

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

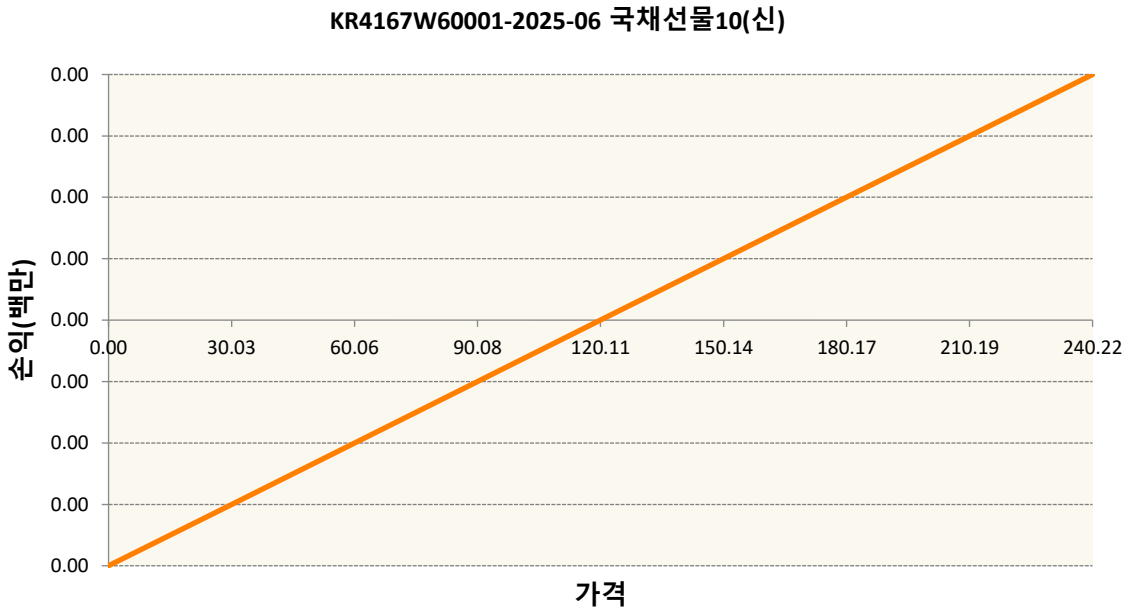
베스트장기채(채권-파생형)

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	158,545	0	158,545	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,596

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

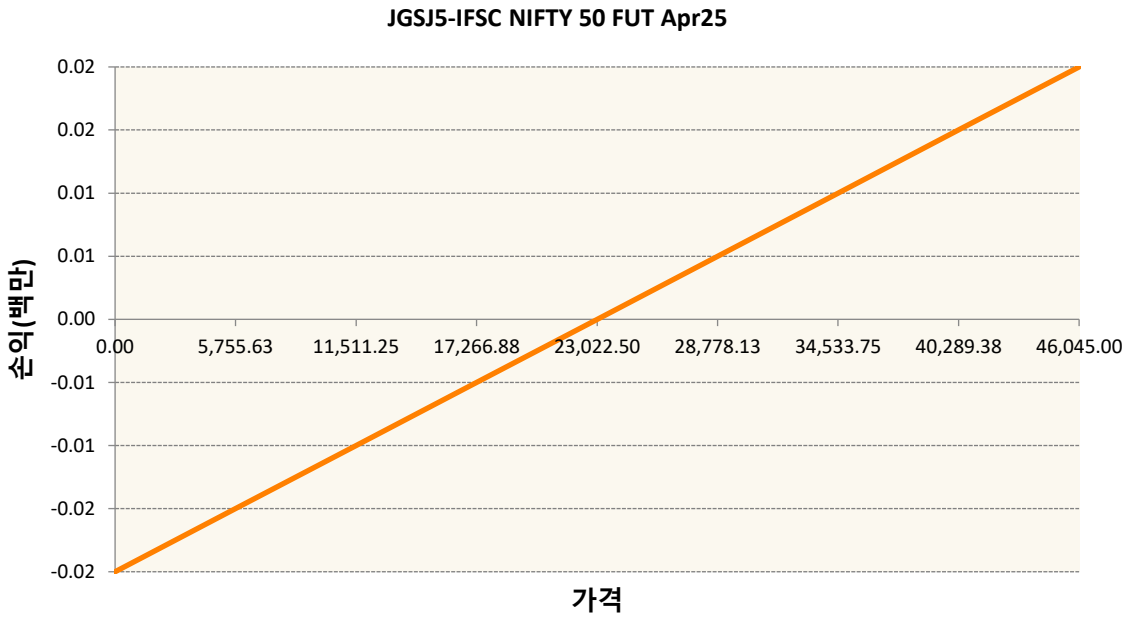
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	743	0	743	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ5	IFSC NIFTY 50 FUT Apr25	59
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

43

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

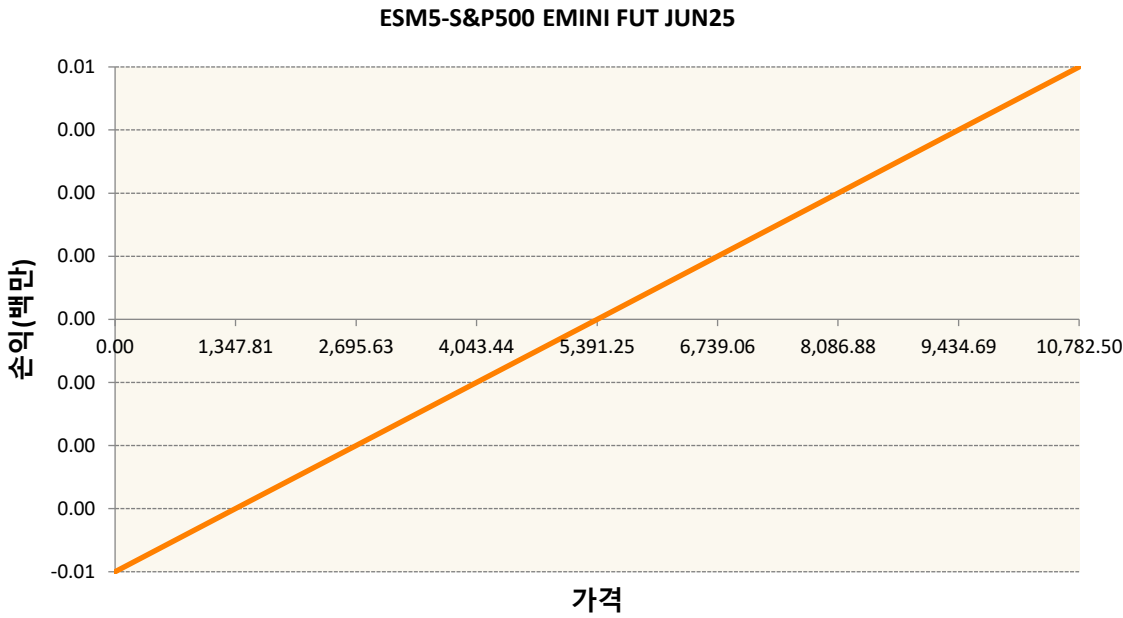
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	395	0	395	

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)

27

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

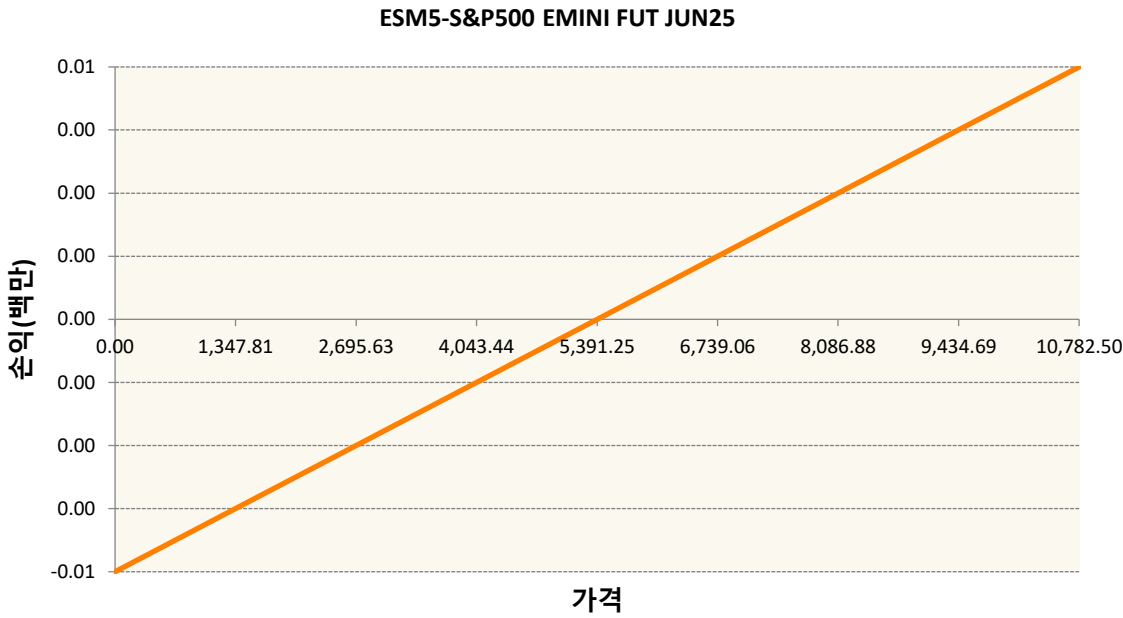
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,370	0	2,370	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5 S&P500 EMINI FUT JUN25

190

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

(단위:백만원)

162

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

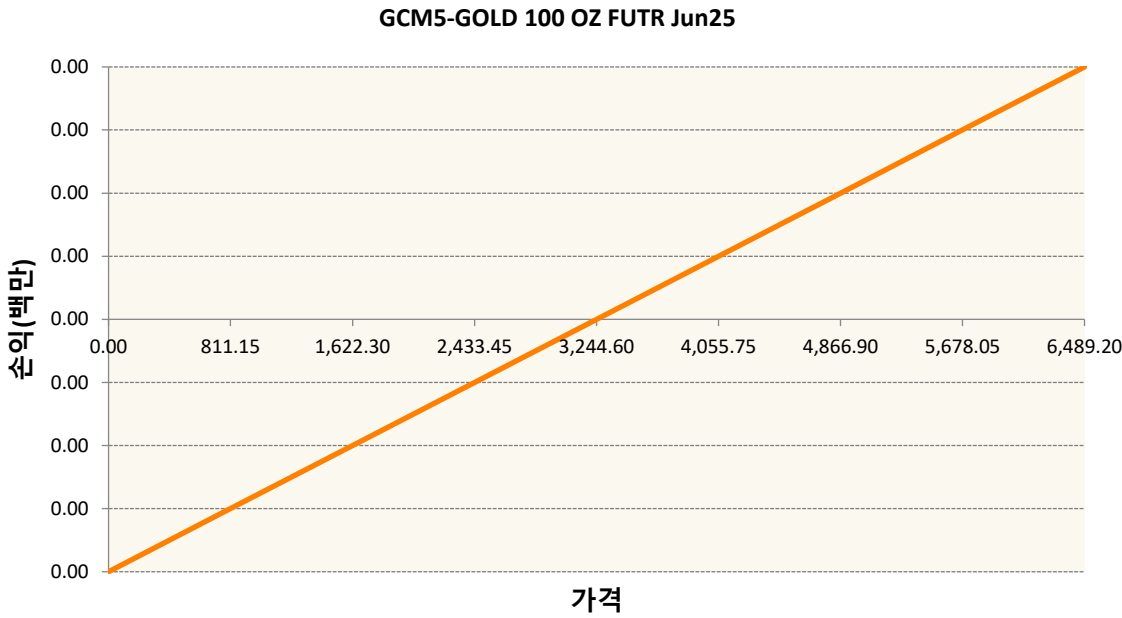
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,379	0	2,379	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 04/17/25 C295 EQUITY	3
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	190

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

(단위:백만원)

147

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

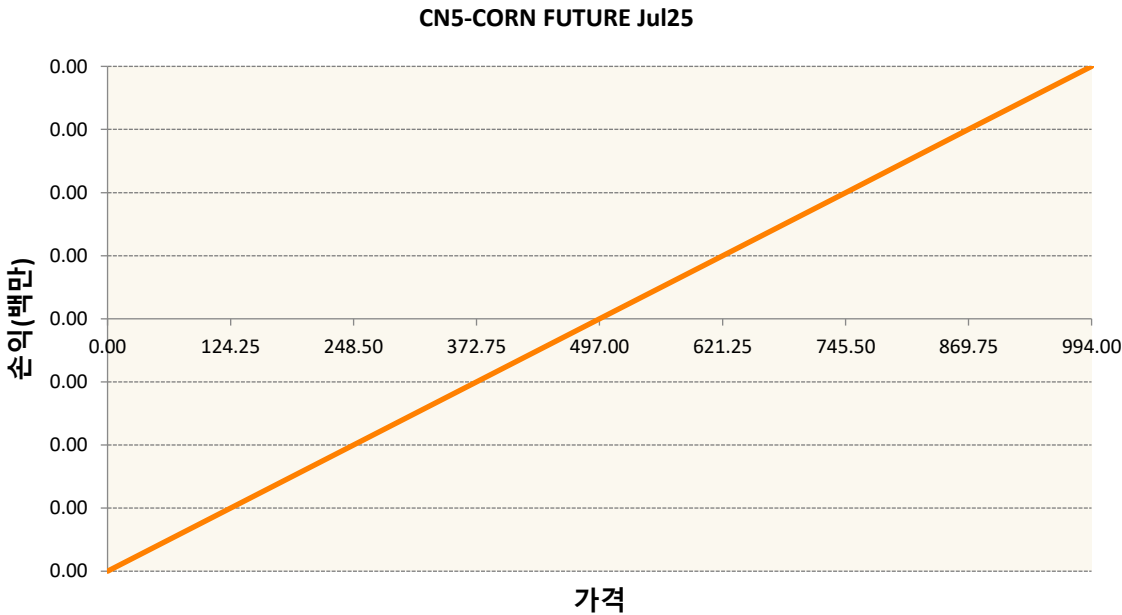
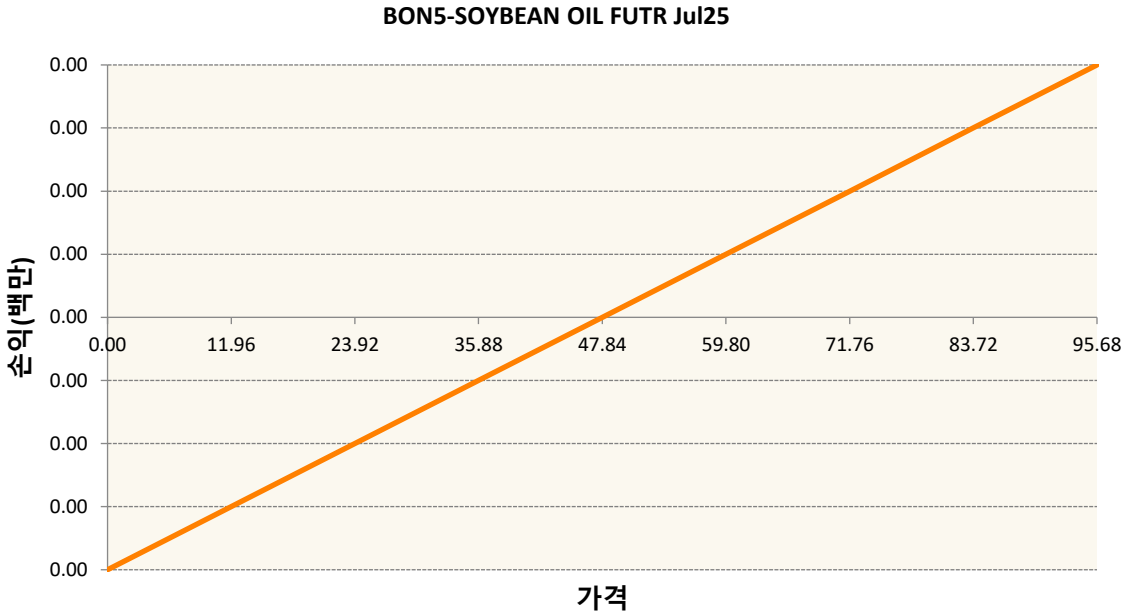
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

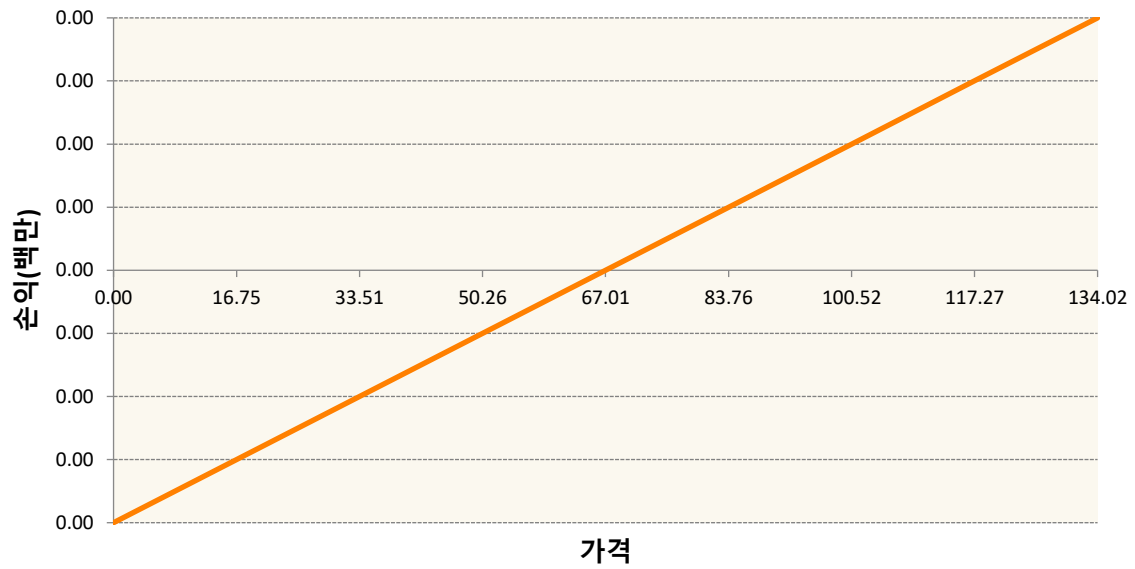
(단위:USD 백만)

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	3,810	0	3,810	
누계	통화	선물	0	285	-285	장내

