

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

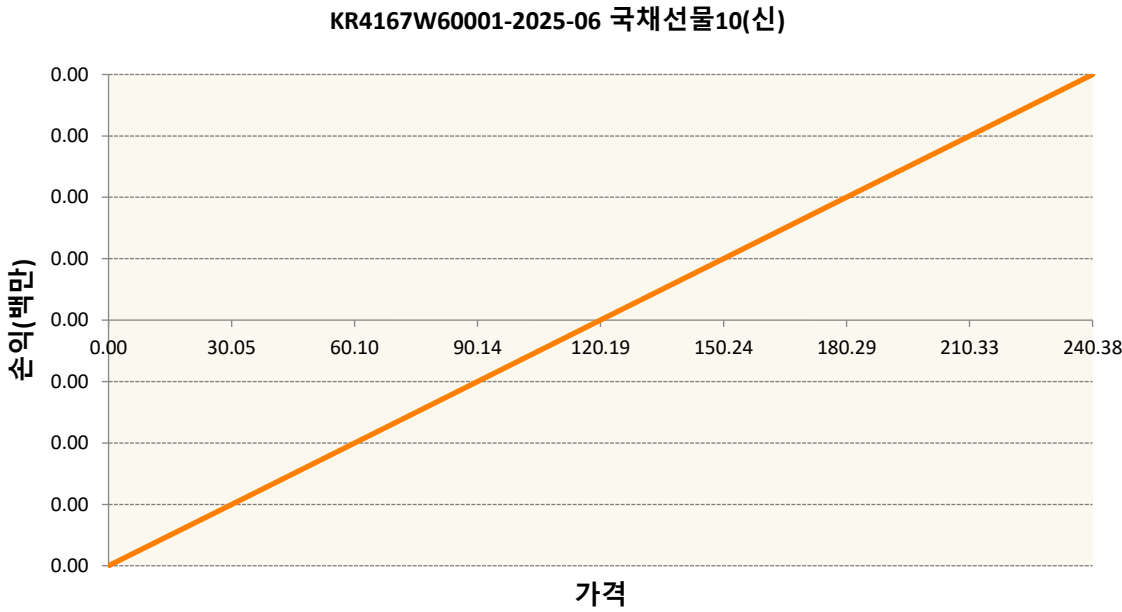
베스트장기채(채권-파생형)

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	158,651	0	158,651	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,629

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

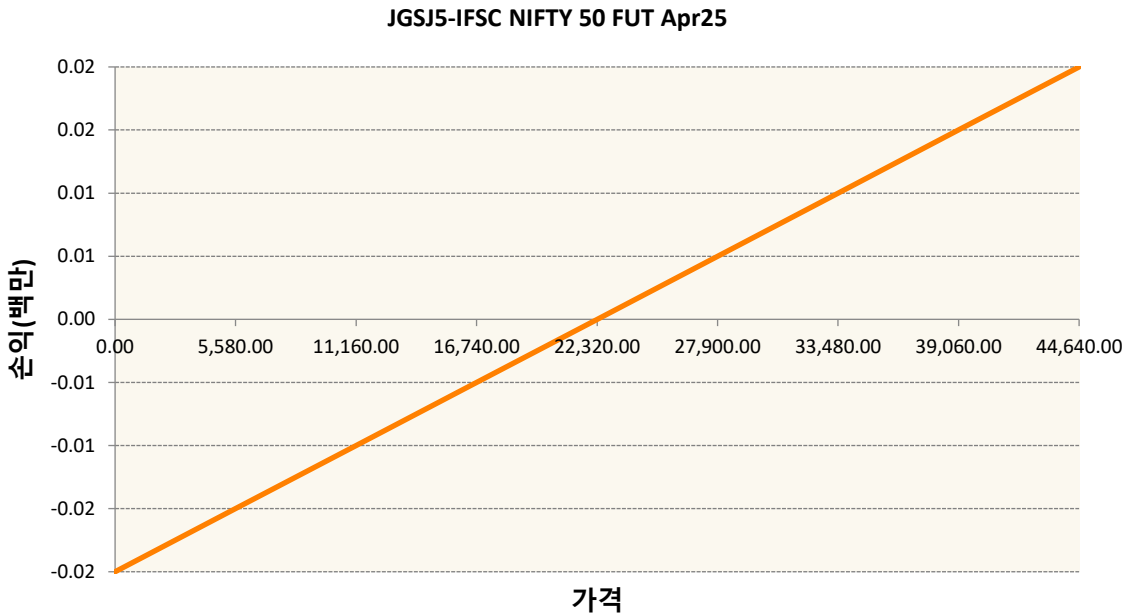
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	719	0	719	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ5	IFSC NIFTY 50 FUT Apr25	58
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

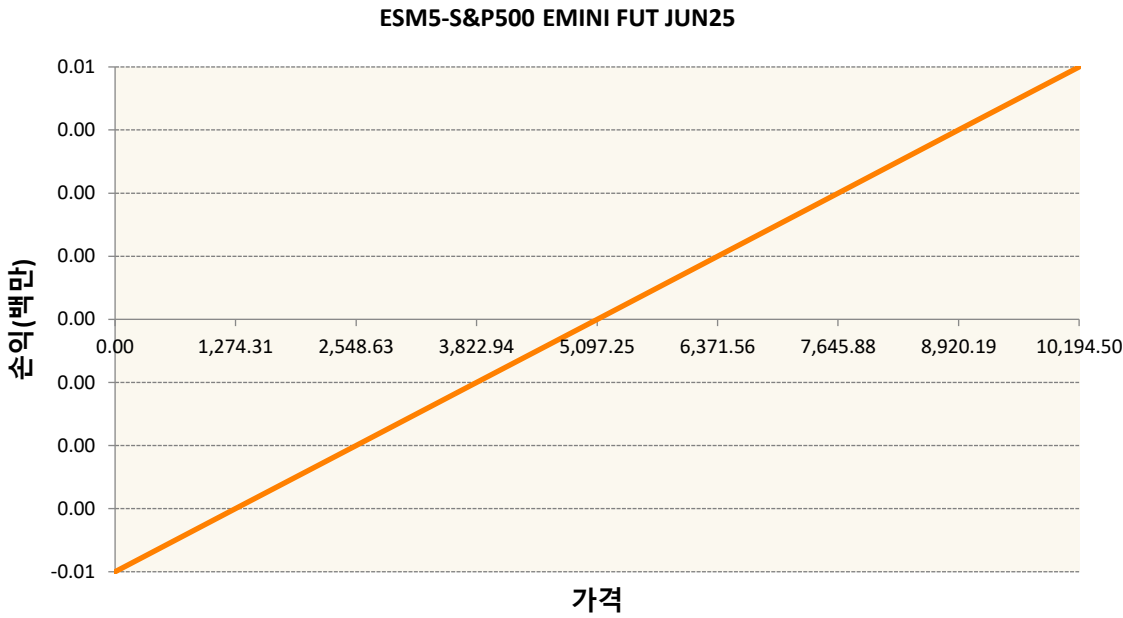
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	372	0	372	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5 S&P500 EMINI FUT JUN25

30

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

(단위:백만원)

23

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

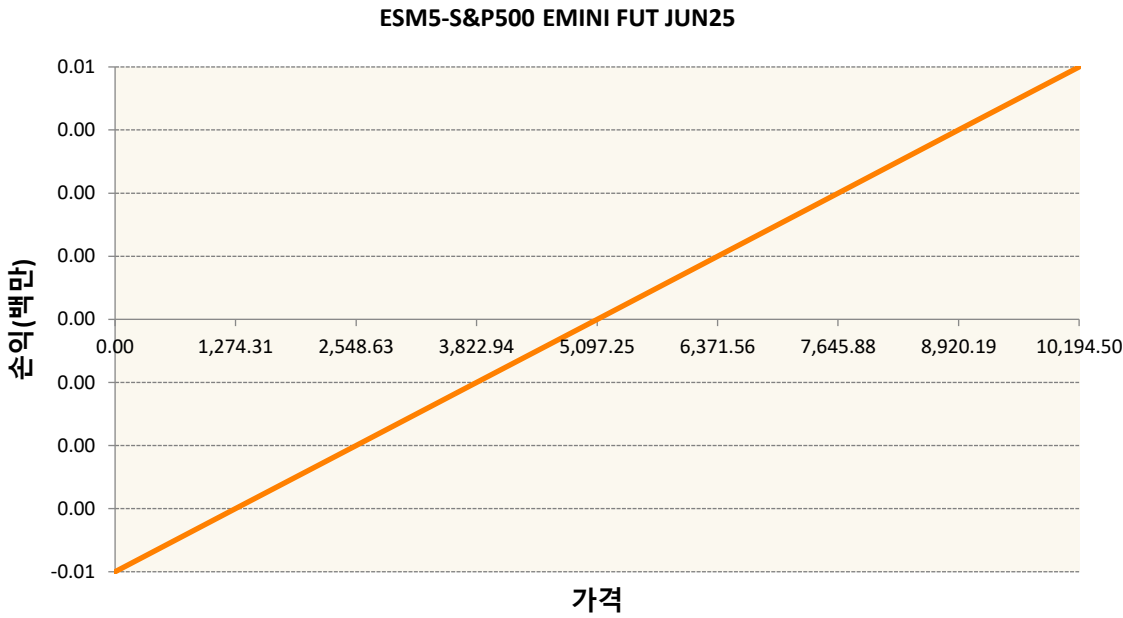
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,235	0	2,235	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	179
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

135

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

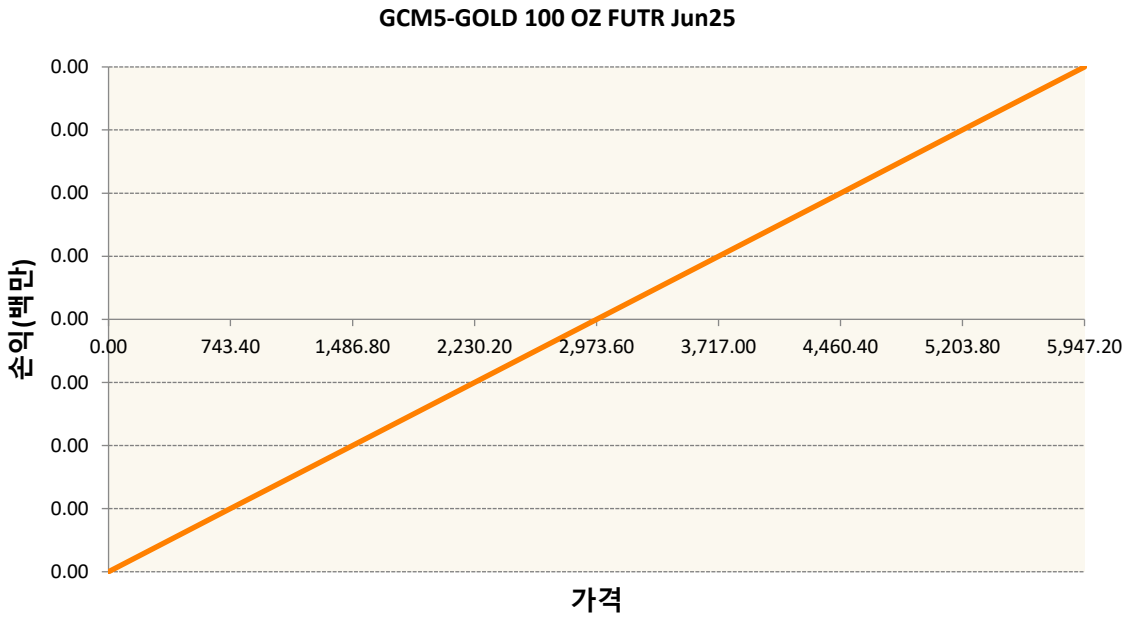
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,184	0	2,184	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 04/11/25 C286 EQUITY	1
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	175

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

(단위:백만원)

130

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

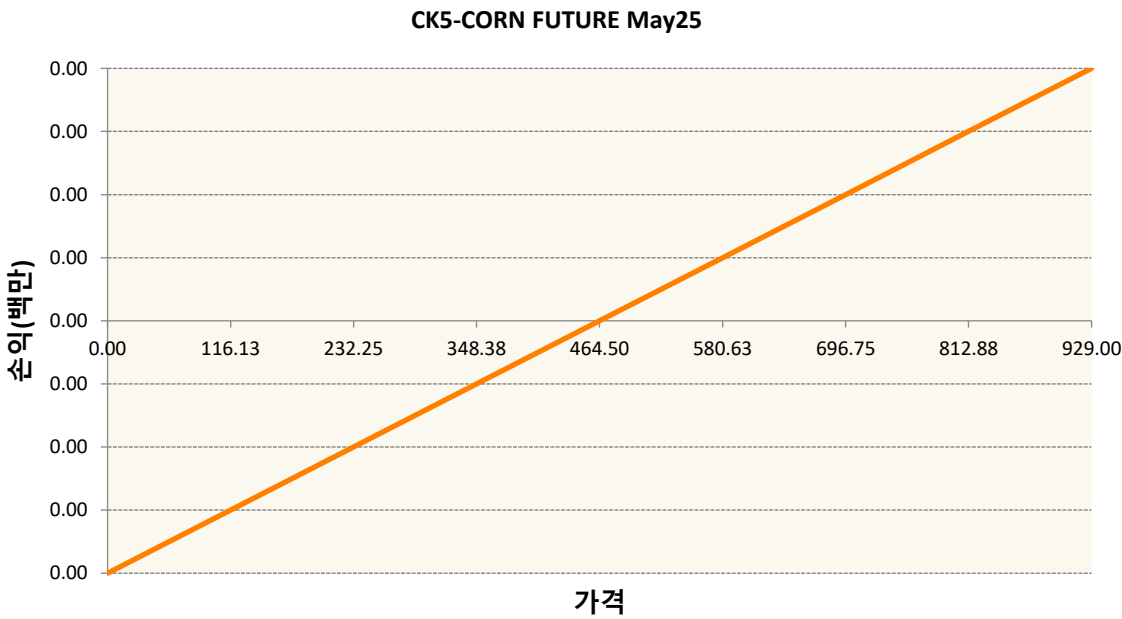
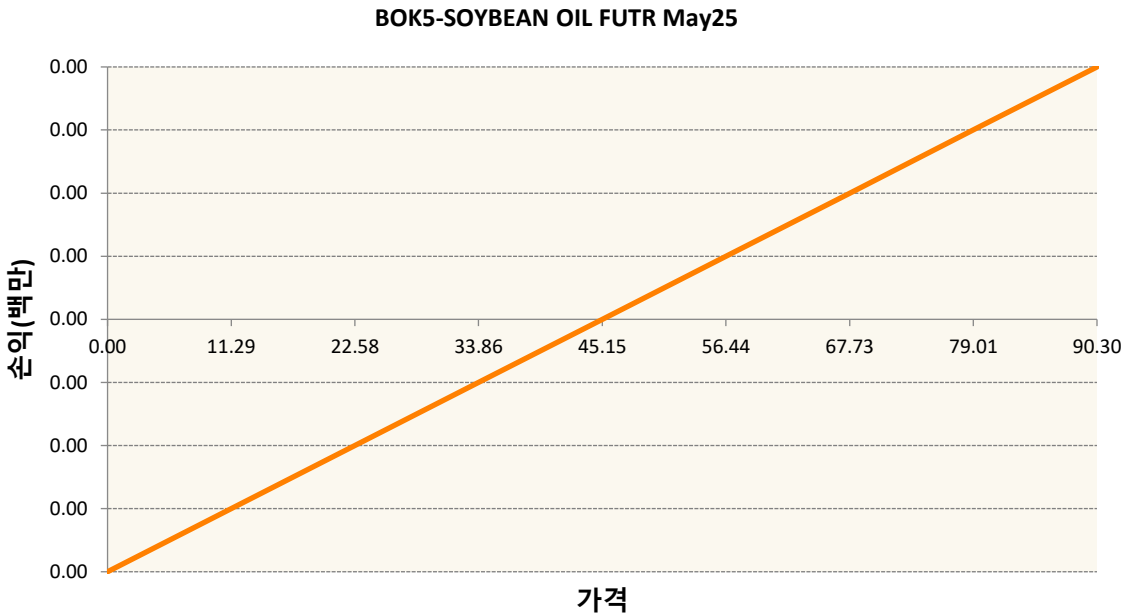
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

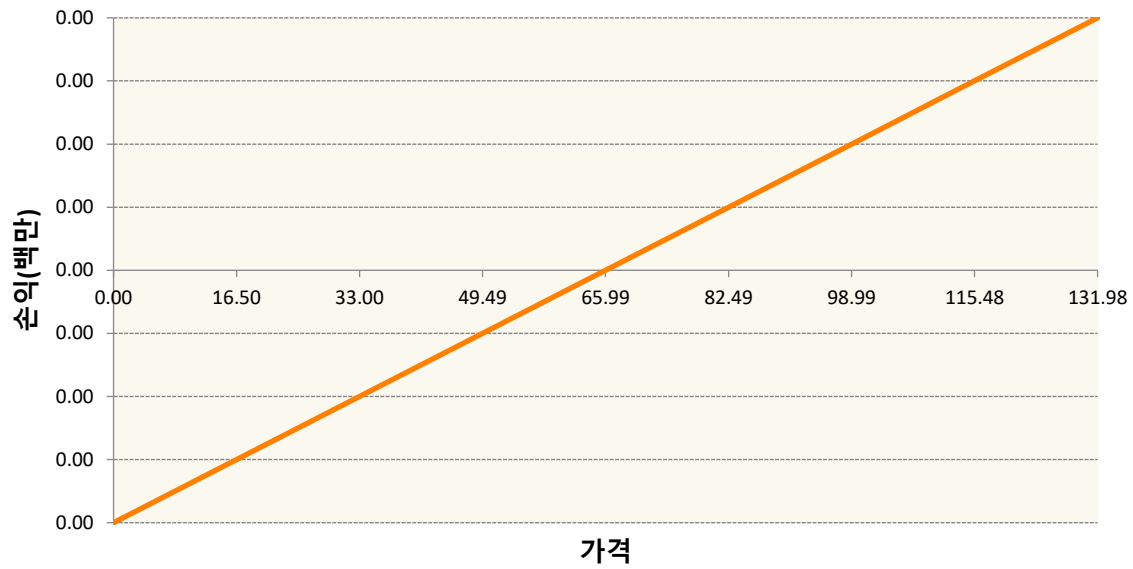
(단위:USD 백만)

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	3,655	0	3,655	
누계	통화	선물	0	294	-294	장내

