

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

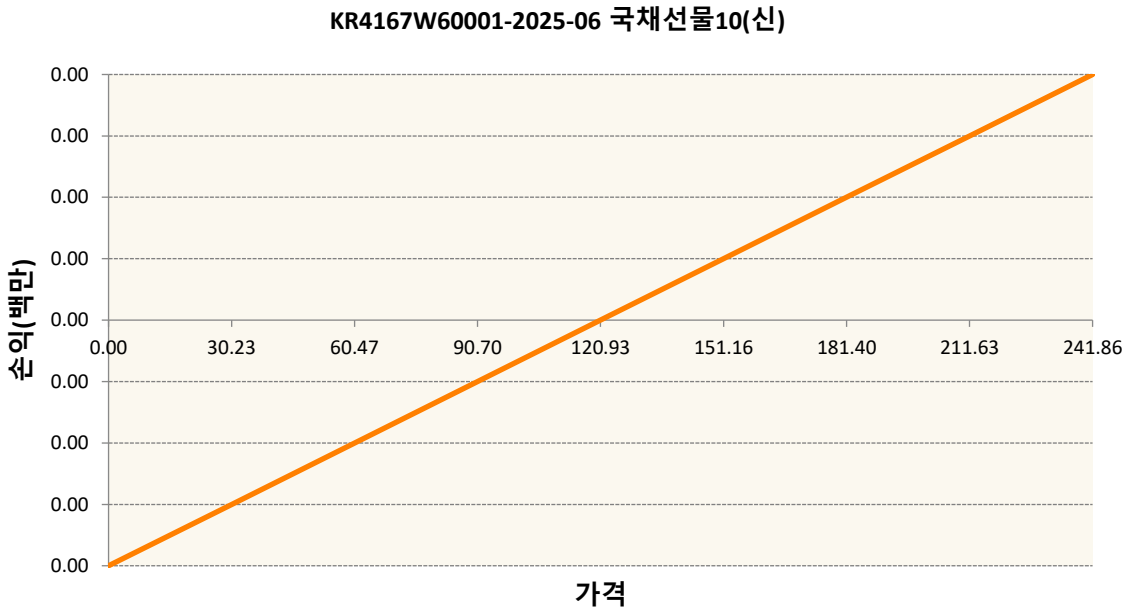
베스트장기채(채권-파생형)

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	48,372	0	48,372	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

583

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

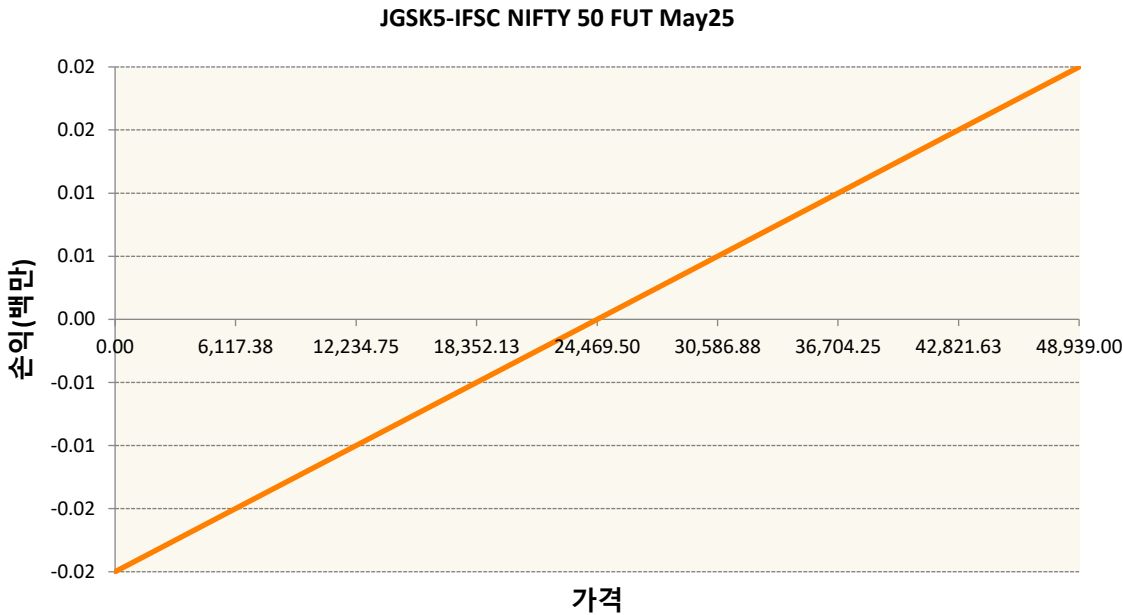
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	844	0	844	

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	2025-04-30
기준일	2025-04-29

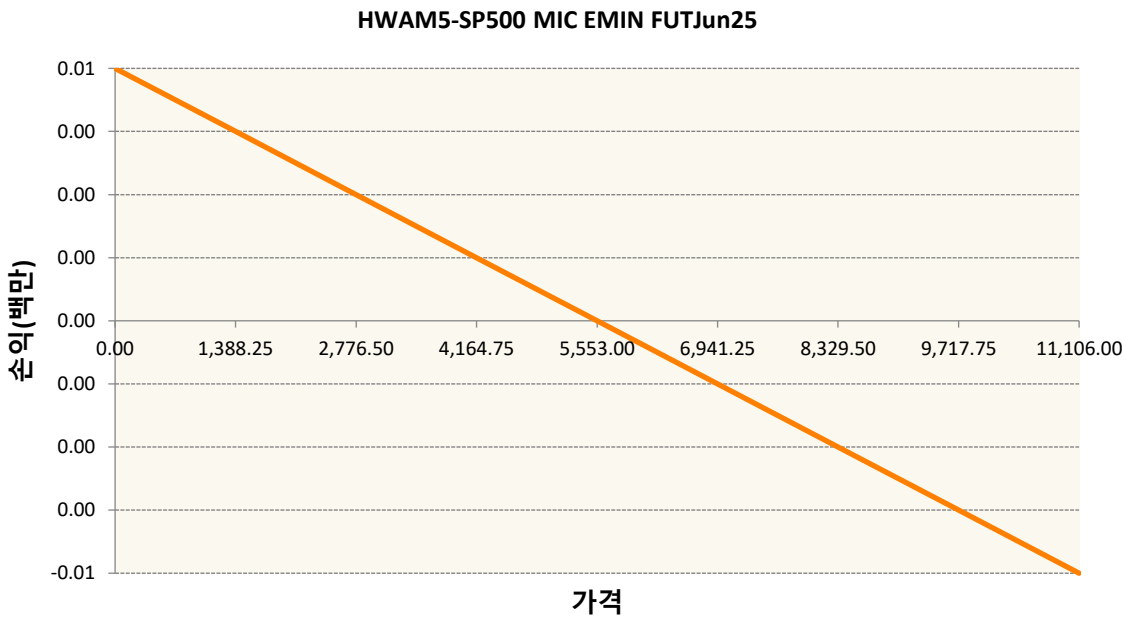
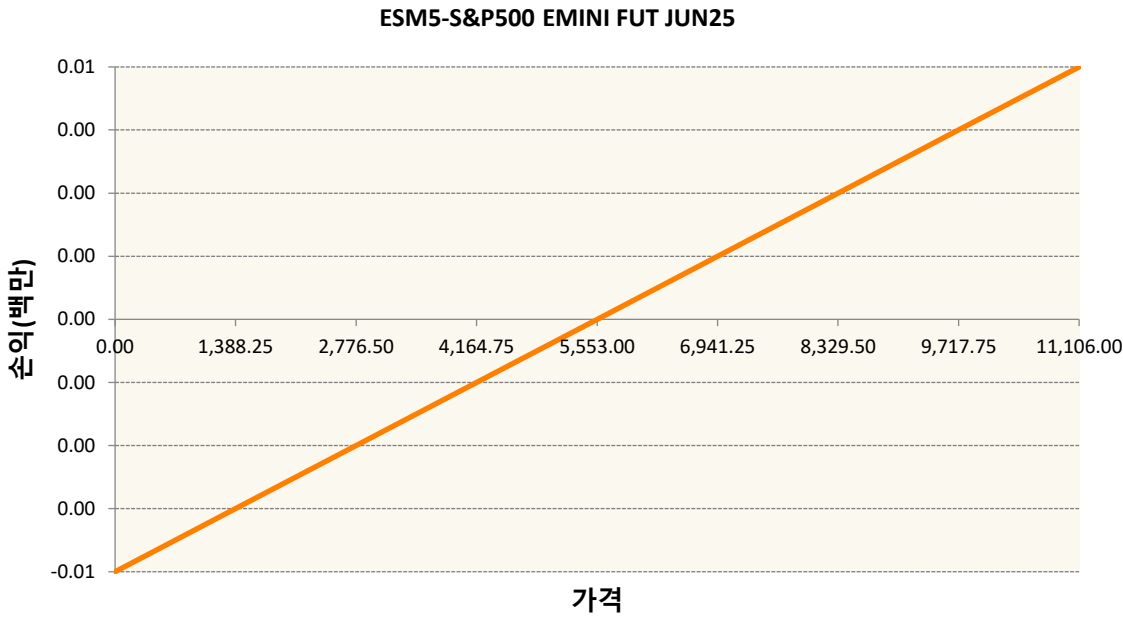
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	0	120	-120	장내
누계	지수	선물	406	0	406	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	33
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	37

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

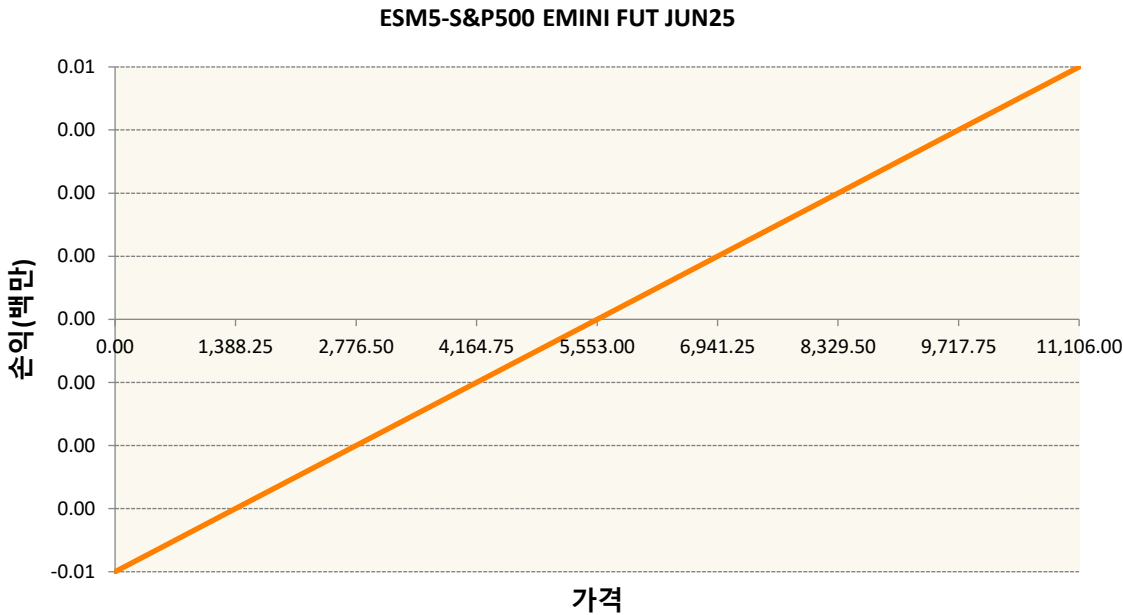
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	2,438	0	2,438	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	195
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

170

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

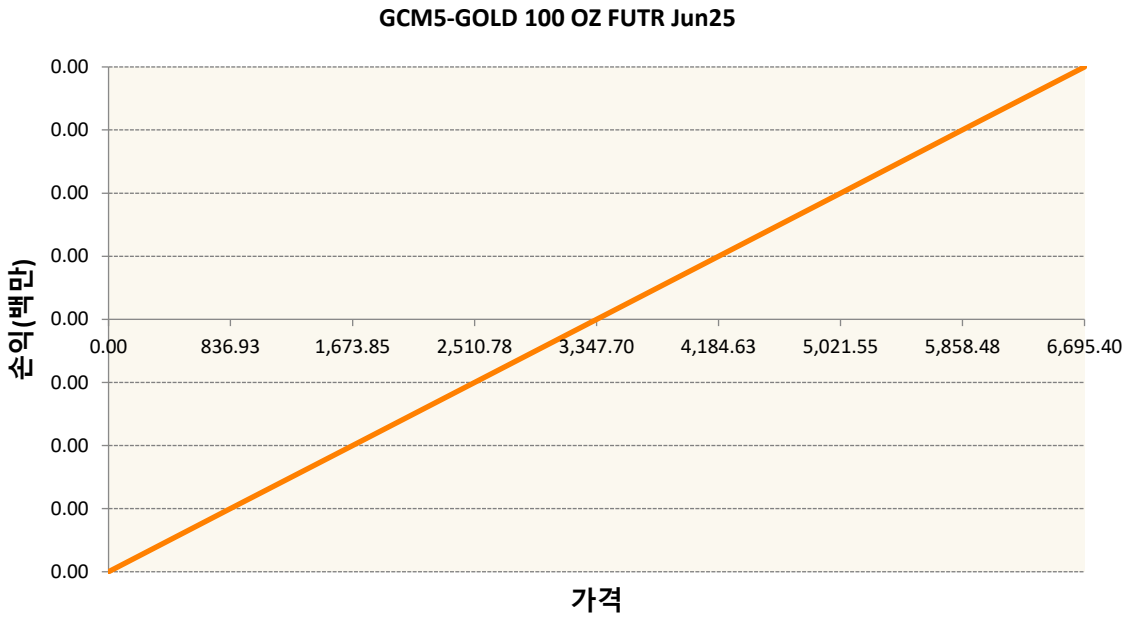
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,454	0	2,454	
누계	실물자산	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 05/02/25 C309 EQUITY	1
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	196

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

(단위:백만원)

157

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

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 05/02/25 C113 EQUITY	4
AOPLTRUSP1 PLTR US 05/02/25 P113 EQUITY	1

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

(단위:백만원)

22

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

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 05/02/25 C88.5 EQUITY

0.39

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

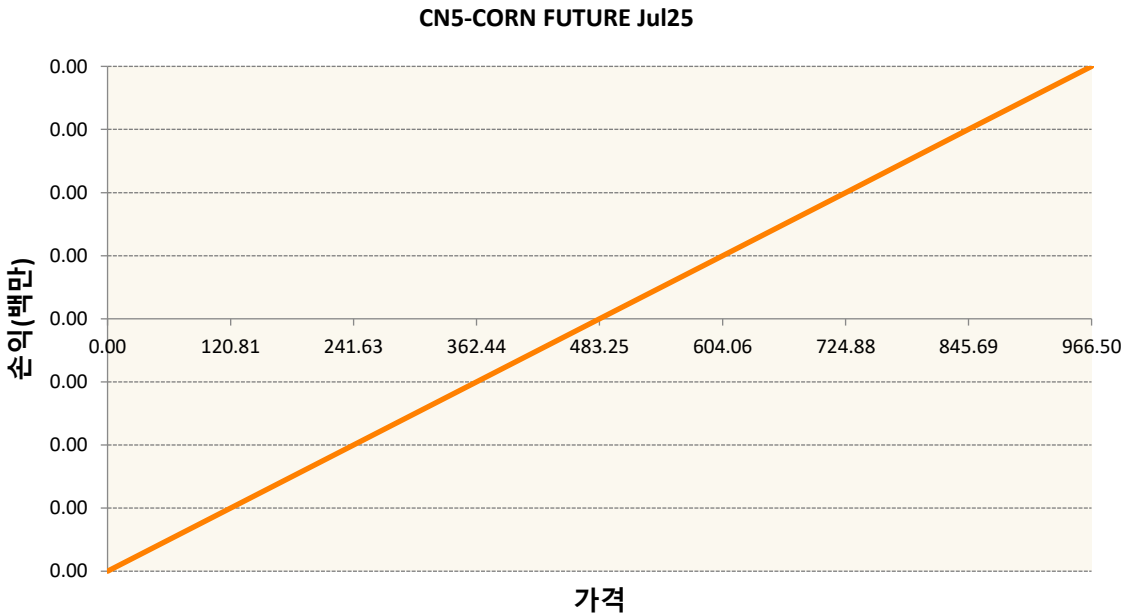
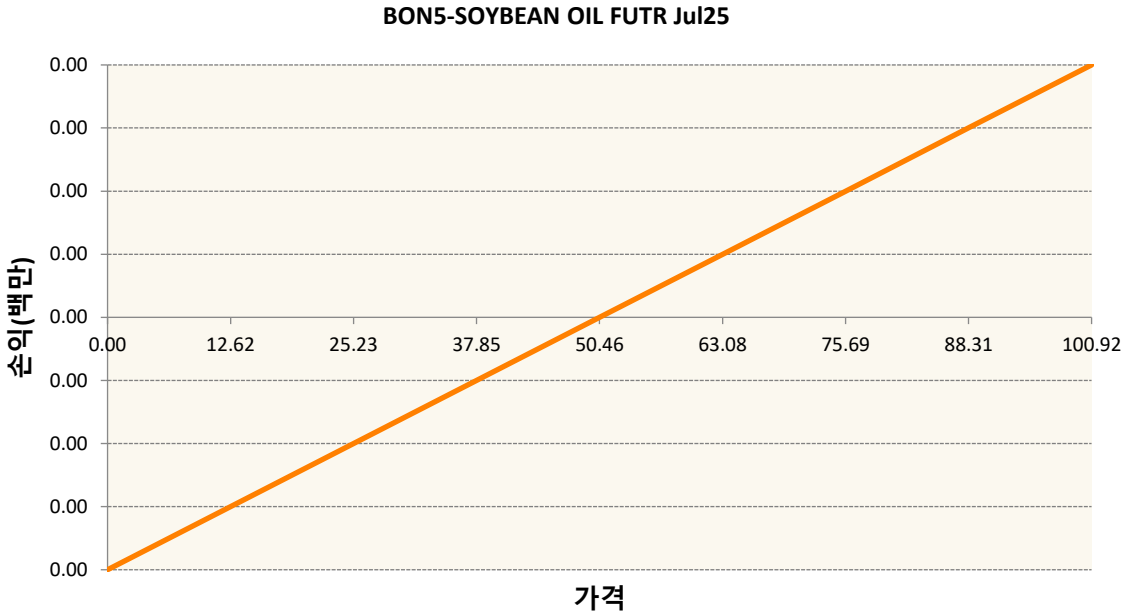
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

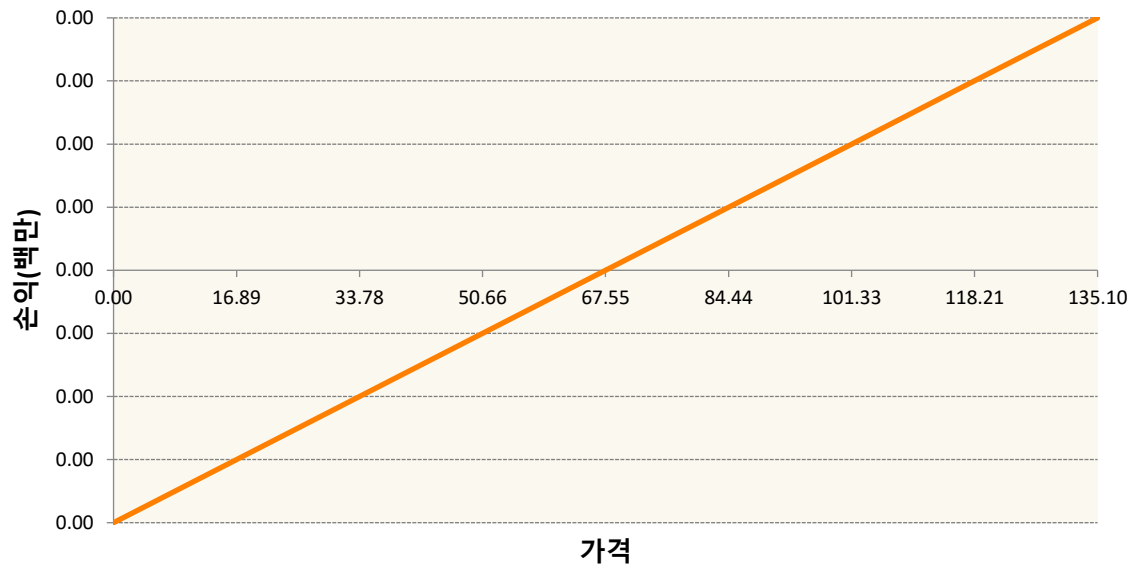
(단위:USD 백만)

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	3,851	0	3,851	
누계	통화	선물	0	330	-330	장내