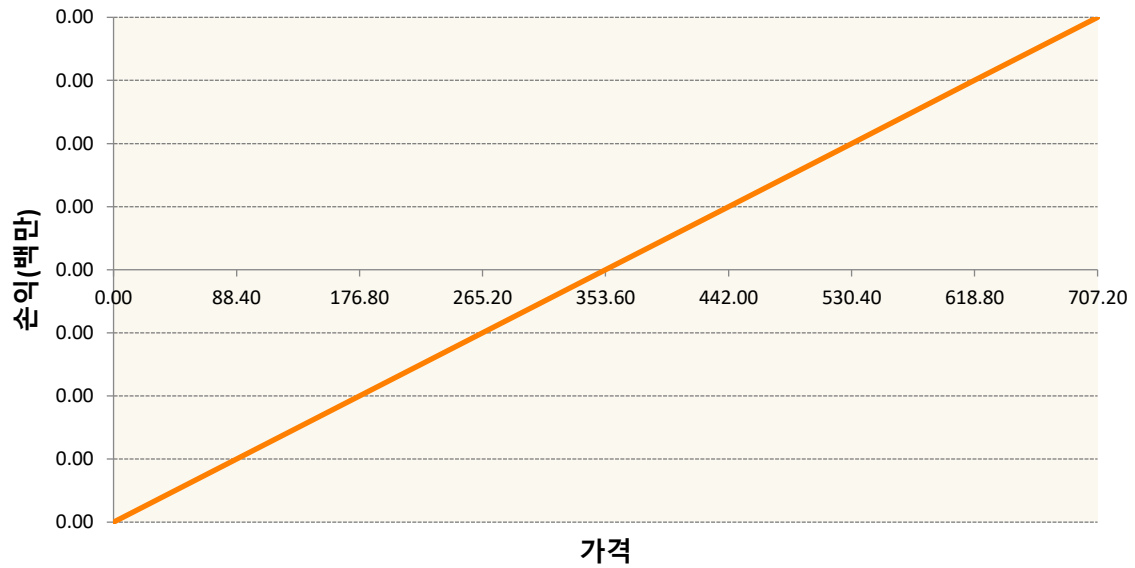
2. 만기시점의 손익구조



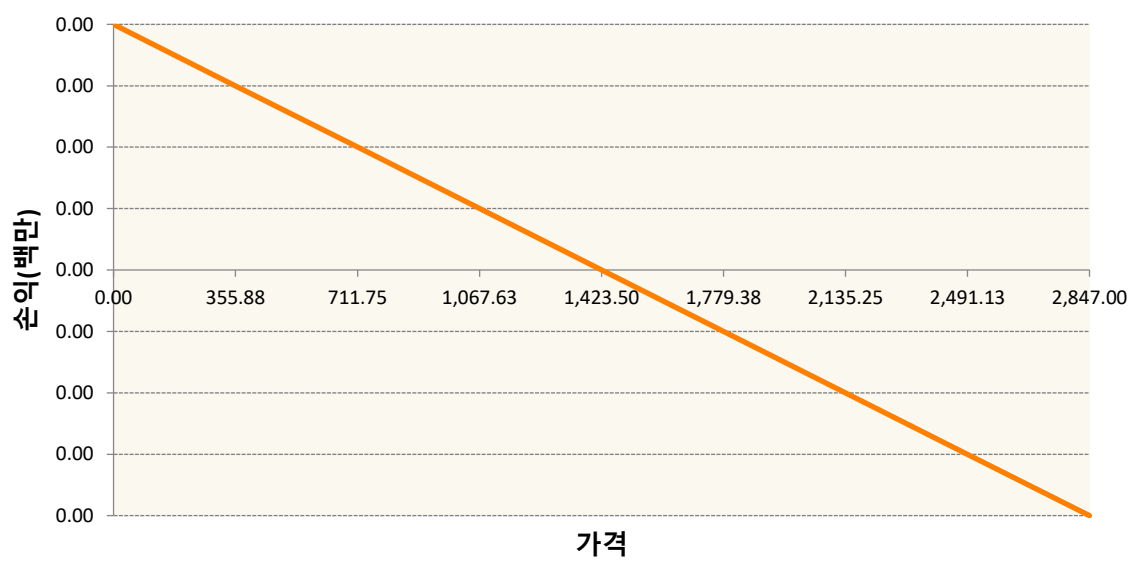
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



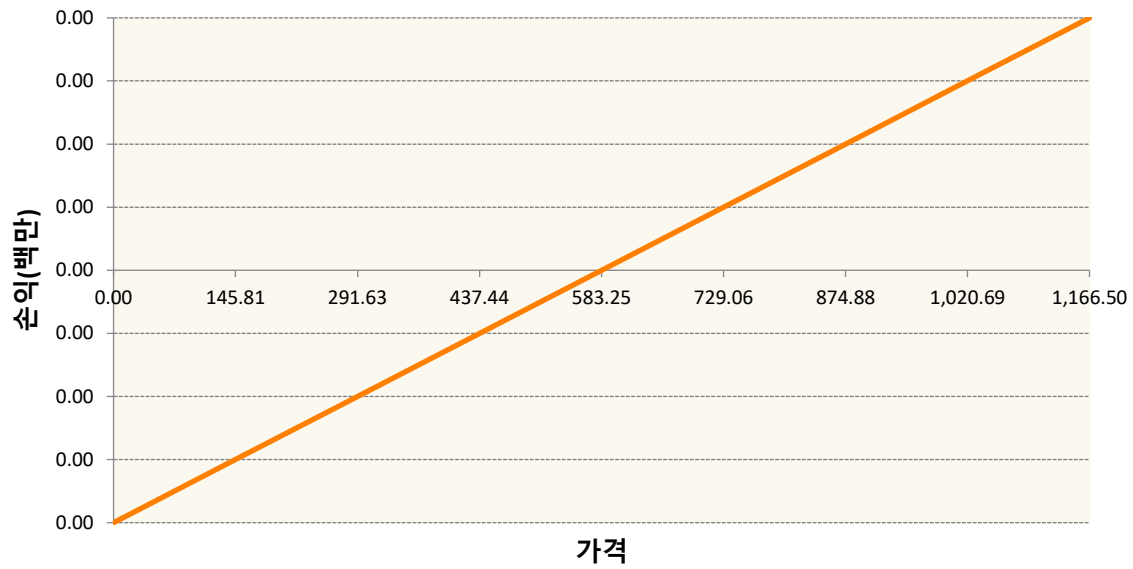
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



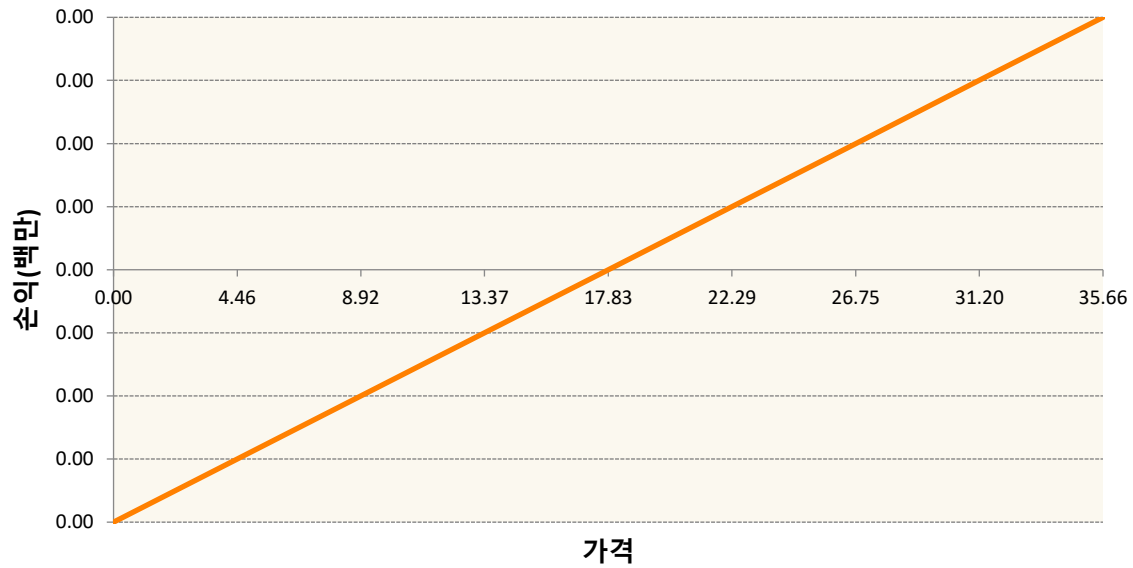
KR4175W40006-2025-04 달러선물



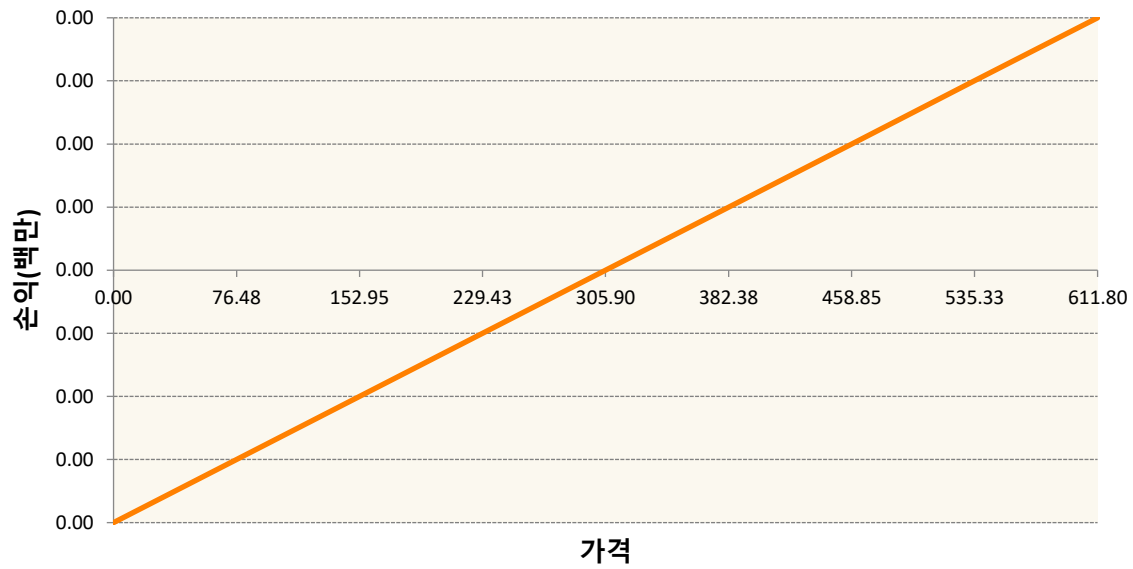
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25

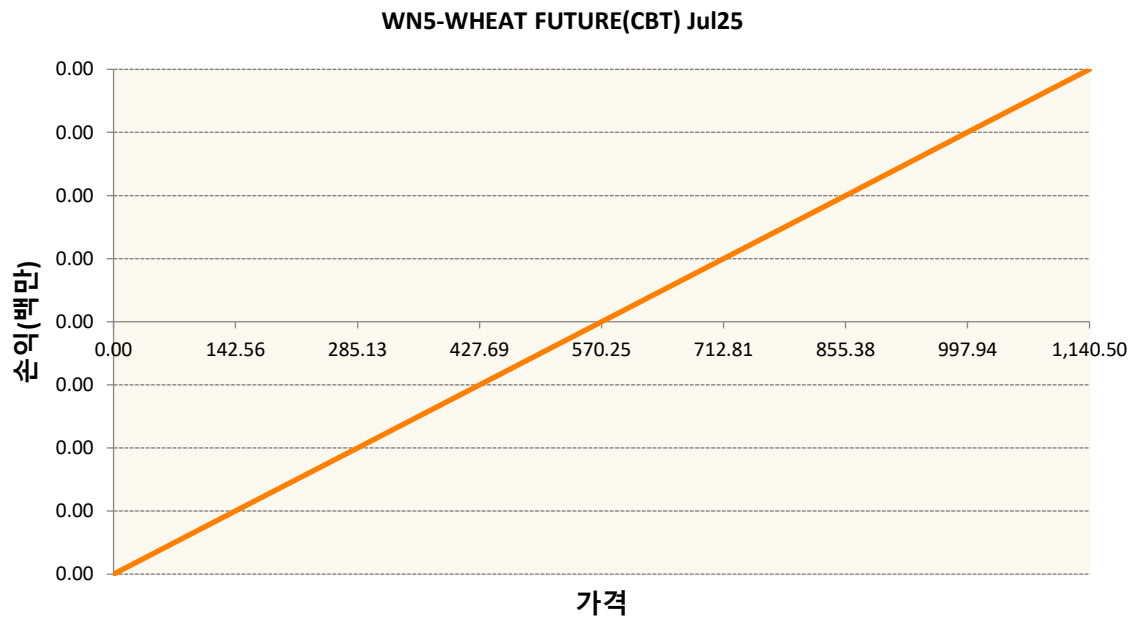
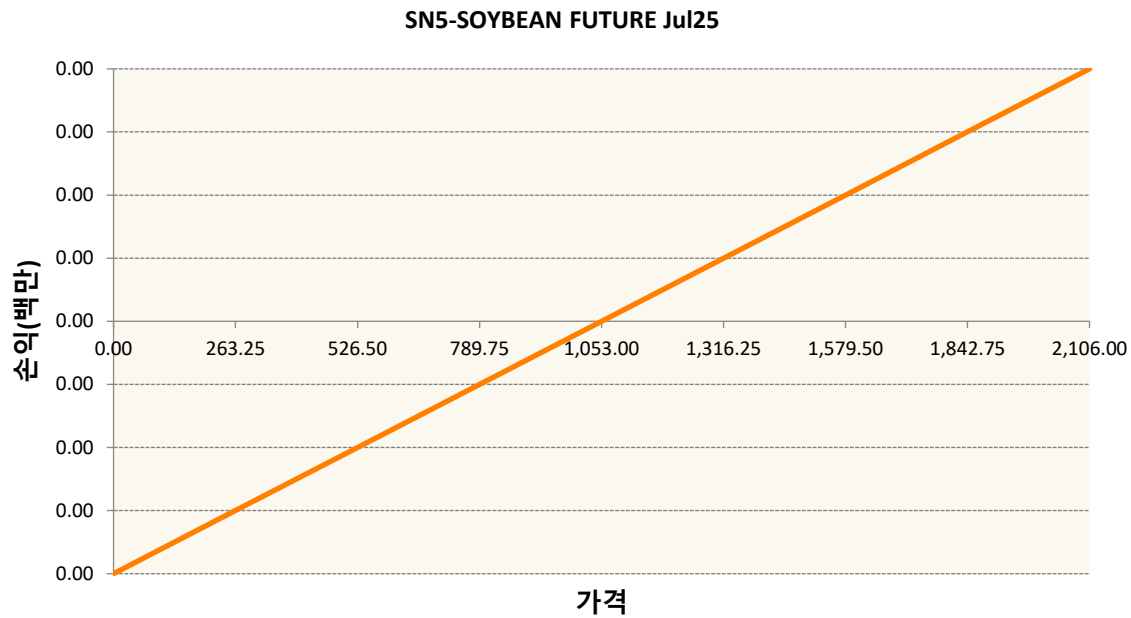


SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



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	2025-04-15
기준일	2025-04-14

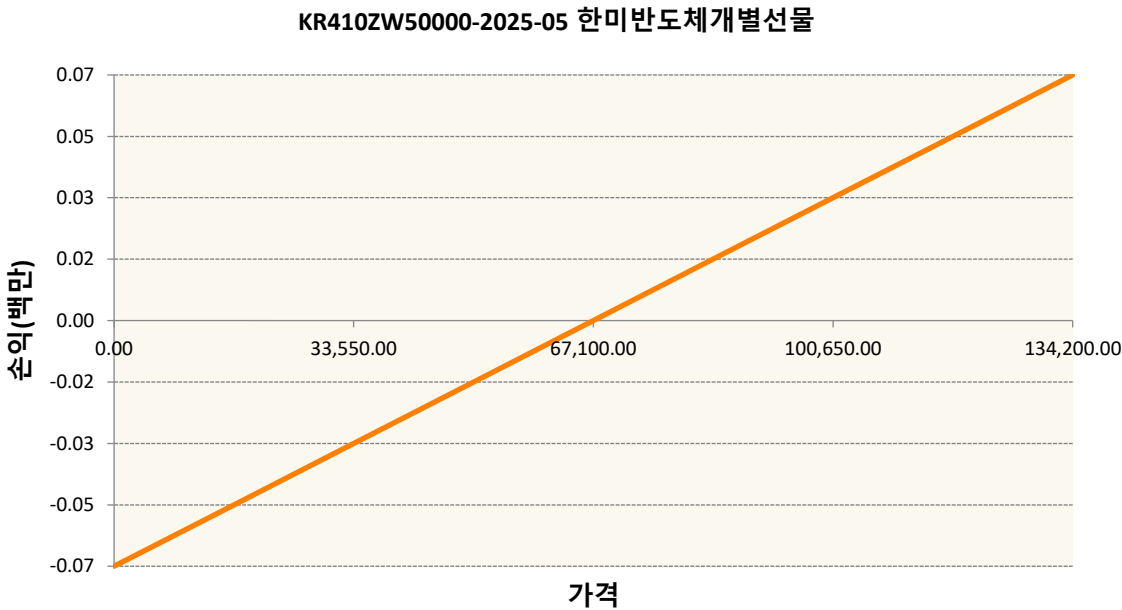
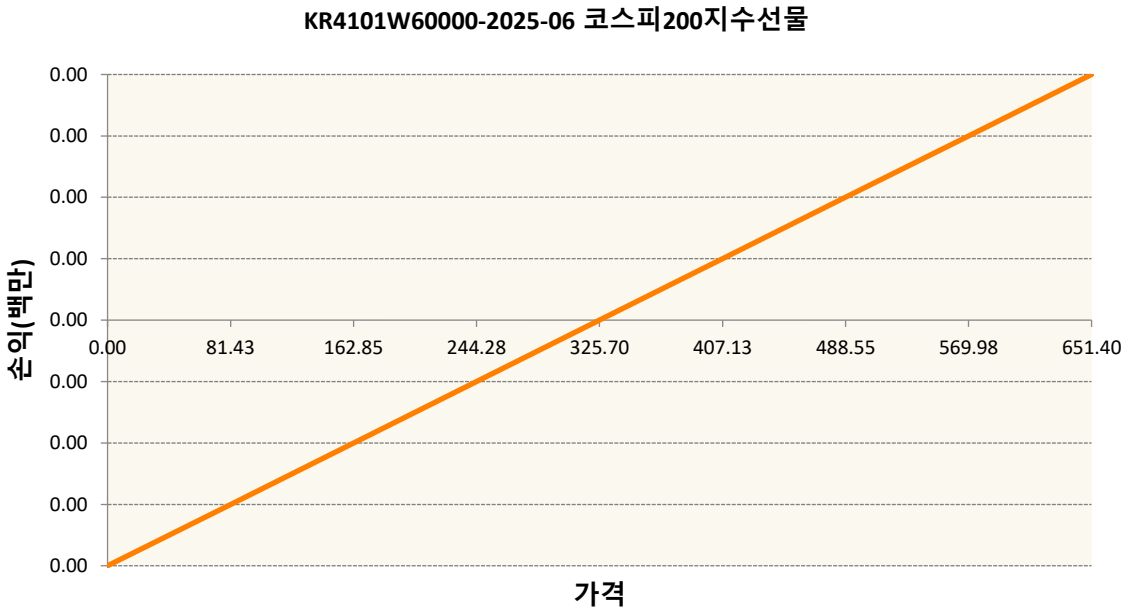
스마트인덱스모

1. 계약금액

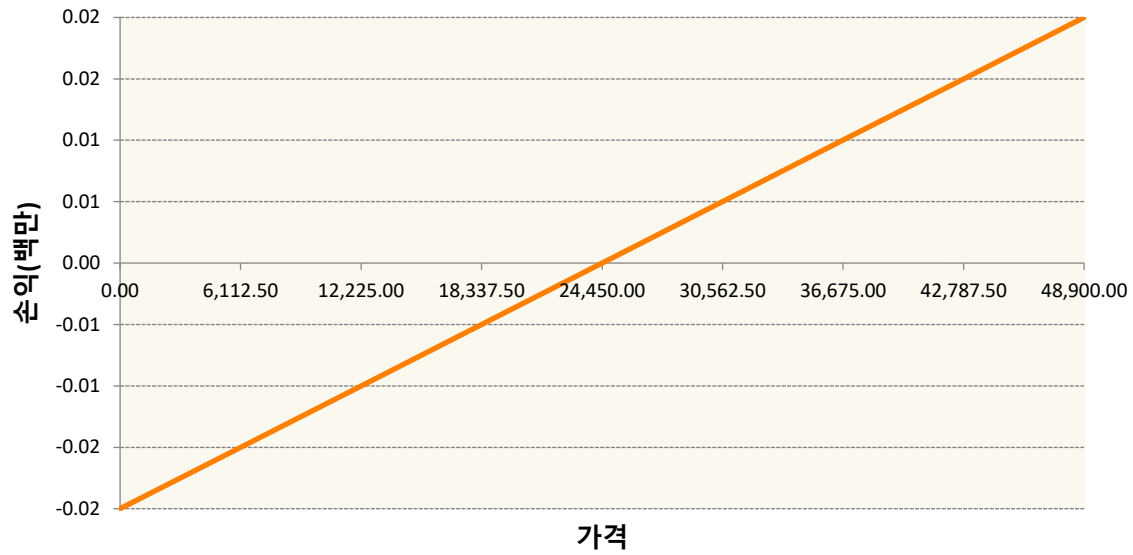
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	18	0	18	장내
누계	유가증권	선물	1,700	0	1,700	장내

