

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

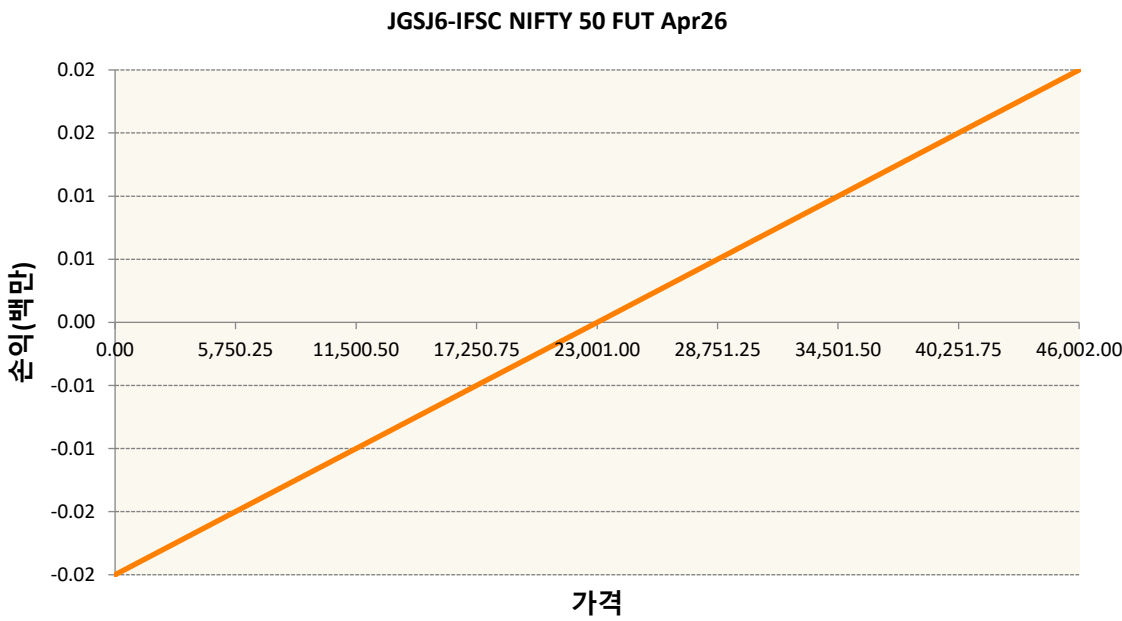
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 624   | 0     | 624       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ6 IFSC NIFTY 50 FUT Apr26

50

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

(단위:백만원)

34

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

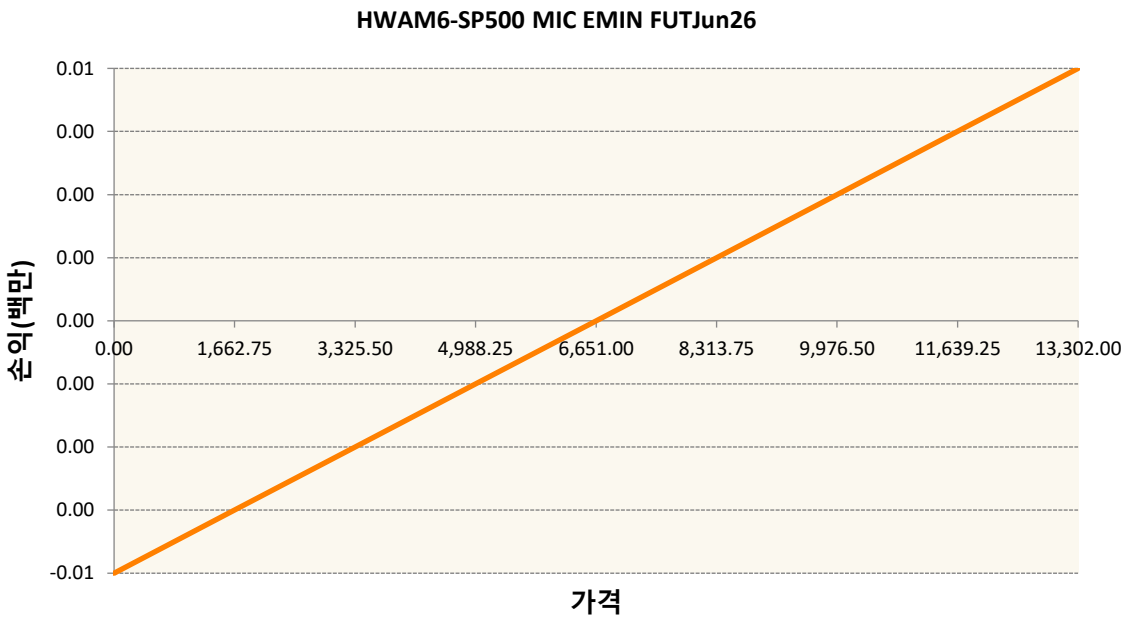
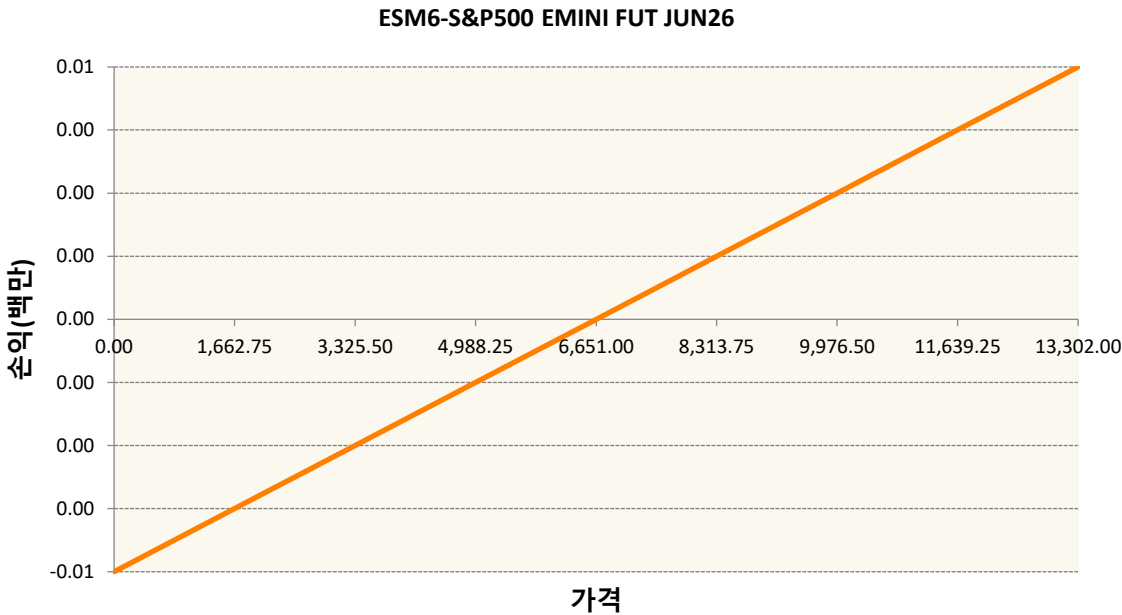
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 499   | 0     | 499       |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 250   | 0     | 250       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| ESM6                      | S&P500 EMINI FUT JUN26  | 40       |
| HWAM6                     | SP500 MIC EMIN FUTJun26 | 20       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 52       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

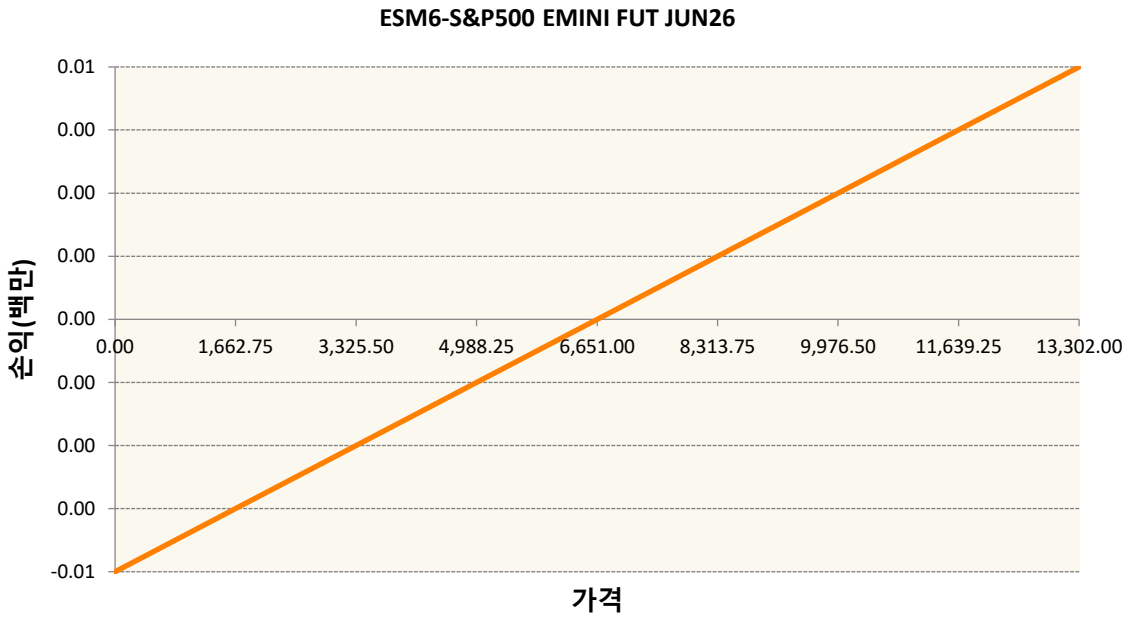
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 998   | 0     | 998       |    |

### 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)

70

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

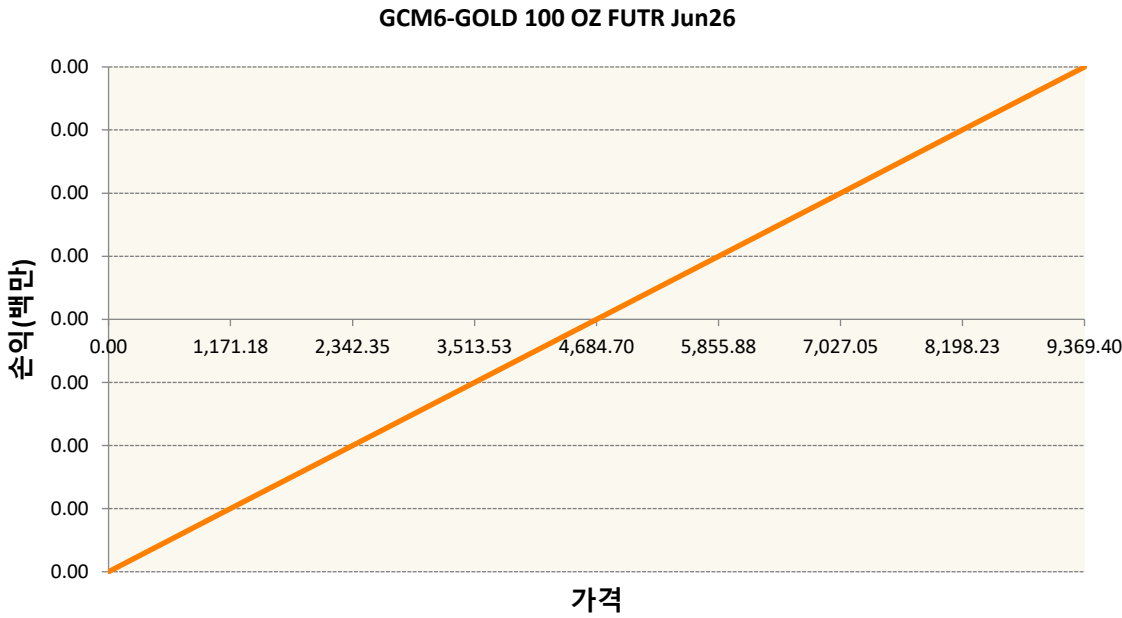
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 4,947 | 0     | 4,947     | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| AOGLDUSCC GLD US 04/10/26 C435 EQUITY | 20  |
| GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26           | 396 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 523 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

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 | 153 |
| AOPLTRUP1!PLTR US 04/10/26 P152.5 EQUITY | 36  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 627 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

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

19

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

(단위:백만원)

13

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

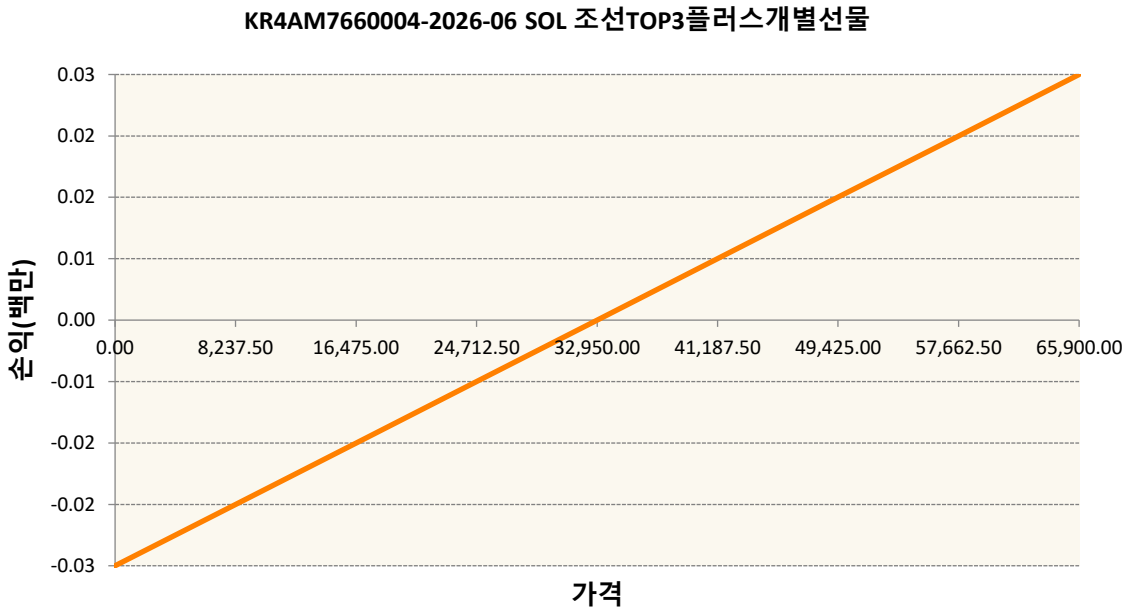
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 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   | 145,313 | 0     | 145,313   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0



