

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

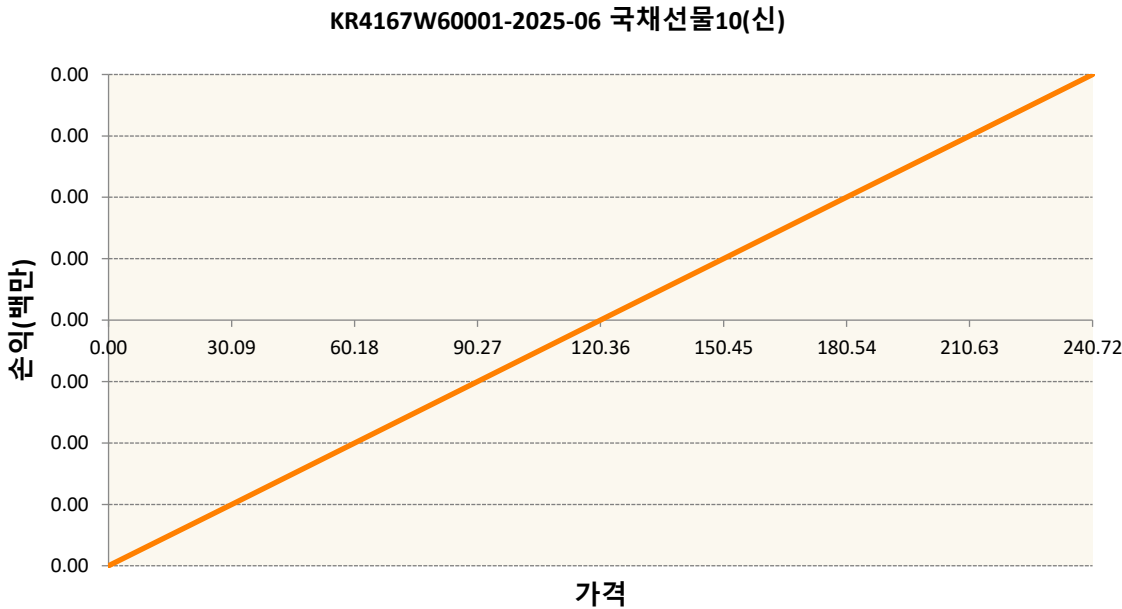
베스트장기채(채권-파생형)

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	158,875	0	158,875	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

3,597

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

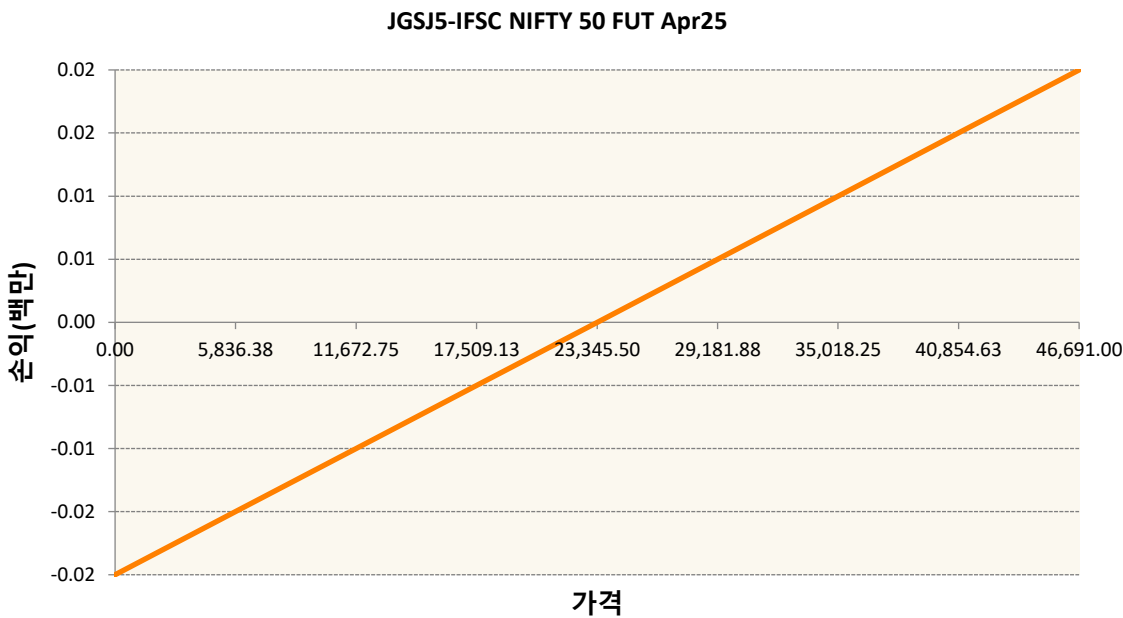
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	819	0	819	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ5	IFSC NIFTY 50 FUT Apr25	66
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

47

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

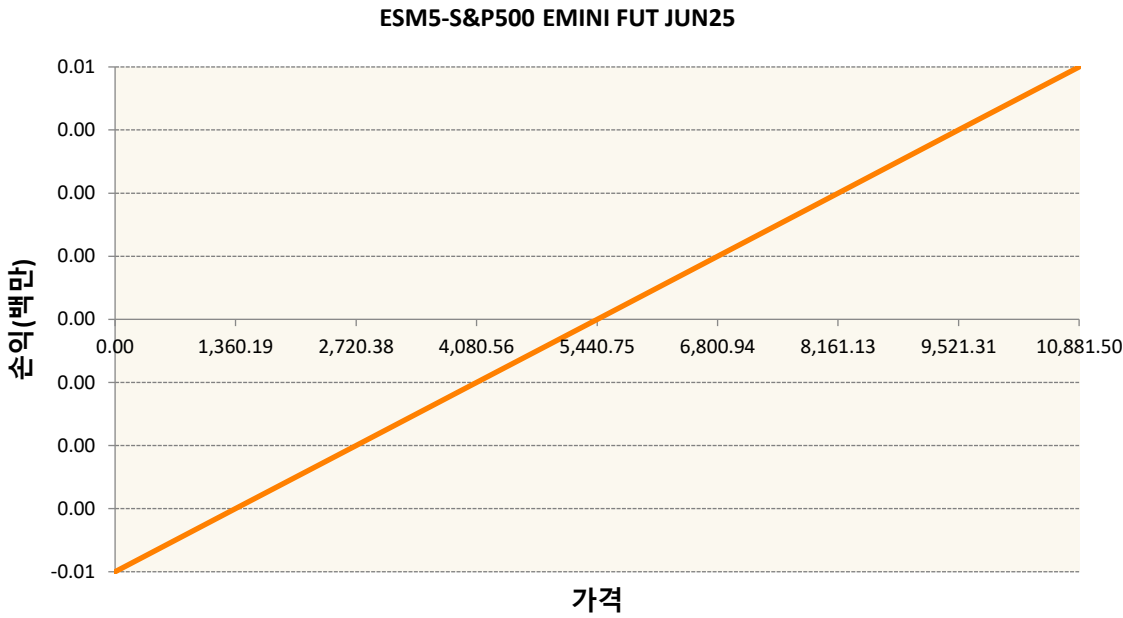
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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)

27

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

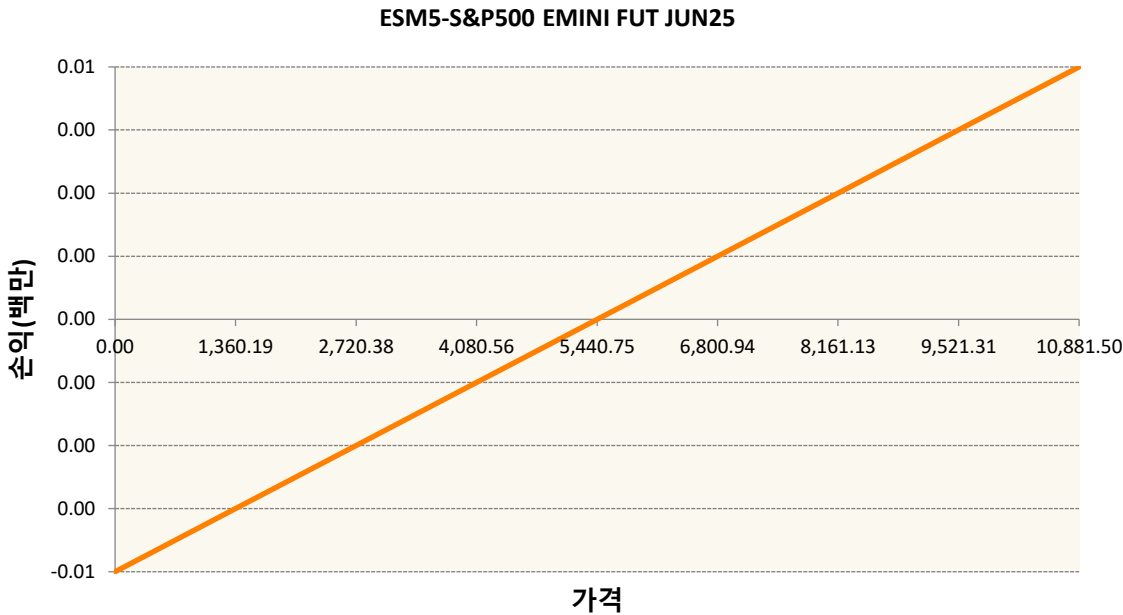
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,391	0	2,391	

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)

164

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

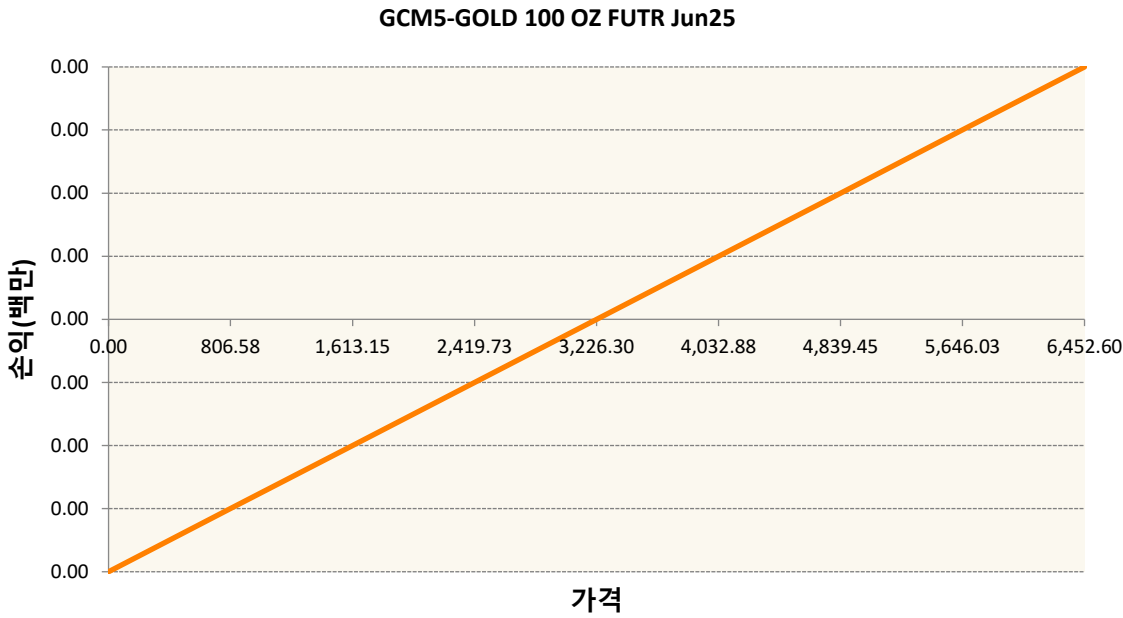
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,366	0	2,366	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 04/17/25 C295 EQUITY	4
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	189

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

(단위:백만원)

147

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

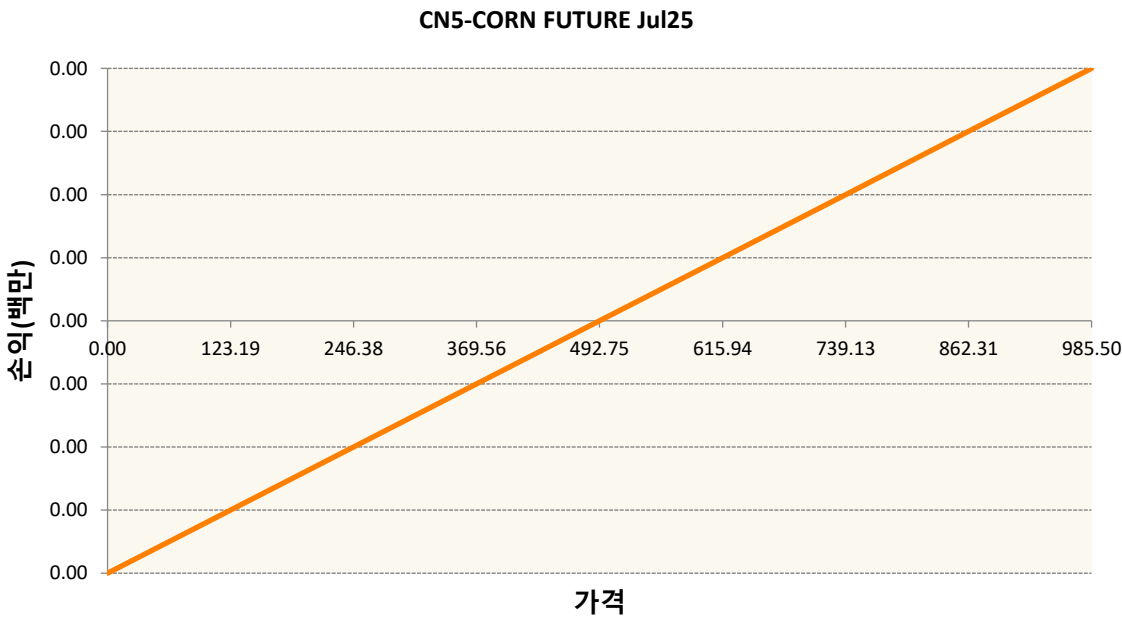
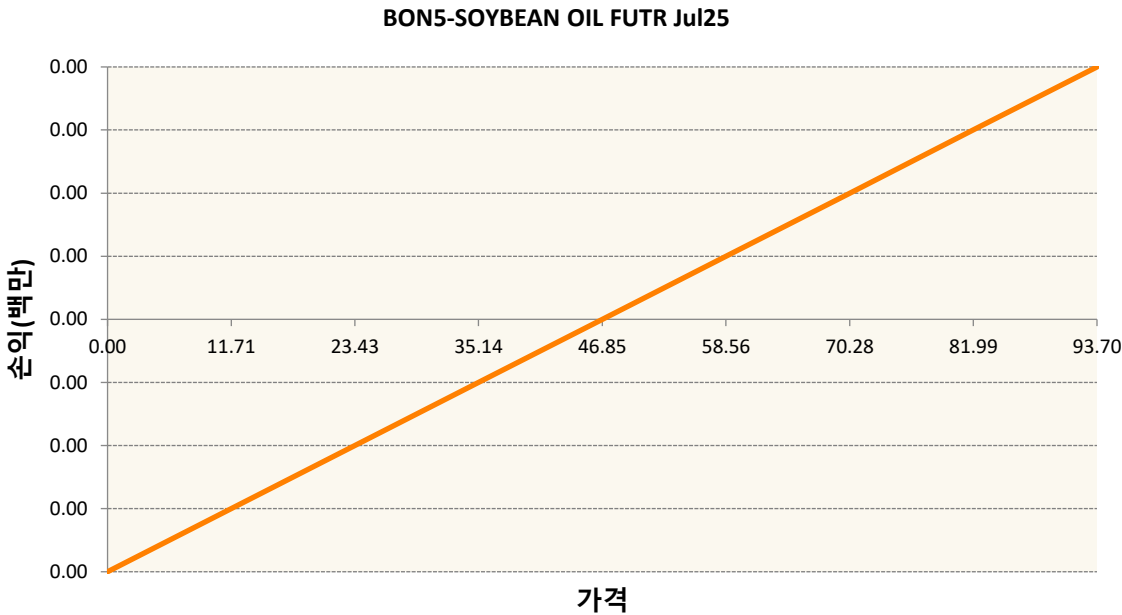
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

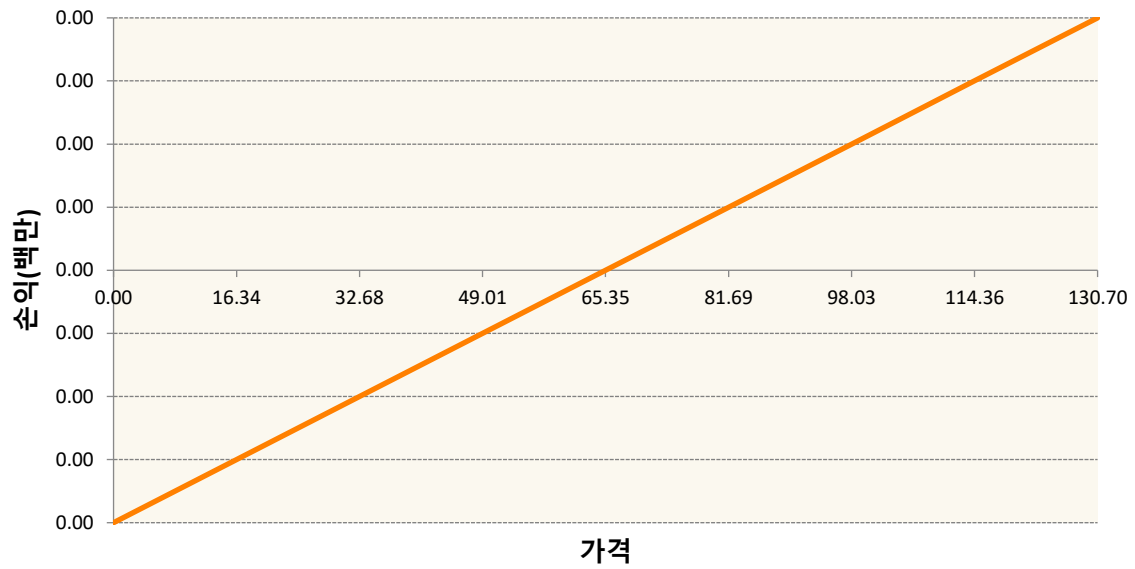
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	43	-43	장내
누계	유가증권	선물	3,806	0	3,806	
누계	통화	선물	0	328	-328	장내

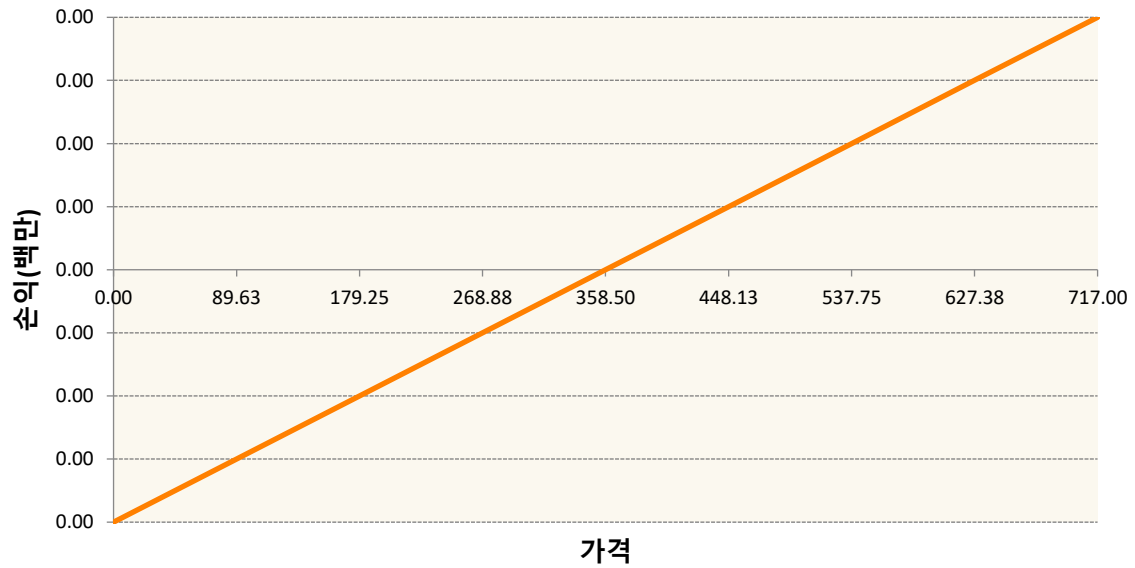
2. 만기시점의 손익구조



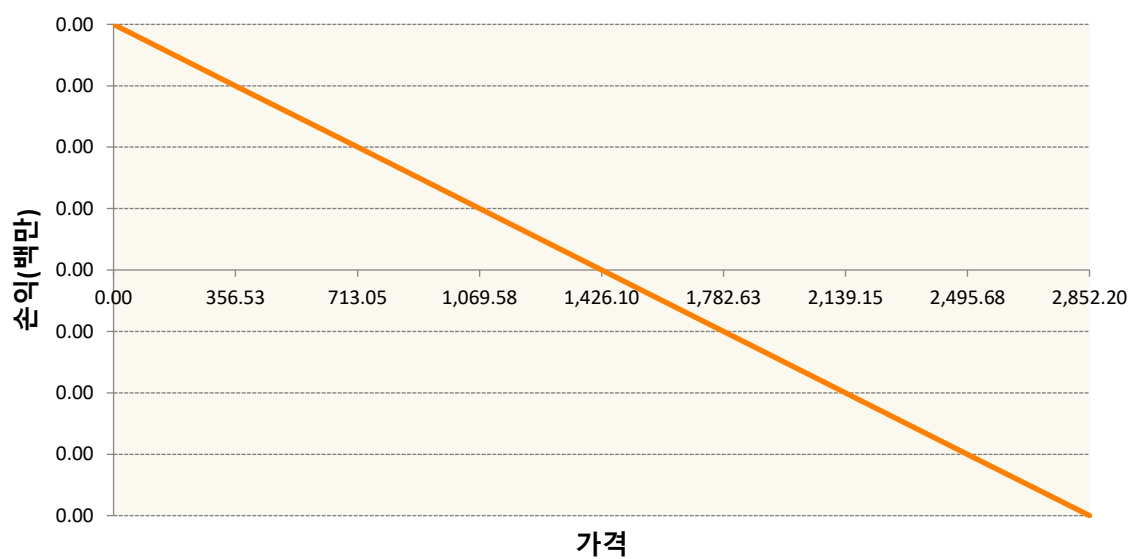
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



