

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

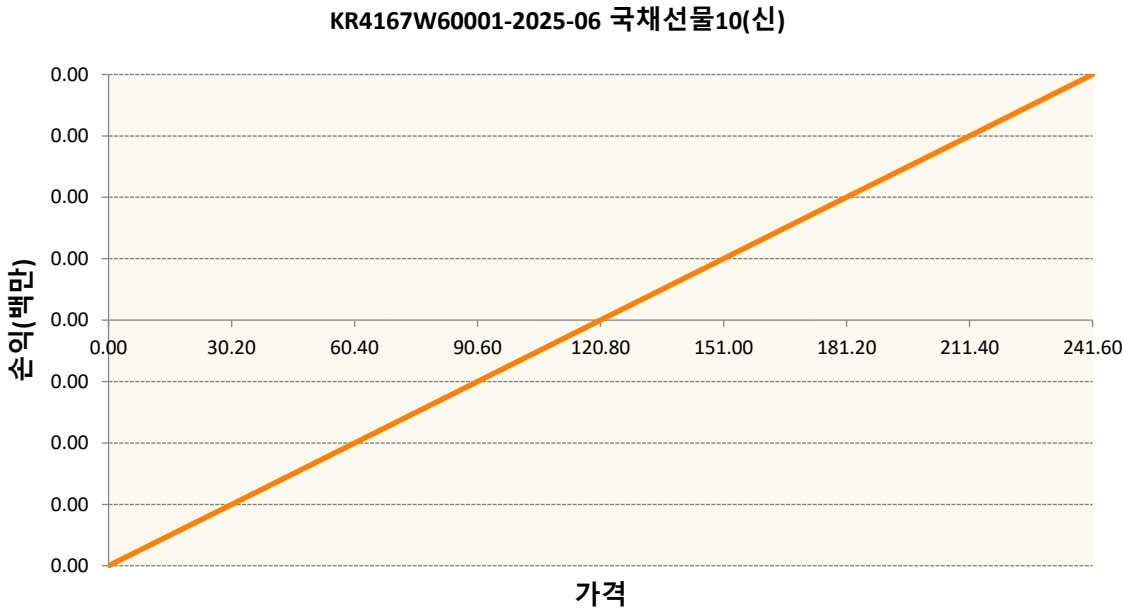
베스트장기채(채권-파생형)

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	60,400	0	60,400	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

732

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

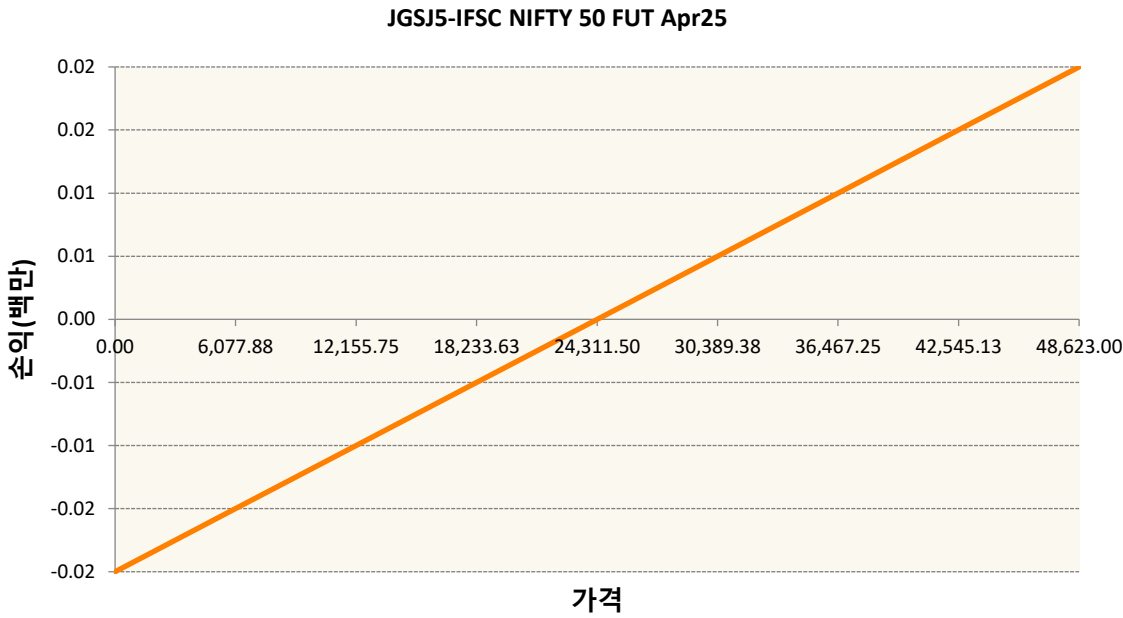
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	853	0	853	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ5 IFSC NIFTY 50 FUT Apr25

68

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

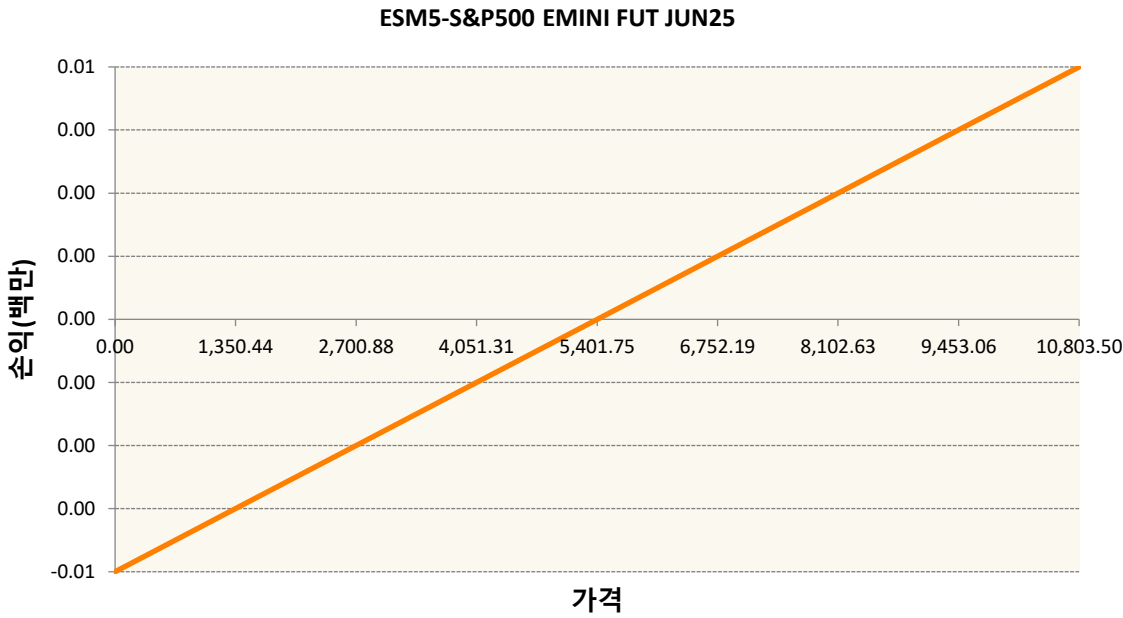
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	396	0	396	

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)

28

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

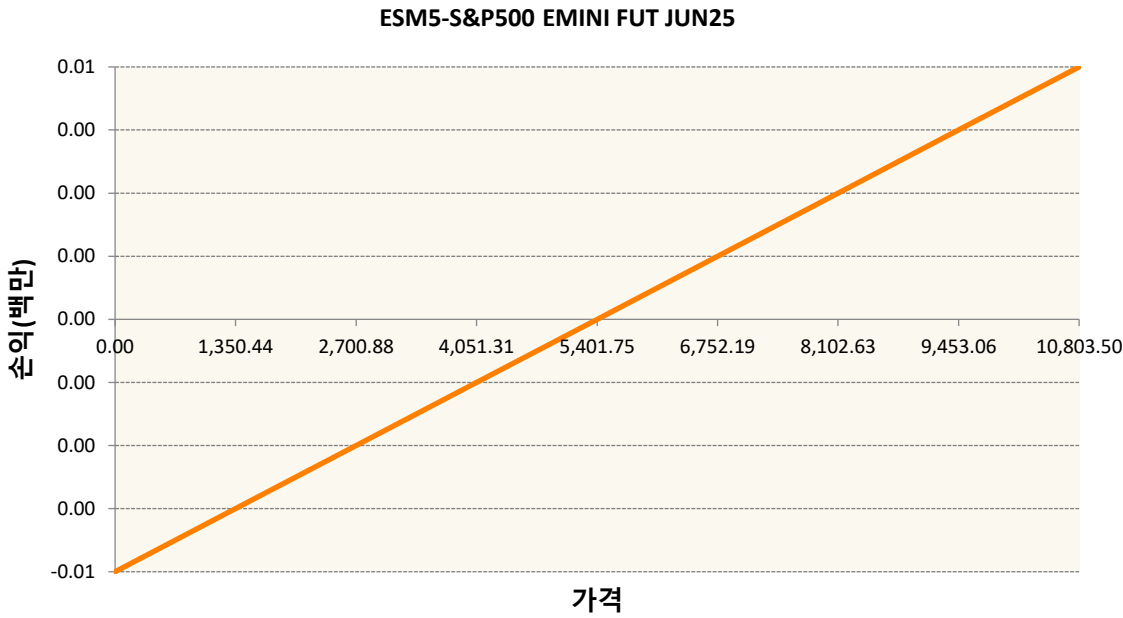
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	2,373	0	2,373	

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)

165

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

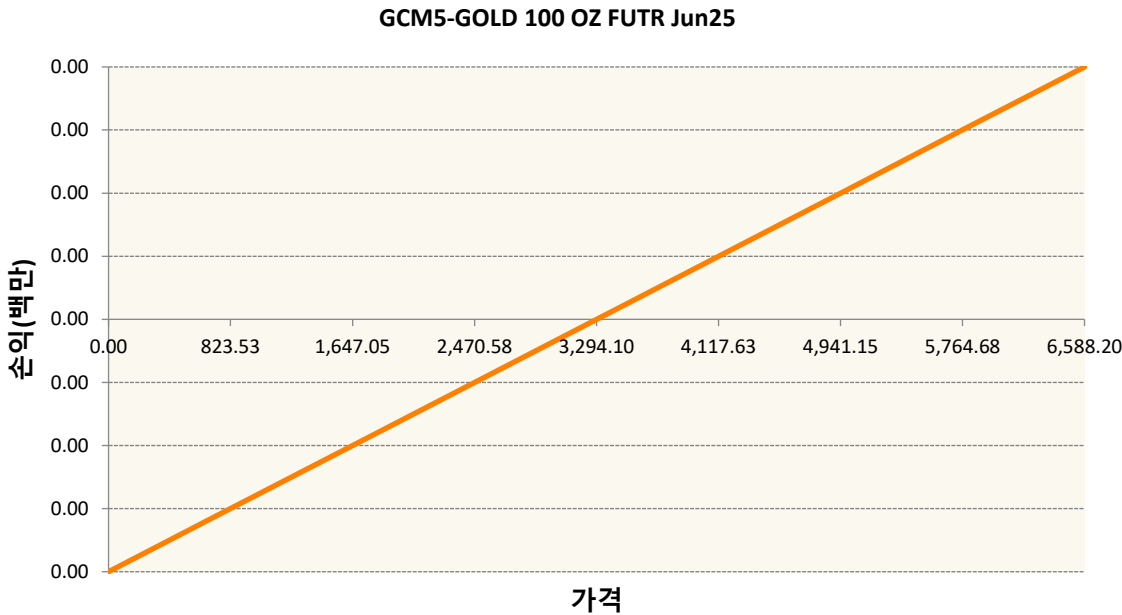
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	스왑	0	0	0	
누계	실물자산	선물	2,415	0	2,415	
누계	실물자산	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 04/25/25 C307 EQUITY	3
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	193

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

(단위:백만원)

155

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC(PLTR US 04/25/25 C97 EQUITY	1
AOPLTRUSP(PLTR US 04/25/25 P97 EQUITY	4

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

(단위:백만원)

18

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSC8TLT US 04/25/25 C88.5 EQUITY

0.42

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

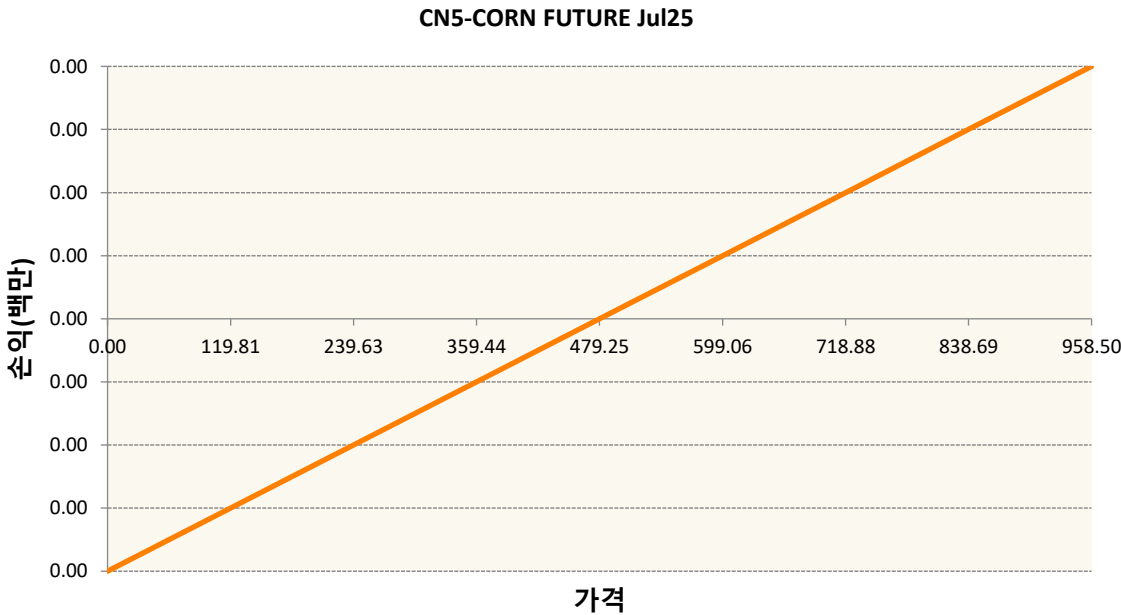
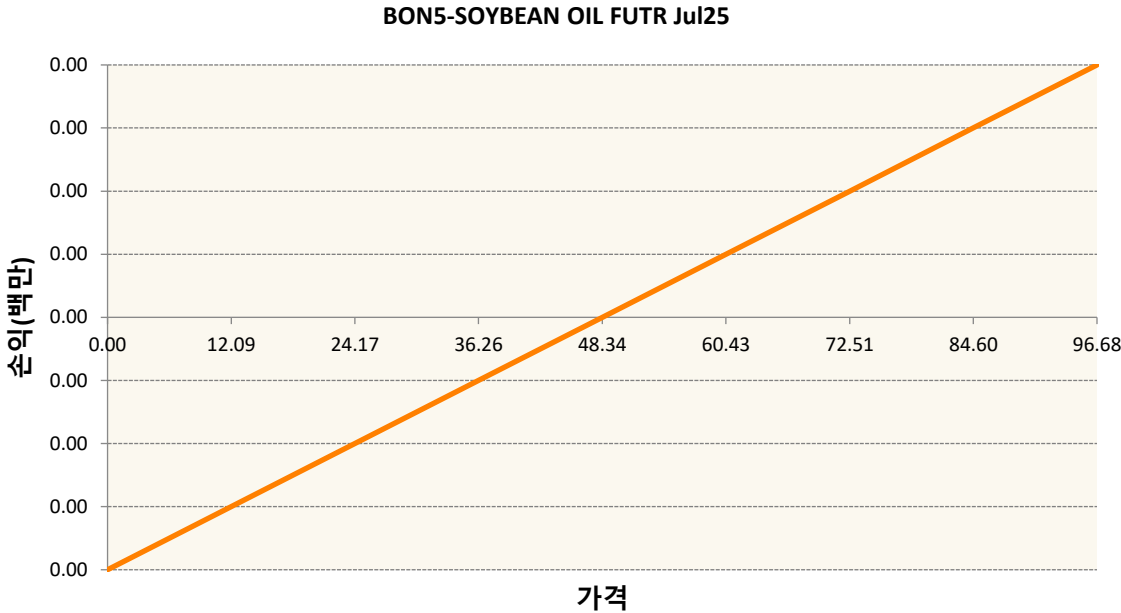
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

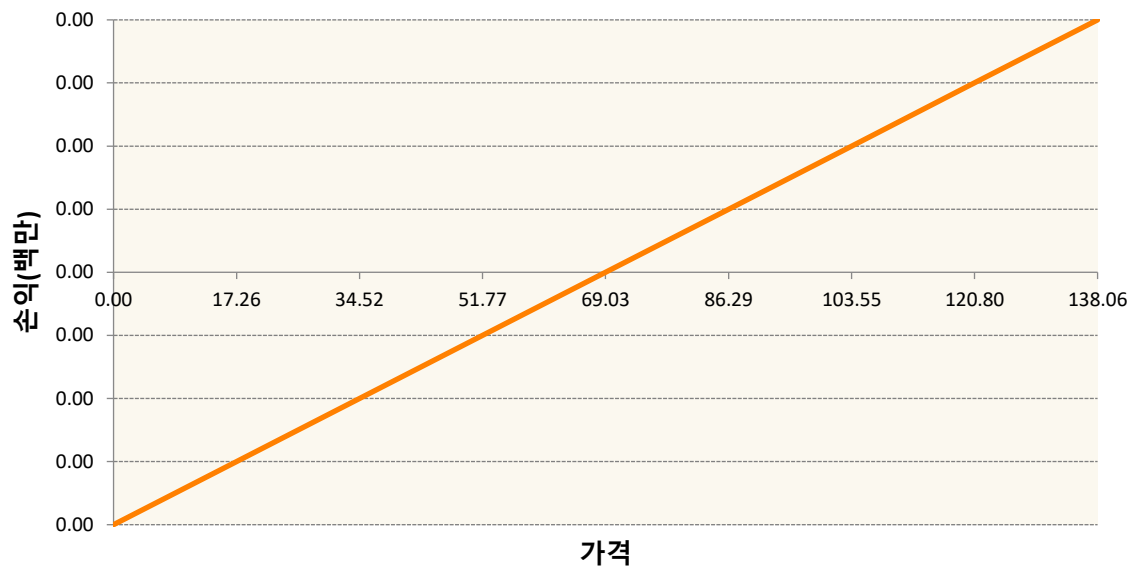
(단위:USD 백만)

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	3,852	0	3,852	
누계	통화	선물	0	330	-330	장내

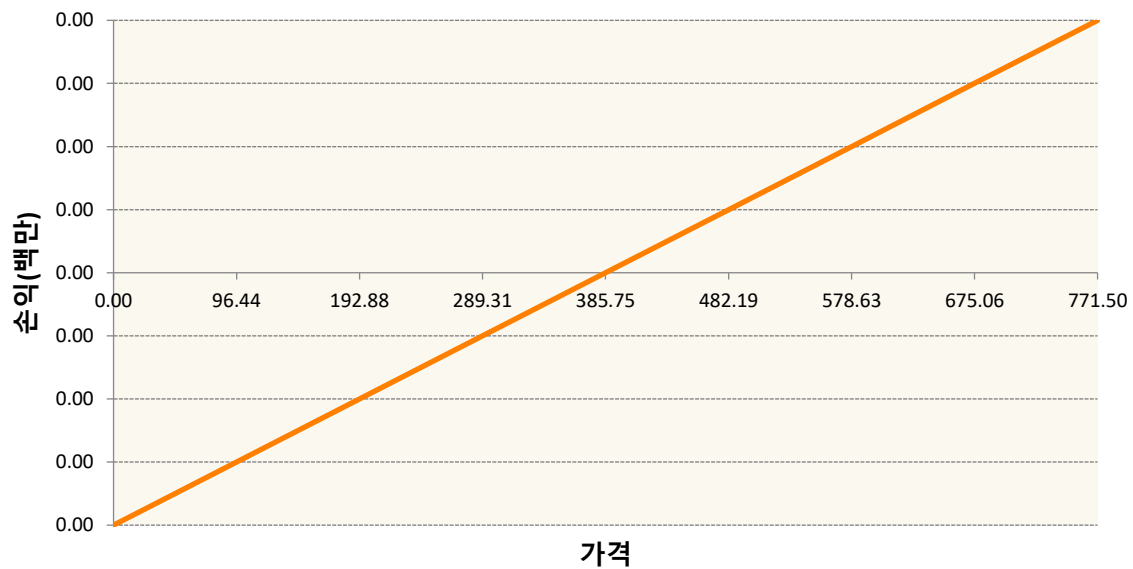
2. 만기시점의 손익구조



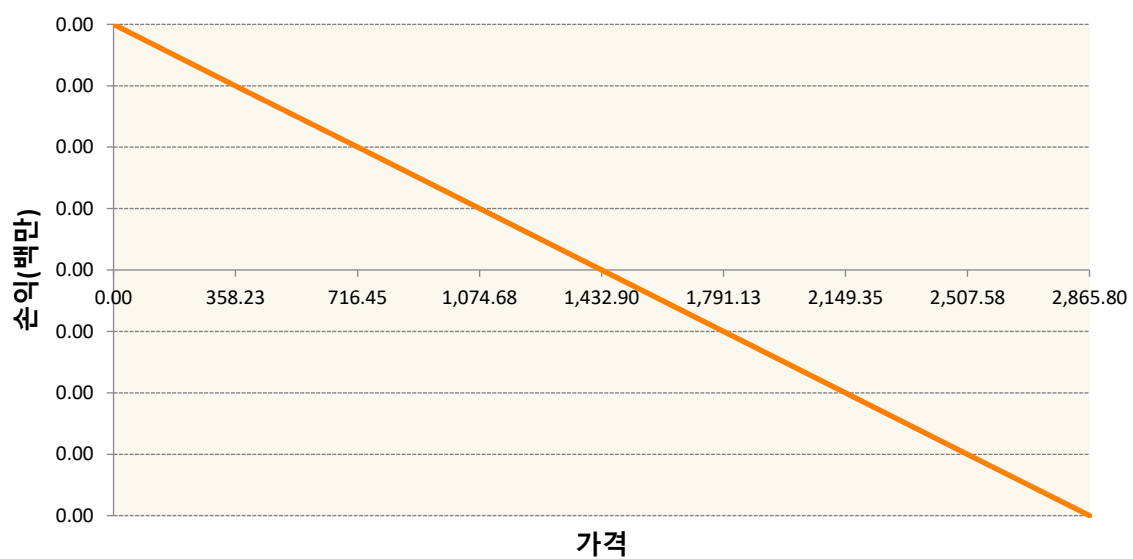
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



