

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

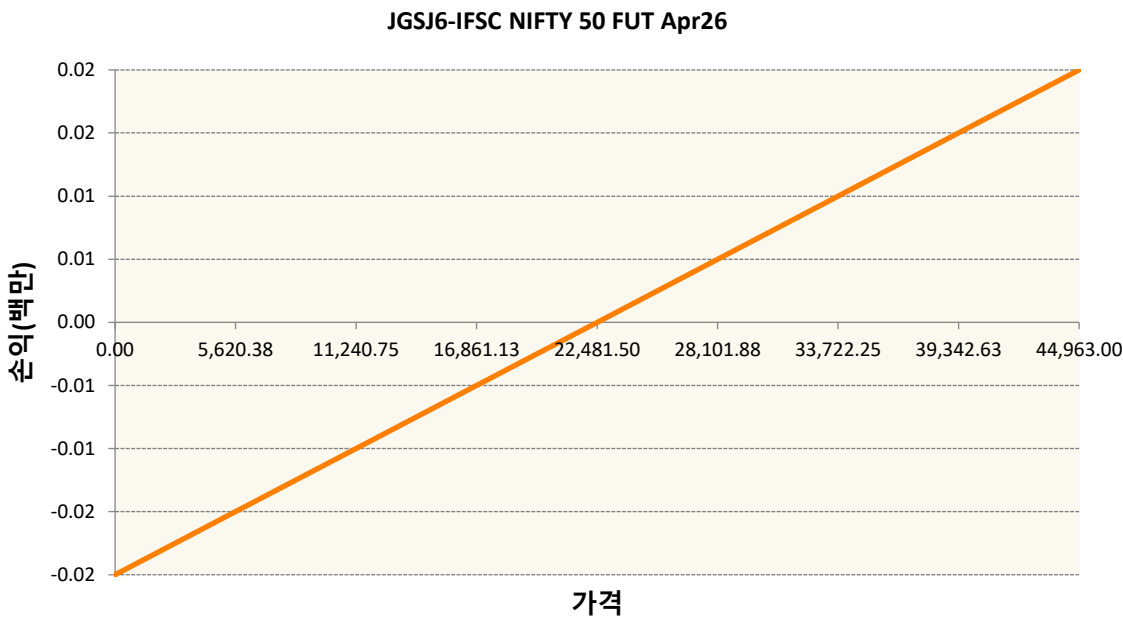
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	610	0	610	

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	2026-04-02
기준일	2026-04-01

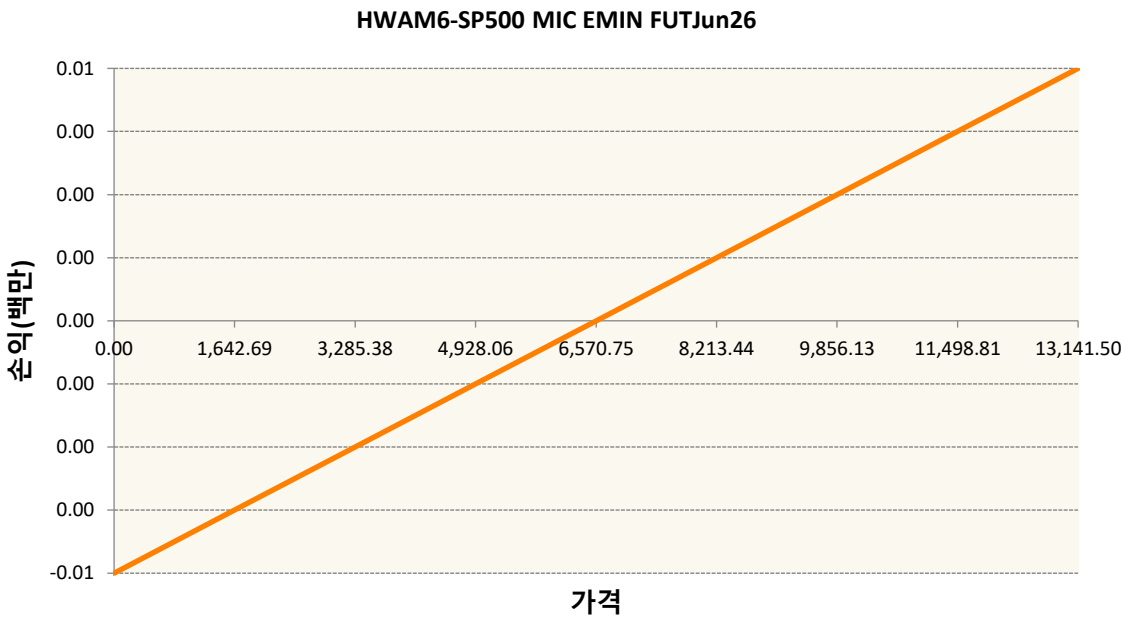
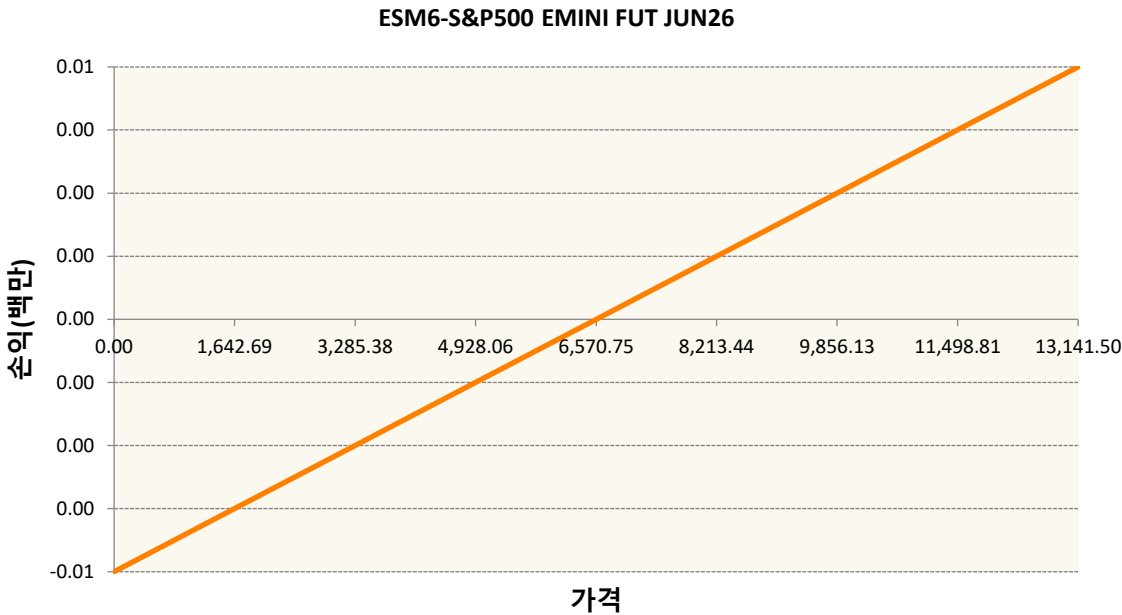
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	493	0	493	
누계	지수	선물	296	0	296	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	39
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	24

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	55

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

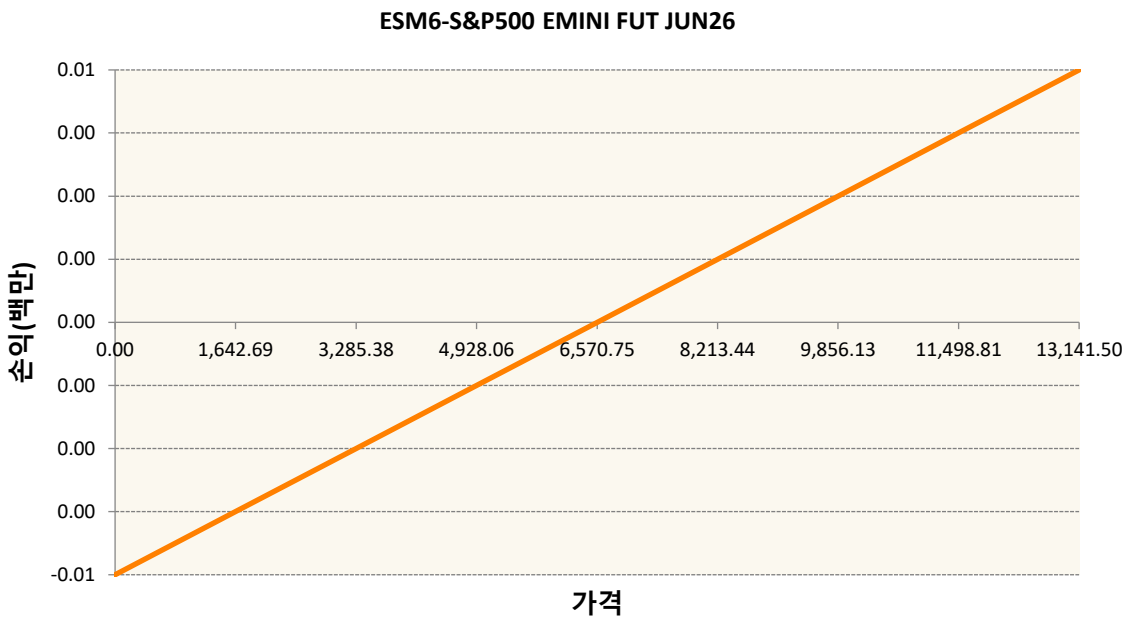
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	986	0	986	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	79
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

69

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

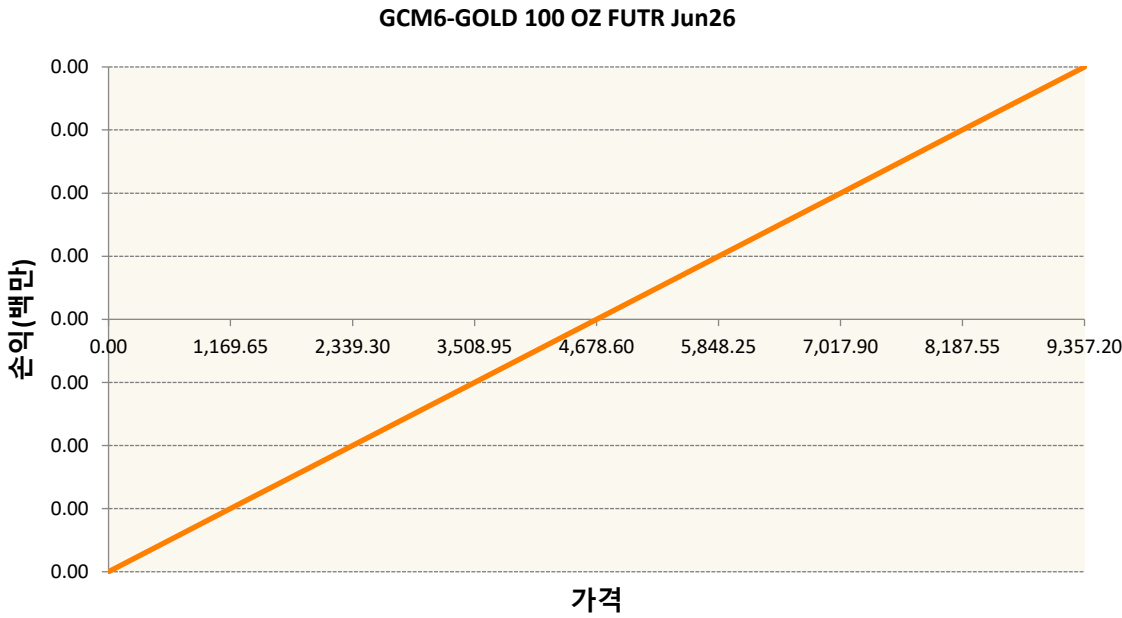
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,940	0	4,940	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 04/02/26 C420 EQUITY	8
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	395

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

(단위:백만원)

503

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

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	43
AOPLTRUCP PLTR US 04/02/26 P155 EQUITY	127
AOPLTRUSC PLTR US 04/02/26 C150 EQUITY	1

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

(단위:백만원)

574

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

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

5

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

(단위:백만원)

16

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

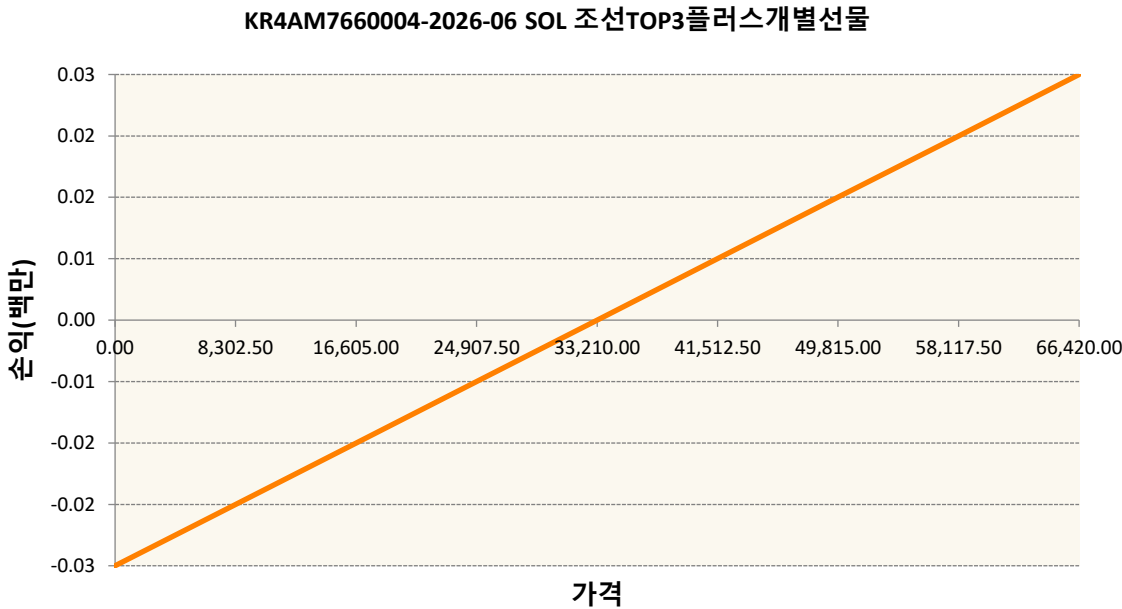
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	135,195	0	135,195	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-04-02

