

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

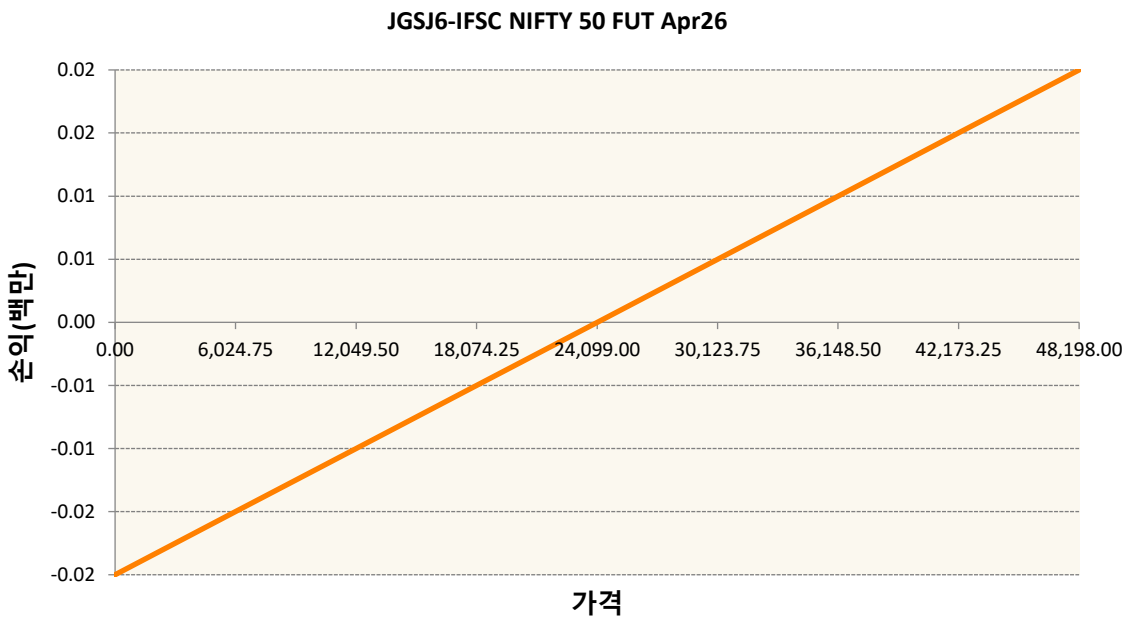
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	653	0	653	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ6	IFSC NIFTY 50 FUT Apr26	52
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

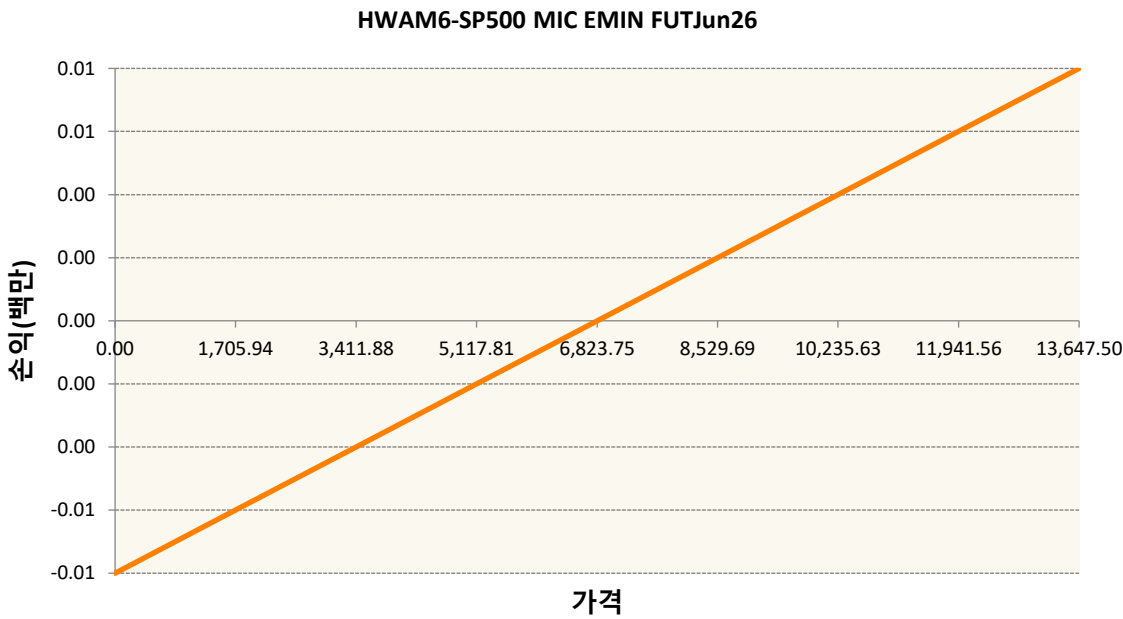
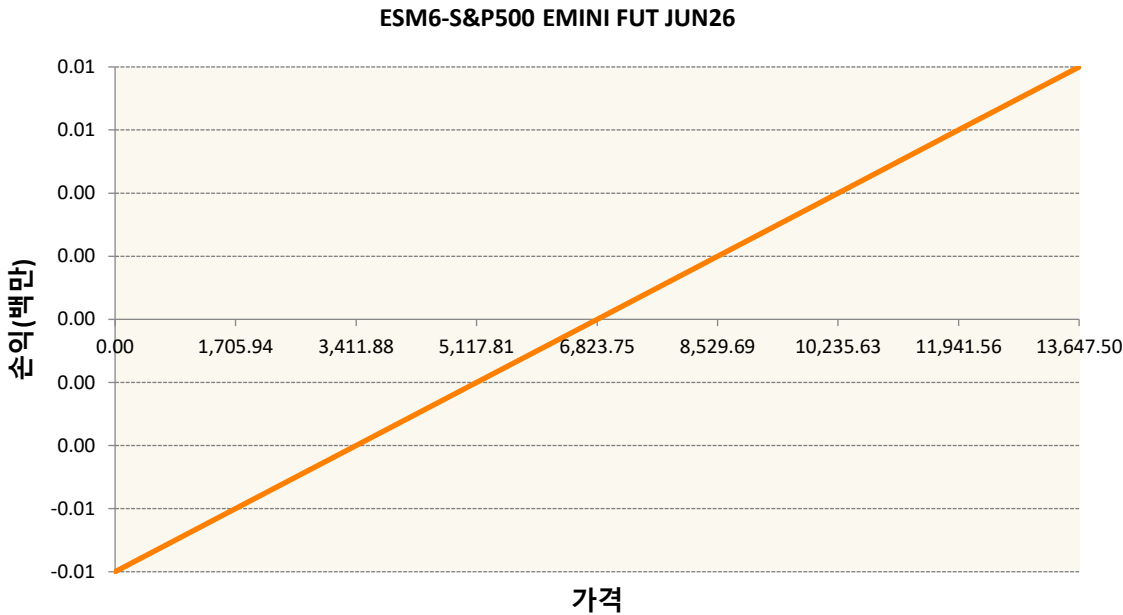
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	512	0	512	
누계	지수	선물	205	0	205	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	41
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	16

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

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

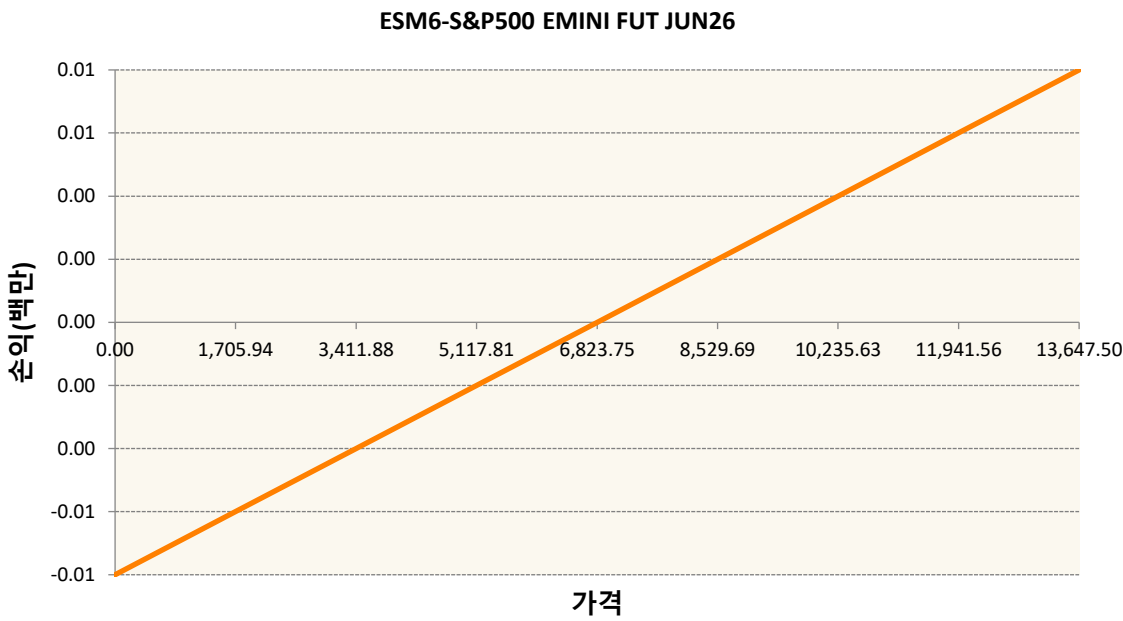
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,024	0	1,024	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	82
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

72

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

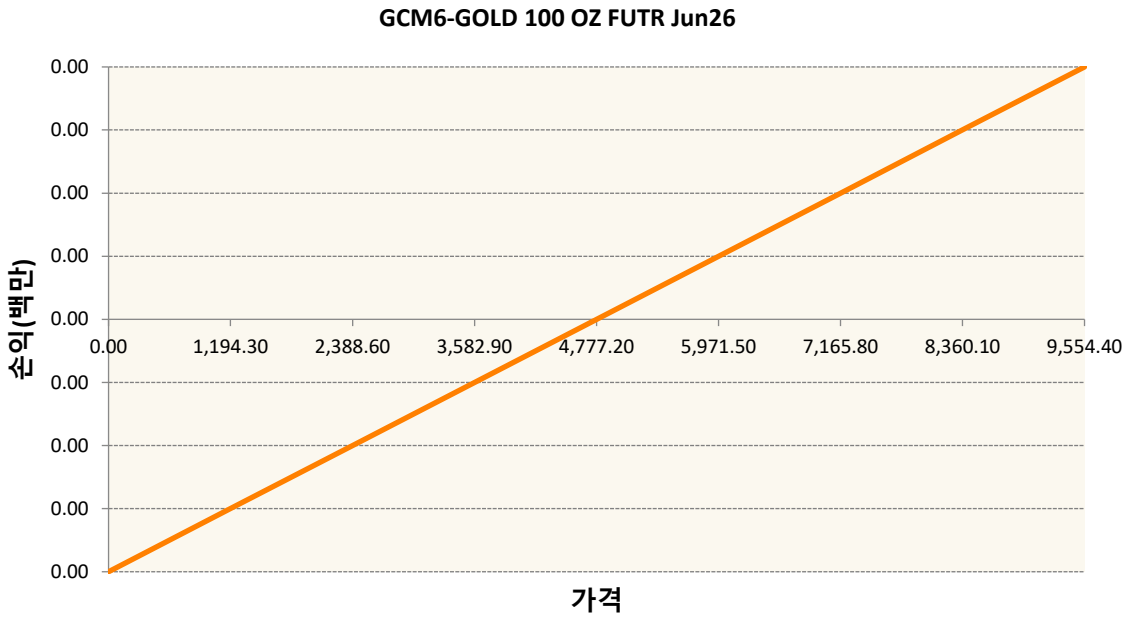
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,039	0	5,039	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 04/10/26 C435 EQUITY	19
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	403

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

(단위:백만원)

530

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

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	218
AOPLTRUP1!PLTR US 04/10/26 P152.5 EQUITY	1

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

(단위:백만원)

731

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

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

20

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

(단위:백만원)

13

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

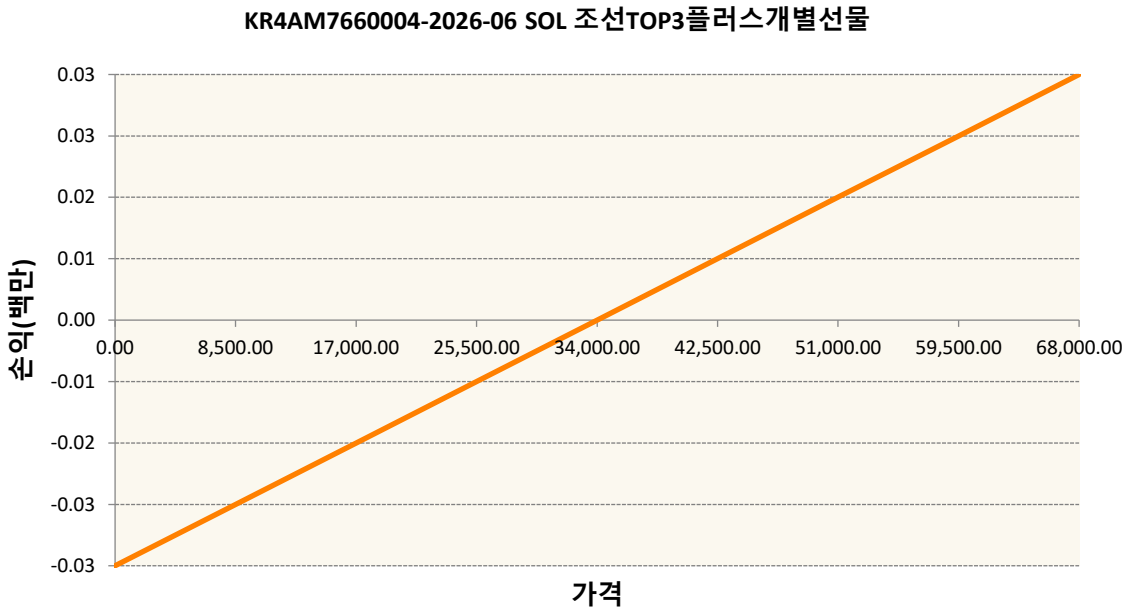
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	149,960	0	149,960	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-04-10