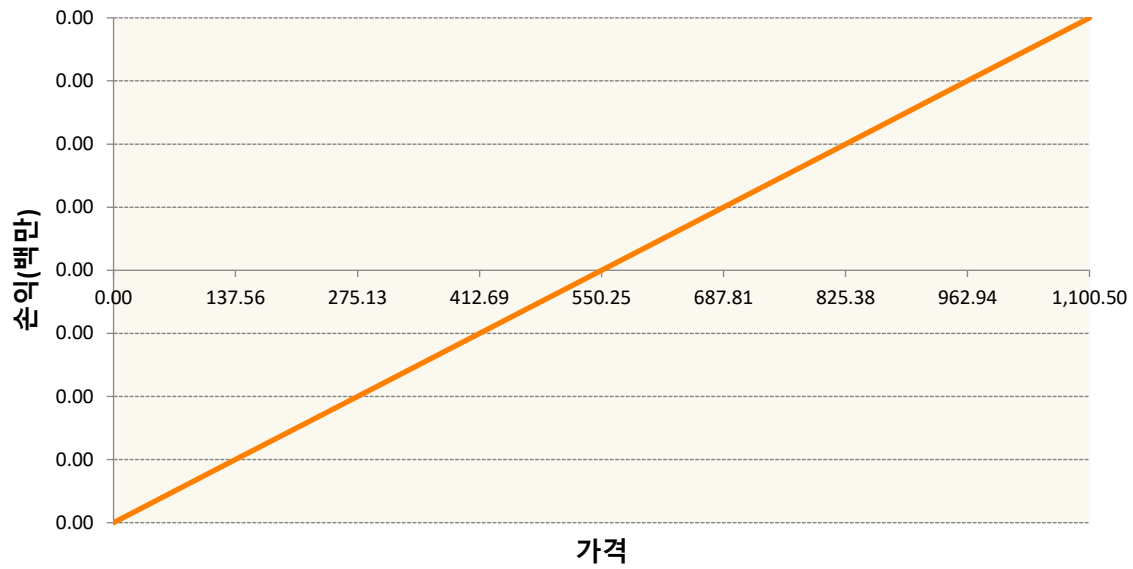
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



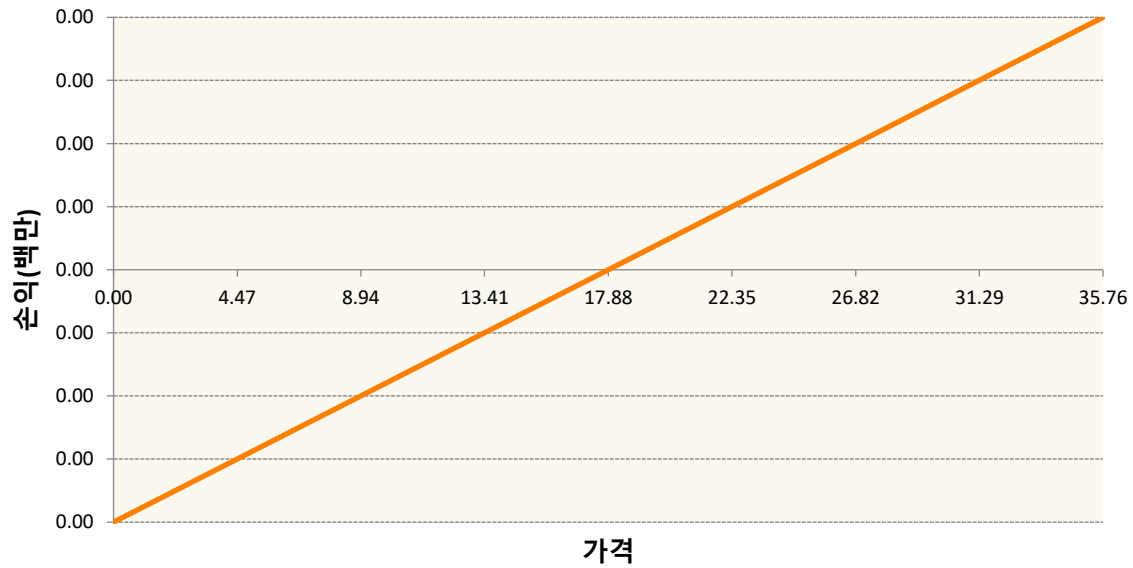
KR4175W50005-2025-05 달러선물



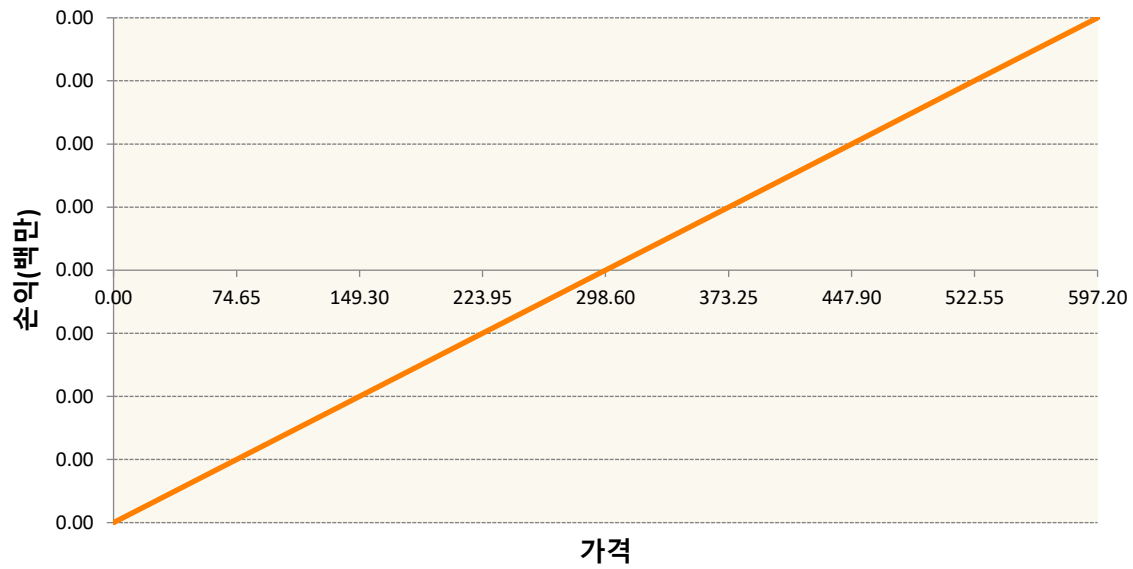
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25

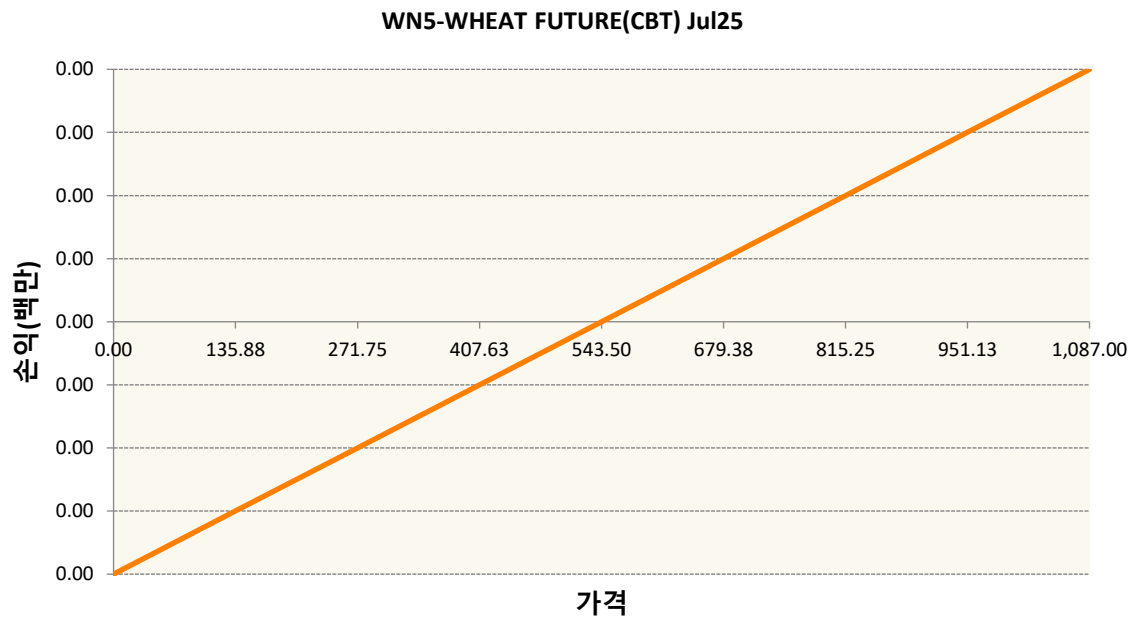
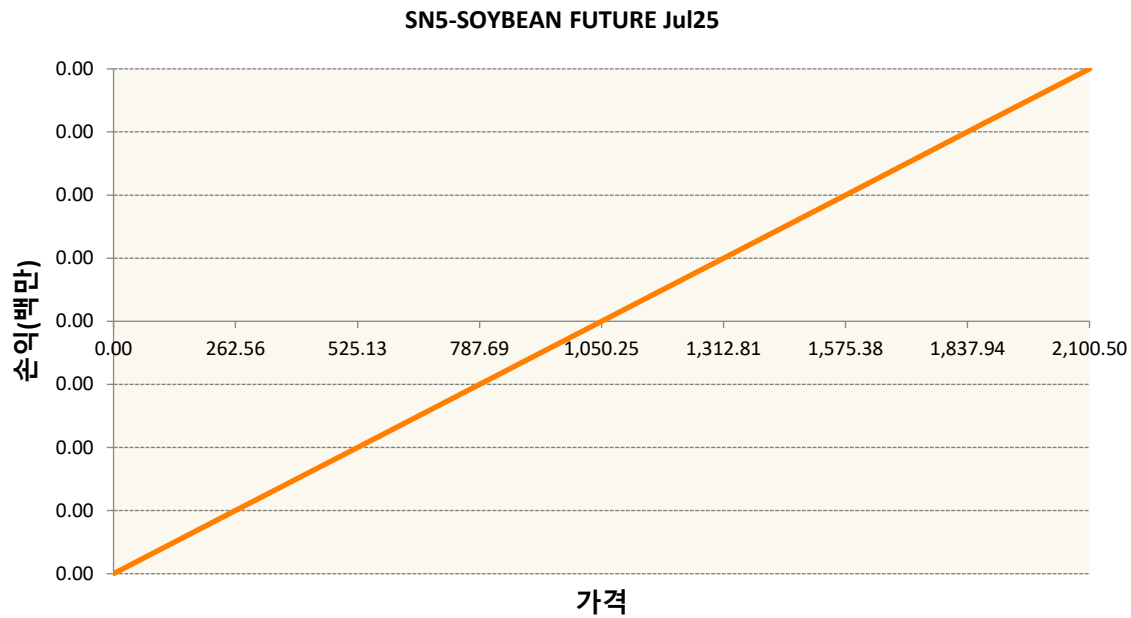


SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



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	2025-04-25
기준일	2025-04-24

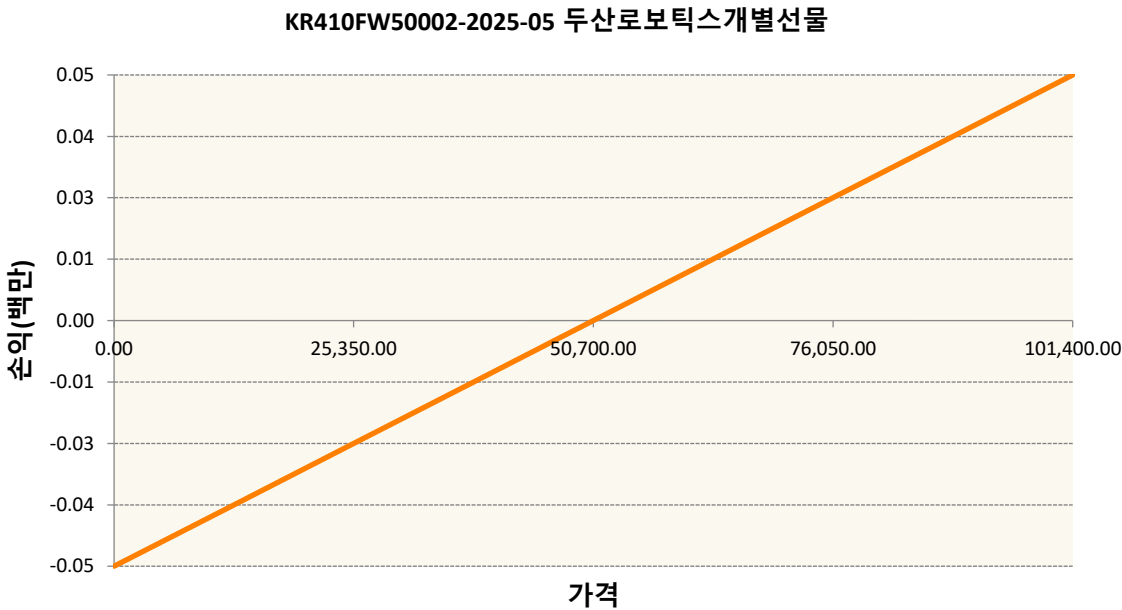
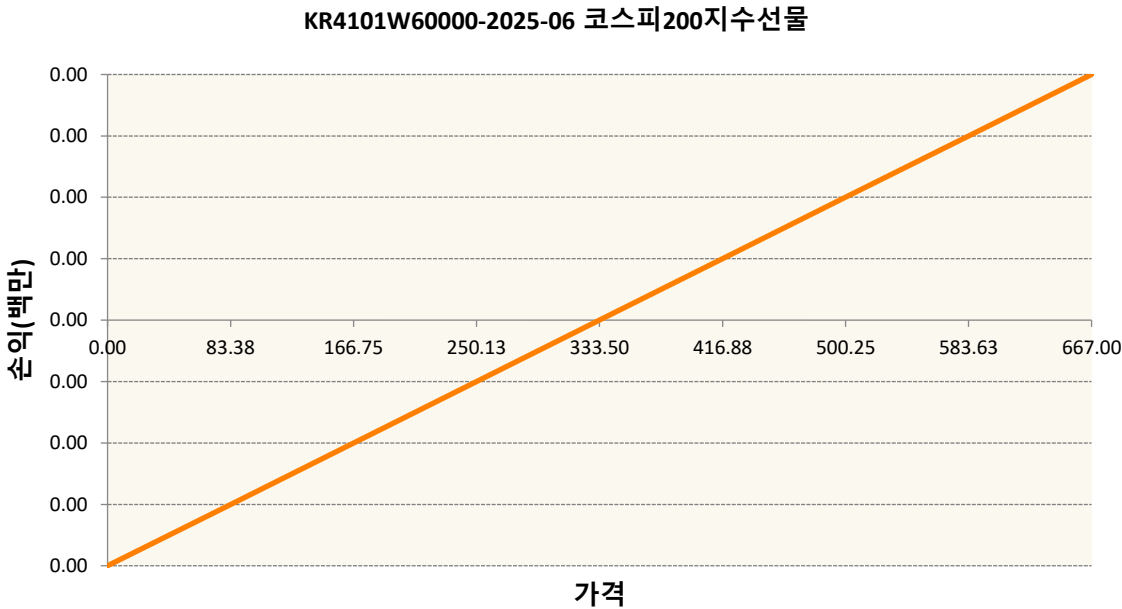
스마트인덱스모

1. 계약금액

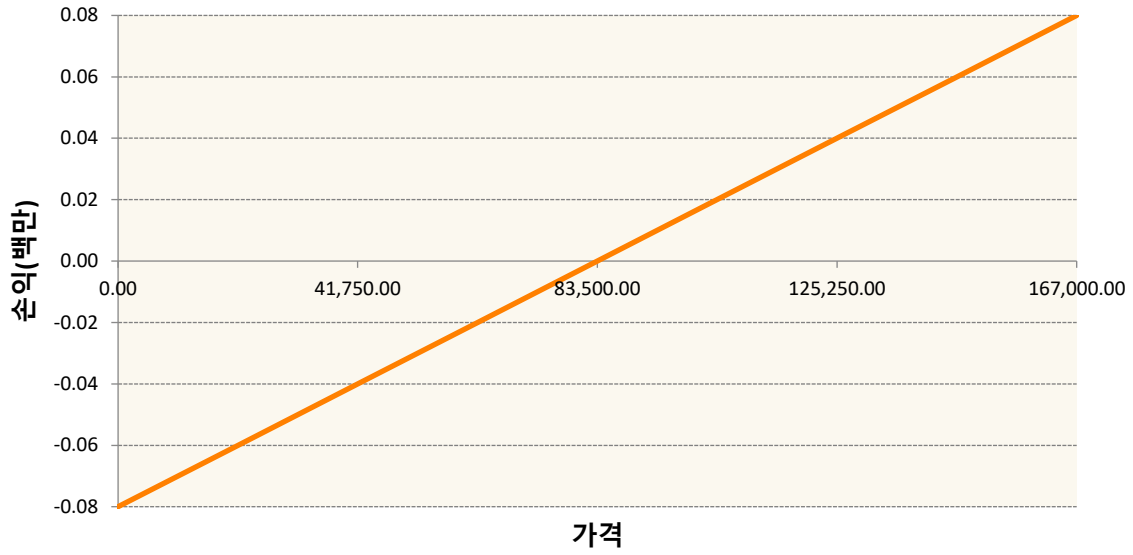
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,729	0	1,729	장내

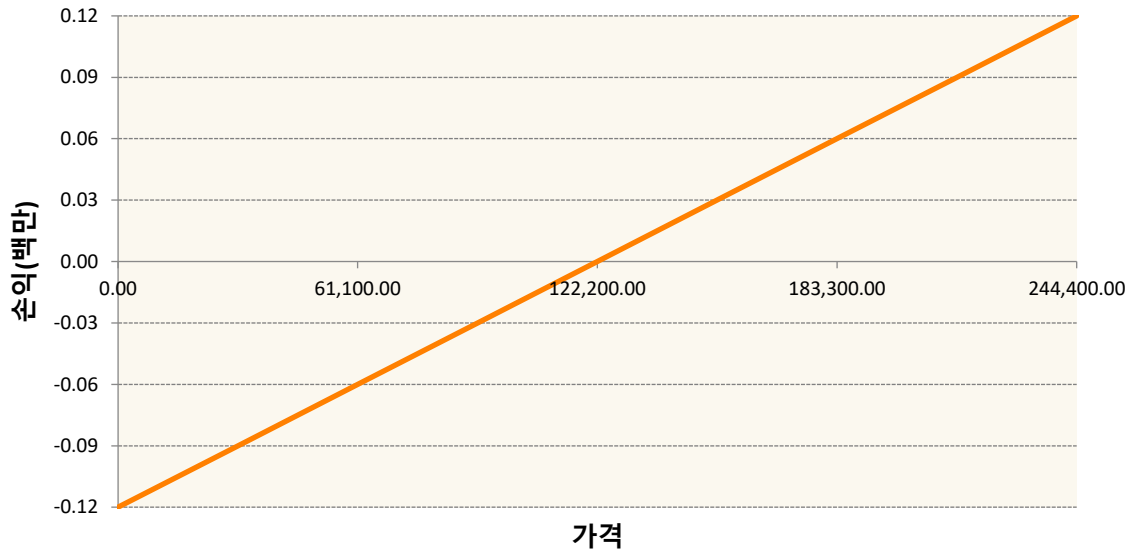
2. 만기시점의 손익구조



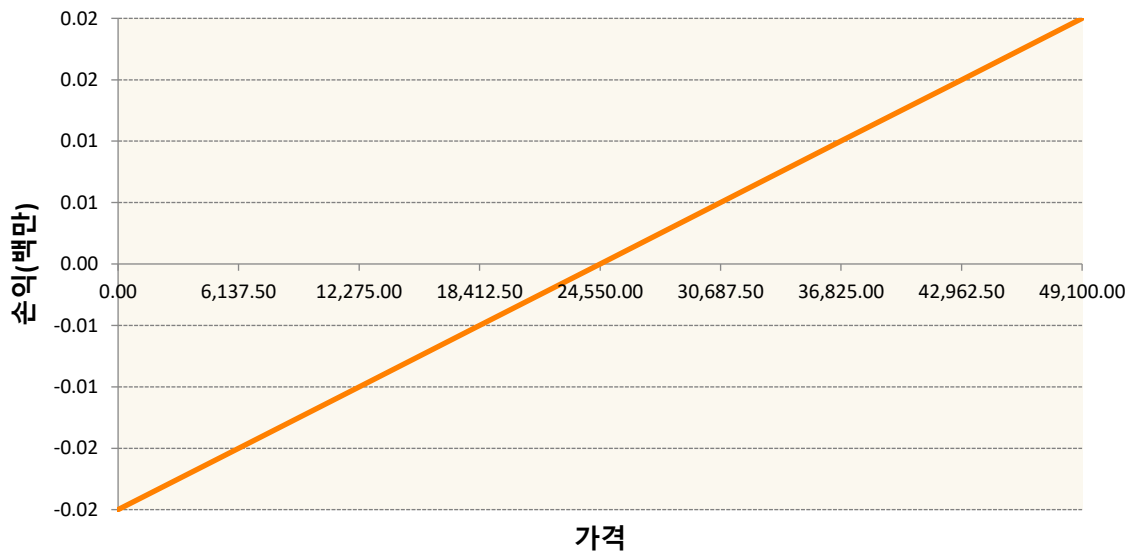
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



