

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

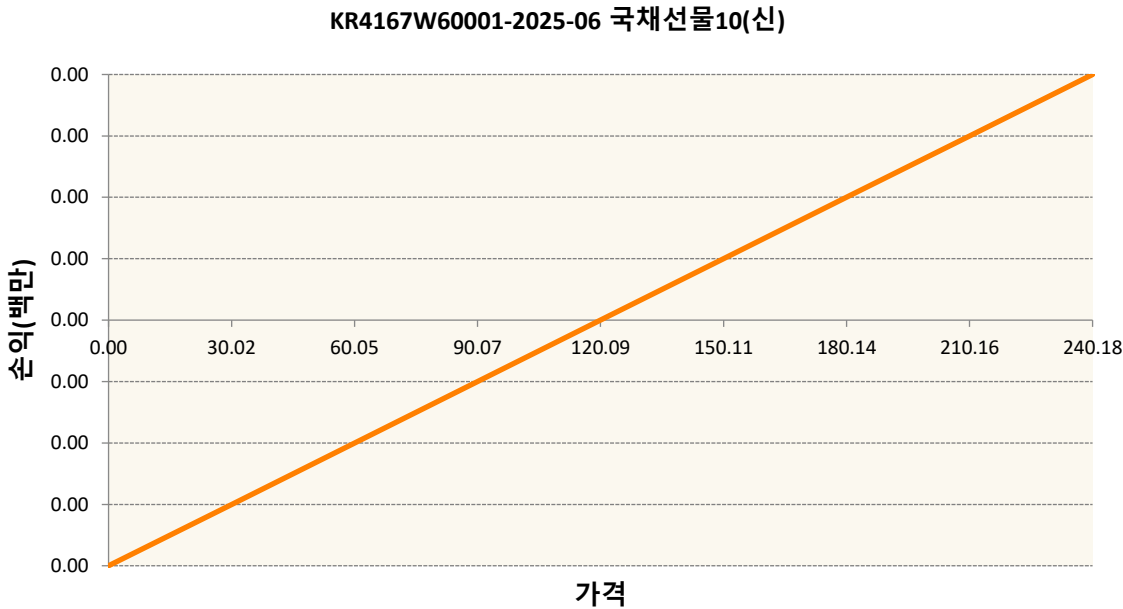
베스트장기채(채권-파생형)

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	158,519	0	158,519	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,601

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

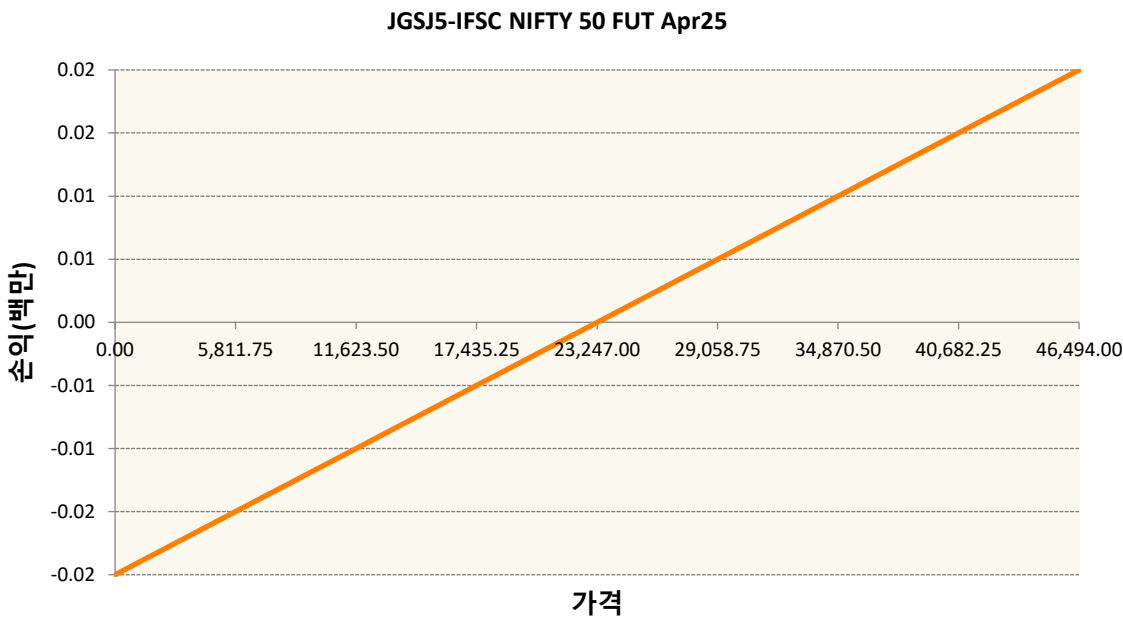
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	750	0	750	

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)

43

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

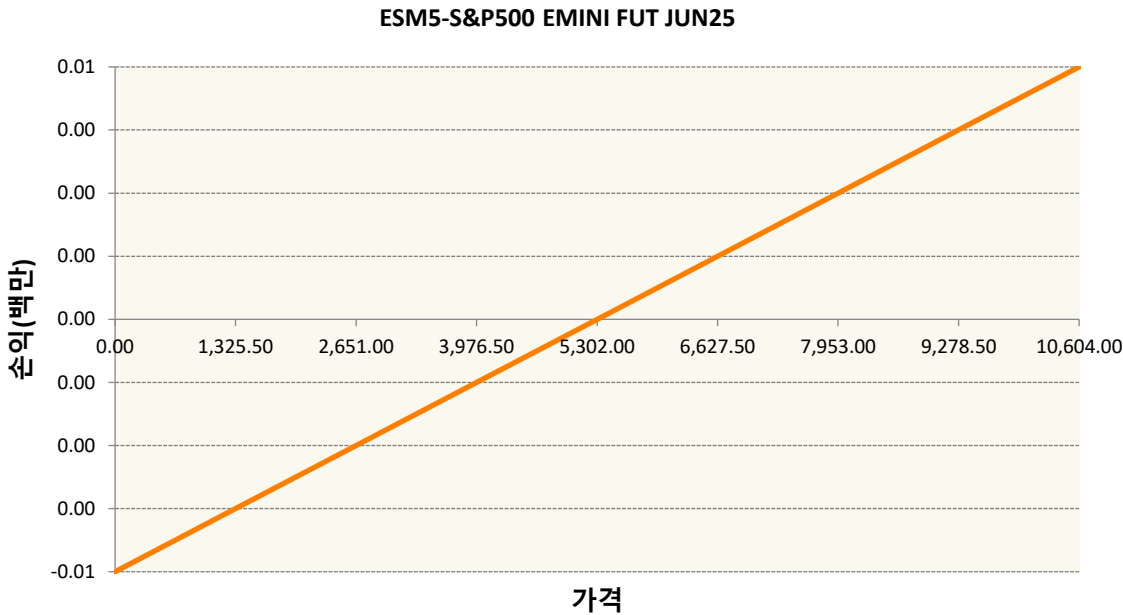
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	388	0	388	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	31
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

26

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

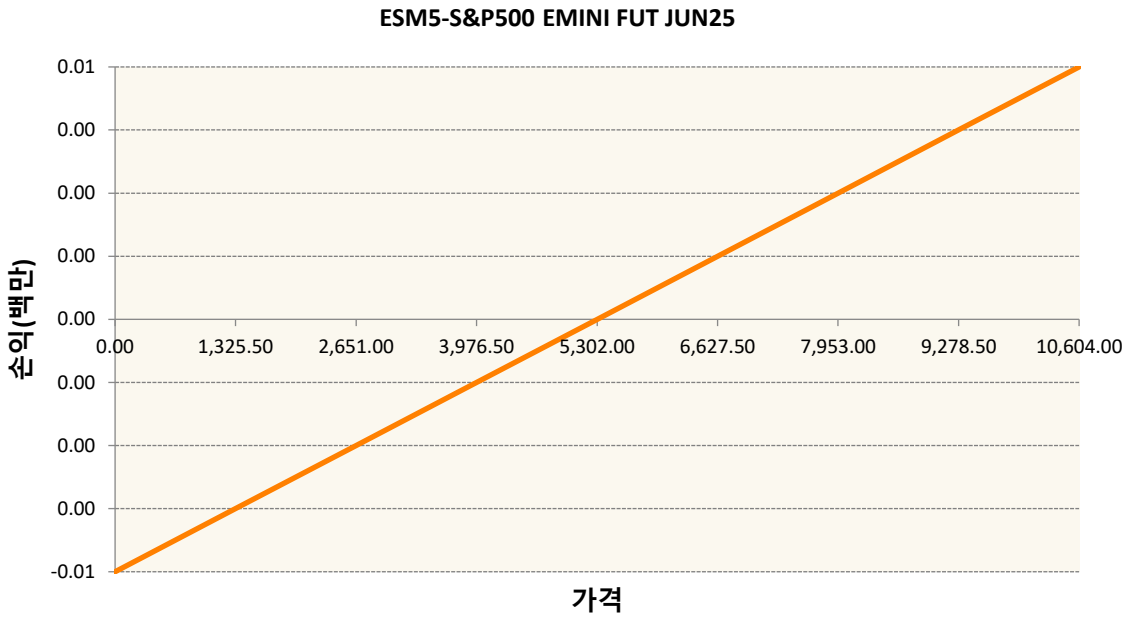
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,328	0	2,328	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	186
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

159

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

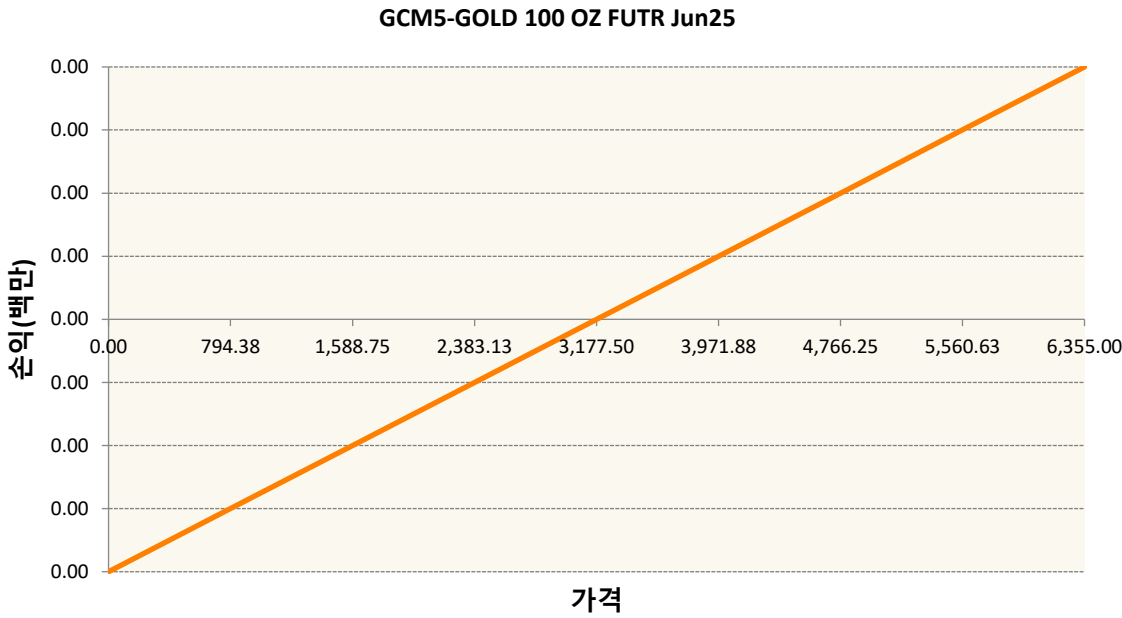
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,332	0	2,332	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 04/11/25 C286 EQUITY	2
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	187

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

(단위:백만원)

143

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

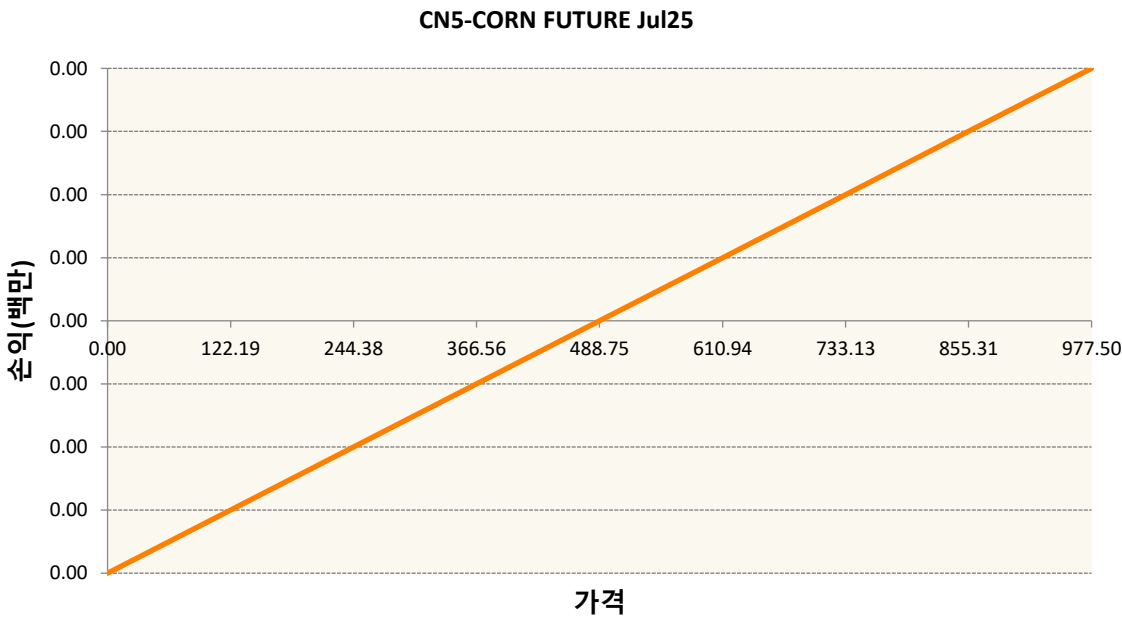
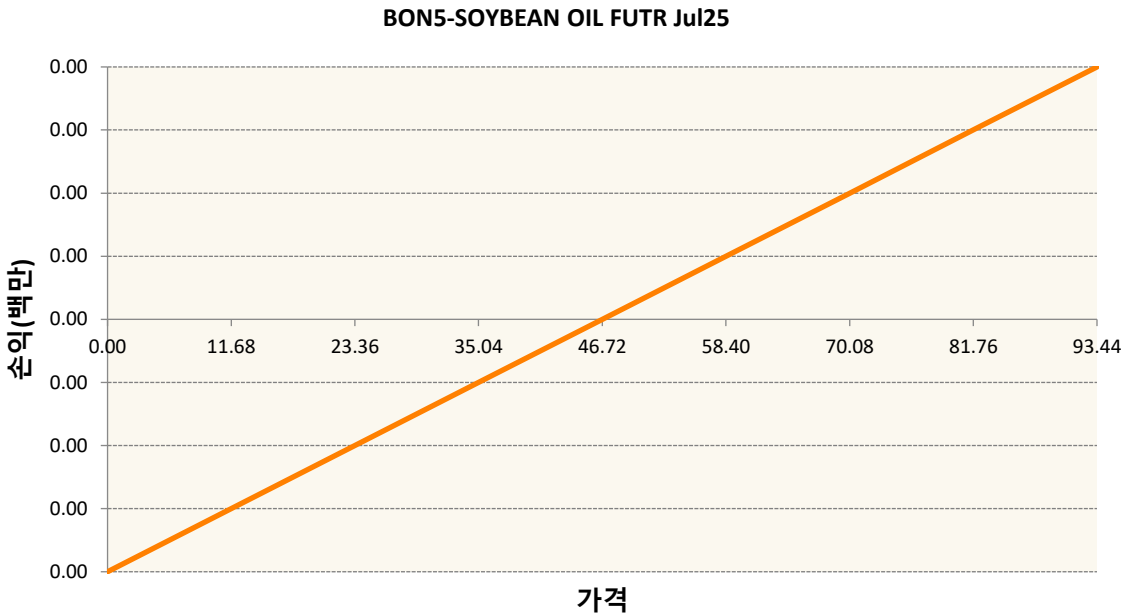
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

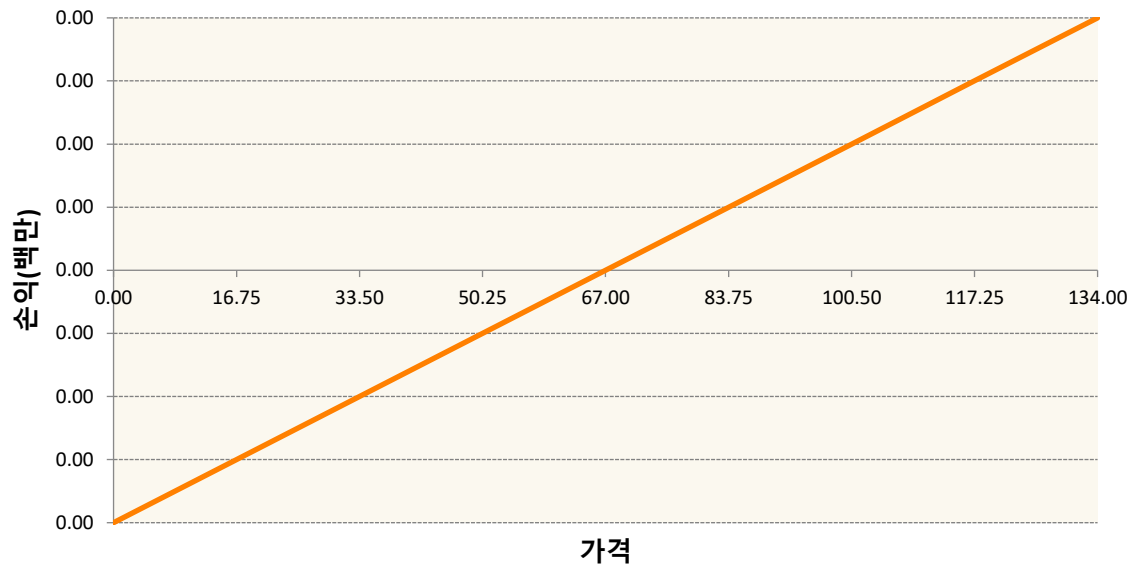
(단위:USD 백만)

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	3,748	0	3,748	
누계	통화	선물	0	290	-290	장내

