

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

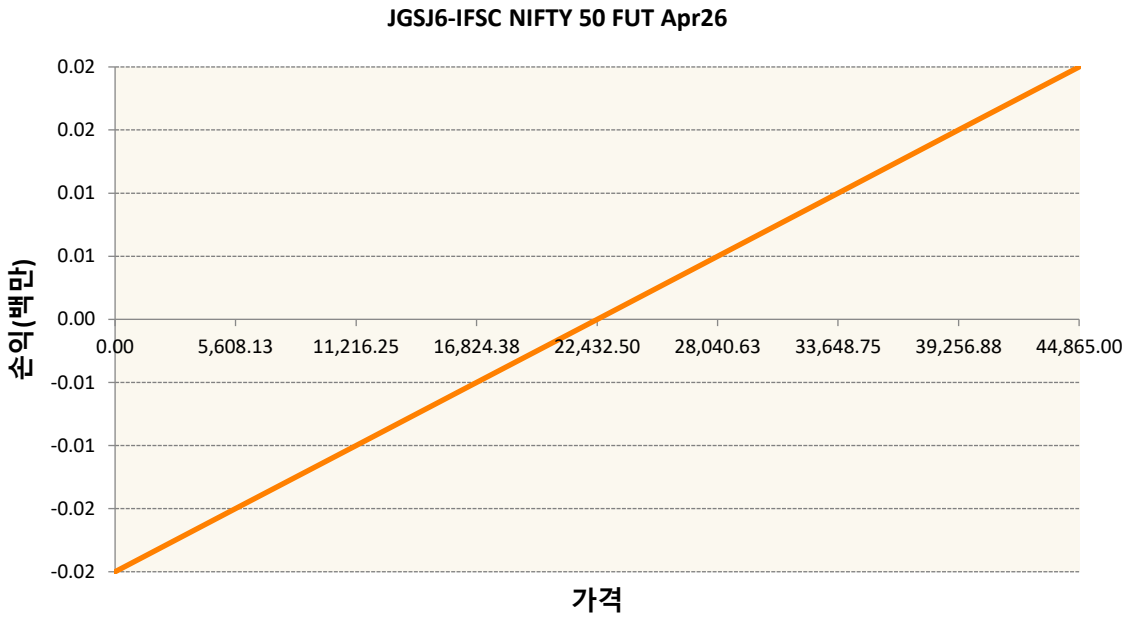
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	608	0	608	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ6	IFSC NIFTY 50 FUT Apr26	49
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

33

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

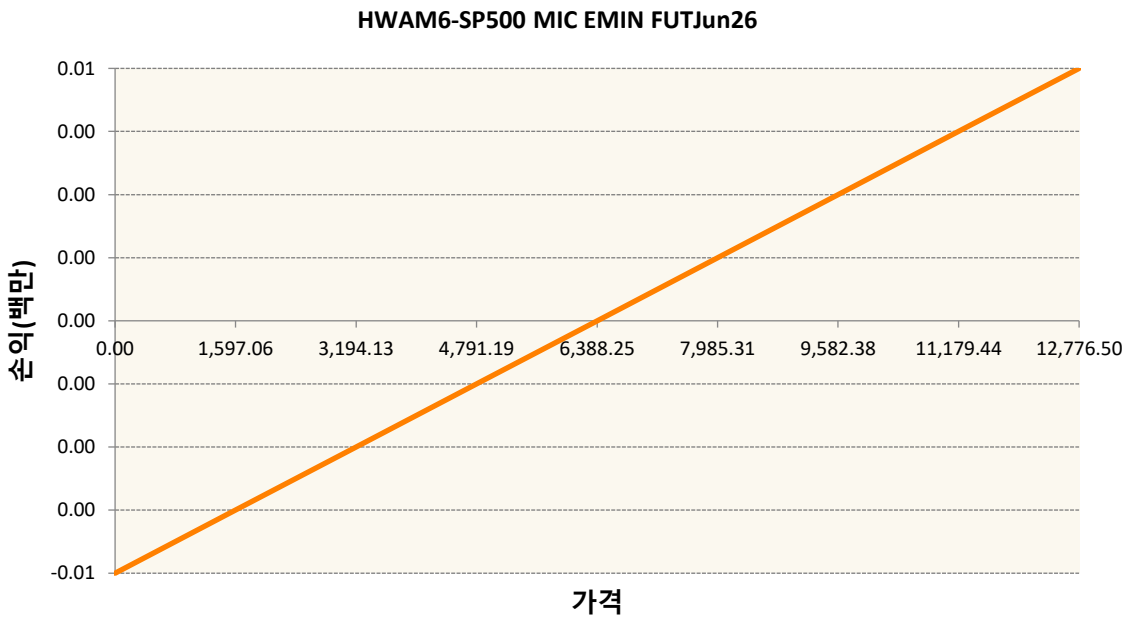
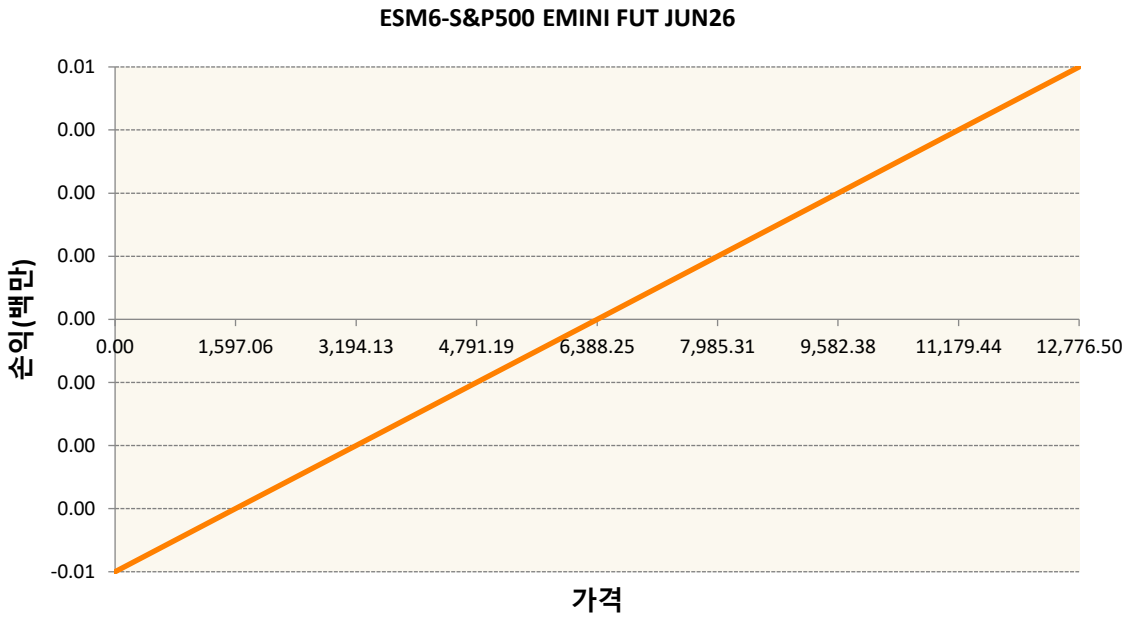
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	479	0	479	
누계	지수	선물	240	0	240	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	38
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	50

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

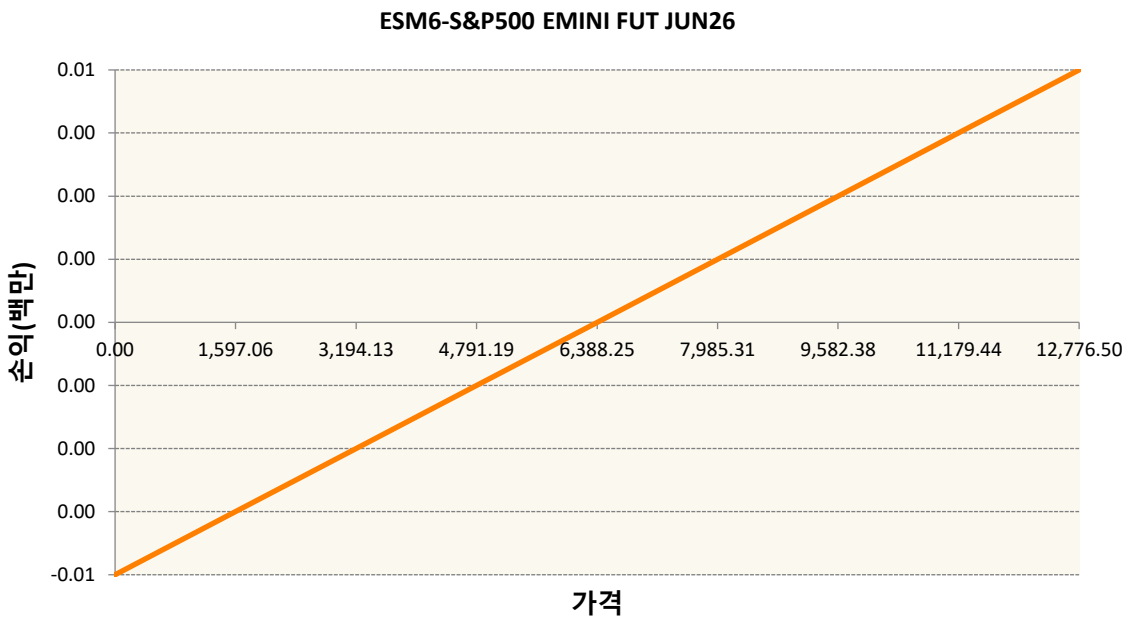
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	958	0	958	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	77
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

66

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

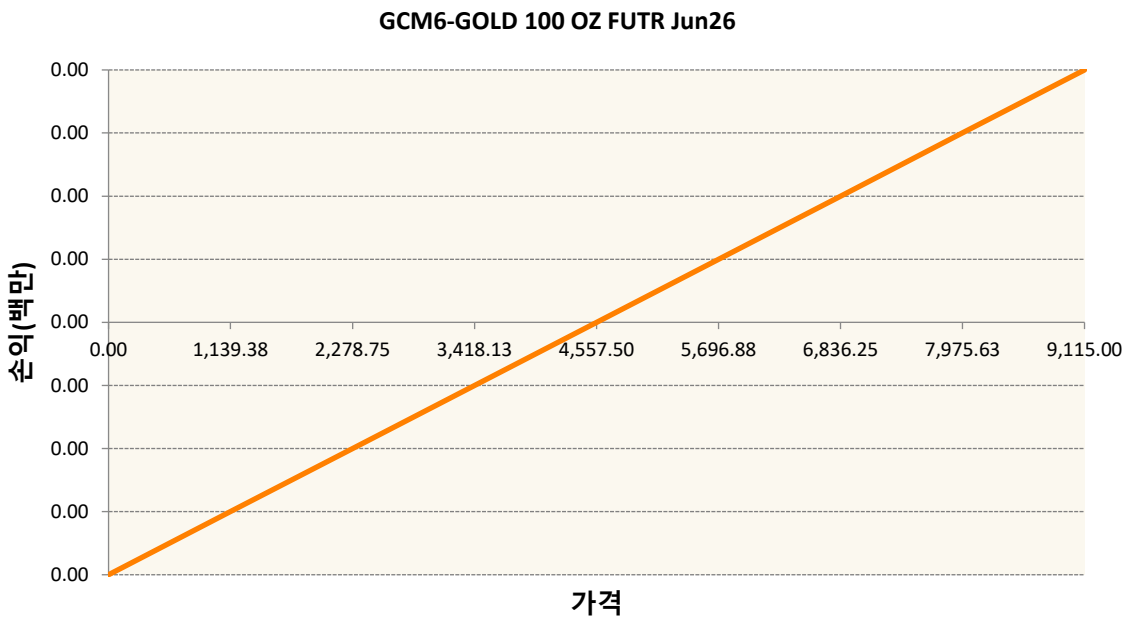
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	4,816	0	4,816	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 04/02/26 C420 EQUITY	27
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	385

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

(단위:백만원)

512

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUCC PLTR US 04/02/26 C155 EQUITY	49
AOPLTRUCP PLTR US 04/02/26 P155 EQUITY	63

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

(단위:백만원)

375

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSCC(TLT US 04/02/26 C86.5

1

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

(단위:백만원)

3

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

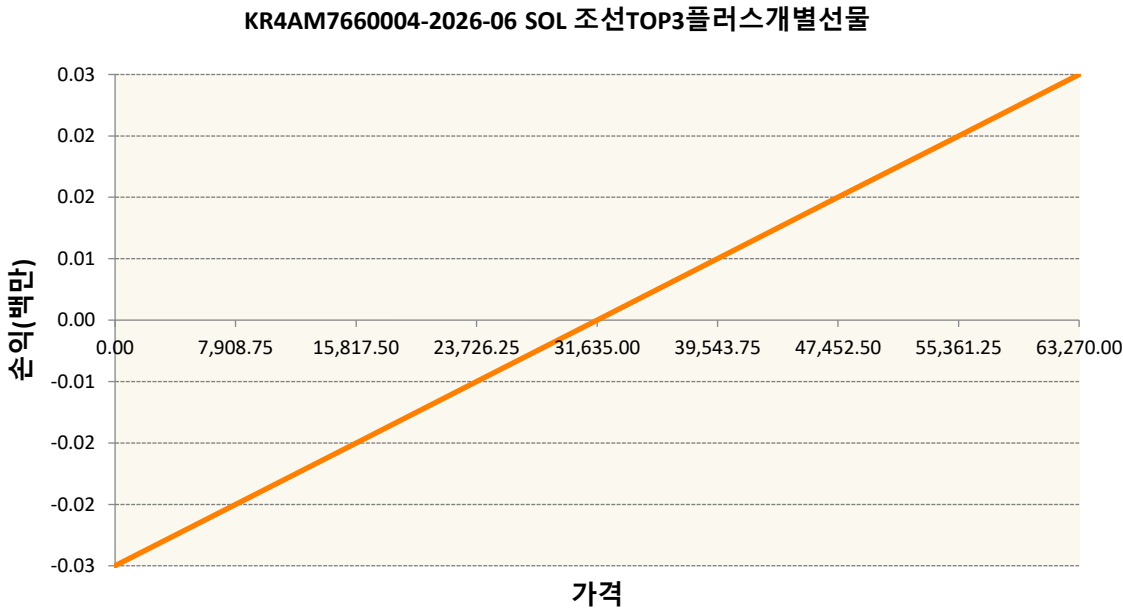
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	119,277	0	119,277	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-04-01