기준일 2026-04-09

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	2026-04-10
기준일	2026-04-09

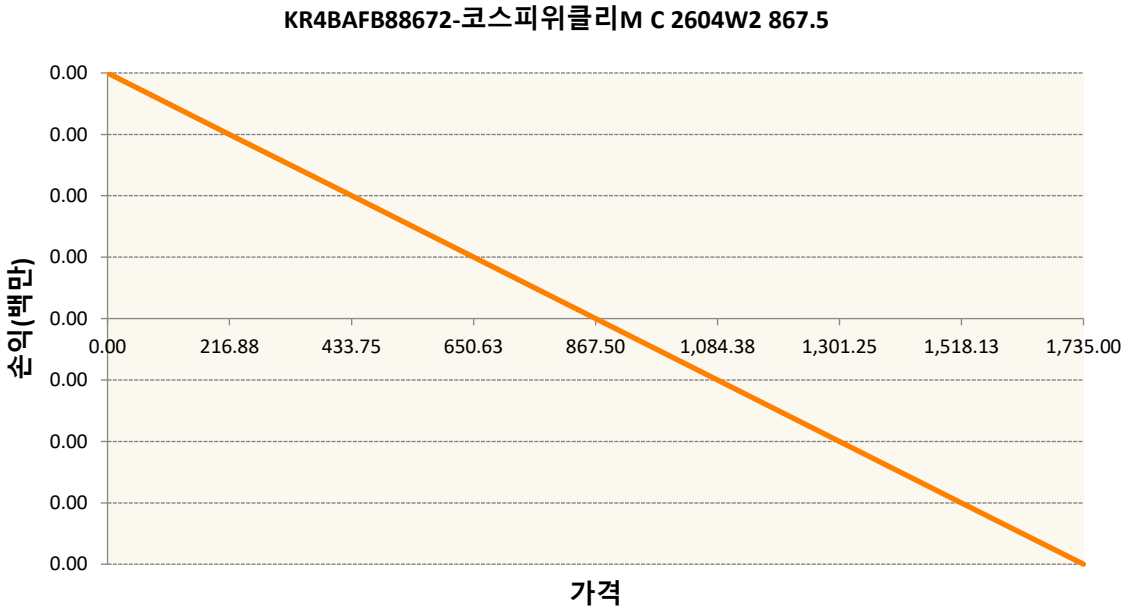
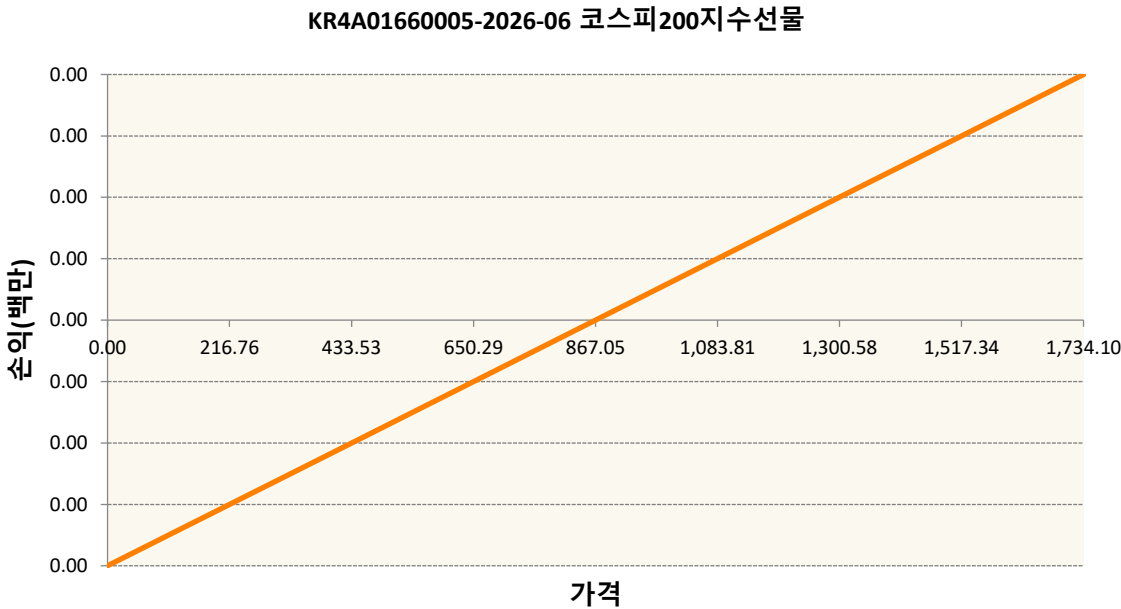
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

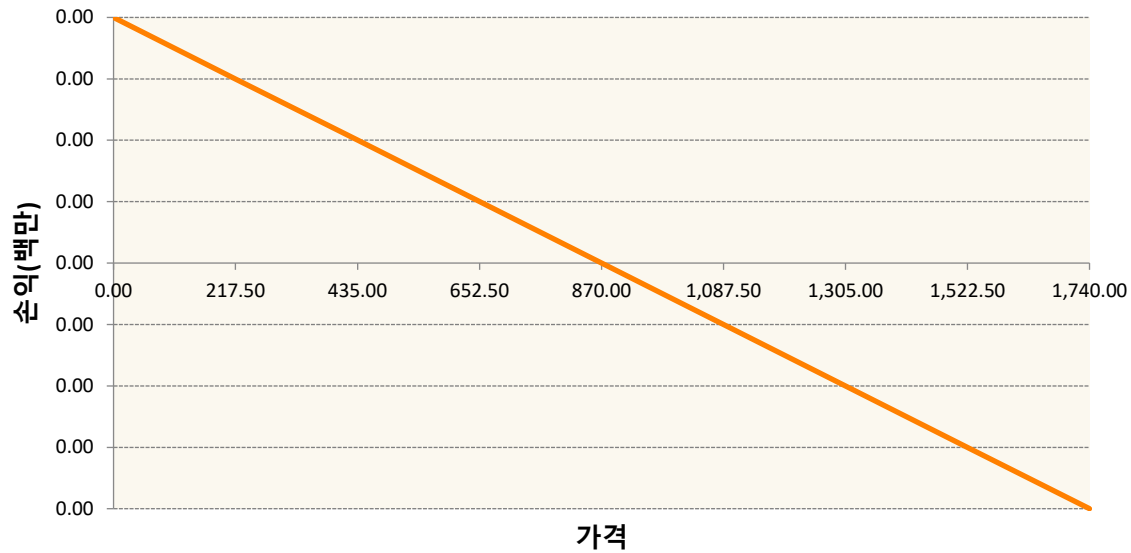
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	17,405	-17,405	장내
누계	유가증권	선물	5,636	17,153	-11,517	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4BAFB88706-코스피위클리M C 2604W2 870.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					450
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450
-5.33%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300
-2.67%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	150	150	150	150	150	150	150
5.33%	300	300	300	300	300	300	300
8.00%	450	450	450	450	450	450	450
KR4BAFB88672		코스피위클리M C 2604W2 867.5					814
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	814	814	814	814	814	814	814
-5.33%	543	543	543	543	543	543	543
-2.67%	271	271	271	271	271	271	271
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-271	-271	-271	-271	-271	-271	-271
5.33%	-543	-543	-543	-543	-543	-543	-543
8.00%	-814	-814	-814	-814	-814	-814	-814
KR4BAFB88706		코스피위클리M C 2604W2 870.0					554
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	554	554	554	554	554	554	554
-5.33%	369	369	369	369	369	369	369
-2.67%	185	185	185	185	185	185	185
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
5.33%	-369	-369	-369	-369	-369	-369	-369
8.00%	-554	-554	-554	-554	-554	-554	-554

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

(단위:백만원)

3,935

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

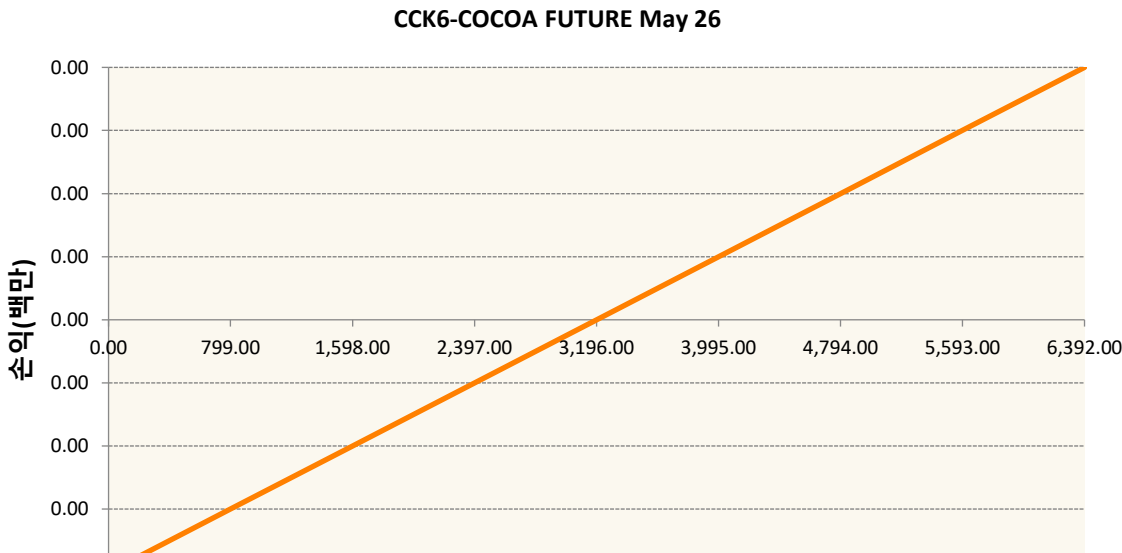
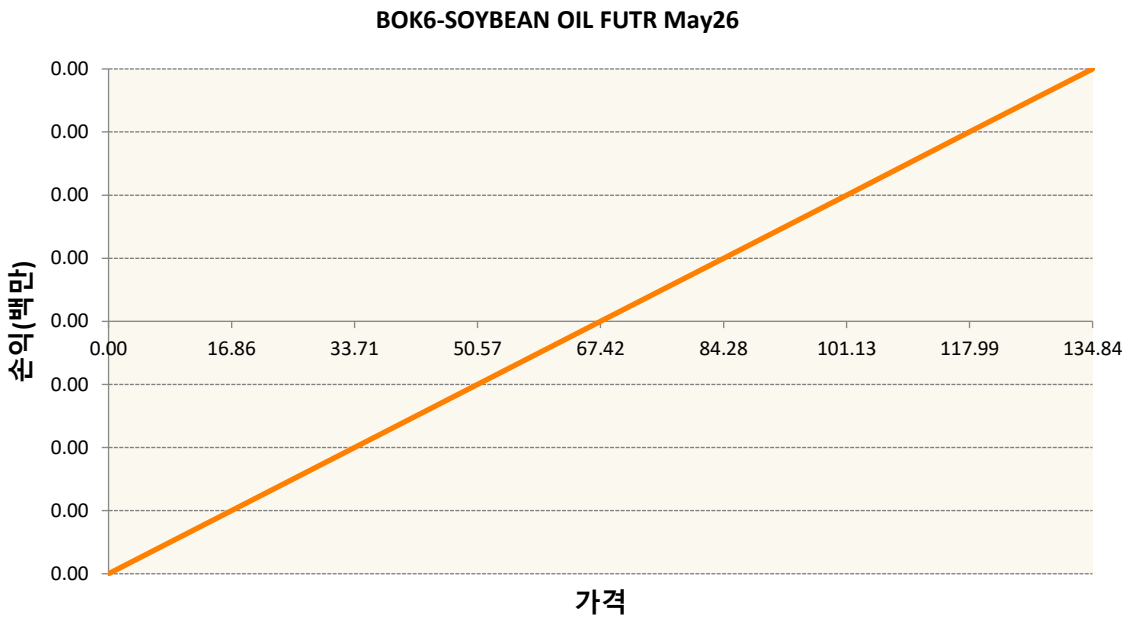
포커스농산물모(채권-파생형)

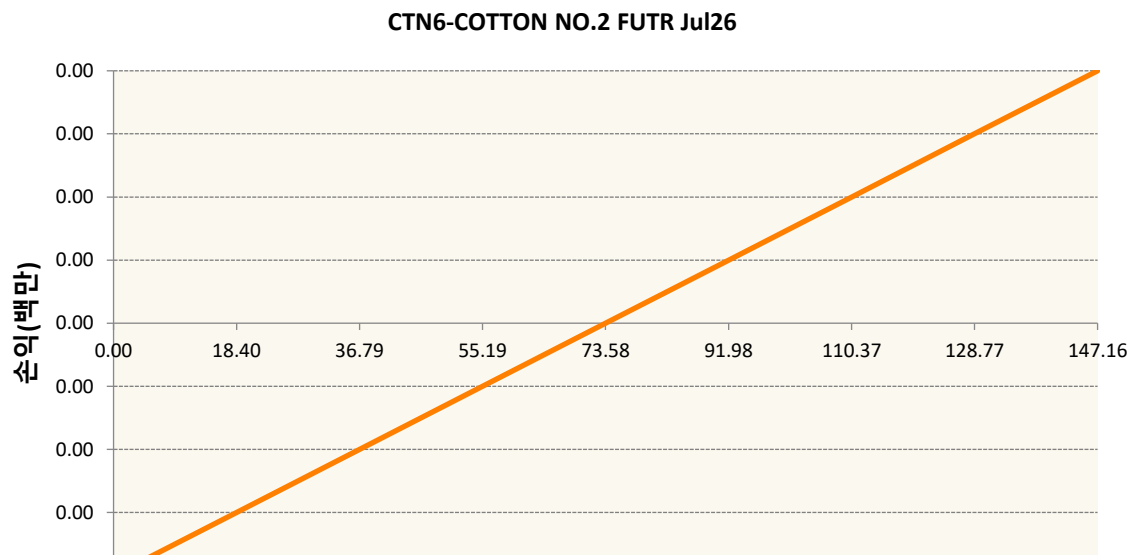
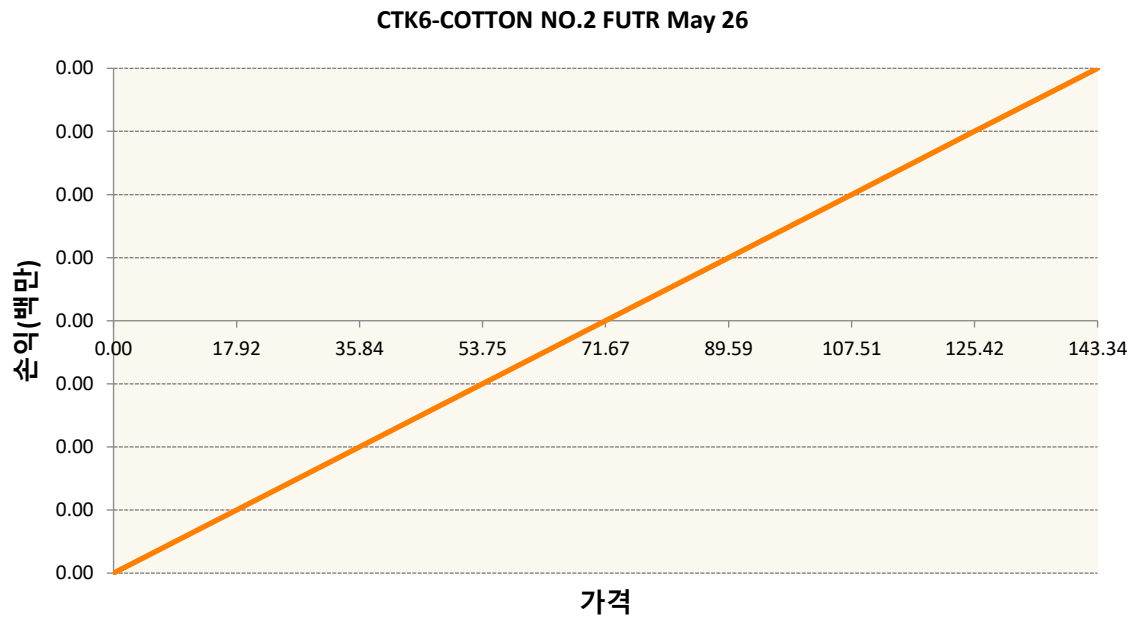
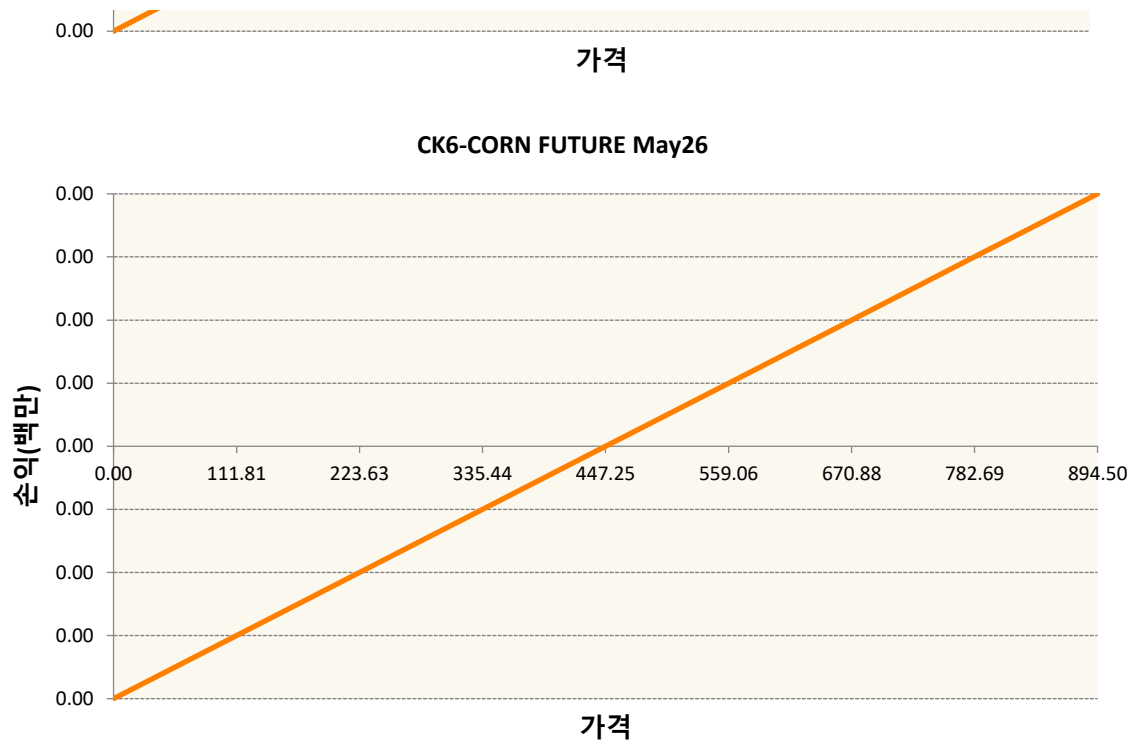
1. 계약금액