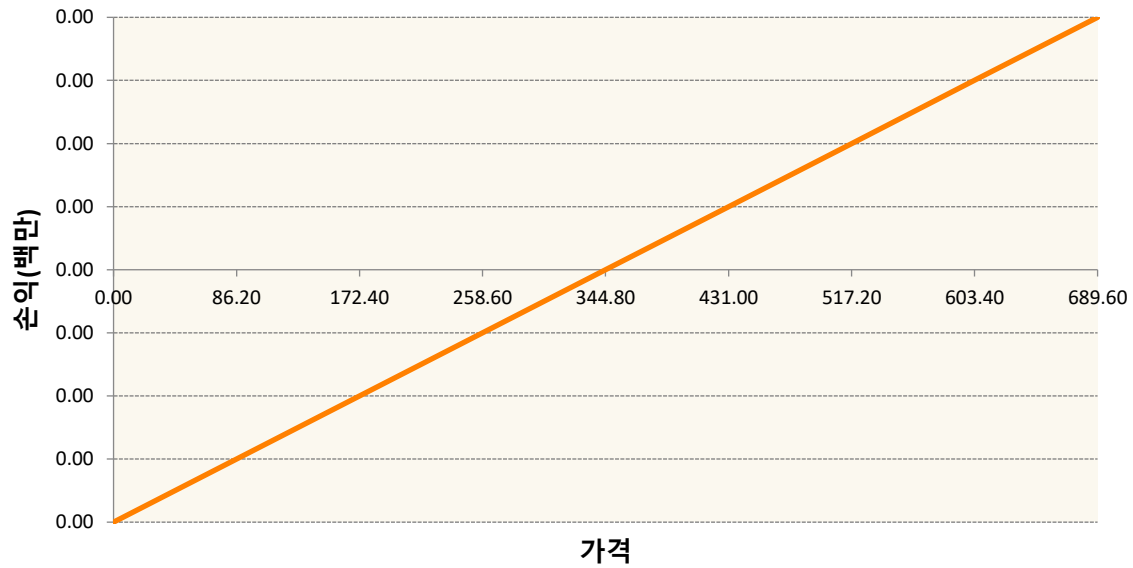
2. 만기시점의 손익구조



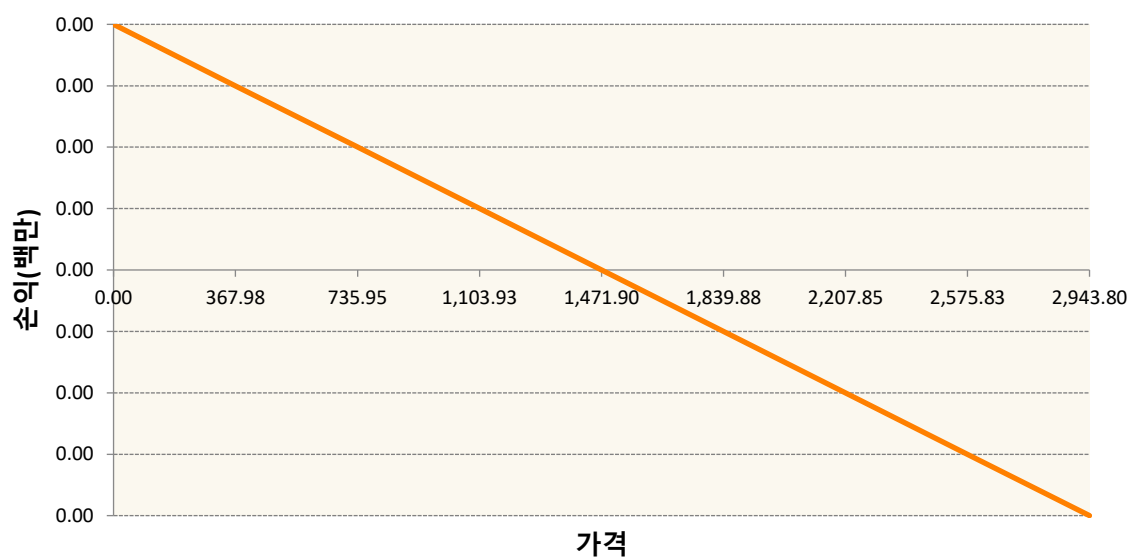
CTK5-COTTON NO.2 FUTR May 25



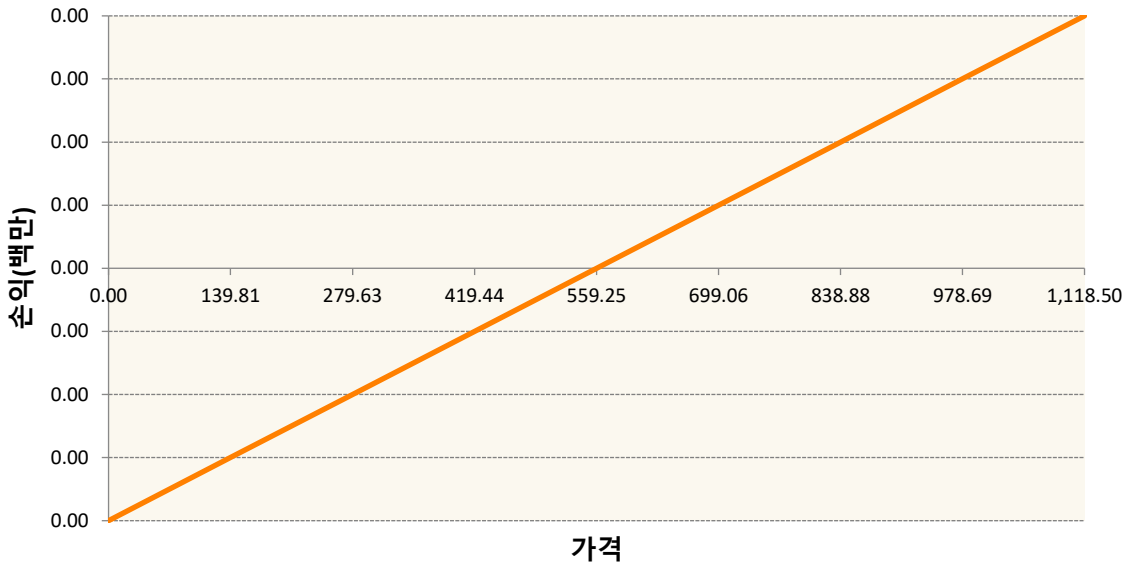
KCK5-COFFEE 'C' FUTURE May 25



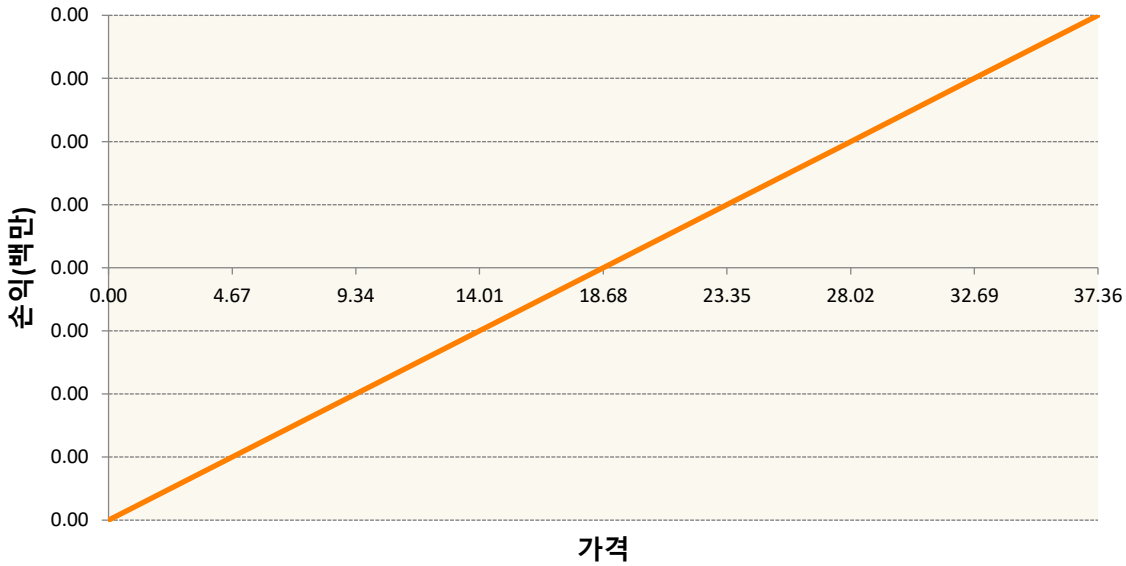
KR4175W40006-2025-04 달러선물



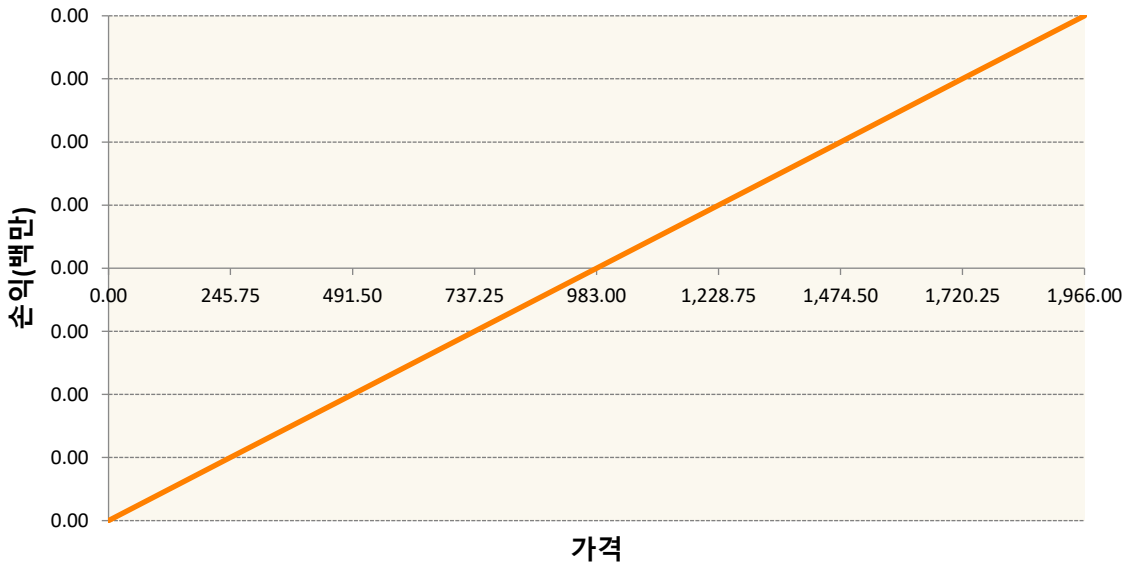
KWK5-KC HRW WHEAT FUT May 25



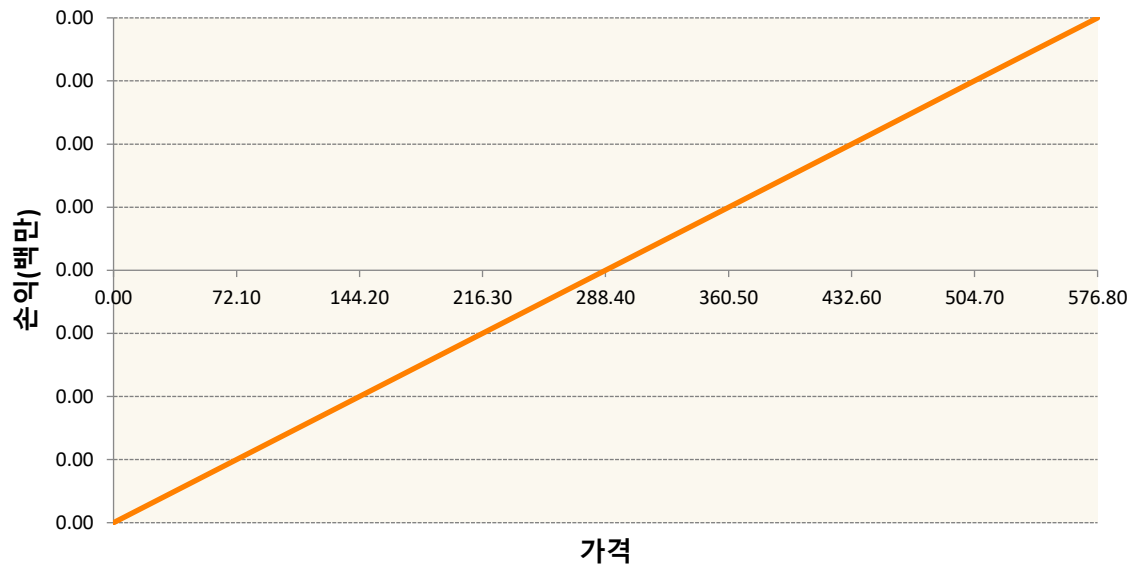
SBK5-Sugar #11 (WORLD) May 25



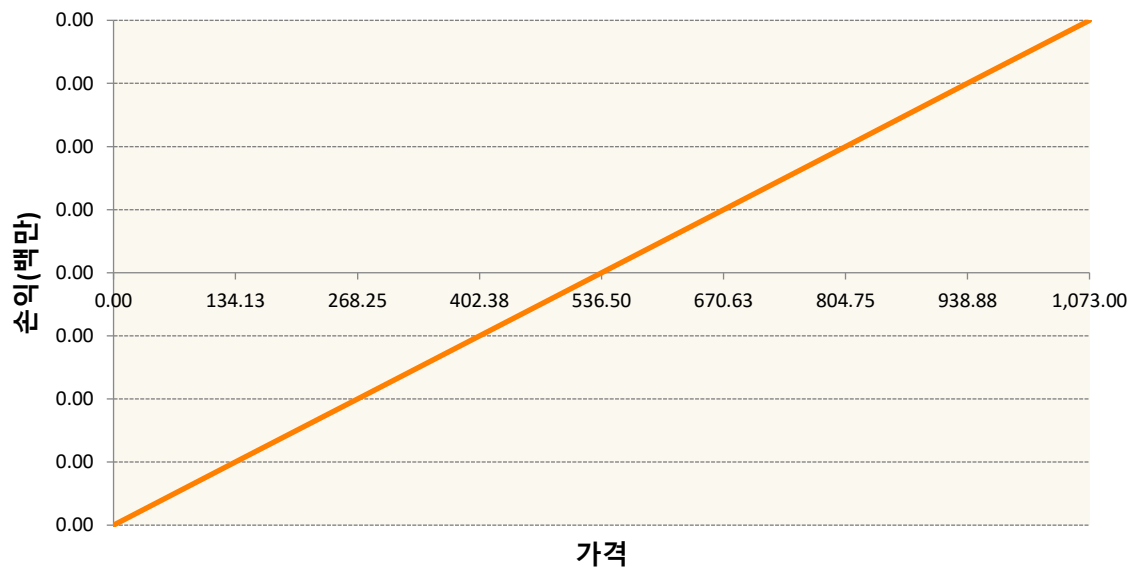
SK5-SOYBEAN FUTURE May 25



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	2025-04-09
기준일	2025-04-08

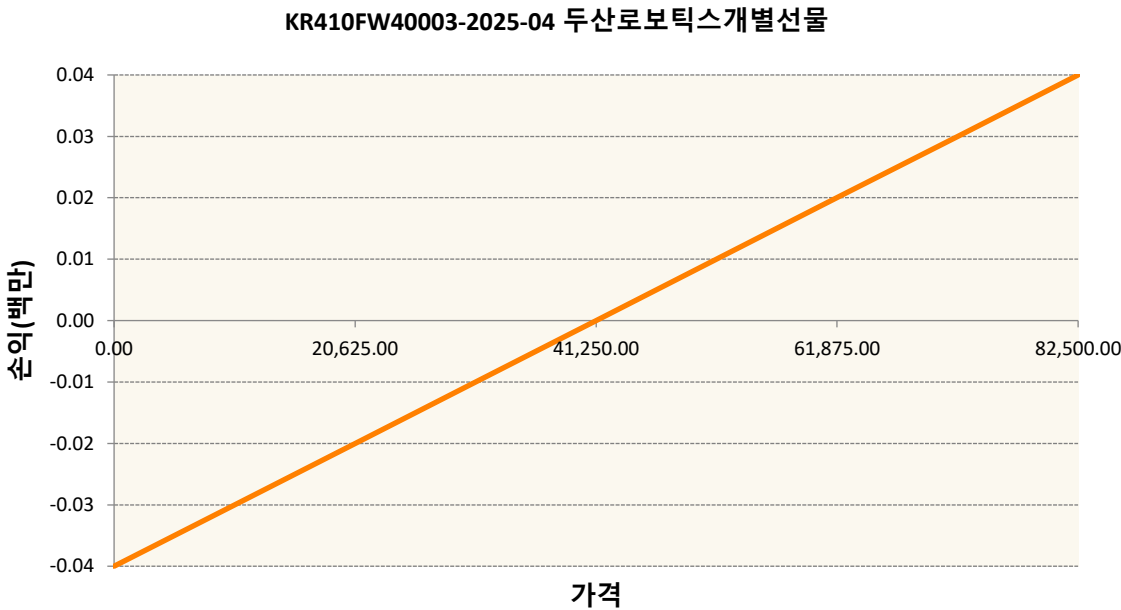
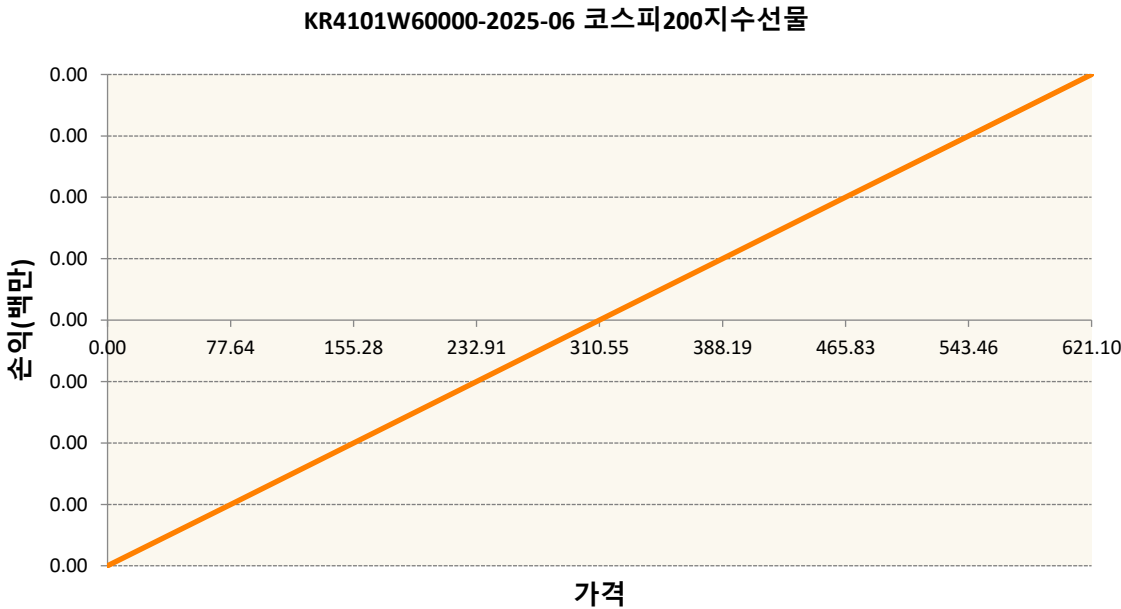
스마트인덱스모

1. 계약금액

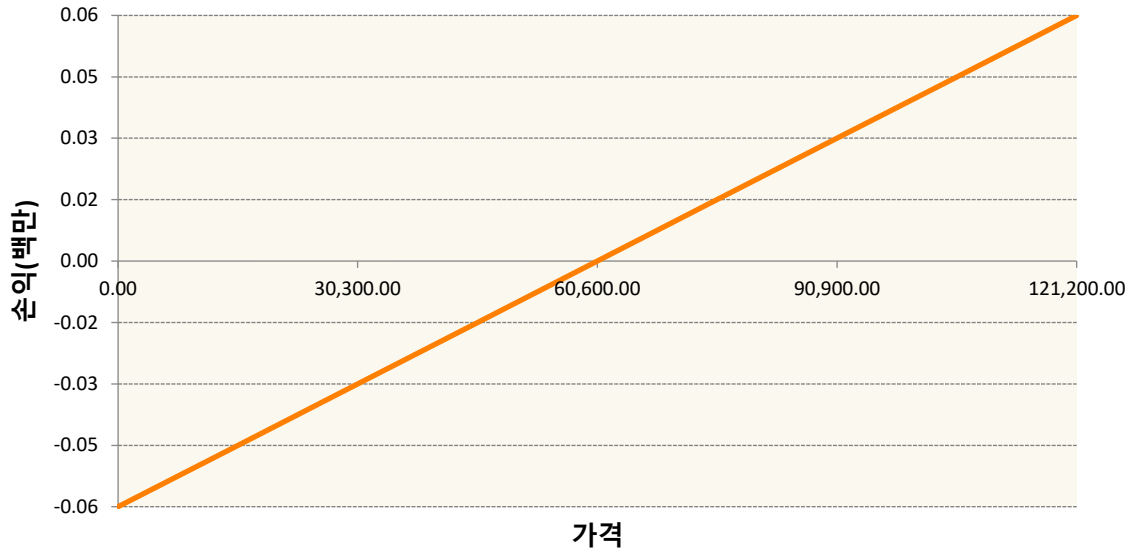
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	291	0	291	장내
누계	유가증권	선물	1,981	0	1,981	장내

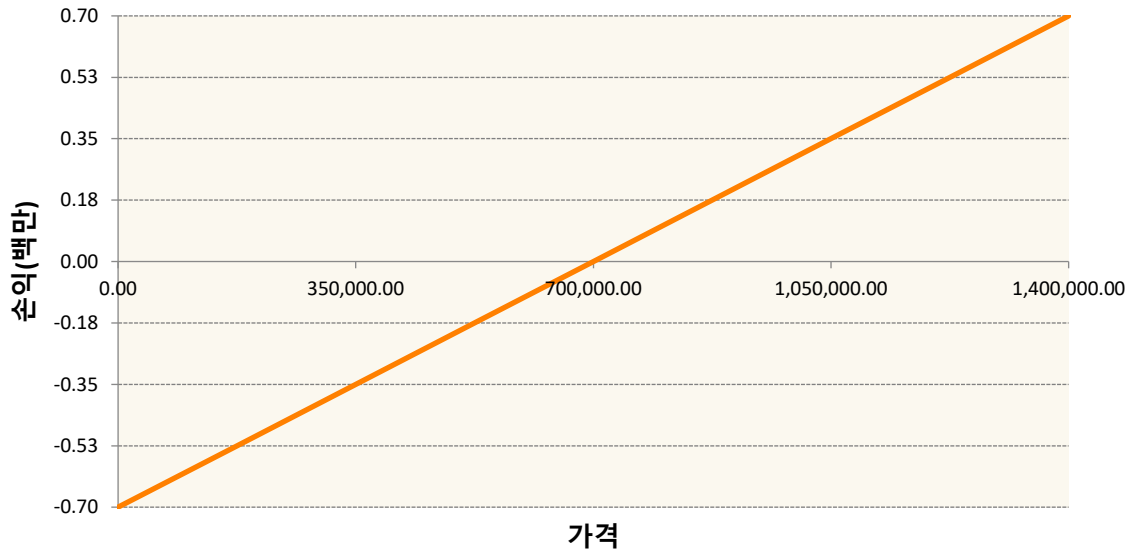
2. 만기시점의 손익구조



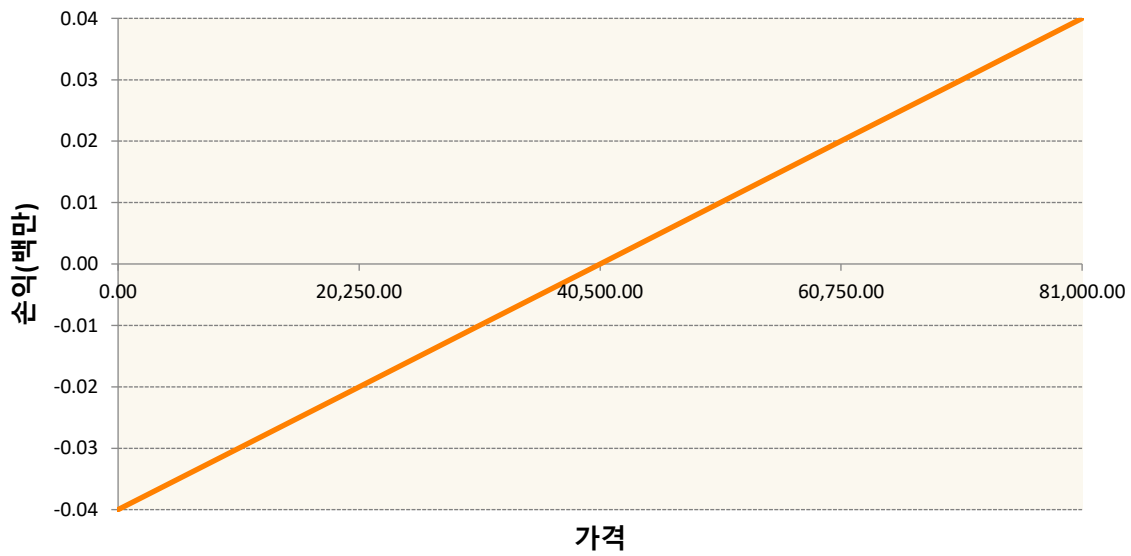
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



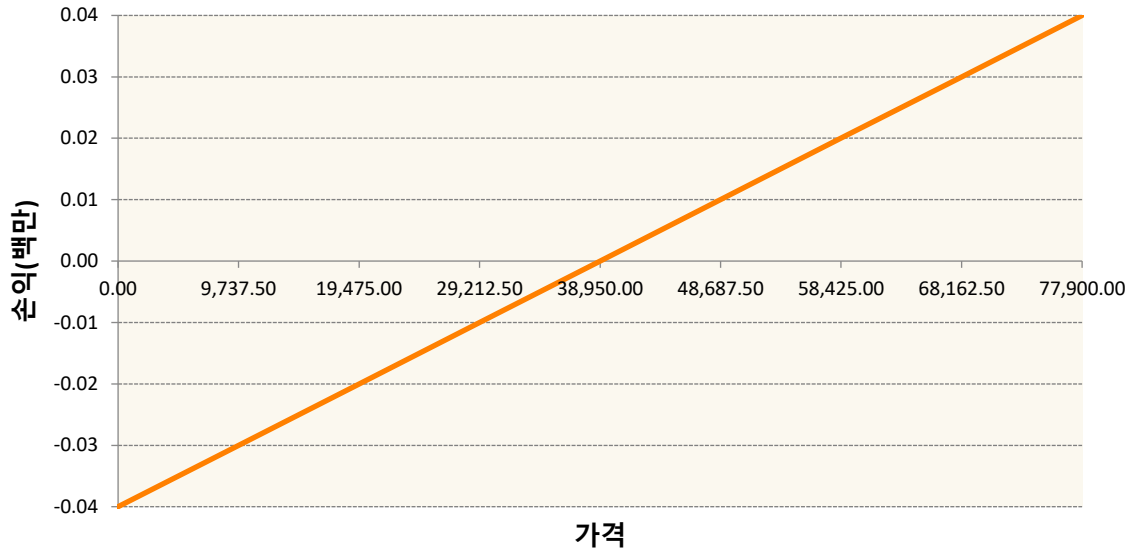
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



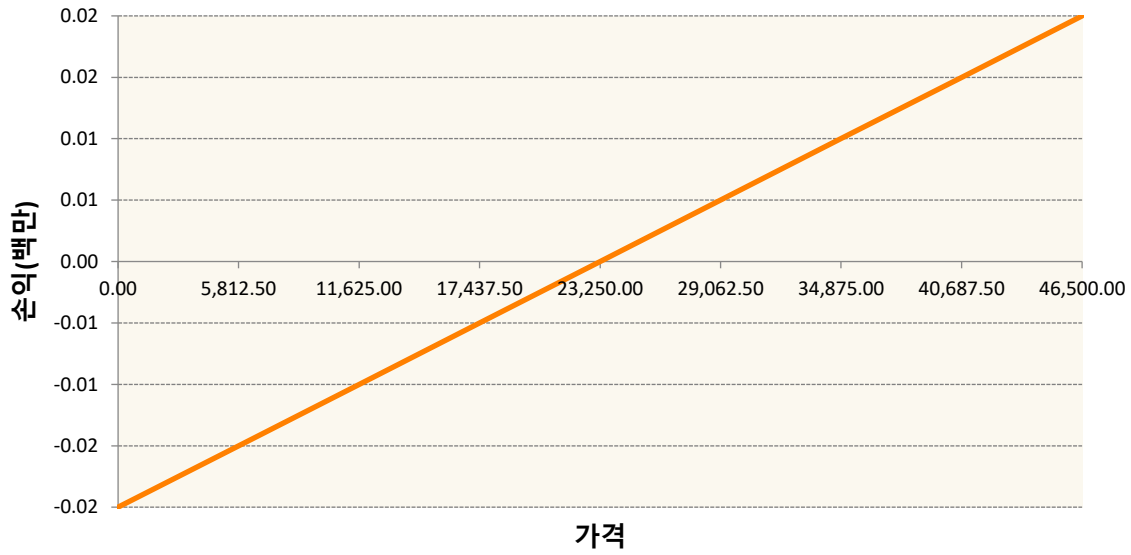
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



