

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

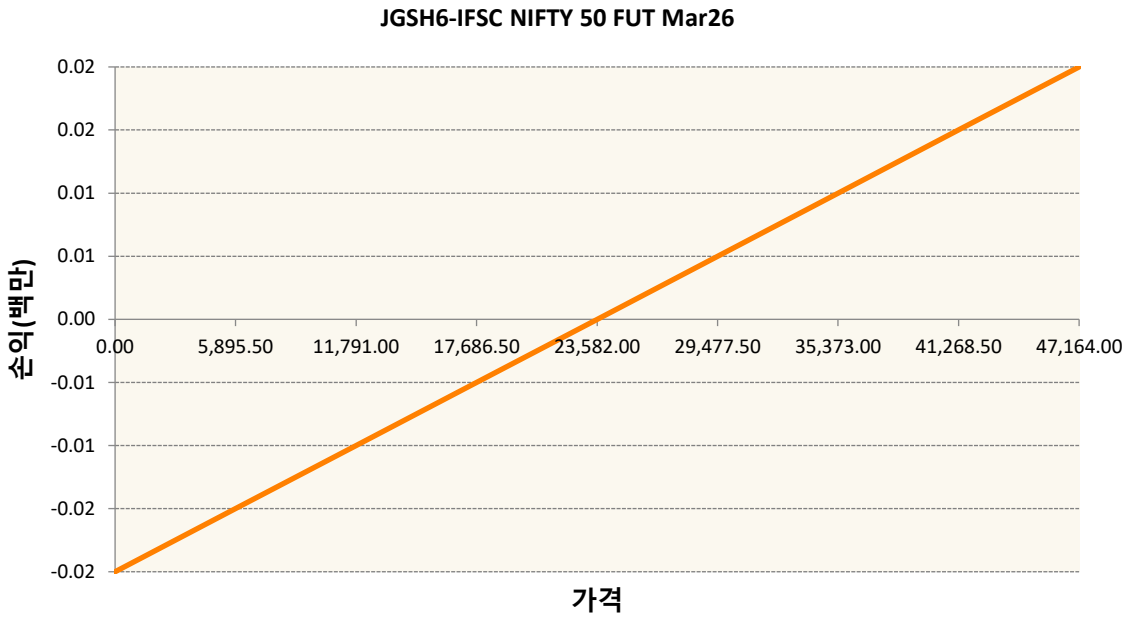
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	610	0	610	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSH6	IFSC NIFTY 50 FUT Mar26	49
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

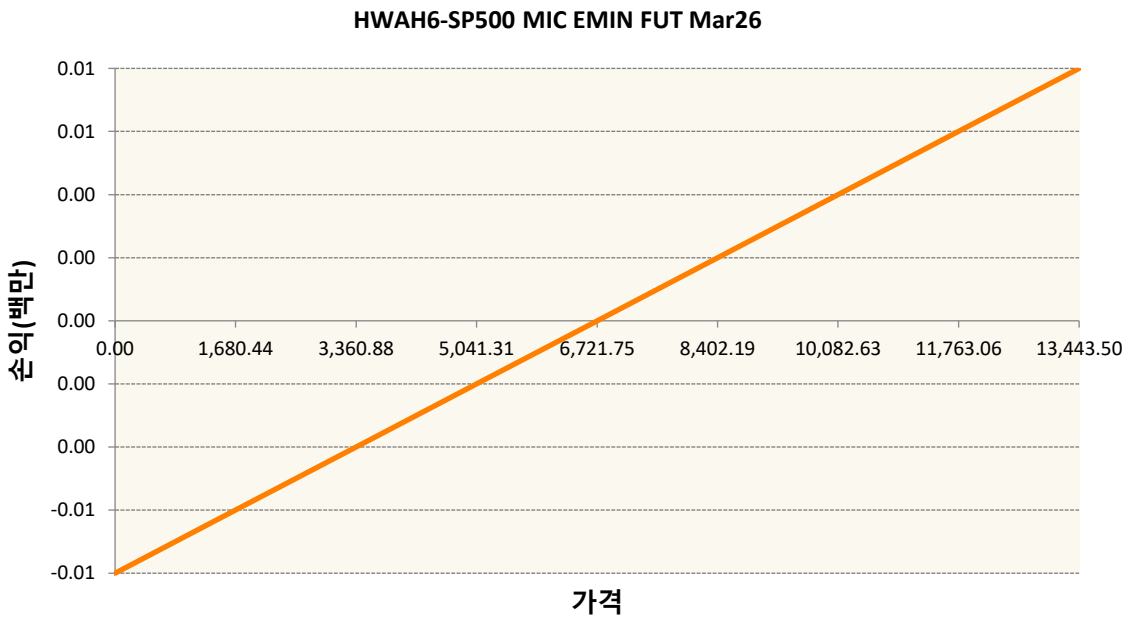
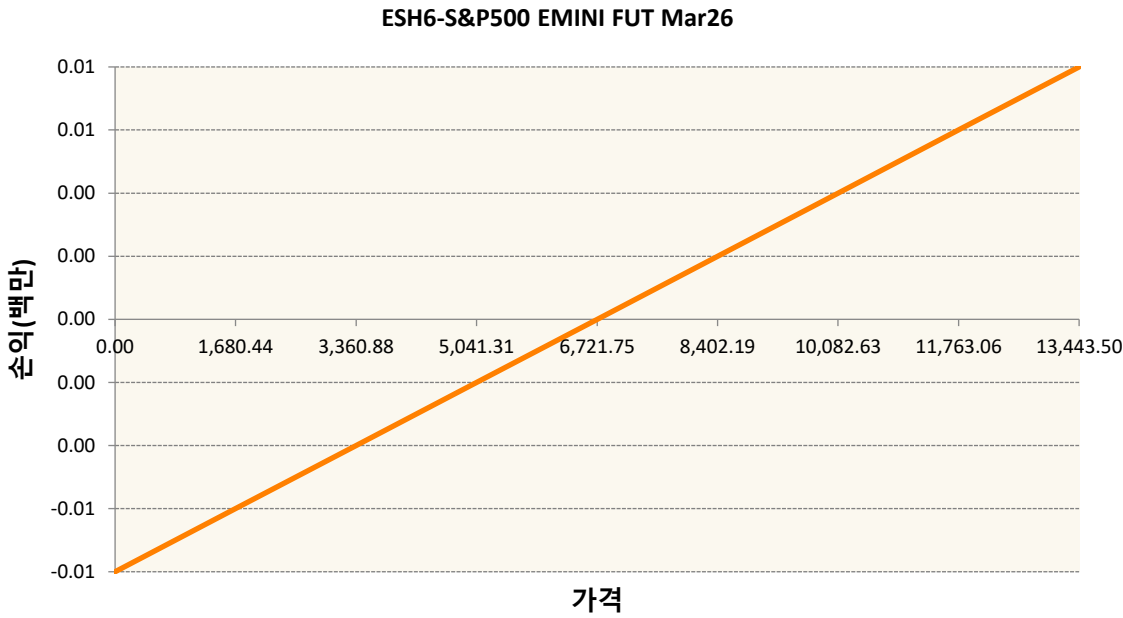
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	497	0	497	

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	2026-03-19
기준일	2026-03-18

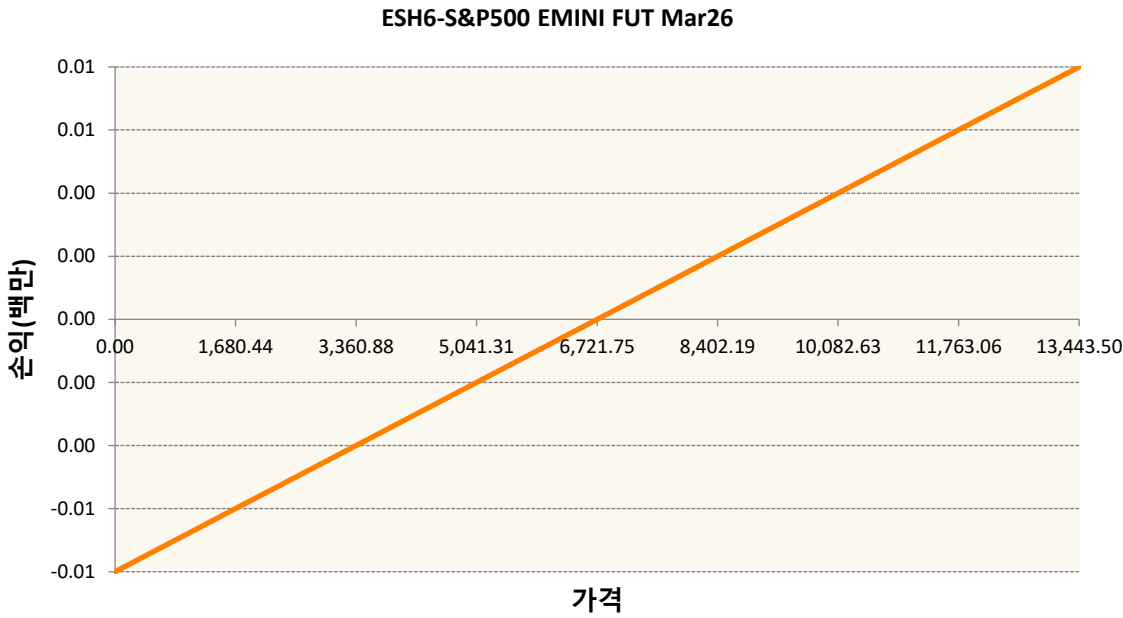
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,490	0	1,490	

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	2026-03-19
기준일	2026-03-18

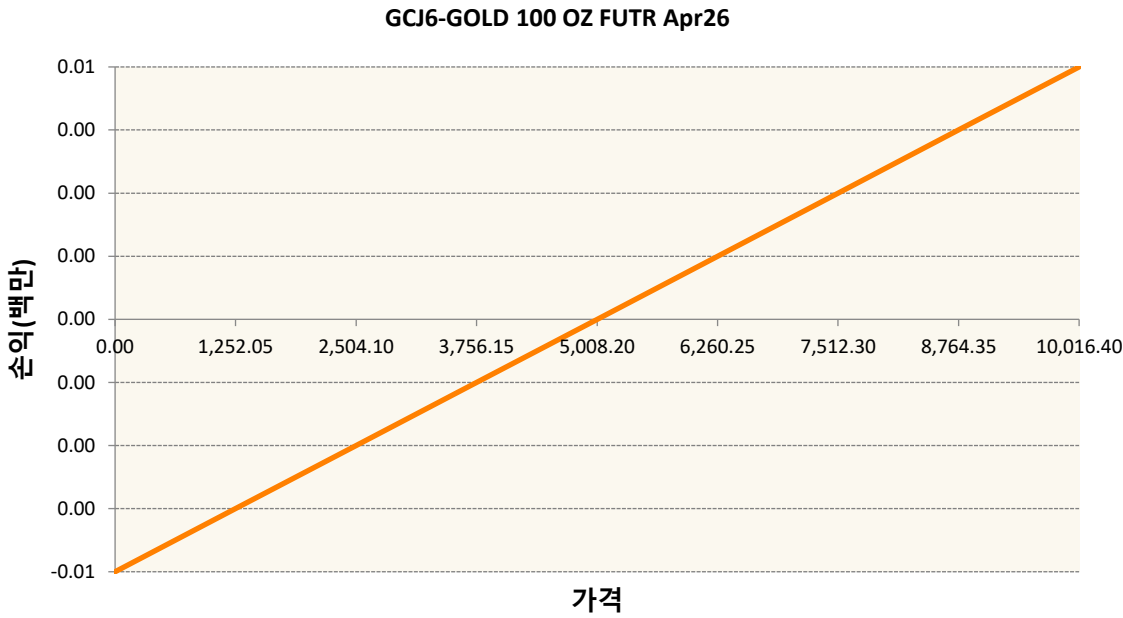
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,004	0	5,004	
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)

476

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

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	57
AOPLTRPUS`PLTR US 03/20/26 P160 EQUITY	62

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

(단위:백만원)

399

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

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	2026-03-19
기준일	2026-03-18

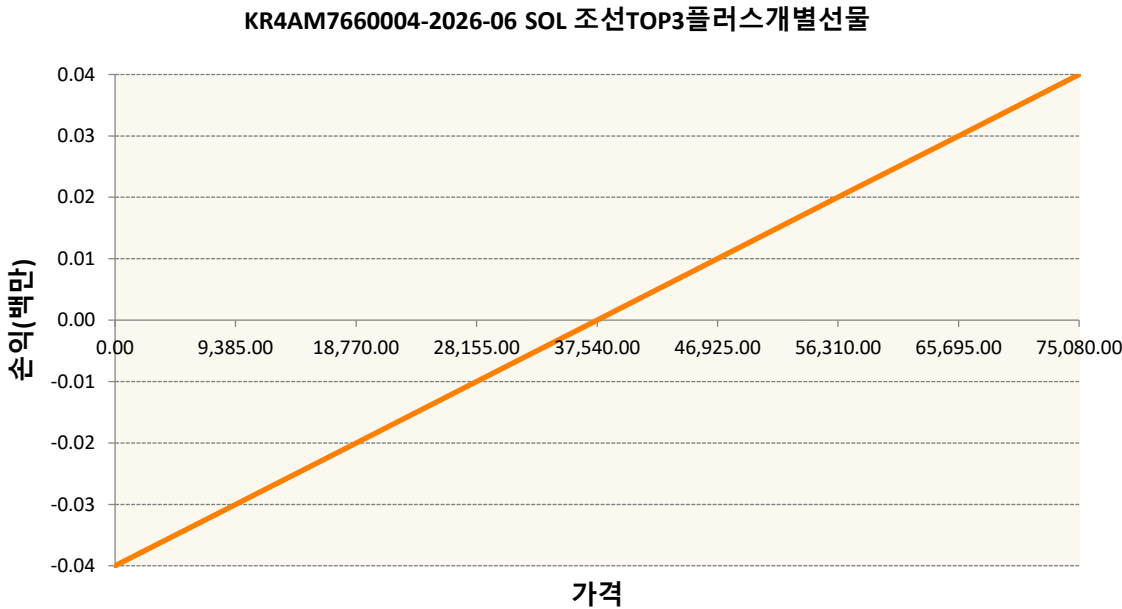
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	152,653	0	152,653	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-03-19

기준일 2026-03-18

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	2026-03-19
기준일	2026-03-18

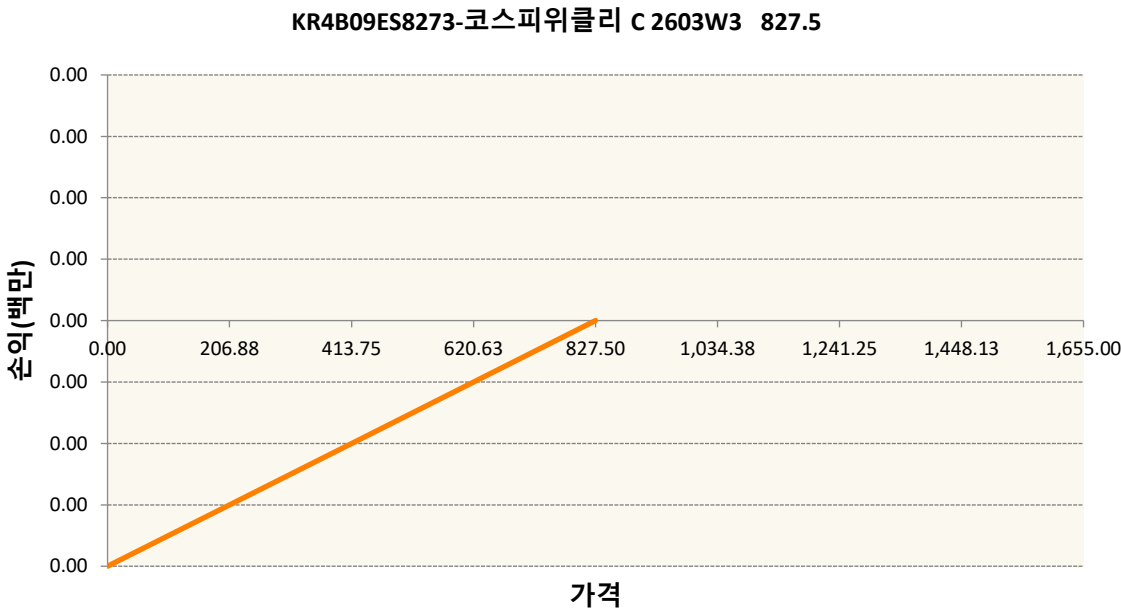
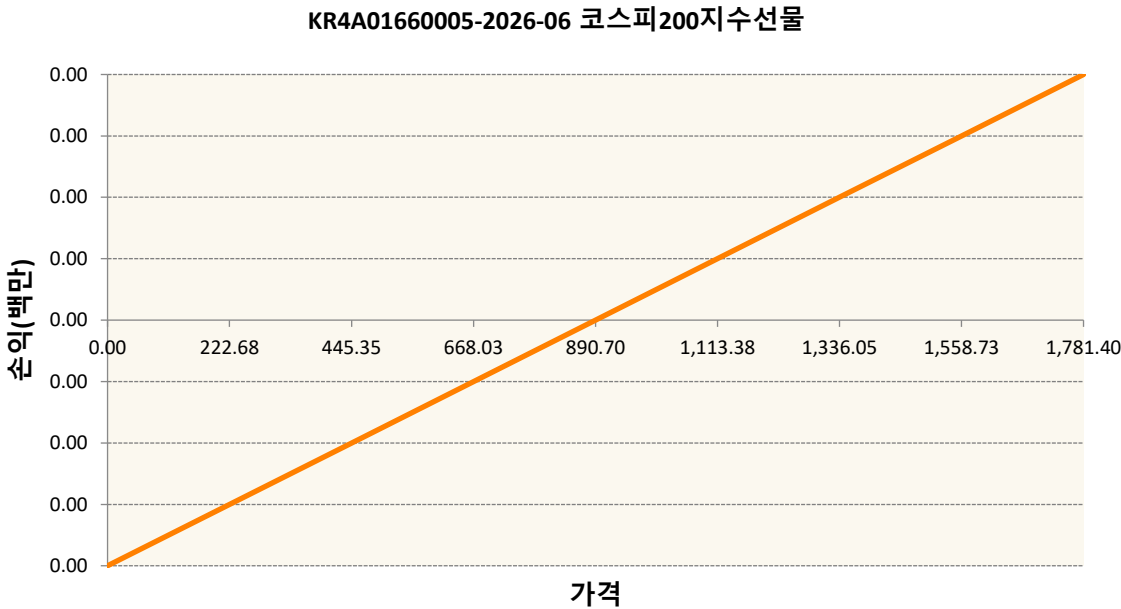
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