기준일 2026-03-31

포커스채권(채권-파생형)(종)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

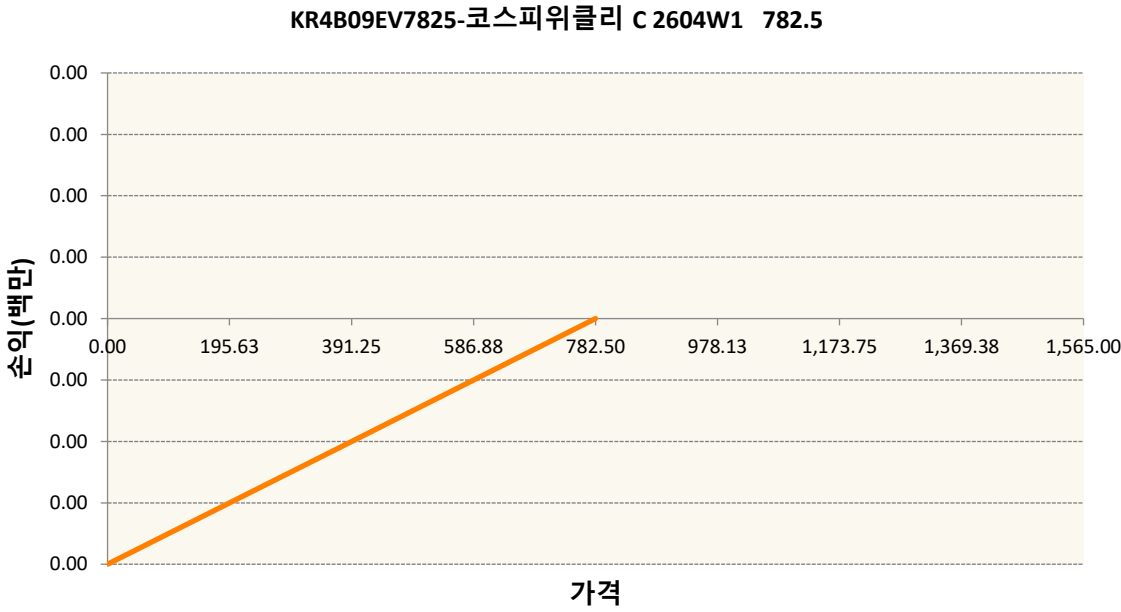
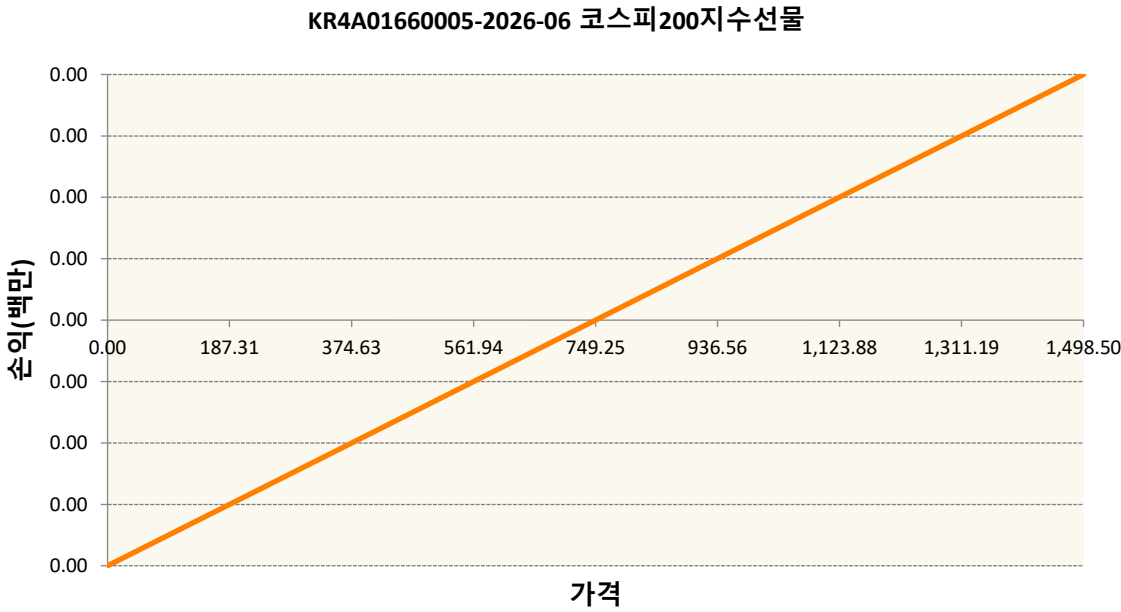
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

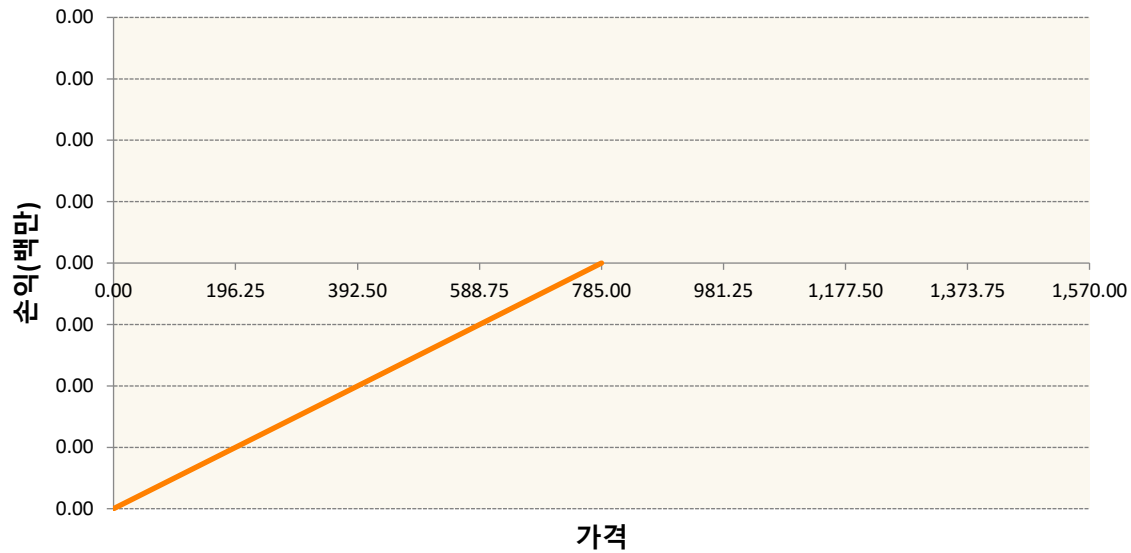
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,870	0	4,870	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,206	-9,206	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4B09EV7858-코스피위클리 C 2604W1 785.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005			2026-06 코스피200지수선물				387
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
-5.33%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-2.67%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	129	129	129	129	129	129	129
5.33%	258	258	258	258	258	258	258
8.00%	387	387	387	387	387	387	387
KR4B09EV7825			코스피위클리 C 2604W1 782.5				396
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-394	-394	-394	-394	-394	-395	-396
-5.33%	-255	-255	-256	-257	-258	-259	-261
-2.67%	-117	-119	-121	-123	-126	-130	-134
0%	14	10	5	0	-6	-12	-18
2.67%	128	121	113	105	97	88	80
5.33%	212	203	193	184	175	166	157
8.00%	259	252	244	236	228	220	212
KR4B09EV7858			코스피위클리 C 2604W1 785.0				270
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-269	-269	-269	-269	-269	-270	-270
-5.33%	-175	-175	-175	-176	-176	-177	-179
-2.67%	-81	-82	-83	-85	-87	-89	-91
0%	9	6	3	0	-4	-8	-12

2.67%	88	83	78	73	68	62	56
5.33%	148	142	135	129	123	117	110
8.00%	183	178	172	167	161	155	149

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

(단위:백만원)

1,508

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

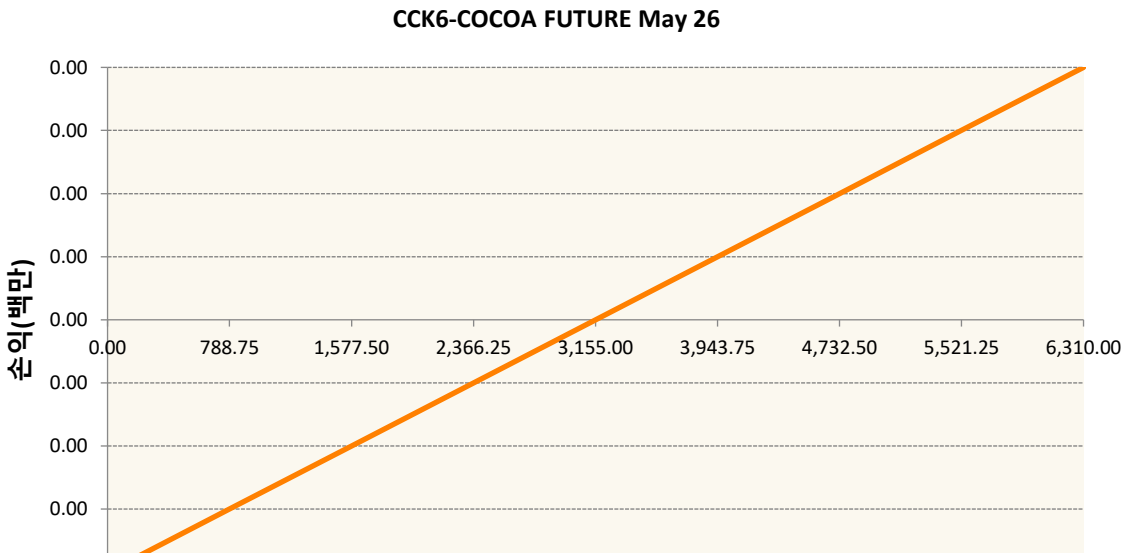
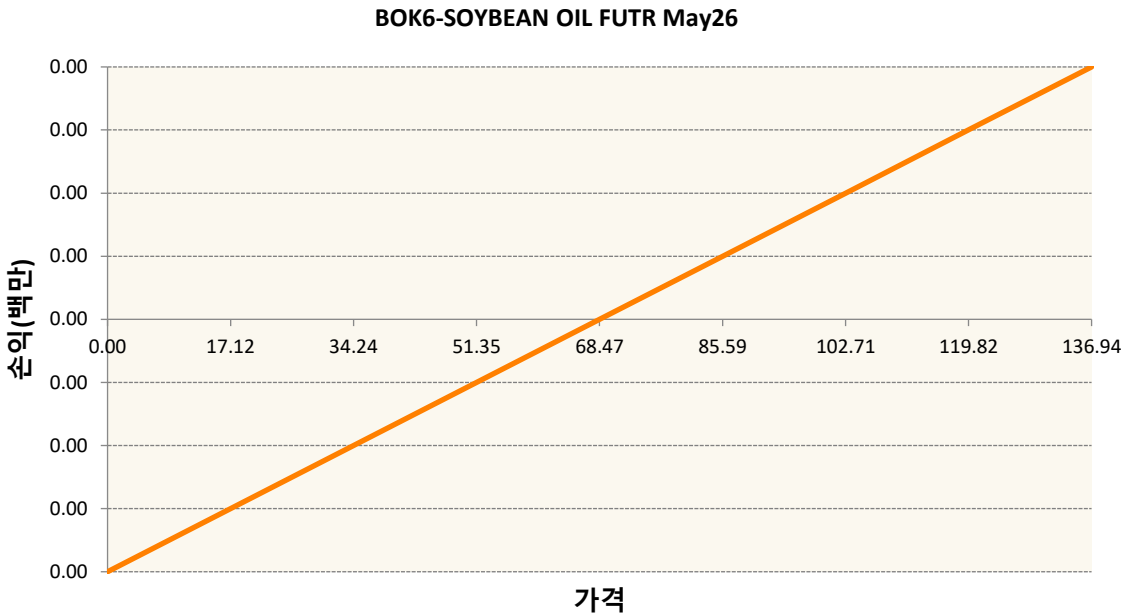
포커스농산물모(채권-파생형)

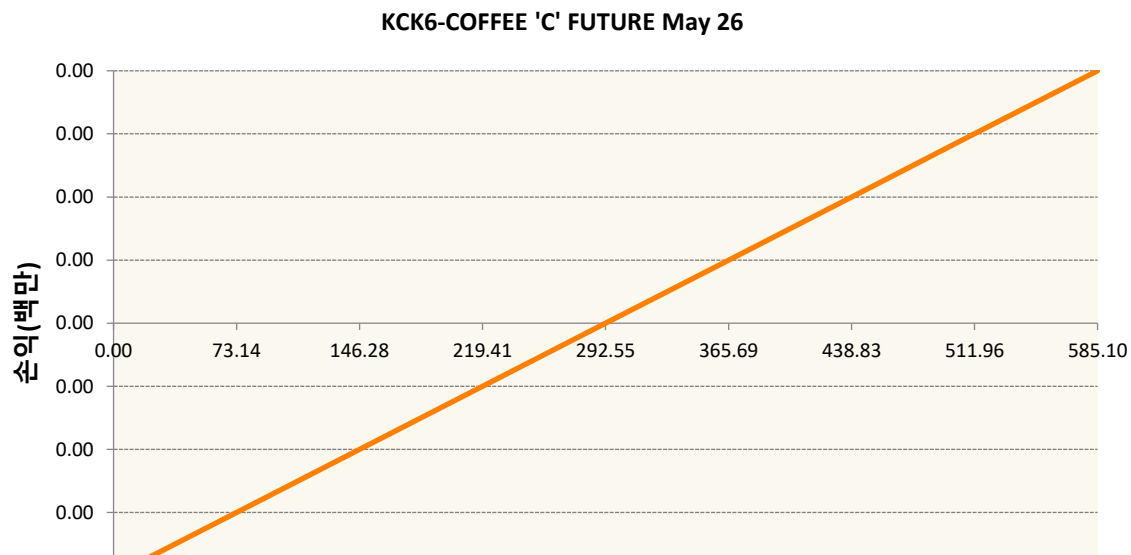
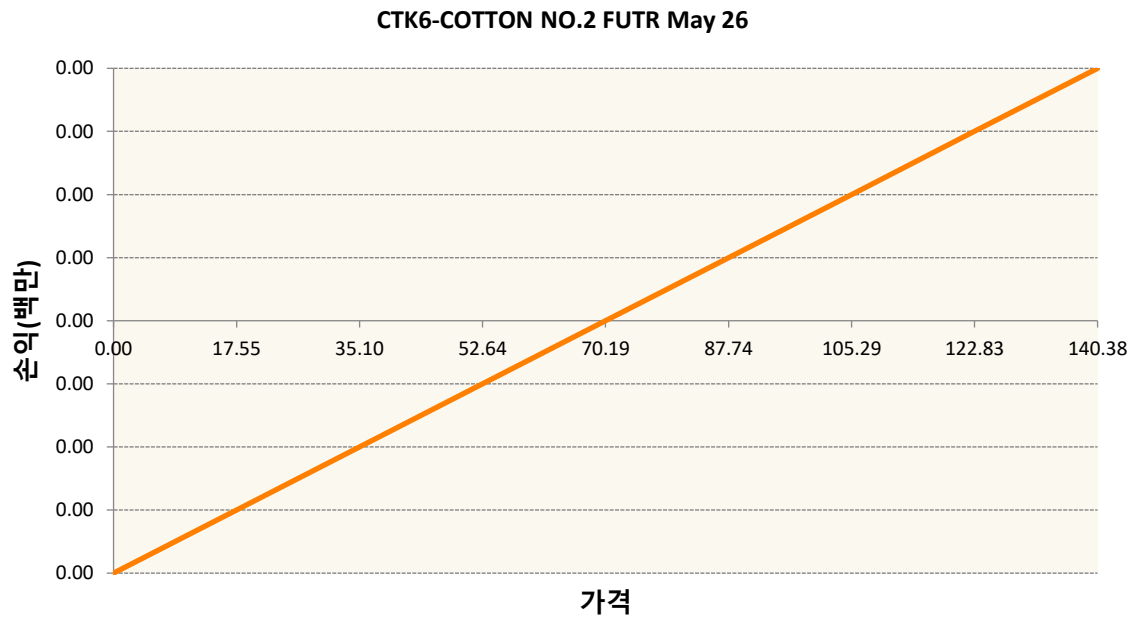
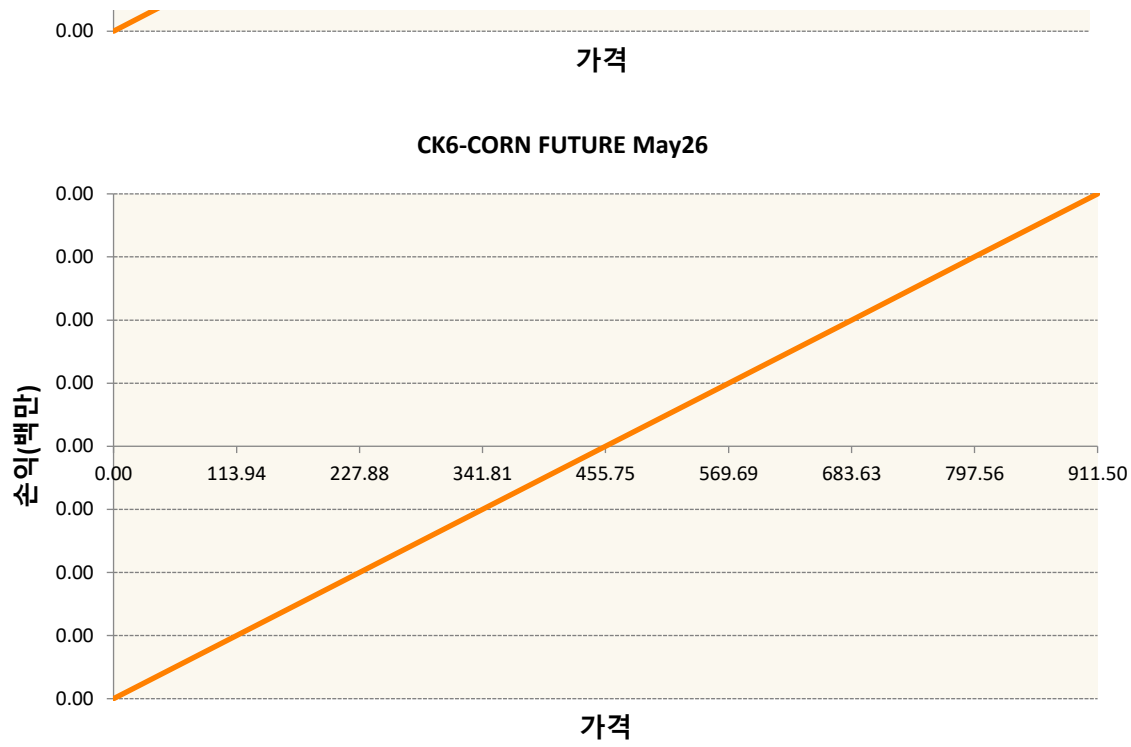
1. 계약금액

