

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

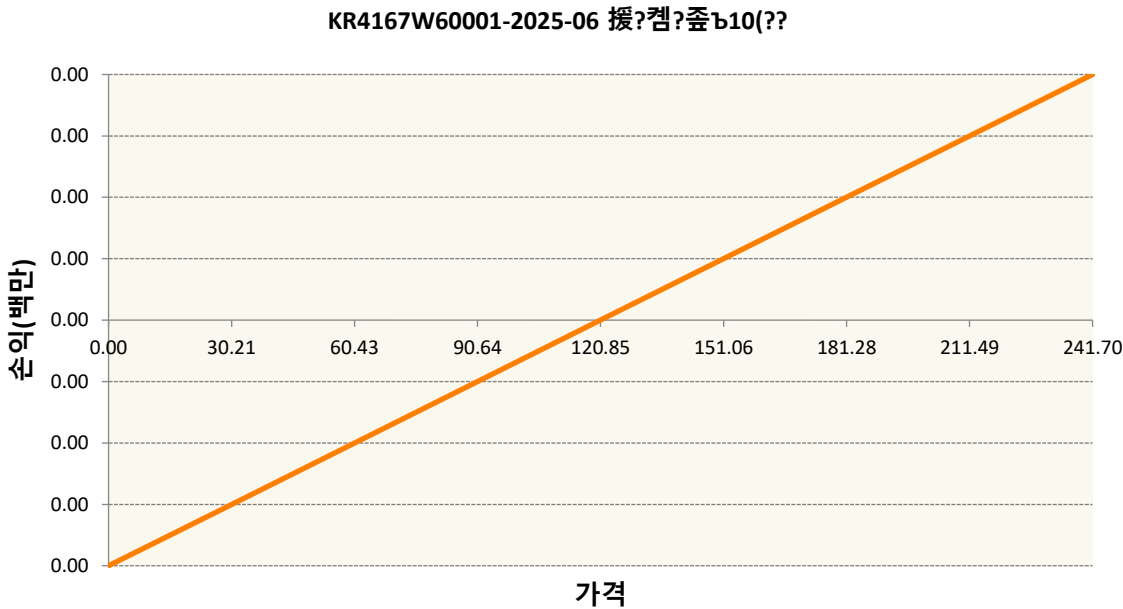
베스트장기채(채권-파생형)

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	87,012	0	87,012	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

1,936

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

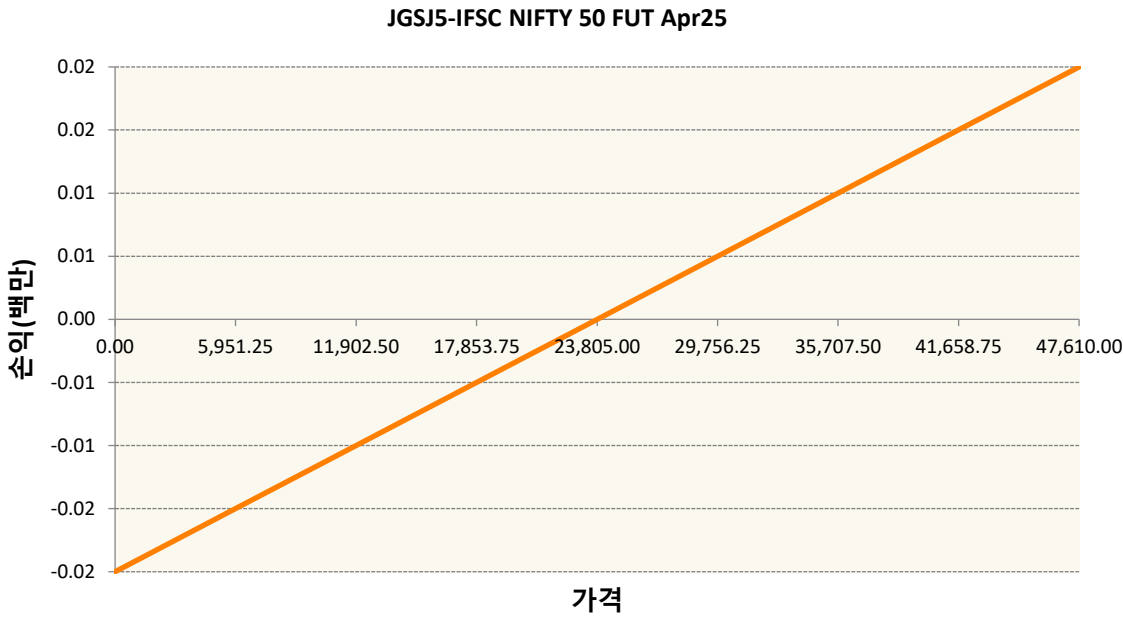
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	835	0	835	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ5 IFSC NIFTY 50 FUT Apr25

67

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

(단위:백만원)

49

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

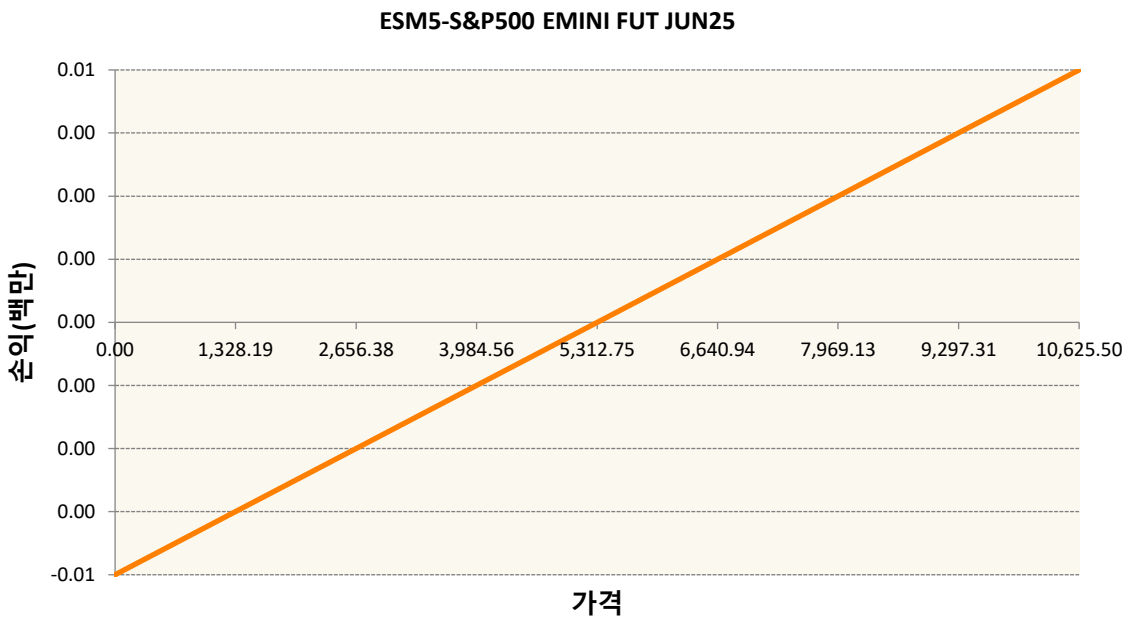
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	389	0	389	

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)

27

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

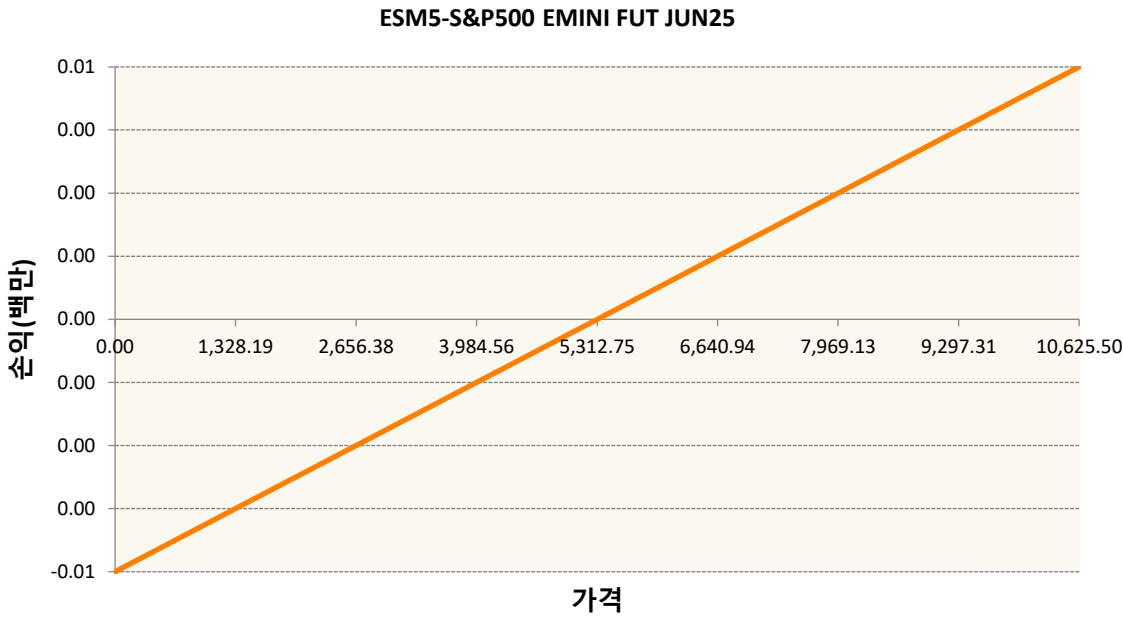
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,336	0	2,336	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5 S&P500 EMINI FUT JUN25

187

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

(단위:백만원)

160

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

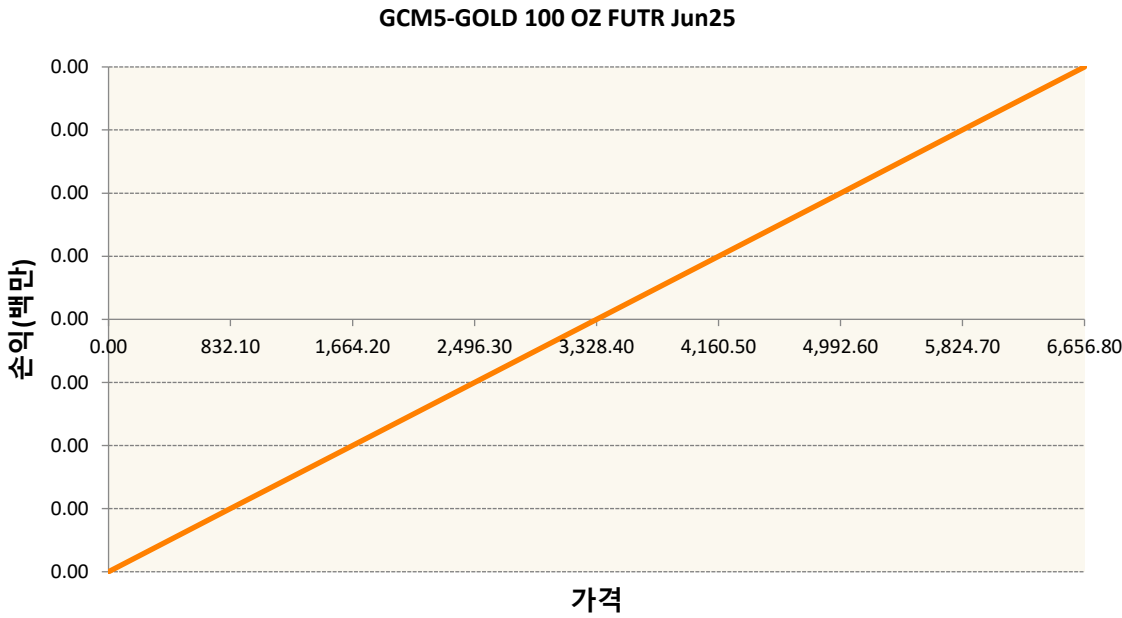
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,438	0	2,438	
누계	지수	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 04/25/25 C307 EQUITY	2
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	195

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

(단위:백만원)

151

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

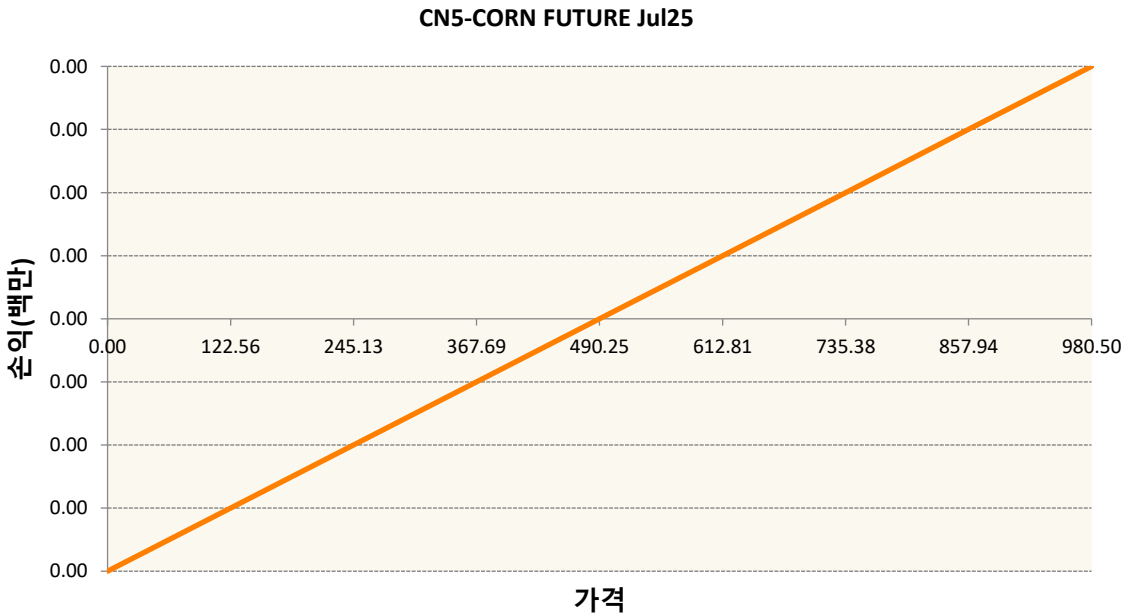
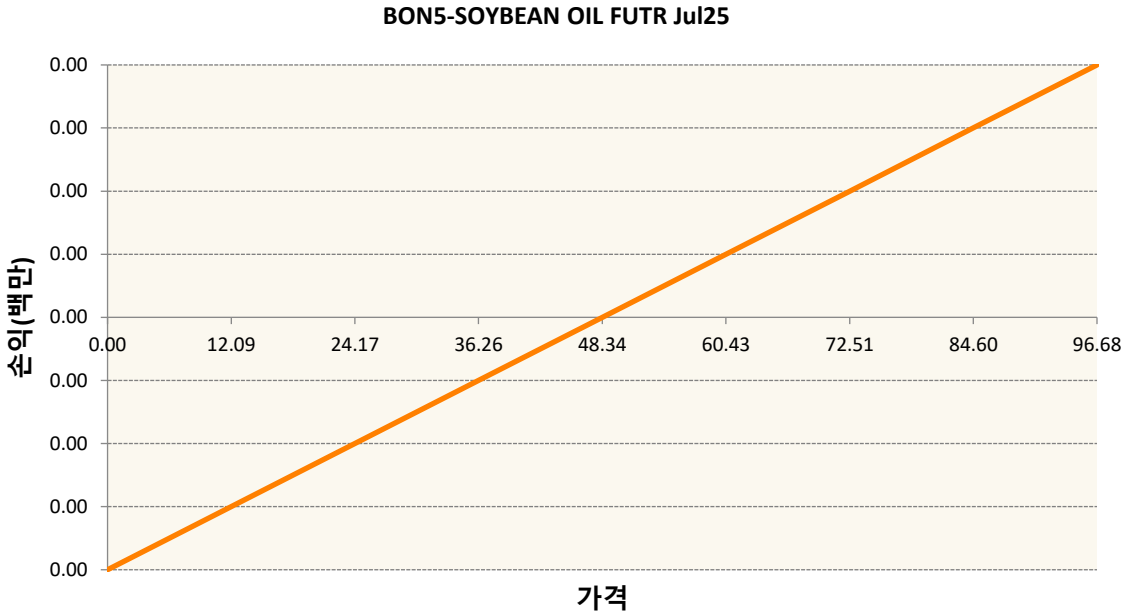
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