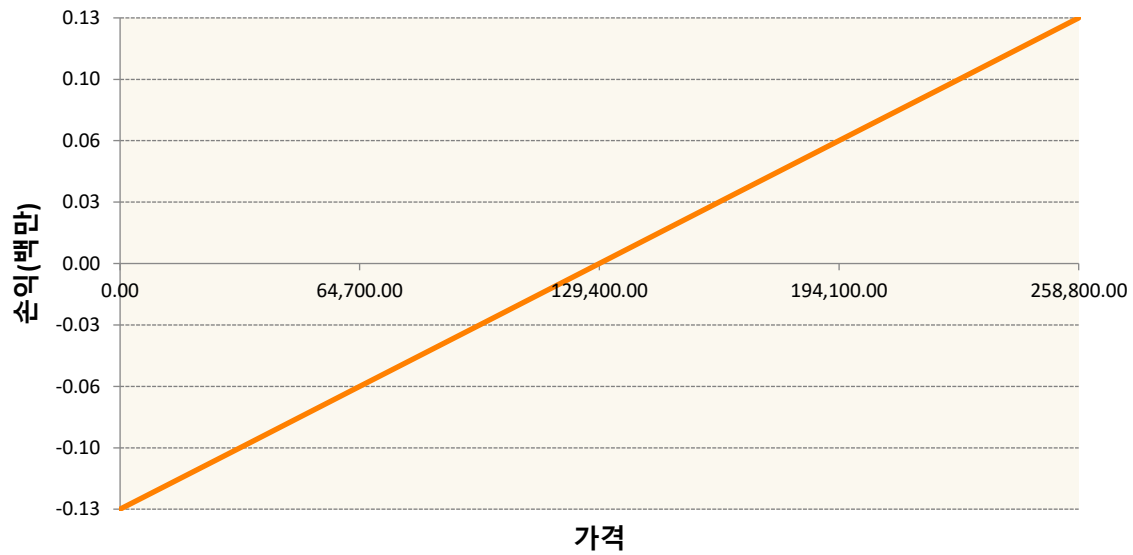
2. 만기시점의 손익구조



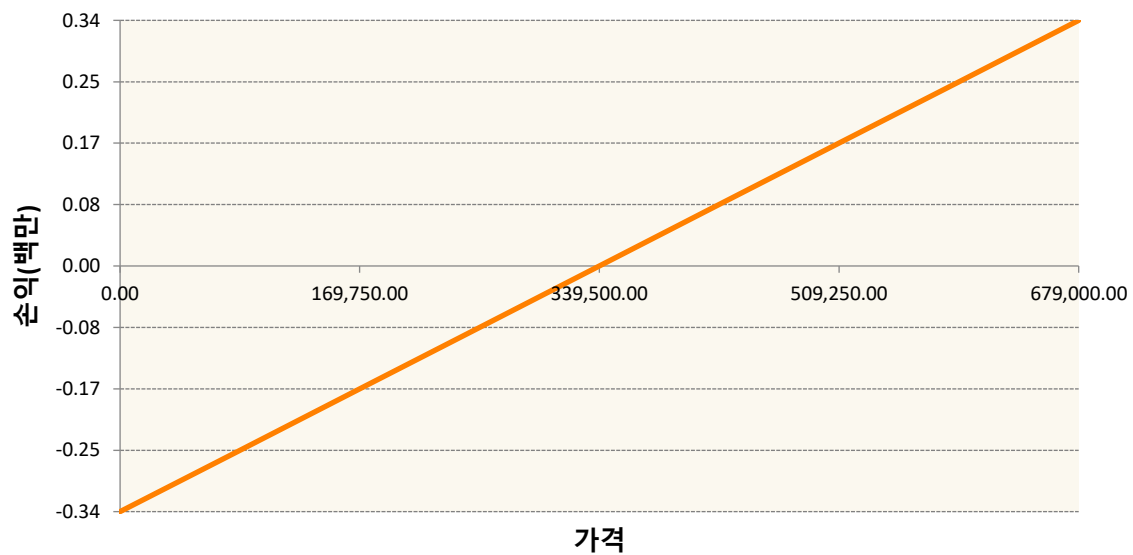
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



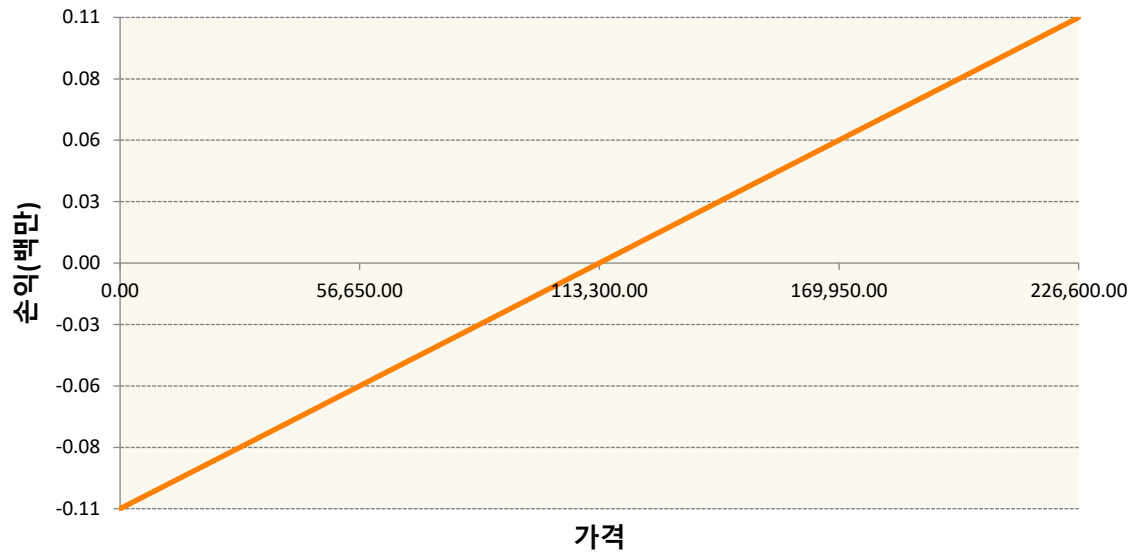
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물

111
3
1
4
14
2

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

(단위:백만원)

217

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

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	281
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

461

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

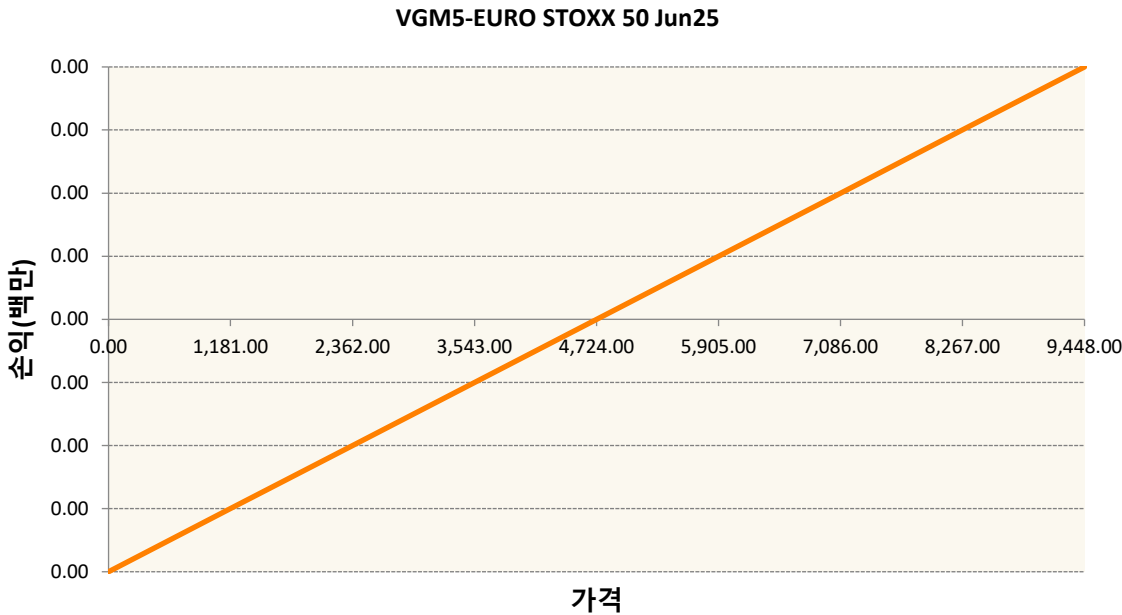
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	751	0	751	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	60
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

48

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

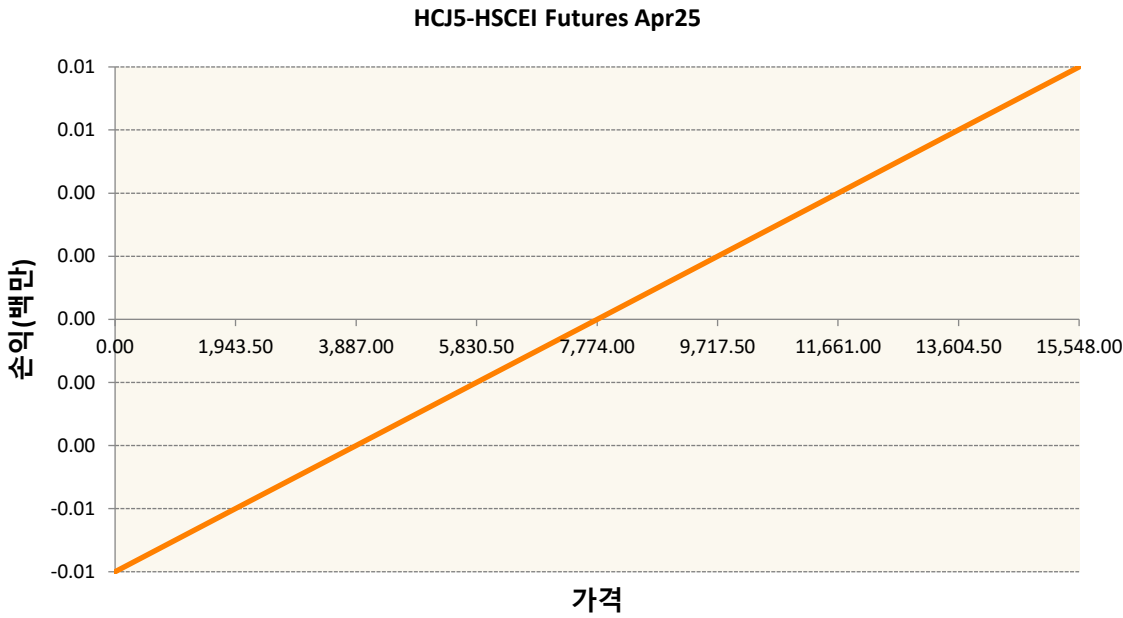
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	3,381	0	3,381	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI5	HSCEI Futures Apr25	271
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

405

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

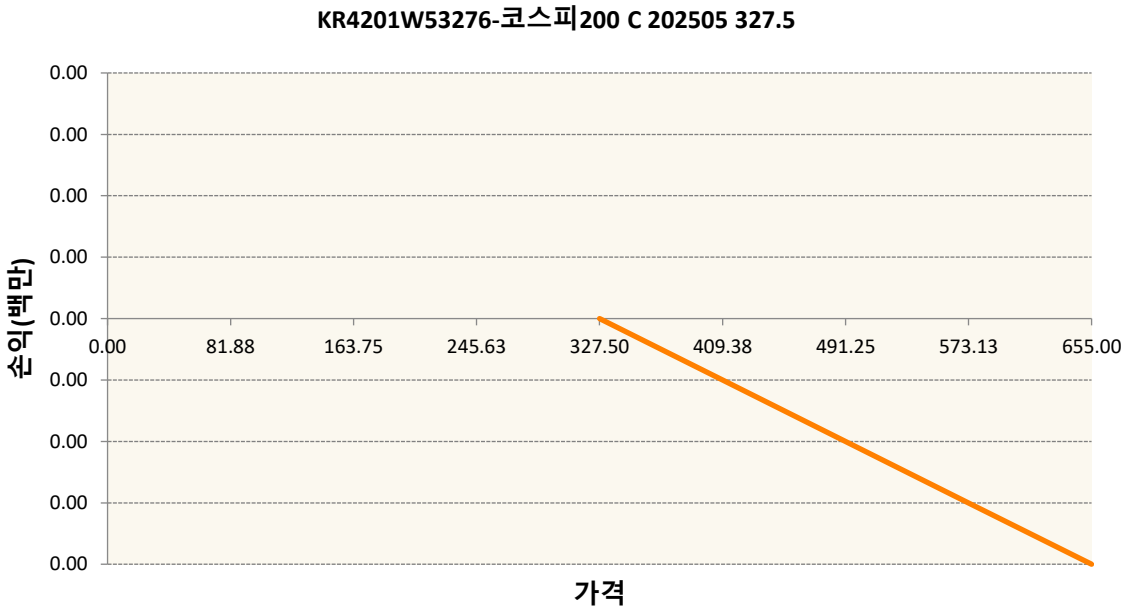
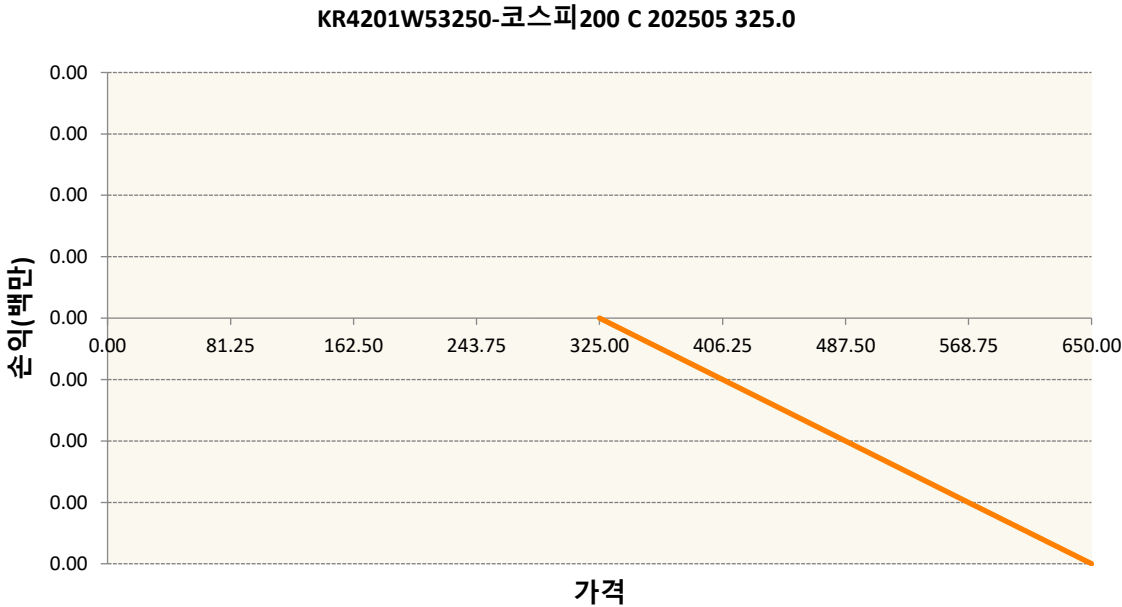
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	238	0	238	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,921	-35,921	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		1,733
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	707	691	672	648	621	591	559	
-5.33%	643	609	573	533	491	447	401	
-2.67%	483	431	378	324	270	215	159	
0%	179	119	60	0	-60	-119	-179	
2.67%	-284	-337	-390	-445	-501	-557	-614	
5.33%	-879	-915	-954	-997	-1,042	-1,088	-1,137	
8.00%	-1,558	-1,577	-1,601	-1,629	-1,661	-1,695	-1,733	
KR4201W53276						코스피200 C 202505 327.5		53
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20	19	19	18	17	17	16
-5.33%	18	17	16	15	14	13	11
-2.67%	14	13	11	9	8	6	4
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	-8	-9	-11	-13	-15	-17	-19
5.33%	-26	-27	-28	-30	-31	-33	-35
8.00%	-47	-48	-48	-50	-51	-52	-53

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

(단위:백만원)

2,151

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

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	531	0	531	

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	2025-04-15
기준일	2025-04-14

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	4,275	0	4,275	

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	2025-04-15
기준일	2025-04-14

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	128	-128	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	12,293	0	12,293	
누계	통화	선도	356	12,318	-11,962	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E		207
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E		211
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E		342
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E		226
FXW213F43C USD/KRW 30-04-25E		9
FXW213F4EC USD/KRW 30-04-25E		19
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	472

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

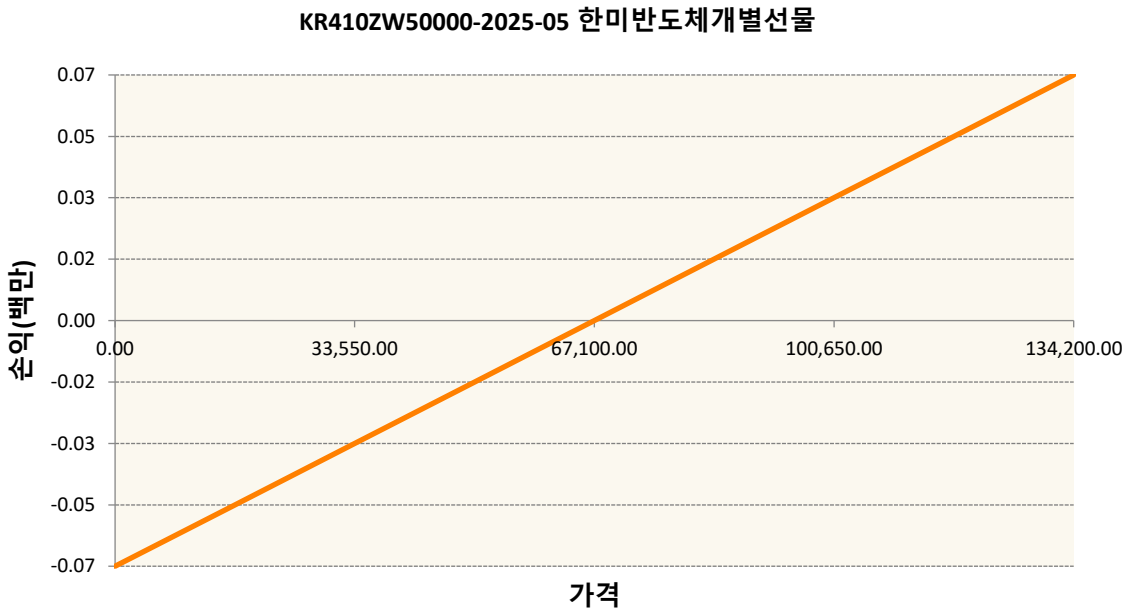
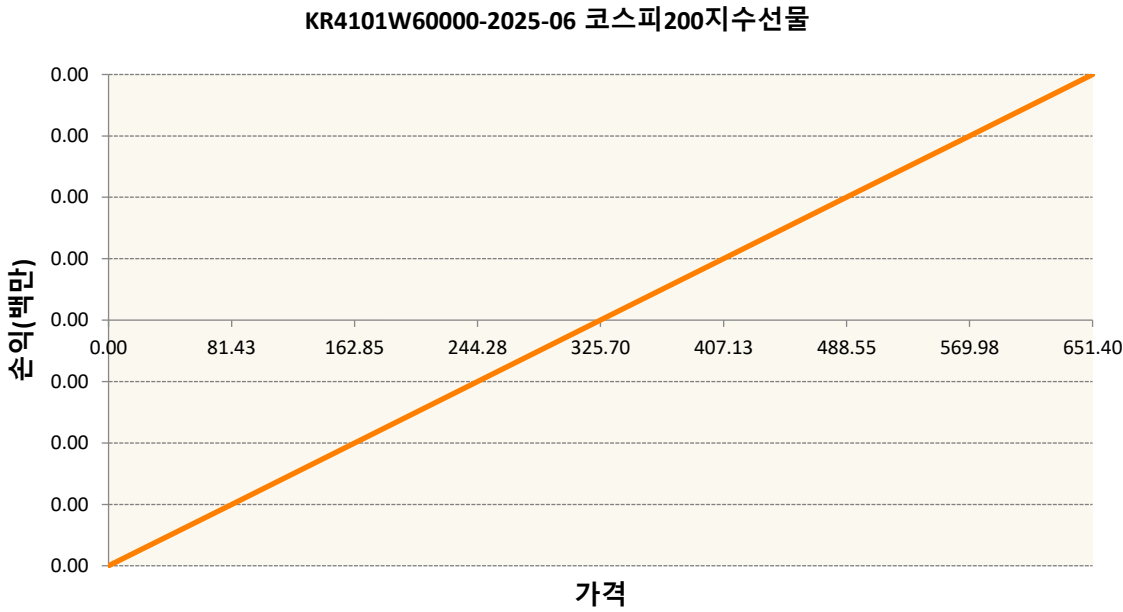
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