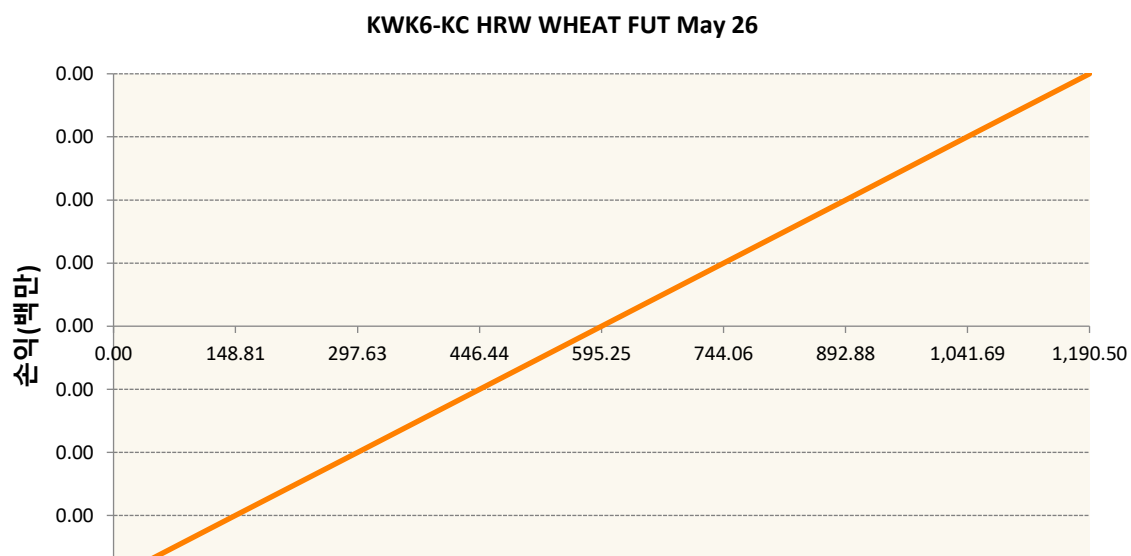
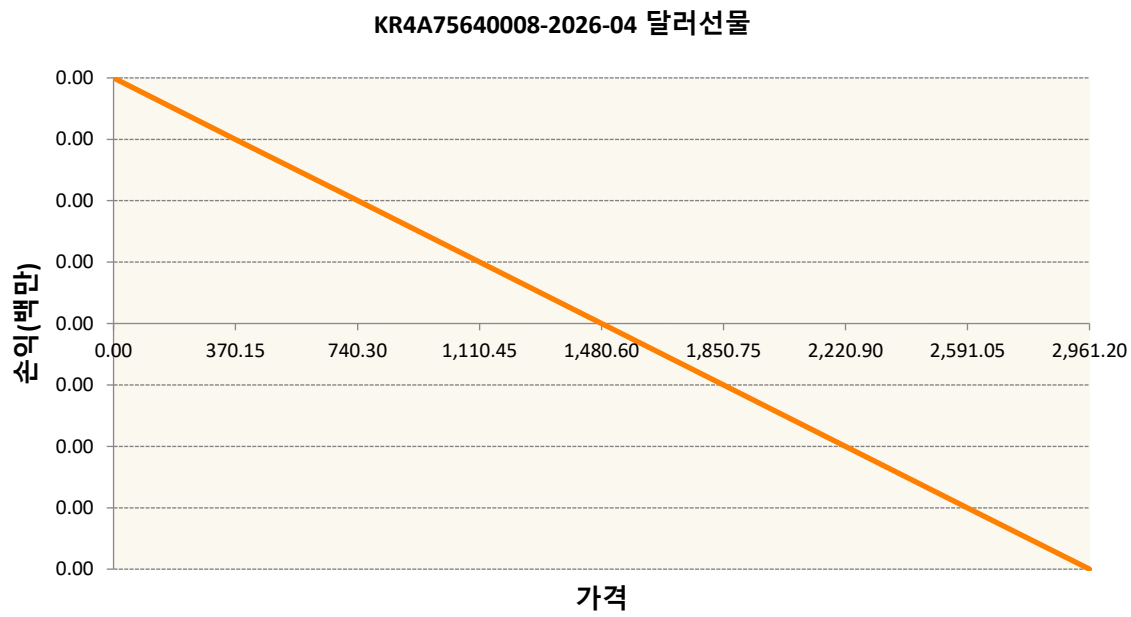
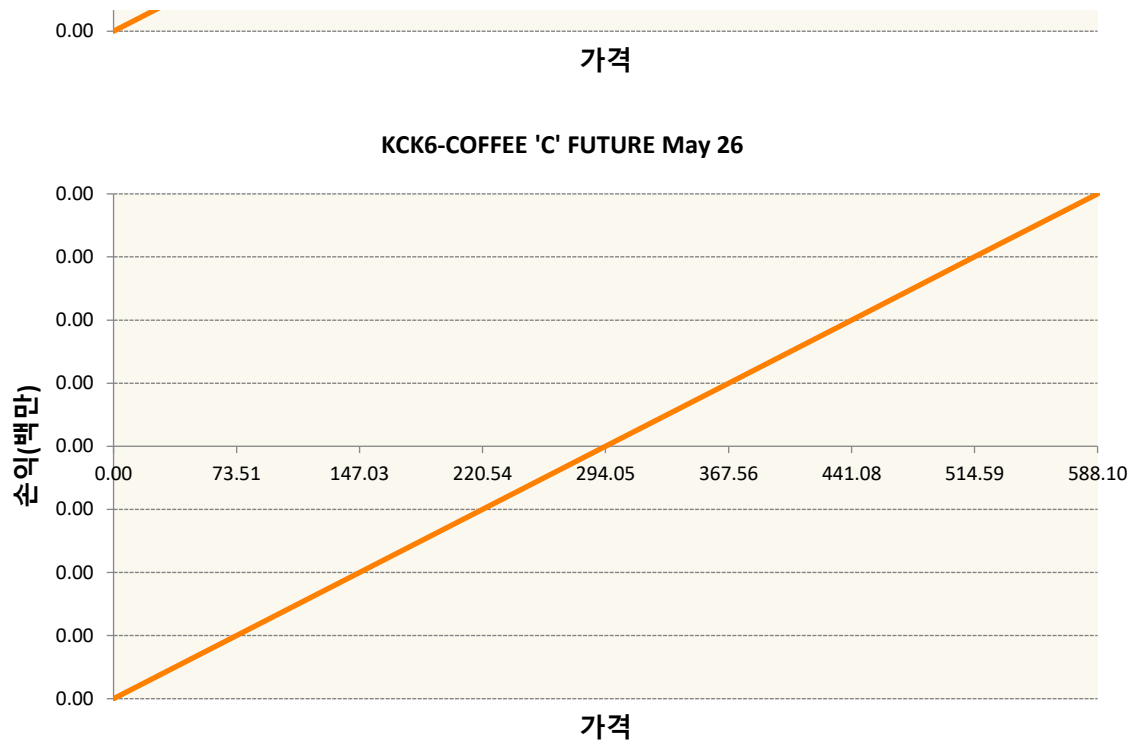
(단위:USD 백만)

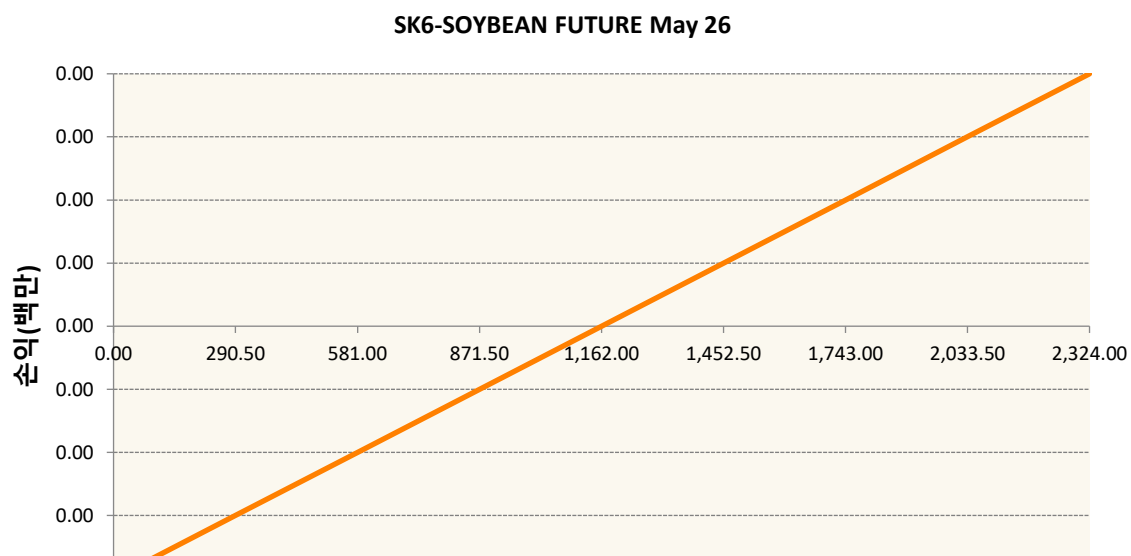
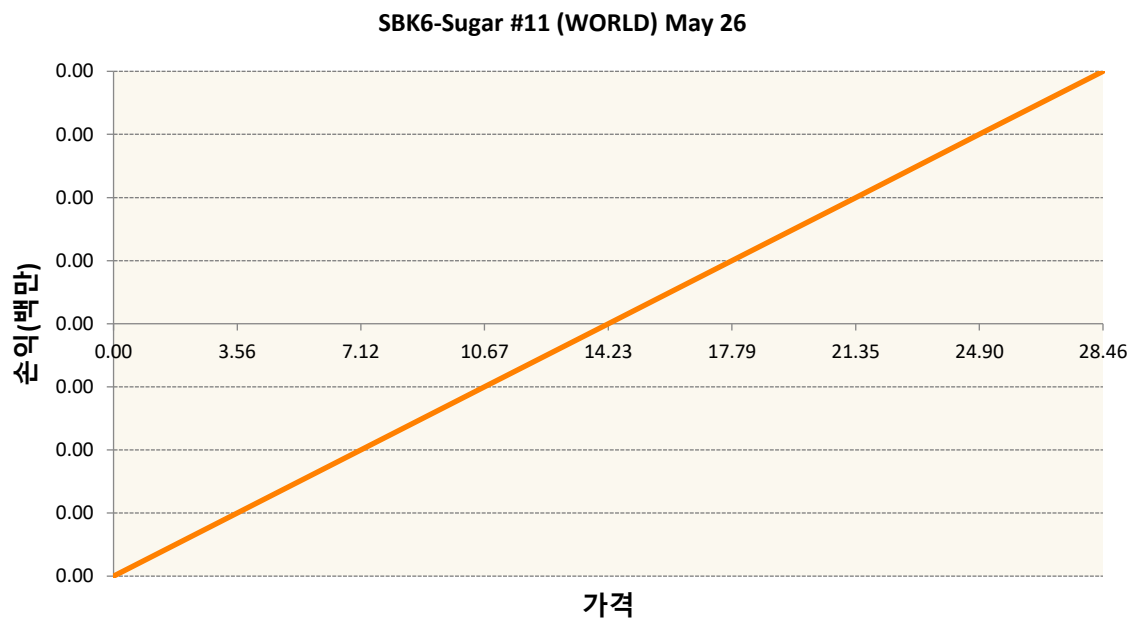
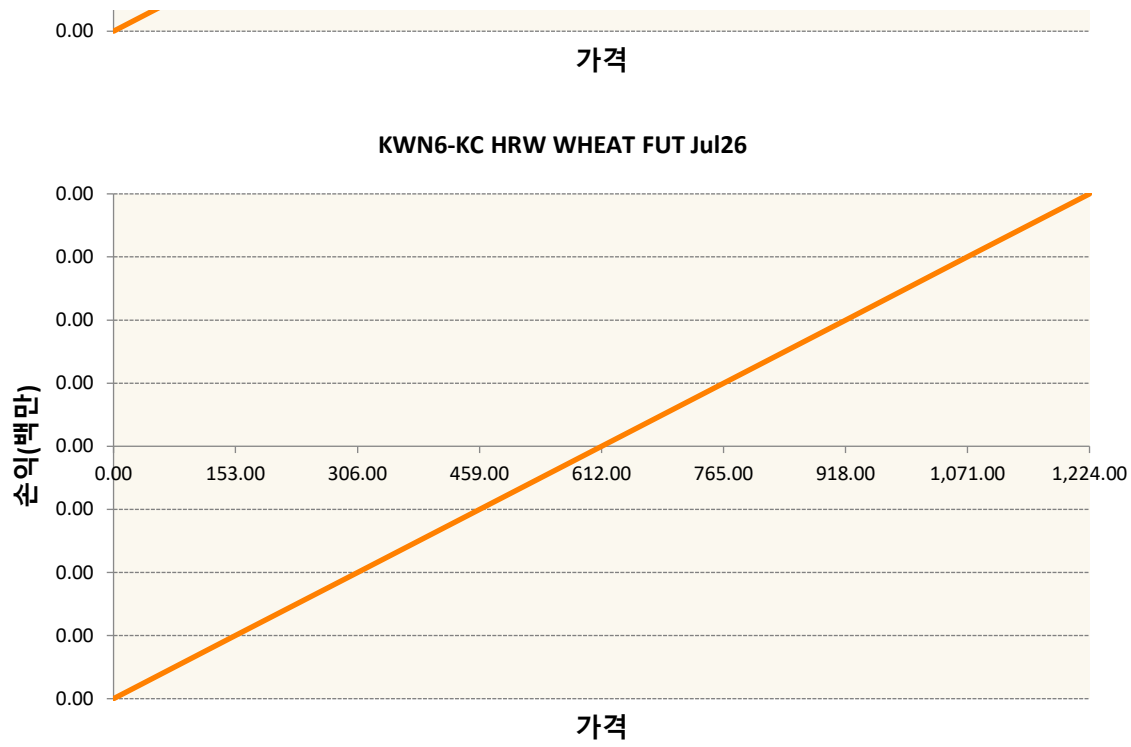
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,279	0	1,279	
누계	유가증권	선물	1,658	0	1,658	
누계	통화	선물	0	355	-355	장내

