

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

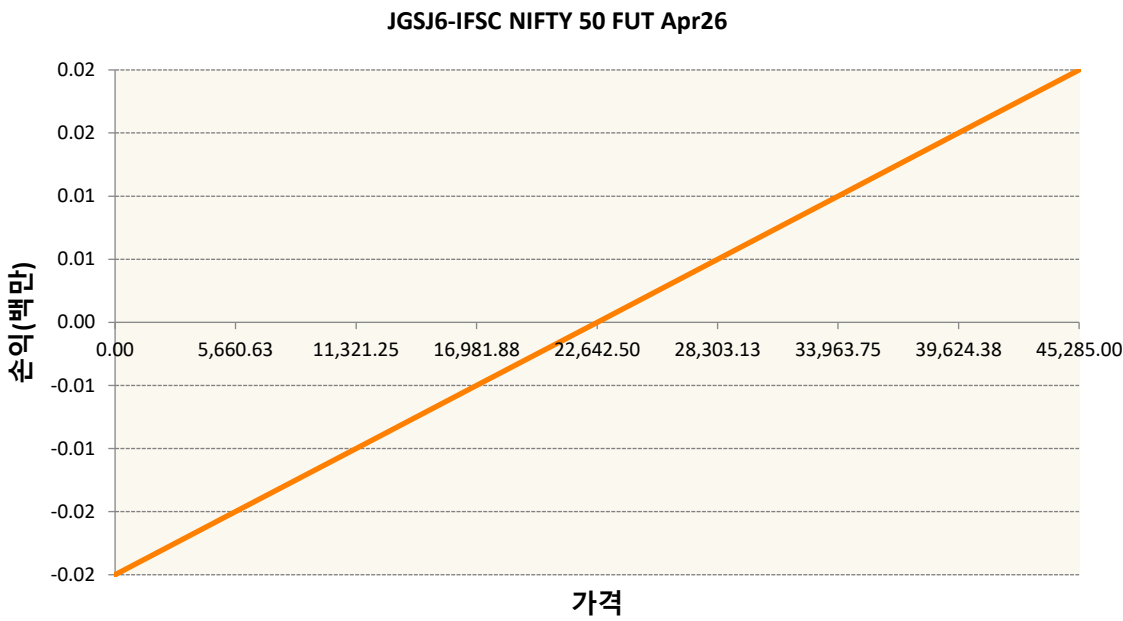
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 614   | 0     | 614       |    |

### 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 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

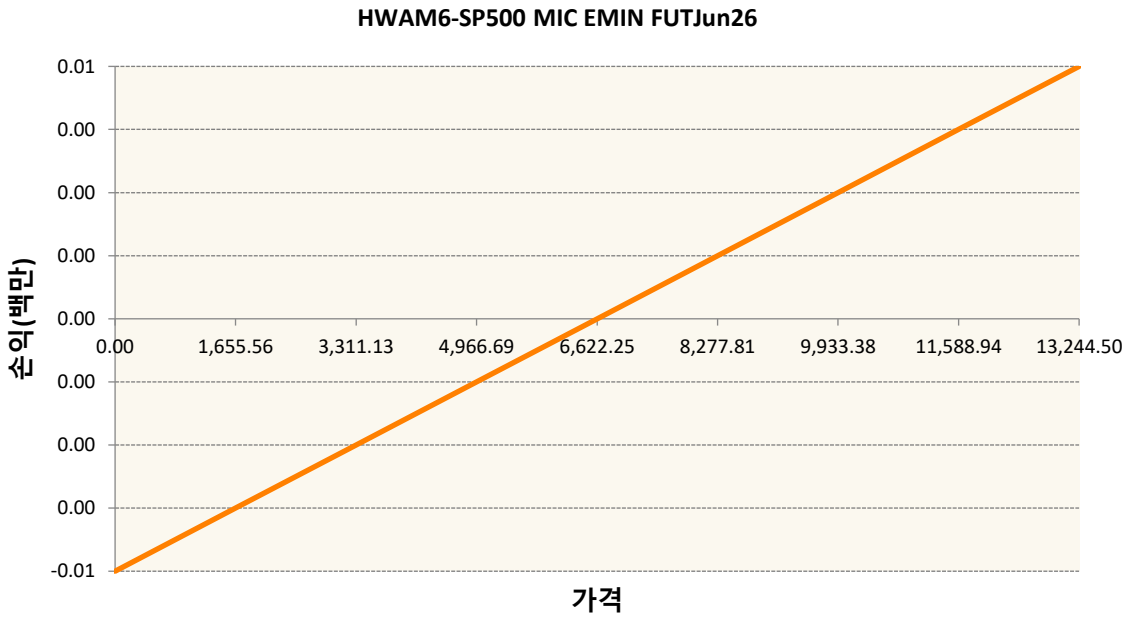
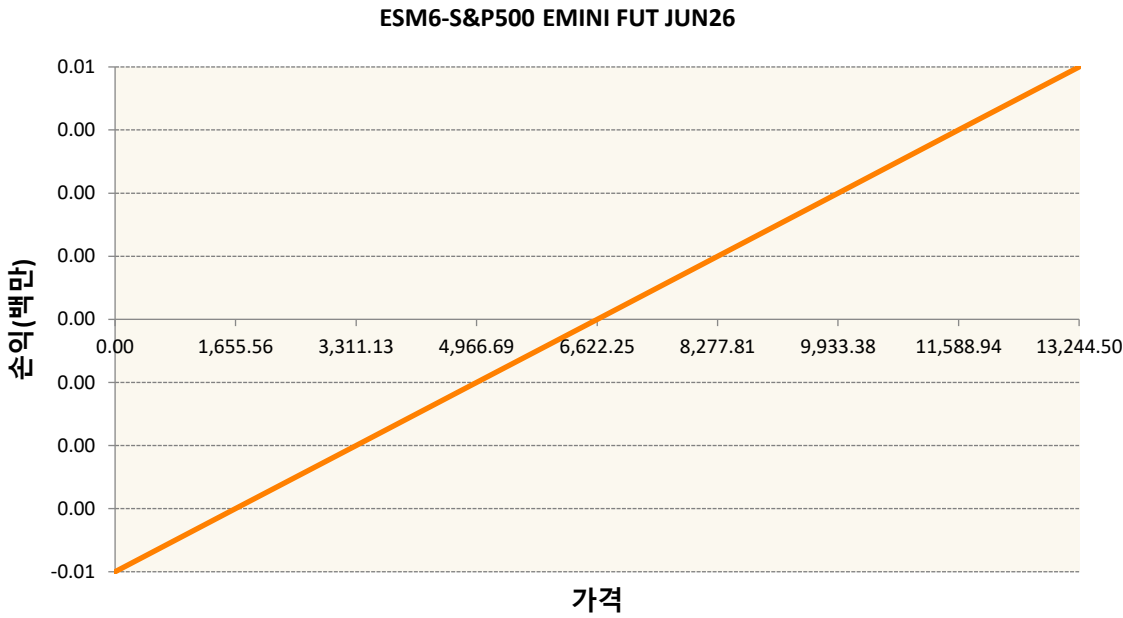
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 497   | 0     | 497       |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 299   | 0     | 299       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| ESM6                      | S&P500 EMINI FUT JUN26  | 40       |
| HWAM6                     | SP500 MIC EMIN FUTJun26 | 24       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 56       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

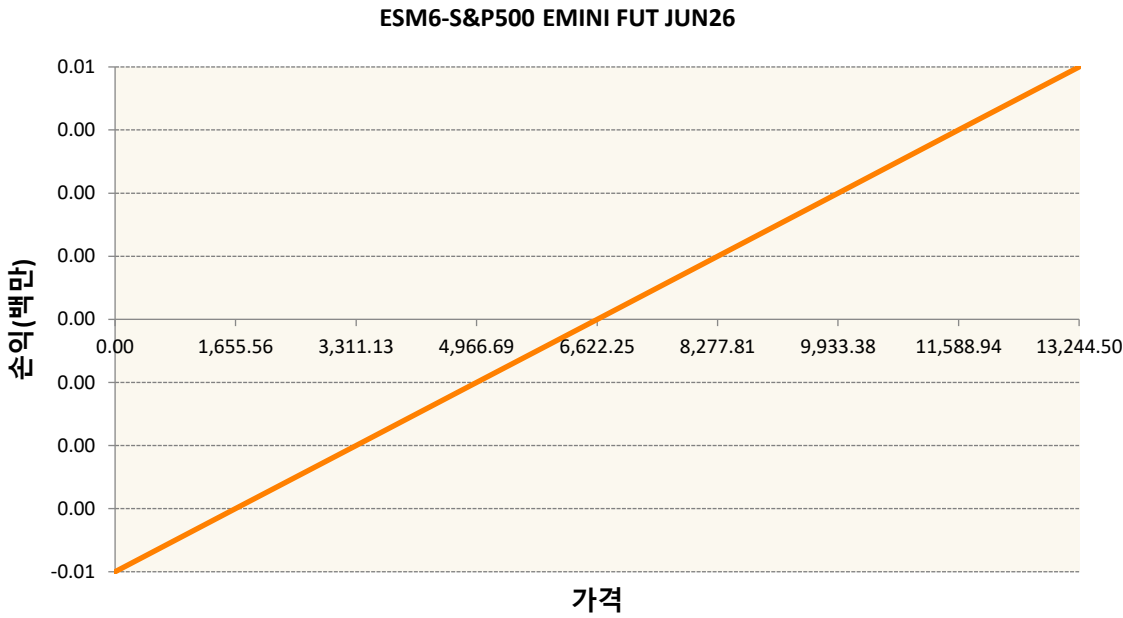
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 994   | 0     | 994       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |    |
|------|------------------------|----|
| ESM6 | S&P500 EMINI FUT JUN26 | 80 |
|------|------------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 69 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

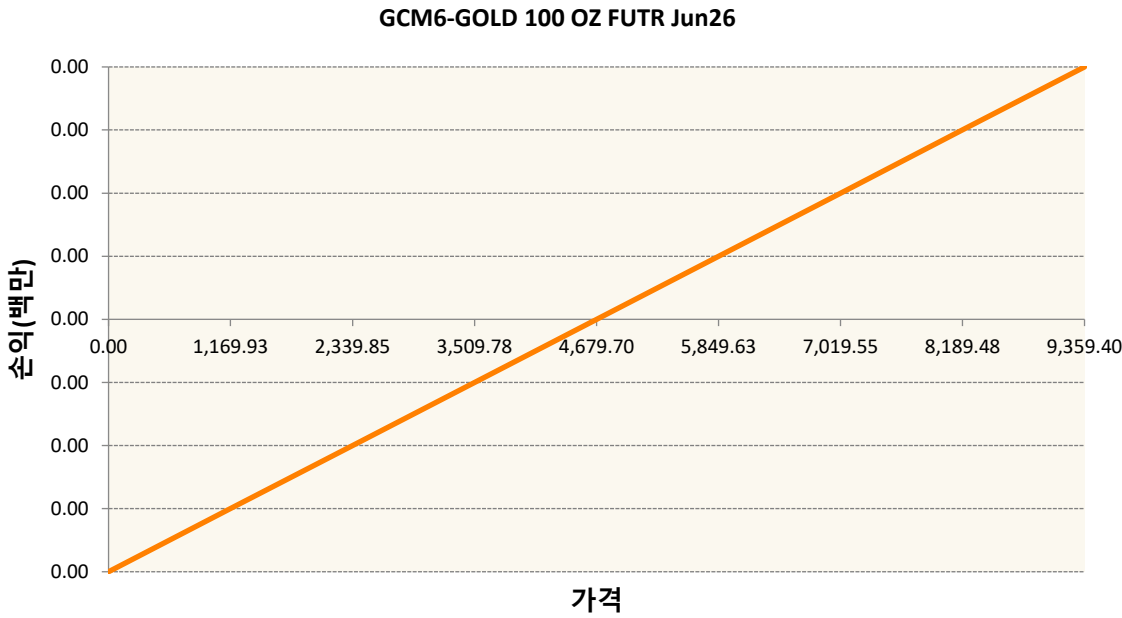
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 4,942 | 0     | 4,942     | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| AOGLDUSCC GLD US 04/10/26 C435 EQUITY | 14  |
| GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26           | 395 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 515 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

## 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)

|                                          |     |
|------------------------------------------|-----|
| AOPLTRUC1!PLTR US 04/10/26 C152.5 EQUITY | 114 |
| AOPLTRUP1!PLTR US 04/10/26 P152.5 EQUITY | 34  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 495 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

## 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)

AOTLTUSC8(TLT US 04/10/26 C86.5 EQUITY

16

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

(단위:백만원)

11

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

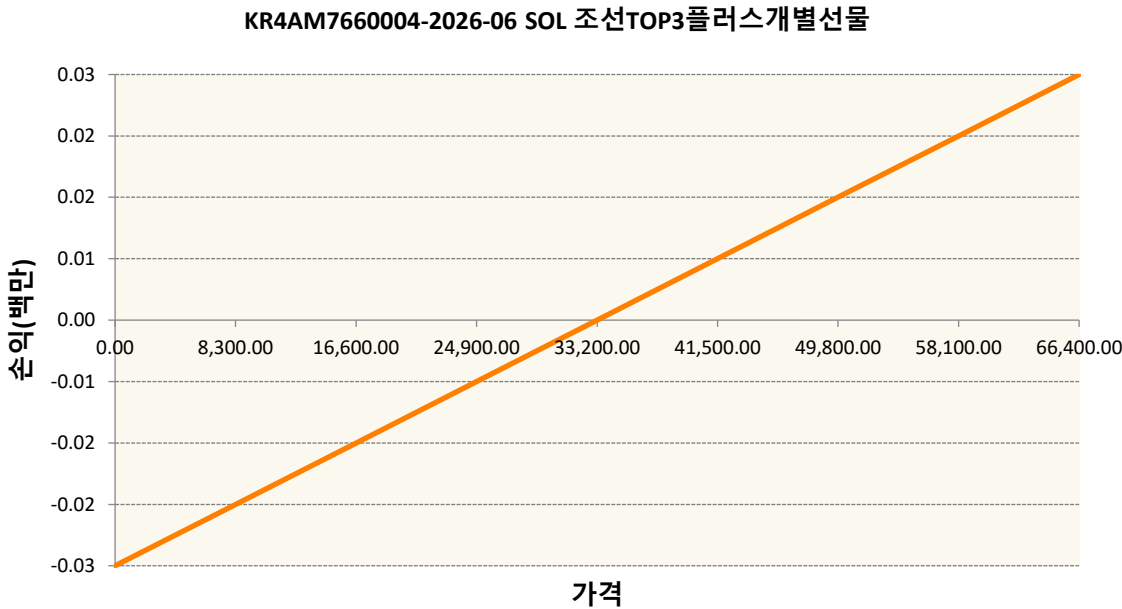
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 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   | 146,415 | 0     | 146,415   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0



공시일 2026-04-07

기준일 2026-04-06

## 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 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

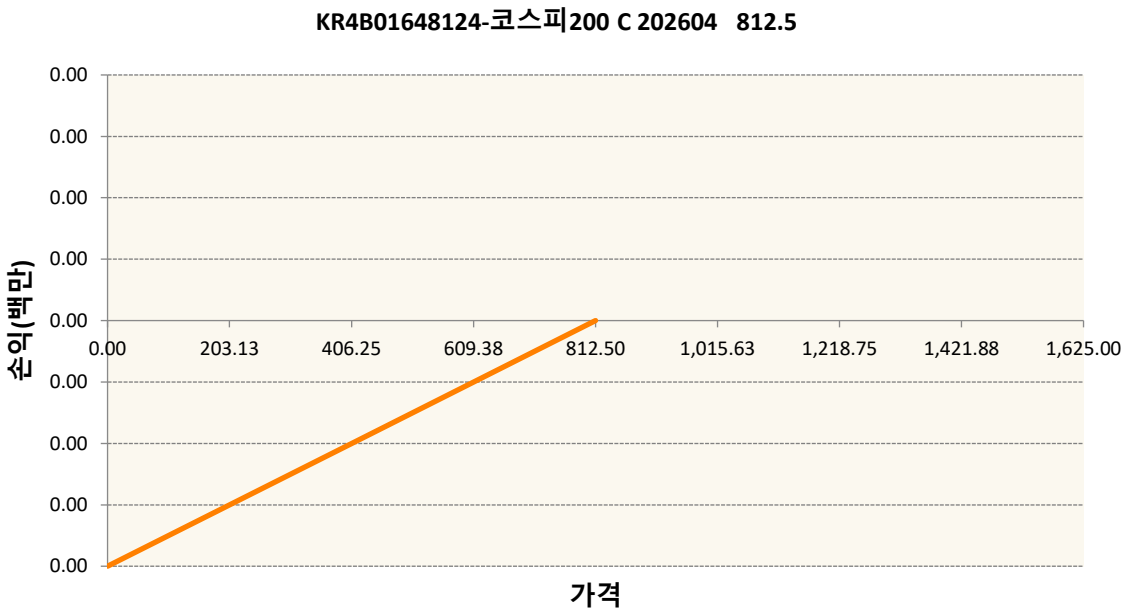
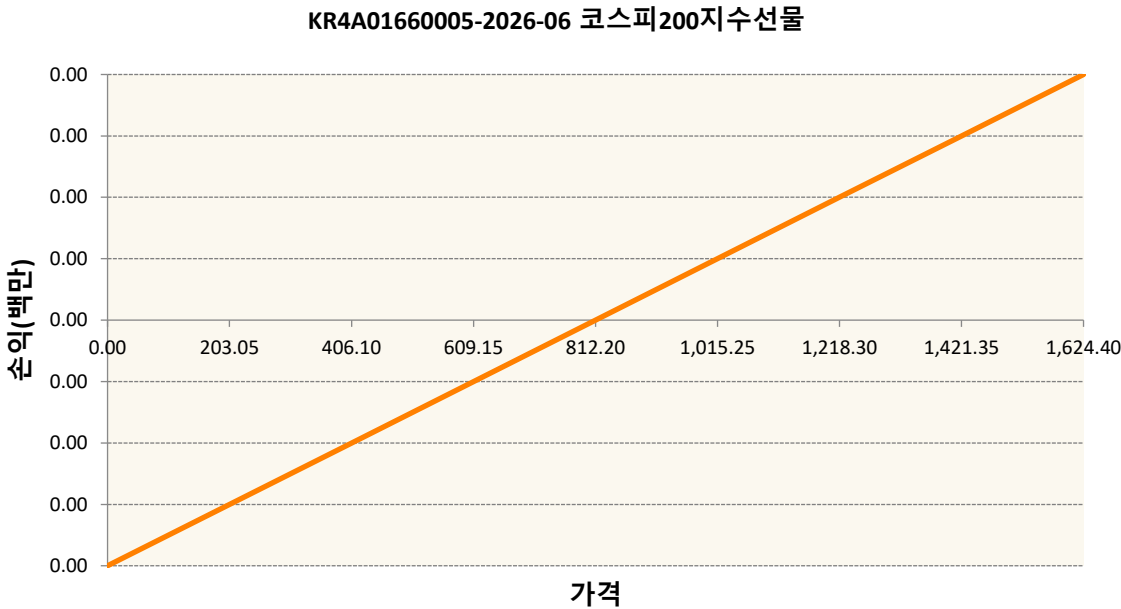
## SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

