

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

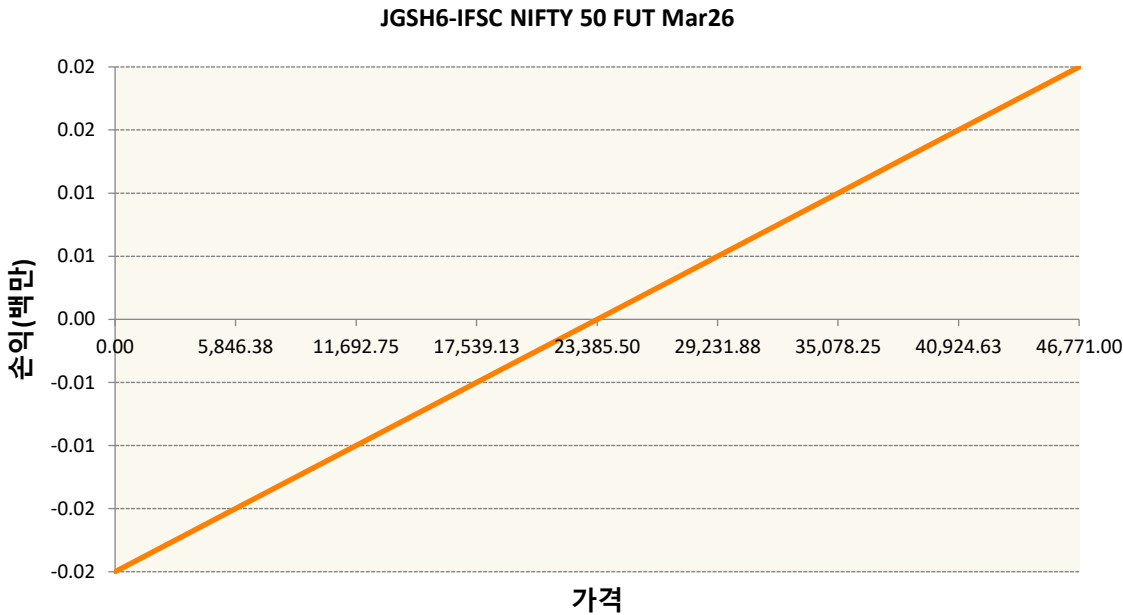
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	604	0	604	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH6	IFSC NIFTY 50 FUT Mar26	48
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

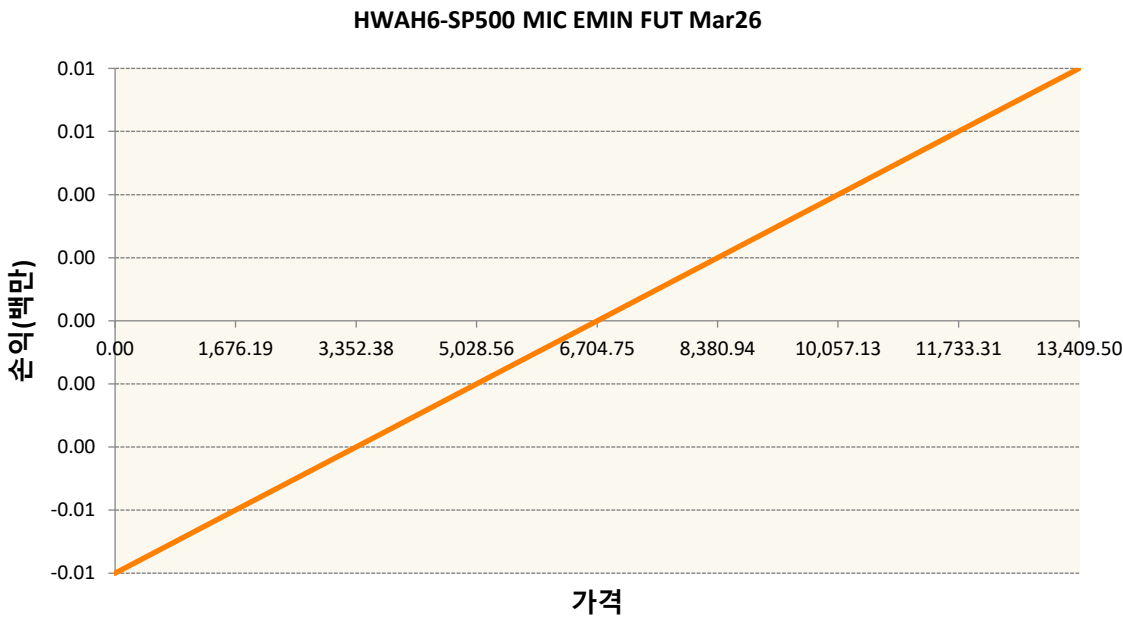
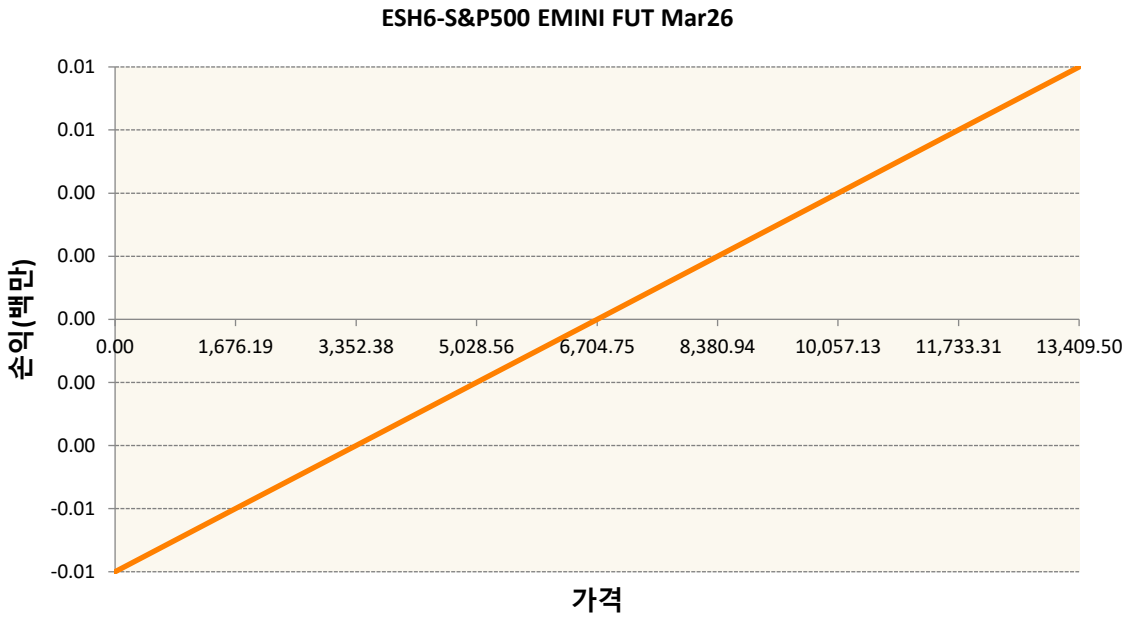
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	149	0	149	장내
누계	지수	선물	495	0	495	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	40
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	44

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

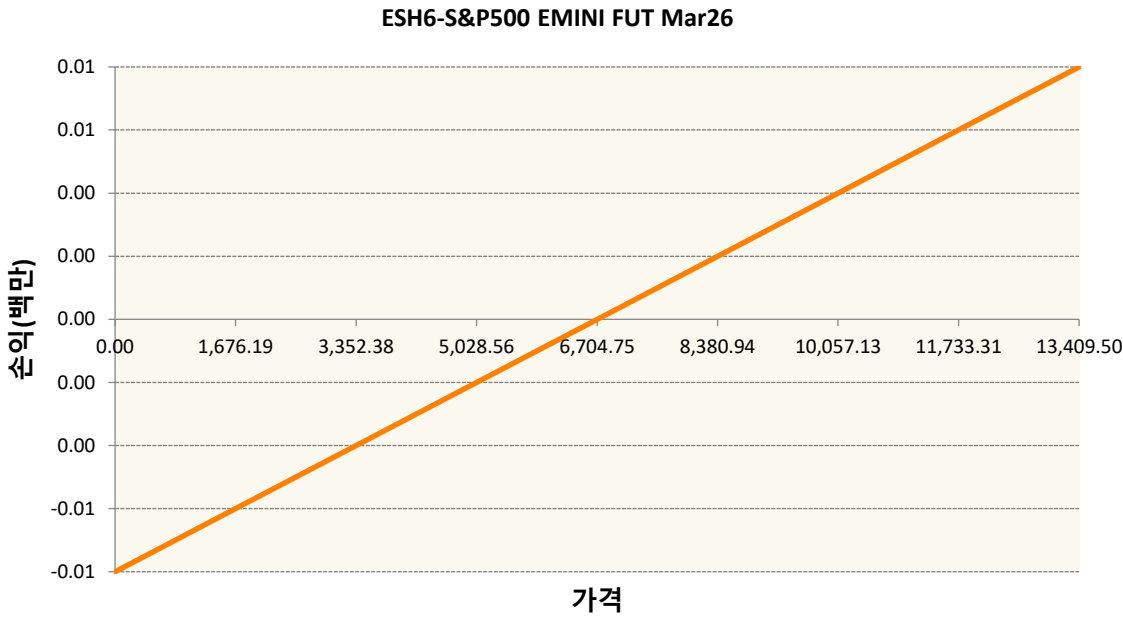
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,486	0	1,486	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	119
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

102

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

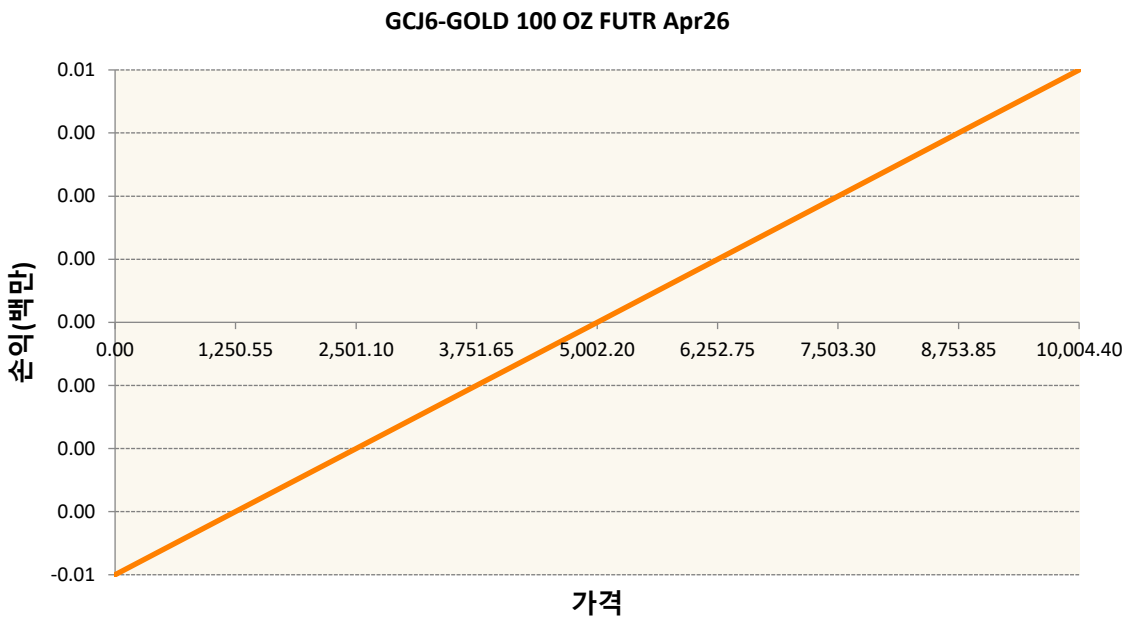
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,998	0	4,998	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 03/20/26 C480 EQUITY	3
GCI6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	400

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

(단위:백만원)

474

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

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)

AOPLTRCUS' PLTR US 03/20/26 C160 EQUITY	62
AOPLTRPUS' PLTR US 03/20/26 P160 EQUITY	52

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

(단위:백만원)

391

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

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)

AOTLTUSC0(TLT US 03/20/26 C88 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

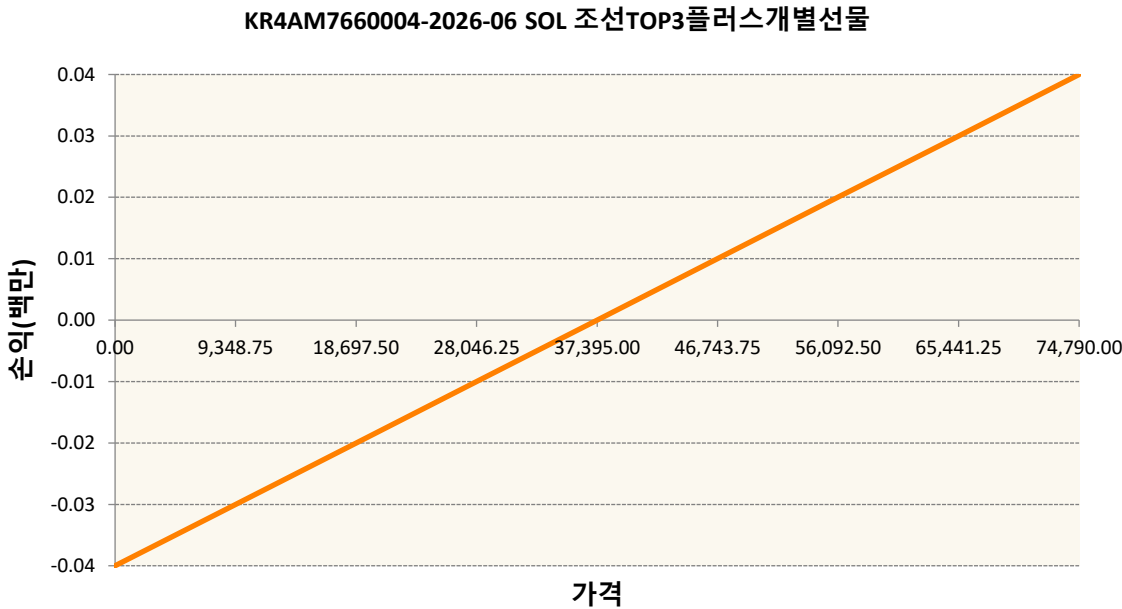
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	150,171	0	150,171	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-03-18

기준일 2026-03-17

포커스채권(채권-파생형)(종)

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	2026-03-18
기준일	2026-03-17

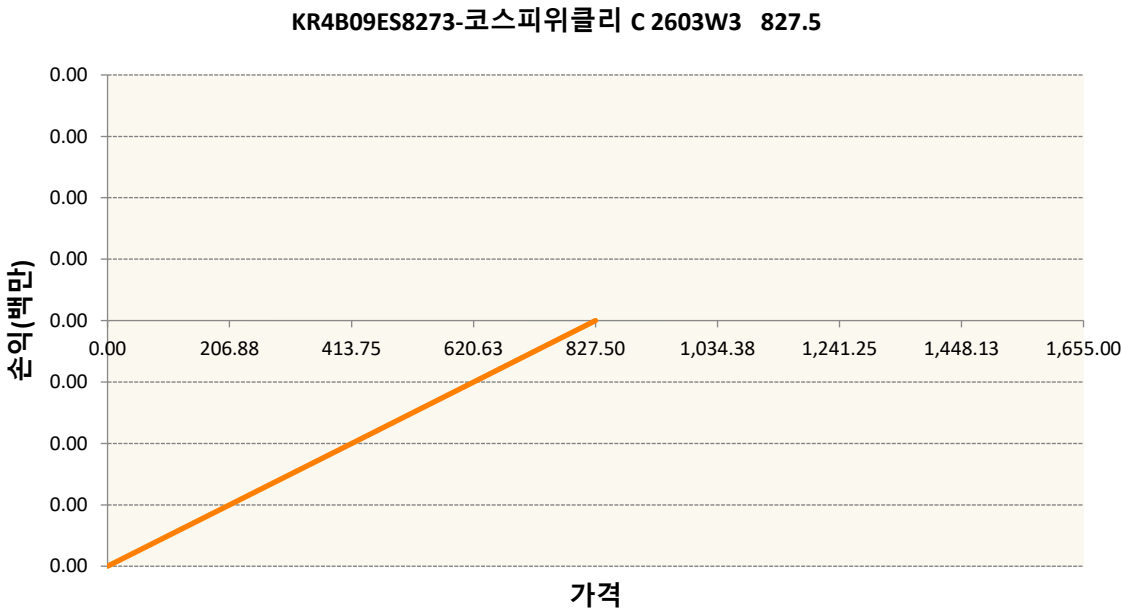
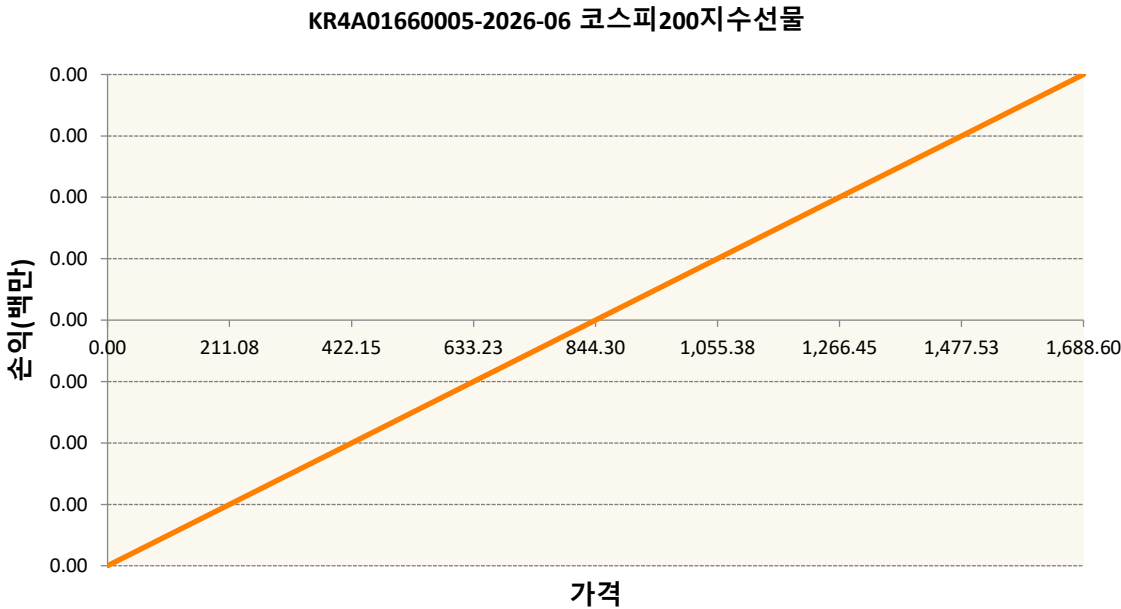
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