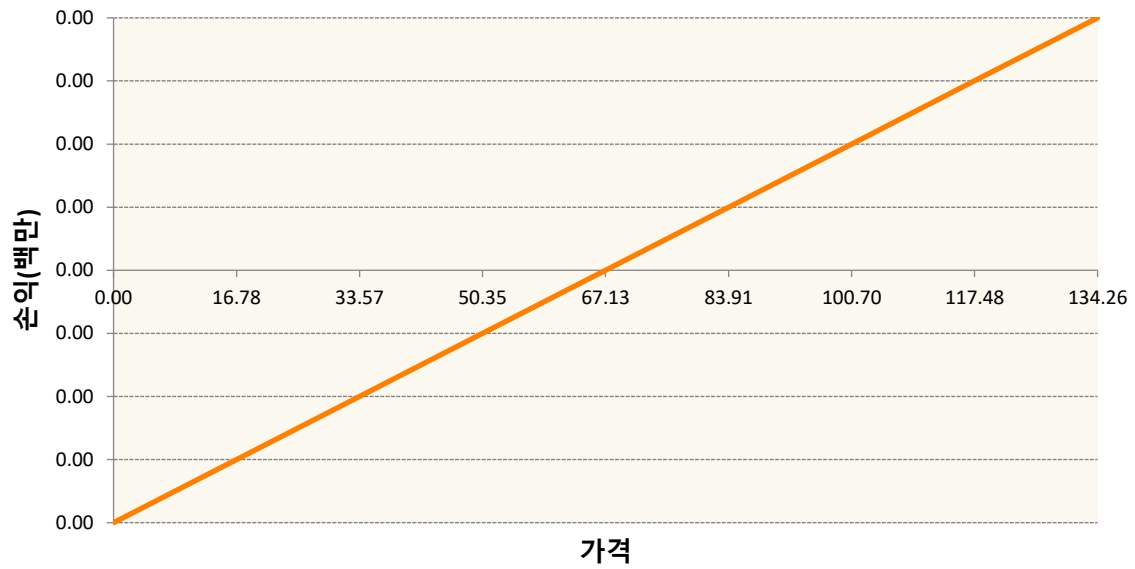
(단위:USD 백만)

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	3,871	0	3,871	
누계	통화	선물	0	327	-327	장내

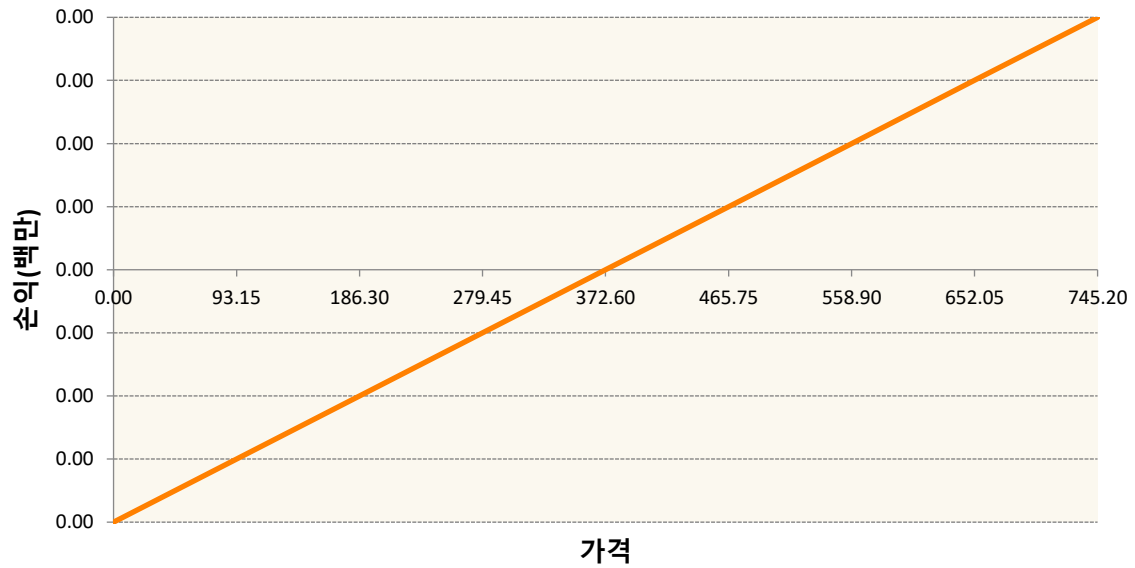
2. 만기시점의 손익구조



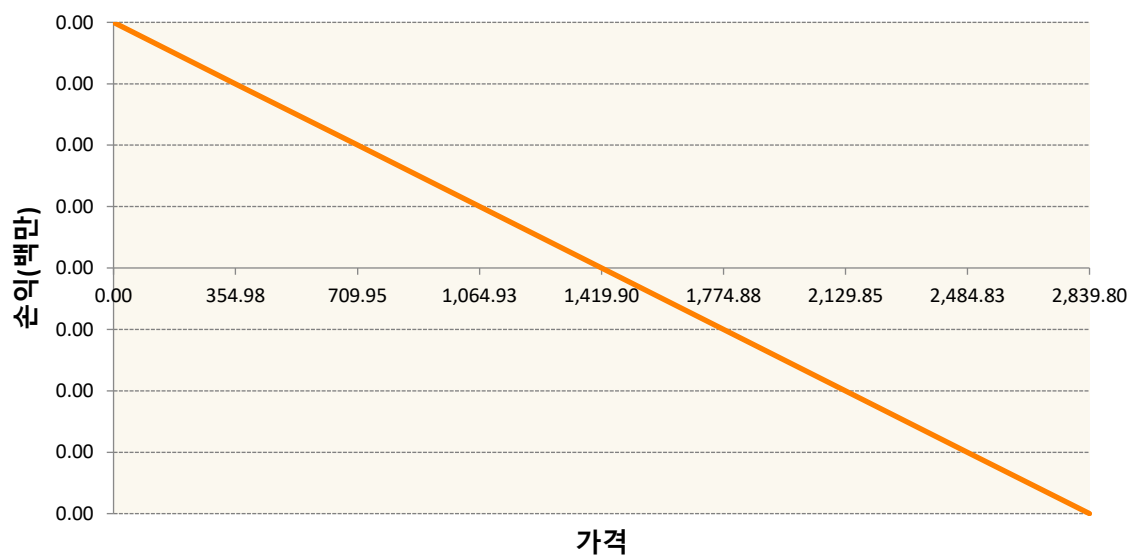
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



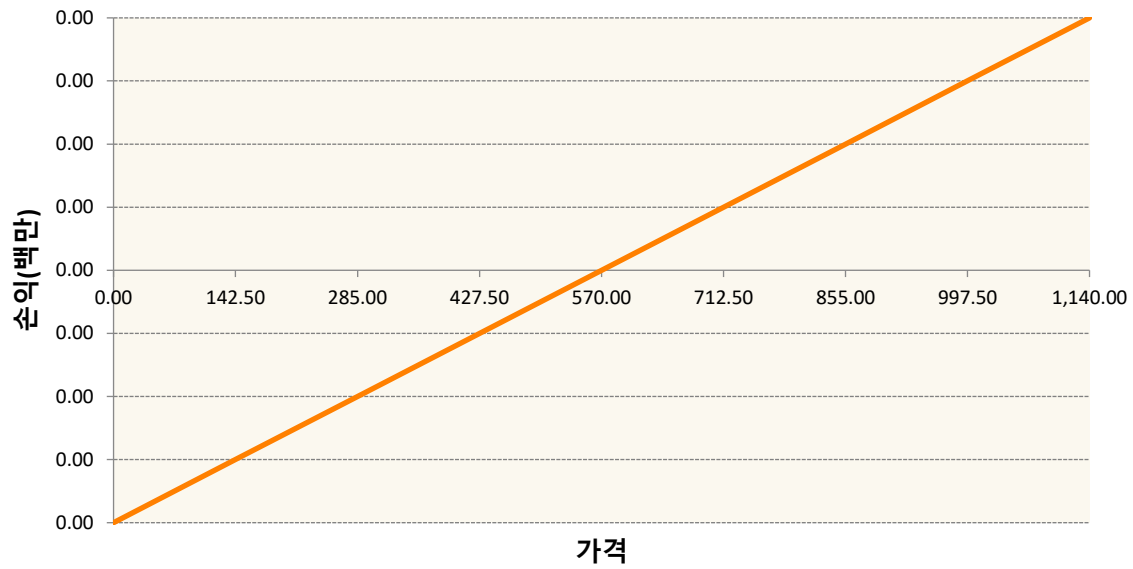
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



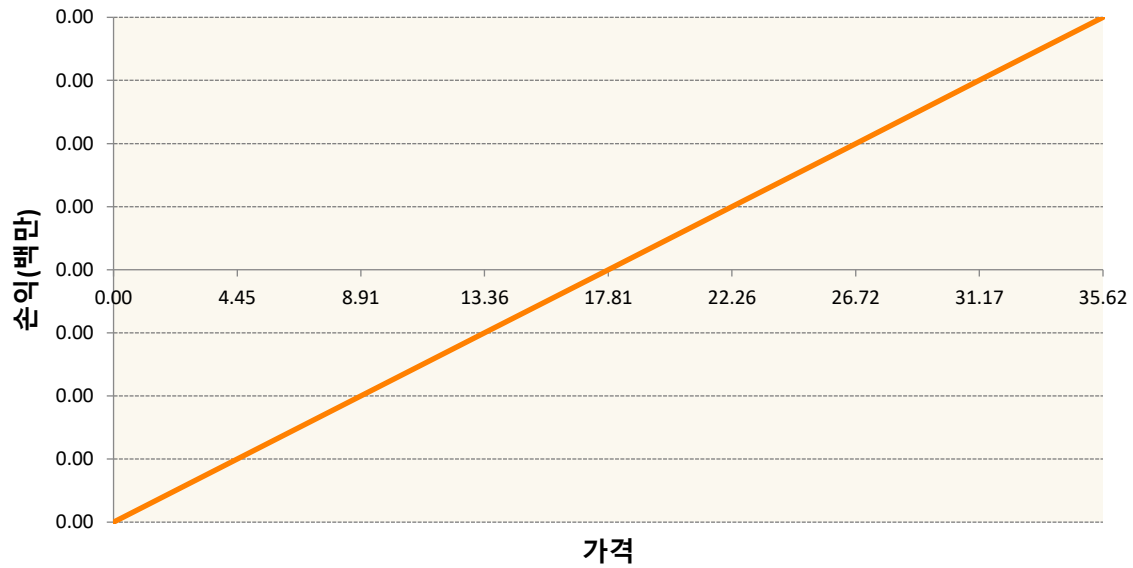
KR4175W50005-2025-05 ?쌀?줍



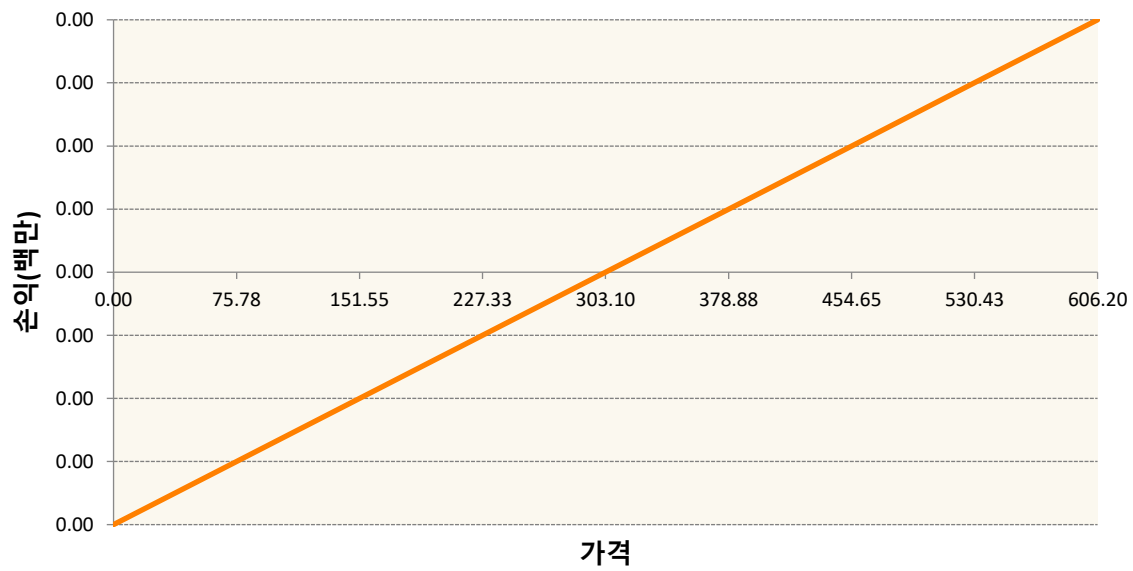
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25

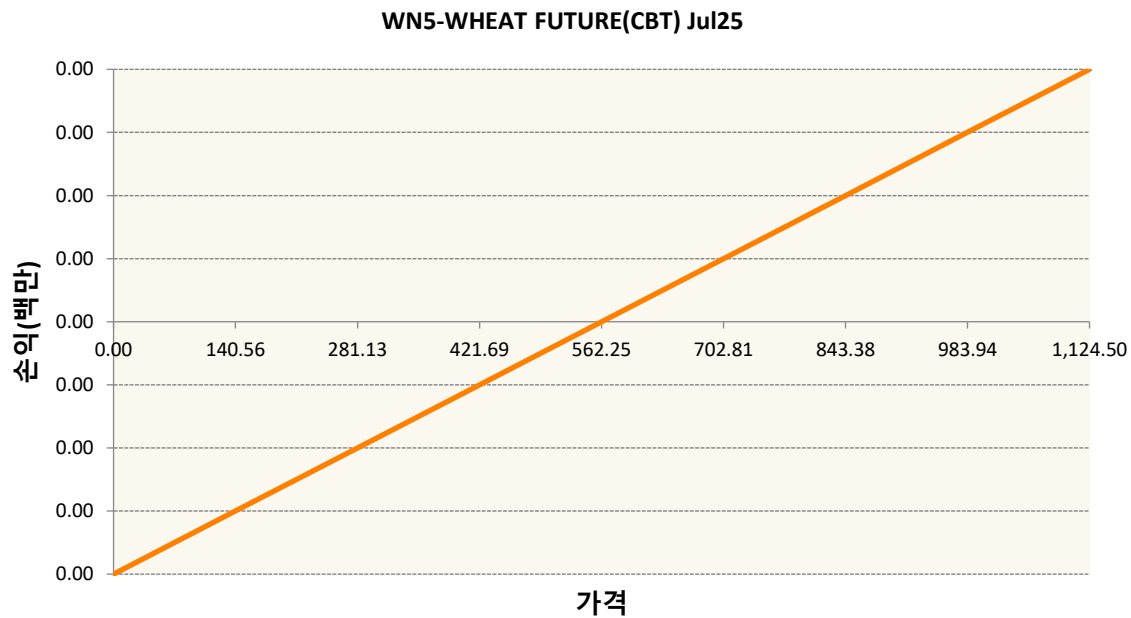
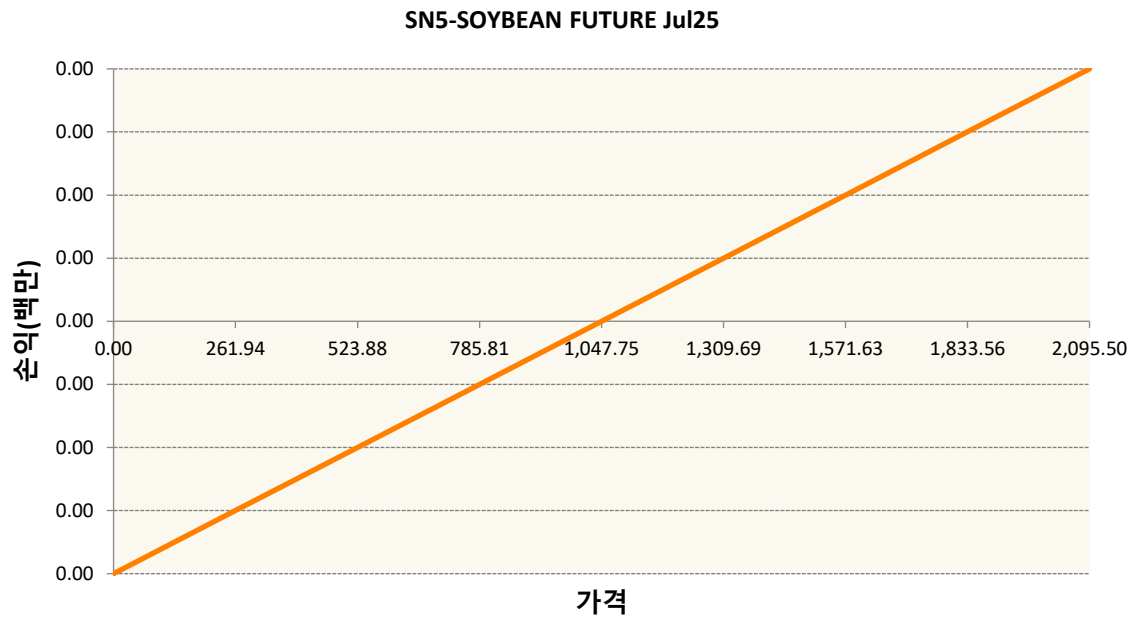


SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



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	2025-04-21
기준일	2025-04-18

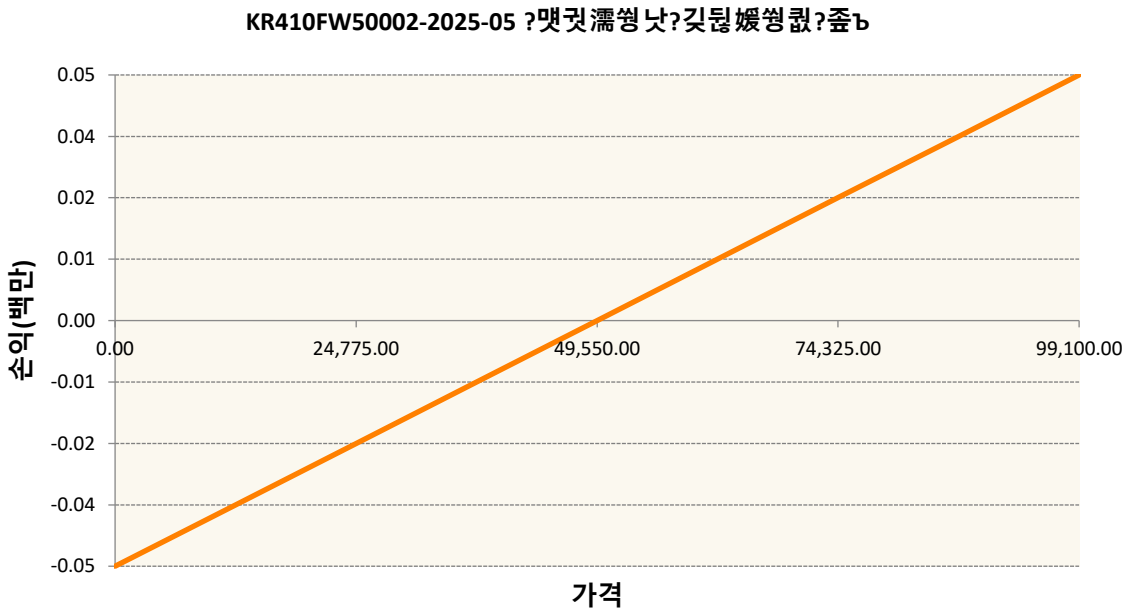
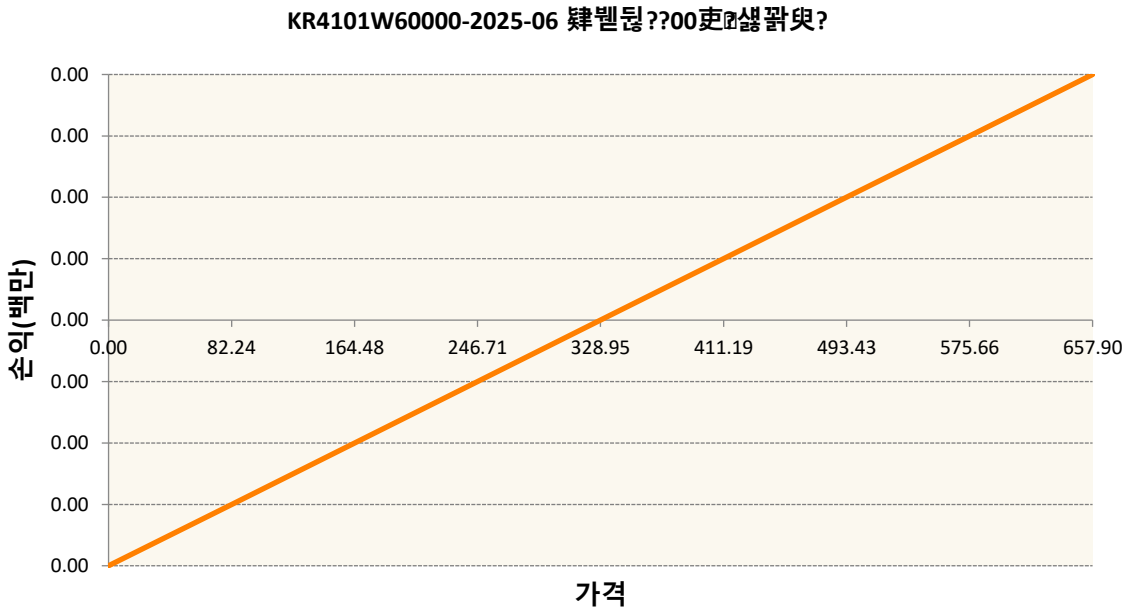
스마트인덱스모

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	1,700	0	1,700	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 肄벵뵐??00吏뵐뵐뵐?)	105
KR410FW50(2025-05 ?맏긔뵐뵐낫?긔뵐媛뵐뵐?쥬b	1
KR410ZW50(2025-05 ?뵐?뵐뵐뵐뵐뵐긔뵐뵐뵐뵐?)	4
KR4123W50(2025-05 ?쑤뵐?뵐린媛뵐뵐?쥬b	4
KR41CNW50 2025-05 ?b뵐 肄뵐X媛뵐뵐?쥬b	1
KR41E8W50(2025-05 ?b뵐 肄벵뵐뵐뵐뵐媛媛뵐뵐?쥬b	4
KR41F5W50(2025-05 LG?맏긔吏뵐뵐 (?뵐긔뵐뵐뵐?)	14
KR41HEW50 2025-05 ?s?利앳뵐媛뵐뵐?쥬b	2

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

(단위:백만원)

221

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

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 ?작뵡CSI500誘뵡250320

281

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

460

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

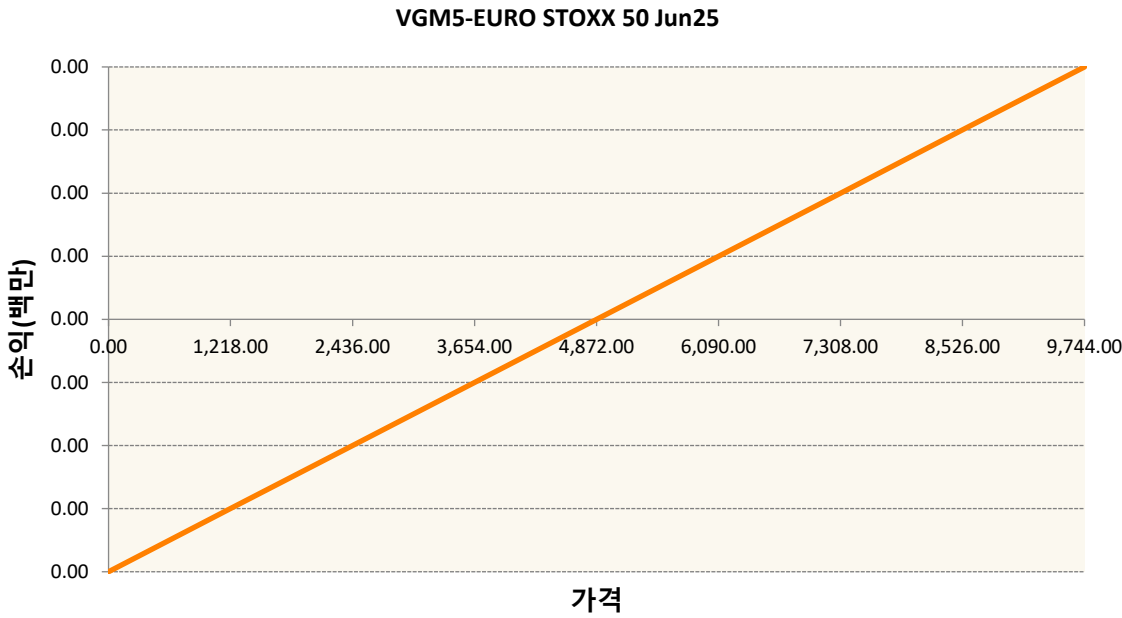
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	775	0	775	

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	2025-04-21
기준일	2025-04-18

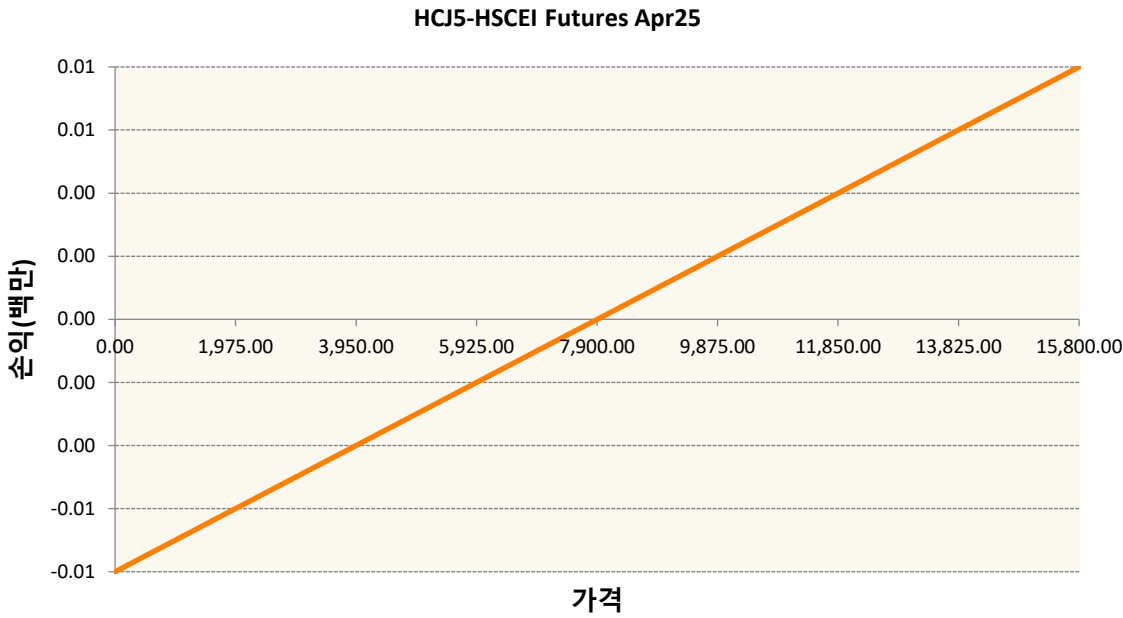
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,241	0	2,241	장내
누계	통화	선도	358	0	358	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F4H(HKD/KRW 22-04-25E	29
HCI5 HSCEI Futures Apr25	179

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

(단위:백만원)

282

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

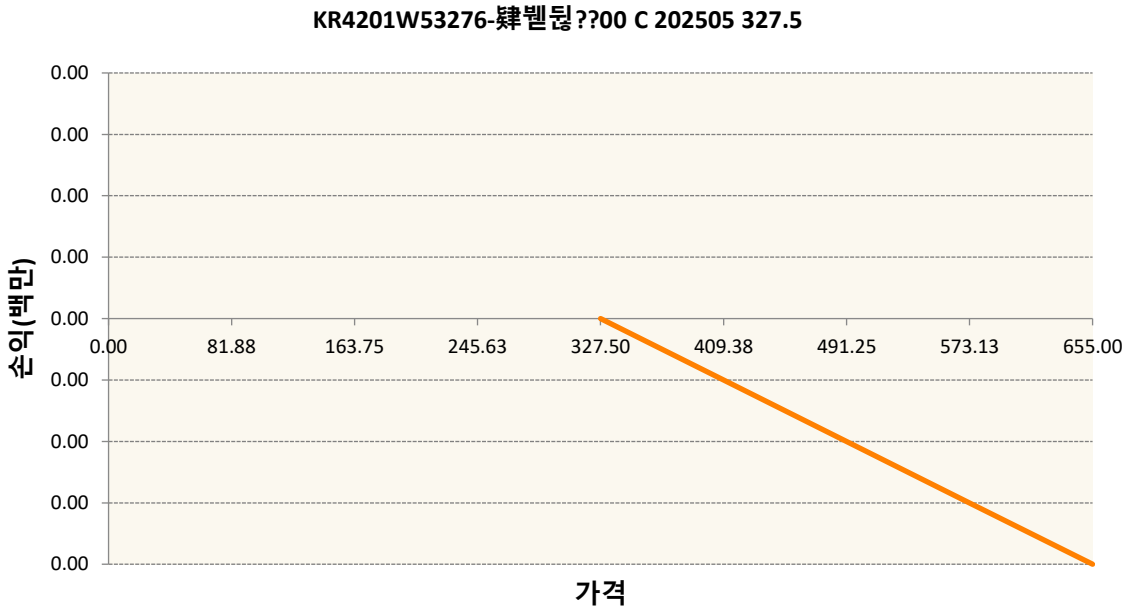
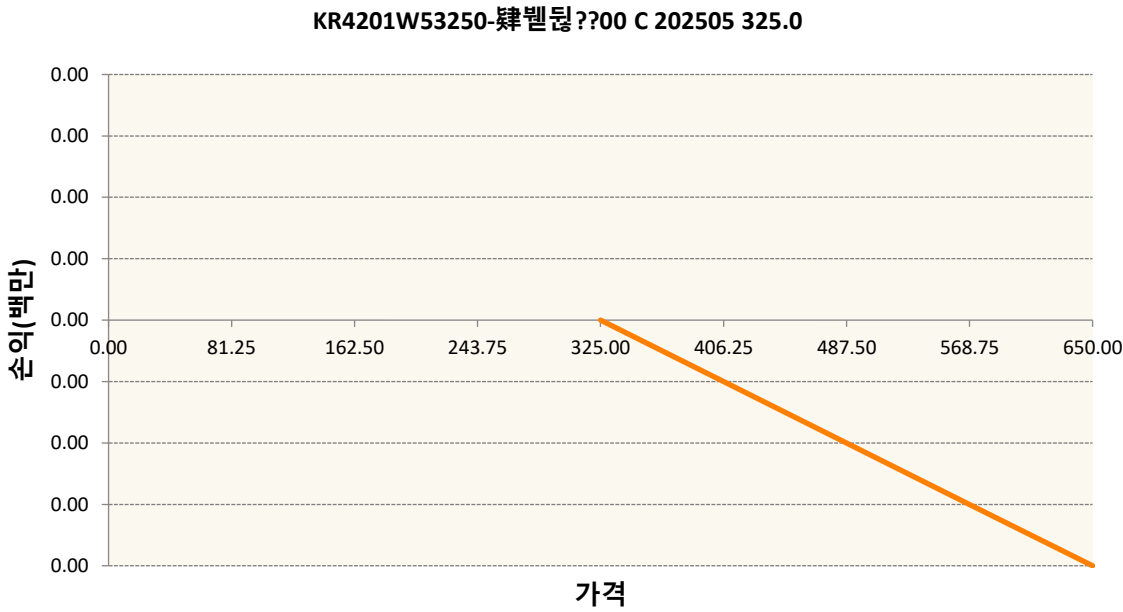
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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 with major ticks every 81.25 units. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. 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	손익(백만)
0.00	0.00
81.25	0.00
162.50	0.00
243.75	0.00
325.00	0.00
406.25	0.00
487.50	0.00
568.75	0.00
650.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 655.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the net income function, starting at the origin (0, 0) and ending at (327.50, 0.00). This indicates that the net income is zero at a price of 327.50.