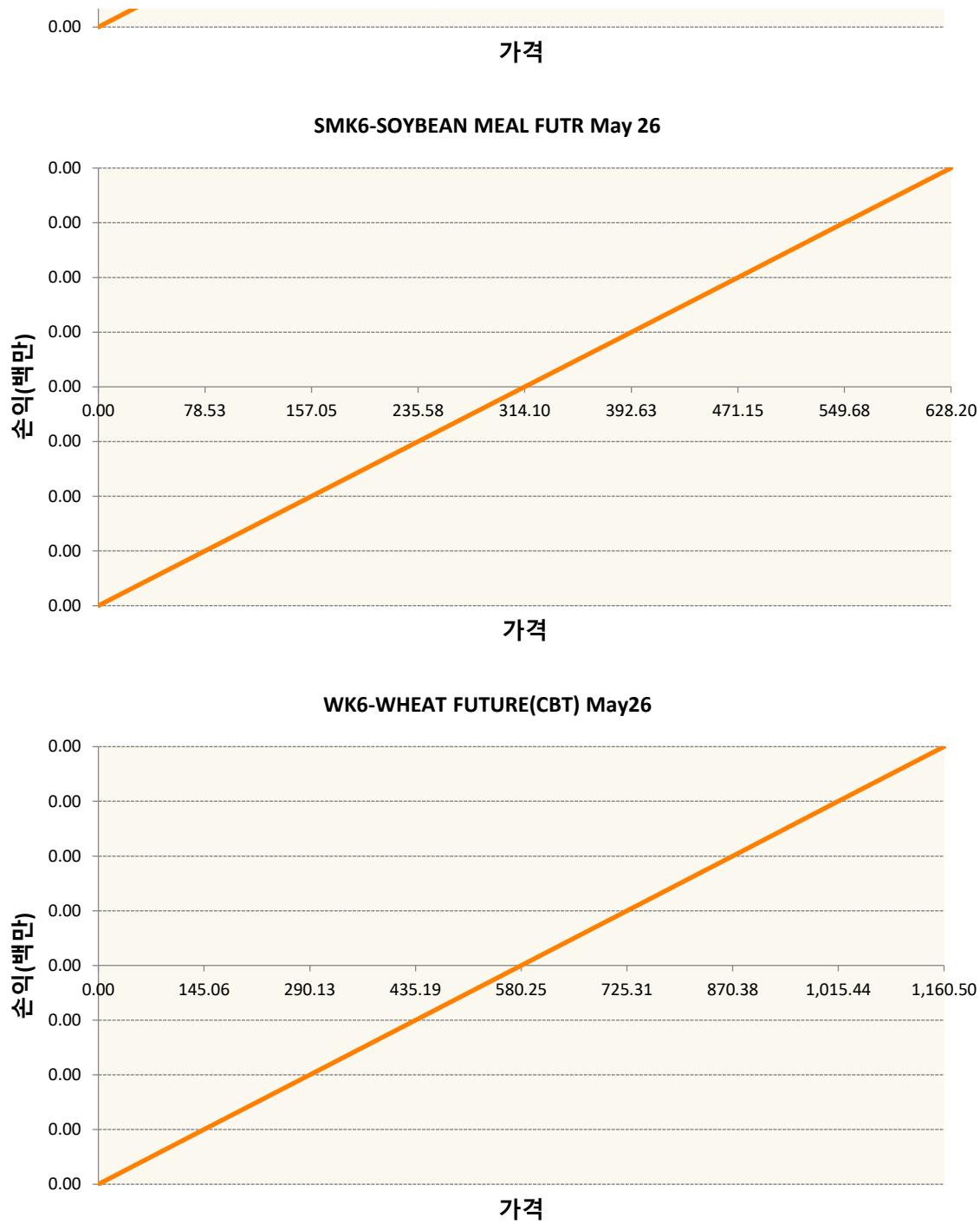
2. 만기시점의 손익구조











3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

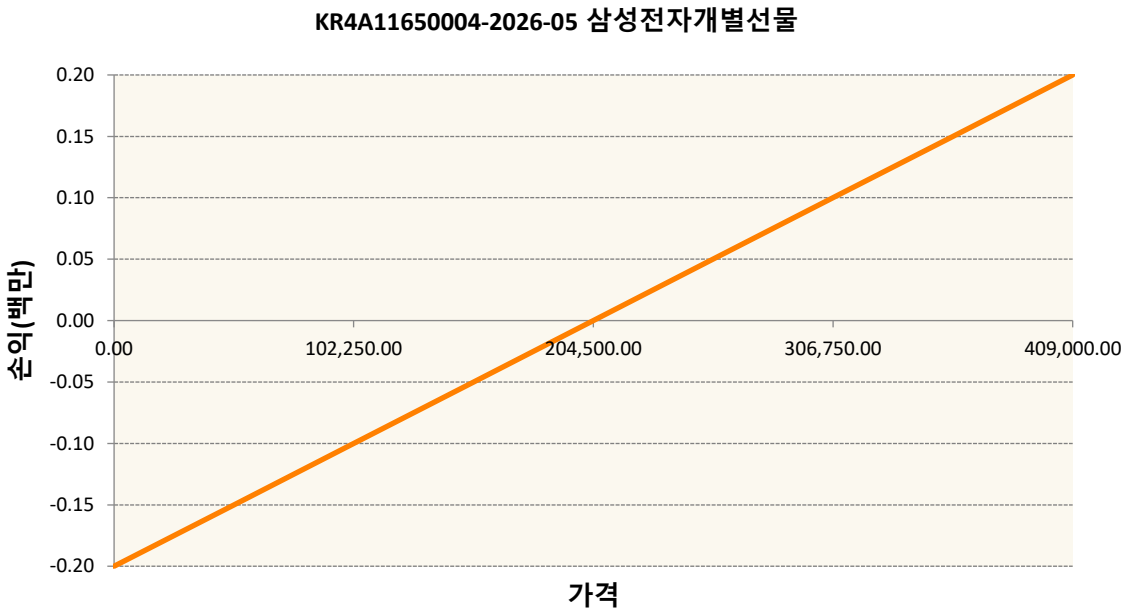
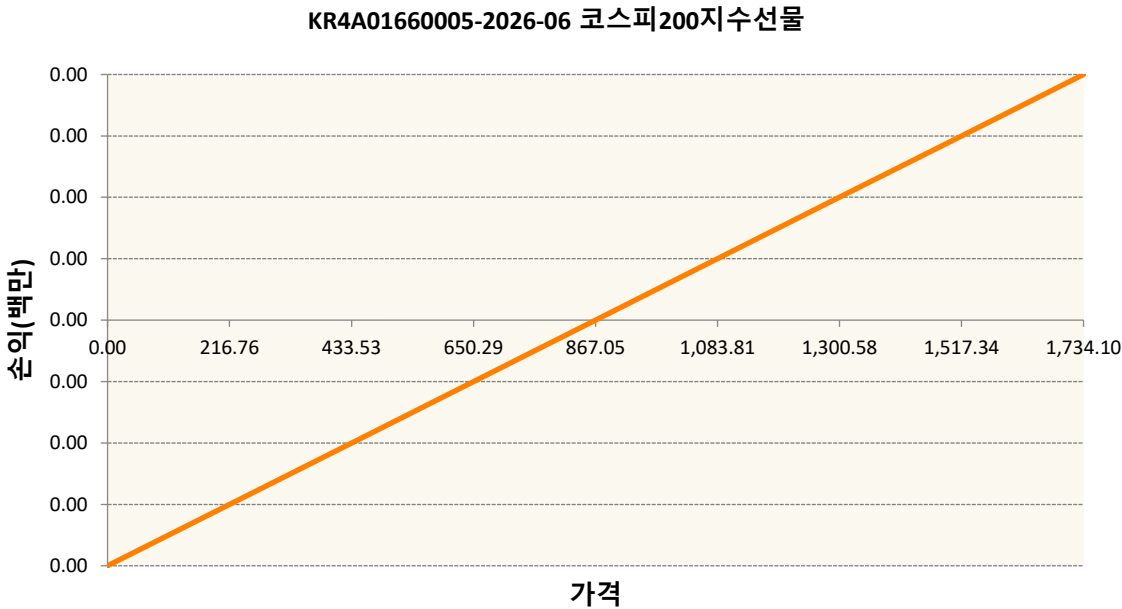
스마트인덱스모

1. 계약금액

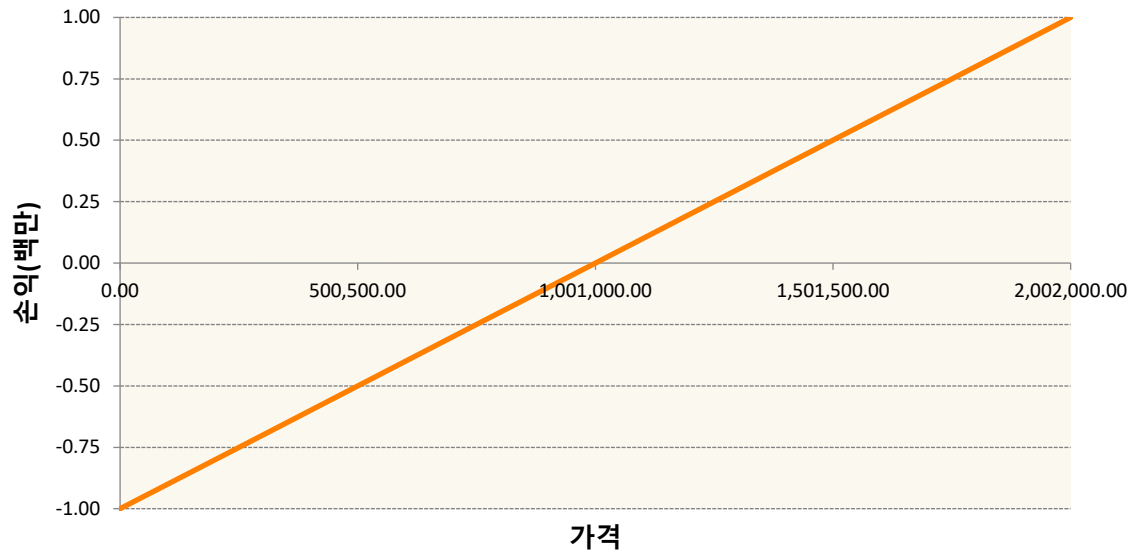
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	572	0	572	장내
누계	유가증권	선물	3,173	0	3,173	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								208
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-5.33%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	69	69	69	69	69	69	69	69
5.33%	139	139	139	139	139	139	139	139
8.00%	208	208	208	208	208	208	208	208
KR4A11650004 2026-05 삼성전자개별선물								37
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	25	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	37	37	37	37	37	37	37	37
KR4A50650006 2026-05 SK하이닉스개별선물								9
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	574

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

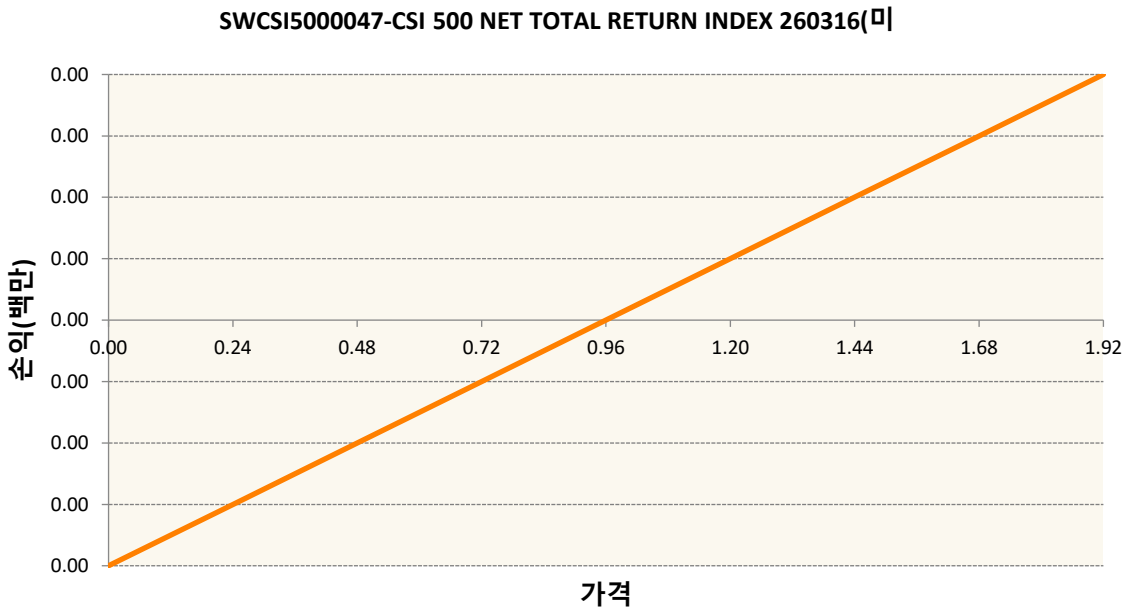
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,418	0	5,418	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

433

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

593

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

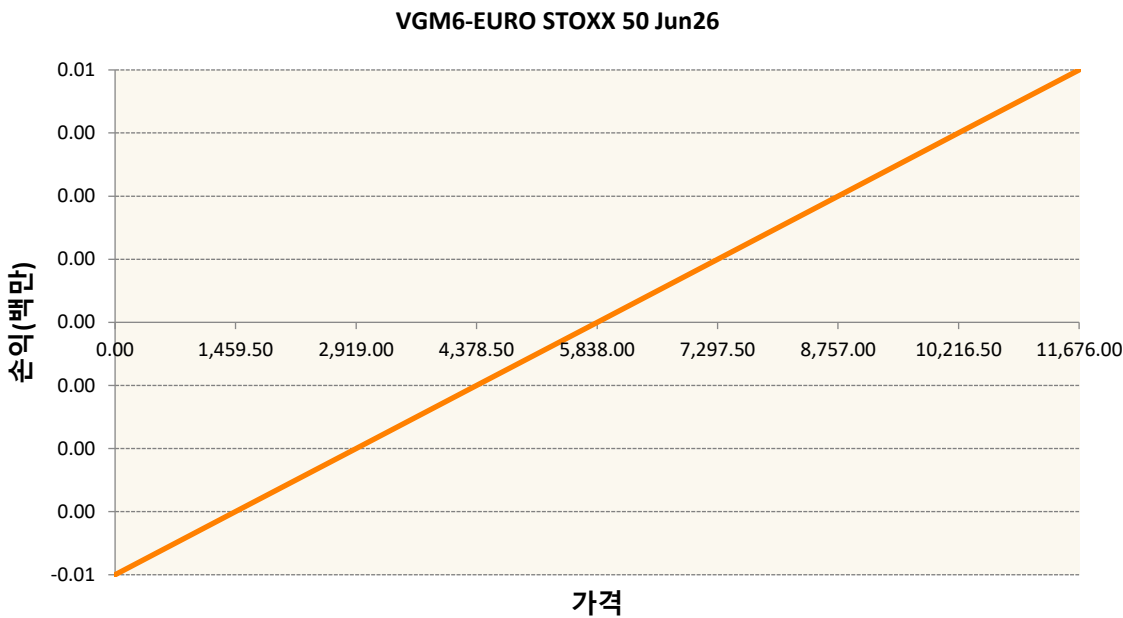
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	900	0	900	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