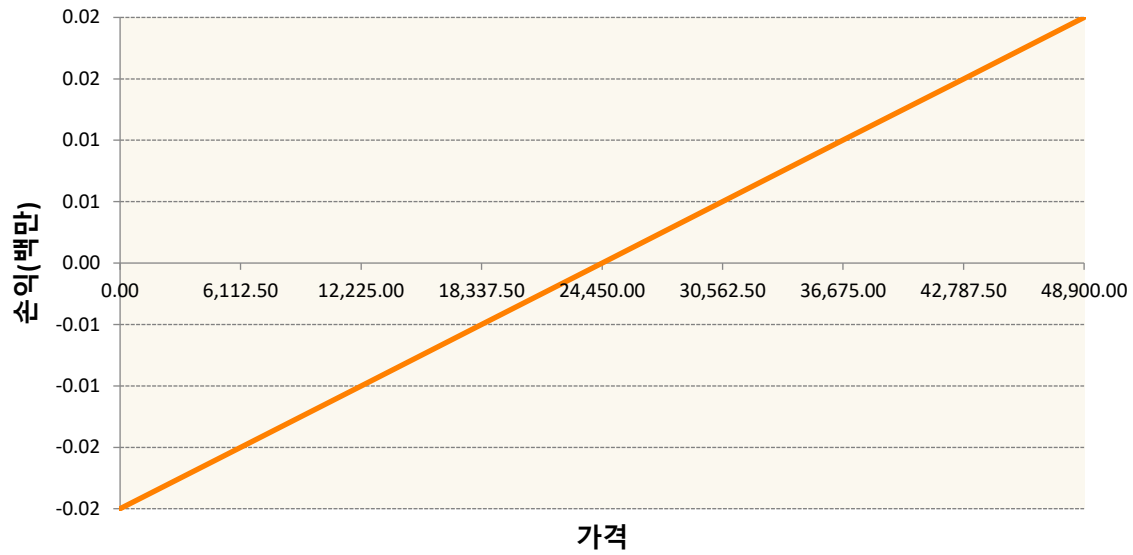
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	8	0	8	장내
누계	유가증권	선물	976	0	976	장내

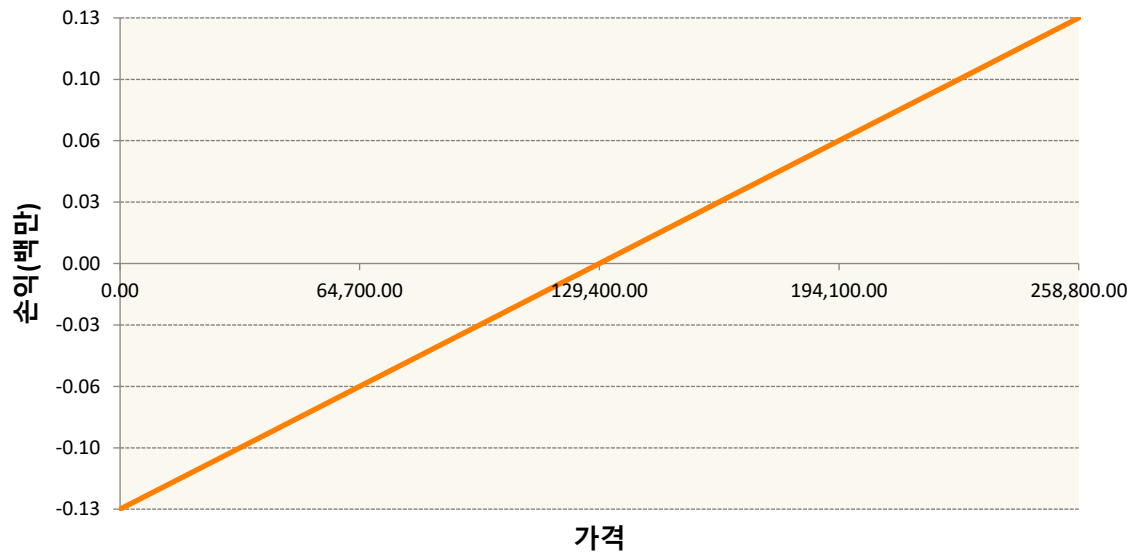
2. 만기시점의 손익구조



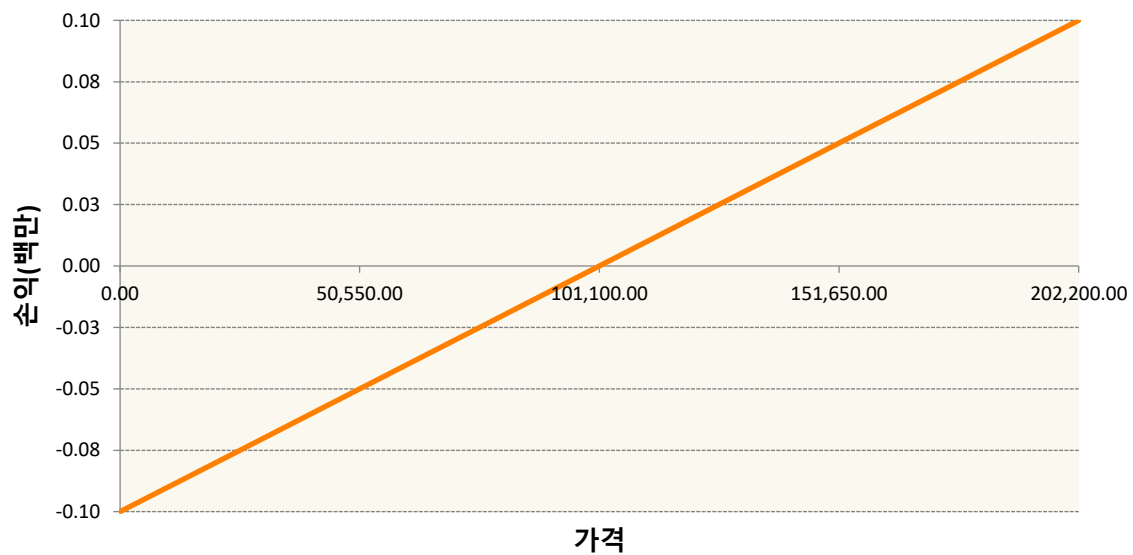
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



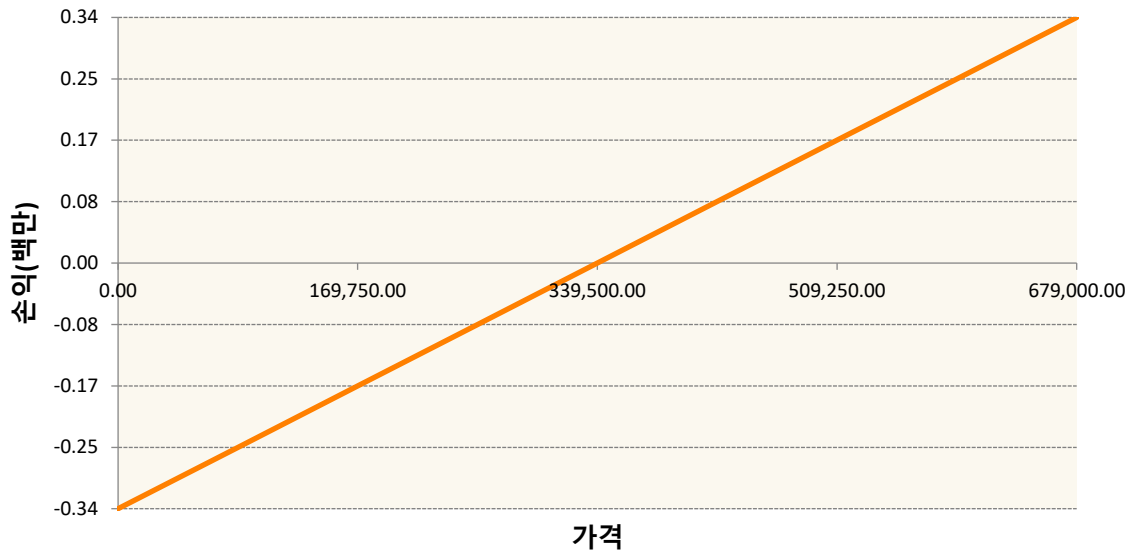
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



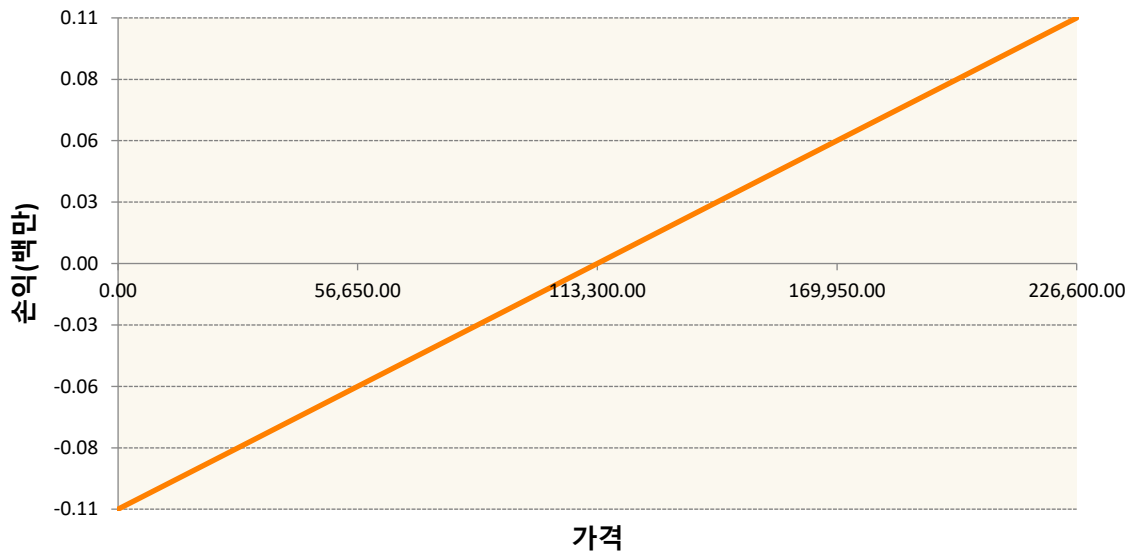
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	65
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	2
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물	1
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EYW50(2025-05 에코프로비엠개별선물	2
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물	6
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물	1

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

(단위:백만원)

124

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

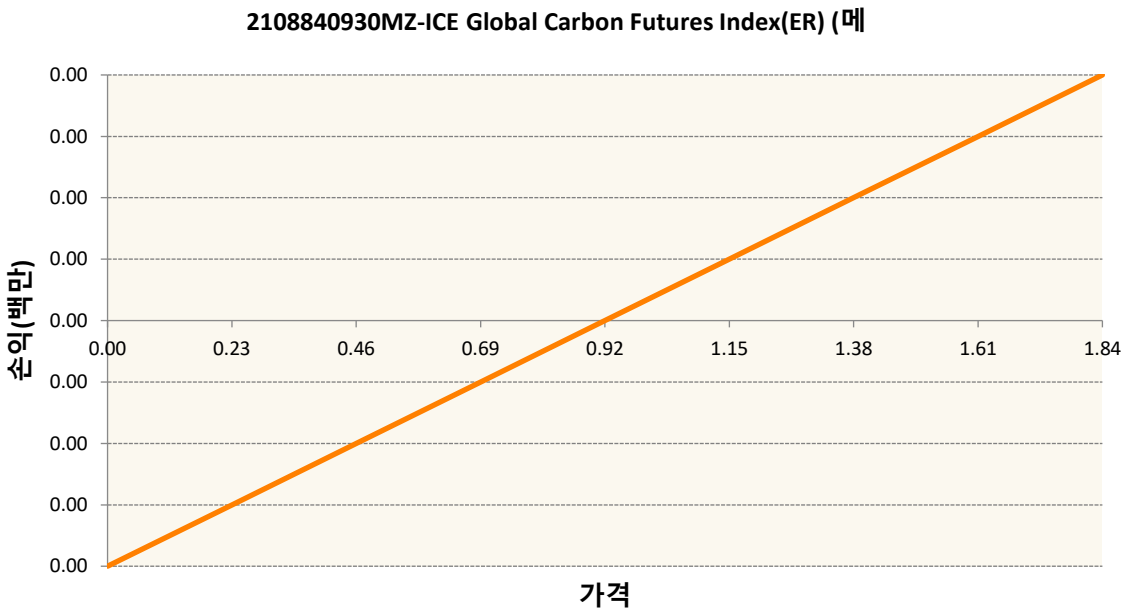
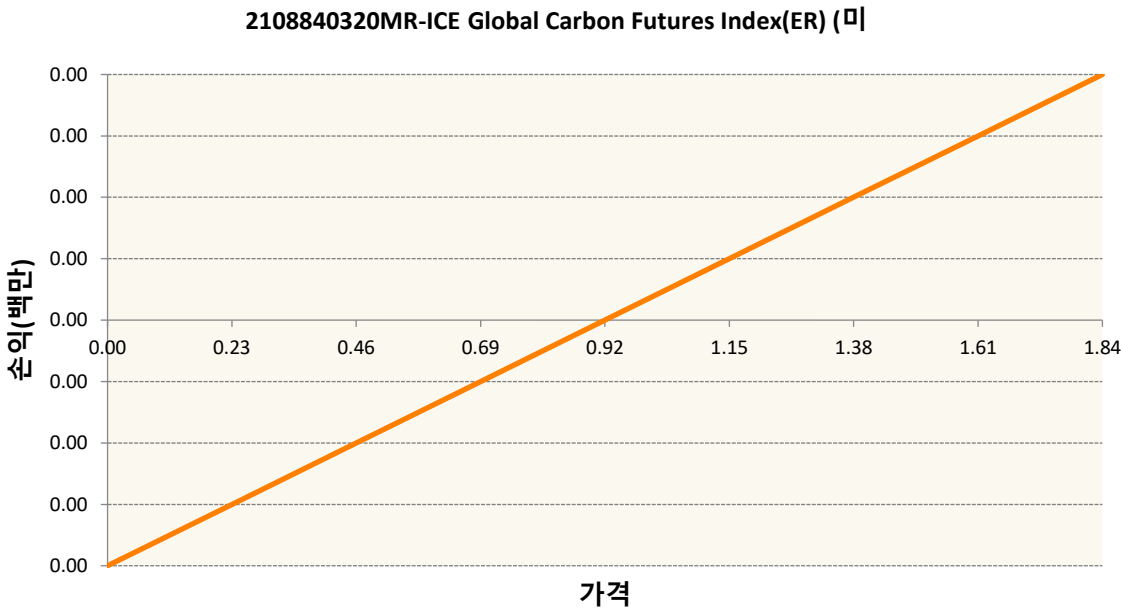
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	540
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	181

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		841

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

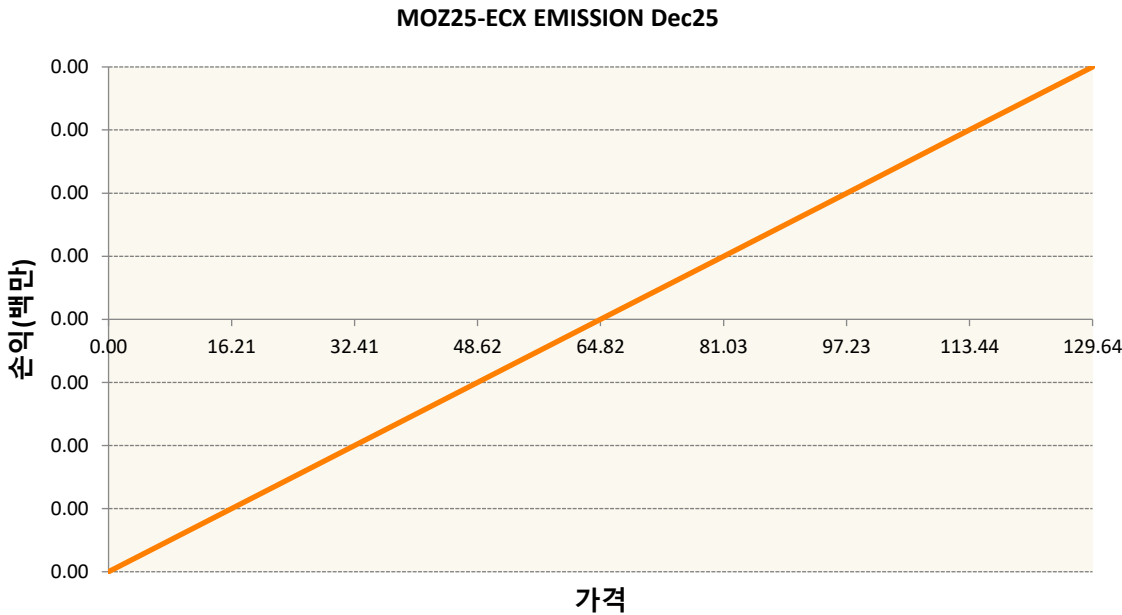
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,806	0	5,806	
누계	통화	선도	0	1,189	-1,189	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	3
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	14
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	81
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	467

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

(단위:백만원)

880

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

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)

113

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

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)	22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	5

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

(단위:백만원)

127

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

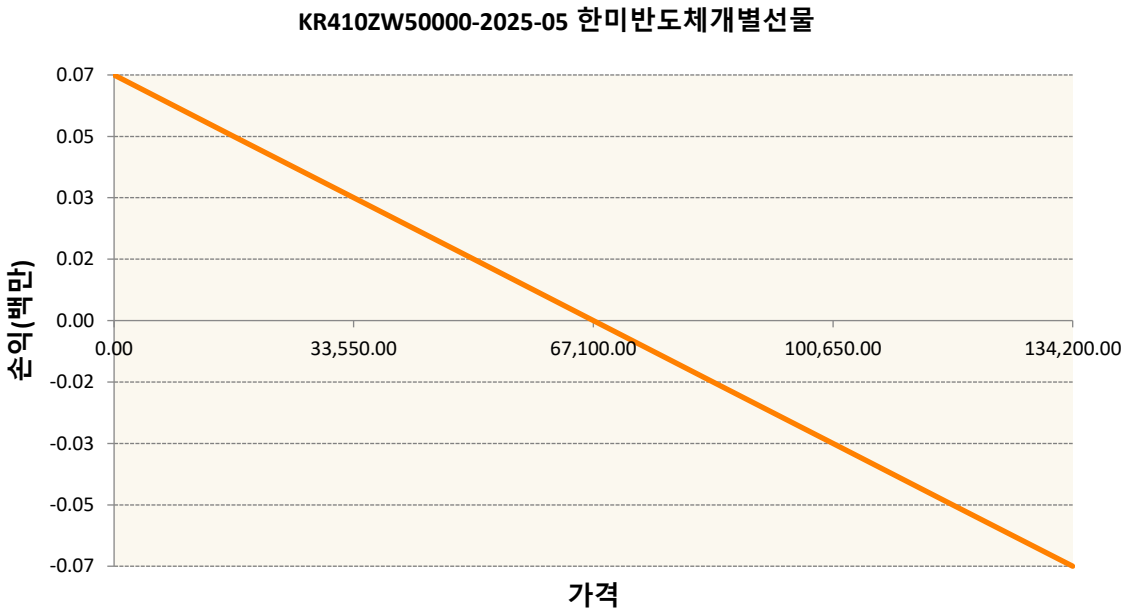
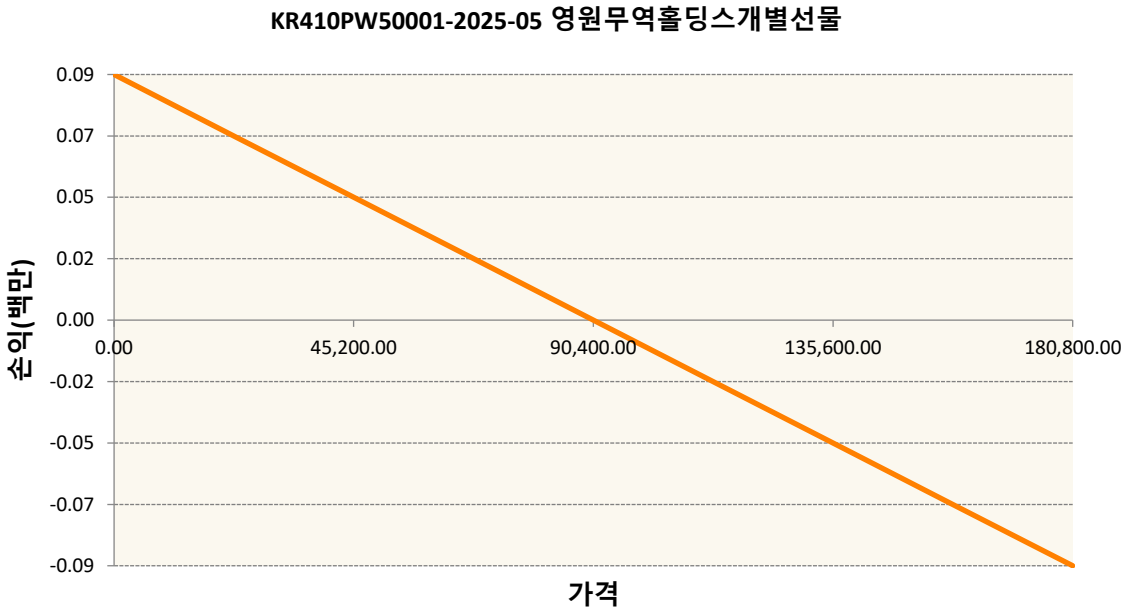
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