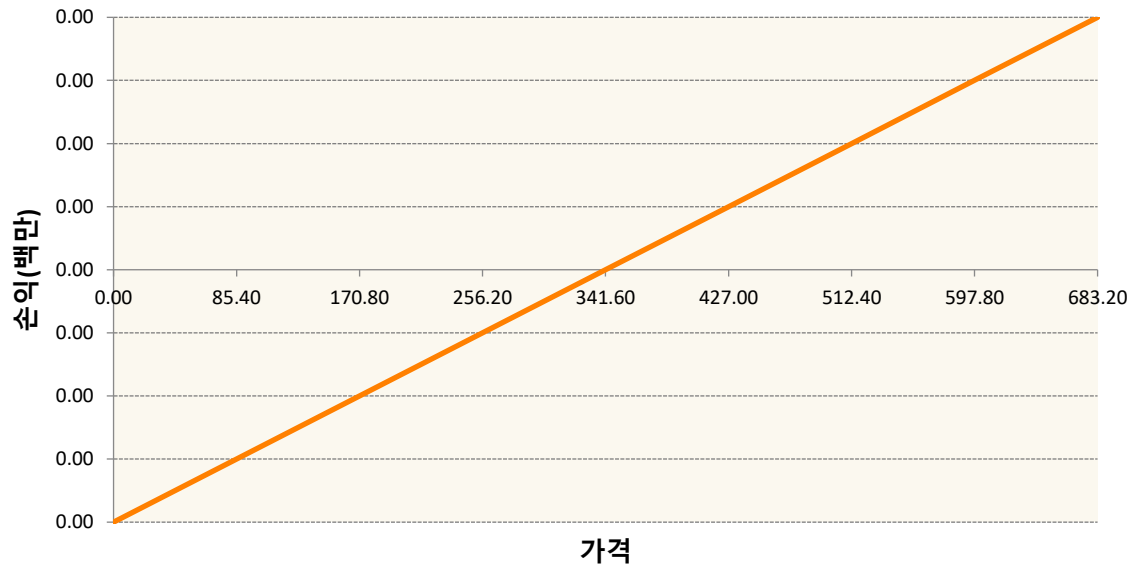
2. 만기시점의 손익구조



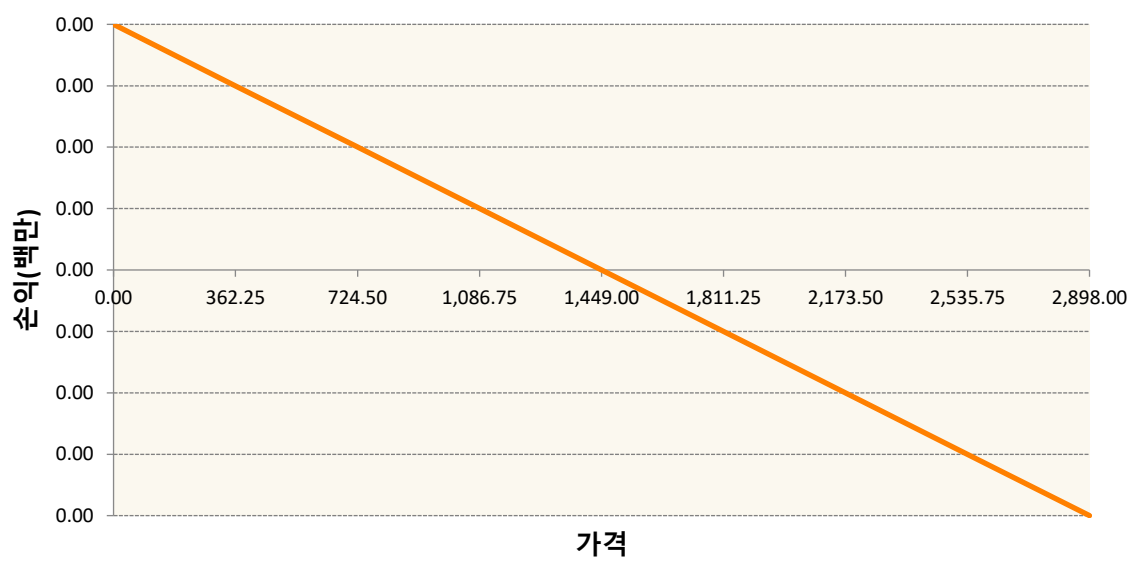
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



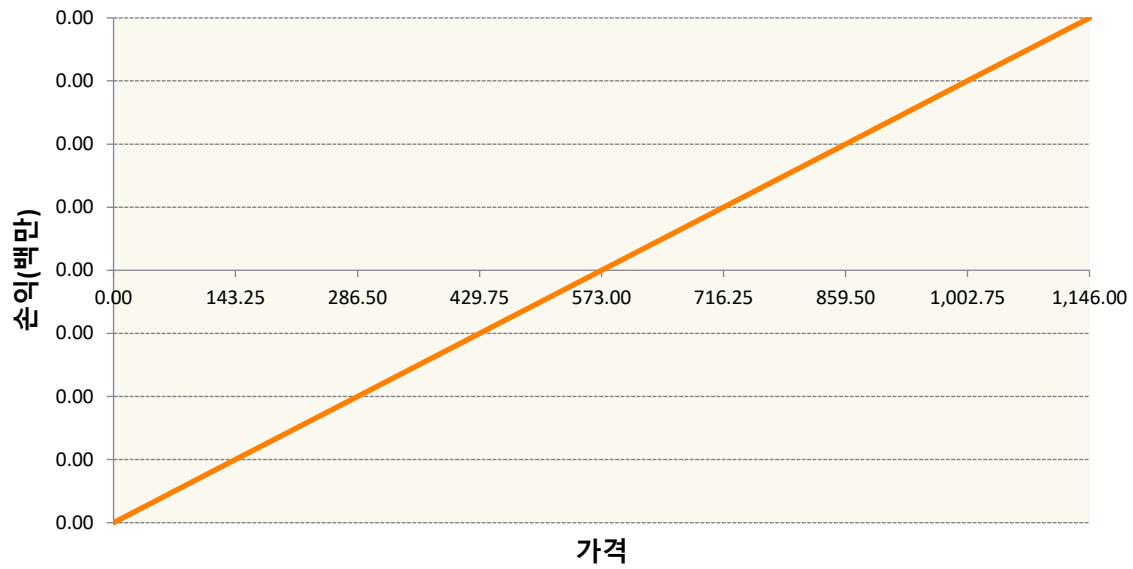
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



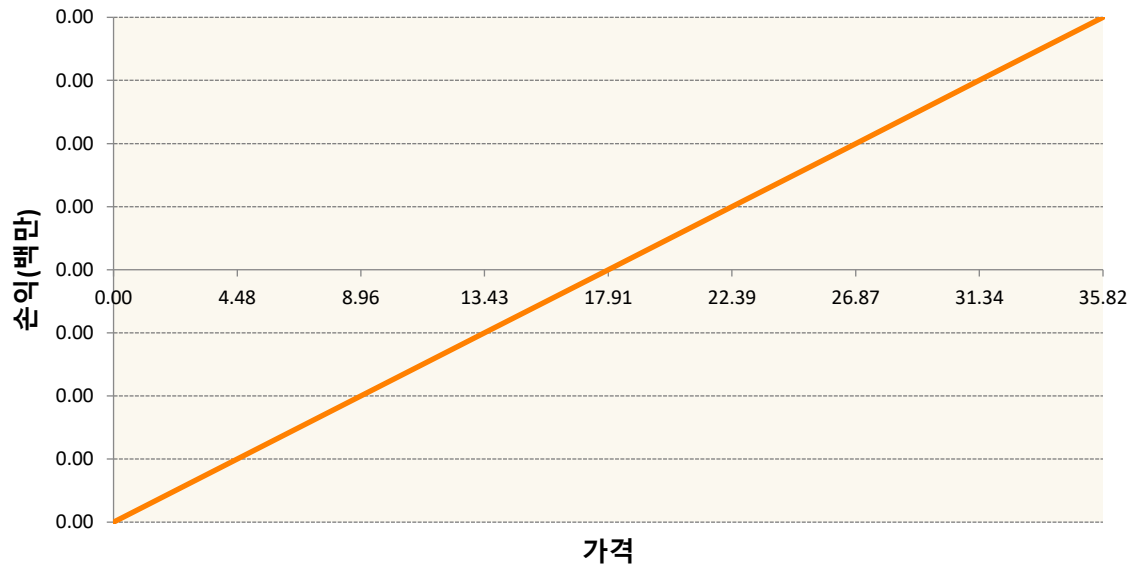
KR4175W40006-2025-04 달러선물



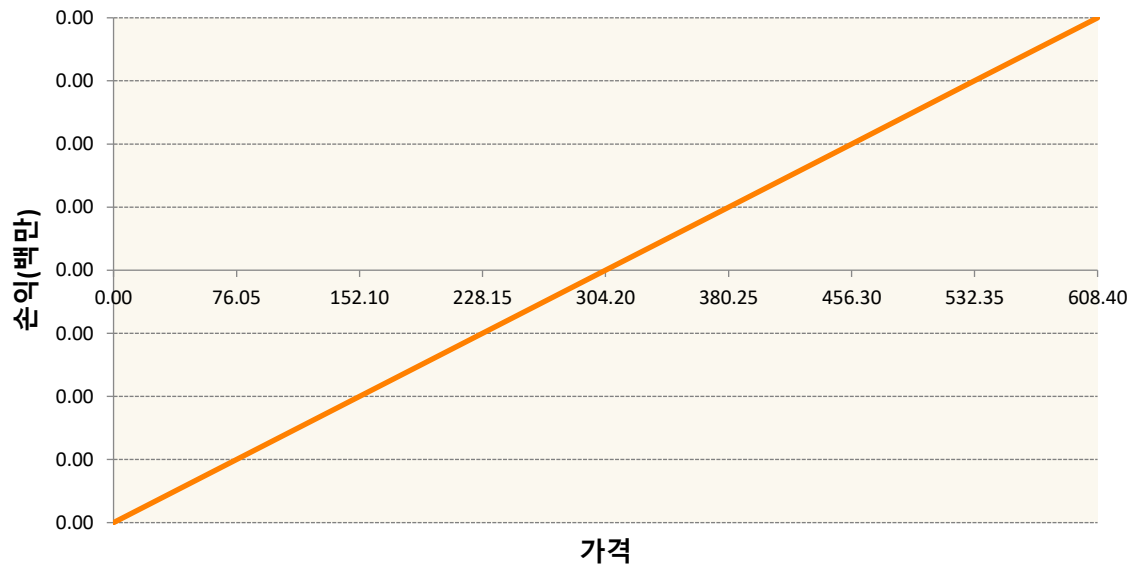
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25

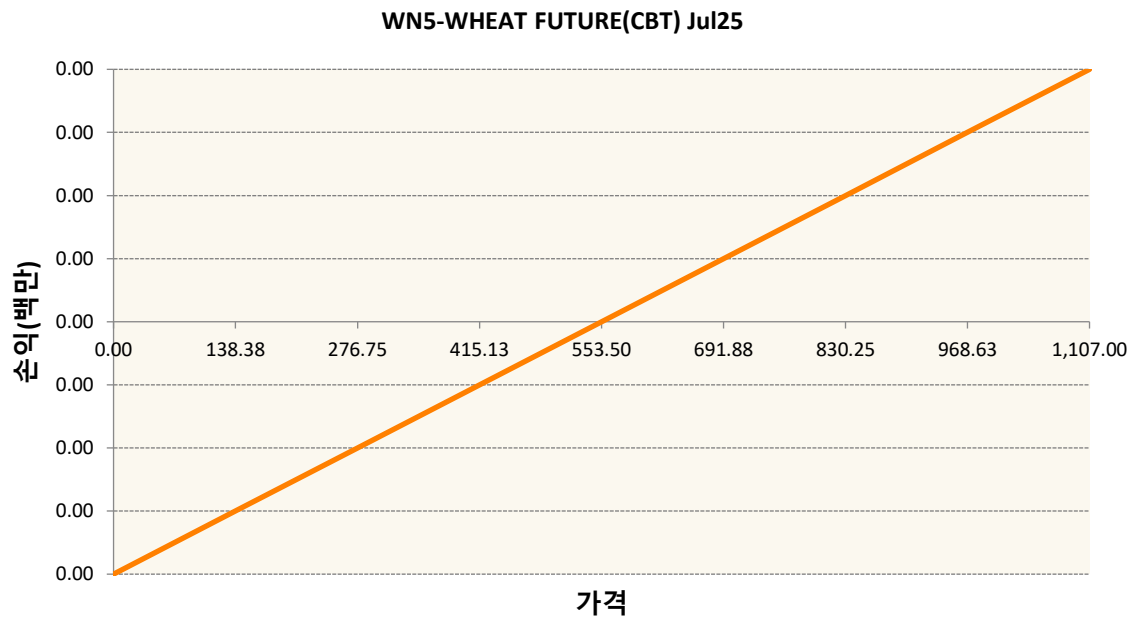
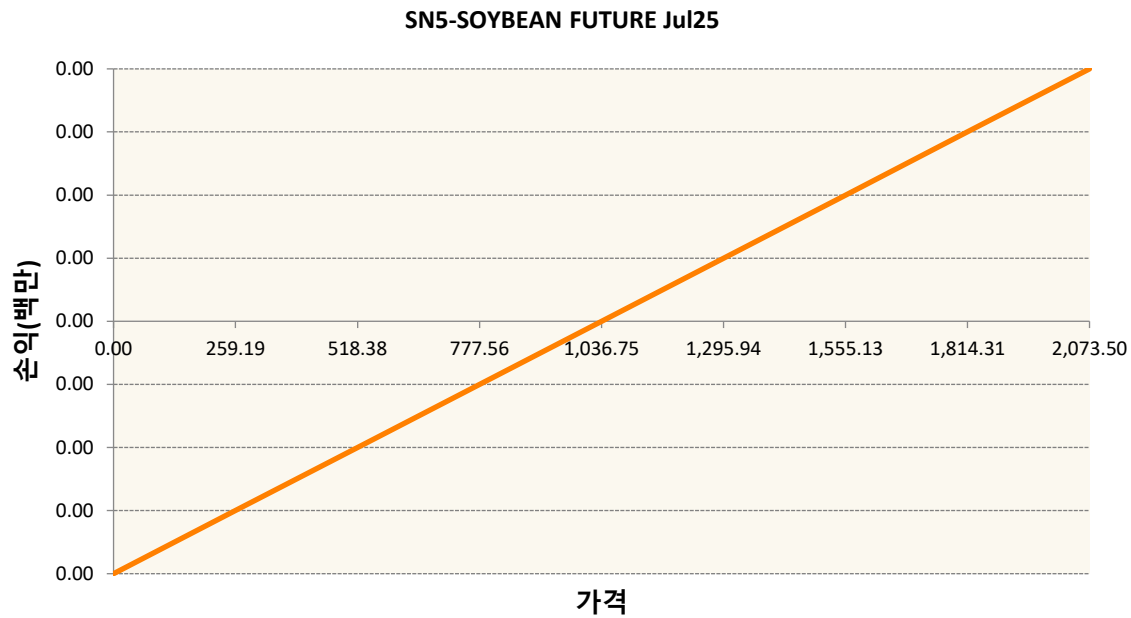


SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



SMN5-SOYBEAN MEAL FUTR Jul25





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

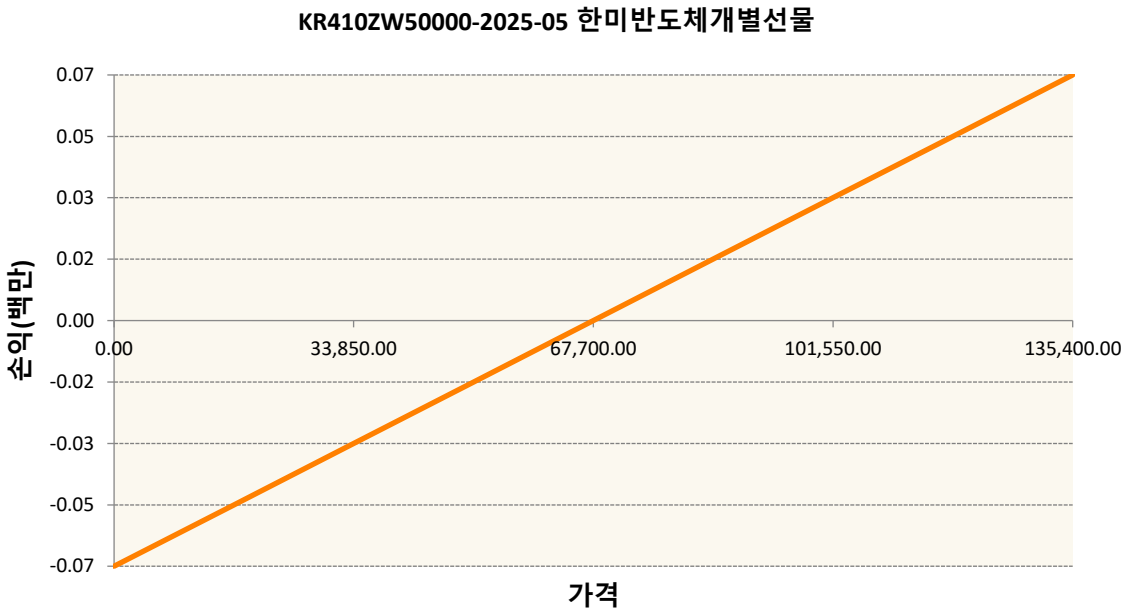
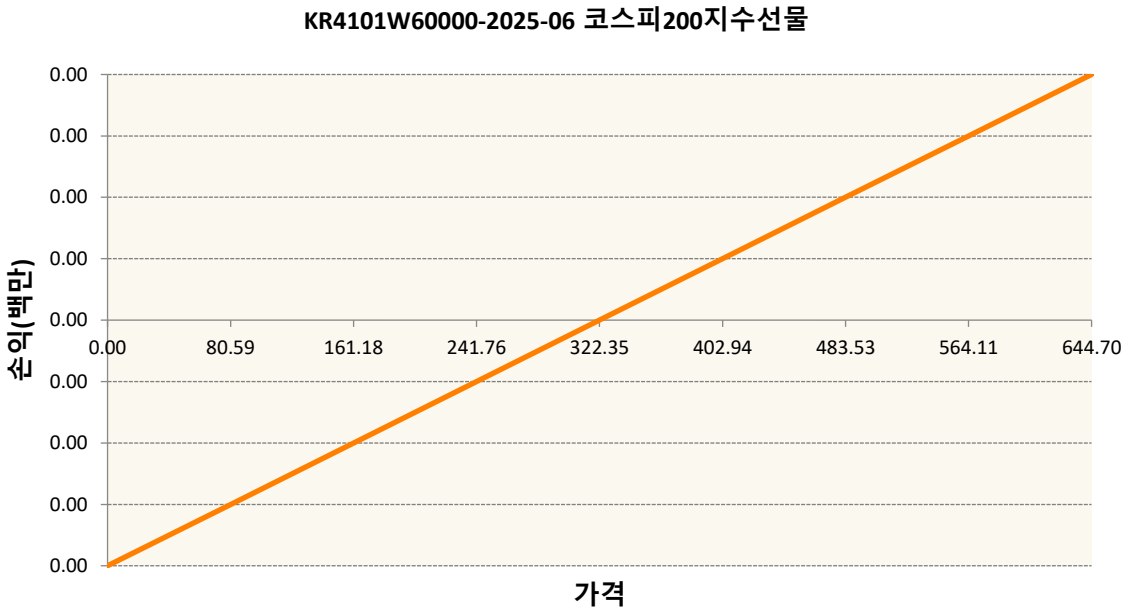
스마트인덱스모

1. 계약금액

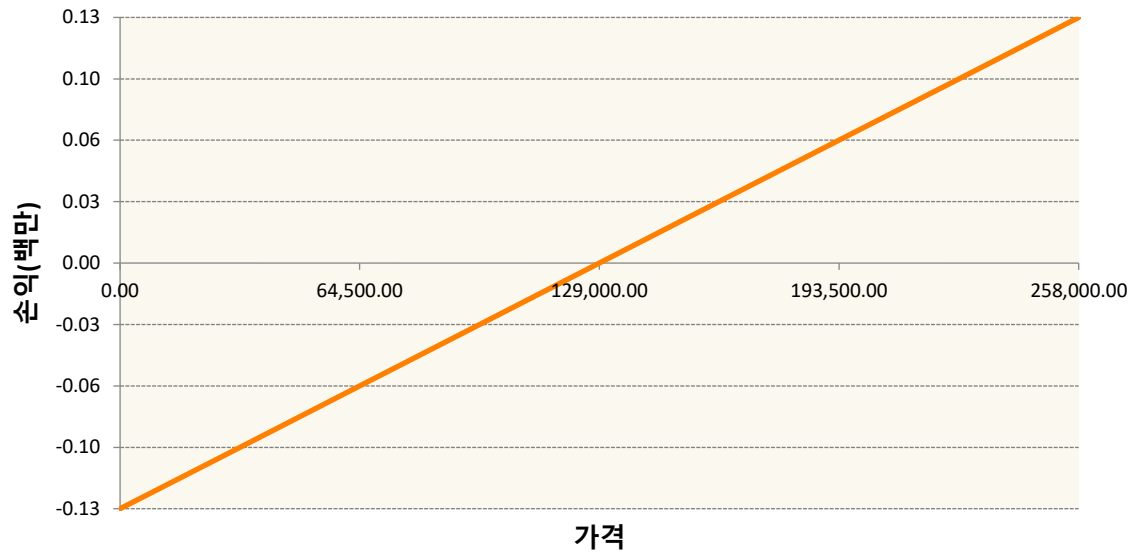
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	22	0	22	장내
누계	유가증권	선물	1,664	0	1,664	장내