### 1. 계약금액

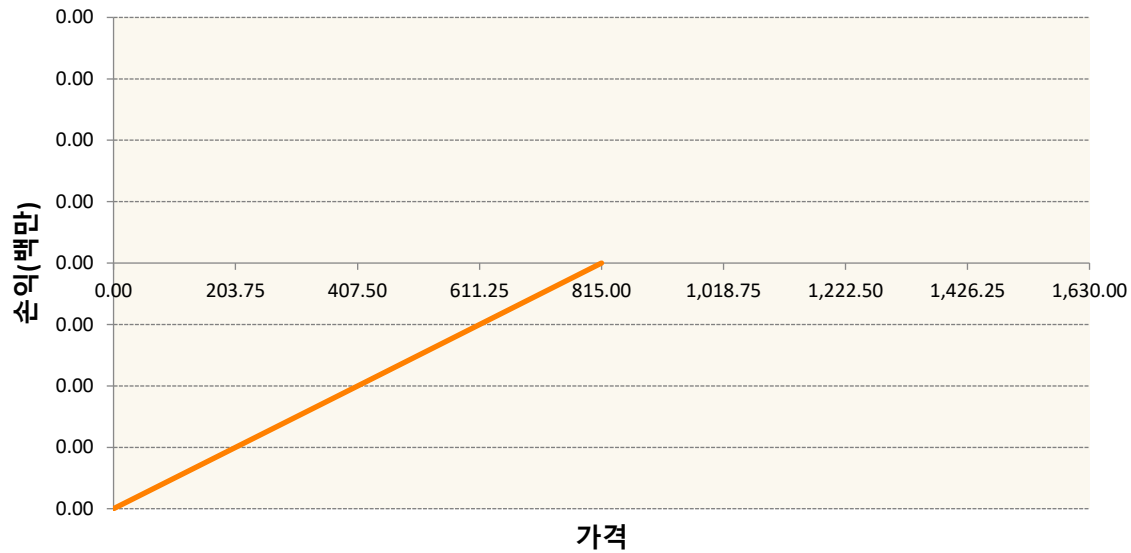
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 9,163 | -9,163    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,279 | 0     | 5,279     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 8,949 | -8,949    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4B01648157-코스피200 C 202604 815.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|              |           |         |                       |      |       |        |        |
|--------------|-----------|---------|-----------------------|------|-------|--------|--------|
| KR4A01660005 |           |         | 2026-06 코스피200지수선물    |      |       |        | 422    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                       |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%                | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -422      | -422    | -422                  | -422 | -422  | -422   | -422   |
| -5.33%       | -281      | -281    | -281                  | -281 | -281  | -281   | -281   |
| -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%        | 281       | 281     | 281                   | 281  | 281   | 281    | 281    |
| 8.00%        | 422       | 422     | 422                   | 422  | 422   | 422    | 422    |
| KR4B01648124 |           |         | 코스피200 C 202604 812.5 |      |       |        | 322    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                       |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%                | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -300      | -302    | -305                  | -308 | -313  | -317   | -322   |
| -5.33%       | -169      | -174    | -180                  | -186 | -193  | -201   | -208   |
| -2.67%       | -55       | -63     | -72                   | -82  | -91   | -101   | -110   |
| 0%           | 32        | 21      | 11                    | 0    | -11   | -21    | -32    |
| 2.67%        | 86        | 76      | 67                    | 57   | 47    | 37     | 27     |
| 5.33%        | 113       | 107     | 100                   | 93   | 85    | 77     | 68     |
| 8.00%        | 124       | 121     | 117                   | 112  | 107   | 101    | 95     |
| KR4B01648157 |           |         | 코스피200 C 202604 815.0 |      |       |        | 227    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                       |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%                | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -213      | -214    | -216                  | -218 | -221  | -224   | -227   |
| -5.33%       | -121      | -124    | -128                  | -132 | -137  | -142   | -147   |
| -2.67%       | -40       | -46     | -52                   | -58  | -65   | -71    | -78    |
| 0%           | 22        | 15      | 7                     | 0    | -7    | -15    | -22    |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 2.67% | 62 | 55 | 48 | 42 | 35 | 28 | 21 |
| 5.33% | 82 | 78 | 73 | 68 | 62 | 56 | 50 |
| 8.00% | 91 | 89 | 86 | 82 | 79 | 74 | 70 |

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

(단위:백만원)

1,805

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

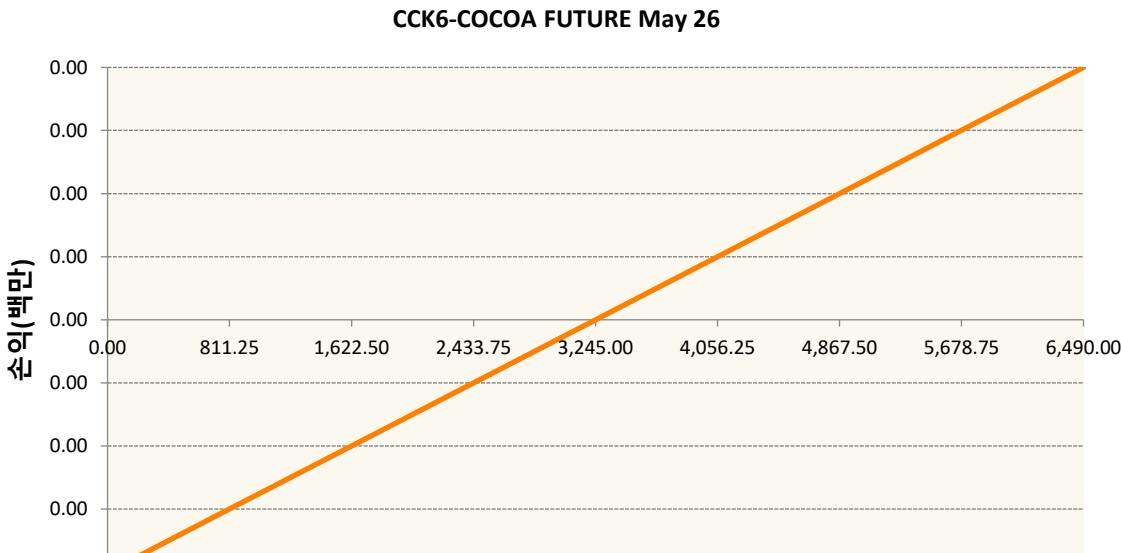
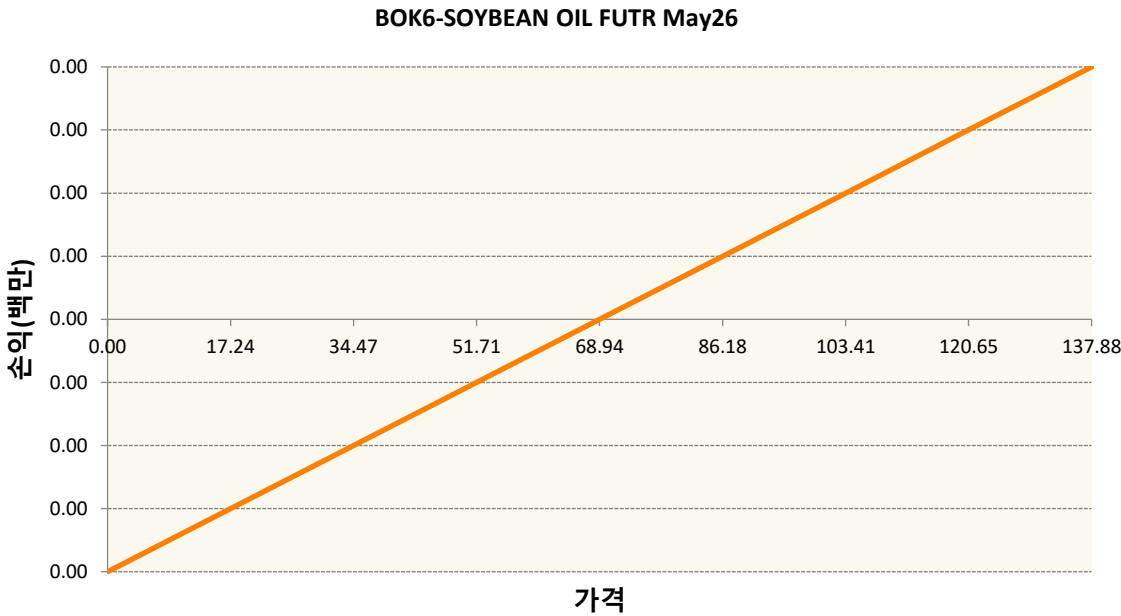
## 포커스농산물모(채권-파생형)

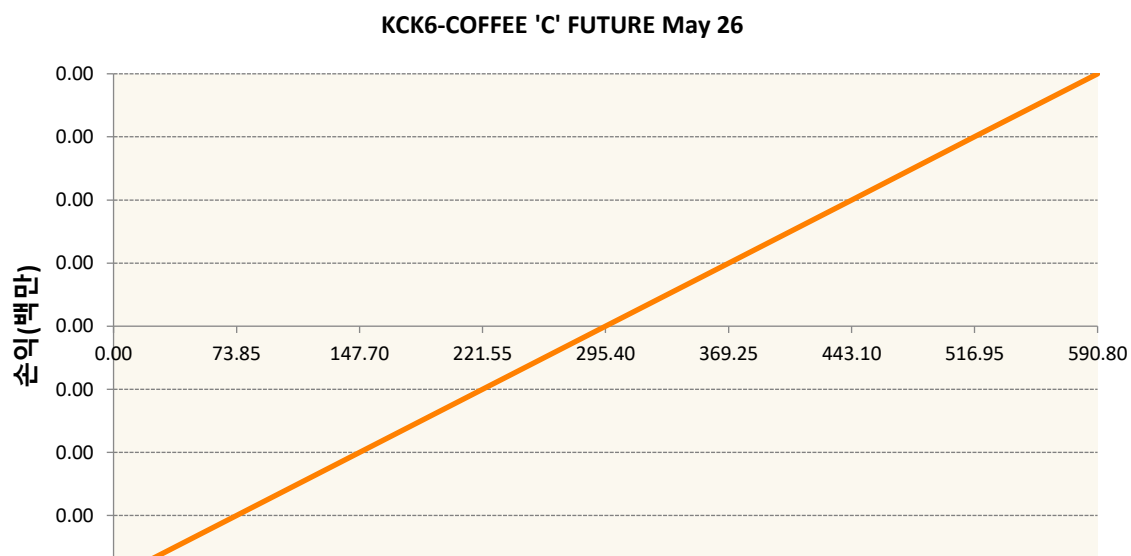
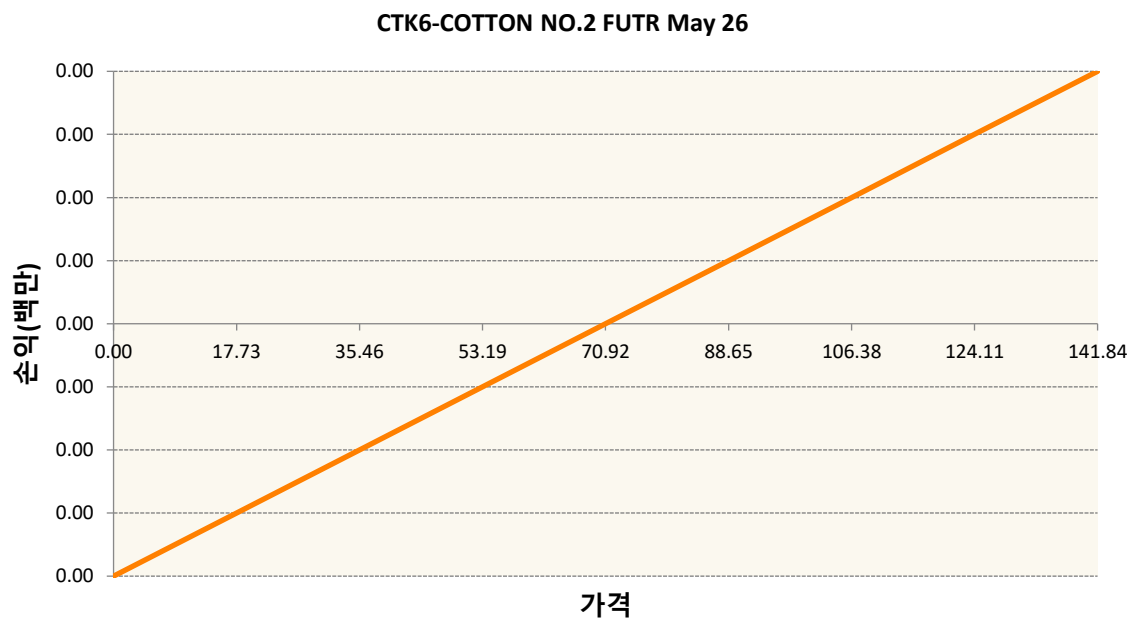
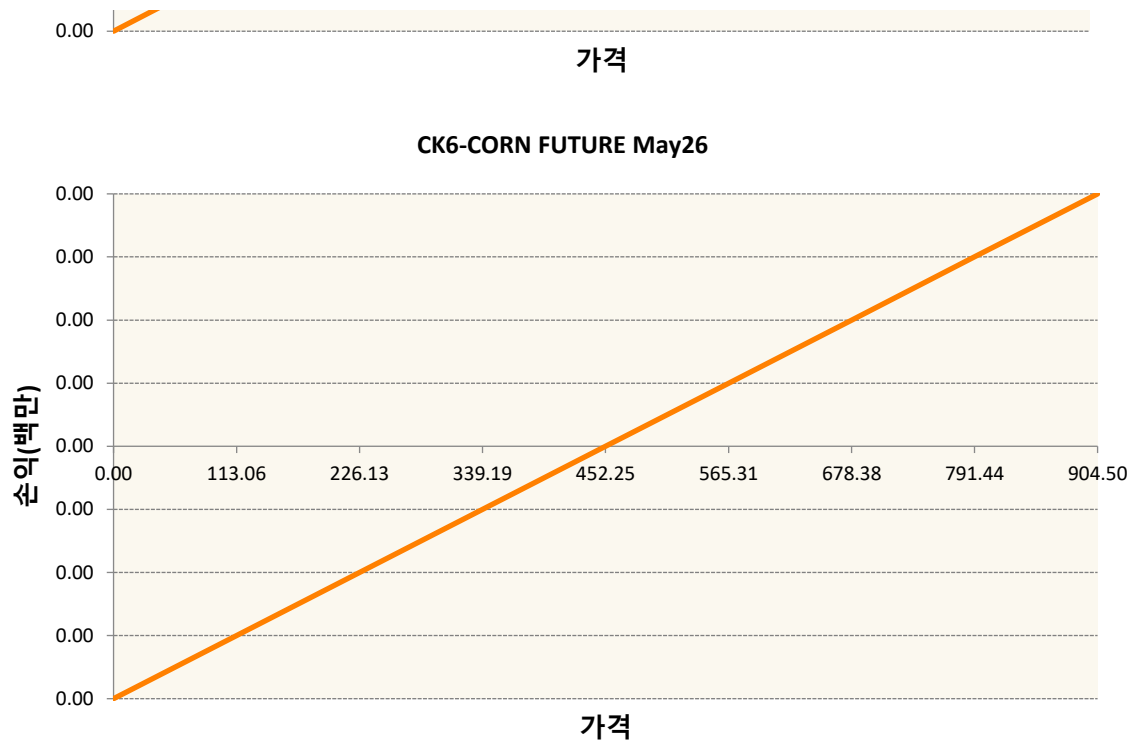
### 1. 계약금액