62

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

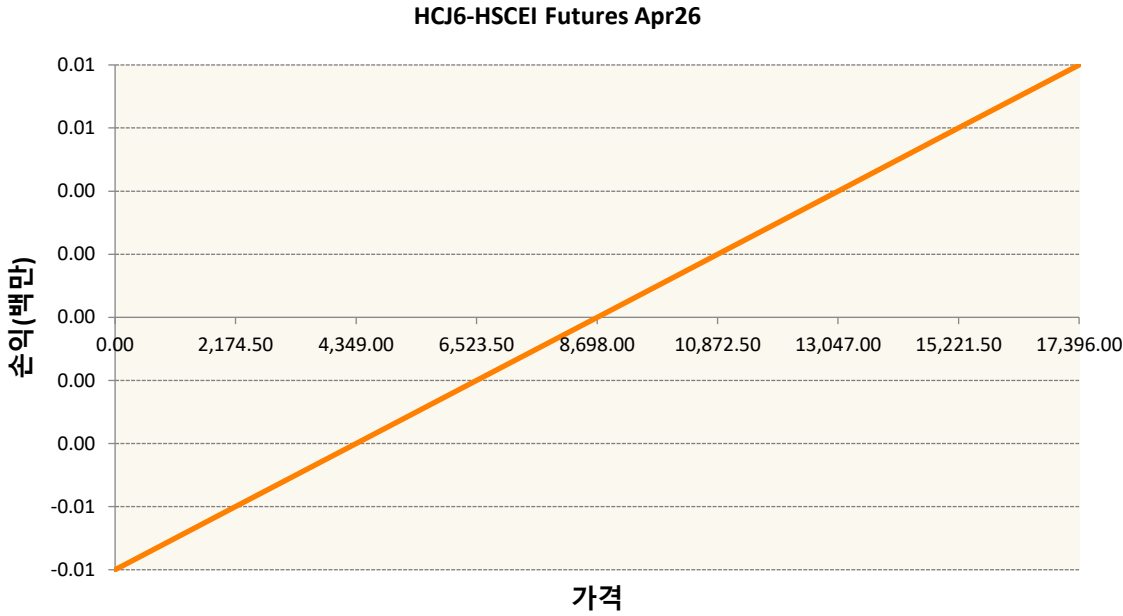
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,674	0	1,674	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ6	HSCEI Futures Apr26	134
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

163

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

(단위:백만원)

1,724

공시일 2026-04-10

기준일 2026-04-09

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	2026-04-10
기준일	2026-04-09

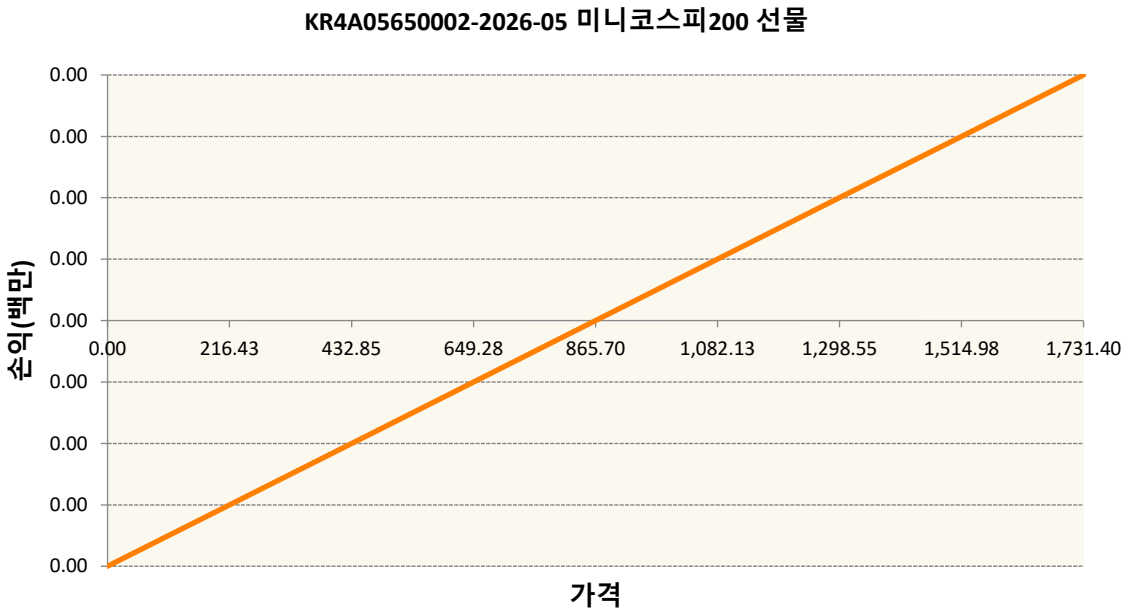
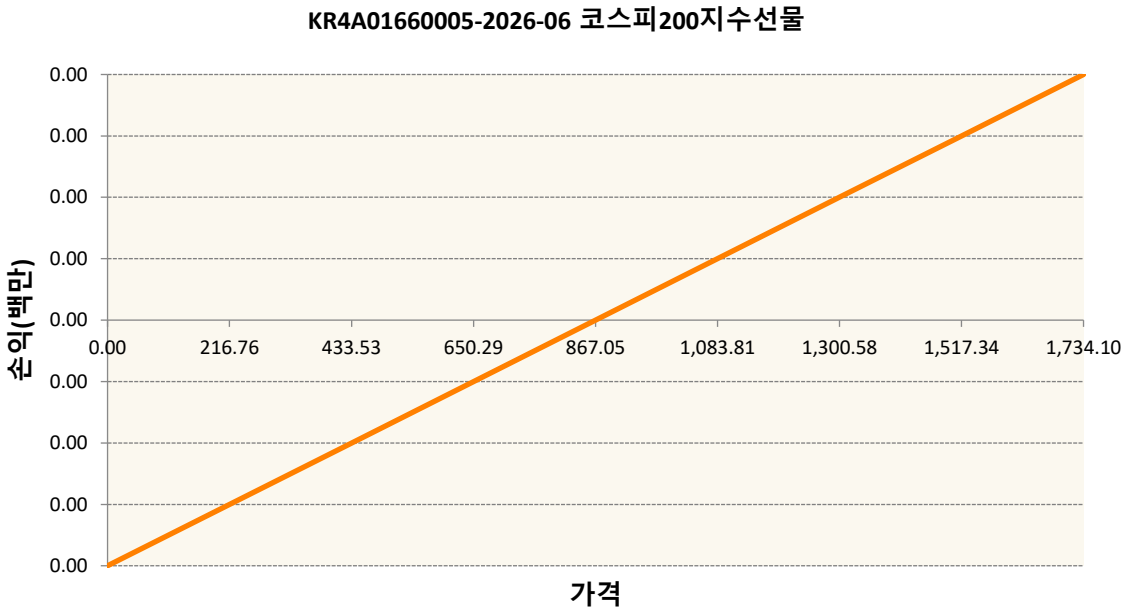
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

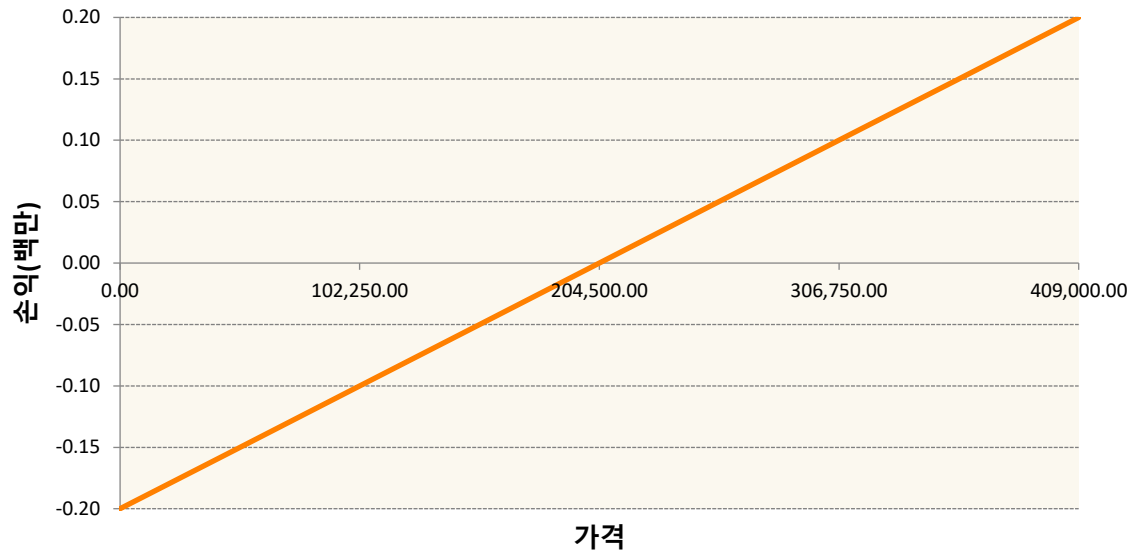
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	219	-219	장내
누계	유가증권	선물	3,759	0	3,759	장내

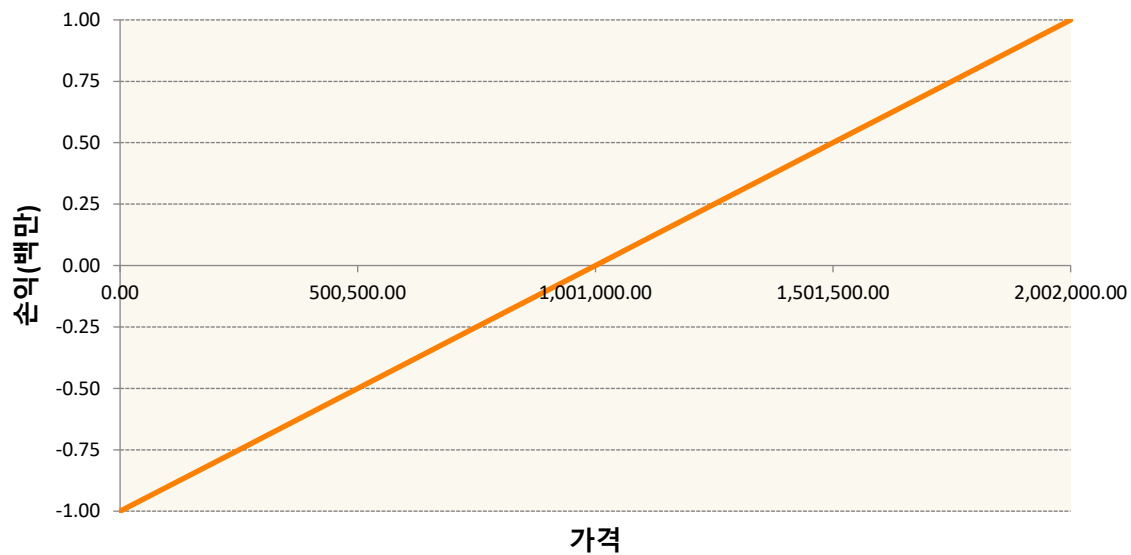
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87
KR4A05650002		2026-05 미니코스피200 선물					42
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	28	28	28	28	28	28	28
8.00%	42	42	42	42	42	42	42

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

5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-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%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

296

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

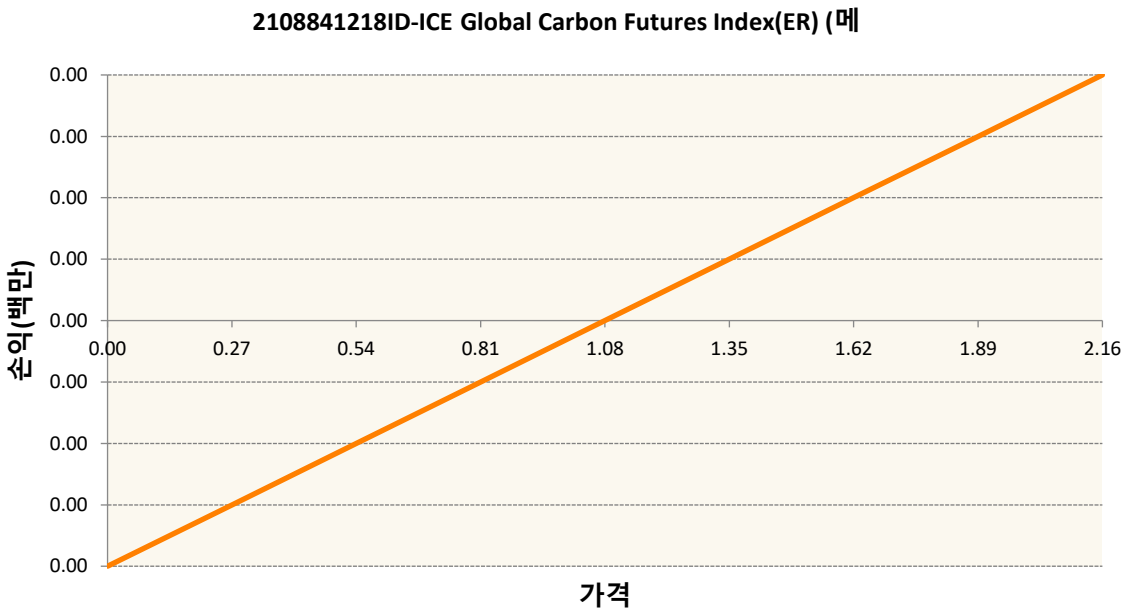
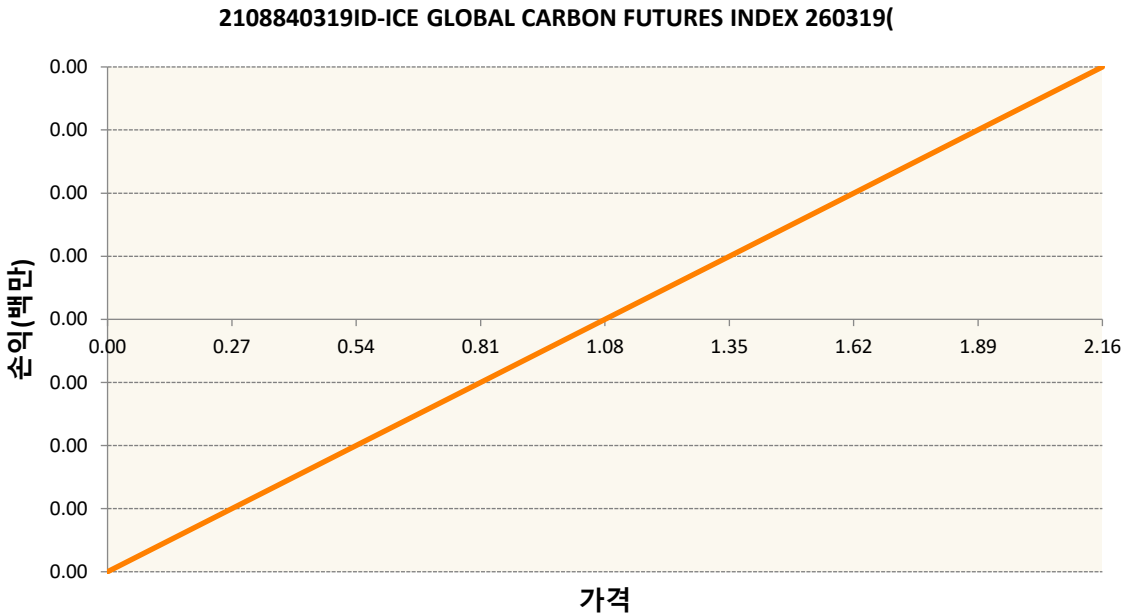
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)
	556