공시일 2026-04-08

기준일 2026-04-07

## 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 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

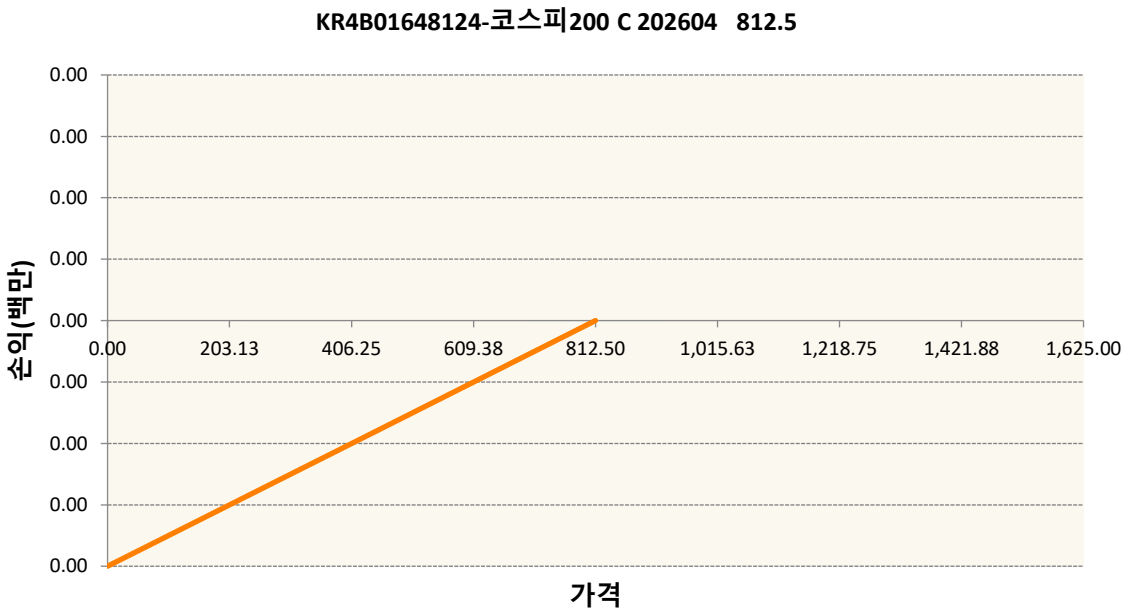
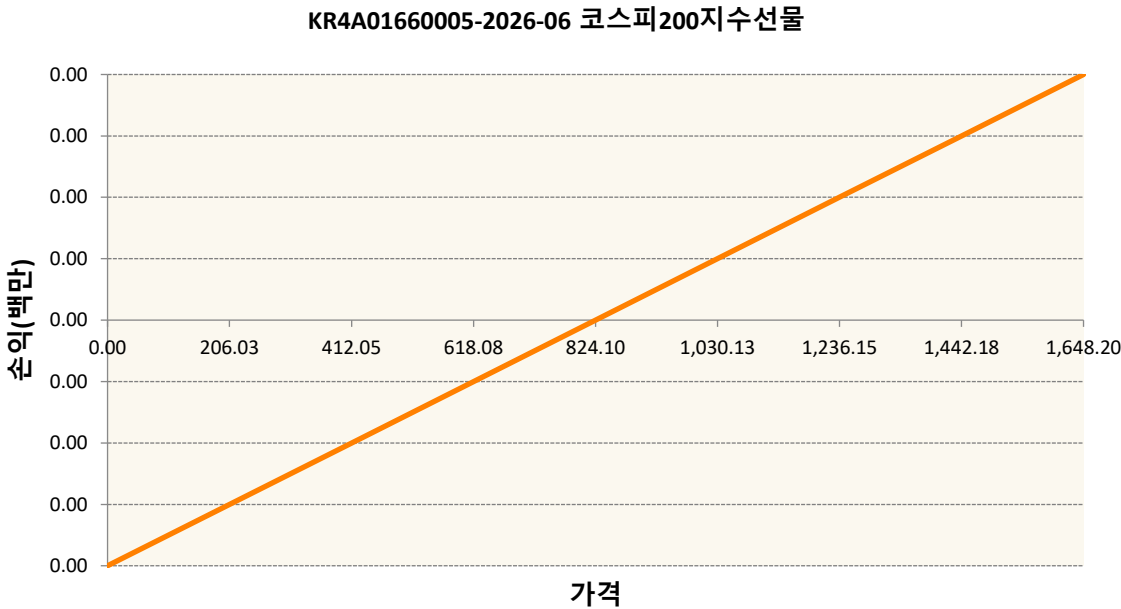
## SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

### 1. 계약금액

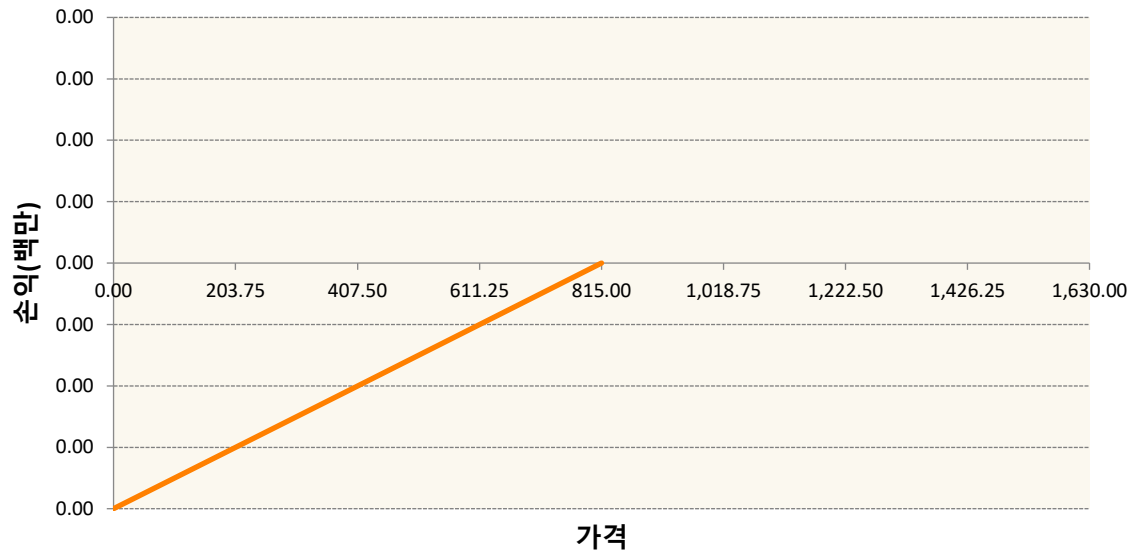
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 417   | -417      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 5,357 | 0     | 5,357     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 9,356 | -9,356    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4B01648157-코스피200 C 202604 815.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|              |           |                       |        |      |       |        |        |
|--------------|-----------|-----------------------|--------|------|-------|--------|--------|
| KR4A01660005 |           | 2026-06 코스피200지수선물    |        |      |       |        | 427    |
|              | 기초자산의 변동성 |                       |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%               | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -427      | -427                  | -427   | -427 | -427  | -427   | -427   |
| -5.33%       | -285      | -285                  | -285   | -285 | -285  | -285   | -285   |
| -2.67%       | -142      | -142                  | -142   | -142 | -142  | -142   | -142   |
| 0%           | 0         | 0                     | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 142       | 142                   | 142    | 142  | 142   | 142    | 142    |
| 5.33%        | 285       | 285                   | 285    | 285  | 285   | 285    | 285    |
| 8.00%        | 427       | 427                   | 427    | 427  | 427   | 427    | 427    |
| KR4B01648124 |           | 코스피200 C 202604 812.5 |        |      |       |        | 323    |
|              | 기초자산의 변동성 |                       |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%               | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -307      | -309                  | -311   | -313 | -316  | -319   | -323   |
| -5.33%       | -168      | -173                  | -178   | -183 | -189  | -195   | -201   |
| -2.67%       | -52       | -60                   | -68    | -76  | -84   | -92    | -101   |
| 0%           | 26        | 17                    | 9      | 0    | -9    | -17    | -26    |
| 2.67%        | 63        | 57                    | 51     | 45   | 38    | 31     | 24     |
| 5.33%        | 76        | 73                    | 70     | 67   | 62    | 58     | 53     |
| 8.00%        | 78        | 78                    | 77     | 75   | 73    | 71     | 68     |
| KR4B01648157 |           | 코스피200 C 202604 815.0 |        |      |       |        | 233    |
|              | 기초자산의 변동성 |                       |        |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%               | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -223      | -224                  | -225   | -226 | -228  | -230   | -233   |
| -5.33%       | -124      | -127                  | -130   | -134 | -137  | -142   | -146   |
| -2.67%       | -40       | -45                   | -50    | -56  | -62   | -67    | -73    |
| 0%           | 18        | 12                    | 6      | 0    | -6    | -12    | -18    |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 2.67% | 47 | 43 | 39 | 34 | 29 | 24 | 18 |
| 5.33% | 58 | 56 | 54 | 51 | 48 | 44 | 40 |
| 8.00% | 60 | 60 | 59 | 58 | 56 | 54 | 52 |

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

(단위:백만원)

1,783

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

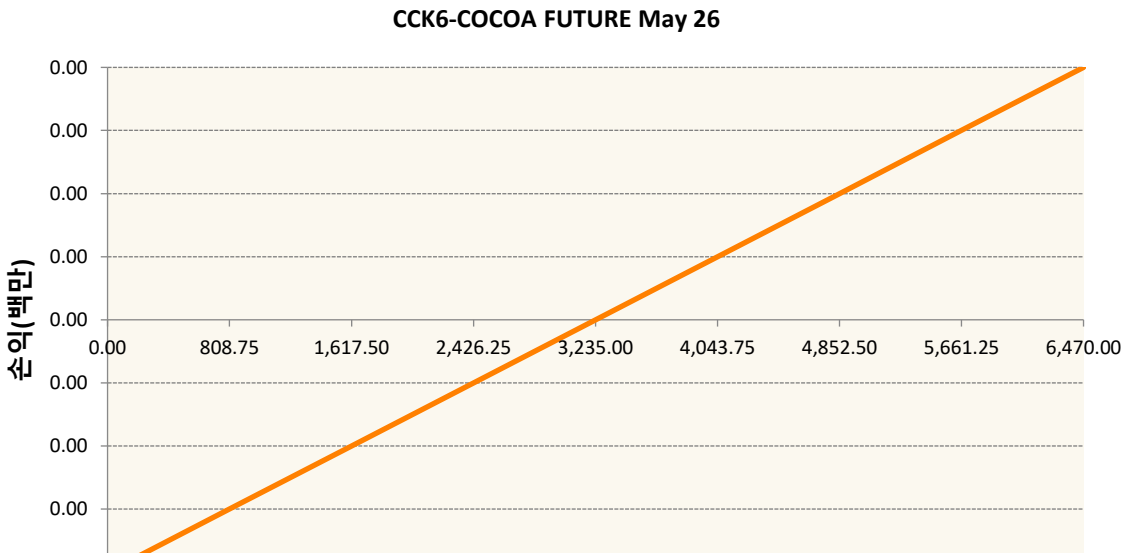
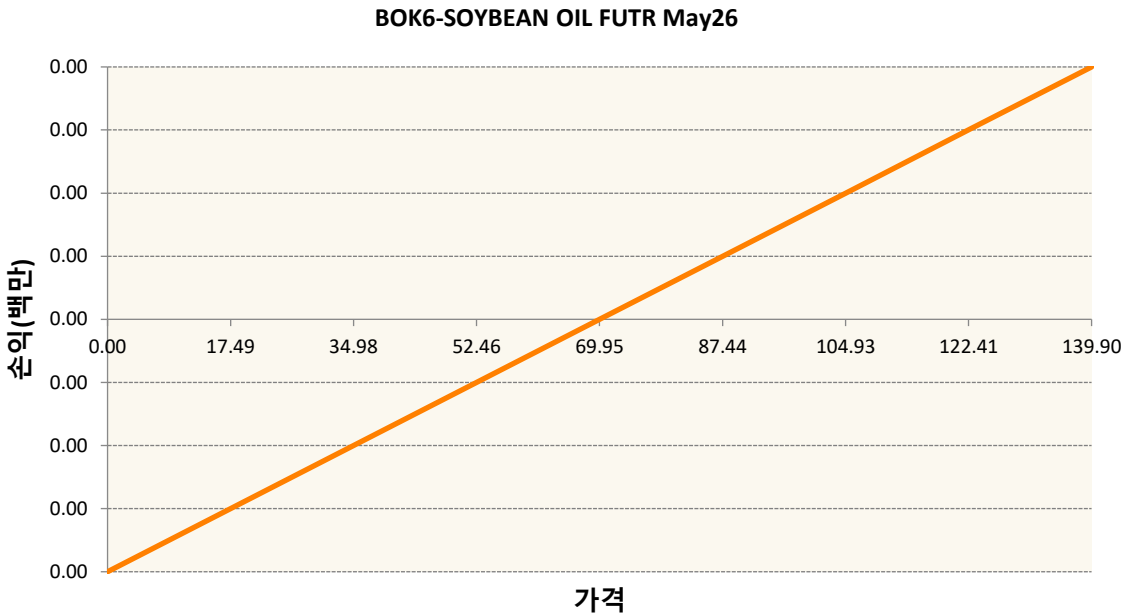
## 포커스농산물모(채권-파생형)

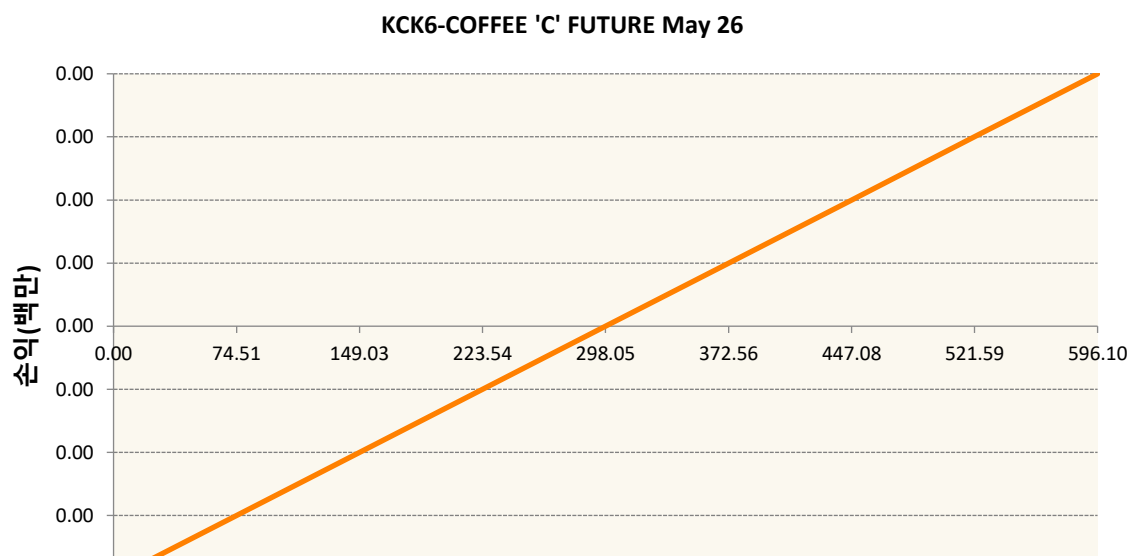
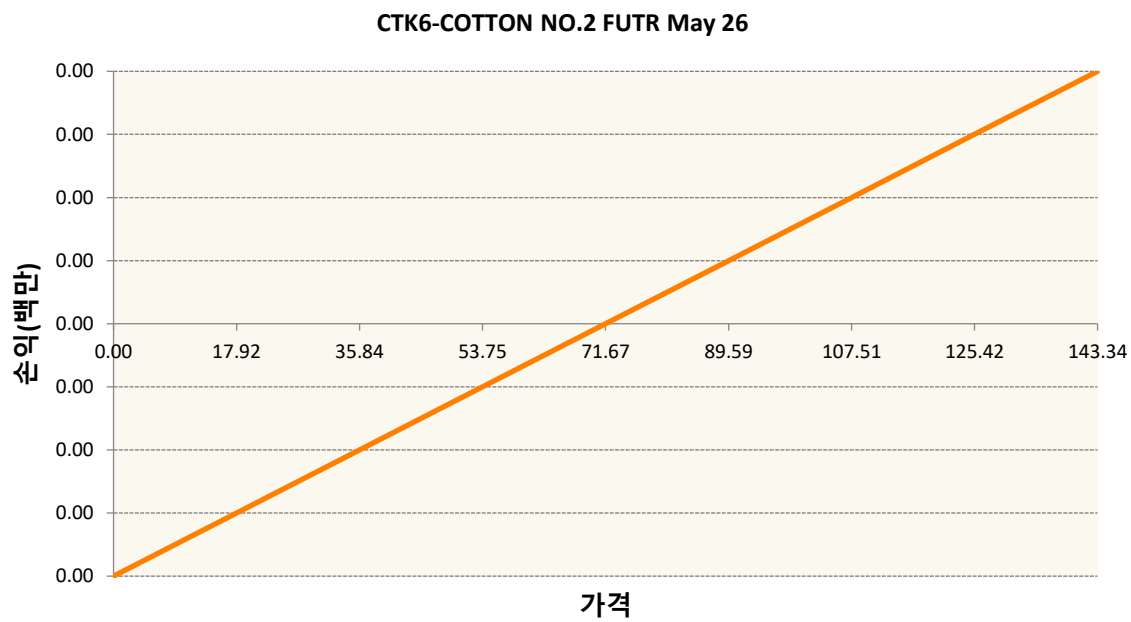
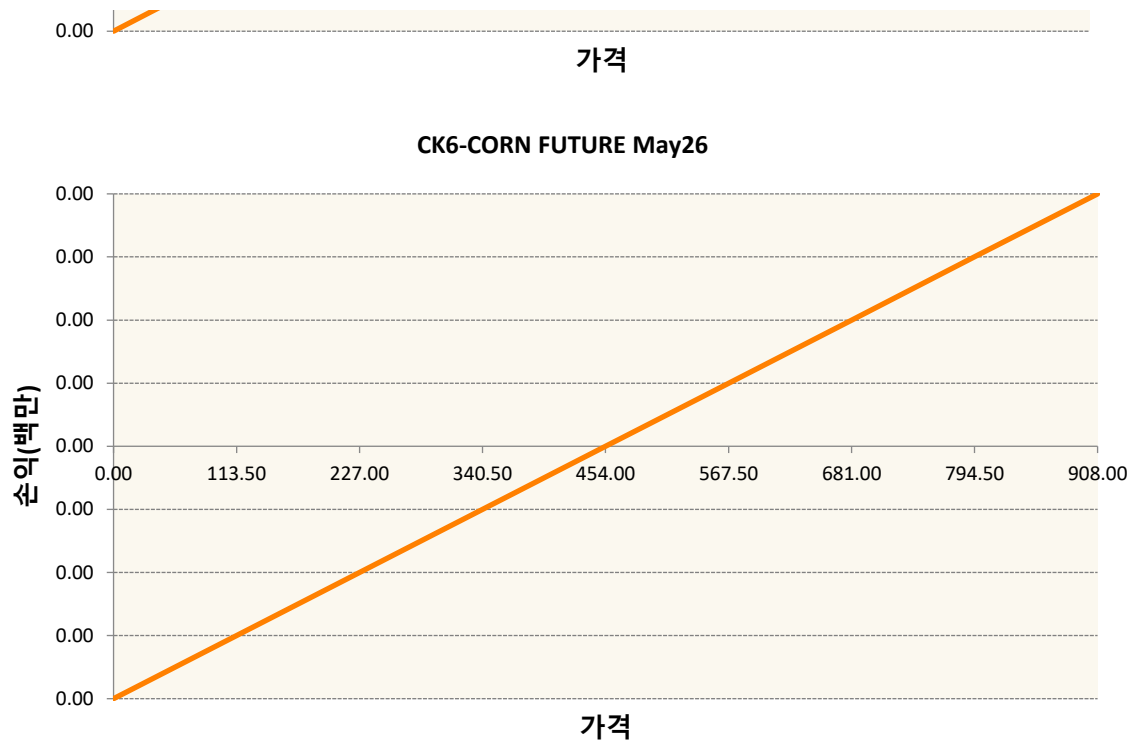
### 1. 계약금액

