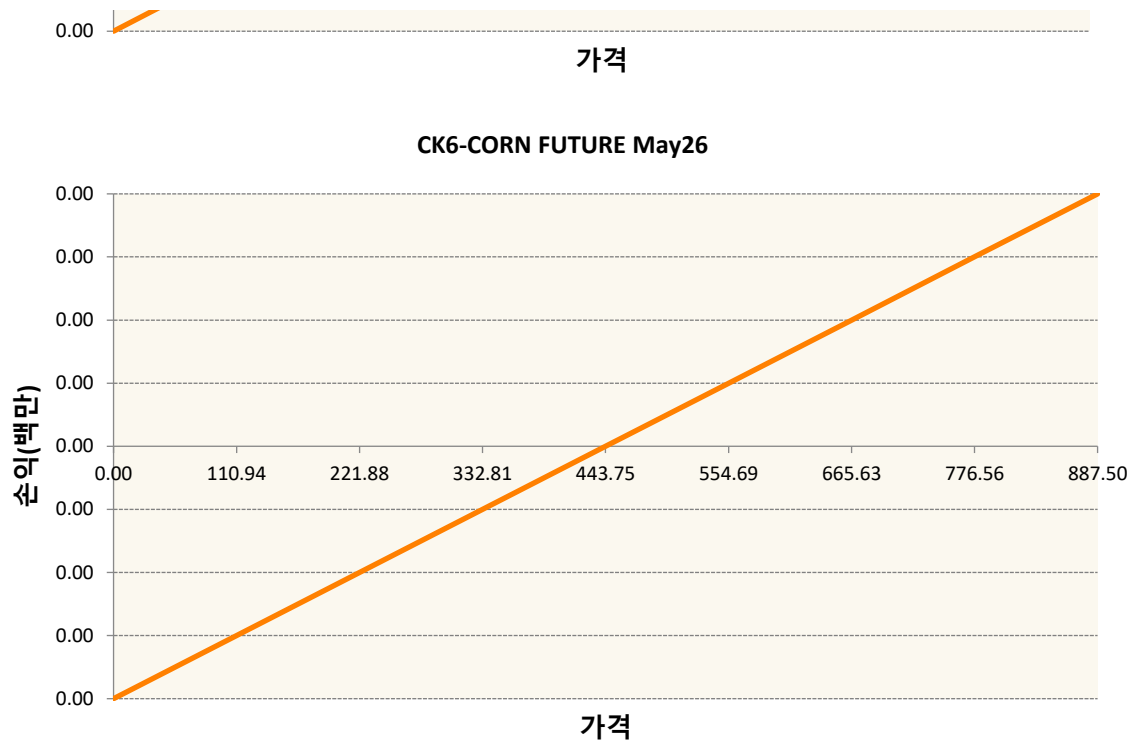
1. 계약금액

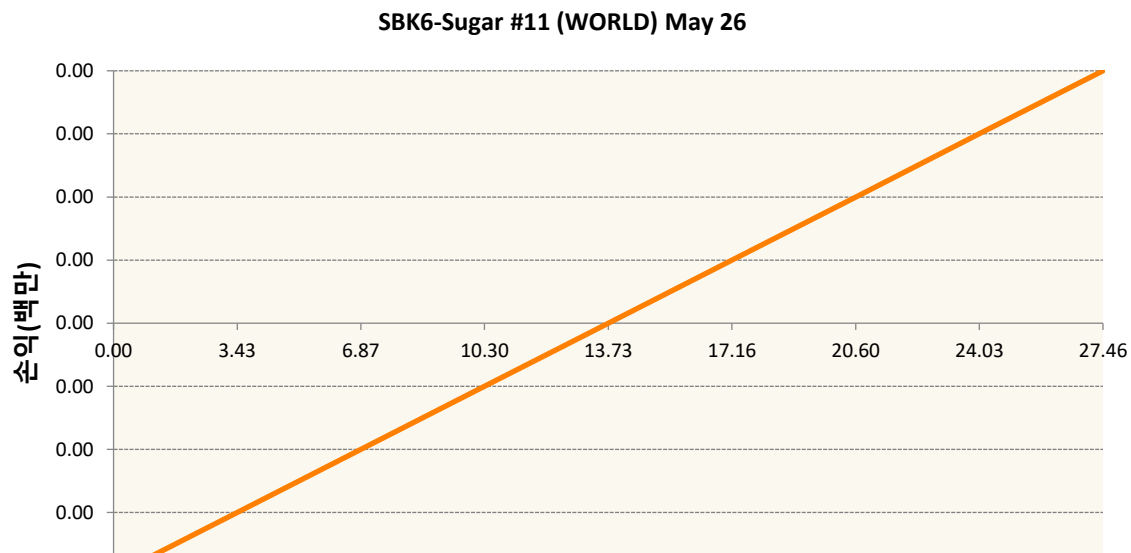
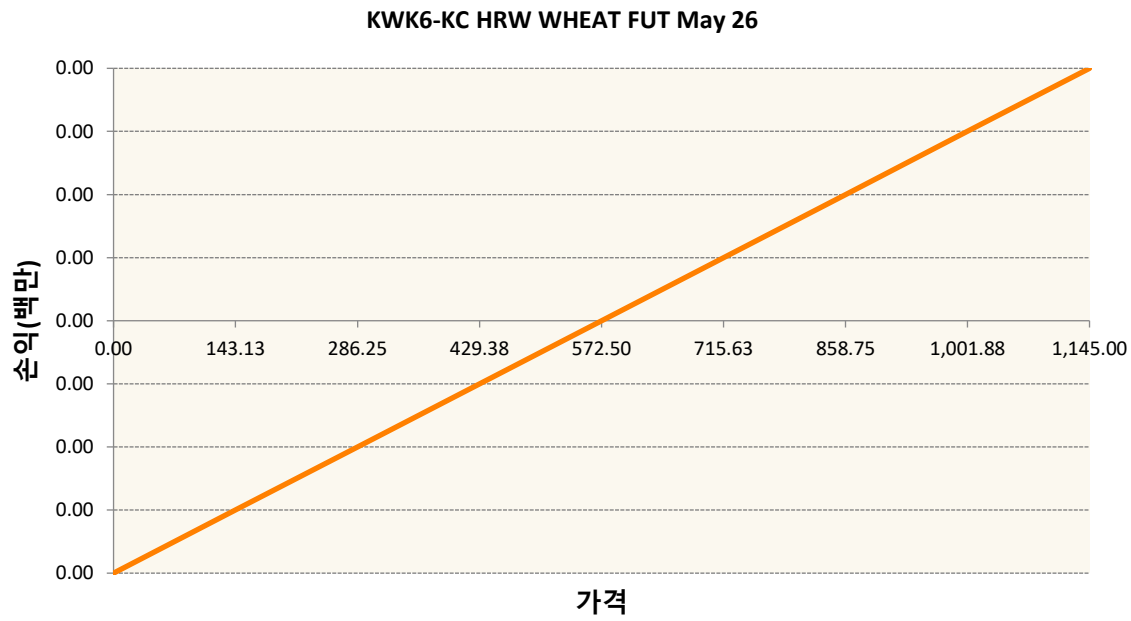
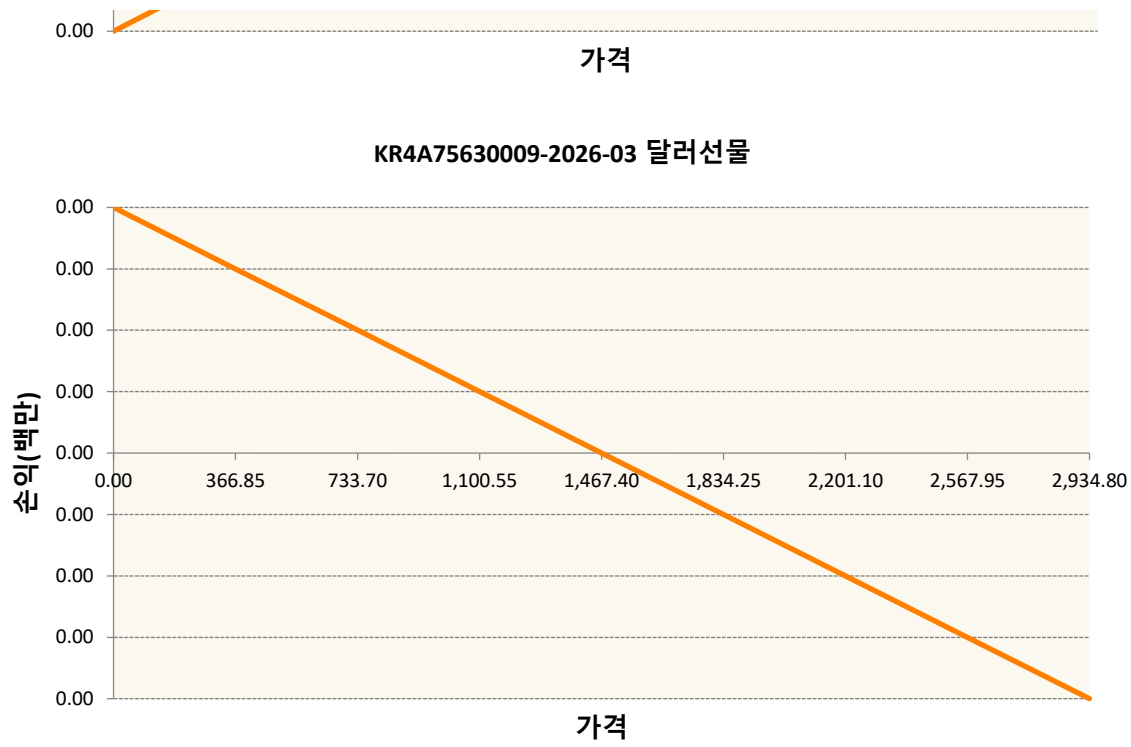
(단위:USD 백만)

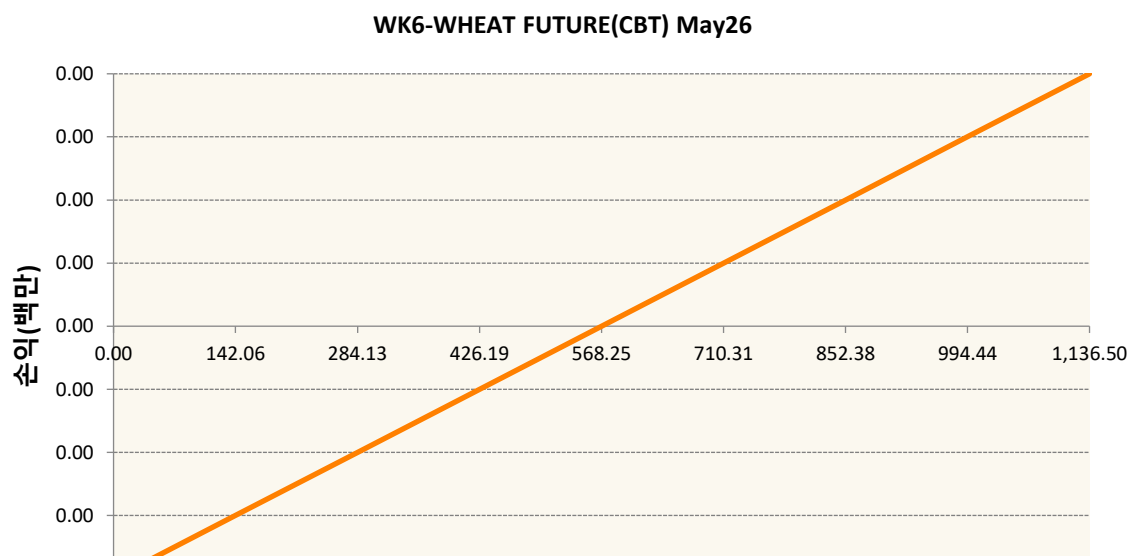
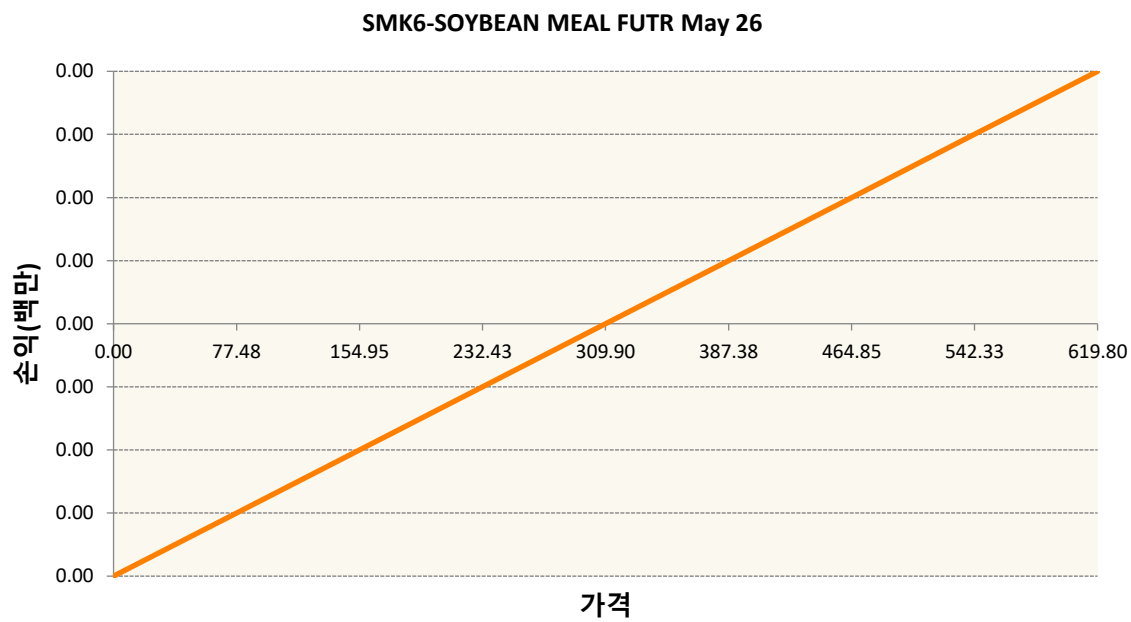
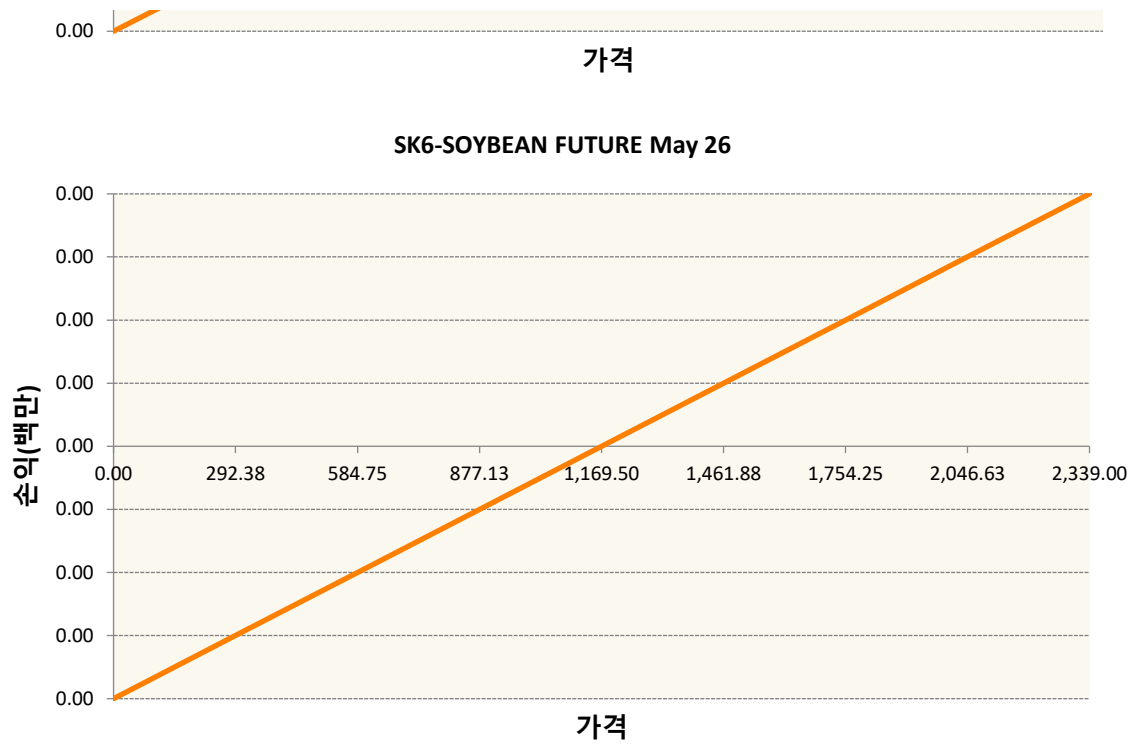
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,256	0	1,256	
누계	유가증권	선물	1,685	0	1,685	
누계	통화	선물	0	308	-308	장내