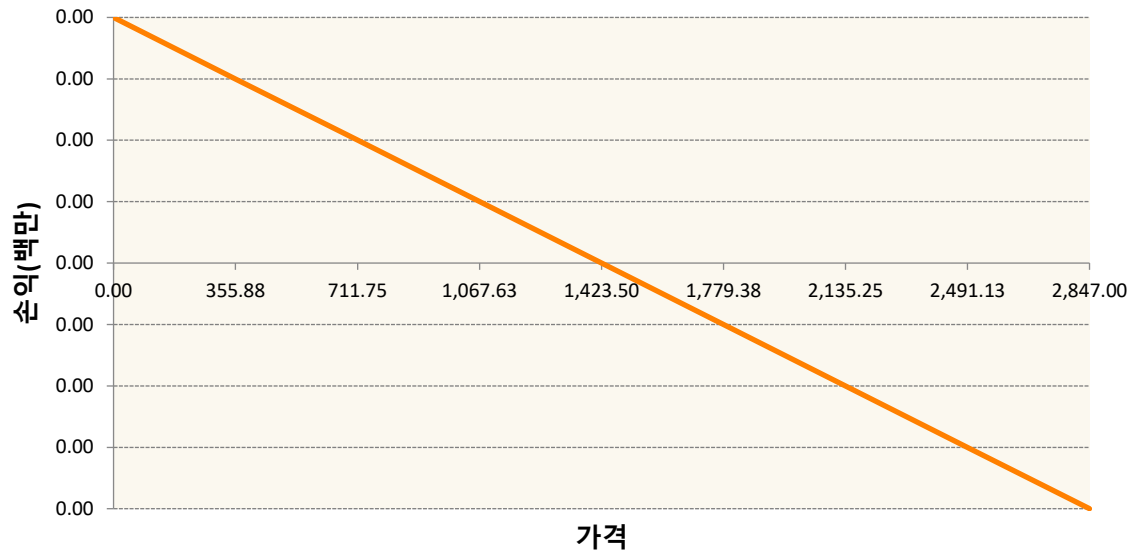
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



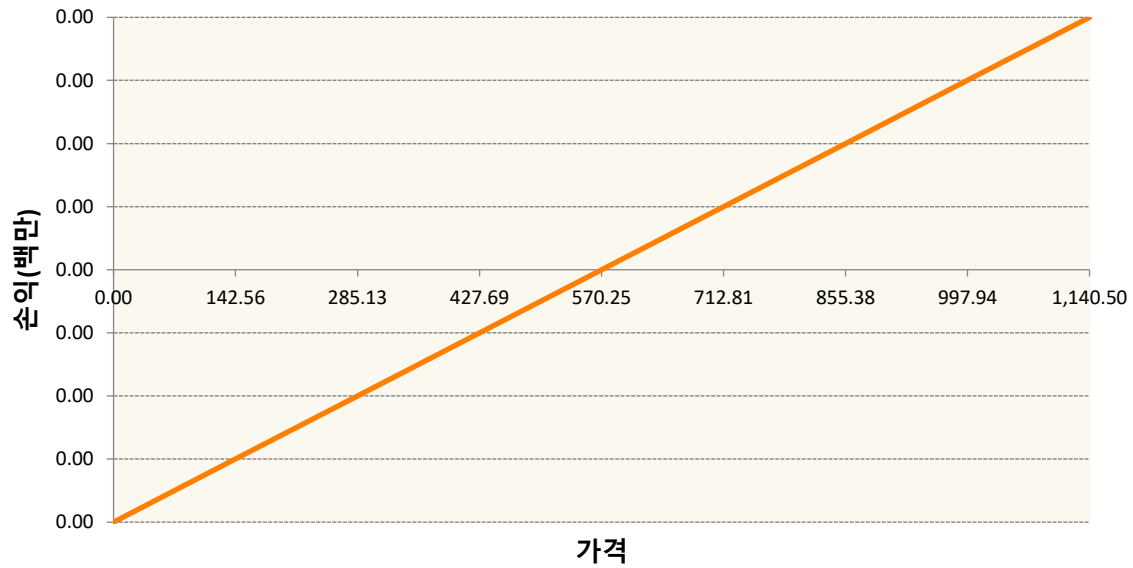
KR4175W40006-2025-04 달러선물



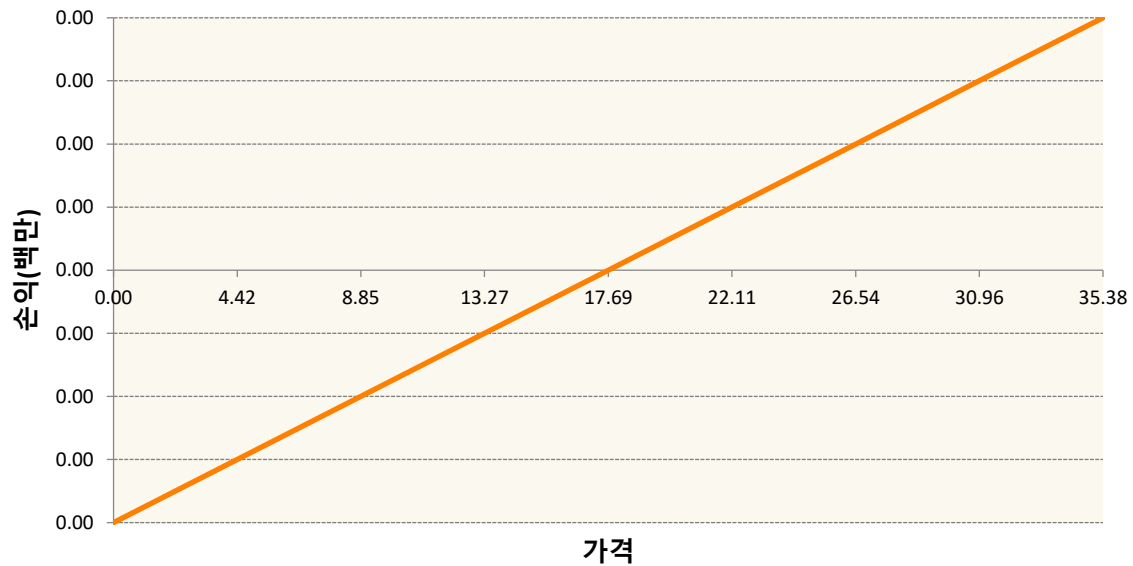
KR4175W50005-2025-05 달러선물



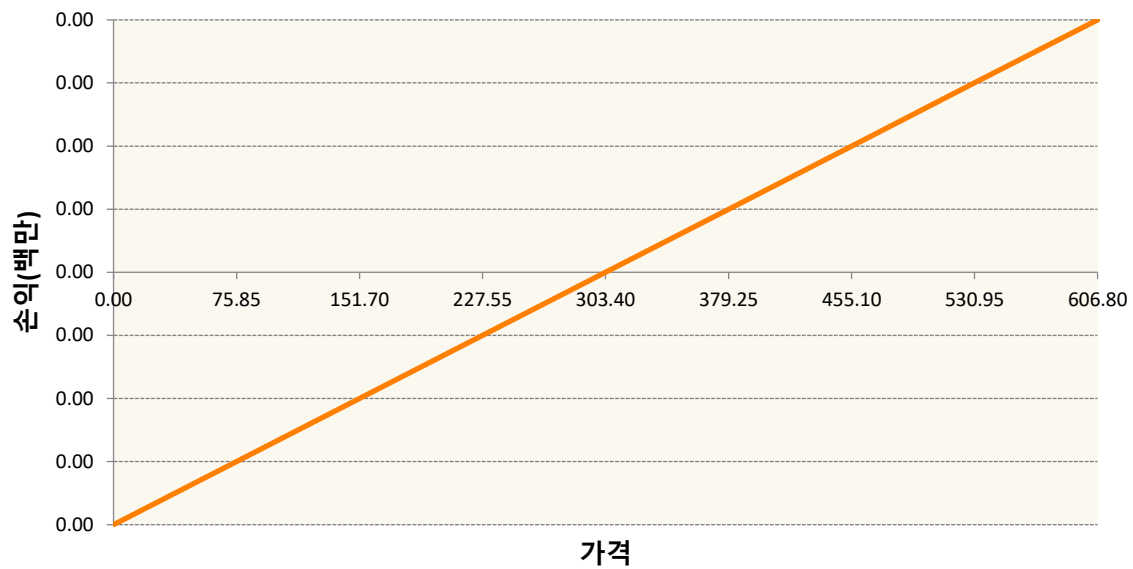
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25



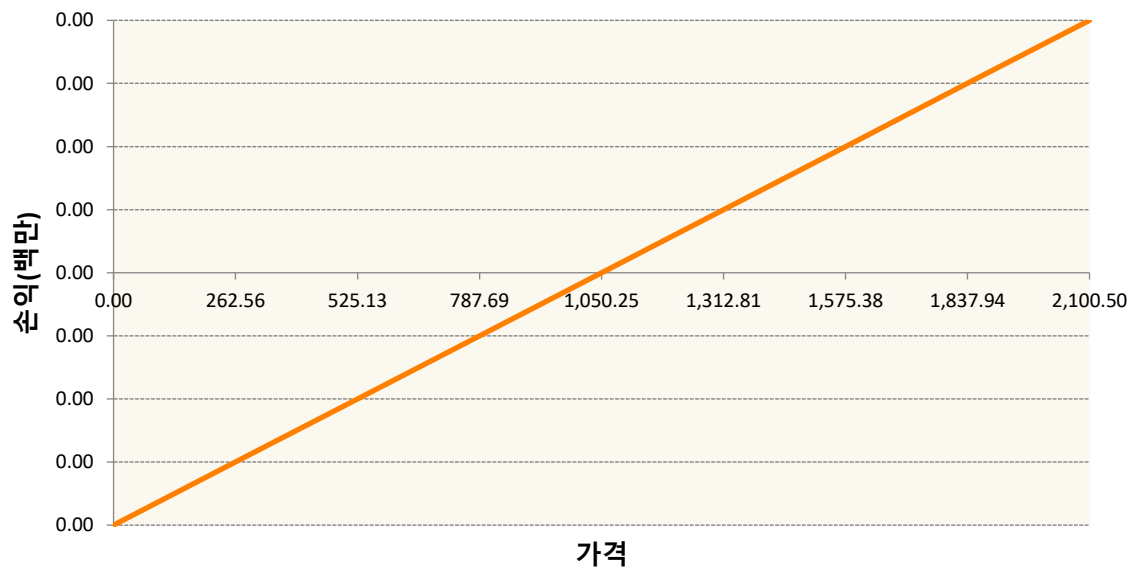
SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



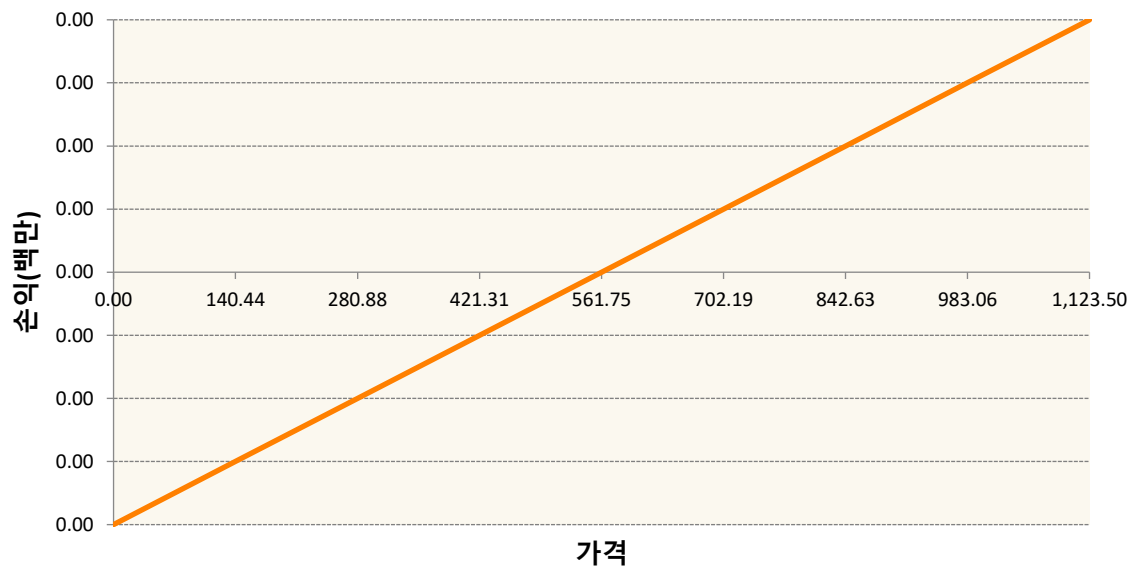
SMN5-SOYBEAN MEAL FUTR Jul25



SN5-SOYBEAN FUTURE Jul25



WN5-WHEAT FUTURE(CBT) 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	2025-04-16
기준일	2025-04-15

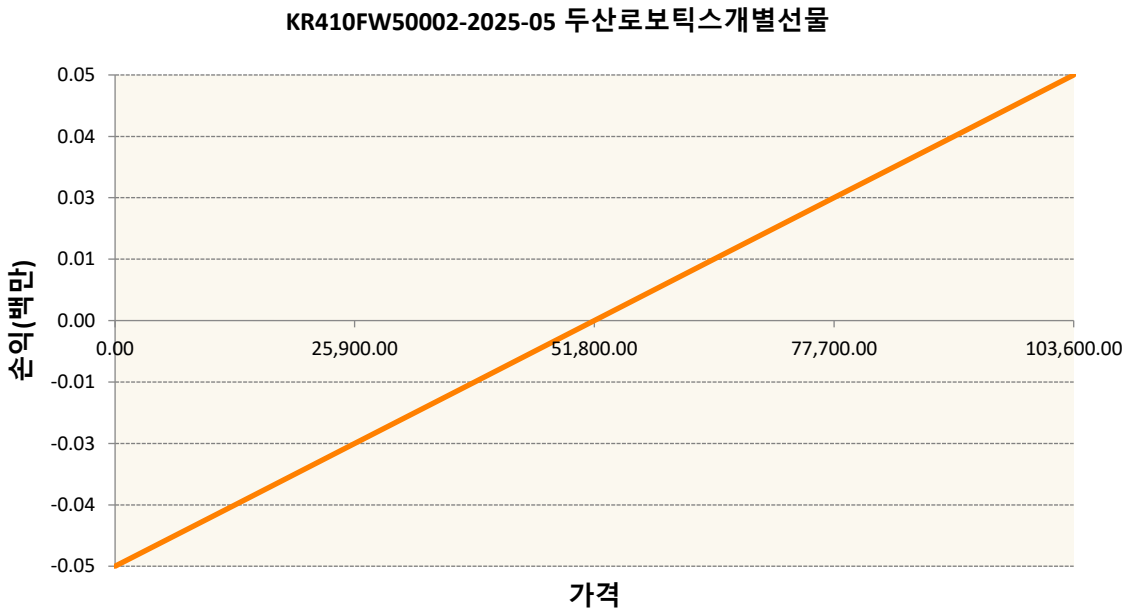
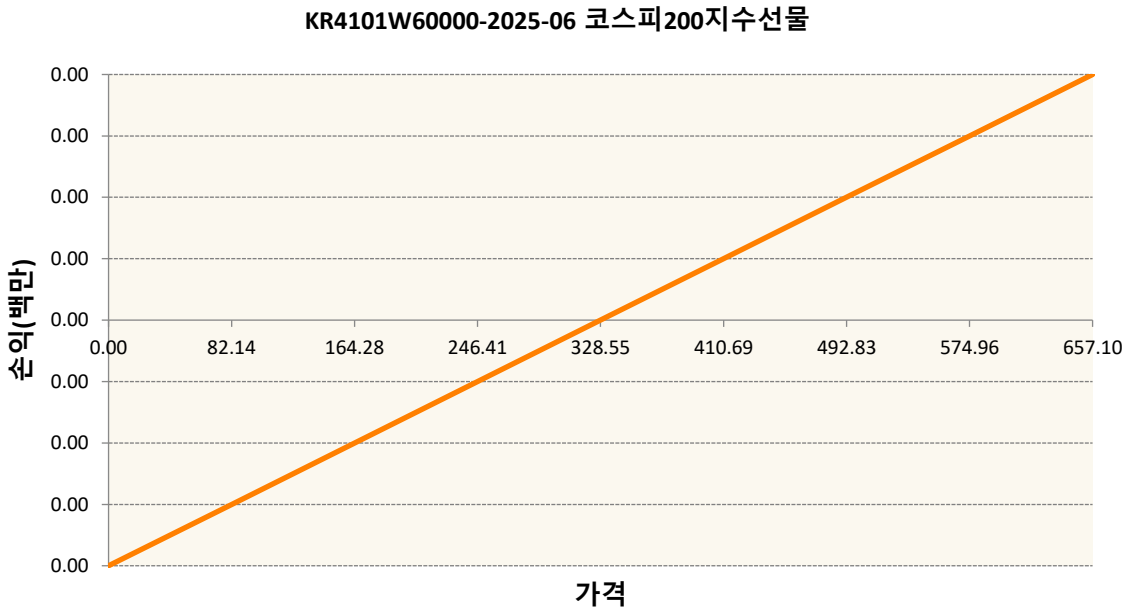
스마트인덱스모

1. 계약금액

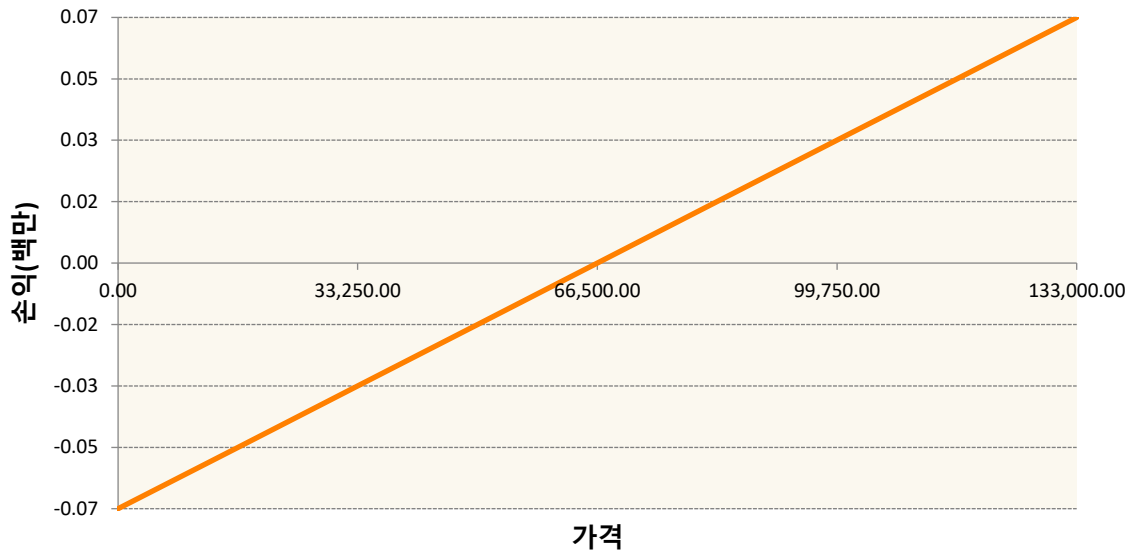
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,727	0	1,727	장내