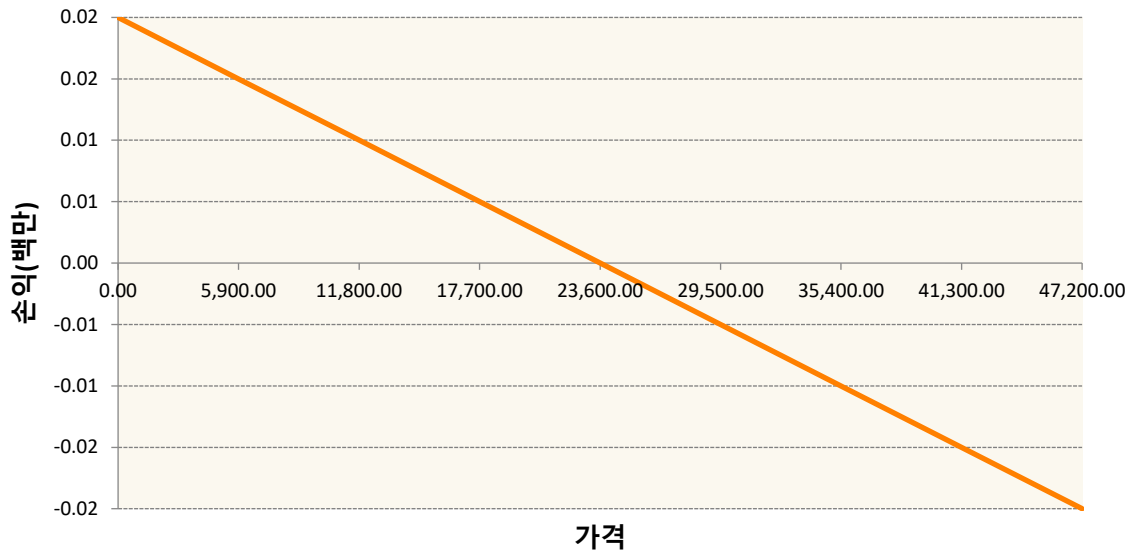
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5	0	5	장내
누계	유가증권	선물	4	131	-127	장내