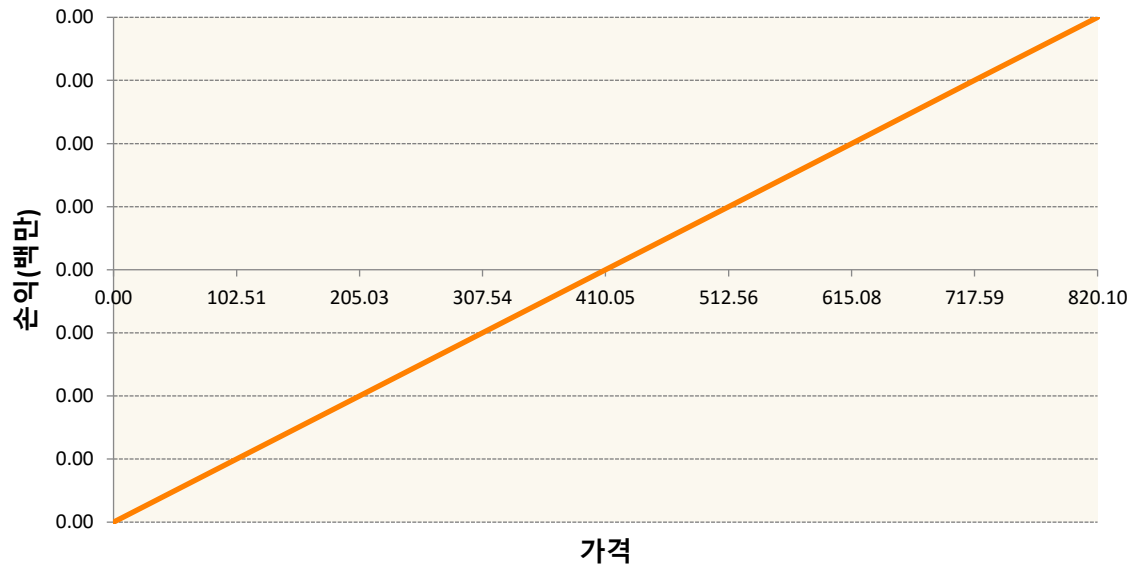
2. 만기시점의 손익구조



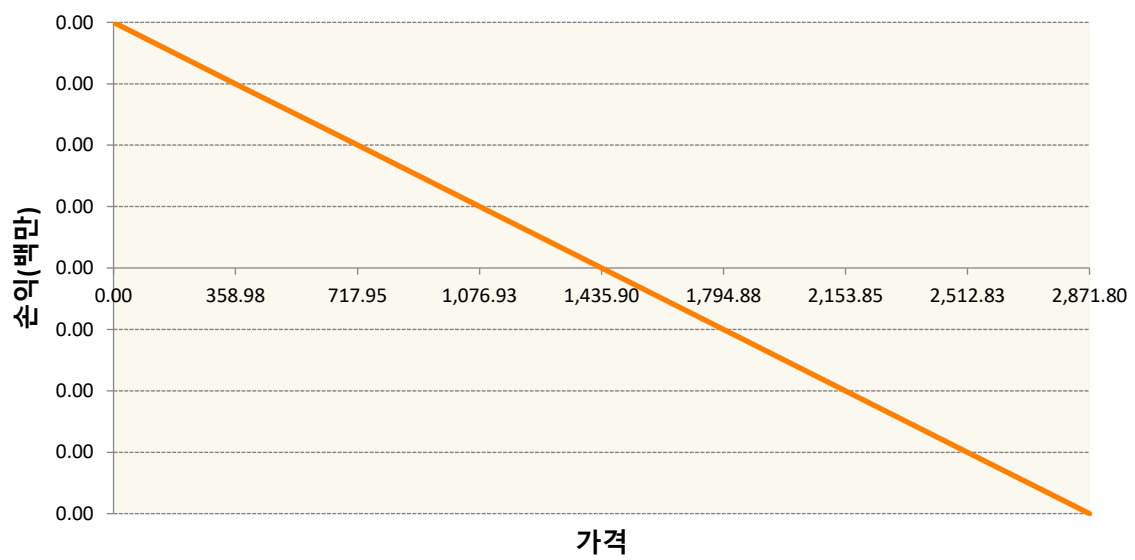
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



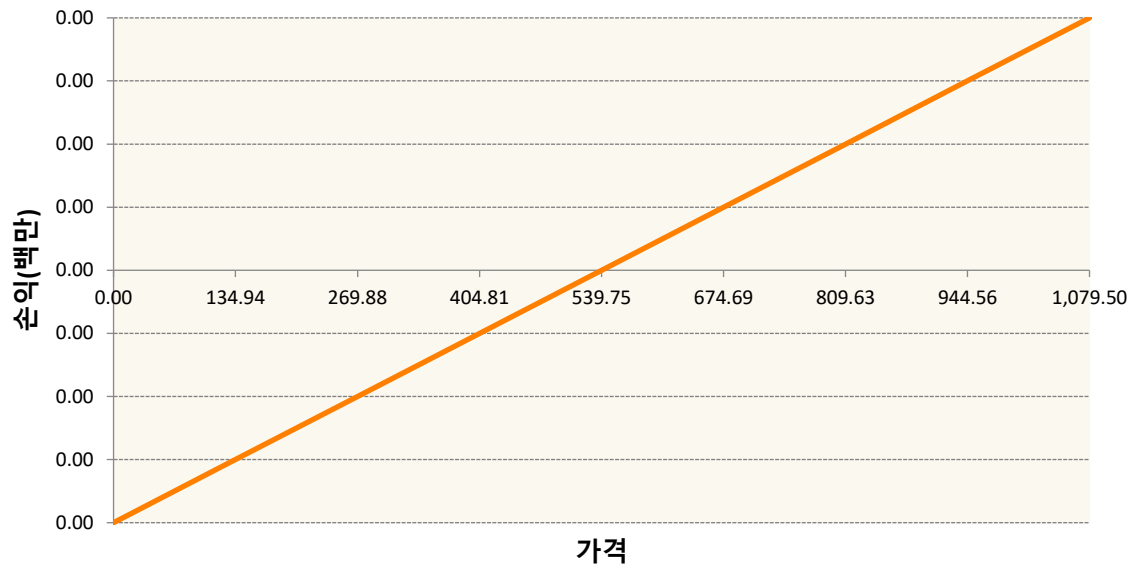
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



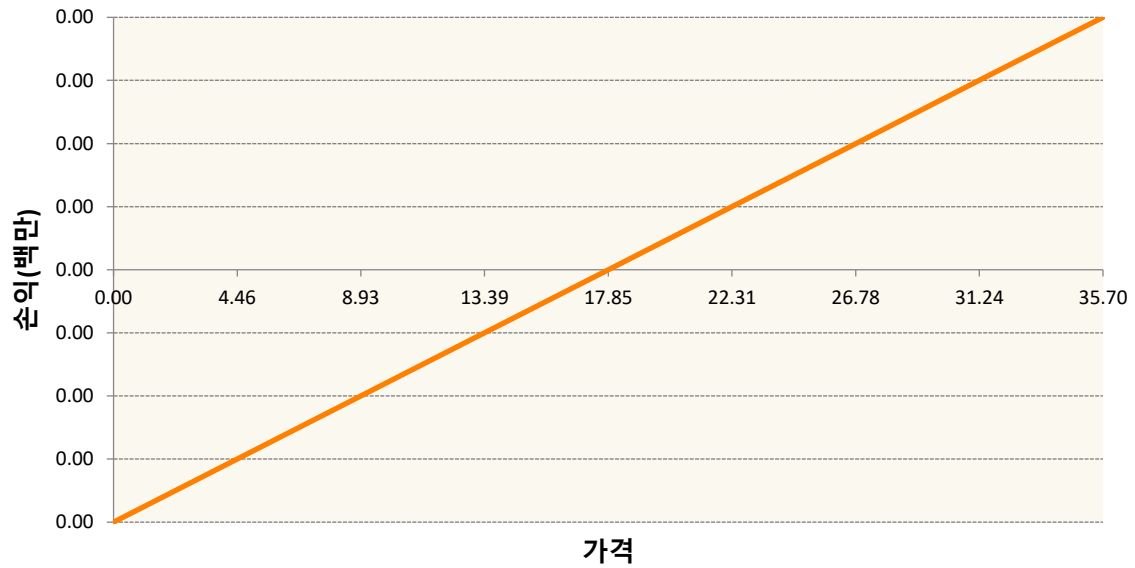
KR4175W50005-2025-05 달러선물



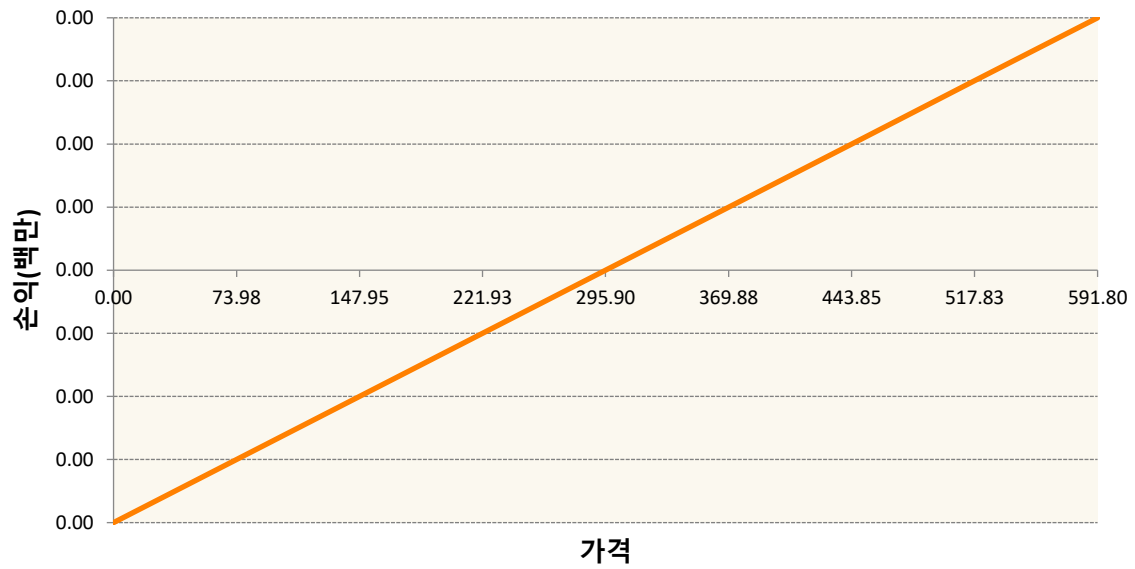
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25

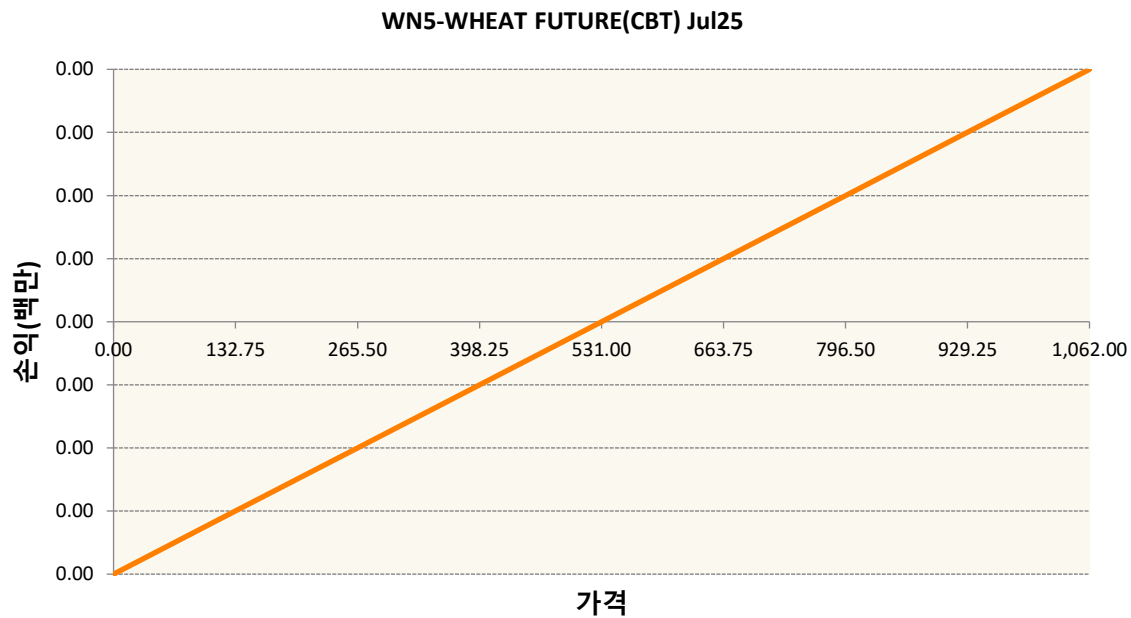
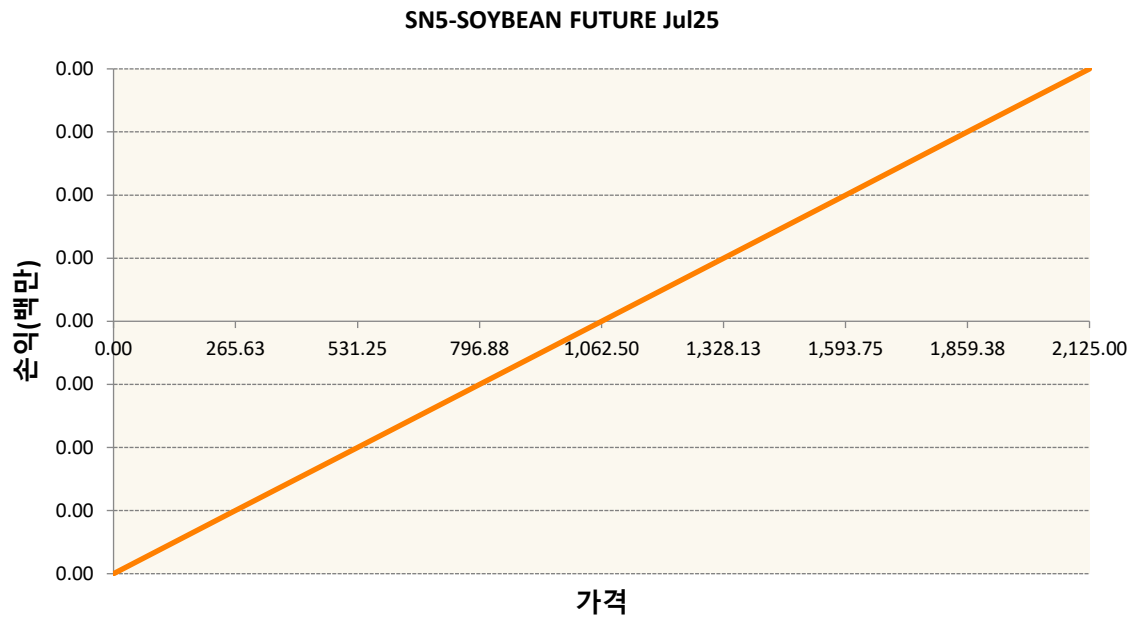


SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



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	2025-04-30
기준일	2025-04-29

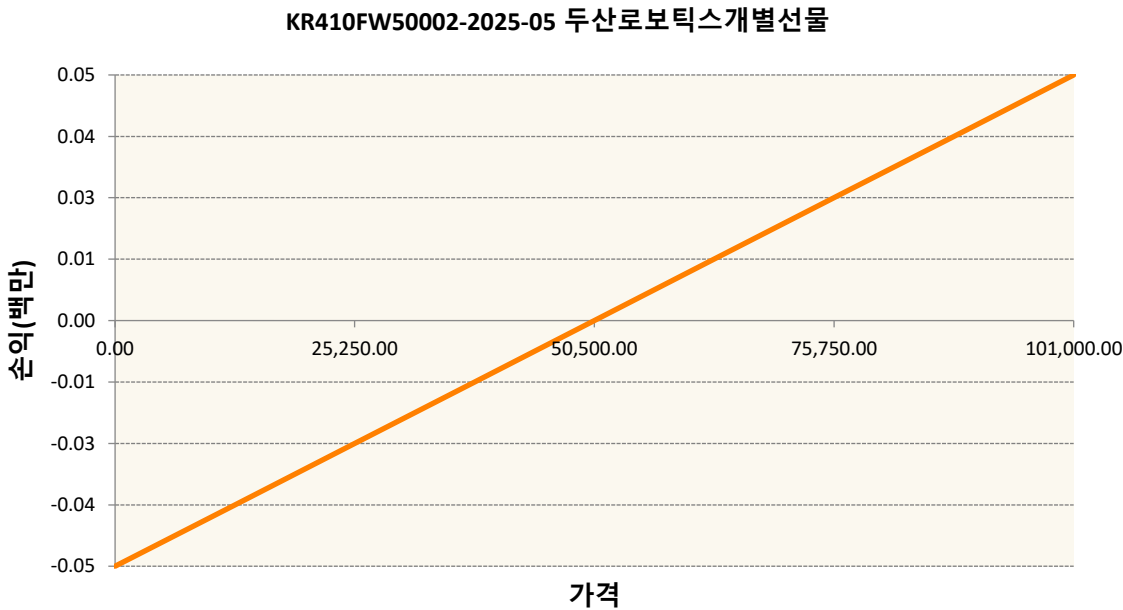
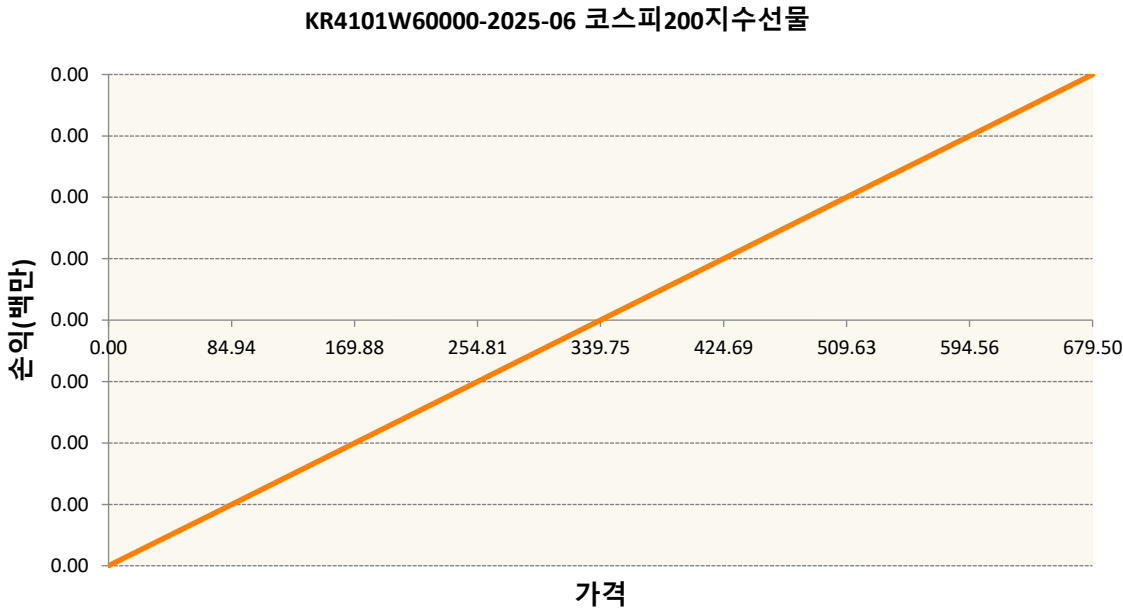
스마트인덱스모

1. 계약금액

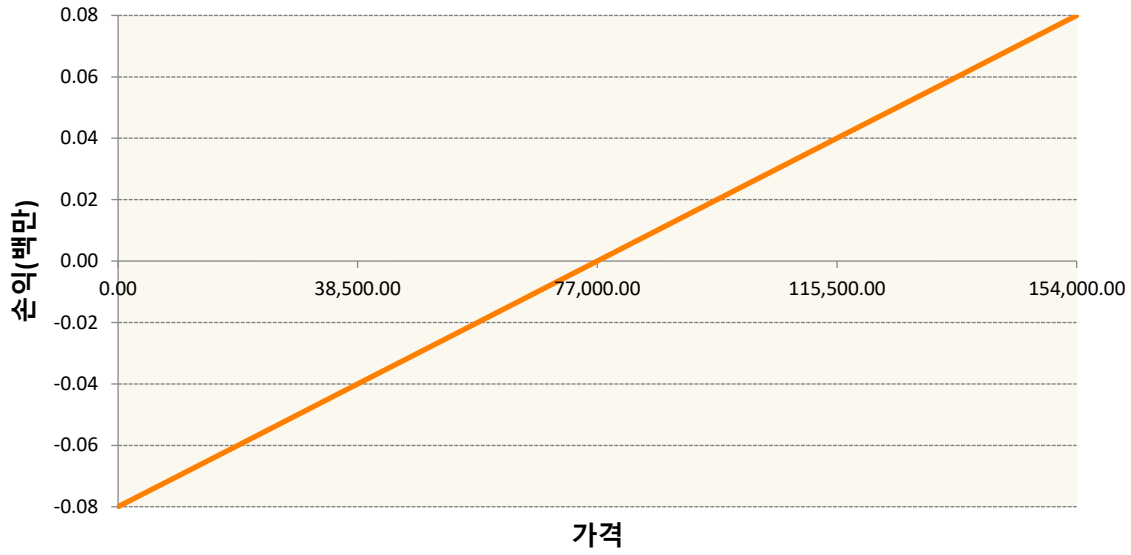
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	85	-85	장내
누계	유가증권	선물	1,673	0	1,673	장내