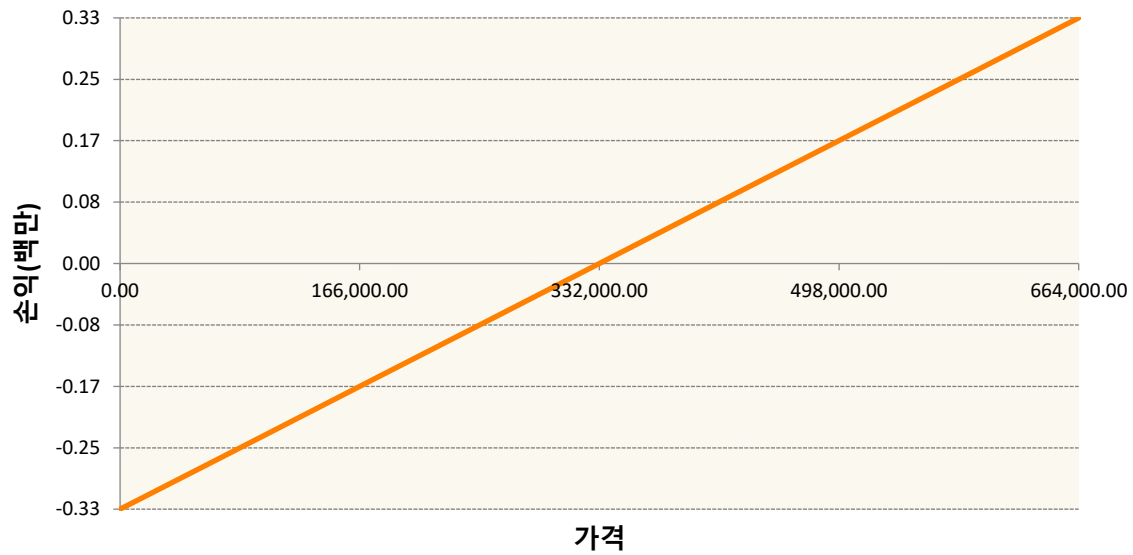
2. 만기시점의 손익구조



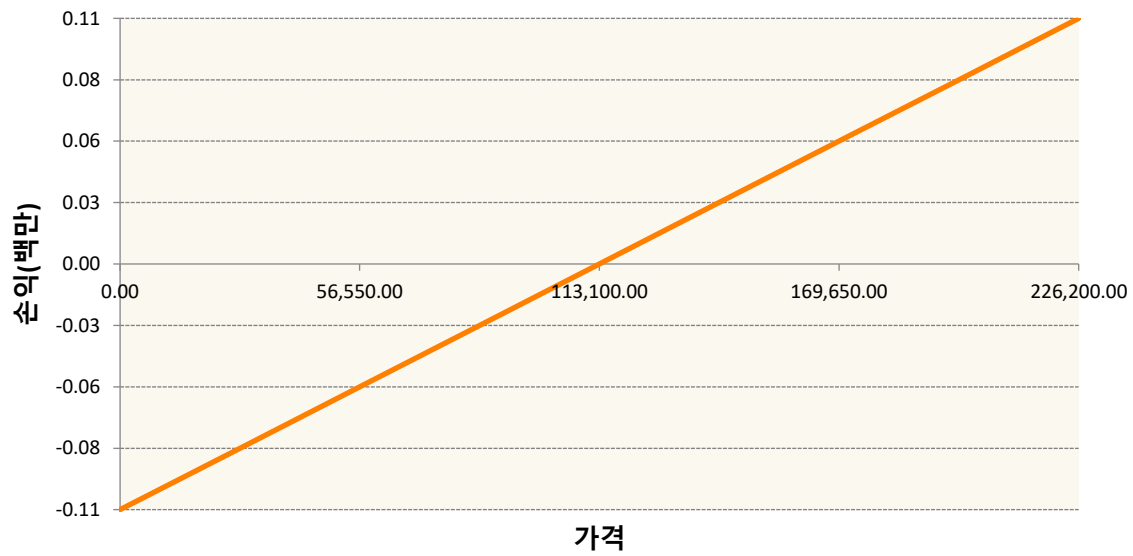
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		110
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물		3
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물		4
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물		14
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	210

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

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

278

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

456

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

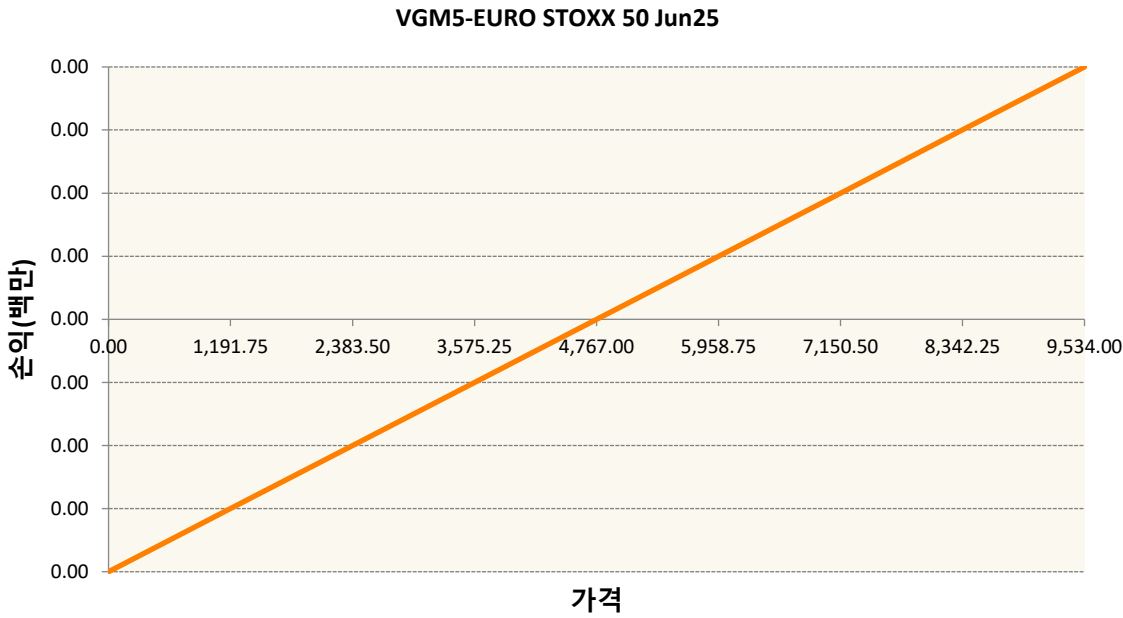
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	833	0	833	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	67
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

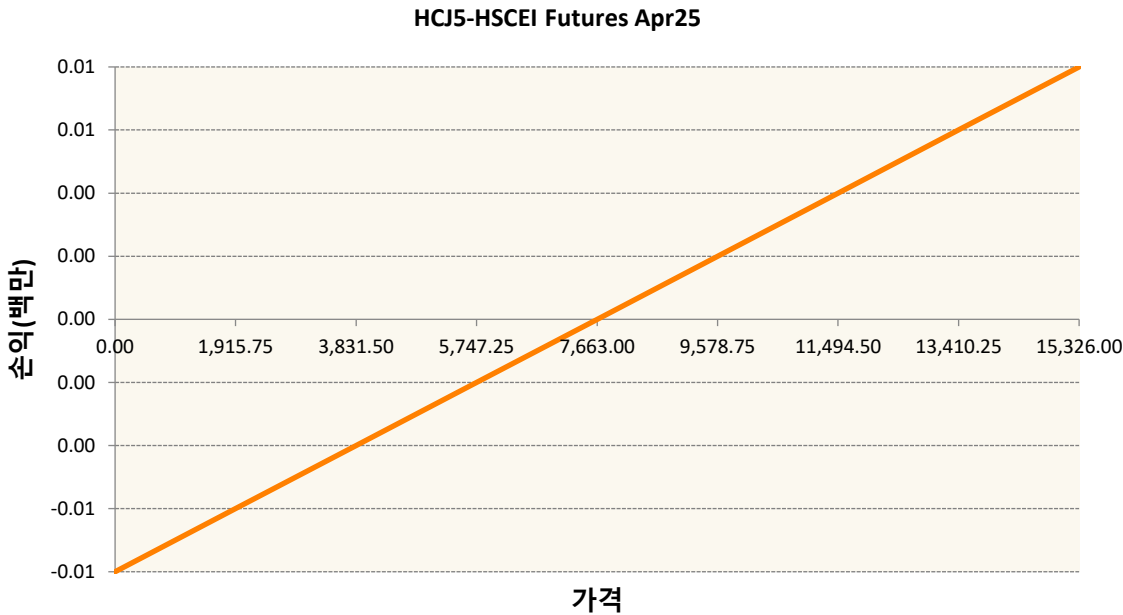
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	3,328	0	3,328	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ5	HSCEI Futures Apr25	266
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

399

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

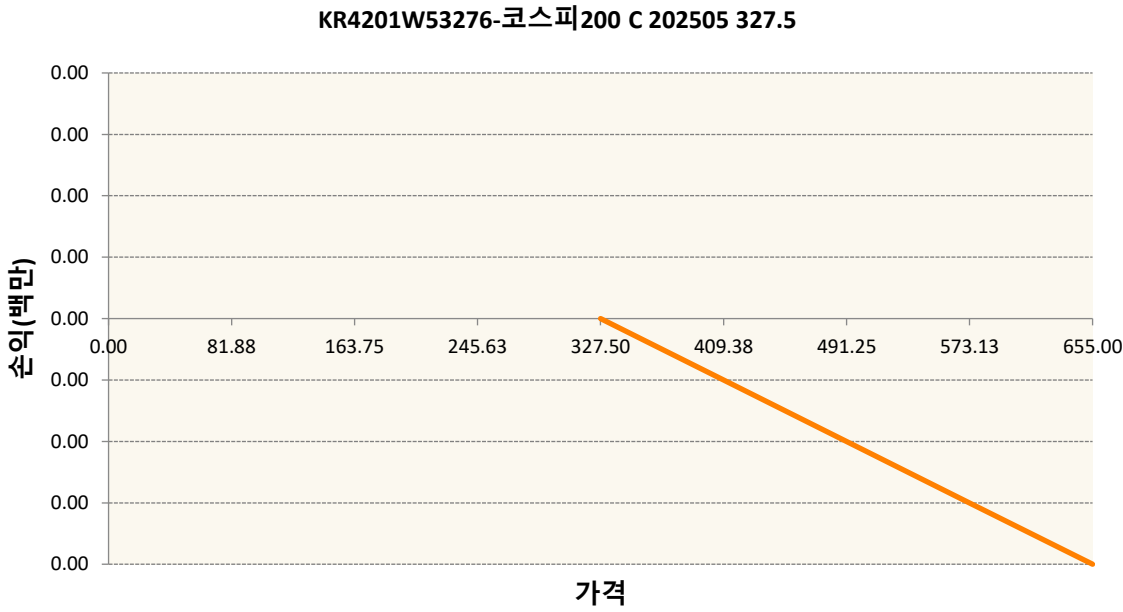
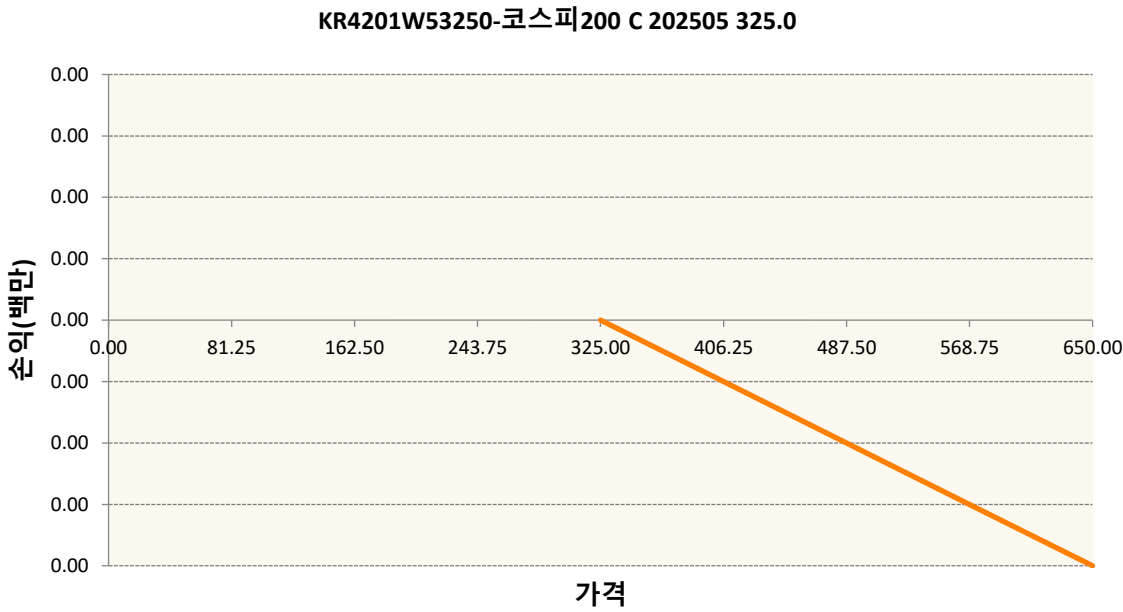
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	33,736	-33,736	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,165	-36,165	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 650.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -10.00 to 10.00. An orange line starts at the origin (0,0) and extends to the point (325, 0), indicating that the profit/loss is zero at a price of 325.00.

가격 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
0.00	-10.00
81.25	-8.00
162.50	-6.00
243.75	-4.00
325.00	-2.00
406.25	0.00
487.50	2.00
568.75	4.00
650.00	6.00

가격	순이익(백만)
0.00	0.00
81.88	0.00
163.75	0.00
245.63	0.00
327.50	0.00
409.38	0.00
491.25	0.00
573.13	0.00
655.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201W53250						코스피200 C 202505 325.0		1,624
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	659	641	619	593	563	530	493	
-5.33%	598	563	524	482	437	390	340	
-2.67%	458	404	348	291	233	173	113	
0%	197	131	66	0	-66	-132	-197	
2.67%	-205	-269	-334	-398	-463	-529	-594	
5.33%	-738	-789	-842	-897	-955	-1,013	-1,073	
8.00%	-1,367	-1,401	-1,438	-1,480	-1,525	-1,573	-1,624	
KR4201W53276						코스피200 C 202505 327.5		50
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	17	17	16	15	14
-5.33%	17	16	15	14	12	11	10
-2.67%	13	12	10	8	7	5	3
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-5	-8	-10	-12	-14	-16	-18
5.33%	-21	-23	-25	-27	-29	-31	-33
8.00%	-41	-42	-43	-45	-46	-48	-50
KR4301W53258 코스피200 P 202505 325.0							432

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-372	-379	-388	-398	-408	-420	-432
-5.33%	-205	-217	-230	-244	-259	-274	-290
-2.67%	-59	-76	-93	-111	-129	-147	-165
0%	58	39	20	0	-20	-39	-59
2.67%	145	125	106	87	67	48	28
5.33%	201	185	168	151	133	115	97
8.00%	235	223	210	196	181	165	149

KR4301W53274 코스피200 P 202505 327.5							15
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13	-14	-14	-14	-14	-15	-15
-5.33%	-8	-8	-8	-9	-9	-10	-10
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-5	-5	-6
0%	2	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	5	5	4	3	3	2	1
5.33%	7	7	6	6	5	4	4
8.00%	9	8	8	7	7	6	6

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

(단위:백만원)

1,982

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

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	535	0	535	

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	2025-04-14
기준일	2025-04-11

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	4,303	0	4,303	

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	2025-04-14
기준일	2025-04-11

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	12,504	0	12,504	
누계	통화	선도	116	12,542	-12,426	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E	211
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E	215
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E	348
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E	230
FXW213F43C USD/KRW 30-04-25E	9
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

470

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

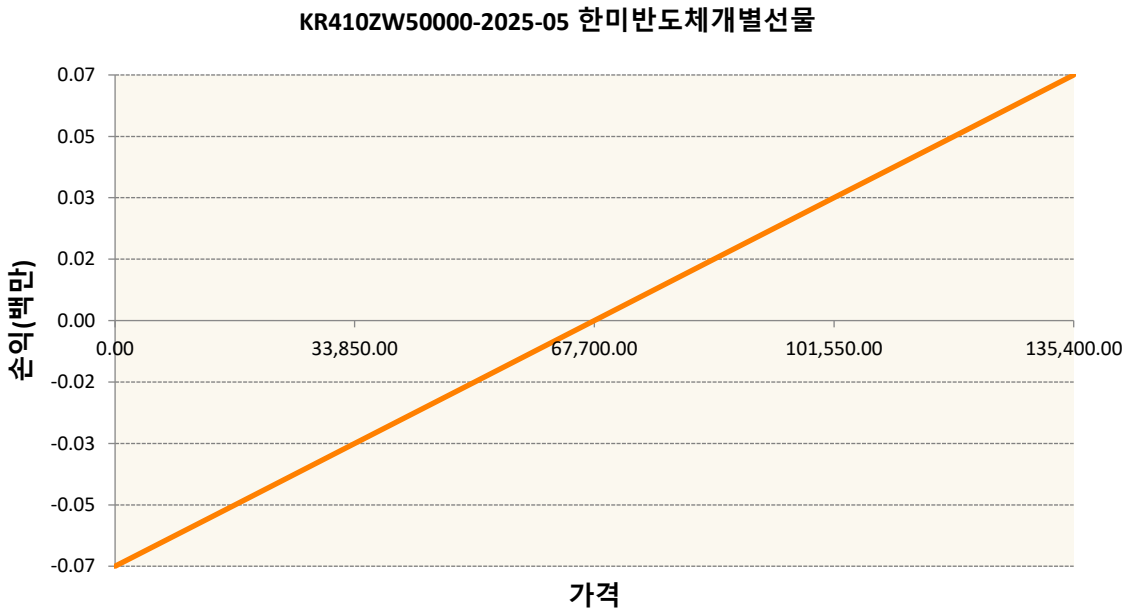
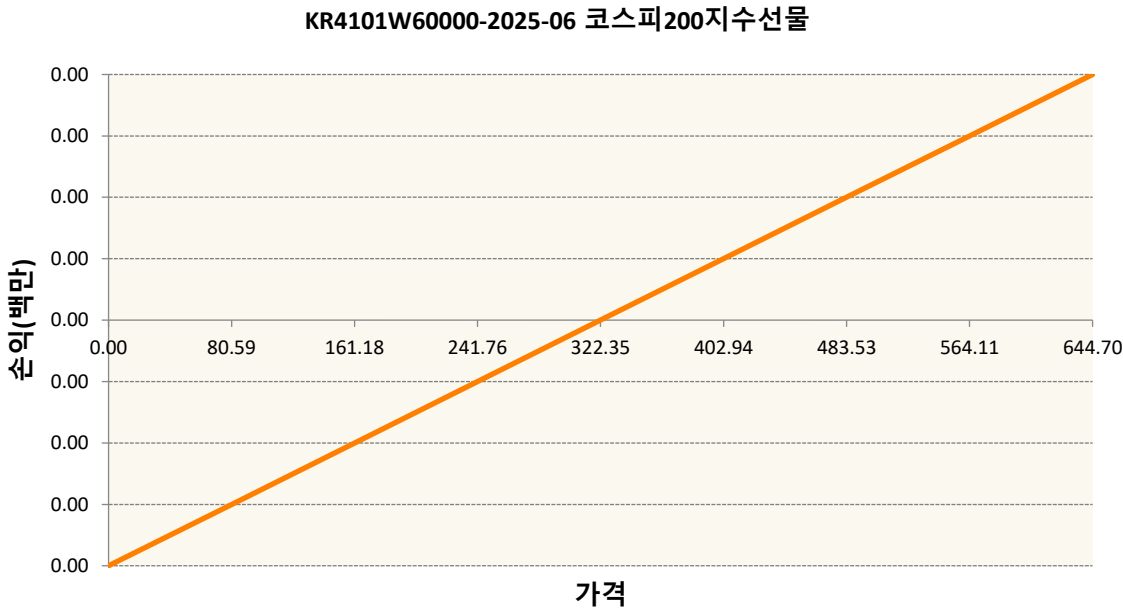
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