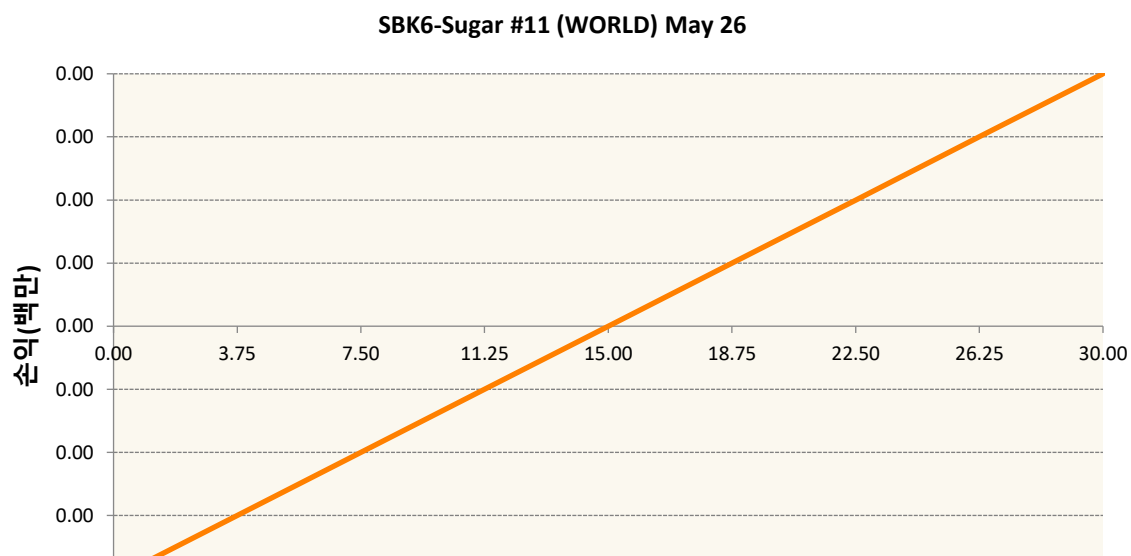
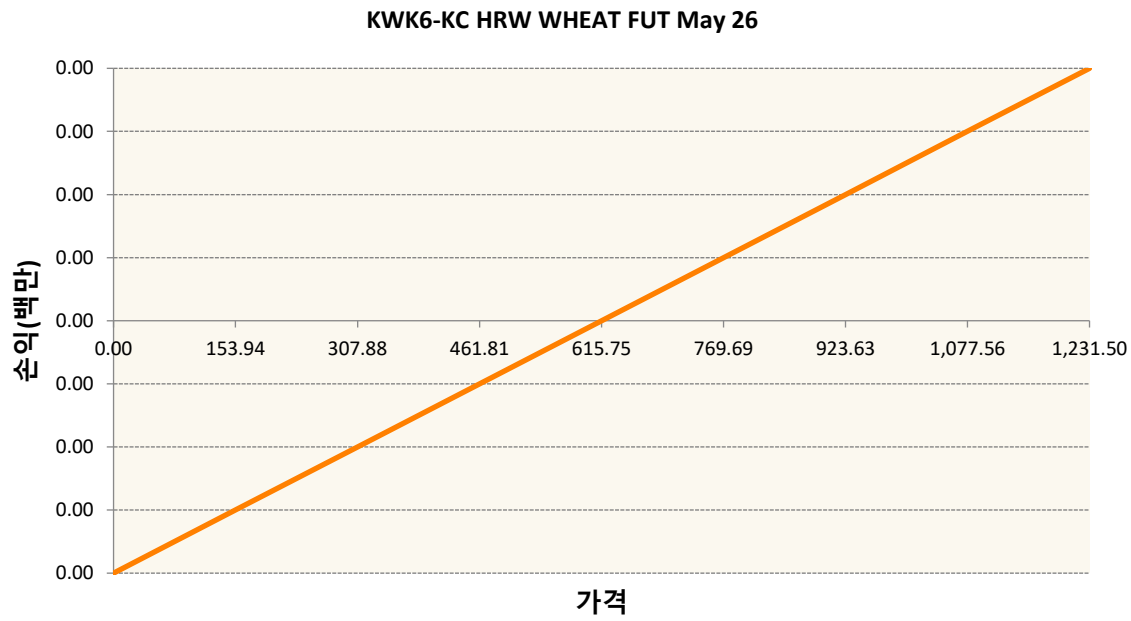
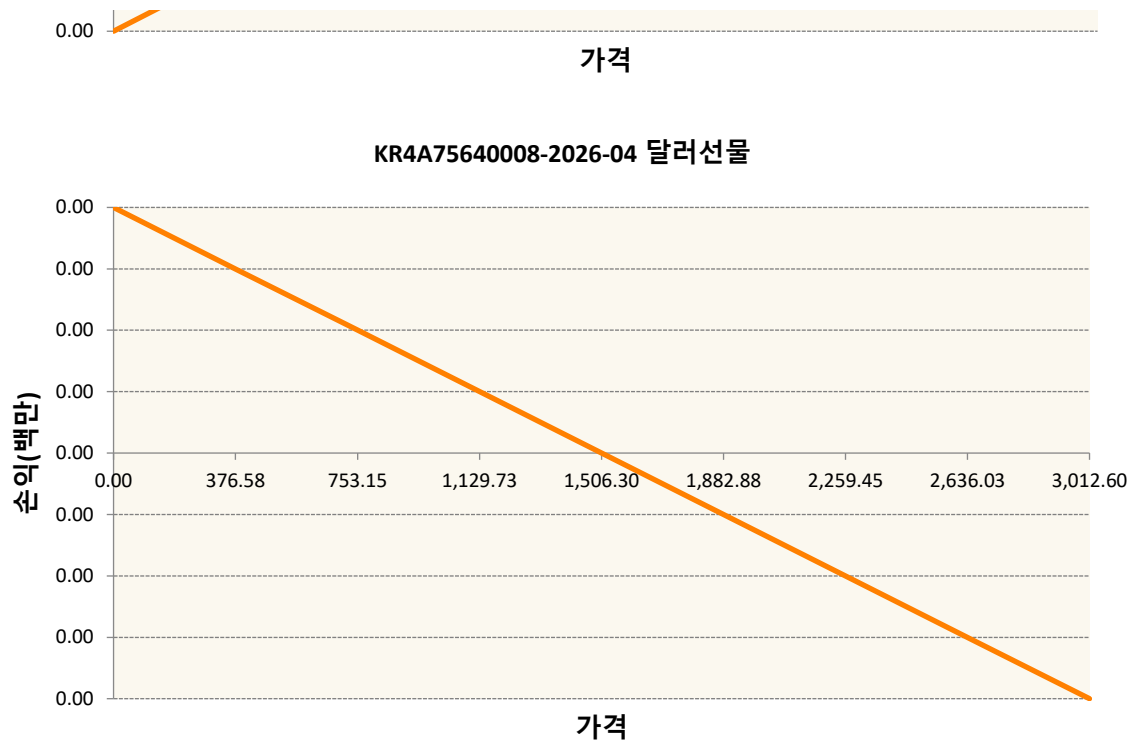
(단위:USD 백만)

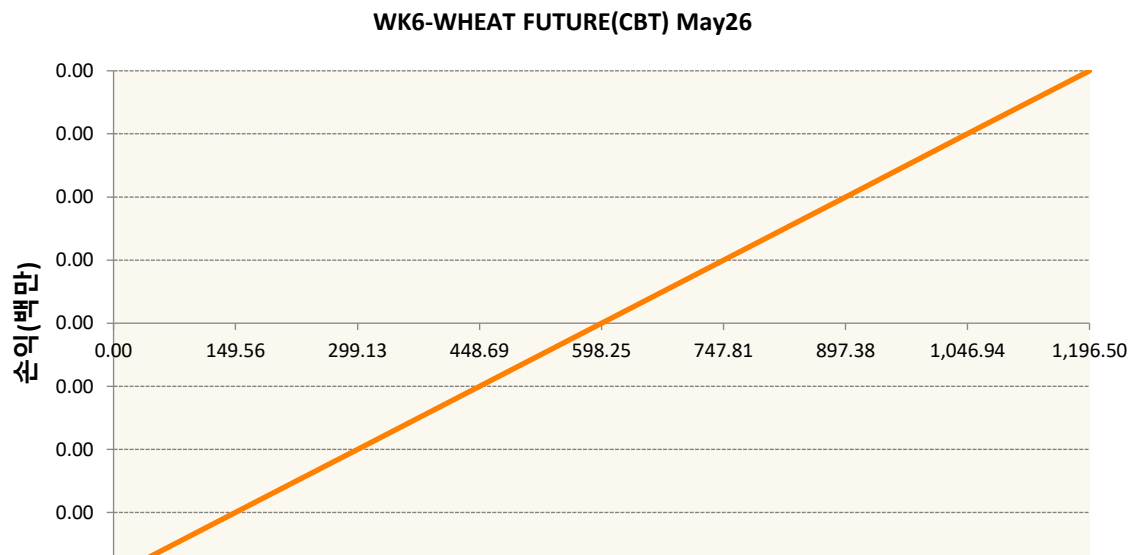
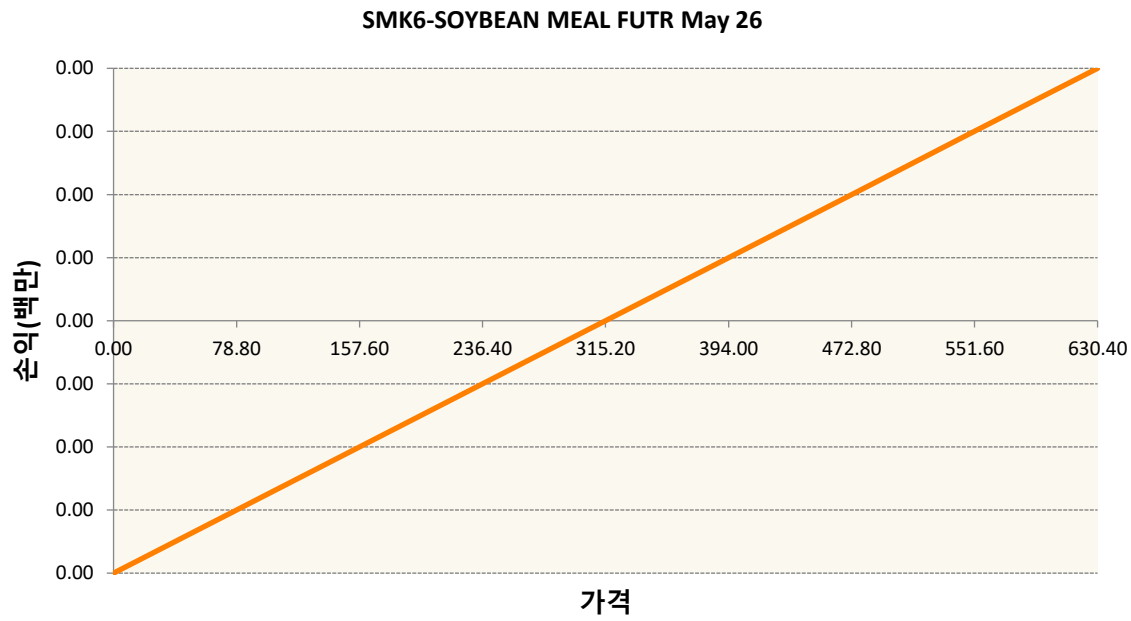
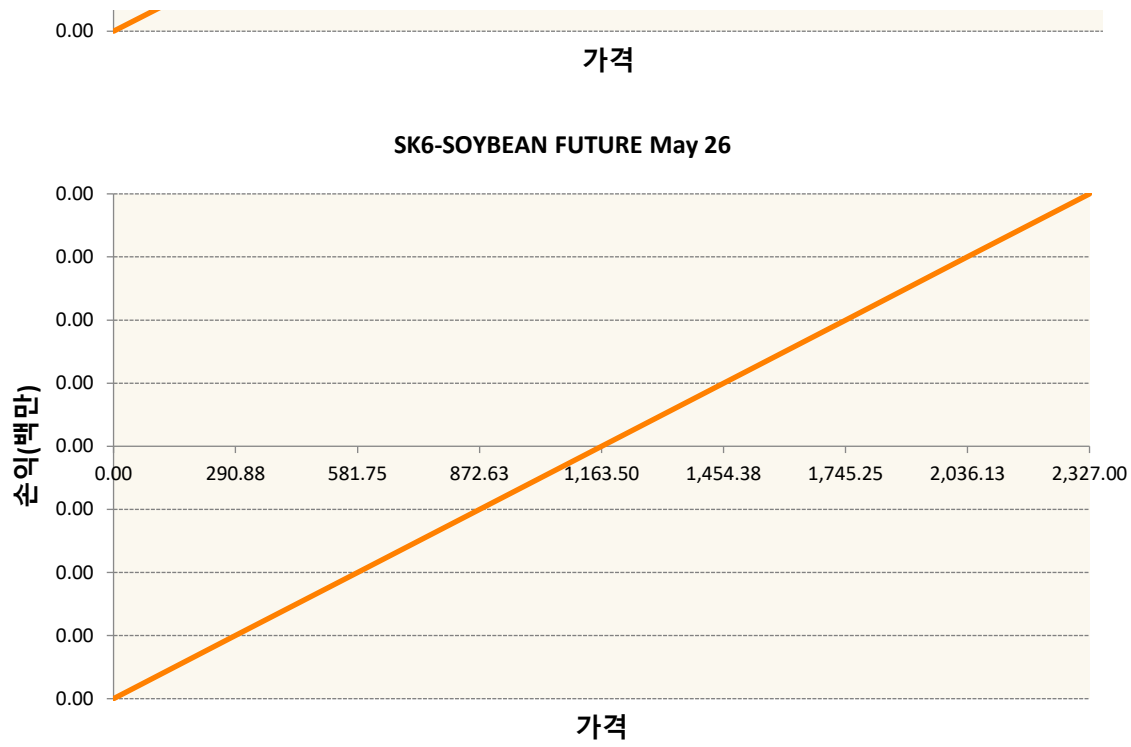
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,305 | 0     | 1,305     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,581 | 0     | 1,581     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 422   | -422      | 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 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

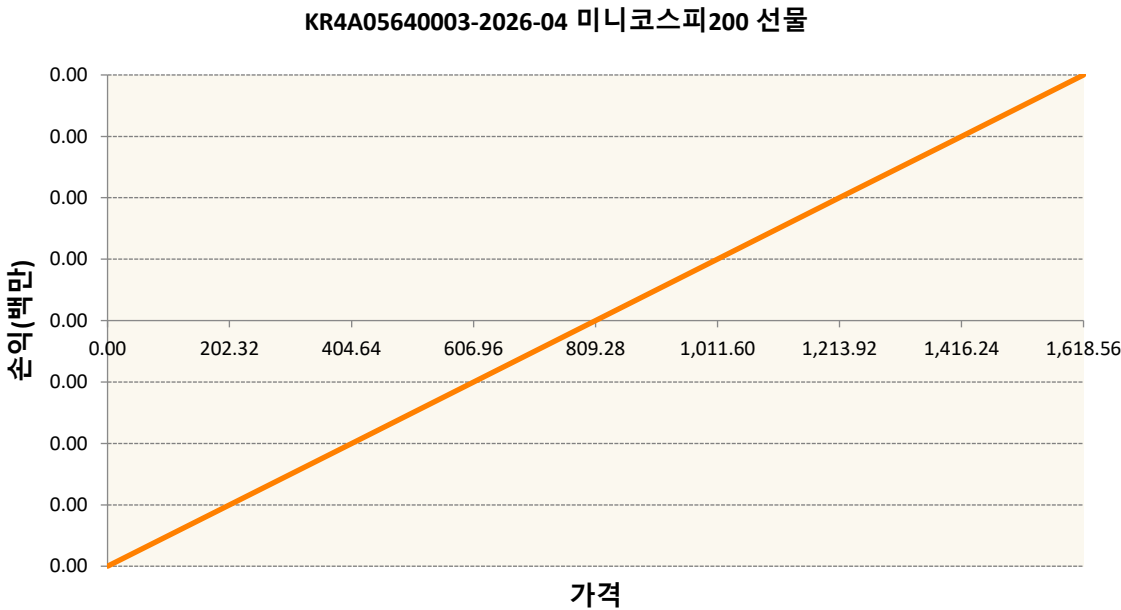
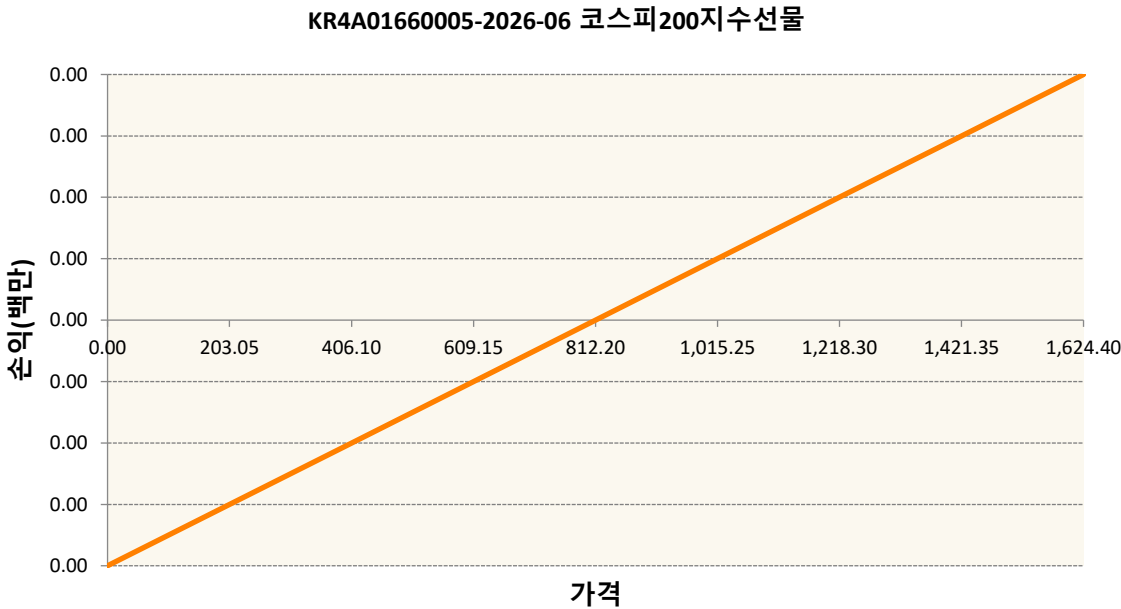
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