기준일 2026-04-01

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	2026-04-02
기준일	2026-04-01

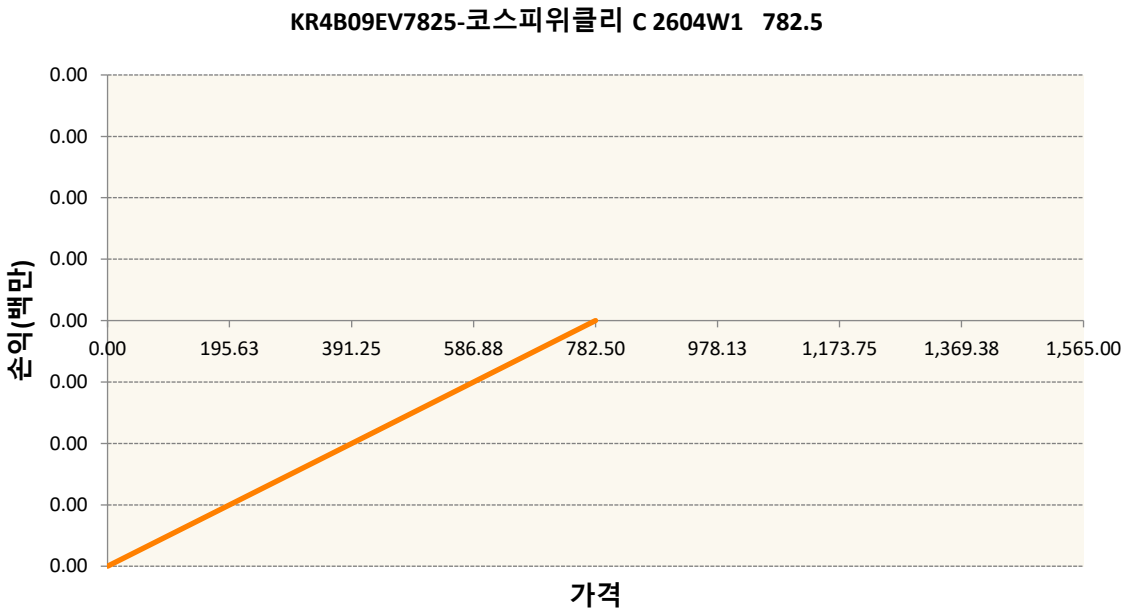
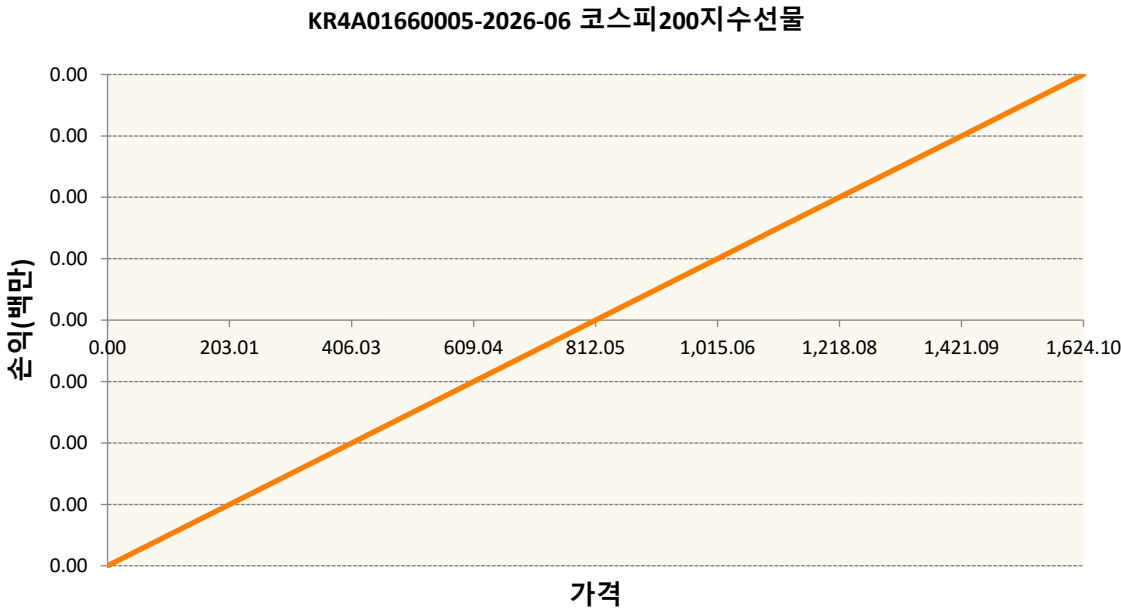
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

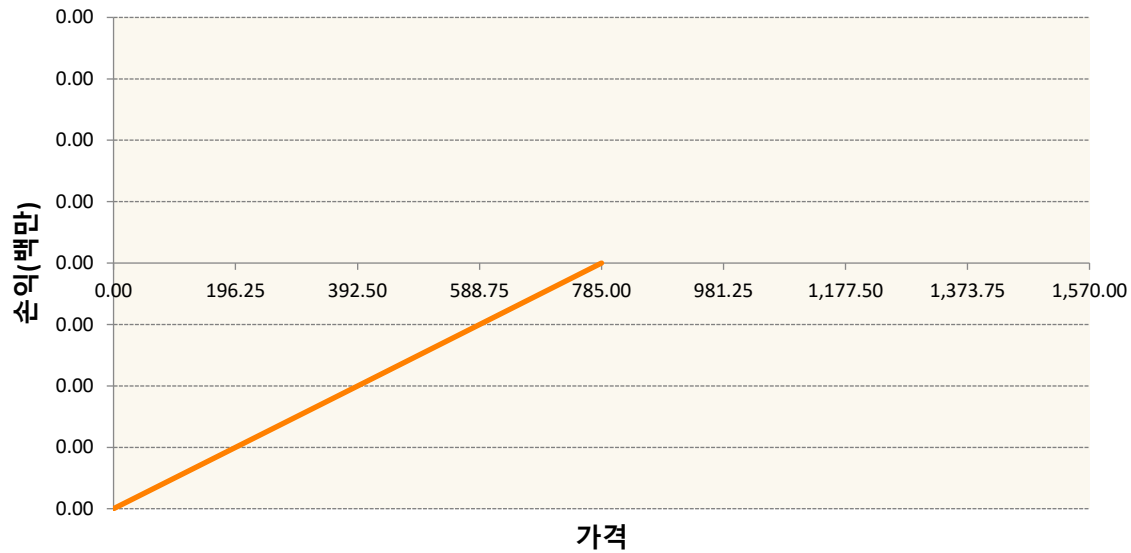
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	611	-611	장내
누계	유가증권	선물	5,278	0	5,278	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,794	-9,794	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4B09EV7858-코스피위클리 C 2604W1 785.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						423
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-423	-423	-423	-423	-423	-423	-423	
-5.33%	-282	-282	-282	-282	-282	-282	-282	
-2.67%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	141	141	141	141	141	141	141	
5.33%	282	282	282	282	282	282	282	
8.00%	423	423	423	423	423	423	423	
KR4B09EV7825		코스피위클리 C 2604W1 782.5						259
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-243	-245	-247	-250	-252	-256	-259	
-5.33%	-102	-108	-114	-119	-125	-131	-137	
-2.67%	-18	-24	-30	-36	-42	-49	-55	
0%	8	6	3	0	-4	-7	-12	
2.67%	12	11	11	10	9	7	6	
5.33%	12	12	12	12	12	11	11	
8.00%	12	12	12	12	12	12	12	
KR4B09EV7858		코스피위클리 C 2604W1 785.0						182
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-173	-173	-175	-176	-178	-180	-182	
-5.33%	-76	-79	-83	-87	-90	-94	-98	
-2.67%	-15	-19	-23	-27	-31	-36	-40	
0%	6	4	2	0	-3	-5	-8	

2.67%	9	9	9	8	7	6	5
5.33%	10	10	10	9	9	9	9
8.00%	10	10	10	10	10	10	9

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

(단위:백만원)

1,225

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

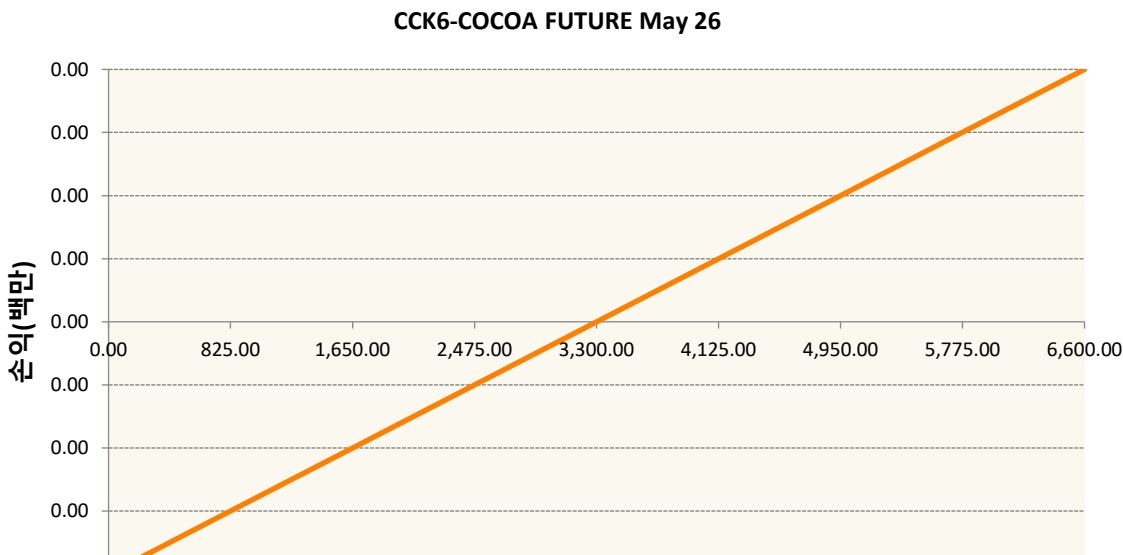
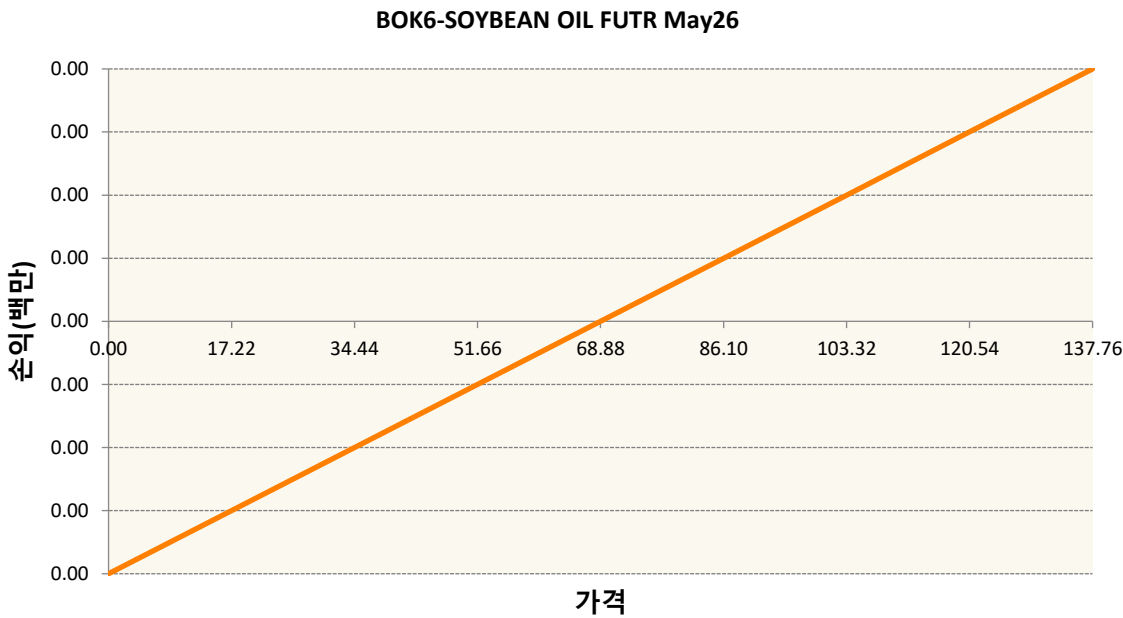
포커스농산물모(채권-파생형)

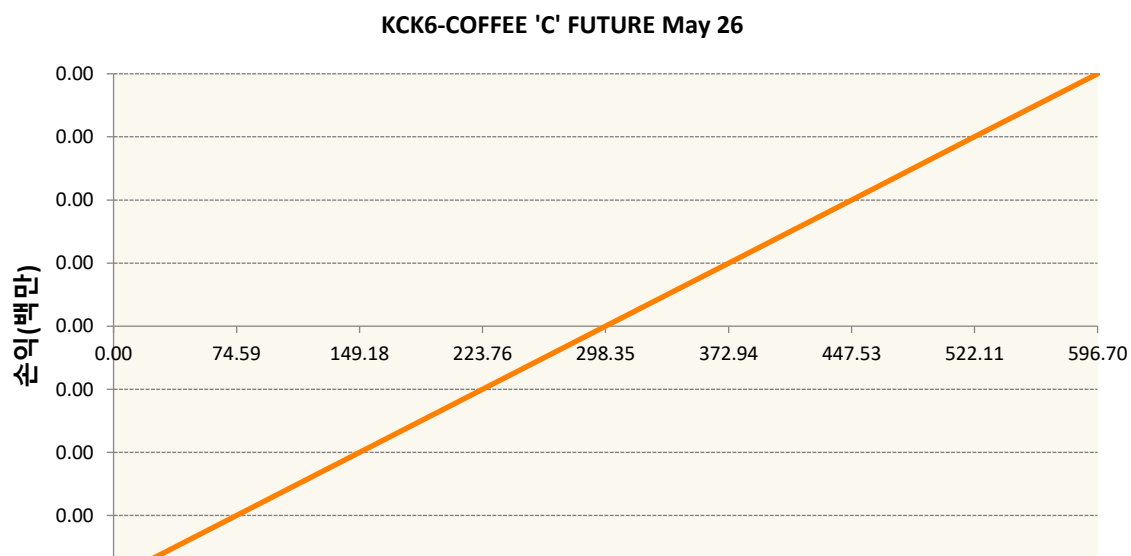
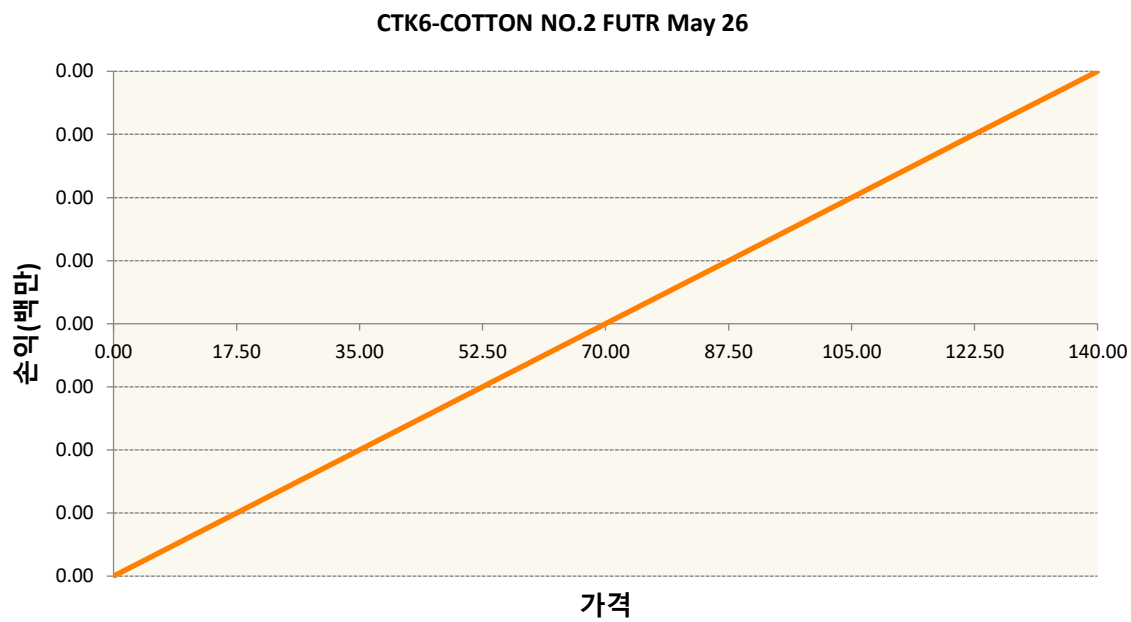
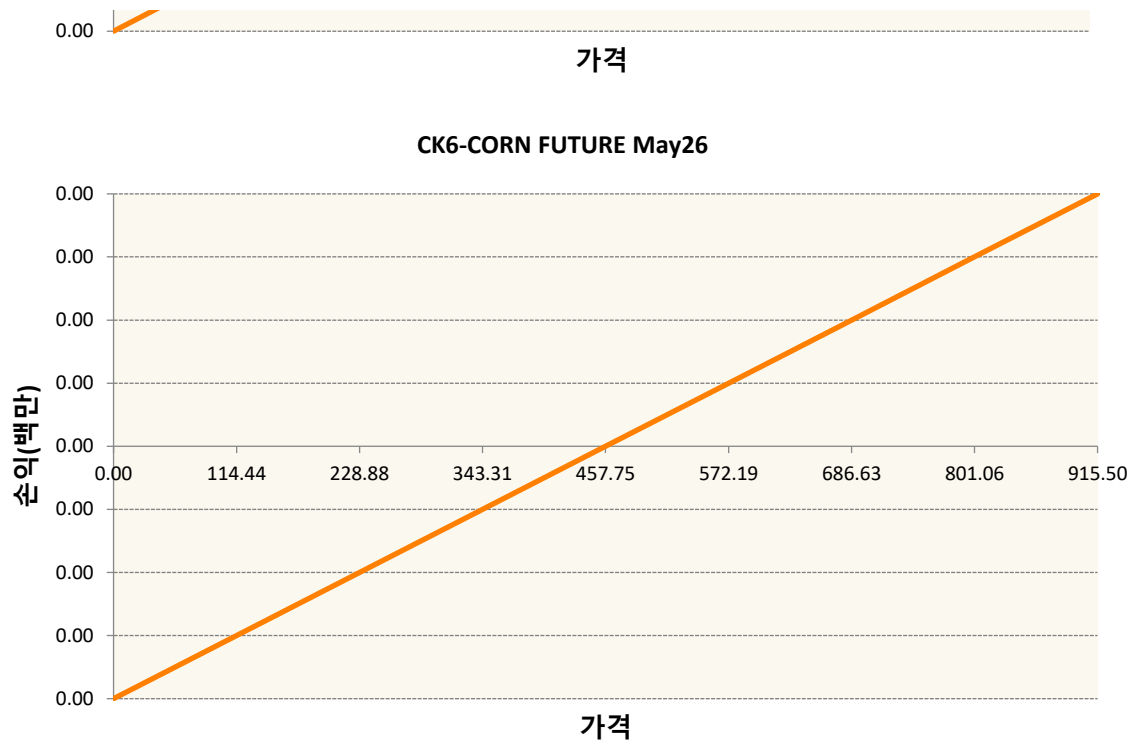
1. 계약금액

