

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

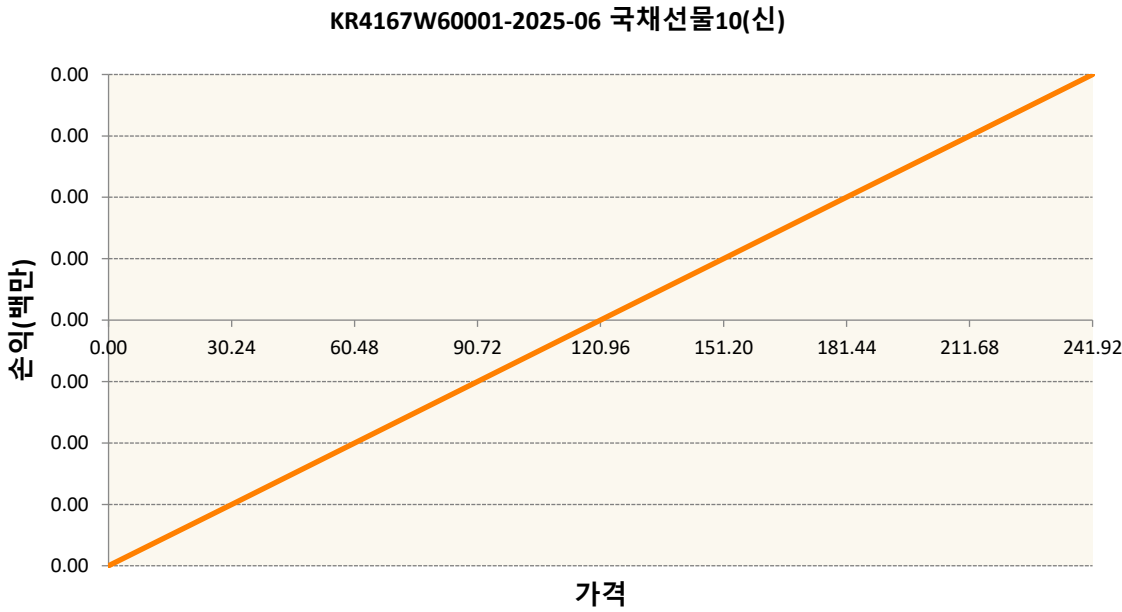
베스트장기채(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	금리	선물	0	0	0	장내
누계	금리	선물	42,336	0	42,336	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

507

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

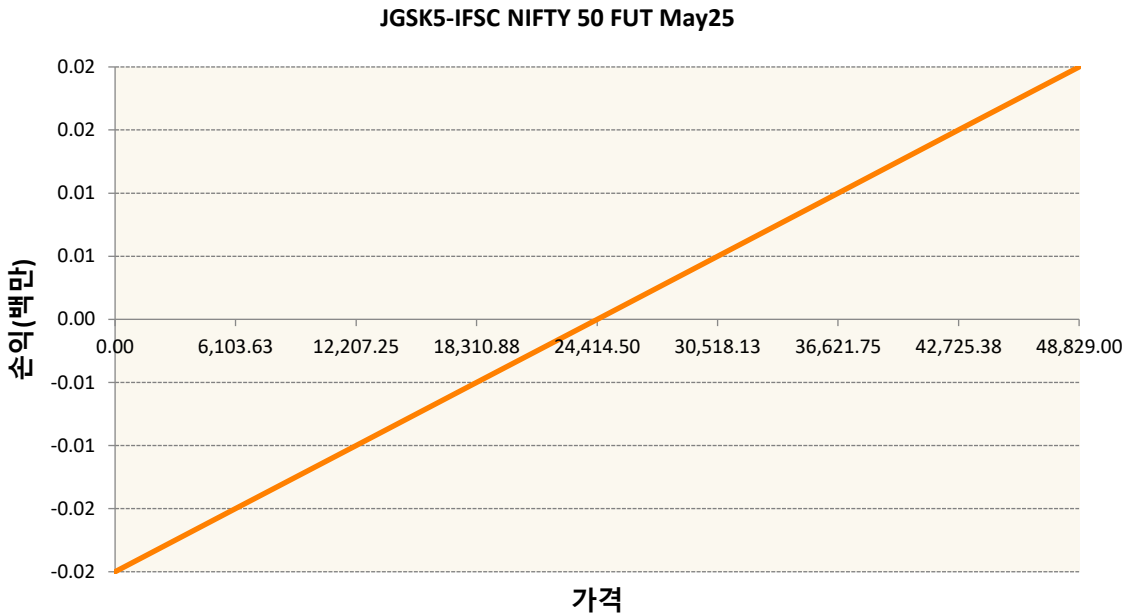
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	842	0	842	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSK5	IFSC NIFTY 50 FUT May25	67
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

49

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

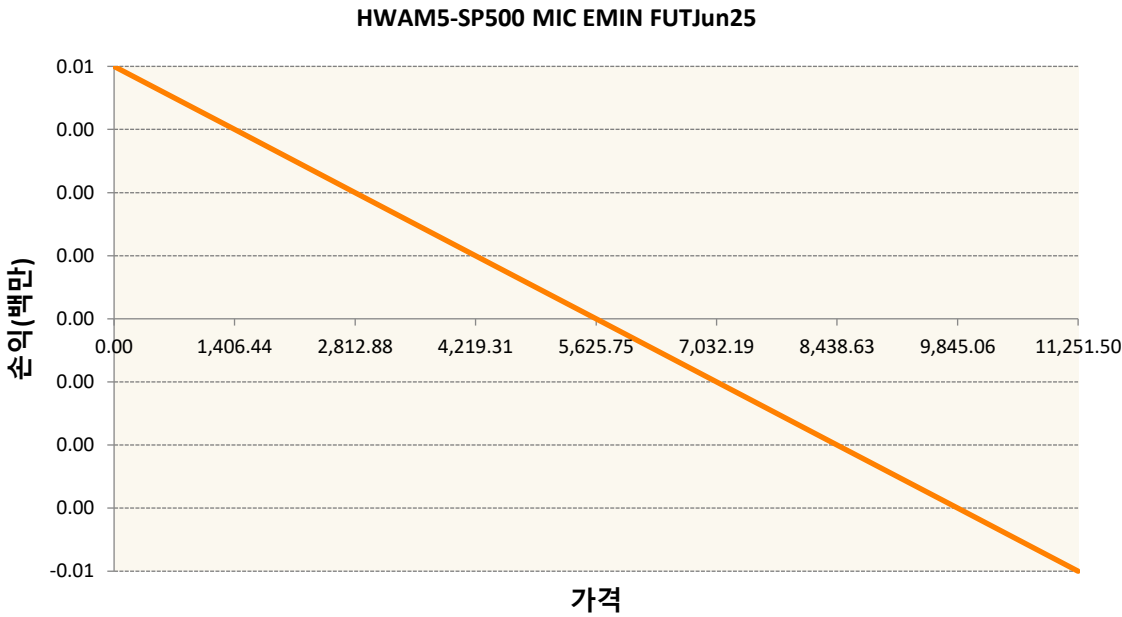
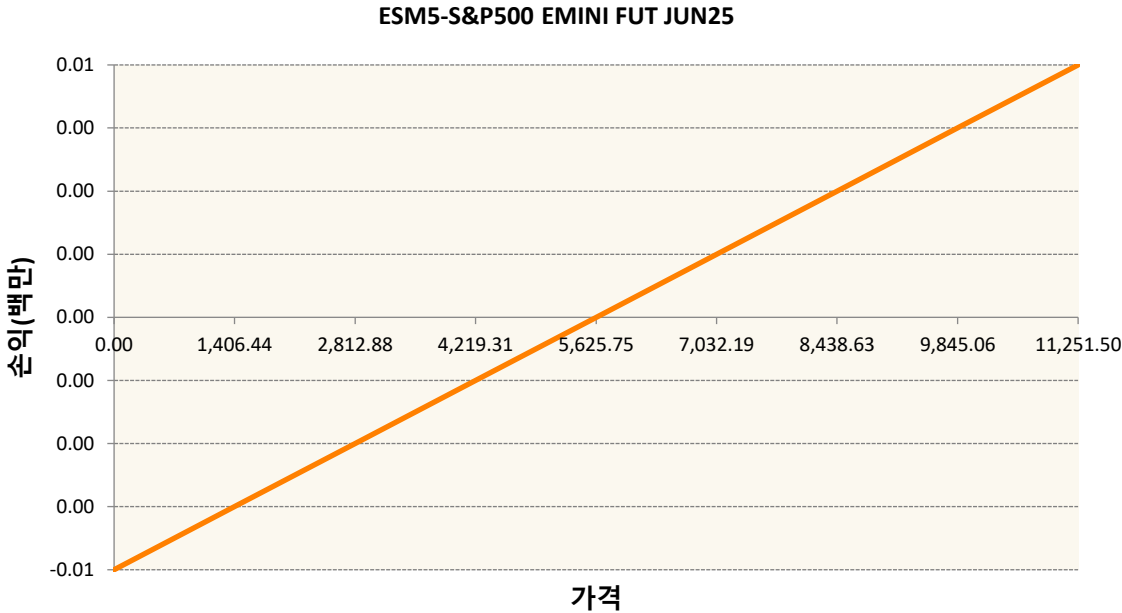
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	118	-118	장내
누계	지수	선물	412	0	412	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	33
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	37

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

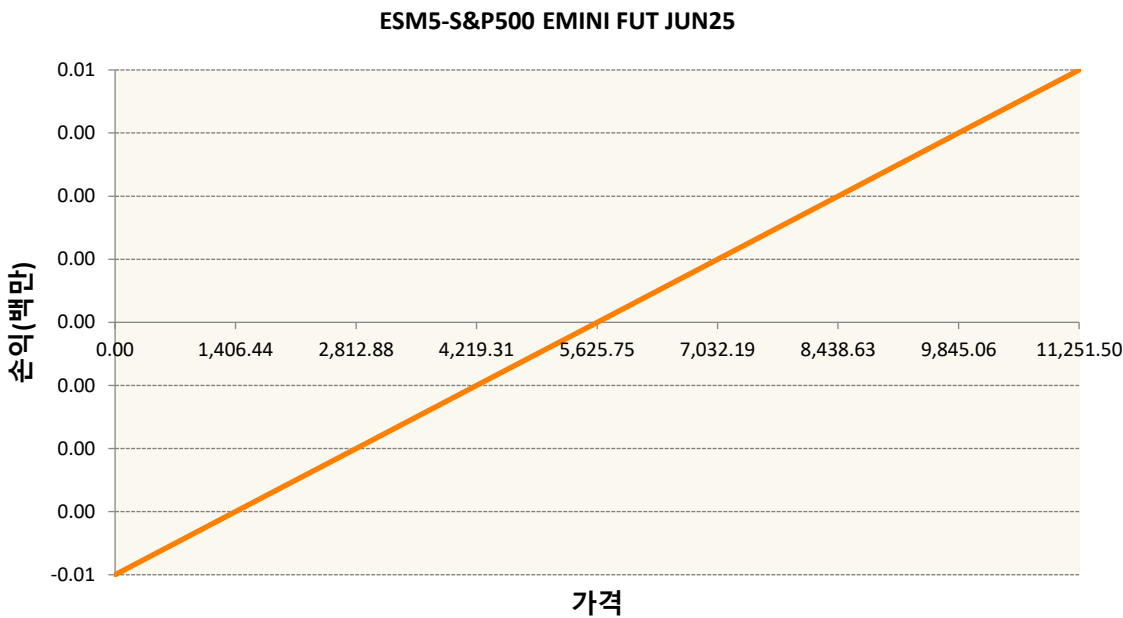
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	2,471	0	2,471	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	198
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

173

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

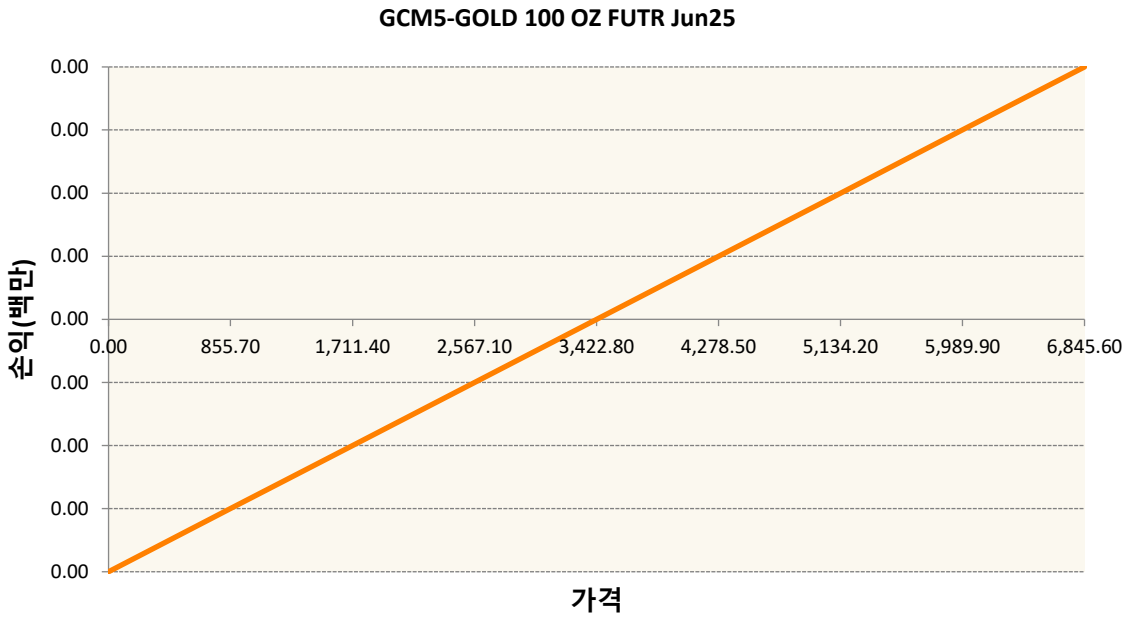
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	스왑	0	0	0	
누계	실물자산	선물	2,501	0	2,501	
누계	실물자산	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC2 GLD US 05/09/25 C299 EQUITY	6
GCM5 GOLD 100 OZ FUTR Jun25	200

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

(단위:백만원)

166

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC`PLTR US 05/09/25 C120 EQUITY	29
AOPLTRUSP1`PLTR US 05/09/25 P120 EQUITY	1

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

(단위:백만원)

118

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSC0TLT US 05/09/25 C89 EQUITY

0.41

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

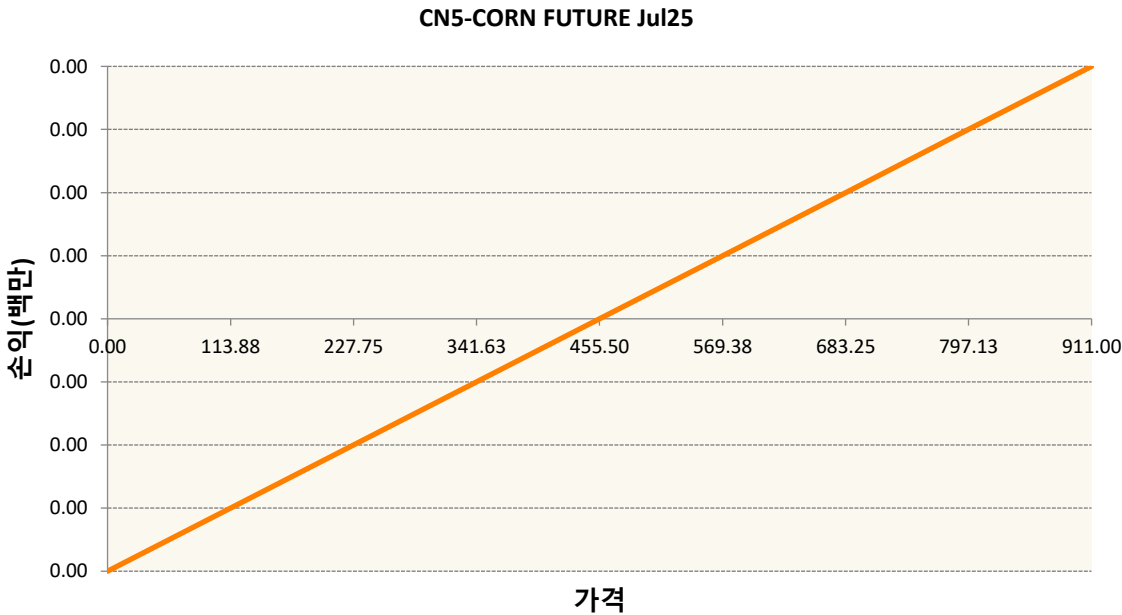
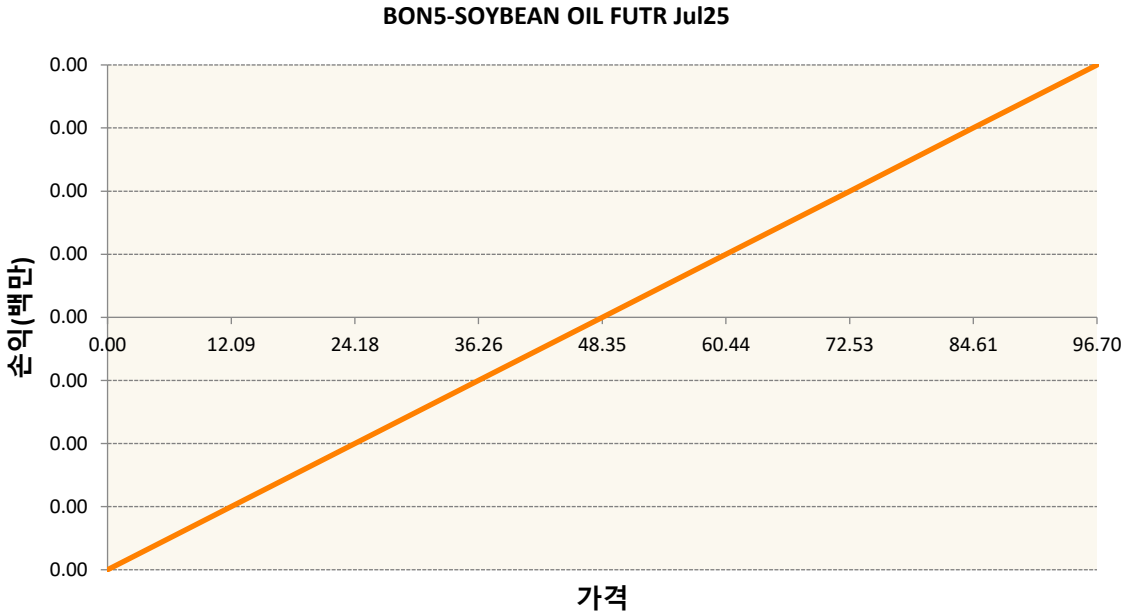
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