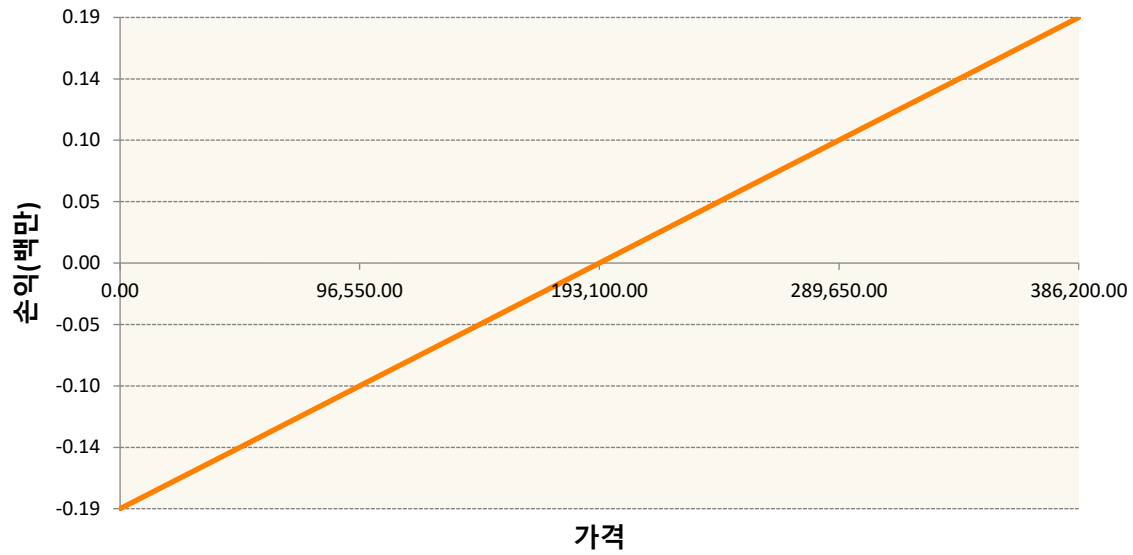
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 4,170 | 0     | 4,170     | 장내 |

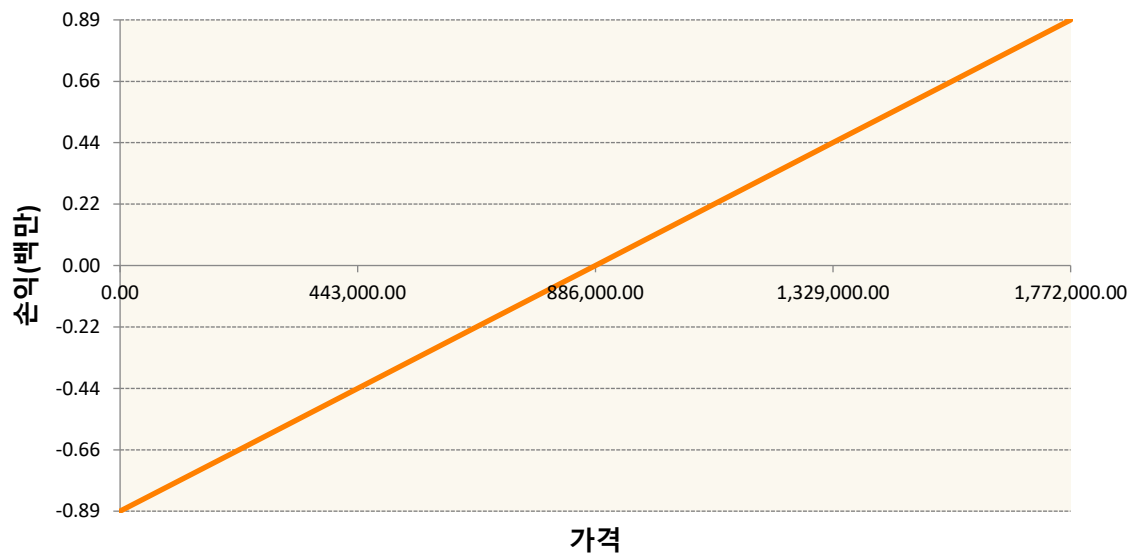
### 2. 만기시점의 손익구조



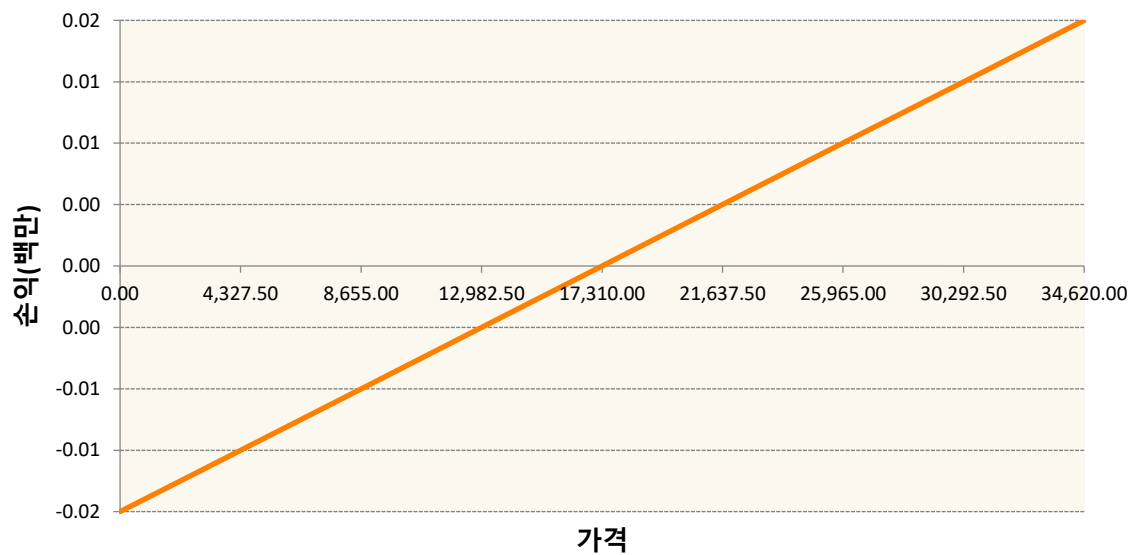
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |        |      |       |        |                     |  |     |  |
|--------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|---------------------|--|-----|--|
| KR4A01660005 |           |         |        |      |       |        | 2026-06 코스피200지수선물  |  | 211 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                     |  |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%              |  |     |  |
| -8.00%       | -211      | -211    | -211   | -211 | -211  | -211   | -211                |  |     |  |
| -5.33%       | -141      | -141    | -141   | -141 | -141  | -141   | -141                |  |     |  |
| -2.67%       | -70       | -70     | -70    | -70  | -70   | -70    | -70                 |  |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                   |  |     |  |
| 2.67%        | 70        | 70      | 70     | 70   | 70    | 70     | 70                  |  |     |  |
| 5.33%        | 141       | 141     | 141    | 141  | 141   | 141    | 141                 |  |     |  |
| 8.00%        | 211       | 211     | 211    | 211  | 211   | 211    | 211                 |  |     |  |
| 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    |  | 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                 |  |     |  |
| -5.33%       | -54       | -54     | -54    | -54  | -54   | -54    | -54                 |  |     |  |
| -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%        | 54        | 54      | 54     | 54   | 54    | 54     | 54                  |  |     |  |
| 8.00%        | 81        | 81      | 81     | 81   | 81    | 81     | 81                  |  |     |  |
| 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)

704

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

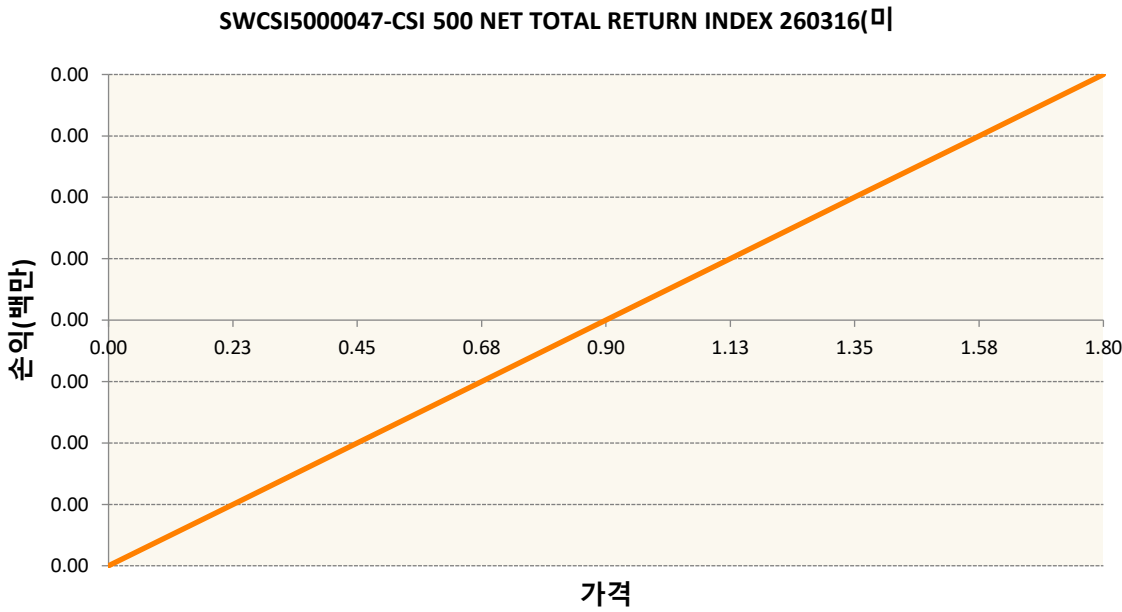
## SOL차이나강소기업CSI500상장

### 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   | 5,079 | 0     | 5,079     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

407

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

543

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

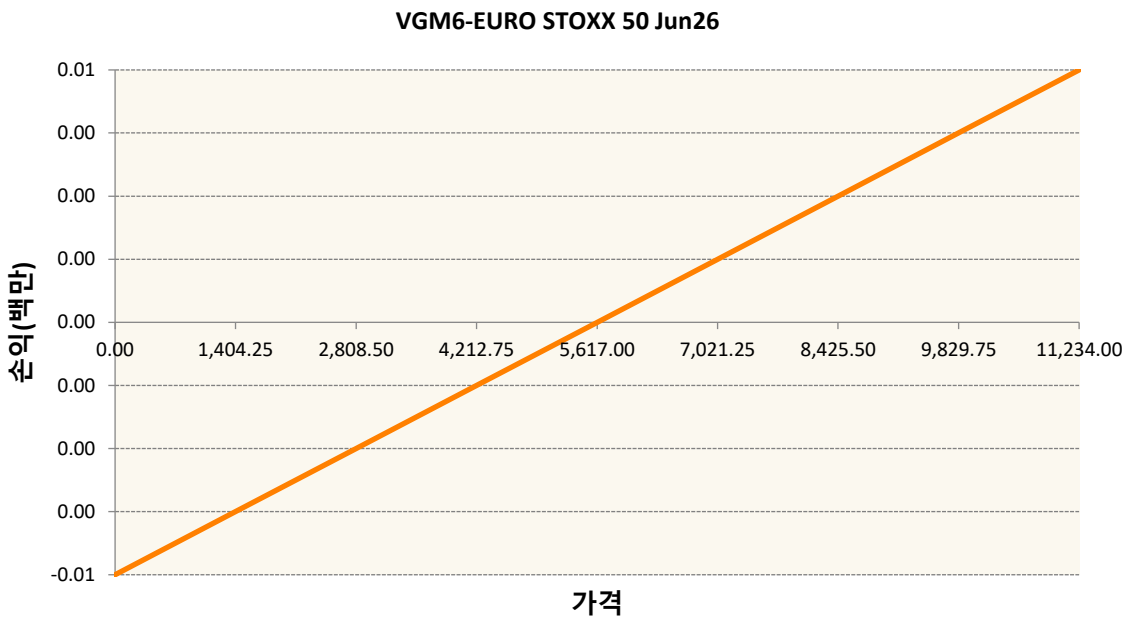
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 865   | 0     | 865       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGM6 | EURO STOXX 50 Jun26 | 69 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 58 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

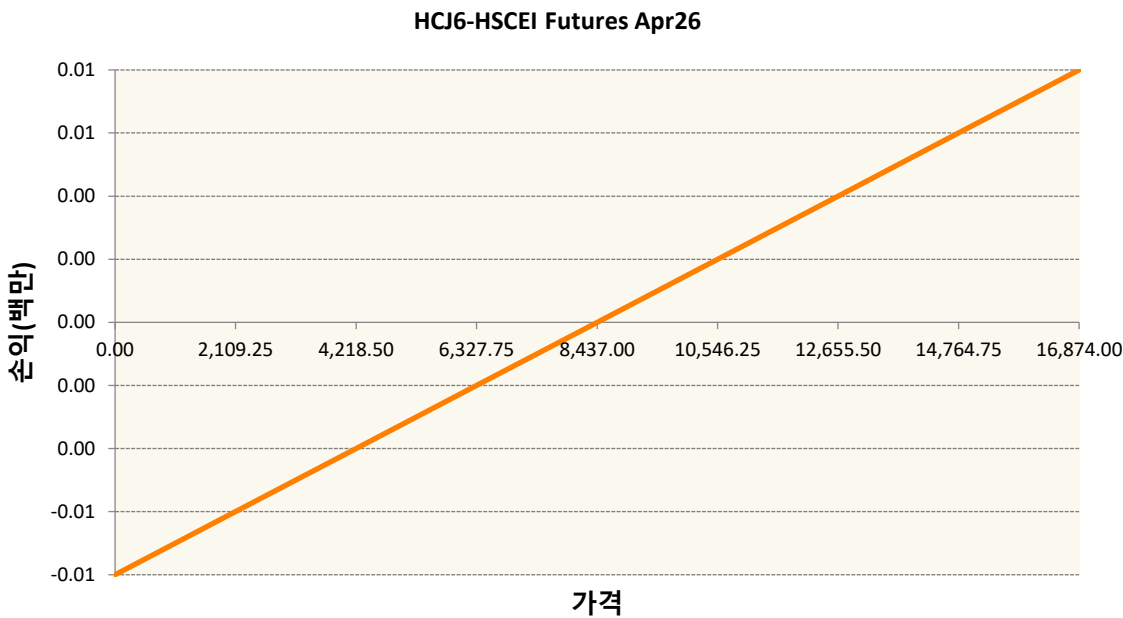
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,464 | 0     | 1,464     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCI6 | HSCEI Futures Apr26 | 117 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