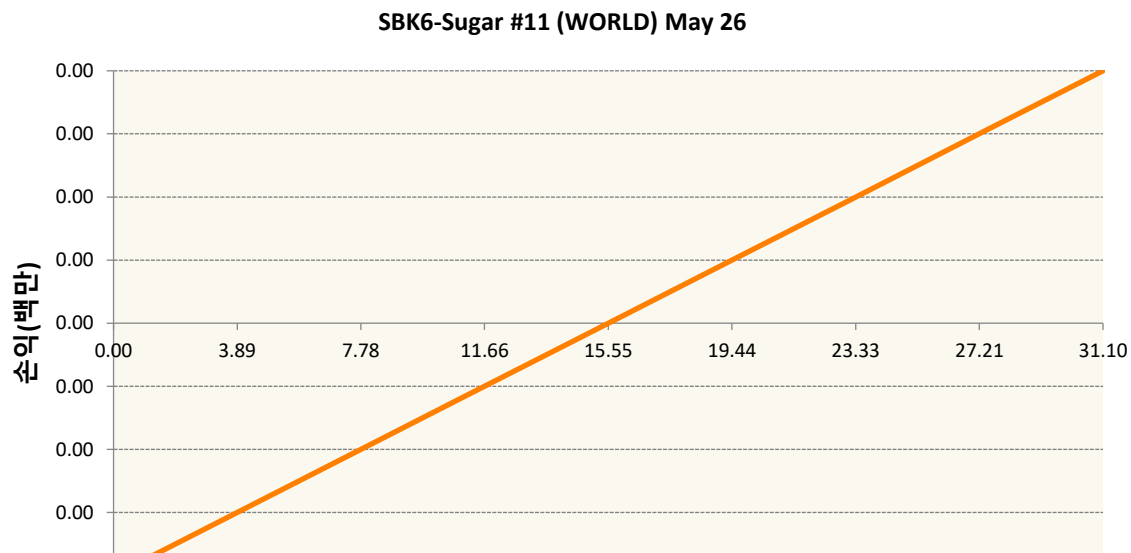
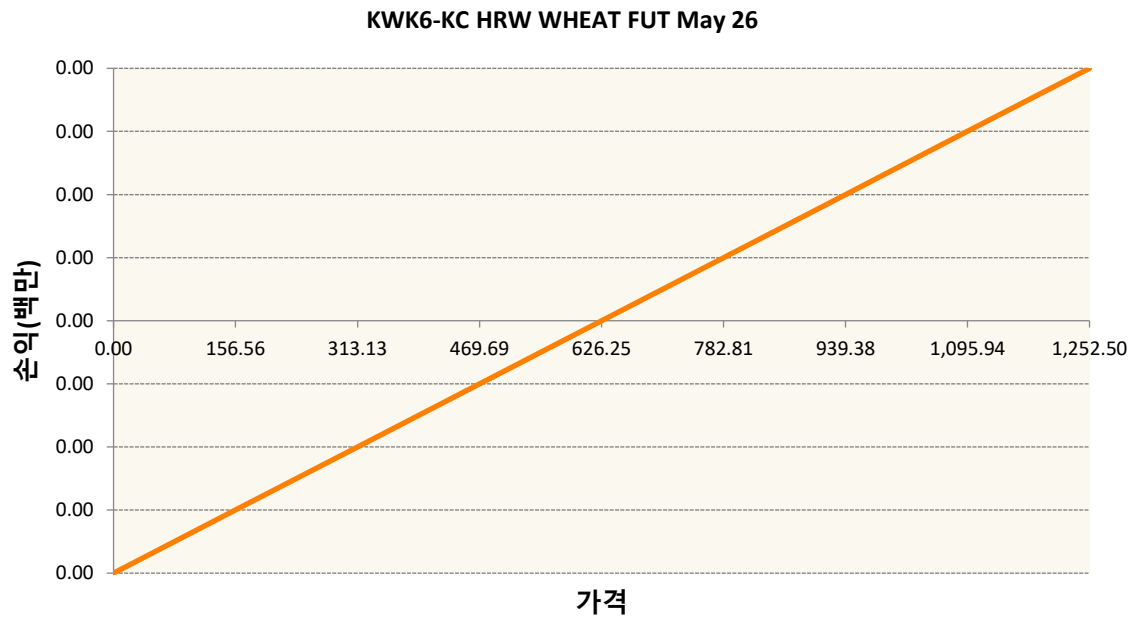
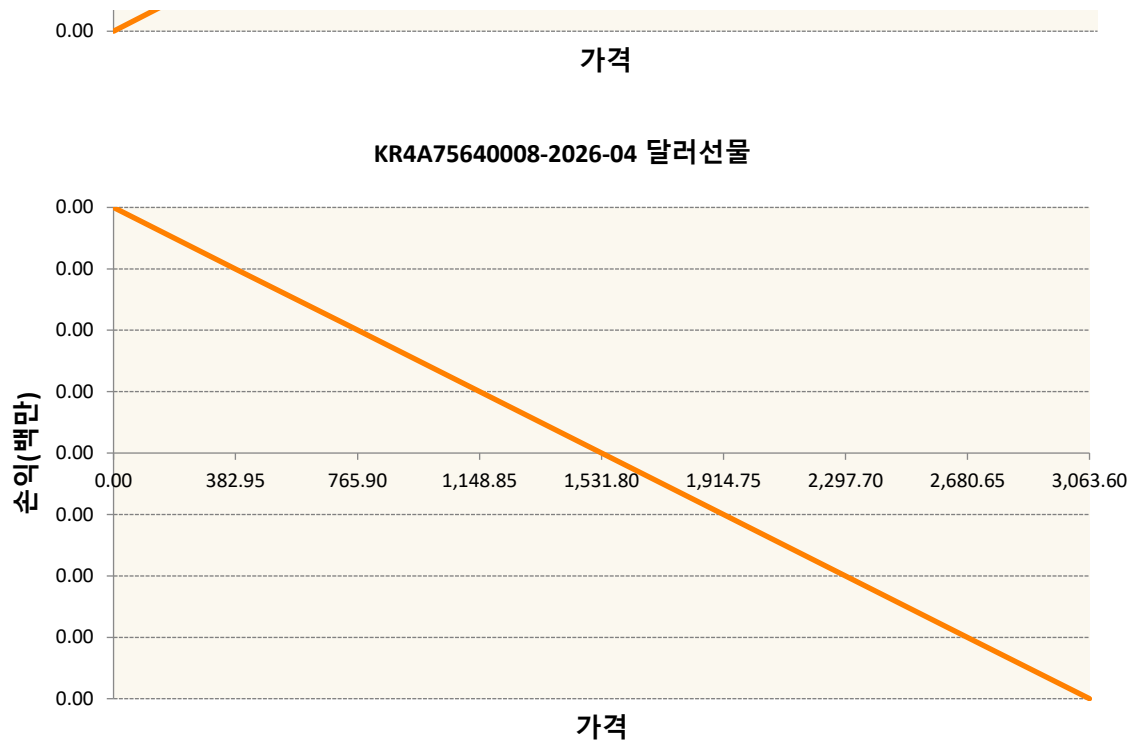
(단위:USD 백만)

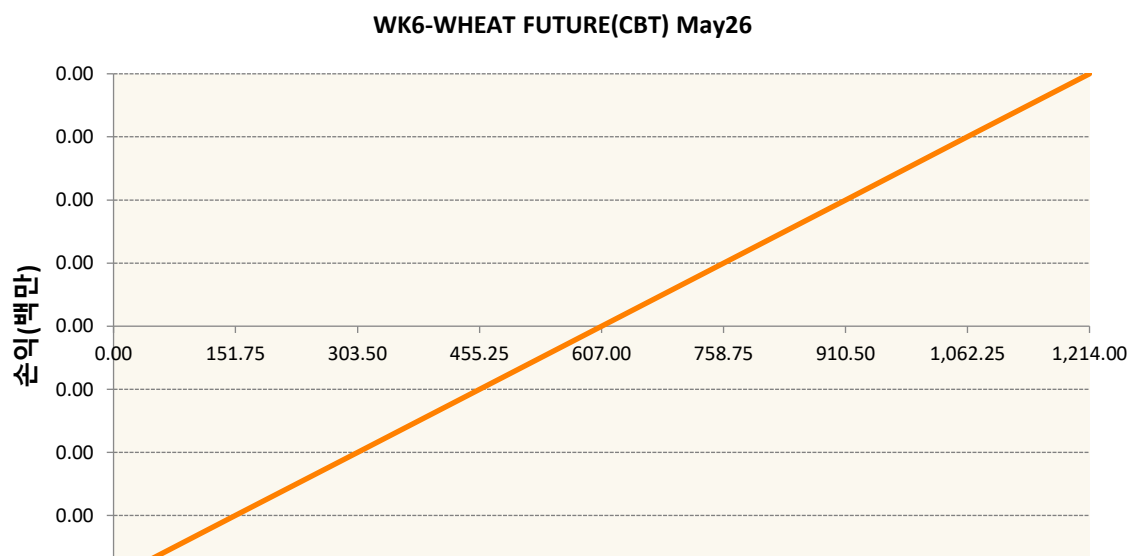
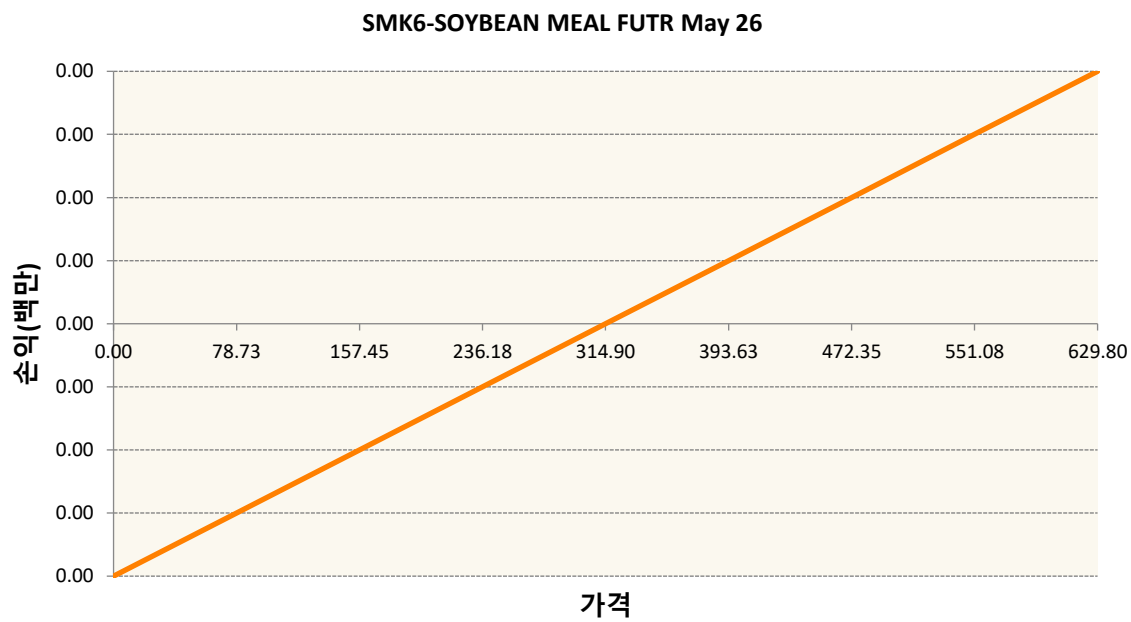
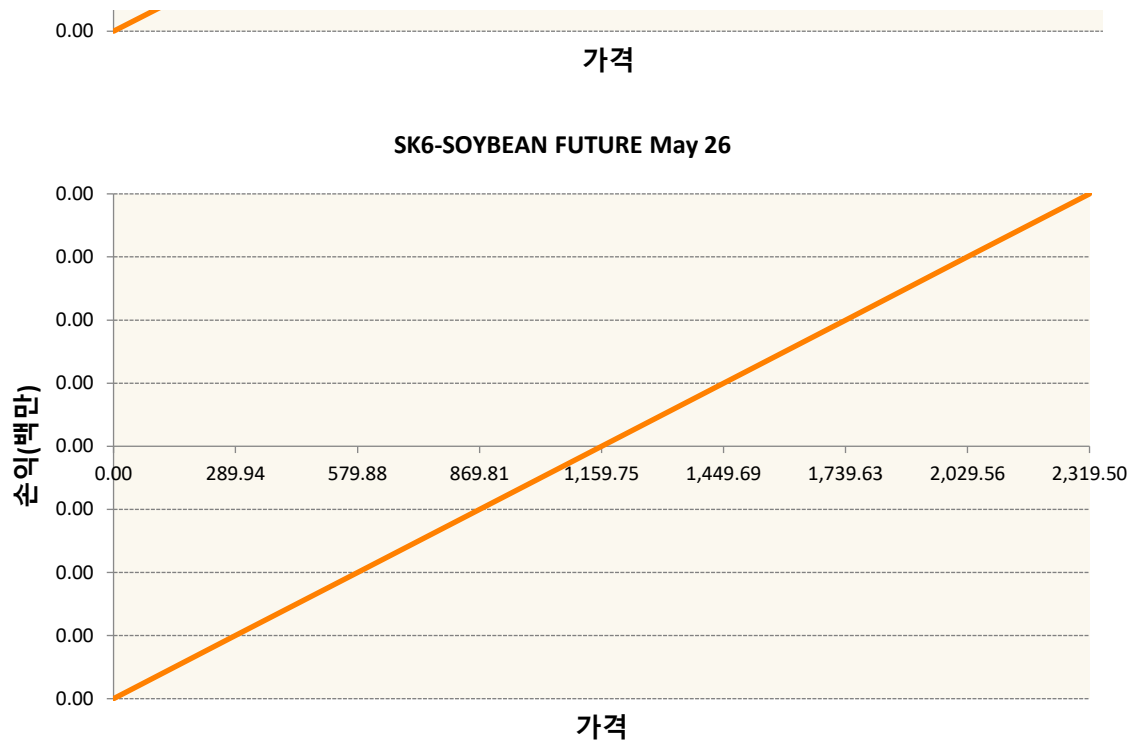
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	46	-46	장내
누계	실물자산	선물	1,309	0	1,309	
누계	유가증권	선물	1,591	0	1,591	
누계	통화	선물	0	505	-505	장내

