

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

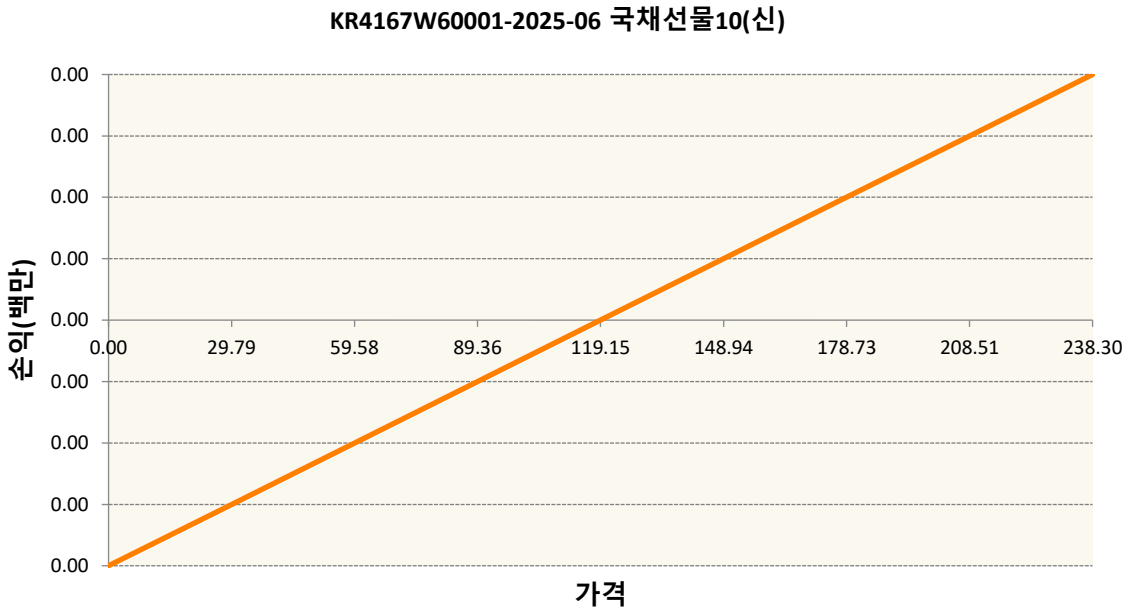
베스트장기채(채권-파생형)

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	157,278	0	157,278	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,628

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

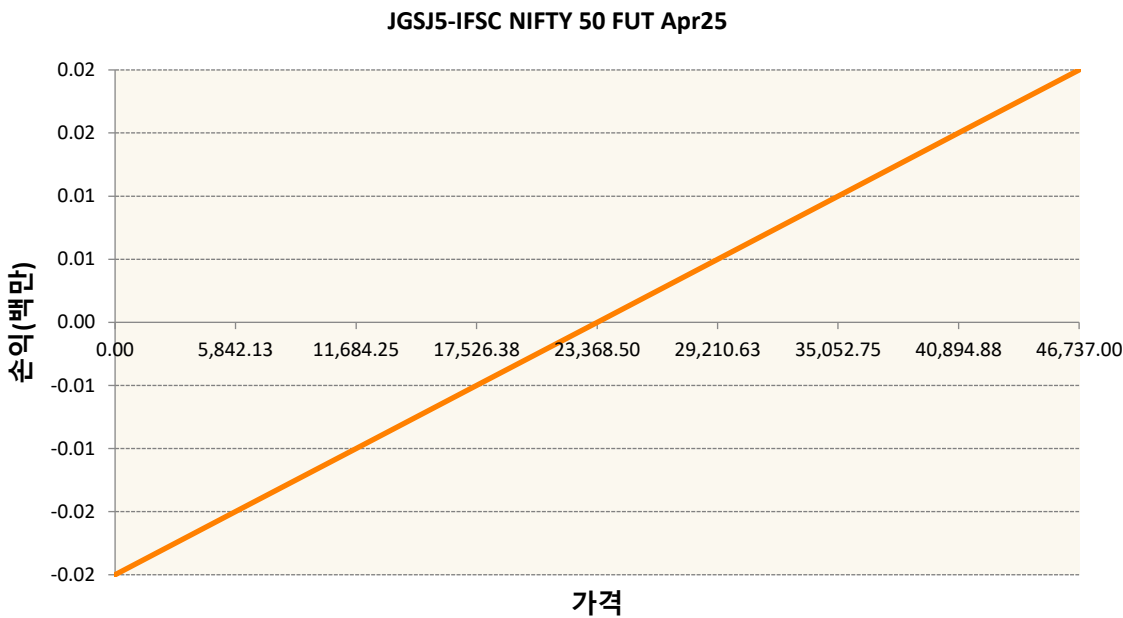
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	753	0	753	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ5	IFSC NIFTY 50 FUT Apr25	60
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

41

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

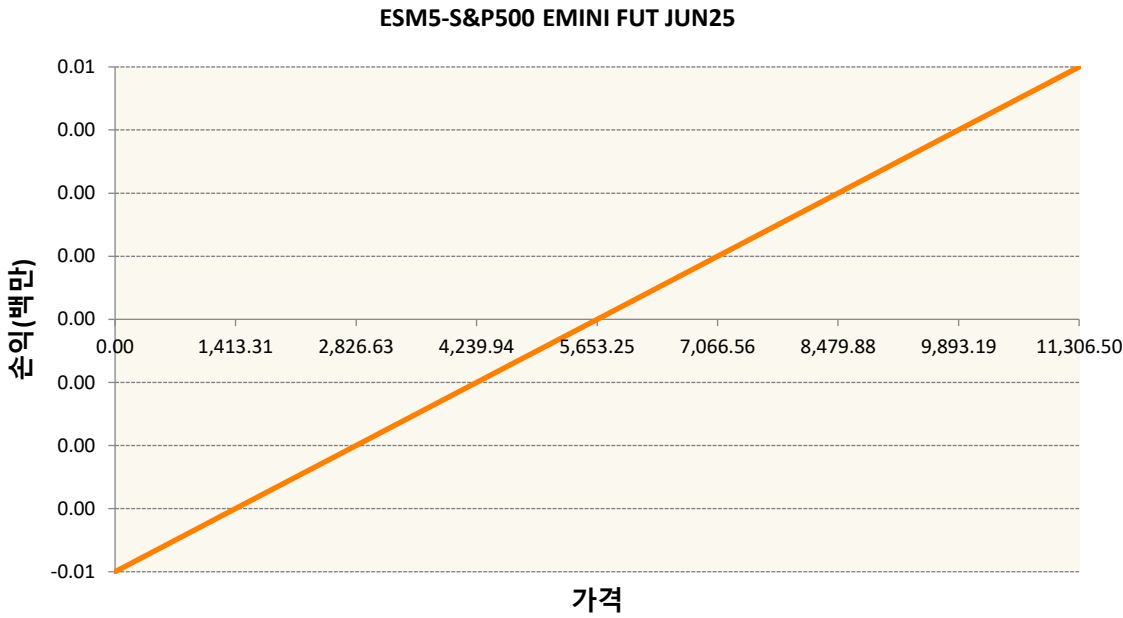
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	413	0	413	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5 S&P500 EMINI FUT JUN25

33

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

(단위:백만원)

23

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

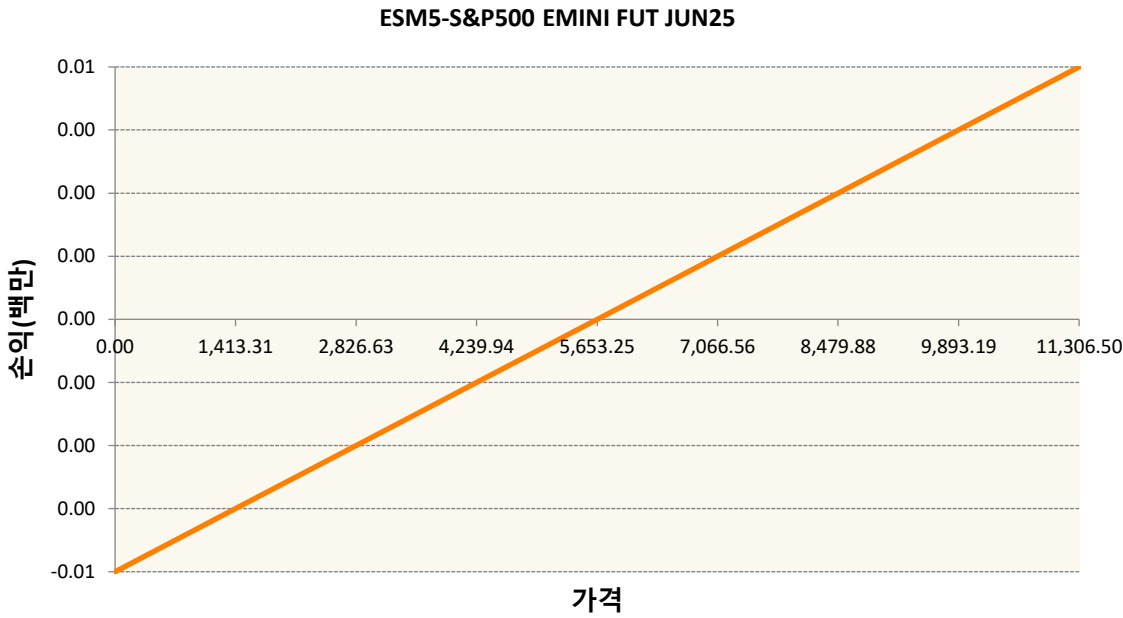
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,480	0	2,480	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	198
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

137

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

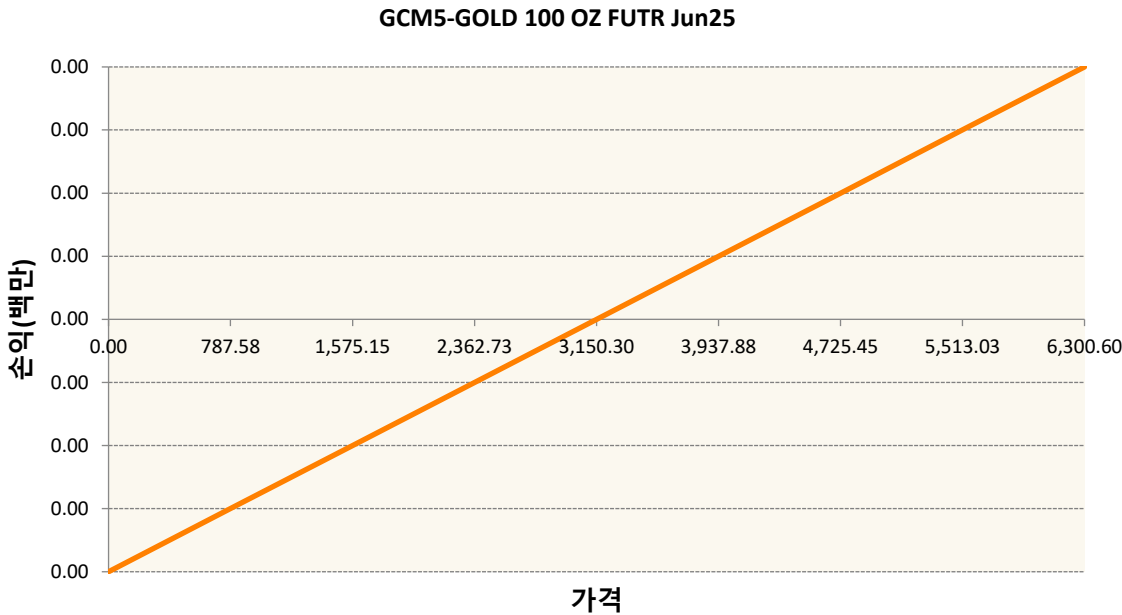
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,314	0	2,314	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 04/04/25 C283 EQUITY	0.1
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	185

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

(단위:백만원)

134

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

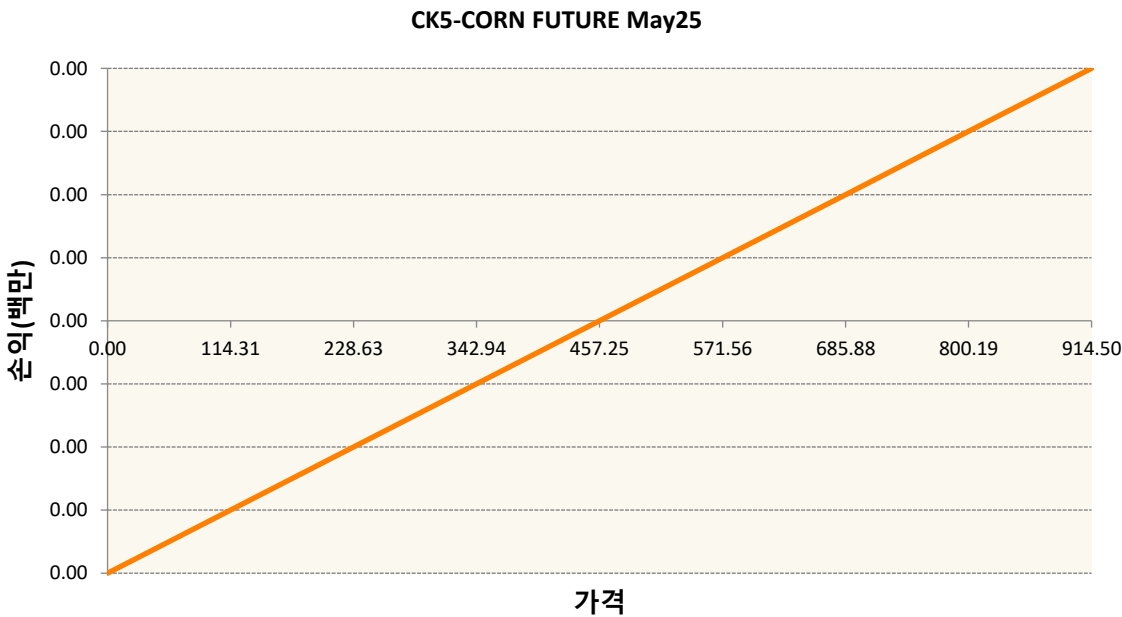
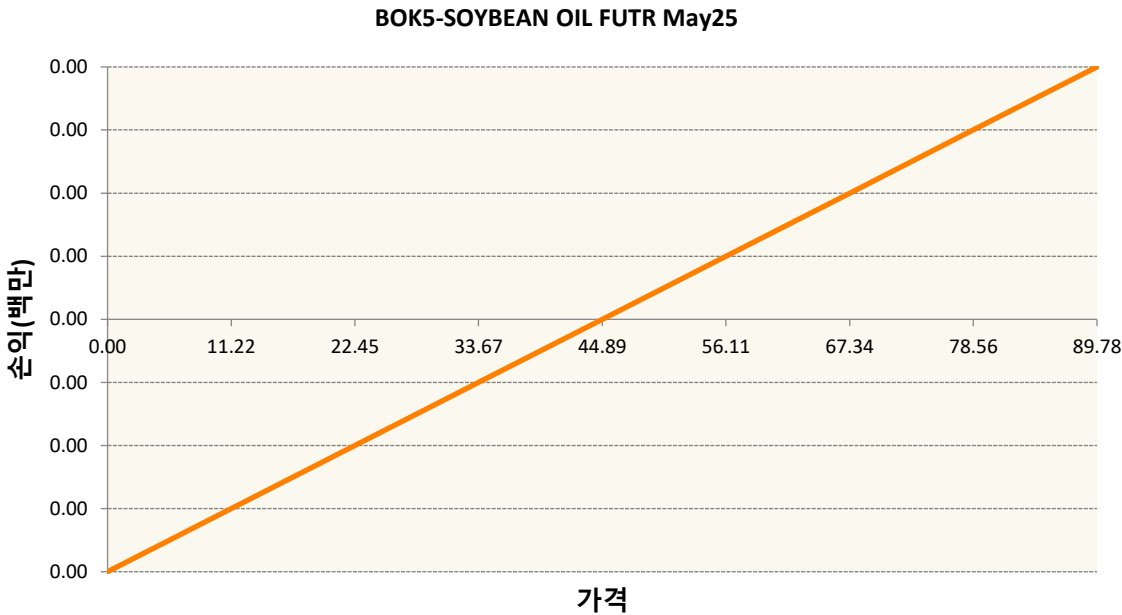
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

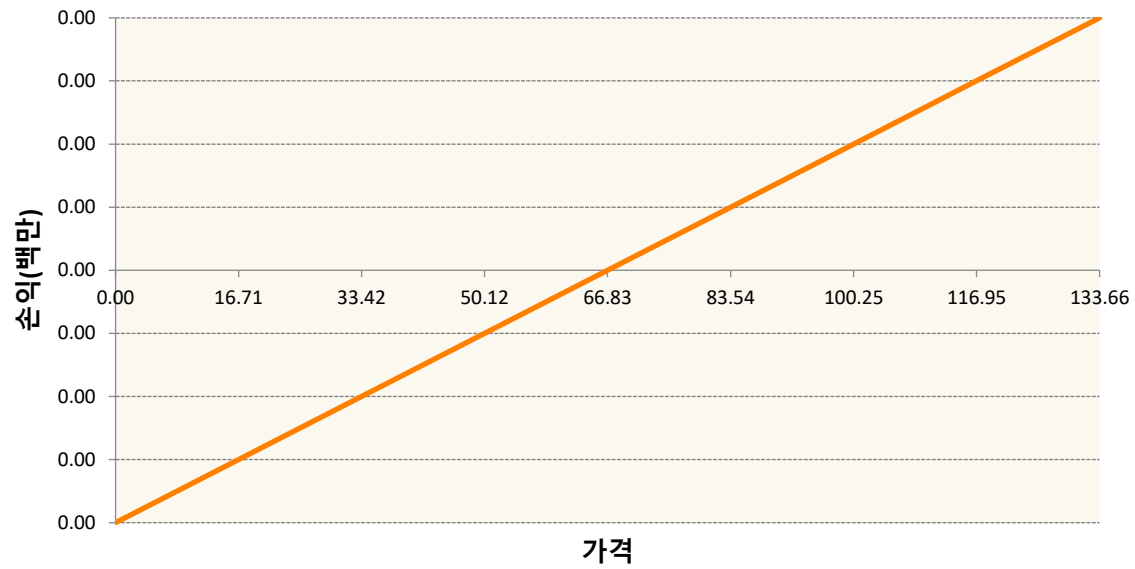
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,708	0	3,708	
누계	통화	선물	0	382	-382	장내

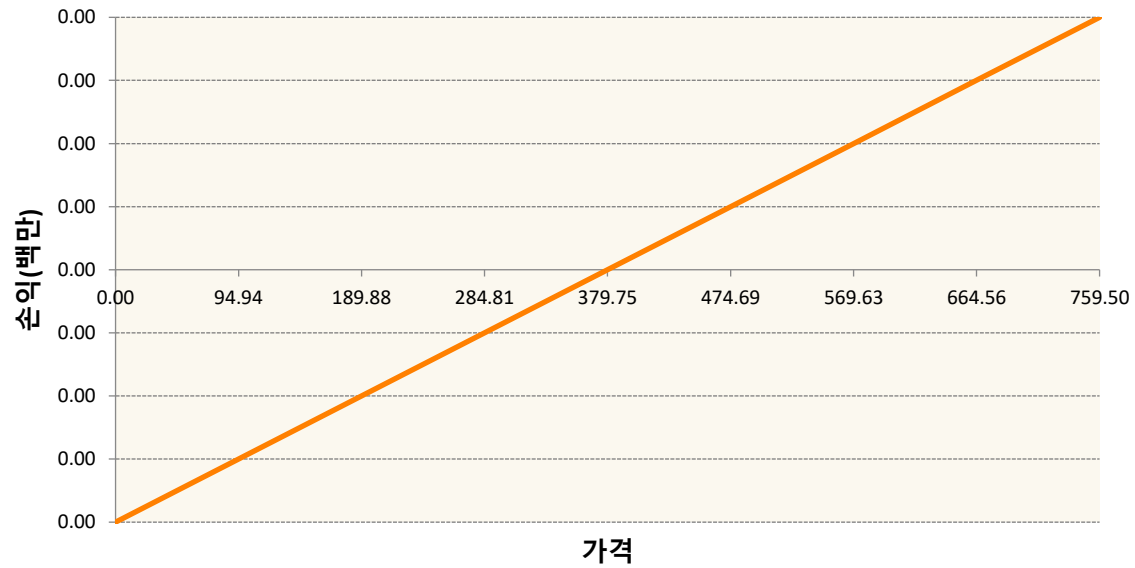
2. 만기시점의 손익구조



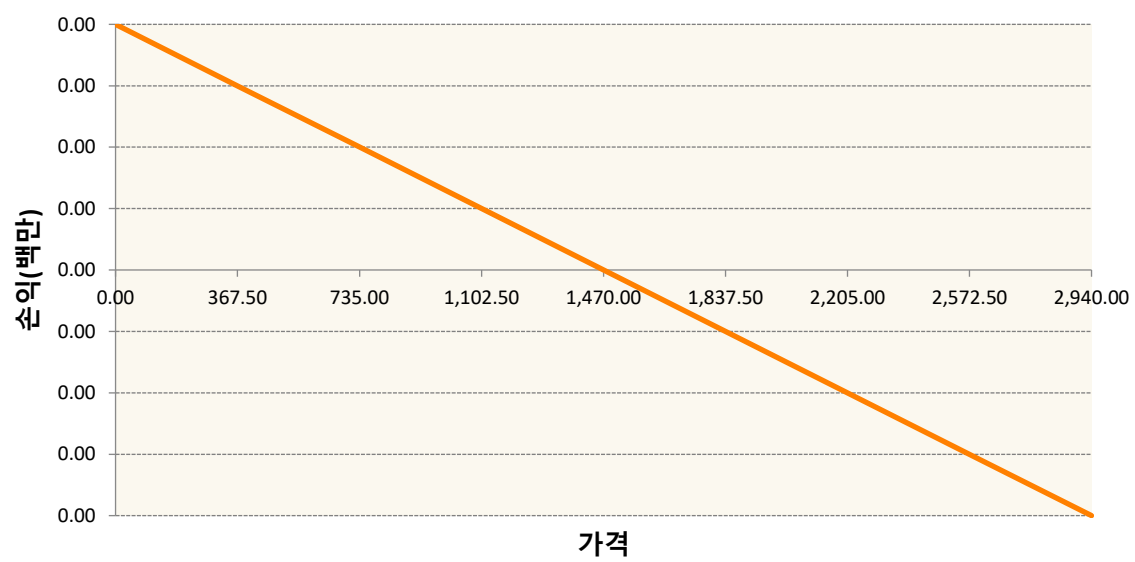
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



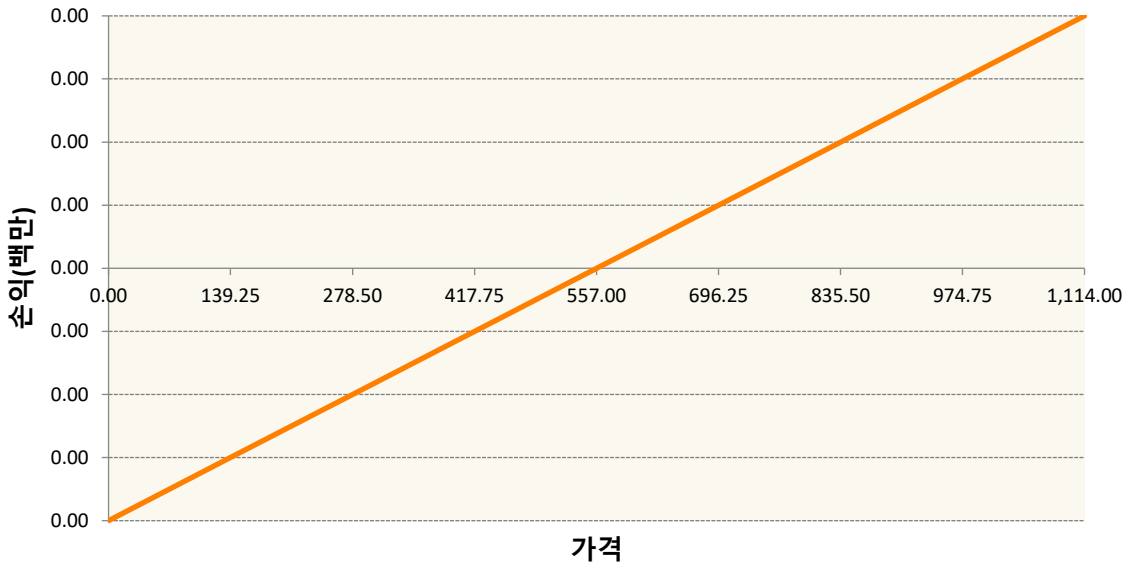
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