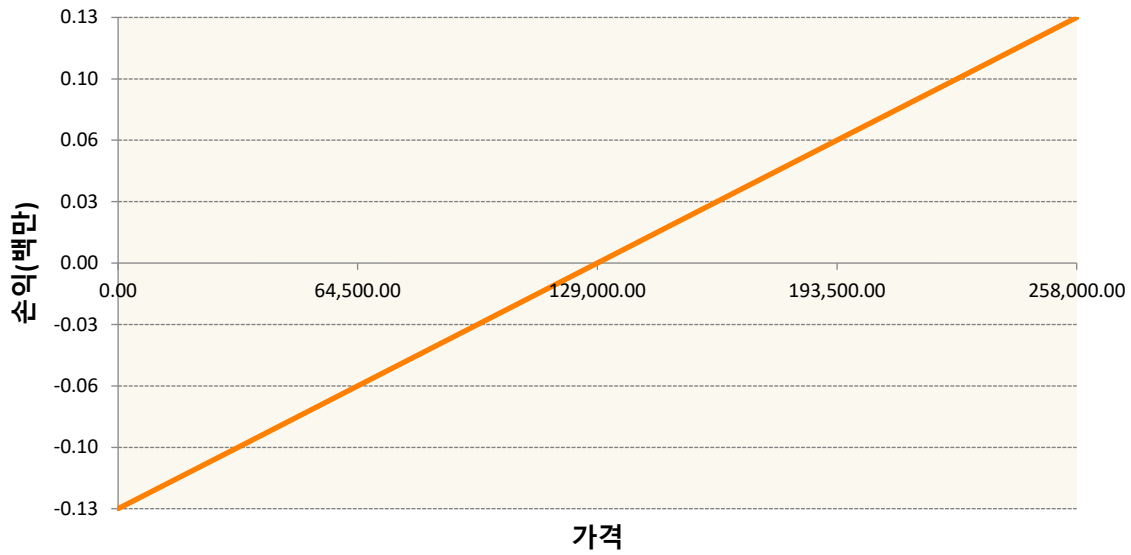
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	9	80	-71	장내
누계	유가증권	선물	958	0	958	장내

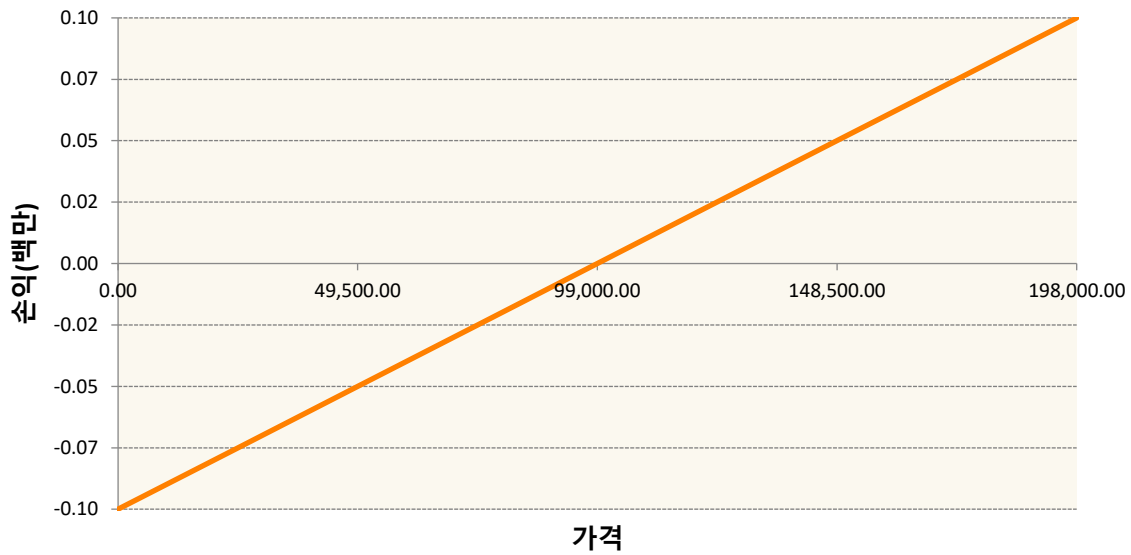
2. 만기시점의 손익구조



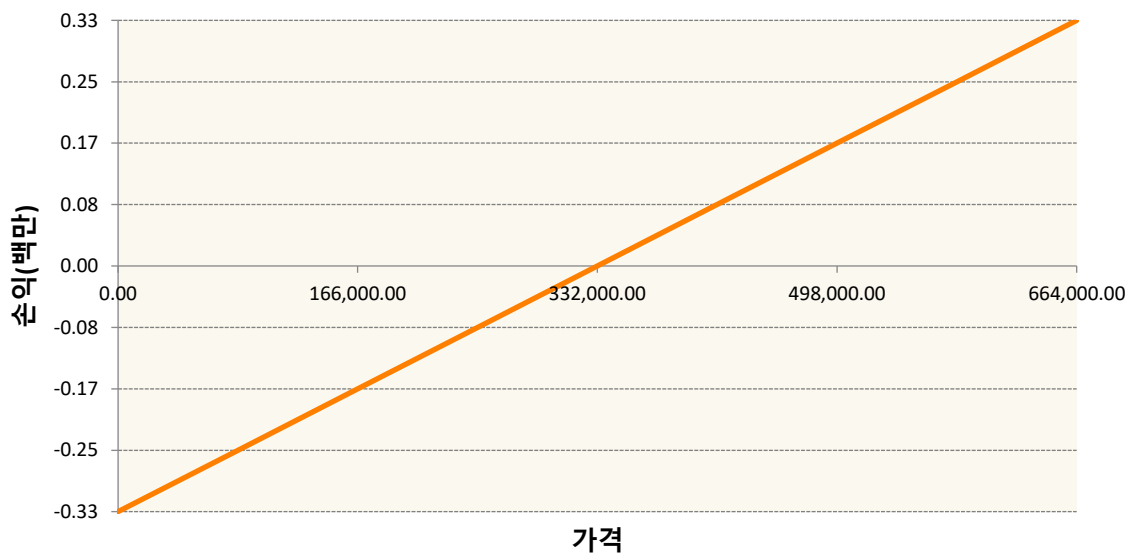
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



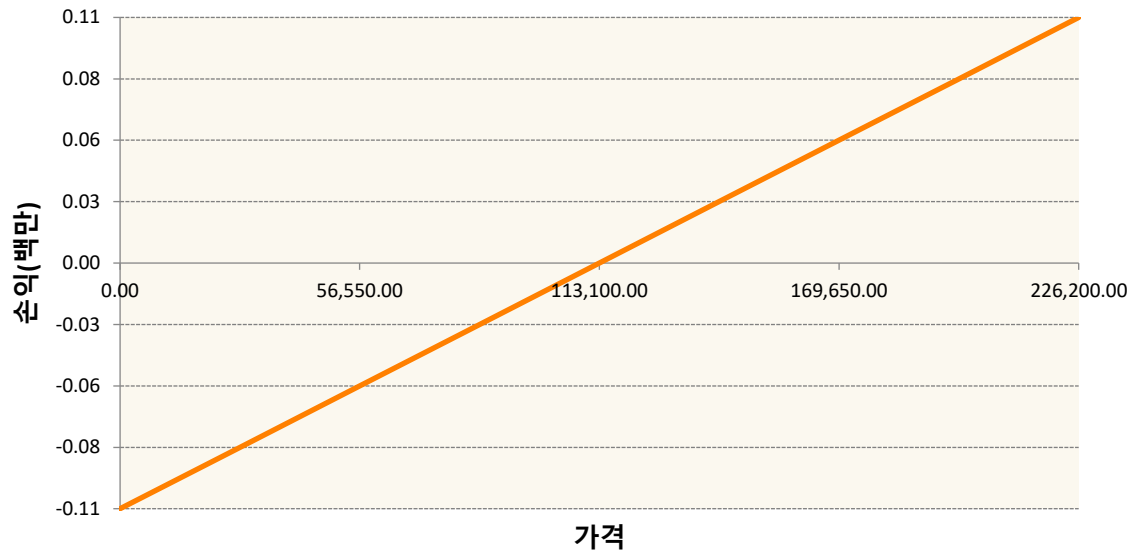
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물
KR41EYW50(2025-05 에코프로비엠개별선물
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물

64
2
2
2
6
1

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

(단위:백만원)

121

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

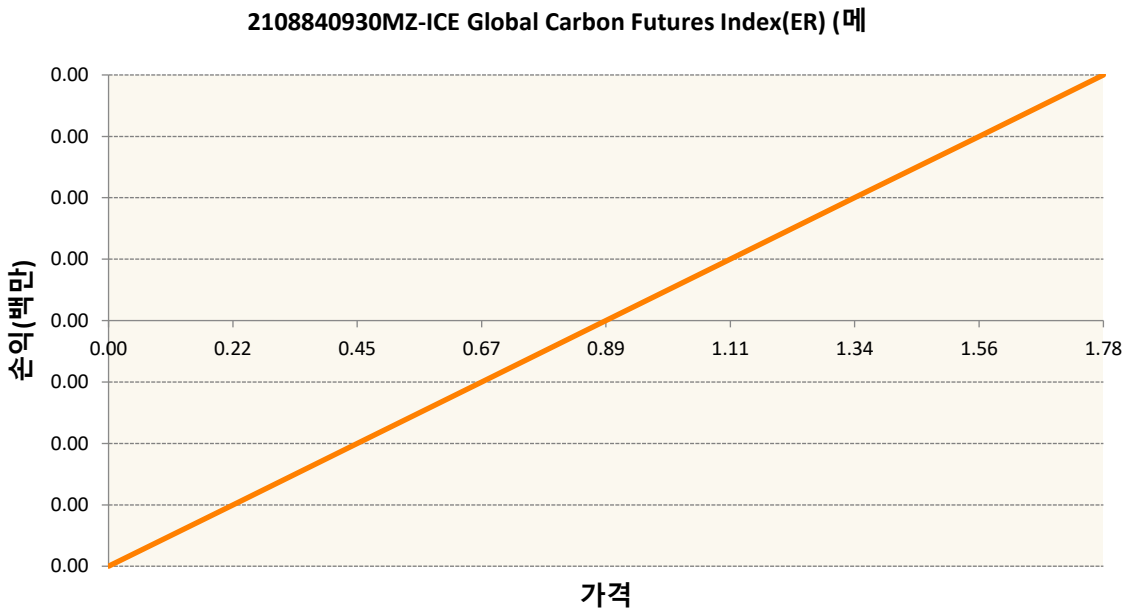
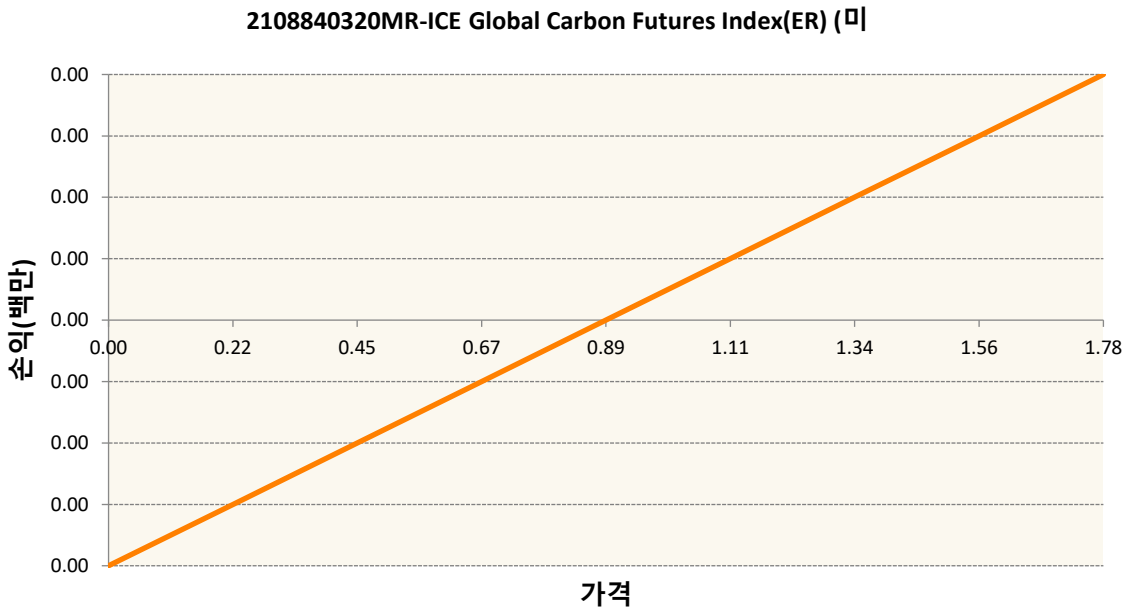
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	8,756	0	8,756	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	525
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	176

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		810

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

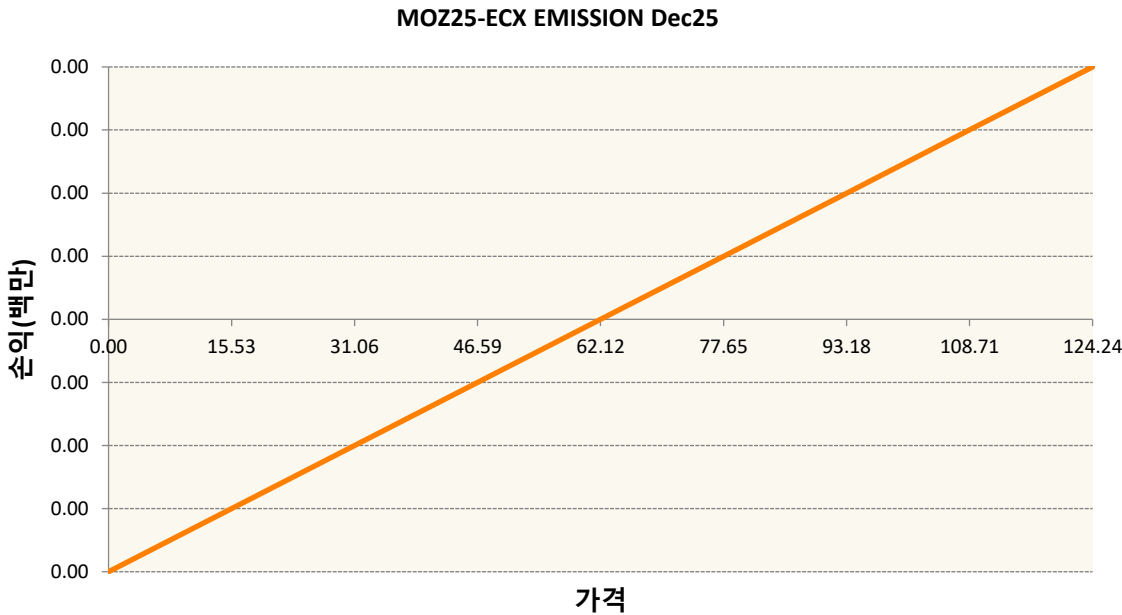
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,525	0	5,525	
누계	통화	선도	0	1,194	-1,194	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	446

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

(단위:백만원)

842

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

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)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	17

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

(단위:백만원)

105

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

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)	23
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	27
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	19
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	6

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

(단위:백만원)

132

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

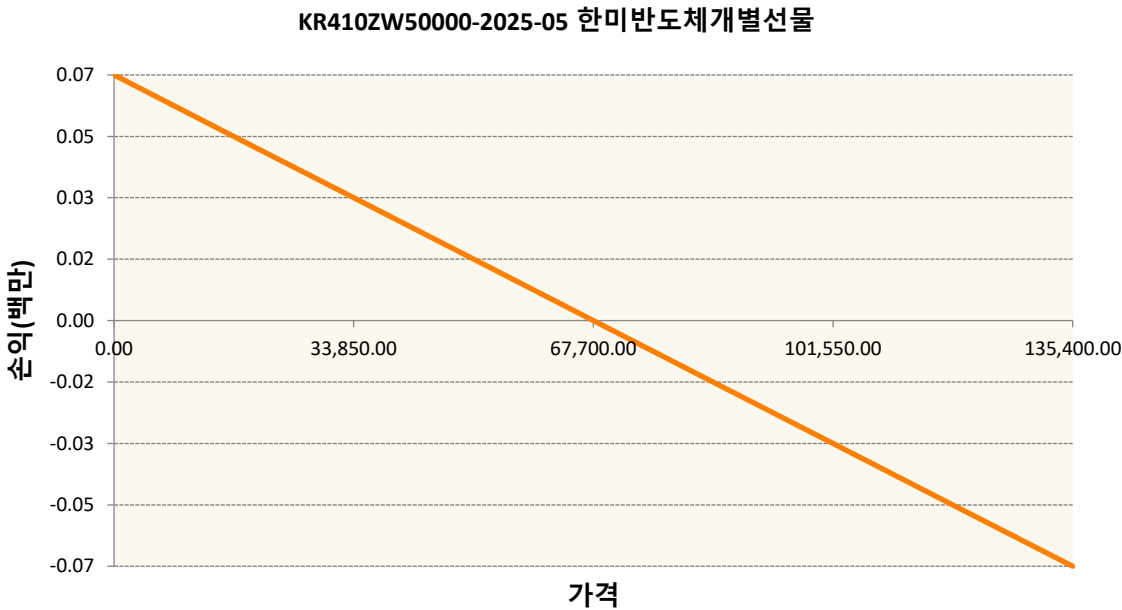
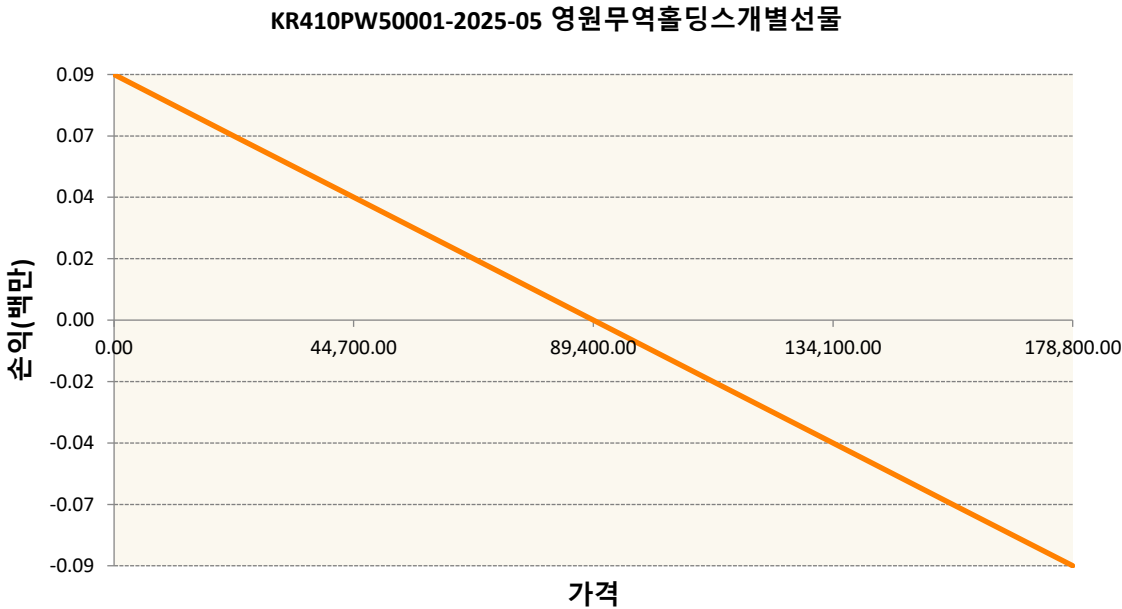
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