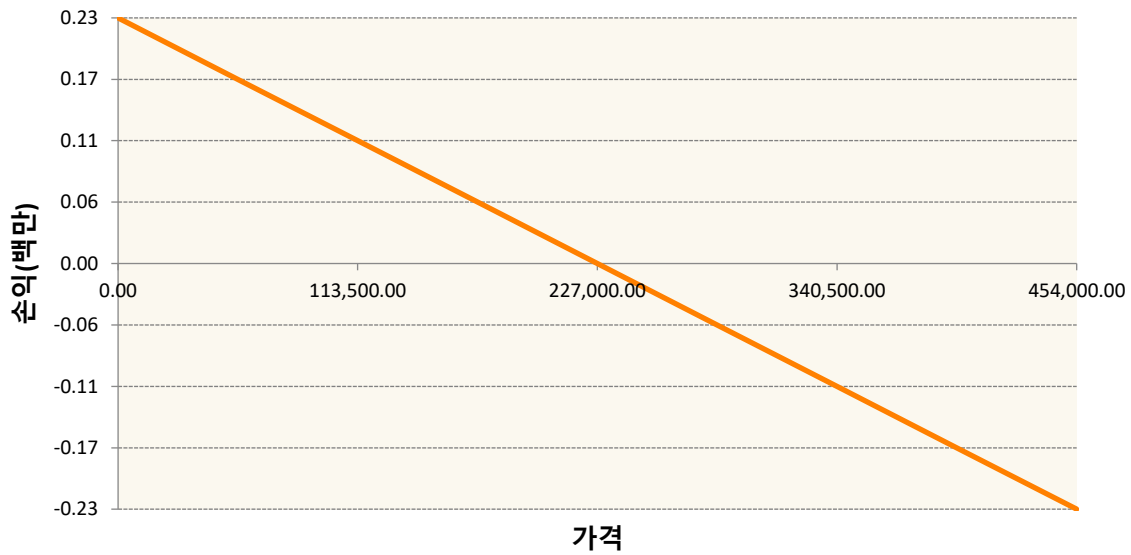
2. 만기시점의 손익구조



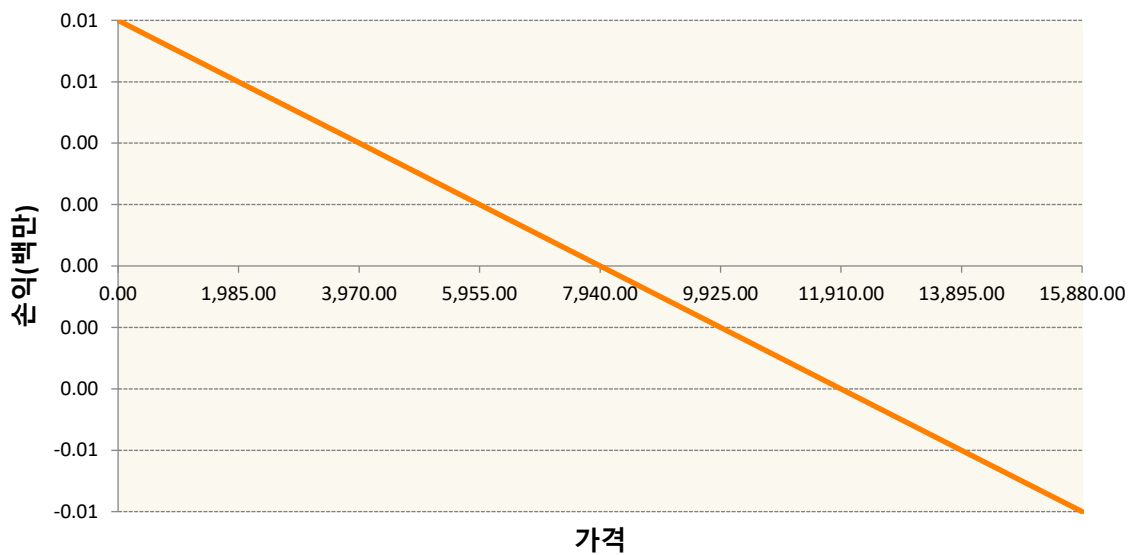
KR4115W50001-2025-05 한국전력개별선물



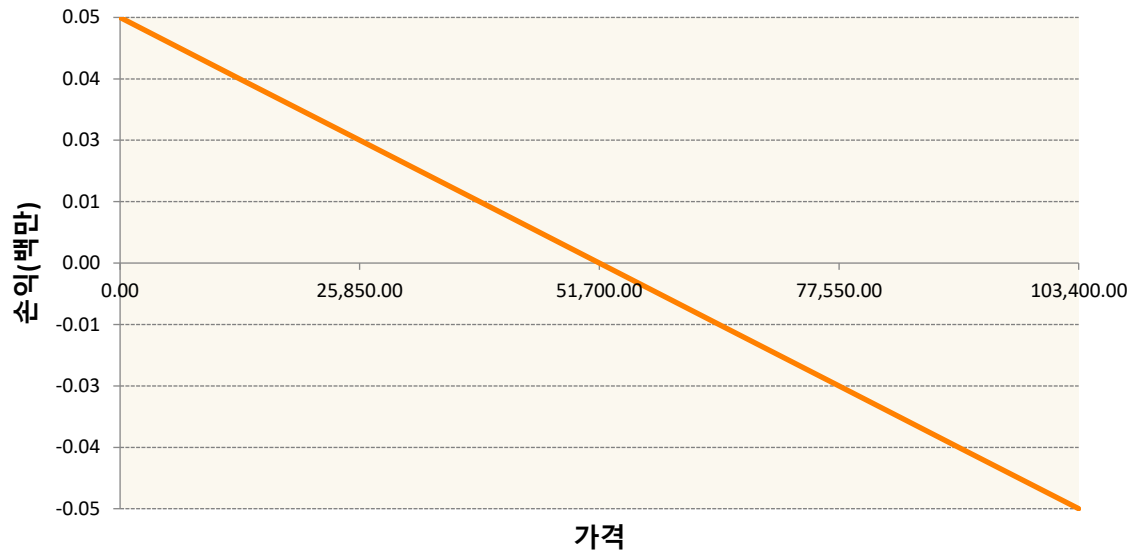
KR4139W50001-2025-05 HD한국조선해양개별선물



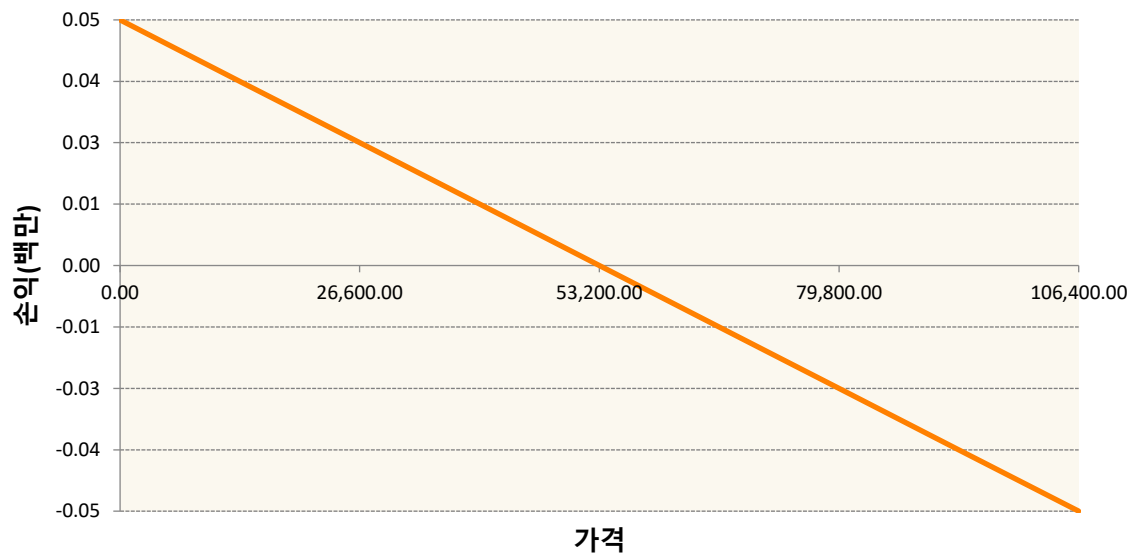
KR4149W50000-2025-05 HD현대인프라코어개별선물



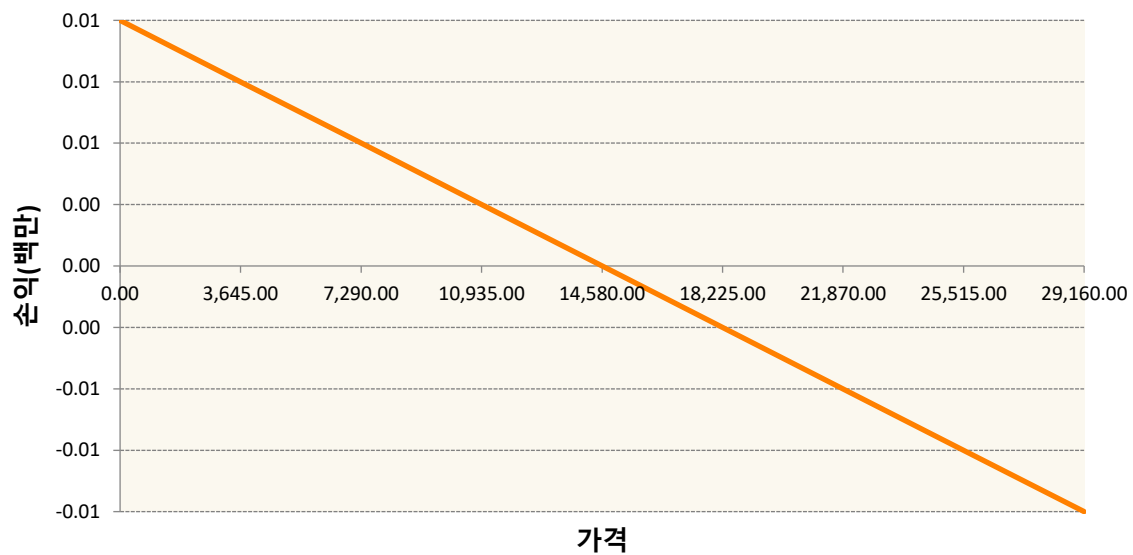
KR41B2W50007-2025-05 S-Oil개별선물



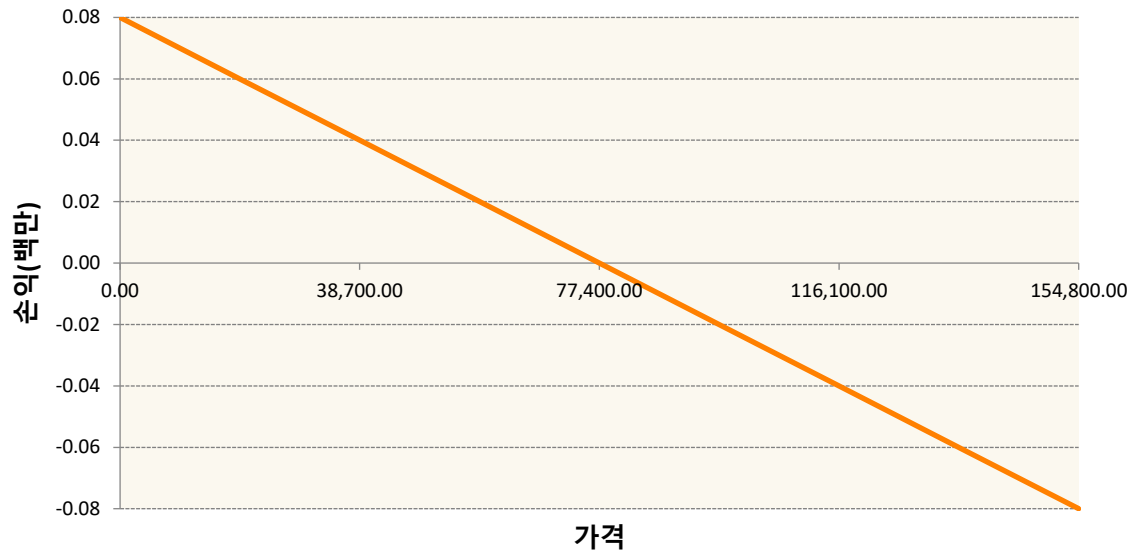
KR41B7W50006-2025-05 포스코인터내셔널개별선물



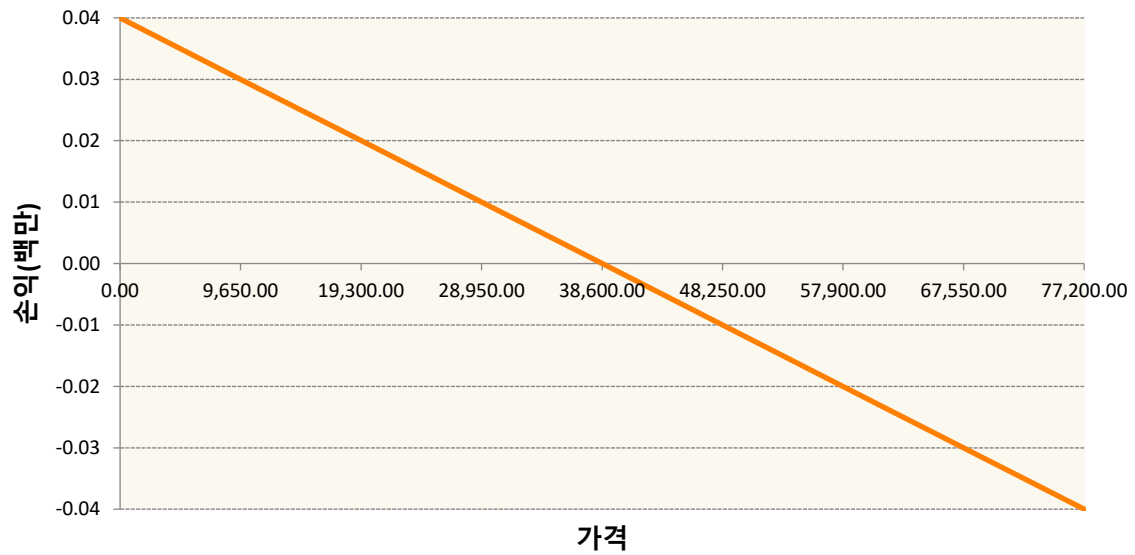
KR41BFW50008-2025-05 삼성중공업개별선물



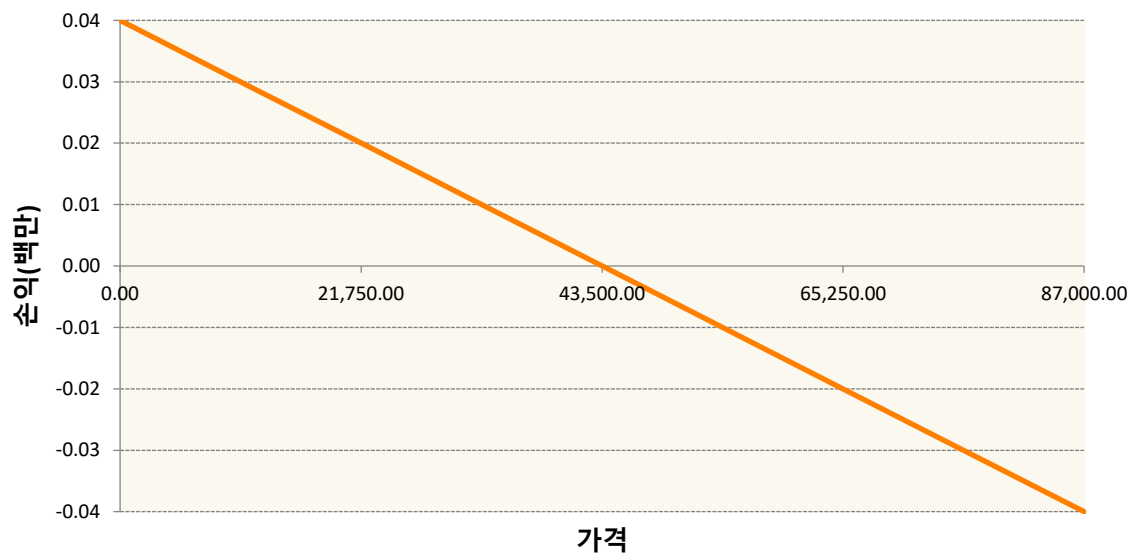
KR41BMW50004-2025-05 한국항공우주개별선물



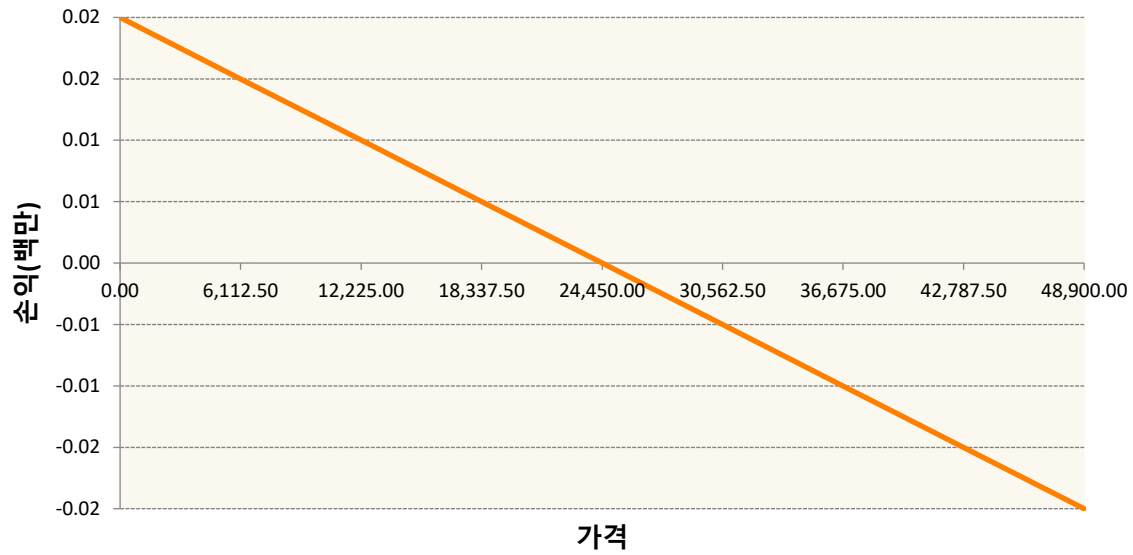
KR41BNW50002-2025-05 현대건설개별선물



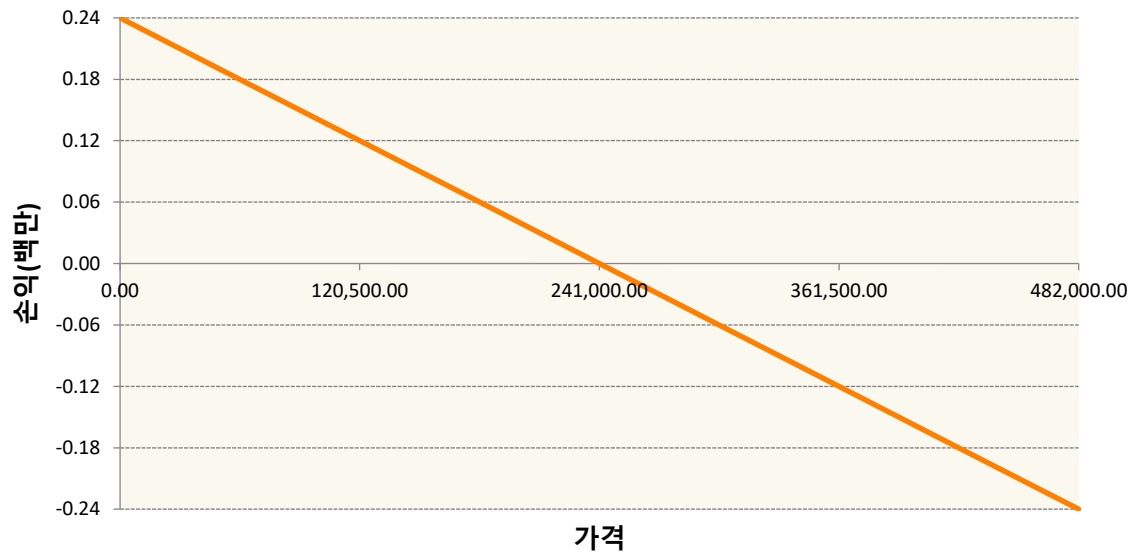
KR41C9W50001-2025-05 한화개별선물



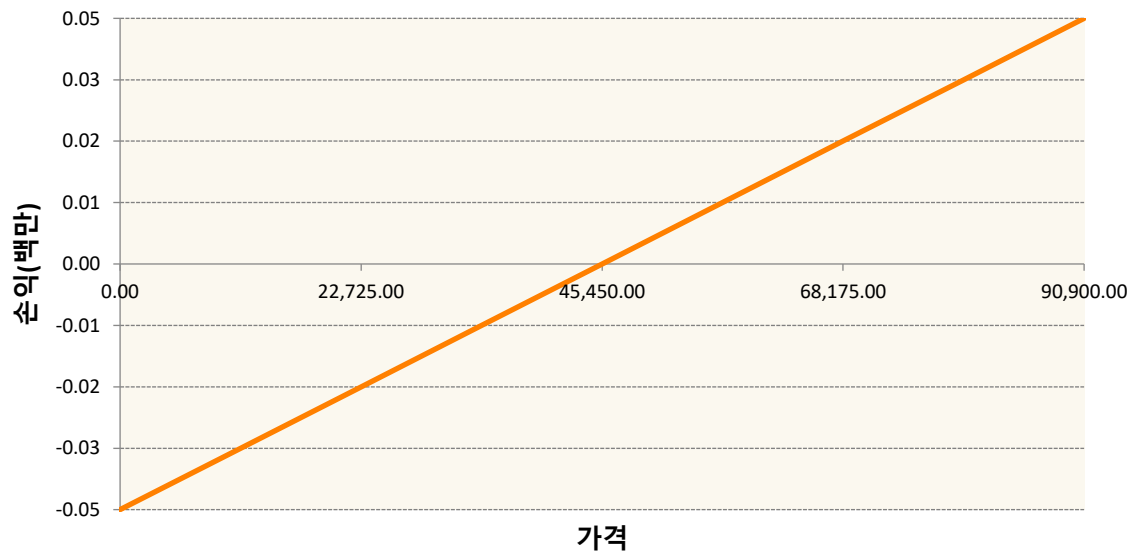
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



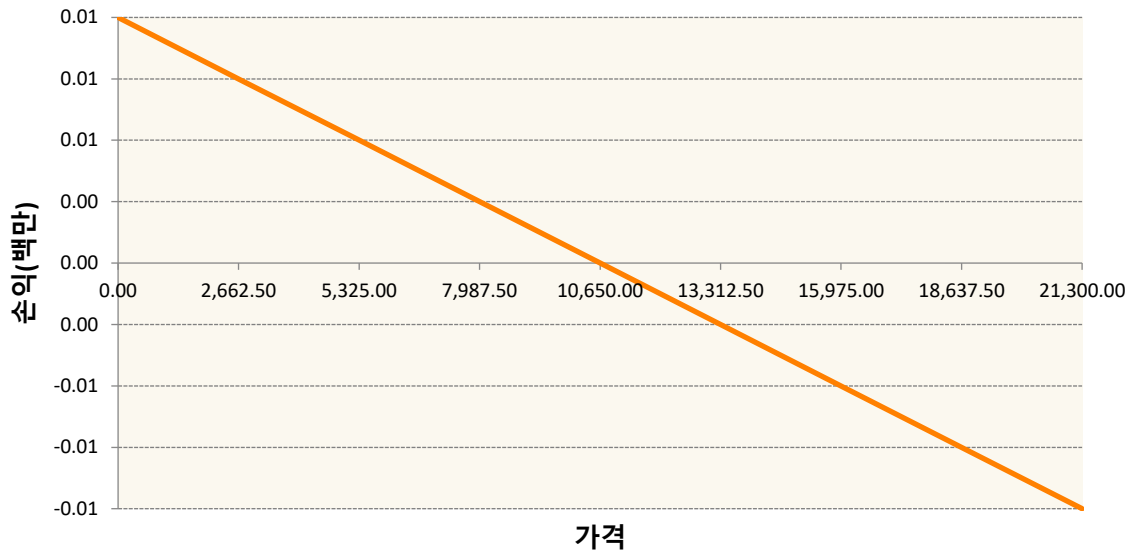
KR41CXW50009-2025-05 한미약품개별선물



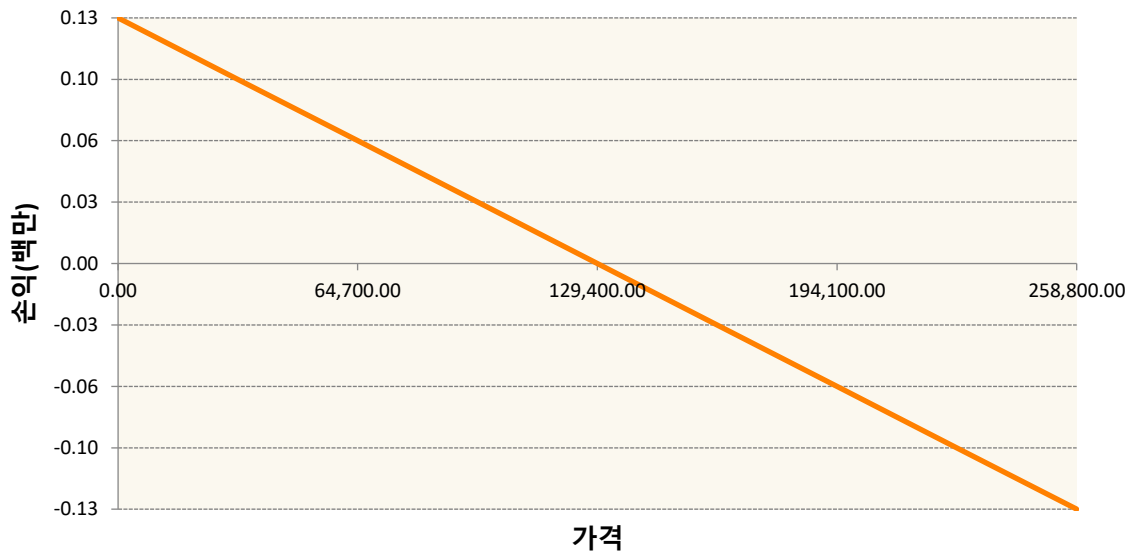
KR41DGW50002-2025-05 영원무역개별선물



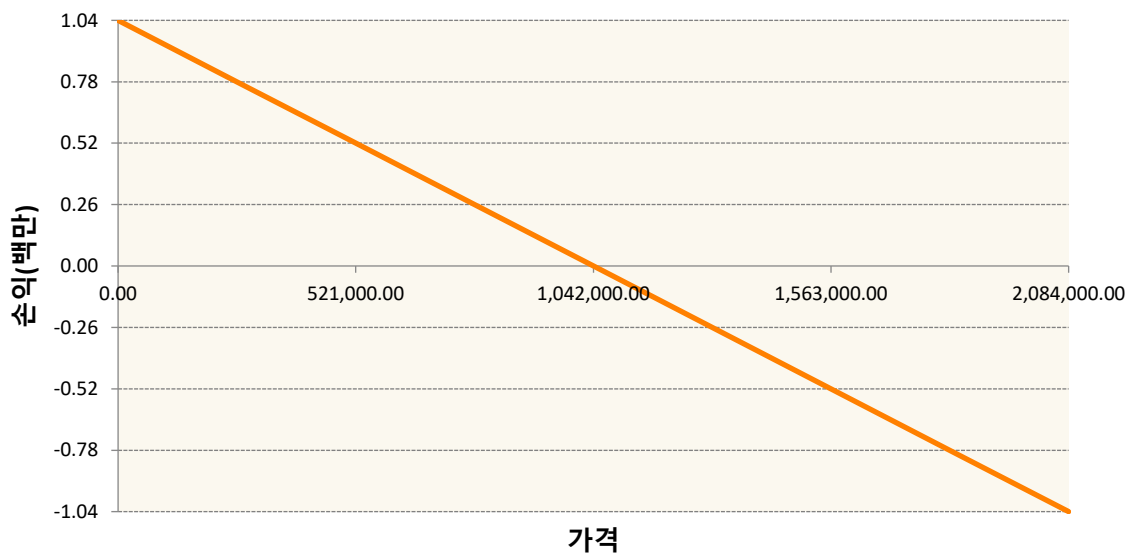
KR41DZW50002-2025-05 한세실업개별선물



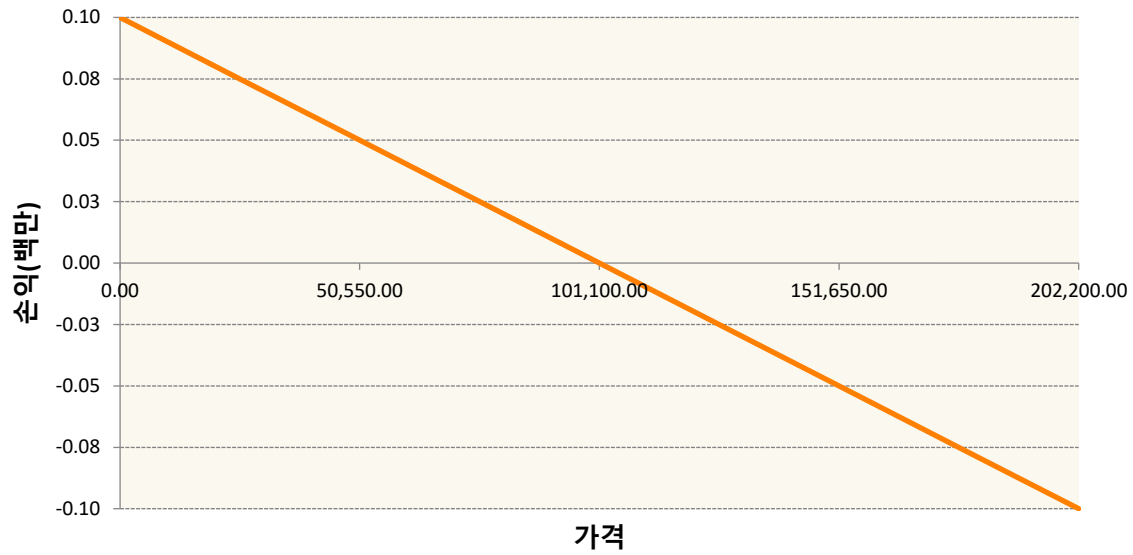
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



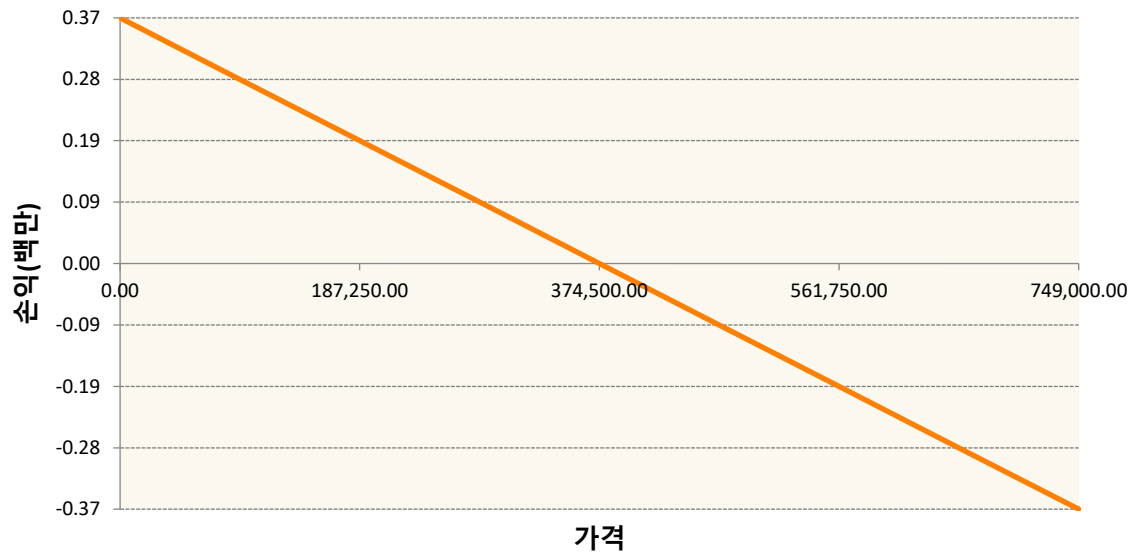
KR41ESW50005-2025-05 삼성바이오로직스개별선물



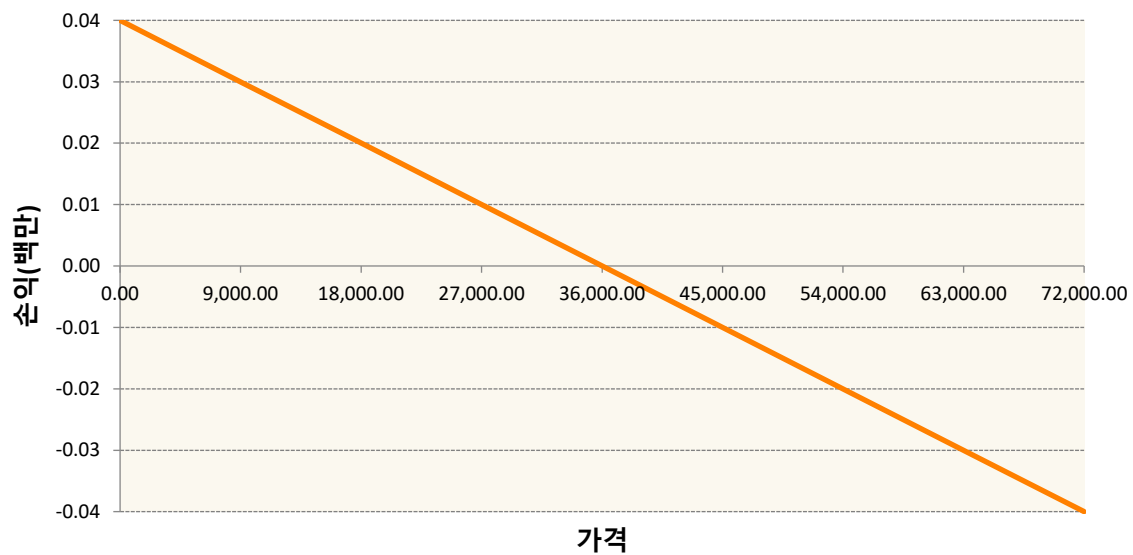
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



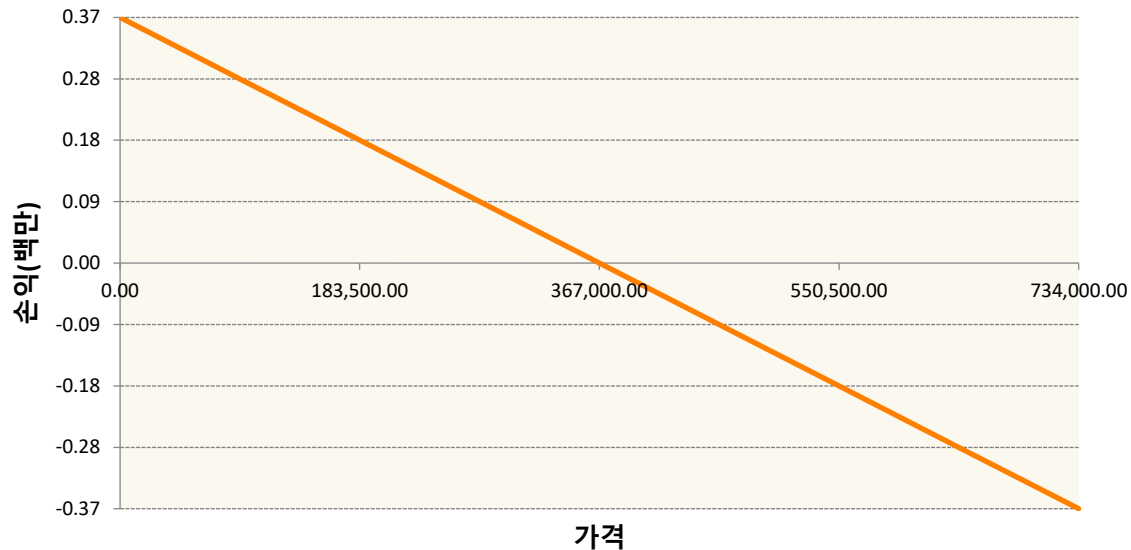
KR41F8W50000-2025-05 크래프톤개별선물



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	0.5
KR41B7W50(2025-05 포스코인터내셔널개별선물	1
KR41BFW50(2025-05 삼성중공업개별선물	1
KR41BMW50 2025-05 한국항공우주개별선물	1
KR41BNW50 2025-05 현대건설개별선물	0.31
KR41C9W50(2025-05 한화개별선물	0.42
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	0.49
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)