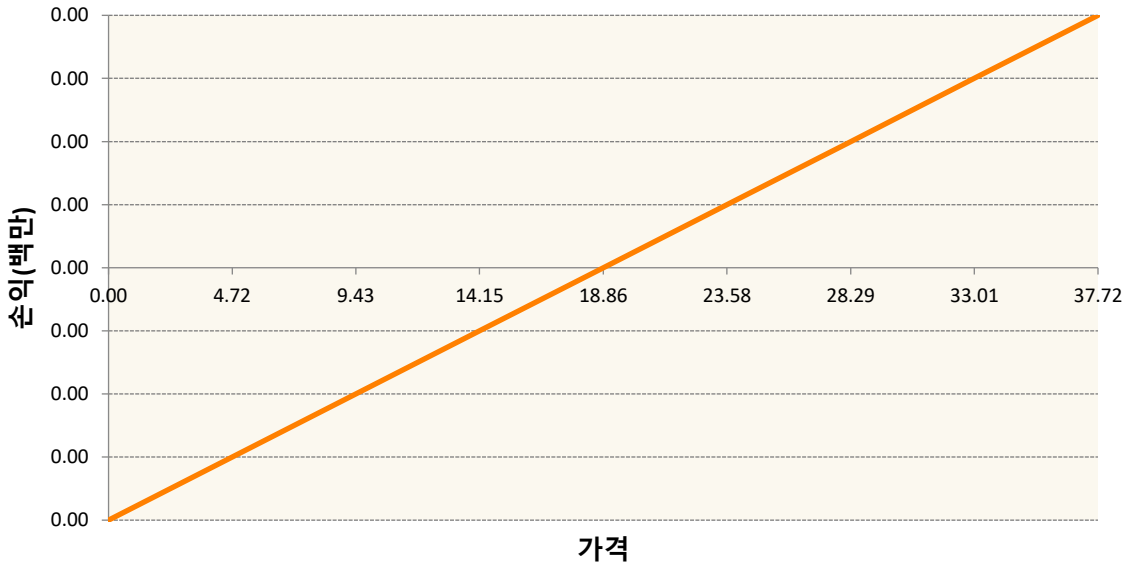
KR4175W40006-2025-04 달러선물



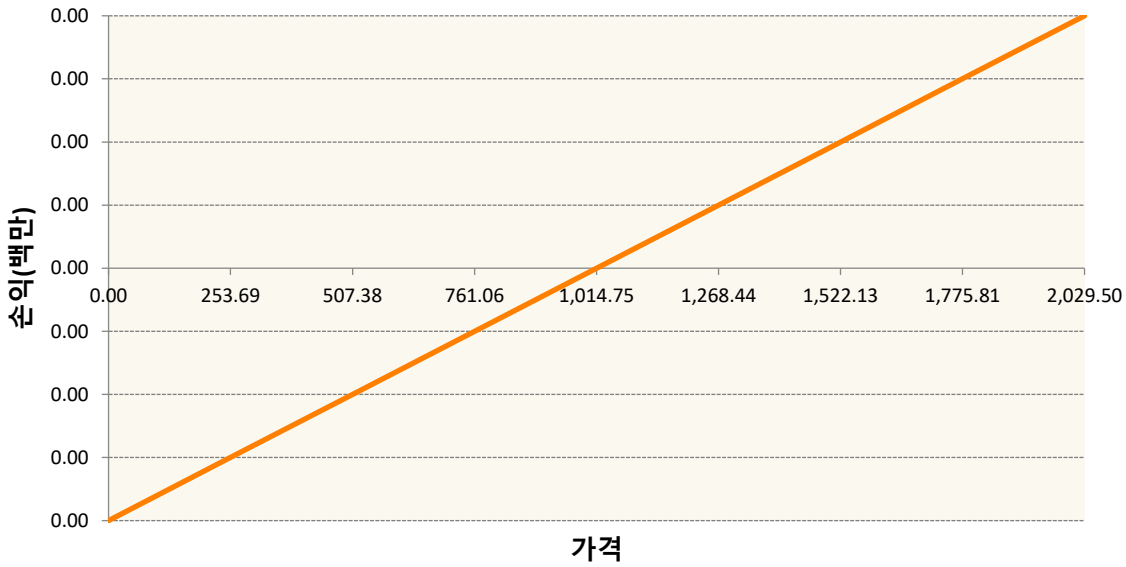
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



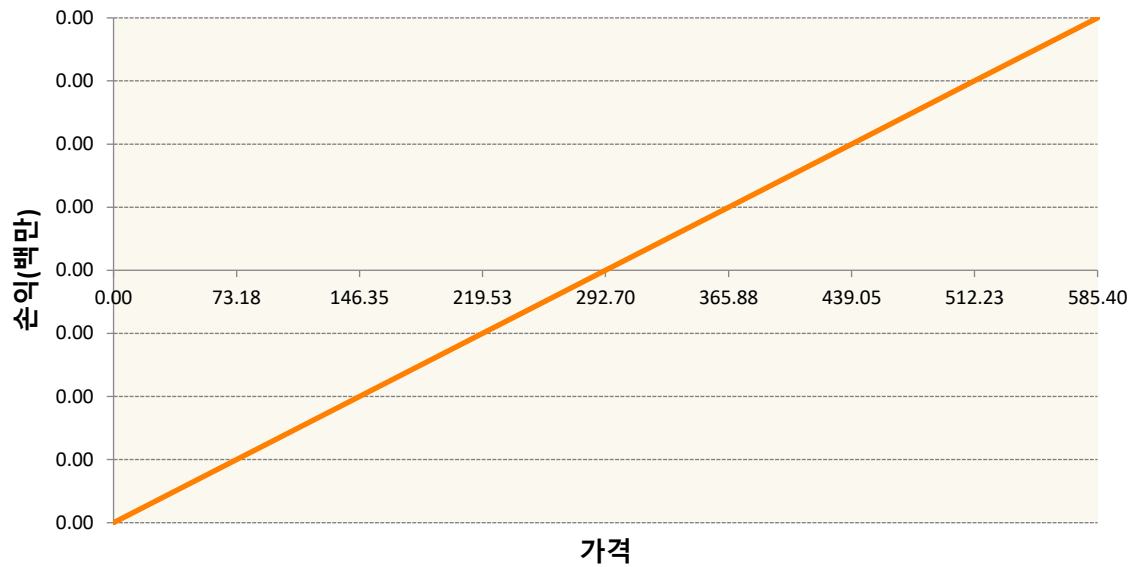
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



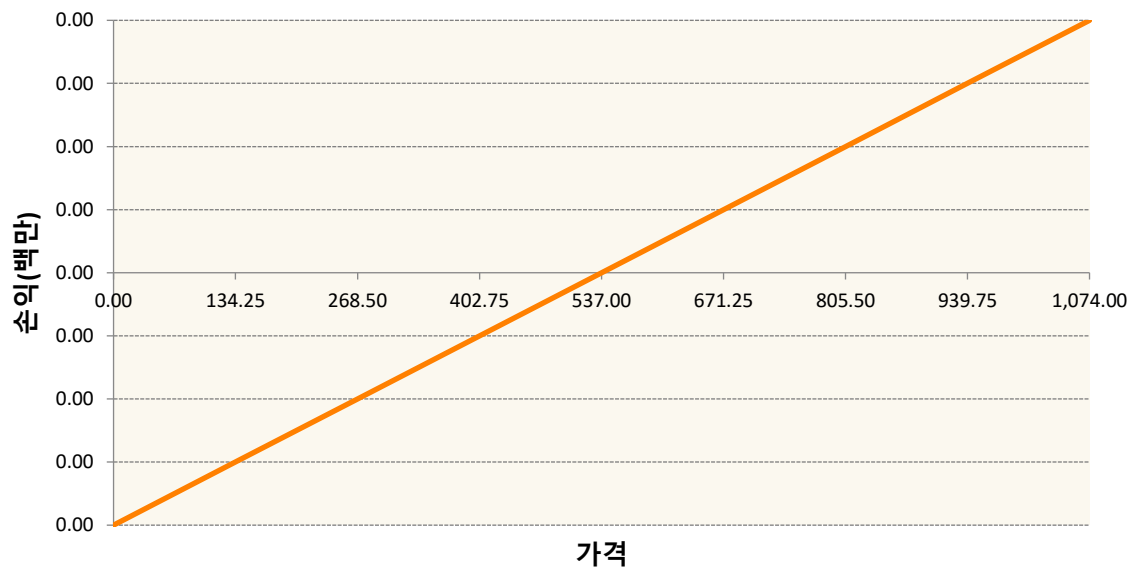
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



SMK5-SOYBEAN MEAL FUTR May 25



WK5-WHEAT FUTURE(CBT) May25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

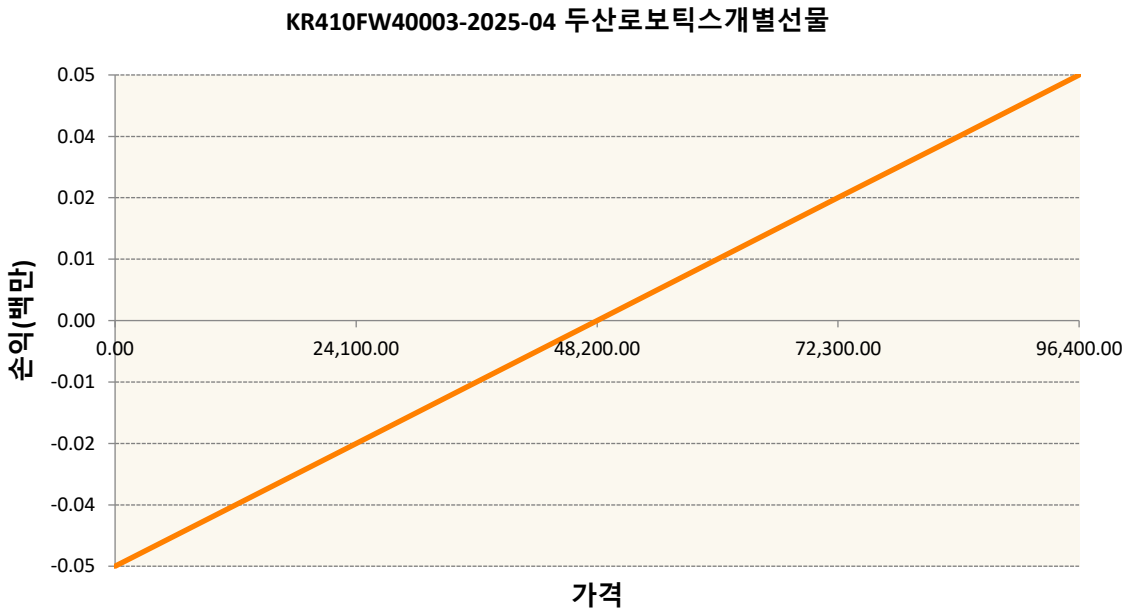
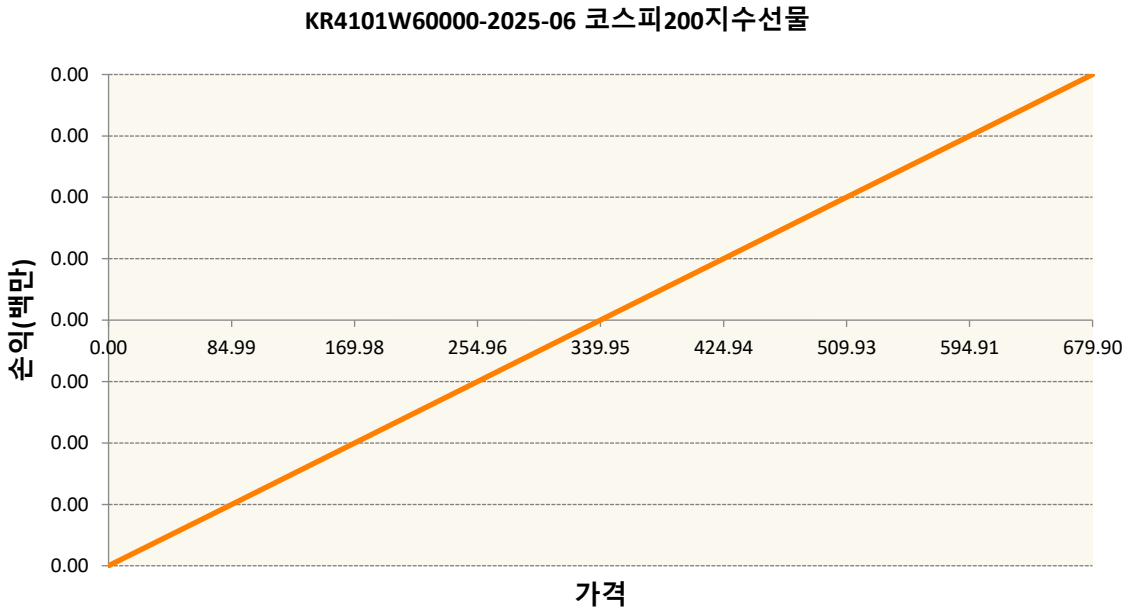
스마트인덱스모

1. 계약금액

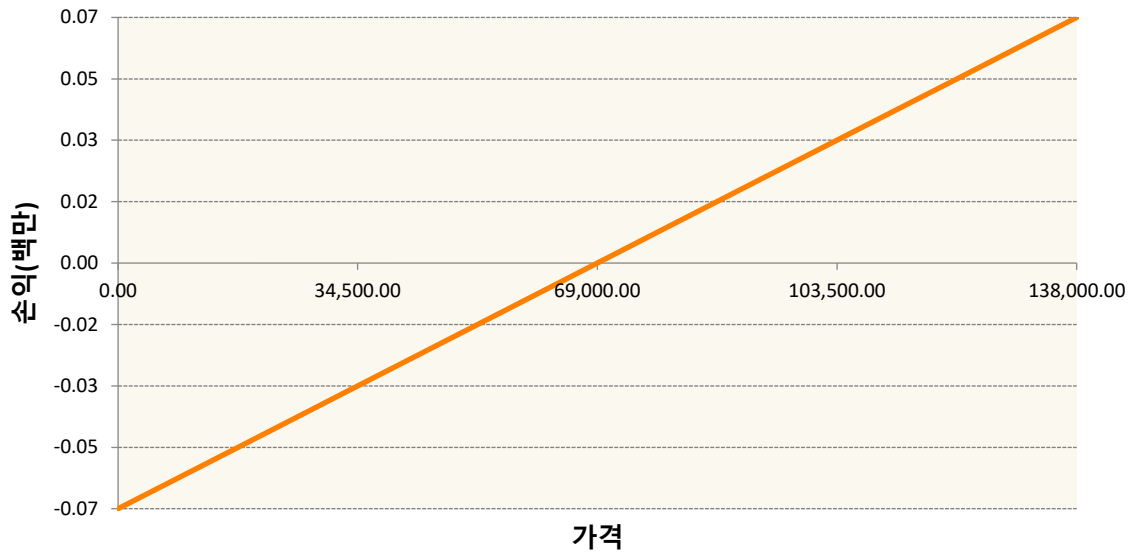
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	85	0	85	장내
누계	유가증권	선물	2,274	0	2,274	장내

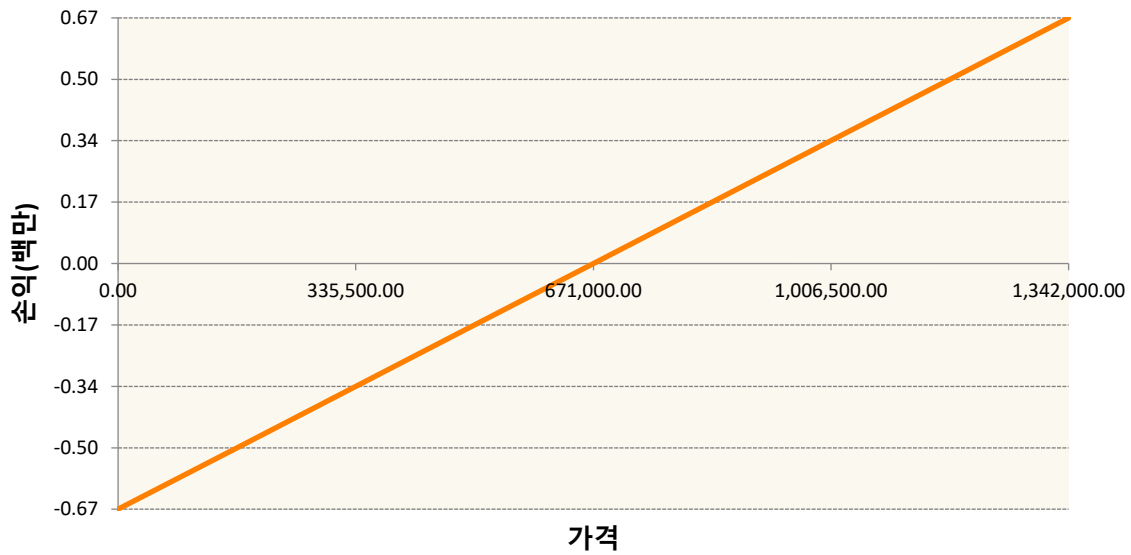
2. 만기시점의 손익구조



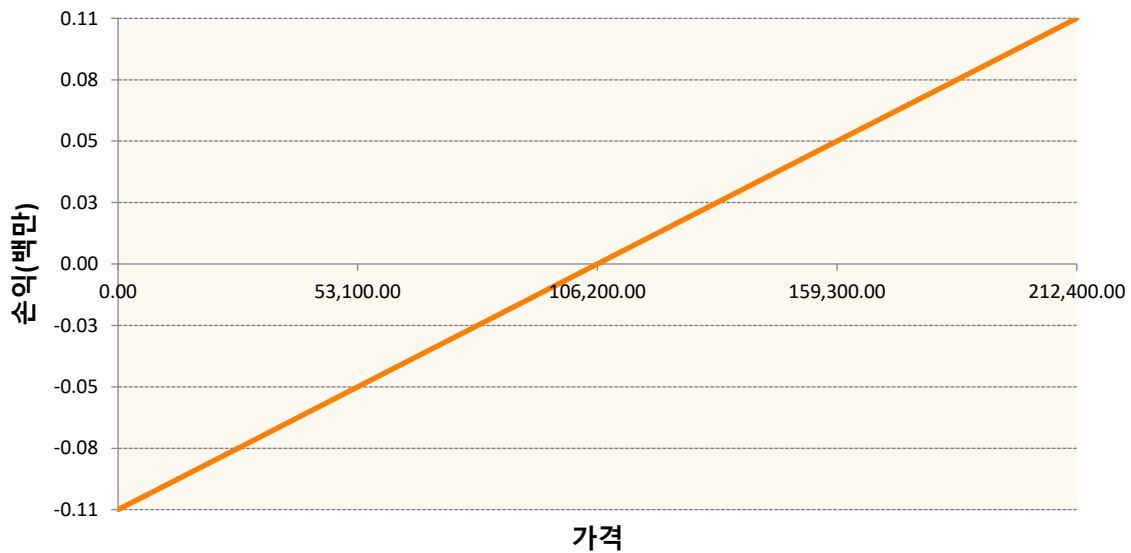
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



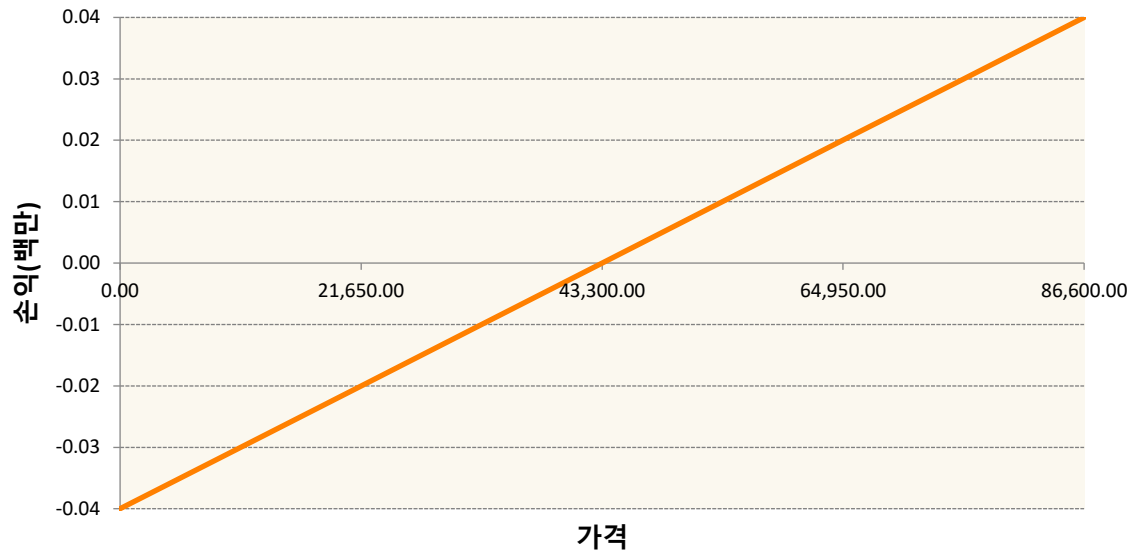
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



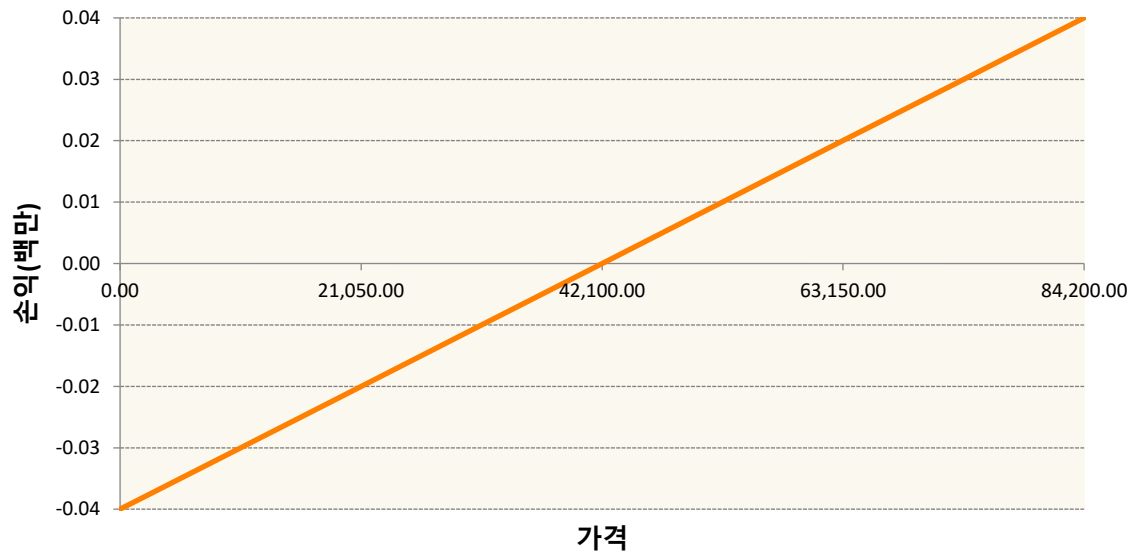
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



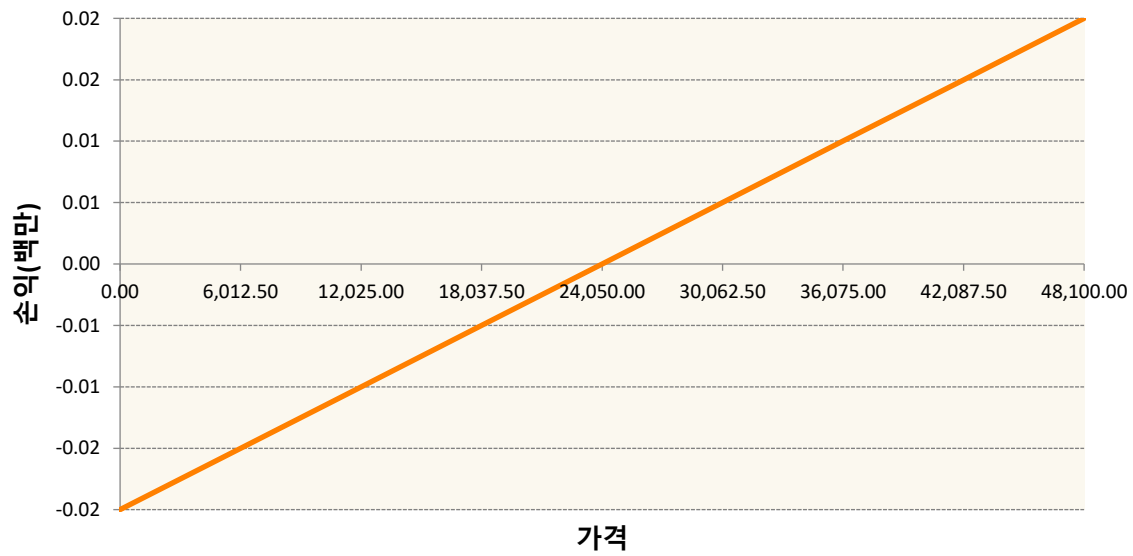
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



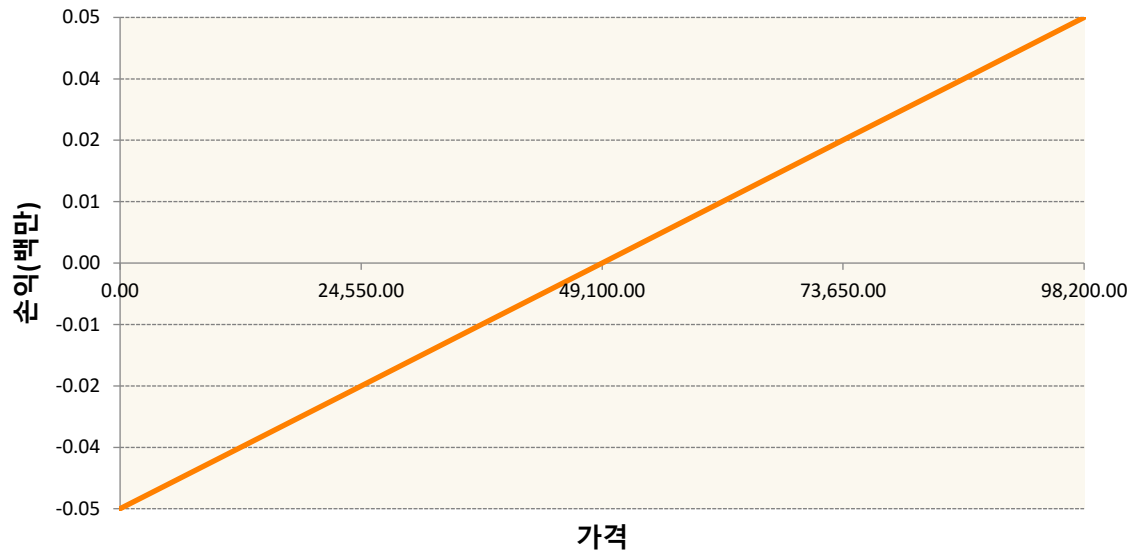
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