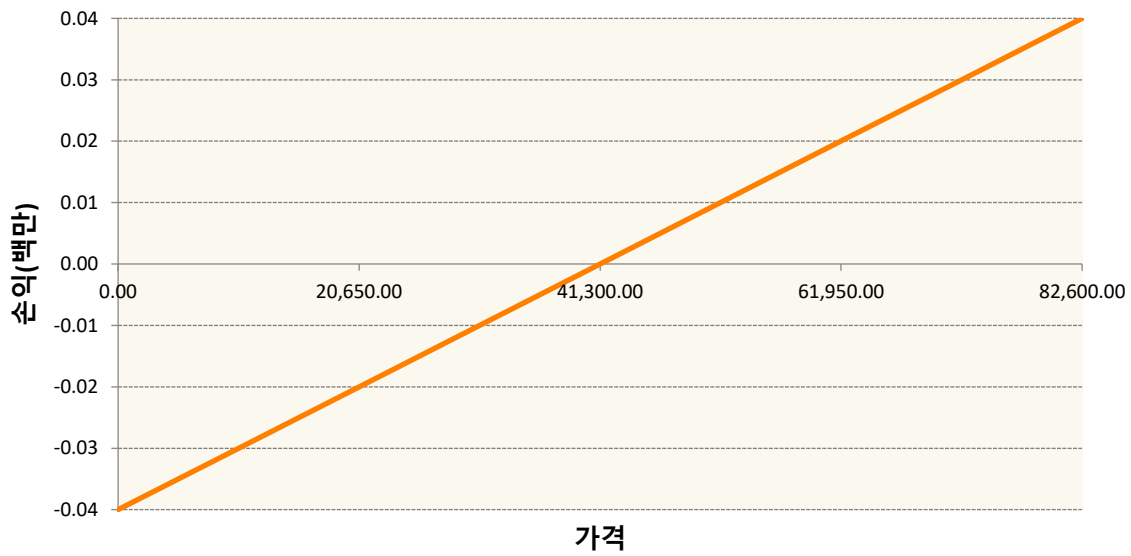
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



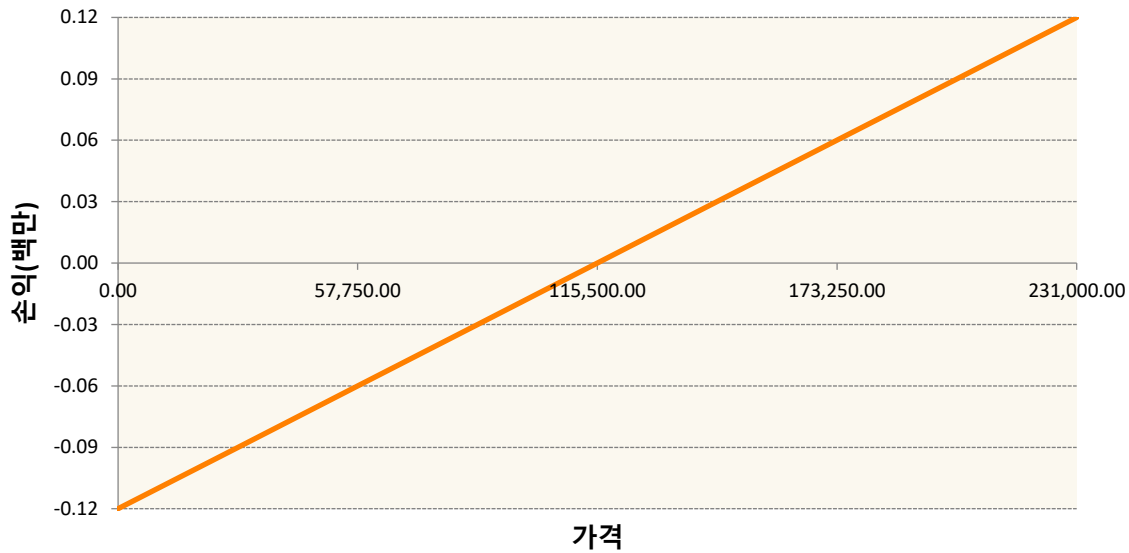
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



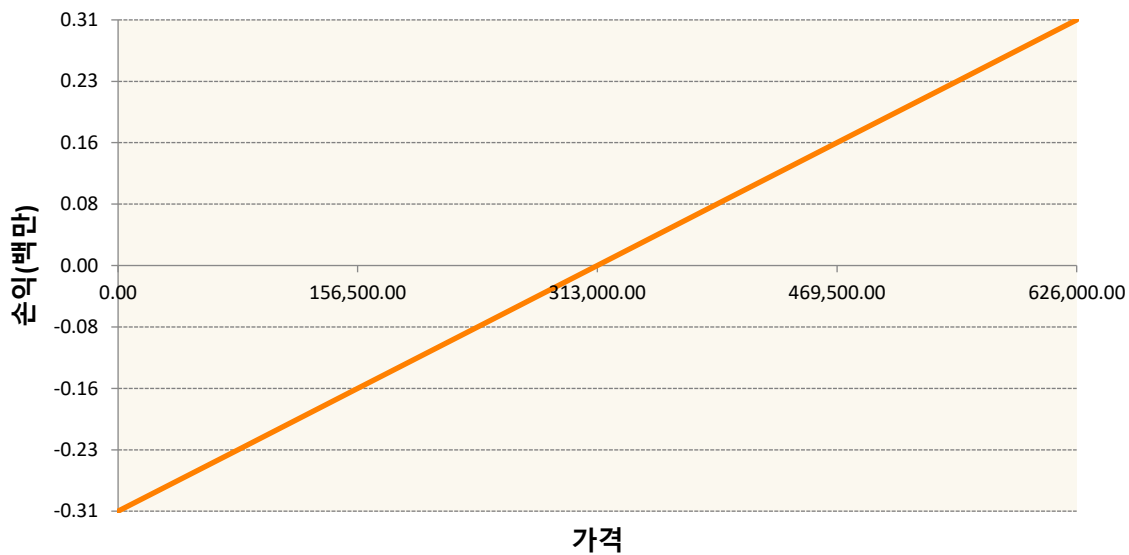
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	93
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	3
KR41BHW40 2025-04 한화에어로스페이스개별선물	26
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물	1
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물	15
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	1
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	1
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물	13

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

(단위:백만원)

321

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

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	266
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

435

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

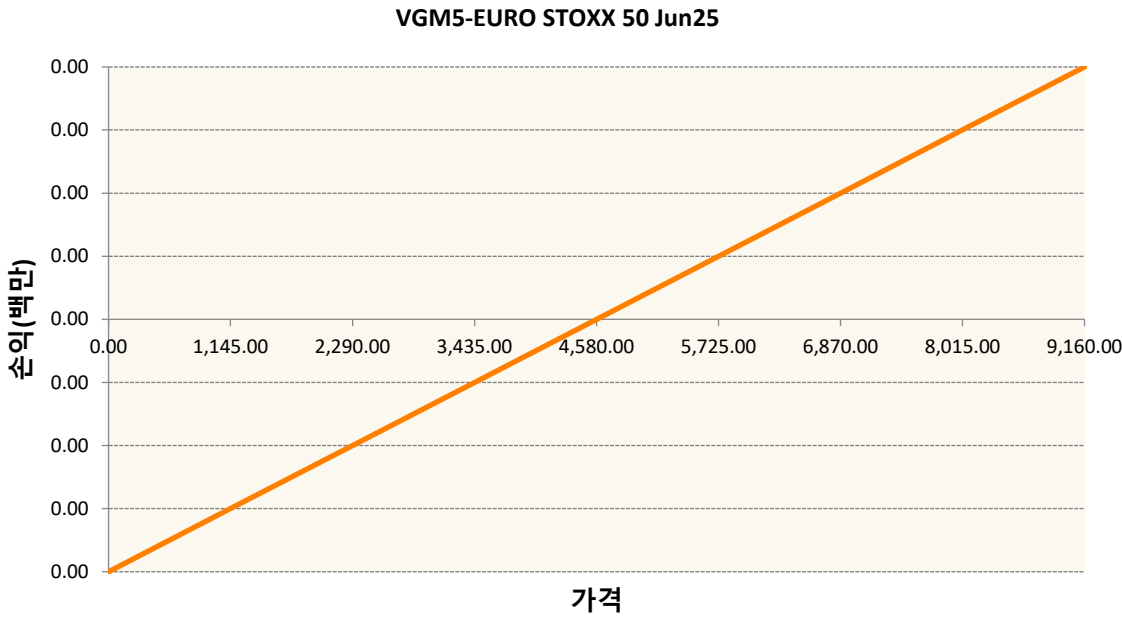
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	798	0	798	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	64
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

49

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

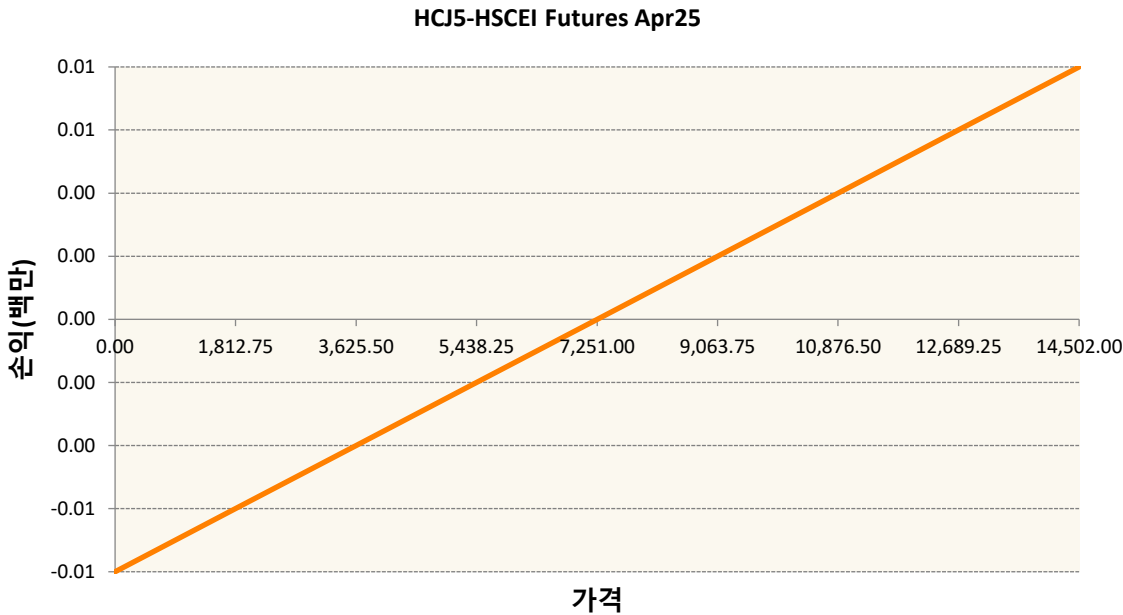
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,662	0	2,662	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ5	HSCEI Futures Apr25	213
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

318

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

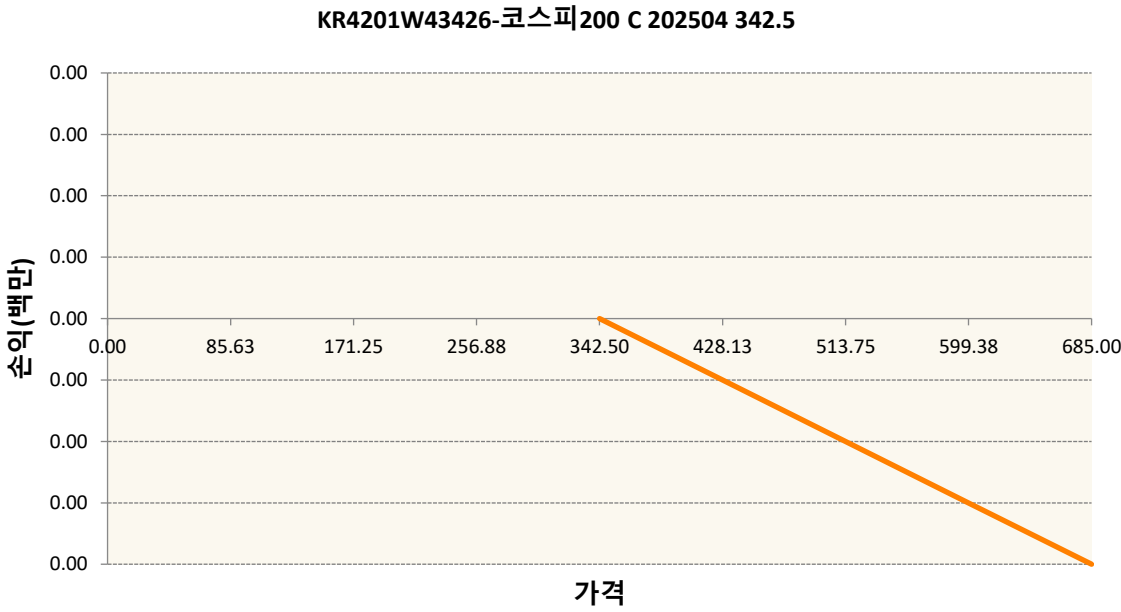
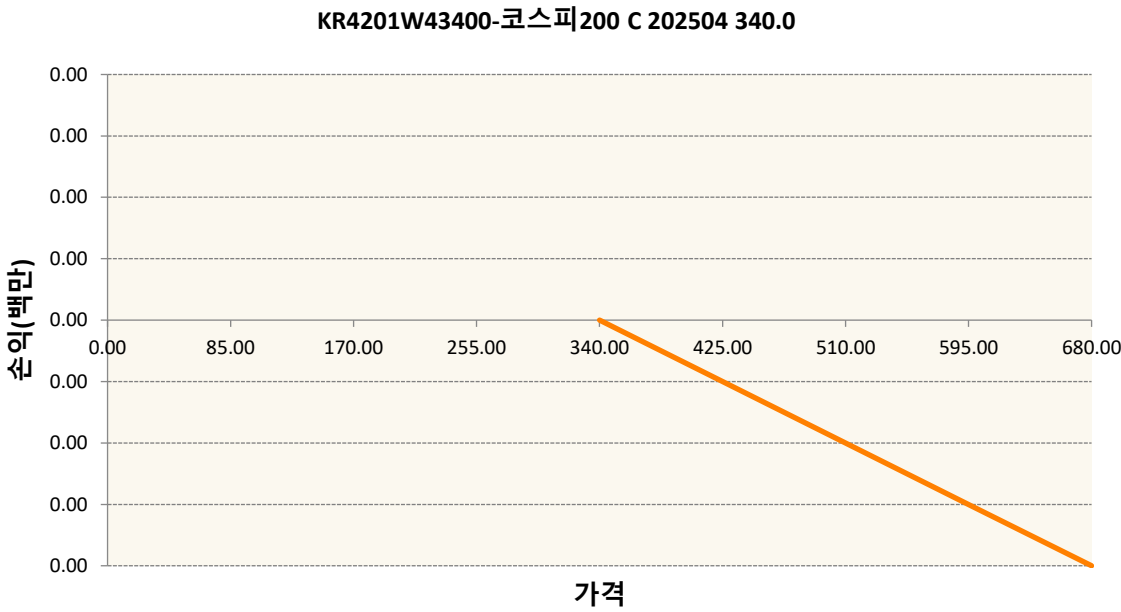
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	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 is plotted, starting at the origin (0, 0) and ending at (340, 0). This indicates that the profit is zero for all prices in the range shown.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
340.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis represents '가격' (Price) and the y-axis represents '순이익 (백만)' (Net Income in millions). The line starts at the origin (0, 0) and increases linearly until it reaches a price of 342.50, where the net income is 0.00. Beyond this point, the net income would be negative, but the graph only shows the positive portion.

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
85.63	0.00
171.25	0.00
256.88	0.00
342.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201W43400							코스피200 C 202504 340.0		65
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0		
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0		
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0		
0%	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	0	0	0	0	0	-1	-1		
5.33%	-1	-1	-2	-4	-6	-8	-11		
8.00%	-20	-27	-34	-41	-49	-57	-65		
KR4201W43426							코스피200 C 202504 342.5		54
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-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	-1
5.33%	0	0	-1	-2	-3	-5	-8
8.00%	-11	-16	-23	-30	-37	-46	-54
KR4301W43408 코스피200 P 202504 340.0							229

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-229	-229	-229	-229	-229	-229	-229
-5.33%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
-2.67%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	76	76	76	76	76	76	76
5.33%	153	153	152	152	152	151	150
8.00%	224	223	221	219	218	216	214

KR4301W43424 코스피200 P 202504 342.5							298
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298
-5.33%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-2.67%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	99	99	99	99	99	99	99
5.33%	198	198	198	198	198	197	196
8.00%	295	294	292	290	289	287	285

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

(단위:백만원)

528

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

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	558	0	558	

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	2025-04-09
기준일	2025-04-08

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	4,488	0	4,488	

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	2025-04-09
기준일	2025-04-08

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	13,040	0	13,040	
누계	통화	선도	118	12,743	-12,625	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		354
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E		233
FXW213F43C USD/KRW 30-04-25E		9
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	464

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

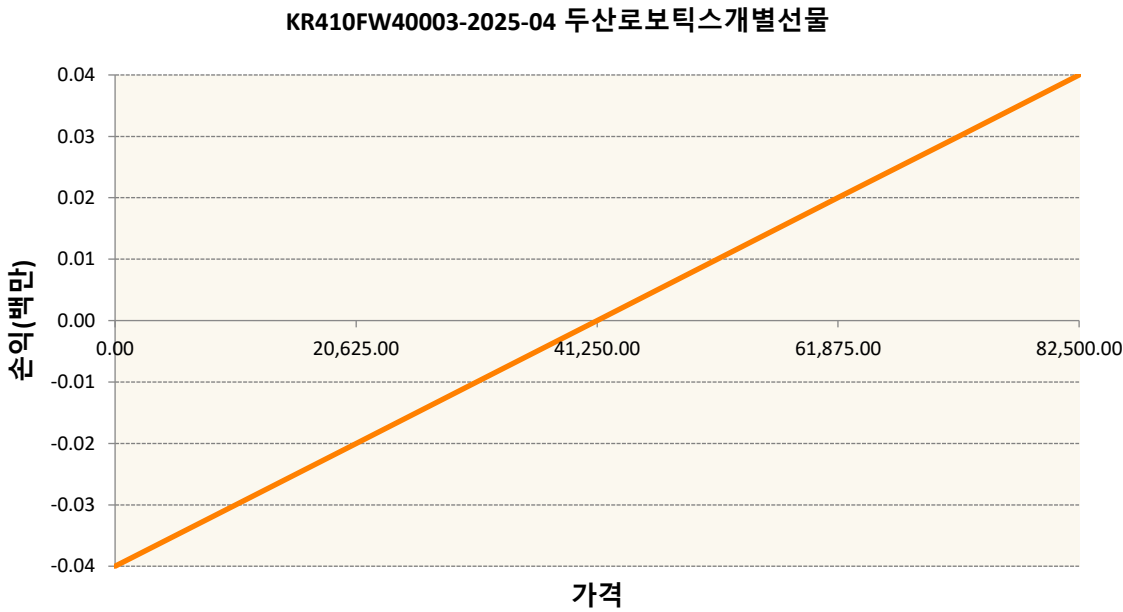
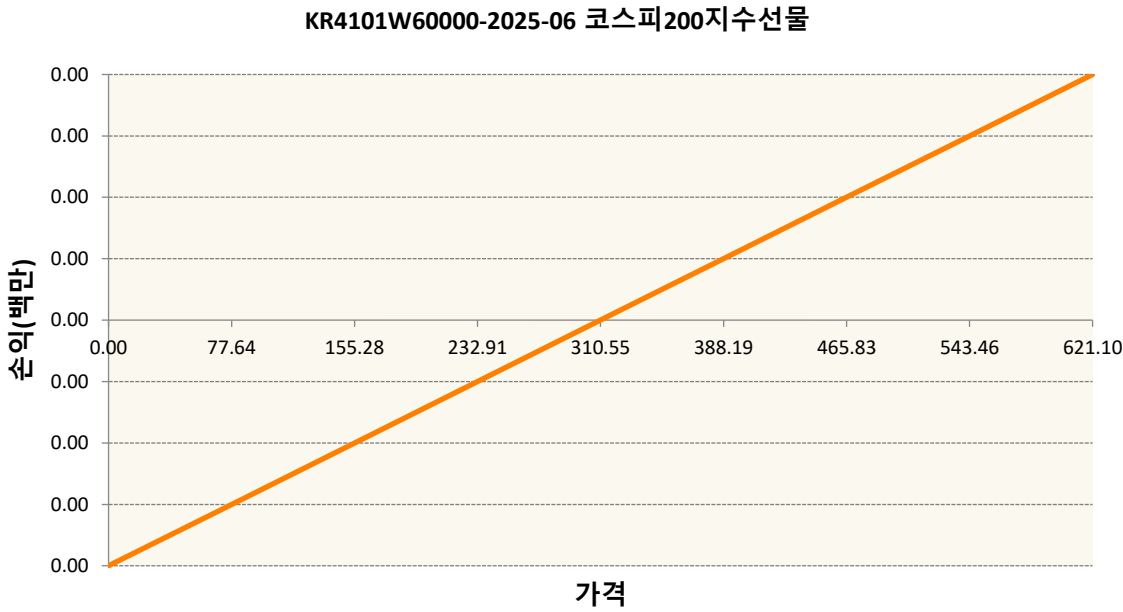
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

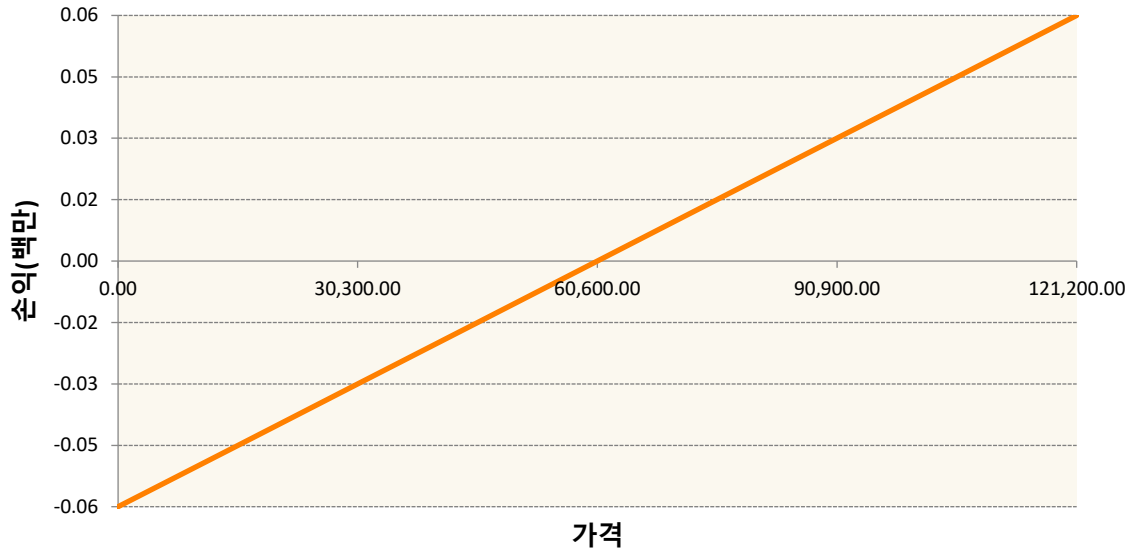
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	166	0	166	장내
누계	유가증권	선물	1,295	0	1,295	장내

