

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

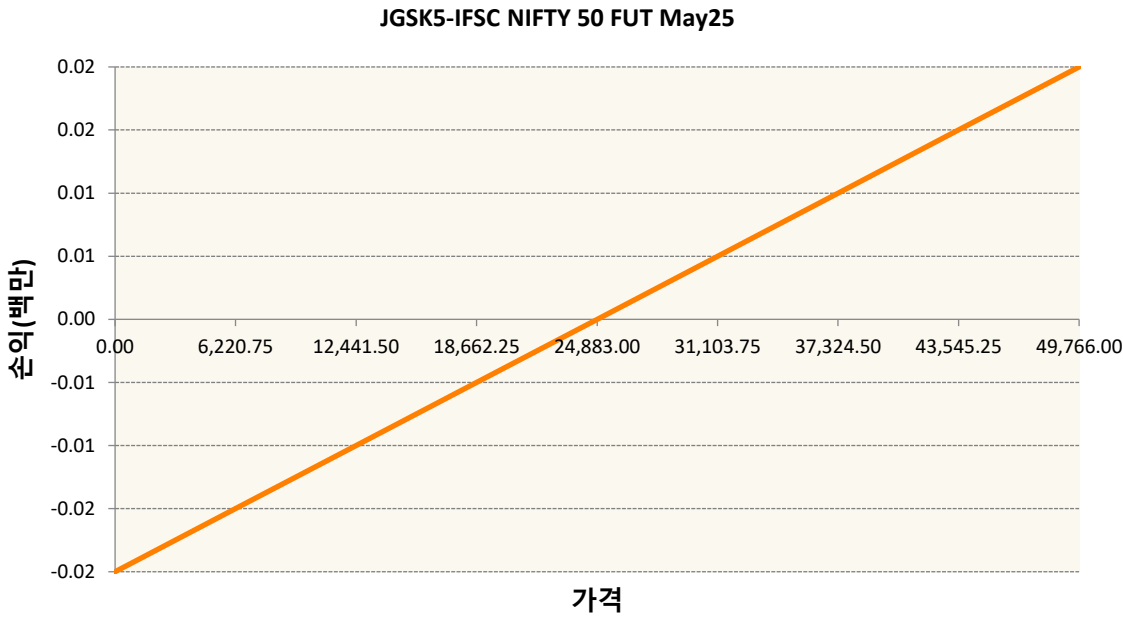
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSK5	IFSC NIFTY 50 FUT May25	80
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

59

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

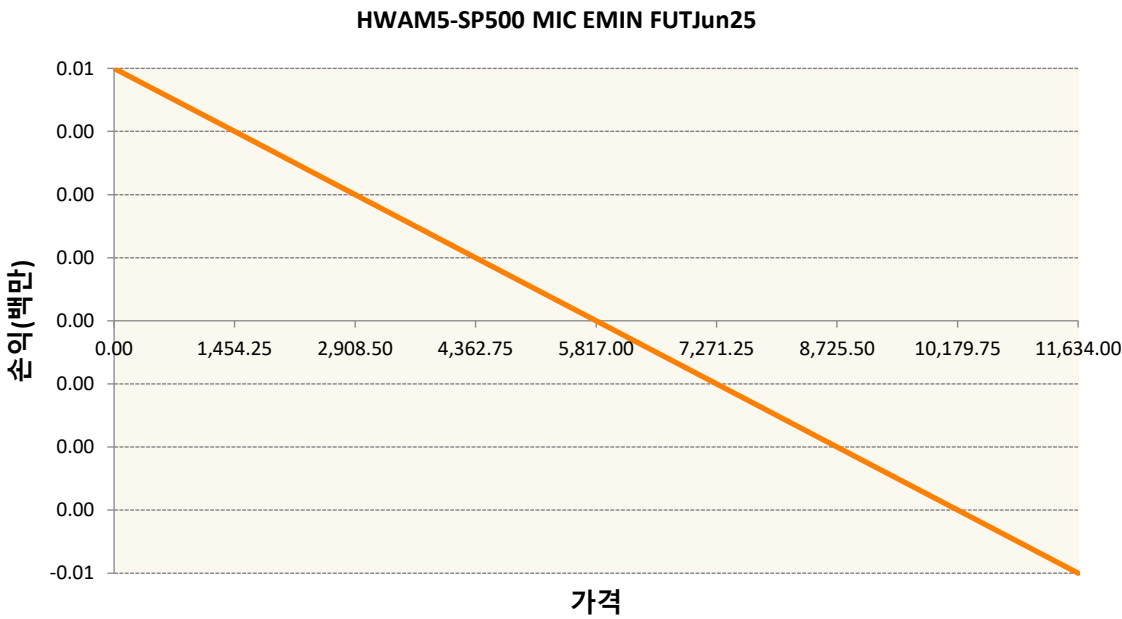
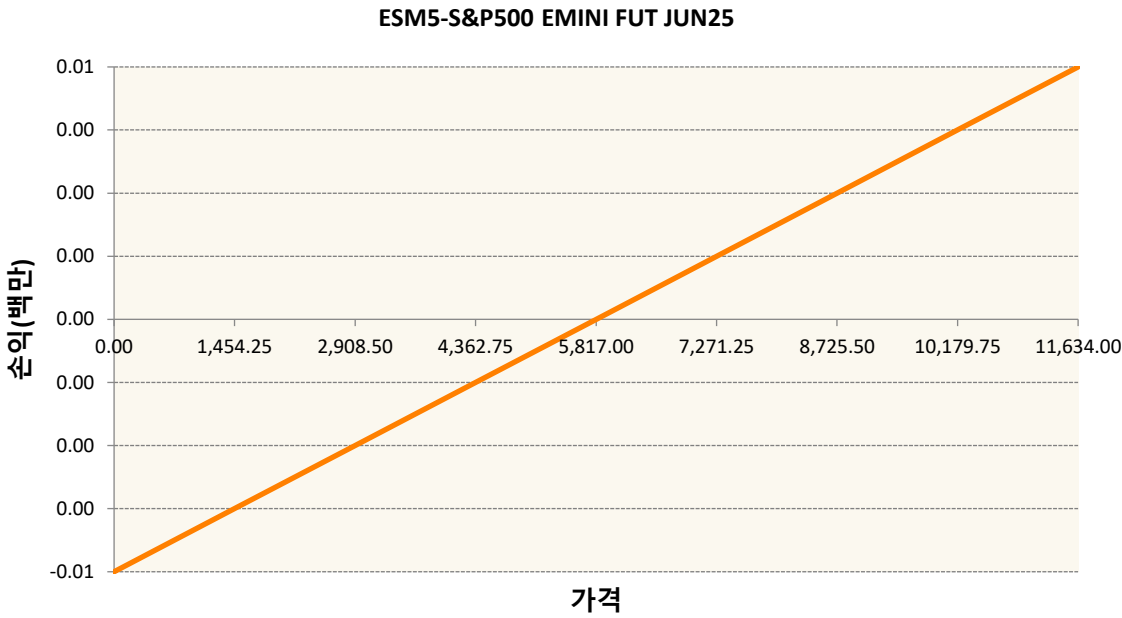
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	115	-115	장내
누계	지수	선물	425	0	425	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	34
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	38

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

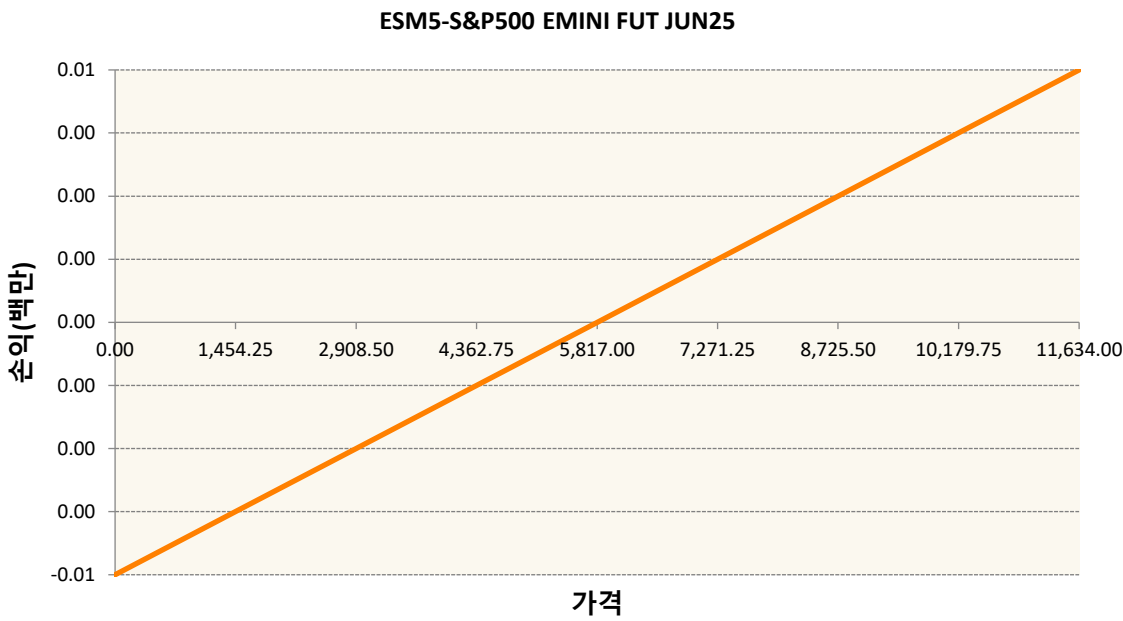
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,275	0	1,275	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	102
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

90

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

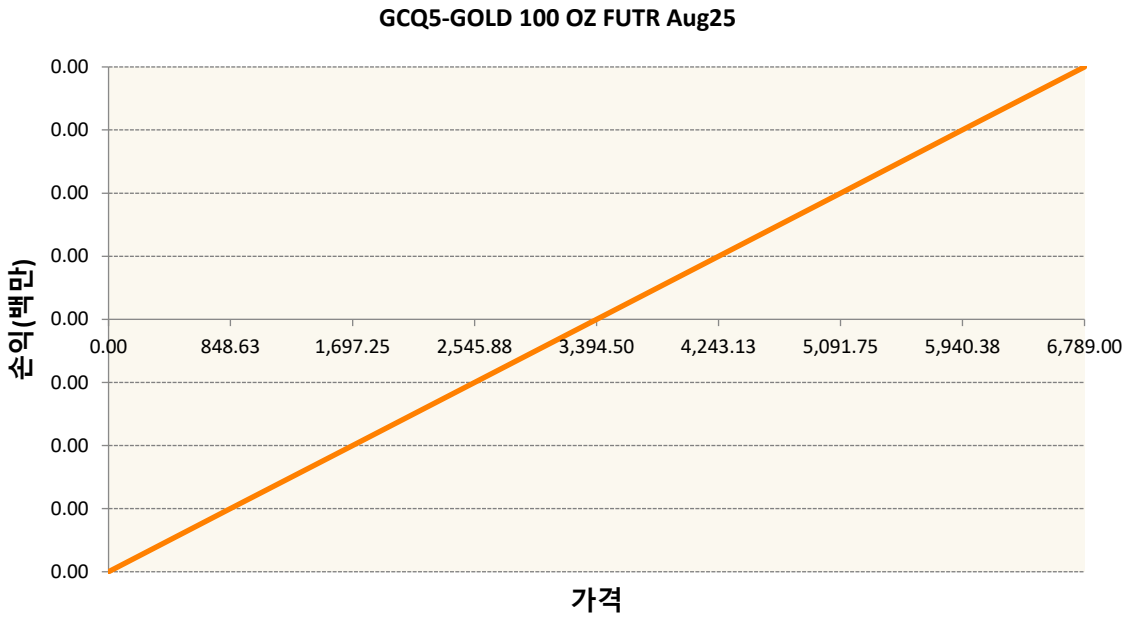
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,334	0	2,334	
누계	실물자산	스왑	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 05/30/25 C306 EQUITY	3
GCQ5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25	187

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

(단위:백만원)

160

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

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)

AOPLTRUSC PLTR US 05/30/25 C127 EQUITY	4
AOPLTRUSP1 PLTR US 05/30/25 P127 EQUITY	1

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

(단위:백만원)

20

공시일 2025-05-27

기준일 2025-05-26

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

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	2025-05-27
기준일	2025-05-26

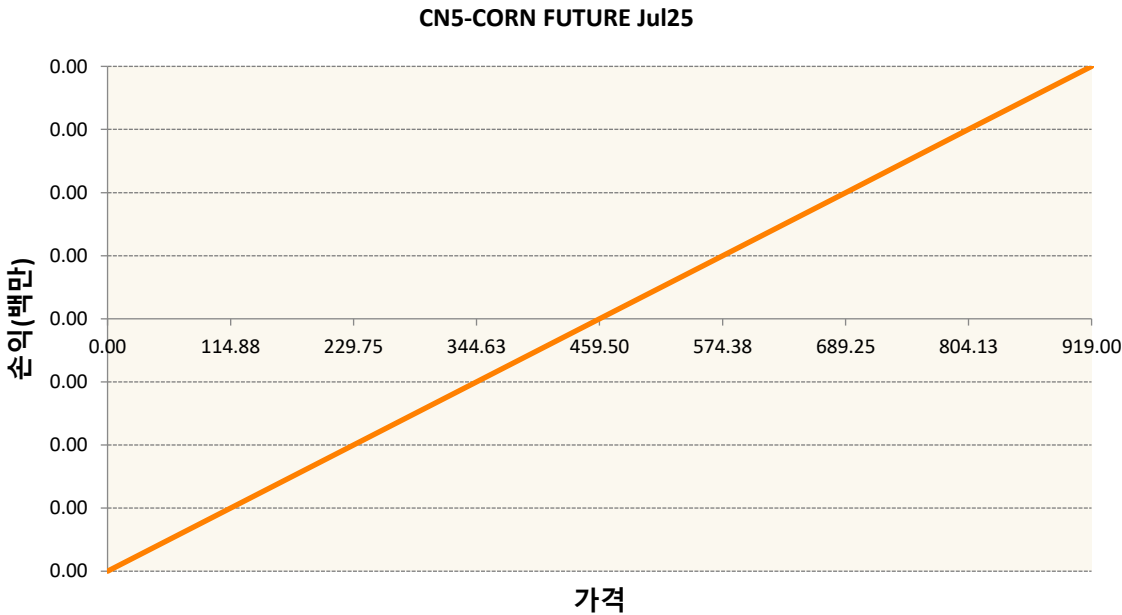
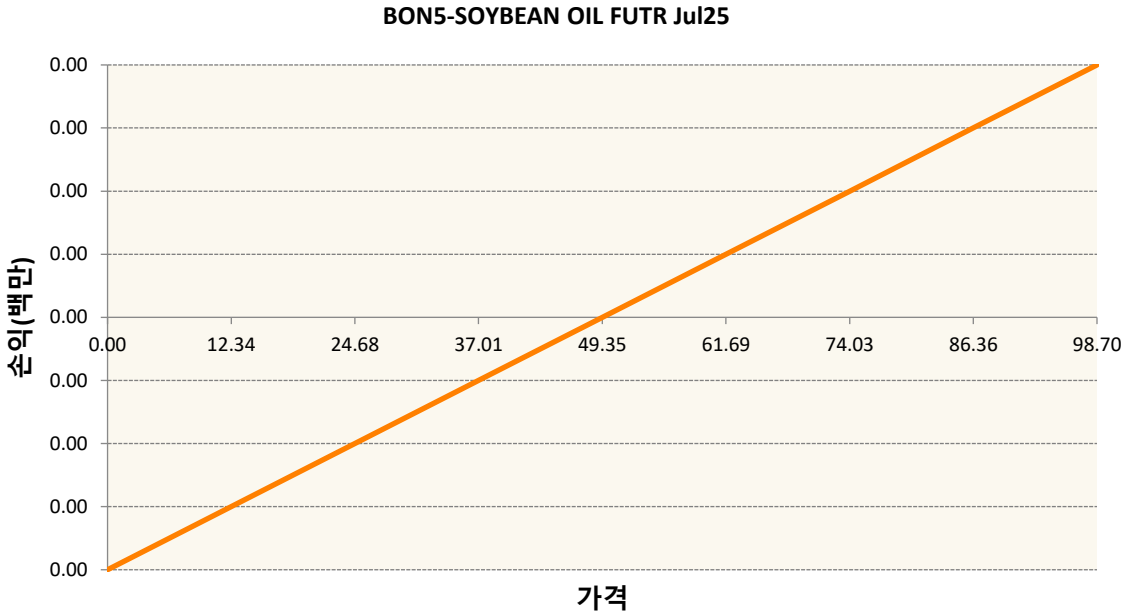
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

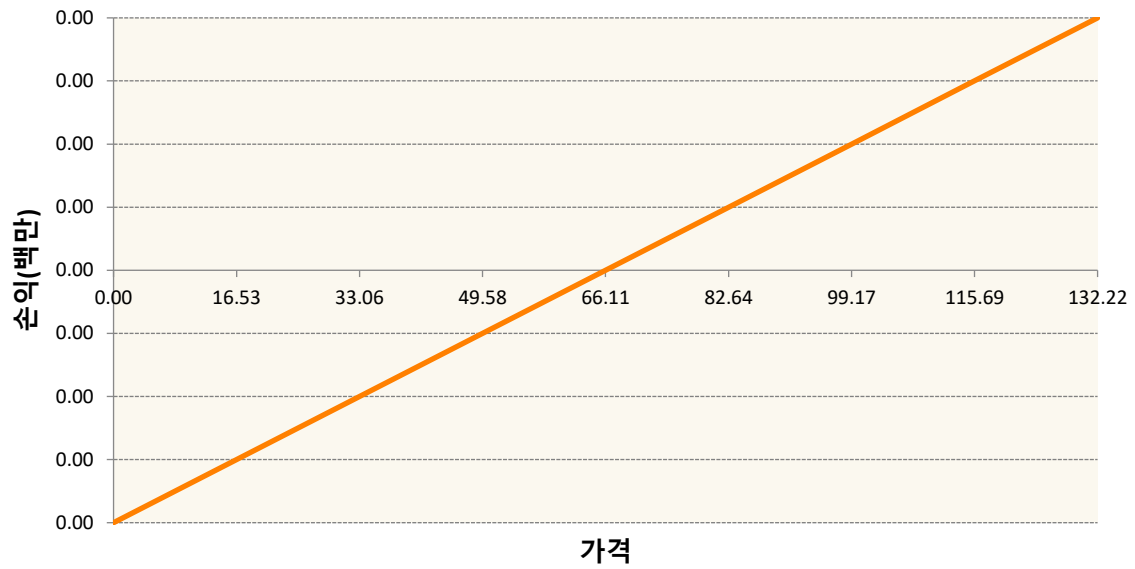
(단위:USD 백만)

