

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

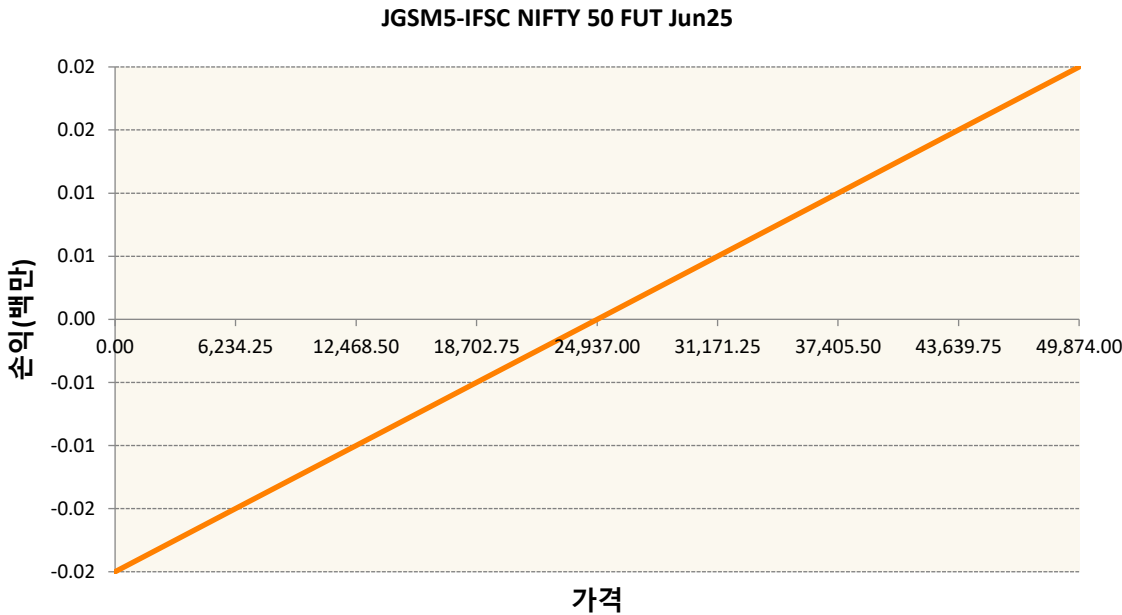
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,648	0	1,648	

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	2025-06-02
기준일	2025-05-30

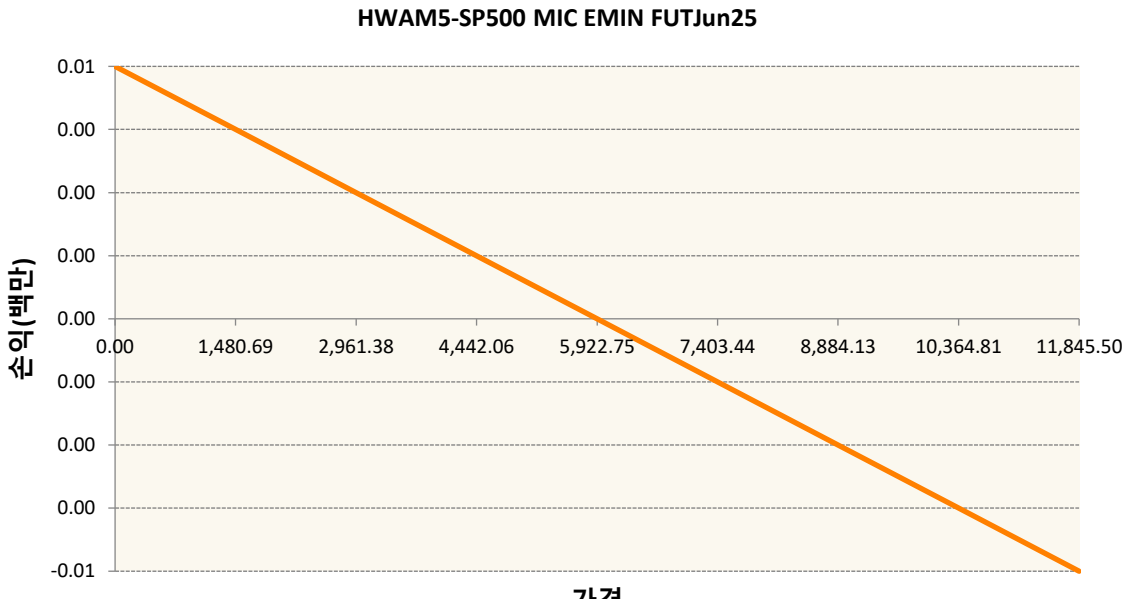
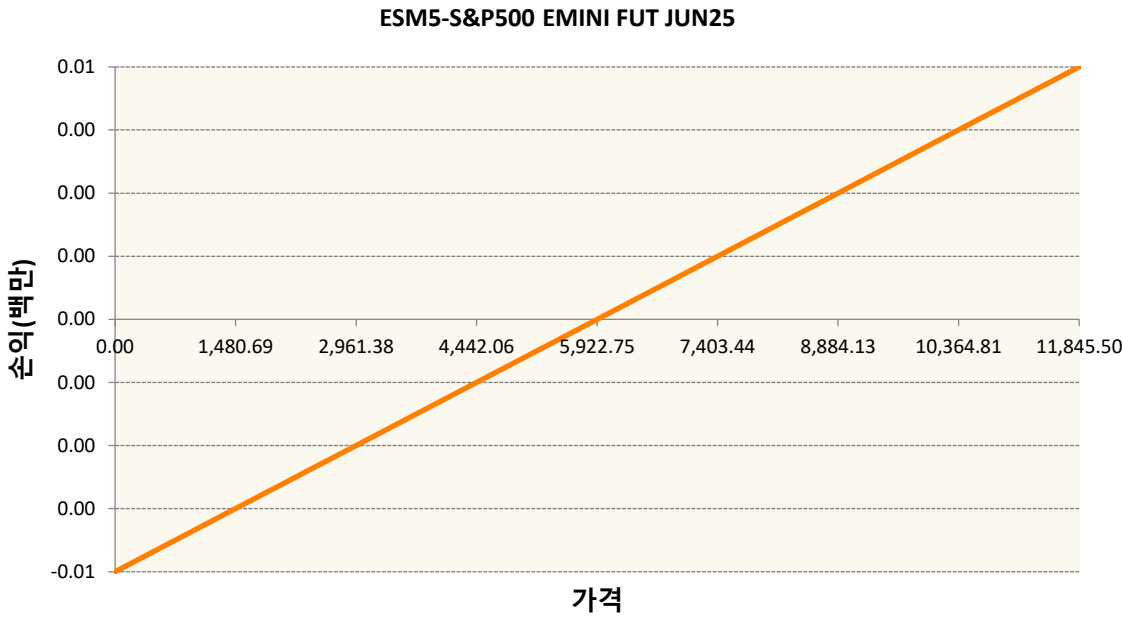
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	432	0	432	

2. 만기시점의 손익구조



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	2025-06-02
기준일	2025-05-30

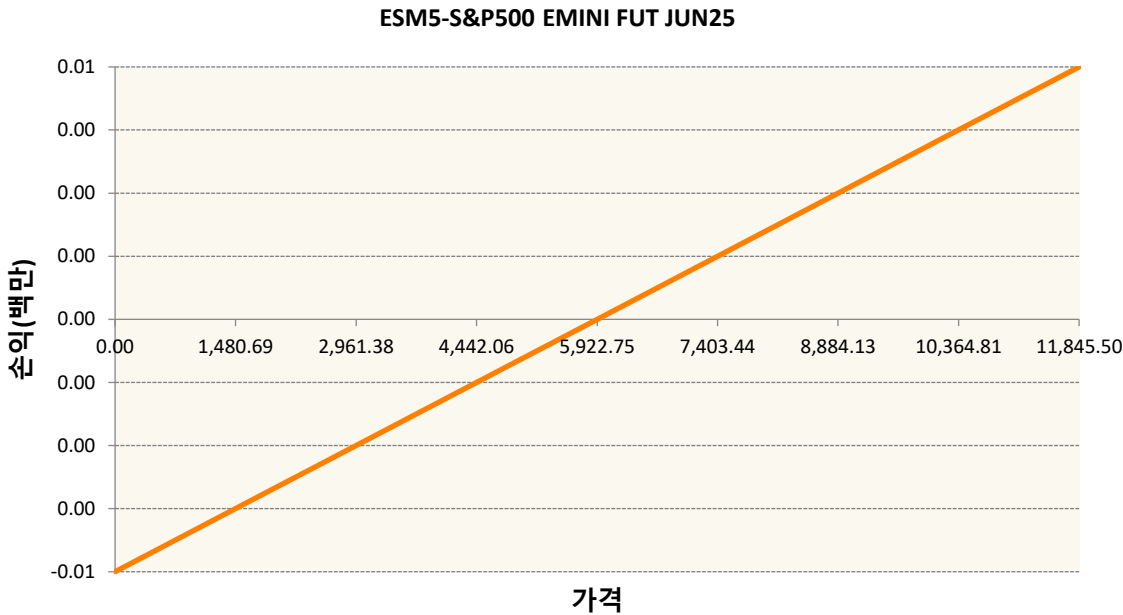
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,297	0	1,297	

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	2025-06-02
기준일	2025-05-30

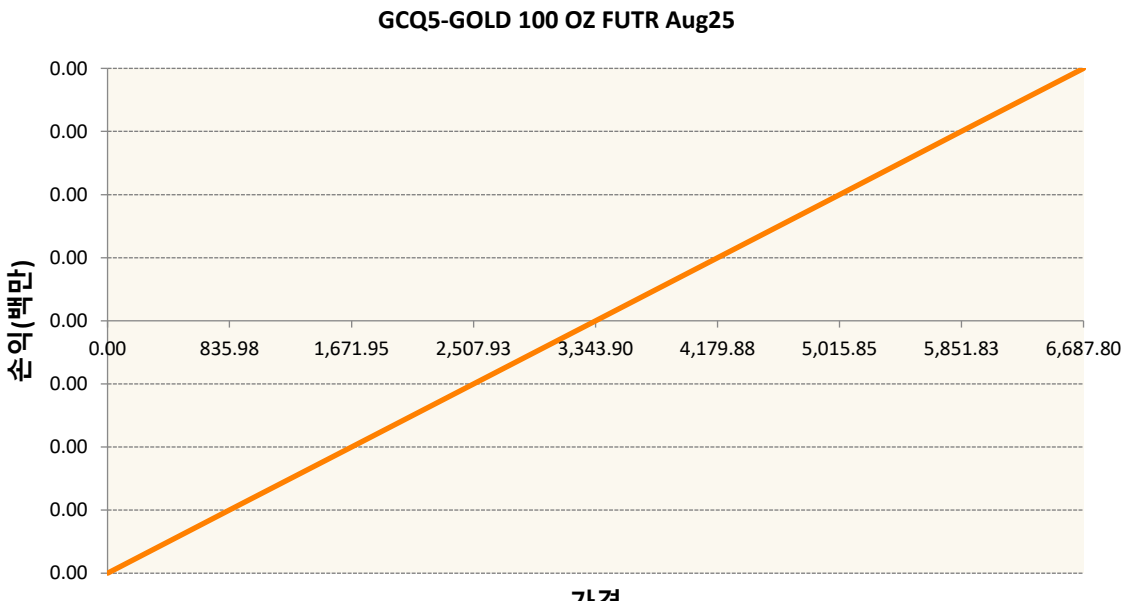
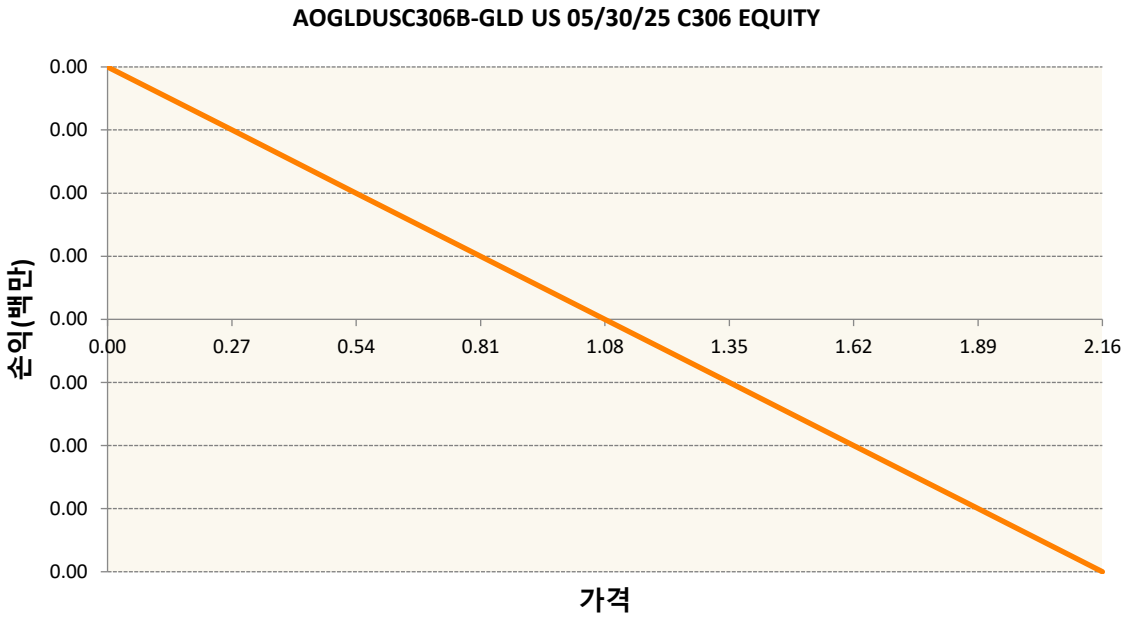
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,300	0	2,300	
누계	실물자산	옵션	0	79	-79	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSC3 GLD US 05/30/25 C306 EQUITY		6
GCQ5	GOLD 100 OZ FUTR Aug25	184

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	161

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

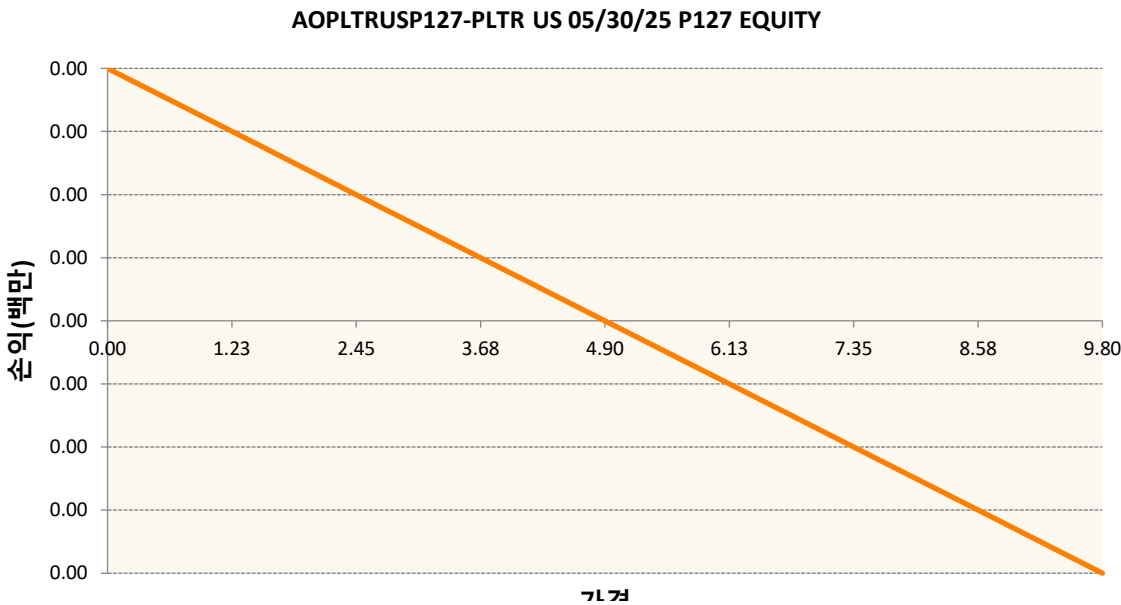
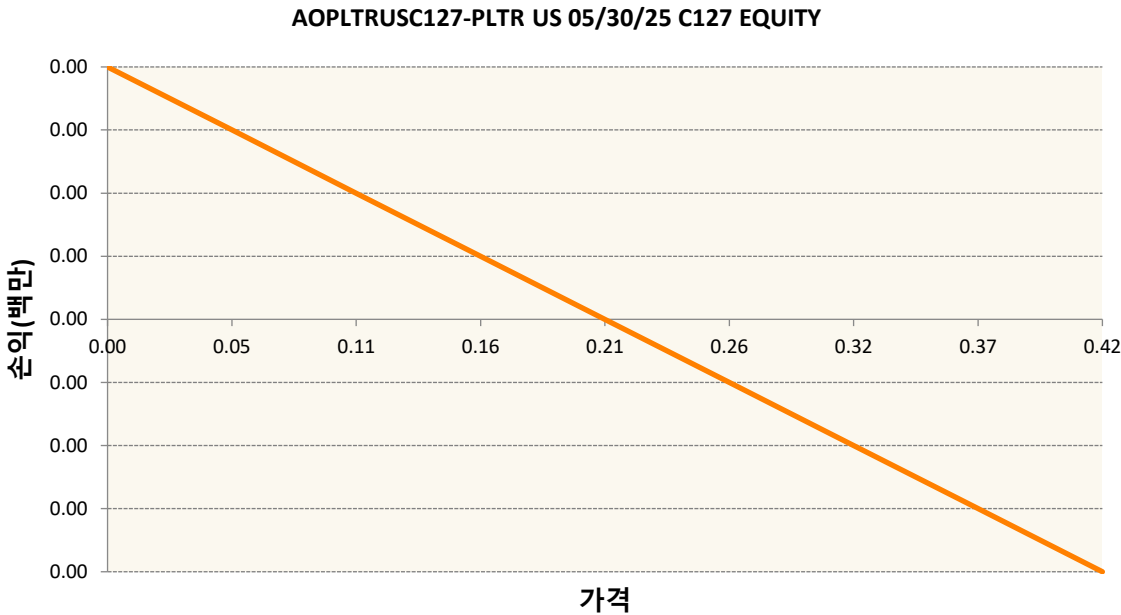
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	97	-97	

2. 만기시점의 손익구조



가액

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOPLTRUSC' PLTR US 05/30/25 C127 EQUITY		6
AOPLTRUSP' PLTR US 05/30/25 P127 EQUITY		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	31