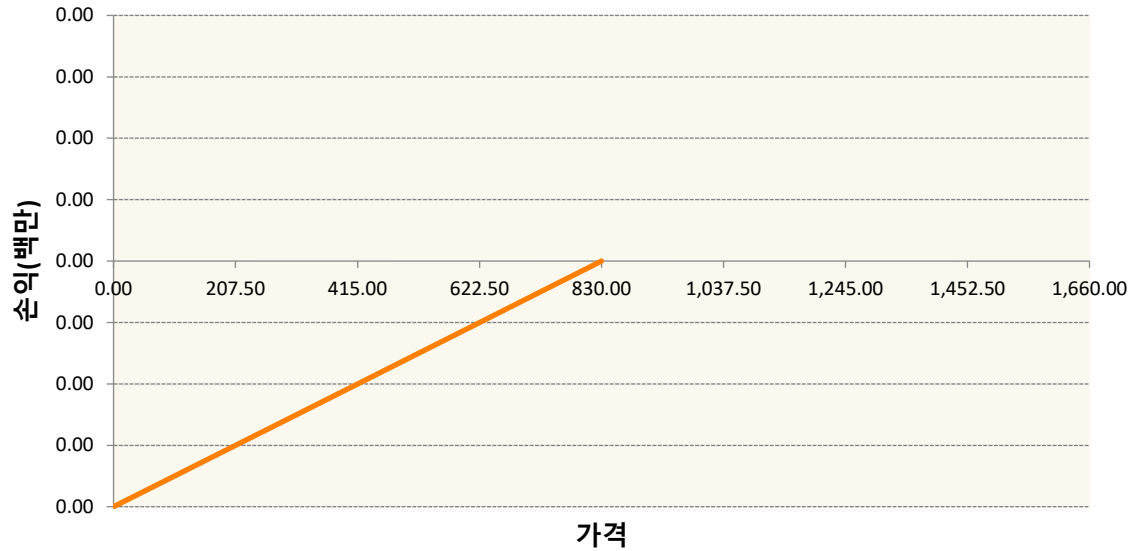
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	1,108	-1,108	장내
누계	유가증권	선물	1,781	0	1,781	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,143	-4,143	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4B09ES8307-코스피위클리 C 2603W3 830.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					142
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-142	-142	-142	-142	-142	-142	-142
-5.33%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95
-2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	47	47	47	47	47	47	47
5.33%	95	95	95	95	95	95	95
8.00%	142	142	142	142	142	142	142
KR4B09ES8273		코스피위클리 C 2603W3 827.5					53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-42	-44	-46	-49	-51	-53
-5.33%	-7	-9	-11	-13	-15	-18	-20
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-4	-5
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4B09ES8307		코스피위클리 C 2603W3 830.0					39
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-31	-33	-34	-36	-37	-39
-5.33%	-6	-7	-9	-10	-12	-13	-15
-2.67%	0	-1	-1	-2	-2	-3	-4
0%	0	0	0	0	0	0	-1

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

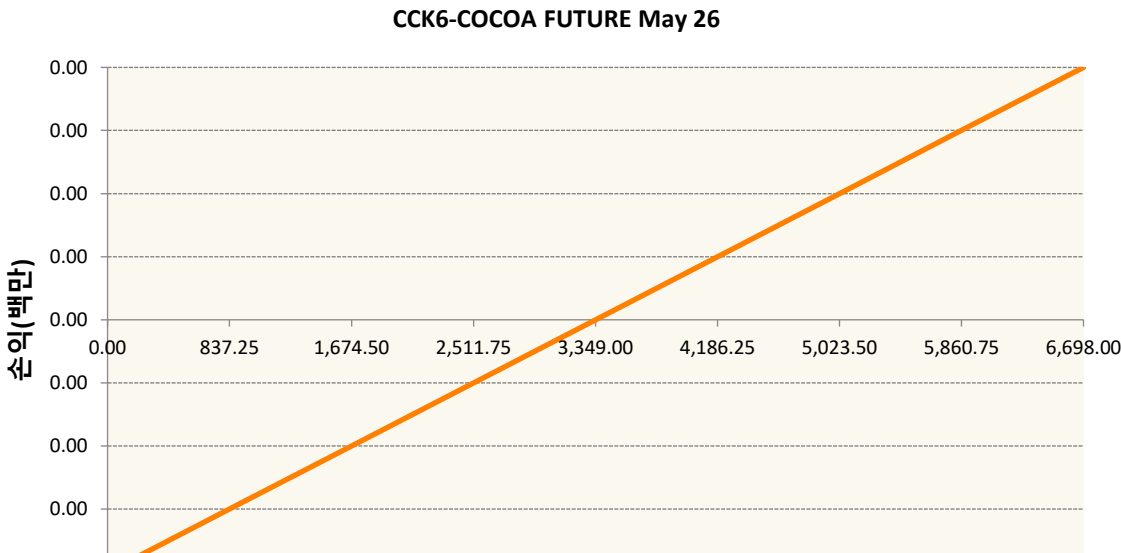
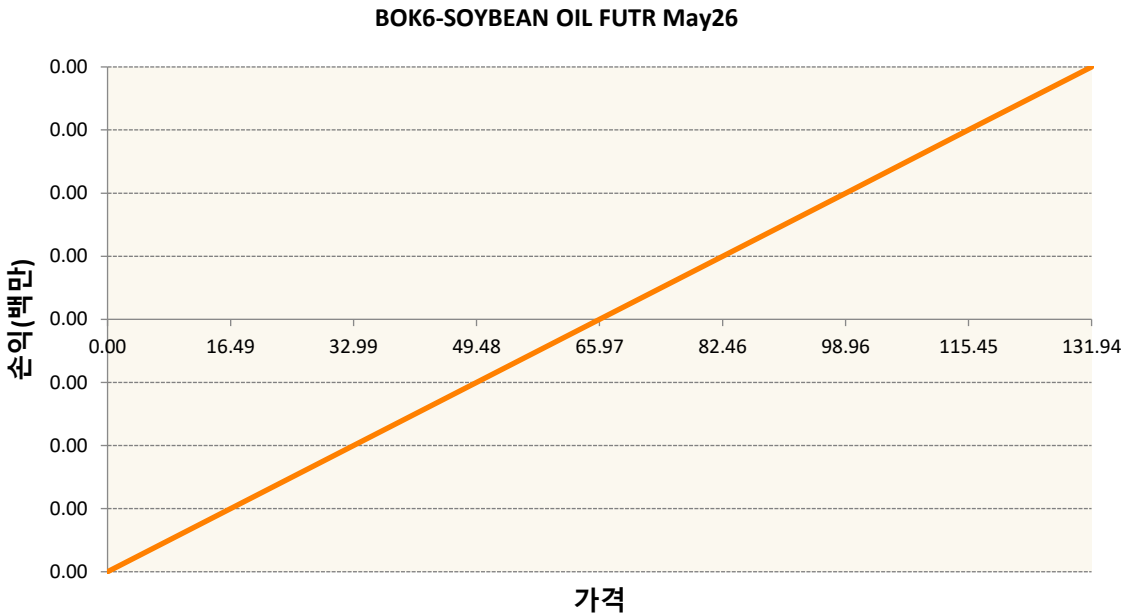
포커스농산물모(채권-파생형)

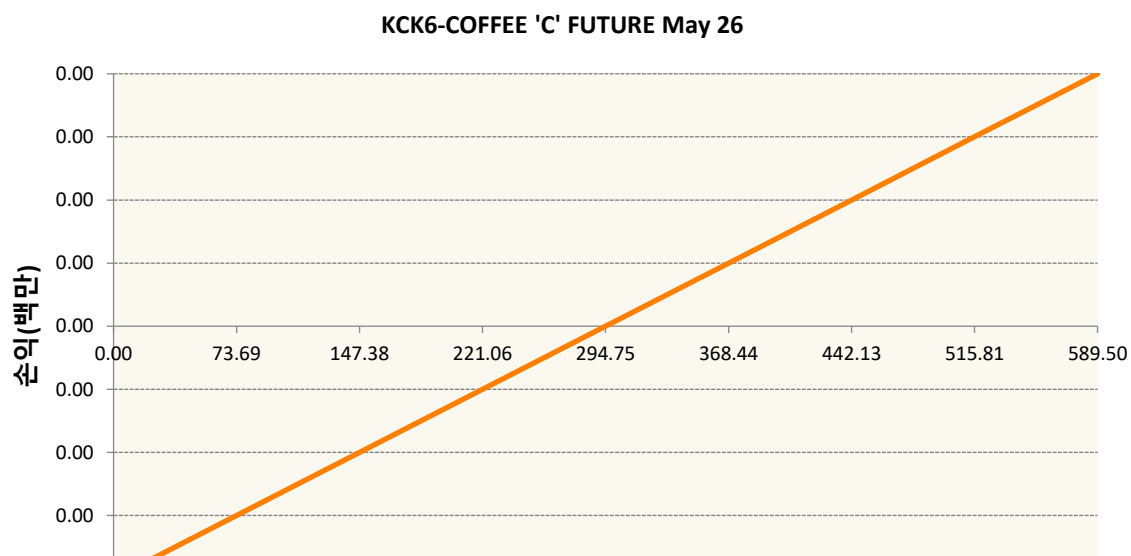
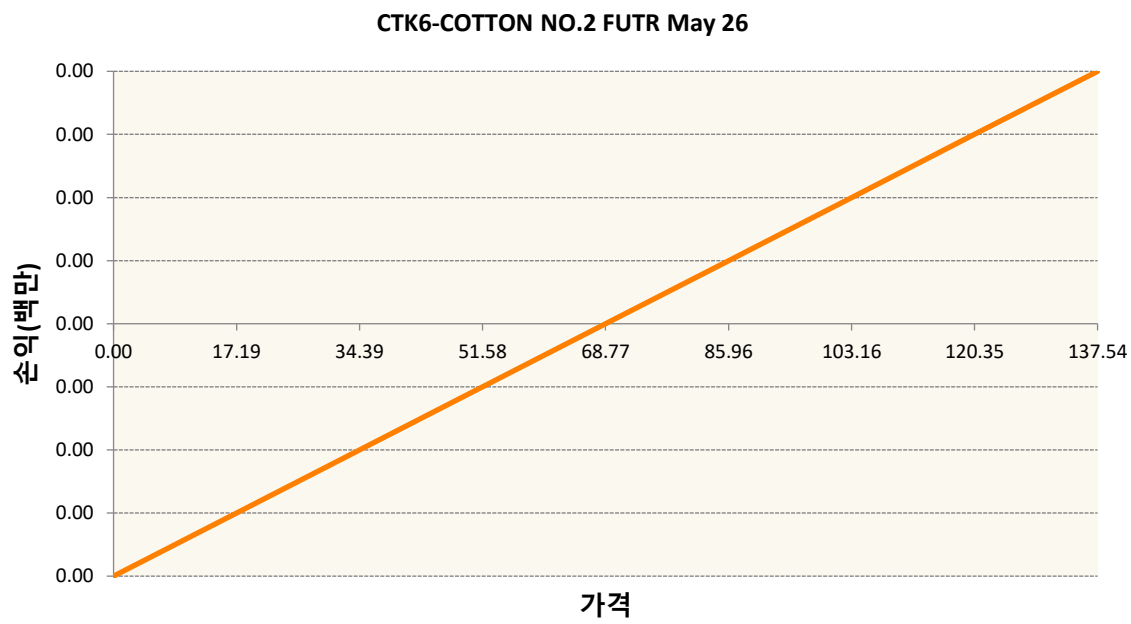
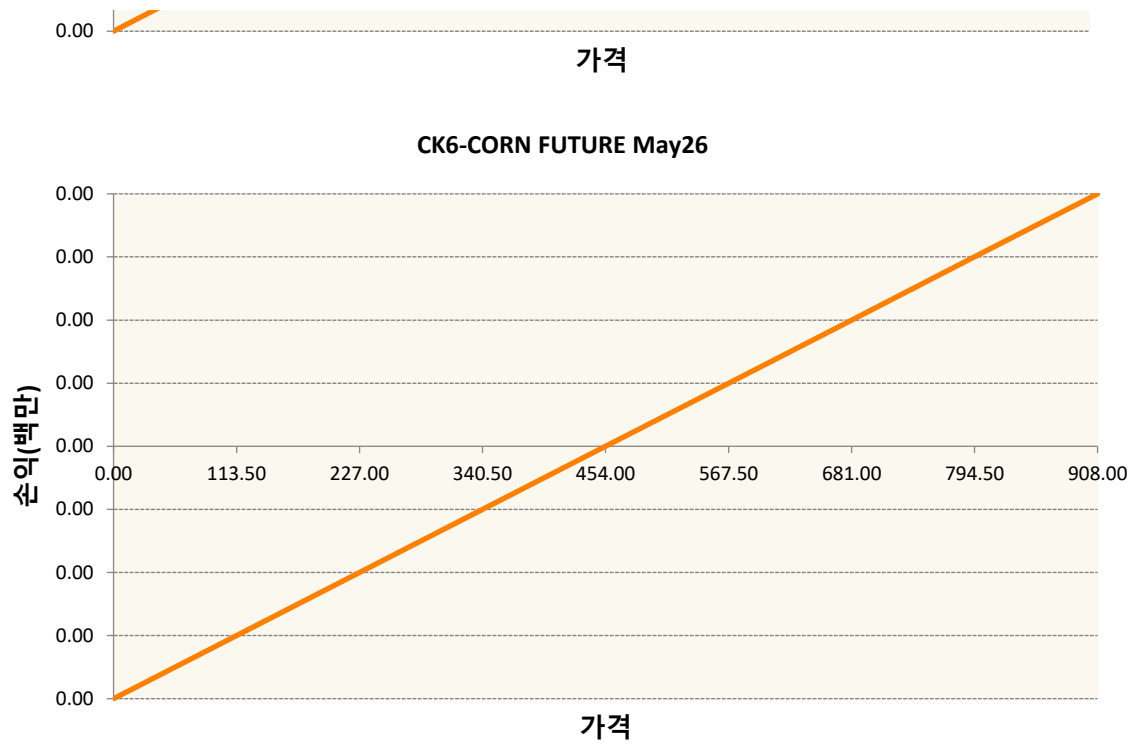
1. 계약금액