2. 만기시점의 손익구조









0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

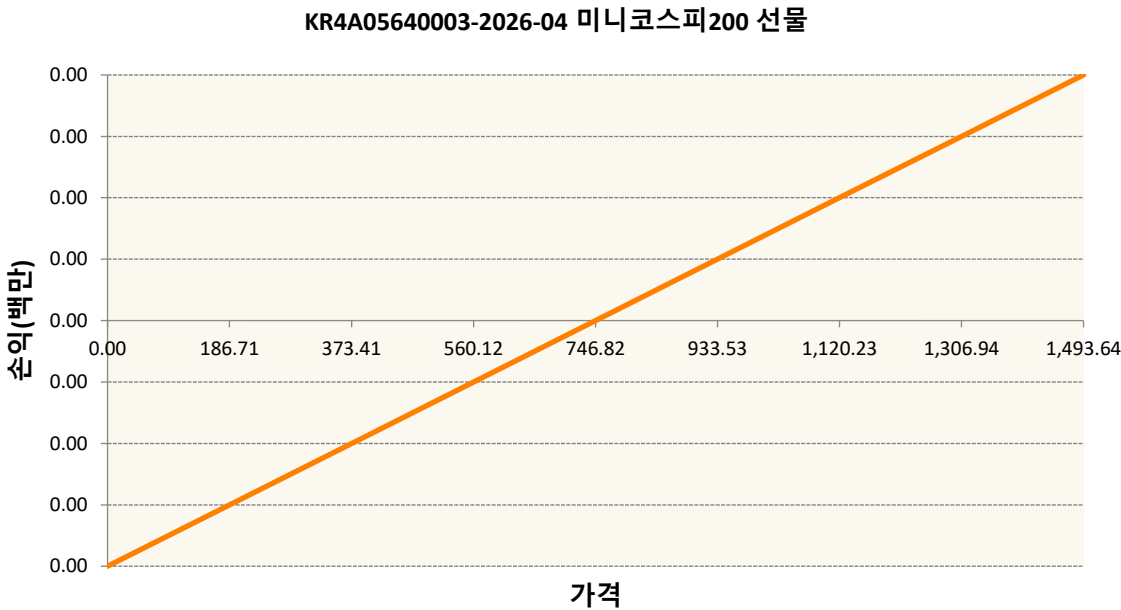
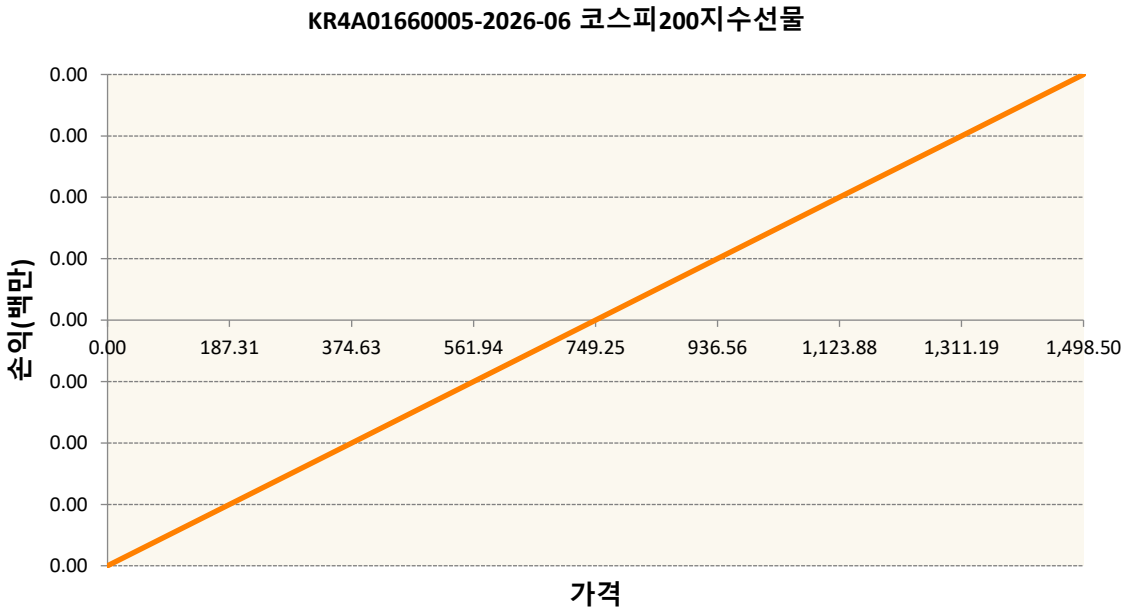
스마트인덱스모

1. 계약금액

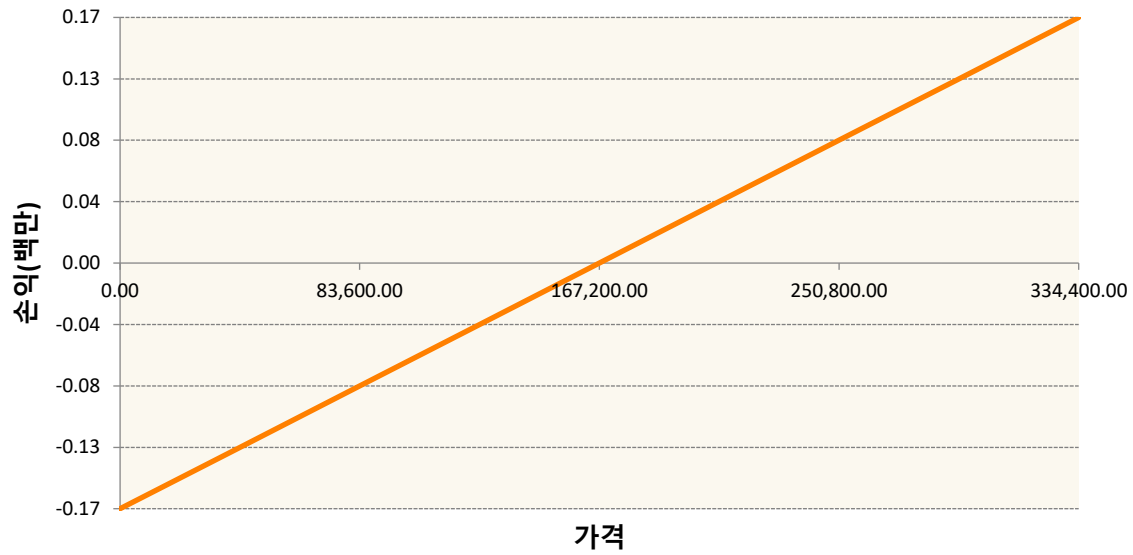
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	382	0	382	장내
누계	유가증권	선물	3,600	0	3,600	장내

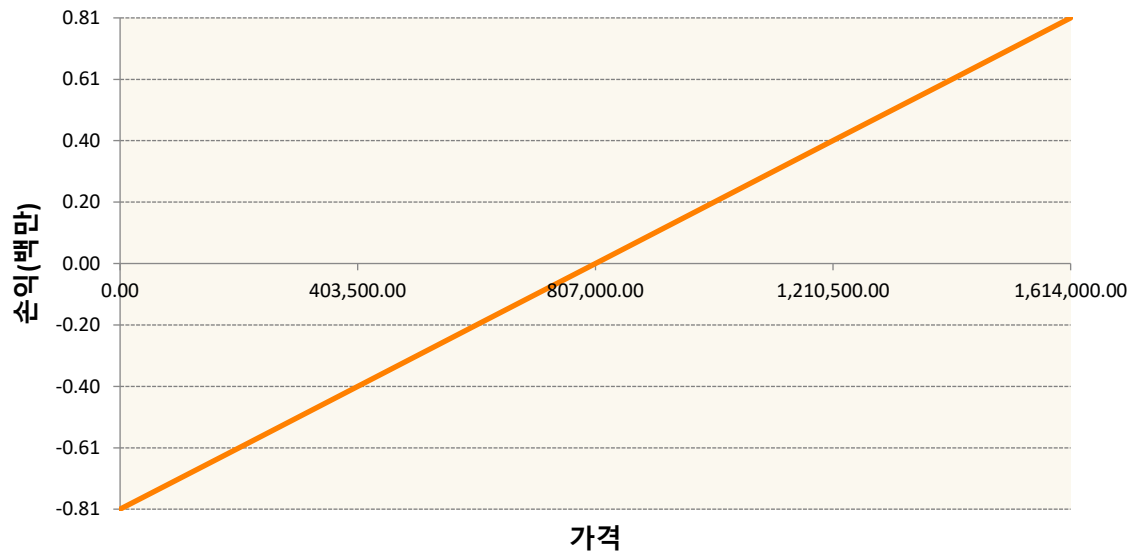
2. 만기시점의 손익구조



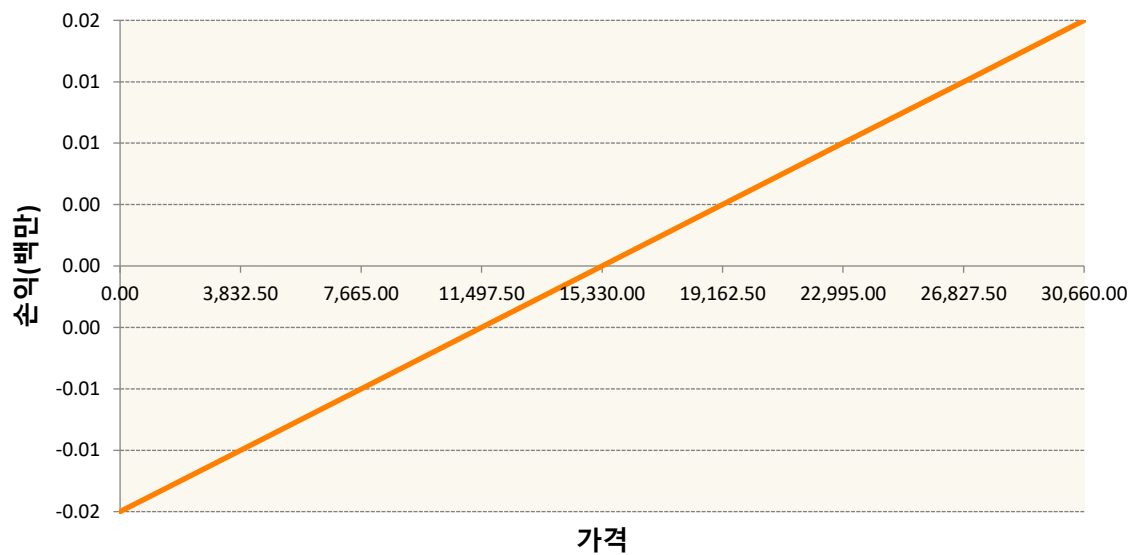
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					179
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179
-5.33%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	119	119	119	119	119	119	119
8.00%	179	179	179	179	179	179	179
KR4A05640003		2026-04 미니코스피200 선물					6
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	6	6	6	6	6	6	6
KR4A11640005		2026-04 삼성전자개별선물					70
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	70	70	70	70	70	70	70
KR4A50640007		2026-04 SK하이닉스개별선물					7
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	7
KR4AFT640008		2026-04 대우건설개별선물					1
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

576

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

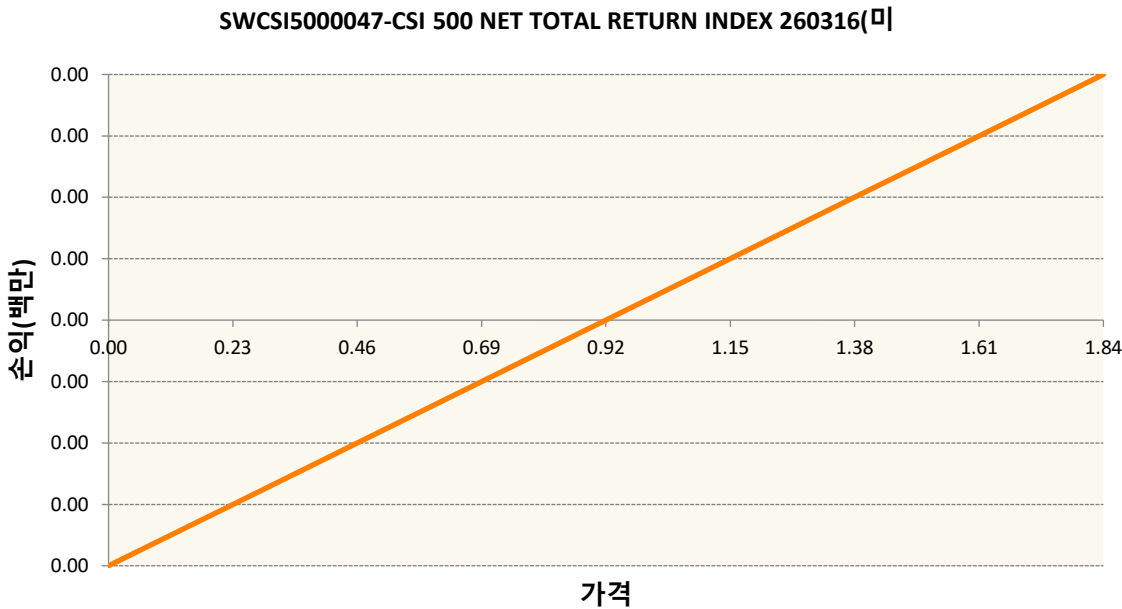
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,192	0	5,192	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

416

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

548

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

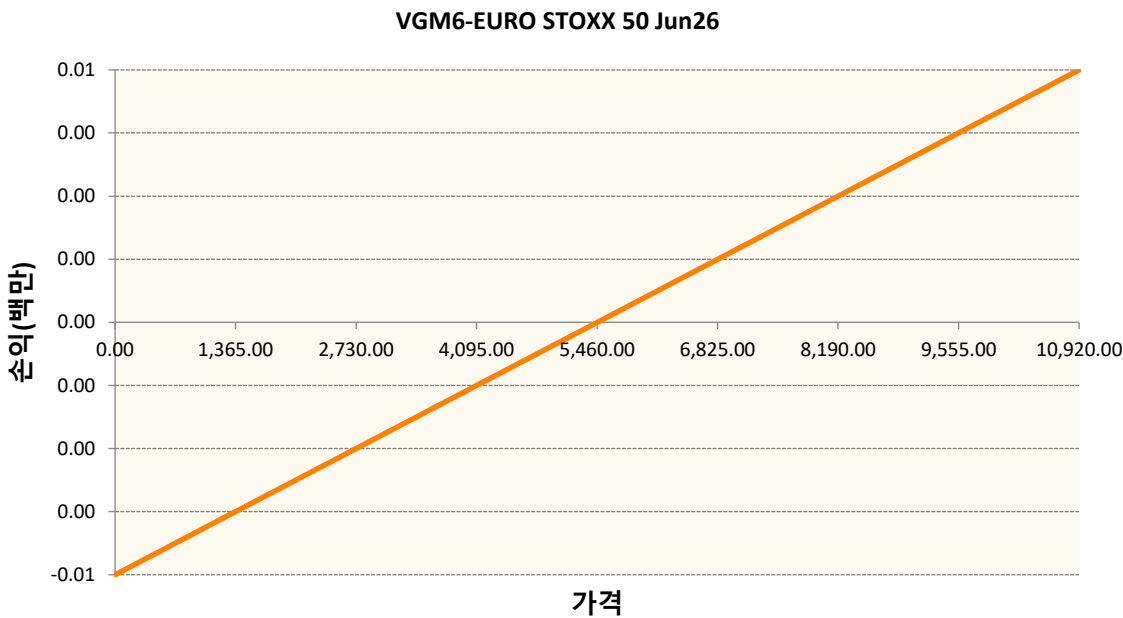
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	840	0	840	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	67
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