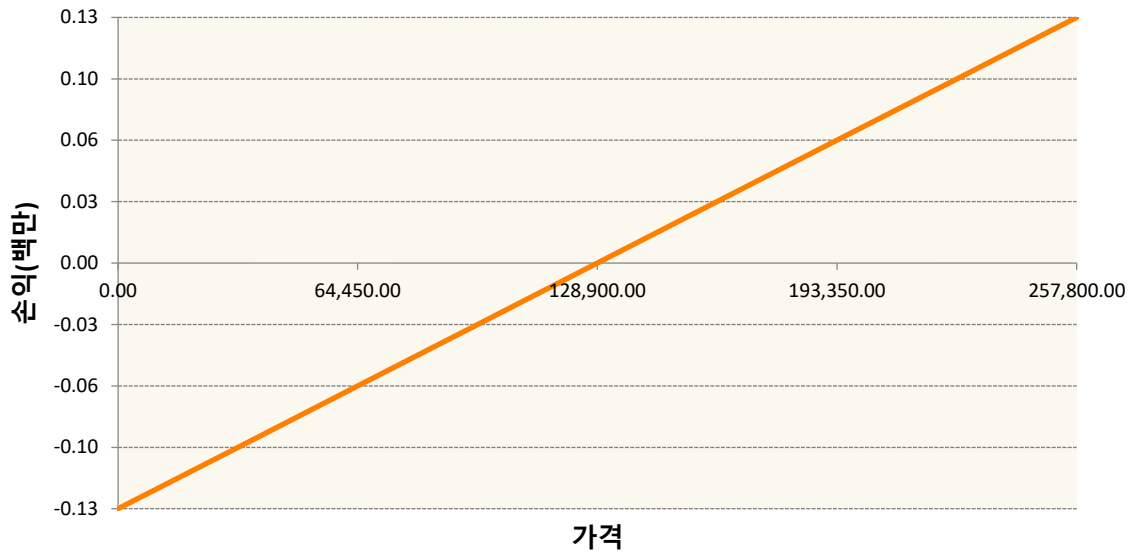
KR4123W50005-2025-05 삼성전자개별선물



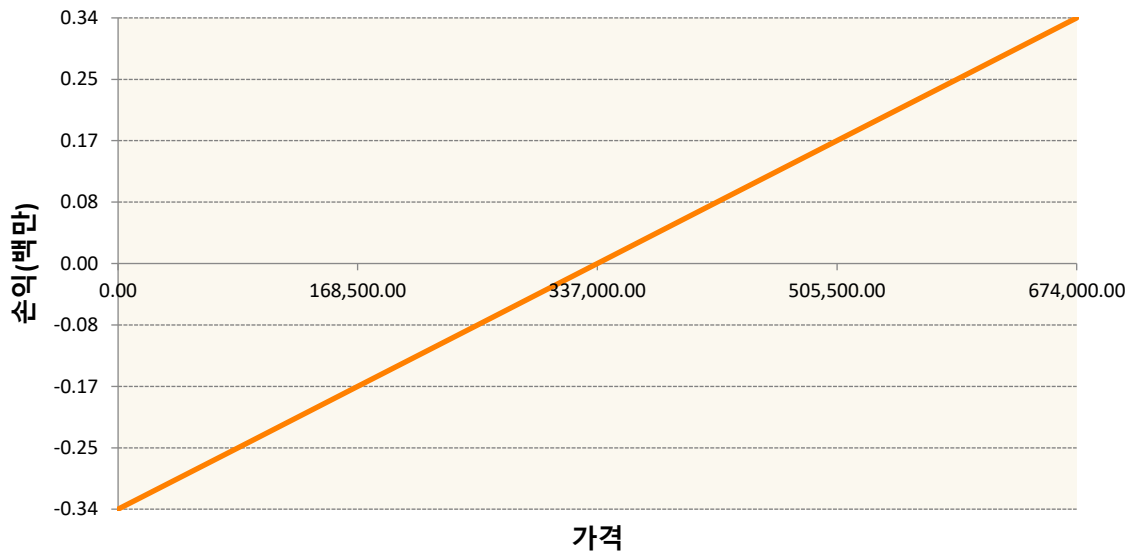
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



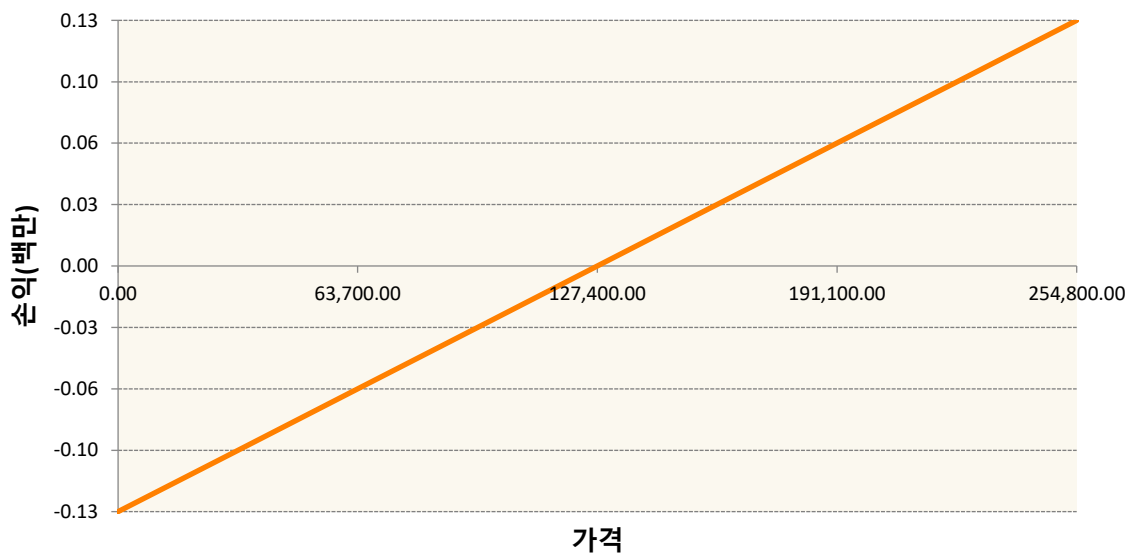
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	107
KR410FW50(2025-05 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	4
KR4123W50(2025-05 삼성전기개별선물	4
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)

226

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

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

285

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

467

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

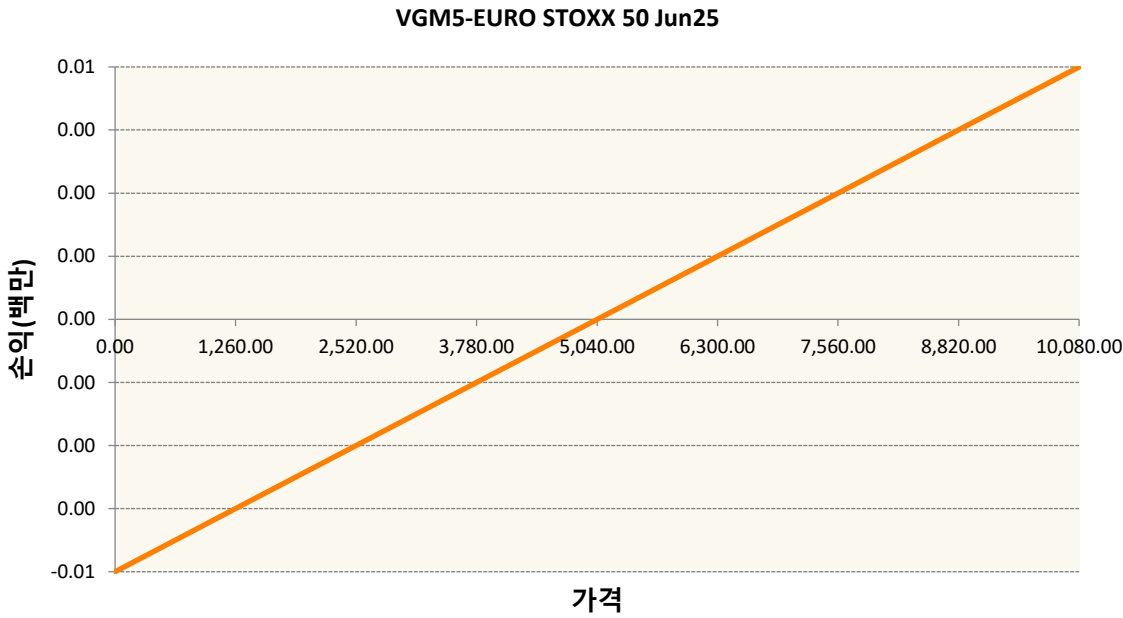
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	802	0	802	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

52

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

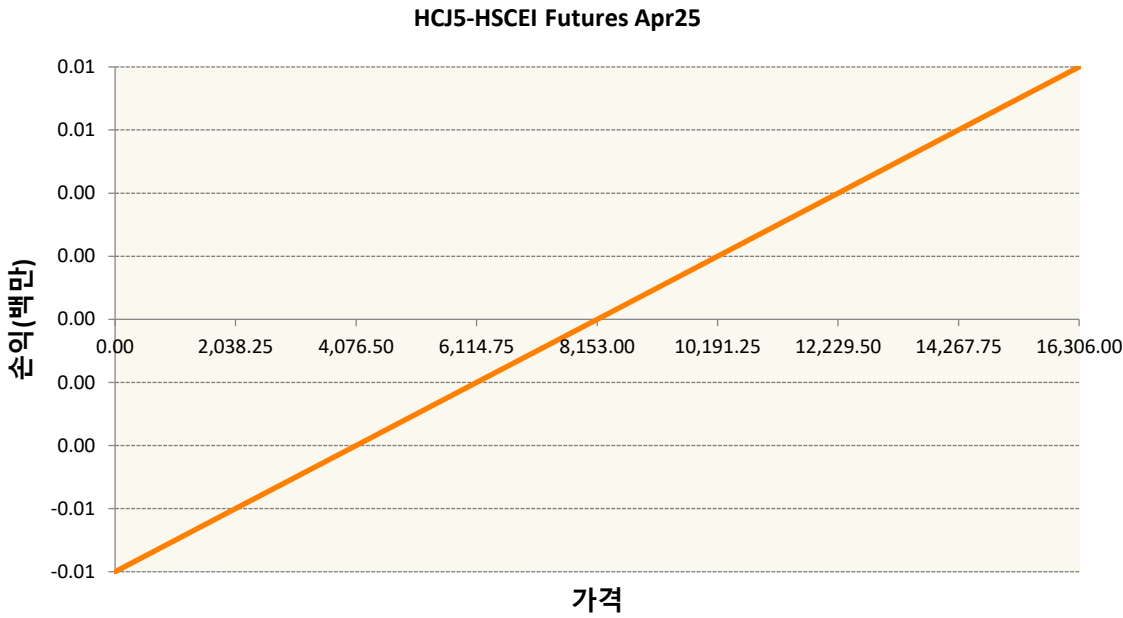
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,310	0	2,310	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI5	HSCEI Futures Apr25	185
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

276

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

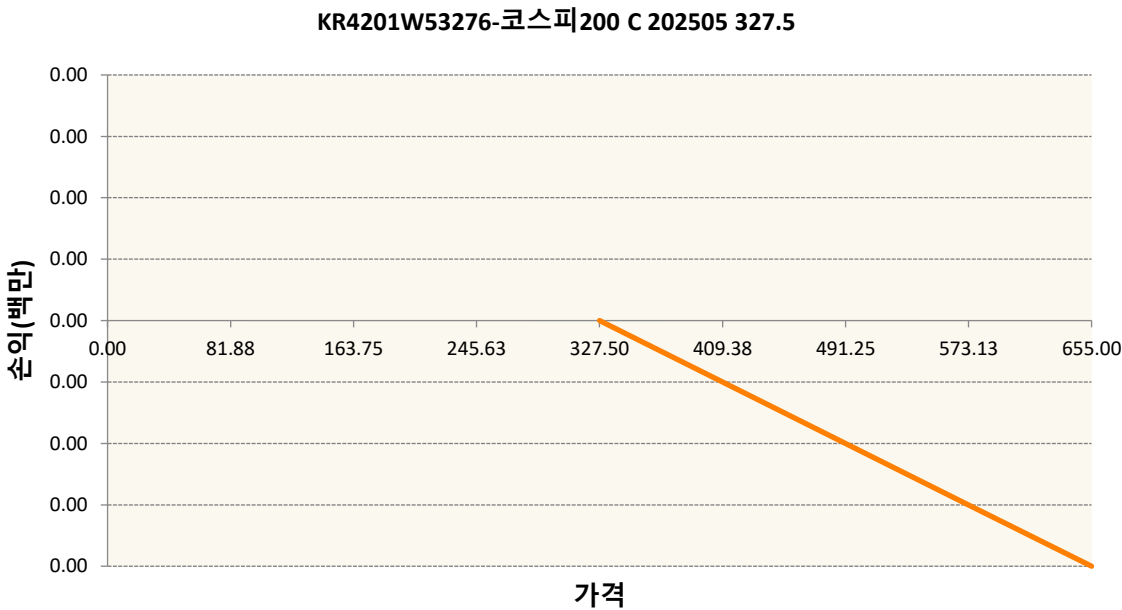
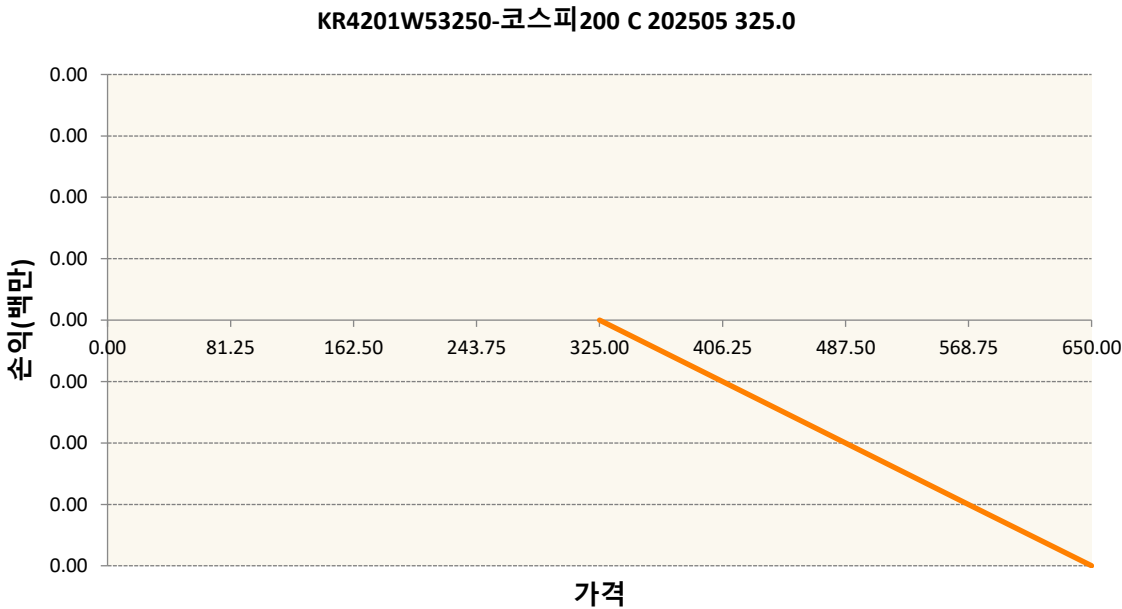
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	35,840	-35,840	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 represents the relationship, starting at the origin (0,0) and reaching a profit of 2 million at a price of 325.00.

가격 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
0.00	0.00
81.25	0.40
162.50	0.80
243.75	1.20
325.00	2.00

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 net income is zero at a price of 327.50.

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				2,090
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	949	937	923	906	886	865	841	
-5.33%	862	832	800	767	732	697	661	
-2.67%	598	556	515	473	431	390	348	
0%	101	69	35	0	-36	-73	-111	
2.67%	-568	-582	-600	-620	-643	-668	-695	
5.33%	-1,309	-1,313	-1,319	-1,327	-1,338	-1,351	-1,367	
8.00%	-2,068	-2,069	-2,070	-2,073	-2,077	-2,082	-2,090	
KR4201W53276				코스피200 C 202505 327.5				65
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	26	25	25	24	24	23
-5.33%	24	23	22	21	20	19	18
-2.67%	18	16	15	14	12	11	10
0%	4	2	1	0	-1	-3	-4
2.67%	-17	-17	-18	-19	-20	-21	-21
5.33%	-40	-40	-40	-41	-41	-42	-42
8.00%	-64	-64	-64	-64	-65	-65	-65
KR4301W53258 코스피200 P 202505 325.0							354

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-328	-331	-334	-338	-343	-348	-354
-5.33%	-162	-170	-178	-186	-194	-203	-211
-2.67%	-40	-50	-61	-71	-81	-91	-102
0%	25	17	9	0	-9	-18	-27
2.67%	48	44	40	35	29	23	17
5.33%	53	52	50	48	46	43	39
8.00%	54	53	53	53	52	50	48

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

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

(단위:백만원)

2,698

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

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	551	0	551	

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	2025-04-25
기준일	2025-04-24

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	4,433	0	4,433	

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	2025-04-25
기준일	2025-04-24

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	12,747	0	12,747	
누계	통화	선도	359	12,843	-12,485	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E	209
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E	212
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E	344
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E	227
FXW213F43C USD/KRW 30-04-25E	9
FXW213F4EC USD/KRW 30-04-25E	20
FXW213F4F0 KRW/USD 30-04-25E	14
FXW213F4M KRW/USD 30-04-25E	21

IE00BD8RGM75 * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

499

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

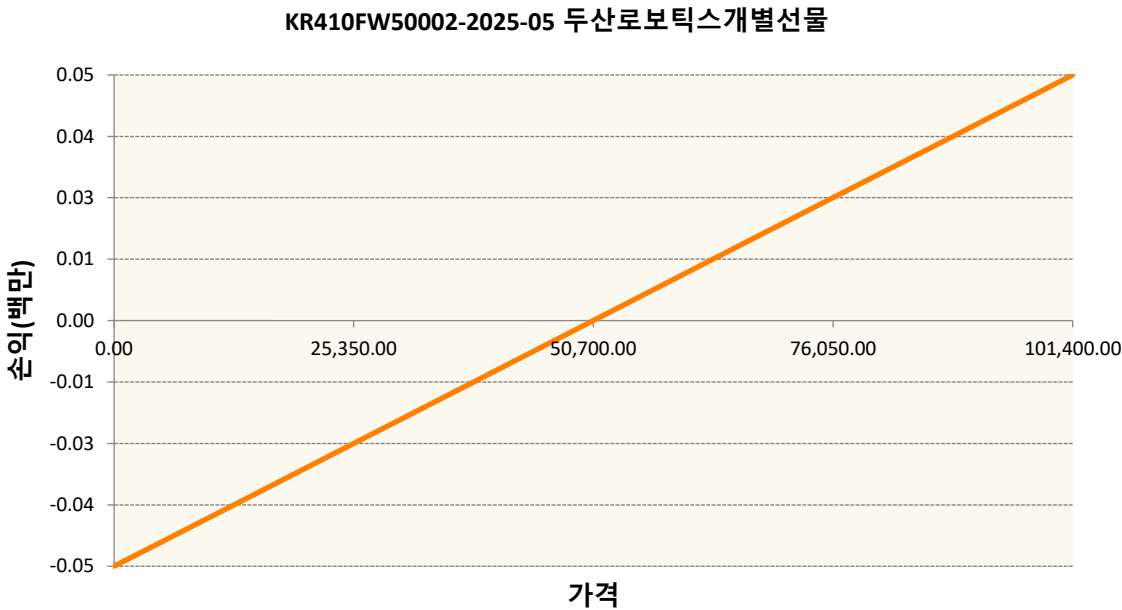
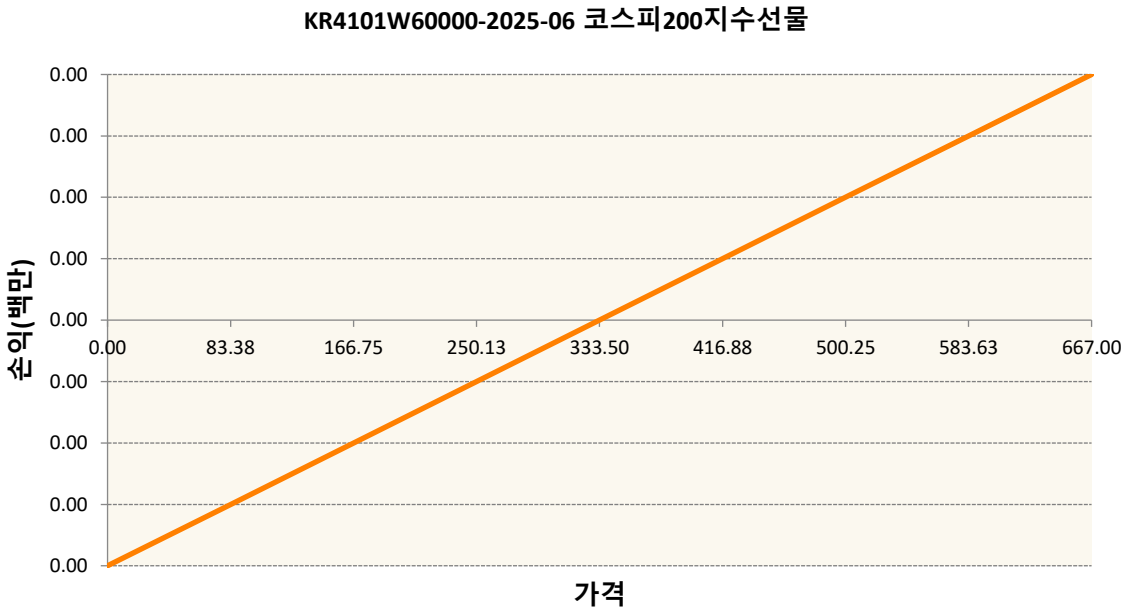
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