공시일 2025-06-02

기준일 2025-05-30

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	2025-06-02
기준일	2025-05-30

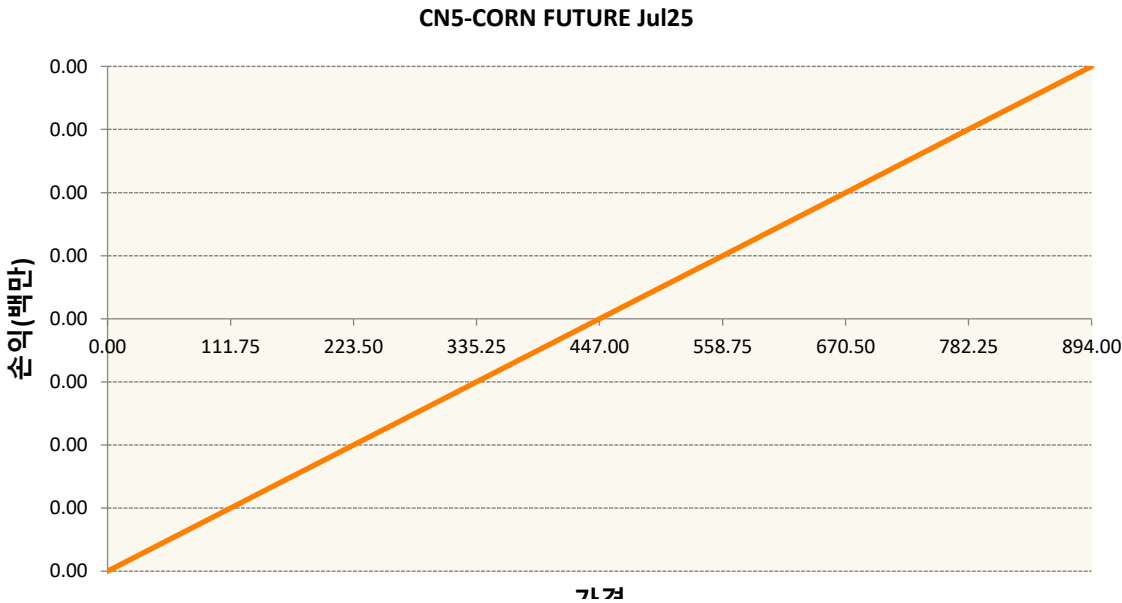
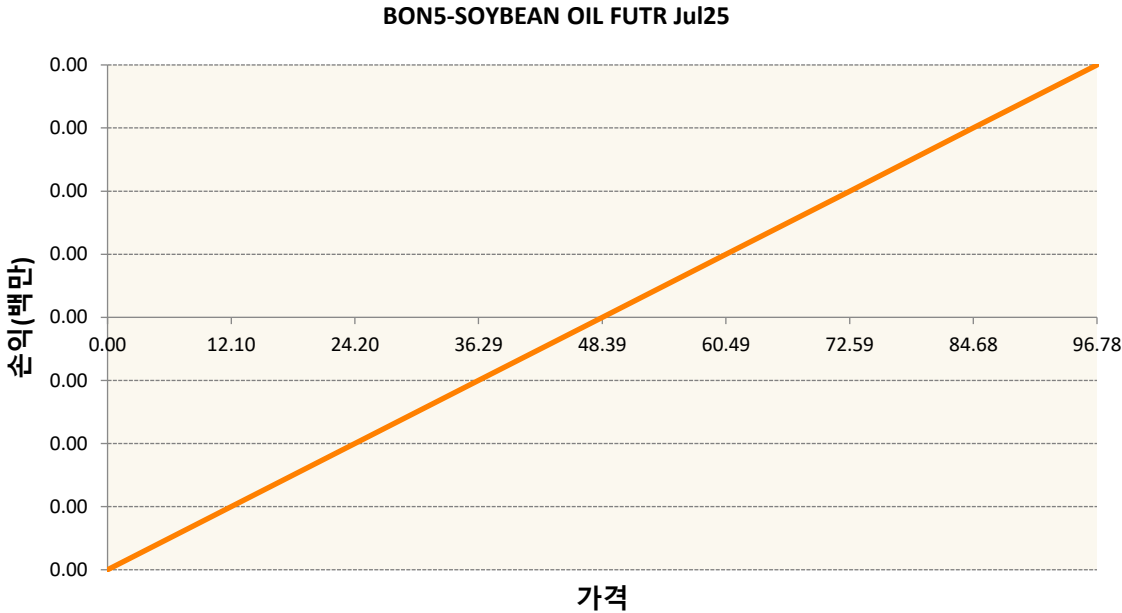
포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

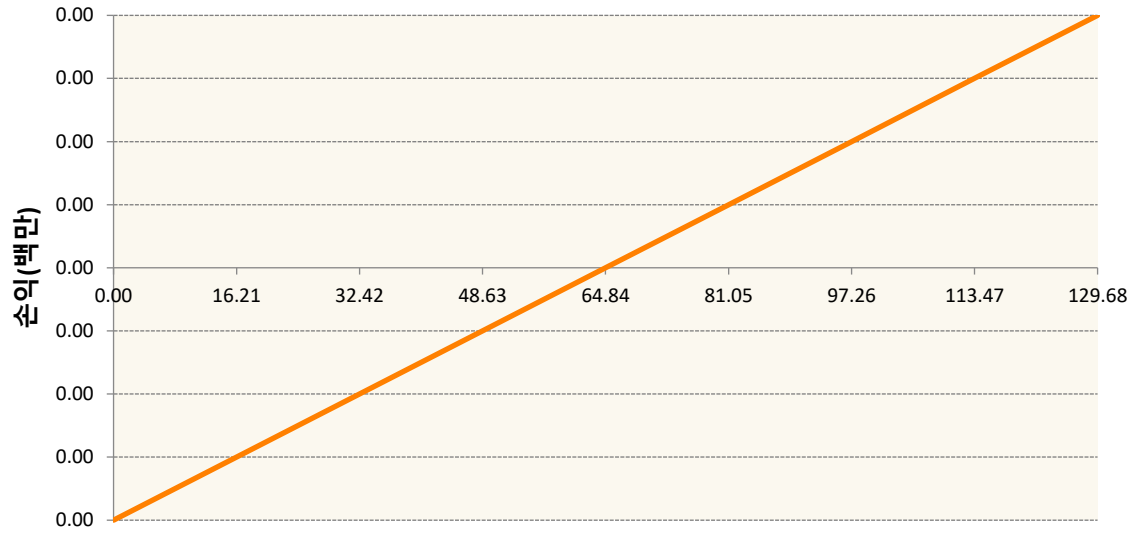
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,848	0	3,848	
누계	통화	선물	0	303	-303	장내

2. 만기시점의 손익구조



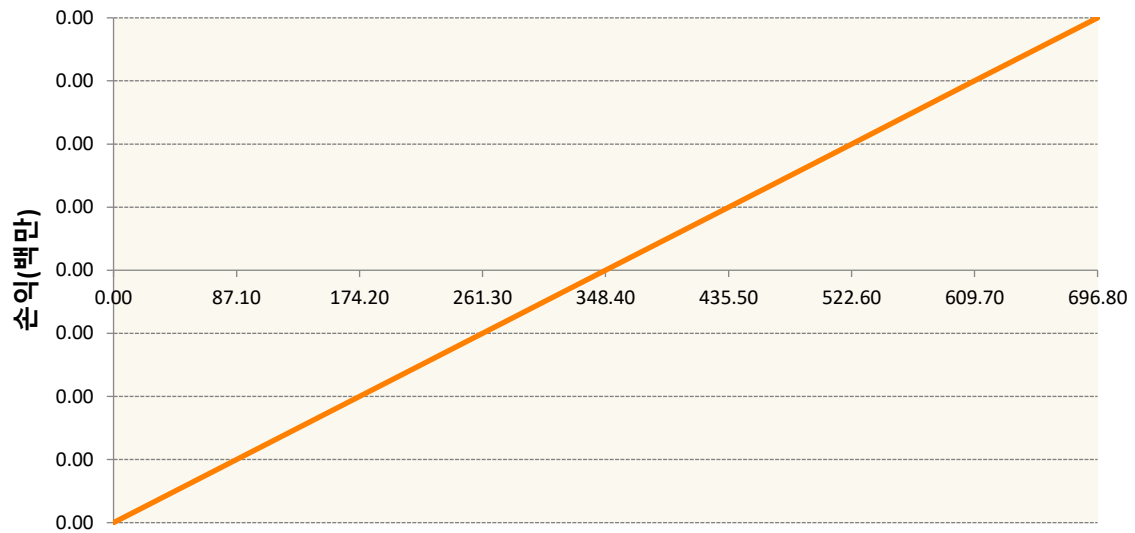
가격

CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



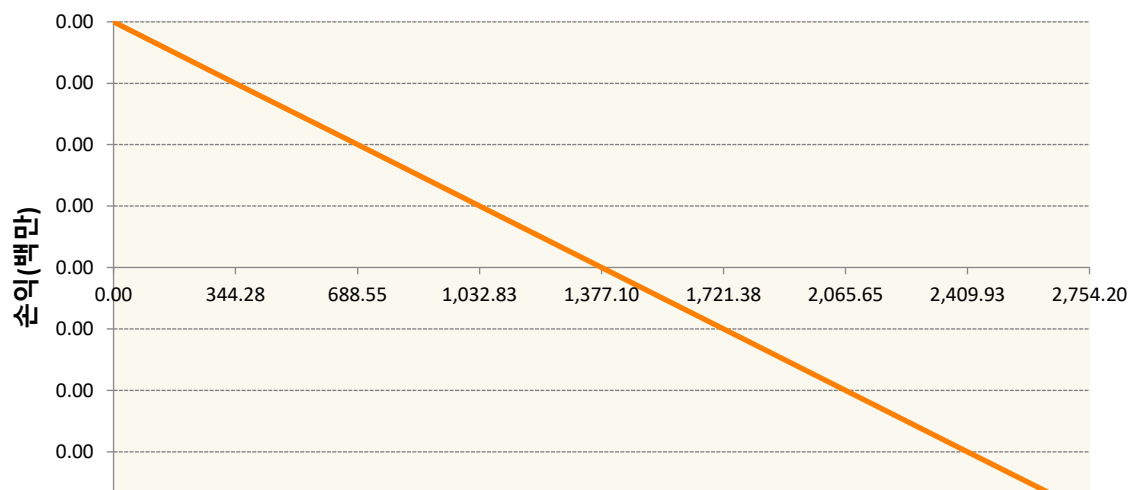
가격

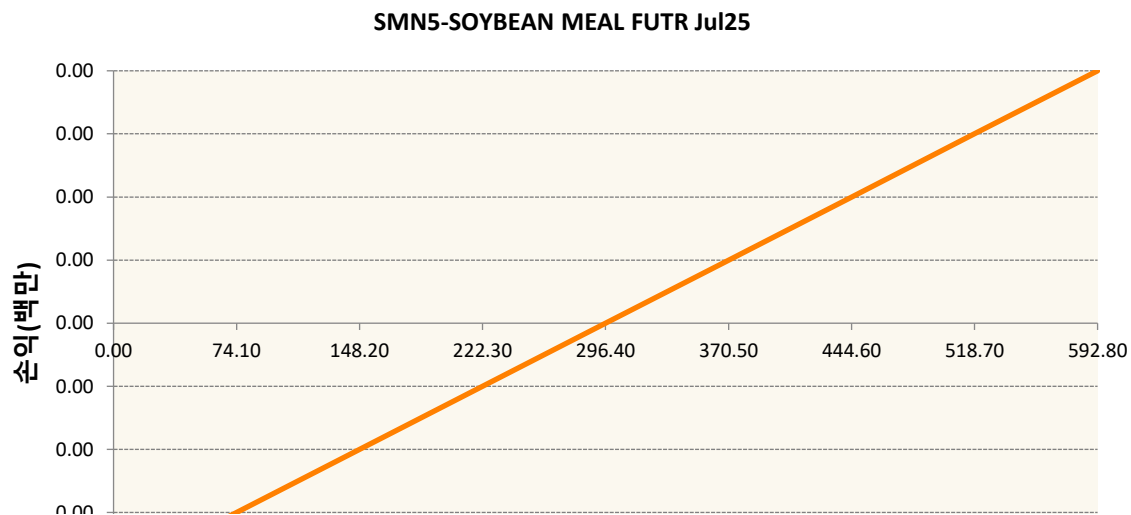
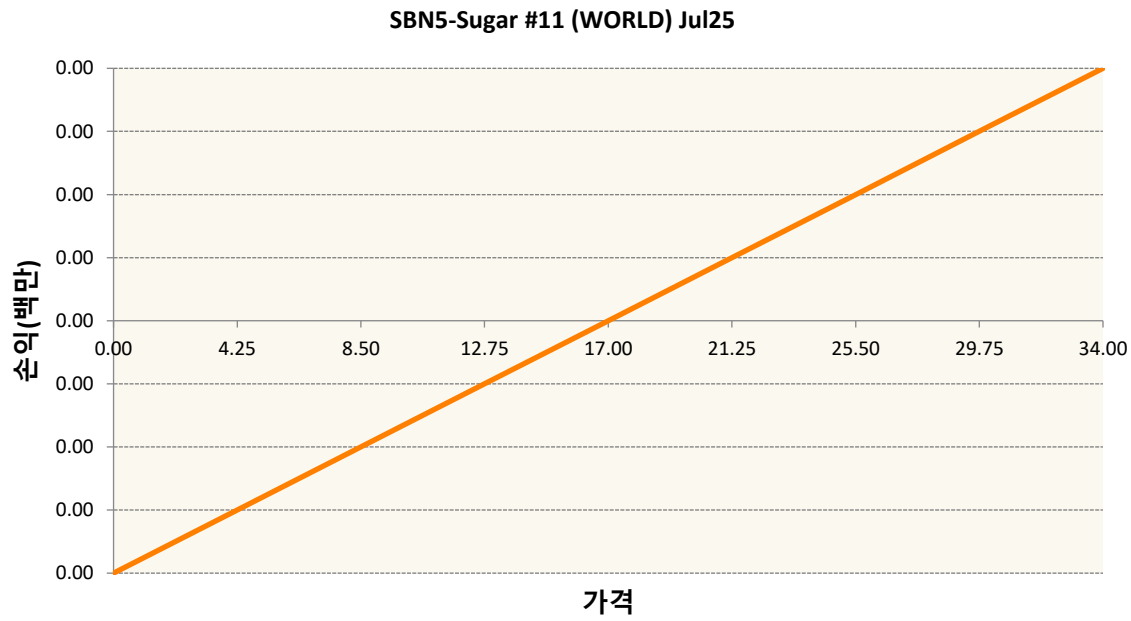
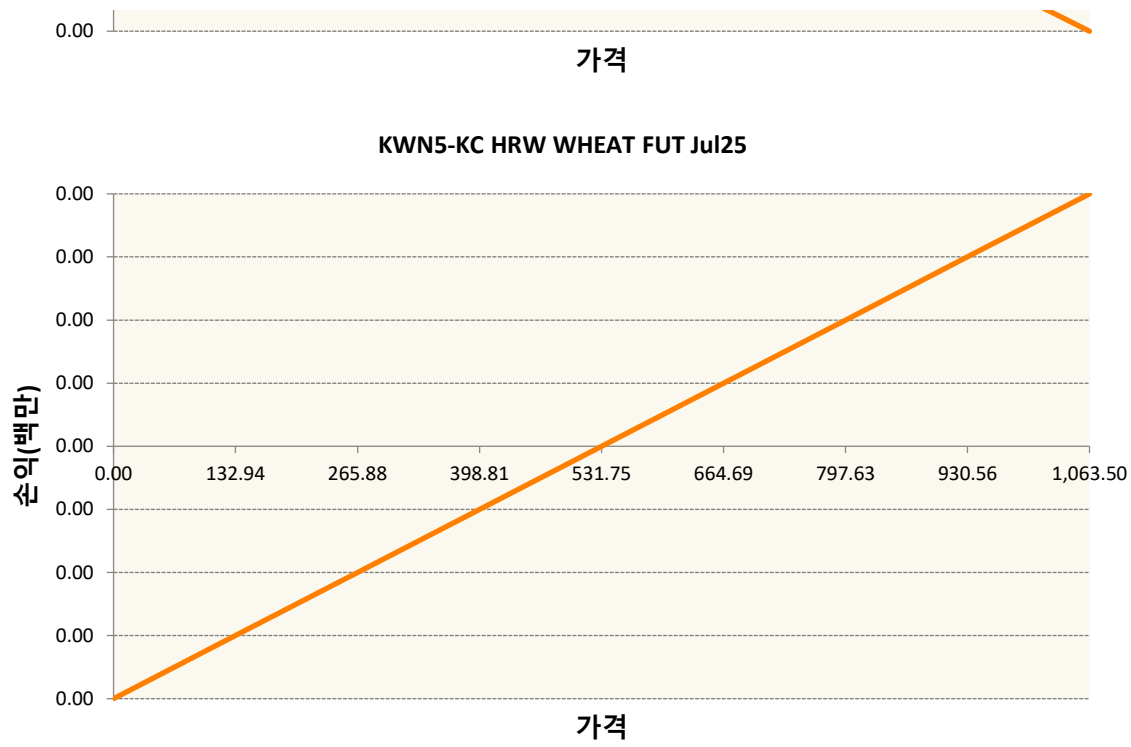
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



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	2025-06-02
기준일	2025-05-30

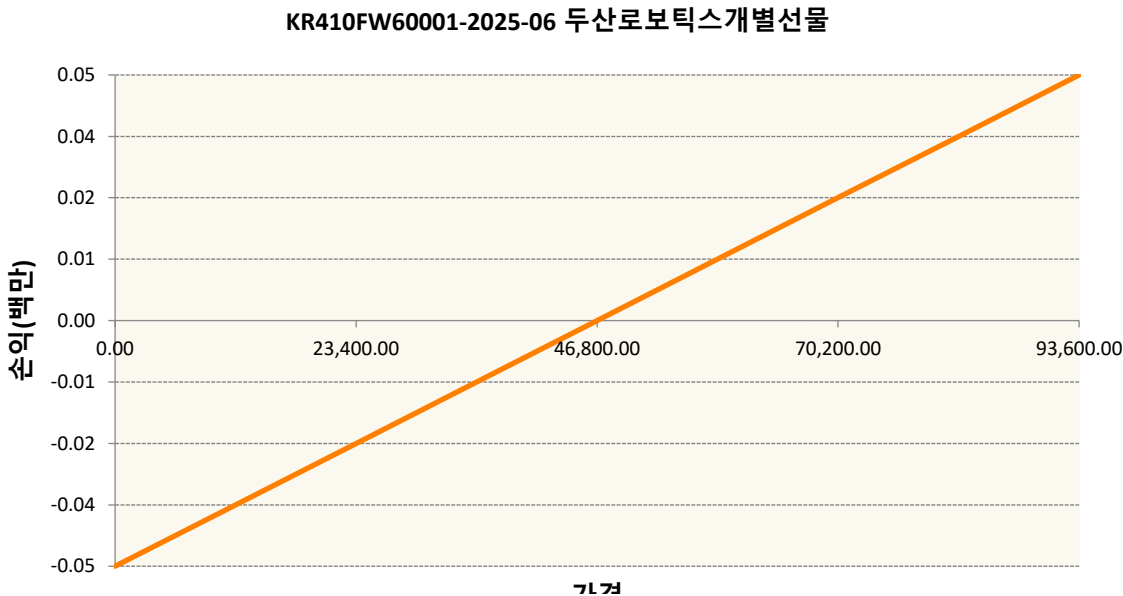
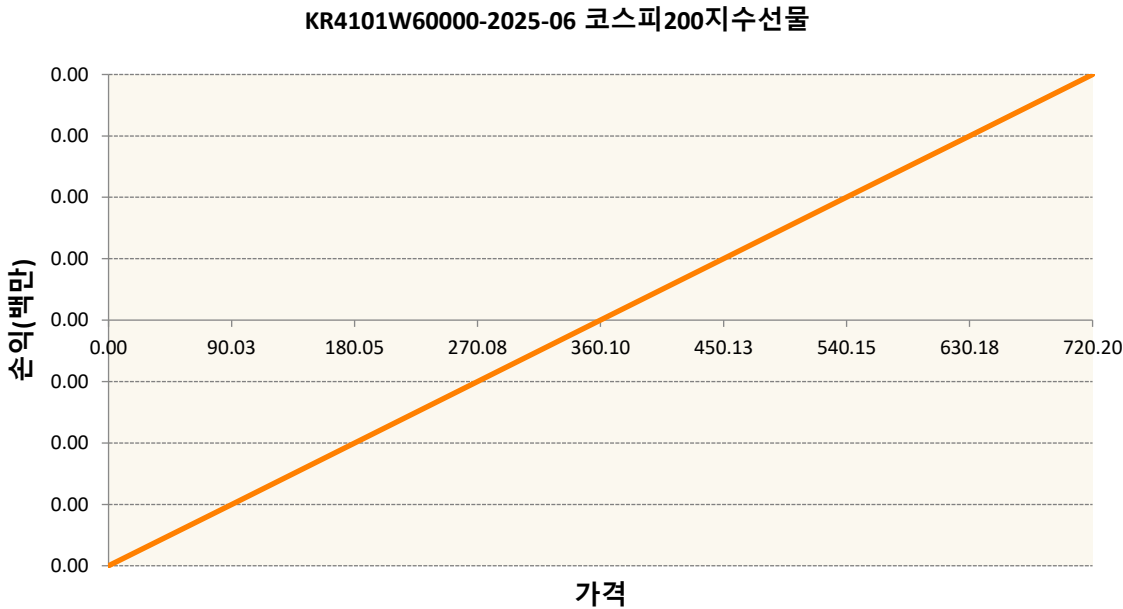
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