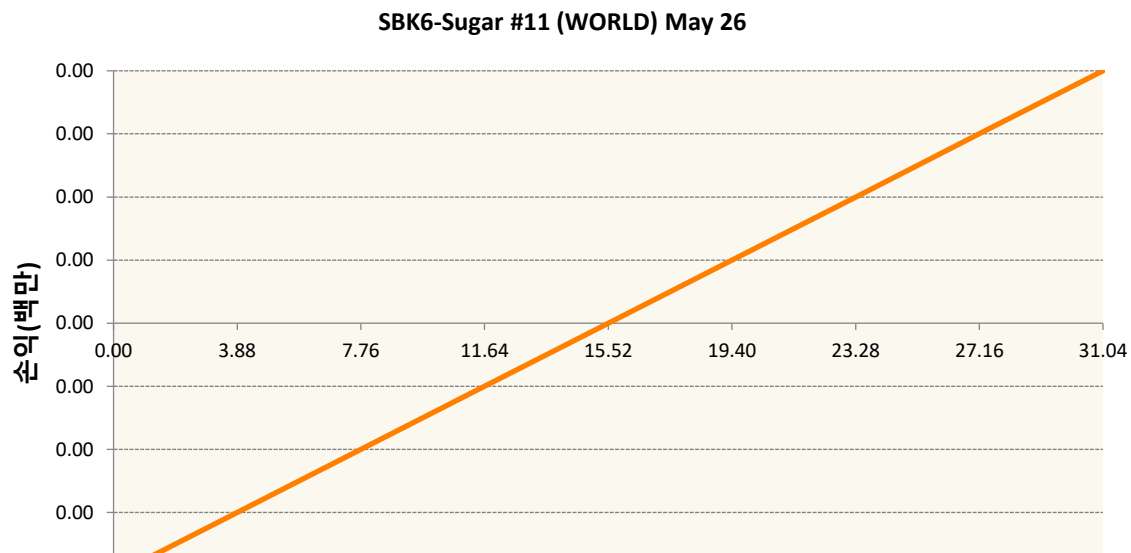
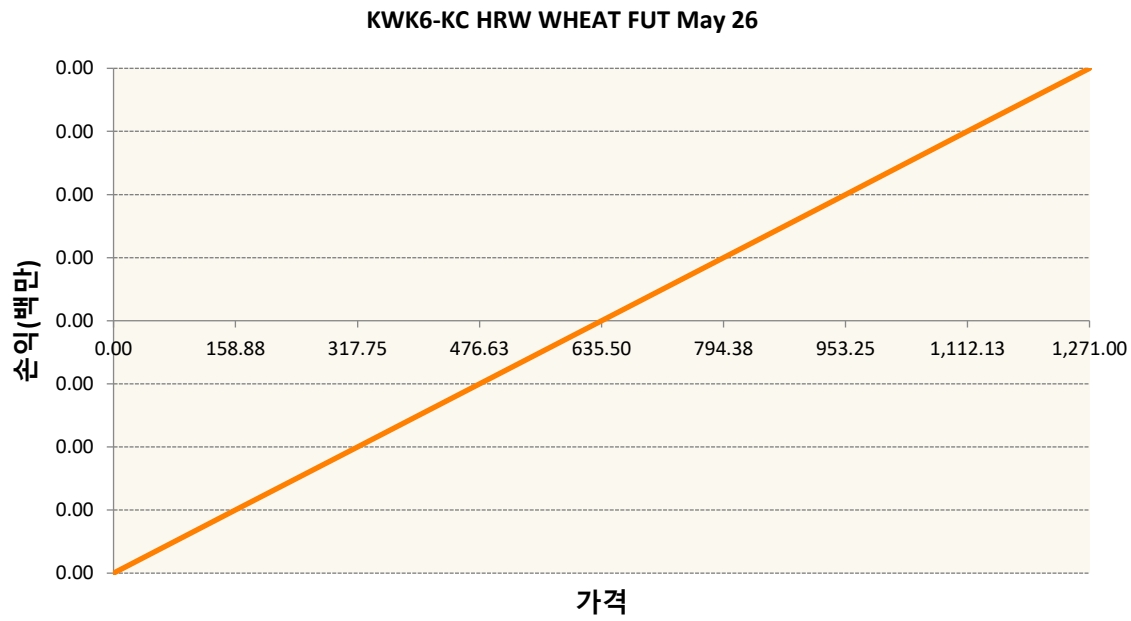
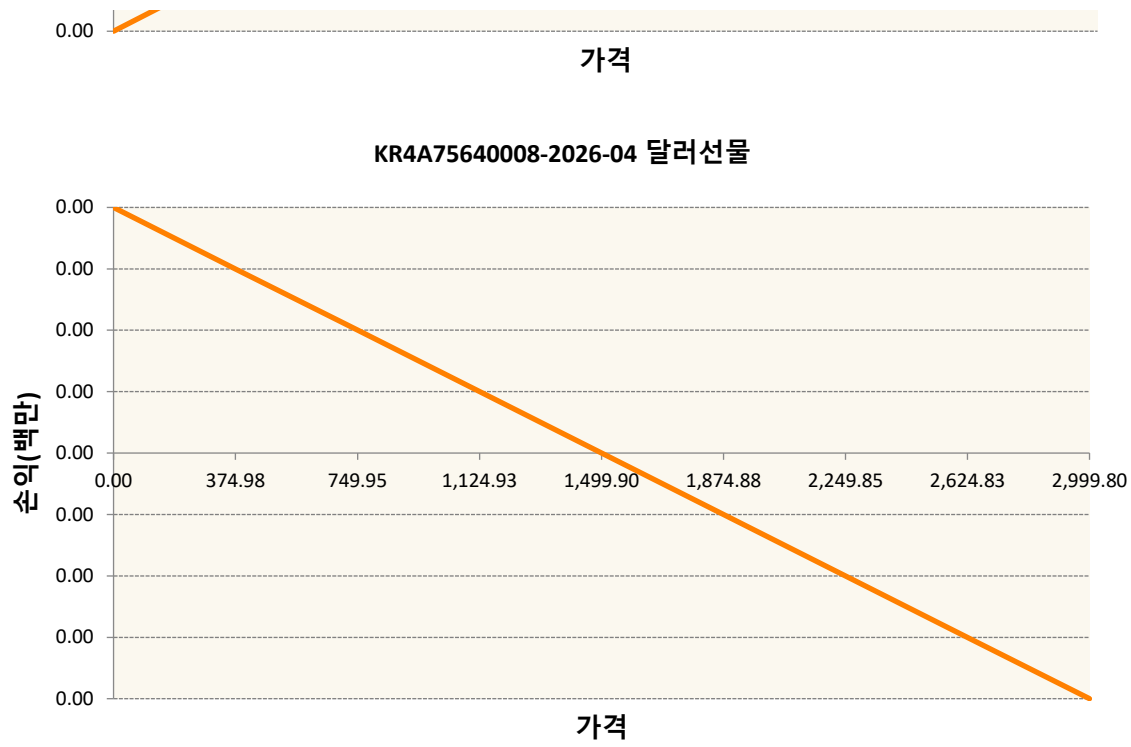
(단위:USD 백만)

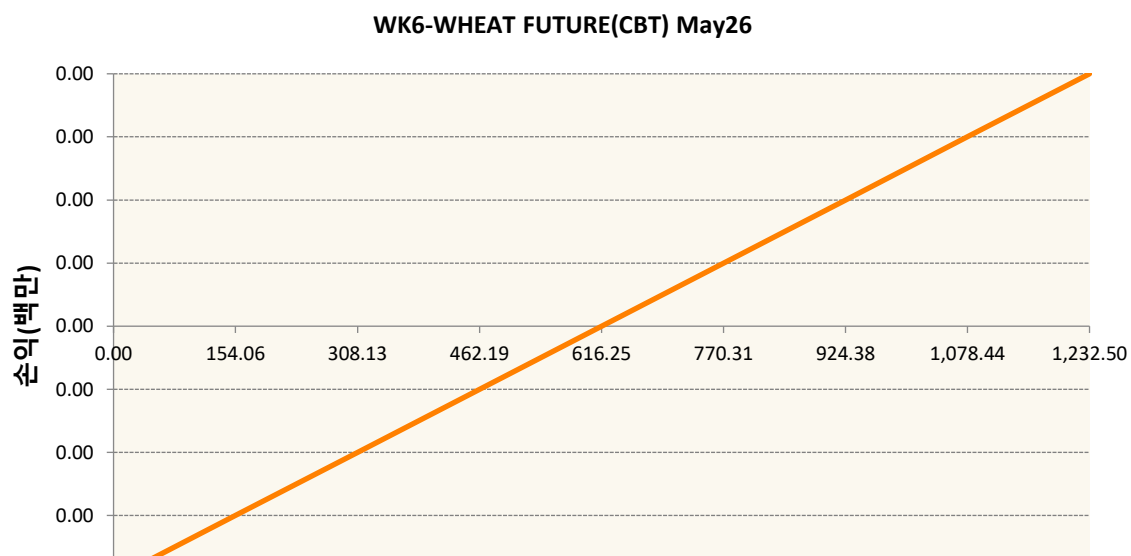
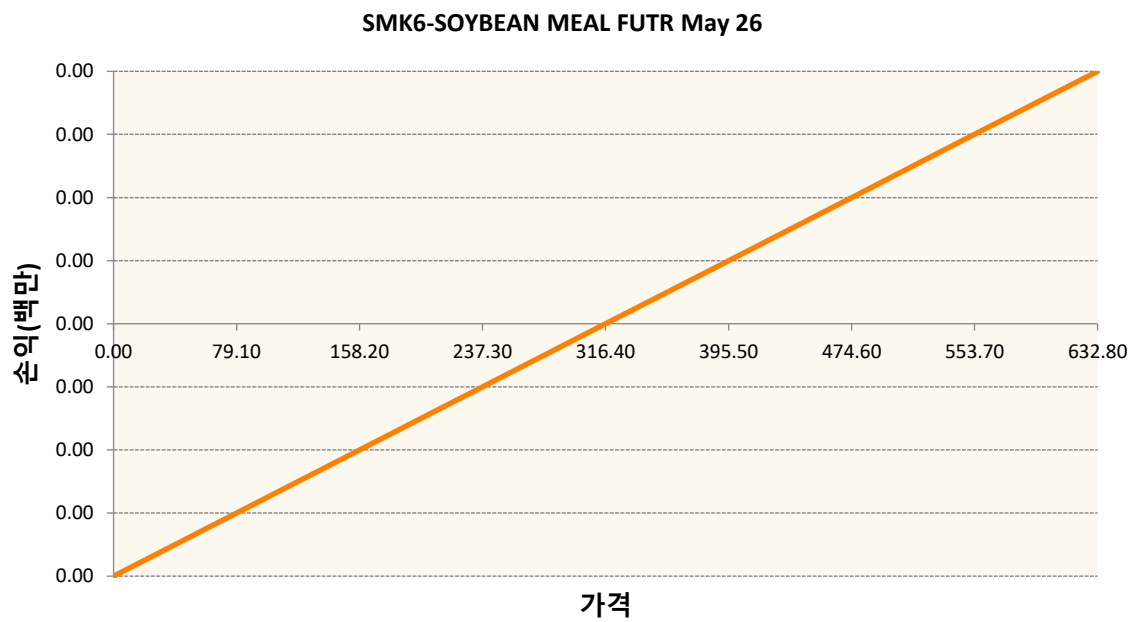
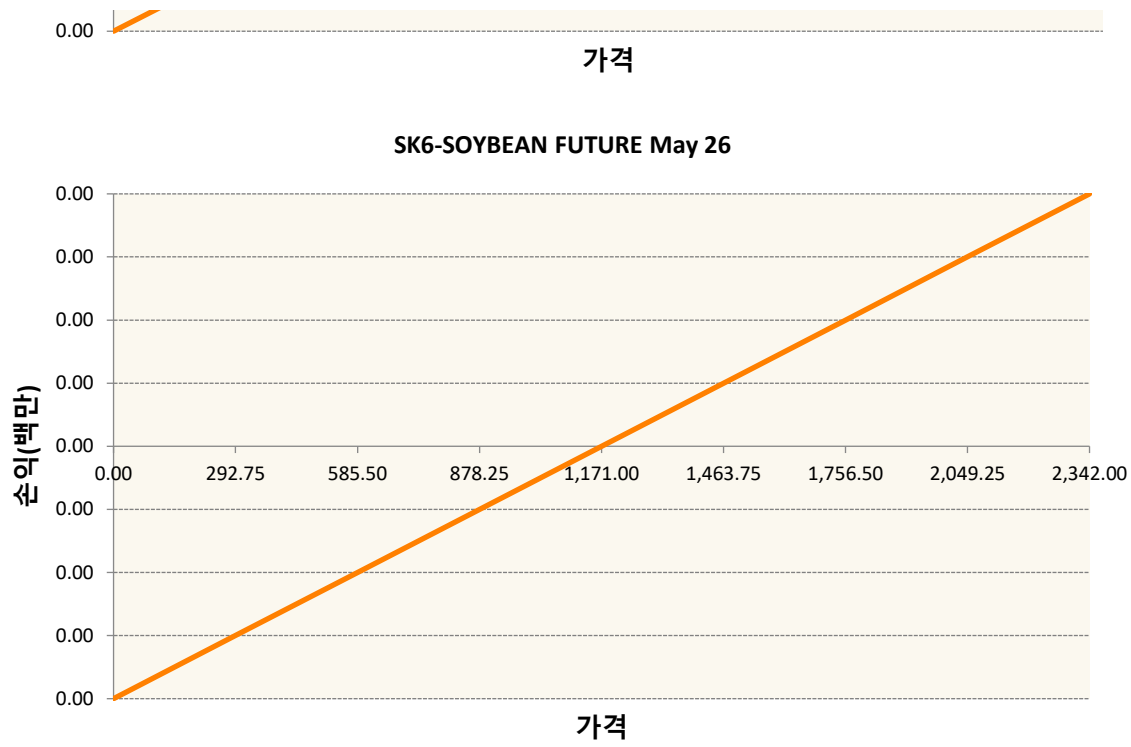
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	30	0	30	장내
누계	실물자산	선물	1,321	0	1,321	
누계	유가증권	선물	1,602	0	1,602	
누계	통화	선물	0	465	-465	장내