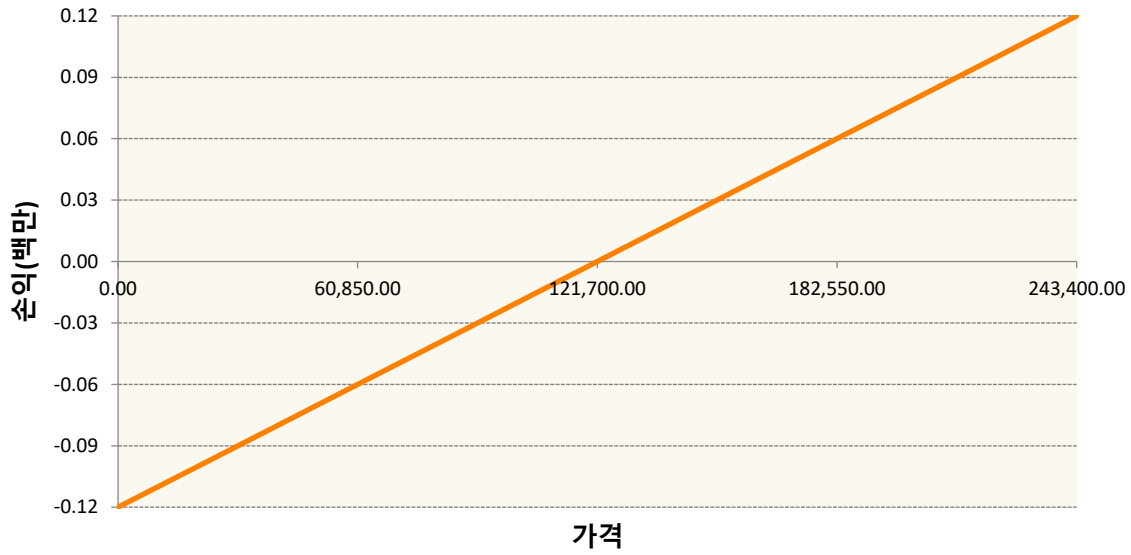
2. 만기시점의 손익구조



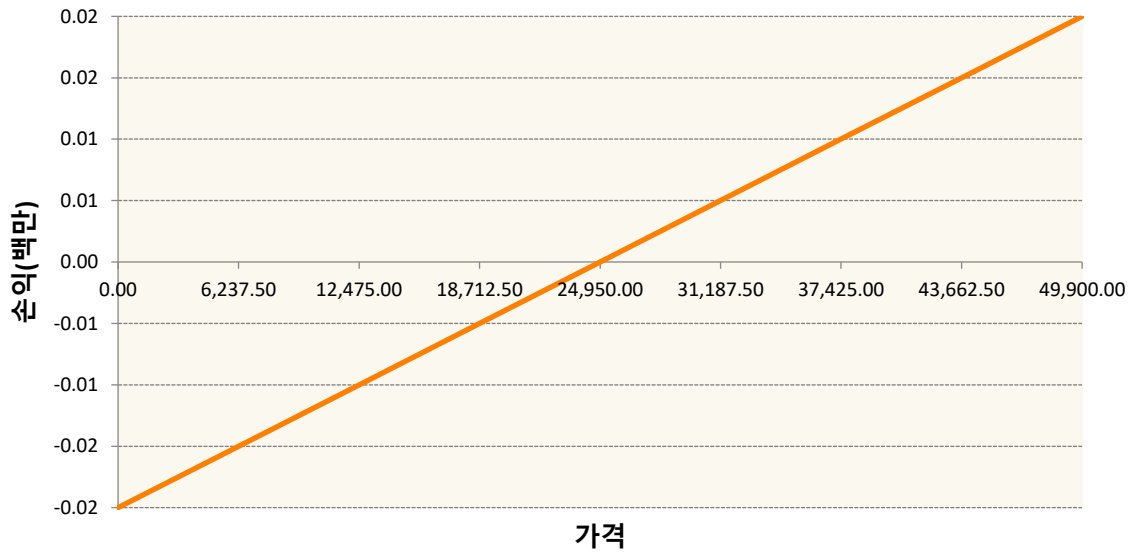
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



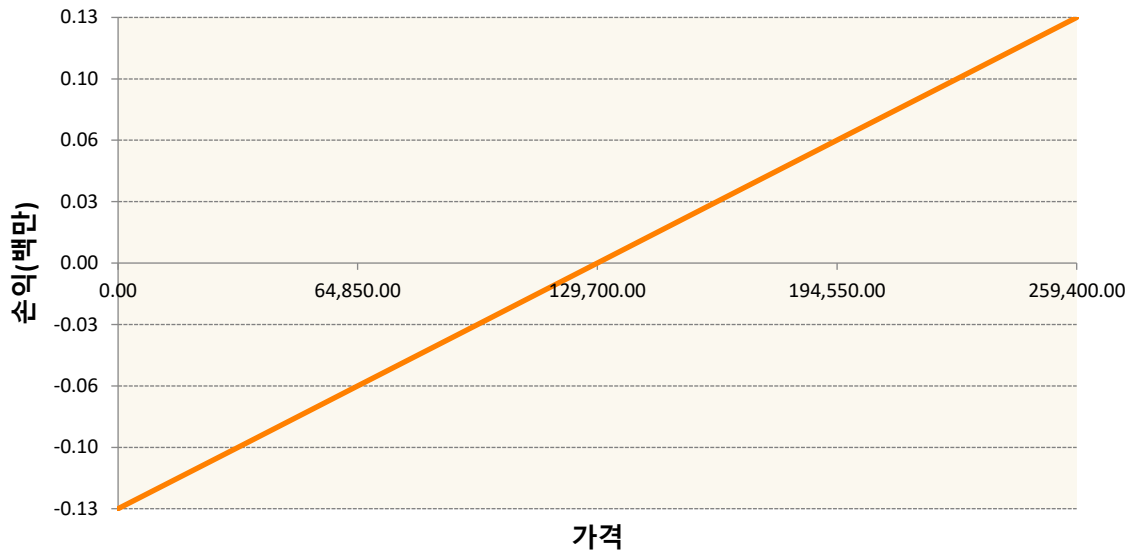
KR4123W50005-2025-05 삼성전자개별선물



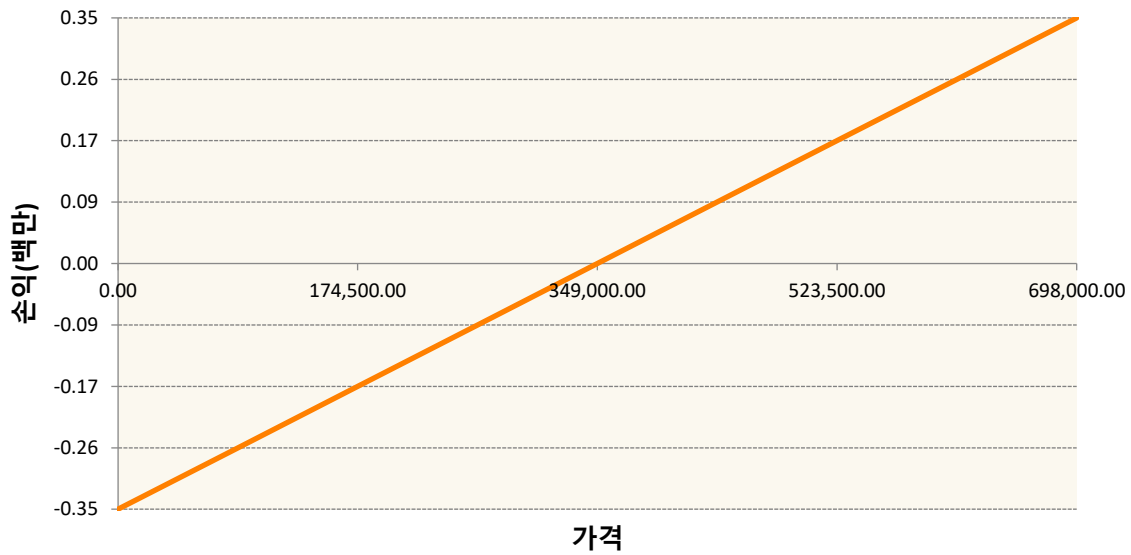
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



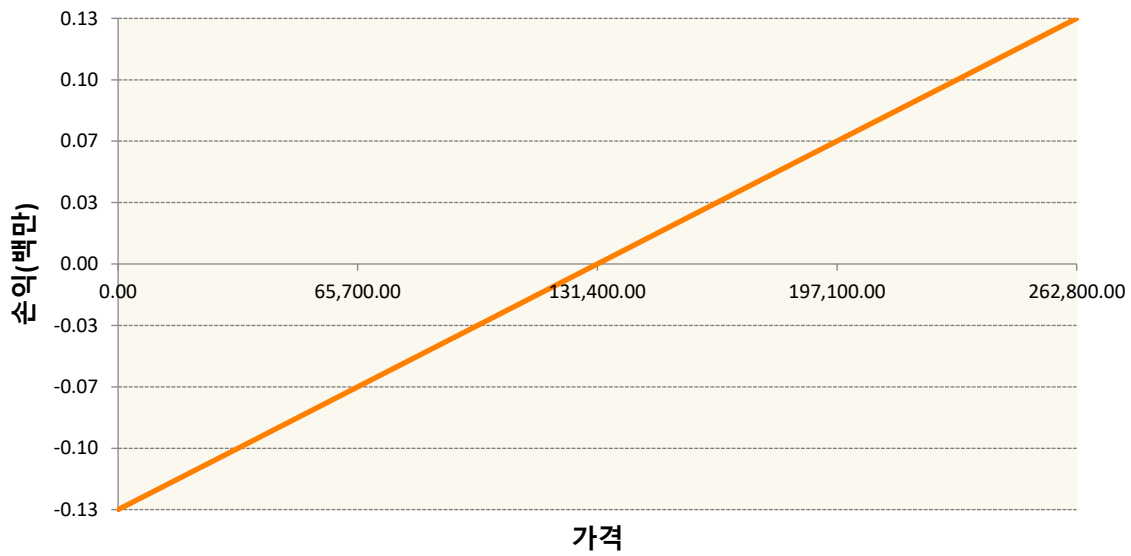
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	102
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	15
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물	2

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

216

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

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

283

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

459

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

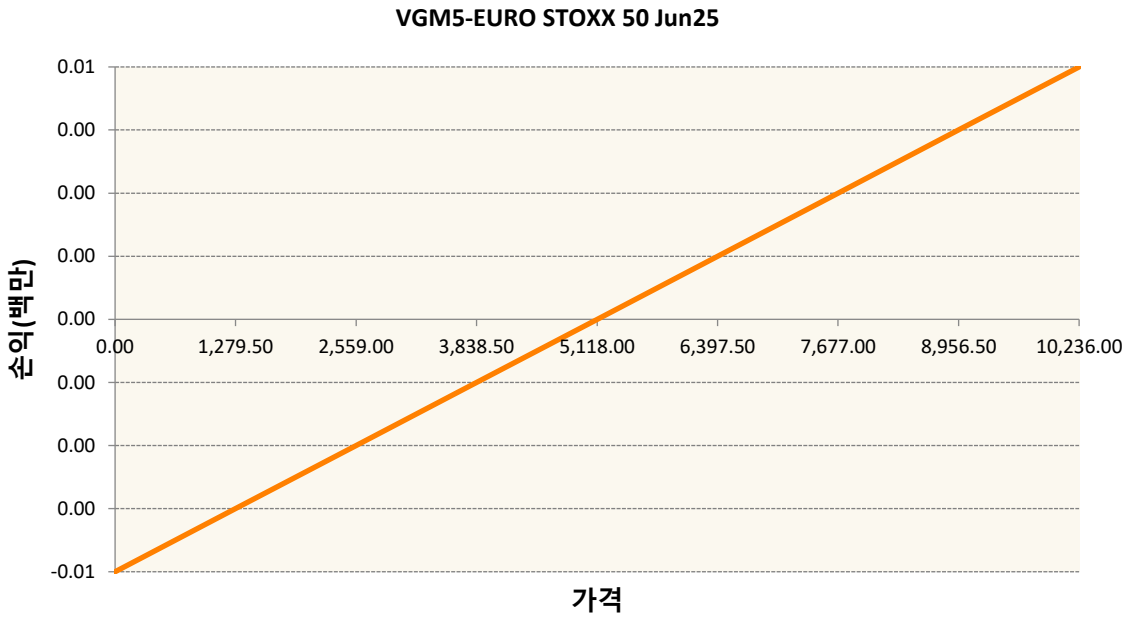
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	814	0	814	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	65
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

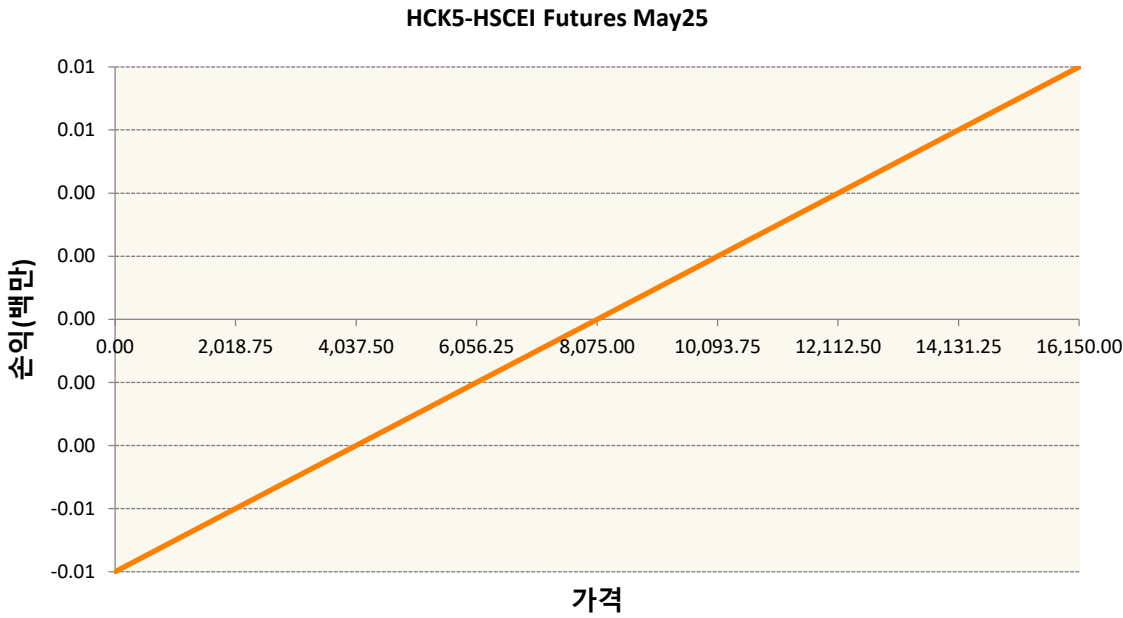
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,252	0	2,252	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK5	HSCEI Futures May25	180
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

269

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

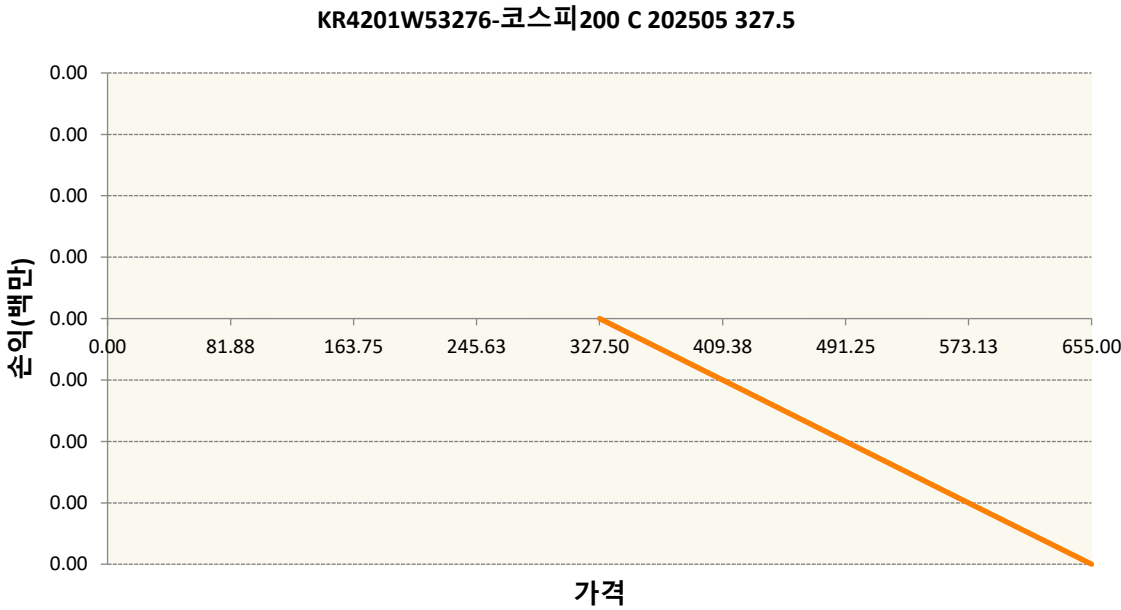
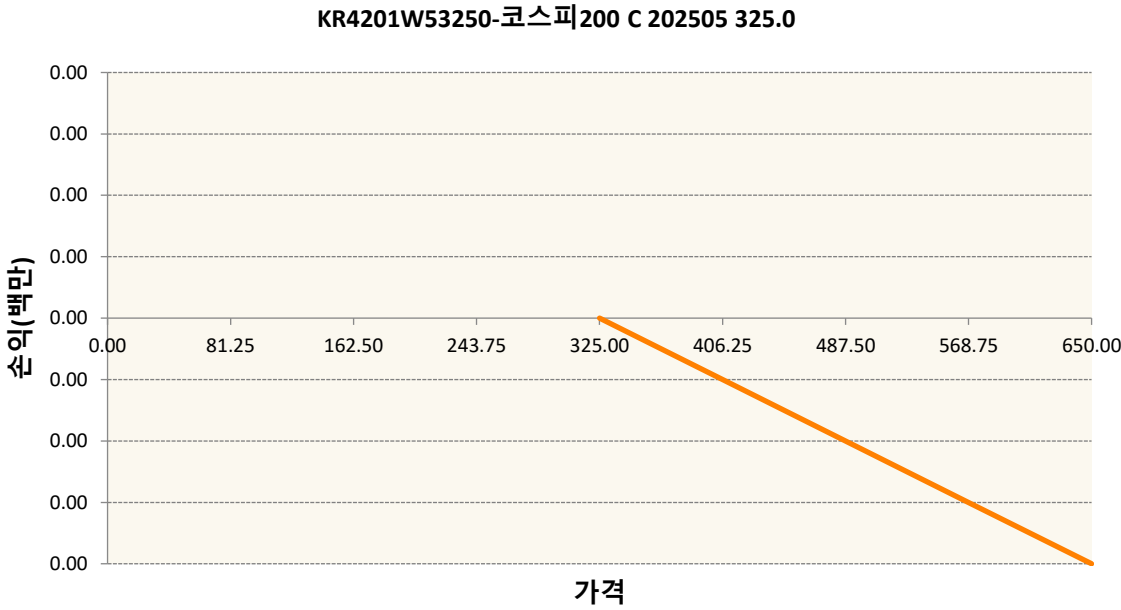
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

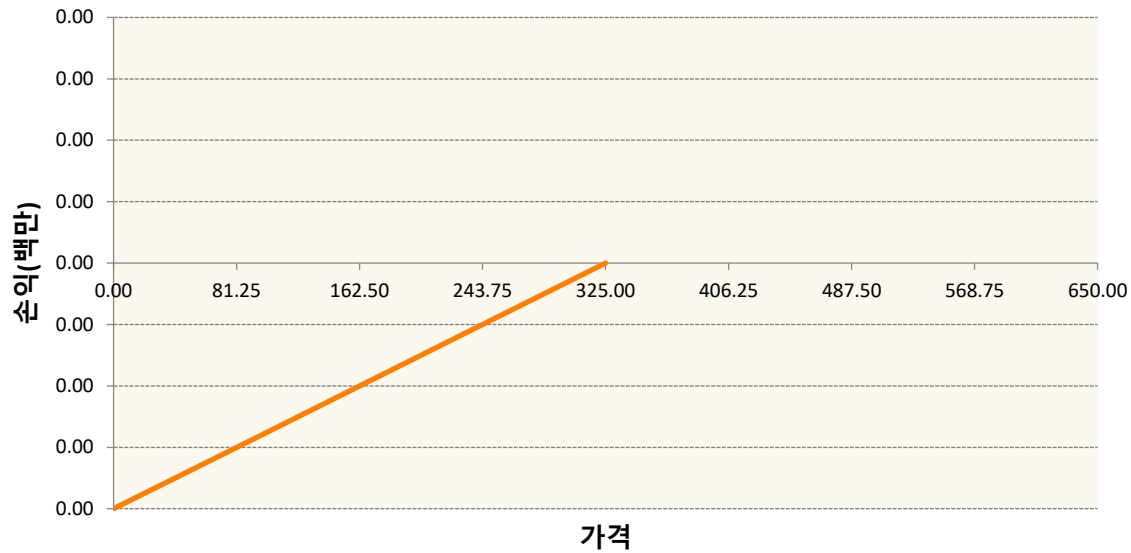
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	562	0	562	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,945	-34,945	장내