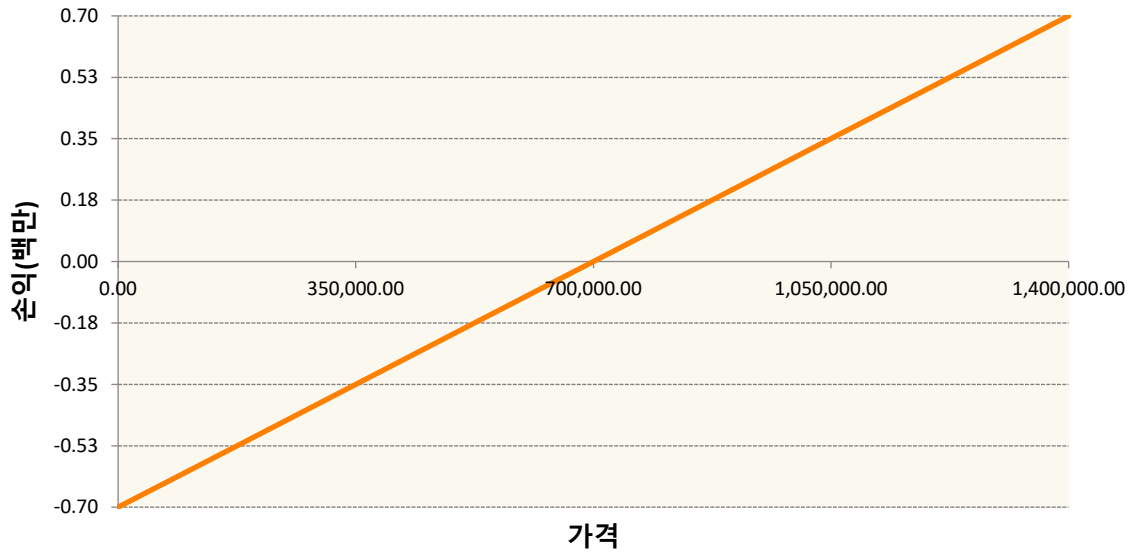
2. 만기시점의 손익구조



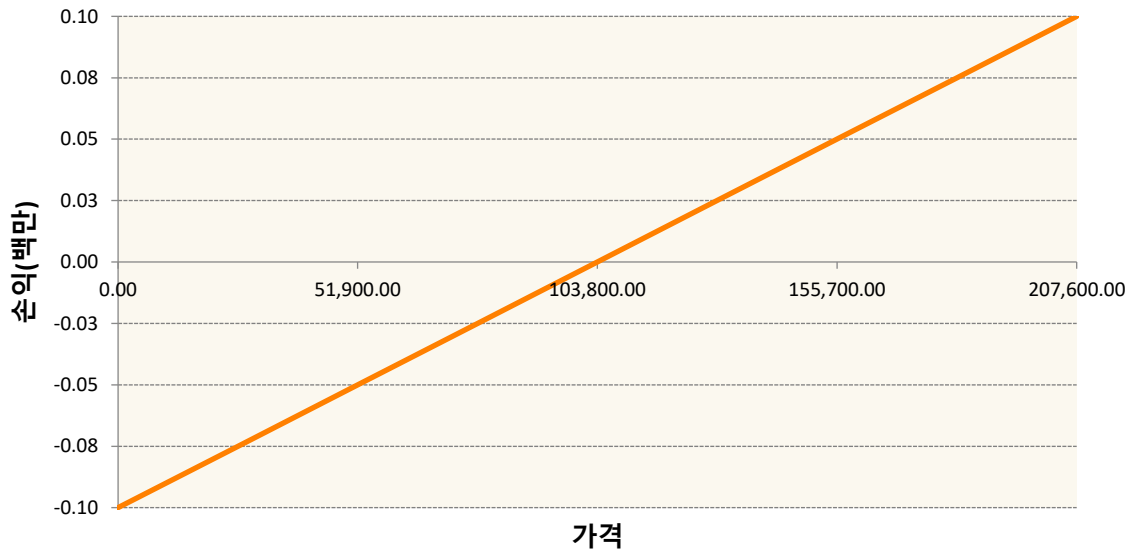
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



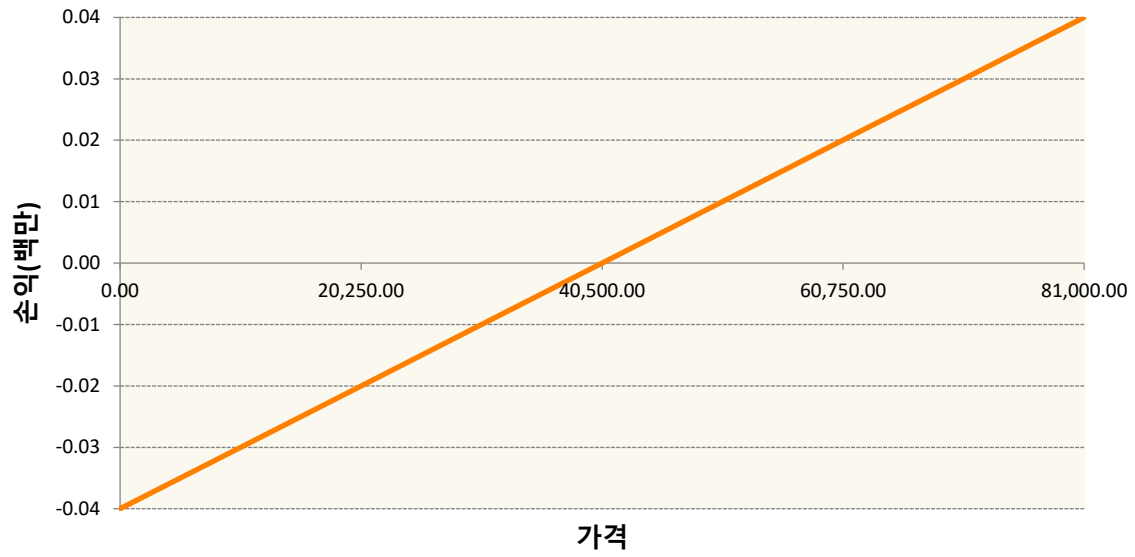
KR41BHW40005-2025-04 한화에어로스페이스개별선물



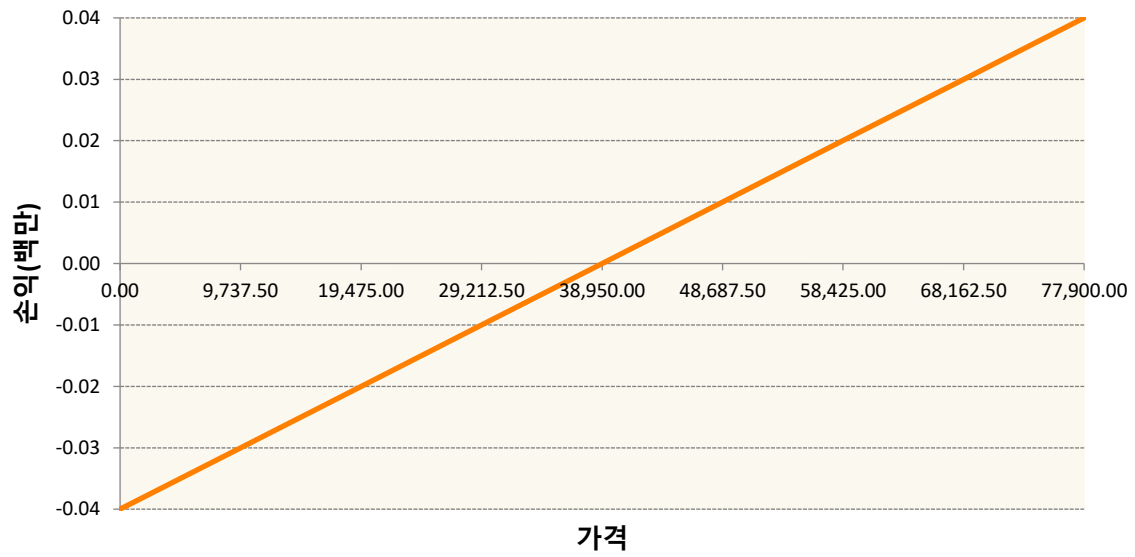
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



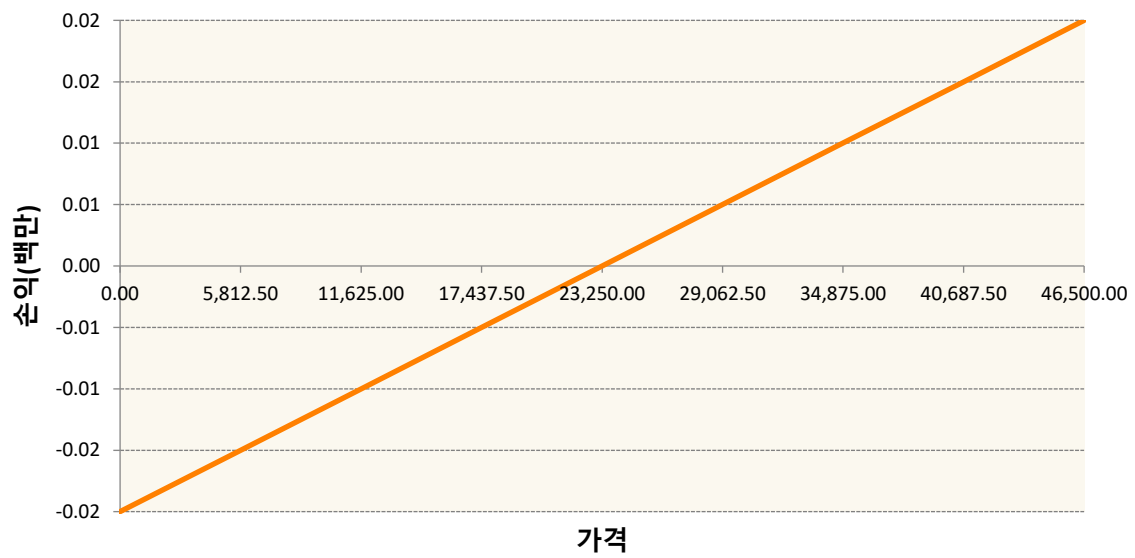
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



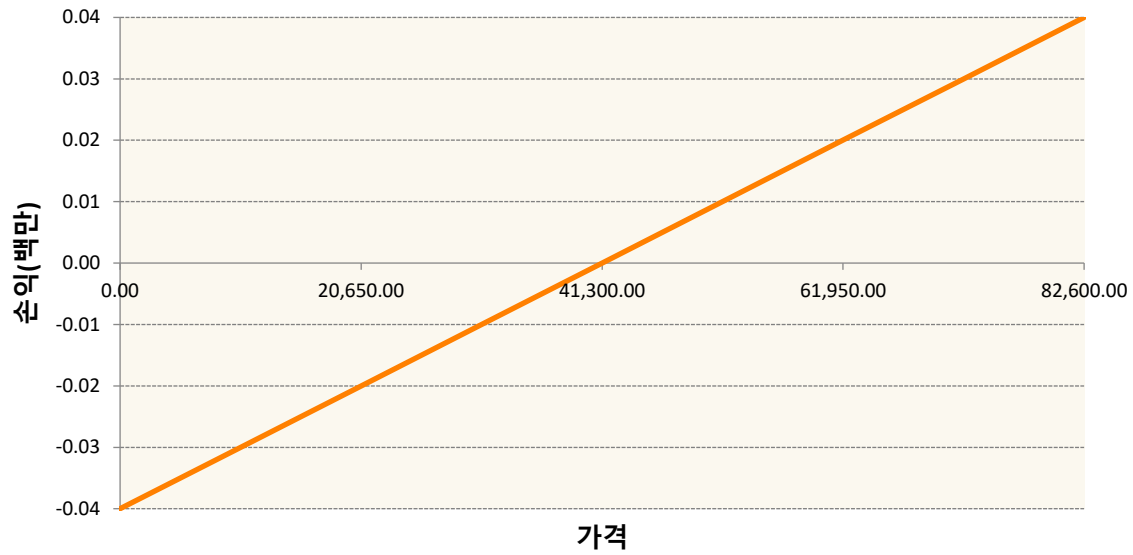
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



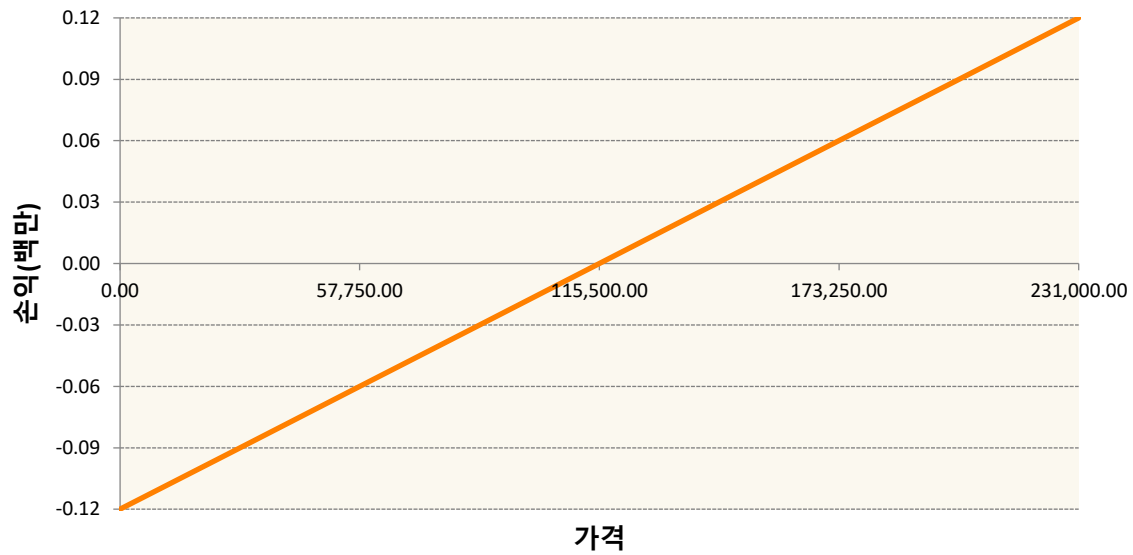
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



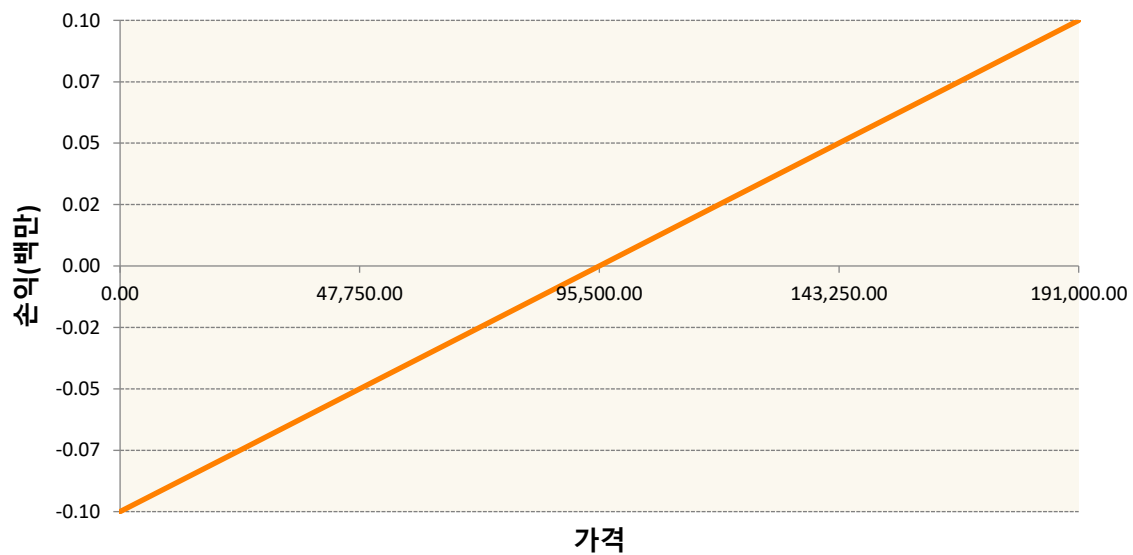
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



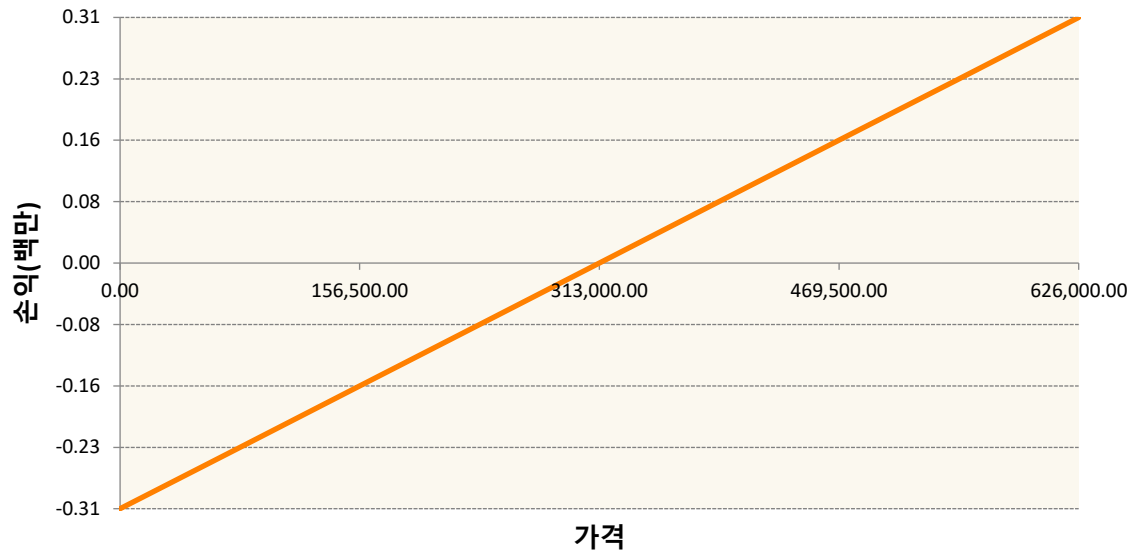
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



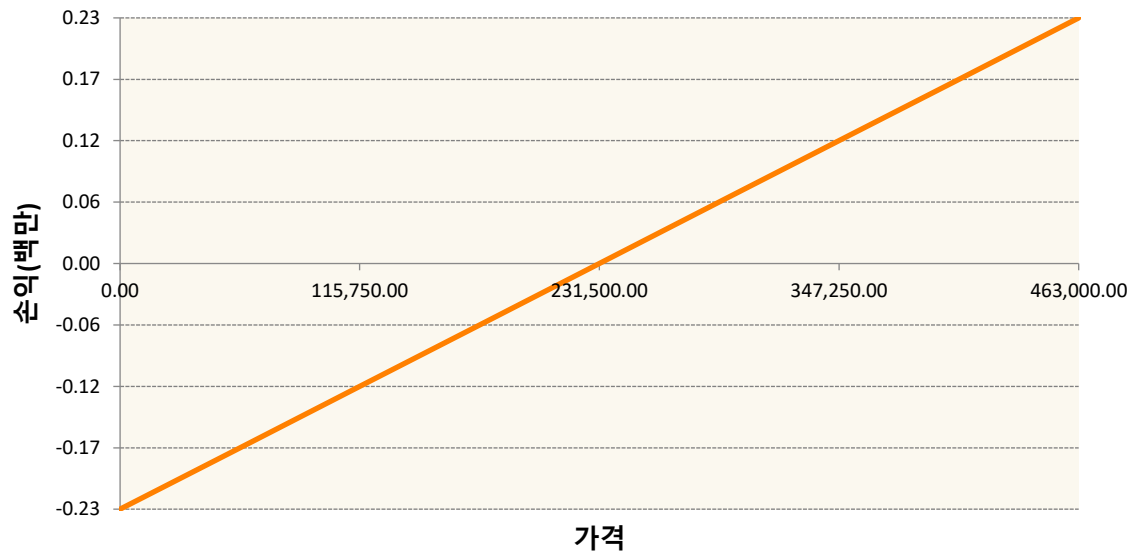
KR41EYW40004-2025-04 에코프로비엠개별선물



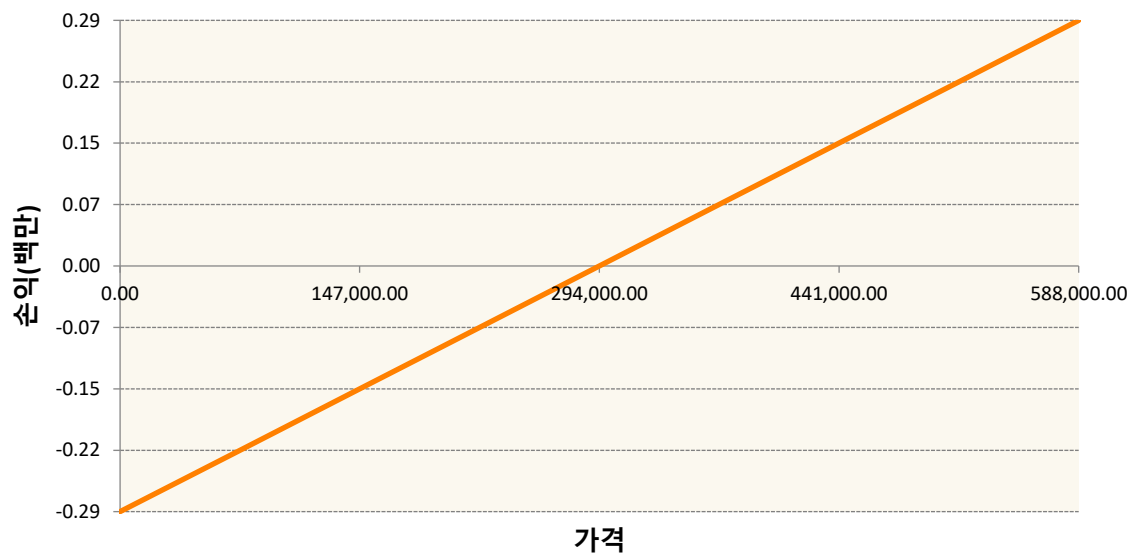
KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



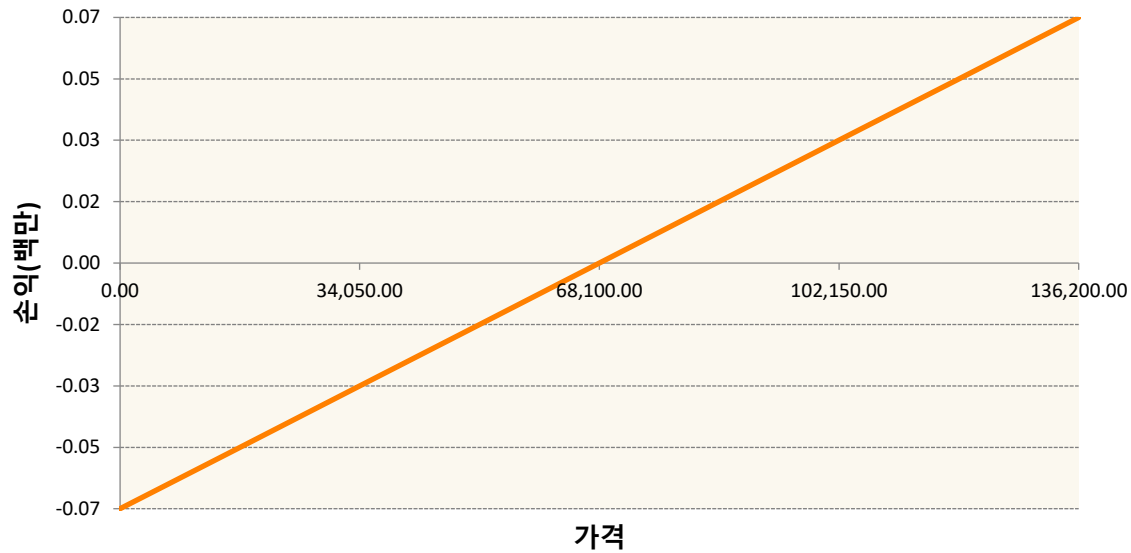
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