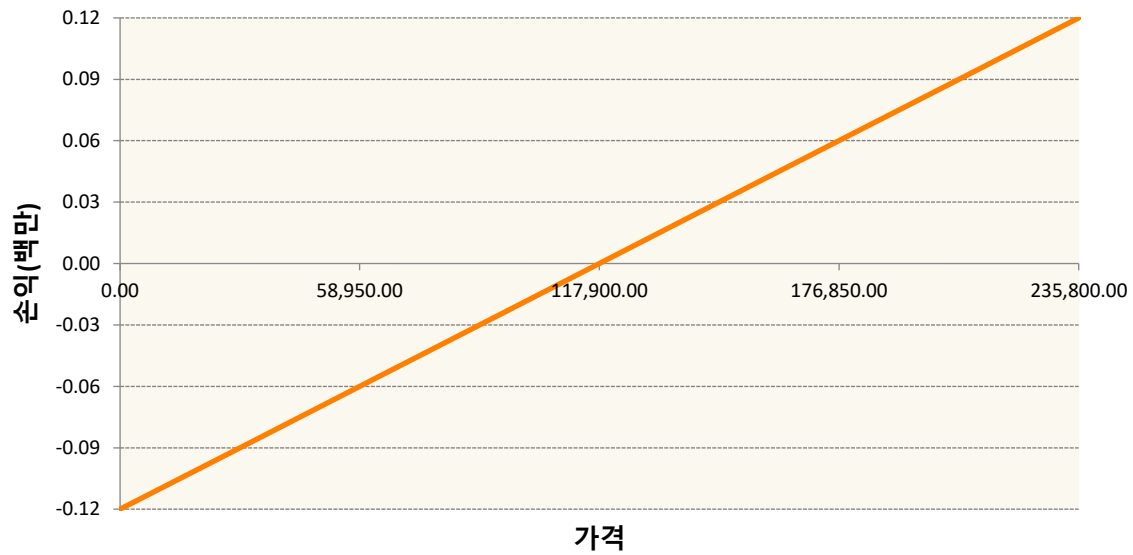
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



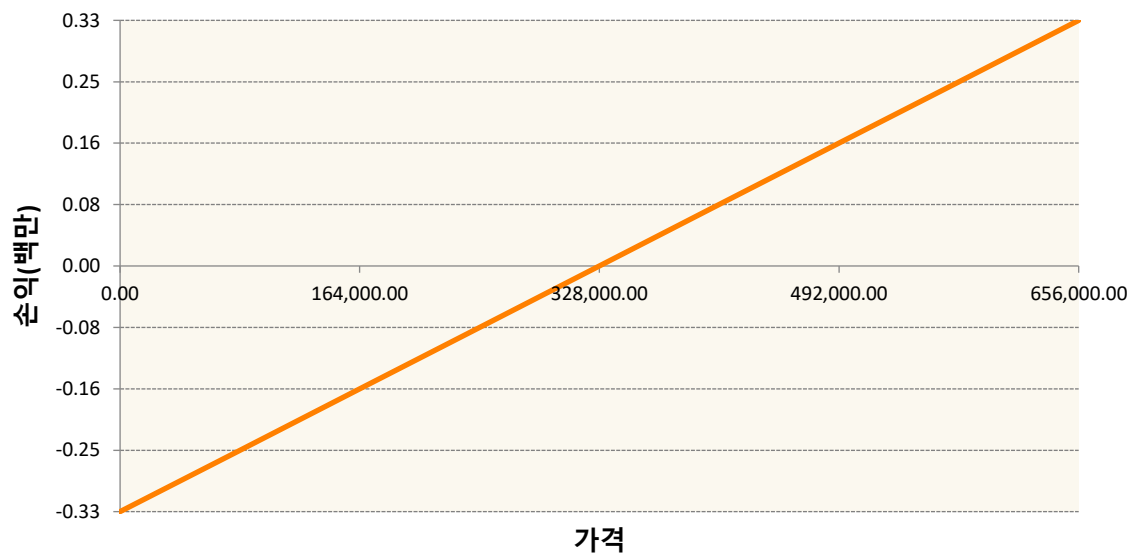
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



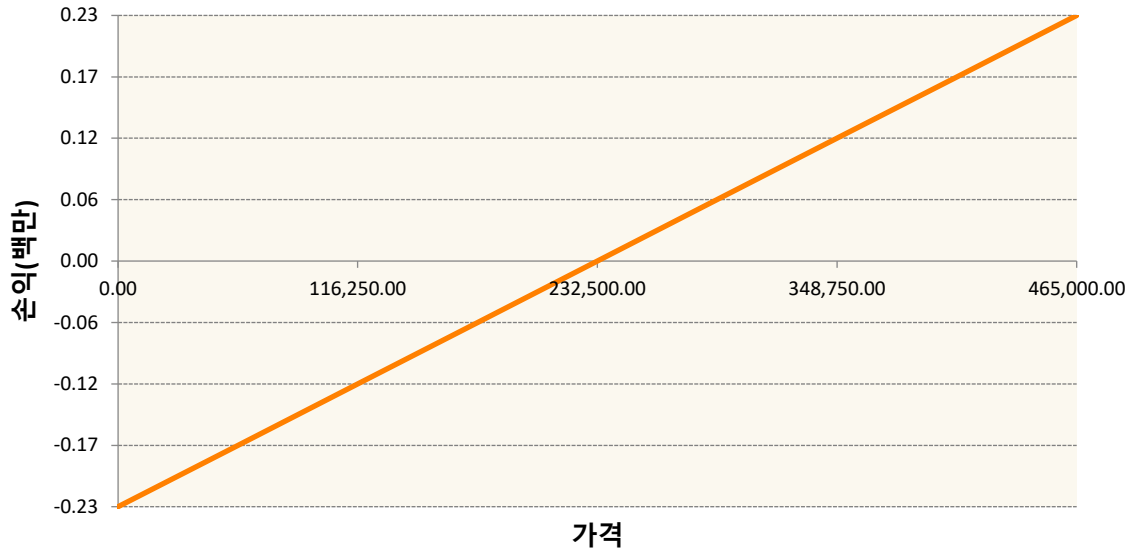
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



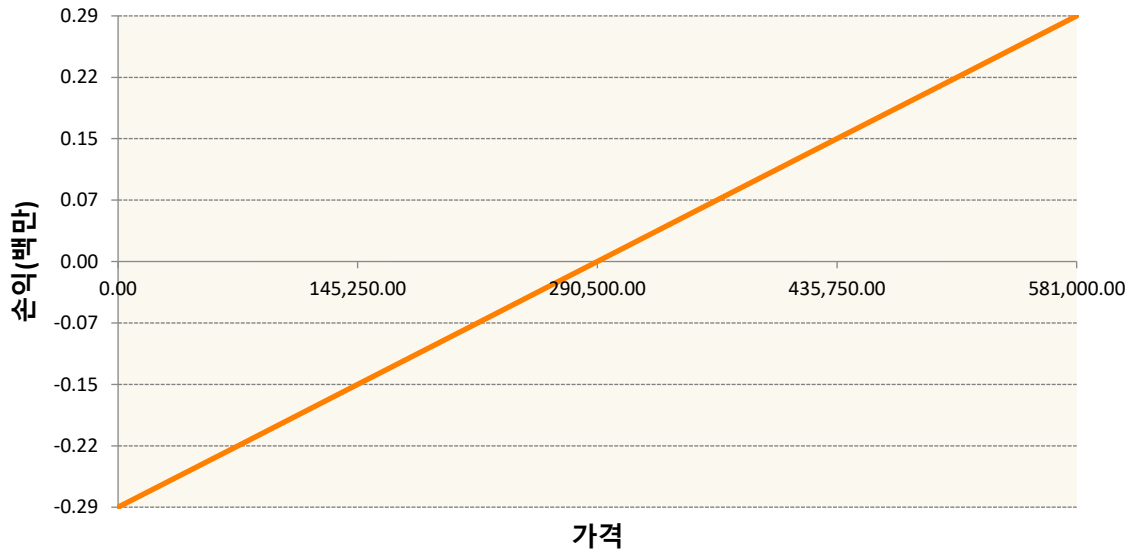
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



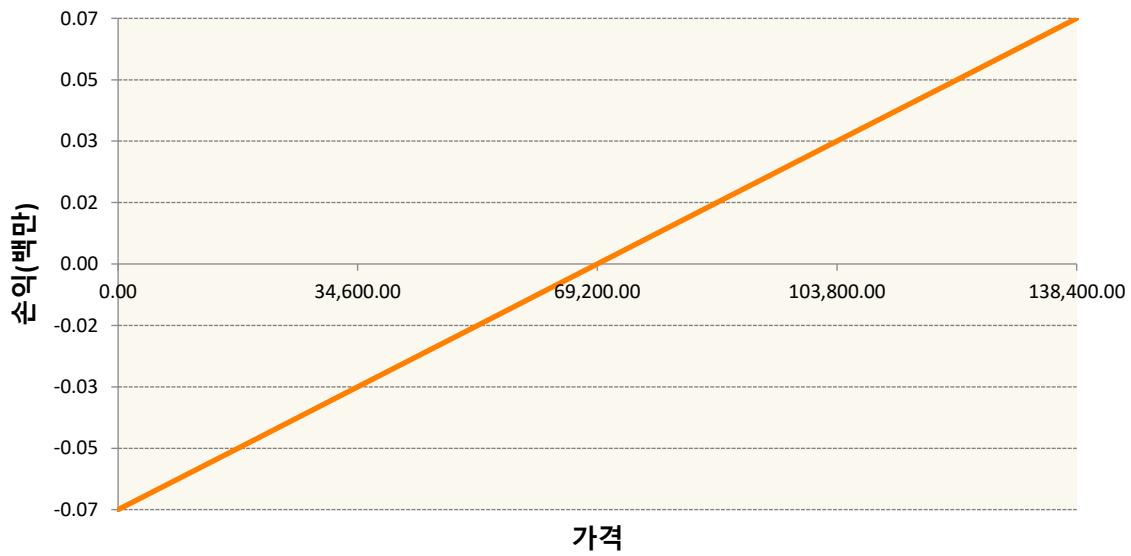
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



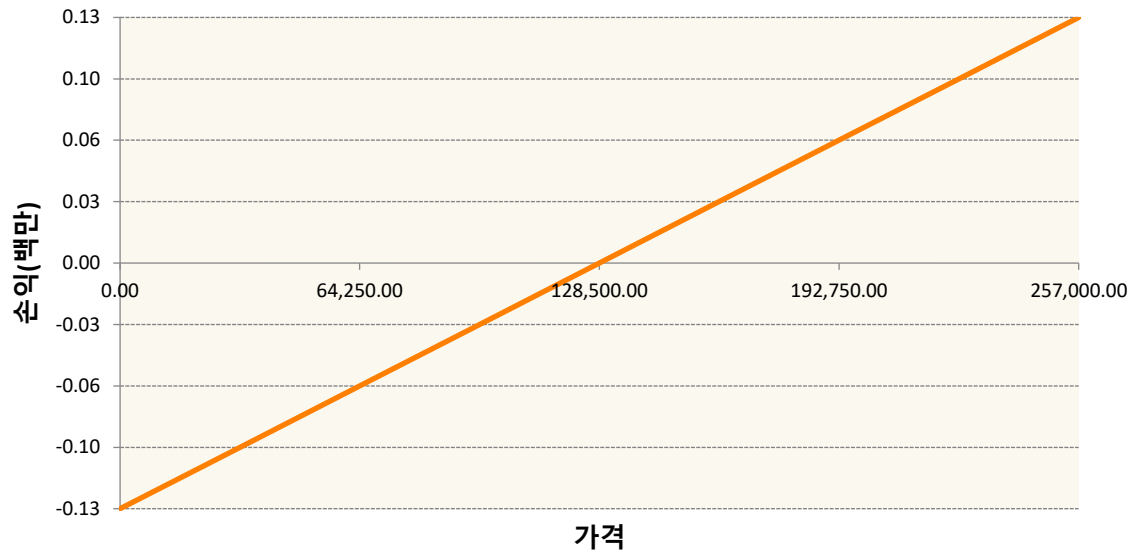
KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



KR41HEW40009-2025-04 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	88
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	3
KR41BHW40 2025-04 한화에어로스페이스개별선물	25
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	4
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물	1
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물	16
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	1
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	1
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물	14
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물	6
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	8
KR41FVW40(2025-04 한화오션개별선물	7
KR41HEW40(2025-04 키움증권개별선물	2

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

(단위:백만원)

383

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

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	3,904	0	3,904	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래250320

297

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

458

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

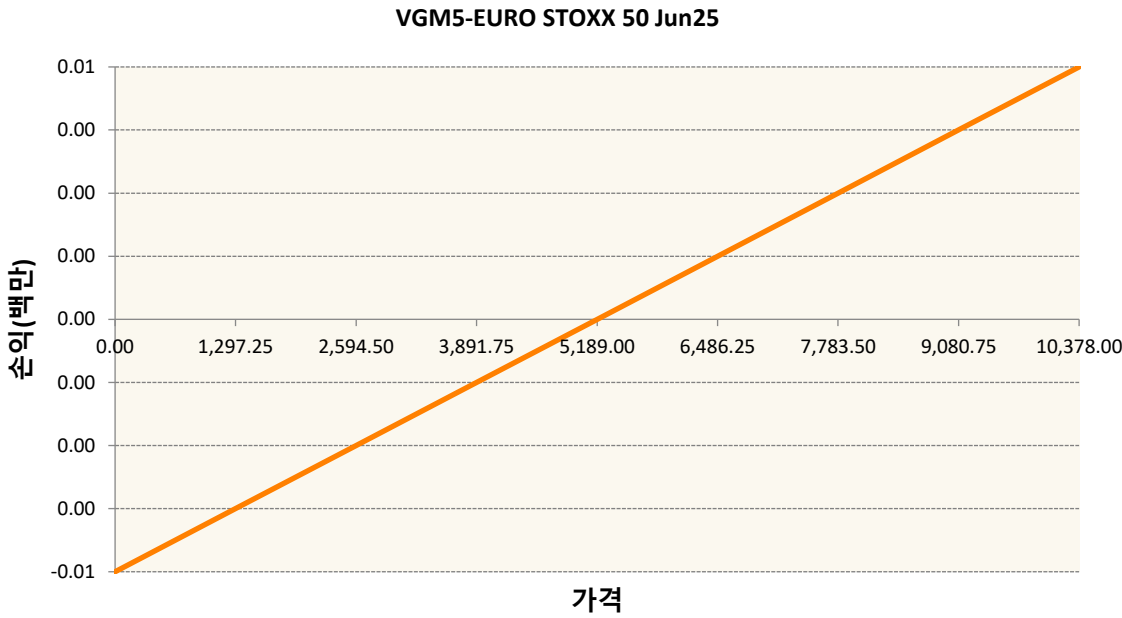
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	907	0	907	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

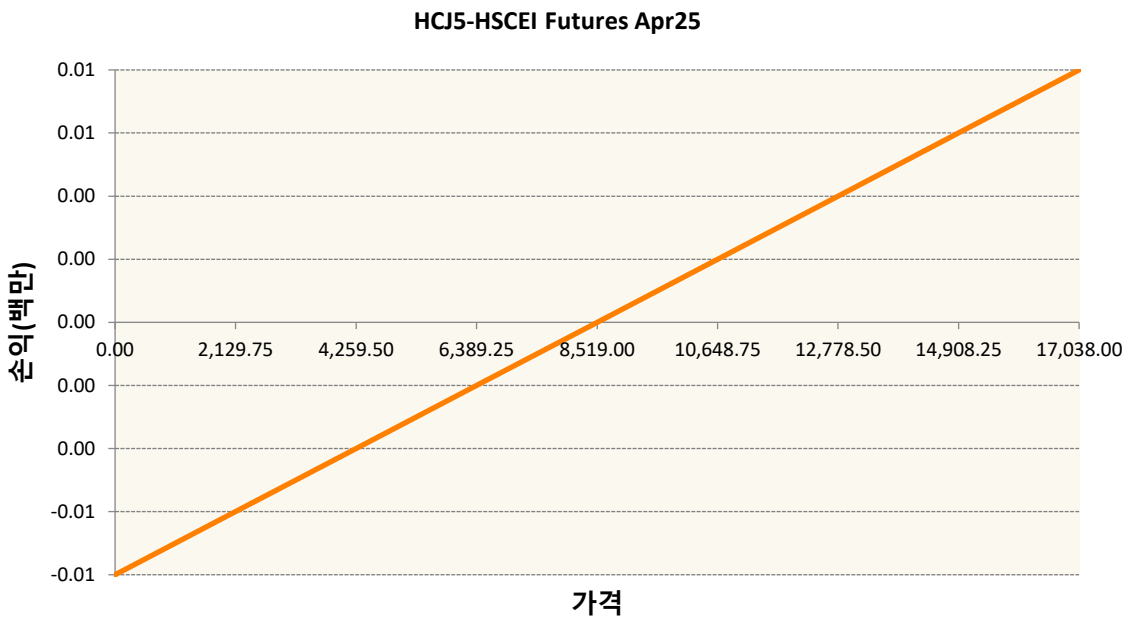
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	3,131	0	3,131	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI5	HSCEI Futures Apr25	250
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

346

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

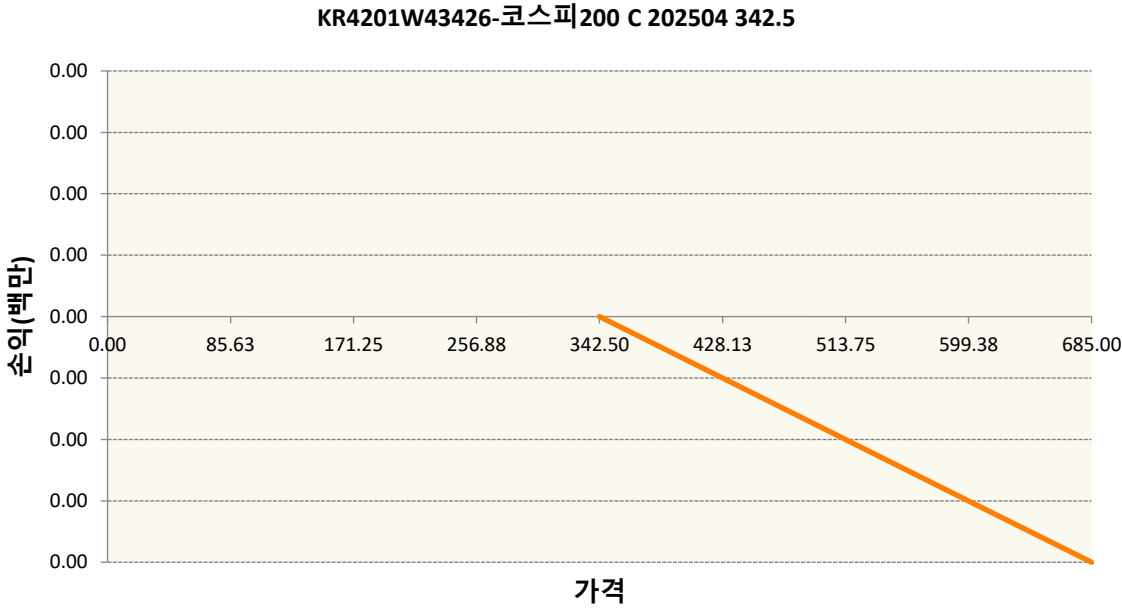
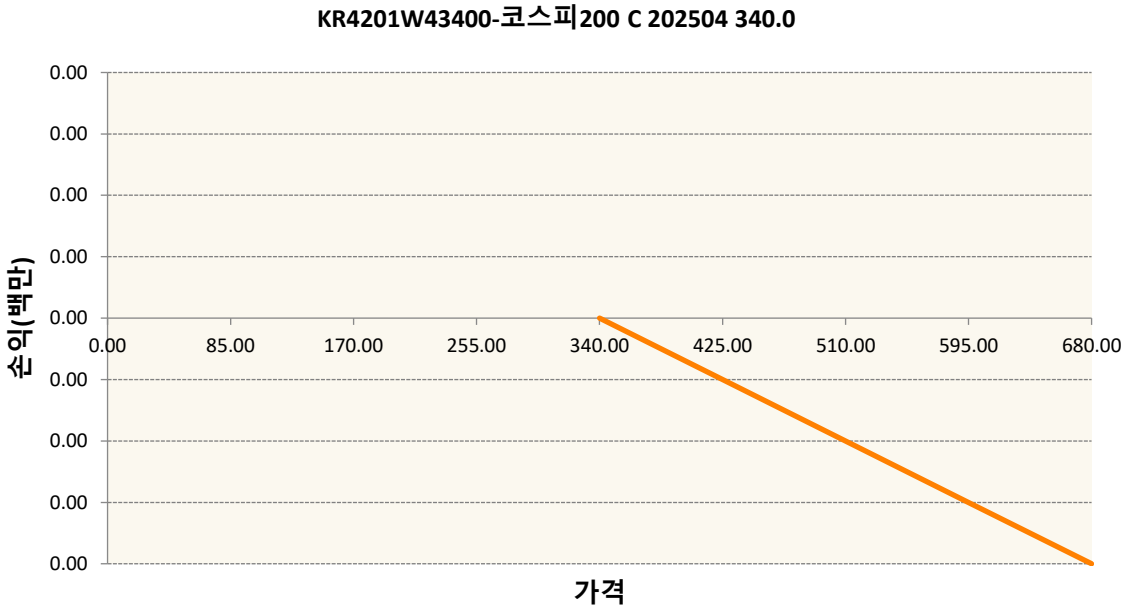
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	174	-174	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,129	-37,129	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph displays a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 680.00 with major ticks every 85.00 units. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A single orange line starts at the origin (0, 0) and ends at (340, 0), indicating that profit is zero for all prices in this range.

가격	이익(백만)
0.00	0.00
340.00	0.00

The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 685.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 100.00. A blue line represents the profit function, starting at (0,0) and ending at (342.50, 100.00). The line is linear, indicating a constant profit margin.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
85.63	25.00
171.25	50.00
256.88	75.00
342.50	100.00

(단위:백만원)

KR4201W43400						코스피200 C 202504 340.0		822
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	163	163	162	161	160	158	156	
-5.33%	161	159	156	152	147	141	134	
-2.67%	140	131	121	110	99	87	75	
0%	48	32	16	0	-16	-32	-48	
2.67%	-164	-176	-190	-203	-218	-232	-247	
5.33%	-467	-472	-478	-485	-493	-502	-512	
8.00%	-805	-806	-808	-810	-813	-817	-822	
KR4201W43426						코스피200 C 202504 342.5		1,014
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	164	163	163	163	162	160	158
-5.33%	162	161	158	154	150	144	137
-2.67%	146	138	127	116	103	89	75
0%	60	40	20	0	-20	-41	-61
2.67%	-174	-193	-213	-233	-253	-274	-295
5.33%	-547	-556	-566	-579	-592	-606	-621
8.00%	-983	-985	-989	-993	-999	-1,006	-1,014

KR4301W43408

코스피200 P 202504 340.0

200

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-198	-198	-198	-198	-199	-199	-200
-5.33%	-120	-120	-121	-122	-123	-125	-126
-2.67%	-46	-48	-51	-53	-56	-59	-62
0%	11	8	4	0	-4	-8	-11
2.67%	42	39	36	33	29	26	22
5.33%	52	51	49	47	45	43	41
8.00%	54	54	53	53	52	51	49

KR4301W43424

코스피200 P 202504 342.5

273

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-272	-272	-272	-272	-272	-273	-273
-5.33%	-168	-169	-170	-171	-172	-173	-175
-2.67%	-69	-71	-74	-76	-80	-83	-86
0%	14	9	5	0	-5	-10	-15
2.67%	64	60	55	50	45	41	36
5.33%	83	81	79	76	72	69	65
8.00%	88	87	86	85	84	82	80

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

(단위:백만원)

2,463

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	556	0	556	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	4,477	0	4,477	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	13,008	0	13,008	
누계	통화	선도	0	12,732	-12,732	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E	214
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E	218
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E	353
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E	233
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

438

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

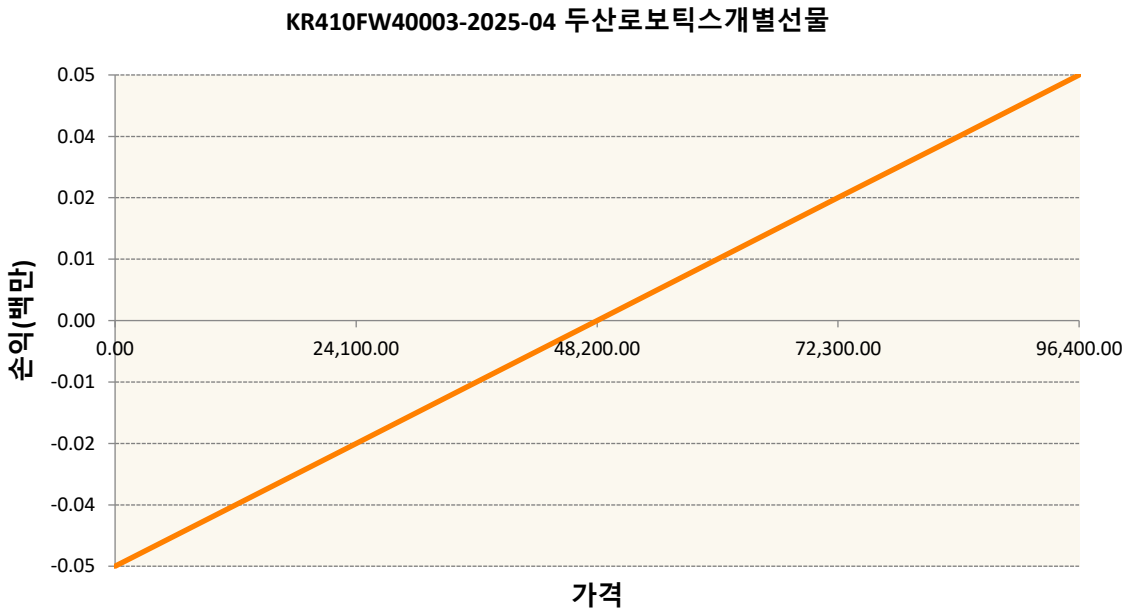
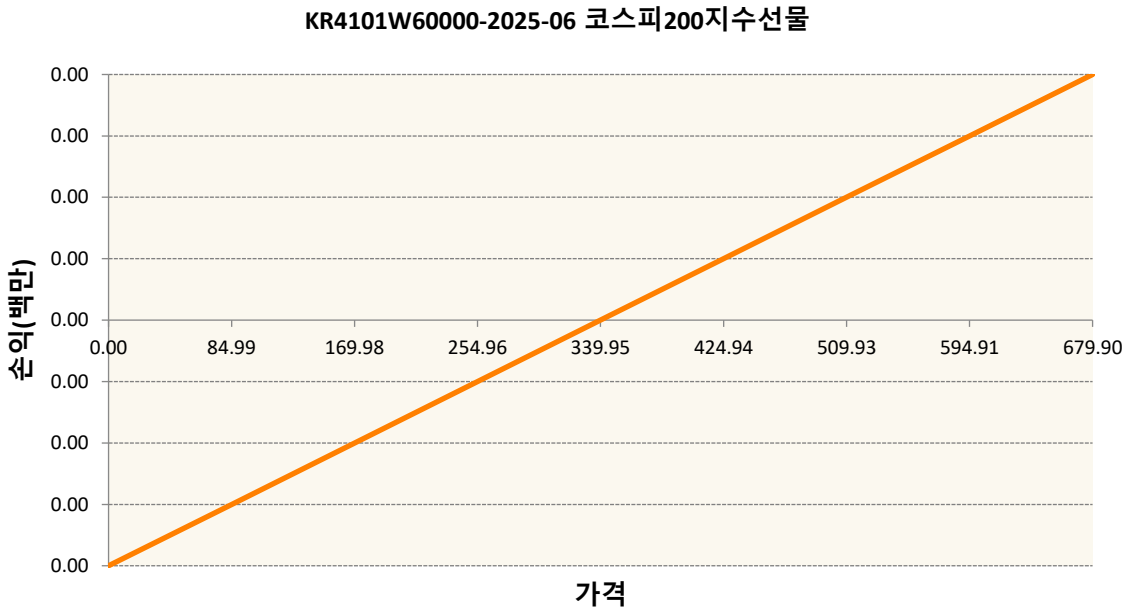
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