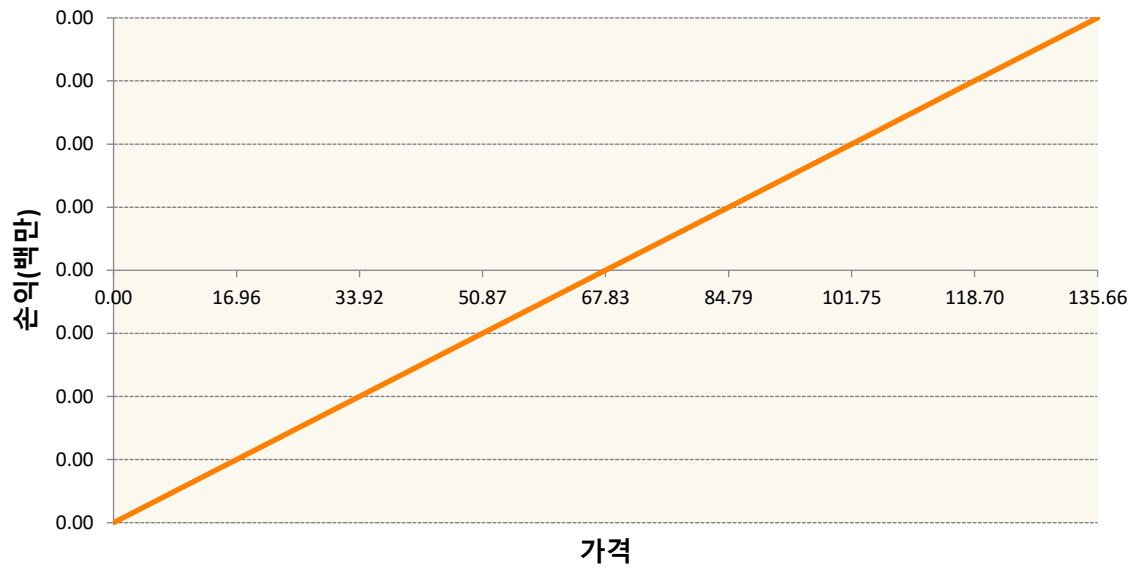
(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,834	0	3,834	
누계	통화	선물	0	321	-321	장내

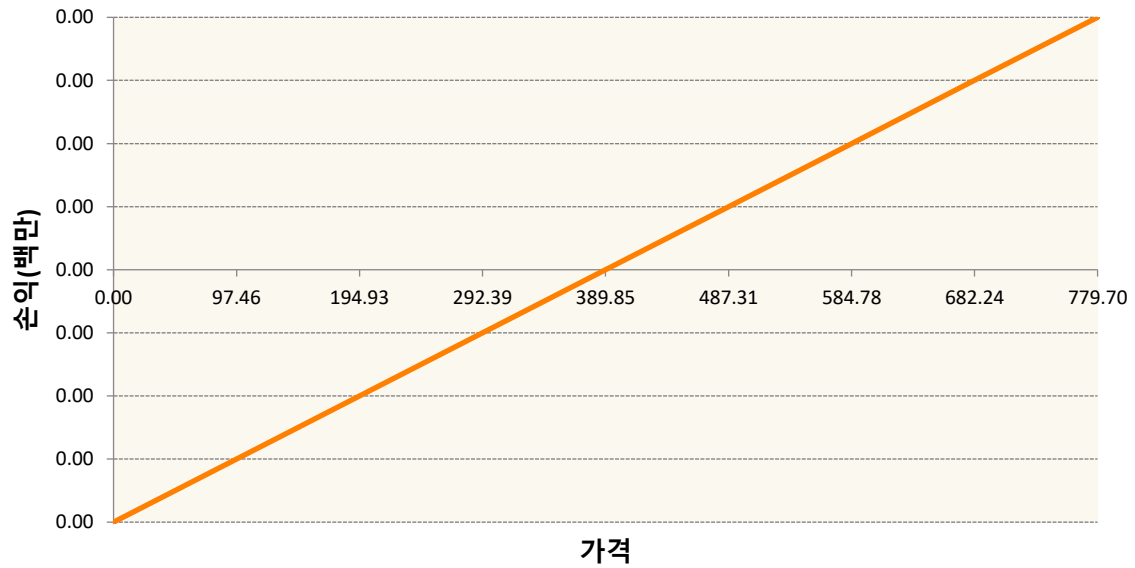
2. 만기시점의 손익구조



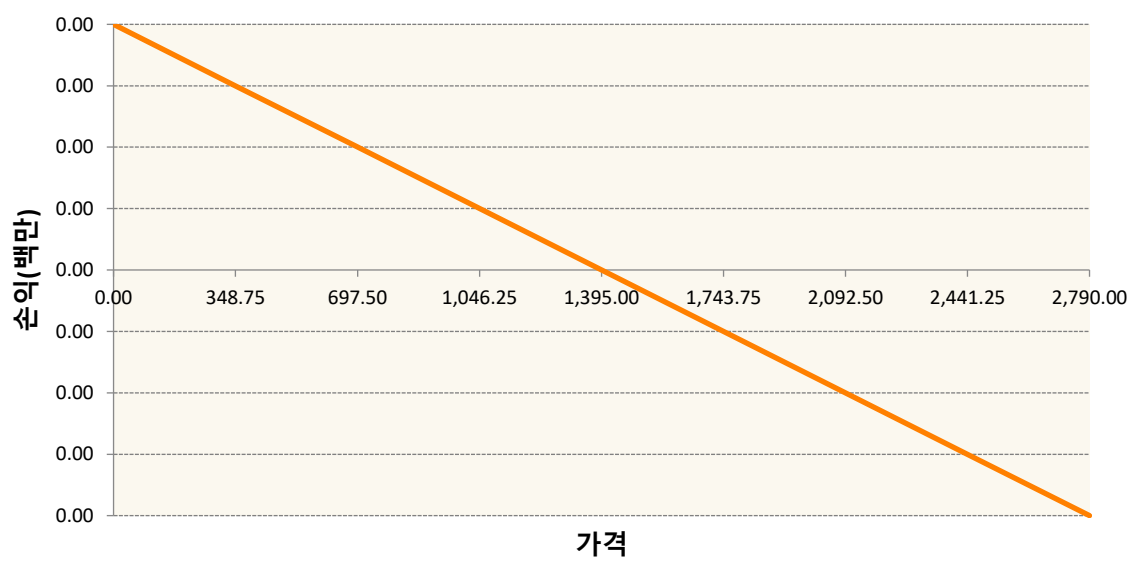
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



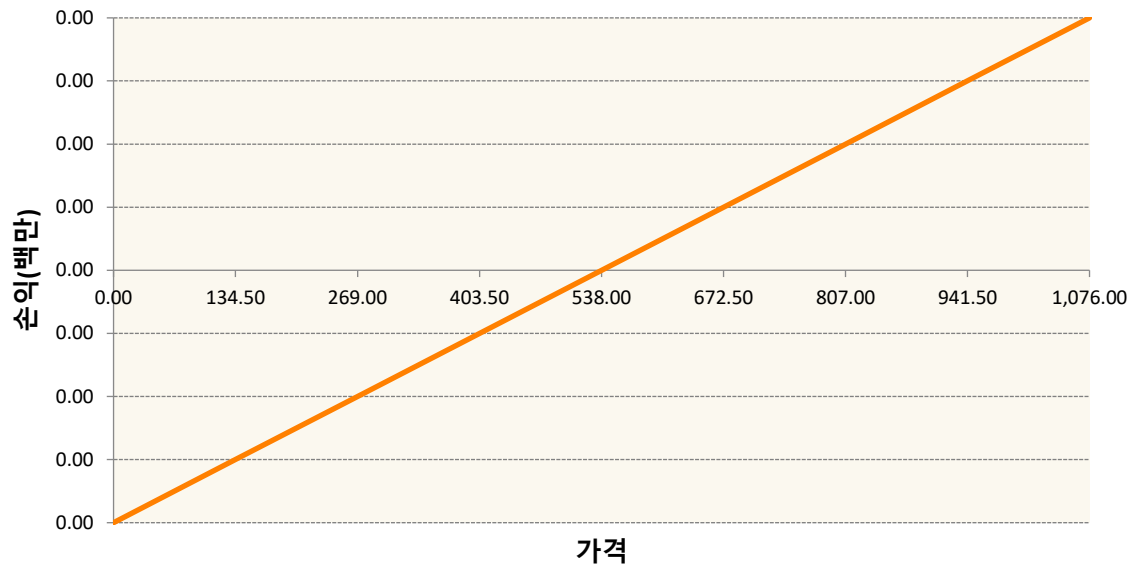
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



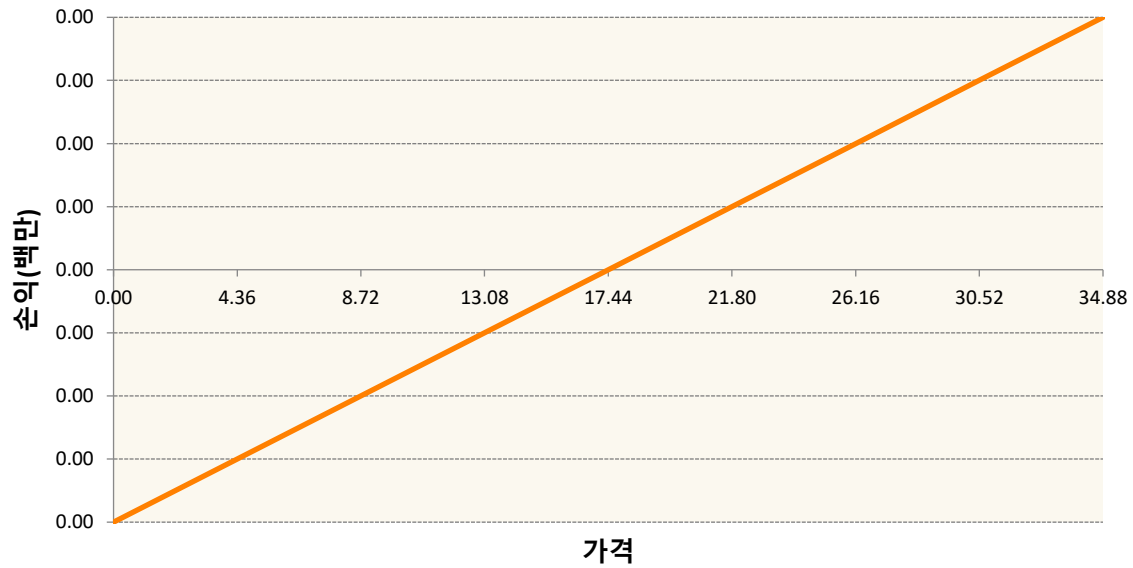
KR4175W50005-2025-05 달러선물



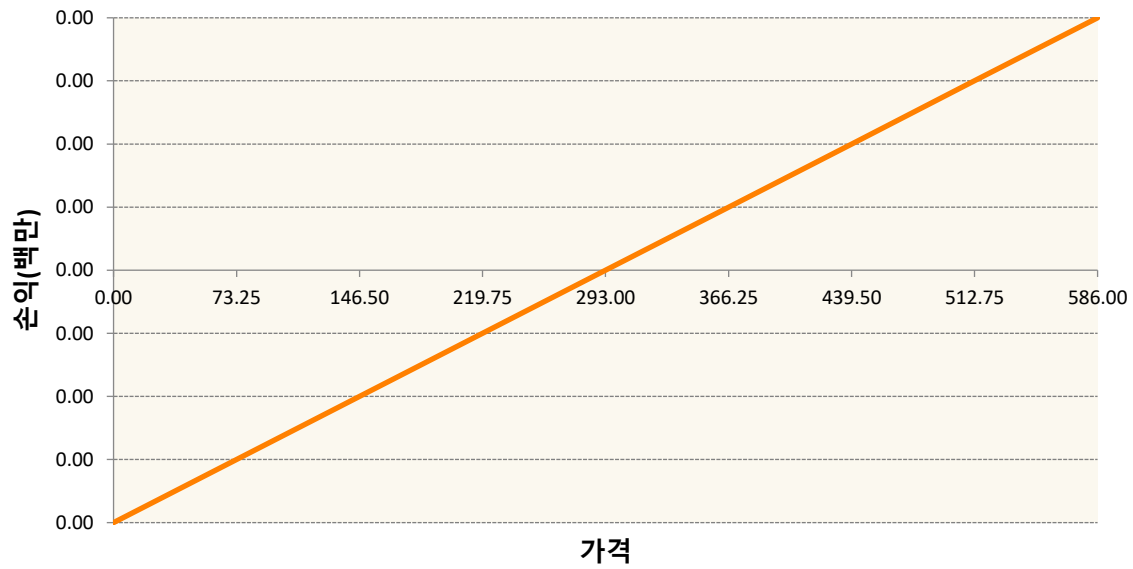
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25

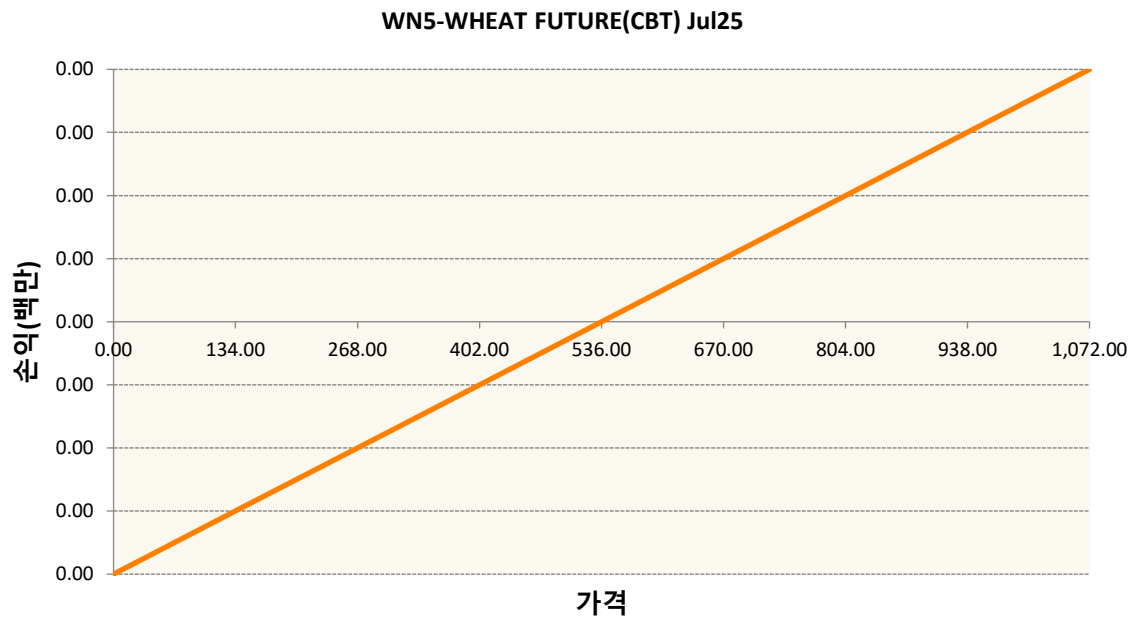
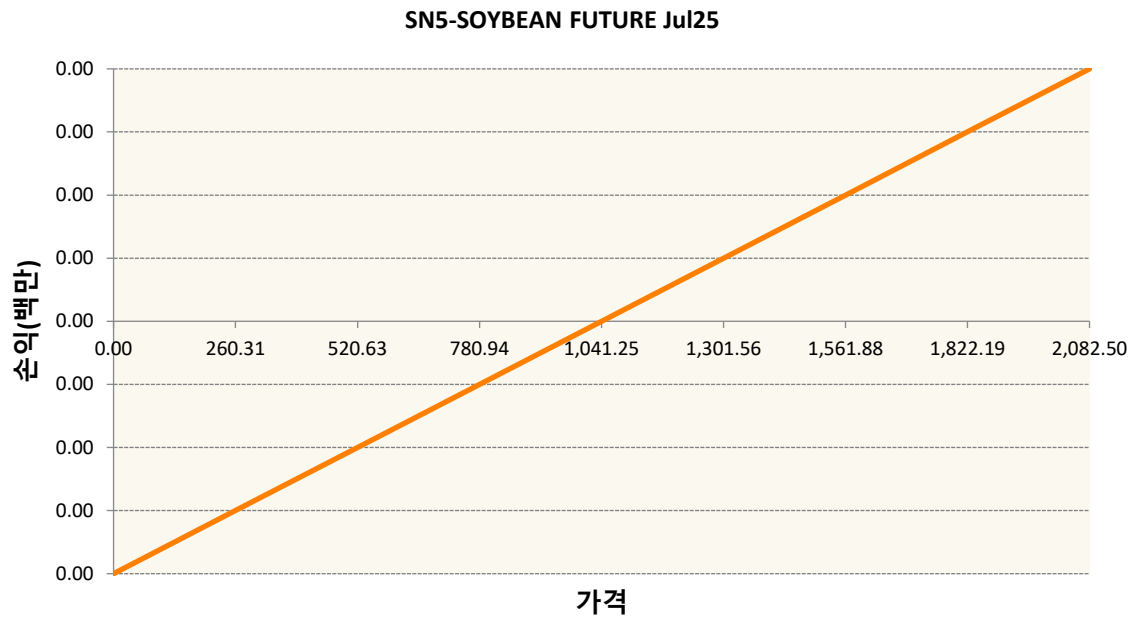


SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



SMN5-SOYBEAN MEAL FUTR Jul25





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

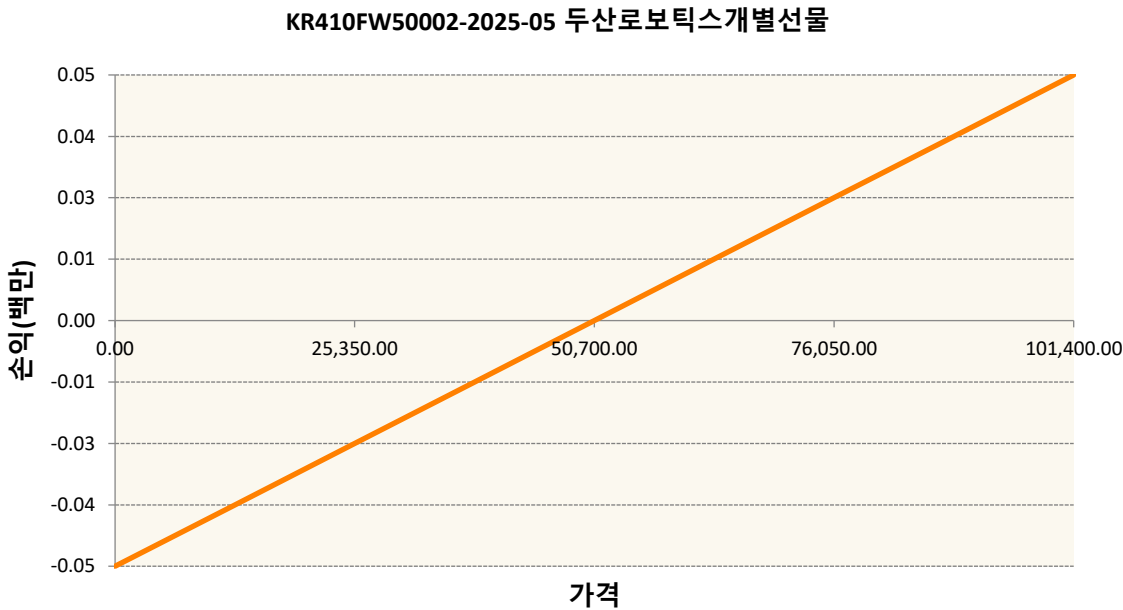
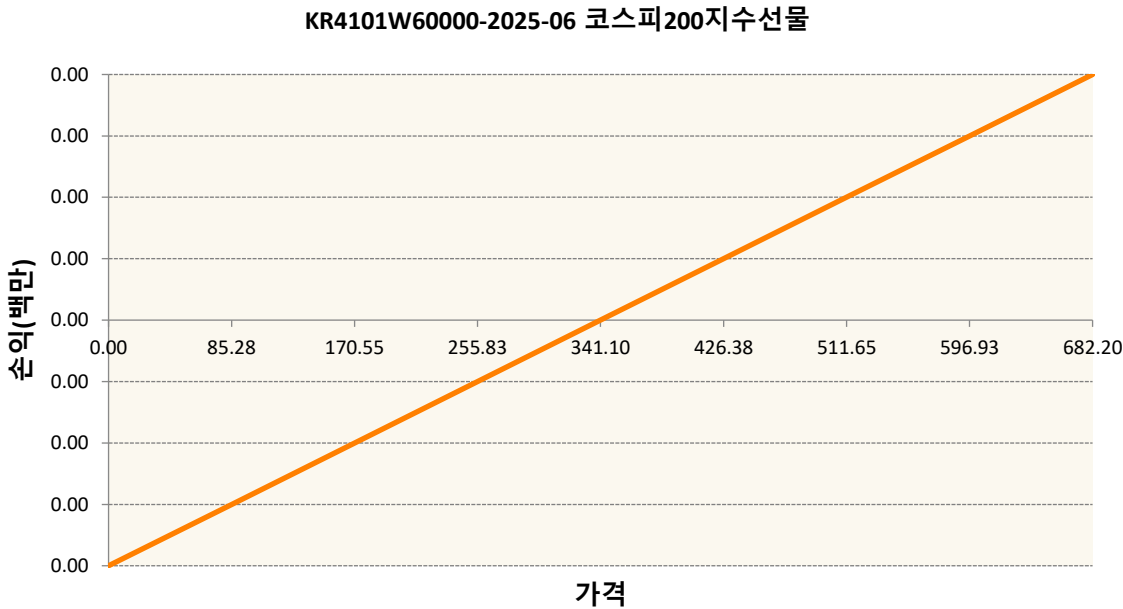
스마트인덱스모