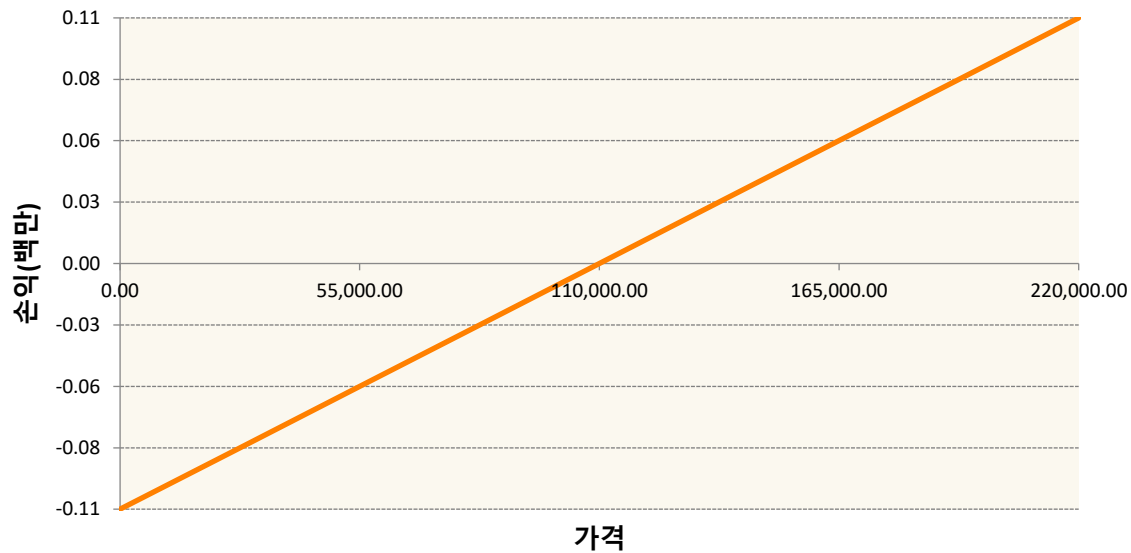
KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



KR41HEW40009-2025-04 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	62
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	0.4
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	1
KR41BHW40 2025-04 한화에어로스페이스개별선물	11
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	2
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물	1
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물	6
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	1
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	0.46
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EYW40(2025-04 에코프로비엠개별선물	2
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물	6

KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물	2
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	3
KR41FVW40(2025-04 한화오션개별선물	3
KR41HEW40(2025-04 키움증권개별선물	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	204

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

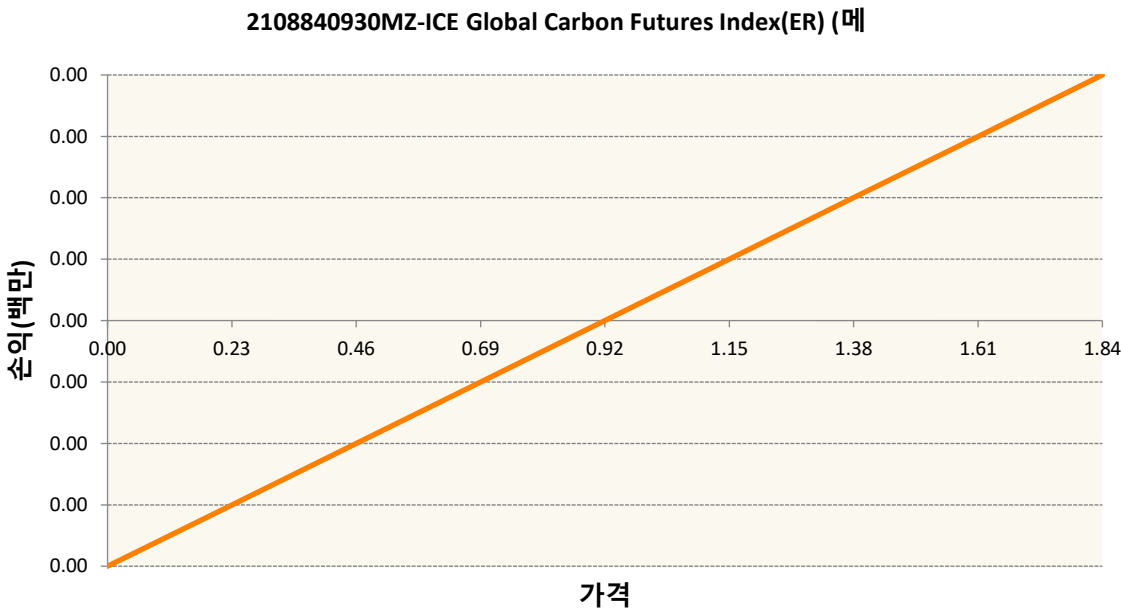
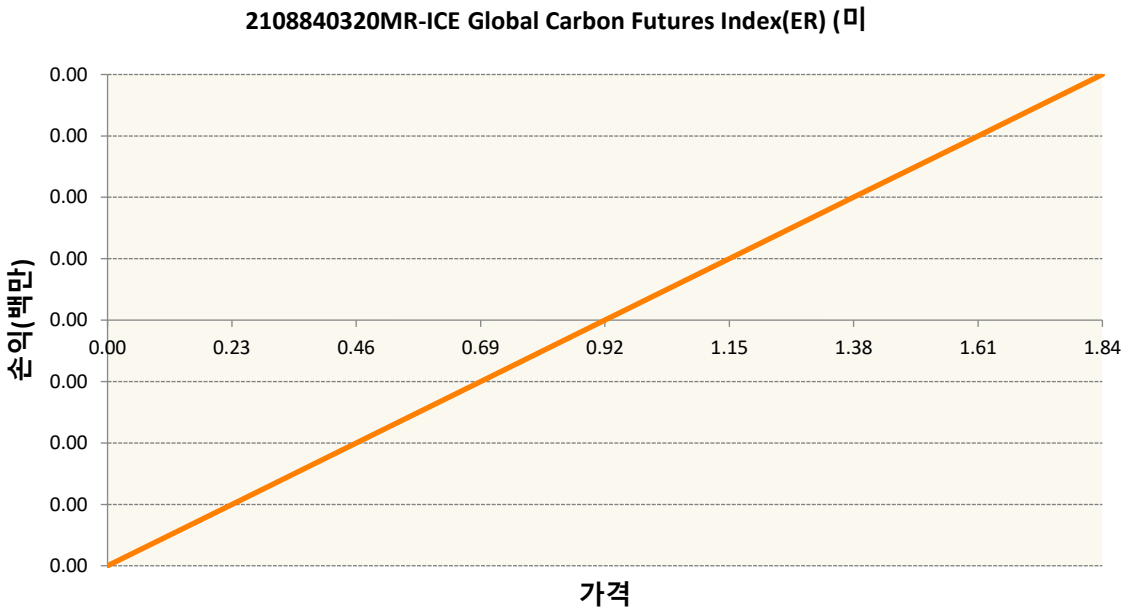
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,051	0	9,051	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	543
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	182

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	830

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

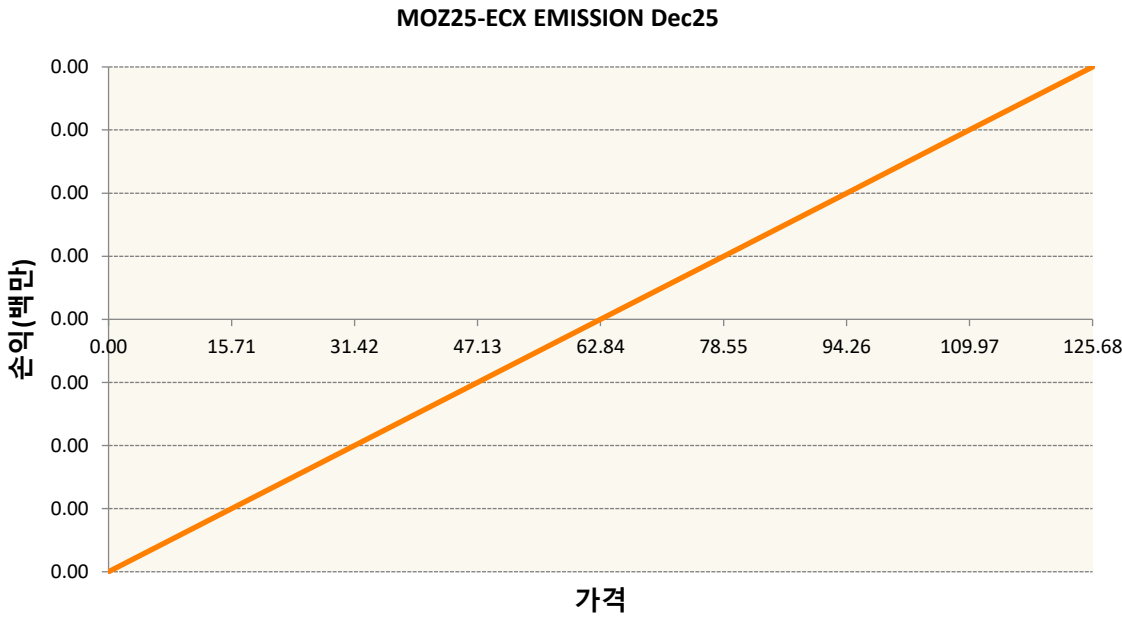
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,604	0	5,604	
누계	통화	선도	0	1,185	-1,185	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	4
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	14
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	81
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	452

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

(단위:백만원)

851

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

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)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	19

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

(단위:백만원)

117

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

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)	33
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	39
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	28
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	8

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

(단위:백만원)

191

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

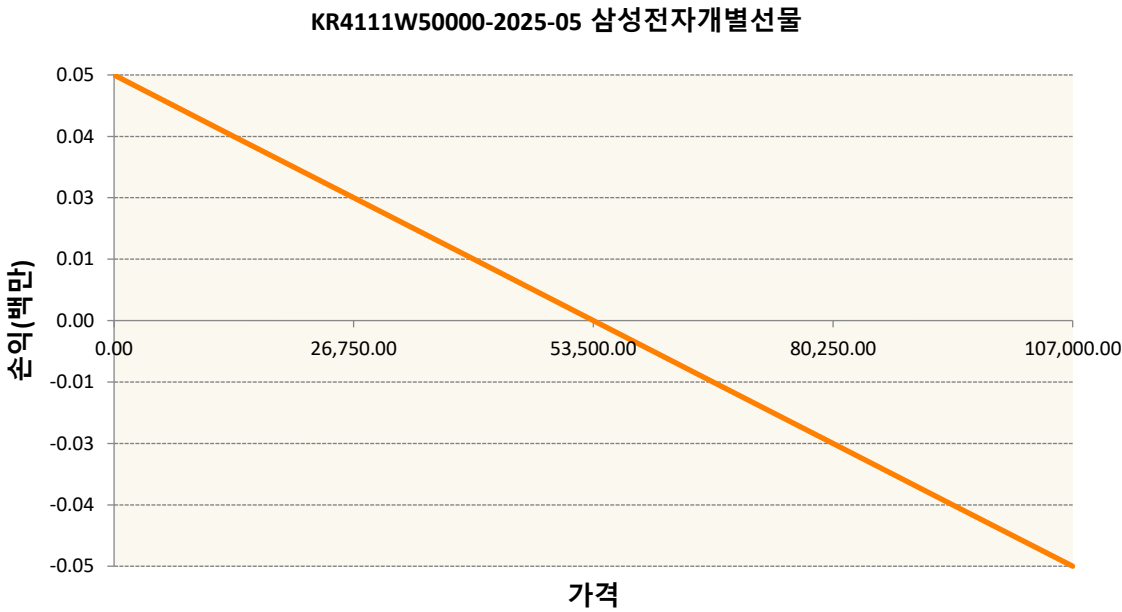
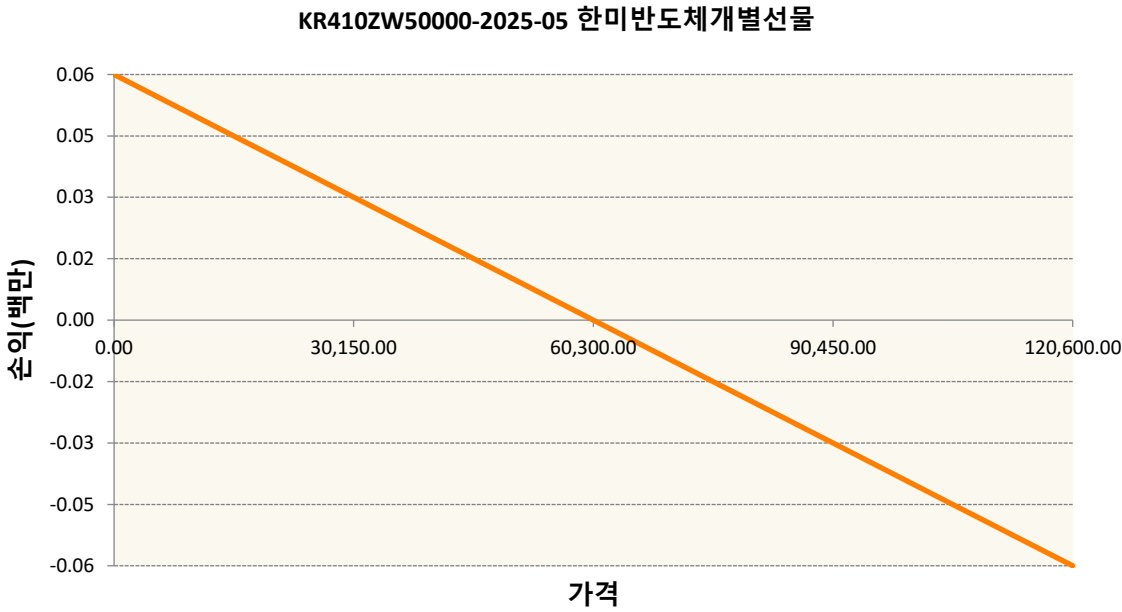
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

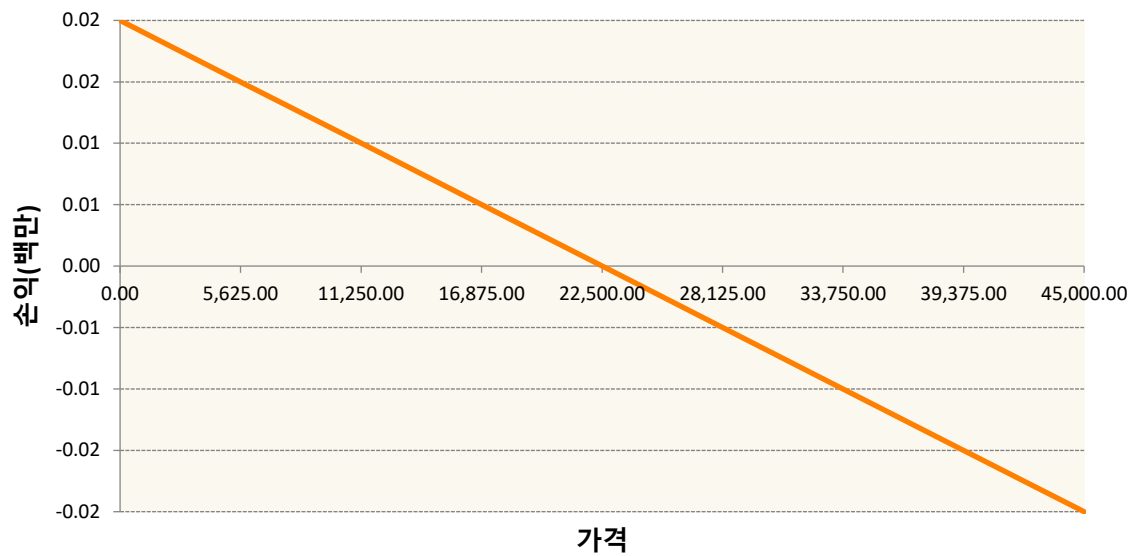
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	41	-41	장내
누계	유가증권	선물	7	64	-57	장내