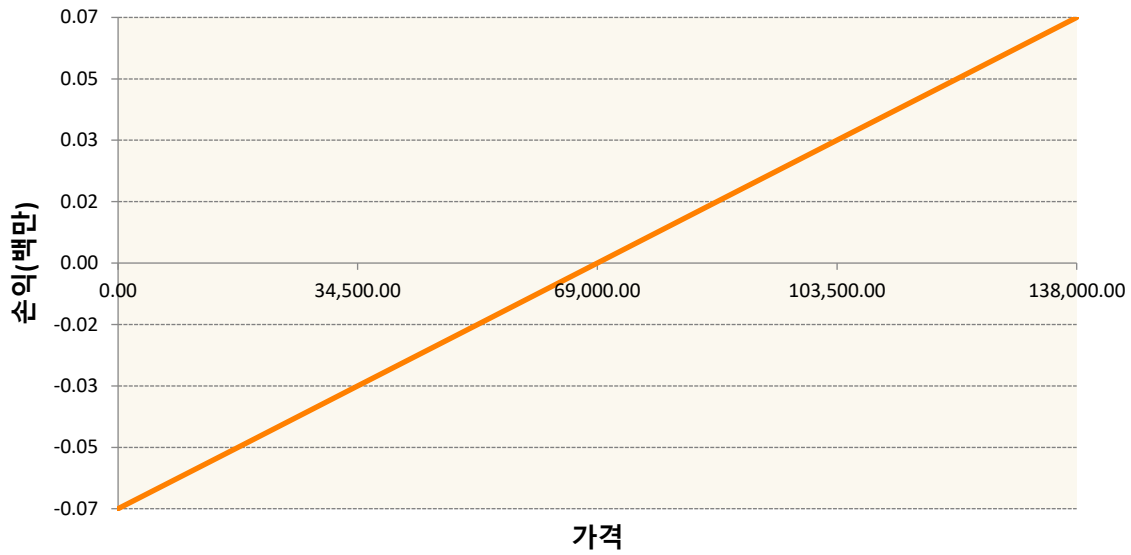
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,210	0	1,210	장내

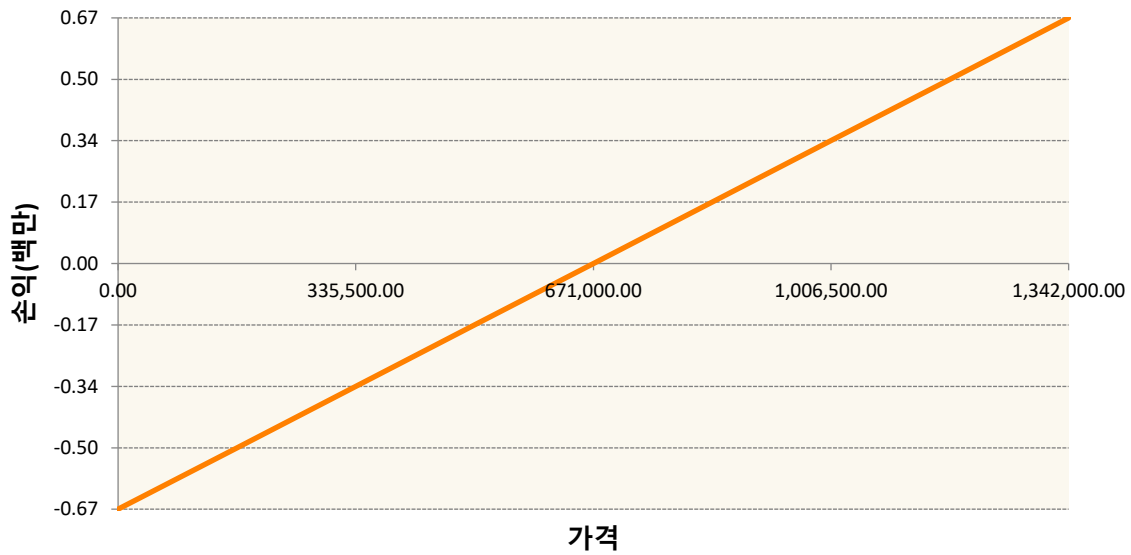
2. 만기시점의 손익구조



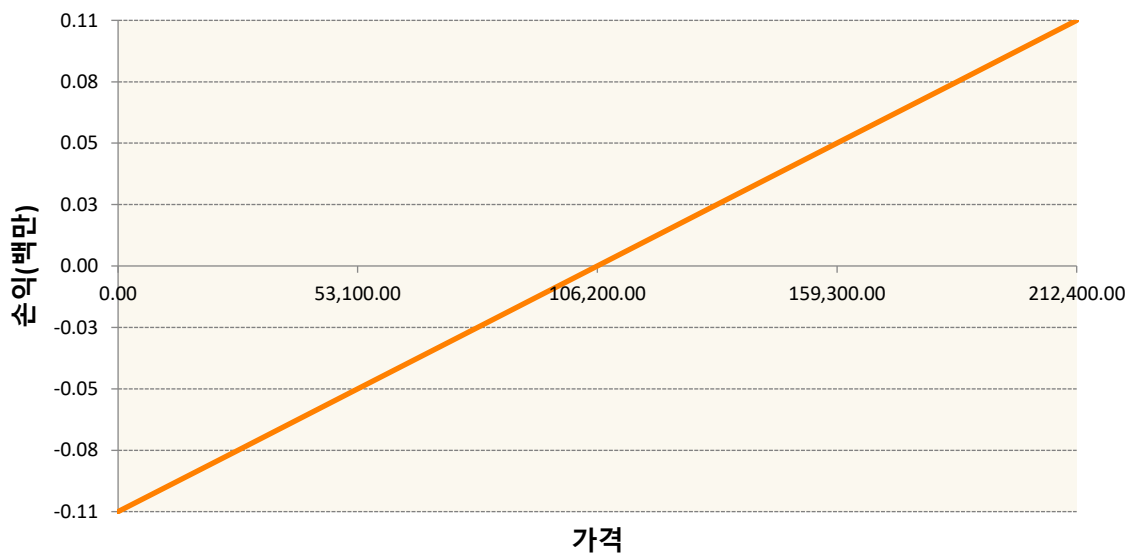
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



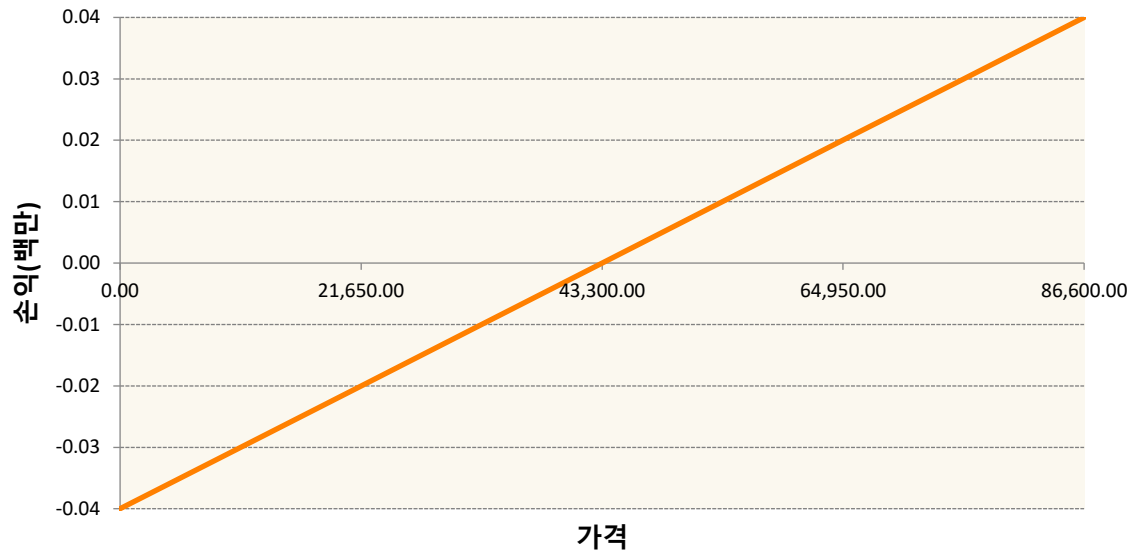
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



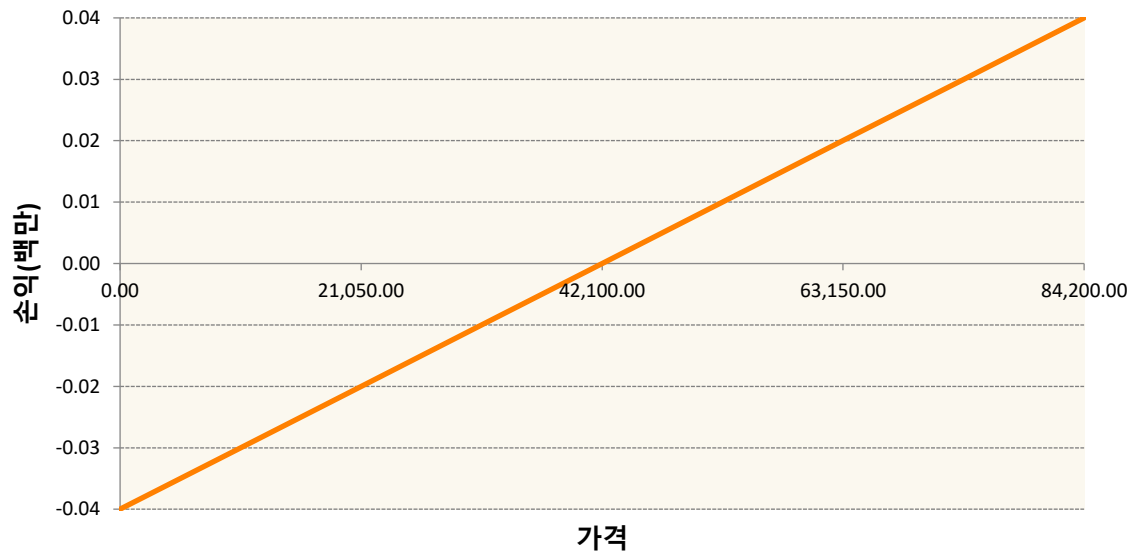
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



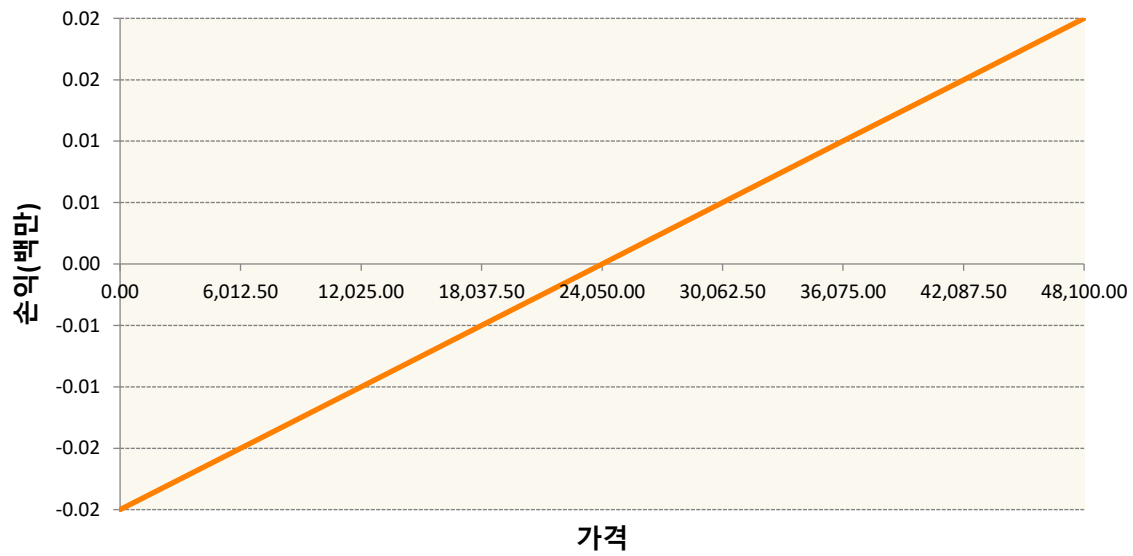
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



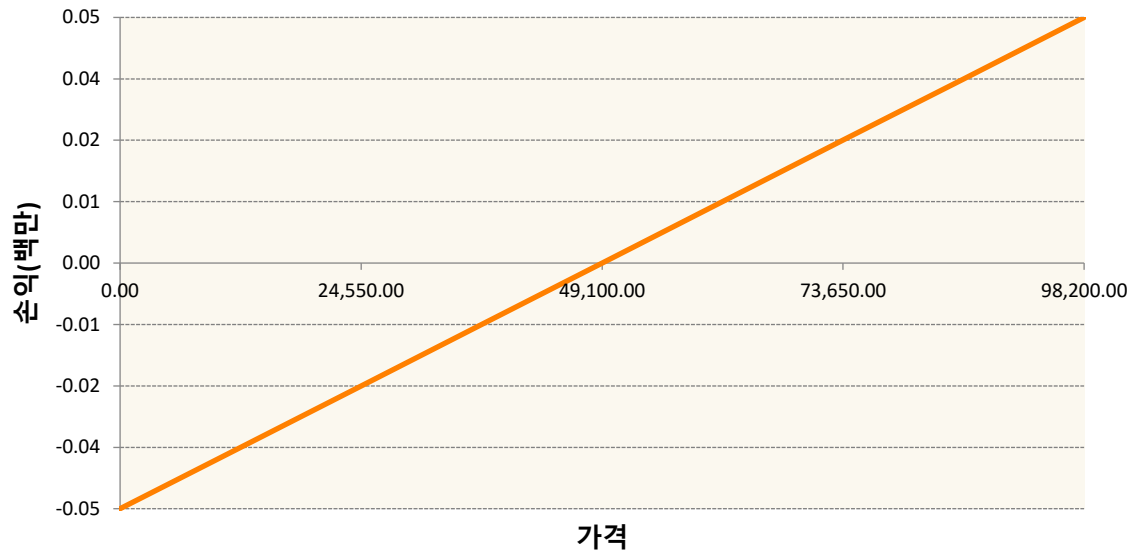
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



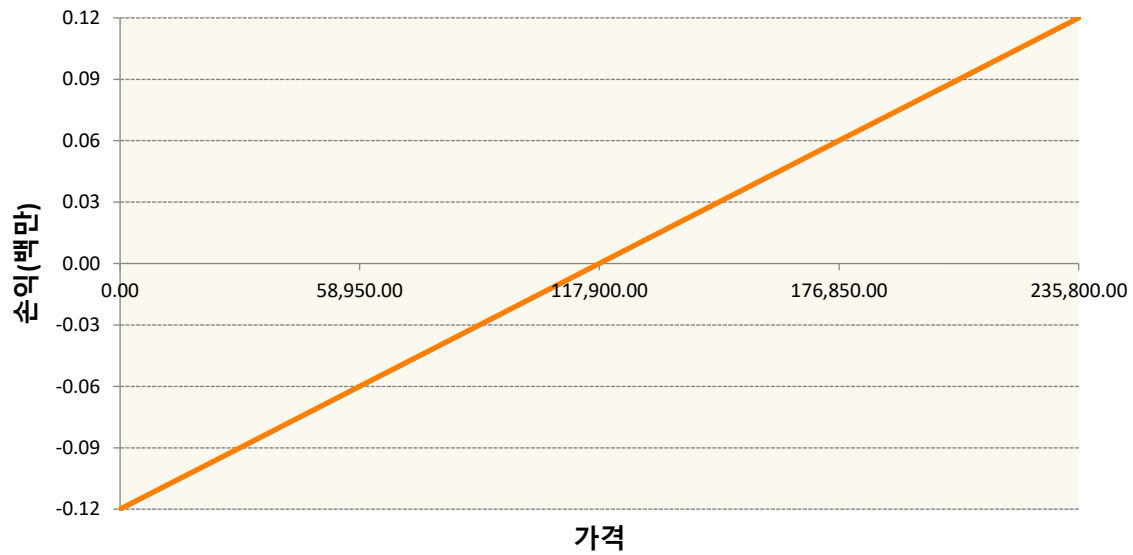
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



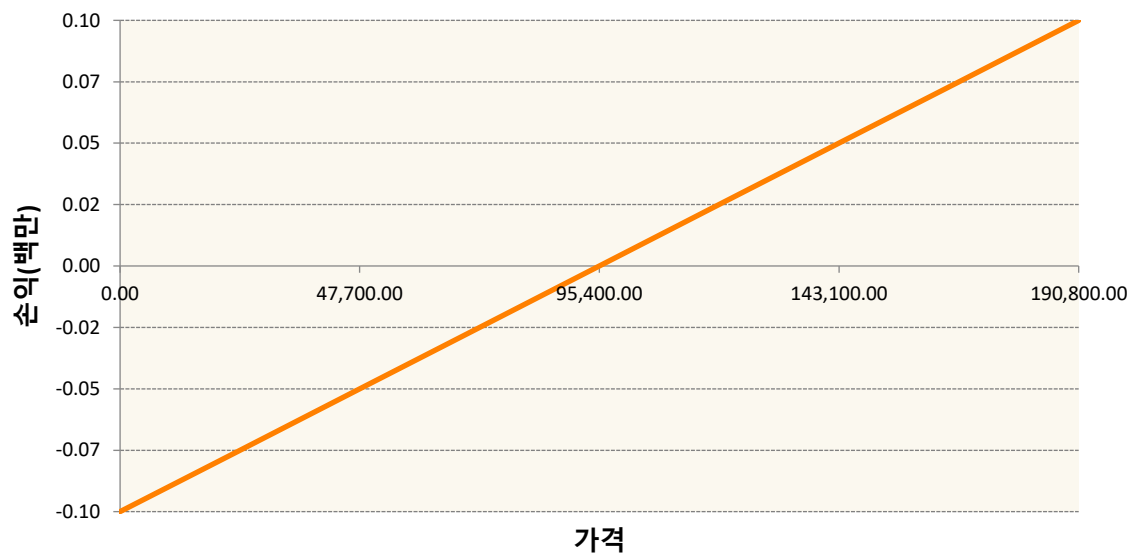
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



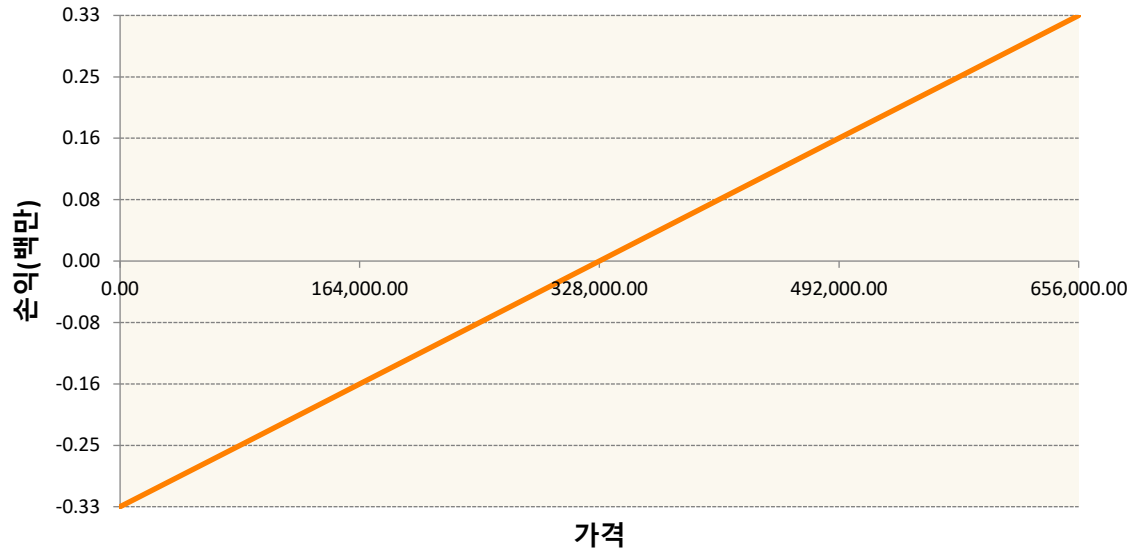
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



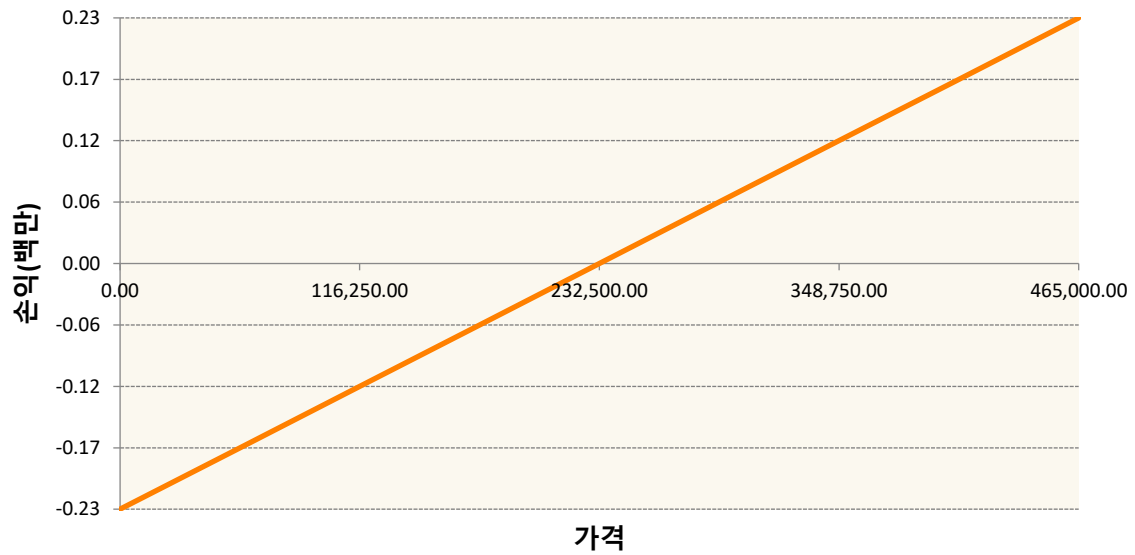
KR41EYW40004-2025-04 에코프로비엠개별선물



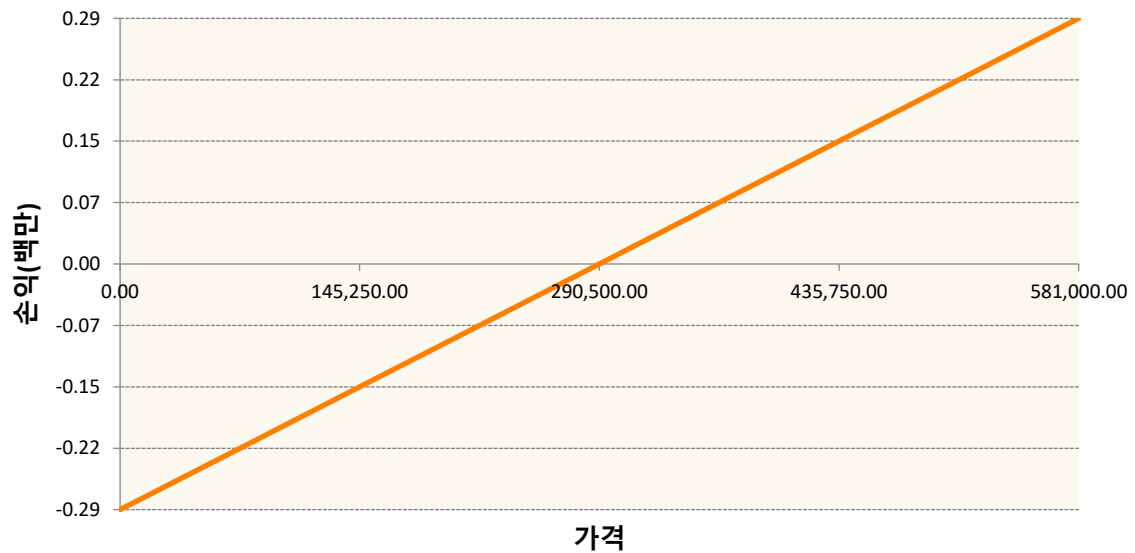
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