가격 (Price)	순이익 (Net Income in millions)
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						肄벵뵐??00 C 202505 325.0		1,867
	기초자산의 변동성							
가궡	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	748	736	721	702	681	657	631	
-5.33%	685	656	624	590	553	515	476	
-2.67%	507	460	413	366	318	269	221	
0%	149	100	50	0	-50	-100	-150	
2.67%	-391	-427	-465	-506	-547	-591	-635	
5.33%	-1,055	-1,074	-1,096	-1,122	-1,151	-1,182	-1,215	
8.00%	-1,779	-1,786	-1,796	-1,809	-1,825	-1,845	-1,867	
KR4201W53276						肄벵뵐??00 C 202505 327.5		57
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	20	20	19	19	18	17
-5.33%	19	18	17	16	15	14	13
-2.67%	15	13	12	10	9	7	6
0%	5	3	2	0	-2	-3	-5
2.67%	-11	-12	-14	-15	-16	-18	-19
5.33%	-31	-32	-33	-34	-35	-36	-37
8.00%	-54	-54	-55	-55	-56	-57	-57

KR4301W53258 4월 25일 P 202505 325.0

401

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-372	-375	-379	-383	-389	-395	-401
-5.33%	-202	-209	-217	-225	-234	-244	-254
-2.67%	-60	-72	-83	-95	-107	-119	-131
0%	37	25	12	0	-12	-25	-37
2.67%	89	80	71	61	50	39	28
5.33%	110	106	100	94	87	79	70
8.00%	117	115	112	109	105	100	95

KR4301W53274 4월 25일 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	-15	-15	-15
-5.33%	-8	-8	-8	-9	-9	-9	-10
-2.67%	-3	-3	-3	-4	-4	-5	-5
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	4	3	3	2	2	2	1
5.33%	5	4	4	4	4	3	3
8.00%	5	5	5	5	4	4	4

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

(단위:백만원)

2,396

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

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	539	0	539	

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	2025-04-21
기준일	2025-04-18

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	4,337	0	4,337	

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	2025-04-21
기준일	2025-04-18

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	12,472	0	12,472	
누계	통화	선도	356	12,482	-12,127	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		225
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	2025-04-21
기준일	2025-04-18

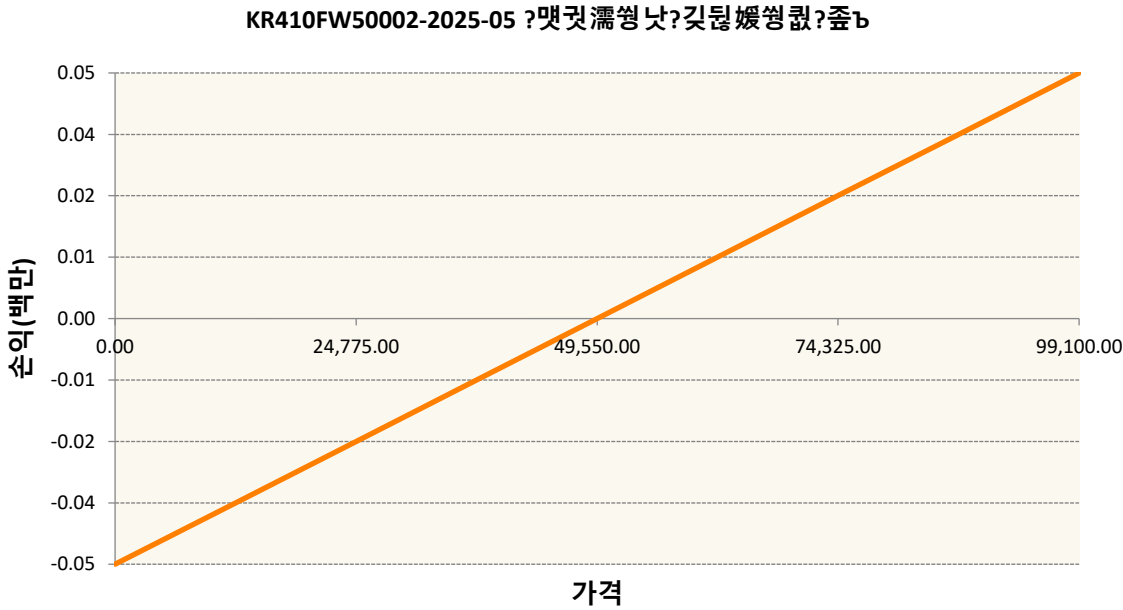
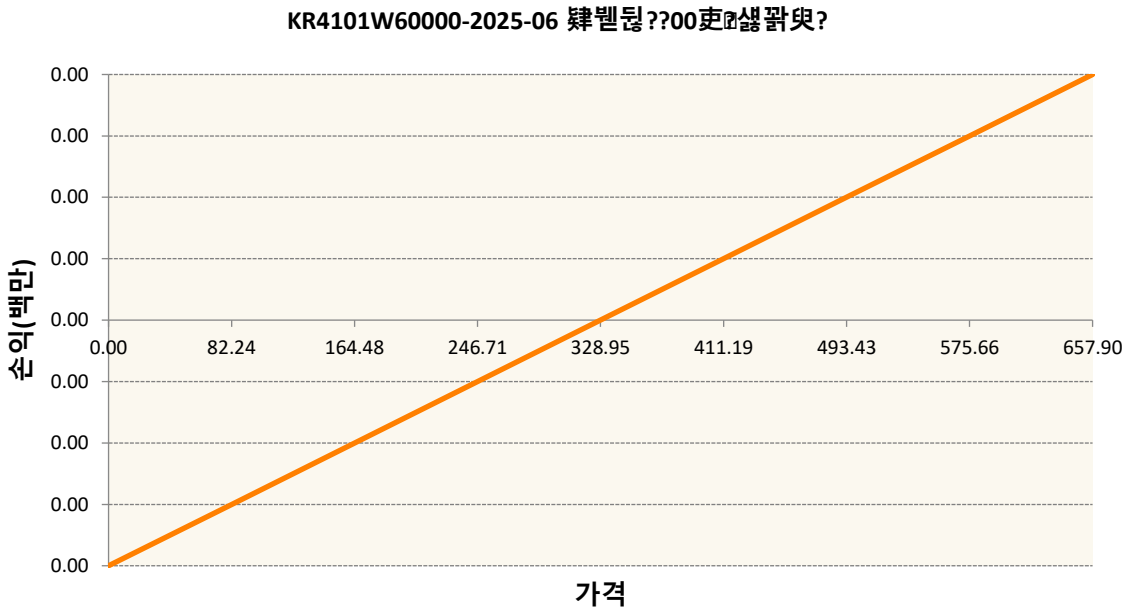
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

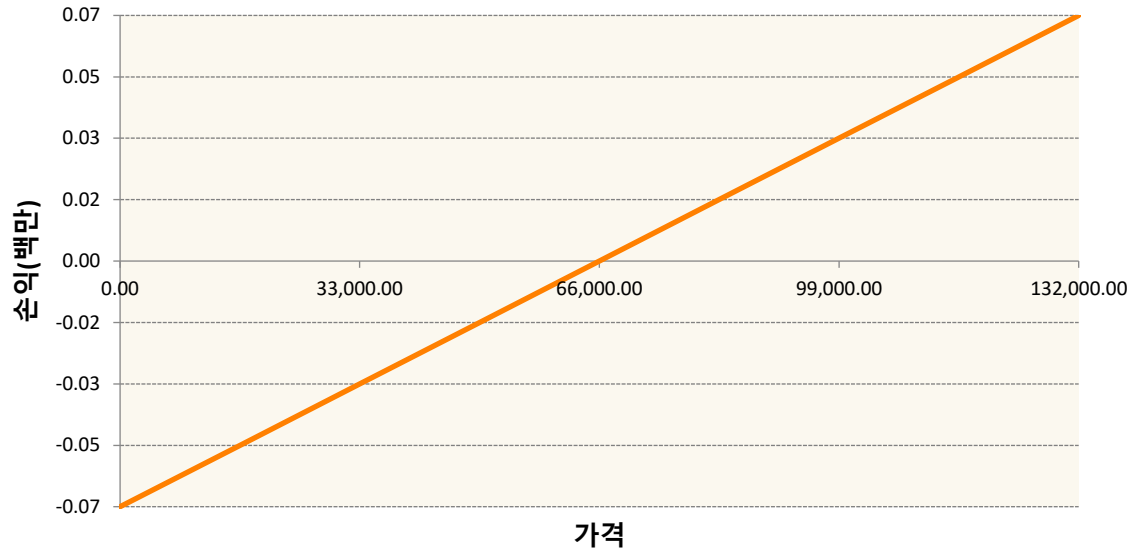
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	39	0	39	장내
누계	유가증권	선물	1,073	0	1,073	장내

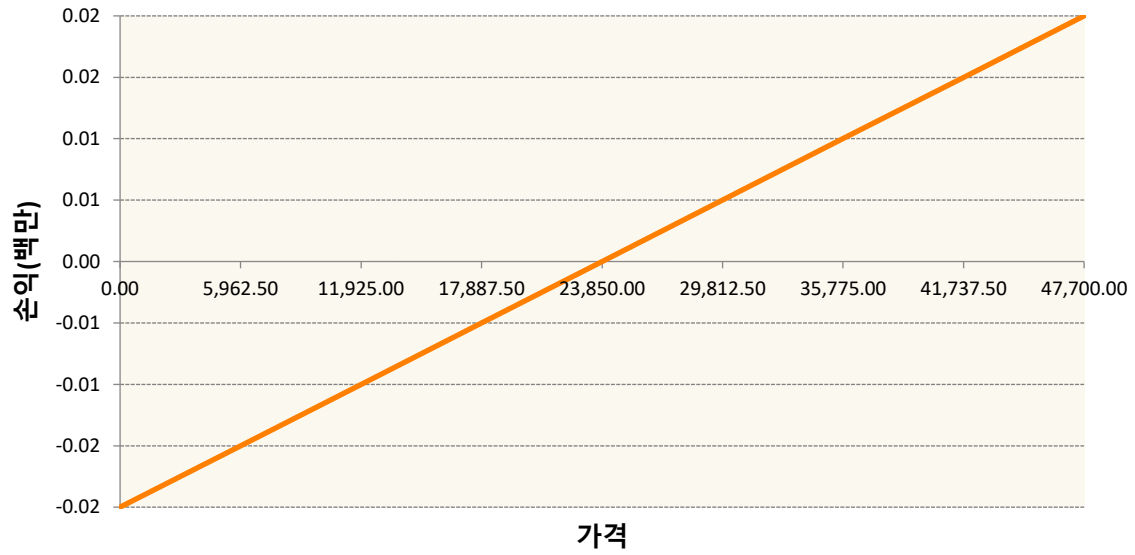
2. 만기시점의 손익구조



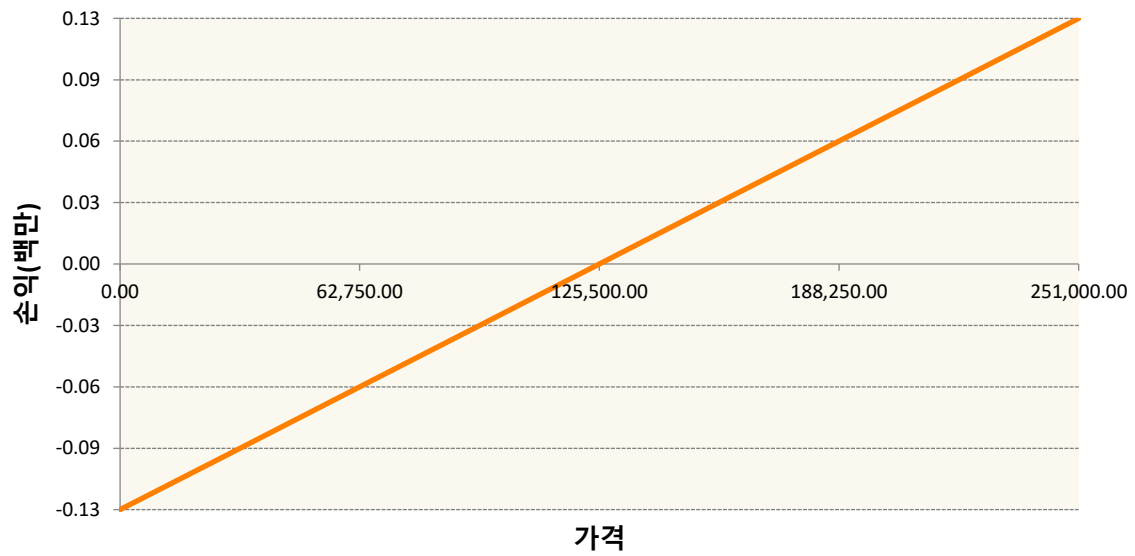
KR41C0W50000-2025-05 OCI? (6) 뿔媛썔궏?쥼



KR41CNW50000-2025-05 ?뿔肄붇X媛썔궏?쥼



KR41E8W50001-2025-05 ?뿔肄뵐뵐泥생궏媛썔궏?쥼



The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 192,000.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -0.10 to 0.10. A solid orange line represents the profit function, starting at a price of 0.00 with a profit of -0.10, crossing the x-axis at a price of 96,000.00 (where profit is 0), and reaching a profit of 0.10 at a price of 192,000.00.

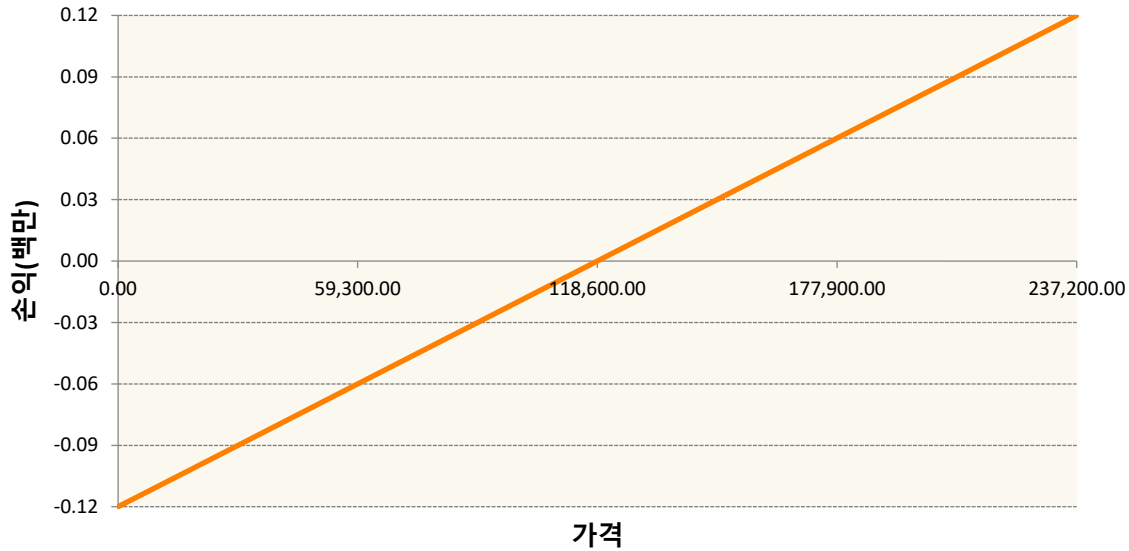
가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-0.10
48,000.00	-0.05
96,000.00	0.00
144,000.00	0.05
192,000.00	0.10

The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), has major ticks at 0.00, 168,250.00, 336,500.00, 504,750.00, and 673,000.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), has major ticks at -0.34, -0.25, -0.17, -0.08, 0.00, 0.08, 0.17, 0.25, and 0.34. A solid orange line represents the profit function, starting at (0, -0.34) and ending at (673,000, 0.34). The line crosses the x-axis at 336,500.00, which is the break-even point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-0.34
168,250.00	-0.17
336,500.00	0.00
504,750.00	0.17
673,000.00	0.34

가격	손익 (백만)
0.00	-0.02
4,842.50	-0.015
9,685.00	-0.01
14,527.50	-0.005
19,370.00	0.00
24,212.50	0.005
29,055.00	0.01
33,897.50	0.015
38,740.00	0.02

KR41HEW50008-2025-05 ????利????媛???????



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 肄벵???00吏????)	66
KR410FW50(2025-05 ????濡???갓???媛????)	0.48
KR410ZW50(2025-05 ???????泥???蹂????)	2
KR4120W50(2025-05 ????紐⑤????)	0.19
KR4123W50(2025-05 ???????媛????)	3
KR41C0W50(2025-05 OCI????)	0.05
KR41CNW50(2025-05 ????肄???媛????)	1
KR41E8W50(2025-05 ????肄벵???媛????)	2
KR41EYW50(2025-05 ???????媛????)	2
KR41F5W50(2025-05 LG???吏??? (????蹂????)	6
KR41FAW50(2025-05 HMM媛????)	3
KR41HEW50(2025-05 ????利????媛????)	1

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

(단위:백만원)

142

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

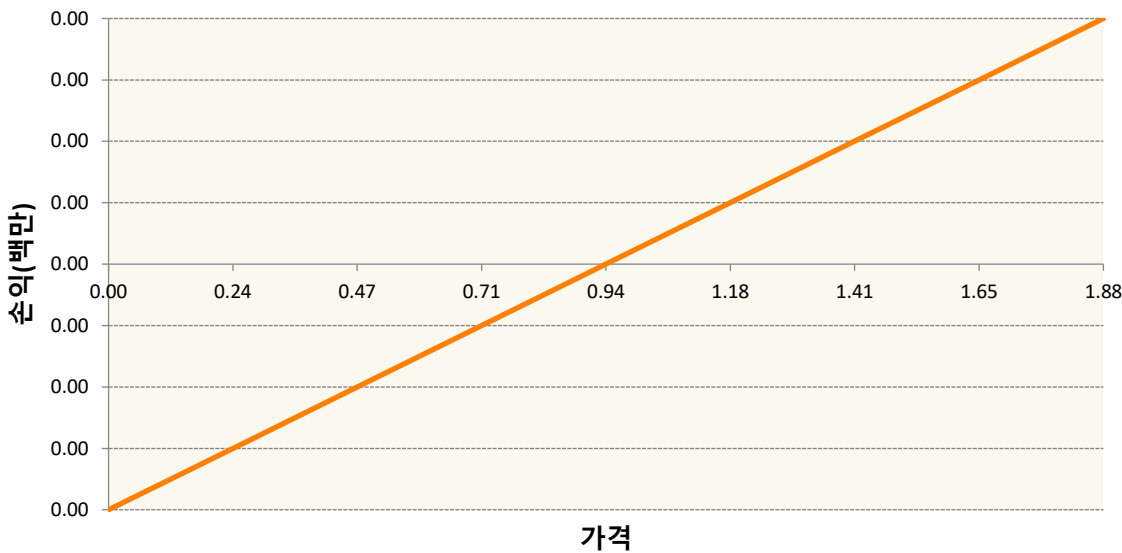
1. 계약금액

(단위:백만원)

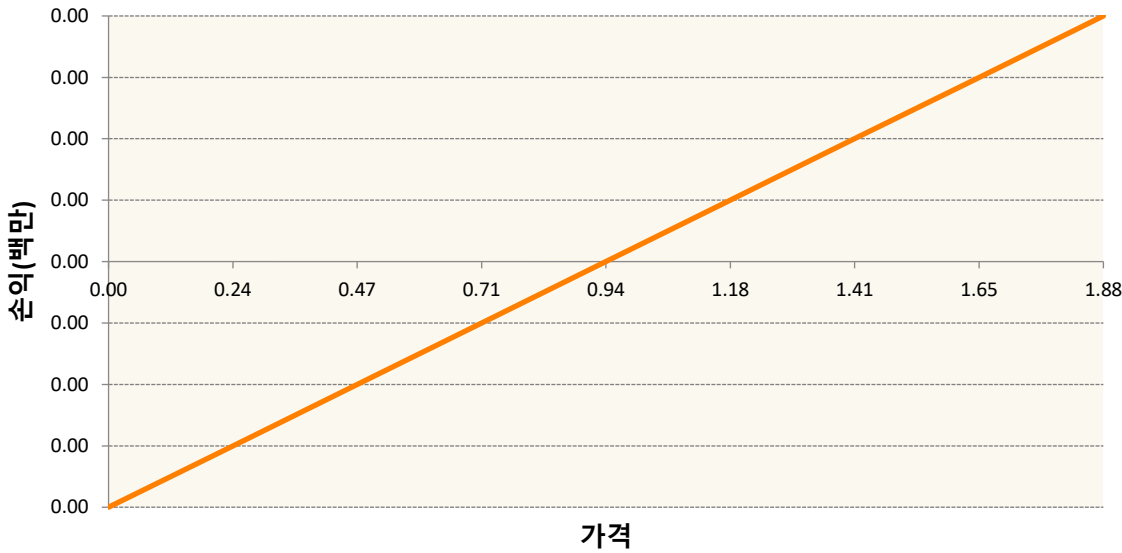
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,248	0	9,248	

2. 만기시점의 손익구조

2108840320MR-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (誘?)



