

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

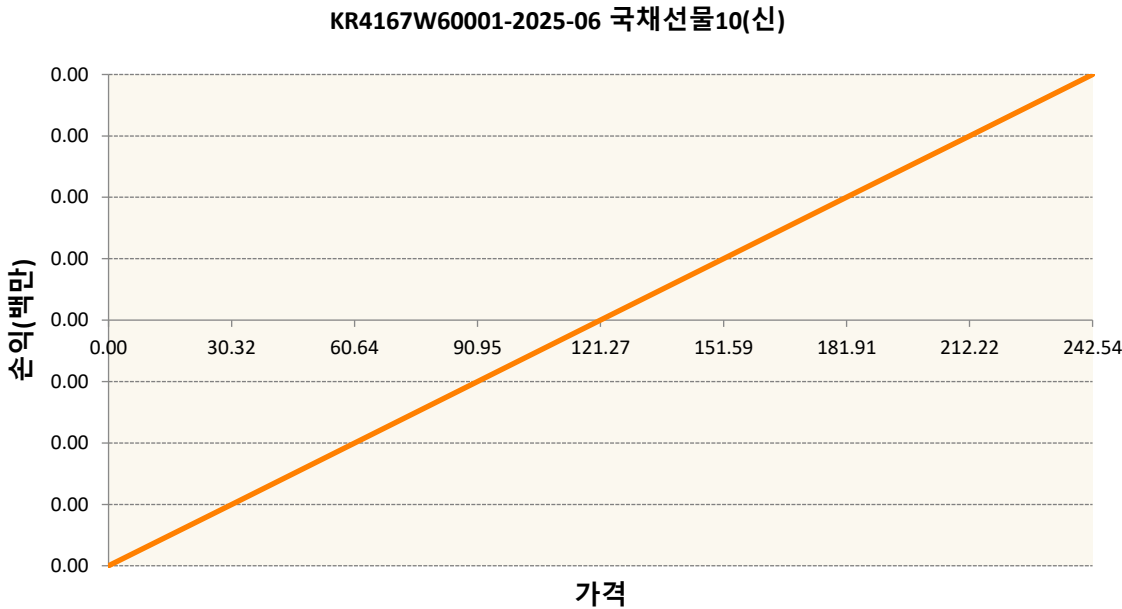
베스트장기채(채권-파생형)

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	60,635	0	60,635	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	2025-04-28
기준일	2025-04-25

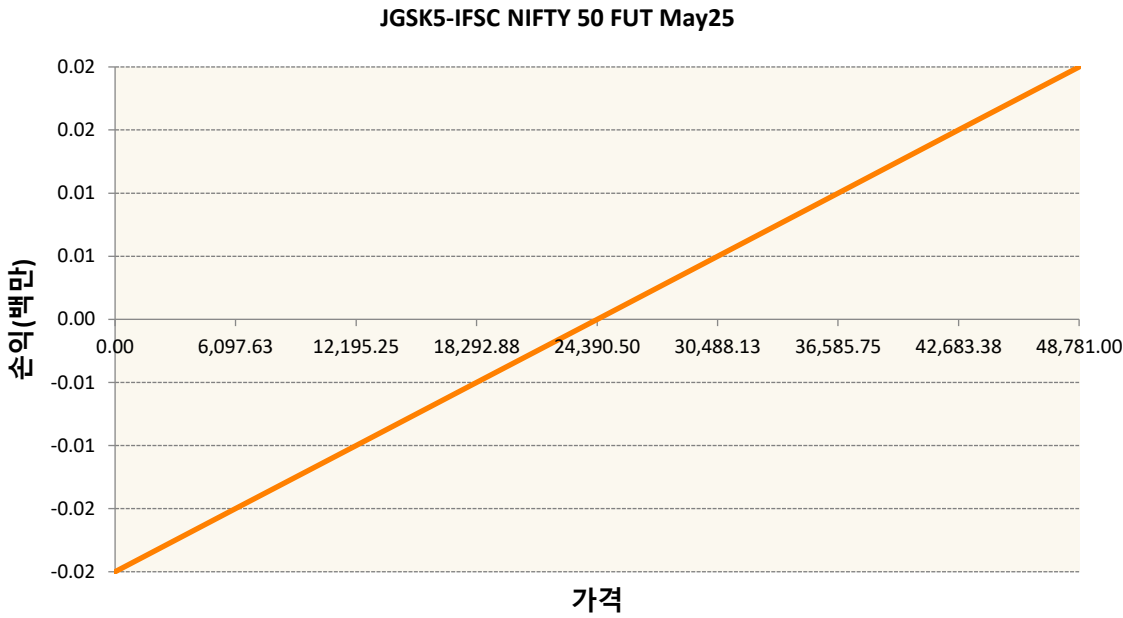
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	841	0	841	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSK5	IFSC NIFTY 50 FUT May25	67
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

49

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

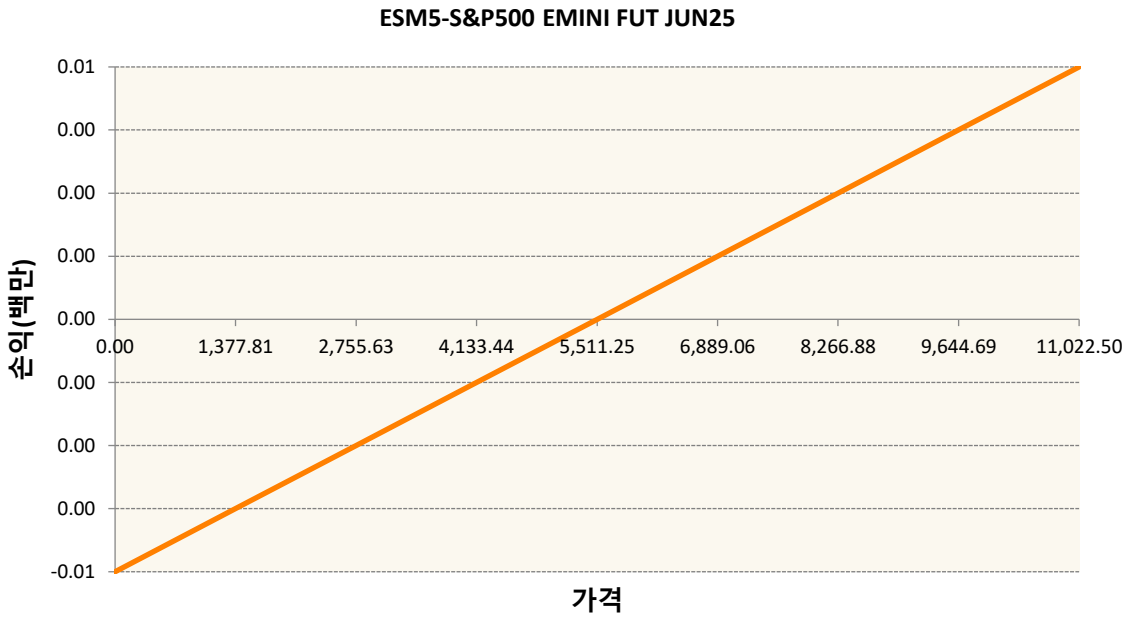
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	403	0	403	

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	2025-04-28
기준일	2025-04-25

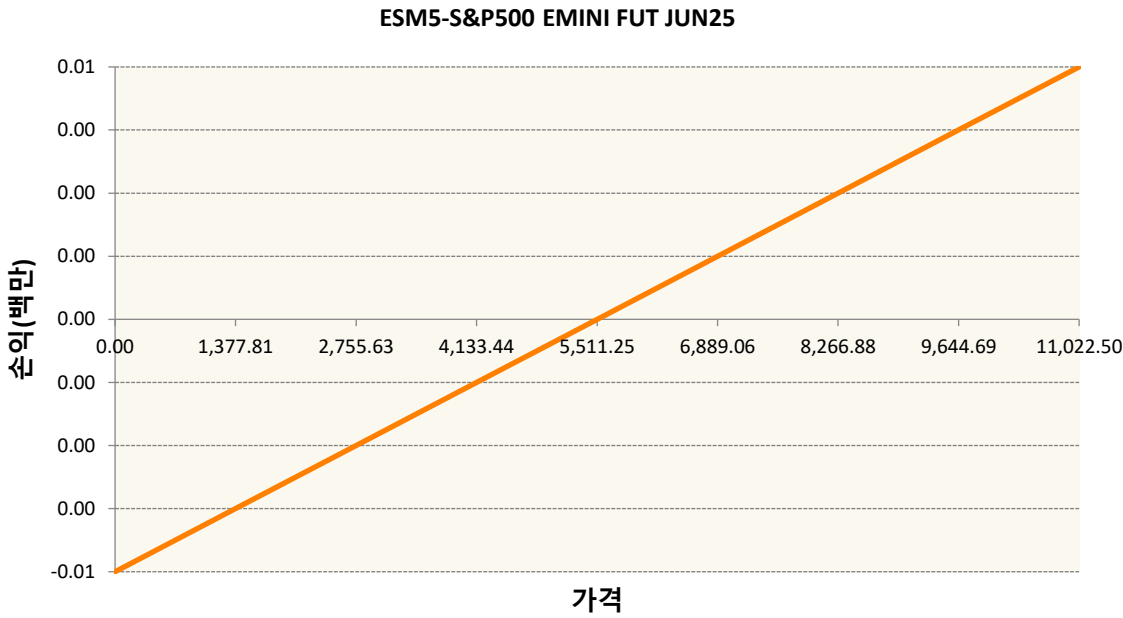
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	2,420	0	2,420	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	194
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

169

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

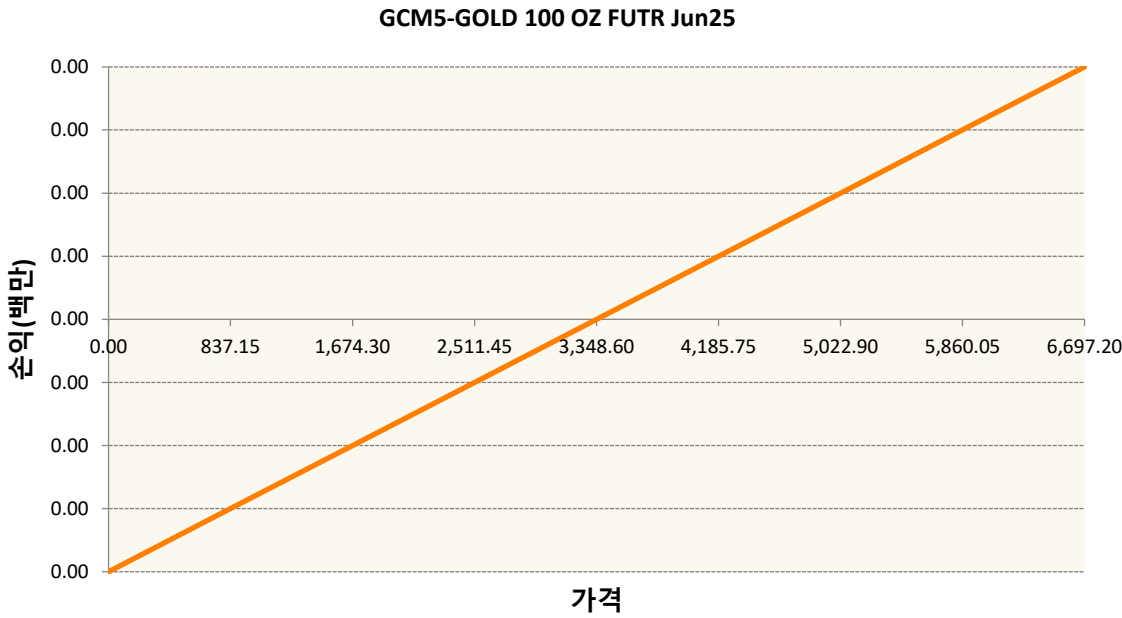
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,455	0	2,455	
누계	실물자산	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	196

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

(단위:백만원)

158

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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	10
AOPLTRUSP(PLTR US 04/25/25 P97 EQUITY	4

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

(단위:백만원)

59

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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

0.34

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

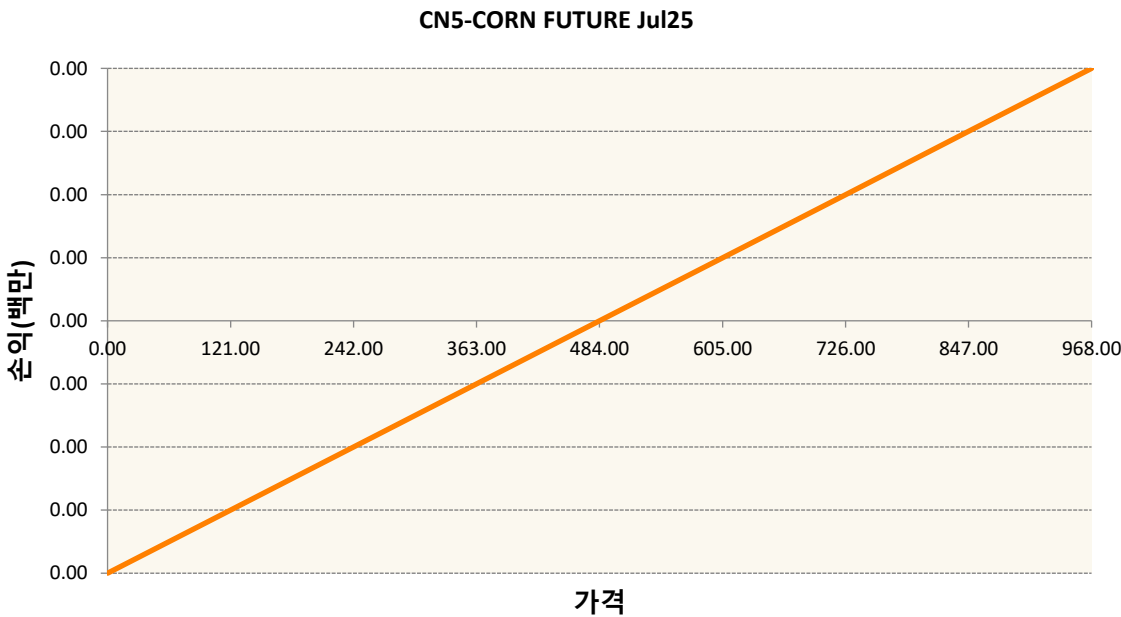
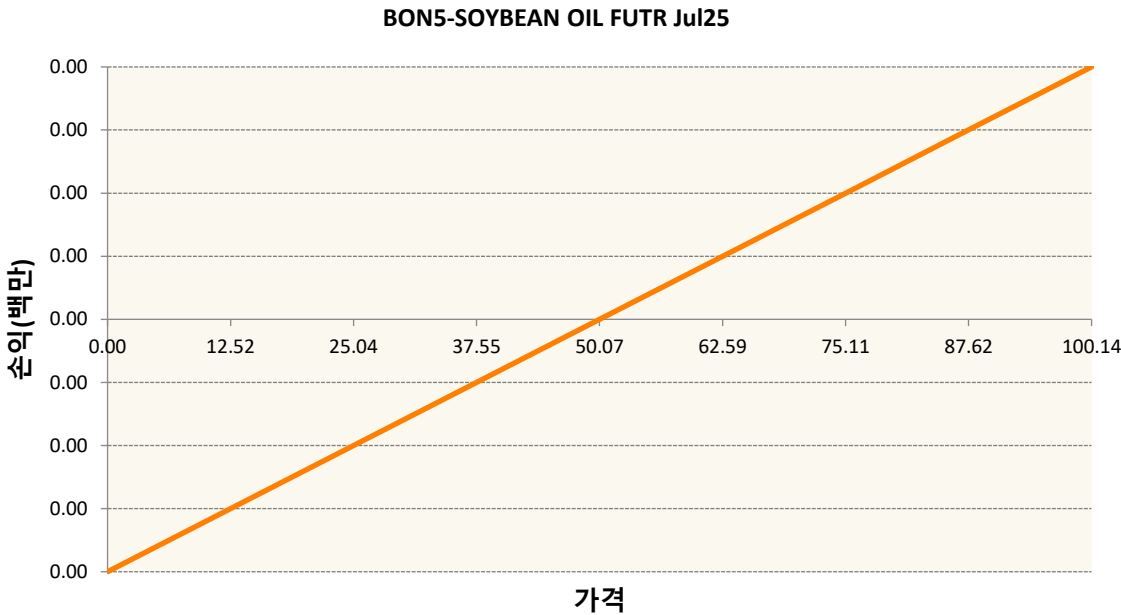
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

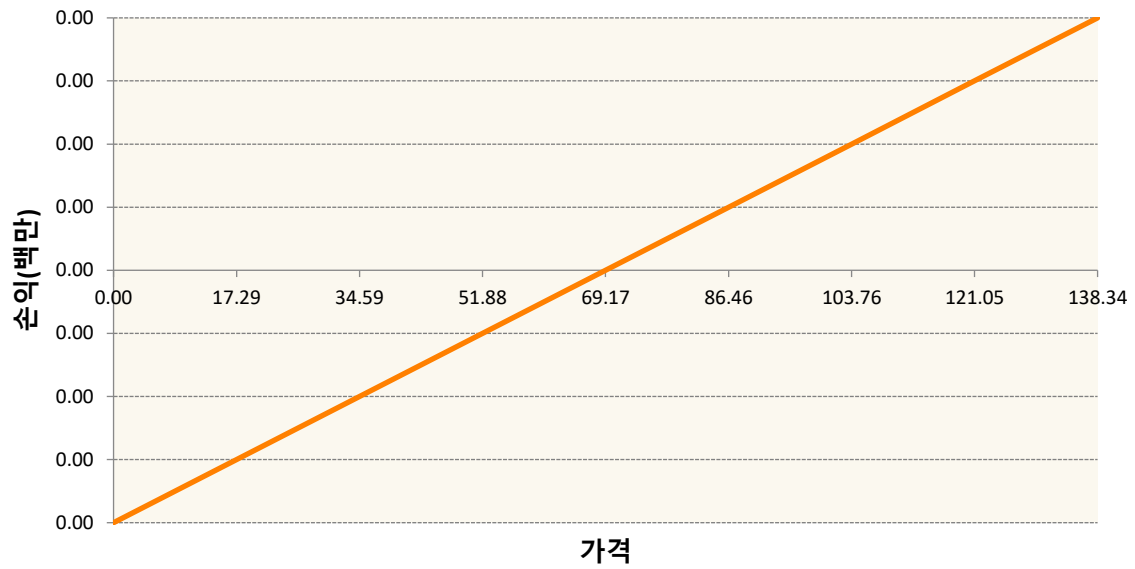
(단위:USD 백만)

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	3,897	0	3,897	
누계	통화	선물	0	330	-330	장내