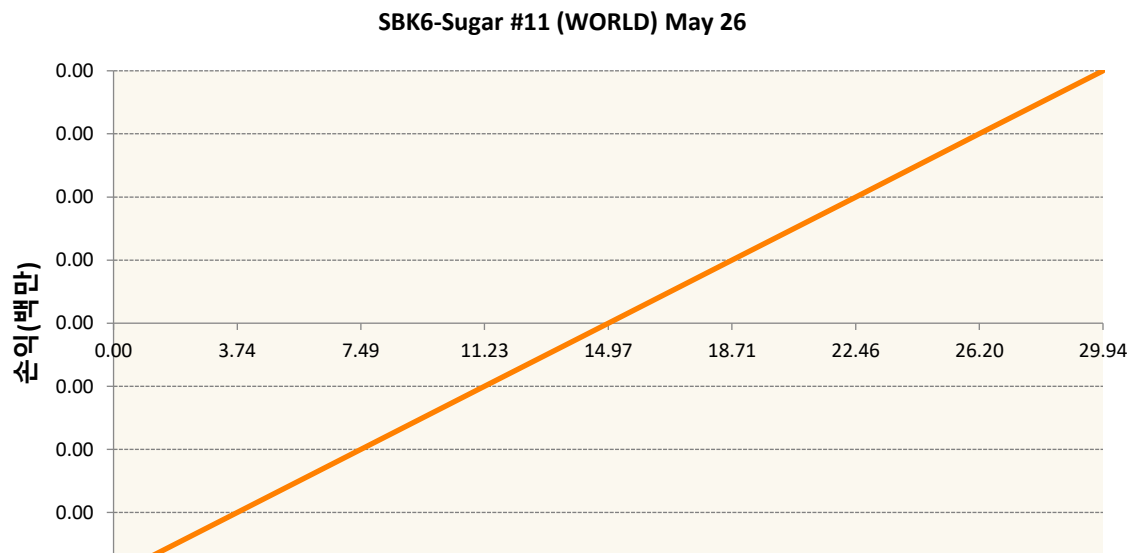
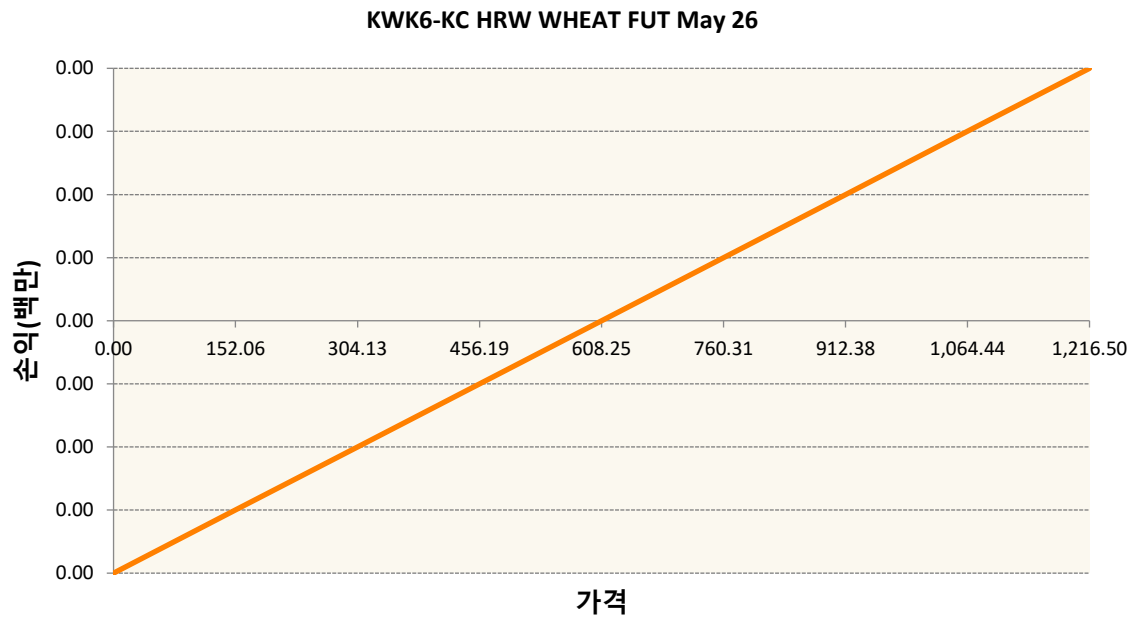
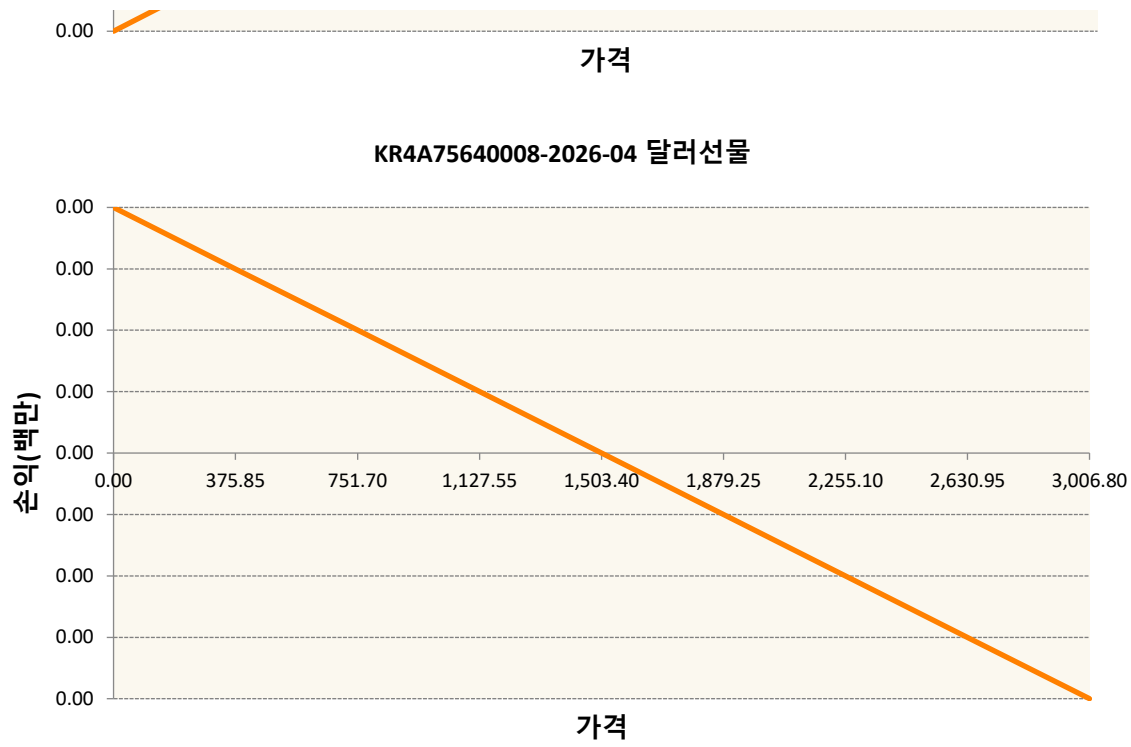
(단위:USD 백만)

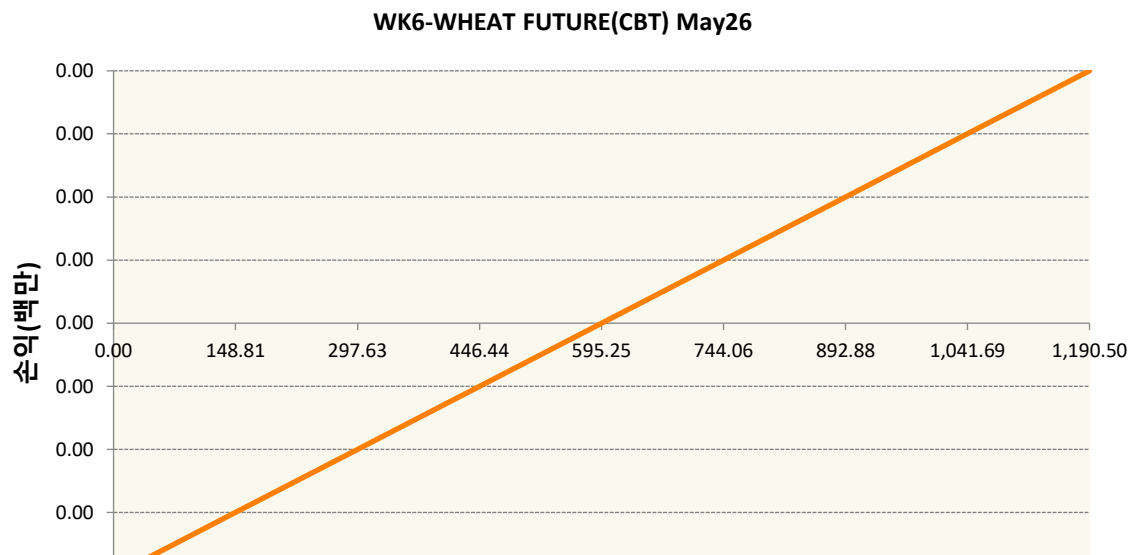
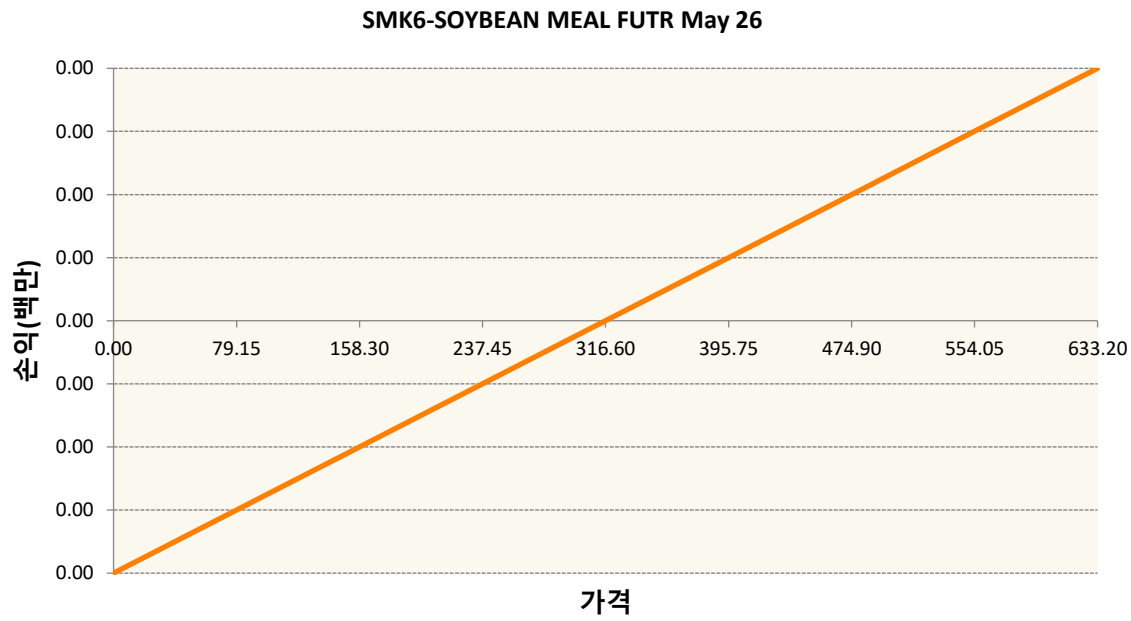
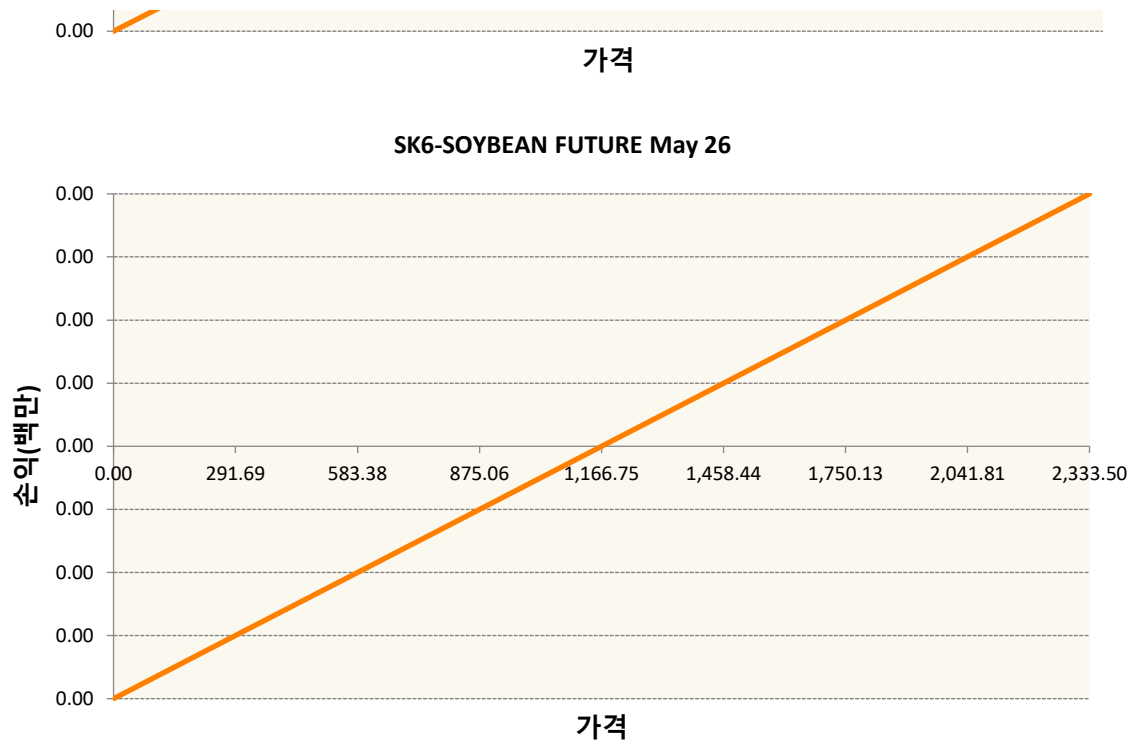
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,312 | 0     | 1,312     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,584 | 0     | 1,584     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 421   | -421      | 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 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

