

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

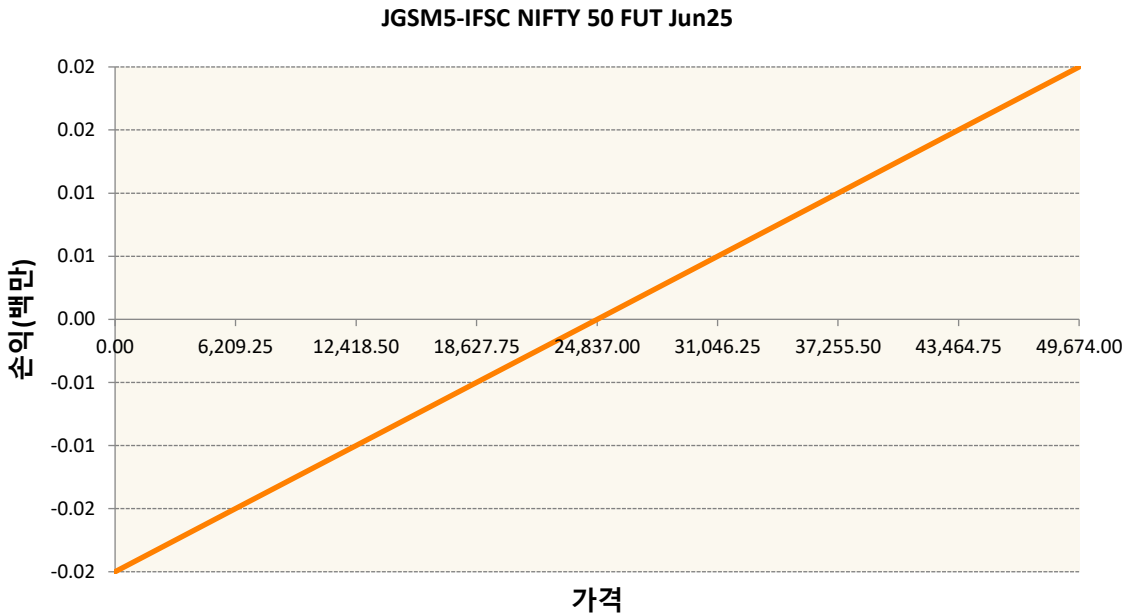
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,641 | 0     | 1,641     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |     |
|-------|-------------------------|-----|
| JGSM5 | IFSC NIFTY 50 FUT Jun25 | 131 |
|-------|-------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 98 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

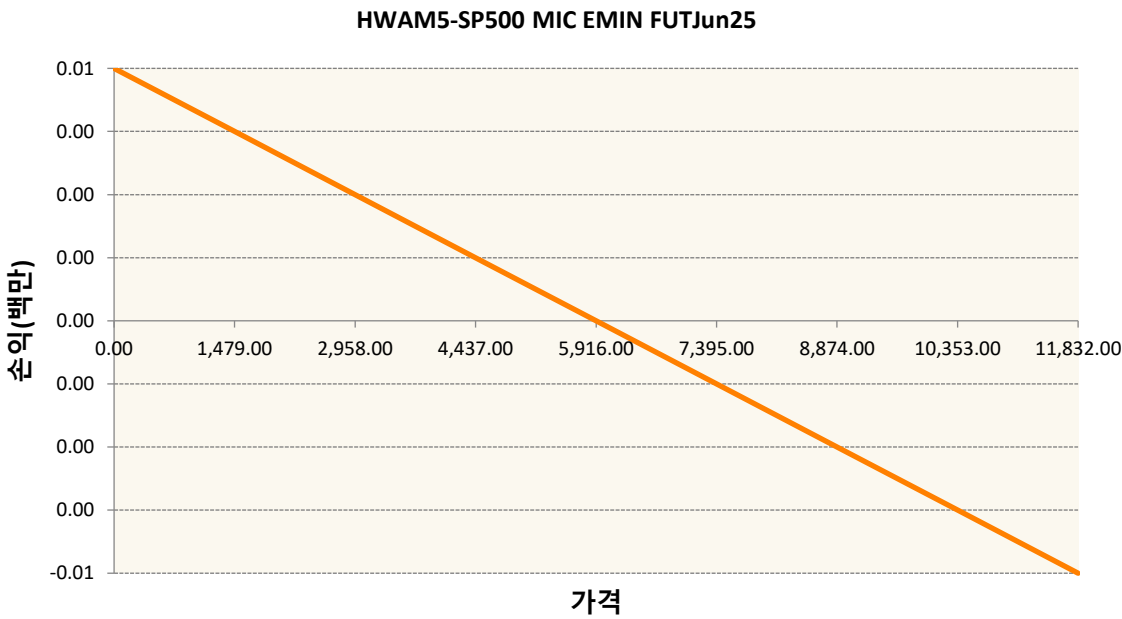
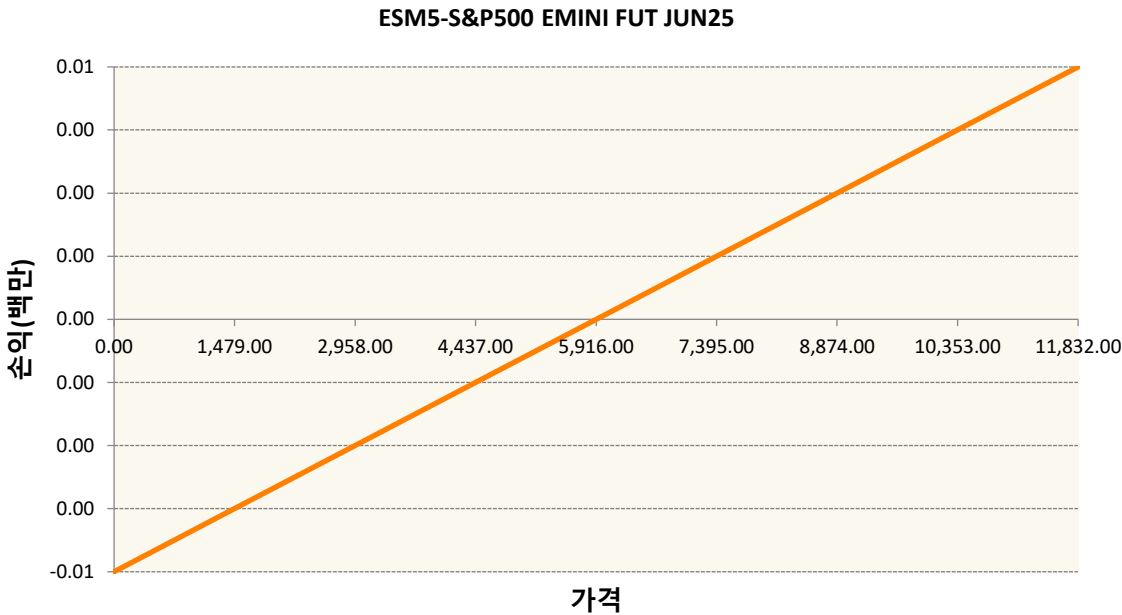
# SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

## 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 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

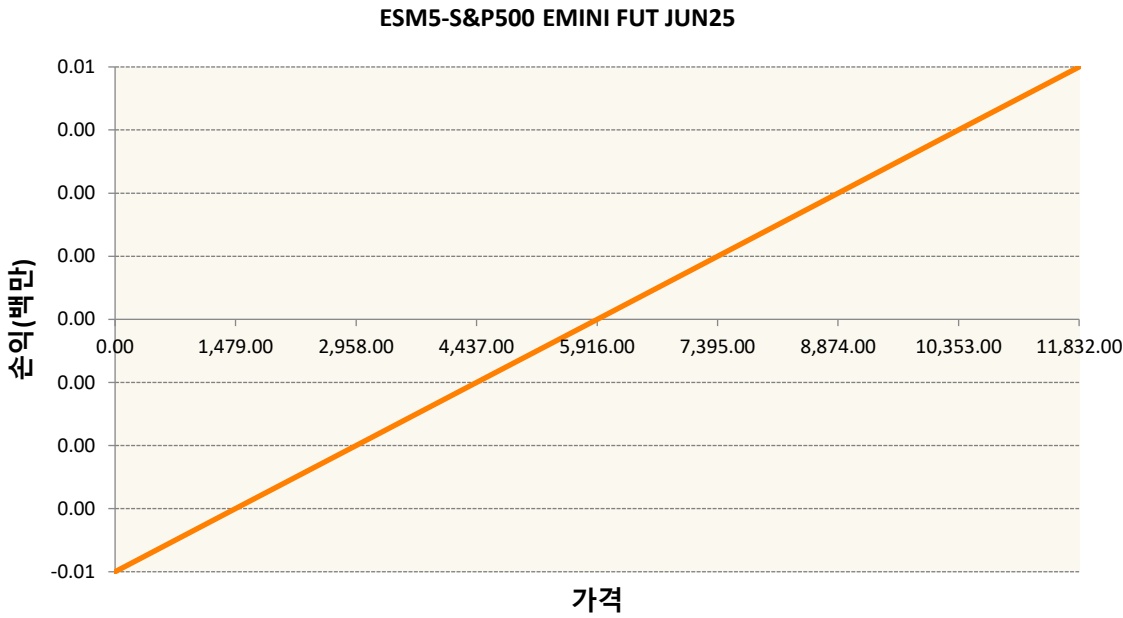
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,295 | 0     | 1,295     |    |

### 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 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

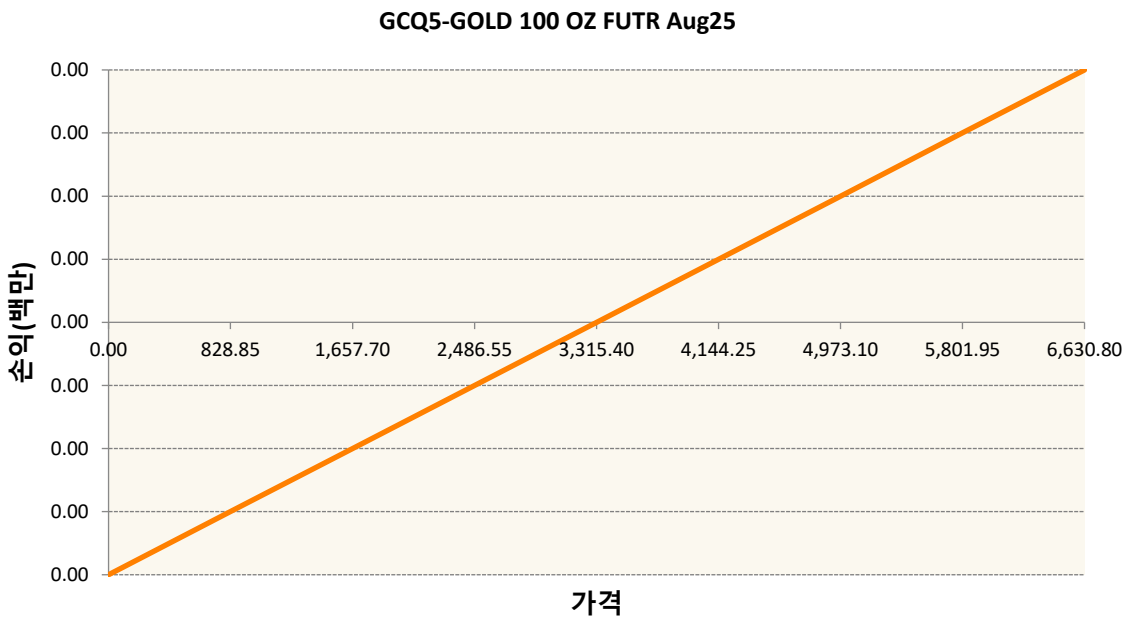
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 2,280 | 0     | 2,280     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| AOGLDUSC3 GLD US 06/09/25 C310 EQUITY | 1   |
| GQC5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25           | 182 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 155 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

## 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 06/13/25 C125 EQUITY |  | 7        |
| AOPLTRUSP1 PLTR US 06/13/25 P125 EQUITY |  | 2        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 33       |

공시일 2025-06-04

기준일 2025-06-02

## 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 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

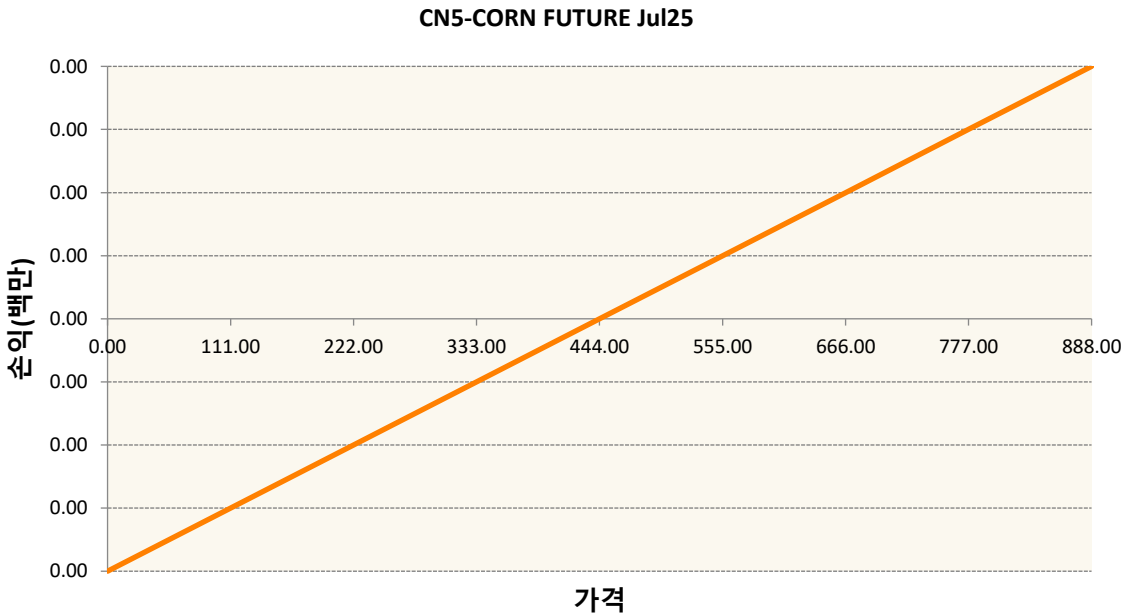
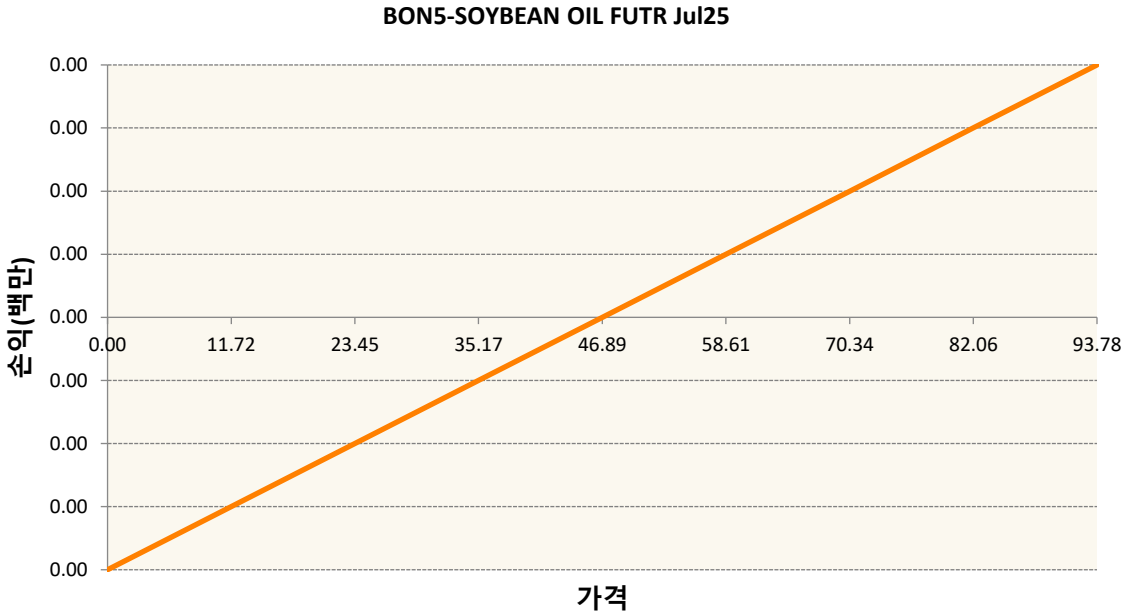
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

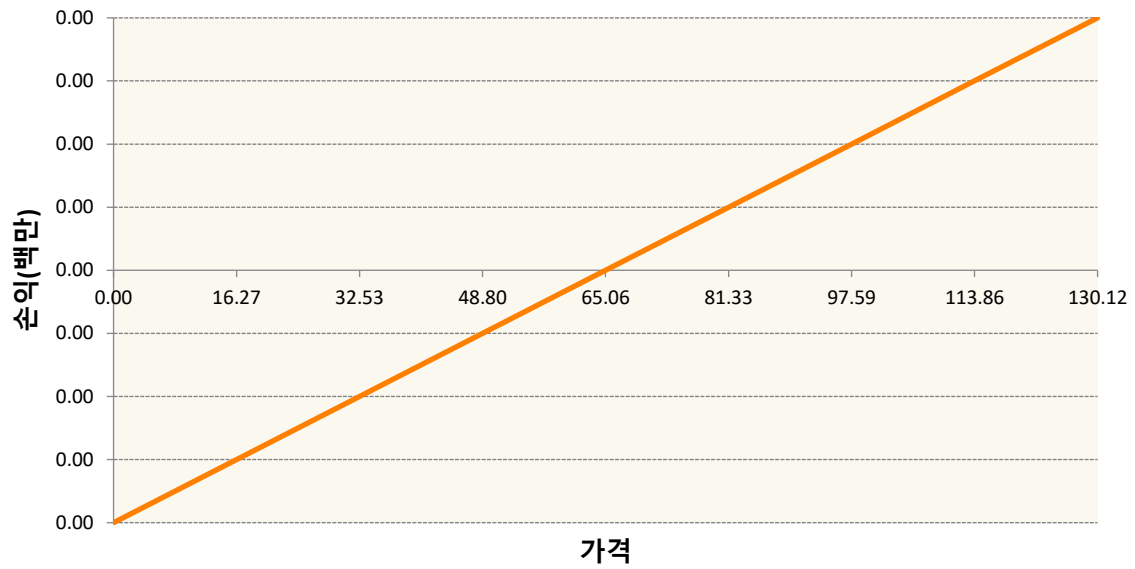
(단위:USD 백만)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 41    | 0     | 41        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,818 | 0     | 3,818     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 260   | -260      | 장내 |

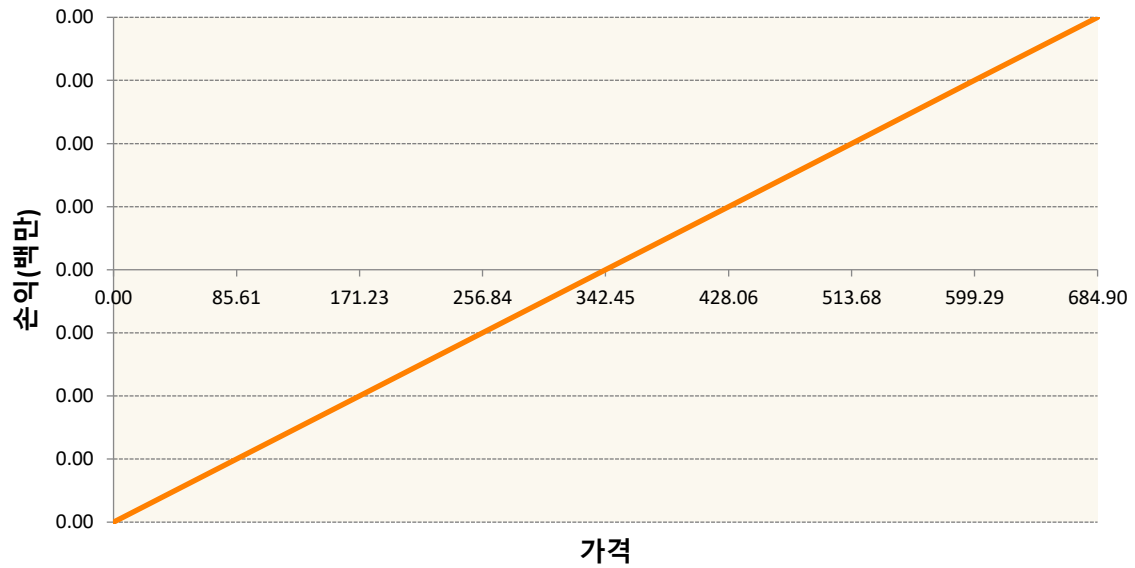
### 2. 만기시점의 손익구조



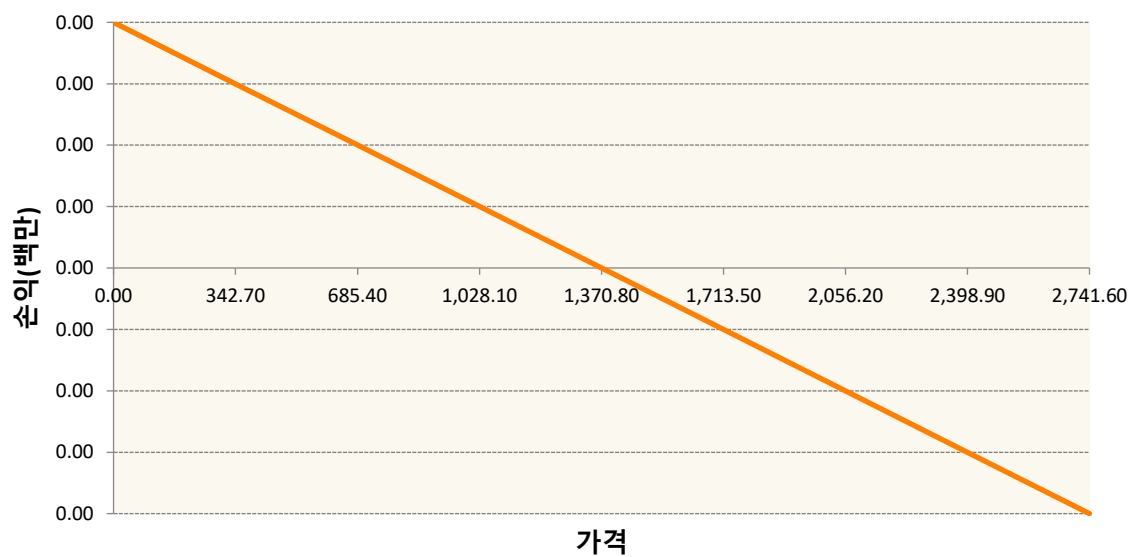
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



