

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

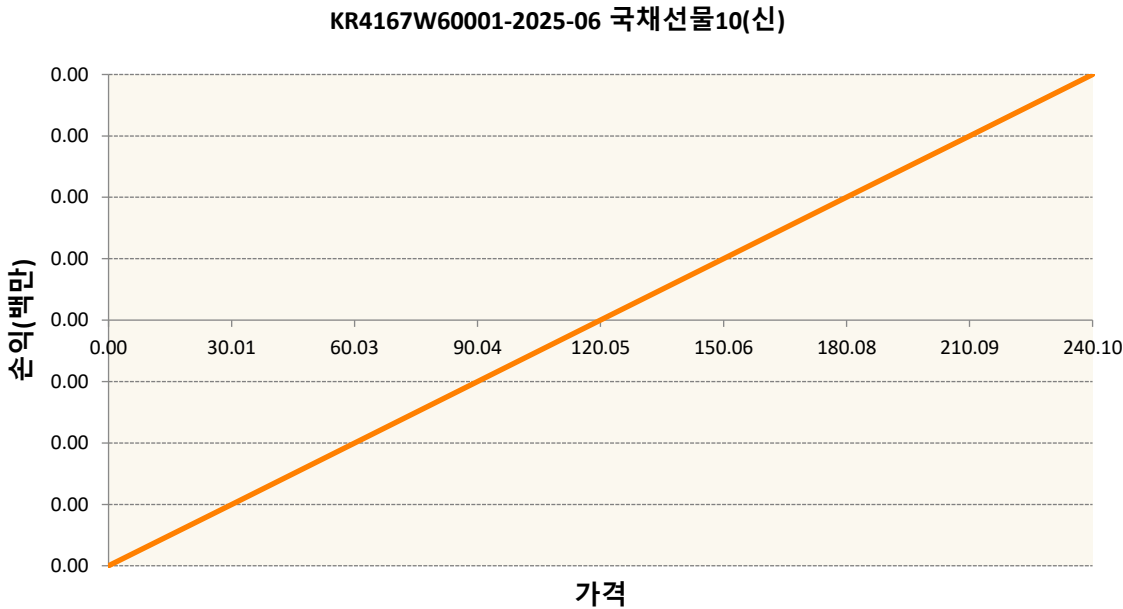
베스트장기채(채권-파생형)

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	158,466	0	158,466	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,631

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

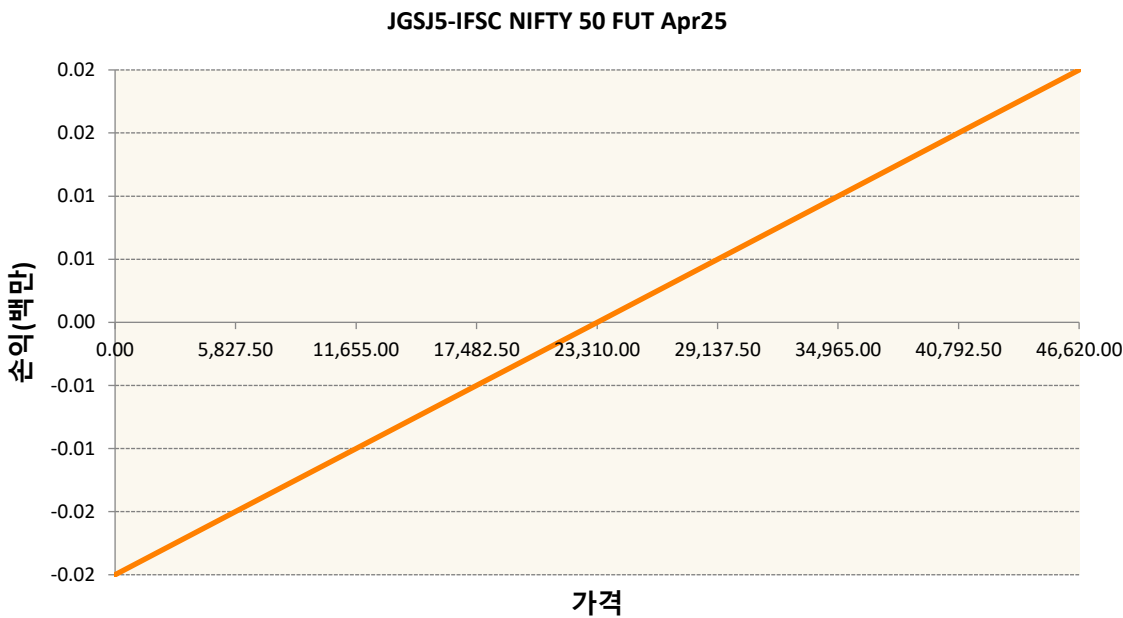
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	752	0	752	

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	2025-04-07
기준일	2025-04-04

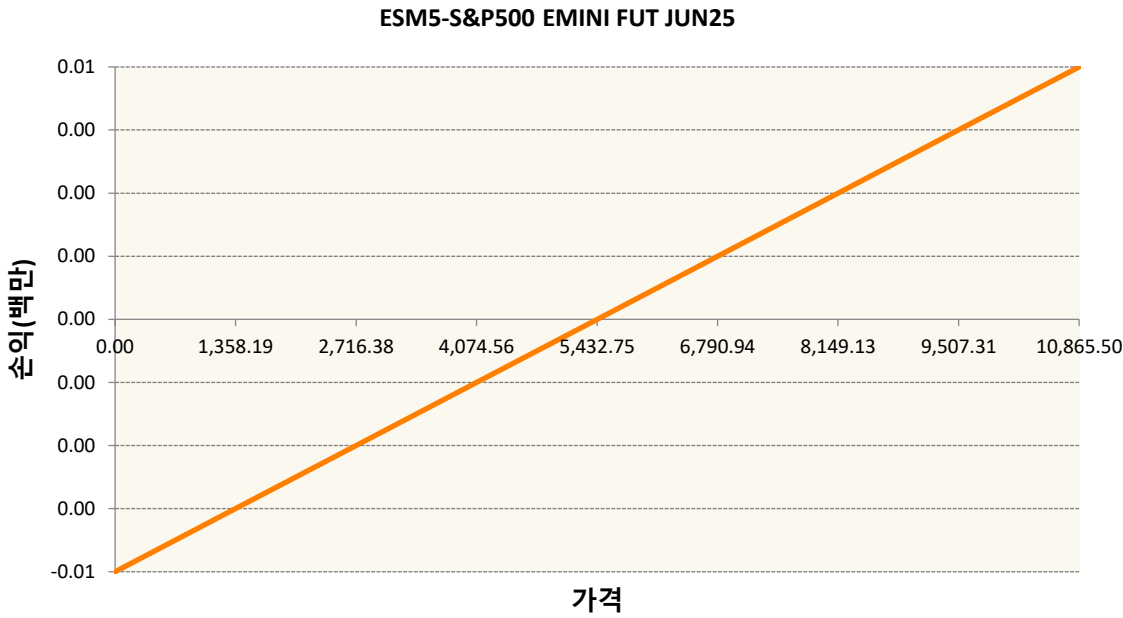
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	398	0	398	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	32
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

23

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

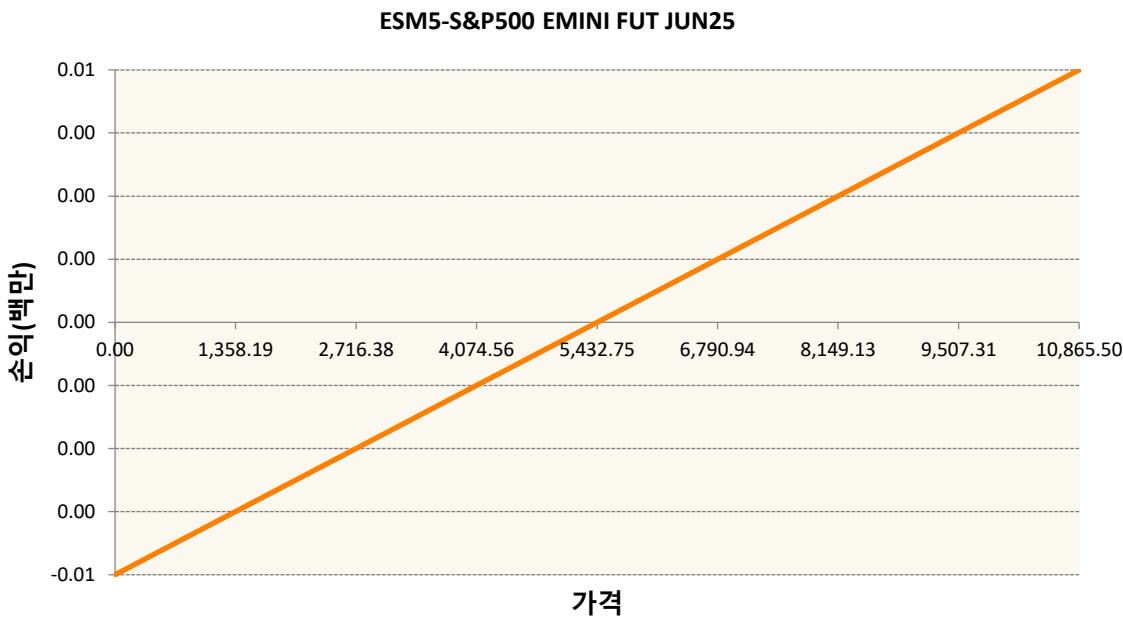
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,386	0	2,386	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	191
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

137

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

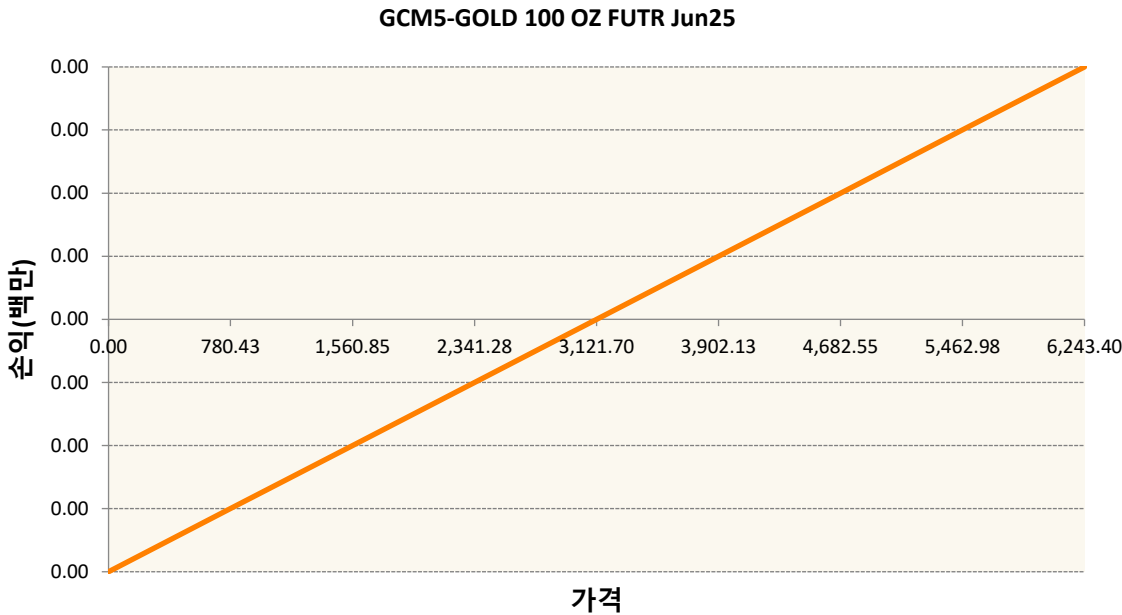
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,291	0	2,291	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 04/04/25 C283 EQUITY	1
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	183

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

(단위:백만원)

134

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

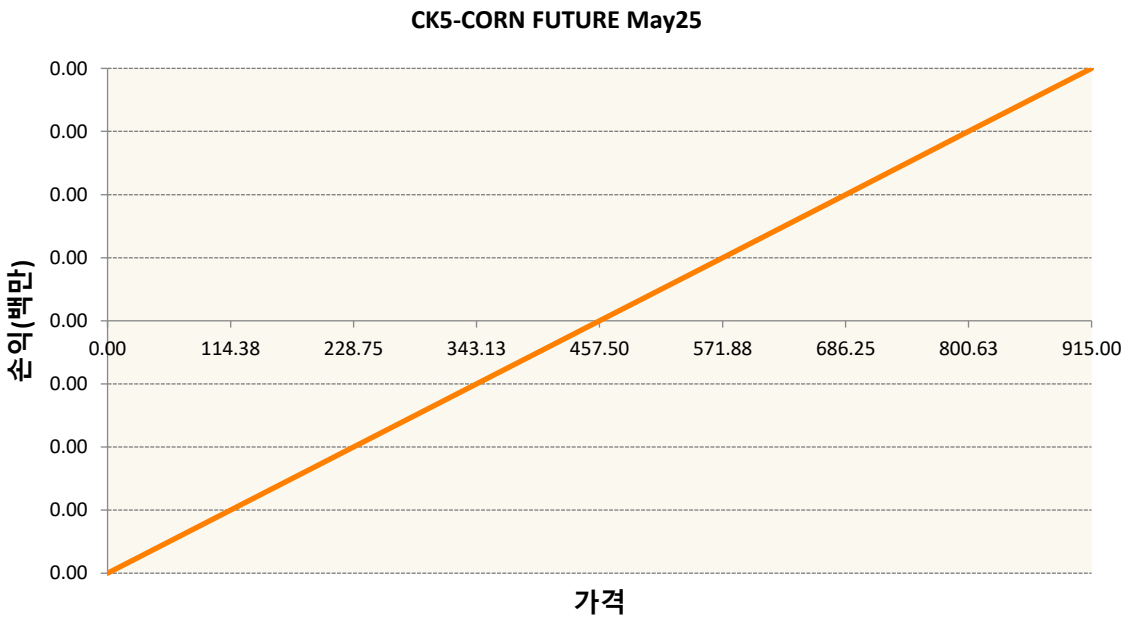
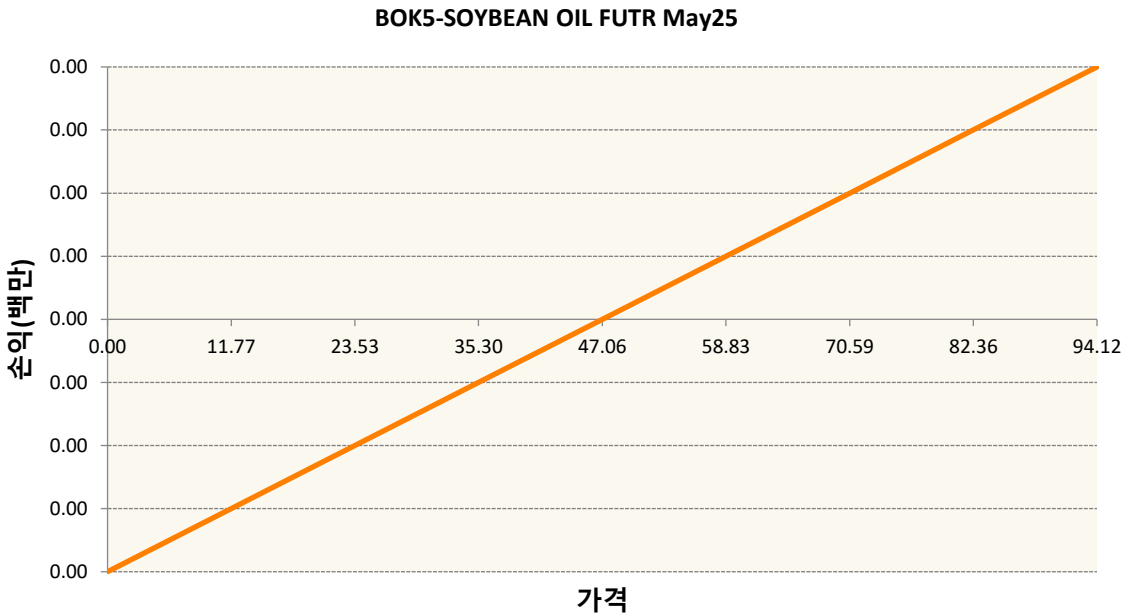
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

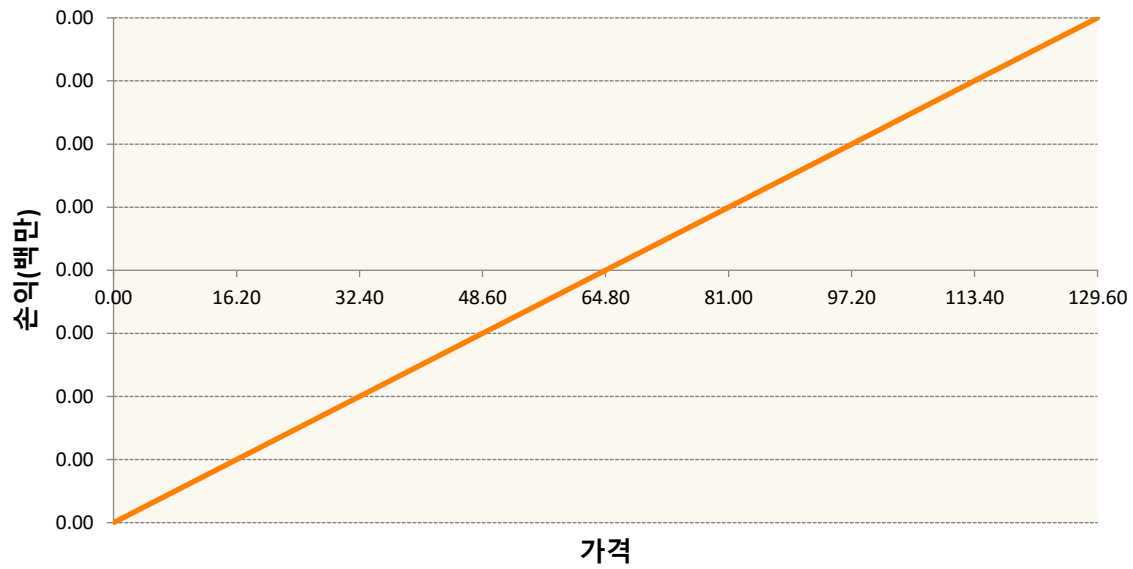
(단위:USD 백만)

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	3,735	0	3,735	
누계	통화	선물	0	373	-373	장내

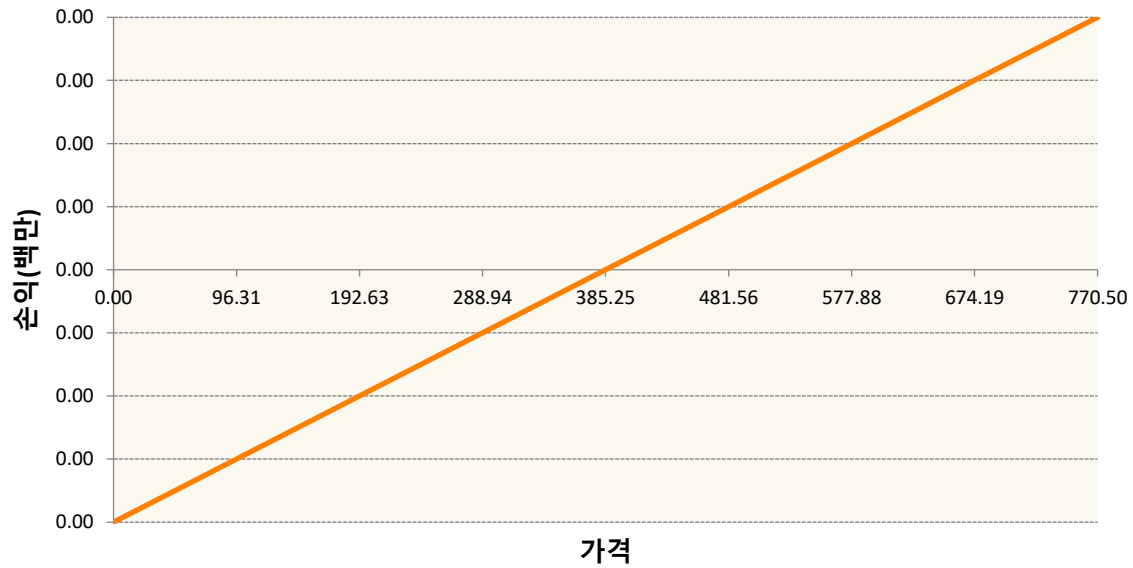
2. 만기시점의 손익구조



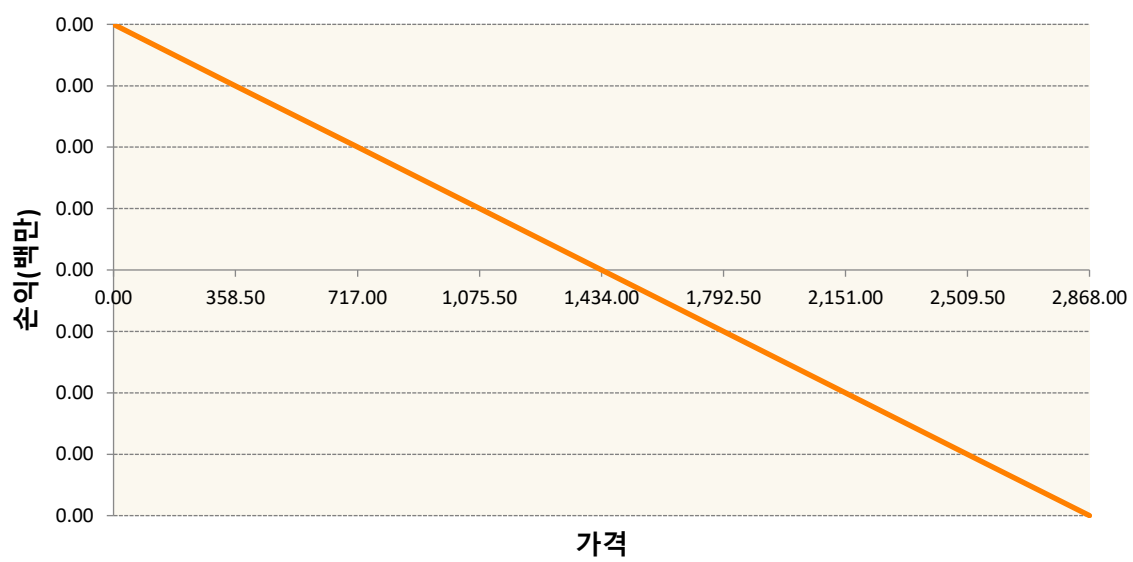
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



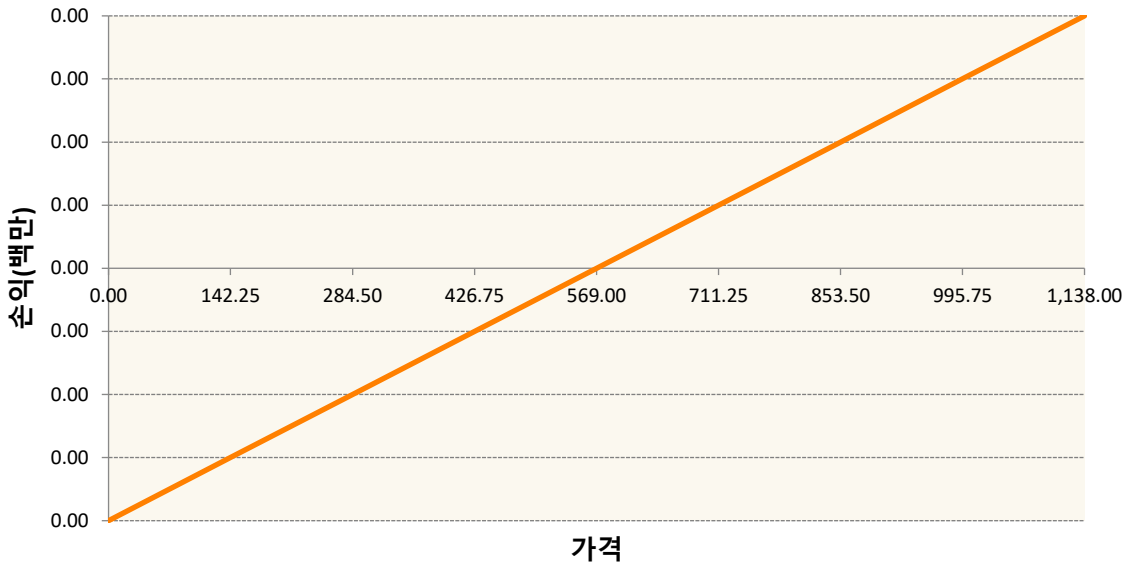
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



