

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

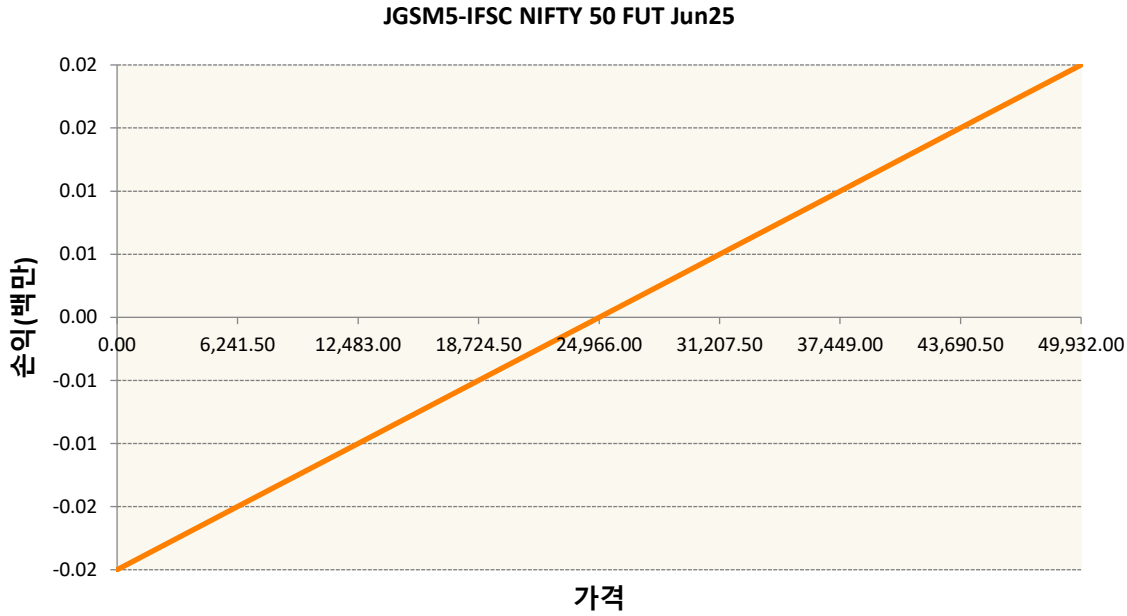
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	1	0	1	
누계	지수	선물	1,650	0	1,650	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSM5	IFSC NIFTY 50 FUT Jun25	132
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

98

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

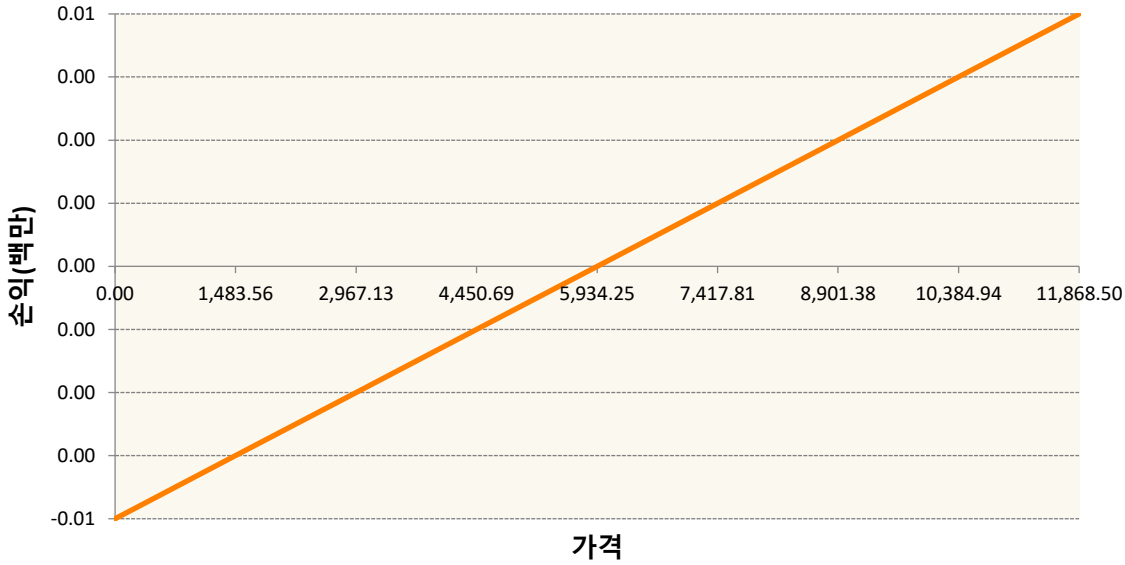
1. 계약금액

(단위:백만원)

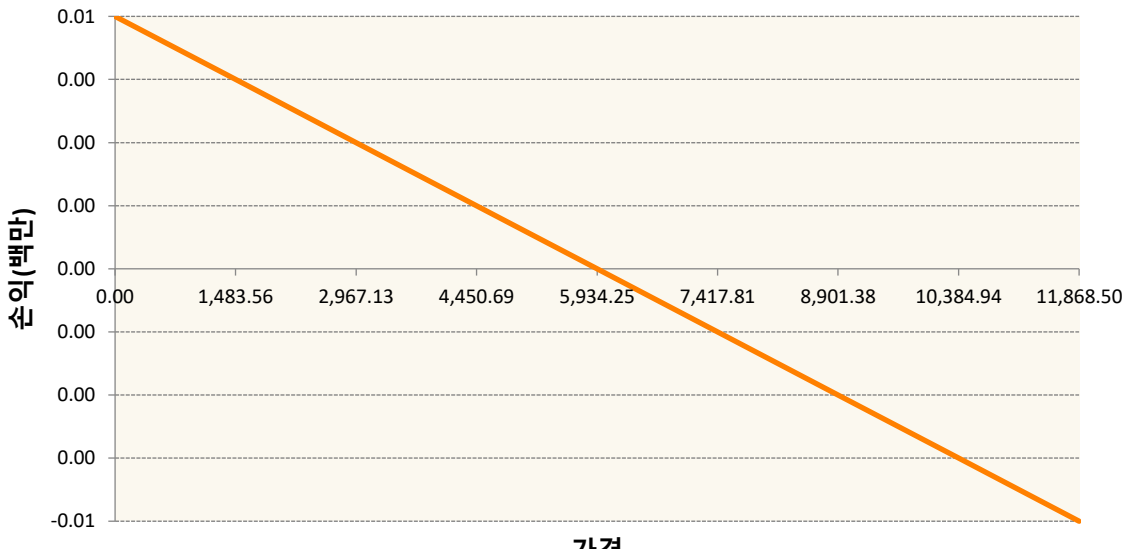
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	112	-112	장내
누계	지수	선물	433	0	433	

2. 만기시점의 손익구조

ESM5-S&P500 EMINI FUT JUN25



HWAM5-SP500 MIC EMIN FUTJun25



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	35
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	39

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

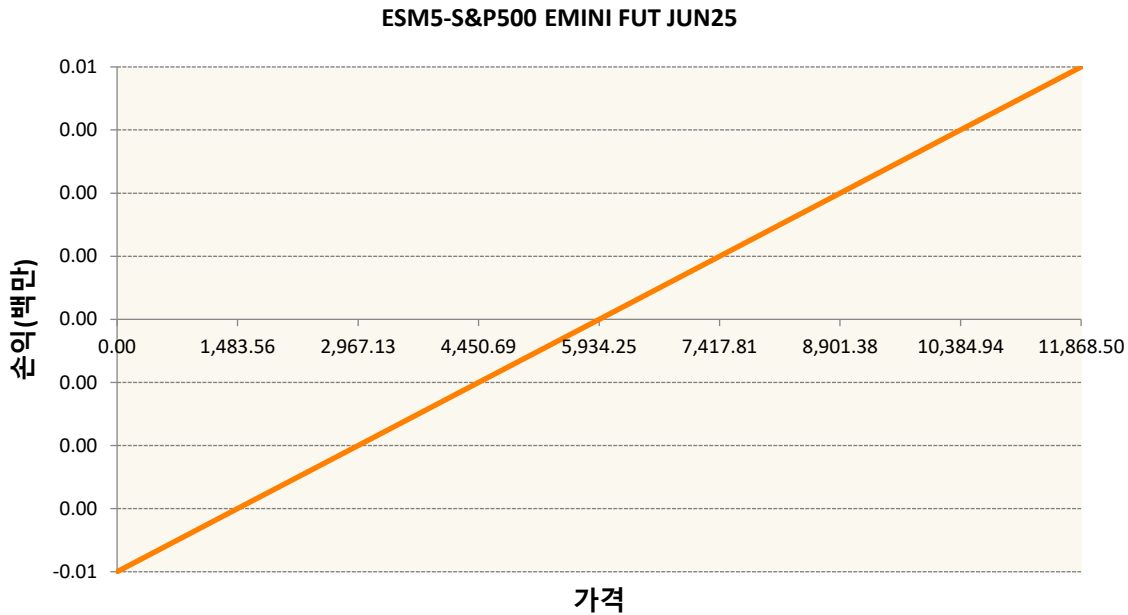
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,299	0	1,299	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	104
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

92

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

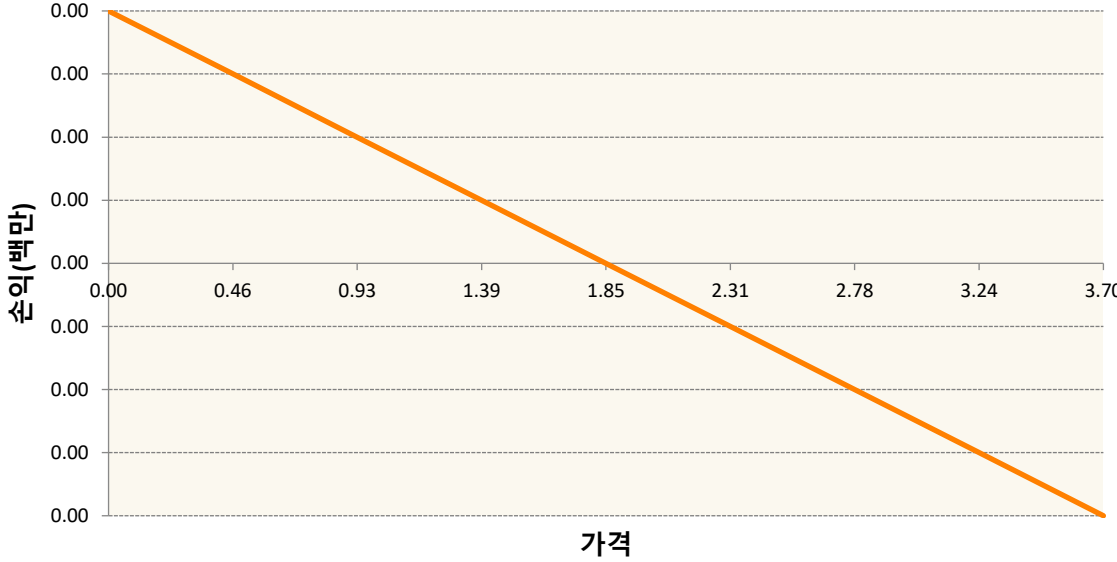
1. 계약금액

(단위:백만원)

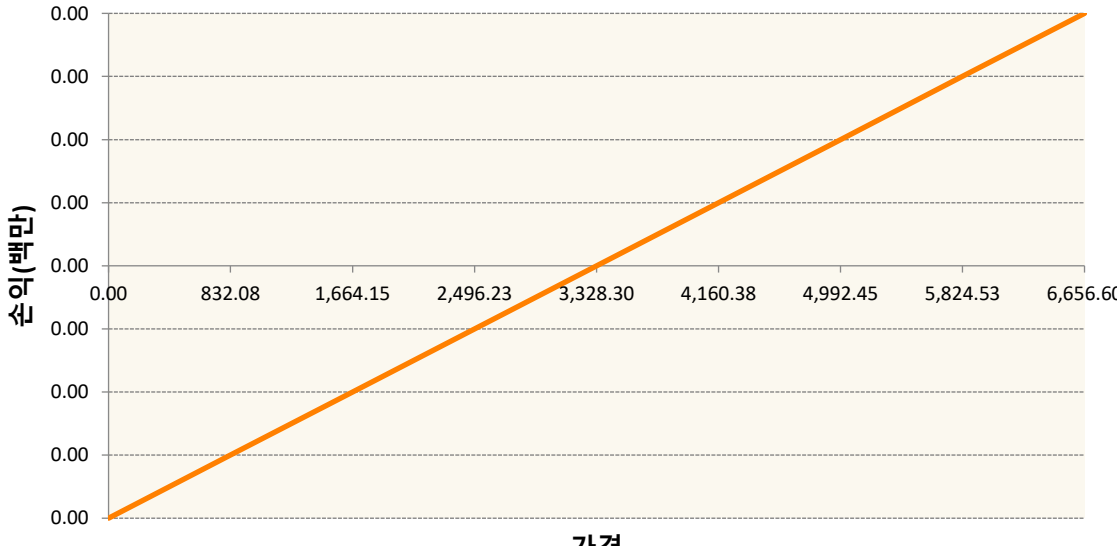
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	2,289	0	2,289	
누계	실물자산	옵션	0	73	-73	

2. 만기시점의 손익구조

AOGLDUSC306B-GLD US 05/30/25 C306 EQUITY



GCQ5-GOLD 100 OZ FUTR Aug25



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
AOGLDUSC3 GLD US 05/30/25 C306 EQUITY	6
GCQ5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25	183

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	160

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

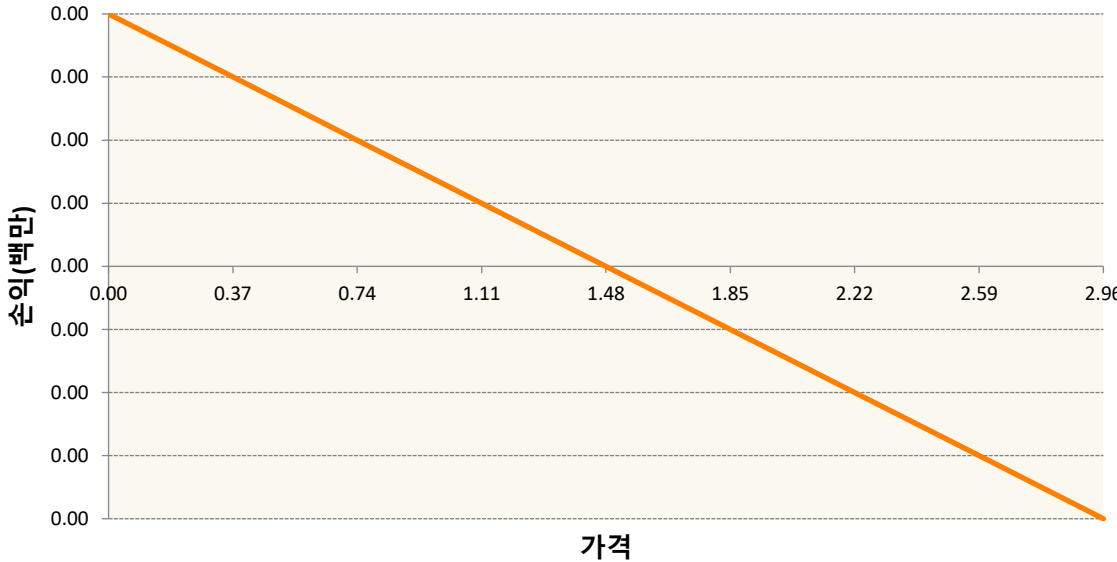
1. 계약금액

(단위:백만원)

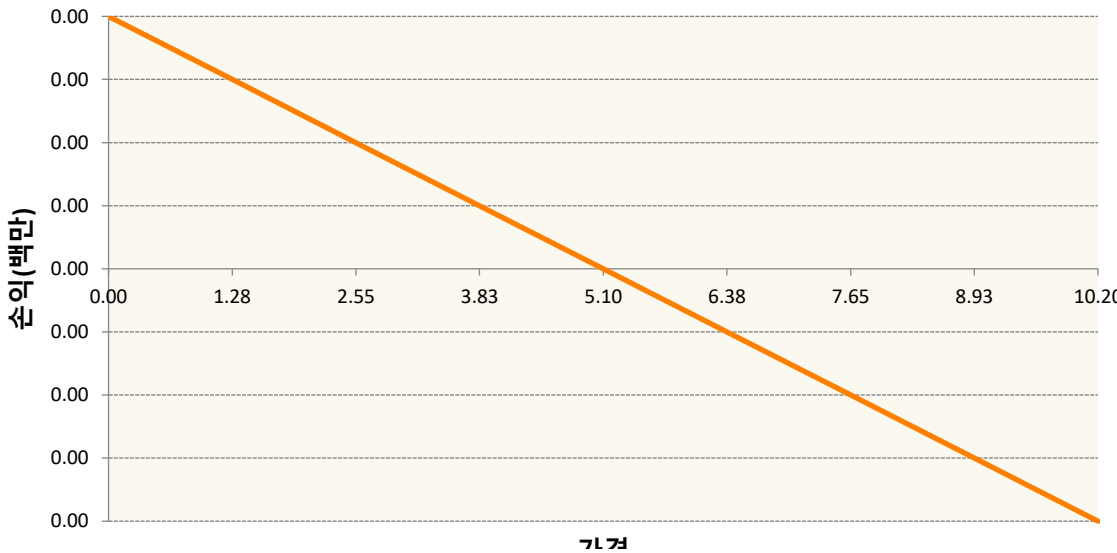
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	옵션	0	75	-75	

2. 만기시점의 손익구조

AOPLTRUSC127-PLTR US 05/30/25 C127 EQUITY



AOPLTRUSP127-PLTR US 05/30/25 P127 EQUITY



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
AOPLTRUSC` PLTR US 05/30/25 C127 EQUITY	4
AOPLTRUSP` PLTR US 05/30/25 P127 EQUITY	2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	24