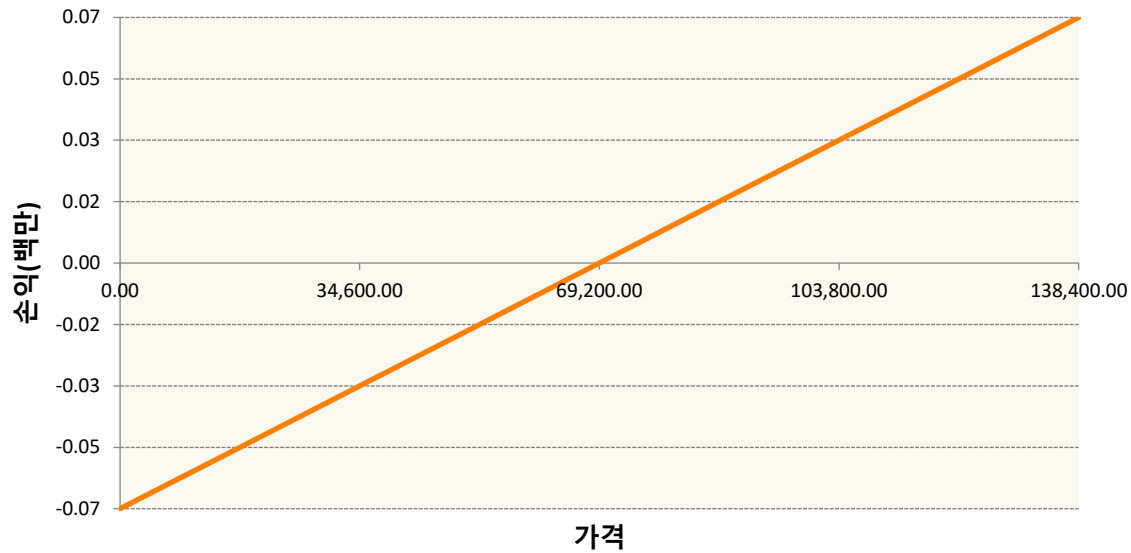
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



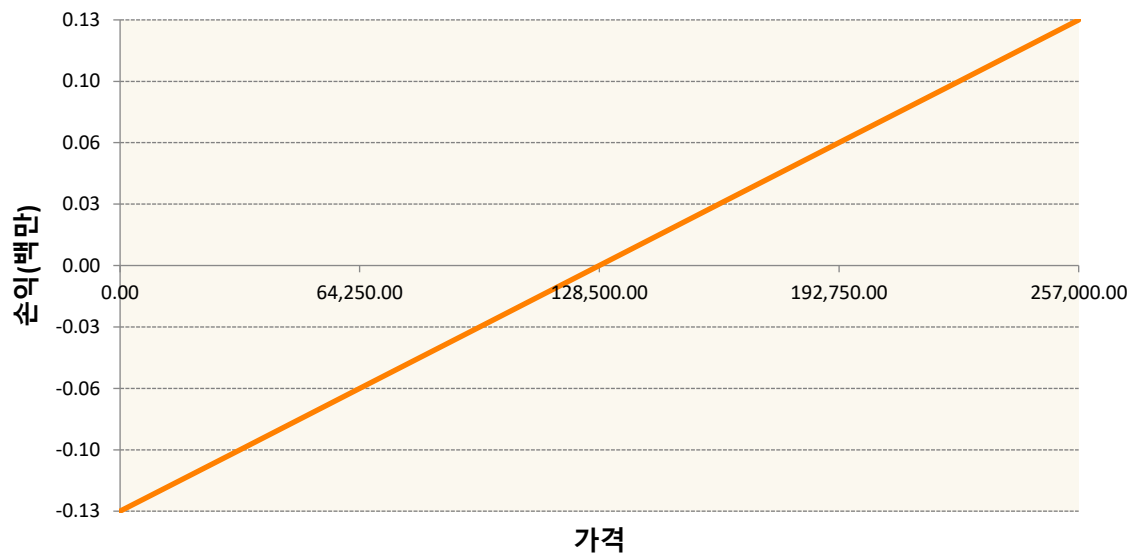
KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



KR41HEW40009-2025-04 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	54
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	0.46
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	2
KR41BHW40 2025-04 한화에어로스페이스개별선물	11
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	2
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물	1
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물	7
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	1
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	1
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EYW40(2025-04 에코프로비엠개별선물	2
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물	6

KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물
 KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물
 KR41FVW40(2025-04 한화오션개별선물
 KR41HEW40(2025-04 키움증권개별선물

	2
	3
	3
	1

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

(단위:백만원)

193

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

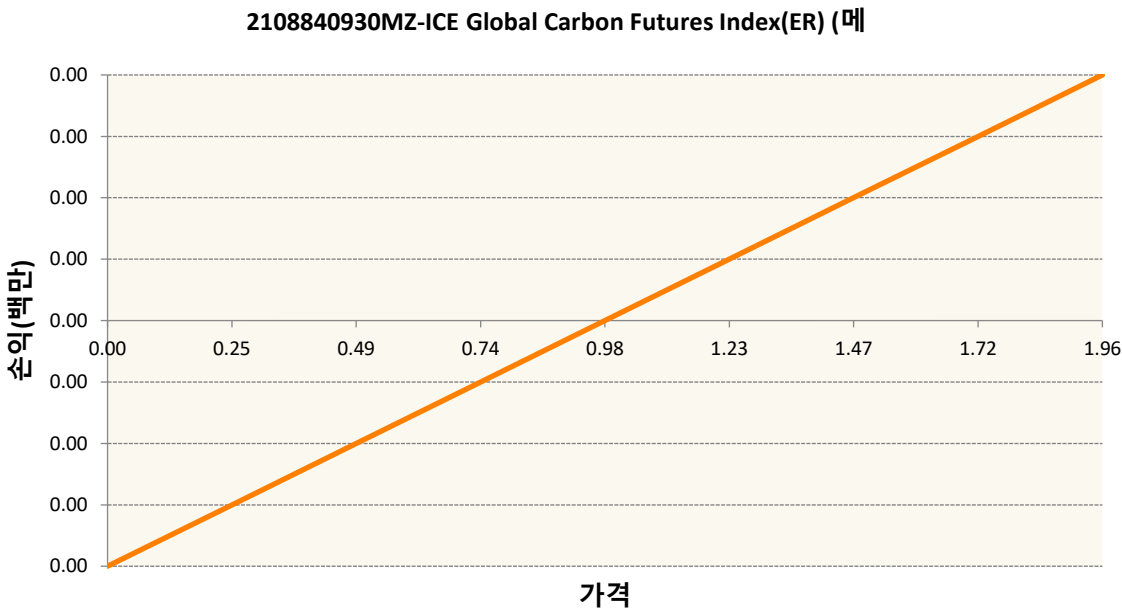
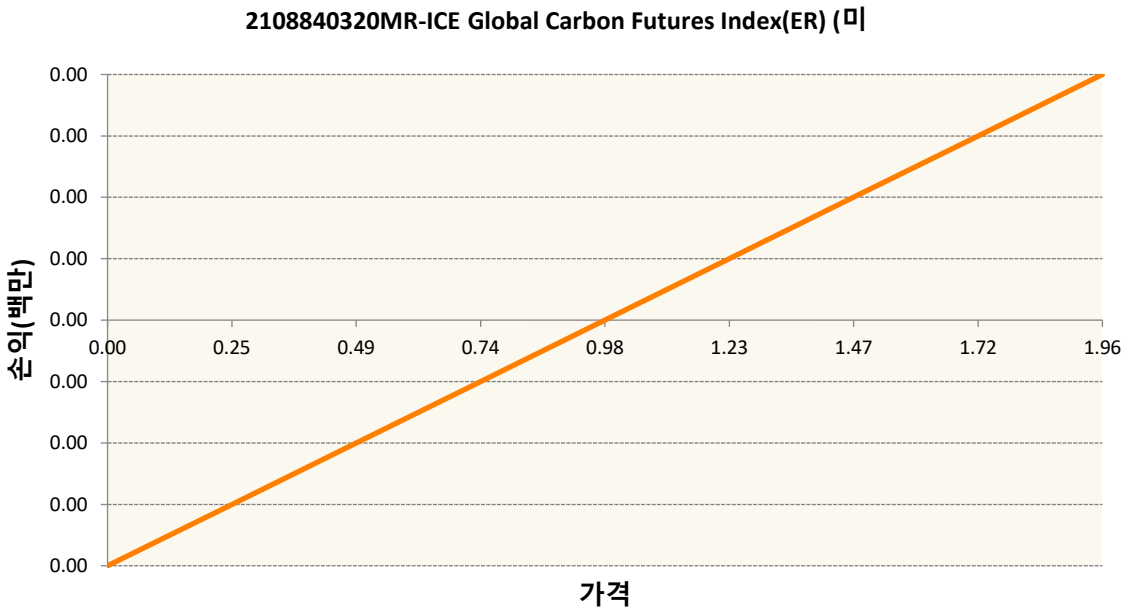
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,642	0	9,642	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	579
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	194

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	872

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

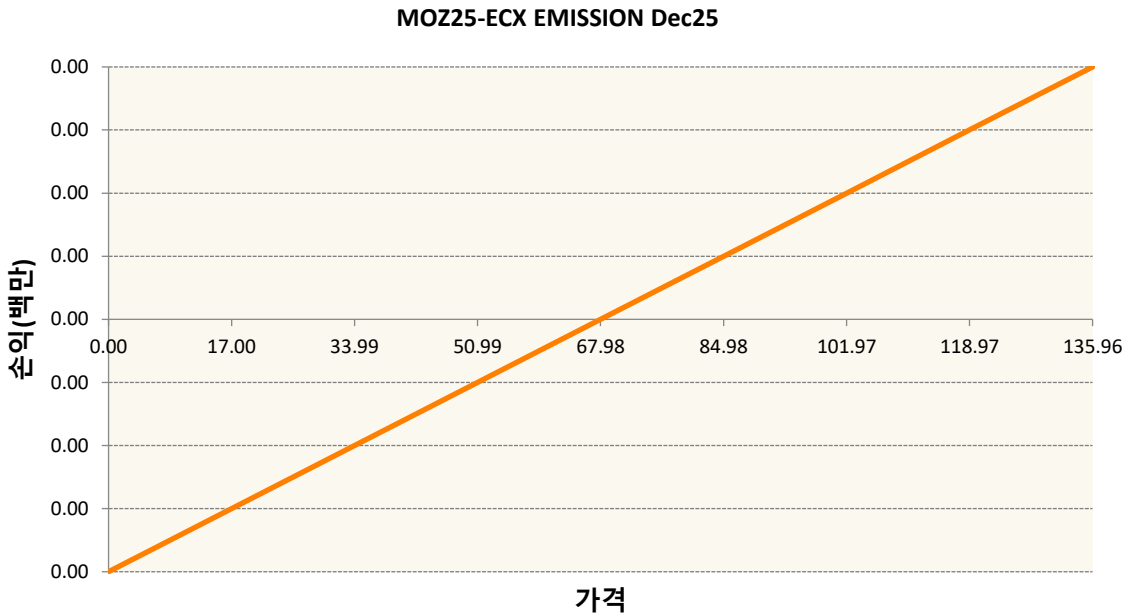
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,140	0	5,140	
누계	통화	선도	0	1,164	-1,164	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	1
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	14
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	79
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	413

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

(단위:백만원)

771

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	4,362	0	4,362	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	6
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	6

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

(단위:백만원)

36

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

SOL차이나육성산업액티브상장지

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	8,845	0	8,845	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	12
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	3

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

(단위:백만원)

67

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

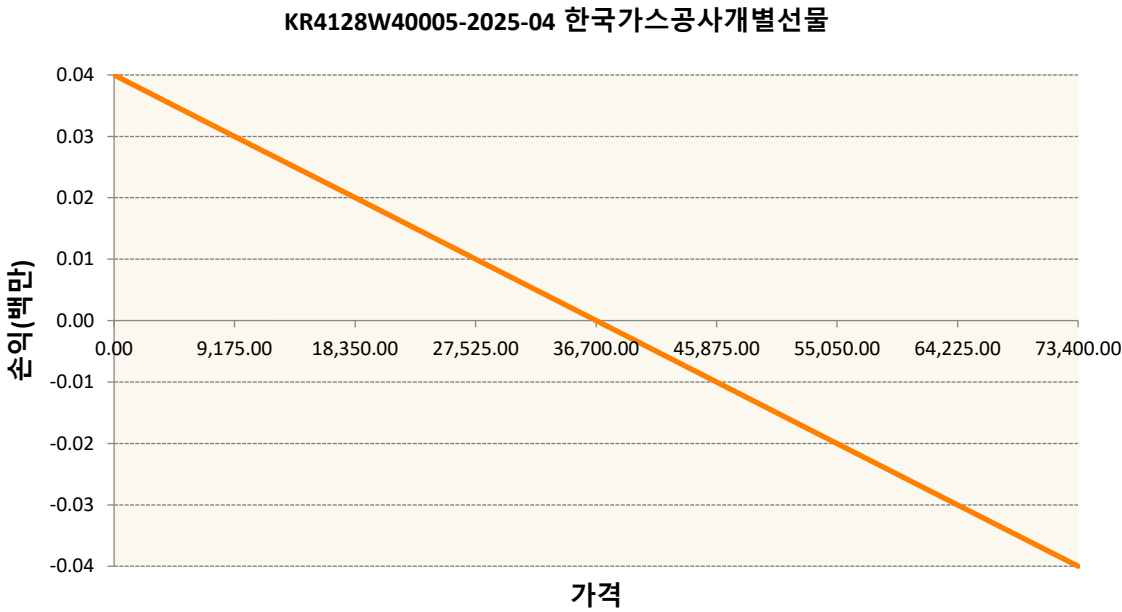
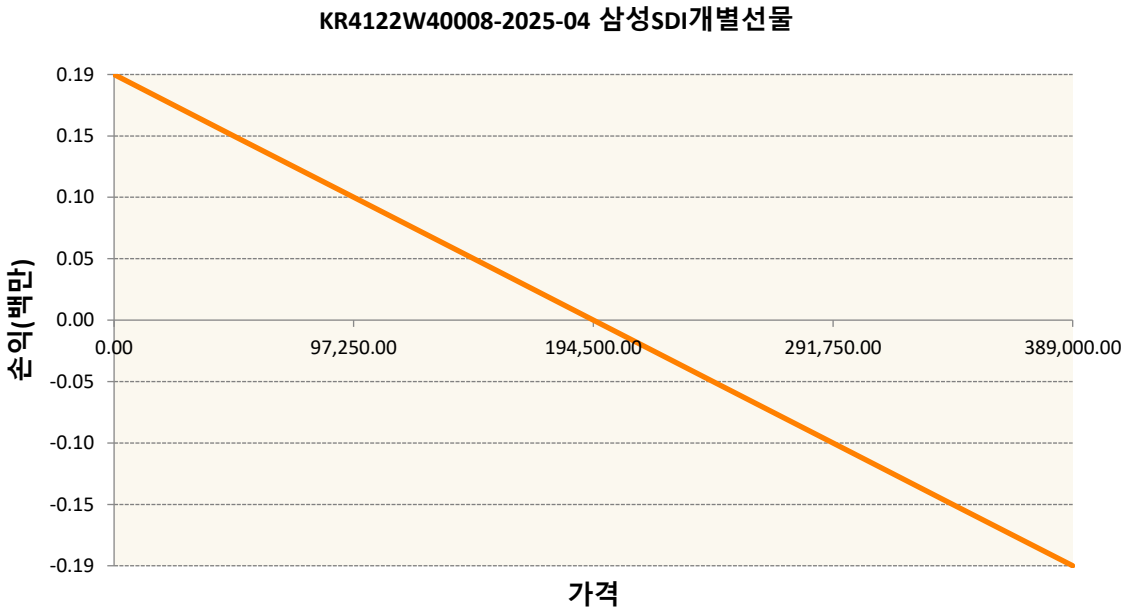
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

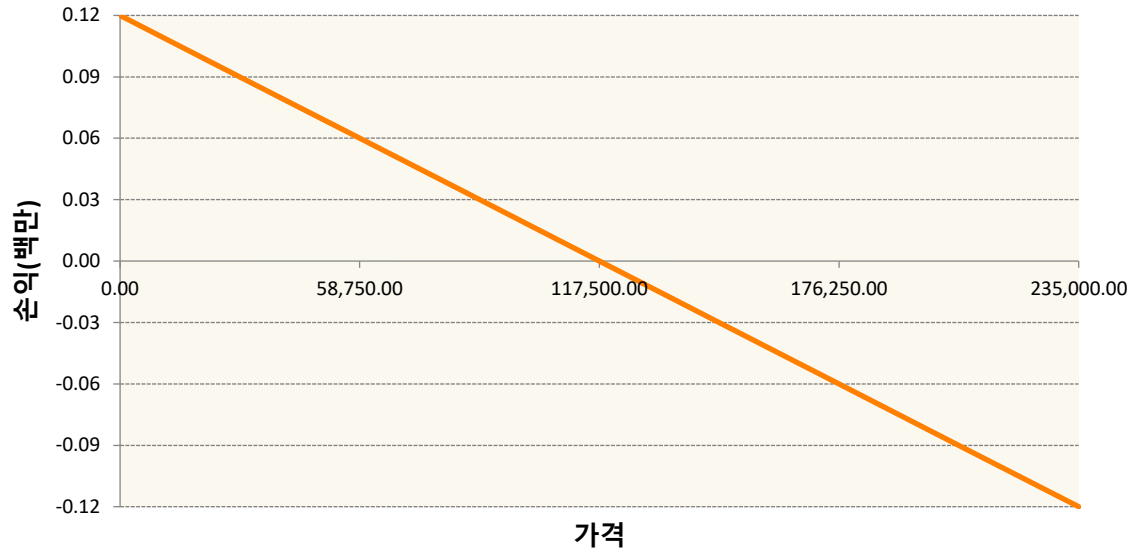
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	17	-17	장내
누계	유가증권	선물	7	71	-64	장내

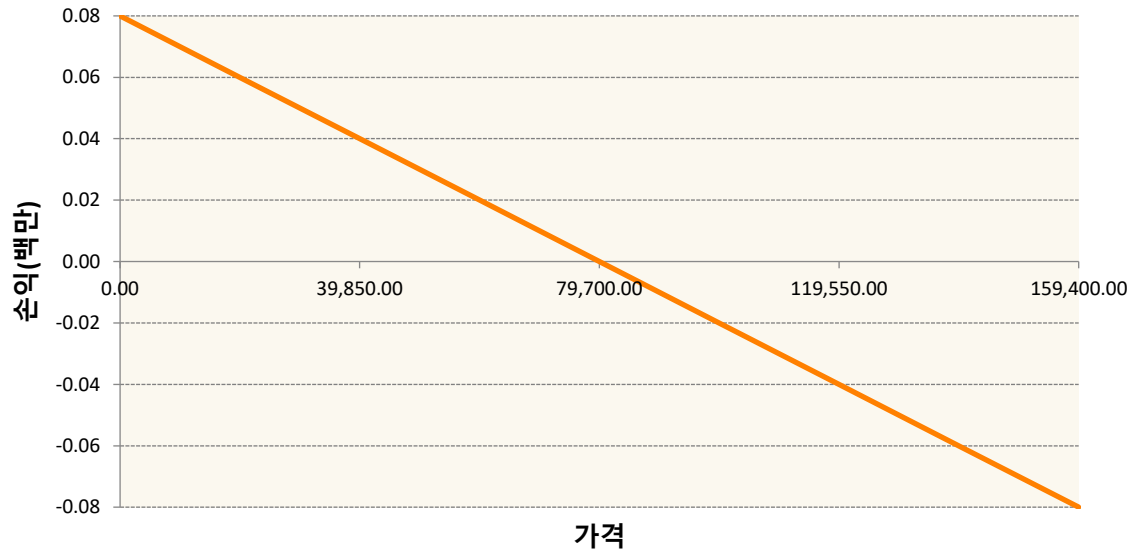
2. 만기시점의 손익구조



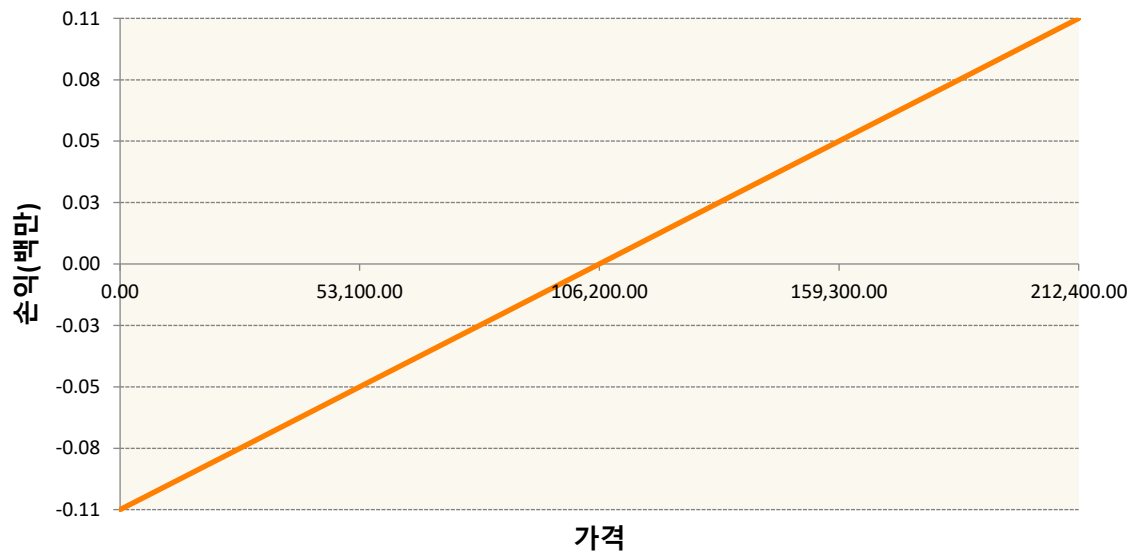
KR4142W40006-2025-04 CJ개별선물



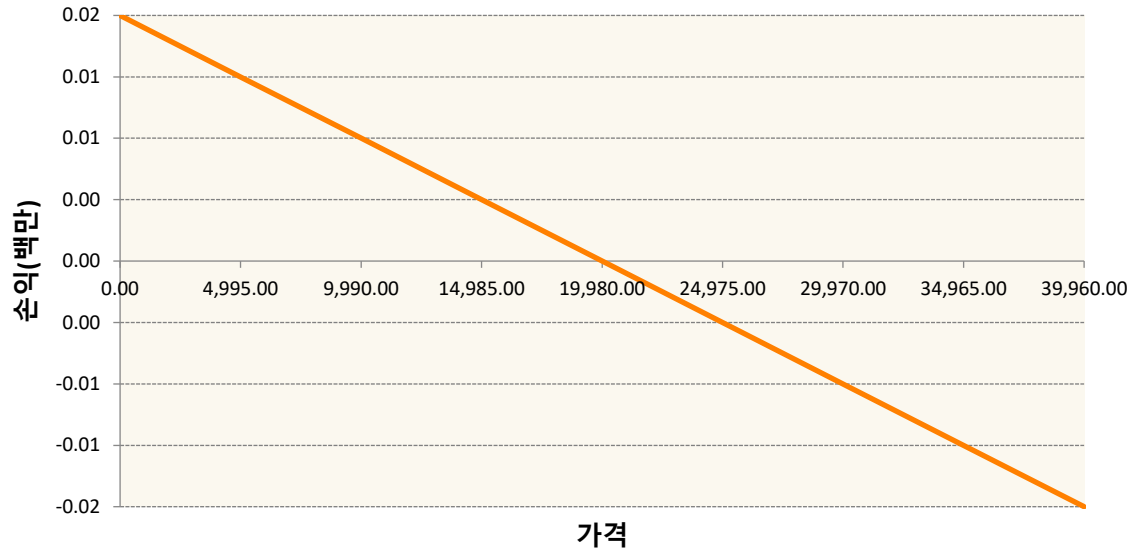
KR41BMW40005-2025-04 한국항공우주개별선물



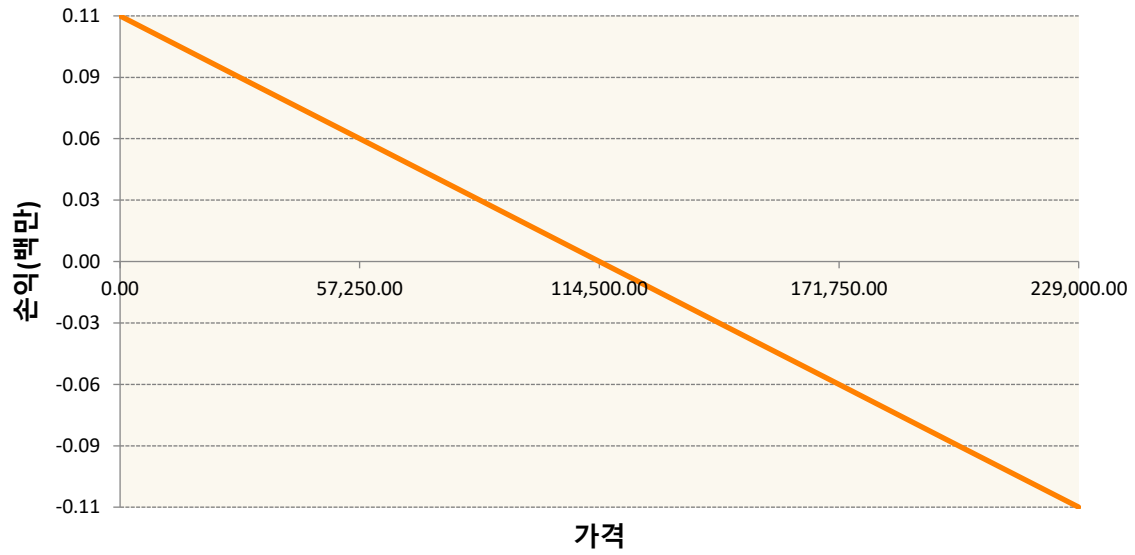
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