142



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

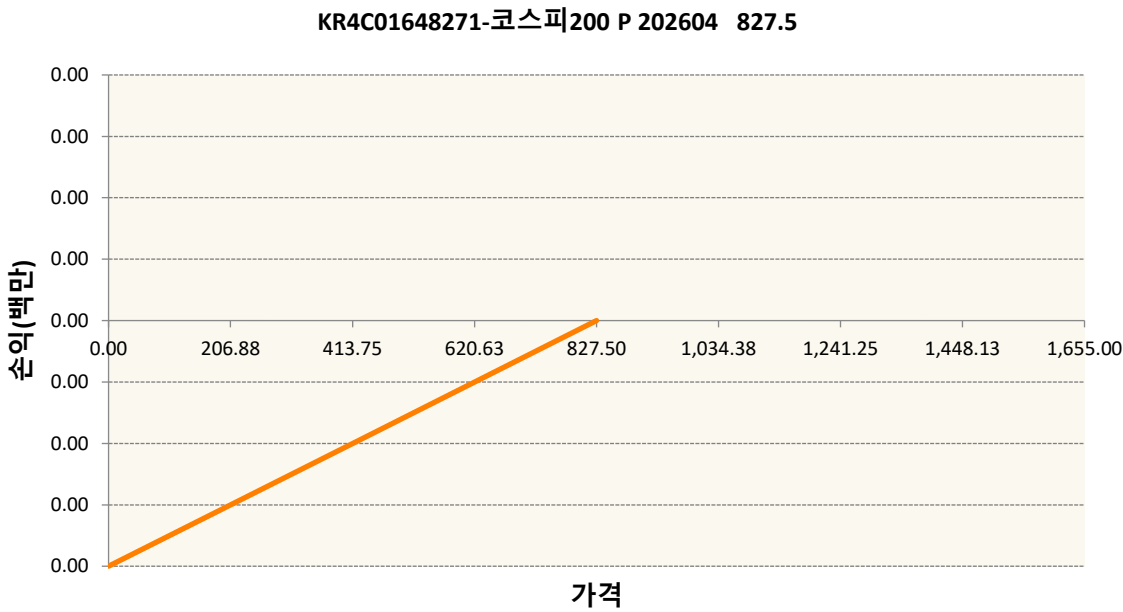
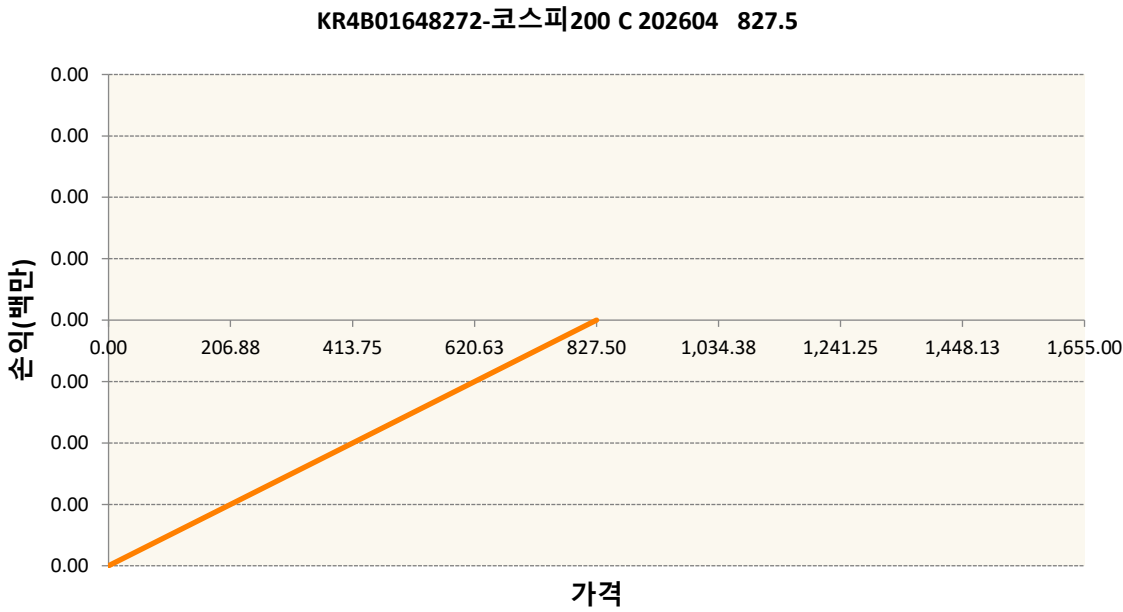
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 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 |         |         |        |        |        |        | 1,946  |
| 기초자산의 변동성                          |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격                                 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                             | -1,867  | -1,873  | -1,881 | -1,893 | -1,908 | -1,925 | -1,946 |
| -5.33%                             | -1,116  | -1,133  | -1,154 | -1,179 | -1,208 | -1,239 | -1,273 |
| -2.67%                             | -419    | -455    | -494   | -536   | -580   | -626   | -674   |
| 0%                                 | 164     | 110     | 55     | 0      | -56    | -112   | -169   |
| 2.67%                              | 583     | 524     | 466    | 407    | 348    | 289    | 230    |
| 5.33%                              | 831     | 784     | 735    | 684    | 632    | 578    | 524    |
| 8.00%                              | 950     | 922     | 888    | 852    | 812    | 770    | 726    |
| KR4C01648271 코스피200 P 202604 827.5 |         |         |        |        |        |        | 463    |
| 기초자산의 변동성                          |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격                                 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                             | -444    | -445    | -447   | -450   | -454   | -458   | -463   |
| -5.33%                             | -265    | -269    | -274   | -280   | -287   | -295   | -303   |
| -2.67%                             | -100    | -108    | -118   | -128   | -138   | -149   | -160   |
| 0%                                 | 39      | 26      | 13     | 0      | -13    | -27    | -40    |
| 2.67%                              | 139     | 125     | 111    | 97     | 83     | 69     | 55     |
| 5.33%                              | 198     | 186     | 175    | 163    | 150    | 138    | 125    |
| 8.00%                              | 226     | 219     | 211    | 203    | 193    | 183    | 173    |

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

4,219

공시일 2026-04-07

기준일 2026-04-06

## 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 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

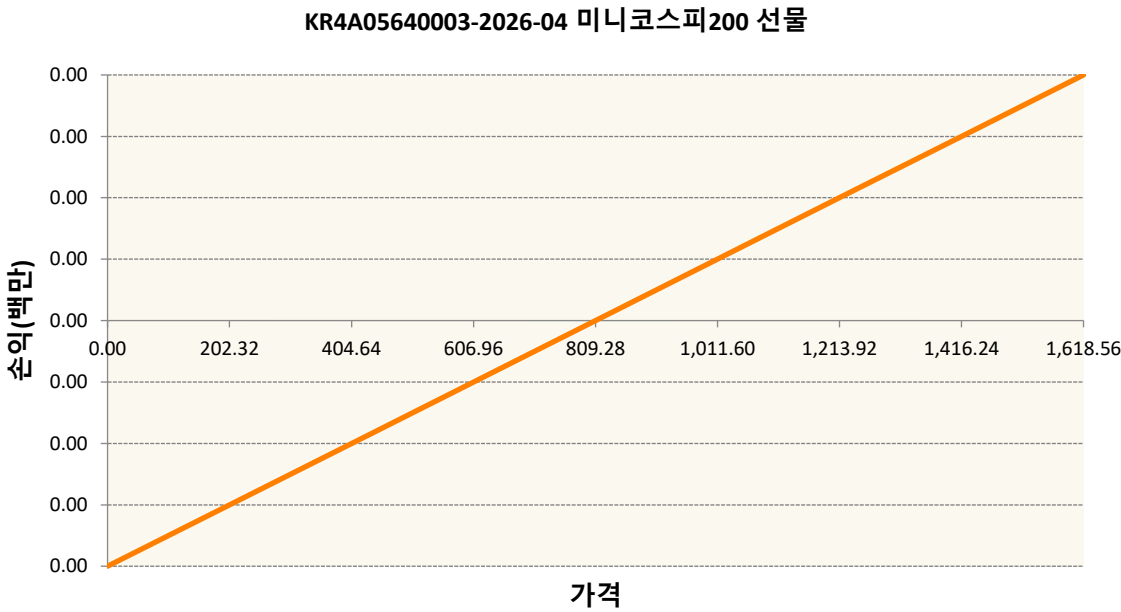
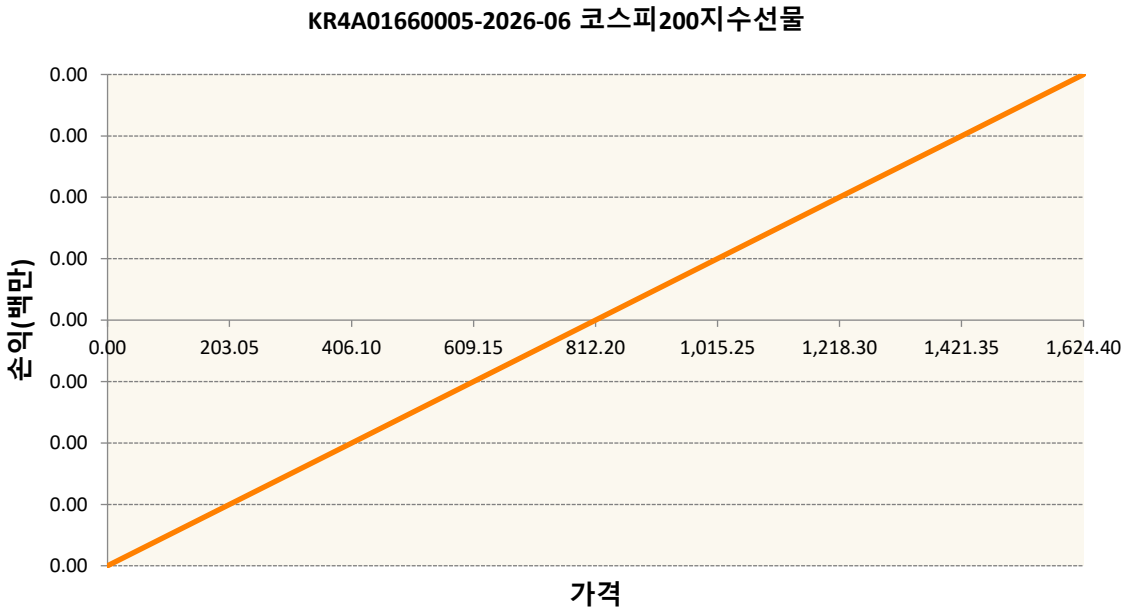
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

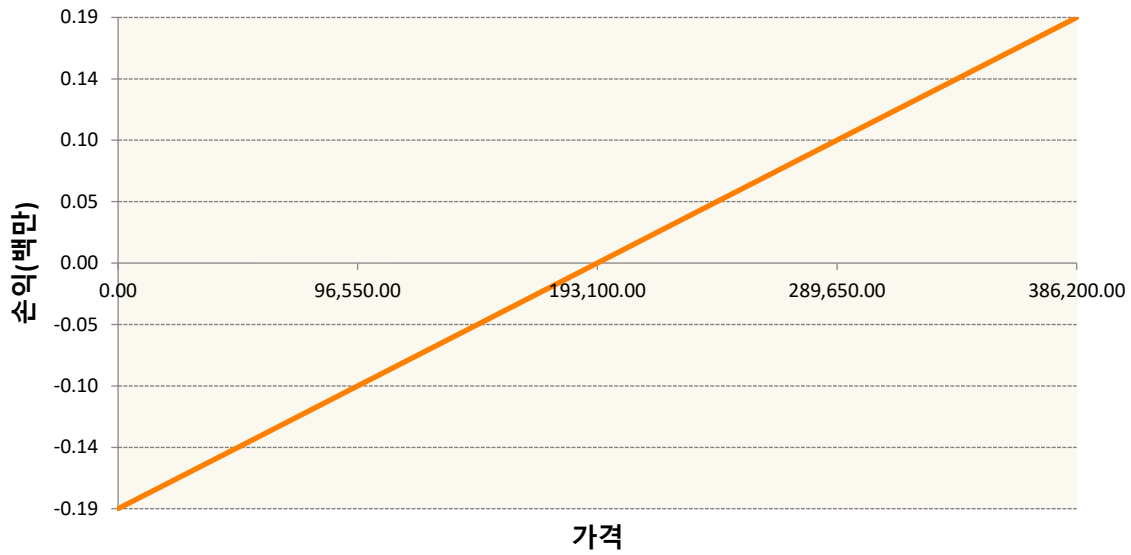
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,595 | 0     | 3,595     | 장내 |

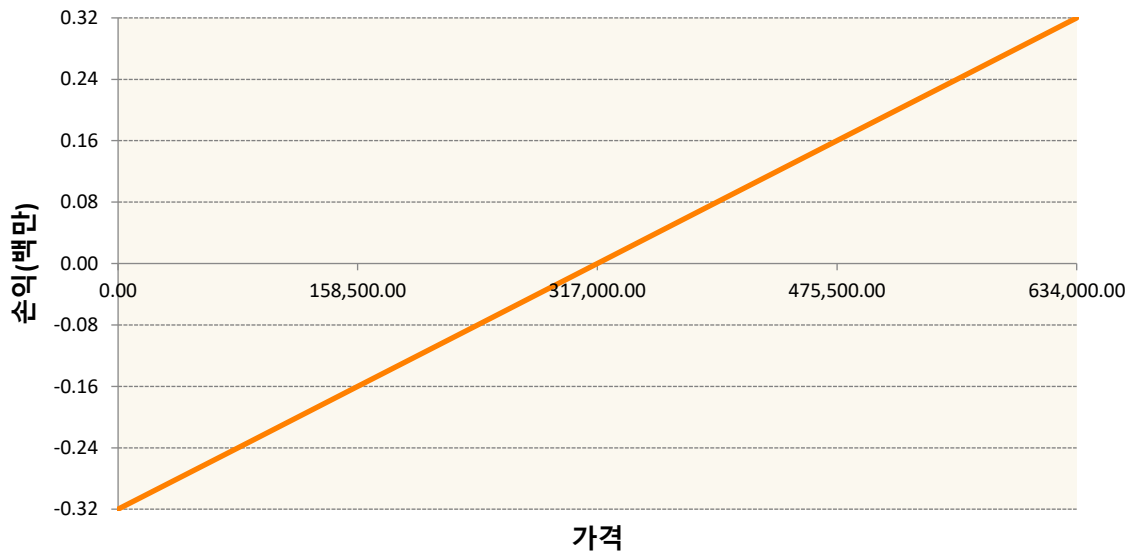
### 2. 만기시점의 손익구조



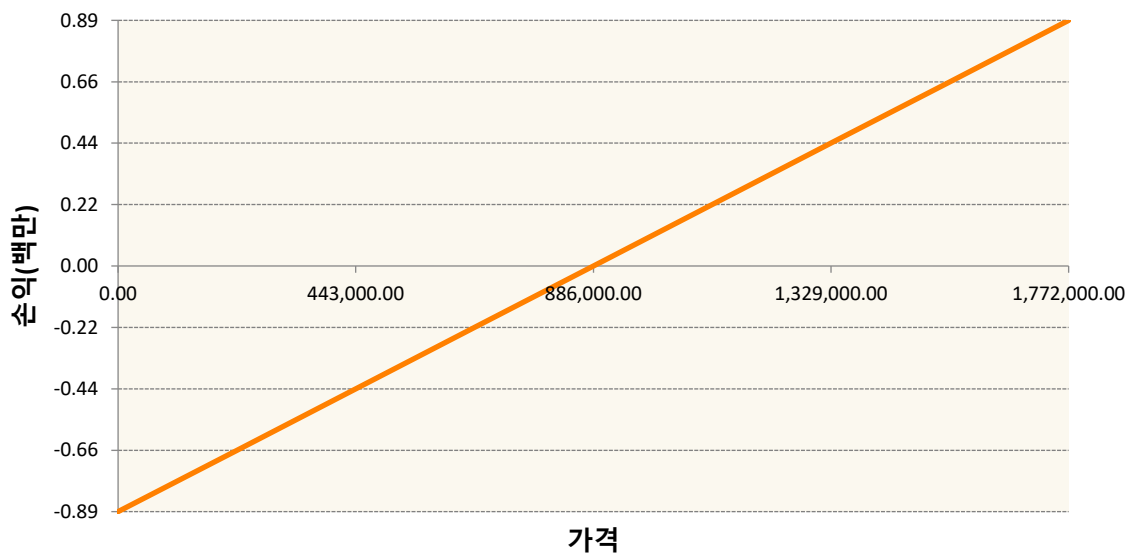
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