2108840930MZ-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (硫?)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (誘?)	557
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (疏?)	186

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	870

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

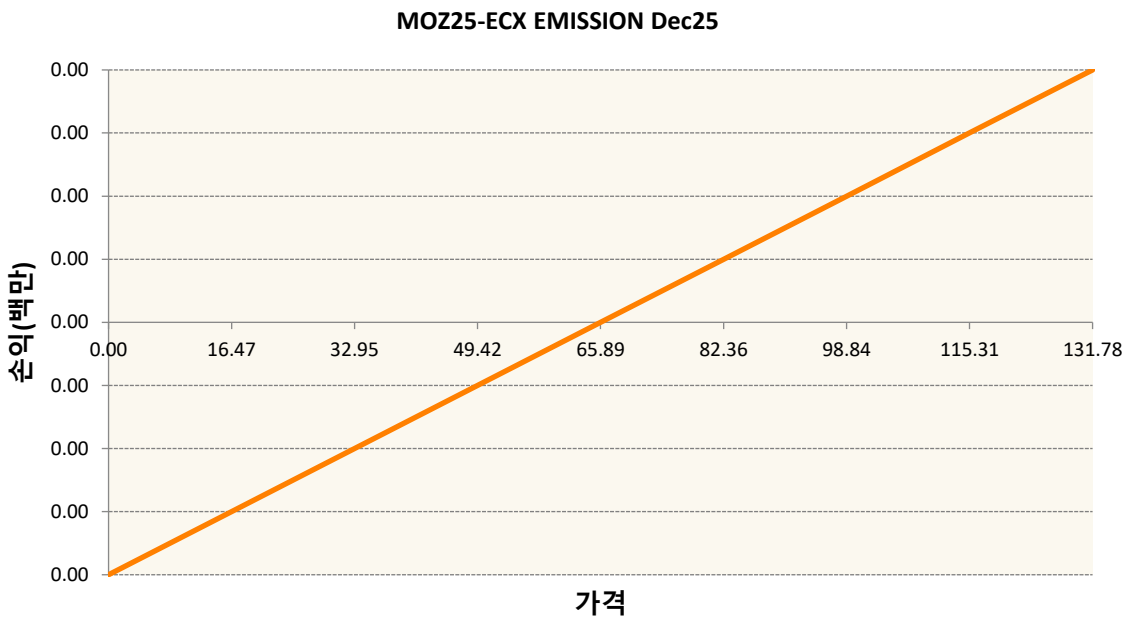
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,915	0	5,915	
누계	통화	선도	0	1,184	-1,184	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	476

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

(단위:백만원)

897

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

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 ?작뵡CSI Index 240620 (?ㄸ?)	13
SWCSI00000 ?작뵡CSI Index 240620 (NH)	13
SWCSI00000 ?작뵡CSI Index 240923 (䄡뵡—痢?)	20
SWCSI00000 ?작뵡CSI Index 240923 (誘뵡엷)	20

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

(단위:백만원)

117

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)

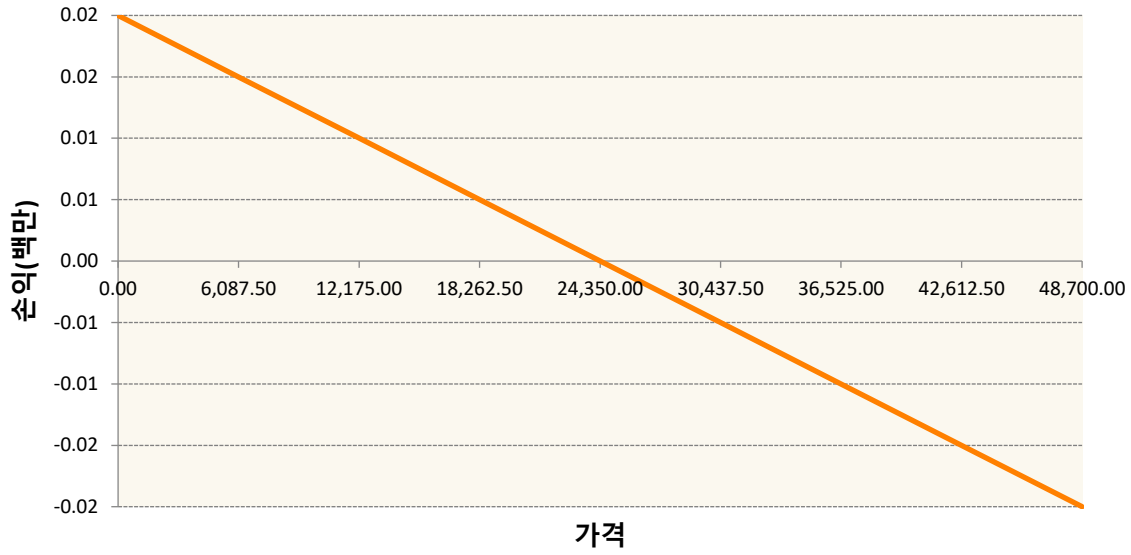
SWSTAR000(?작뵡 STAR 50 Index 241219(誘뵡엎)	21
SWSTAR000(?작뵡 STAR 50 Index 241219(疏뵡一痢?)	25
SWSTAR000(?작뵡 STAR 50 Index 241219(NH)	18
SWSTAR000(?작뵡 STAR 50 Index 231226(?ㅅ?)	5

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

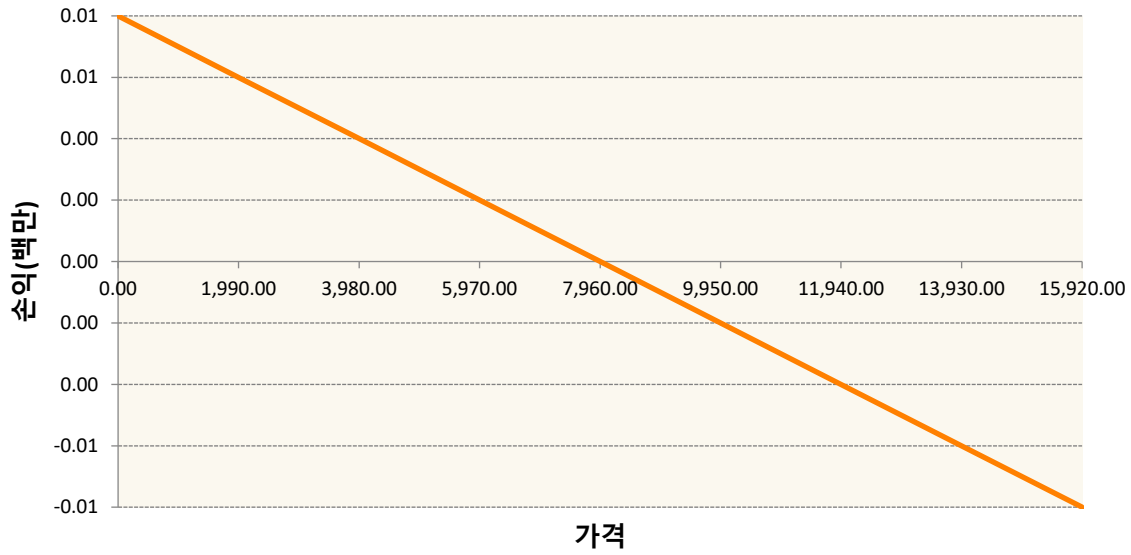
(단위:백만원)

121

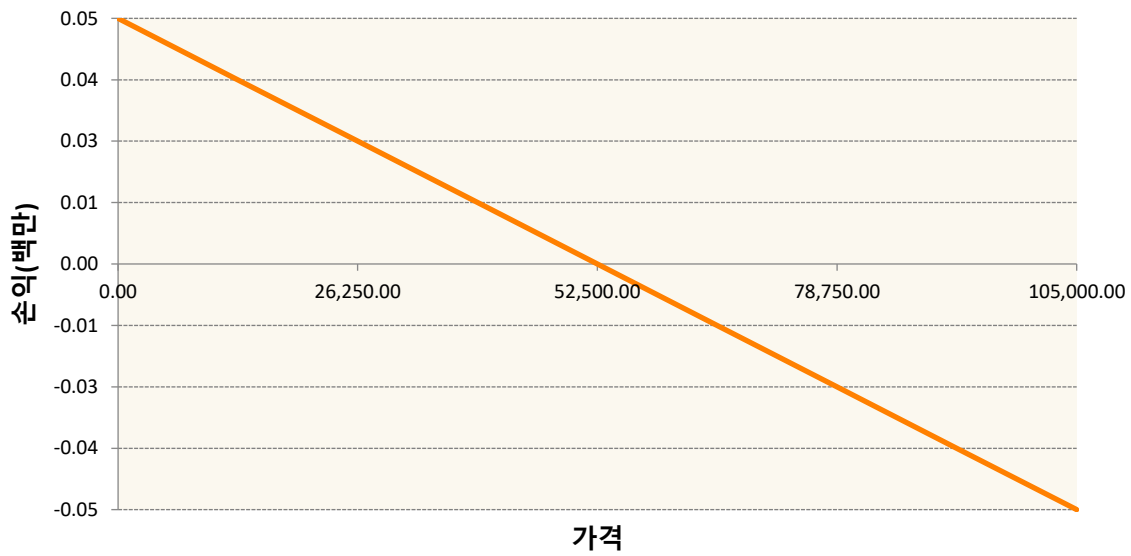
KR4115W50001-2025-05 ?윗뎡?뿡젼媛쵸꺾?쥼ㄴ



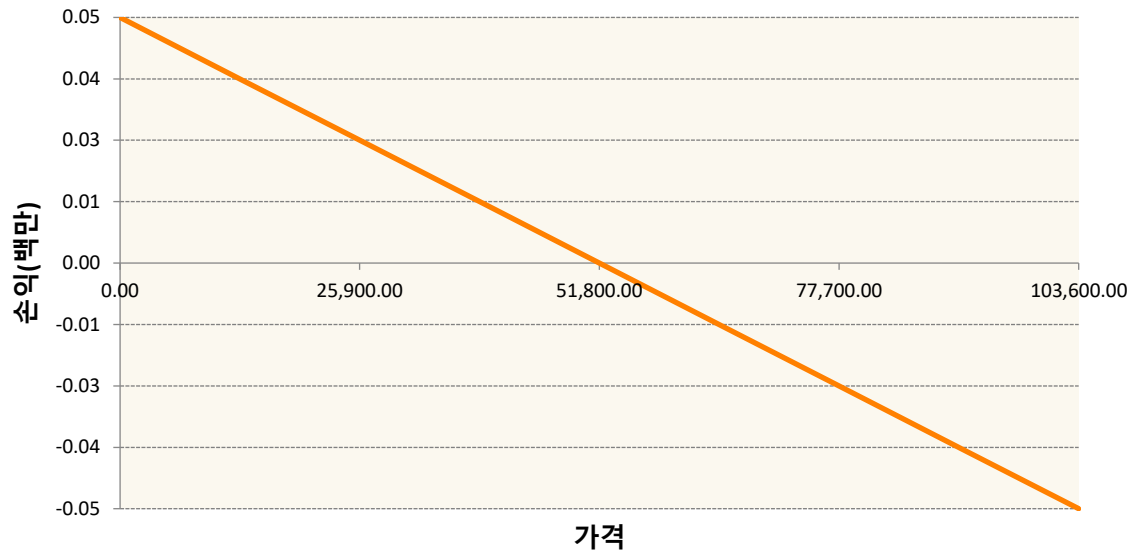
KR4149W50000-2025-05 HD?뿡??명뵼?쵸꺾?당킷蹂뿡꺾꺾?