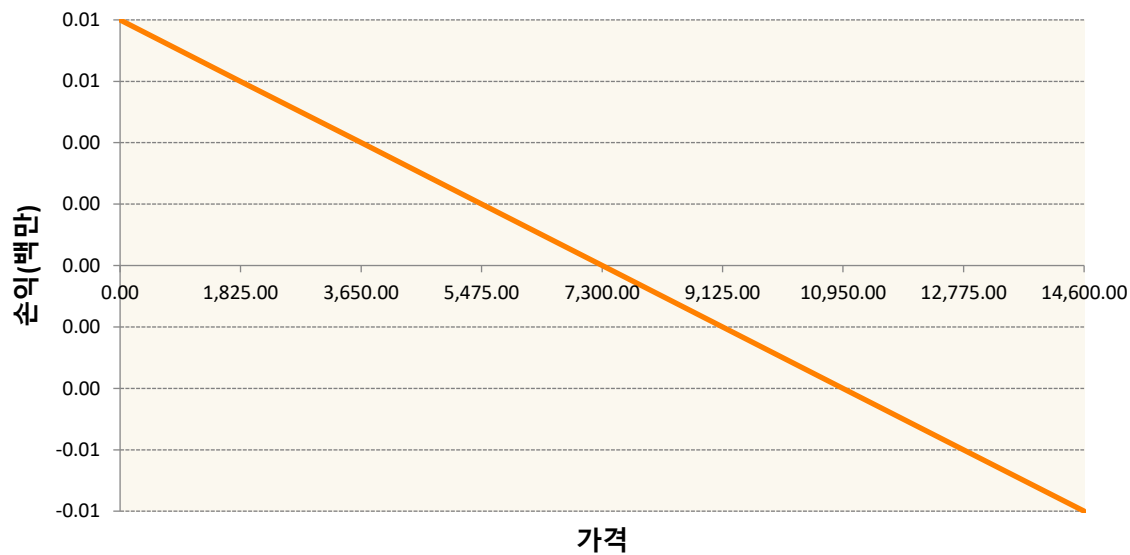
2. 만기시점의 손익구조



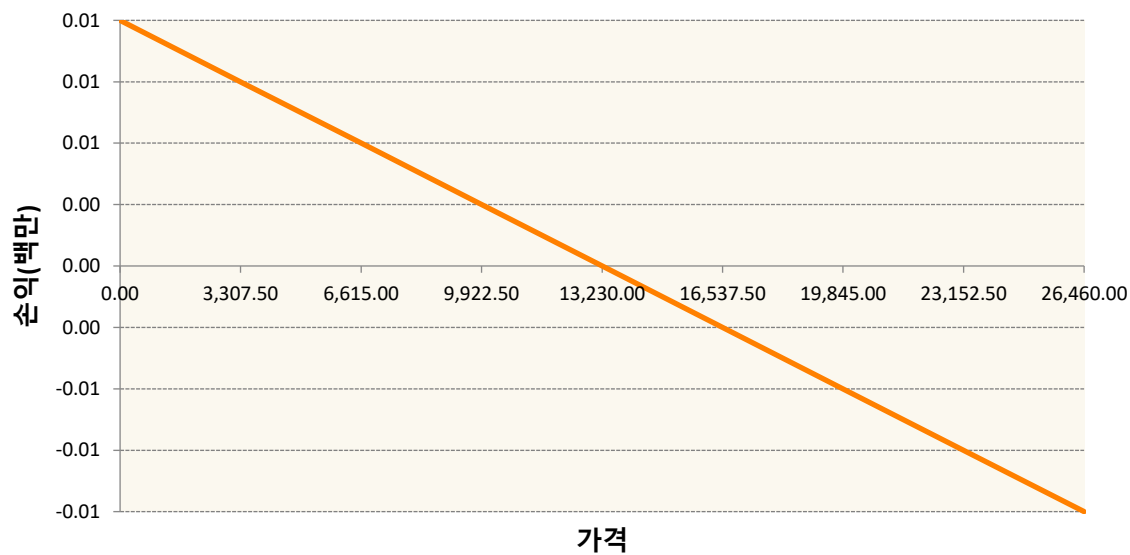
KR4115W50001-2025-05 한국전력개별선물



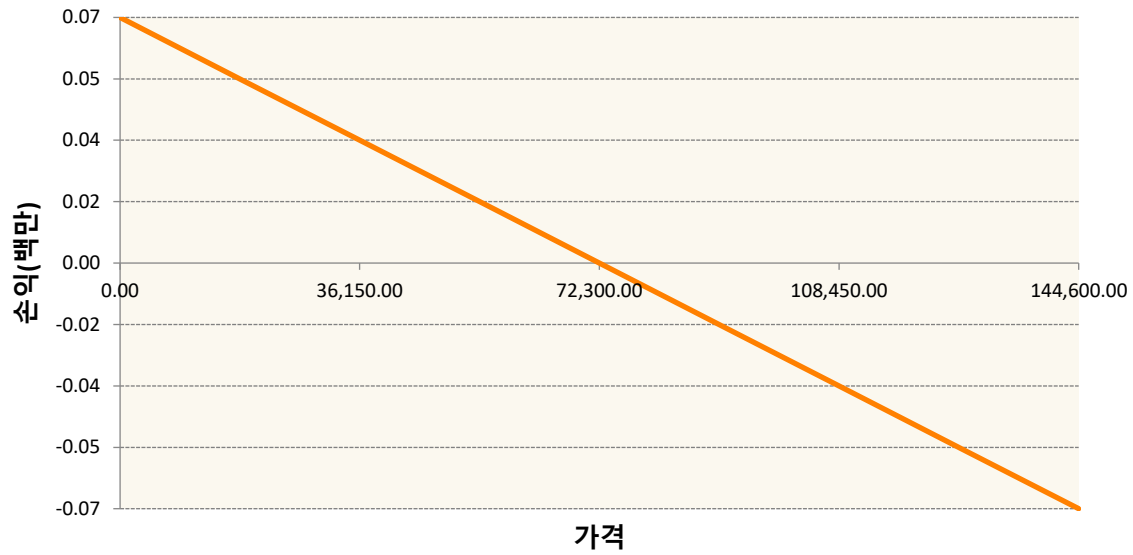
KR4149W50000-2025-05 HD현대인프라코어개별선물



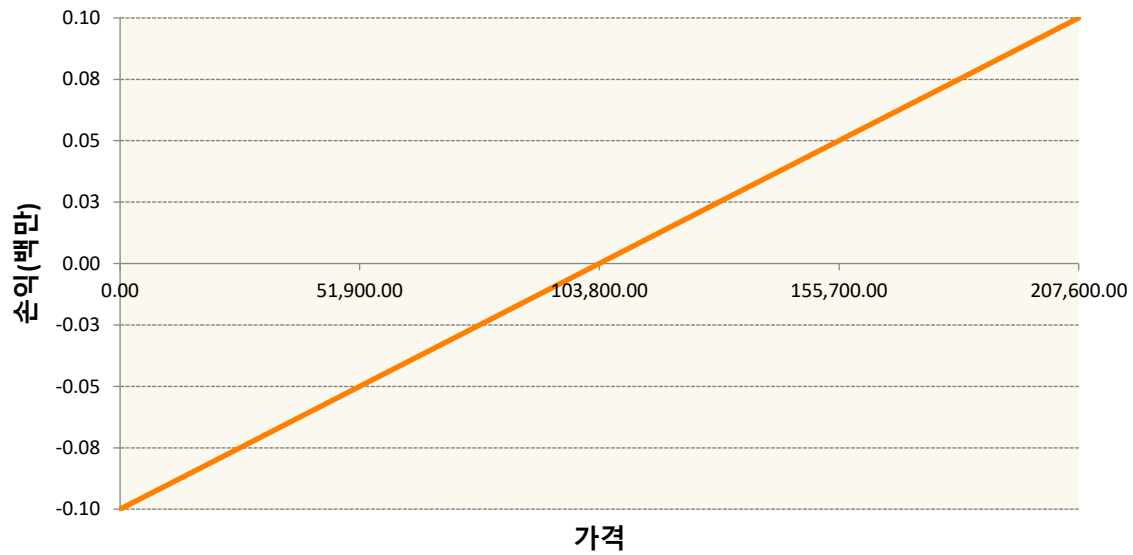
KR41BFW50008-2025-05 삼성중공업개별선물



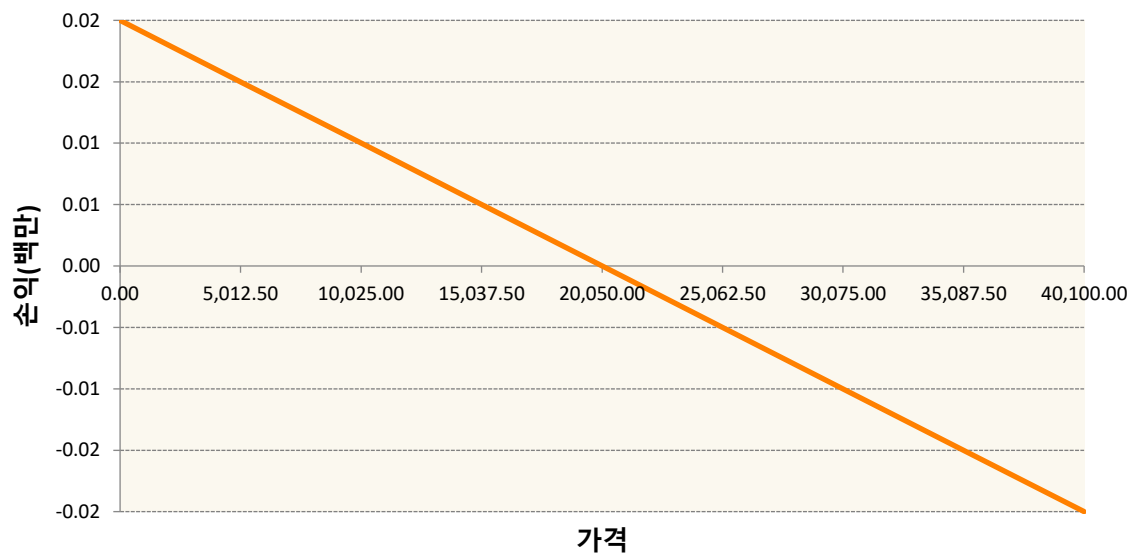
KR41BMW50004-2025-05 한국항공우주개별선물



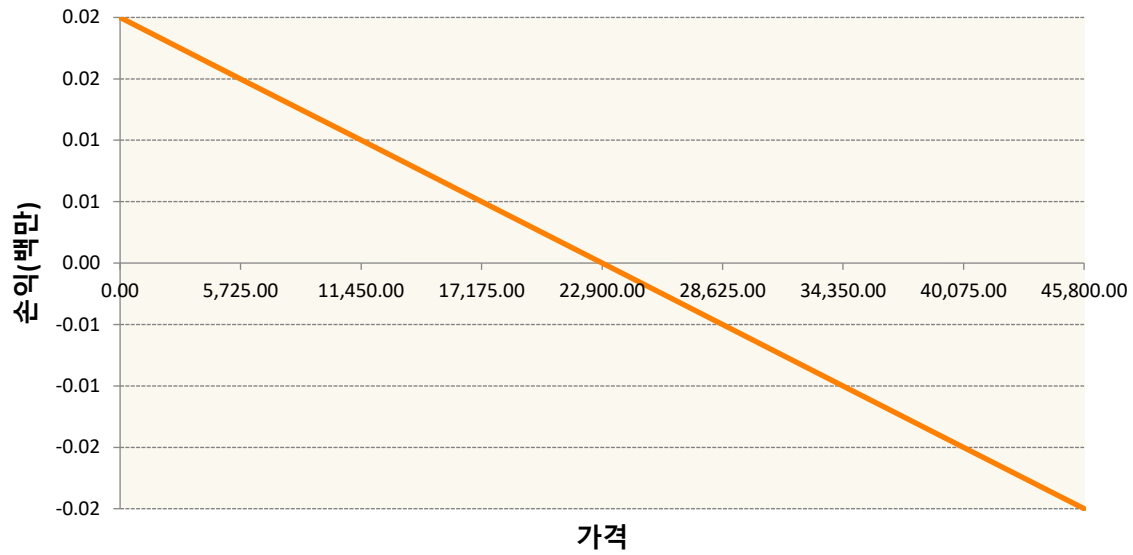
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



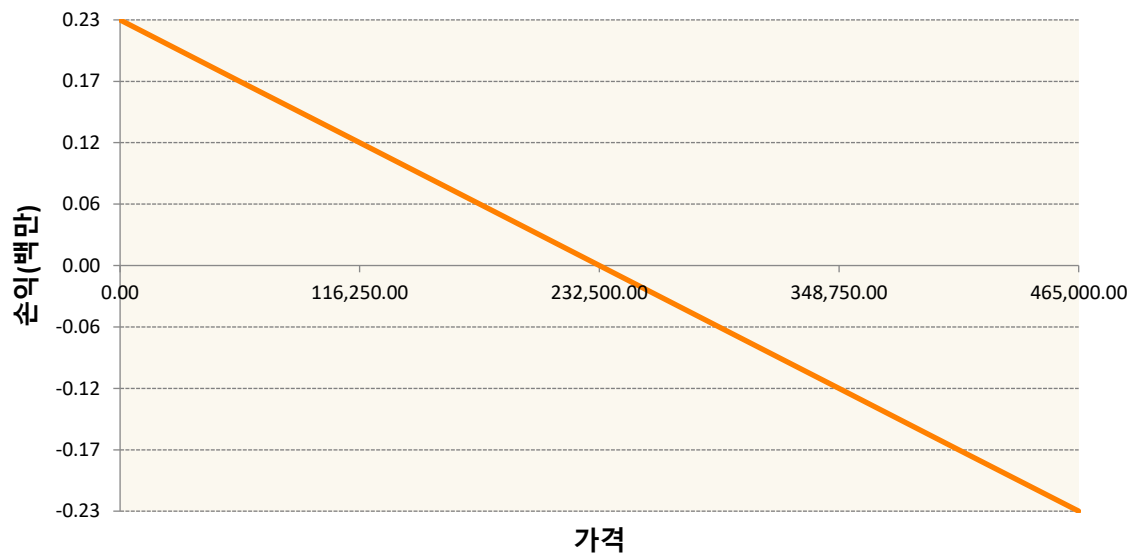
KR41CBW50005-2025-05 한화솔루션개별선물



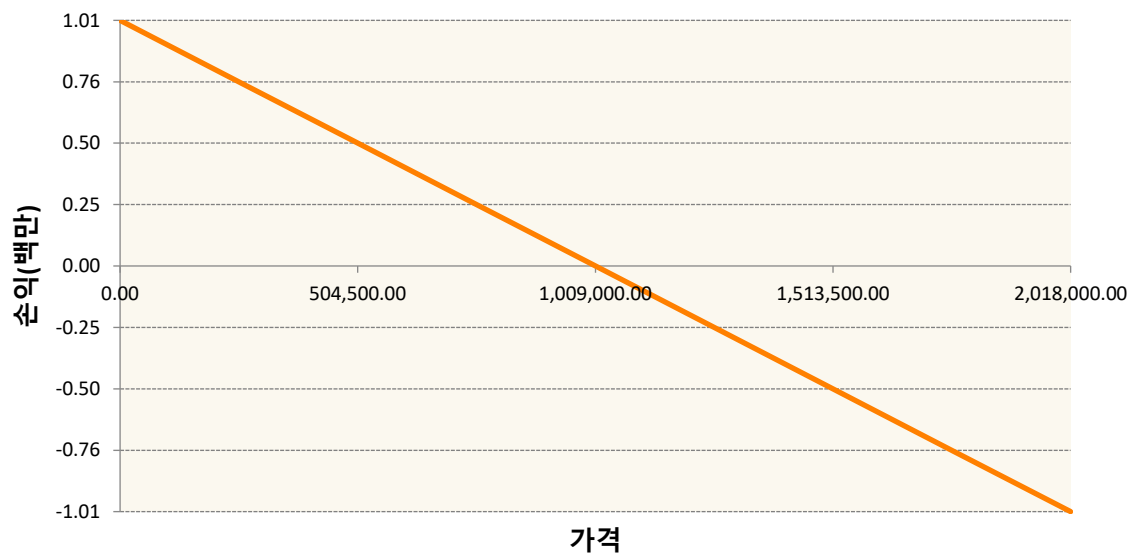
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



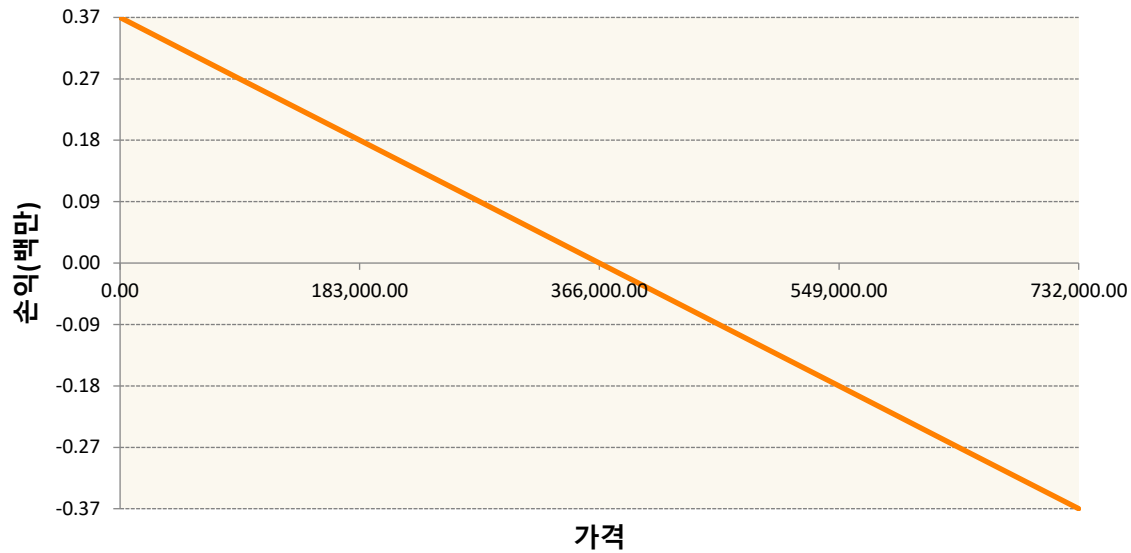
KR41CXW50009-2025-05 한미약품개별선물



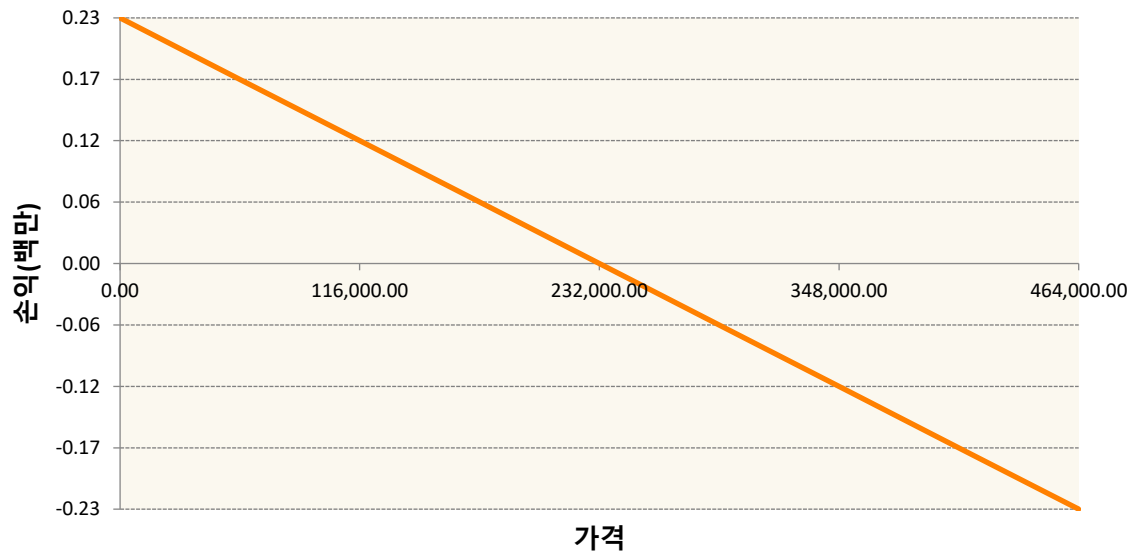
KR41ESW50005-2025-05 삼성바이오로직스개별선물



KR41F8W50000-2025-05 크래프톤개별선물



KR41FCW50006-2025-05 하이브개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	0.34
KR4111W50(2025-05 삼성전자개별선물	0.04
KR4115W50(2025-05 한국전력개별선물	0.29
KR4149W50(2025-05 HD현대인프라코어개별선물	0.29
KR41BFW50(2025-05 삼성중공업개별선물	1
KR41BMW50(2025-05 한국항공우주개별선물	1
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	1
KR41CBW50(2025-05 한화솔루션개별선물	0.45
KR41CNW50(2025-05 포스코DX개별선물	0.48
KR41CXW50(2025-05 한미약품개별선물	0.37
KR41ESW50(2025-05 삼성바이오로직스개별선물	1
KR41F8W50(2025-05 크래프톤개별선물	1

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

(단위:백만원)

14

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

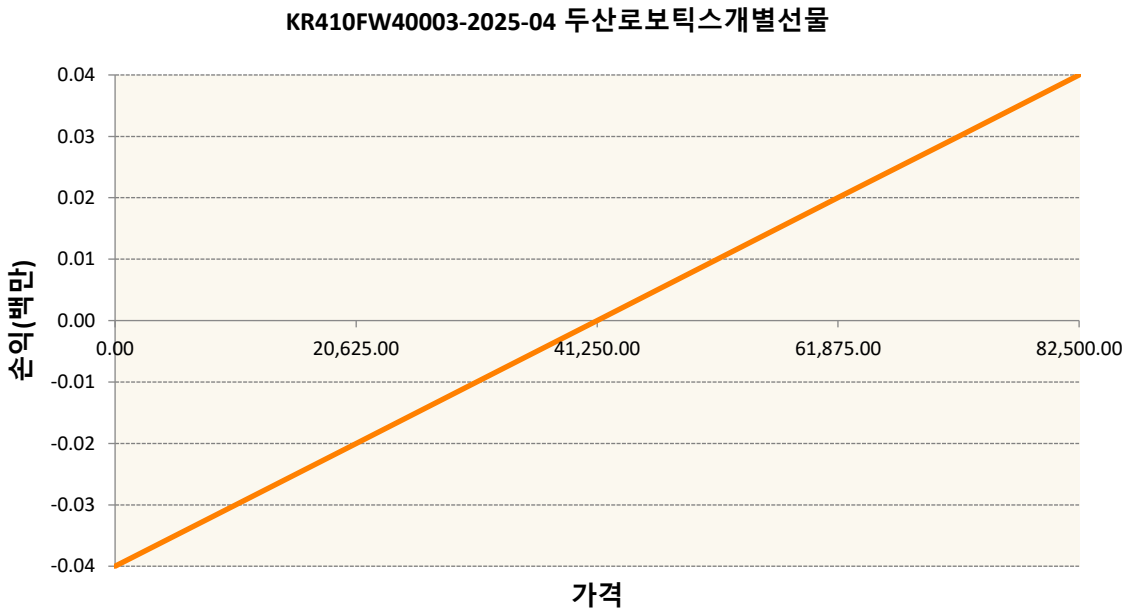
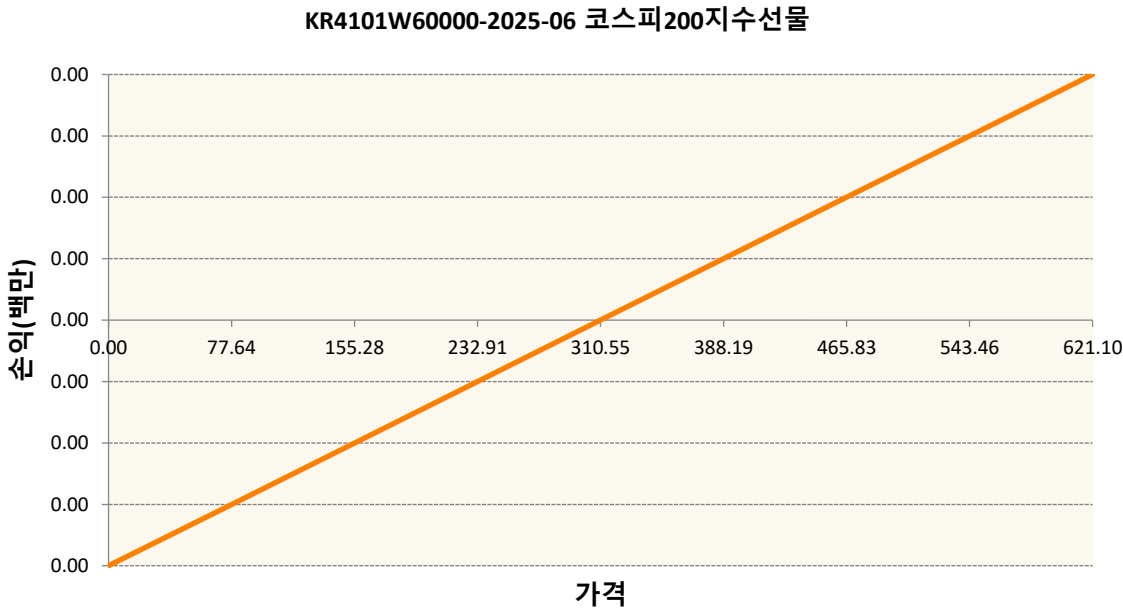
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

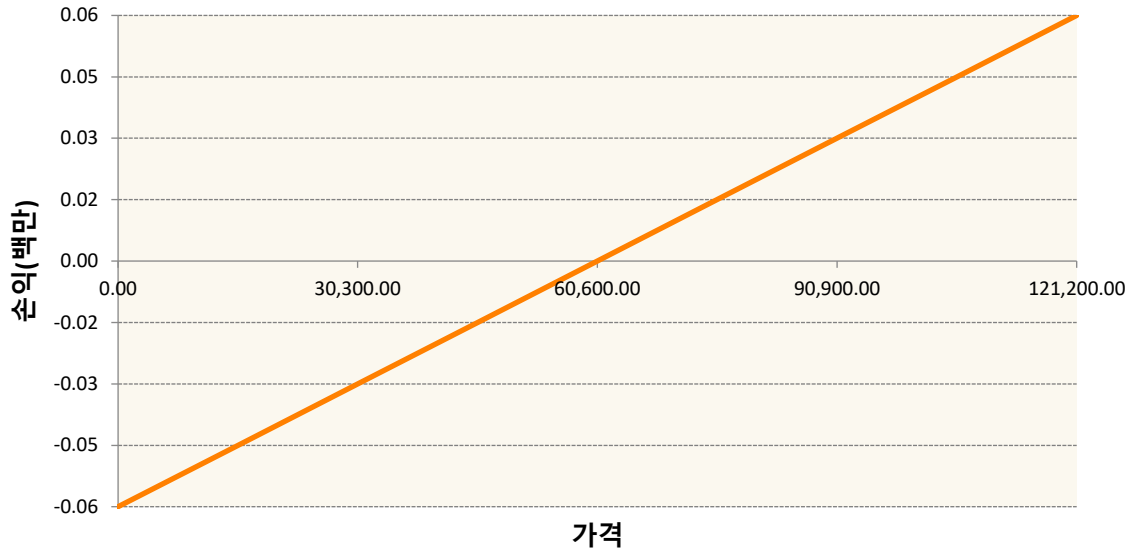
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,535	0	1,535	장내
누계	유가증권	선물	11,250	0	11,250	장내