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	2026-03-06
기준일	2026-03-05

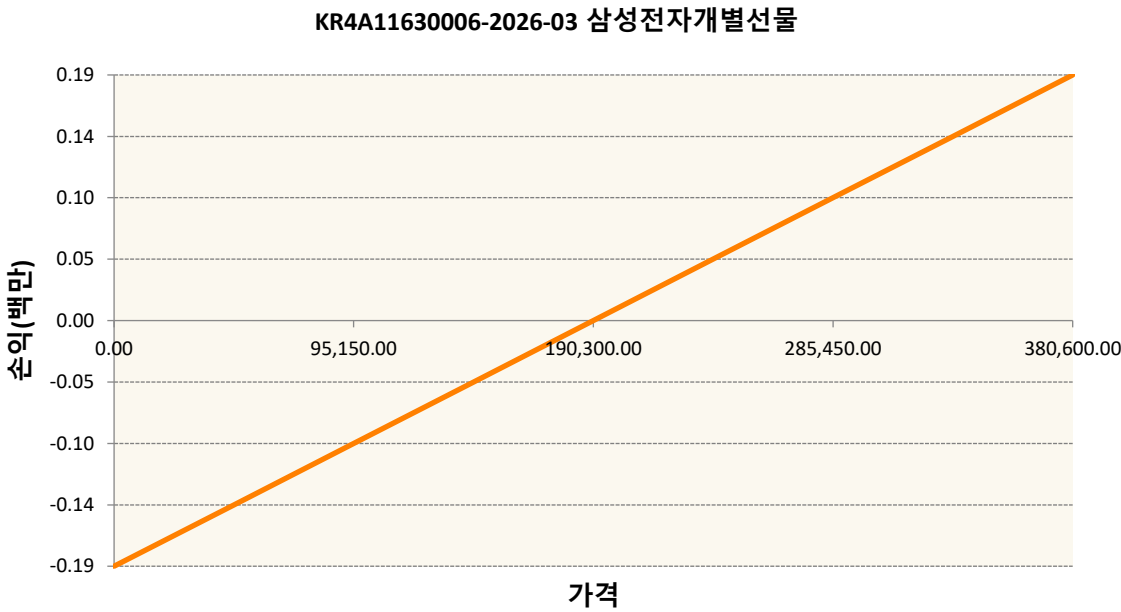
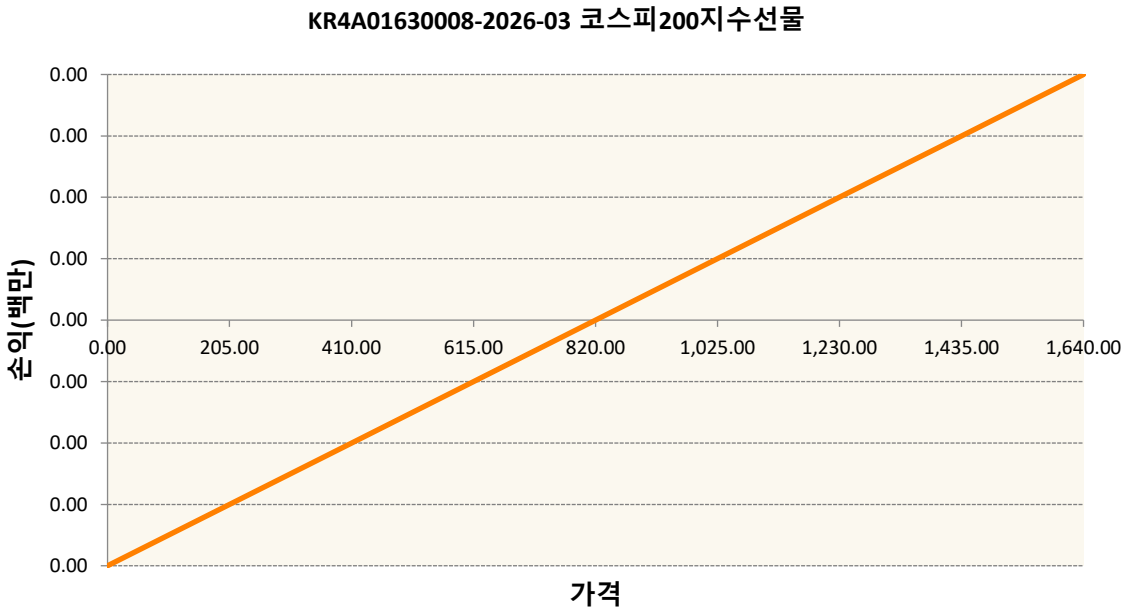
스마트인덱스모

1. 계약금액

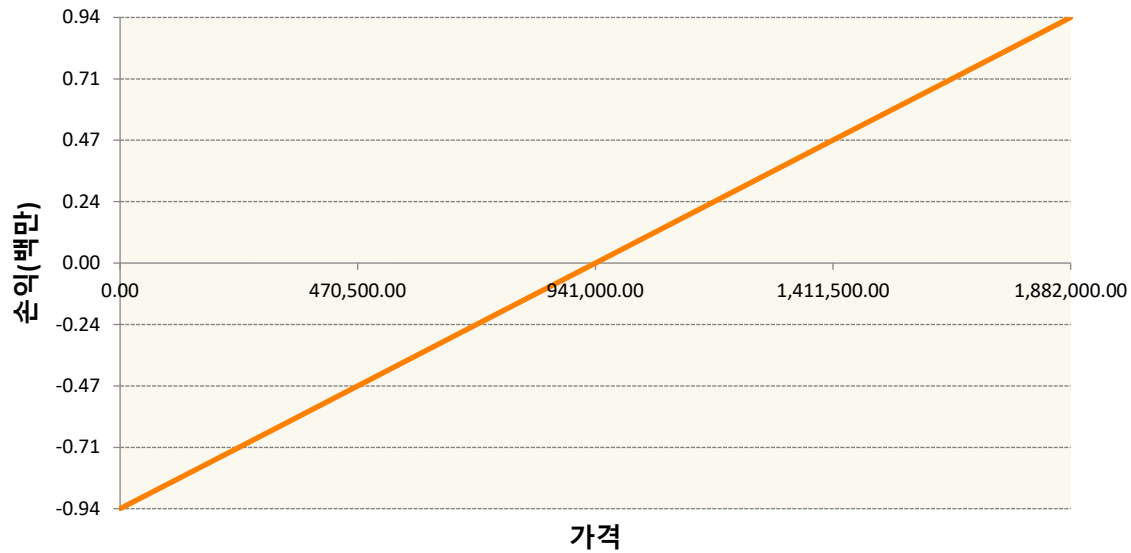
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	208	-208	장내
누계	유가증권	선물	3,832	0	3,832	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50630008-2026-03 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물
 KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물
 KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물

295
3
8

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

(단위:백만원)

6

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

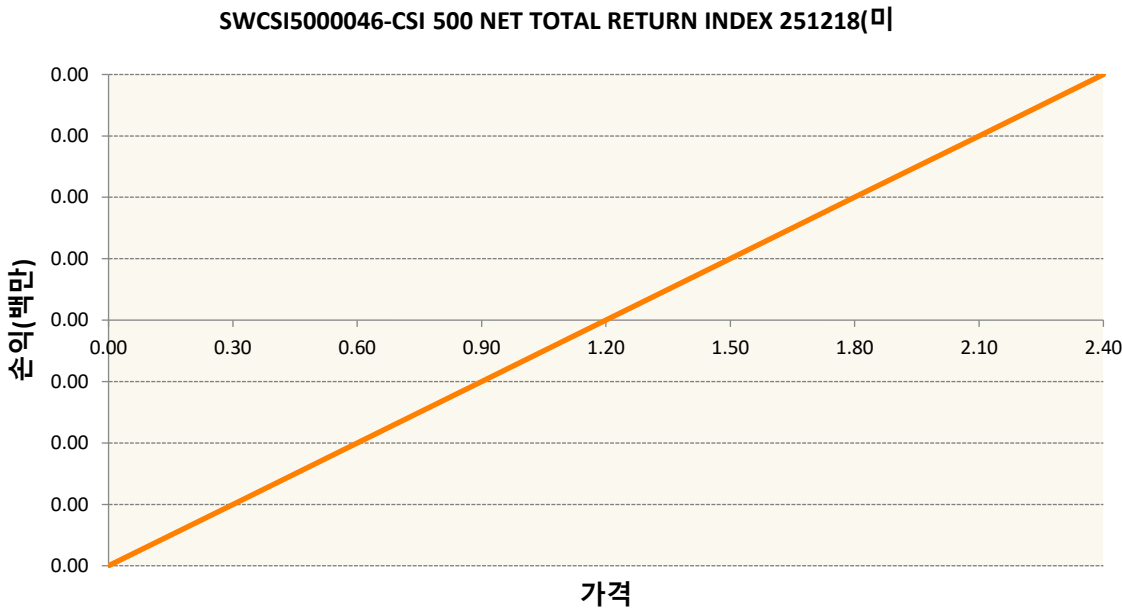
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,543	0	5,543	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

443

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

563

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

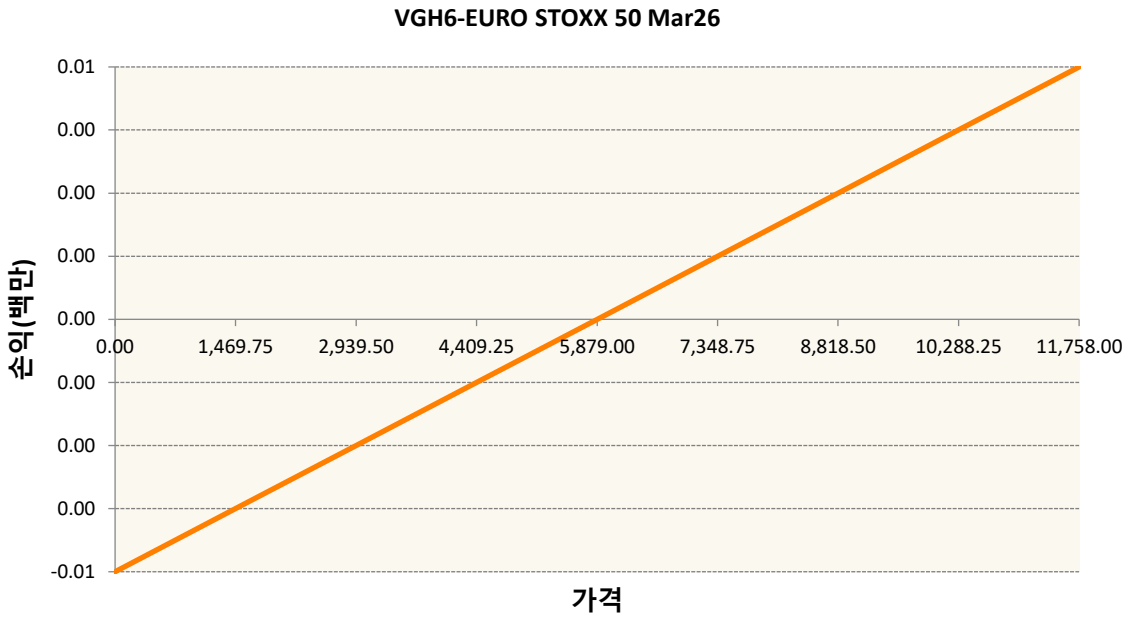
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	916	0	916	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EURO STOXX 50 Mar26	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