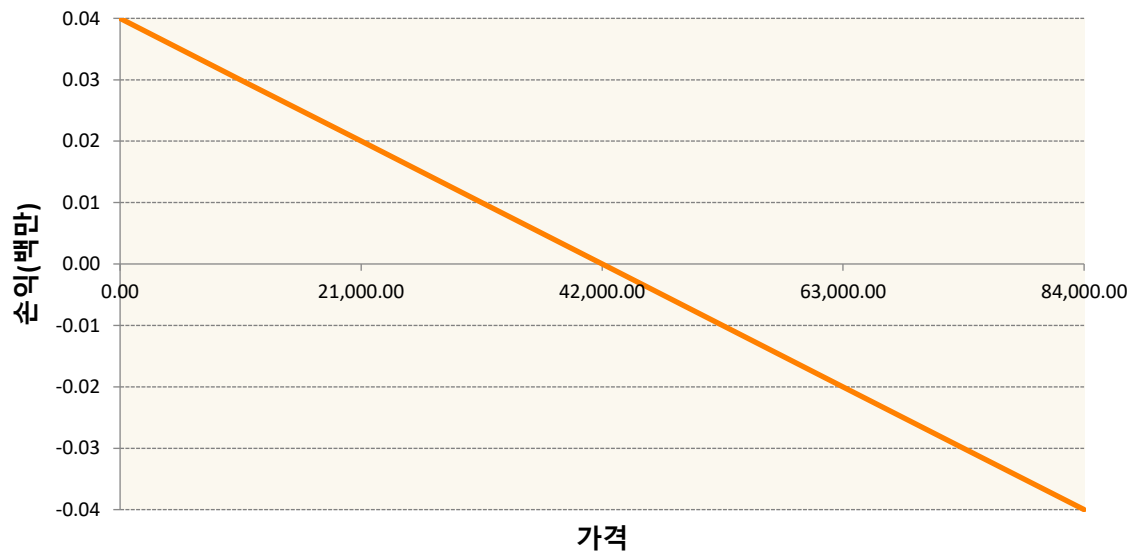
KR41CBW40006-2025-04 한화솔루션개별선물



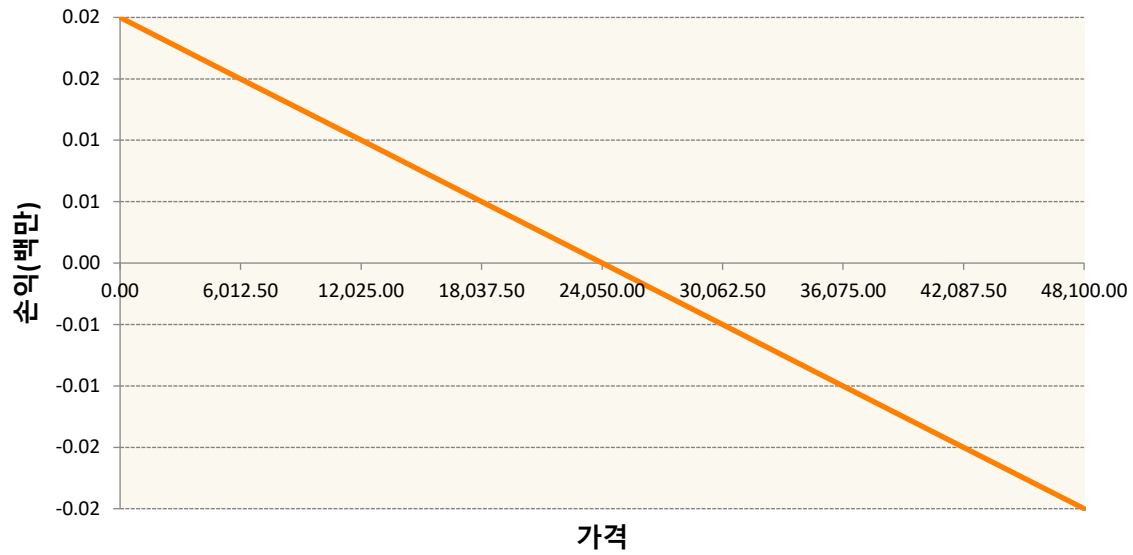
KR41CDW40002-2025-04 HD현대미포개별선물



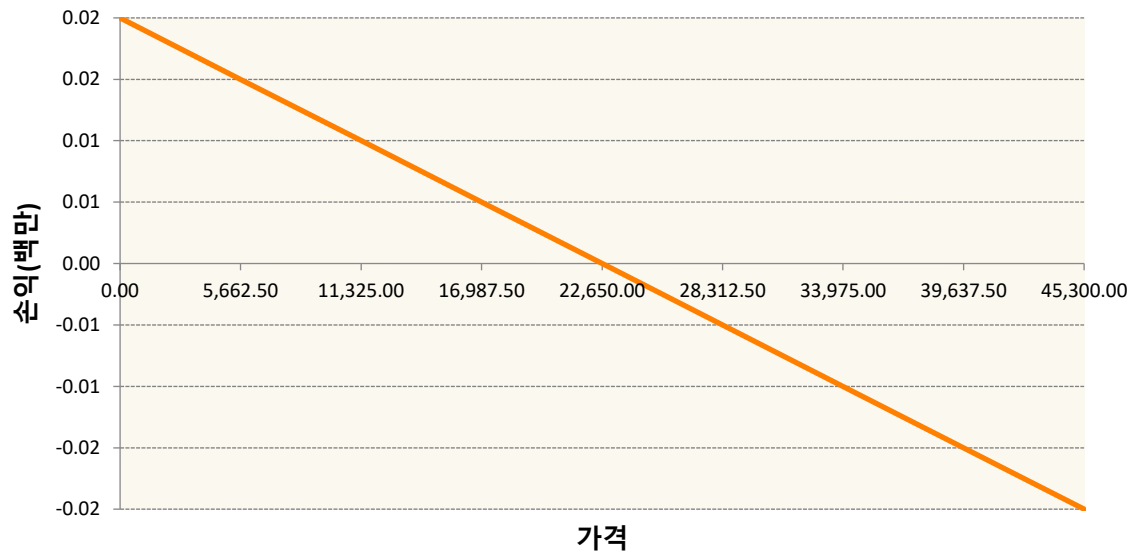
KR41CFW50006-2025-05 카카오개별선물



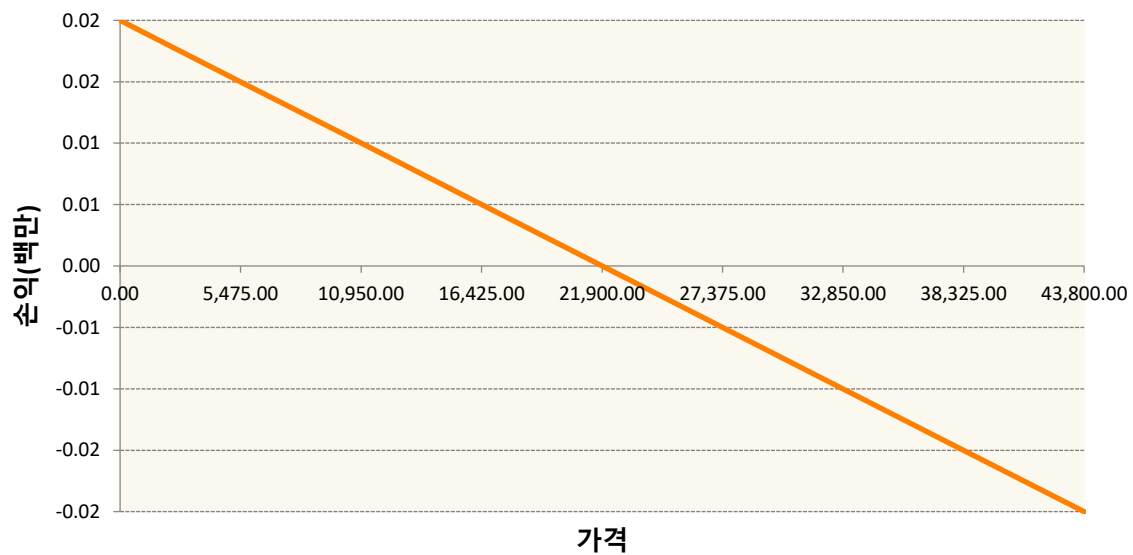
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



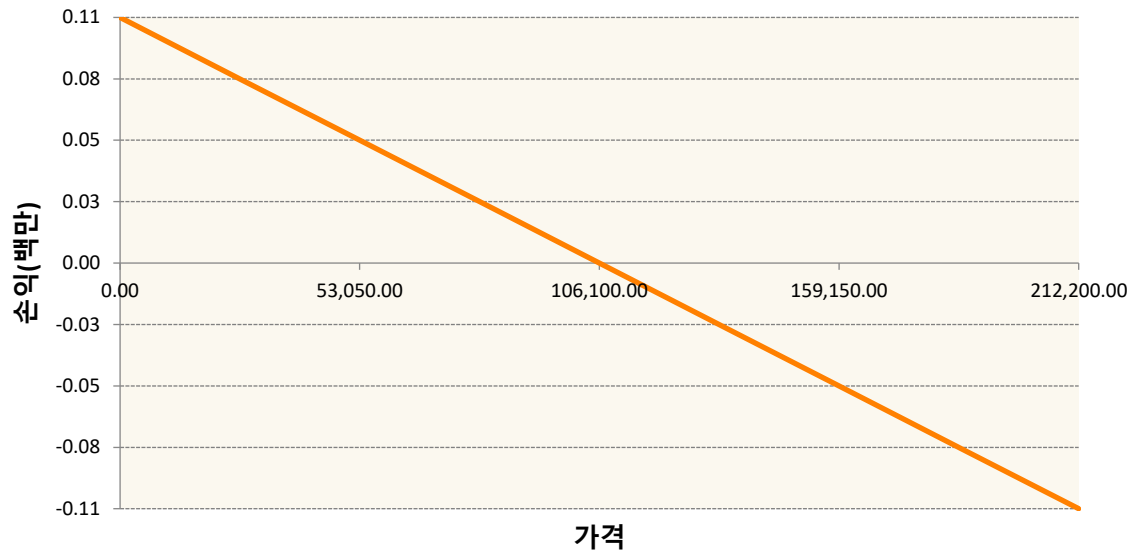
KR41F6W40005-2025-04 카카오뱅크개별선물



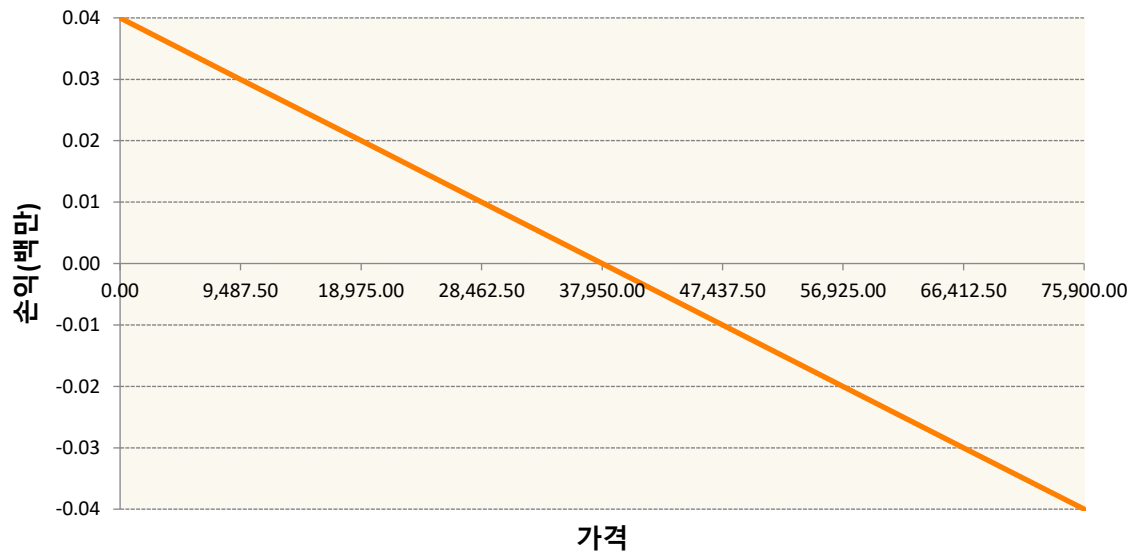
KR41FBW40009-2025-04 SK아이이테크놀로지개별선물



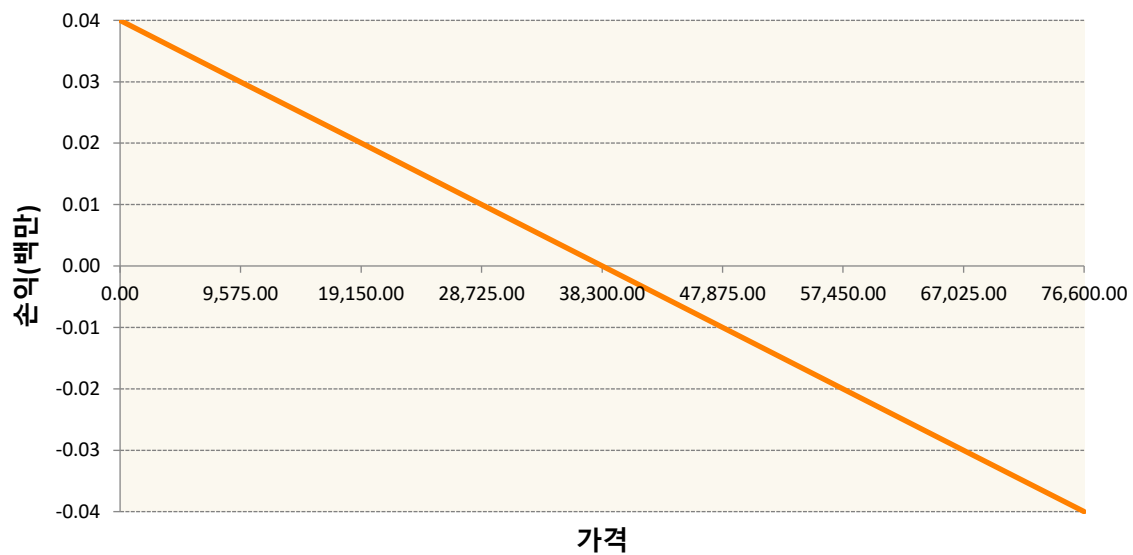
KR41G6W40004-2025-04 현대로템개별선물



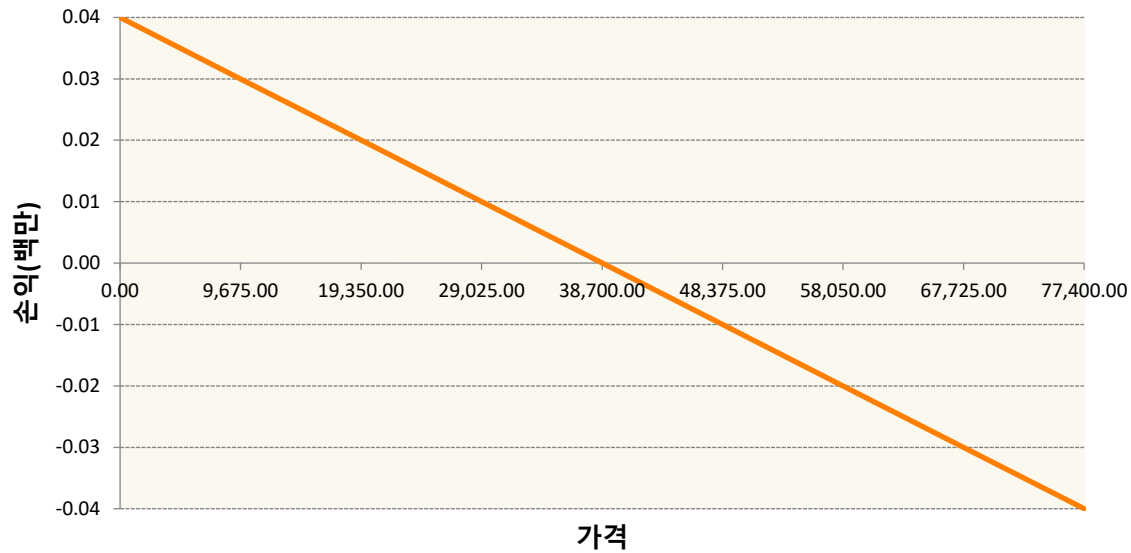
KR41GYW40009-2025-04 에스엘개별선물



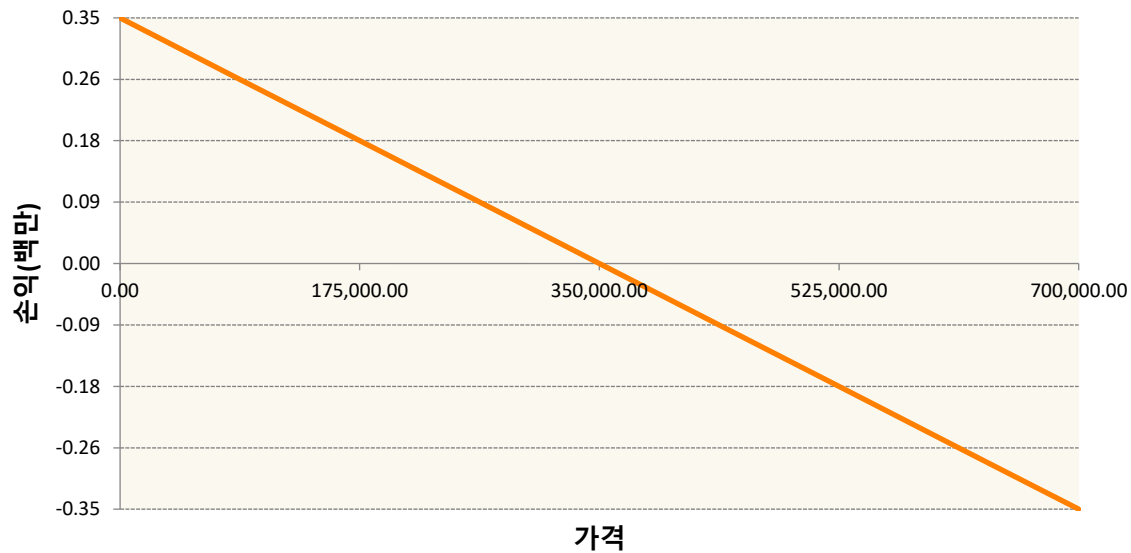
KR41HJW40008-2025-04 휠라홀딩스개별선물



KR41HRW40001-2025-04 주성엔지니어링개별선물



KR41HSW40009-2025-04 파마리서치개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4122W40(2025-04 삼성SDI개별선물	0.47
KR4128W40(2025-04 한국가스공사개별선물	0.35
KR4142W40(2025-04 CJ개별선물	0.38
KR41BMW4C 2025-04 한국항공우주개별선물	0.38
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	1
KR41CBW40(2025-04 한화솔루션개별선물	0.3
KR41CDW40 2025-04 HD현대미포개별선물	1
KR41CFW50(2025-05 카카오개별선물	0.4
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	0.42
KR41F6W40(2025-04 카카오뱅크개별선물	0.07
KR41FBW40(2025-04 SK아이이테크놀로지개별선물	0.28
KR41G6W40(2025-04 현대로템개별선물	1

KR41GYW40 2025-04 에스엘개별선물	0.49
KR41HJW40(2025-04 휠라홀딩스개별선물	0.4
KR41HRW40 2025-04 주성엔지니어링개별선물	0.34
KR41HSW40 2025-04 파마리서치개별선물	0.28

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	16

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

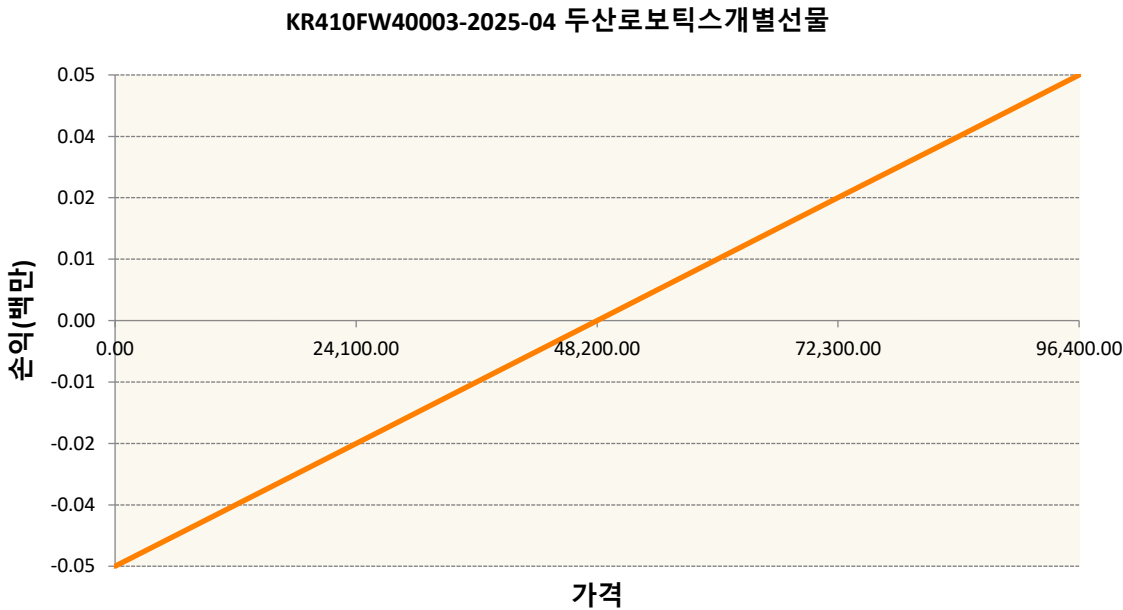
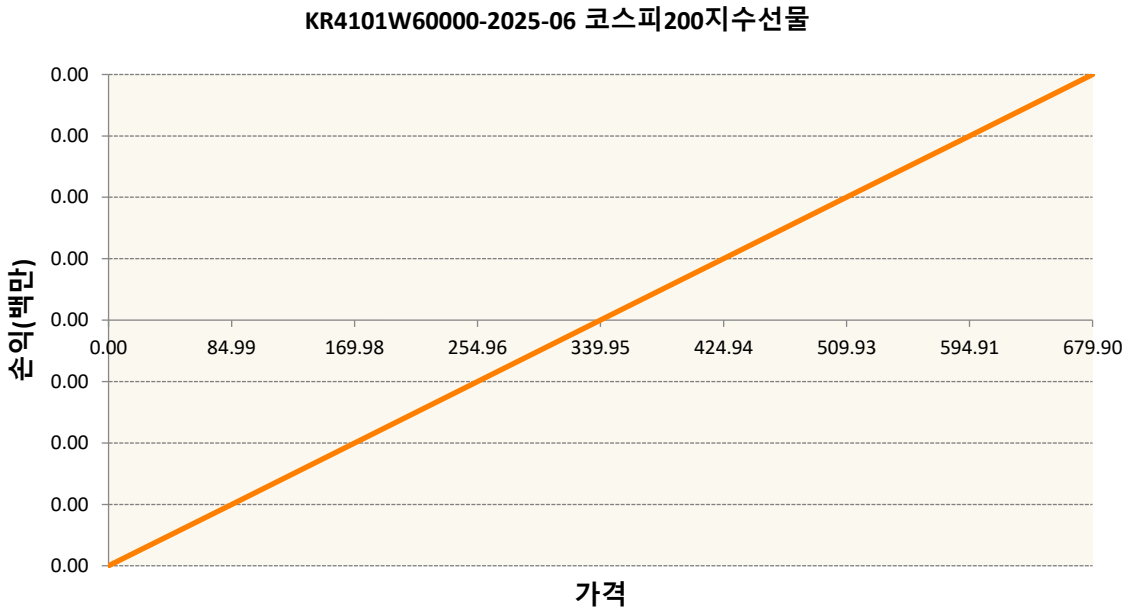
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

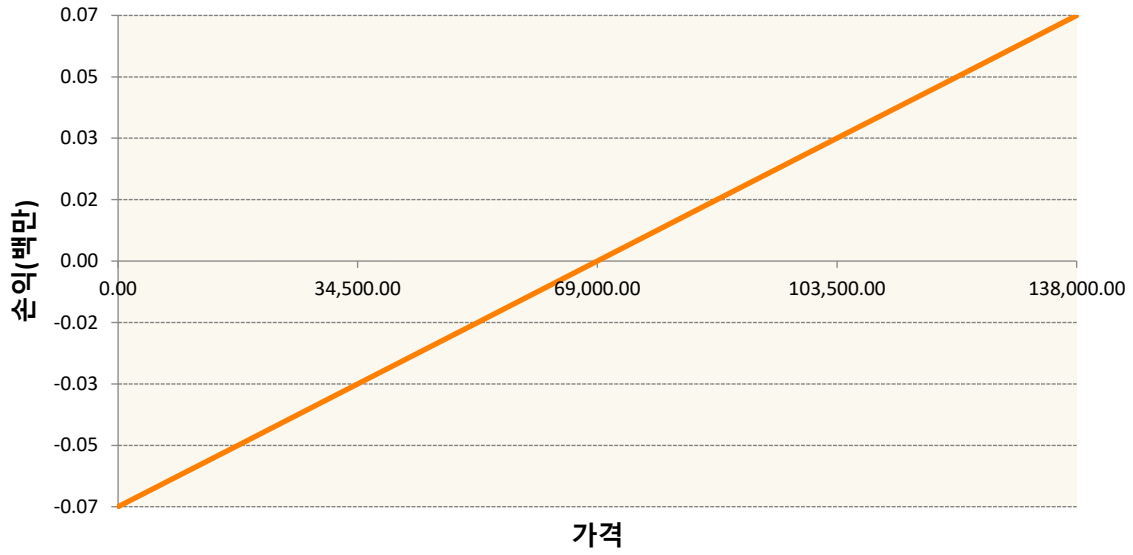
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	170	-170	장내
누계	유가증권	선물	12,044	0	12,044	장내