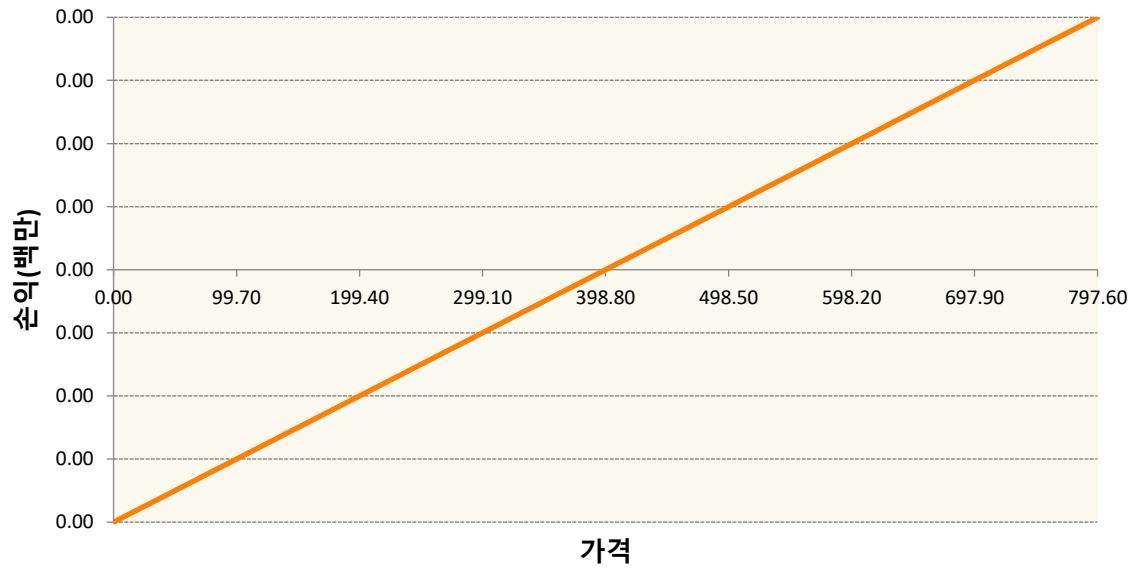
2. 만기시점의 손익구조



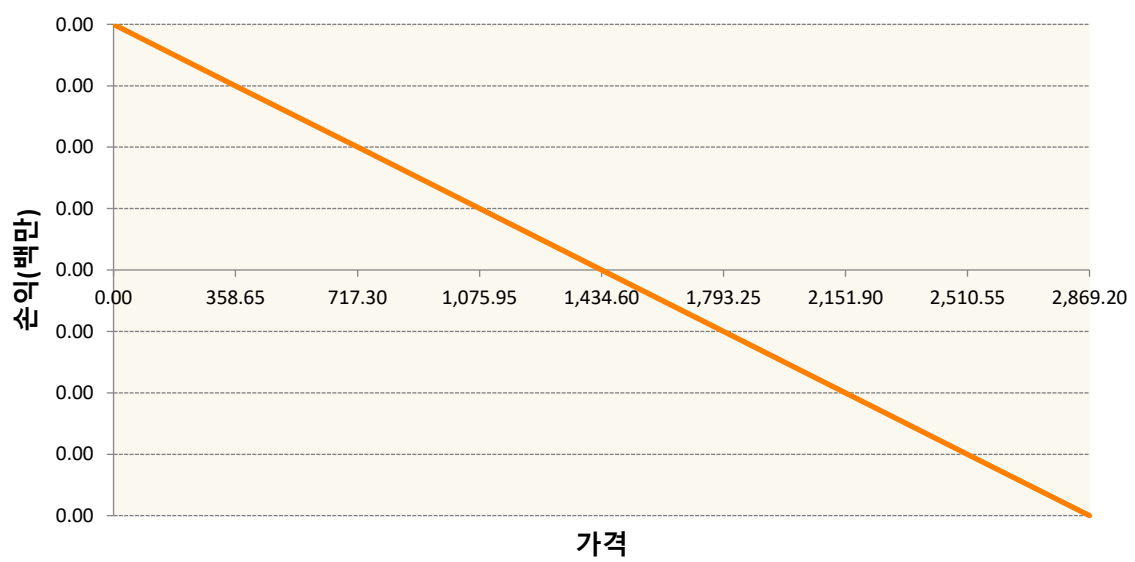
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



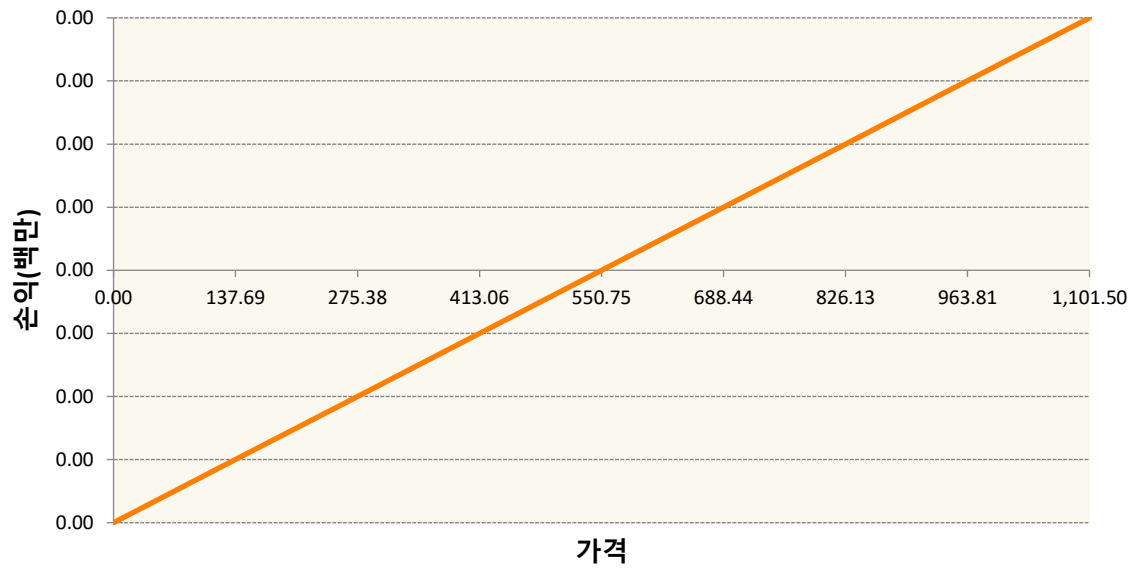
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



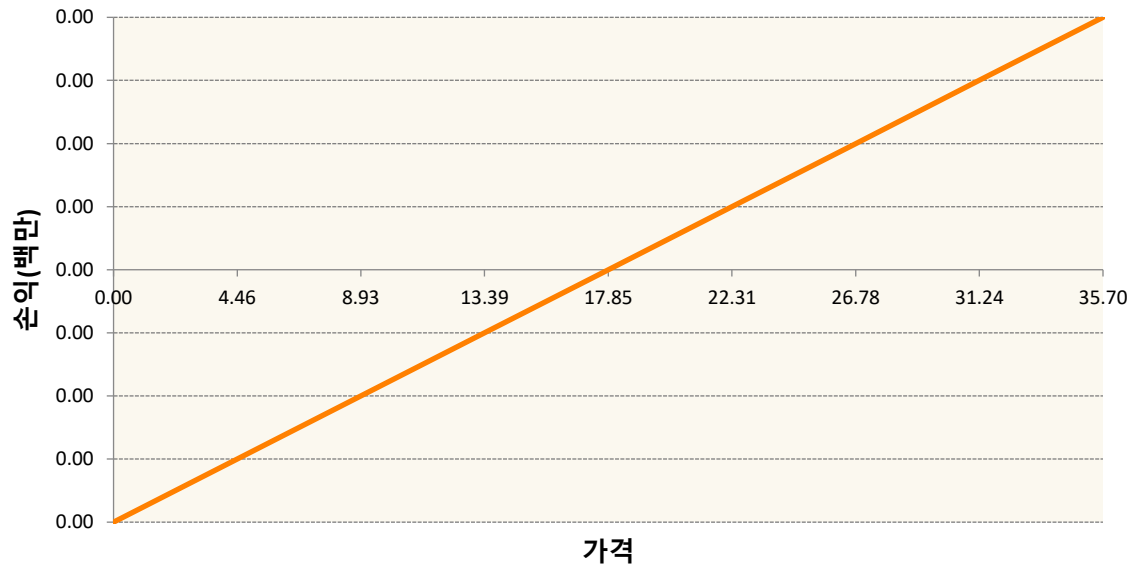
KR4175W50005-2025-05 달러선물



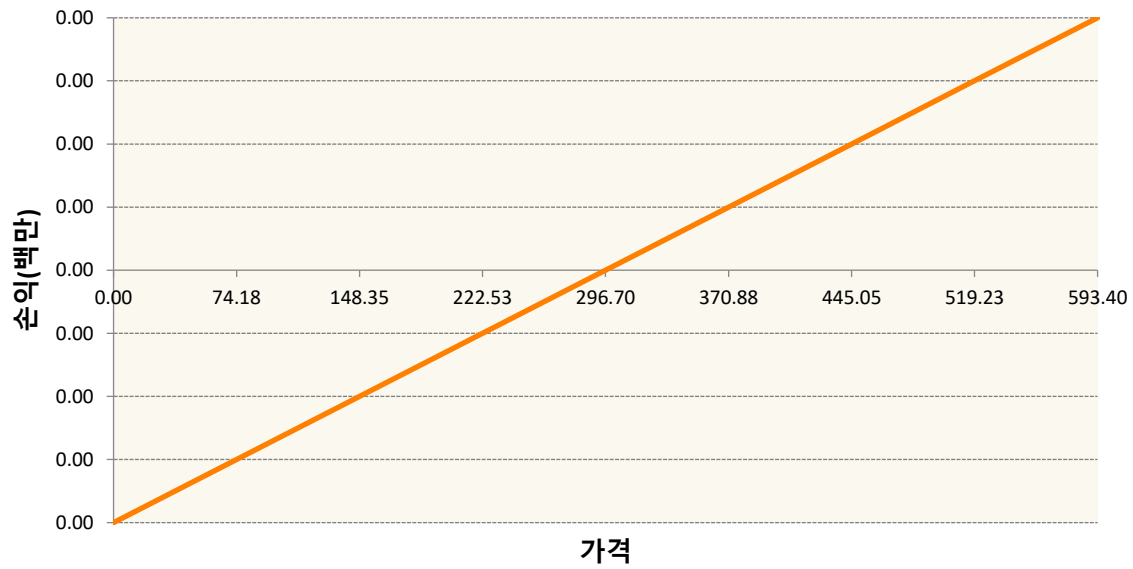
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25

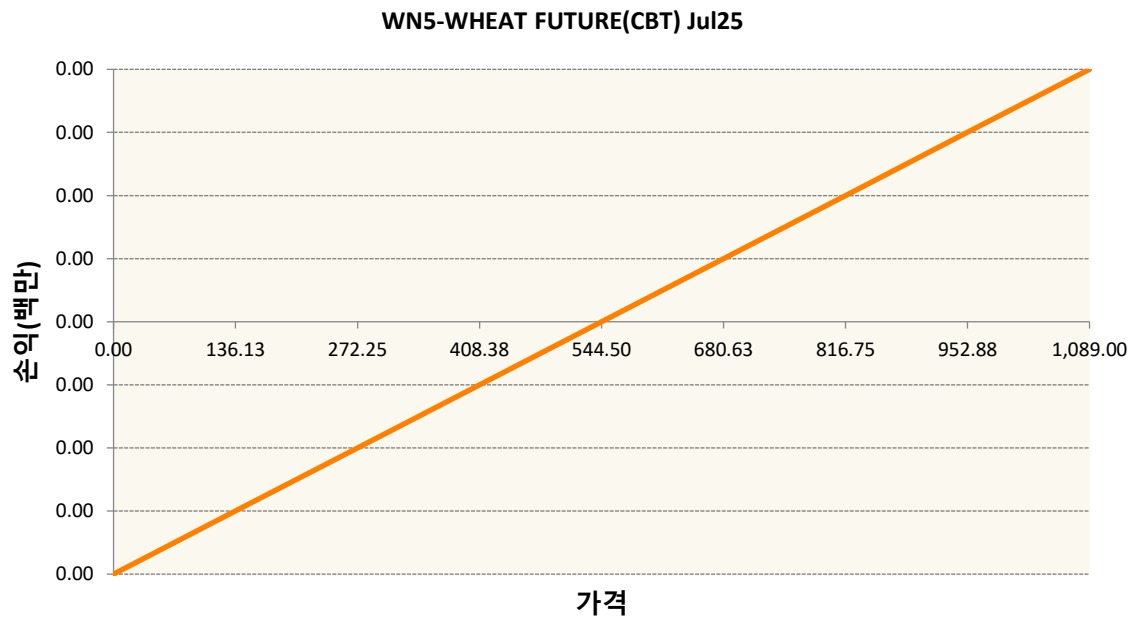
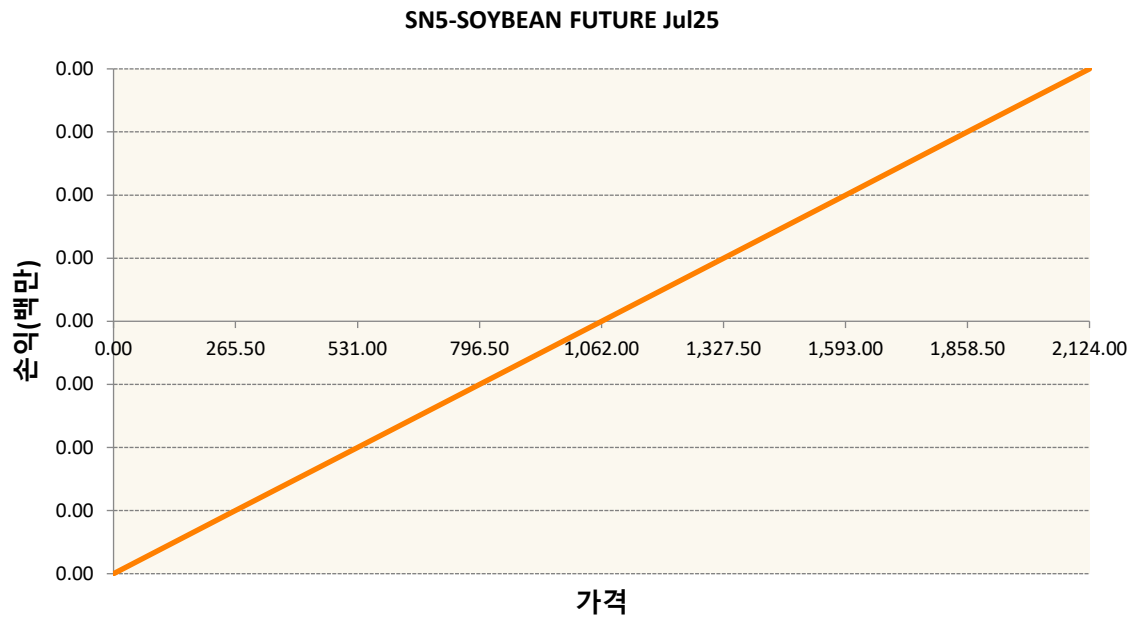


SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



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	2025-04-28
기준일	2025-04-25

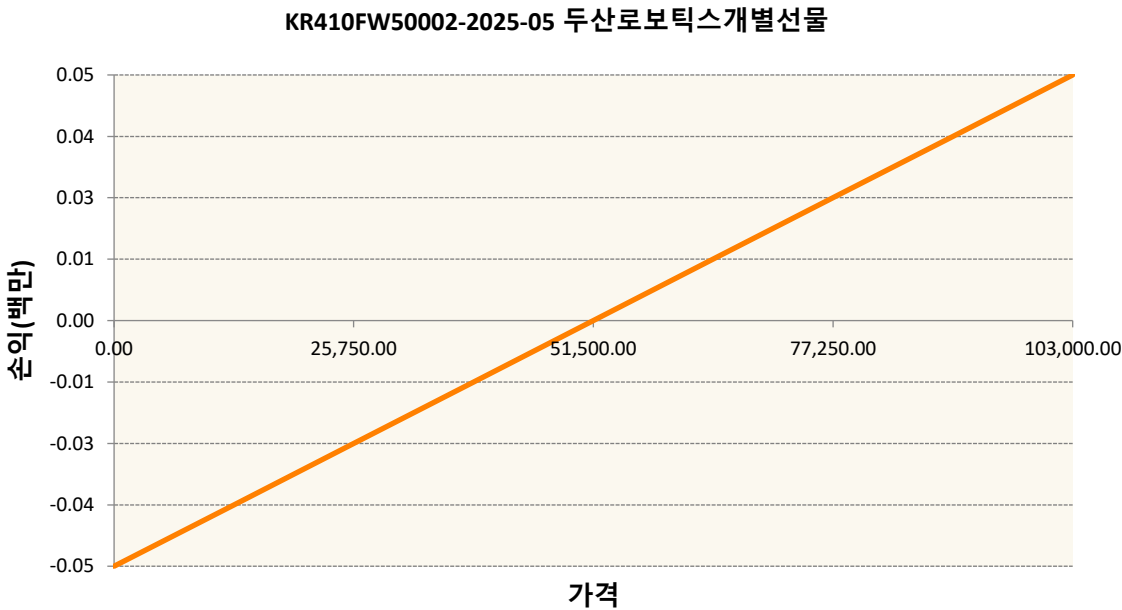
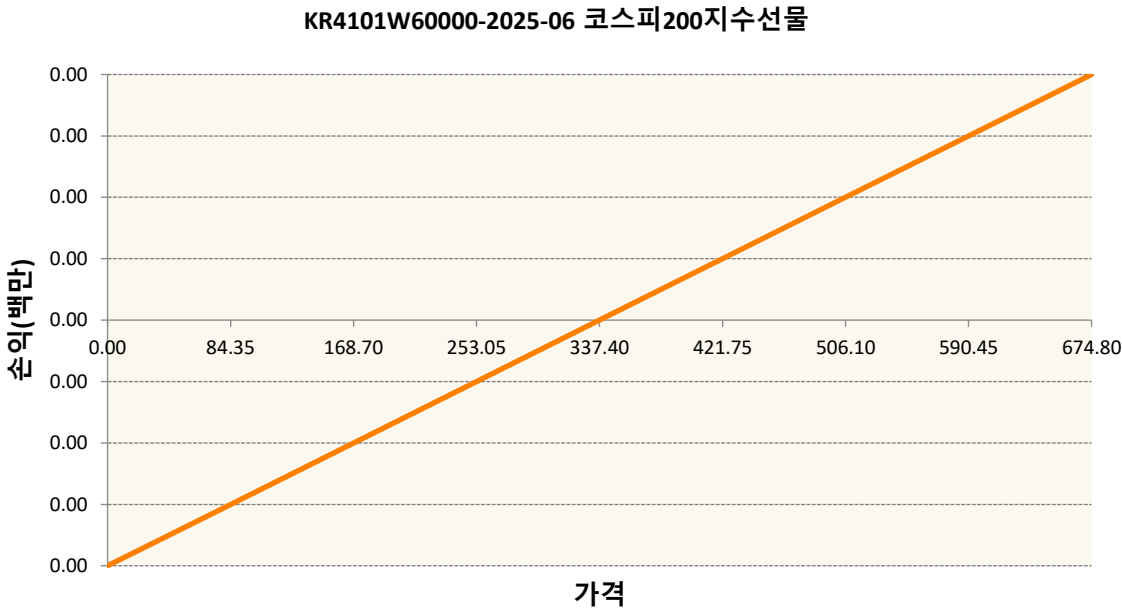
스마트인덱스모

1. 계약금액

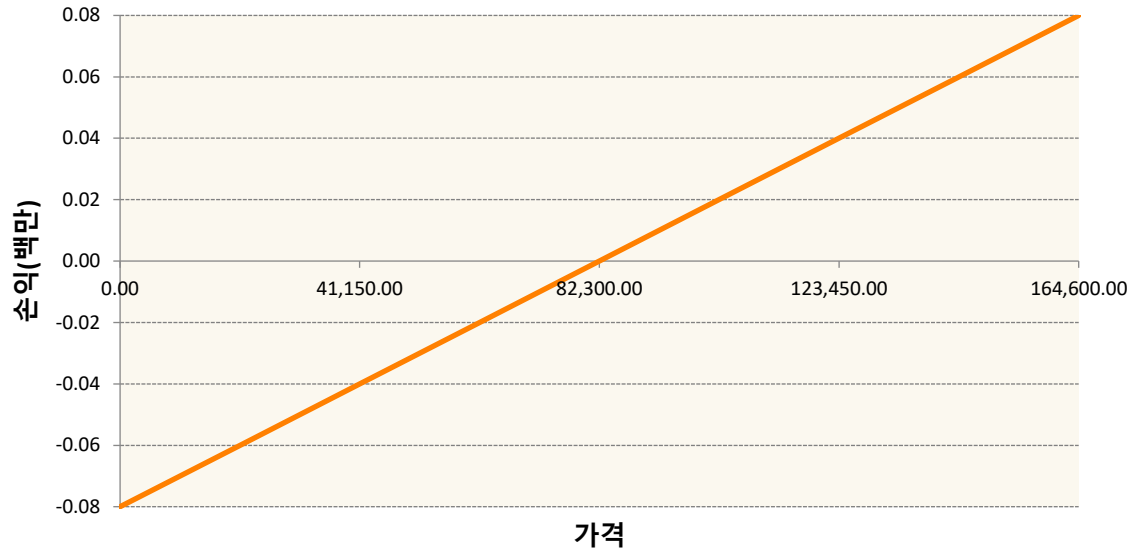
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,748	0	1,748	장내