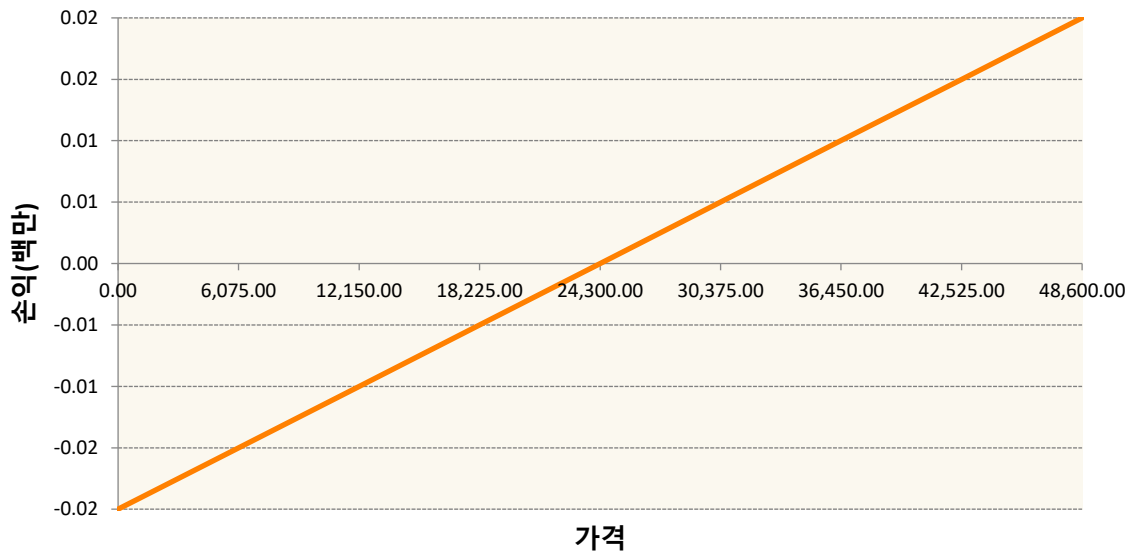
2. 만기시점의 손익구조



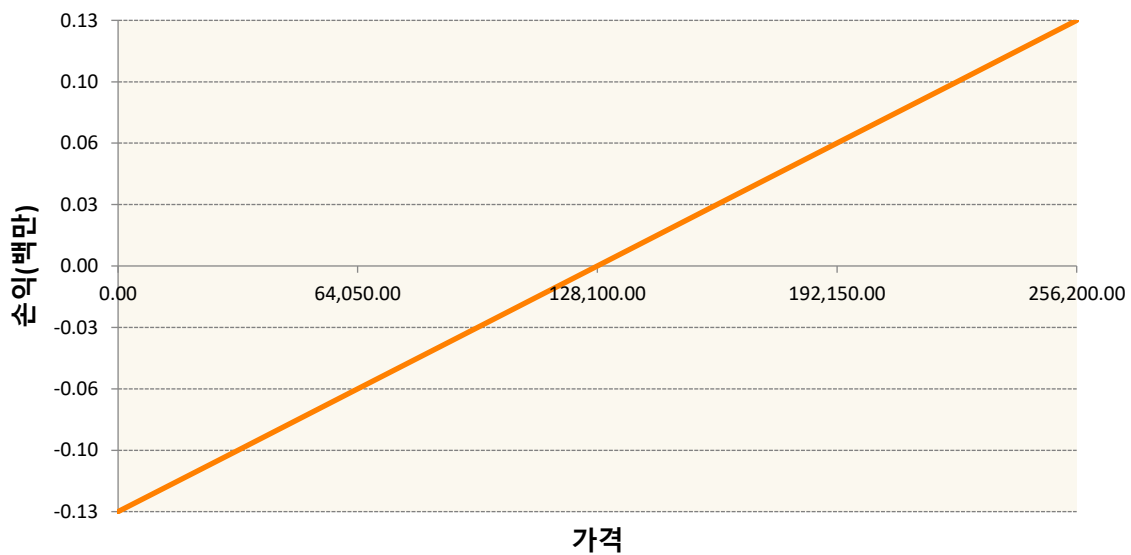
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



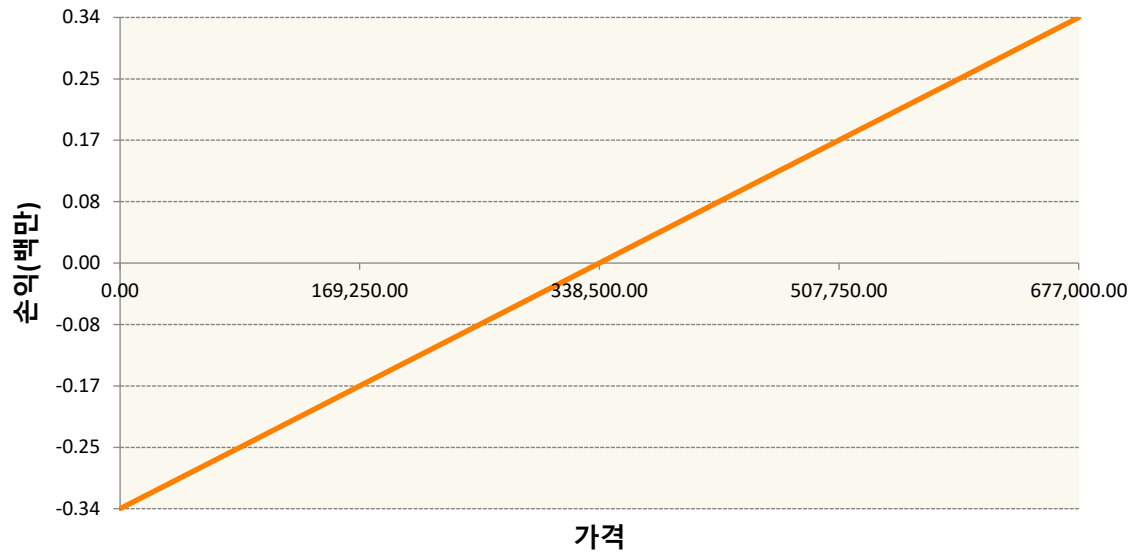
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



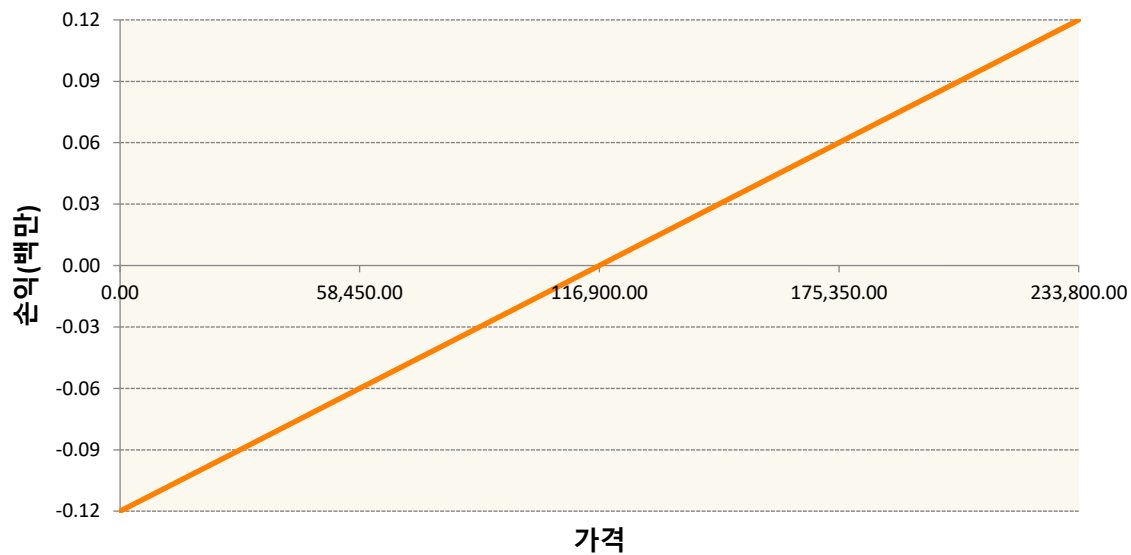
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	112
KR410FW50(2025-05 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	3
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물	1
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물	14
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물	2

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

(단위:백만원)

221

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

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	284
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

466

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

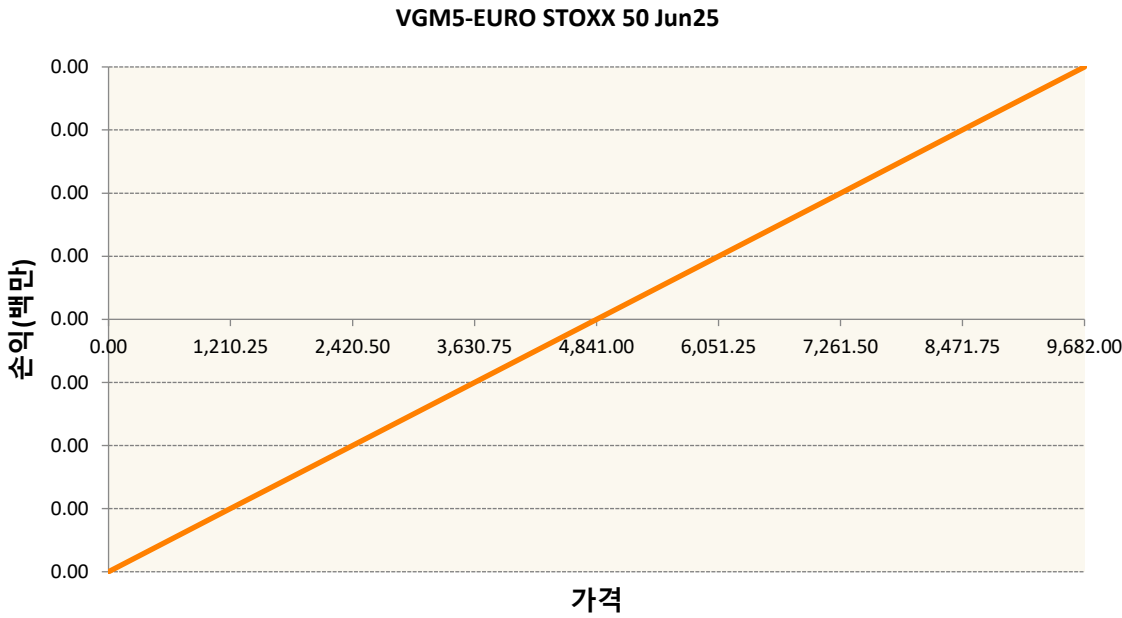
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	770	0	770	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	62
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

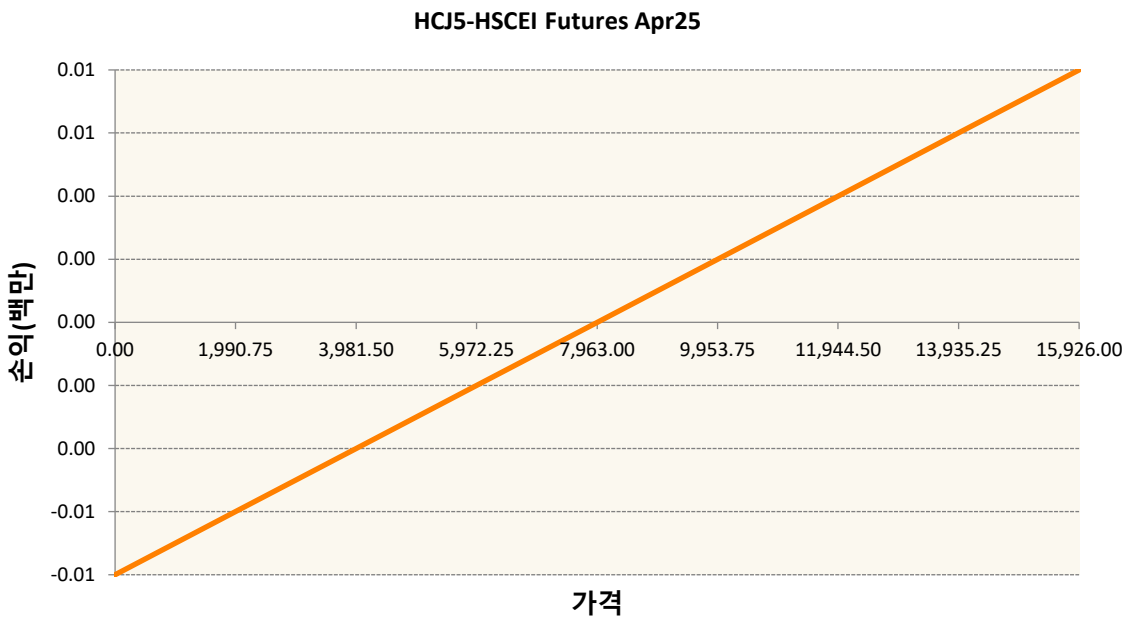
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	3,461	0	3,461	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI5	HSCEI Futures Apr25	277
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

415

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

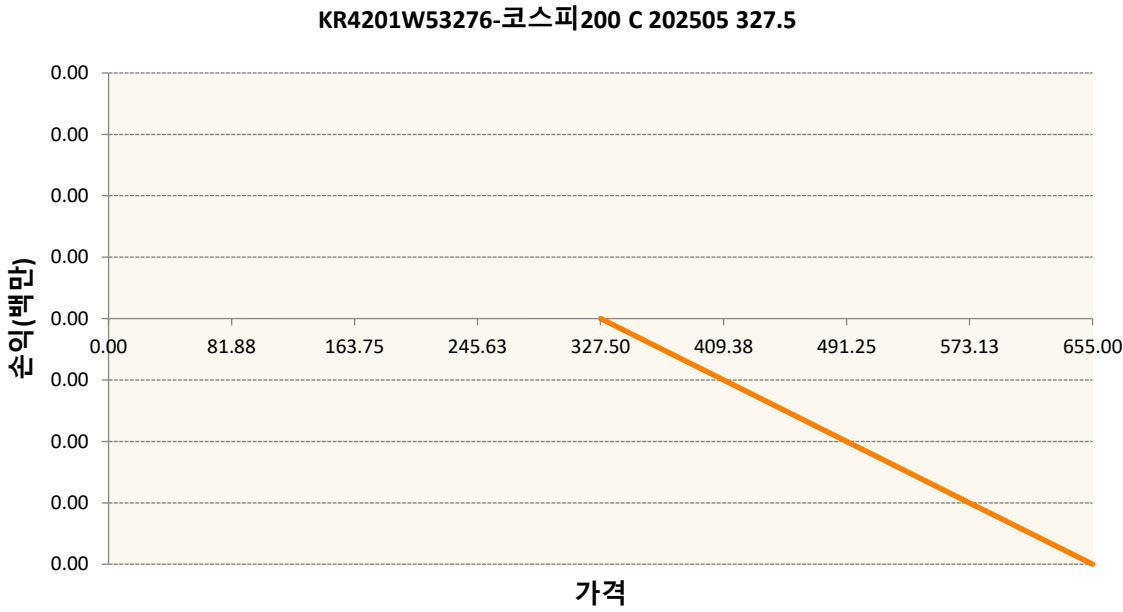
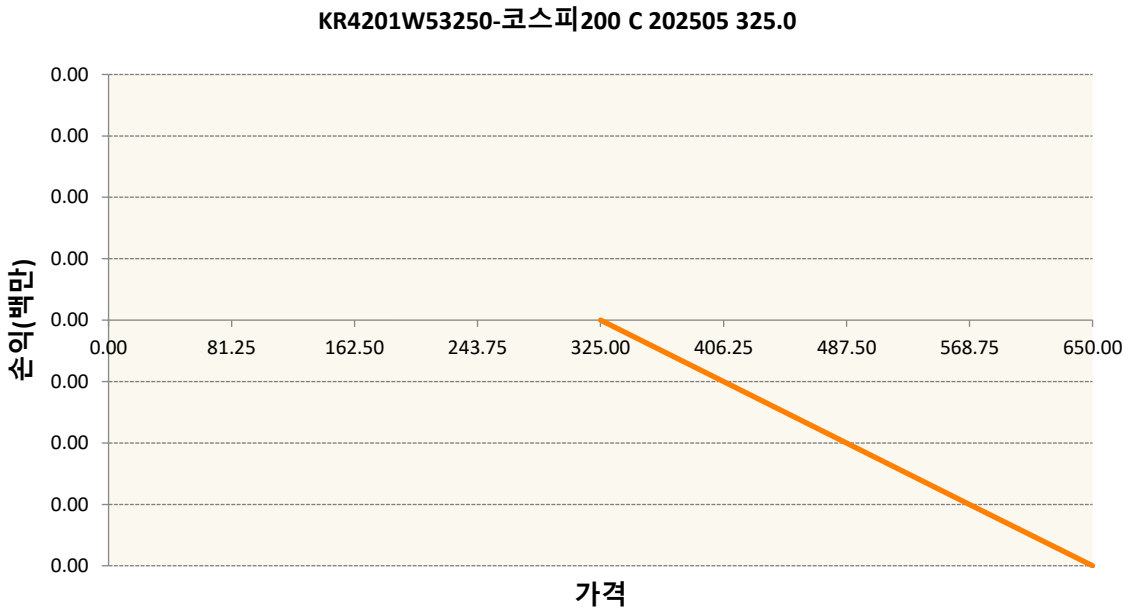
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	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 0.00 to 0.00. 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	0.00
325.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the profit/loss (손익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 655.00 with major ticks every 81.88. The y-axis represents the profit/loss, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. An orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (327.50, 0.00), indicating that the profit/loss is zero at this price point.

가액	손익(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							1,842
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	778	763	744	722	696	668	637
-5.33%	705	672	636	597	556	514	470
-2.67%	517	467	416	364	312	260	207
0%	162	108	54	0	-54	-108	-163
2.67%	-364	-406	-449	-495	-541	-589	-638
5.33%	-1,013	-1,037	-1,064	-1,096	-1,130	-1,166	-1,205
8.00%	-1,727	-1,737	-1,751	-1,769	-1,790	-1,815	-1,842
KR4201W53276 코스피200 C 202505 327.5							57
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	21	21	20	19	19	18
-5.33%	20	19	18	17	16	14	13
-2.67%	15	14	12	10	9	7	6
0%	5	4	2	0	-2	-4	-5
2.67%	-10	-12	-13	-15	-16	-18	-20
5.33%	-30	-31	-32	-33	-34	-36	-37
8.00%	-52	-53	-53	-54	-55	-56	-57
KR4301W53258 코스피200 P 202505 325.0							399

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-362	-366	-371	-377	-384	-391	-399
-5.33%	-195	-204	-213	-223	-233	-244	-255
-2.67%	-57	-69	-82	-95	-108	-122	-135
0%	41	27	14	0	-14	-27	-41
2.67%	96	86	75	63	52	39	27
5.33%	122	116	109	101	92	83	73
8.00%	131	128	125	120	114	108	101
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%	-14	-14	-14	-14	-14	-15	-15
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-9	-9	-10
-2.67%	-2	-3	-3	-4	-4	-5	-5
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	4	3	3	3	2	2	1
5.33%	5	5	4	4	4	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	4	4

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

(단위:백만원)

2,326

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

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	529	0	529	

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	2025-04-16
기준일	2025-04-15

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	4,259	0	4,259	

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	2025-04-16
기준일	2025-04-15

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	12,248	0	12,248	
누계	통화	선도	356	12,502	-12,145	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E	208
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
FXW213F4F0 KRW/USD 30-04-25E	14
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

488

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

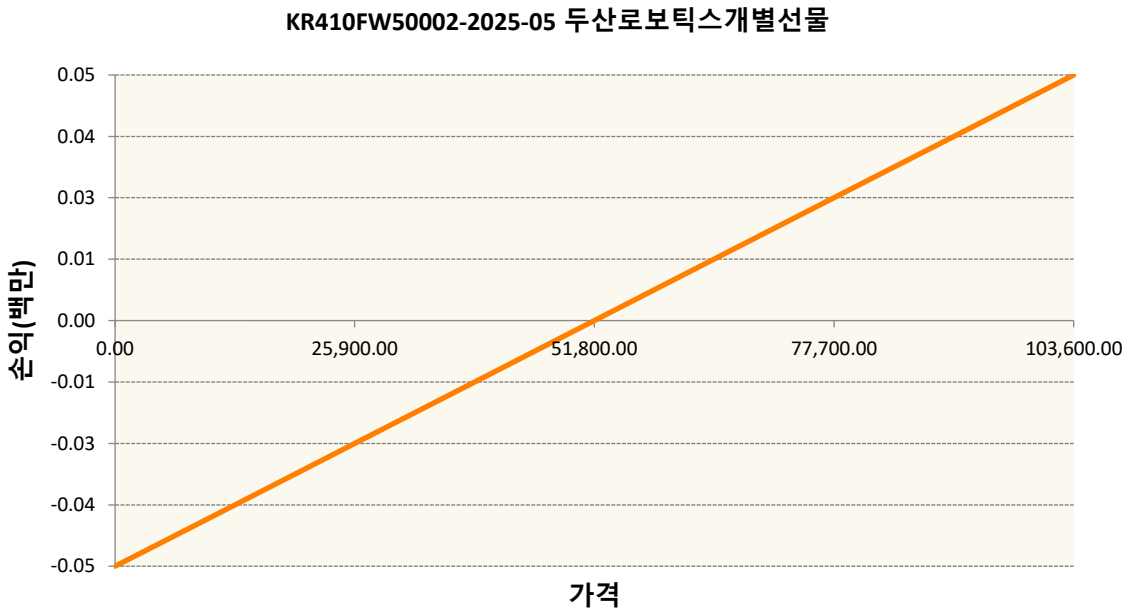
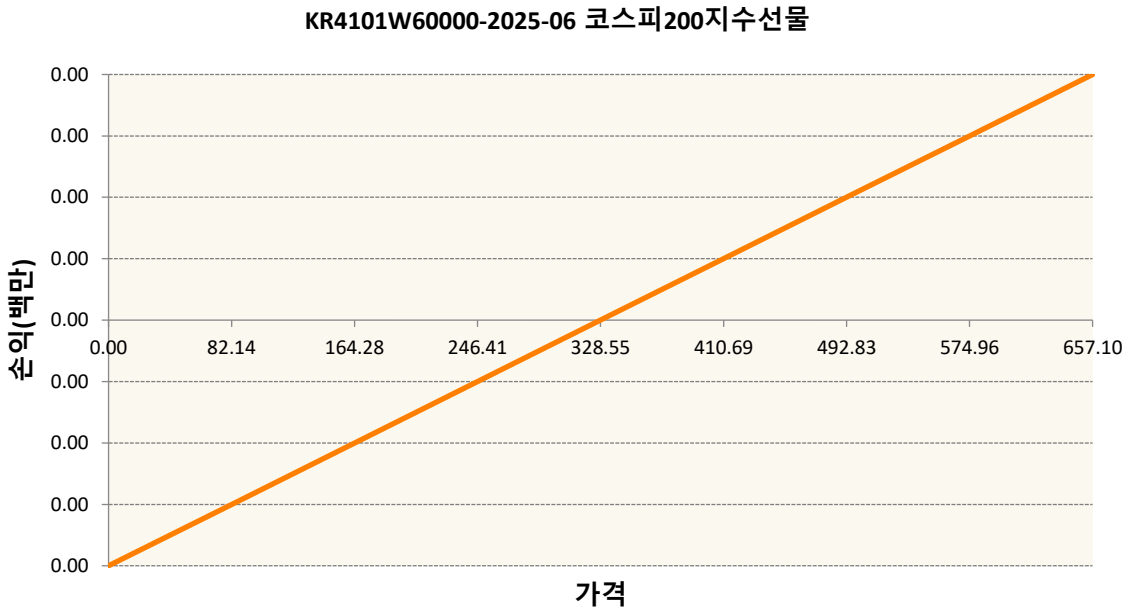
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