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	2026-04-02
기준일	2026-04-01

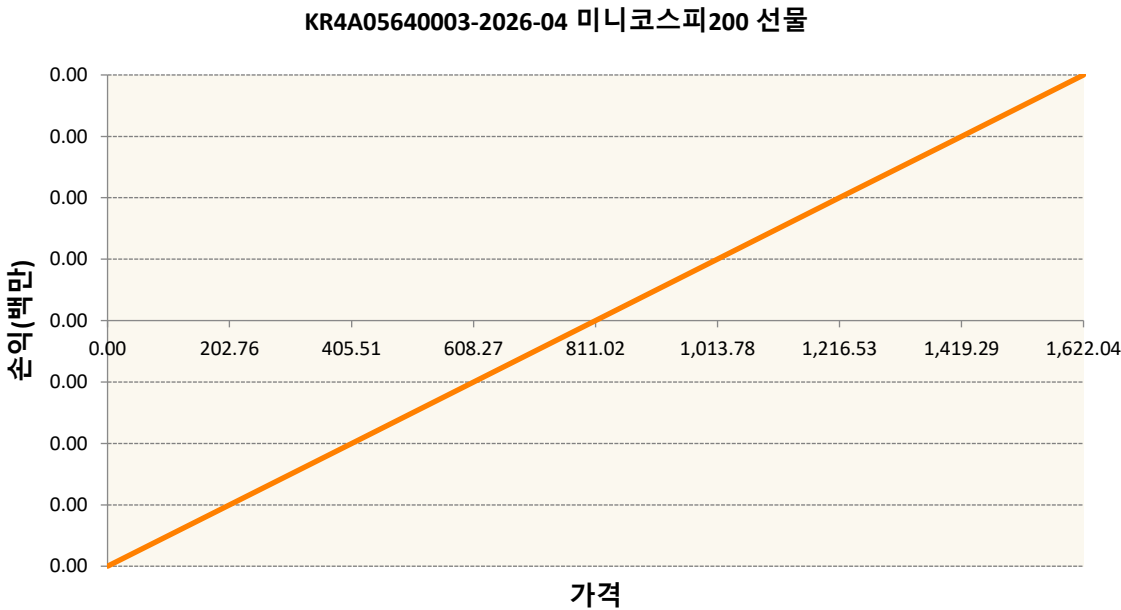
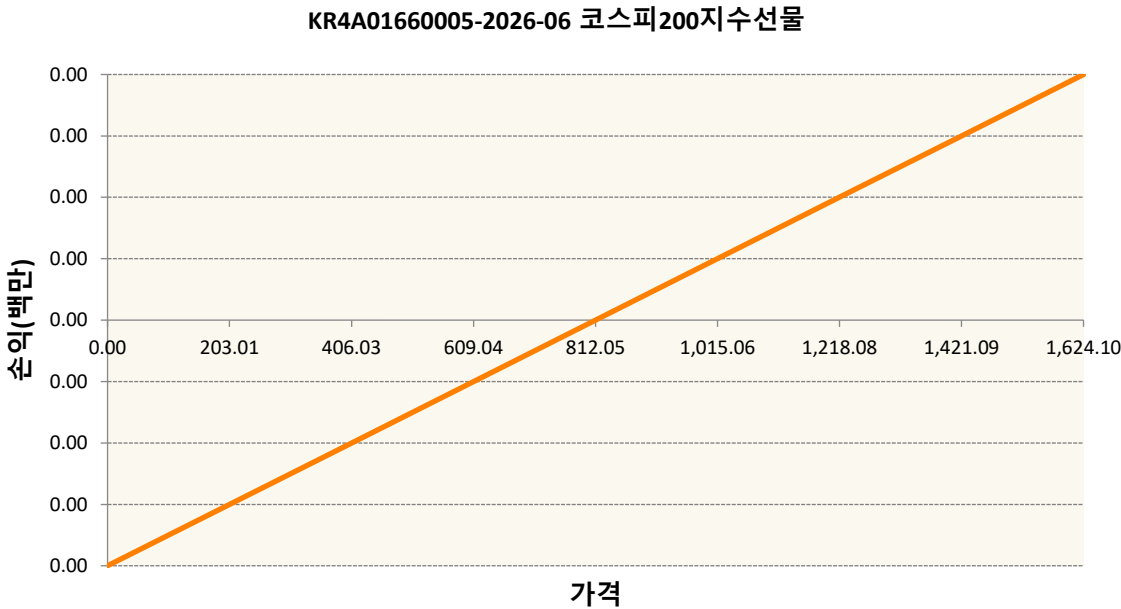
스마트인덱스모

1. 계약금액

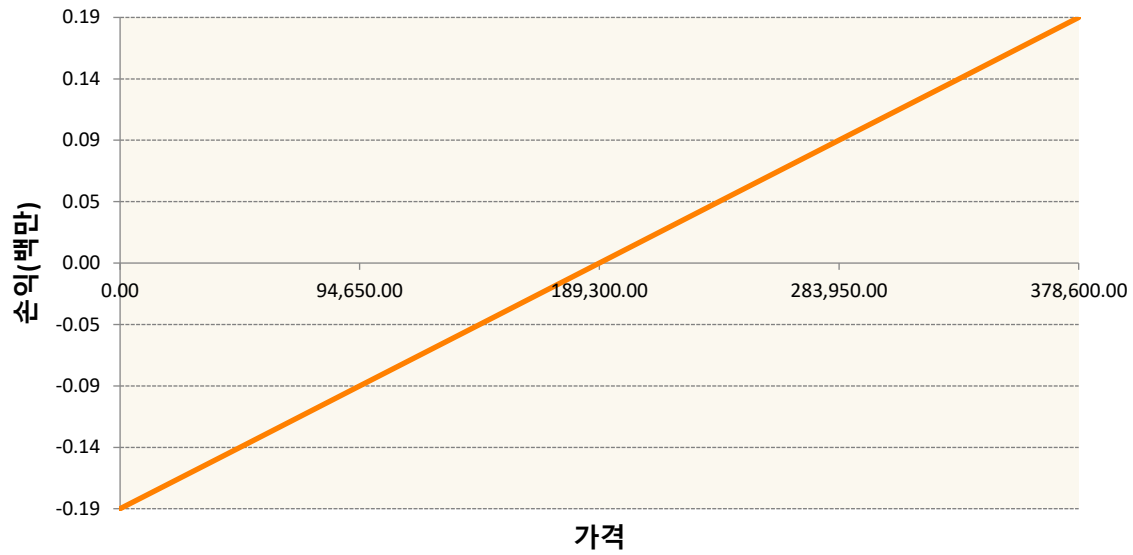
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,949	0	3,949	장내

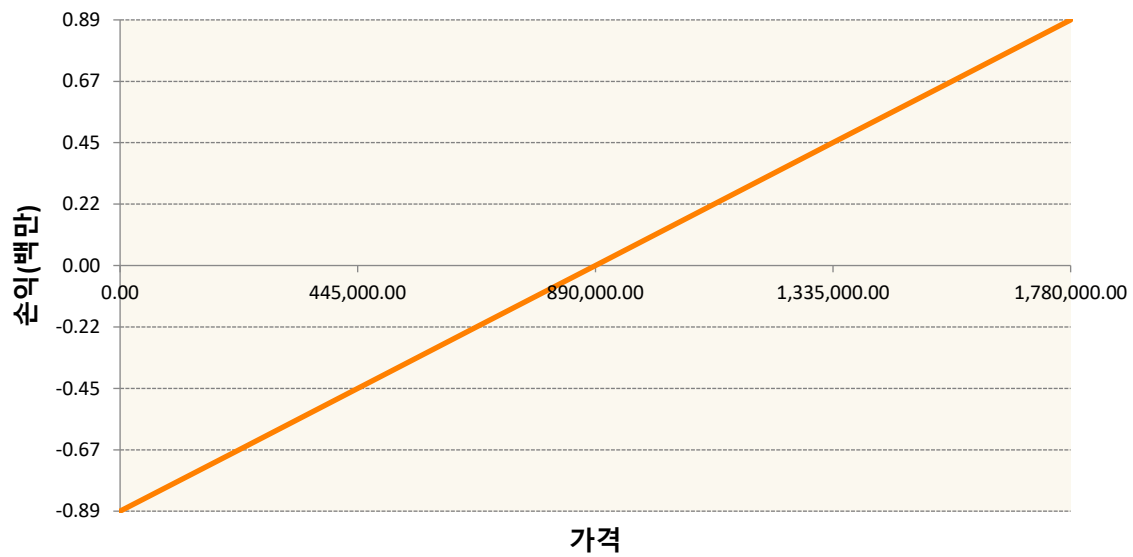
2. 만기시점의 손익구조



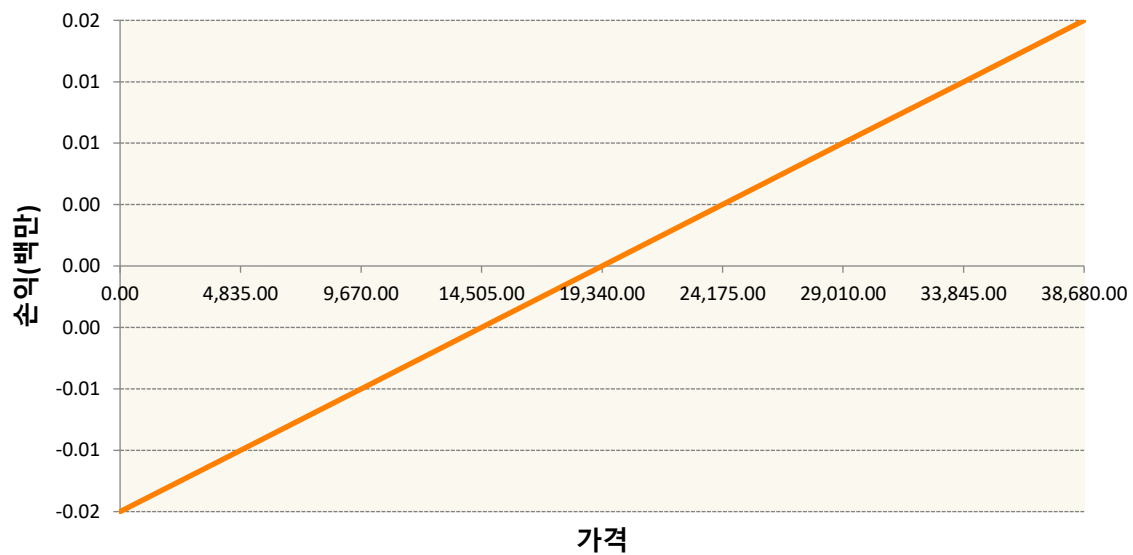
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		195	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195			
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130			
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	65	65	65	65	65	65	65			
5.33%	130	130	130	130	130	130	130			
8.00%	195	195	195	195	195	195	195			
KR4A05640003							2026-04 미니코스피200 선물		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%	-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%	7	7	7	7	7	7	7			
KR4A11640005							2026-04 삼성전자개별선물		80	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80			
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53			
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	27	27	27	27	27	27	27			
5.33%	53	53	53	53	53	53	53			
8.00%	80	80	80	80	80	80	80			
KR4A50640007							2026-04 SK하이닉스개별선물		8	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8			
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5			
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	3	3	3	3	3	3	3			
5.33%	5	5	5	5	5	5	5			
8.00%	8	8	8	8	8	8	8			
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)

657

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

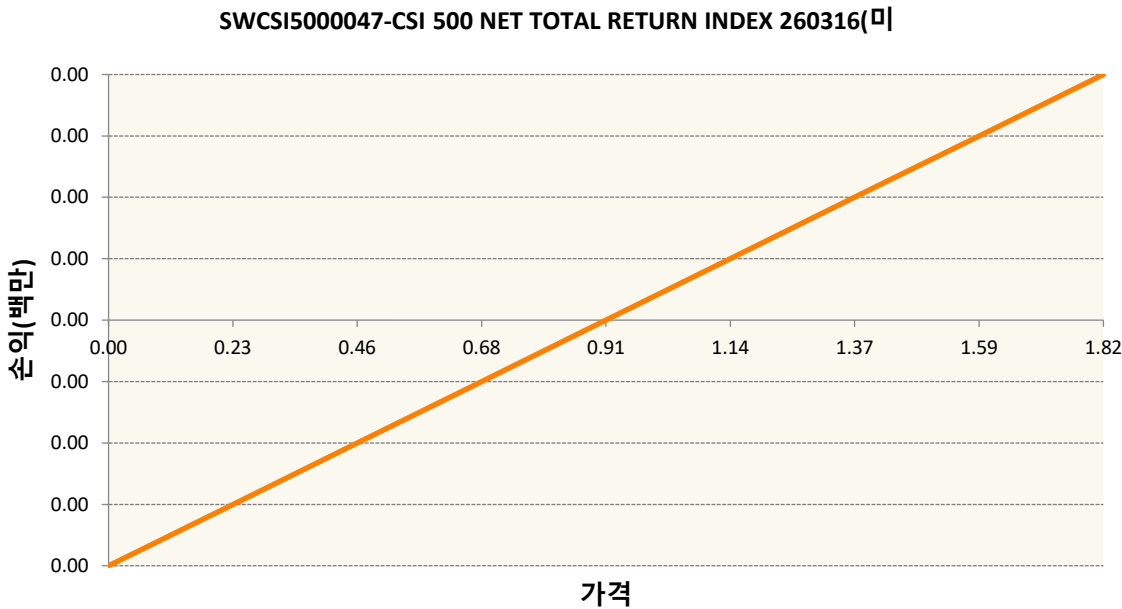
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,136	0	5,136	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

410

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

541

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

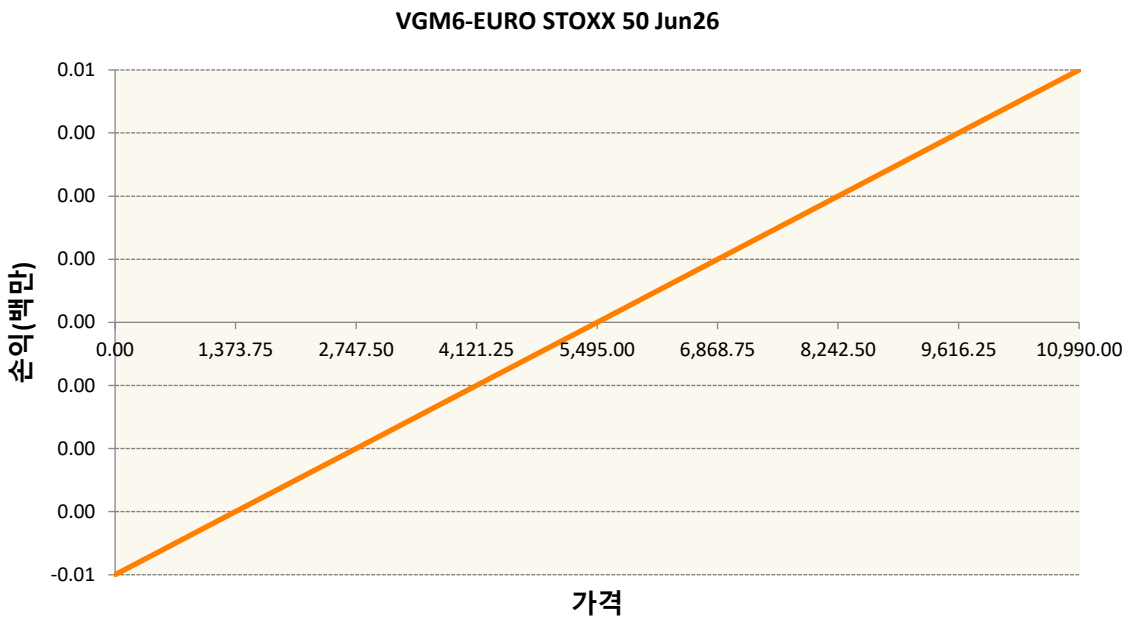
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	846	0	846	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	68
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