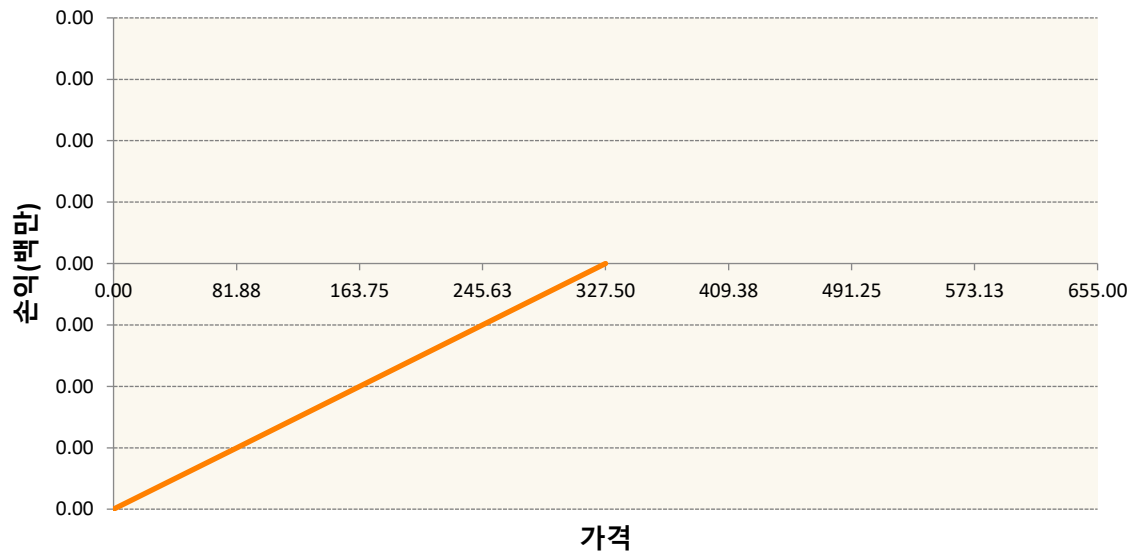
2. 만기시점의 손익구조



KR4301W53258-코스피|200 P 202505 325.0



KR4301W53274-코스피|200 P 202505 327.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201W53250						코스피200 C 202505 325.0		2,254
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1,229	1,219	1,207	1,192	1,176	1,158	1,139	
-5.33%	1,101	1,073	1,044	1,015	985	955	925	
-2.67%	697	669	641	612	583	554	524	
0%	36	26	14	0	-16	-34	-53	
2.67%	-717	-719	-721	-725	-730	-737	-746	
5.33%	-1,484	-1,484	-1,485	-1,485	-1,486	-1,488	-1,491	
8.00%	-2,252	-2,252	-2,252	-2,252	-2,253	-2,253	-2,254	
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%	31	31	31	30	30	29	29
-5.33%	29	28	27	26	26	25	24
-2.67%	19	18	17	17	16	15	14
0%	1	1	1	0	-1	-1	-2
2.67%	-20	-20	-20	-21	-21	-21	-22
5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
KR4301W53258 코스피200 P 202505 325.0							266

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-248	-250	-252	-255	-258	-262	-266
-5.33%	-99	-105	-111	-117	-124	-130	-137
-2.67%	-16	-21	-27	-34	-40	-46	-53
0%	7	5	3	0	-3	-7	-11
2.67%	10	9	9	8	7	6	5
5.33%	10	10	10	10	9	9	9
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

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

(단위:백만원)

2,764

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

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	556	0	556	

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	2025-04-30
기준일	2025-04-29

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	4,471	0	4,471	

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	2025-04-30
기준일	2025-04-29

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	12,857	0	12,857	
누계	통화	선도	359	18,211	-17,851	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
FXW213F4V(KRW/USD 31-07-25E	428

IE00BD8RGM75 * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

694

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

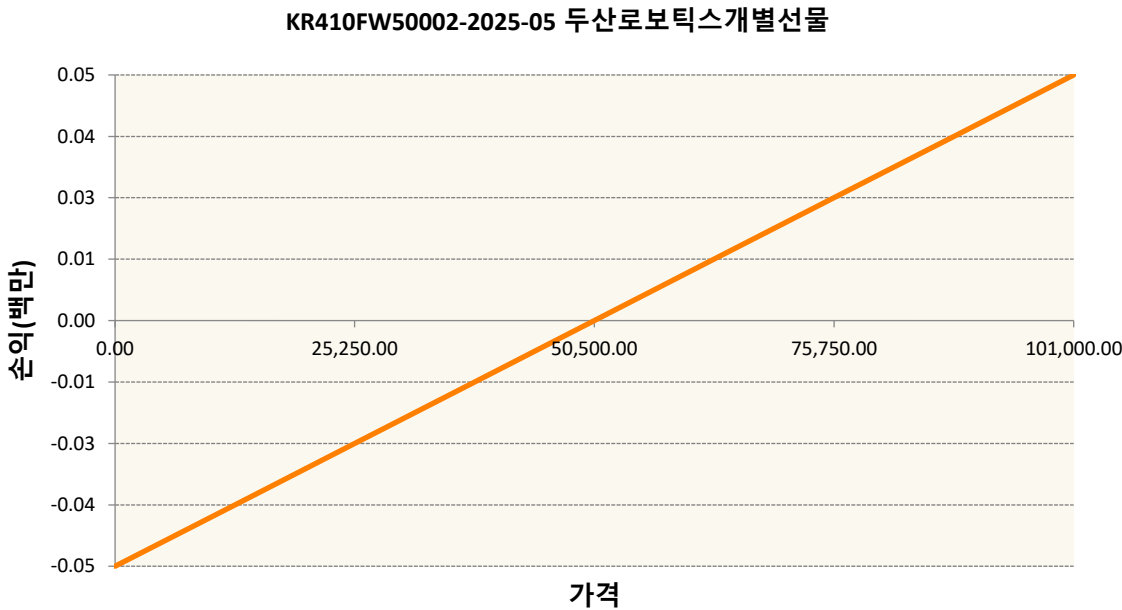
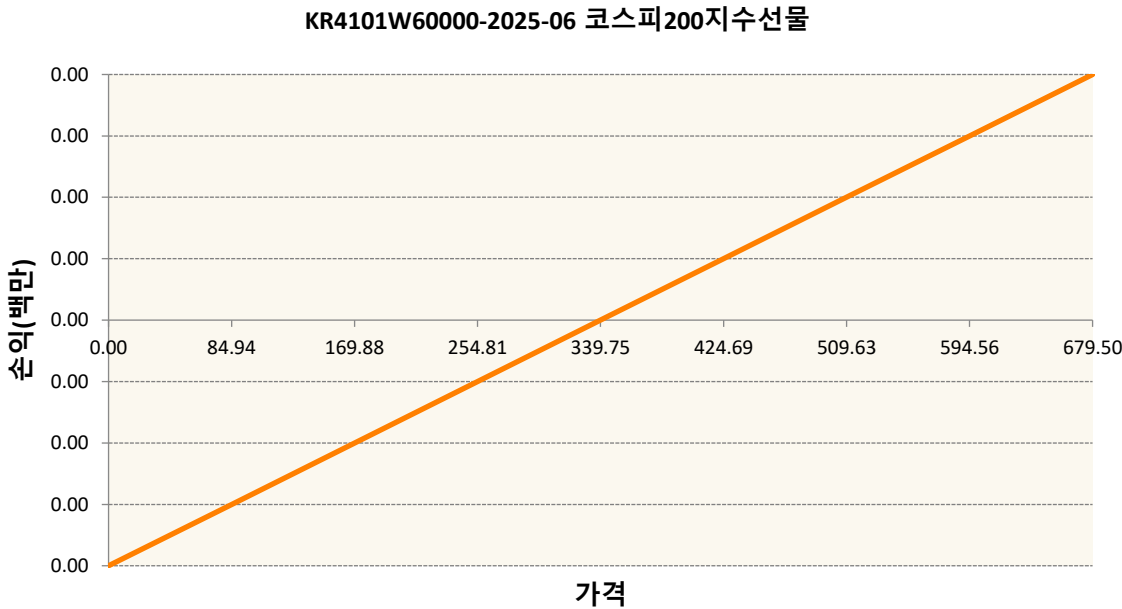
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

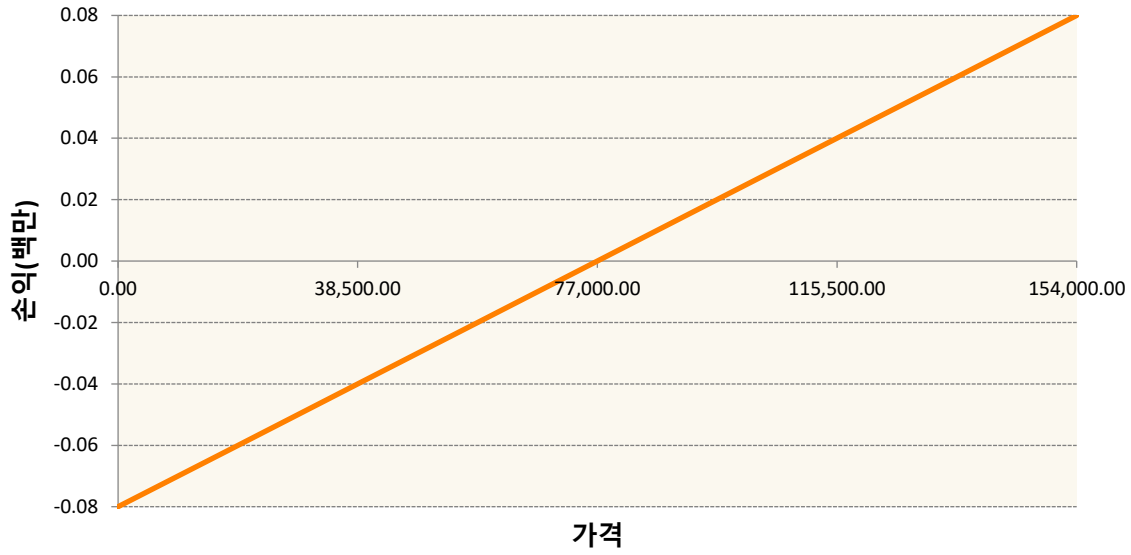
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,129	0	1,129	장내

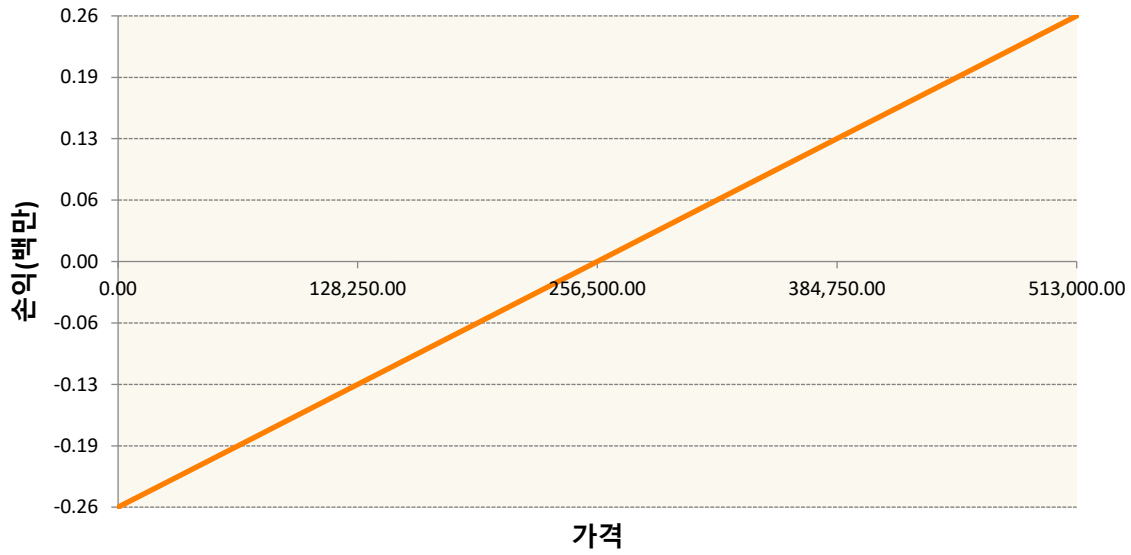
2. 만기시점의 손익구조



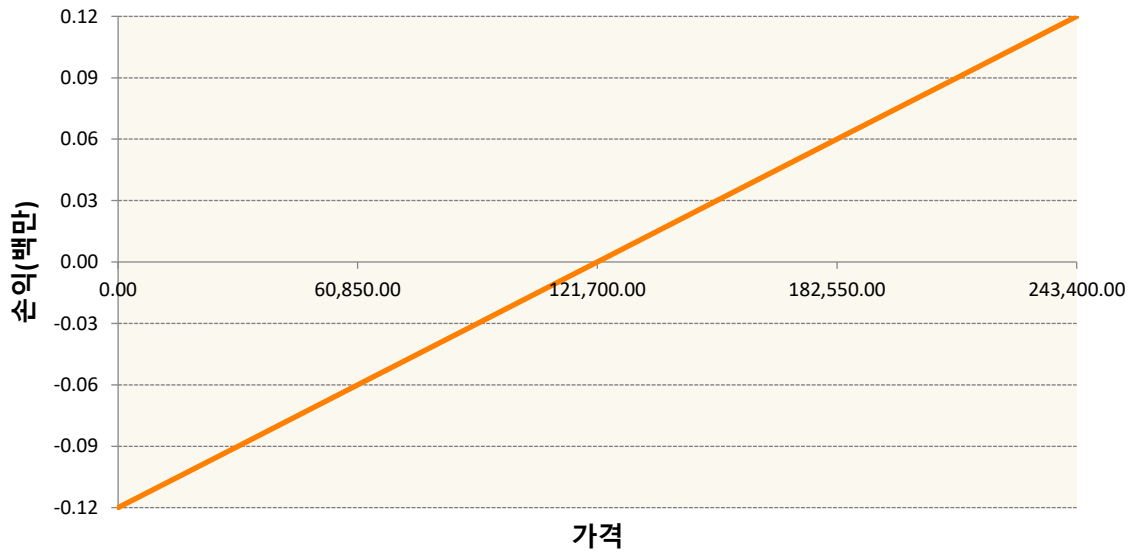
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