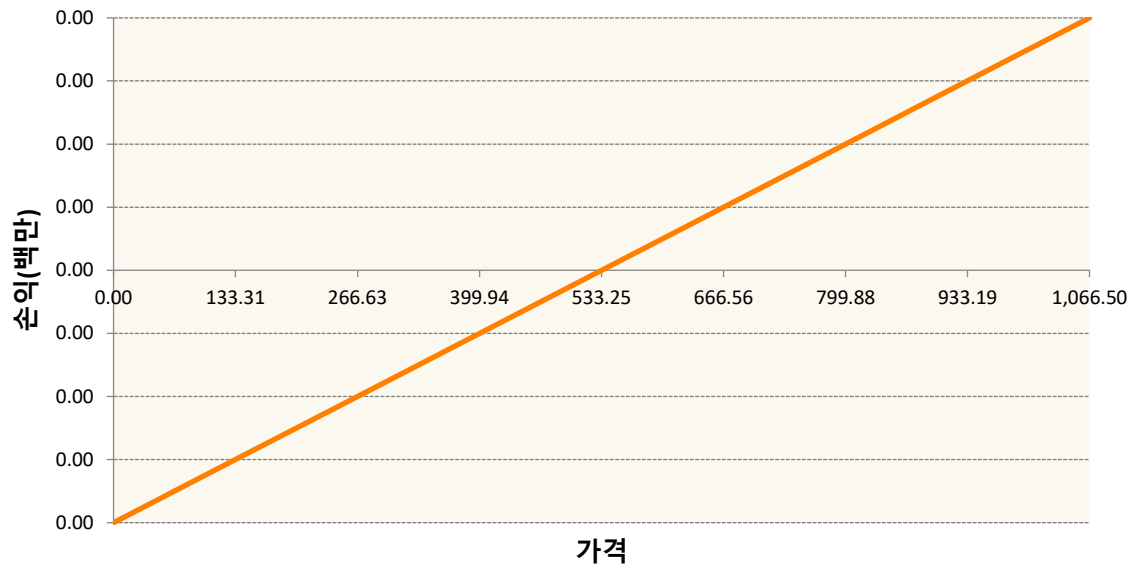
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



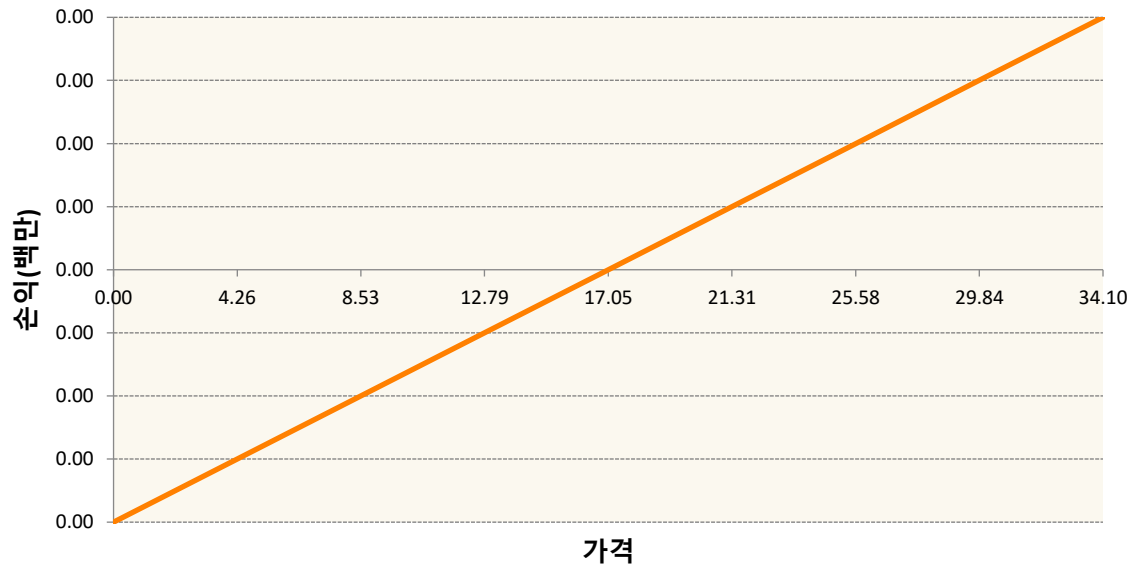
KR4175W60004-2025-06 달러선물



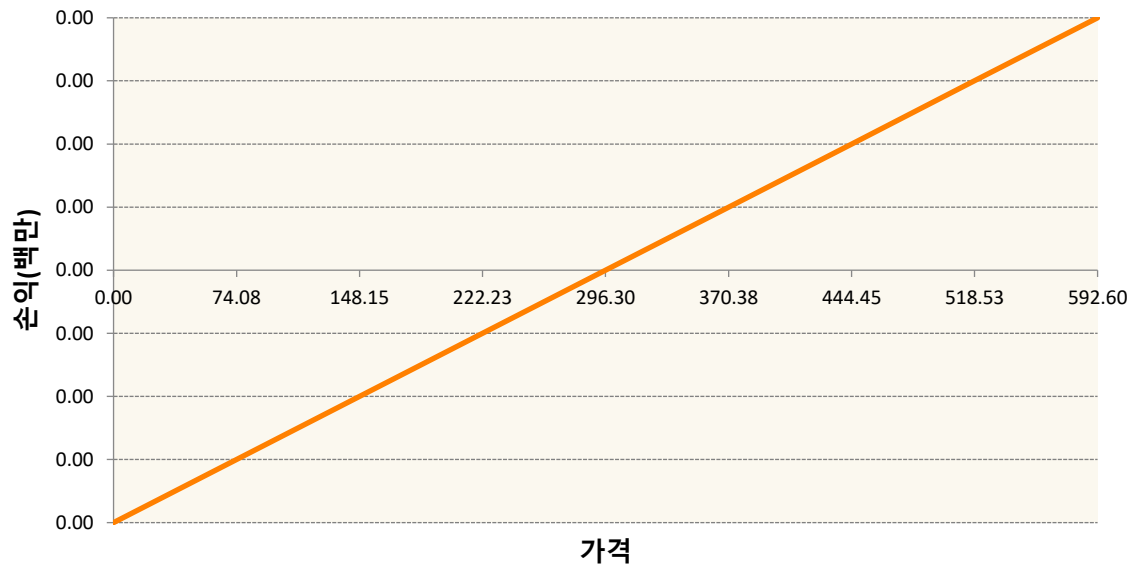
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25



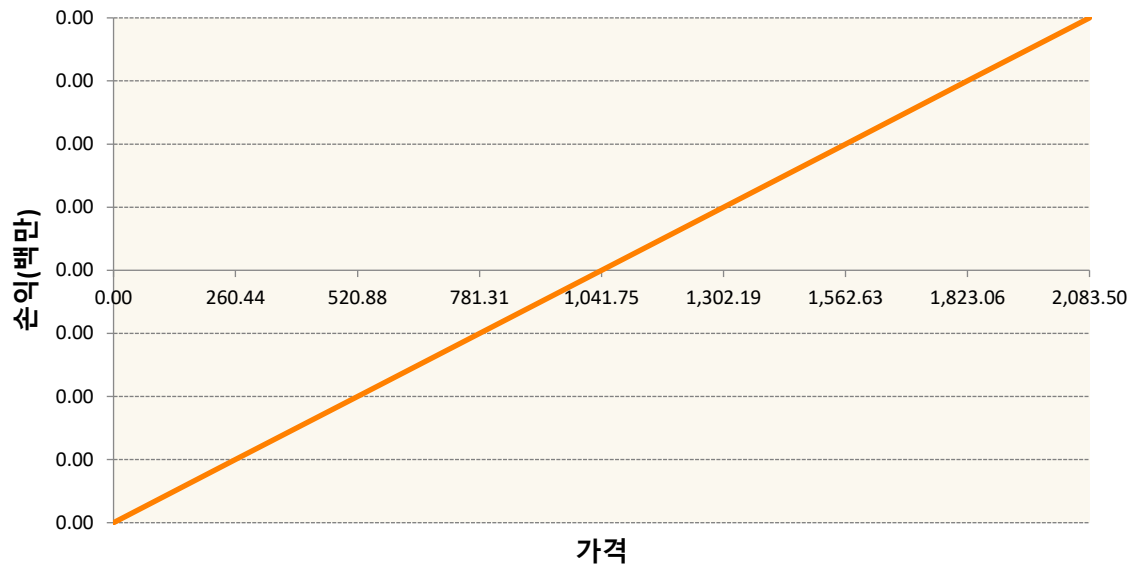
SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



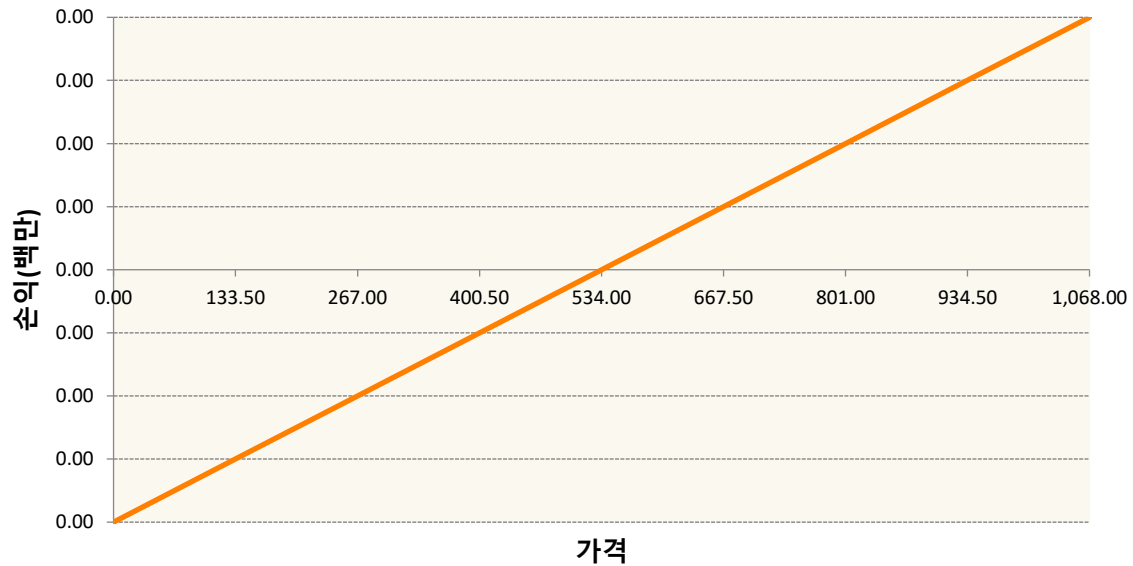
SMN5-SOYBEAN MEAL FUTR Jul25



SN5-SOYBEAN FUTURE Jul25



WN5-WHEAT FUTURE(CBT) 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 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

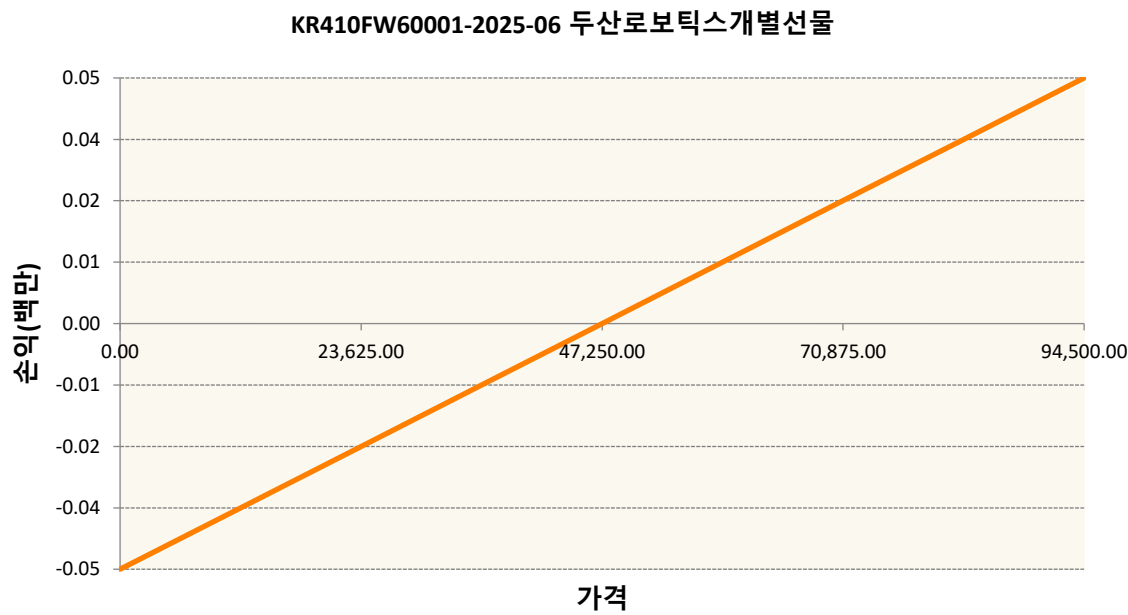
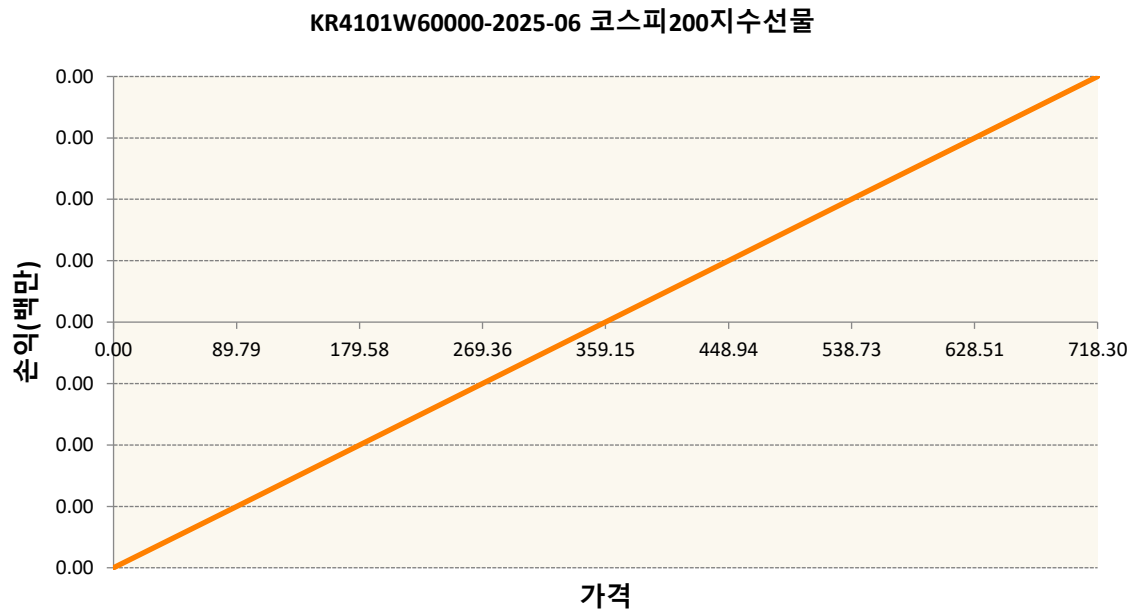
스마트인덱스모

1. 계약금액

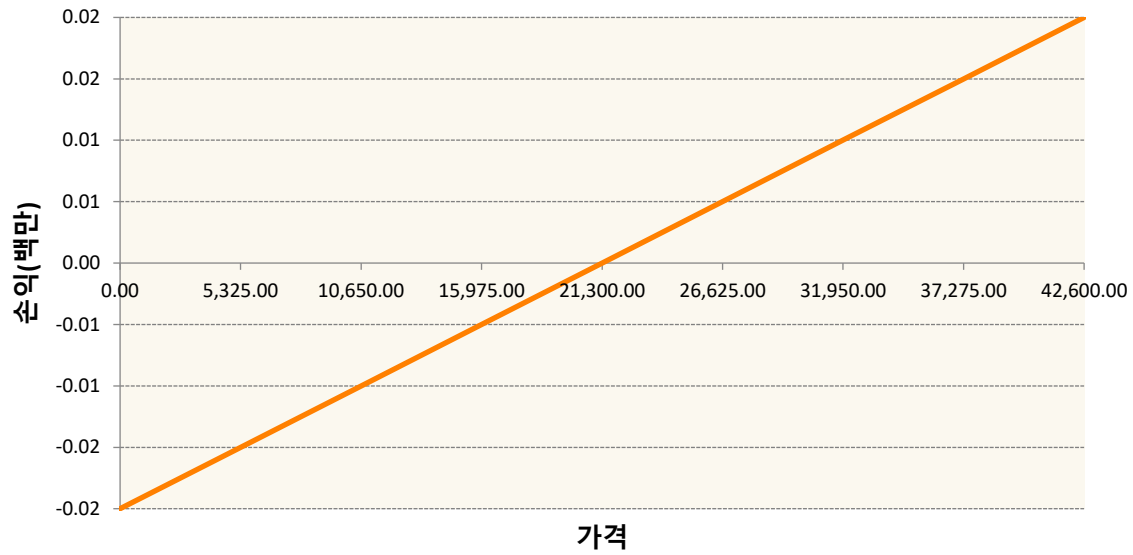
(단위:백만원)

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

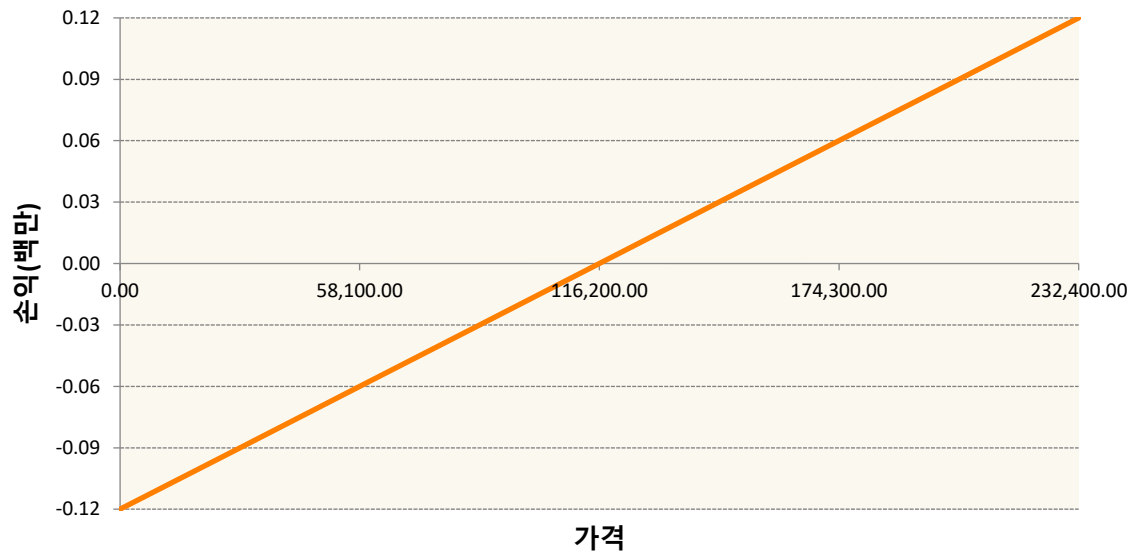
2. 만기시점의 손익구조



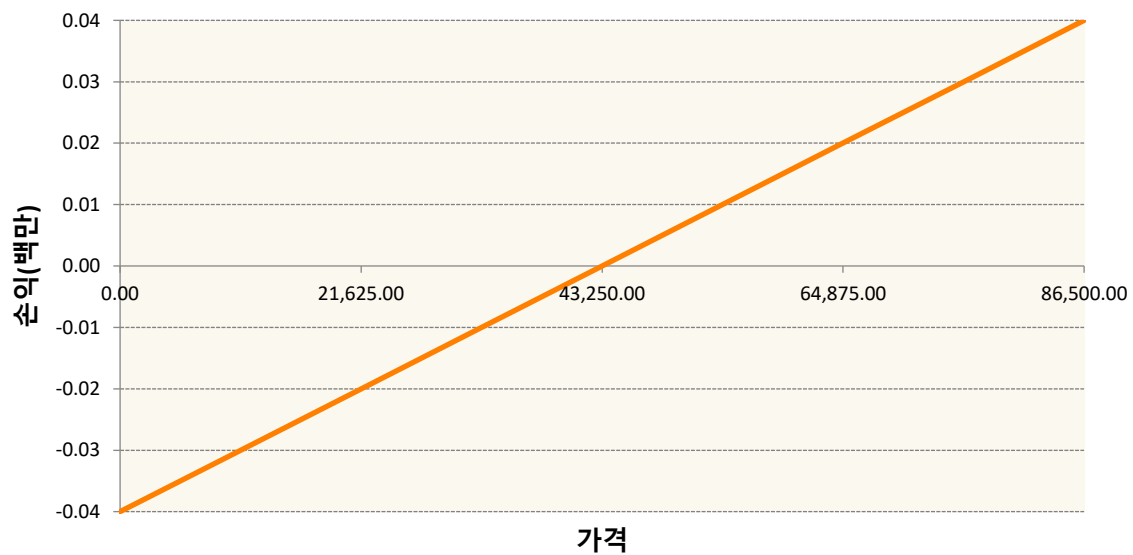
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



