

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

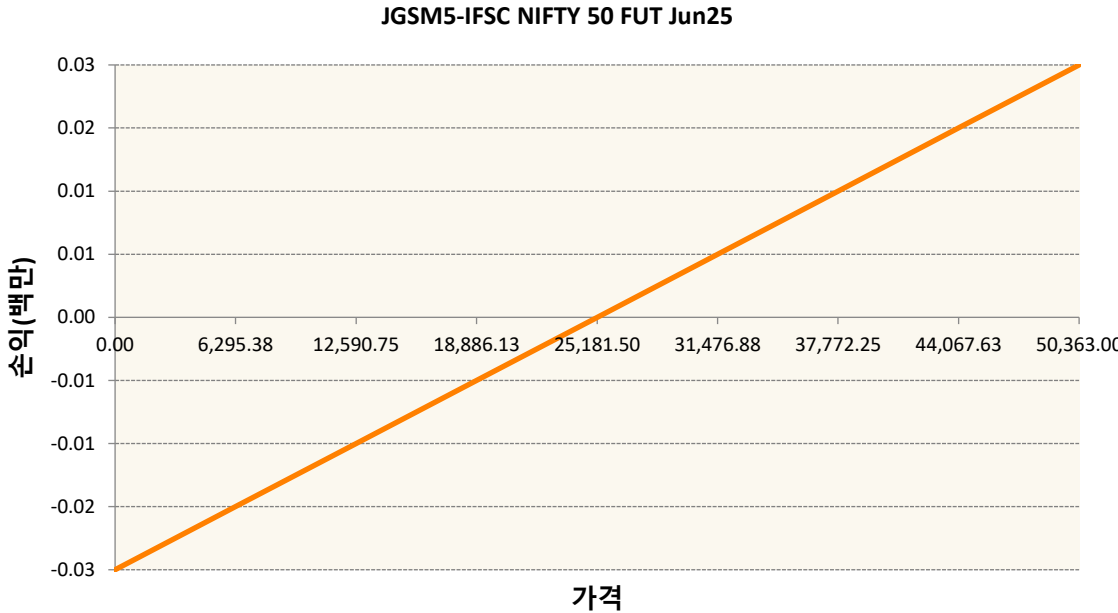
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,519	0	1,519	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSM5	IFSC NIFTY 50 FUT Jun25	122
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

90

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

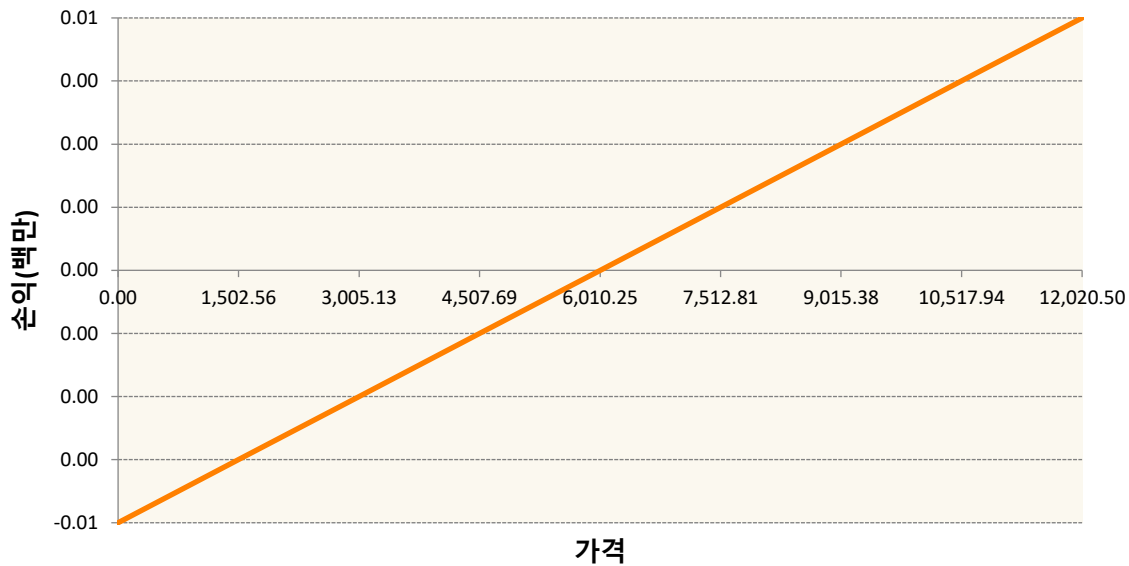
1. 계약금액

(단위:백만원)