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

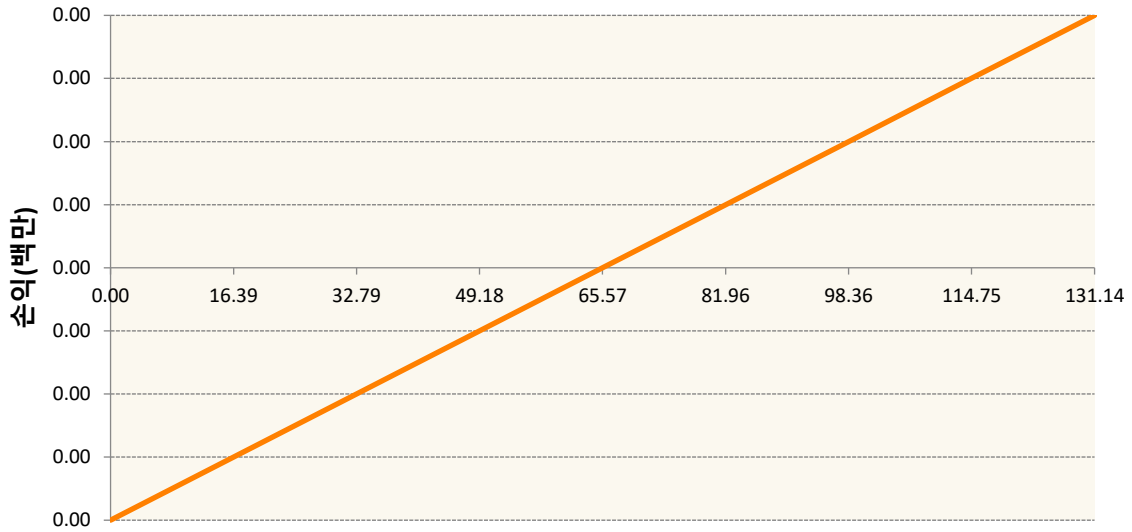
* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

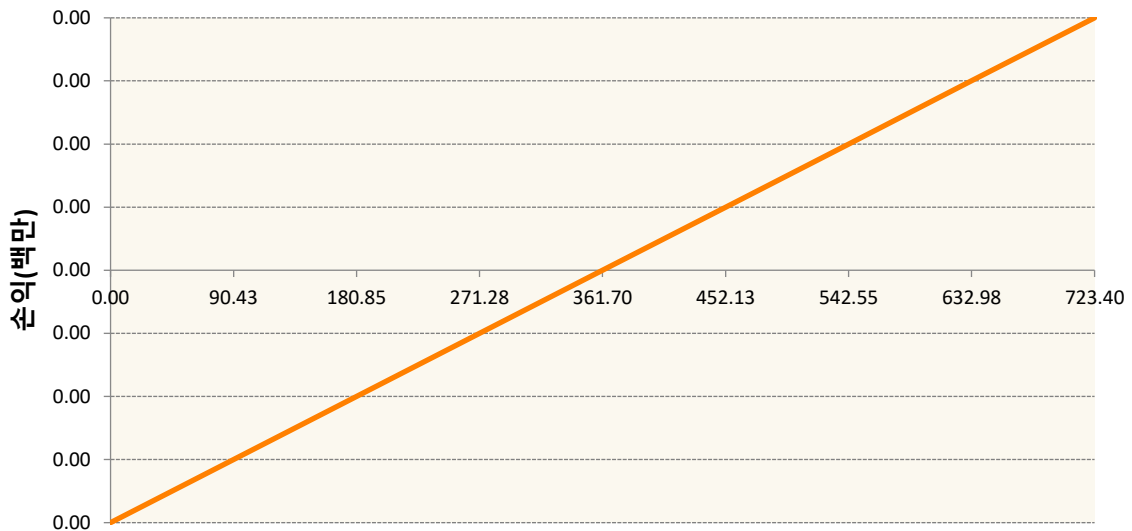
가격

CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



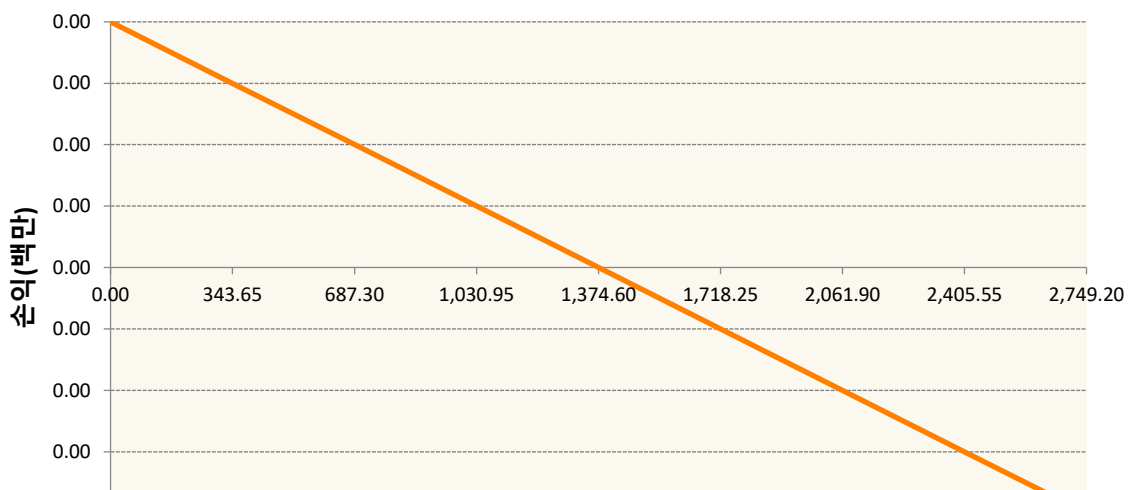
가격

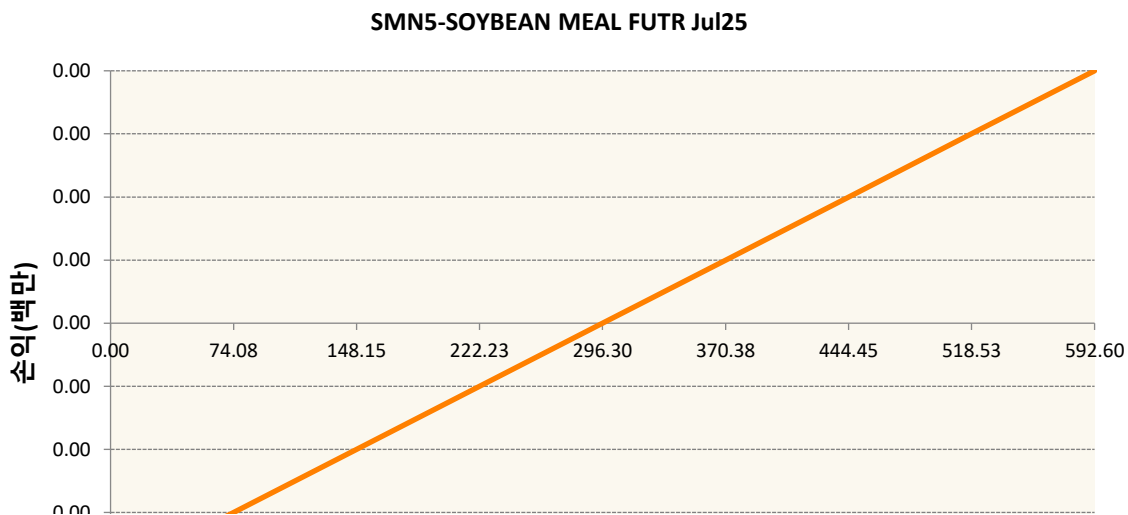
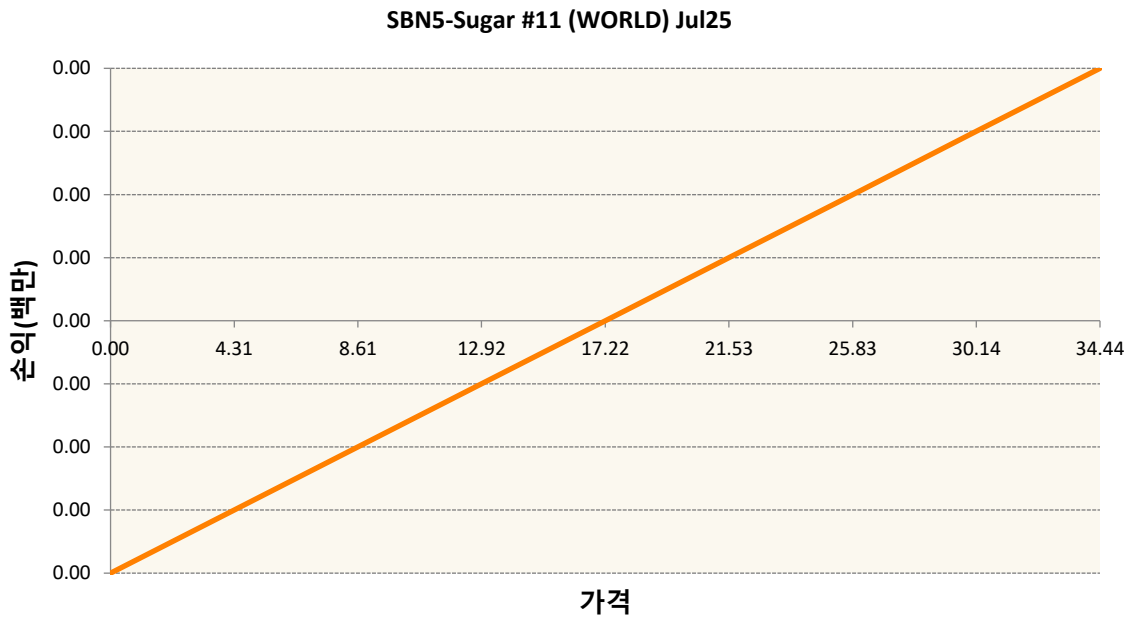
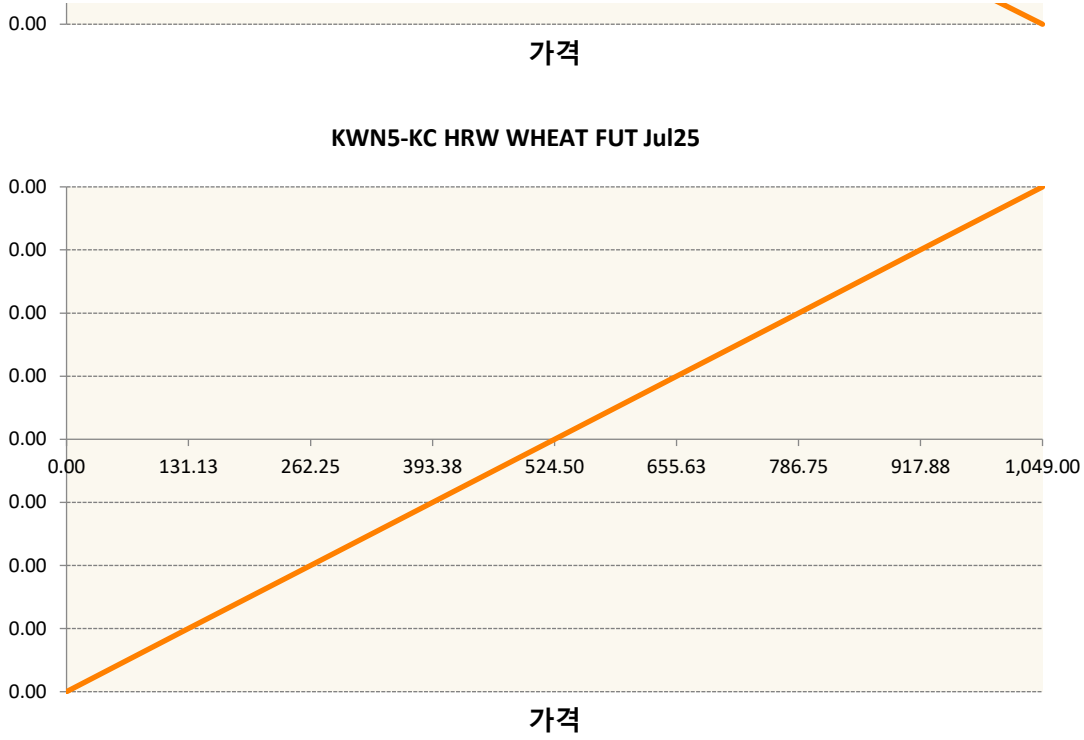
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25

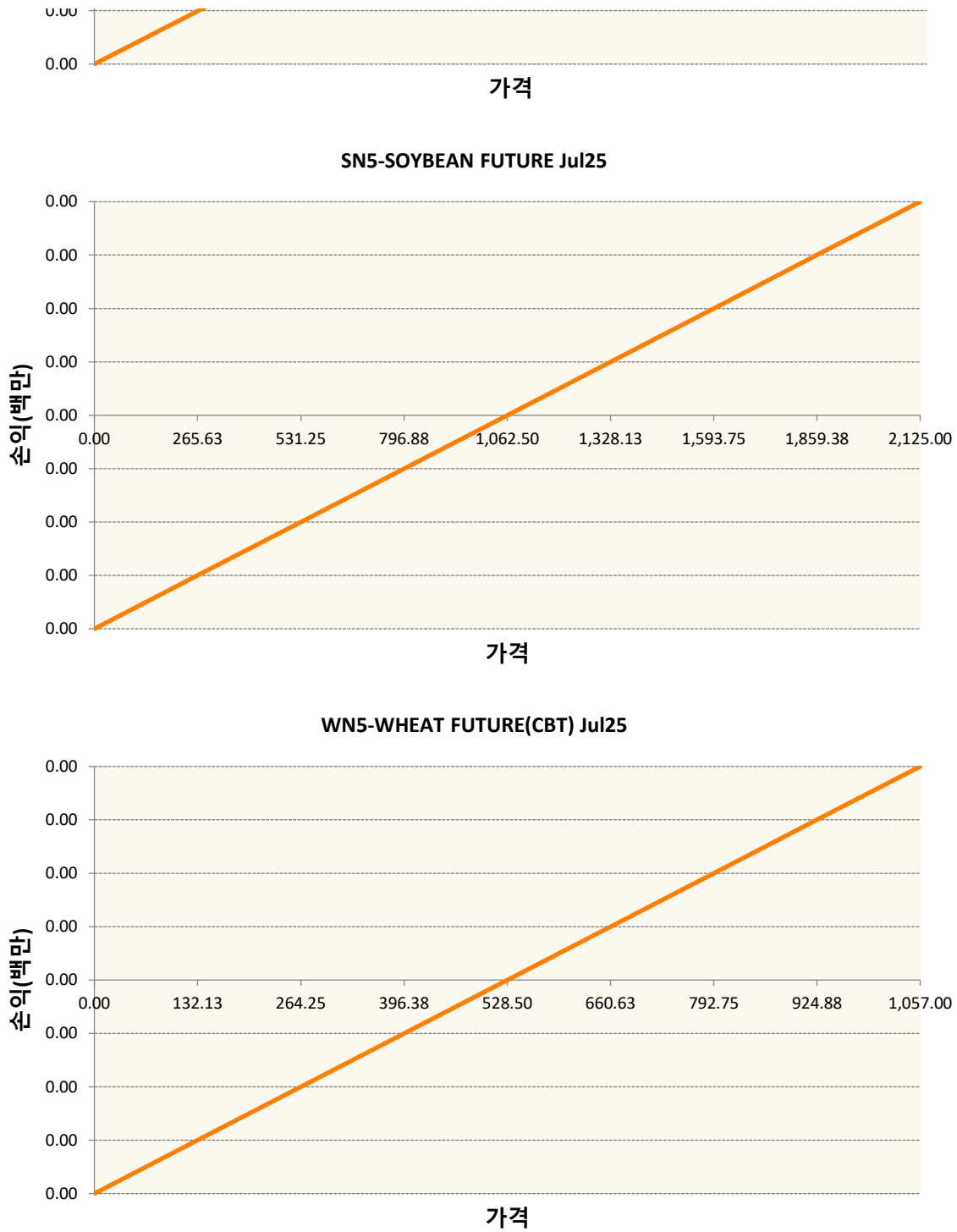


가격

KR4175W60004-2025-06 달러선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

스마트인덱스모

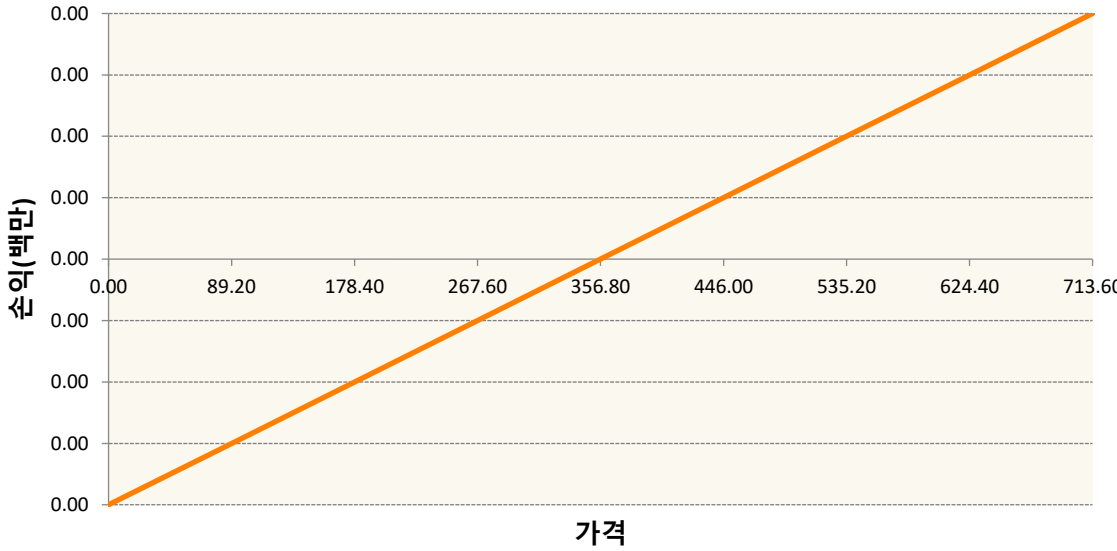
1. 계약금액

(단위:백만원)