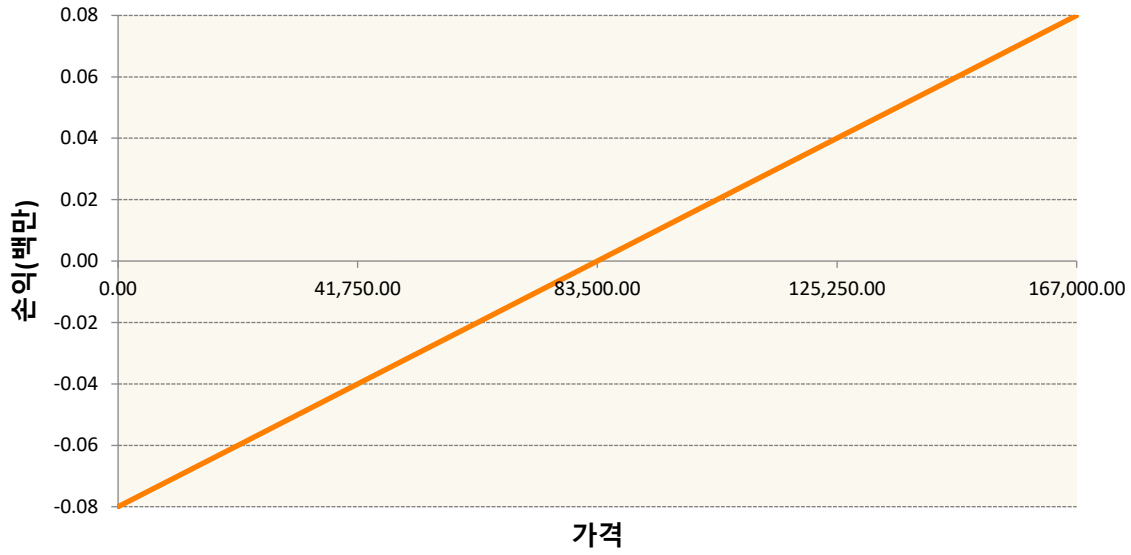
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	17	0	17	장내
누계	유가증권	선물	1,112	0	1,112	장내

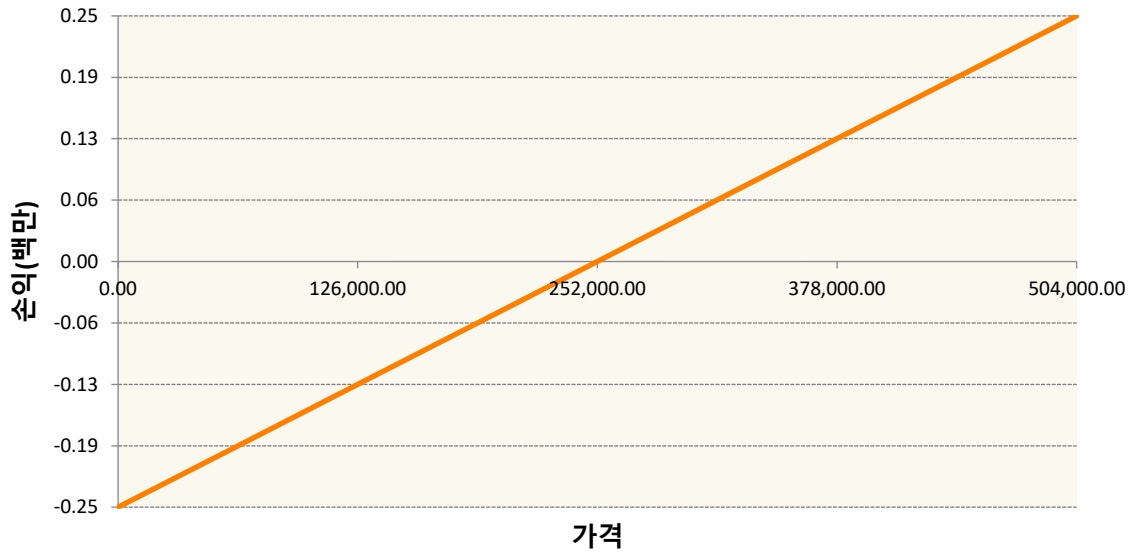
2. 만기시점의 손익구조



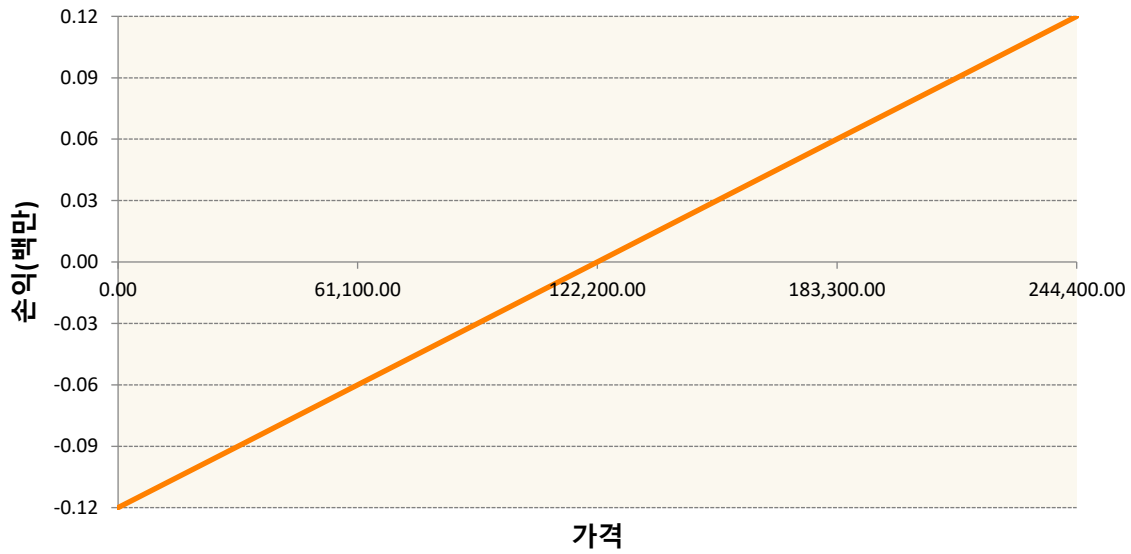
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



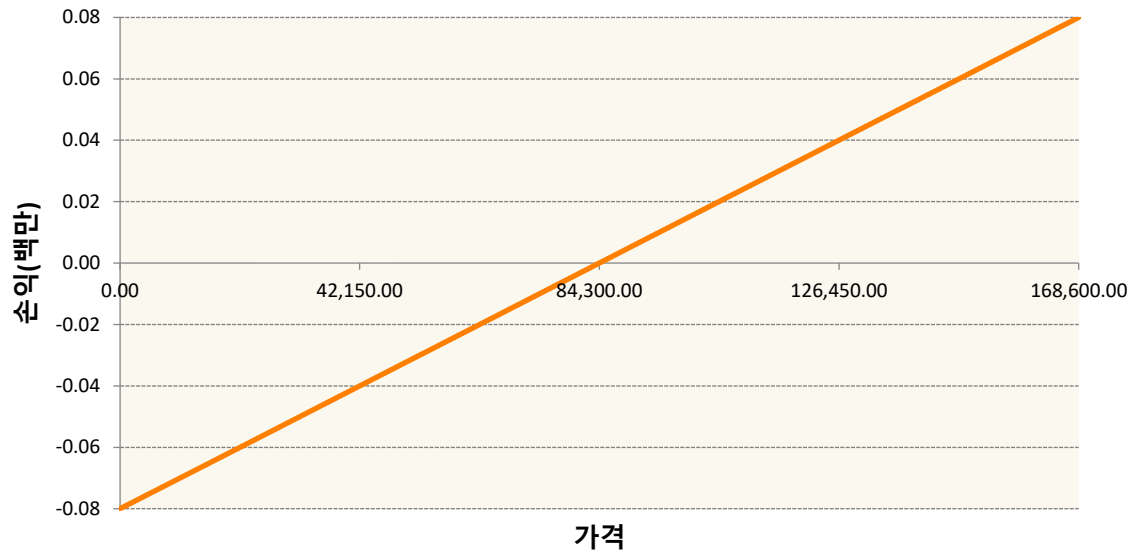
KR4120W50001-2025-05 현대모비스개별선물



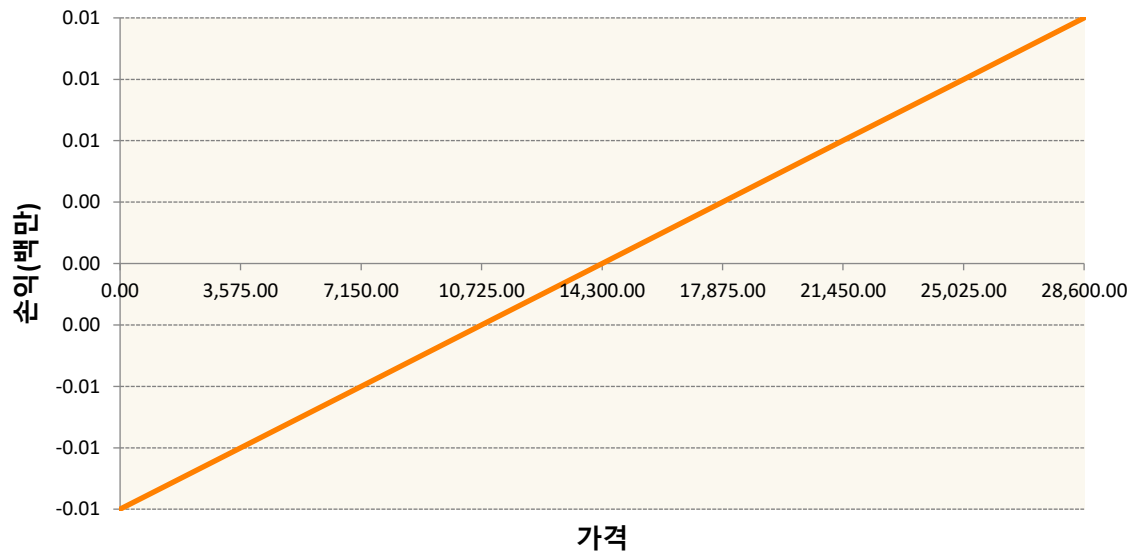
KR4123W50005-2025-05 삼성전기개별선물



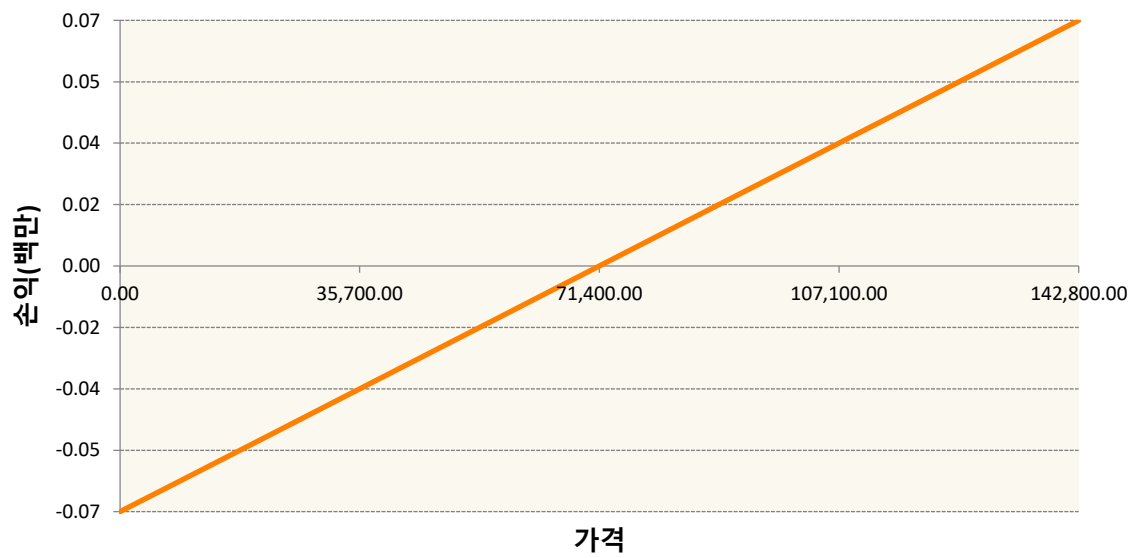
KR4146W50006-2025-05 KB금융개별선물



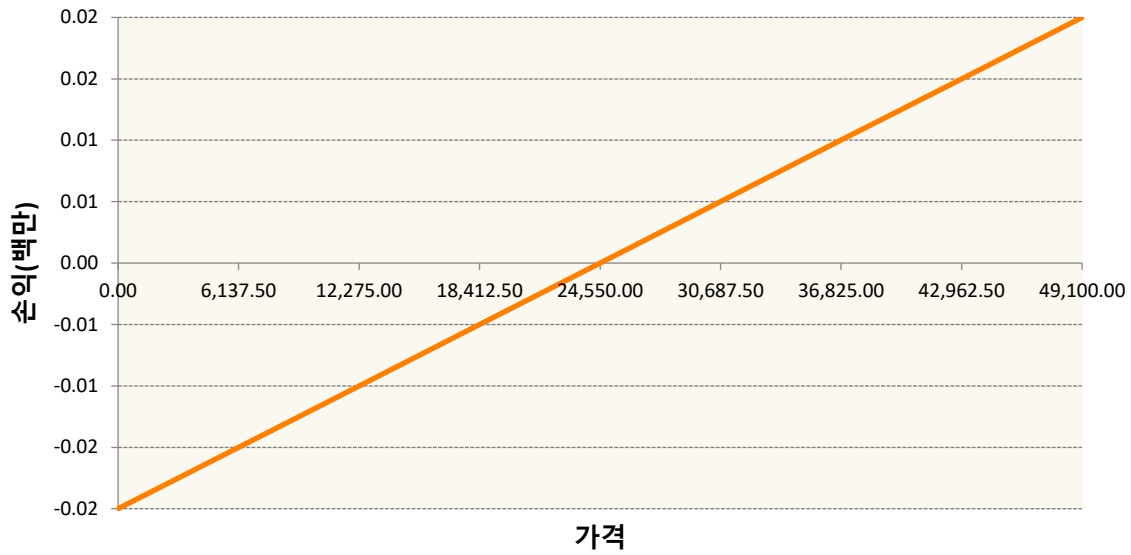
KR41BFW50008-2025-05 삼성중공업개별선물



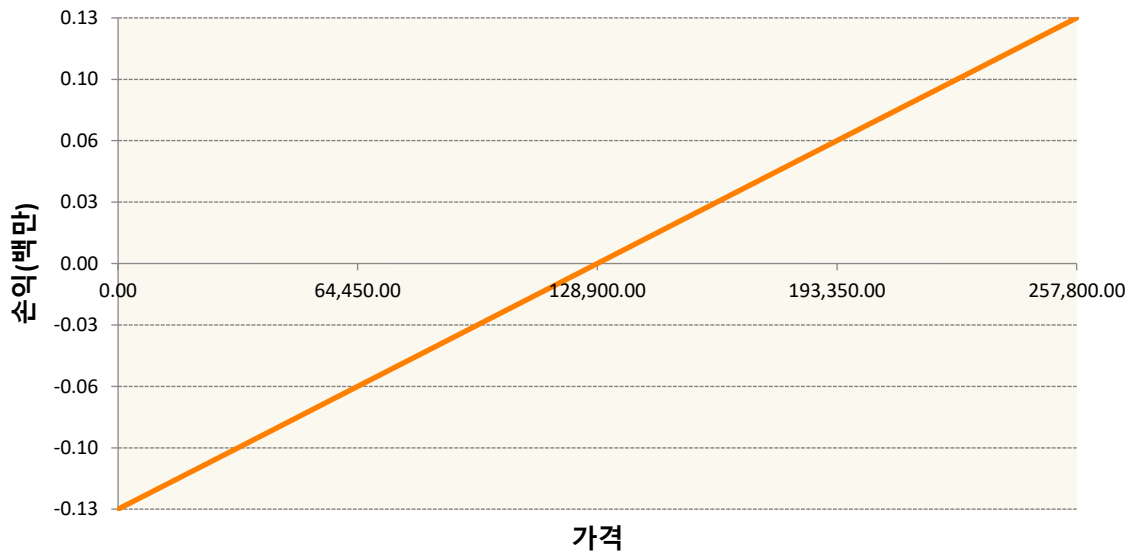
KR41C0W50000-2025-05 OCI홀딩스개별선물



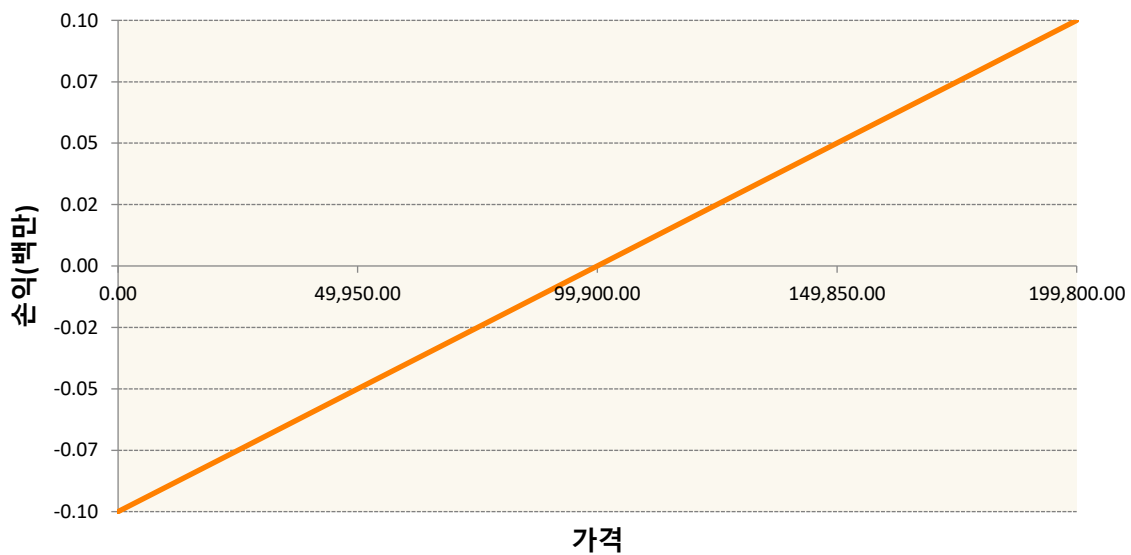
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



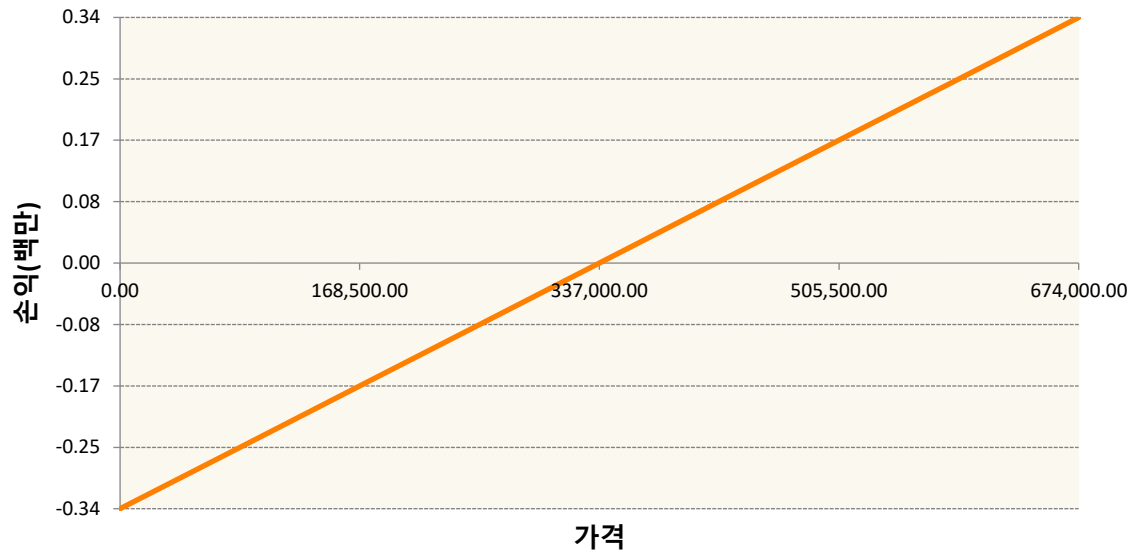
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



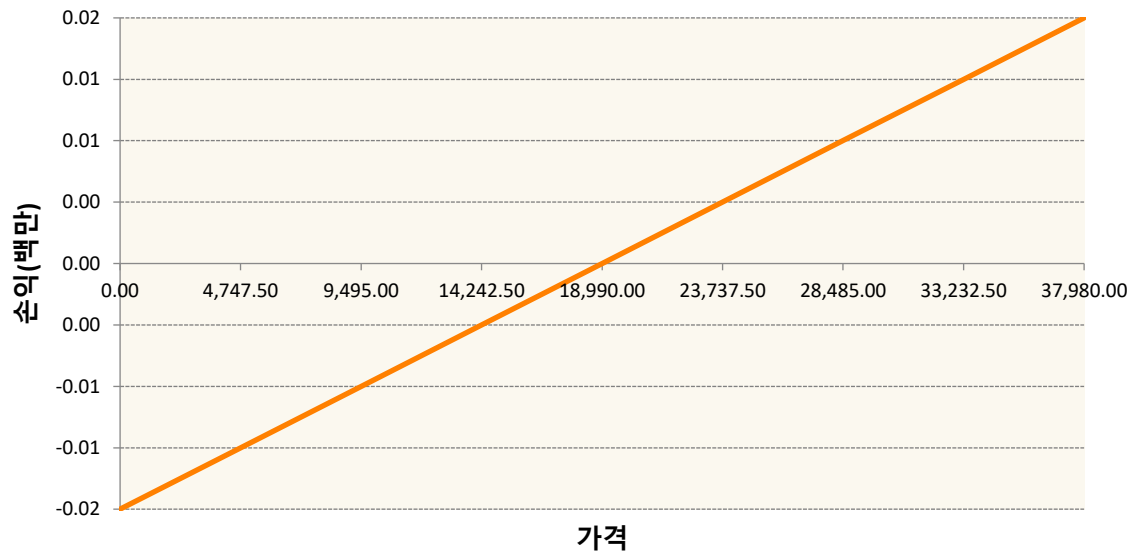
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