26

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

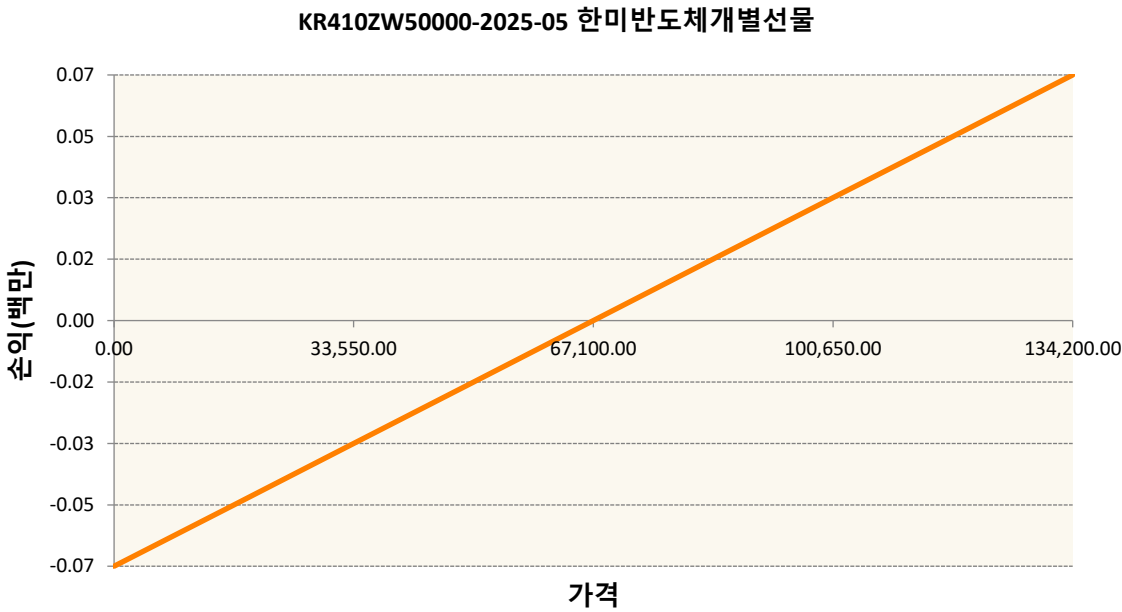
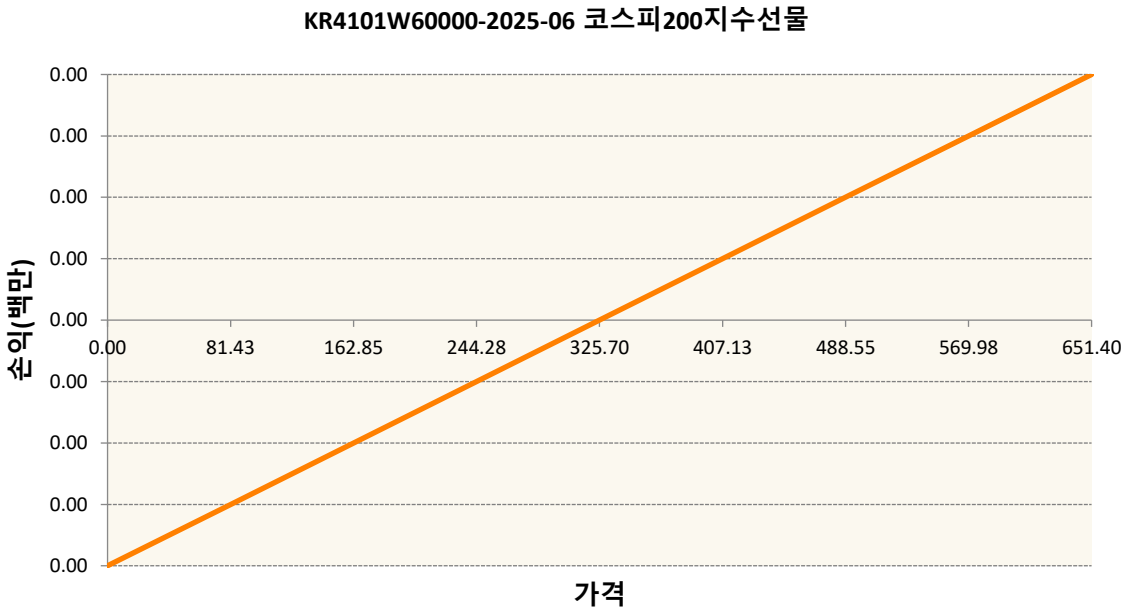
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

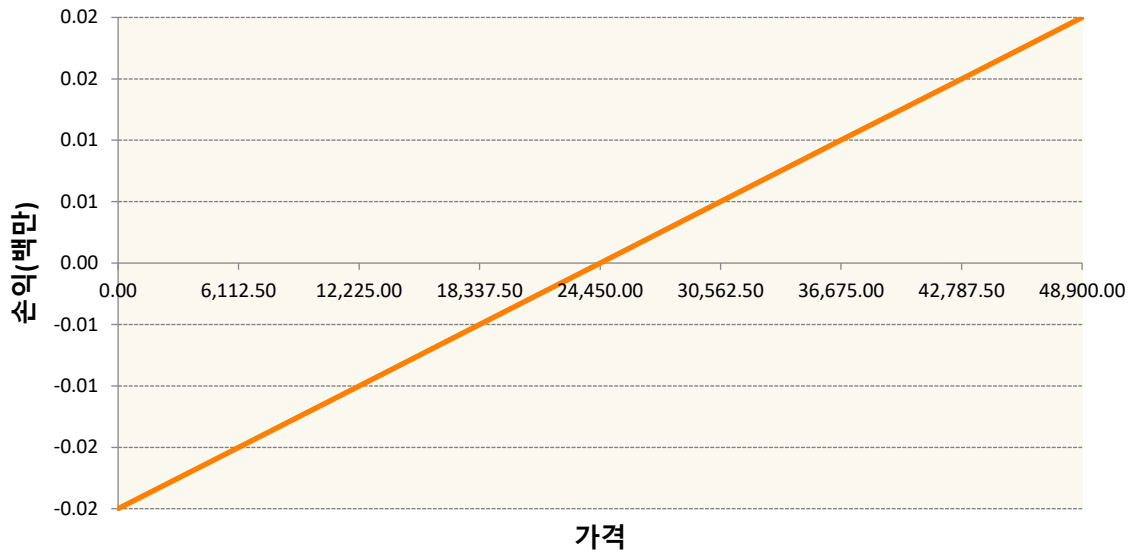
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	154	0	154	장내
누계	유가증권	선물	9,350	0	9,350	장내

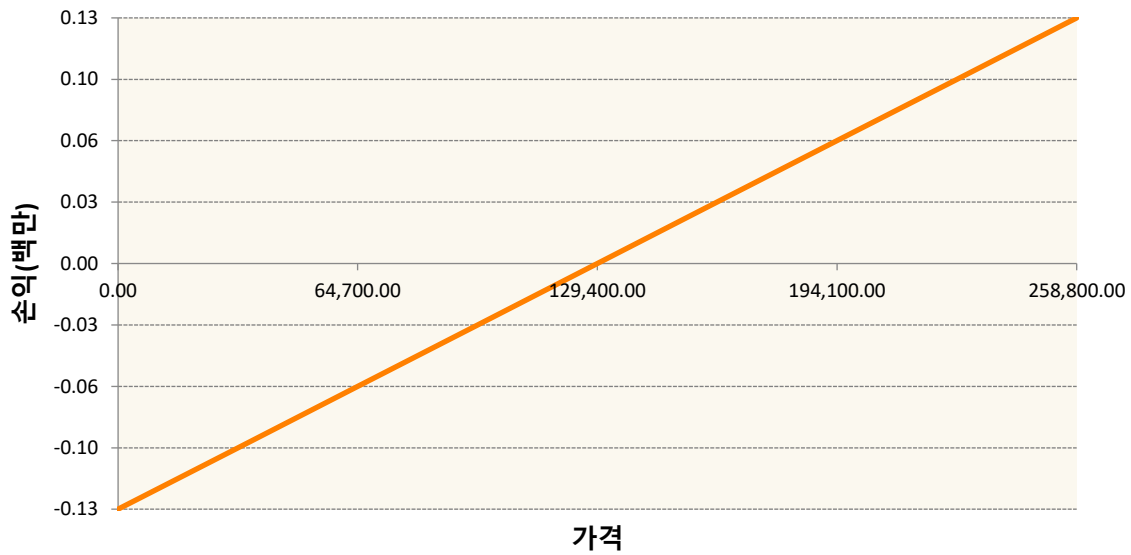
2. 만기시점의 손익구조



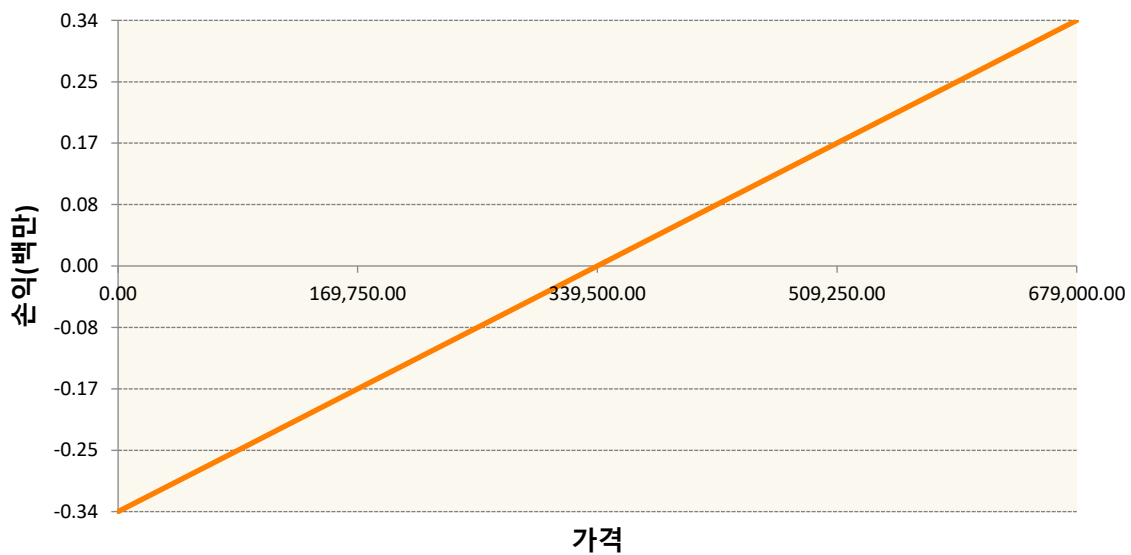
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		573
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물		28
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물		12
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물		16
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물		118

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,232

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

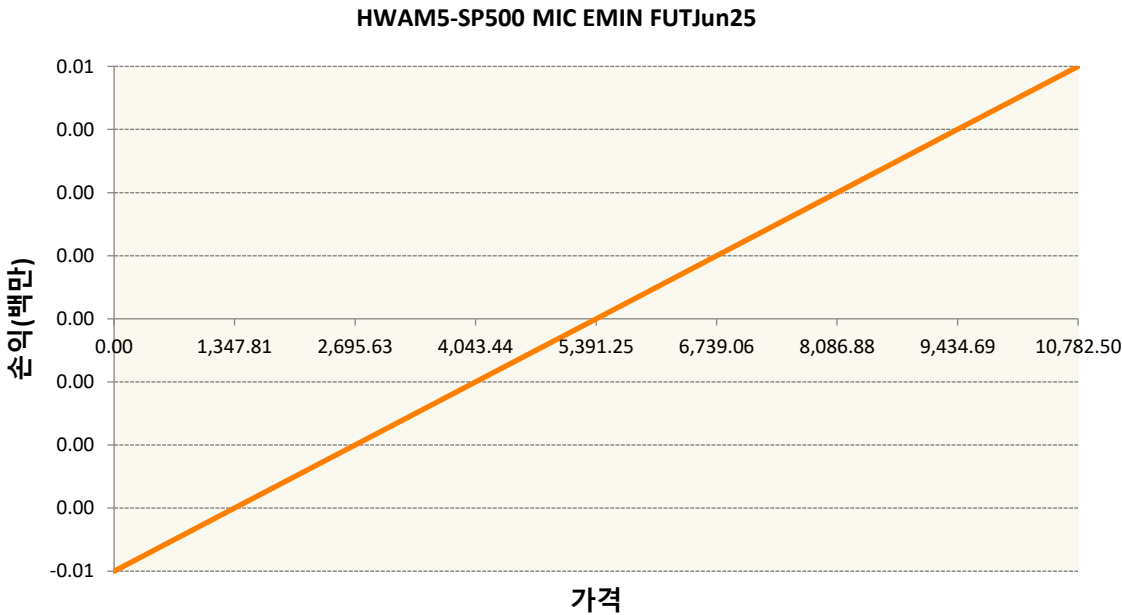
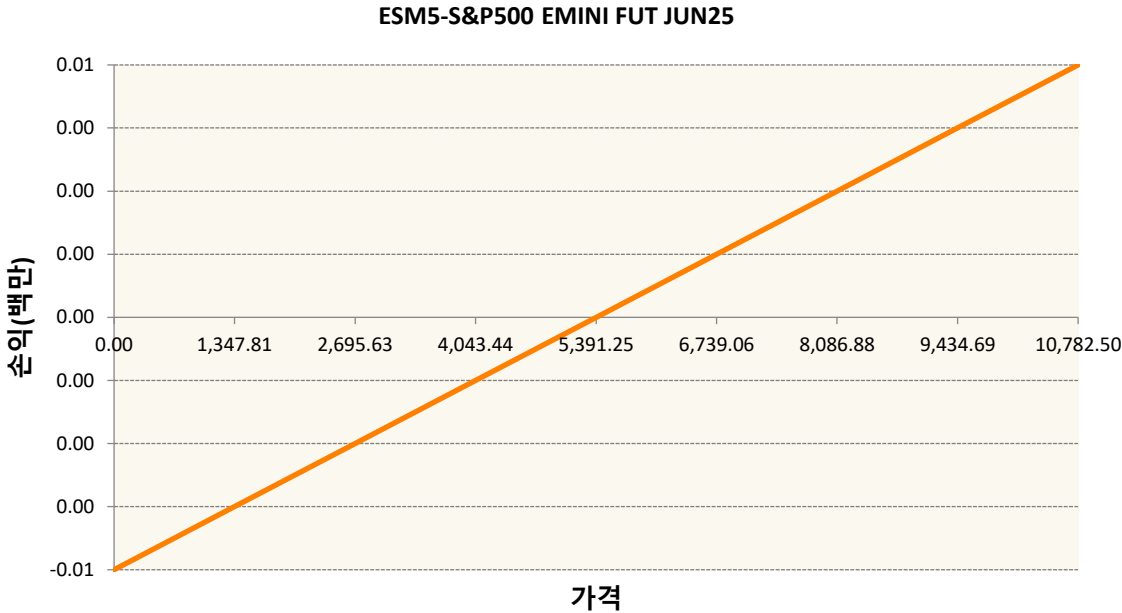
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	25,995	0	25,995	
누계	유가증권	선물	1,142	0	1,142	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,080
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	91

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,857

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

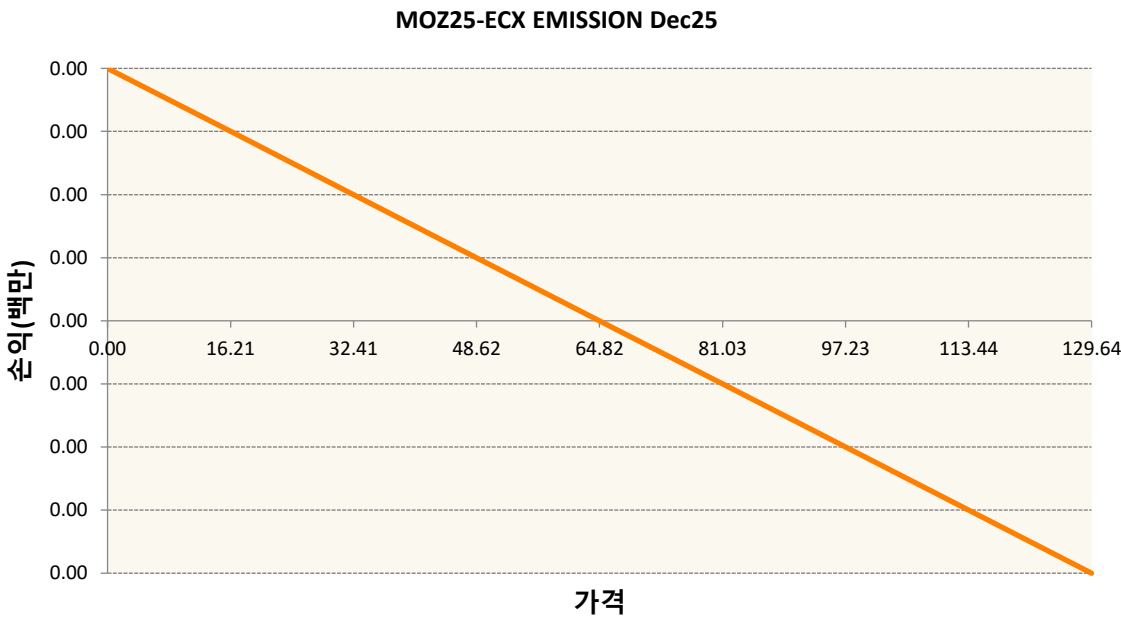
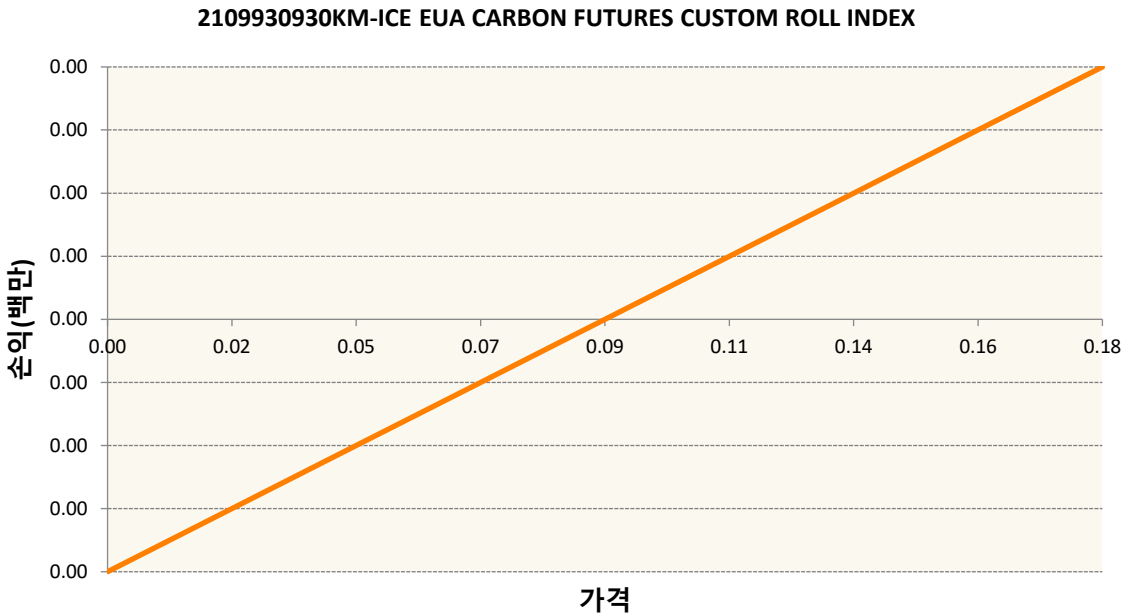
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	34	6,760	-6,726	
누계	통화	선도	0	1,171	-1,171	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		3
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E		5
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E		89
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		541