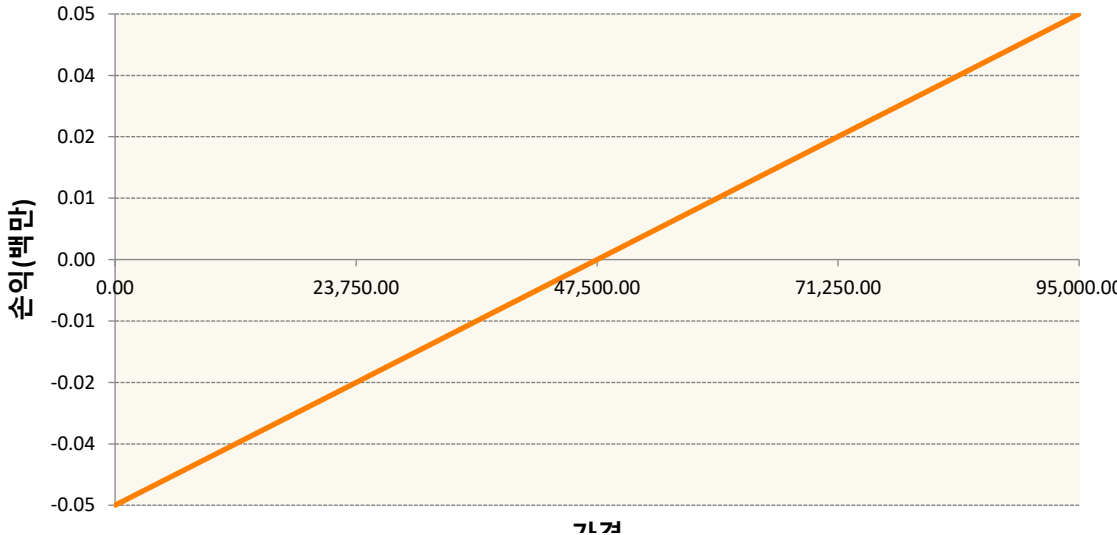
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,426	0	1,426	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101W60000-2025-06 코스피200지수선물

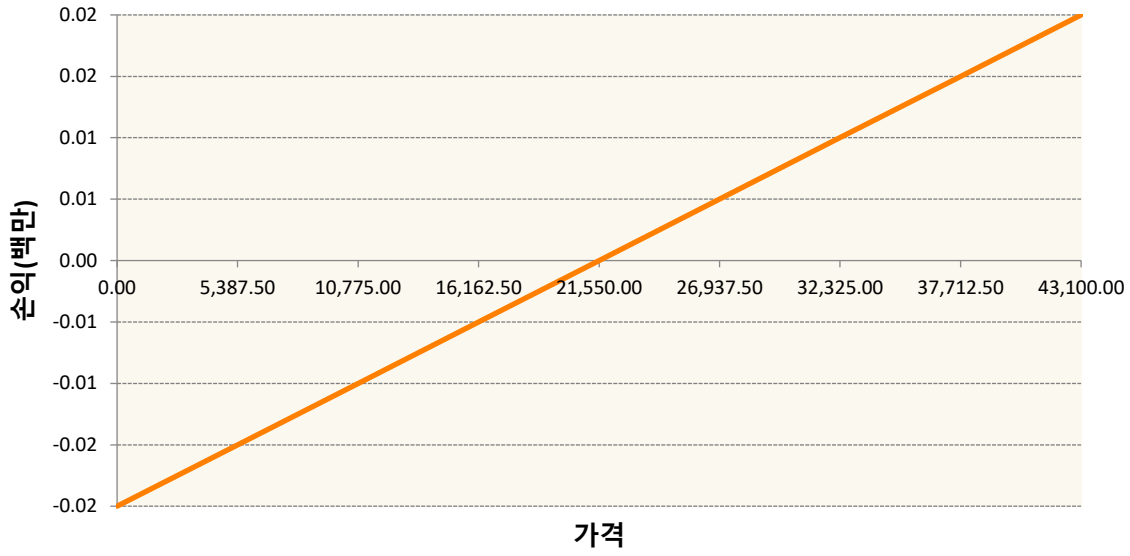


KR410FW60001-2025-06 두산로보틱스개별선물

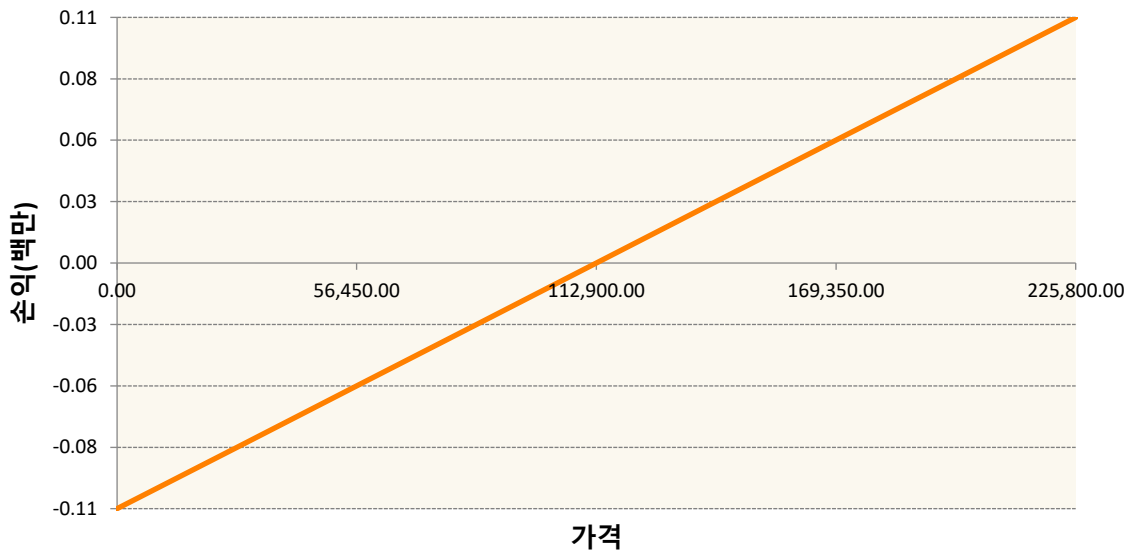


가격

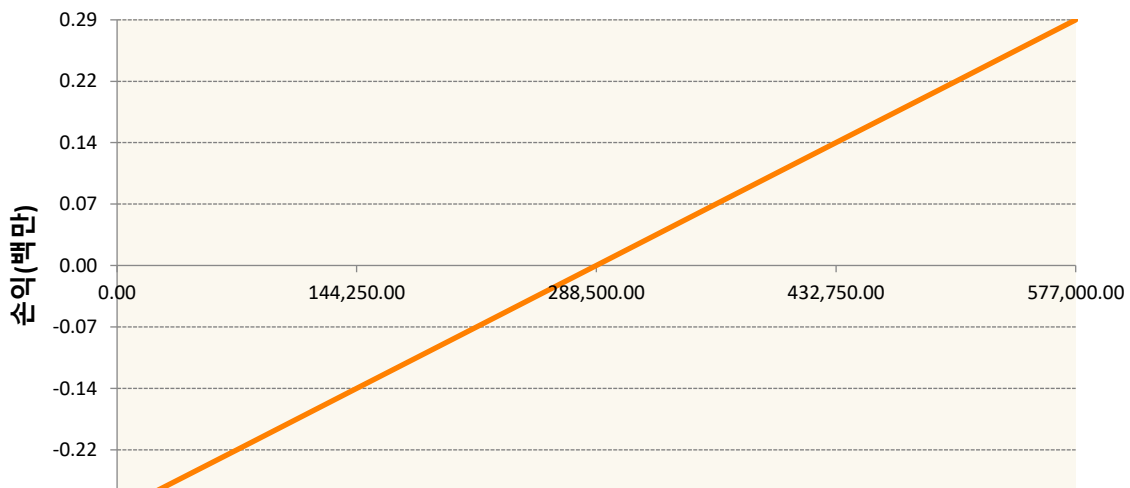
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물

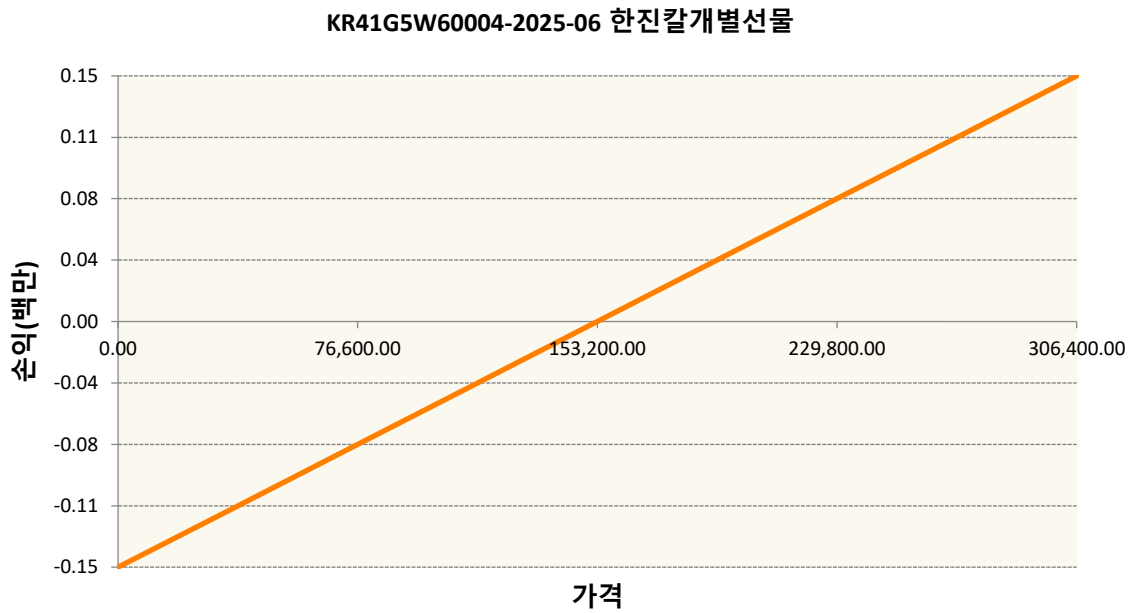
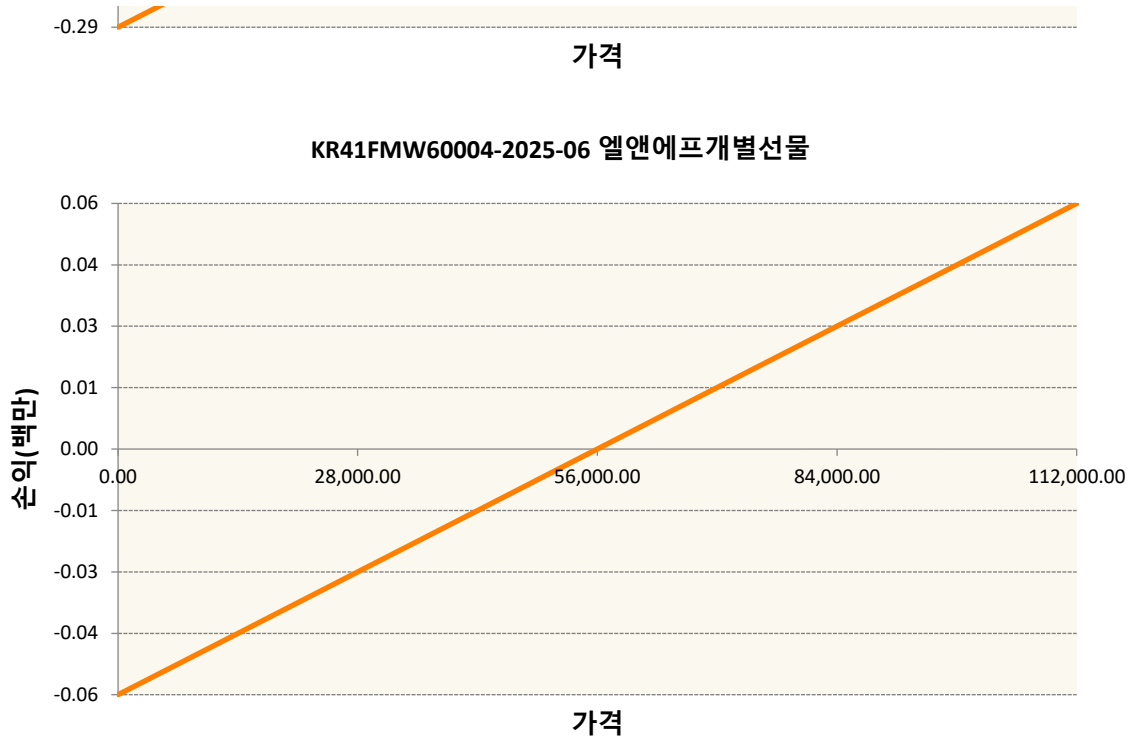


KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	86
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물	1
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물	1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물	12
KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물	2
KR41G5W60 2025-06 한진칼개별선물	8

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

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

292

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

471

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

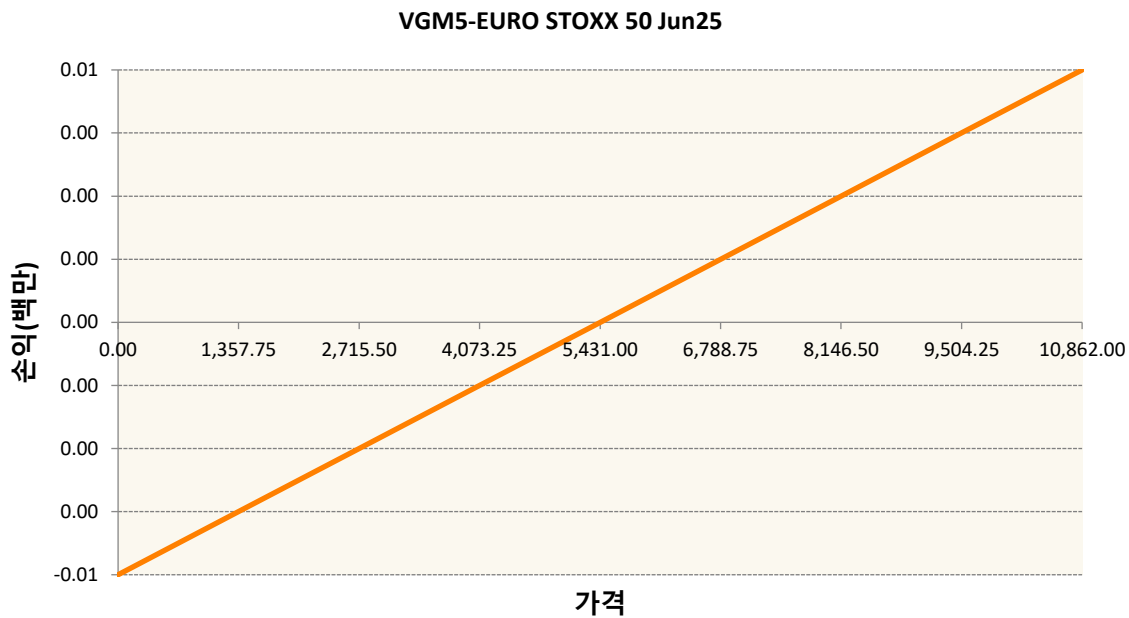
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,037	0	1,037	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	83
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

69

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

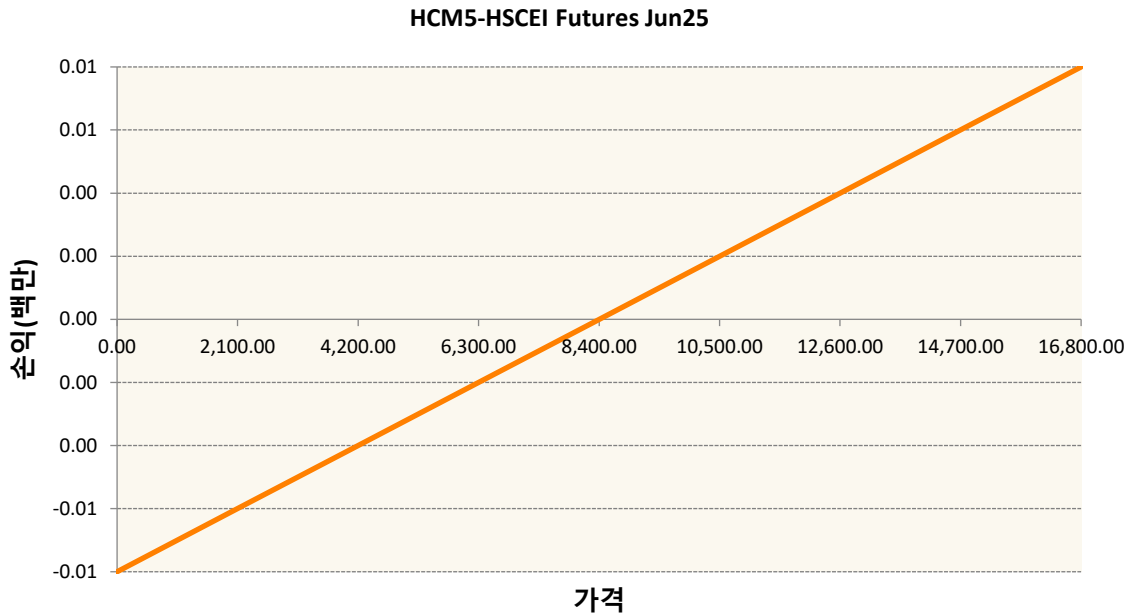
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,434	0	2,434	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM5	HSCEI Futures Jun25	195
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

290

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

커버드콜모(주식혼합-파생형)

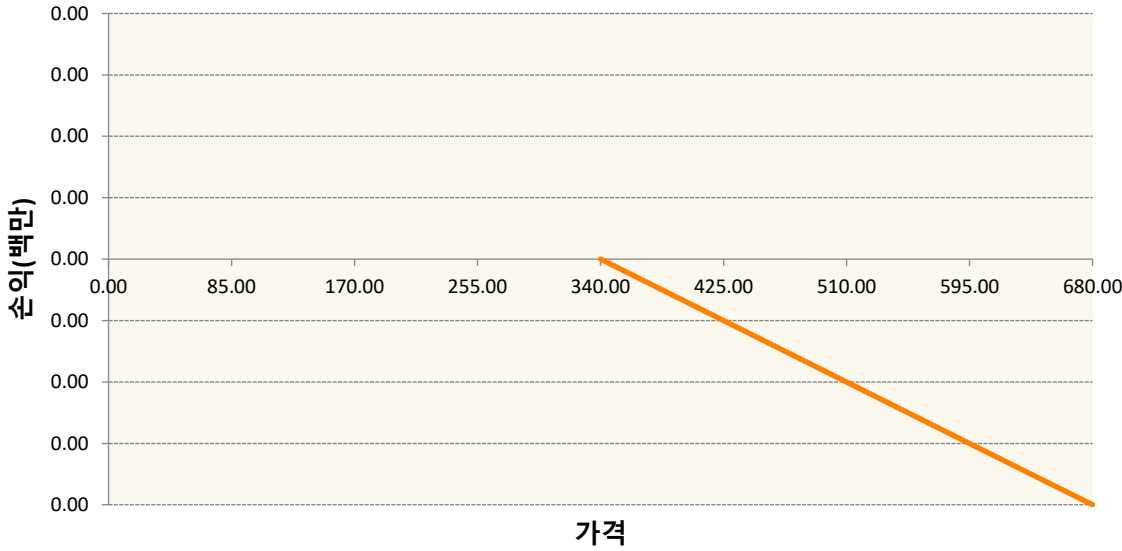
1. 계약금액

(단위:백만원)