1. 계약금액

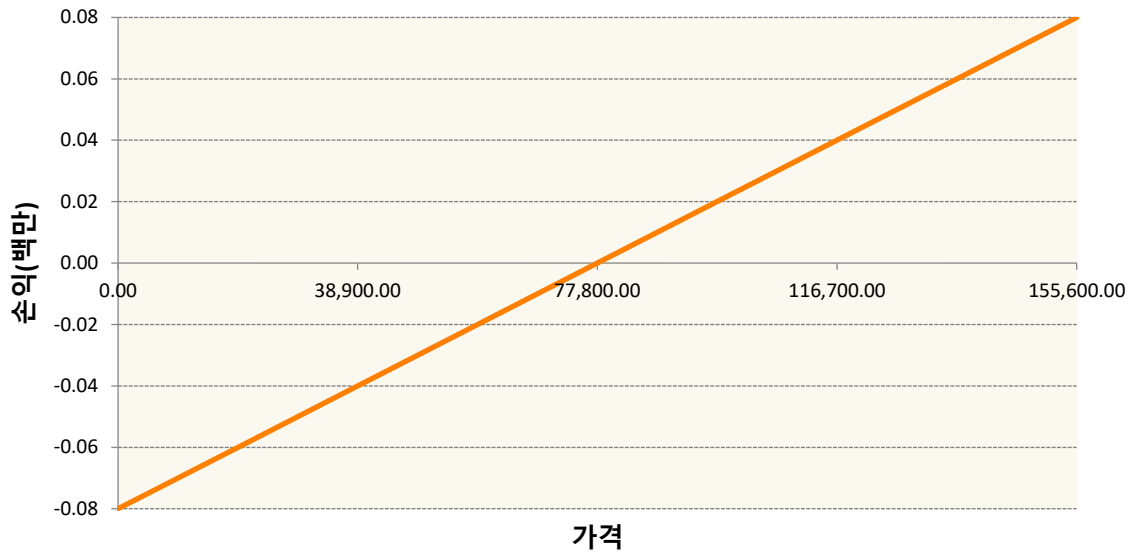
(단위:백만원)

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

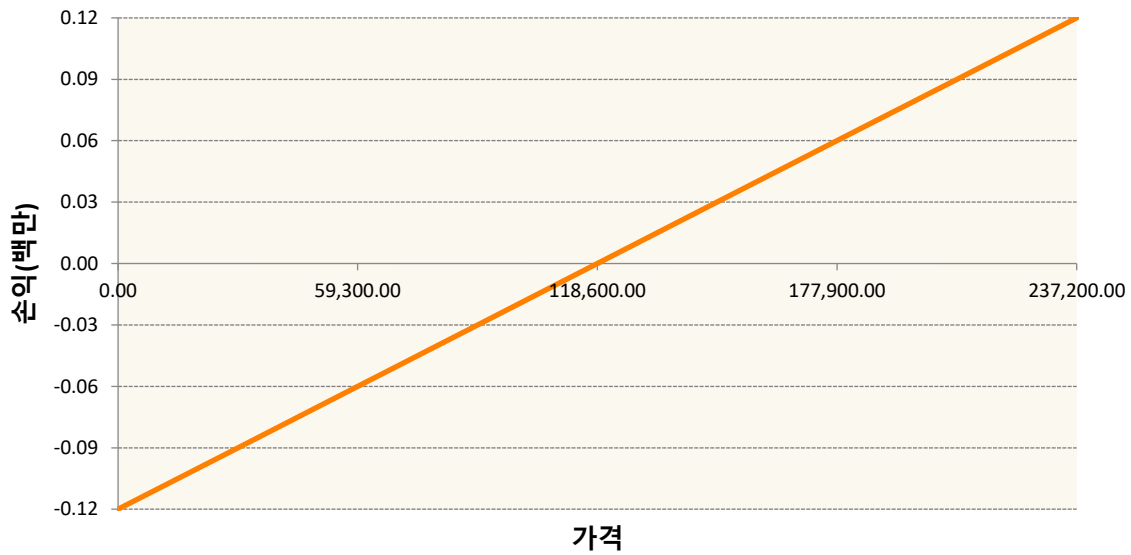
2. 만기시점의 손익구조



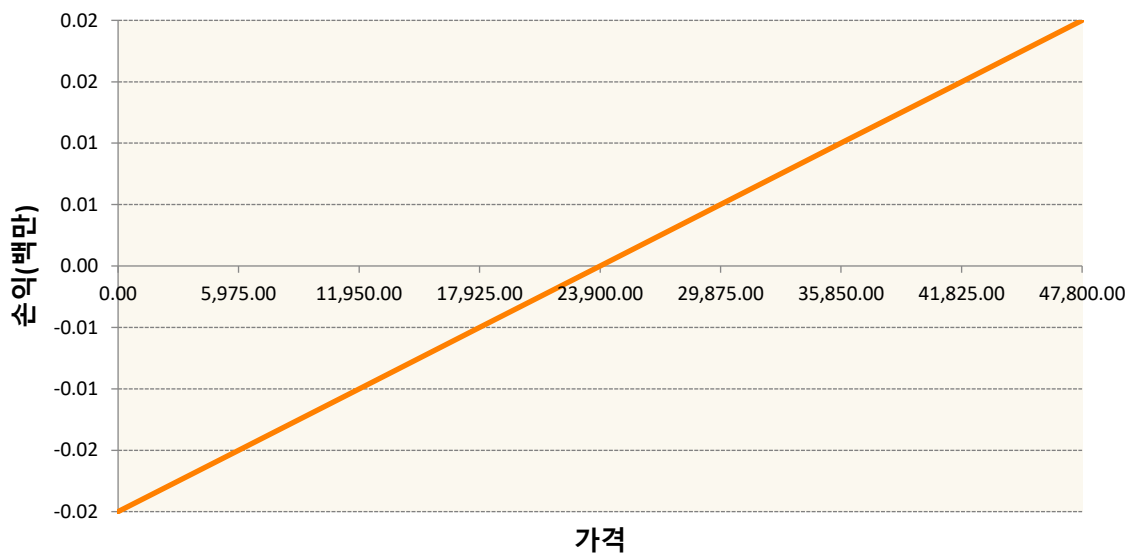
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



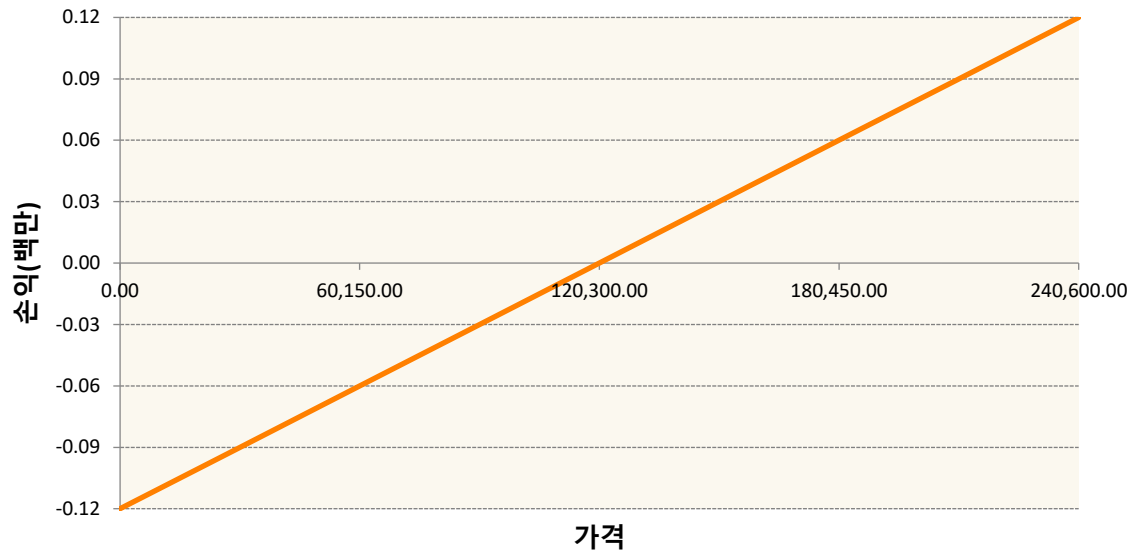
KR4123W50005-2025-05 삼성전자개별선물



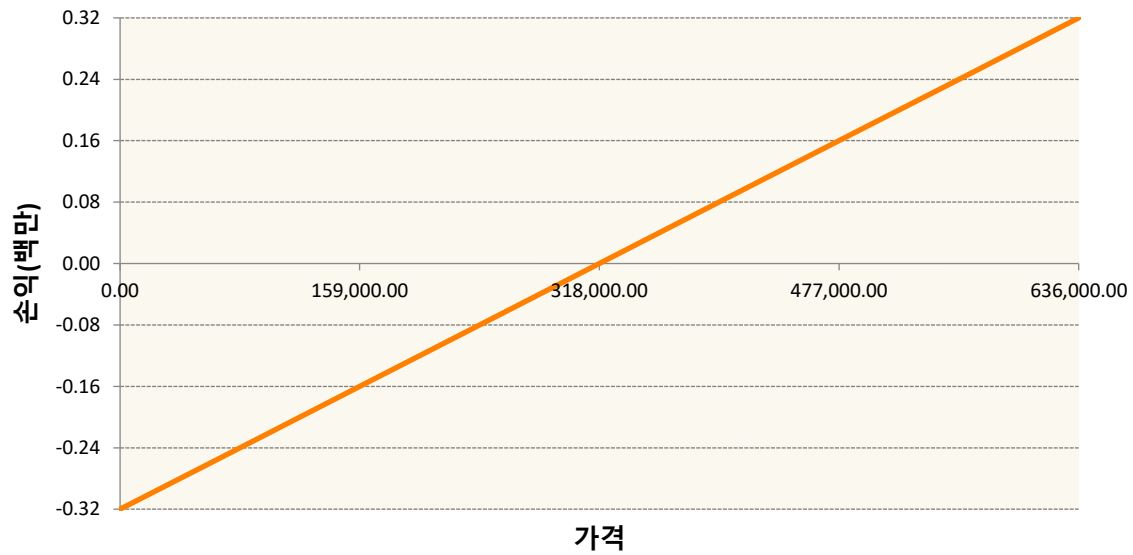
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



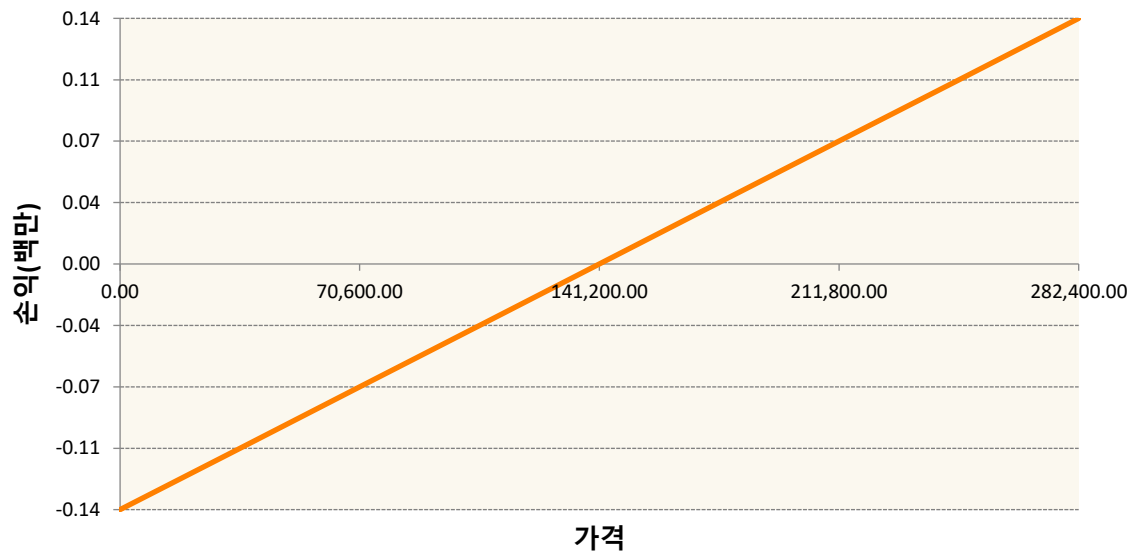
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	102
KR410FW50(2025-05 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물	4
KR4123W50(2025-05 삼성전기개별선물	4
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물	1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물	13
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물	2

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

212

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

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	3,904	0	3,904	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래250320	294
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

476

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

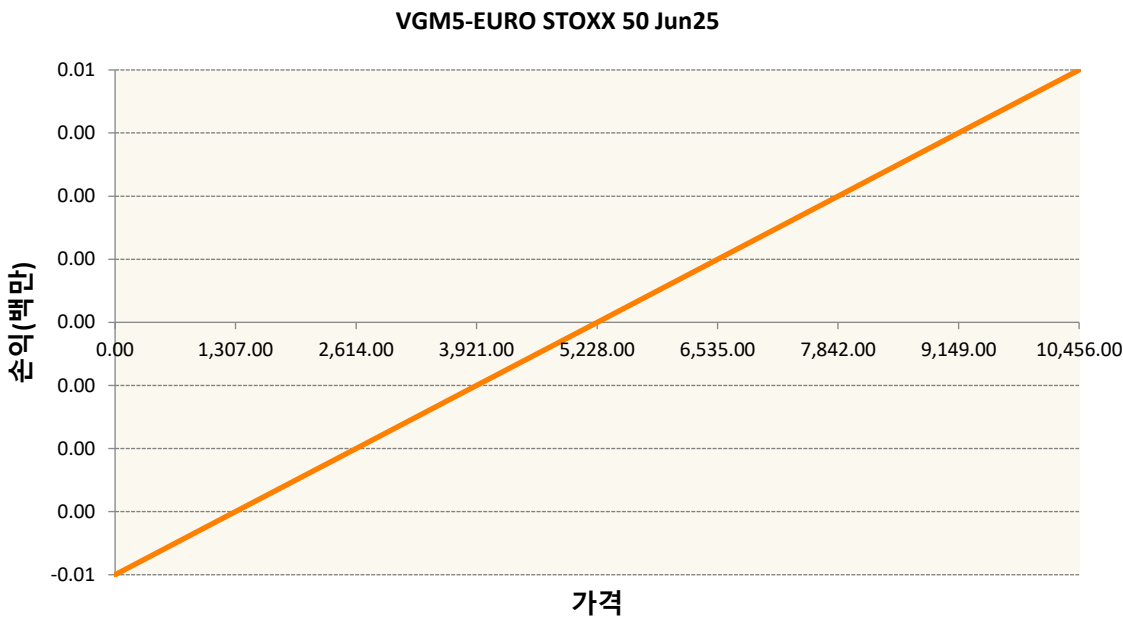
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	916	0	916	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

60

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

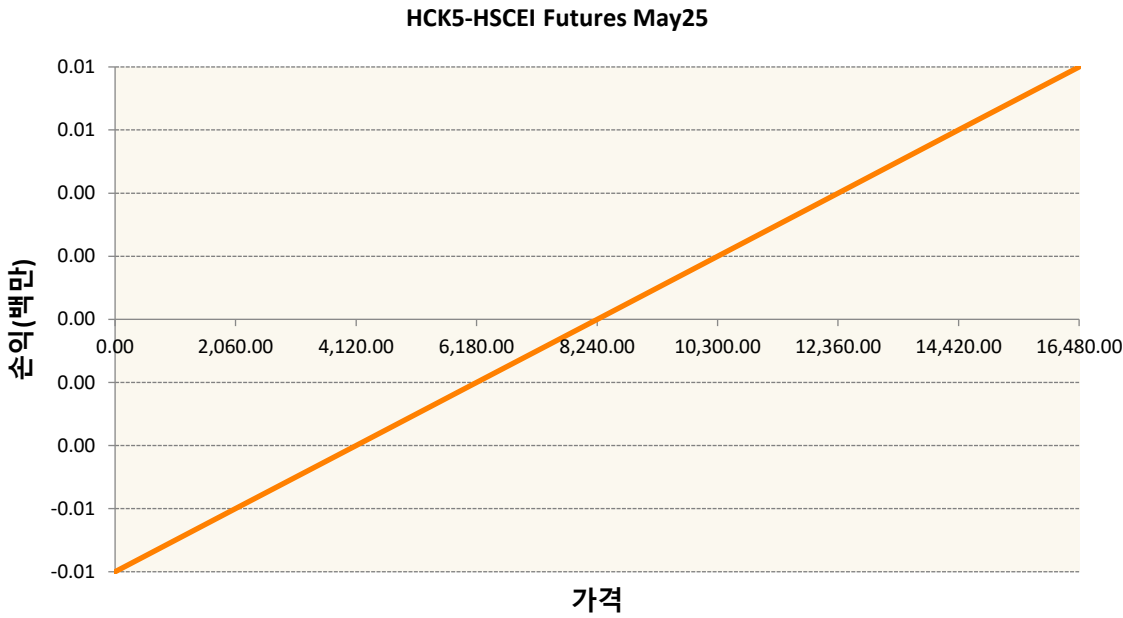
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,372	0	2,372	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK5	HSCEI Futures May25	190
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

283

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

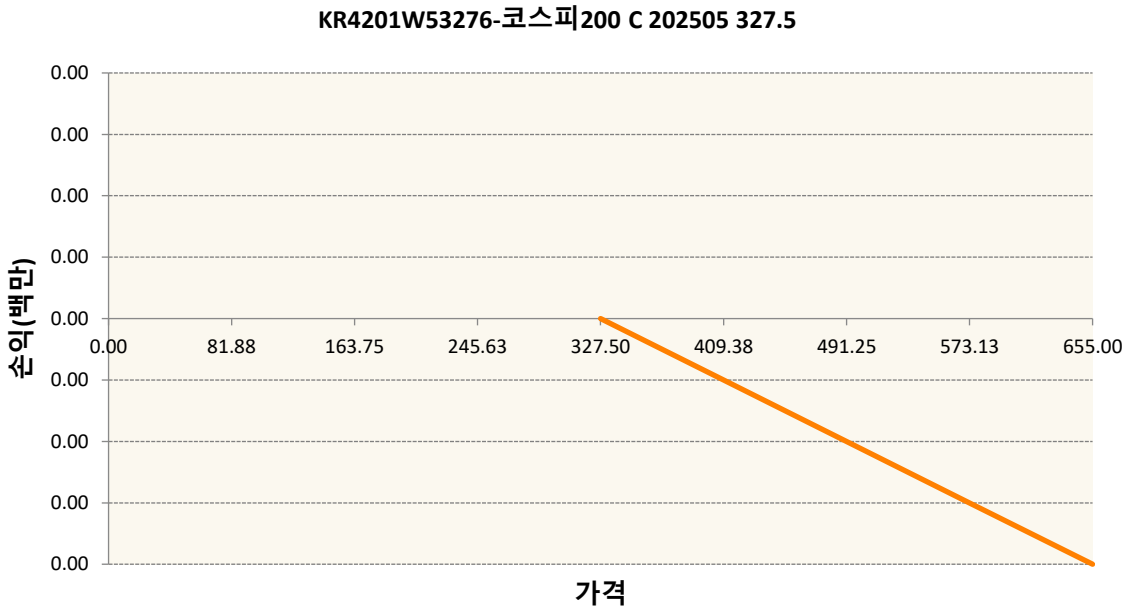
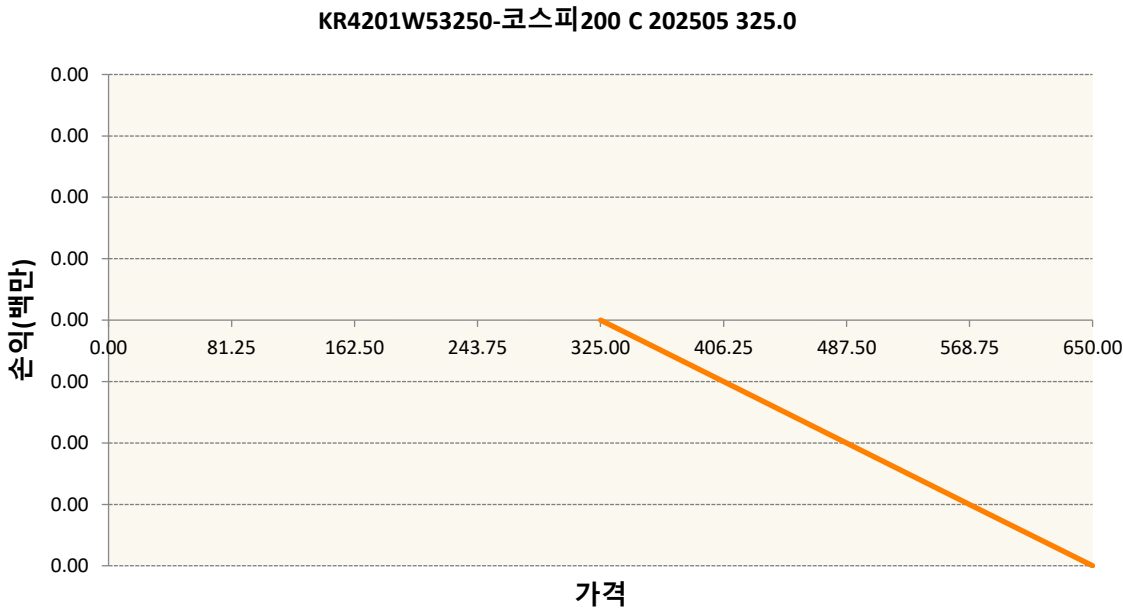
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	35,108	-35,108	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 650.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -10.00 to 10.00. An orange line represents the relationship, starting at the origin (0,0) and reaching a profit of 2 million at a price of 325.00.