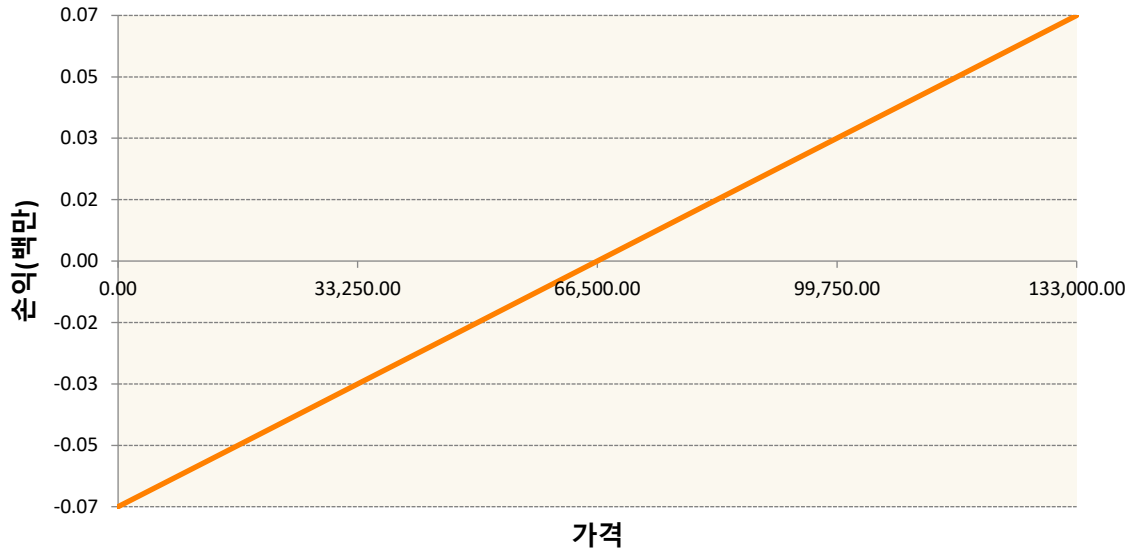
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2	0	2	장내
누계	유가증권	선물	991	0	991	장내

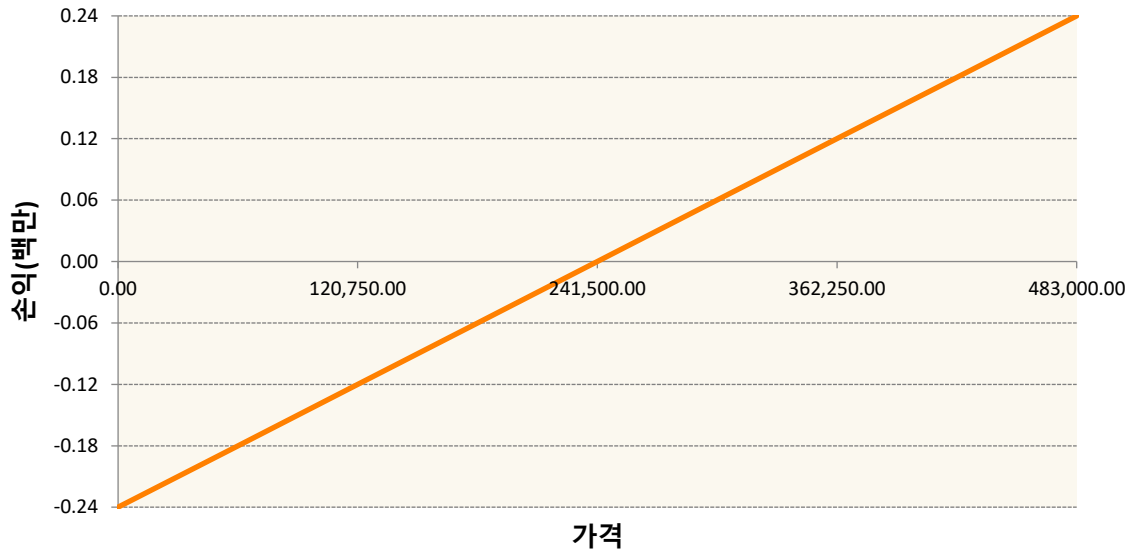
2. 만기시점의 손익구조



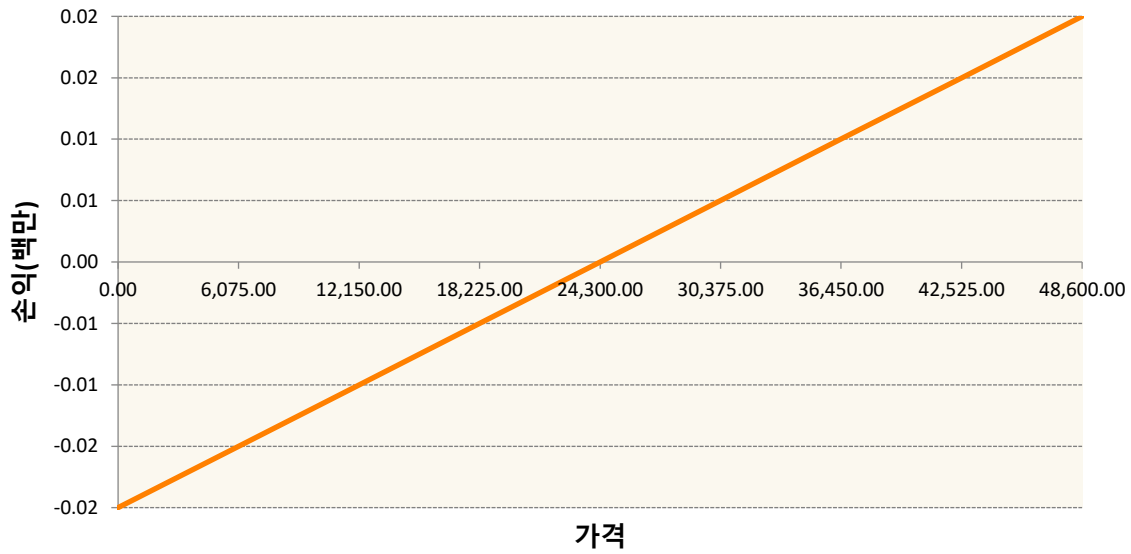
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



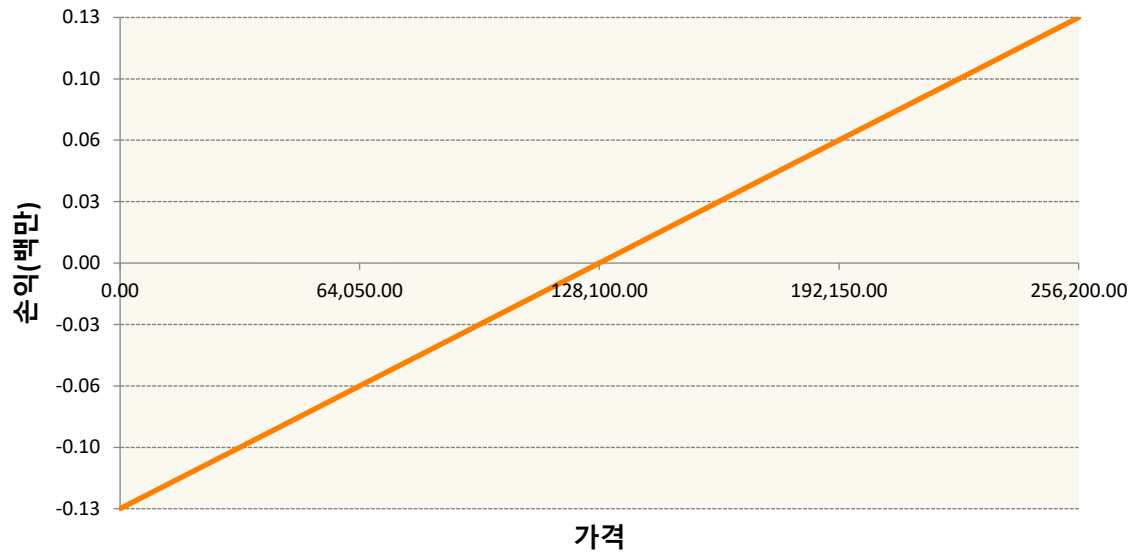
KR4120W50001-2025-05 현대모비스개별선물



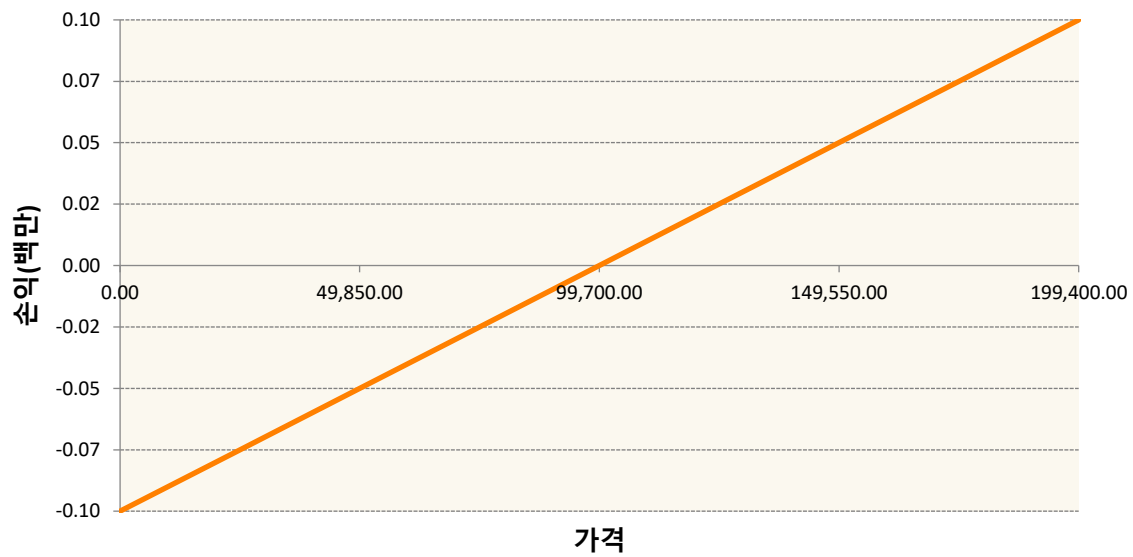
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



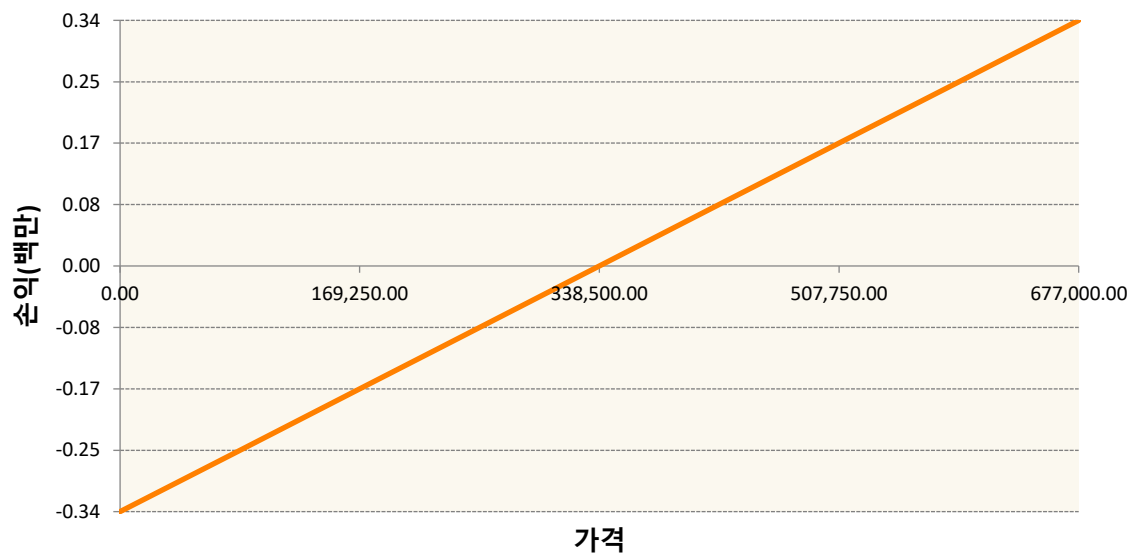
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



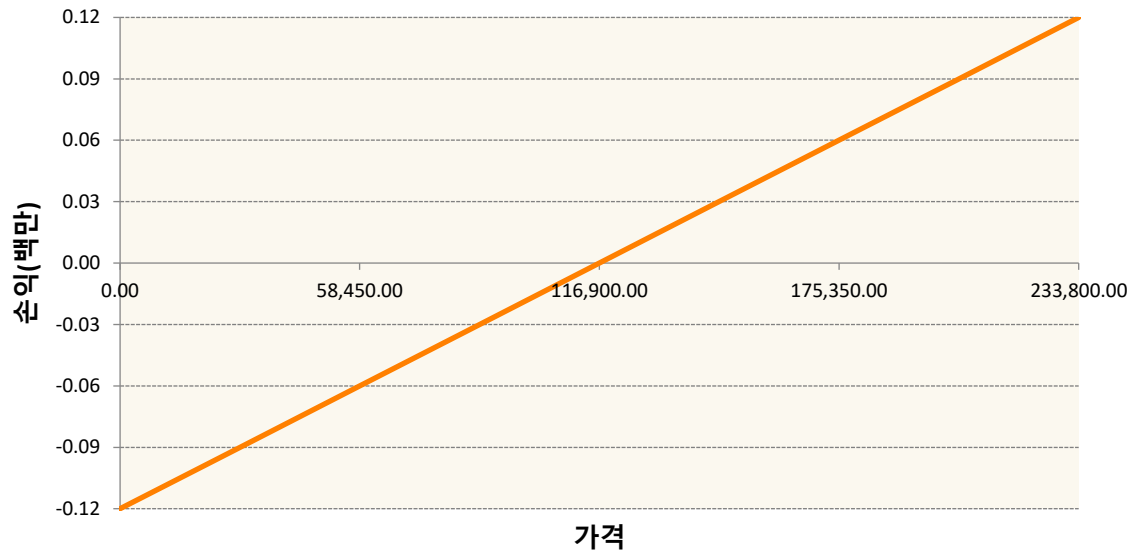
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	66
KR410FW50(2025-05 두산로보틱스개별선물	0.5
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	1
KR4120W50(2025-05 현대모비스개별선물	0.19
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)

127

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

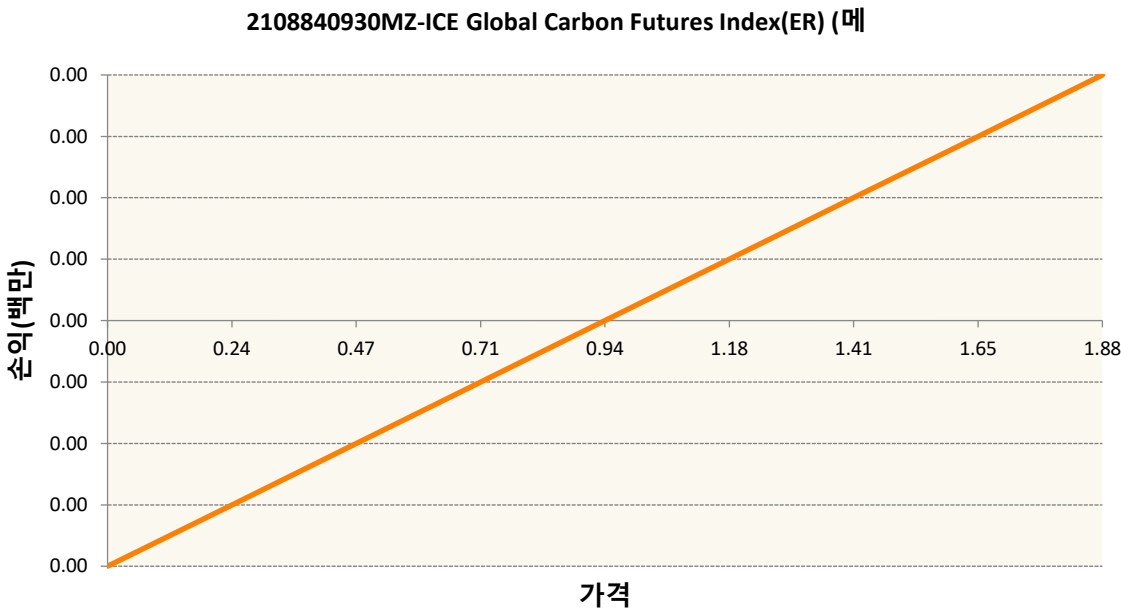
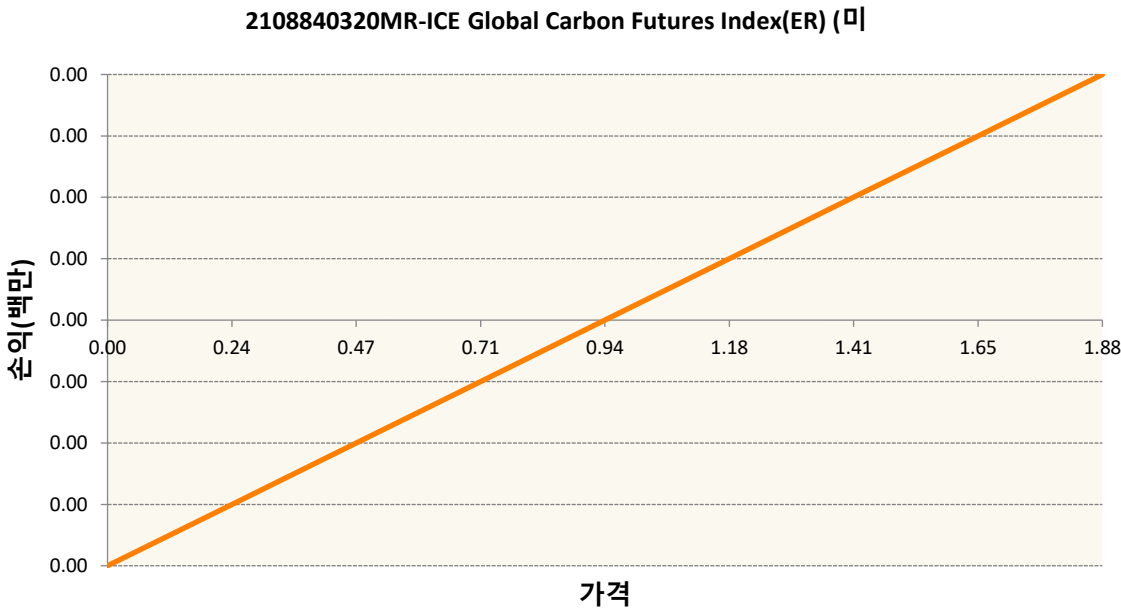
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,248	0	9,248	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	553
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	185

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	864

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

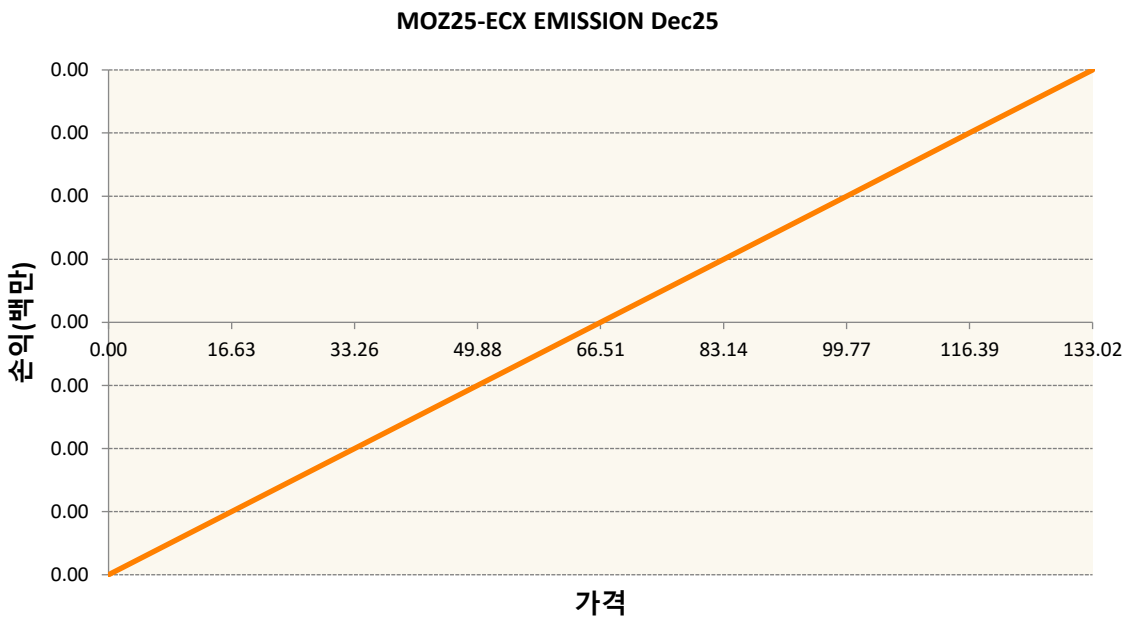
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,979	0	5,979	
누계	통화	선도	0	1,183	-1,183	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	80
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	480