57

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

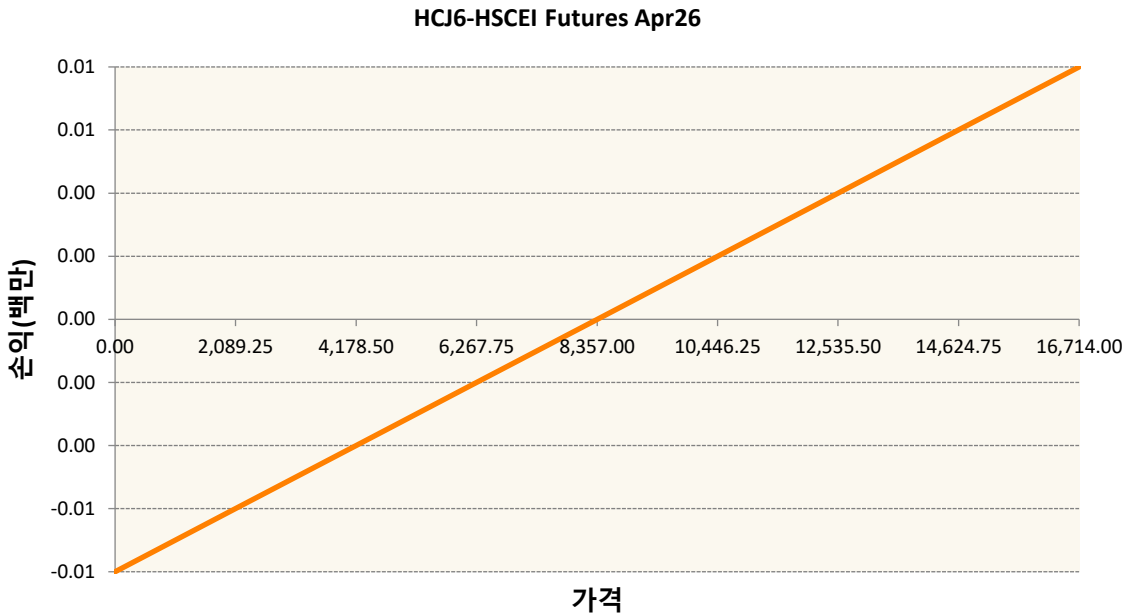
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,451	0	1,451	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	2026-04-02
기준일	2026-04-01

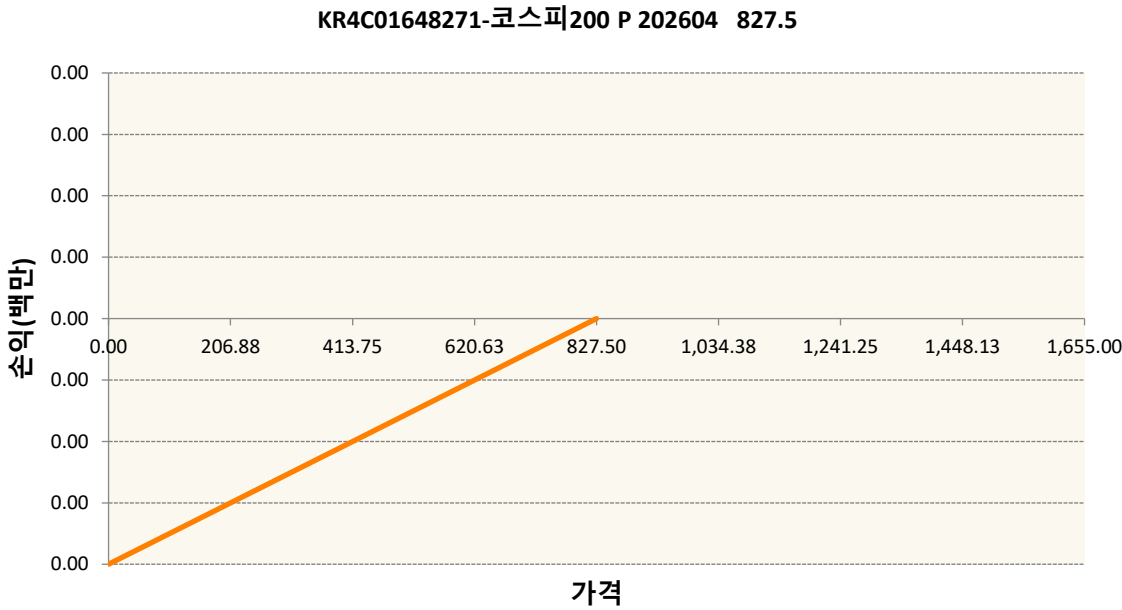
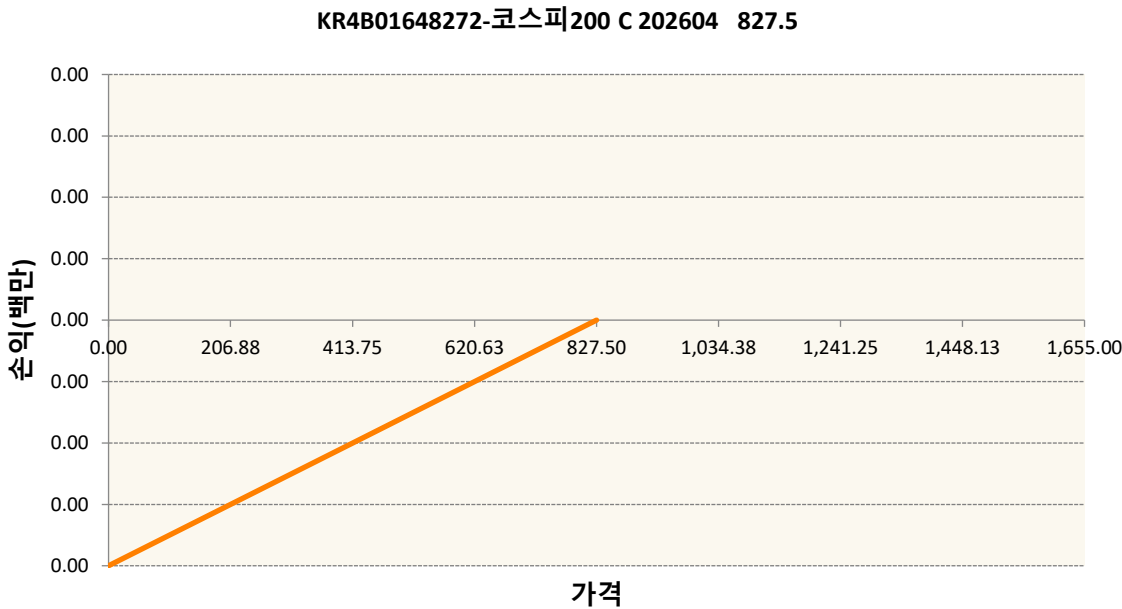
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	36,617	-36,617	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01648272 코스피200 C 202604 827.5							1,812
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,512	-1,549	-1,592	-1,641	-1,694	-1,751	-1,812
-5.33%	-833	-890	-953	-1,019	-1,088	-1,161	-1,235
-2.67%	-230	-307	-387	-469	-552	-636	-721
0%	272	182	91	0	-91	-183	-274
2.67%	662	569	476	383	290	196	103
5.33%	942	858	771	683	594	504	414
8.00%	1,128	1,058	985	908	828	746	663
KR4C01648271 코스피200 P 202604 827.5							431
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-359	-368	-378	-390	-403	-416	-431
-5.33%	-198	-212	-226	-242	-259	-276	-294
-2.67%	-55	-73	-92	-111	-131	-151	-171
0%	65	43	22	0	-22	-43	-65
2.67%	157	135	113	91	69	47	25
5.33%	224	204	183	162	141	120	98
8.00%	268	252	234	216	197	177	158

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

2,061

공시일 2026-04-02

기준일 2026-04-01

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	2026-04-02
기준일	2026-04-01

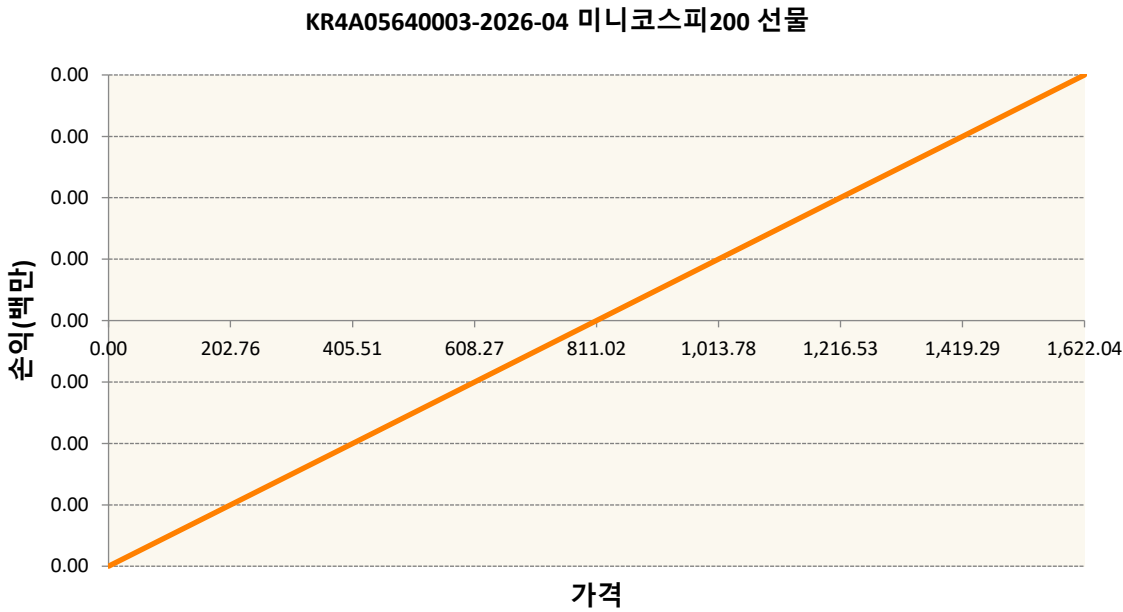
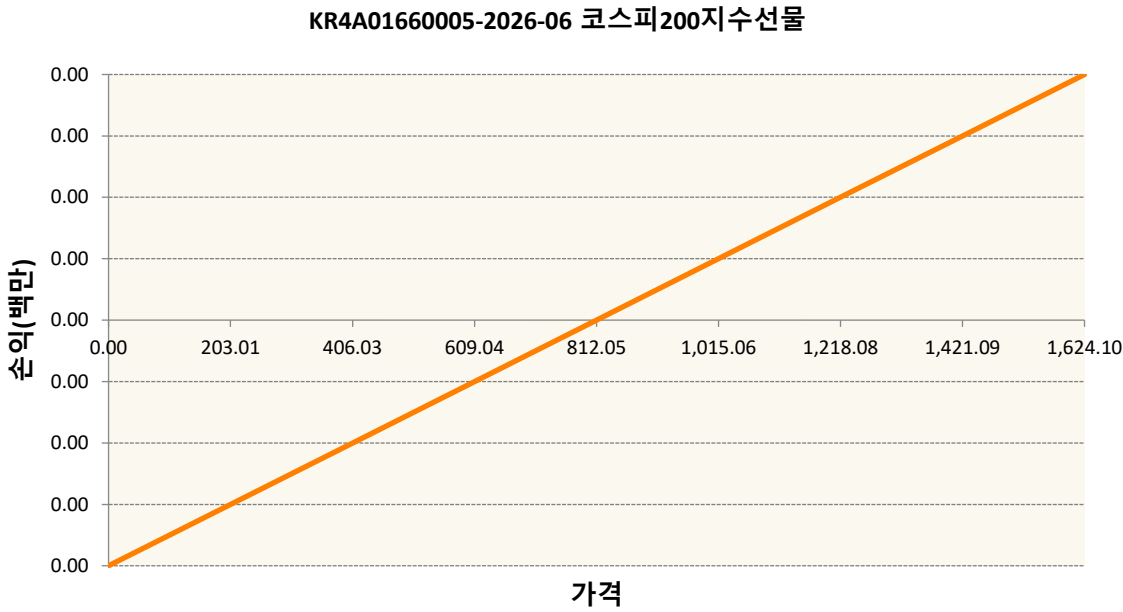
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

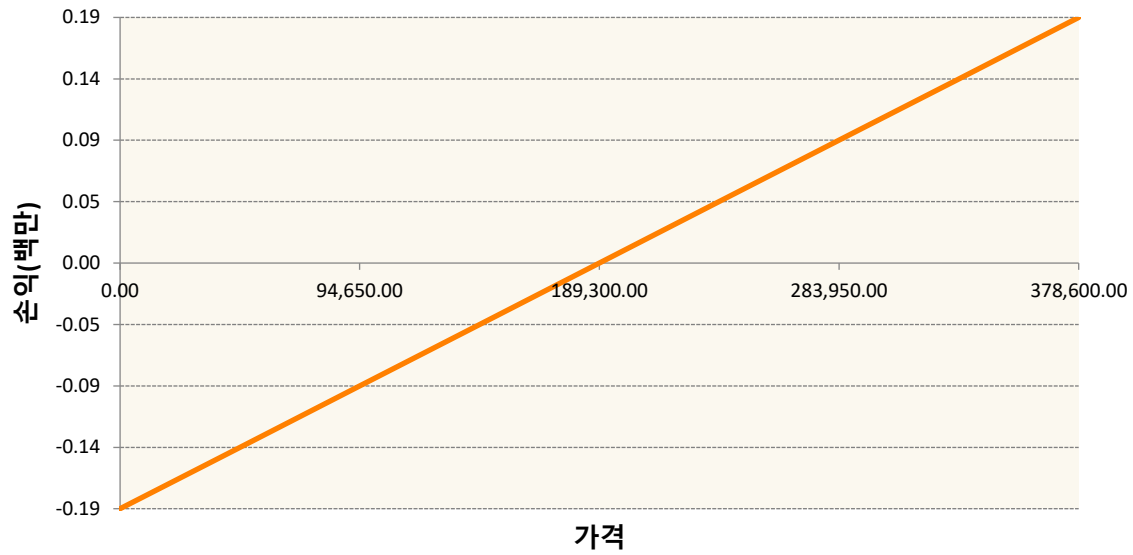
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,202	-1,202	장내
누계	유가증권	선물	3,194	0	3,194	장내

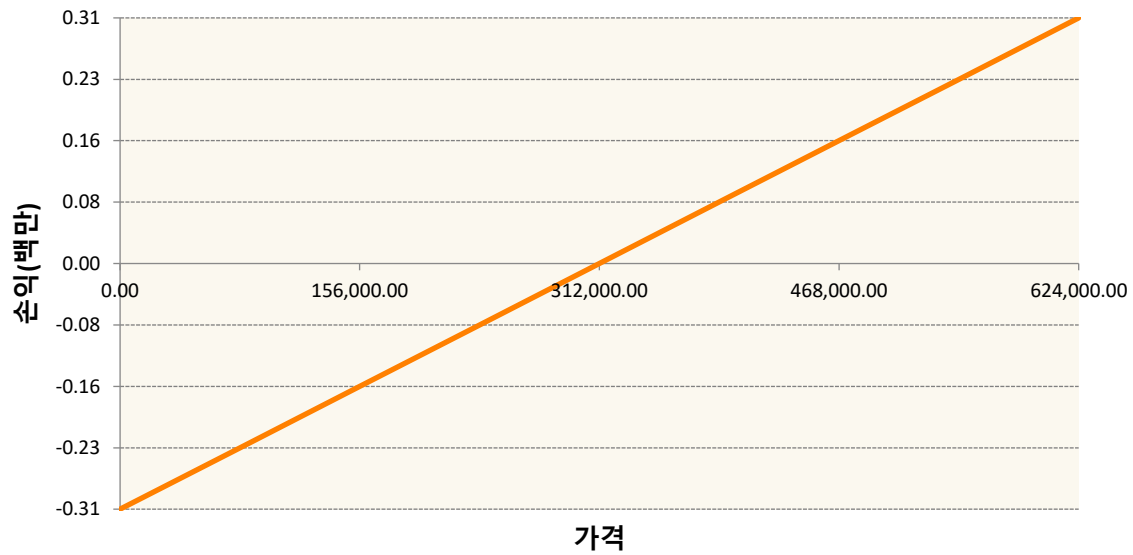
2. 만기시점의 손익구조



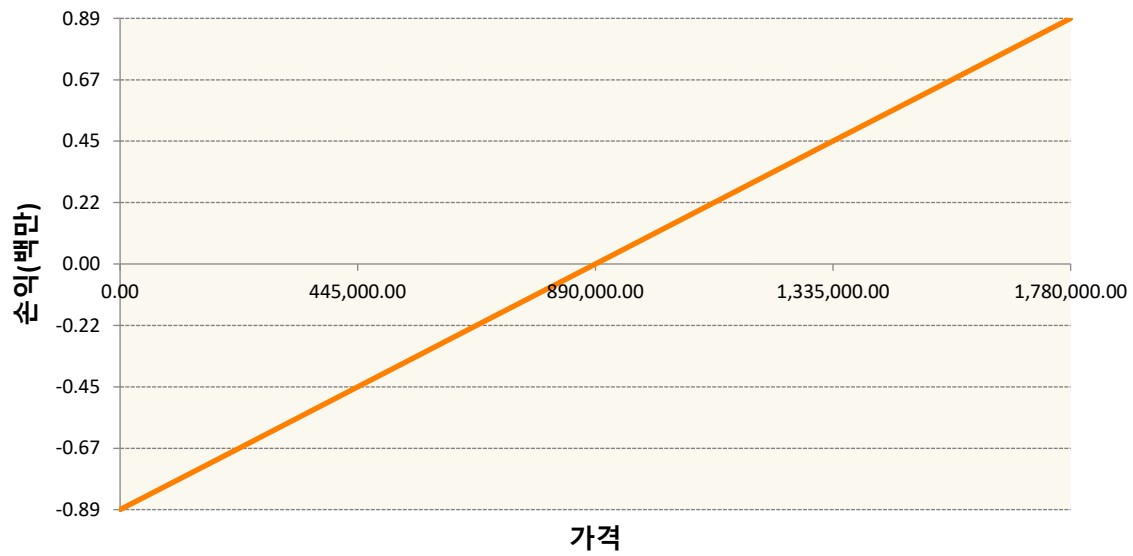
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