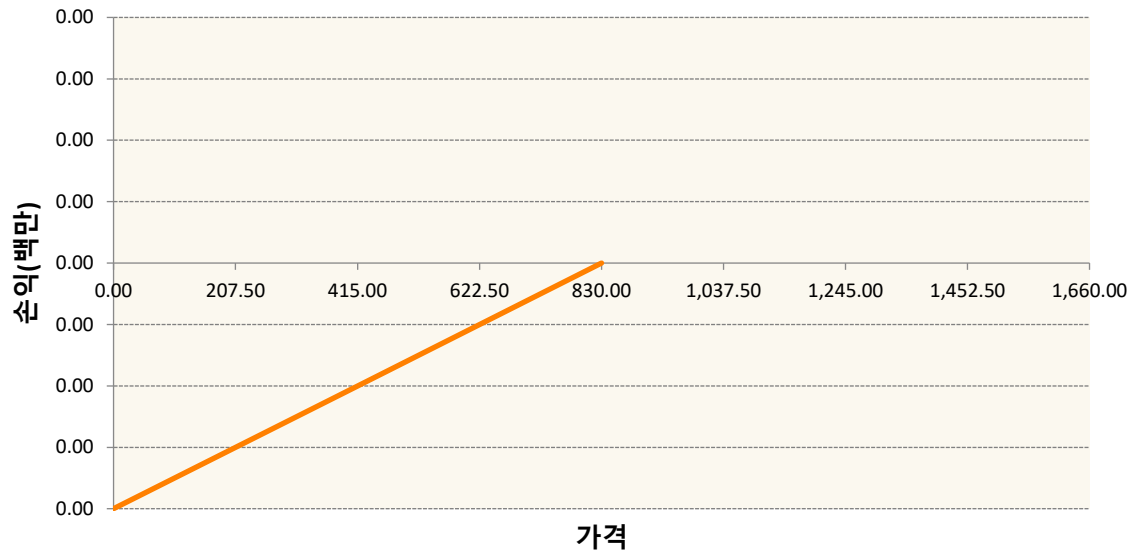
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	2,122	-2,122	장내
누계	유가증권	선물	1,689	0	1,689	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,107	-3,107	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4B09ES8307-코스피위클리 C 2603W3 830.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005			2026-06 코스피200지수선물				135
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
-5.33%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	90	90	90	90	90	90	90
8.00%	135	135	135	135	135	135	135
KR4B09ES8273			코스피위클리 C 2603W3 827.5				108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-104	-104	-105	-105	-106	-107	-108
-5.33%	-56	-57	-58	-60	-61	-63	-65
-2.67%	-16	-19	-21	-24	-26	-28	-31
0%	7	5	2	0	-2	-5	-7
2.67%	15	14	13	12	10	8	7
5.33%	17	17	16	16	15	14	13
8.00%	17	17	17	17	17	17	16
KR4B09ES8307			코스피위클리 C 2603W3 830.0				74
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-73	-73	-74
-5.33%	-39	-40	-41	-42	-43	-44	-45
-2.67%	-12	-14	-15	-17	-18	-20	-21
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5

2.67%	11	10	10	9	7	6	5
5.33%	13	12	12	12	11	11	10
8.00%	13	13	13	13	13	12	12

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

(단위:백만원)

441

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

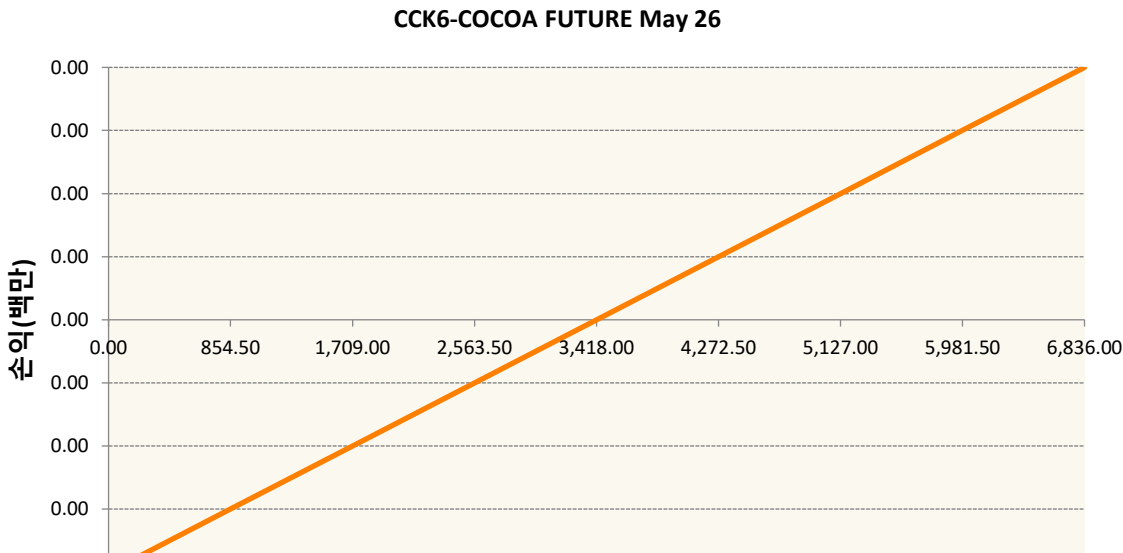
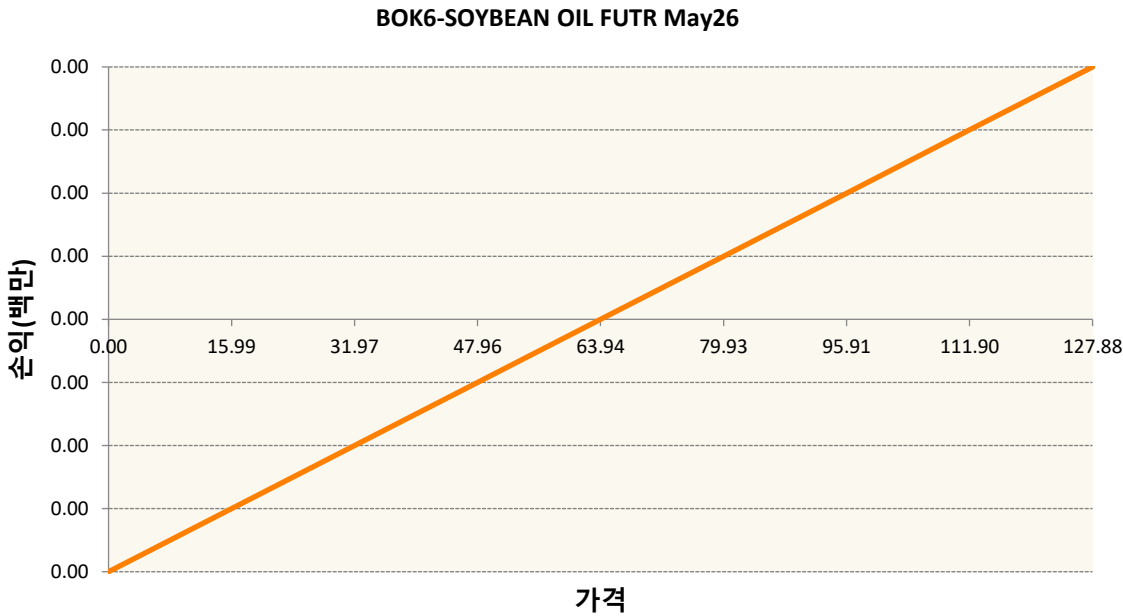
포커스농산물모(채권-파생형)

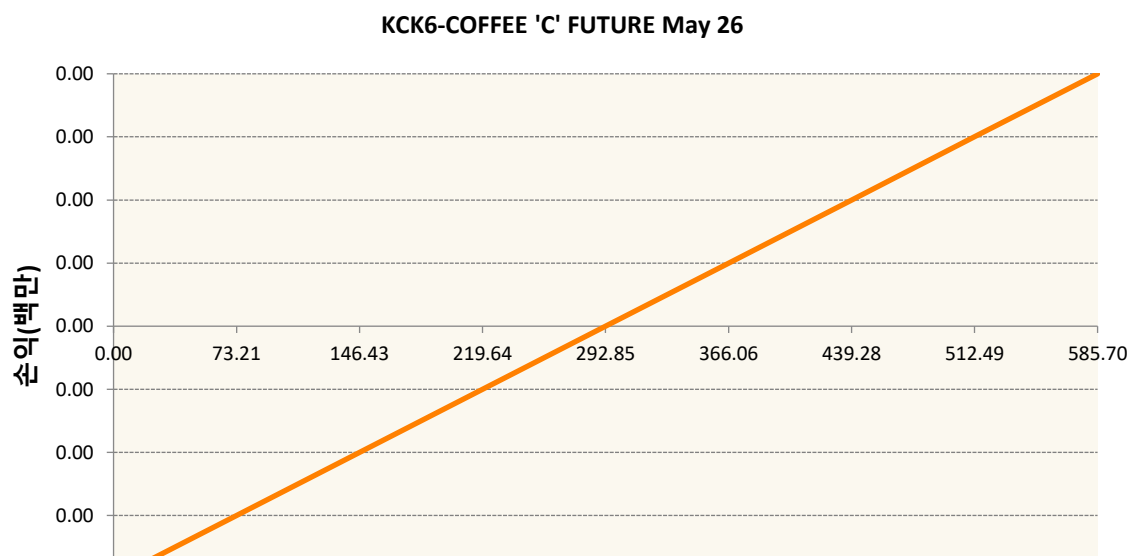
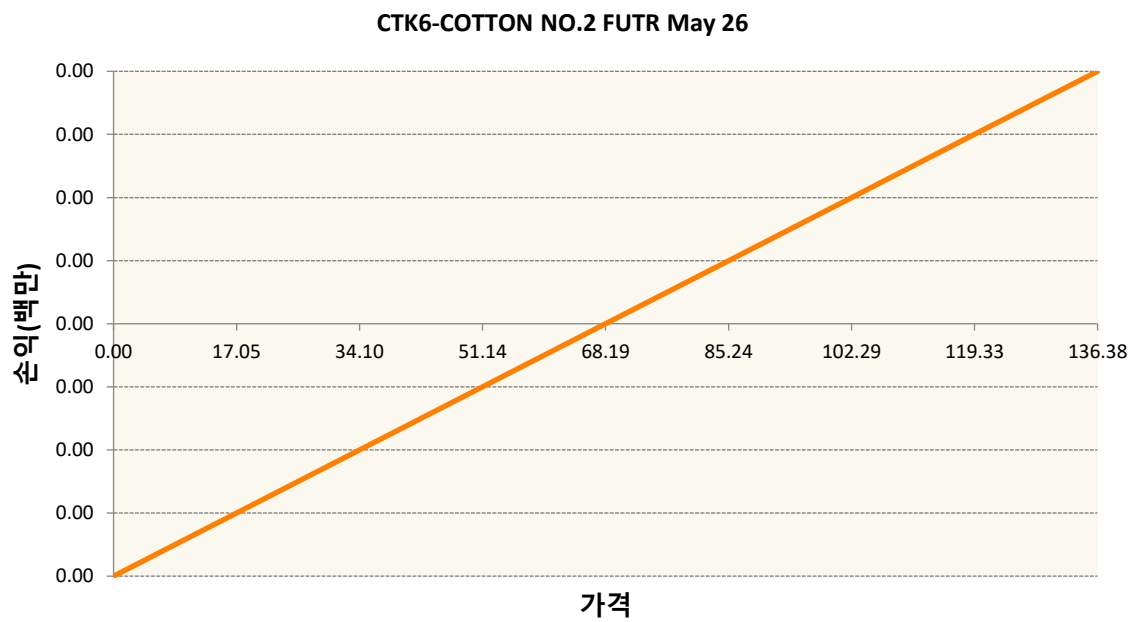
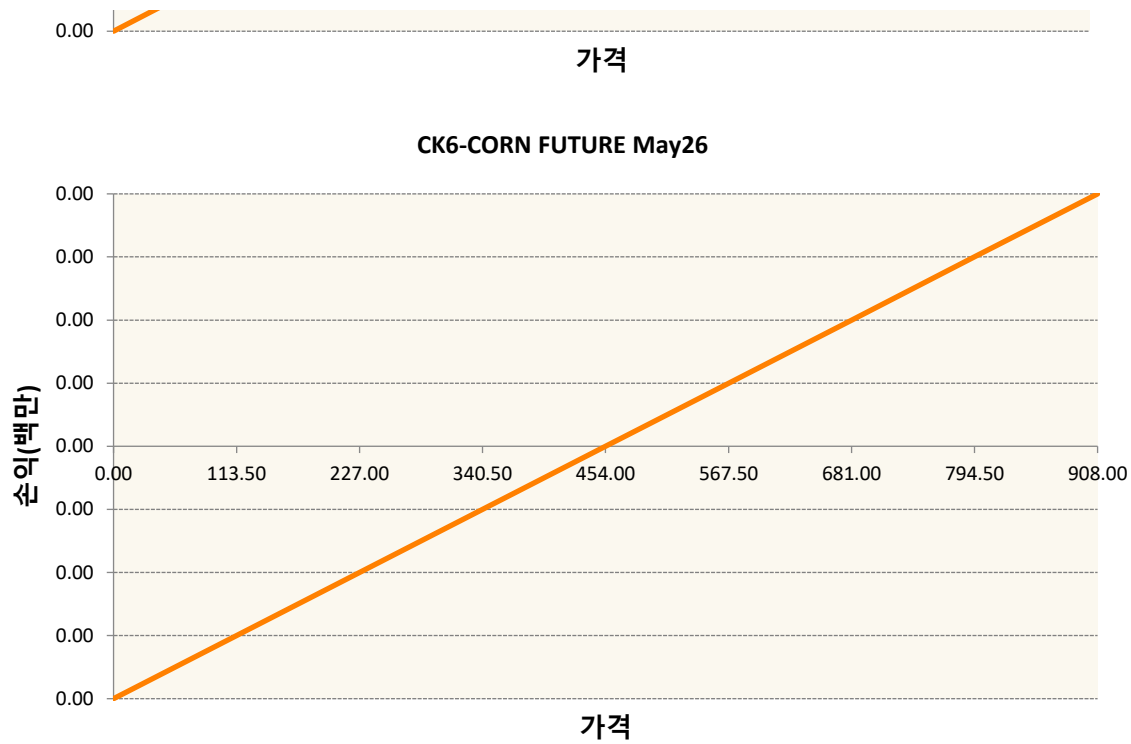
1. 계약금액