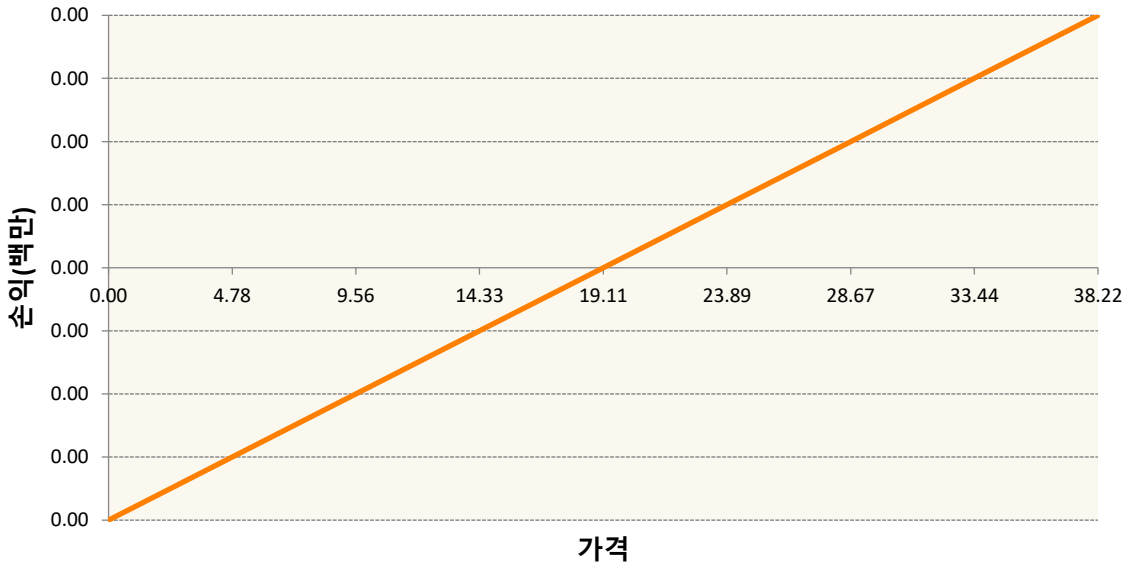
KR4175W40006-2025-04 달러선물



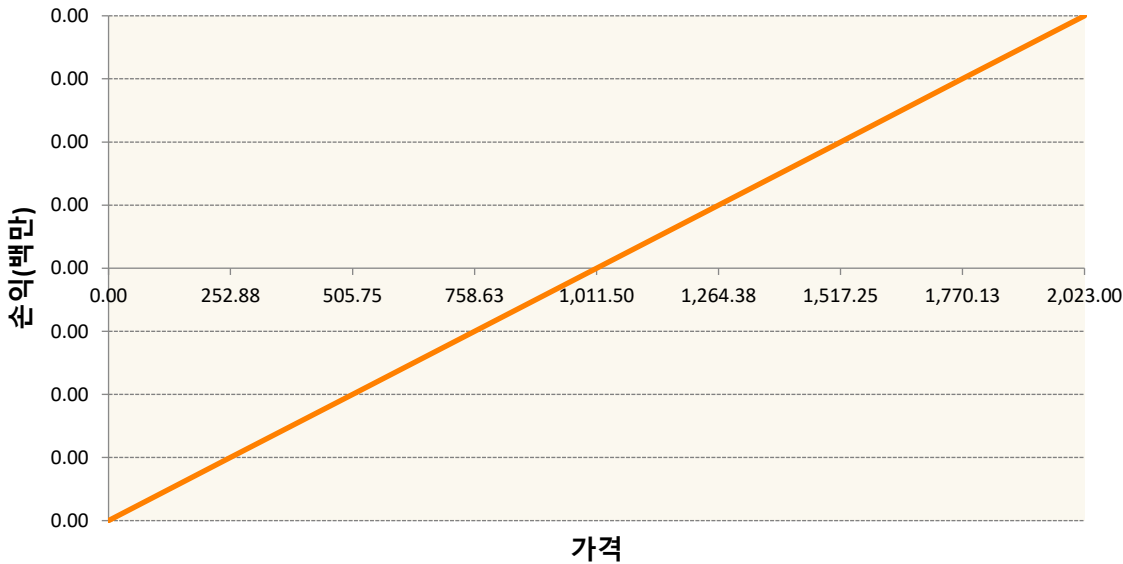
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



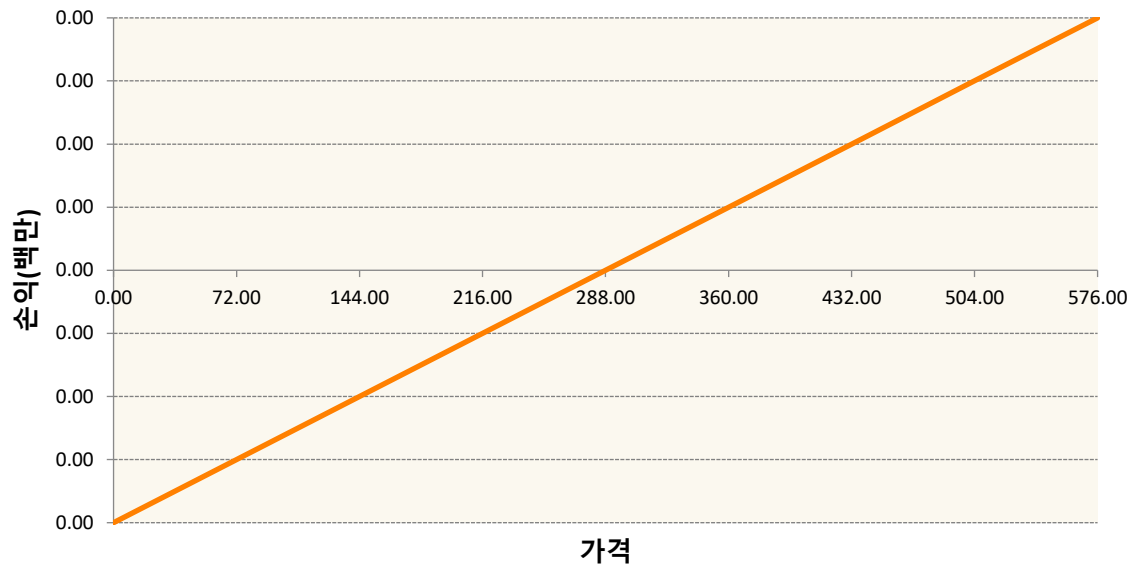
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



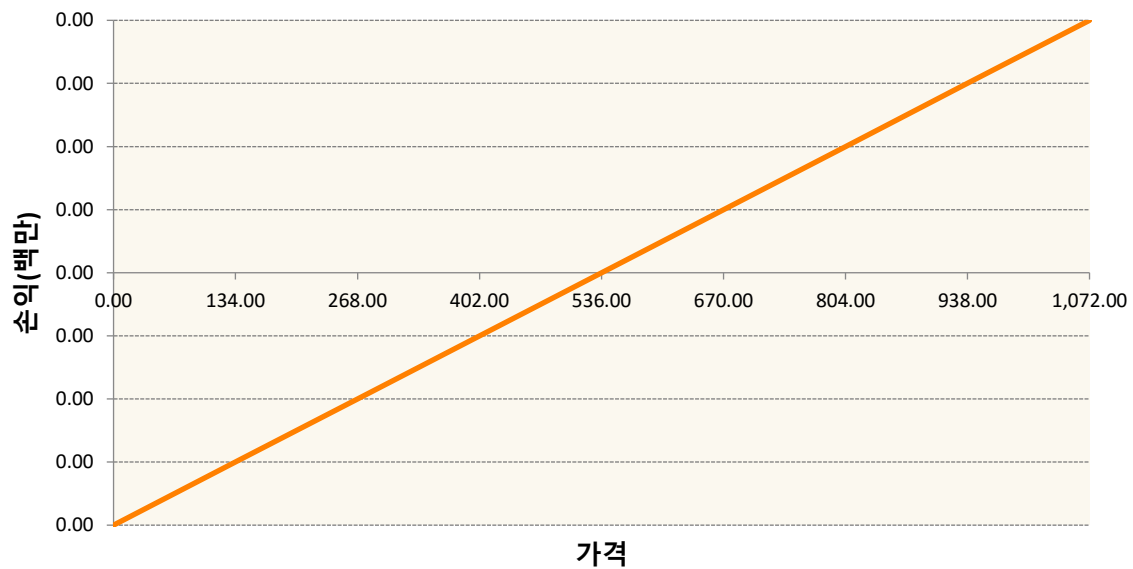
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-04-07
기준일	2025-04-04

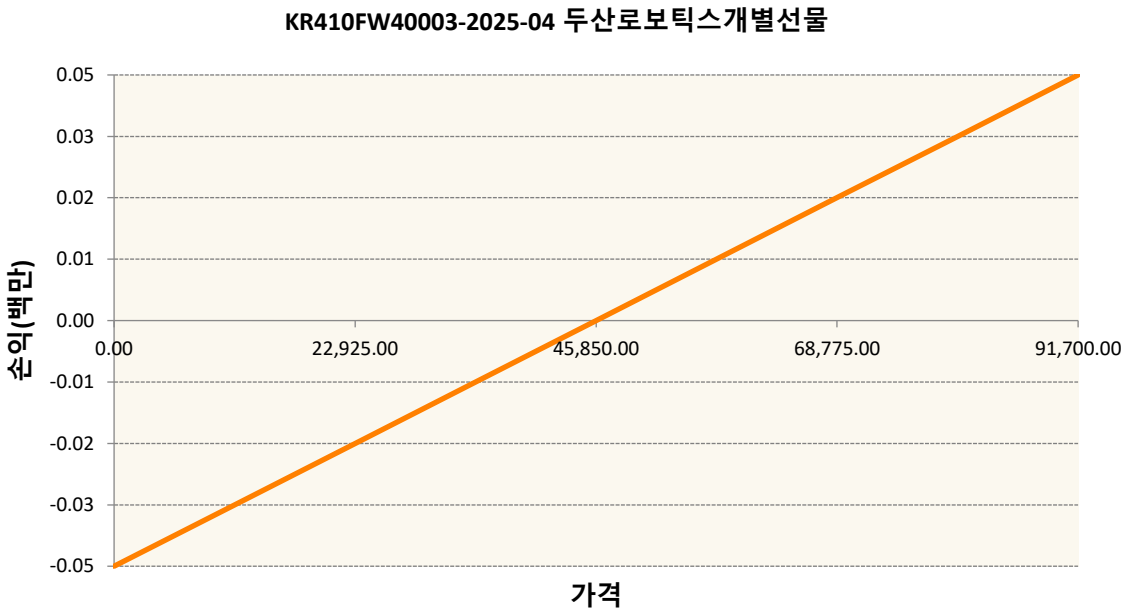
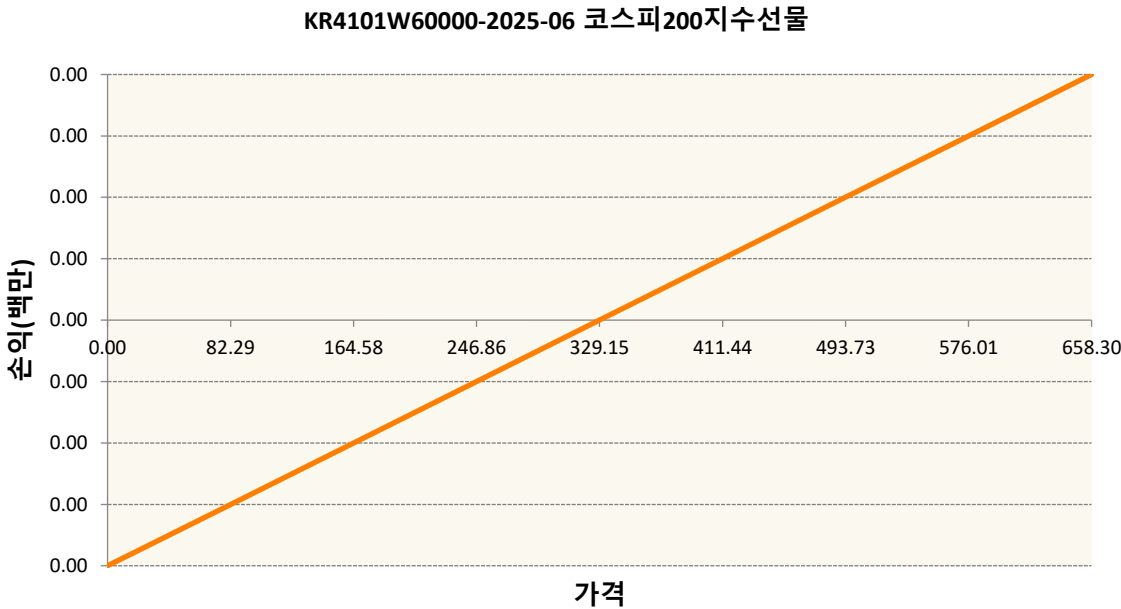
스마트인덱스모

1. 계약금액

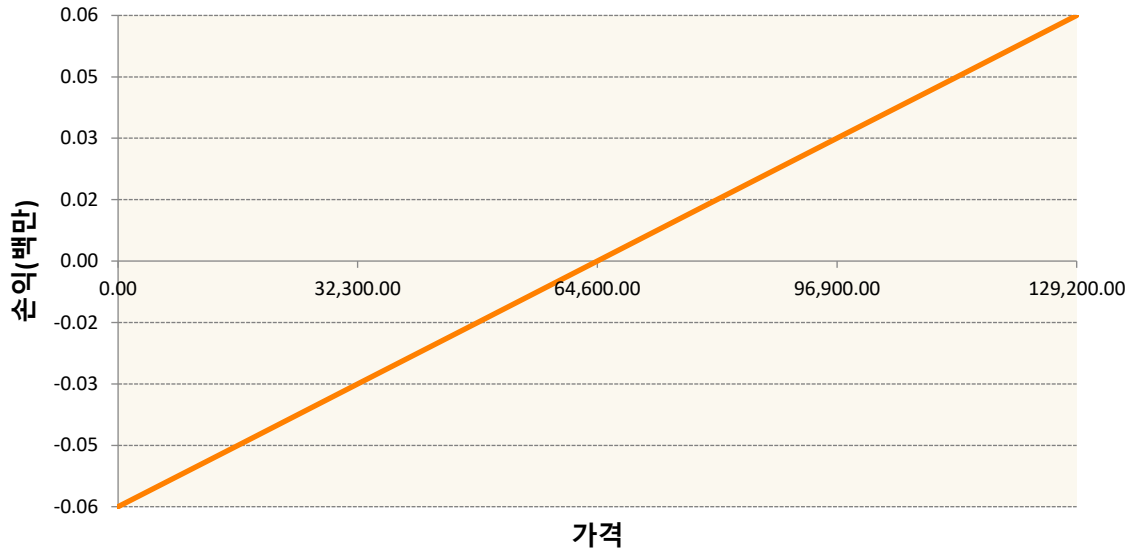
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	164	82	82	장내
누계	유가증권	선물	2,339	0	2,339	장내

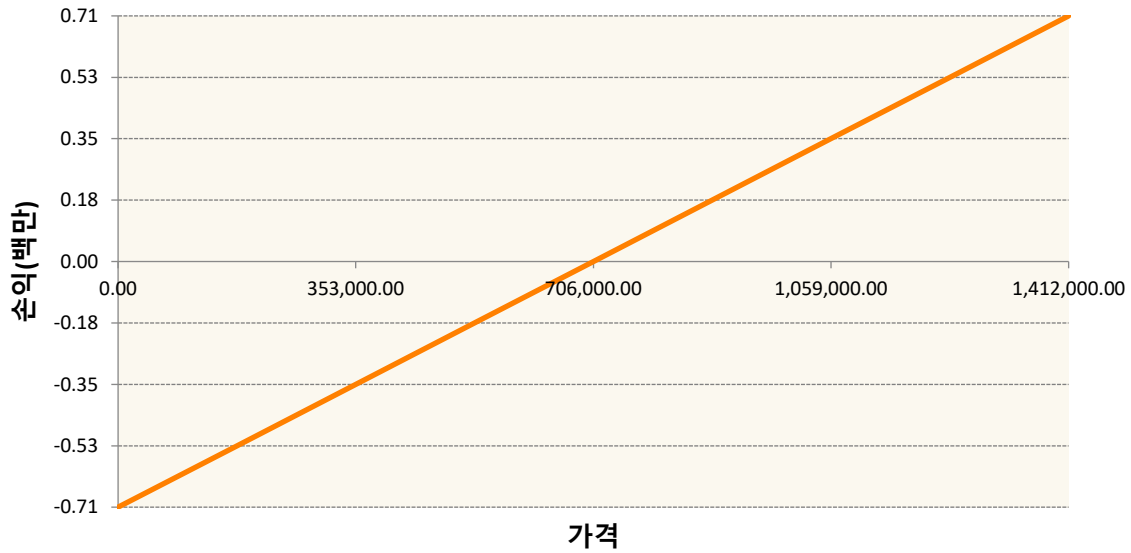
2. 만기시점의 손익구조



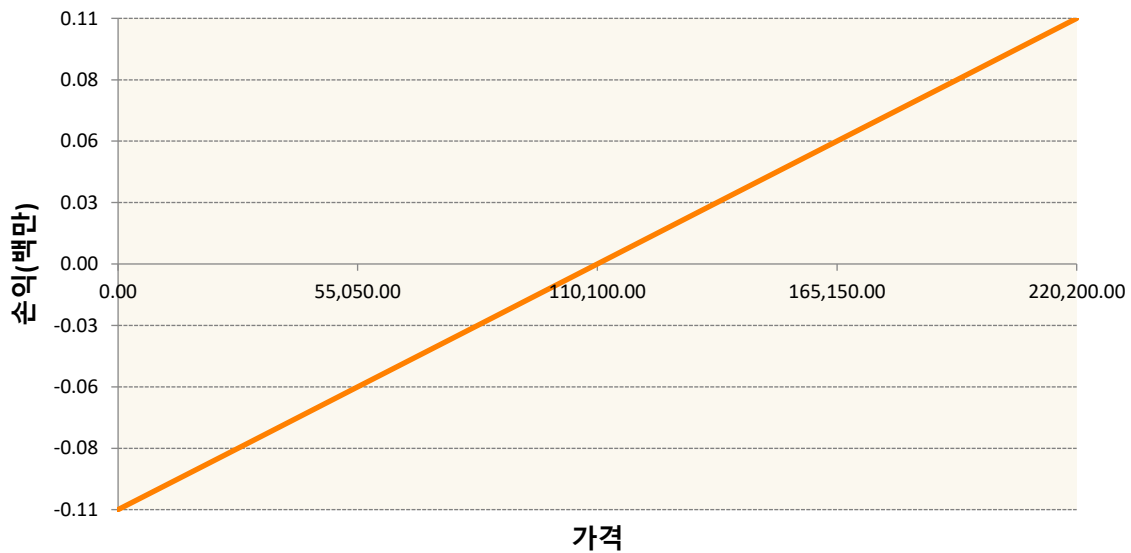
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



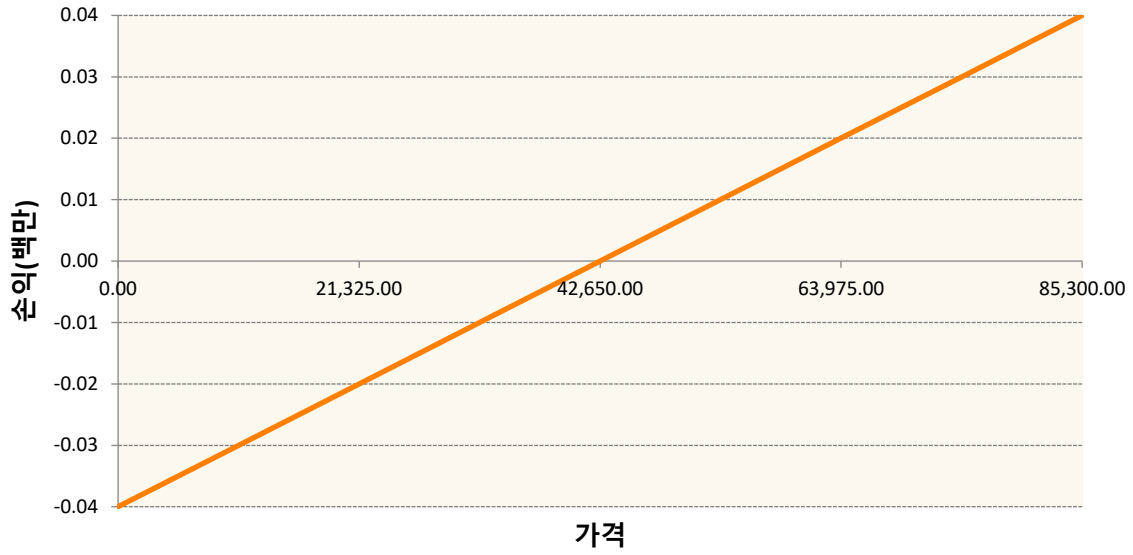
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



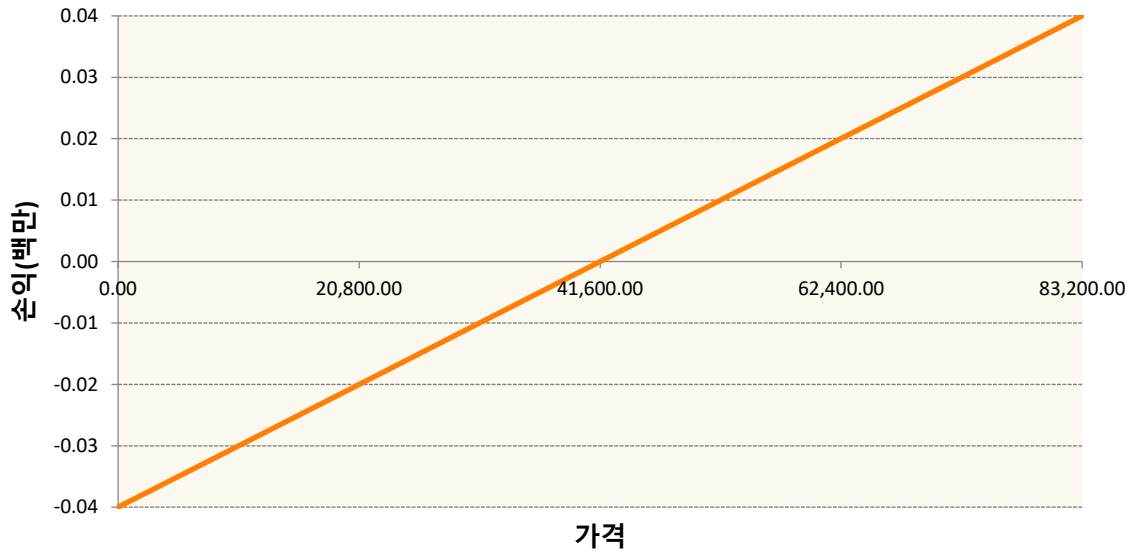
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



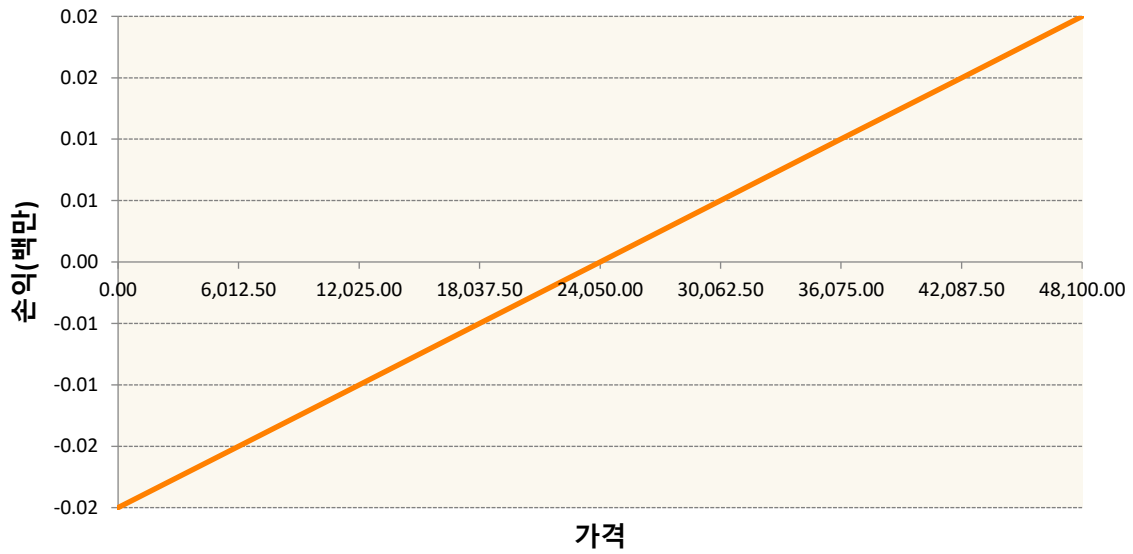
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