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

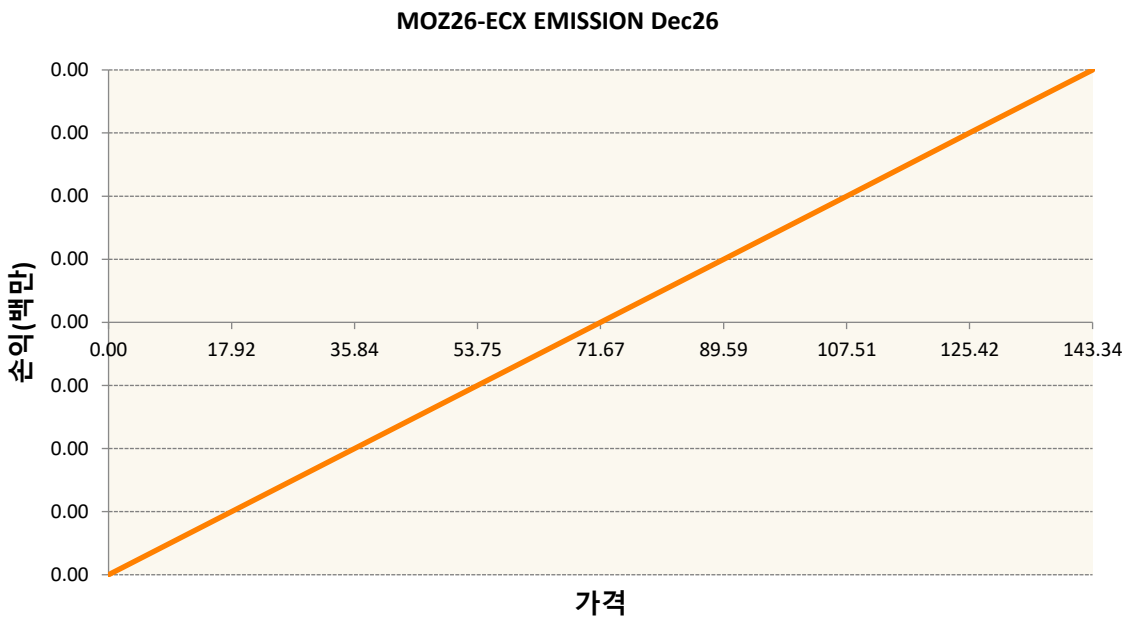
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,621	0	4,621	
누계	통화	선도	0	2,190	-2,190	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E)	175
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	370

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

(단위:백만원)

642

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

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	1,602	0	1,602	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	13
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	9
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	22
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	9

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

(단위:백만원)

83

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

SOL차이나육성산업액티브상장지

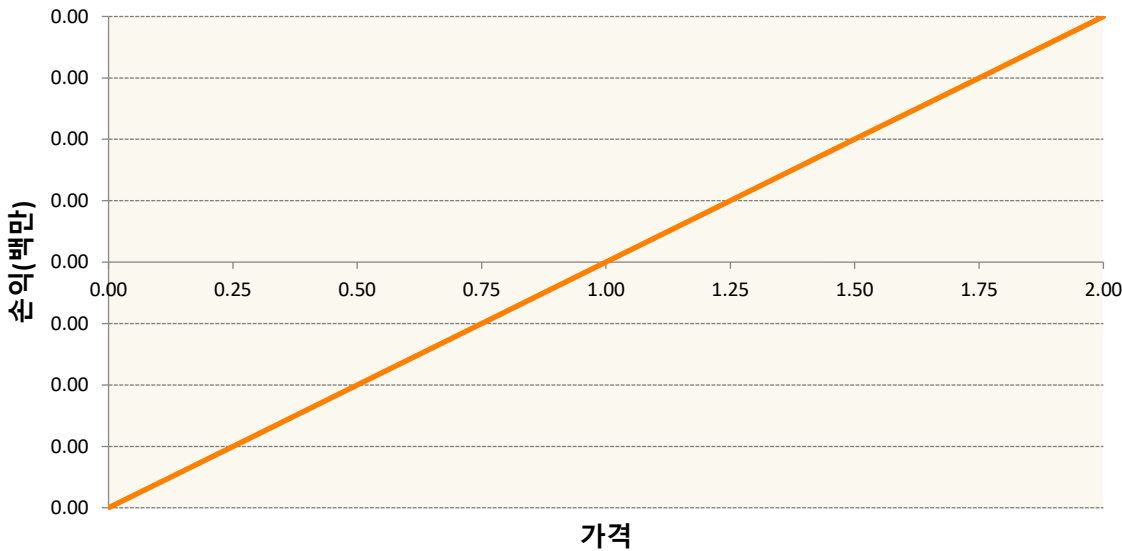
1. 계약금액

(단위:백만원)

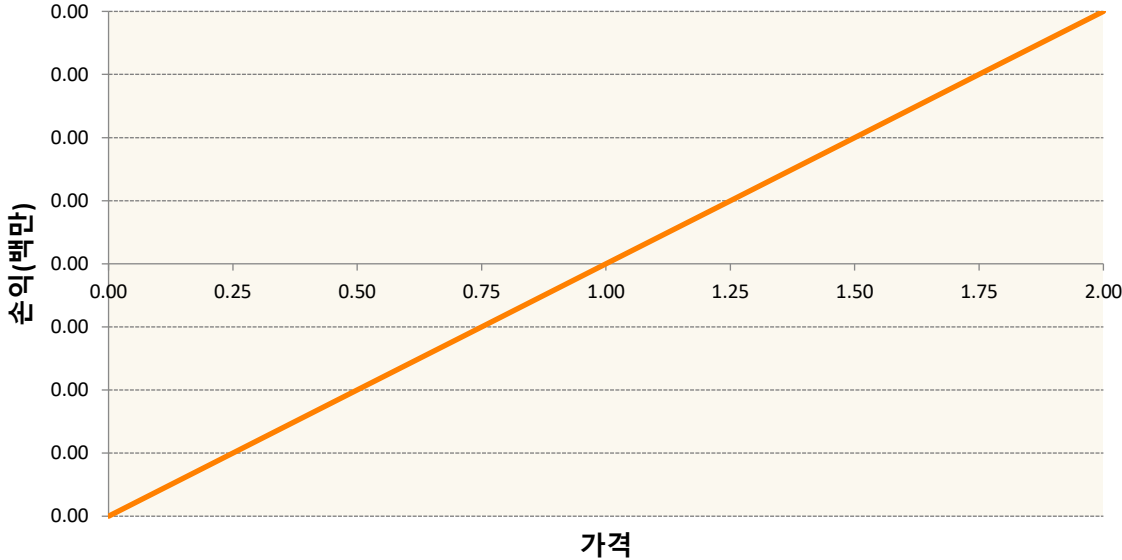
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	0	0	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

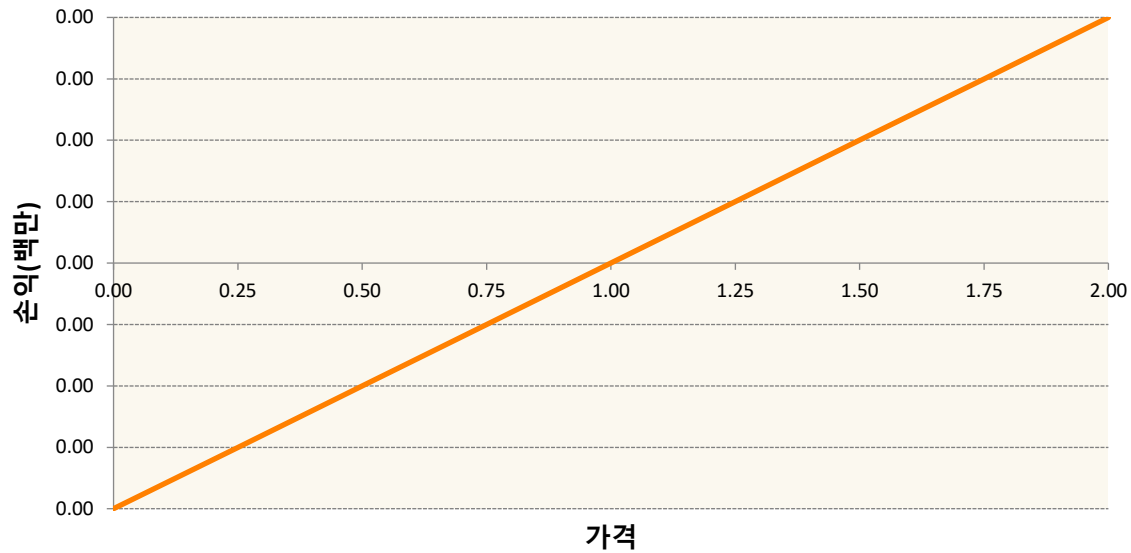
SWSTAR000027-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)



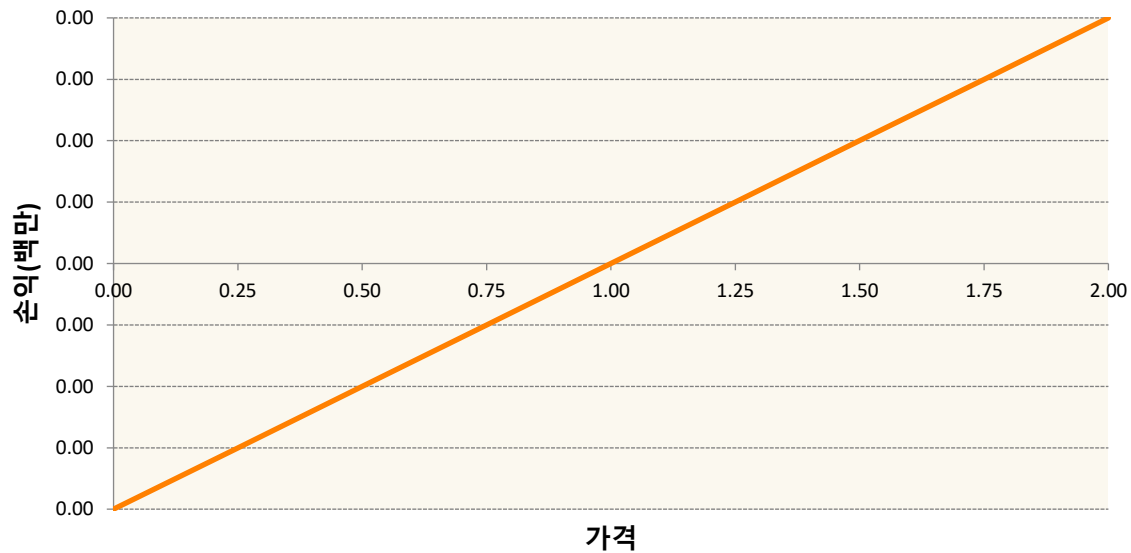
SWSTAR000030-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)



SWSTAR000031-STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)



SWSTAR000032-STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)	0.17
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	1
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	3
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	1

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

(단위:백만원)

8

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

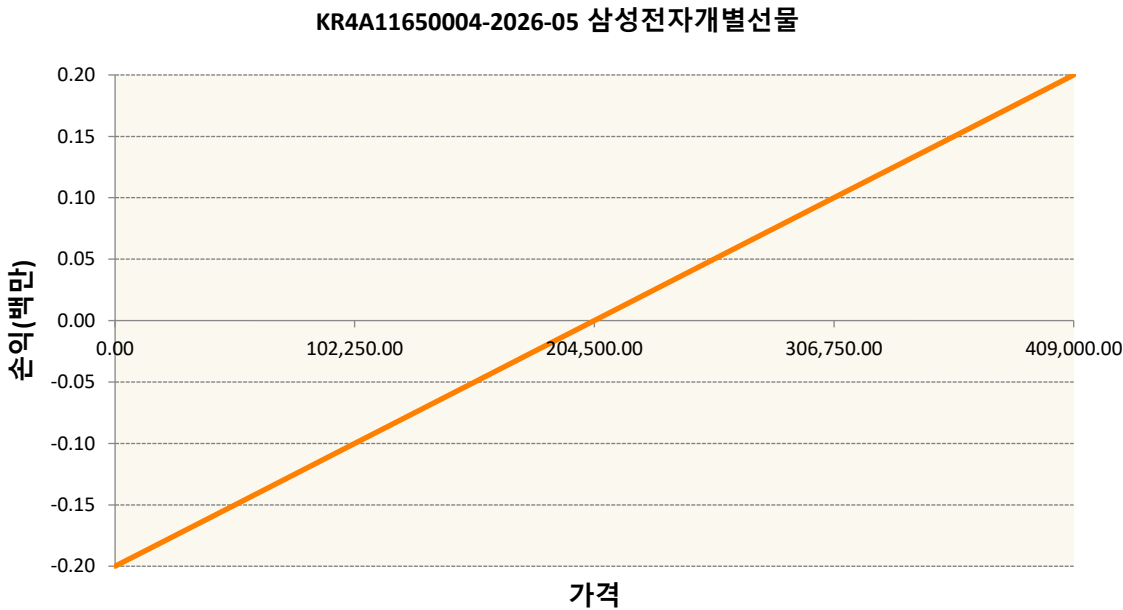
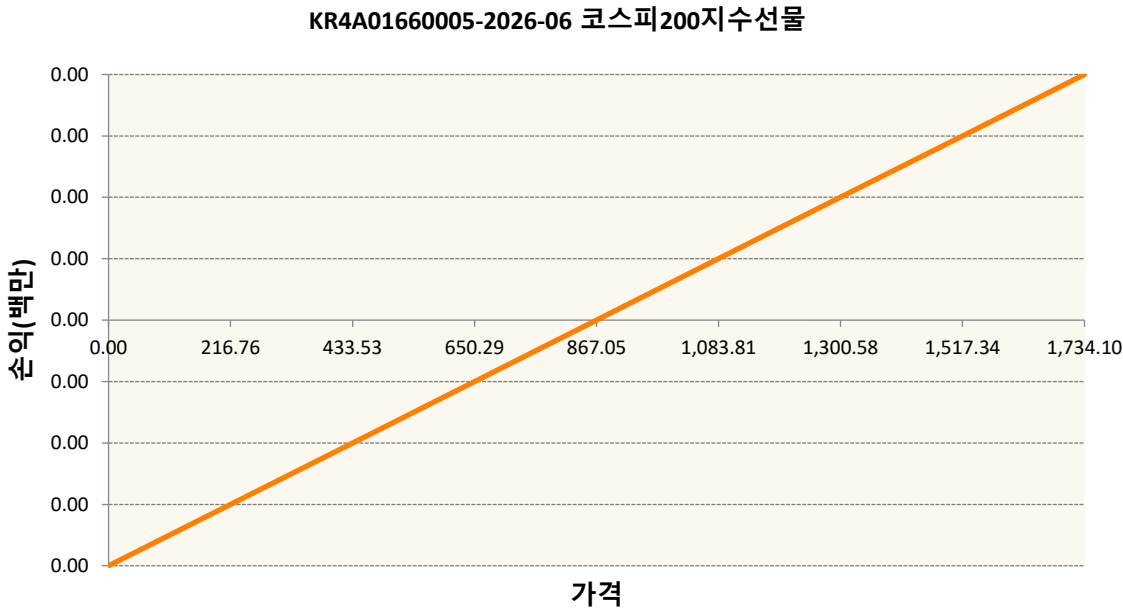
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

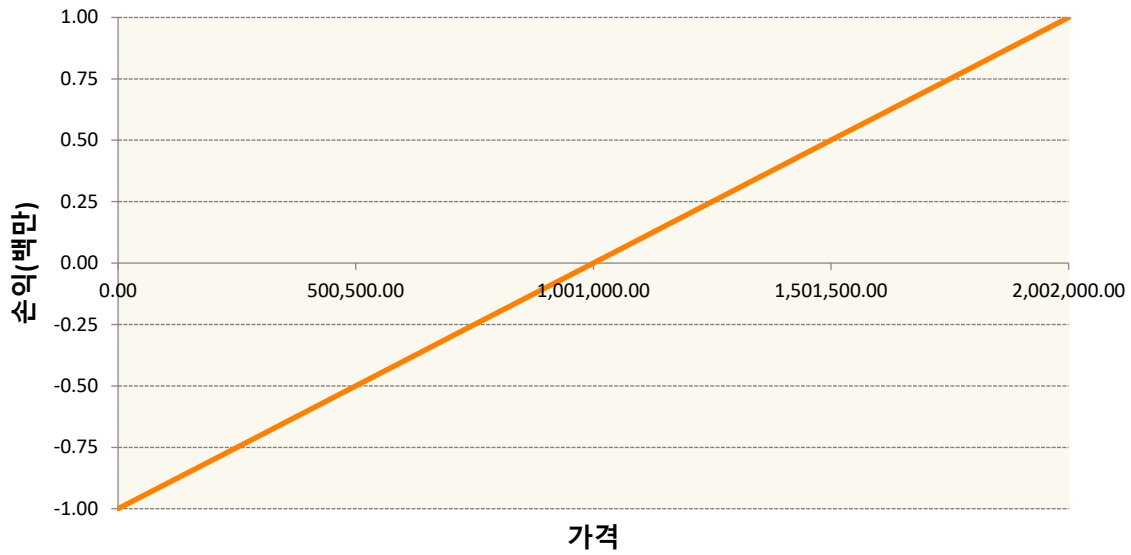
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,588	0	2,588	장내
누계	유가증권	선물	23,786	1,718	22,068	장내