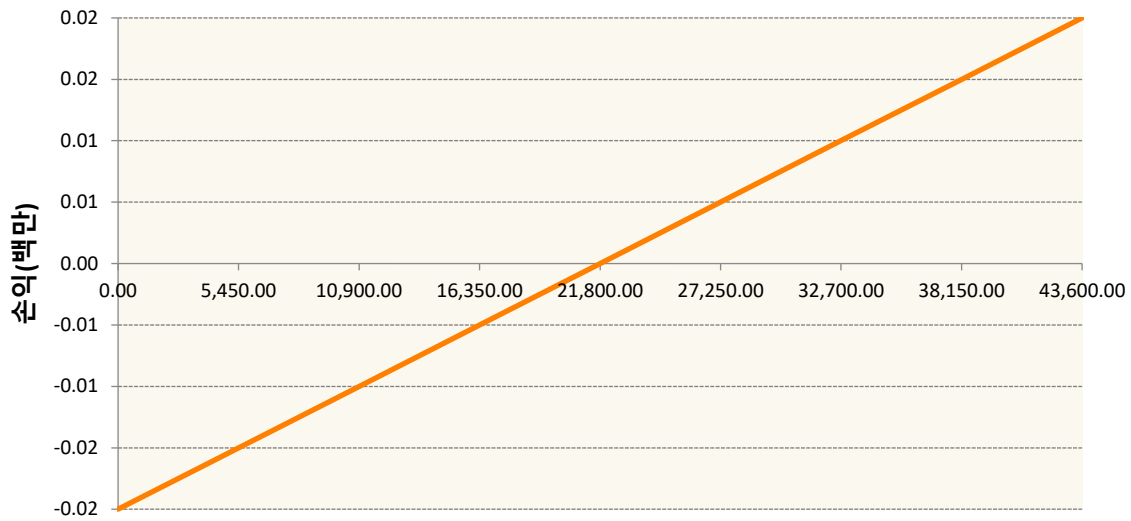
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	55	0	55	장내
누계	유가증권	선물	1,303	0	1,303	장내

2. 만기시점의 손익구조



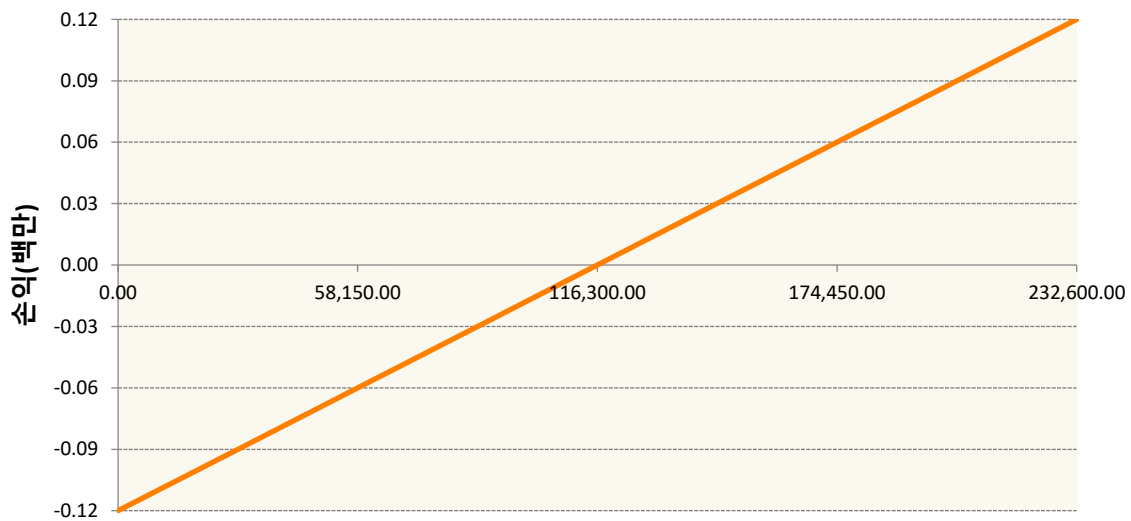
가격

KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



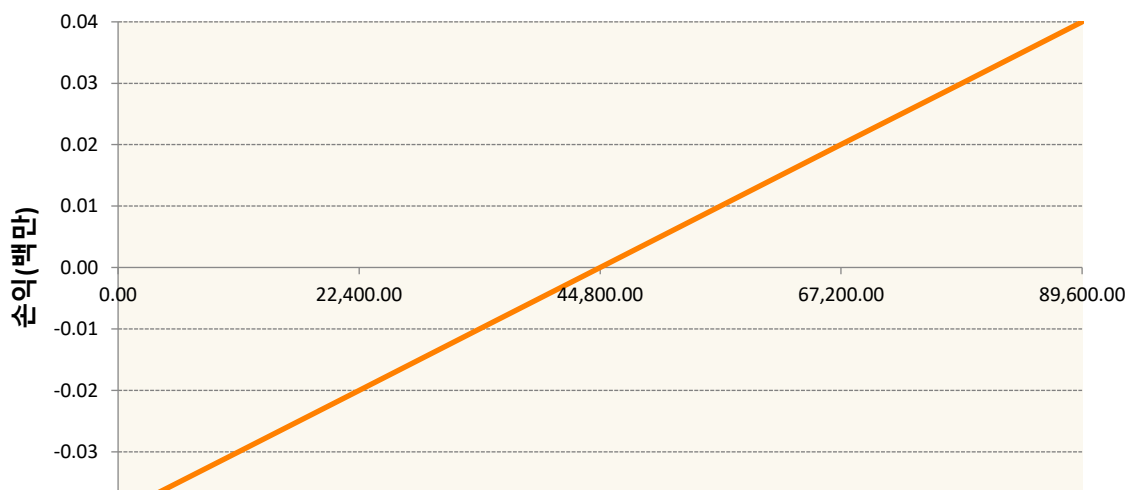
가격

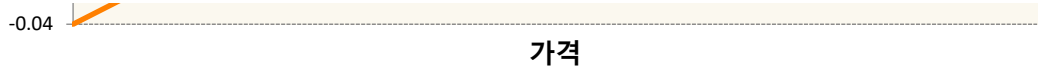
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



가격

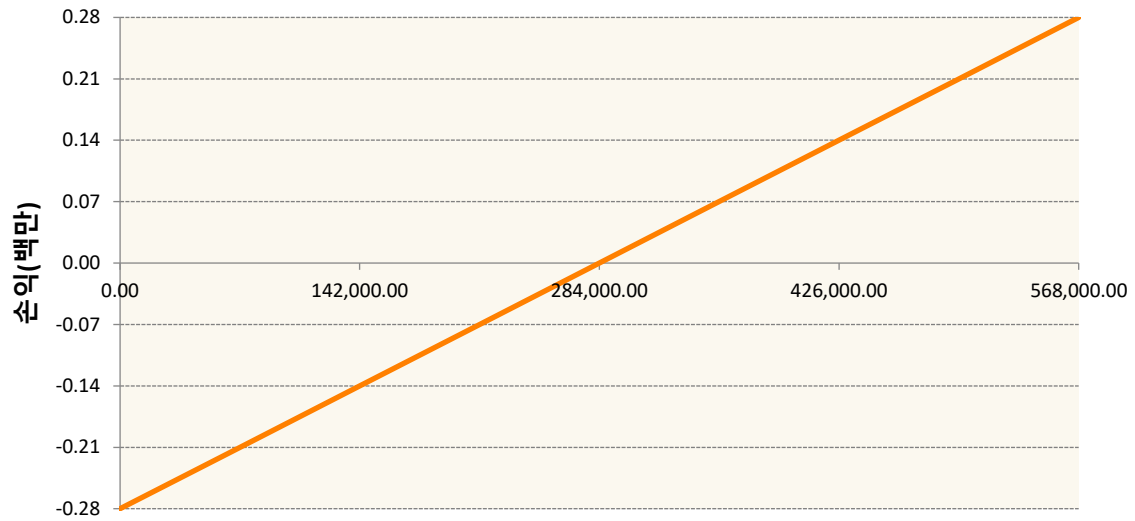
KR41EVW60008-2025-06 한화시스템개별선물





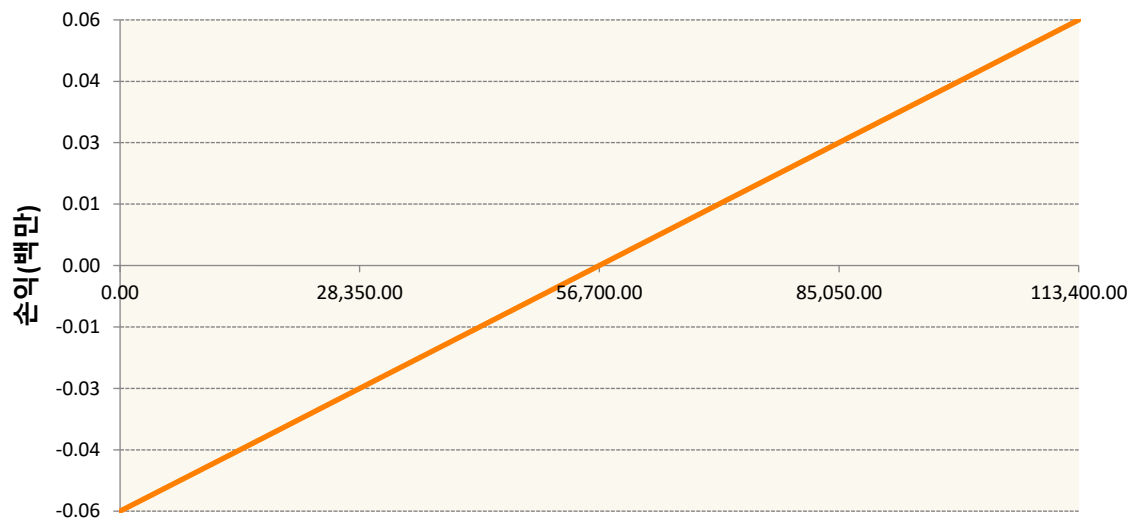
가격

KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



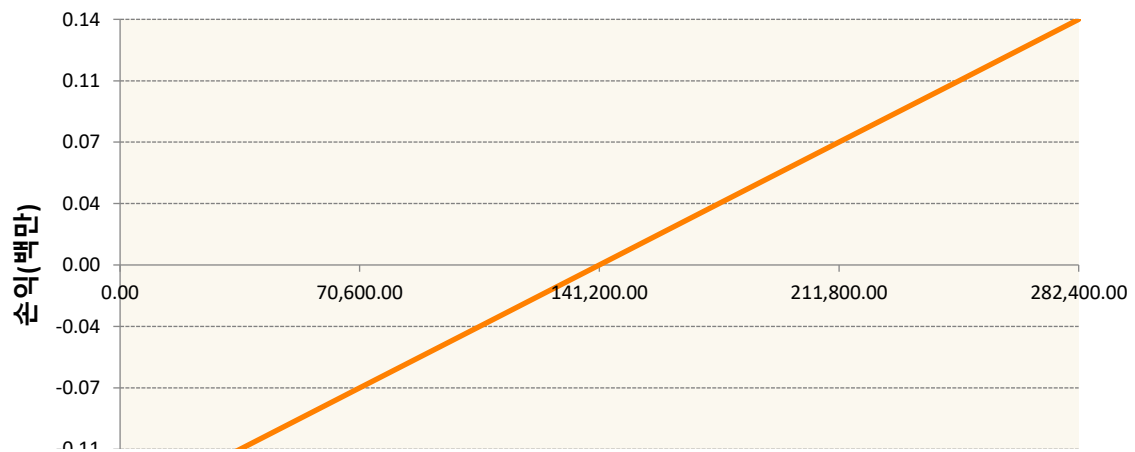
가격

KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물



가격

KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	72
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물	1
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물	1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41EVW60(2025-06 한화시스템개별선물	4
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물	12
KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물	2
KR41G5W60 2025-06 한진칼개별선물	8
KR41HEW60 2025-06 키움증권개별선물	1

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

183

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

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	295
-----------------------------	-----

* 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	2025-06-02
기준일	2025-05-30

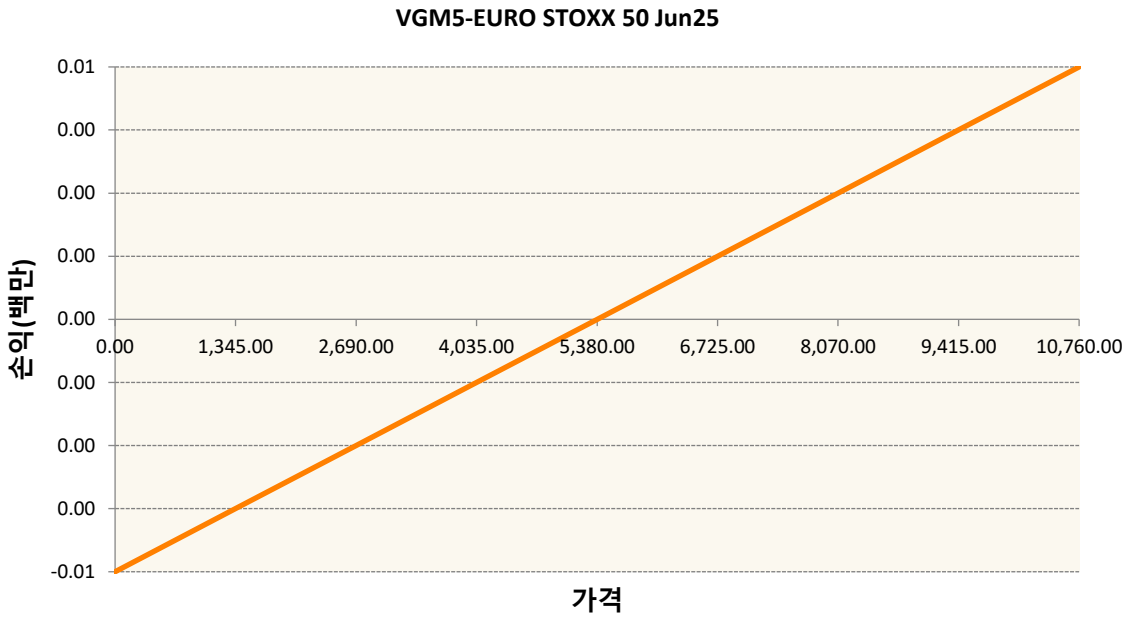
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,027	0	1,027	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

68

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

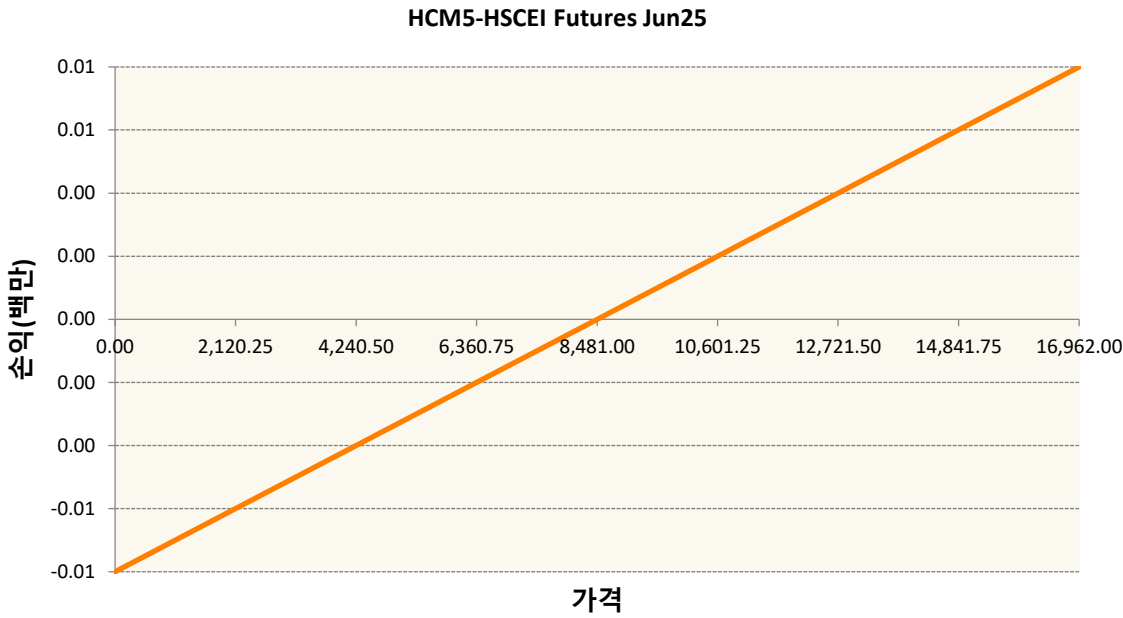
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,458	0	2,458	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM5	HSCEI Futures Jun25	197
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

292

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

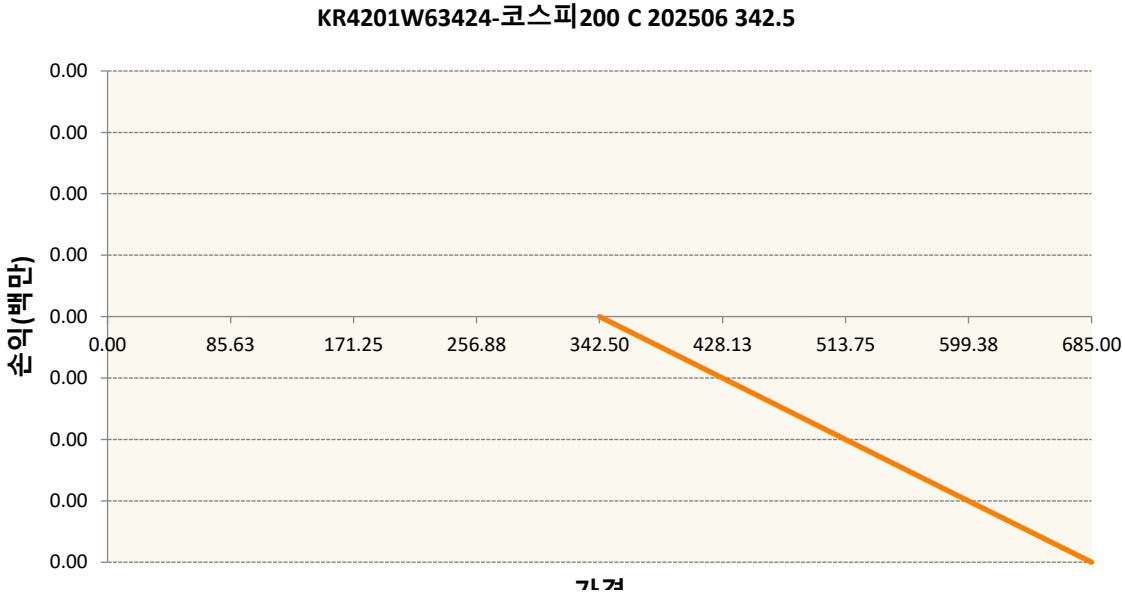
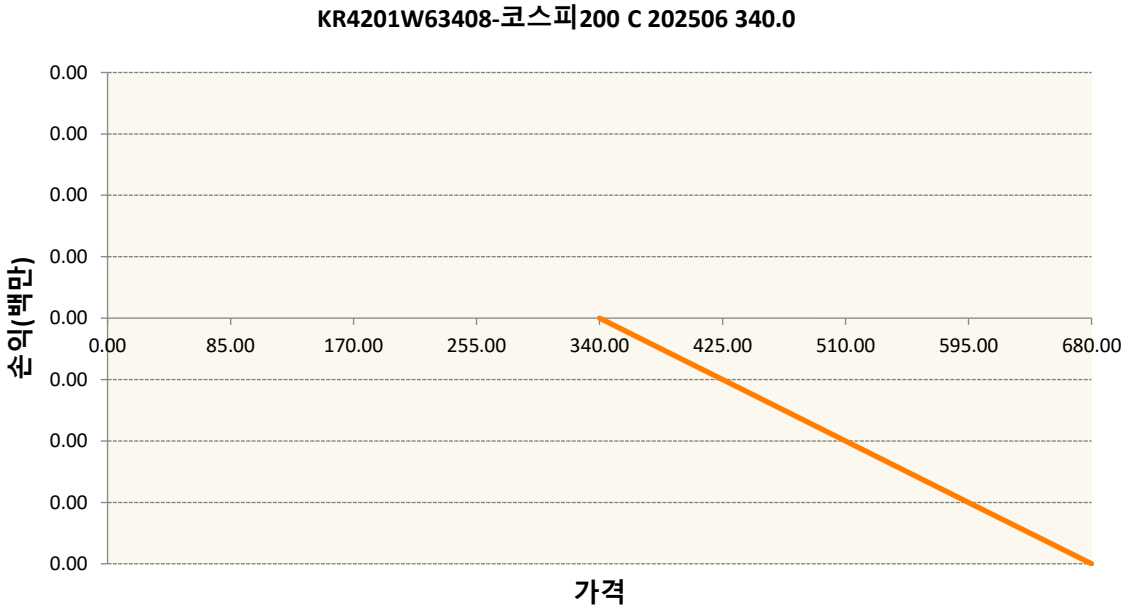
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	34,660	-34,660	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4201W63424						코스피200 C 202506 342.5		1,384
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	848	836	824	810	795	780	763	
-5.33%	727	706	685	663	642	620	599	
-2.67%	440	423	405	386	367	348	328	
0%	24	17	9	0	-11	-23	-36	
2.67%	-439	-441	-442	-445	-449	-455	-461	
5.33%	-911	-911	-911	-912	-913	-914	-916	
8.00%	-1,382	-1,382	-1,382	-1,383	-1,383	-1,383	-1,384	
KR4301W63406						코스피200 P 202506 340.0		87
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-70	-73	-75	-78	-81	-84	-87	
-5.33%	-25	-29	-32	-36	-39	-43	-46	
-2.67%	-3	-6	-8	-11	-14	-17	-20	
0%	3	3	1	0	-2	-3	-5	
2.67%	5	4	4	4	3	2	1	
5.33%	5	5	5	5	4	4	4	
8.00%	5	5	5	5	5	5	4	
KR4301W63422						코스피200 P 202506 342.5		145
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-123	-126	-130	-133	-137	-141	-145	
-5.33%	-49	-54	-59	-64	-69	-74	-80	
-2.67%	-7	-12	-16	-21	-25	-30	-35	
0%	7	5	3	0	-3	-6	-10	
2.67%	10	9	9	8	6	5	3	
5.33%	10	10	10	10	9	9	8	
8.00%	10	10	10	10	10	10	9	