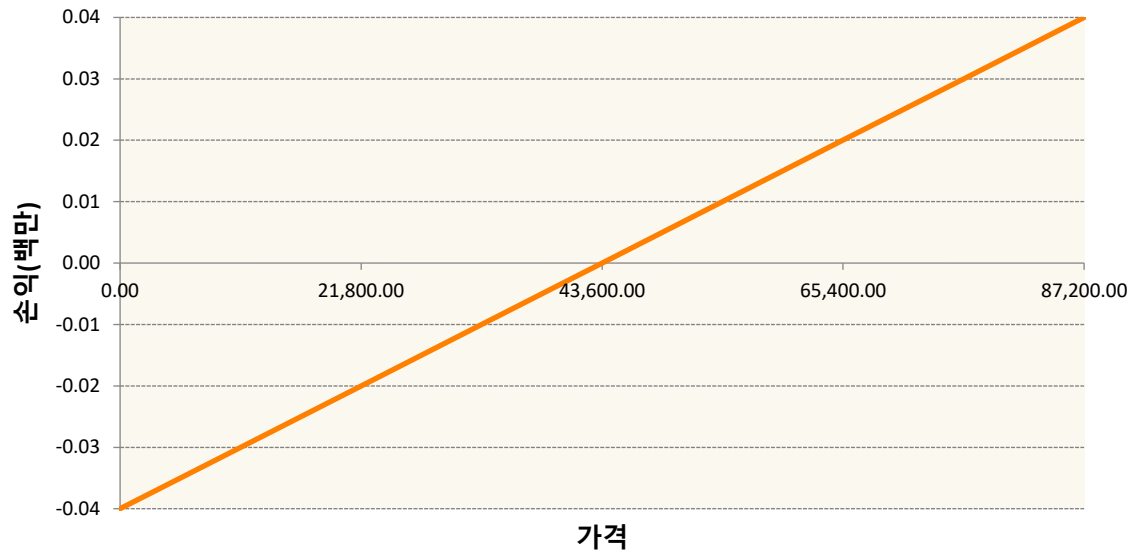
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



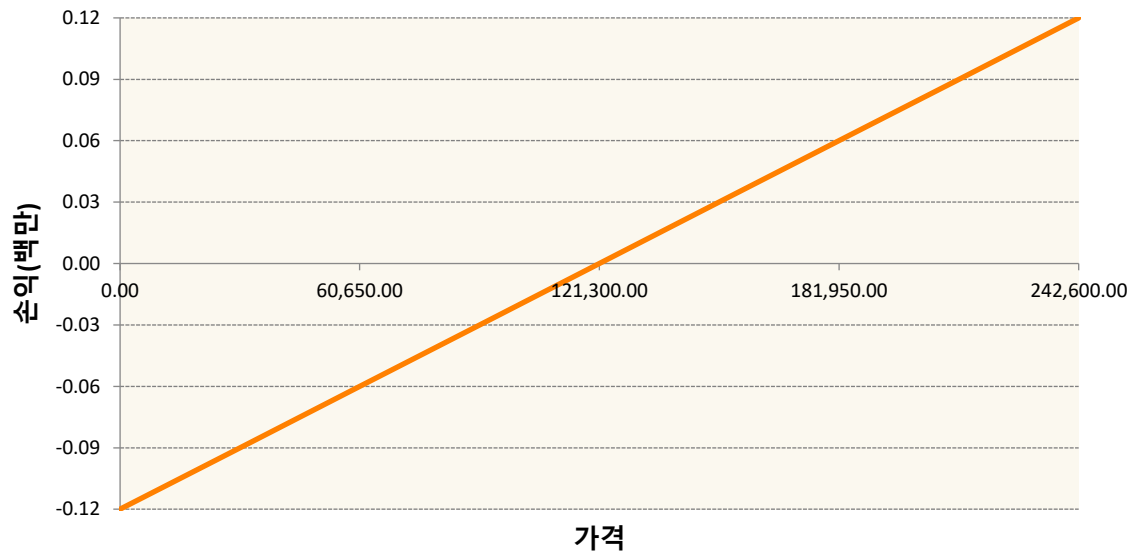
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



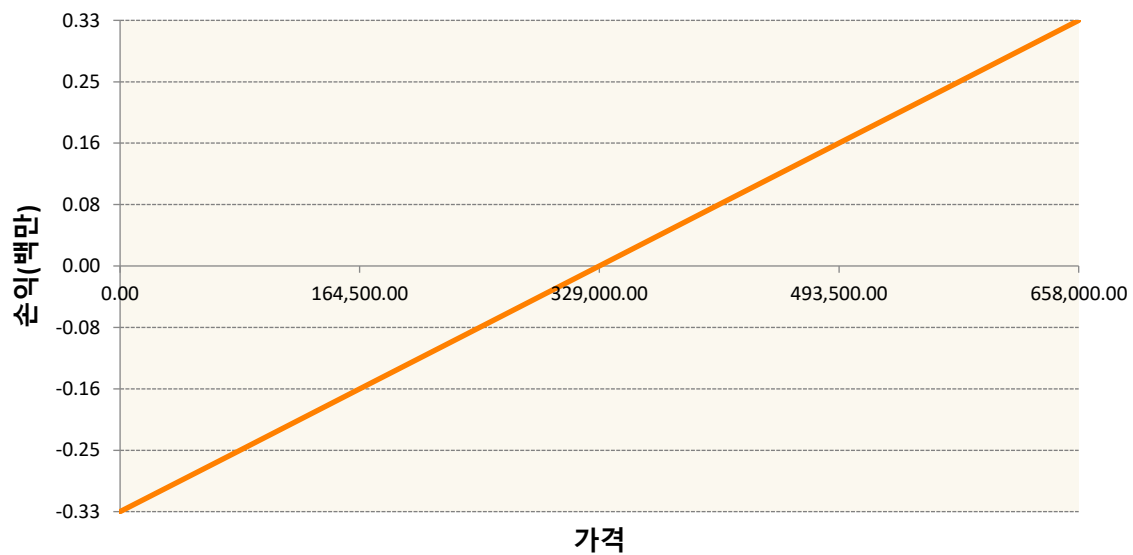
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



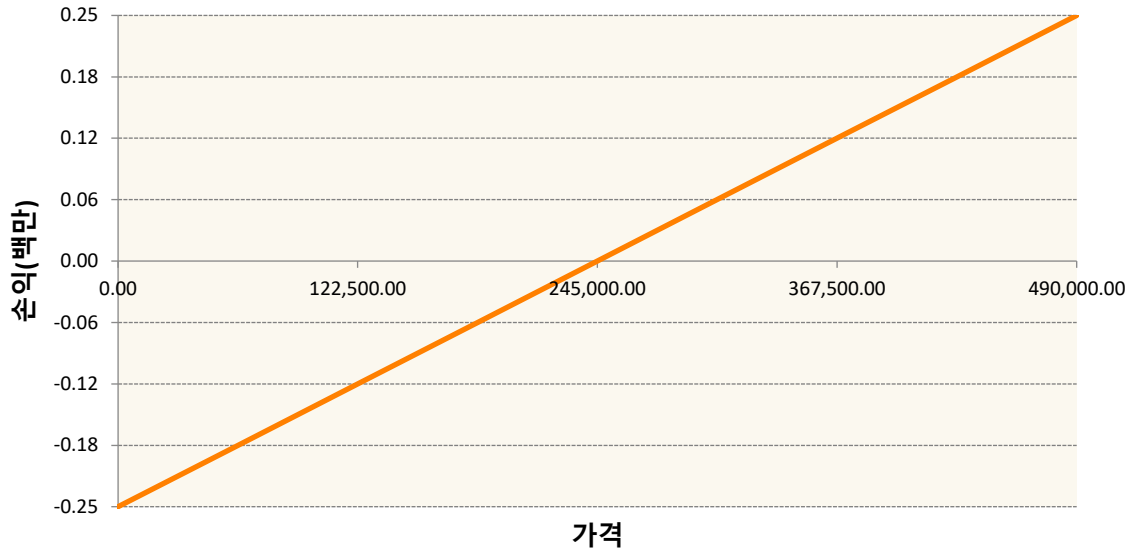
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



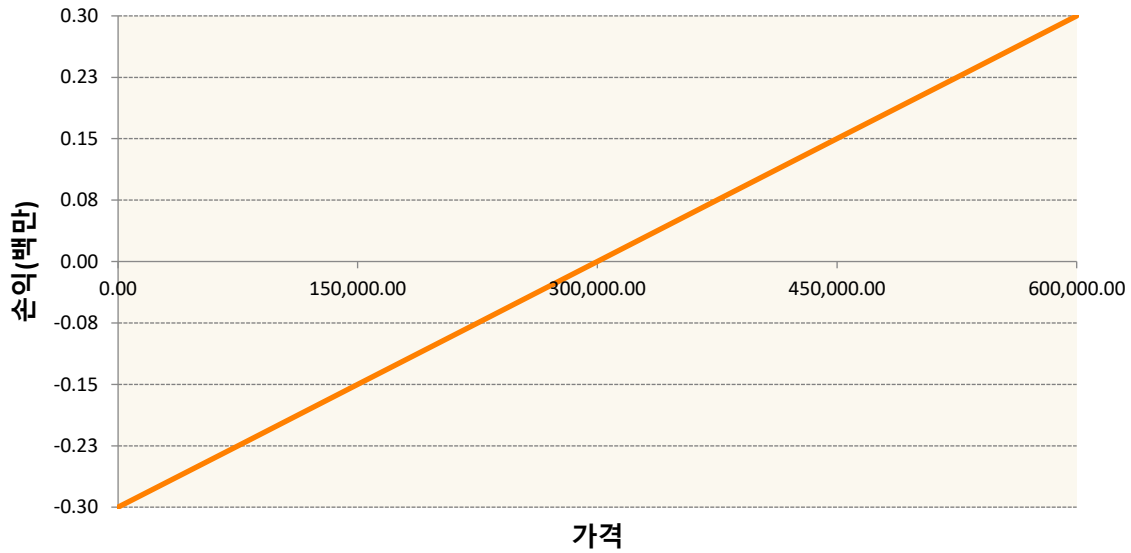
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



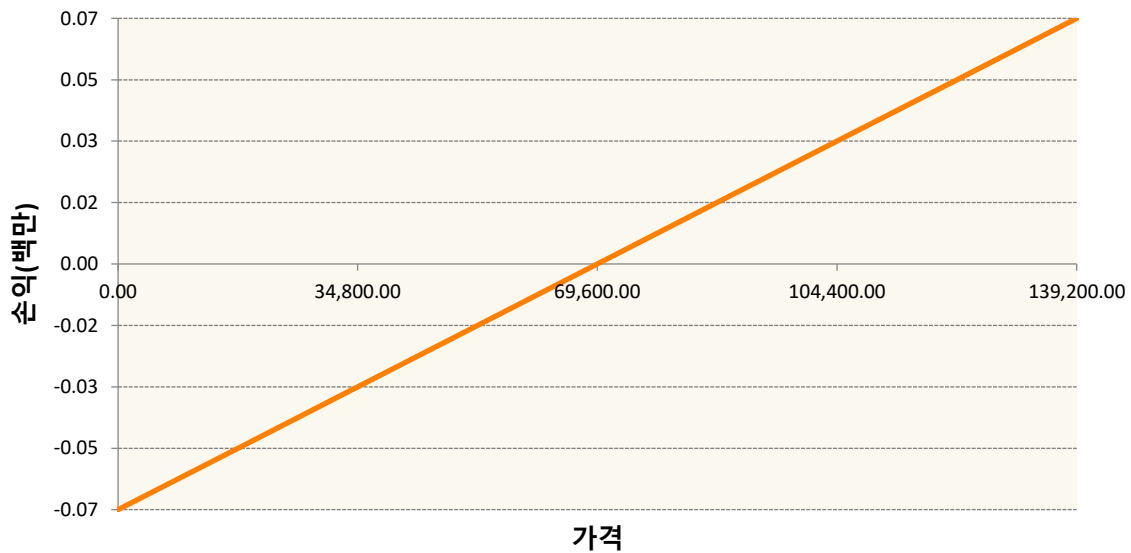
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



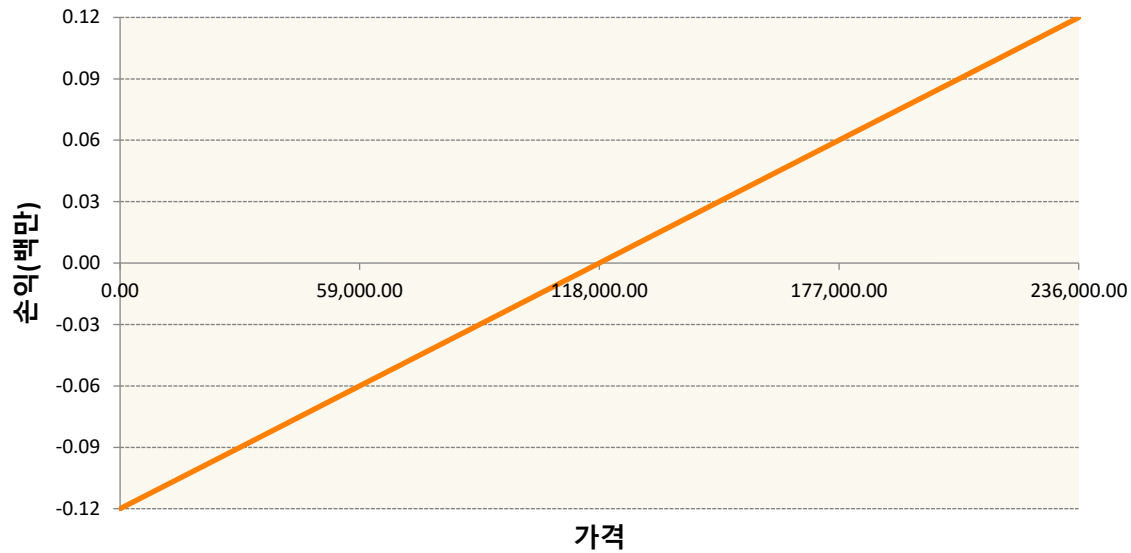
KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



KR41HEW40009-2025-04 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	92
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	3
KR41BHW40 2025-04 한화에어로스페이스개별선물	26
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)

392

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,904	0	3,904	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래250320

295

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

453

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

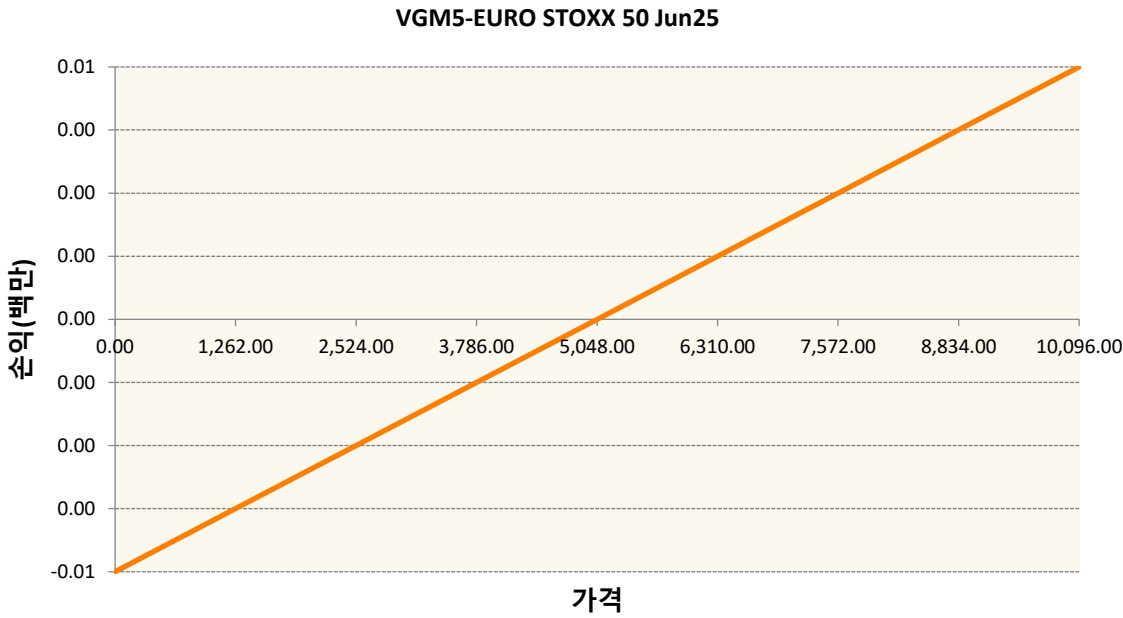
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	883	0	883	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5 EURO STOXX 50 Jun25

71

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

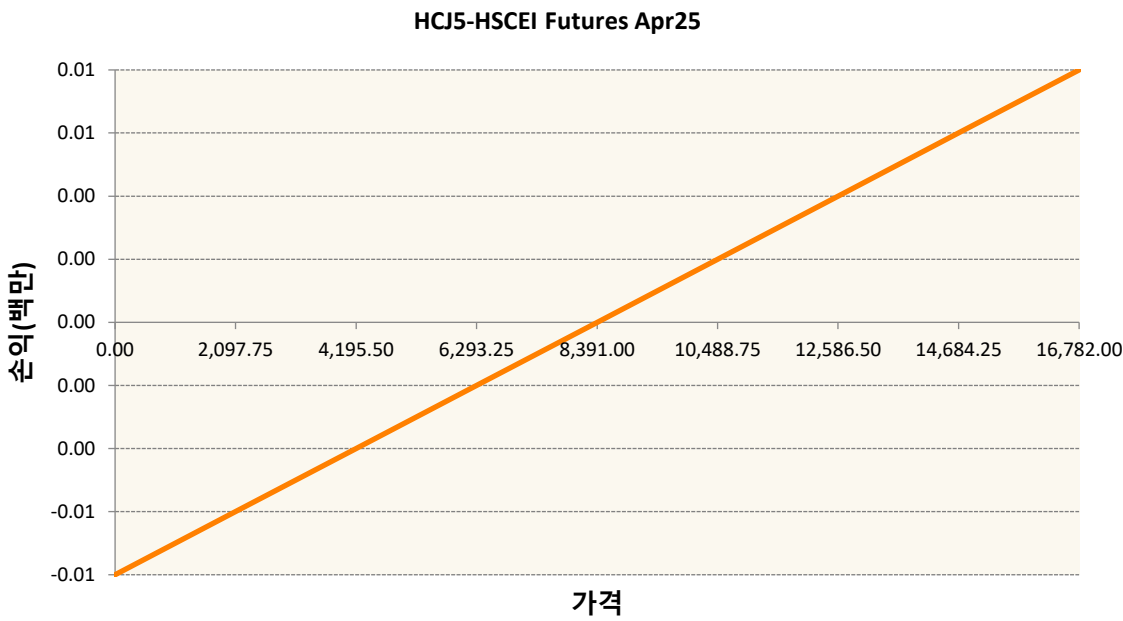
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,086	0	3,086	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI5	HSCEI Futures Apr25	247
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

338

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

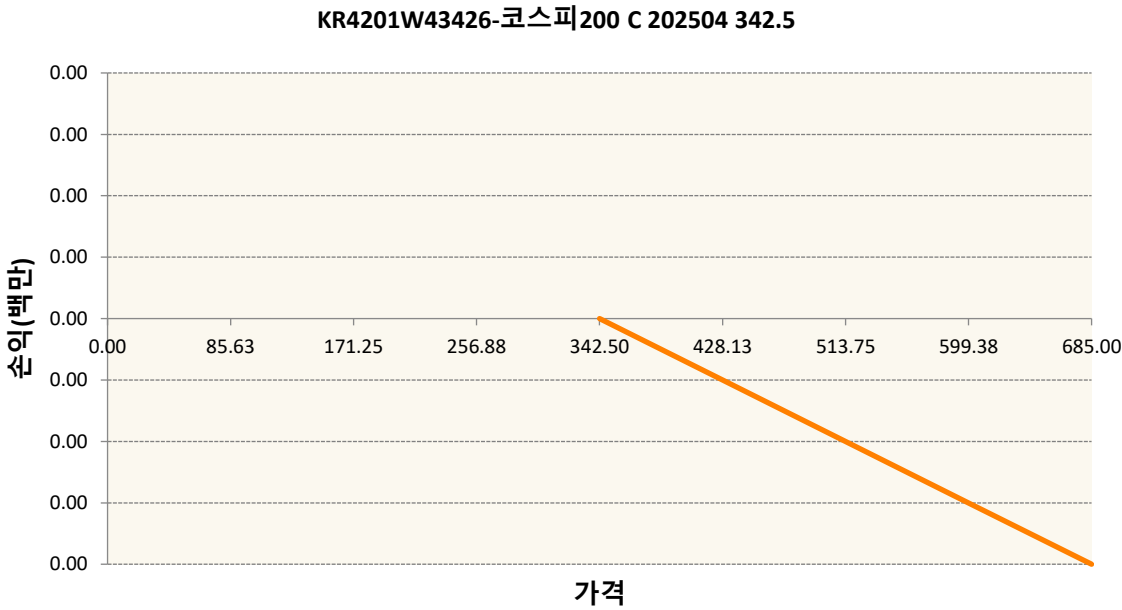
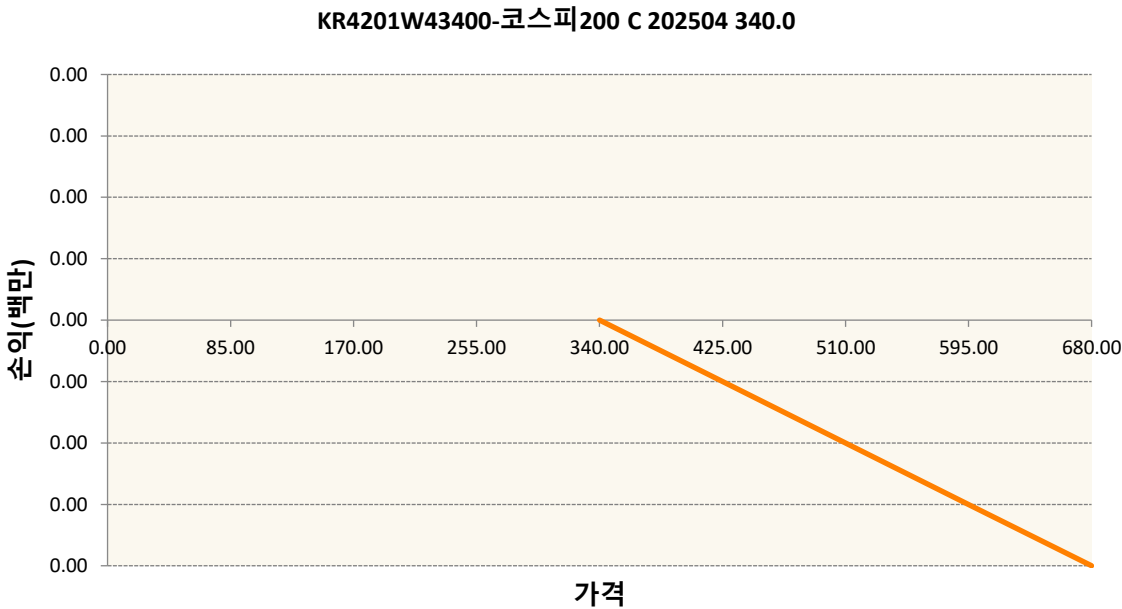
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	178	-178	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,471	-37,471	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 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
340.00	0.00

가격	순이익(백만)
0.00	0.00
85.63	0.00
171.25	0.00
256.88	0.00
342.50	0.00
428.13	0.00
513.75	0.00
599.38	0.00
685.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201W43400						코스피200 C 202504 340.0		581
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33	33
-5.33%	33	33	33	32	32	31	30	30
-2.67%	32	31	30	28	25	21	17	17
0%	21	15	8	0	-9	-18	-27	-27
2.67%	-51	-65	-79	-92	-106	-120	-134	-134
5.33%	-248	-259	-271	-283	-295	-308	-321	-321
8.00%	-545	-548	-553	-559	-565	-573	-581	-581
KR4201W43426						코스피200 C 202504 342.5		675
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	28	28	28	27
-5.33%	28	28	28	27	27	26	26
-2.67%	27	27	26	24	21	18	14
0%	20	14	8	0	-9	-19	-29
2.67%	-43	-59	-75	-91	-108	-126	-143
5.33%	-251	-269	-286	-304	-322	-340	-358
8.00%	-613	-620	-629	-639	-650	-662	-675
KR4301W43408 코스피200 P 202504 340.0							232

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-232	-232	-232	-232	-232	-232	-232
-5.33%	-151	-151	-151	-151	-152	-152	-153
-2.67%	-71	-71	-72	-72	-73	-75	-76
0%	6	5	2	0	-3	-5	-8
2.67%	68	64	61	57	53	49	46
5.33%	102	99	96	92	89	85	82
8.00%	113	112	110	109	107	104	102