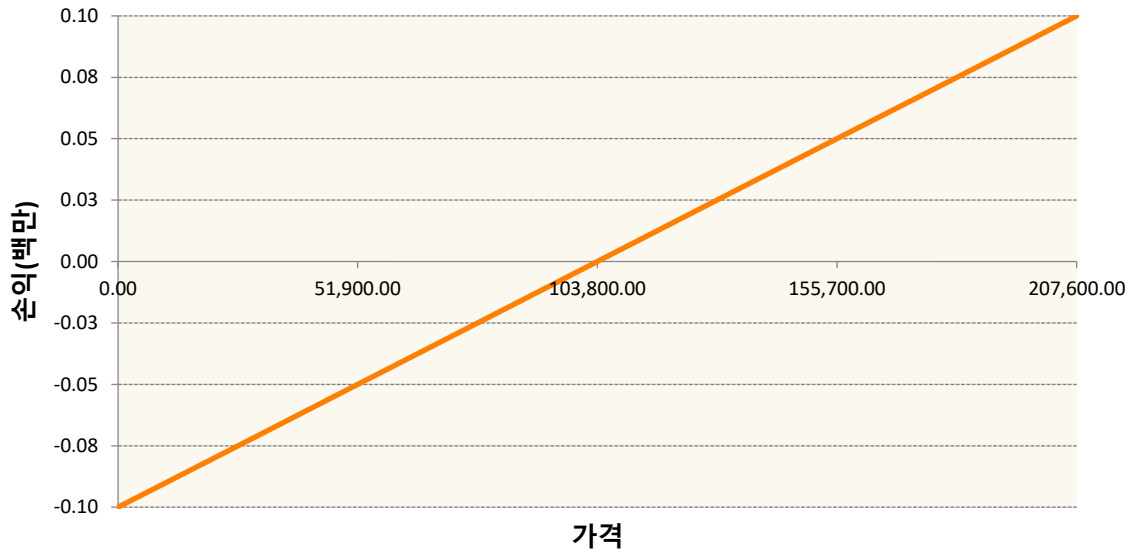
2. 만기시점의 손익구조



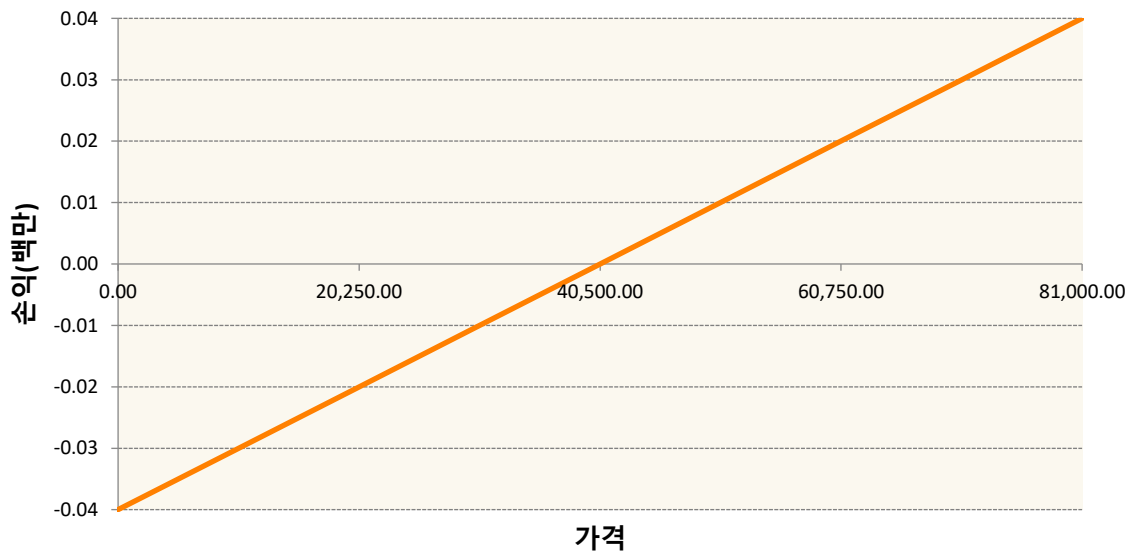
KR410ZW40001-2025-04 한미반도체개별선물



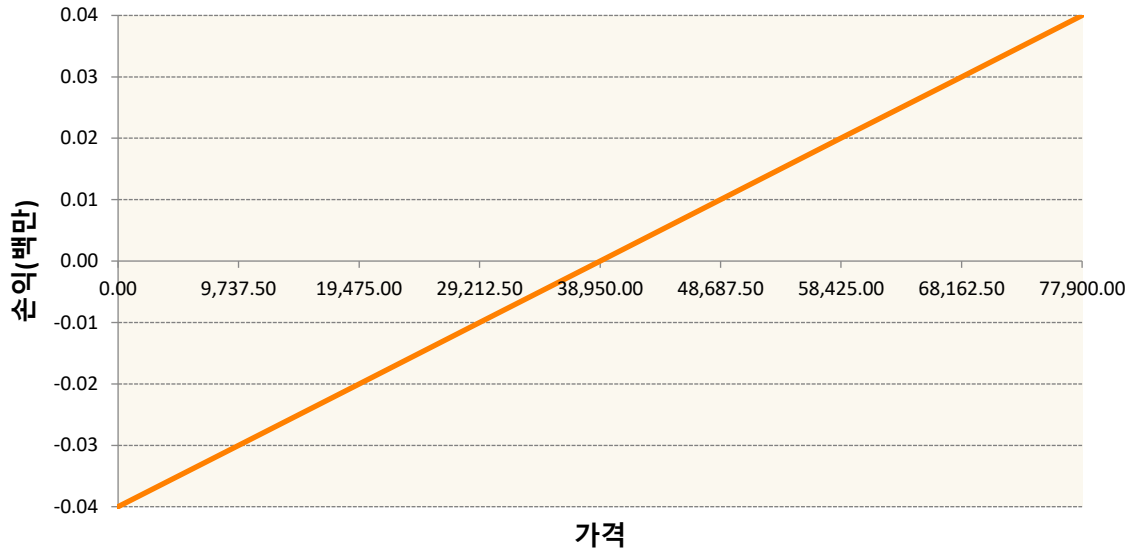
KR41C6W40008-2025-04 아모레퍼시픽개별선물



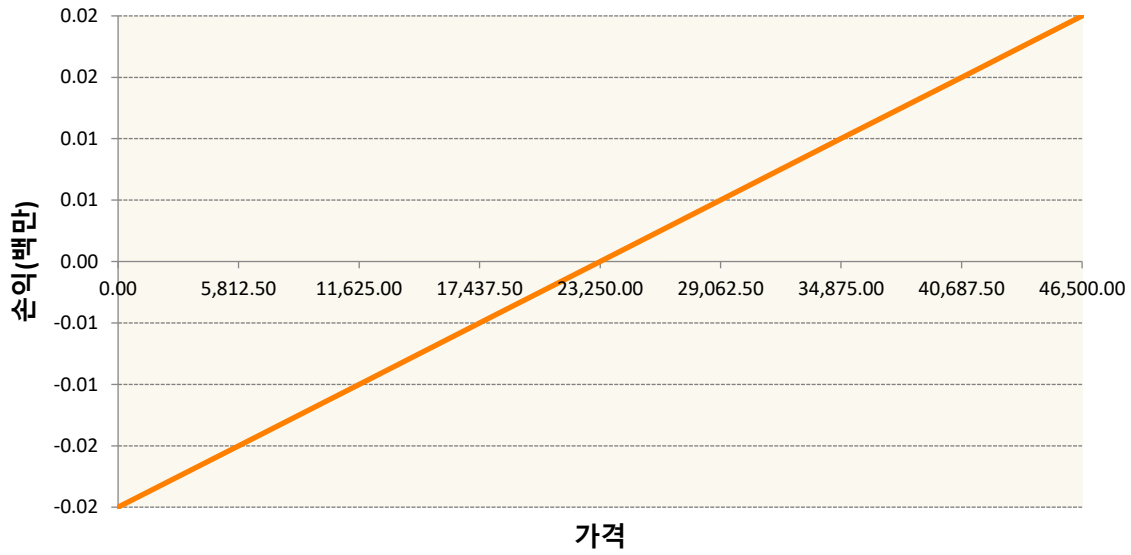
KR41C9W40002-2025-04 한화개별선물



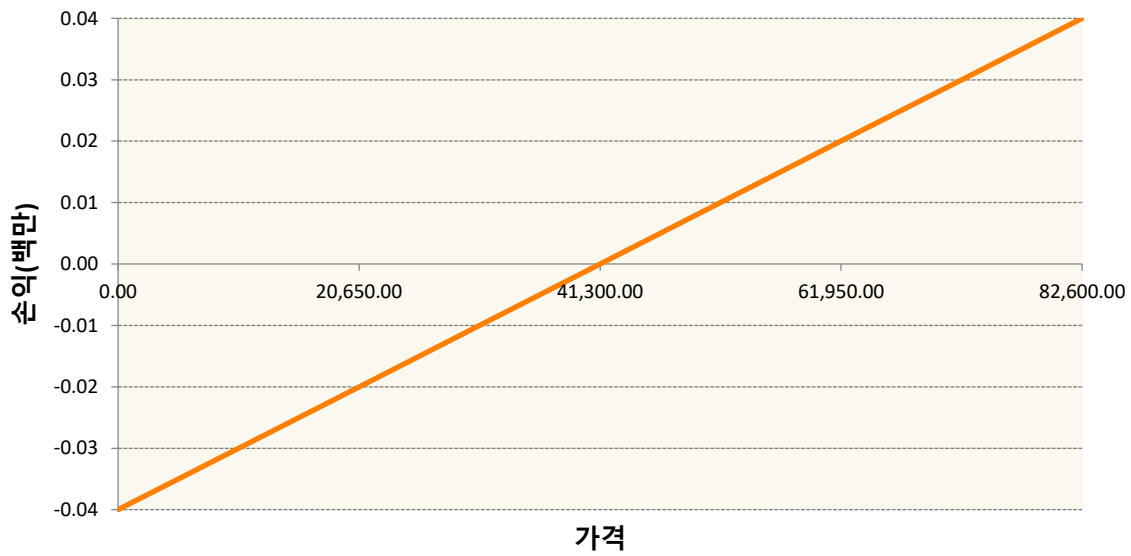
KR41CFW40007-2025-04 카카오개별선물



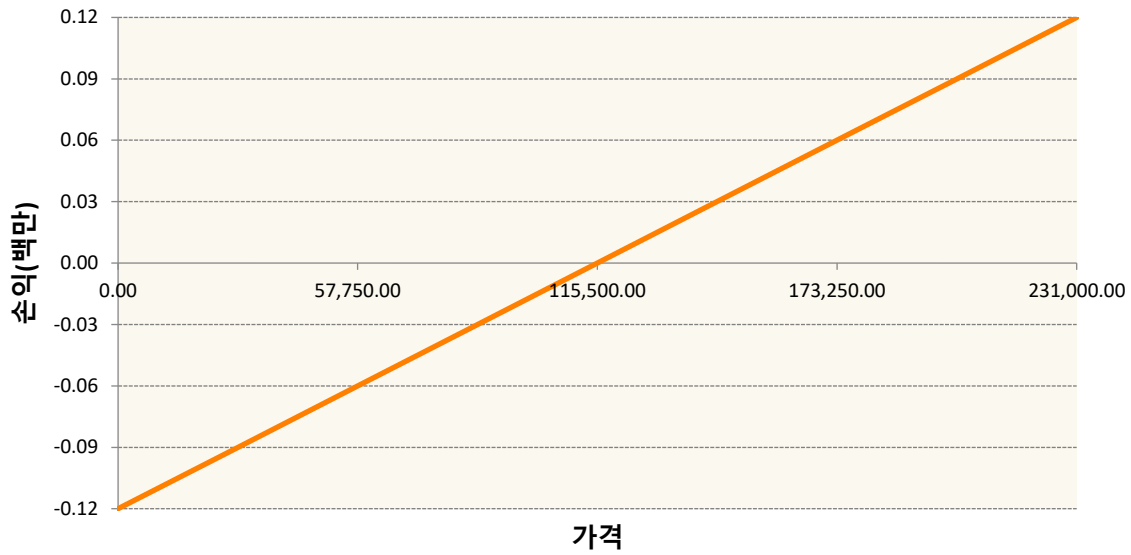
KR41CNW40001-2025-04 포스코DX개별선물



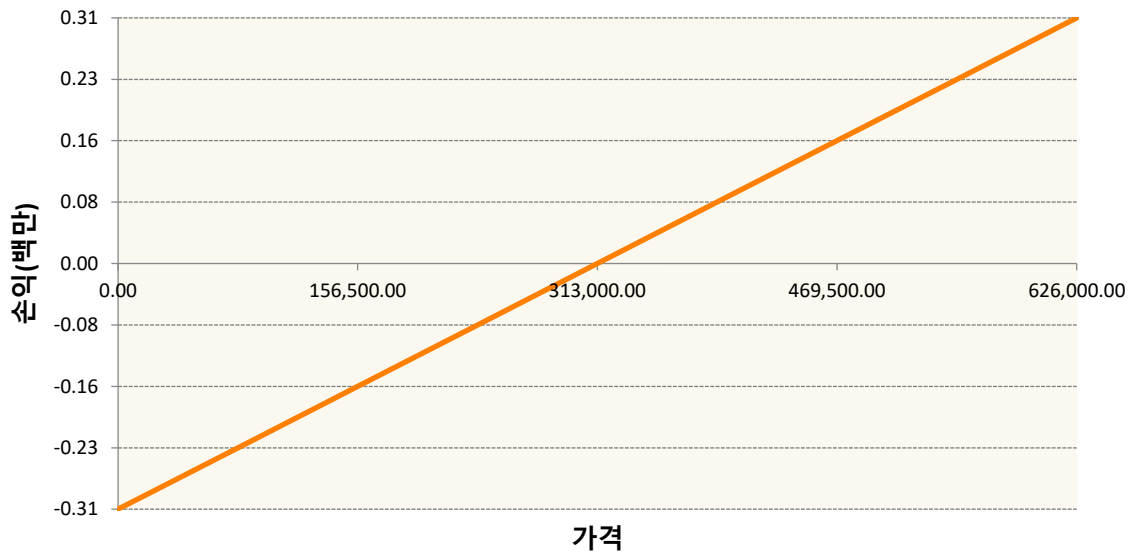
KR41DGW40003-2025-04 영원무역개별선물



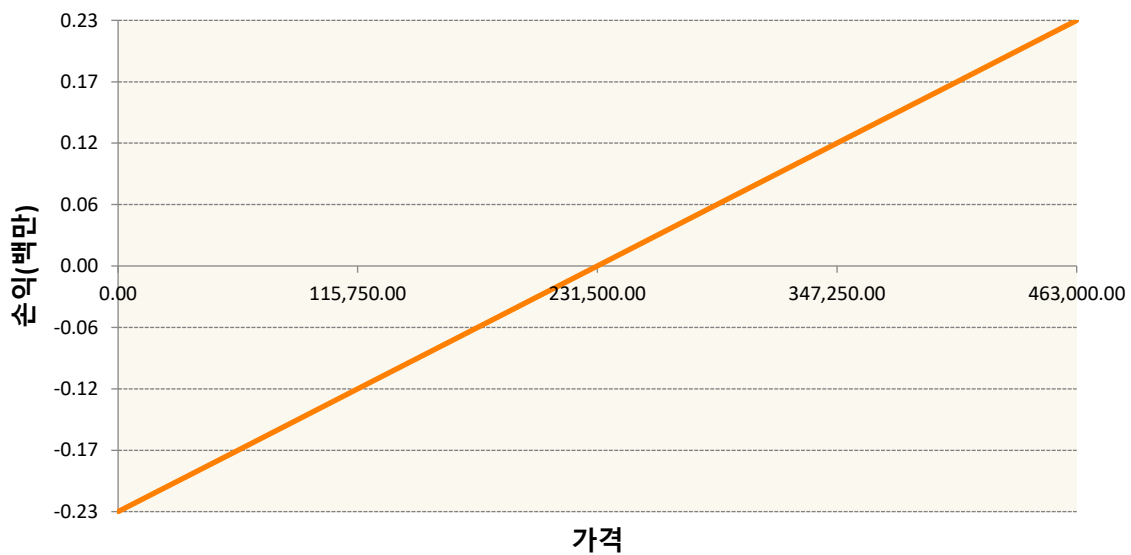
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



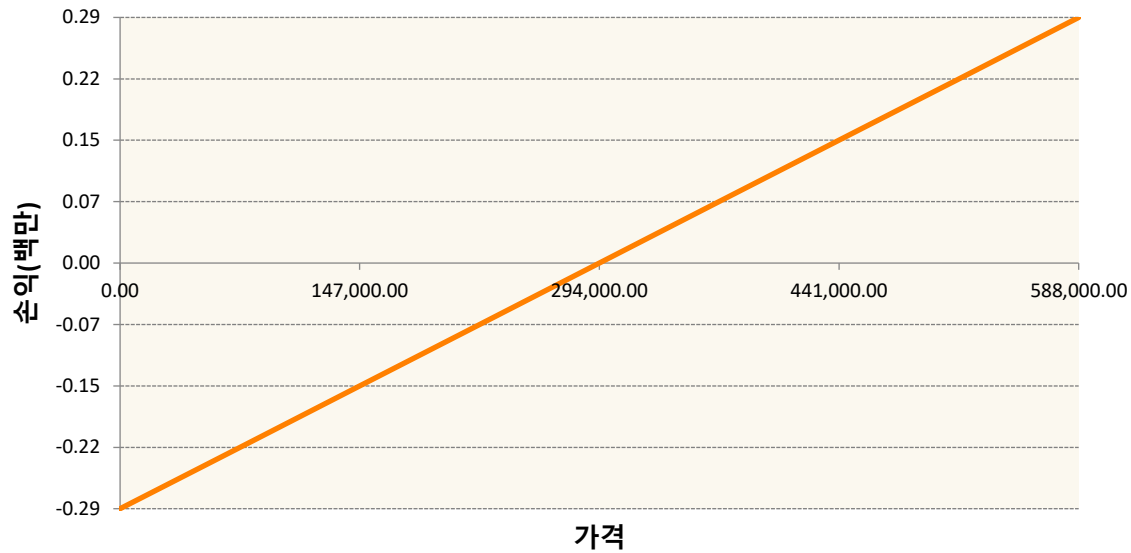
KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



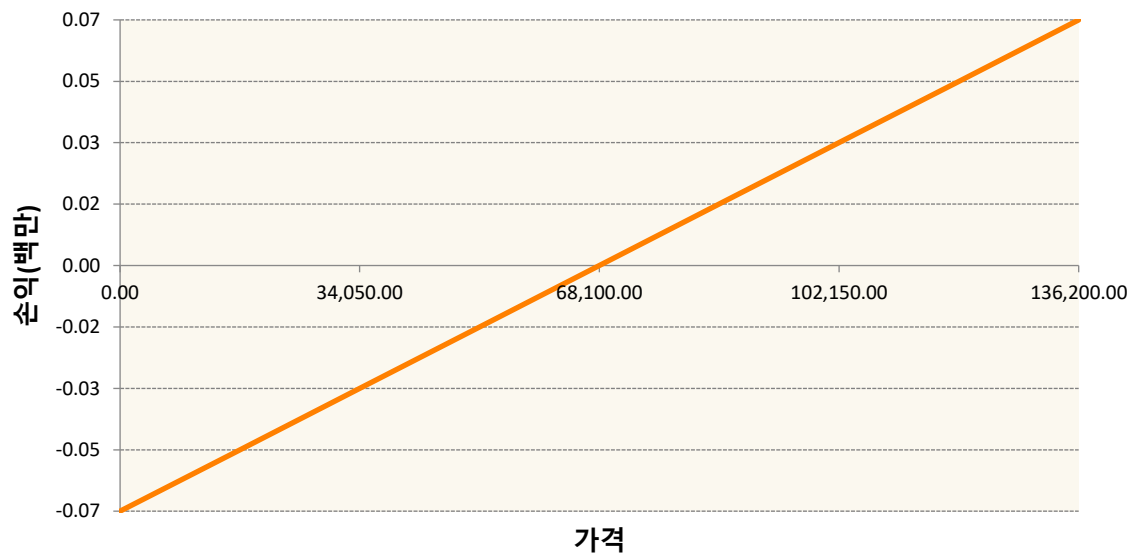
KR41FCW40007-2025-04 하이브개별선물



KR41FDW40005-2025-04 HD현대중공업개별선물



KR41FVW40007-2025-04 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	547
KR410FW40(2025-04 두산로보틱스개별선물	2
KR410ZW40(2025-04 한미반도체개별선물	25
KR41C6W40(2025-04 아모레퍼시픽개별선물	4
KR41C9W40(2025-04 한화개별선물	11
KR41CFW40(2025-04 카카오개별선물	3
KR41CNW40 2025-04 포스코DX개별선물	12
KR41DGW40 2025-04 영원무역개별선물	3
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물	15
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물	109
KR41FCW40(2025-04 하이브개별선물	47
KR41FDW40(2025-04 HD현대중공업개별선물	65

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

(단위:백만원)

1,622

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

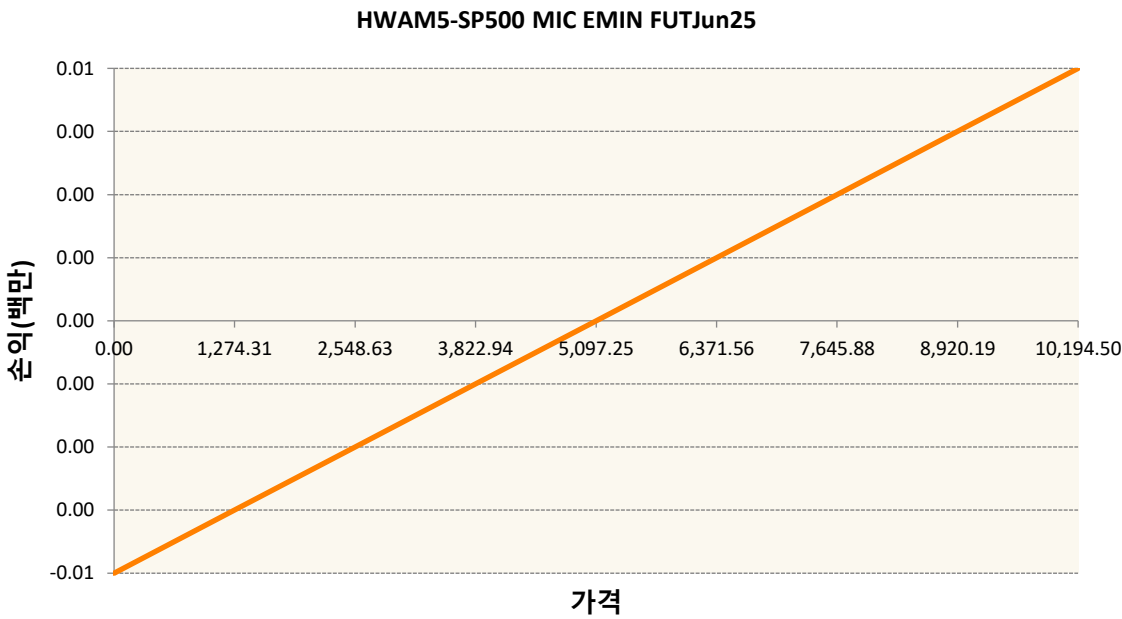
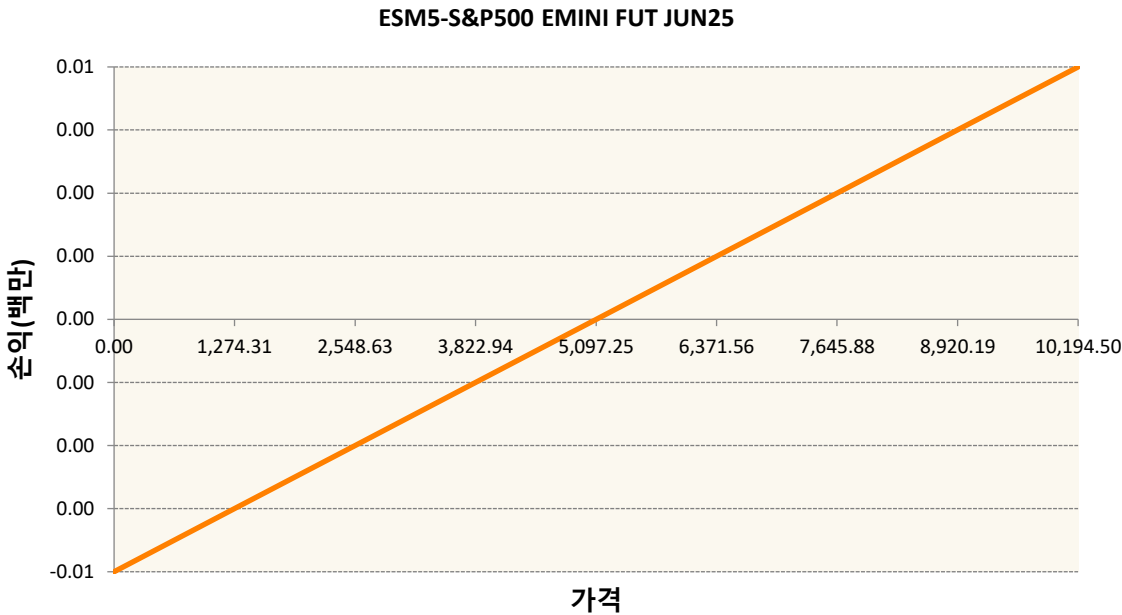
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	26,380	0	26,380	
누계	유가증권	선물	1,077	0	1,077	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,110
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	86