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

(단위:백만원)

2,710

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

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	536	0	536	

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	2025-06-02
기준일	2025-05-30

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	4,312	0	4,312	

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	2025-06-02
기준일	2025-05-30

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	12,400	0	12,400	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

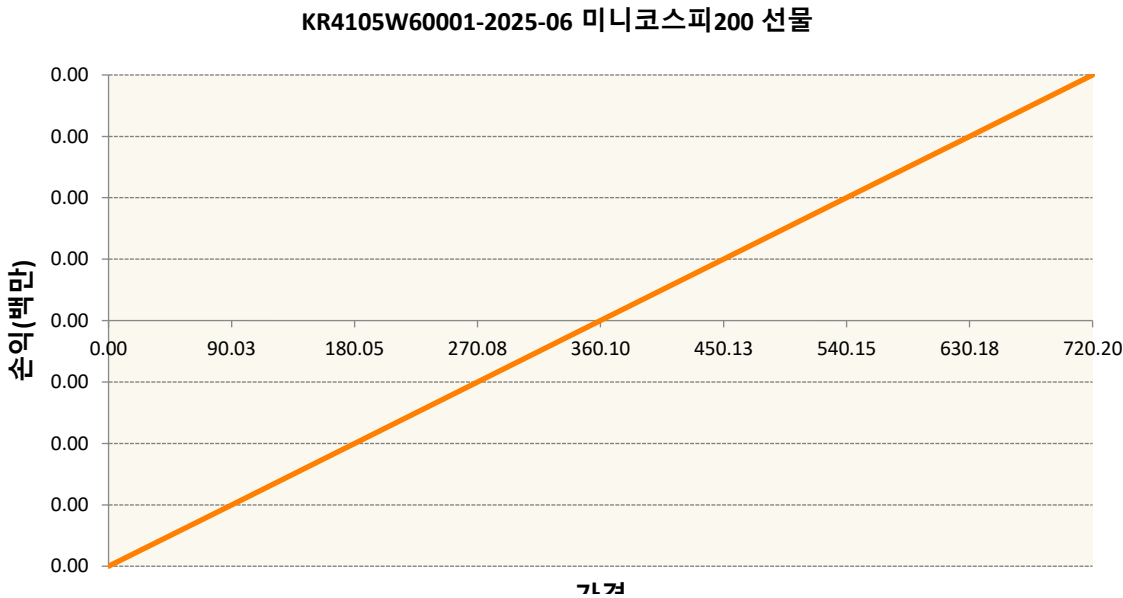
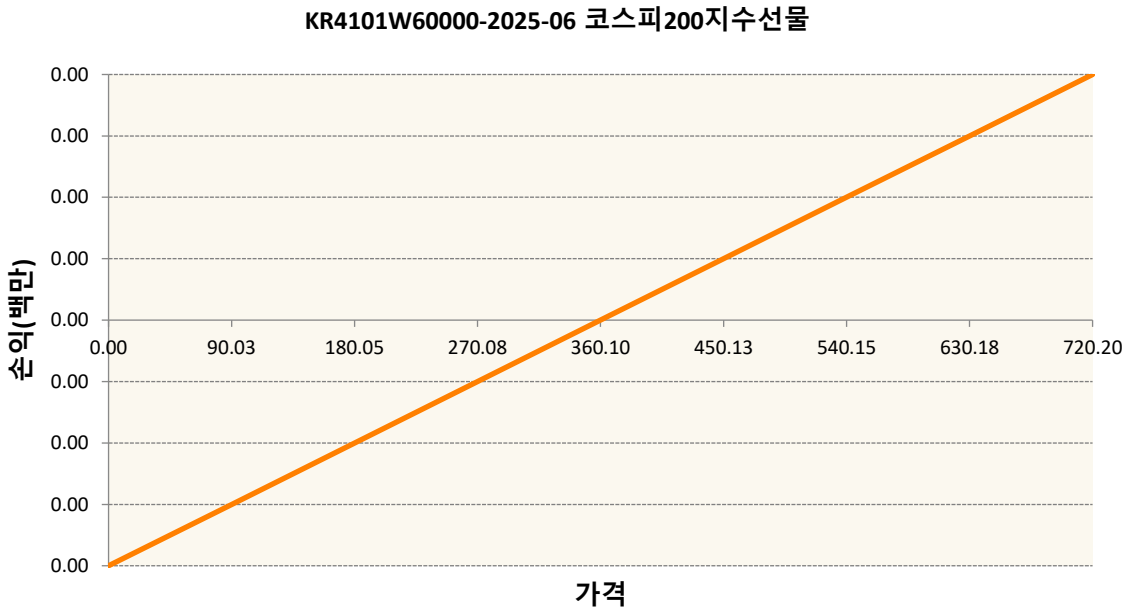
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

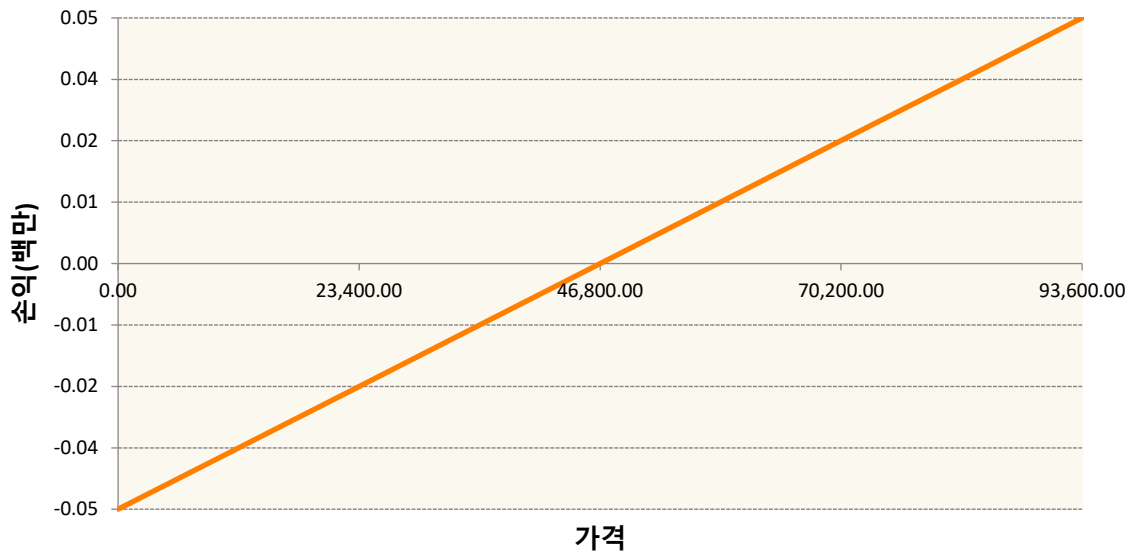
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	23	0	23	장내
누계	유가증권	선물	1,185	0	1,185	장내

2. 만기시점의 손익구조

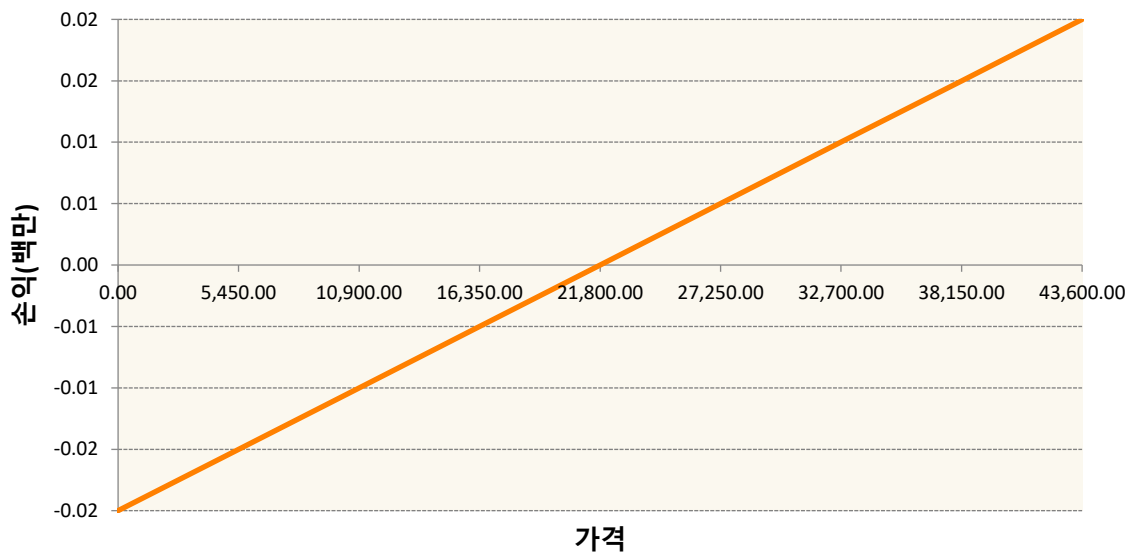


가격

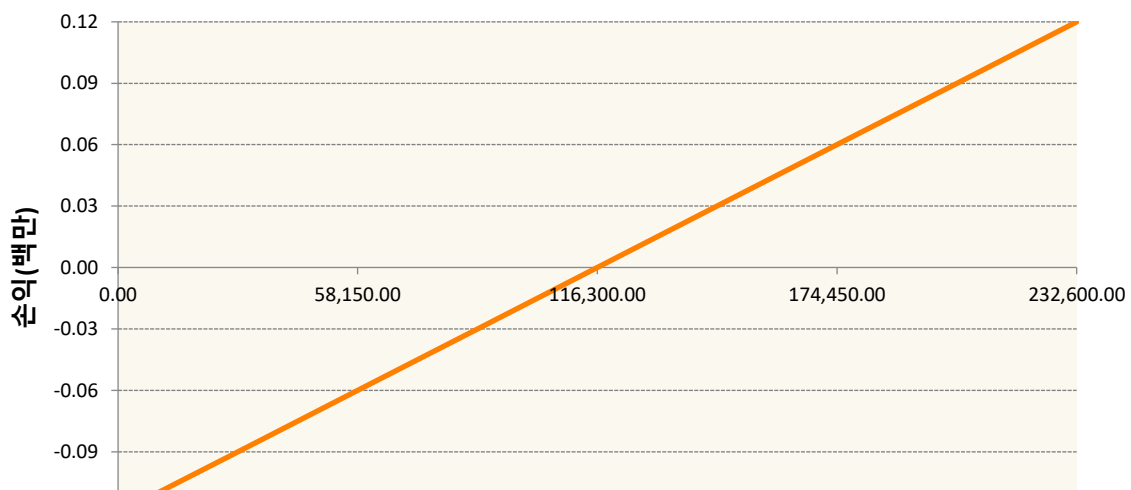
KR410FW60001-2025-06 두산로보틱스개별선물

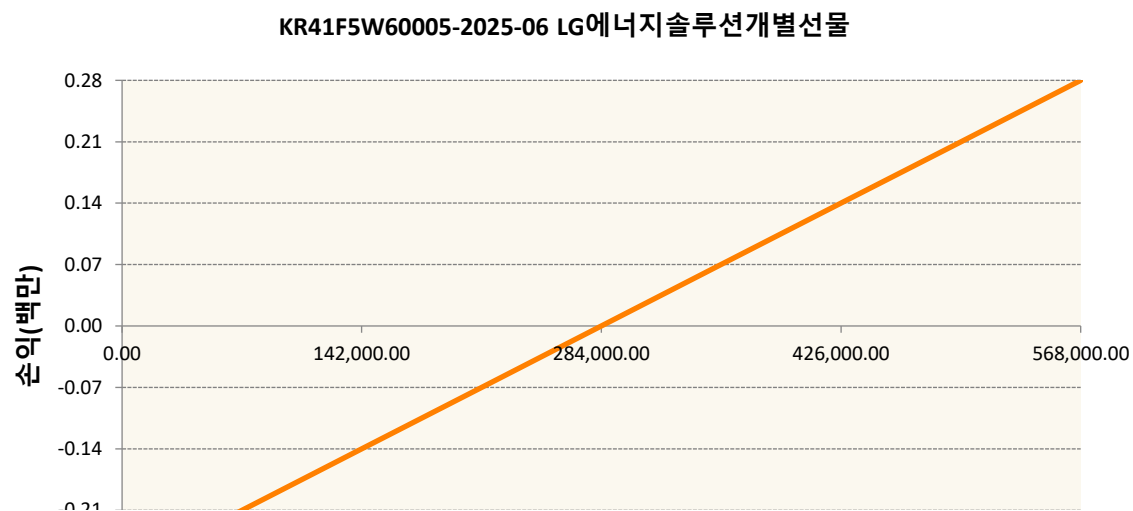
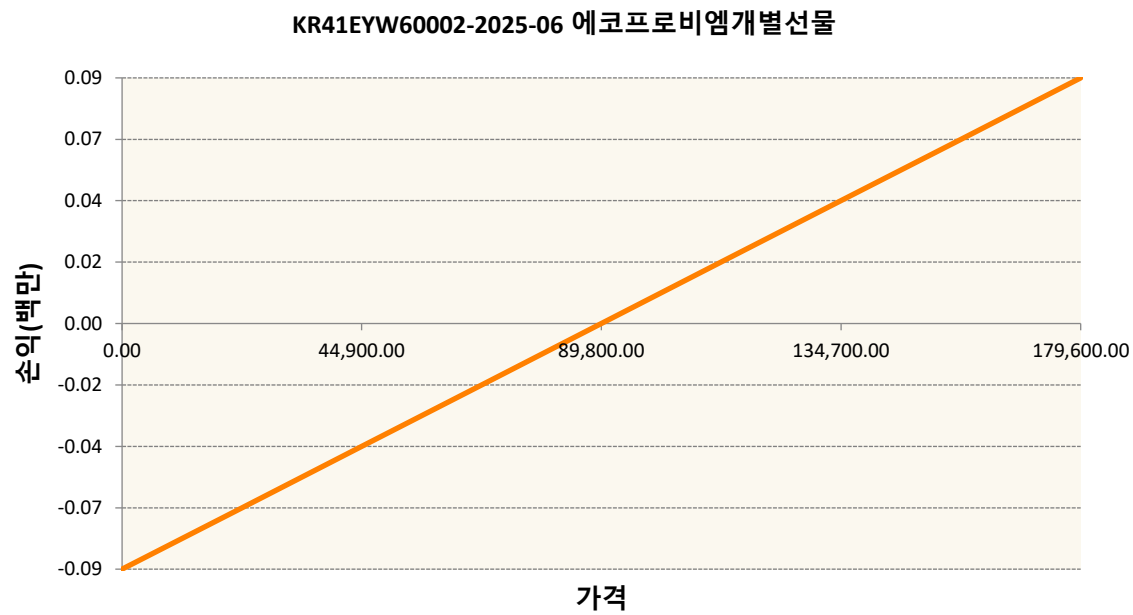
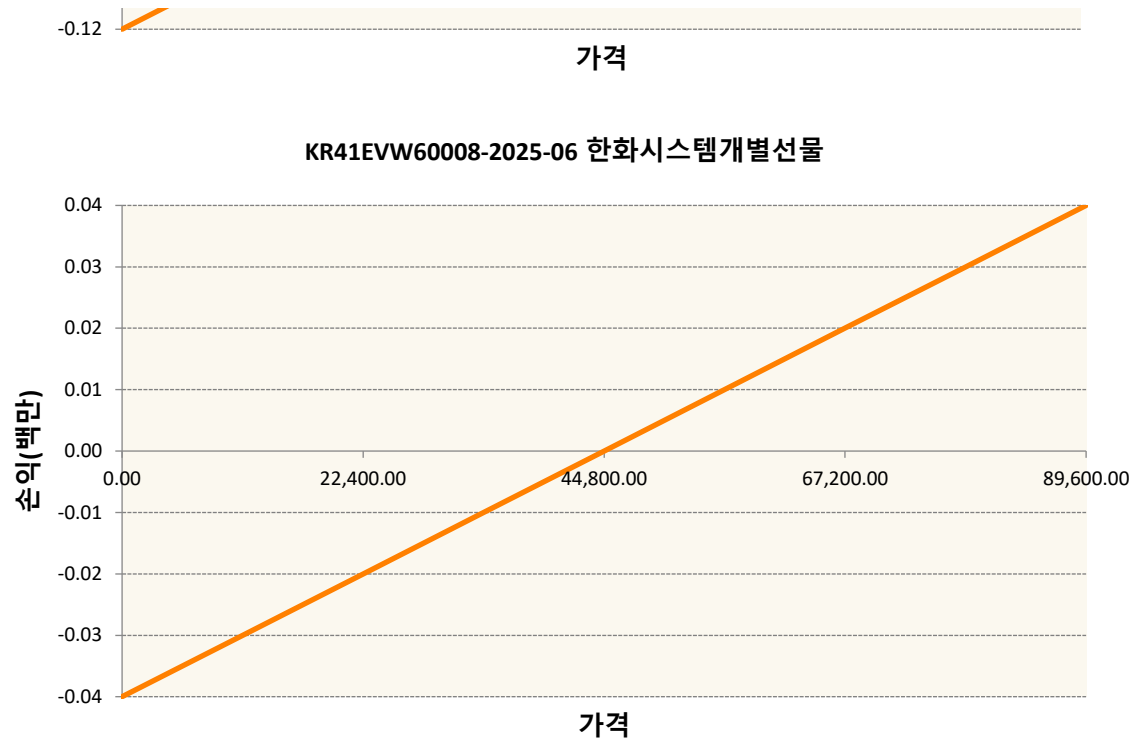


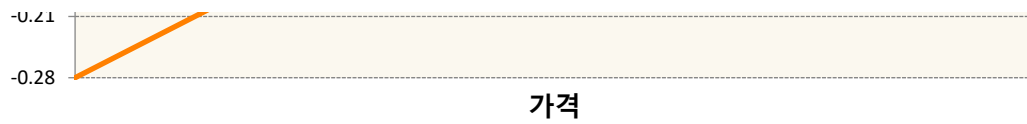
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



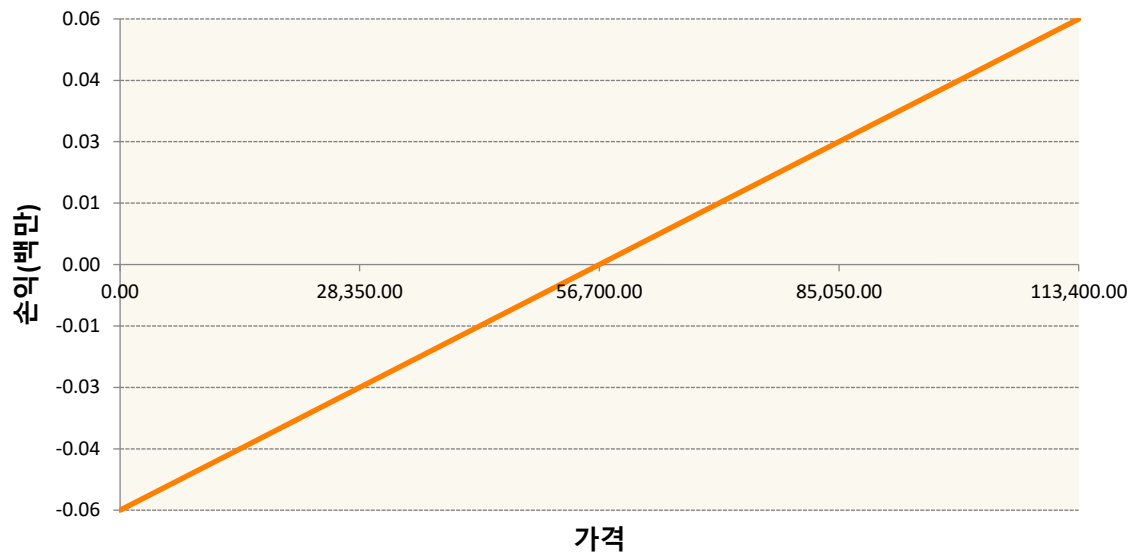
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