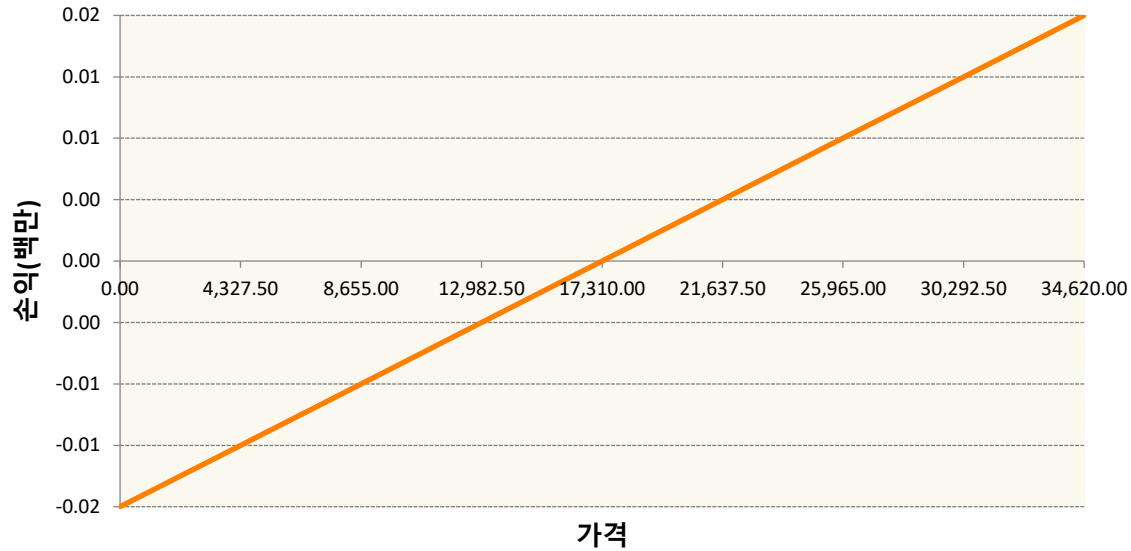
KR4A47640003-2026-04 LG화학개별선물



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 |         |         |        |     |       |        |        | 39  |
| 기초자산의 변동성                        |         |         |        |     |       |        |        |     |
| 가격                               | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |     |
| -8.00%                           | -39     | -39     | -39    | -39 | -39   | -39    | -39    | -39 |
| -5.33%                           | -26     | -26     | -26    | -26 | -26   | -26    | -26    | -26 |
| -2.67%                           | -13     | -13     | -13    | -13 | -13   | -13    | -13    | -13 |
| 0%                               | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      | 0   |
| 2.67%                            | 13      | 13      | 13     | 13  | 13    | 13     | 13     | 13  |
| 5.33%                            | 26      | 26      | 26     | 26  | 26    | 26     | 26     | 26  |
| 8.00%                            | 39      | 39      | 39     | 39  | 39    | 39     | 39     | 39  |
| 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)

286

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

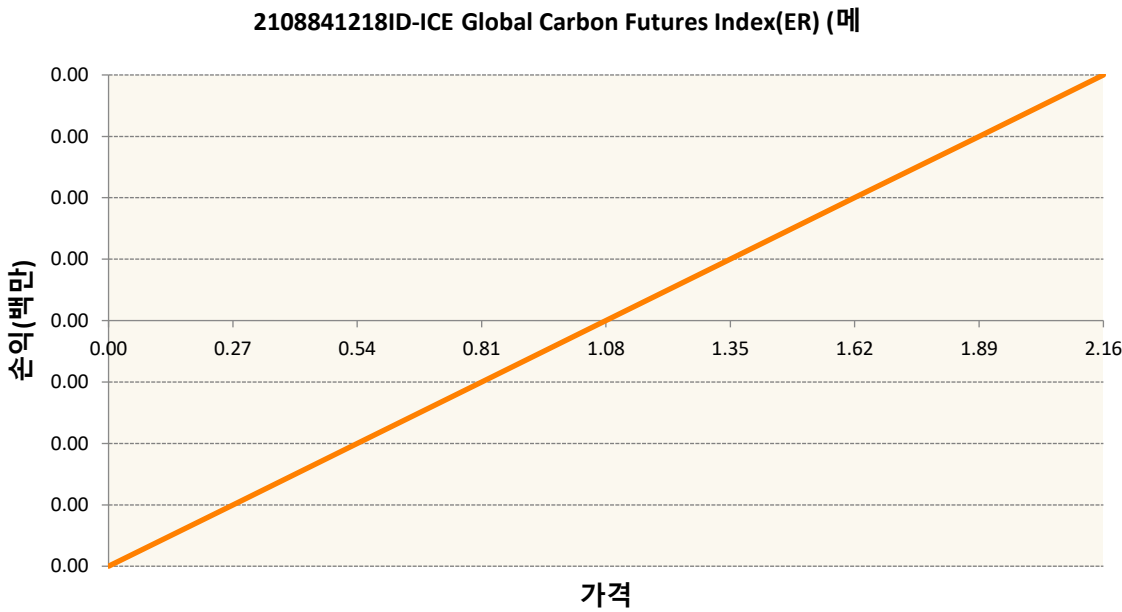
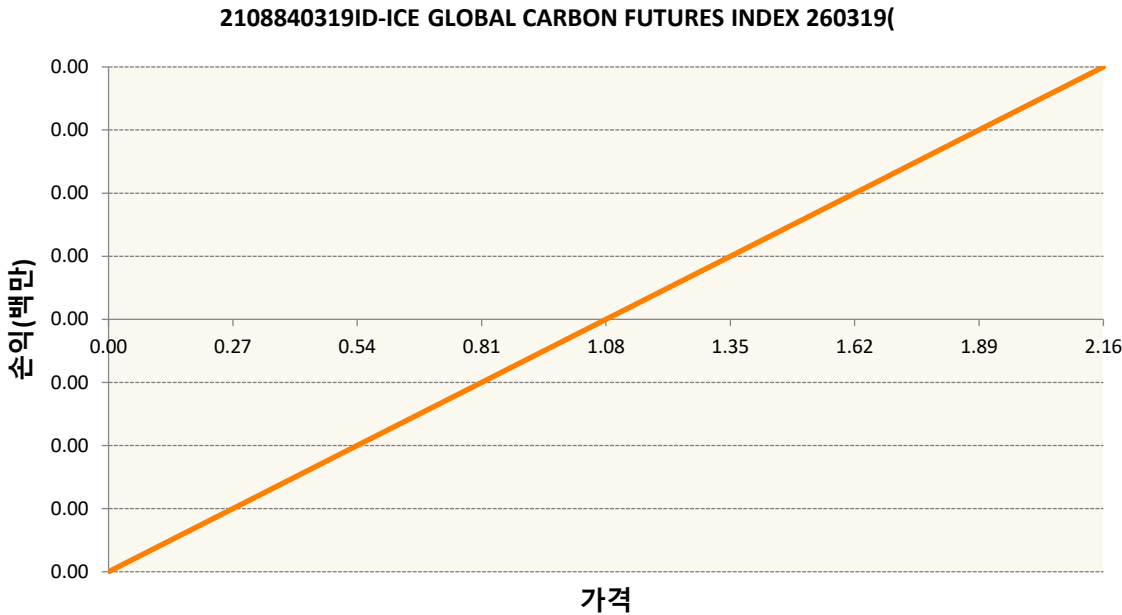
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 558      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

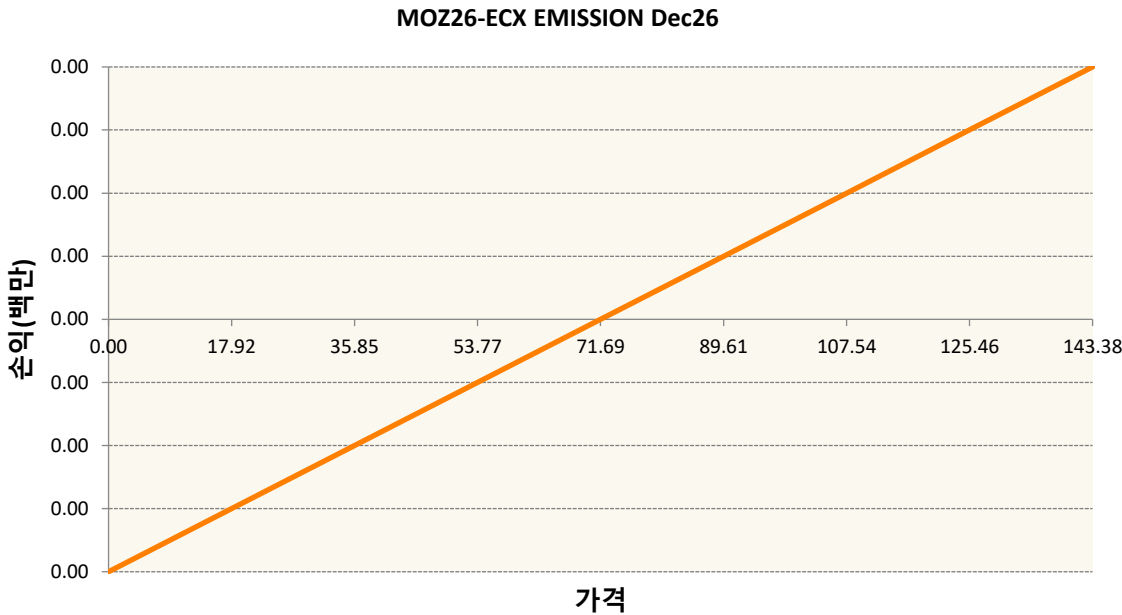
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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 |      |      | 4,618 | 0     | 4,618     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,200 | -2,200    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E | 176 |
| MOZ26 ECX EMISSION Dec26    | 369 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 641 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

## 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   | 1,431 | 0     | 1,431     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                   |    |
|---------------------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)                | 18 |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)    | 12 |
| SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)               | 30 |
| SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325( | 12 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 116 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

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) | 75 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)  | 28 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 191 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

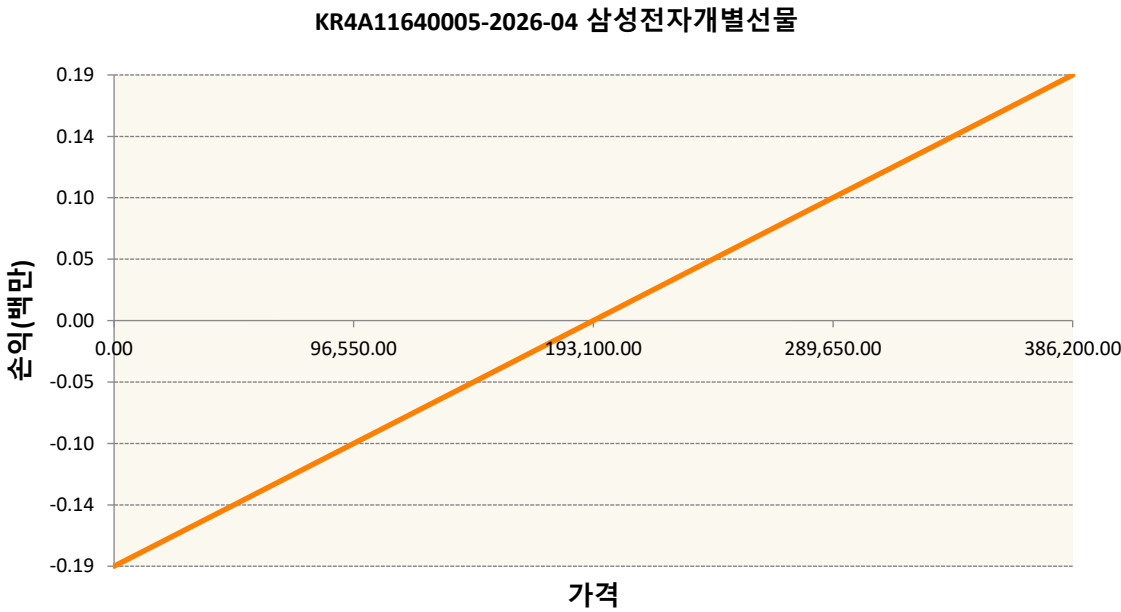
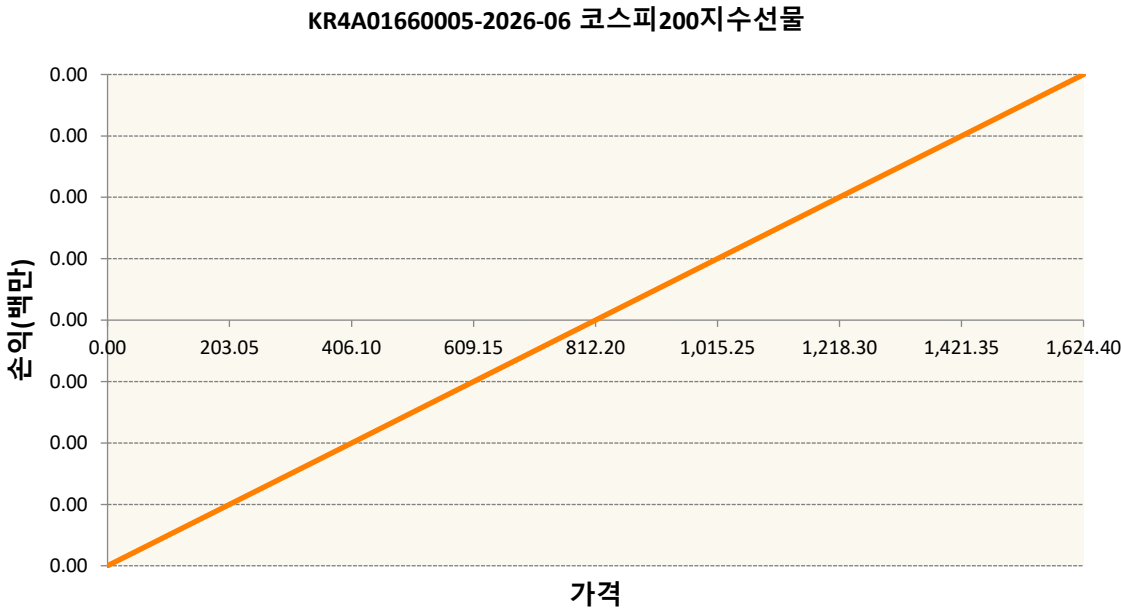
## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 1. 계약금액

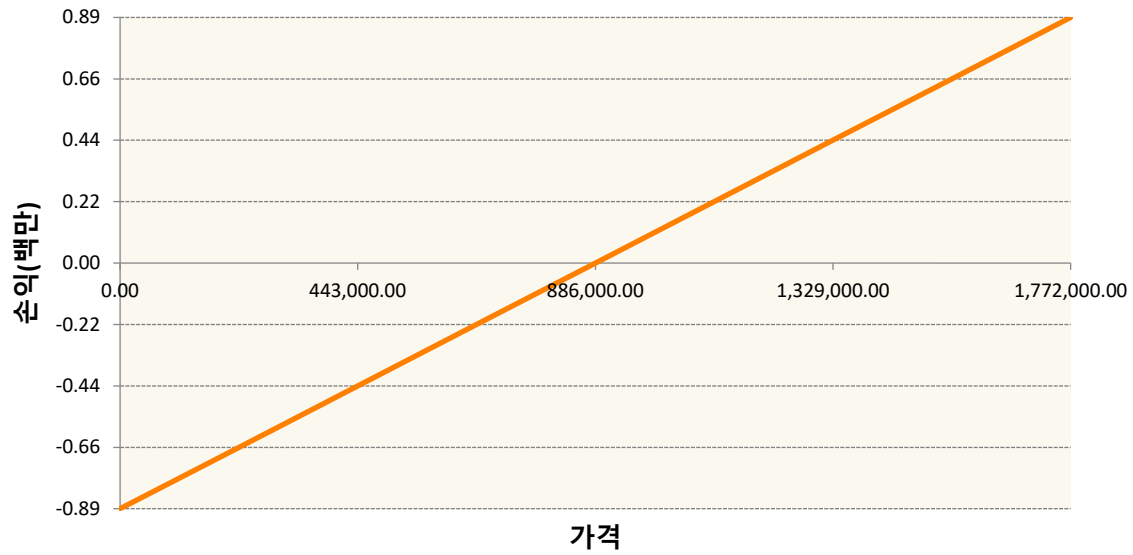
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 19,728 | 1,589 | 18,139    | 장내 |