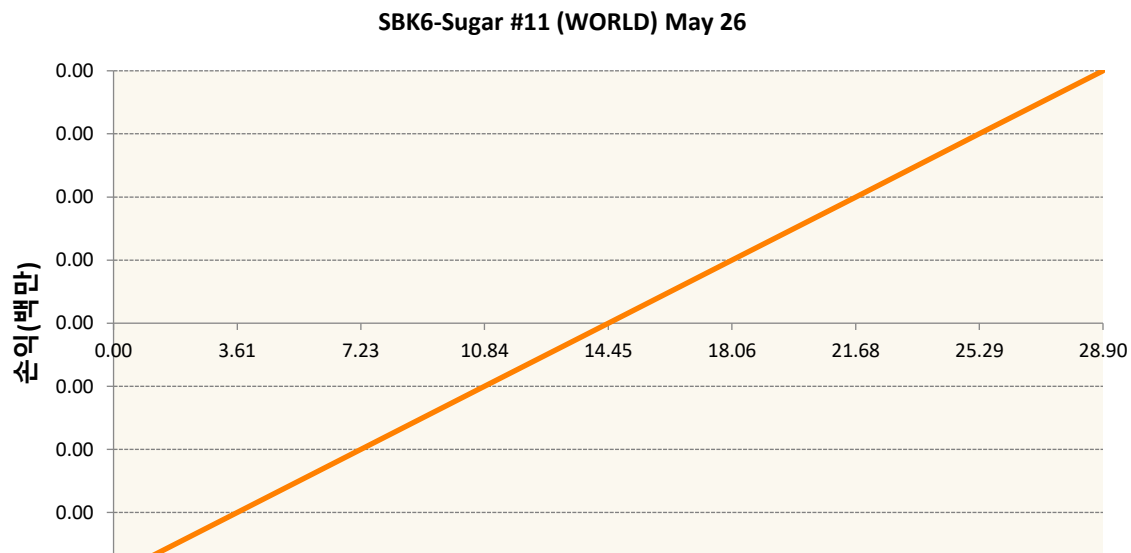
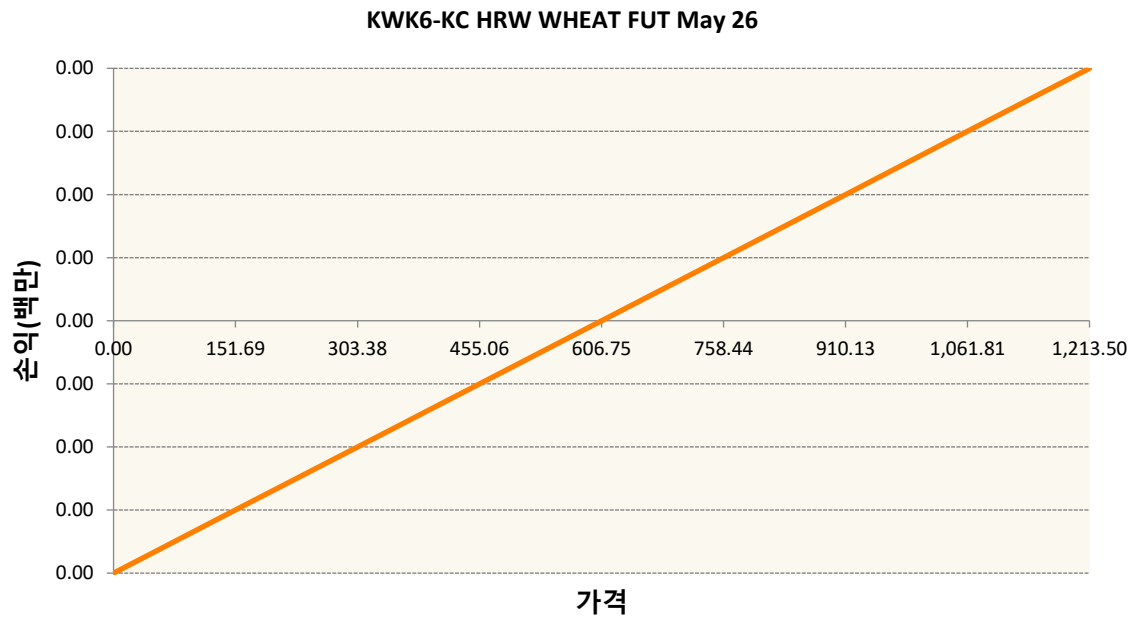
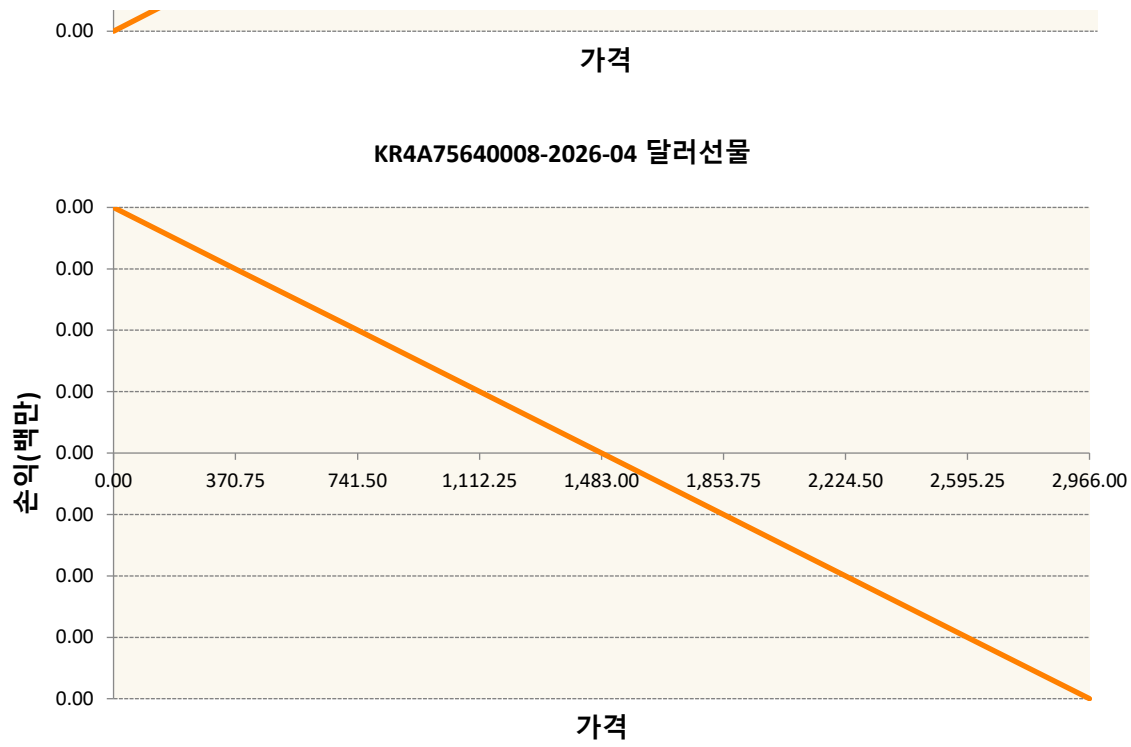
(단위:USD 백만)

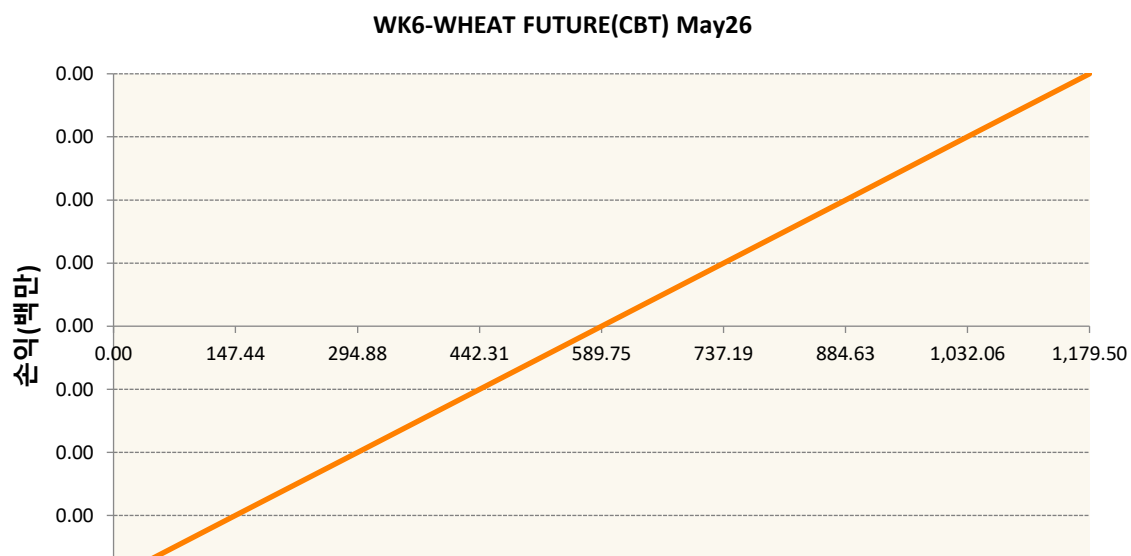
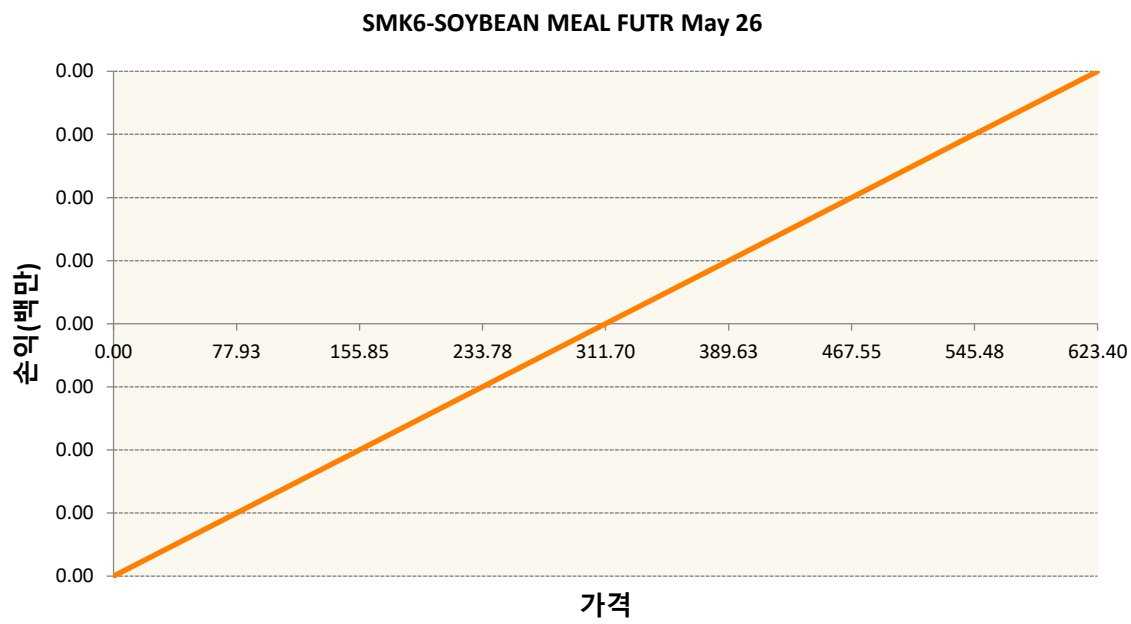
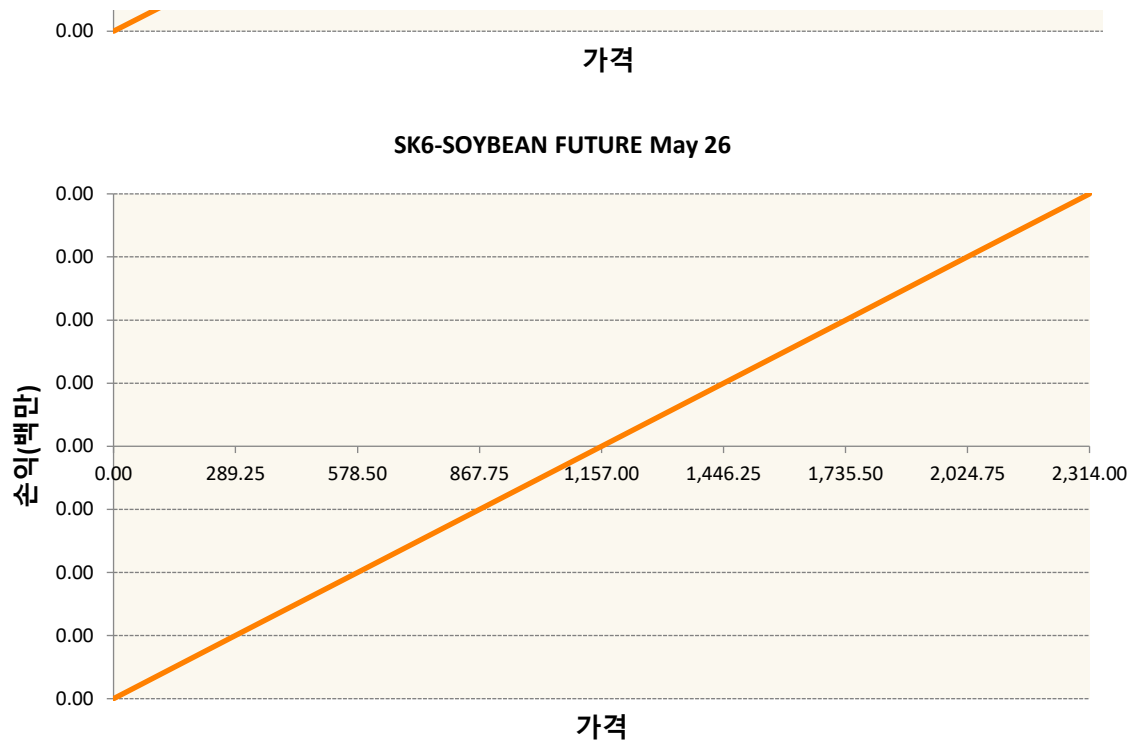
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,226	0	1,226	
누계	유가증권	선물	1,749	0	1,749	
누계	통화	선물	0	445	-445	장내

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	2026-03-19
기준일	2026-03-18

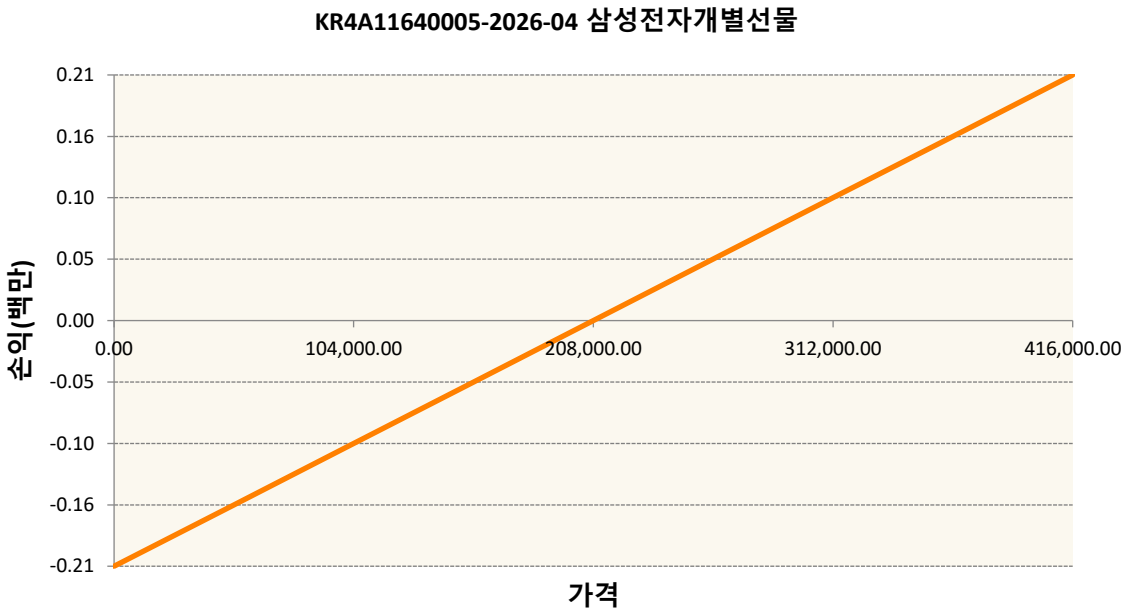
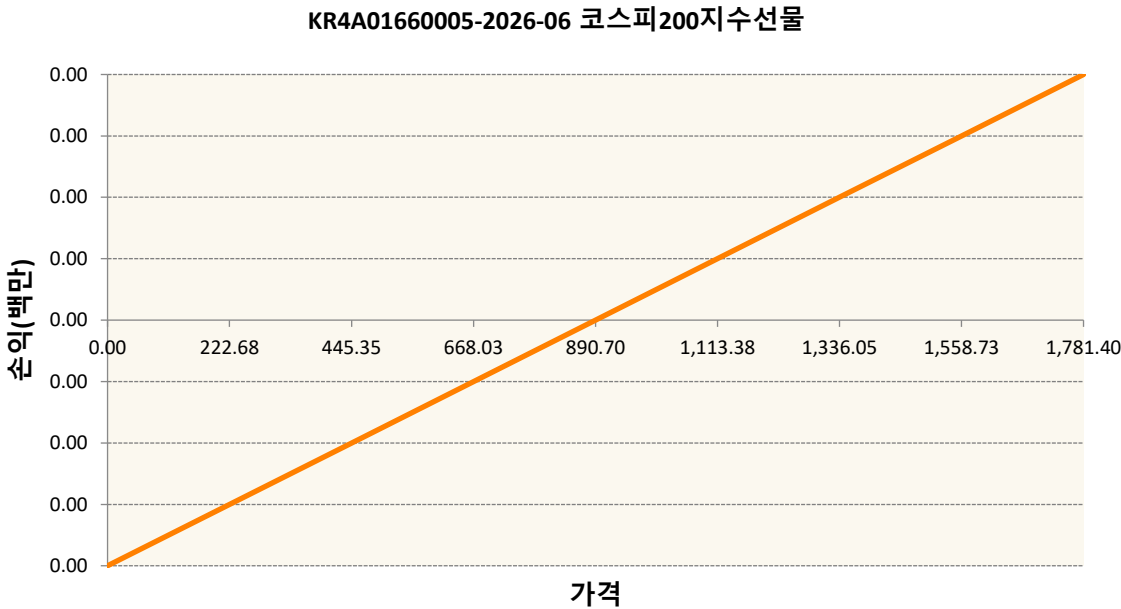
스마트인덱스모

1. 계약금액

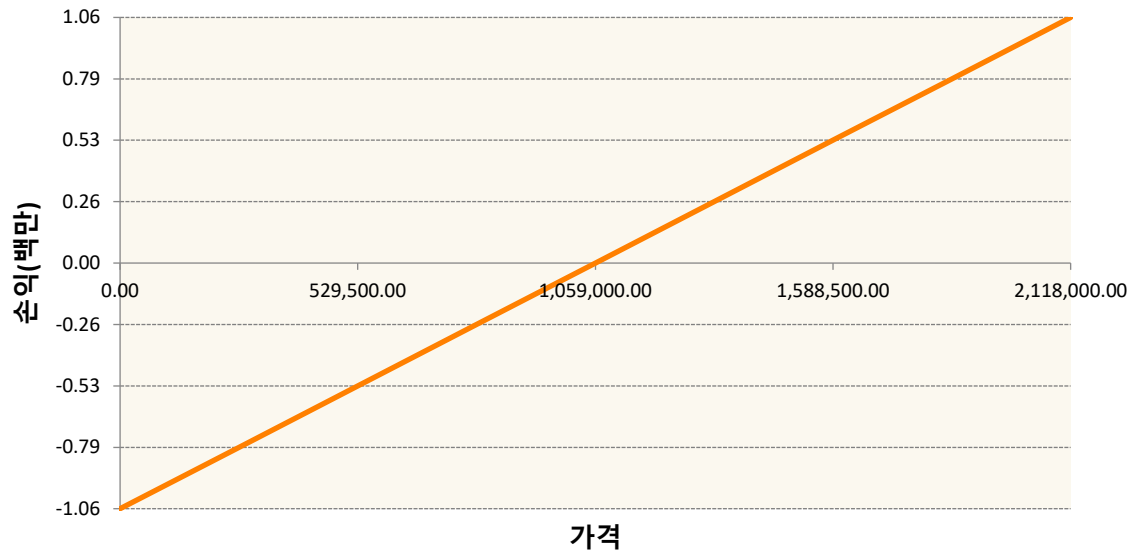
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,612	0	4,612	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005			2026-06 코스피200지수선물				355
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-355	-355	-355	-355	-355	-355	-355
-5.33%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
-2.67%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	118	118	118	118	118	118	118
5.33%	237	237	237	237	237	237	237
8.00%	355	355	355	355	355	355	355
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)
	729