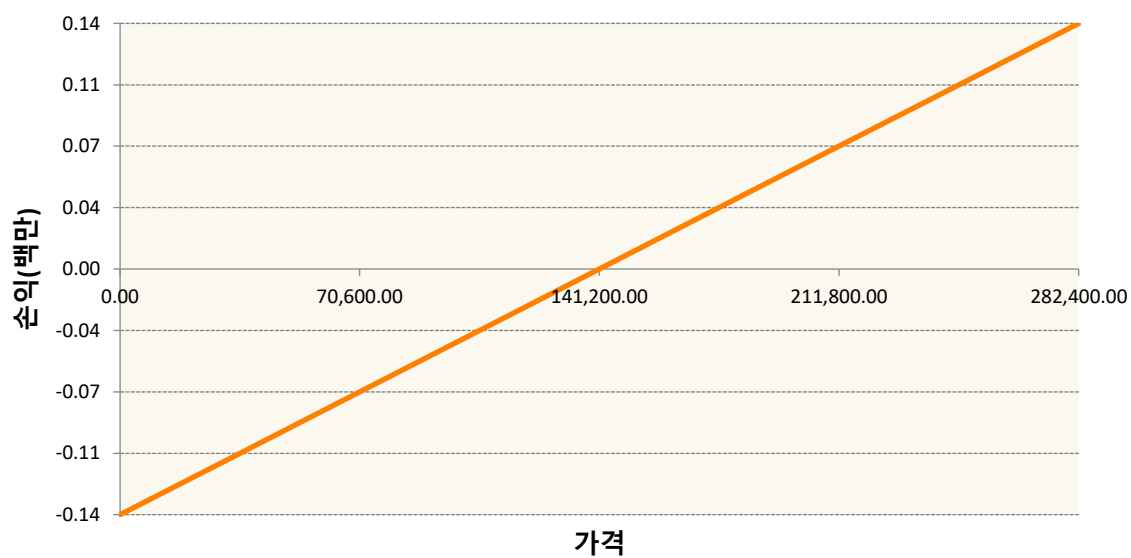




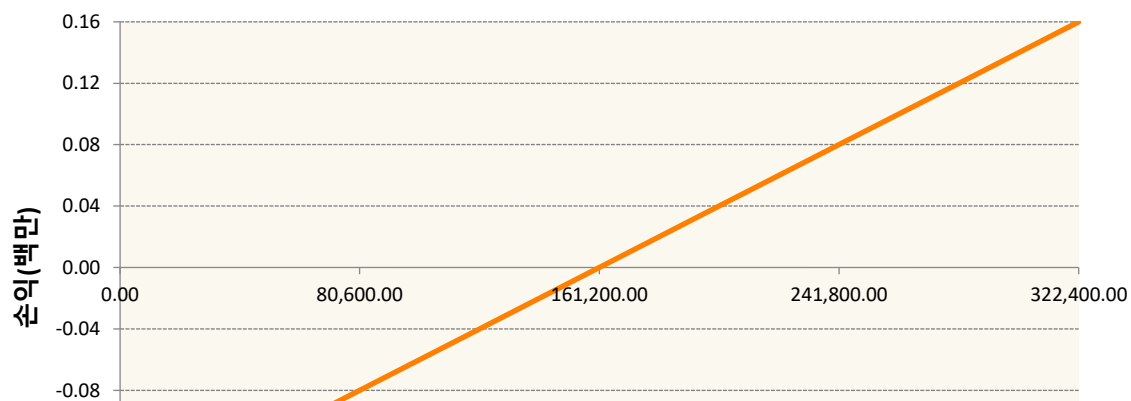
KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물

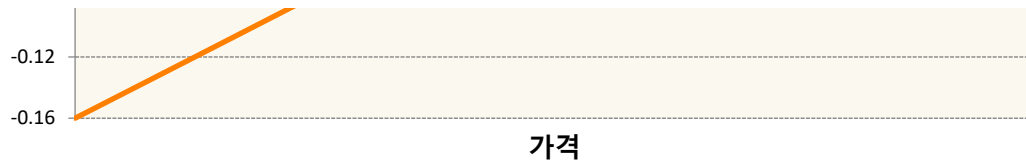


KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



KR41HEW60007-2025-06 키움증권개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	65
KR4105W60(2025-06 미니코스피200 선물	3
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물	0.45
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물	1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EVW60(2025-06 한화시스템개별선물	2
KR41EYW60(2025-06 에코프로비엠개별선물	2
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물	5
KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물	1
KR41G5W60 2025-06 한진칼개별선물	3
KR41HEW60 2025-06 키움증권개별선물	0.26

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

134

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

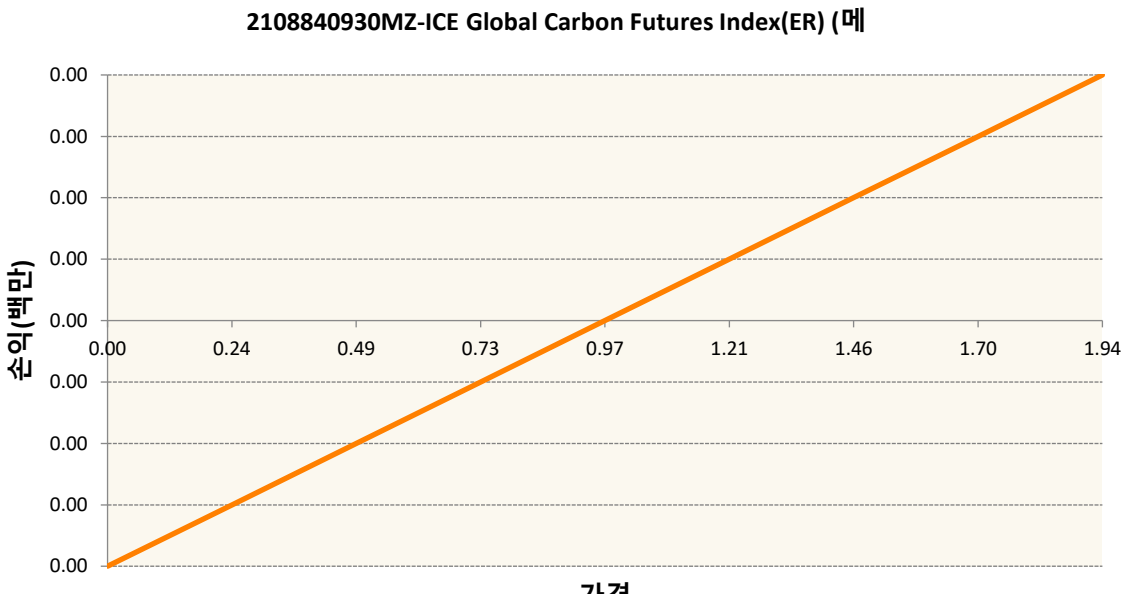
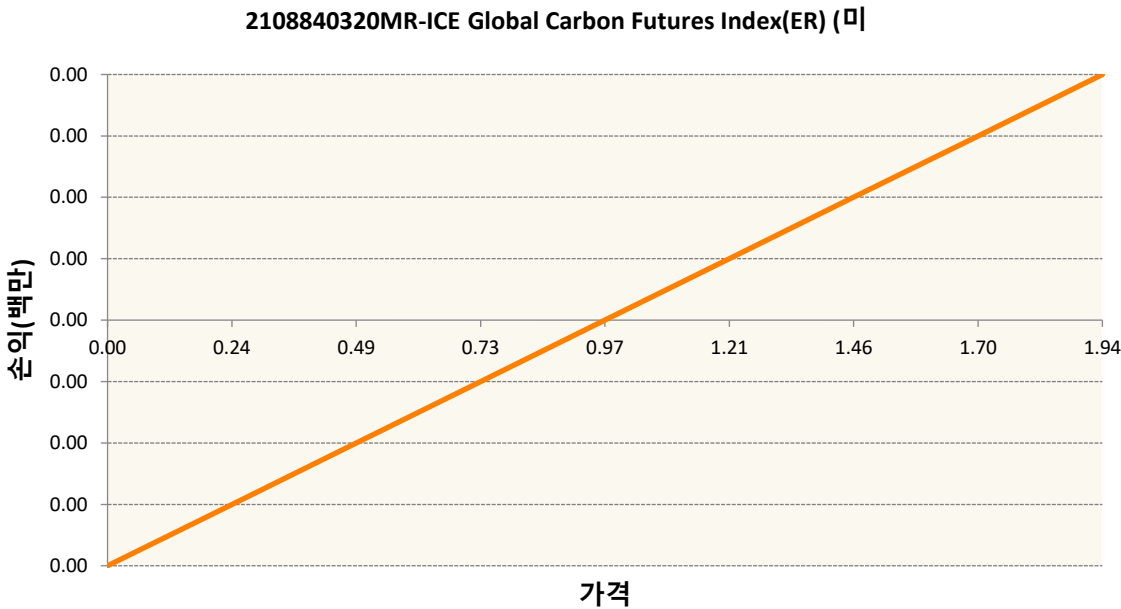
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	572
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	191

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		890

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

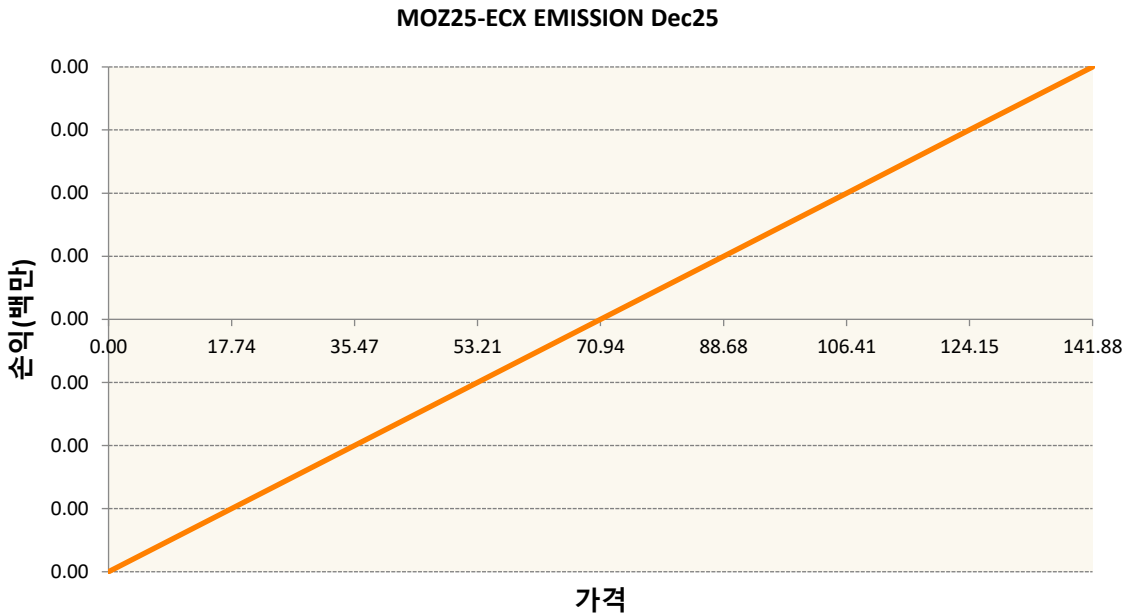
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,431	0	6,431	
누계	통화	선도	0	1,387	-1,387	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	0.19
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	33
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	78
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	515

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

(단위:백만원)

964

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

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)	14
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	21
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	21

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

(단위:백만원)

124

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

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)	30
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	36
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	8

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

(단위:백만원)

176

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

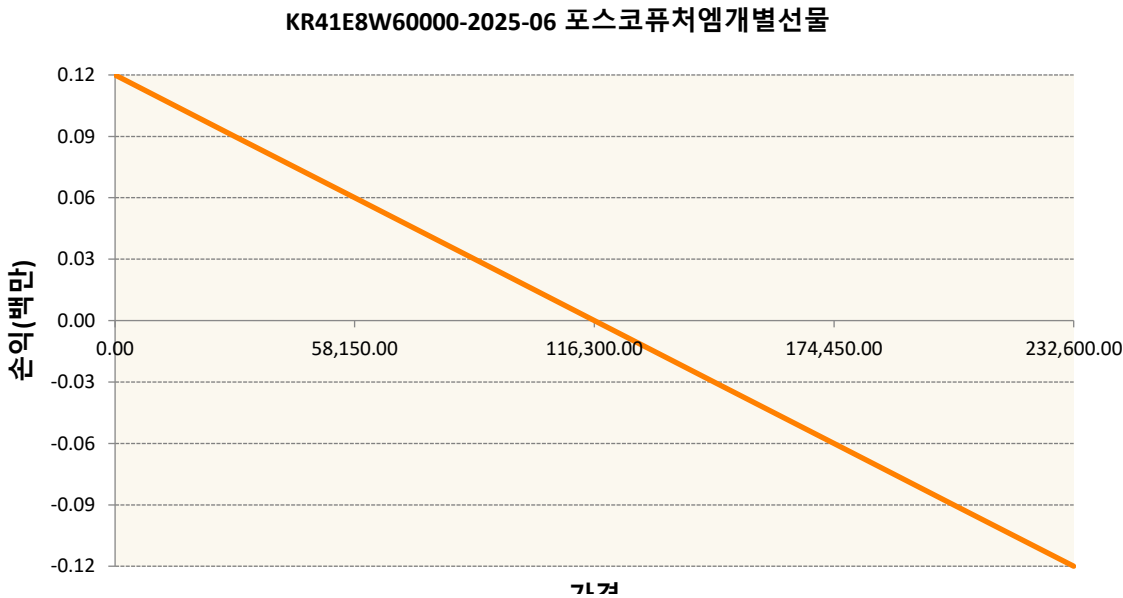
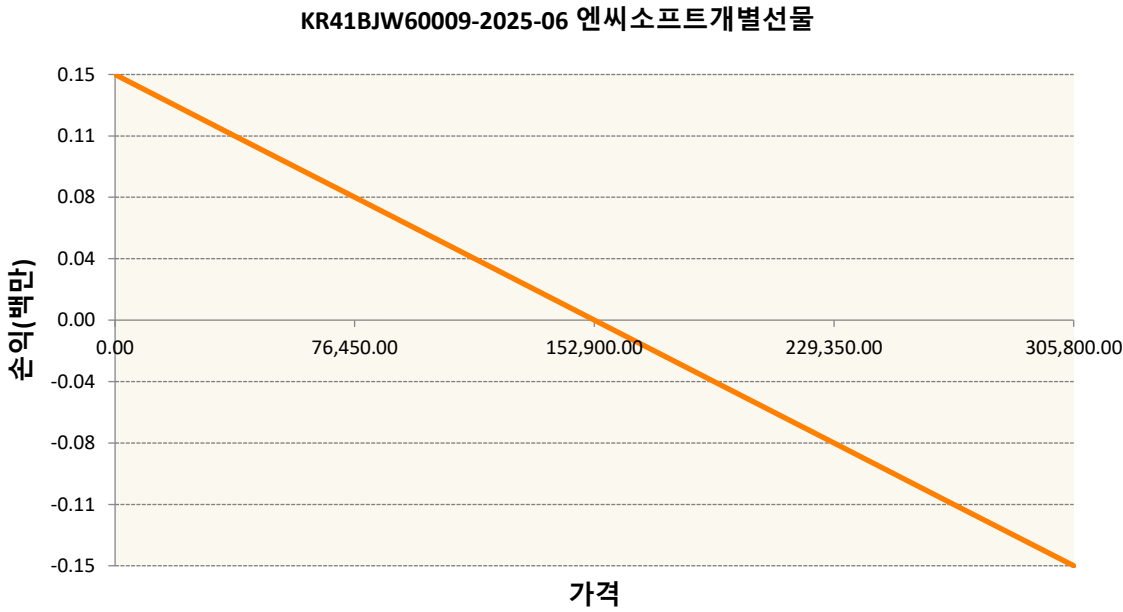
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3	-3	장내
누계	유가증권	선물	0	8	-8	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR41BJW60C 2025-06 엔씨소프트개별선물		0.37
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물		0.28

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

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

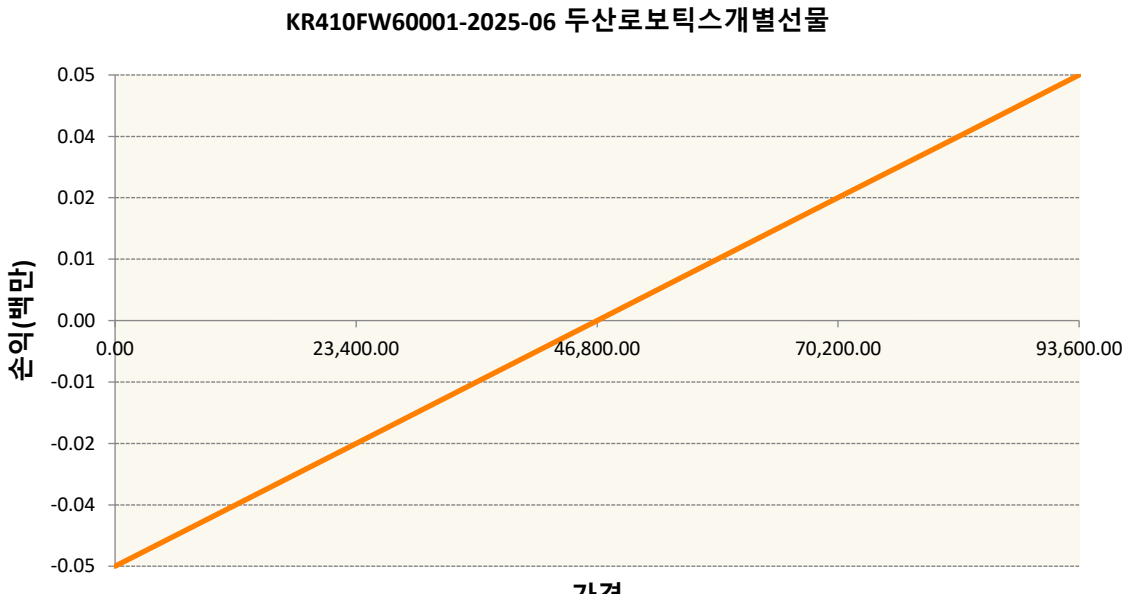
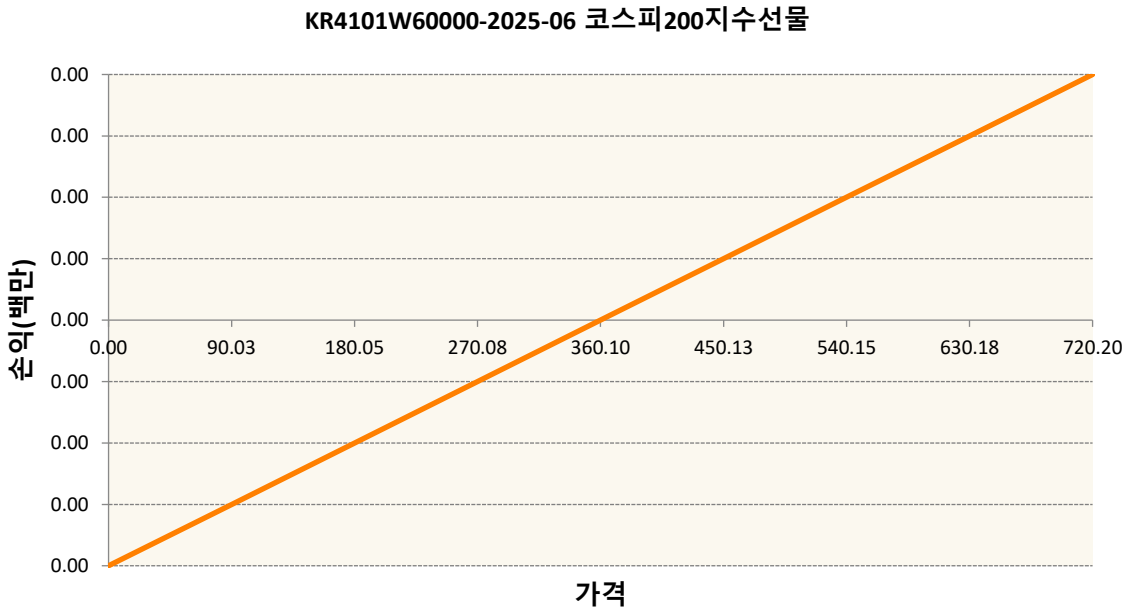
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