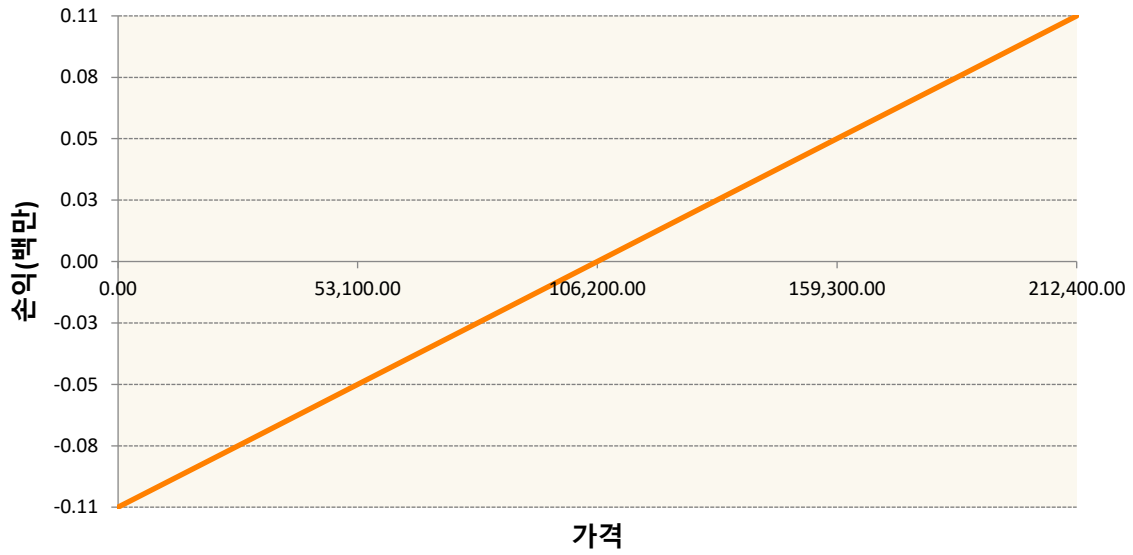
2. 만기시점의 손익구조



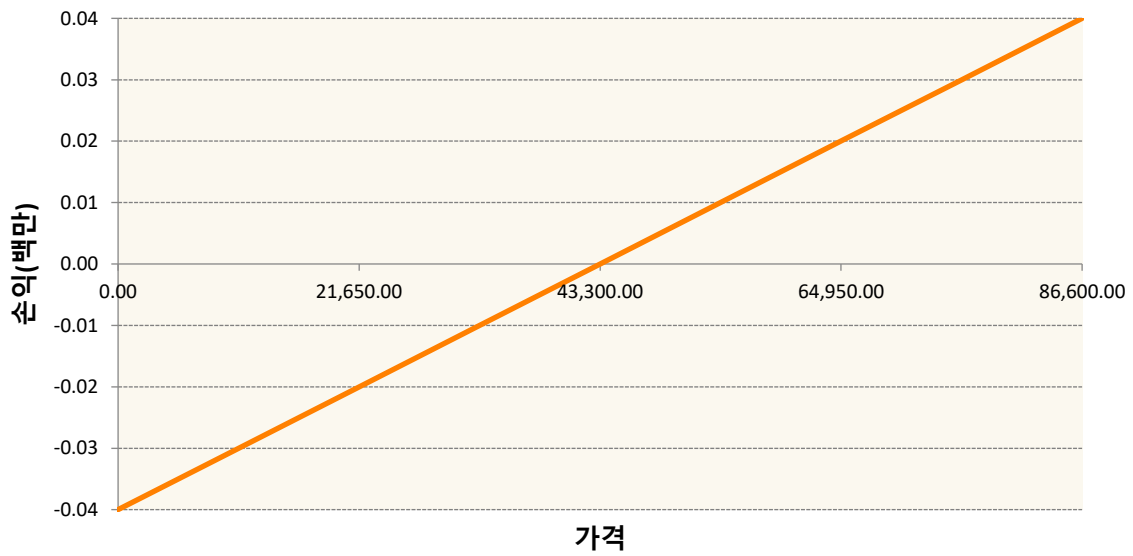
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



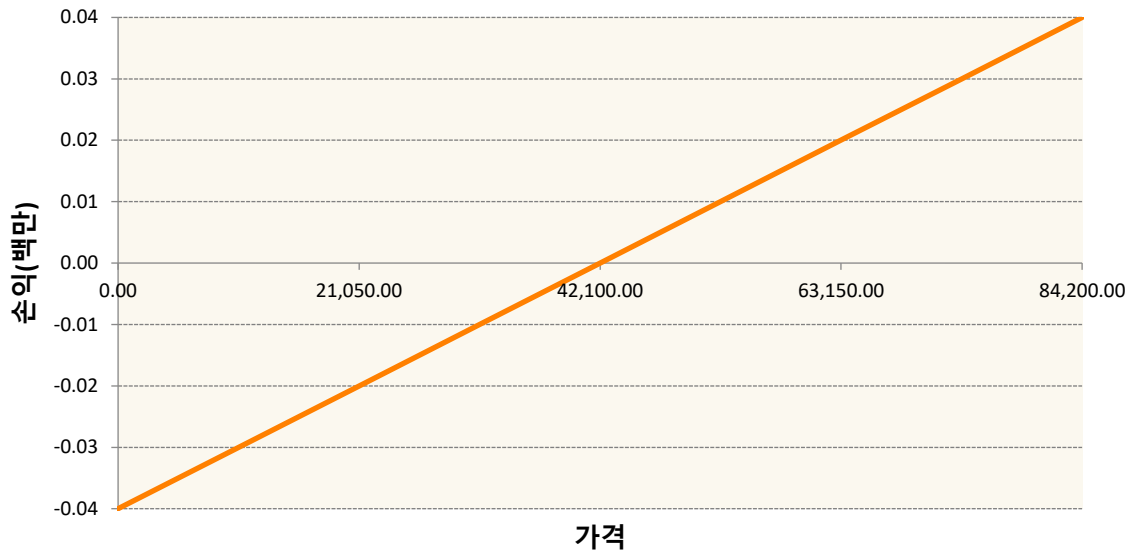
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



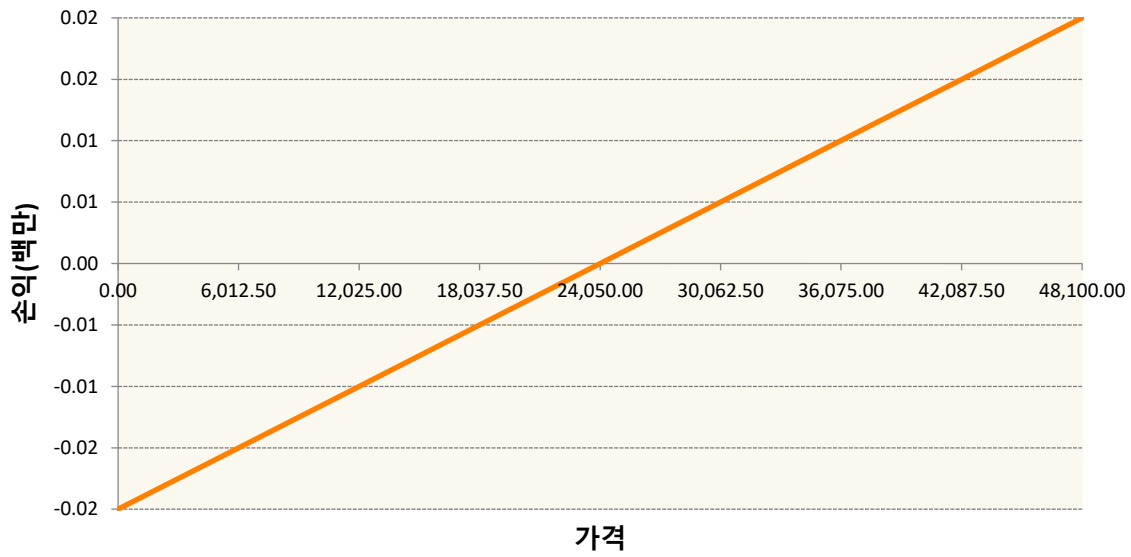
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



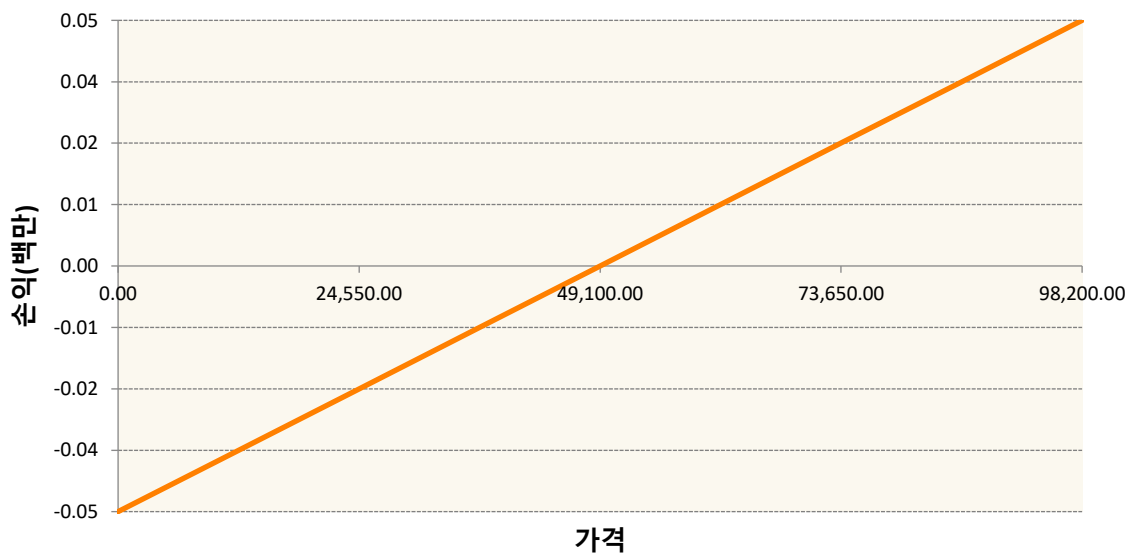
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



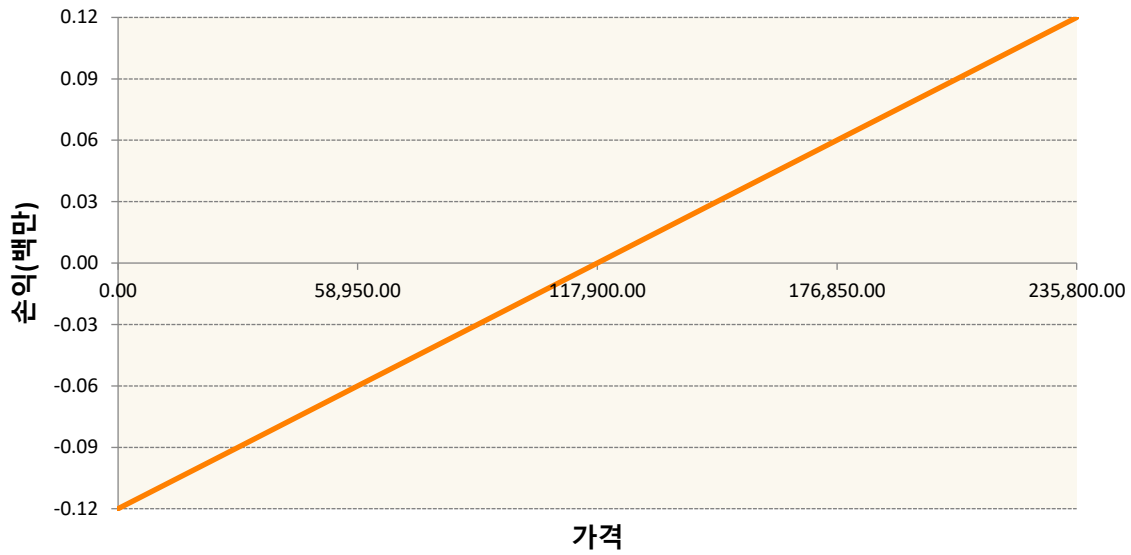
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



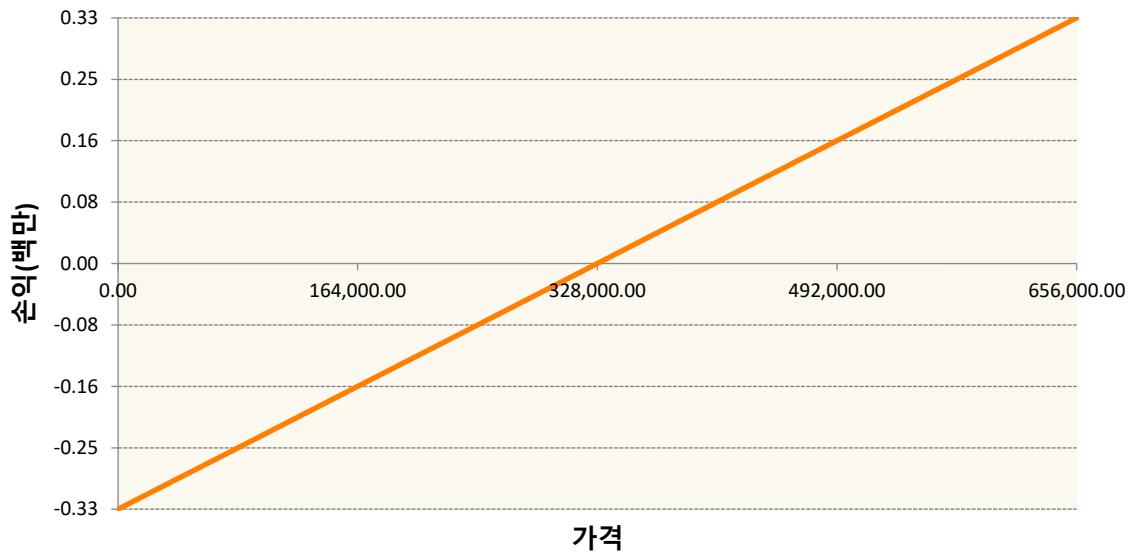
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



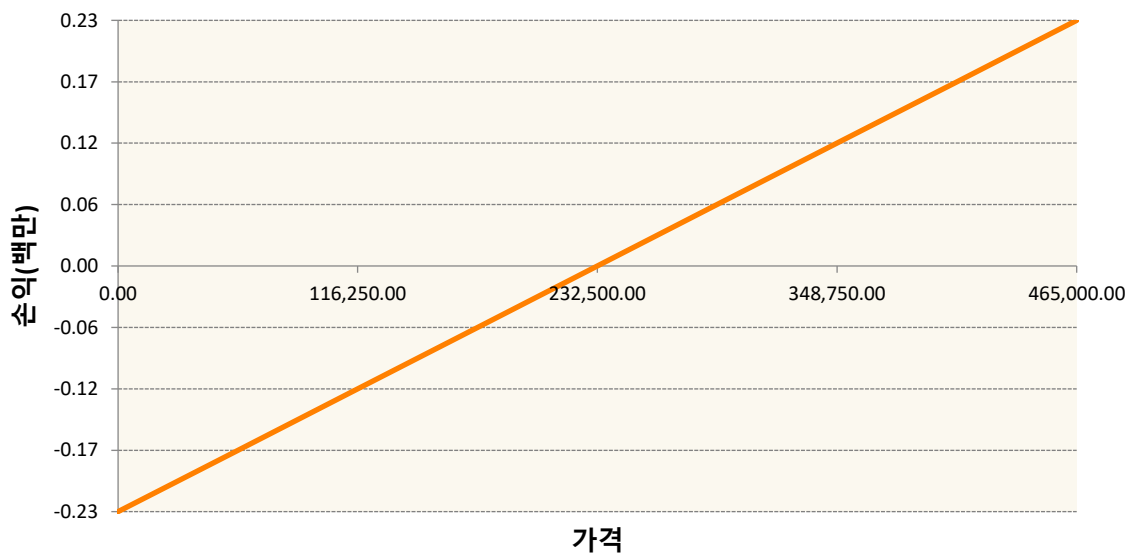
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



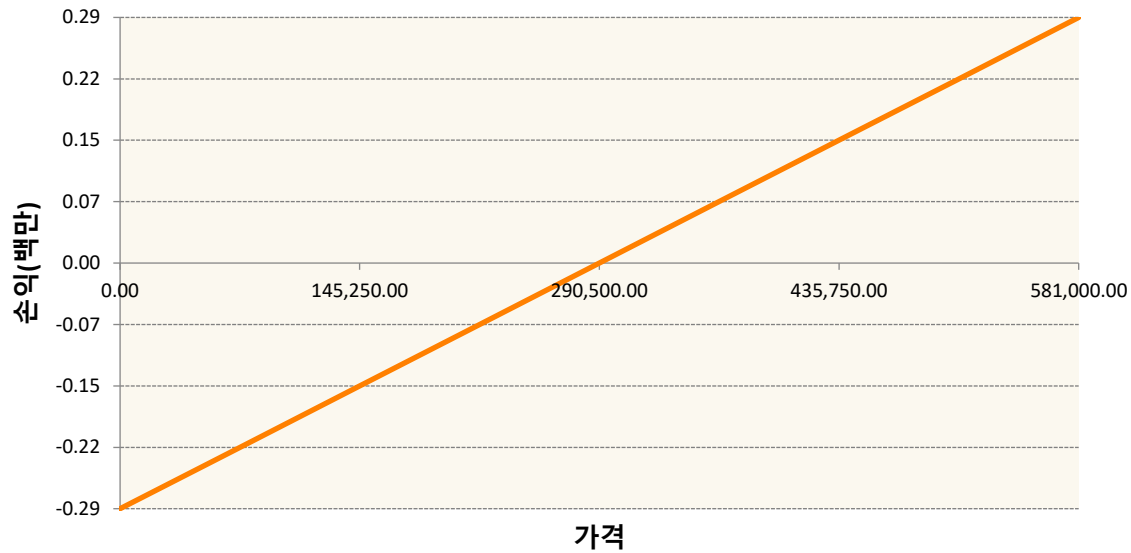
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



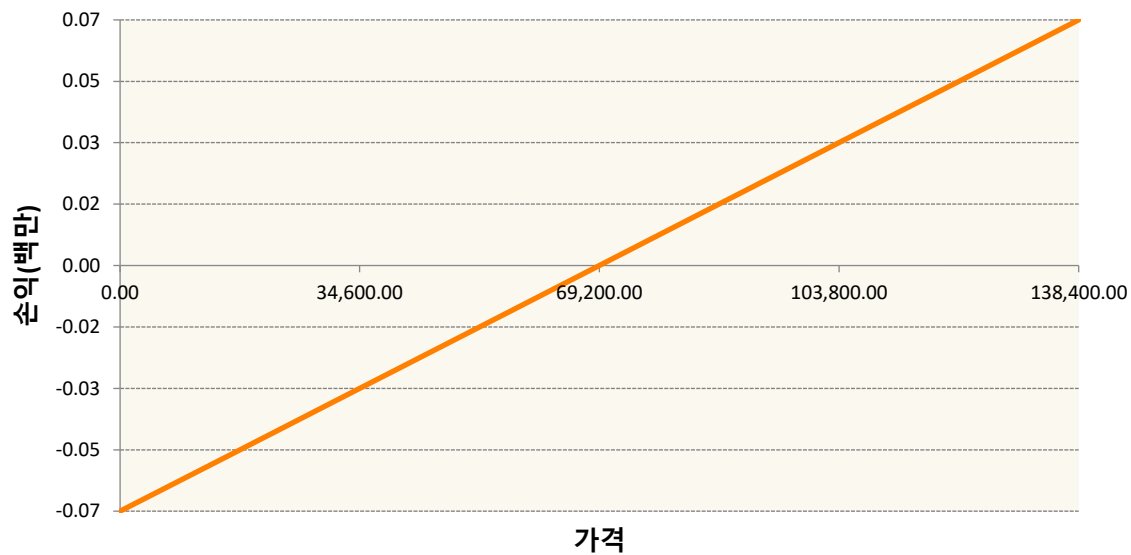
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	598
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	3
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	29
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	5
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물	12
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물	4
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	12
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	3
KR41E8W40(2025-04 포스코퓨처엠개별선물	15
KR41F5W40(2025-04 LG에너지솔루션개별선물	114
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물	47
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	64

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

(단위:백만원)

1,695

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

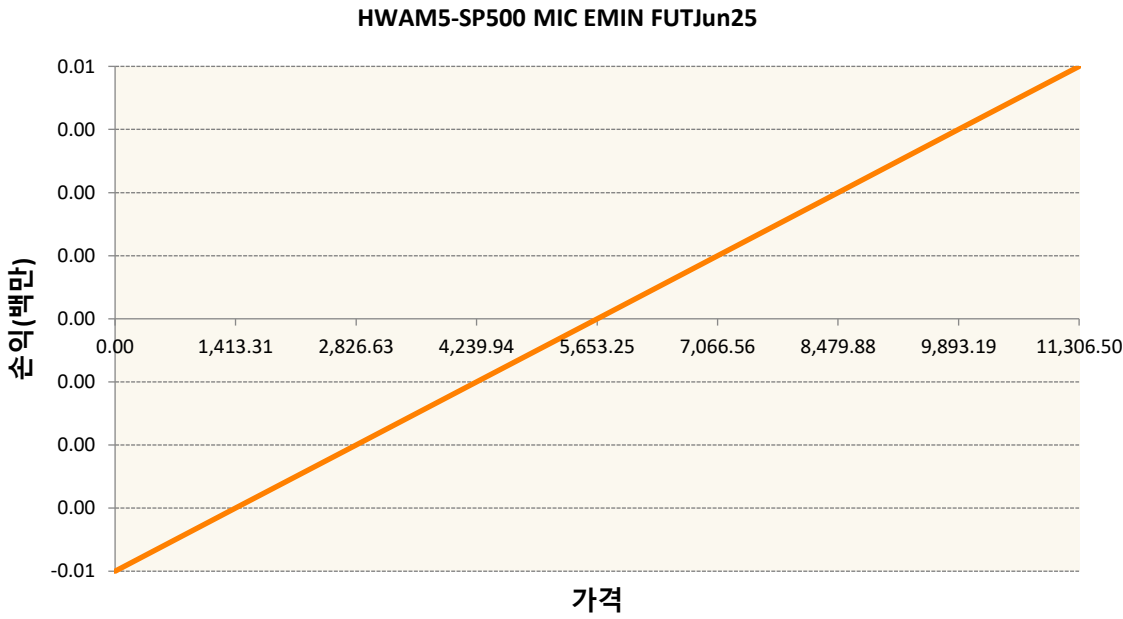
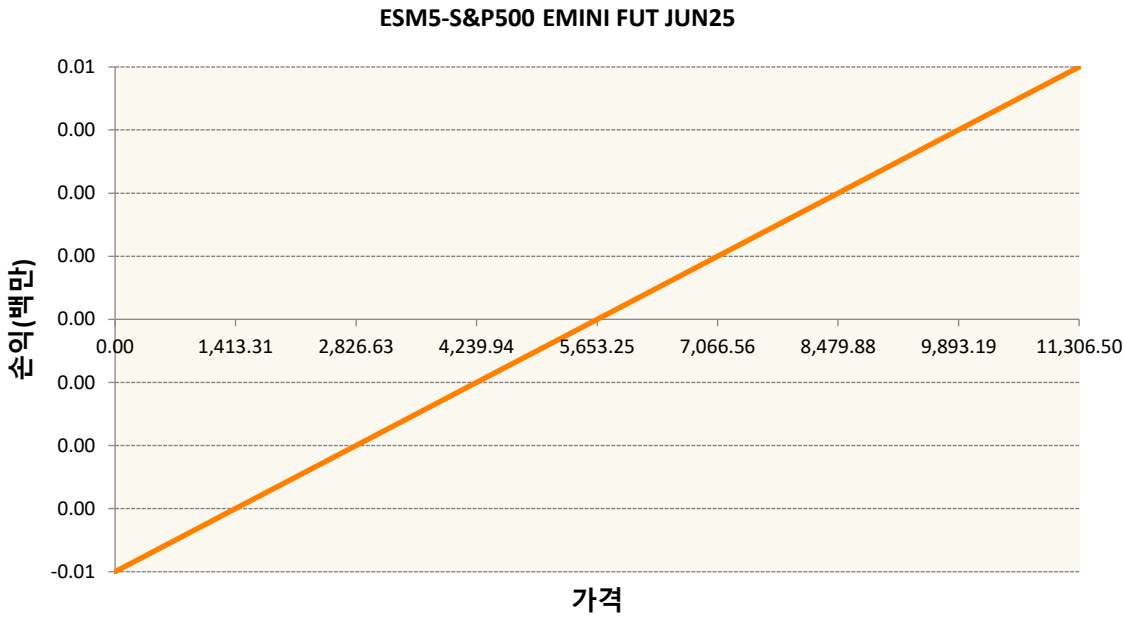
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	27,627	0	27,627	
누계	유가증권	선물	1,196	0	1,196	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,210
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	96