KR4301W43424 코스피200 P 202504 342.5							306
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306
-5.33%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-202
-2.67%	-96	-96	-97	-97	-98	-99	-101
0%	6	5	2	0	-3	-6	-9
2.67%	94	90	85	81	76	71	67
5.33%	149	144	140	135	130	125	120
8.00%	170	168	165	162	159	155	152

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

(단위:백만원)

1,564

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

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	544	0	544	

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	2025-04-07
기준일	2025-04-04

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	4,381	0	4,381	

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	2025-04-07
기준일	2025-04-04

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	12,728	0	12,728	
누계	통화	선도	115	12,405	-12,290	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E	209
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E	212
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E	344
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E	227
FXW213F43C USD/KRW 30-04-25E	9
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

426

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

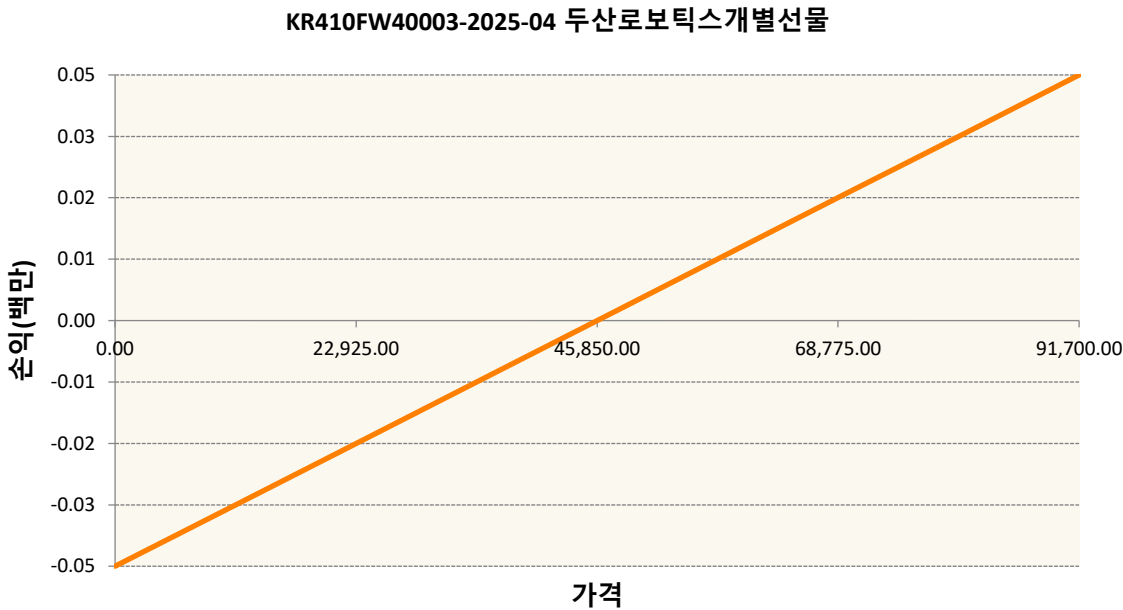
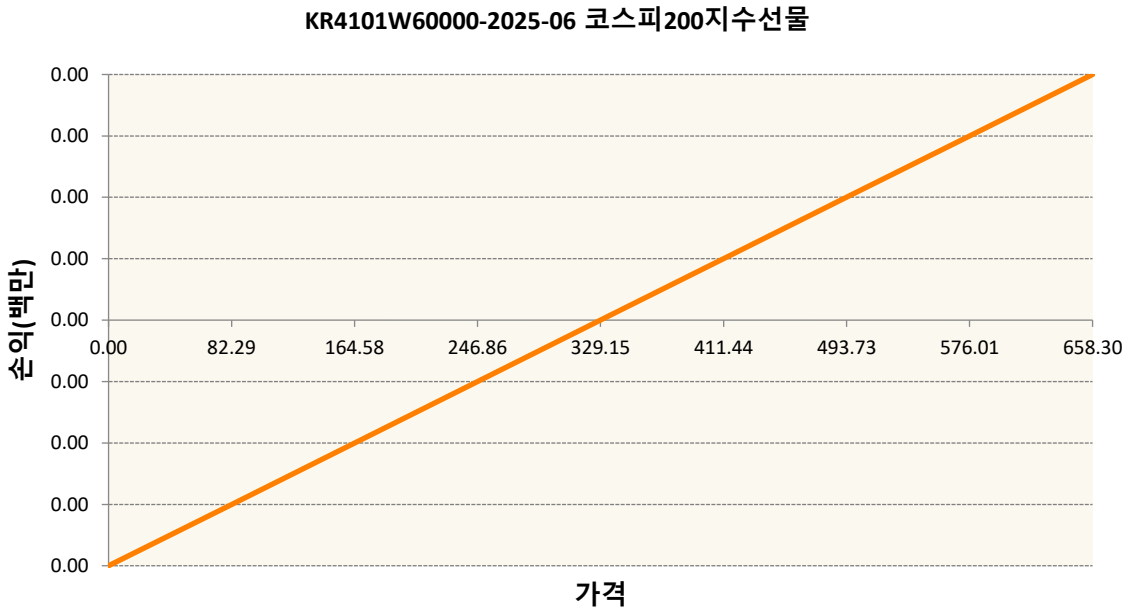
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

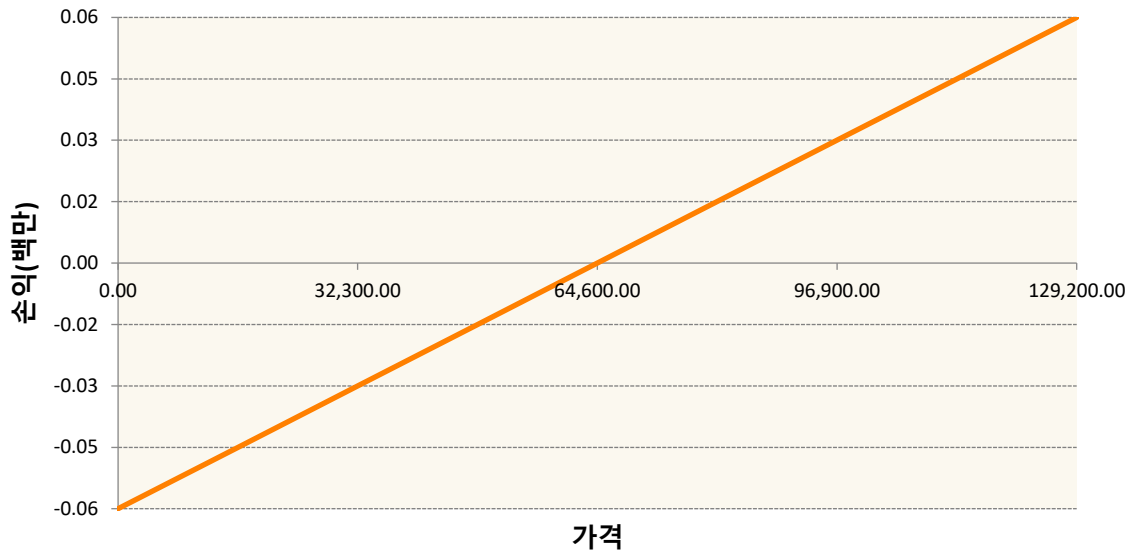
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	164	83	81	장내
누계	유가증권	선물	1,279	0	1,279	장내

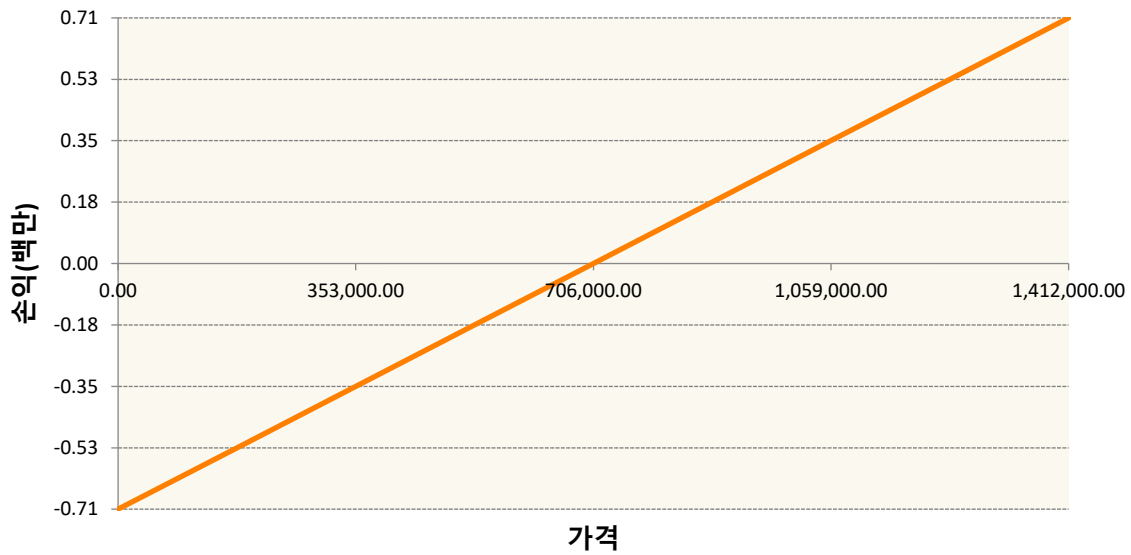
2. 만기시점의 손익구조



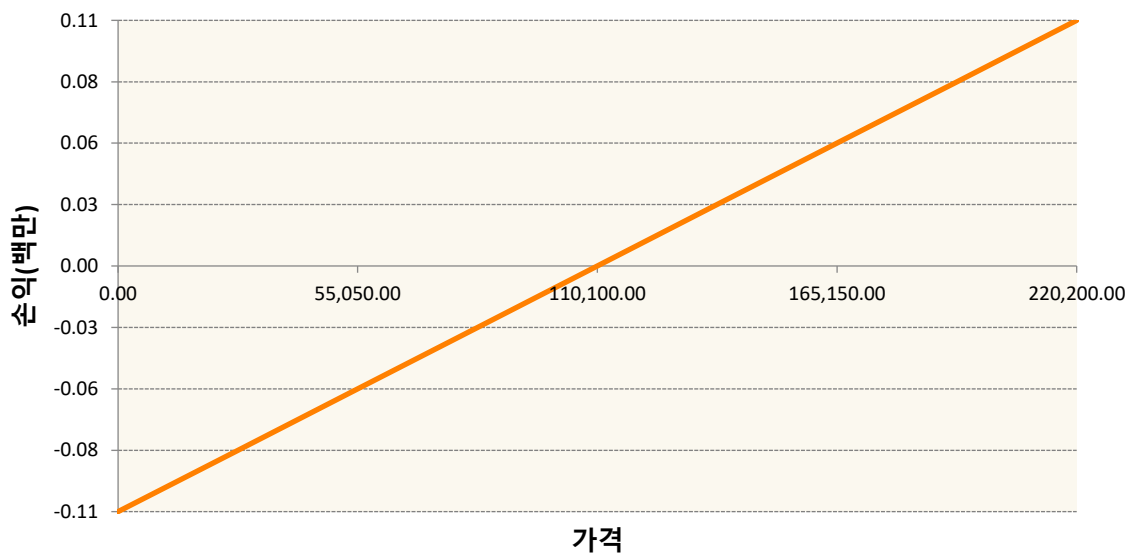
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



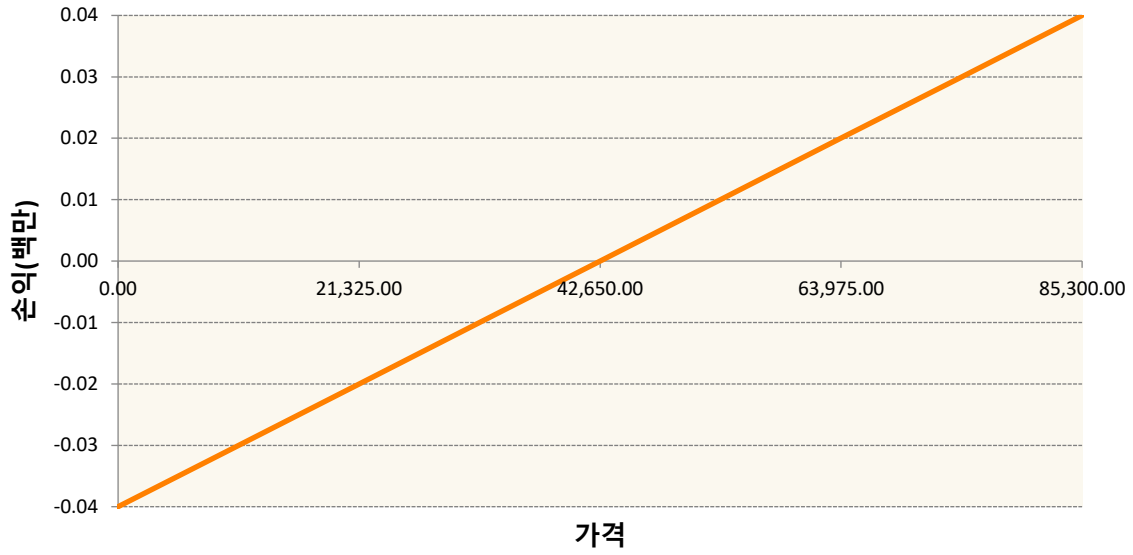
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



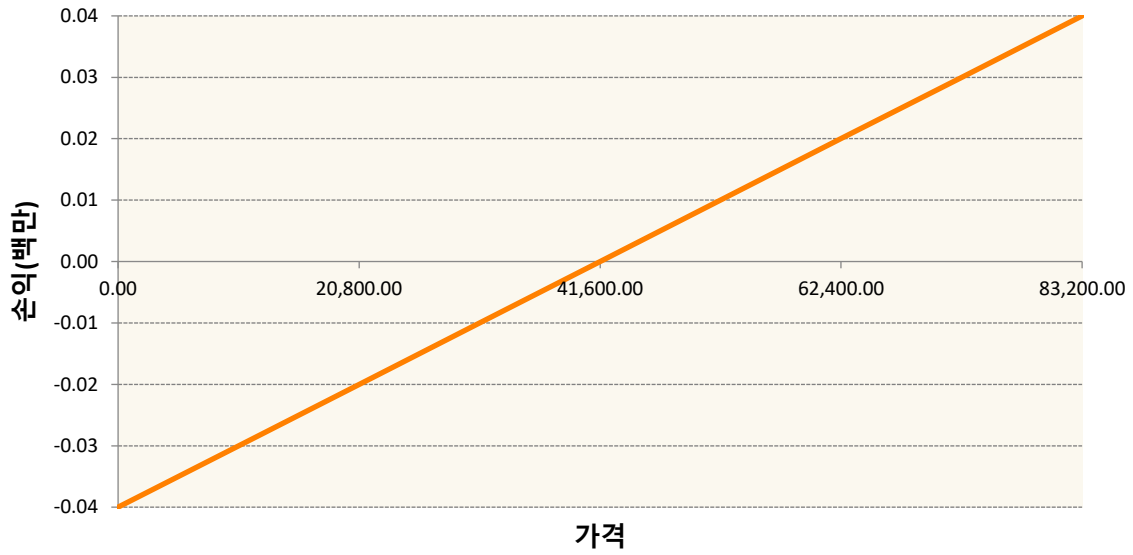
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



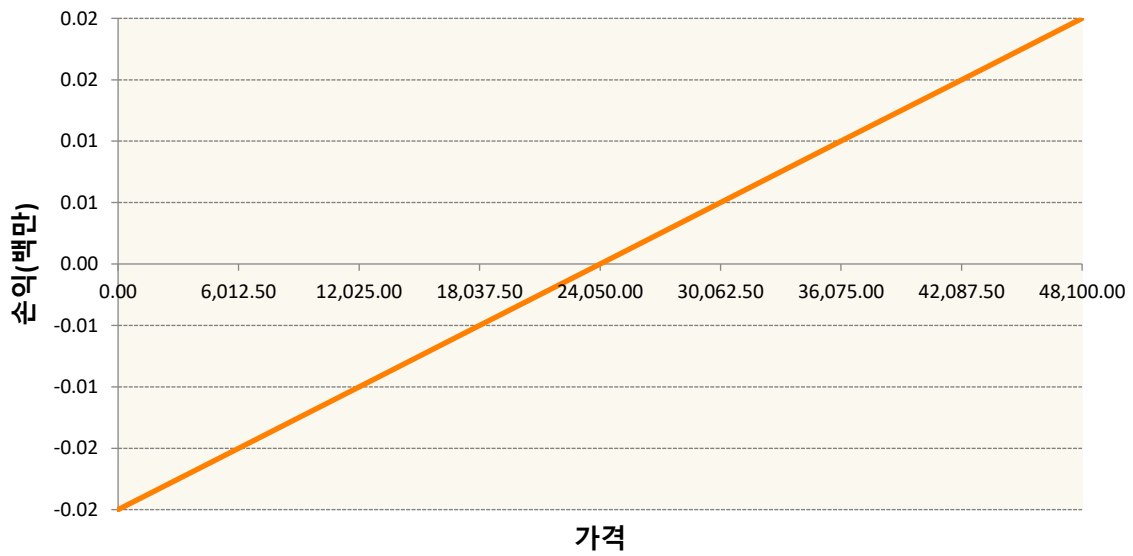
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



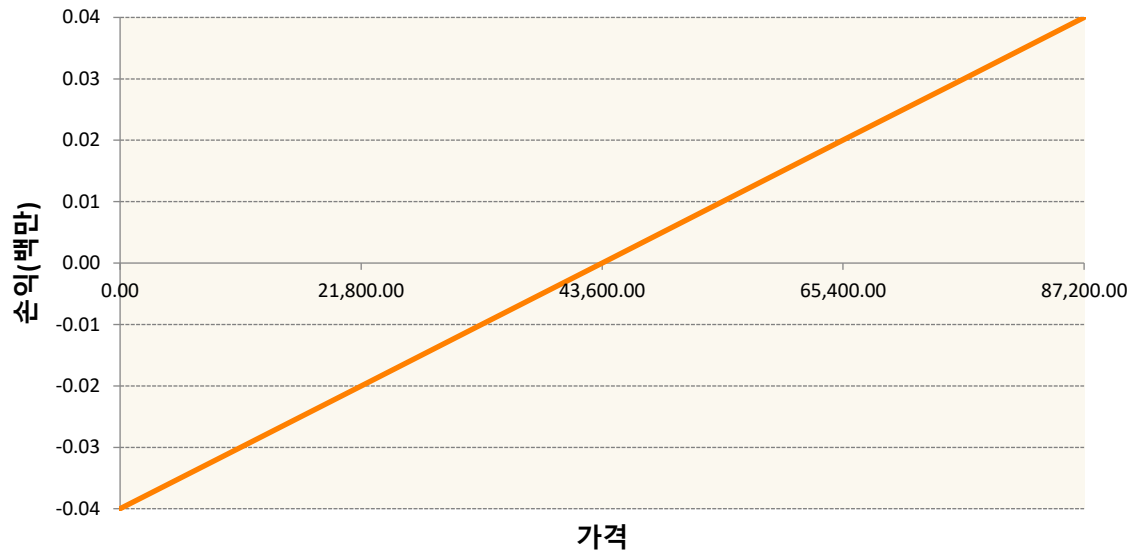
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



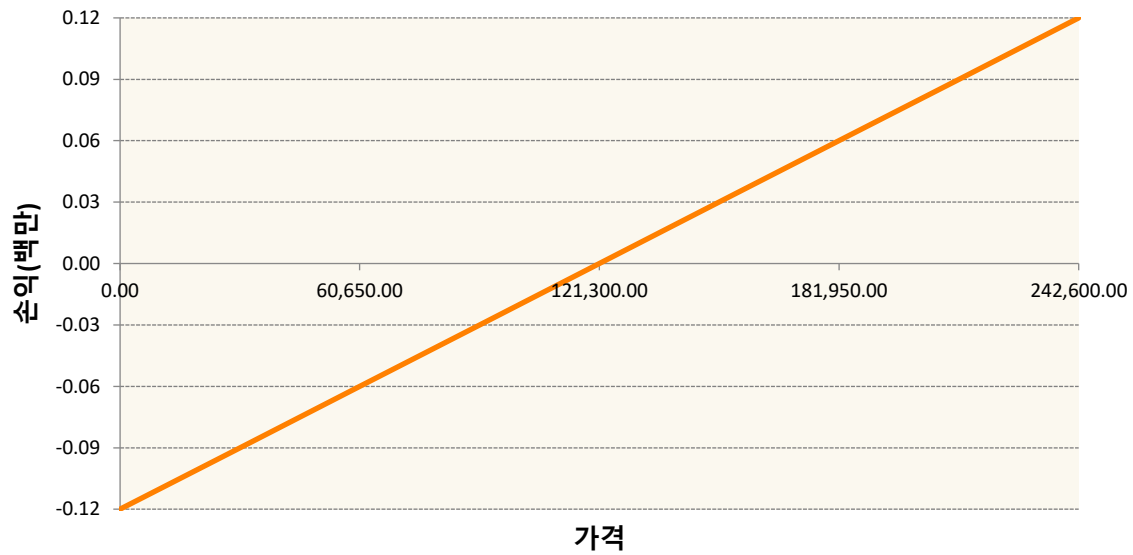
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



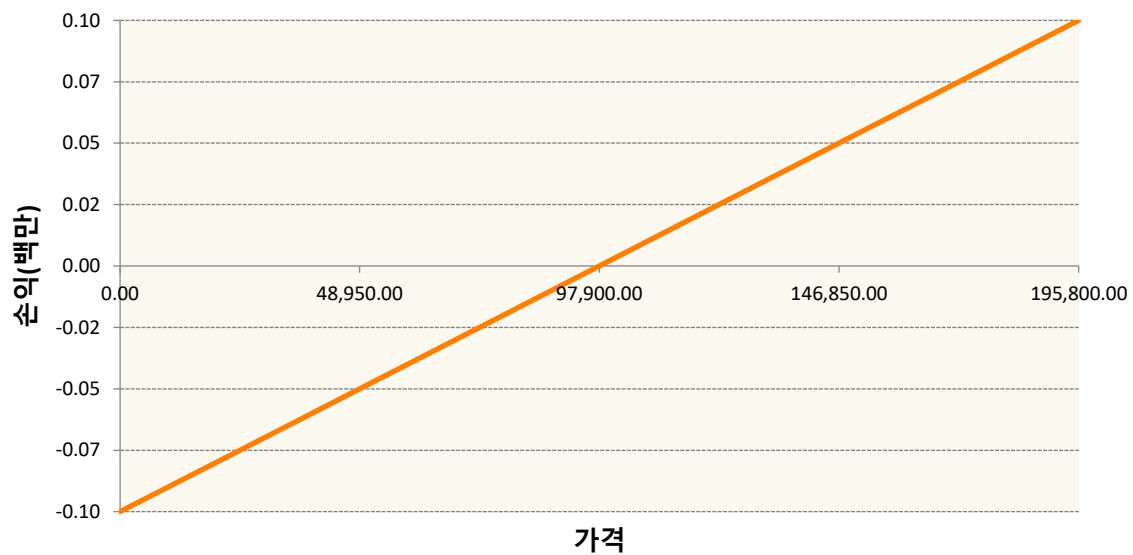
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



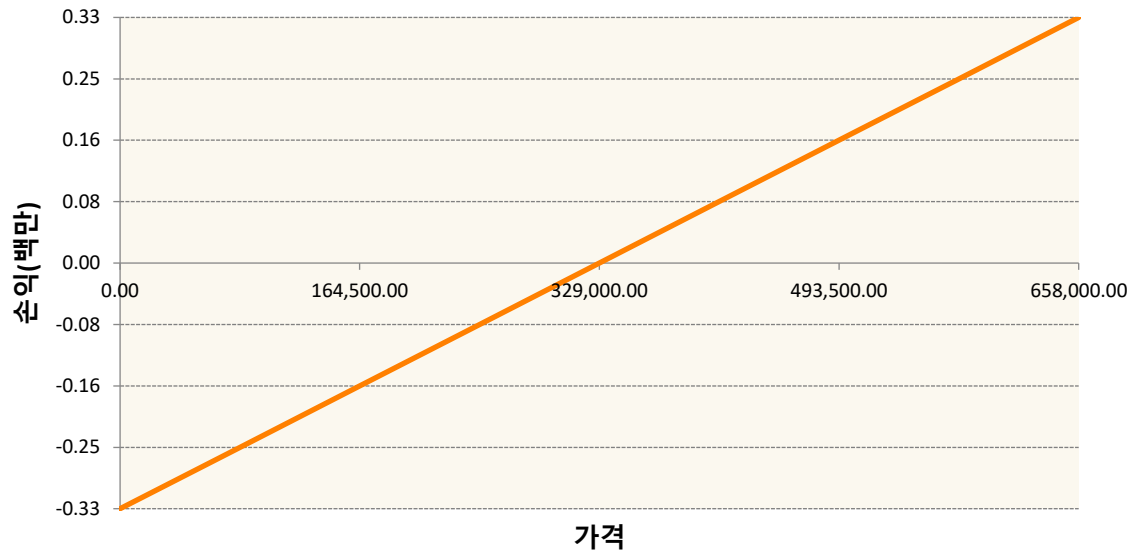
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