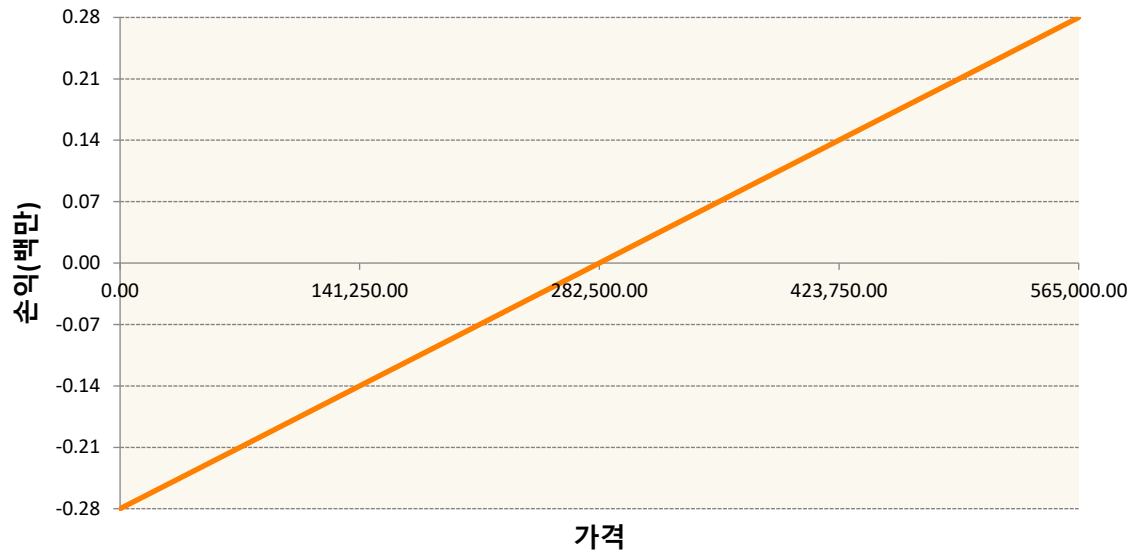
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



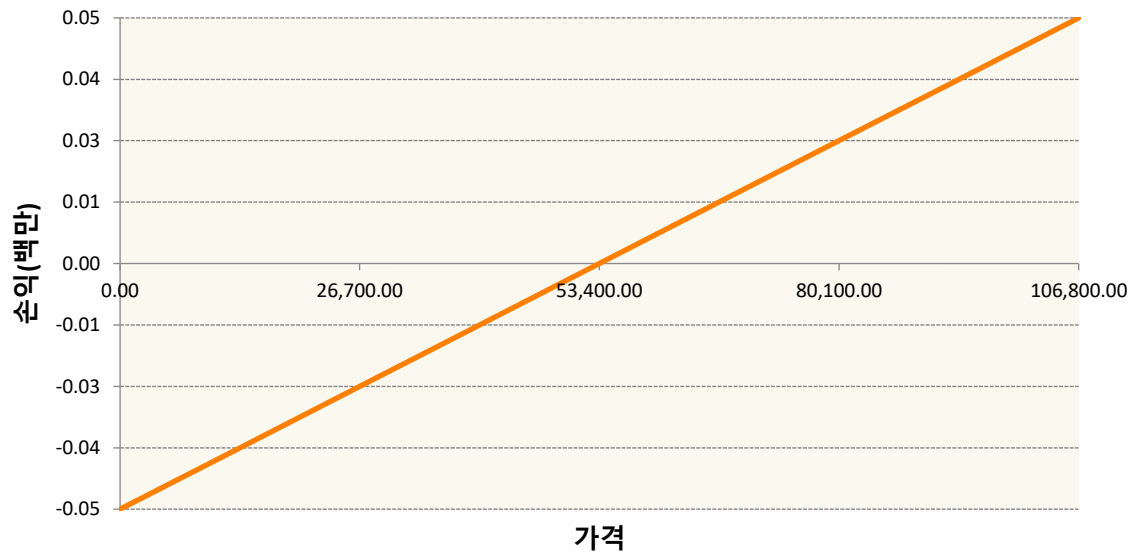
KR41EVW60008-2025-06 한화시스템개별선물



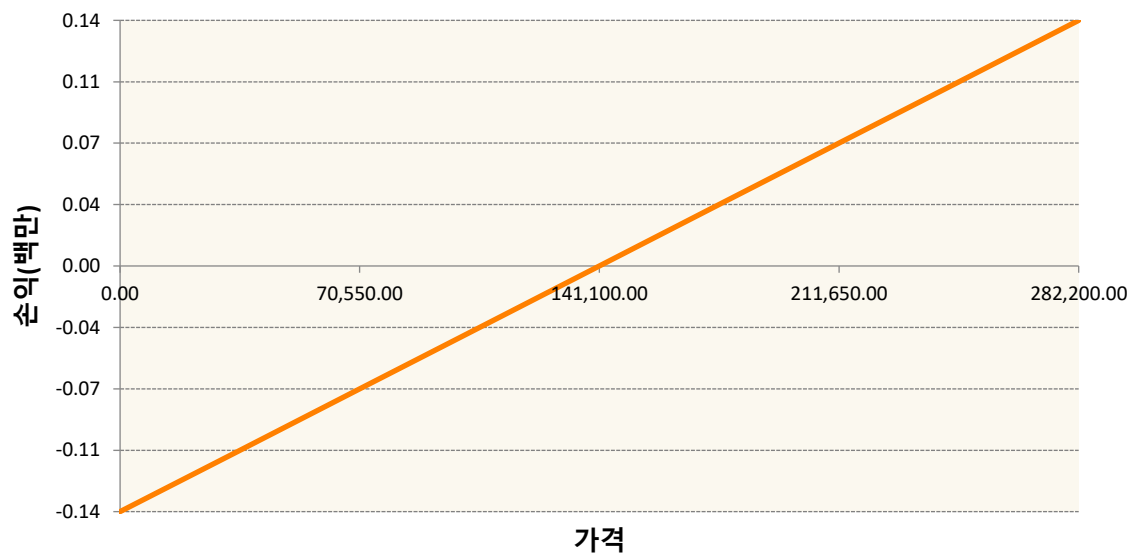
KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



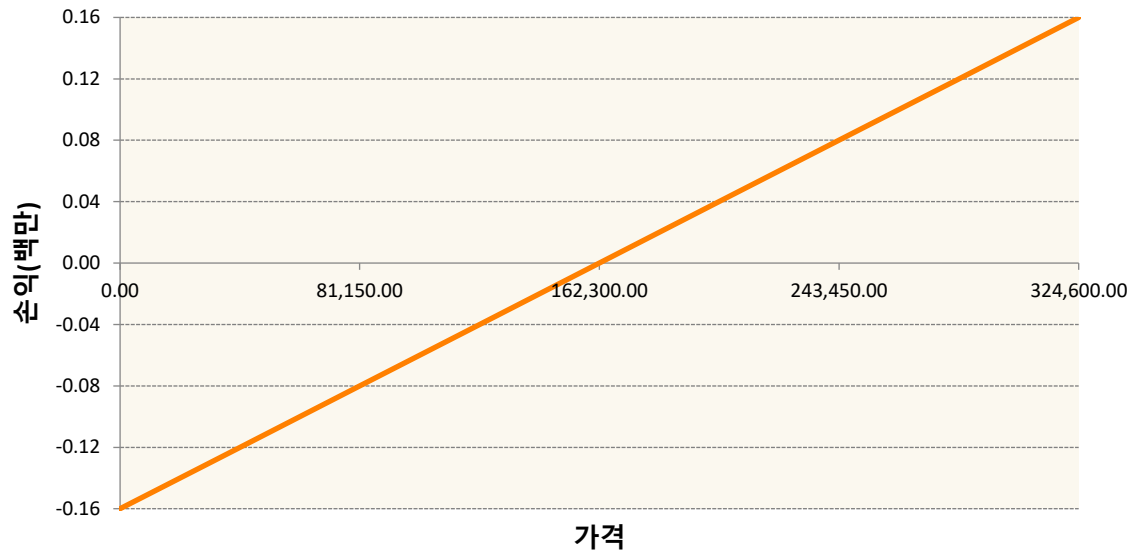
KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물



KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



### KR41HEW60007-2025-06 키움증권개별선물



### 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)

182

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

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

293

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

473

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

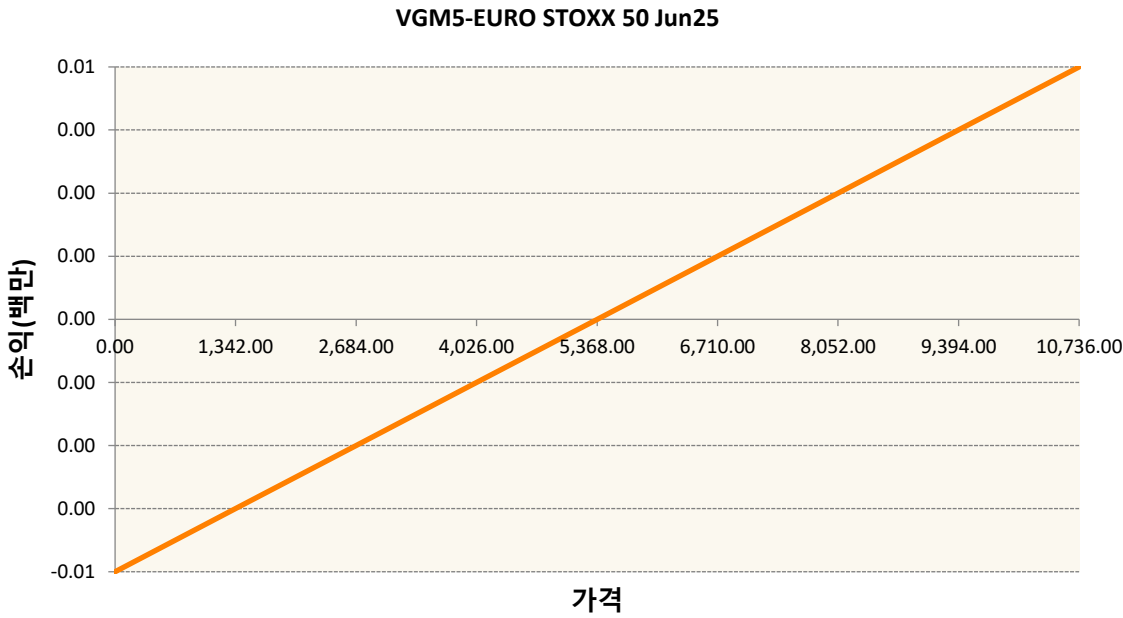
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,025 | 0     | 1,025     |    |

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 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

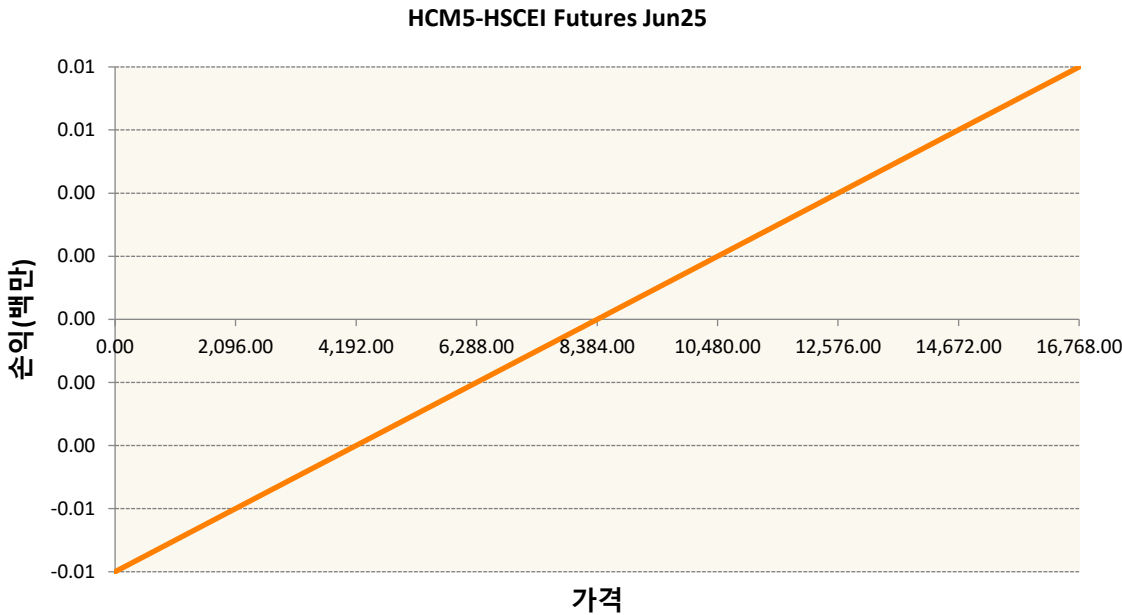
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 2,429 | 0     | 2,429     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCM5 | HSCEI Futures Jun25 | 194 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 289 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

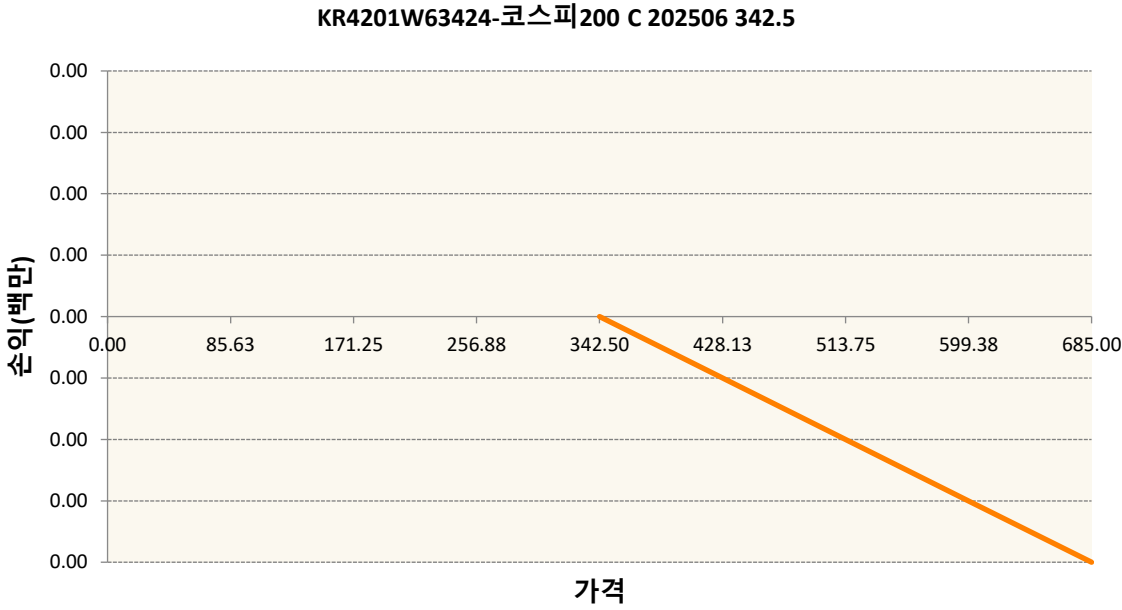
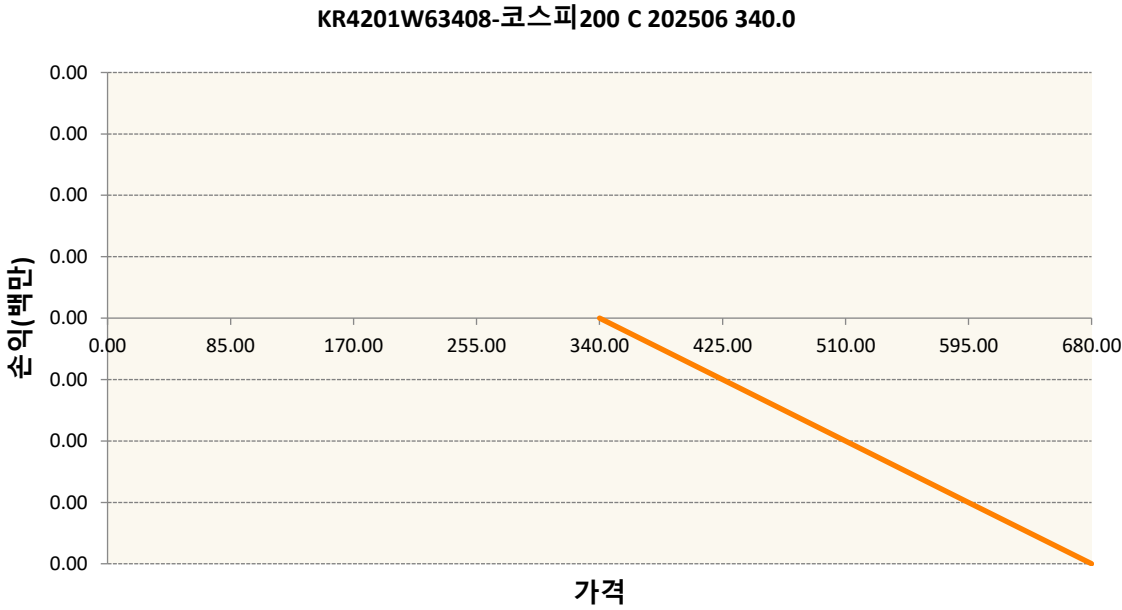
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 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



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 the range from 0 to 340 million won.

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

The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 685.00. The y-axis, labeled '순이익 (백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the net income function, starting at the origin (0, 0) and ending at (342.50, 0.00). This indicates that net income is zero at a price of 342.50.

| 가격 (Price) | 순이익 (백만) (Net Income in millions) |
|------------|-----------------------------------|
| 0.00       | 0.00                              |
| 85.63      | -0.00                             |
| 171.25     | -0.00                             |
| 256.88     | -0.00                             |
| 342.50     | 0.00                              |
| 428.13     | -0.00                             |
| 513.75     | -0.00                             |
| 599.38     | -0.00                             |
| 685.00     | -0.00                             |

(단위:백만원)

|                                   |           |         |        |      |       |        |        |
|-----------------------------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| KR4201W63408코스피200 C 202506 340.0 |           |         |        |      |       | 976    |        |
|                                   | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |        |
| 가격                                | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                            | 660       | 652     | 643    | 634  | 624   | 614    | 603    |
| -5.33%                            | 554       | 541     | 527    | 514  | 501   | 487    | 474    |
| -2.67%                            | 318       | 310     | 302    | 292  | 283   | 273    | 262    |
| 0%                                | 7         | 6       | 3      | 0    | -4    | -9     | -14    |
| 2.67%                             | -320      | -320    | -320   | -321 | -322  | -323   | -325   |
| 5.33%                             | -648      | -648    | -648   | -648 | -648  | -648   | -649   |
| 8.00%                             | -976      | -976    | -976   | -976 | -976  | -976   | -976   |
| KR4201W63424코스피200 C 202506 342.5 |           |         |        |      |       | 1,396  |        |
|                                   | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |        |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -8.00% | 848     | 840     | 830    | 819    | 807    | 794    | 781    |
| -5.33% | 738     | 719     | 701    | 682    | 663    | 644    | 625    |
| -2.67% | 444     | 430     | 415    | 400    | 384    | 367    | 350    |
| 0%     | 16      | 12      | 7      | 0      | -8     | -17    | -26    |
| 2.67%  | -452    | -452    | -453   | -454   | -457   | -460   | -464   |
| 5.33%  | -923    | -924    | -924   | -924   | -924   | -925   | -926   |
| 8.00%  | -1,396  | -1,396  | -1,396 | -1,396 | -1,396 | -1,396 | -1,396 |

KR4301W63406

코스피200 P 202506 340.0

81

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -69     | -70     | -72    | -74 | -76   | -79    | -81    |
| -5.33%    | -22     | -25     | -27    | -30 | -33   | -36    | -39    |
| -2.67%    | -2      | -4      | -6     | -8  | -10   | -12    | -14    |
| 0%        | 2       | 1       | 1      | 0   | -1    | -2     | -3     |
| 2.67%     | 2       | 2       | 2      | 2   | 1     | 1      | 1      |
| 5.33%     | 2       | 2       | 2      | 2   | 2     | 2      | 2      |
| 8.00%     | 2       | 2       | 2      | 2   | 2     | 2      | 2      |

KR4301W63422

코스피200 P 202506 342.5

139

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -124    | -126    | -128   | -130 | -133  | -136   | -139   |
| -5.33%    | -45     | -49     | -53    | -57  | -61   | -66    | -70    |
| -2.67%    | -6      | -9      | -12    | -16  | -19   | -23    | -27    |
| 0%        | 3       | 3       | 1      | 0    | -2    | -4     | -6     |
| 2.67%     | 4       | 4       | 4      | 4    | 3     | 3      | 2      |
| 5.33%     | 5       | 5       | 4      | 4    | 4     | 4      | 4      |
| 8.00%     | 5       | 5       | 5      | 5    | 5     | 4      | 4      |