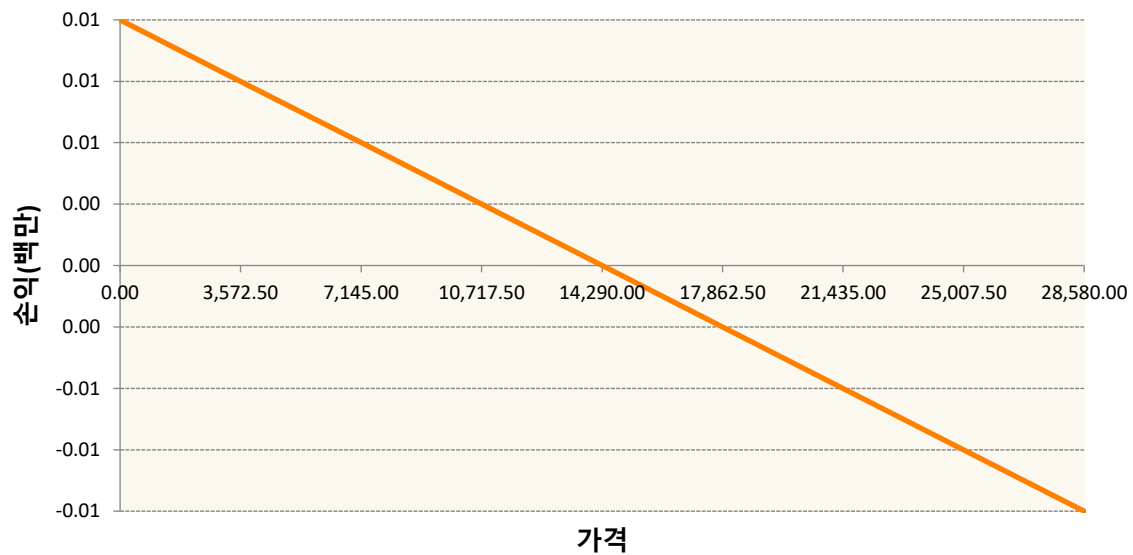
KR41B2W50007-2025-05 S-Oil媛쵸꺾?쥼ㄴ



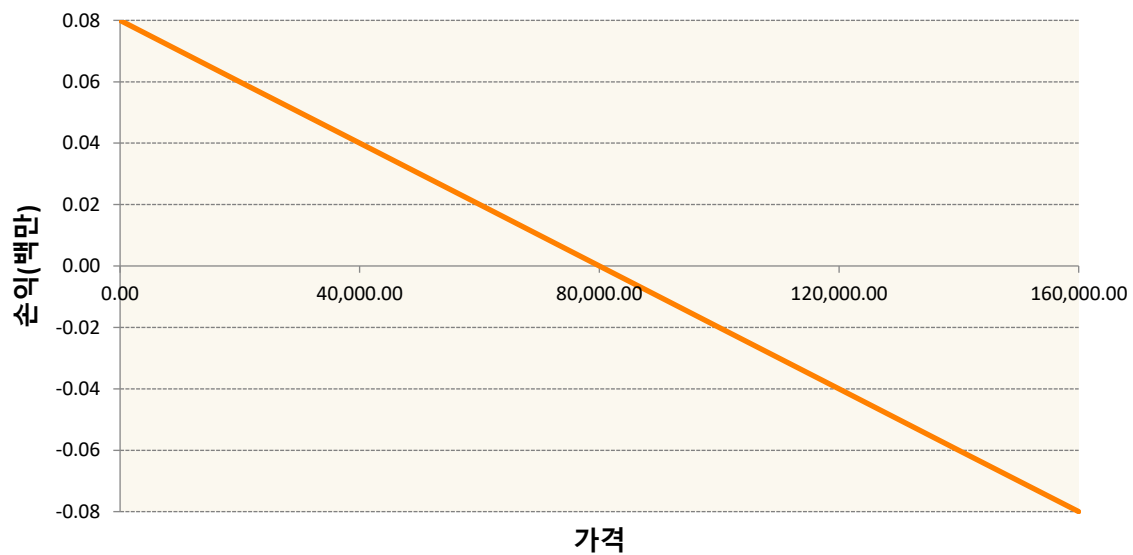
KR41B7W50006-2025-05 ?뵐뵔뵔뵔?뵔뵔?뵔뵔뵔뵔?뵔뵔



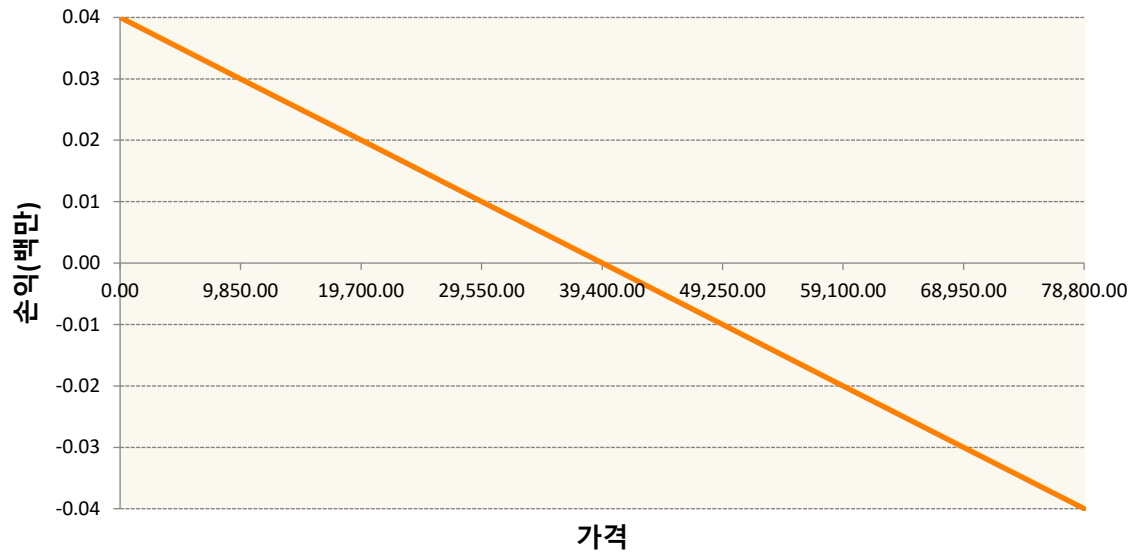
KR41BFW50008-2025-05 ?쉽팩以몫났?깁컷蹂꼴꽤긔?



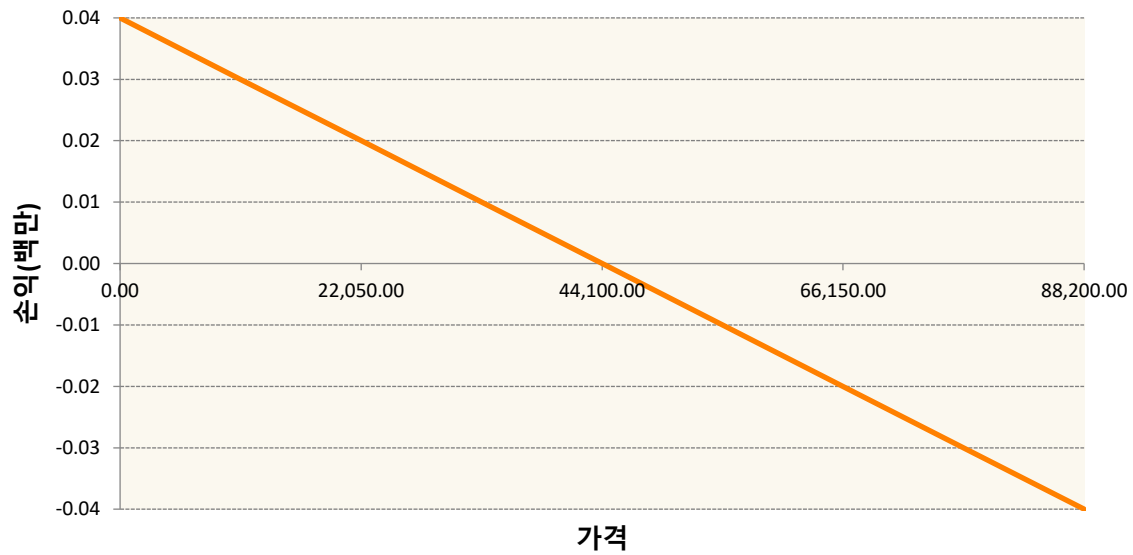
KR41BMW50004-2025-05 ?췘뎡??났?젷 <媛췘궡?췘b



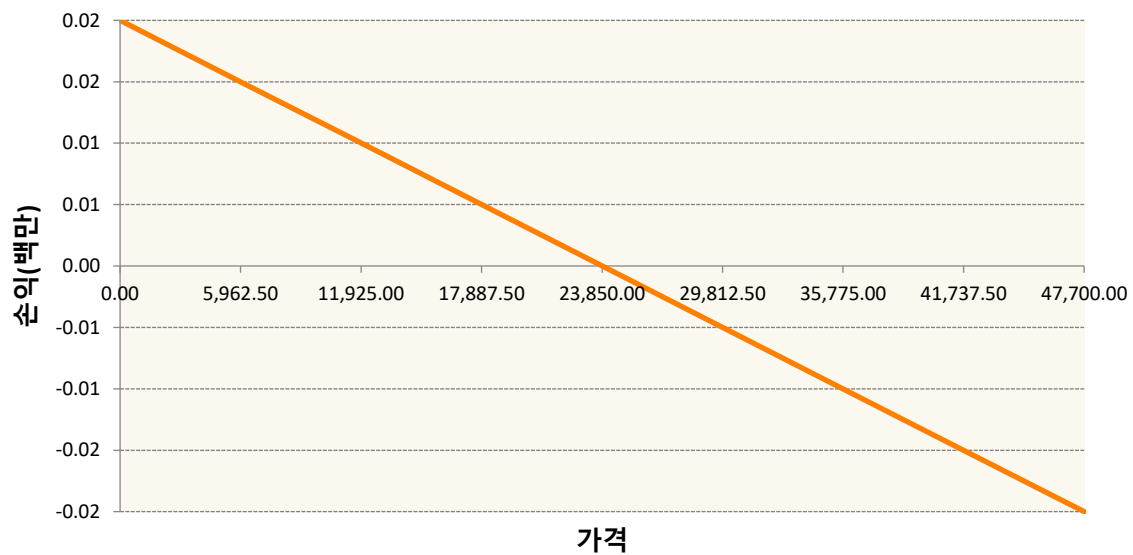
KR41BNW50002-2025-05 ?꿔?嫖덑꿔媛씽꺾?쥬b



KR41C9W50001-2025-05 ?싯슌媛뽕꺾?쥬b



KR41CNW50000-2025-05 ?b뵐뵍뵍X媛쑹꺾?쥬b



가액 (Price)	순익(백만) (Net Income in millions)
0.00	0.02
4,842.50	0.01
9,685.00	0.00
14,527.50	-0.01
19,370.00	-0.02
24,212.50	-0.03
29,055.00	-0.04
33,897.50	-0.05
38,740.00	-0.06

가격	손익 (백만)
0.00	0.37
182,500.00	0.18
365,000.00	0.00
547,500.00	-0.18
730,000.00	-0.37

(단위:백만원)

KR410PW50(2025-05 ?곡쌔딧덱뵘?ㄹ6)뵘媛崈궏?쥬ㄴ	0.07
KR410ZW50(2025-05 ?崈?諛쑤뵘泥닿킷蹂궏궏뵘?	0.47
KR4115W50(2025-05 ?쑤뵘?궏쑤媛崈궏?쥬ㄴ	0.31
KR4149W50(2025-05 HD?궏??명뵘?쑤뵘?닿킷蹂궏궏뵘?	1
KR41B2W50(2025-05 S-Oil媛崈궏?쥬ㄴ	1
KR41B7W50(2025-05 ?ㄴ뵘肄뵘쑤?궏궏?뵘궏媛崈궏?쥬ㄴ	1
KR41BFW50(2025-05 ?쑤뵘以뵘뵘?궏킷蹂궏궏뵘?	1
KR41BMW5C(2025-05 ?쑤뵘??뵘?궏 <媛崈궏?쥬ㄴ	1
KR41BNW50(2025-05 ?궏?媛덱궏媛崈궏?쥬ㄴ	0.32
KR41C9W50(2025-05 ?쑤쑤媛崈궏?쥬ㄴ	0.42
KR41CNW50(2025-05 ?ㄴ뵘肄궏X媛崈궏?쥬ㄴ	0.36
KR41CXW50(2025-05 ?崈??쑤뵘媛崈궏?쥬ㄴ	0.38

KR41DGW50 2025-05 ?곡쌔뮁덢뽕媛쵸궂	0.29
KR41DYW50 2025-05 ?궂??쌔—궂궂쵸媛쵸궂	0.28
KR41DZW50 2025-05 ?쵸궂?뮁뽕媛쵸궂	1
KR41E8W50(2025-05 ?뮁뽕뽕뽕뽕媛쵸궂	0.3
KR41ESW50(2025-05 ?쵸궂뽕뽕?뮁쵸궂媛쵸궂	1
KR41FAW50(2025-05 HMM媛쵸궂	0.31
KR41HSW50 2025-05 ?뽕궂뮁뽕뽕媛쵸궂	0.29

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

(단위:백만원)

19

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

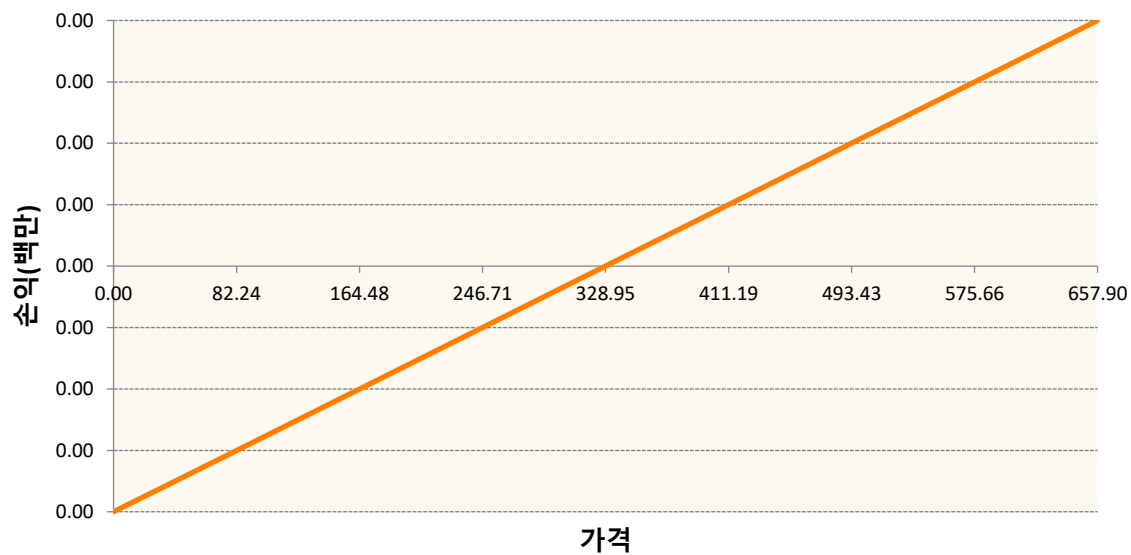
1. 계약금액

(단위:백만원)

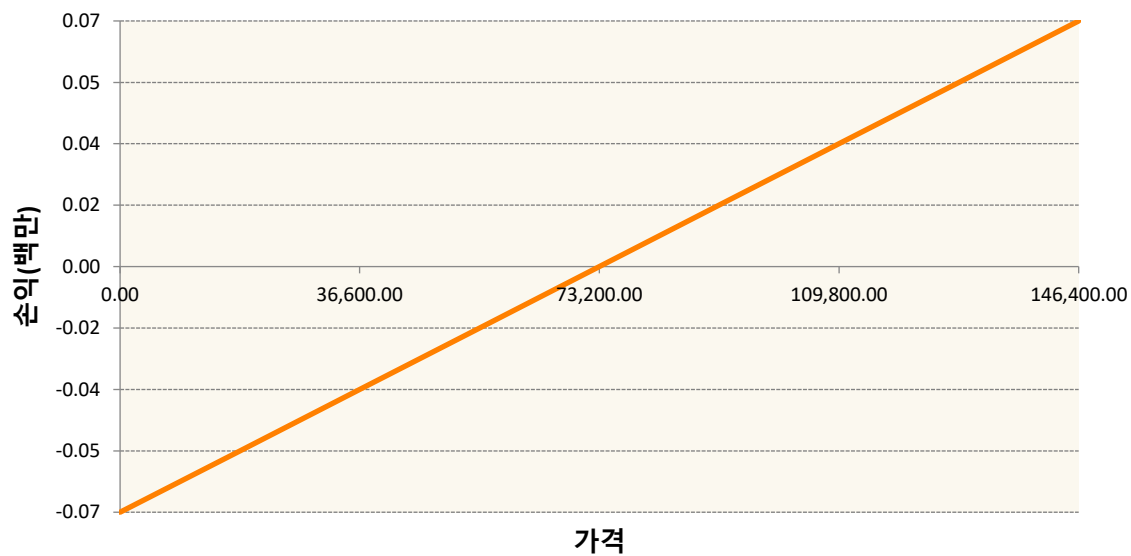
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,431	0	9,431	장내

2. 만기시점의 손익구조

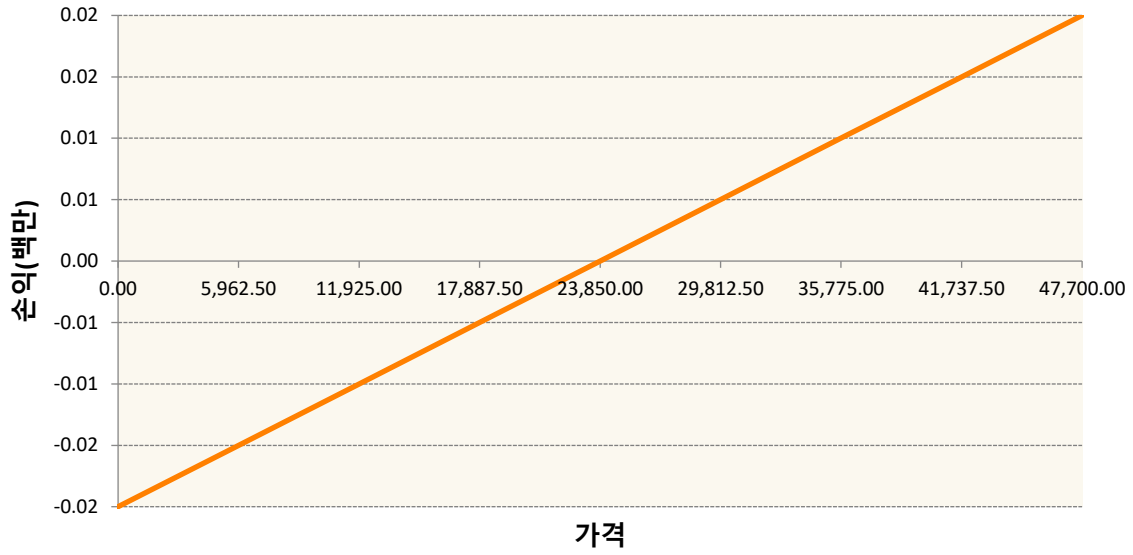
KR4101W60000-2025-06 肄뵔뵔??00吏뵔뵔뵔?