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

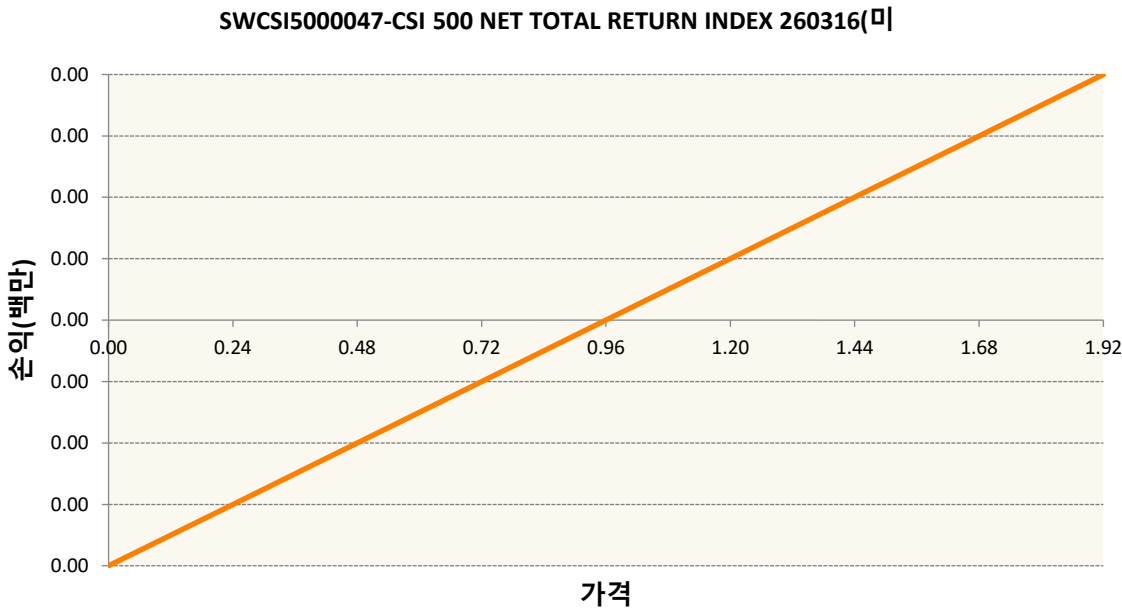
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,418	0	5,418	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

432

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

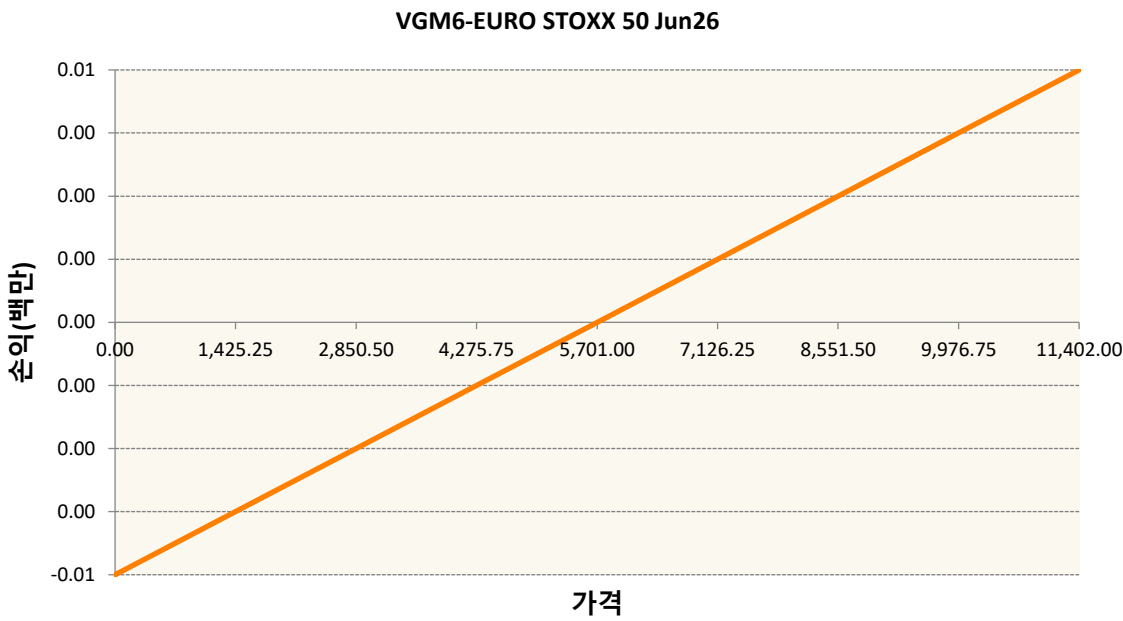
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	878	0	878	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	70
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

58

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

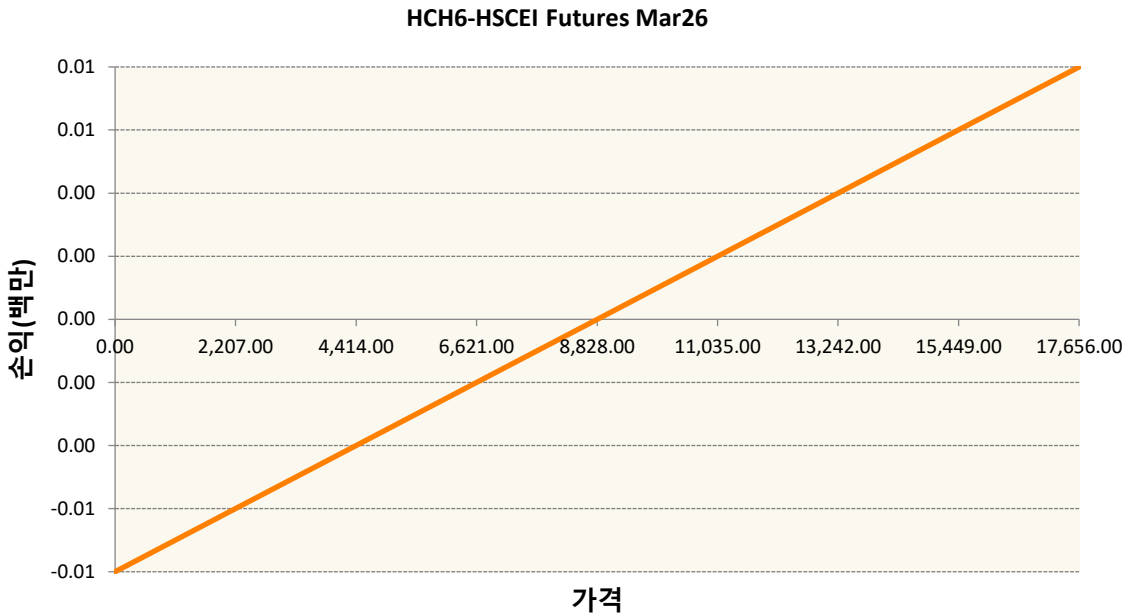
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,447	0	1,447	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH6	HSCEI Futures Mar26	116
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

132

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

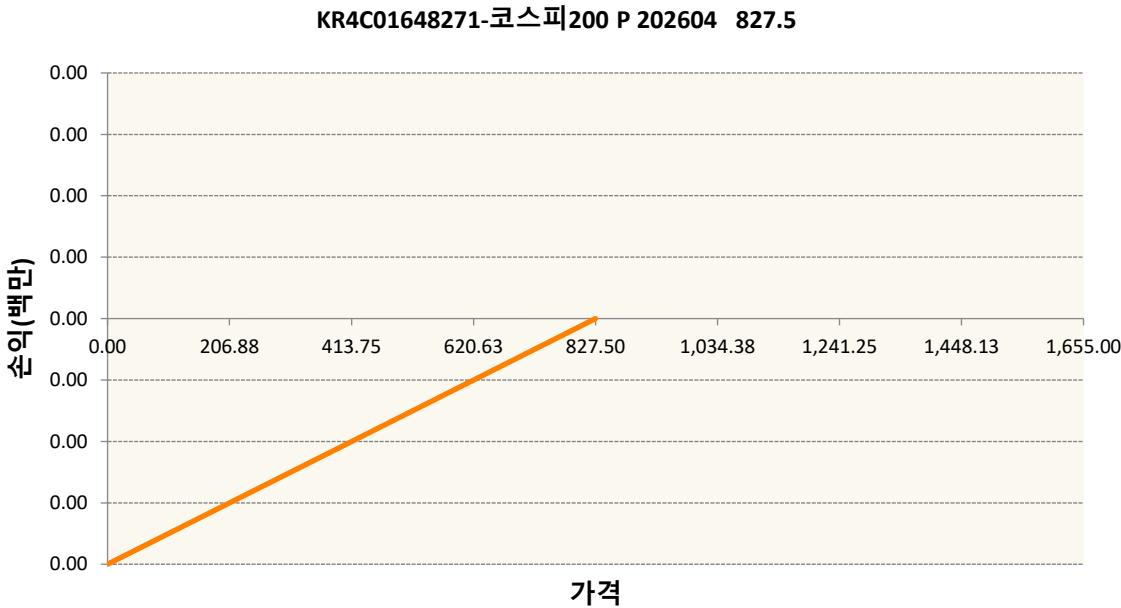
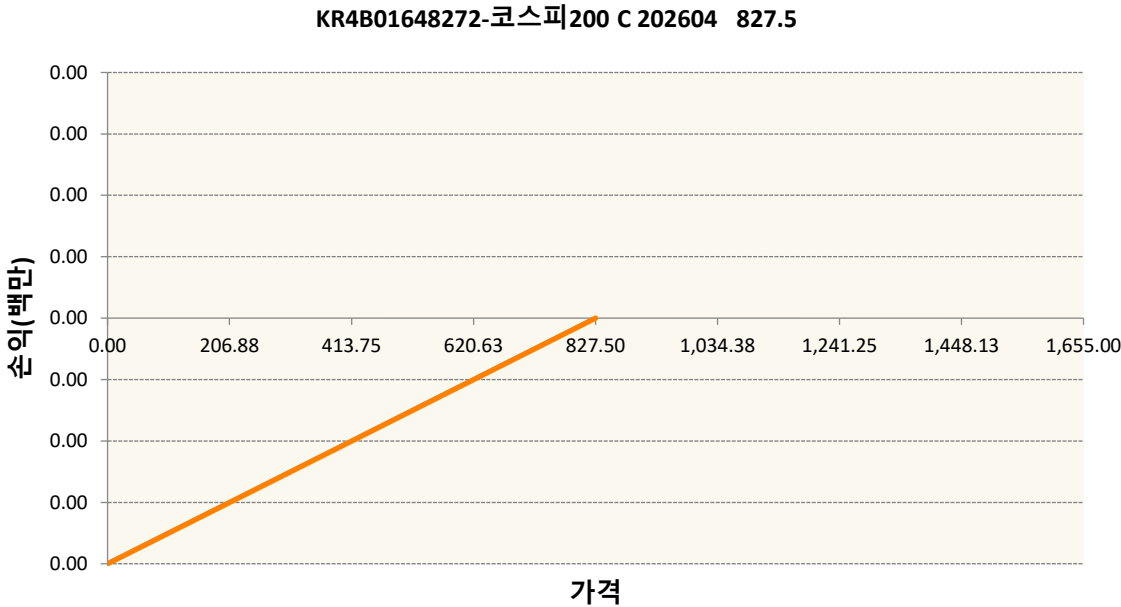
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	935	0	935	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,376	-35,376	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01648272 코스피200 C 202604 827.5							1,328
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-552	-681	-810	-940	-1,069	-1,199	-1,328
-5.33%	-173	-303	-434	-564	-695	-826	-956
-2.67%	121	-2	-127	-253	-380	-508	-636
0%	339	230	117	0	-119	-241	-364
2.67%	495	404	305	201	92	-20	-136
5.33%	602	529	446	356	260	159	54
8.00%	673	617	550	475	393	304	209
KR4C01648271 코스피200 P 202604 827.5							330
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-137	-169	-201	-233	-265	-297	-330
-5.33%	-43	-75	-108	-140	-172	-205	-237
-2.67%	30	0	-31	-63	-94	-126	-158
0%	84	57	29	0	-30	-60	-90
2.67%	123	100	76	50	23	-5	-34
5.33%	149	131	111	88	65	40	13
8.00%	167	153	137	118	97	75	52

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

1,147

공시일 2026-03-19

기준일 2026-03-18

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	2026-03-19
기준일	2026-03-18

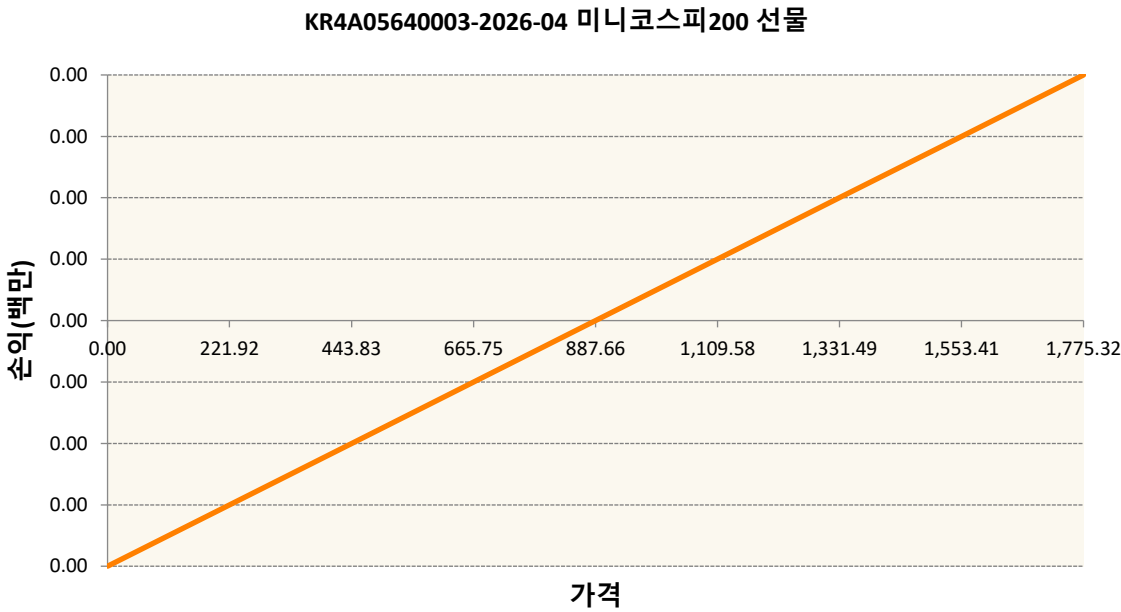
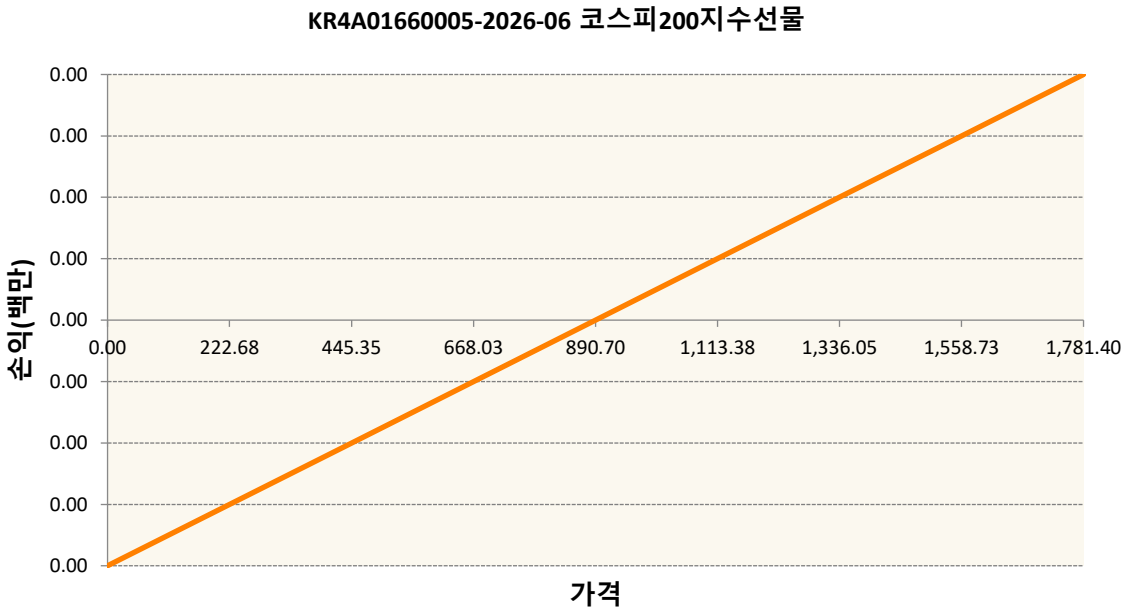
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