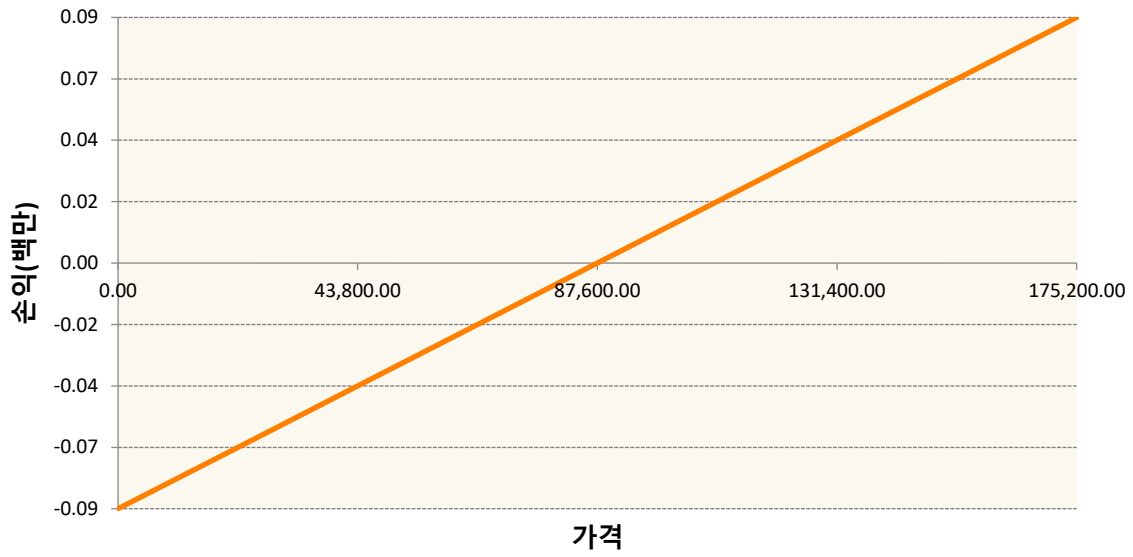
KR4120W50001-2025-05 현대모비스개별선물



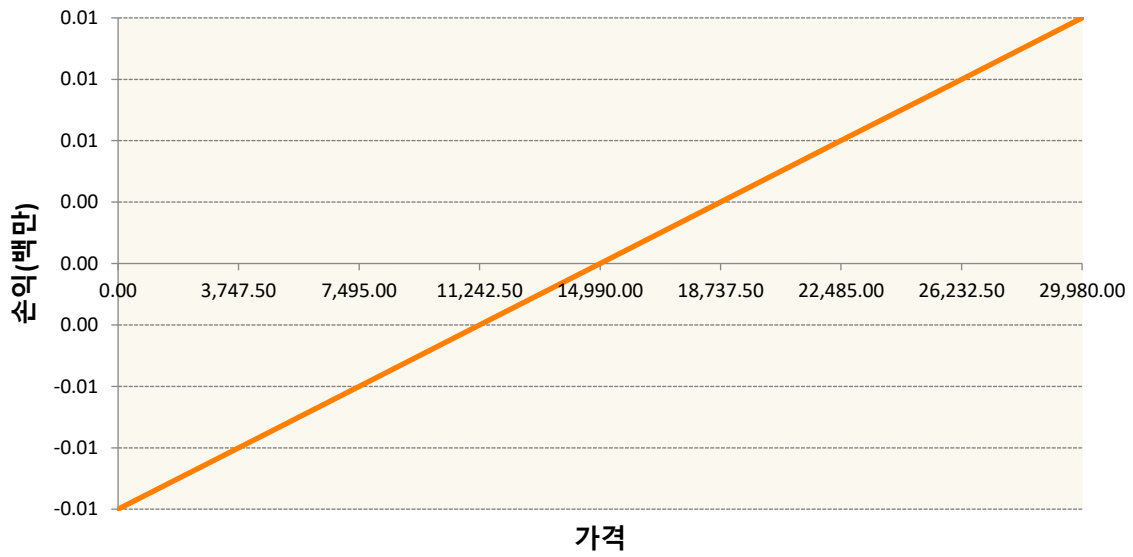
KR4123W50005-2025-05 삼성전기개별선물



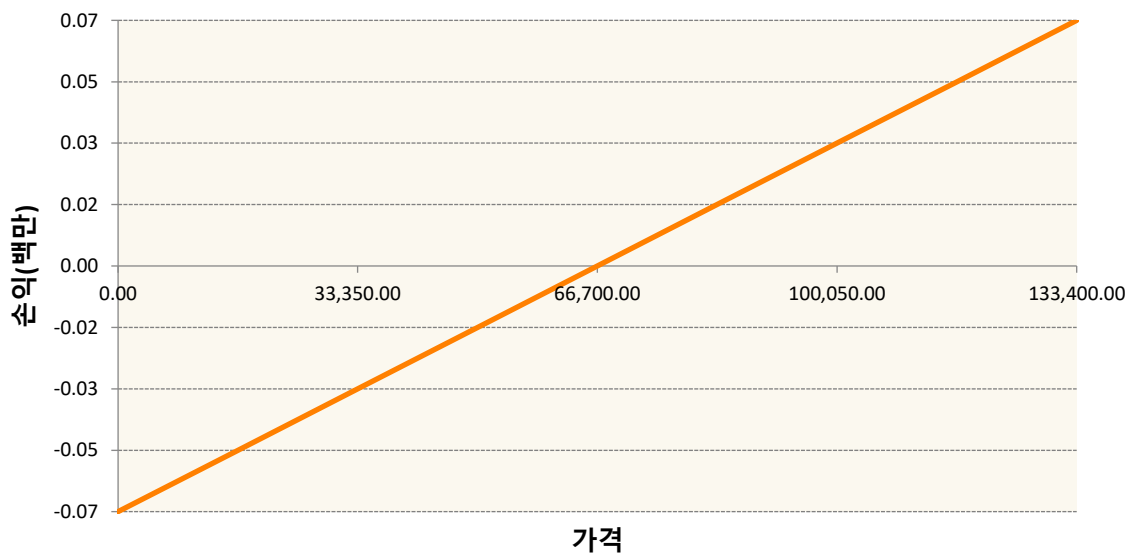
KR4146W50006-2025-05 KB금융개별선물



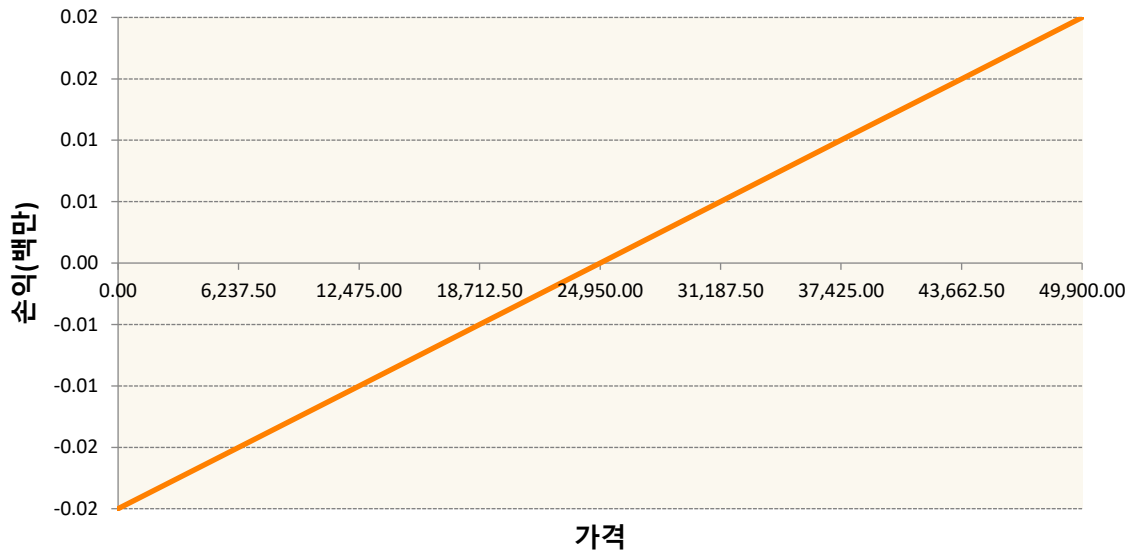
KR41BFW50008-2025-05 삼성중공업개별선물



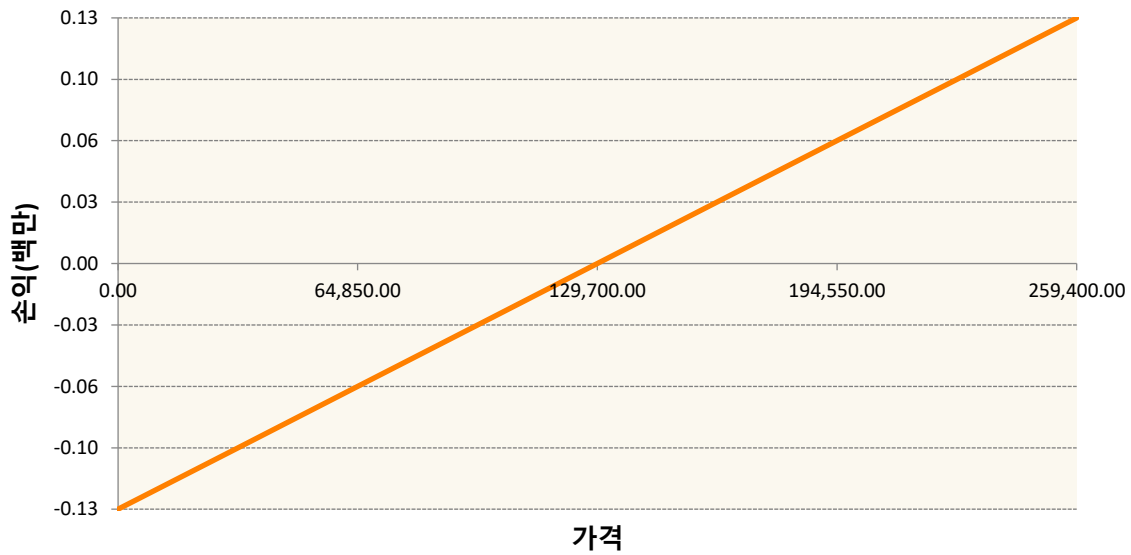
KR41C0W50000-2025-05 OCI홀딩스개별선물



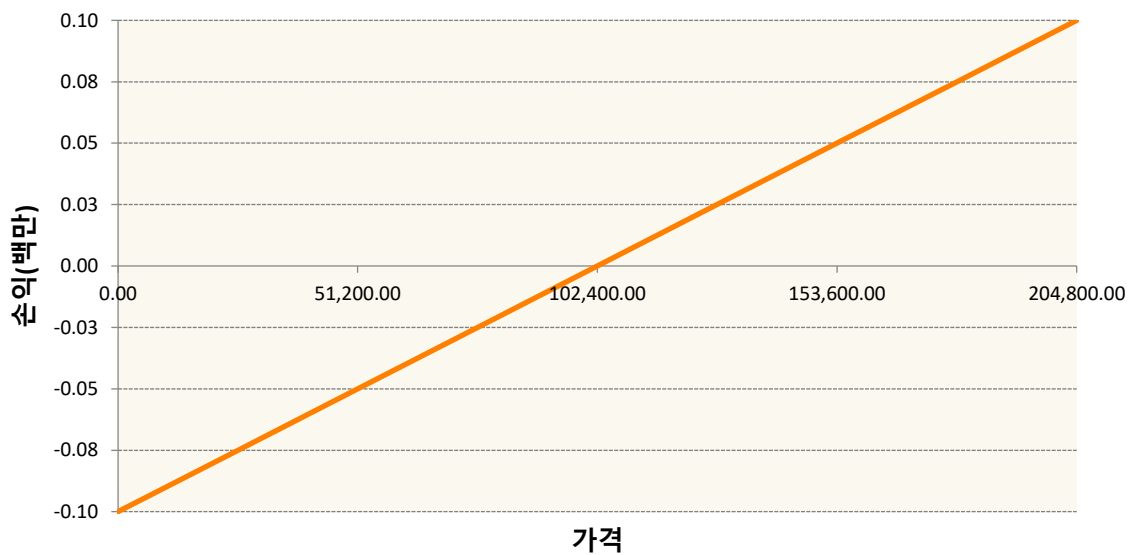
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



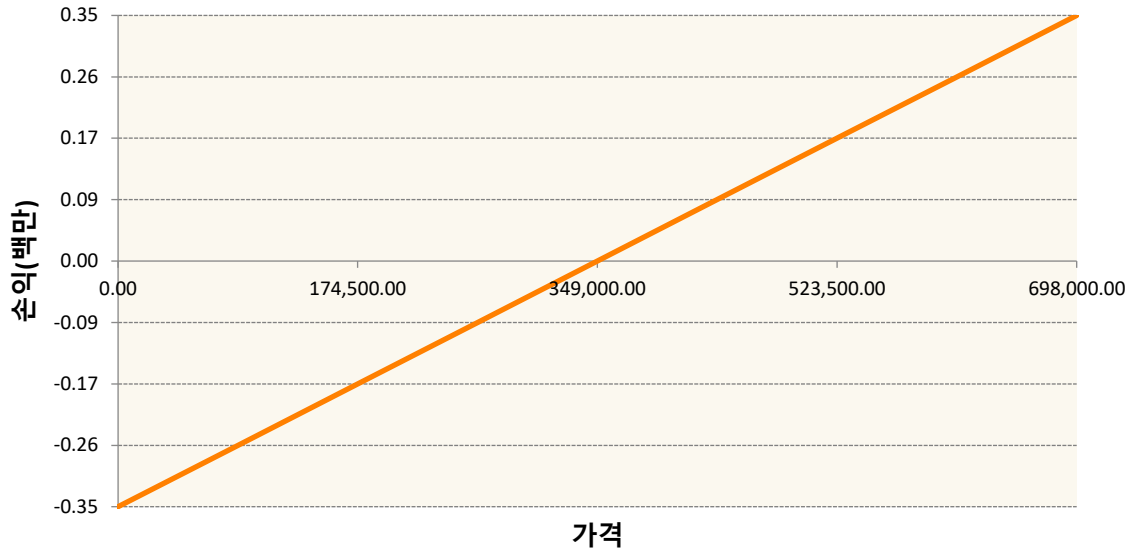
KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



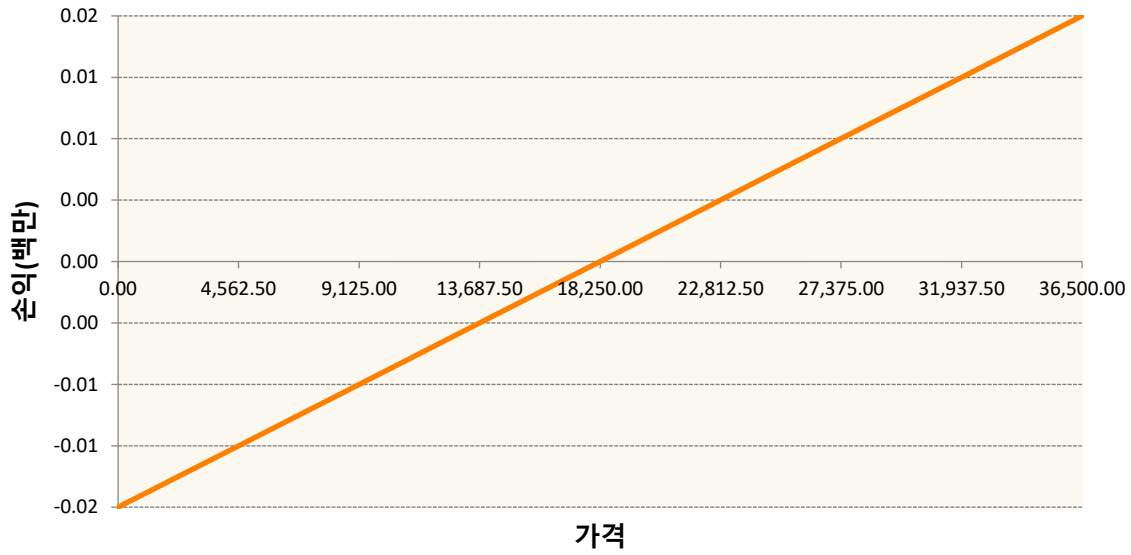
KR41EYW50003-2025-05 에코프로비엠개별선물



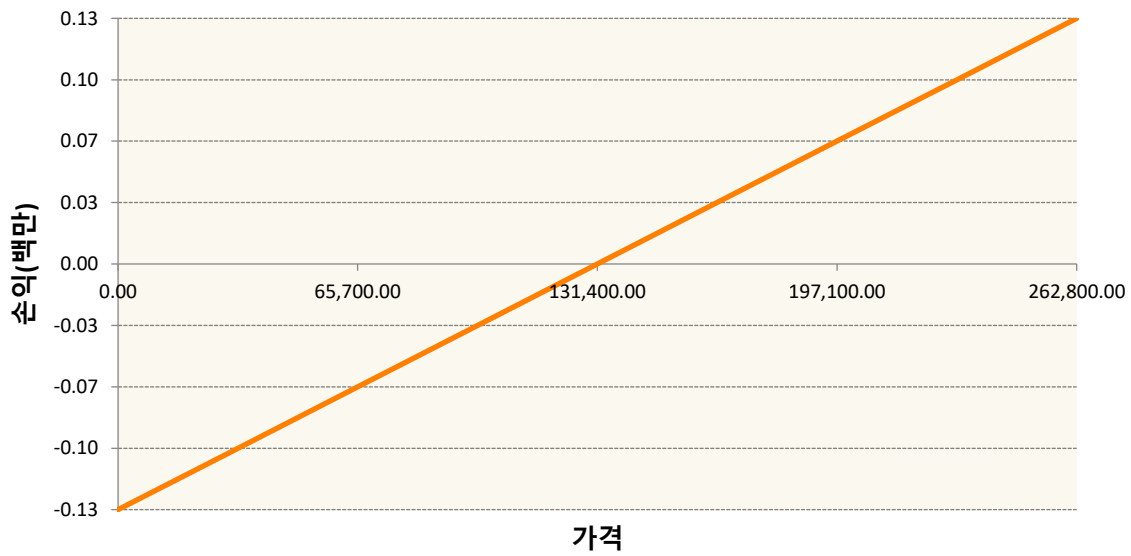
KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



KR41FAW50000-2025-05 HMM개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		68
KR410FW50(2025-05 두산로보틱스개별선물		0.48
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물		2
KR4120W50(2025-05 현대모비스개별선물		0.21
KR4123W50(2025-05 삼성전기개별선물		4
KR4146W50(2025-05 KB금융개별선물		1
KR41BFW50(2025-05 삼성중공업개별선물		0.42
KR41C0W50(2025-05 OCI홀딩스개별선물		0.05
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	2025-04-30
기준일	2025-04-29

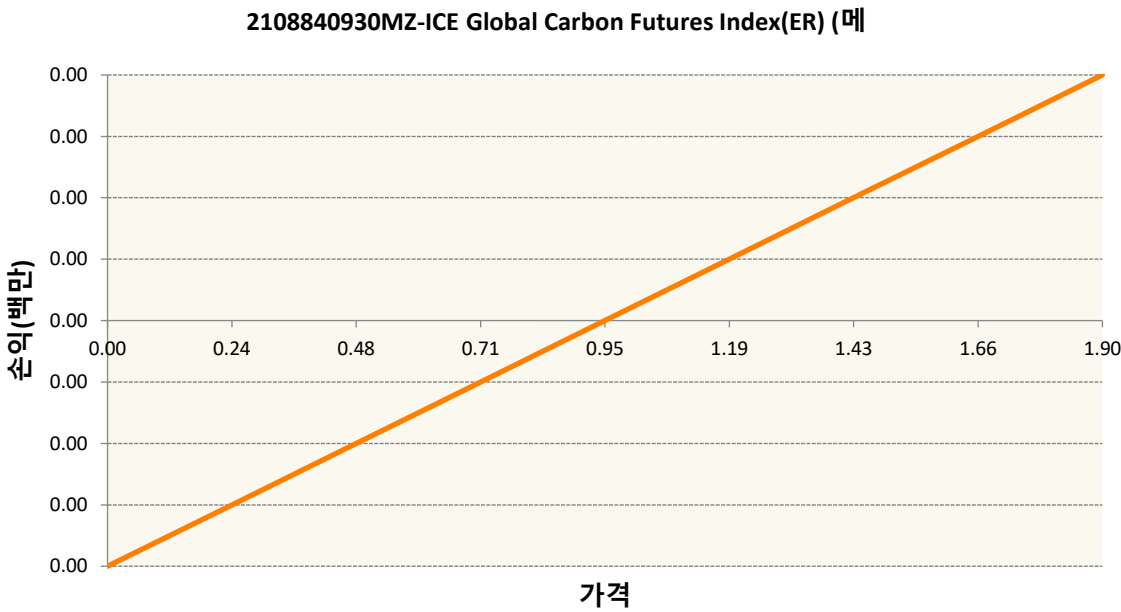
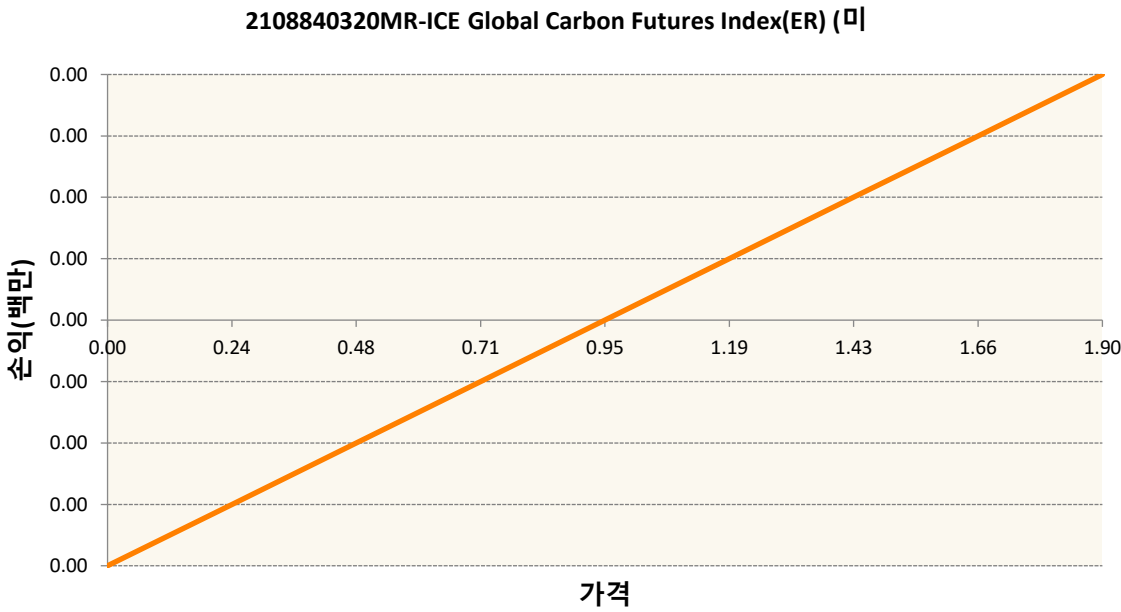
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	559
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	187

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	873

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

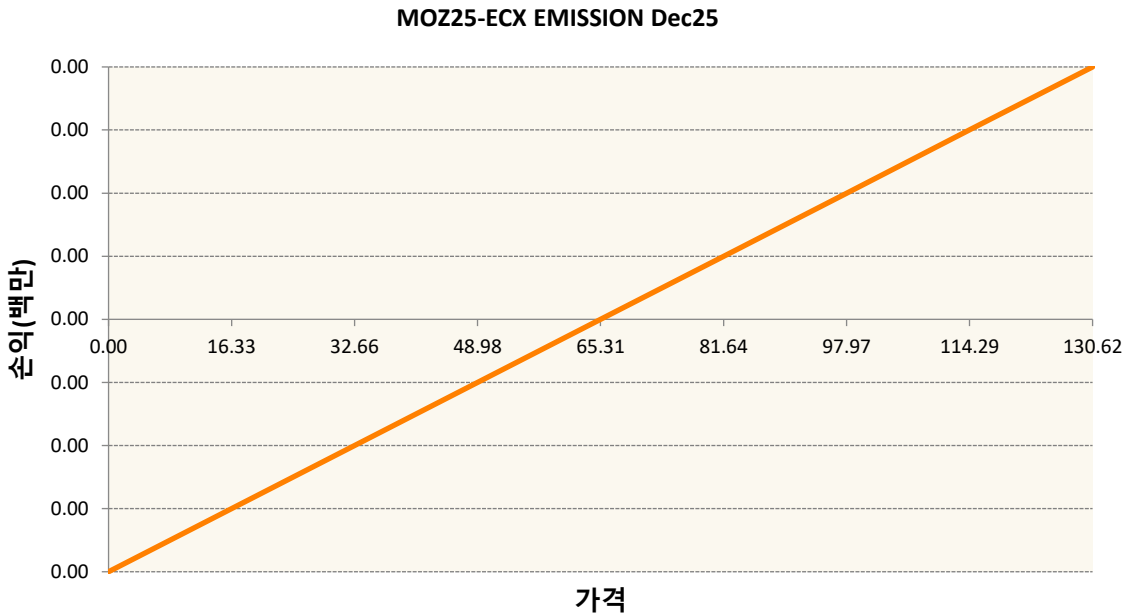
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,662	0	5,662	
누계	통화	선도	0	2,215	-2,215	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	3
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	14
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E	81
FXW213F4V(KRW/EUR 30-05-25E	81
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	455

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

(단위:백만원)

911

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

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)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	19

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

(단위:백만원)