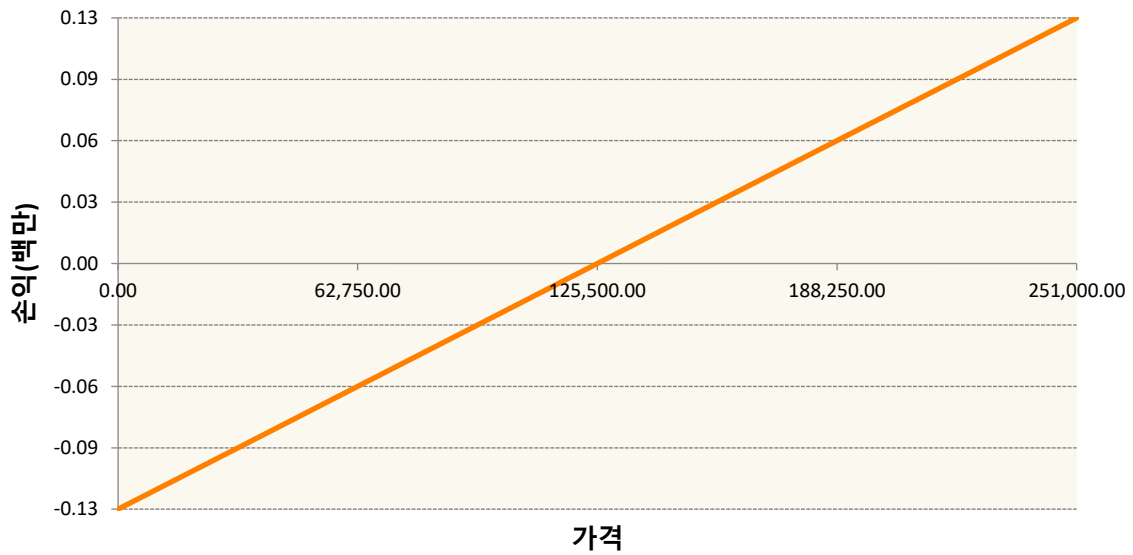
KR410ZW50000-2025-05 ?똥?誤謬뤼泥당킷蹂躪꺾與?



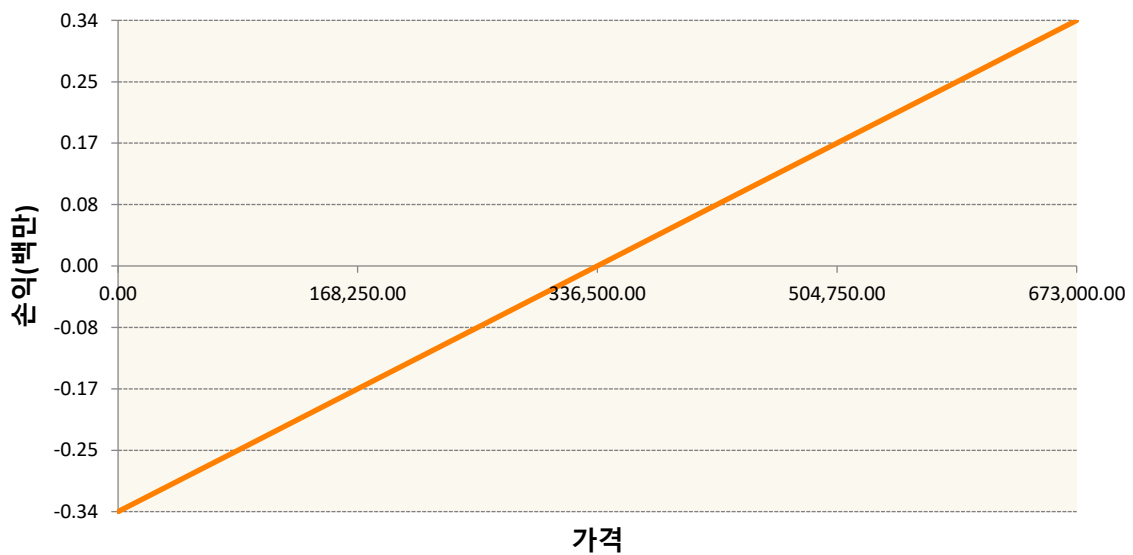
KR41CNW50000-2025-05 ?뵚뵚뵚X媛뵚뵚?뵚뵚



KR41E8W50001-2025-05 ?뵚뵚뵚뵚뵚뵚뵚媛뵚뵚?뵚뵚



KR41F5W50006-2025-05 LG?뵚뵚뵚뵚뵚 (?뵚뵚뵚뵚뵚뵚?)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 肆월 貳拾貳日 生計 變動?)		579
KR410ZW50(2025-05 5월 5일 生計 變動?)		31
KR41CNW50 2025-05 5월 5일 生計 變動?)		12
KR41E8W50(2025-05 5월 5일 生計 變動?)		16
KR41F5W50(2025-05 5월 5일 生計 變動?)		117

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,237

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

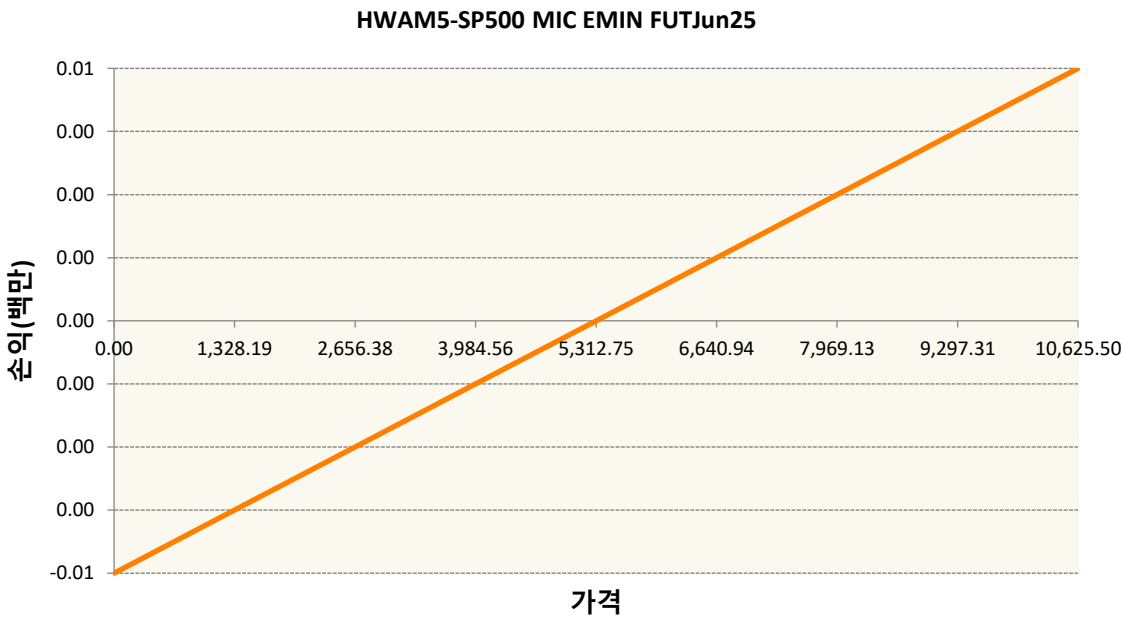
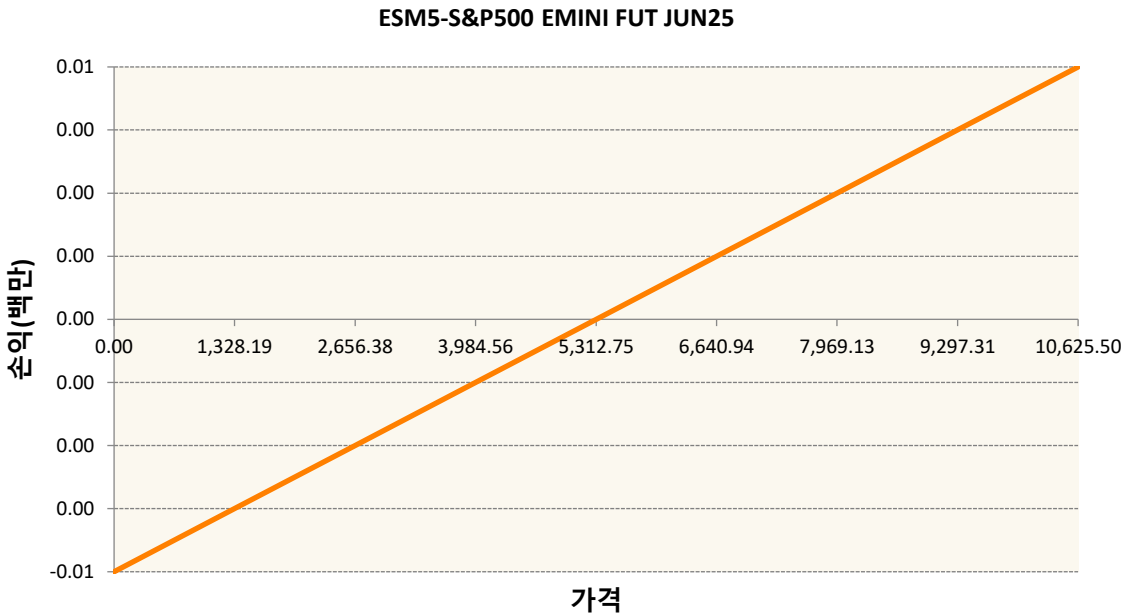
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	25,627	0	25,627	
누계	유가증권	선물	1,126	0	1,126	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,050
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	90

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,838

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

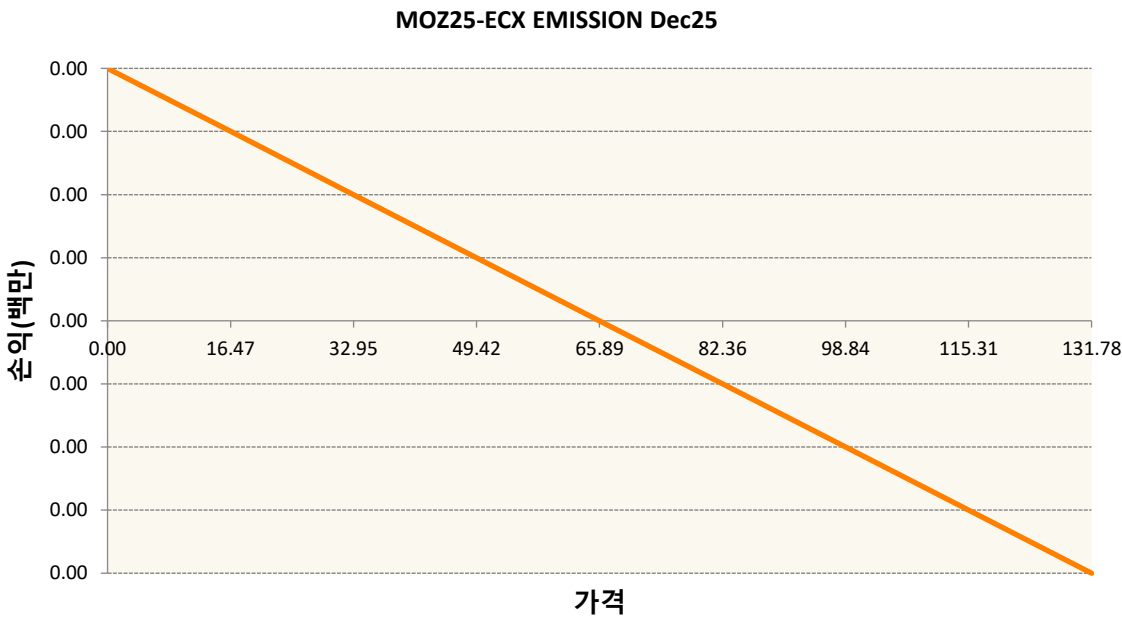
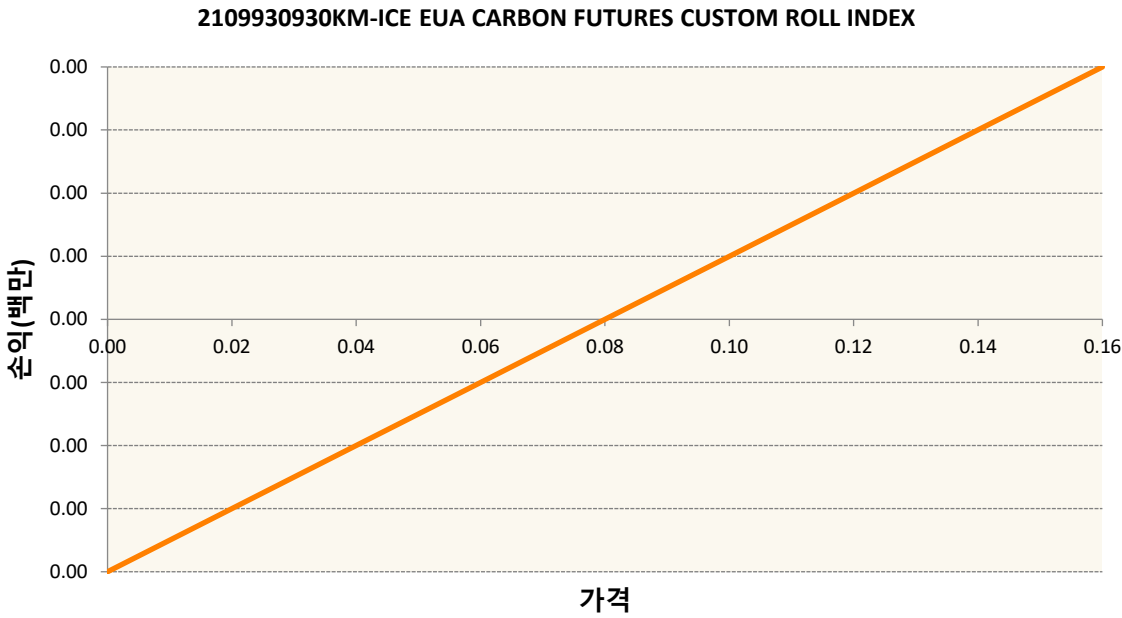
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	30	6,448	-6,418	
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	2
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	5
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	89
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	516

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

967

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

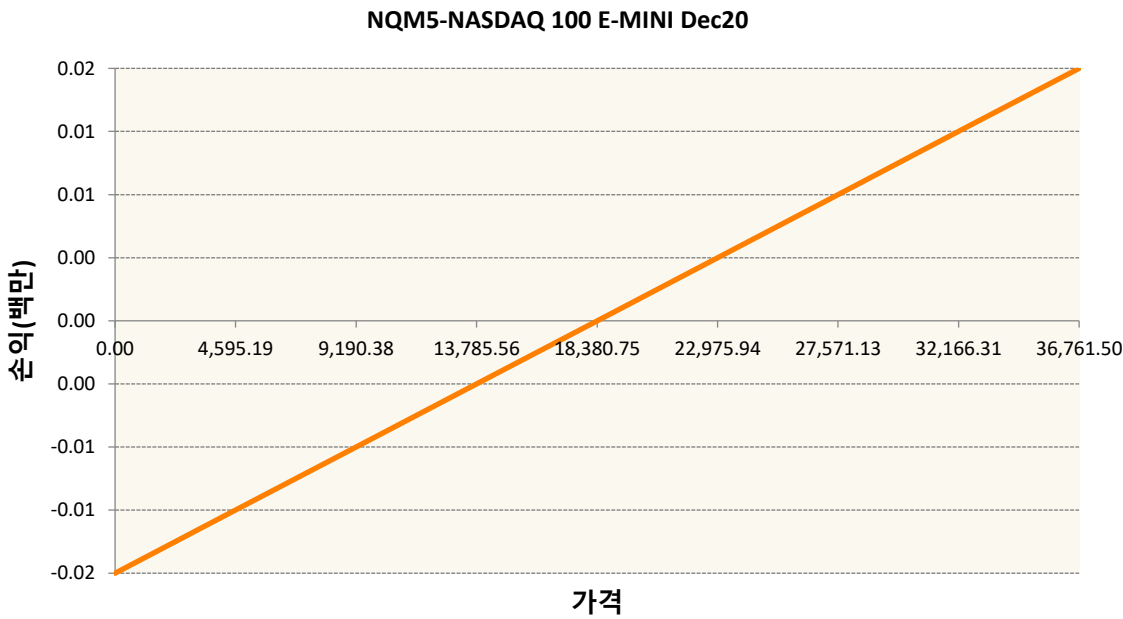
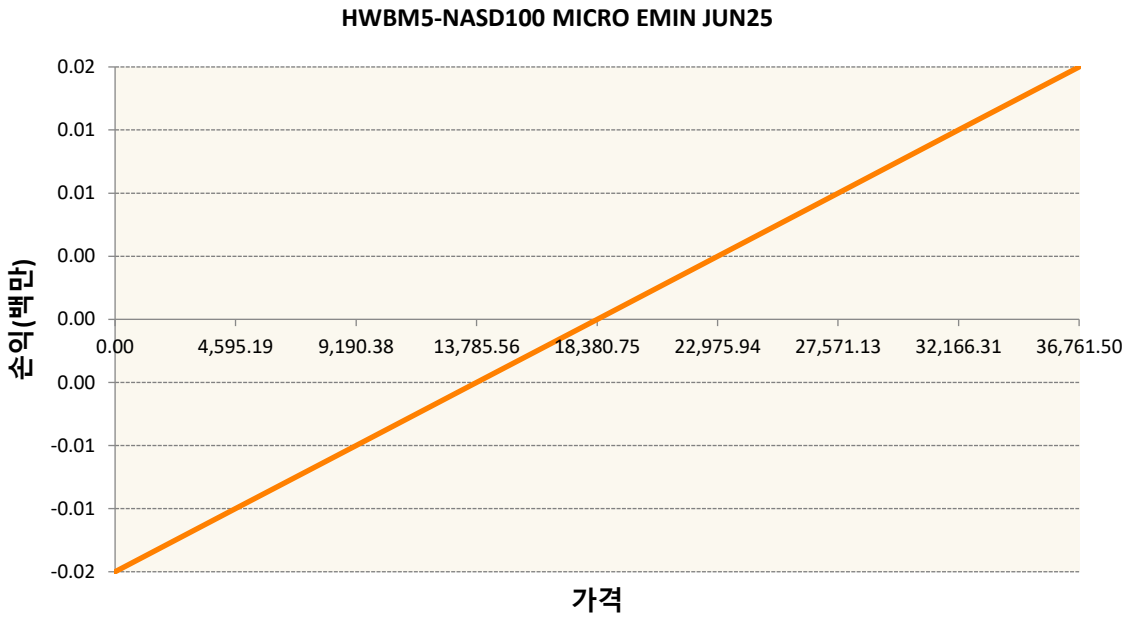
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	12,341	0	12,341	
누계	유가증권	선물	485	0	485	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		39
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		987