60

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

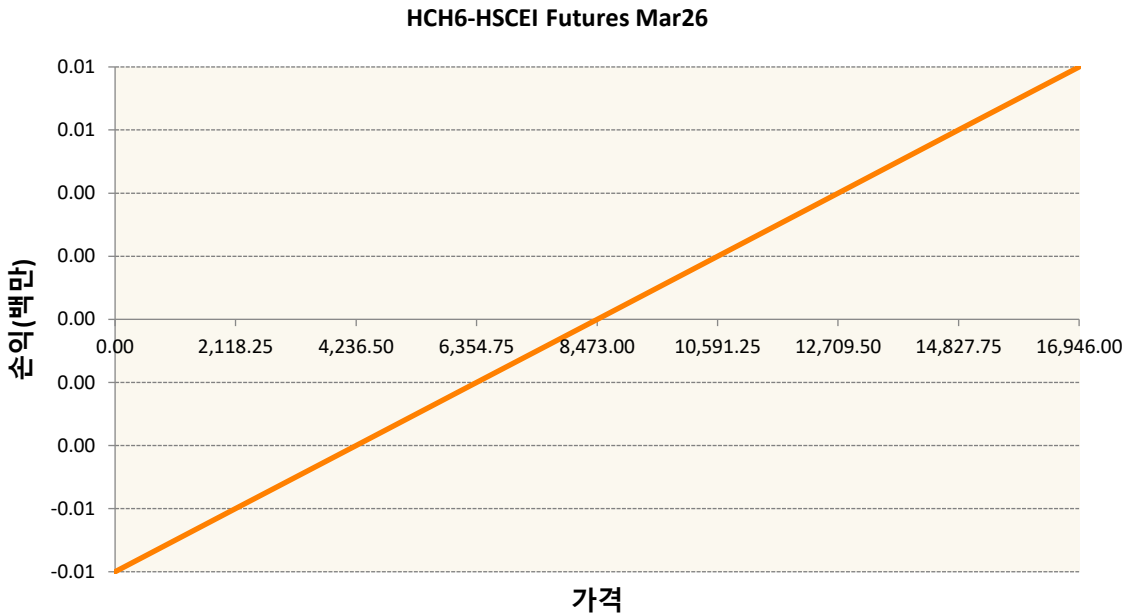
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,541	0	1,541	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH6	HSCEI Futures Mar26	123
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

141

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

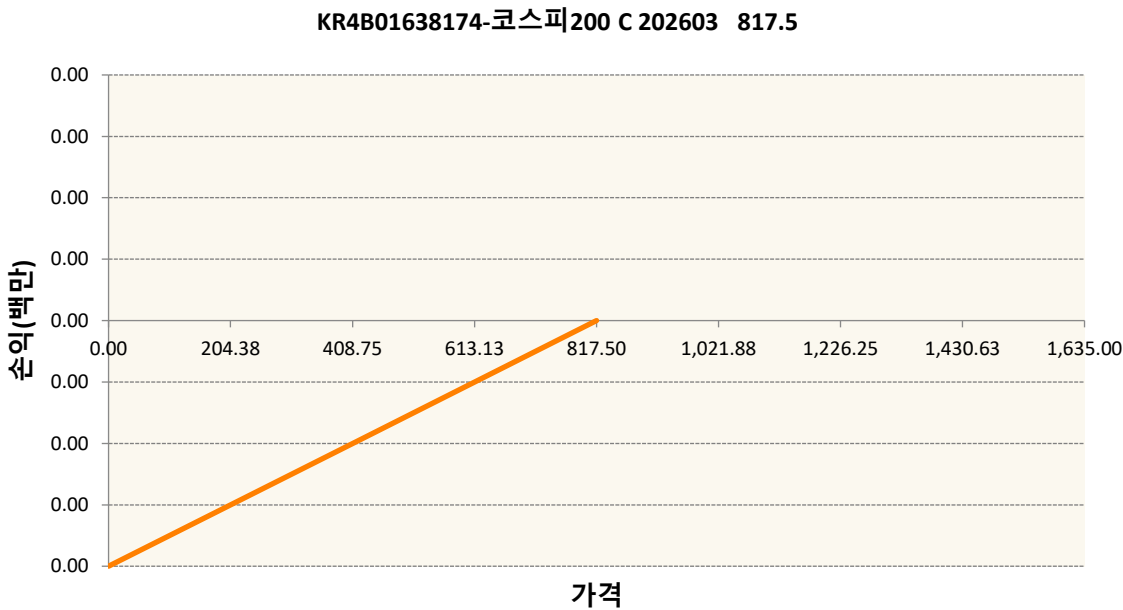
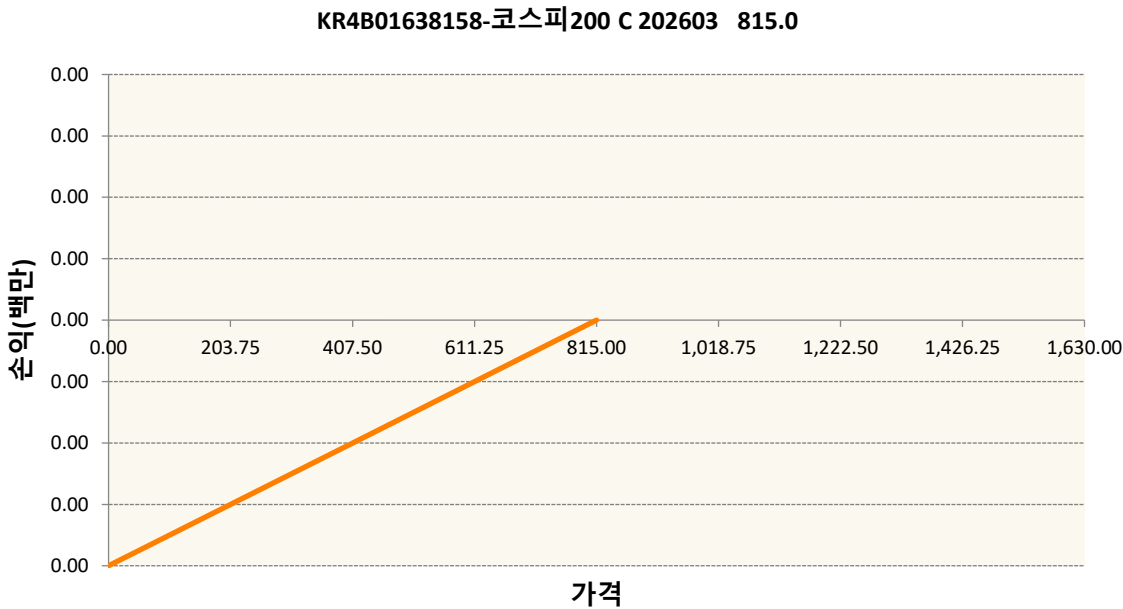
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

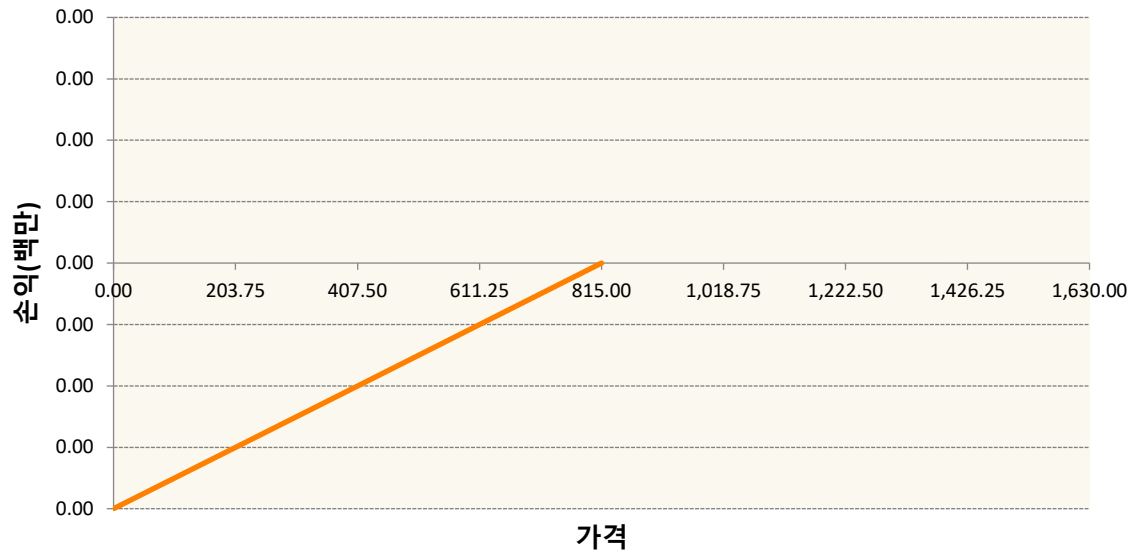
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,942	-1,942	장내
누계	유가증권	옵션	0	33,059	-33,059	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01638157-코스피200 P 202603 815.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016381 코스피200 C 202603 815.0
 KR4B016381 코스피200 C 202603 817.5
 KR4C016381 코스피200 P 202603 815.0

766
1,357
522

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-03-06

기준일 2026-03-05

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	2026-03-06
기준일	2026-03-05

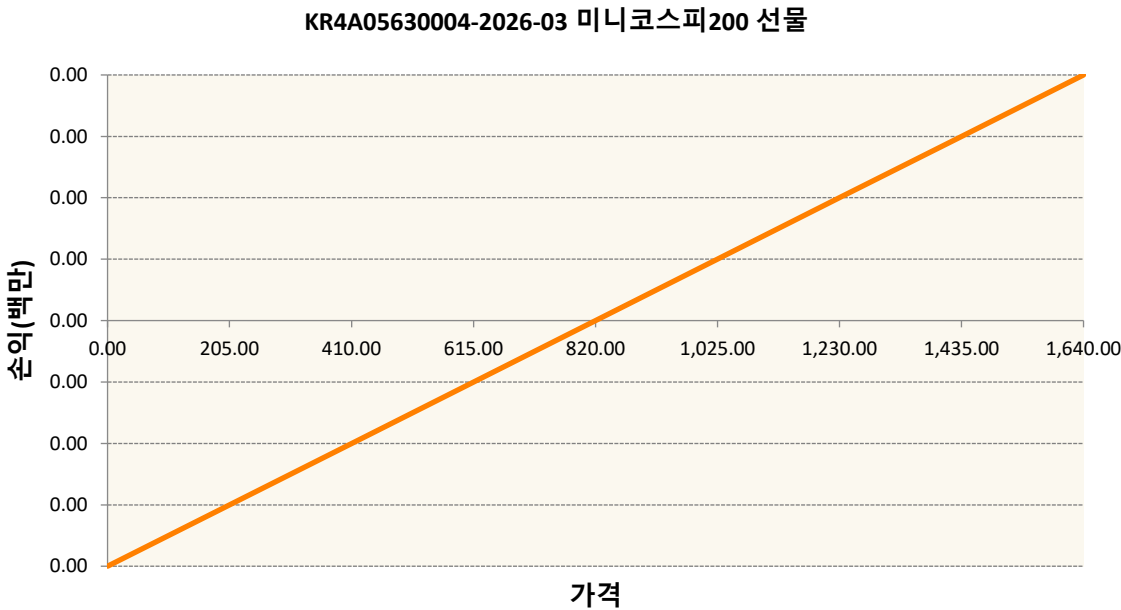
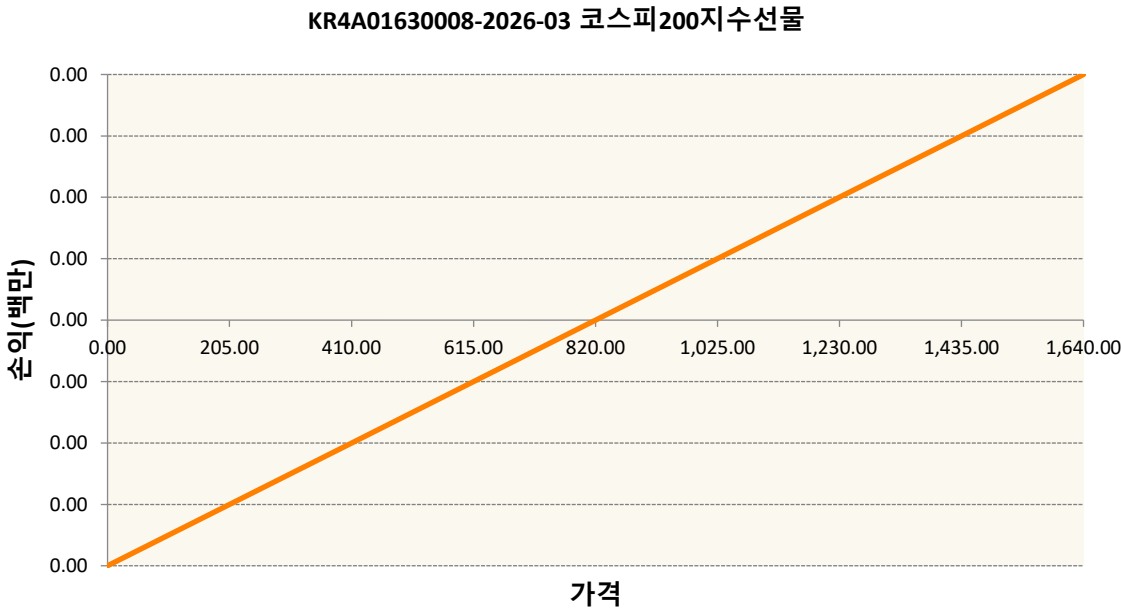
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

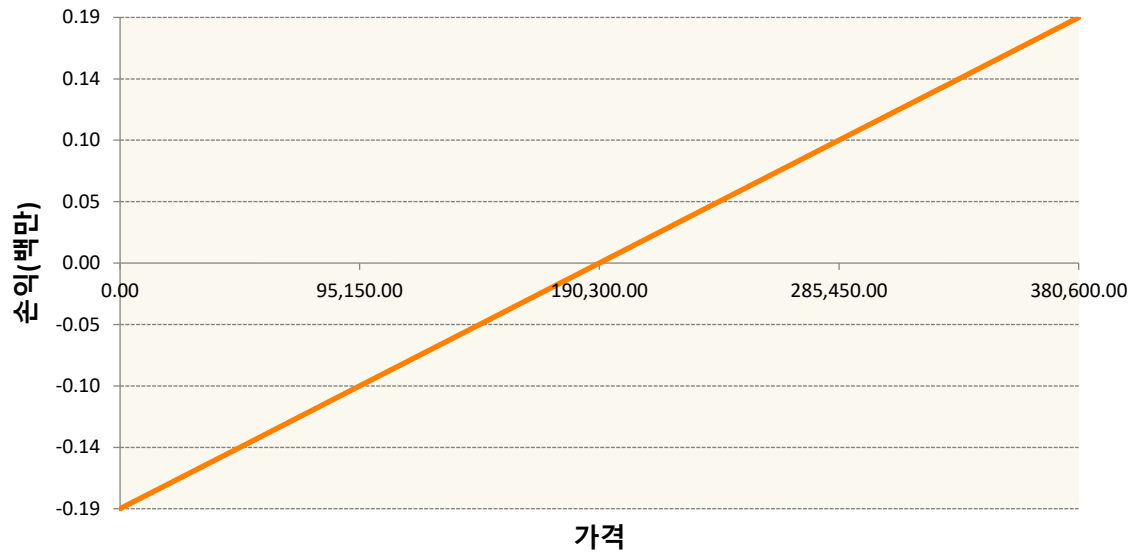
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,454	-1,454	장내
누계	유가증권	선물	5,072	0	5,072	장내