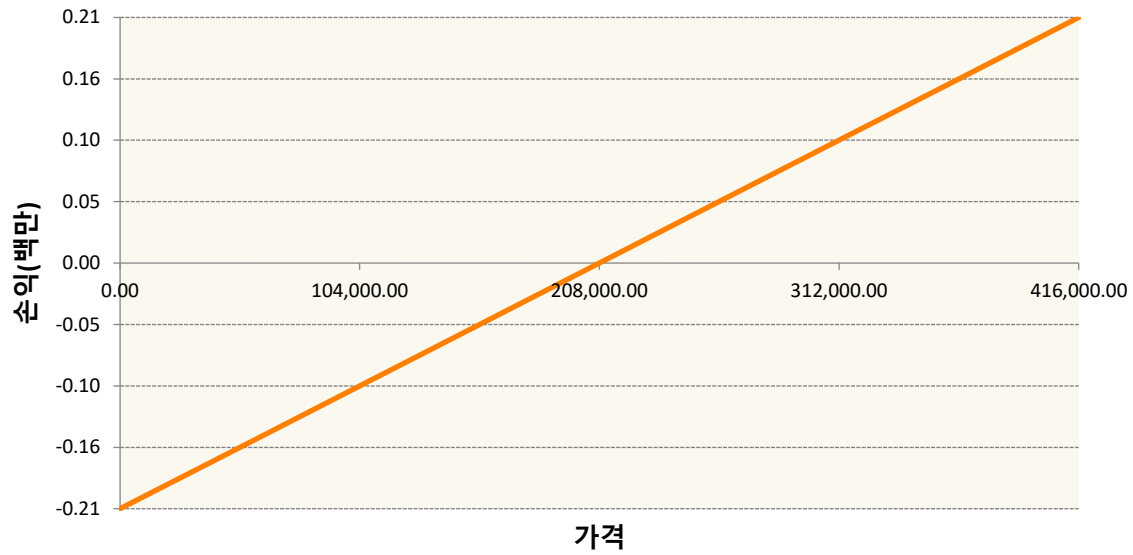
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,488	0	5,488	장내

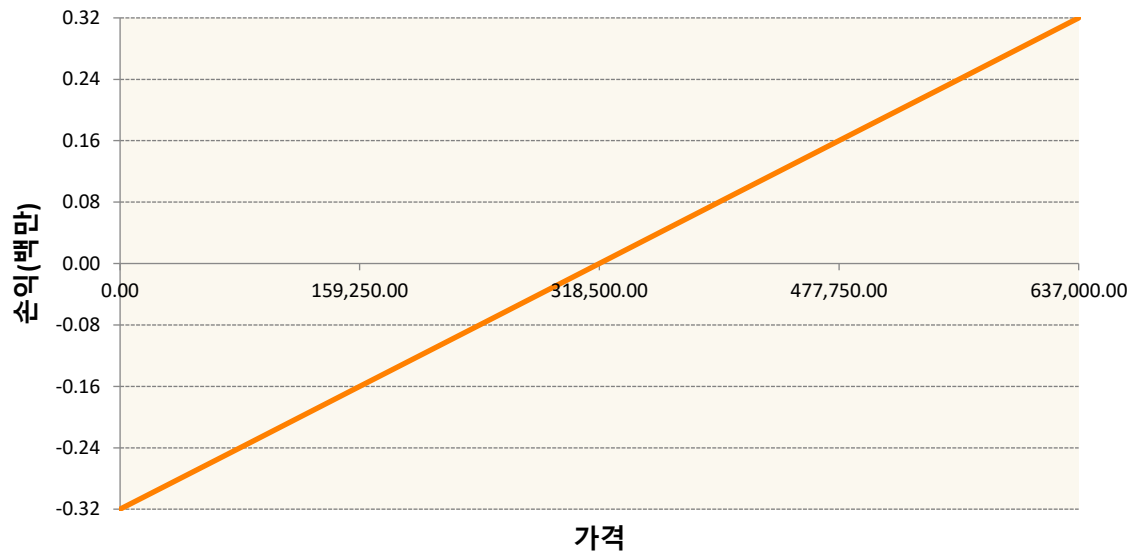
2. 만기시점의 손익구조



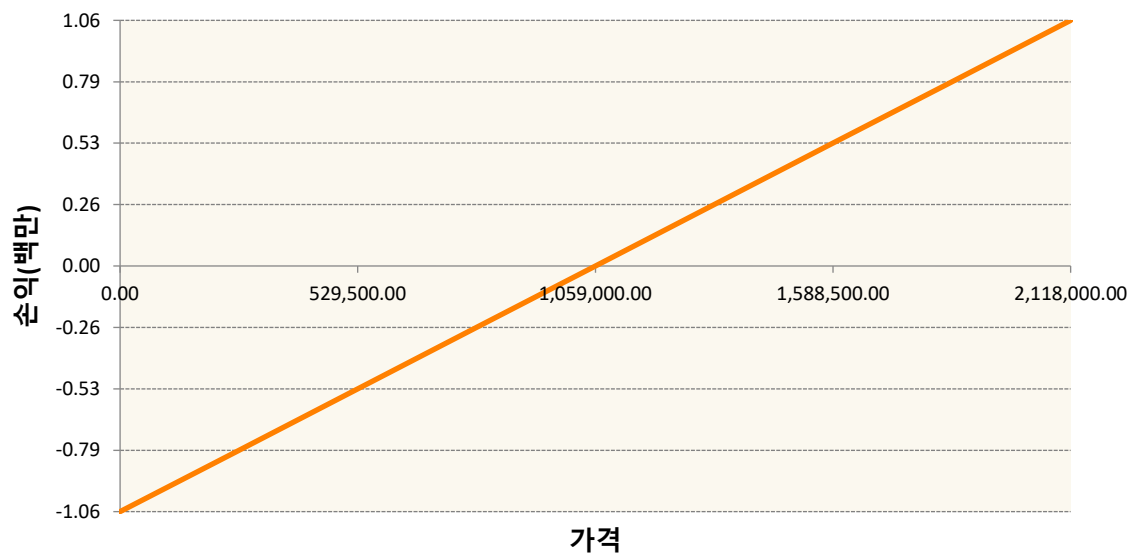
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



KR4A47640003-2026-04 LG화학개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		89	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89			
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59			
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	30	30	30	30	30	30	30			
5.33%	59	59	59	59	59	59	59			
8.00%	89	89	89	89	89	89	89			
KR4A05640003							2026-04 미니코스피200 선물		68	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68			
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45			
-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%	45	45	45	45	45	45	45			
8.00%	68	68	68	68	68	68	68			
KR4A11640005							2026-04 삼성전자개별선물		2	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2			
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1			
-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%	1	1	1	1	1	1	1			
8.00%	2	2	2	2	2	2	2			
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)

335

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

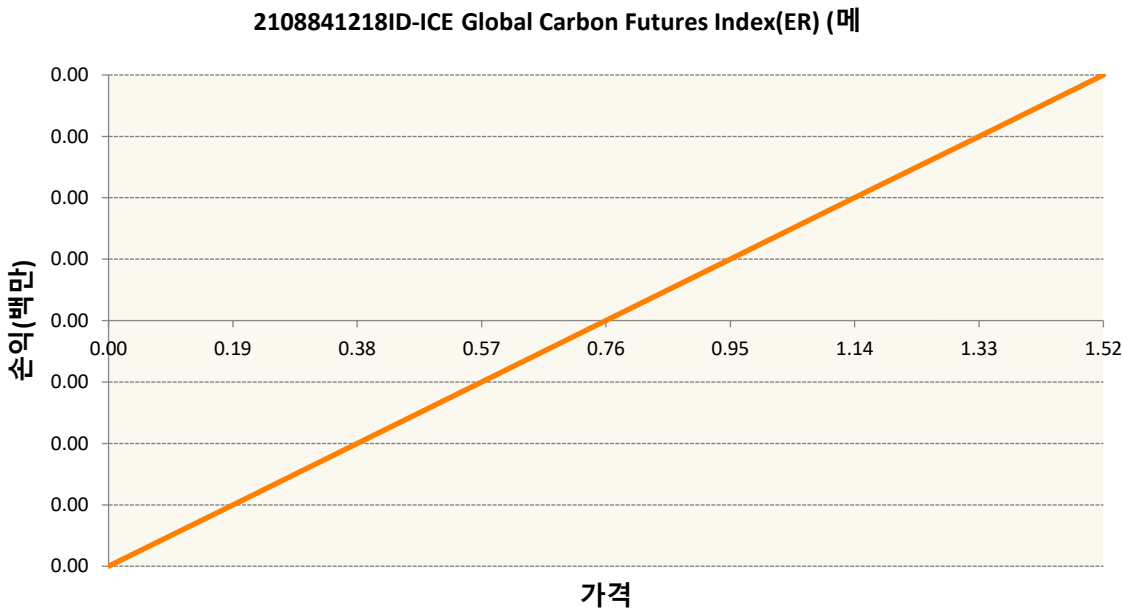
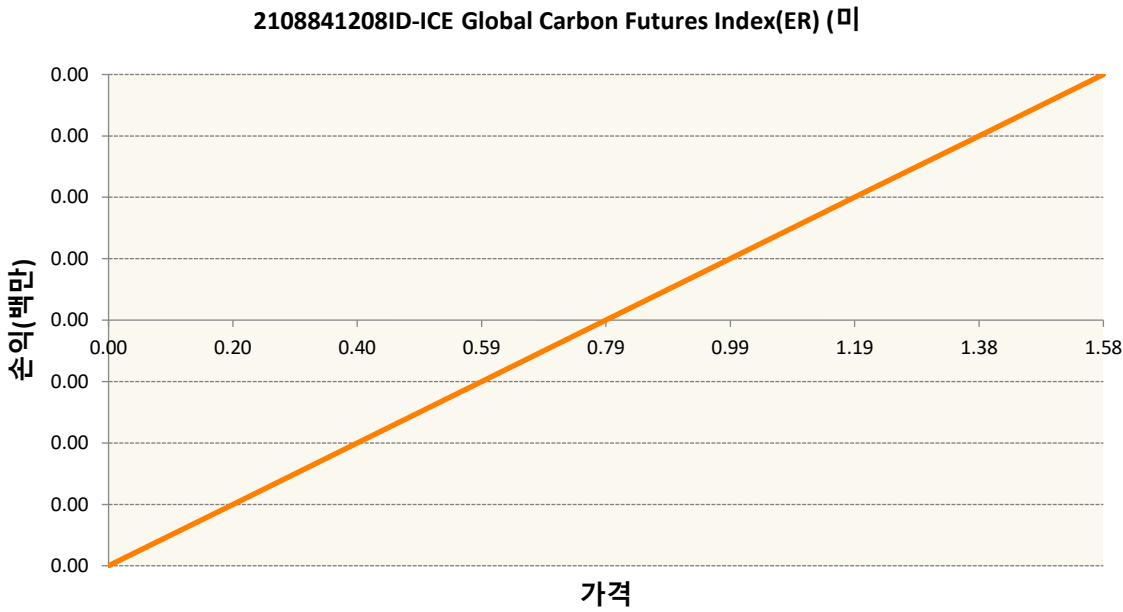
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	5,756	0	5,756	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		368
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		92

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	500

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

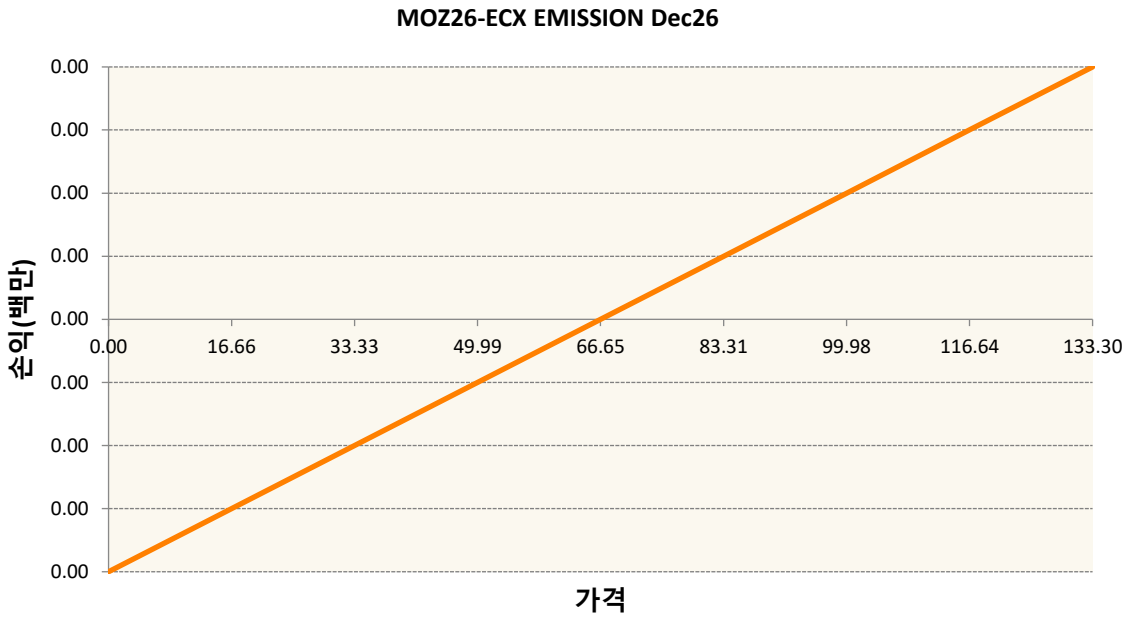
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,414	0	4,414	
누계	통화	선도	438	2,444	-2,006	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	353

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

(단위:백만원)

639

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

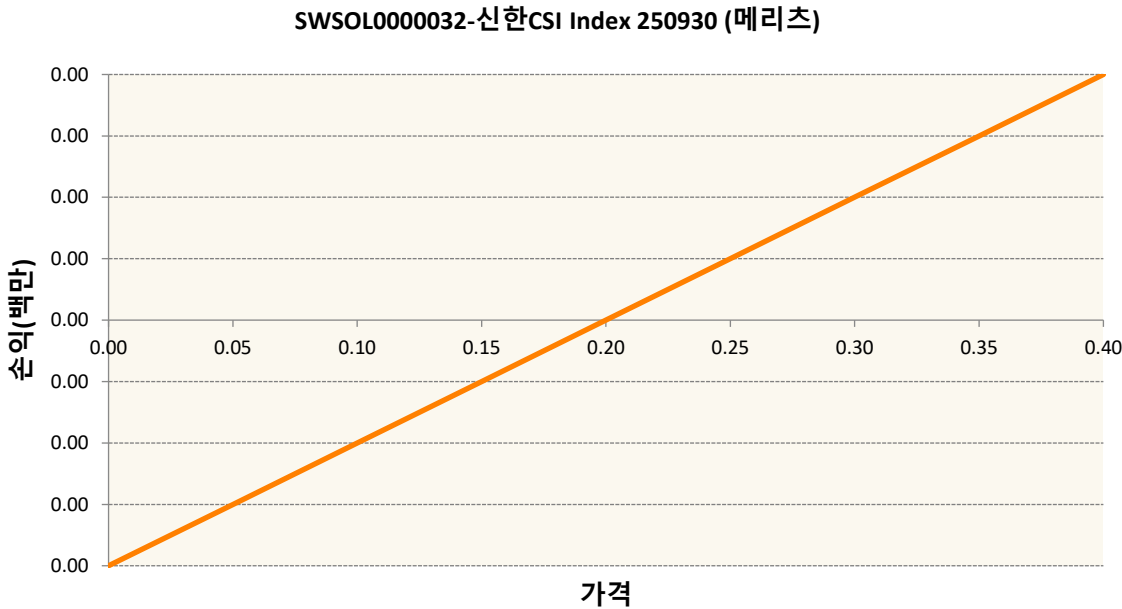
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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)	17
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	17
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	43

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

(단위:백만원)