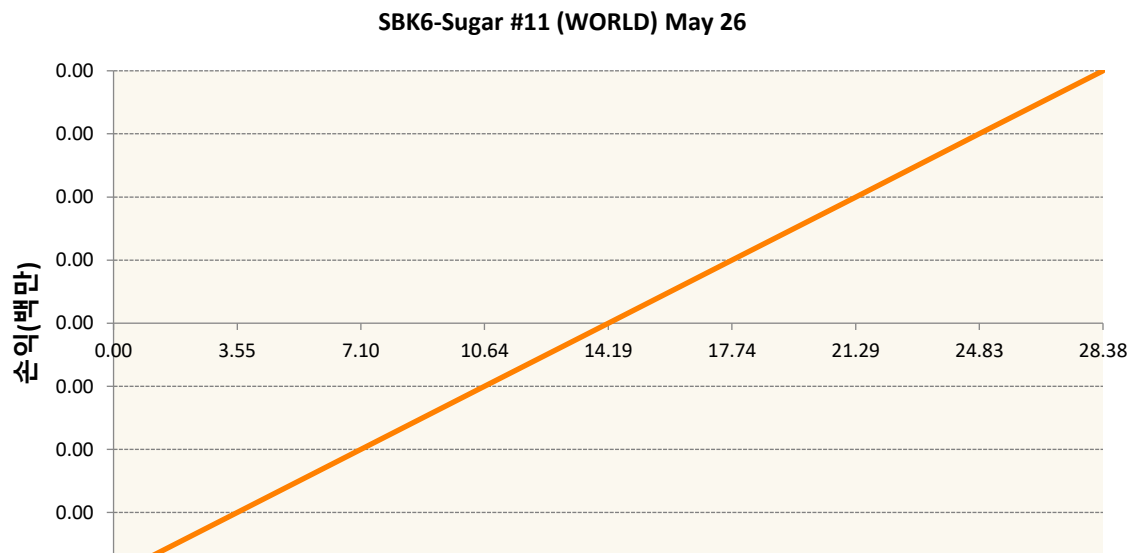
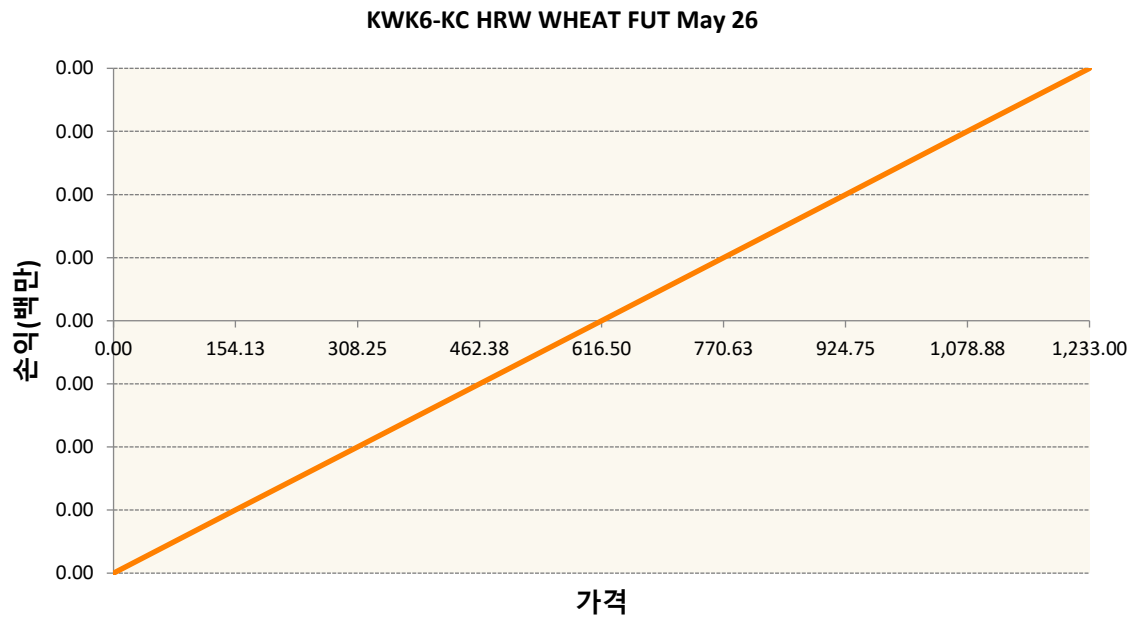
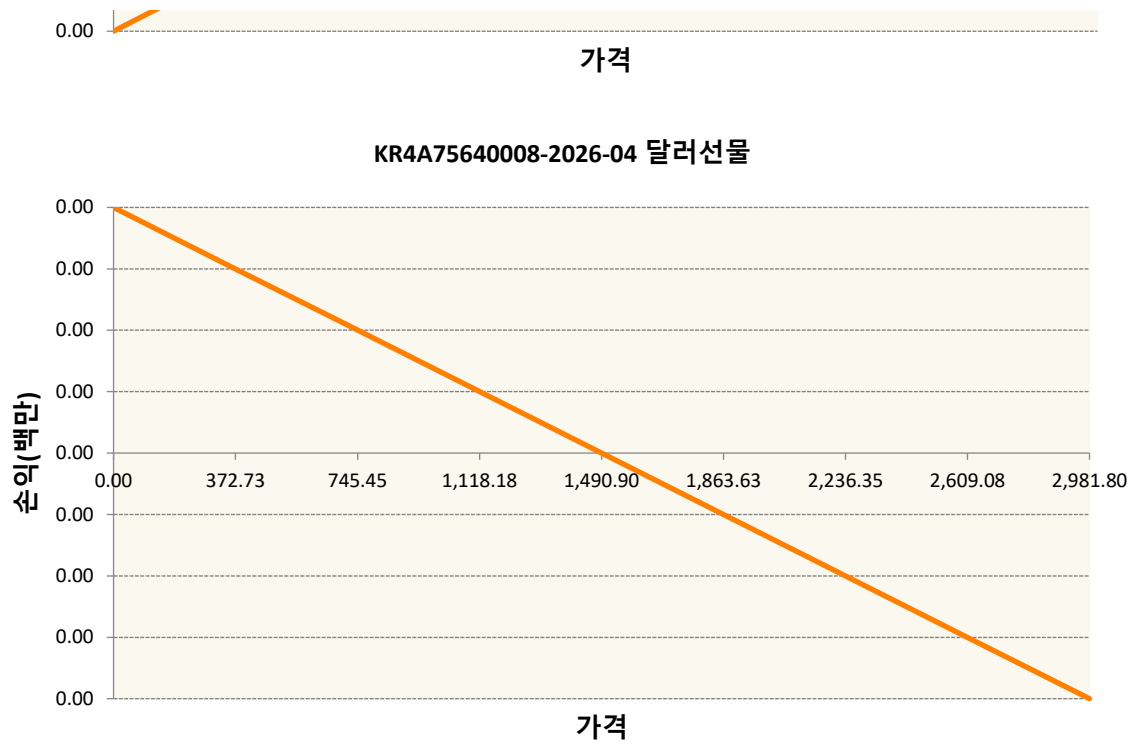
(단위:USD 백만)

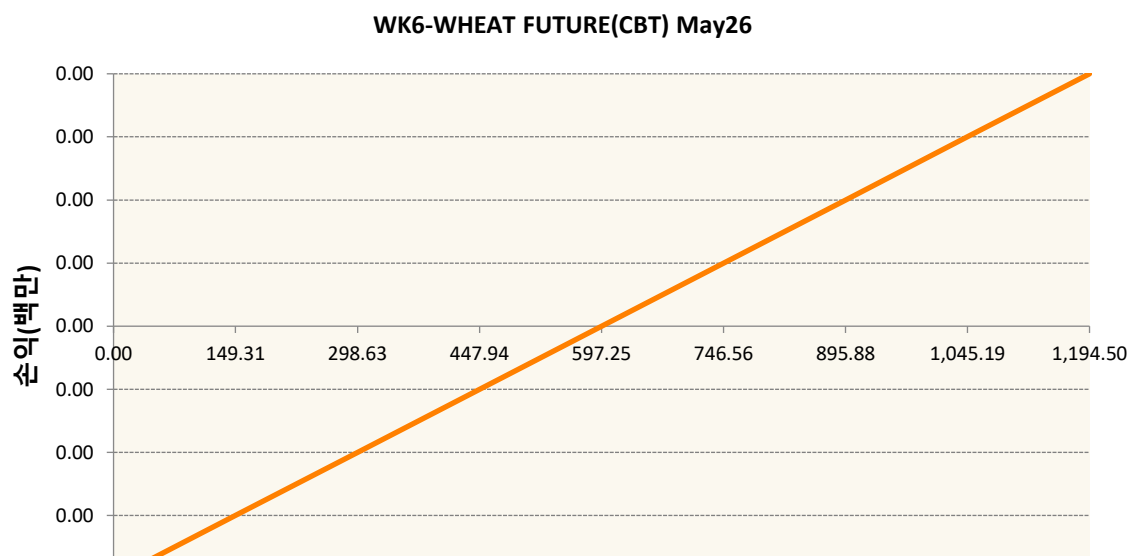
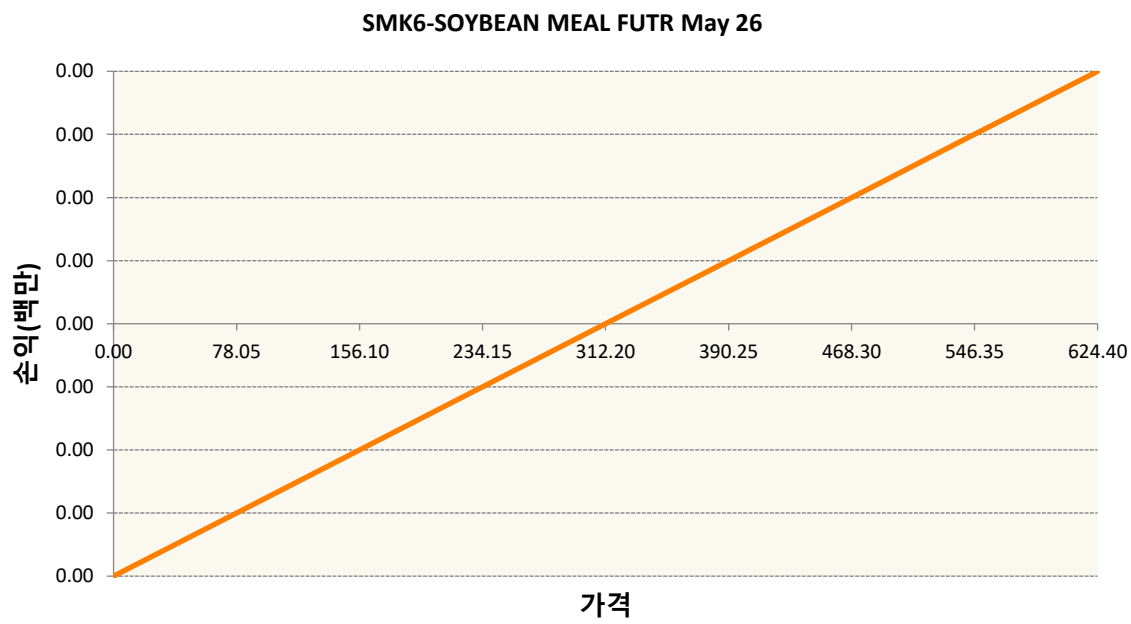
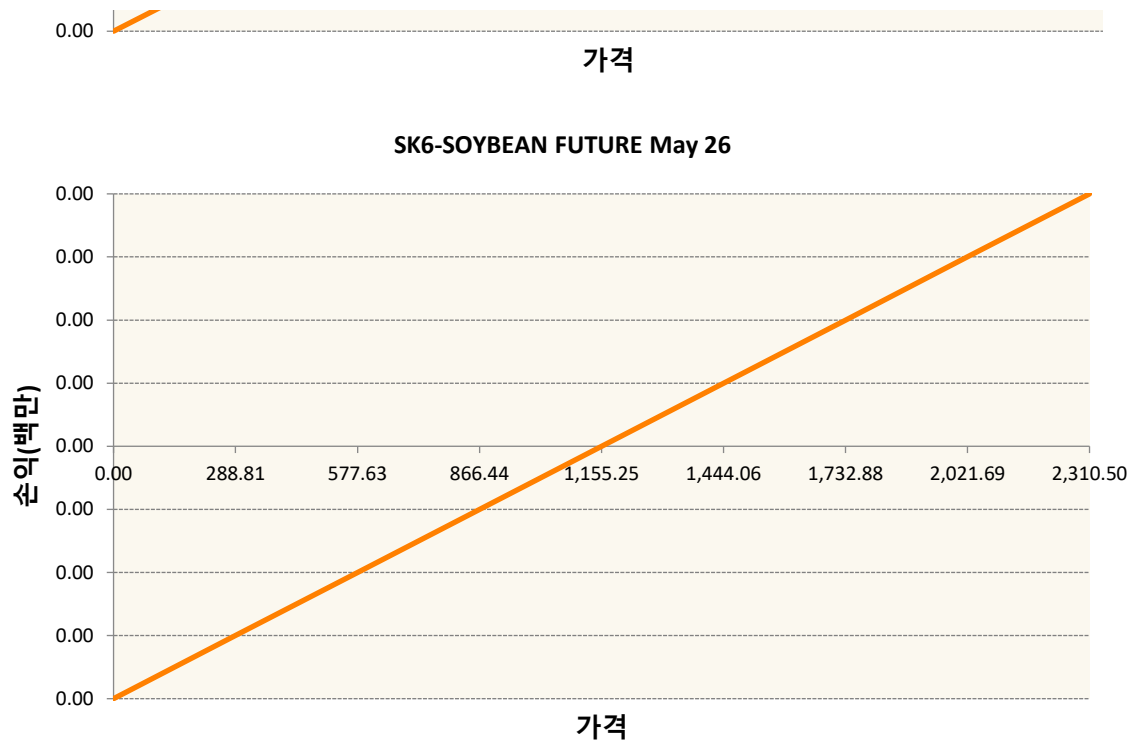
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	45	0	45	장내
누계	실물자산	선물	1,221	0	1,221	
누계	유가증권	선물	1,744	0	1,744	
누계	통화	선물	0	447	-447	장내

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	2026-03-18
기준일	2026-03-17

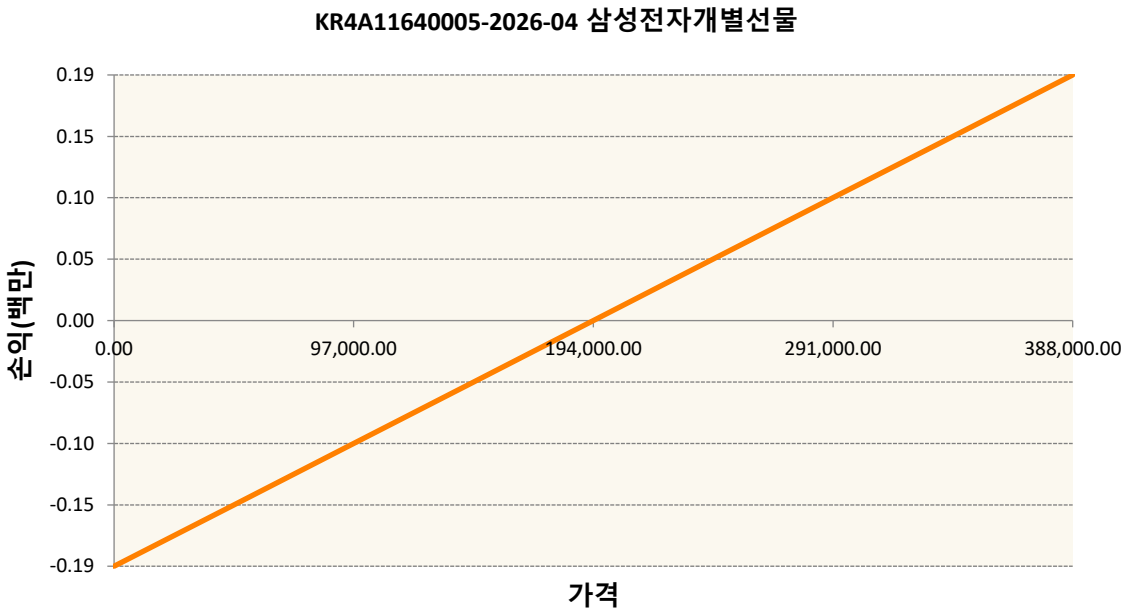
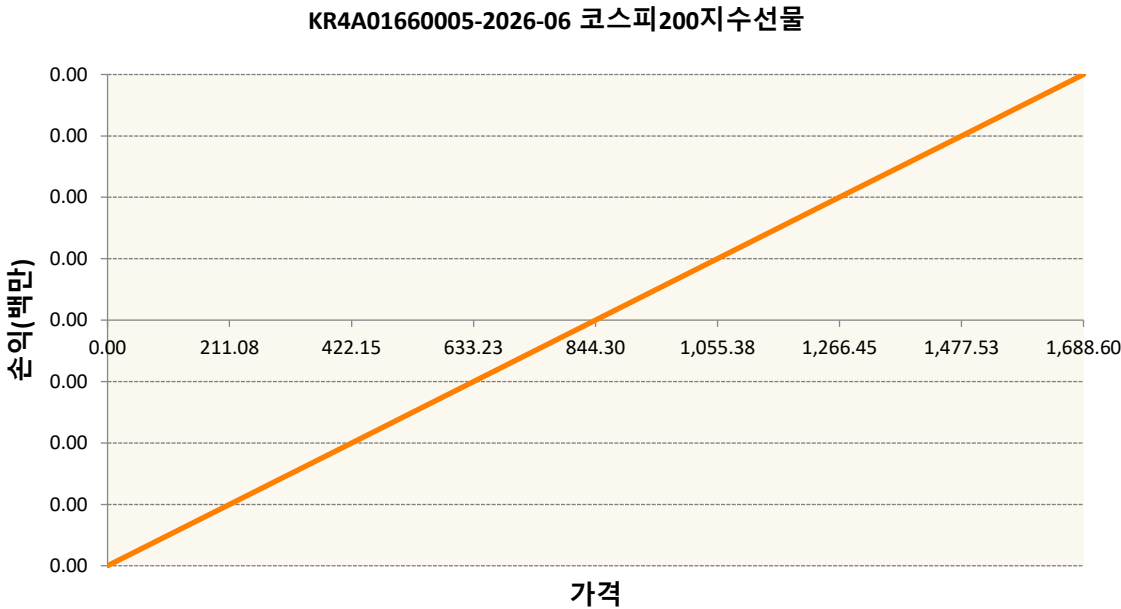
스마트인덱스모

1. 계약금액

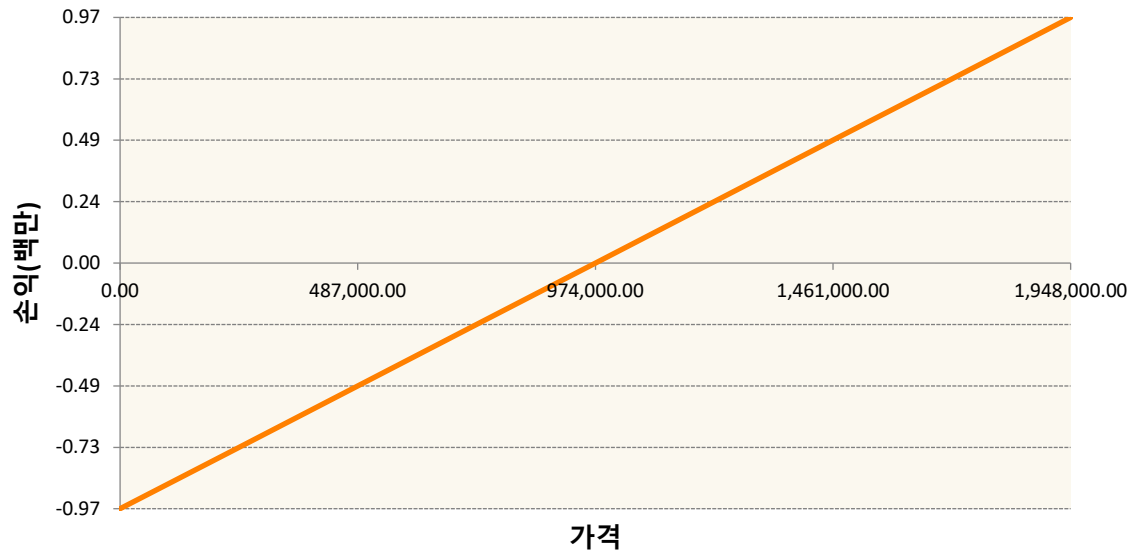
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	213	-213	장내
누계	유가증권	선물	4,367	0	4,367	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					336
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-336	-336	-336	-336	-336	-336	-336
-5.33%	-224	-224	-224	-224	-224	-224	-224
-2.67%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	112	112	112	112	112	112	112
5.33%	224	224	224	224	224	224	224
8.00%	336	336	336	336	336	336	336
KR4A11640005		2026-04 삼성전자개별선물					3
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR4A50640007		2026-04 SK하이닉스개별선물					9
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	681