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	3,869	0	3,869	
누계	통화	선물	0	300	-300	장내

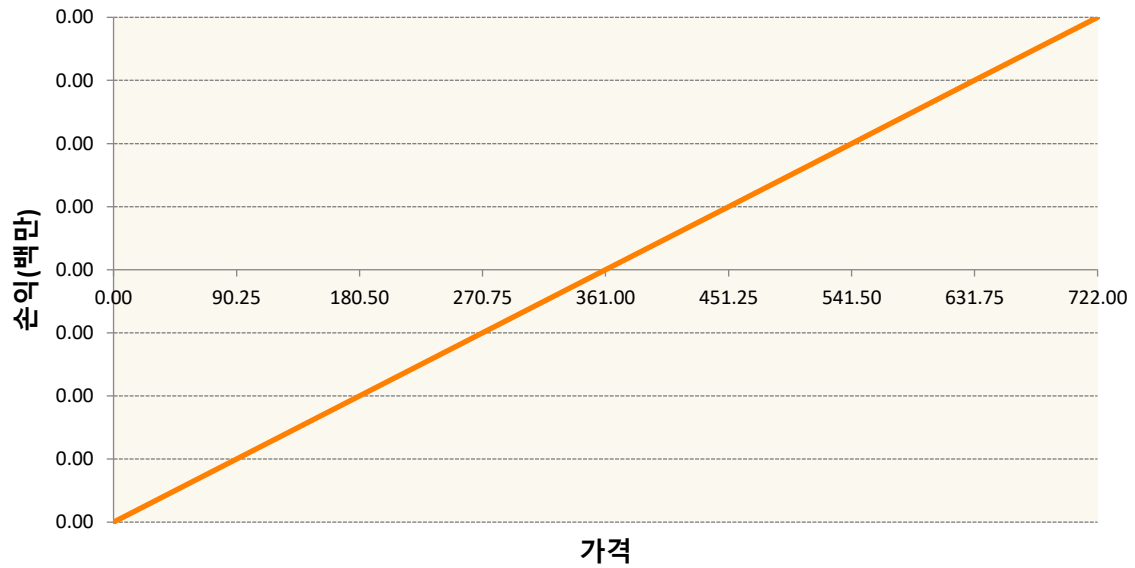
2. 만기시점의 손익구조



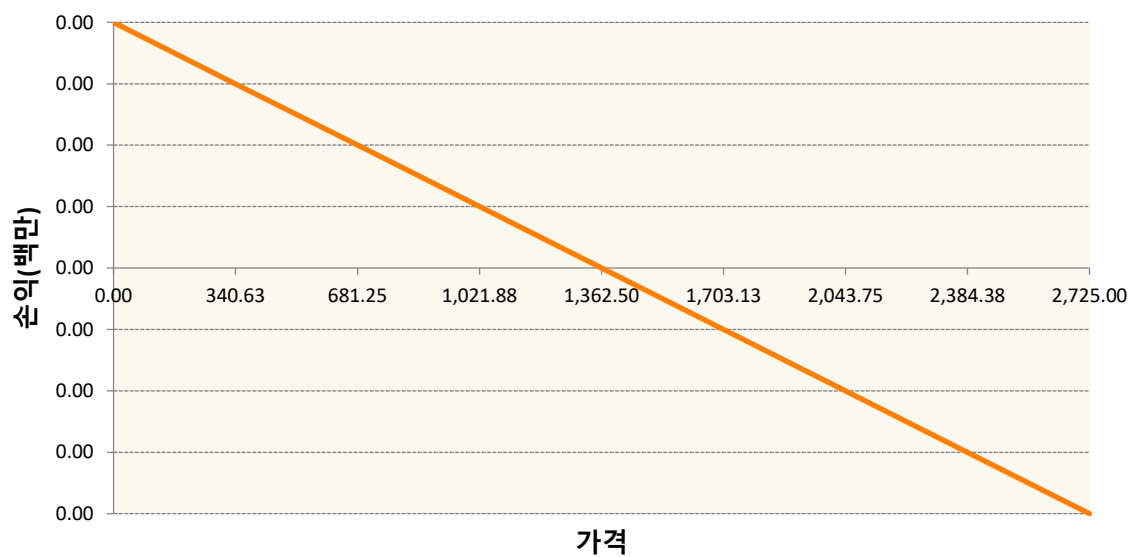
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



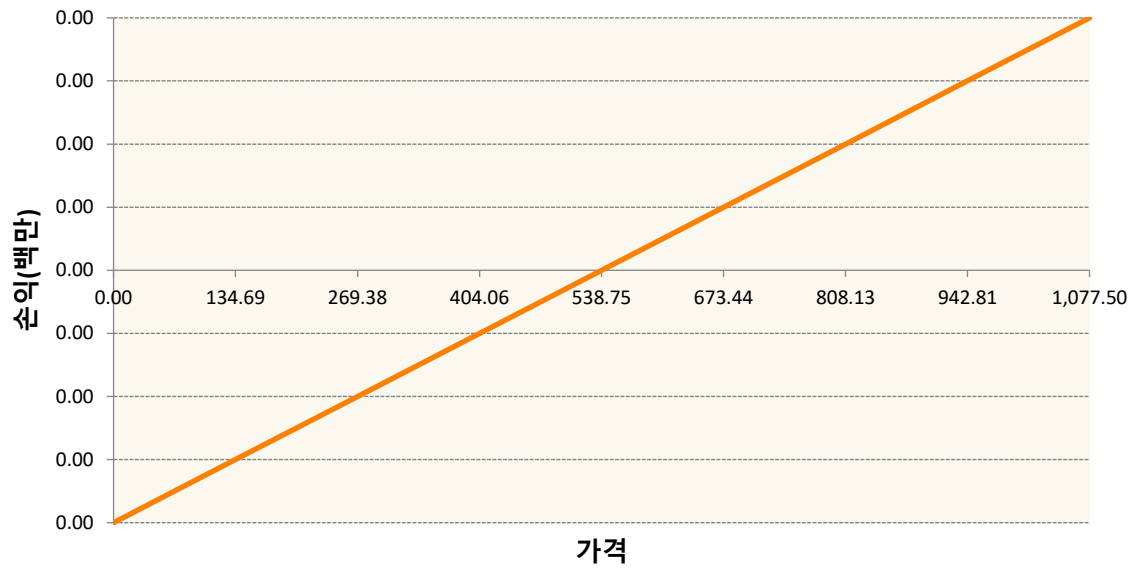
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



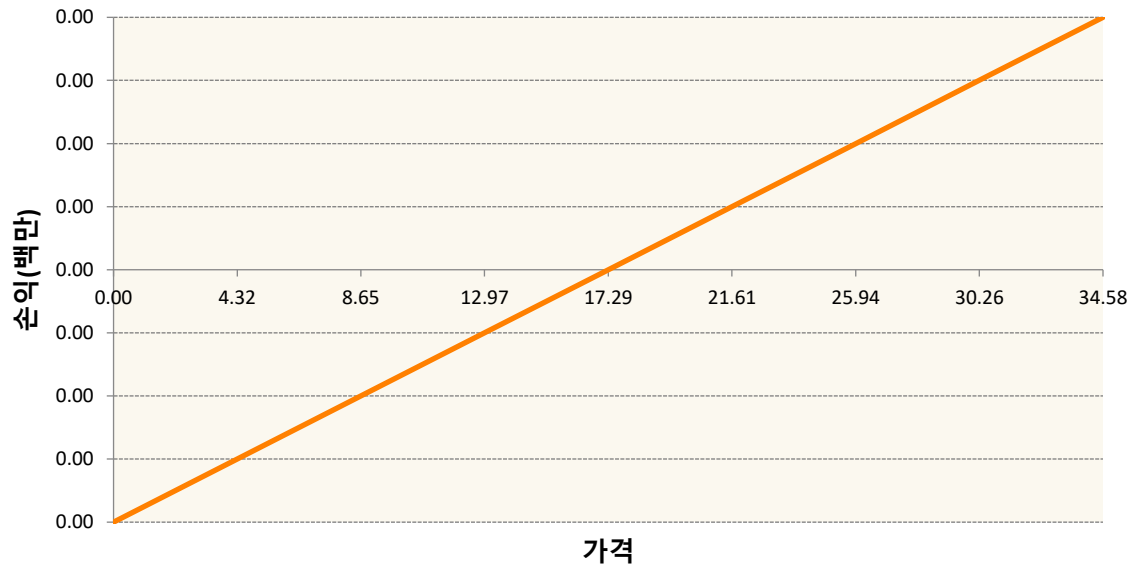
KR4175W60004-2025-06 달러선물



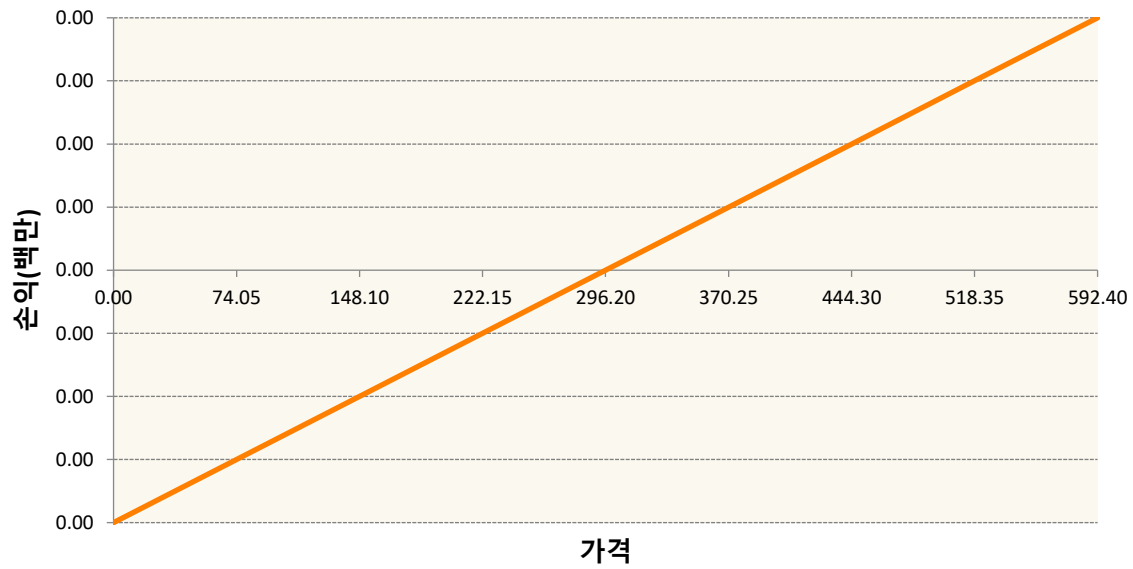
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25

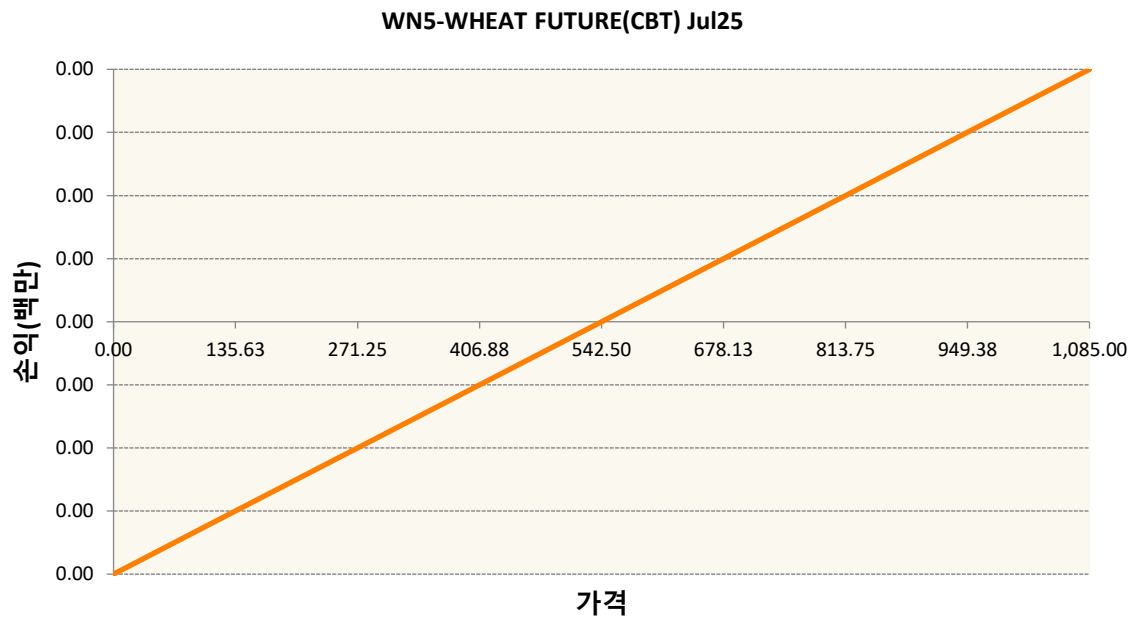
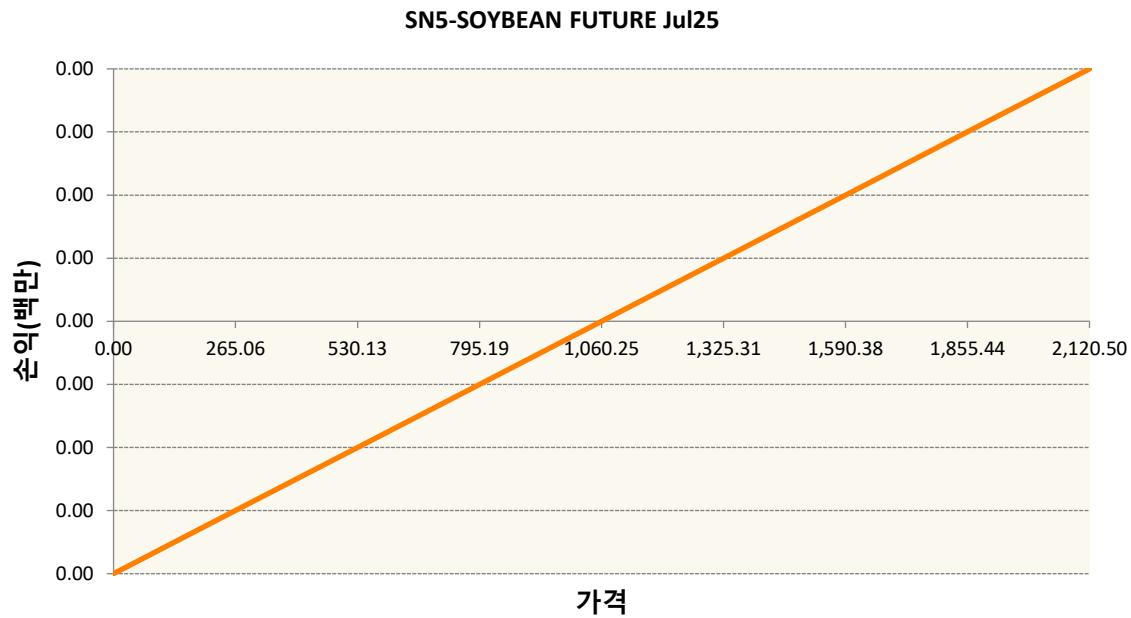


SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



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	2025-05-27
기준일	2025-05-26

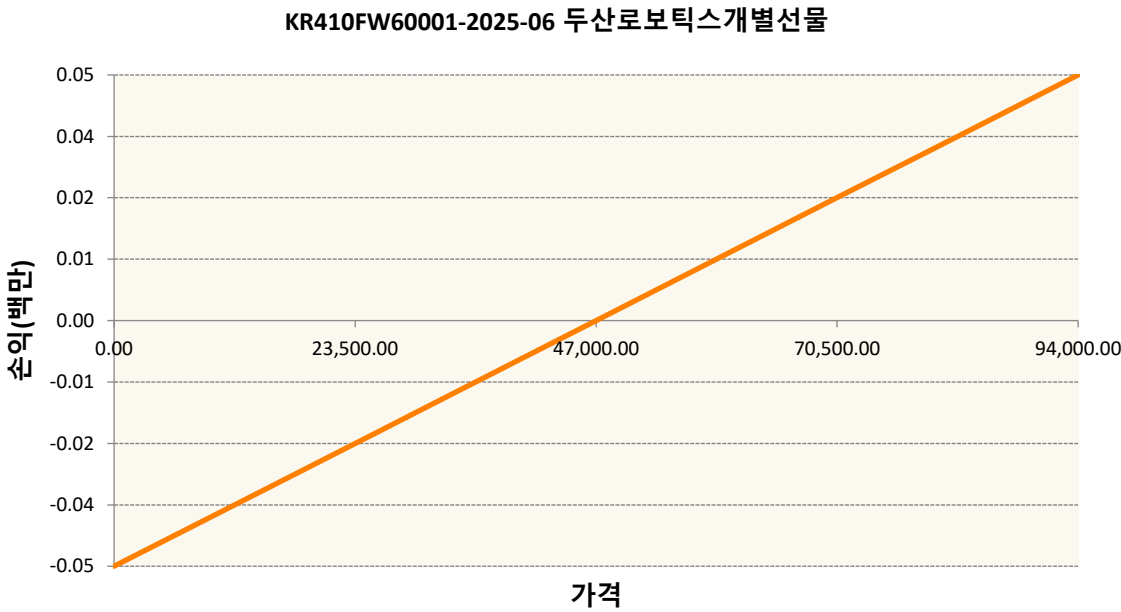
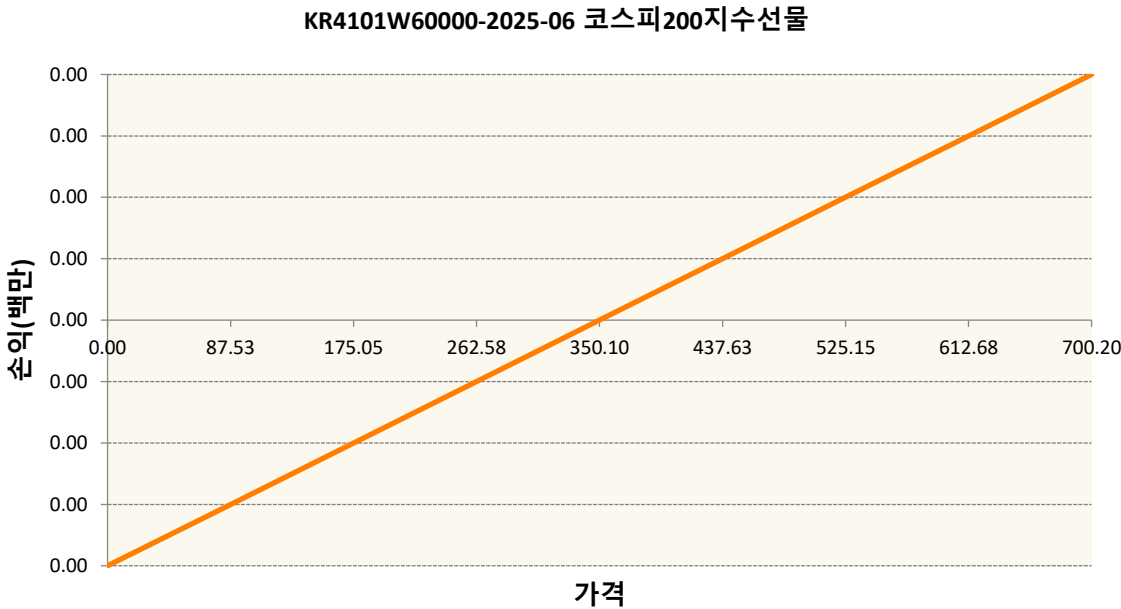
스마트인덱스모

1. 계약금액

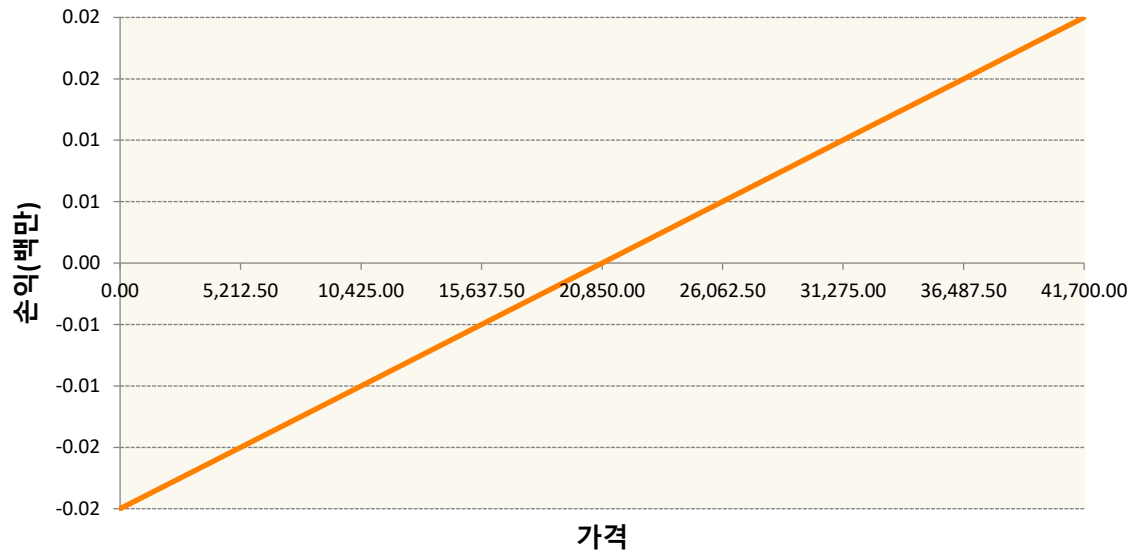
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	17	0	17	장내
누계	유가증권	선물	1,376	0	1,376	장내

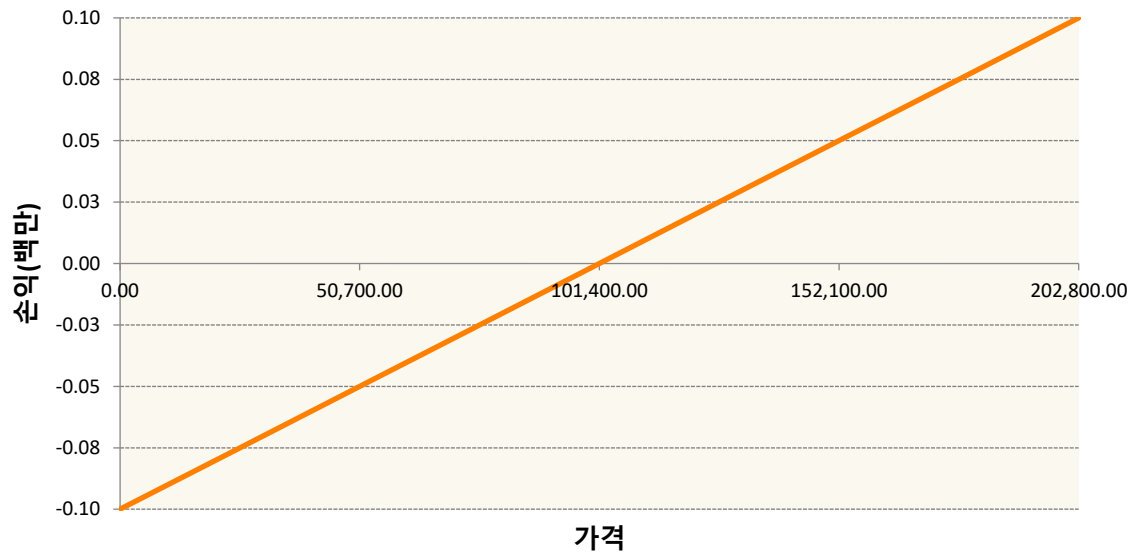
2. 만기시점의 손익구조



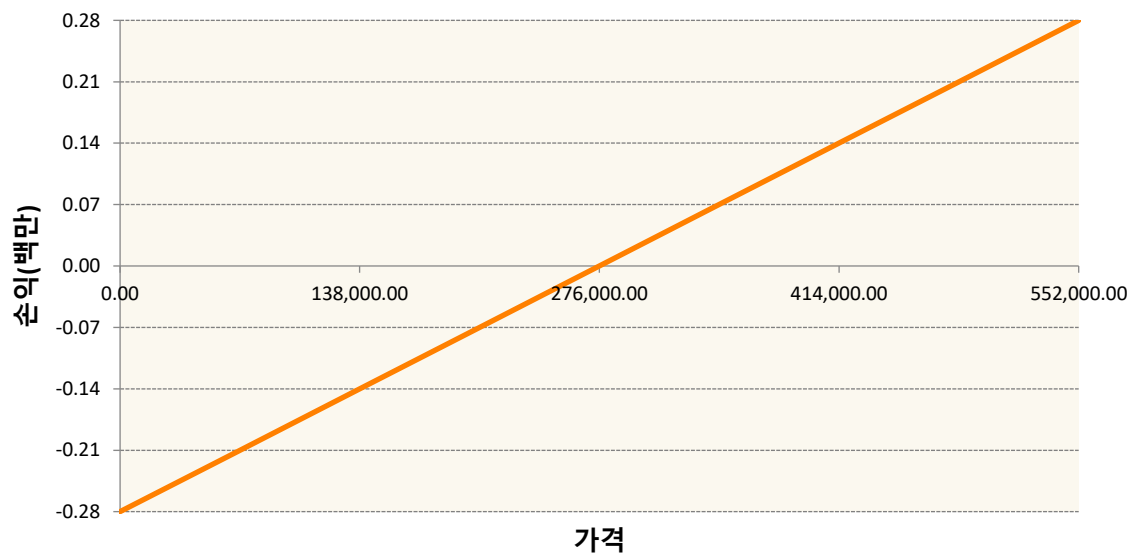
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



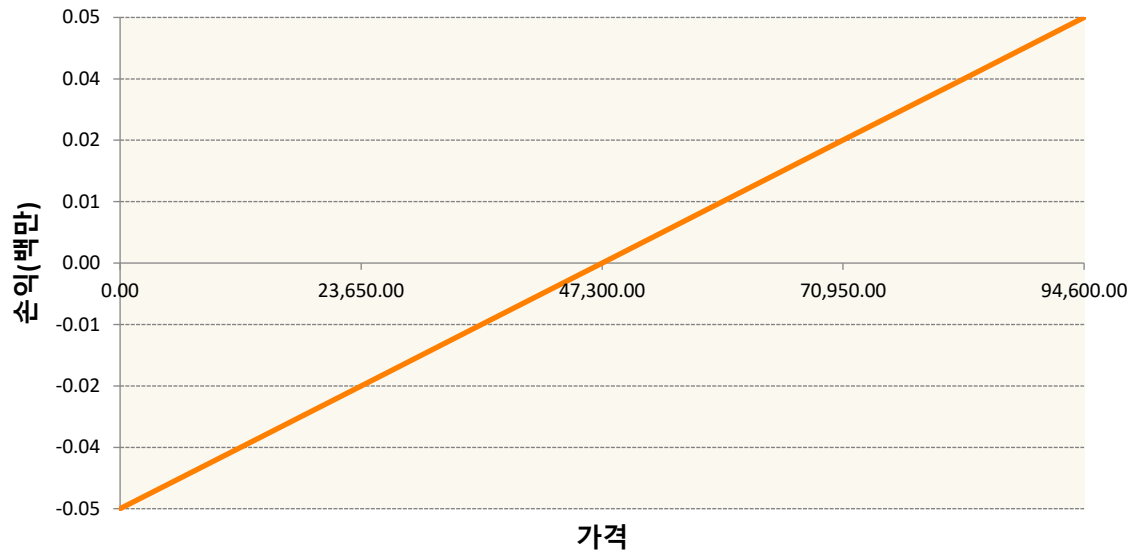
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



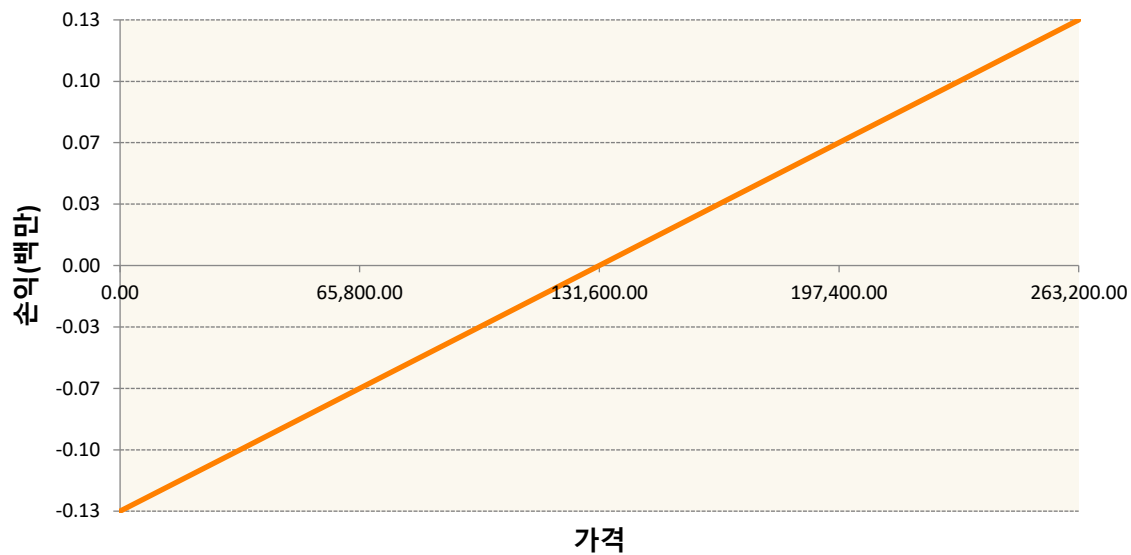
KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물



KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	84
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물	1
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물	1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	3
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물	12
KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물	1
KR41G5W60 2025-06 한진칼개별선물	7

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

(단위:백만원)

180

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

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	291
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

471

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

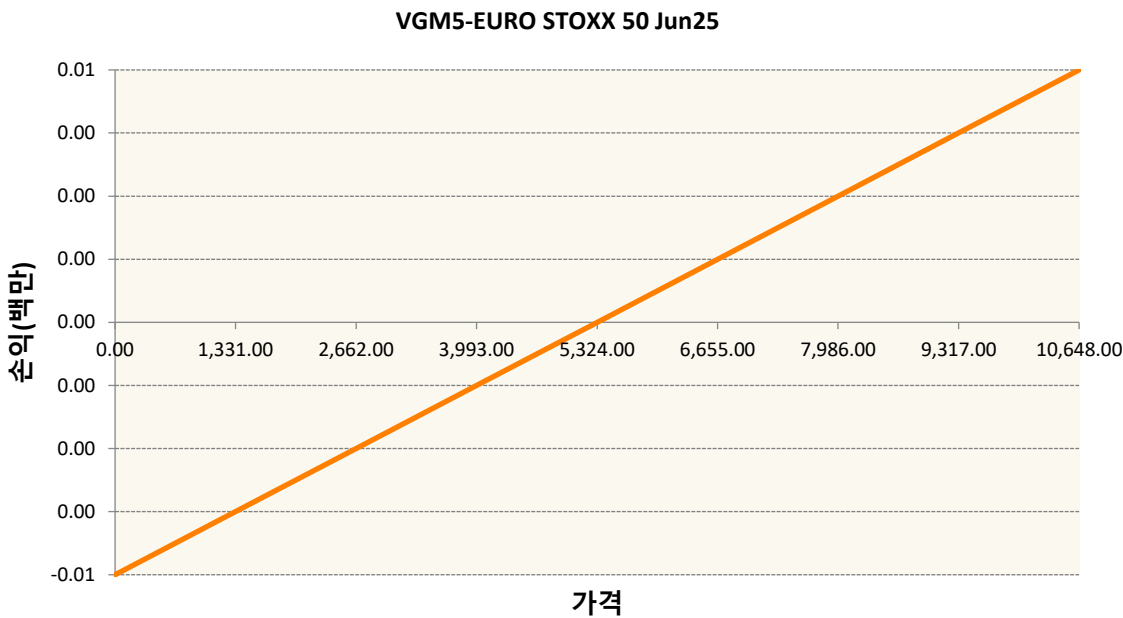
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,017	0	1,017	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

67

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

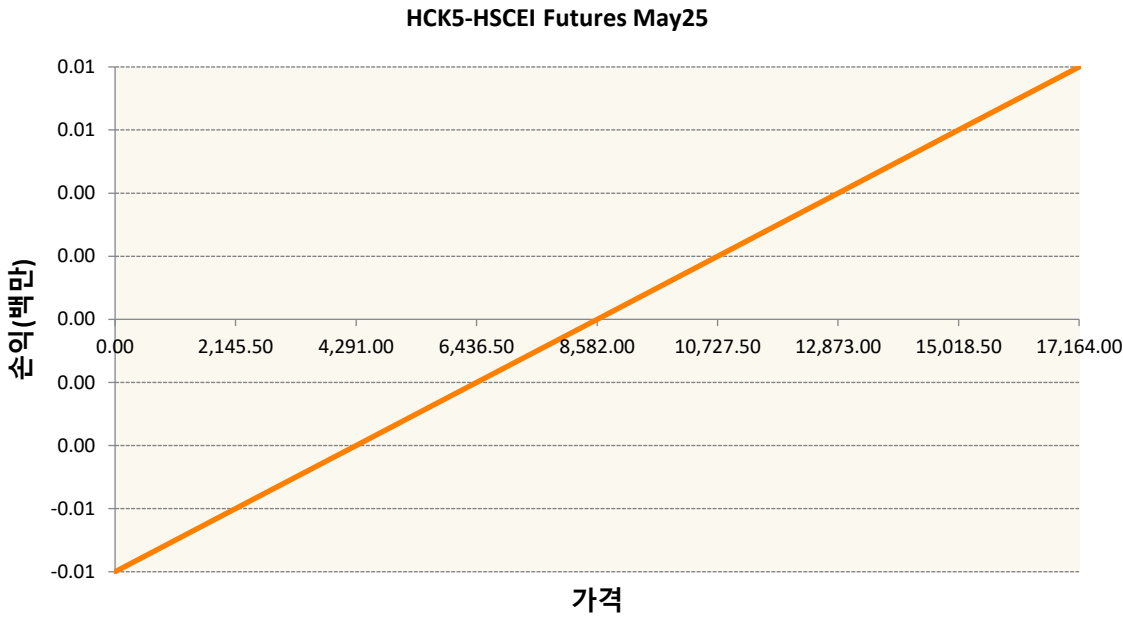
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,530	0	2,530	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK5	HSCEI Futures May25	202
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