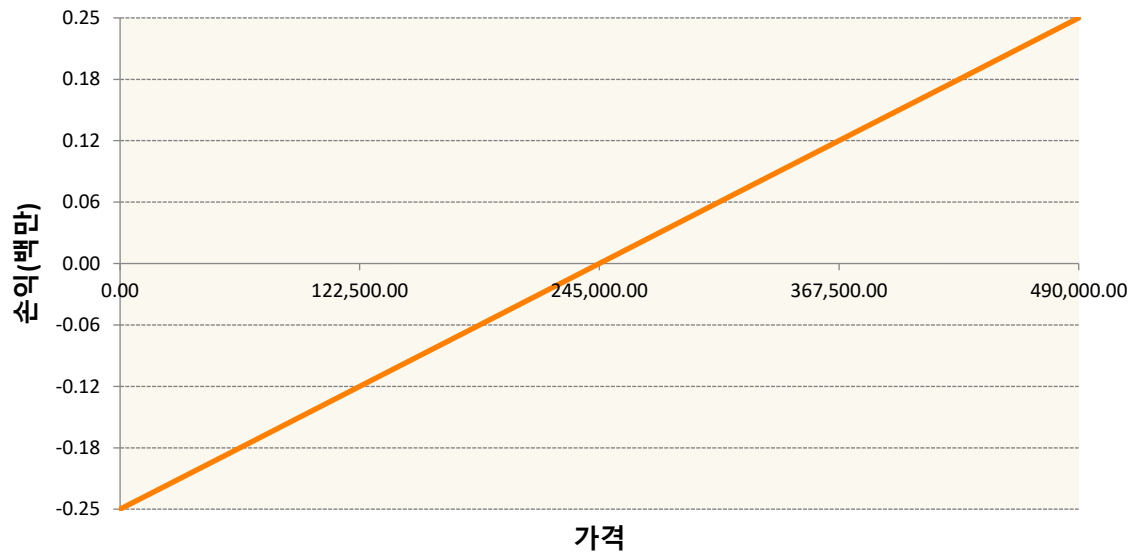
KR41EYW40004-2025-04 에코프로비엠개별선물



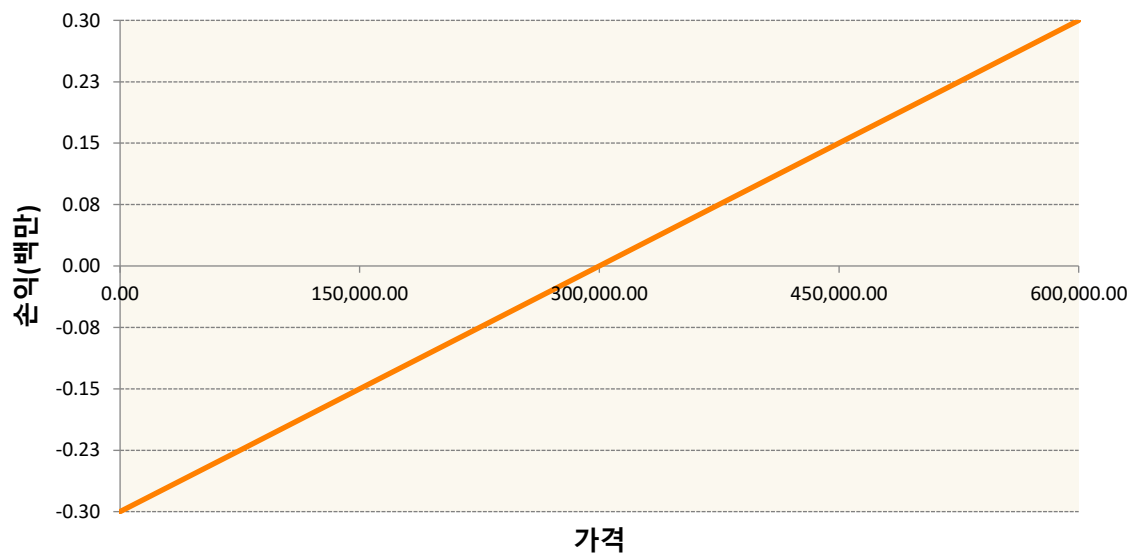
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



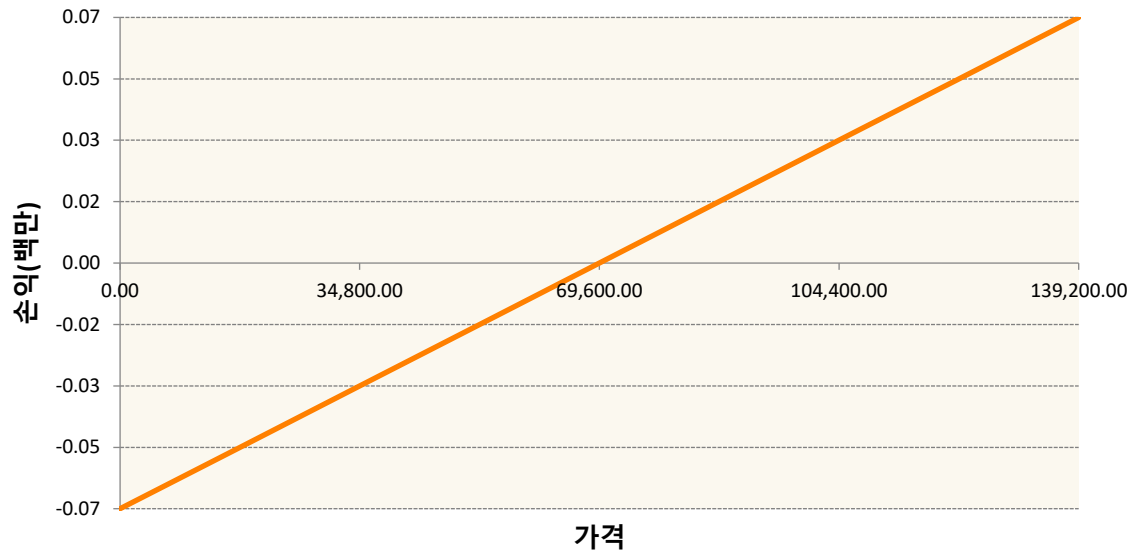
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



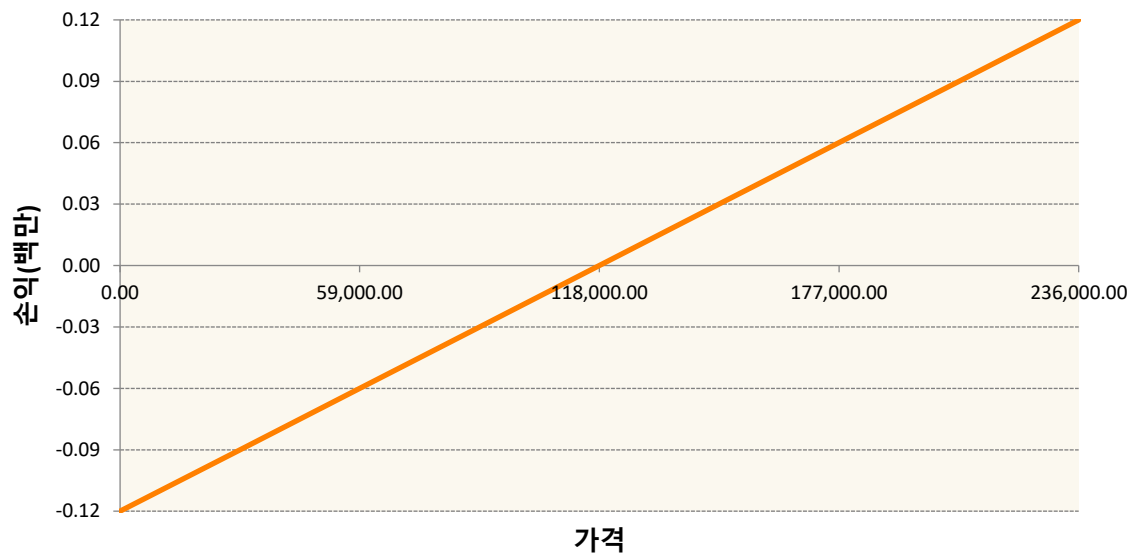
KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



KR41HEW40009-2025-04 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	59
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	0.44
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	1
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	0.49
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

3
3
3
1

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

(단위:백만원)

201

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

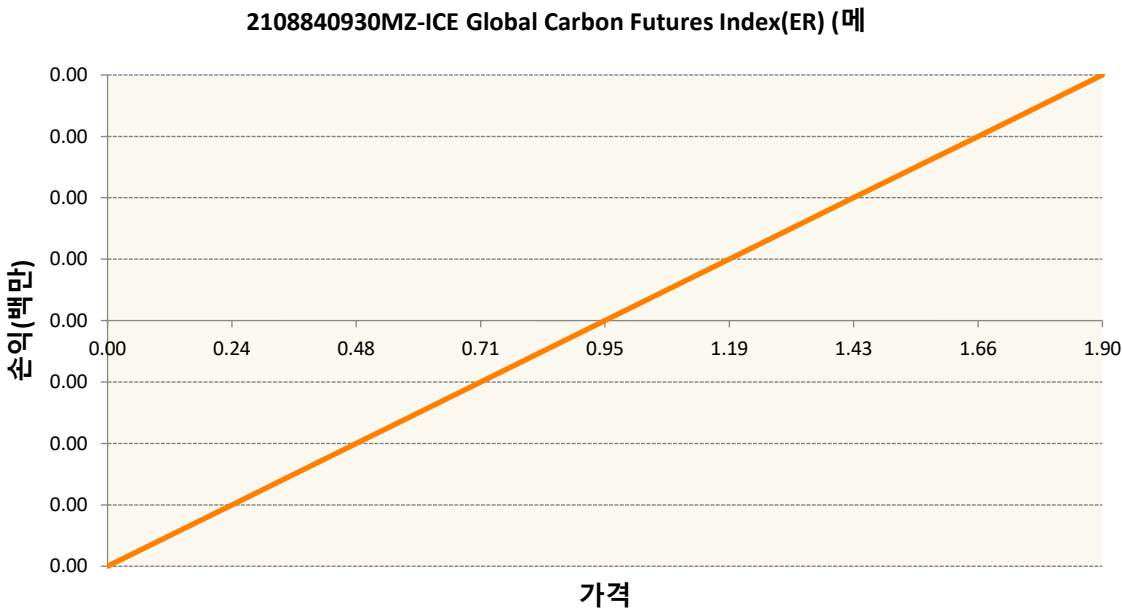
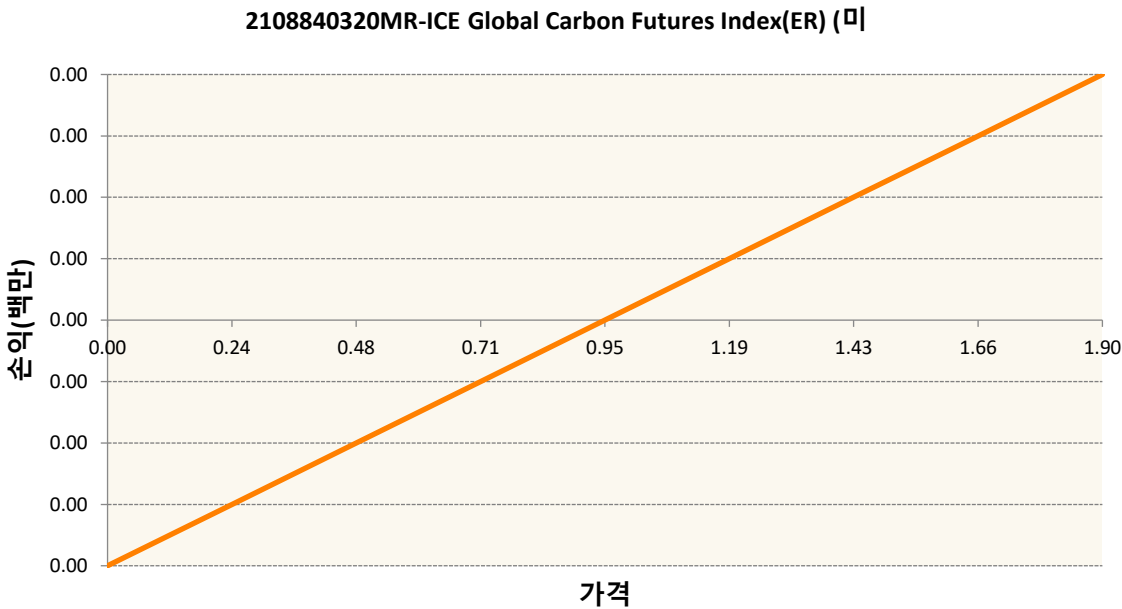
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,347	0	9,347	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	563
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	188

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	850

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

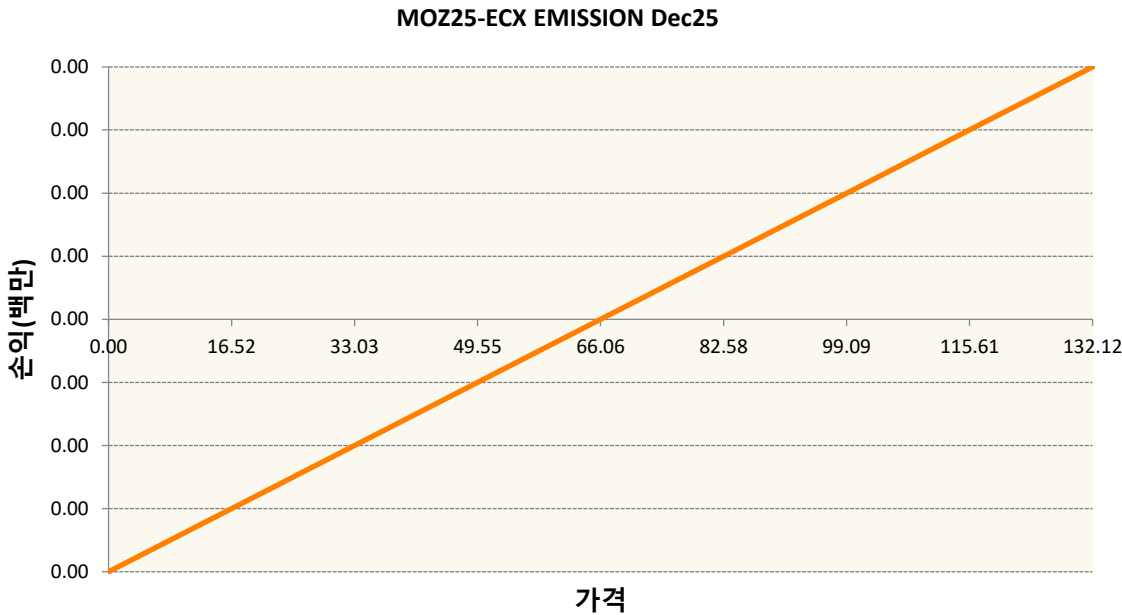
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	4,977	0	4,977	
누계	통화	선도	0	1,161	-1,161	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	2
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	14
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	79
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	400

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

(단위:백만원)

755

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

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)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	10

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

(단위:백만원)

58

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

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)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	16
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	5

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

(단위:백만원)

104

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

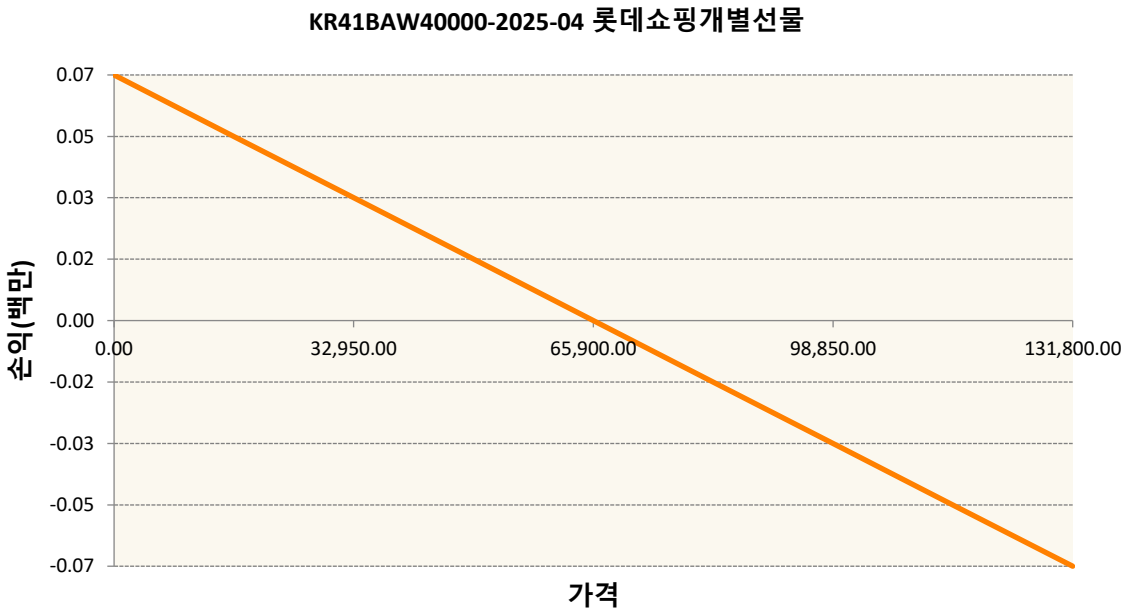
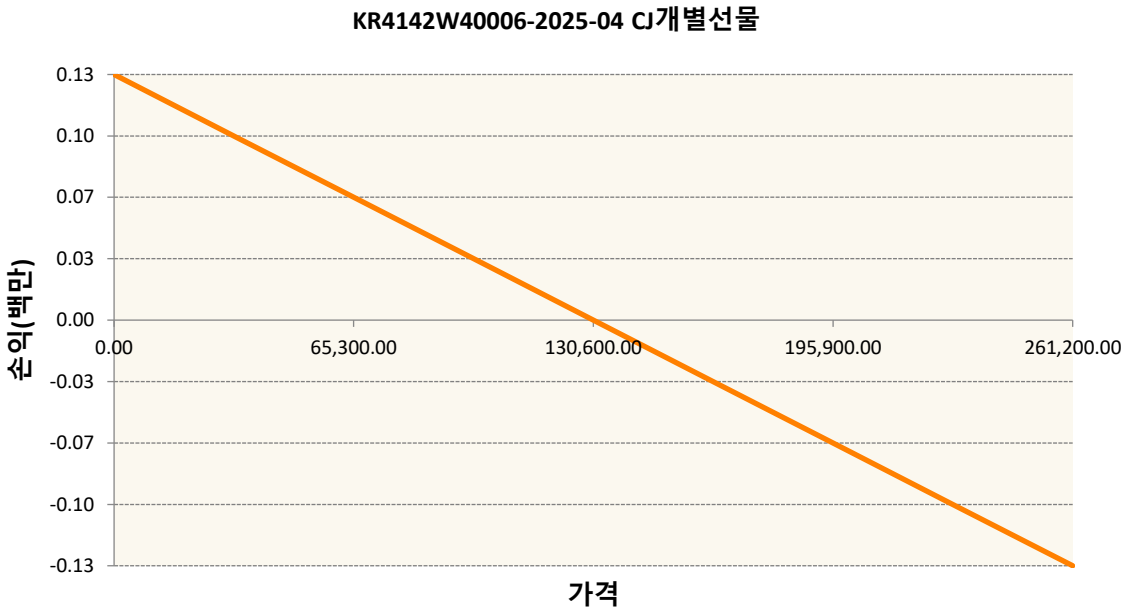
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

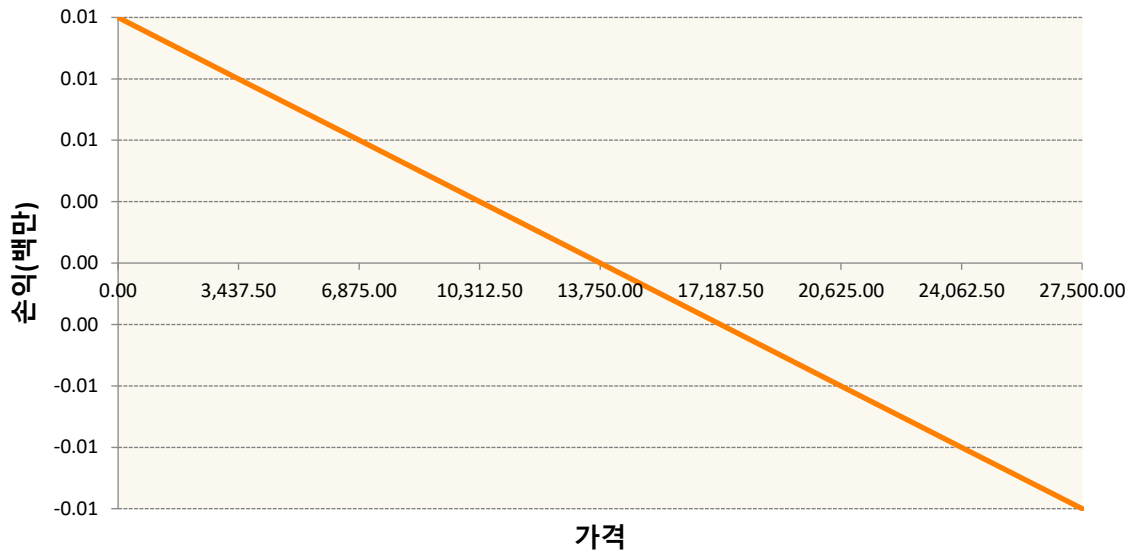
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	12	34	-22	장내
누계	유가증권	선물	8	41	-33	장내