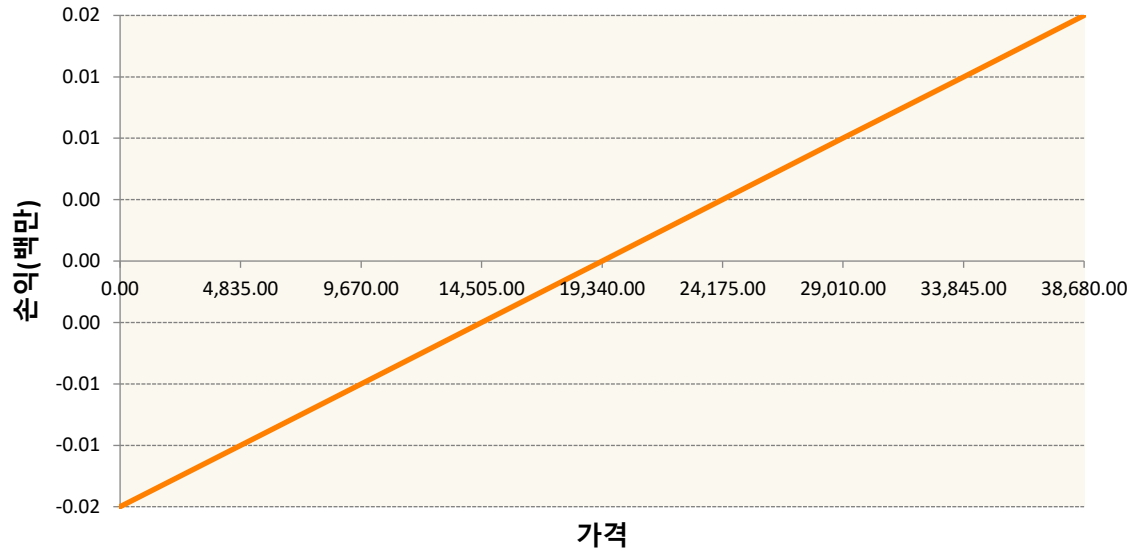
KR4A47640003-2026-04 LG화학개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								81
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	54	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	81	81	81	81	81	81	81	81
KR4A05640003 2026-04 미니코스피200 선물								33
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	22	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	33	33	33	33	33	33	33	33
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)

270

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

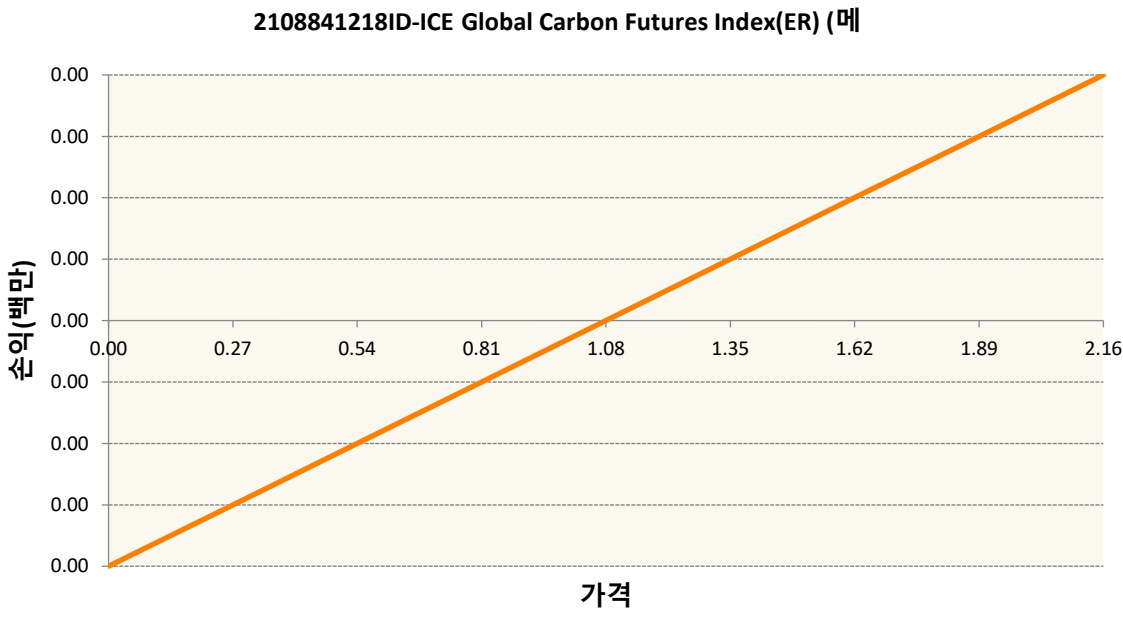
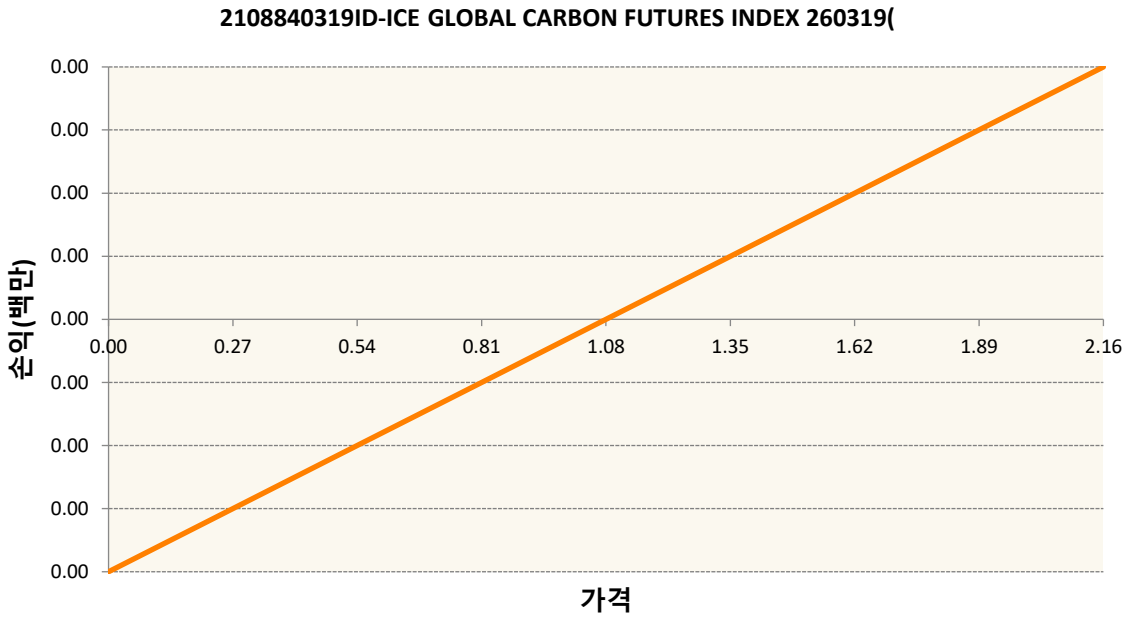
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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(		398
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	553

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

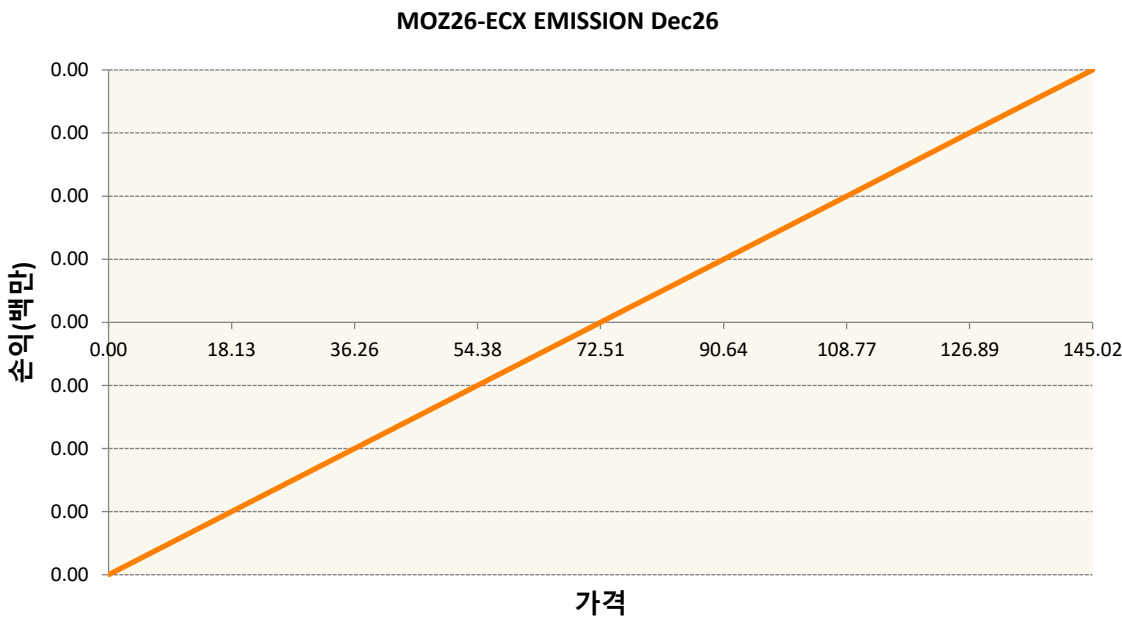
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,671	0	4,671	
누계	통화	선도	0	2,204	-2,204	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E	176
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	374

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

(단위:백만원)

645

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	1,333	0	1,333	장외
누계	지수	스왑	1,648	0	1,648	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	11
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	8
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	19
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	7

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

(단위:백만원)

75

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

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	-1,518	0	-1,518	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)	4
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	15
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	78
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	29

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

(단위:백만원)

200

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

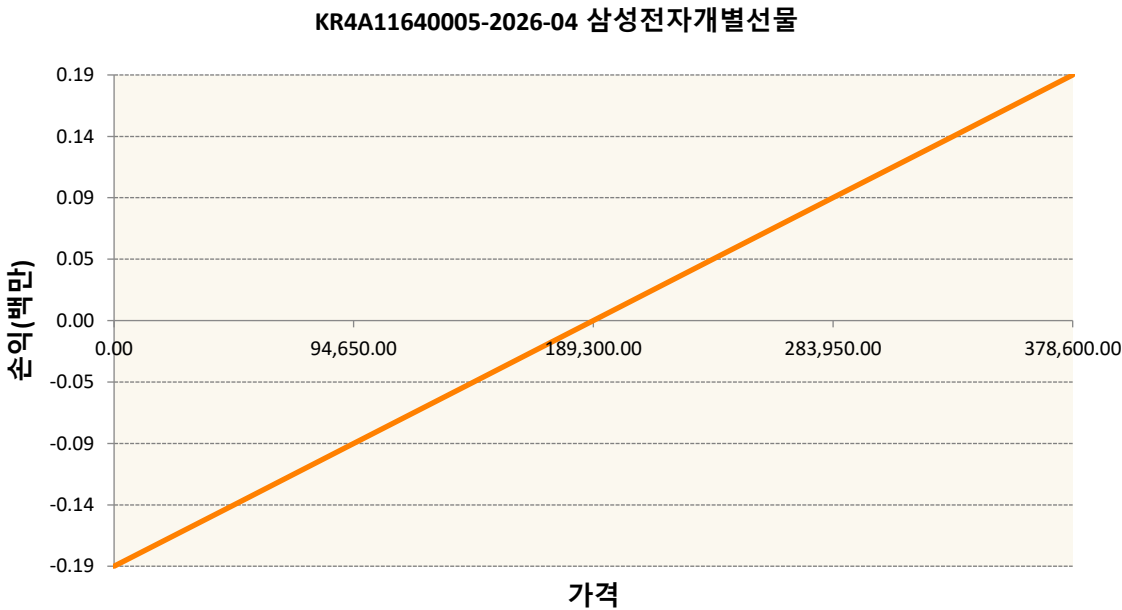
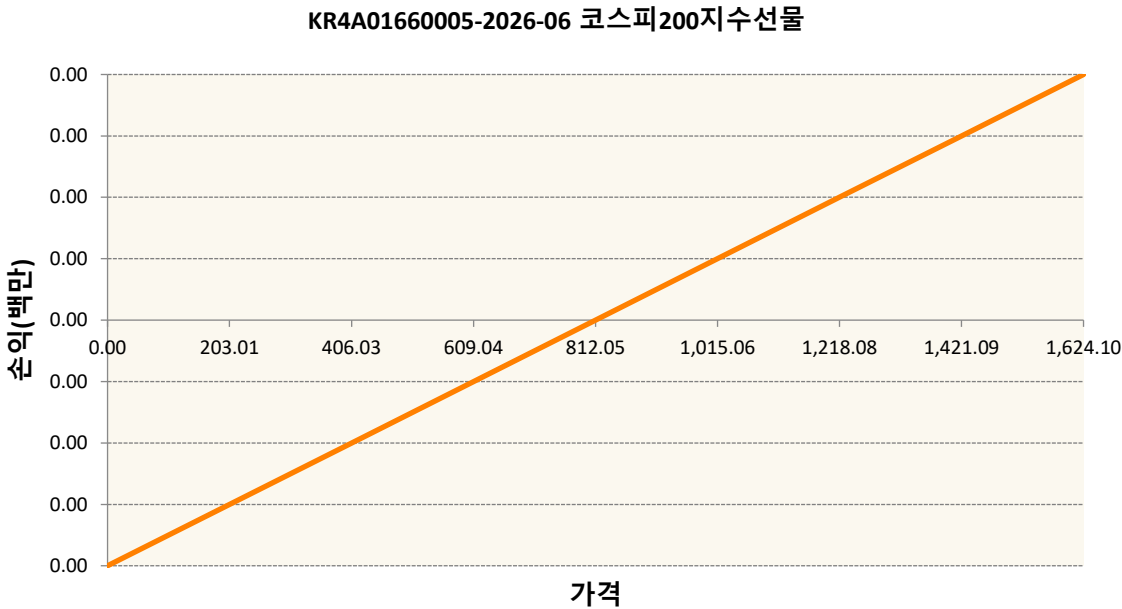
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