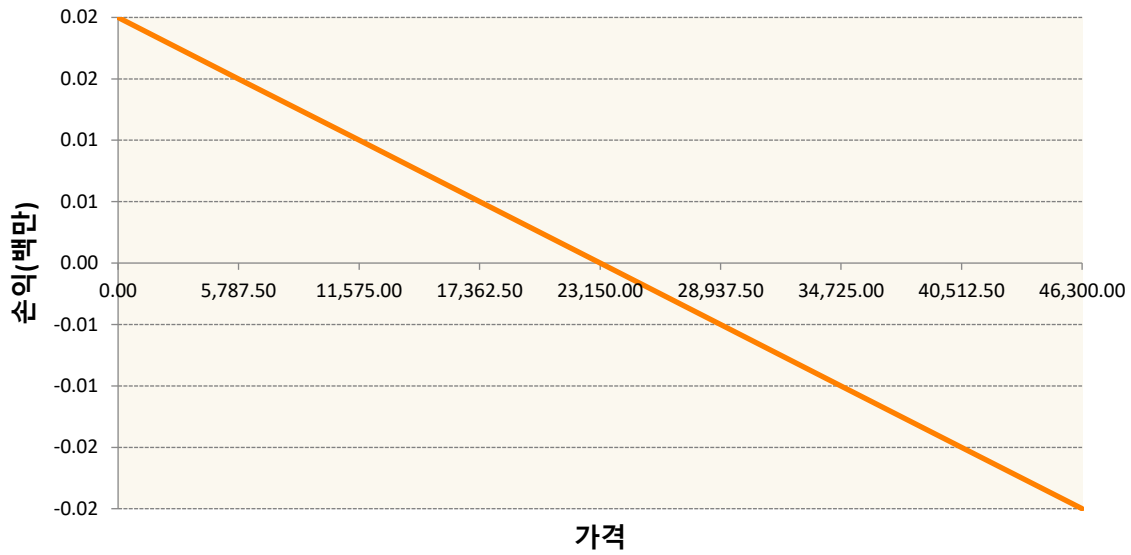
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6	0	6	장내
누계	유가증권	선물	4	138	-134	장내