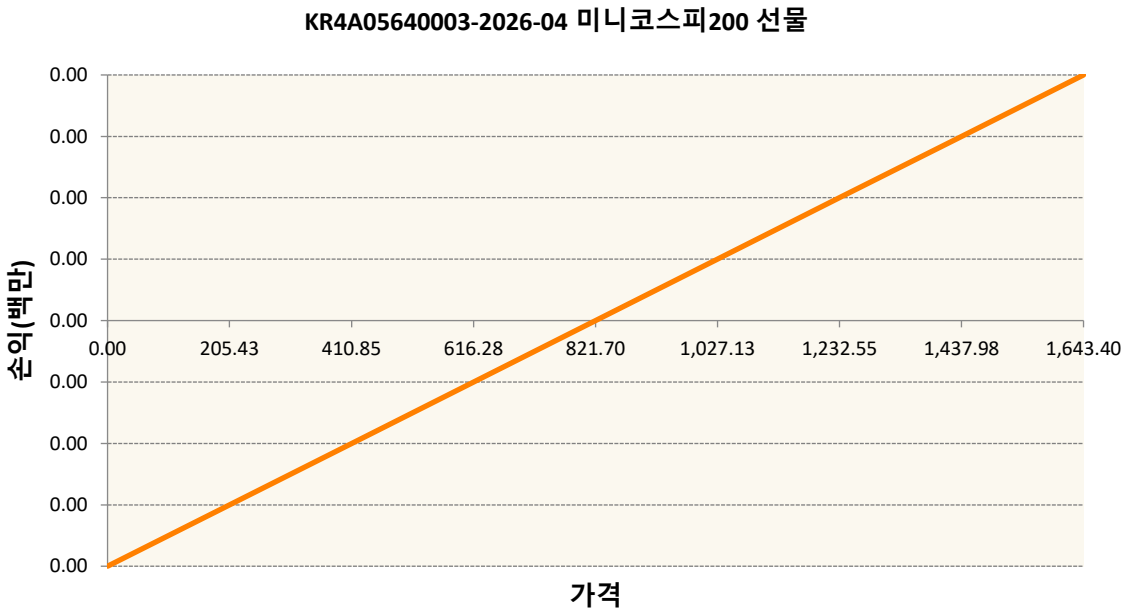
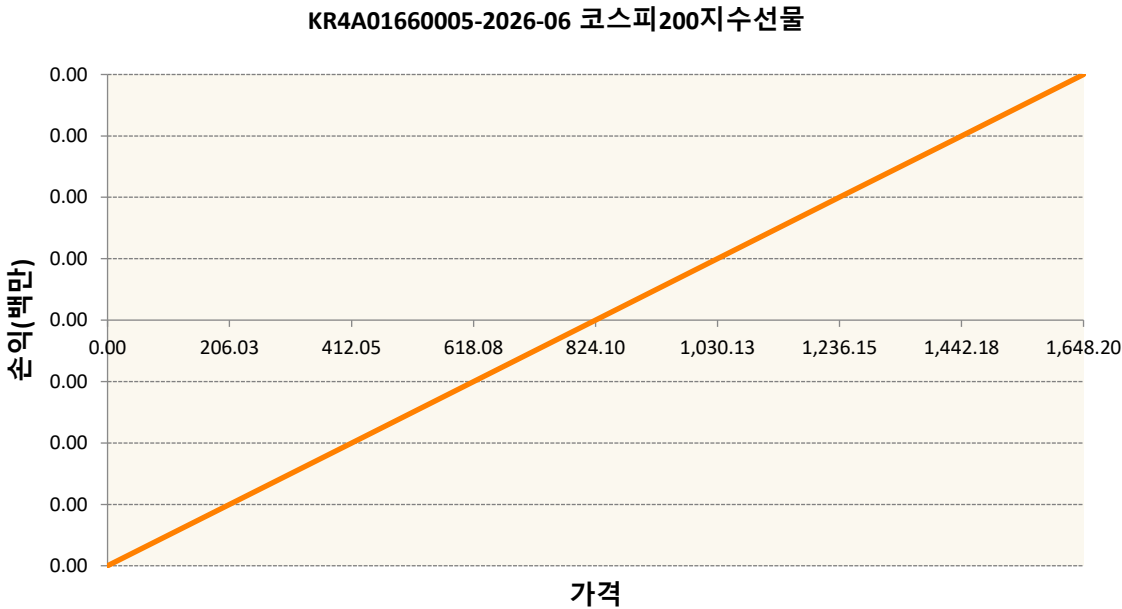
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

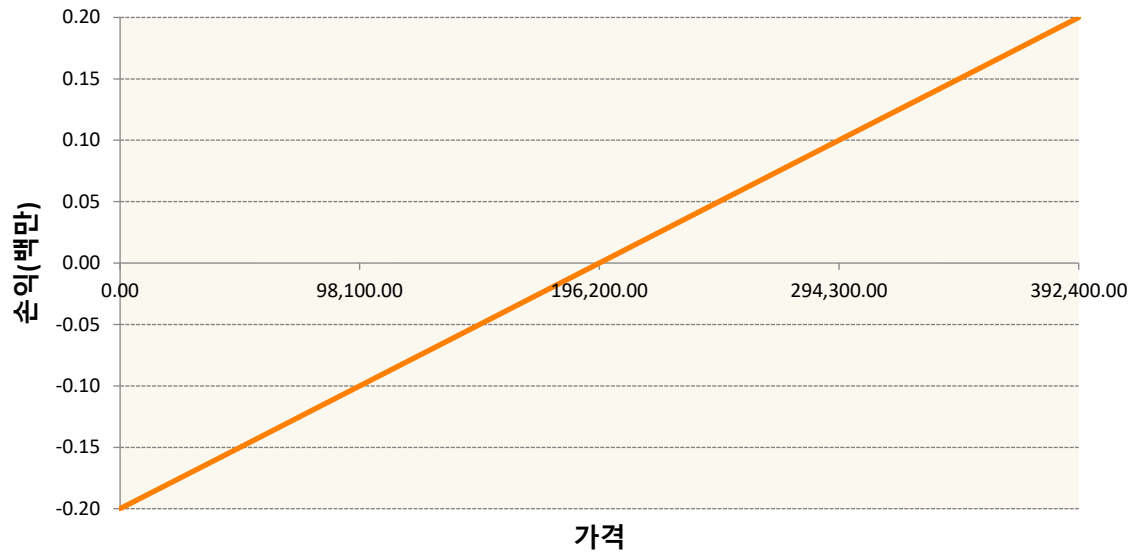
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 203   | -203      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 4,028 | 0     | 4,028     | 장내 |

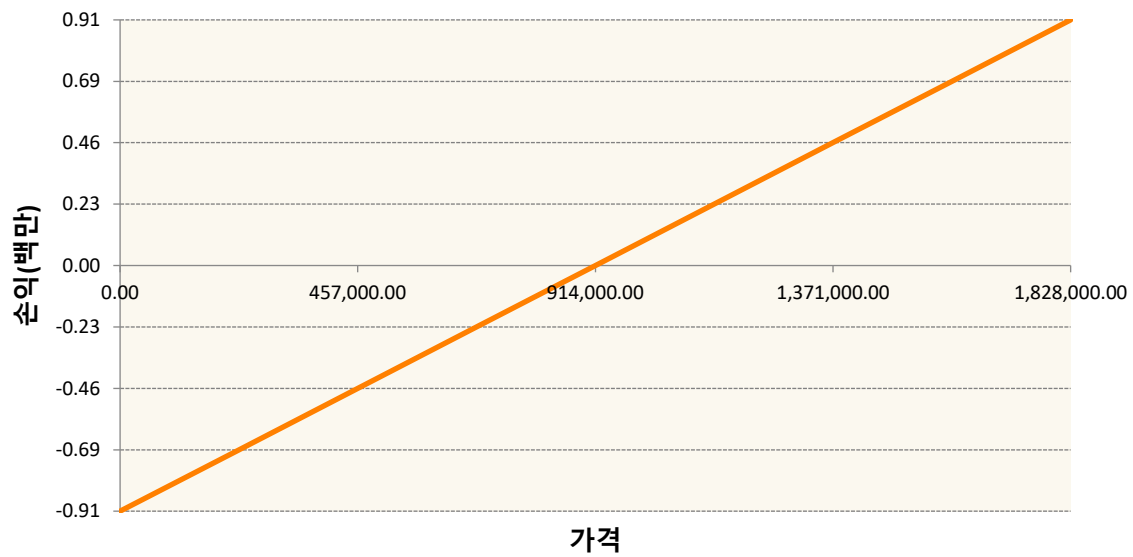
### 2. 만기시점의 손익구조



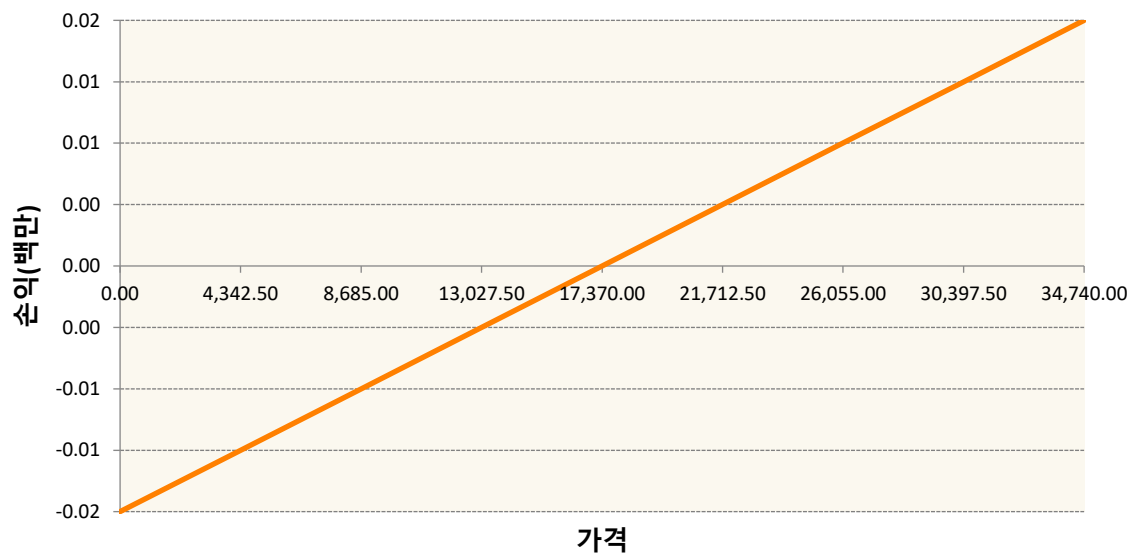
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |        |      |       |        |                     |  |     |  |
|--------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|---------------------|--|-----|--|
| KR4A01660005 |           |         |        |      |       |        | 2026-06 코스피200지수선물  |  | 197 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                     |  |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%              |  |     |  |
| -8.00%       | -197      | -197    | -197   | -197 | -197  | -197   | -197                |  |     |  |
| -5.33%       | -131      | -131    | -131   | -131 | -131  | -131   | -131                |  |     |  |
| -2.67%       | -66       | -66     | -66    | -66  | -66   | -66    | -66                 |  |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                   |  |     |  |
| 2.67%        | 66        | 66      | 66     | 66   | 66    | 66     | 66                  |  |     |  |
| 5.33%        | 131       | 131     | 131    | 131  | 131   | 131    | 131                 |  |     |  |
| 8.00%        | 197       | 197     | 197    | 197  | 197   | 197    | 197                 |  |     |  |
| 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    |  | 83  |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                     |  |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%              |  |     |  |
| -8.00%       | -83       | -83     | -83    | -83  | -83   | -83    | -83                 |  |     |  |
| -5.33%       | -55       | -55     | -55    | -55  | -55   | -55    | -55                 |  |     |  |
| -2.67%       | -28       | -28     | -28    | -28  | -28   | -28    | -28                 |  |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                   |  |     |  |
| 2.67%        | 28        | 28      | 28     | 28   | 28    | 28     | 28                  |  |     |  |
| 5.33%        | 55        | 55      | 55     | 55   | 55    | 55     | 55                  |  |     |  |
| 8.00%        | 83        | 83      | 83     | 83   | 83    | 83     | 83                  |  |     |  |
| 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)

678

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

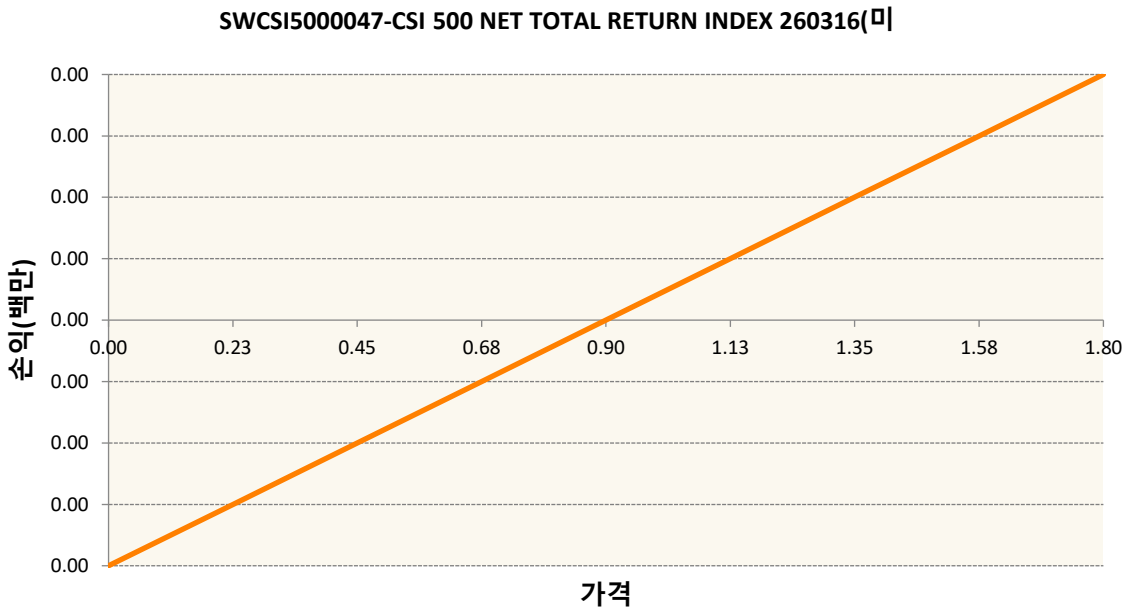
## SOL차이나강소기업CSI500상장

### 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 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

542

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

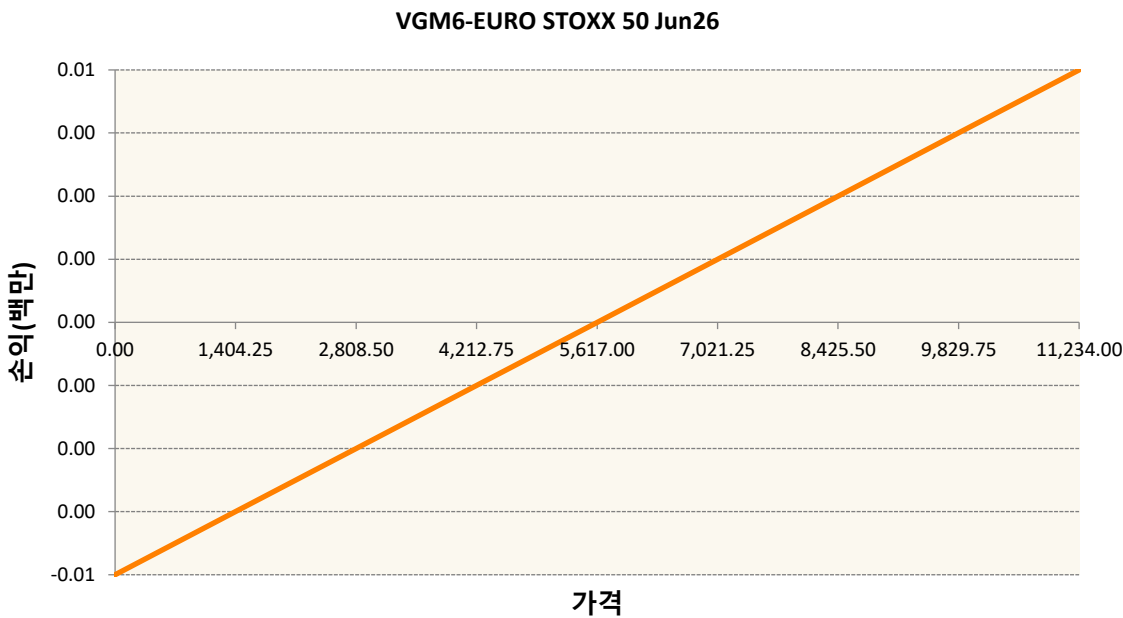
유로인덱스모(주식-파생형)

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 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