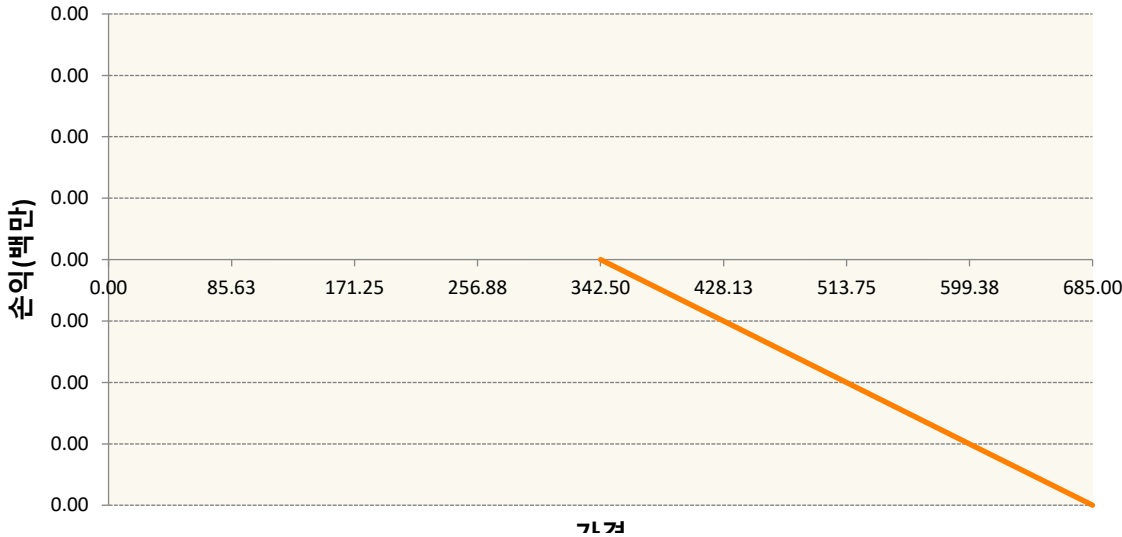
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	664	0	664	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,001	-35,001	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201W63408-코스피200 C 202506 340.0

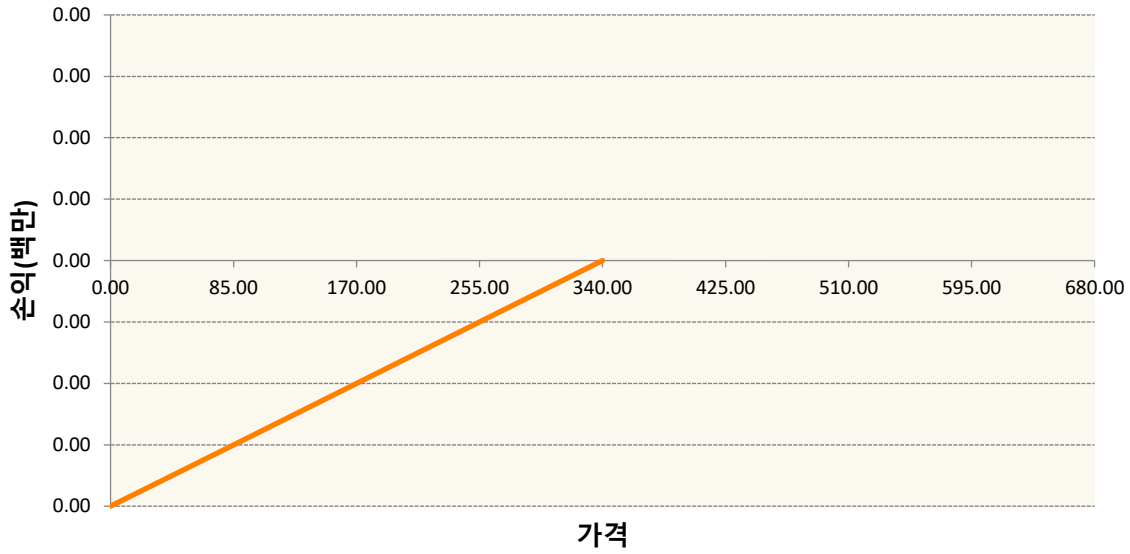


KR4201W63424-코스피200 C 202506 342.5

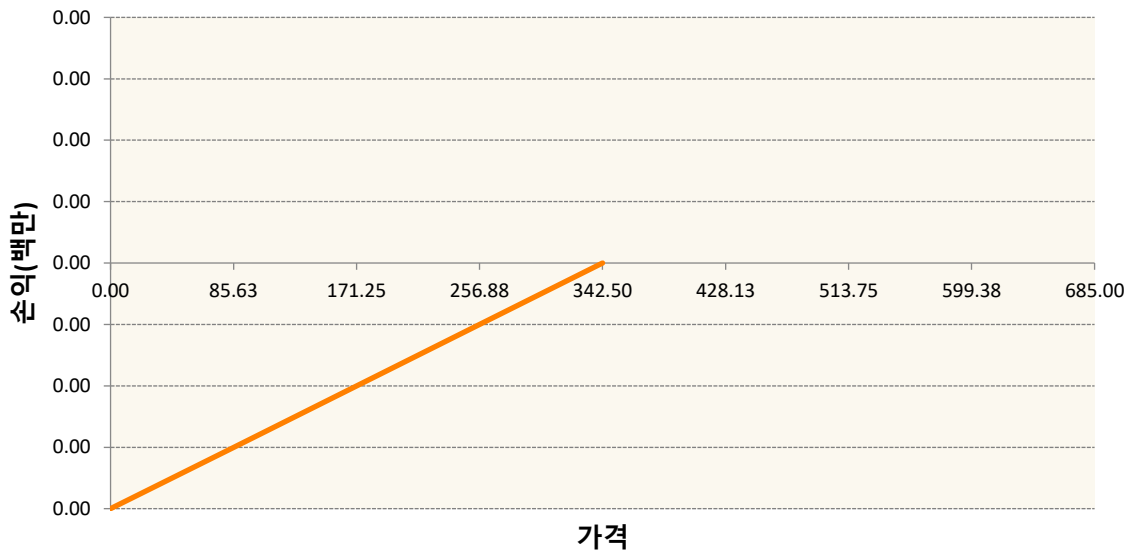


가격

KR4301W63406-코스피200 P 202506 340.0



KR4301W63422-코스피200 P 202506 342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201W63408		코스피200 C 202506 340.0						957
		기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	573	565	556	547	537	526	515	
-5.33%	494	479	464	450	435	420	405	
-2.67%	302	290	277	263	250	236	222	
0%	18	13	7	0	-8	-17	-27	
2.67%	-302	-303	-304	-307	-310	-314	-319	
5.33%	-629	-629	-629	-629	-630	-632	-633	
8.00%	-956	-956	-956	-956	-956	-957	-957	

KR4201W63424 코스피200 C 202506 342.5							1,357
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	726	718	708	697	685	672	658
-5.33%	645	625	605	585	565	544	523
-2.67%	415	394	373	352	331	310	288
0%	34	24	13	0	-14	-29	-45
2.67%	-417	-419	-423	-428	-434	-441	-450
5.33%	-885	-885	-886	-887	-889	-891	-895
8.00%	-1,354	-1,355	-1,355	-1,355	-1,355	-1,356	-1,357
KR4301W63406 코스피200 P 202506 340.0							102
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-91	-93	-95	-97	-99	-102
-5.33%	-35	-38	-41	-45	-48	-51	-54
-2.67%	-5	-8	-11	-14	-17	-20	-23
0%	4	3	2	0	-2	-4	-6
2.67%	6	5	5	5	4	3	2
5.33%	6	6	6	6	5	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6
KR4301W63422 코스피200 P 202506 342.5							167
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-152	-154	-156	-158	-161	-164	-167
-5.33%	-66	-70	-74	-79	-83	-88	-93
-2.67%	-12	-17	-21	-26	-31	-36	-40
0%	8	5	3	0	-3	-6	-10
2.67%	12	11	10	9	8	6	4
5.33%	12	12	12	12	11	11	10
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

2,752

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

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	535	0	535	

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 2025-05-29

기준일 2025-05-28

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	4,301	0	4,301	

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	2025-05-29
기준일	2025-05-28

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	12,367	0	12,367	
누계	통화	선도	110	15,995	-15,885	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F2SC KRW/USD 30-05-25E	330
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E	218
FXW213F4V(KRW/USD 31-07-25E	410
FXW213F5G(USD/KRW 30-05-25E	9
FXW213F5V(KRW/USD 29-08-25E	322
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

626

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

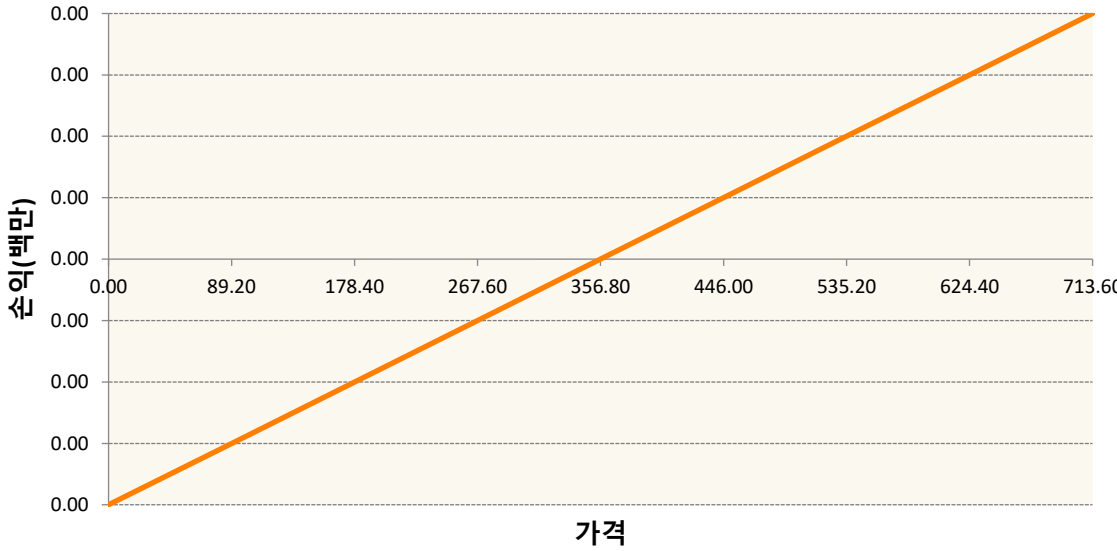
1. 계약금액

(단위:백만원)

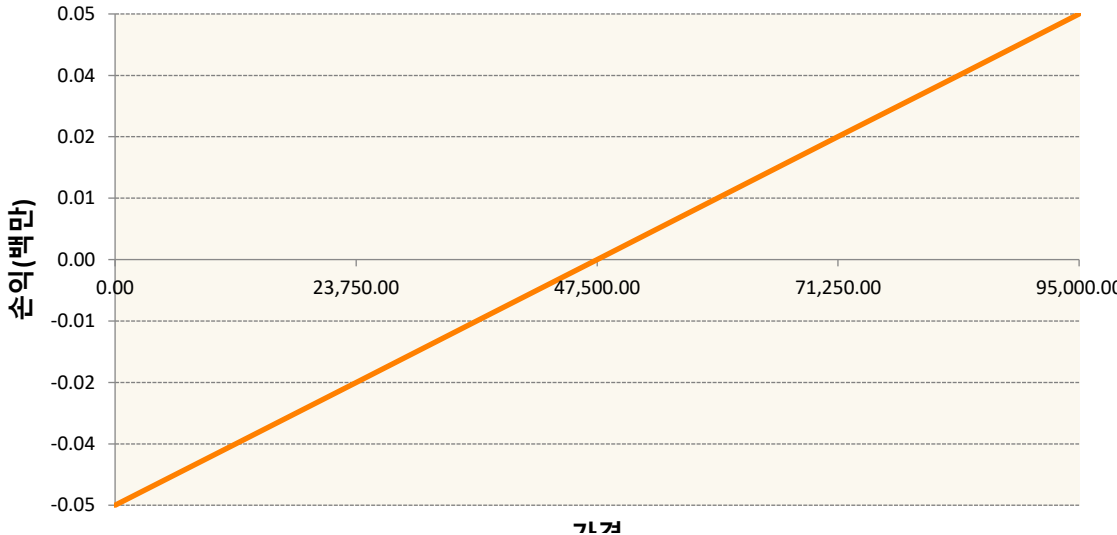
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,067	0	1,067	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101W60000-2025-06 코스피200지수선물

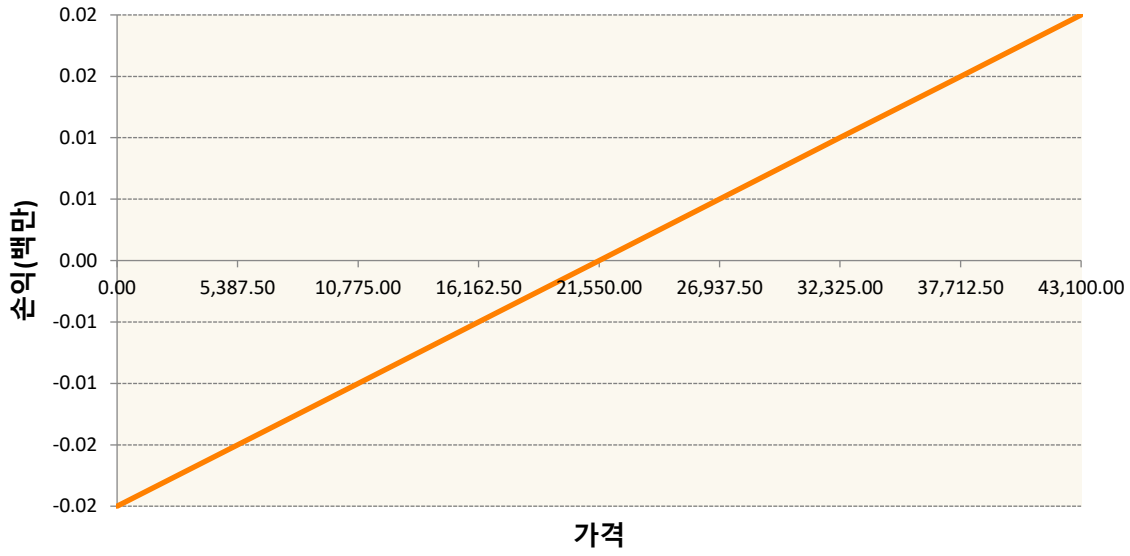


KR410FW60001-2025-06 두산로보틱스개별선물

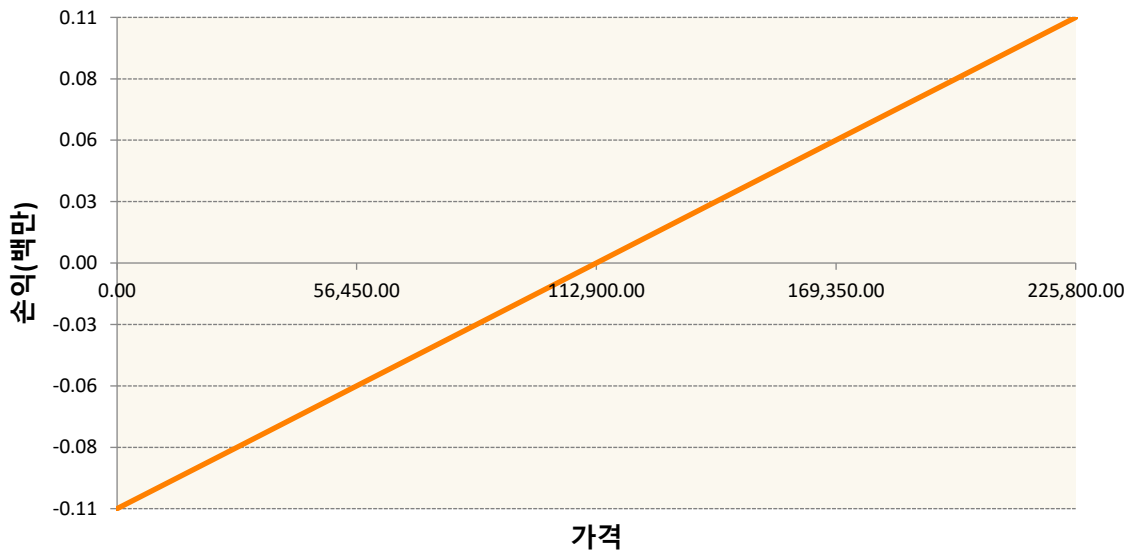


가격

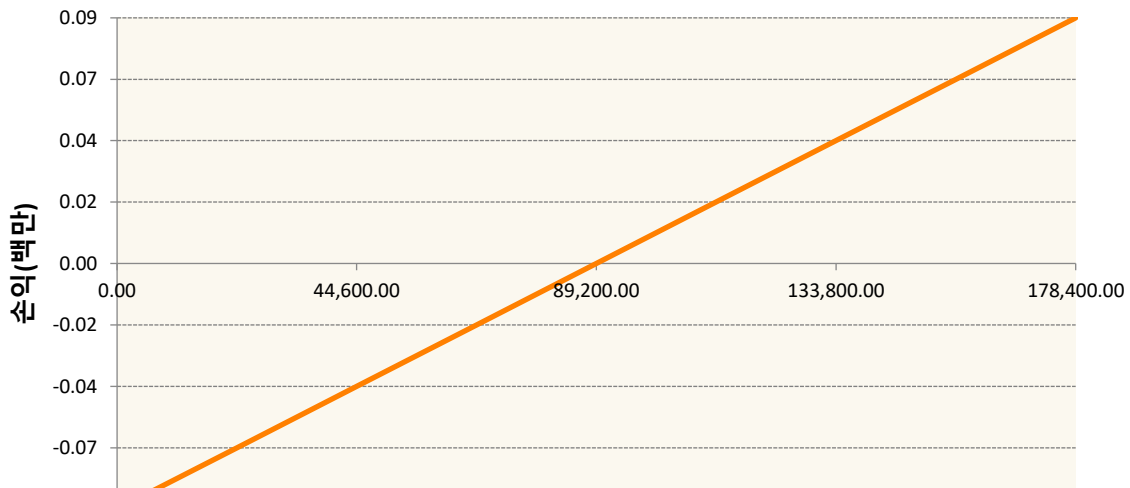
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물