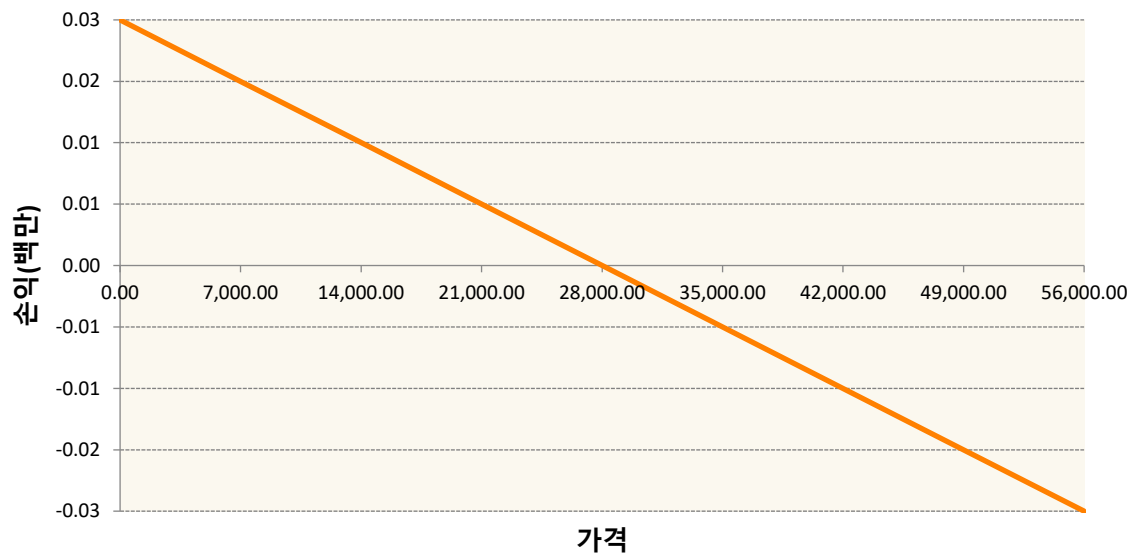
### 2. 만기시점의 손익구조



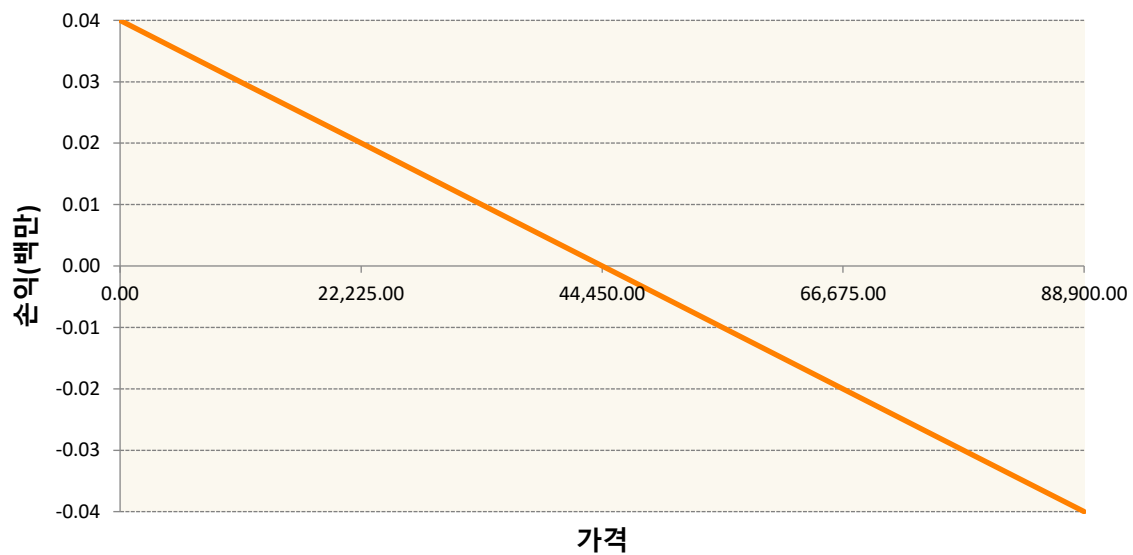
KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



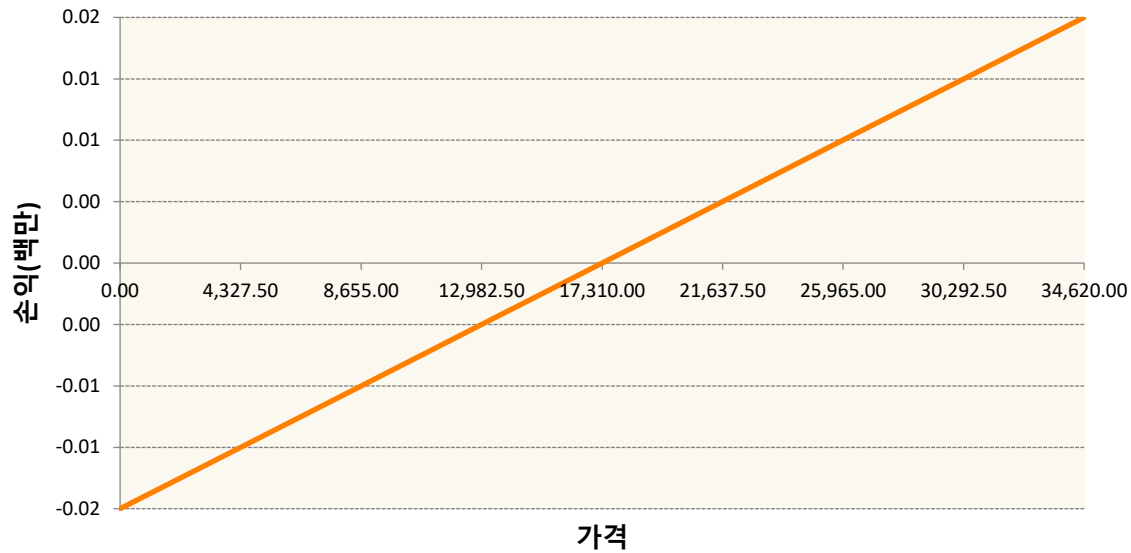
KR4A51640006-2026-04 GS건설개별선물



KR4ACF640007-2026-04 카카오개별선물



### KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물 |         |         |        |        |        |        |        | 1,315  |
|---------------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |        |        |        |        |        |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |        |
| -8.00%                          | -1,315  | -1,315  | -1,315 | -1,315 | -1,315 | -1,315 | -1,315 | -1,315 |
| -5.33%                          | -877    | -877    | -877   | -877   | -877   | -877   | -877   | -877   |
| -2.67%                          | -438    | -438    | -438   | -438   | -438   | -438   | -438   | -438   |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                           | 438     | 438     | 438    | 438    | 438    | 438    | 438    | 438    |
| 5.33%                           | 877     | 877     | 877    | 877    | 877    | 877    | 877    | 877    |
| 8.00%                           | 1,315   | 1,315   | 1,315  | 1,315  | 1,315  | 1,315  | 1,315  | 1,315  |
| KR4A11640005 2026-04 삼성전자개별선물   |         |         |        |        |        |        |        | 160    |
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |        |        |        |        |        |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |        |
| -8.00%                          | -160    | -160    | -160   | -160   | -160   | -160   | -160   | -160   |
| -5.33%                          | -106    | -106    | -106   | -106   | -106   | -106   | -106   | -106   |
| -2.67%                          | -53     | -53     | -53    | -53    | -53    | -53    | -53    | -53    |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                           | 53      | 53      | 53     | 53     | 53     | 53     | 53     | 53     |
| 5.33%                           | 106     | 106     | 106    | 106    | 106    | 106    | 106    | 106    |
| 8.00%                           | 160     | 160     | 160    | 160    | 160    | 160    | 160    | 160    |
| 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    | -77    |
| -5.33%                          | -51     | -51     | -51    | -51    | -51    | -51    | -51    | -51    |
| -2.67%                          | -26     | -26     | -26    | -26    | -26    | -26    | -26    | -26    |
| 0%                              | 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     |
| KR4A51640006 2026-04 GS건설개별선물 |         |         |        |      |       |        | 14     |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | 14      | 14      | 14     | 14   | 14    | 14     | 14     |
| -5.33%                        | 9       | 9       | 9      | 9    | 9     | 9      | 9      |
| -2.67%                        | 5       | 5       | 5      | 5    | 5     | 5      | 5      |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | -5      | -5      | -5     | -5   | -5    | -5     | -5     |
| 5.33%                         | -9      | -9      | -9     | -9   | -9    | -9     | -9     |
| 8.00%                         | -14     | -14     | -14    | -14  | -14   | -14    | -14    |
| KR4ACF640007 2026-04 카카오개별선물  |         |         |        |      |       |        | 114    |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | 114     | 114     | 114    | 114  | 114   | 114    | 114    |
| -5.33%                        | 76      | 76      | 76     | 76   | 76    | 76     | 76     |
| -2.67%                        | 38      | 38      | 38     | 38   | 38    | 38     | 38     |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | -38     | -38     | -38    | -38  | -38   | -38    | -38    |
| 5.33%                         | -76     | -76     | -76    | -76  | -76   | -76    | -76    |
| 8.00%                         | -114    | -114    | -114   | -114 | -114  | -114   | -114   |
| KR4AFT640008 2026-04 대우건설개별선물 |         |         |        |      |       |        | 26     |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | -26     | -26     | -26    | -26  | -26   | -26    | -26    |
| -5.33%                        | -18     | -18     | -18    | -18  | -18   | -18    | -18    |
| -2.67%                        | -9      | -9      | -9     | -9   | -9    | -9     | -9     |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | 9       | 9       | 9      | 9    | 9     | 9      | 9      |
| 5.33%                         | 18      | 18      | 18     | 18   | 18    | 18     | 18     |
| 8.00%                         | 26      | 26      | 26     | 26   | 26    | 26     | 26     |

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

(단위:백만원)

3,733



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

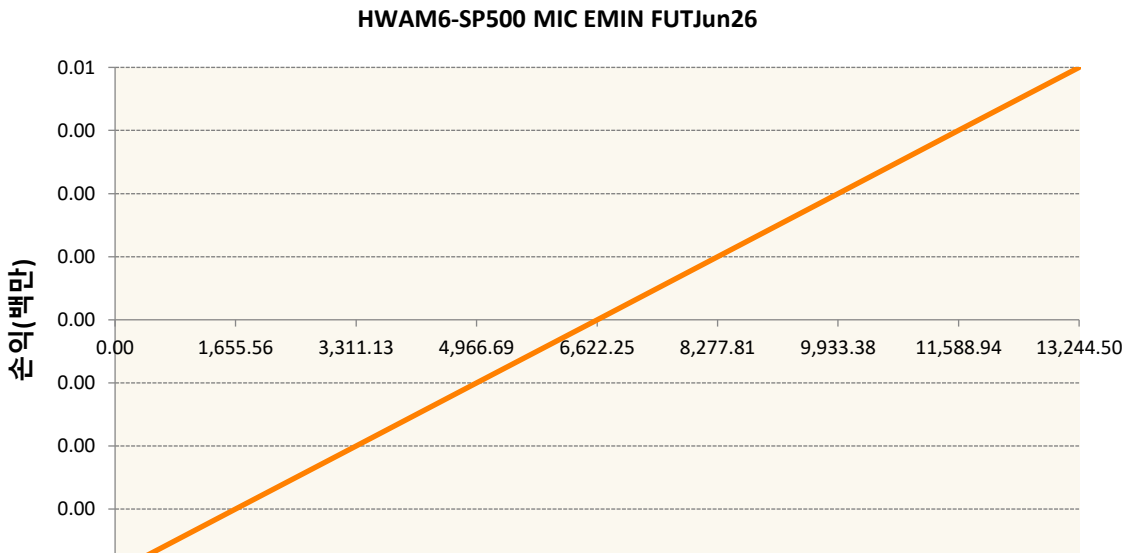
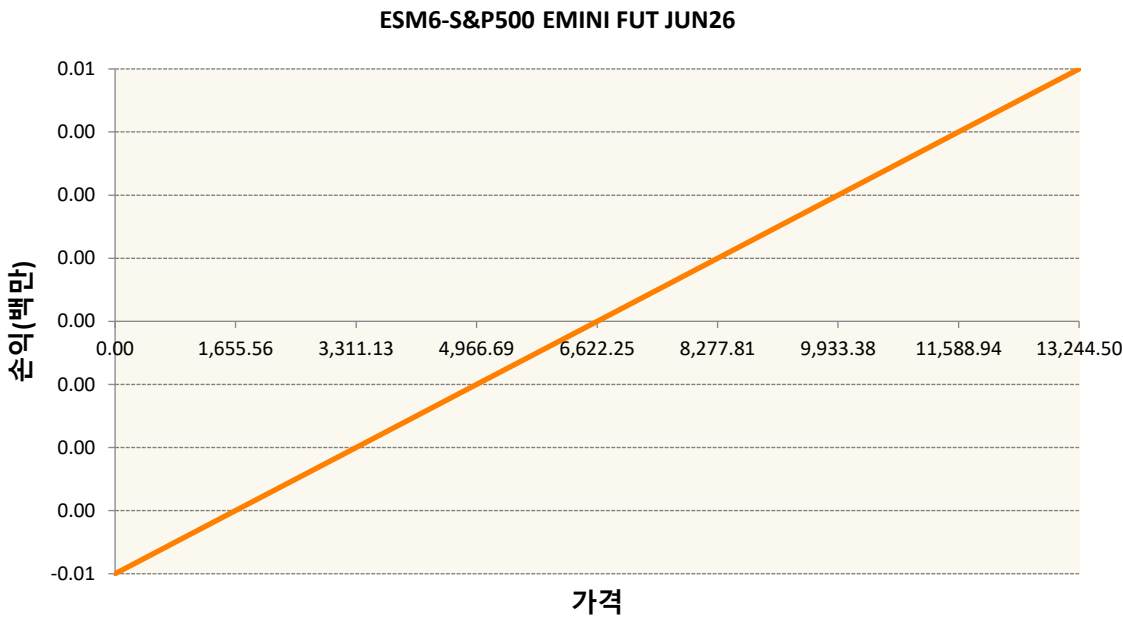
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

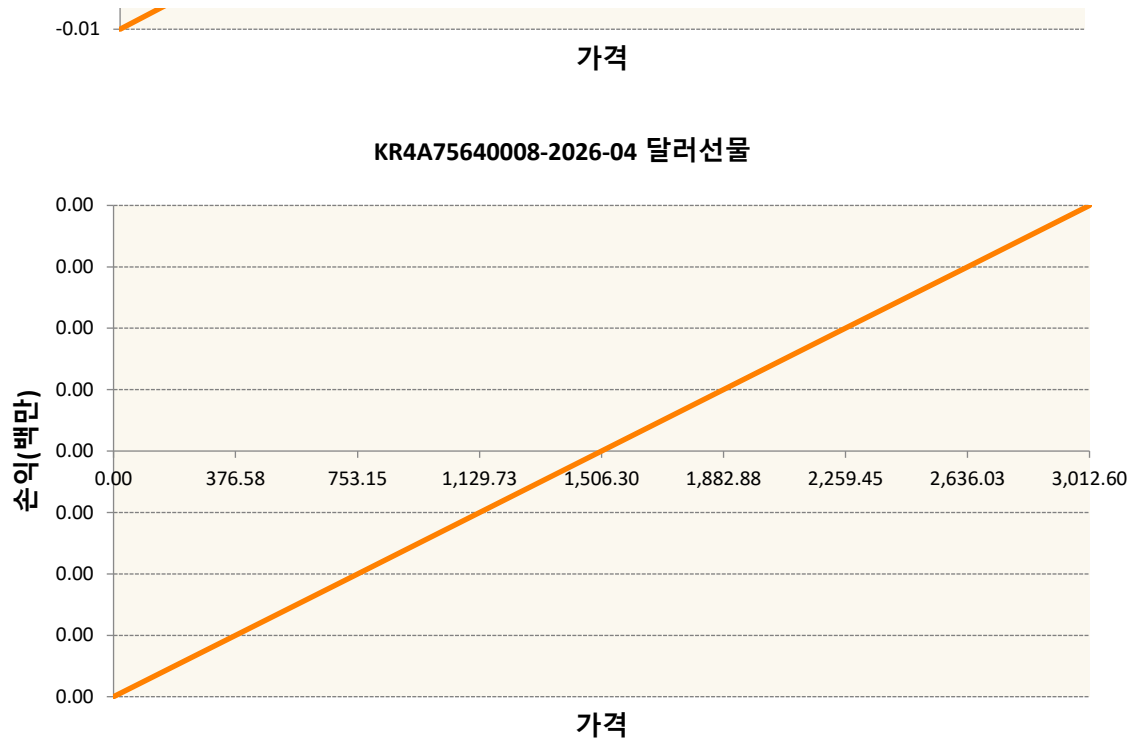
### 1. 계약금액

(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   | 54,677 | 0     | 54,677    |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 151    | 0     | 151       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선물   | 12,502 | 0     | 12,502    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| ESM6                      | S&P500 EMINI FUT JUN26  |  | 4,374    |
| HWAM6                     | SP500 MIC EMIN FUTJun26 |  | 12       |
| KR4A756400 2026-04 달러선물   |                         |  | 1,000    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 3,826    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