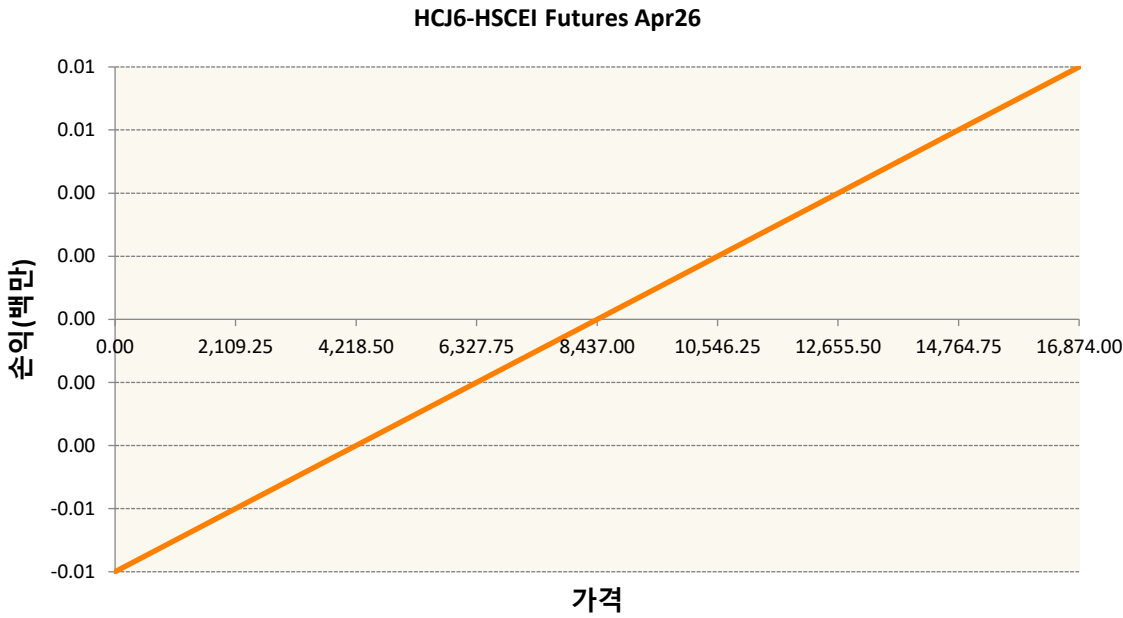
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

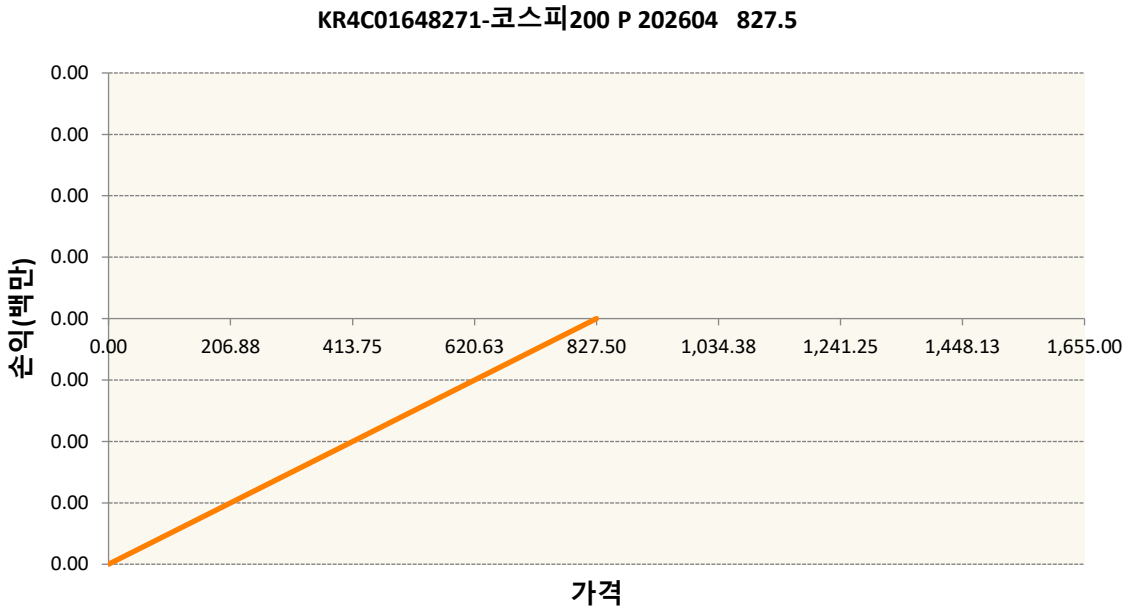
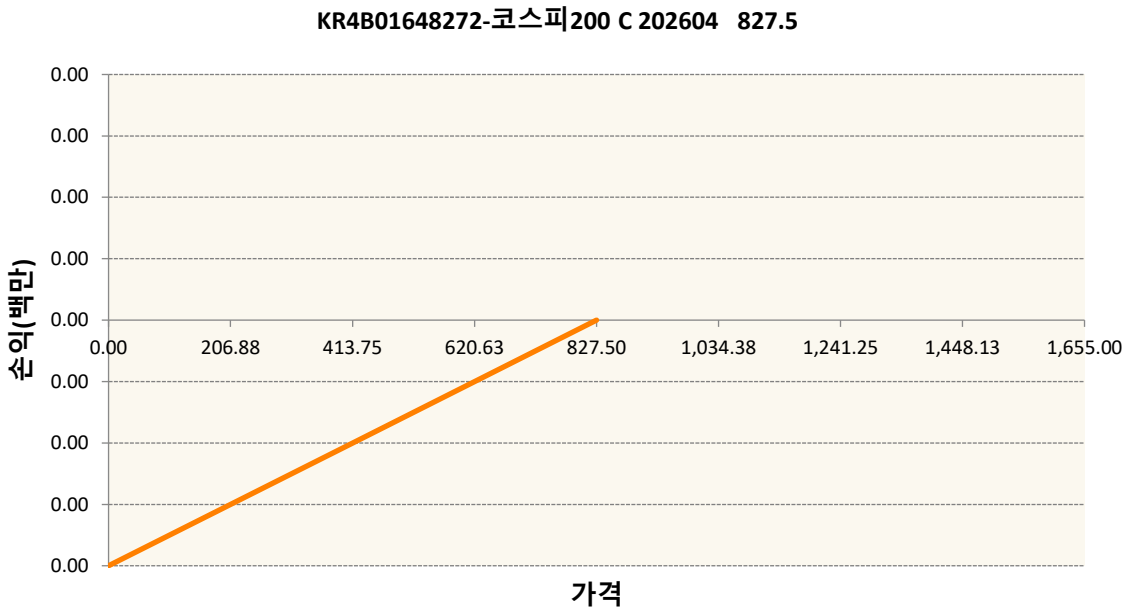
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 1,262  | -1,262    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 37,858 | -37,858   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|                                    |         |         |        |        |        |        |        |
|------------------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| KR4B01648272 코스피200 C 202604 827.5 |         |         |        |        |        |        | 2,018  |
| 기초자산의 변동성                          |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격                                 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                             | -1,970  | -1,973  | -1,978 | -1,984 | -1,993 | -2,005 | -2,018 |
| -5.33%                             | -1,171  | -1,183  | -1,199 | -1,218 | -1,240 | -1,264 | -1,291 |
| -2.67%                             | -435    | -467    | -501   | -538   | -576   | -615   | -655   |
| 0%                                 | 145     | 97      | 48     | 0      | -48    | -97    | -146   |
| 2.67%                              | 498     | 454     | 409    | 363    | 317    | 270    | 223    |
| 5.33%                              | 654     | 628     | 599    | 568    | 534    | 498    | 460    |
| 8.00%                              | 702     | 692     | 679    | 662    | 643    | 620    | 595    |
| KR4C01648271 코스피200 P 202604 827.5 |         |         |        |        |        |        | 461    |
| 기초자산의 변동성                          |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격                                 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                             | -450    | -450    | -451   | -453   | -455   | -457   | -461   |
| -5.33%                             | -267    | -270    | -274   | -278   | -283   | -289   | -295   |
| -2.67%                             | -99     | -106    | -114   | -123   | -131   | -140   | -150   |
| 0%                                 | 33      | 22      | 11     | 0      | -11    | -22    | -33    |
| 2.67%                              | 114     | 104     | 93     | 83     | 72     | 62     | 51     |
| 5.33%                              | 149     | 143     | 137    | 129    | 122    | 114    | 105    |
| 8.00%                              | 160     | 158     | 155    | 151    | 147    | 142    | 136    |

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

4,275

공시일 2026-04-08

기준일 2026-04-07

## 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 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

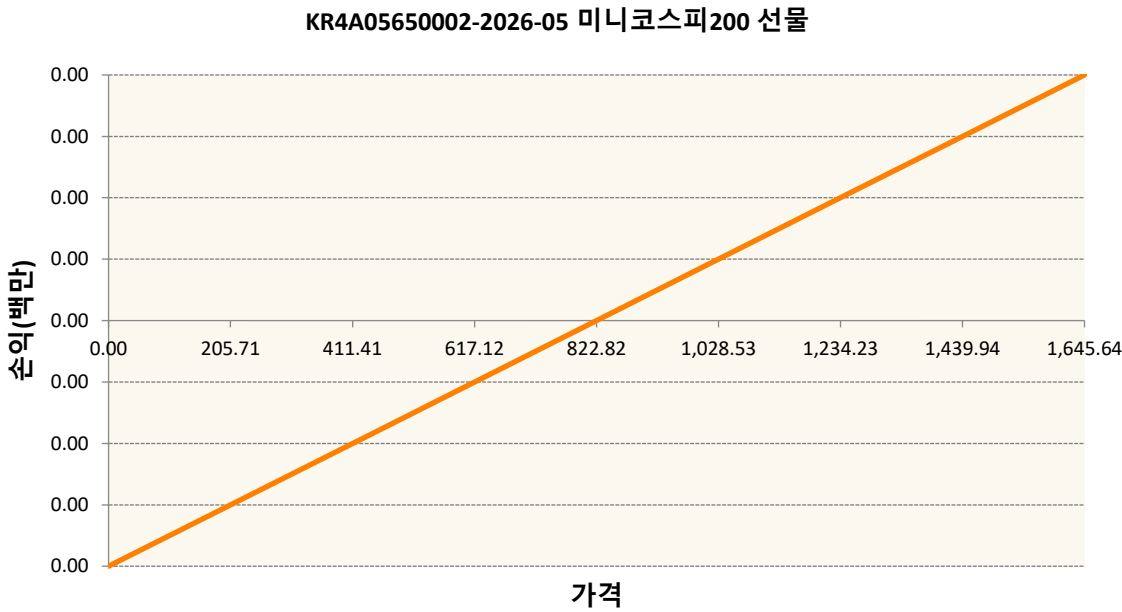
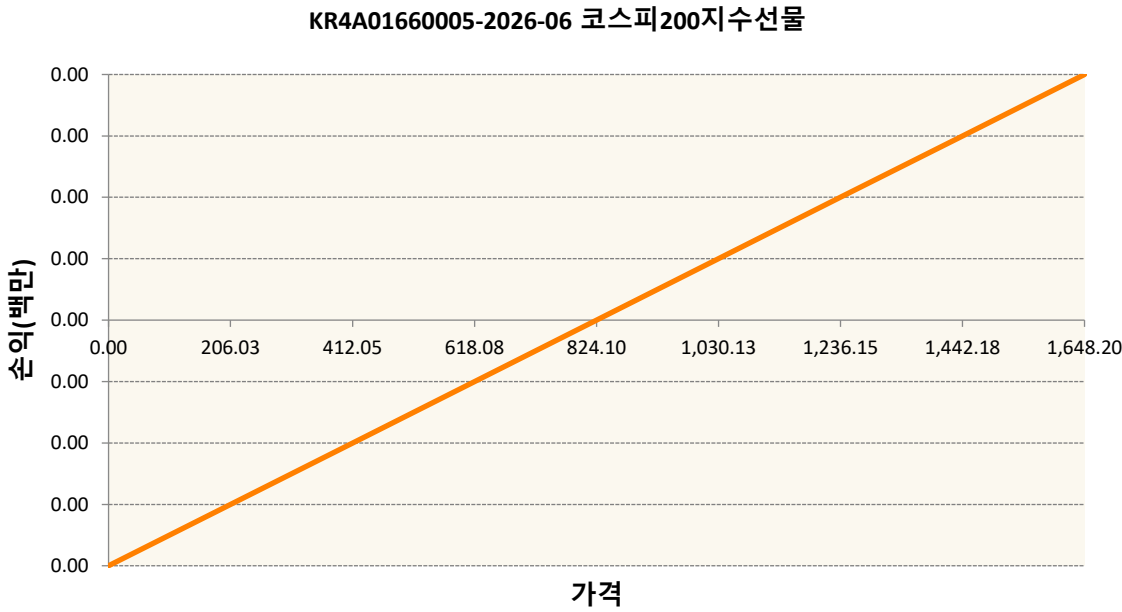
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

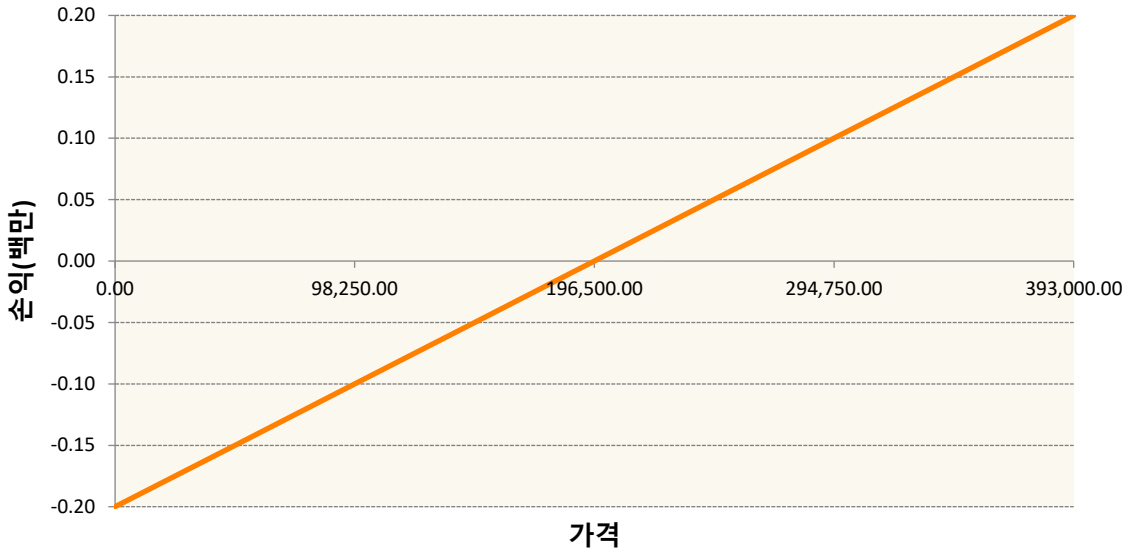
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 2,530 | 0     | 2,530     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,571 | 0     | 3,571     | 장내 |

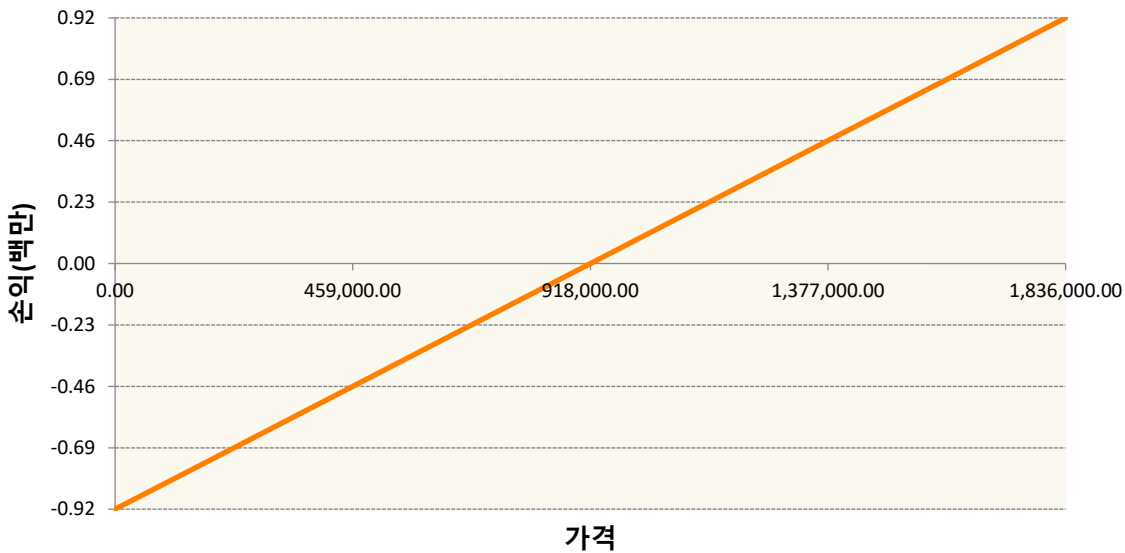
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |                     |        |     |       |        |        |
|--------------|-----------|---------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
| KR4A01660005 |           | 2026-06 코스피200지수선물  |        |     |       |        | 82     |
|              | 기초자산의 변동성 |                     |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%             | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -82       | -82                 | -82    | -82 | -82   | -82    | -82    |
| -5.33%       | -55       | -55                 | -55    | -55 | -55   | -55    | -55    |
| -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%        | 55        | 55                  | 55     | 55  | 55    | 55     | 55     |
| 8.00%        | 82        | 82                  | 82     | 82  | 82    | 82     | 82     |
| KR4A05650002 |           | 2026-05 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    |
| -5.33% | -26     | -26     | -26    | -26 | -26   | -26    | -26    |
| -2.67% | -13     | -13     | -13    | -13 | -13   | -13    | -13    |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 13      | 13      | 13     | 13  | 13    | 13     | 13     |
| 5.33%  | 26      | 26      | 26     | 26  | 26    | 26     | 26     |
| 8.00%  | 39      | 39      | 39     | 39  | 39    | 39     | 39     |