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

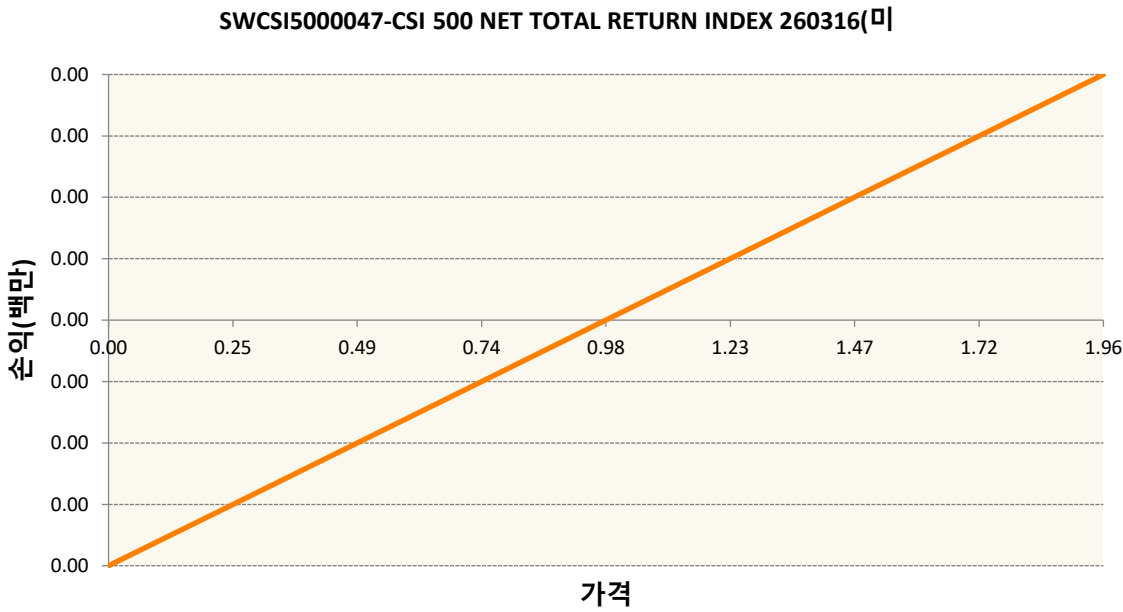
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,531	0	5,531	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

441

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

555

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

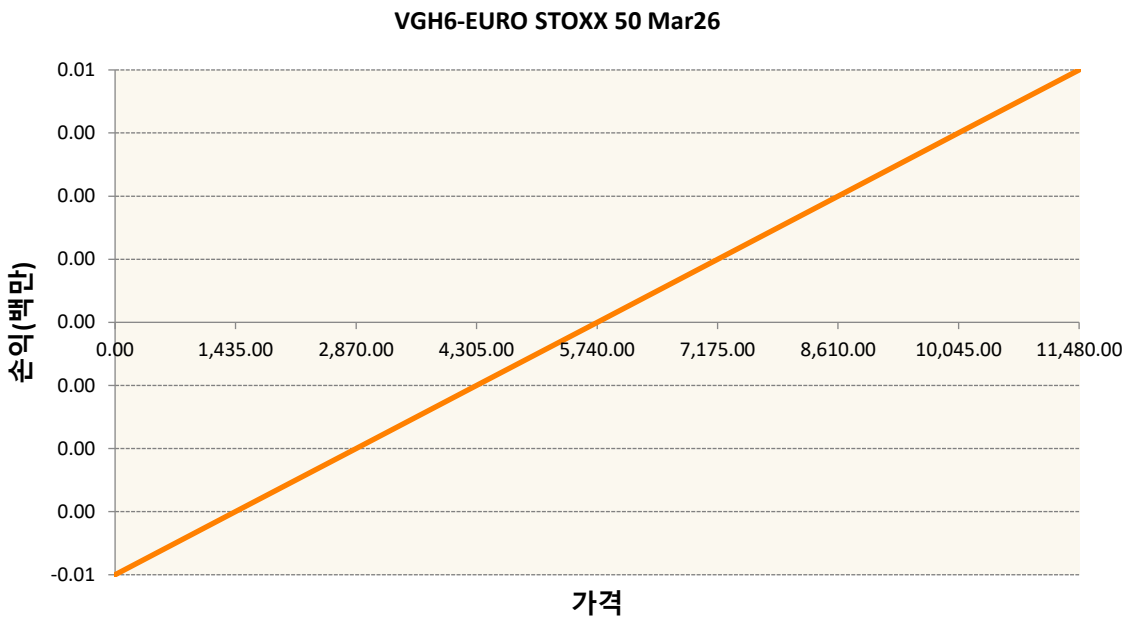
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	895	0	895	

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	2026-03-18
기준일	2026-03-17

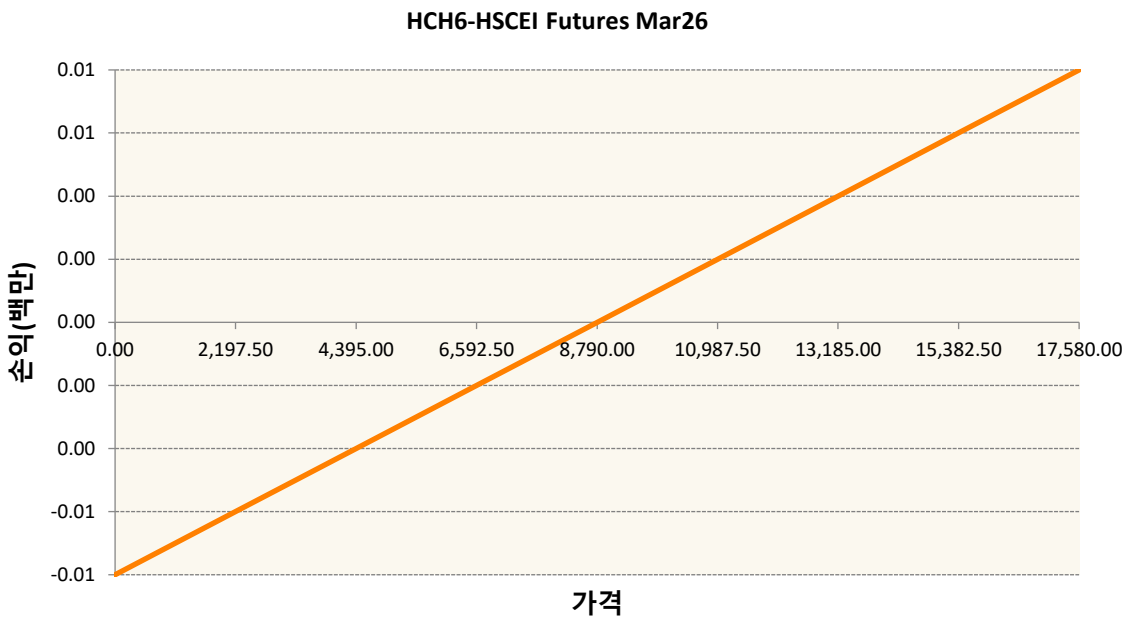
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,440	0	1,440	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH6	HSCEI Futures Mar26	115
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

131

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

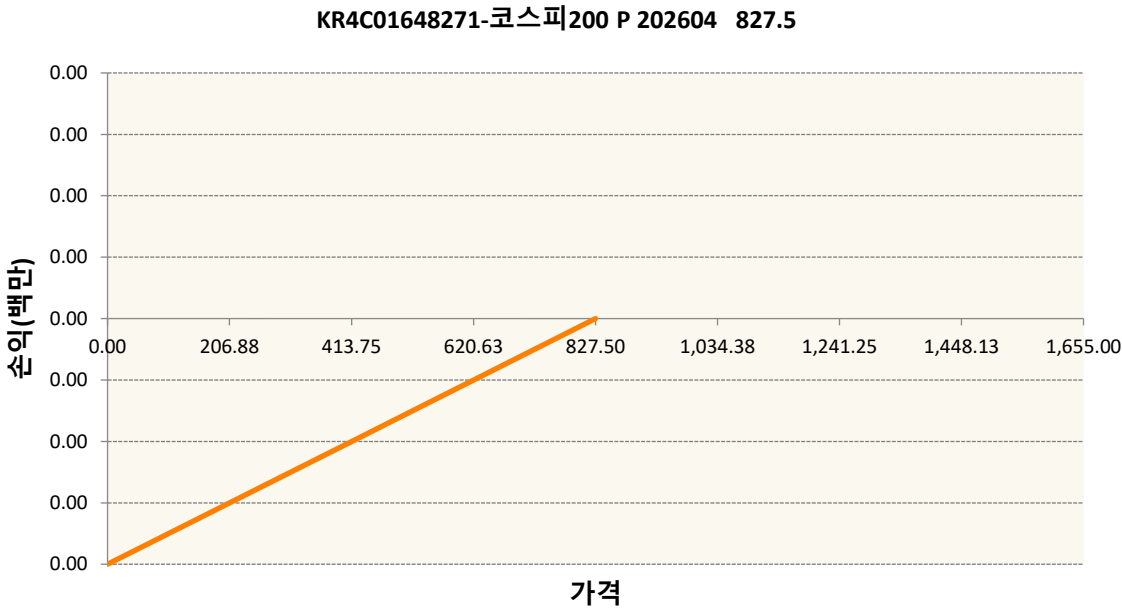
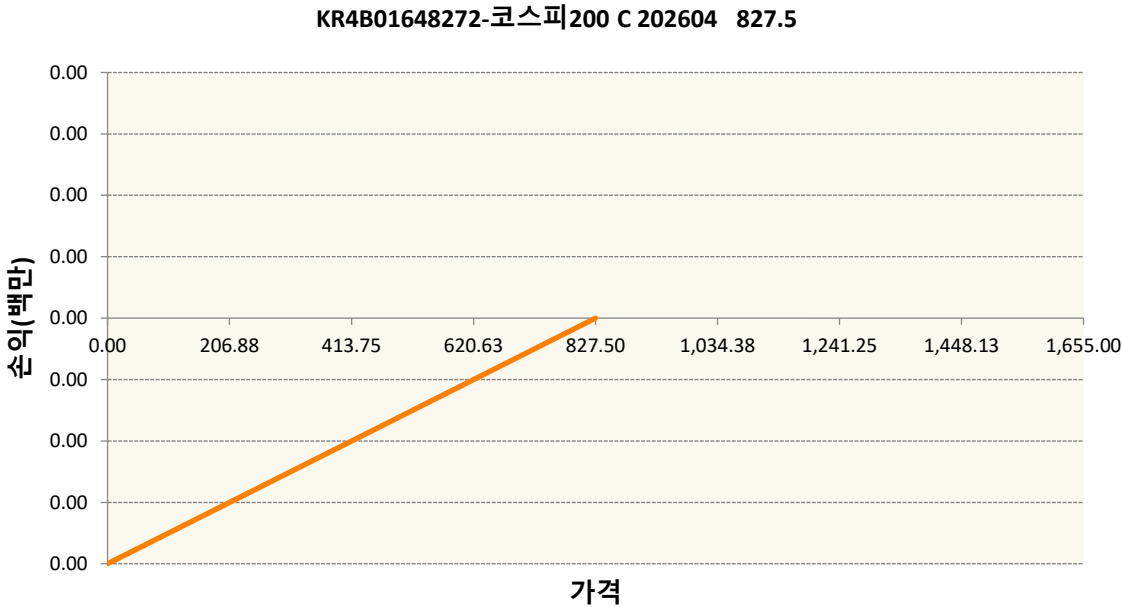
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	36,410	-36,410	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01648272 코스피200 C 202604 827.5							1,644
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-966	-1,072	-1,182	-1,294	-1,409	-1,526	-1,644
-5.33%	-428	-550	-674	-799	-924	-1,050	-1,177
-2.67%	27	-105	-236	-368	-499	-631	-762
0%	397	265	132	0	-133	-265	-398
2.67%	687	562	435	307	178	48	-83
5.33%	904	793	677	558	436	312	187
8.00%	1,062	967	866	758	647	532	414
KR4C01648271 코스피200 P 202604 827.5							394
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-231	-257	-283	-310	-337	-365	-394
-5.33%	-103	-132	-161	-191	-221	-252	-282
-2.67%	6	-25	-57	-88	-120	-151	-182
0%	95	63	32	0	-32	-64	-95
2.67%	164	134	104	73	43	11	-20
5.33%	217	190	162	134	104	75	45
8.00%	254	232	207	182	155	127	99

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

1,598

공시일 2026-03-18

기준일 2026-03-17

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	2026-03-18
기준일	2026-03-17

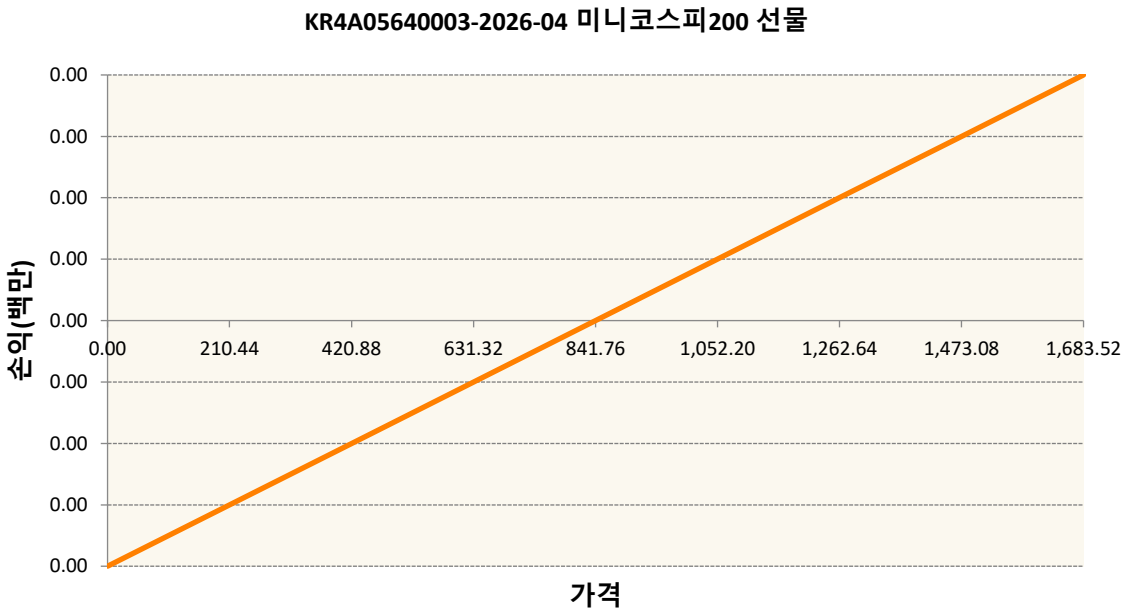
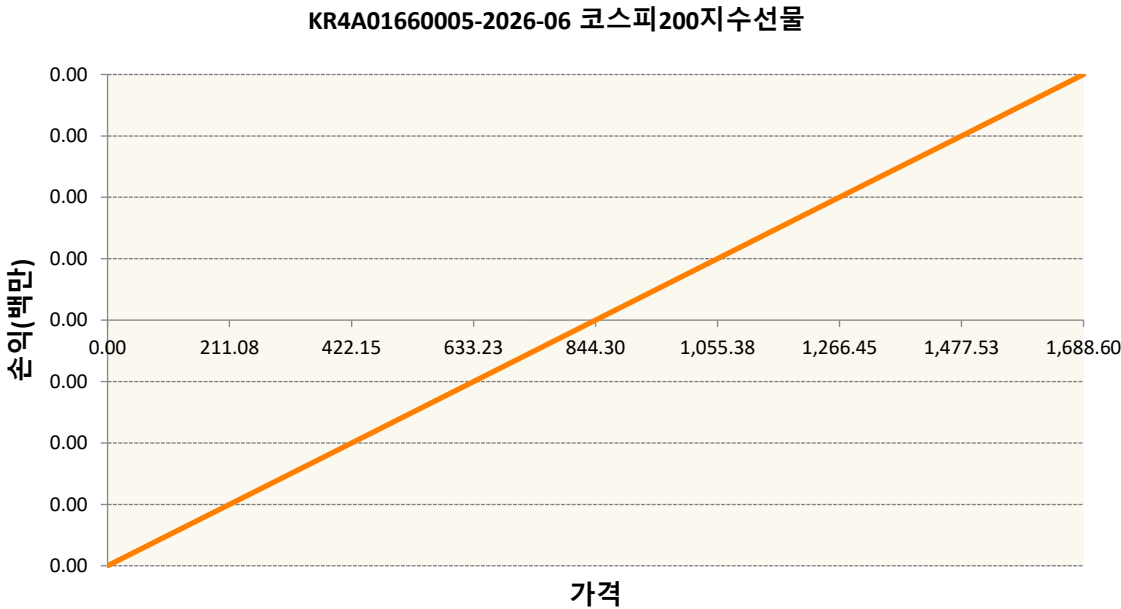
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