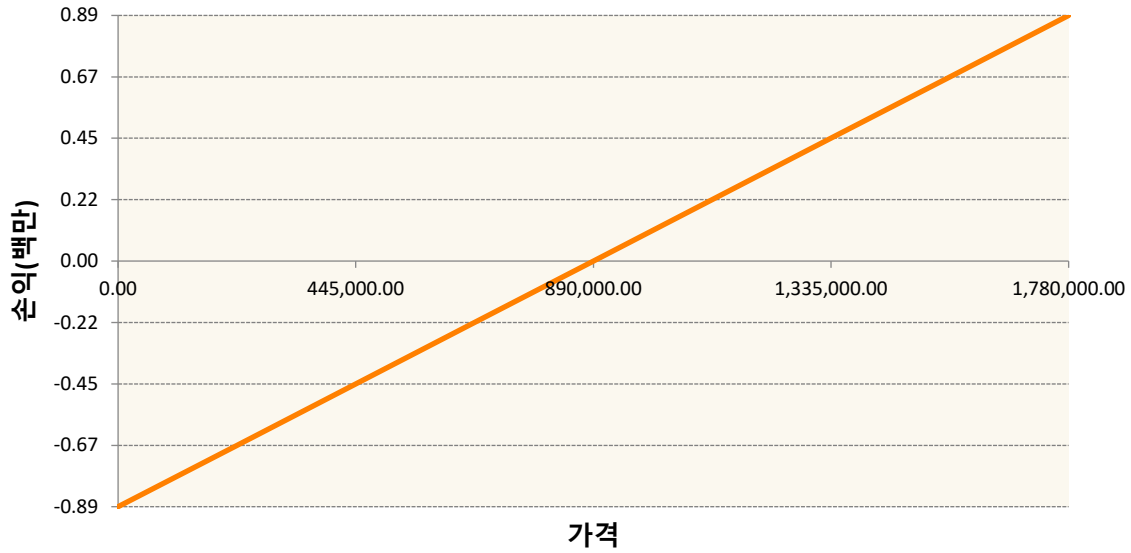
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,380	1,640	-260	장내
누계	유가증권	선물	18,307	1,536	16,772	장내

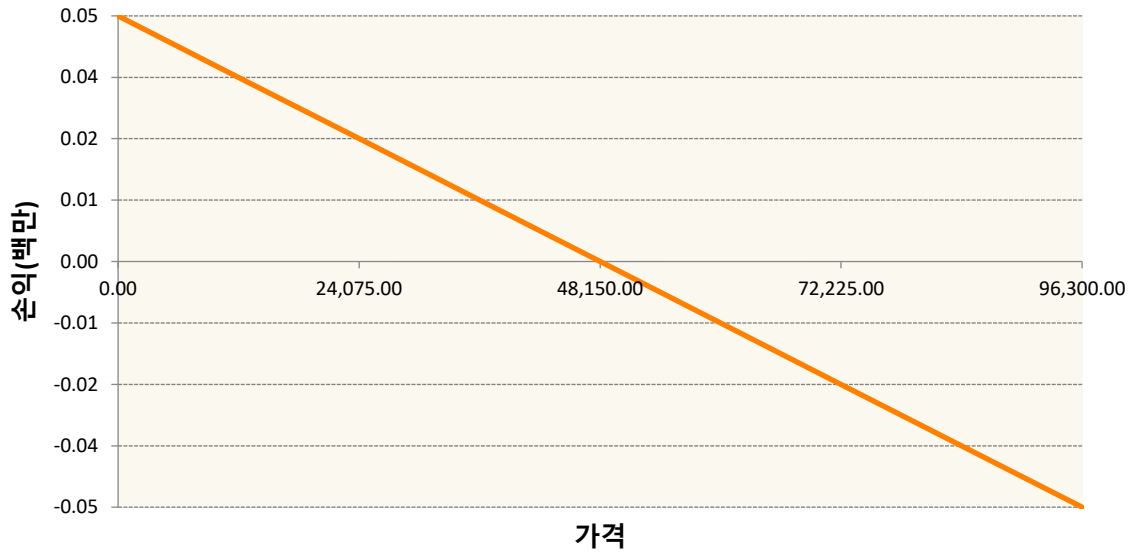
2. 만기시점의 손익구조



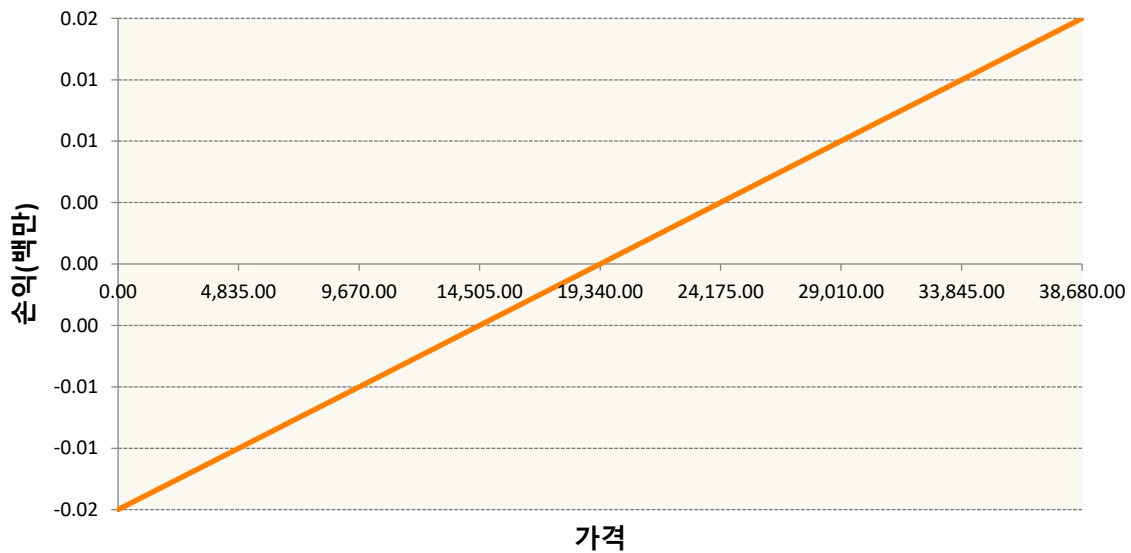
KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4ACF640007-2026-04 카카오개별선물



KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		1,204	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-1,204	-1,204	-1,204	-1,204	-1,204	-1,204	-1,204			
-5.33%	-803	-803	-803	-803	-803	-803	-803			
-2.67%	-401	-401	-401	-401	-401	-401	-401			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	401	401	401	401	401	401	401			
5.33%	803	803	803	803	803	803	803			
8.00%	1,204	1,204	1,204	1,204	1,204	1,204	1,204			
KR4A11640005							2026-04 삼성전자개별선물		157	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157			
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104			
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	52	52	52	52	52	52	52			
5.33%	104	104	104	104	104	104	104			
8.00%	157	157	157	157	157	157	157			
KR4A50640007							2026-04 SK하이닉스개별선물		77	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77			
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51			
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	26	26	26	26	26	26	26			
5.33%	51	51	51	51	51	51	51			
8.00%	77	77	77	77	77	77	77			
KR4ACF640007							2026-04 카카오개별선물		123	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	123	123	123	123	123	123	123			
-5.33%	82	82	82	82	82	82	82			
-2.67%	41	41	41	41	41	41	41			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41			
5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82			
8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123			
KR4AFT640008							2026-04 대우건설개별선물		30	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	30	30	30	30	30	30	30

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

(단위:백만원)

3,459

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

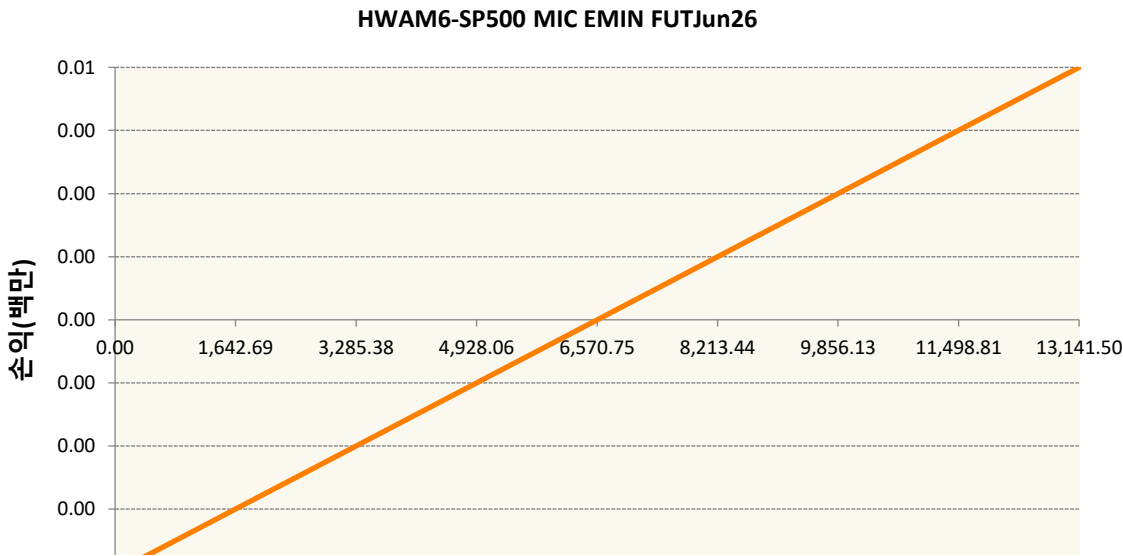
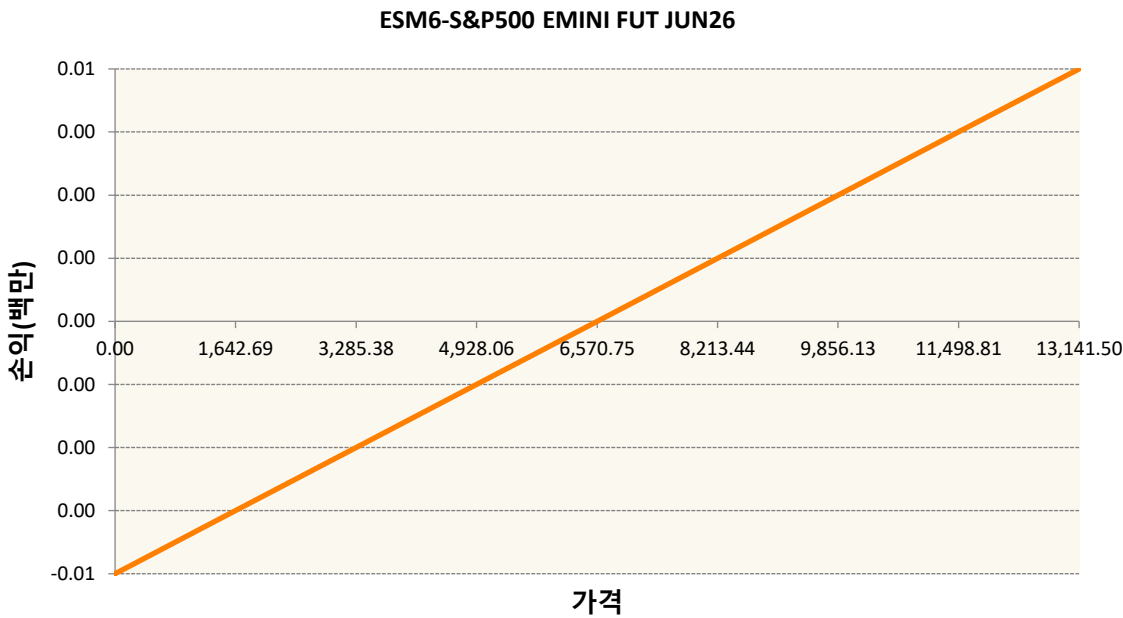
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

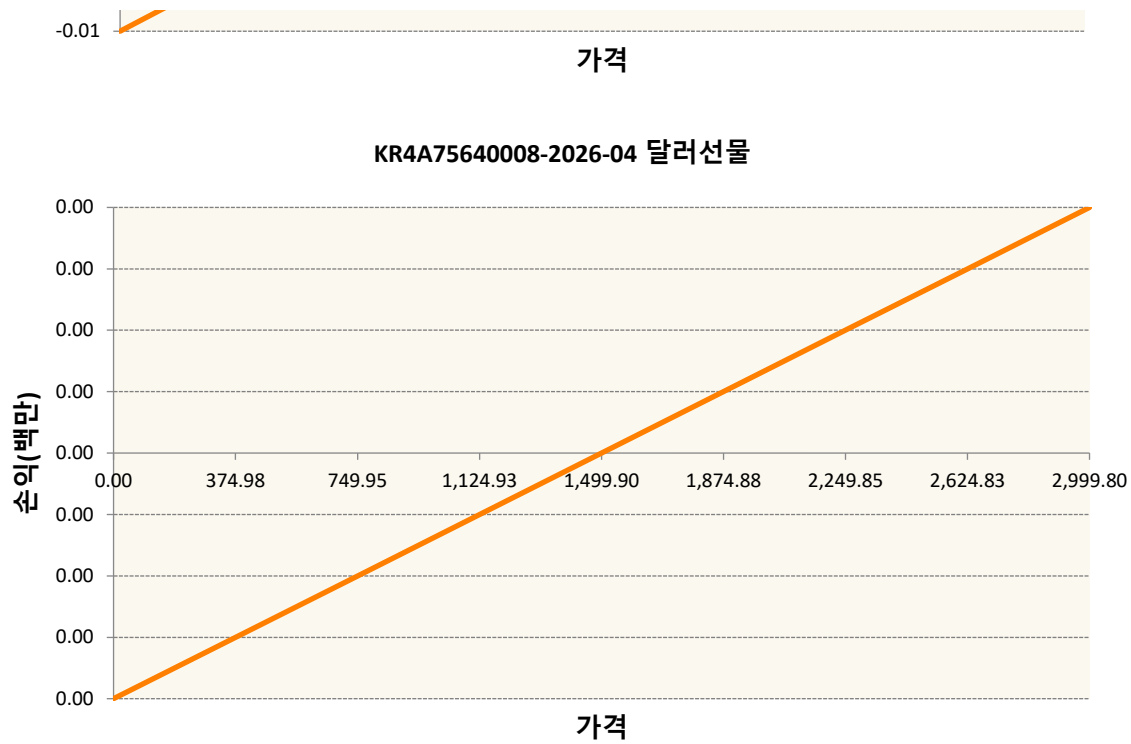
1. 계약금액

(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	51,779	0	51,779	
누계	지수	선물	149	0	149	장내
누계	통화	선물	12,449	0	12,449	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,142
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	12
KR4A756400 2026-04 달러선물		996

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

(단위:백만원)

3,622

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

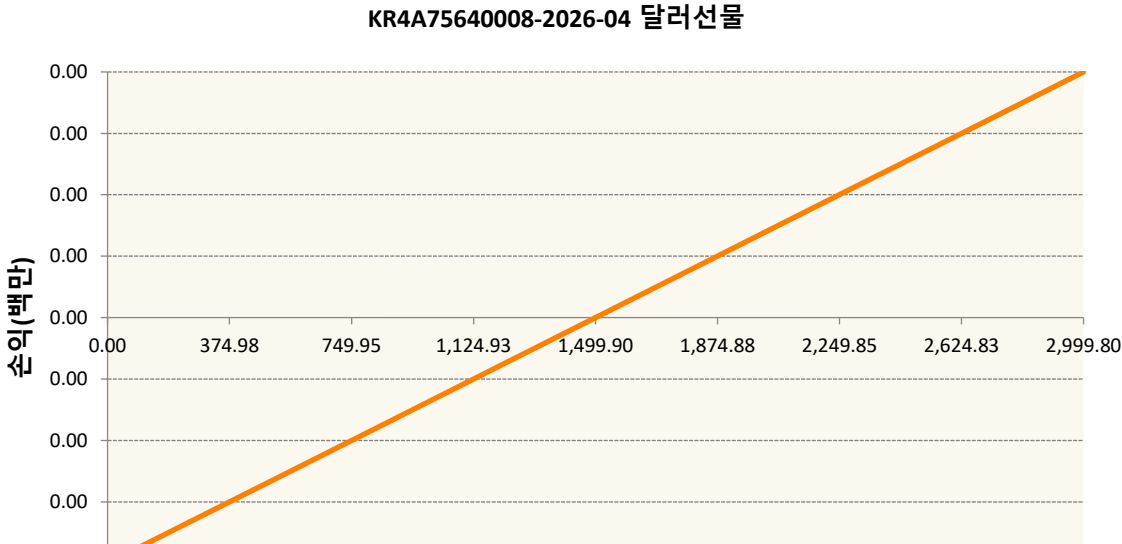
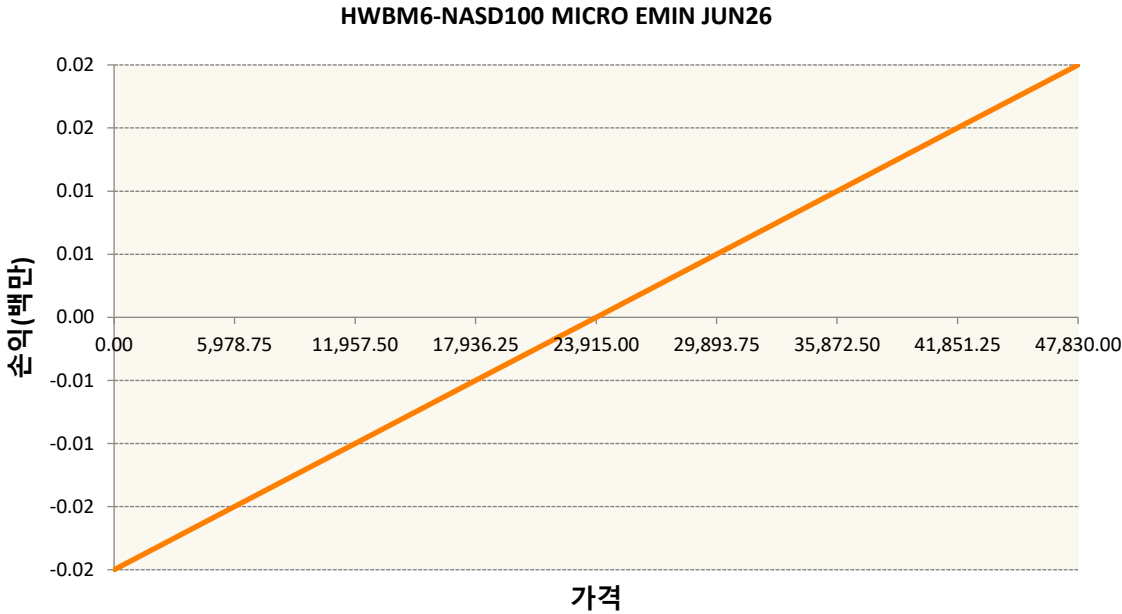
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