302

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

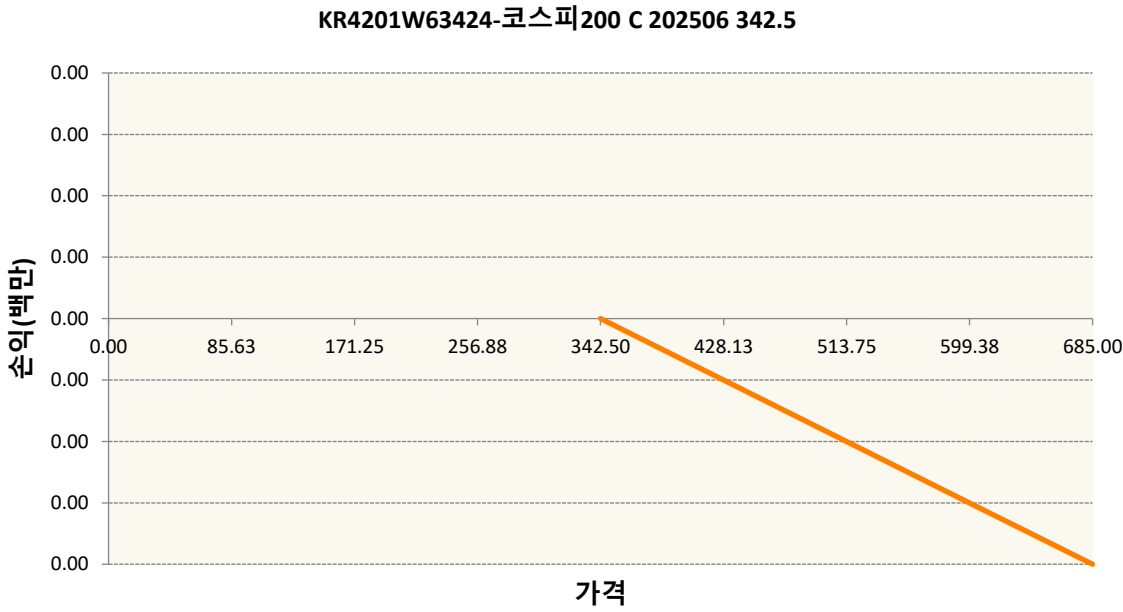
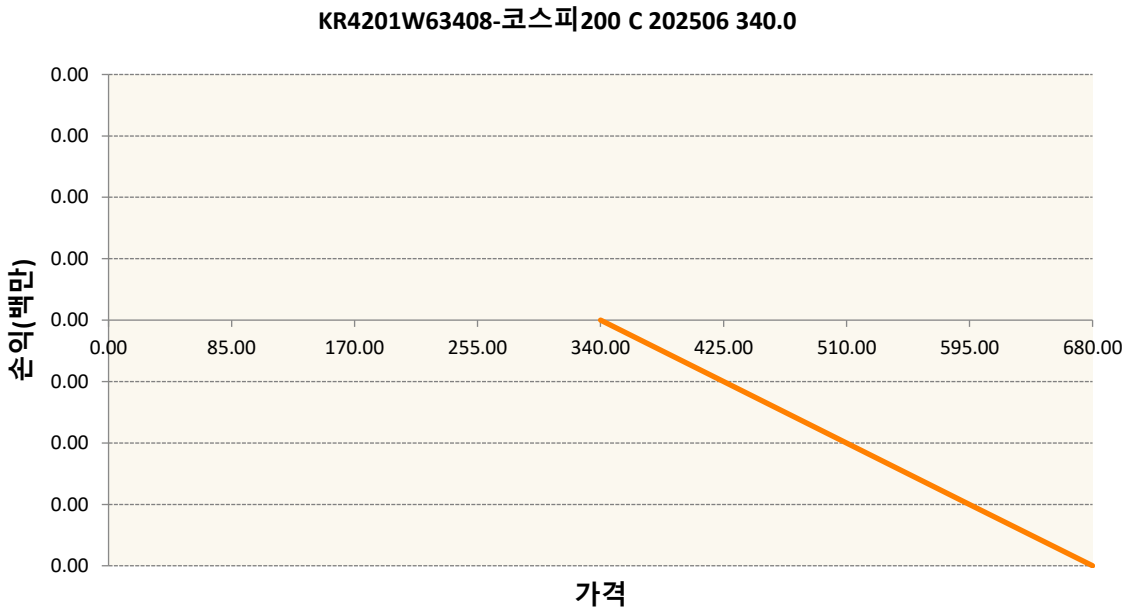
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	35,769	-35,769	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 680.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line is plotted, starting at (0, 0) and ending at (340, 0). This indicates that the profit is zero for all prices in this range.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
340.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 685.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at (0, 0) and ends at (342.50, 0.00), indicating that profit is zero at this price point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
342.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201W63408						코스피200 C 202506 340.0		932
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	471	465	458	451	442	432	422	
-5.33%	421	407	393	379	364	349	334	
-2.67%	279	263	246	230	214	197	181	
0%	32	22	11	0	-12	-25	-38	
2.67%	-275	-278	-282	-288	-294	-301	-309	
5.33%	-600	-600	-602	-603	-606	-609	-613	
8.00%	-928	-928	-928	-928	-929	-930	-932	
KR4201W63424						코스피200 C 202506 342.5		1,311
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	585	580	572	564	553	542	529
-5.33%	536	520	502	483	464	444	423
-2.67%	373	349	325	301	277	253	229
0%	54	37	19	0	-20	-40	-61
2.67%	-370	-376	-385	-395	-406	-419	-432
5.33%	-833	-834	-836	-840	-844	-850	-858
8.00%	-1,303	-1,303	-1,304	-1,304	-1,306	-1,308	-1,311
KR4301W63406 코스피200 P 202506 340.0							129

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-118	-120	-122	-124	-126	-129
-5.33%	-54	-57	-60	-64	-67	-71	-74
-2.67%	-11	-15	-19	-23	-26	-30	-34
0%	8	5	3	0	-3	-6	-9
2.67%	13	12	11	10	8	6	4
5.33%	14	13	13	13	12	11	10
8.00%	14	14	14	14	13	13	13

KR4301W63422 코스피200 P 202506 342.5							202
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-189	-190	-192	-194	-197	-199	-202
-5.33%	-93	-97	-101	-105	-110	-114	-119
-2.67%	-22	-28	-34	-39	-45	-50	-56
0%	13	9	4	0	-5	-9	-14
2.67%	24	22	20	18	15	12	9
5.33%	26	26	25	24	23	22	20
8.00%	26	26	26	26	26	25	24

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

(단위:백만원)

2,779

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

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	528	0	528	

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	2025-05-27
기준일	2025-05-26

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	4,250	0	4,250	

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	2025-05-27
기준일	2025-05-26

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	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	12,223	0	12,223	
누계	통화	선도	109	0	109	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F5G(USD/KRW 30-05-25E	9
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

4

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

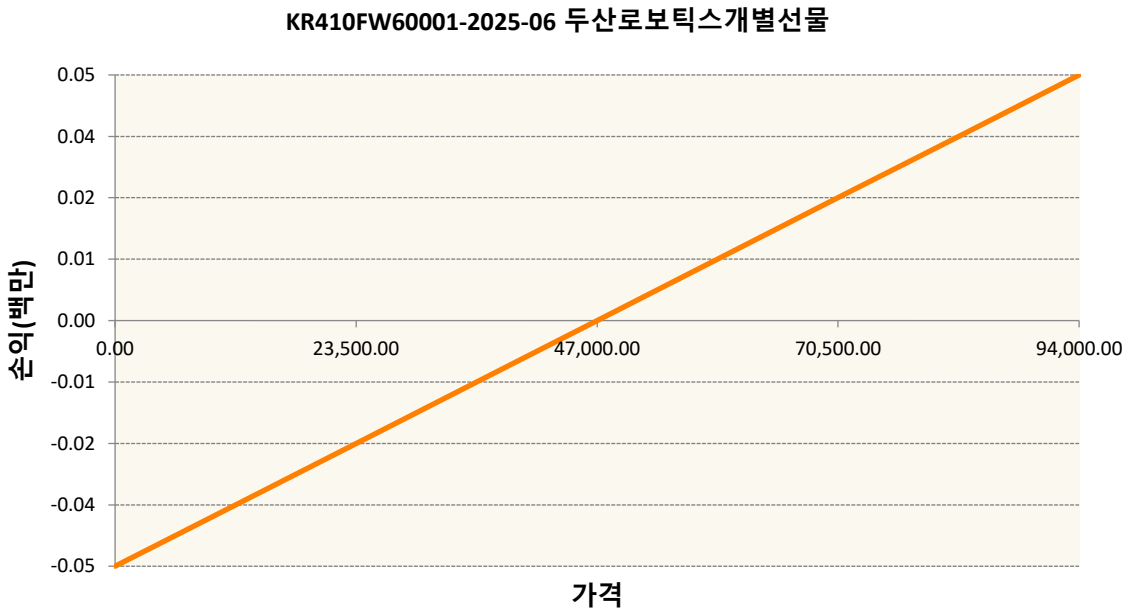
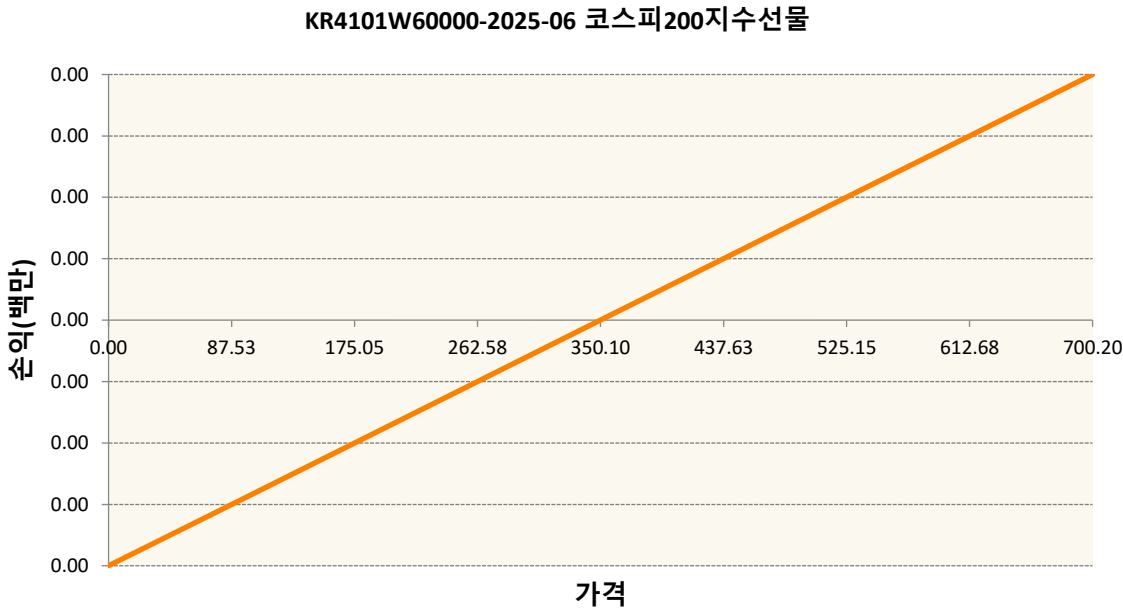
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

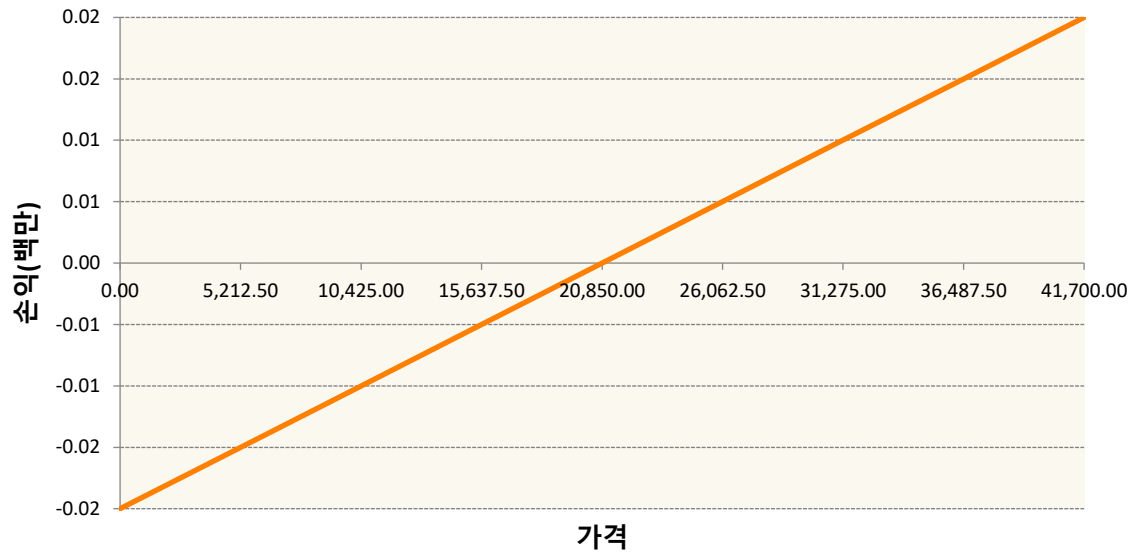
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	8	0	8	장내
누계	유가증권	선물	1,036	0	1,036	장내

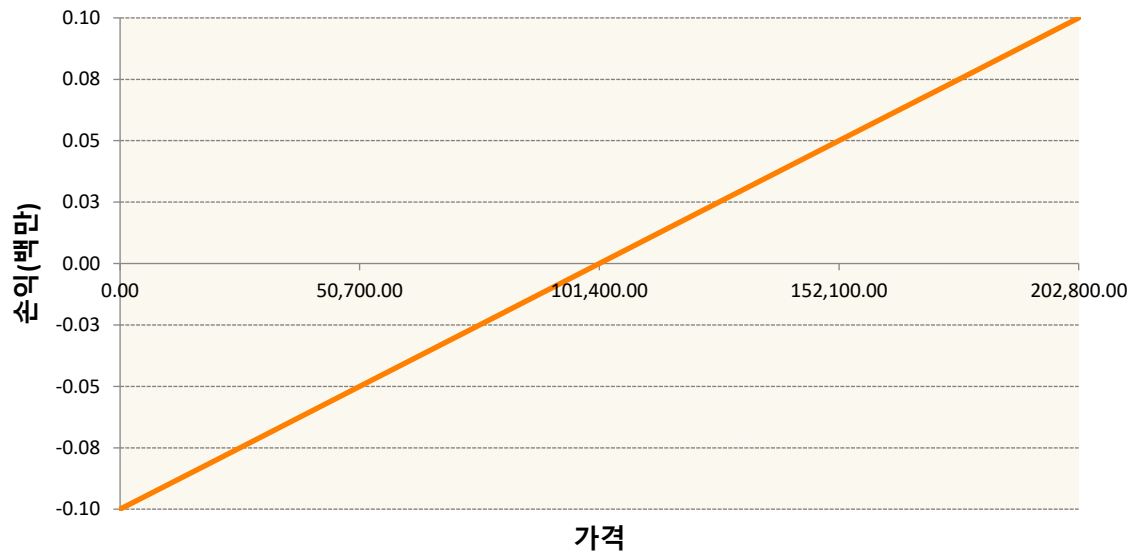
2. 만기시점의 손익구조



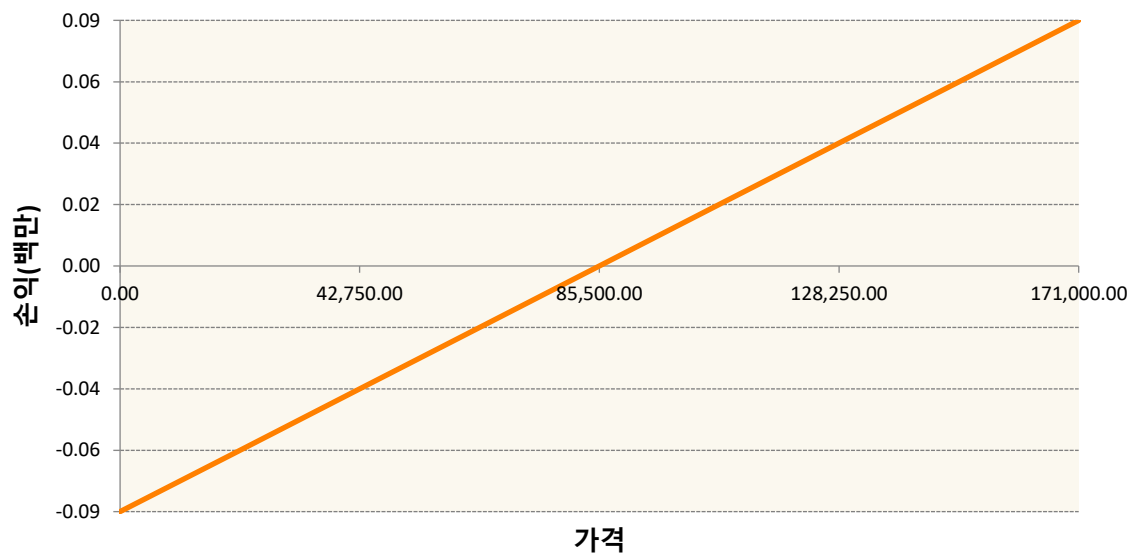
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