187

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

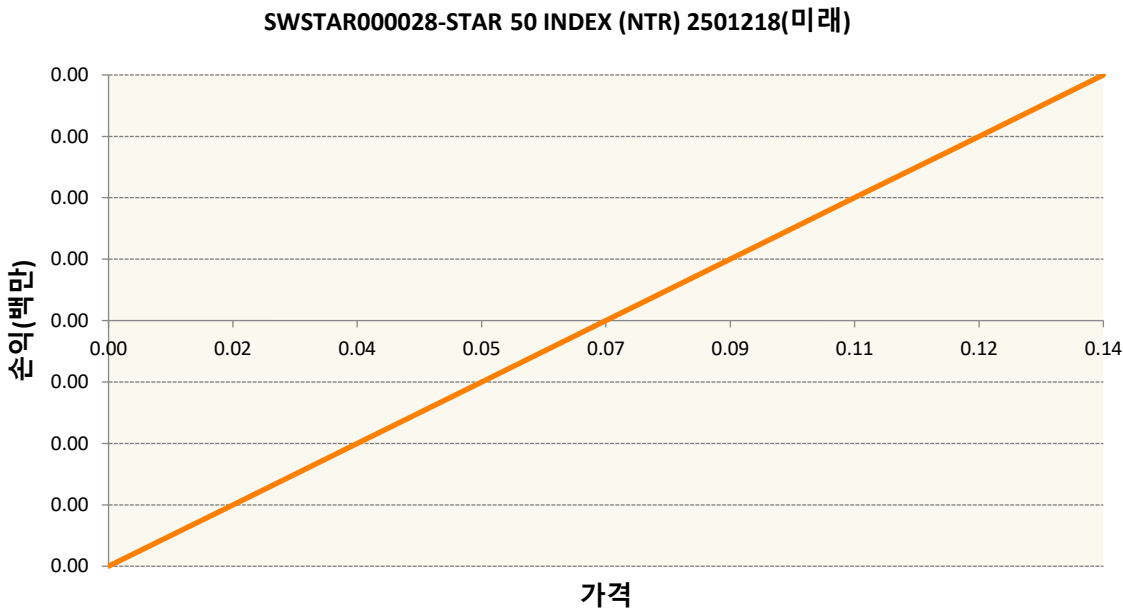
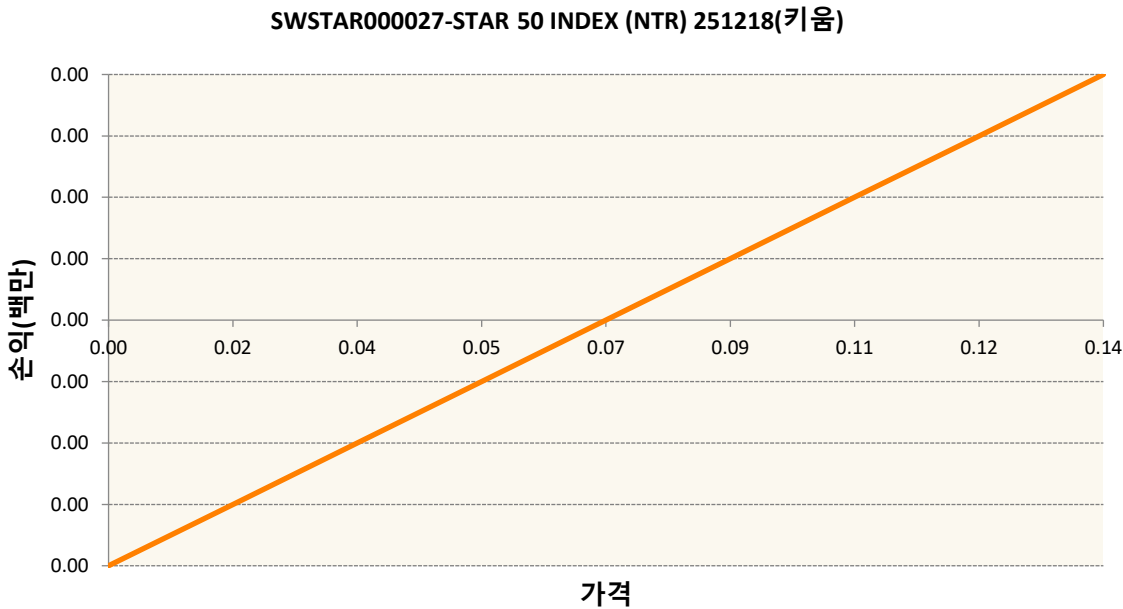
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

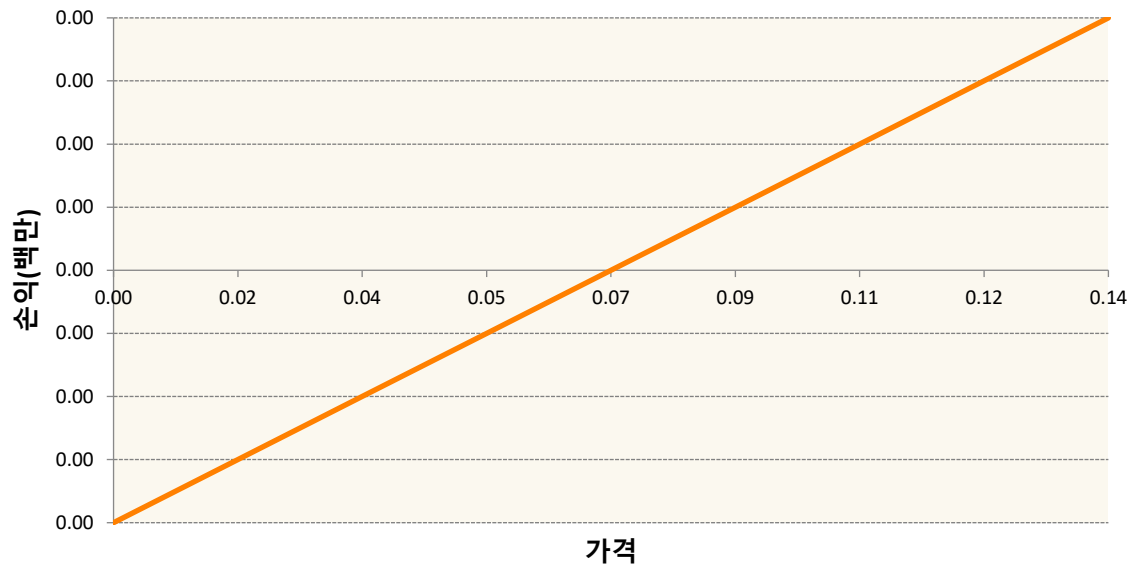
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	641	0	641	장외

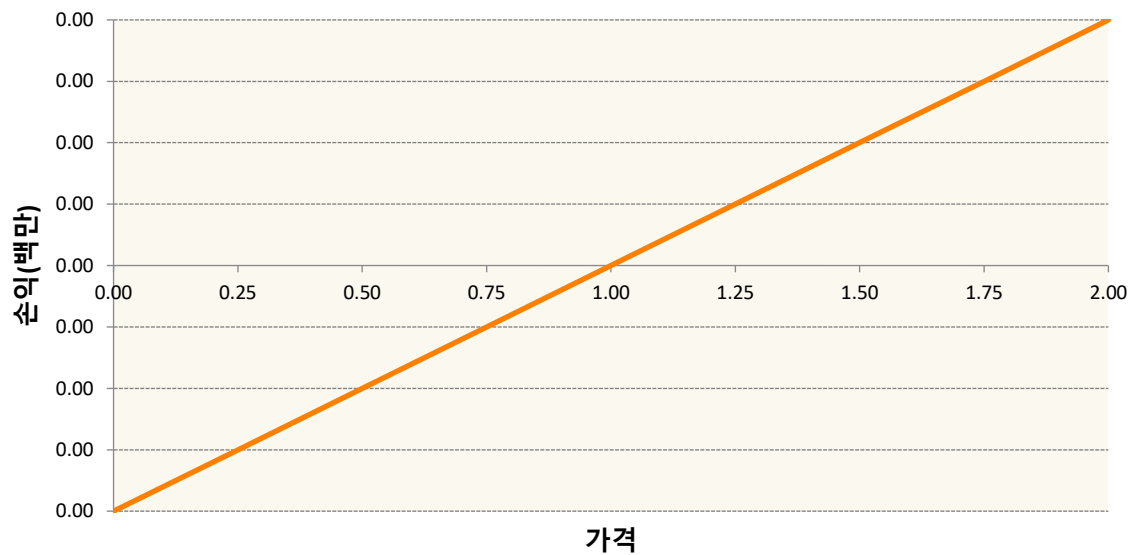
2. 만기시점의 손익구조



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))	4
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))	29
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))	15
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠))	1

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

(단위:백만원)

93

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

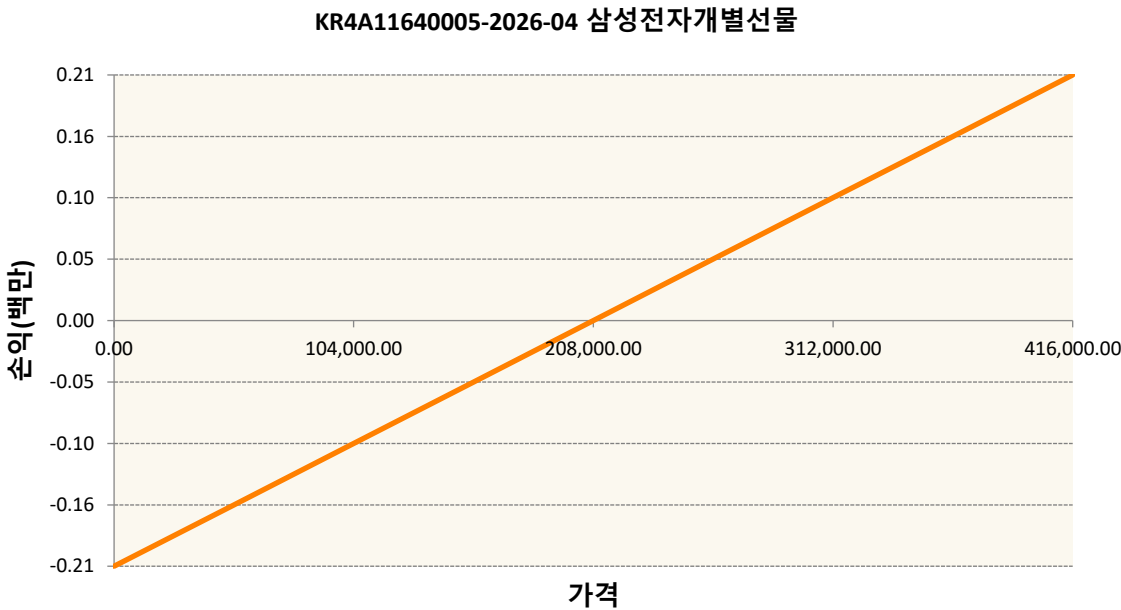
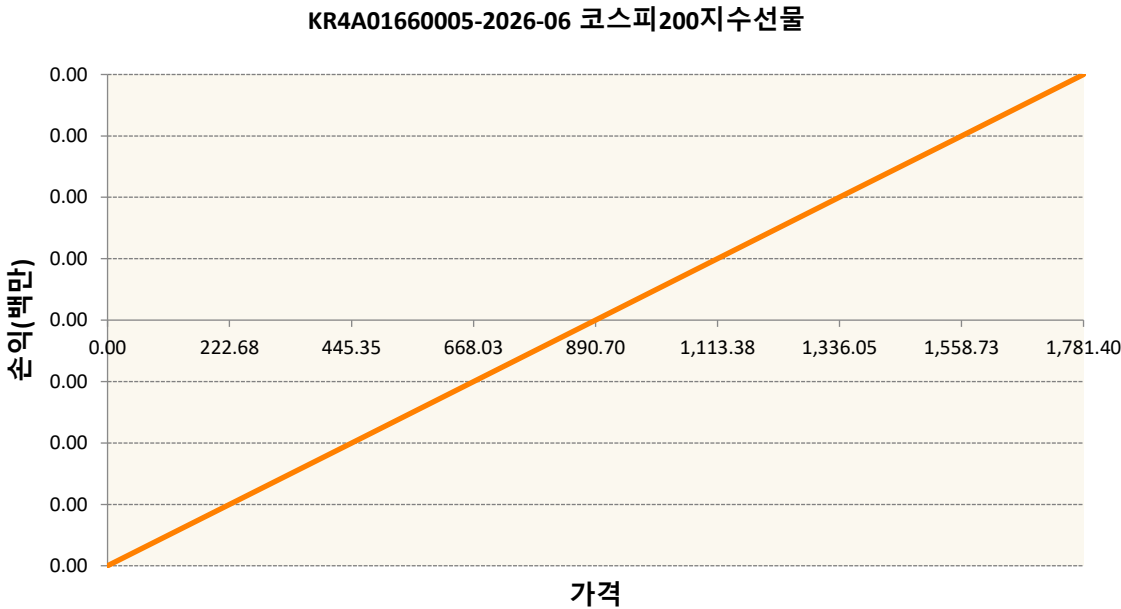
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

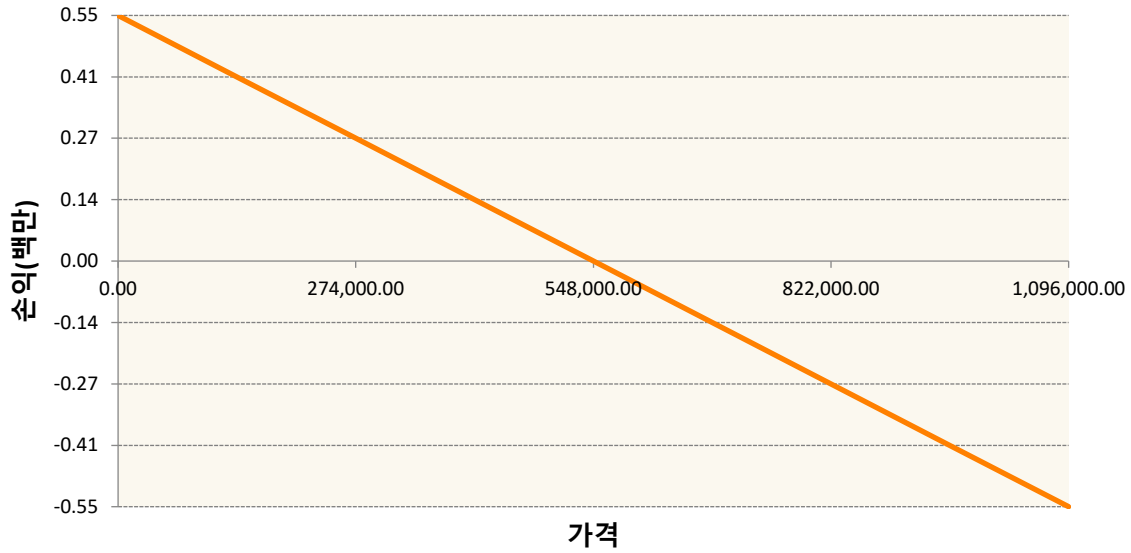
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,451	0	4,451	장내
누계	유가증권	선물	17,766	2,379	15,387	장내

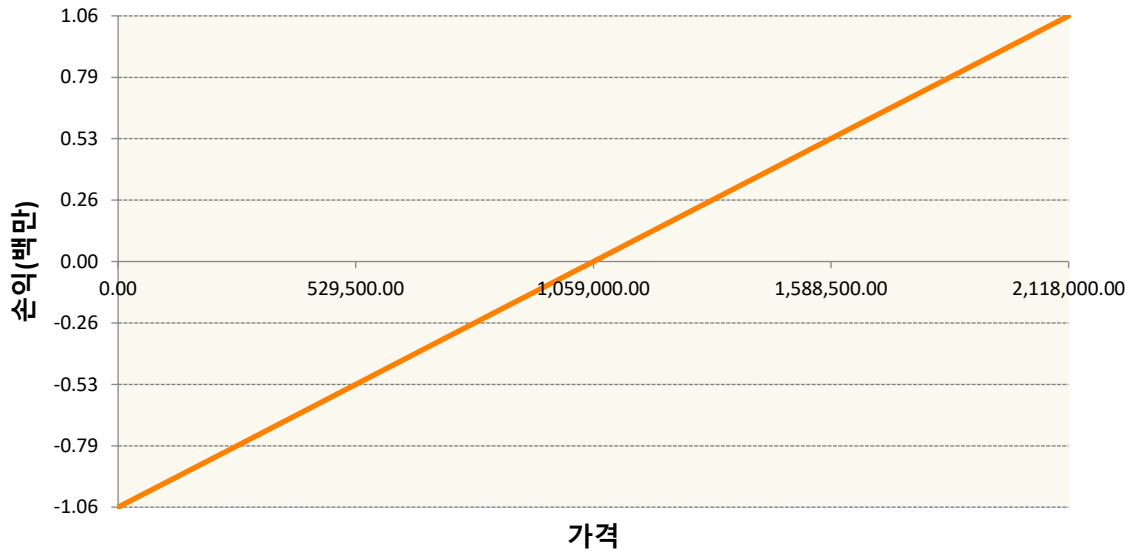
2. 만기시점의 손익구조



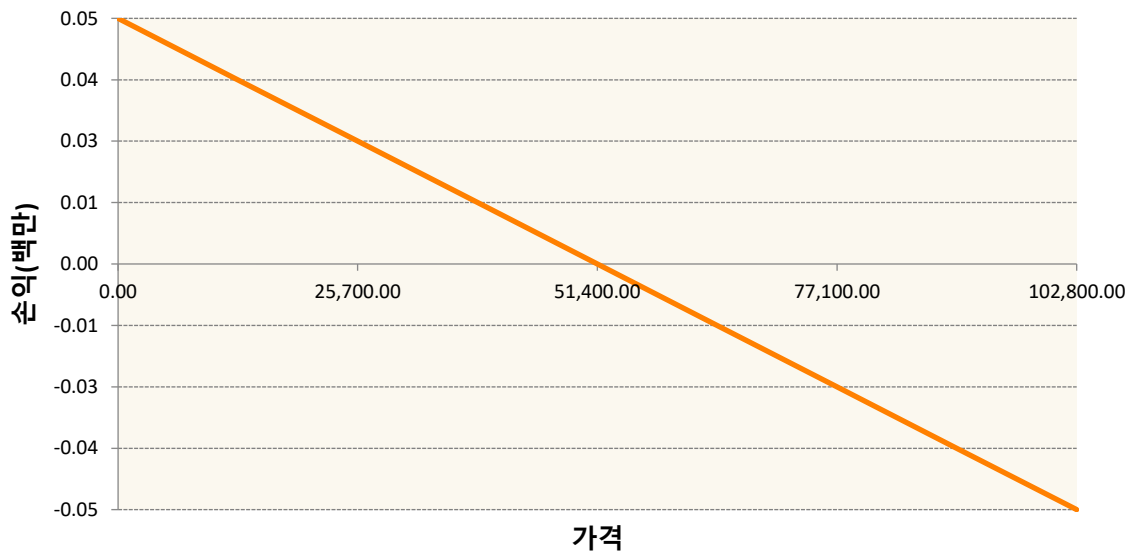
KR4A16640000-2026-04 현대차개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4ACF640007-2026-04 카카오개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		1,155	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-1,155	-1,155	-1,155	-1,155	-1,155	-1,155	-1,155			
-5.33%	-770	-770	-770	-770	-770	-770	-770			
-2.67%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	385	385	385	385	385	385	385			
5.33%	770	770	770	770	770	770	770			
8.00%	1,155	1,155	1,155	1,155	1,155	1,155	1,155			
KR4A11640005							2026-04 삼성전자개별선물		172	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172			
-5.33%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115			
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	57	57	57	57	57	57	57			
5.33%	115	115	115	115	115	115	115			
8.00%	172	172	172	172	172	172	172			
KR4A16640000							2026-04 현대차개별선물		59	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59			
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39			
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20			
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39			
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59			
KR4A50640007							2026-04 SK하이닉스개별선물		91	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91			
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61			
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	30	30	30	30	30	30	30			
5.33%	61	61	61	61	61	61	61			
8.00%	91	91	91	91	91	91	91			
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%	88	88	88	88	88	88	88
-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%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131