111

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

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)
	122

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

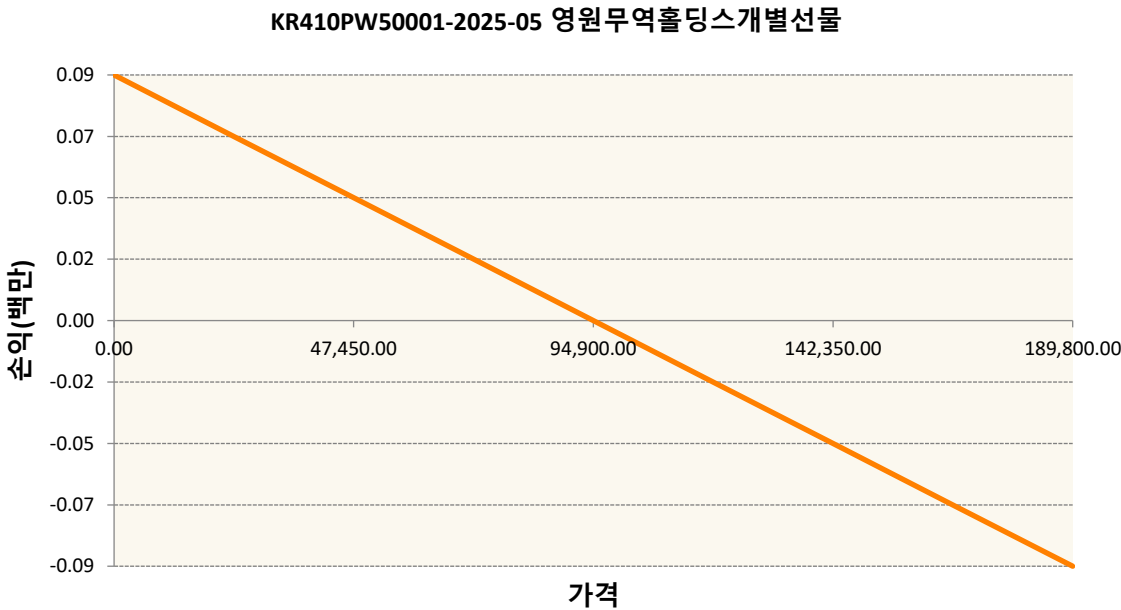
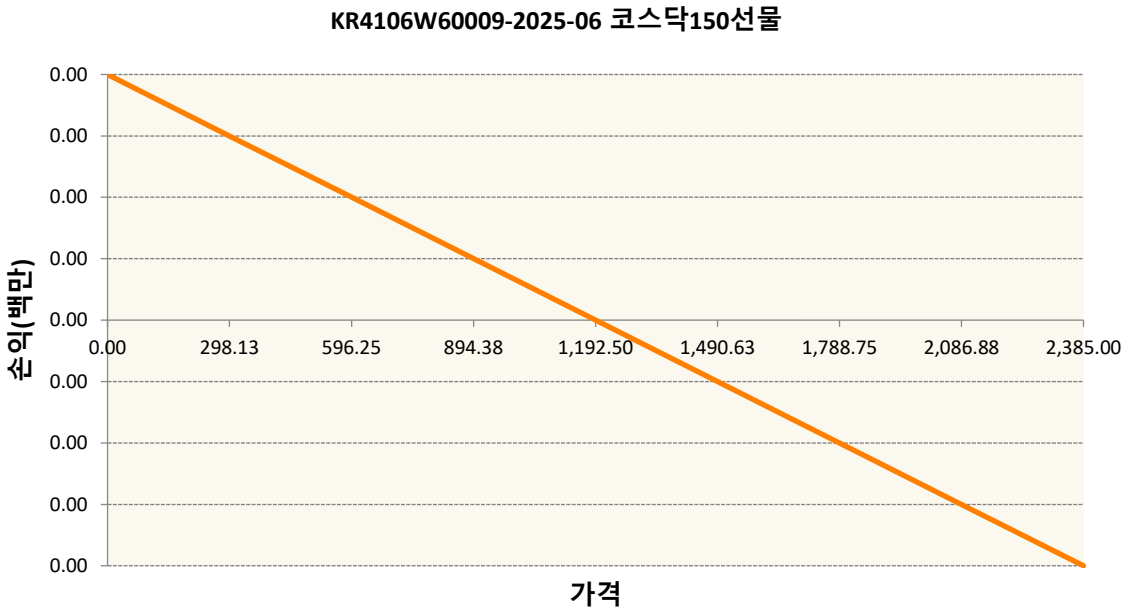
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

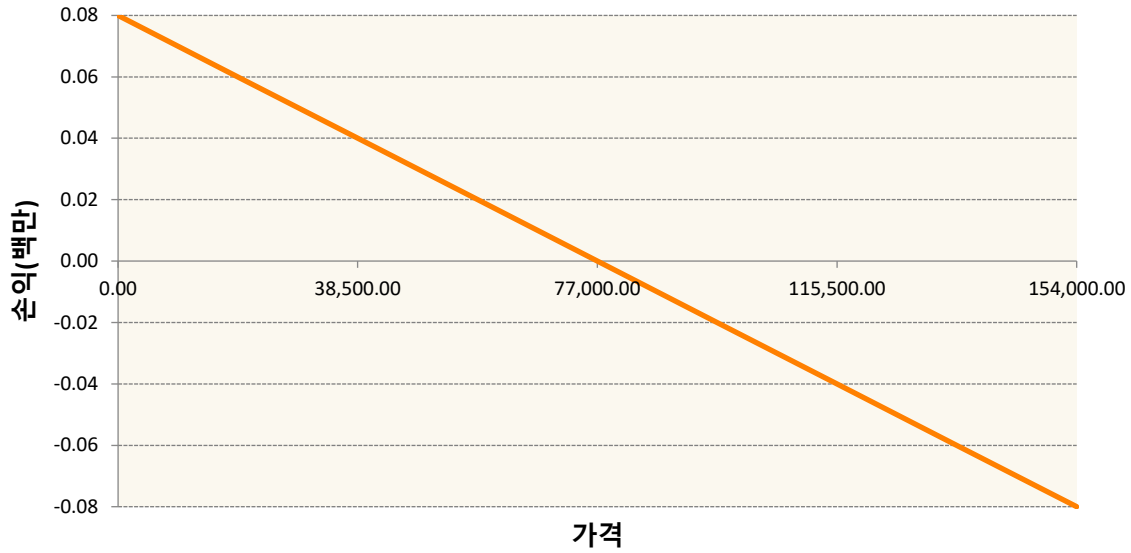
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	8	0	8	장내
누계	유가증권	선물	0	47	-47	장내

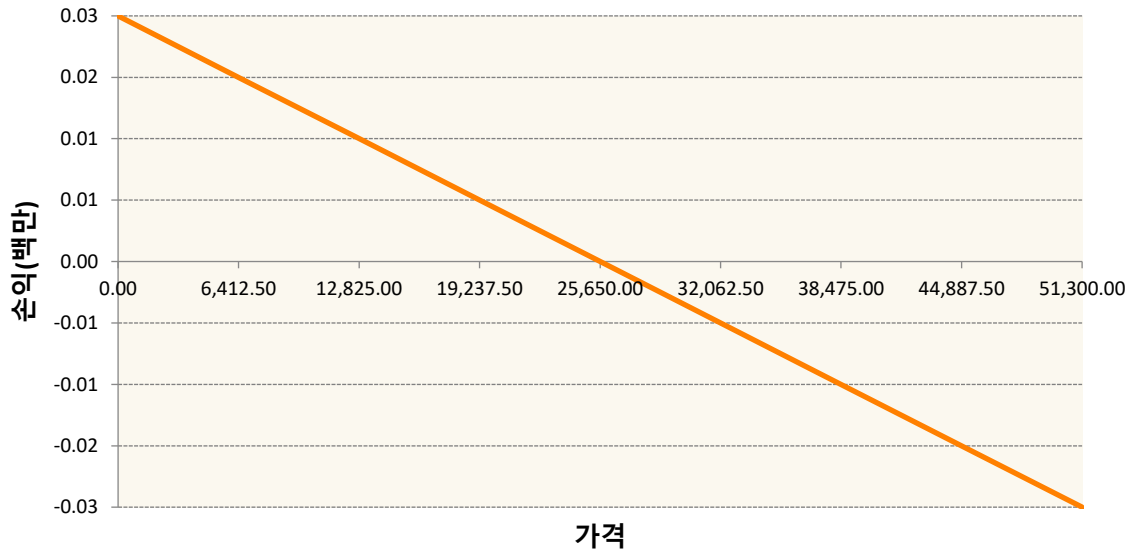
2. 만기시점의 손익구조



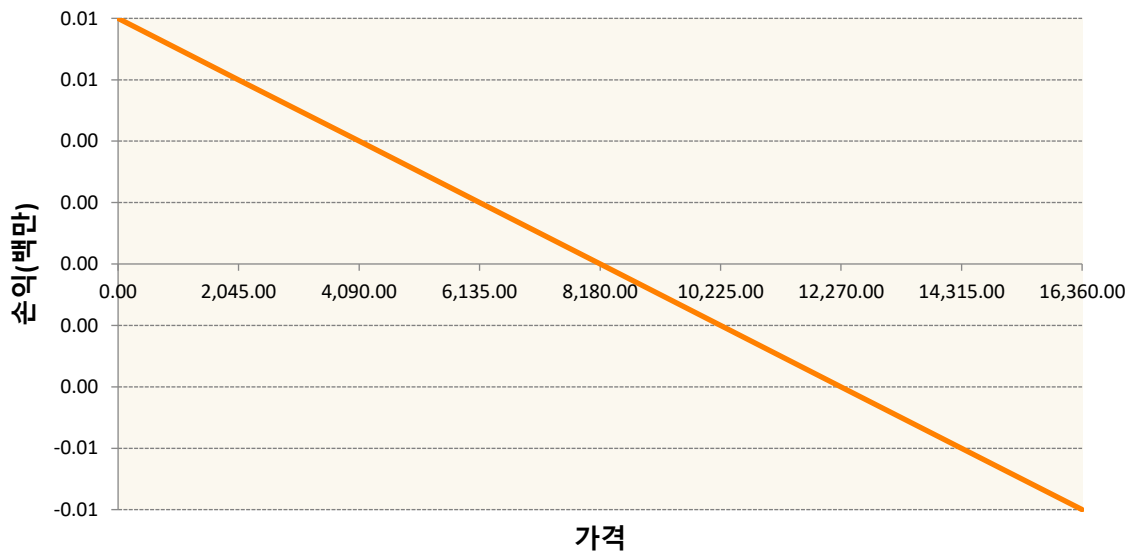
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



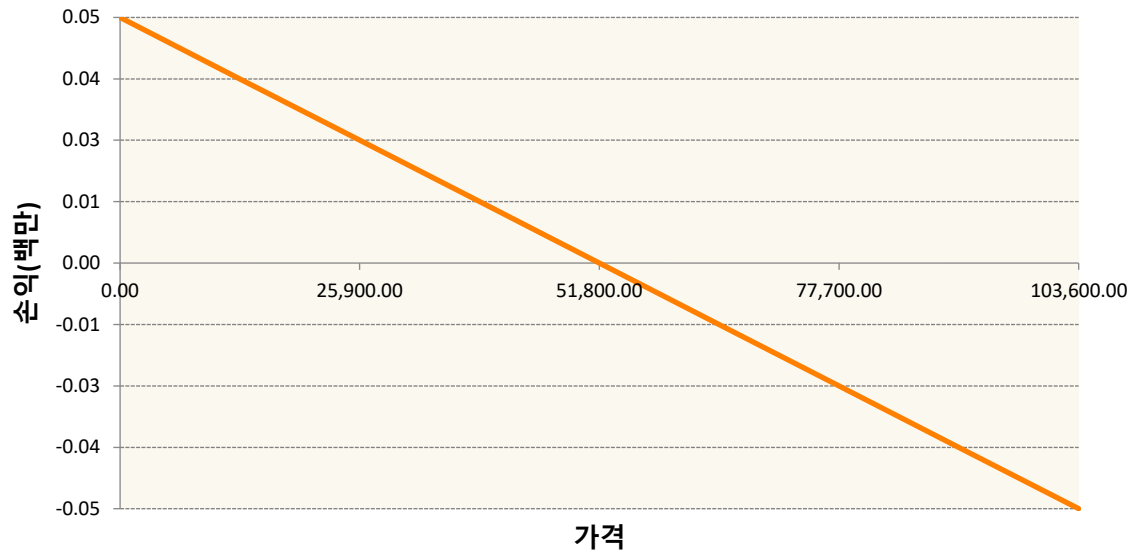
KR4115W50001-2025-05 한국전력개별선물



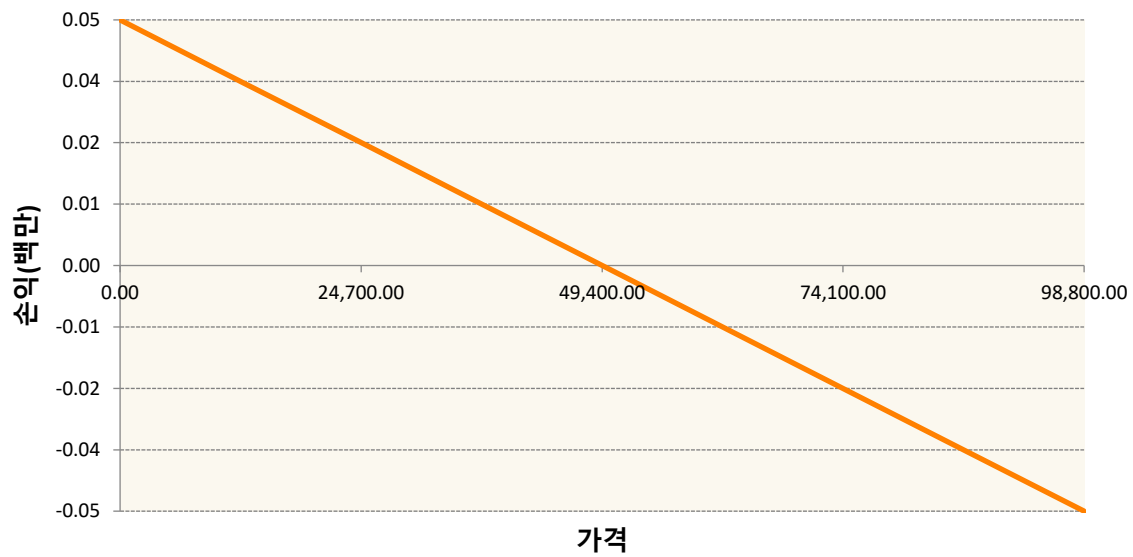
KR4149W50000-2025-05 HD현대인프라코어개별선물



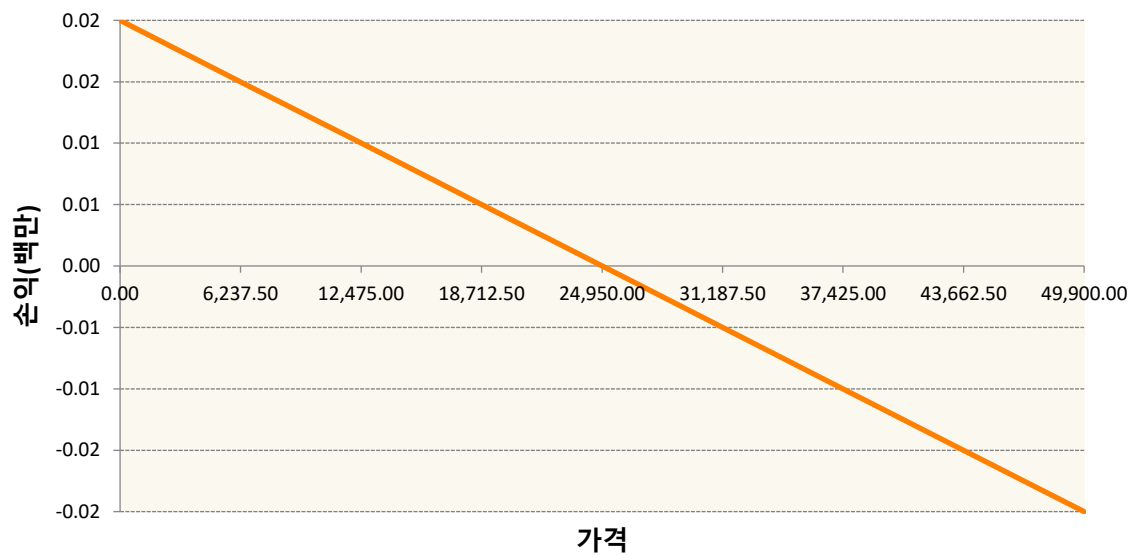
KR41B2W50007-2025-05 S-Oil개별선물



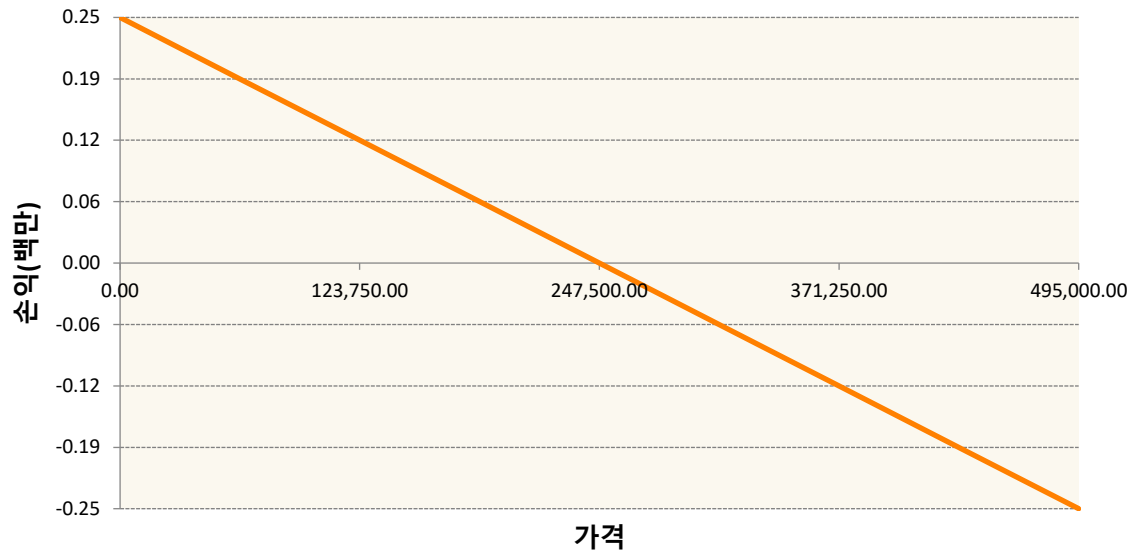
KR41B7W50006-2025-05 포스코인터내셔널개별선물



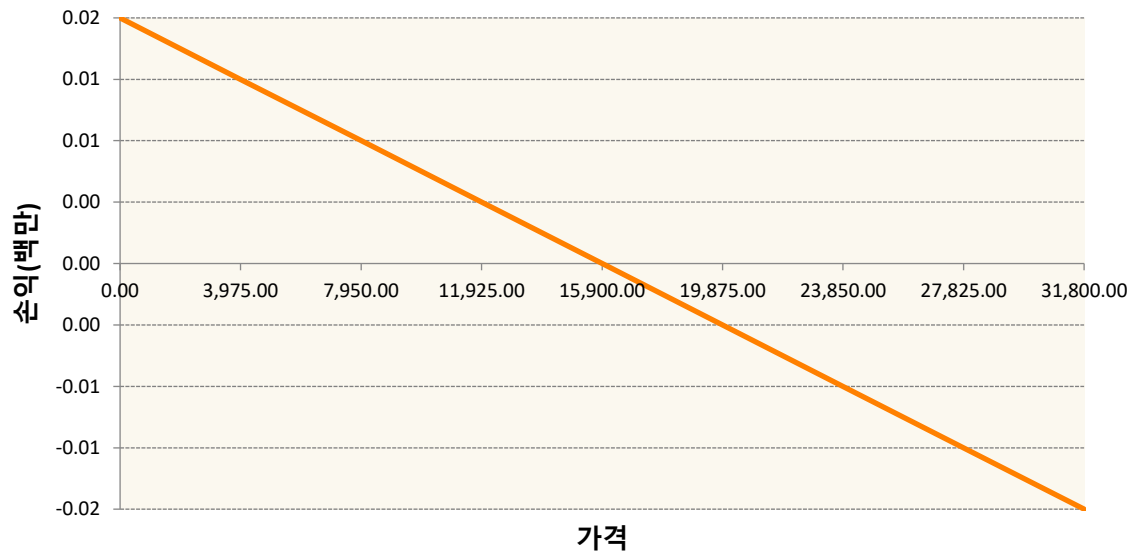
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