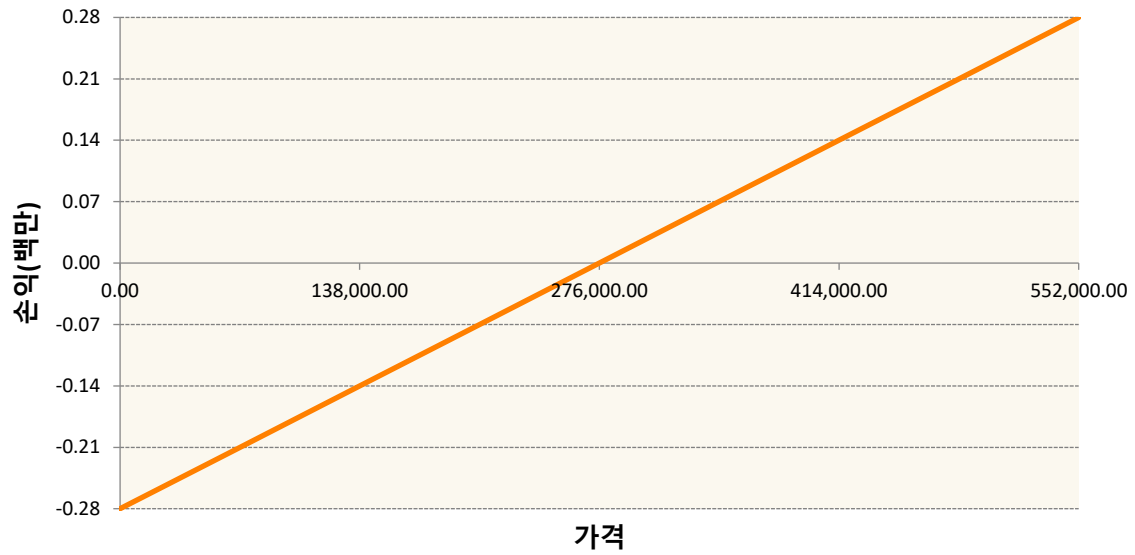
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



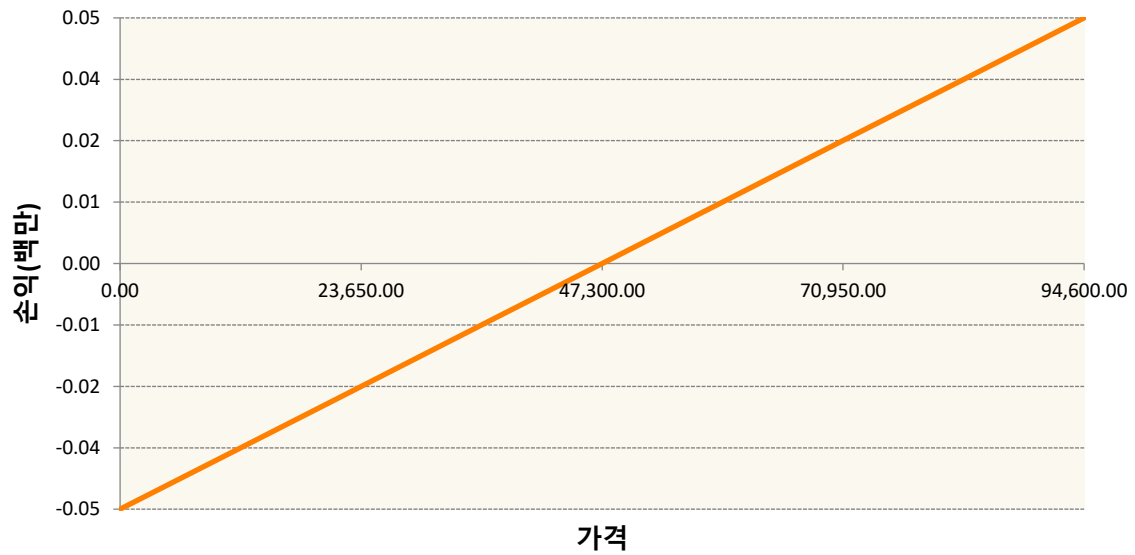
KR41EYW60002-2025-06 에코프로비엠개별선물



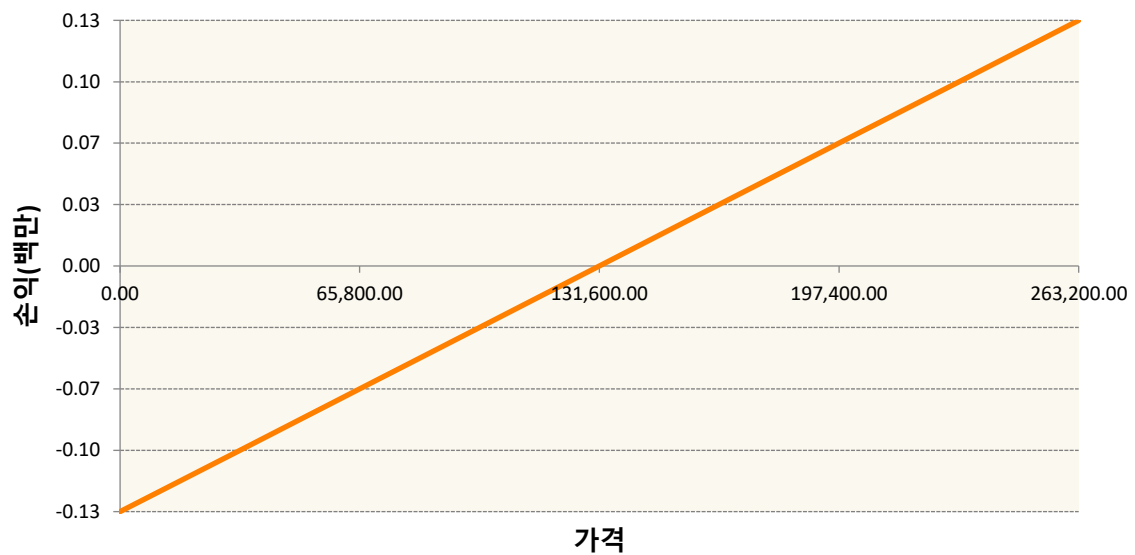
KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물



KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물		70
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물		0.45
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물		1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물		1
KR41EYW60(2025-06 에코프로비엠개별선물		2
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물		5
KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물		1
KR41G5W60(2025-06 한진칼개별선물		3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	128

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

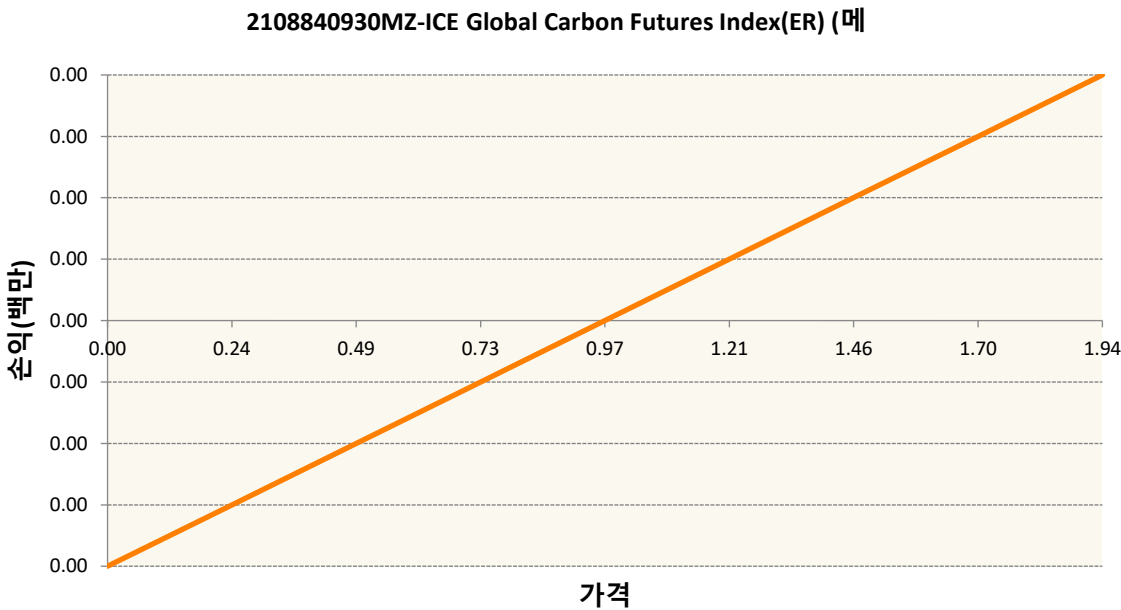
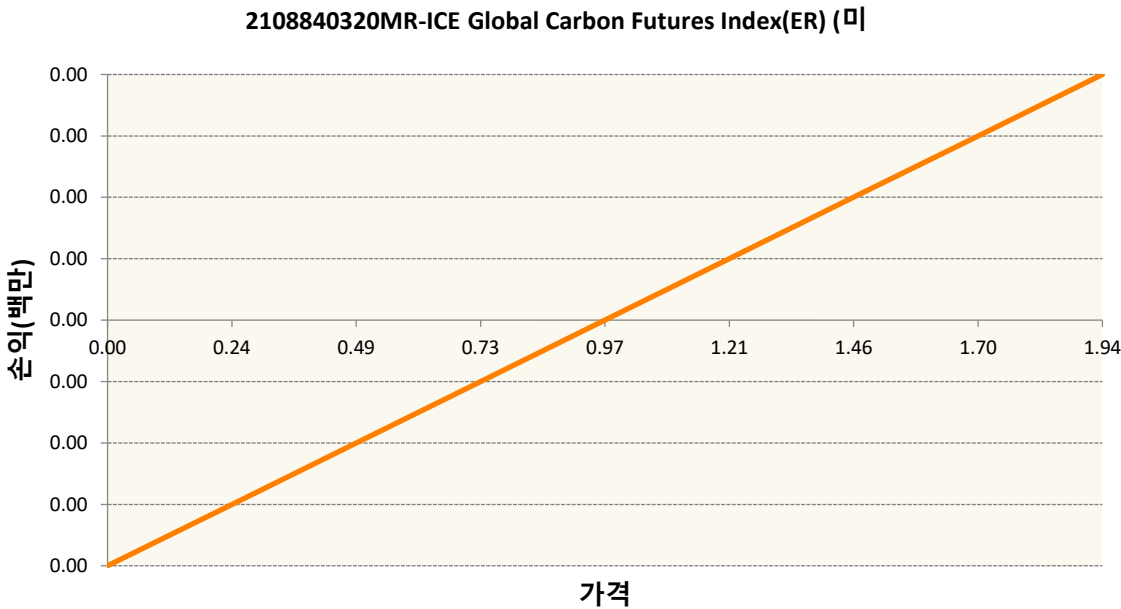
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	570
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	191

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	895

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

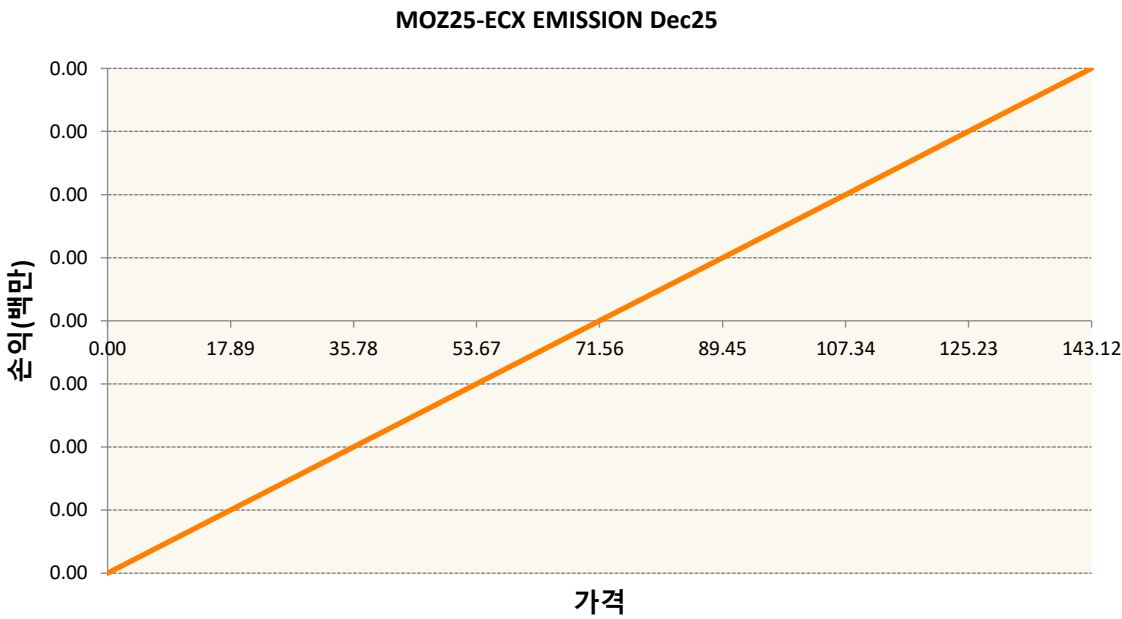
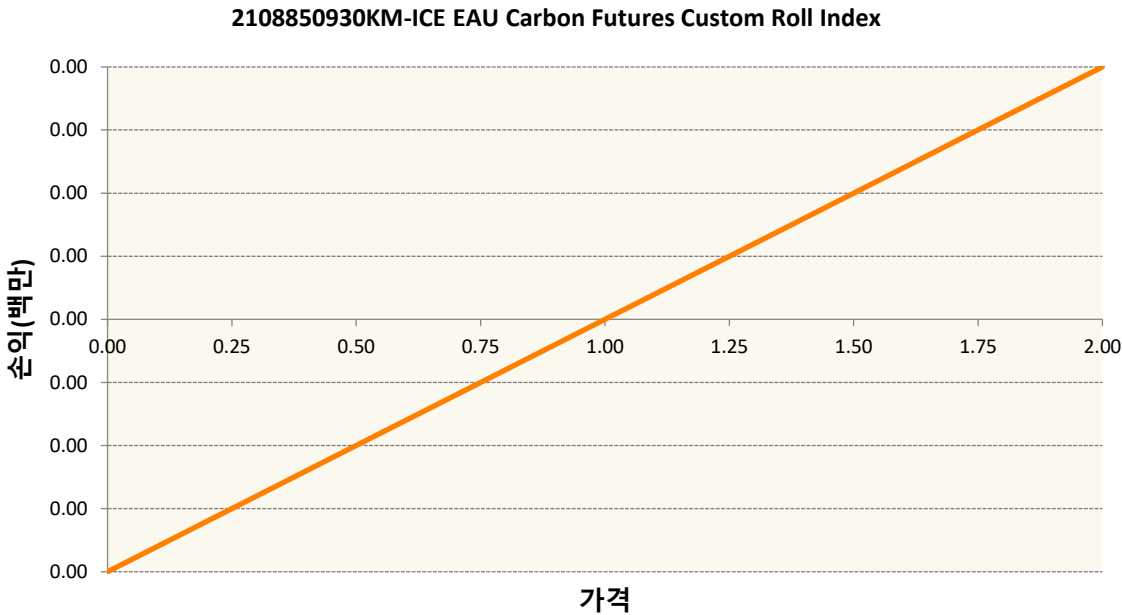
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,268	0	6,268	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		0.08
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		501

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	877

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

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)	14
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	21

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

(단위:백만원)

127

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

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)	33
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	40
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	28
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	8

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

(단위:백만원)

192

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

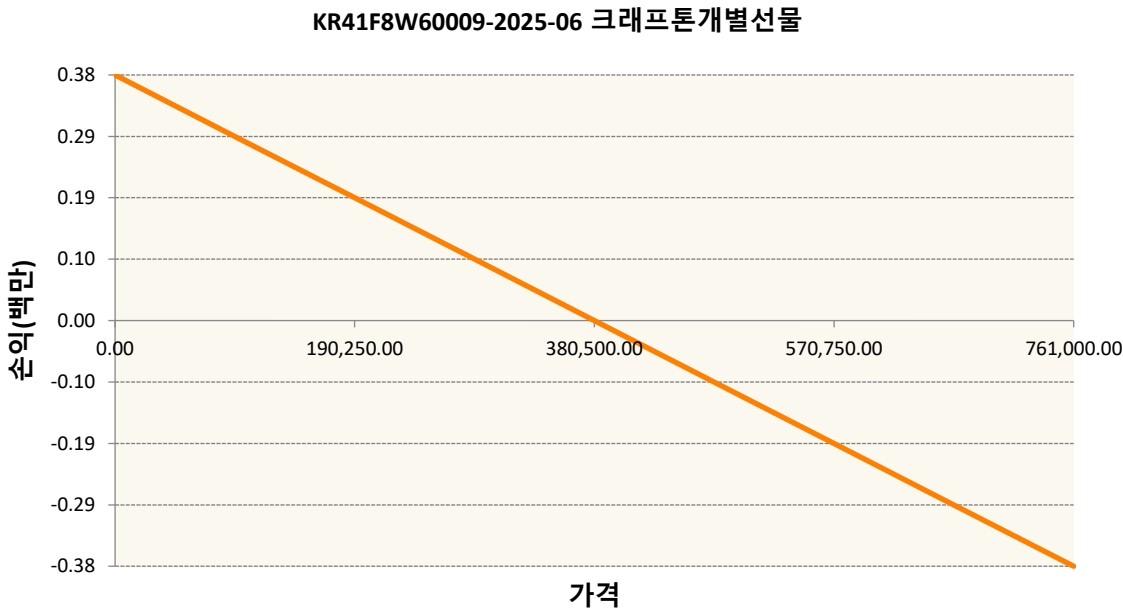
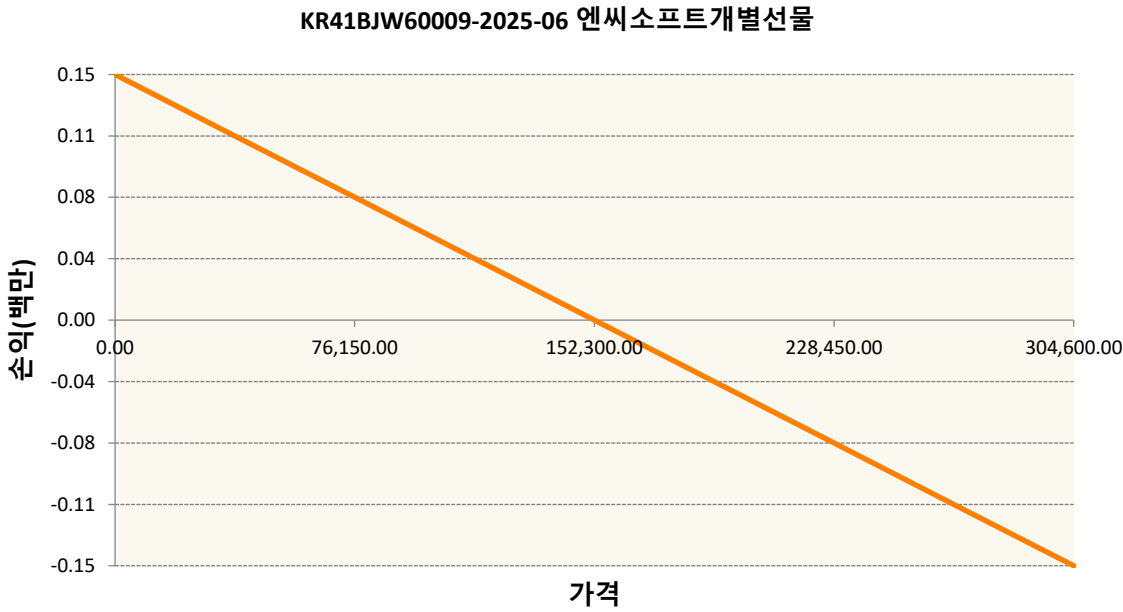
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	8	-8	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR41BJW60C 2025-06 엔씨소프트개별선물		0.37
KR41F8W60C 2025-06 크래프톤개별선물		0.3