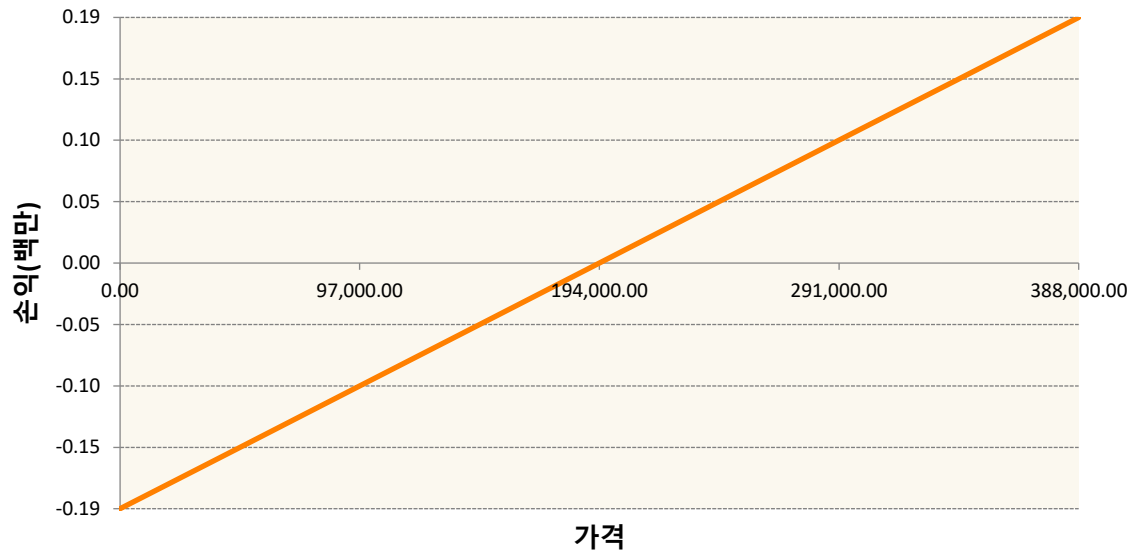
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	846	-846	장내
누계	유가증권	선물	5,203	0	5,203	장내

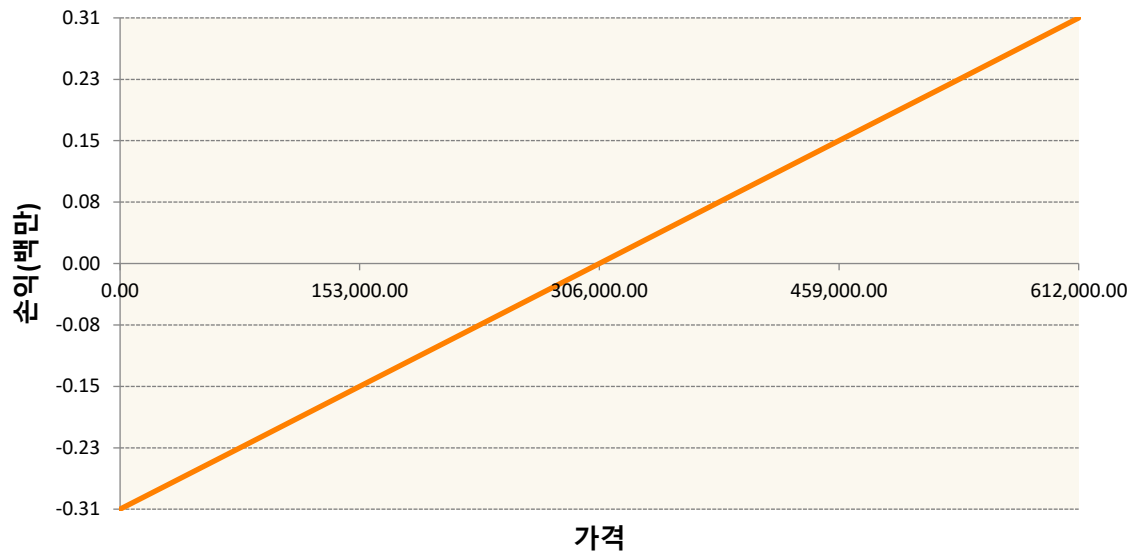
2. 만기시점의 손익구조



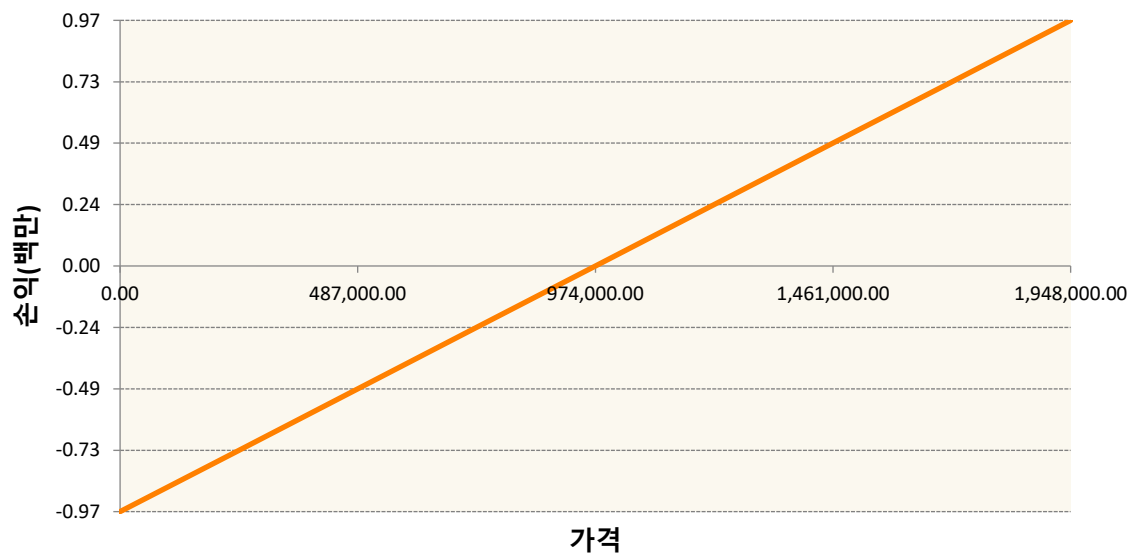
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



KR4A47640003-2026-04 LG화학개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		84		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84				
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56				
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	28	28	28	28	28	28	28				
5.33%	56	56	56	56	56	56	56				
8.00%	84	84	84	84	84	84	84				
KR4A05640003							2026-04 미니코스피200 선물		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				
KR4A11640005							2026-04 삼성전자개별선물		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				
KR4A47640003							2026-04 LG화학개별선물		6		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6				
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4				
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	2	2	2	2	2	2	2				
5.33%	4	4	4	4	4	4	4				
8.00%	6	6	6	6	6	6	6				
KR4A50640007							2026-04 SK하이닉스개별선물		5		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

313

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

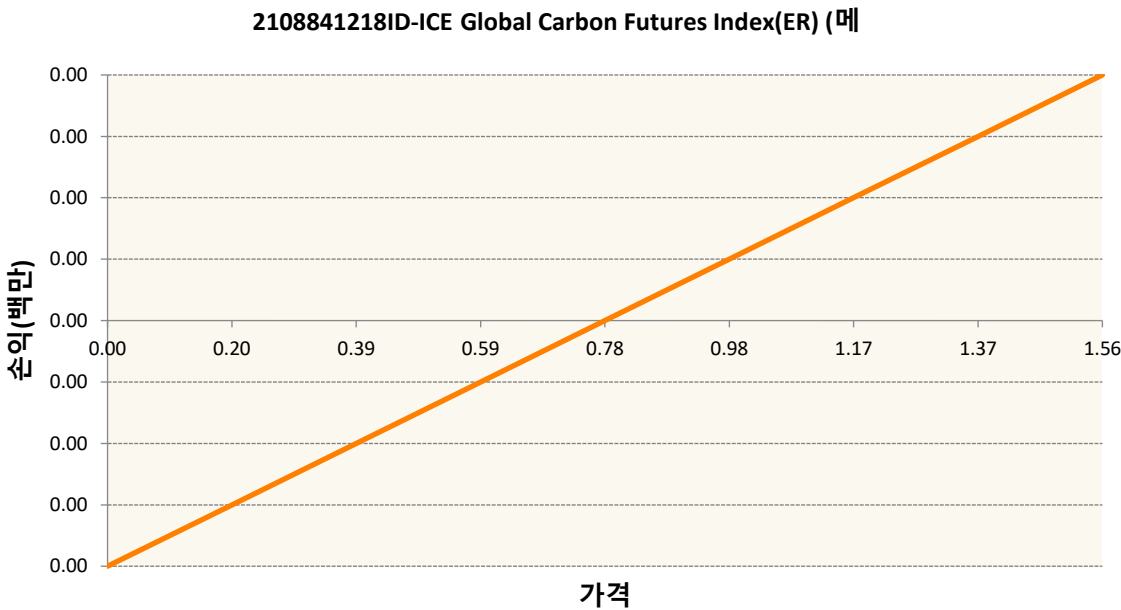
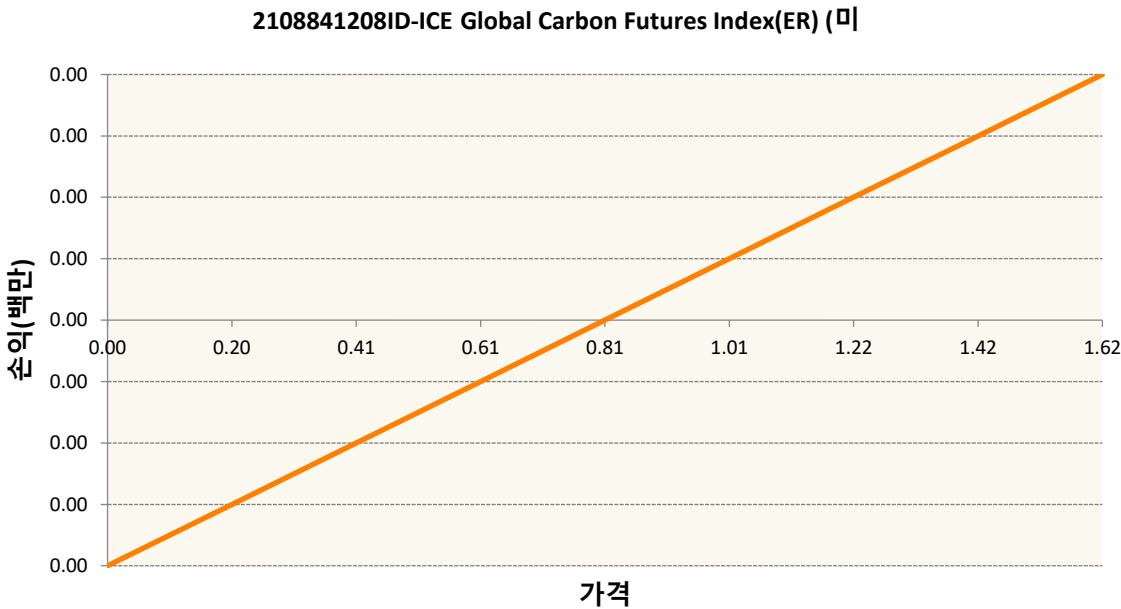
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	5,903	0	5,903	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		379
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		95

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	513

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

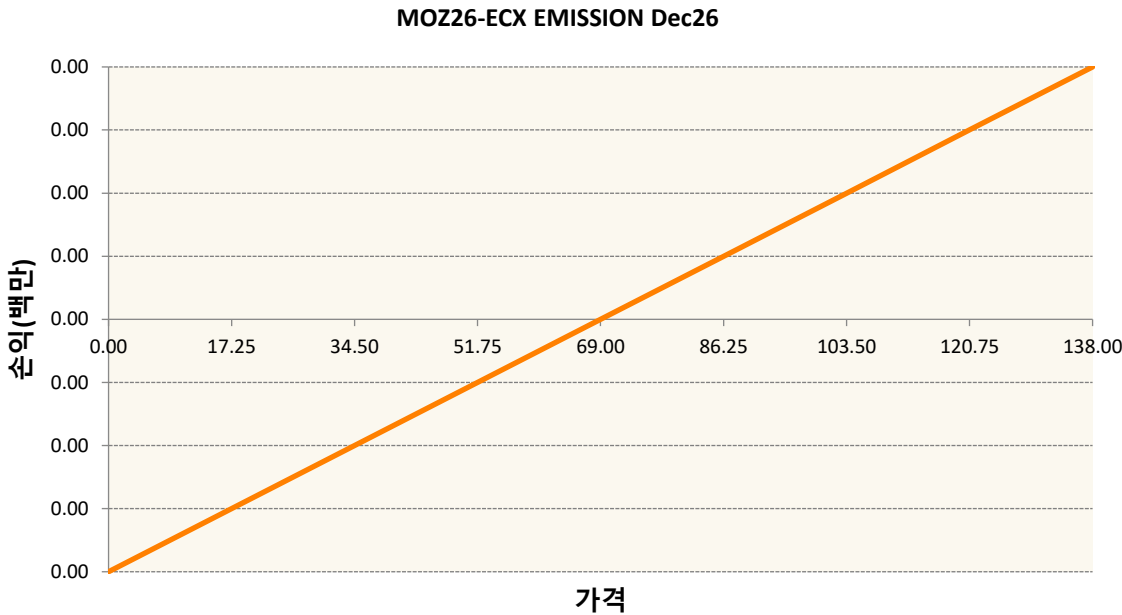
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,569	0	4,569	
누계	통화	선도	439	2,448	-2,009	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G2P(EUR/KRW 31-03-26E	22
FXW213G2R(KRW/EUR 31-03-26E	196
FXW213G3G EUR/KRW 31-03-26E	13
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	366

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

(단위:백만원)

657

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

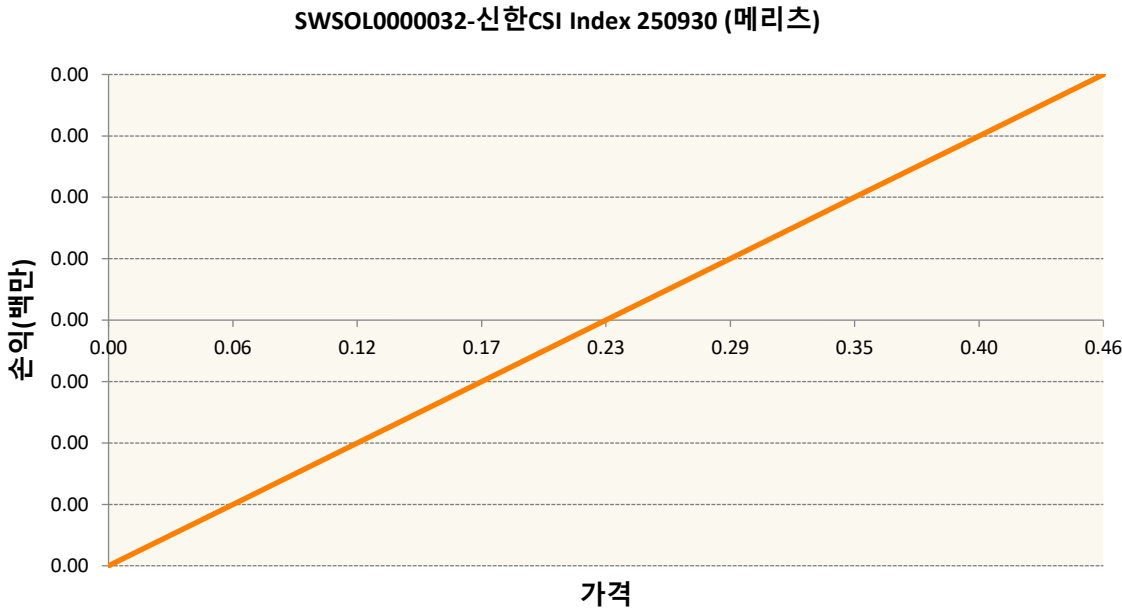
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,352	0	3,352	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	29
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	20
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	20
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	49

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

(단위:백만원)