가격 (Price)	손익 (Profit/Loss in millions)
0.00	0.00
81.25	0.40
162.50	0.80
243.75	1.20
325.00	2.00

The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 655.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the profit function, starting at (0, 0) and ending at (327.50, 0.00). This indicates that the profit is zero at a price of 327.50.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
327.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201W53250 코스피200 C 202505 325.0							2,328
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,390	1,390	1,390	1,390	1,390	1,390	1,389
-5.33%	1,358	1,350	1,341	1,333	1,324	1,315	1,306
-2.67%	776	775	774	773	771	769	767
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-776	-776	-776	-776	-776	-776	-776
5.33%	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552	-1,552
8.00%	-2,328	-2,328	-2,328	-2,328	-2,328	-2,328	-2,328
KR4201W53276 코스피200 C 202505 327.5							75
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	38	38	38	38
-5.33%	38	38	38	37	37	37	37
-2.67%	25	25	25	25	24	24	24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
KR4301W53258 코스피200 P 202505 325.0							215

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-215
-5.33%	-44	-46	-48	-50	-52	-54	-56
-2.67%	0	0	0	-1	-1	-1	-2
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

KR4301W53274 코스피200 P 202505 327.5							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%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-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)

2,425

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	541	0	541	

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	2025-05-08
기준일	2025-05-07

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	4,350	0	4,350	

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	2025-05-08
기준일	2025-05-07

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	12,510	0	12,510	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

IE00BD8RGM75

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

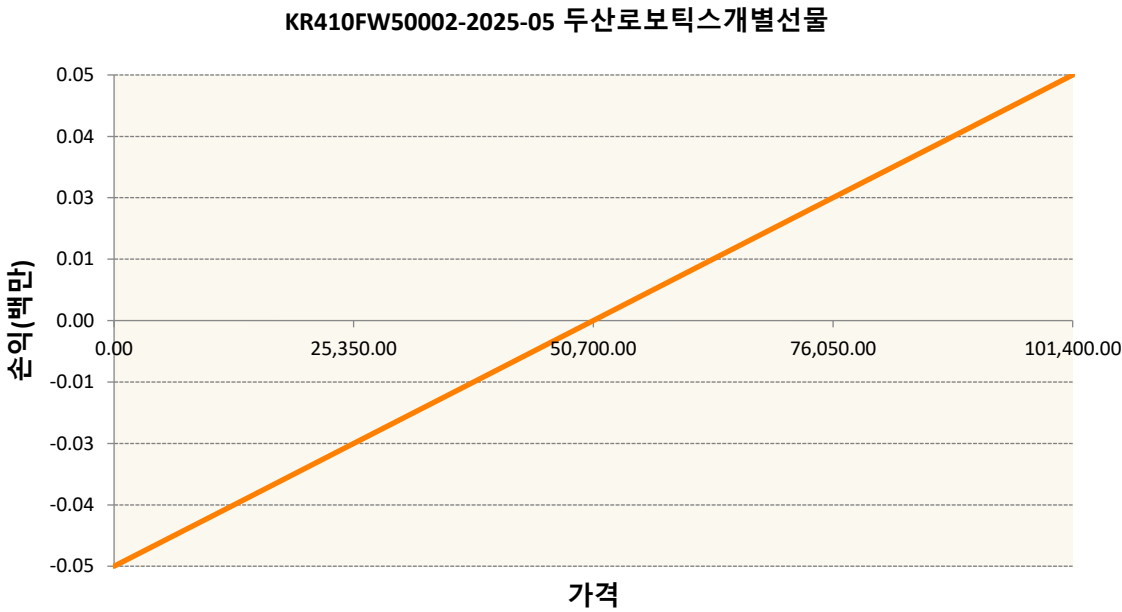
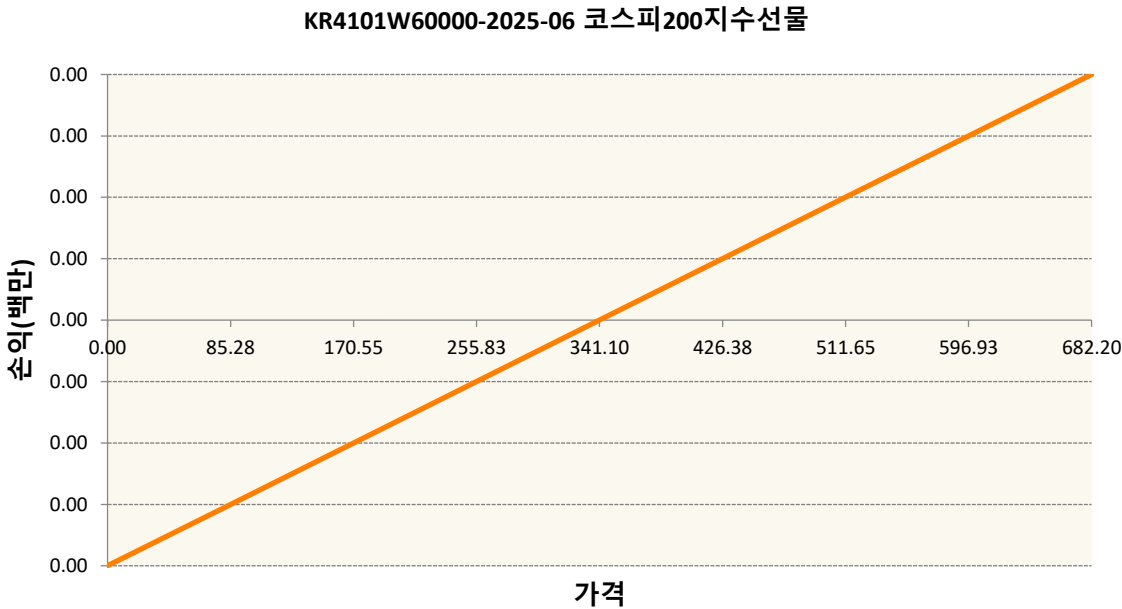
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

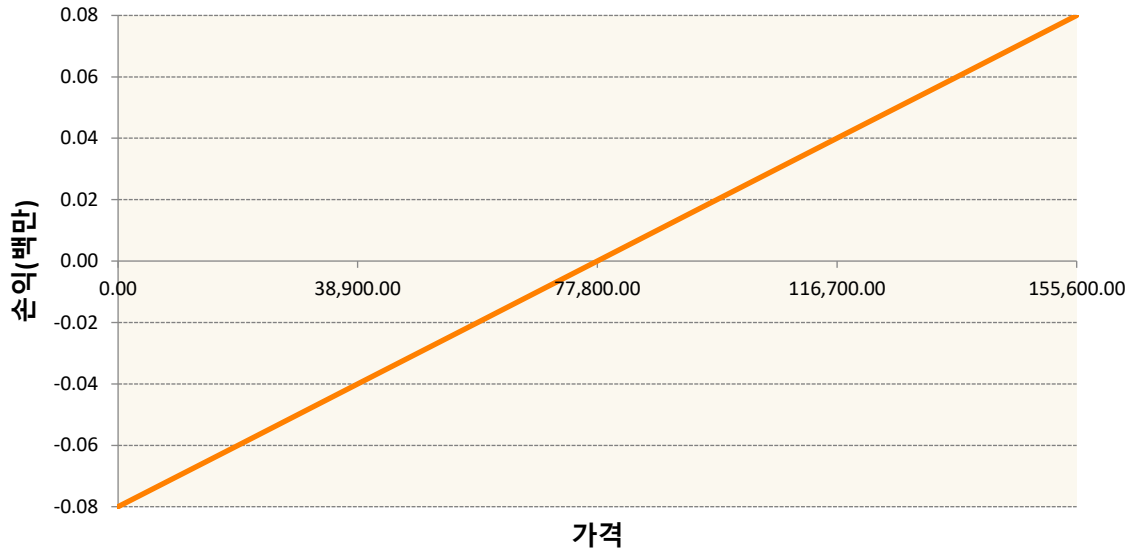
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,124	0	1,124	장내