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

(단위:백만원)

904

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

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)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	18

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

(단위:백만원)

109

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

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)	21
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	25
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)

124

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

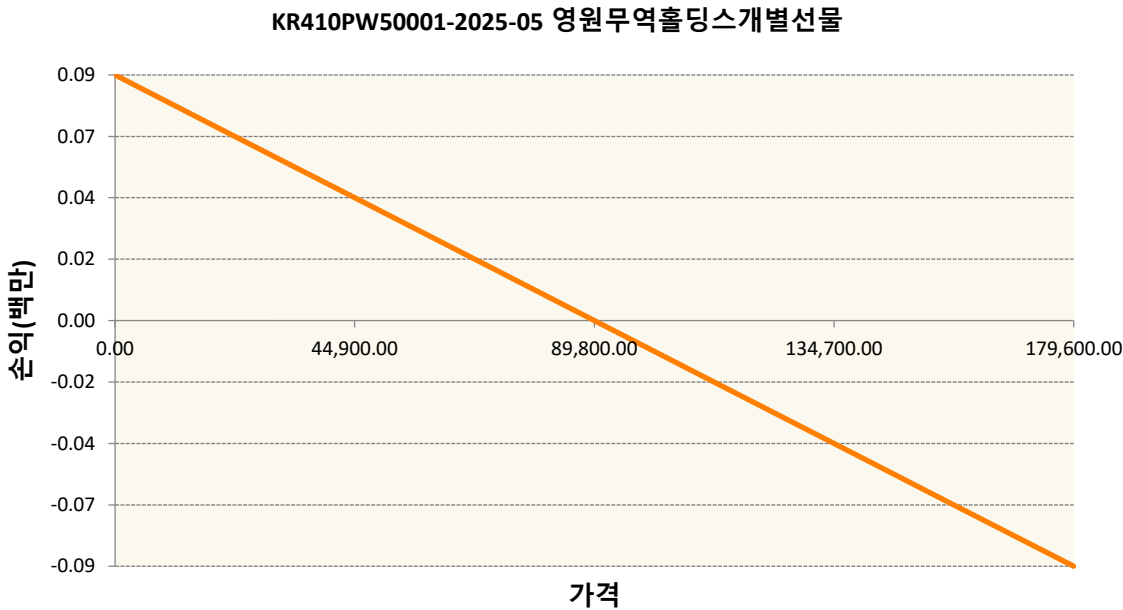
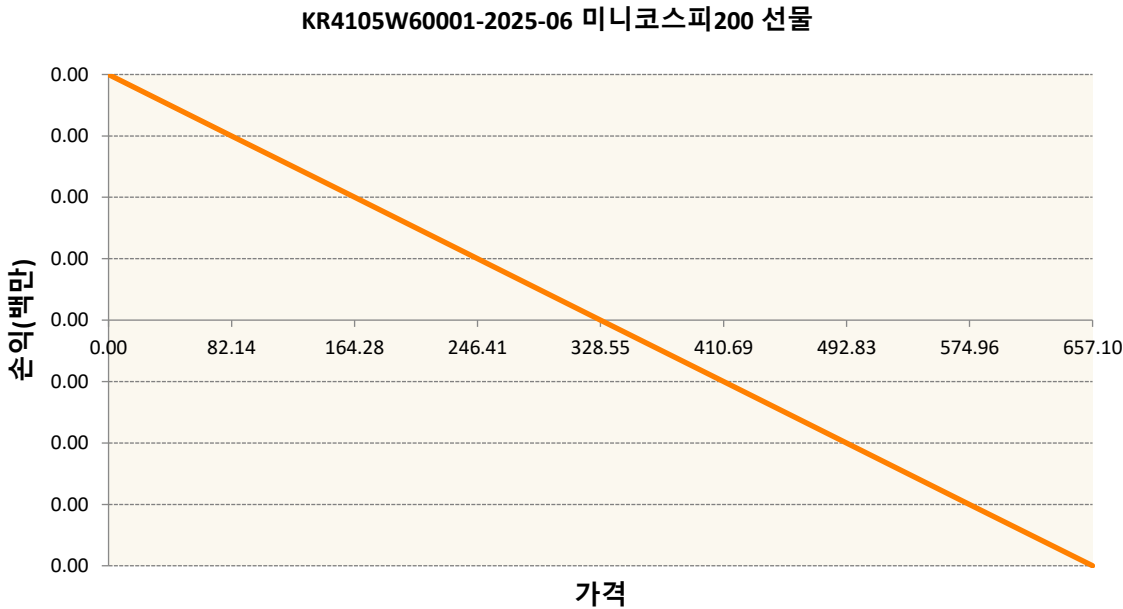
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

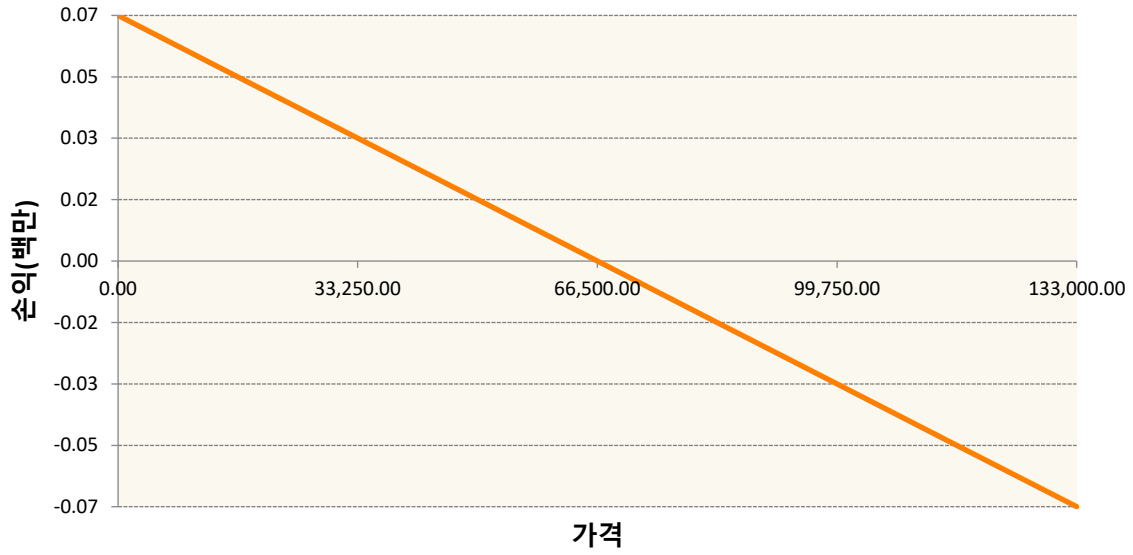
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	86	-86	장내
누계	유가증권	선물	4	209	-206	장내

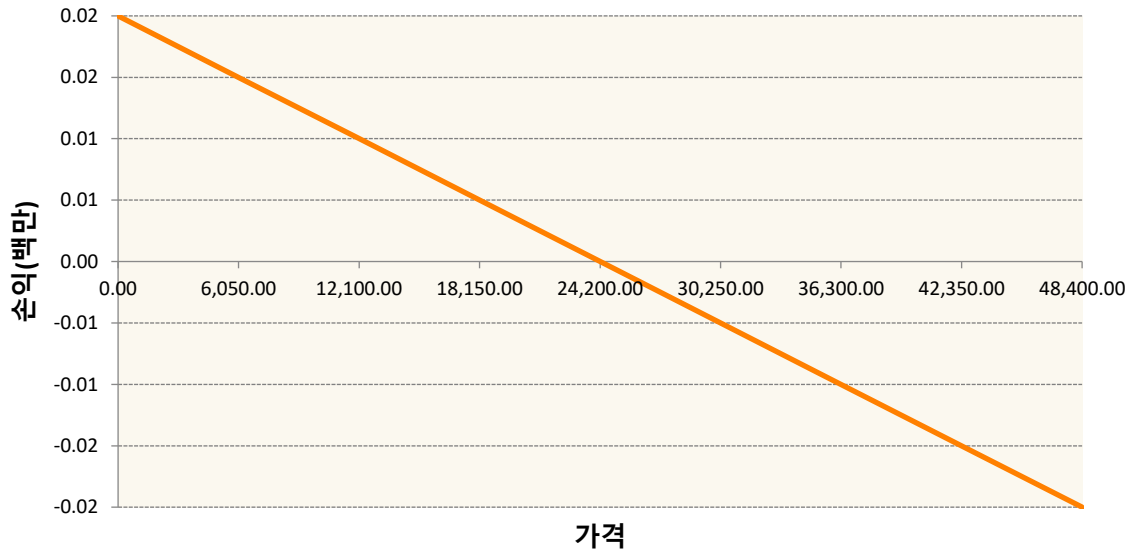
2. 만기시점의 손익구조



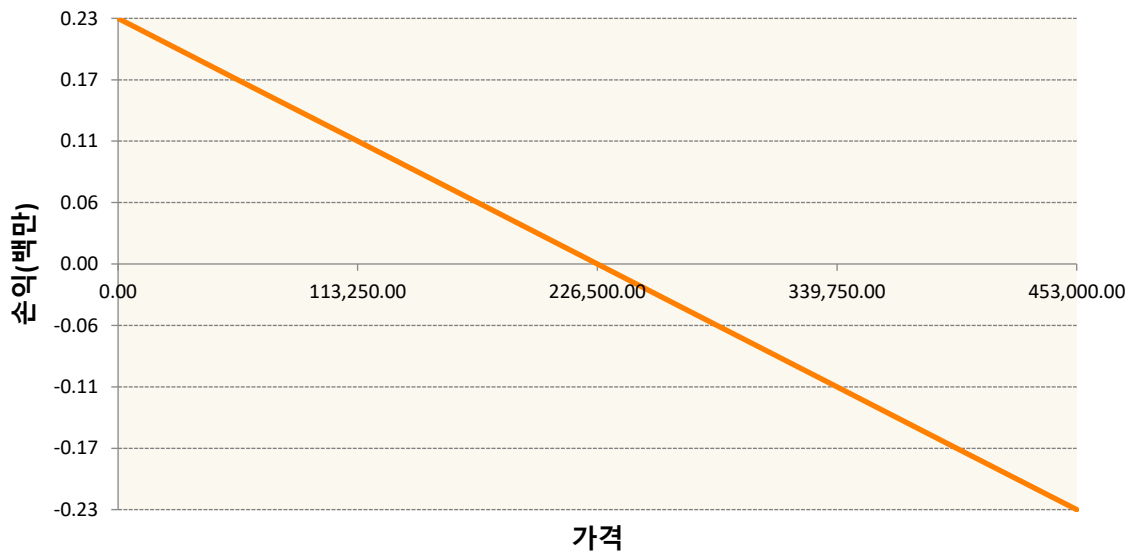
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