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,587

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

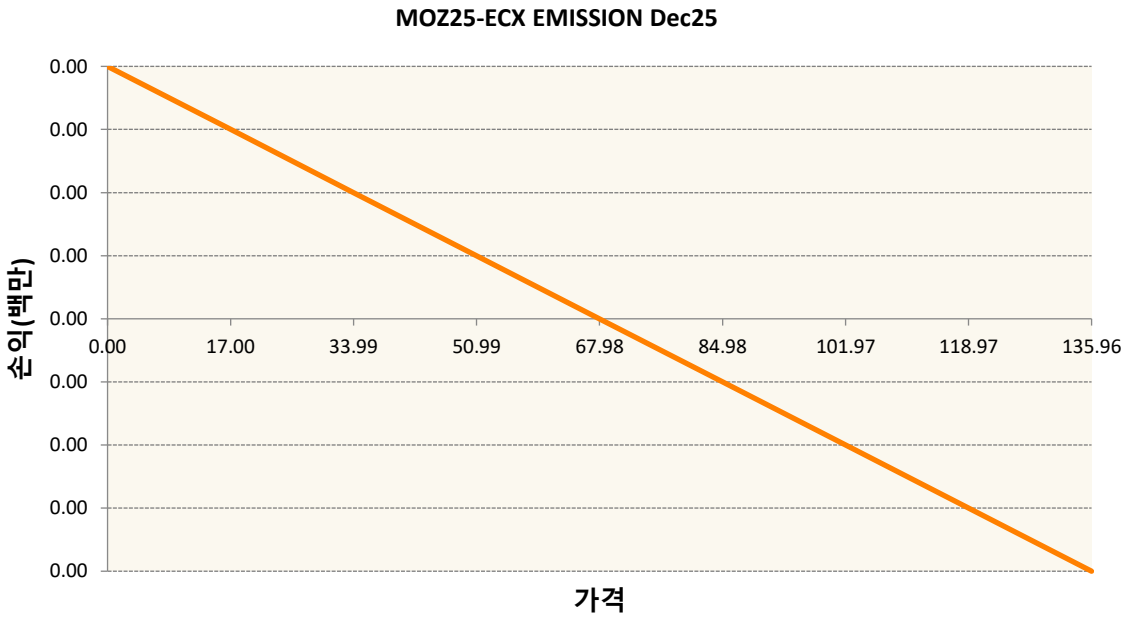
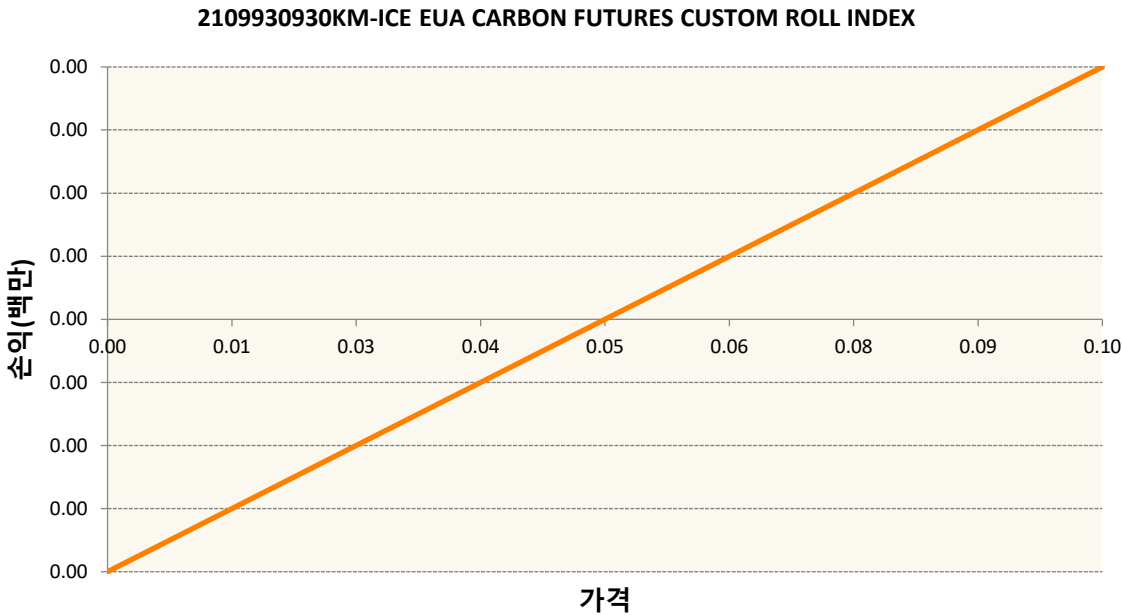
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	19	6,171	-6,152	
누계	통화	선도	0	1,146	-1,146	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	5
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	87
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	494

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

911

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

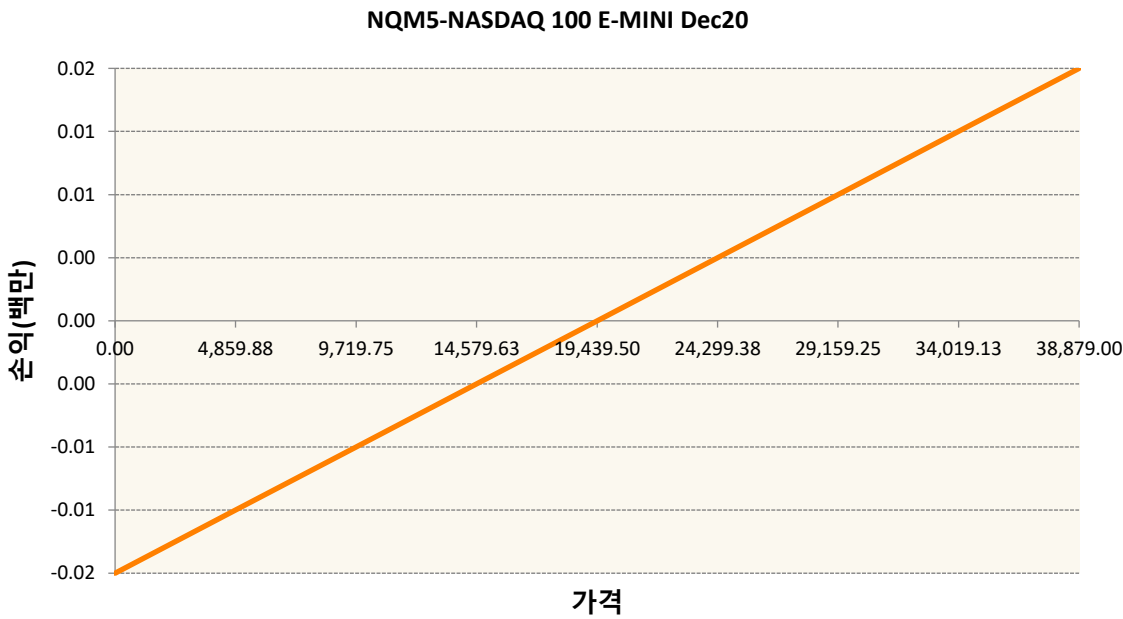
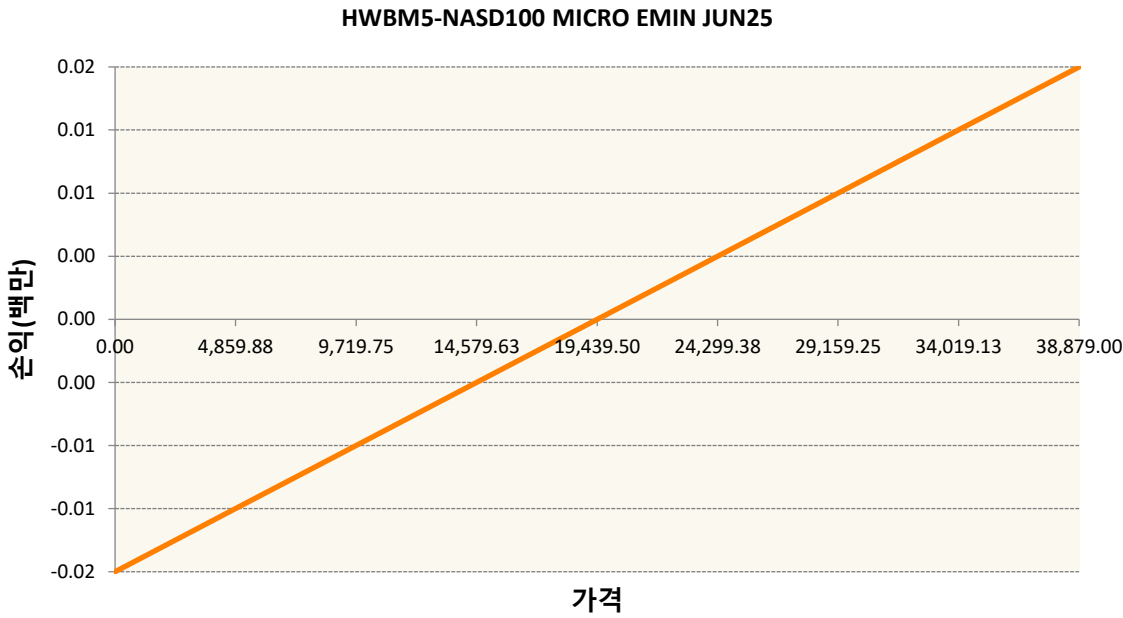
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,611	0	13,611	
누계	유가증권	선물	511	0	511	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		41
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,089

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,066

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	196,070	0	196,070	장외
누계	지수	스왑	245,384	0	245,384	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	753
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,269
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,102
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,678

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

(단위:백만원)

9,406

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

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	6,643	0	6,643	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.34
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.34
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.34
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.34

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

(단위:백만원)

2

공시일	2025-04-02
기준일	2025-04-01

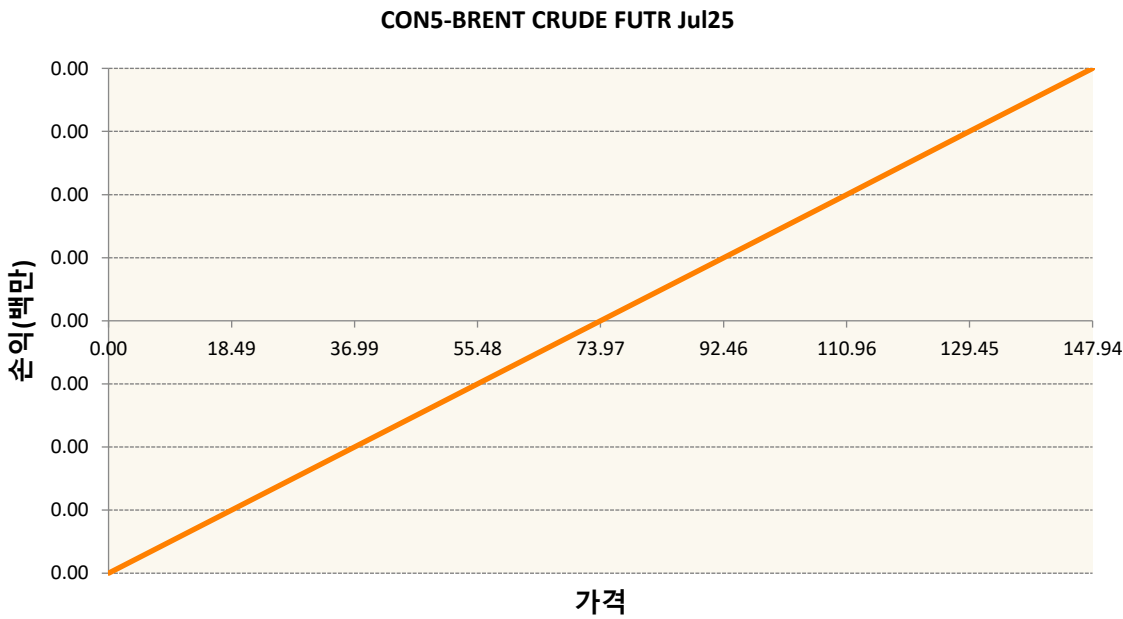
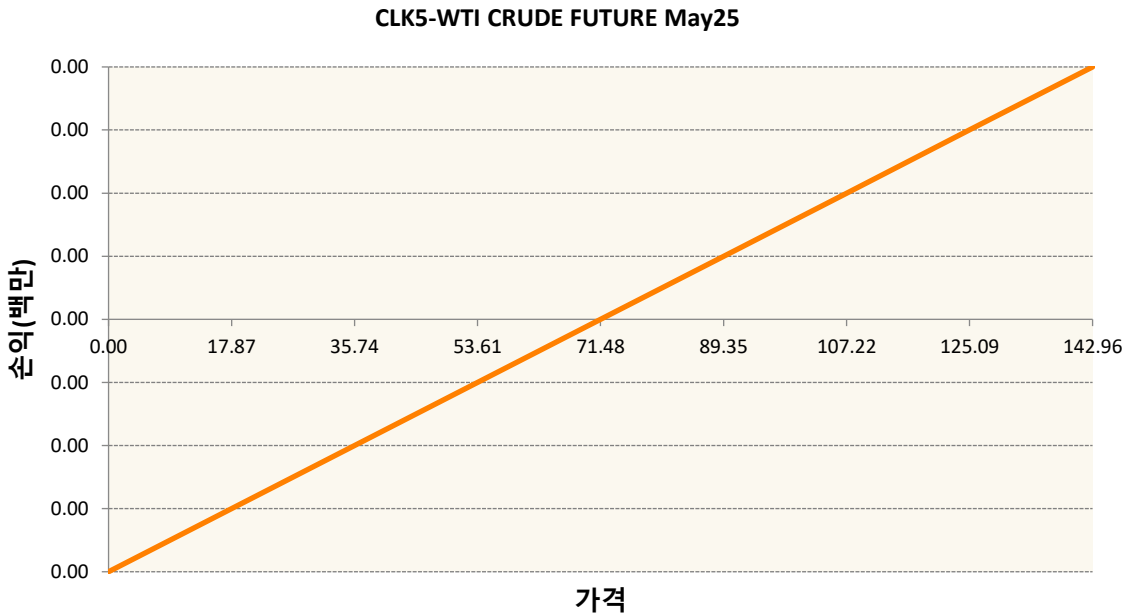
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

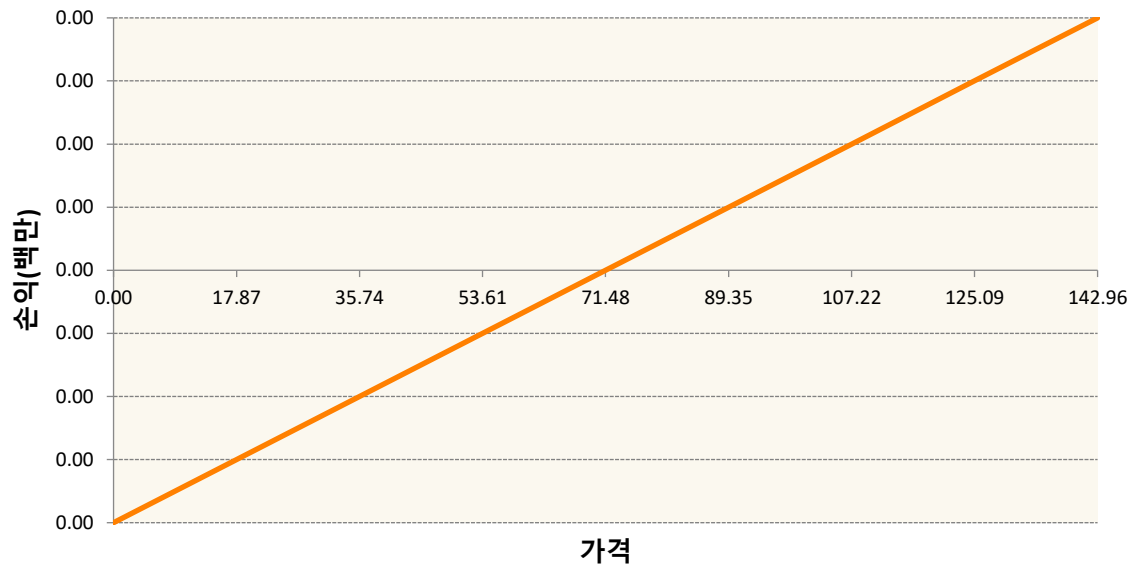
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	864	0	864	
누계	통화	선물	0	147	-147	장내

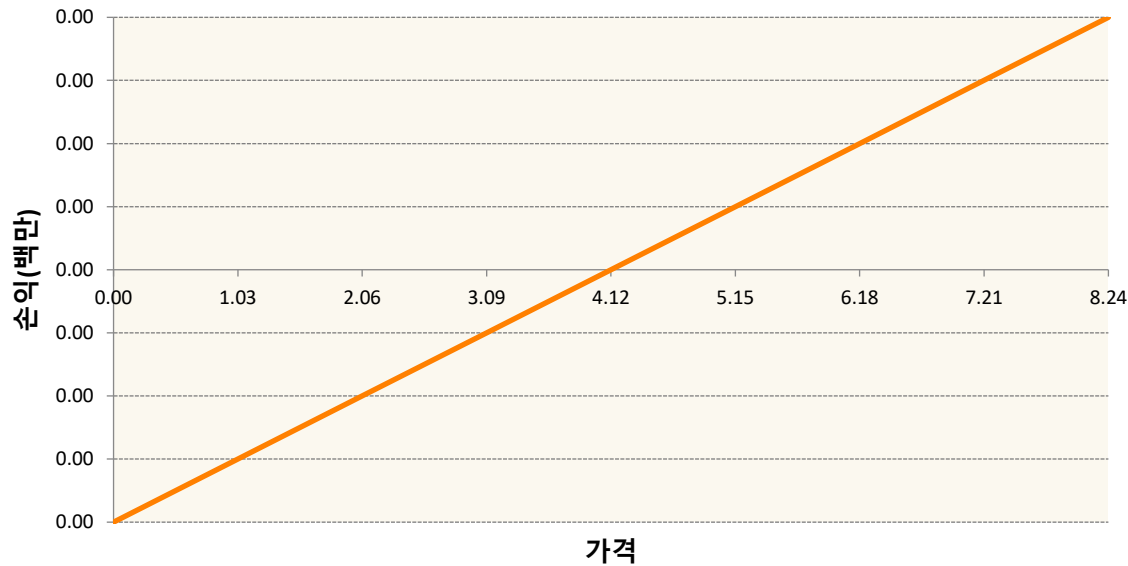
2. 만기시점의 손익구조



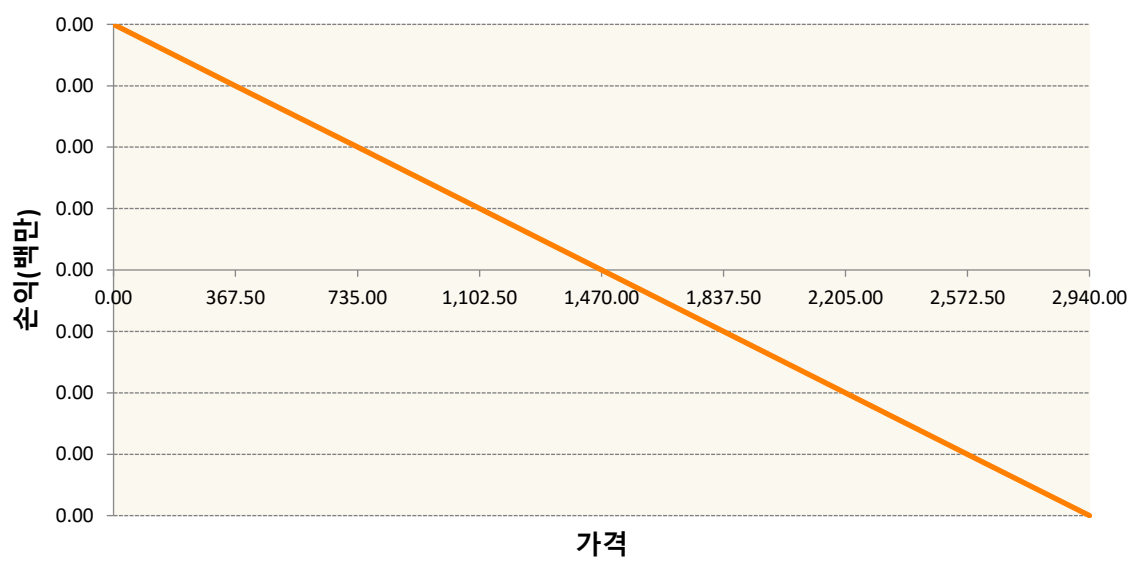
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



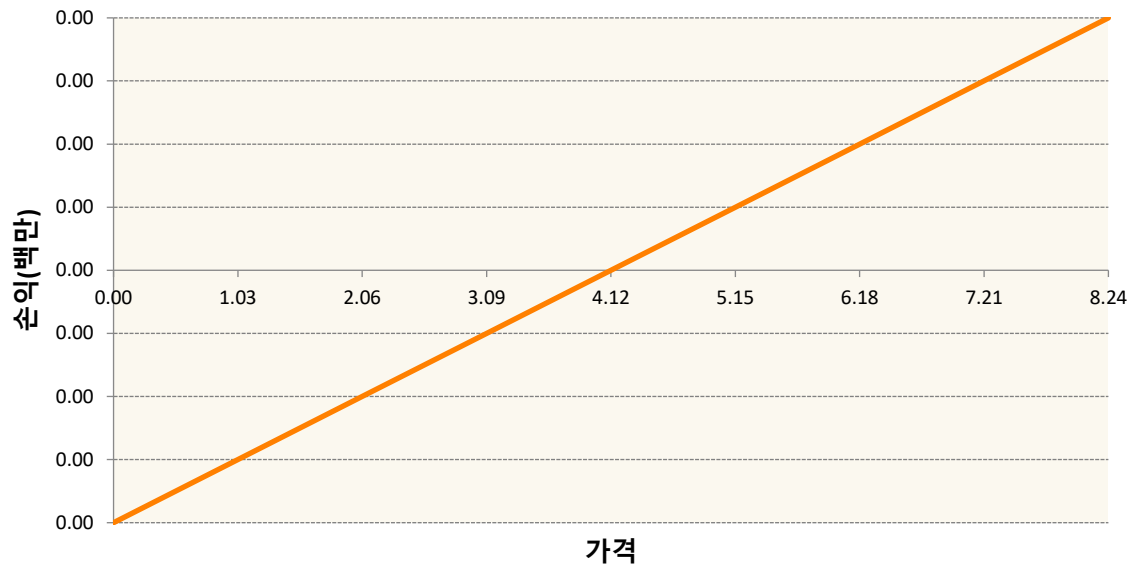
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



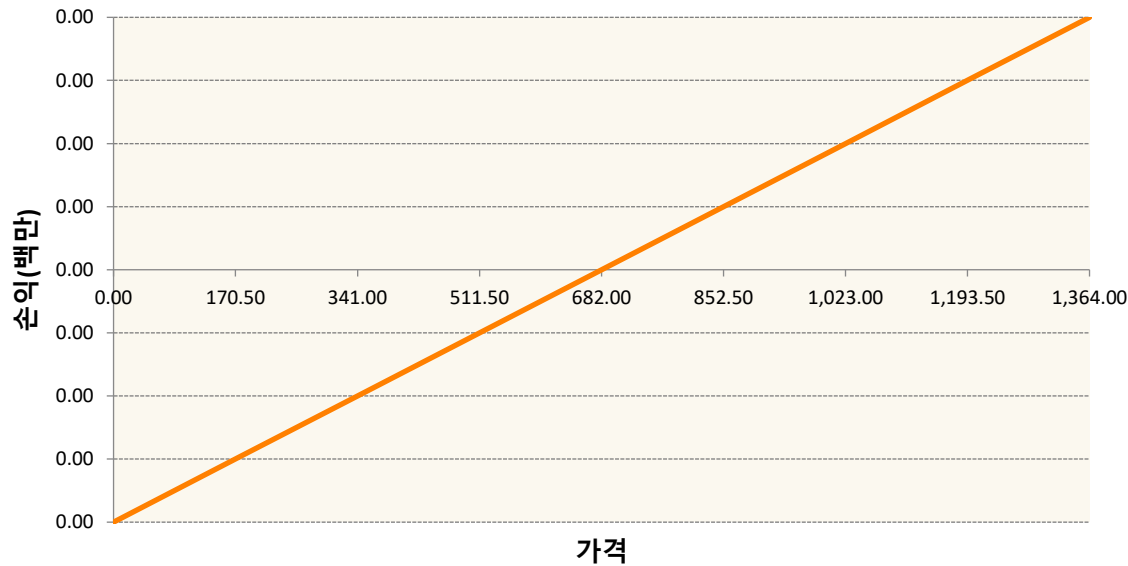
KR4175W40006-2025-04 달러선물



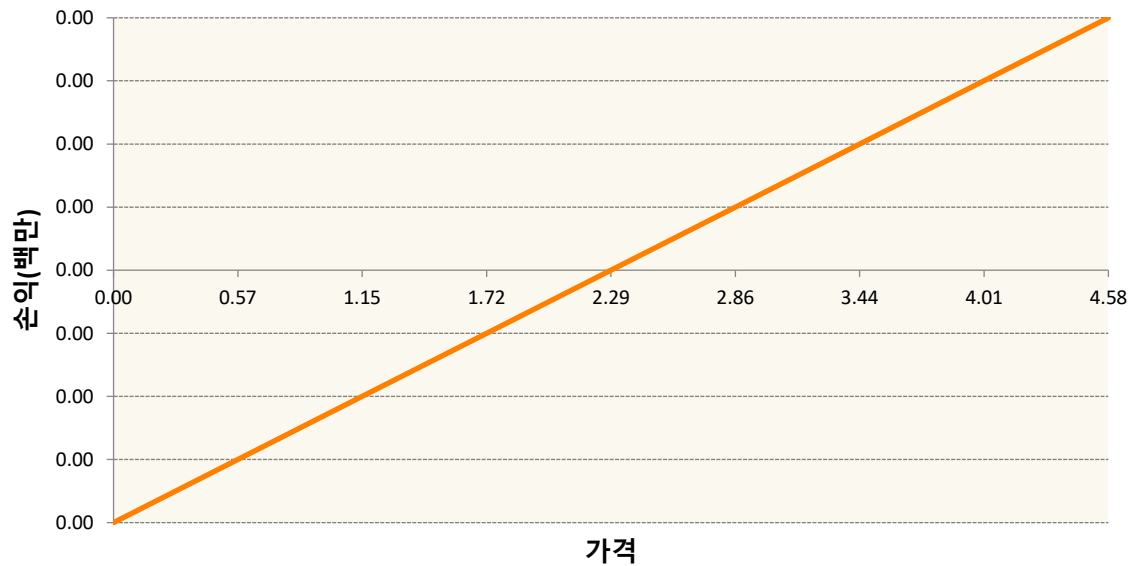
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



QSK5-Low Su Gasoil G May 25



XBK5-GASOLINE RBOB FUT May 25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLK5	WTI CRUDE FUTURE May25	8
CON5	BRENT CRUDE FUTR Jul25	17
ECK5	E-mini Crude Oil May 25	4
EOK5	E-MINI NATURAL GAS May 25	6
KR4175W40	(2025-04 달러선물	12
NGK25	NATURAL GAS FUTR May 25	14
QSK5	Low Su Gasoil G May 25	8
XBK5	GASOLINE RBOB FUT May 25	11

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

148