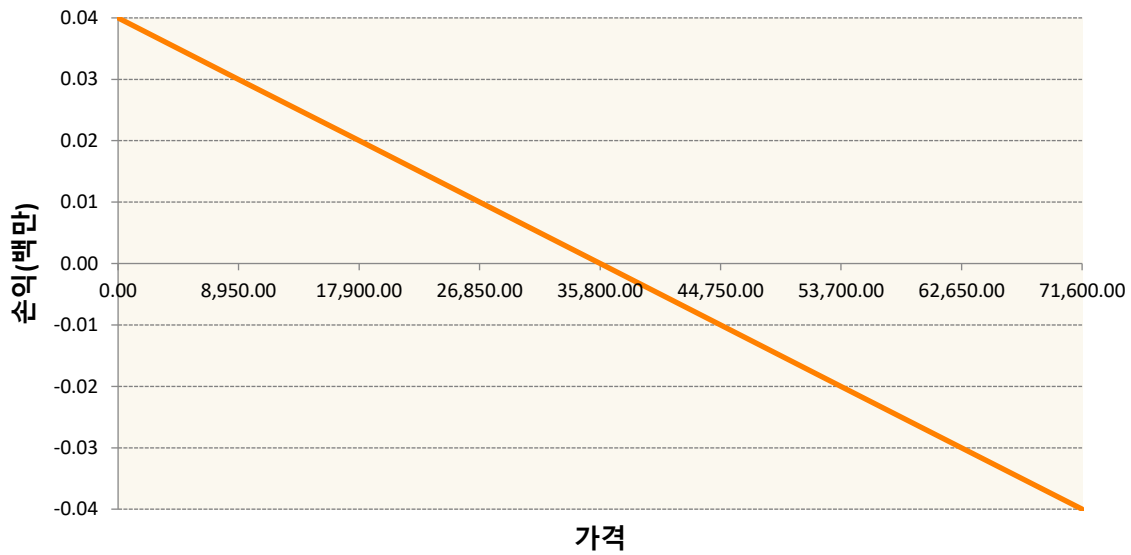
2. 만기시점의 손익구조



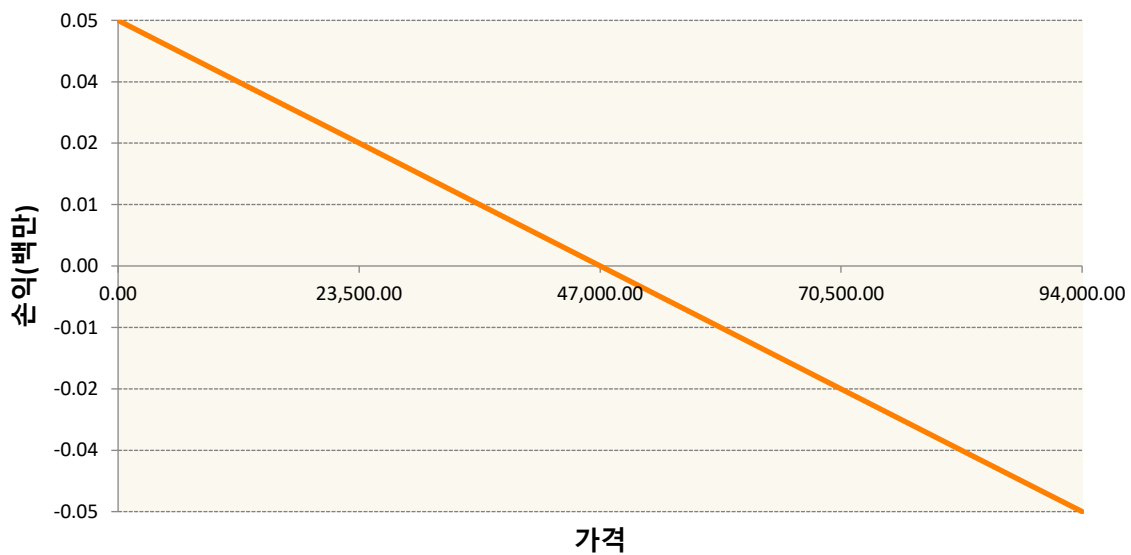
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4A51650005-2026-05 GS건설개별선물



KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		1,645	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645	-1,645			
-5.33%	-1,097	-1,097	-1,097	-1,097	-1,097	-1,097	-1,097			
-2.67%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	548	548	548	548	548	548	548			
5.33%	1,097	1,097	1,097	1,097	1,097	1,097	1,097			
8.00%	1,645	1,645	1,645	1,645	1,645	1,645	1,645			
KR4A11650004							2026-05 삼성전자개별선물		169	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169			
-5.33%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112			
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	56	56	56	56	56	56	56			
5.33%	112	112	112	112	112	112	112			
8.00%	169	169	169	169	169	169	169			
KR4A50650006							2026-05 SK하이닉스개별선물		86	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86			
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57			
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	29	29	29	29	29	29	29			
5.33%	57	57	57	57	57	57	57			
8.00%	86	86	86	86	86	86	86			
KR4A51650005							2026-05 GS건설개별선물		17	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17			
-5.33%	12	12	12	12	12	12	12			
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6			
5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12			
8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17			
KR4ACF650006							2026-05 카카오개별선물		121	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	121	121	121	121	121	121	121
-5.33%	80	80	80	80	80	80	80
-2.67%	40	40	40	40	40	40	40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121

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

(단위:백만원)

4,490

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

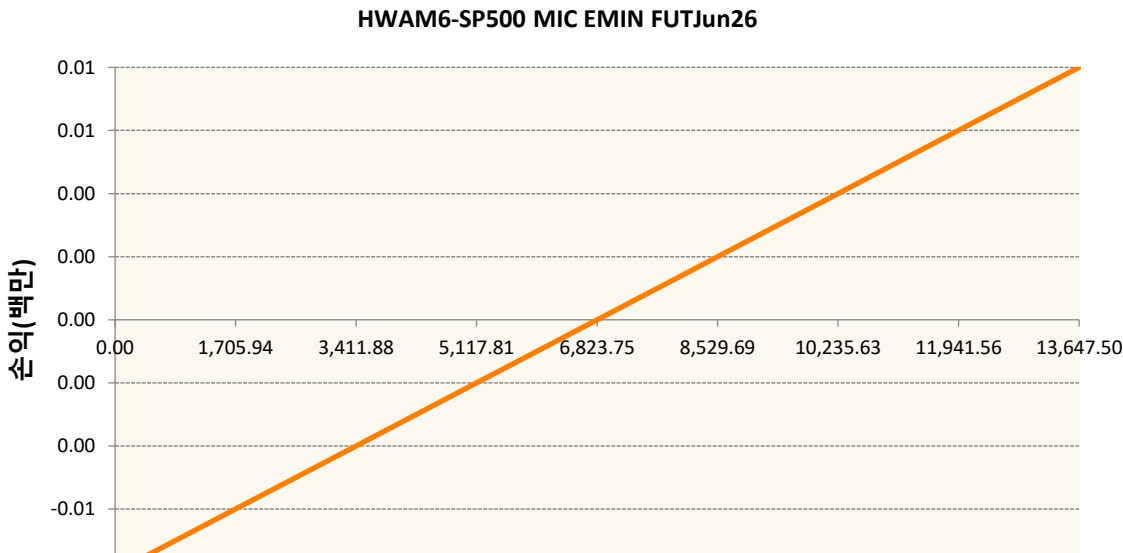
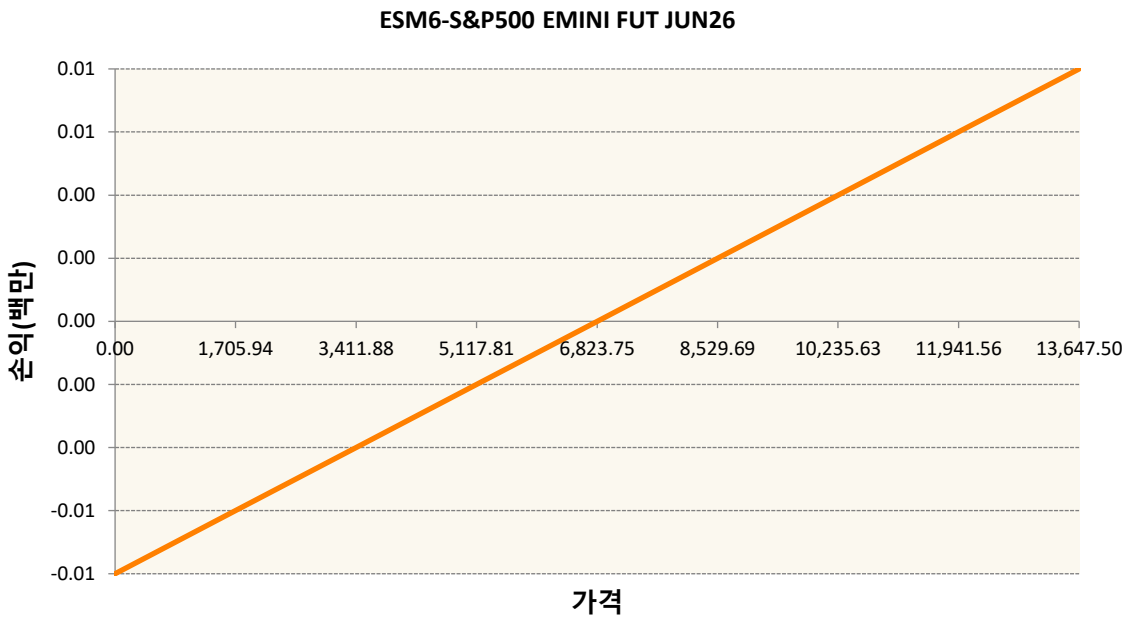
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

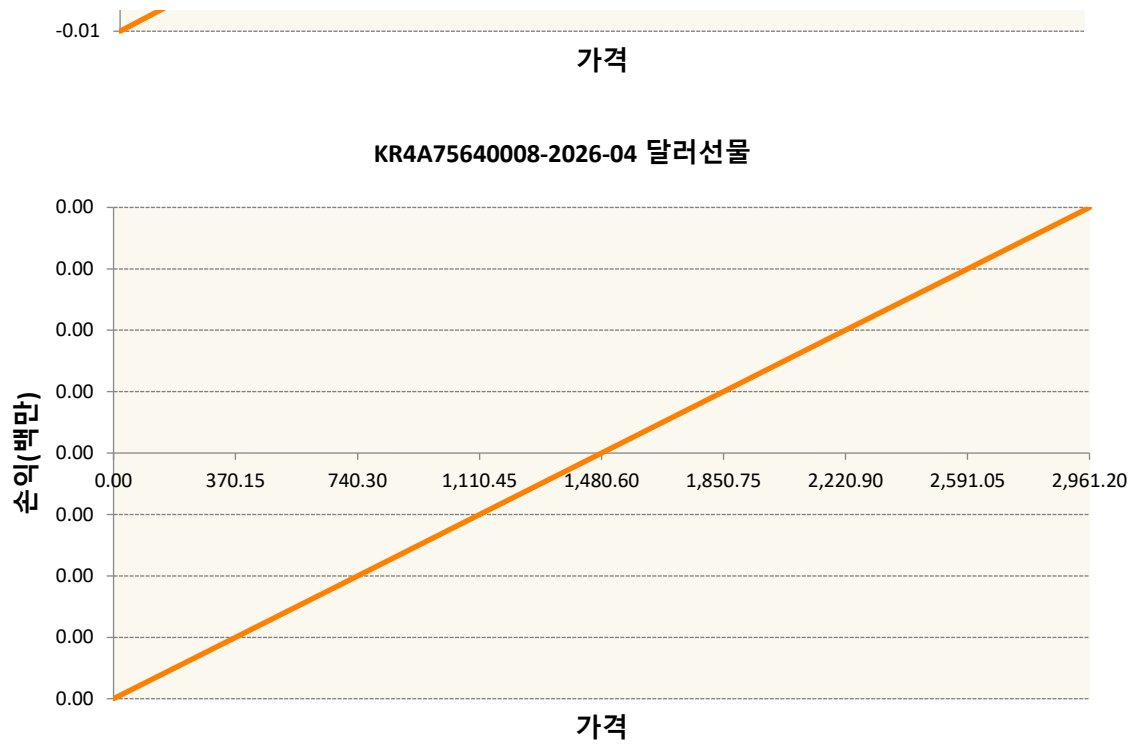
1. 계약금액

(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	56,334	0	56,334	
누계	지수	선물	155	0	155	장내
누계	통화	선물	10,512	0	10,512	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,507
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	12
KR4A756400 2026-04 달러선물		841

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

(단위:백만원)

3,951

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

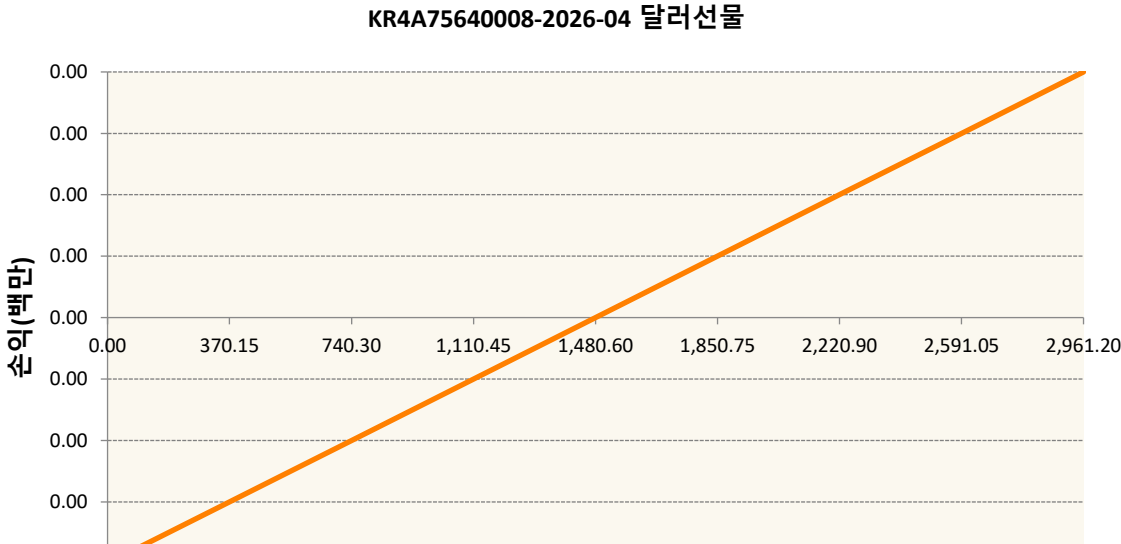
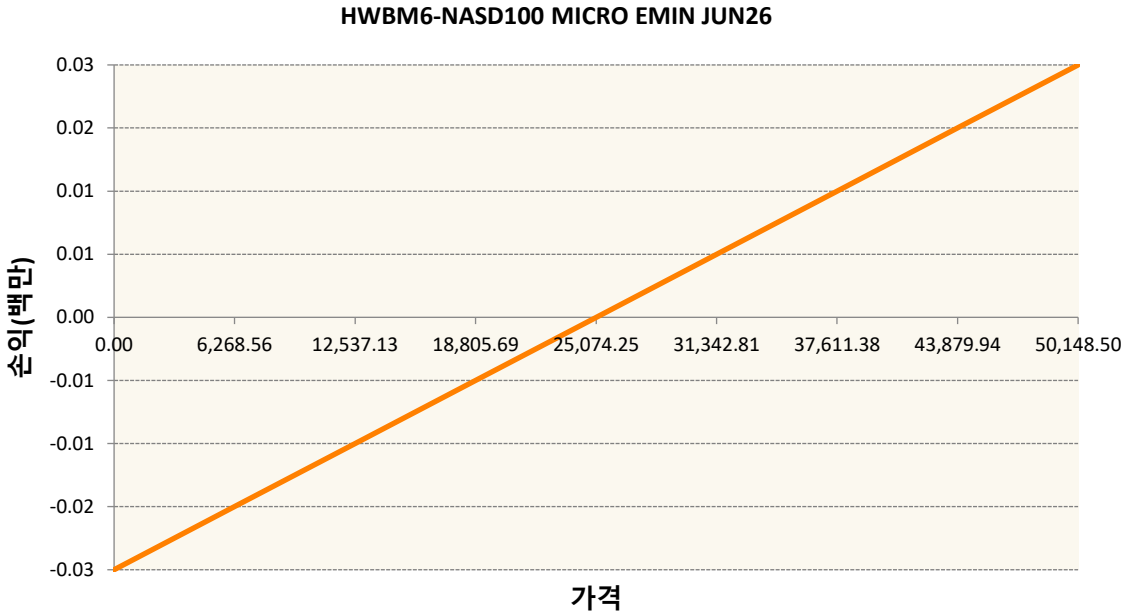
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