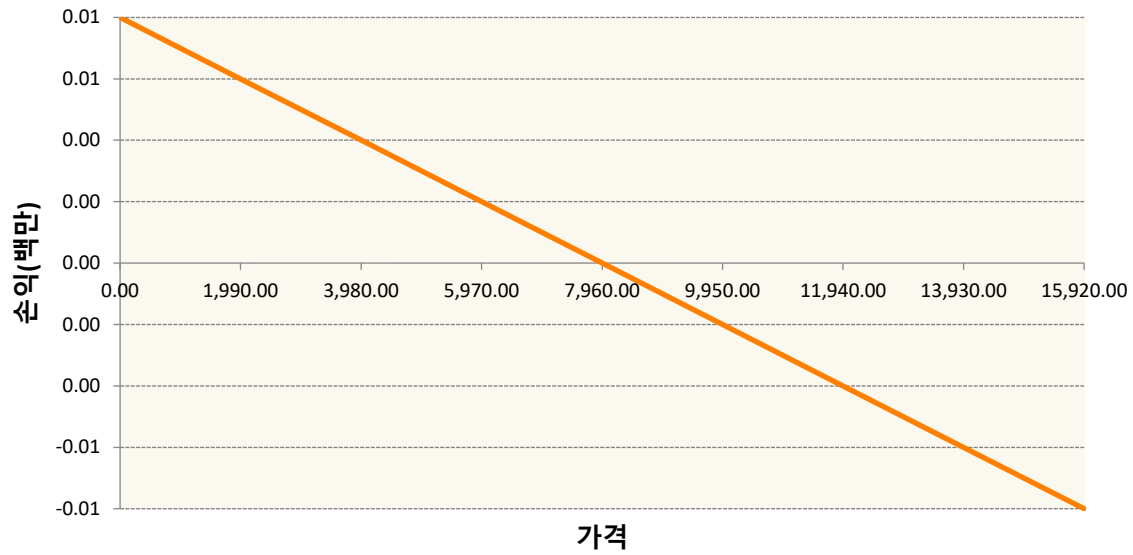
KR4115W50001-2025-05 한국전력개별선물



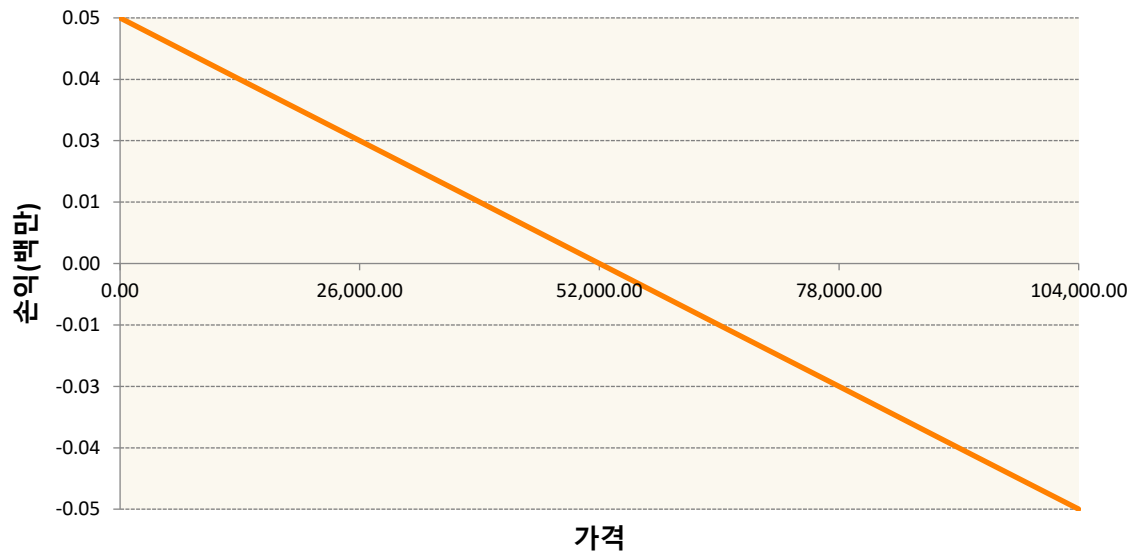
KR4139W50001-2025-05 HD한국조선해양개별선물



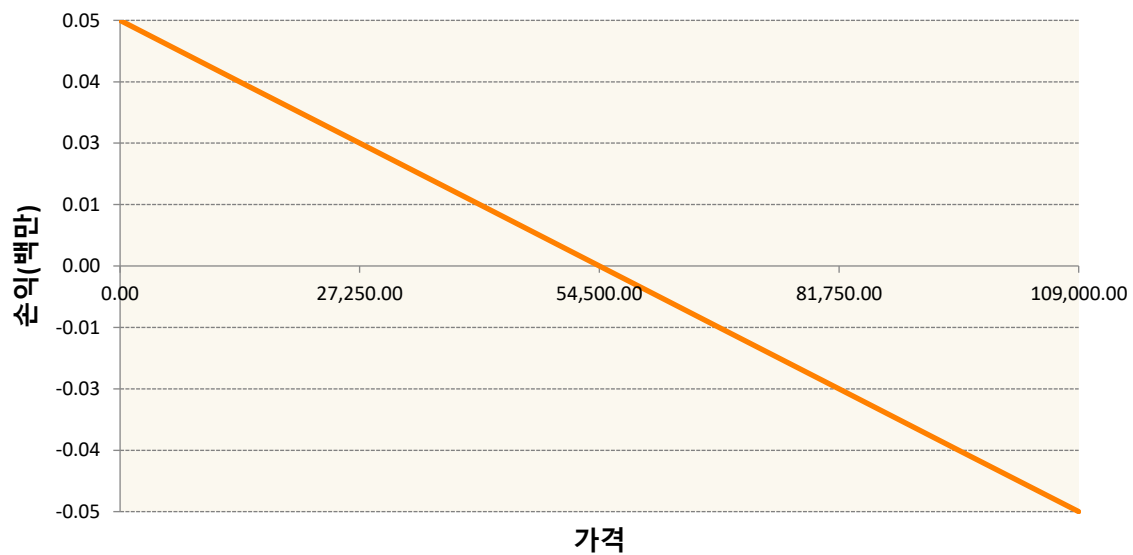
KR4149W50000-2025-05 HD현대인프라코어개별선물



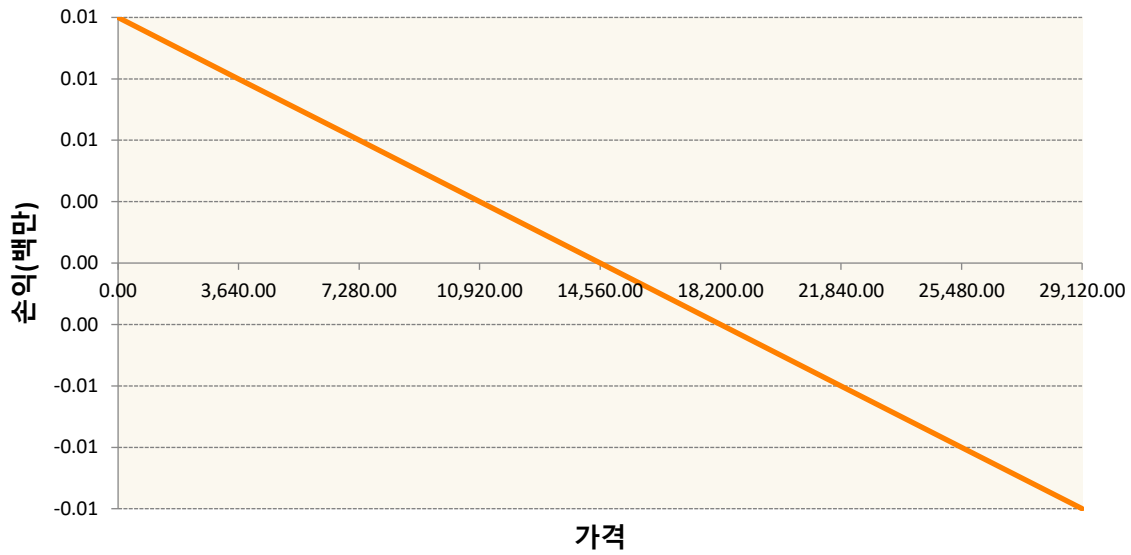
KR41B2W50007-2025-05 S-Oil개별선물



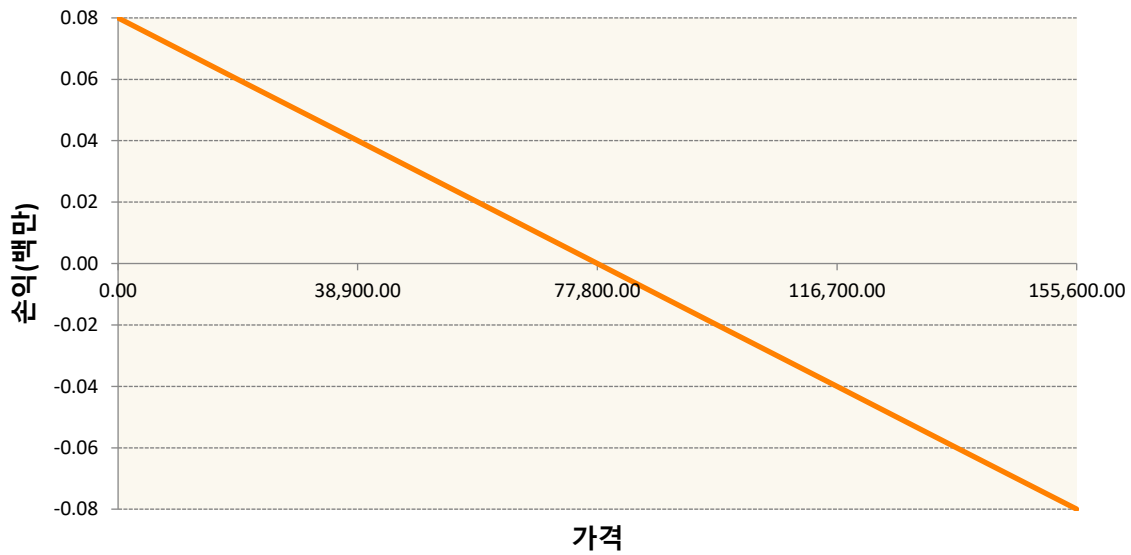
KR41B7W50006-2025-05 포스코인터내셔널개별선물



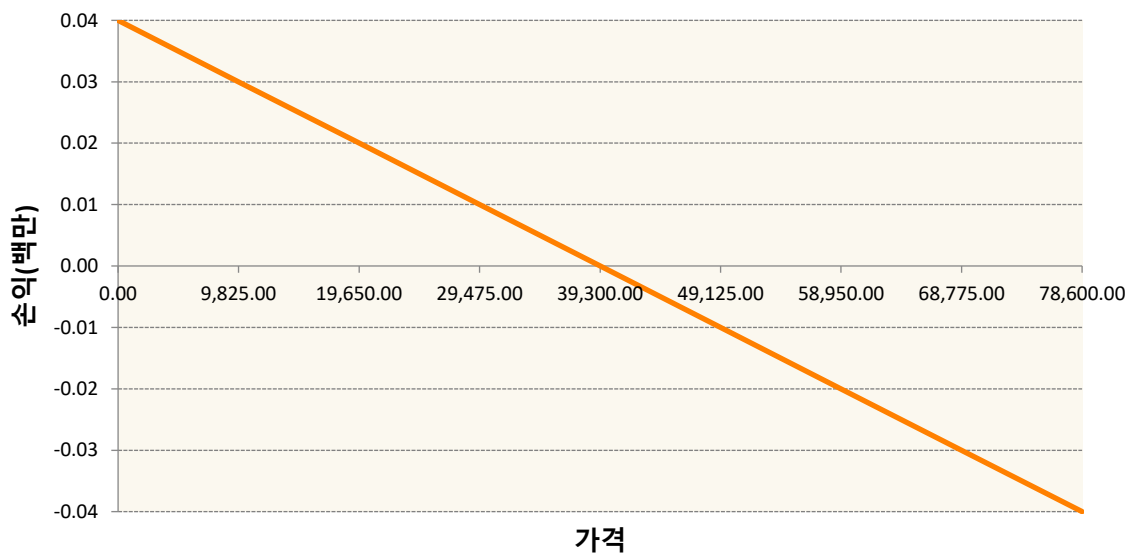
KR41BFW50008-2025-05 삼성중공업개별선물



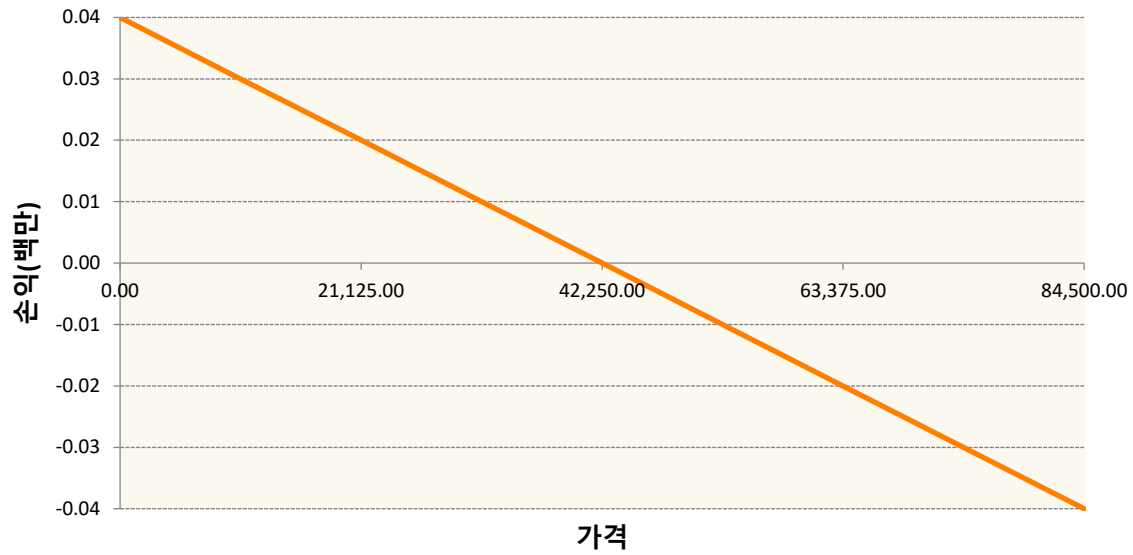
KR41BMW50004-2025-05 한국항공우주개별선물



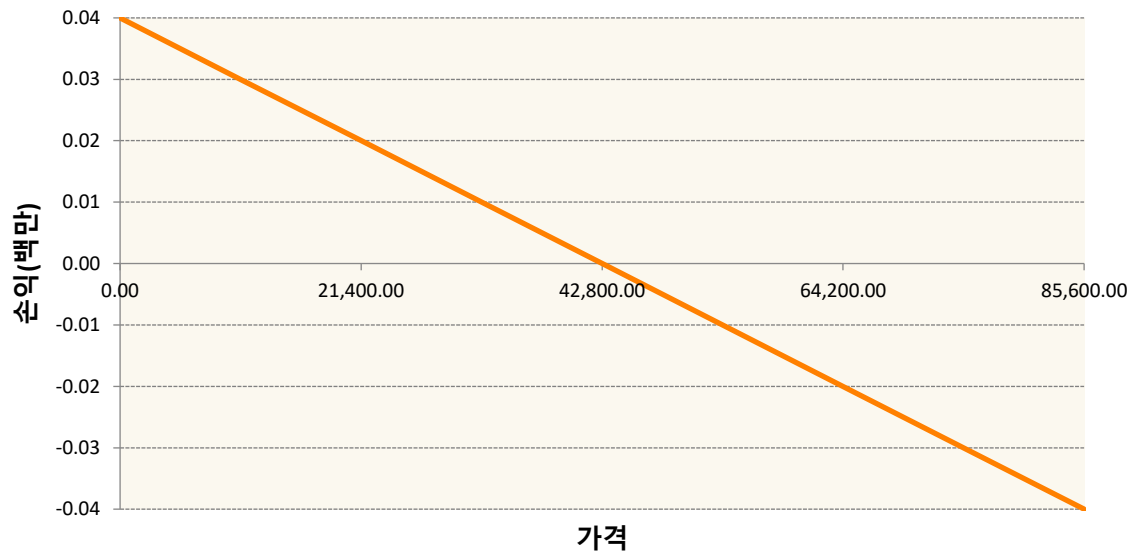
KR41BNW50002-2025-05 현대건설개별선물



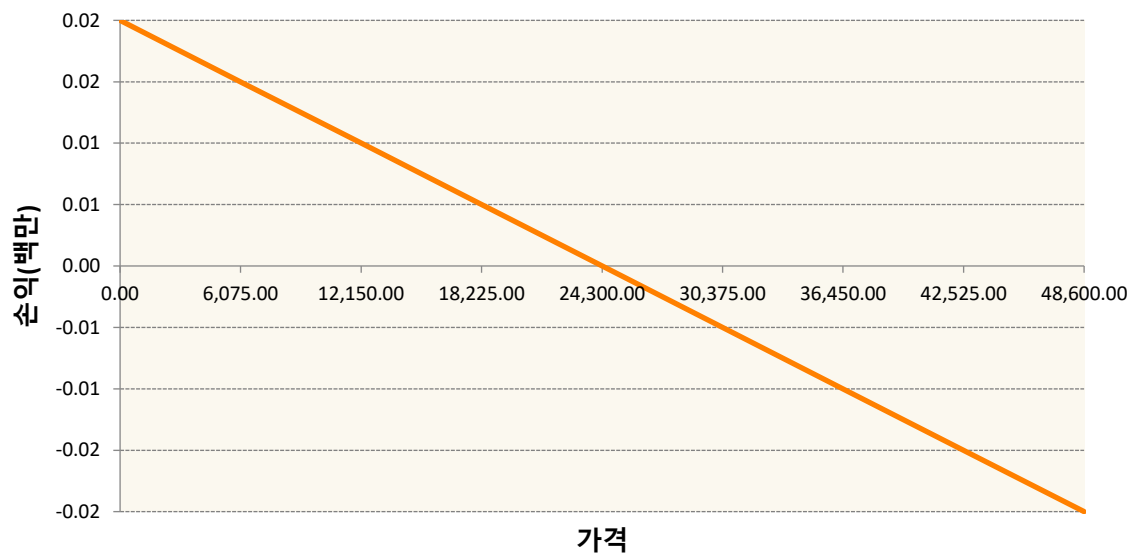
KR41BPW50007-2025-05 현대위아개별선물



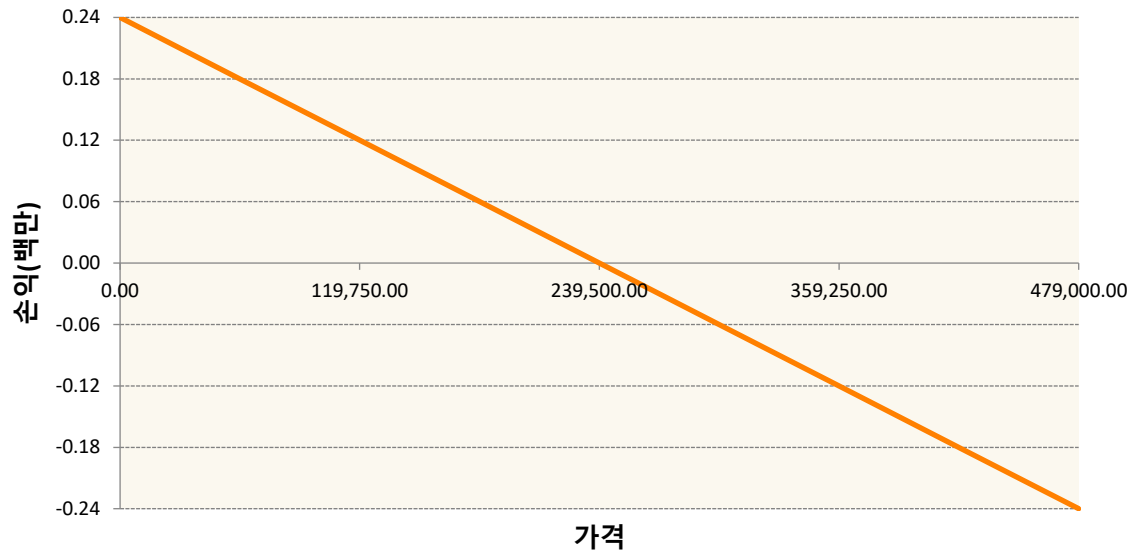
KR41C9W50001-2025-05 한화개별선물



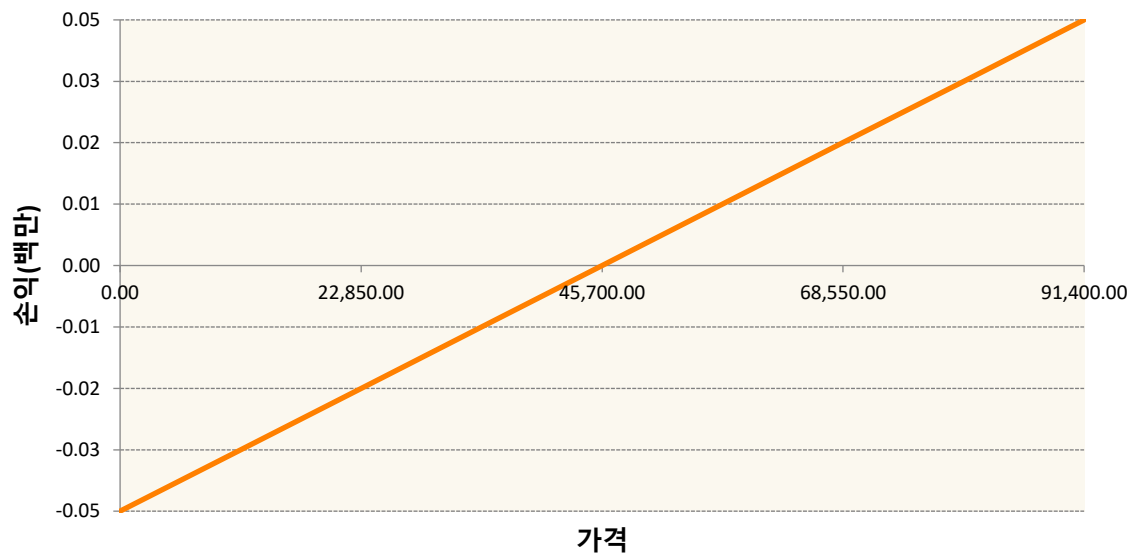
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



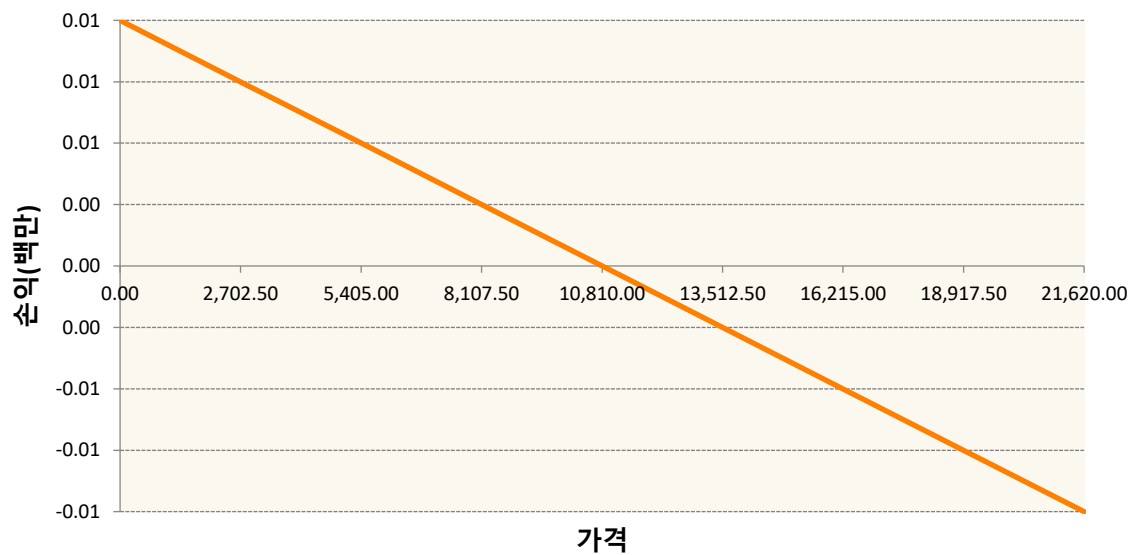
KR41CXW50009-2025-05 한미약품개별선물



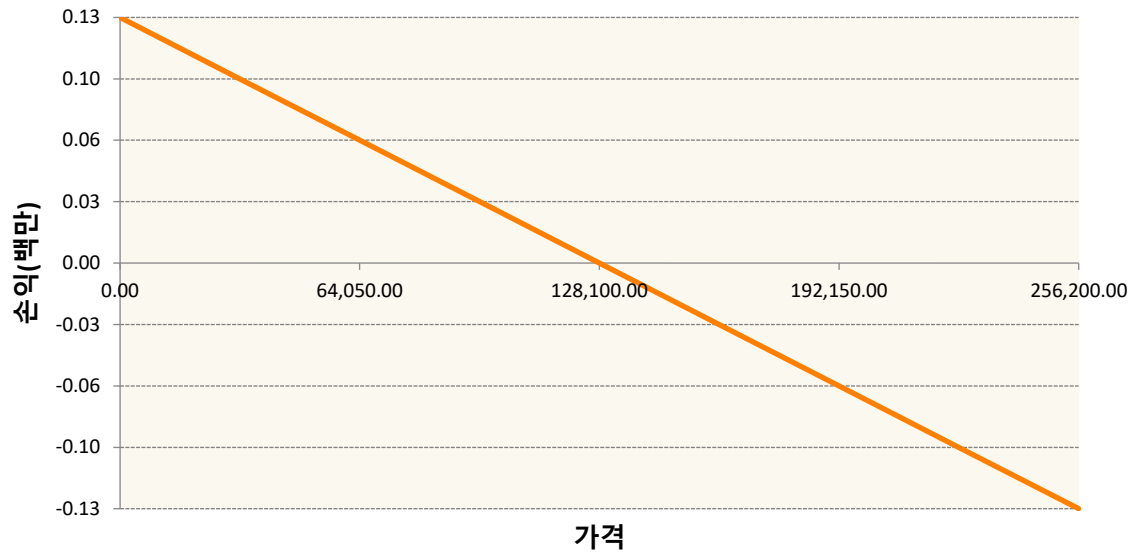
KR41DGW50002-2025-05 영원무역개별선물



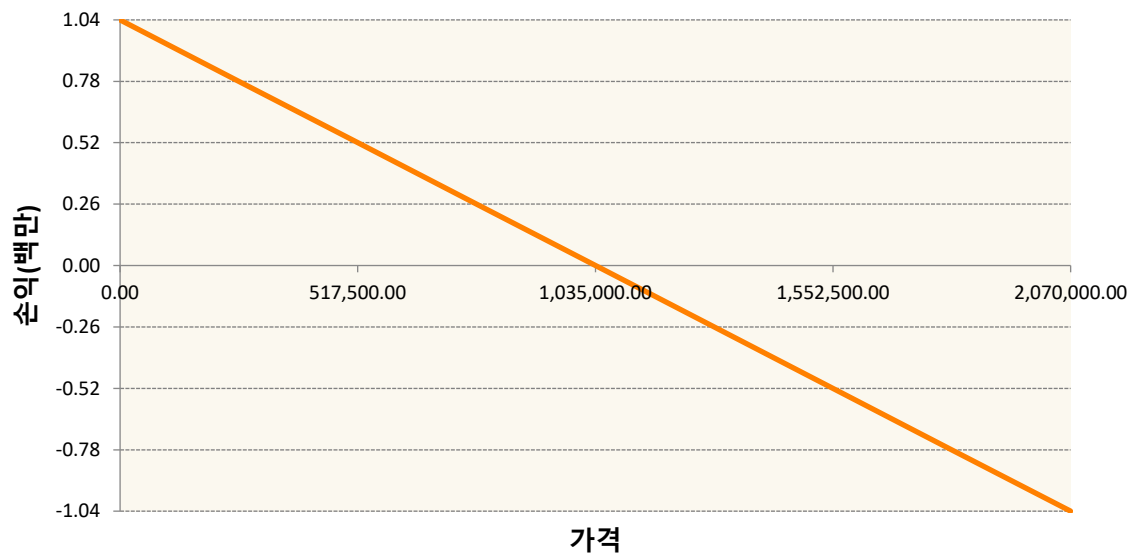
KR41DZW50002-2025-05 한세실업개별선물



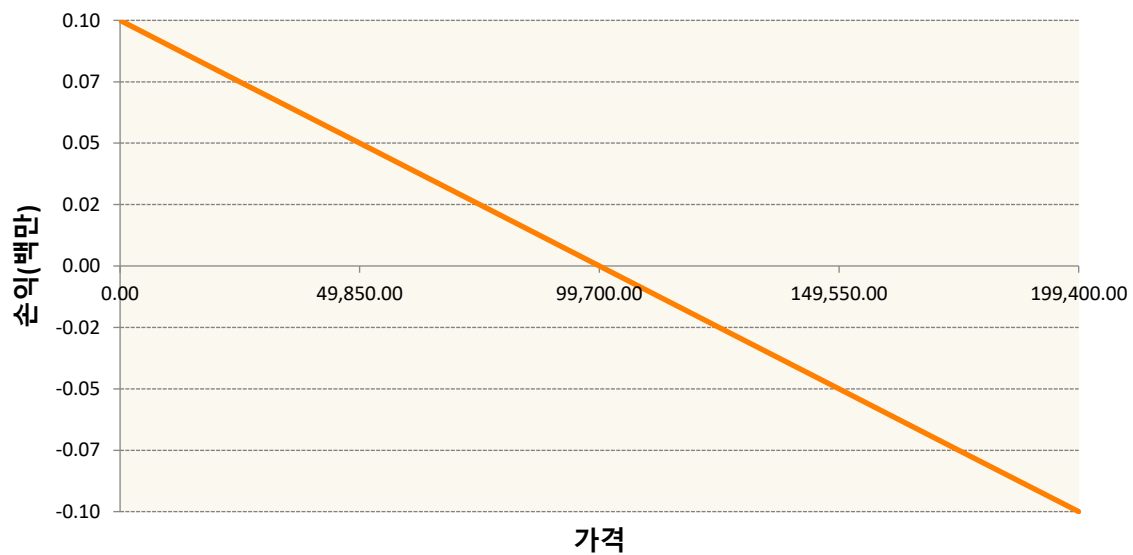
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