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

(단위:백만원)

2,696

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

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 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

## 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 | 4,305 | 0     | 4,305     |    |

### 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 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

## 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 | 12,380 | 0      | 12,380    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0      | 11,836 | -11,836   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |                                 |
|------------------------------|---------------------------------|
| FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E | 217                             |
| FXW213F4V( KRW/USD 31-07-25E | 409                             |
| FXW213F5V( KRW/USD 29-08-25E | 321                             |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 460 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

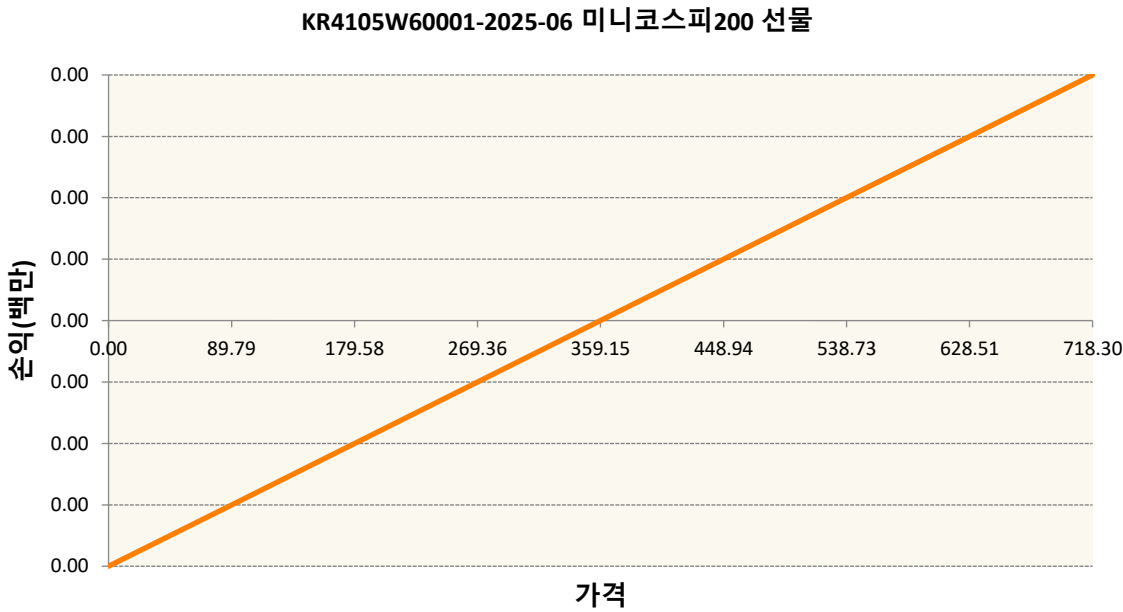
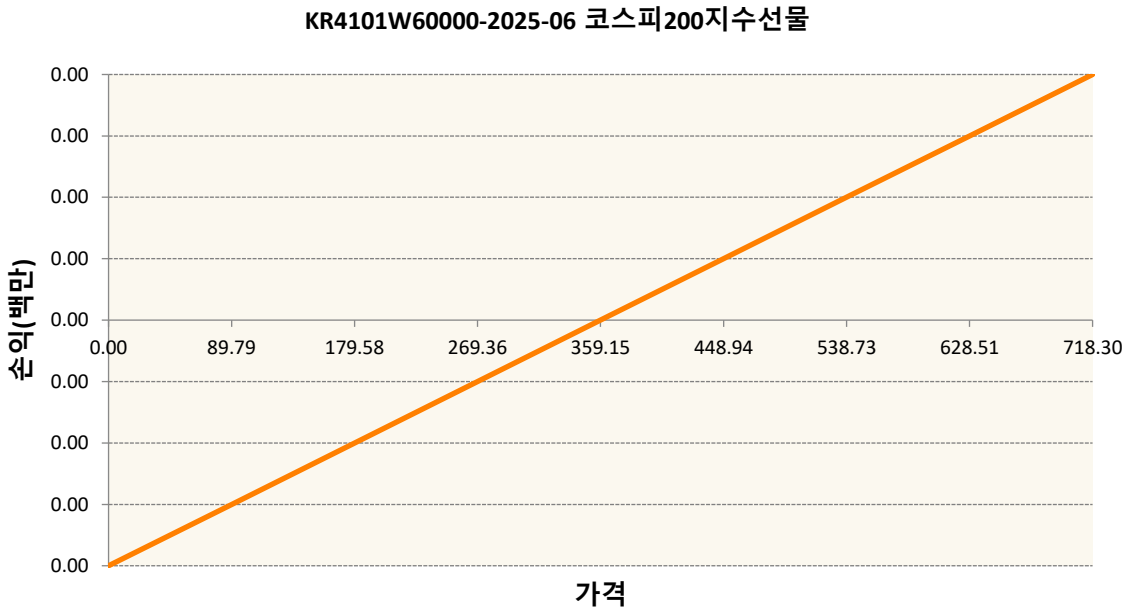
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

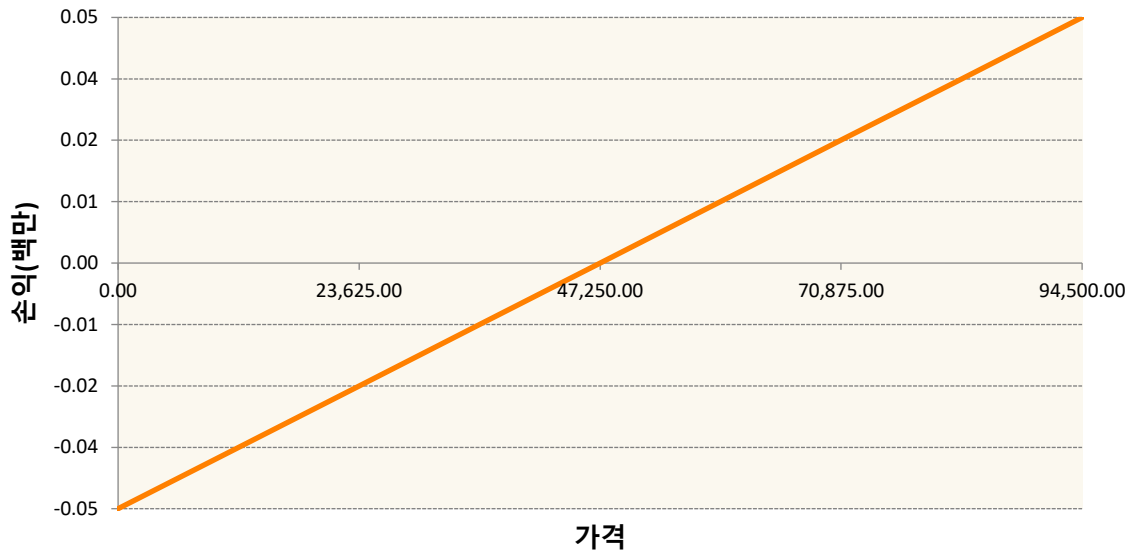
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,181 | 0     | 1,181     | 장내 |

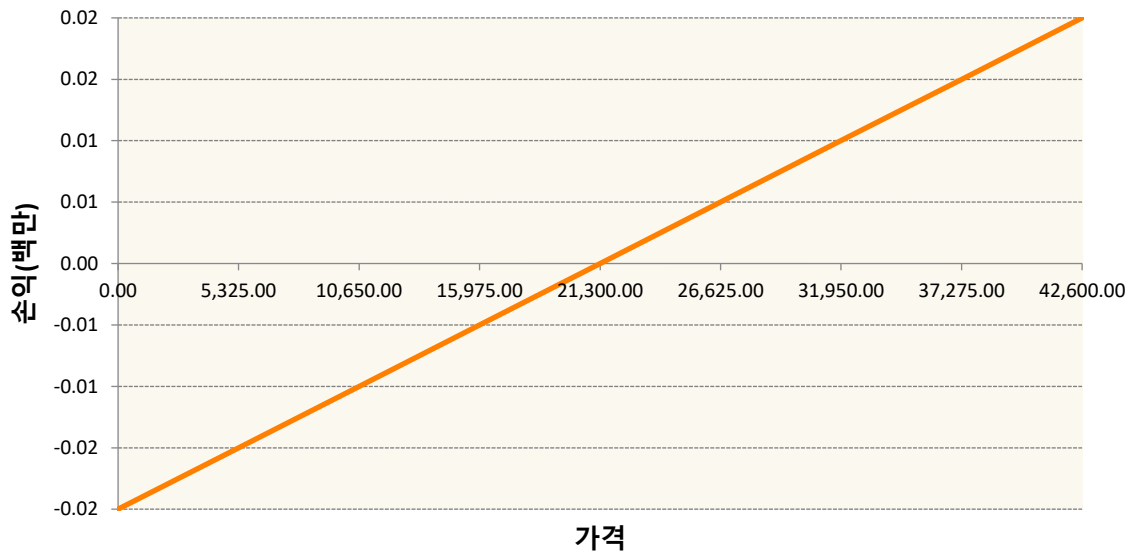
2. 만기시점의 손익구조



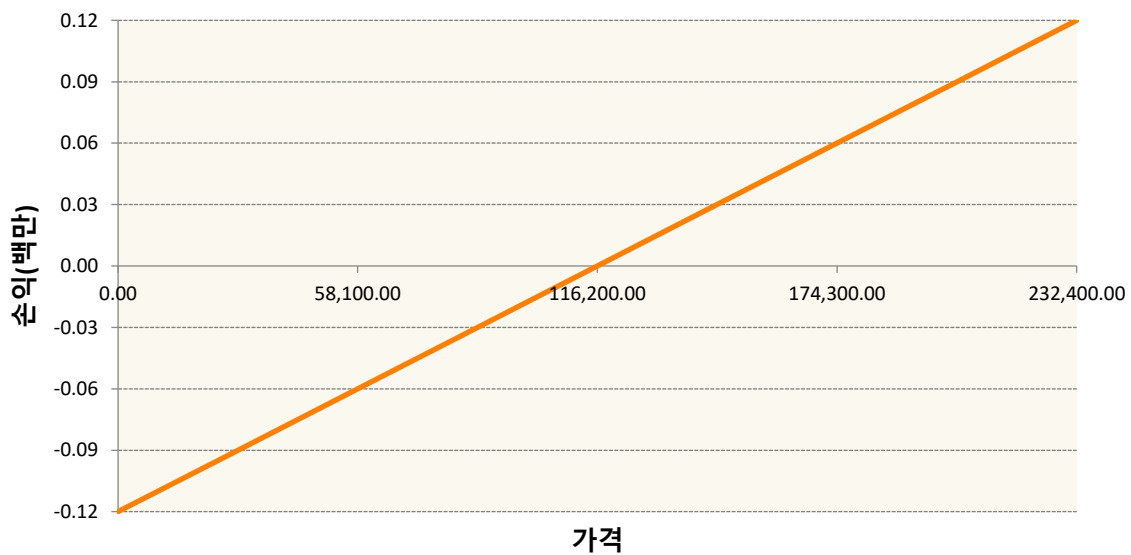
KR410FW60001-2025-06 두산로보틱스개별선물



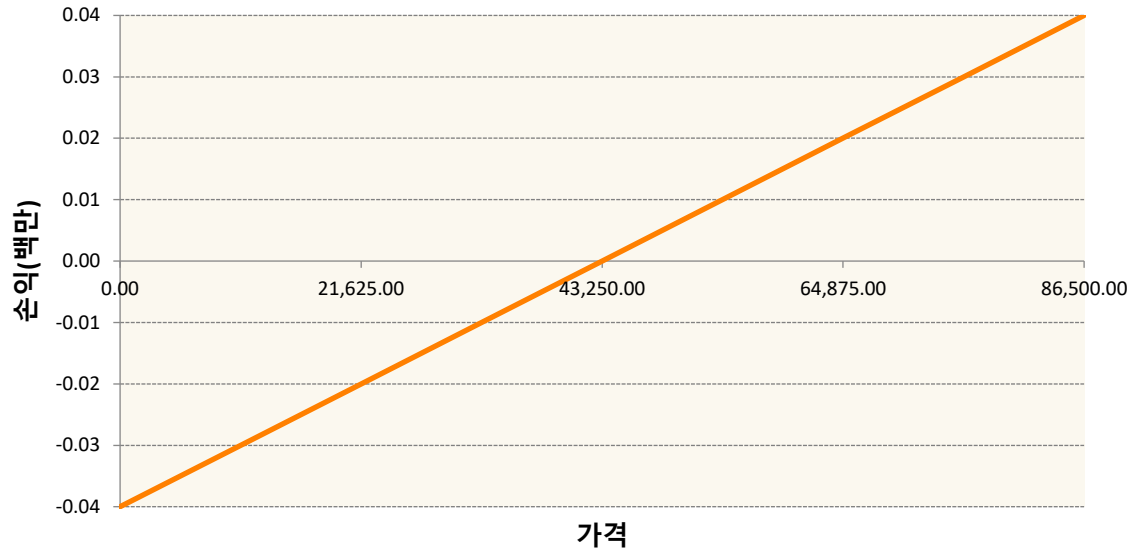
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



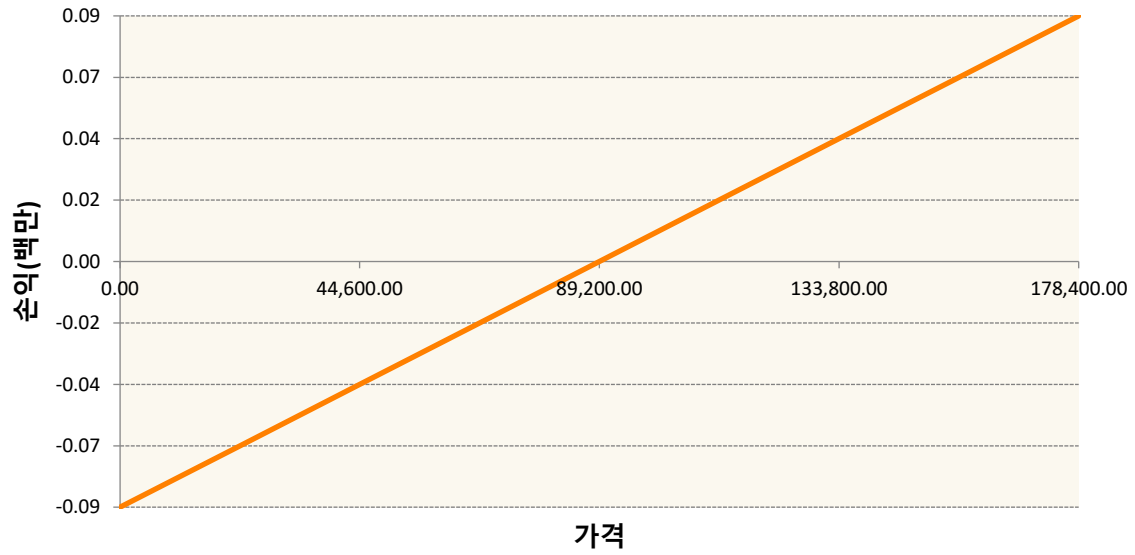
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



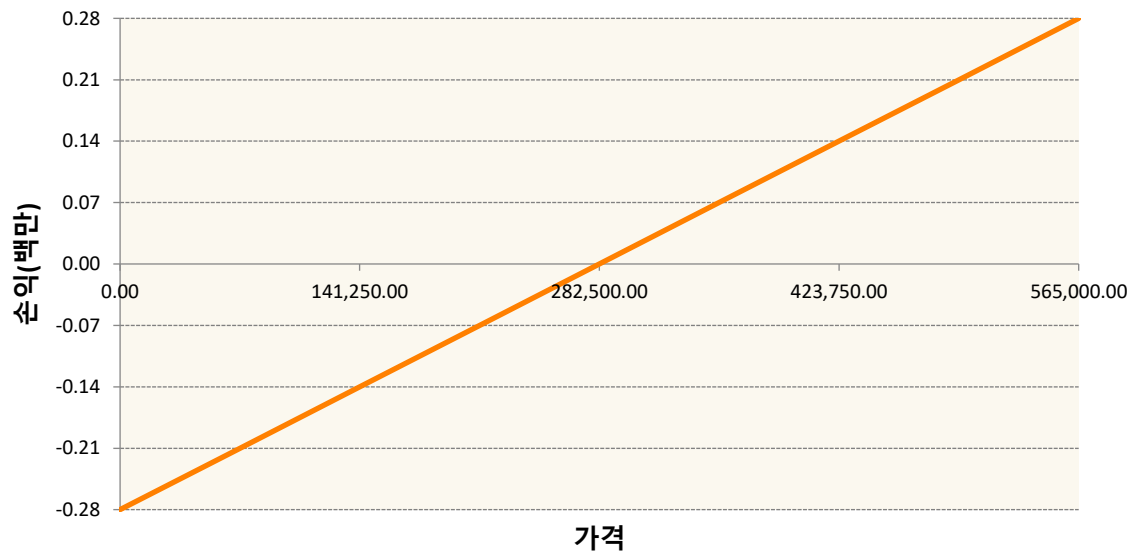
KR41EVW60008-2025-06 한화시스템개별선물



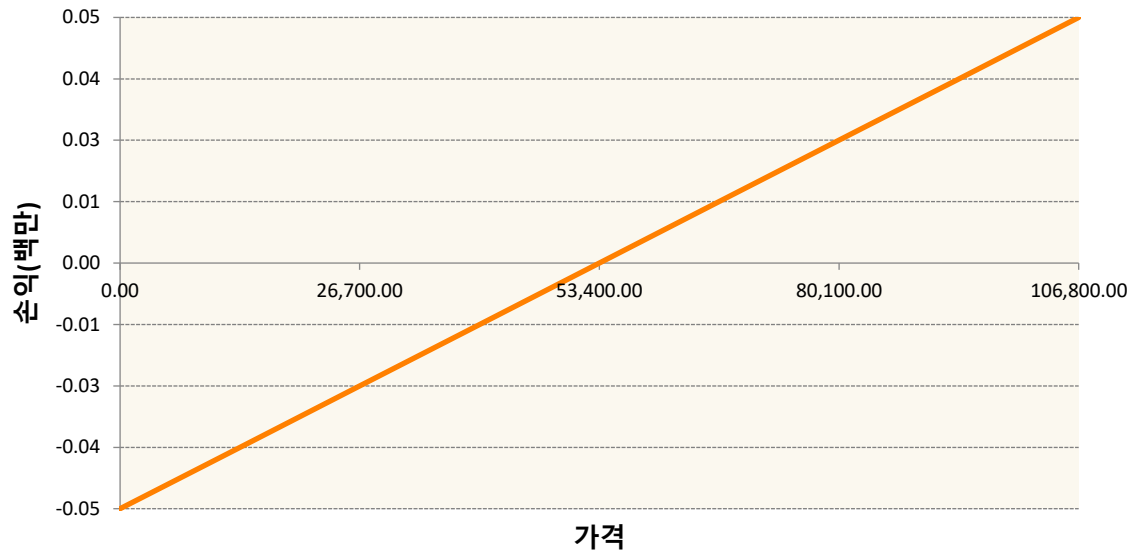
KR41EYW60002-2025-06 에코프로비엠개별선물



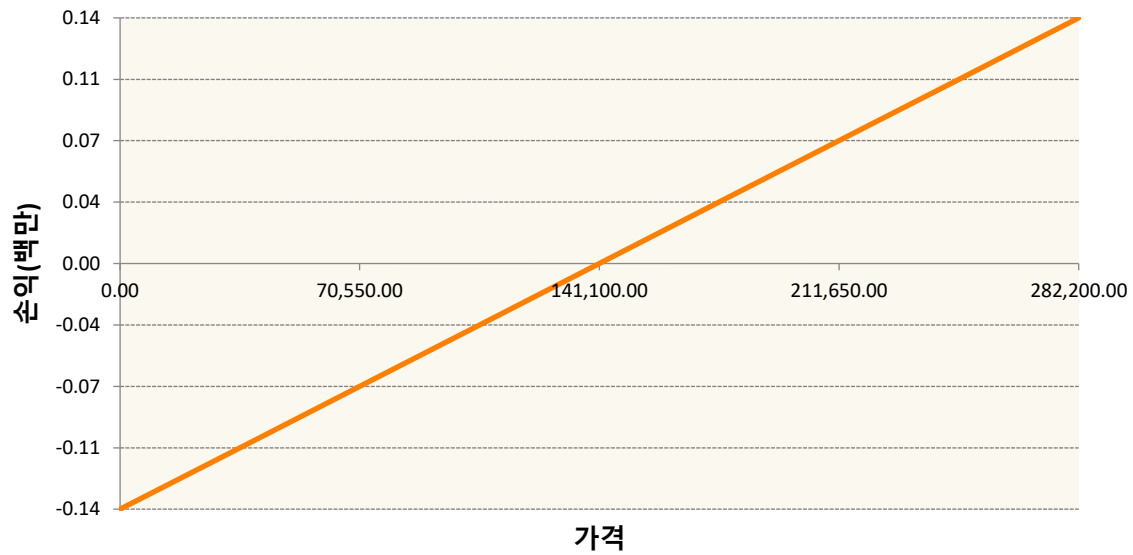
KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