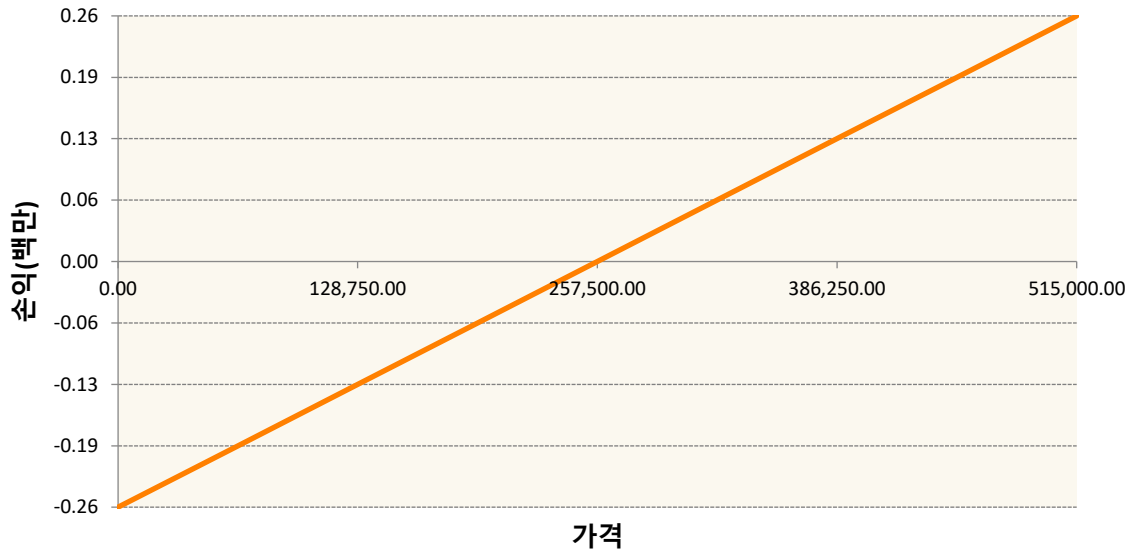
2. 만기시점의 손익구조



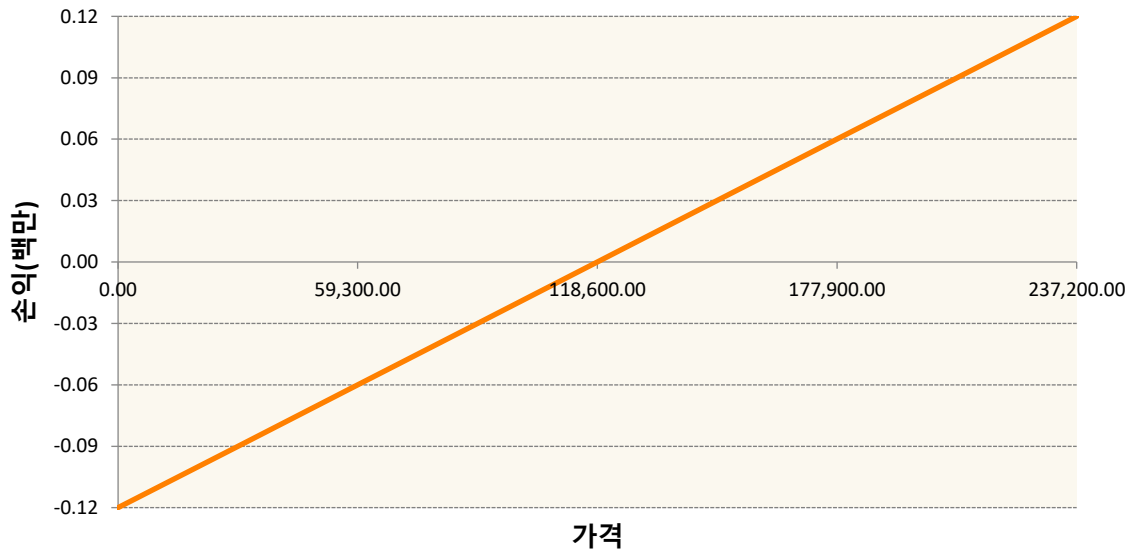
KR410ZW50000-2025-05 한미반도체개별선물



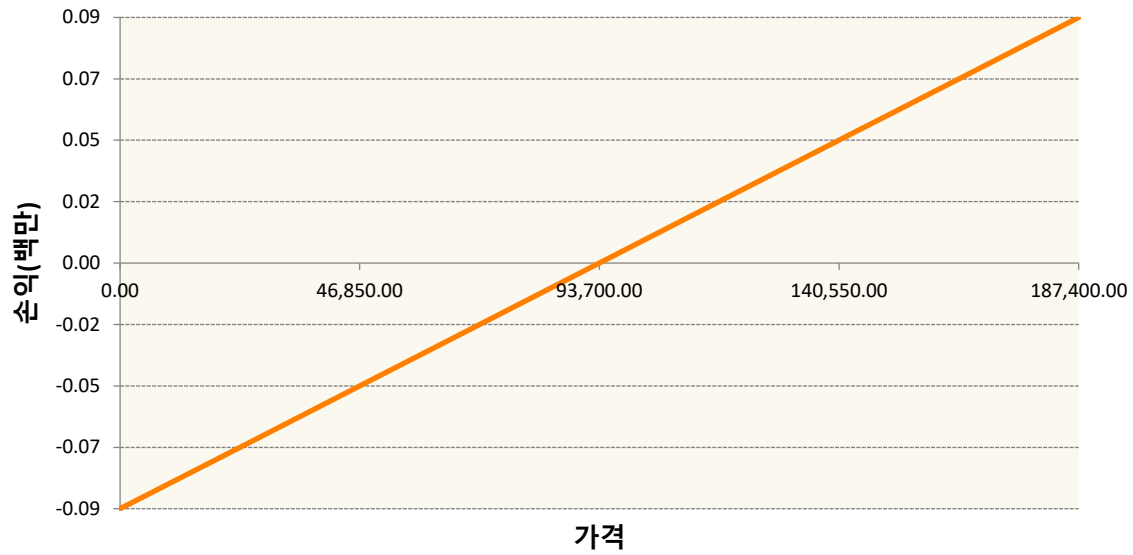
KR4120W50001-2025-05 현대모비스개별선물



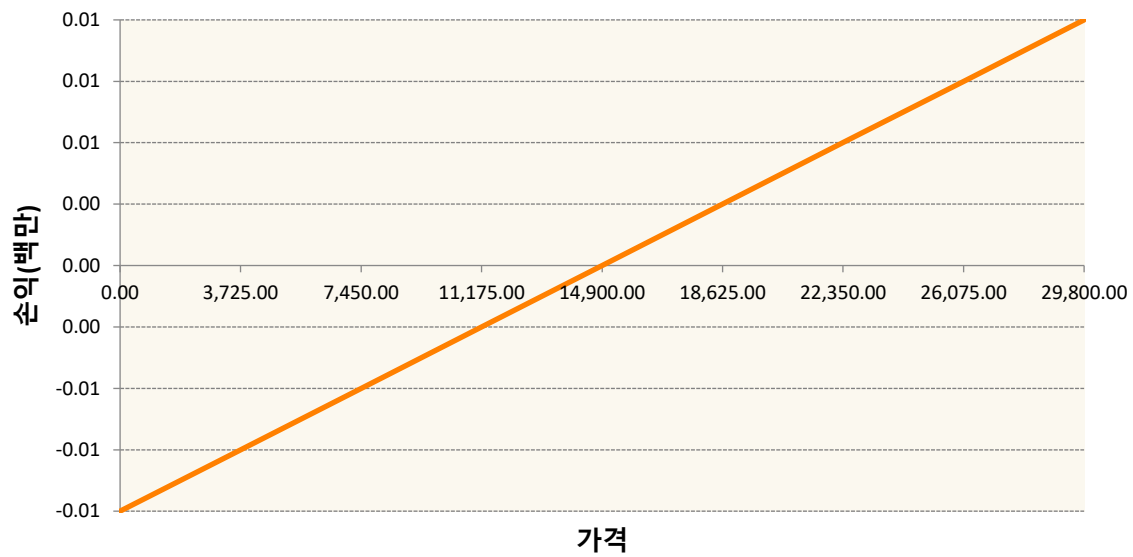
KR4123W50005-2025-05 삼성전자개별선물



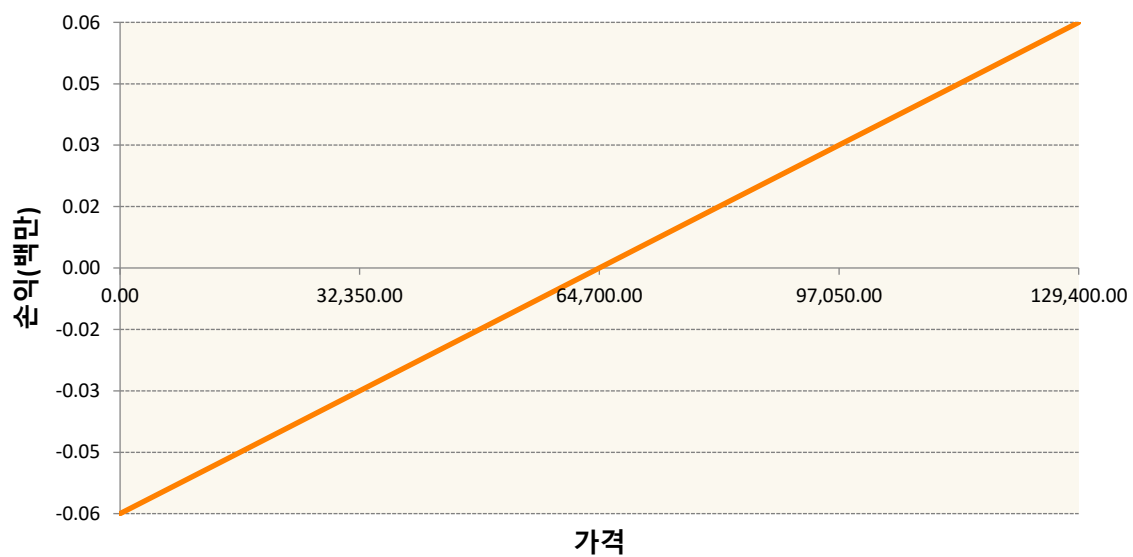
KR4146W50006-2025-05 KB금융개별선물



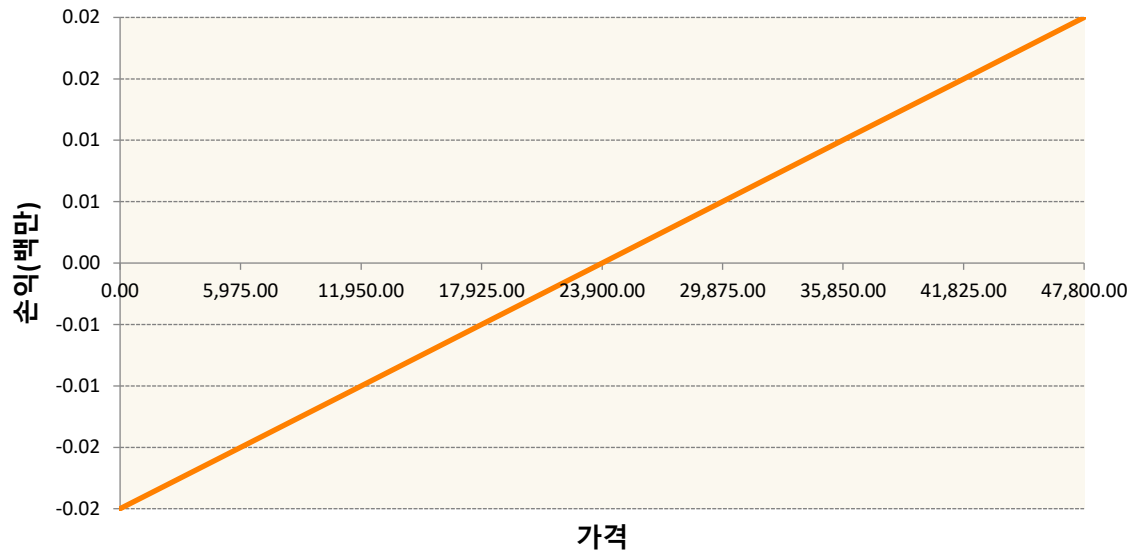
KR41BFW50008-2025-05 삼성중공업개별선물



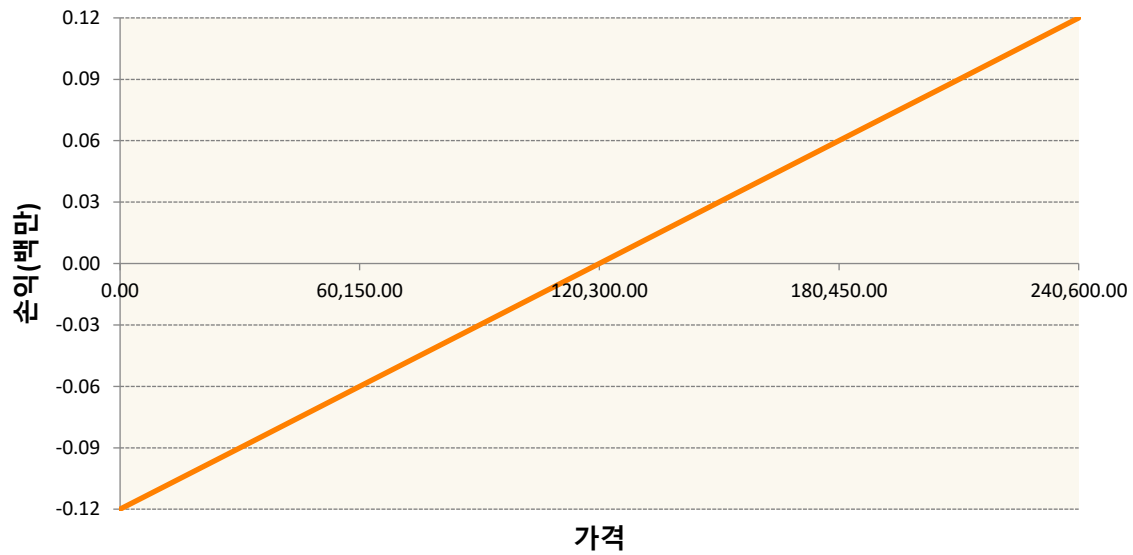
KR41C0W50000-2025-05 OCI홀딩스개별선물



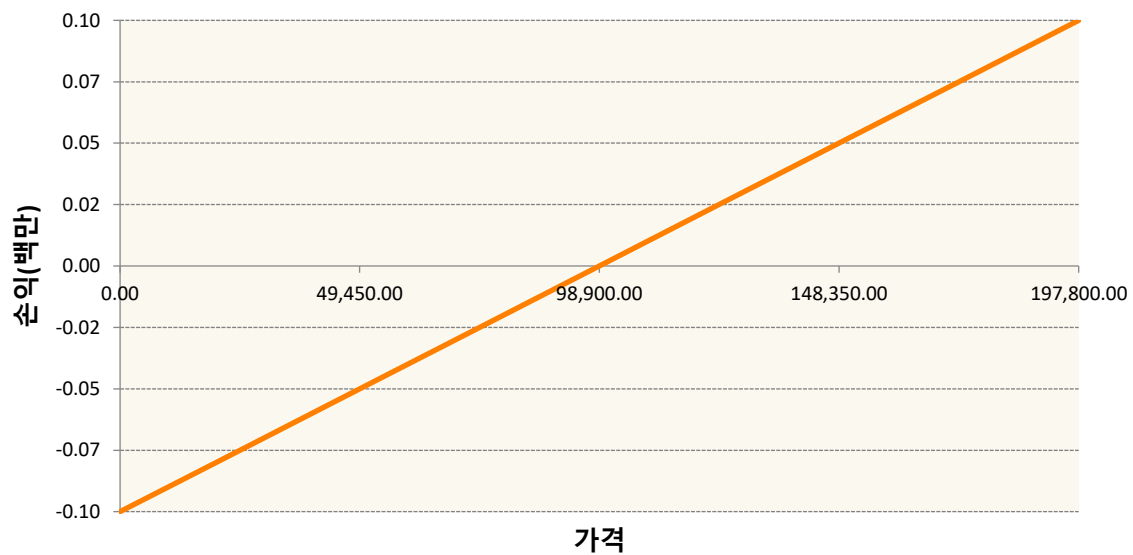
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



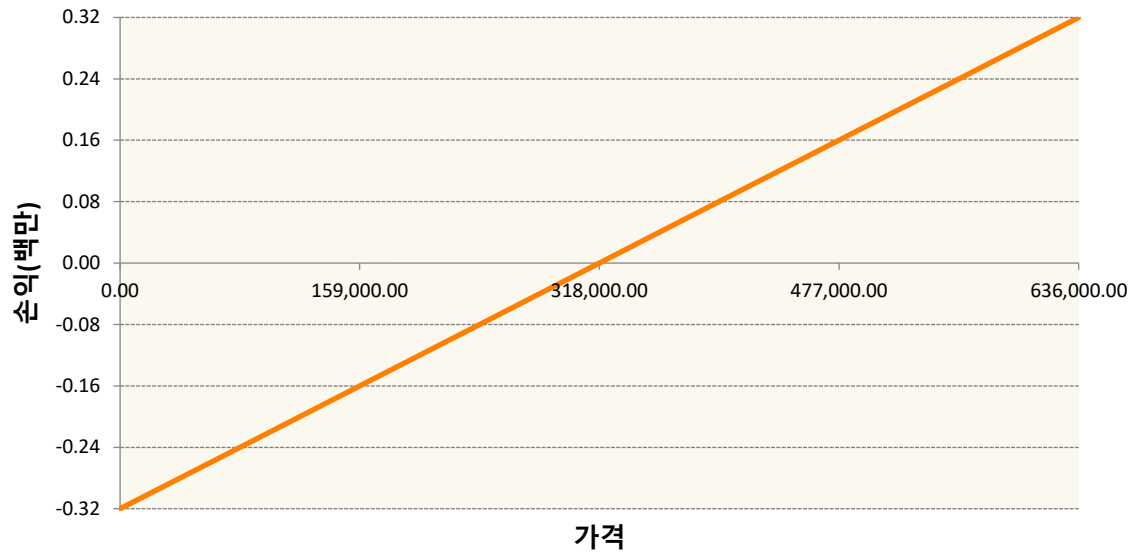
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



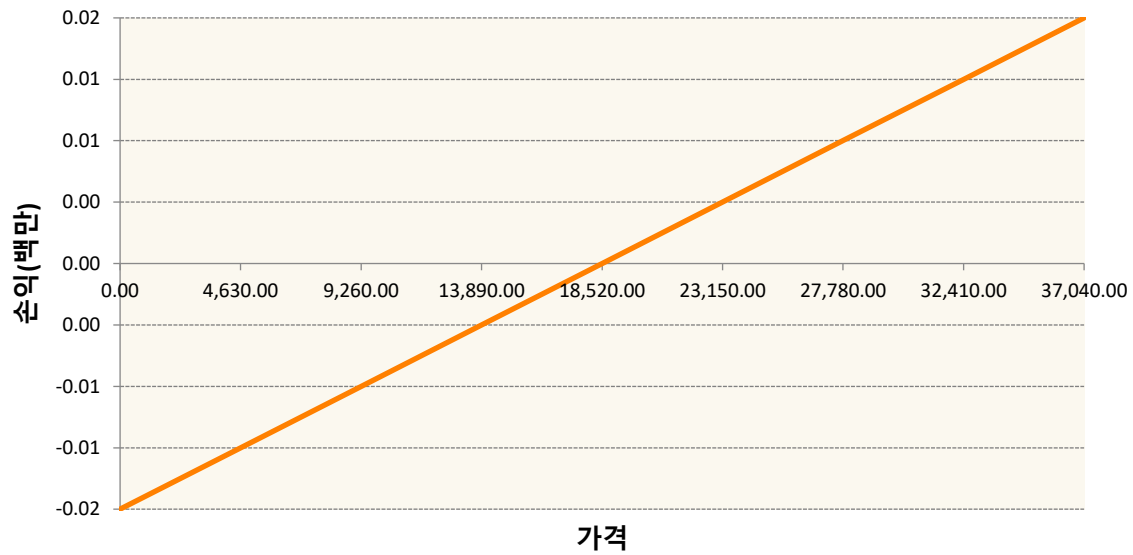
KR41EYW60002-2025-06 에코프로비엠개별선물



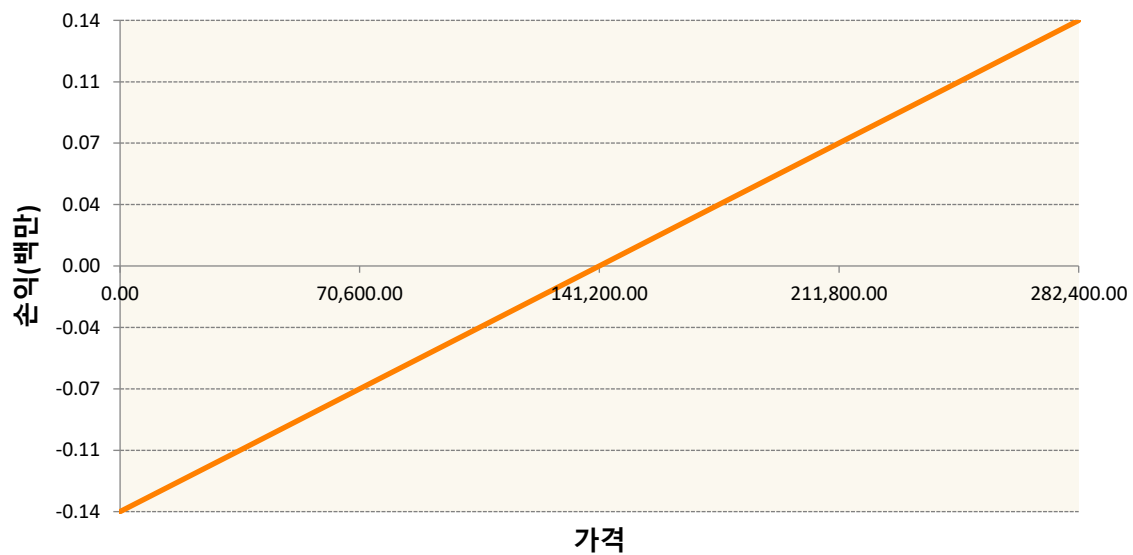
KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



KR41FAW50000-2025-05 HMM개별선물



KR41HEW50008-2025-05 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		68
KR410FW50(2025-05 두산로보틱스개별선물		0.49
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물		2
KR4120W50(2025-05 현대모비스개별선물		0.21
KR4123W50(2025-05 삼성전기개별선물		3
KR4146W50(2025-05 KB금융개별선물		1
KR41BFW50(2025-05 삼성중공업개별선물		0.42
KR41C0W50(2025-05 OCI홀딩스개별선물		0.05
KR41CNW60(2025-06 포스코DX개별선물		1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물		2
KR41EYW60(2025-06 에코프로비엠개별선물		2
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물		6
KR41FAW50(2025-05 HMM개별선물		3
KR41HEW50(2025-05 키움증권개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	146

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

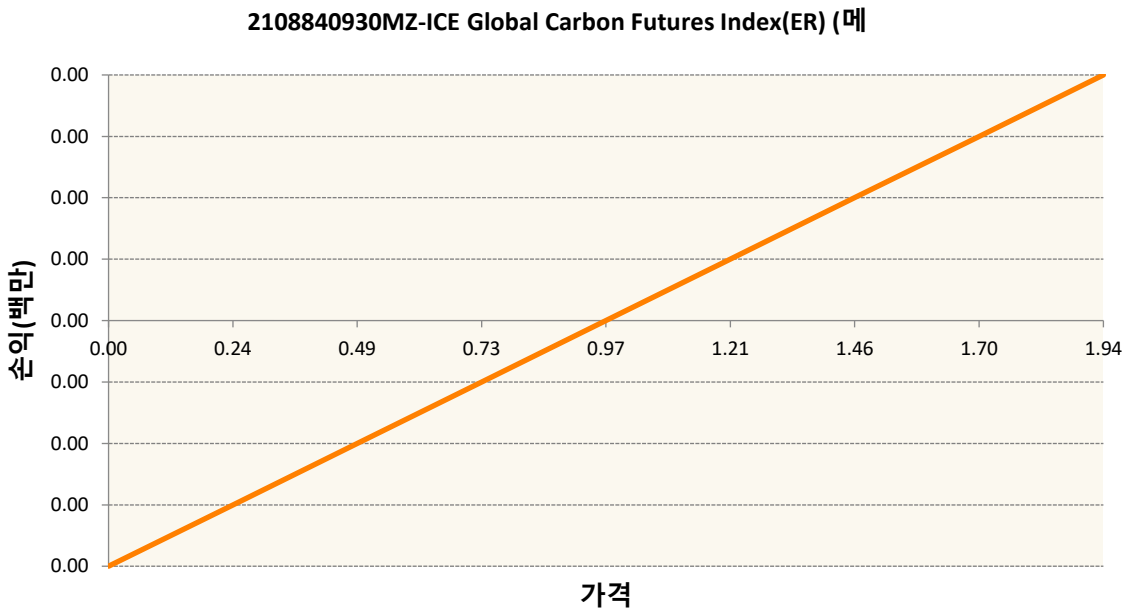
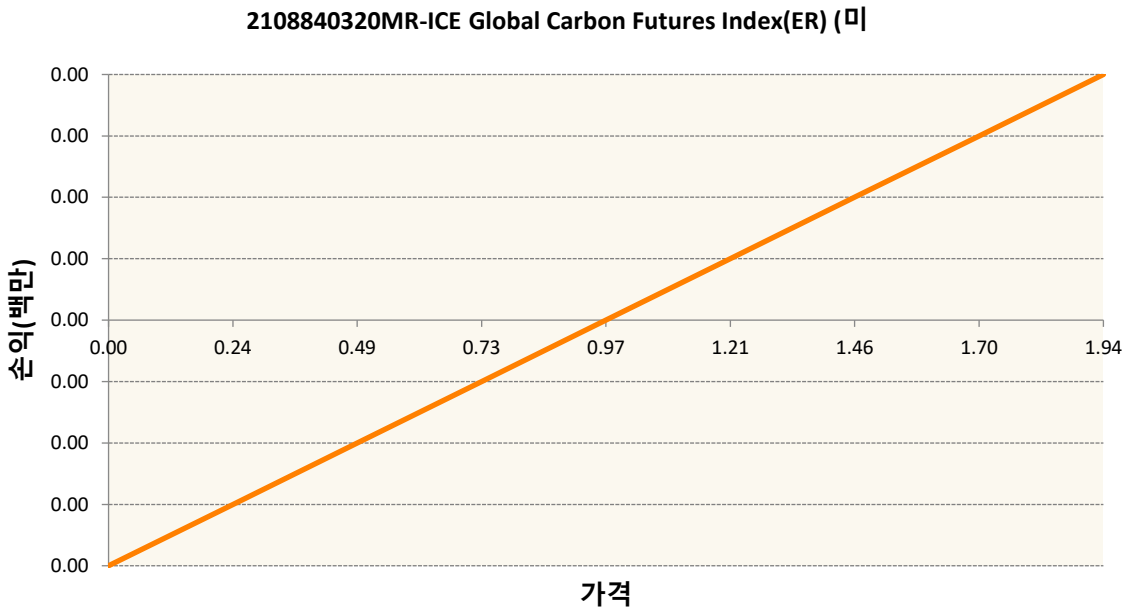
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,543	0	9,543	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	574
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	192