56

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

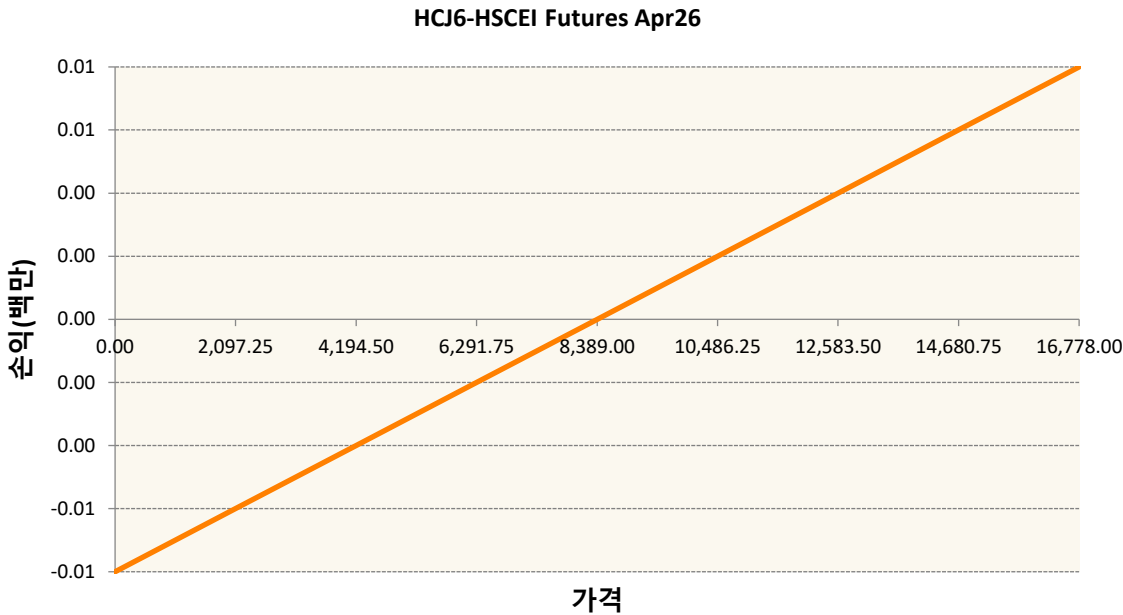
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,456	0	1,456	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI6	HSCEI Futures Apr26	116
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

142

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

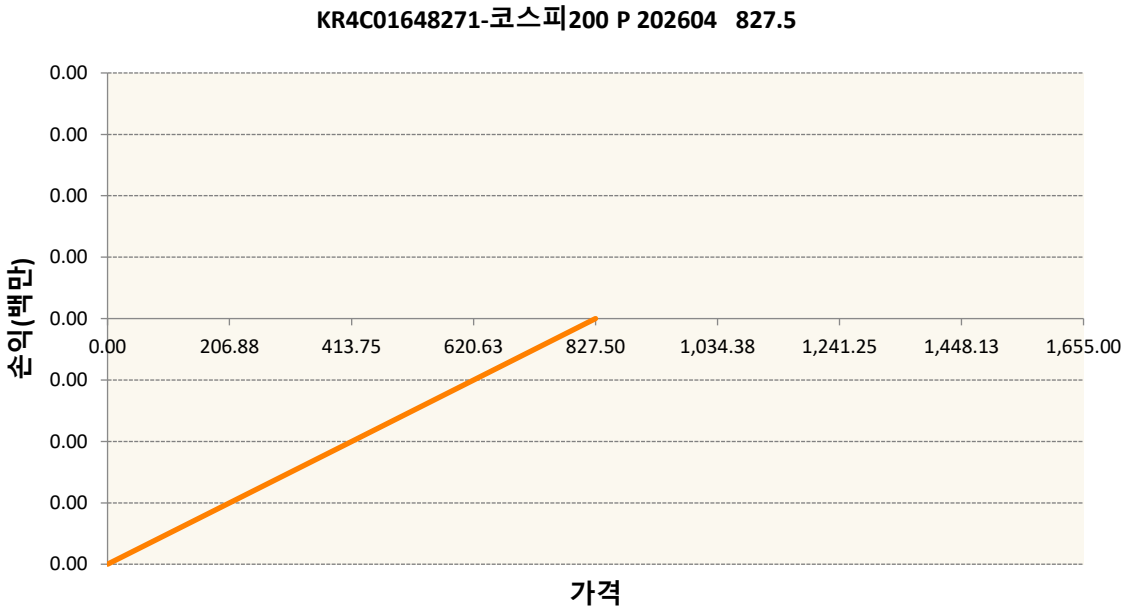
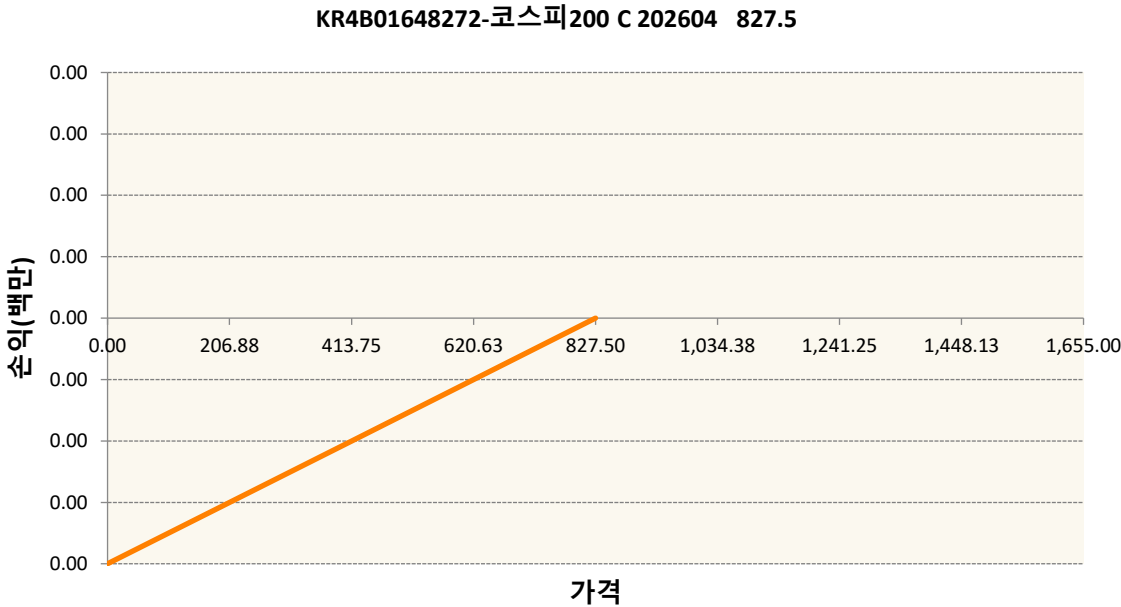
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	625	-625	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,617	-36,617	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01648272 코스피200 C 202604 827.5							2,000
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,878	-1,886	-1,898	-1,916	-1,939	-1,967	-2,000
-5.33%	-1,180	-1,196	-1,219	-1,248	-1,282	-1,322	-1,367
-2.67%	-498	-527	-563	-606	-654	-708	-766
0%	158	112	59	0	-64	-132	-203
2.67%	771	706	635	560	482	400	316
5.33%	1,326	1,242	1,155	1,066	975	882	788
8.00%	1,808	1,710	1,611	1,511	1,411	1,310	1,209
KR4C01648271 코스피200 P 202604 827.5							475
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-446	-448	-451	-456	-461	-468	-475
-5.33%	-281	-284	-290	-297	-305	-314	-325
-2.67%	-118	-125	-134	-144	-156	-168	-182
0%	38	27	14	0	-15	-31	-48
2.67%	183	168	151	133	114	95	75
5.33%	315	295	275	253	232	210	187
8.00%	430	407	383	359	335	312	288

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

2,420

공시일 2026-04-01

기준일 2026-03-31

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

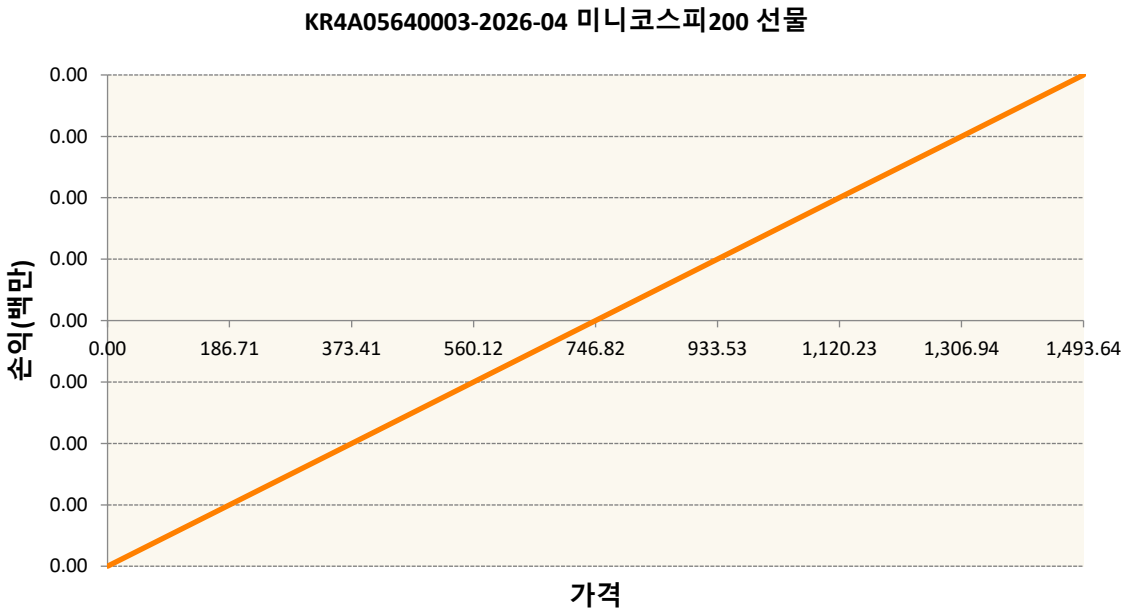
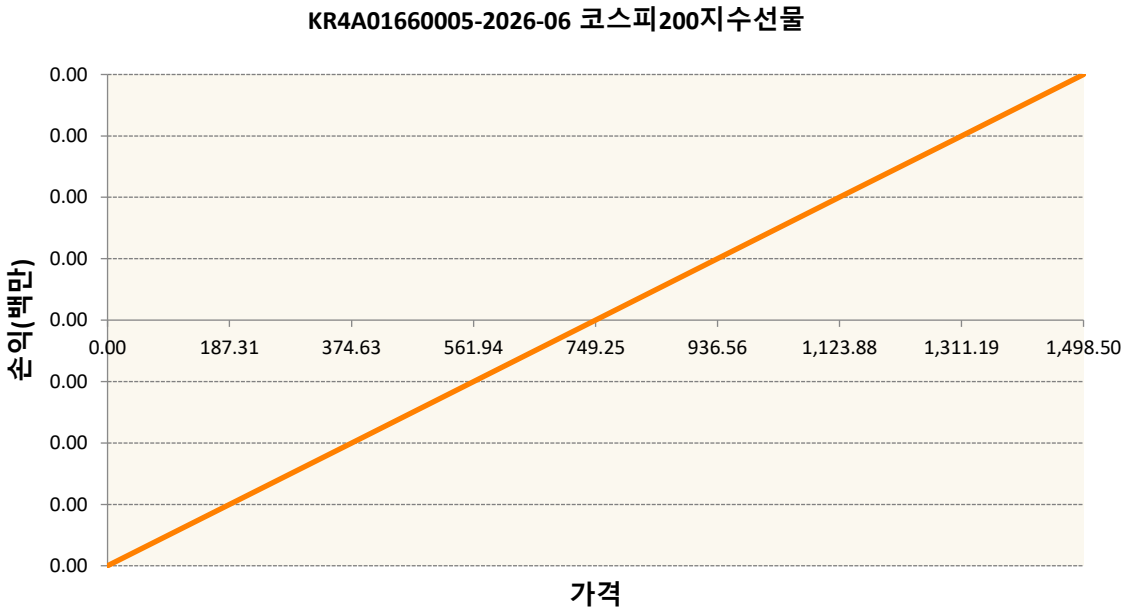
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

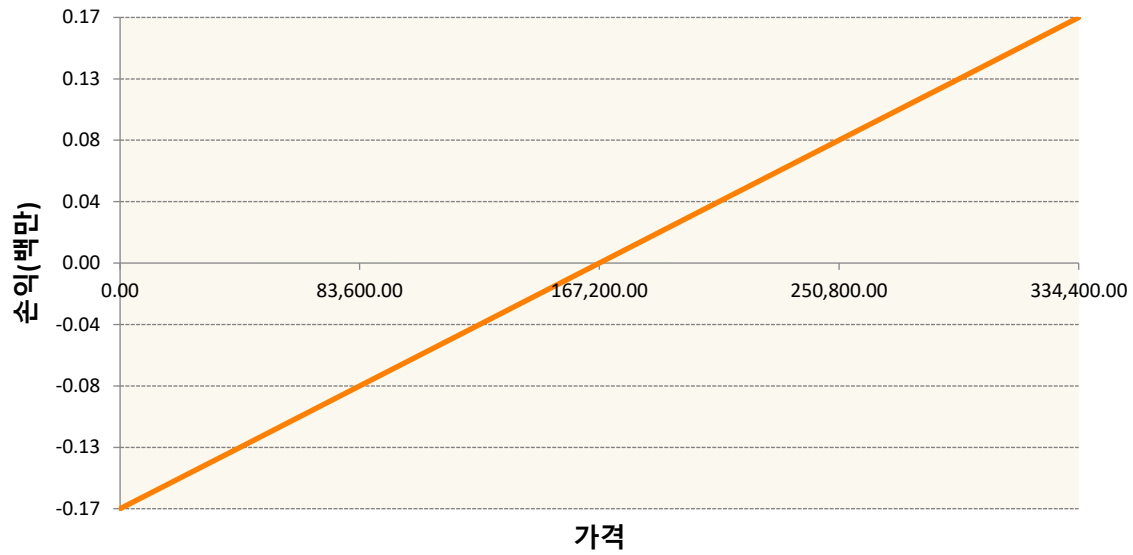
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,064	0	4,064	장내

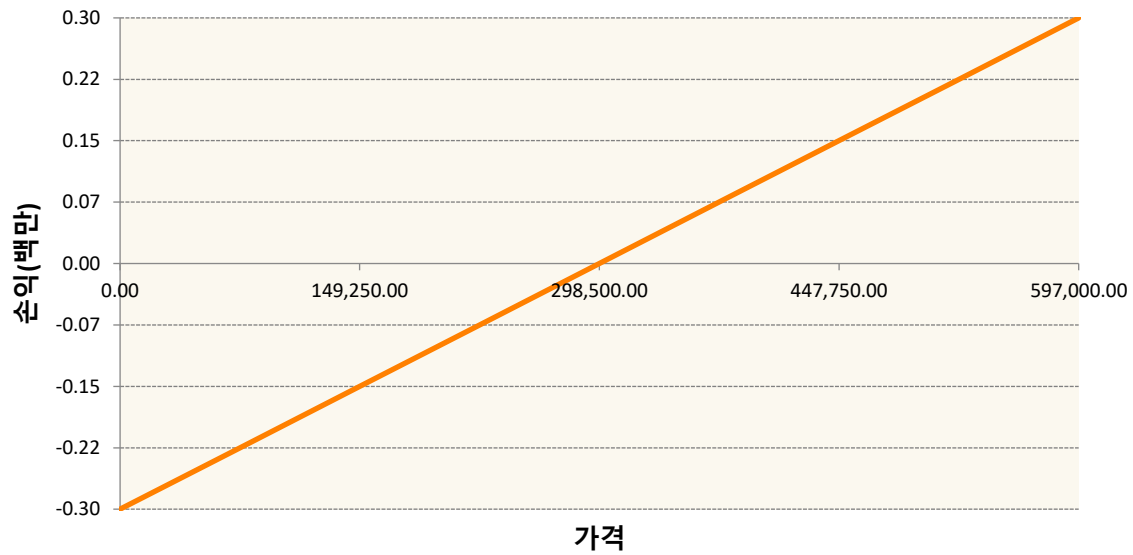
2. 만기시점의 손익구조



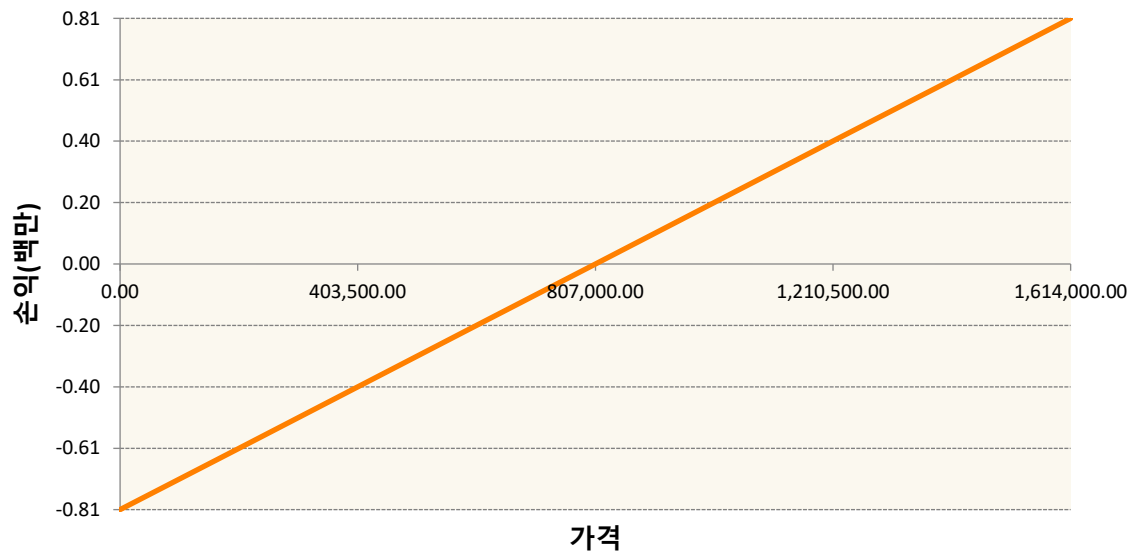
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