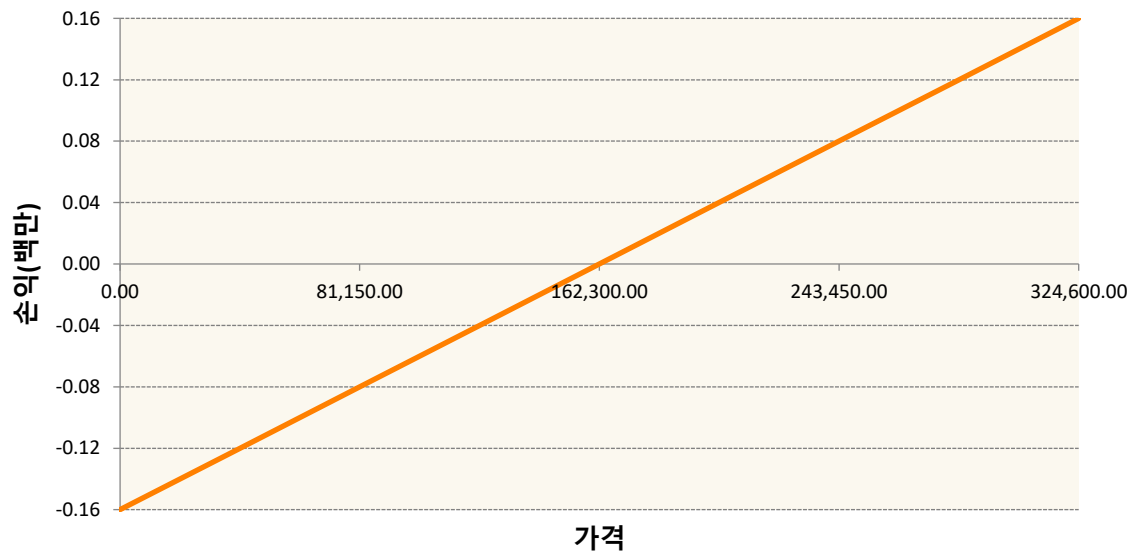
KR41FMW60004-2025-06 엘애프개별선물



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) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 133      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

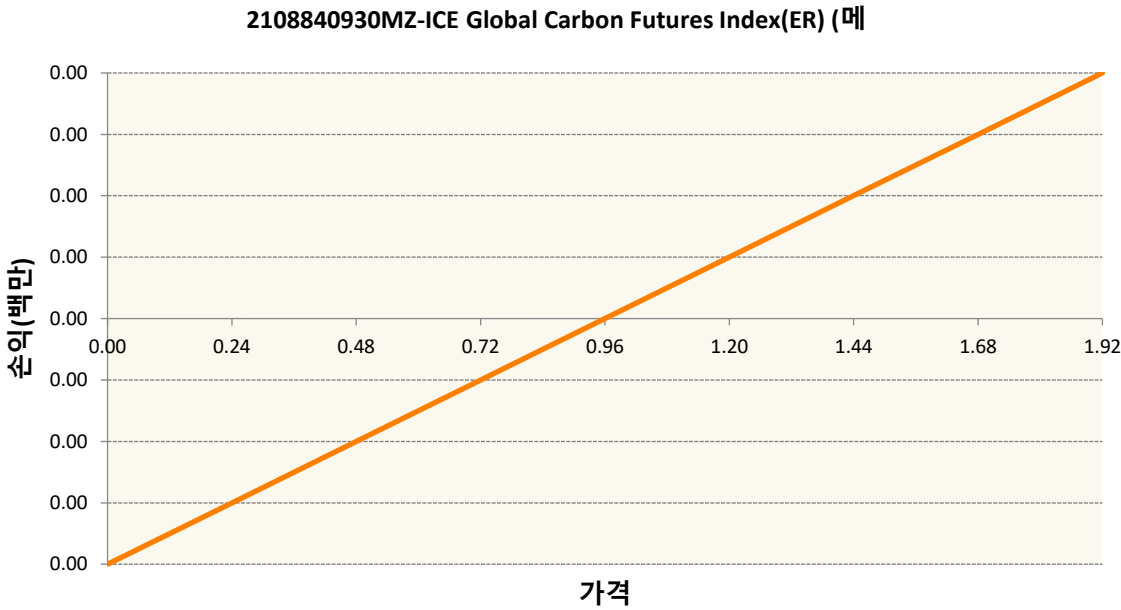
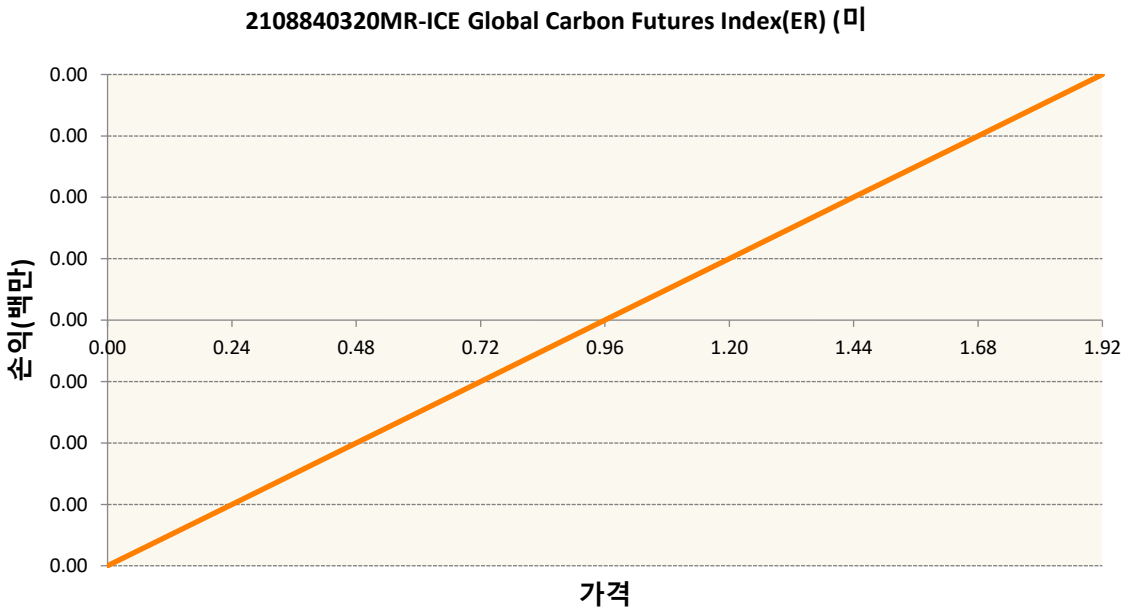
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 9,445 | 0     | 9,445     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                                        | (단위:백만원) |
|---------------------------|----------------------------------------|----------|
| 2108840320                | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 | 565      |
| 2108840930                | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 | 189      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 879      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

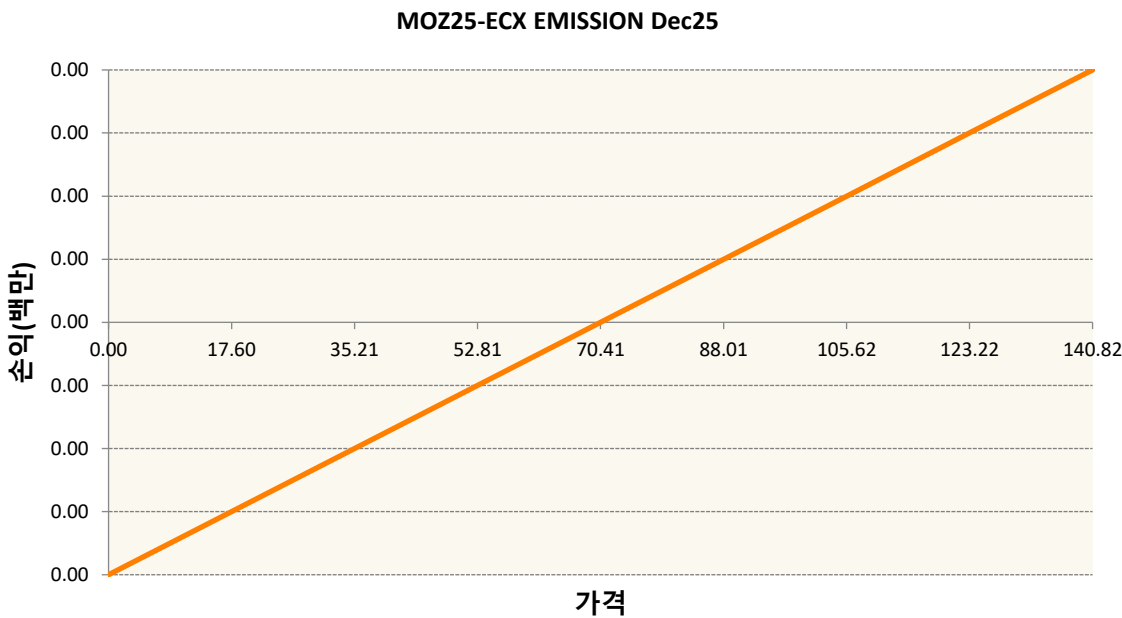
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 6,381 | 0     | 6,381     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,386 | -1,386    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |      |
|-----------------------------------------------------|------|
| 2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index | 0.41 |
| FXW213F5V( KRW/EUR 30-06-25E                        | 33   |
| FXW213F5V( KRW/EUR 30-06-25E                        | 78   |
| MOZ25        ECX EMISSION Dec25                     | 511  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 951 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

## 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)  | 15 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)  | 15 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠) | 23 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)  | 23 |

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

(단위:백만원)

135

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

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)

193

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

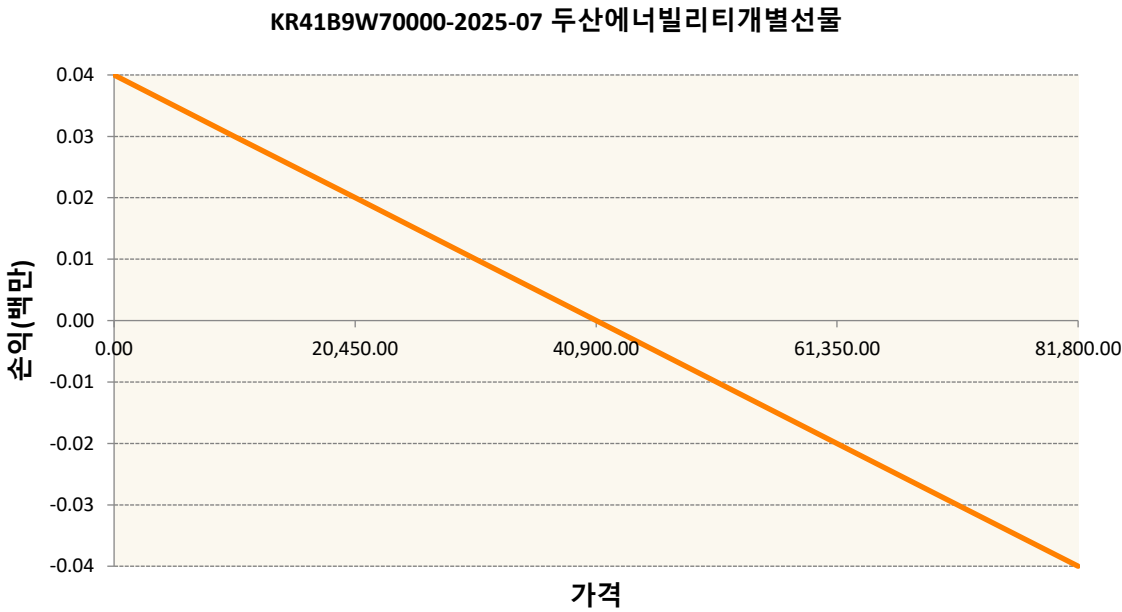
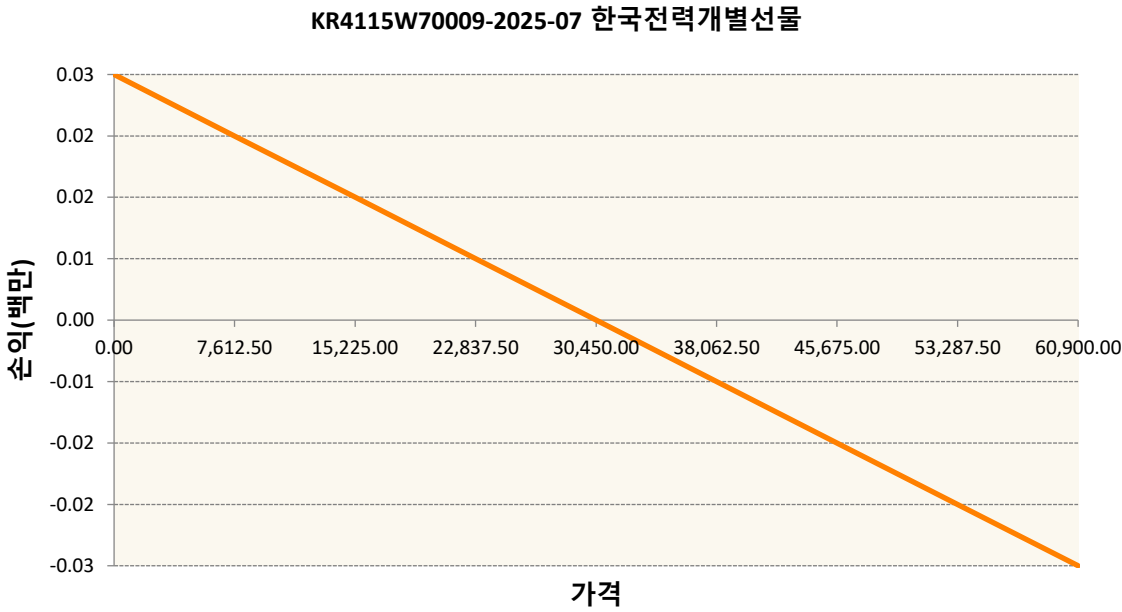
## 에퀴티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

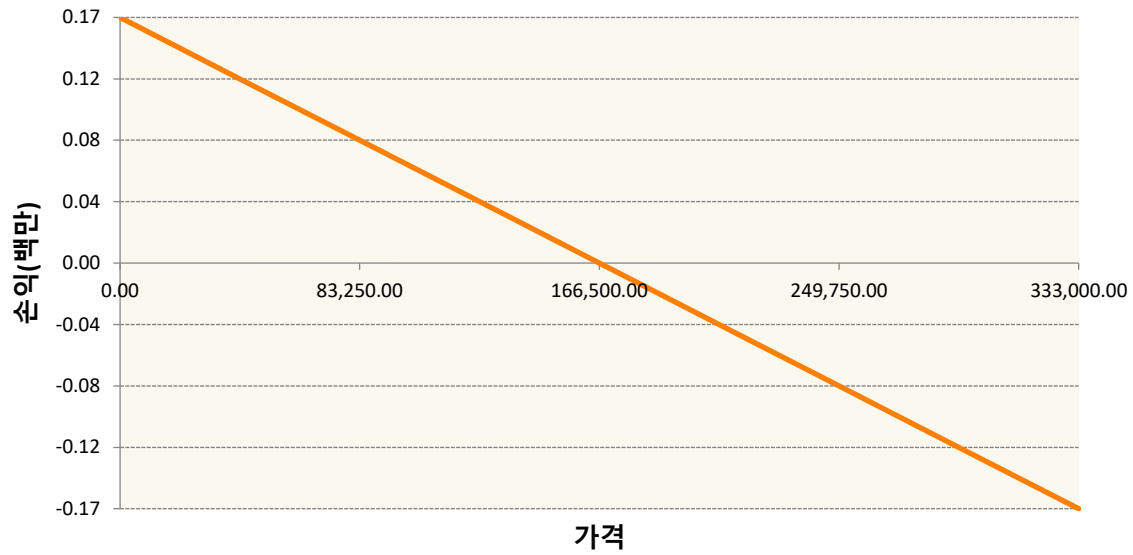
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 9     | -9        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 17    | -17       | 장내 |

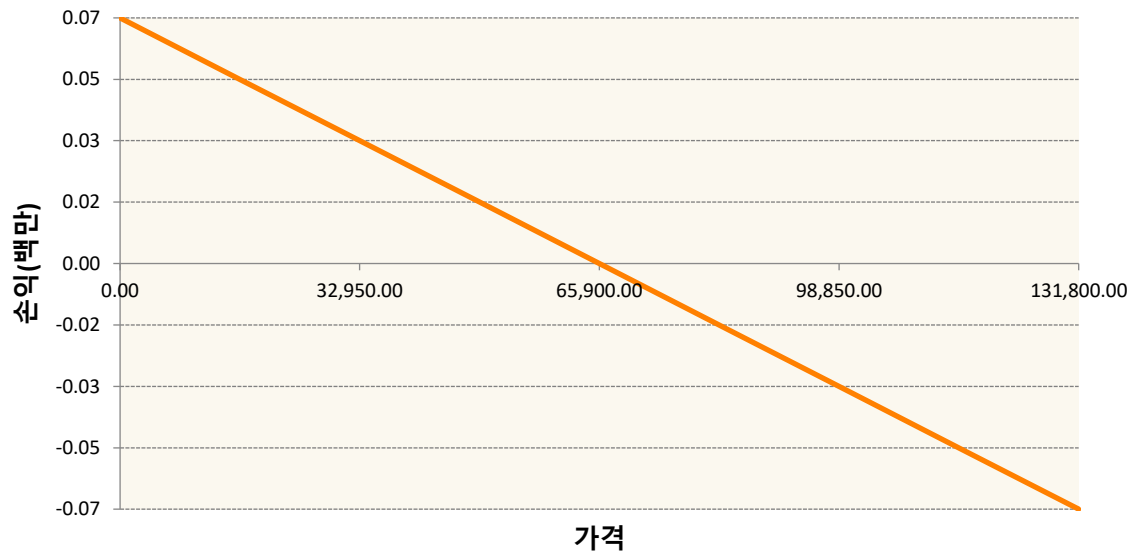
### 2. 만기시점의 손익구조



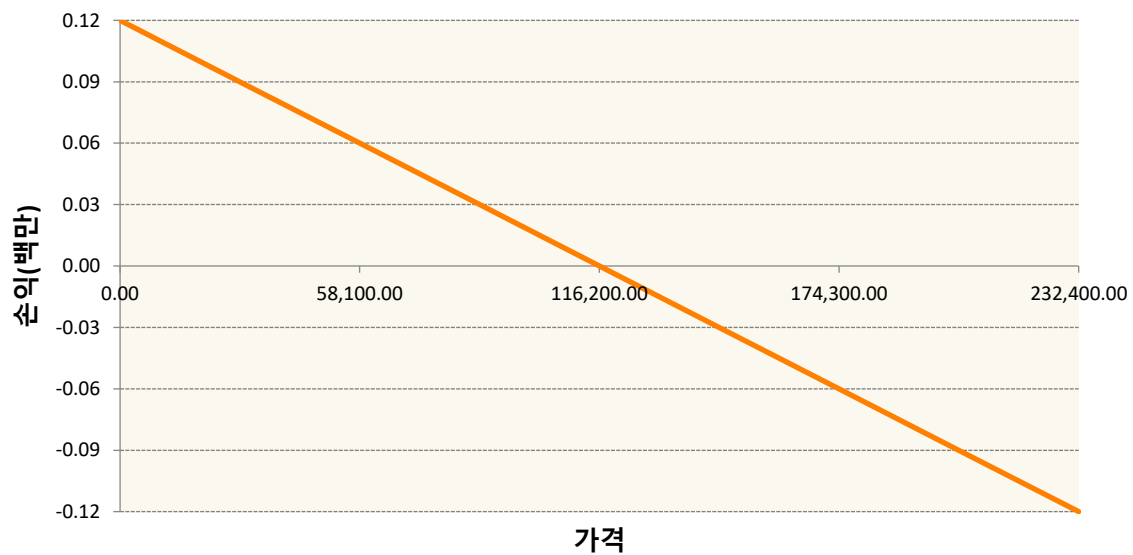
KR41BJW60009-2025-06 엔씨소프트개별선물



KR41BNW70000-2025-07 현대건설개별선물



KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)     |  | (단위:백만원) |
|-------------------------------|--|----------|
| KR4115W70( 2025-07 한국전력개별선물   |  | 0.29     |
| KR41B9W70( 2025-07 두산에너지개별선물  |  | 0.16     |
| KR41BJW60C 2025-06 엔씨소프트개별선물  |  | 0.4      |
| KR41BNW70 2025-07 현대건설개별선물    |  | 0.26     |
| KR41E8W60( 2025-06 포스코퓨처엠개별선물 |  | 0.28     |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 3        |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