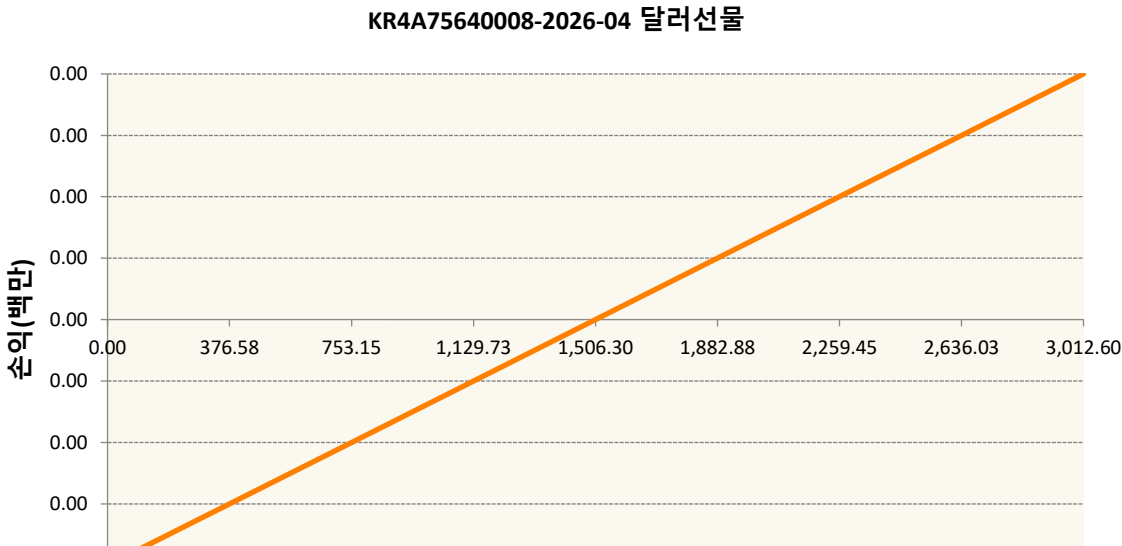
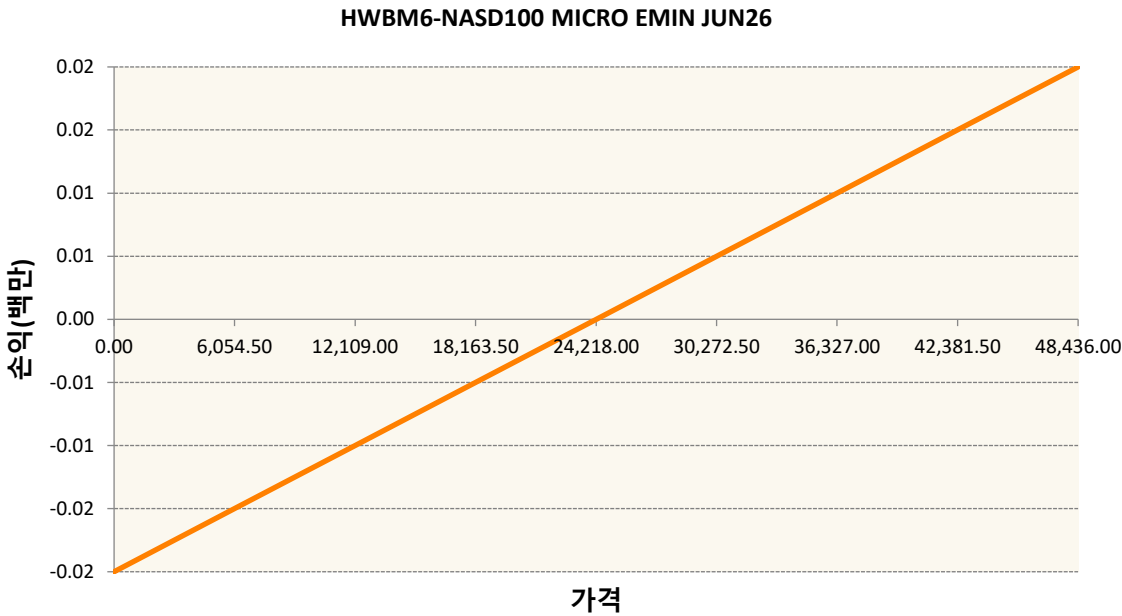
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

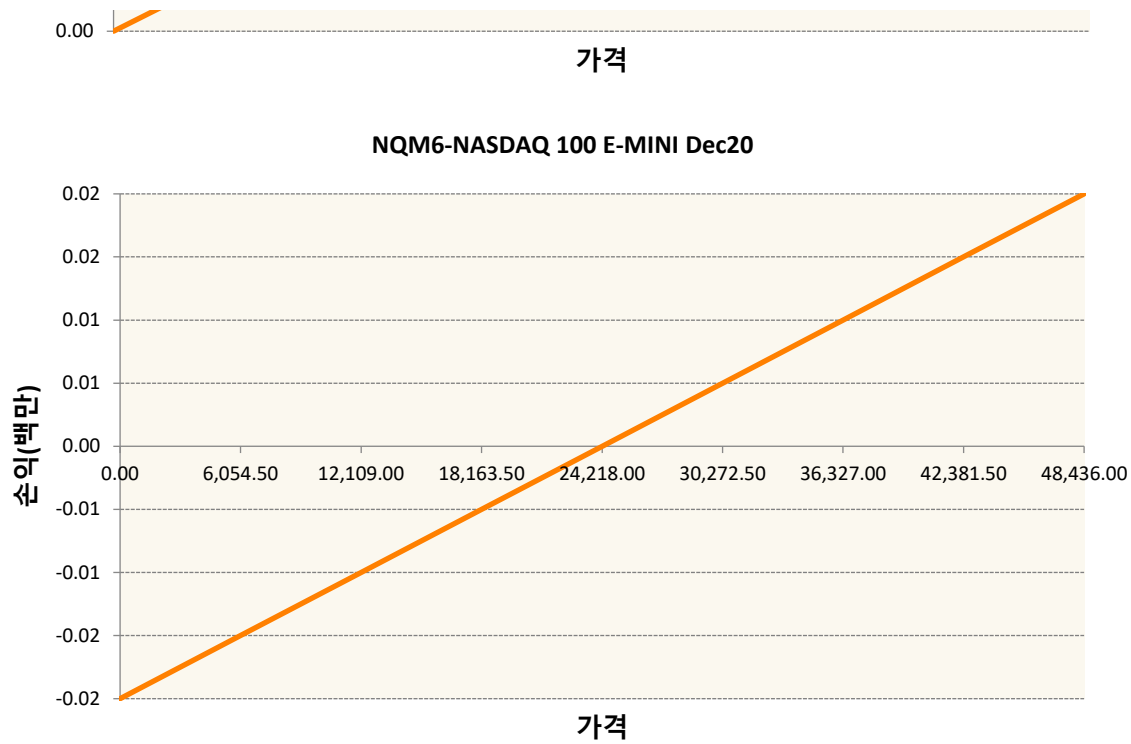
### 1. 계약금액

(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   | 22,539 | 0     | 22,539    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 146    | 0     | 146       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선물   | 5,046  | 0     | 5,046     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBM6 NASD100 MICRO EMIN JUN26  
 KR4A756400 2026-04 달러선물  
 NQM6 NASDAQ 100 E-MINI Dec20

|       |
|-------|
| 12    |
| 404   |
| 1,803 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 2,004 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-07 |
| 기준일 | 2026-04-06 |

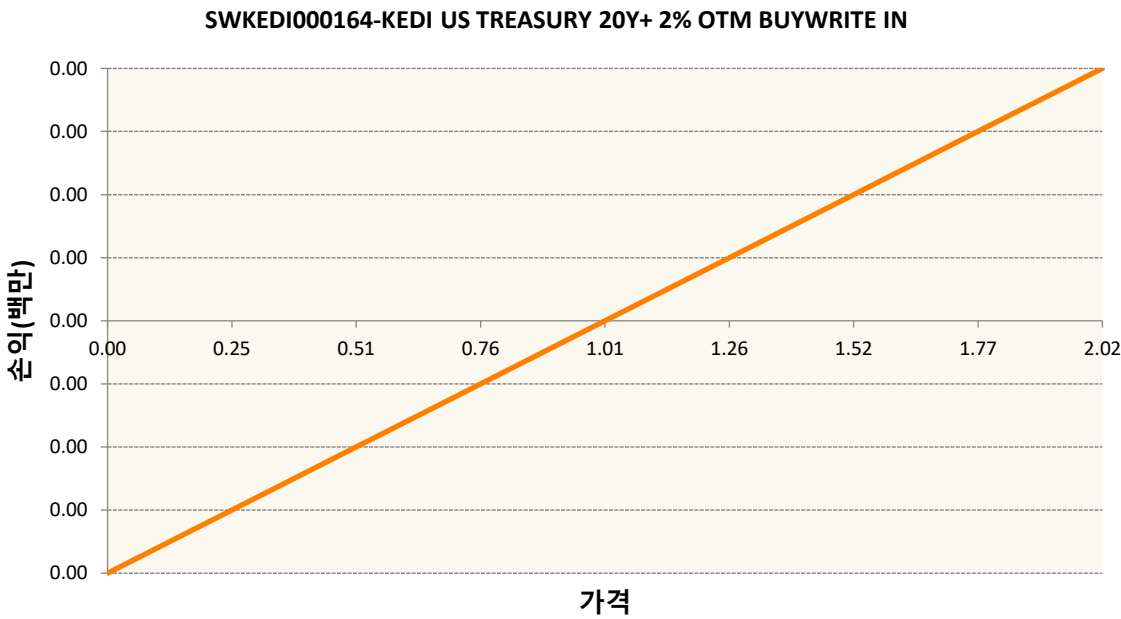
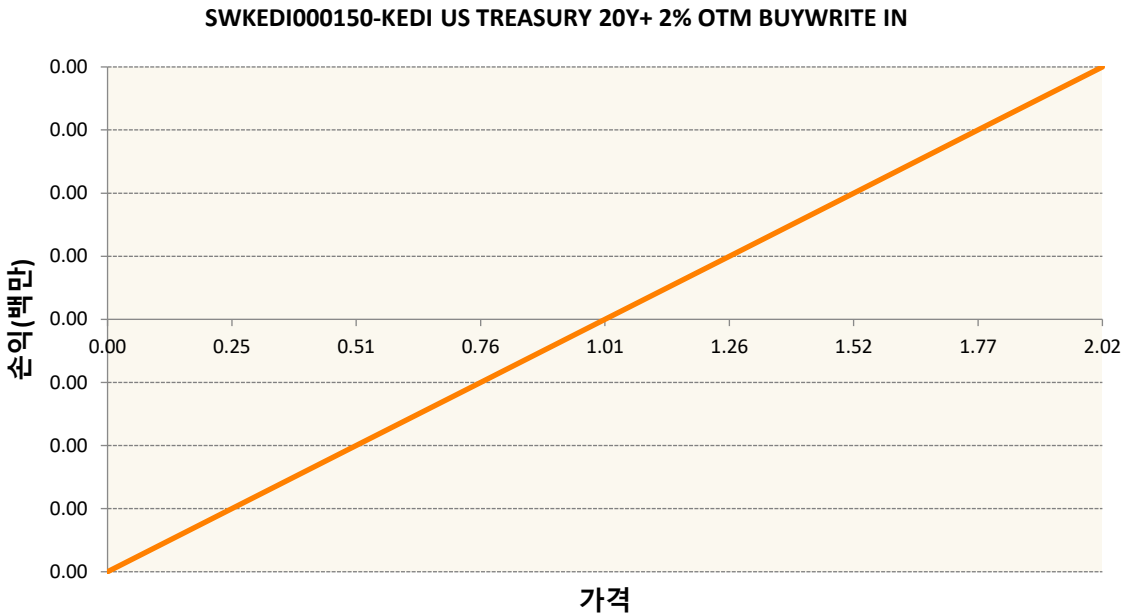
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

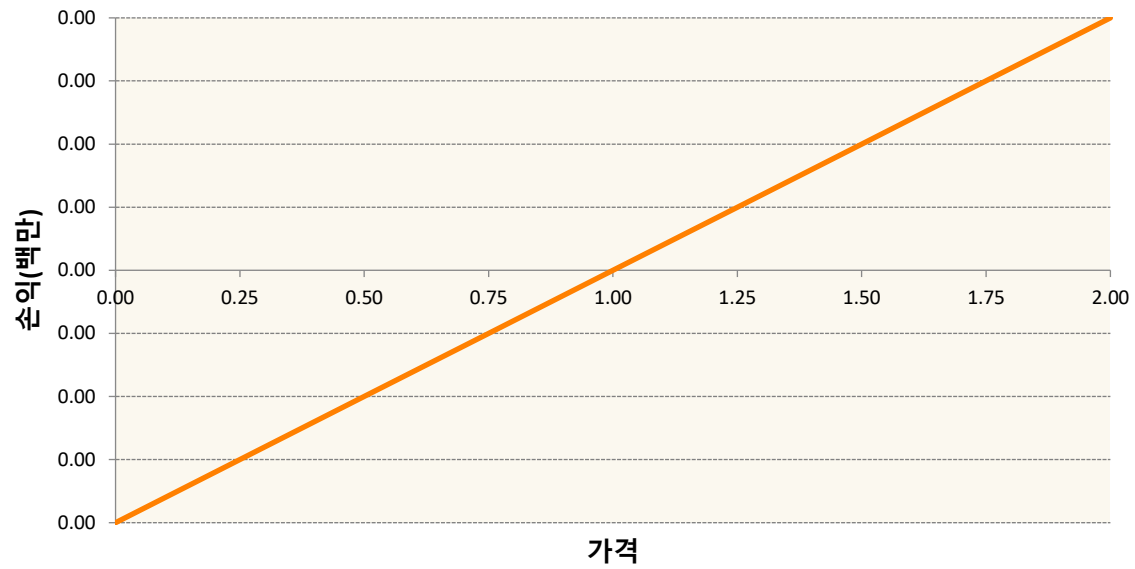
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 367,920 | 0     | 367,920   | 장외 |

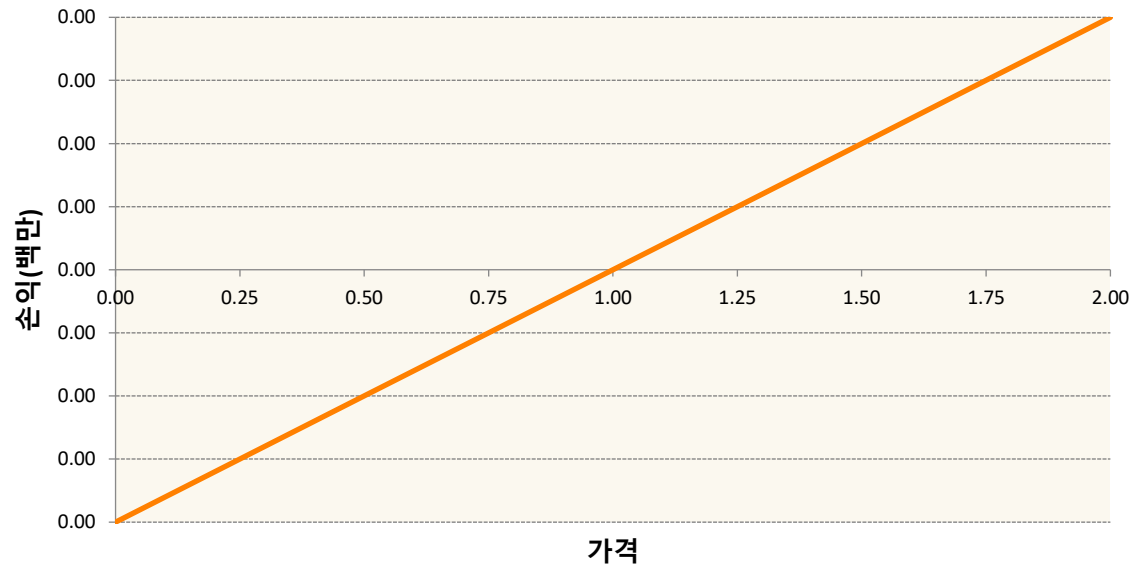
### 2. 만기시점의 손익구조



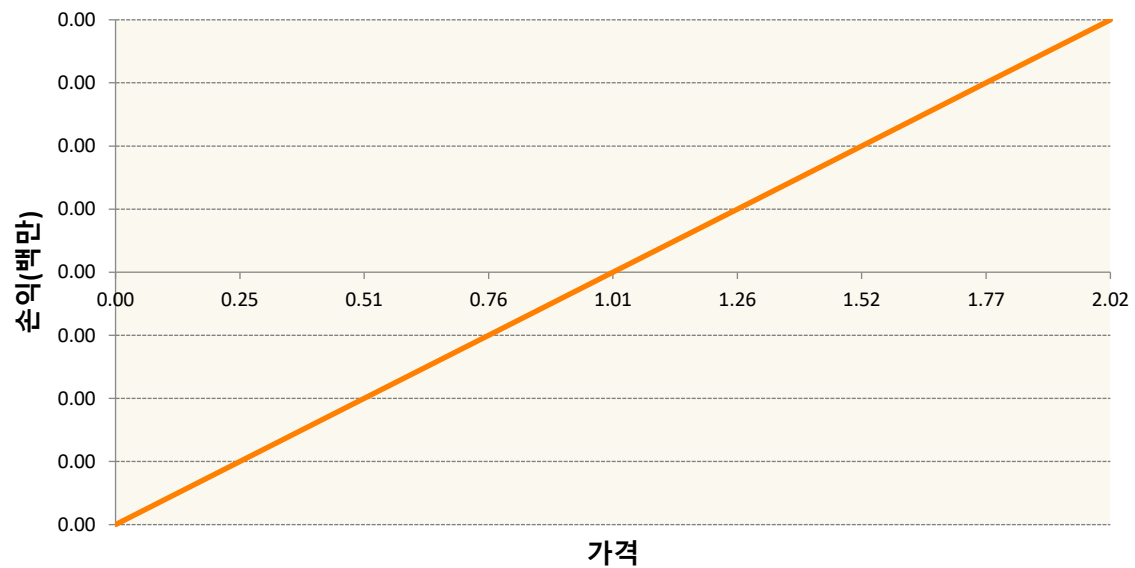
SWKEDI000169-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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



SWKEDI000172-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|--|----------|
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 8,475    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 155      |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 9,441    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 7,864    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 3,480    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 12,665   |

공시일 2026-04-07

기준일 2026-04-06

## 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