KR4A11650004

2026-05 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     |
| -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      |

KR4A50650006

2026-05 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      |

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

(단위:백만원)

277

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

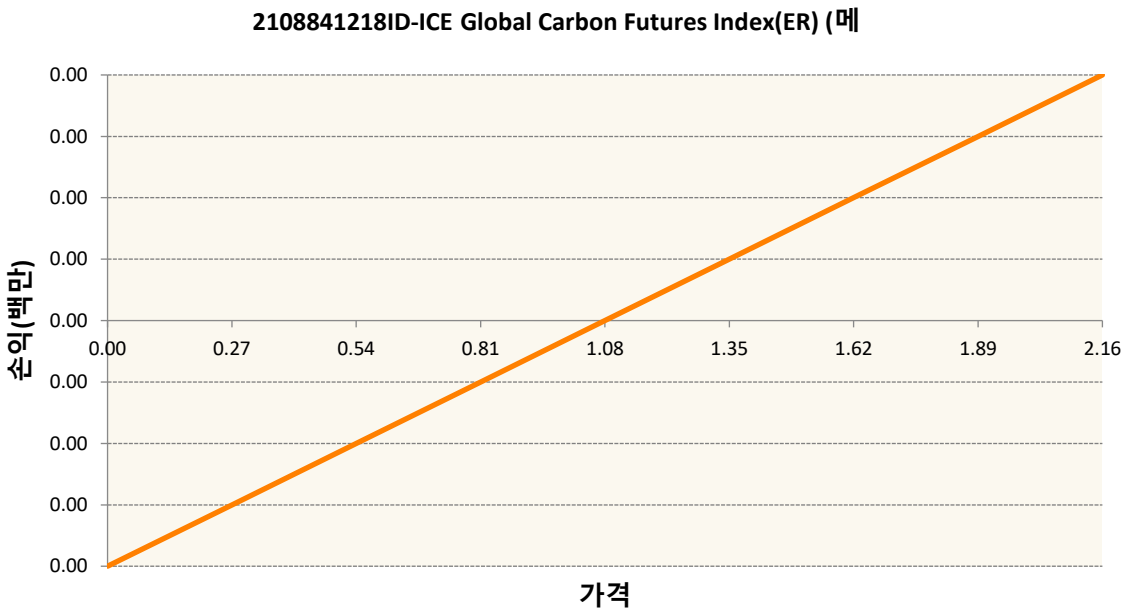
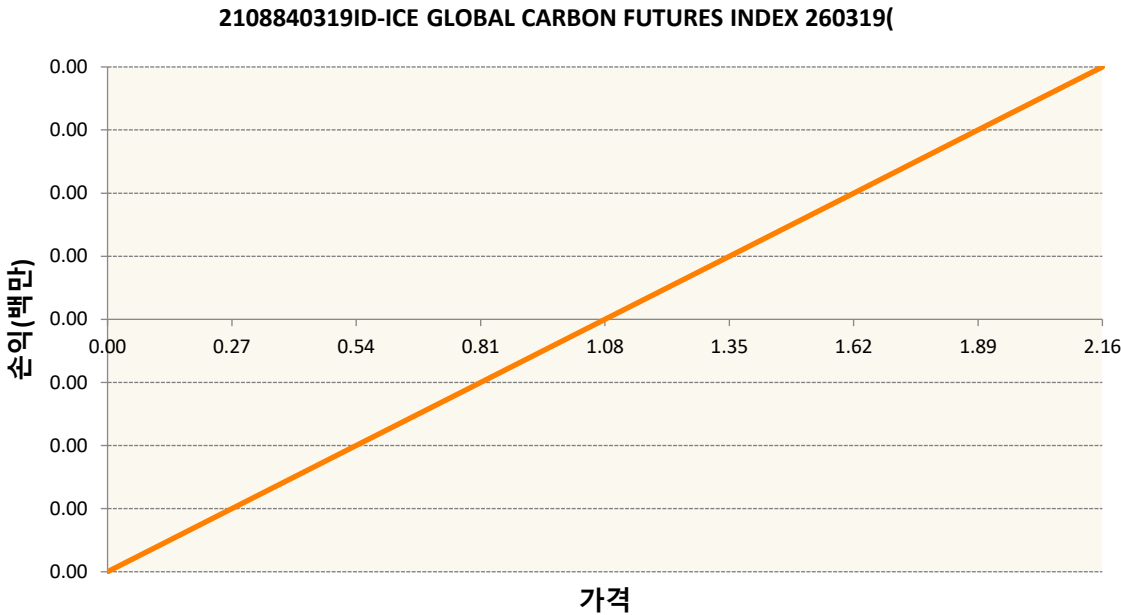
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 557      |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

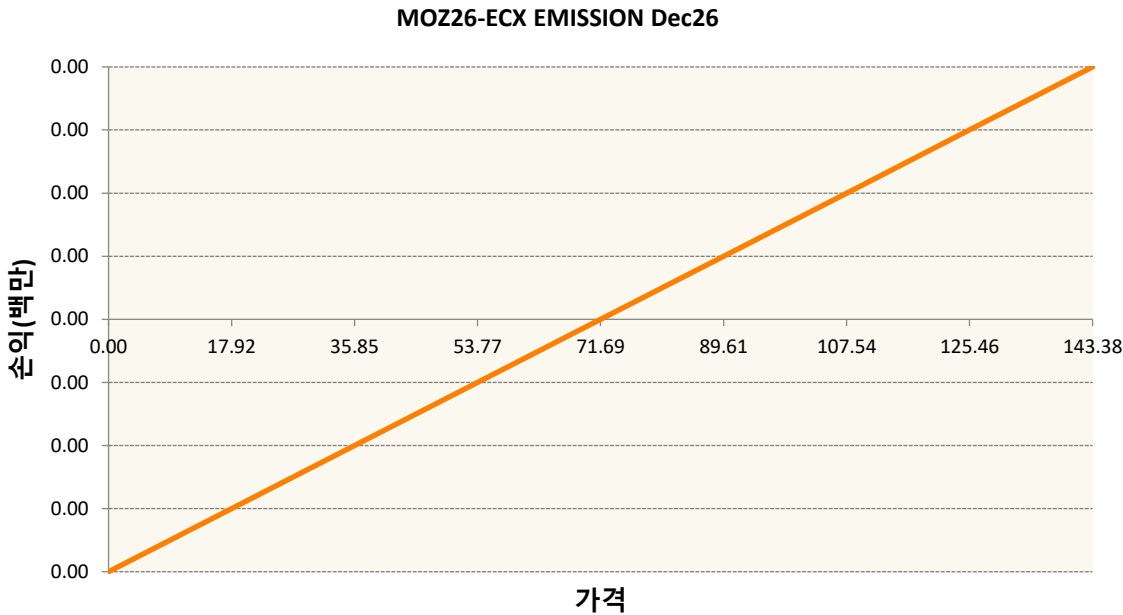
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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)

|     |
|-----|
| 640 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

## 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   | 1,417 | 0     | 1,417     | 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 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

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) | 76 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)  | 28 |

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

(단위:백만원)

192

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

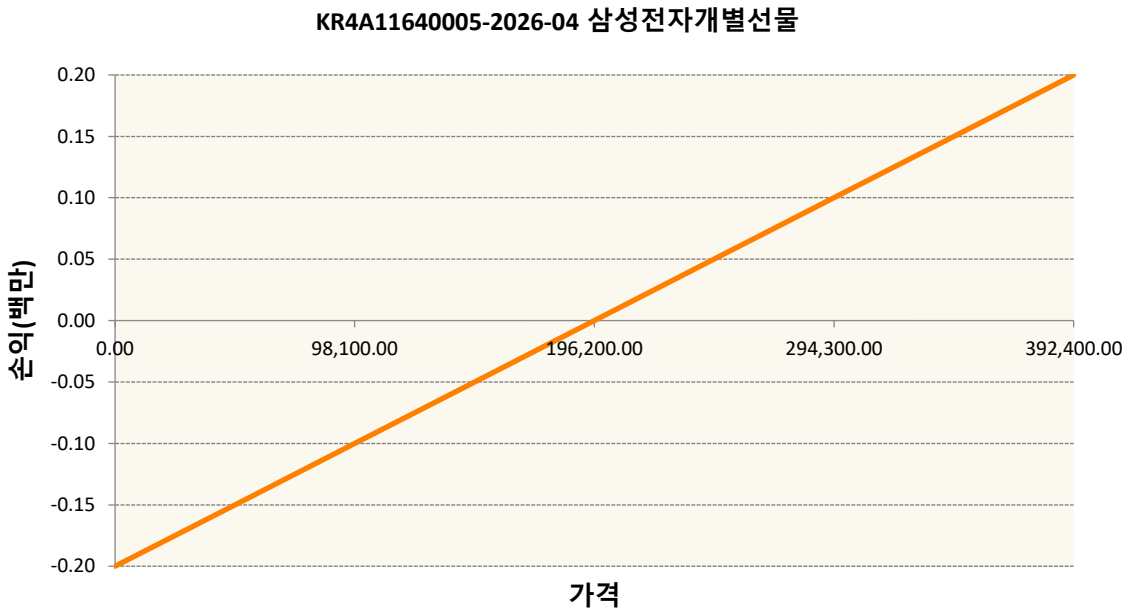
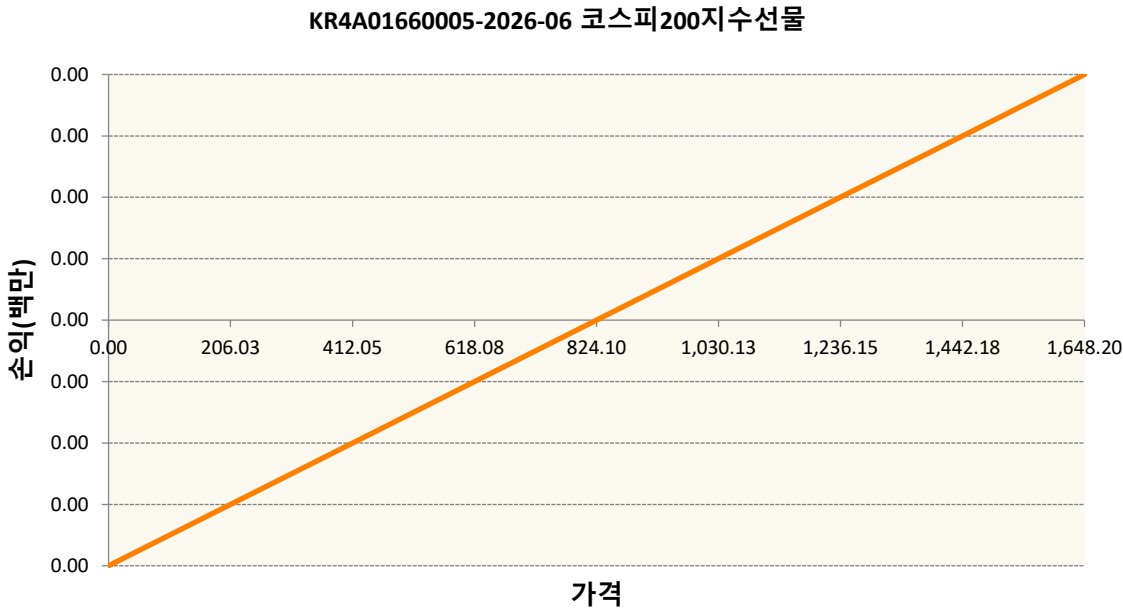
## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 1. 계약금액

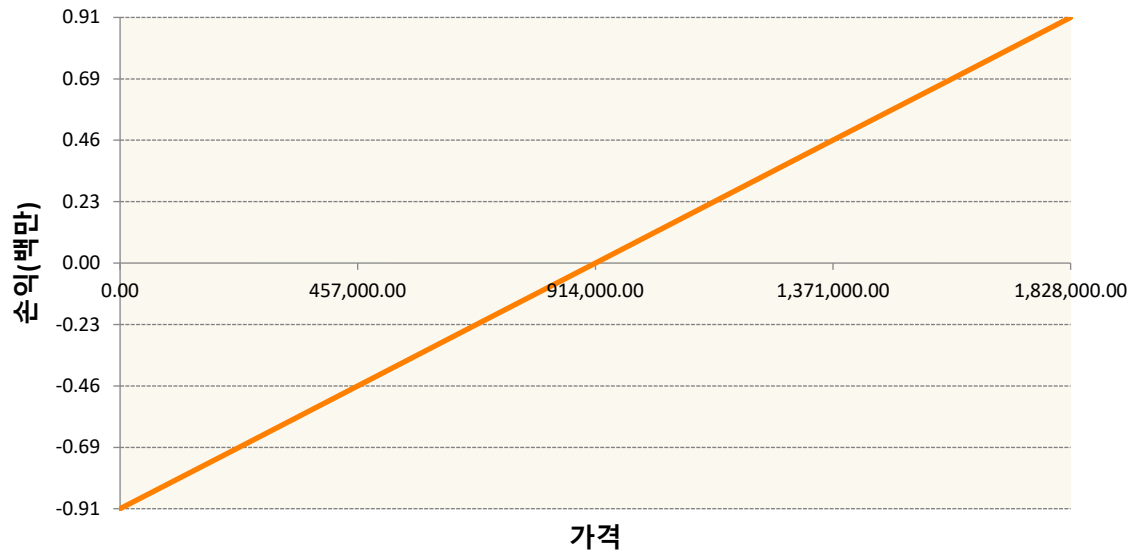
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 1,441  | 1,658 | -216      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 21,474 | 1,648 | 19,827    | 장내 |