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

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

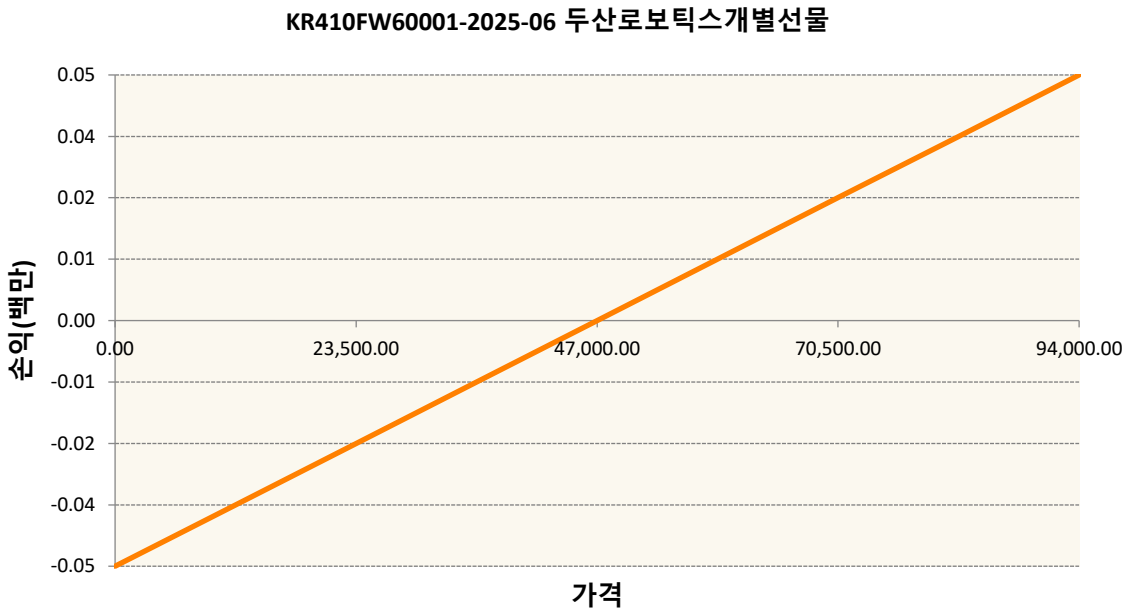
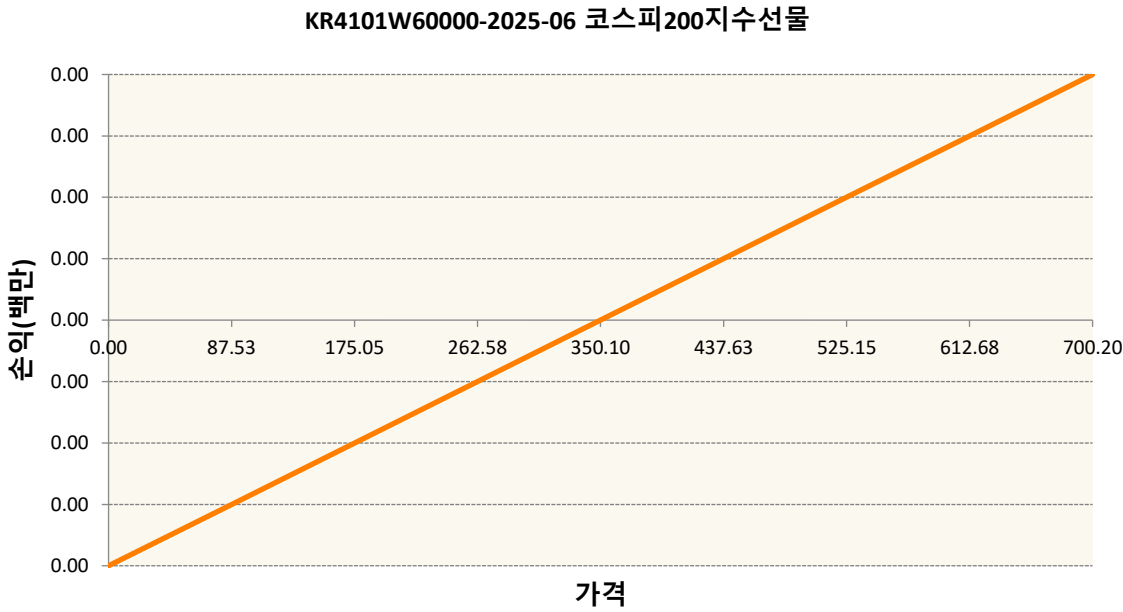
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

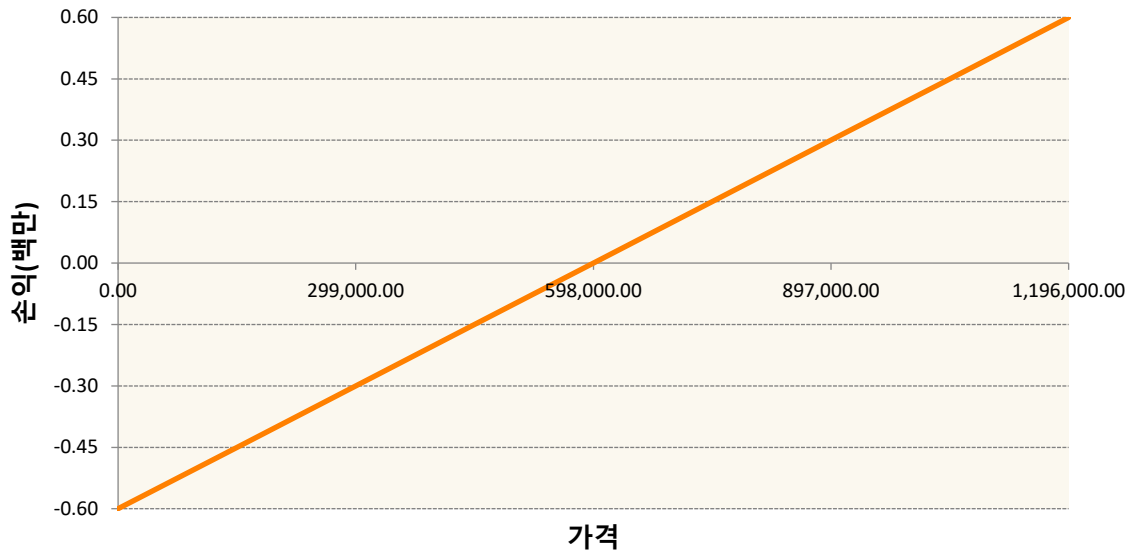
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	32	-32	장내
누계	유가증권	선물	9,819	0	9,819	장내

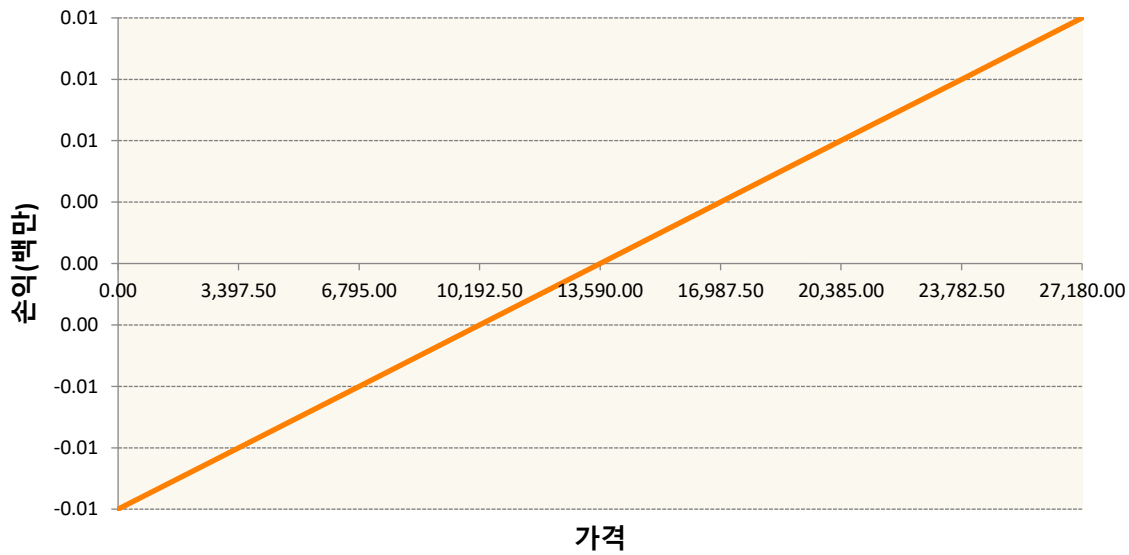
2. 만기시점의 손익구조



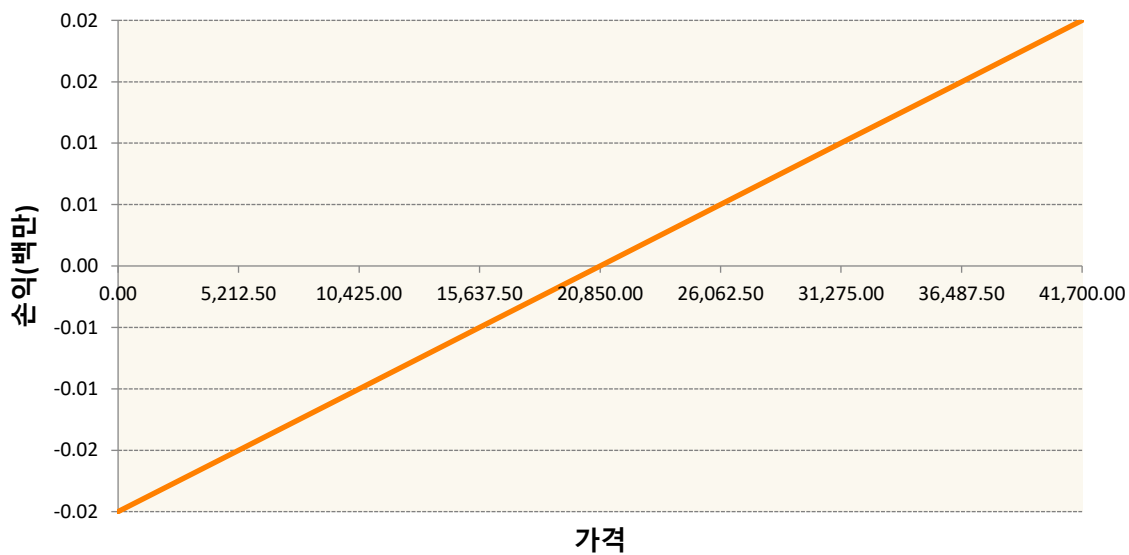
KR411SW60002-2025-06 효성중공업개별선물



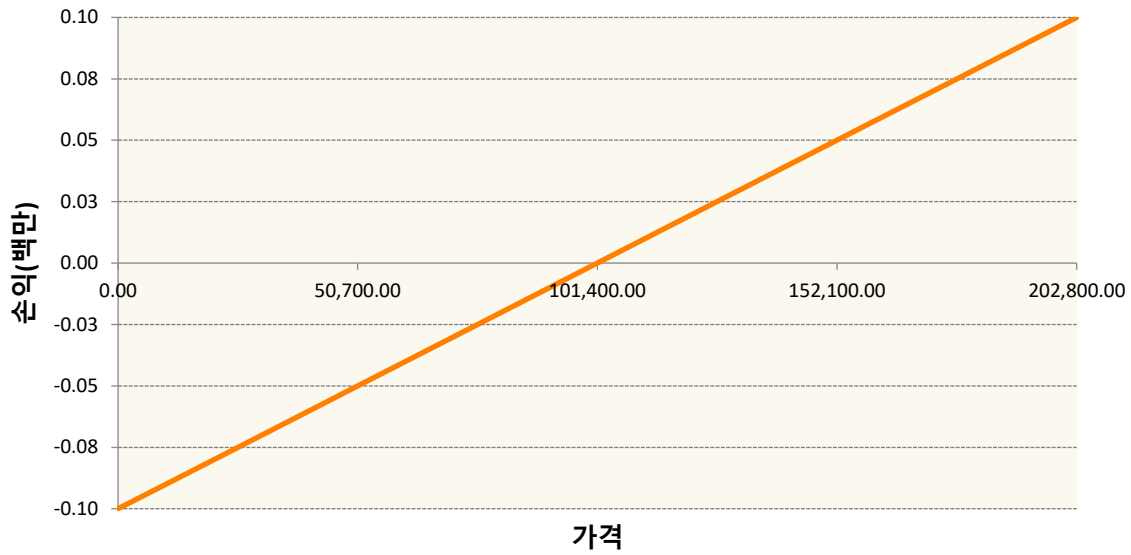
KR4148W60001-2025-06 미래에셋증권개별선물



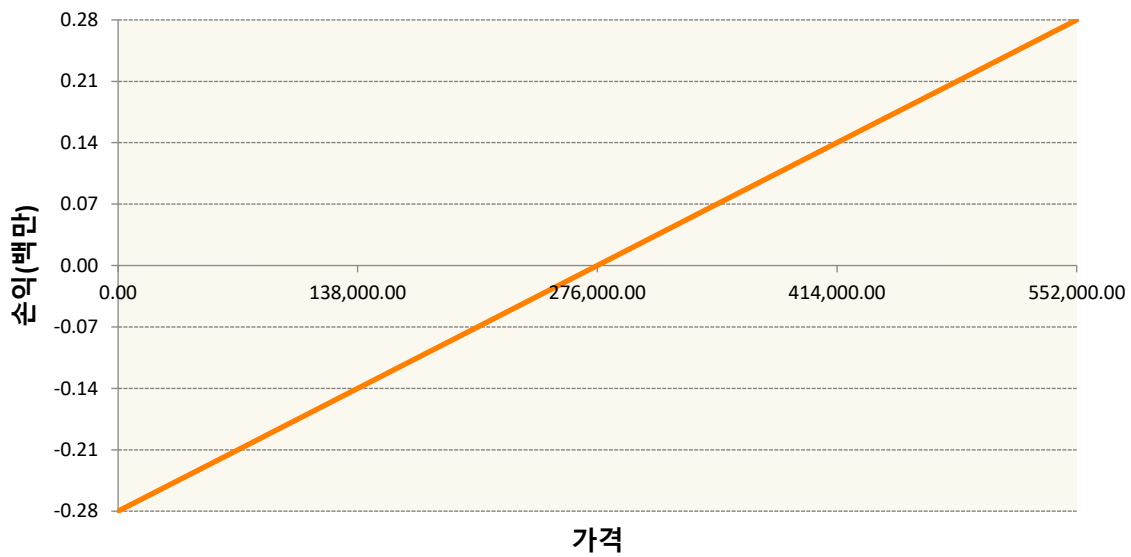
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