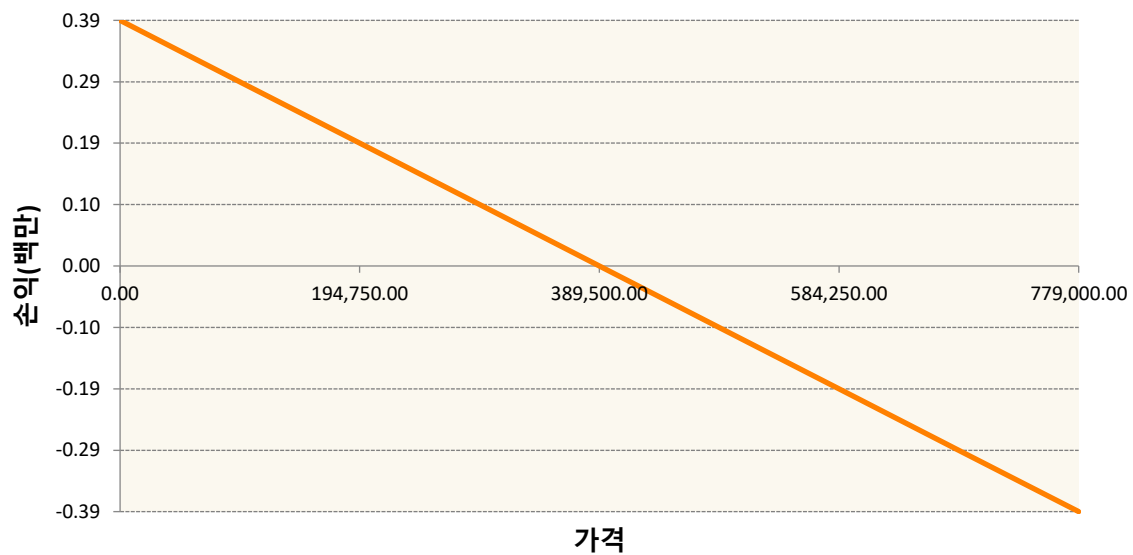
KR41CXW50009-2025-05 한미약품개별선물



KR41HCW50002-2025-05 코스모화학개별선물



KR41HSW50008-2025-05 파마리서치개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4106W60(2025-06 코스닥150선물	1
KR410PW50(2025-05 영원무역홀딩스개별선물	0.08
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	0.25
KR4115W50(2025-05 한국전력개별선물	0.33
KR4149W50(2025-05 HD현대인프라코어개별선물	0.39
KR41B2W50(2025-05 S-Oil개별선물	0.25
KR41B7W50(2025-05 포스코인터내셔널개별선물	0.2
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물	0.38
KR41CXW50 2025-05 한미약품개별선물	0.4
KR41HCW50 2025-05 코스모화학개별선물	0.25
KR41HSW50 2025-05 파마리서치개별선물	0.31

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

9

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

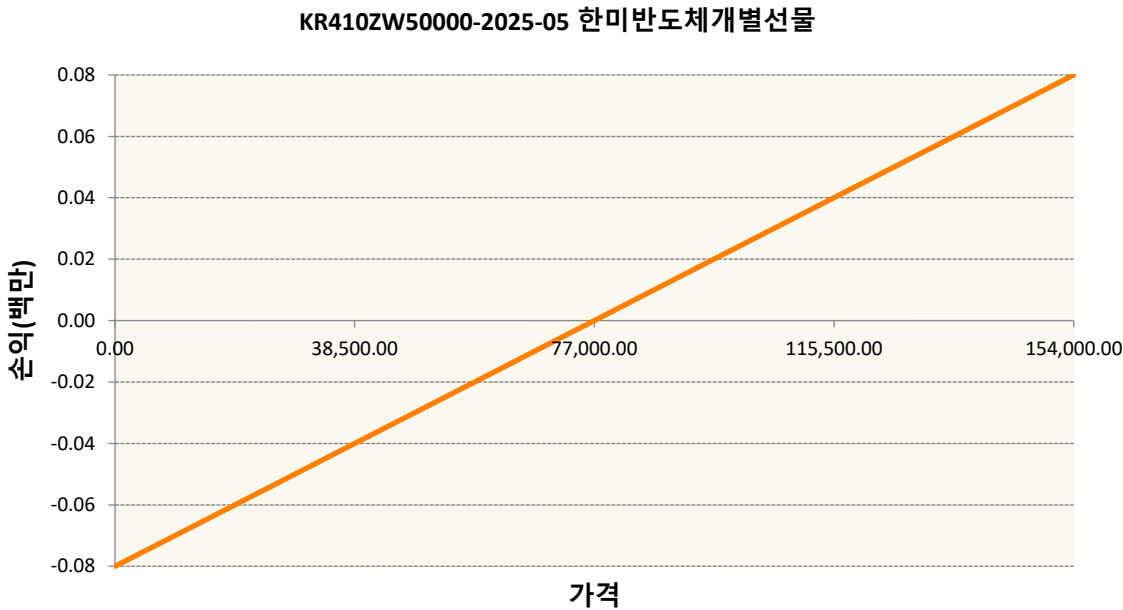
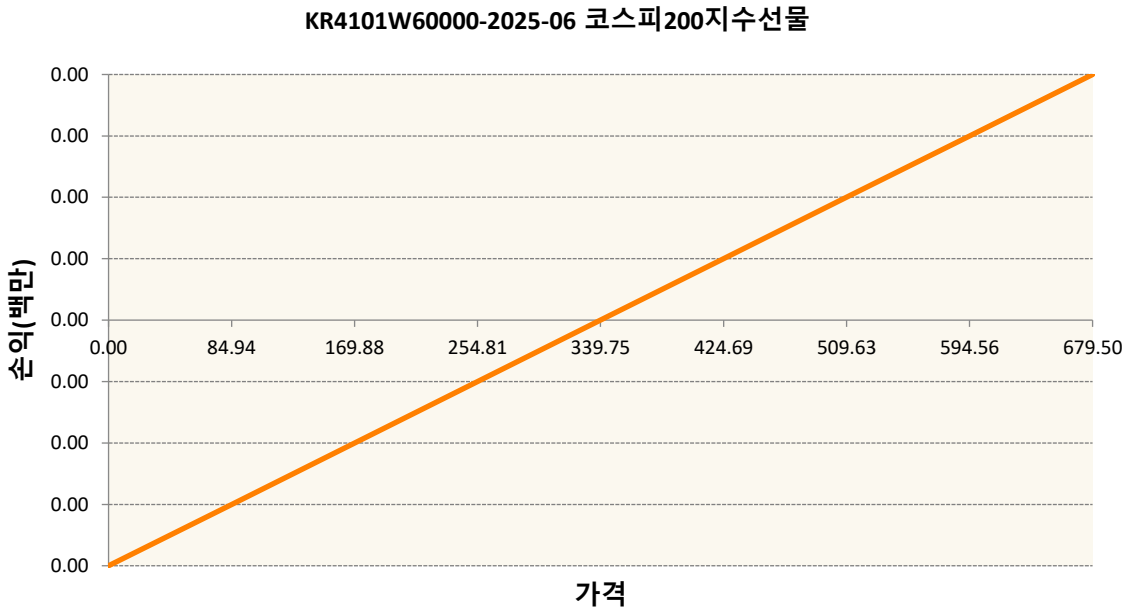
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

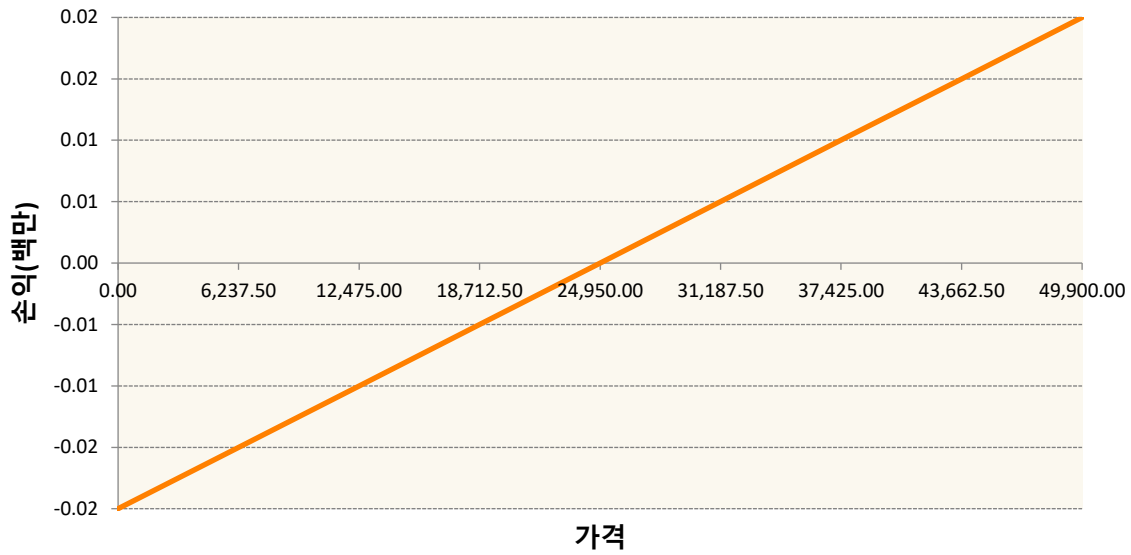
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,756	0	9,756	장내

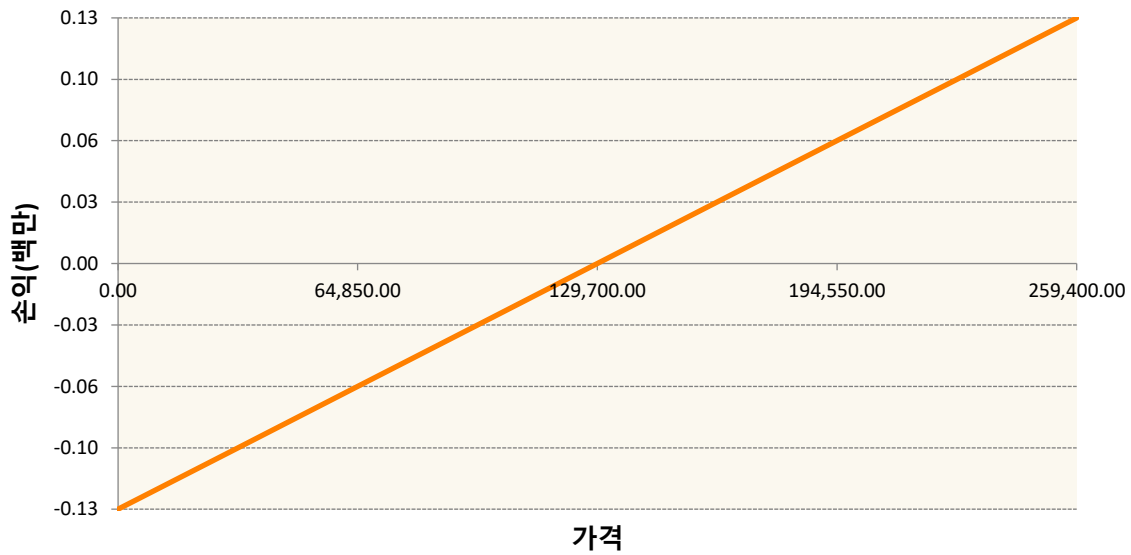
2. 만기시점의 손익구조



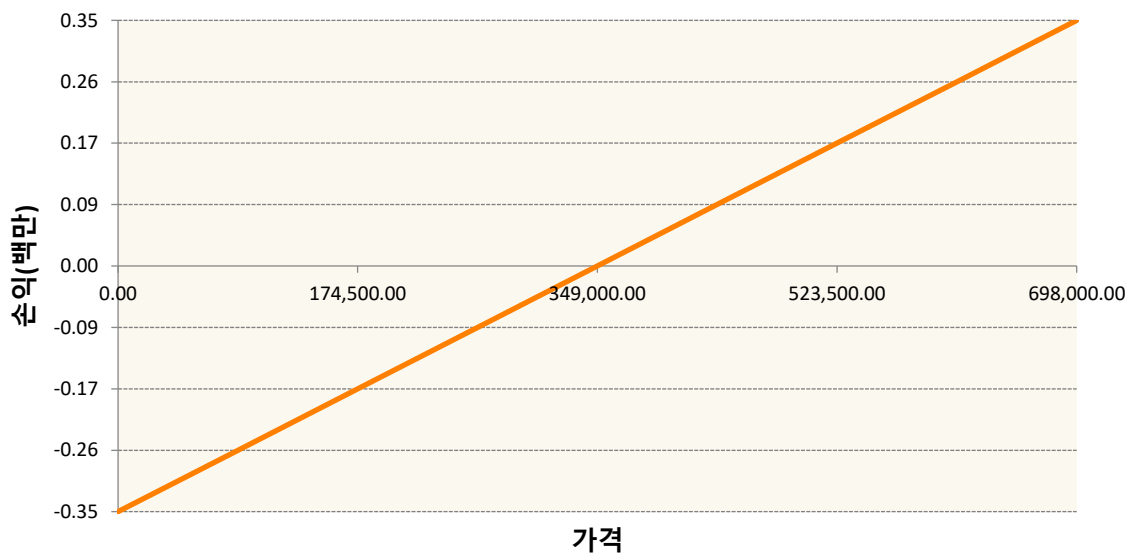
KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



KR41E8W50001-2025-05 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W50006-2025-05 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		598
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물		33
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물		12
KR41E8W50(2025-05 포스코퓨처엠개별선물		16
KR41F5W50(2025-05 LG에너지솔루션개별선물		121

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,254

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

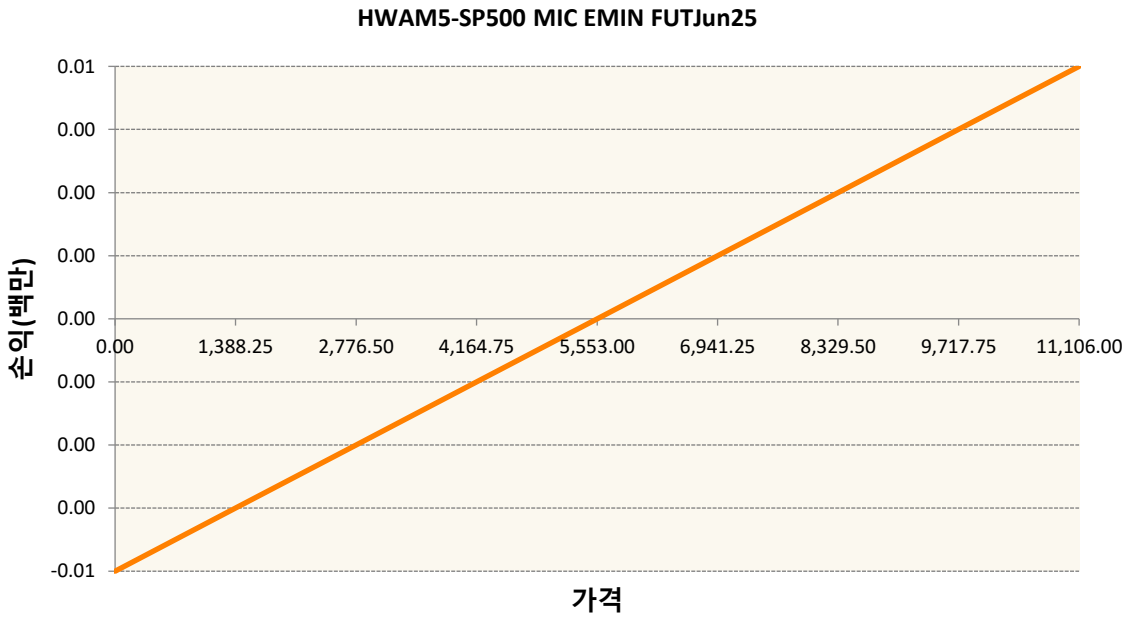
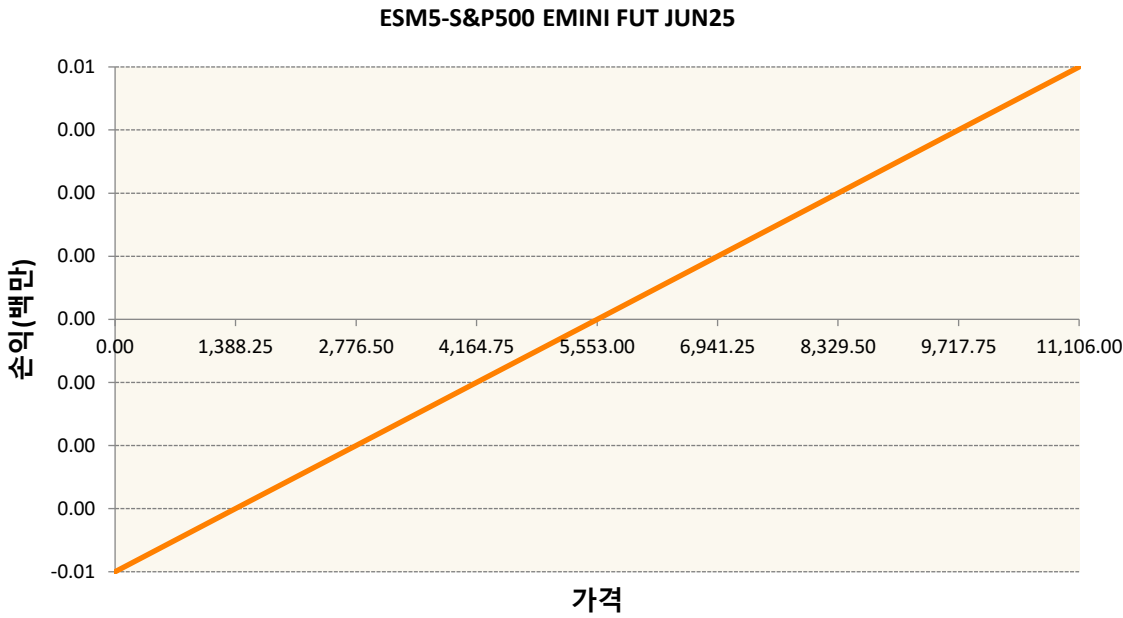
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,175	0	1,175	장내
누계	지수	선물	26,751	0	26,751	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,140
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	94

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,951

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

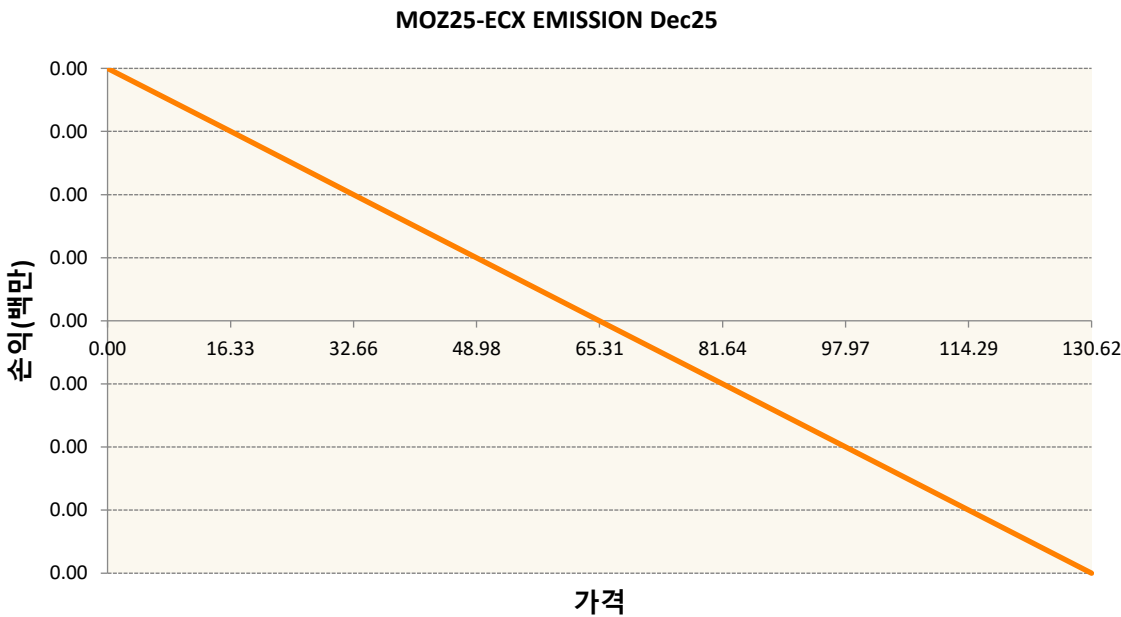
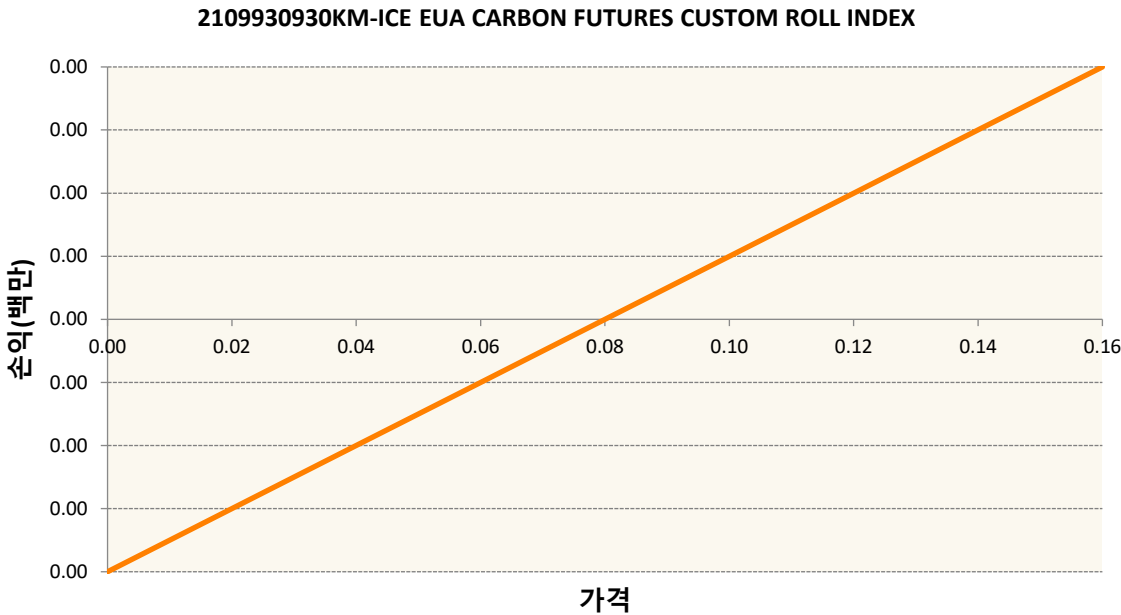
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	6,313	-6,283	
누계	통화	선도	0	2,647	-2,647	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		3
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E		5
FXW213F3TC KRW/EUR 30-04-25E		90
FXW213F4V(KRW/EUR 30-05-25E		23
FXW213F4V(KRW/EUR 30-05-25E		94
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		505