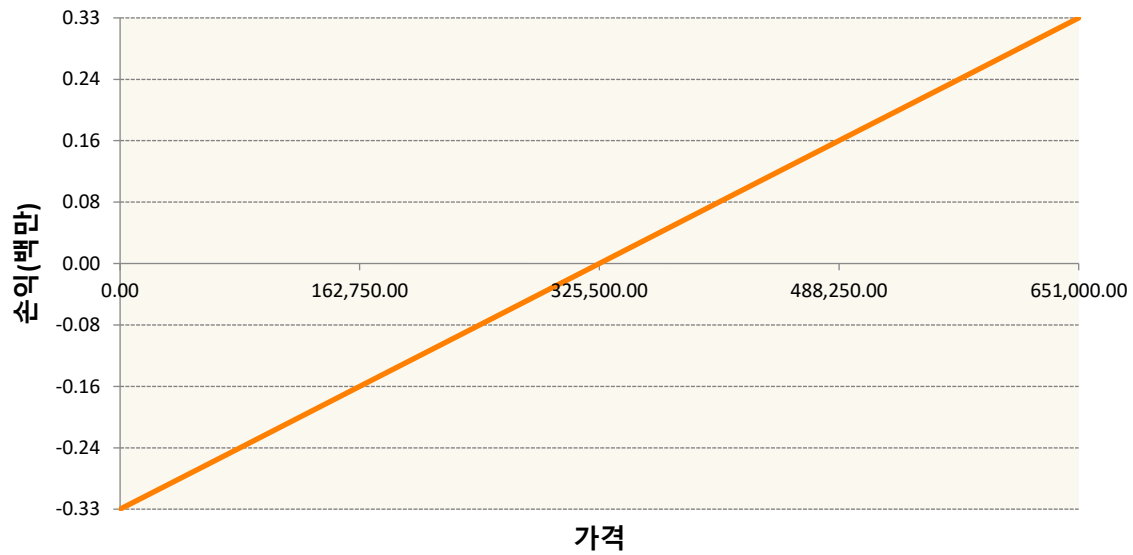
2. 만기시점의 손익구조



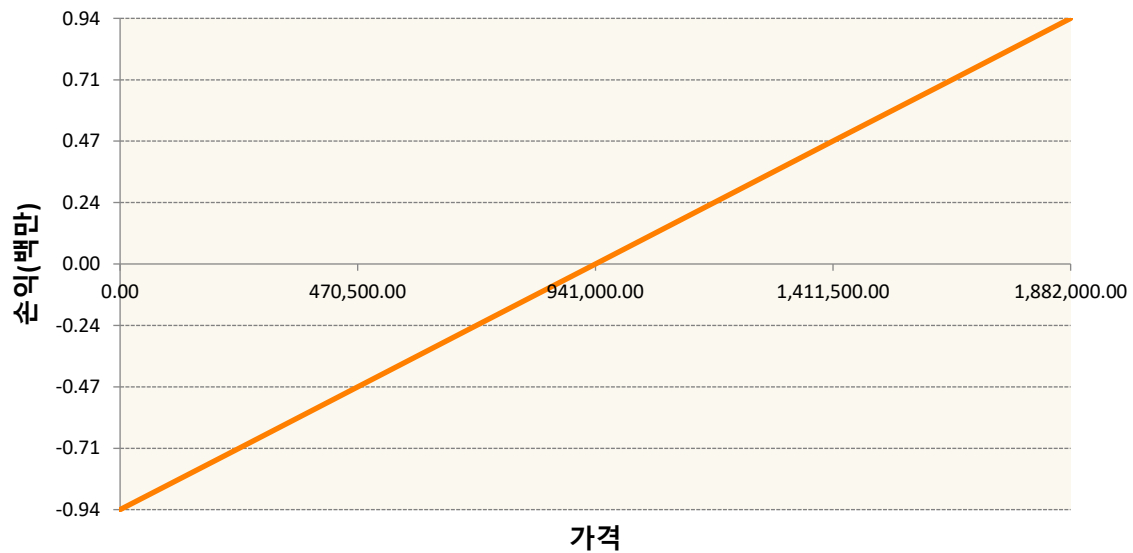
KR4A11630006-2026-03 삼성전자개별선물



KR4A47630004-2026-03 LG화학개별선물



KR4A50630008-2026-03 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		82
KR4A056300 2026-03 미니코스피200 선물		62
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		1
KR4A476300 2026-03 LG화학개별선물		6
KR4A506300 2026-03 SK하이닉스개별선물		5

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

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

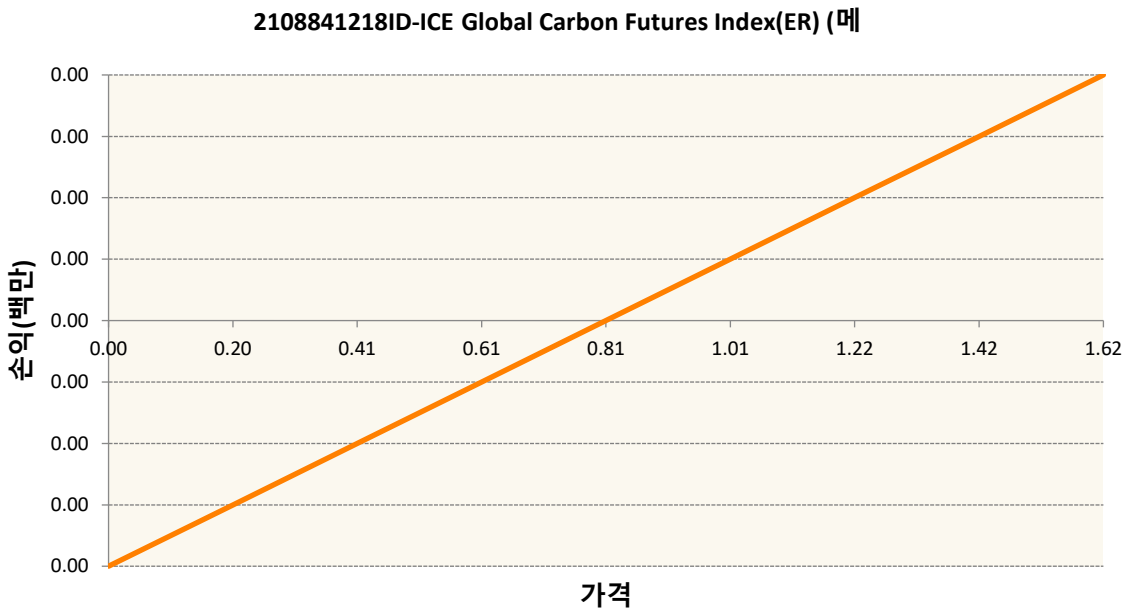
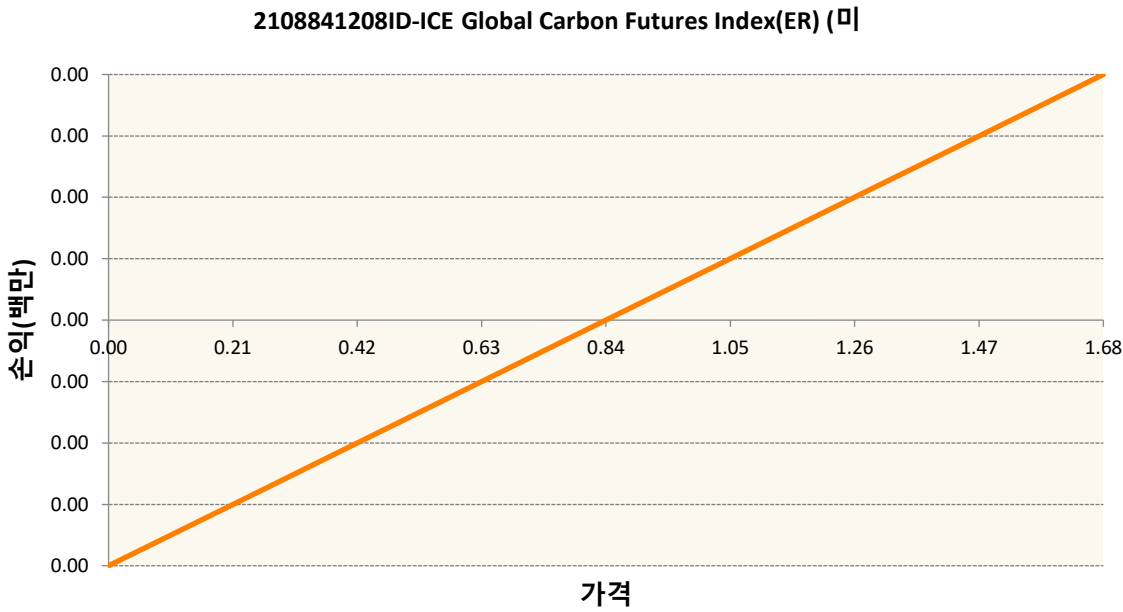
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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		390
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	526

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

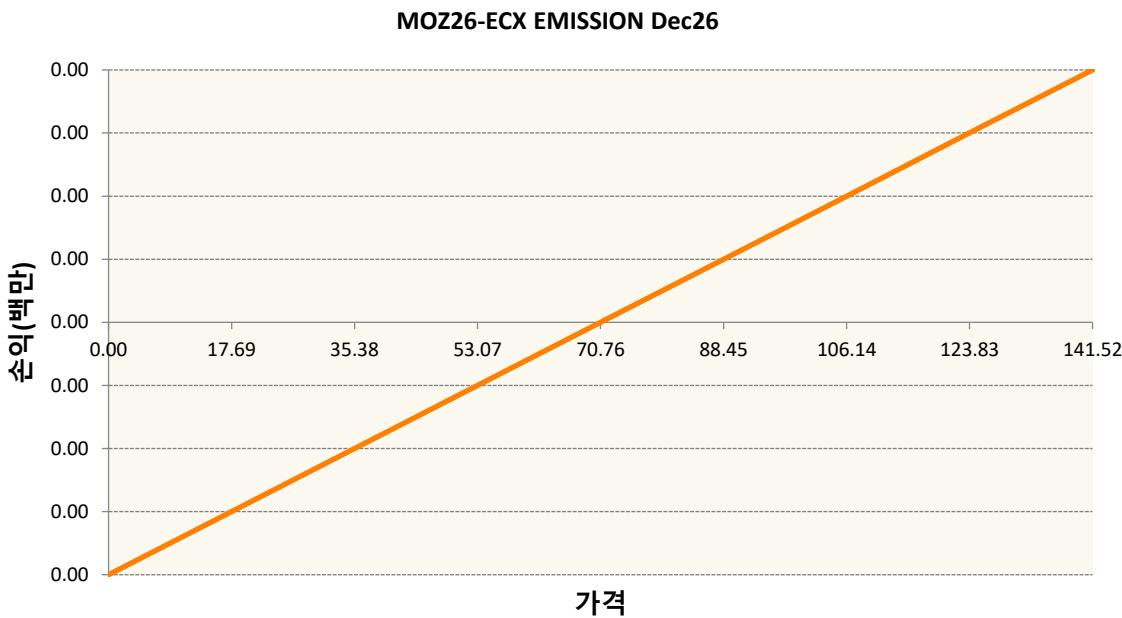
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,692	0	4,692	
누계	통화	선도	271	2,432	-2,161	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	375

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

(단위:백만원)

658

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

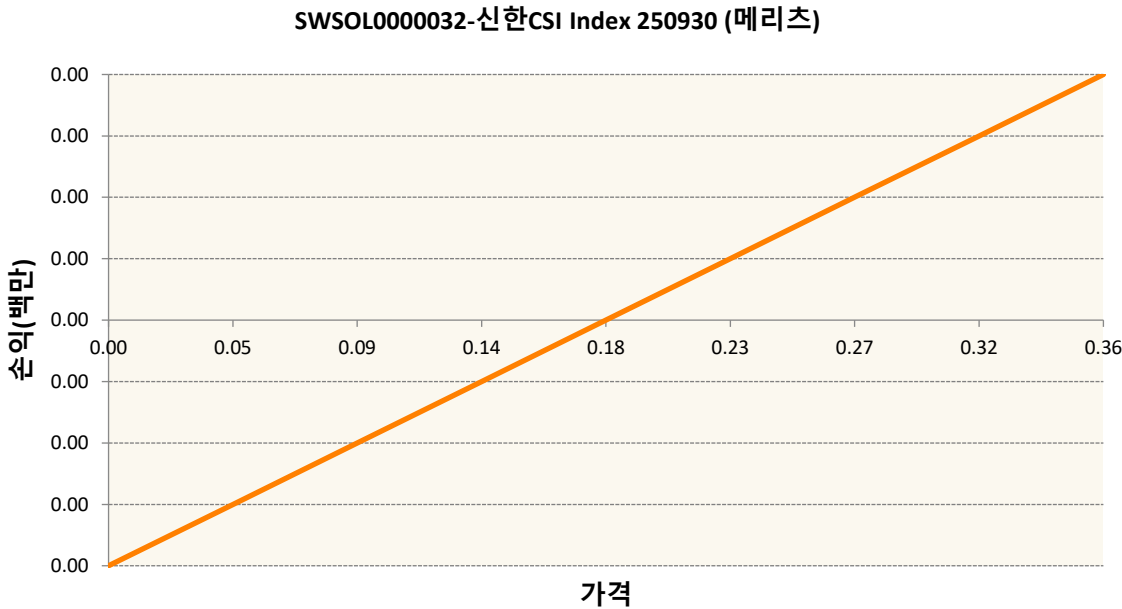
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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)	15
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	15
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	38

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

(단위:백만원)