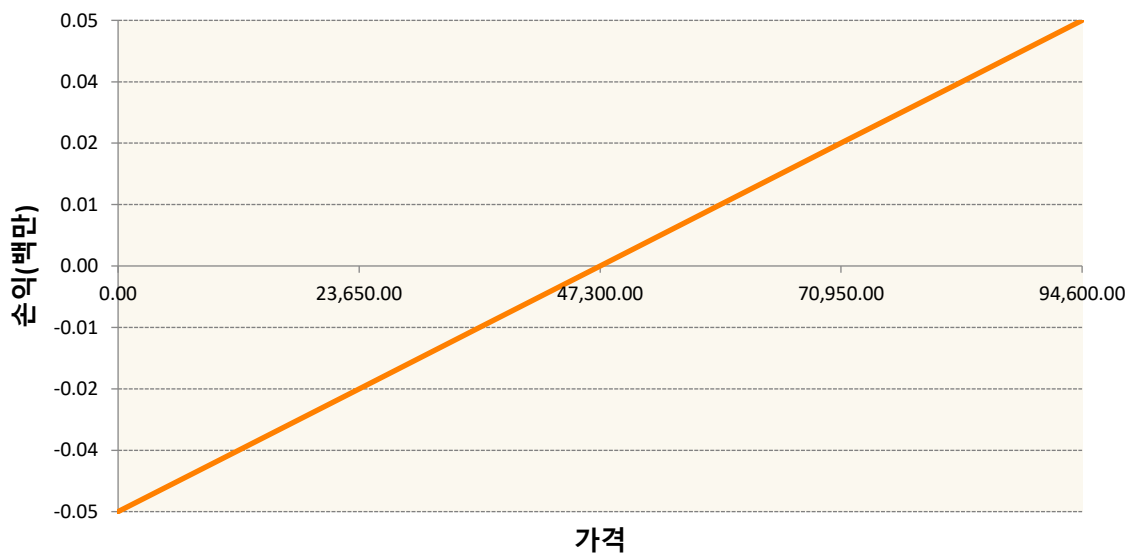
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



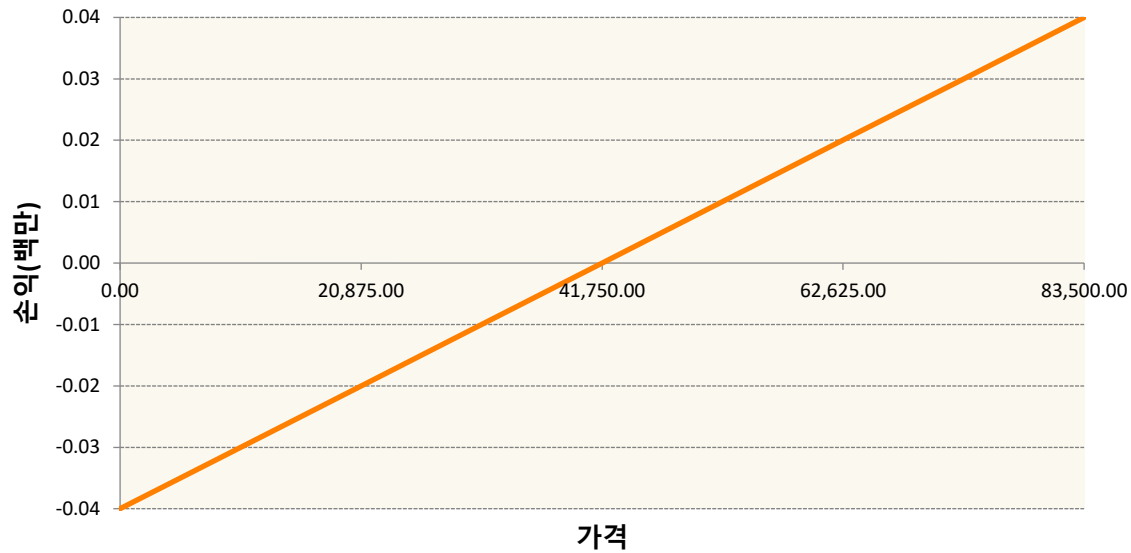
KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



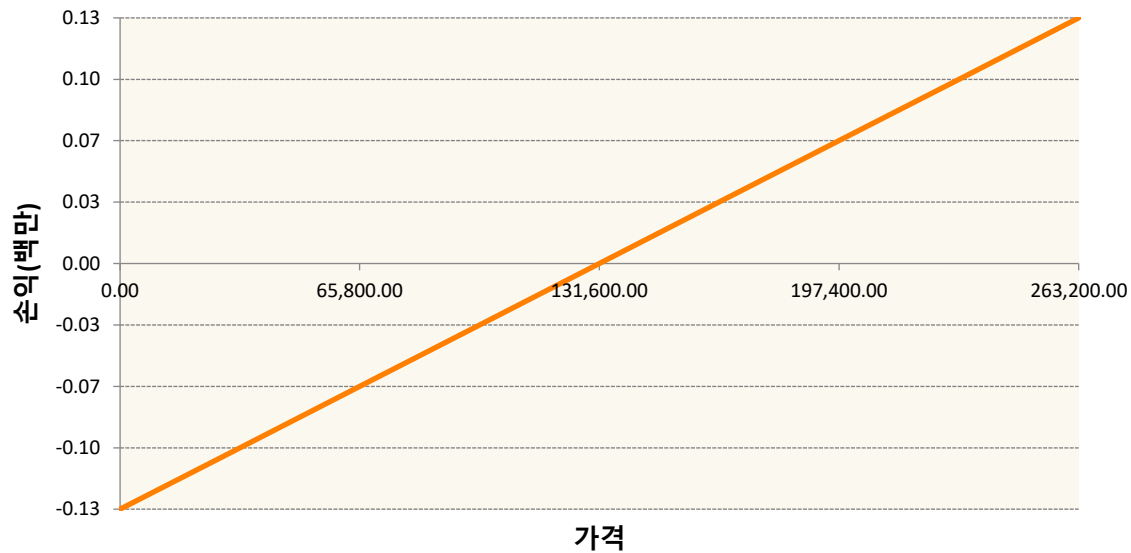
KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물



KR41G0W60005-2025-06 씨에스원드개별선물



KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	616
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물	6
KR411SW60(2025-06 효성중공업개별선물	5
KR4148W60(2025-06 미래에셋증권개별선물	1
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물	10
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	30
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물	96
KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물	9
KR41G0W60 2025-06 씨에스원드개별선물	0.3
KR41G5W60 2025-06 한진칼개별선물	12

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

(단위:백만원)

1,247

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

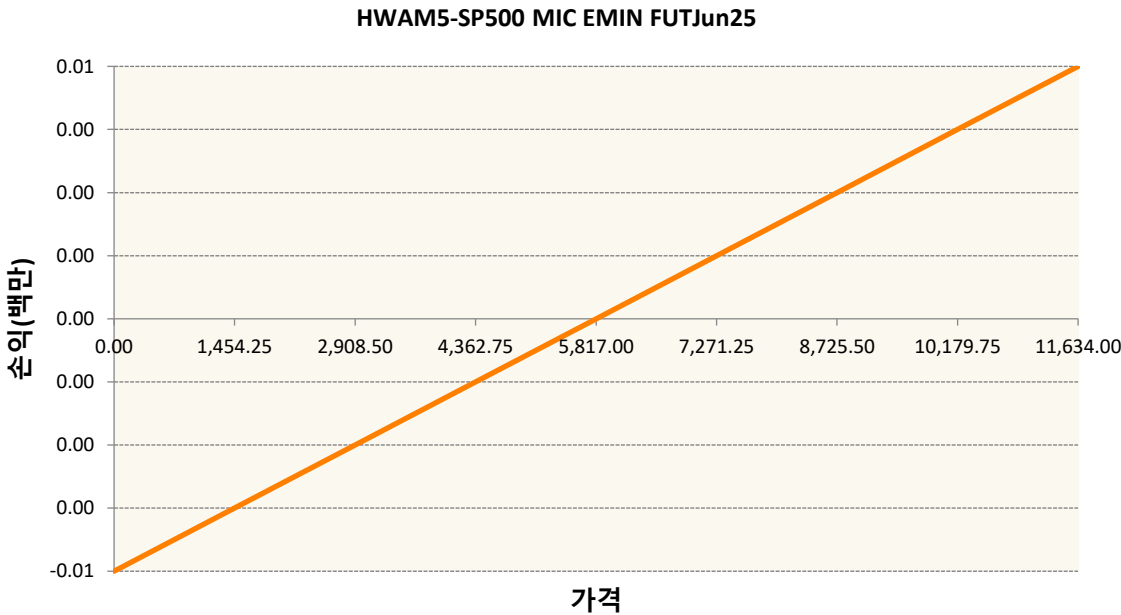
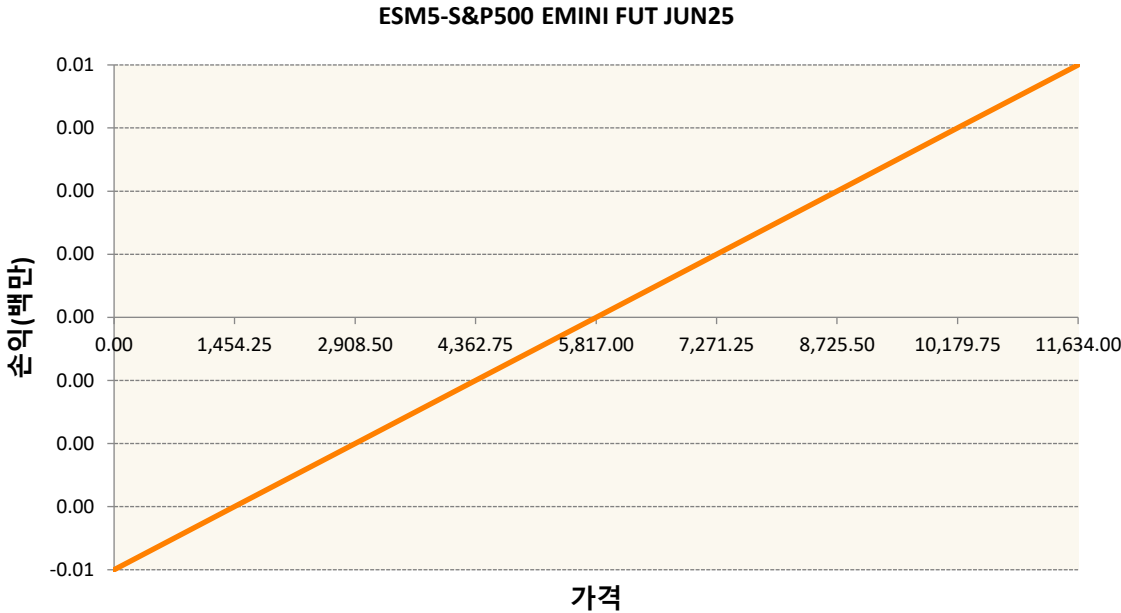
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	2,074	0	2,074	장내
누계	지수	선물	29,574	0	29,574	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,366
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	166

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,238

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

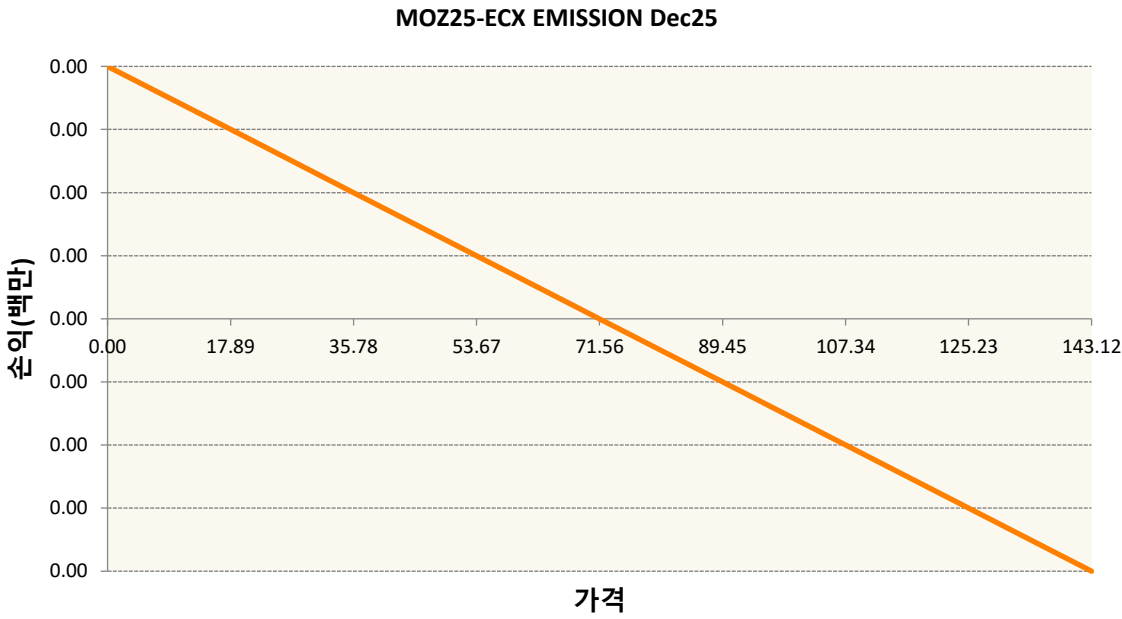
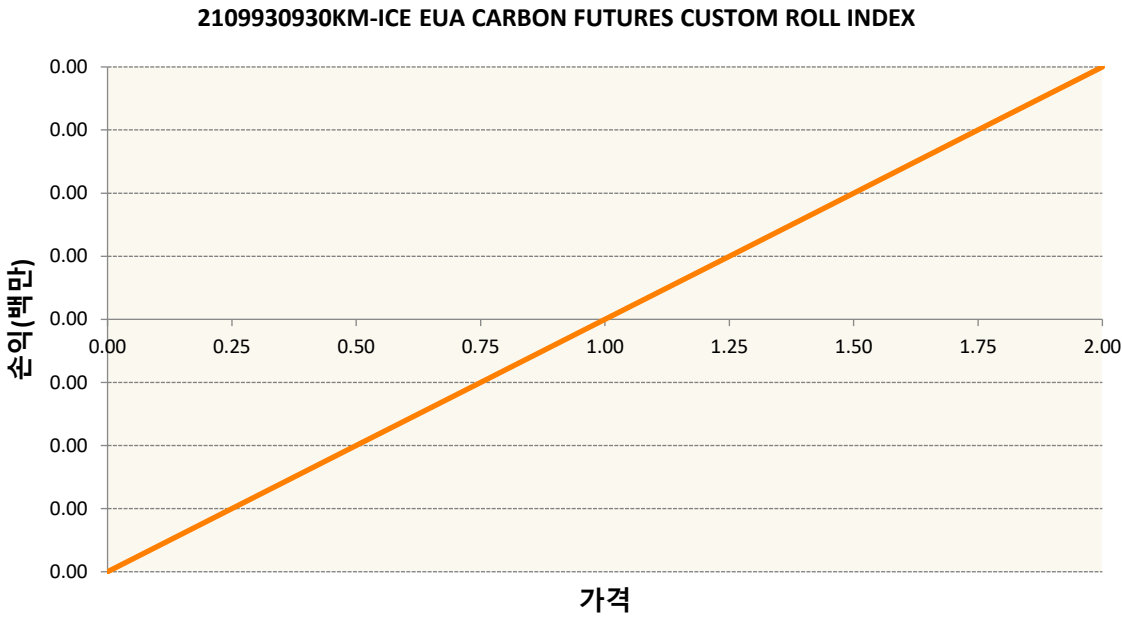
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	4,726	-4,726	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930	ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.14
MOZ25	ECX EMISSION Dec25	378

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	662

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

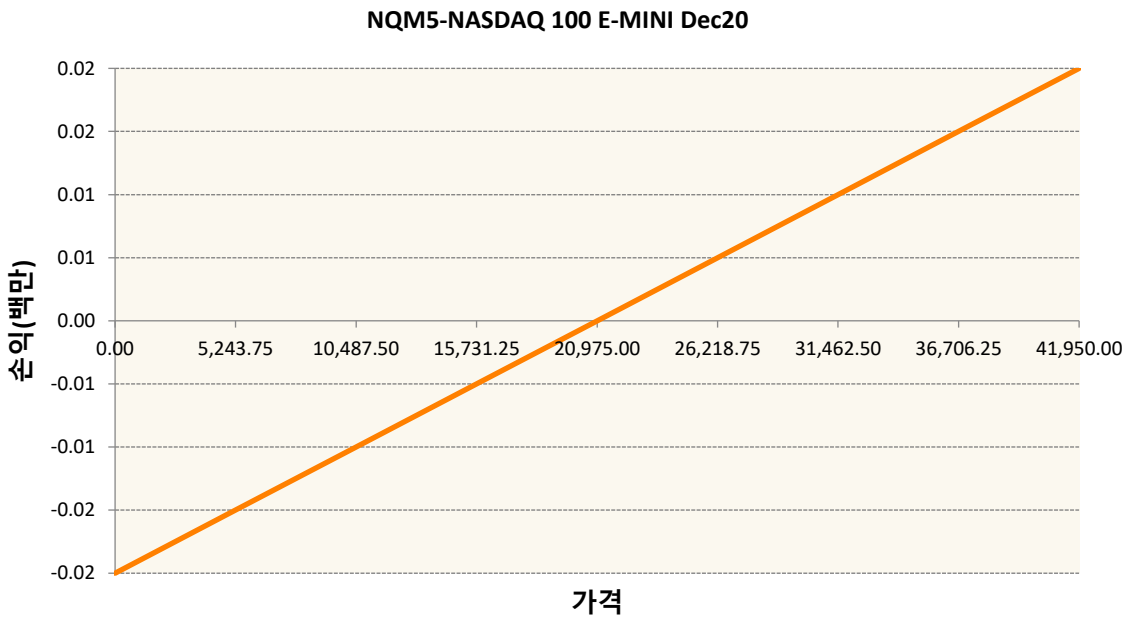
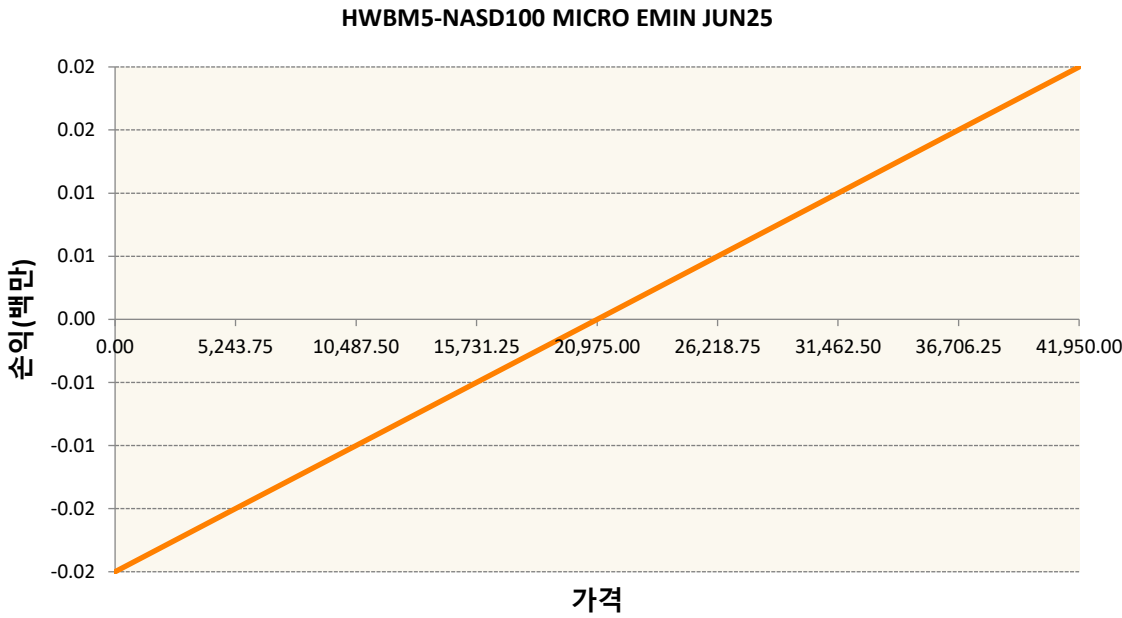
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,005	0	14,005	
누계	유가증권	선물	710	0	710	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		57
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,120