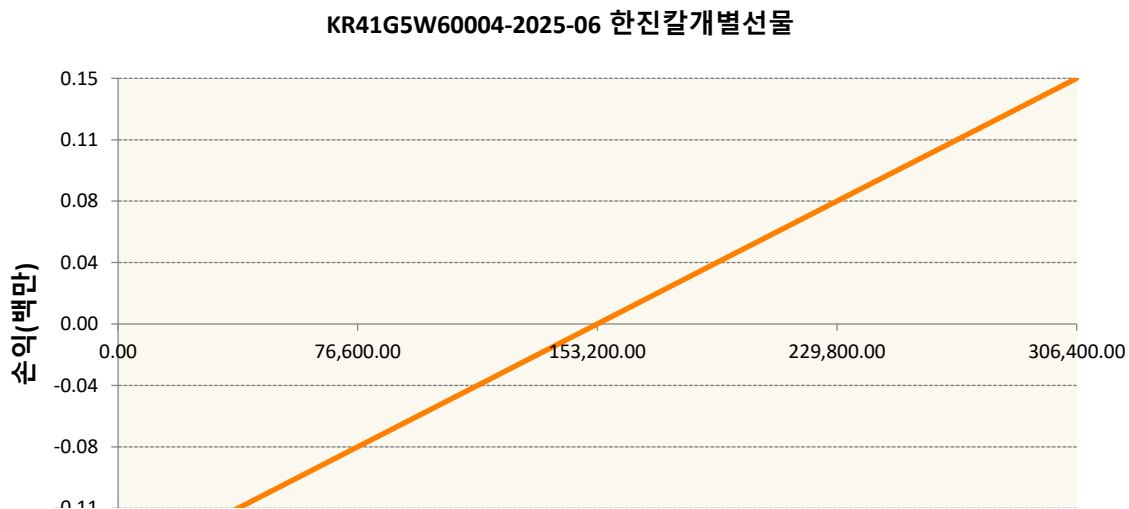
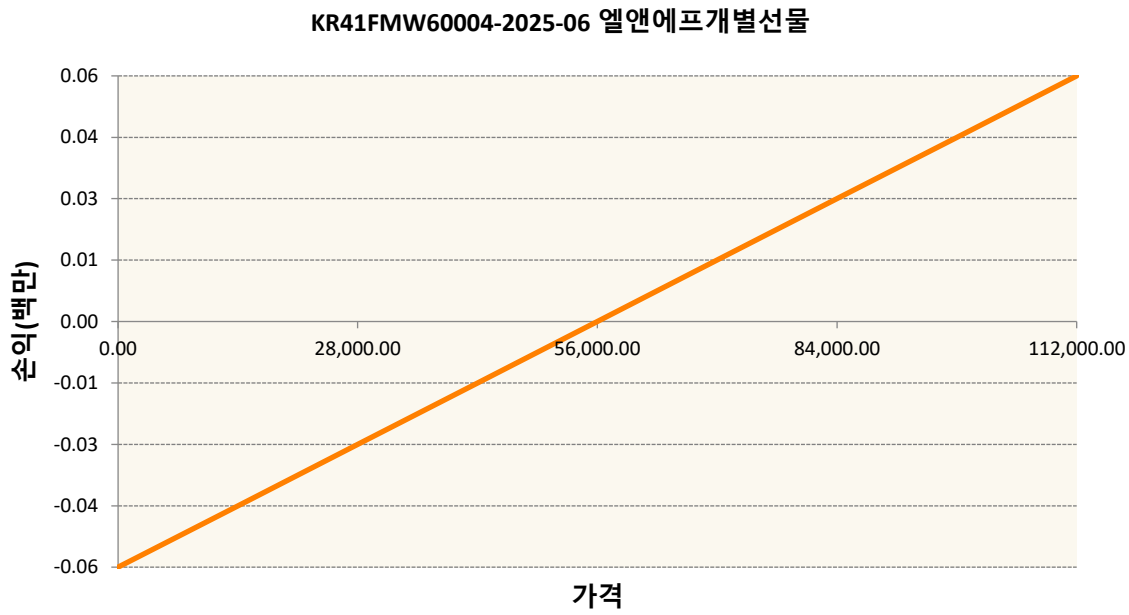
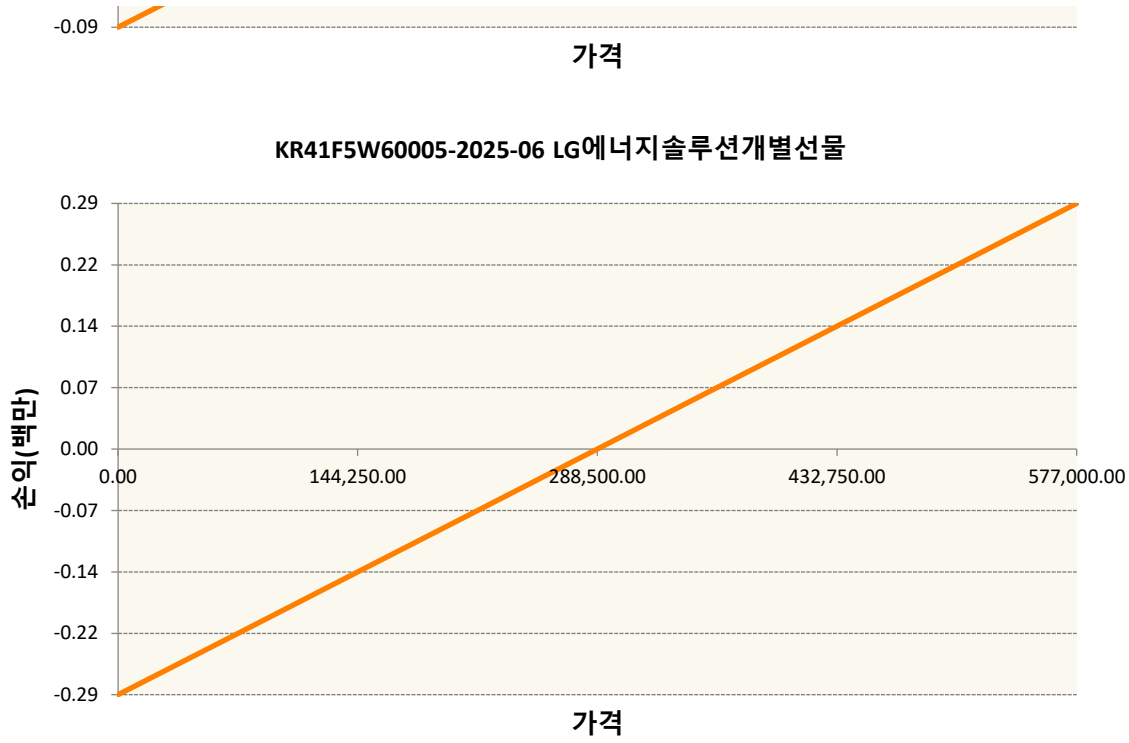


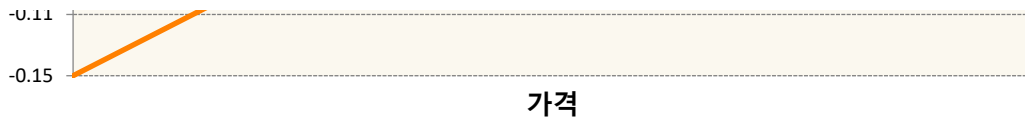
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



KR41EYW60002-2025-06 에코프로비엠개별선물







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물)	71
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물)	0.46
KR41CNW60(2025-06 포스코DX개별선물)	1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물)	2
KR41EYW60(2025-06 에코프로비엠개별선물)	2
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물)	5
KR41FMW60(2025-06 엘앤에프개별선물)	1
KR41G5W60(2025-06 한진칼개별선물)	4

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

134

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

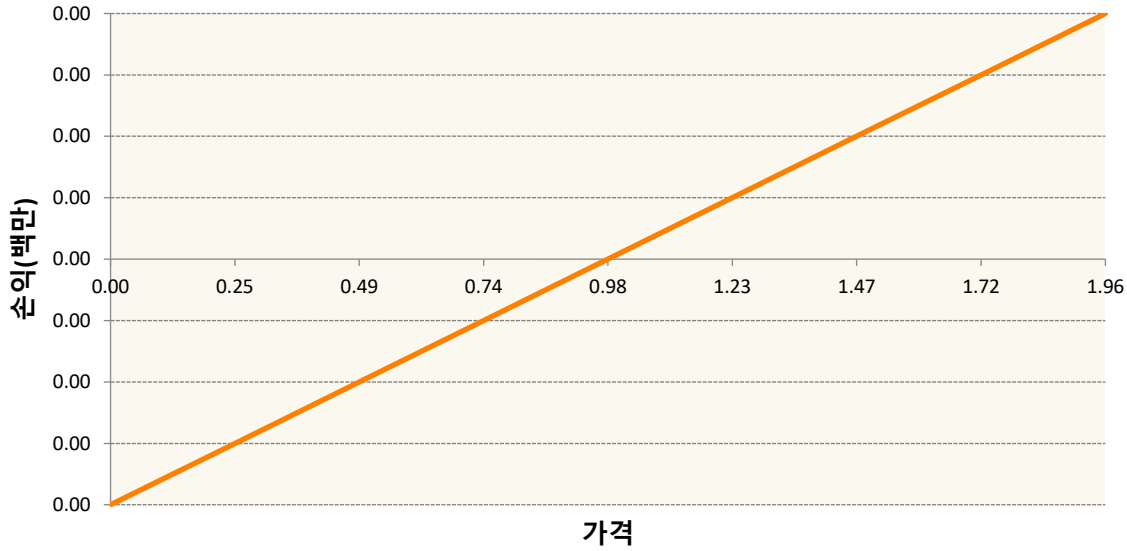
1. 계약금액

(단위:백만원)

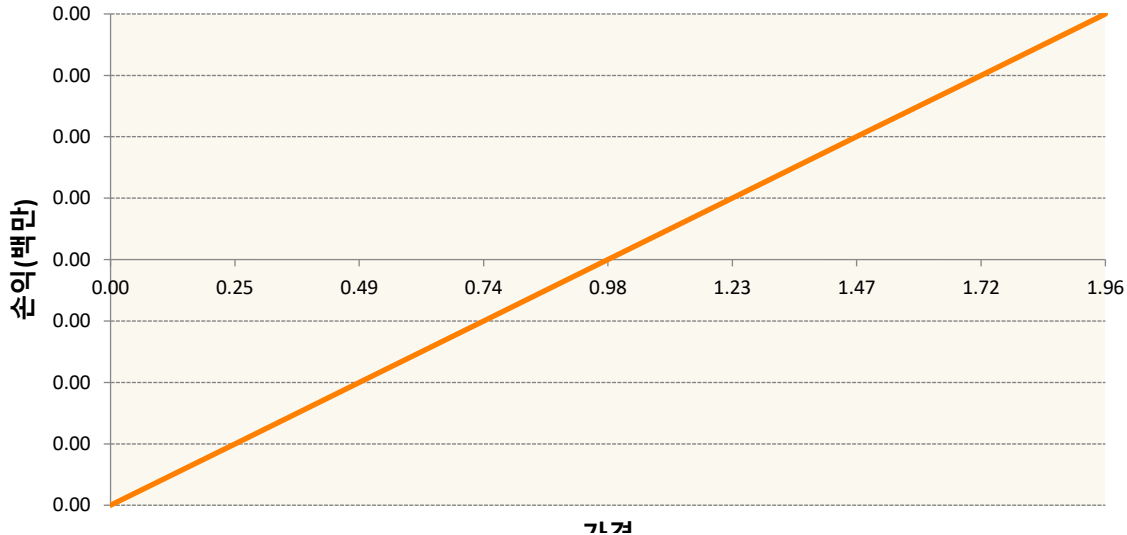
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,642	0	9,642	

2. 만기시점의 손익구조

2108840320MR-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)



2108840930MZ-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
2108840320ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)	576
2108840930ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)	193

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	904

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

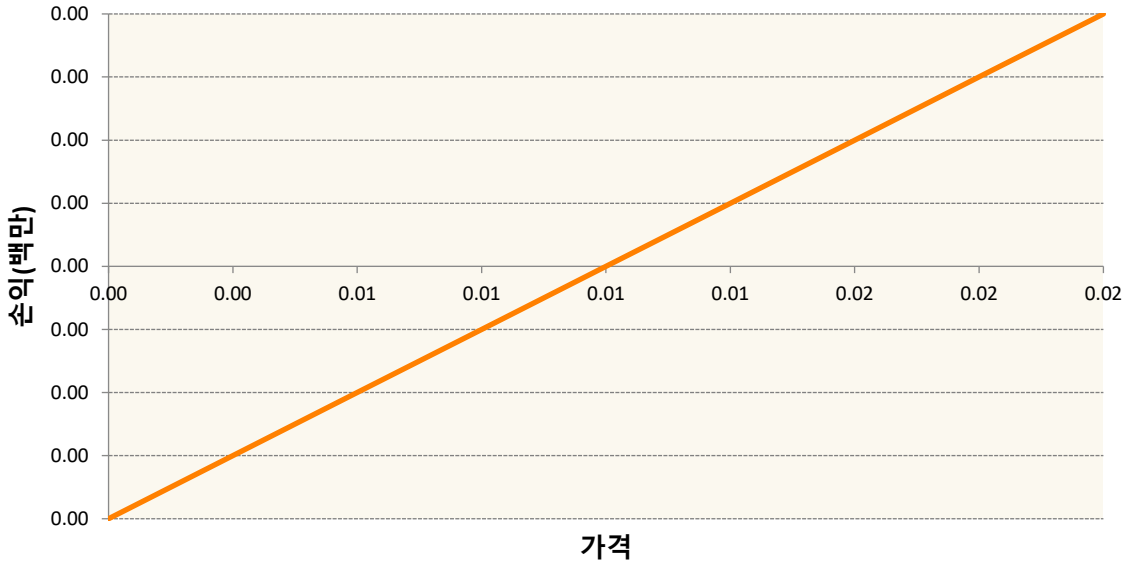
1. 계약금액

(단위:백만원)

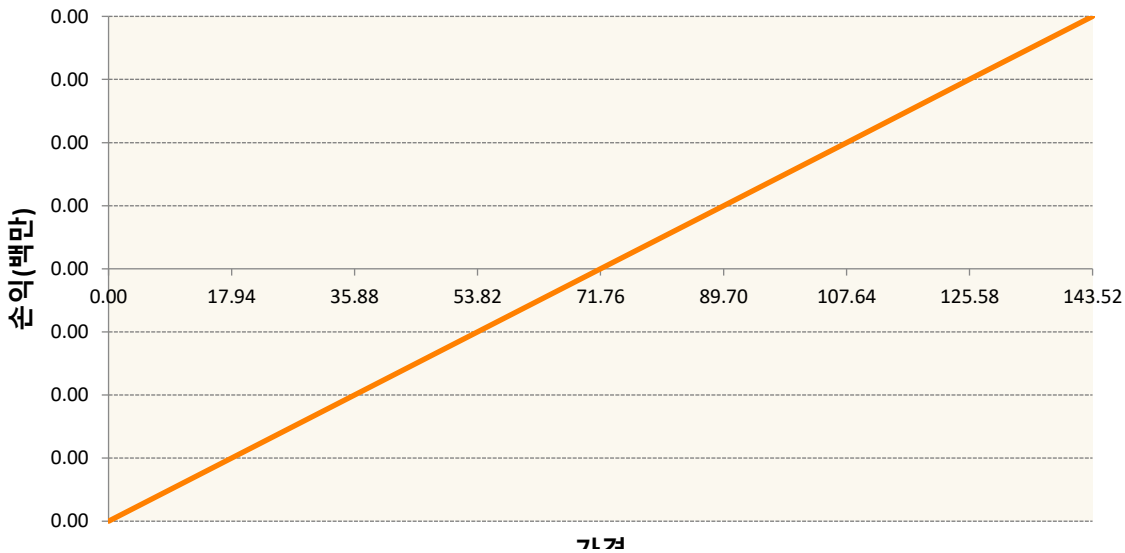
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,513	0	6,513	
누계	통화	선도	0	2,345	-2,345	장외

2. 만기시점의 손익구조

2108850930KM-ICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index



MOZ25-ECX EMISSION Dec25



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	0.16
FXW213F4V(KRW/EUR 30-05-25E	77
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	33
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	77
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	521

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,024

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

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	2025-05-29
기준일	2025-05-28

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)	34
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	40
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	29
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	8

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

(단위:백만원)

194

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

에쿼티알파일반사모혼합자산

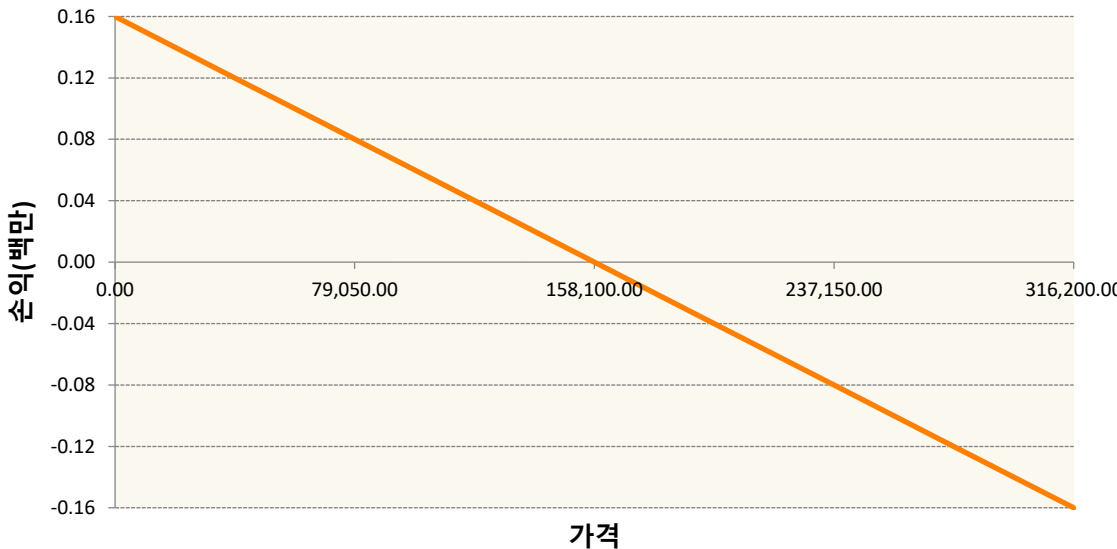
1. 계약금액

(단위:백만원)