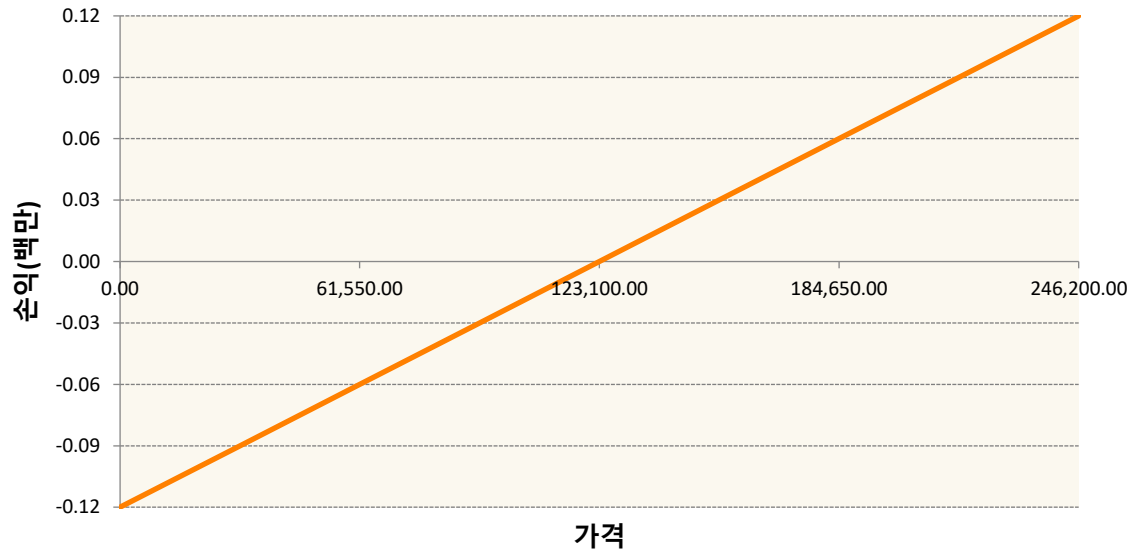
2. 만기시점의 손익구조



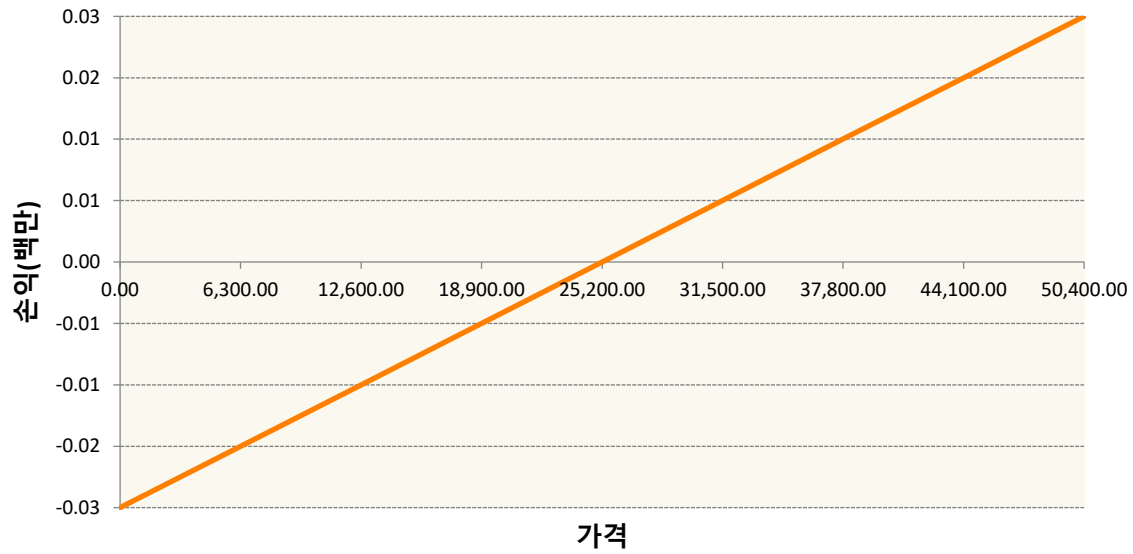
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



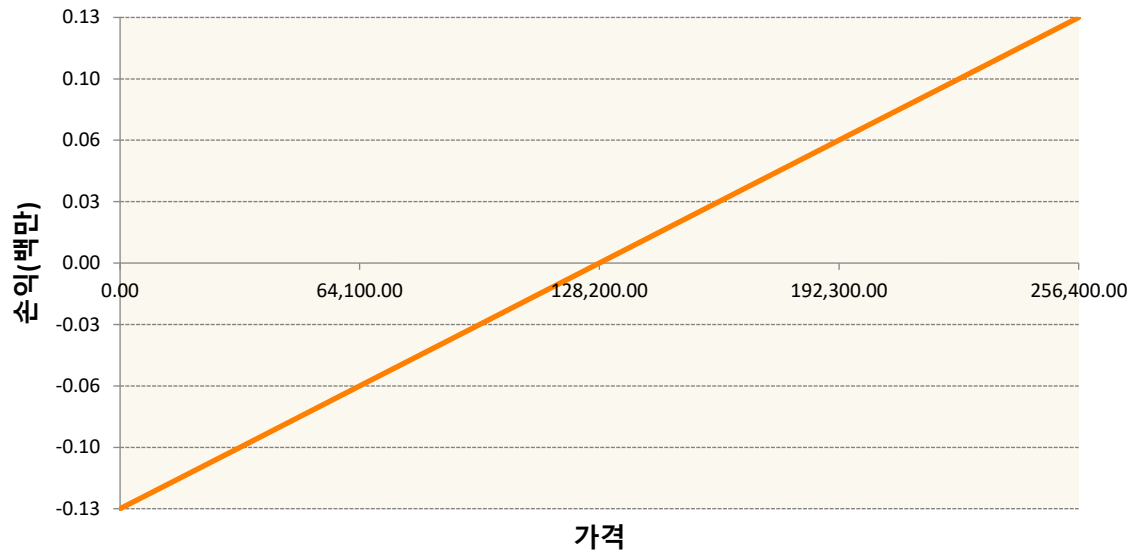
KR4123W50005-2025-05 삼성전자개별선물



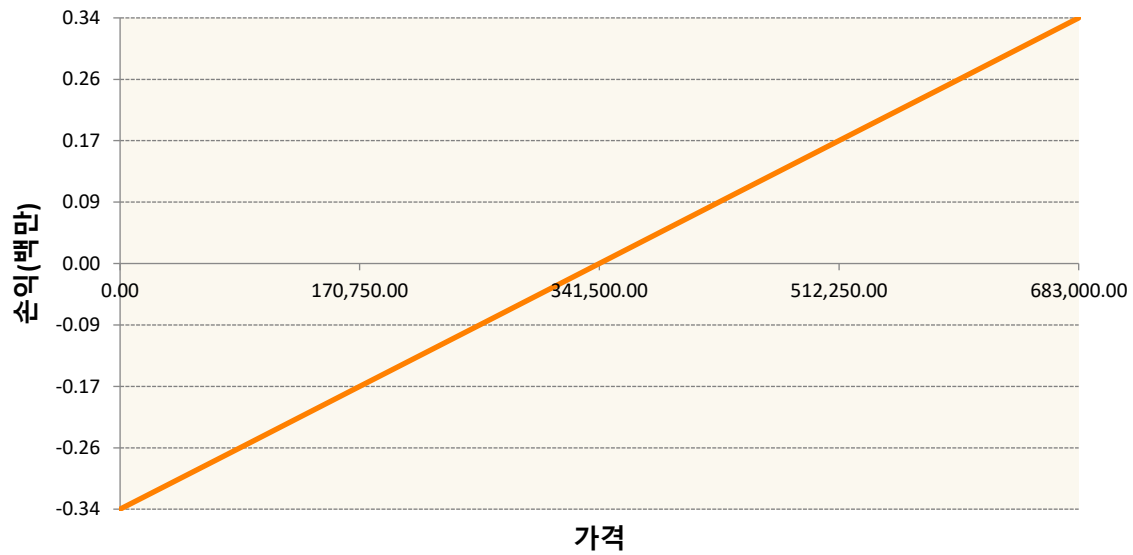
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



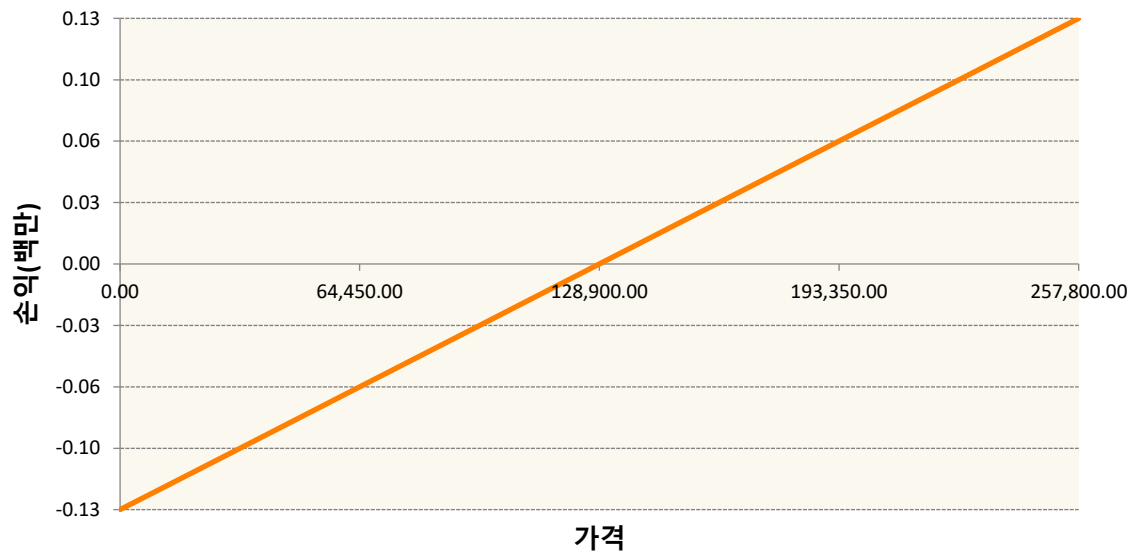
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	108
KR410FW50(2025-05 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	4
KR4123W50(2025-05 삼성전기개별선물	4
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물	2
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물	14
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물	2

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

227

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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)

462

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

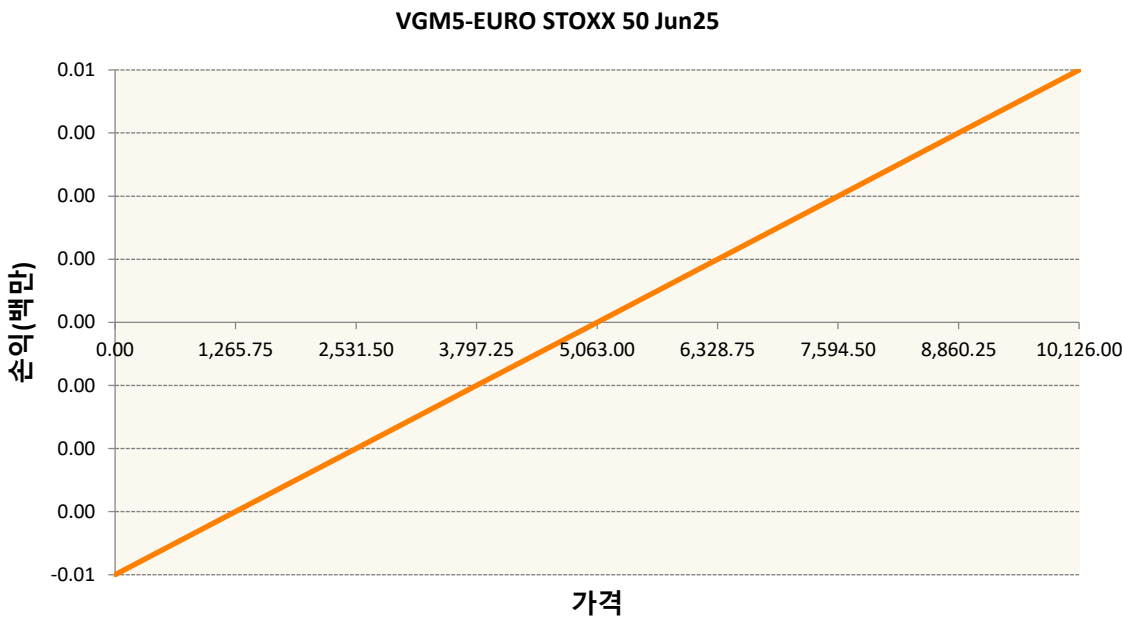
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	806	0	806	

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	2025-04-28
기준일	2025-04-25

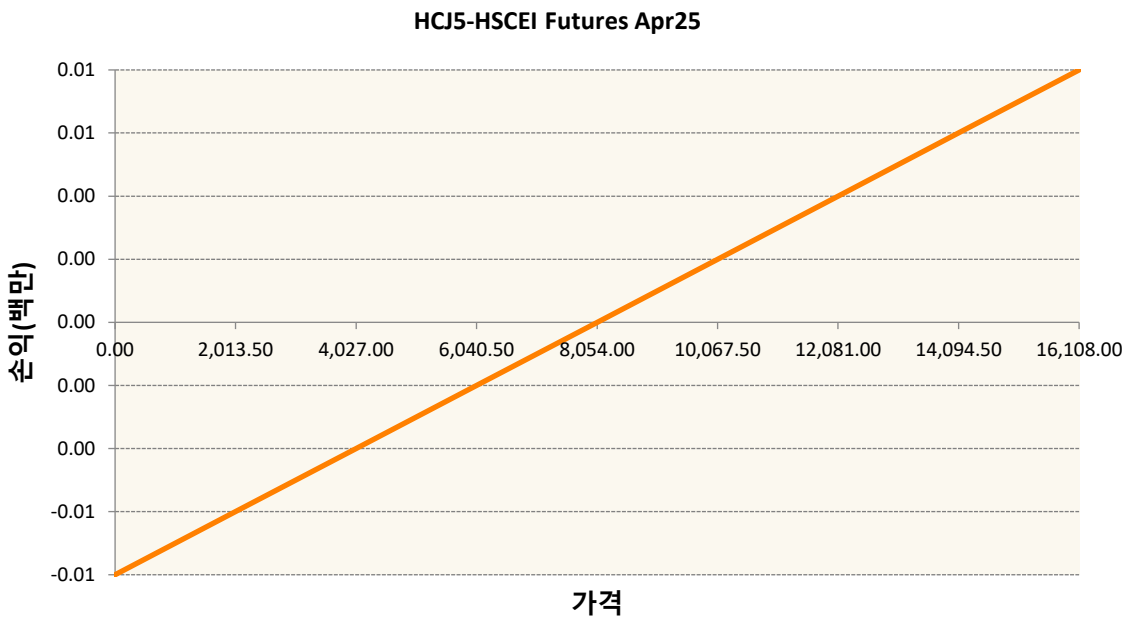
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,282	0	2,282	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI5	HSCEI Futures Apr25	183
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

273

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

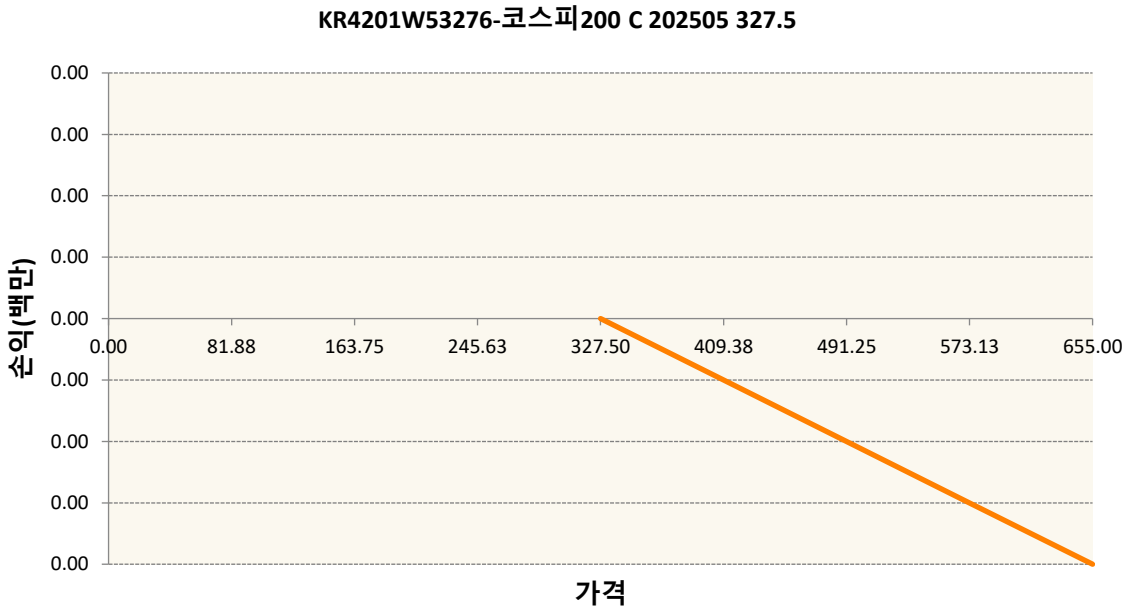
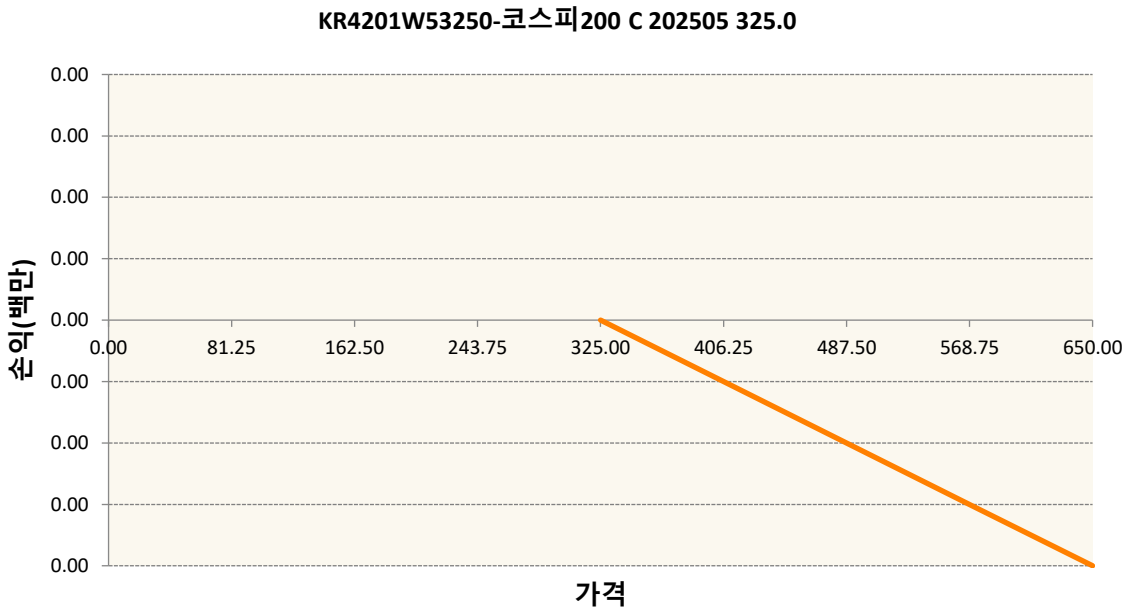
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	318	0	318	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,515	-35,515	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 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
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 represents price, with labels at 0.00, 81.88, 163.75, 245.63, 327.50, 409.38, 491.25, 573.13, and 655.00. The y-axis represents net income in millions, with labels from 0.00 to 0.00 in increments of 0.00. An orange line starts at (0, 0) and ends at (327.50, 0.00).