214

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

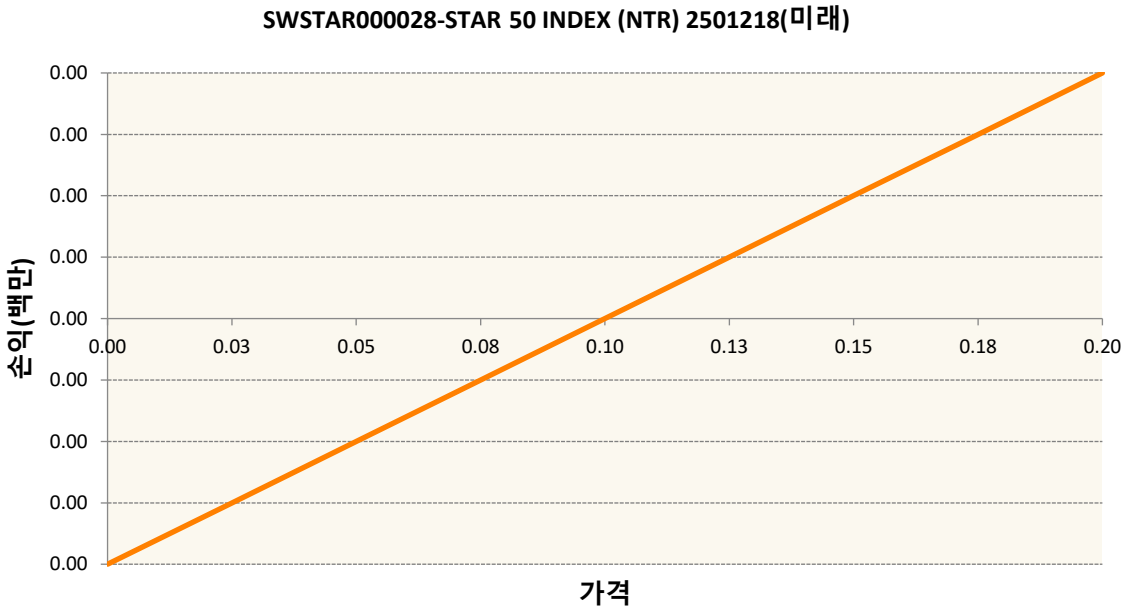
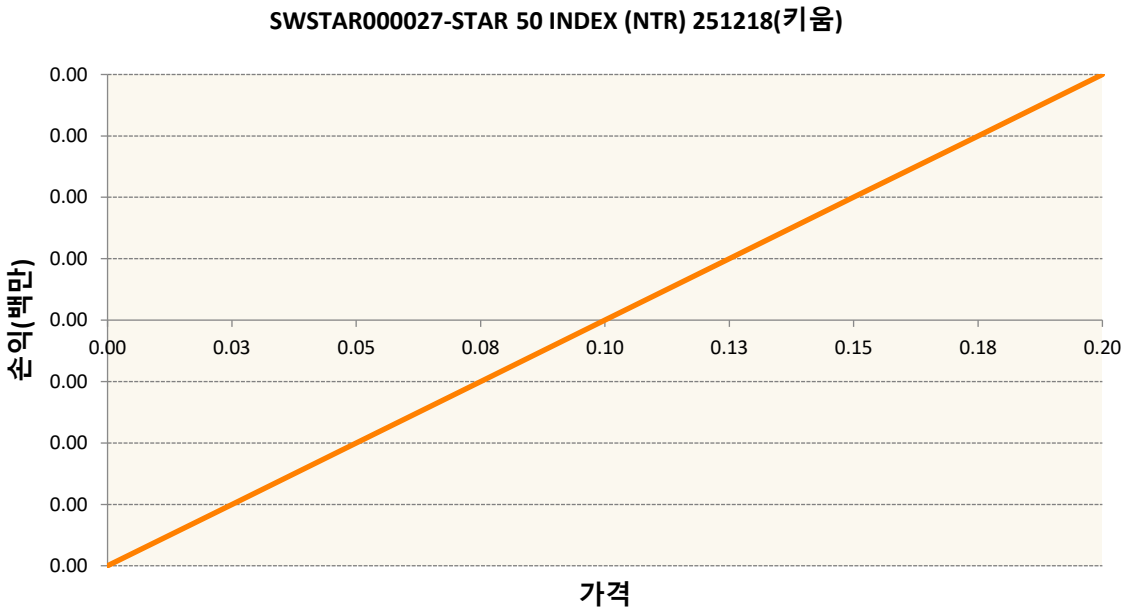
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

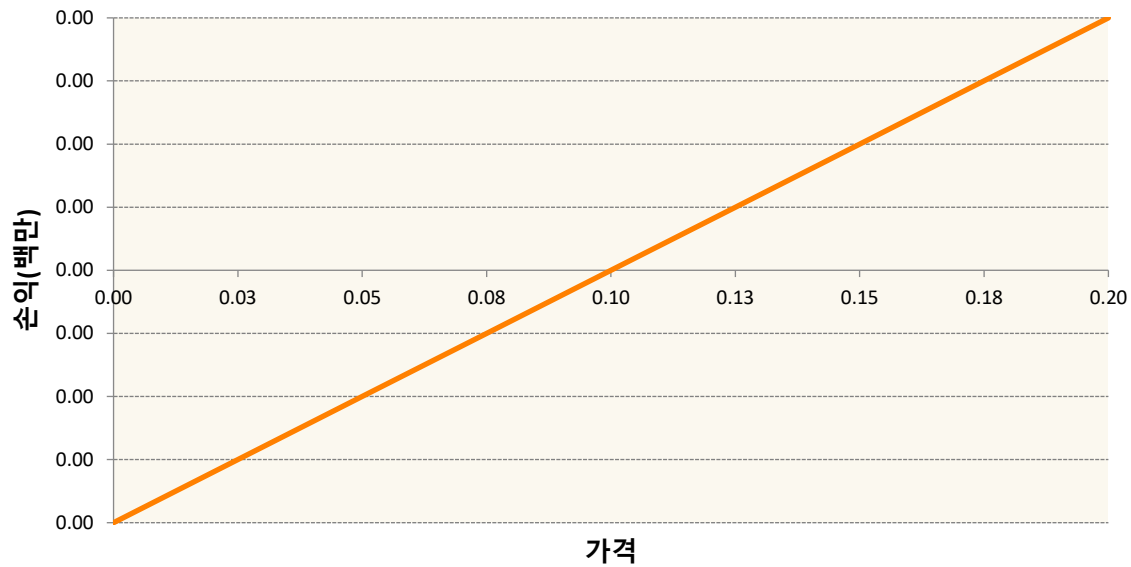
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	1,380	0	1,380	장외

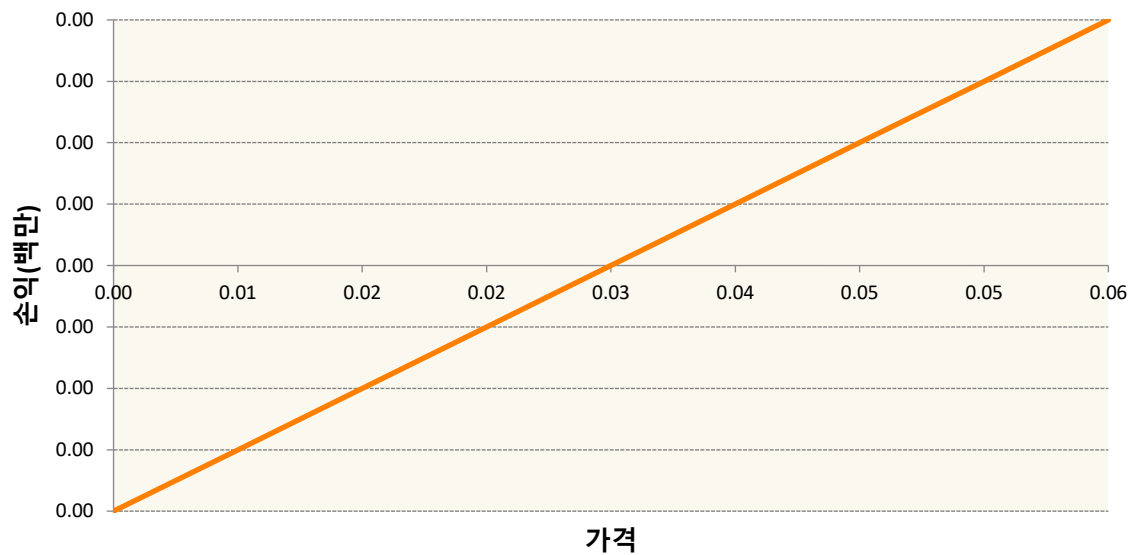
2. 만기시점의 손익구조



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))	6
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))	43
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))	22
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠))	33

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

(단위:백만원)

193

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

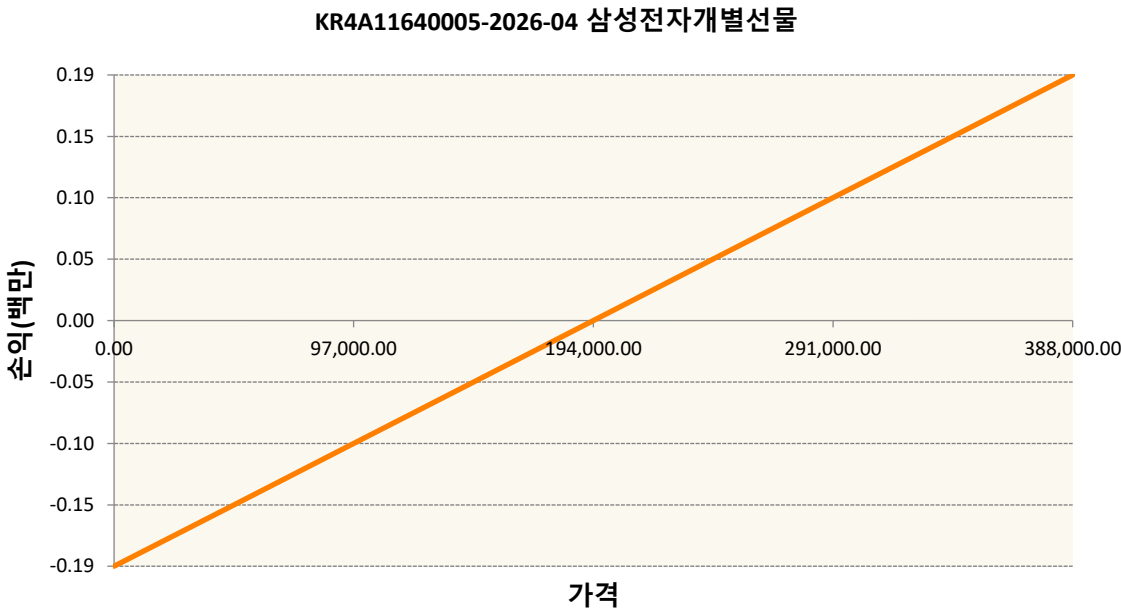
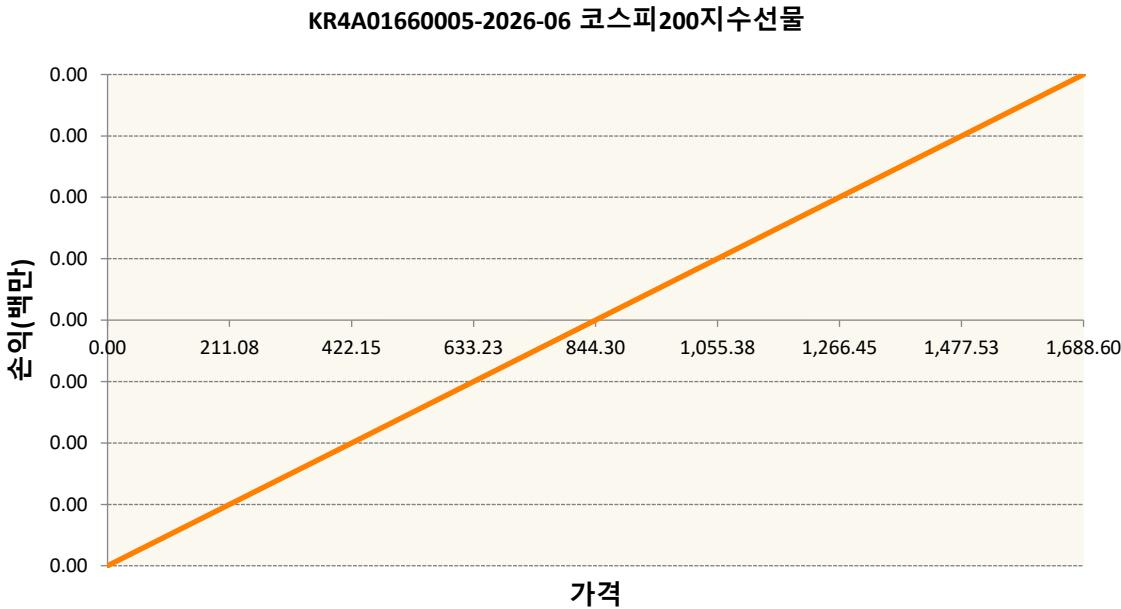
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

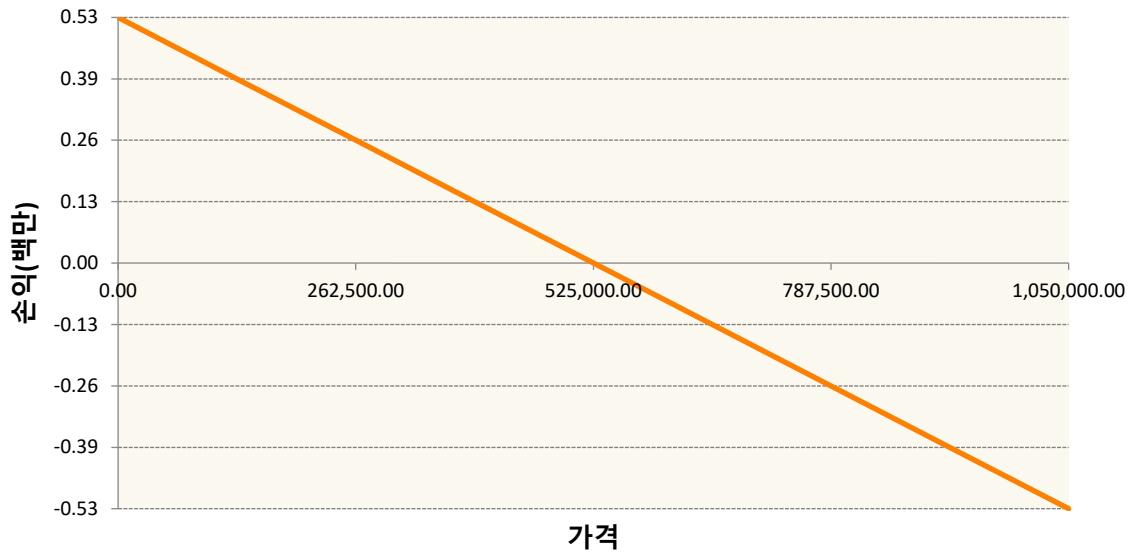
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,554	2,348	10,206	장내

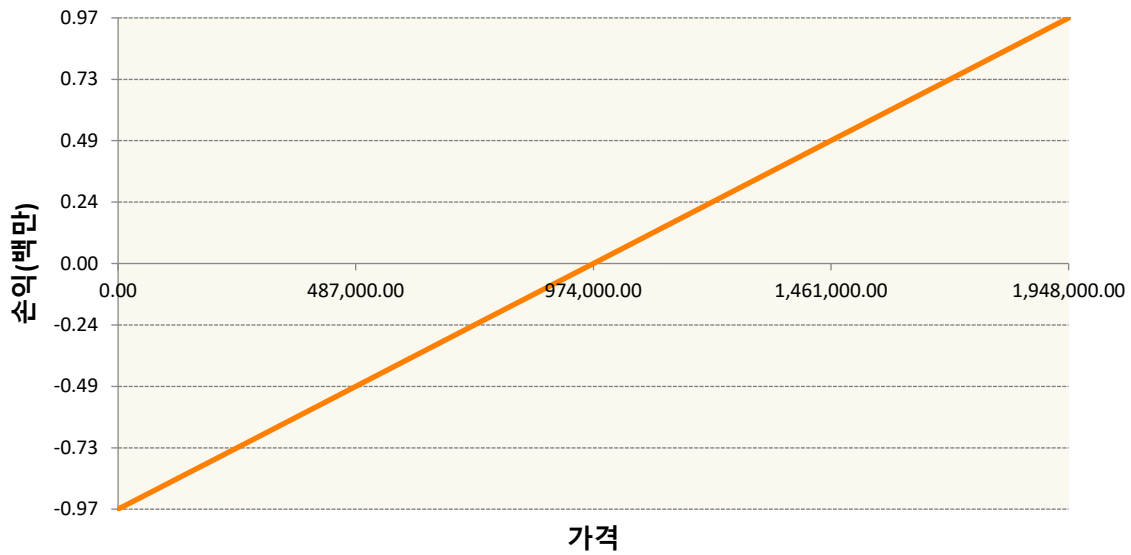
2. 만기시점의 손익구조



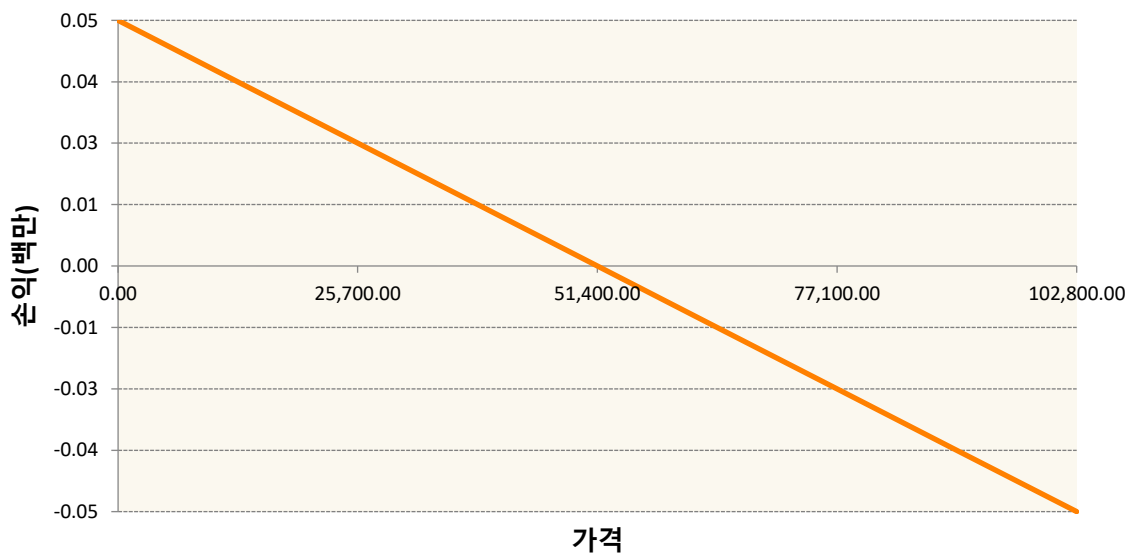
KR4A16640000-2026-04 현대차개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4ACF640007-2026-04 카카오개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		757		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-757	-757	-757	-757	-757	-757	-757				
-5.33%	-505	-505	-505	-505	-505	-505	-505				
-2.67%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	252	252	252	252	252	252	252				
5.33%	505	505	505	505	505	505	505				
8.00%	757	757	757	757	757	757	757				
KR4A11640005							2026-04 삼성전자개별선물		160		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160				
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107				
-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%	107	107	107	107	107	107	107				
8.00%	160	160	160	160	160	160	160				
KR4A16640000							2026-04 현대차개별선물		56		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	56	56	56	56	56	56	56				
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38				
-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%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38				
8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56				
KR4A50640007							2026-04 SK하이닉스개별선물		84		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84				
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56				
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	28	28	28	28	28	28	28				
5.33%	56	56	56	56	56	56	56				
8.00%	84	84	84	84	84	84	84				
KR4ACF640007							2026-04 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