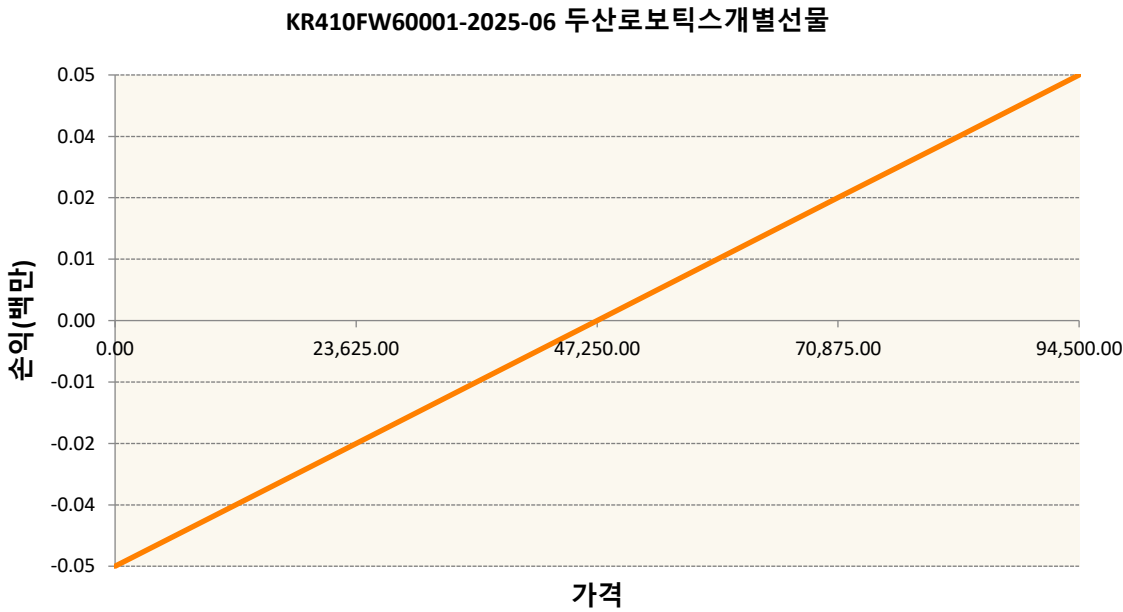
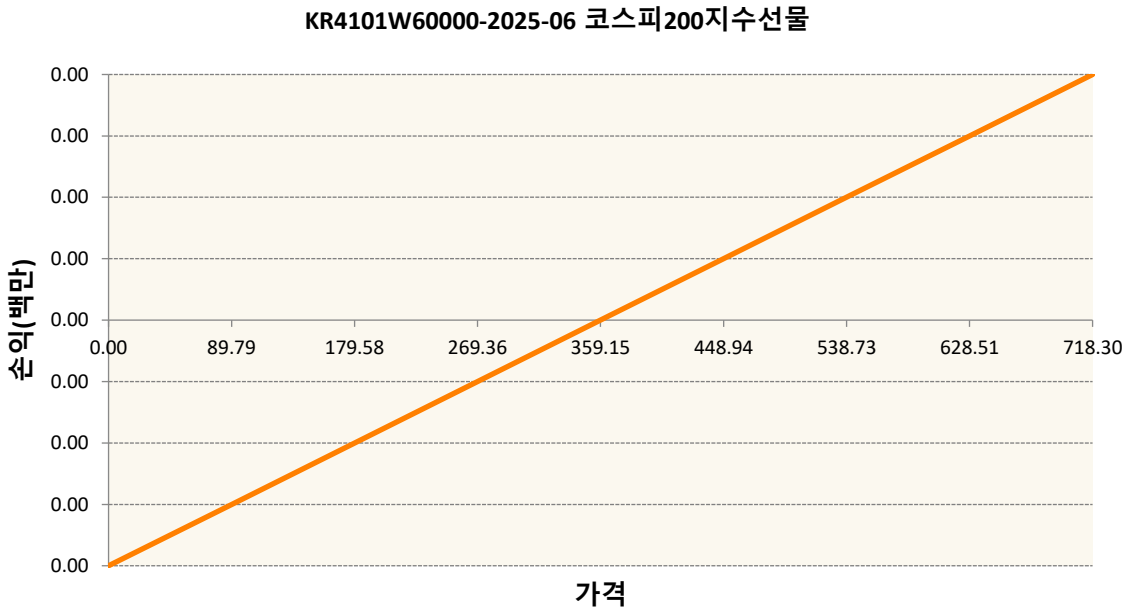
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

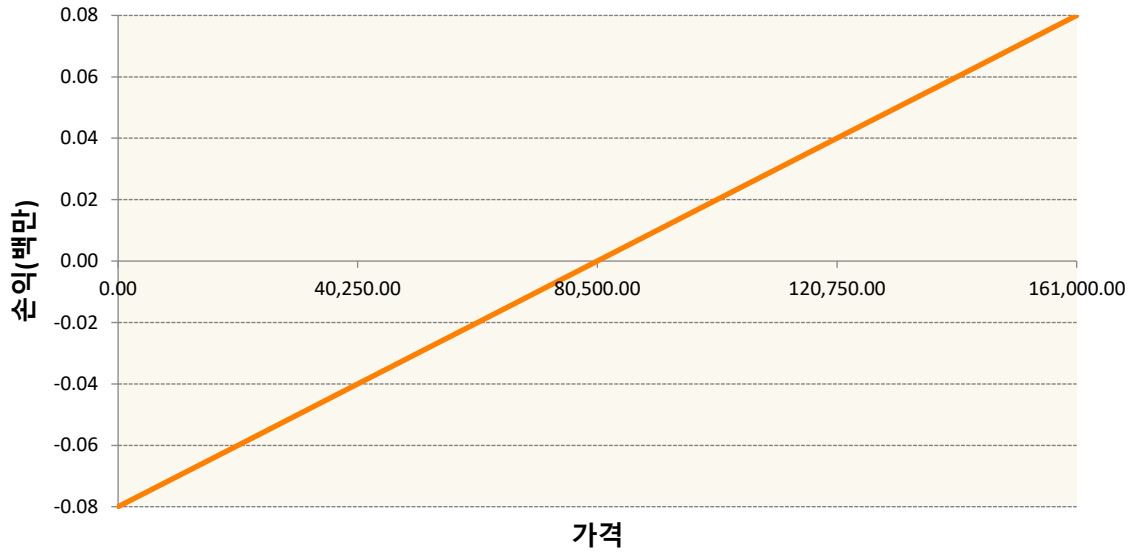
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 12,017 | 0     | 12,017    | 장내 |

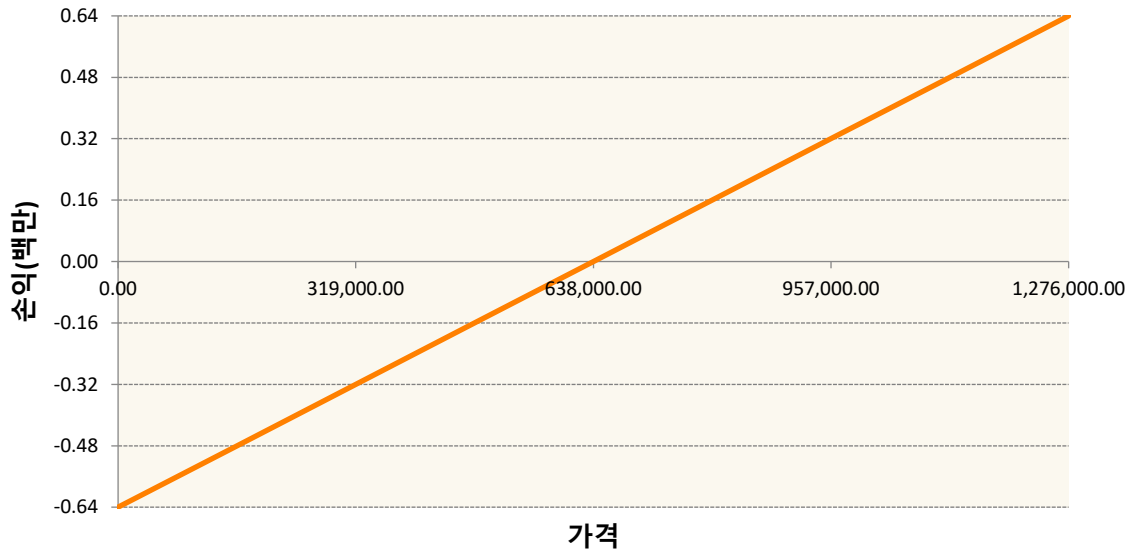
2. 만기시점의 손익구조



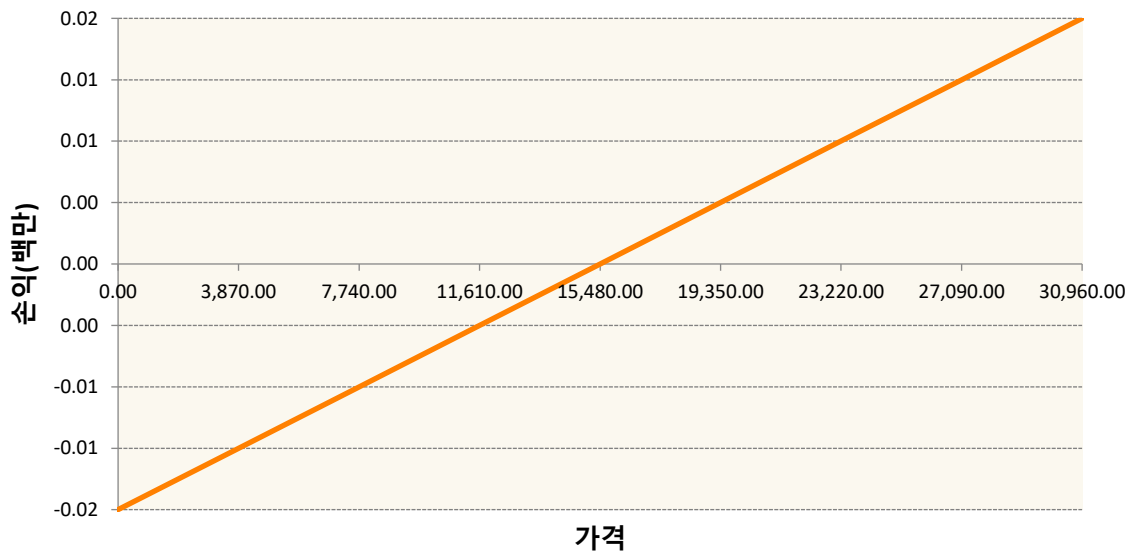
KR410ZW60009-2025-06 한미반도체개별선물



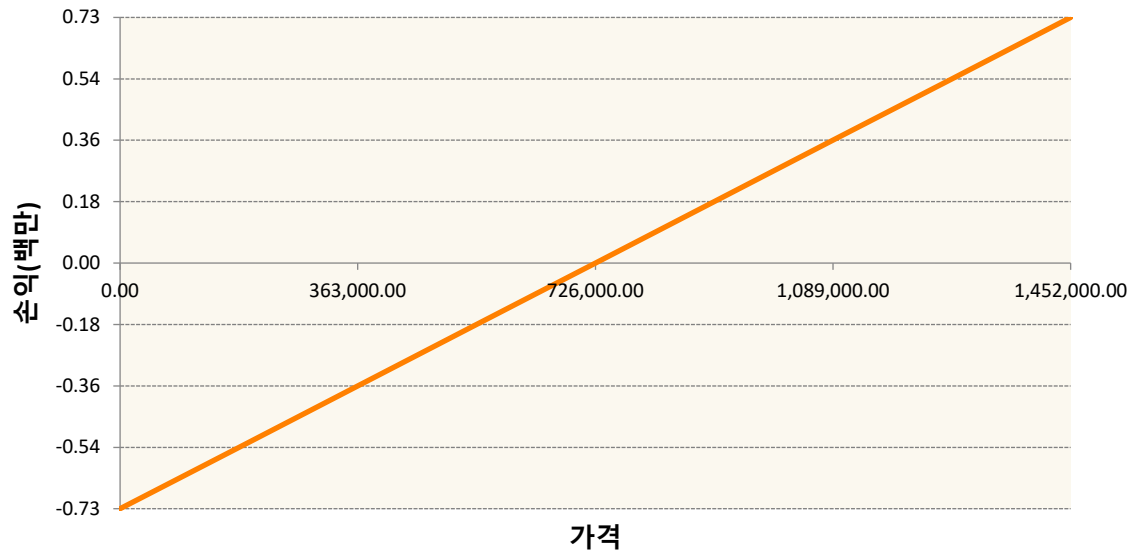
KR411SW60002-2025-06 효성중공업개별선물



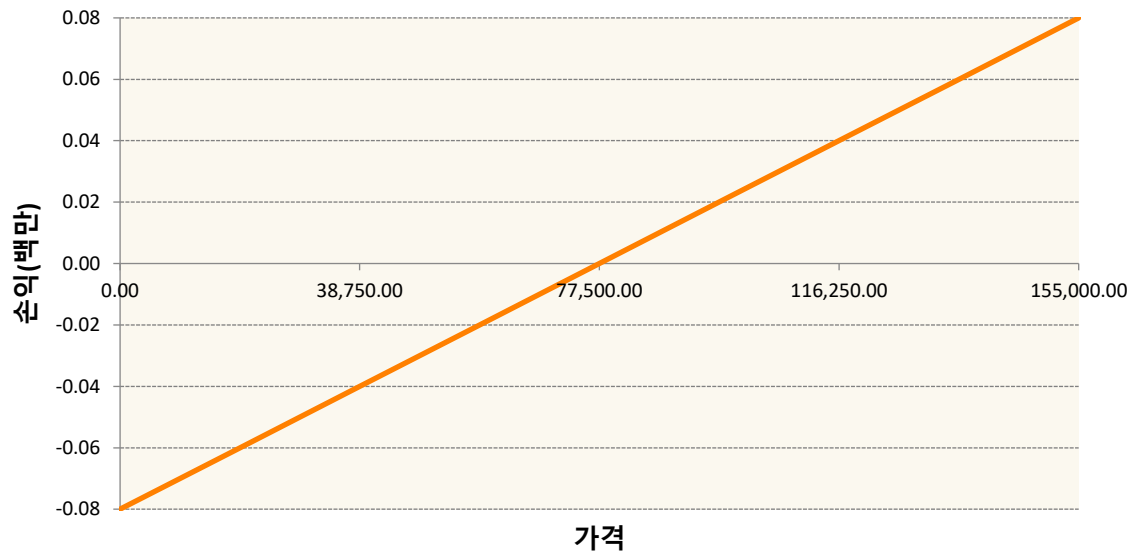
KR4148W60001-2025-06 미래에셋증권개별선물



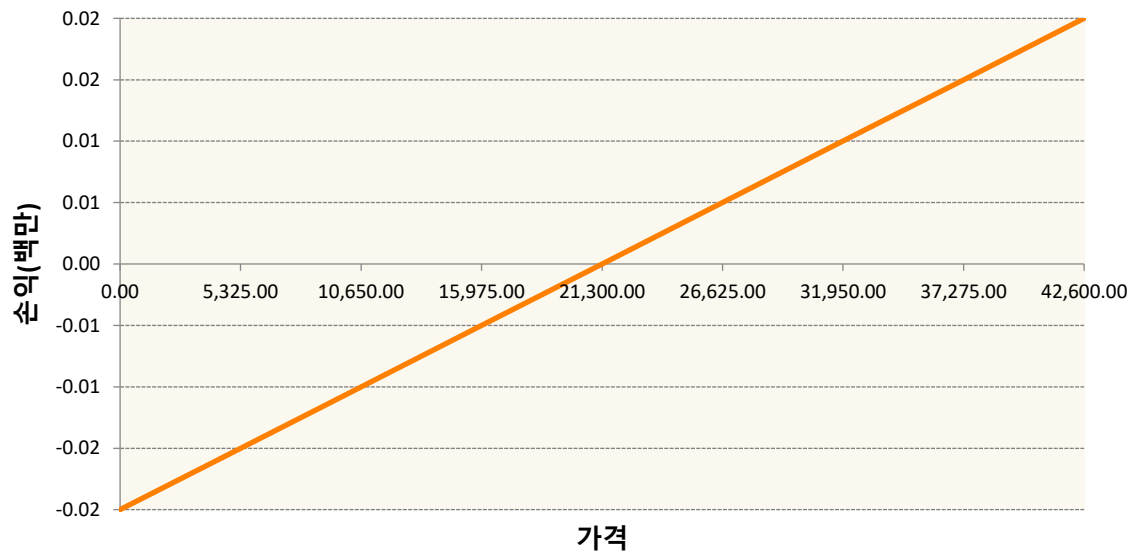
KR41B3W60004-2025-06 고려아연개별선물



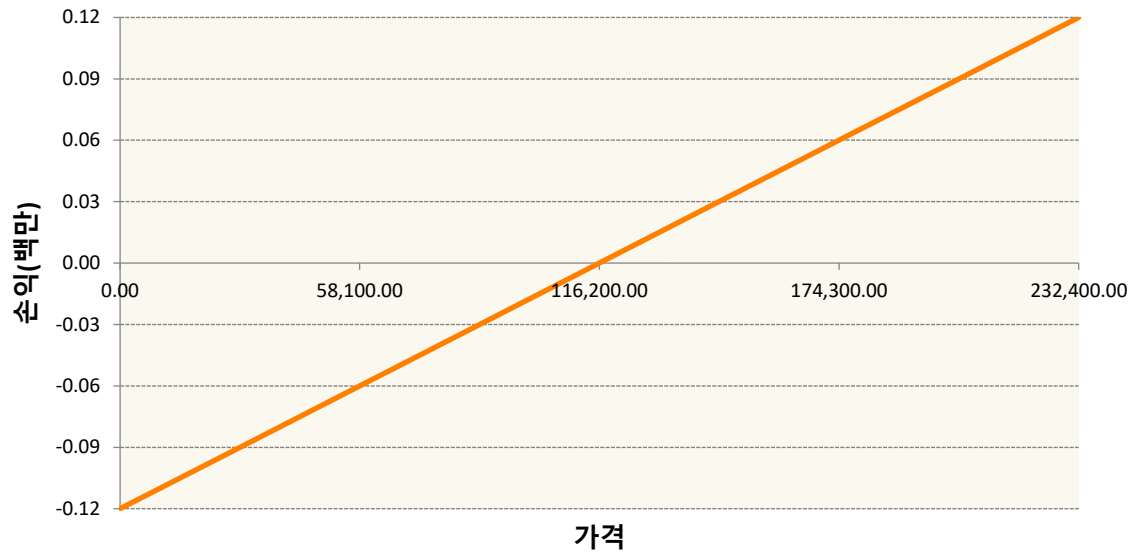
KR41C9W60000-2025-06 한화개별선물



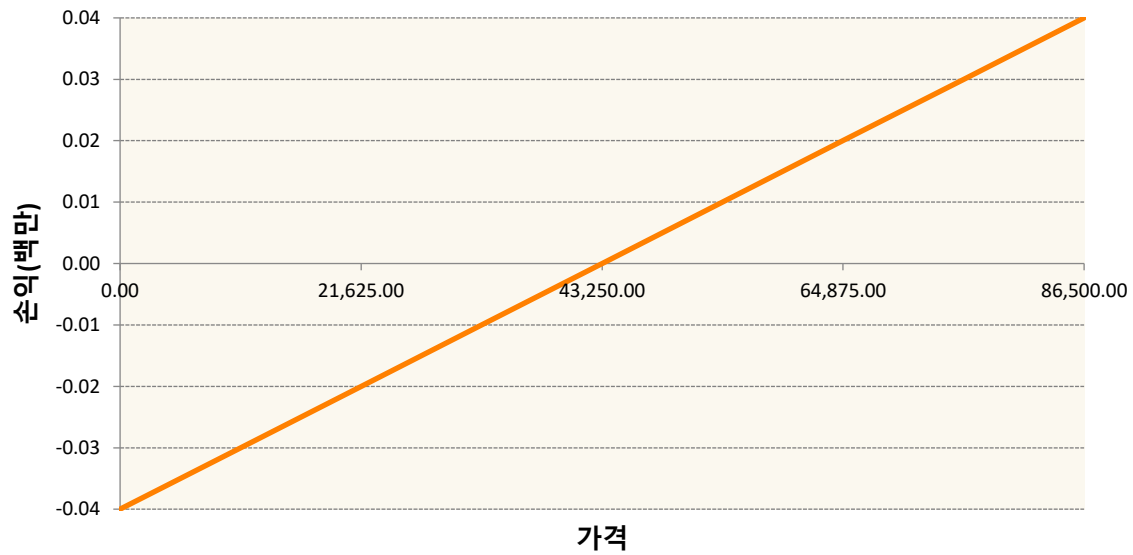
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



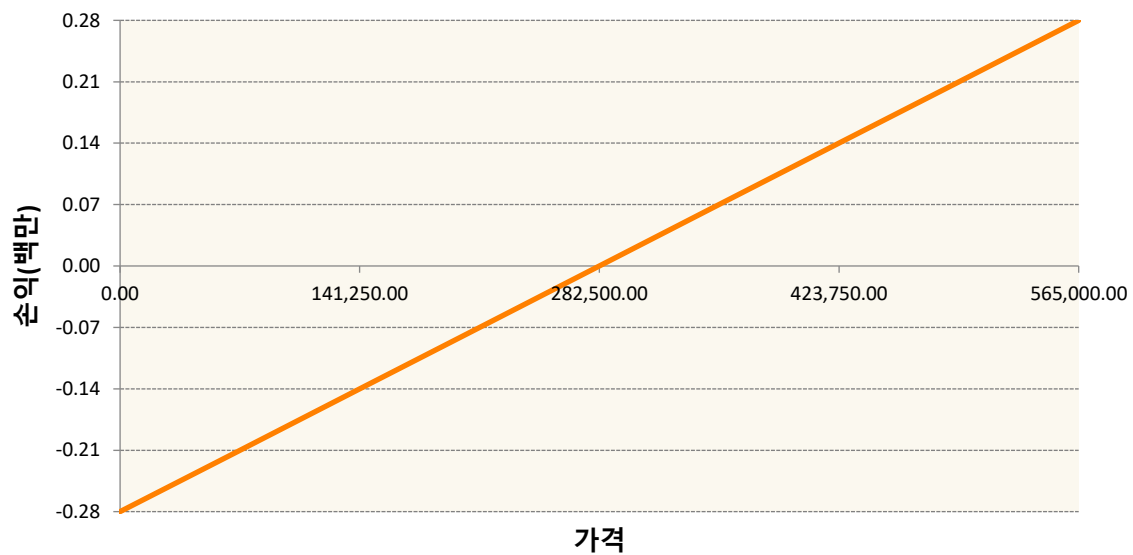
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