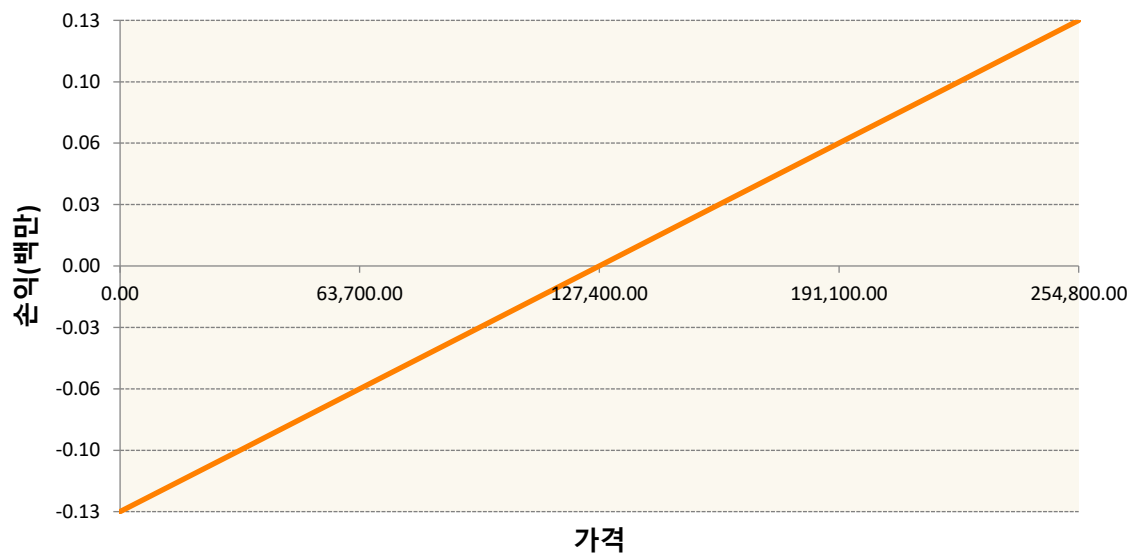
KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41FAW50000-2025-05 HMM개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		67
KR410FW50(2025-05 두산로보틱스개별선물		0.49
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물		2
KR4120W50(2025-05 현대모비스개별선물		0.2
KR4123W50(2025-05 삼성전기개별선물		4
KR4146W50(2025-05 KB금융개별선물		1
KR41BFW50(2025-05 삼성중공업개별선물		0.4
KR41C0W50(2025-05 OCI홀딩스개별선물		0.06
KR41CNW50(2025-05 포스코DX개별선물		1
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물		2
KR41EYW50(2025-05 에코프로비엠개별선물		2
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물		6
KR41FAW50(2025-05 HMM개별선물		3
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	148

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

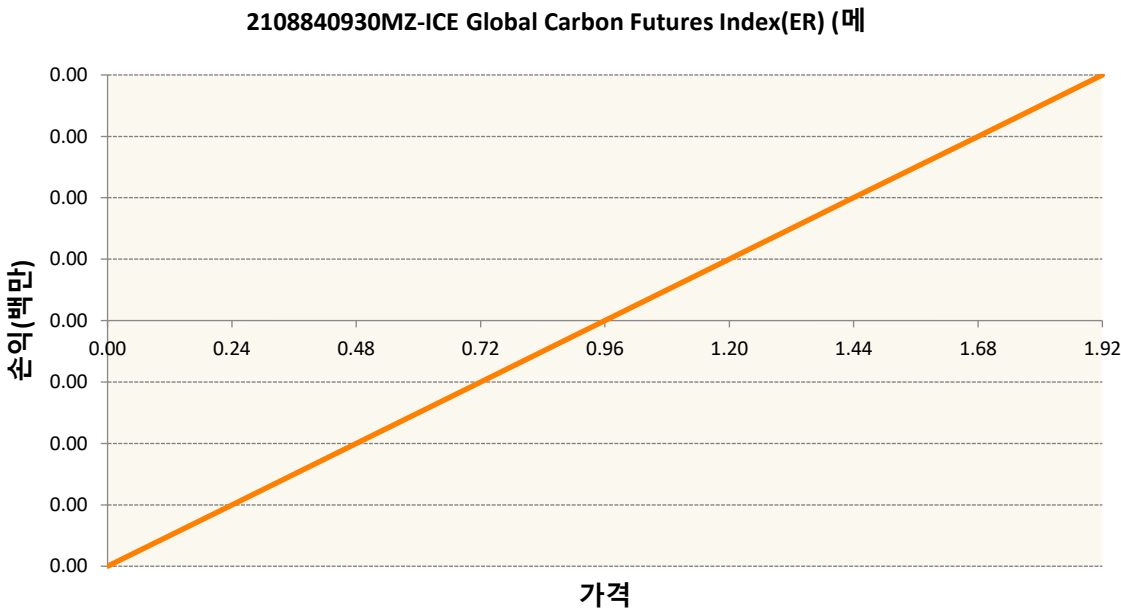
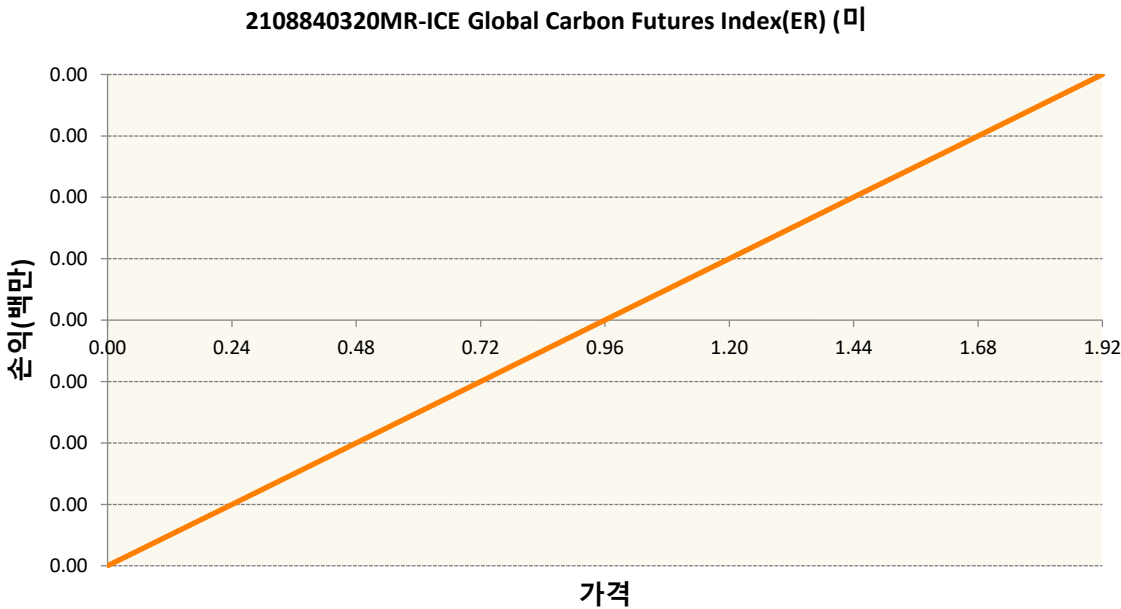
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,445	0	9,445	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	564
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	189

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	881

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

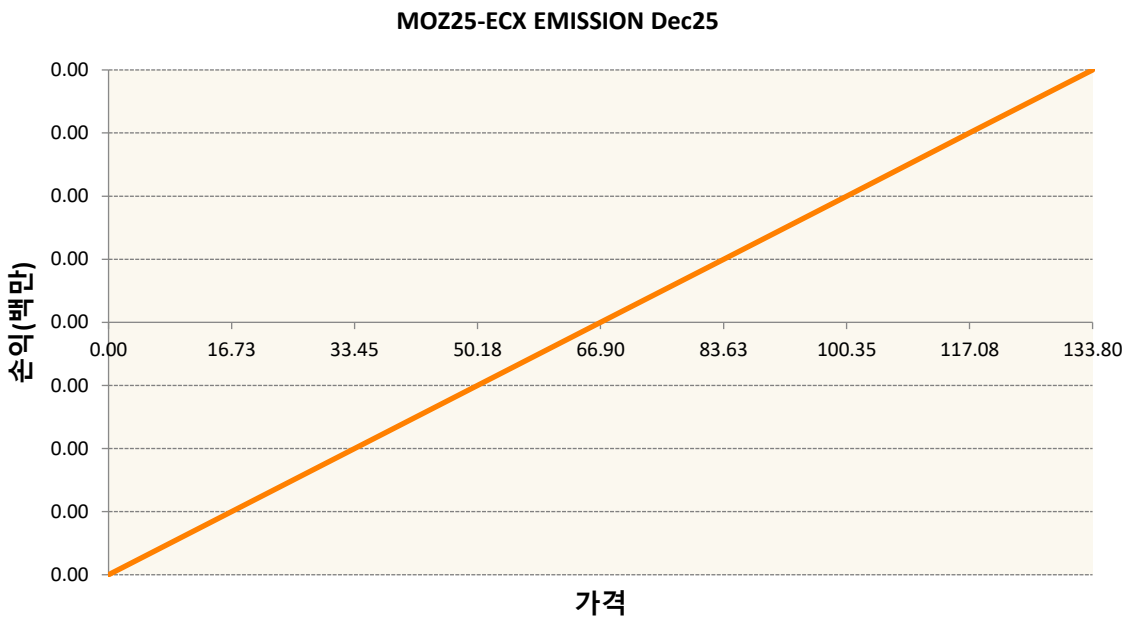
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,020	0	6,020	
누계	통화	선도	0	1,192	-1,192	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	81
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	483

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

(단위:백만원)

911

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

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)

112

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

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)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	24
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	5

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

(단위:백만원)

117

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

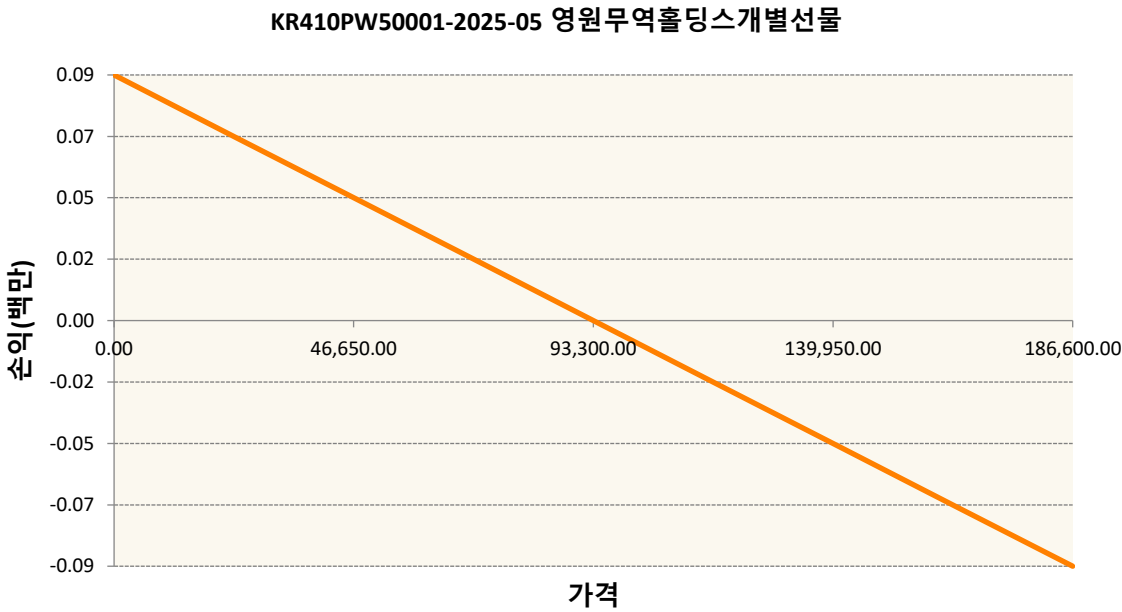
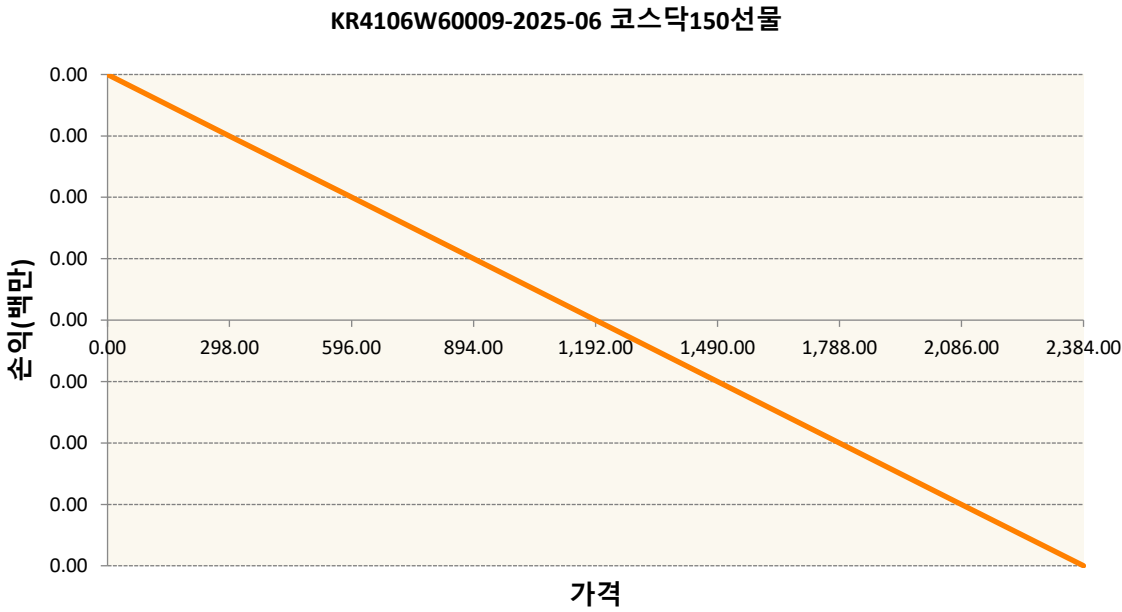
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

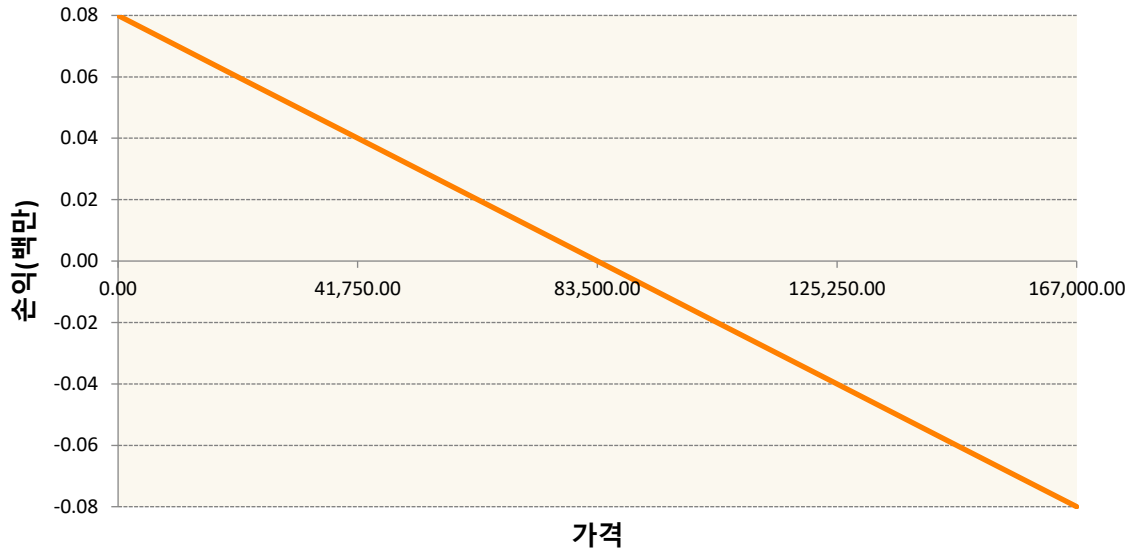
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	8	0	8	장내
누계	유가증권	선물	0	105	-105	장내

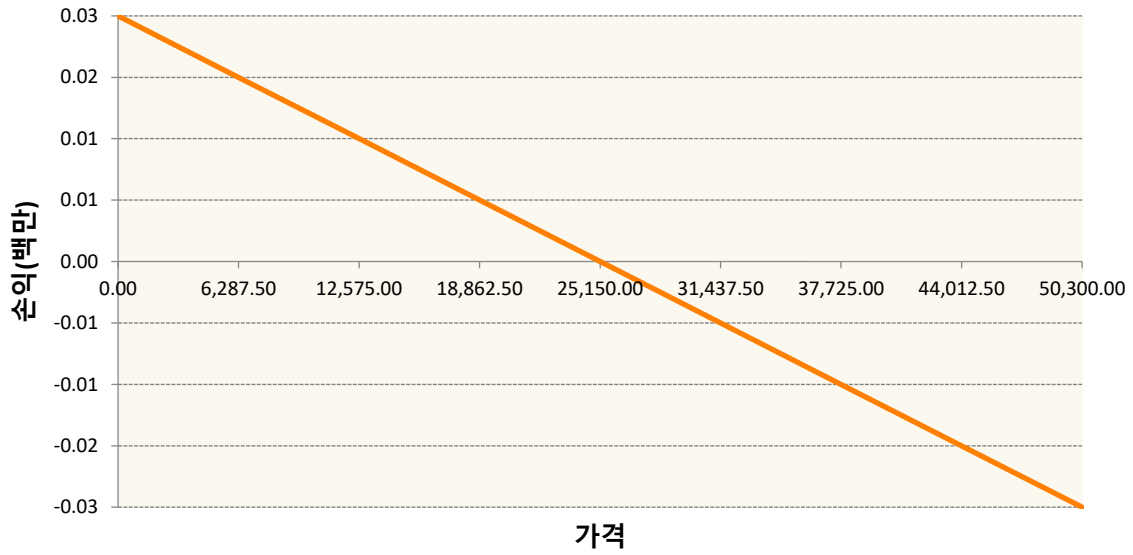
2. 만기시점의 손익구조



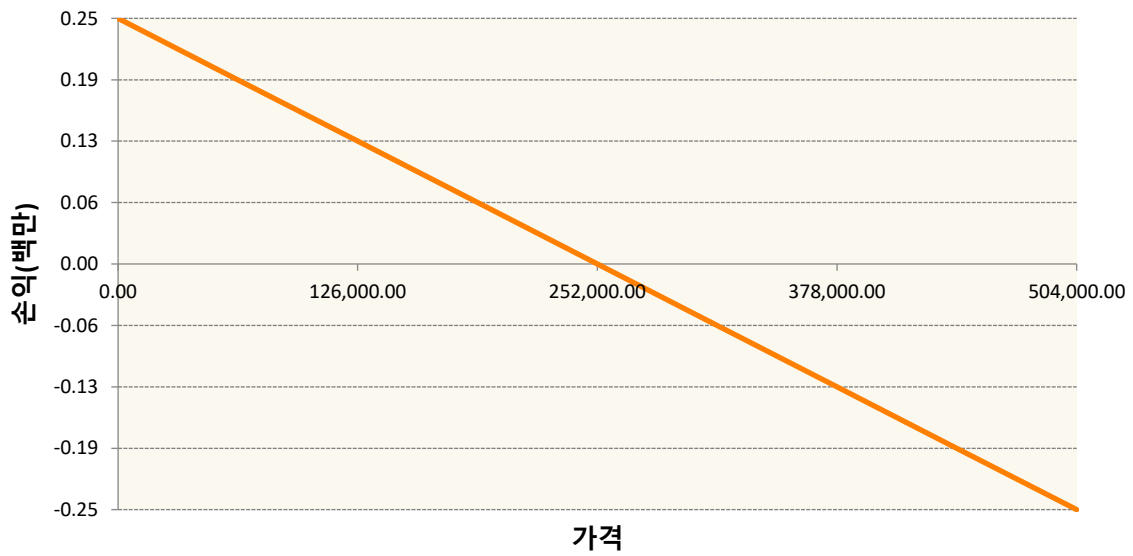
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