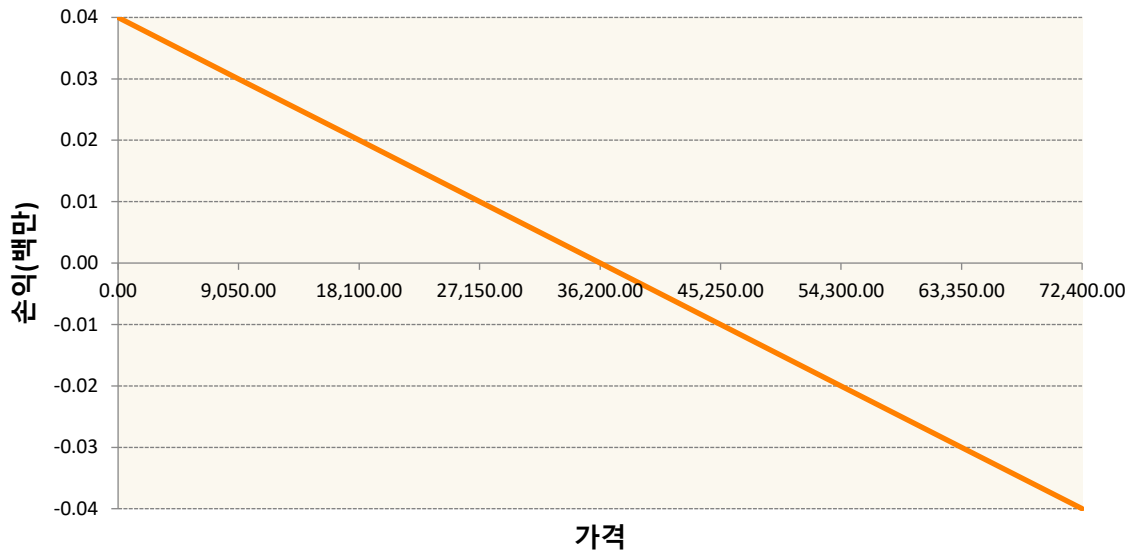
KR41ESW50005-2025-05 삼성바이오로직스개별선물



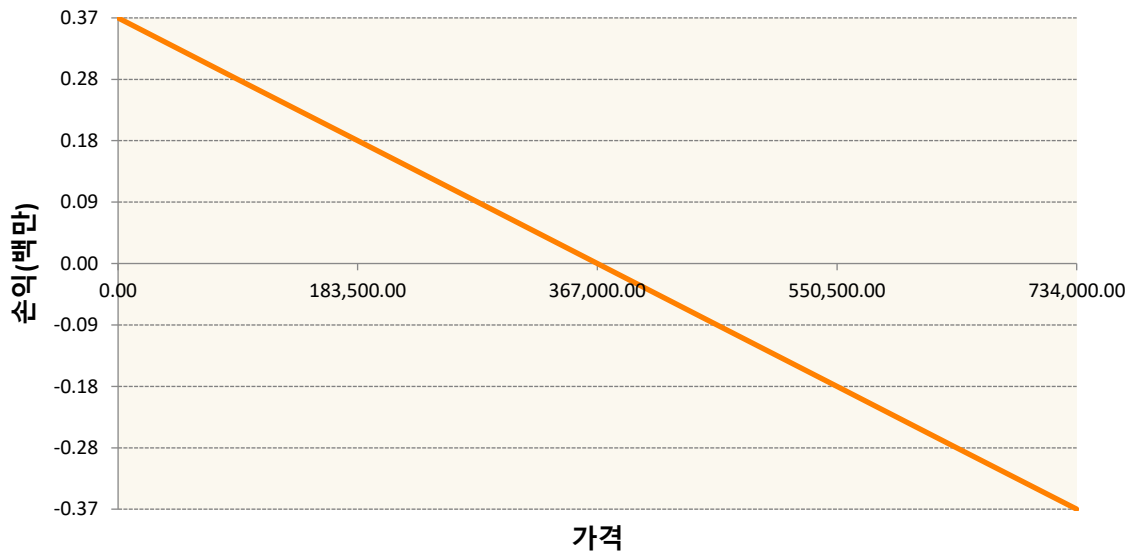
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



KR41HRW50000-2025-05 주성엔지니어링개별선물



KR41HSW50008-2025-05 파마리서치개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105W60(2025-06 미니코스피200 선물	1
KR410PW50(2025-05 영원무역홀딩스개별선물	0.07
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	1
KR4115W50(2025-05 한국전력개별선물	0.31
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
KR41BMW5C 2025-05 한국항공우주개별선물	1
KR41BNW50 2025-05 현대건설개별선물	0.31
KR41BPW50(2025-05 현대위아개별선물	0.3

KR41C9W50(2025-05 한화개별선물	0.41
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물	1
KR41CXW50(2025-05 한미약품개별선물	0.38
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
KR41HRW50 2025-05 주성엔지니어링개별선물	0.26
KR41HSW50 2025-05 파마리서치개별선물	0.29

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	27

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

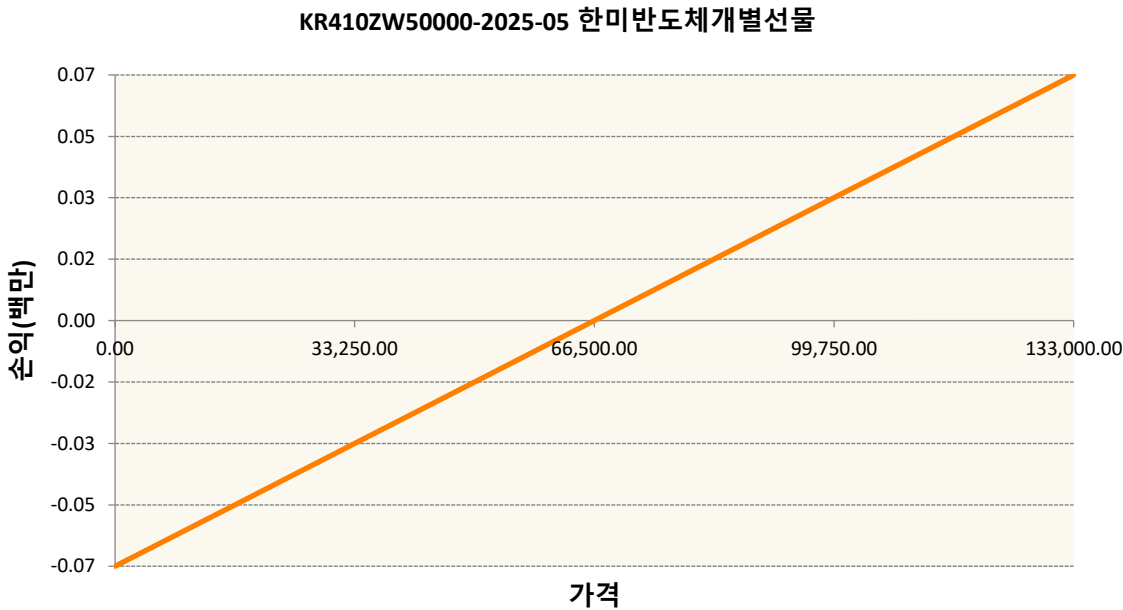
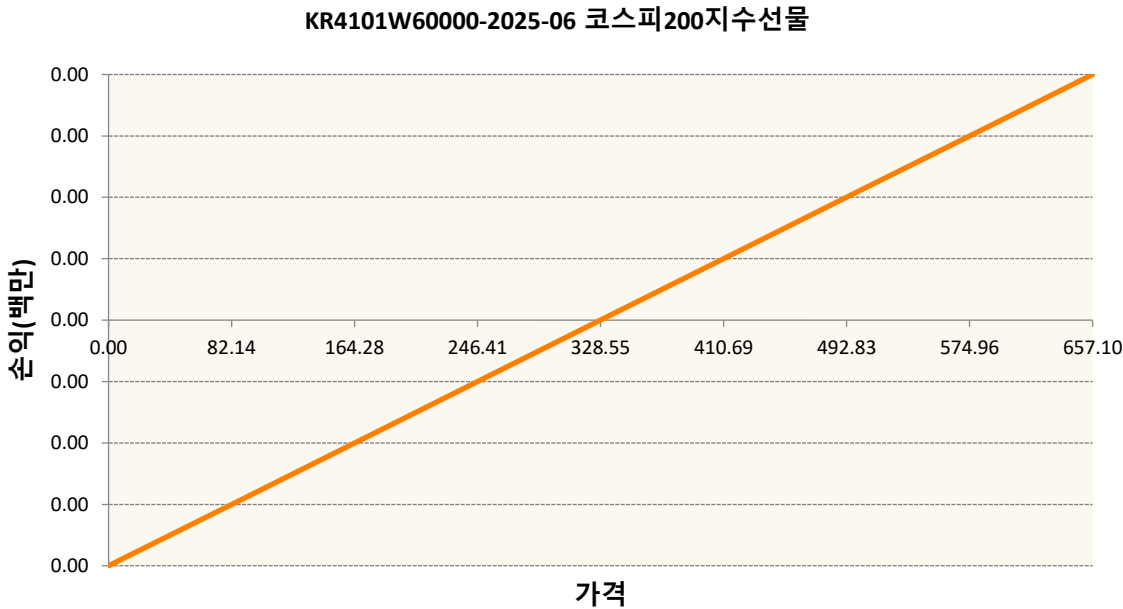
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

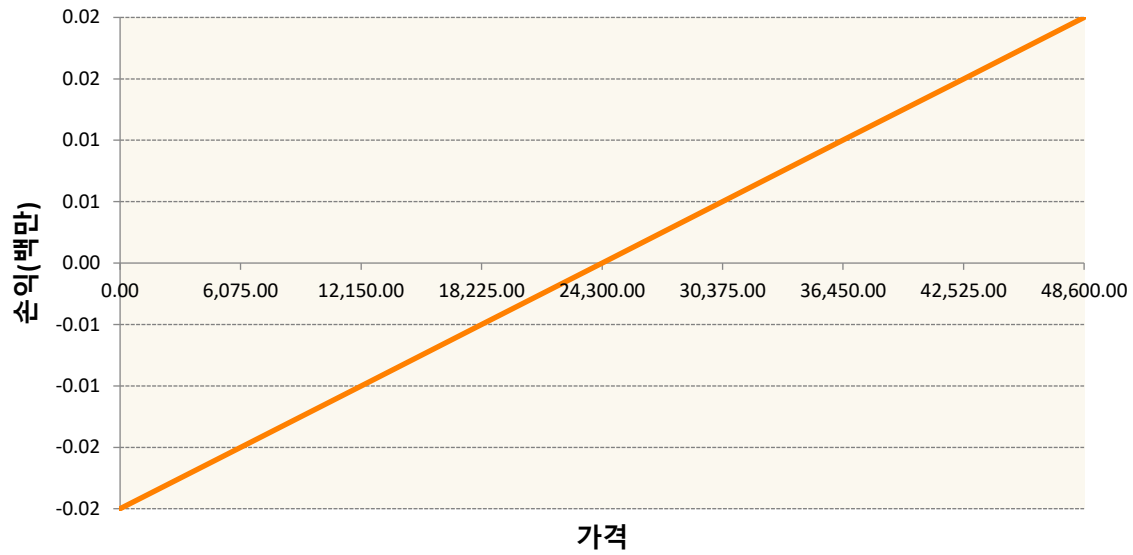
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,402	0	9,402	장내

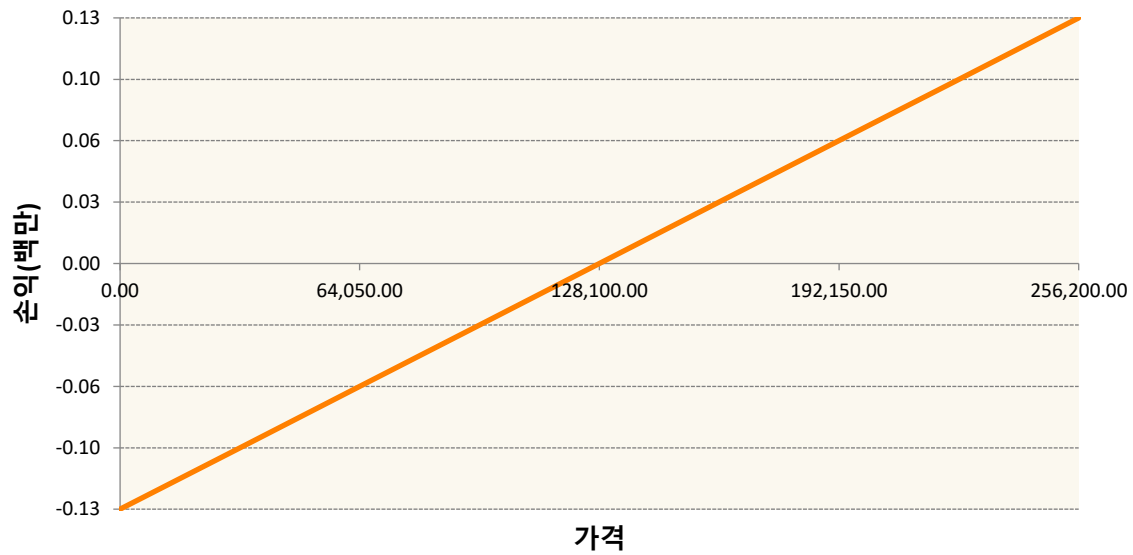
2. 만기시점의 손익구조



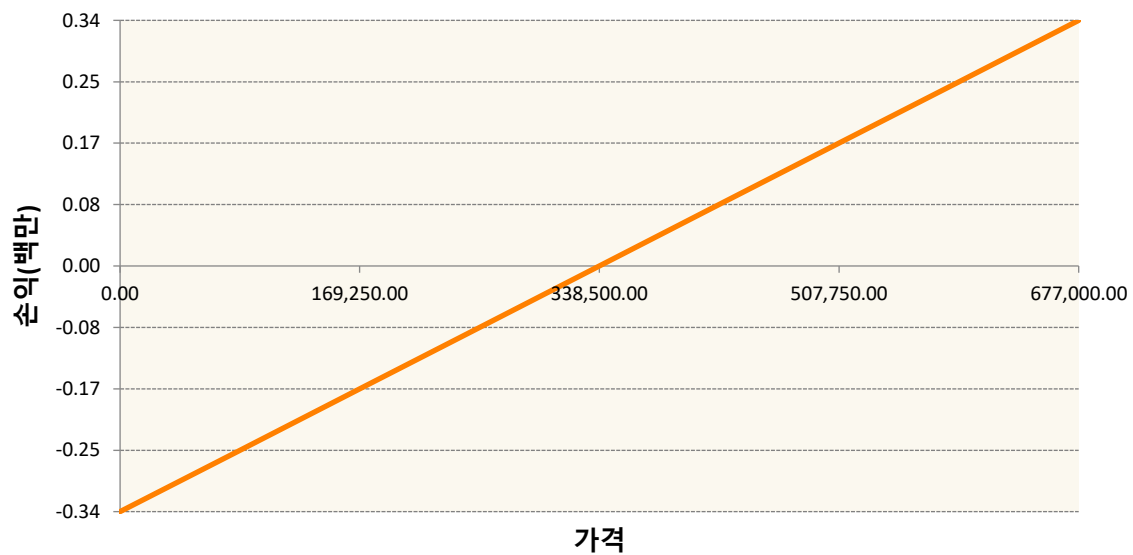
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		578
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)
	1,235

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

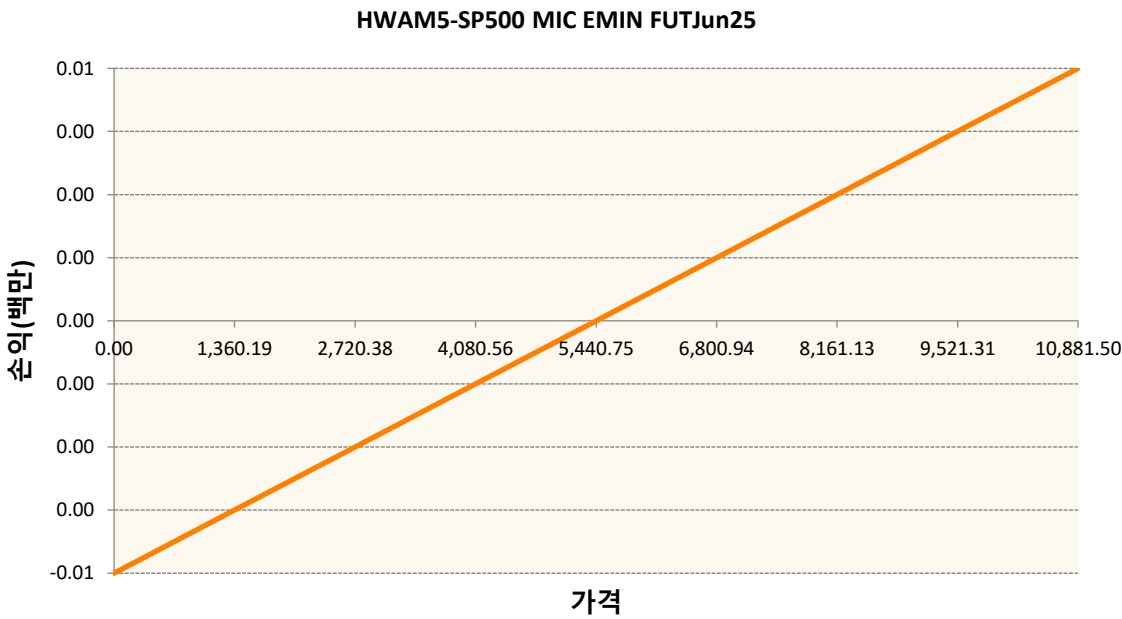
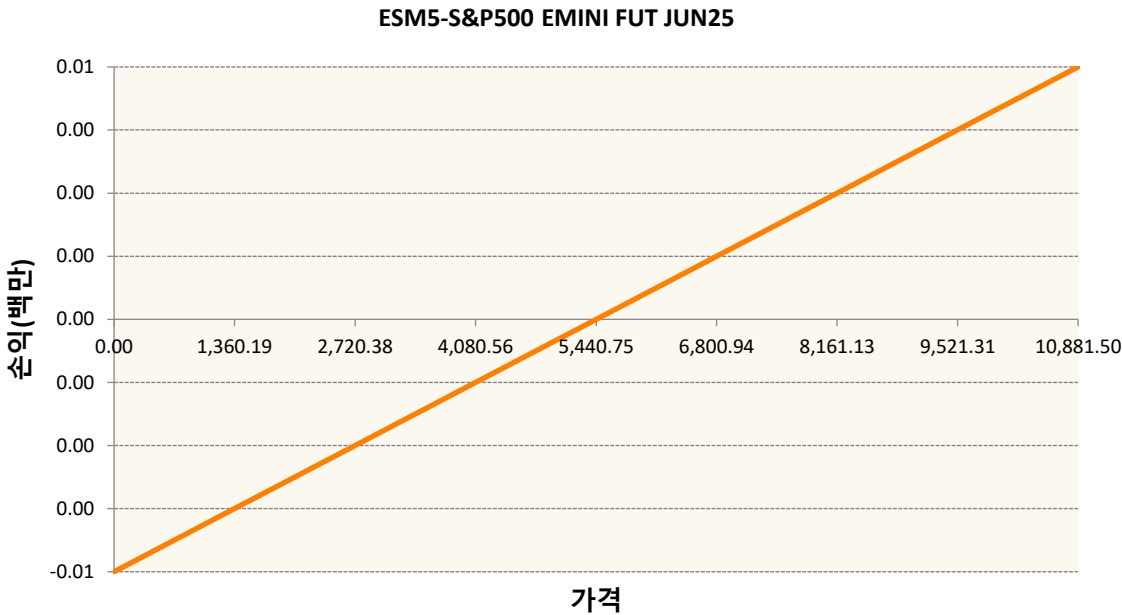
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	26,227	0	26,227	
누계	유가증권	선물	1,152	0	1,152	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,098
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	92

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,876

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

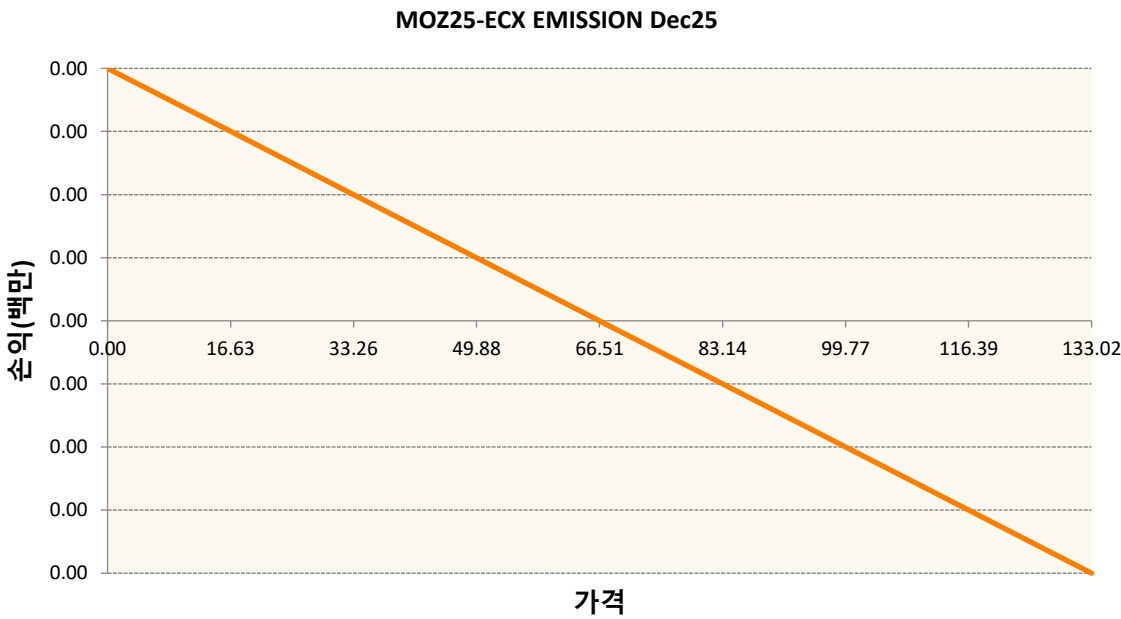
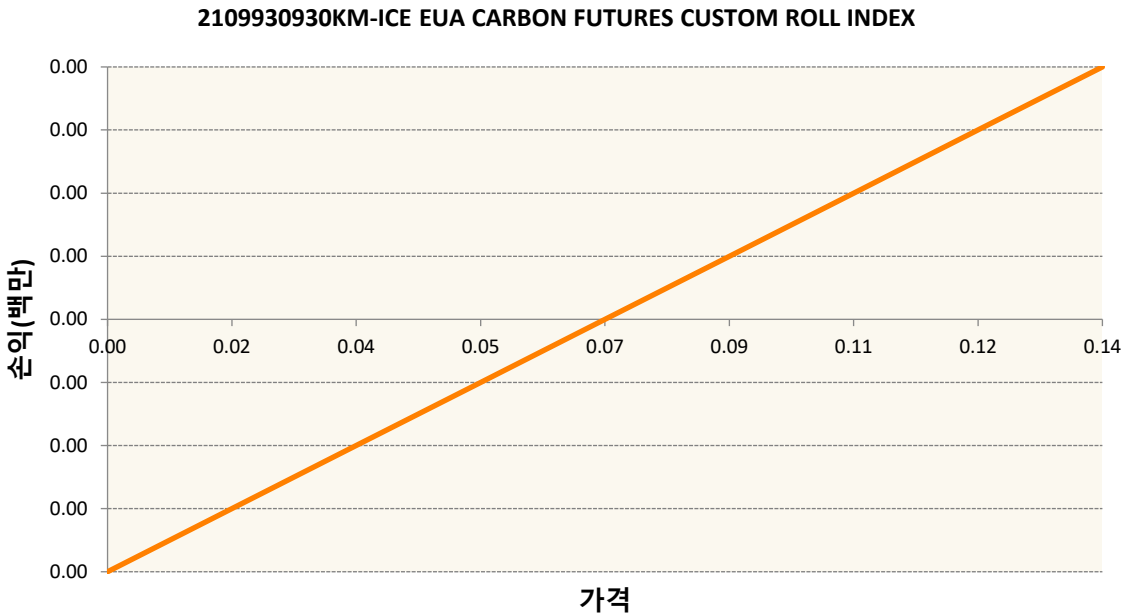
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	6,325	-6,299	
누계	통화	선도	0	1,165	-1,165	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		89
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		506