166

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

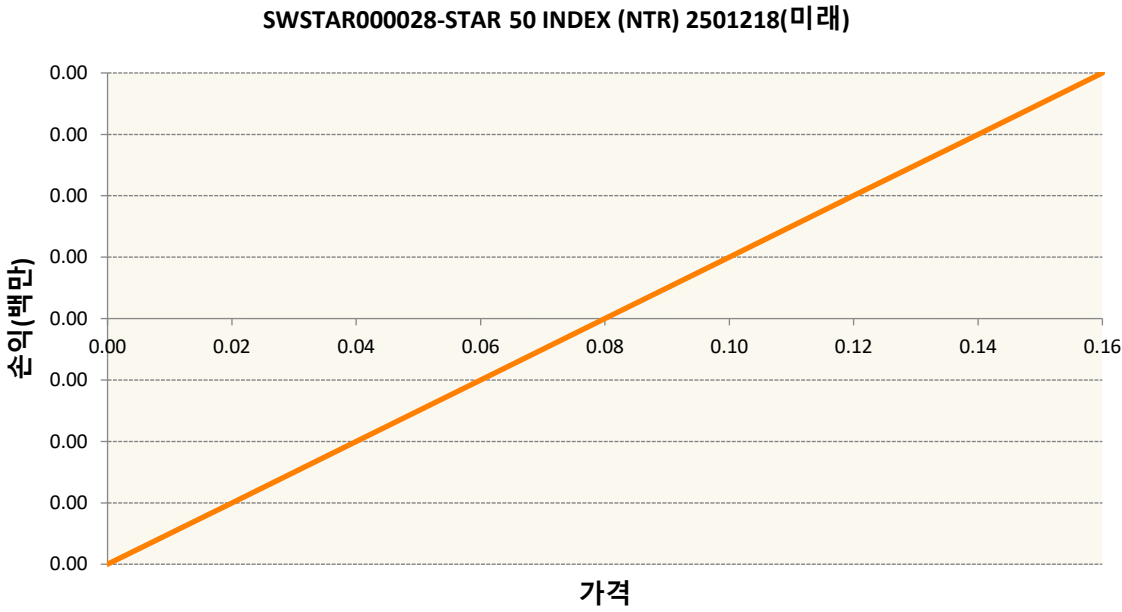
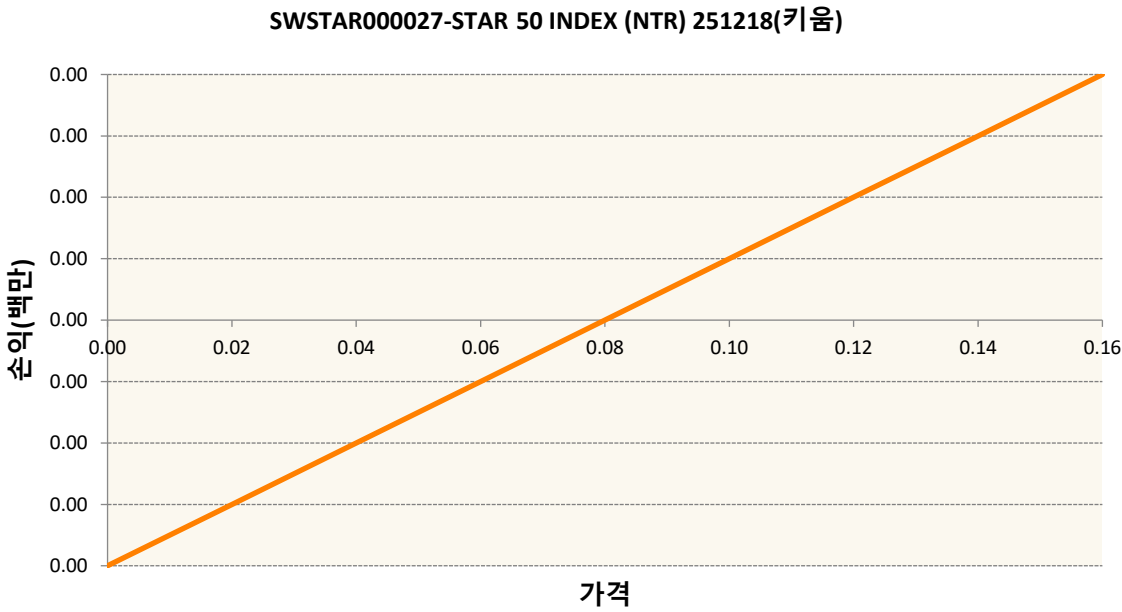
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

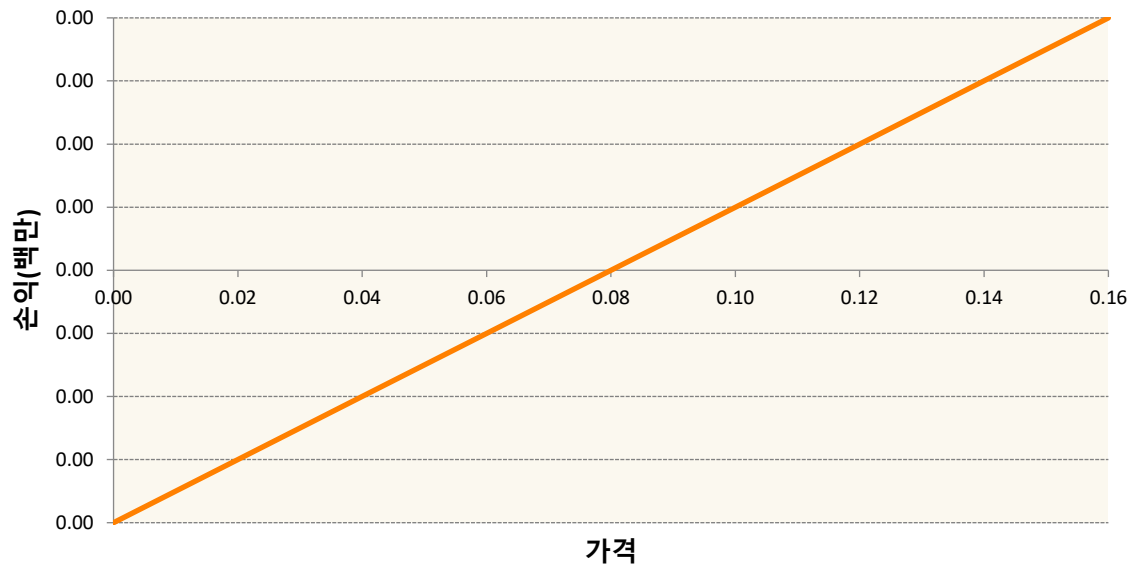
(단위:백만원)

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

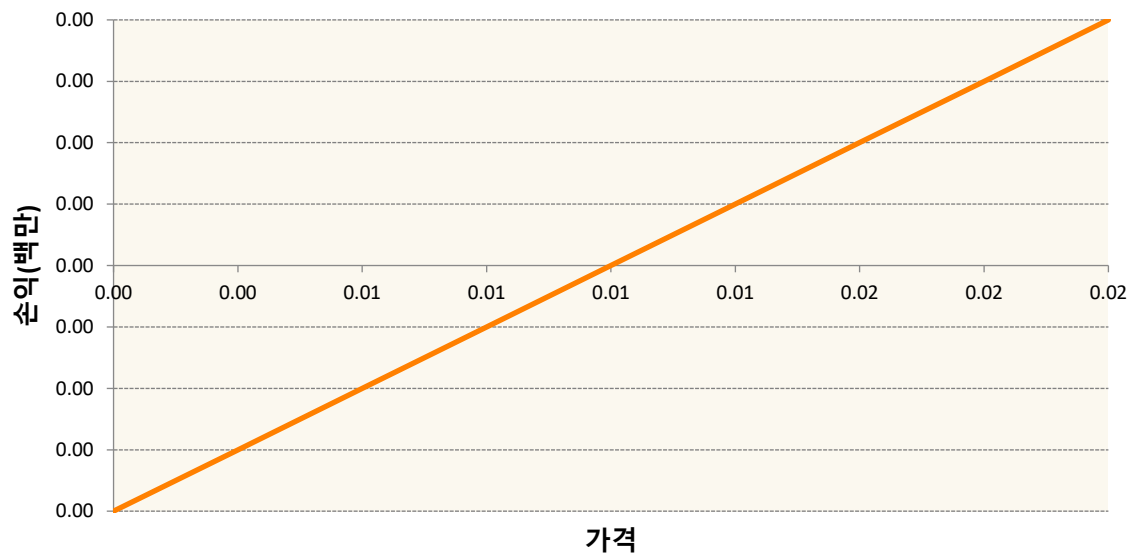
2. 만기시점의 손익구조



SWSTAR000030-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)



SWSTAR000031-STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)



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)

5
33
17
9

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

(단위:백만원)

118

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

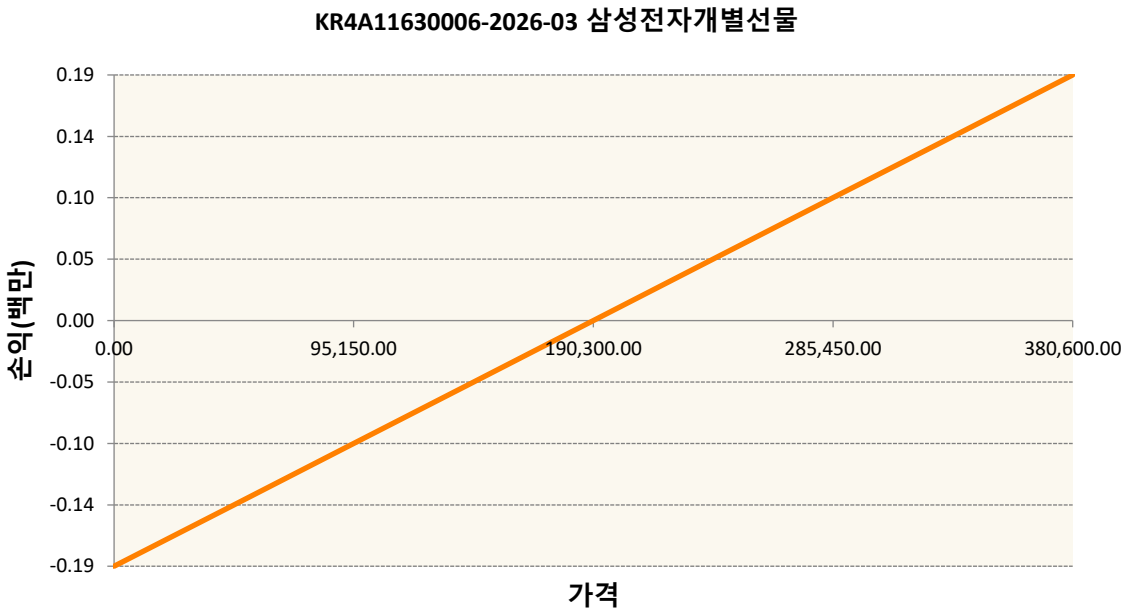
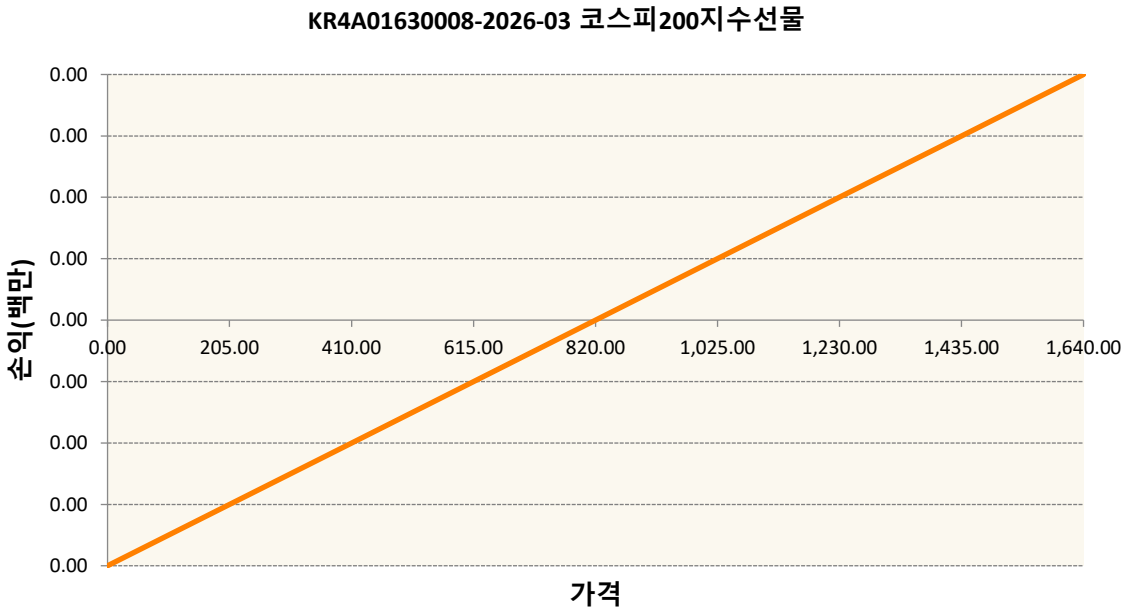
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

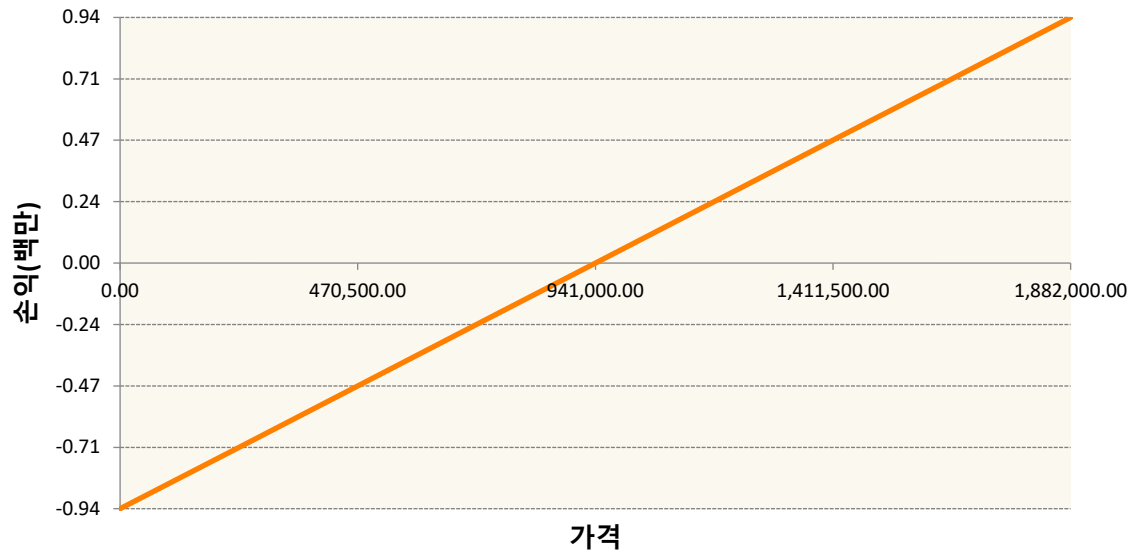
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	208	0	208	장내
누계	유가증권	선물	11,791	4,208	7,584	장내