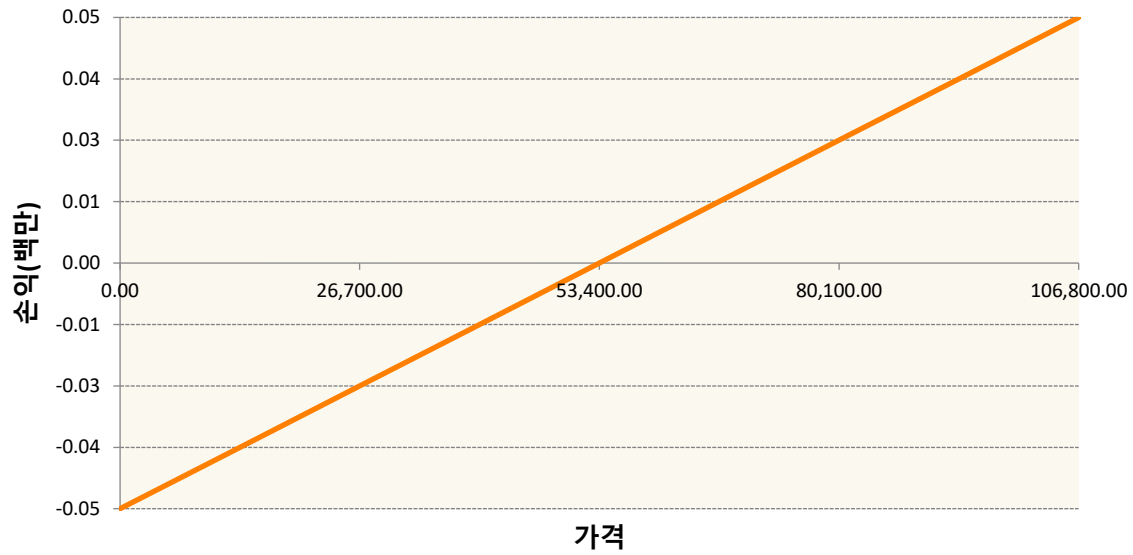
KR41EVW60008-2025-06 한화시스템개별선물



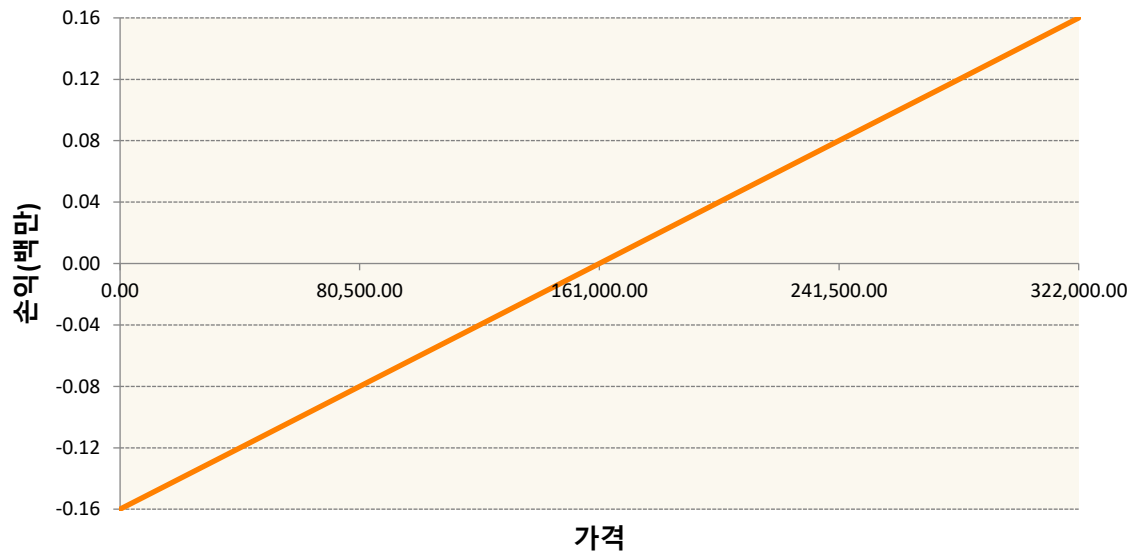
KR41F5W60005-2025-06 LG에너지솔루션개별선물



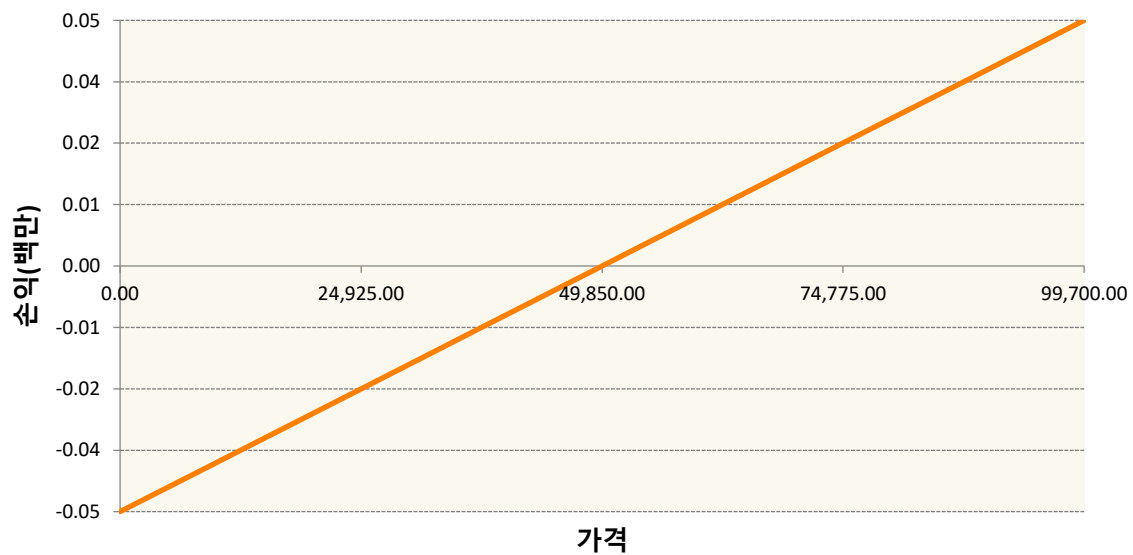
KR41FMW60004-2025-06 엘애프개별선물



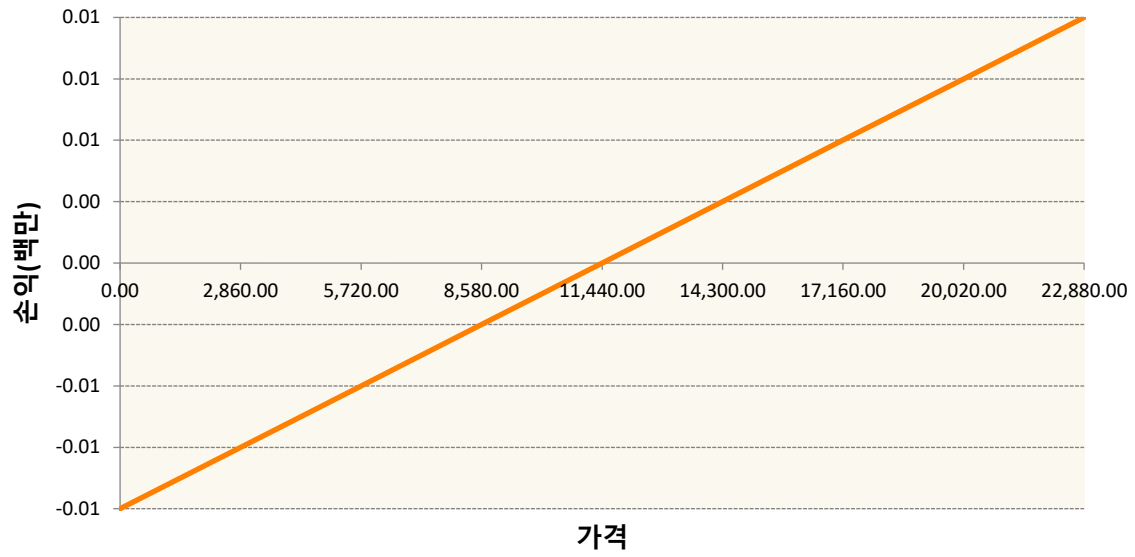
KR41FSW60001-2025-06 LS개별선물



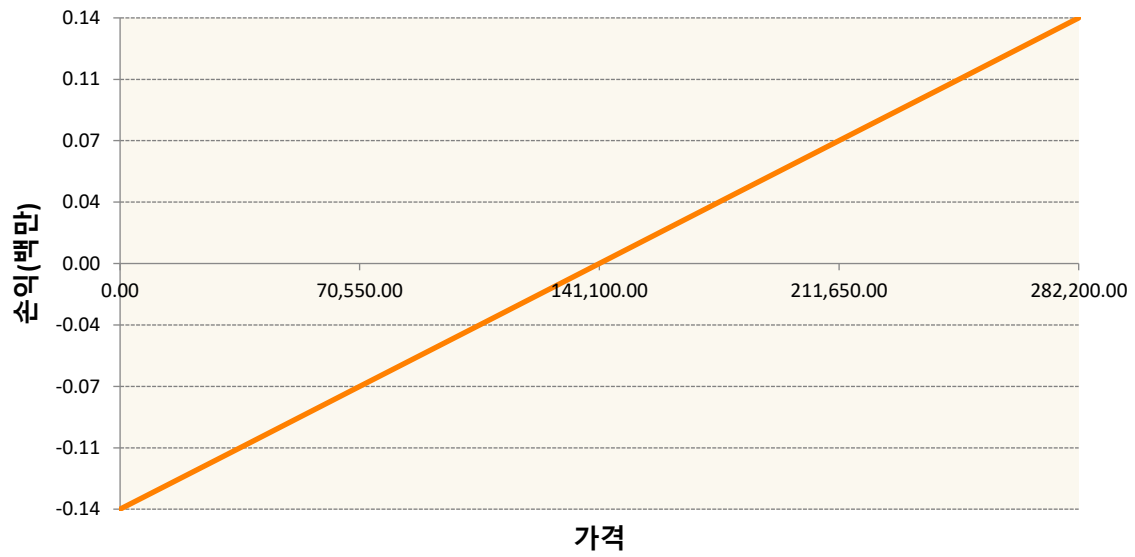
KR41G0W60005-2025-06 씨에스원드개별선물



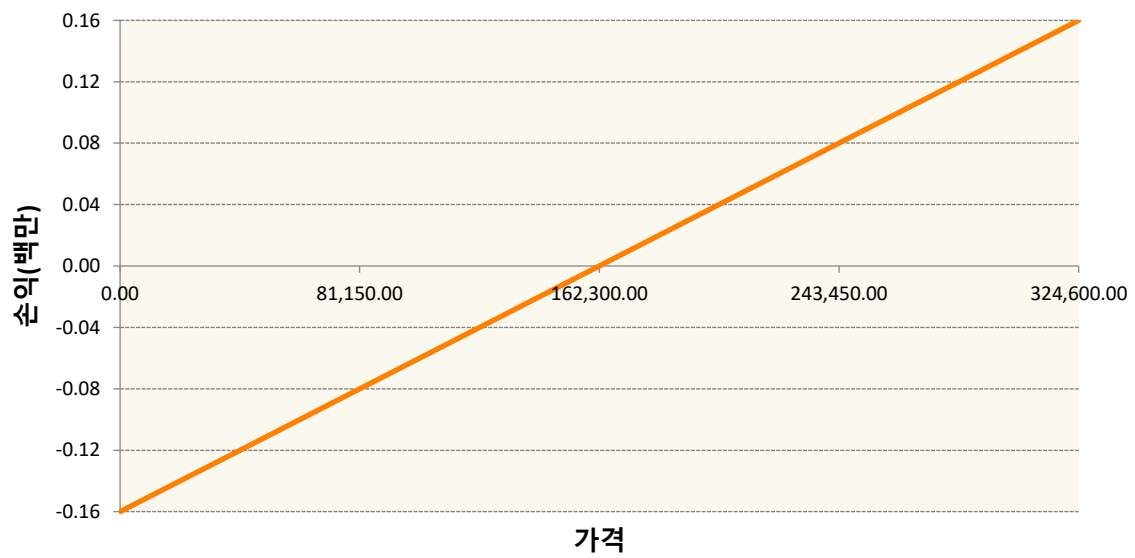
KR41G2W60001-2025-06 에스디바이오센서개별선물



KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



KR41HEW60007-2025-06 키움증권개별선물



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

|                                 |      |
|---------------------------------|------|
| KR4101W60( 2025-06 코스피200지수선물   | 661  |
| KR410FW60( 2025-06 두산로보틱스개별선물   | 6    |
| KR410ZW60( 2025-06 한미반도체개별선물    | 0.19 |
| KR411SW60( 2025-06 효성중공업개별선물    | 6    |
| 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    | 33   |
| KR41F5W60( 2025-06 LG에너지솔루션개별선물 | 98   |
| KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물      | 10   |
| KR41FSW60( 2025-06 LS개별선물       | 1    |
| KR41G0W60 2025-06 씨에스윈드개별선물     | 0.48 |
| KR41G2W60 2025-06 에스디바이오센서개별선물  | 4    |
| KR41G5W60( 2025-06 한진칼개별선물      | 68   |
| KR41HEW60( 2025-06 키움증권개별선물     | 21   |

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

**1,687**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

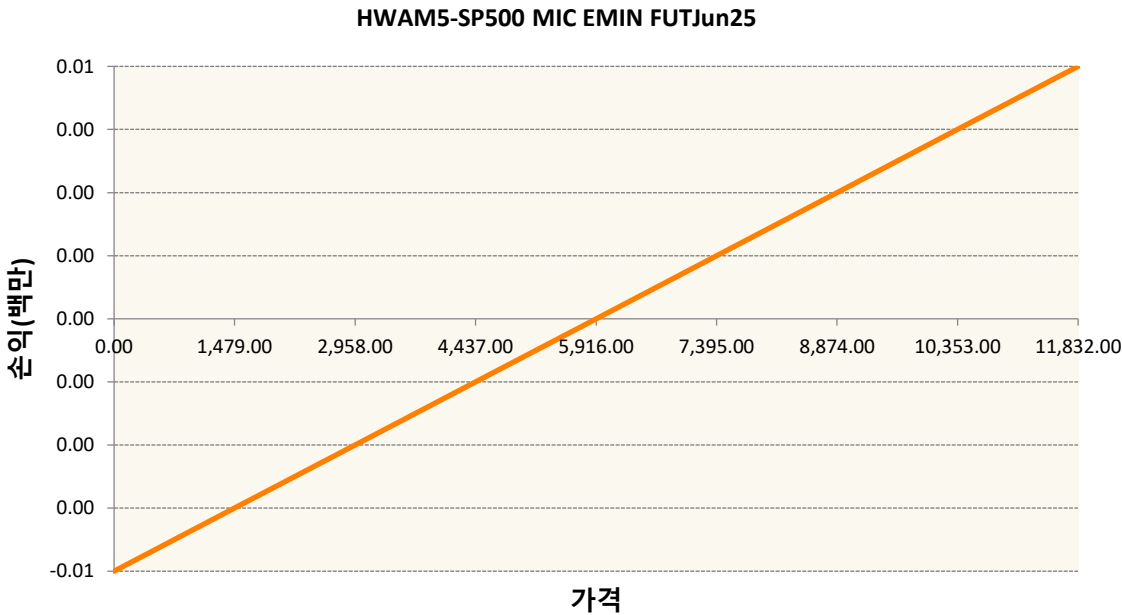
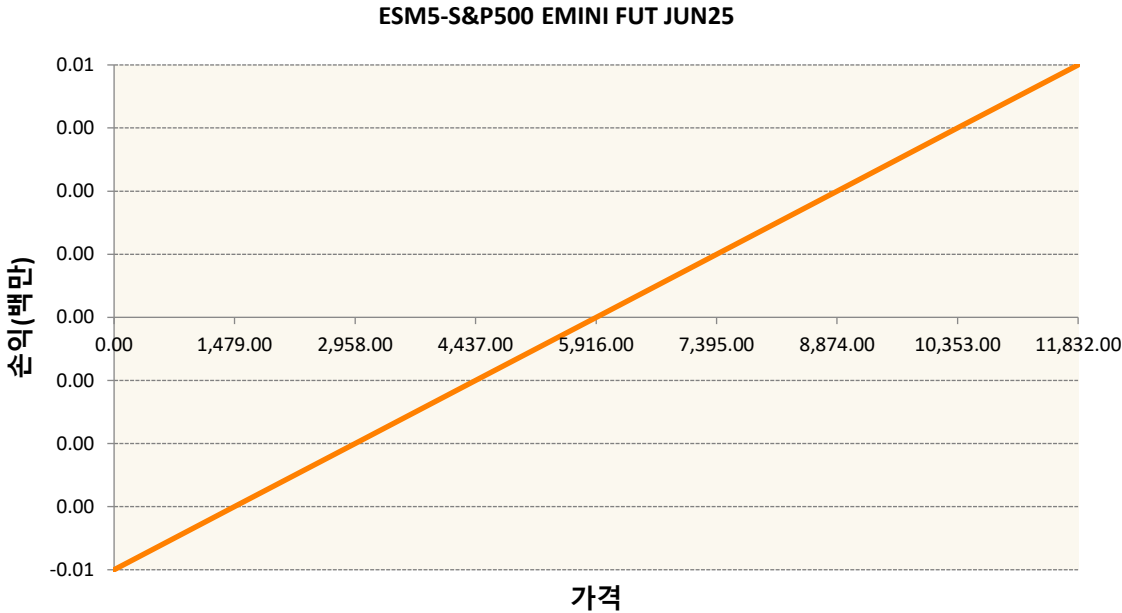
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,893  | 0     | 1,893     | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 31,269 | 0     | 31,269    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| ESM5                      | S&P500 EMINI FUT JUN25  | 2,502    |
| HWAM5                     | SP500 MIC EMIN FUTJun25 | 151      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 2,348    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

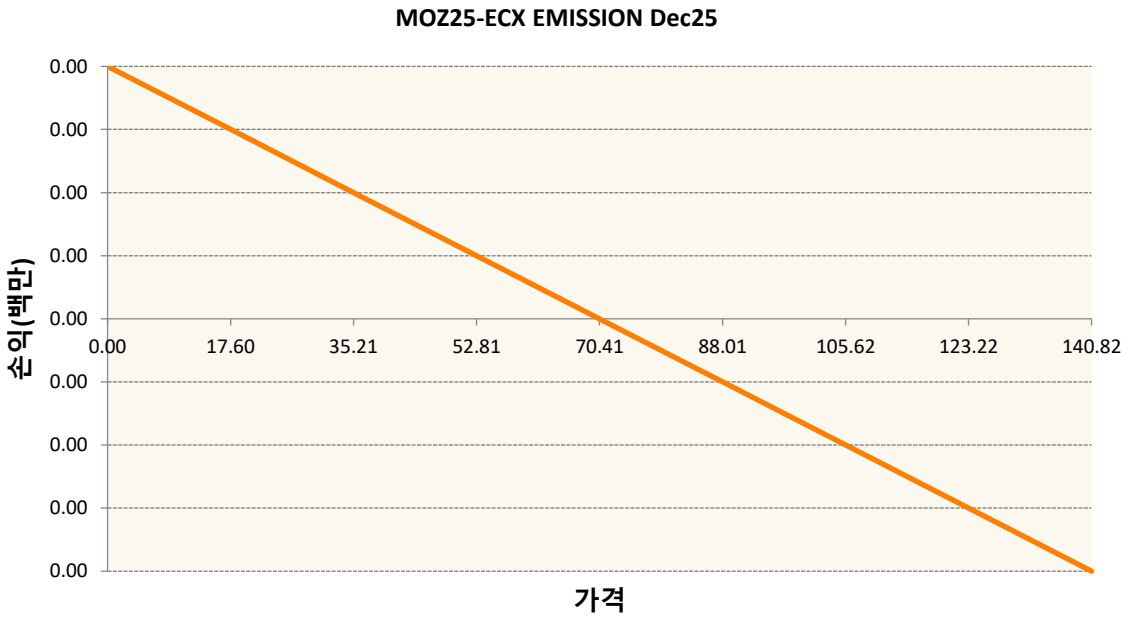
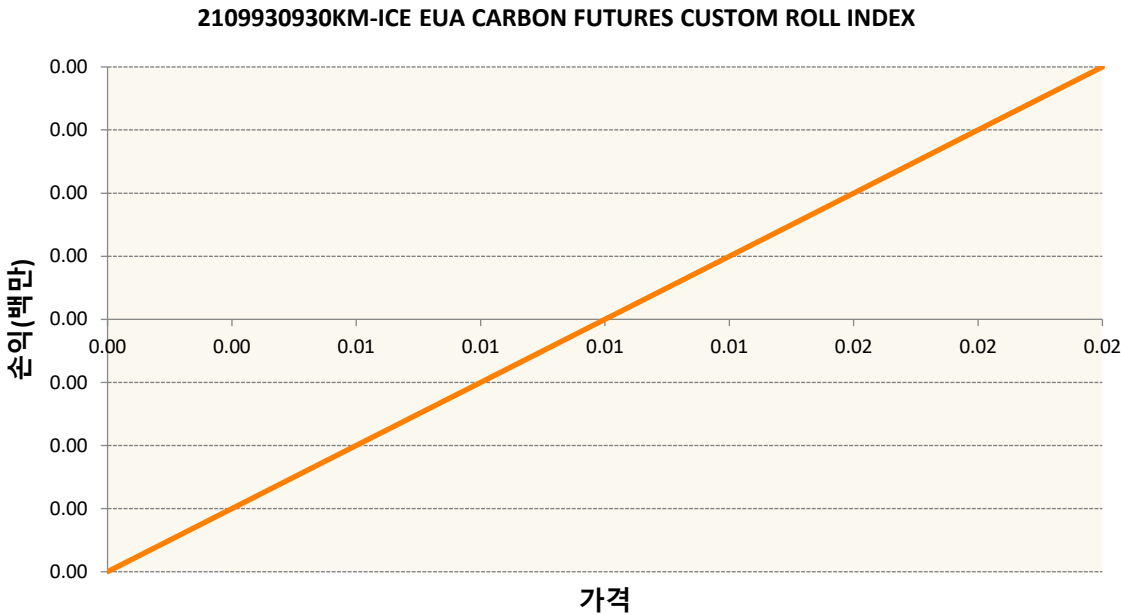
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 5,057 | -5,053    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 949   | -949      | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|--|----------|
| 2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX |  | 0.34     |
| FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E                         |  | 76       |
| MOZ25      ECX EMISSION Dec25                       |  | 405      |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