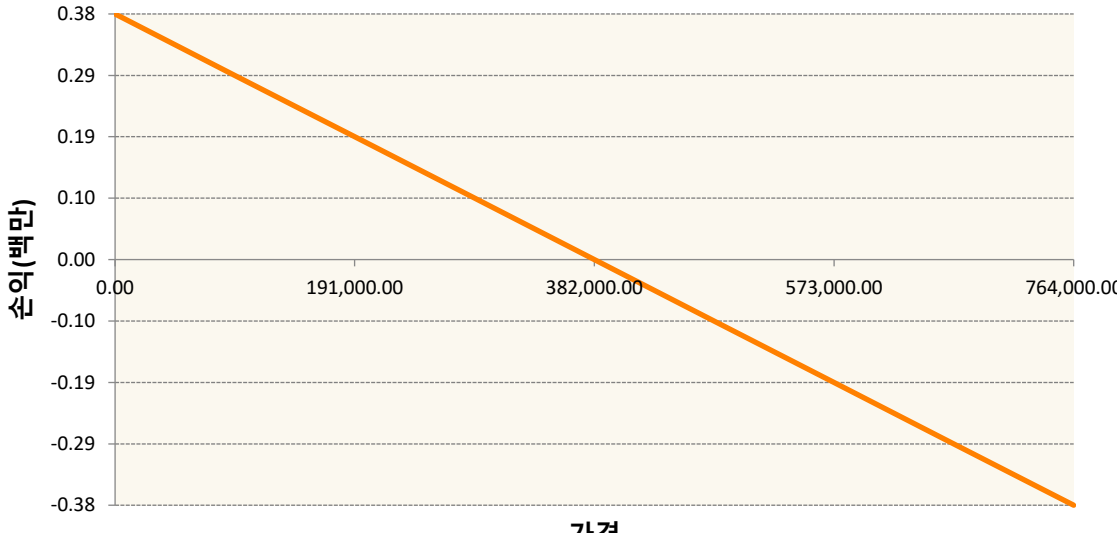
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	9	-9	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR41BJW60009-2025-06 엔씨소프트개별선물



KR41F8W60009-2025-06 크래프톤개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR41BJW60C 2025-06 엔씨소프트개별선물		0.38
KR41F8W60C 2025-06 크래프톤개별선물		0.31

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

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

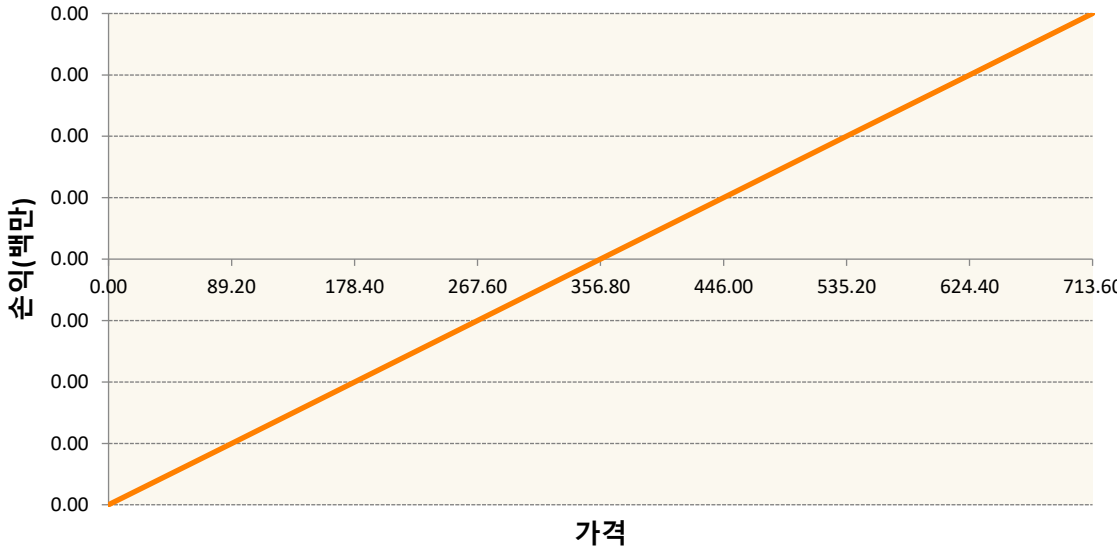
1. 계약금액

(단위:백만원)

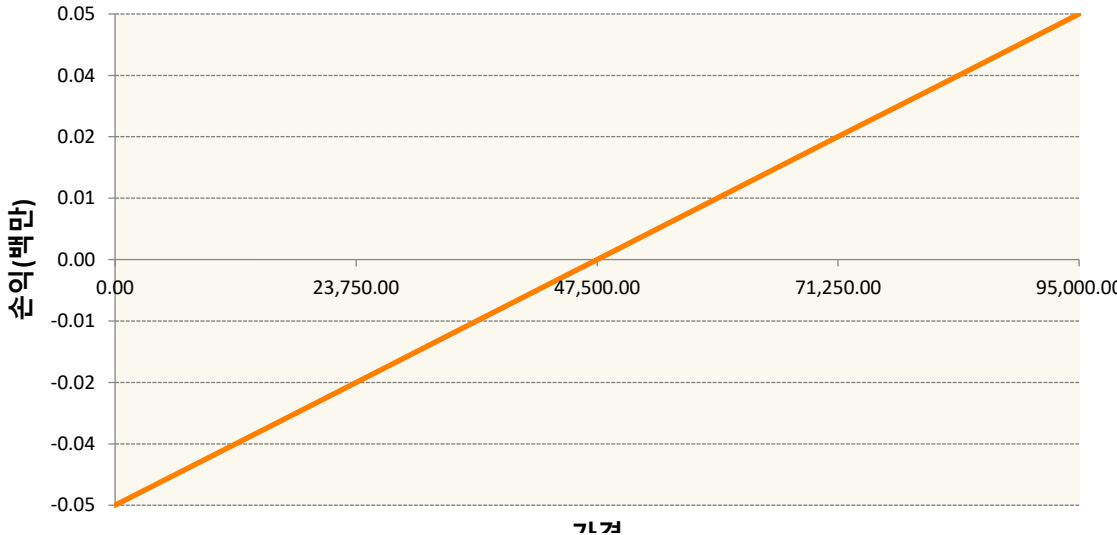
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	788	624	165	장내
누계	유가증권	선물	10,231	0	10,231	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101W60000-2025-06 코스피200지수선물

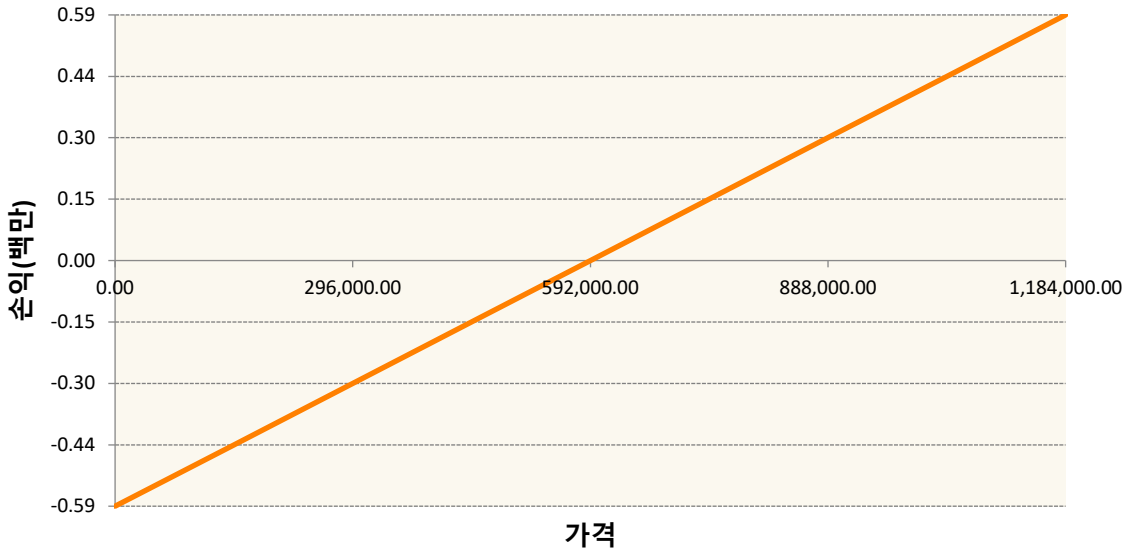


KR410FW60001-2025-06 두산로보틱스개별선물

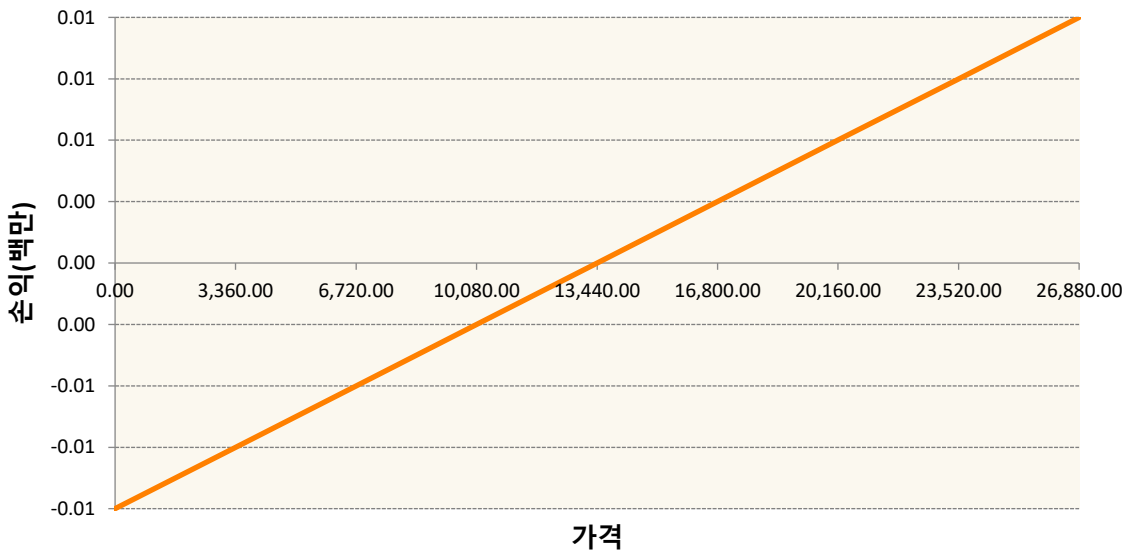


가격

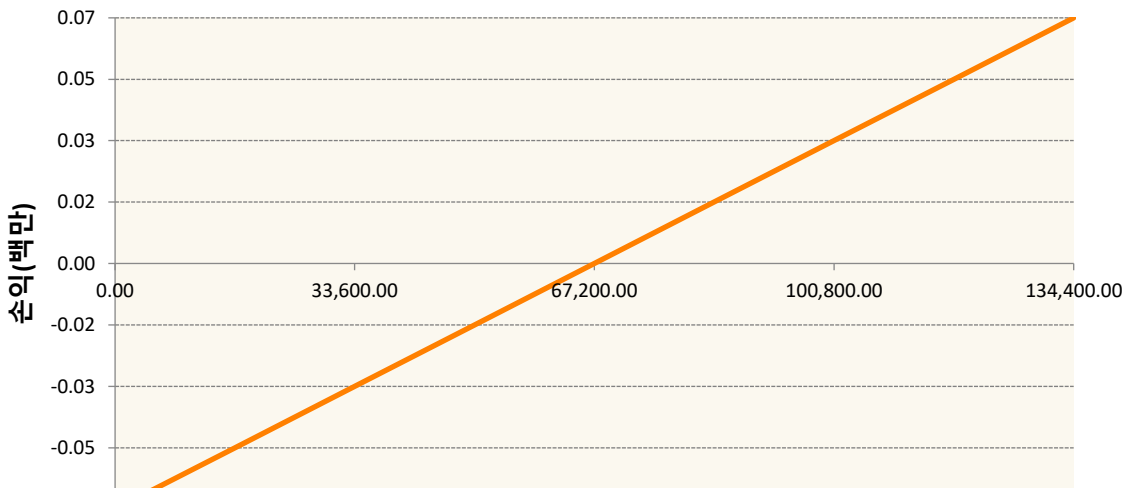
KR411SW60002-2025-06 효성중공업개별선물

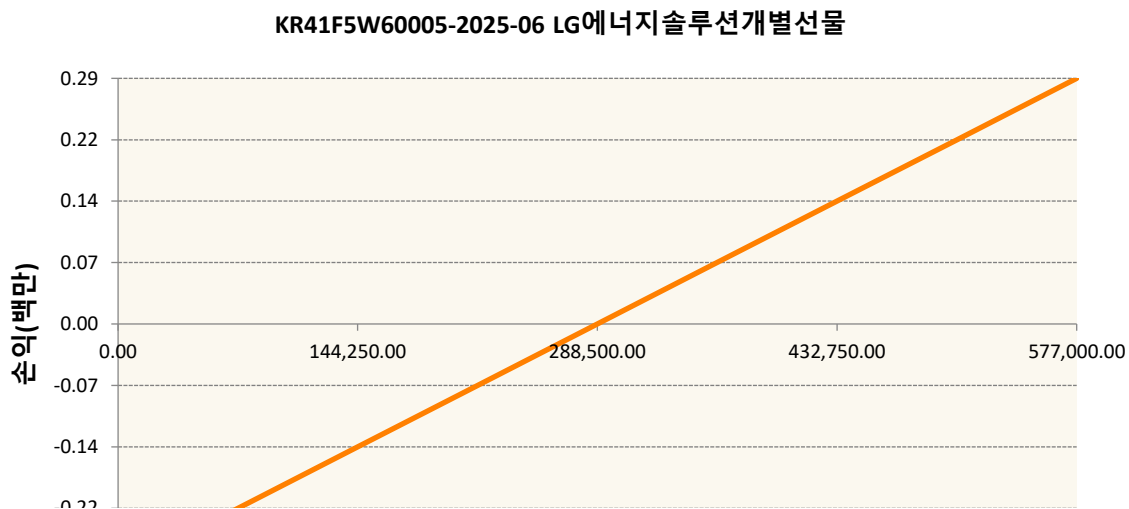
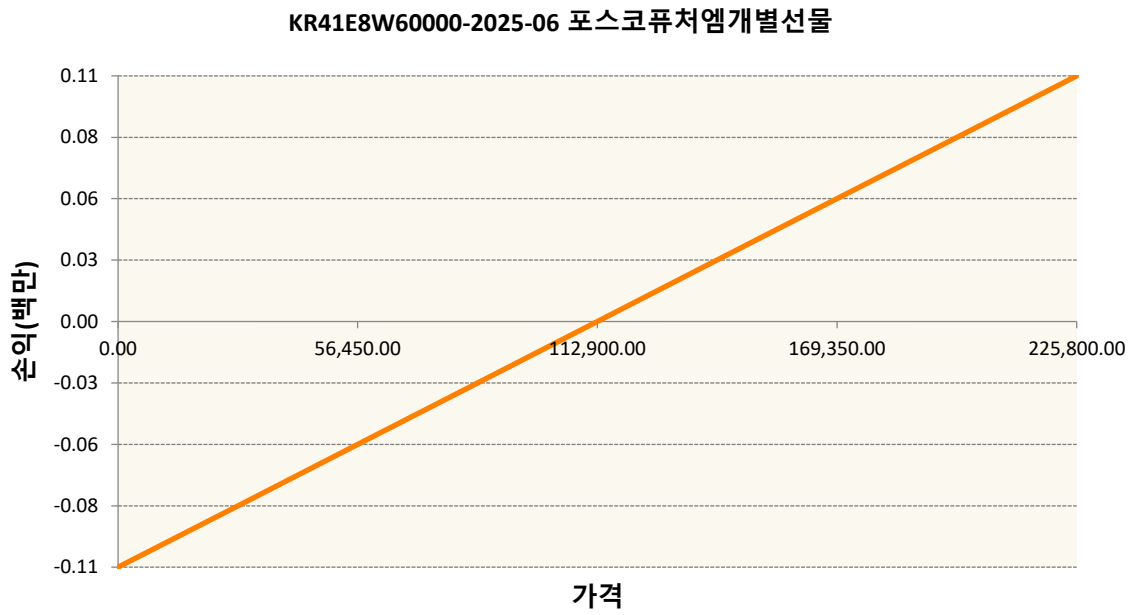
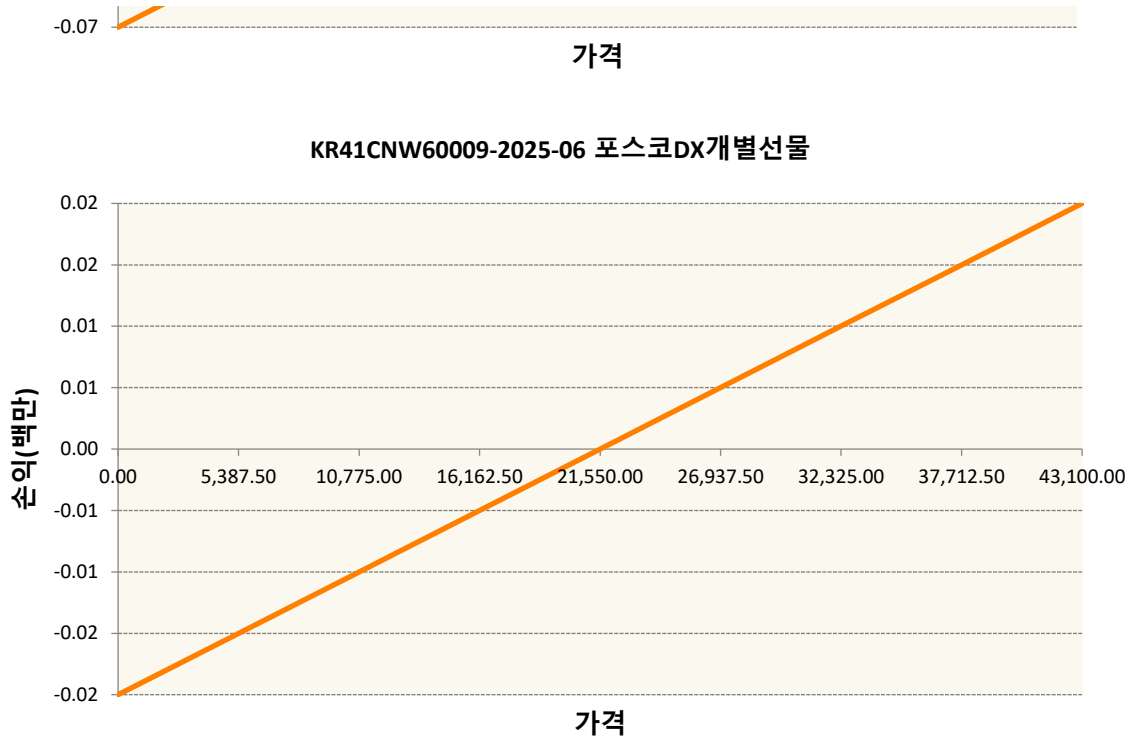