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

(단위:백만원)

2,410

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

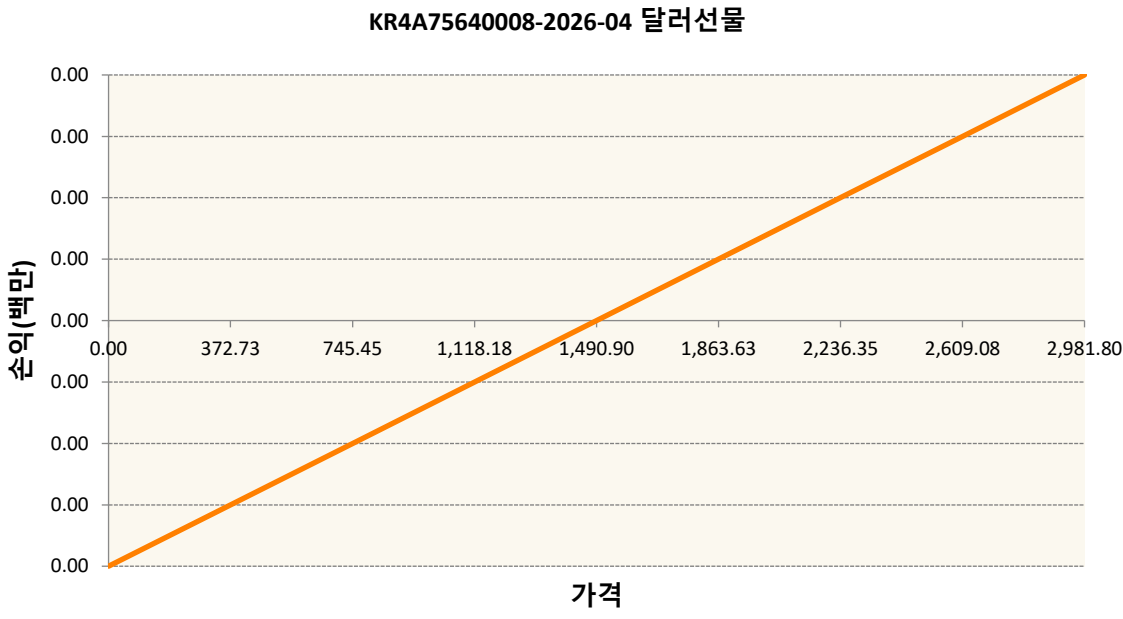
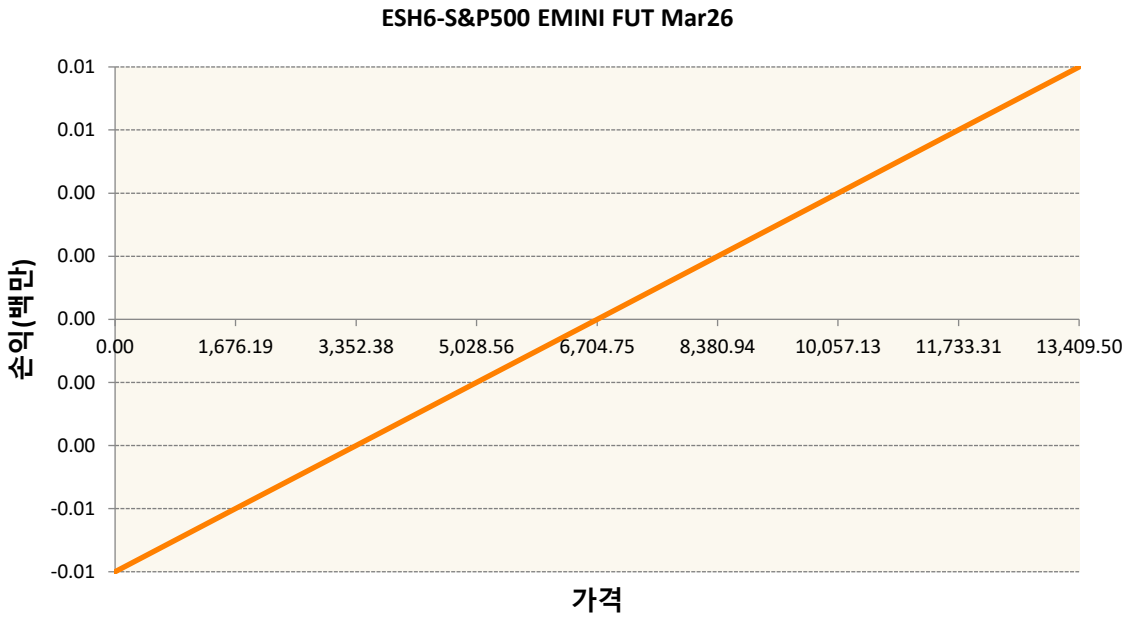
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	51,885	0	51,885	
누계	통화	선물	12,374	0	12,374	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	4,151
	KR4A756400 2026-04 달러선물	990

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,560

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

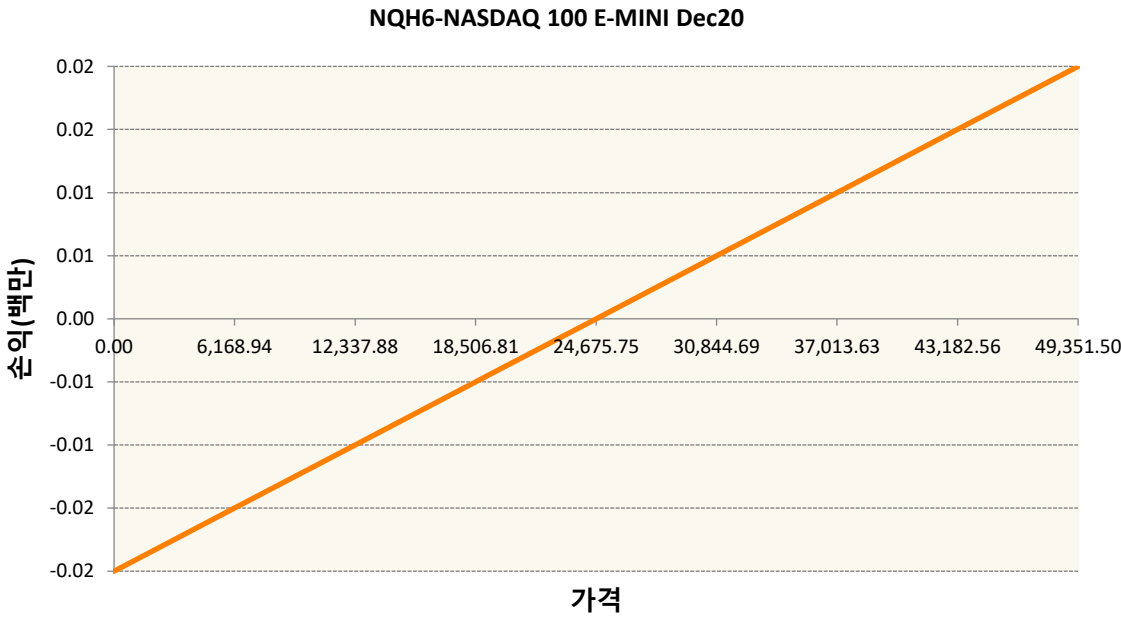
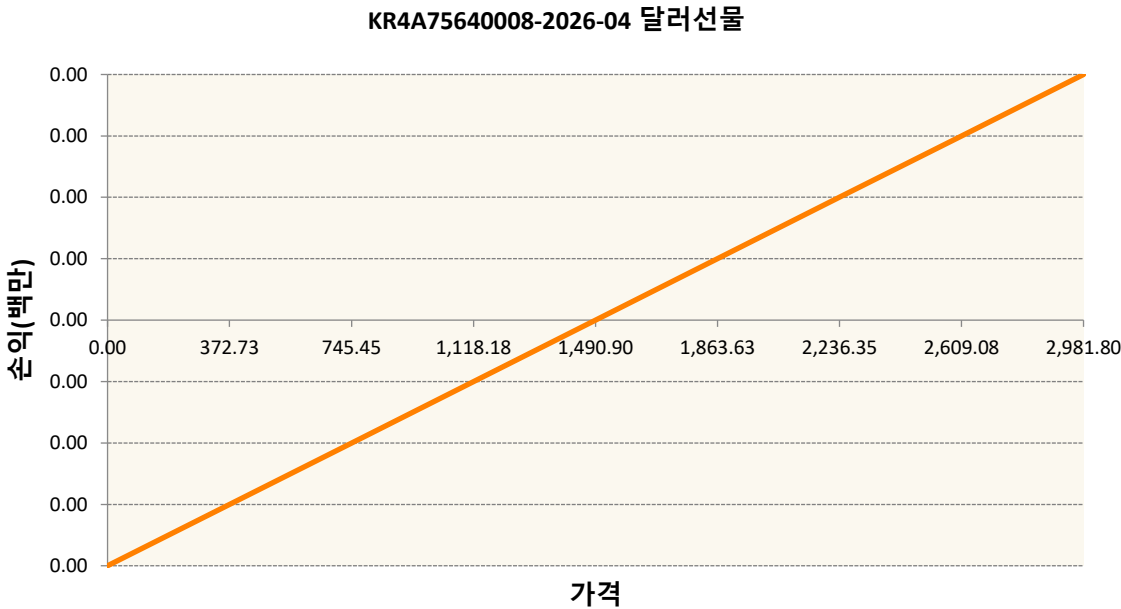
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	22,571	0	22,571	장내
누계	통화	선물	4,995	0	4,995	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A756400 2026-04 달러선물		400
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,806

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,969

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

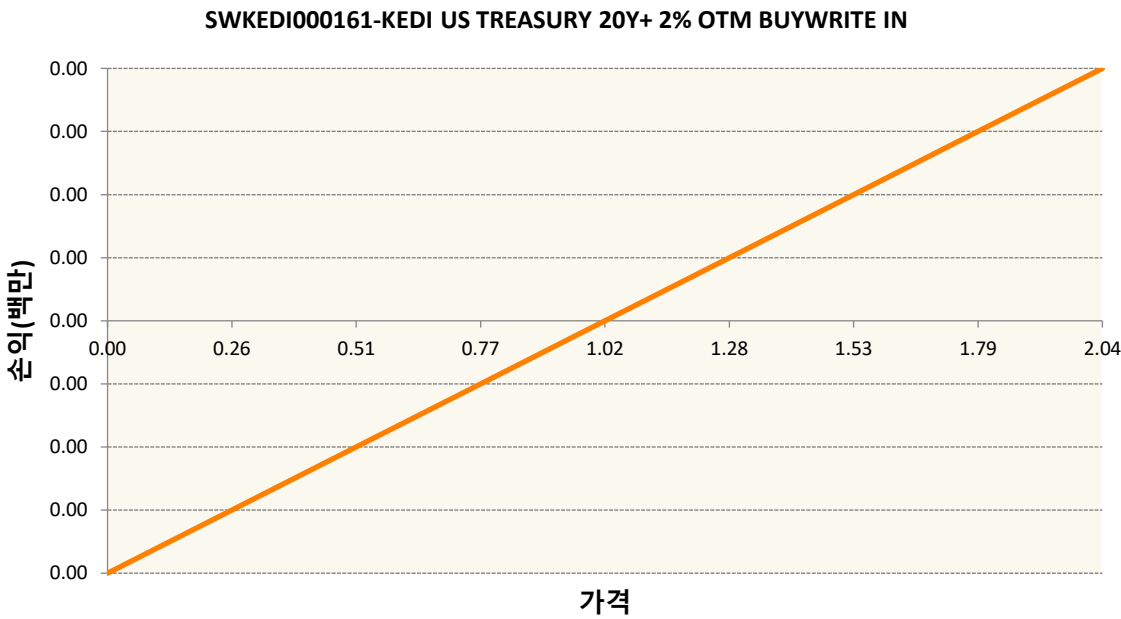
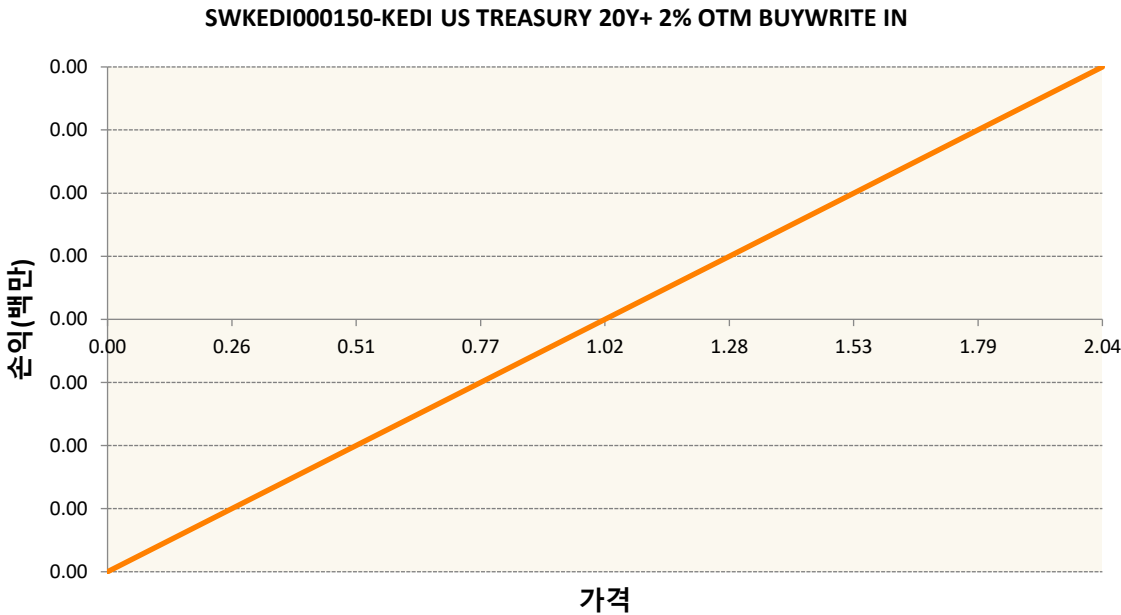
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

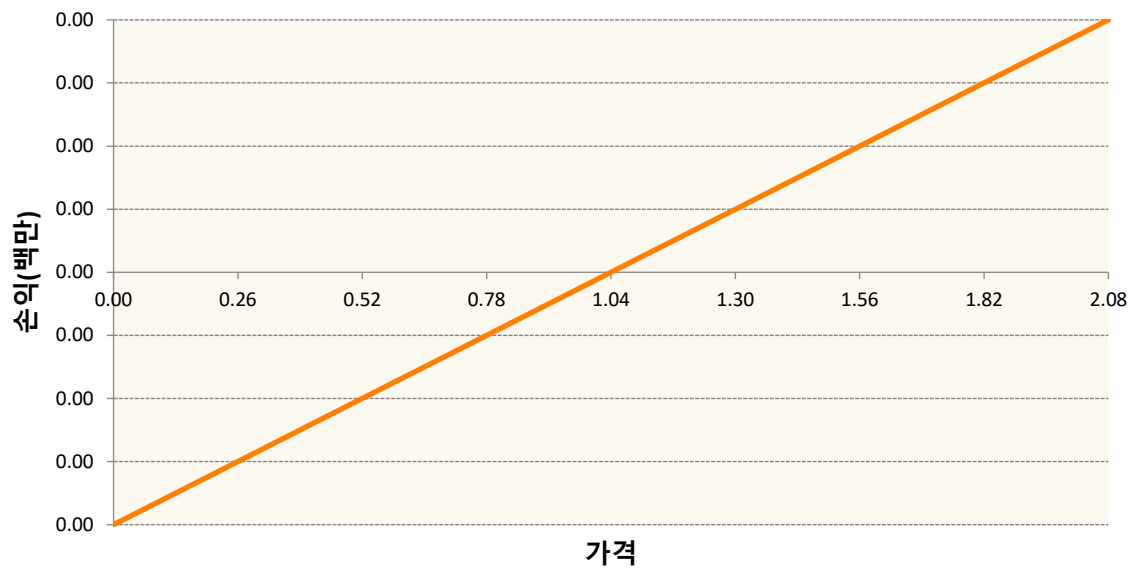
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	377,774	0	377,774	장외