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,143

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	18,102	0	18,102	장외
누계	지수	스왑	252,356	0	252,356	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,041
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,143
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,903
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,443

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

(단위:백만원)

9,852

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

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

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

(단위:백만원)

52

공시일	2025-04-21
기준일	2025-04-18

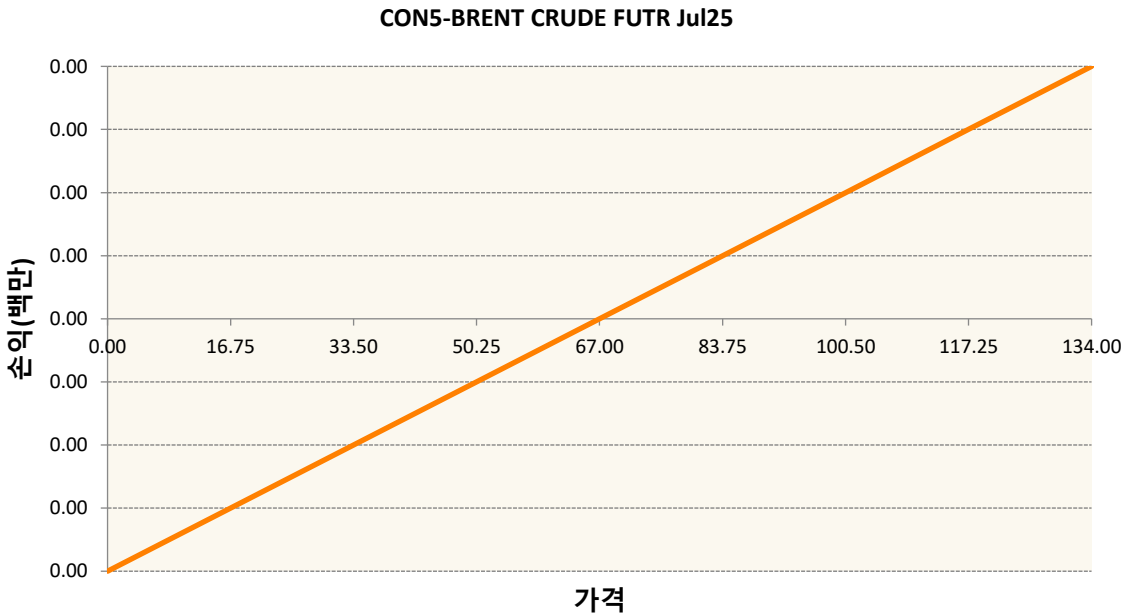
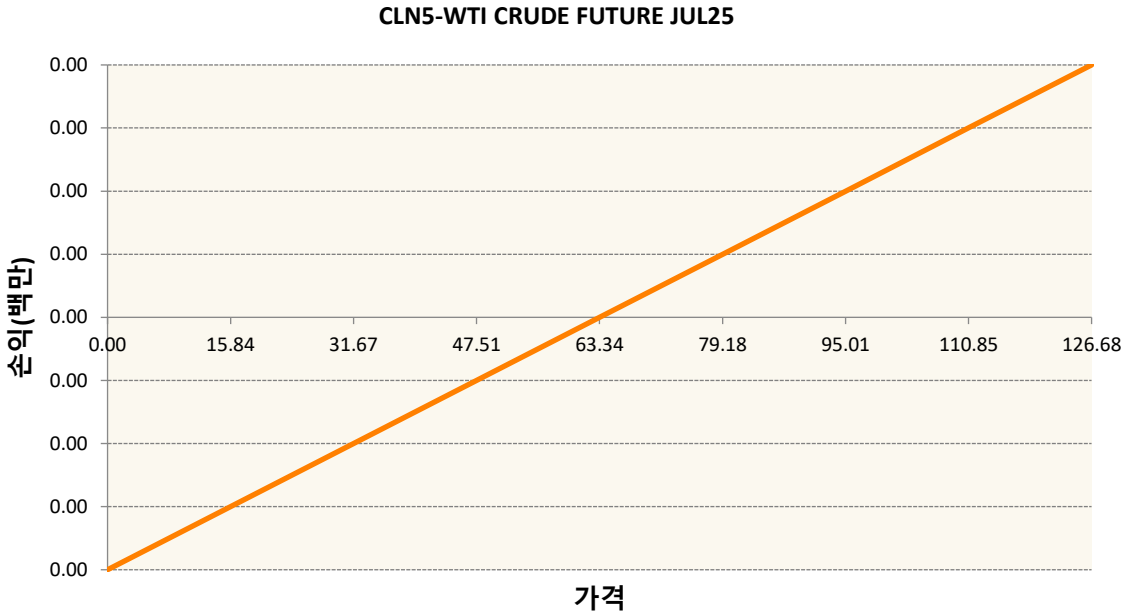
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

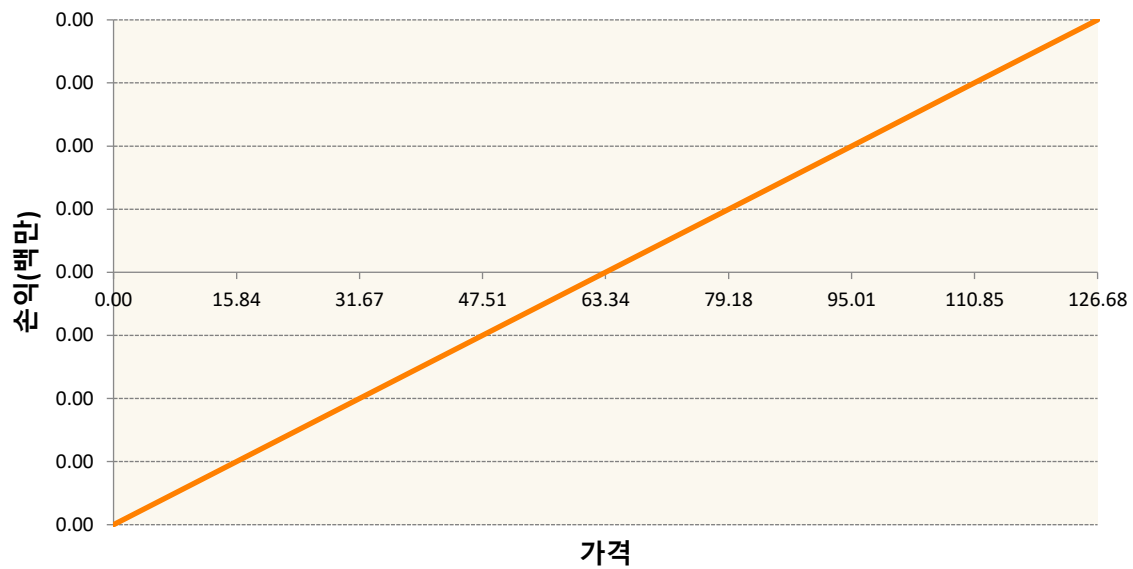
(단위:백만원)

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	663	0	663	
누계	통화	선물	0	85	-85	장내

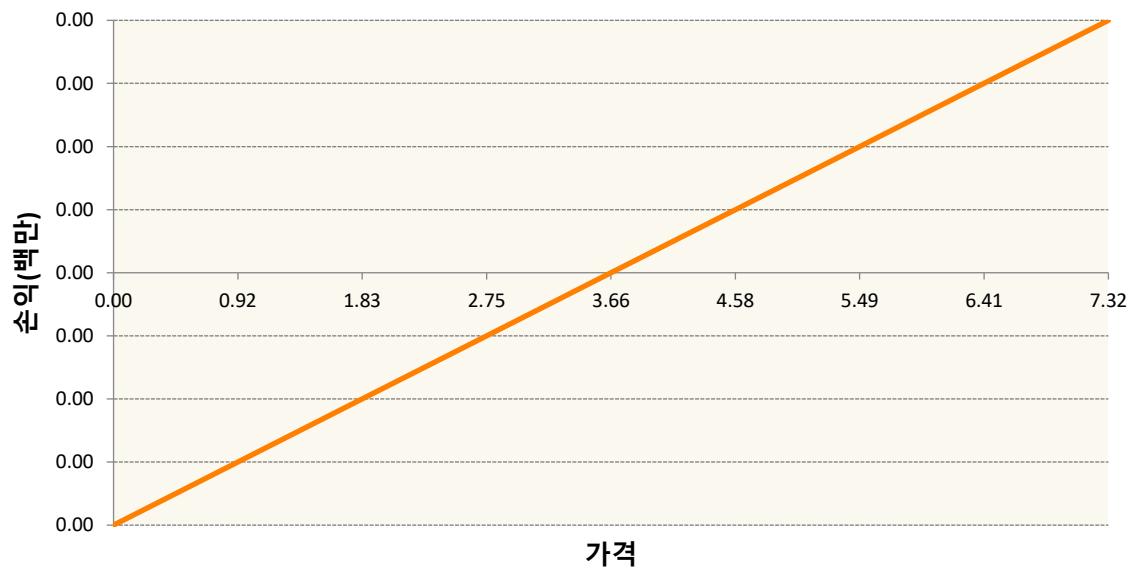
2. 만기시점의 손익구조



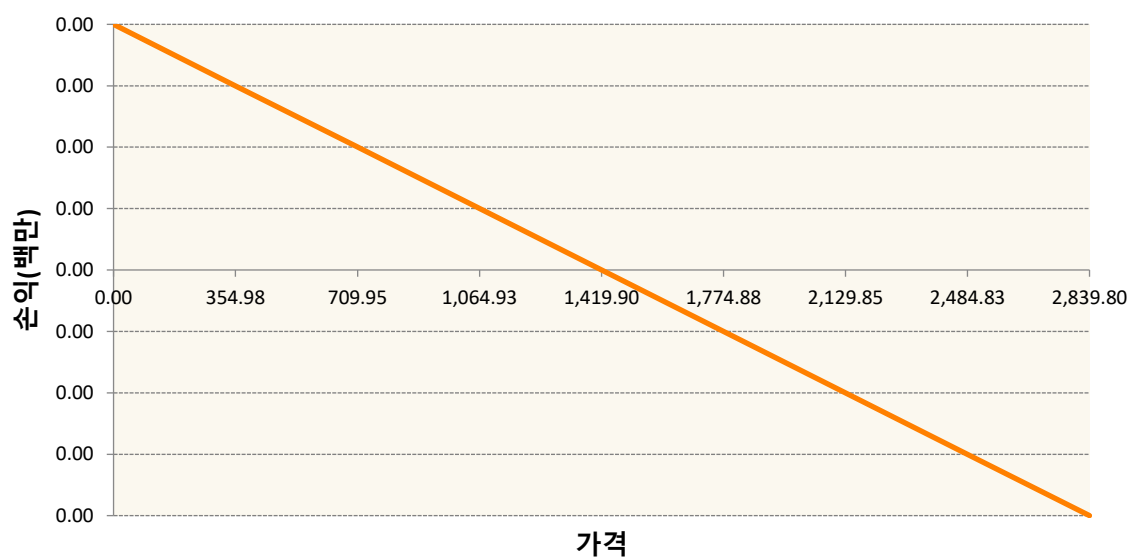
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



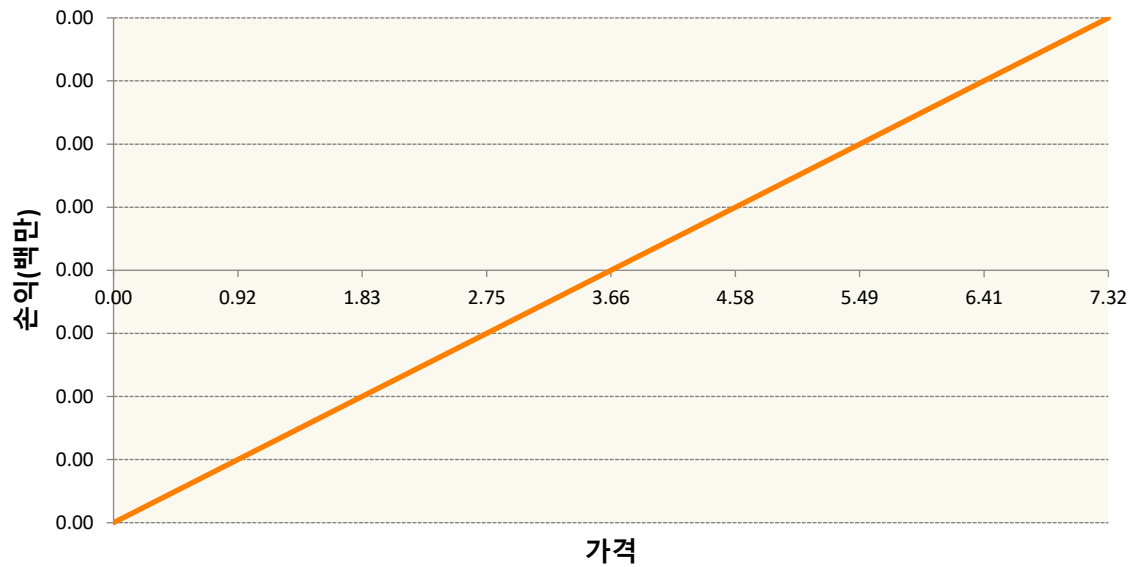
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



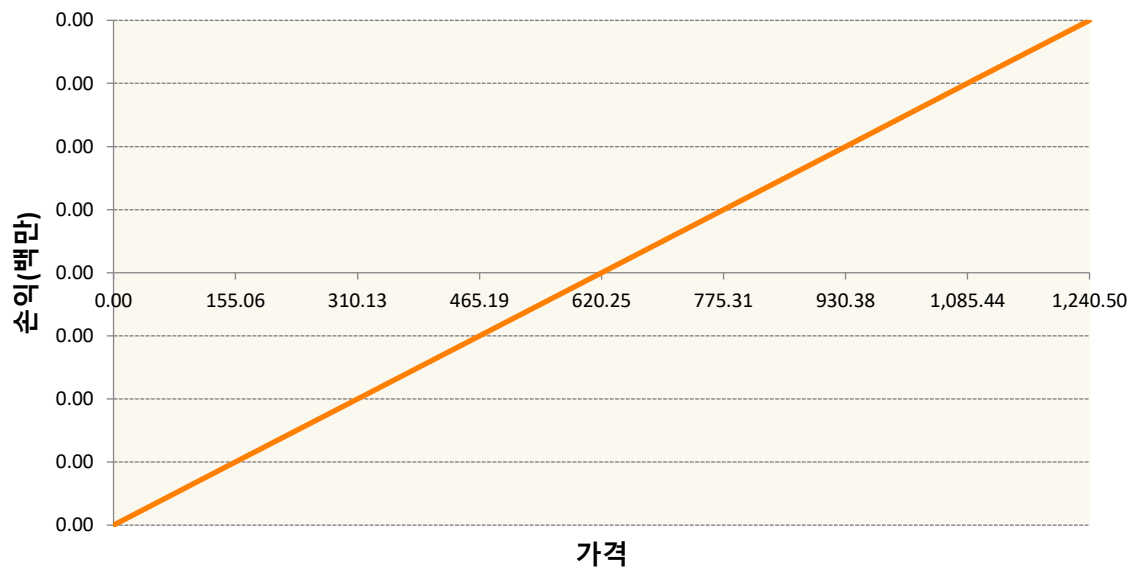
KR4175W50005-2025-05 ?₩₩₩₩₩₩₩₩₩₩



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	16
ECN5	E-mini Crude Oil JUL25	4
EON5	E-MINI NATURAL GAS JUL25	6
KR4175W50(2025-05 ?????)		7
NGN25	NATURAL GAS FUTR JUL25	13
QSN5	Low Su Gasoil G JUL25	7

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

(단위:백만원)

123