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	948

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

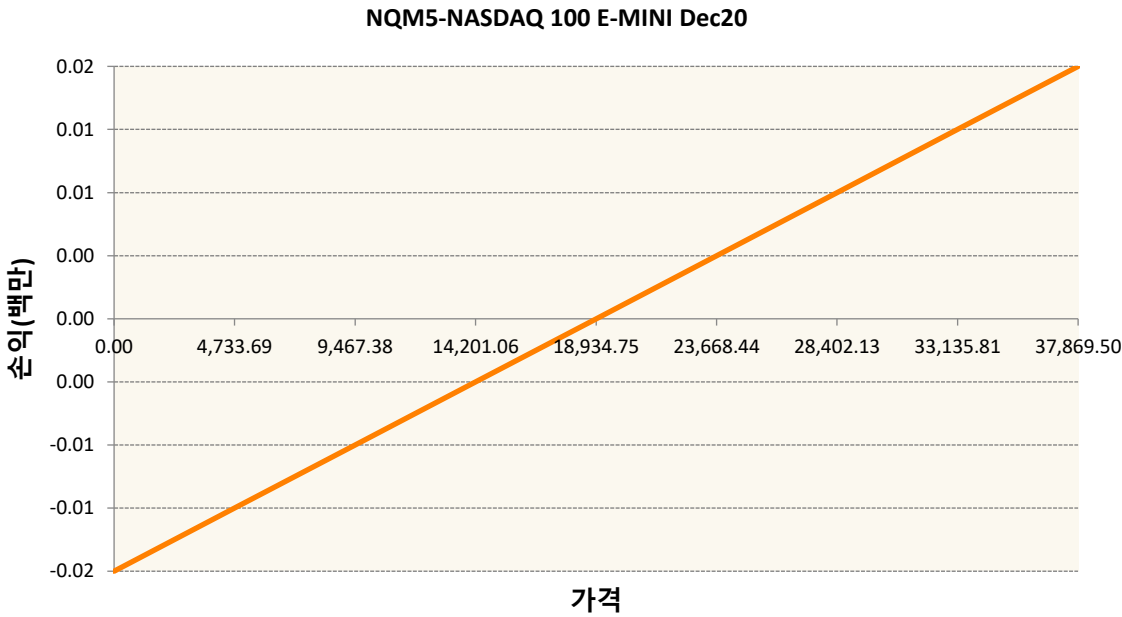
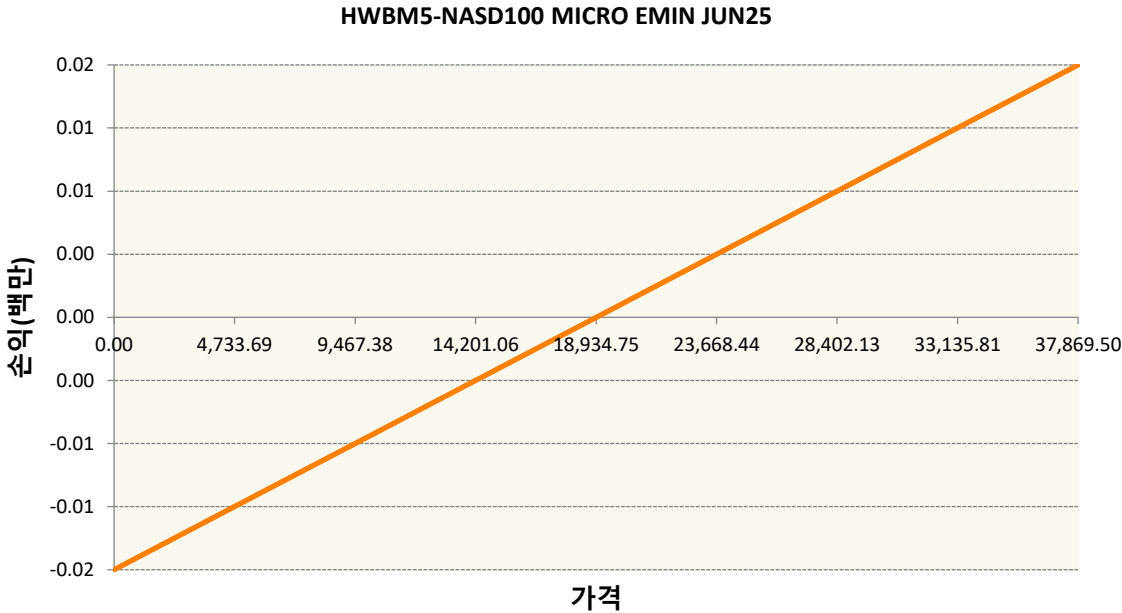
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	12,703	0	12,703	
누계	유가증권	선물	499	0	499	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25	40
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,016

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,173

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

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	700
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,040
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,536
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,142

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

(단위:백만원)

9,269

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

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)

14

공시일	2025-04-16
기준일	2025-04-15

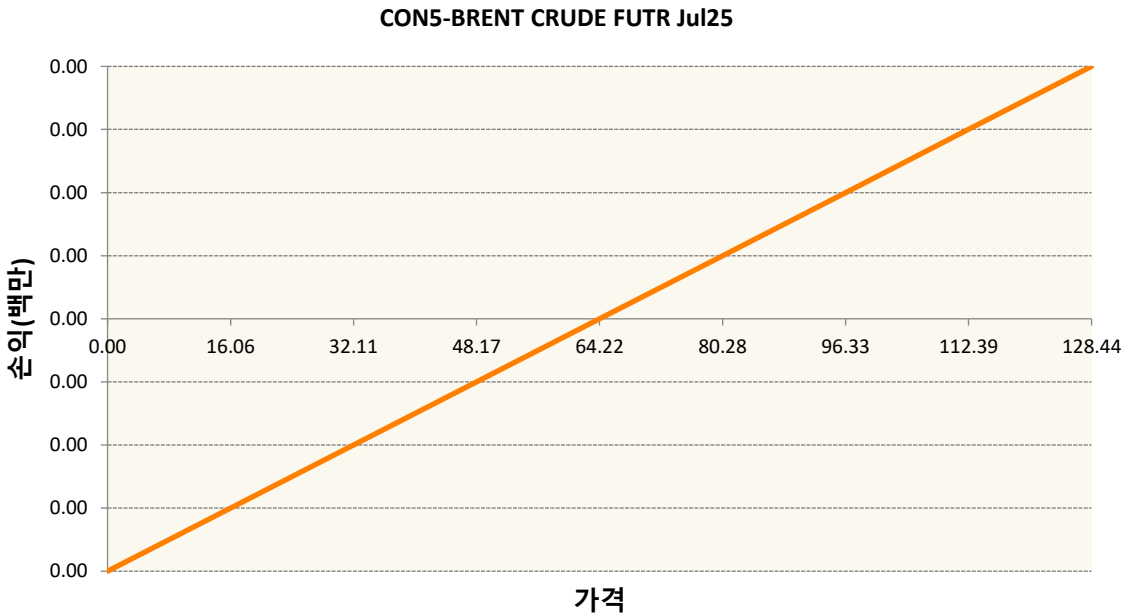
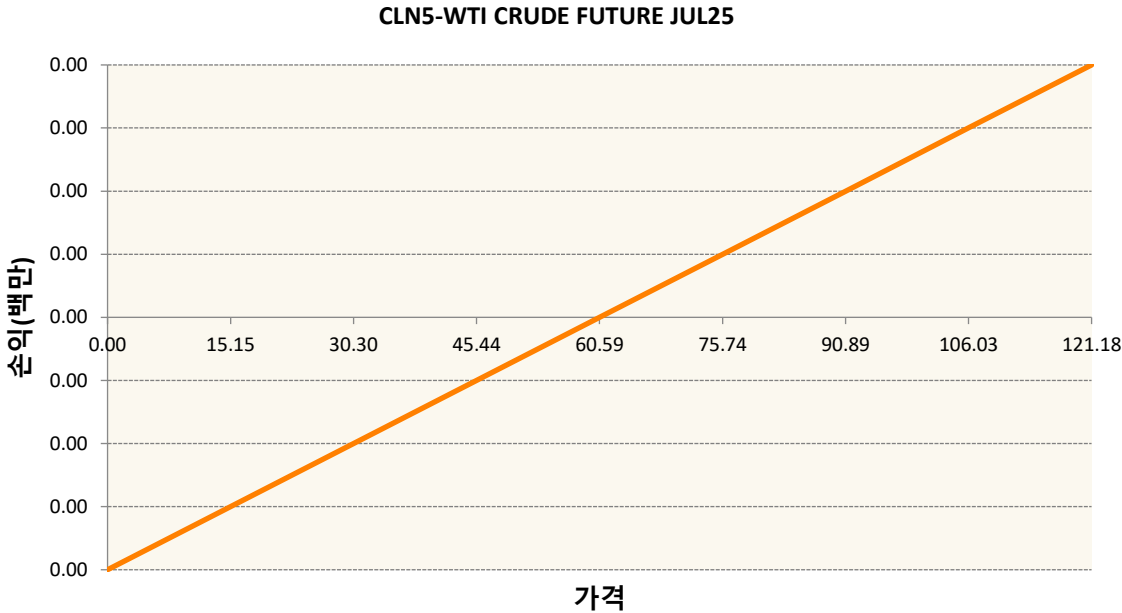
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

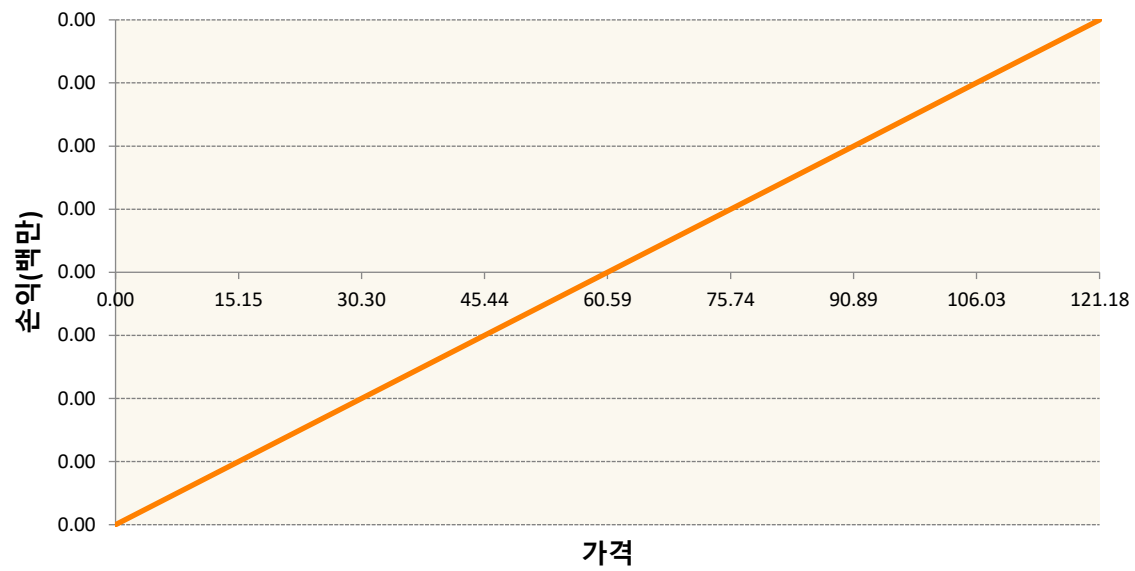
(단위:백만원)

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	647	0	647	
누계	통화	선물	0	86	-86	장내

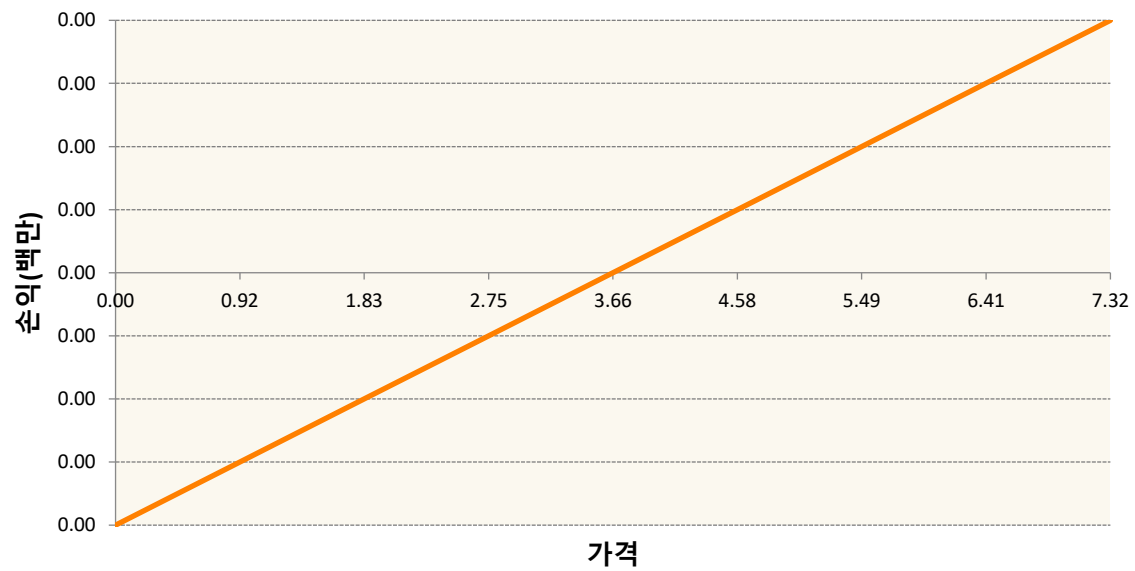
2. 만기시점의 손익구조



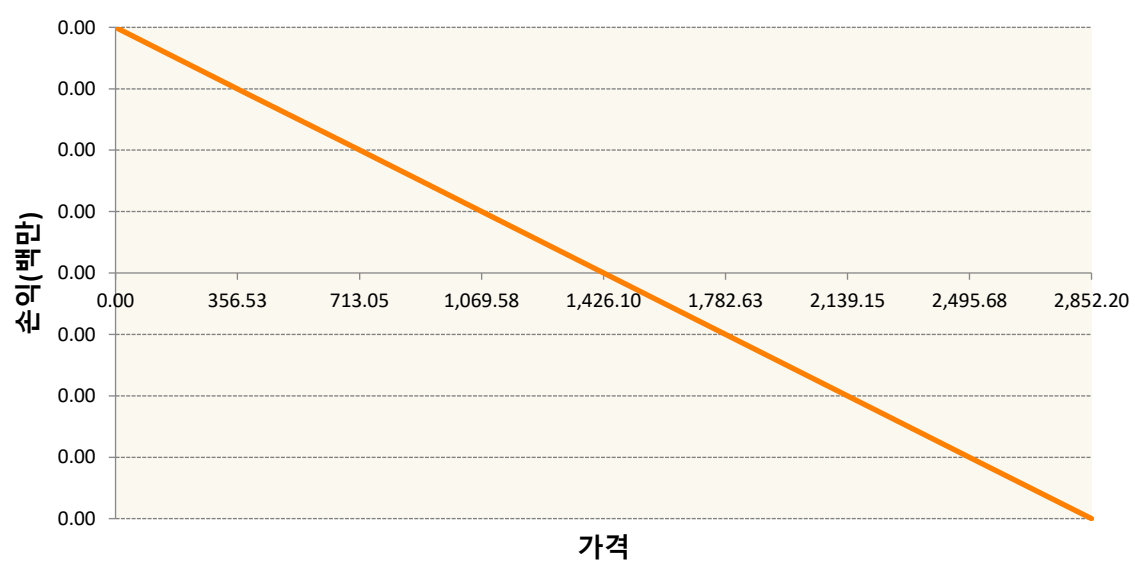
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



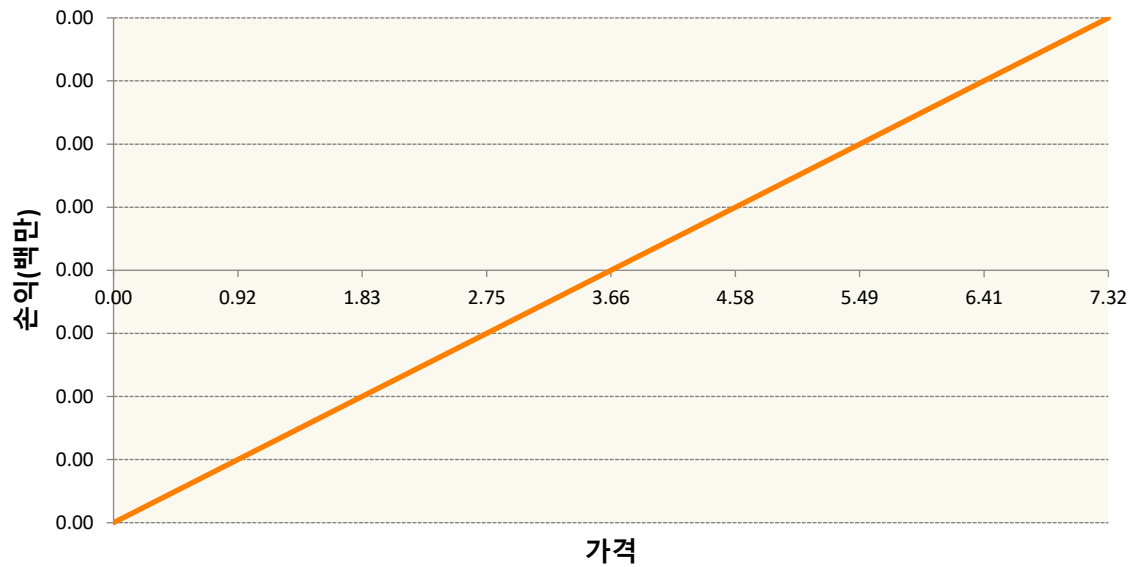
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



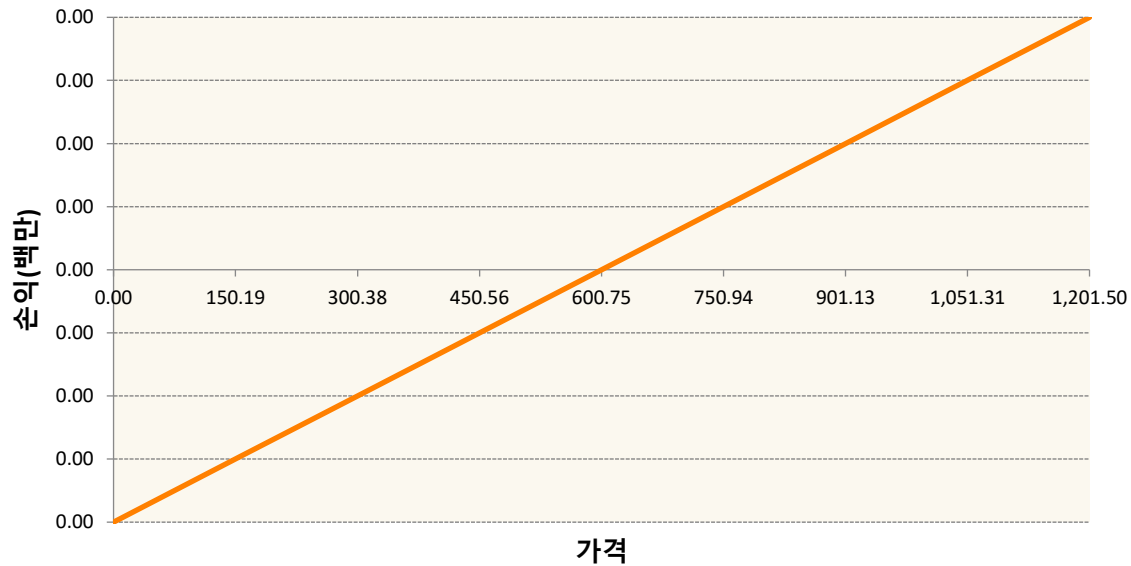
KR4175W40006-2025-04 달러선물



NGN25-NATURAL GAS FUTR JUL25



QSN5-Low Su Gasoil G JUL25



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)

121