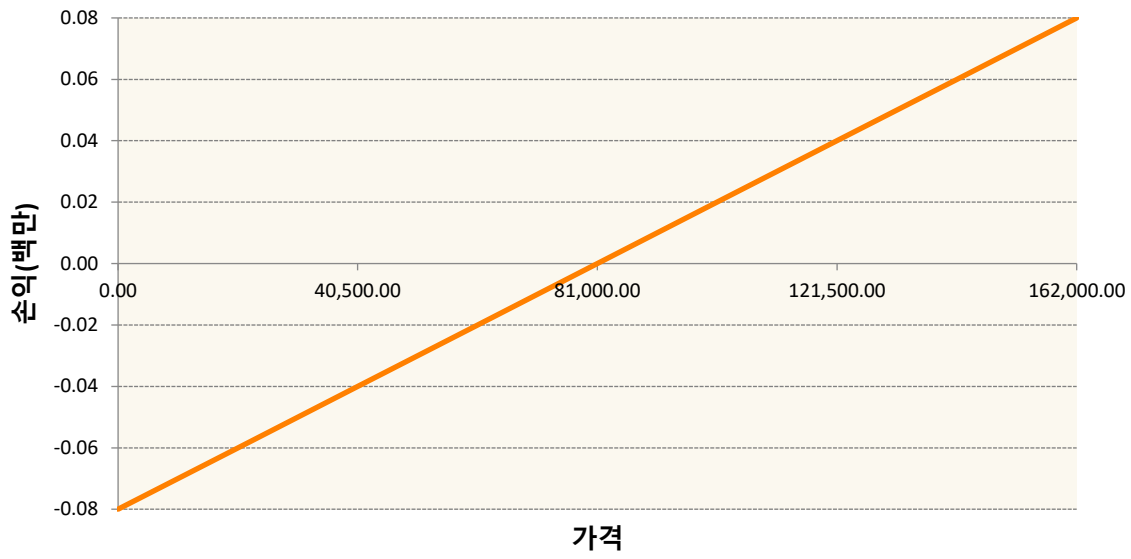
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	895	0	895	장내
누계	유가증권	선물	12,068	0	12,068	장내

2. 만기시점의 손익구조

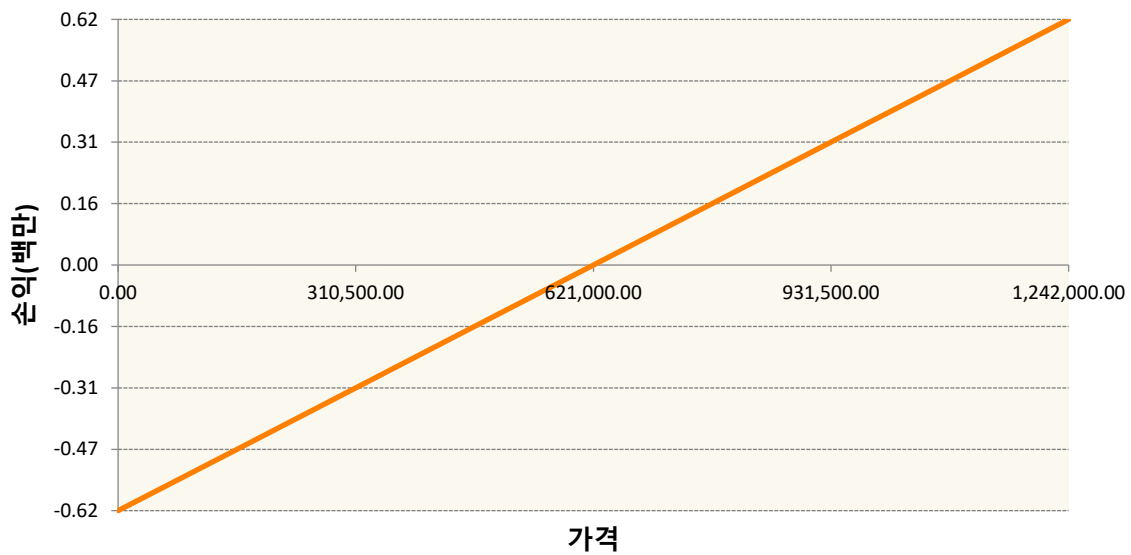


가격

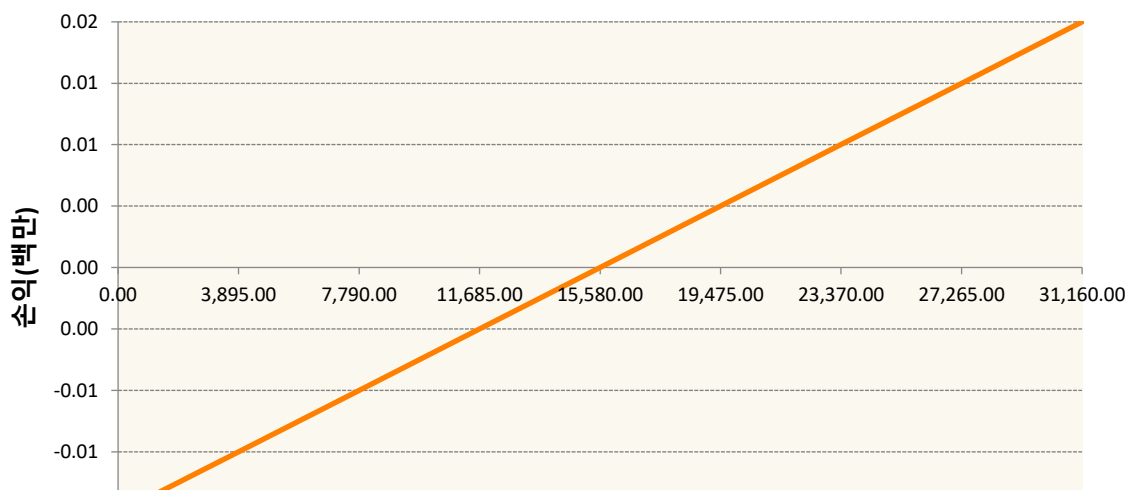
KR410ZW60009-2025-06 한미반도체개별선물

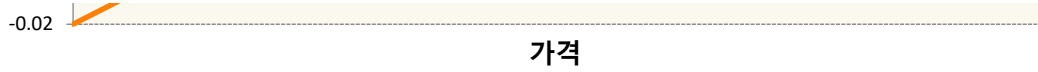


KR411SW60002-2025-06 효성중공업개별선물



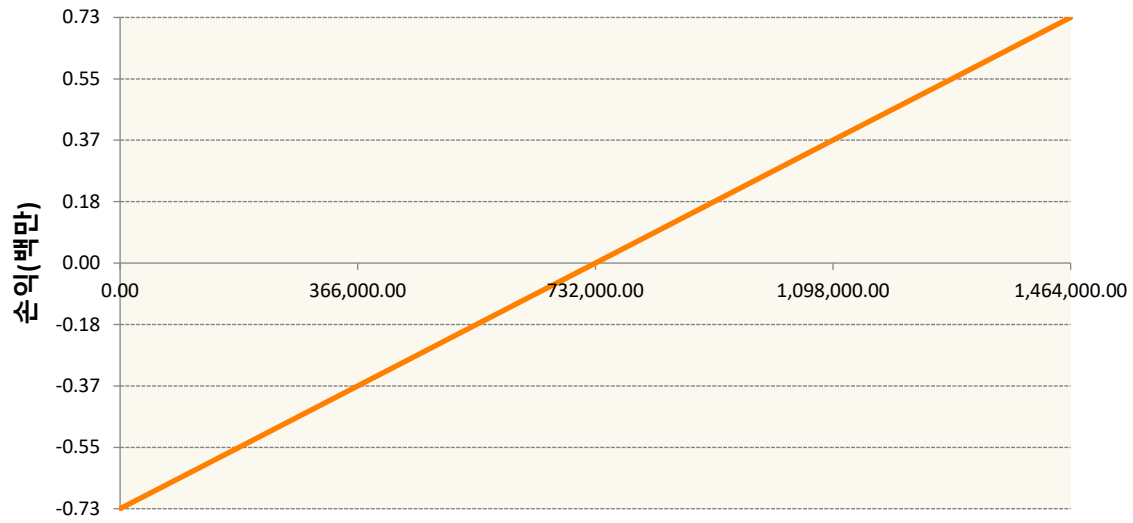
KR4148W60001-2025-06 미래에셋증권개별선물





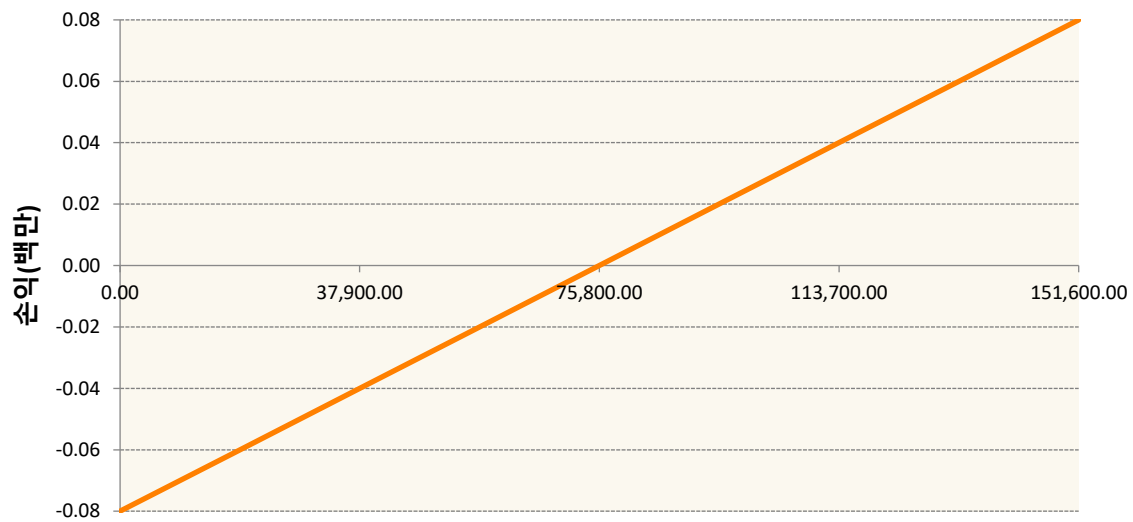
가격

KR41B3W60004-2025-06 고려아연개별선물



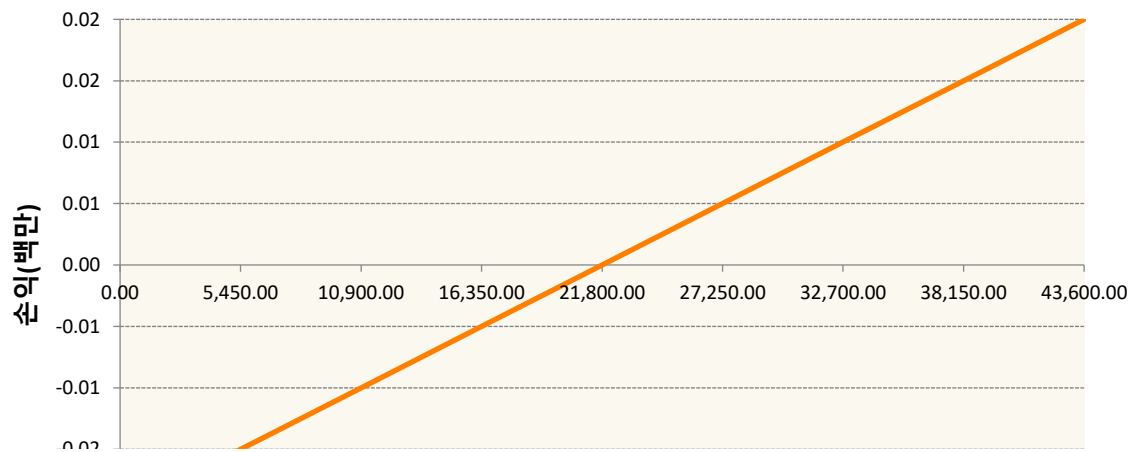
가격

KR41C9W60000-2025-06 한화개별선물

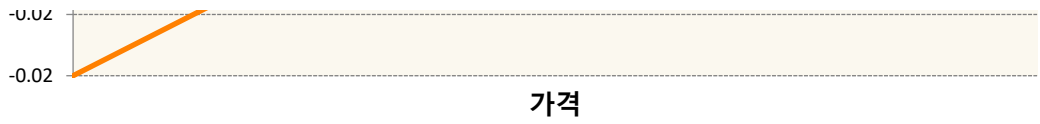


가격

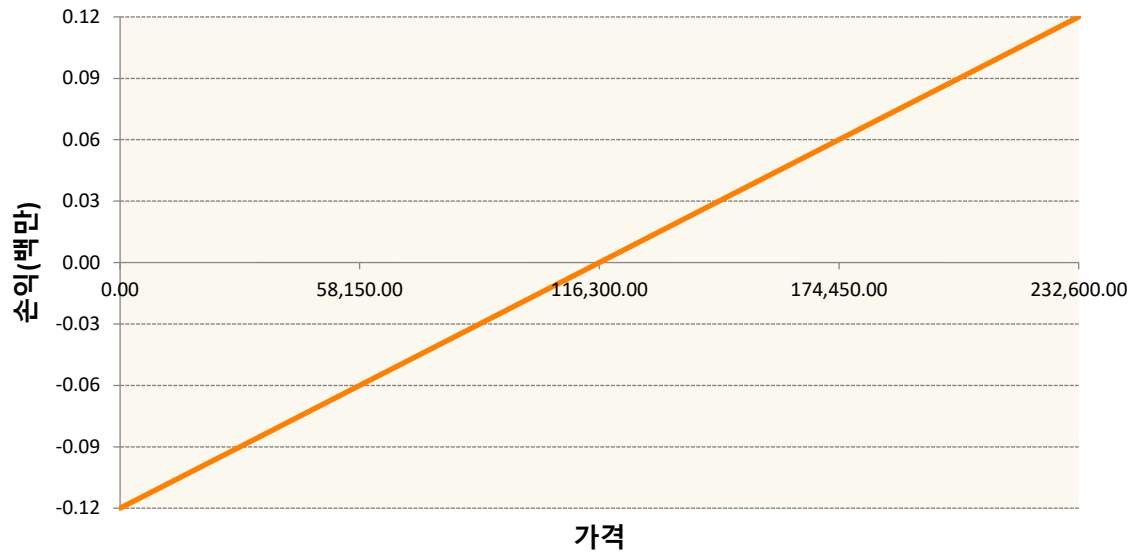
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



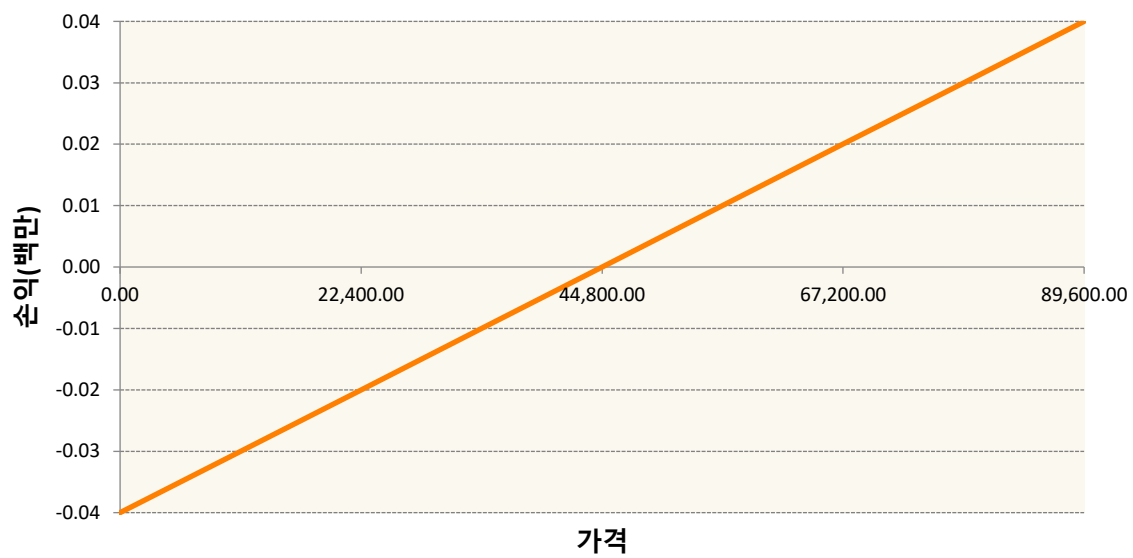
손익(백만)



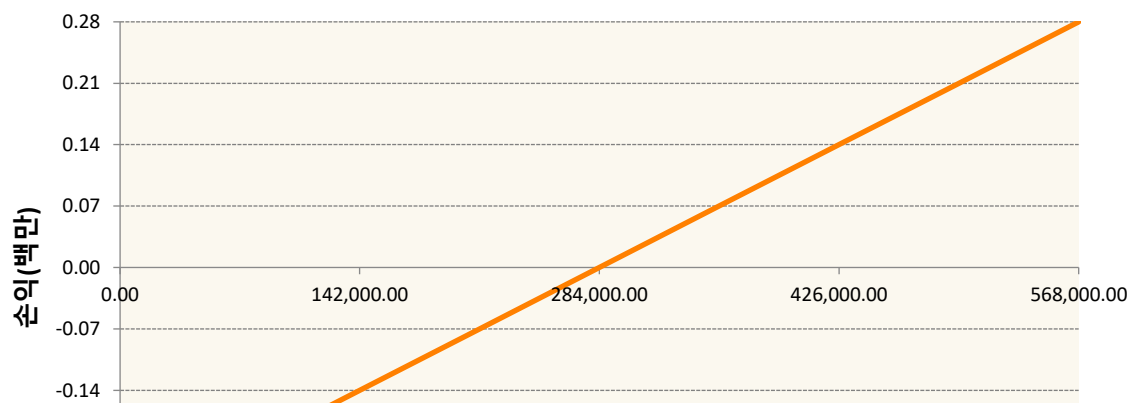
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물