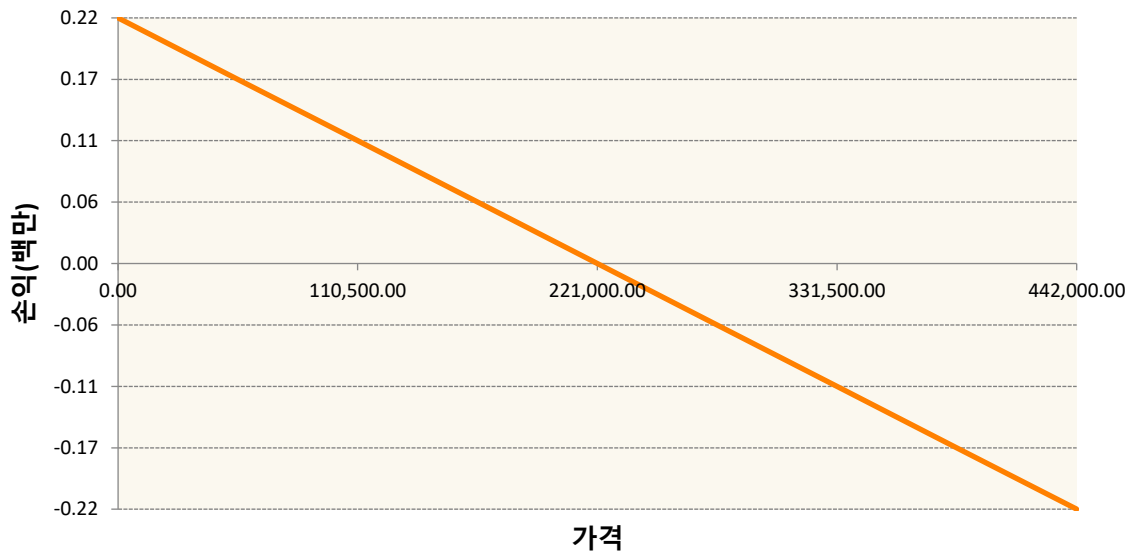
2. 만기시점의 손익구조



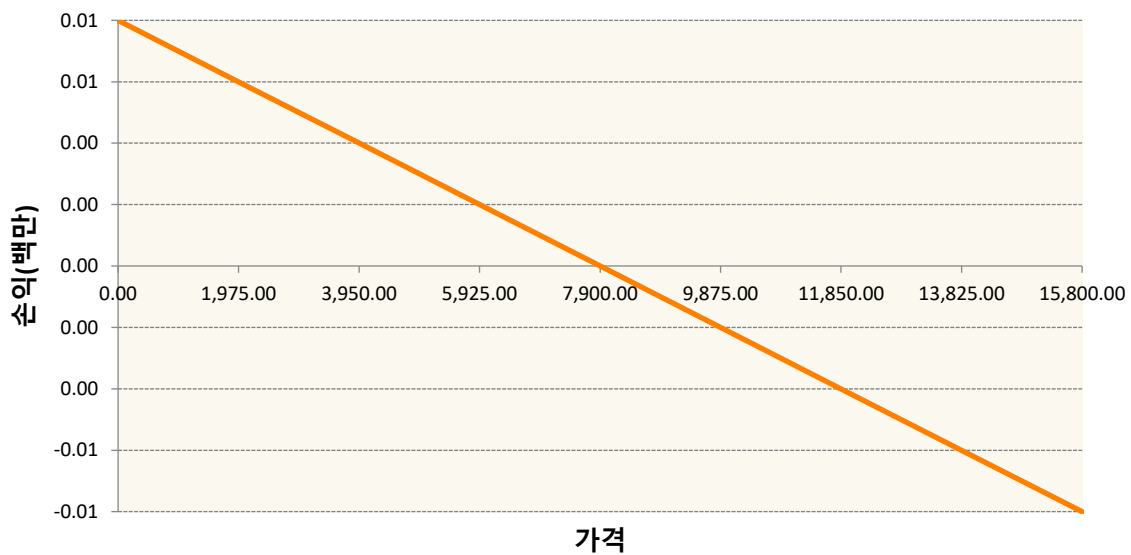
KR4115W50001-2025-05 한국전력개별선물



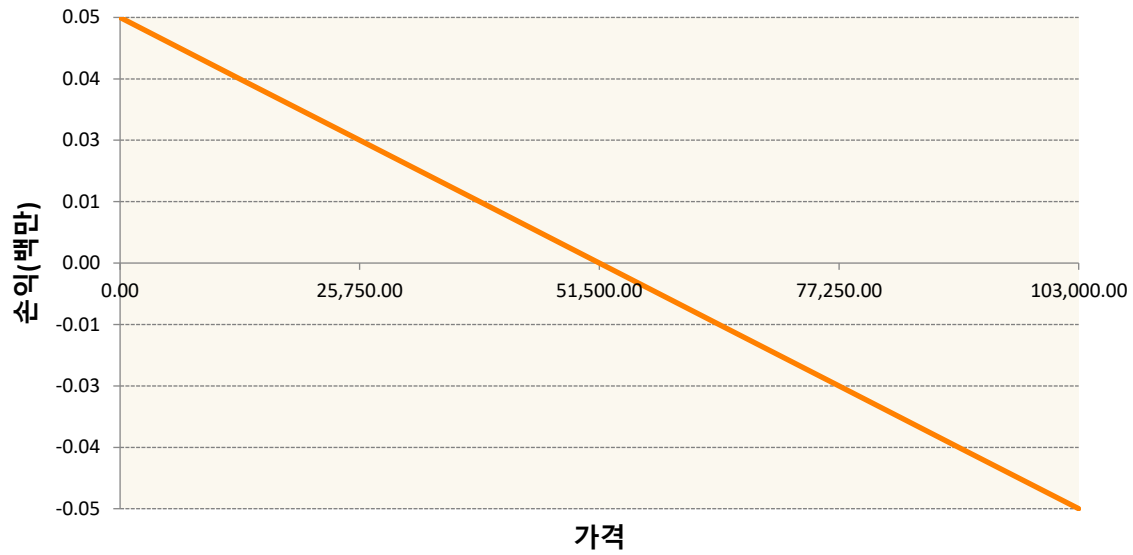
KR4139W50001-2025-05 HD한국조선해양개별선물



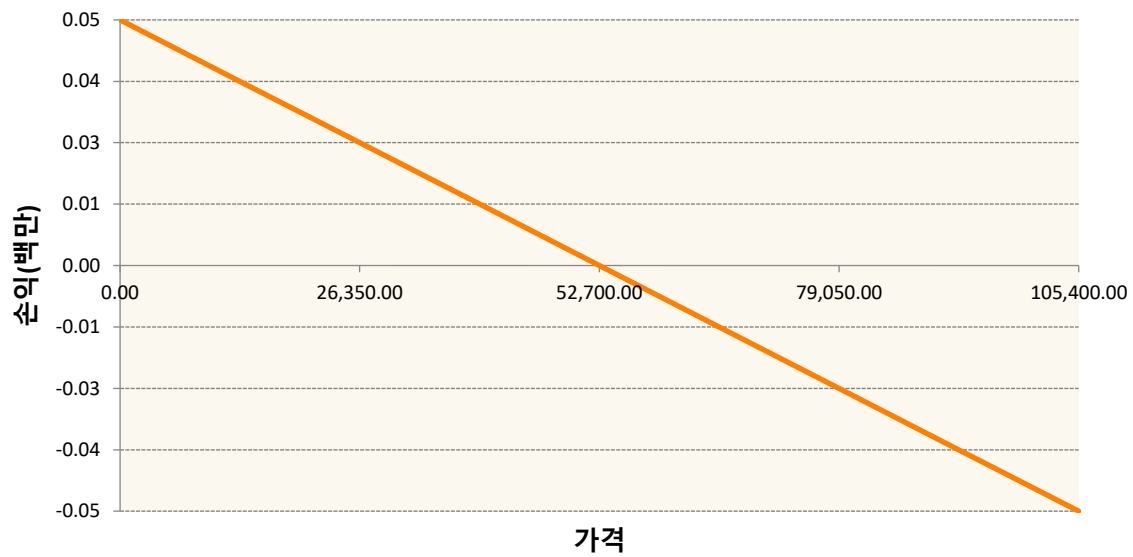
KR4149W50000-2025-05 HD현대인프라코어개별선물



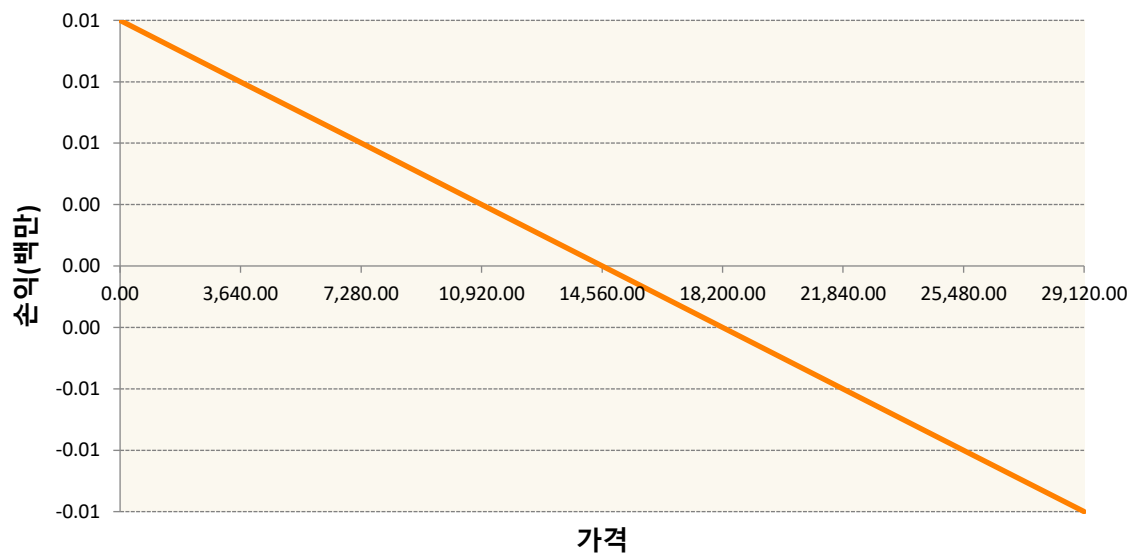
KR41B2W50007-2025-05 S-Oil개별선물



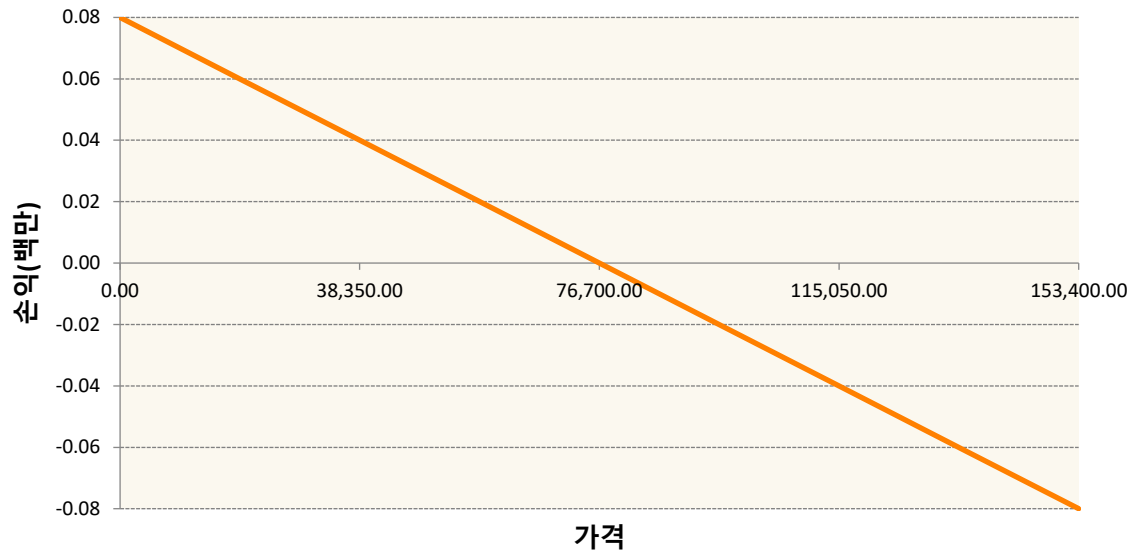
KR41B7W50006-2025-05 포스코인터내셔널개별선물



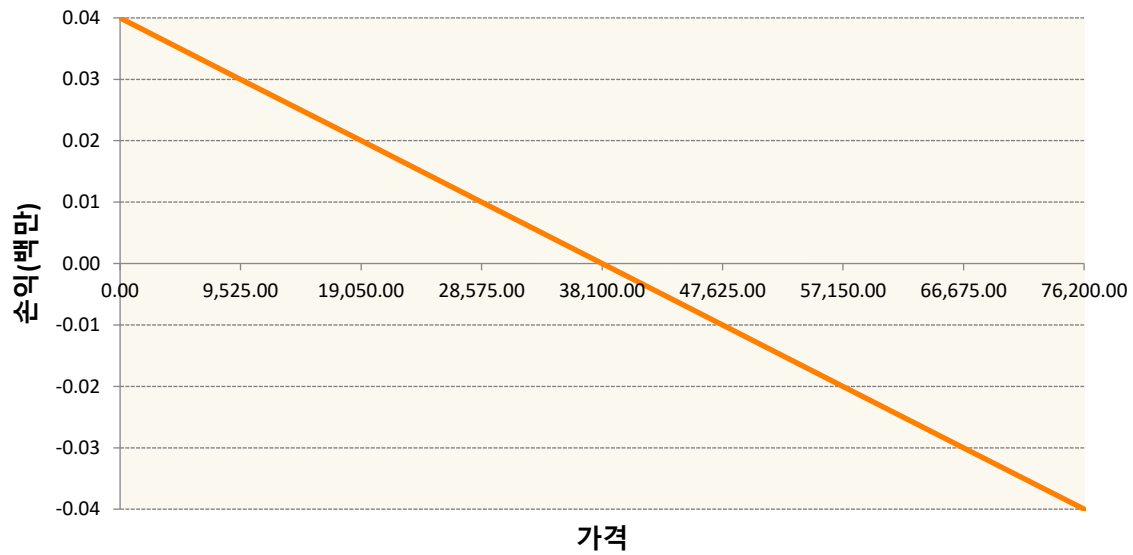
KR41BFW50008-2025-05 삼성중공업개별선물



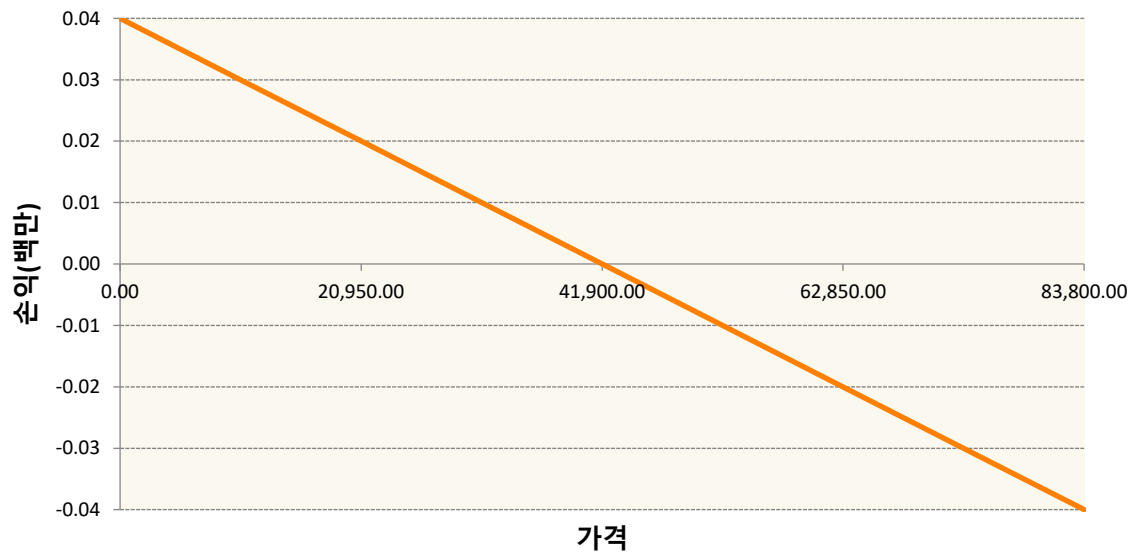
KR41BMW50004-2025-05 한국항공우주개별선물



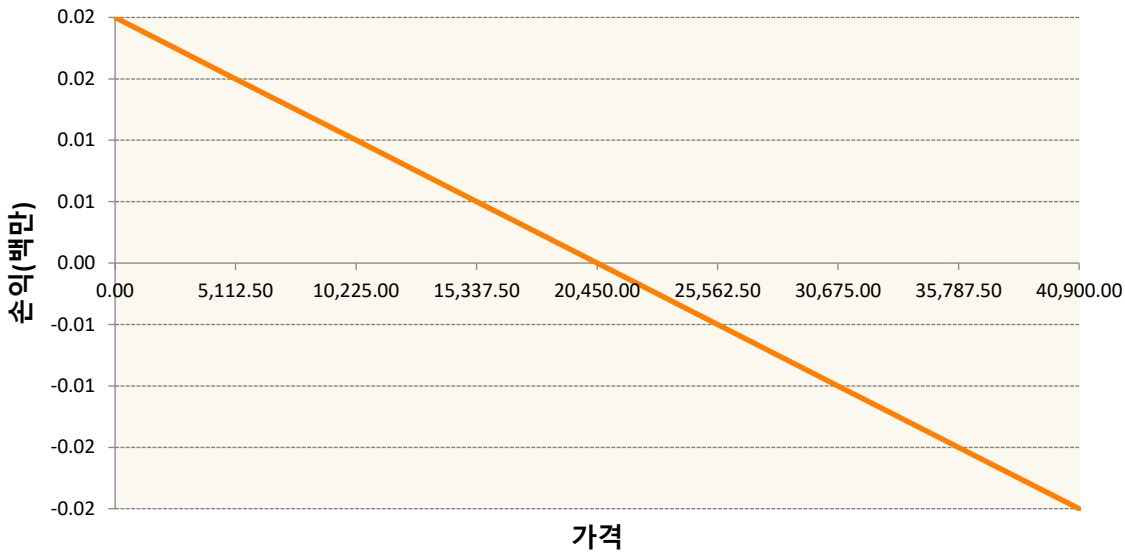
KR41BNW50002-2025-05 현대건설개별선물



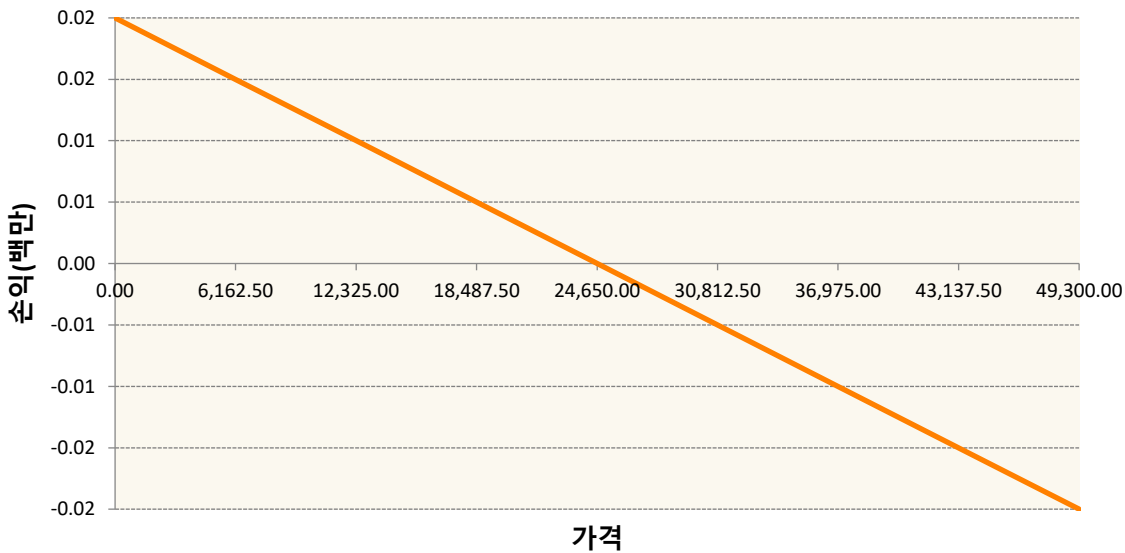
KR41C9W50001-2025-05 한화개별선물



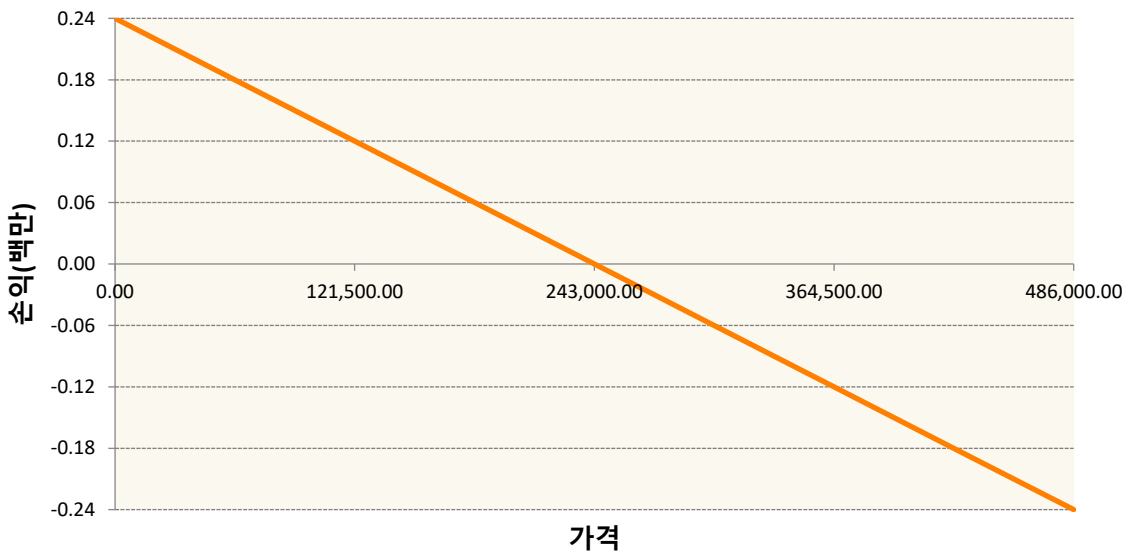
KR41CBW50005-2025-05 한화솔루션개별선물



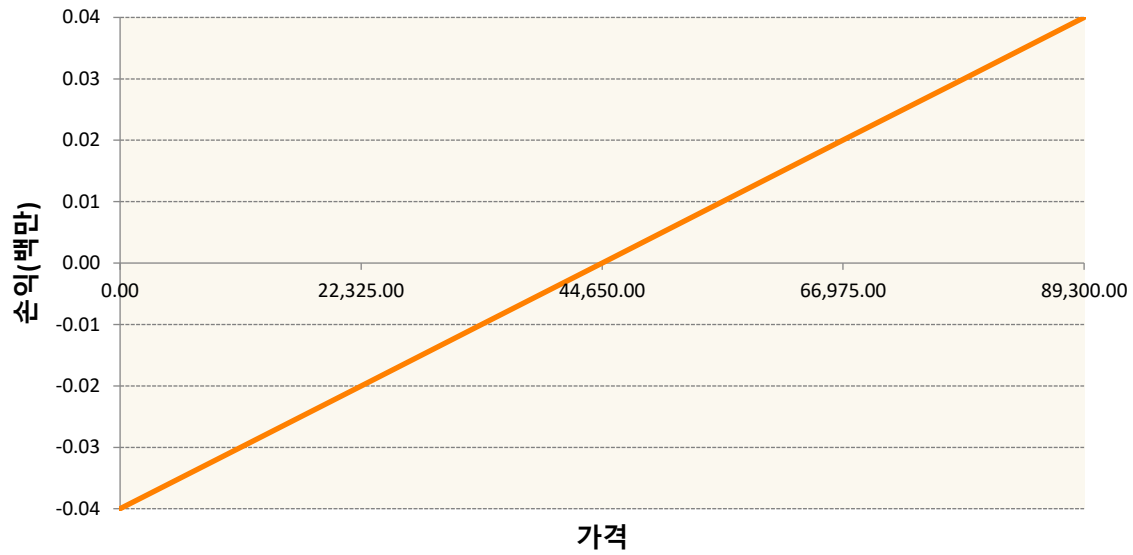
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



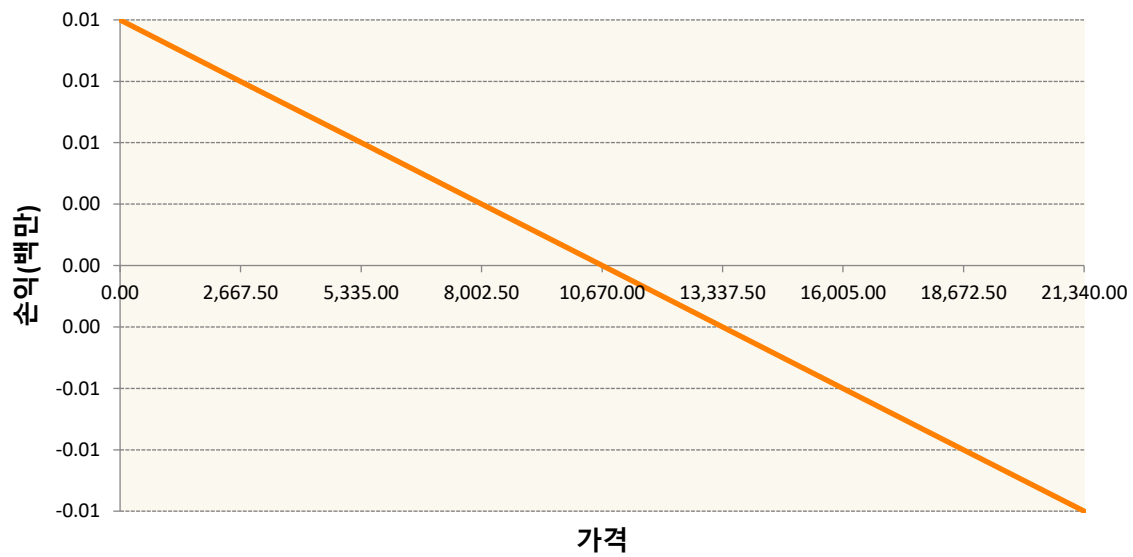
KR41CXW50009-2025-05 한미약품개별선물



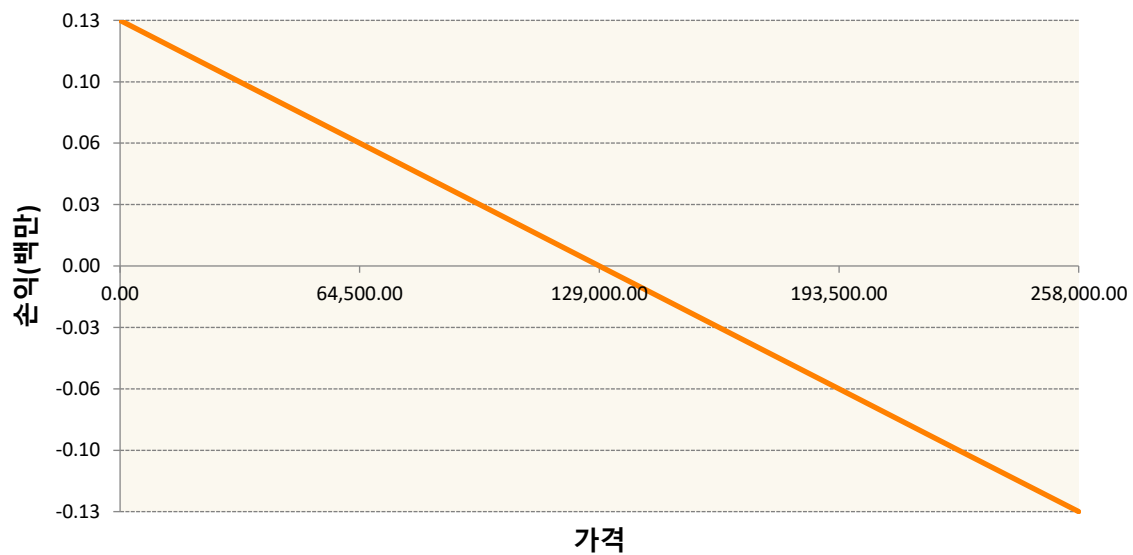
KR41DGW50002-2025-05 영원무역개별선물



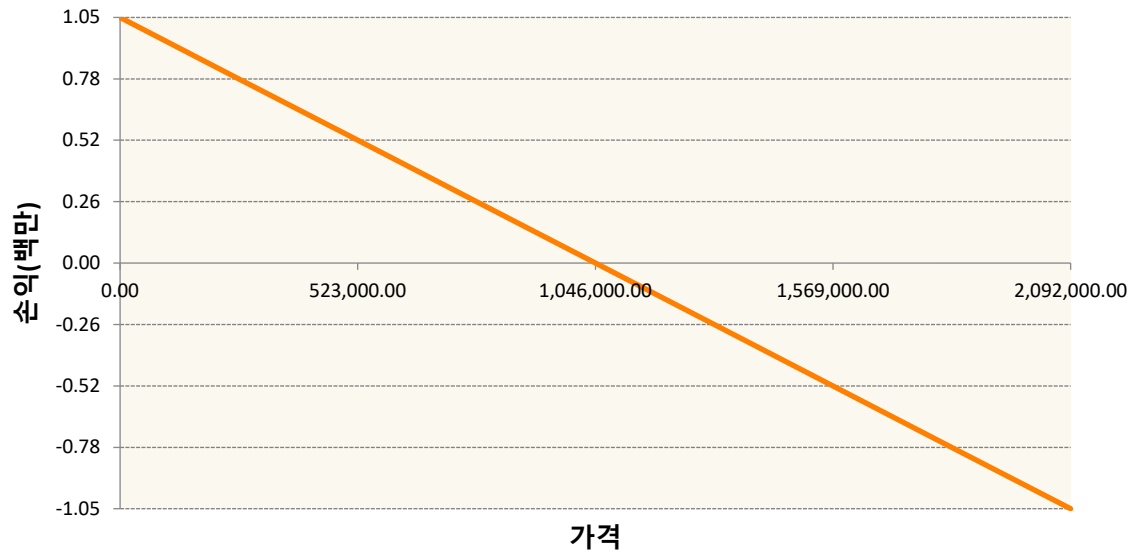
KR41DZW50002-2025-05 한세실업개별선물



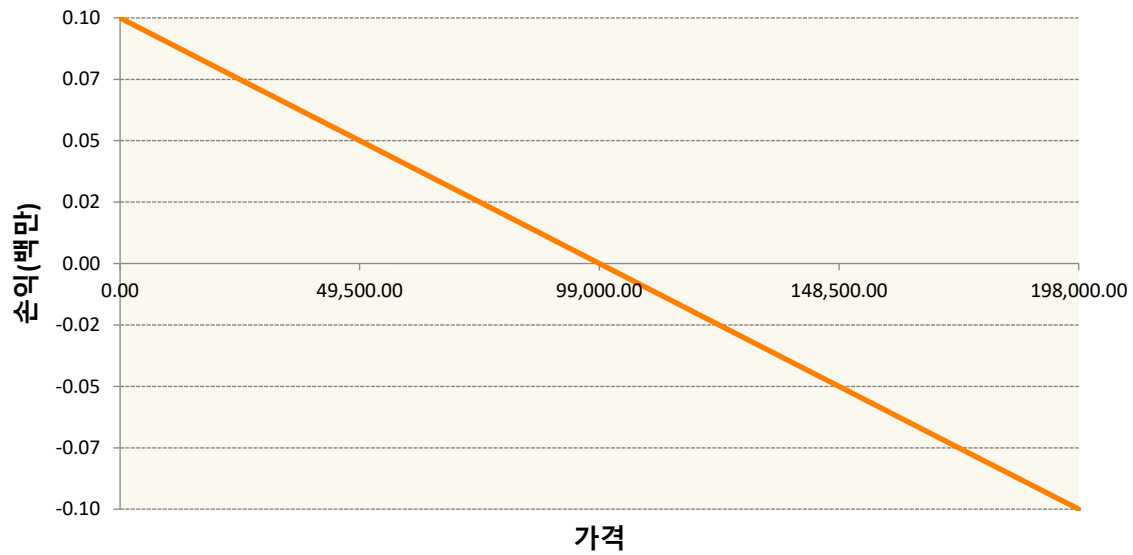
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



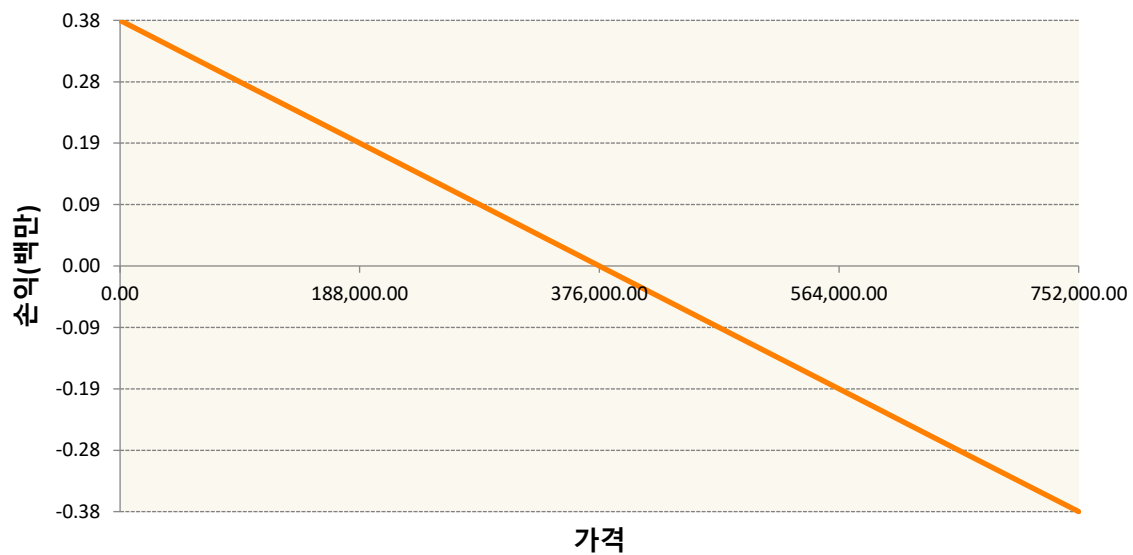
KR41ESW50005-2025-05 삼성바이오로직스개별선물



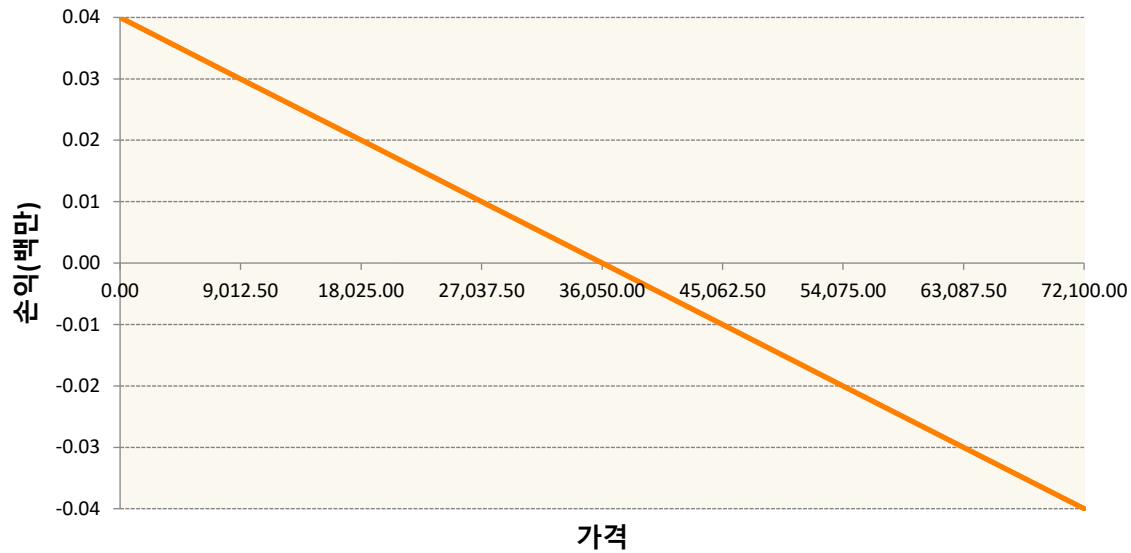
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