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,664

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

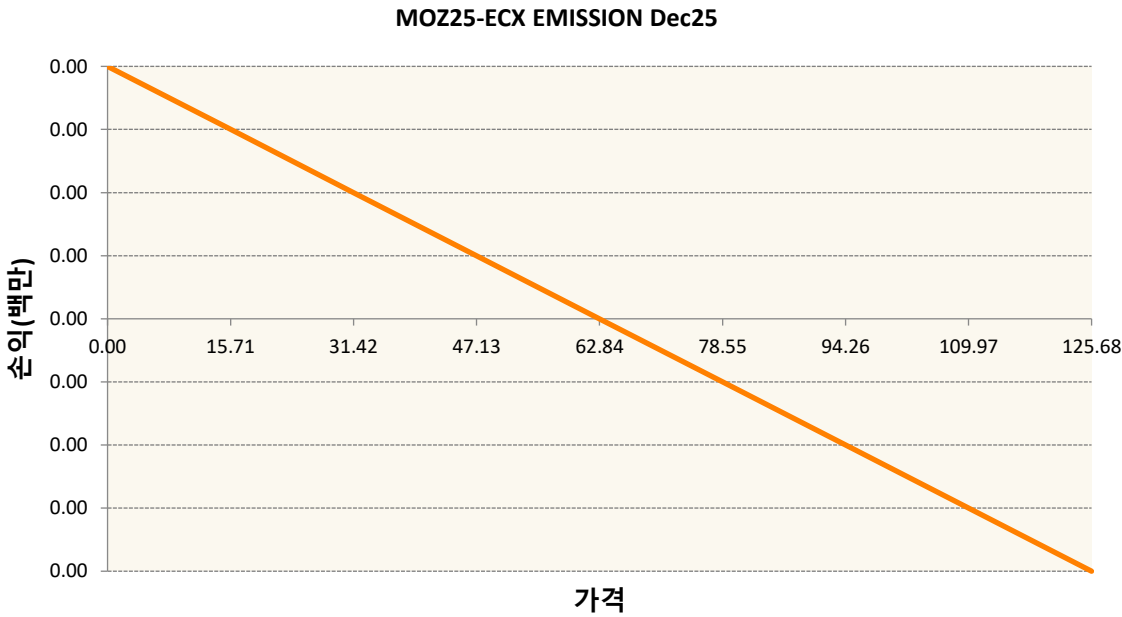
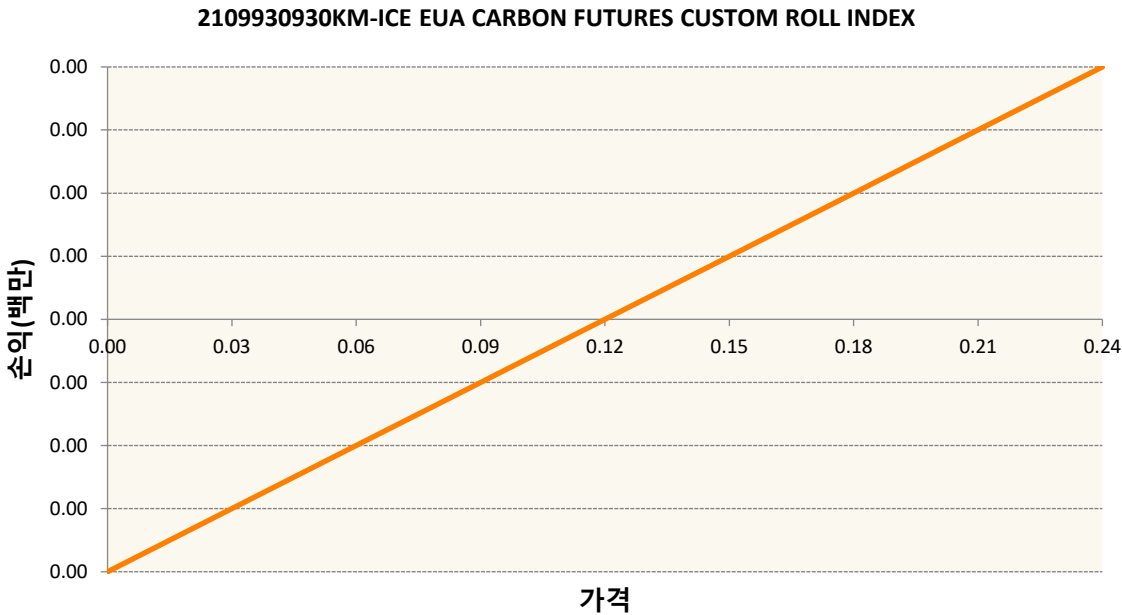
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	45	7,502	-7,457	
누계	통화	선도	0	1,166	-1,166	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		4
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E		5
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E		89
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		600

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,110

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

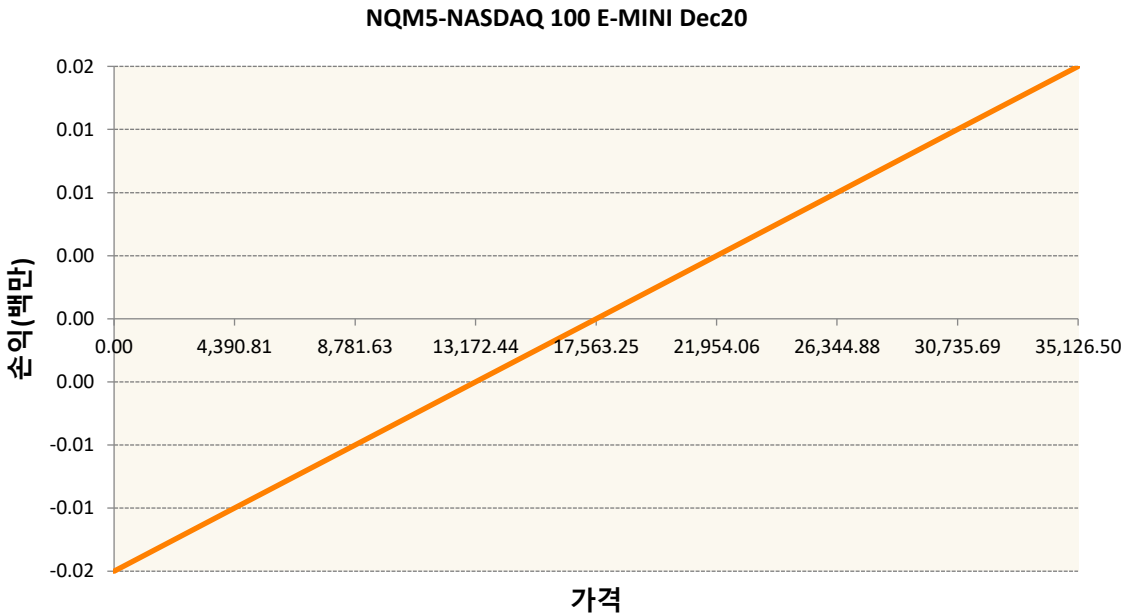
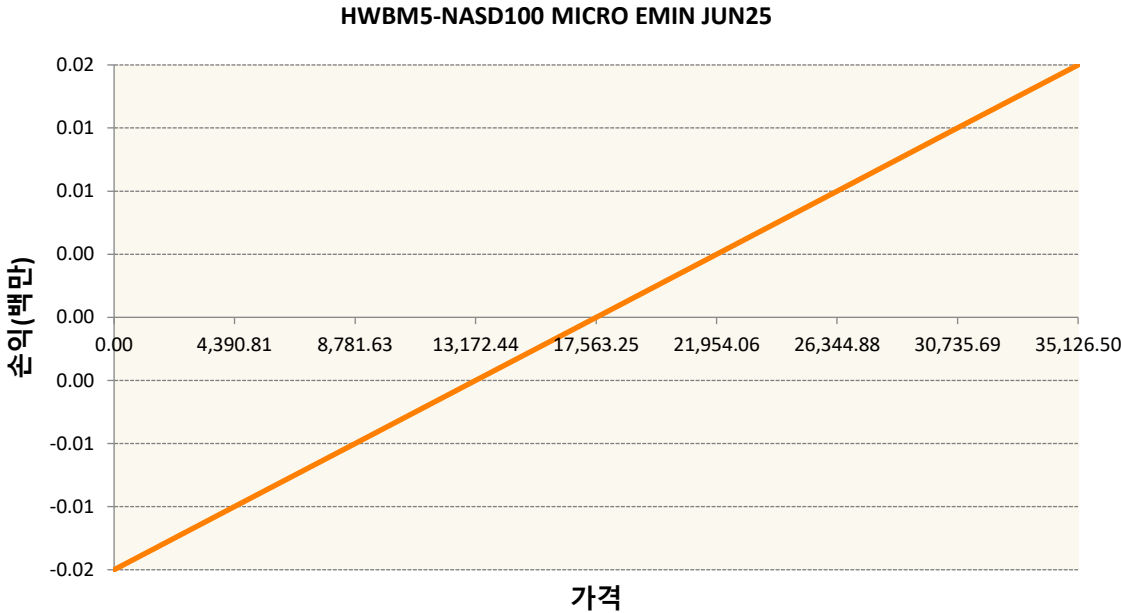
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	12,283	0	12,283	
누계	유가증권	선물	462	0	462	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		37
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		983

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,017

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

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	743
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,226
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,997
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,579

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

(단위:백만원)

9,486

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

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	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13

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

(단위:백만원)

61

공시일	2025-04-09
기준일	2025-04-08

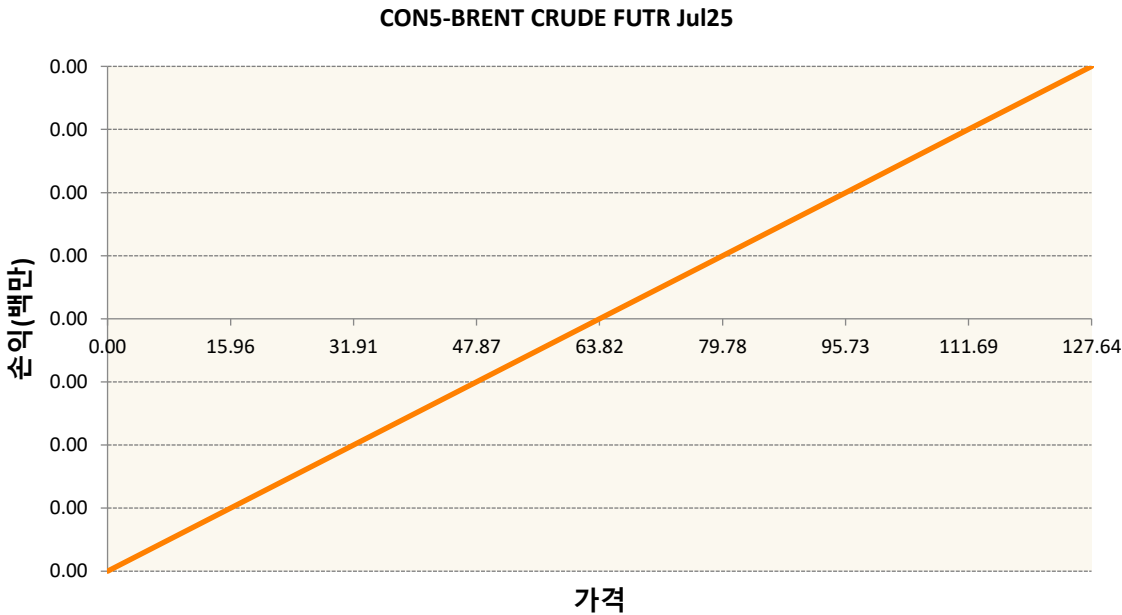
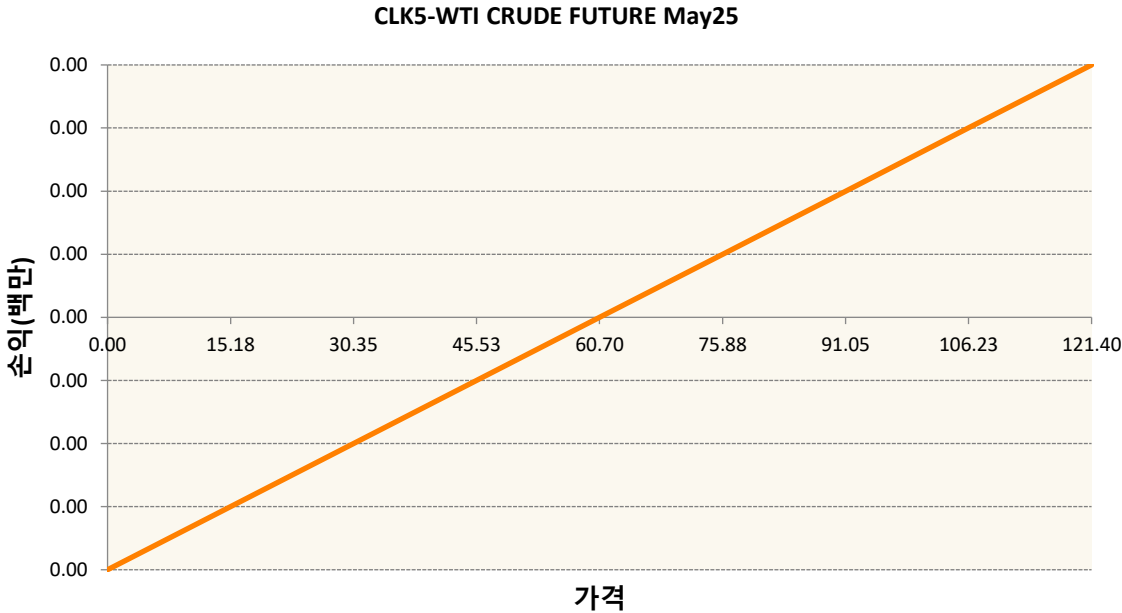
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

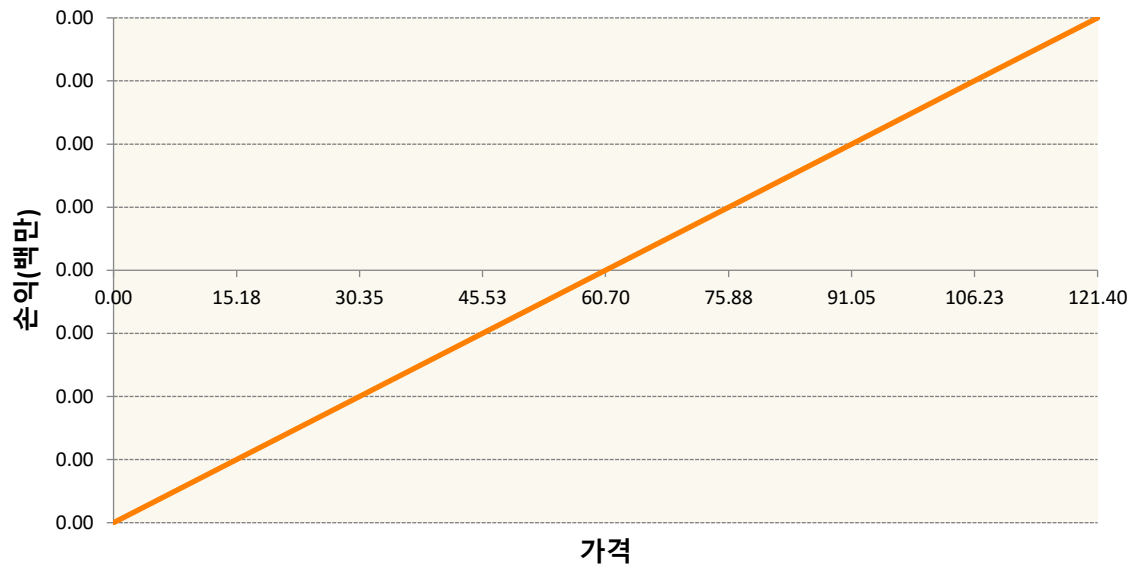
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	44	-44	장내
누계	유가증권	선물	630	0	630	
누계	통화	선물	0	74	-74	장내

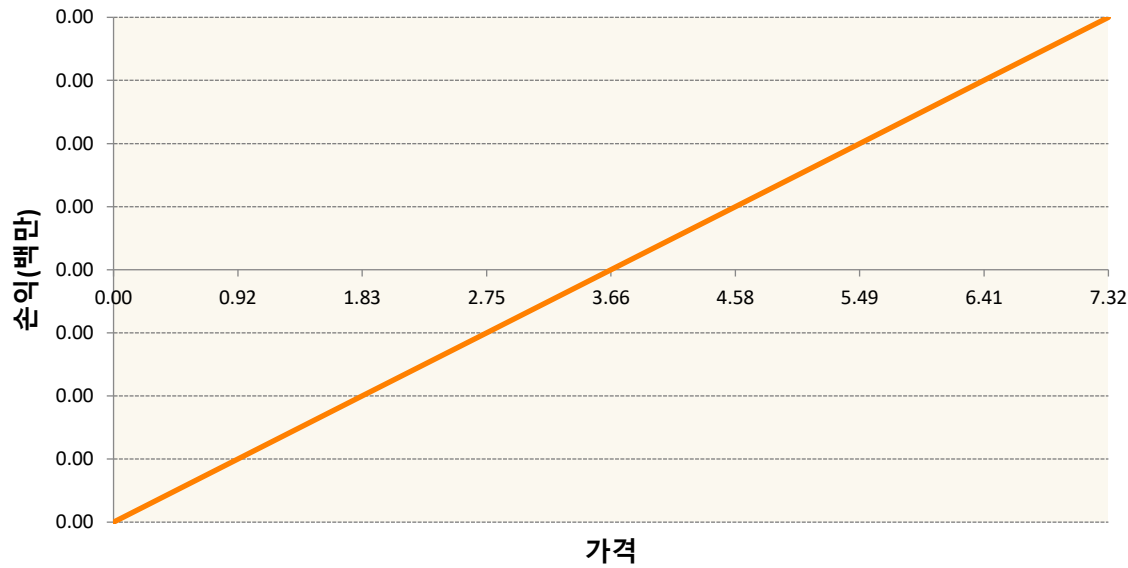
2. 만기시점의 손익구조



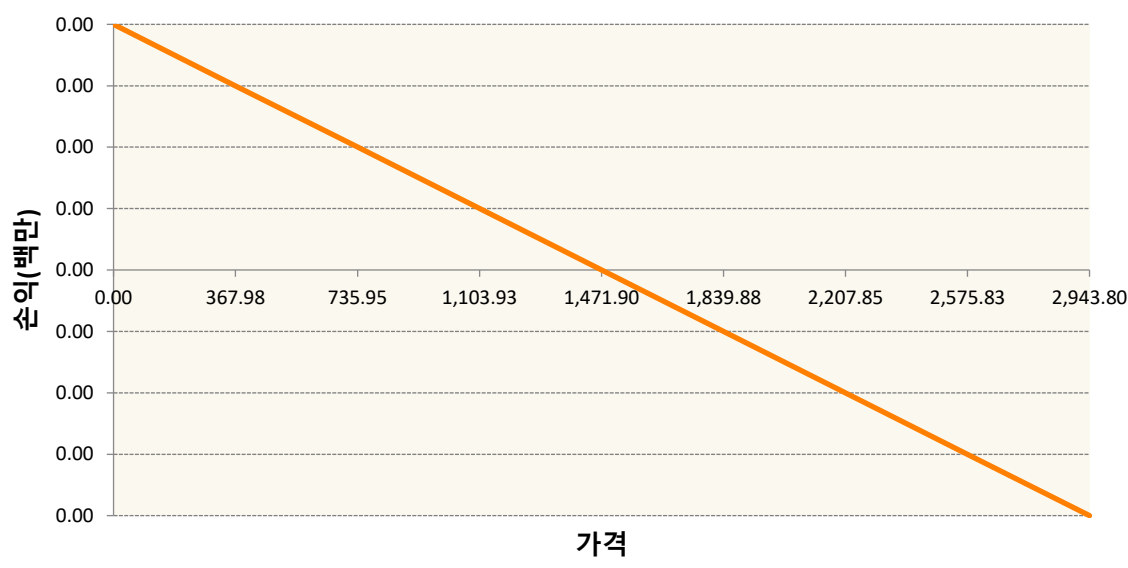
ECK5-E-mini Crude Oil May 25

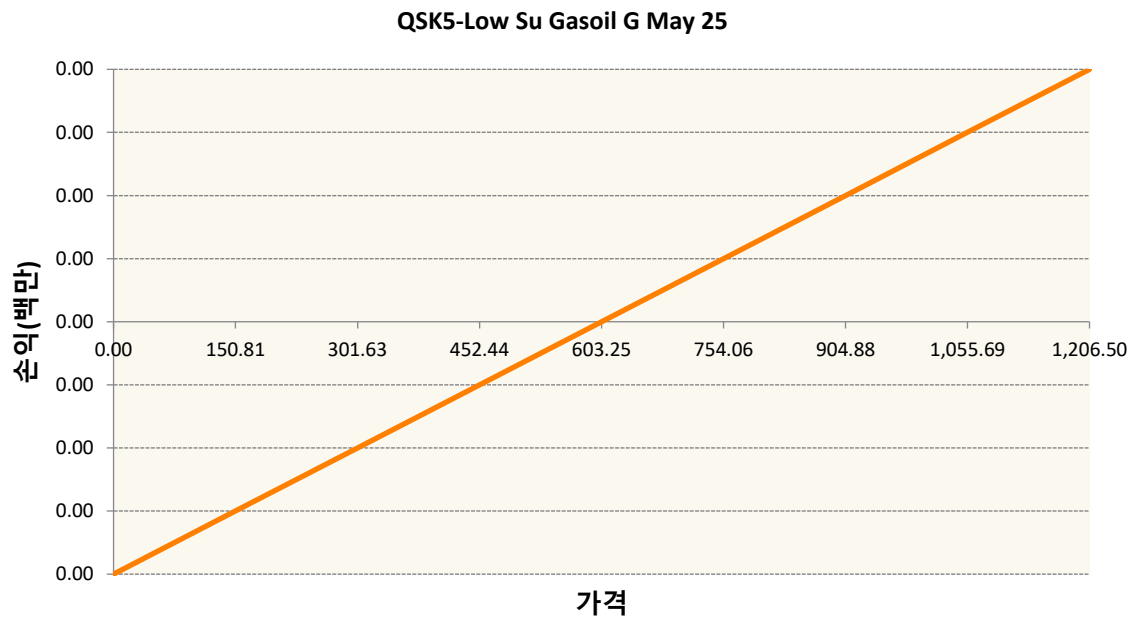
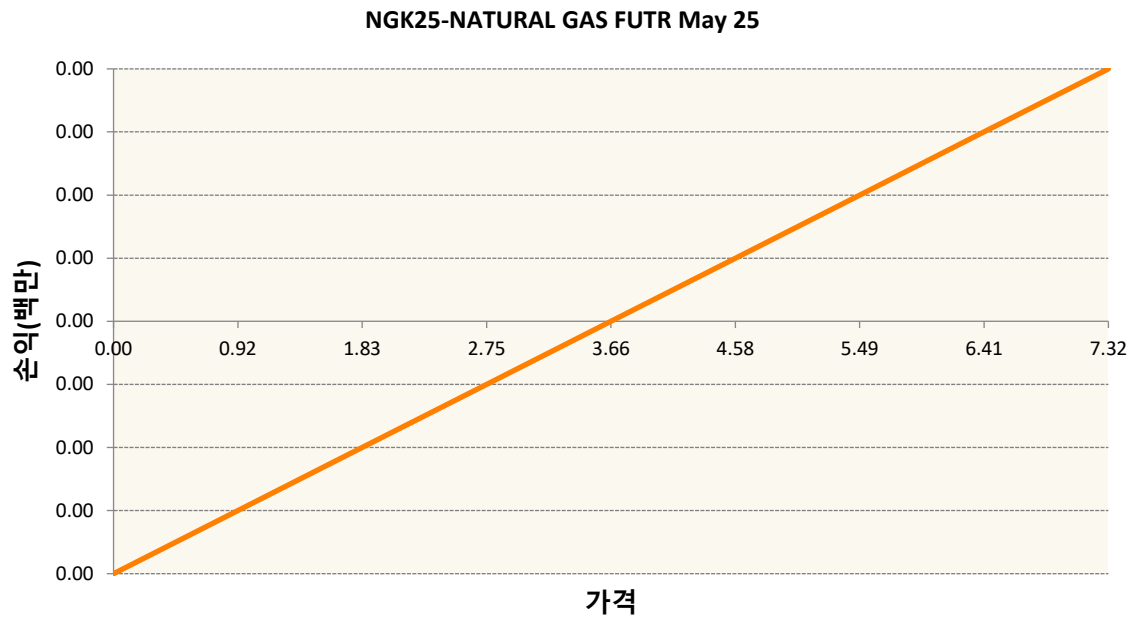


EOK5-E-MINI NATURAL GAS May 25



KR4175W40006-2025-04 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK5	WTI CRUDE FUTURE May25		7
CON5	BRENT CRUDE FUTR Jul25		15
ECK5	E-mini Crude Oil May 25		4
EOK5	E-MINI NATURAL GAS May 25		5
KR4175W40	(2025-04 달러선물		6
NGK25	NATURAL GAS FUTR May 25		13
QSK5	Low Su Gasoil G May 25		7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	115