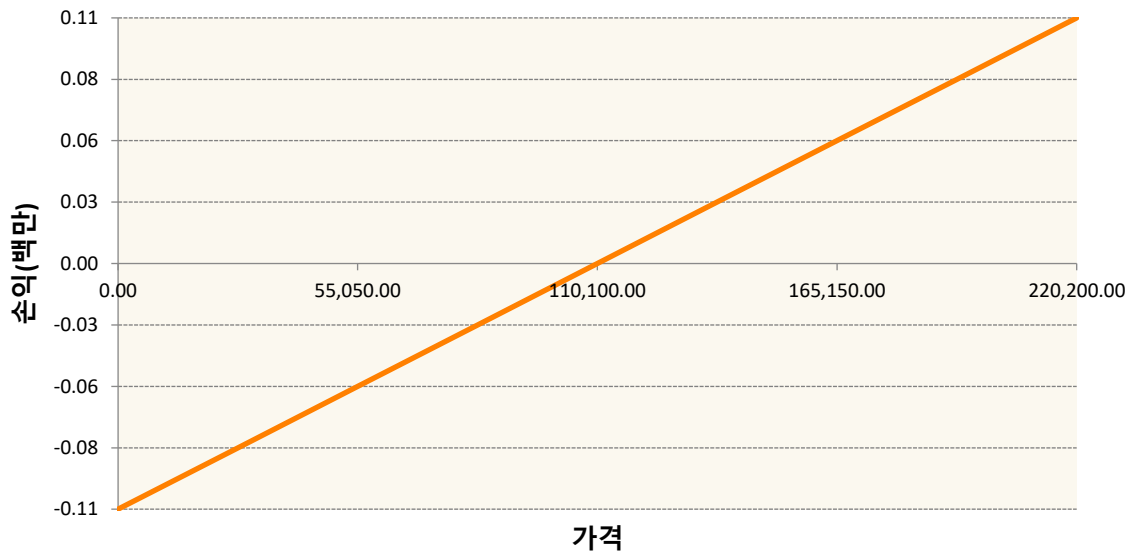
2. 만기시점의 손익구조



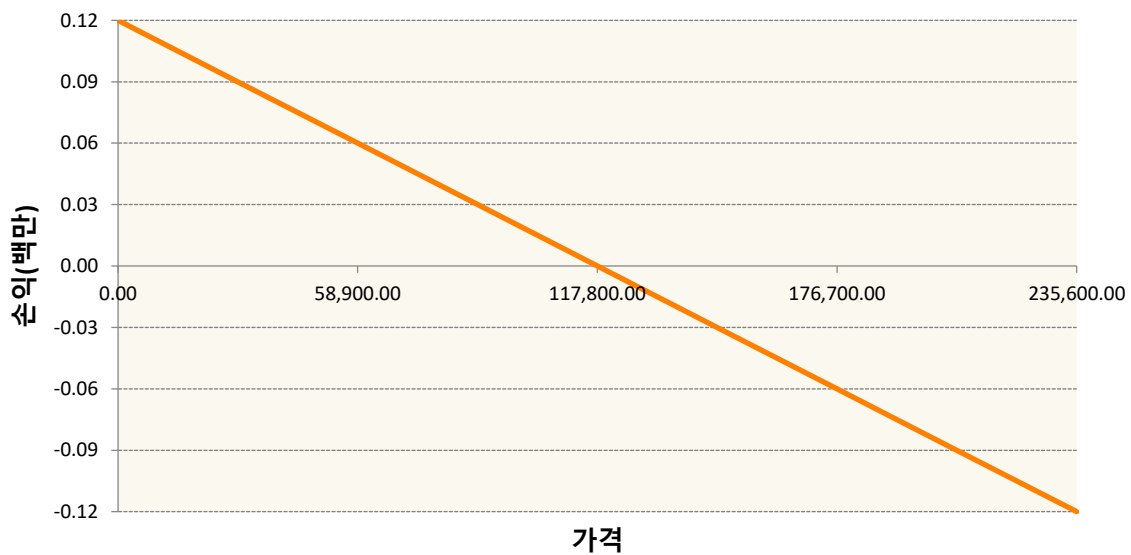
KR41BFW40009-2025-04 삼성중공업개별선물



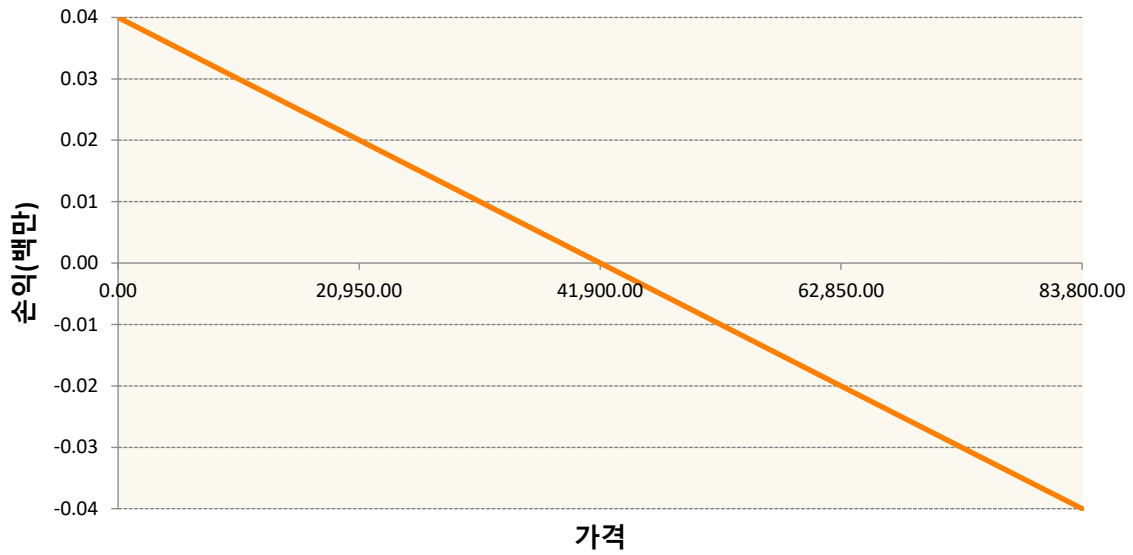
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



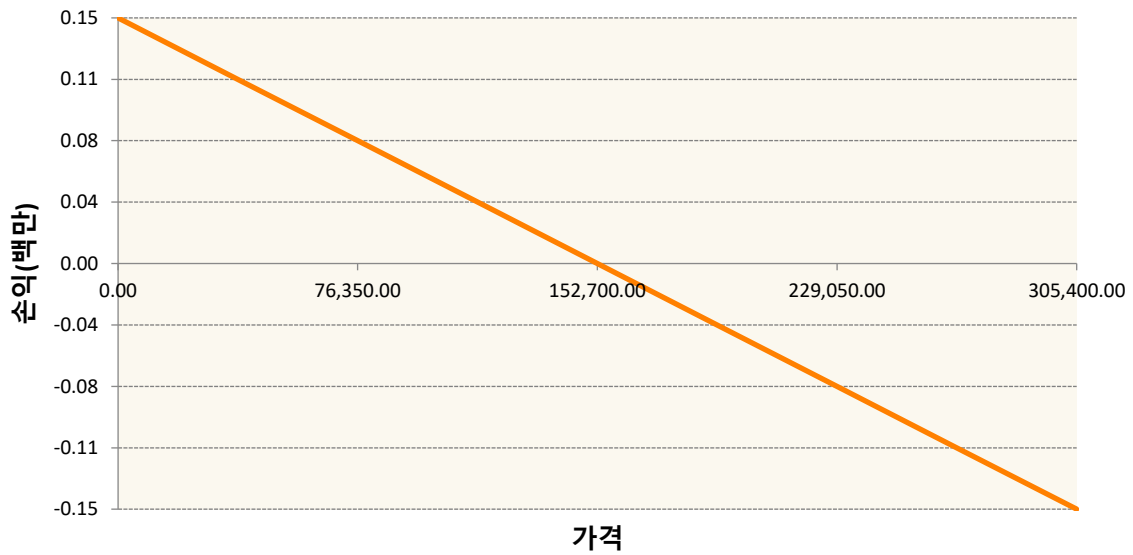
KR41CDW40002-2025-04 HD현대미포개별선물



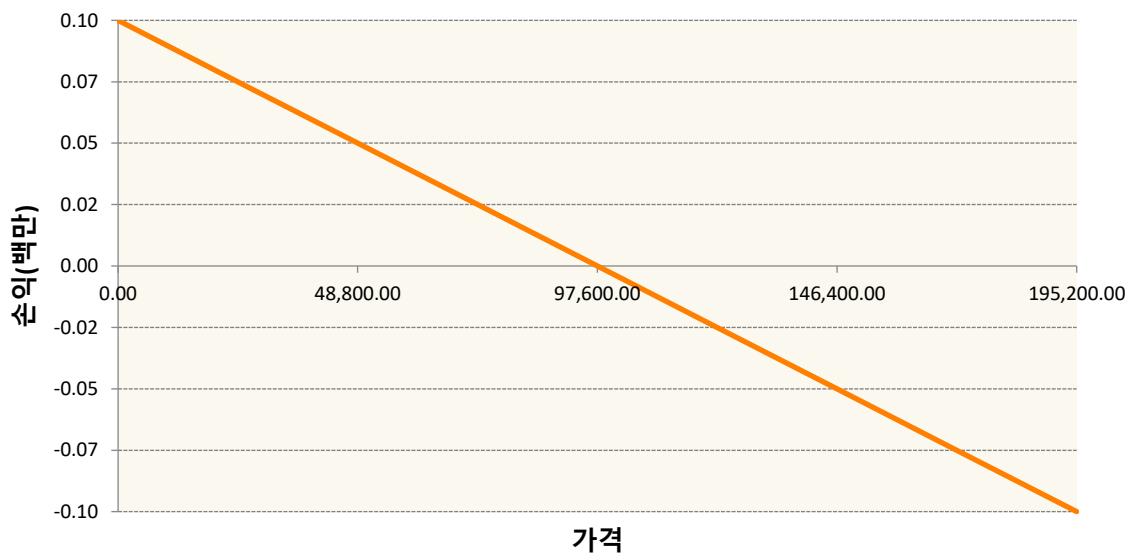
KR41CFW50006-2025-05 카카오개별선물



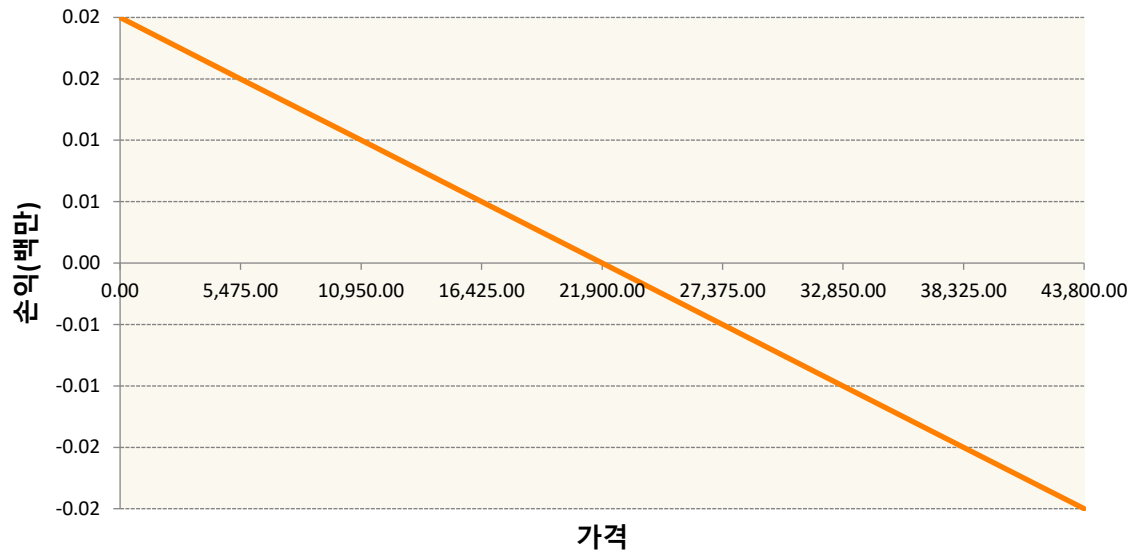
KR41DDW40000-2025-04 신세계개별선물



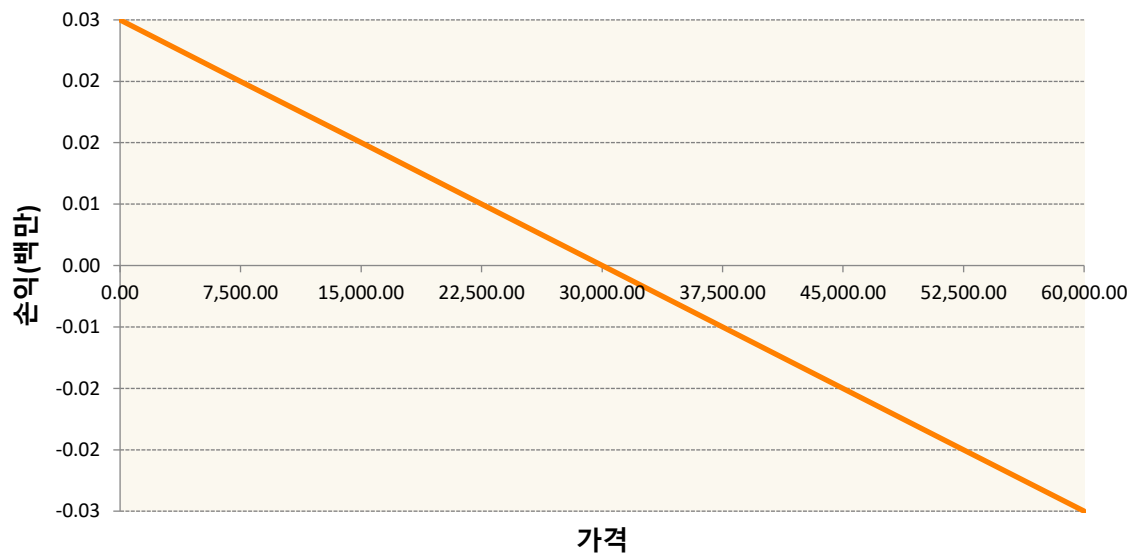
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



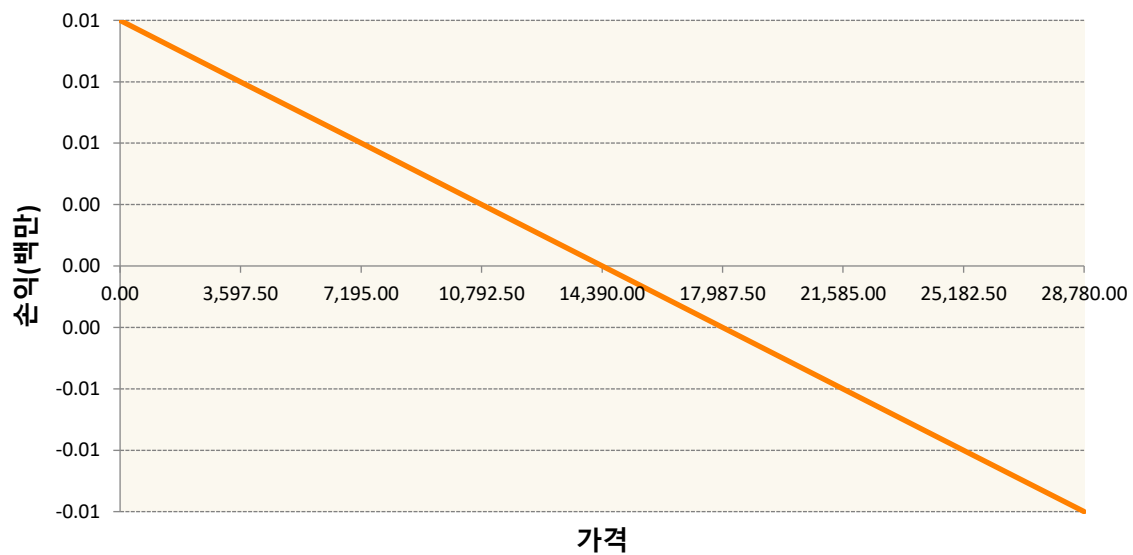
KR41F6W40005-2025-04 카카오뱅크개별선물



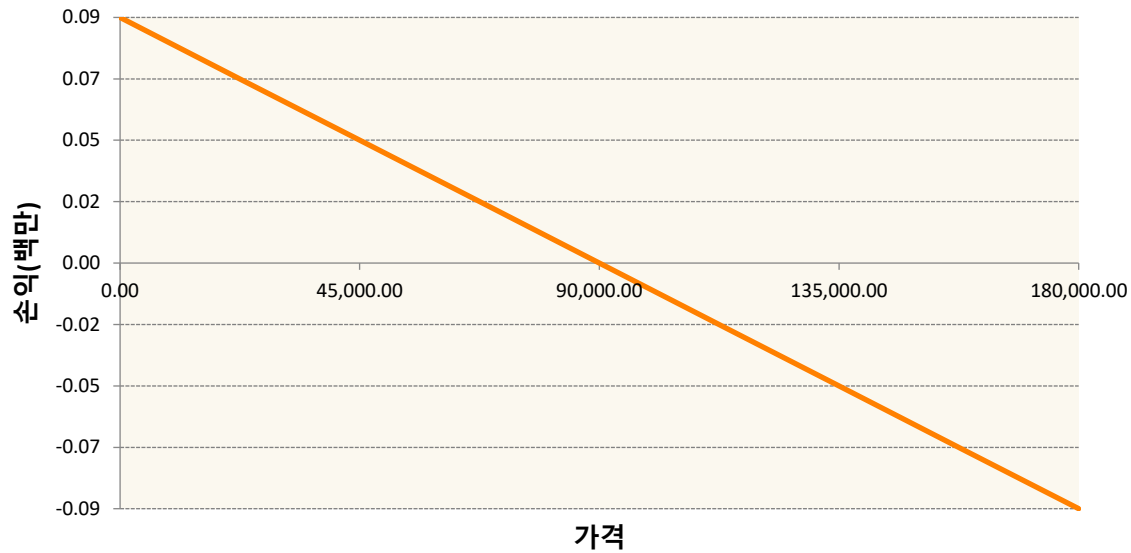
KR41F7W40003-2025-04 카카오페이개별선물



KR41FYW40001-2025-04 두산퓨얼셀개별선물



KR41G1W40005-2025-04 CJ대한통운개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4142W40(2025-04 CJ개별선물	1
KR41BAW40(2025-04 롯데쇼핑개별선물	0.32
KR41BFW40(2025-04 삼성중공업개별선물	0.36
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	1
KR41CDW40 2025-04 HD현대미포개별선물	0.28
KR41CFW50(2025-05 카카오개별선물	0.23
KR41DDW40 2025-04 신세계개별선물	0.24
KR41EYW50(2025-05 에코프로비엠개별선물	0.23
KR41F6W40(2025-04 카카오뱅크개별선물	0.07
KR41F7W40(2025-04 카카오페이개별선물	0.14
KR41FYW40(2025-04 두산퓨얼셀개별선물	0.45
KR41G1W40(2025-04 CJ대한통운개별선물	0.29

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

(단위:백만원)

9

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

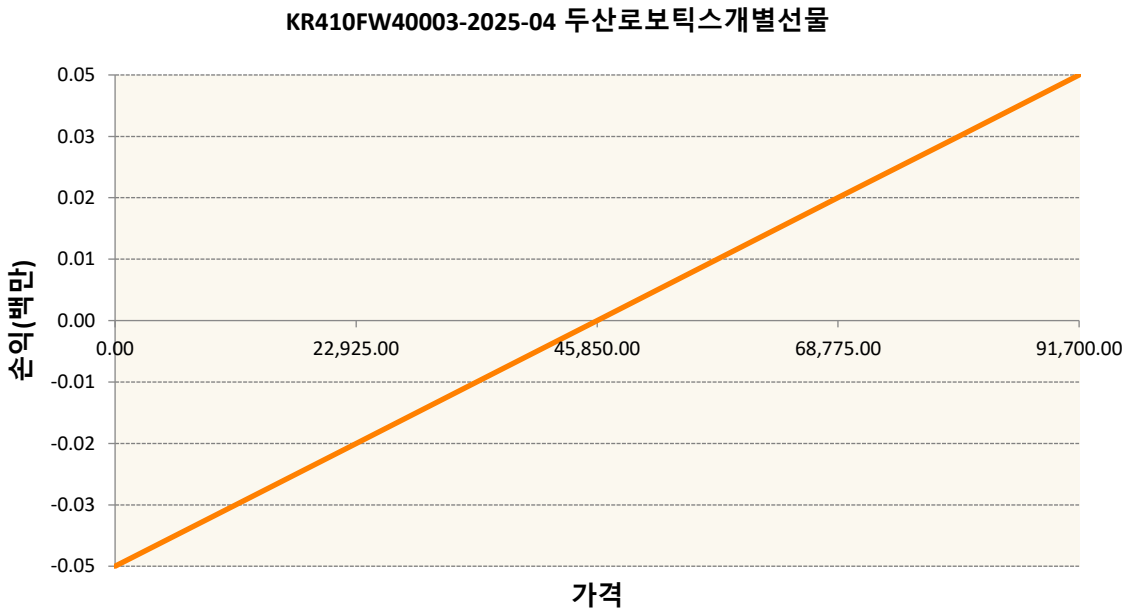
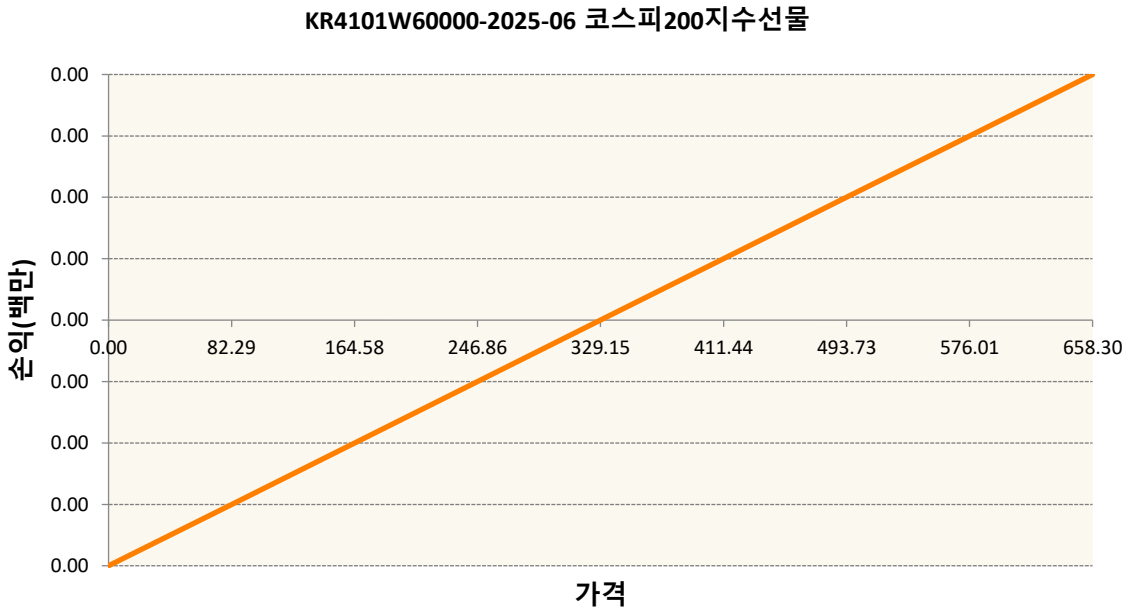
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

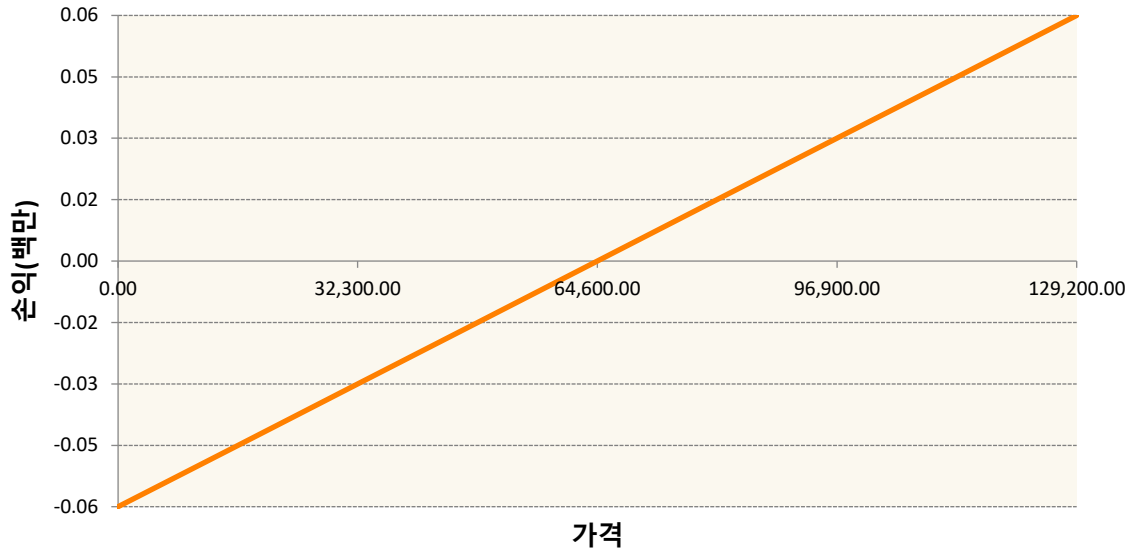
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,849	0	11,849	장내

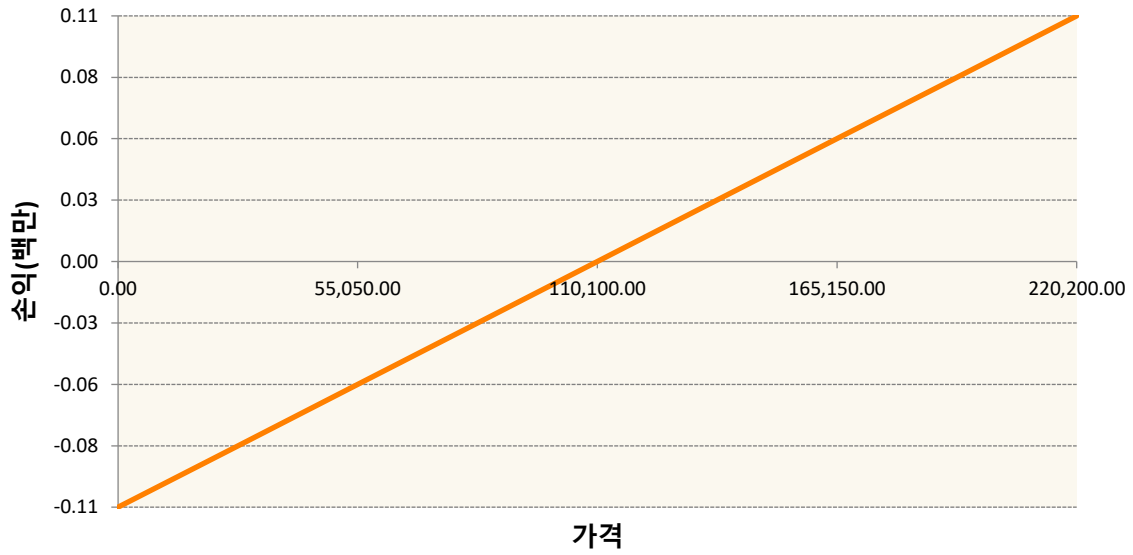
2. 만기시점의 손익구조



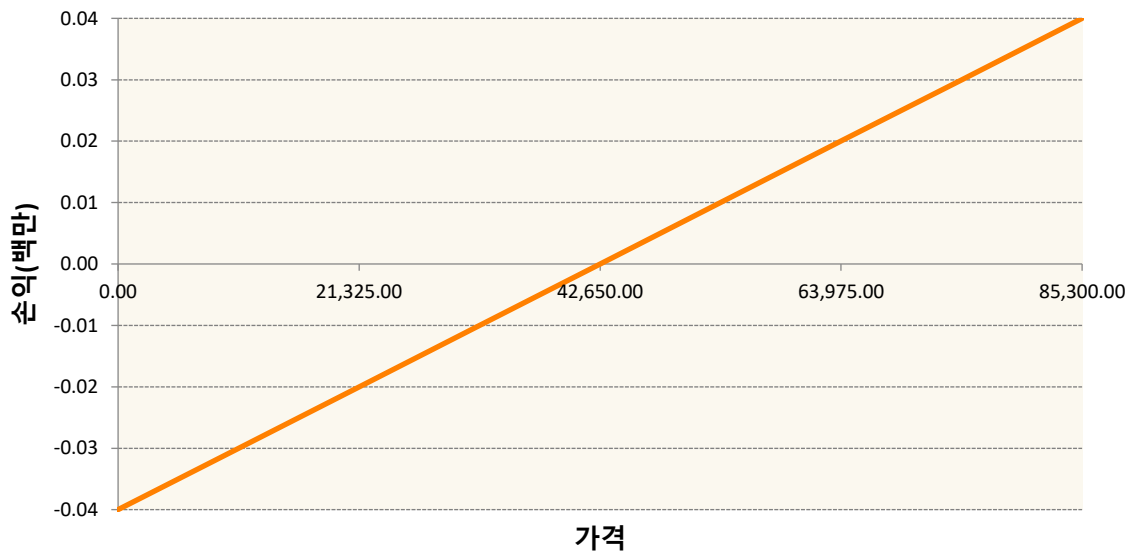
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