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	896

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

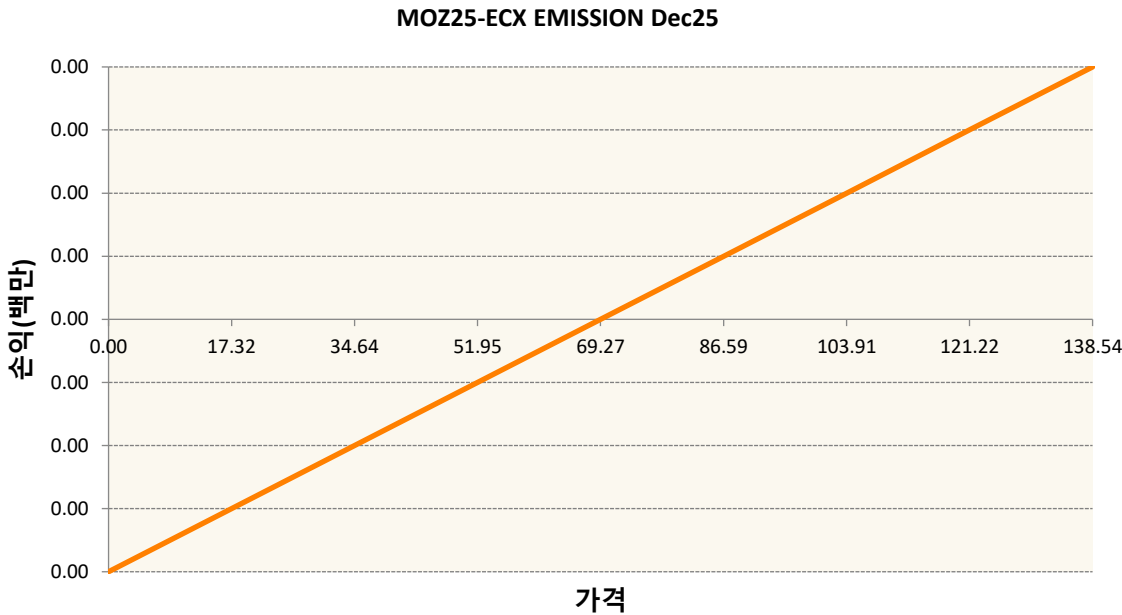
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,053	0	6,053	
누계	통화	선도	0	987	-987	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	1
FXW213F4V(KRW/EUR 30-05-25E	79
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	485

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

(단위:백만원)

900

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	4,362	0	4,362	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	19

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

(단위:백만원)

111

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

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	8,845	0	8,845	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	21
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	25
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	5

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

(단위:백만원)

121

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

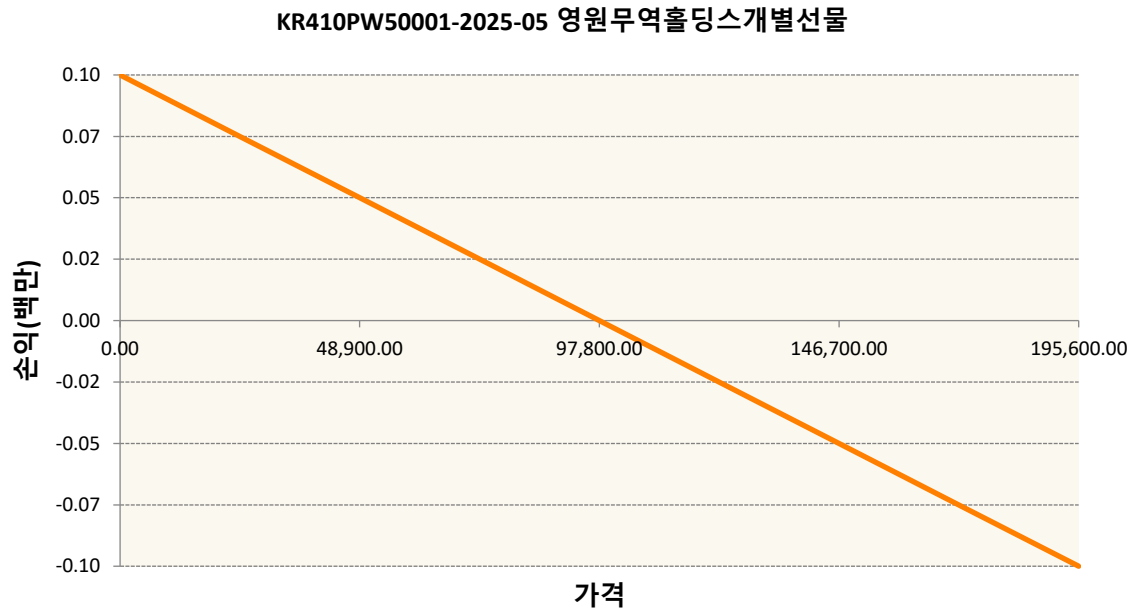
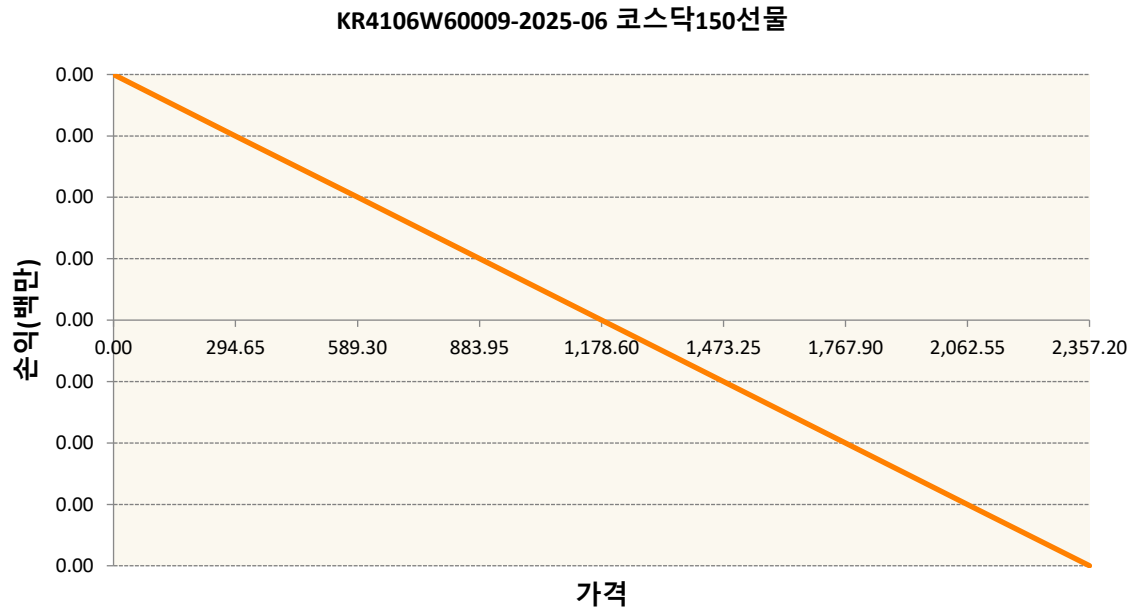
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

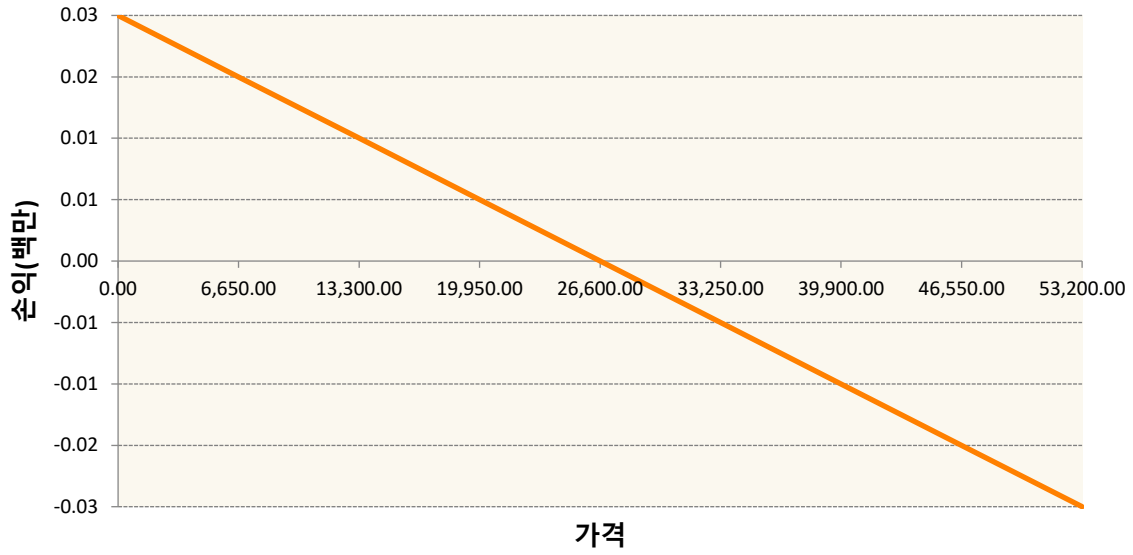
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	34	-34	장내

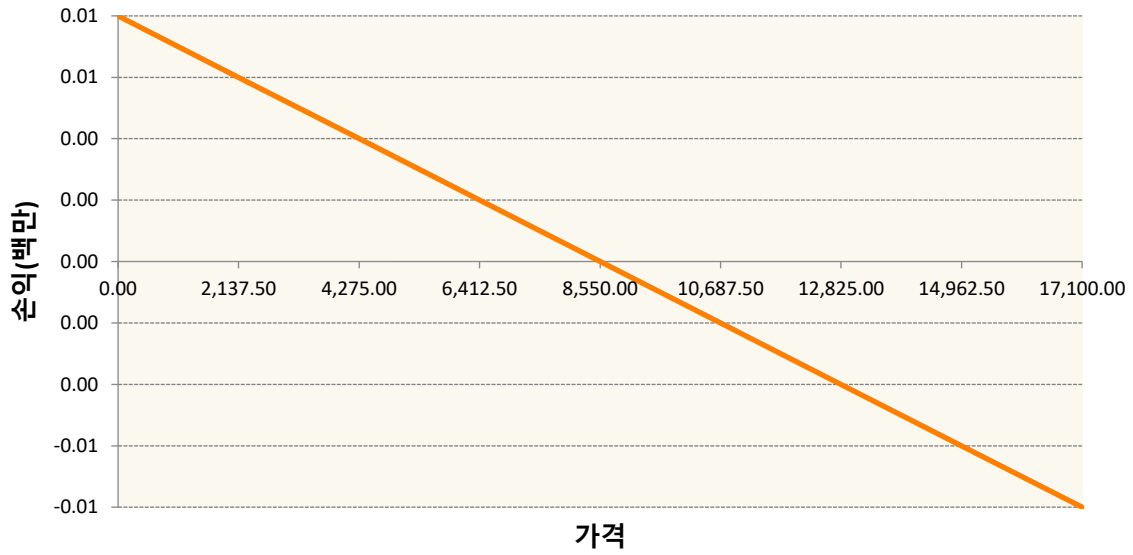
2. 만기시점의 손익구조



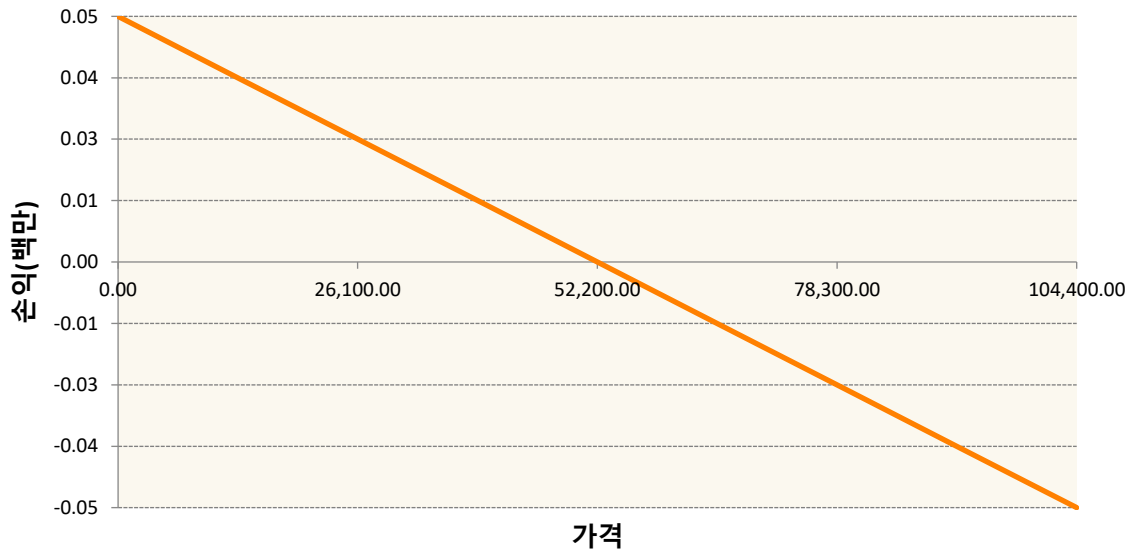
KR4115W50001-2025-05 한국전력개별선물



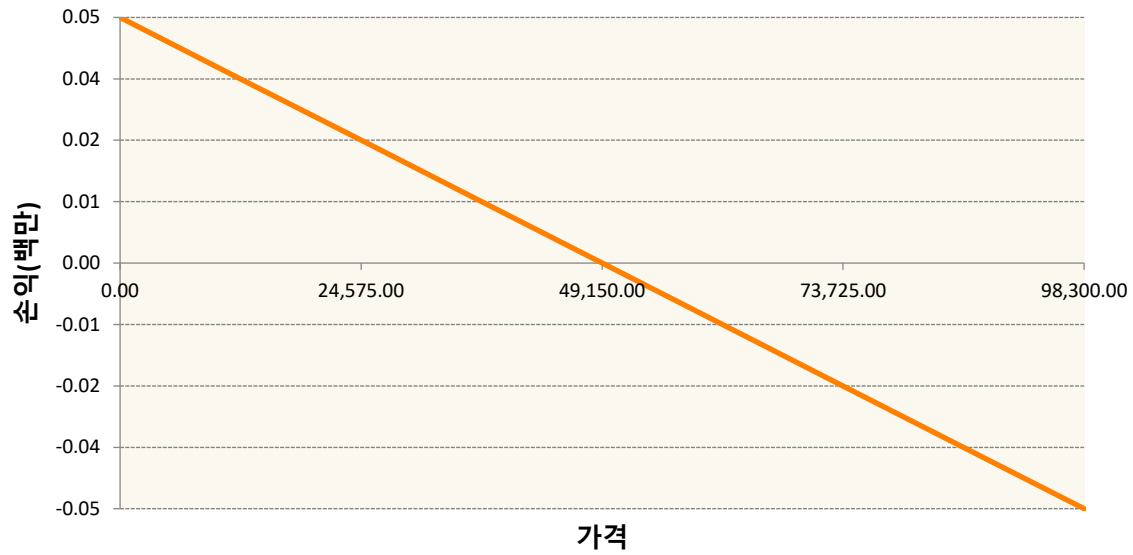
KR4149W50000-2025-05 HD현대인프라코어개별선물



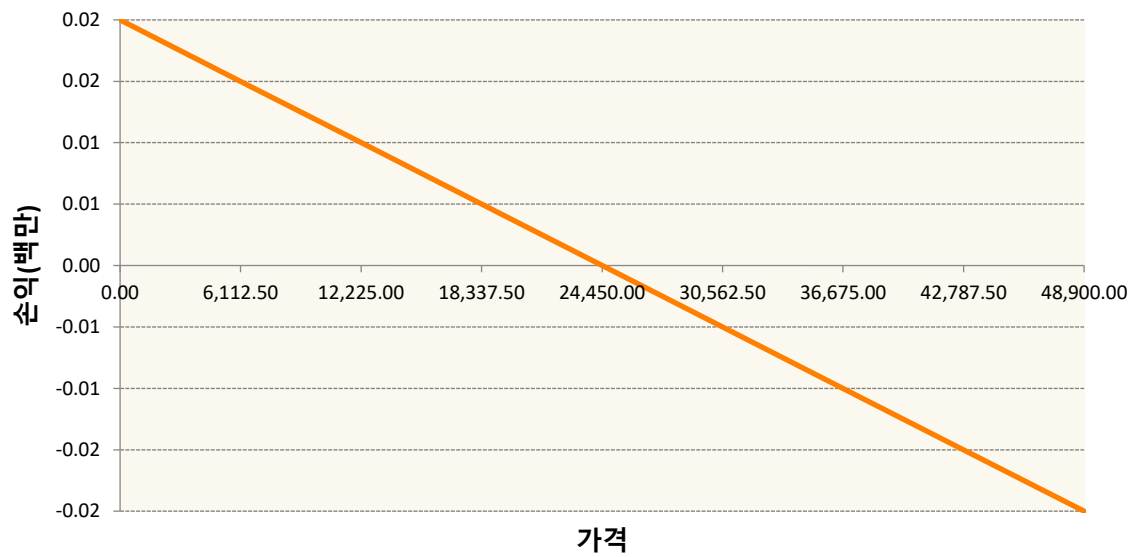
KR41B2W50007-2025-05 S-Oil개별선물



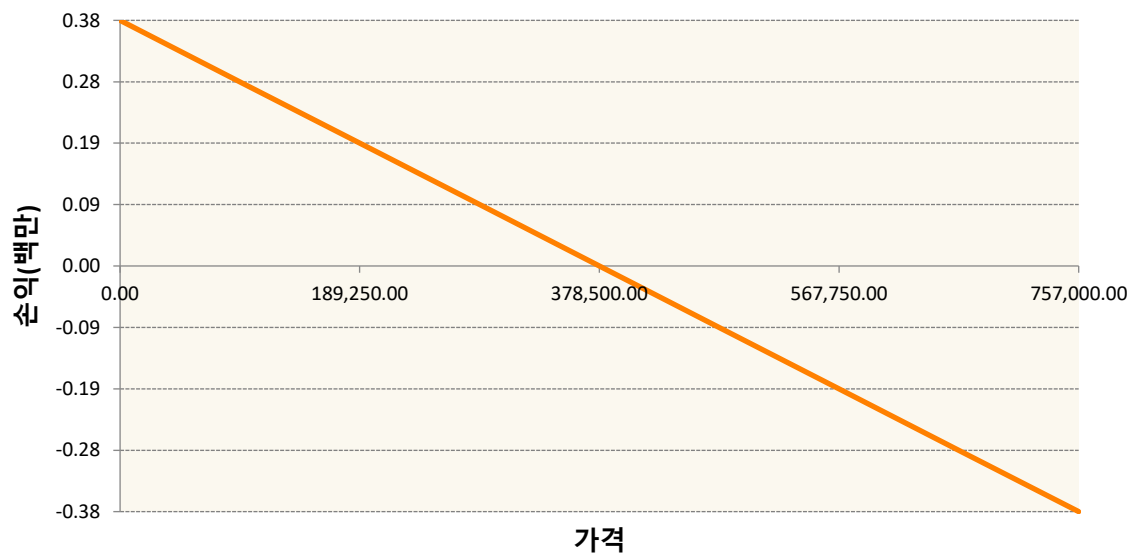
KR41B7W50006-2025-05 포스코인터내셔널개별선물



KR41CNW50000-2025-05 포스코DX개별선물



KR41HSW50008-2025-05 파마리서치개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4106W60(2025-06 코스닥150선물		1
KR410PW50(2025-05 영원무역홀딩스개별선물		0.08
KR4115W50(2025-05 한국전력개별선물		0.34
KR4149W50(2025-05 HD현대인프라코어개별선물		0.21
KR41B2W50(2025-05 S-Oil개별선물		0.25
KR41B7W50(2025-05 포스코인터내셔널개별선물		0.2
KR41CNW50 2025-05 포스코DX개별선물		0.37
KR41HSW50 2025-05 파마리서치개별선물		0.3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