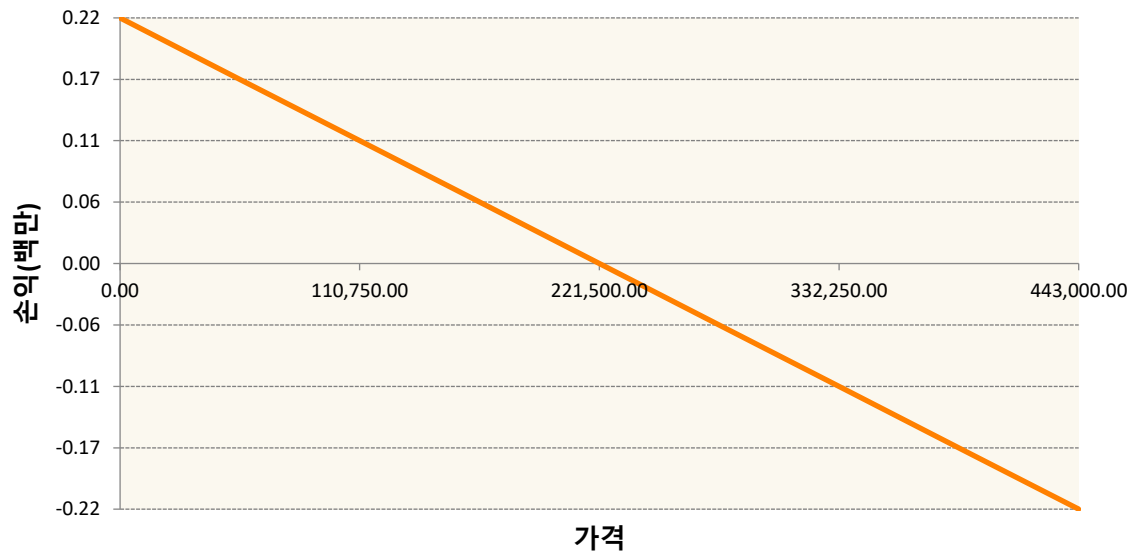
2. 만기시점의 손익구조



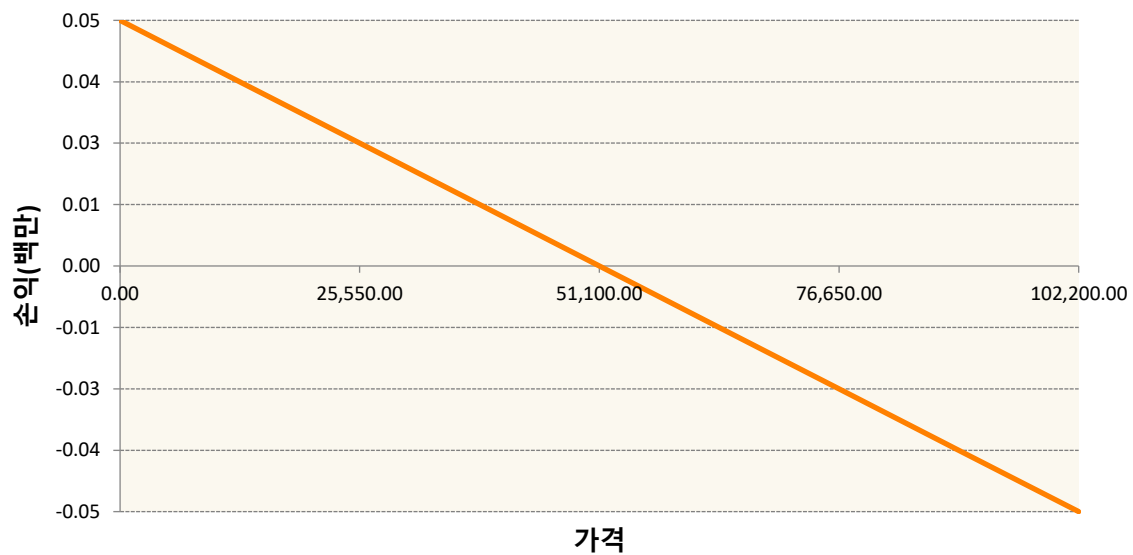
KR4A50630008-2026-03 SK하이닉스개별선물



KR4A56630002-2026-03 NAVER개별선물



KR4ACF630008-2026-03 카카오개별선물



가격	순이익(백만)
0.00	-0.06
29,850.00	-0.03
59,700.00	0.00
89,550.00	0.03
119,400.00	0.06

The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 440,000.00. The y-axis, labeled '이익 (백만)' (Profit in millions), ranges from -0.22 to 0.22. A solid orange line represents the profit function, starting at a profit of 0.22 when the price is 0.00 and decreasing linearly to a profit of -0.22 at a price of 440,000.00. The line intersects the x-axis at a price of 220,000.00, indicating the break-even point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.22
110,000.00	0.11
220,000.00	0.00
330,000.00	-0.11
440,000.00	-0.22

(단위:백만원)

KR4A01630008				2026-03 코스피200지수선물			582
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-582	-582	-582	-582	-582	-582	-582
-5.33%	-388	-388	-388	-388	-388	-388	-388
-2.67%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	194	194	194	194	194	194	194
5.33%	388	388	388	388	388	388	388
8.00%	582	582	582	582	582	582	582
KR4A11630006				2026-03 삼성전자개별선물			289
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289
-5.33%	-193	-193	-193	-193	-193	-193	-193
-2.67%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	96	96	96	96	96	96	96
5.33%	193	193	193	193	193	193	193
8.00%	289	289	289	289	289	289	289

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 129

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	129	129	129	129	129	129	129
-5.33%	86	86	86	86	86	86	86
-2.67%	43	43	43	43	43	43	43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129

KR4ACF630008 2026-03 카카오개별선물 131

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	131	131	131	131	131	131	131
-5.33%	87	87	87	87	87	87	87
-2.67%	44	44	44	44	44	44	44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131

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
KR4AG6630000 2026-03 현대로템개별선물							79
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	79	79	79	79	79	79	79
-5.33%	52	52	52	52	52	52	52
-2.67%	26	26	26	26	26	26	26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79

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

(단위:백만원)

2,382

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

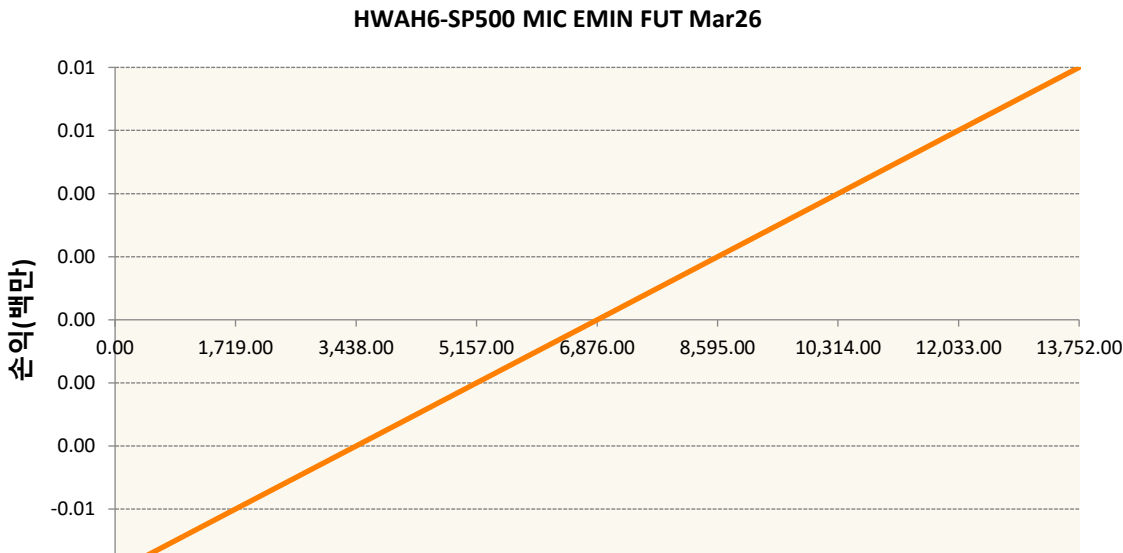
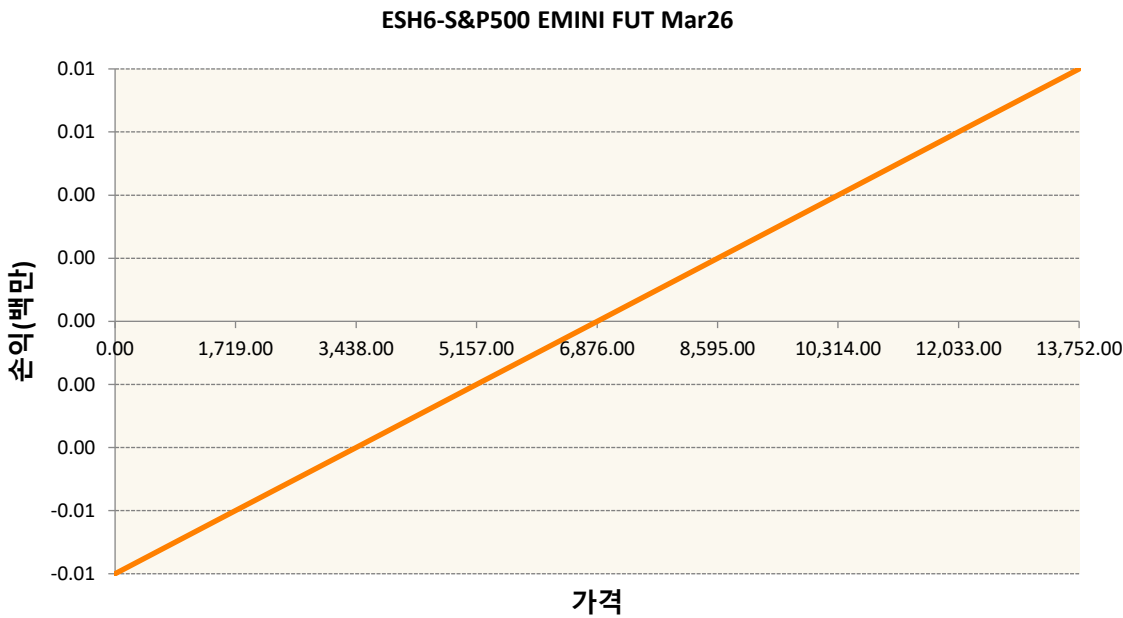
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

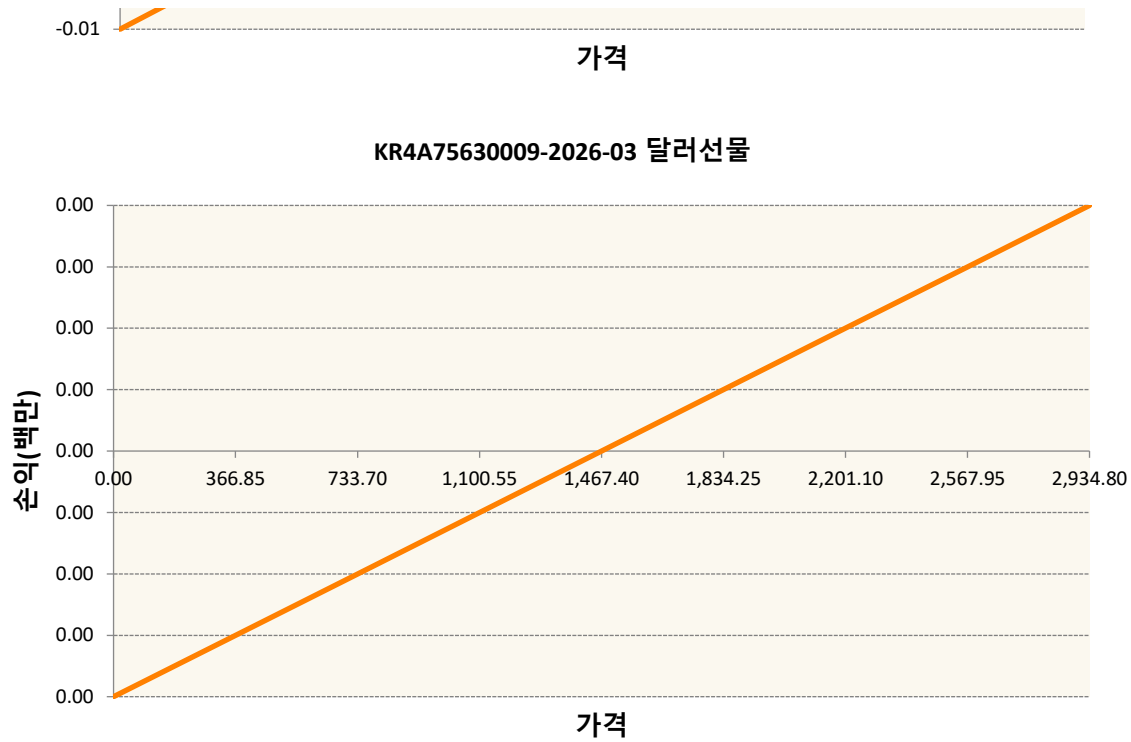
1. 계약금액

(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	53,222	0	53,222	
누계	통화	선물	12,179	0	12,179	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26		4,258
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26		8
KR4A756300 2026-03 달러선물			974