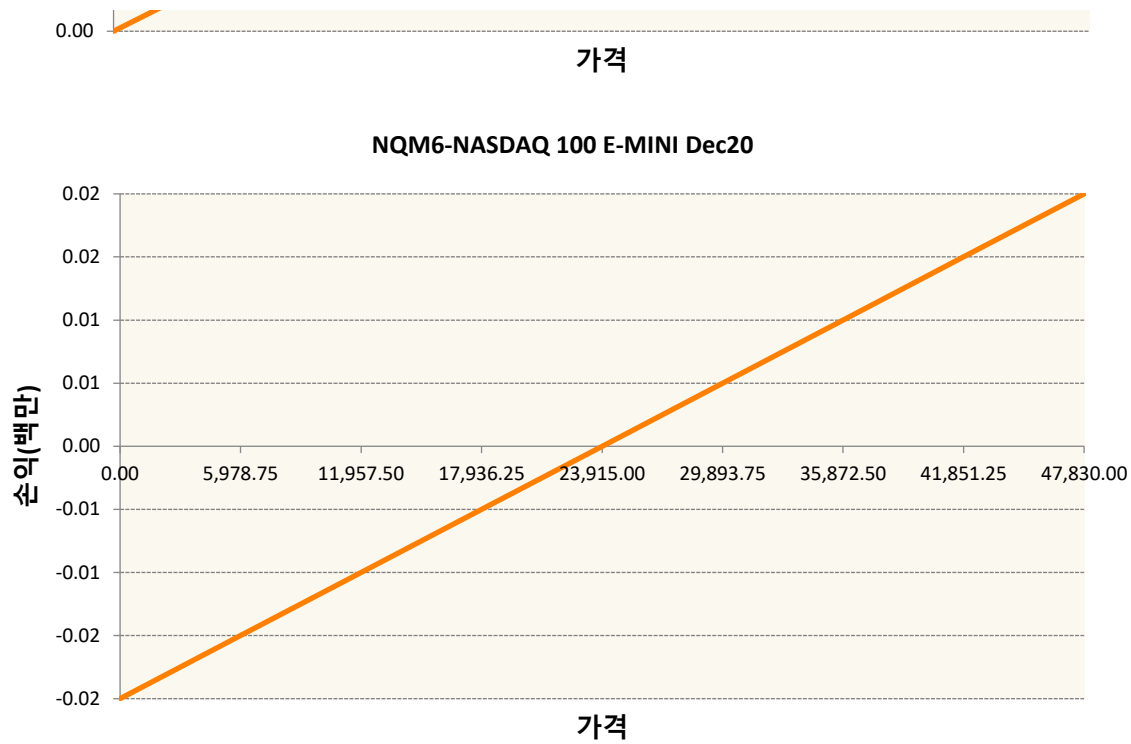
1. 계약금액

(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	22,256	0	22,256	
누계	유가증권	선물	144	0	144	장내
누계	통화	선물	5,025	0	5,025	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	12
KR4A756400	2026-04 달러선물	402
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,780

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

1,978

공시일	2026-04-02
기준일	2026-04-01

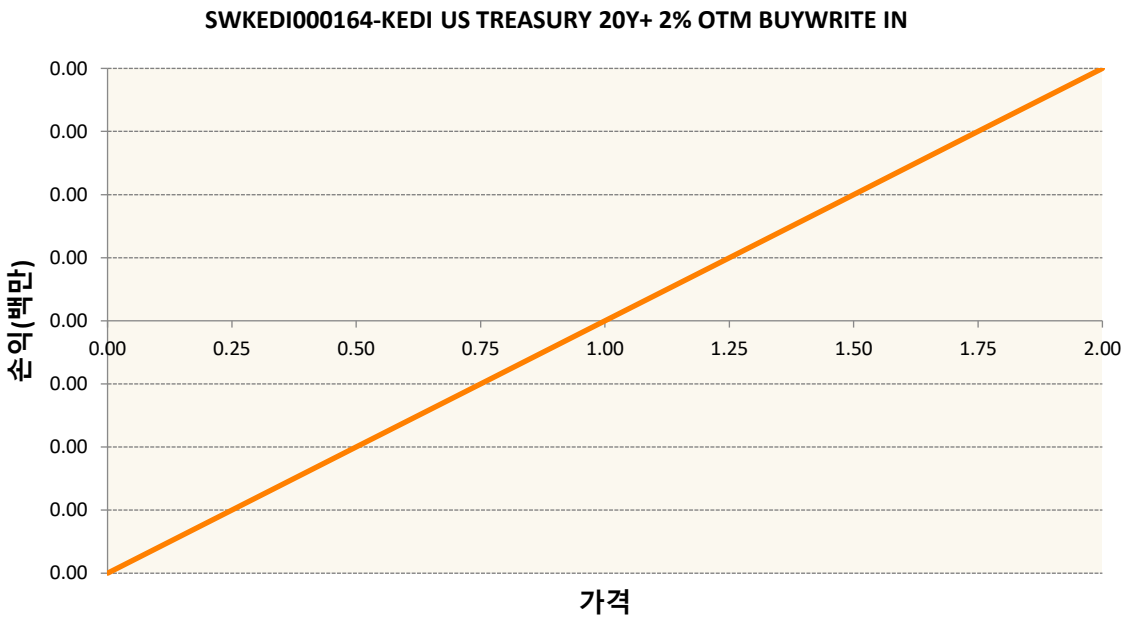
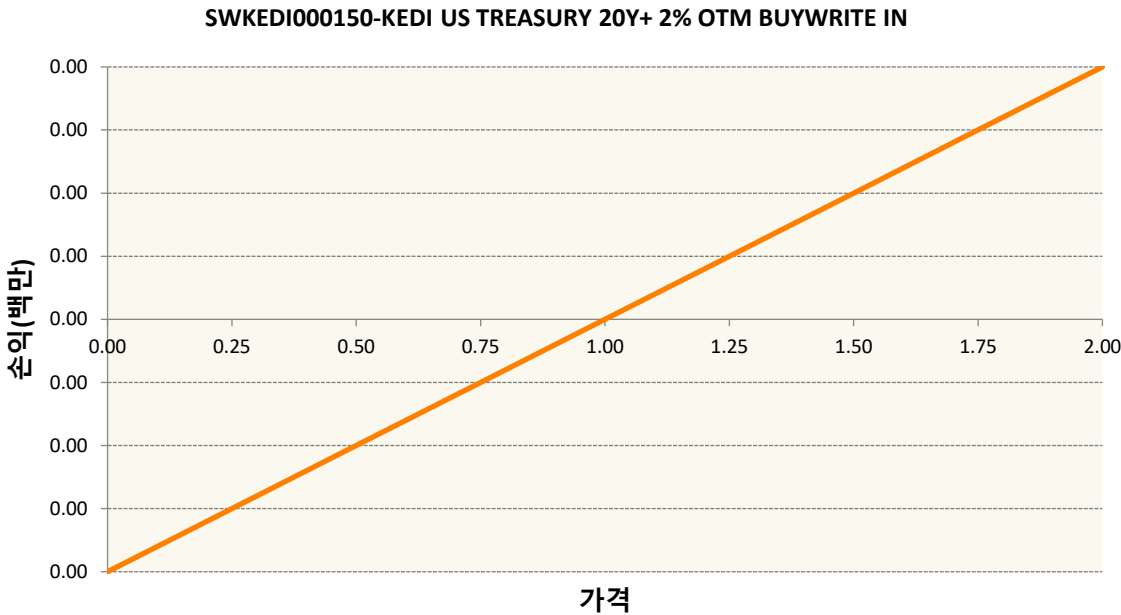
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

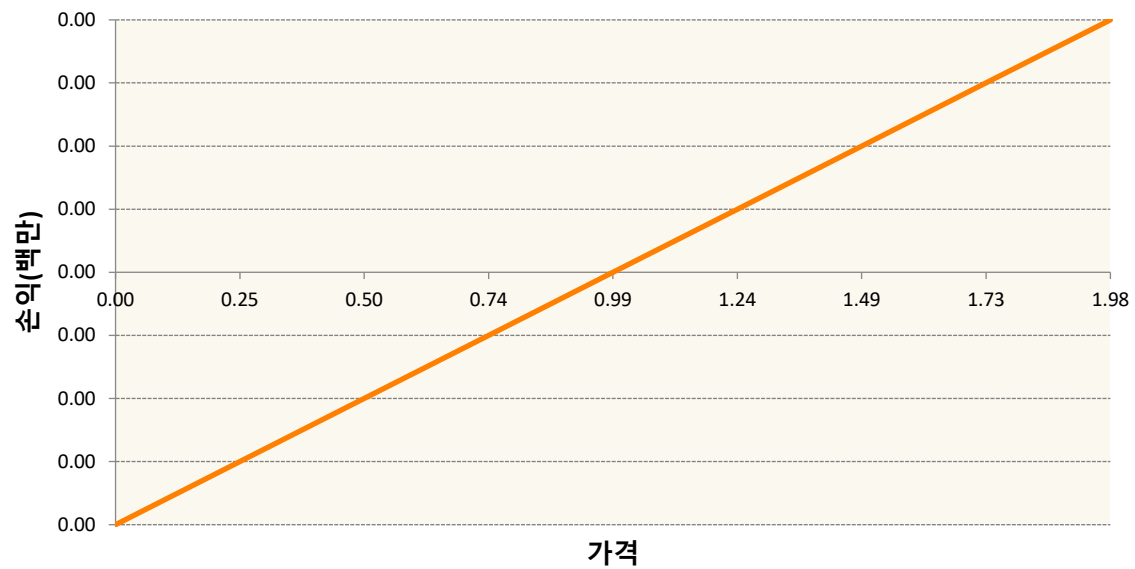
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	367,737	0	367,737	장외

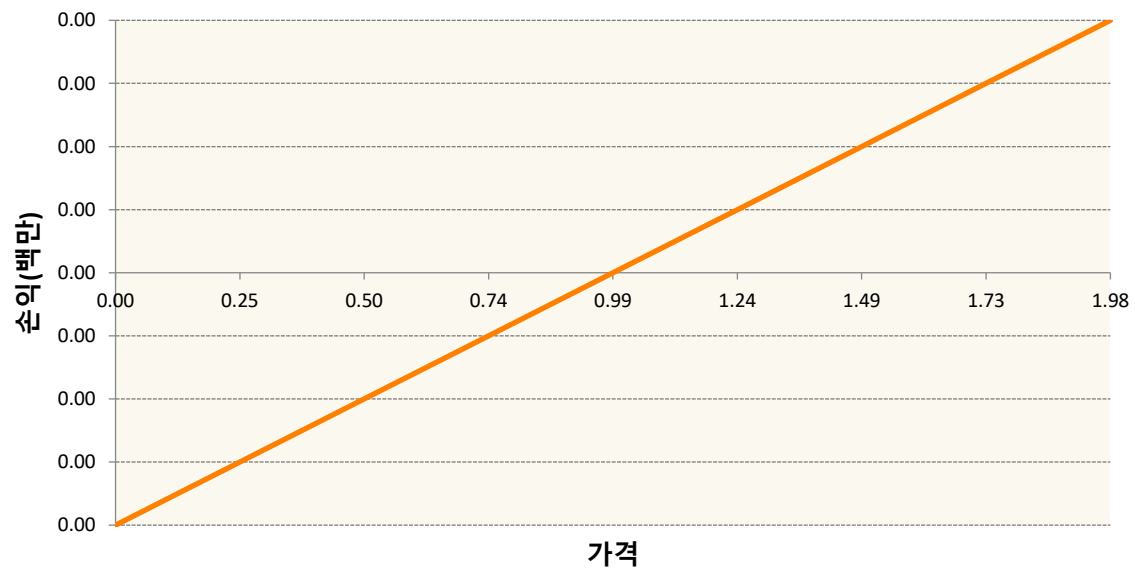
2. 만기시점의 손익구조



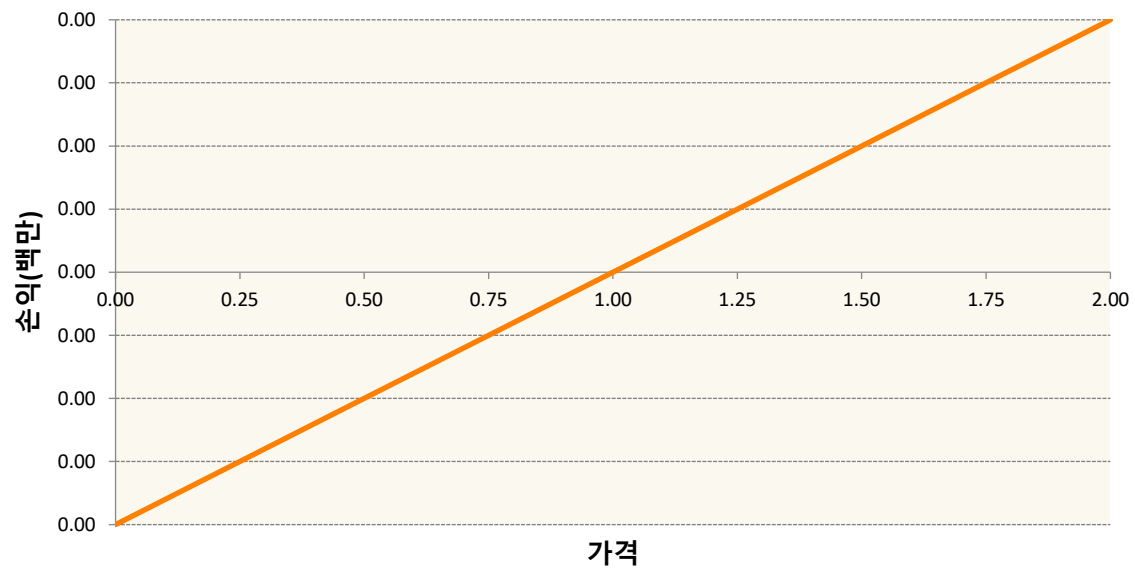
SWKEDI000169-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,408
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		154
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,366
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,802
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,713

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,677

공시일 2026-04-02

기준일 2026-04-01

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