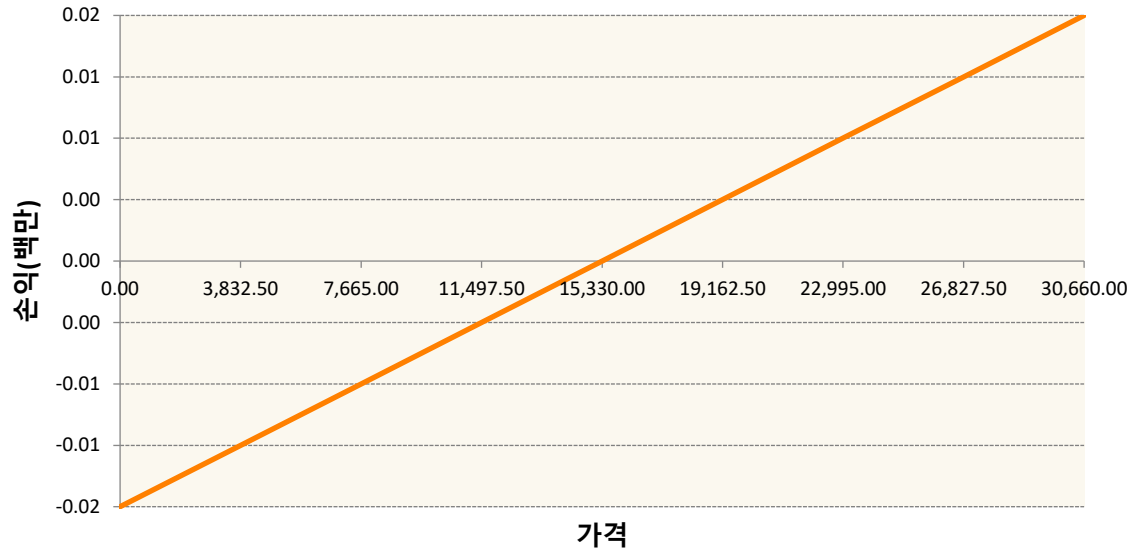
KR4A47640003-2026-04 LG화학개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								74
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	50	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	74	74	74	74	74	74	74	74
KR4A05640003 2026-04 미니코스피200 선물								48
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	32	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	48	48	48	48	48	48	48	48
KR4A11640005 2026-04 삼성전자개별선물								1
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR4A47640003 2026-04 LG화학개별선물 6

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

KR4A50640007 2026-04 SK하이닉스개별선물 4

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4AFT640008 2026-04 대우건설개별선물 0

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
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)

277

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

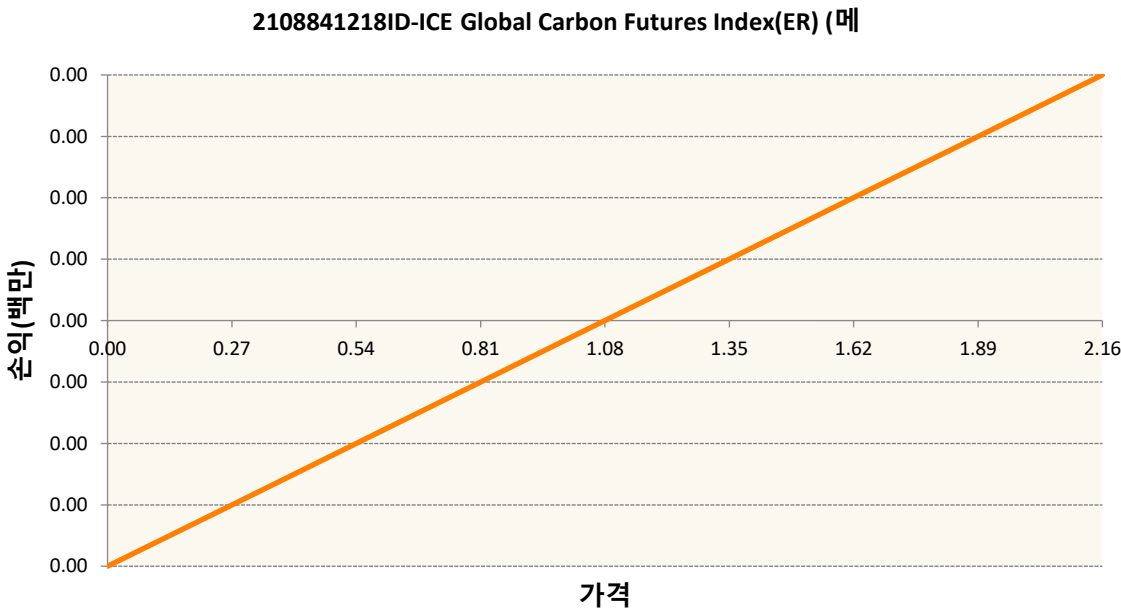
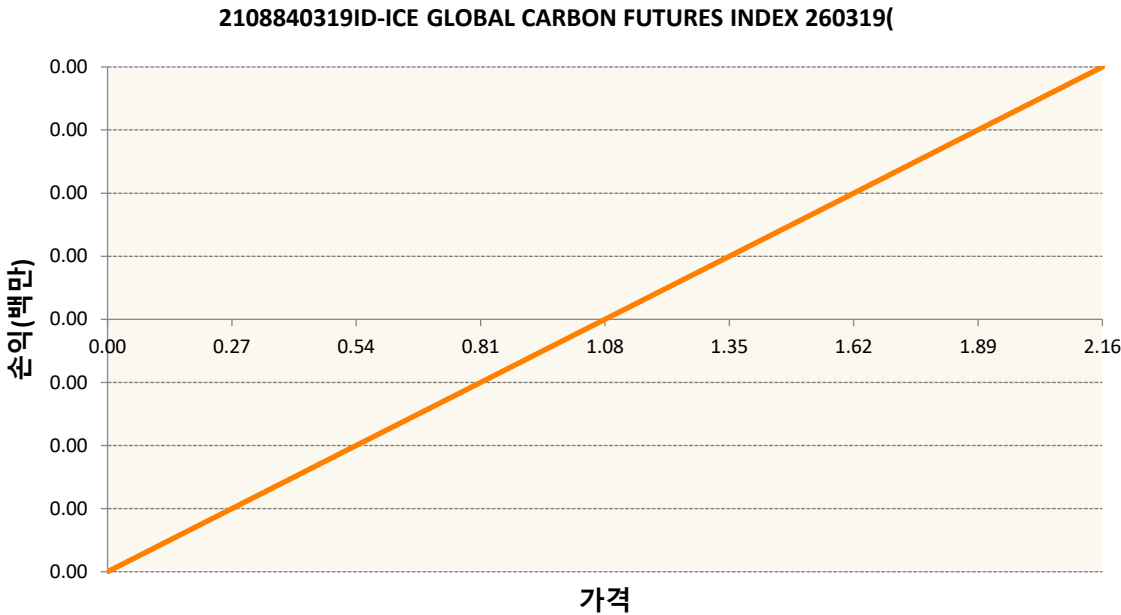
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,206	0	6,206	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		397
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		551

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

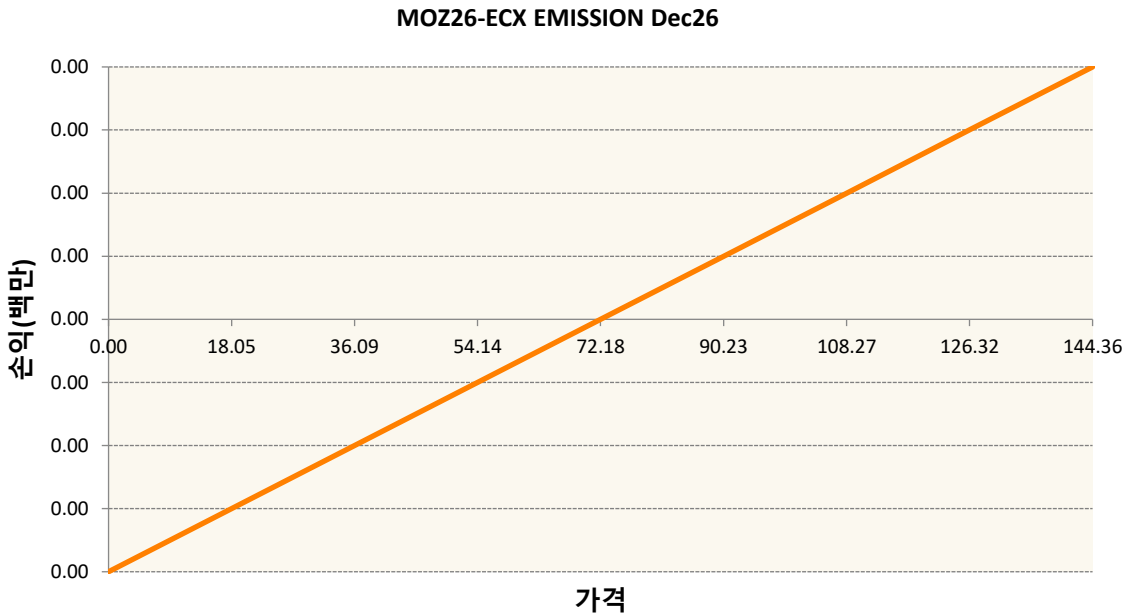
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			4,643	0	4,643	
누계	통화	선도	0	2,223	-2,223	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E	178
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	371

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

(단위:백만원)

641

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	229	0	229	장외
신규	지수	스왑	338	0	338	장외
누계	유가증권	스왑	1,333	0	1,333	장외
누계	지수	스왑	1,833	0	1,833	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	4
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	3
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	7
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	3

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

(단위:백만원)

28

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

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	-506	0	-506	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)	2
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	6
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	29
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	11

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

(단위:백만원)

80

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

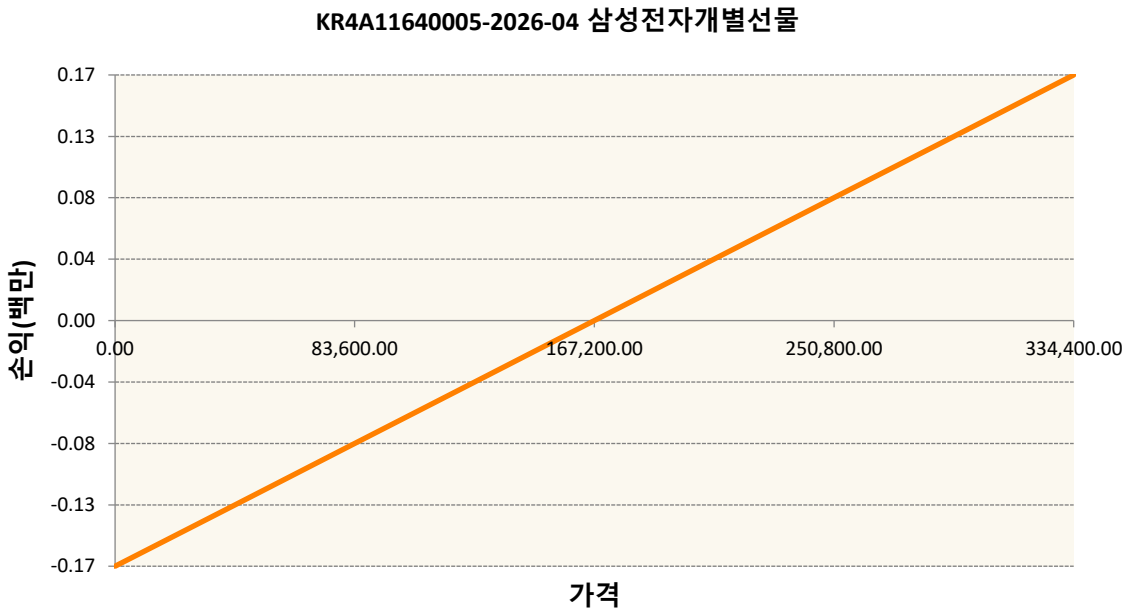
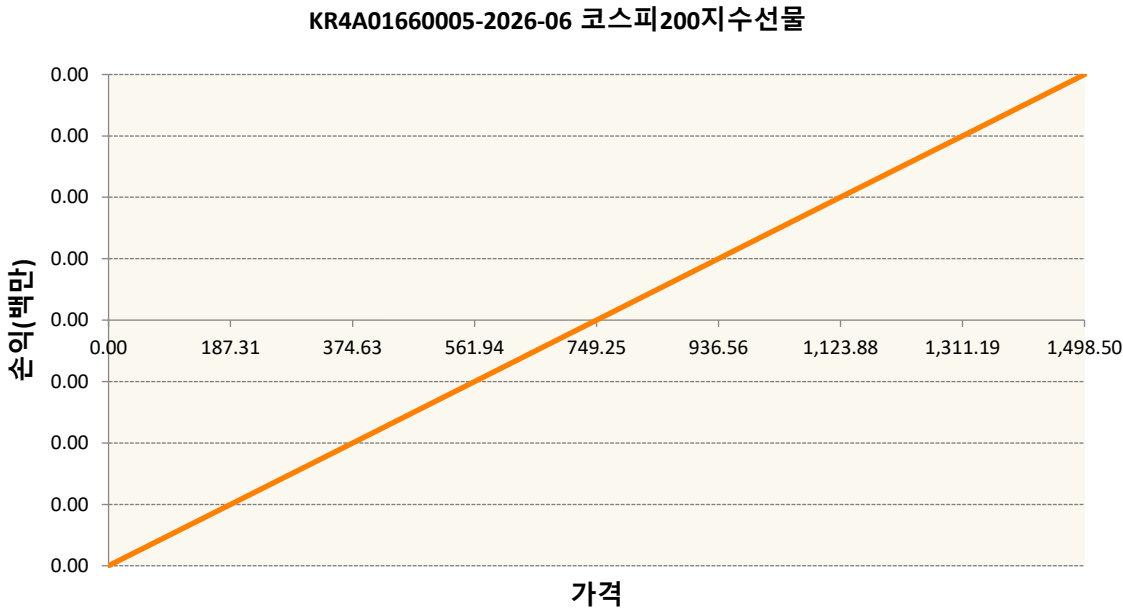
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