(단위:백만원)

KR4201W53250 코스피200 C 202505 325.0							2,176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,115	1,102	1,085	1,067	1,046	1,023	999
-5.33%	995	962	929	895	860	825	789
-2.67%	654	617	579	542	504	466	427
0%	72	51	26	0	-28	-57	-88
2.67%	-645	-652	-661	-673	-688	-704	-723
5.33%	-1,403	-1,404	-1,406	-1,410	-1,415	-1,422	-1,431
8.00%	-2,167	-2,167	-2,168	-2,169	-2,170	-2,172	-2,176
KR4201W53276 코스피200 C 202505 327.5							69
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	30	30	29	29	28
-5.33%	28	27	27	26	25	23	22
-2.67%	20	18	17	16	15	13	12
0%	3	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	-19	-20	-20	-21	-21	-22	-23
5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-45	-45
8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-69	-69
KR4301W53258 코스피200 P 202505 325.0							312

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-284	-287	-291	-295	-300	-306	-312
-5.33%	-129	-137	-145	-153	-161	-170	-178
-2.67%	-27	-36	-45	-54	-63	-72	-81
0%	17	12	6	0	-7	-14	-21
2.67%	29	27	25	22	19	15	10
5.33%	31	30	30	29	28	26	24
8.00%	31	31	31	31	30	30	29

KR4301W53274 코스피200 P 202505 327.5							13
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-13
-5.33%	-6	-6	-6	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-1	-2	-2	-2	-3	-3	-3
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	1	1

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

(단위:백만원)

2,751

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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	552	0	552	

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	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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	4,444	0	4,444	

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	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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	12,780	0	12,780	
누계	통화	선도	359	12,857	-12,498	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213F1PC KRW/USD 30-04-25E		209
FXW213F2SC KRW/USD 30-04-25E		213
FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E		345
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E		228
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)
	497

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

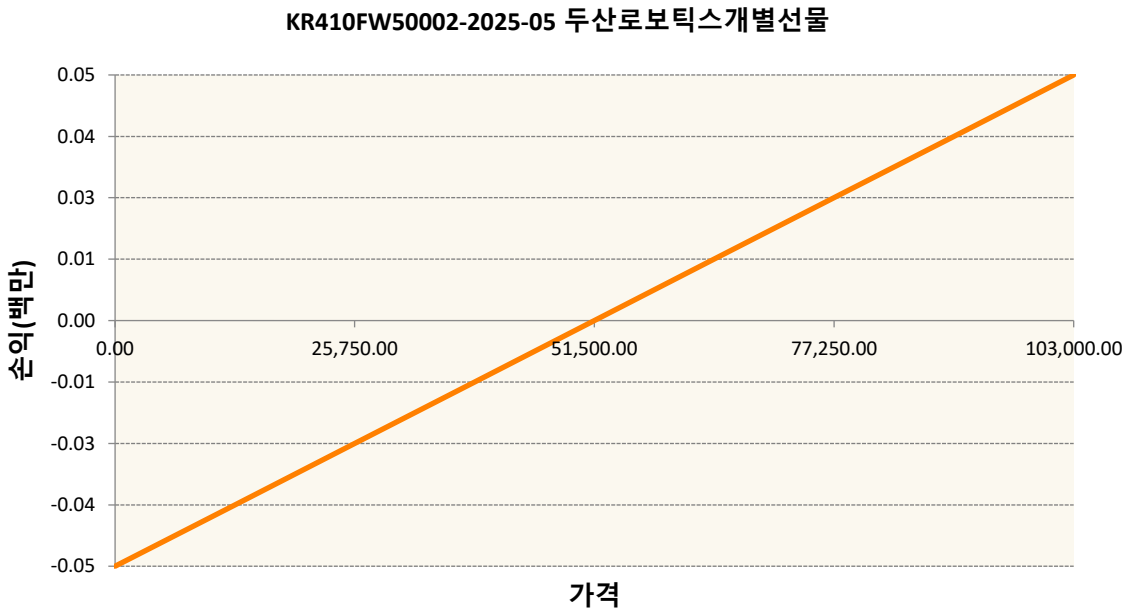
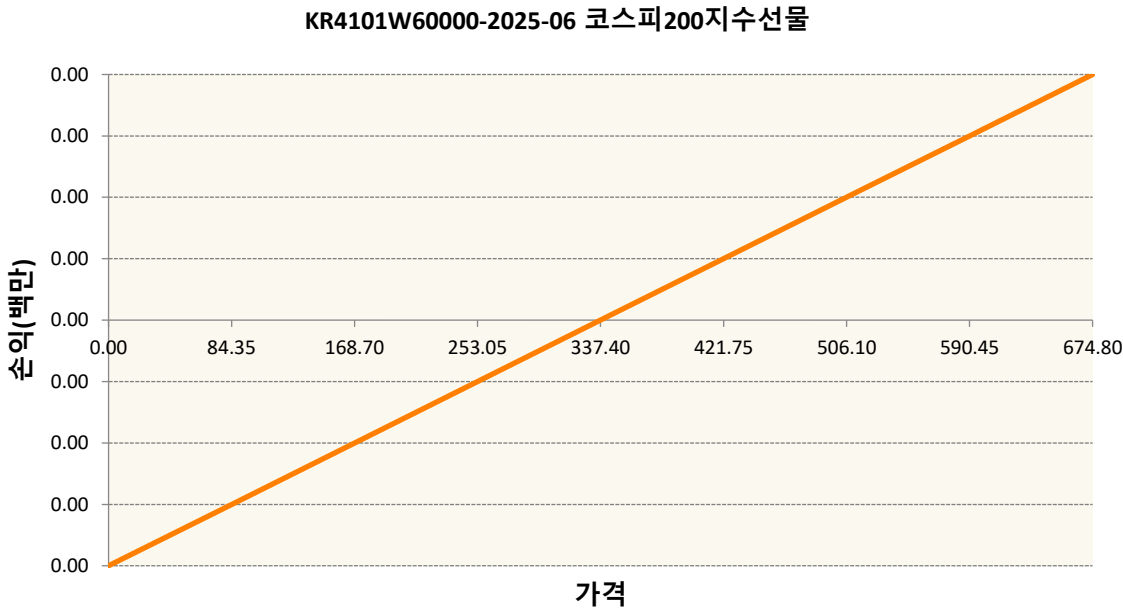
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

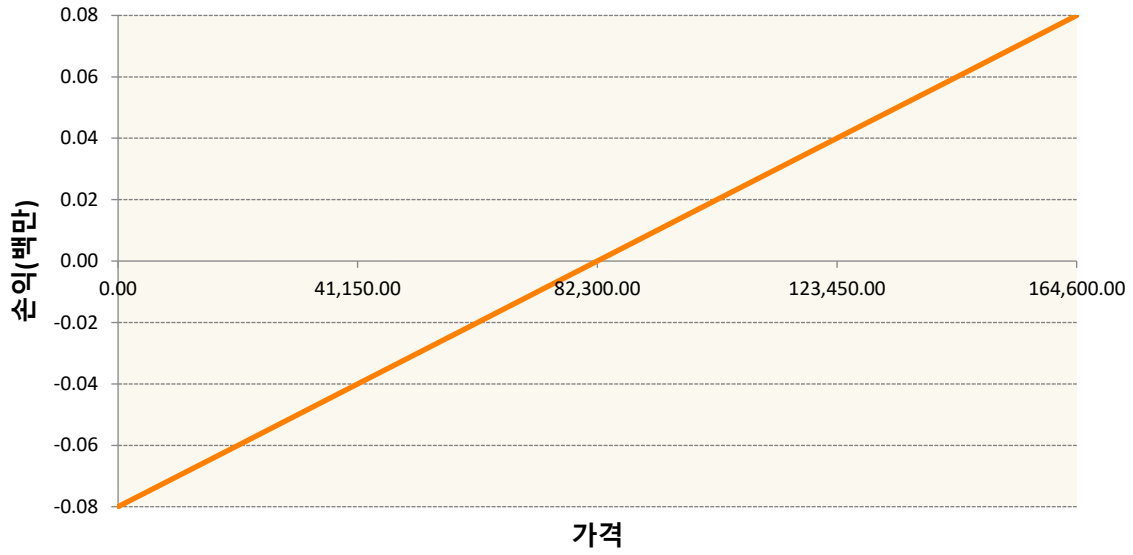
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,124	0	1,124	장내

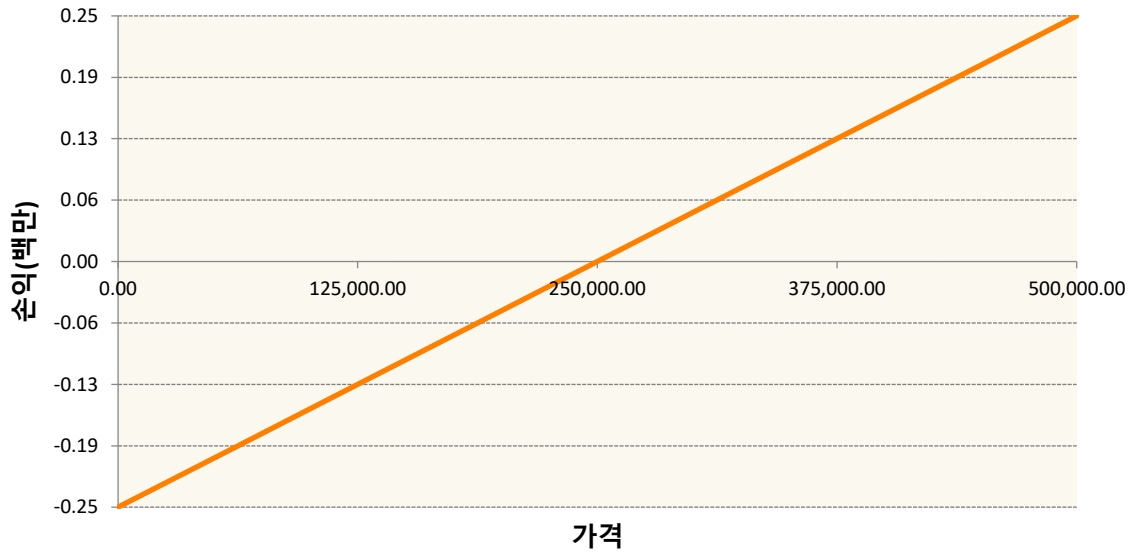
2. 만기시점의 손익구조



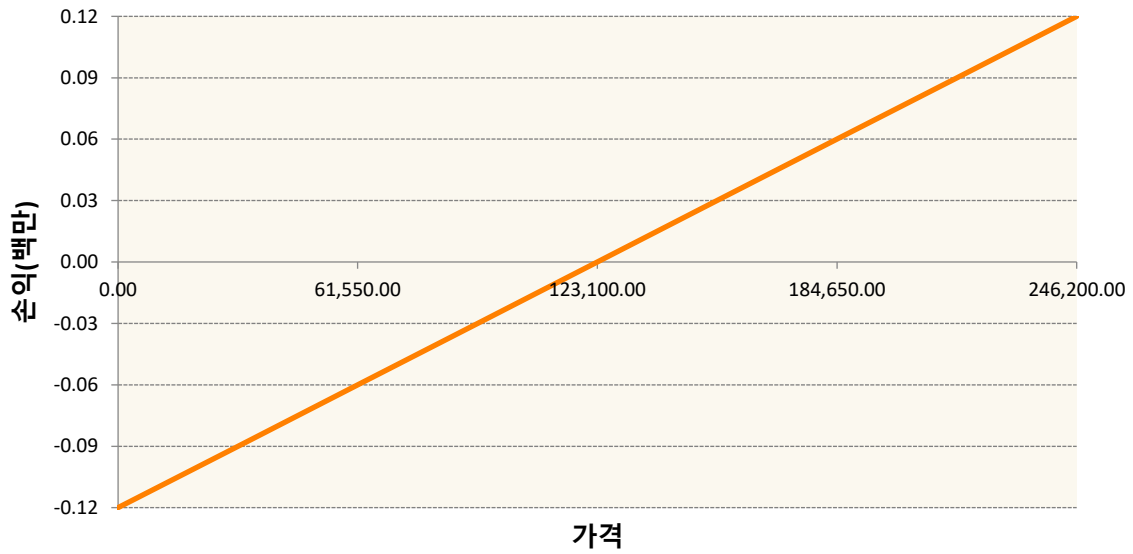
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



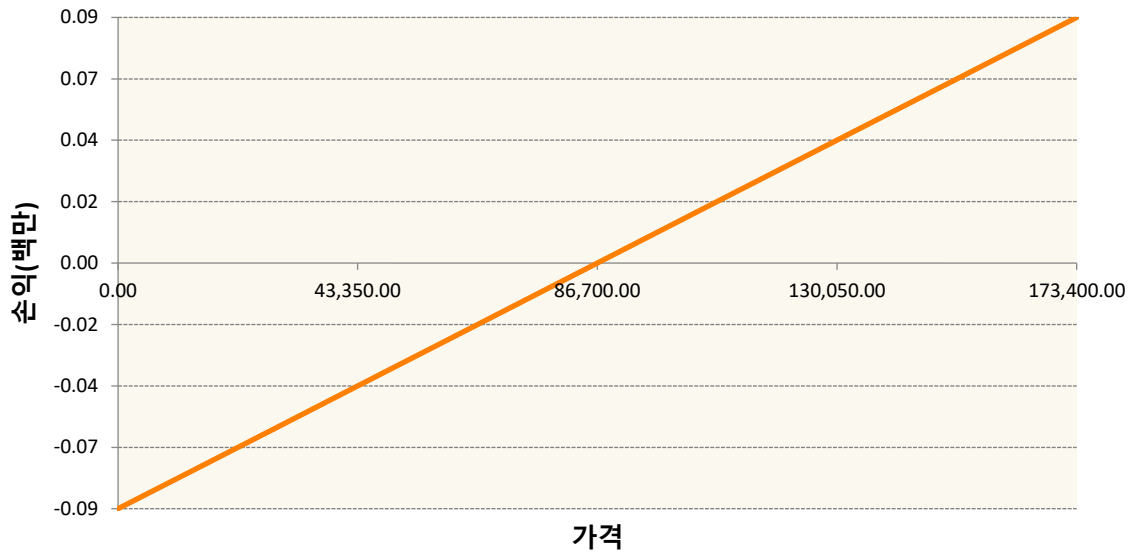
KR4120W50001-2025-05 현대모비스개별선물



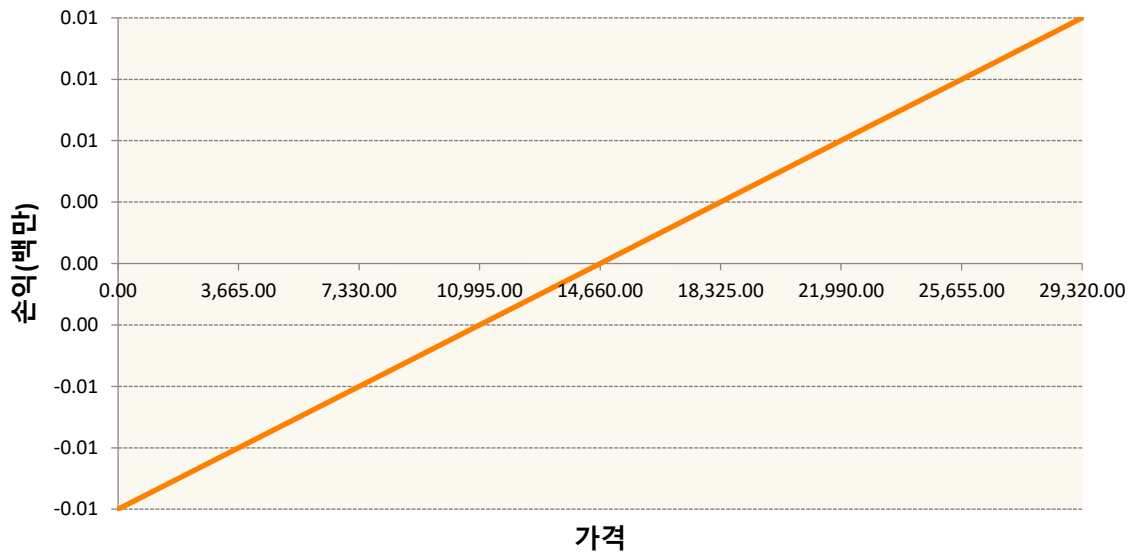
KR4123W50005-2025-05 삼성전기개별선물



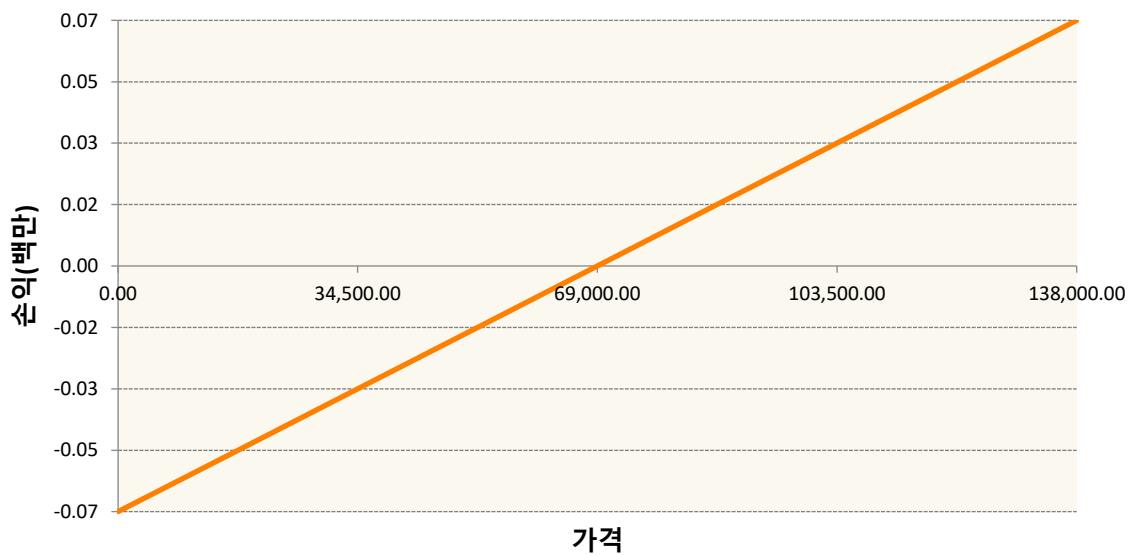
KR4146W50006-2025-05 KB금융개별선물



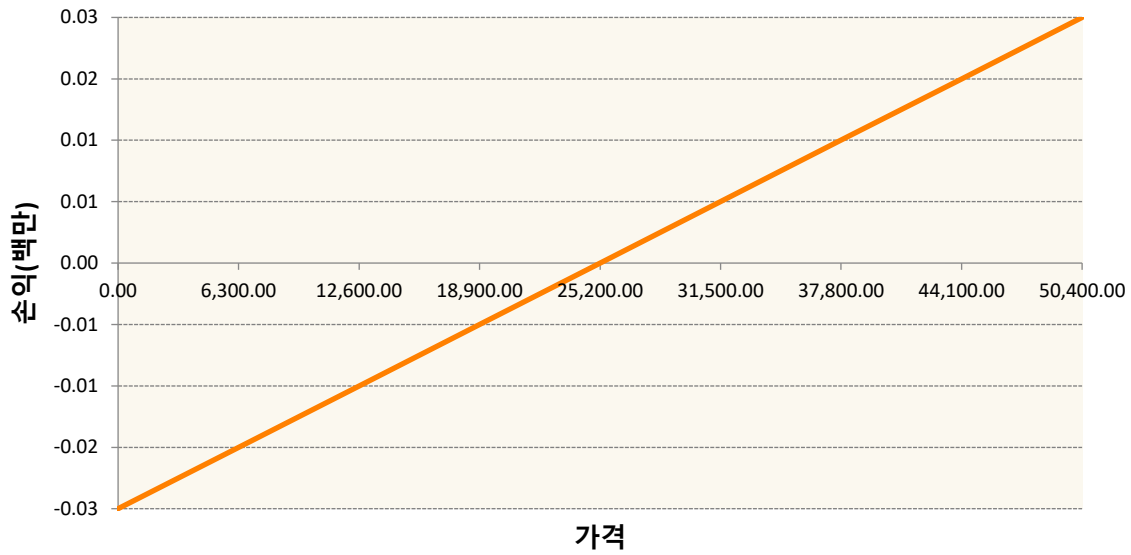
KR41BFW50008-2025-05 삼성중공업개별선물



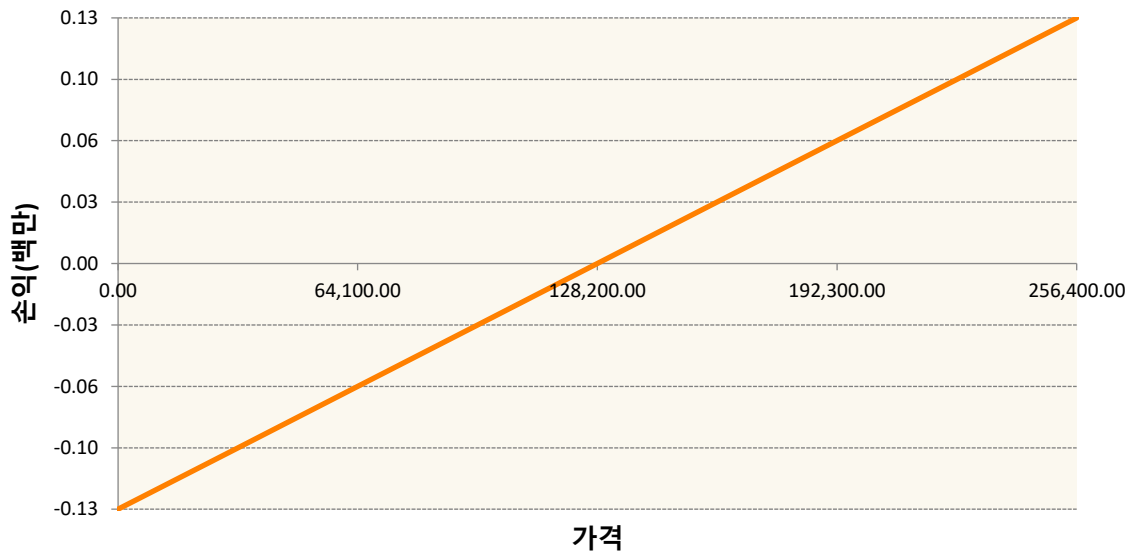
KR41C0W50000-2025-05 OCI홀딩스개별선물



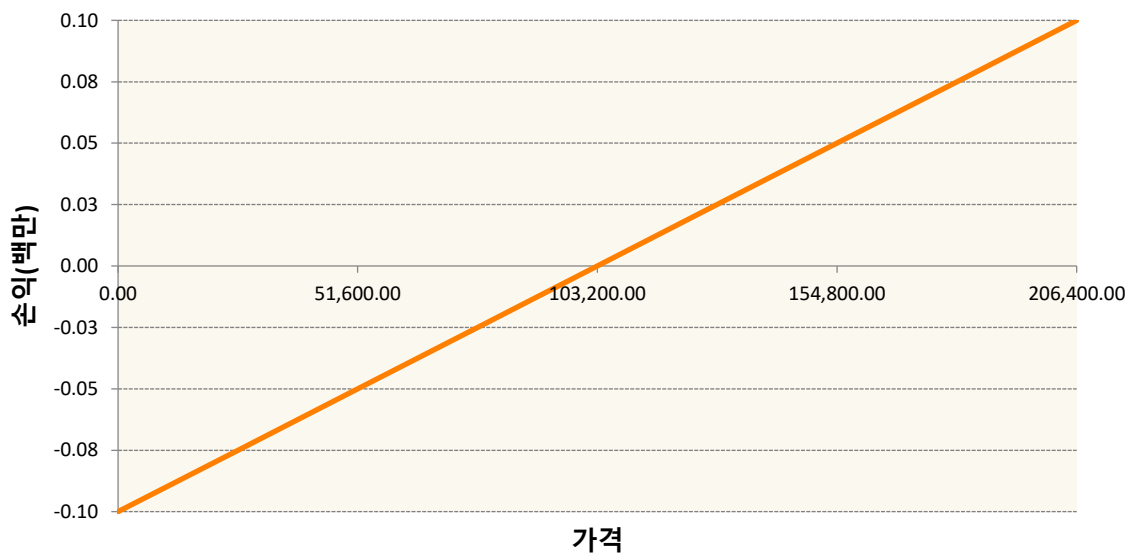
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