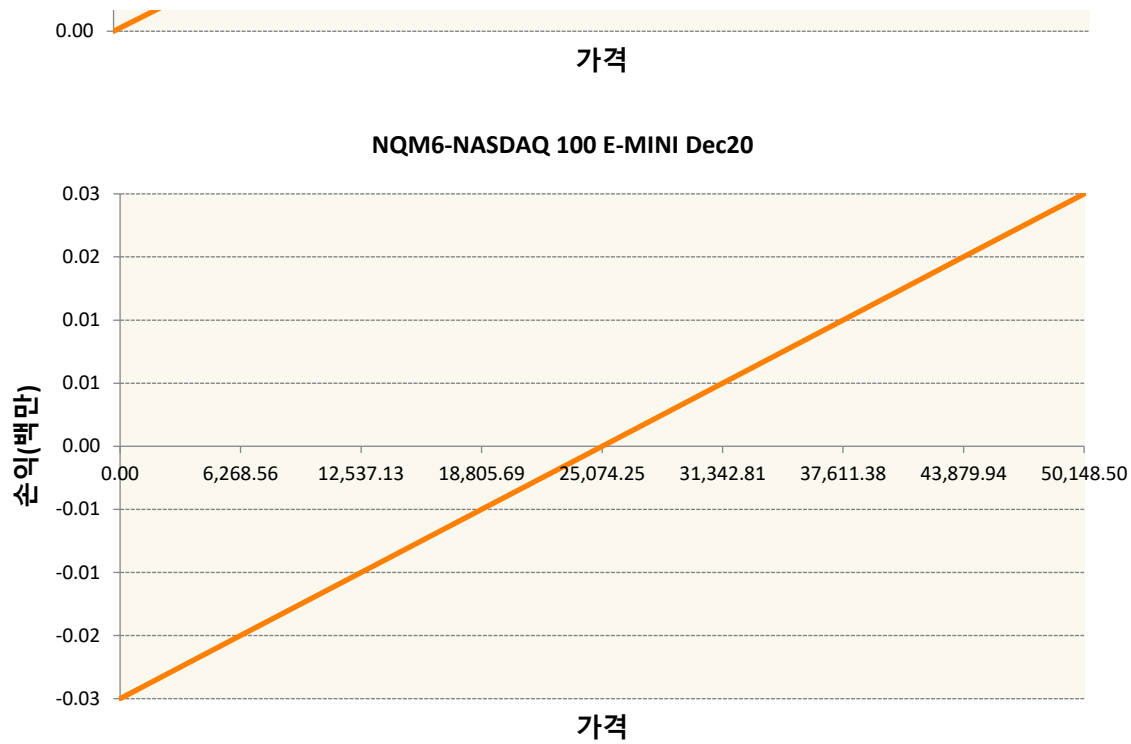
1. 계약금액

(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	23,335	0	23,335	
누계	유가증권	선물	225	0	225	장내
누계	통화	선물	3,864	0	3,864	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	18
KR4A756400	2026-04 달러선물	309
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,867

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

2,079

공시일	2026-04-10
기준일	2026-04-09

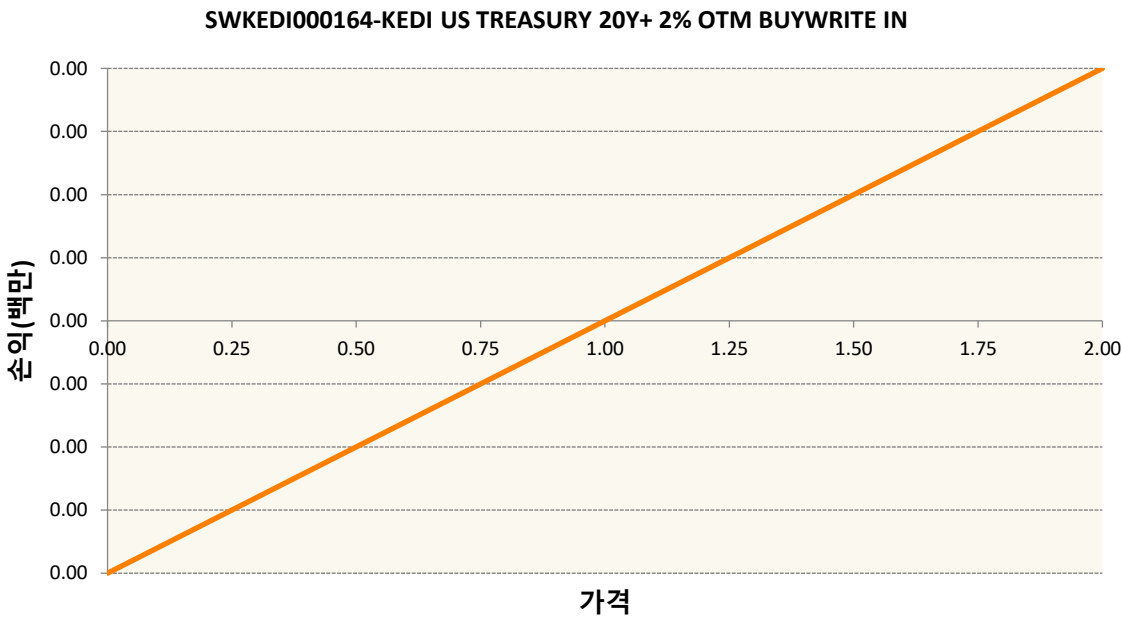
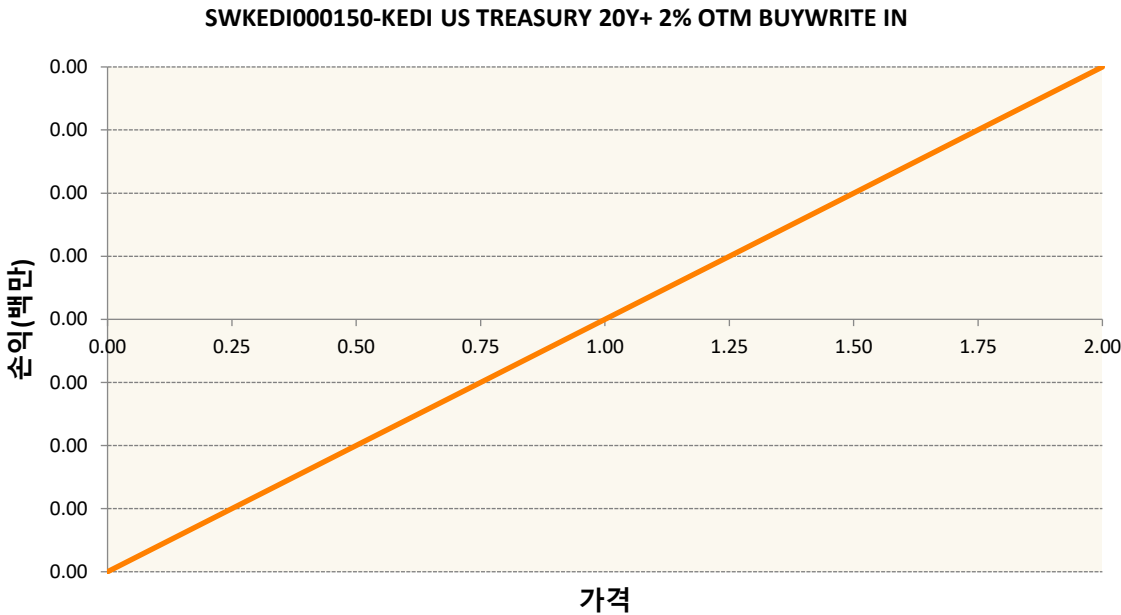
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

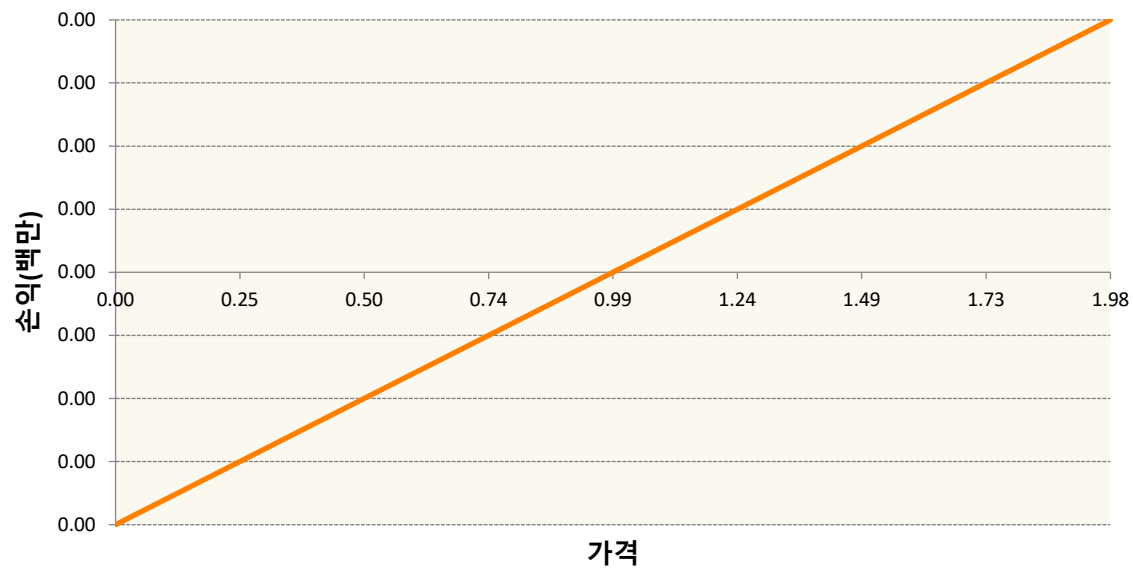
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	358,570	0	358,570	장외

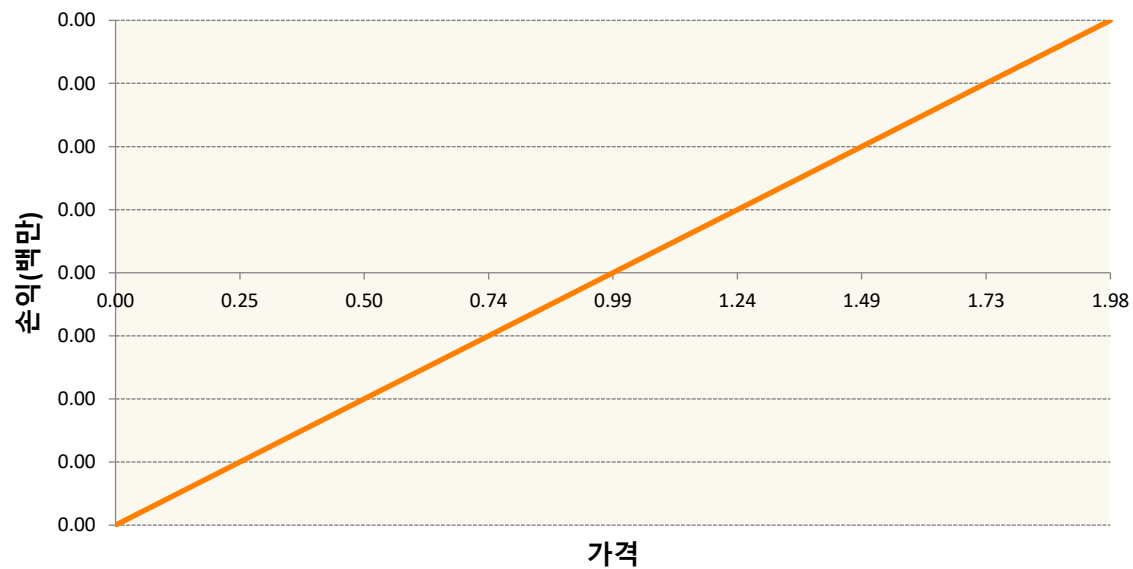
2. 만기시점의 손익구조



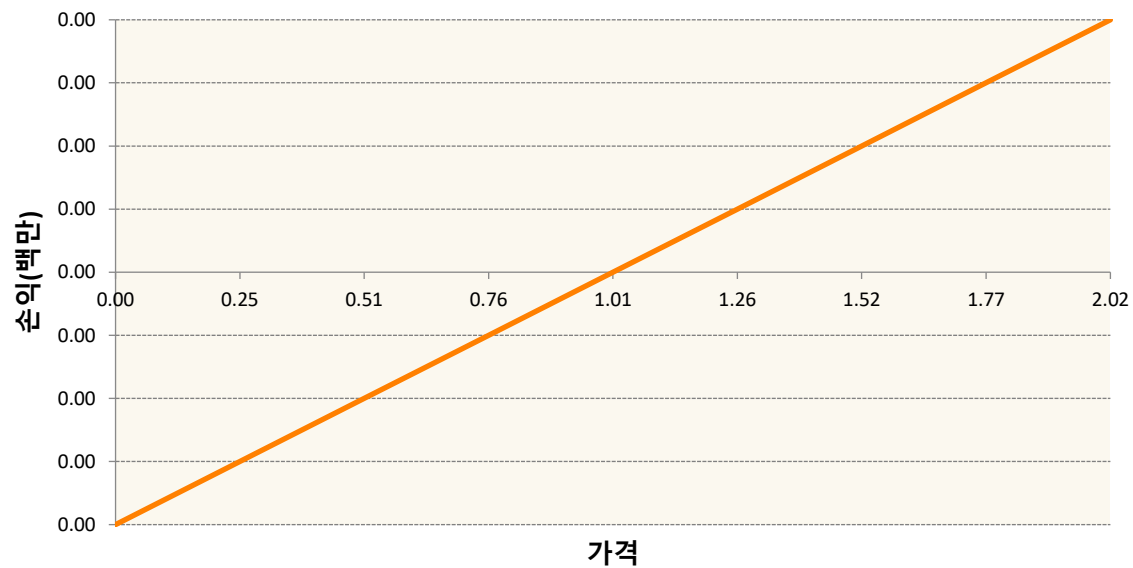
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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



SWKEDI000173-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,360
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		153
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,757
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,432
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,978

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,349

공시일 2026-04-10

기준일 2026-04-09

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