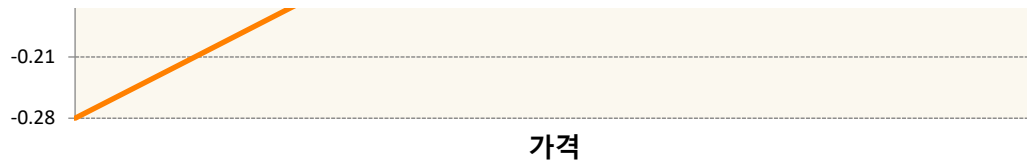


KR41EVW60008-2025-06 한화시스템개별선물

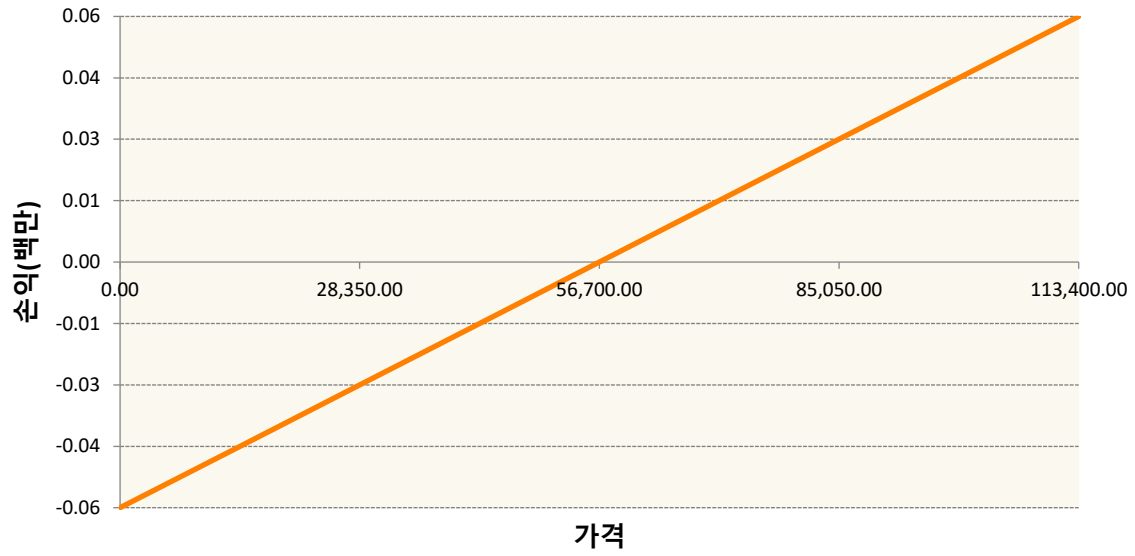


KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물

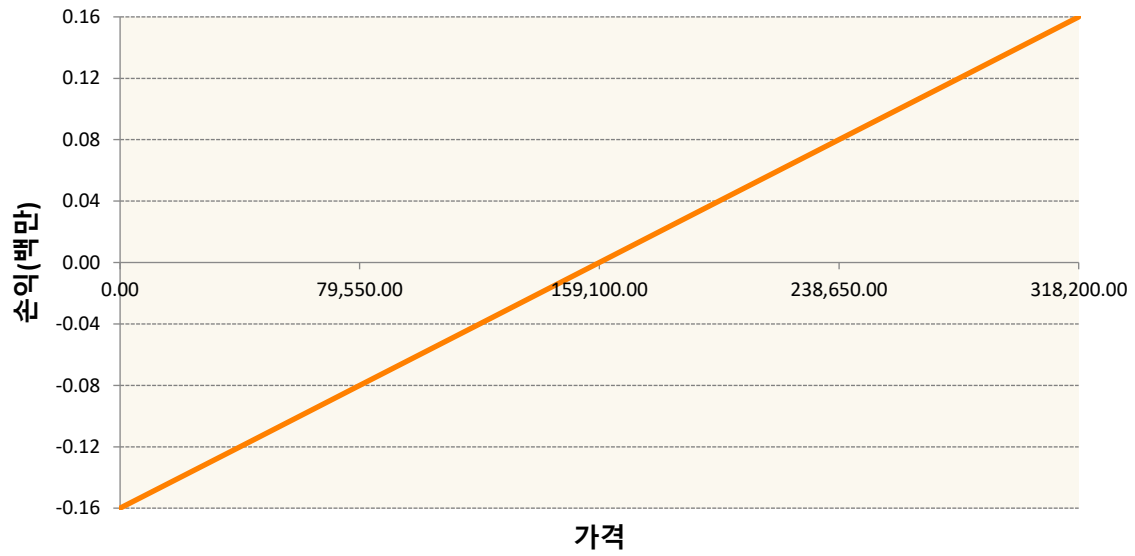




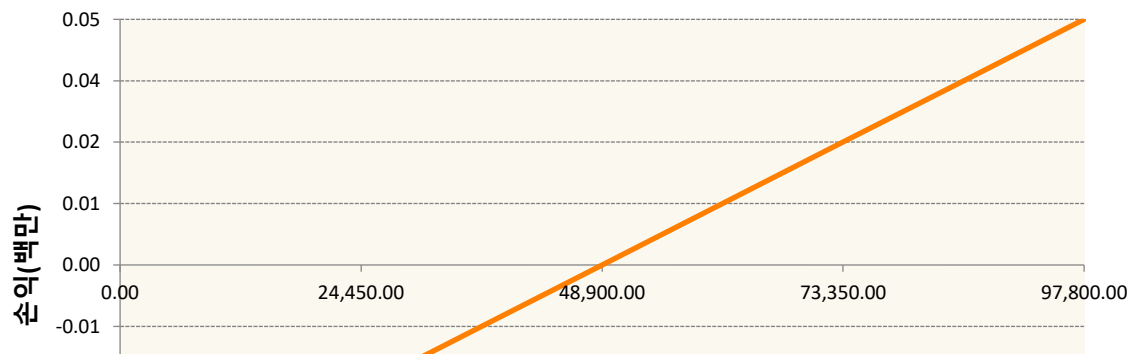
KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물

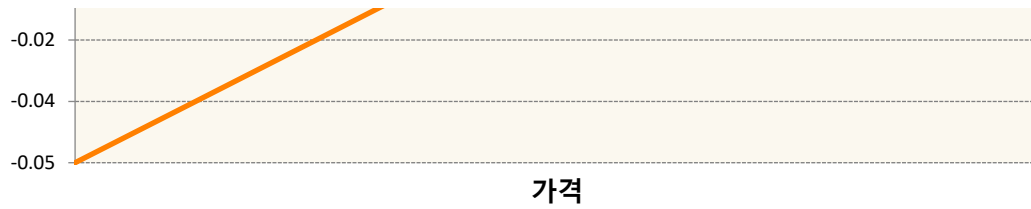


KR41FSW60001-2025-06 LS개별선물

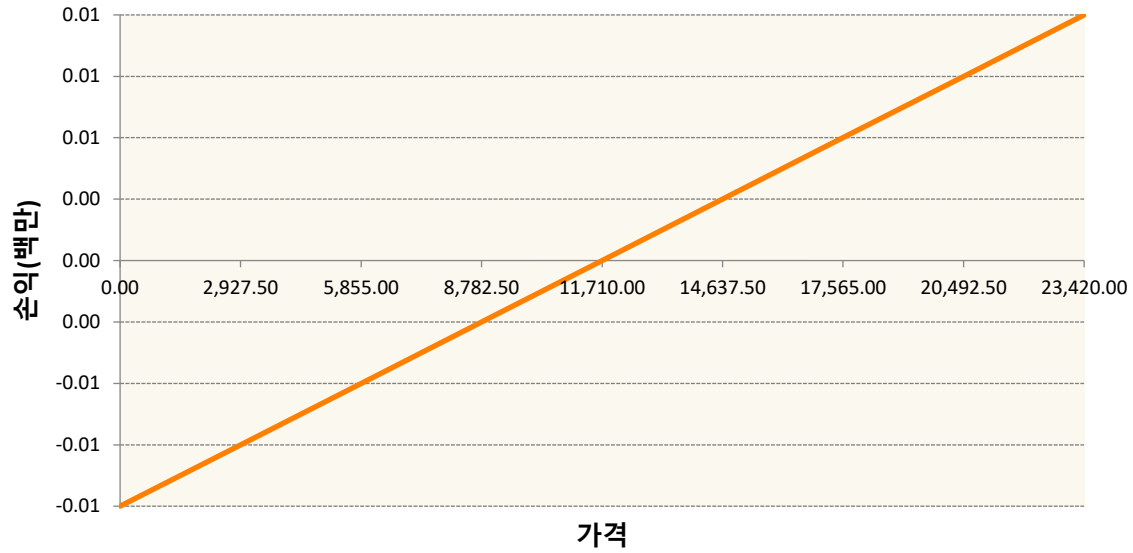


KR41G0W60005-2025-06 씨에스원드개별선물

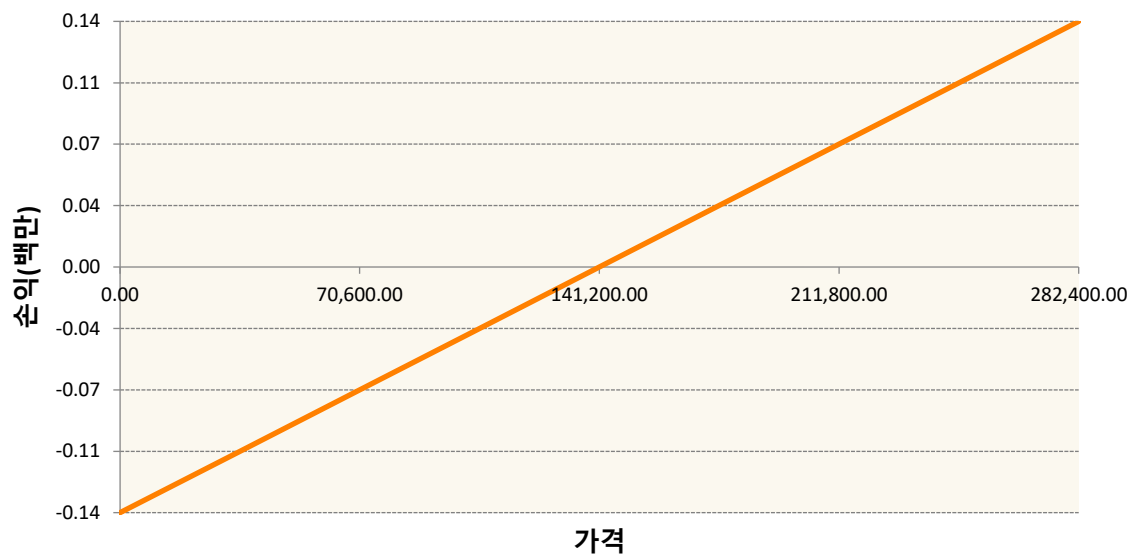




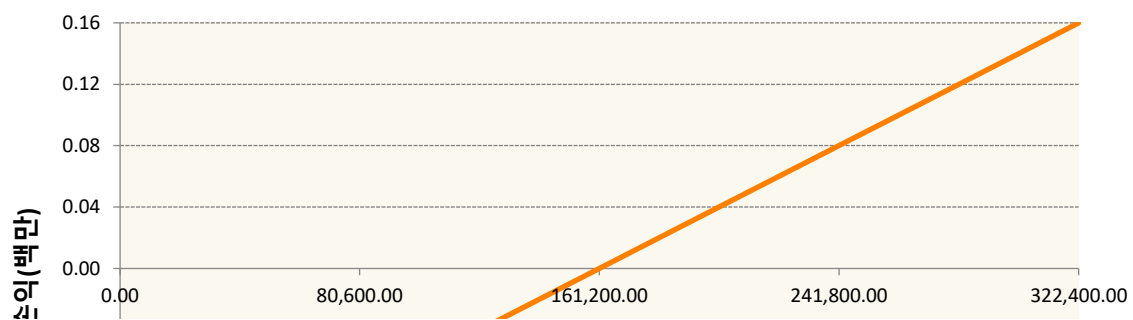
KR41G2W60001-2025-06 에스디바이오센서개별선물

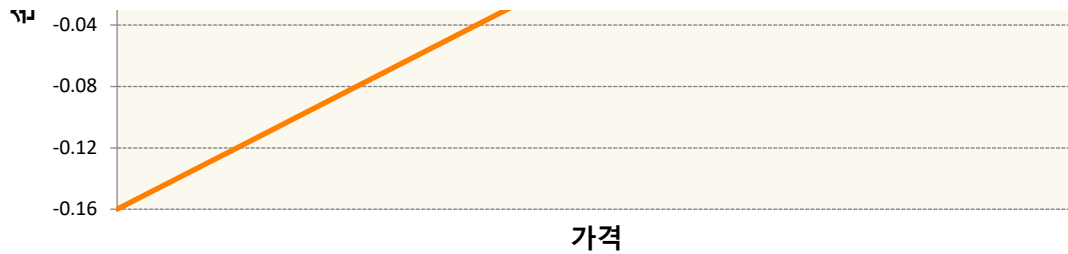


KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



KR41HEW60007-2025-06 키움증권개별선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	663
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물	6
KR410ZW60(2025-06 한미반도체개별선물	0.19
KR411SW60(2025-06 효성중공업개별선물	5
KR4148W60(2025-06 미래에셋증권개별선물	3
KR41B3W60(2025-06 고려아연개별선물	1
KR41C9W60(2025-06 한화개별선물	5
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물	11
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	34
KR41EVW60(2025-06 한화시스템개별선물	34
KR41F5W60(2025-06 LG에너지솔루션개별선물	99
KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물	11
KR41FSW60(2025-06 LS개별선물	1
KR41G0W60(2025-06 씨에스윈드개별선물	0.47
KR41G2W60(2025-06 에스디바이오센서개별선물	4
KR41G5W60(2025-06 한진칼개별선물	68
KR41HEW60(2025-06 키움증권개별선물	21

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

(단위:백만원)

1,696

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

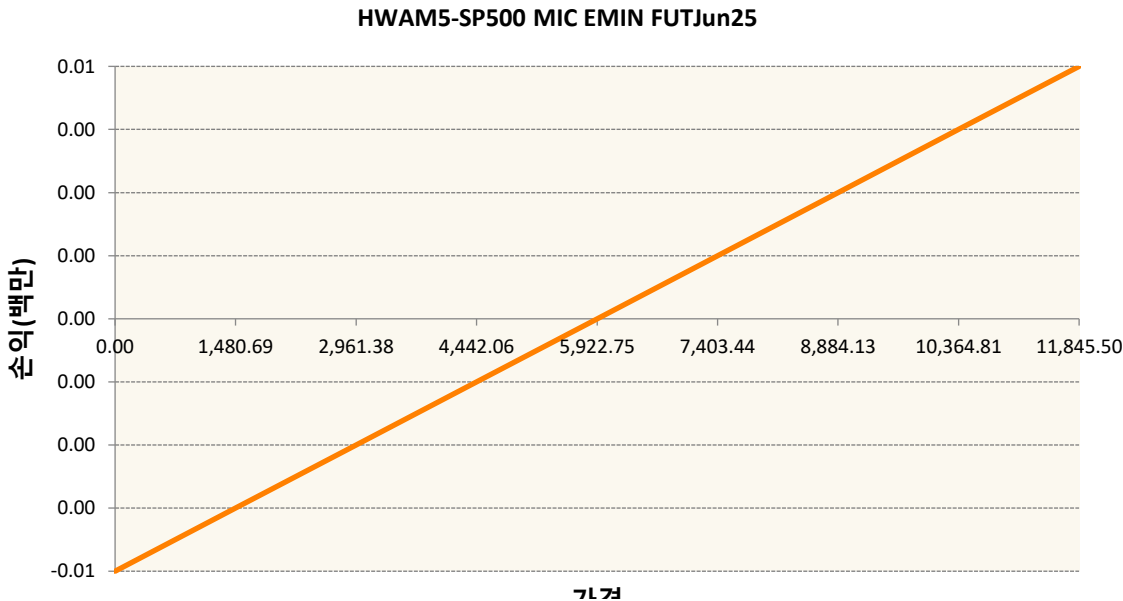
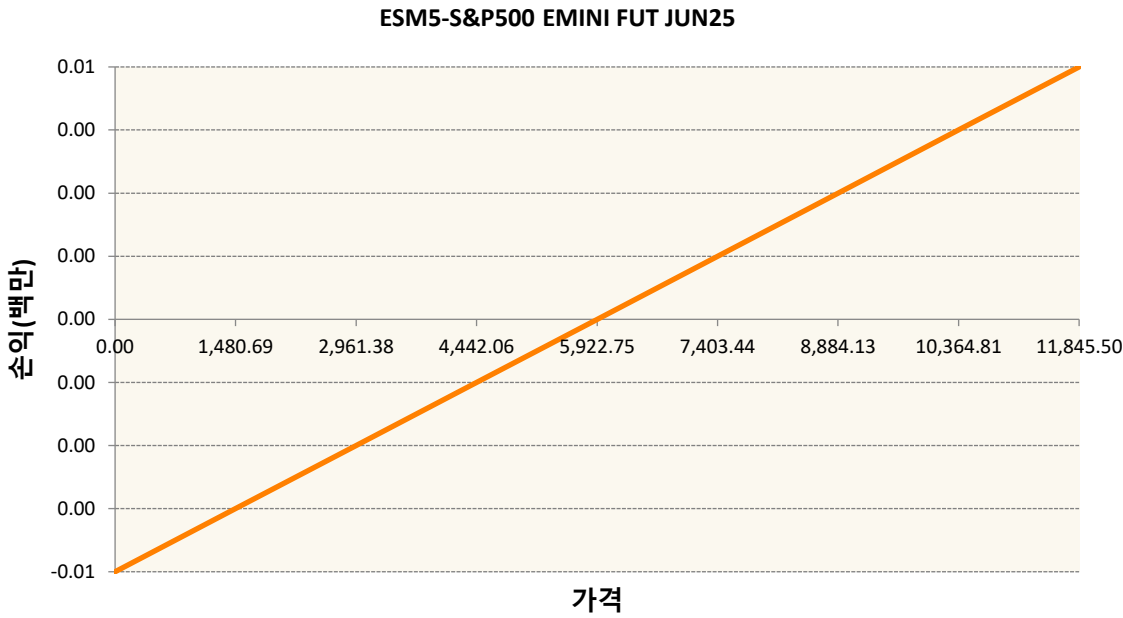
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,895	0	1,895	장내
누계	지수	선물	31,309	0	31,309	

2. 만기시점의 손익구조



가액

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25		2,505
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25		152

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			2,351

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

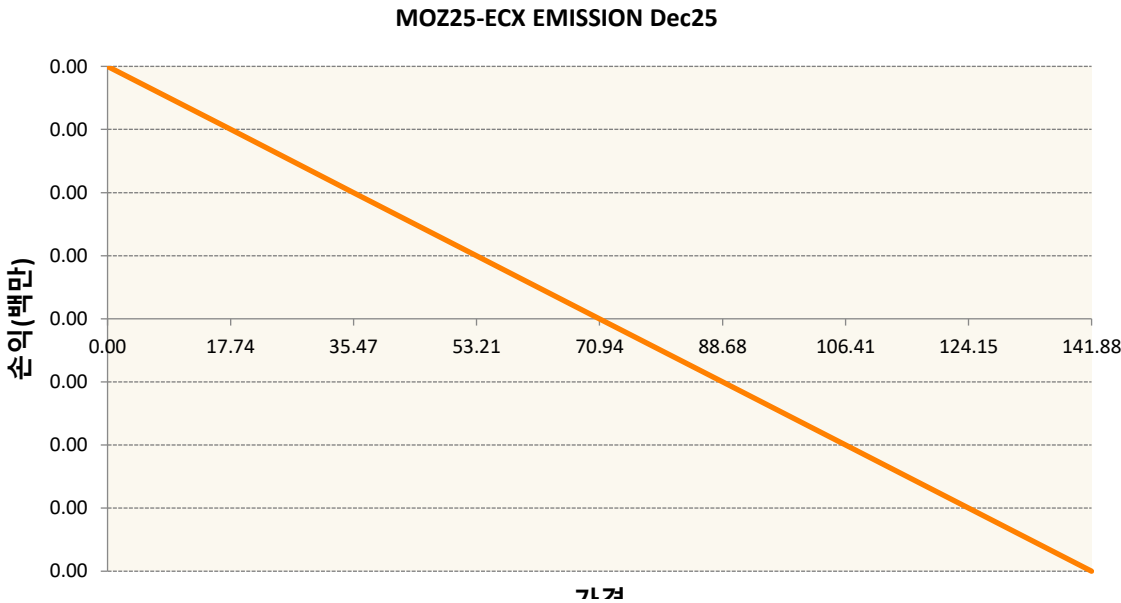
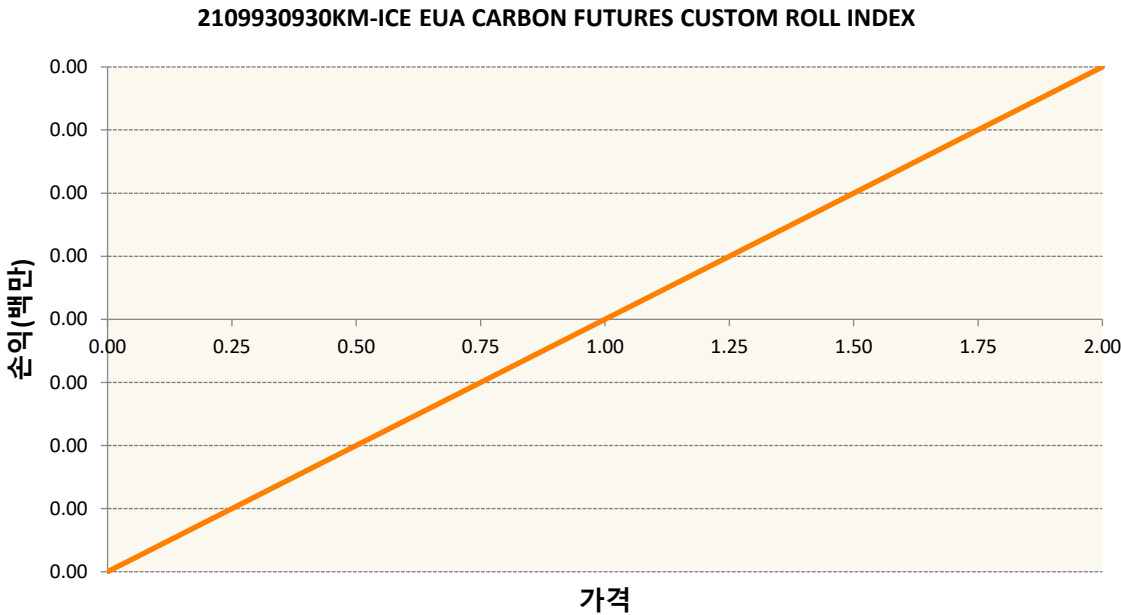
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	0	5,016	-5,016	
누계	통화	선도	0	950	-950	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930IICE	EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.12
FXW213F5V(	KRW/EUR 30-06-25E	76
MOZ25	ECX EMISSION Dec25	401