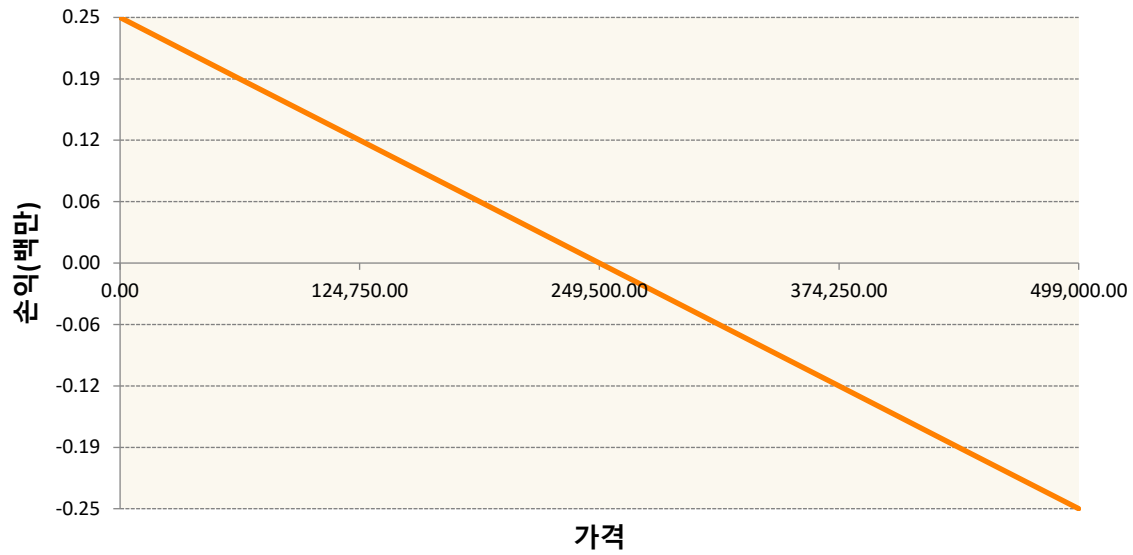
KR4115W50001-2025-05 한국전력개별선물



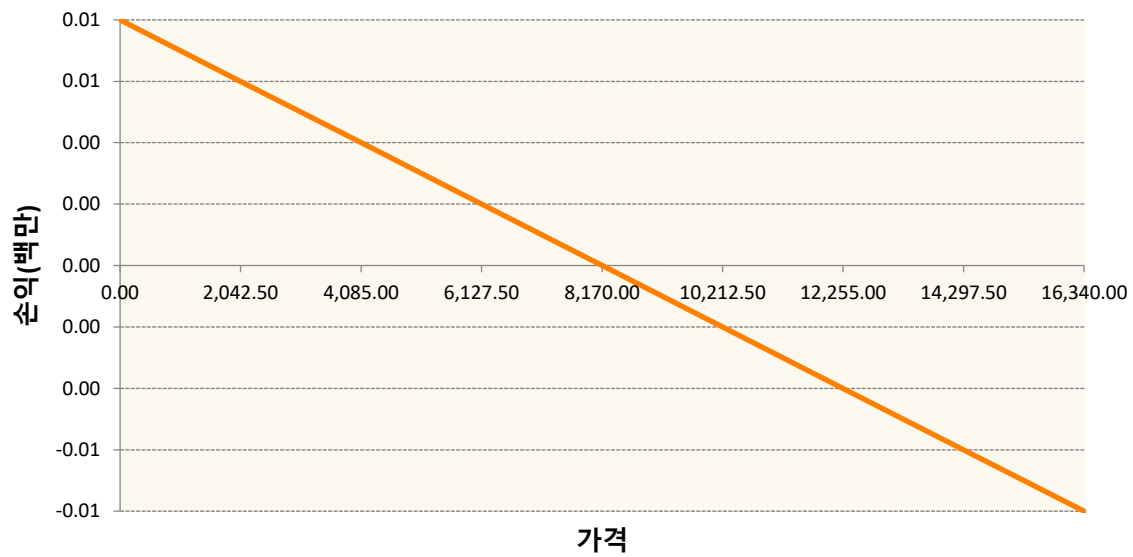
KR4120W50001-2025-05 현대모비스개별선물



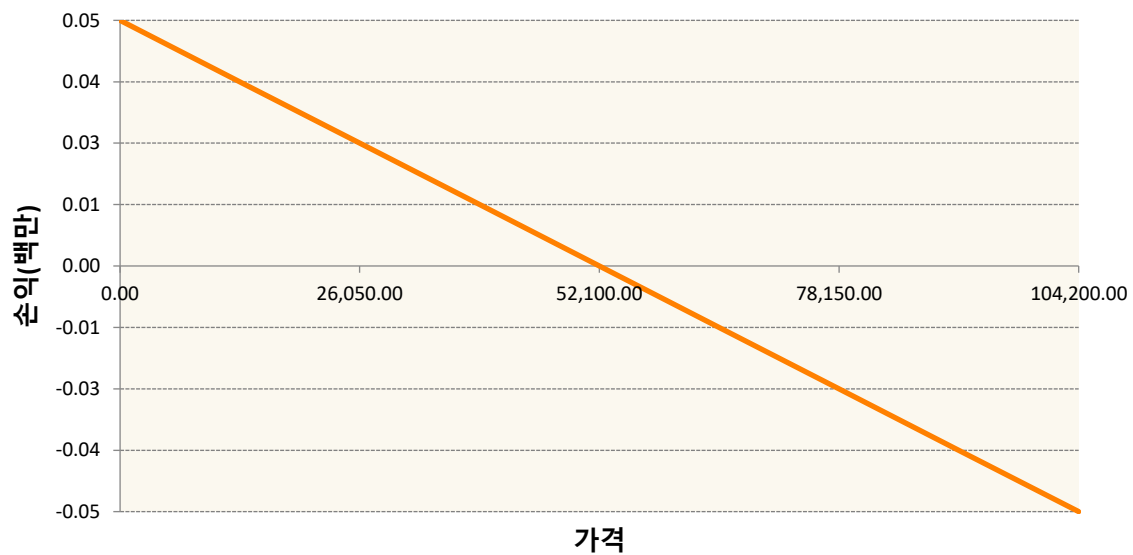
KR4139W50001-2025-05 HD한국조선해양개별선물



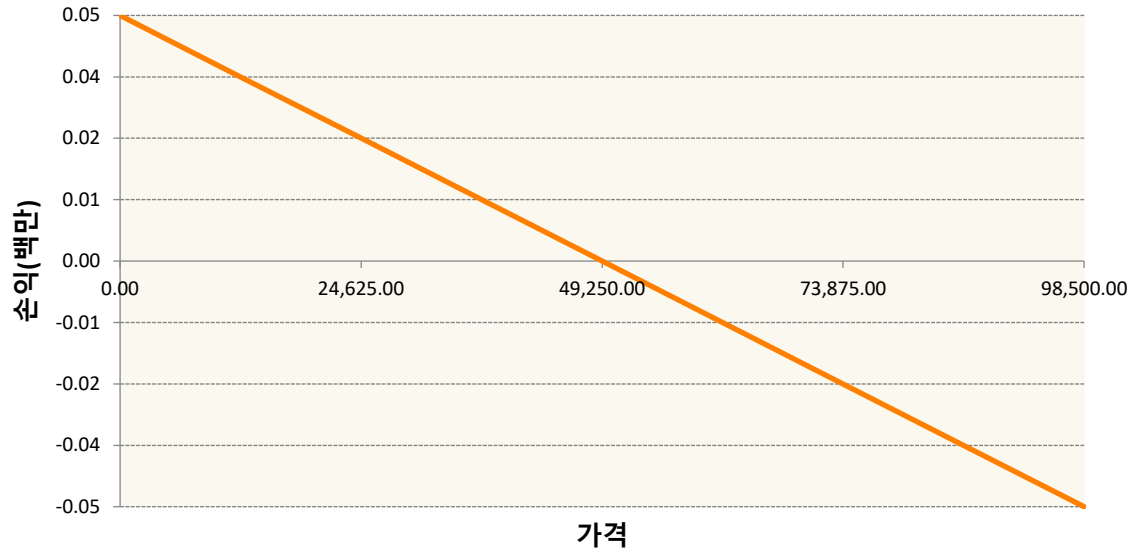
KR4149W50000-2025-05 HD현대인프라코어개별선물



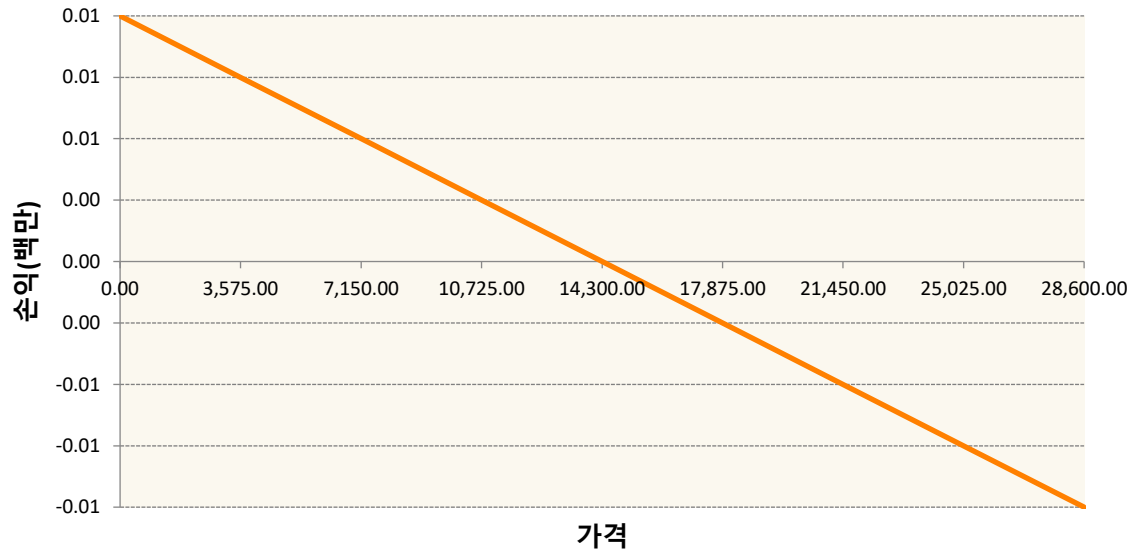
KR41B2W50007-2025-05 S-Oil개별선물



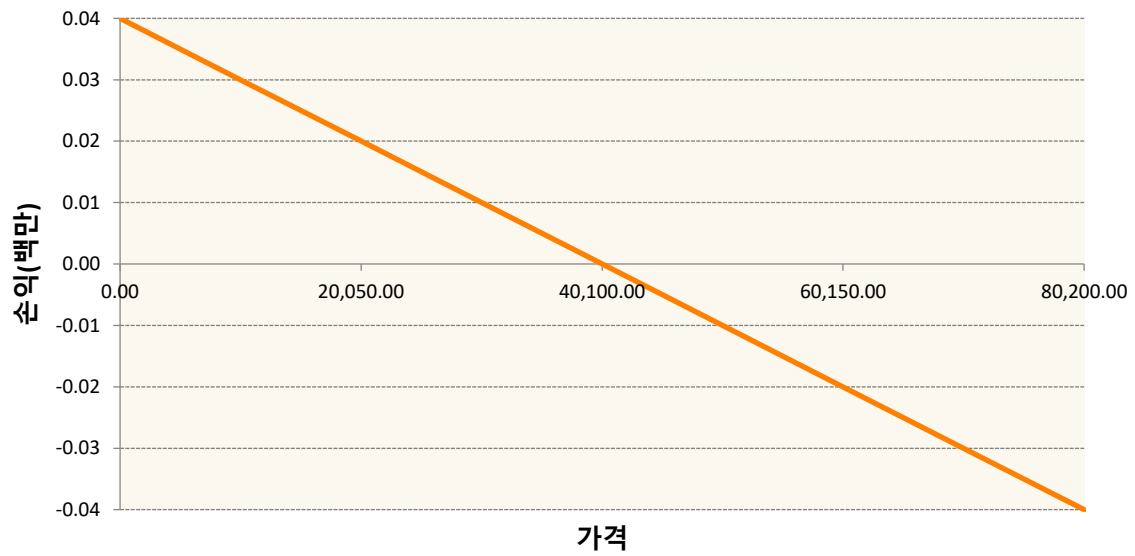
KR41B7W50006-2025-05 포스코인터내셔널개별선물



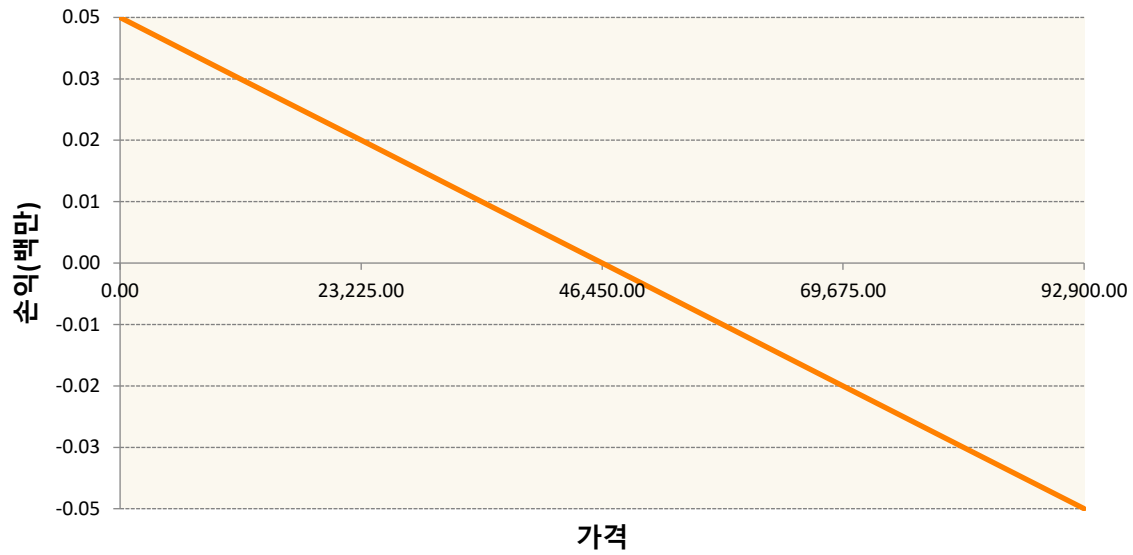
KR41BFW50008-2025-05 삼성중공업개별선물



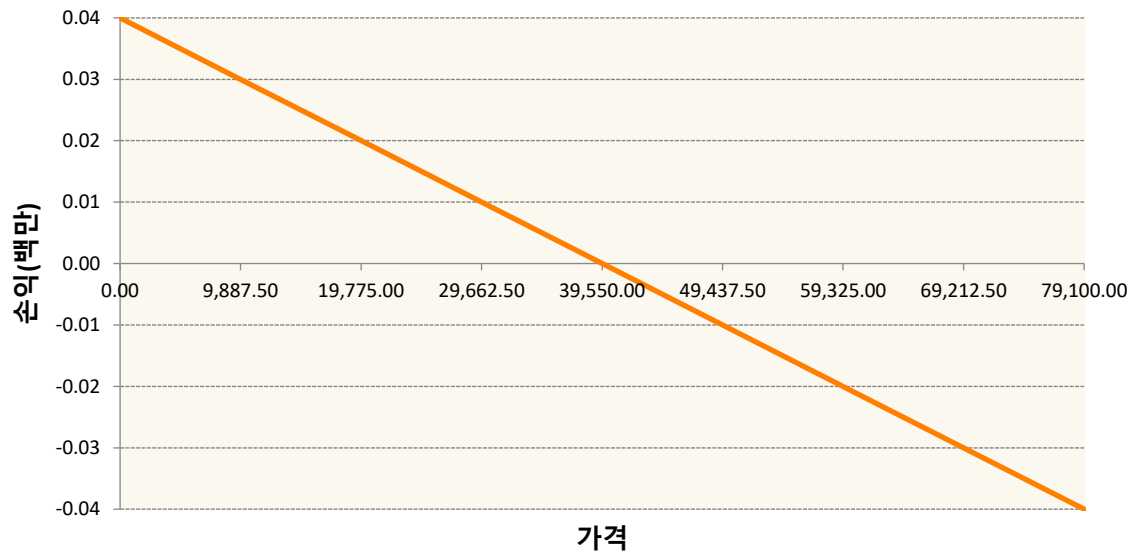
KR41BNW50002-2025-05 현대건설개별선물



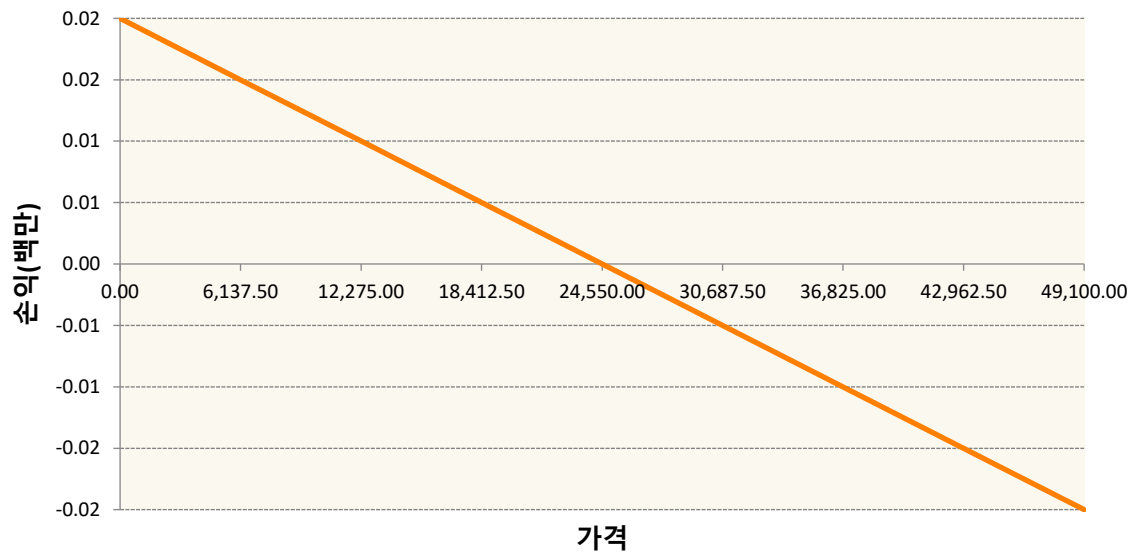
KR41C9W50001-2025-05 한화개별선물



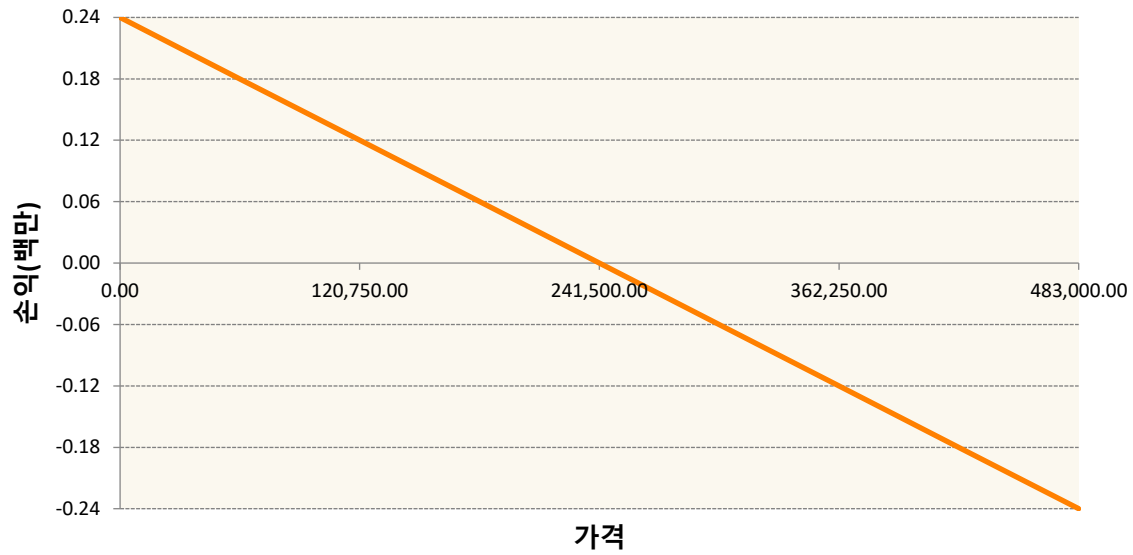
KR41CFW50006-2025-05 카카오개별선물



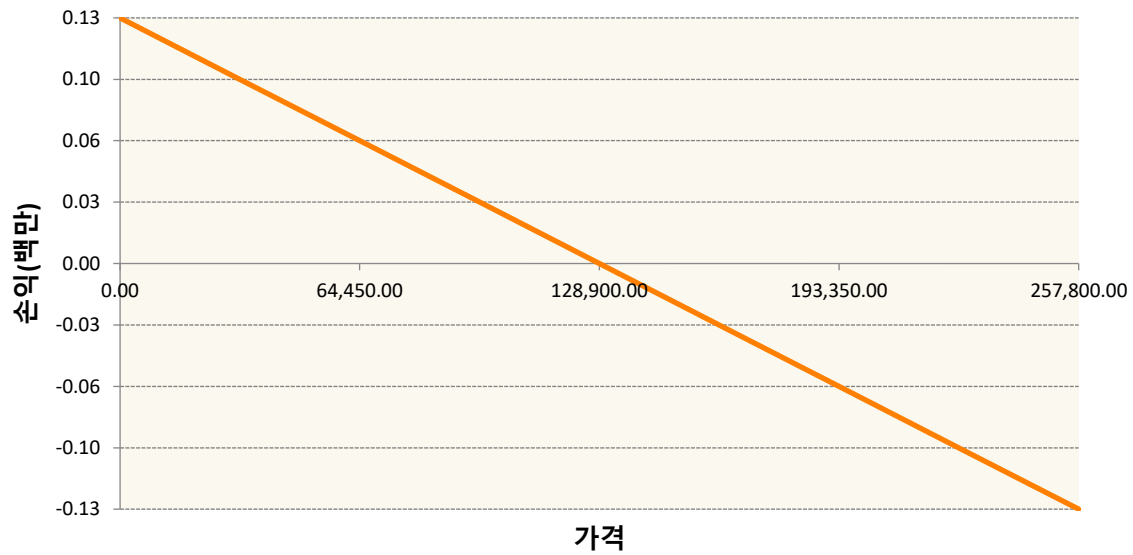
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



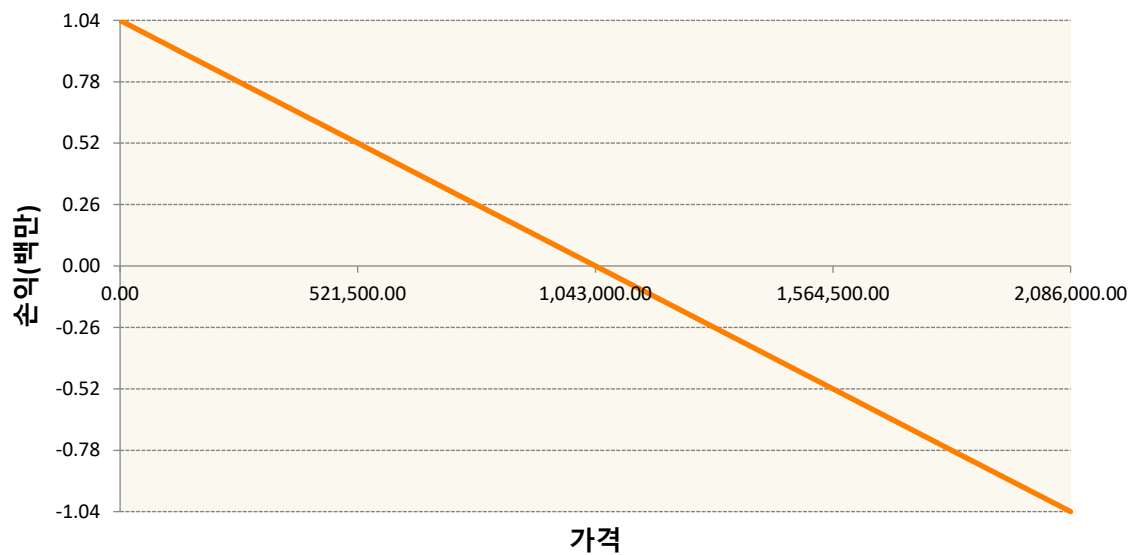
KR41CXW50009-2025-05 한미약품개별선물



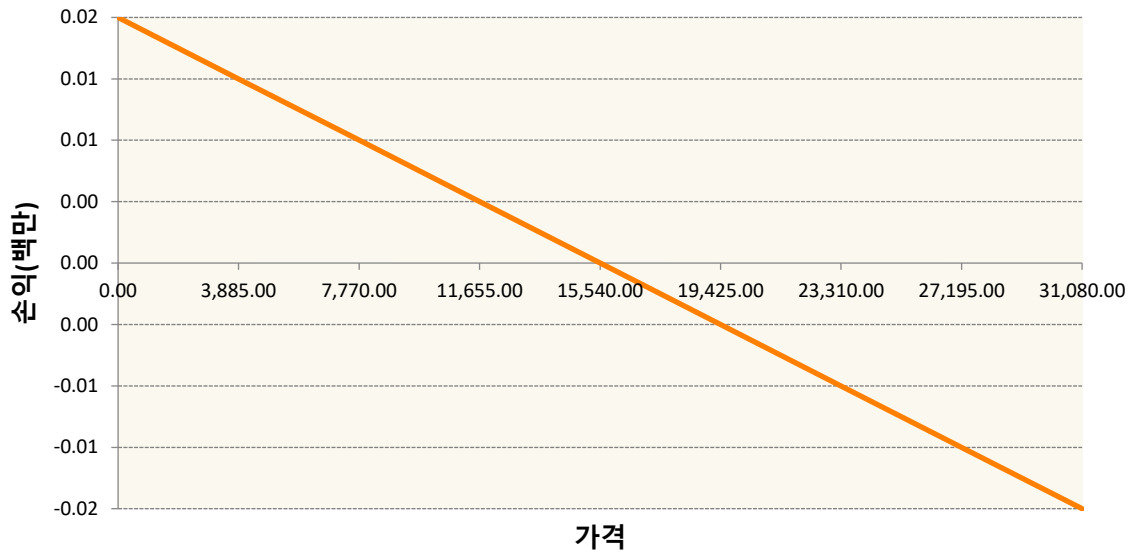
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