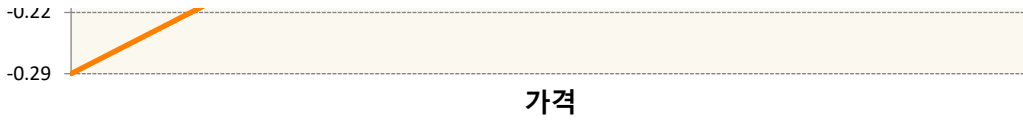
KR4148W60001-2025-06 미래에셋증권개별선물



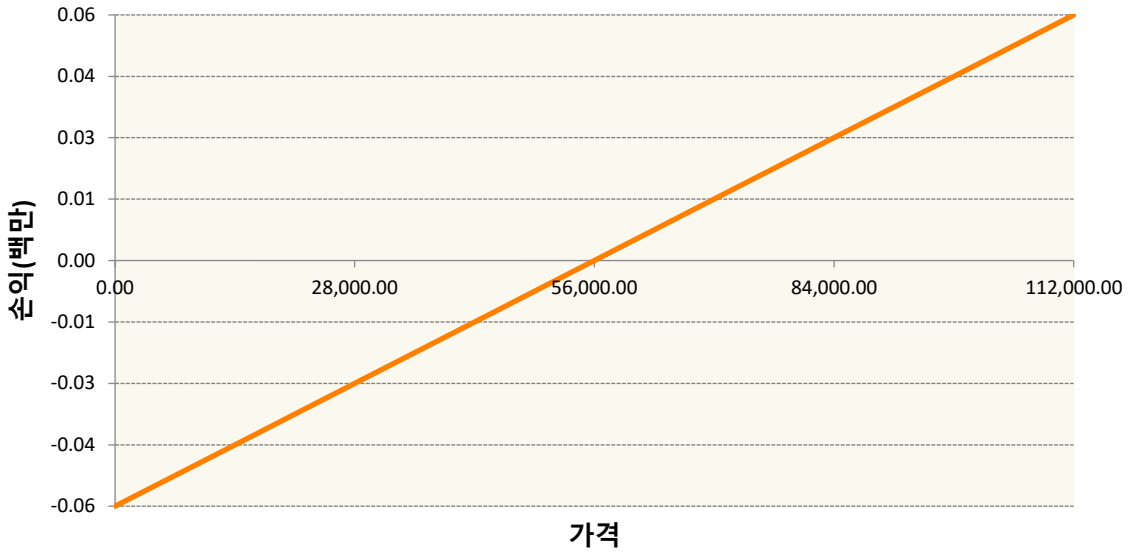
KR41C9W60000-2025-06 한화개별선물



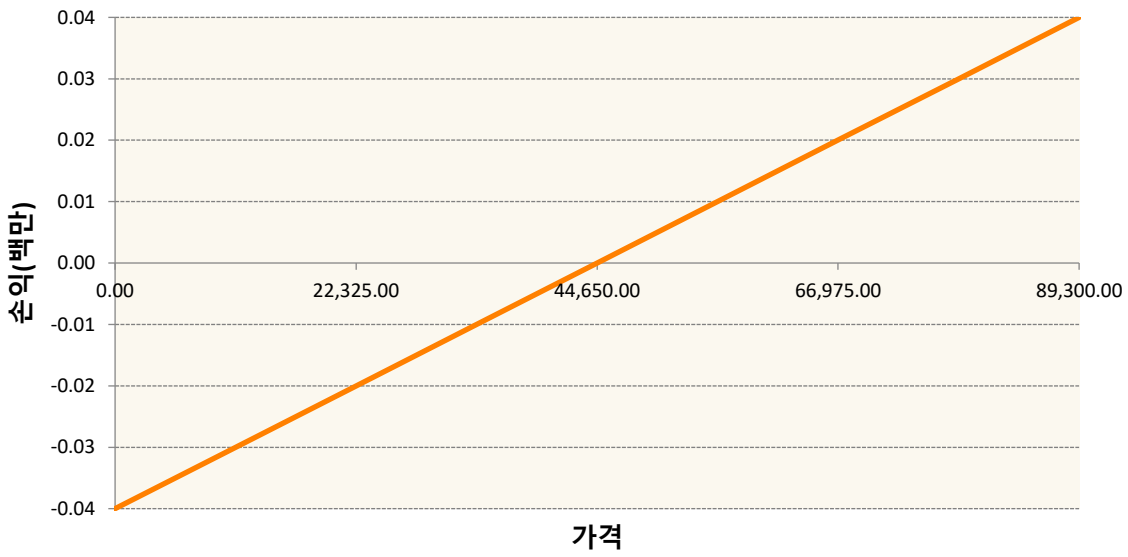




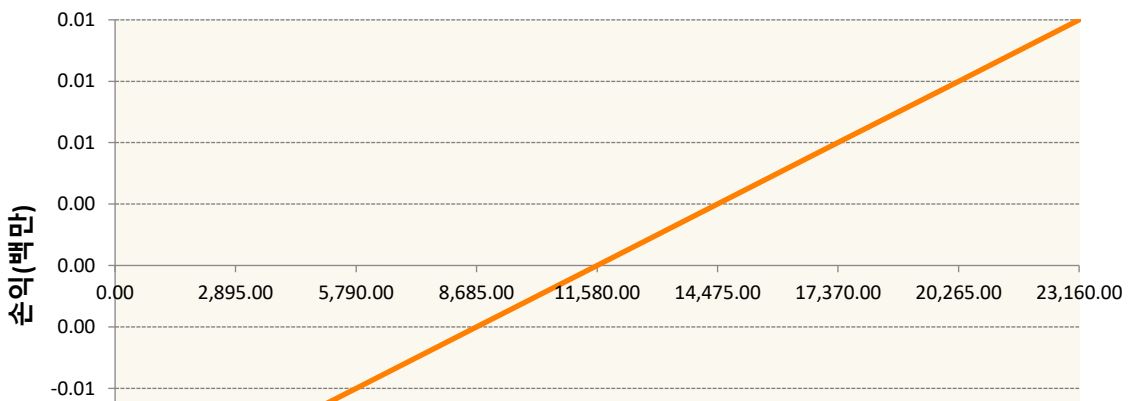
KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물

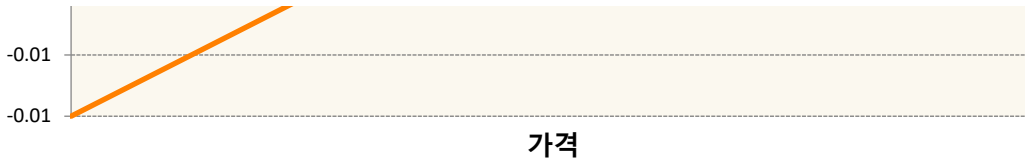


KR41G0W60005-2025-06 씨에스원드개별선물

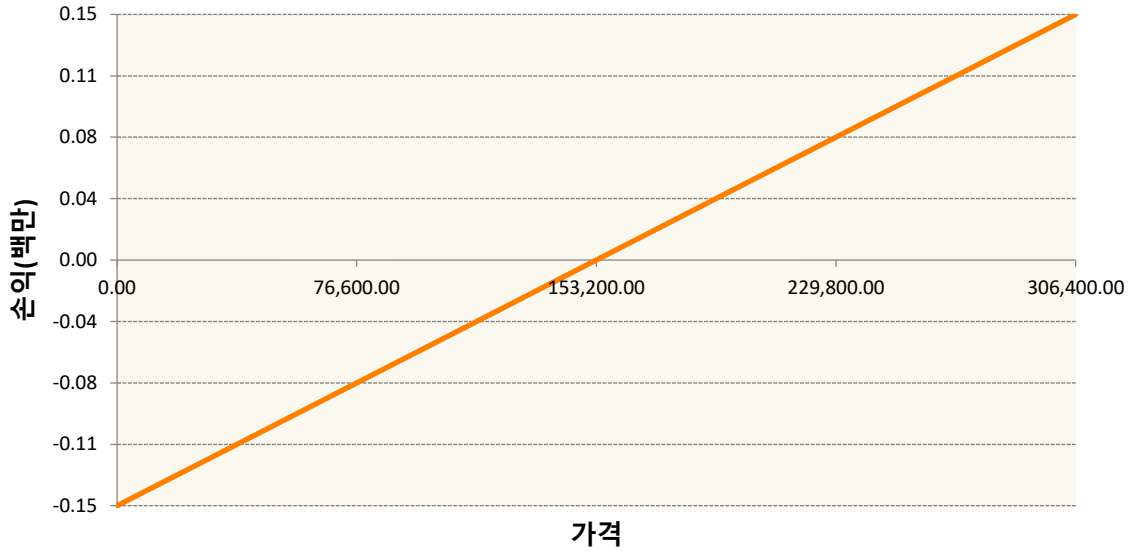


KR41G2W60001-2025-06 에스디바이오센서개별선물





KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	571
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물	6
KR411SW60(2025-06 효성중공업개별선물	5
KR4148W60(2025-06 미래에셋증권개별선물	1
KR41C9W60(2025-06 한화개별선물	2
KR41CNW60(2025-06 포스코DX개별선물	11
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	33
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물	100
KR41FMW60(2025-06 엘앤에프개별선물	11
KR41G0W60(2025-06 씨에스윈드개별선물	0.32
KR41G2W60(2025-06 에스디바이오센서개별선물	4
KR41G5W60(2025-06 한진칼개별선물	74

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

(단위:백만원)

1,424

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

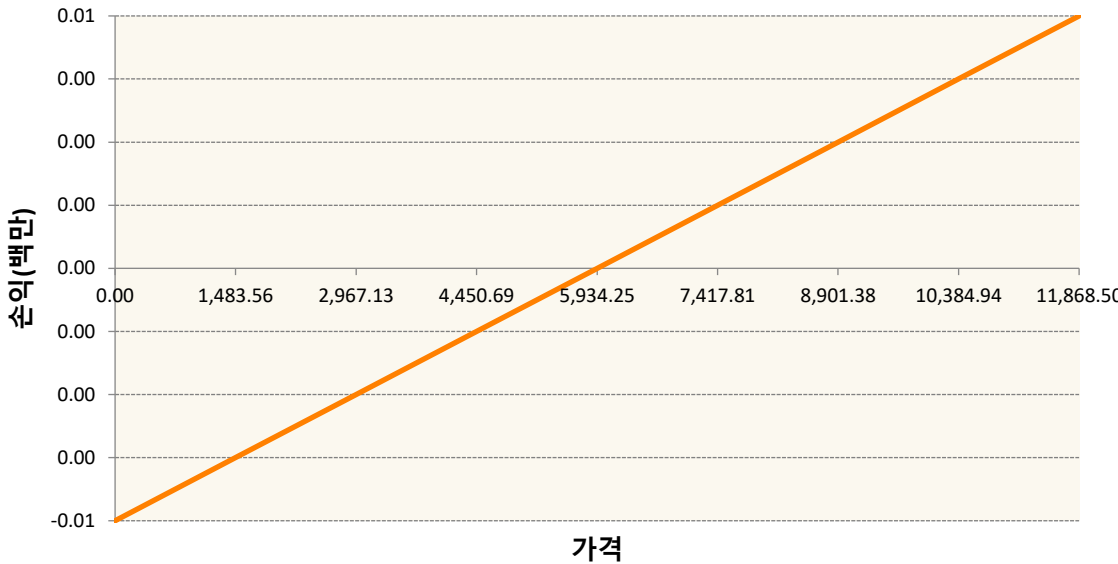
1. 계약금액

(단위:백만원)

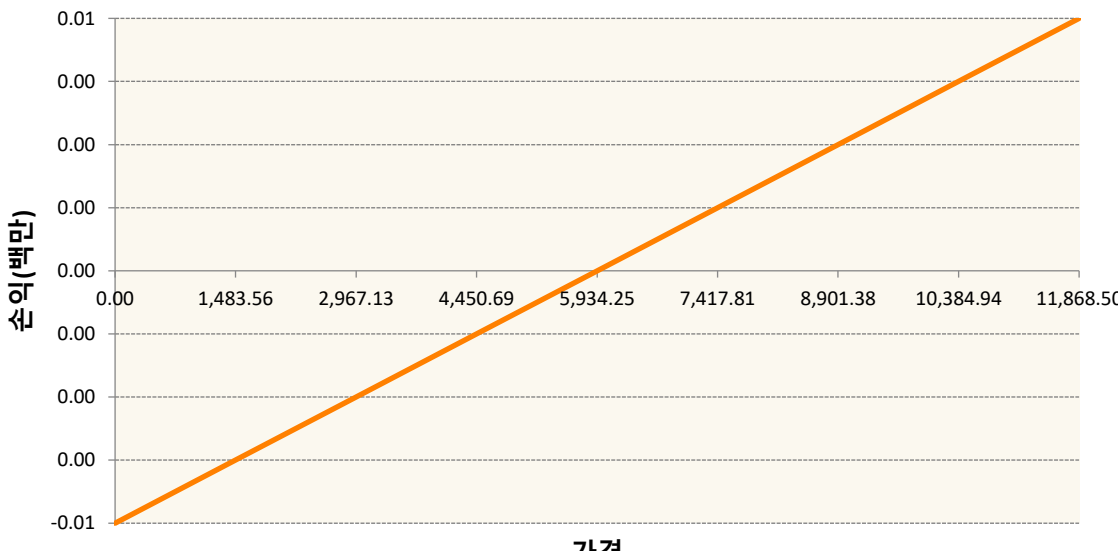
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,114	0	2,114	장내
누계	지수	선물	31,364	0	31,364	

2. 만기시점의 손익구조

ESM5-S&P500 EMINI FUT JUN25



HWAM5-SP500 MIC EMIN FUTJun25



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,509
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	169

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		2,377

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

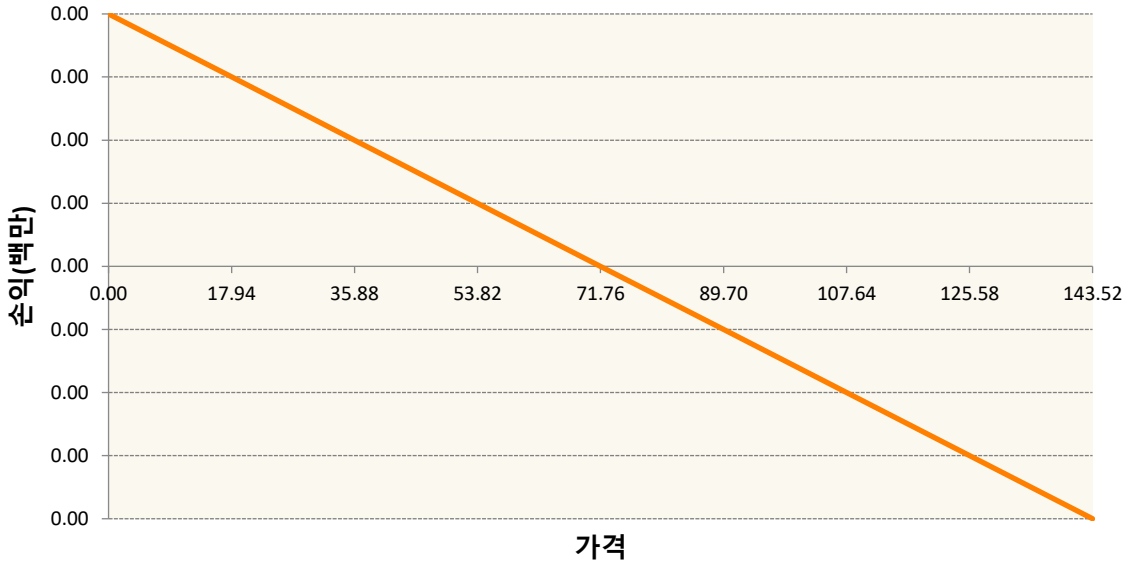
1. 계약금액

(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	-4	4,834	-4,838	
누계	통화	선도	0	2,339	-2,339	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ25-ECX EMISSION Dec25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.23
FXW213F4V(KRW/EUR 30-05-25E	22
FXW213F4V(KRW/EUR 30-05-25E	90
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	75
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	387

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

(단위:백만원)

791

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

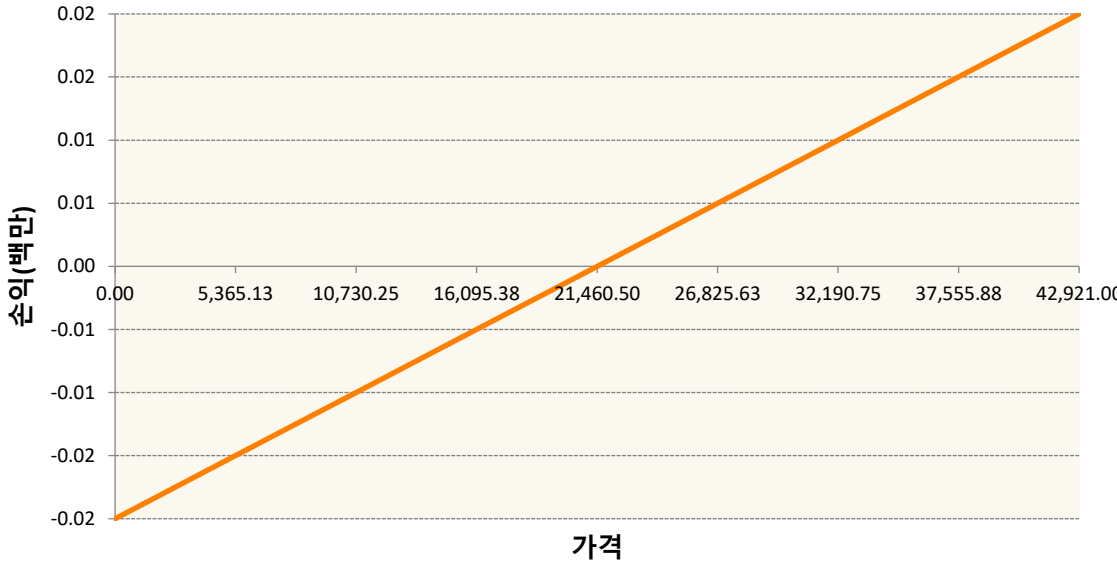
1. 계약금액

(단위:백만원)