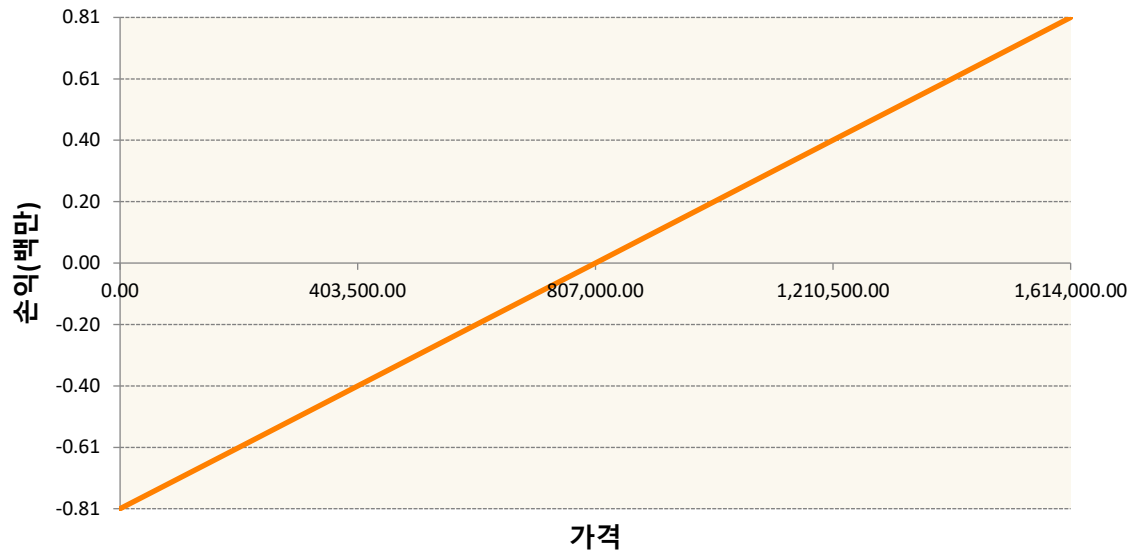
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,873	0	1,873	장내
누계	유가증권	선물	16,939	1,467	15,472	장내

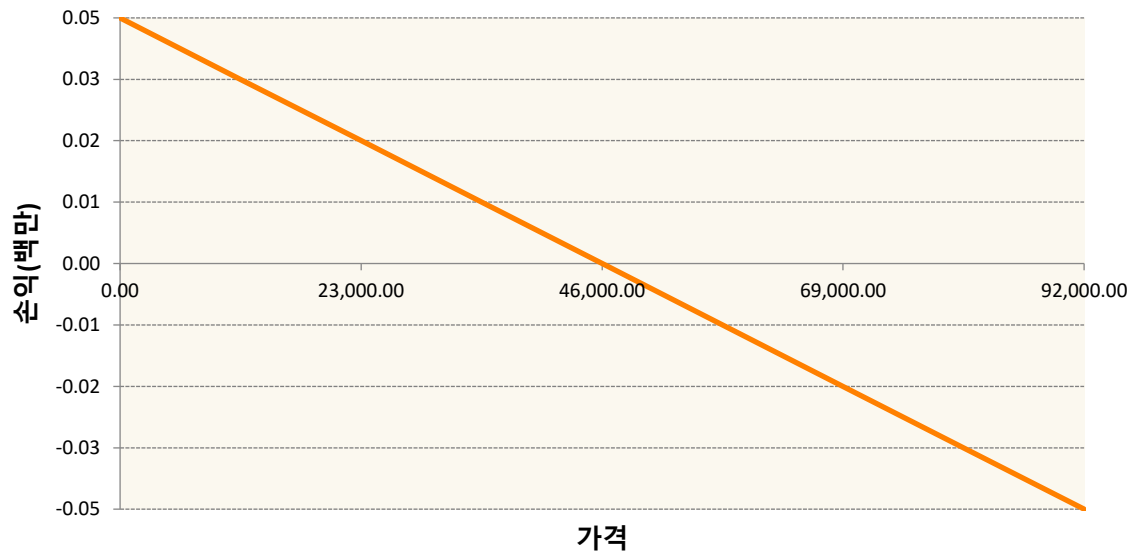
2. 만기시점의 손익구조



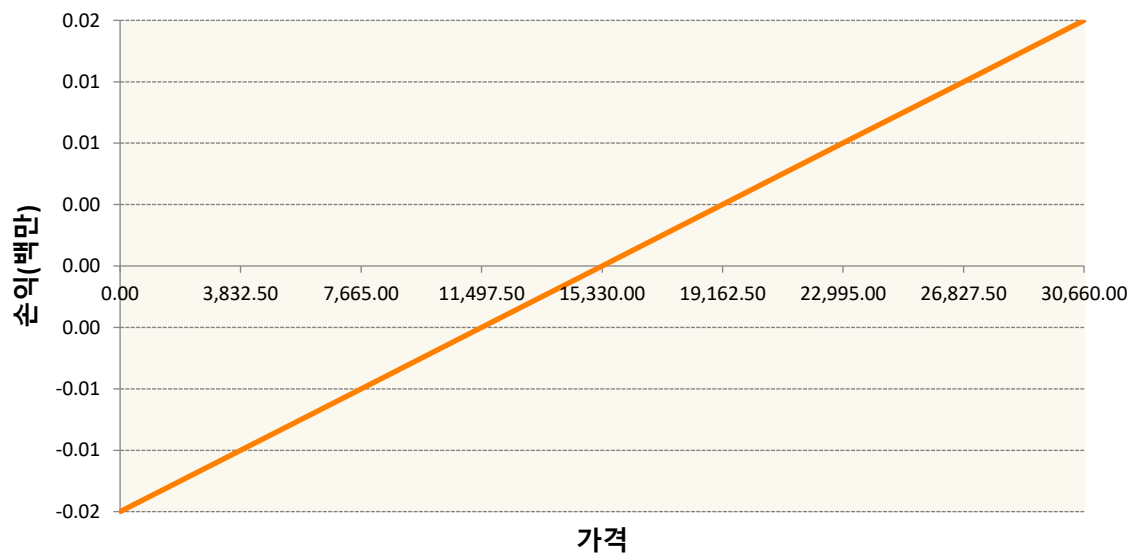
KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4ACF640007-2026-04 카카오개별선물



KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		1,117	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-1,117	-1,117	-1,117	-1,117	-1,117	-1,117	-1,117			
-5.33%	-745	-745	-745	-745	-745	-745	-745			
-2.67%	-372	-372	-372	-372	-372	-372	-372			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	372	372	372	372	372	372	372			
5.33%	745	745	745	745	745	745	745			
8.00%	1,117	1,117	1,117	1,117	1,117	1,117	1,117			
KR4A11640005							2026-04 삼성전자개별선물		138	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138			
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92			
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	46	46	46	46	46	46	46			
5.33%	92	92	92	92	92	92	92			
8.00%	138	138	138	138	138	138	138			
KR4A50640007							2026-04 SK하이닉스개별선물		70	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70			
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46			
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	23	23	23	23	23	23	23			
5.33%	46	46	46	46	46	46	46			
8.00%	70	70	70	70	70	70	70			
KR4ACF640007							2026-04 카카오개별선물		117	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	117	117	117	117	117	117	117			
-5.33%	78	78	78	78	78	78	78			
-2.67%	39	39	39	39	39	39	39			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39			
5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78			
8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117			
KR4AFT640008							2026-04 대우건설개별선물		24	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	24	24	24	24	24	24	24

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

(단위:백만원)

3,091

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

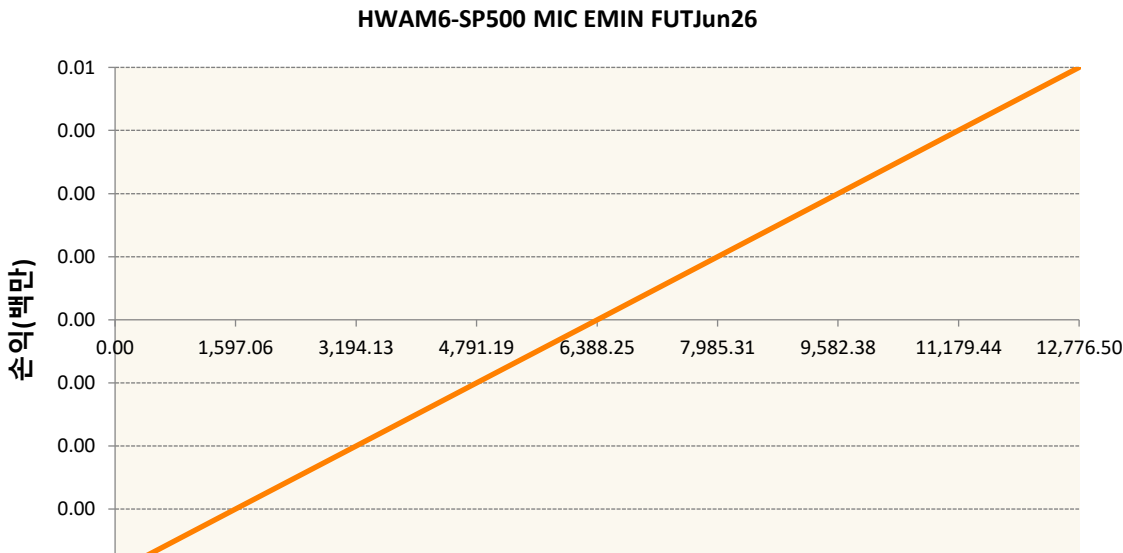
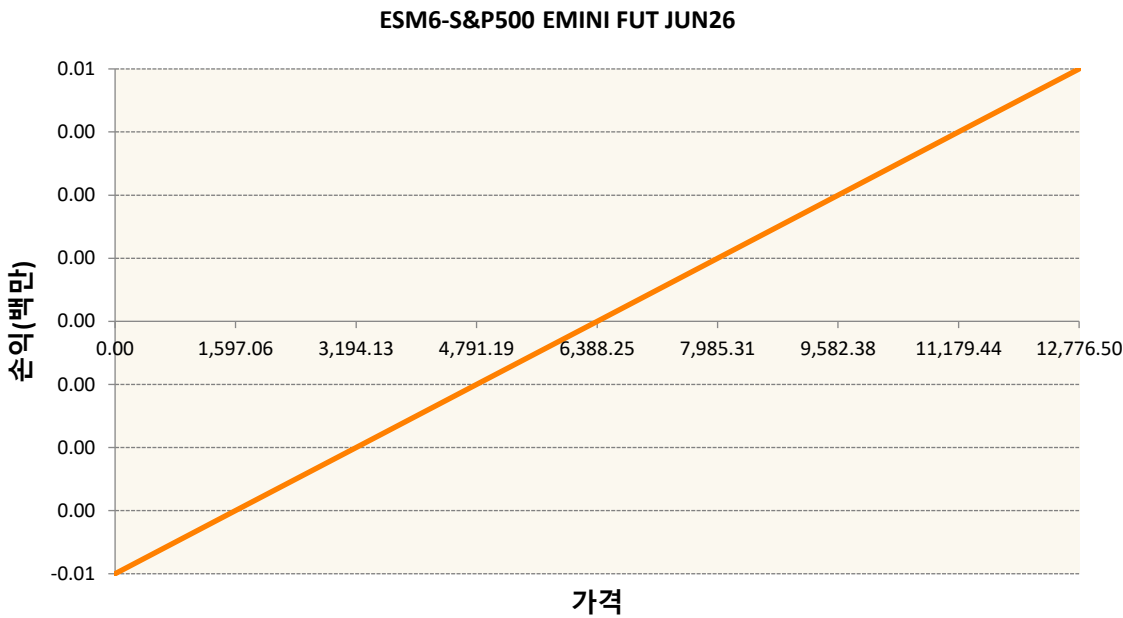
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

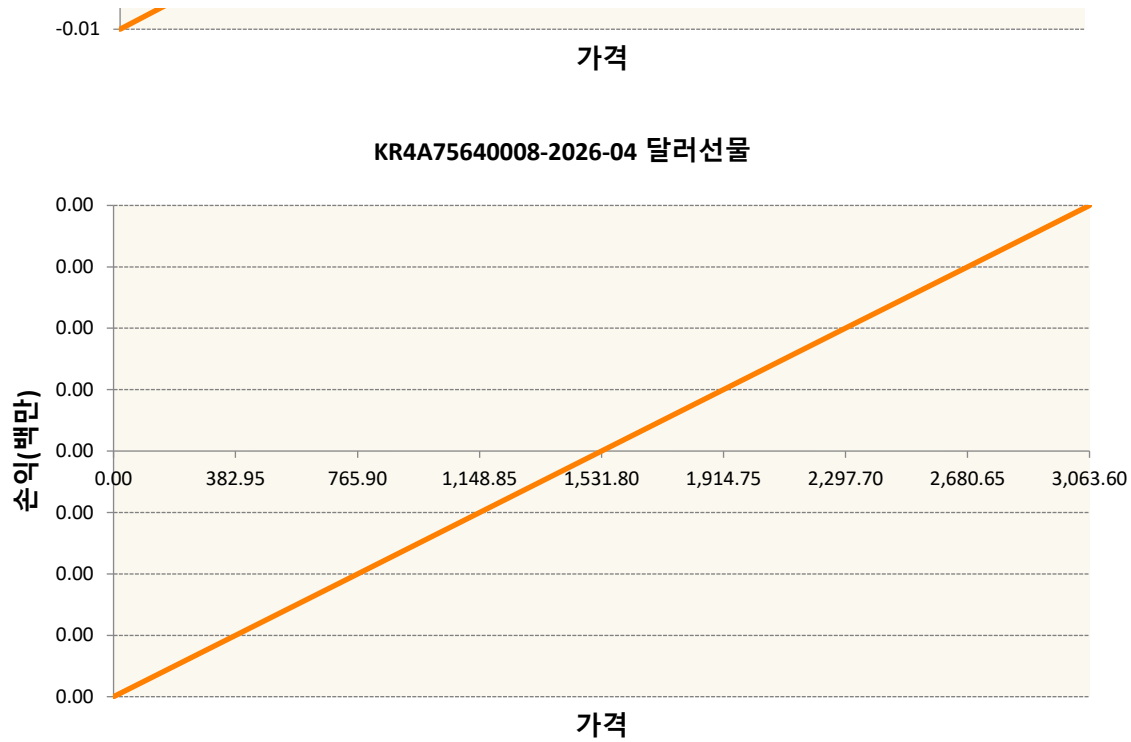
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	50,287	0	50,287	
누계	지수	선물	145	0	145	장내
누계	통화	선물	12,714	0	12,714	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,023
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		12
KR4A756400 2026-04 달러선물			1,017

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,490

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

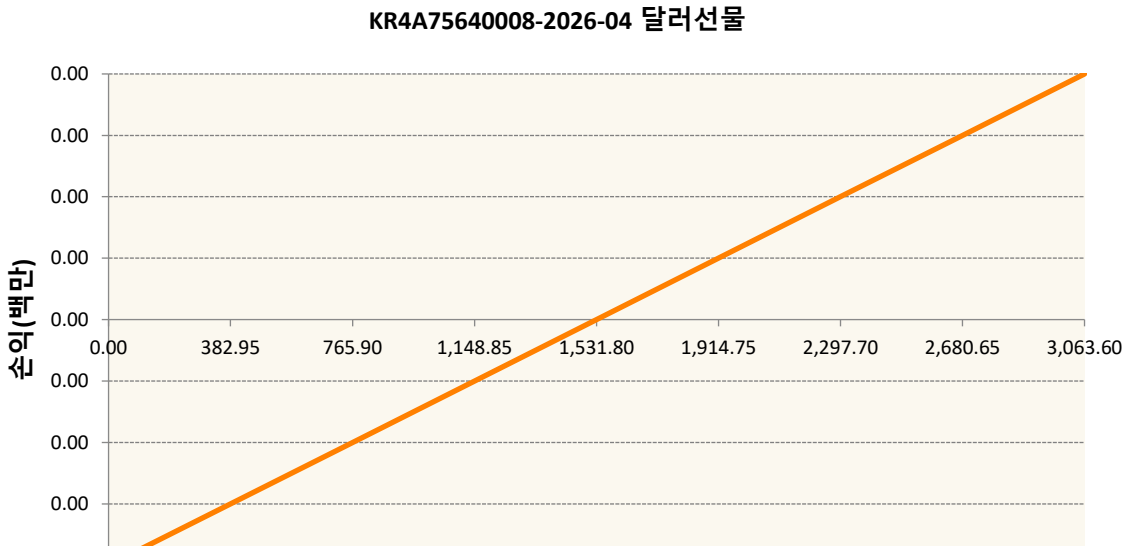
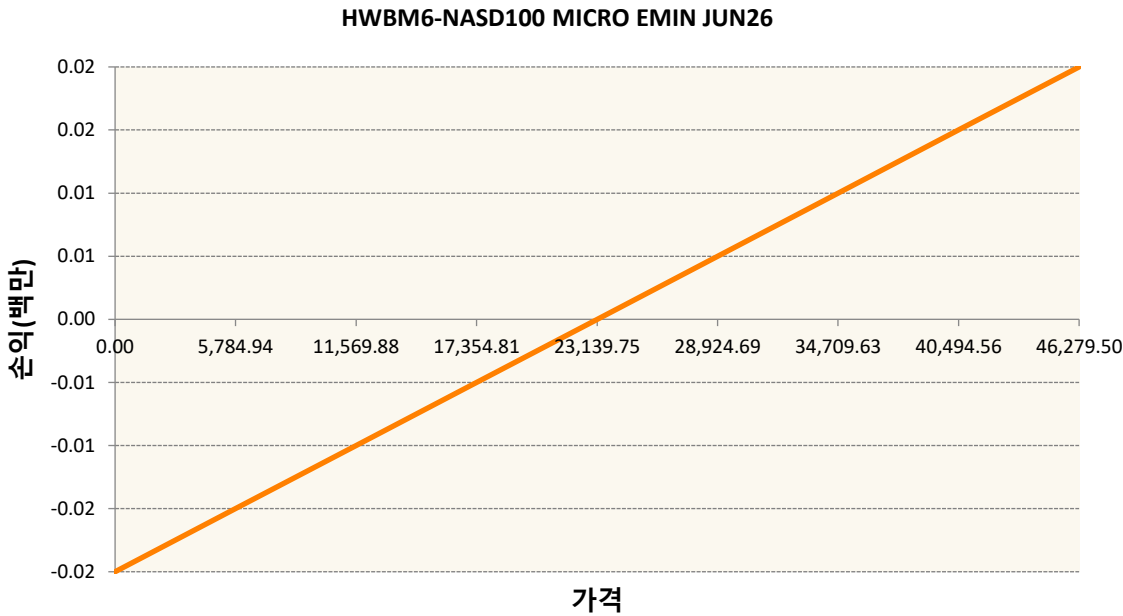
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