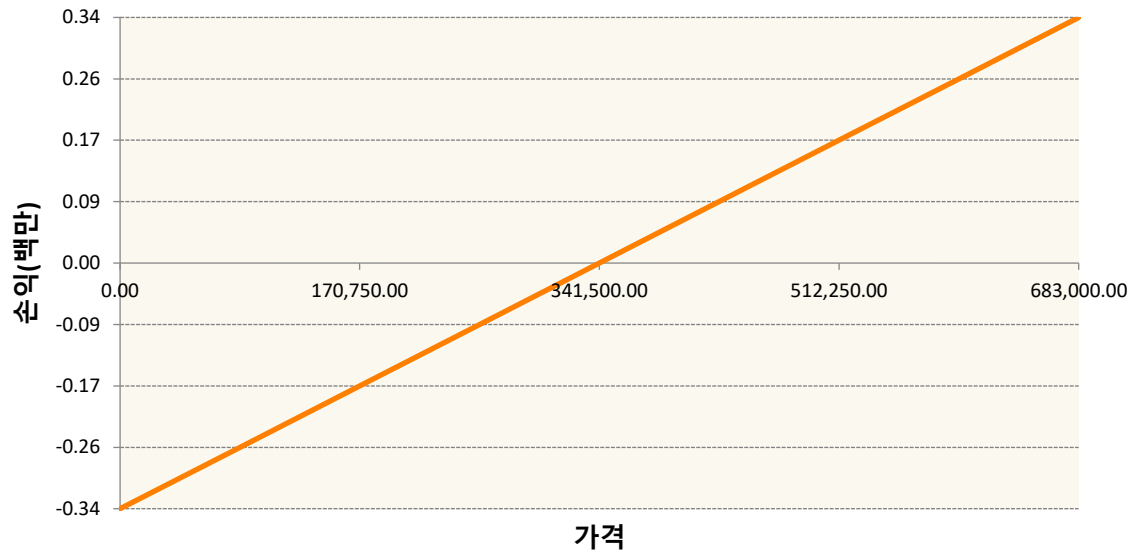
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



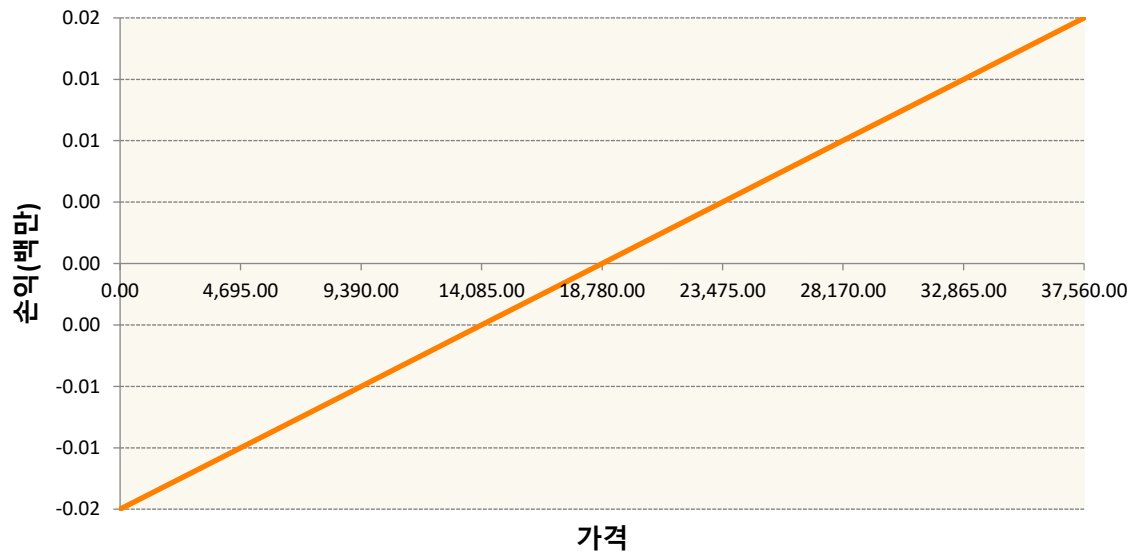
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



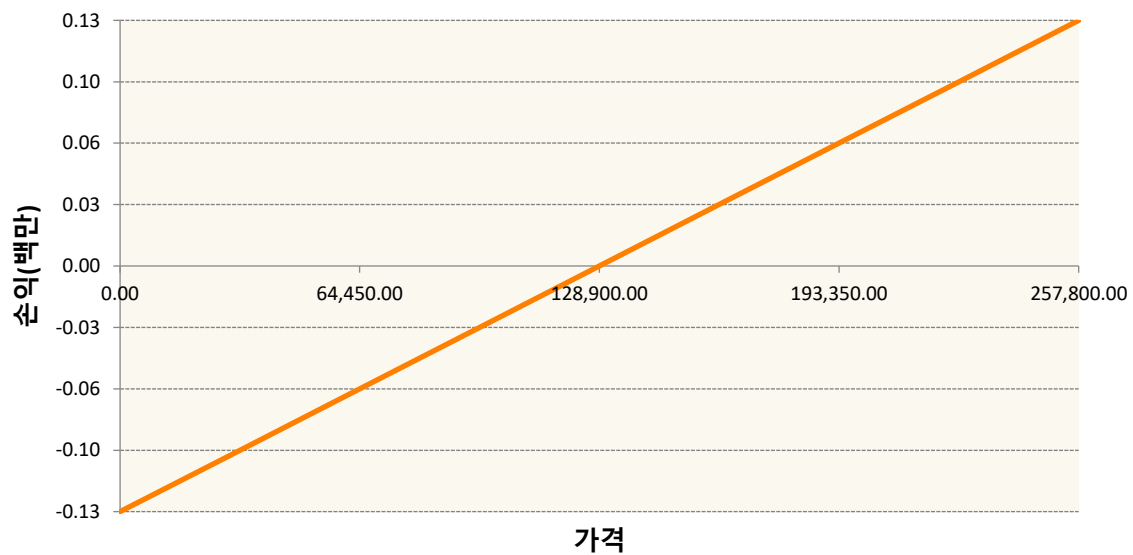
KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



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		0.41
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)
	149

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

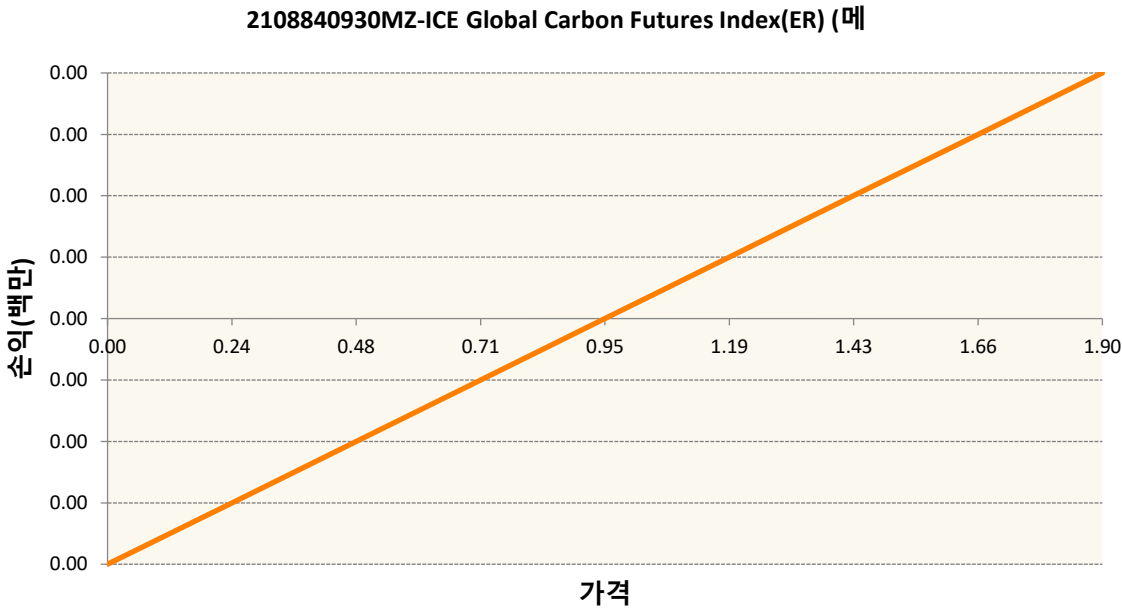
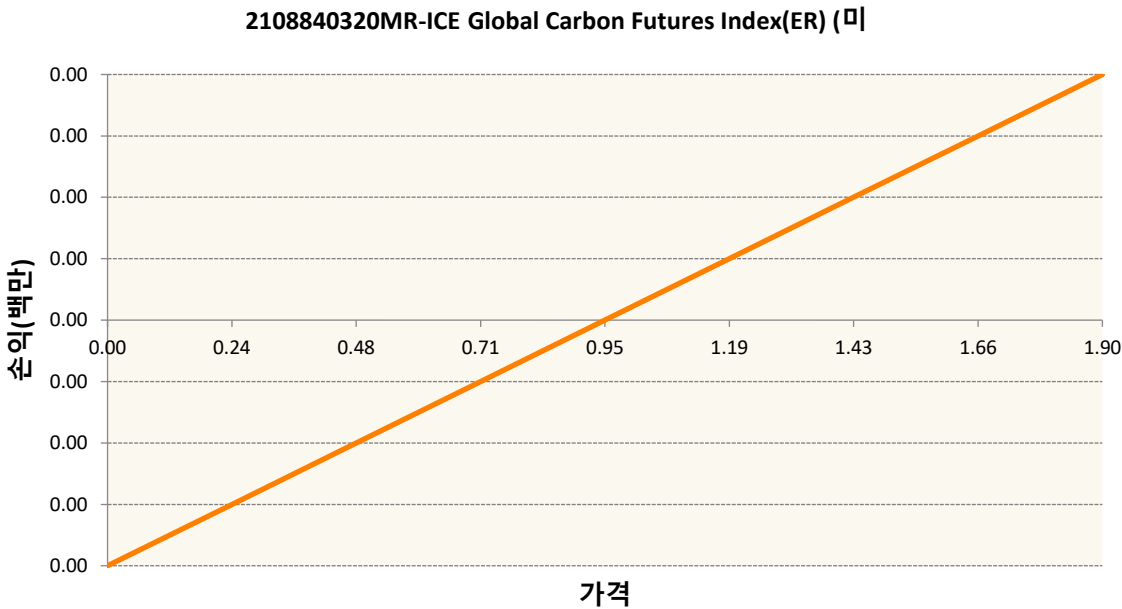
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,347	0	9,347	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	562
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	188

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

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

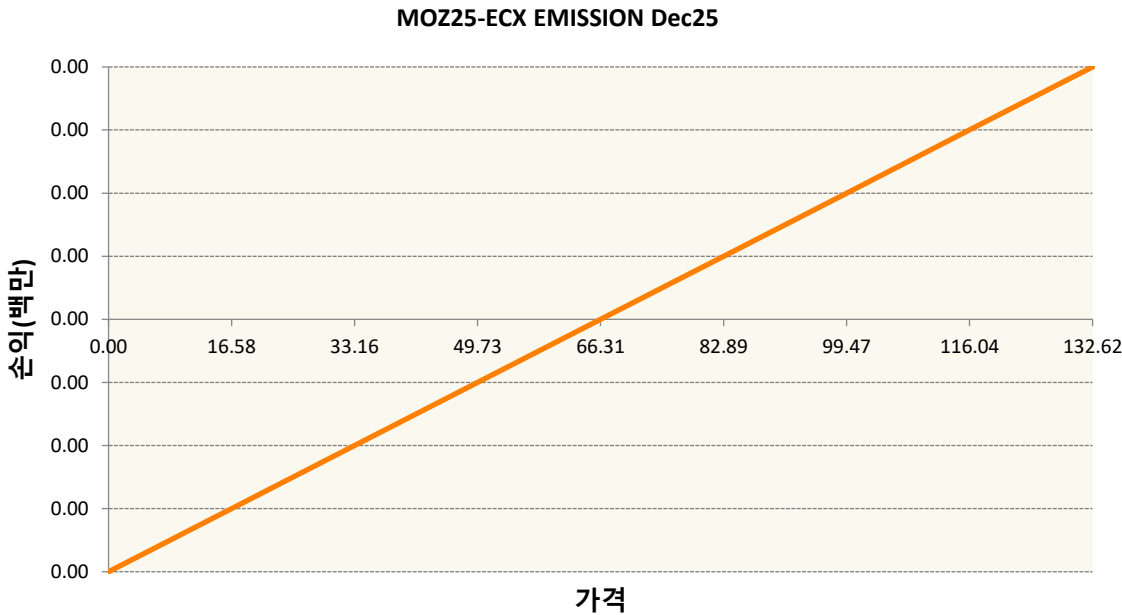
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,958	0	5,958	
누계	통화	선도	0	1,193	-1,193	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	479

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

(단위:백만원)

903

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	20

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

(단위:백만원)

117

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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)	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)

125

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

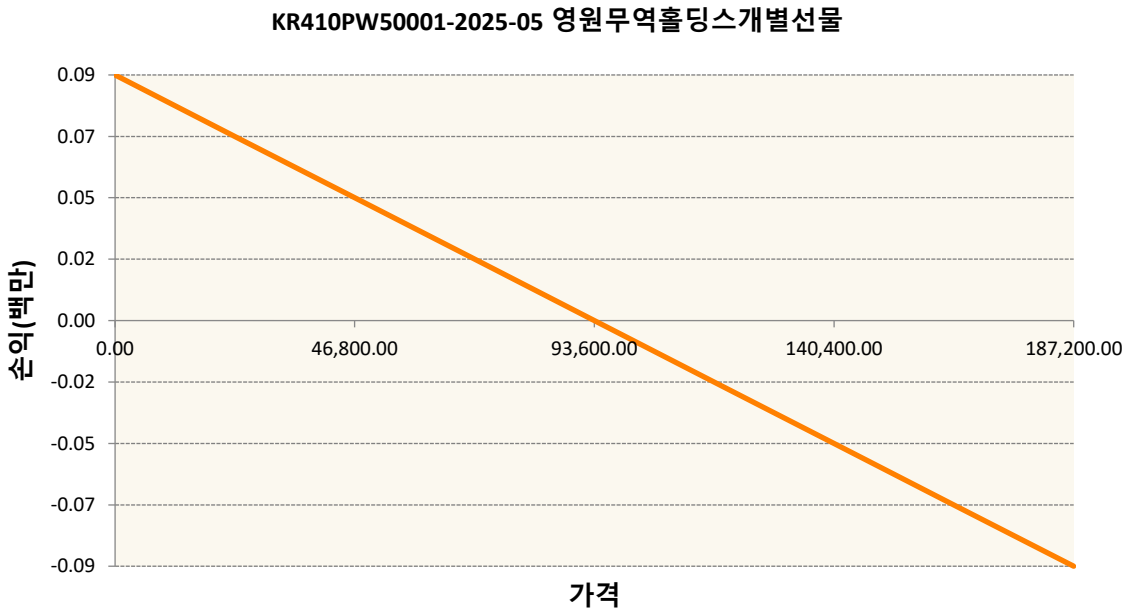
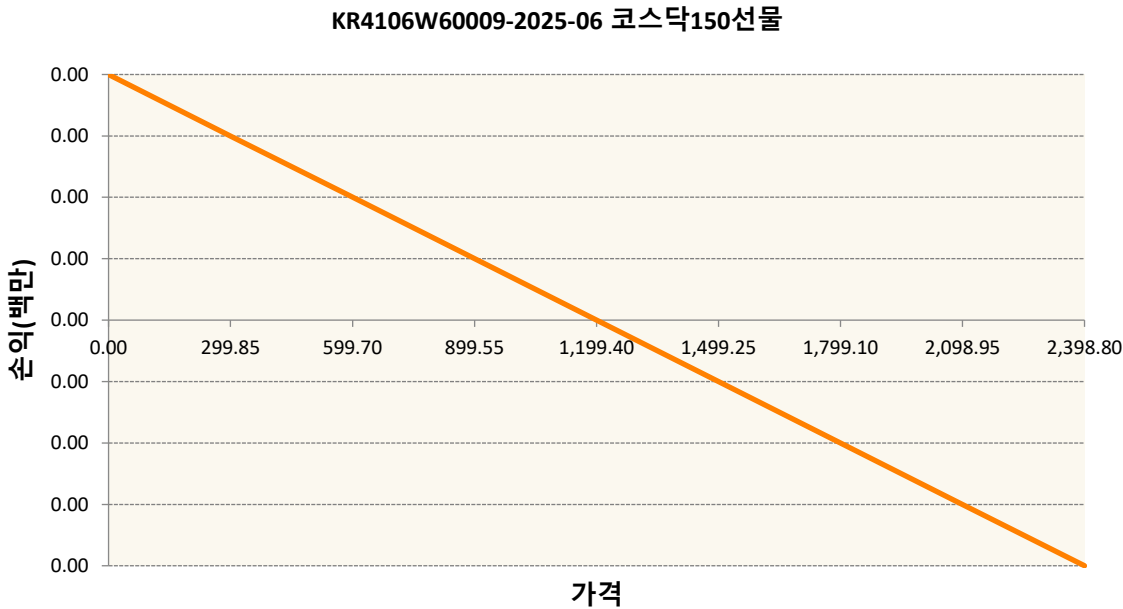
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