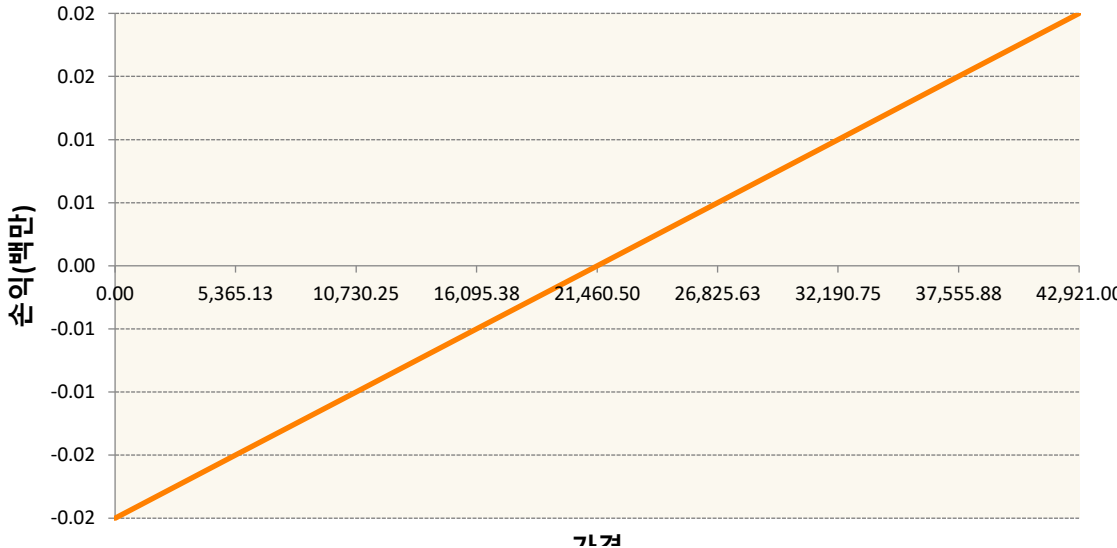
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	14,320	0	14,320	
누계	유가증권	선물	961	0	961	장내

2. 만기시점의 손익구조

HWBM5-NASD100 MICRO EMIN JUN25



NQM5-NASDAQ 100 E-MINI Dec20



가역

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25	77
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,146

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		1,391

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

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	2,930
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,463
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,623
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	898
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	157

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

(단위:백만원)

9,623

공시일 2025-05-29

기준일 2025-05-28

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	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	13

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

(단위:백만원)

73

공시일	2025-05-29
기준일	2025-05-28

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

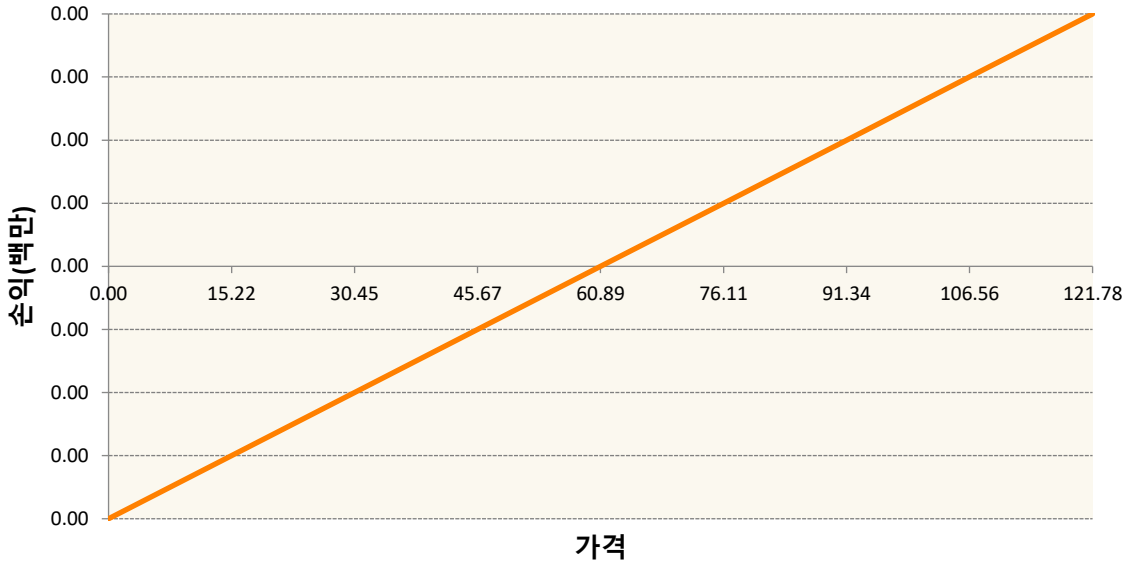
1. 계약금액

(단위:백만원)

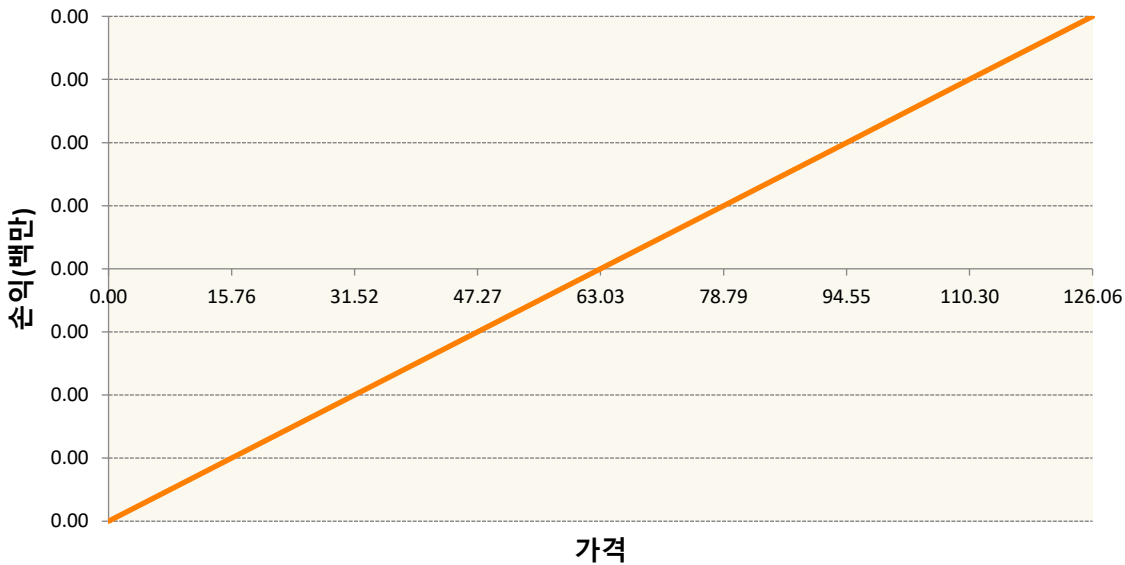
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	670	0	670	
누계	통화	선물	0	82	-82	장내

2. 만기시점의 손익구조

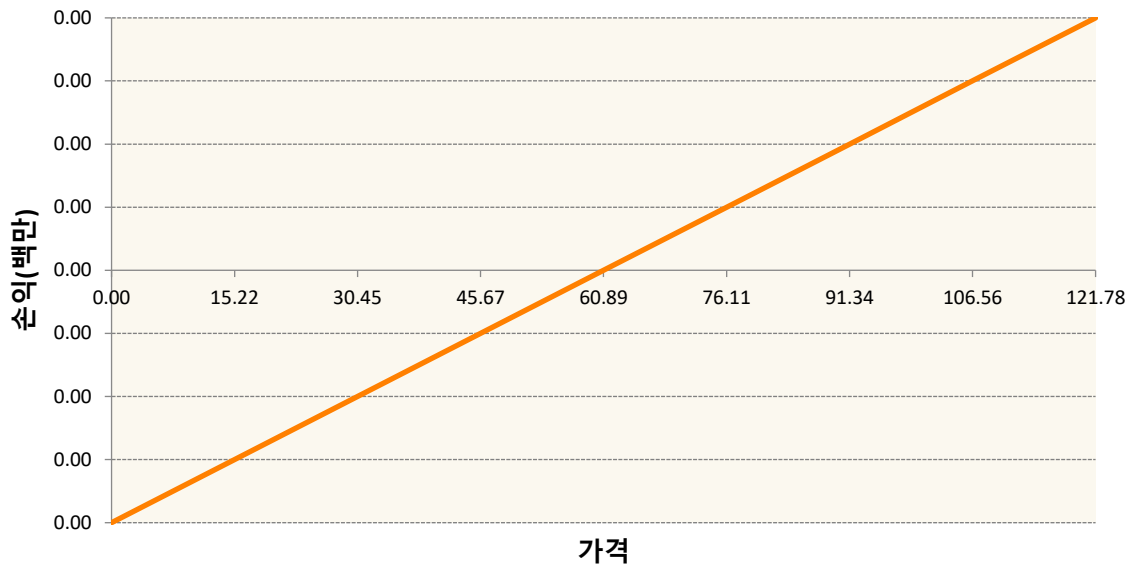
CLN5-WTI CRUDE FUTURE JUL25



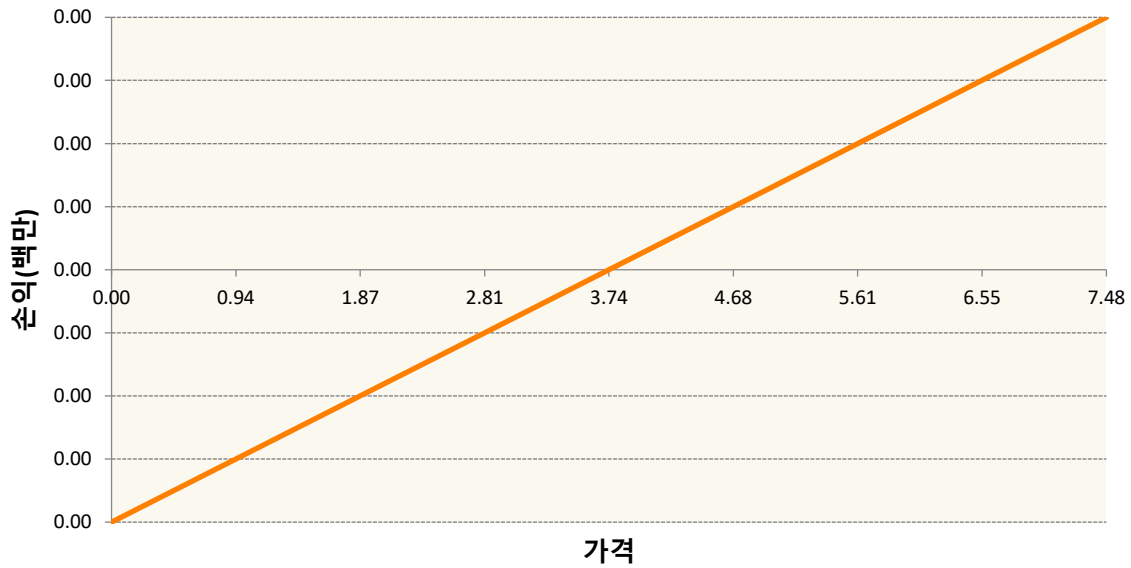
COU5-BRENT CRUDE FUTR Sep25



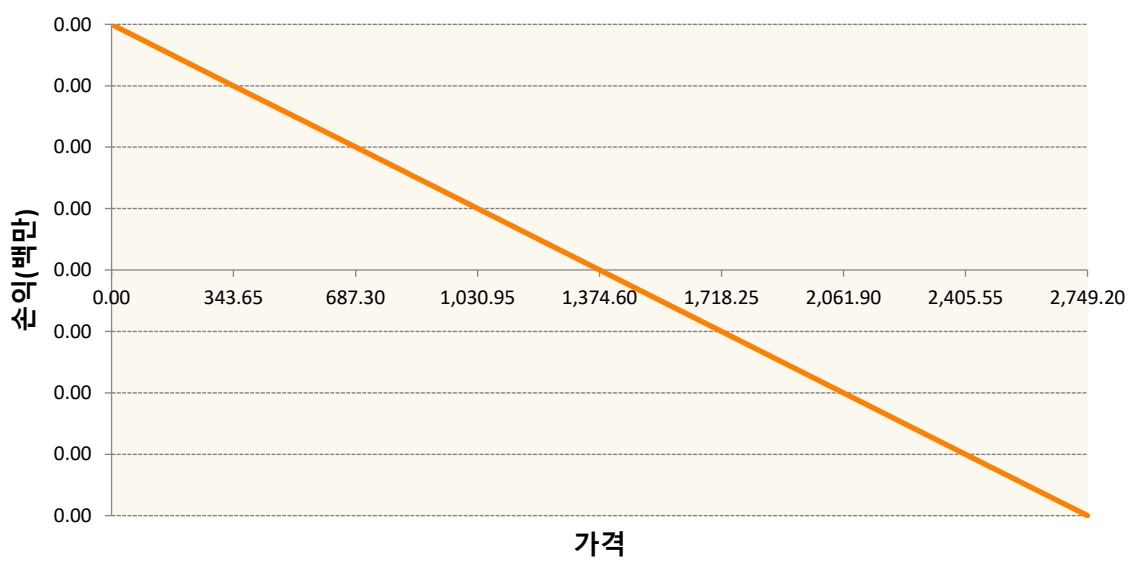
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



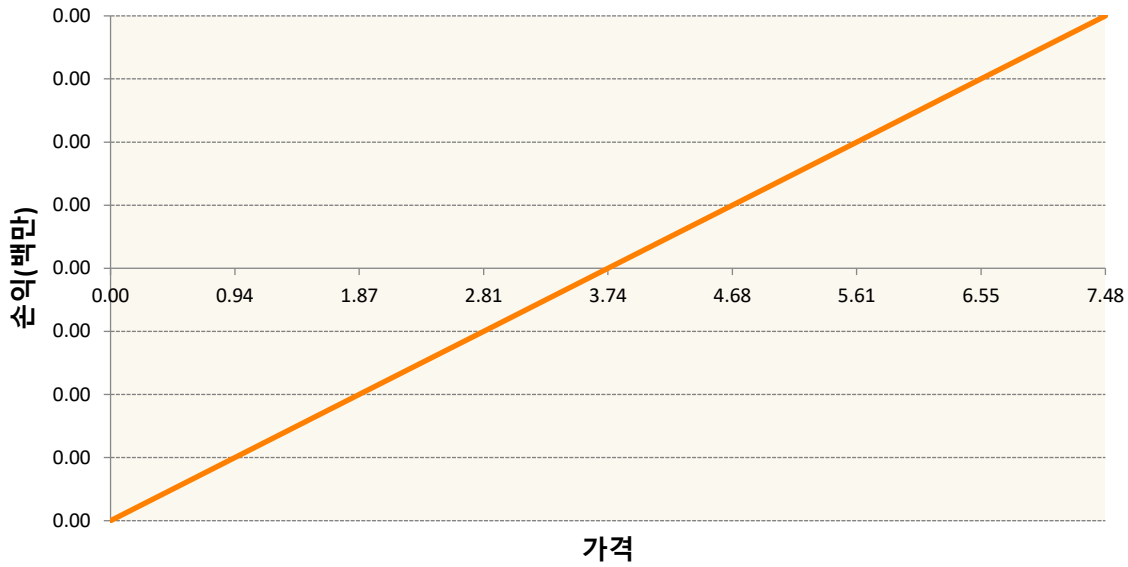
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



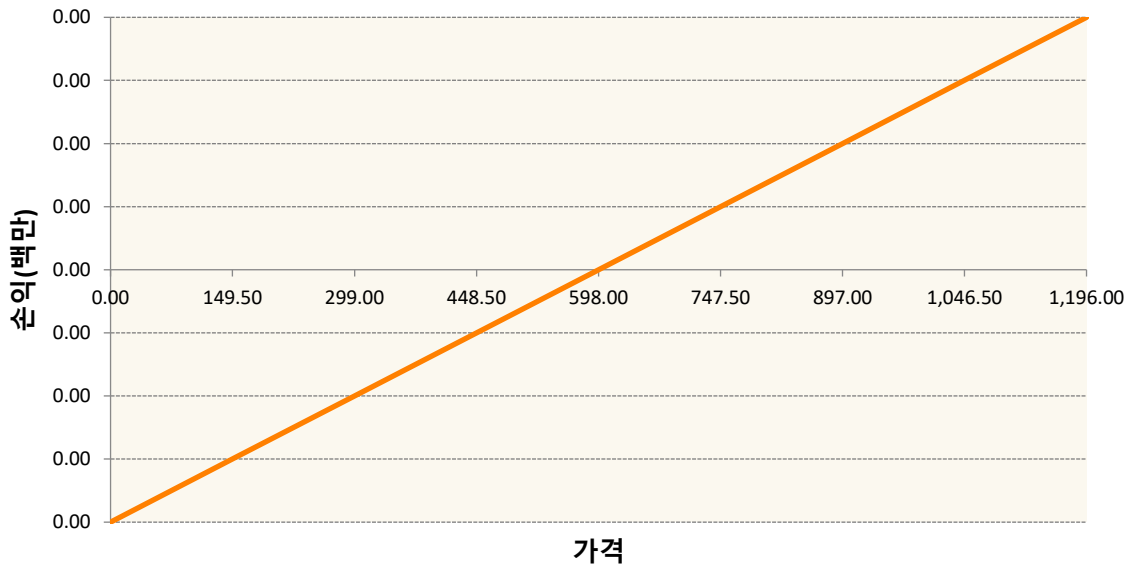
KR4175W60004-2025-06 달러선물



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)

128