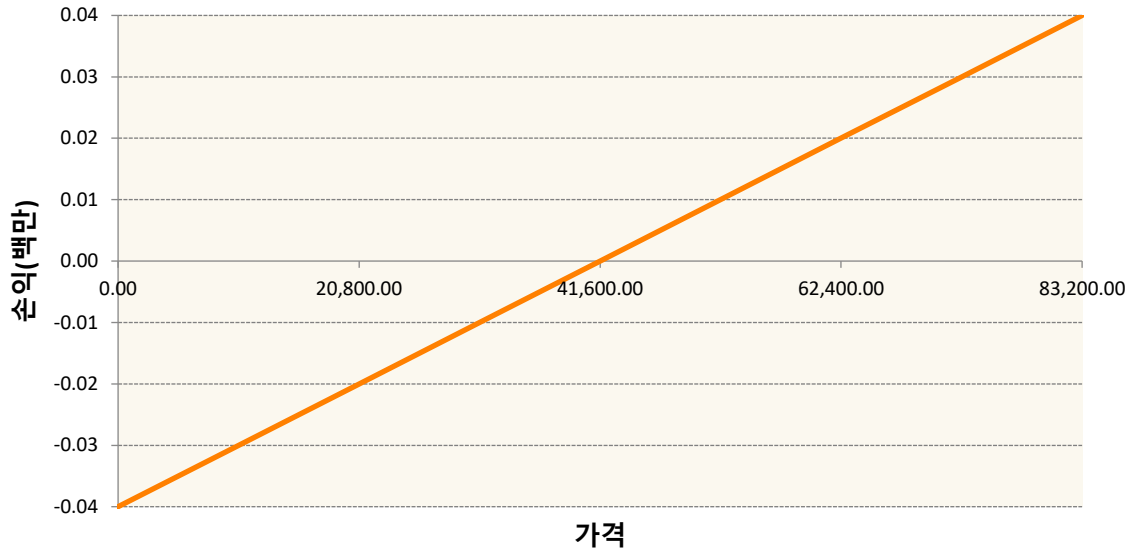
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



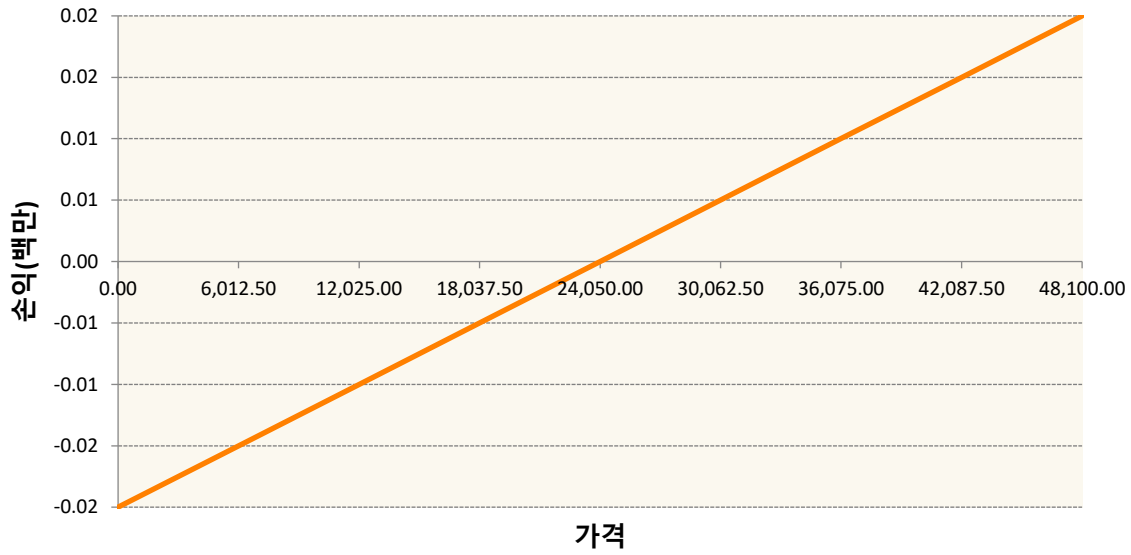
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



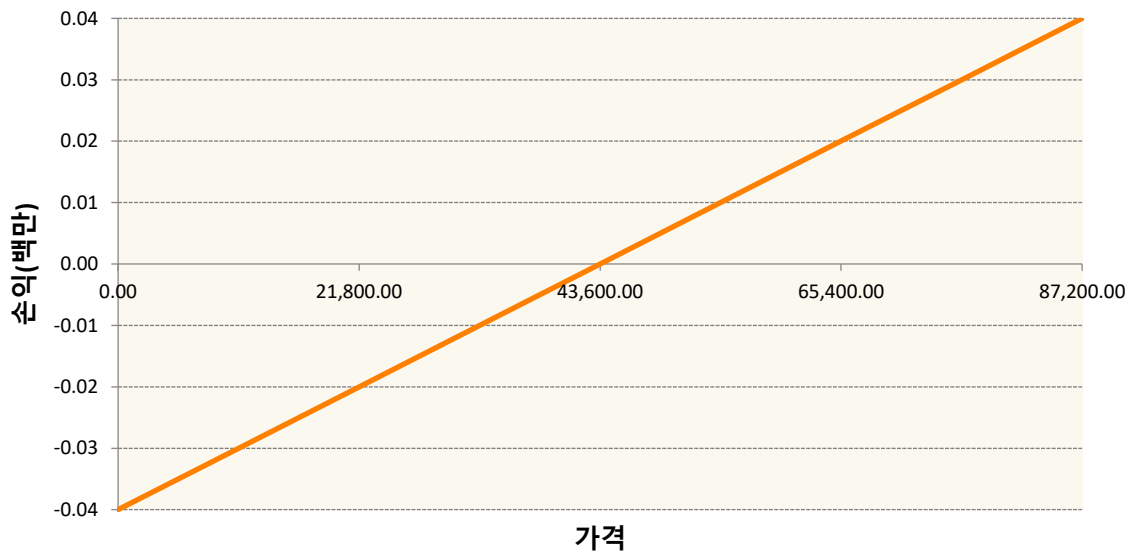
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



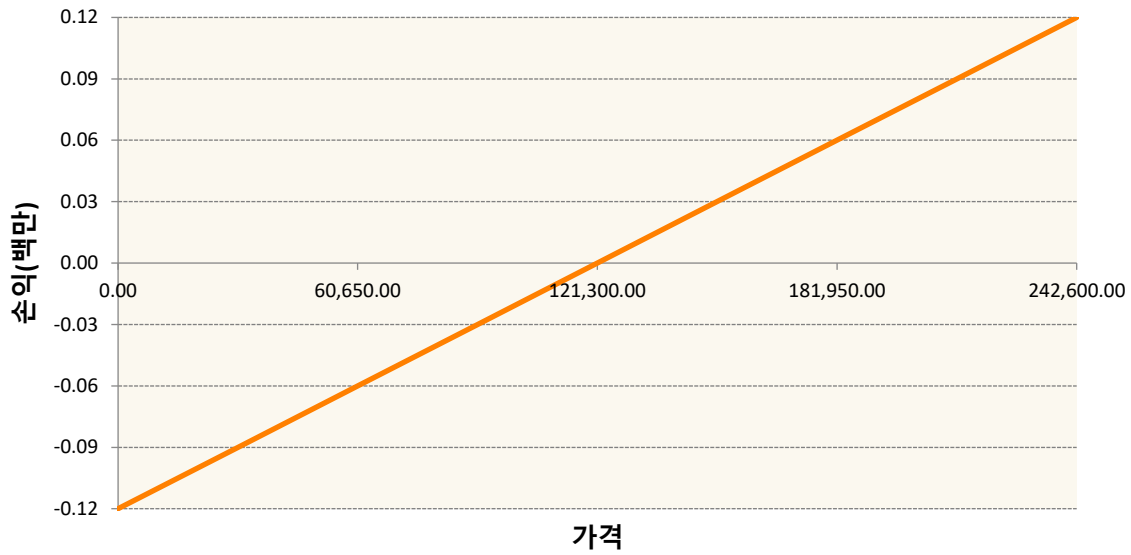
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



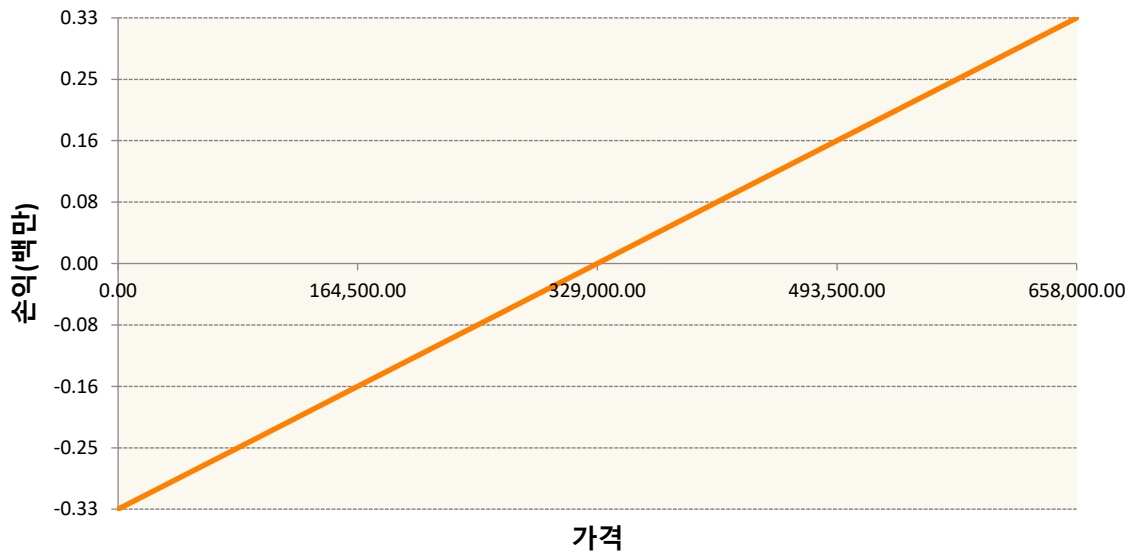
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



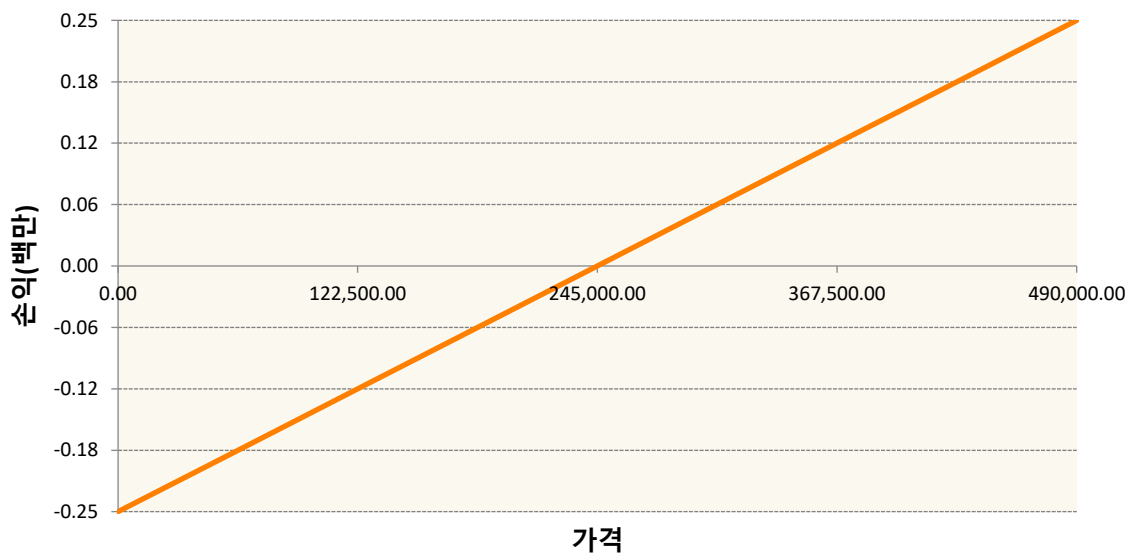
KR41E8W40002-2025-04 포스코퓨처엠개별선물



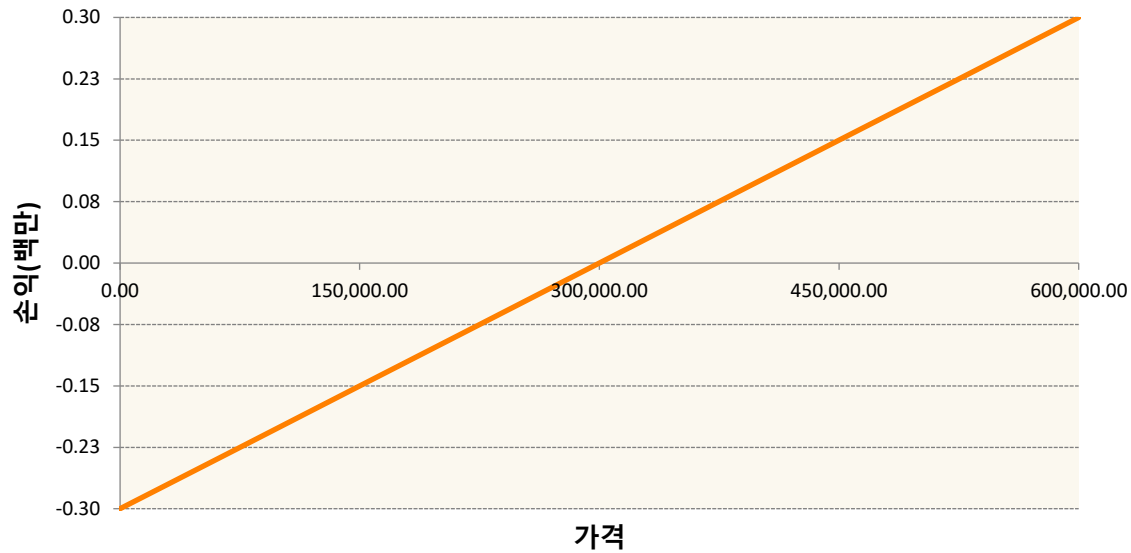
KR41F5W40007-2025-04 LG에너지솔루션개별선물



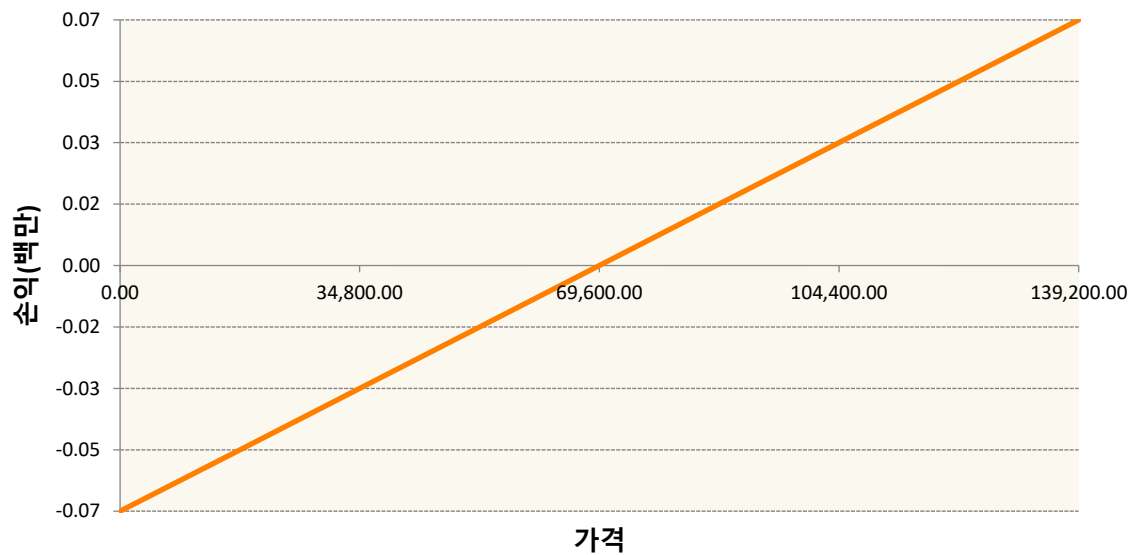
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	579
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	3
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	27
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	50
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	66

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

(단위:백만원)

1,672

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

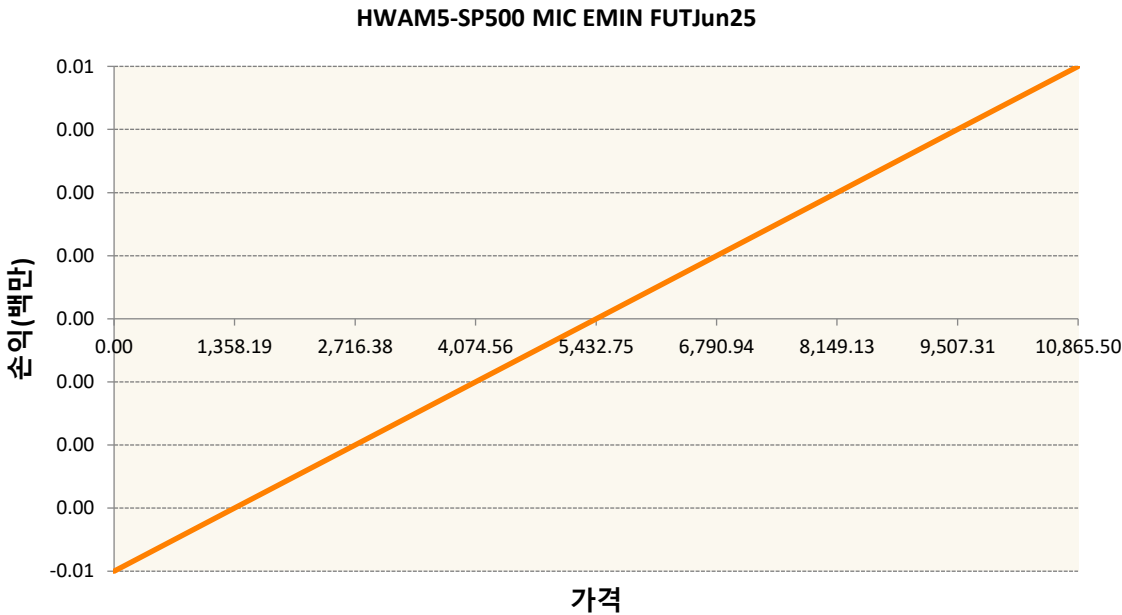
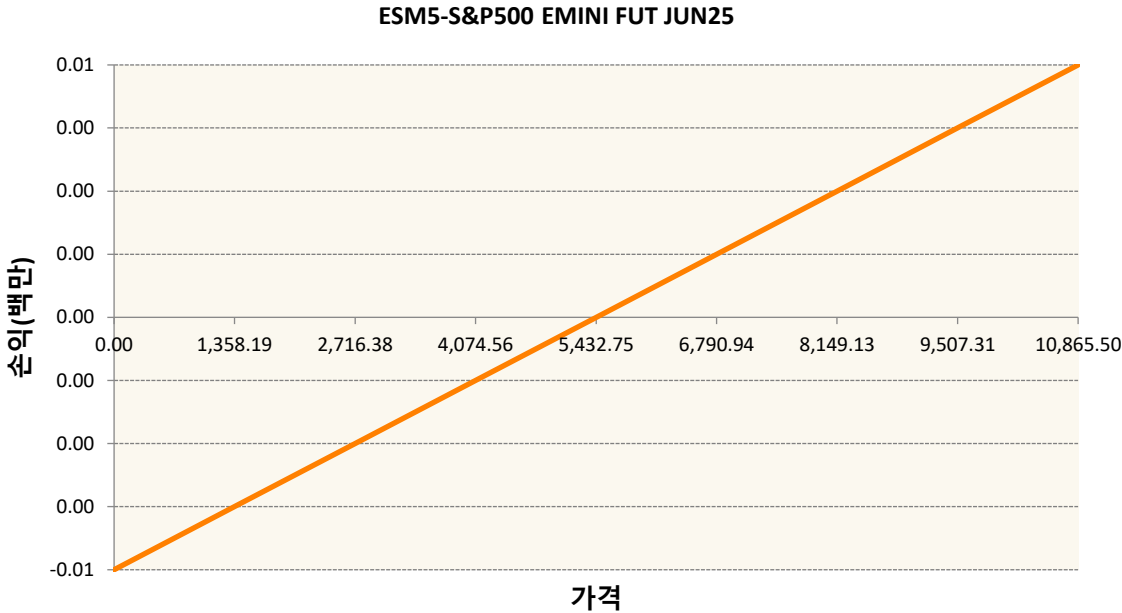
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	26,573	0	26,573	
누계	유가증권	선물	1,150	0	1,150	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,126
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	92