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,340

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

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	2,055	0	2,055	장외
누계	지수	스왑	232,105	0	232,105	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,867
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,303
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,481
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	878
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	153

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

(단위:백만원)

9,372

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

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	8
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8

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

(단위:백만원)

47

공시일	2025-05-27
기준일	2025-05-26

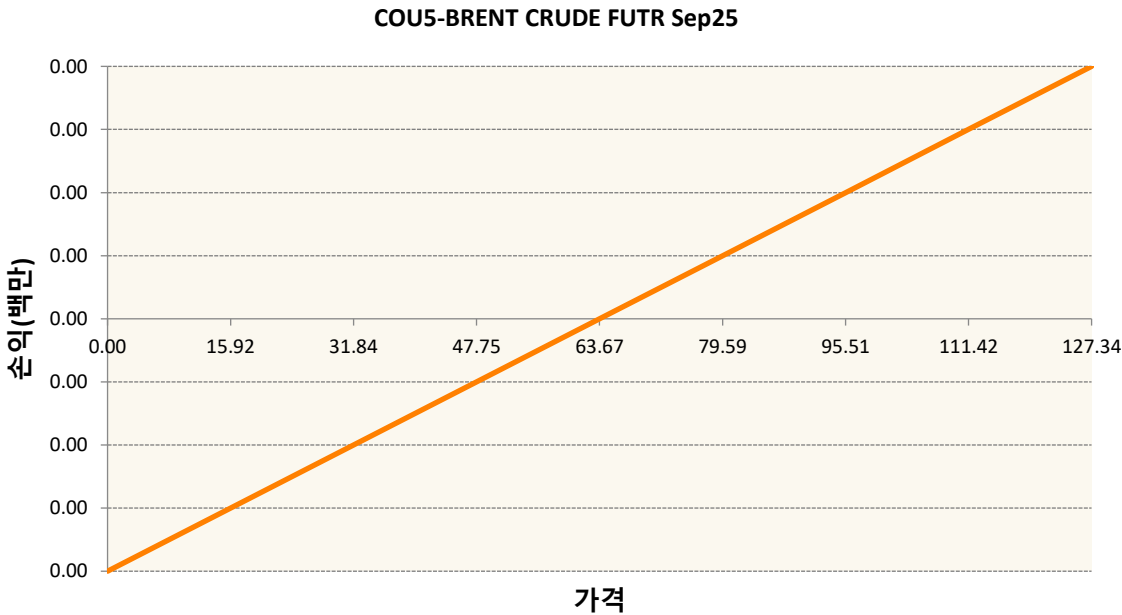
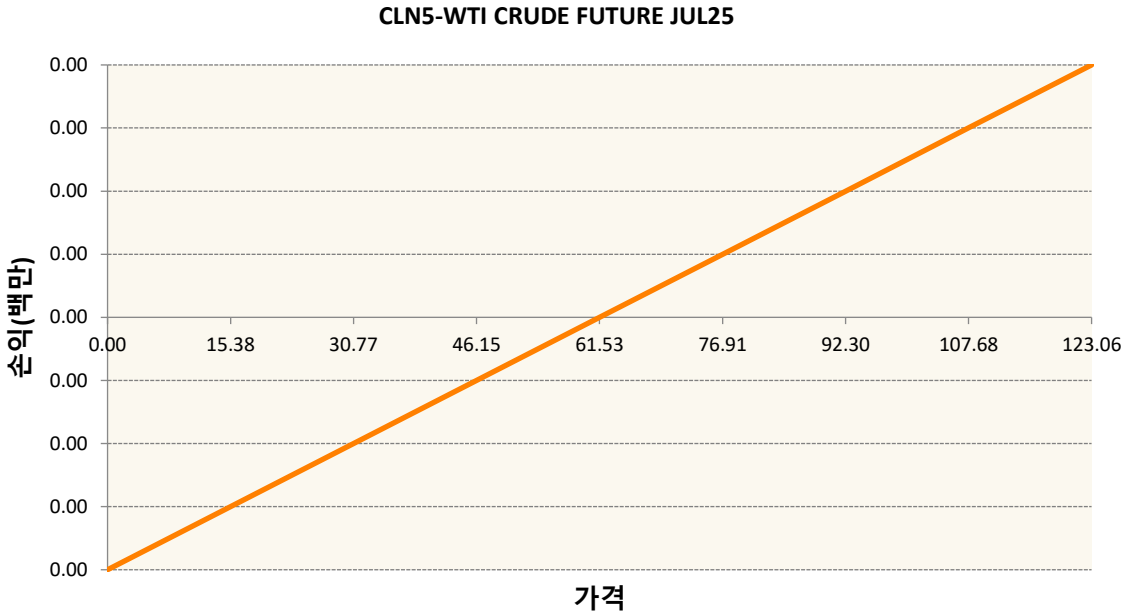
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

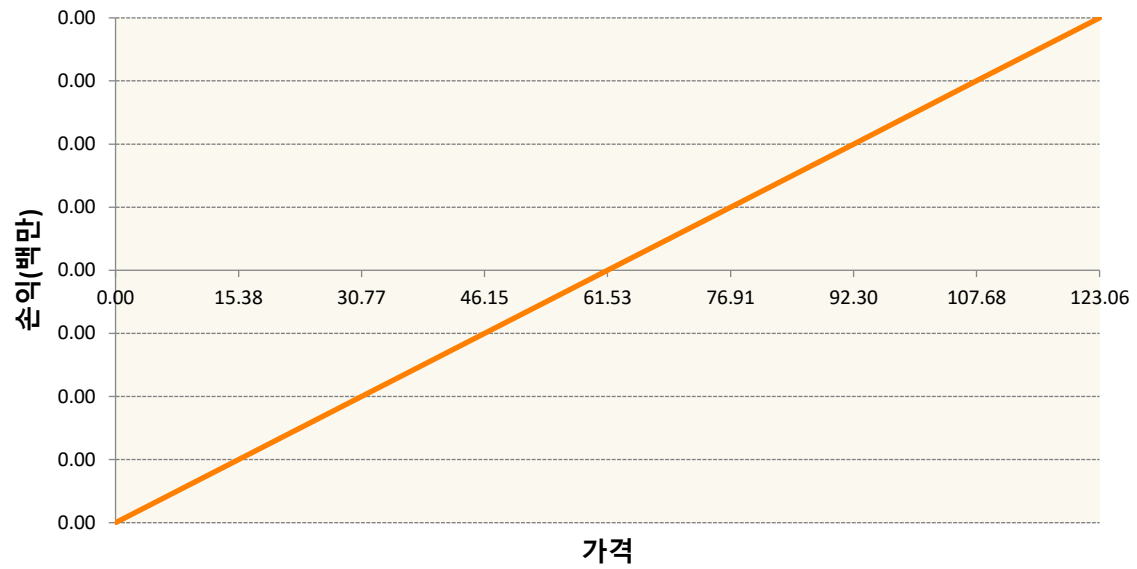
(단위:백만원)

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	673	0	673	
누계	통화	선물	0	82	-82	장내

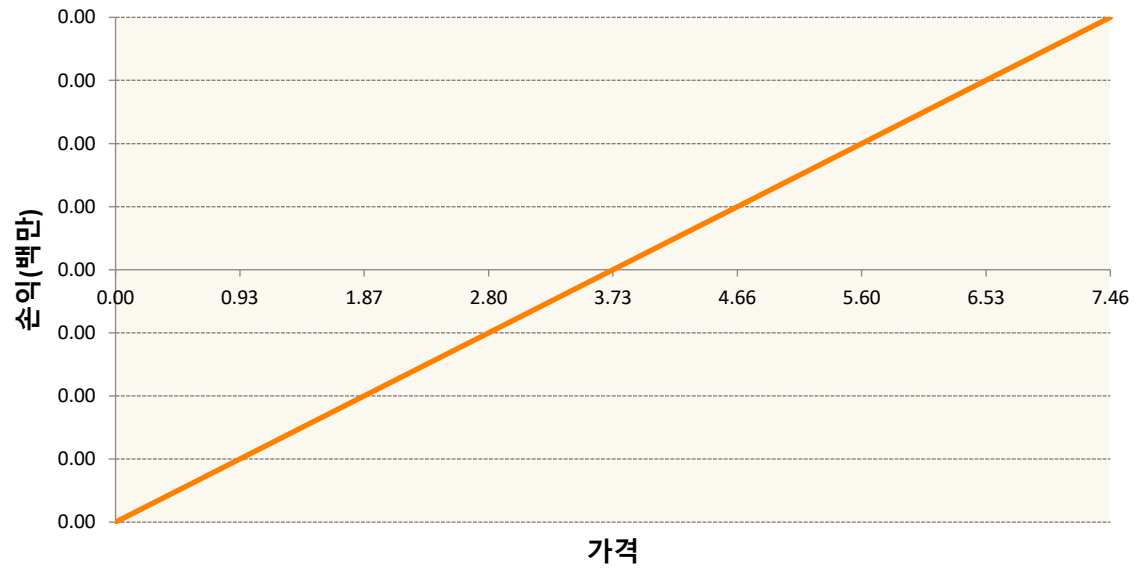
2. 만기시점의 손익구조



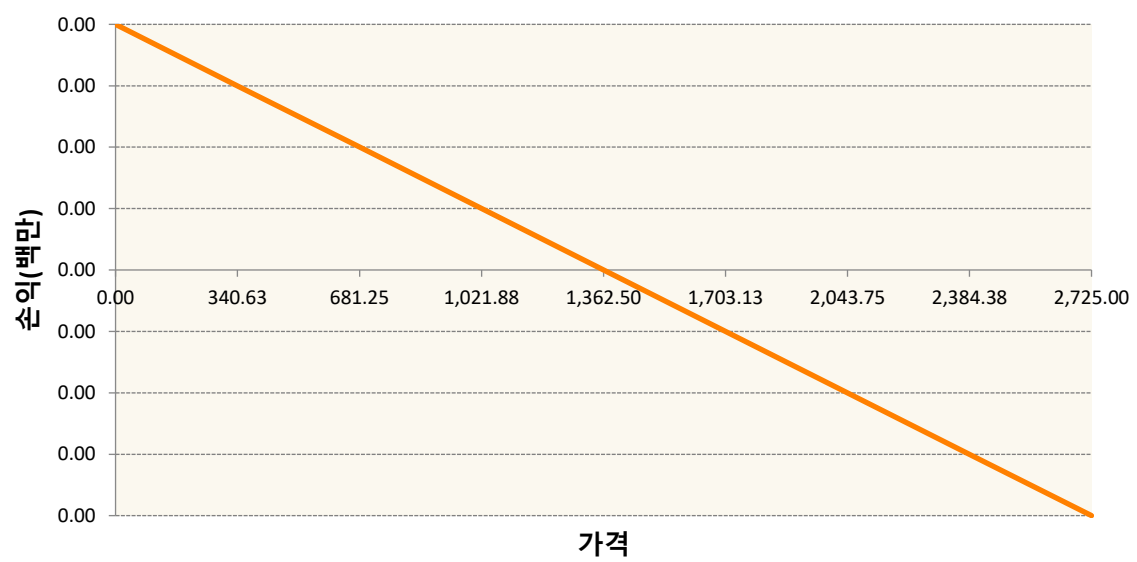
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



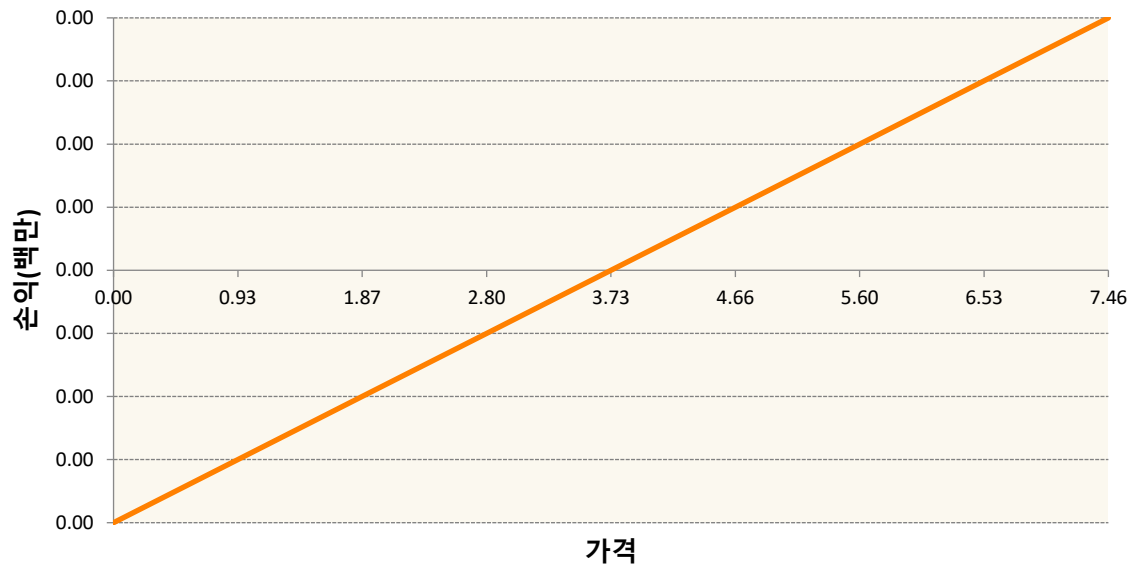
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



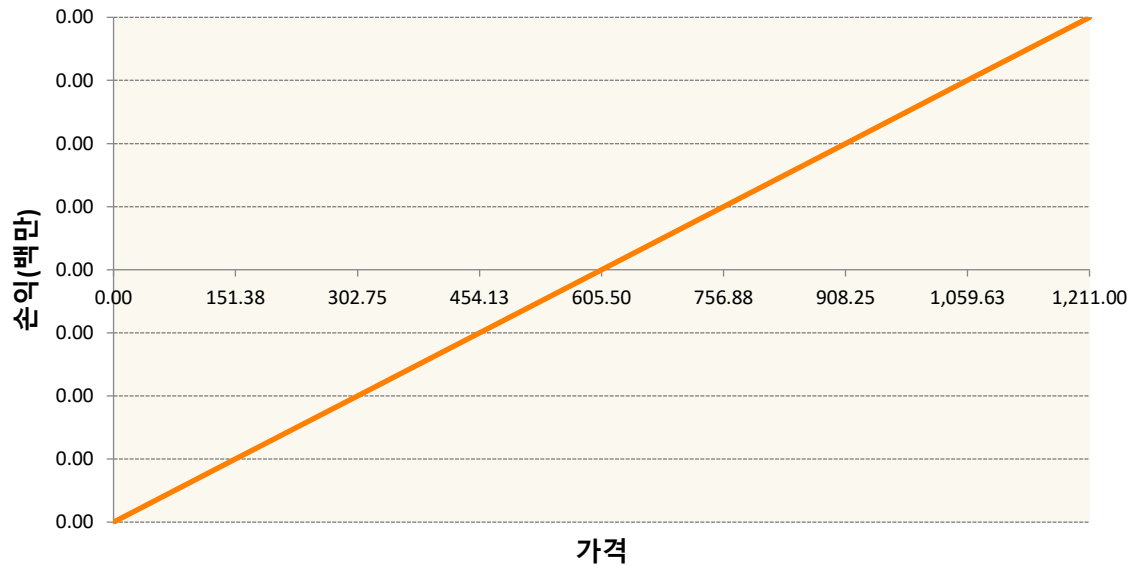
KR4175W60004-2025-06 달러선물



NGN25-NATURAL GAS FUTR JUL25



QSN5-Low Su Gasoil G JUL25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLN5	WTI CRUDE FUTURE JUL25	7
COU5	BRENT CRUDE FUTR Sep25	14
ECN5	E-mini Crude Oil JUL25	4
EON5	E-MINI NATURAL GAS JUL25	9
KR4175W60(2025-06 달러선물		7
NGN25	NATURAL GAS FUTR JUL25	13
QSN5	Low Su Gasoil G JUL25	7

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

(단위:백만원)

129