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,647

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

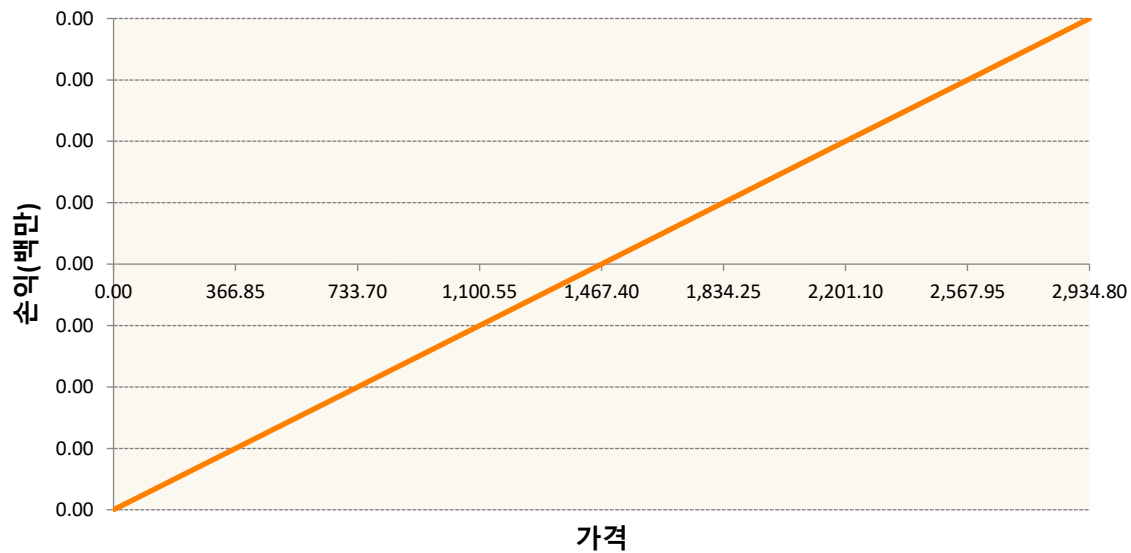
1. 계약금액

(단위:백만원)

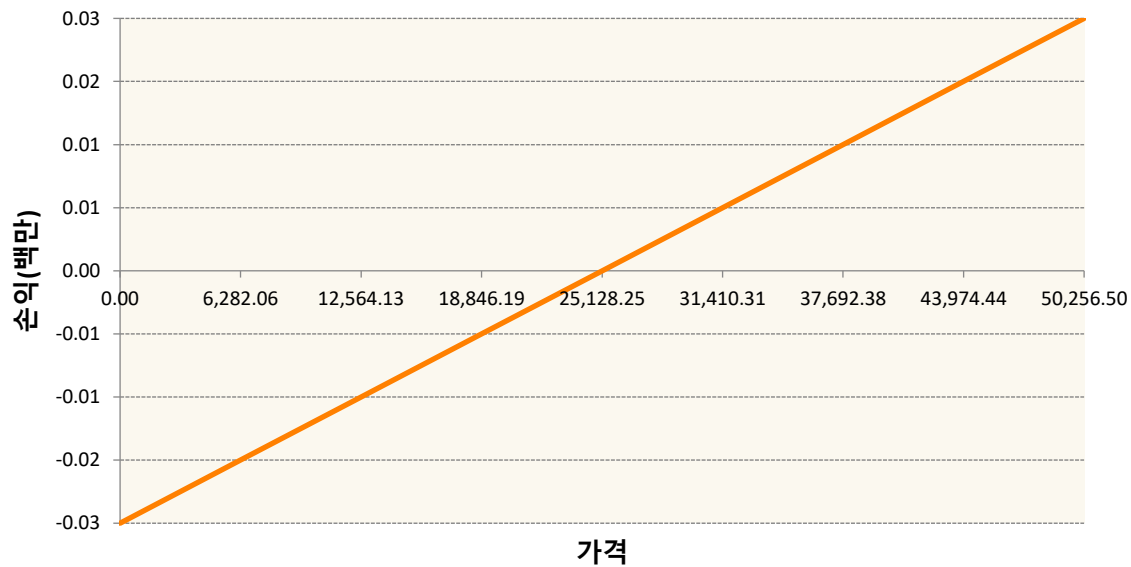
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	22,991	0	22,991	장내
누계	통화	선물	4,916	0	4,916	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A75630009-2026-03 달러선물



NQH6-NASDAQ 100 E-MINI Dec20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A756300 2026-03 달러선물		393
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,839

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,003

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

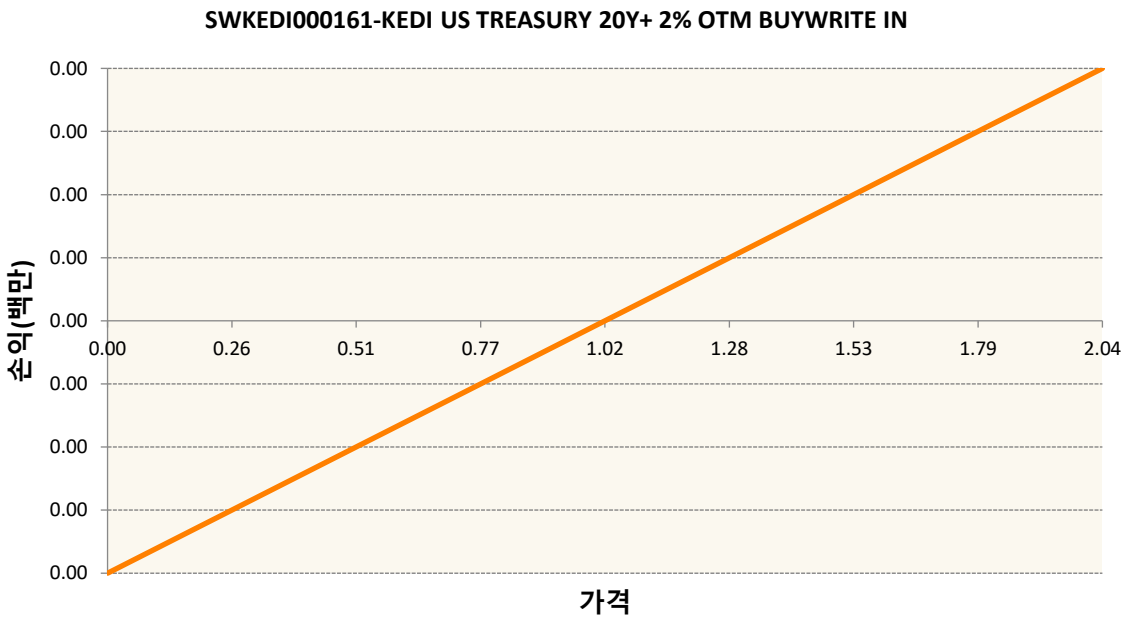
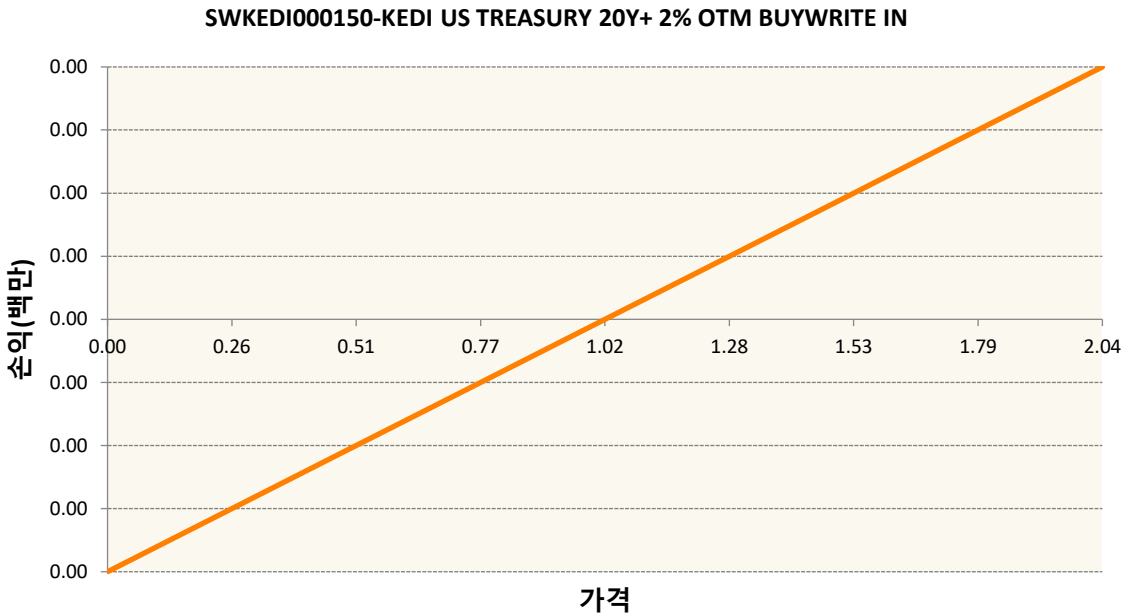
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

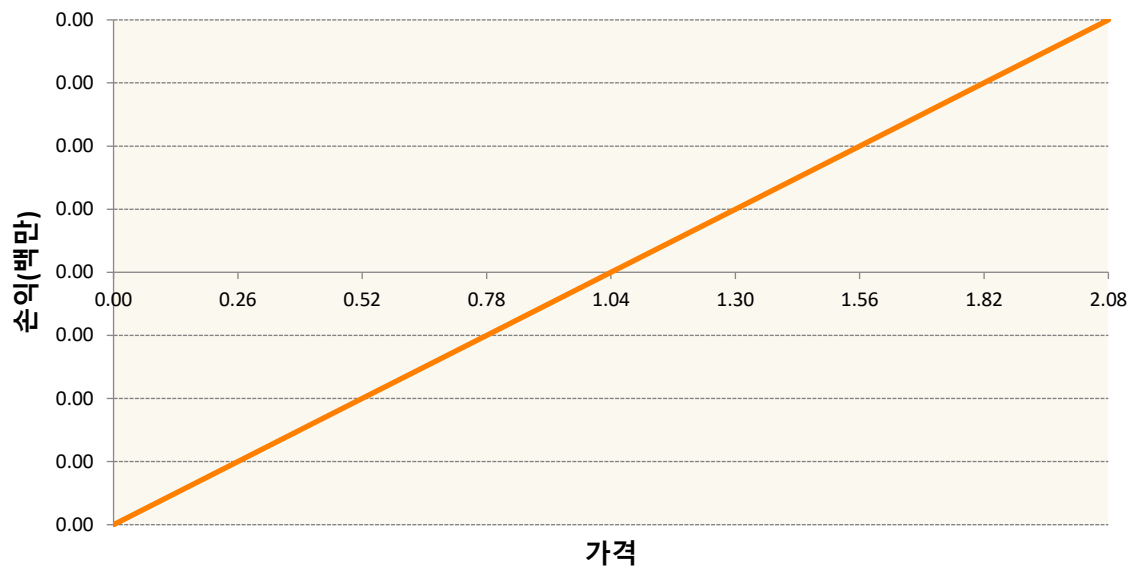
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	388,543	0	388,543	장외

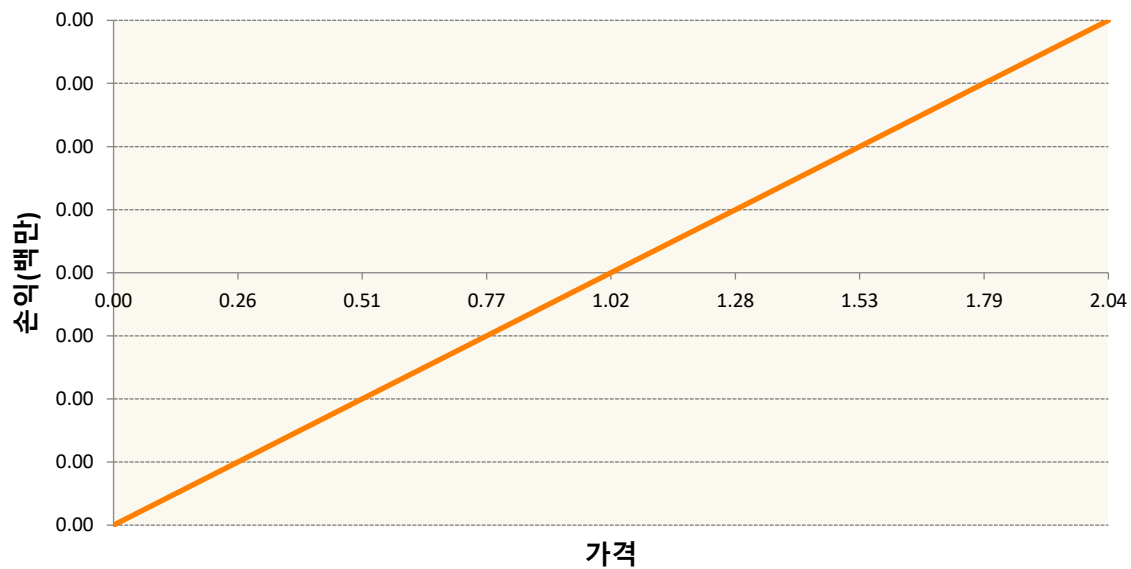
2. 만기시점의 손익구조



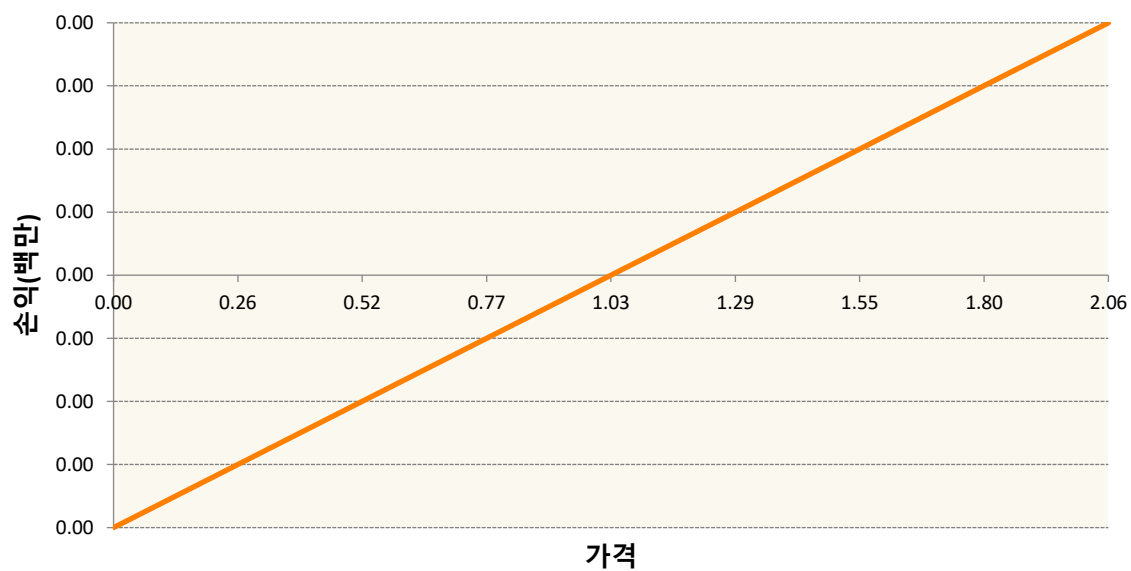
SWKEDI000164-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000167-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000168-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,413
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,768
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		152
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		10,126
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,560