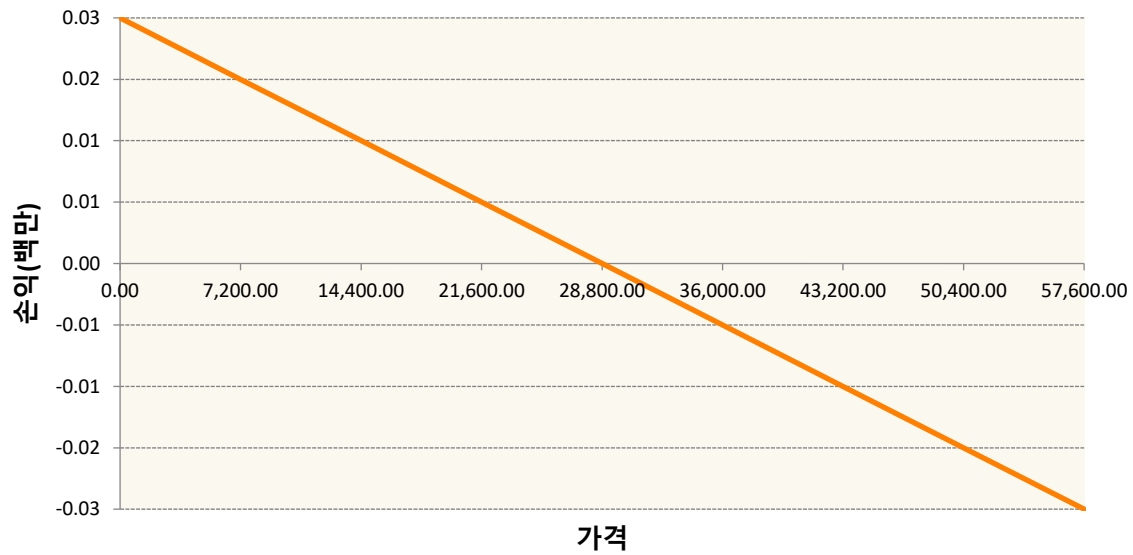
### 2. 만기시점의 손익구조



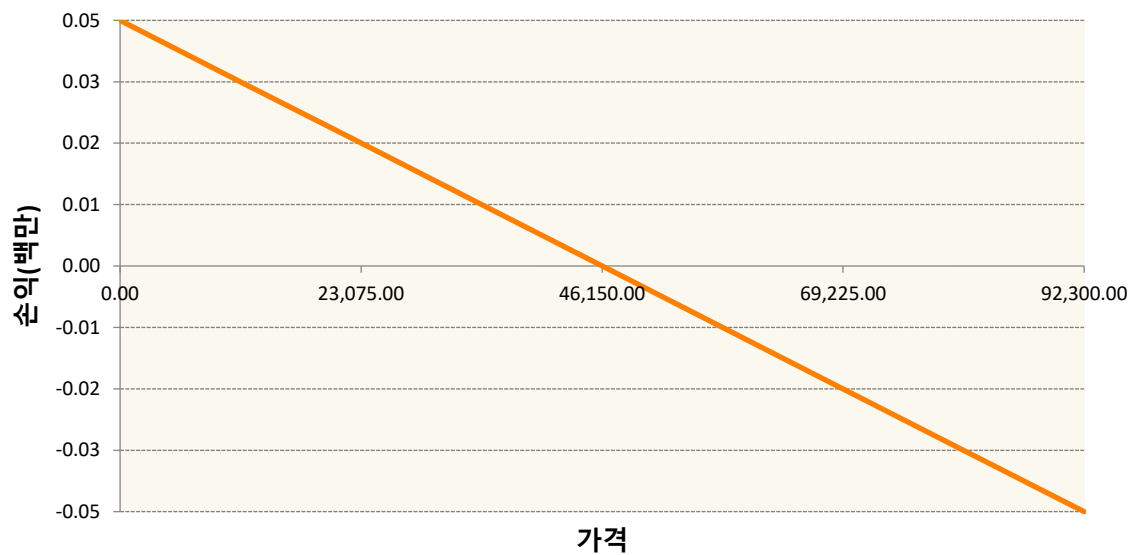
KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



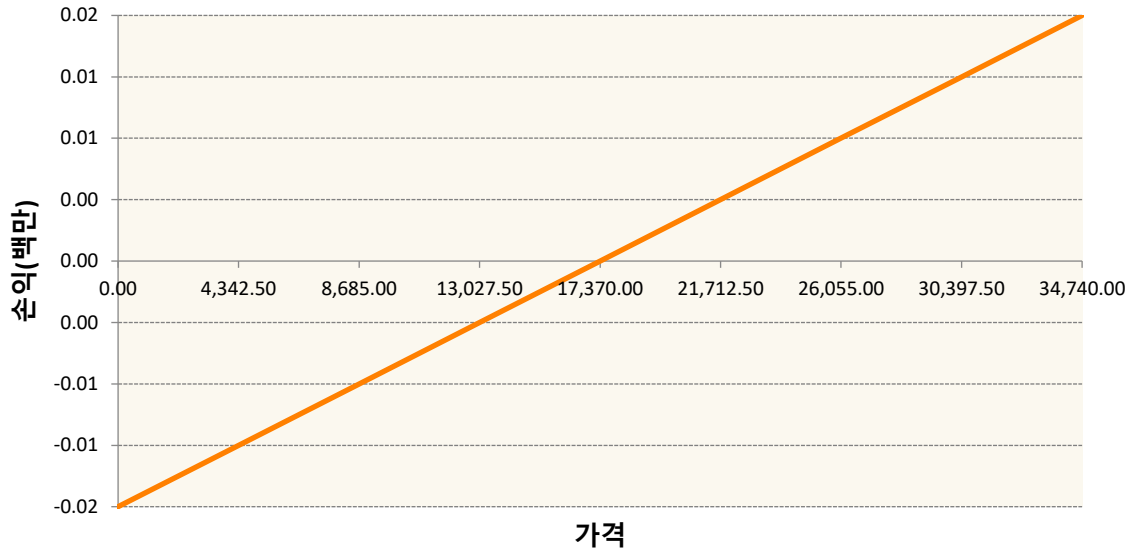
KR4A51650005-2026-05 GS건설개별선물



KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



# KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물 |         |         |        |        |        |        |        | 1,445  |
|---------------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |        |        |        |        |        |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |        |
| -8.00%                          | -1,445  | -1,445  | -1,445 | -1,445 | -1,445 | -1,445 | -1,445 | -1,445 |
| -5.33%                          | -963    | -963    | -963   | -963   | -963   | -963   | -963   | -963   |
| -2.67%                          | -482    | -482    | -482   | -482   | -482   | -482   | -482   | -482   |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                           | 482     | 482     | 482    | 482    | 482    | 482    | 482    | 482    |
| 5.33%                           | 963     | 963     | 963    | 963    | 963    | 963    | 963    | 963    |
| 8.00%                           | 1,445   | 1,445   | 1,445  | 1,445  | 1,445  | 1,445  | 1,445  | 1,445  |
| KR4A11640005 2026-04 삼성전자개별선물   |         |         |        |        |        |        |        | 162    |
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |        |        |        |        |        |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |        |
| -8.00%                          | -162    | -162    | -162   | -162   | -162   | -162   | -162   | -162   |
| -5.33%                          | -108    | -108    | -108   | -108   | -108   | -108   | -108   | -108   |
| -2.67%                          | -54     | -54     | -54    | -54    | -54    | -54    | -54    | -54    |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                           | 54      | 54      | 54     | 54     | 54     | 54     | 54     | 54     |
| 5.33%                           | 108     | 108     | 108    | 108    | 108    | 108    | 108    | 108    |
| 8.00%                           | 162     | 162     | 162    | 162    | 162    | 162    | 162    | 162    |
| KR4A50640007 2026-04 SK하이닉스개별선물 |         |         |        |        |        |        |        | 79     |
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |        |        |        |        |        |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |        |
| -8.00%                          | -79     | -79     | -79    | -79    | -79    | -79    | -79    | -79    |
| -5.33%                          | -53     | -53     | -53    | -53    | -53    | -53    | -53    | -53    |
| -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%                         | 53      | 53      | 53     | 53   | 53    | 53     | 53     |
| 8.00%                         | 79      | 79      | 79     | 79   | 79    | 79     | 79     |
| KR4A51650005 2026-05 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    |
| KR4ACF650006 2026-05 카카오개별선물  |         |         |        |      |       |        | 118    |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | 118     | 118     | 118    | 118  | 118   | 118    | 118    |
| -5.33%                        | 79      | 79      | 79     | 79   | 79    | 79     | 79     |
| -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%                         | -79     | -79     | -79    | -79  | -79   | -79    | -79    |
| 8.00%                         | -118    | -118    | -118   | -118 | -118  | -118   | -118   |
| 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)

4,026

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

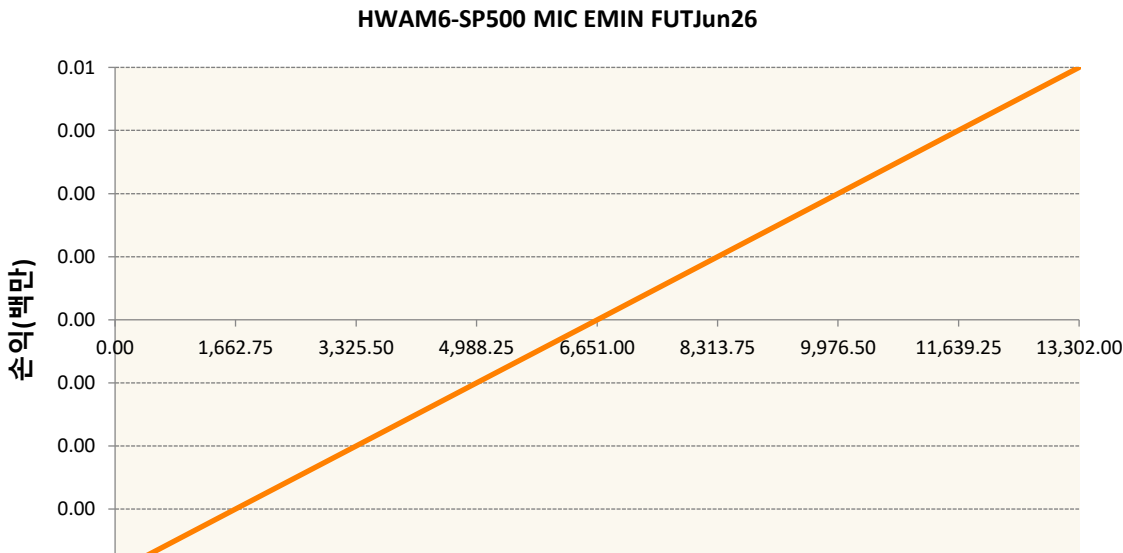
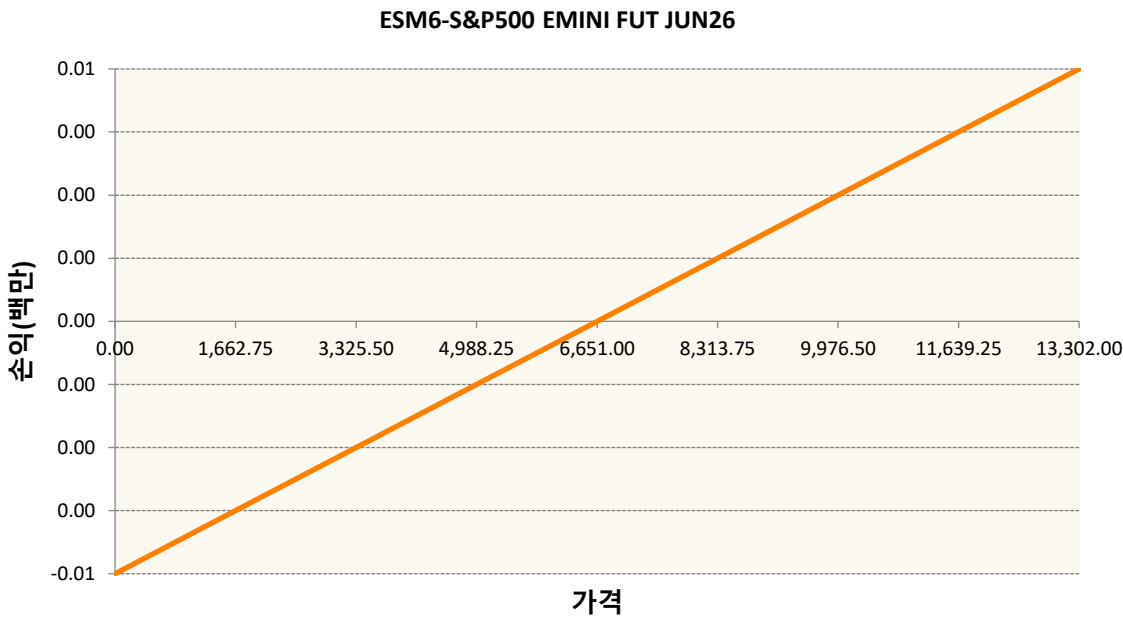
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

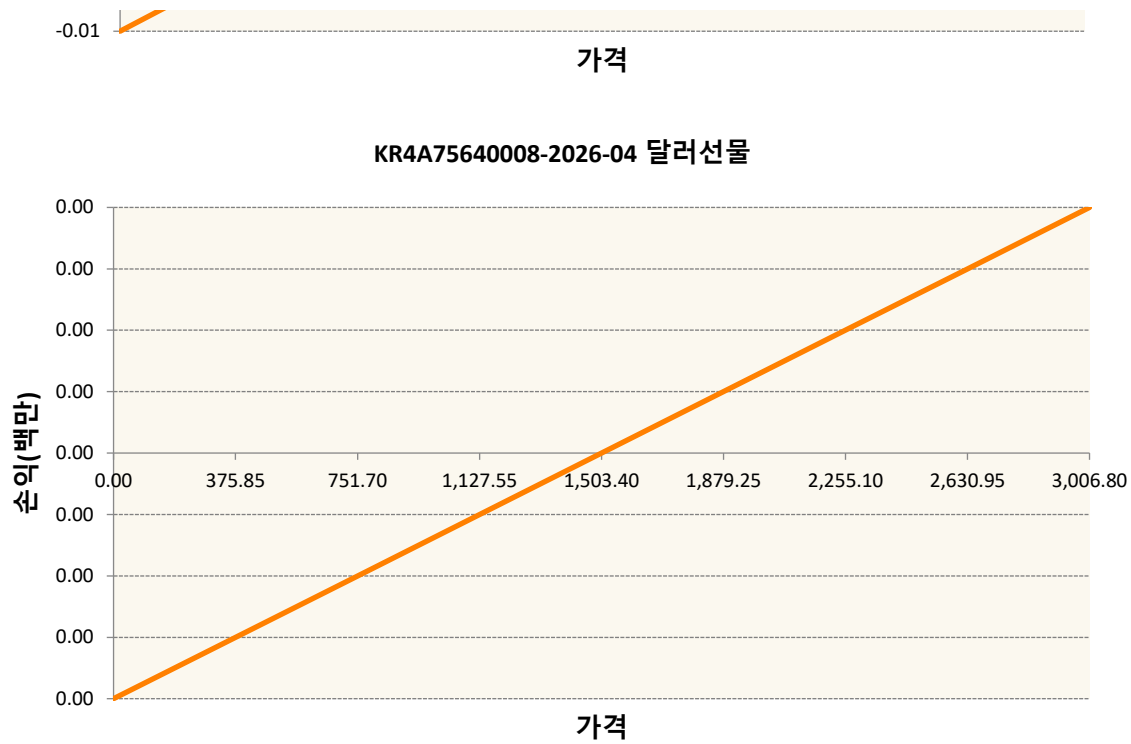
(단위:백만원)

| 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   | 54,916 | 0     | 54,916    |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 151    | 0     | 151       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선물   | 12,478 | 0     | 12,478    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조







### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                         |       |
|------------|-------------------------|-------|
| ESM6       | S&P500 EMINI FUT JUN26  | 4,393 |
| HWAM6      | SP500 MIC EMIN FUTJun26 | 12    |
| KR4A756400 | 2026-04 달러선물            | 998   |

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

(단위:백만원)