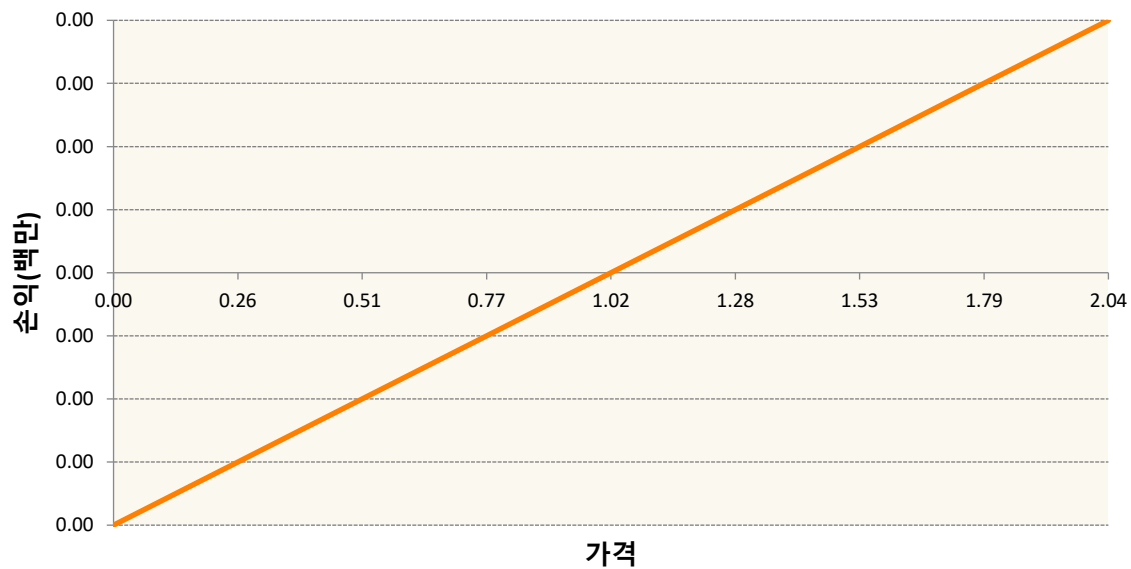
2. 만기시점의 손익구조



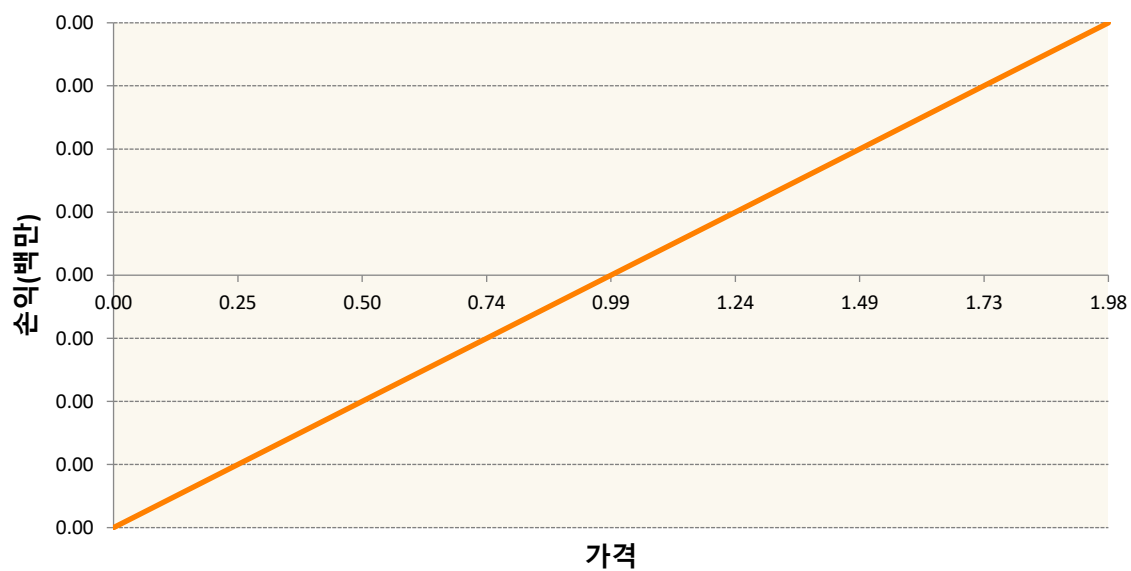
SWKEDI000164-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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



SWKEDI000169-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,387
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,756
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		152
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,533
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,343

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,503

공시일	2026-03-18
기준일	2026-03-17

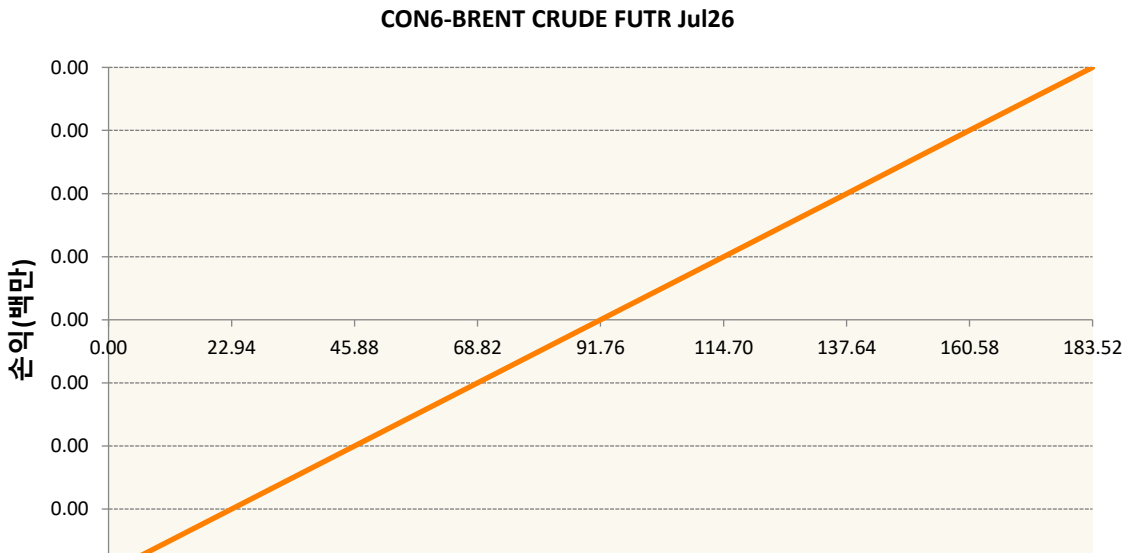
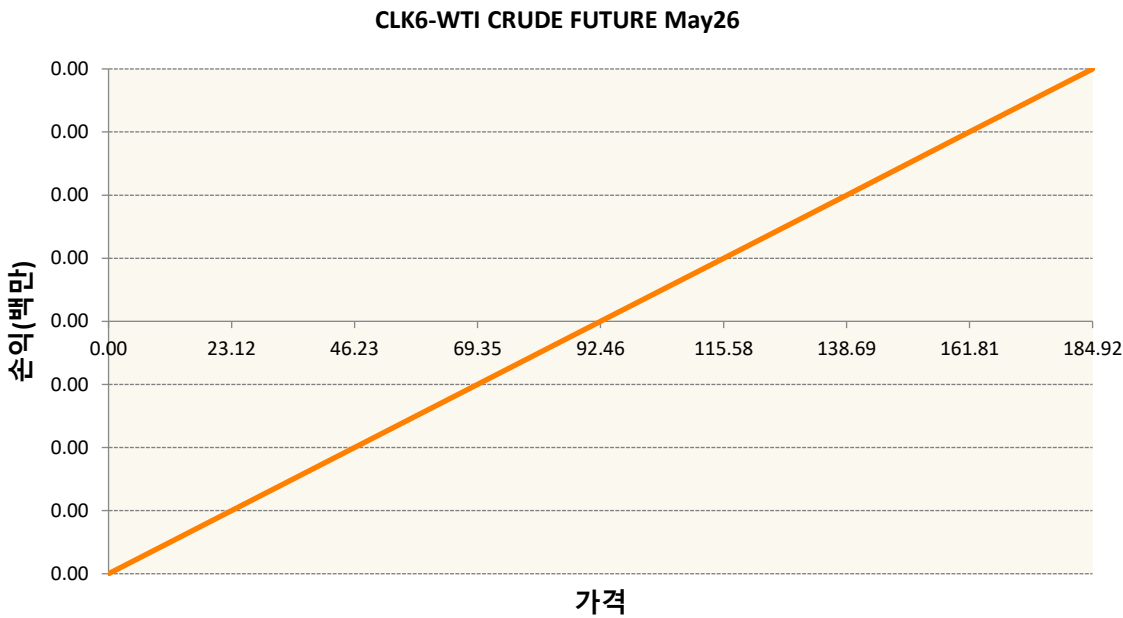
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

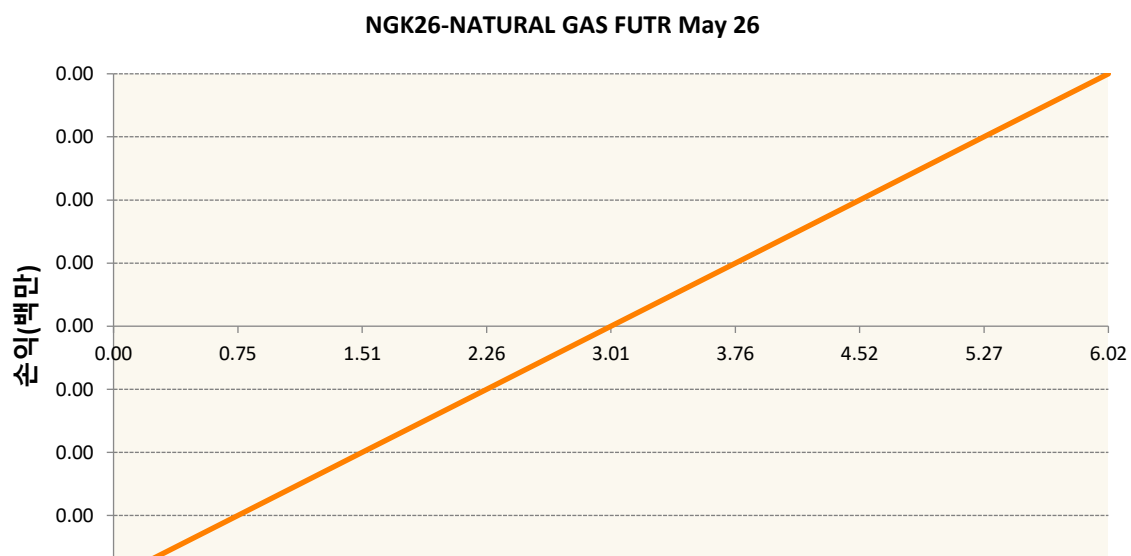
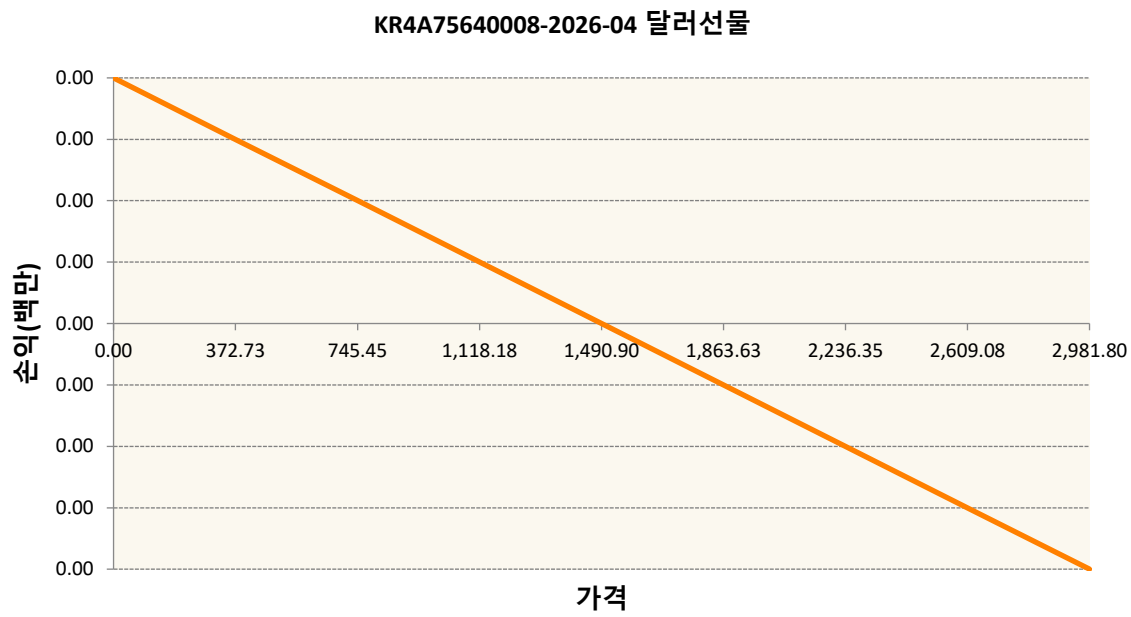
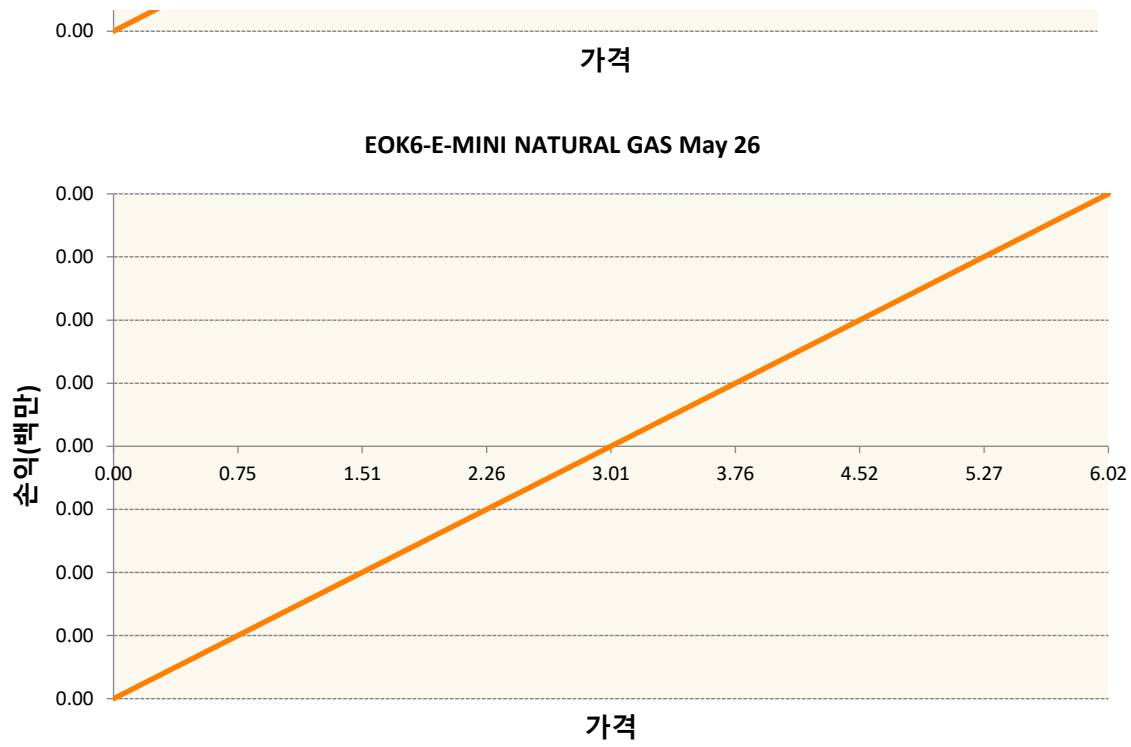
1. 계약금액

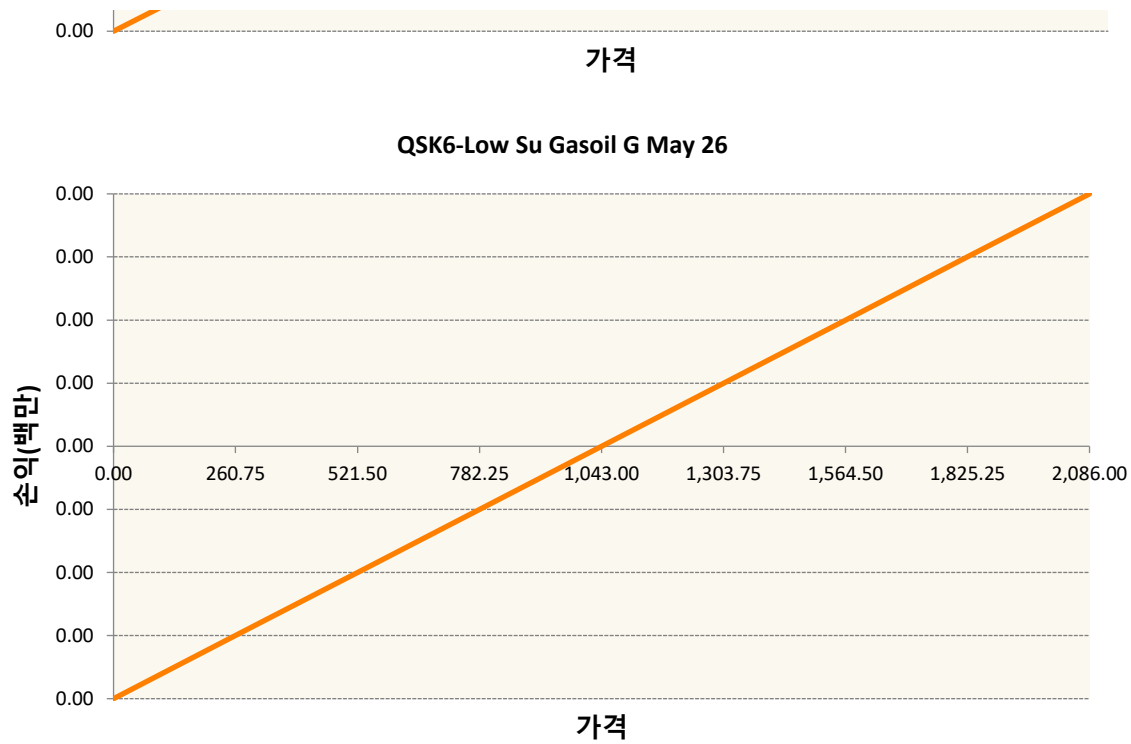
(단위:백만원)

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	242	0	242	
누계	유가증권	선물	304	0	304	
누계	통화	선물	0	164	-164	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLK6	WTI CRUDE FUTURE May26	11
CON6	BRENT CRUDE FUTR Jul26	11
EOK6	E-MINI NATURAL GAS May 26	3
KR4A756400	2026-04 달러선물	13
NGK26	NATURAL GAS FUTR May 26	7
QSK6	Low Su Gasoil G May 26	12

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

(단위:백만원)

115