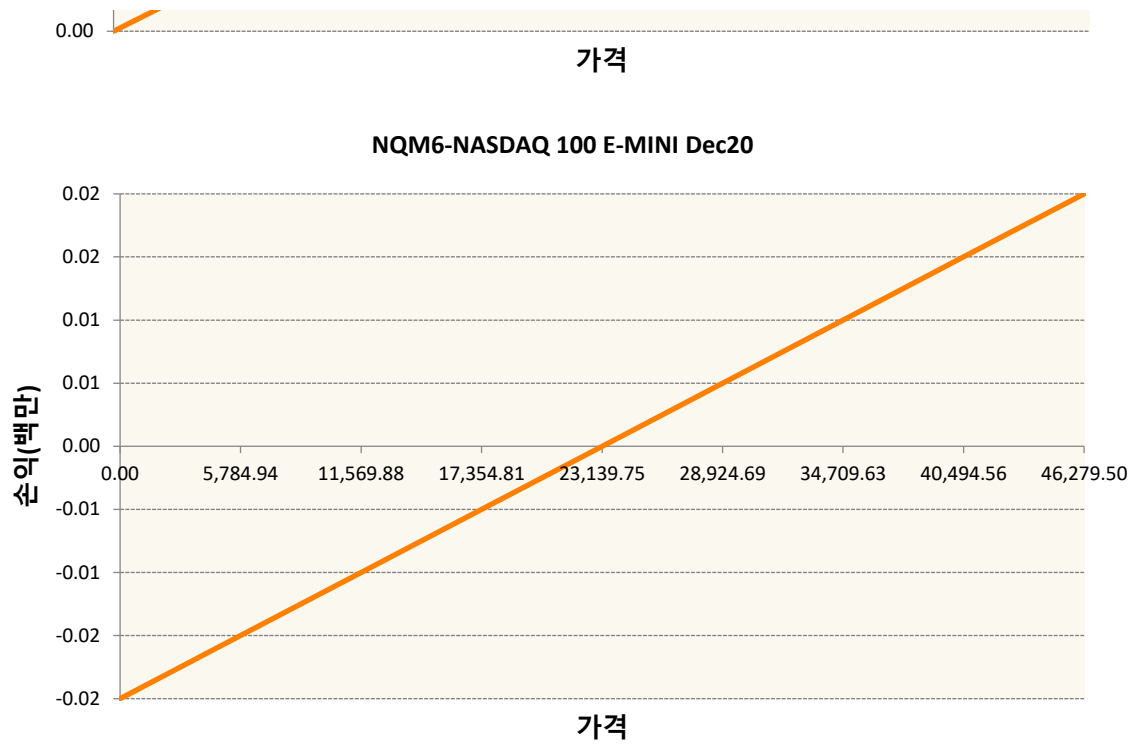
1. 계약금액

(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
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	21,503	0	21,503	
누계	유가증권	선물	70	0	70	장내
누계	통화	선물	5,132	0	5,132	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	6
KR4A756400	2026-04 달러선물	411
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,720

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

1,895

공시일	2026-04-01
기준일	2026-03-31

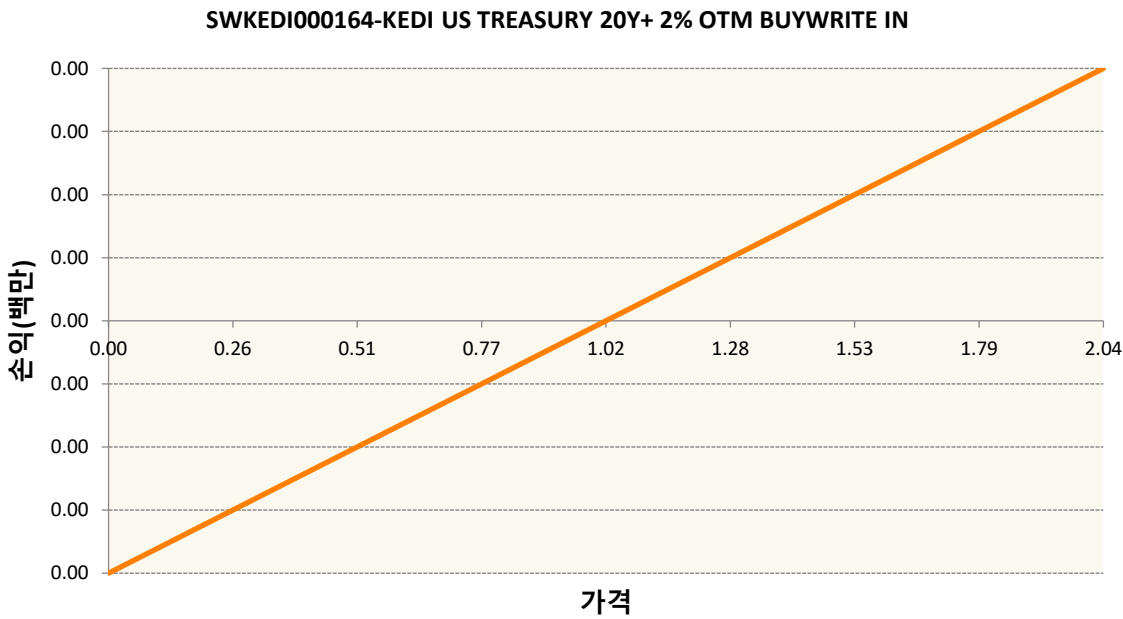
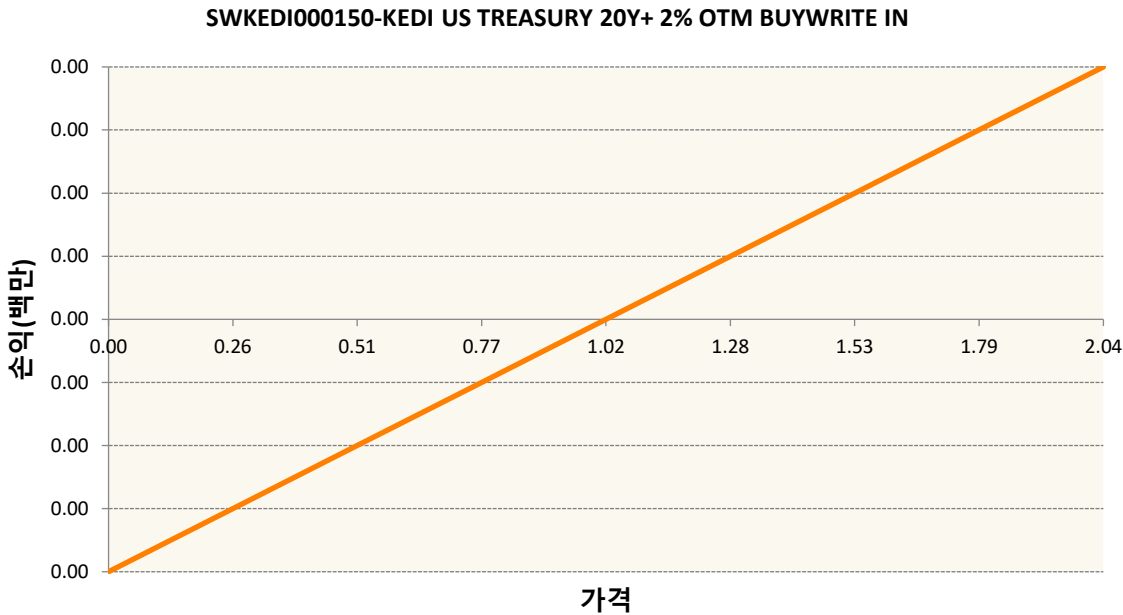
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

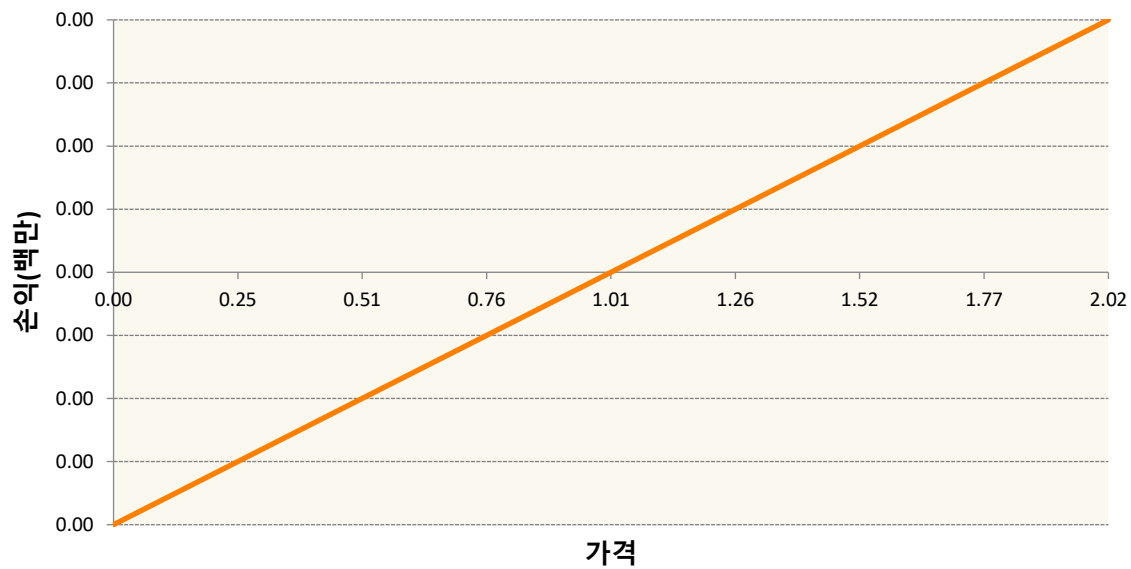
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	374,669	0	374,669	장외

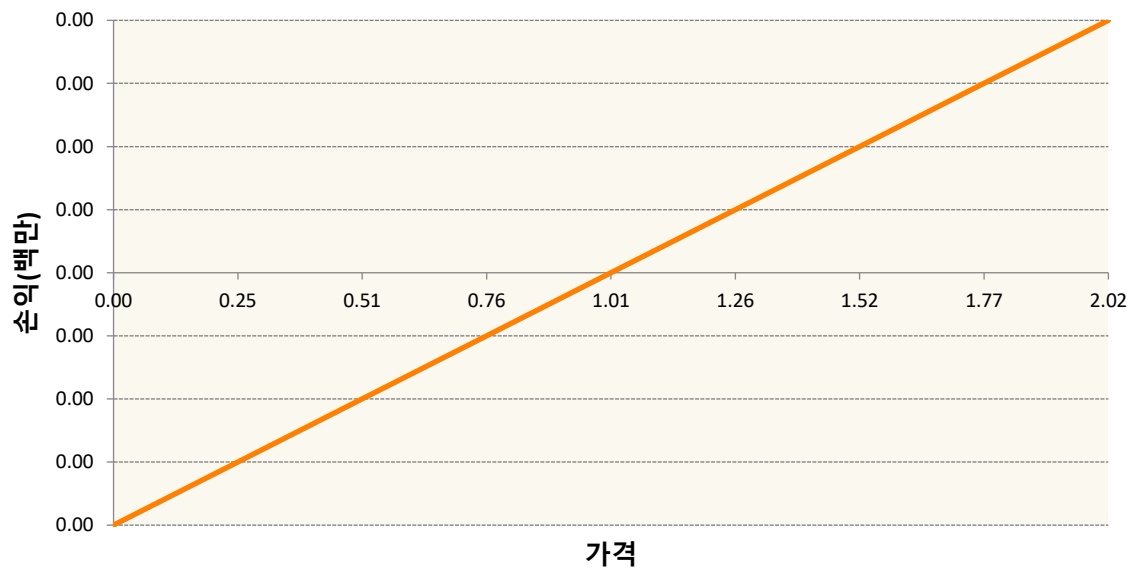
2. 만기시점의 손익구조



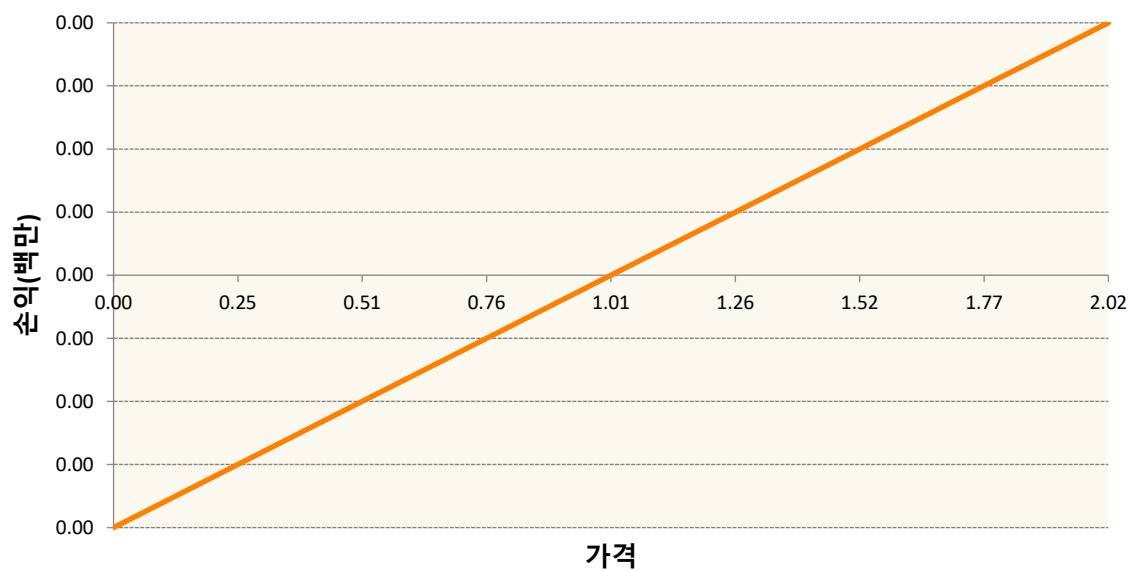
SWKEDI000169-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000171-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,567
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		157
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,544
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,950
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,784

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,961

공시일 2026-04-01

기준일 2026-03-31

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음