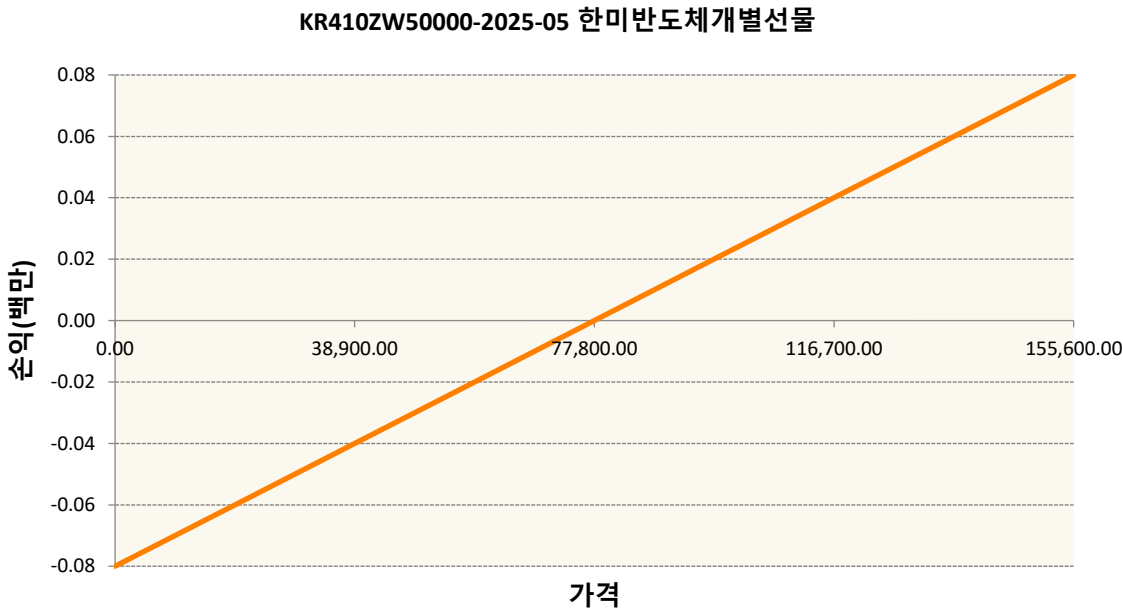
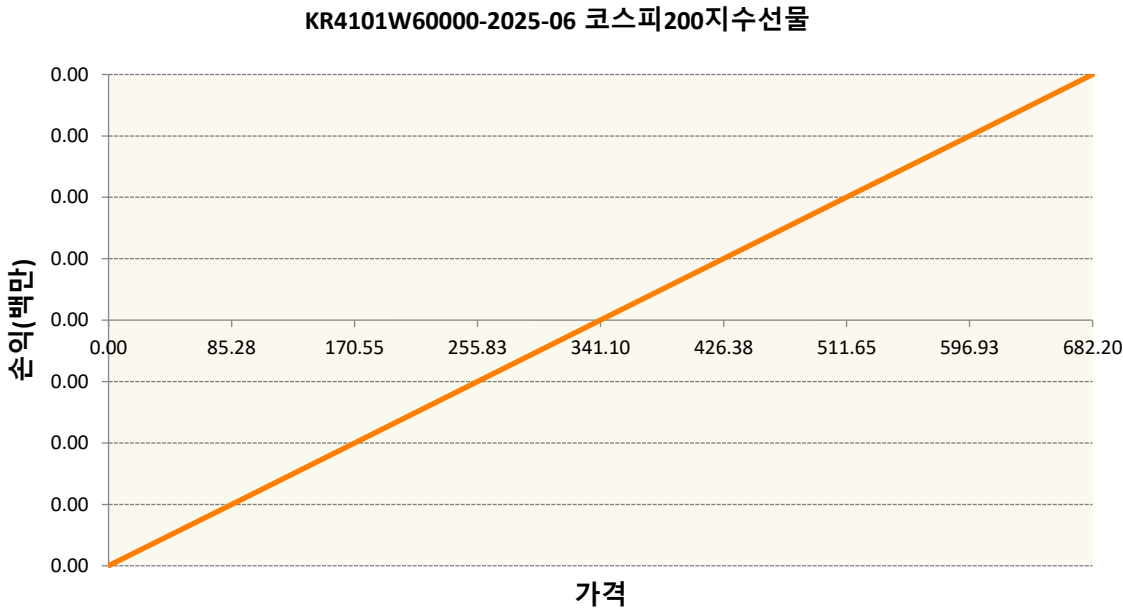
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

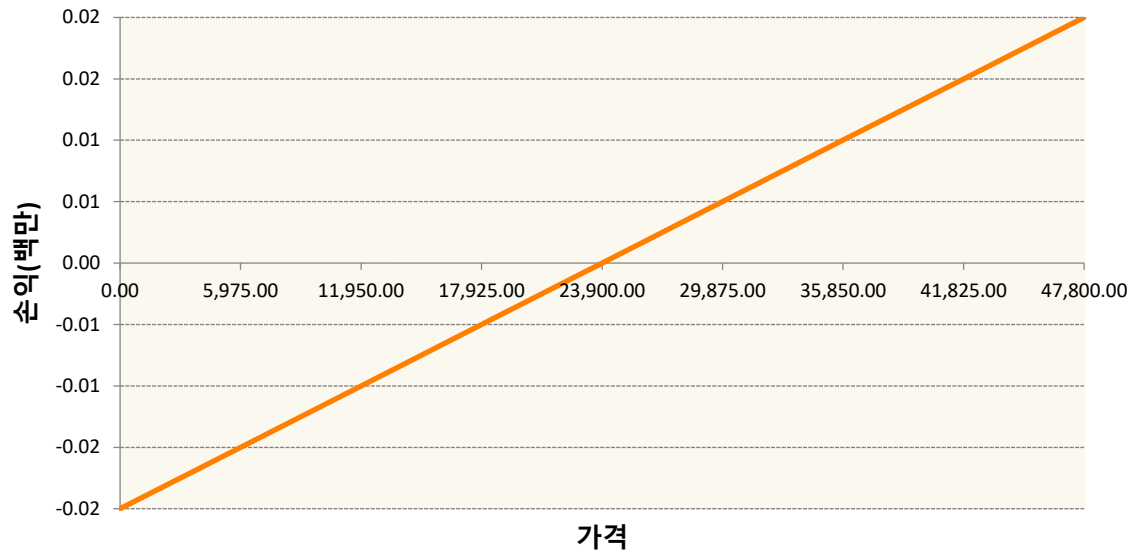
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	171	0	171	장내
누계	유가증권	선물	9,805	0	9,805	장내

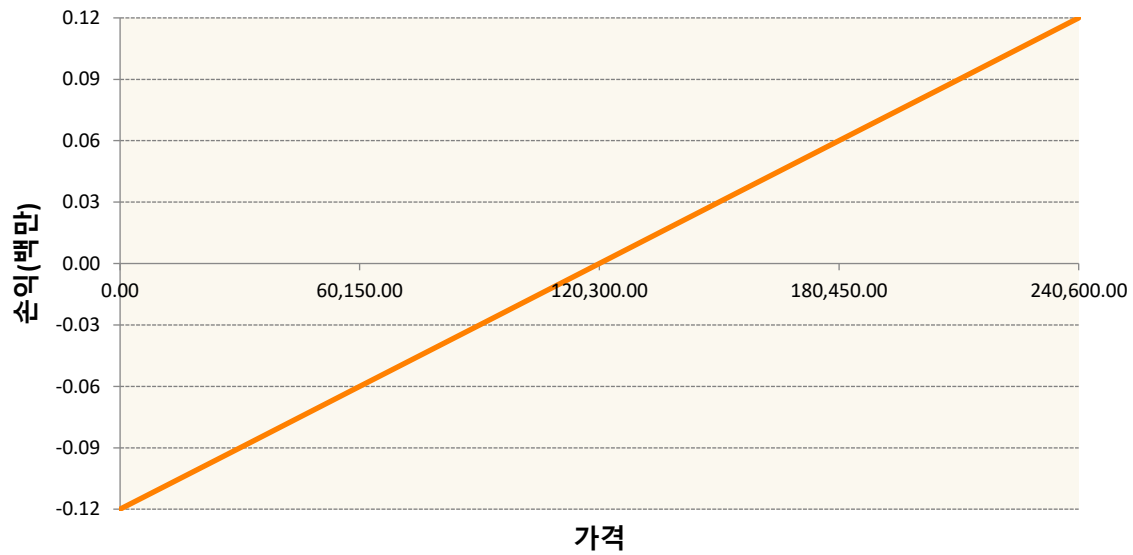
2. 만기시점의 손익구조



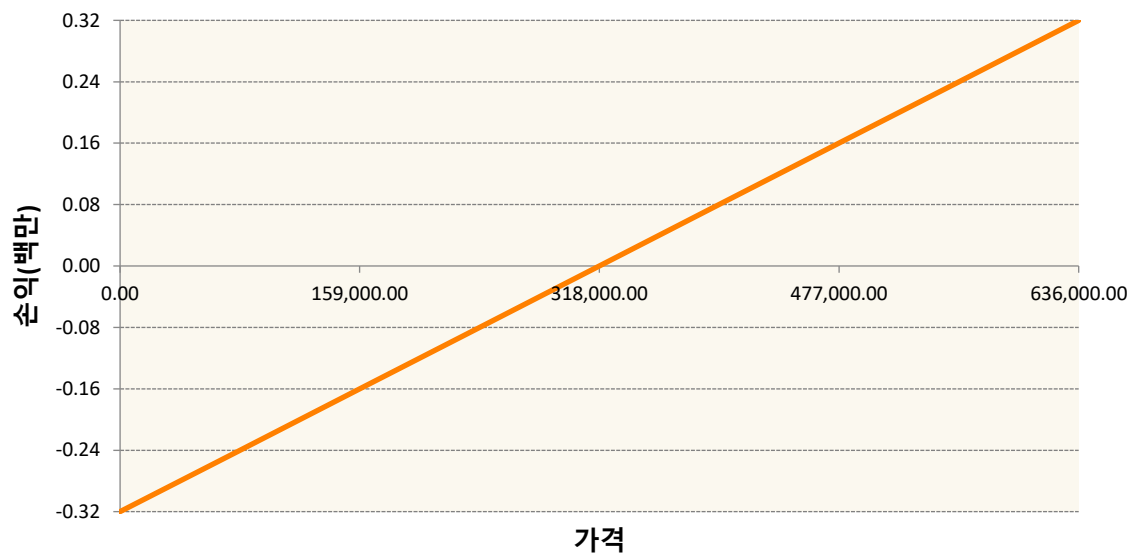
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		614
KR410ZW50(2025-05 한미반도체개별선물		33
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물		12
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물		15
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물		110

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,241

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

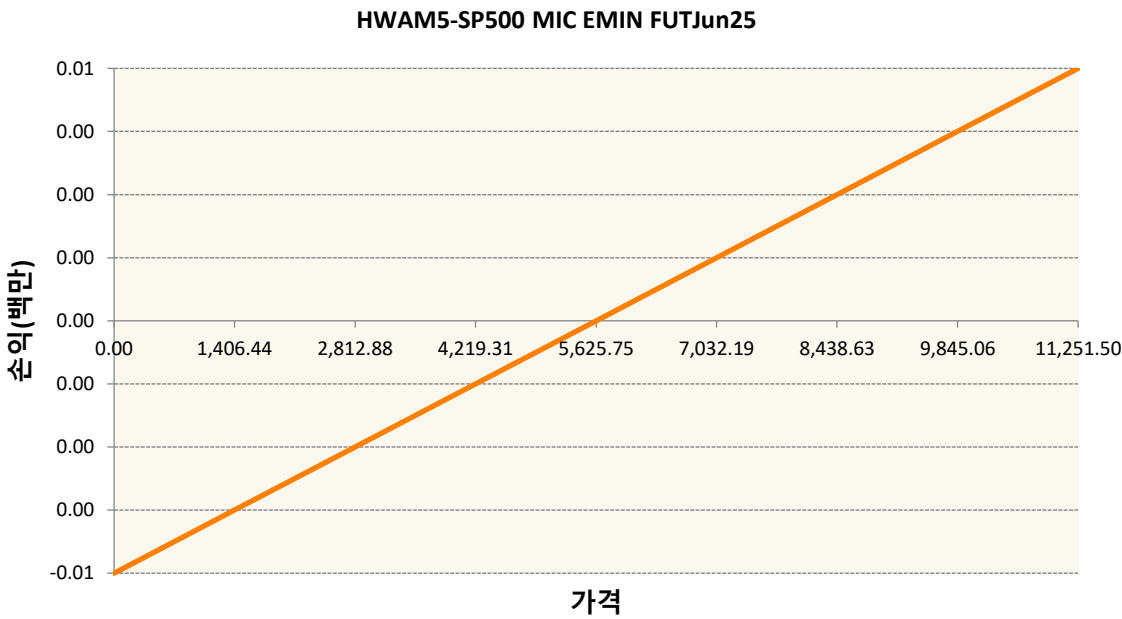
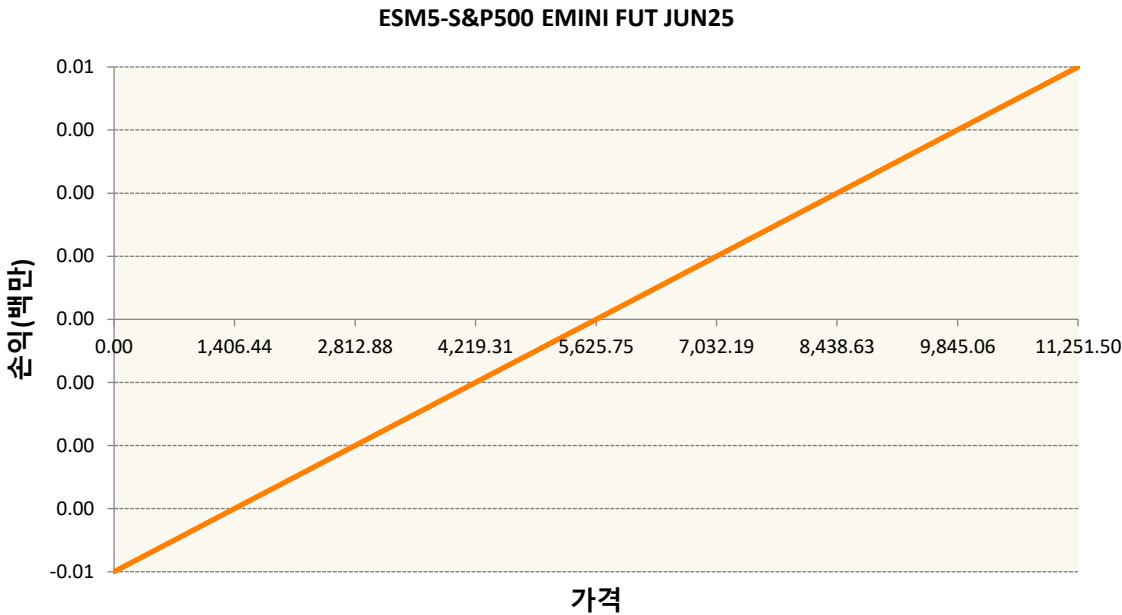
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,191	0	1,191	장내
누계	지수	선물	27,100	0	27,100	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,168
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	95

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,982

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

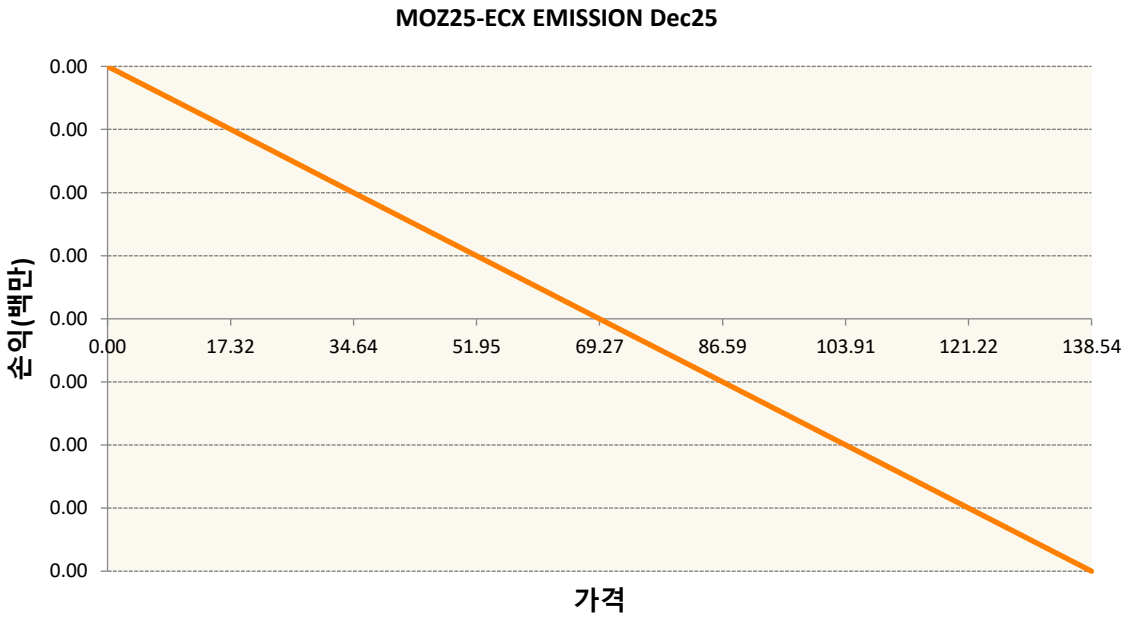
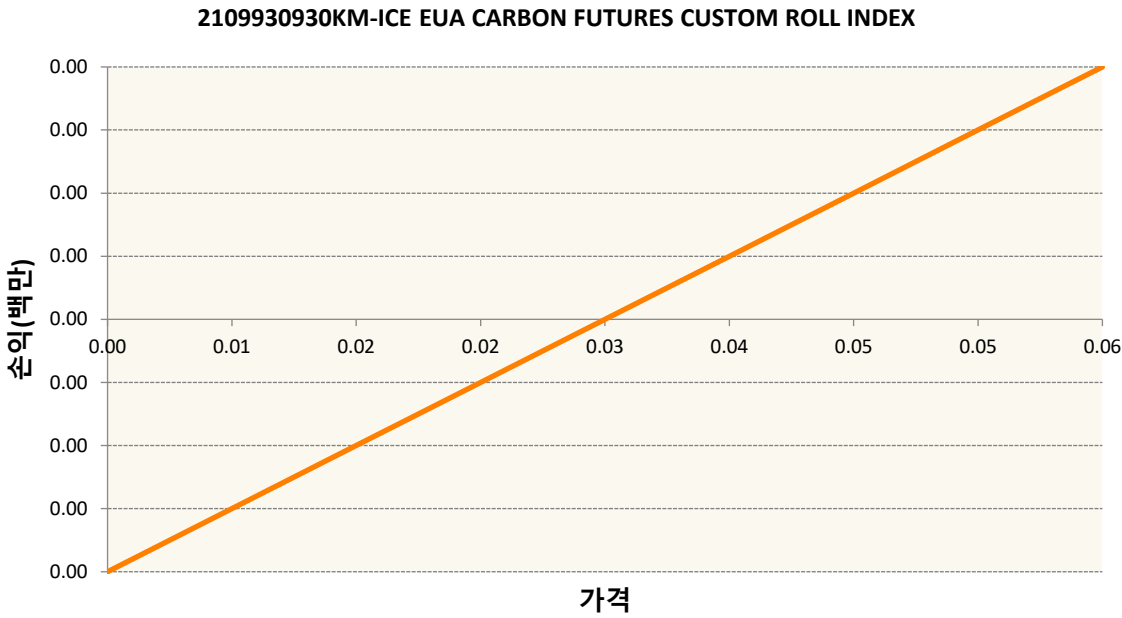
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	11	5,434	-5,422	
누계	통화	선도	0	1,425	-1,425	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		1
FXW213F4V(KRW/EUR 30-05-25E		22
FXW213F4V(KRW/EUR 30-05-25E		92
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		435