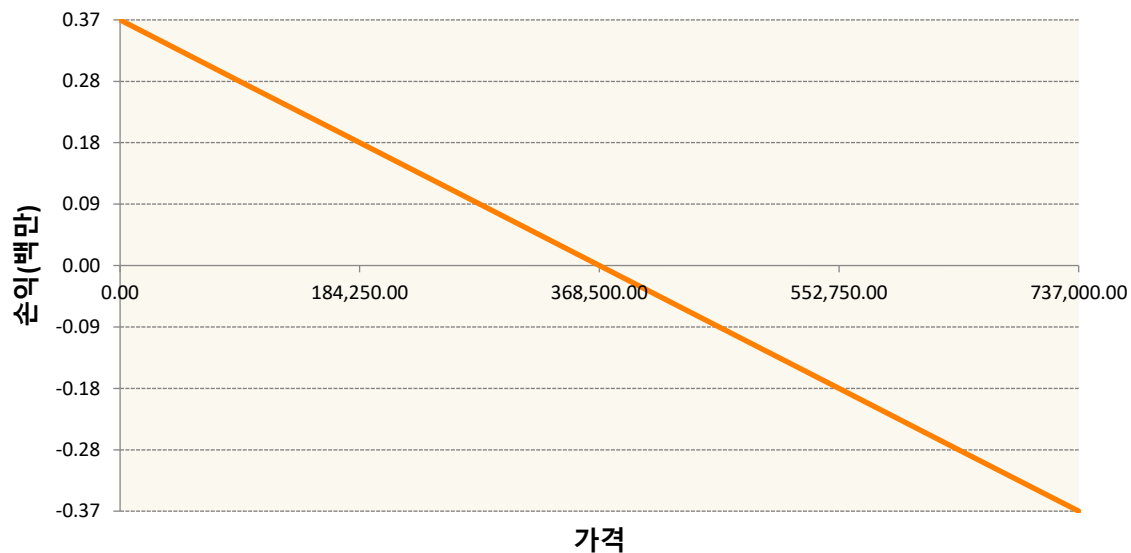
KR41F8W50000-2025-05 크래프톤개별선물



KR41HRW50000-2025-05 주성엔지니어링개별선물



KR41HSW50008-2025-05 파마리서치개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR410PW50(2025-05 영원무역홀딩스개별선물	0.07
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	1
KR4115W50(2025-05 한국전력개별선물	0.3
KR4139W50(2025-05 HD한국조선해양개별선물	1
KR4149W50(2025-05 HD현대인프라코어개별선물	1
KR41B2W50(2025-05 S-Oil개별선물	0.49
KR41B7W50(2025-05 포스코인터내셔널개별선물	1
KR41BFW50(2025-05 삼성중공업개별선물	1
KR41BMW50(2025-05 한국항공우주개별선물	1
KR41BNW50(2025-05 현대건설개별선물	0.3
KR41C9W50(2025-05 한화개별선물	0.4
KR41CBW50(2025-05 한화솔루션개별선물	0.23

KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물	1
KR41CXW50 2025-05 한미약품개별선물	0.39
KR41DGW50 2025-05 영원무역개별선물	0.29
KR41DZW50 2025-05 한세실업개별선물	1
KR41E8W50 2025-05 포스코퓨처엠개별선물	1
KR41ESW50 2025-05 삼성바이오로직스개별선물	1
KR41EYW50 2025-05 에코프로비엠개별선물	0.48
KR41F8W50 2025-05 크래프톤개별선물	1
KR41HRW50 2025-05 주성엔지니어링개별선물	0.26
KR41HSW50 2025-05 파마리서치개별선물	0.29

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

(단위:백만원)

28

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

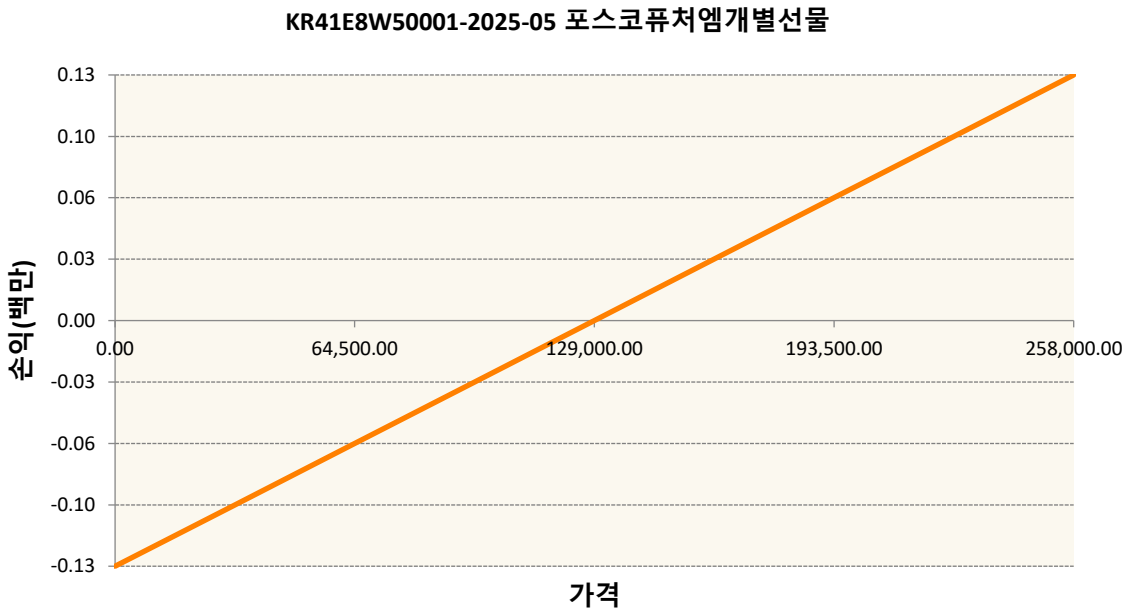
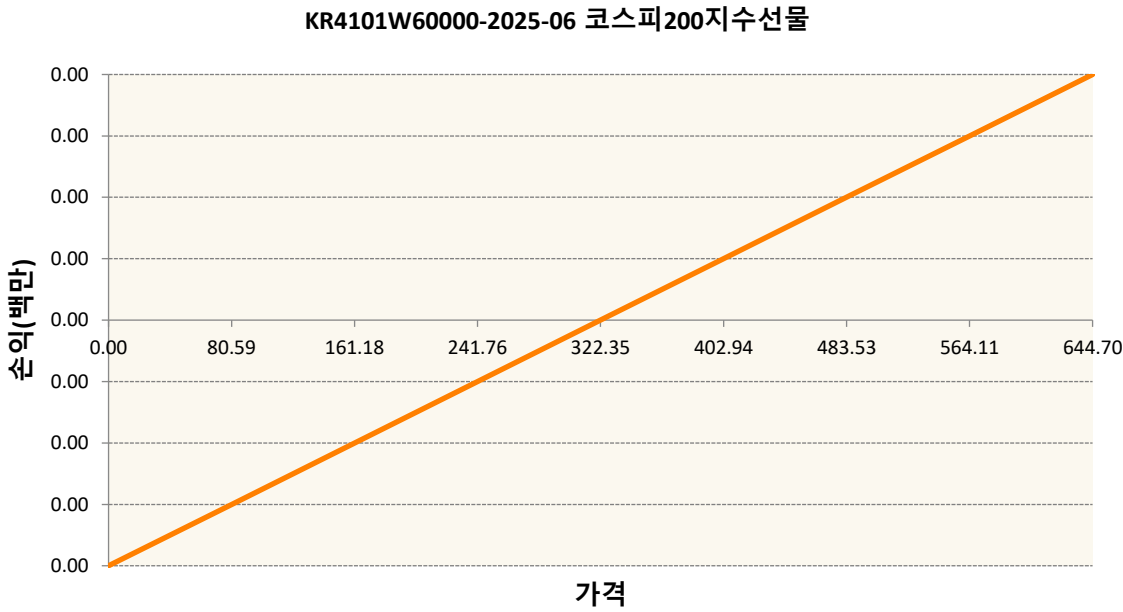
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

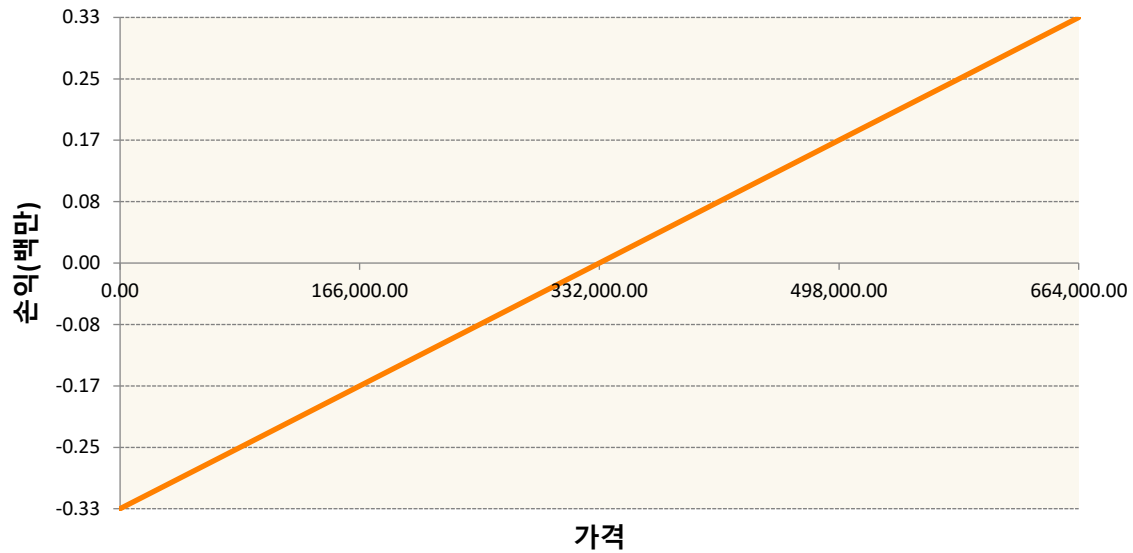
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	8,736	0	8,736	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	567
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물	16
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물	115

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

(단위:백만원)

1,084

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

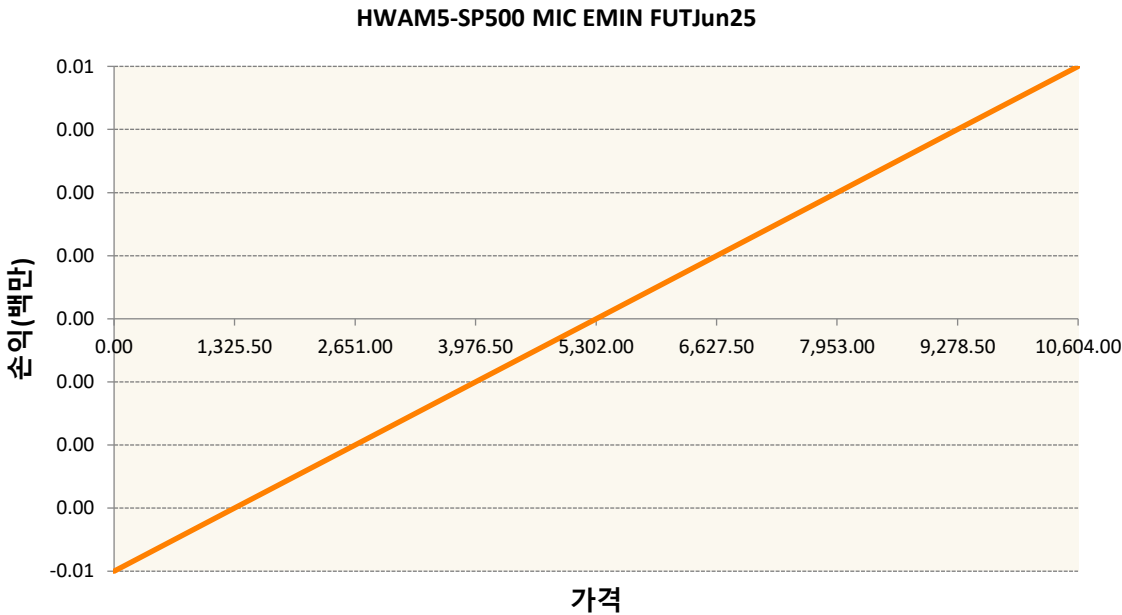
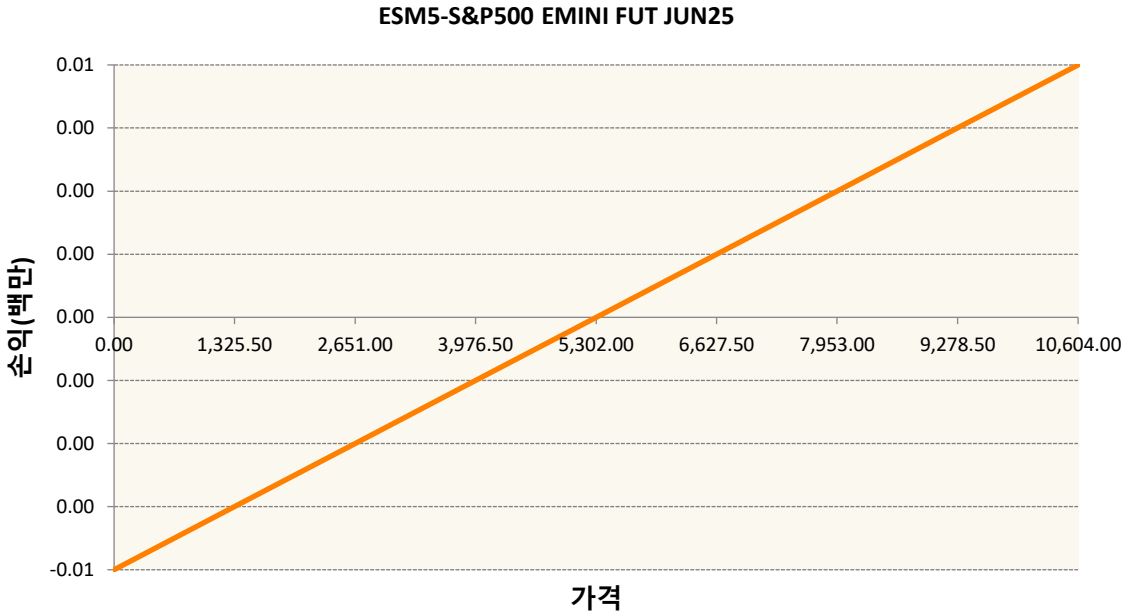
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	25,545	0	25,545	
누계	유가증권	선물	1,122	0	1,122	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,044
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	90

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,820

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

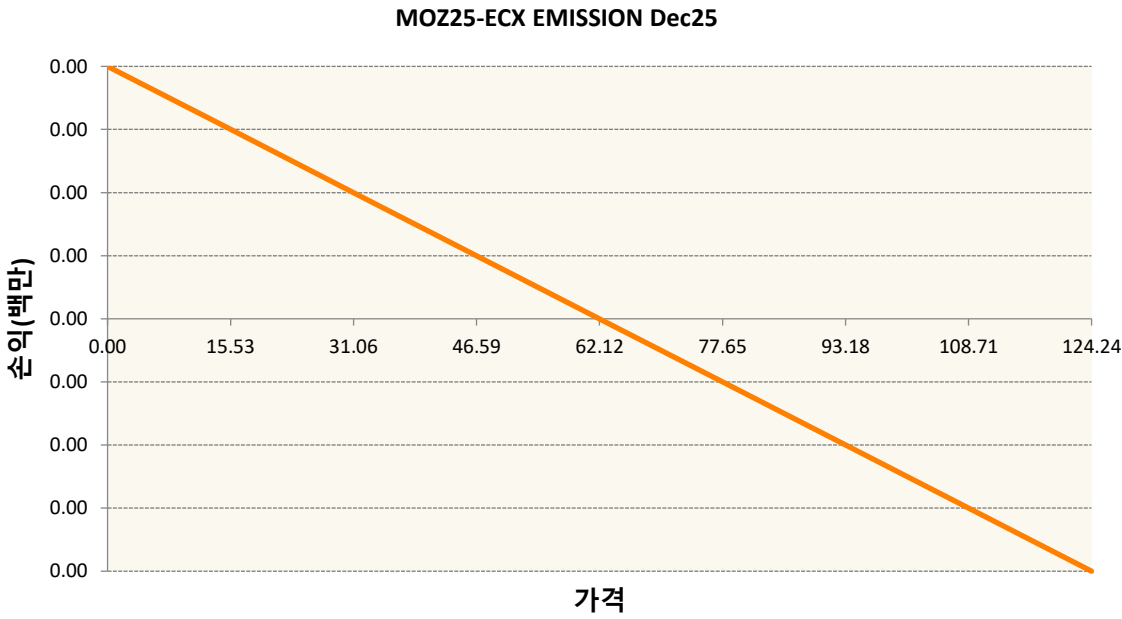
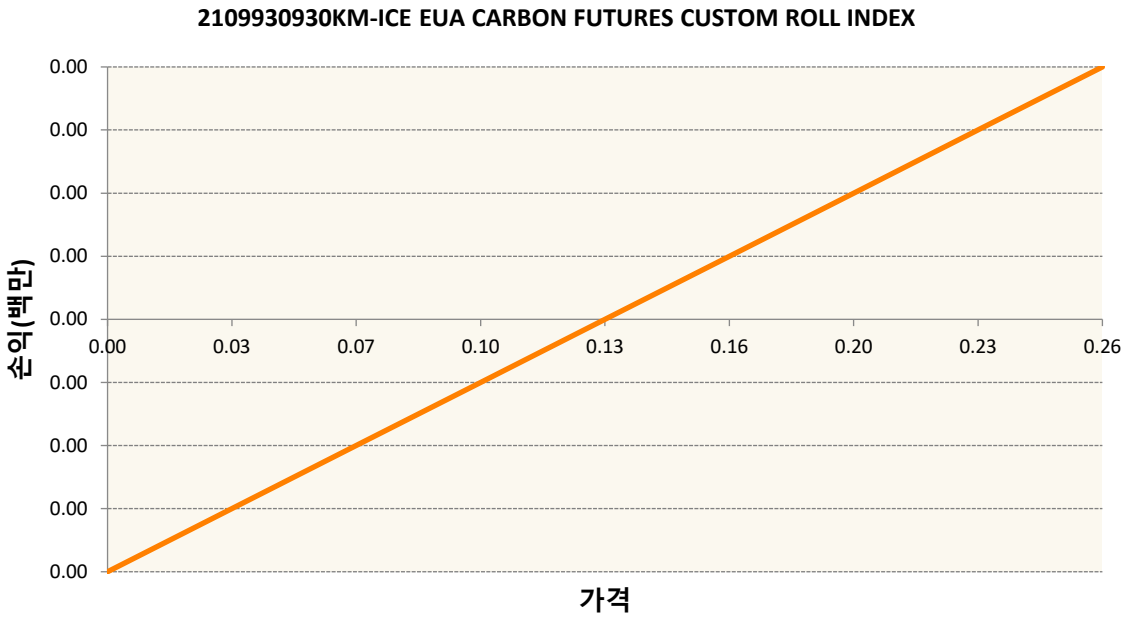
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	49	8,165	-8,116	
누계	통화	선도	0	1,176	-1,176	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	653