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,019

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

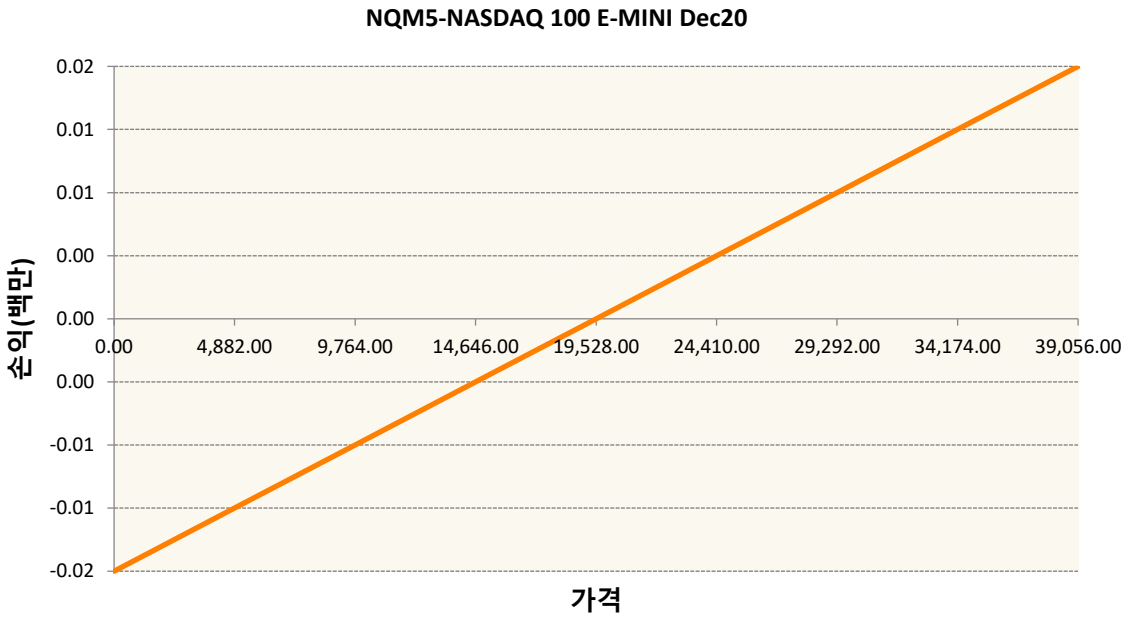
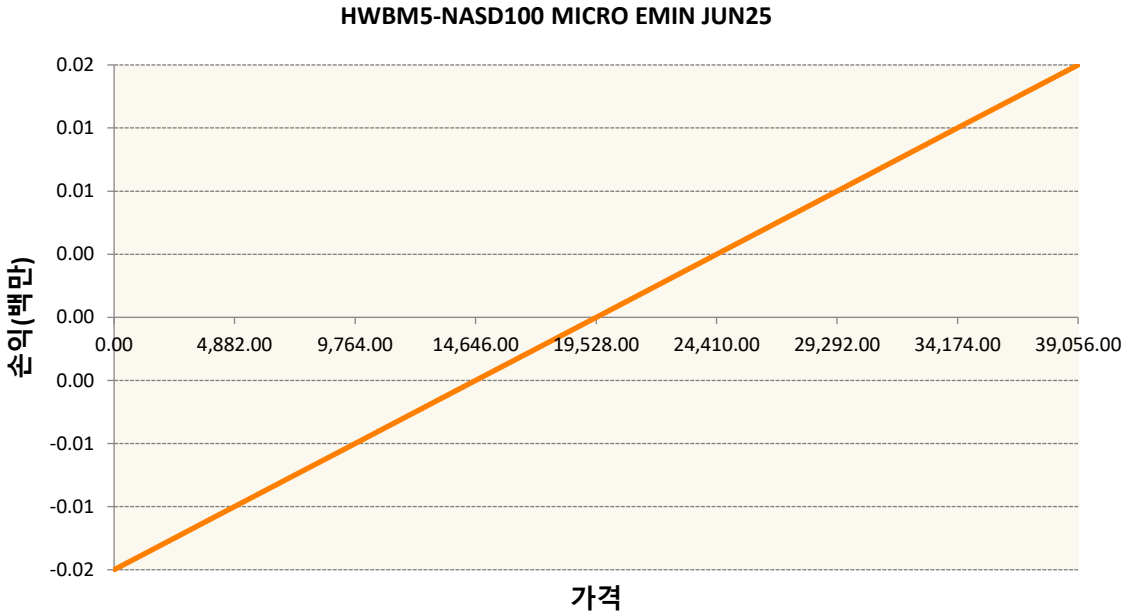
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,091	0	13,091	
누계	유가증권	선물	286	0	286	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		23
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,047

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,214

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액 (단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	2,055	0	2,055	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		3,104
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,291
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,067
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		1,472
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		166

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	10,302

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,643	0	6,643	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

16

공시일	2025-04-30
기준일	2025-04-29

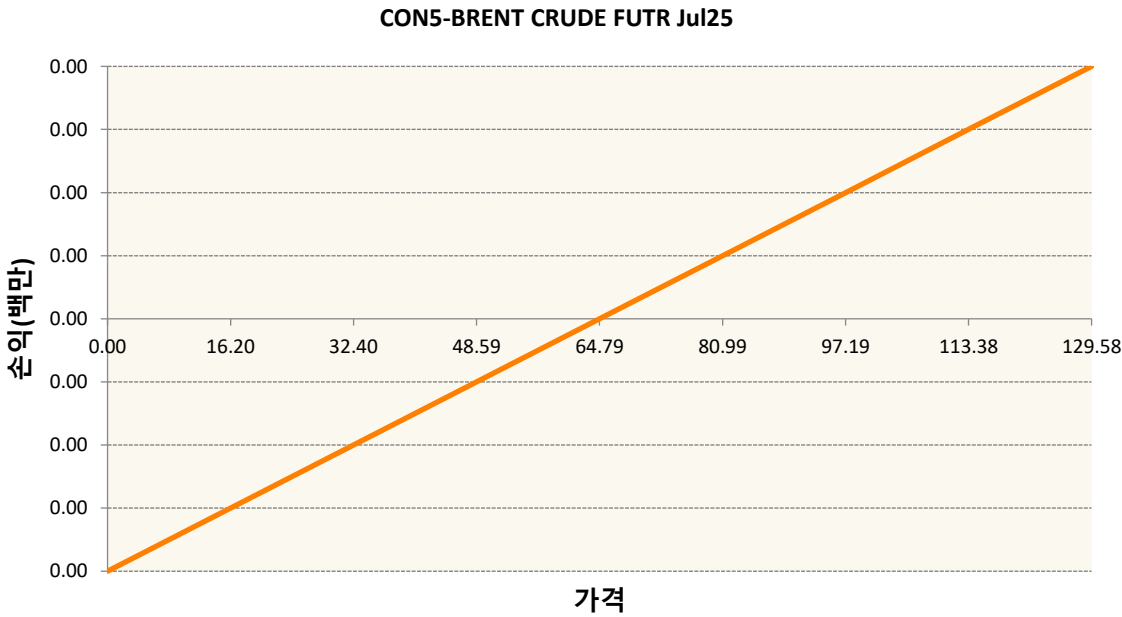
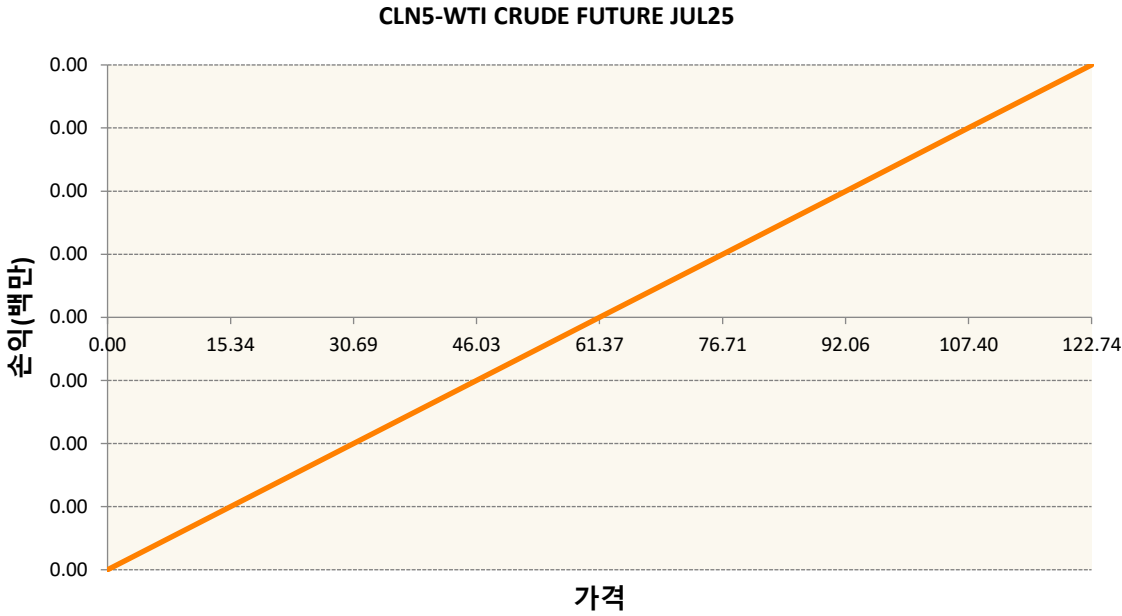
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

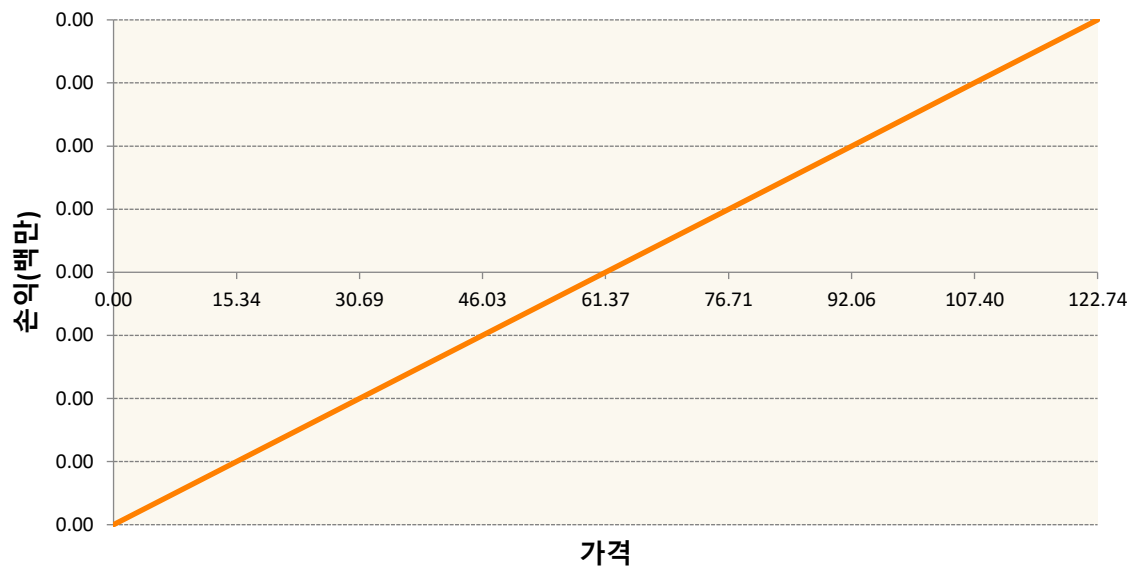
(단위:백만원)

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	72	-72	장내

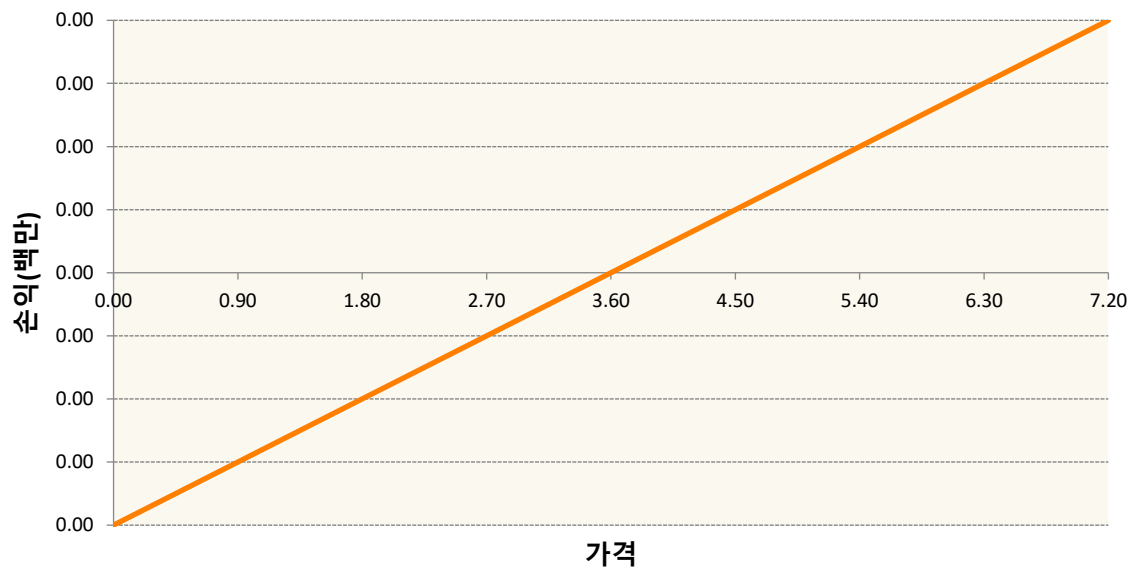
2. 만기시점의 손익구조



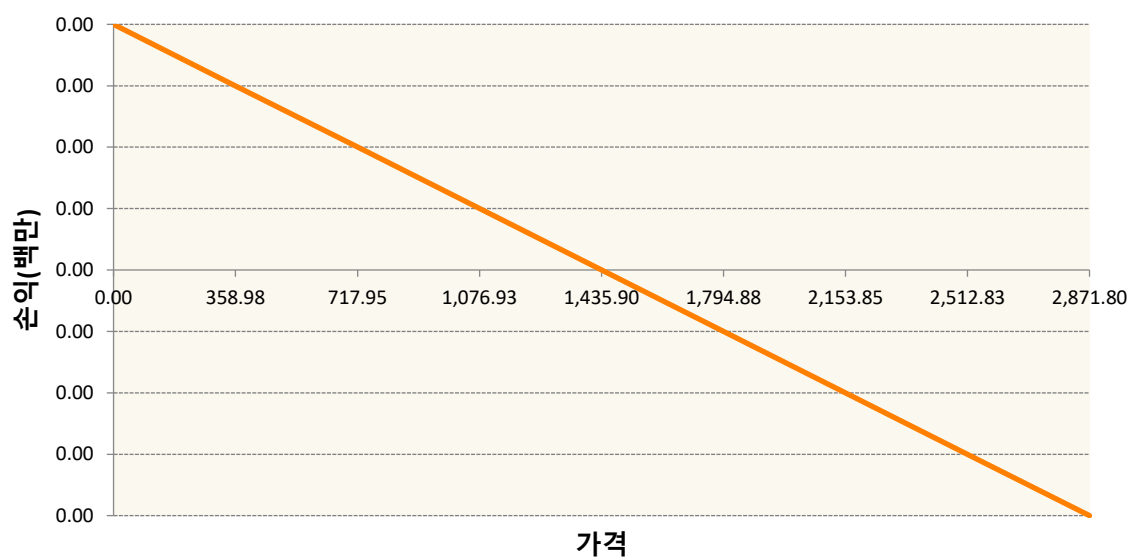
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



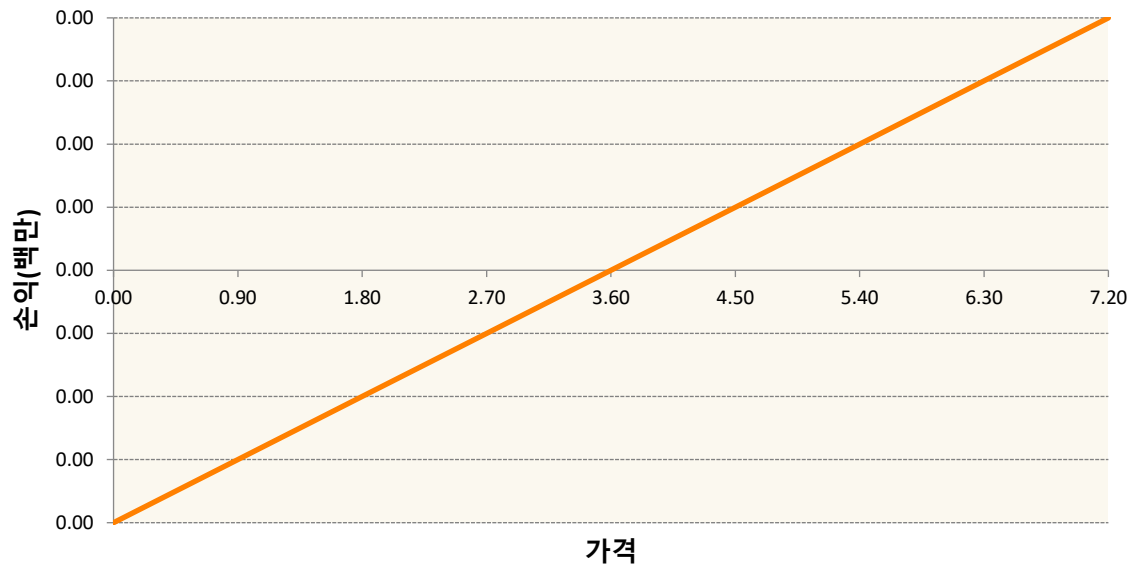
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



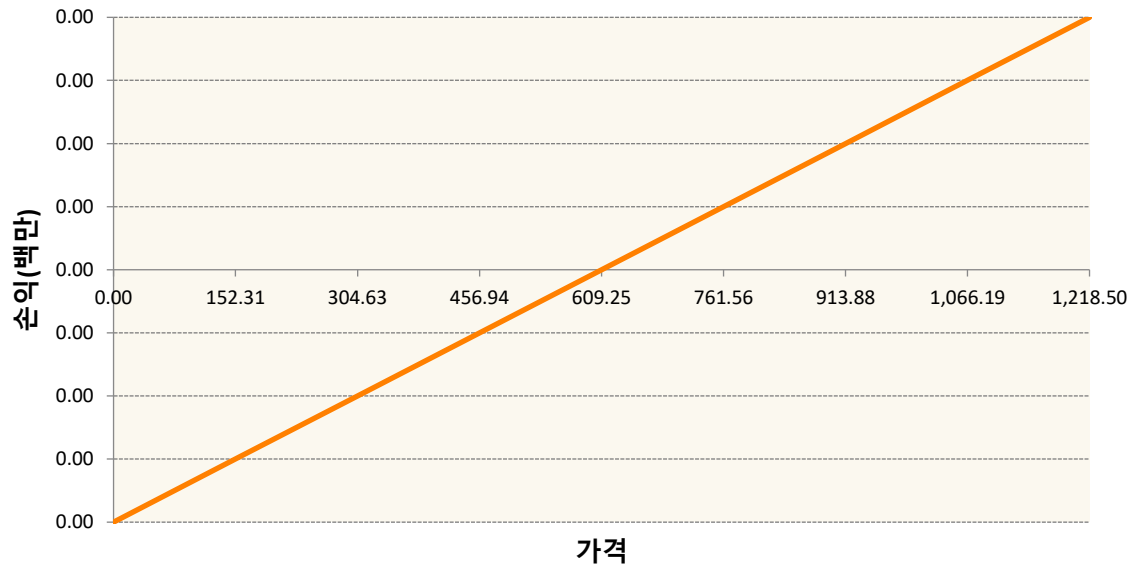
KR4175W50005-2025-05 달러선물



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	13
QSN5	Low Su Gasoil G JUL25	7

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

(단위:백만원)

120