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,586

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

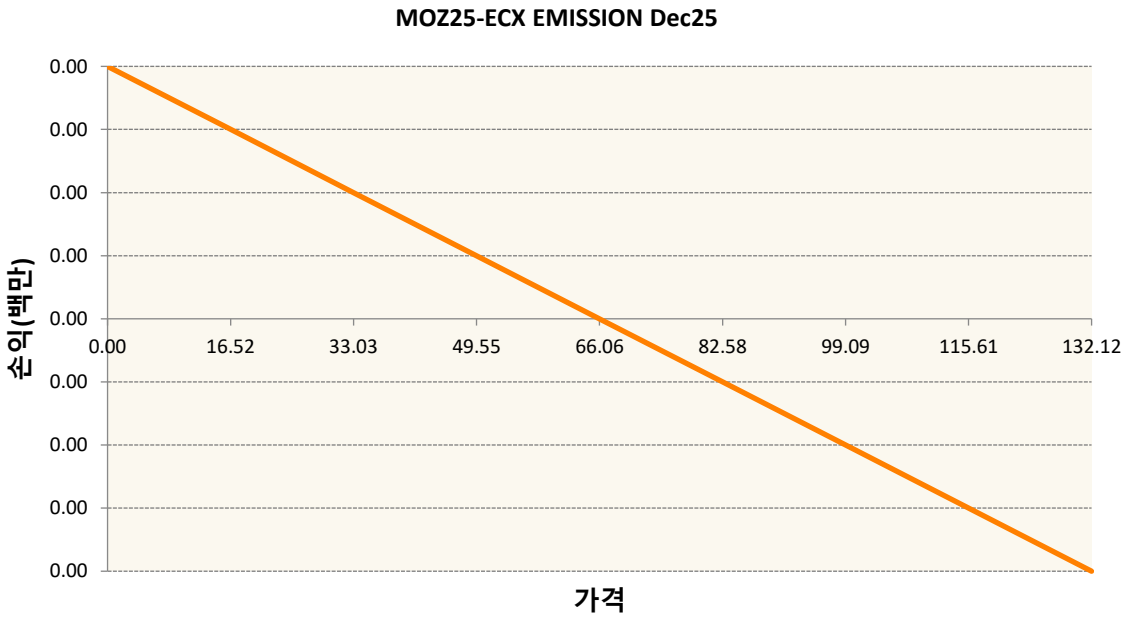
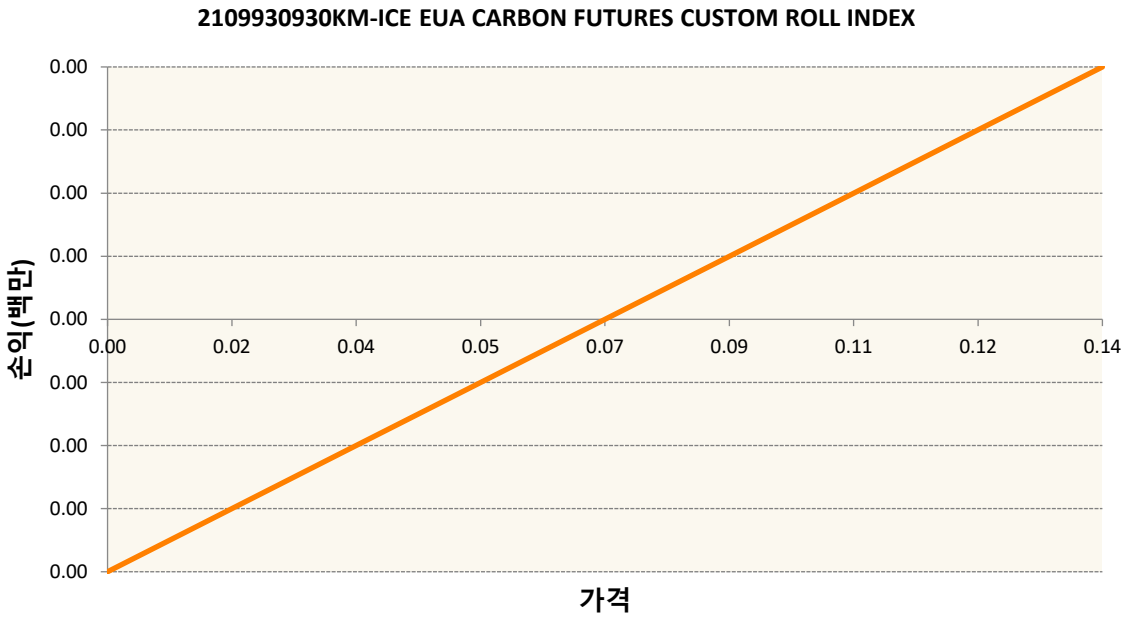
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	26	6,577	-6,550	
누계	통화	선도	0	1,143	-1,143	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	5
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	87
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	526

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

974

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

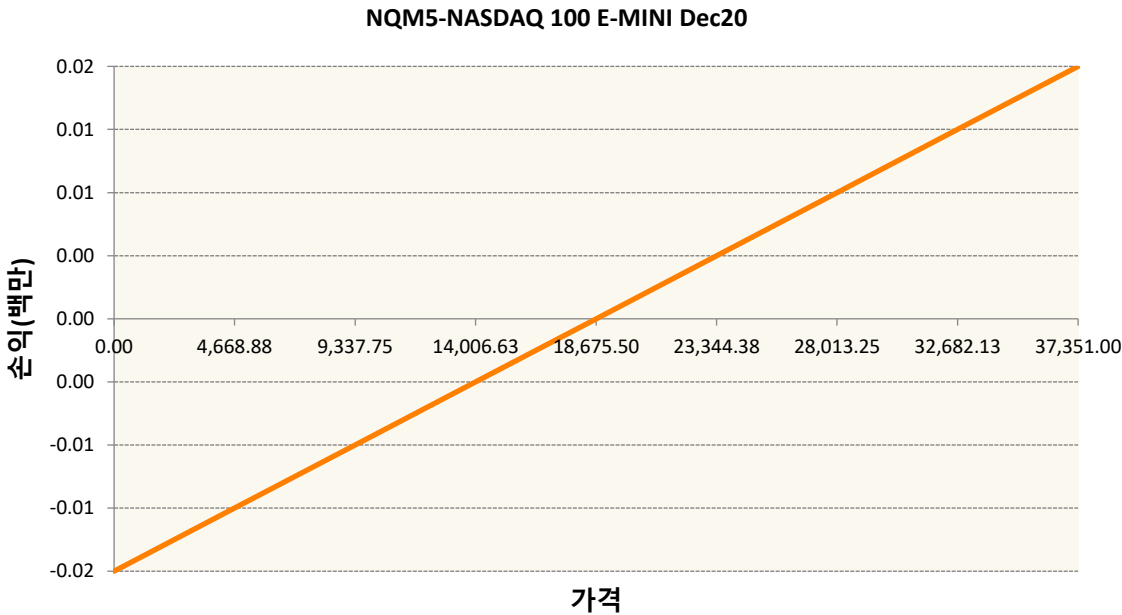
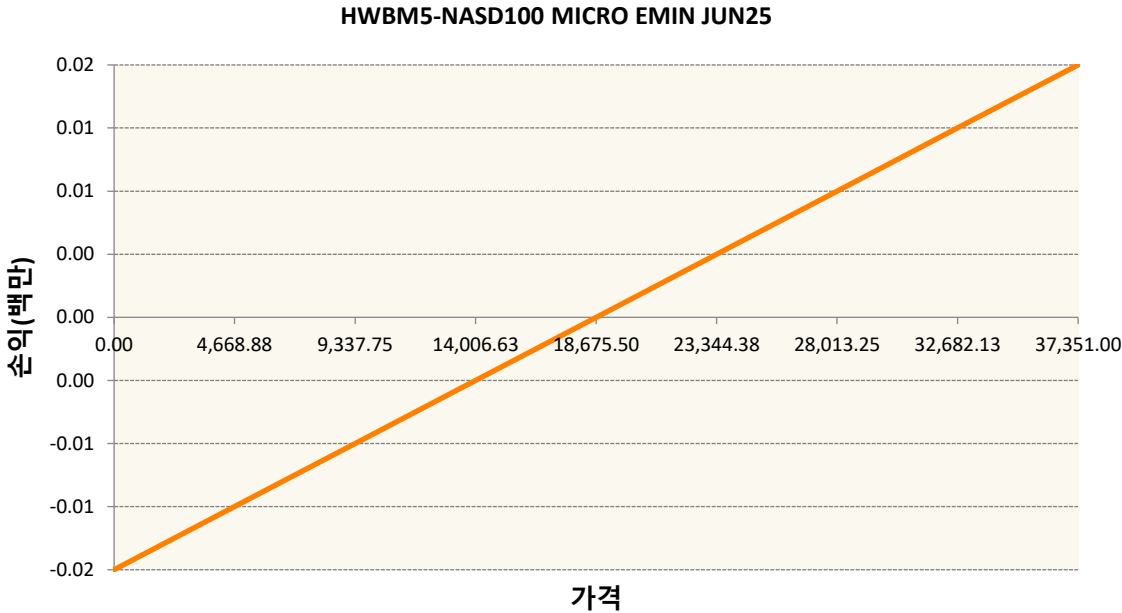
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,092	0	13,092	
누계	유가증권	선물	492	0	492	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		39
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,047

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,047

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	737
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,199
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,931
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,516

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

(단위:백만원)

9,212

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

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	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9

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

(단위:백만원)

43

공시일	2025-04-07
기준일	2025-04-04

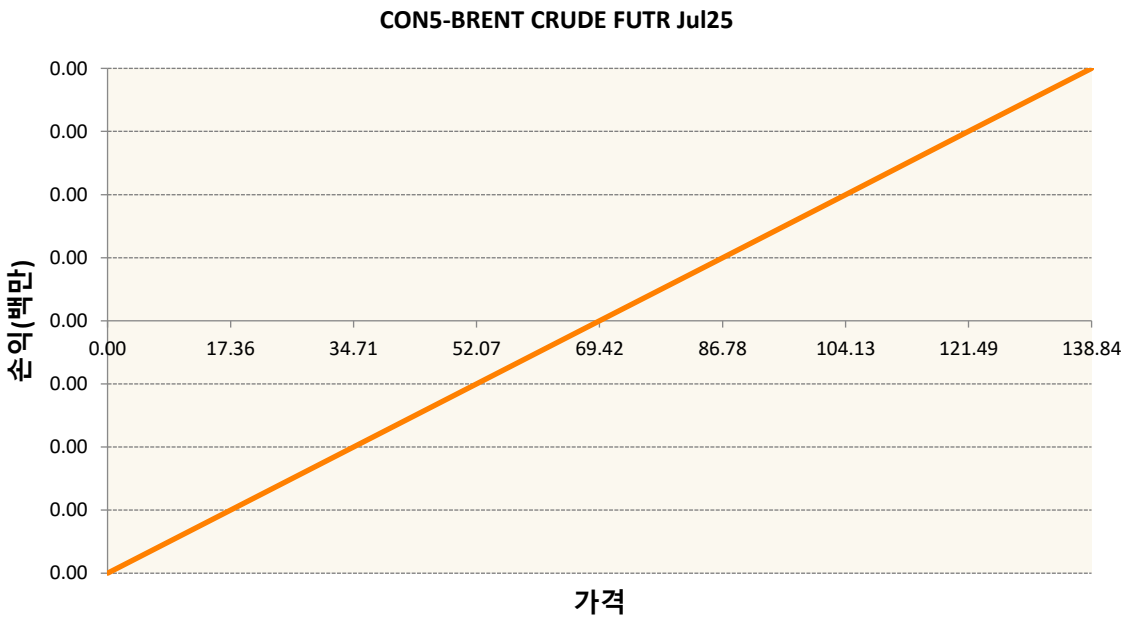
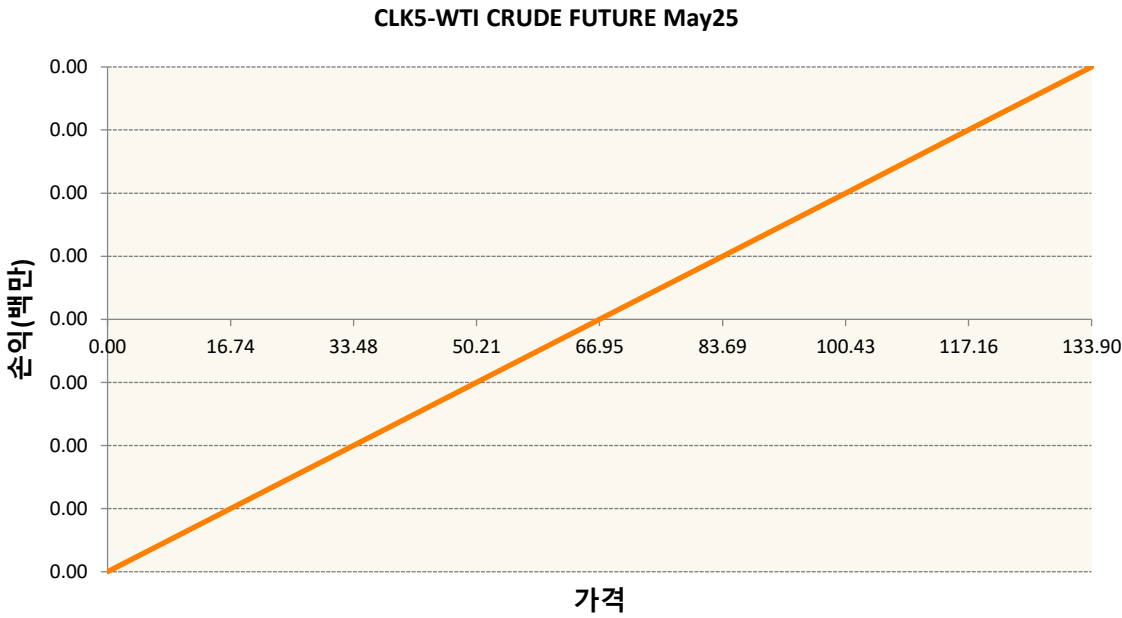
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

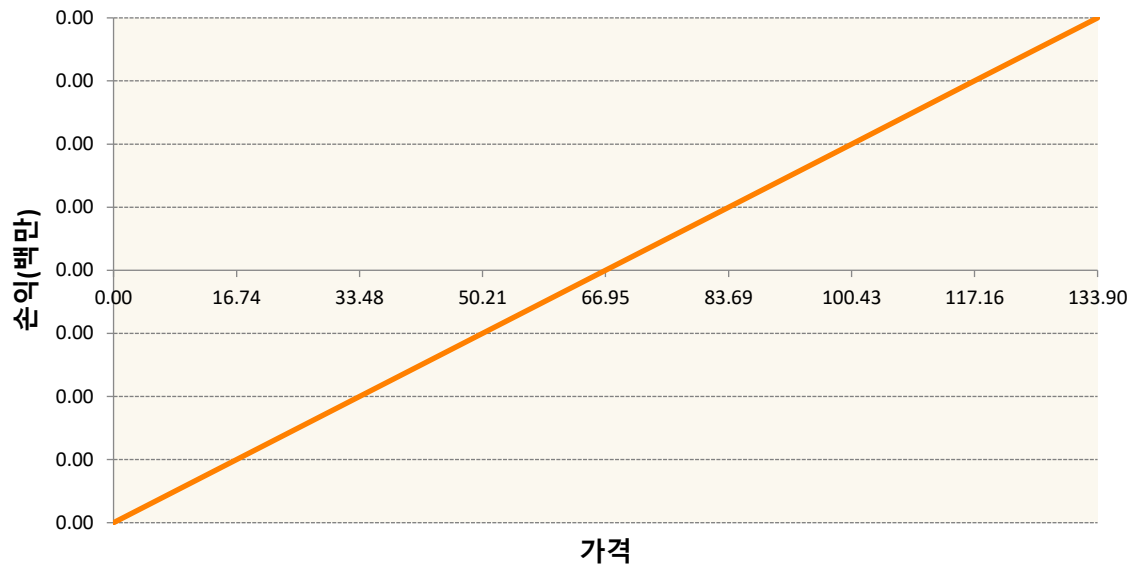
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	29	0	29	장내
누계	유가증권	선물	814	0	814	
누계	통화	선물	0	115	-115	장내

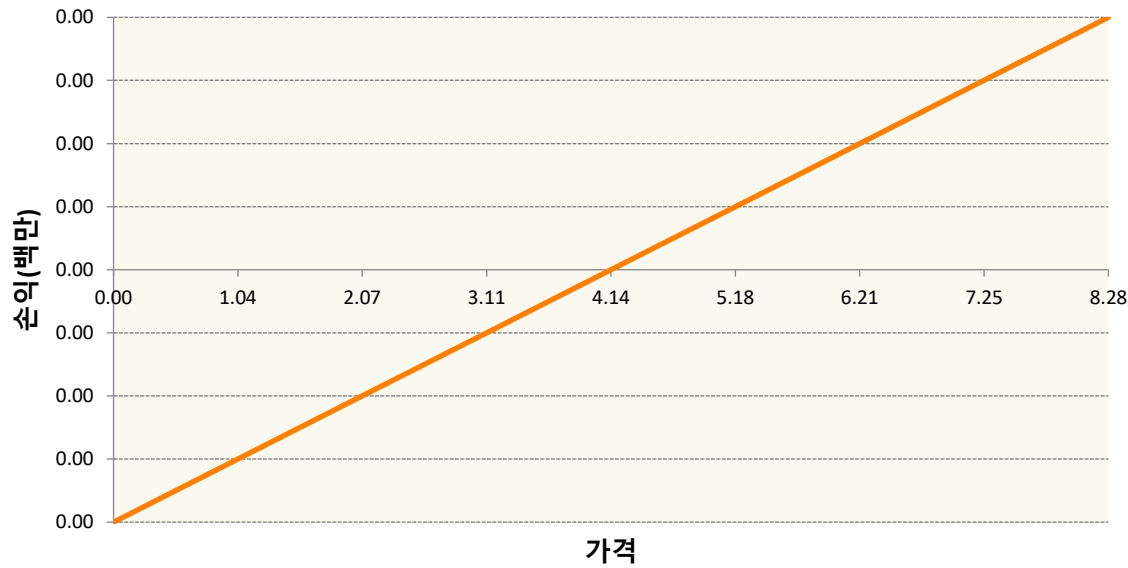
2. 만기시점의 손익구조



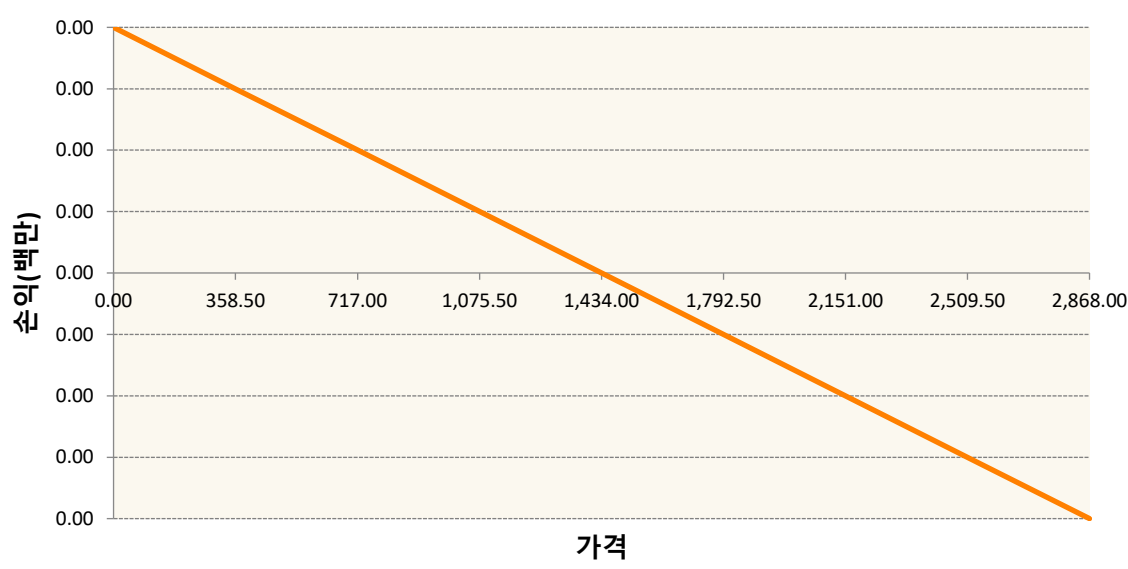
ECK5-E-mini Crude Oil May 25



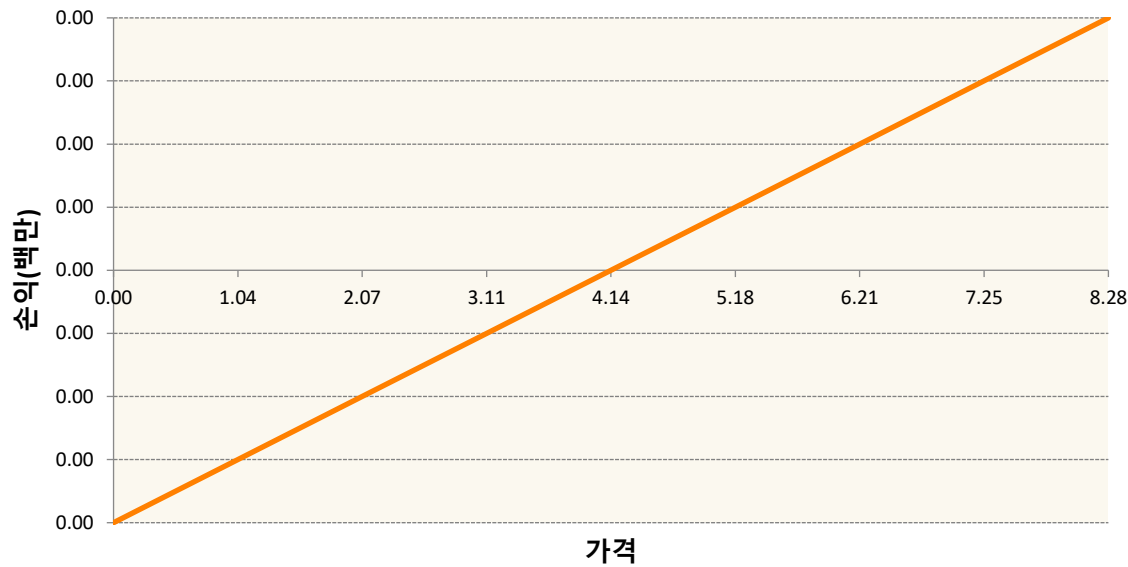
EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



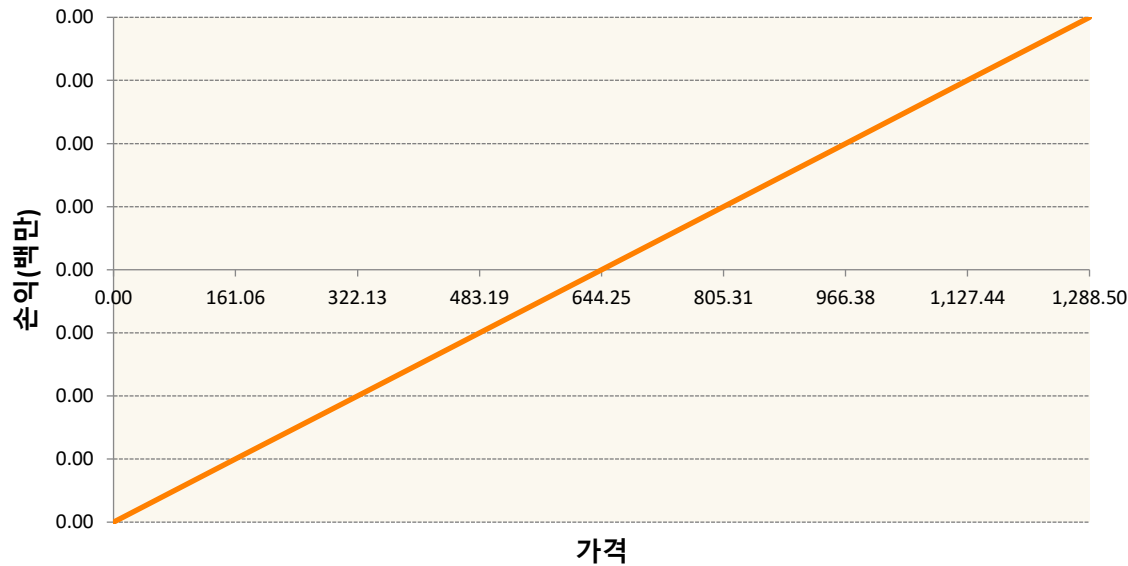
KR4175W40006-2025-04 달러선물



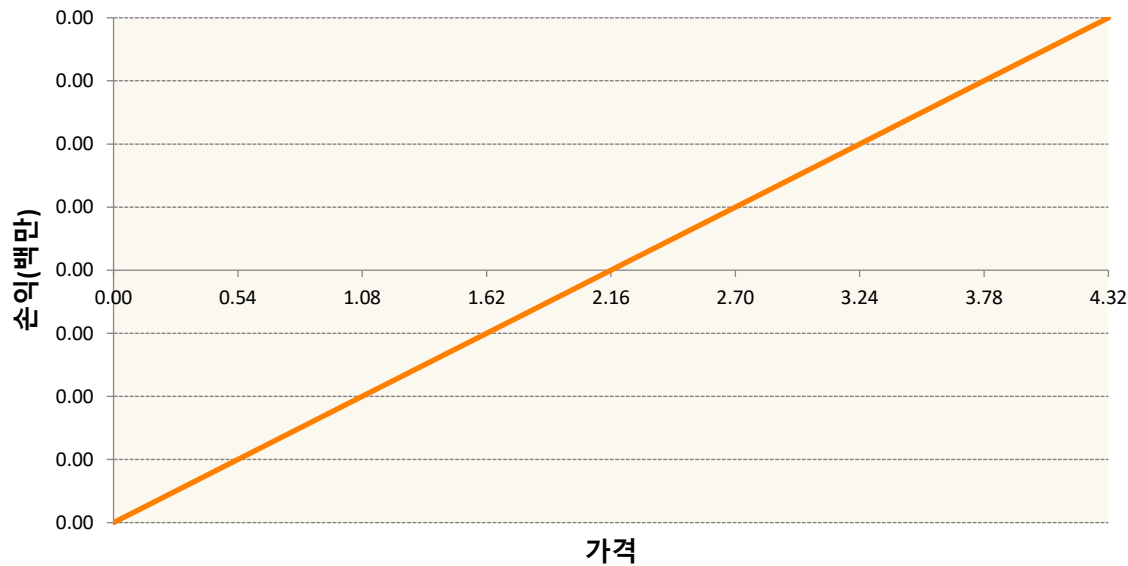
NGK25-NATURAL GAS FUTR May 25



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	16
ECK5	E-mini Crude Oil May 25	4
EOK5	E-MINI NATURAL GAS May 25	5
KR4175W40	(2025-04 달러선물	9
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)

141