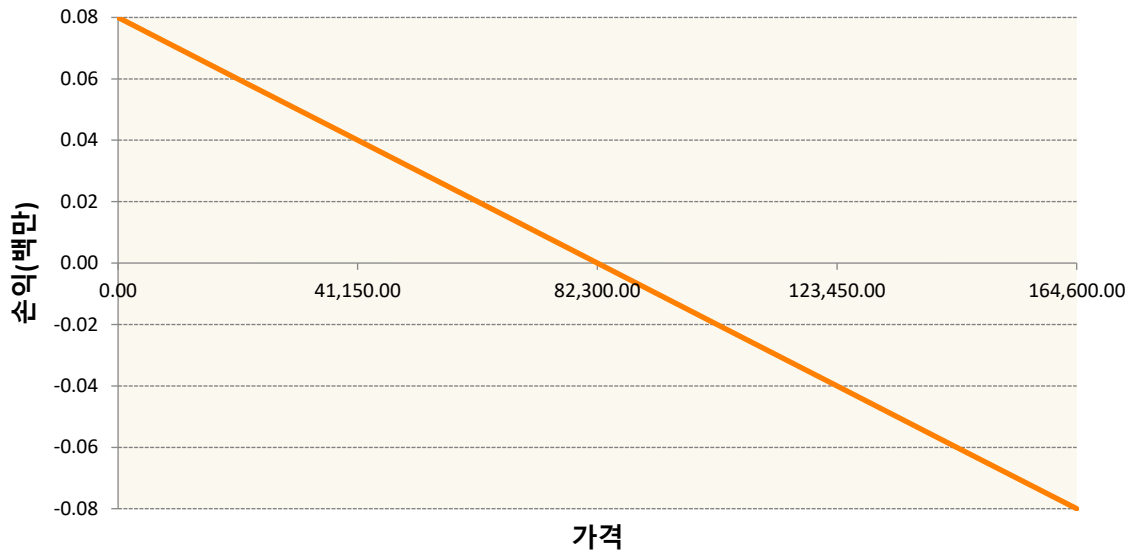
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	72	-72	장내

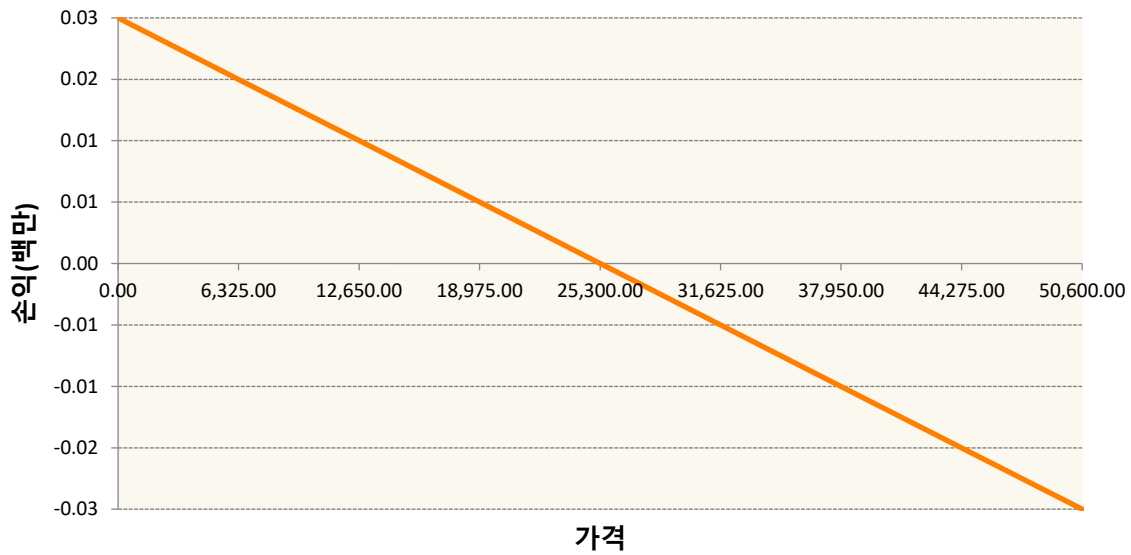
2. 만기시점의 손익구조



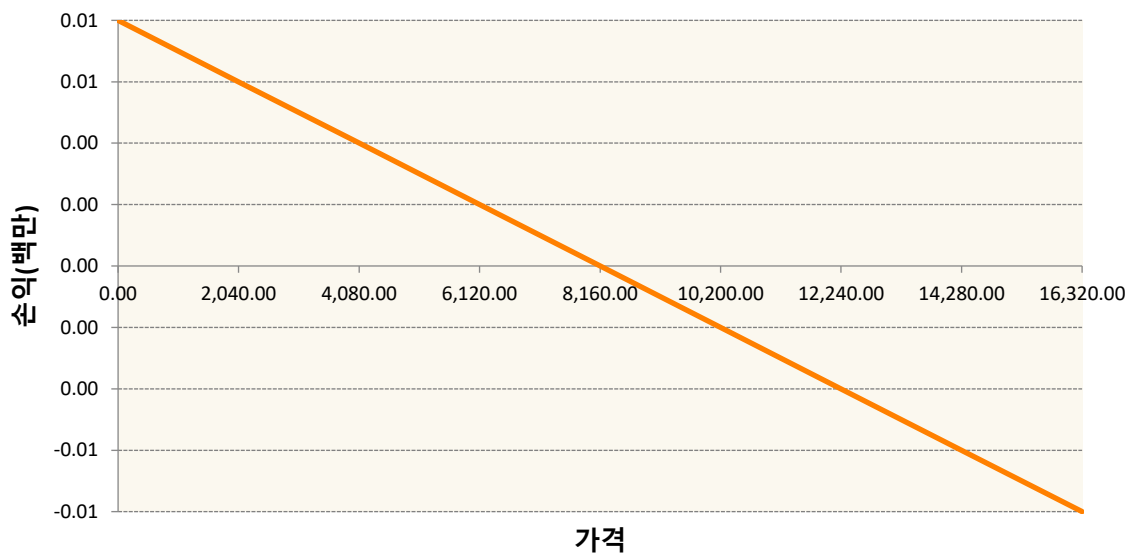
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



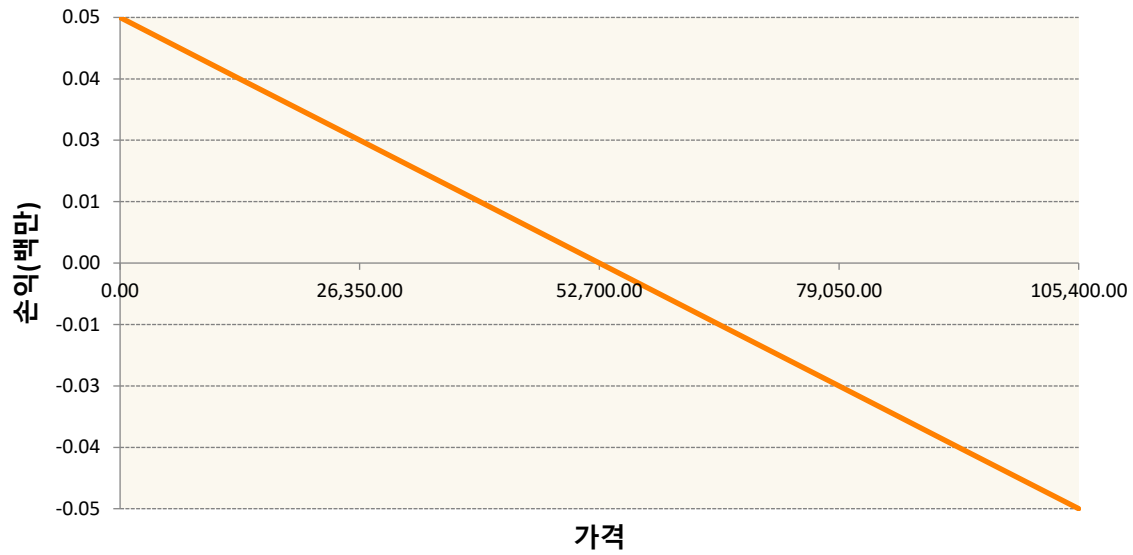
KR4115W50001-2025-05 한국전력개별선물



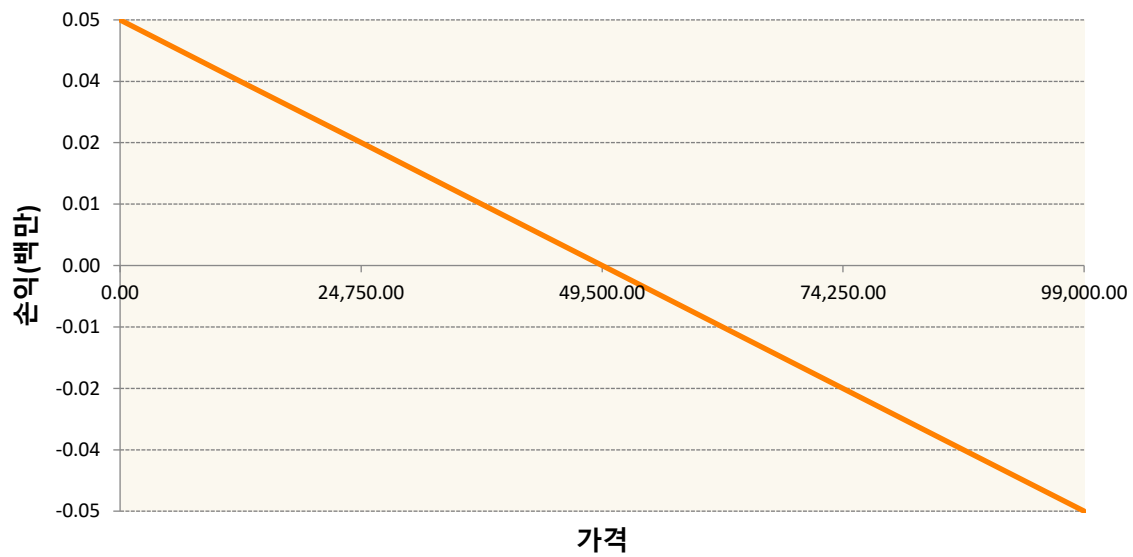
KR4149W50000-2025-05 HD현대인프라코어개별선물



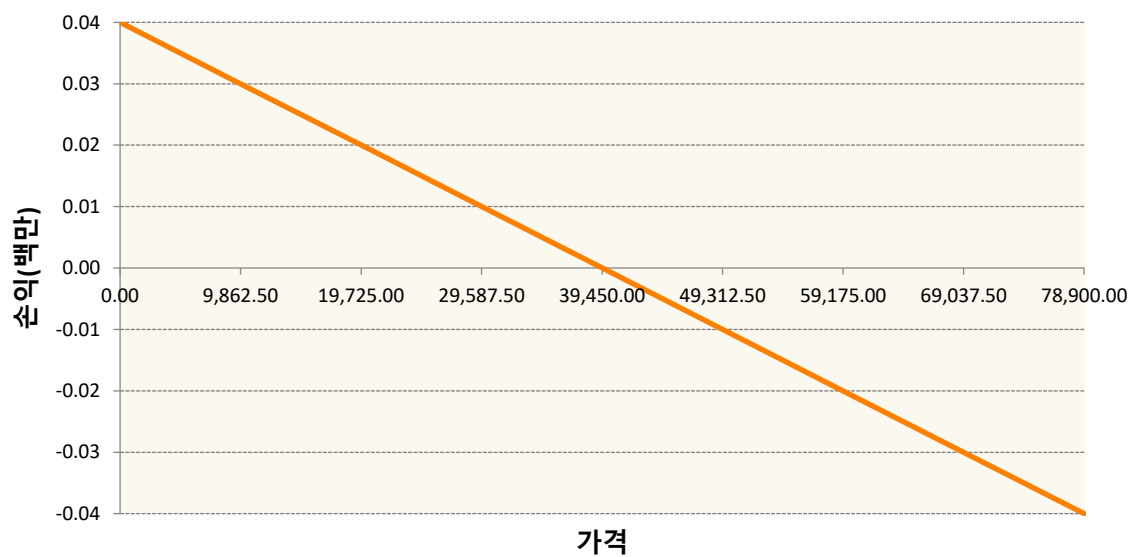
KR41B2W50007-2025-05 S-Oil개별선물



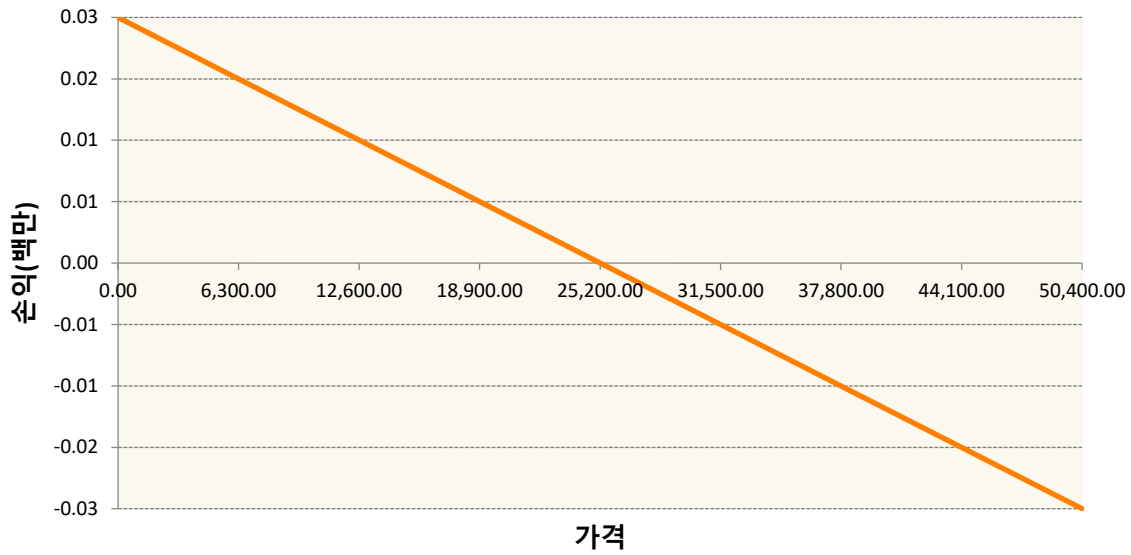
KR41B7W50006-2025-05 포스코인터내셔널개별선물



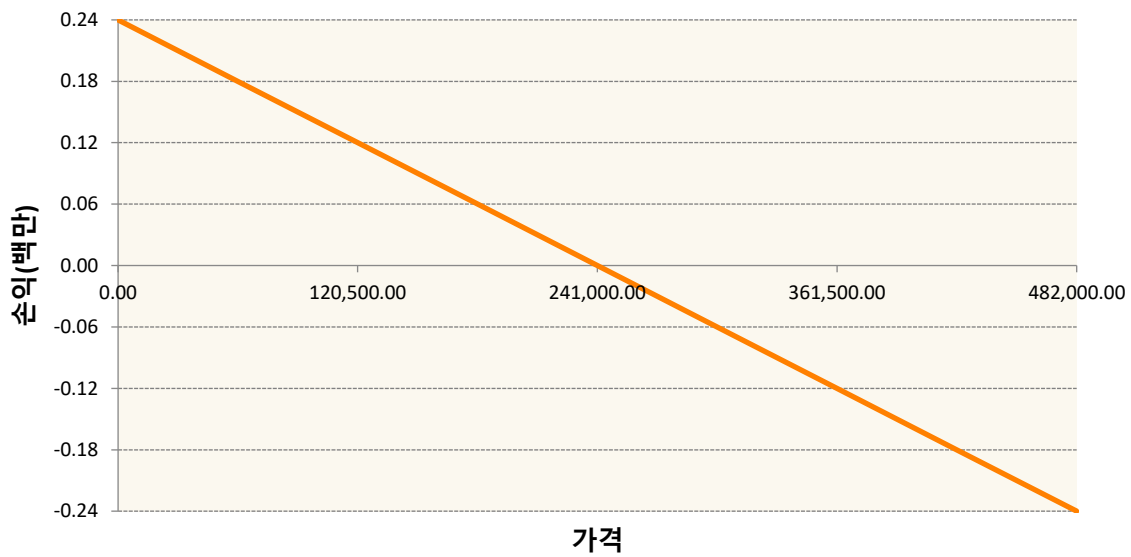
KR41BNW50002-2025-05 현대건설개별선물



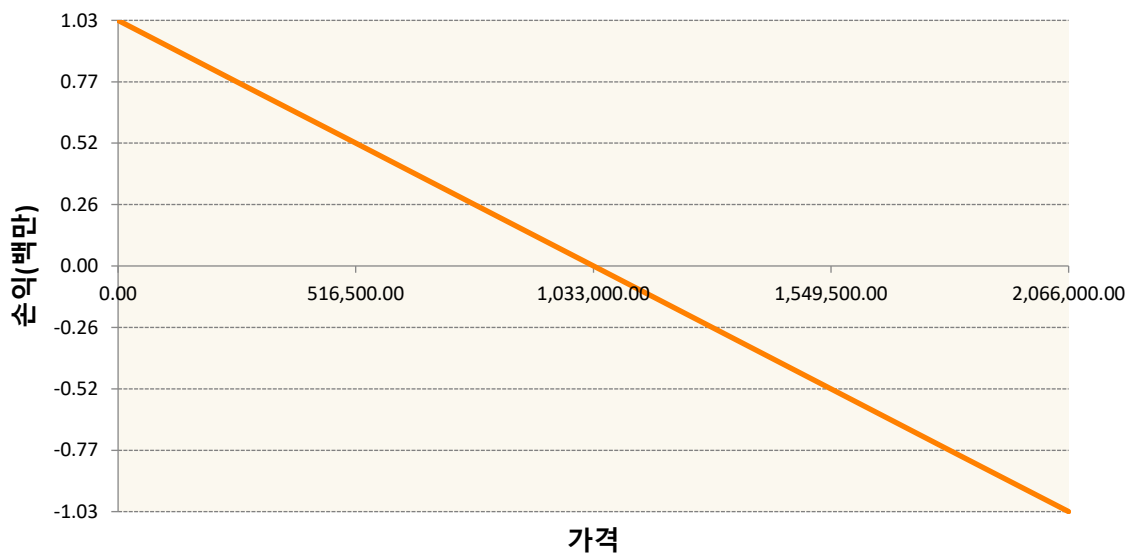
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



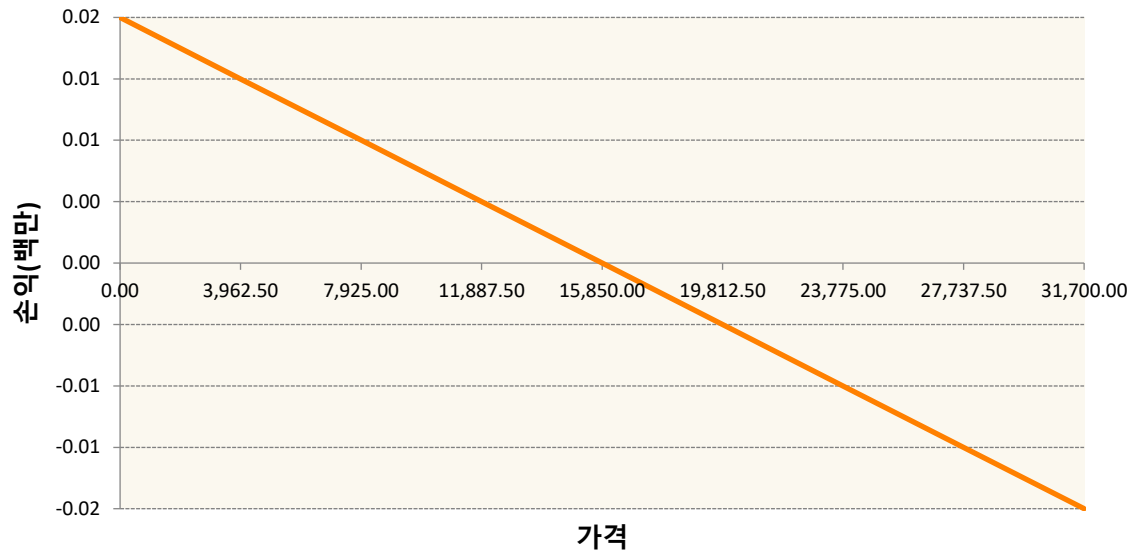
KR41CXW50009-2025-05 한미약품개별선물



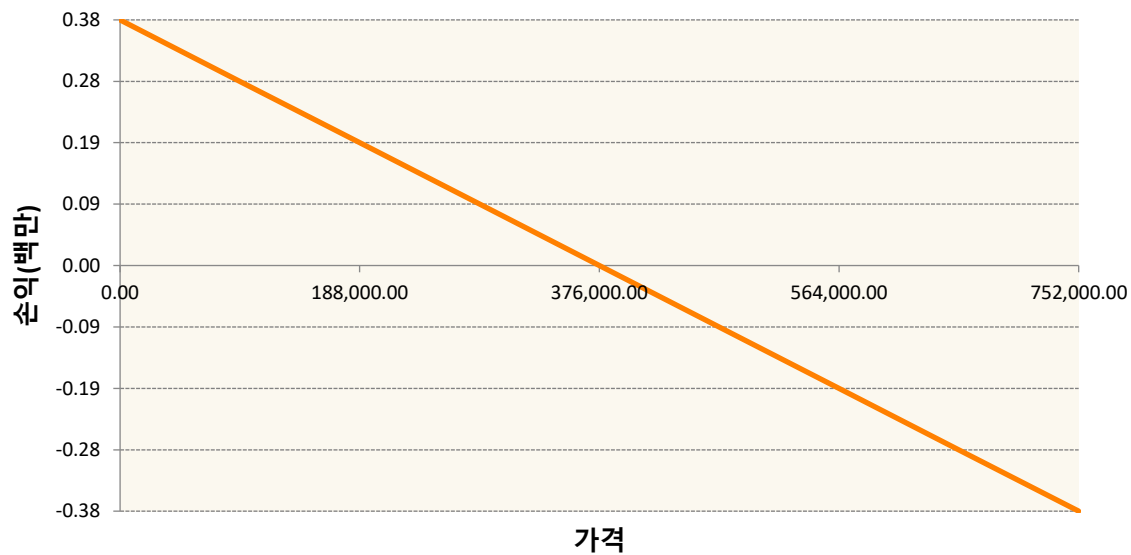
KR41ESW50005-2025-05 삼성바이오로직스개별선물



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
KR4149W50(2025-05 HD현대인프라코어개별선물	0.39
KR41B2W50(2025-05 S-Oil개별선물	1
KR41B7W50(2025-05 포스코인터내셔널개별선물	0.4
KR41BNW50 2025-05 현대건설개별선물	0.32
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물	0.38
KR41CXW50(2025-05 한미약품개별선물	0.39
KR41ESW50(2025-05 삼성바이오로직스개별선물	1
KR41HCW50 2025-05 코스모화학개별선물	0.3