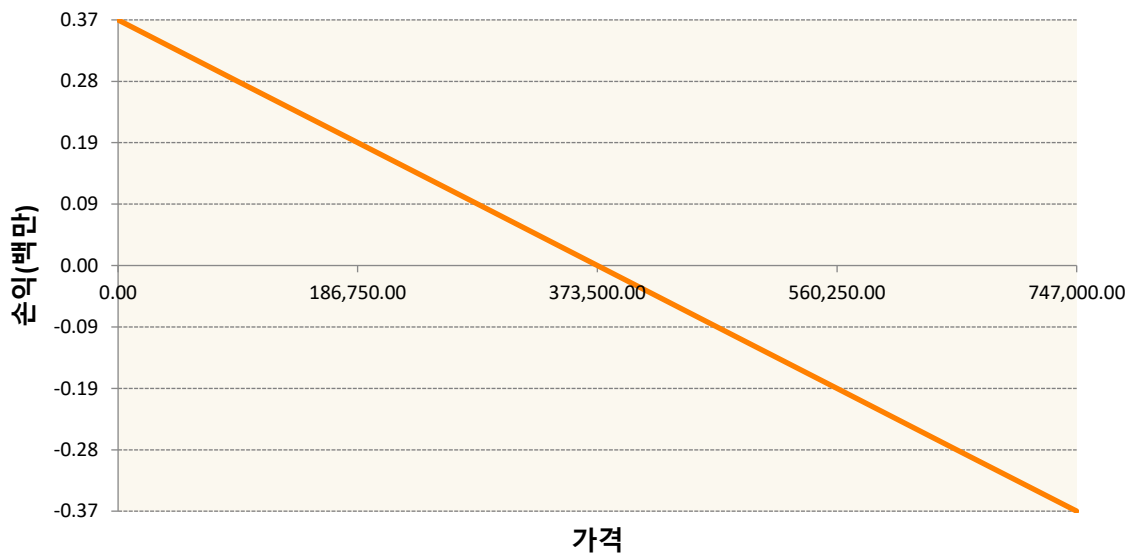
KR41ESW50005-2025-05 삼성바이오로직스개별선물



KR41HCW50002-2025-05 코스모화학개별선물



KR41HSW50008-2025-05 파마리서치개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4106W60(2025-06 코스닥150선물	1
KR410PW50(2025-05 영원무역홀딩스개별선물	0.07
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	1
KR4115W50(2025-05 한국전력개별선물	0.32
KR4120W50(2025-05 현대모비스개별선물	1
KR4139W50(2025-05 HD한국조선해양개별선물	0.2
KR4149W50(2025-05 HD현대인프라코어개별선물	0.39
KR41B2W50(2025-05 S-Oil개별선물	1
KR41B7W50(2025-05 포스코인터내셔널개별선물	0.39
KR41BFW50(2025-05 삼성중공업개별선물	1
KR41BNW50 2025-05 현대건설개별선물	0.32
KR41C9W50(2025-05 한화개별선물	0.45

KR41CFW50(2025-05 카카오개별선물	0.32
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물	0.37
KR41CXW50(2025-05 한미약품개별선물	0.39
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물	1
KR41ESW50(2025-05 삼성바이오로직스개별선물	1
KR41HCW50 2025-05 코스모화학개별선물	0.3
KR41HSW50 2025-05 파마리서치개별선물	0.3

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

(단위:백만원)

19

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

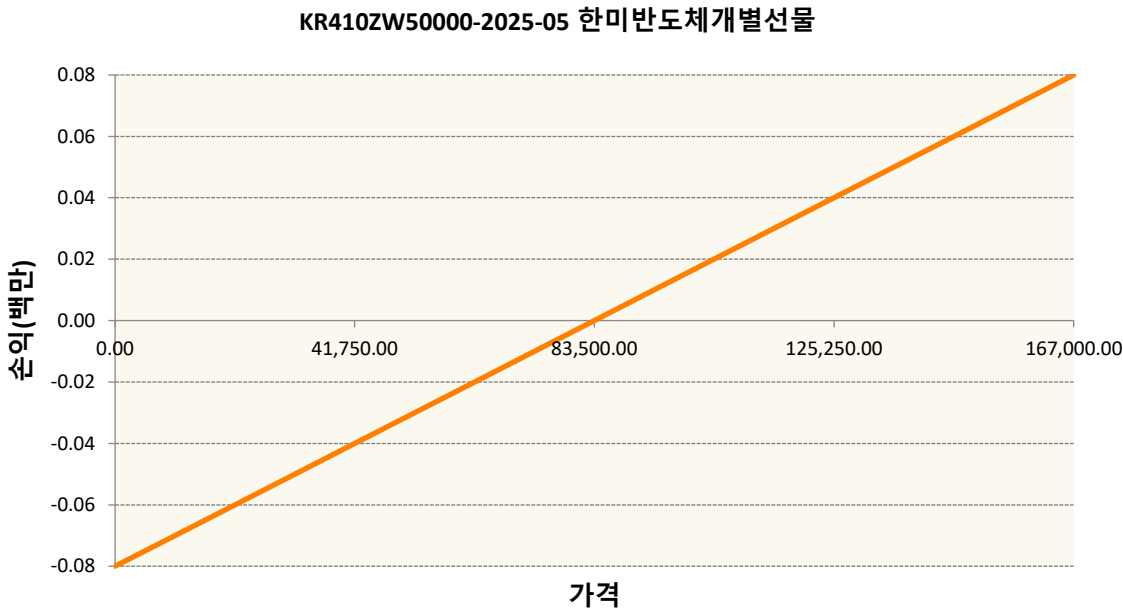
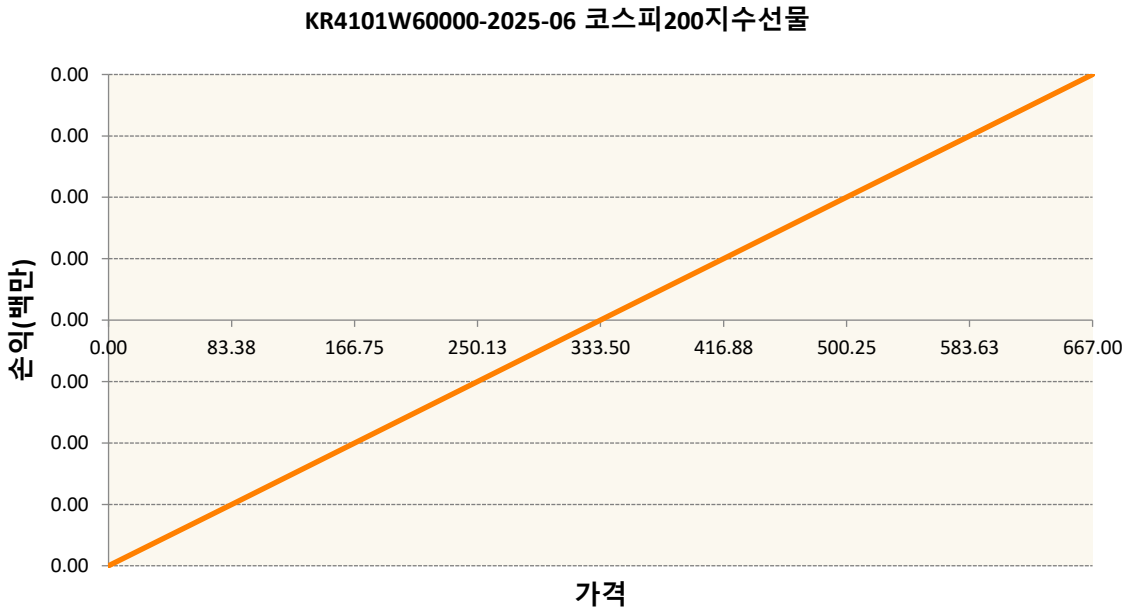
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

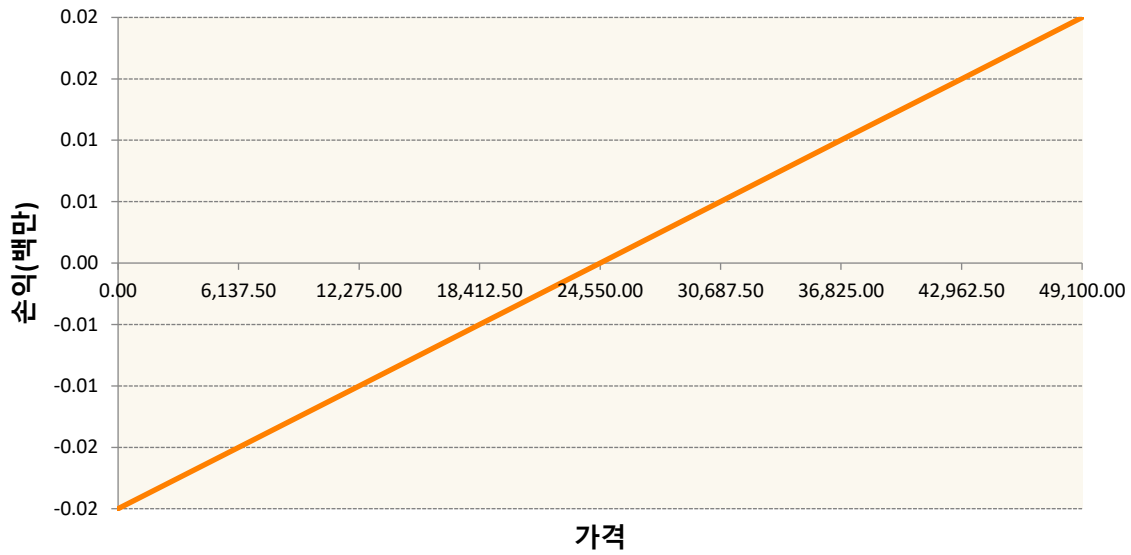
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,597	0	9,597	장내

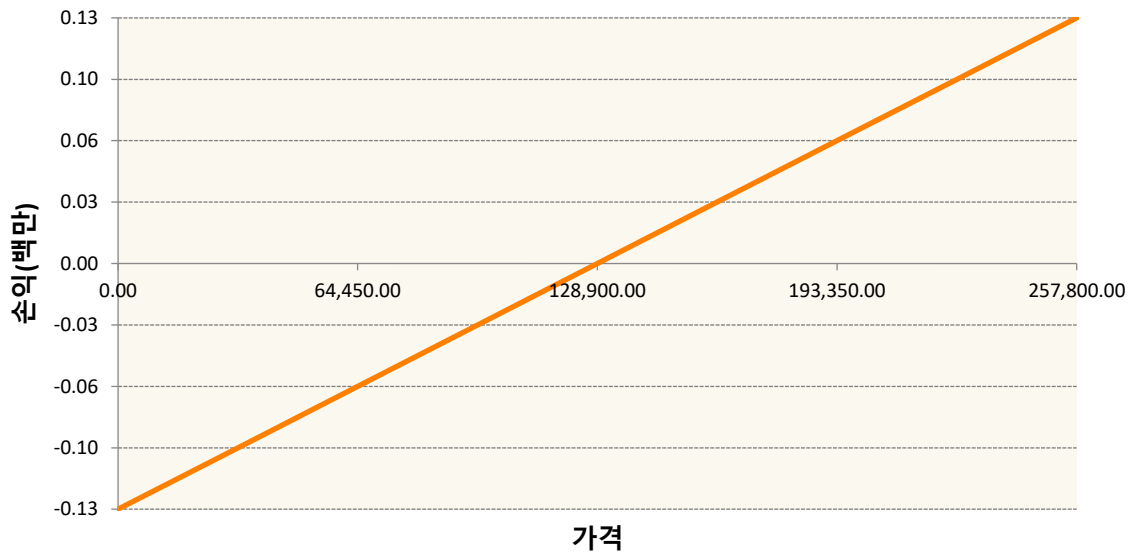
2. 만기시점의 손익구조



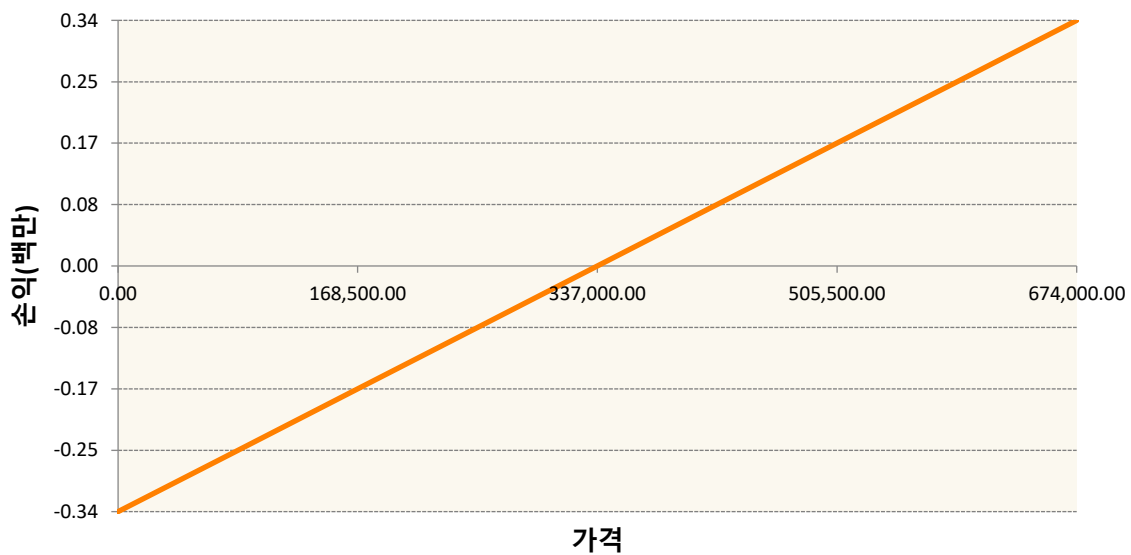
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		587
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물		35
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물		12
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물		16
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물		117

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,268

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

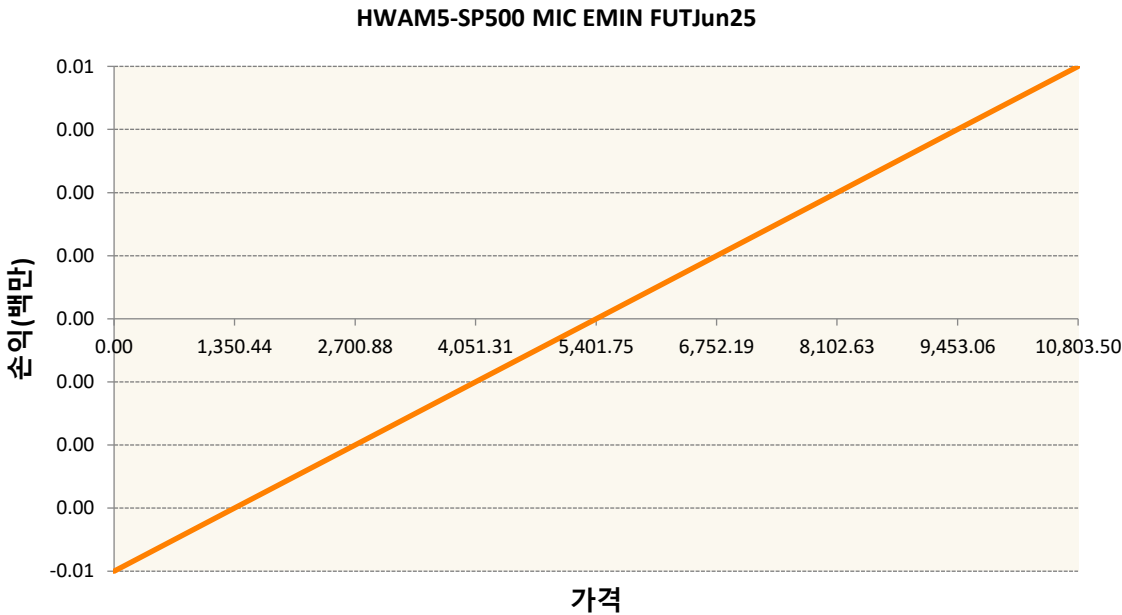
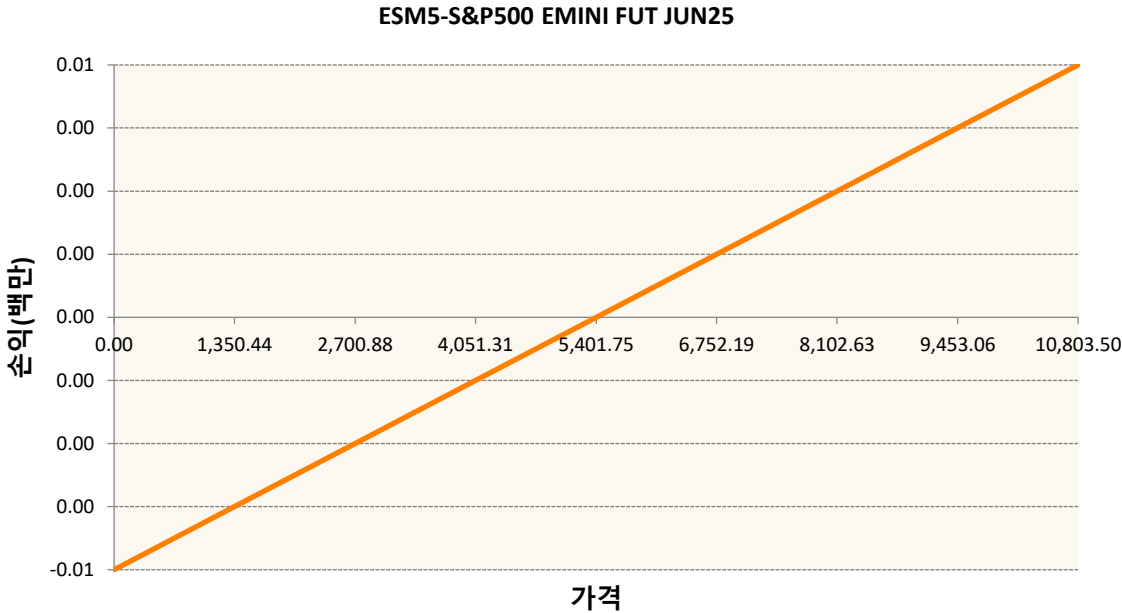
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,144	0	1,144	장내
누계	지수	선물	26,036	0	26,036	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,083
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	91

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,890

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

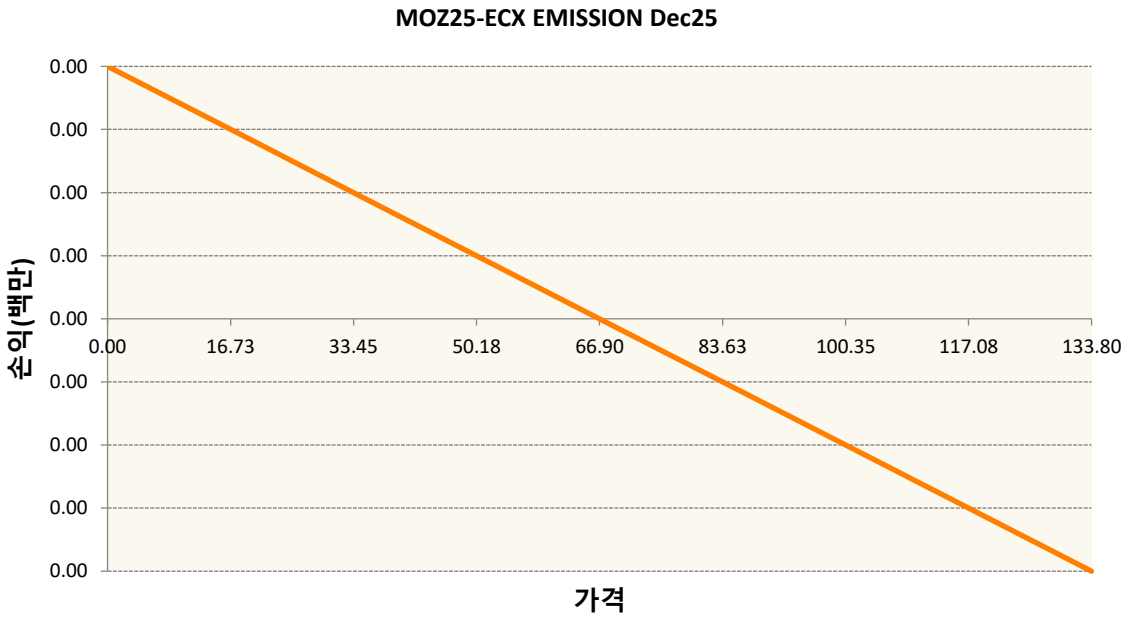
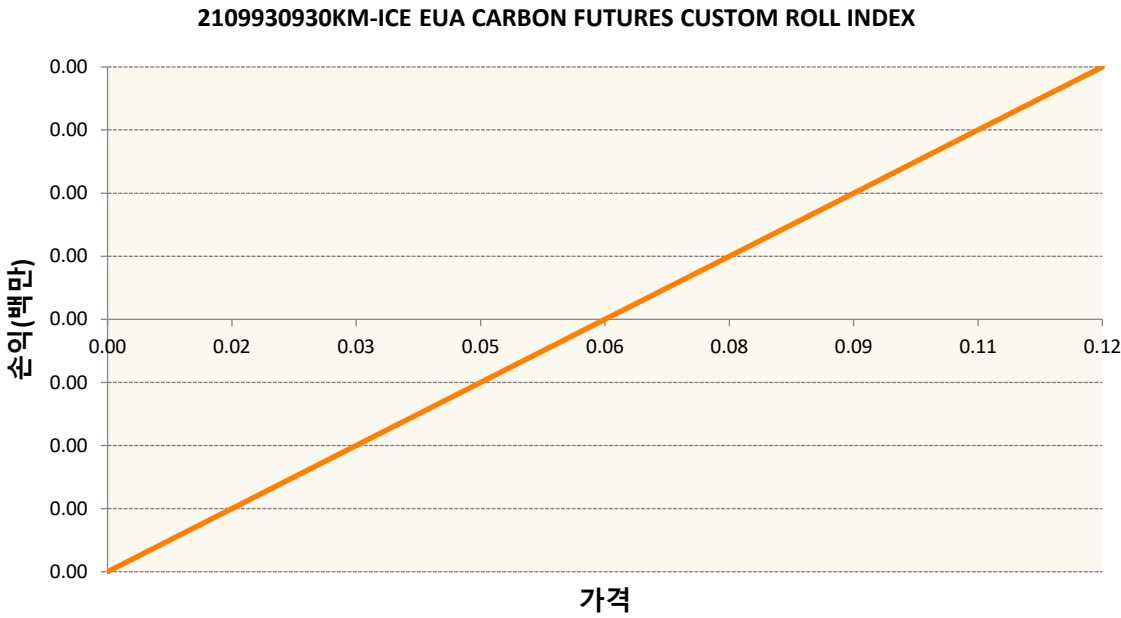
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	23	6,025	-6,003	
누계	통화	선도	0	1,174	-1,174	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		482