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

(단위:백만원)

3,265

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

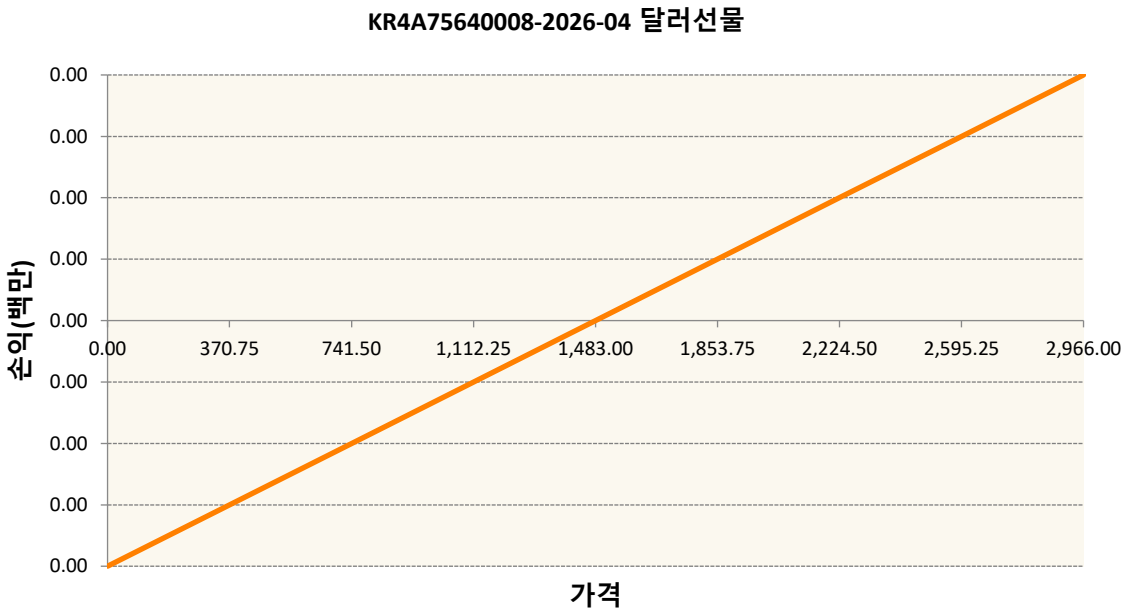
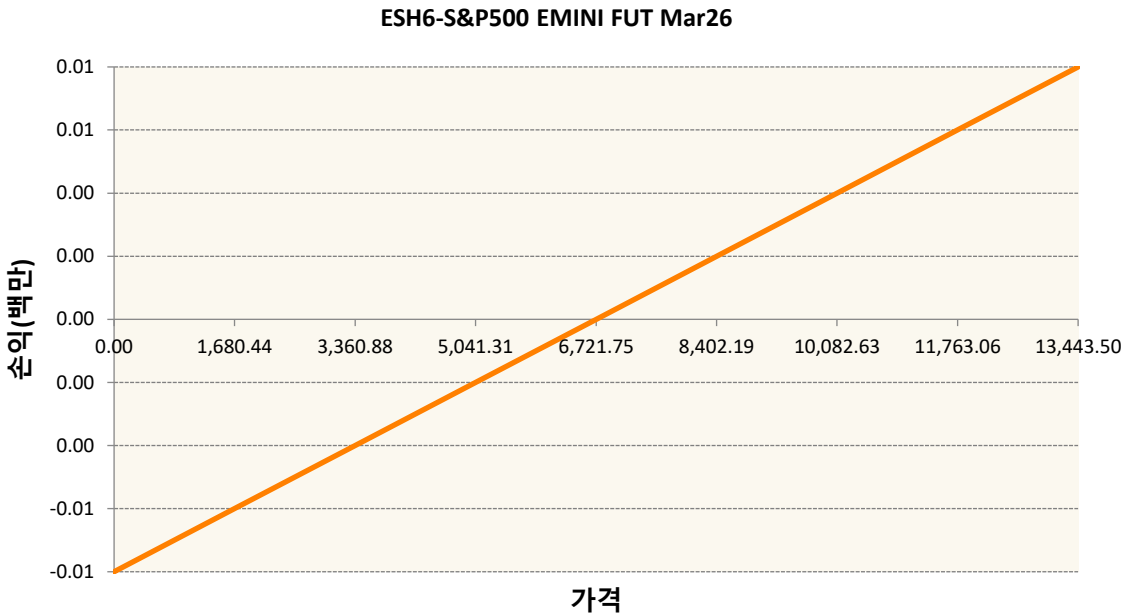
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	52,025	0	52,025	
누계	통화	선물	12,309	0	12,309	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	4,162
	KR4A756400 2026-04 달러선물	985

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,570

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

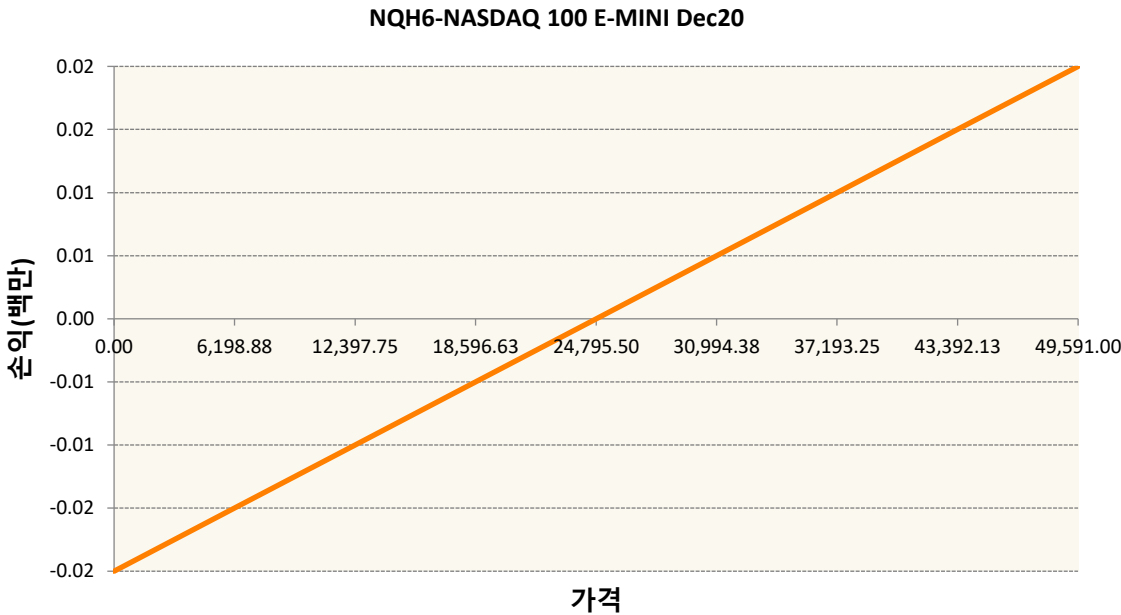
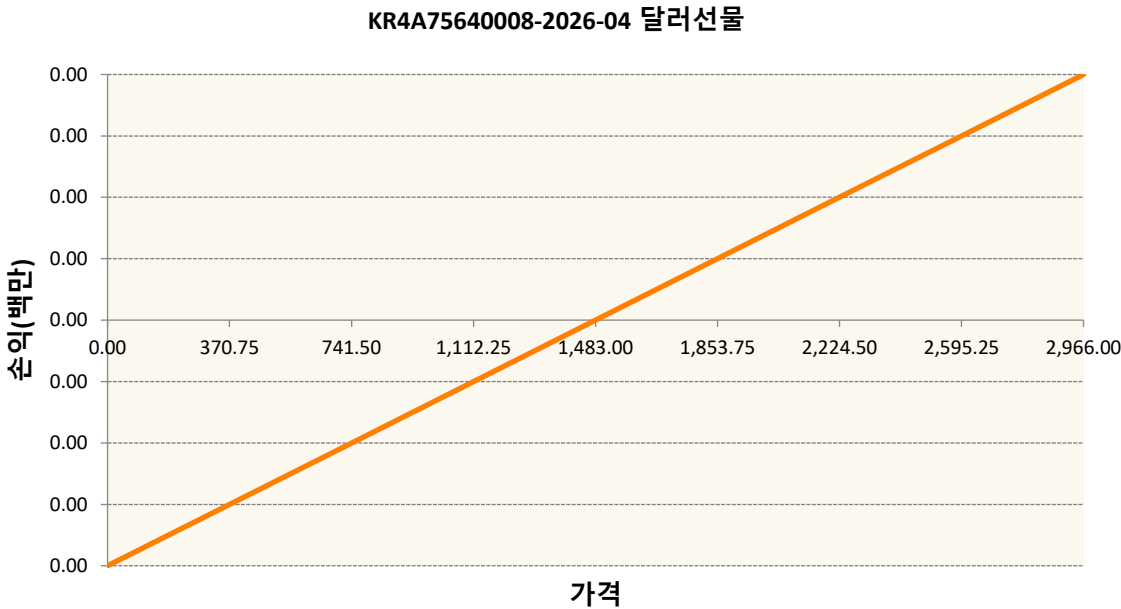
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	22,685	0	22,685	장내
누계	통화	선물	4,968	0	4,968	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A756400 2026-04 달러선물		397
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,815

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,979

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

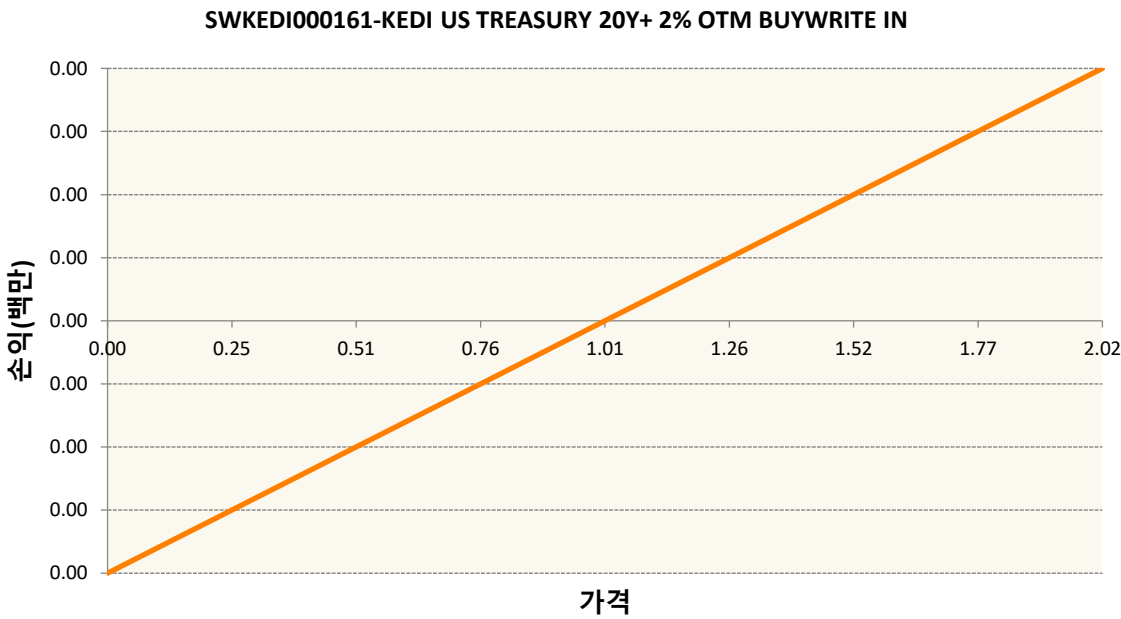
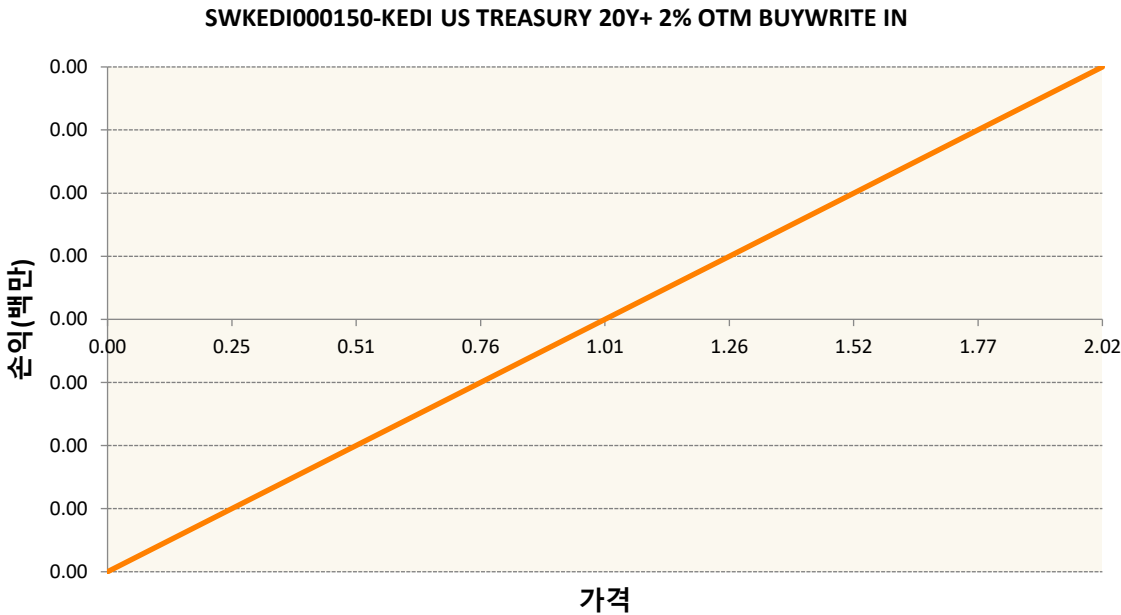
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

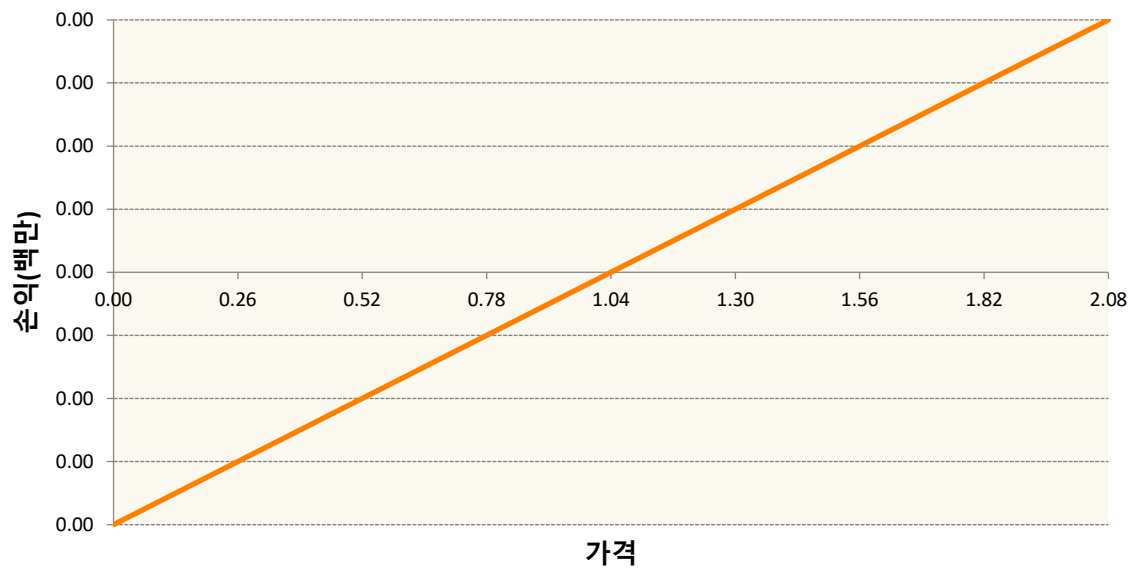
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	375,097	0	375,097	장외