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

(단위:백만원)

13

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

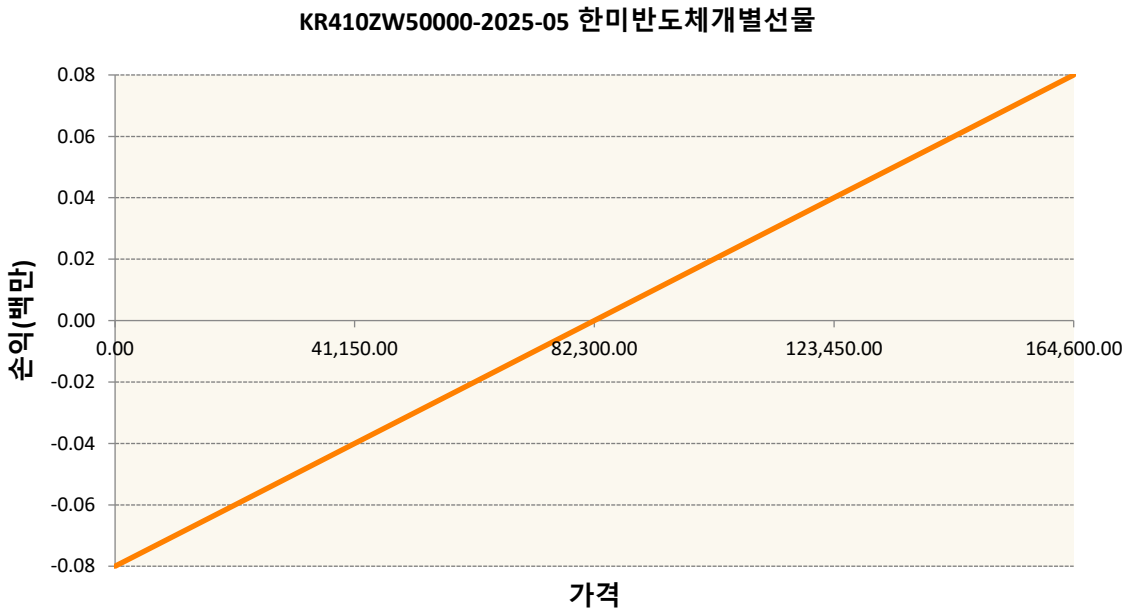
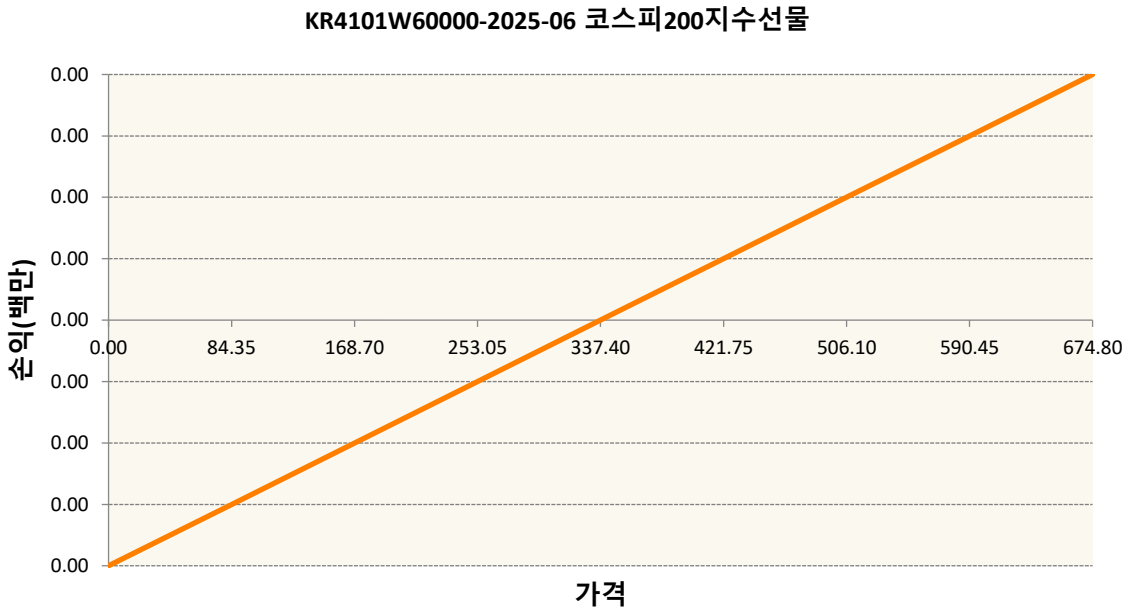
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

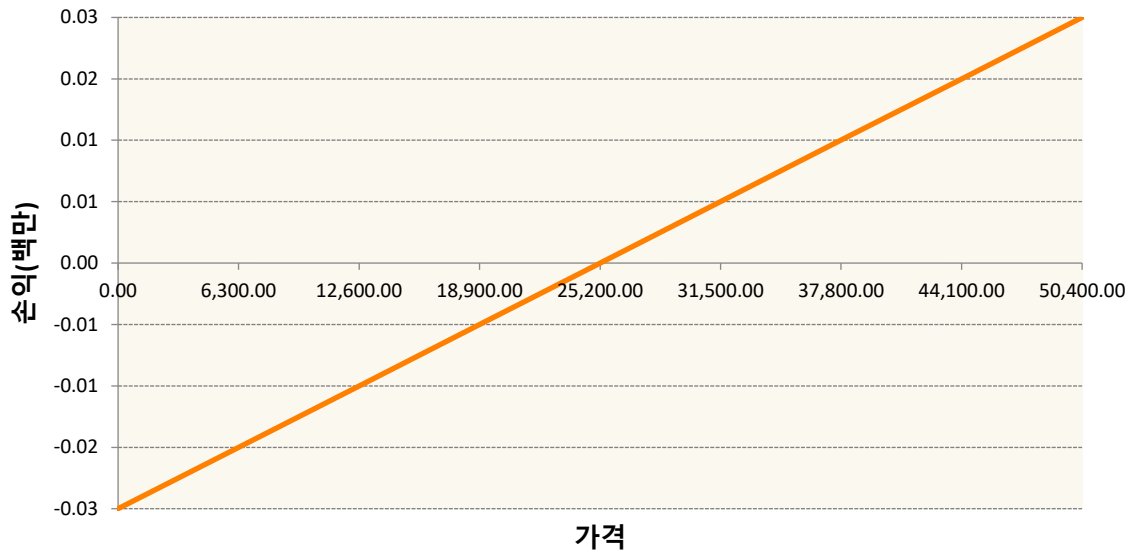
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,699	0	9,699	장내

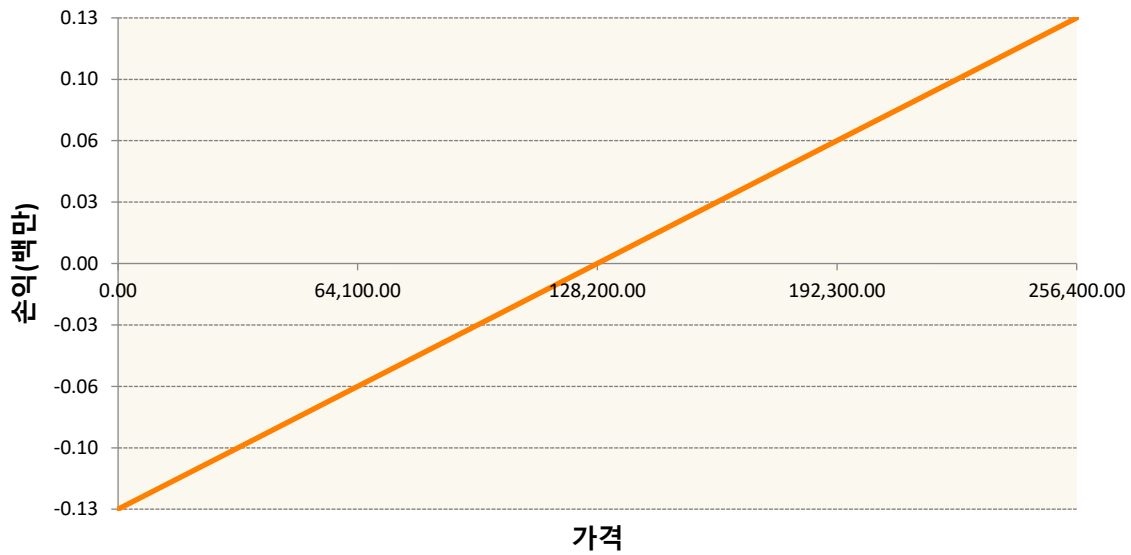
2. 만기시점의 손익구조



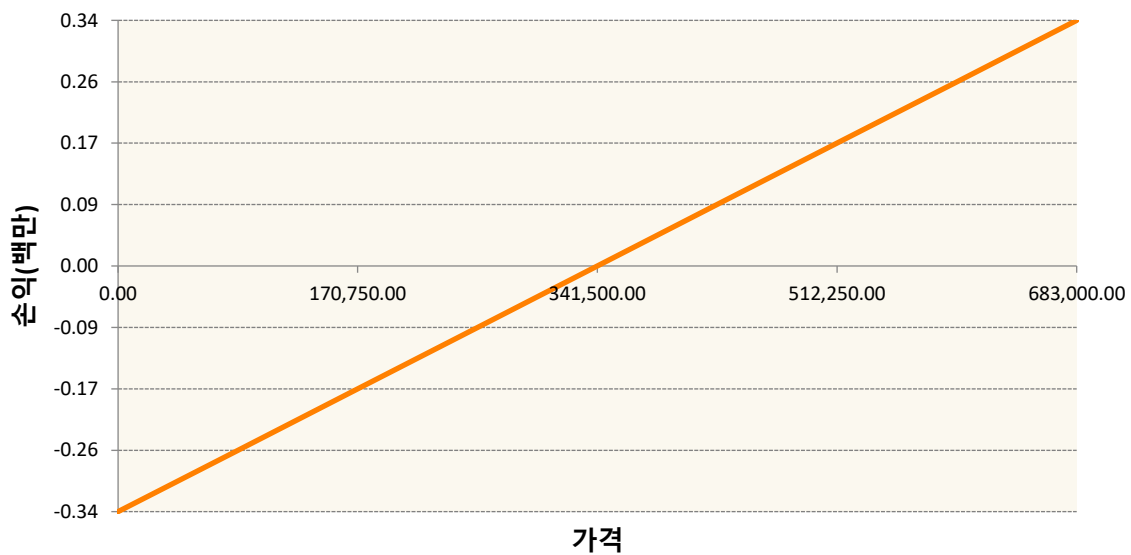
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		594
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물		35
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물		13
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물		16
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물		119

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,275

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

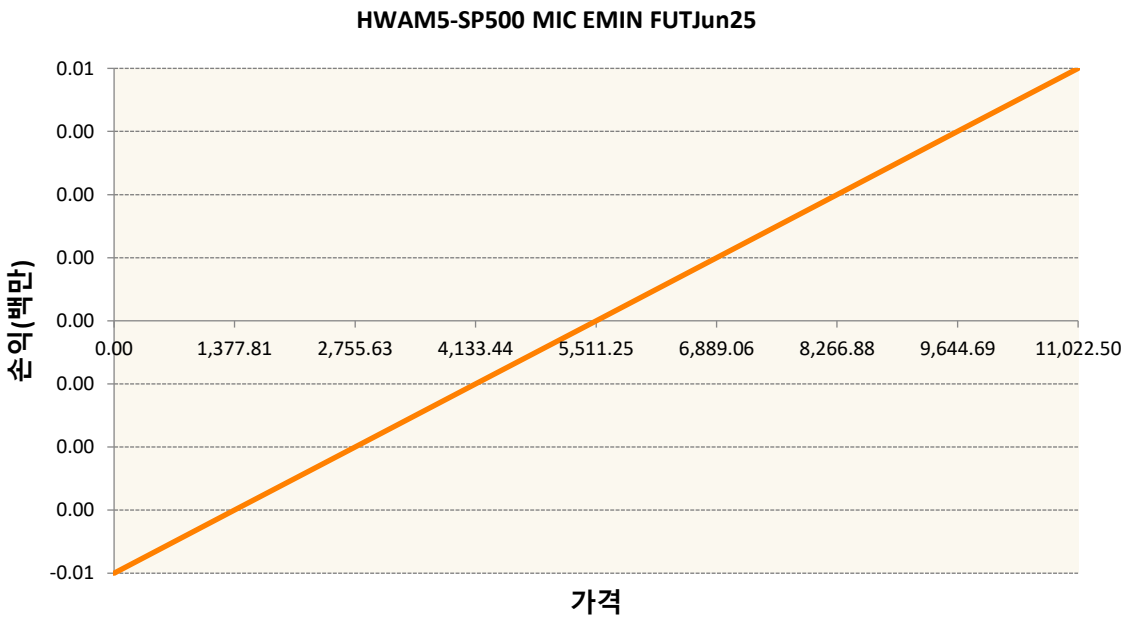
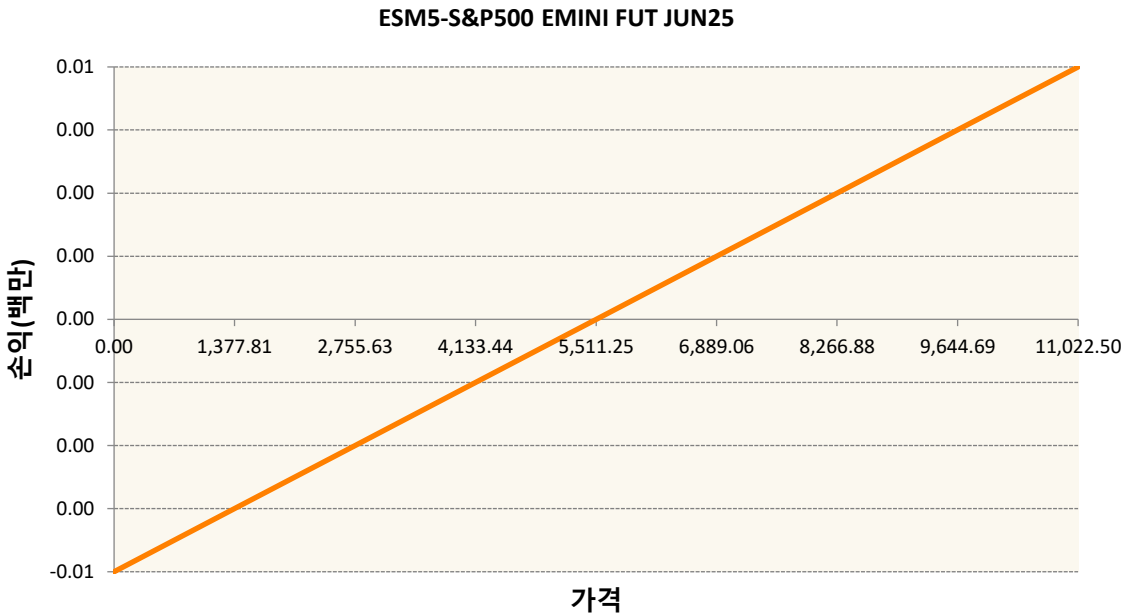
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,166	0	1,166	장내
누계	지수	선물	26,553	0	26,553	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,124
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	93

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,937

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

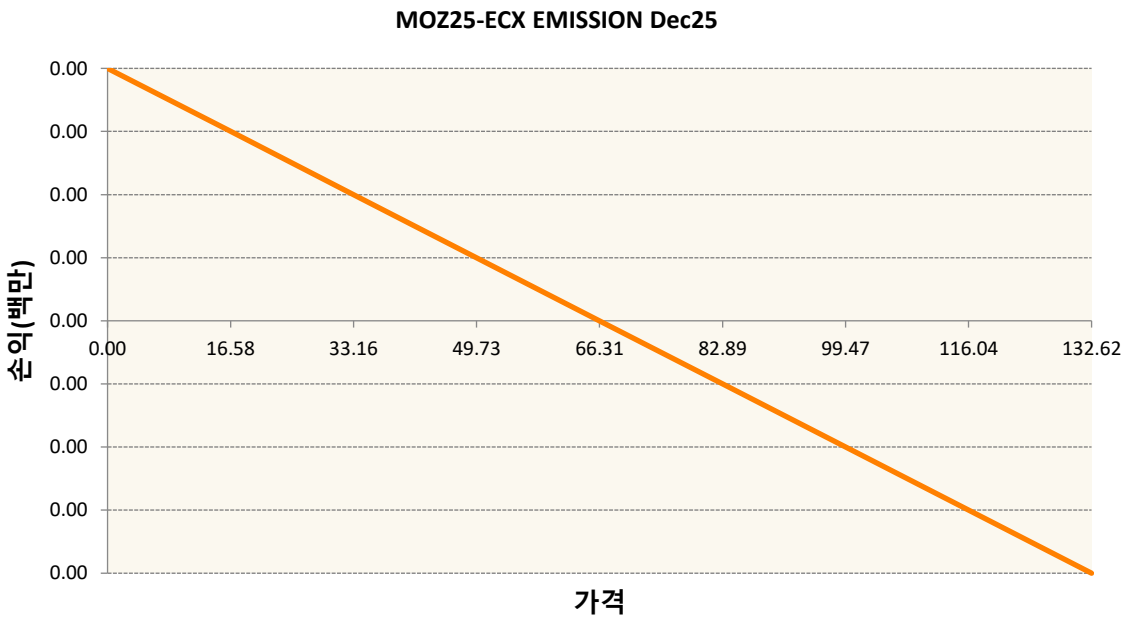
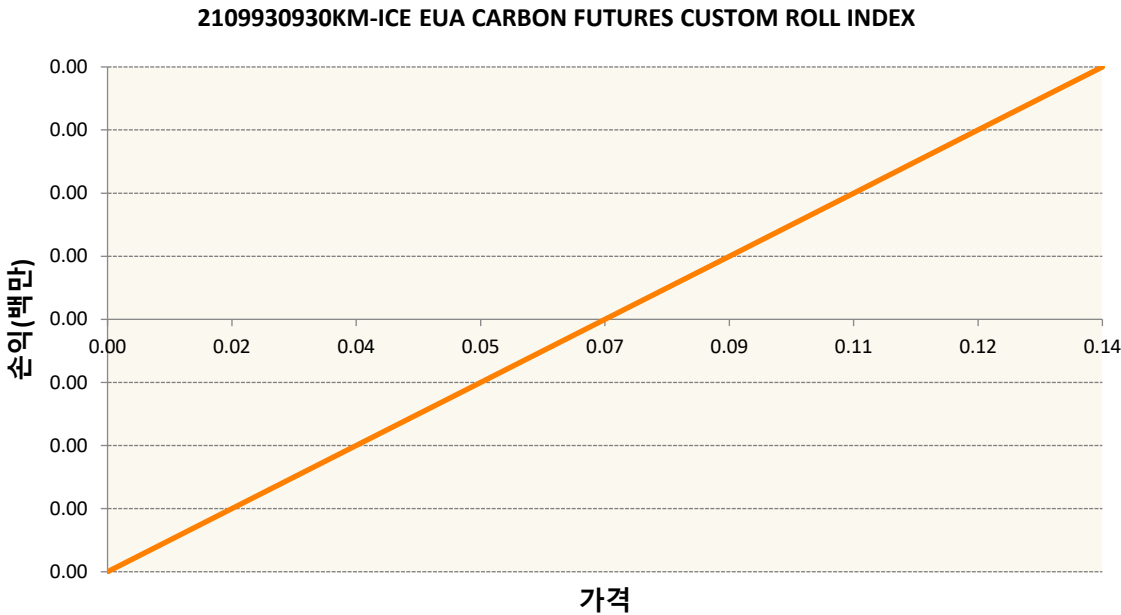
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	6,186	-6,159	
누계	통화	선도	0	1,175	-1,175	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		495