3,843

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

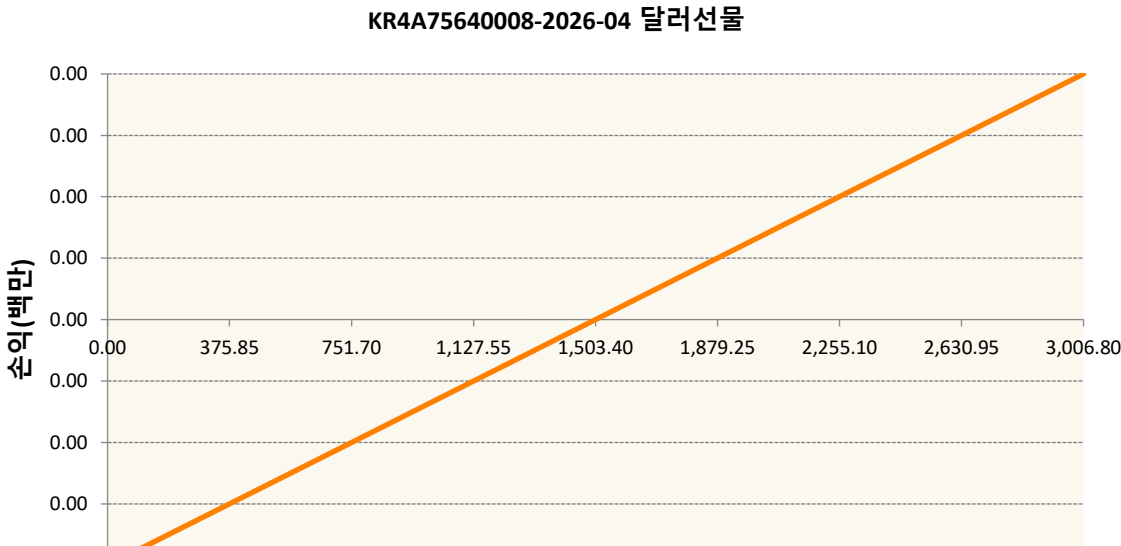
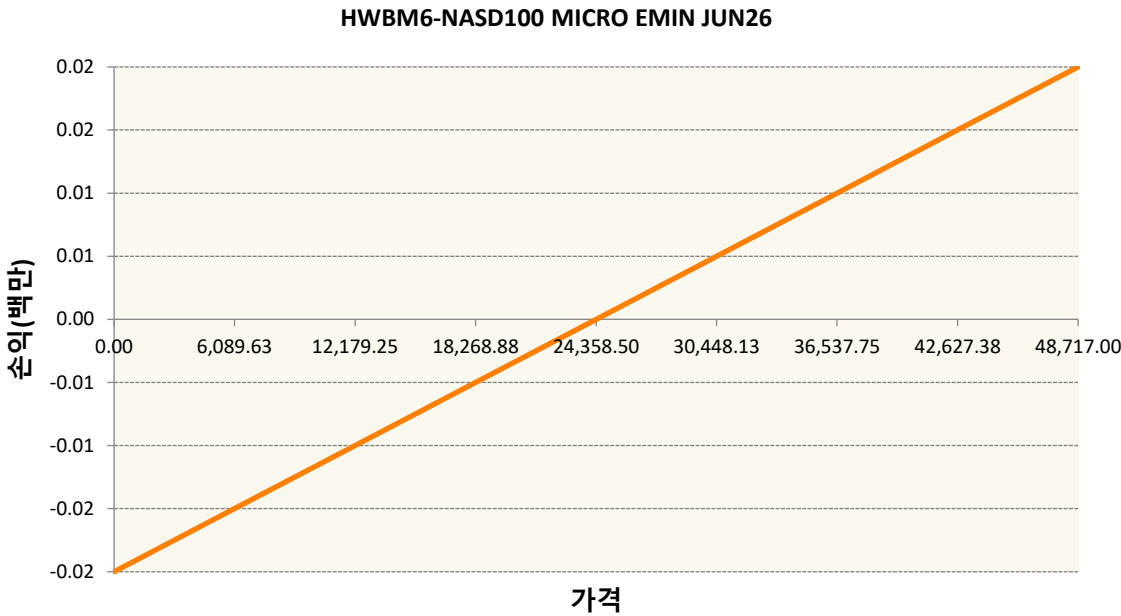
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

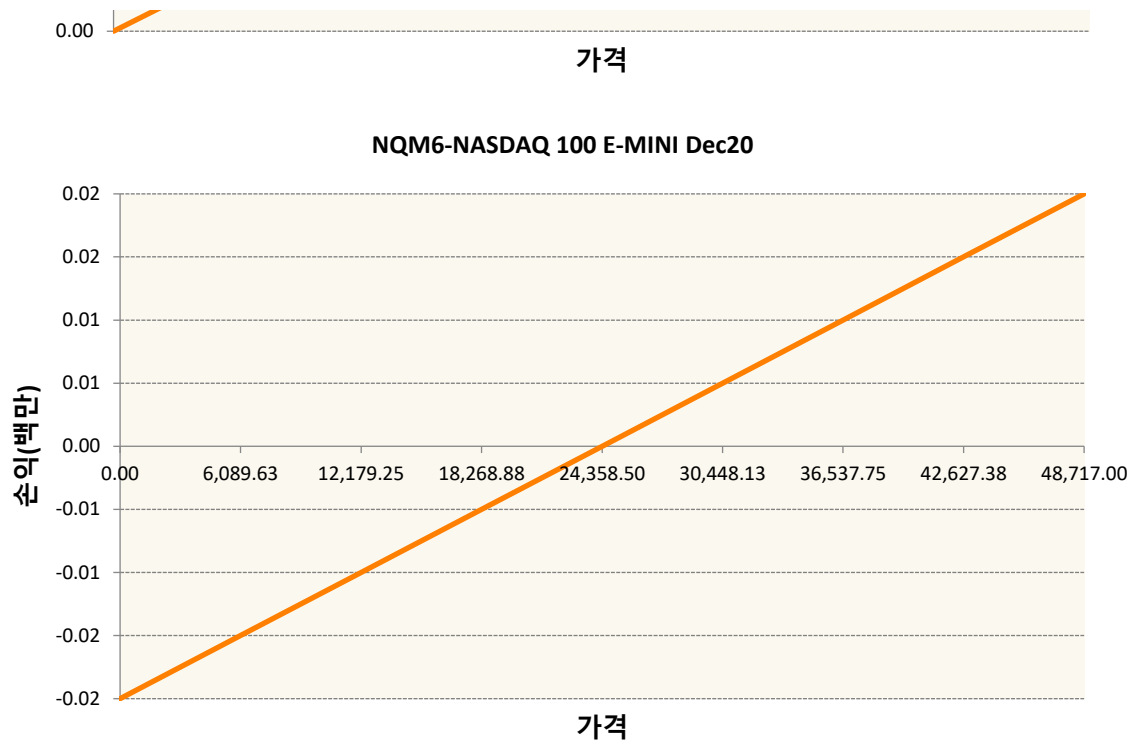
### 1. 계약금액

(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   | 22,670 | 0     | 22,670    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 147    | 0     | 147       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선물   | 5,036  | 0     | 5,036     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBM6 NASD100 MICRO EMIN JUN26

12

KR4A756400 2026-04 달러선물

403

NQM6 NASDAQ 100 E-MINI Dec20

1,814

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

(단위:백만원)

2,015

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-04-08 |
| 기준일 | 2026-04-07 |

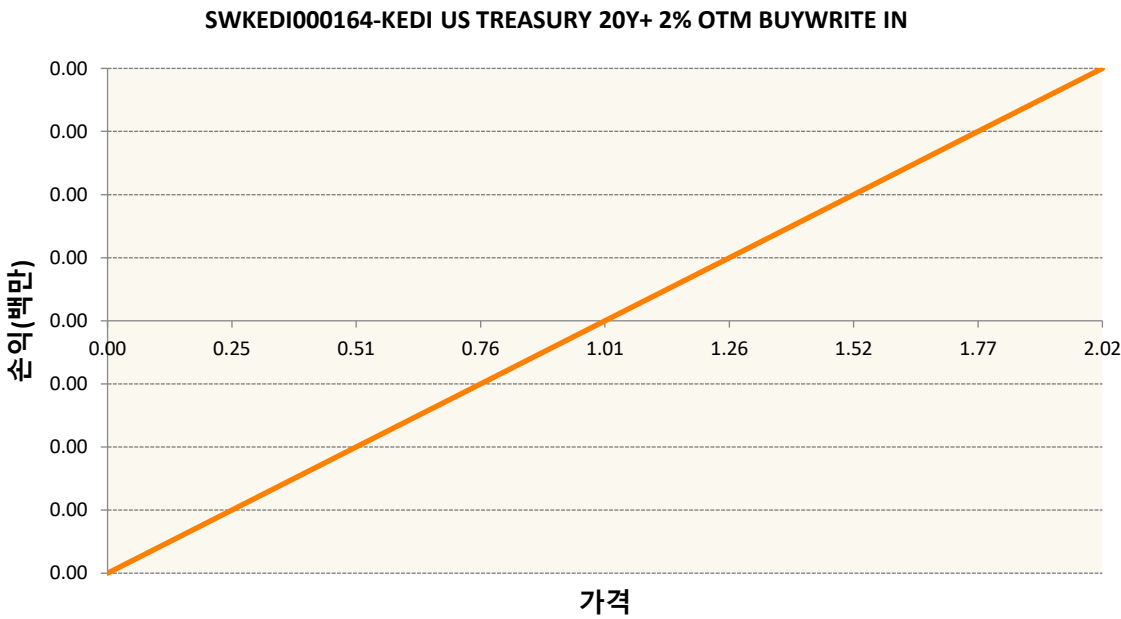
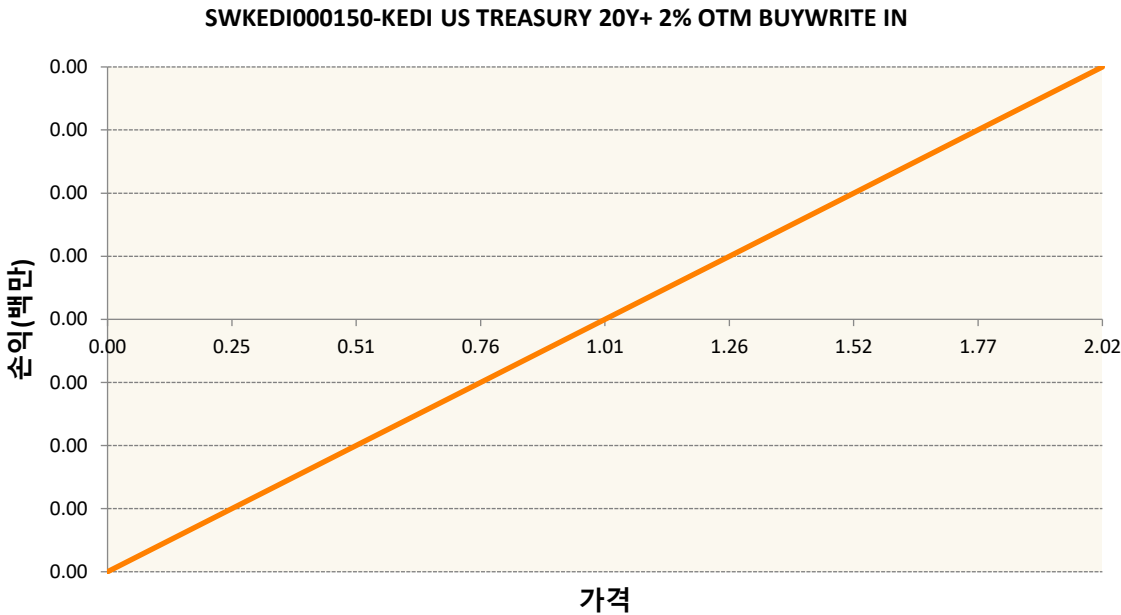
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

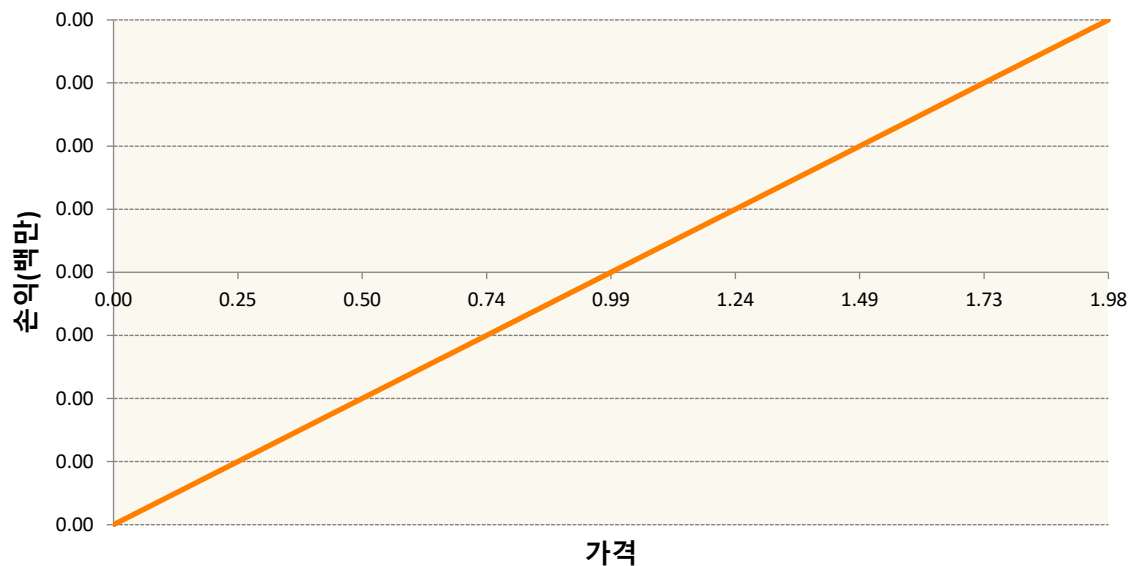
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 366,735 | 0     | 366,735   | 장외 |

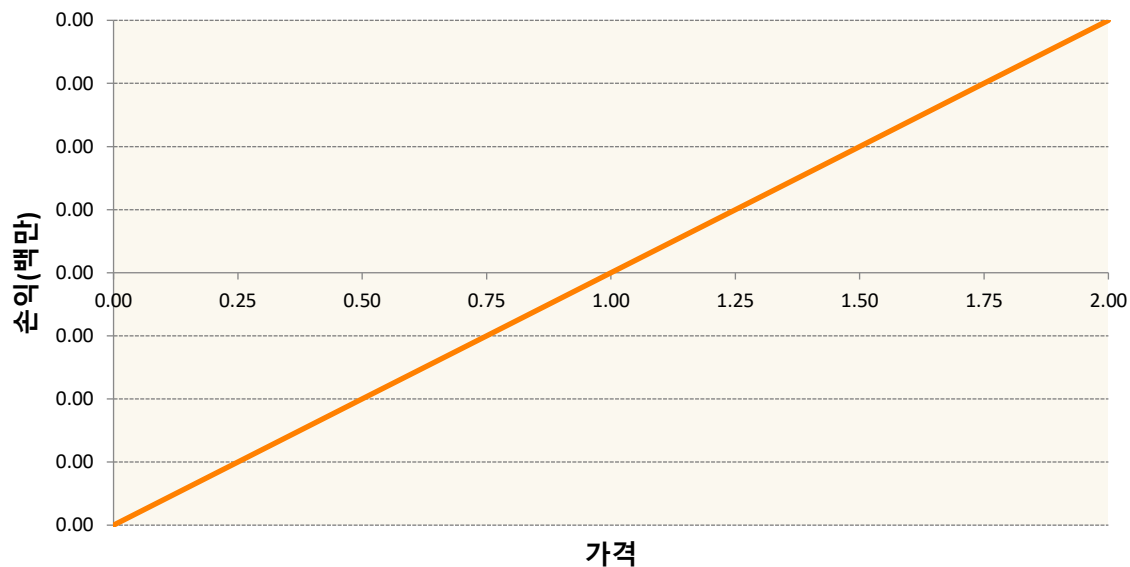
### 2. 만기시점의 손익구조



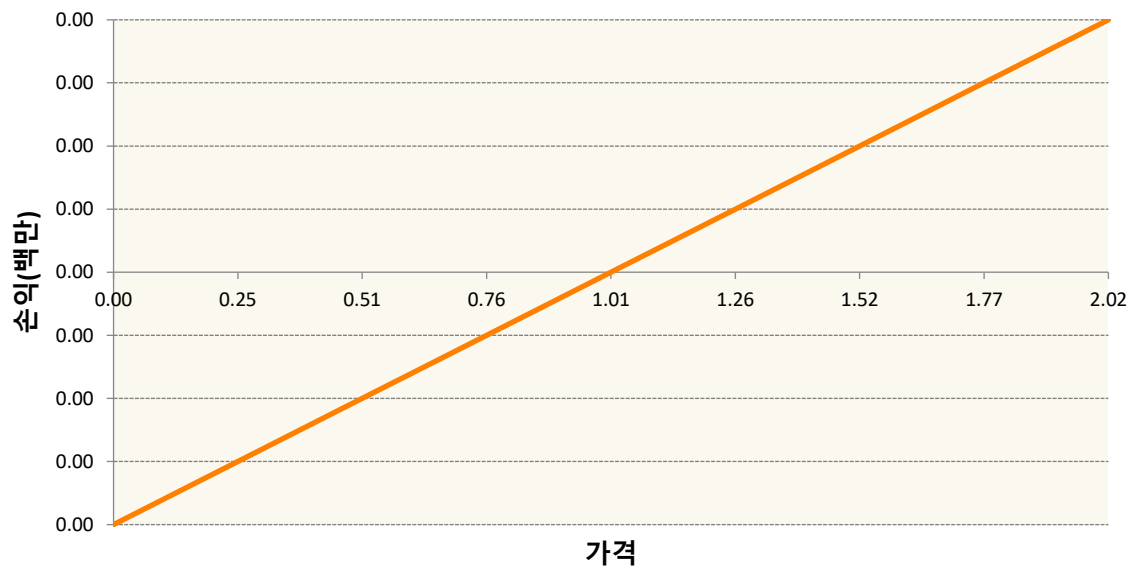
SWKEDI000169-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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 |  | 8,459    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 155      |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 9,423    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 7,849    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 3,473    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 12,641   |

공시일 2026-04-08

기준일 2026-04-07

## 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