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

1,205

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

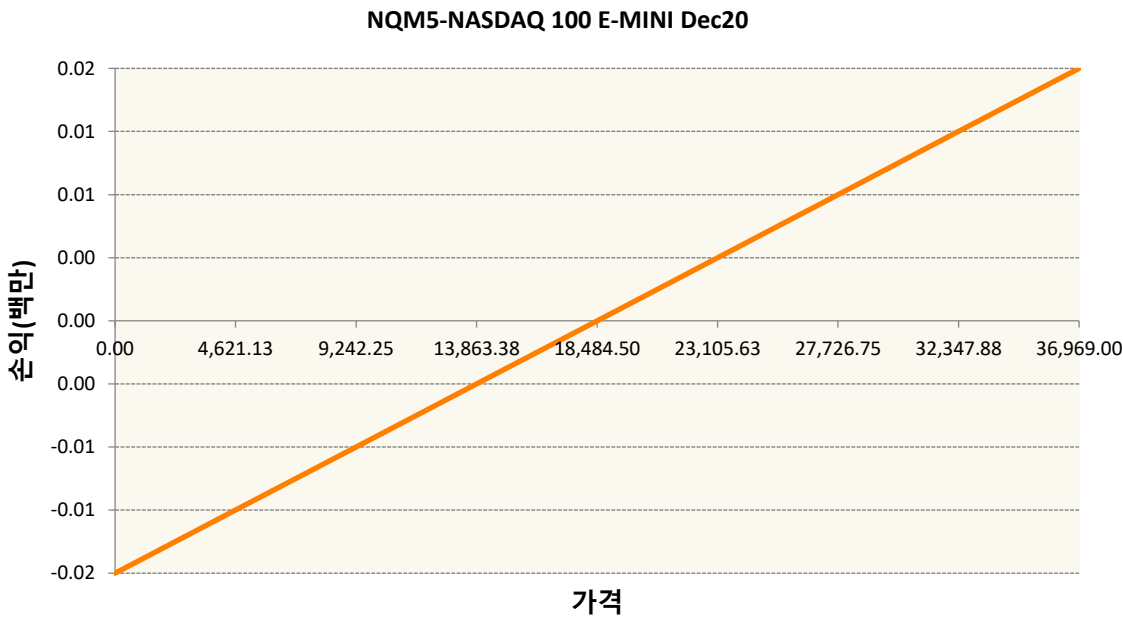
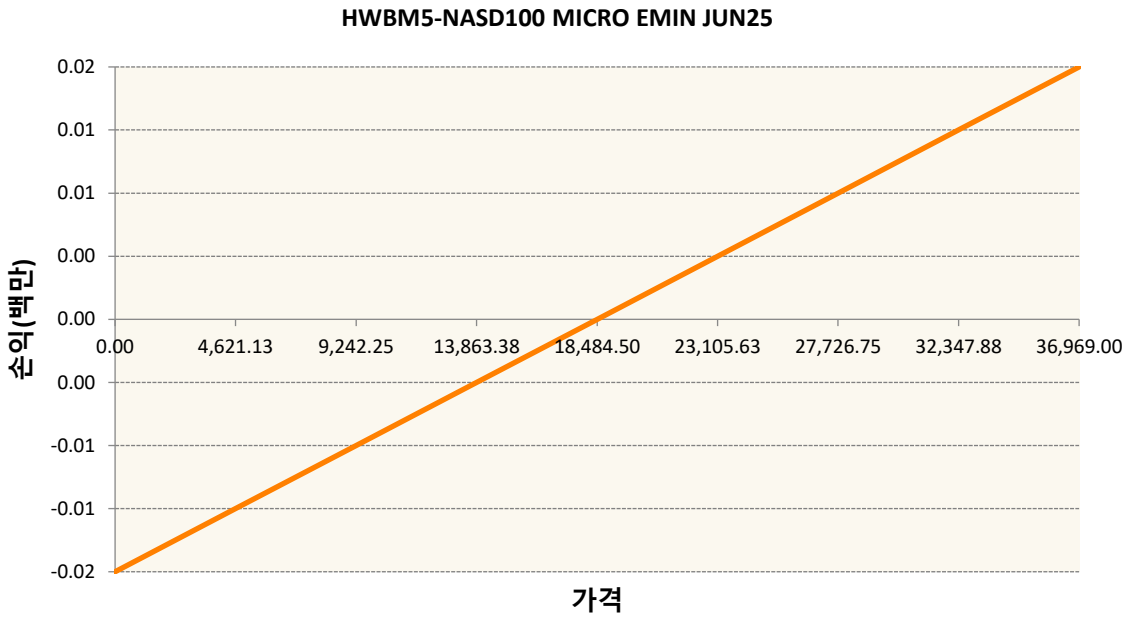
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	11,867	0	11,867	
누계	유가증권	선물	487	0	487	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		39
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		949

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,096

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

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	704
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,055
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,572
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,176

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

(단위:백만원)

9,313

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

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	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4

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

(단위:백만원)

20

공시일	2025-04-14
기준일	2025-04-11

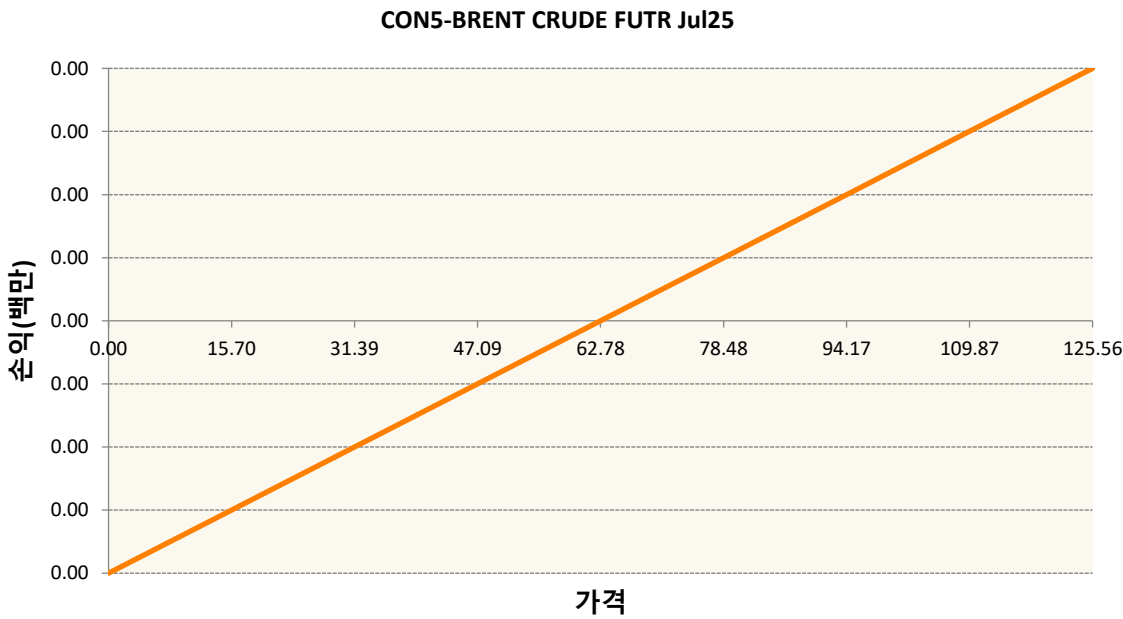
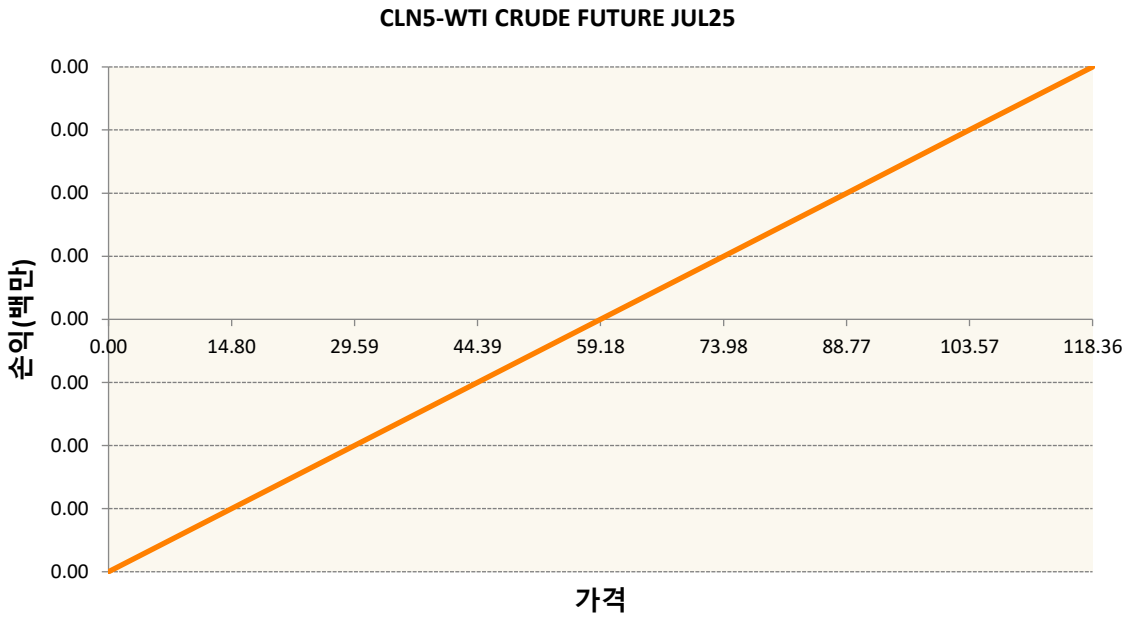
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

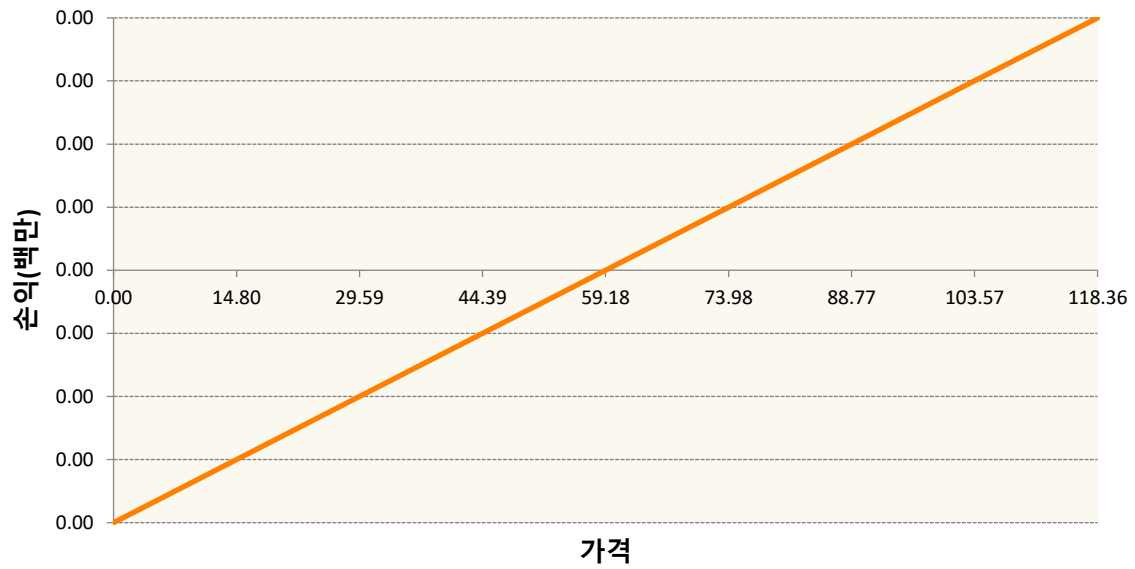
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	15	0	15	장내
누계	유가증권	선물	635	0	635	
누계	통화	선물	0	87	-87	장내

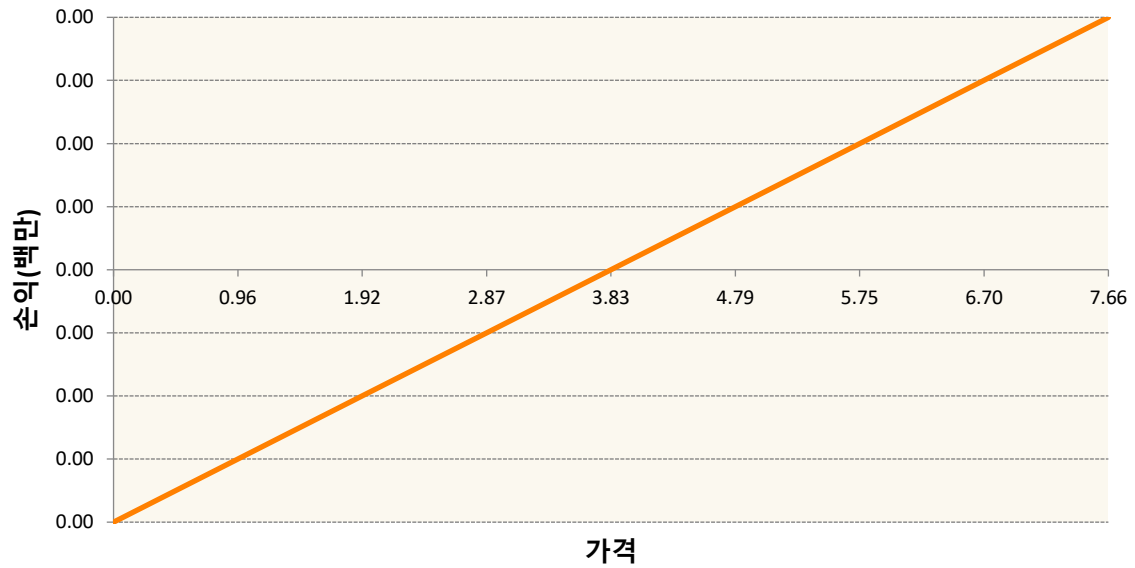
2. 만기시점의 손익구조



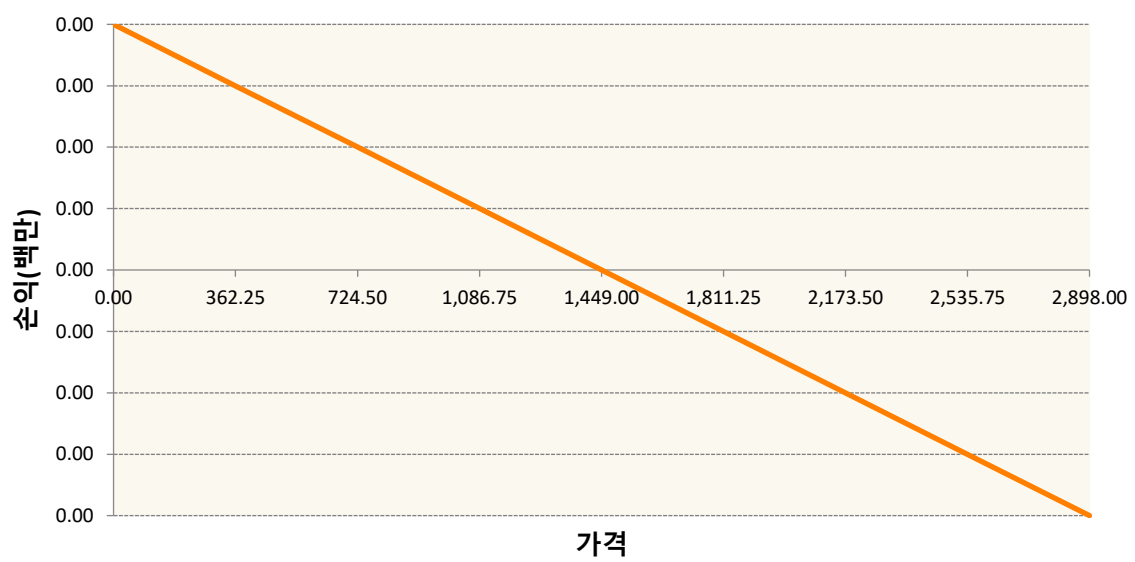
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25

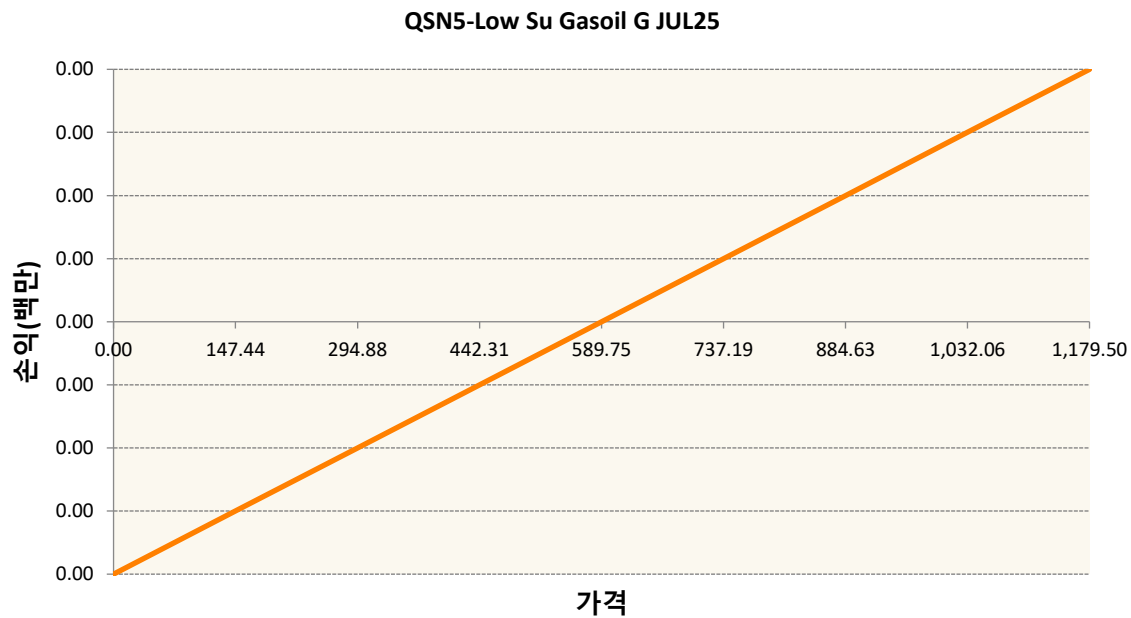
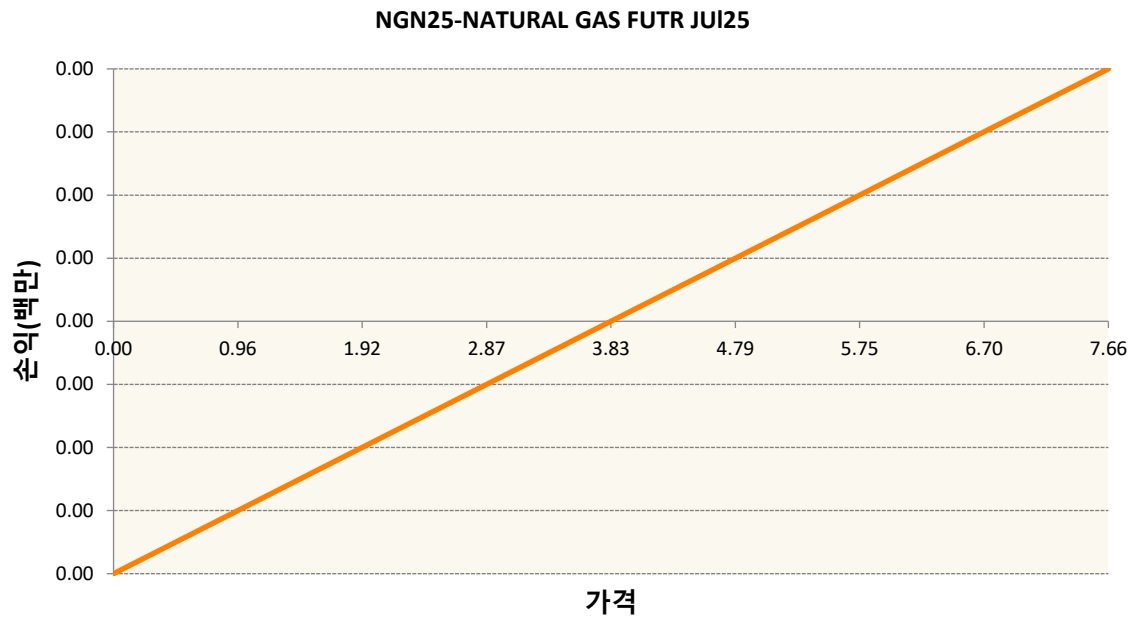


EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



KR4175W40006-2025-04 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLN5	WTI CRUDE FUTURE JUL25		7
CON5	BRENT CRUDE FUTR Jul25		15
ECN5	E-mini Crude Oil JUL25		3
EON5	E-MINI NATURAL GAS JUL25		6
KR4175W40	(2025-04 달러선물		7
NGN25	NATURAL GAS FUTR JUL25		13
QSN5	Low Su Gasoil G JUL25		7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	120