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	930

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

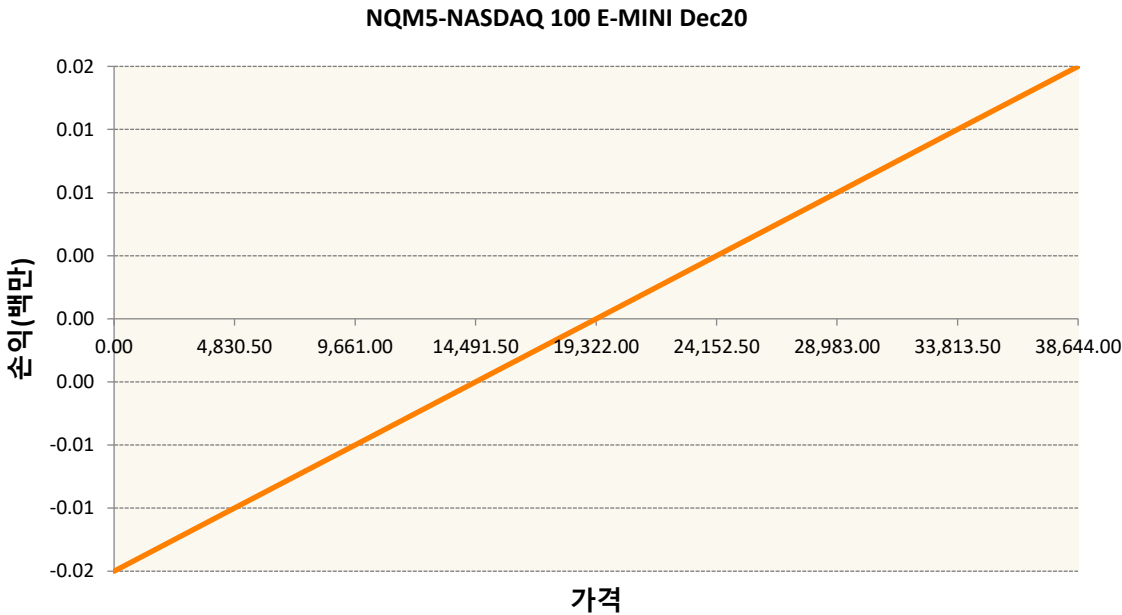
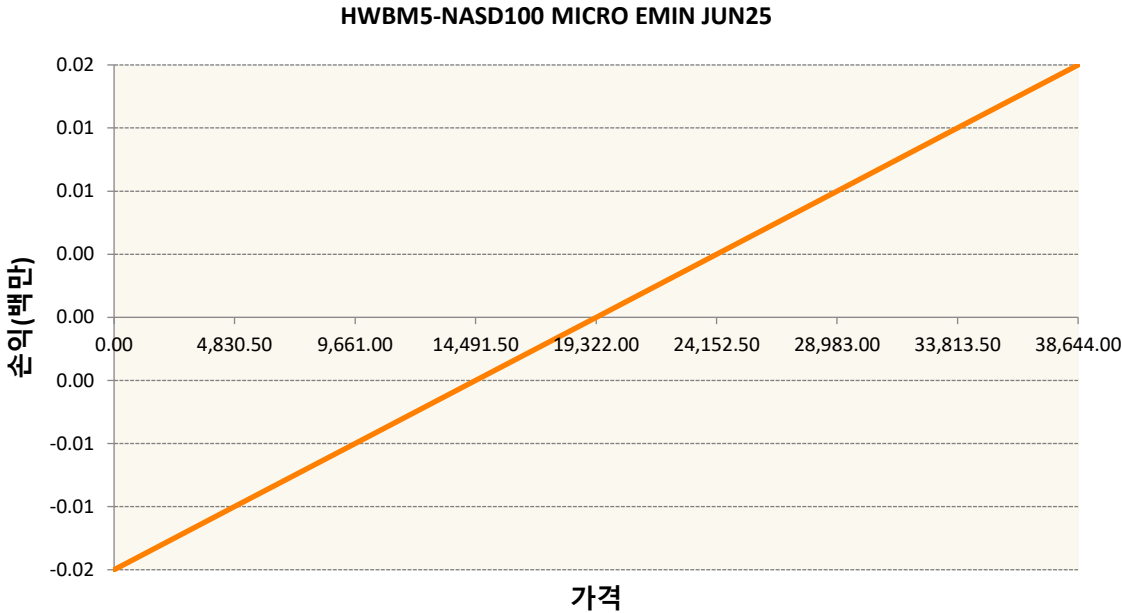
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	12,954	0	12,954	
누계	유가증권	선물	509	0	509	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25	41
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,036

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,217

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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	3,077
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,227
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,996
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,459

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

(단위:백만원)

10,108

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

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	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-04-28
기준일	2025-04-25

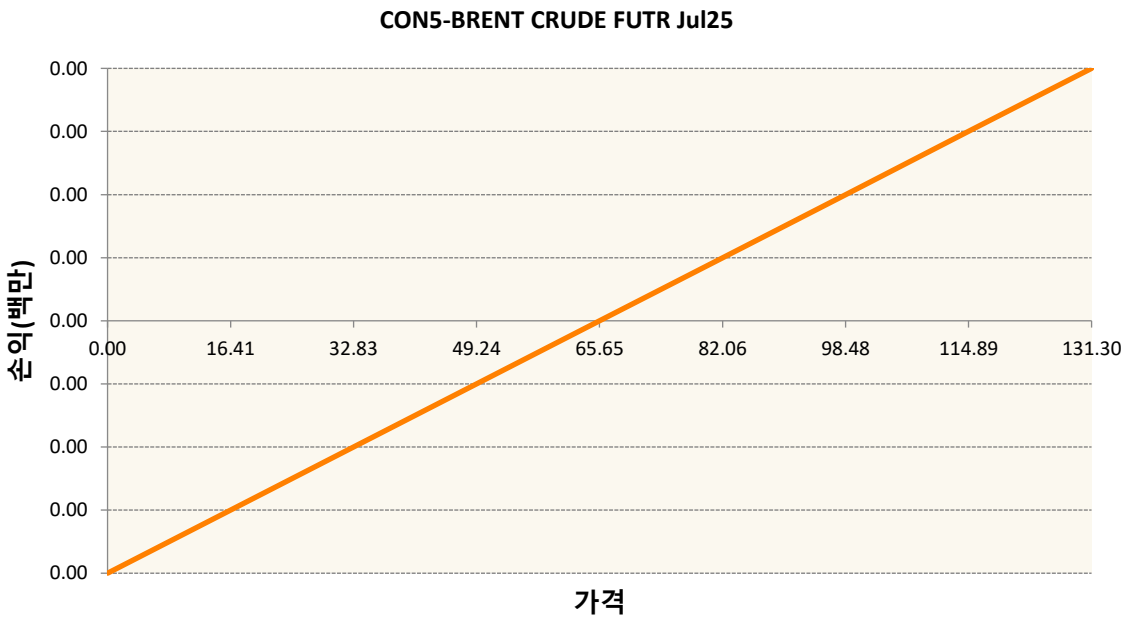
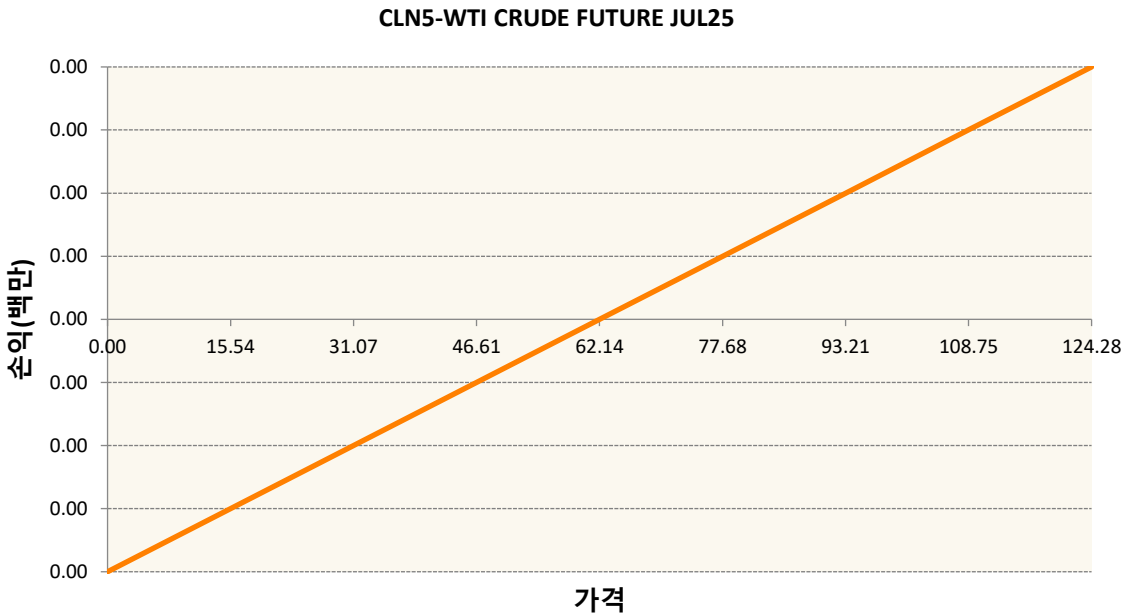
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

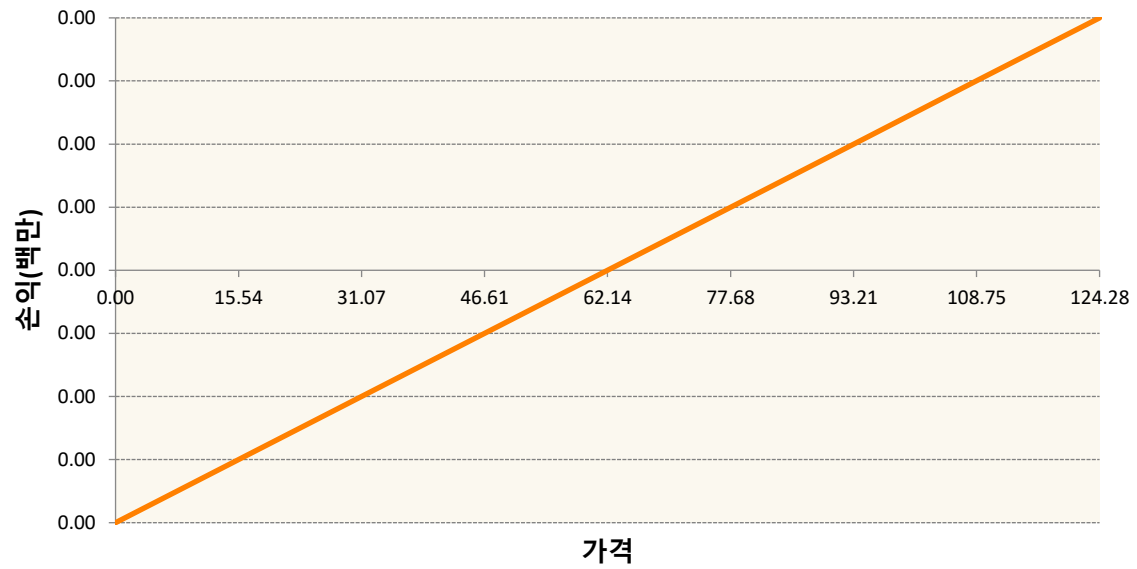
(단위:백만원)

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

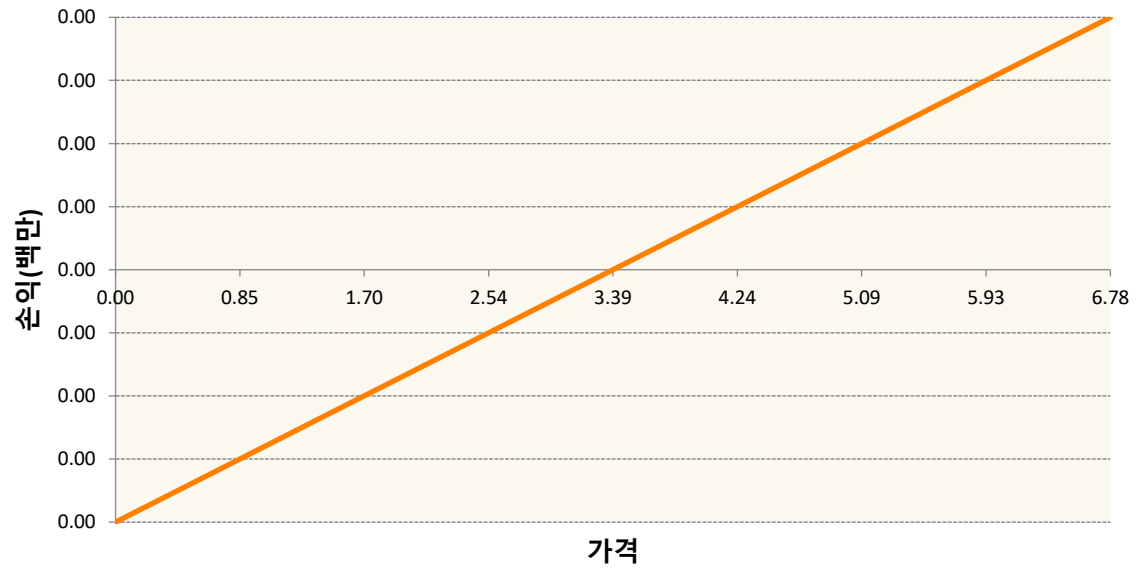
2. 만기시점의 손익구조



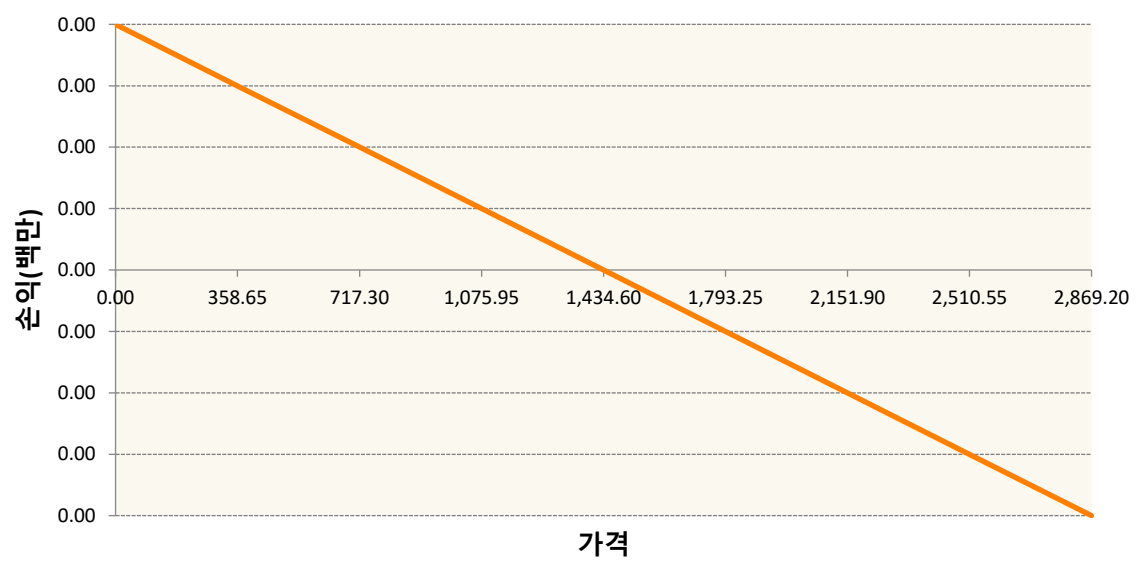
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



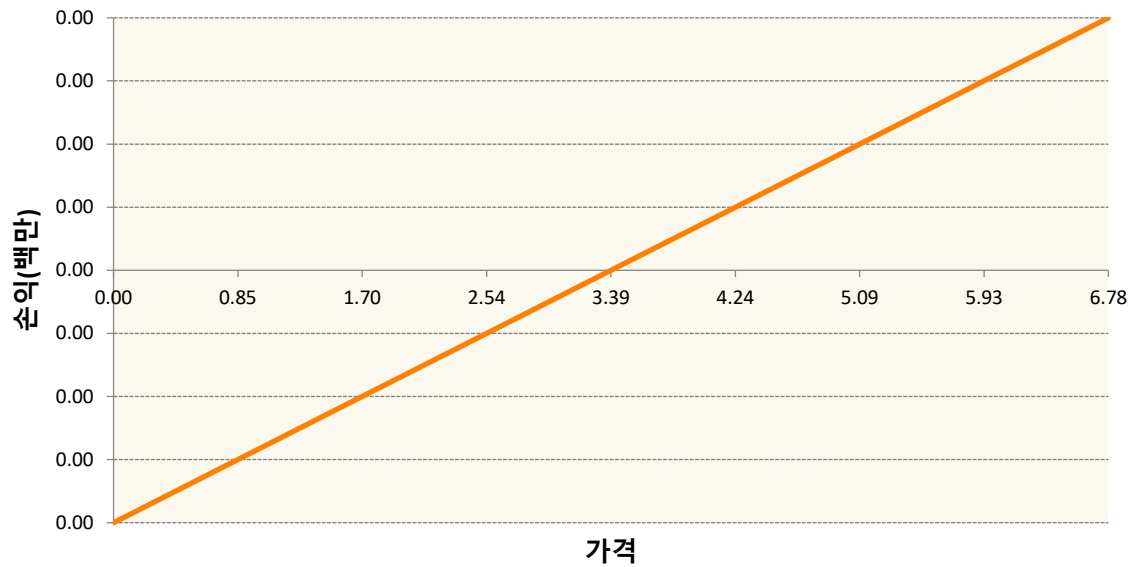
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



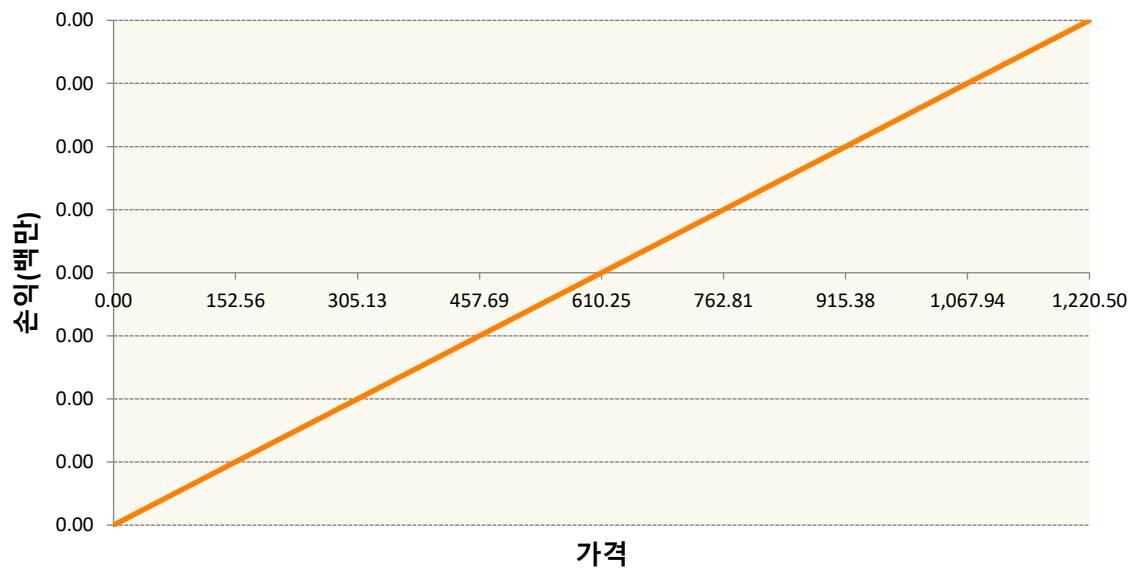
KR4175W50005-2025-05 달러선물



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