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	745

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

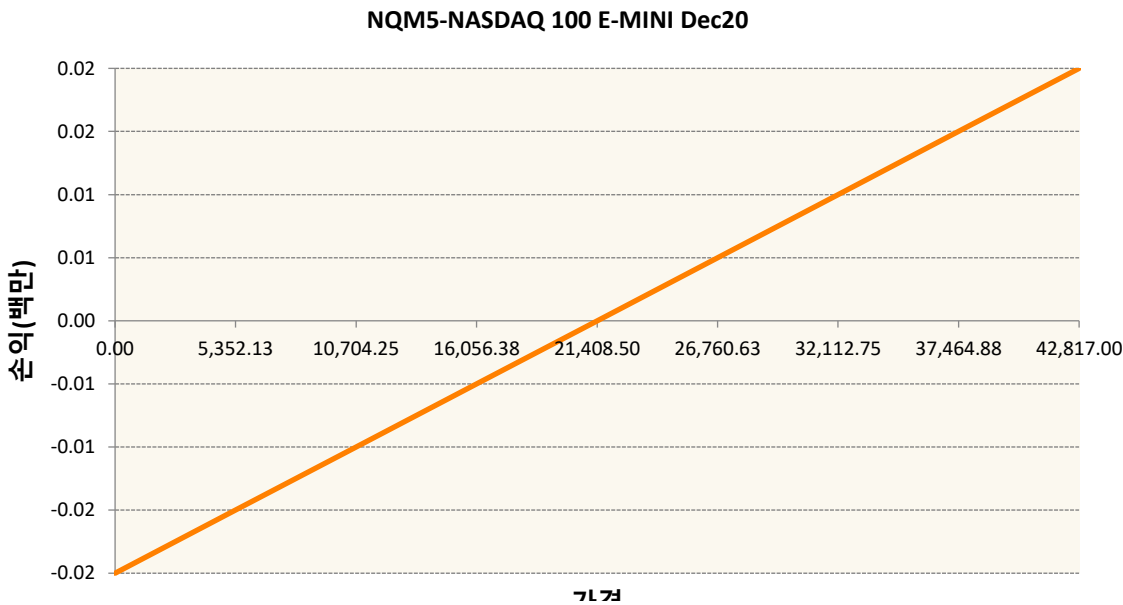
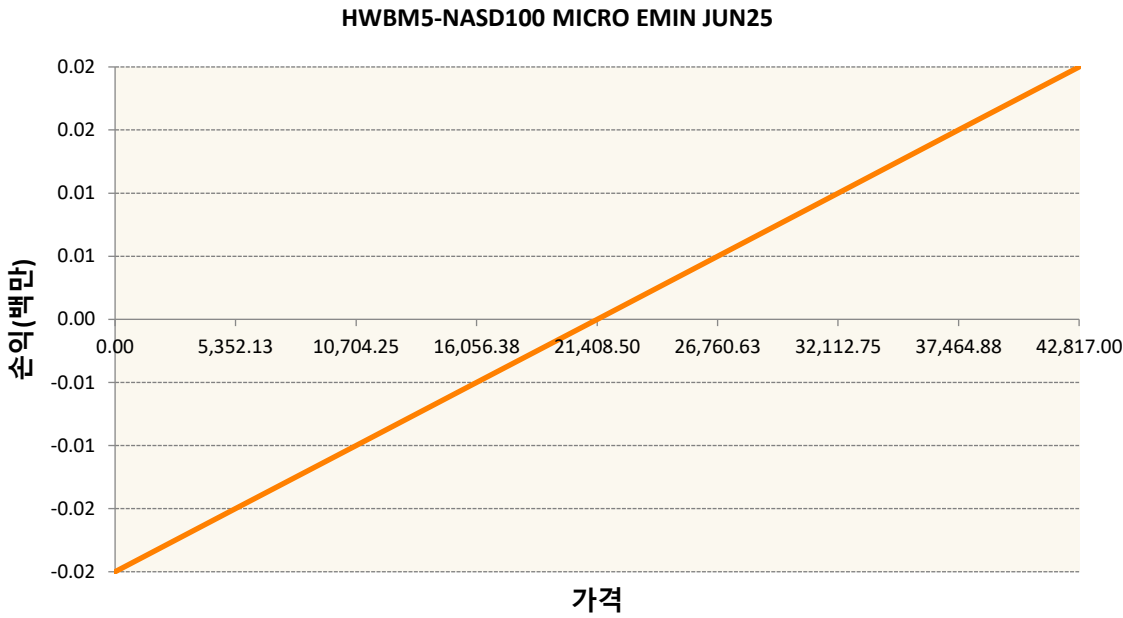
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,290	0	14,290	
누계	유가증권	선물	647	0	647	장내

2. 만기시점의 손익구조



가액

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25	52
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,143

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,363

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

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	2,953
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,523
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,676
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	905
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	158

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

(단위:백만원)

9,711

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

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	14
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	14
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	14
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	14

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

(단위:백만원)

77

공시일	2025-06-02
기준일	2025-05-30

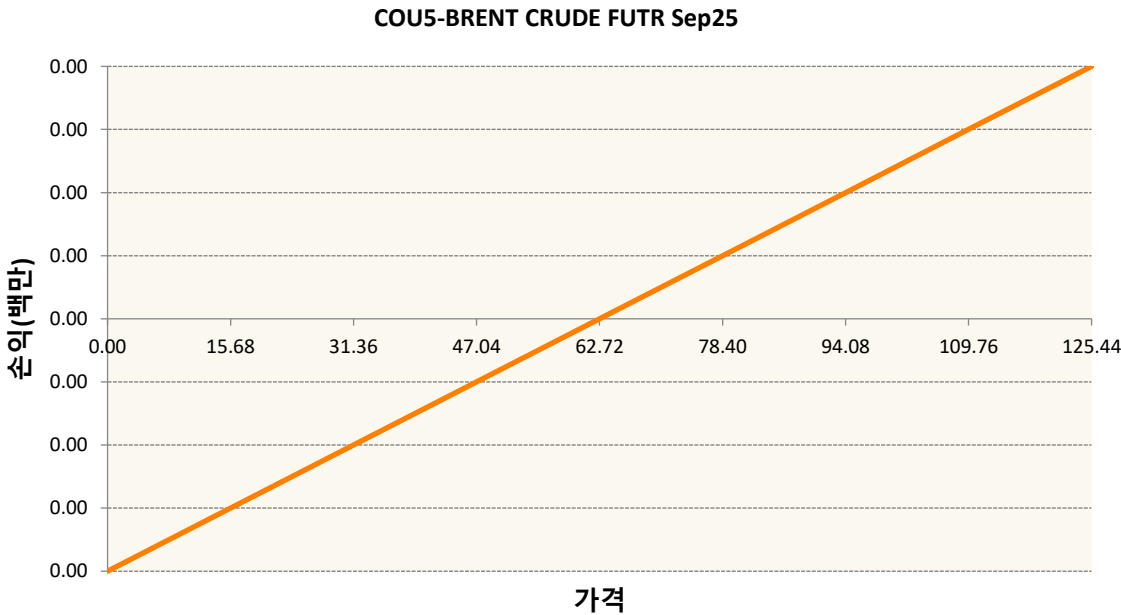
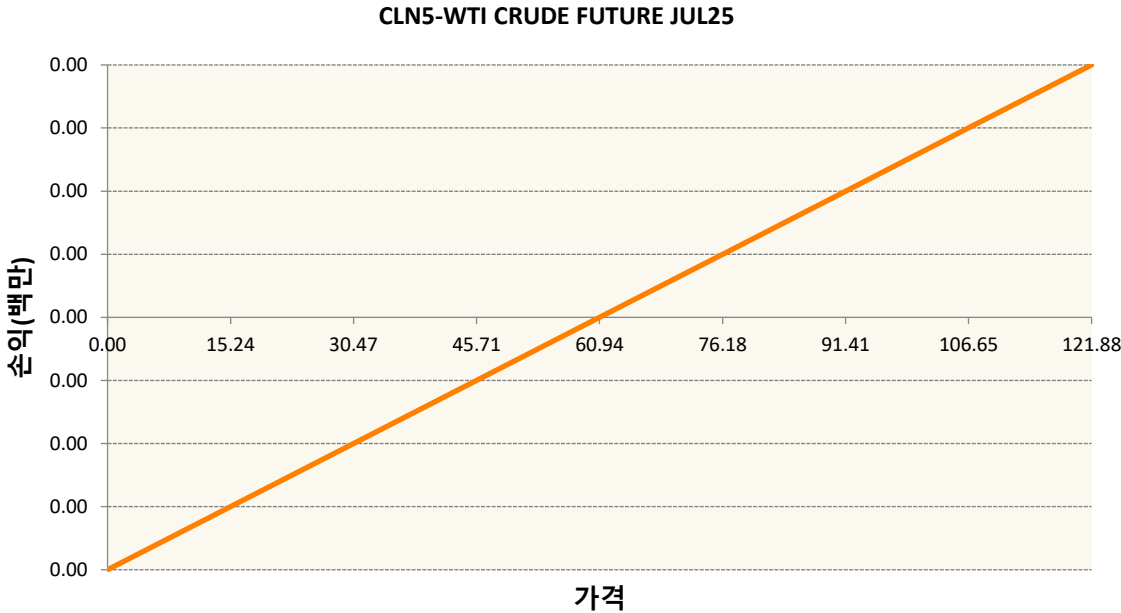
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

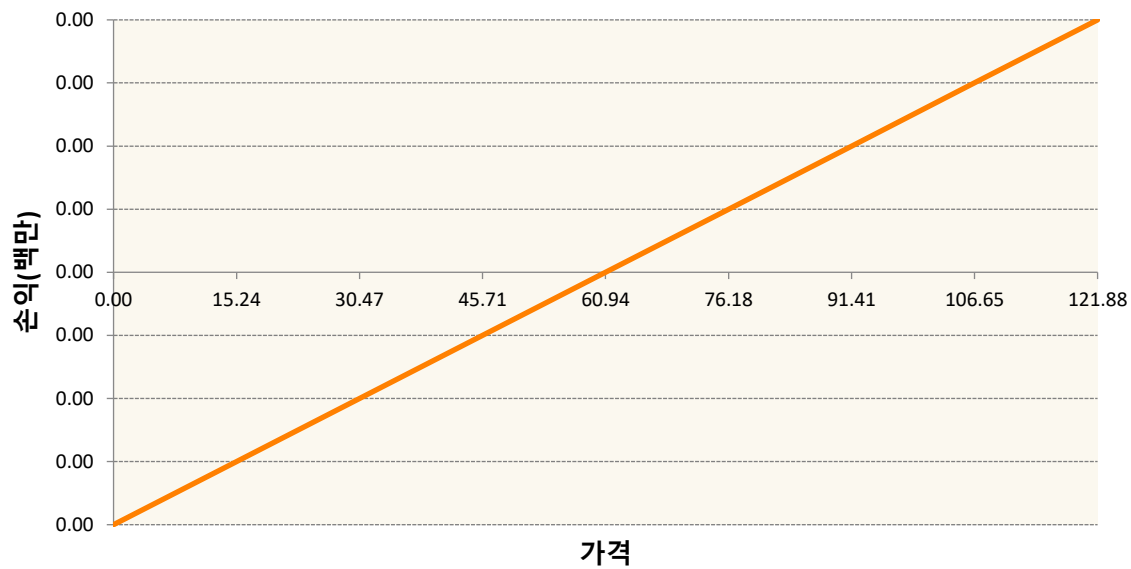
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	14	0	14	장내
누계	유가증권	선물	654	0	654	
누계	통화	선물	0	69	-69	장내

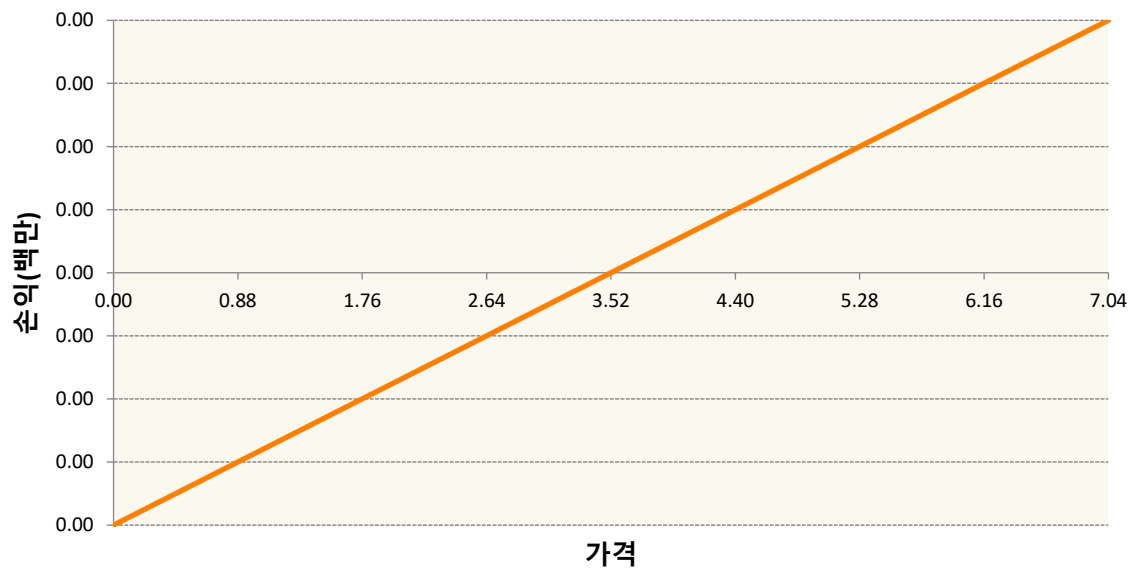
2. 만기시점의 손익구조



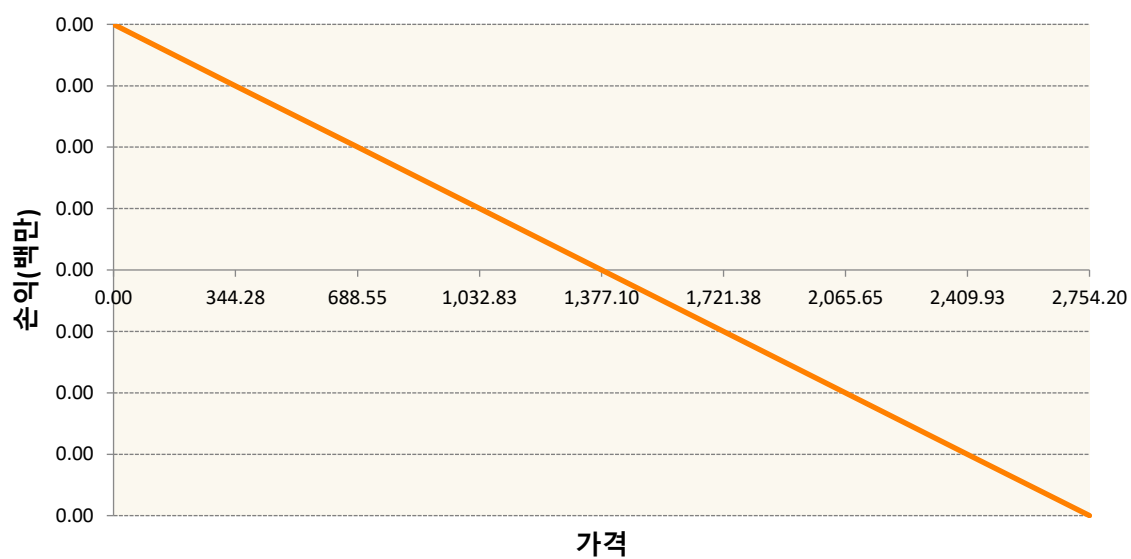
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



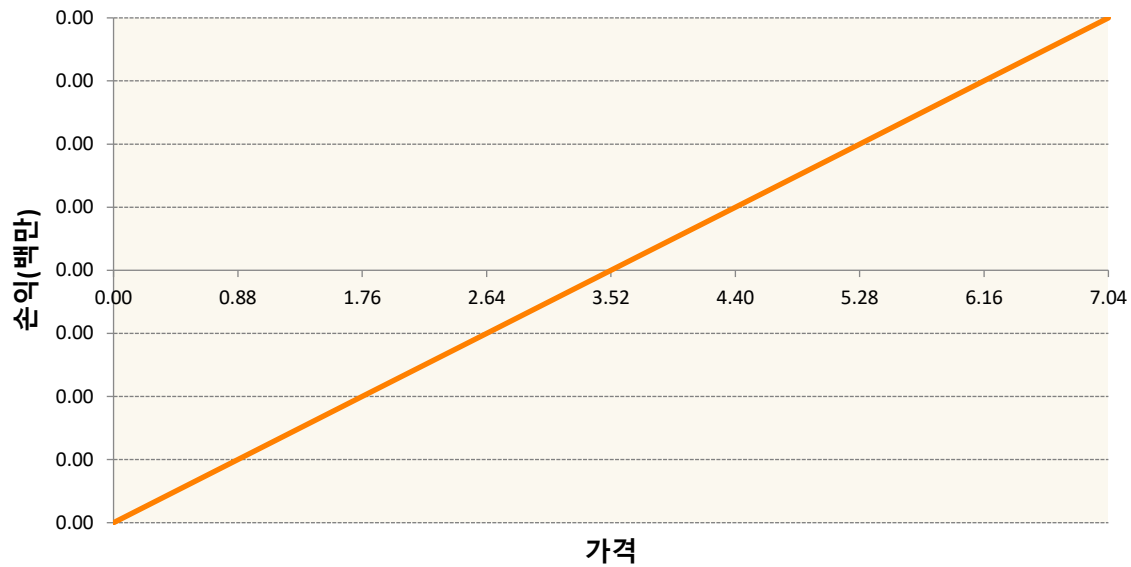
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



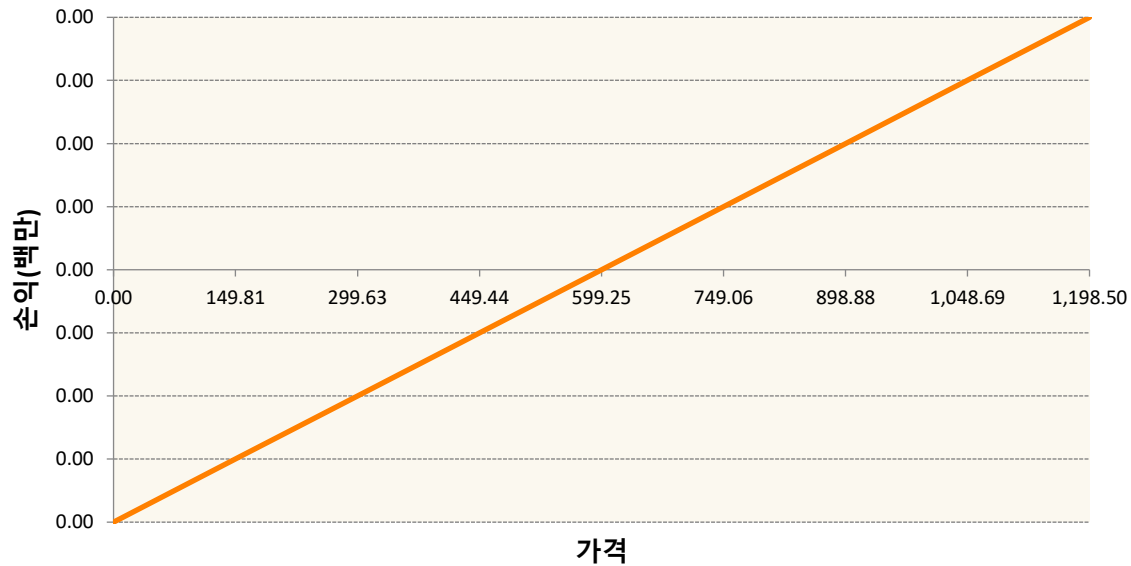
KR4175W60004-2025-06 달러선물



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	8
KR4175W60(2025-06 달러선물		6
NGN25	NATURAL GAS FUTR JUL25	12
QSN5	Low Su Gasoil G JUL25	7

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

(단위:백만원)

124