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,008

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

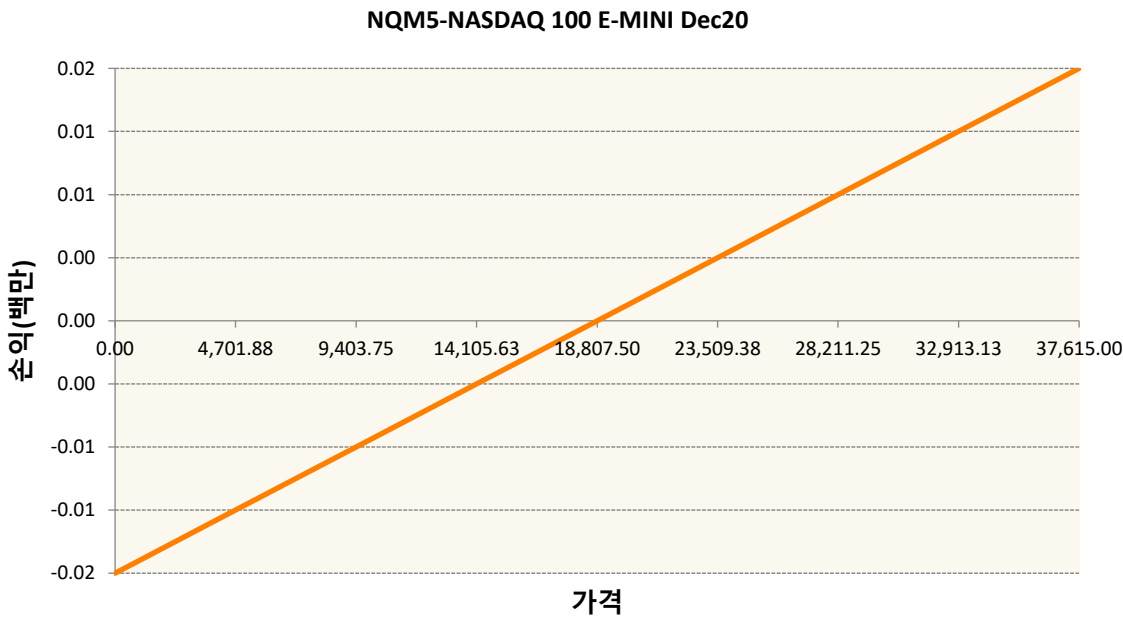
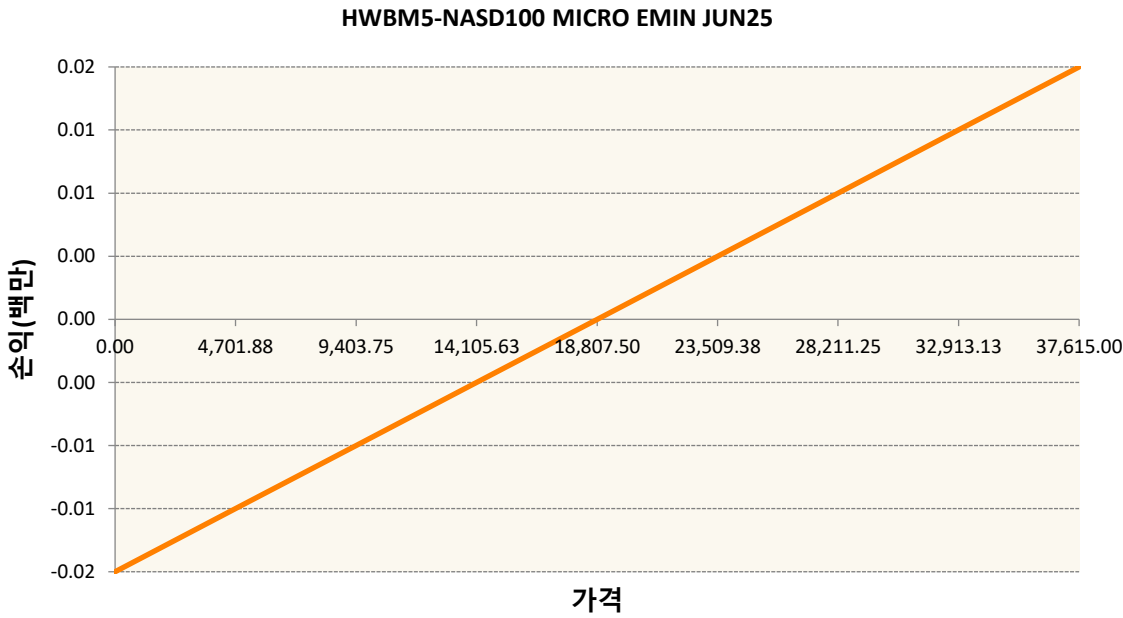
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	12,620	0	12,620	
누계	유가증권	선물	496	0	496	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		40
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,010

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,166

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

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	694
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,015
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,474
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,083

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

(단위:백만원)

9,194

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

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	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3

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

(단위:백만원)

16

공시일	2025-04-15
기준일	2025-04-14

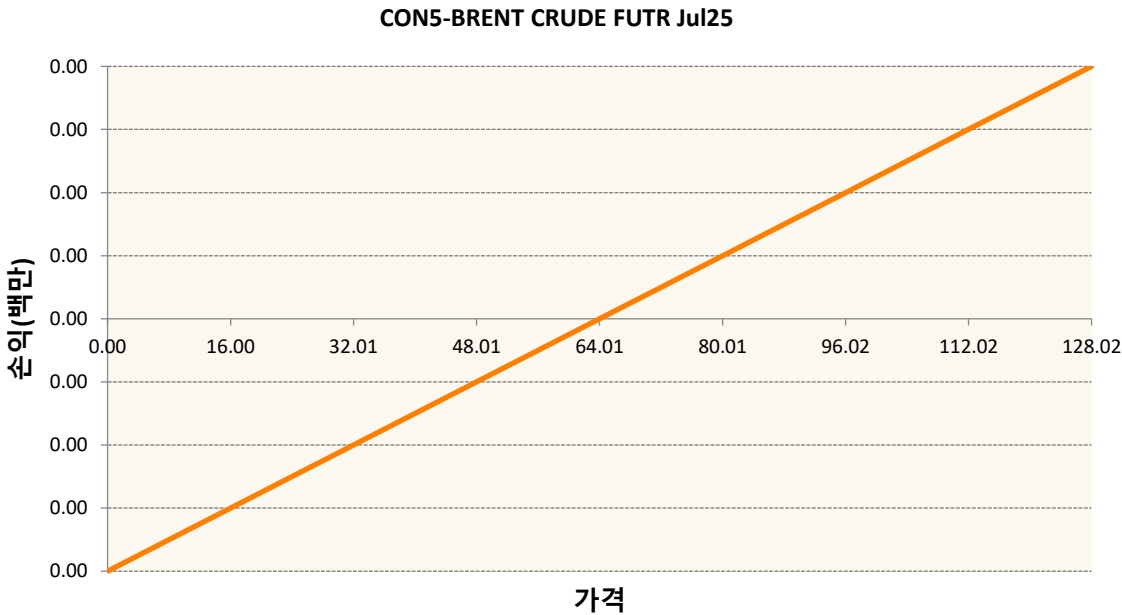
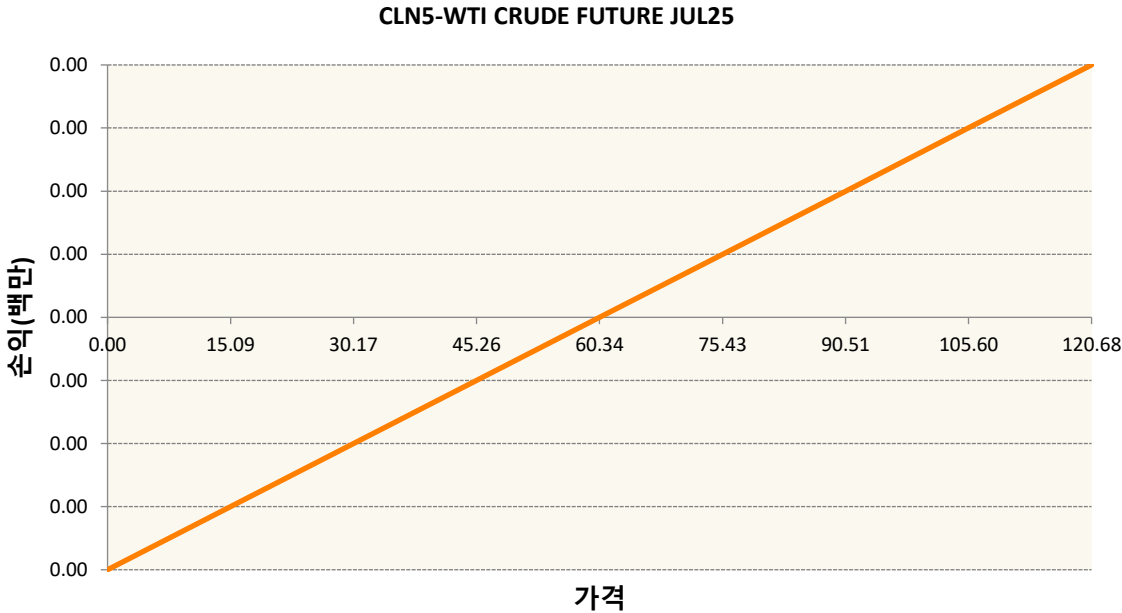
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

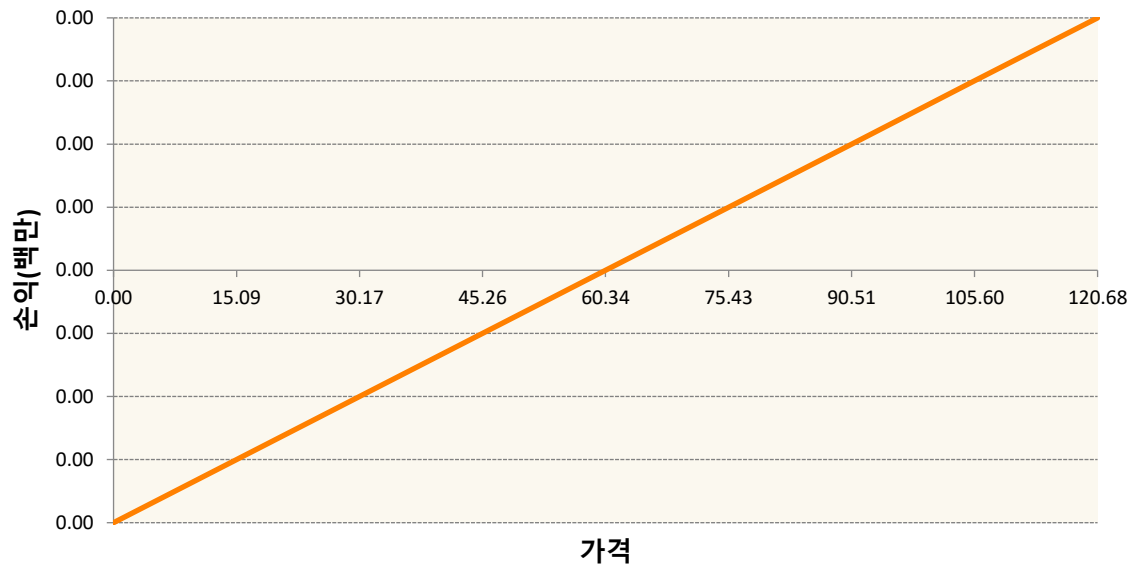
(단위:백만원)

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	641	0	641	
누계	통화	선물	0	85	-85	장내

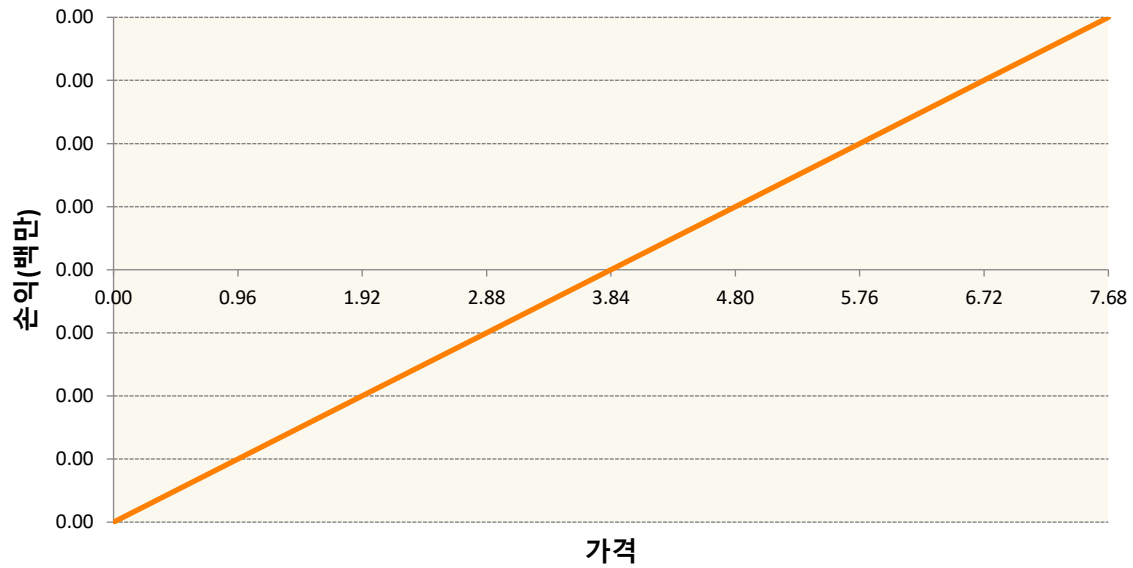
2. 만기시점의 손익구조



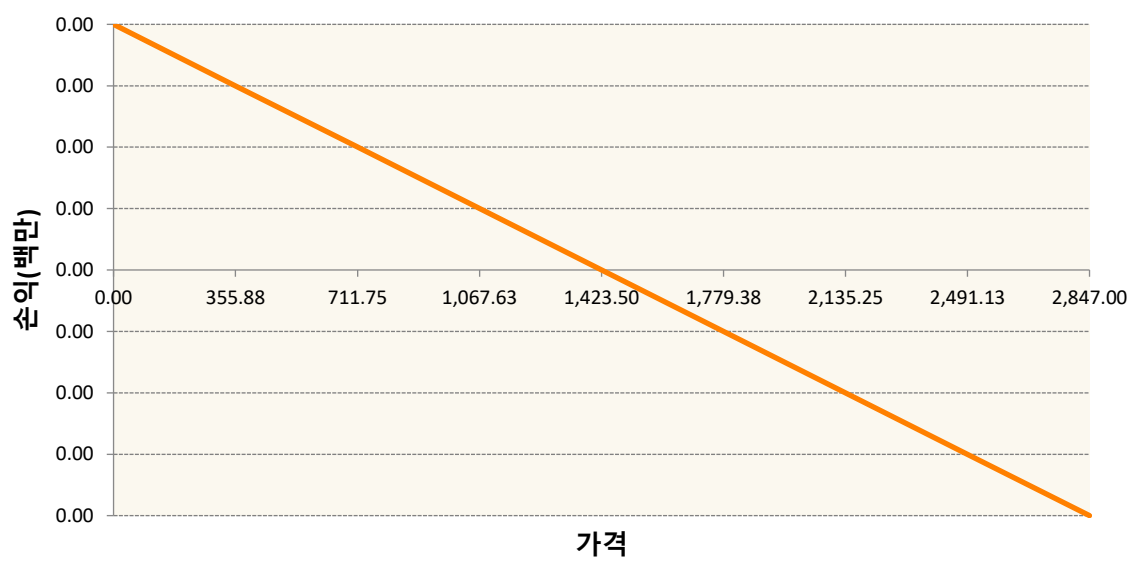
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25

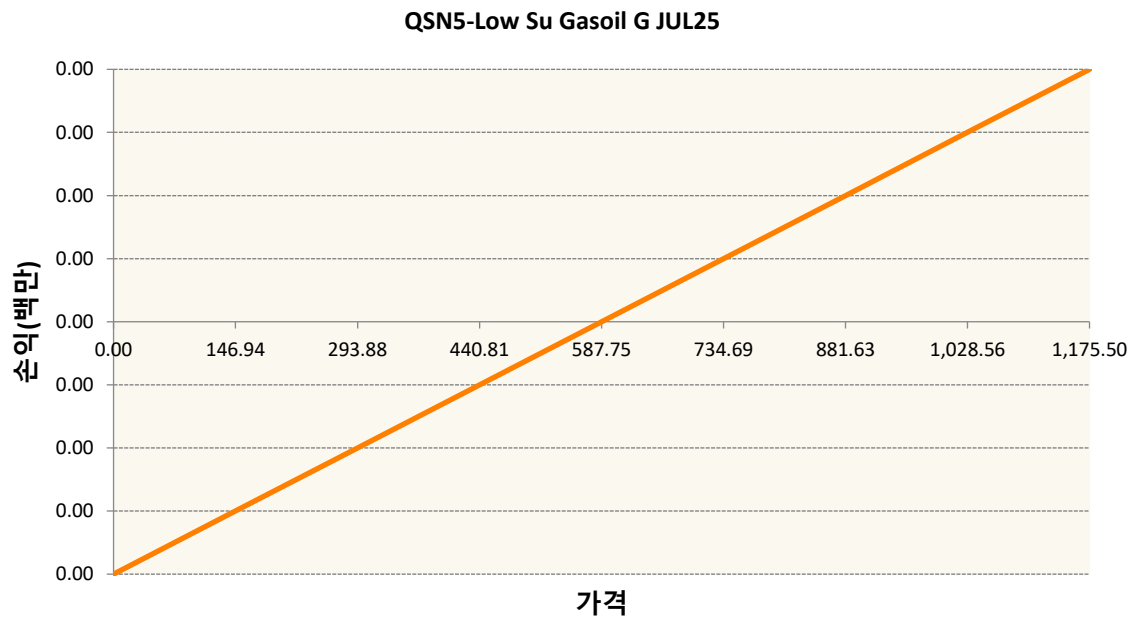
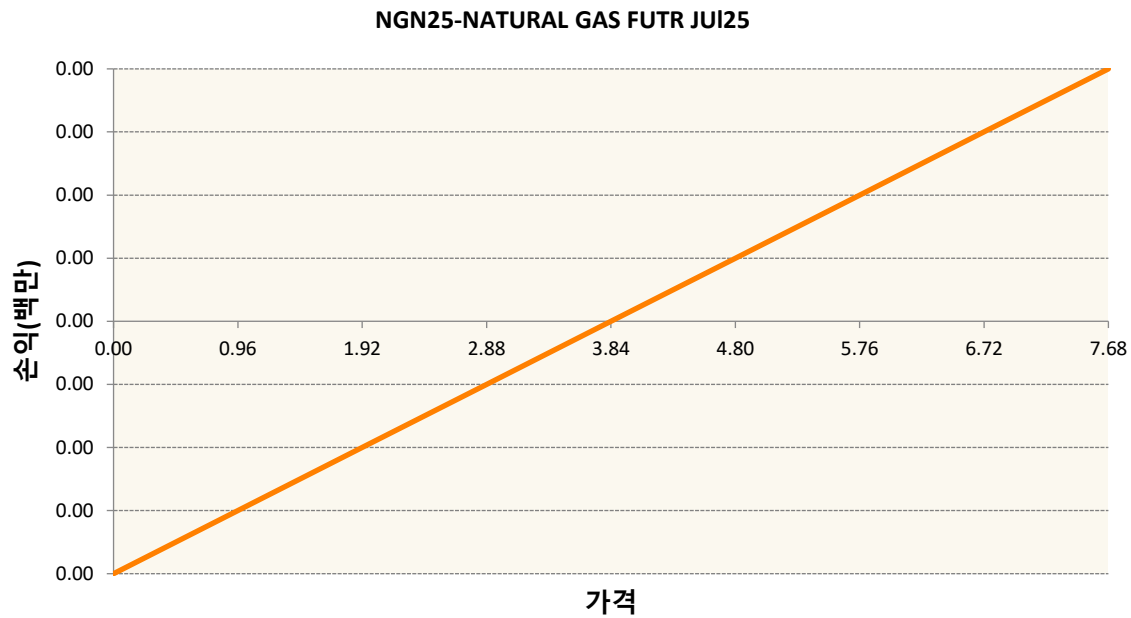


EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



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		4
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