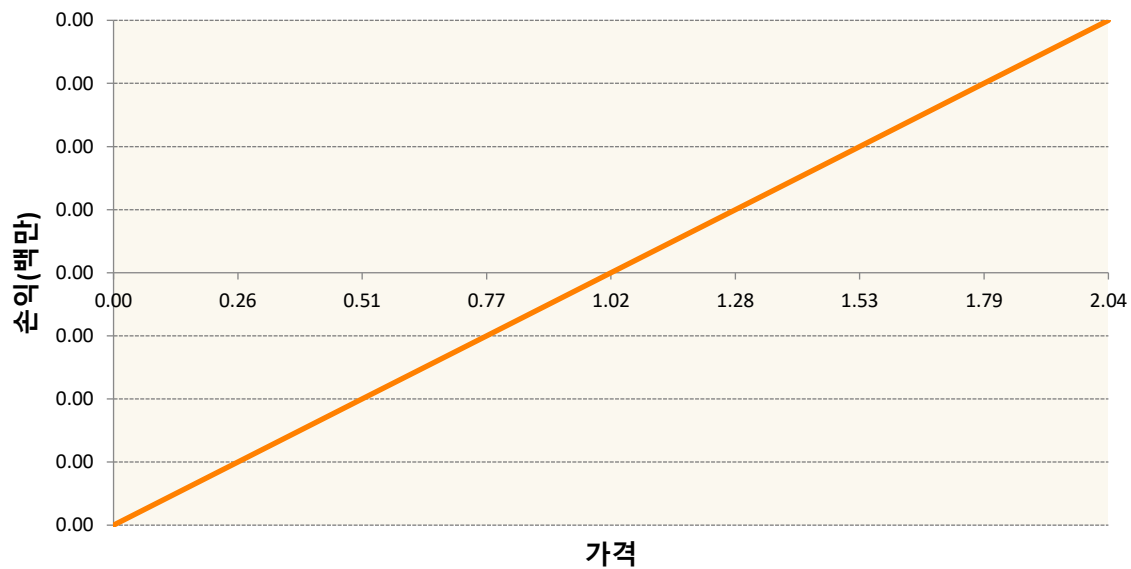
2. 만기시점의 손익구조



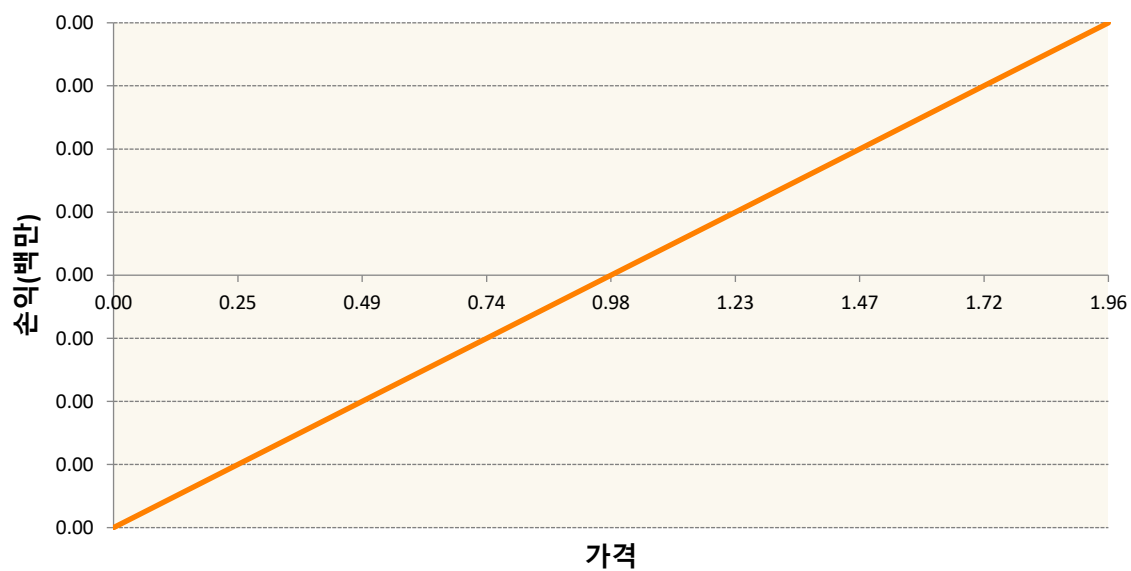
SWKEDI000164-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,352
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,741
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		151
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,498
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,305

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,448

공시일	2026-03-19
기준일	2026-03-18

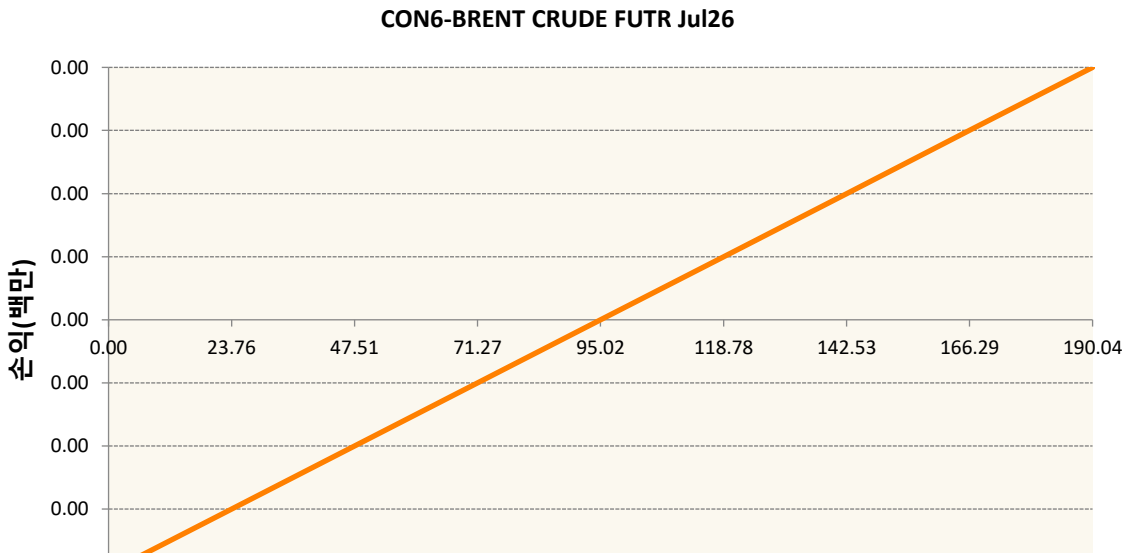
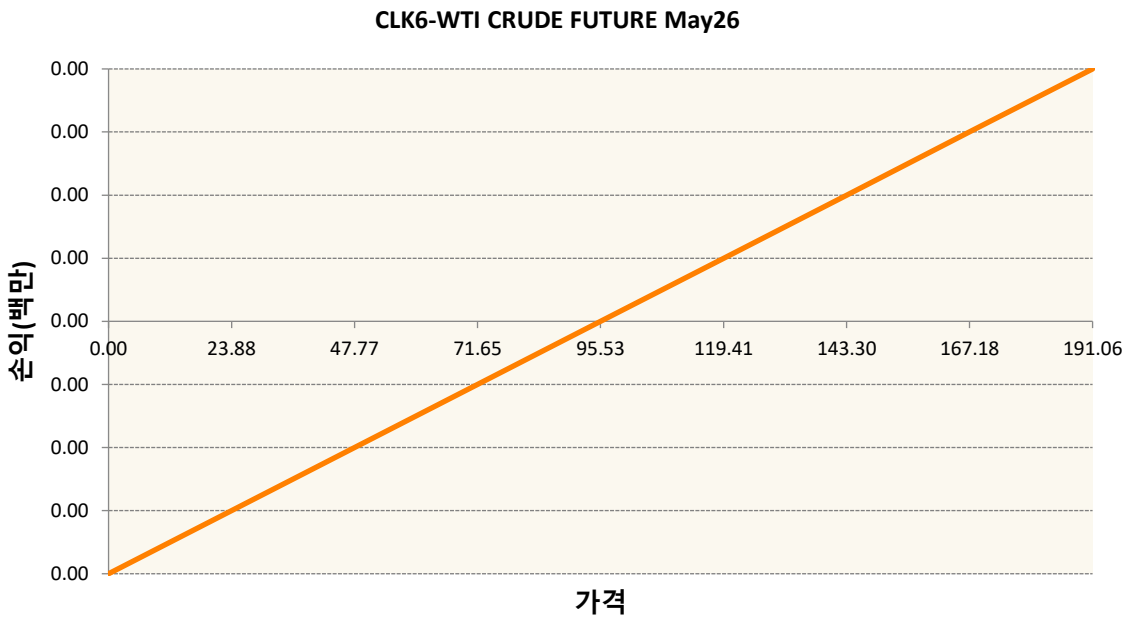
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

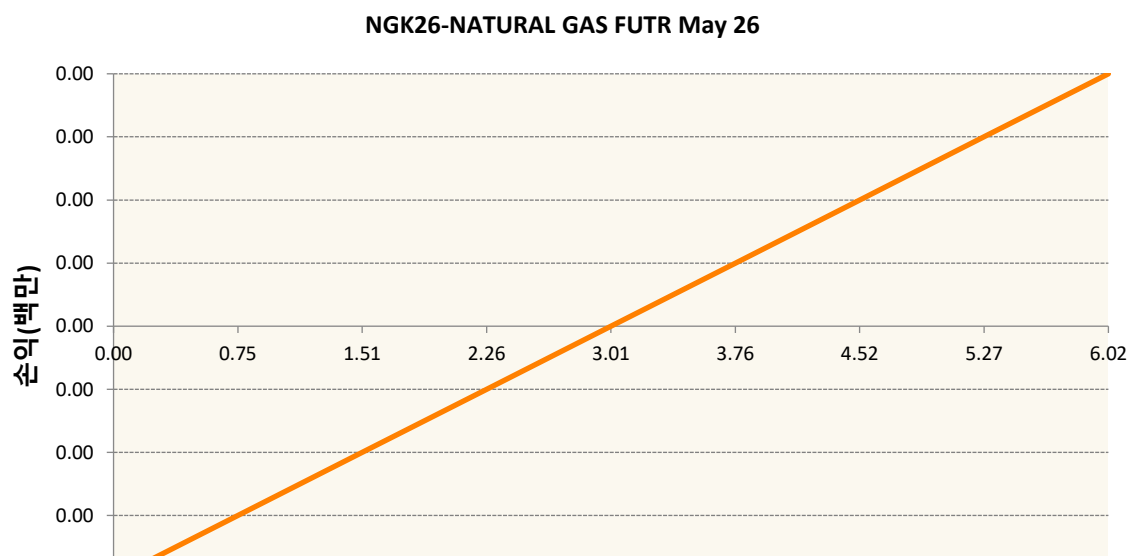
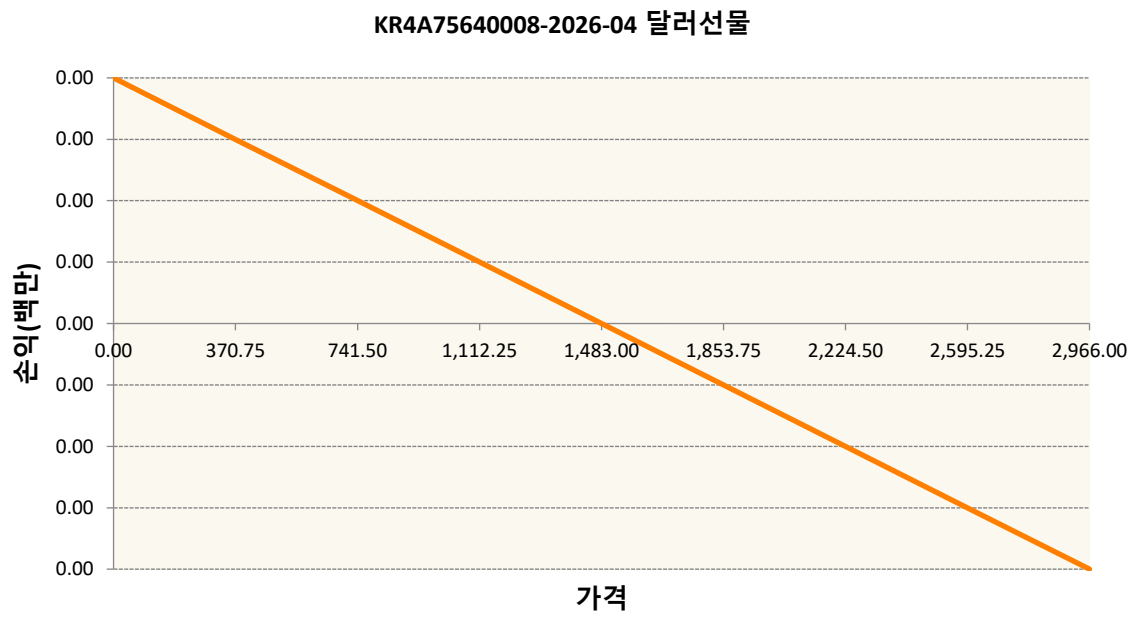
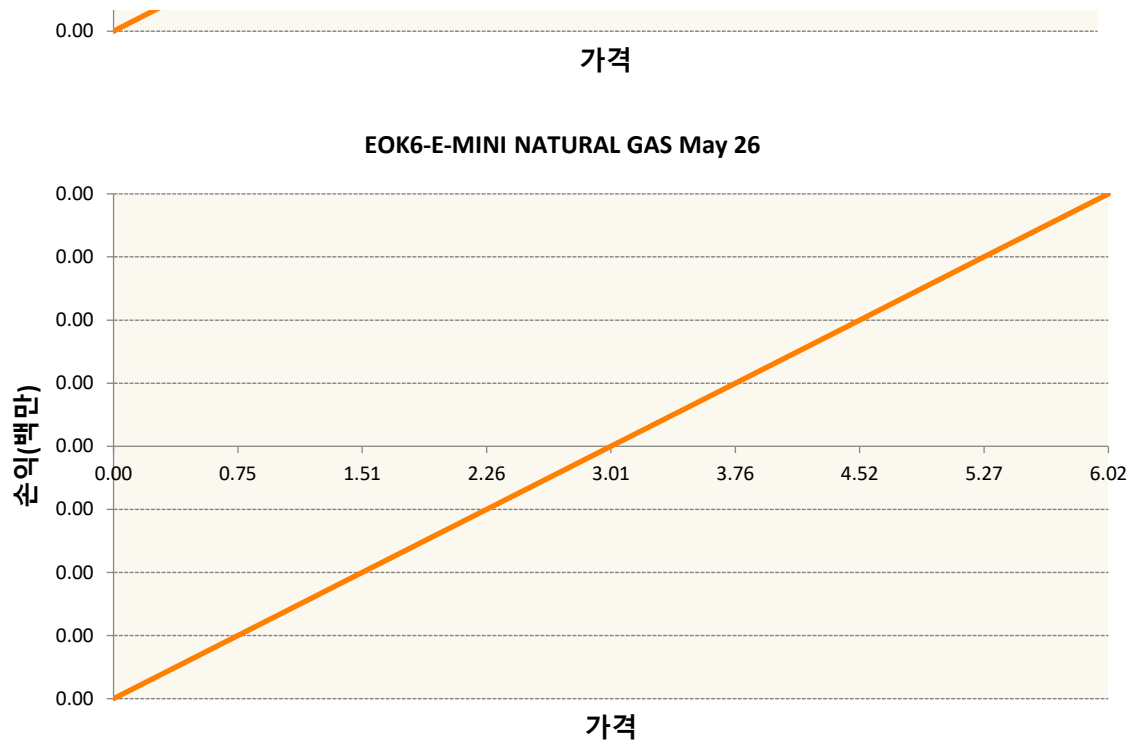
1. 계약금액

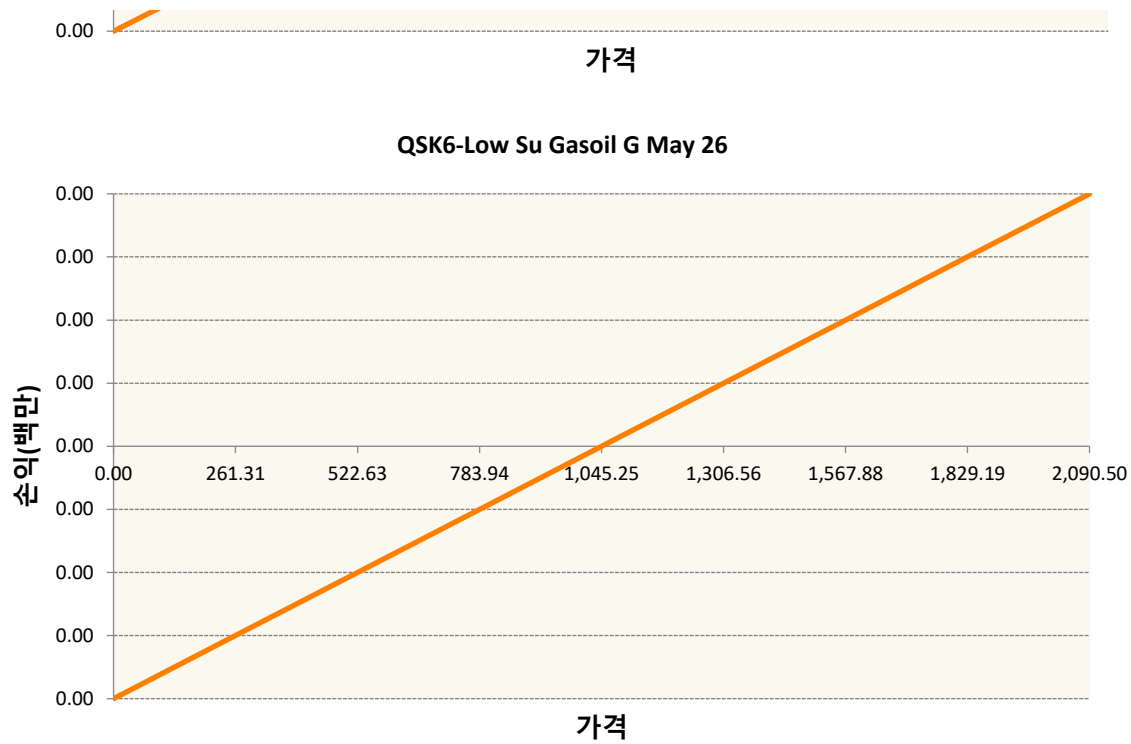
(단위:백만원)

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	198	0	198	
누계	유가증권	선물	313	0	313	
누계	통화	선물	0	163	-163	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	4
QSK6	Low Su Gasoil G May 26	12

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

(단위:백만원)

100