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,793

공시일	2026-03-06
기준일	2026-03-05

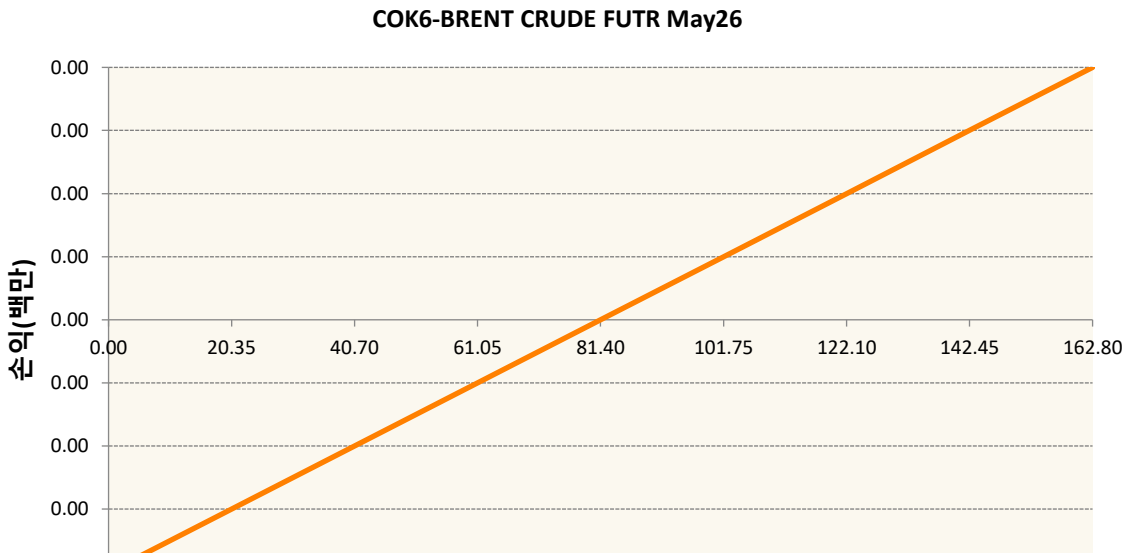
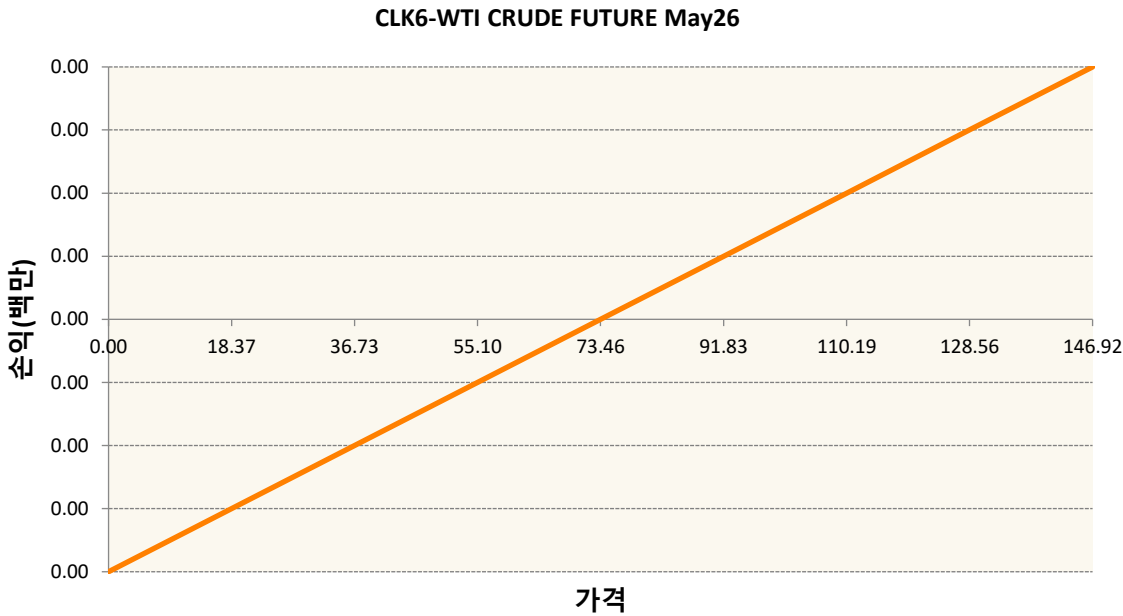
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

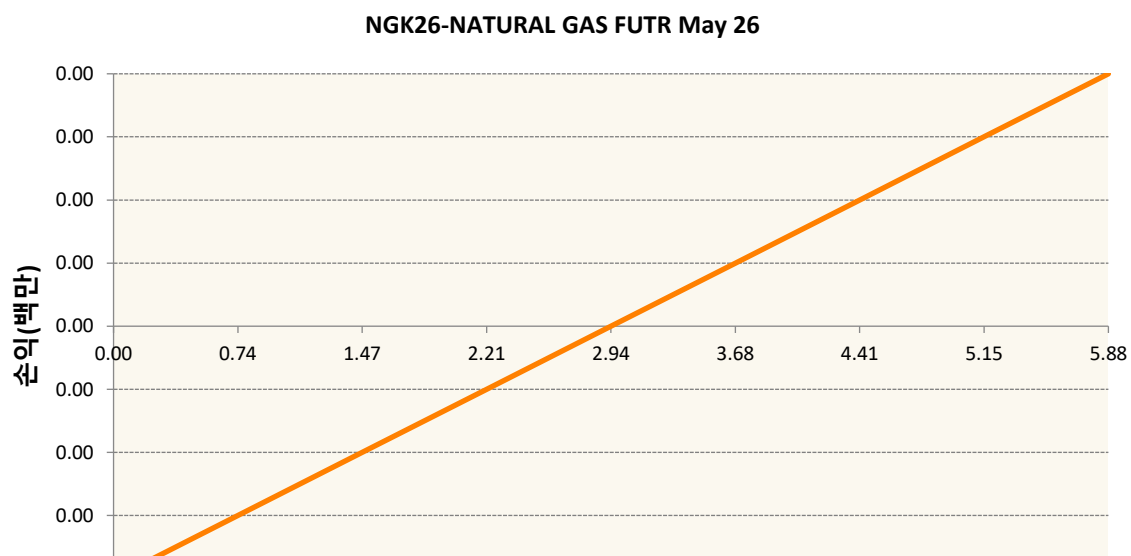
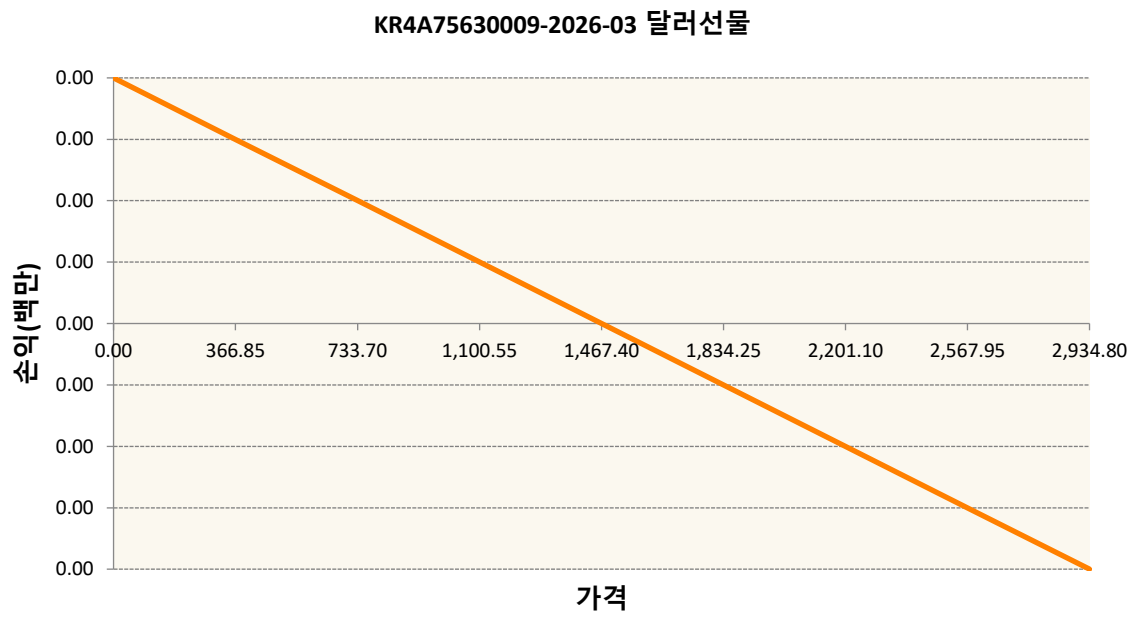
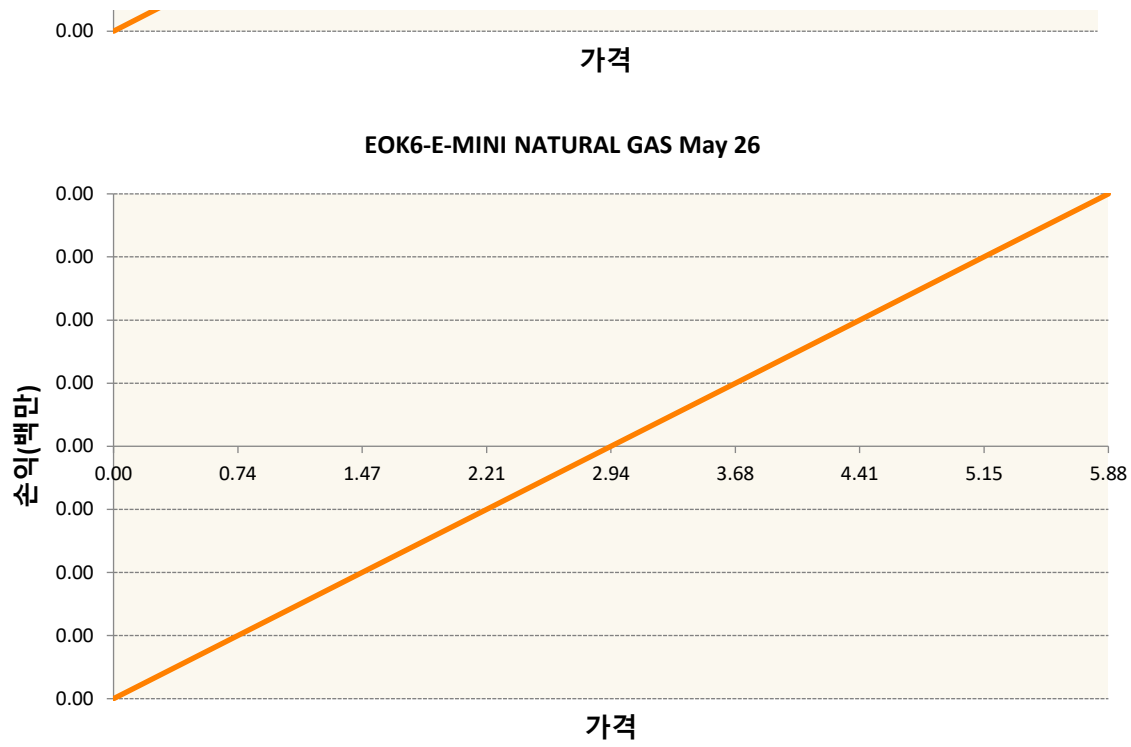
1. 계약금액

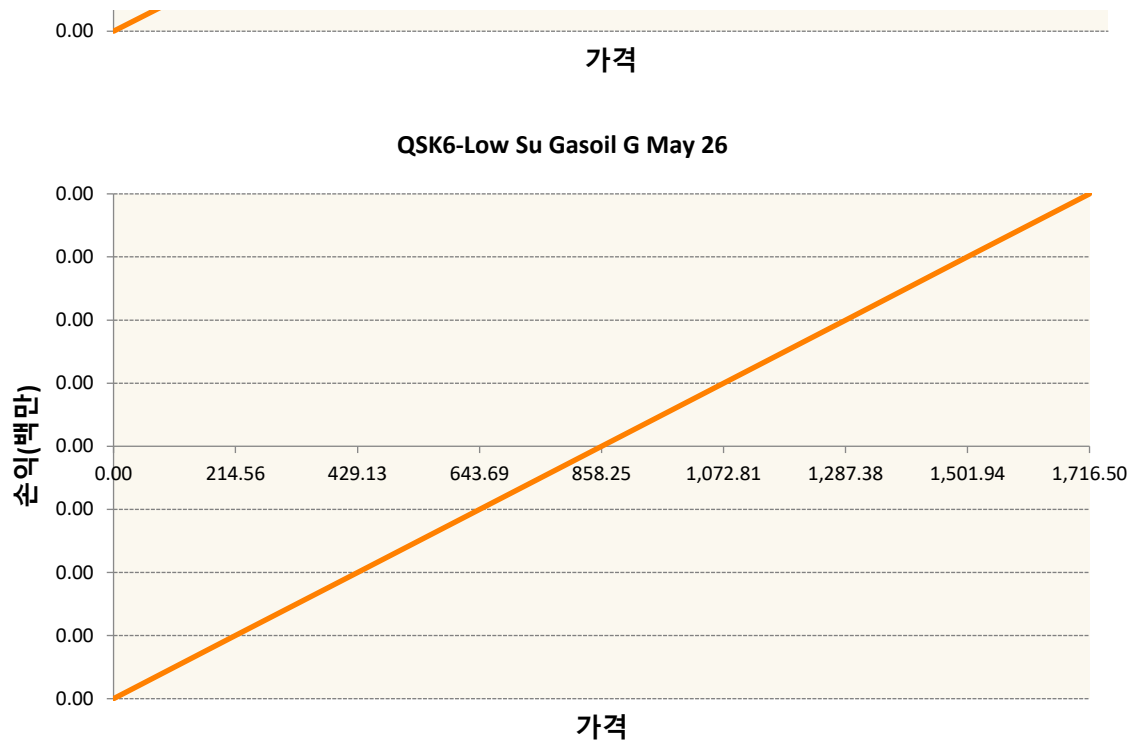
(단위:백만원)

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	167	0	167	
누계	유가증권	선물	357	0	357	
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	3
QSK6	Low Su Gasoil G May 26	10

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

(단위:백만원)

90