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	907

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

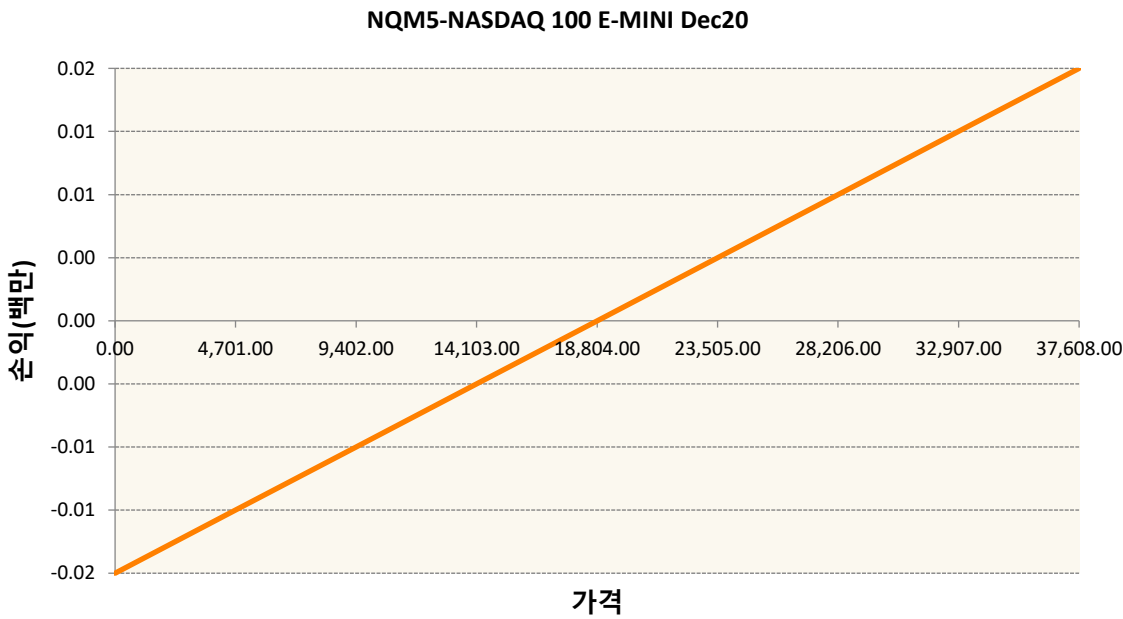
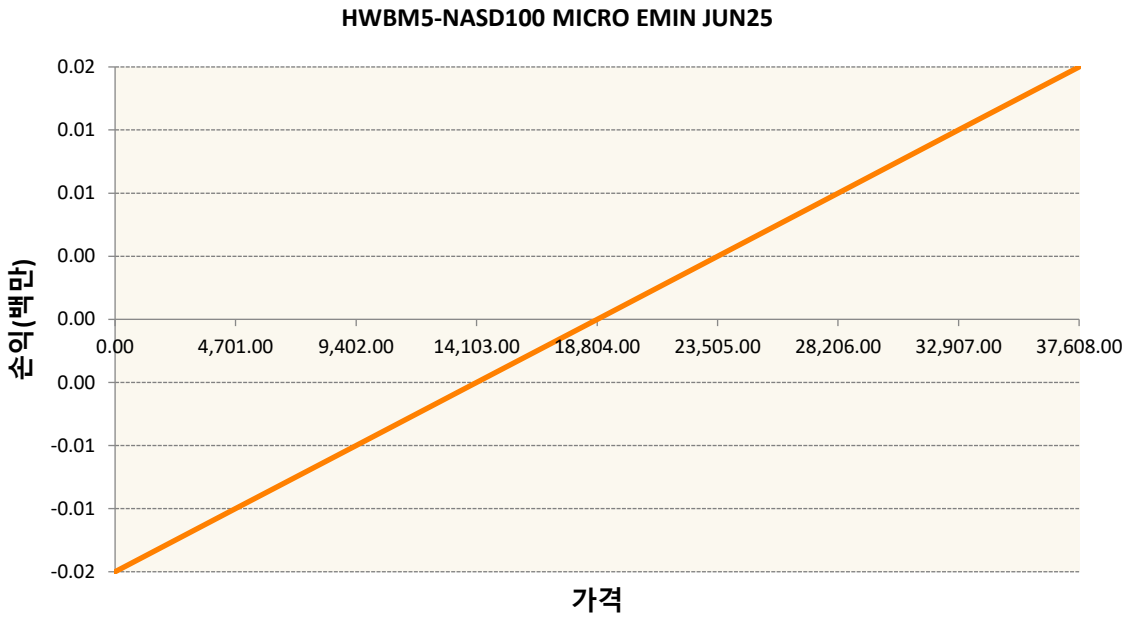
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	12,613	0	12,613	
누계	유가증권	선물	495	0	495	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25	40
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,009

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,179

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

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	252,356	0	252,356	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,050
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,164
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,926
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,447

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

(단위:백만원)

9,999

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

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)
	21

공시일	2025-04-25
기준일	2025-04-24

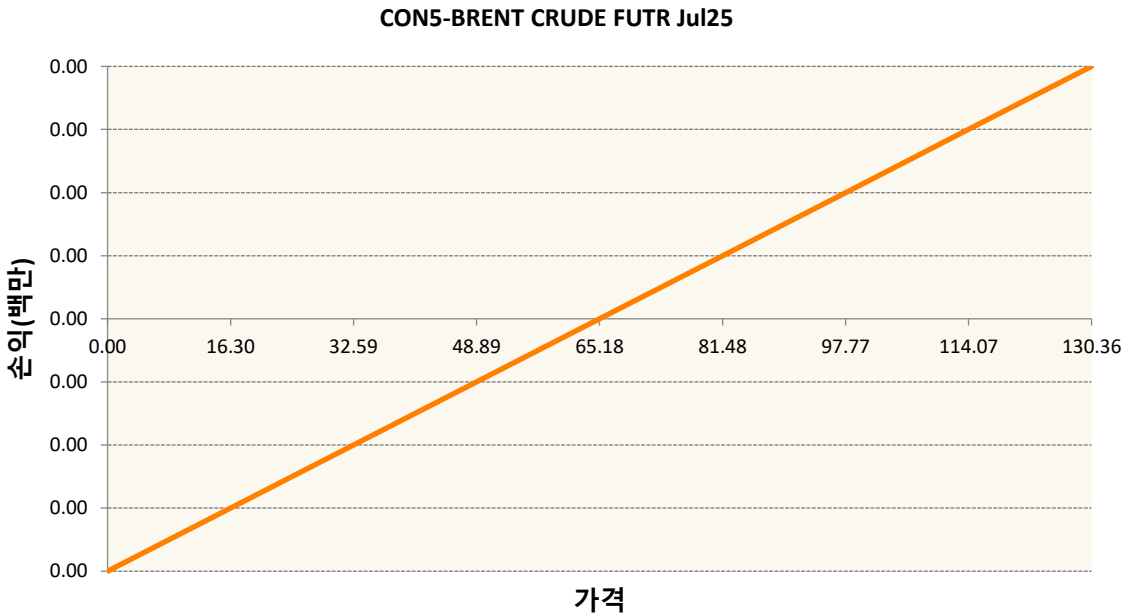
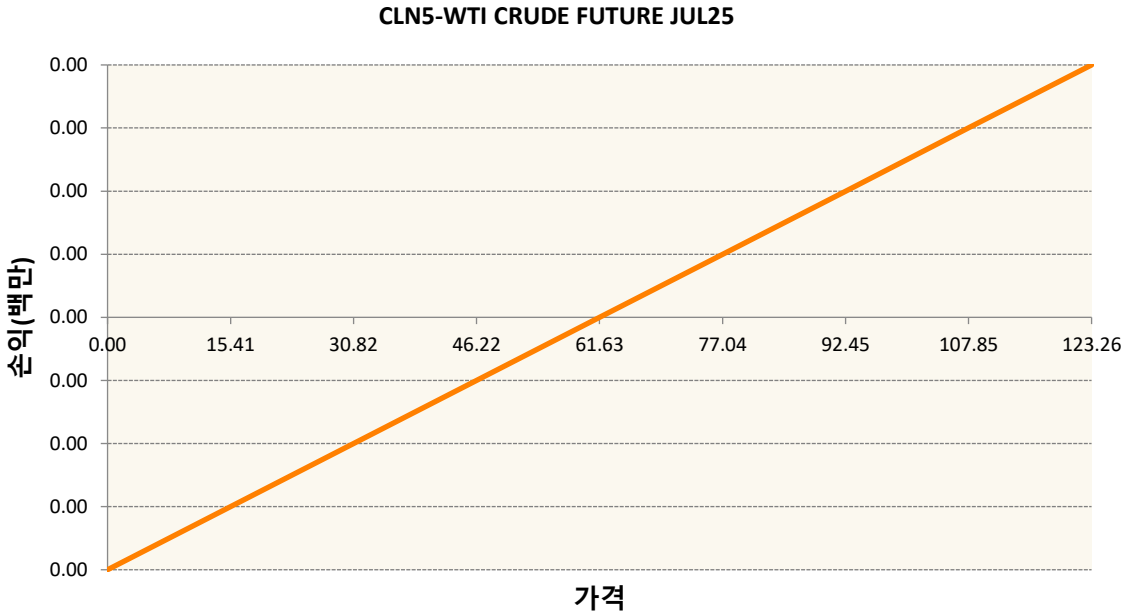
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

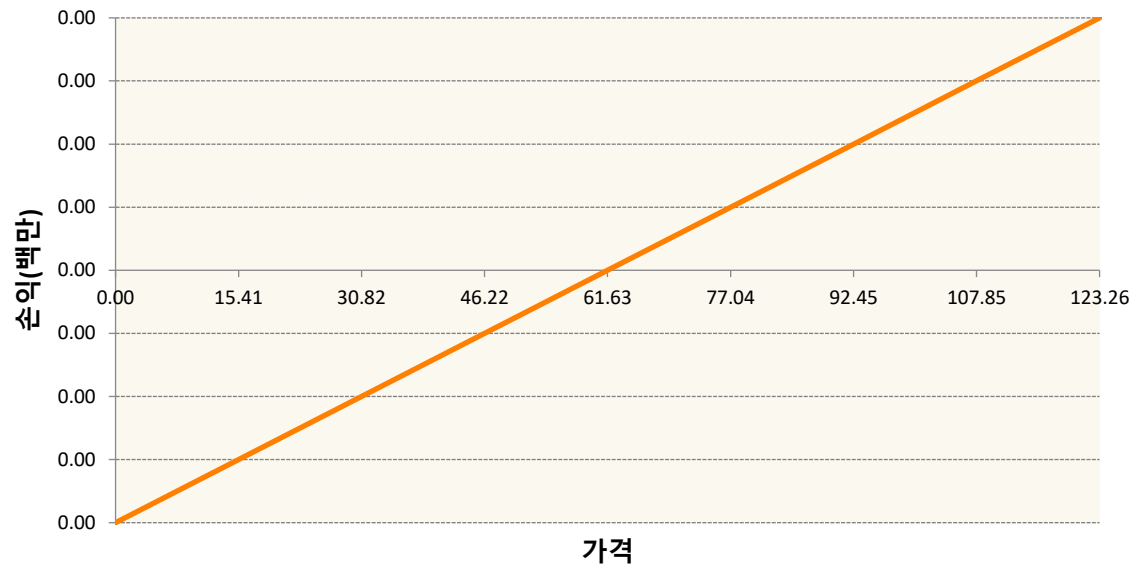
(단위:백만원)

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	637	0	637	
누계	통화	선물	0	72	-72	장내

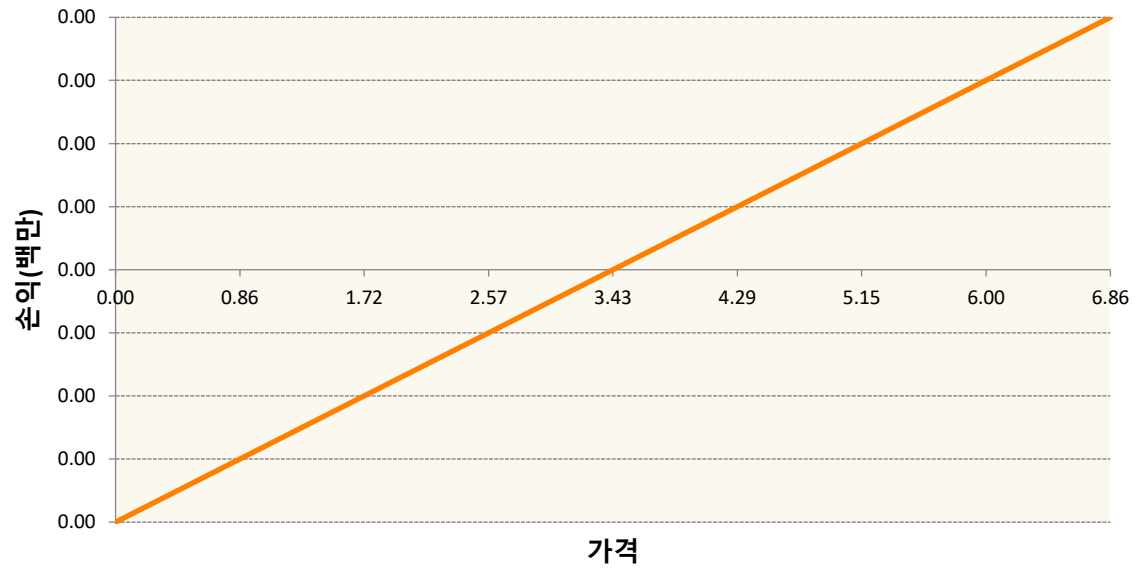
2. 만기시점의 손익구조



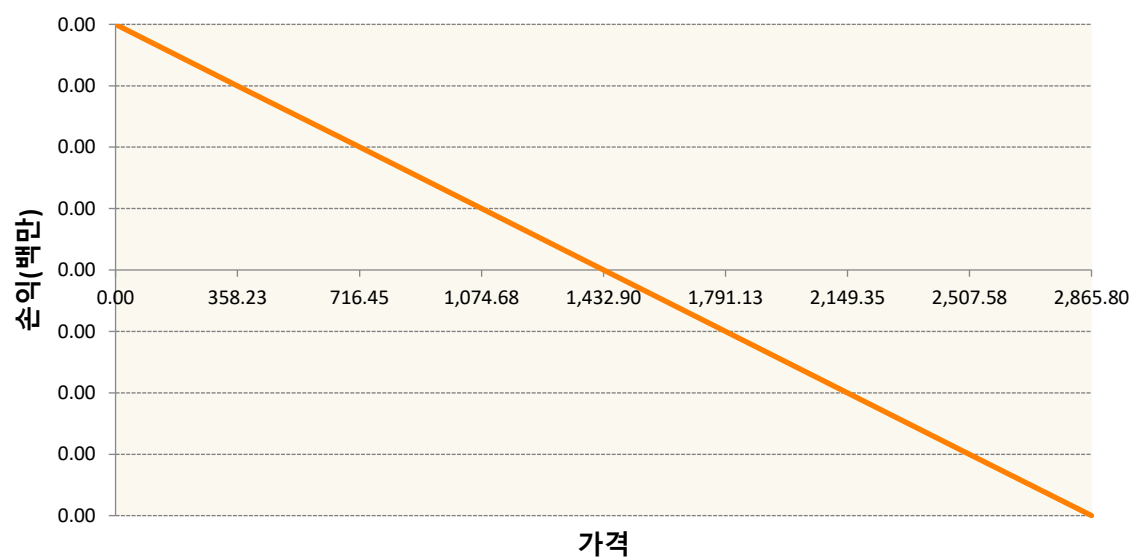
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



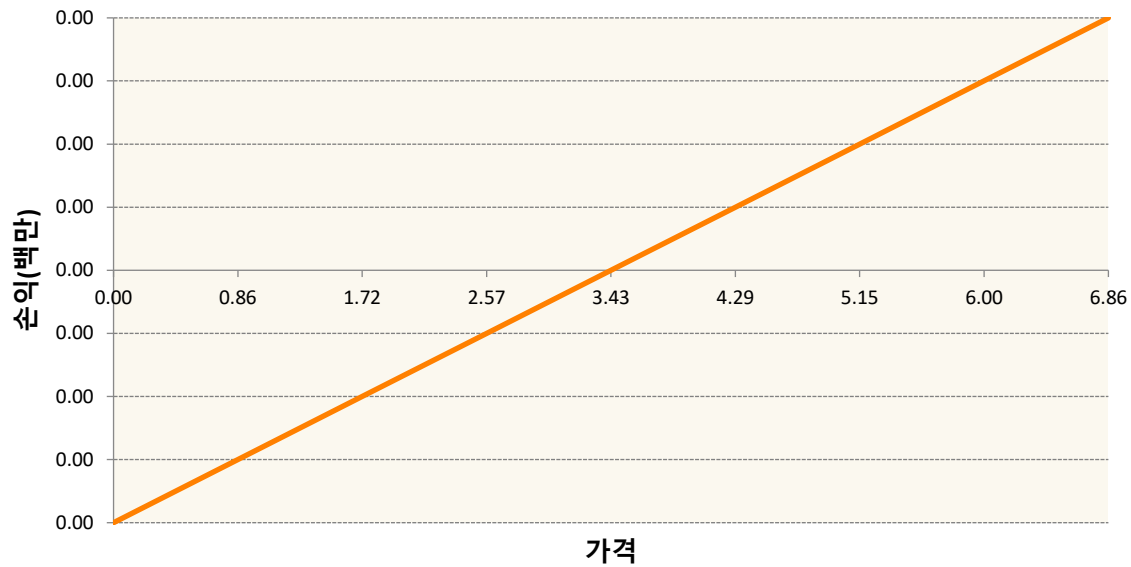
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



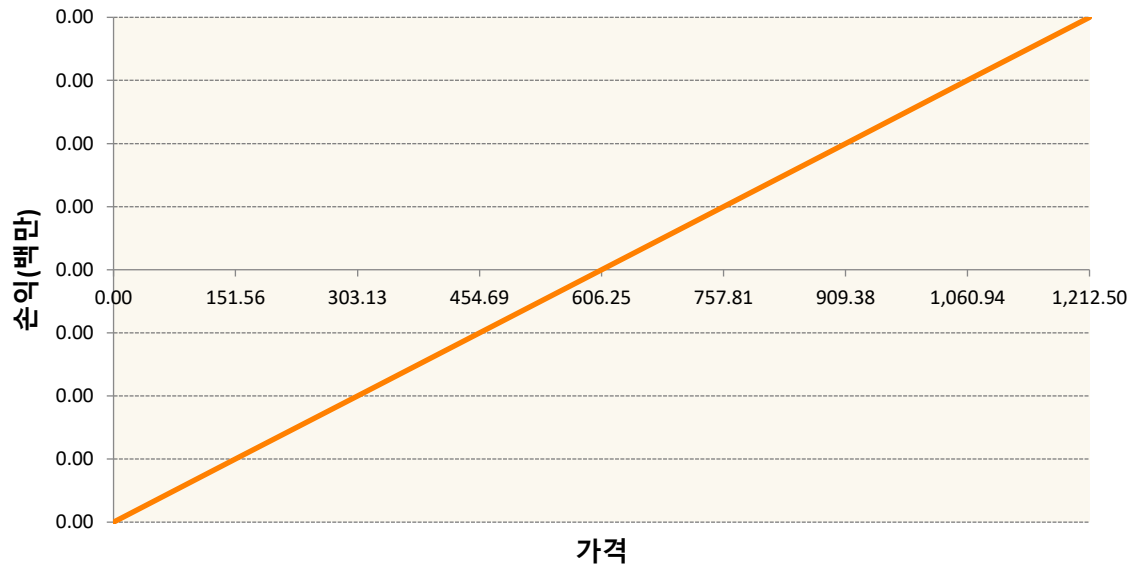
KR4175W50005-2025-05 달러선물



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
KR4175W50(2025-05 달러선물		6
NGN25	NATURAL GAS FUTR JUL25	12
QSN5	Low Su Gasoil G JUL25	7

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

(단위:백만원)

117