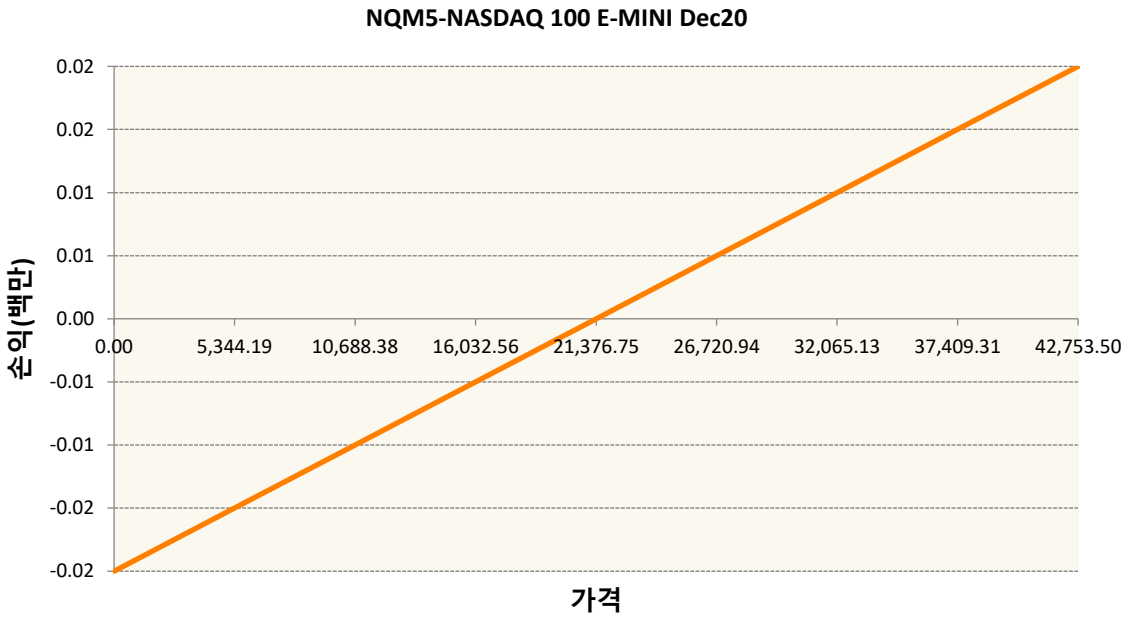
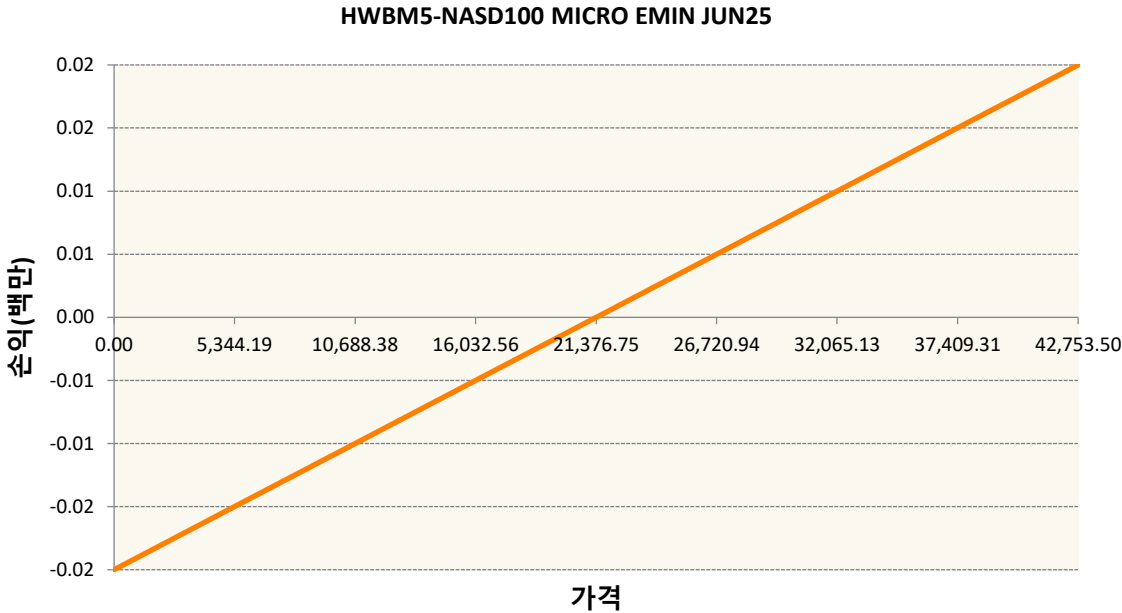
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 14,264 | 0     | 14,264    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 646    | 0     | 646       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| HWBM5                     | NASD100 MICRO EMIN JUN25 | 52       |
| NQM5                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  | 1,141    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,360    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

## 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 | 2,948 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 7,511 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 6,665 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 903   |
| SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN  | 158   |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 9,699 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

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)

|    |
|----|
| 71 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-06-04 |
| 기준일 | 2025-06-02 |

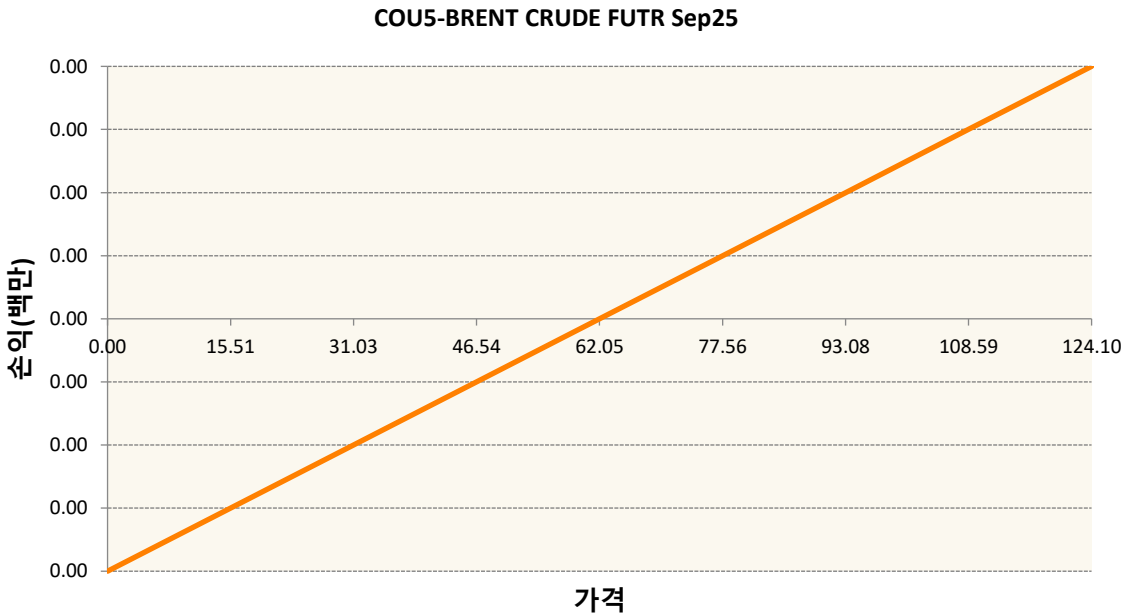
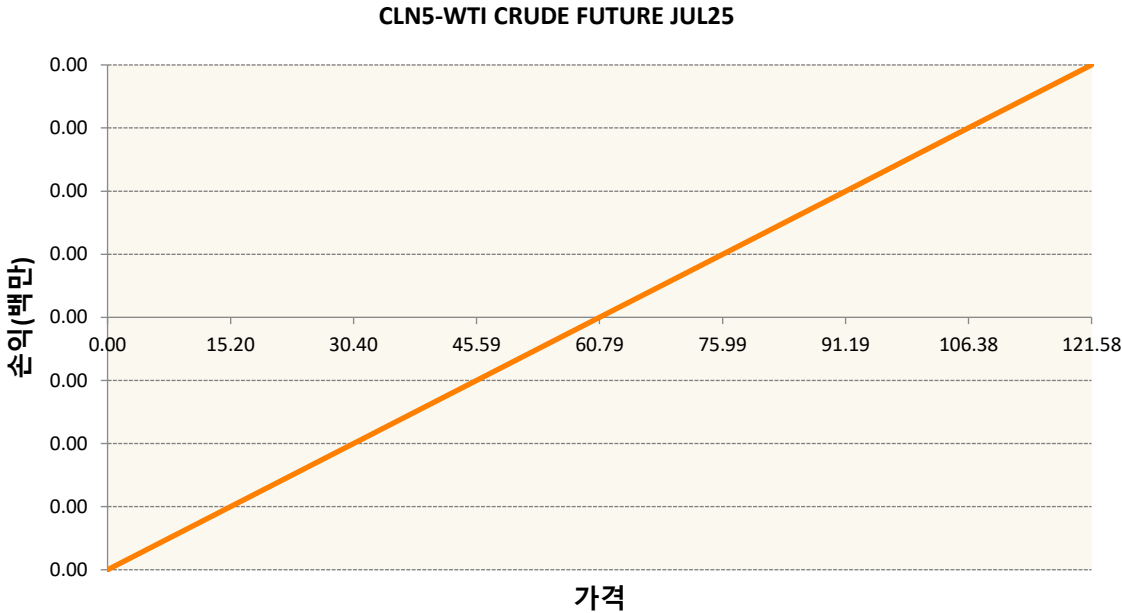
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

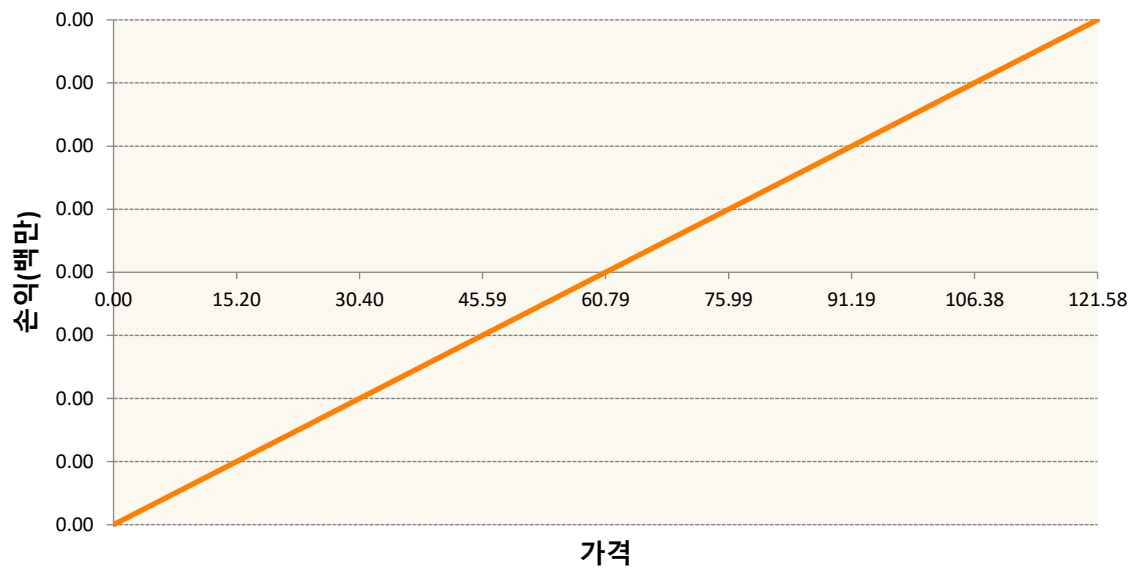
(단위:백만원)

| 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   | 646   | 0     | 646       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 69    | -69       | 장내 |

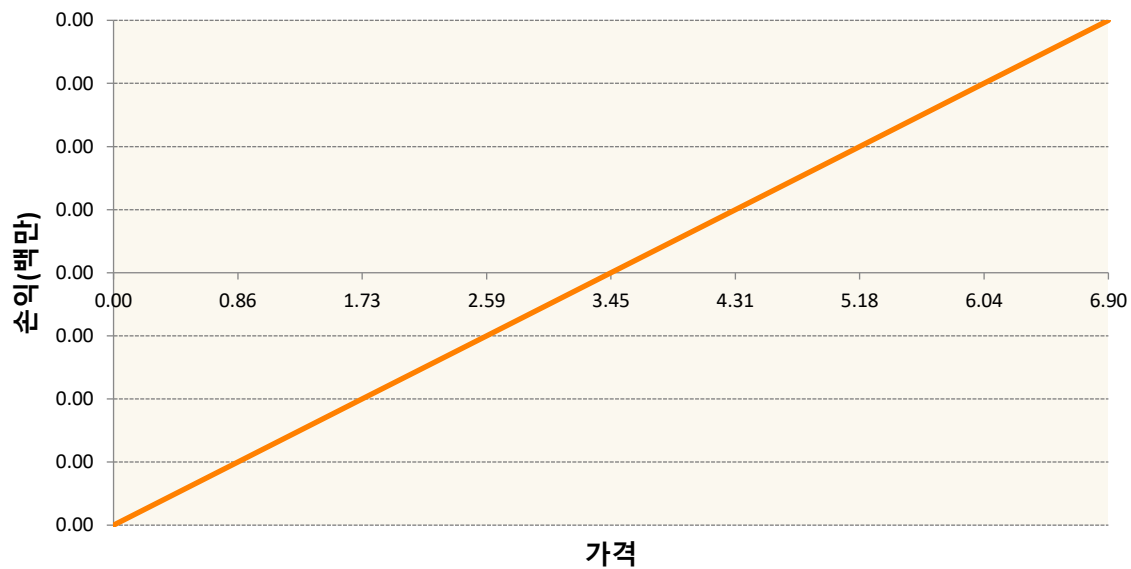
### 2. 만기시점의 손익구조



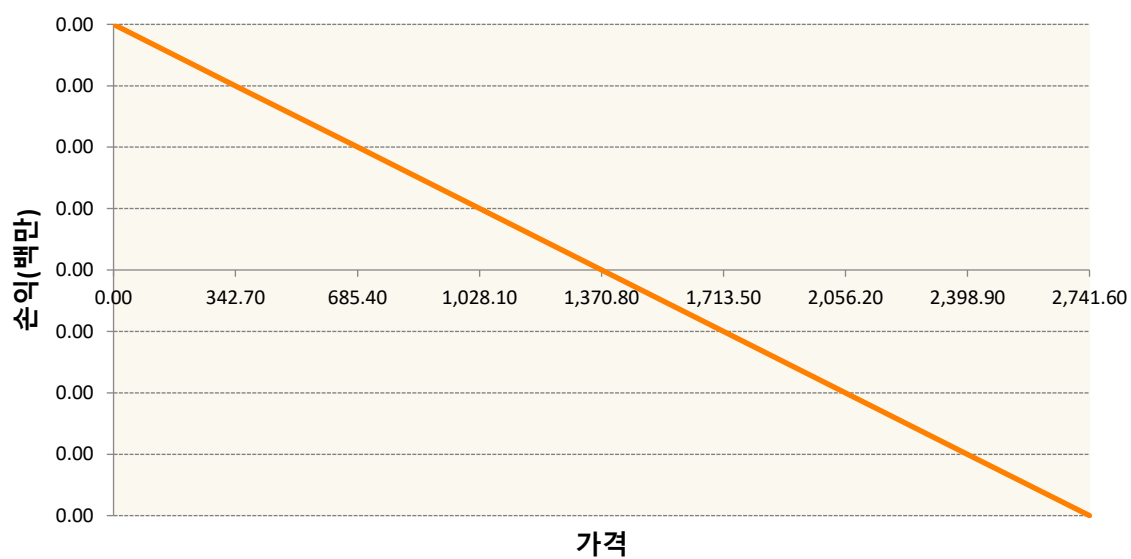
ECN5-E-mini Crude Oil JUL25



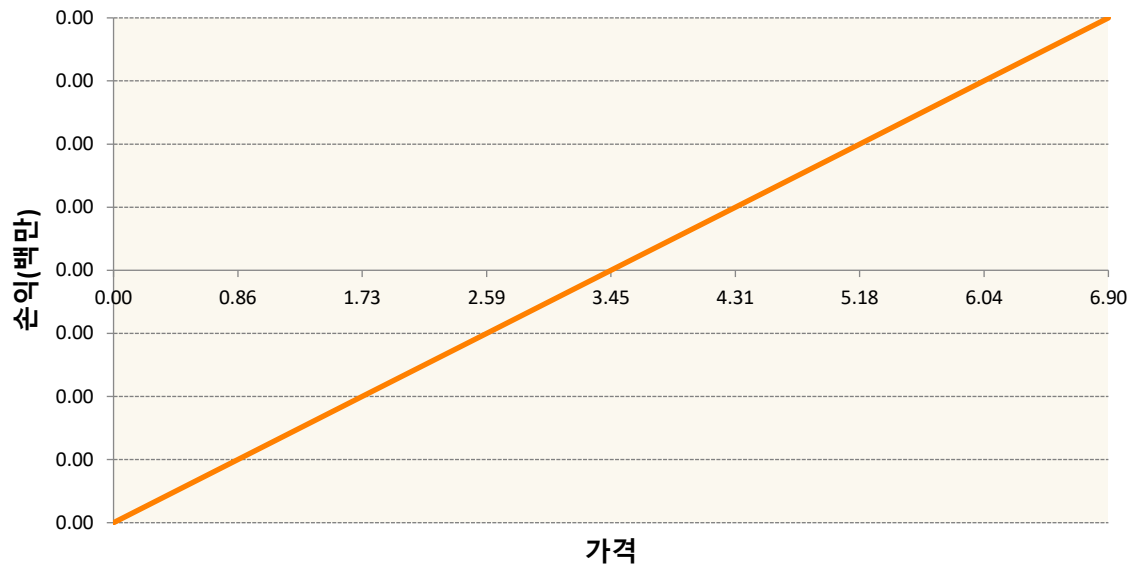
EON5-E-MINI NATURAL GAS JUL25



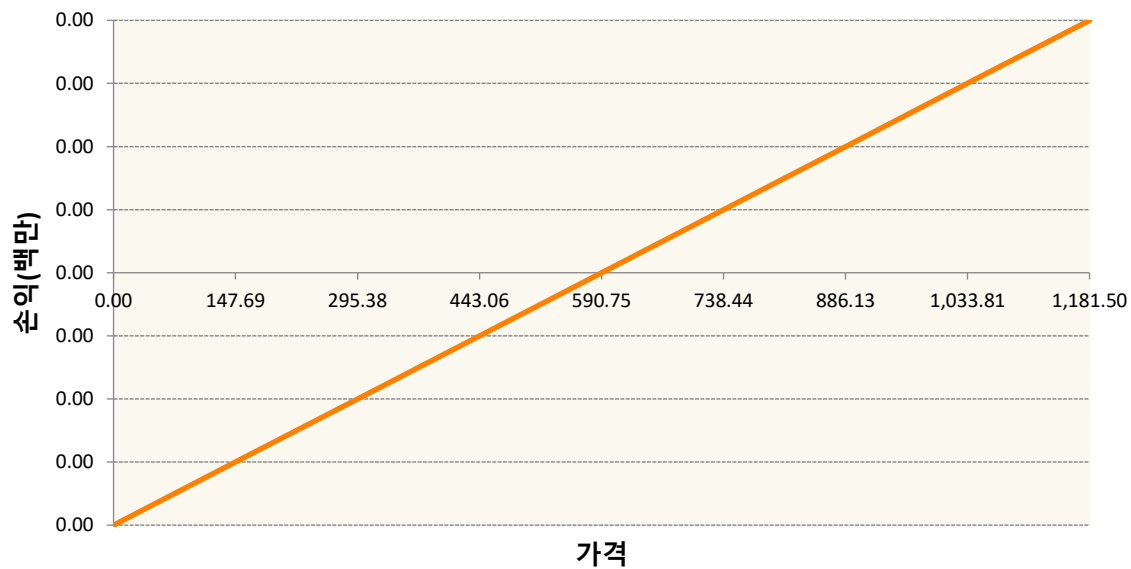
KR4175W60004-2025-06 달러선물



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 |                          | 5  |
| NGN25                   | NATURAL GAS FUTR JUL25   | 12 |
| QSN5                    | Low Su Gasoil G JUL25    | 7  |

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

(단위:백만원)

122