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	833

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

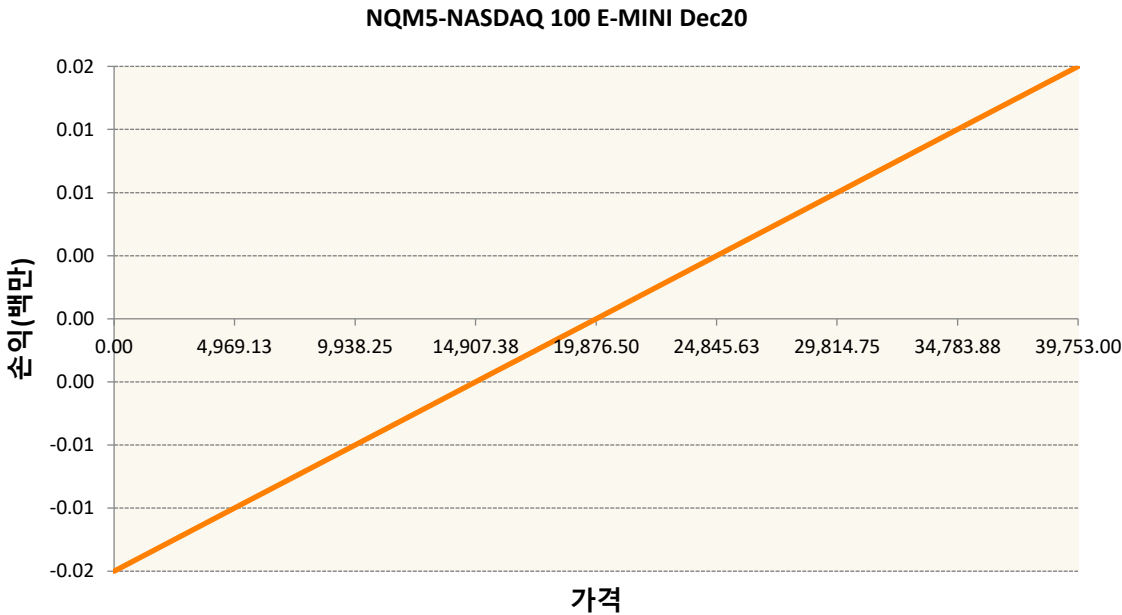
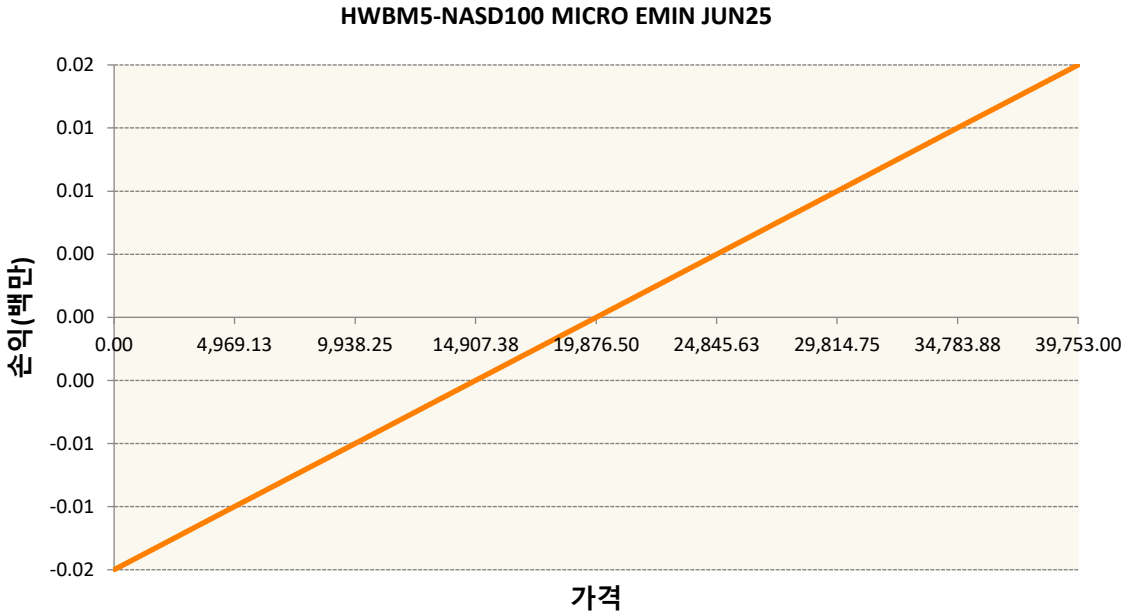
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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
누계	유가증권	선물	13,318	0	13,318	
누계	유가증권	선물	291	0	291	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		23
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,065

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,237

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	ELS	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	ELS	2,055	0	2,055	장외
누계	지수	스왑	252,406	0	252,406	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,980
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,001
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	1,414
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,592
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	159

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

(단위:백만원)

9,842

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

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	6,643	0	6,643	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2

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

(단위:백만원)

13

공시일	2025-05-08
기준일	2025-05-07

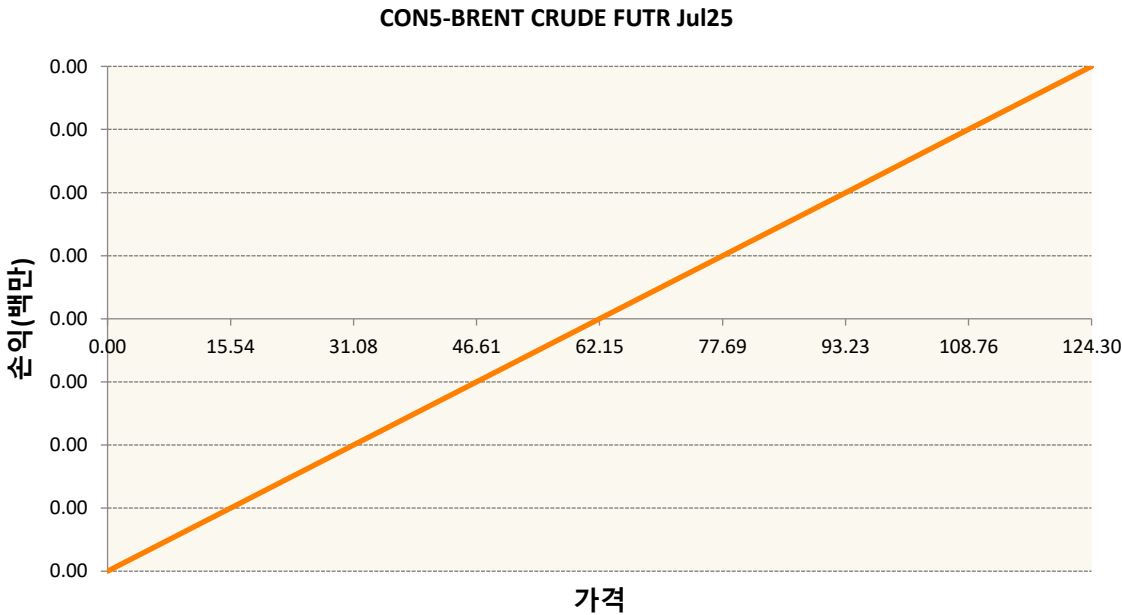
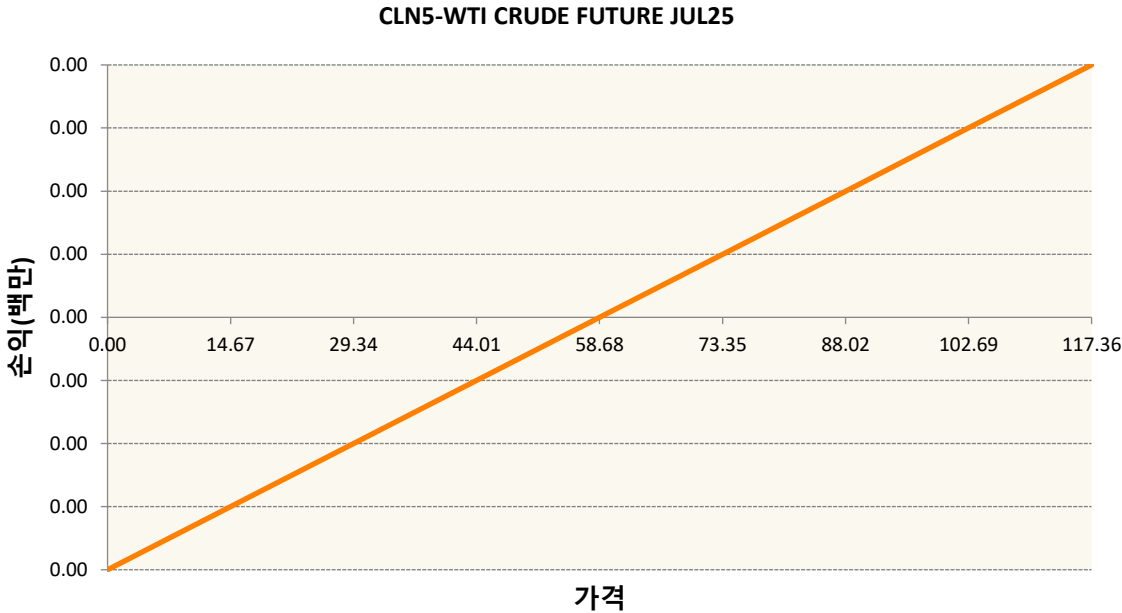
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

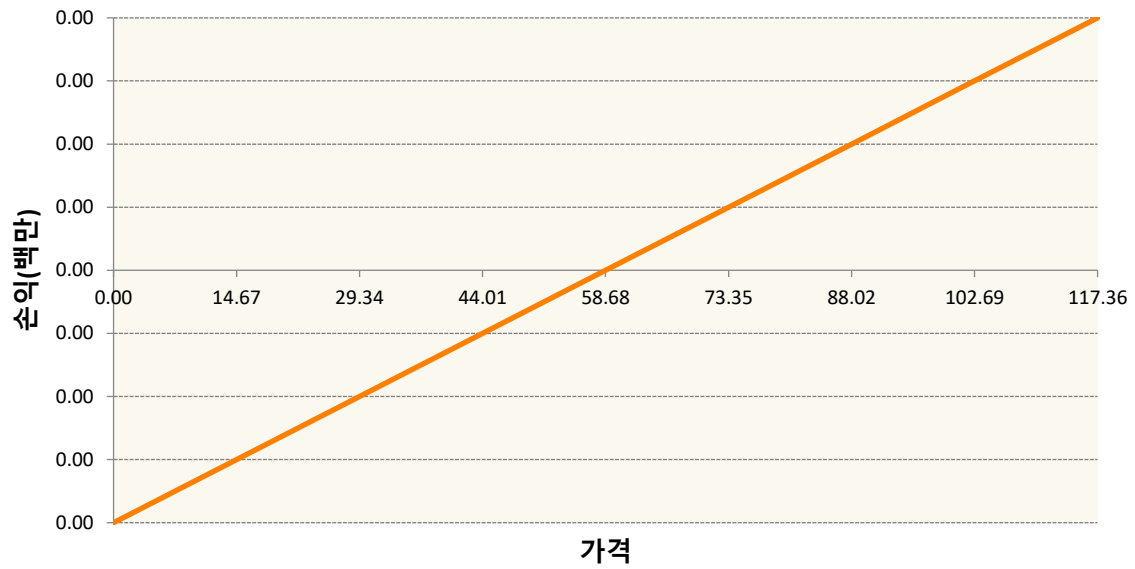
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	659	0	659	
누계	통화	선물	0	70	-70	장내

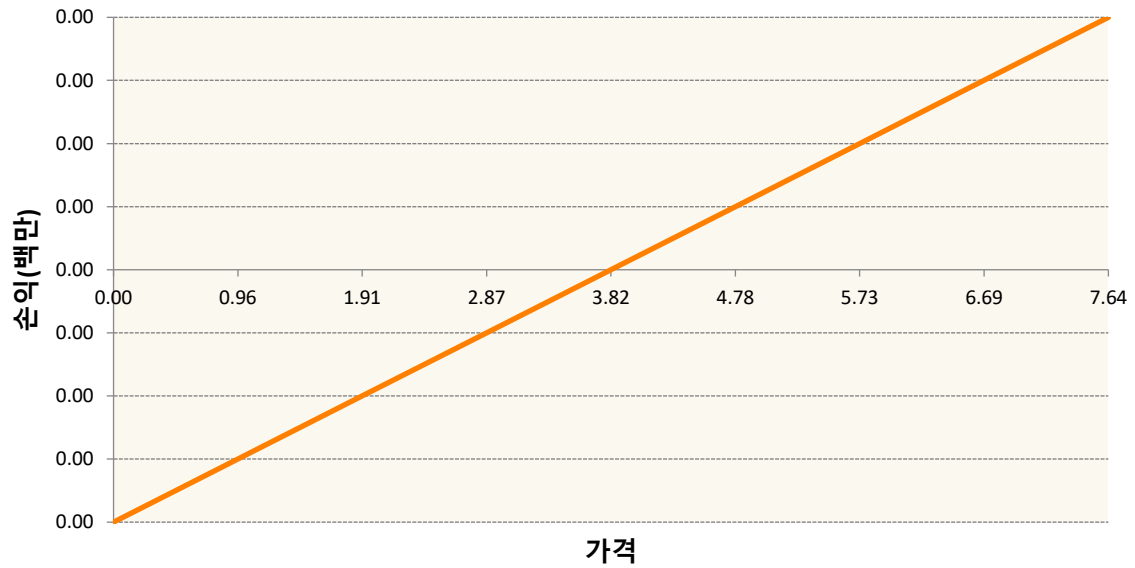
2. 만기시점의 손익구조



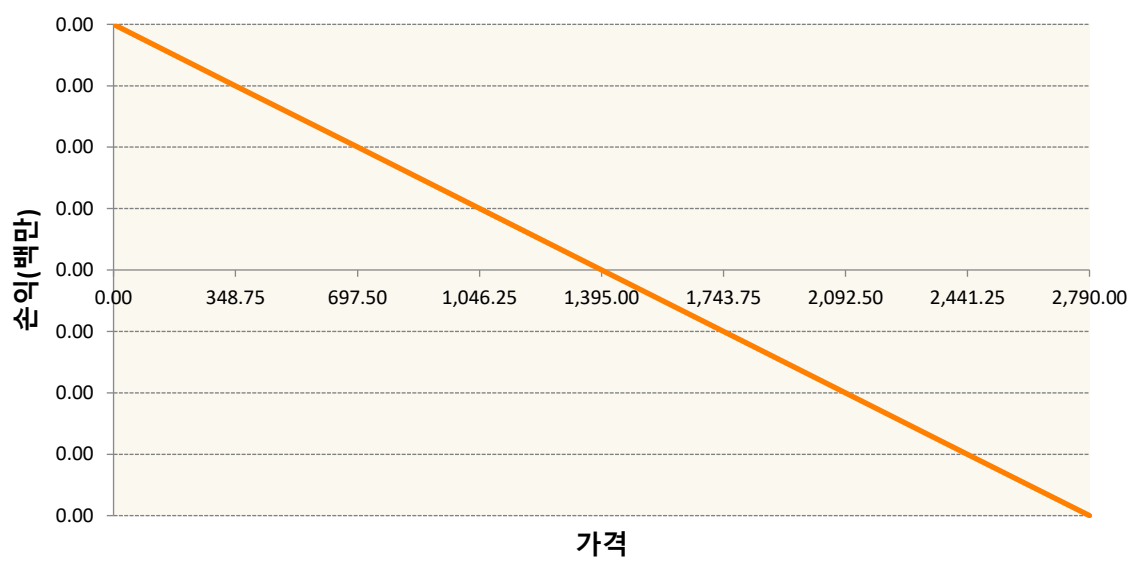
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



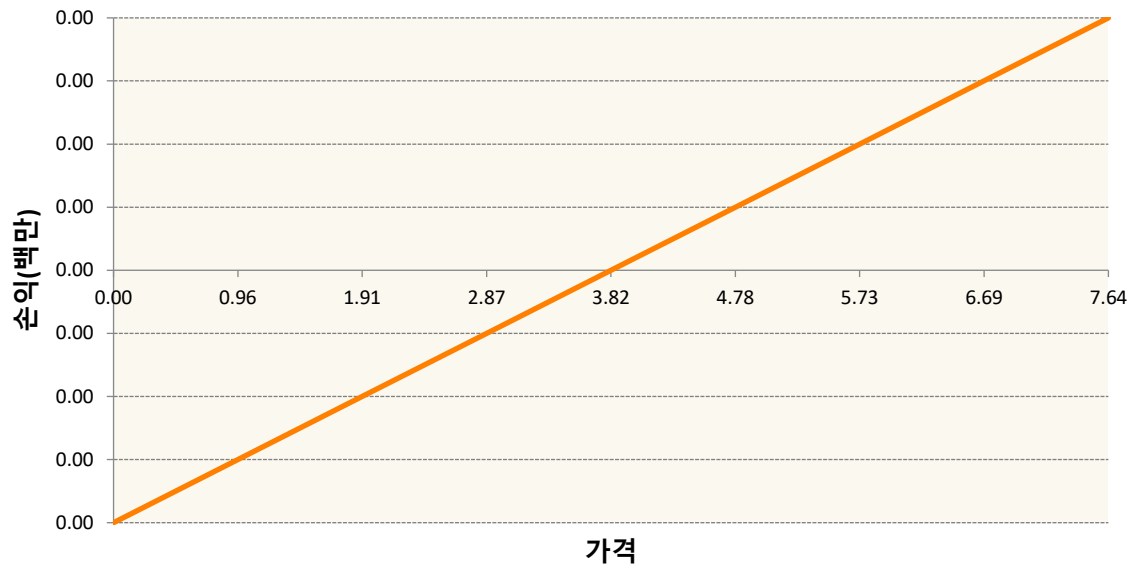
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



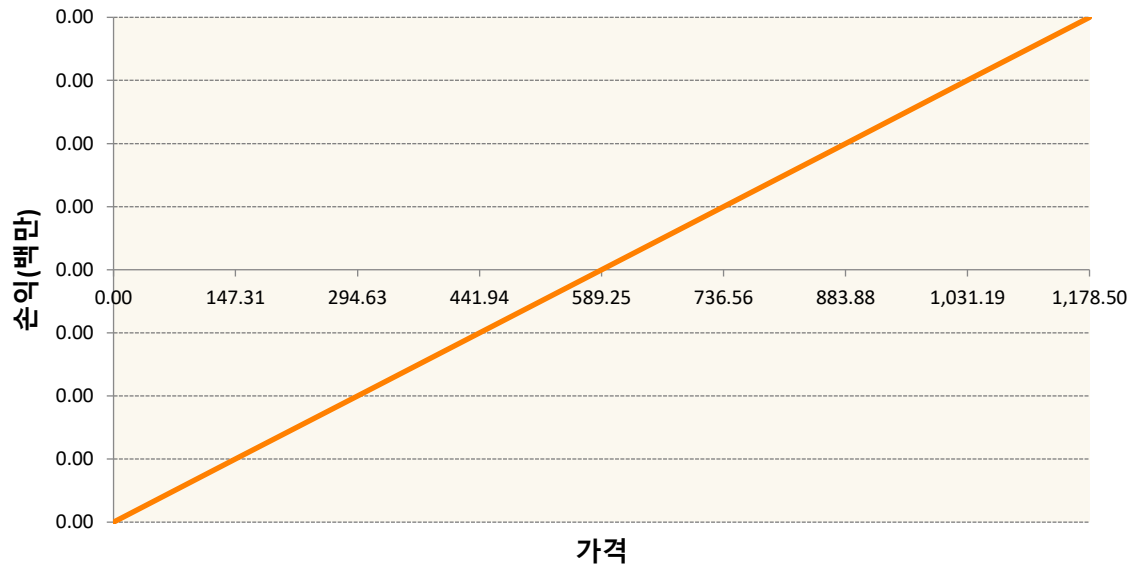
KR4175W50005-2025-05 달러선물



NGN25-NATURAL GAS FUTR JUL25



QSN5-Low Su Gasoil G JUL25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN5	WTI CRUDE FUTURE JUL25	7
CON5	BRENT CRUDE FUTR Jul25	14
ECN5	E-mini Crude Oil JUL25	3
EON5	E-MINI NATURAL GAS JUL25	8
KR4175W50(2025-05 달러선물		6
NGN25	NATURAL GAS FUTR JUL25	13
QSN5	Low Su Gasoil G JUL25	7

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

(단위:백만원)

126