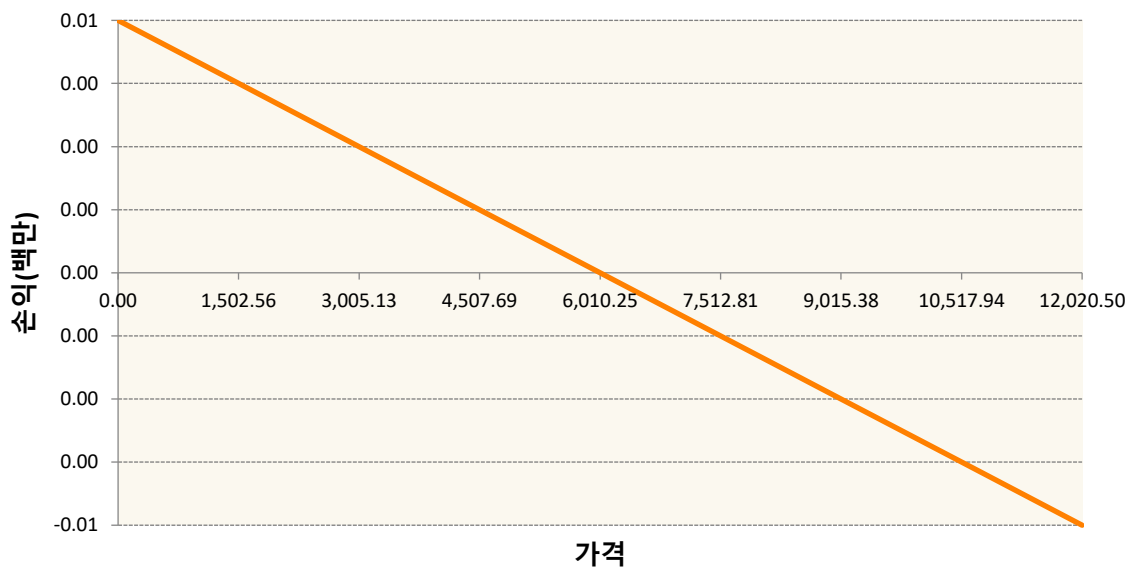
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	111	-111	장내
누계	지수	선물	438	0	438	

2. 만기시점의 손익구조

ESM5-S&P500 EMINI FUT JUN25



HWAM5-SP500 MIC EMIN FUTJun25



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	2025-06-11
기준일	2025-06-10

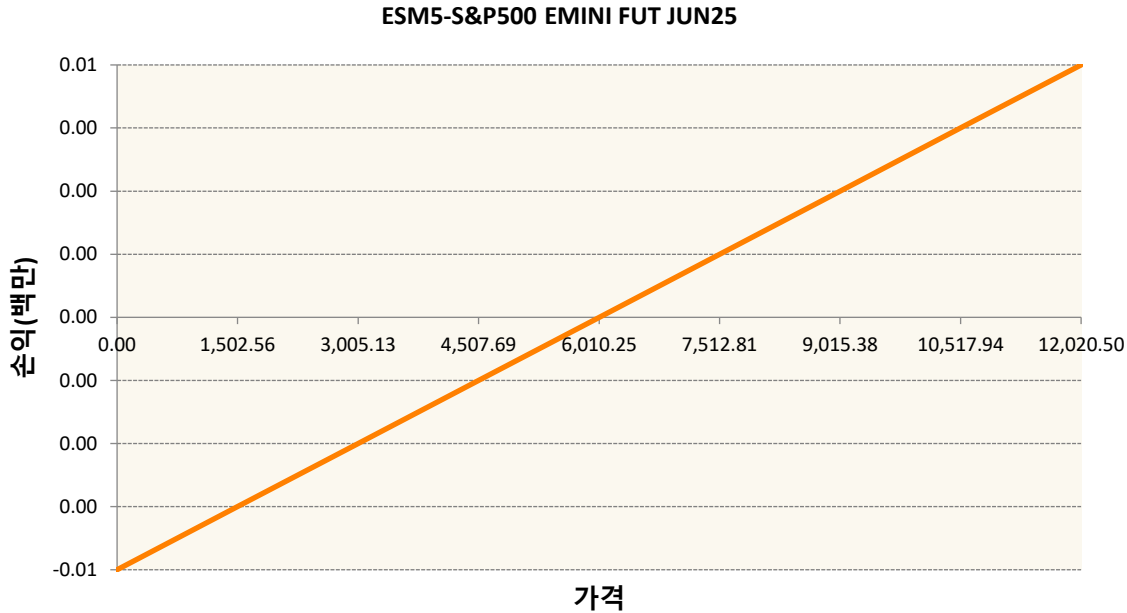
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,315	0	1,315	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	105
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

93

공시일 2025-06-11

기준일 2025-06-10

SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

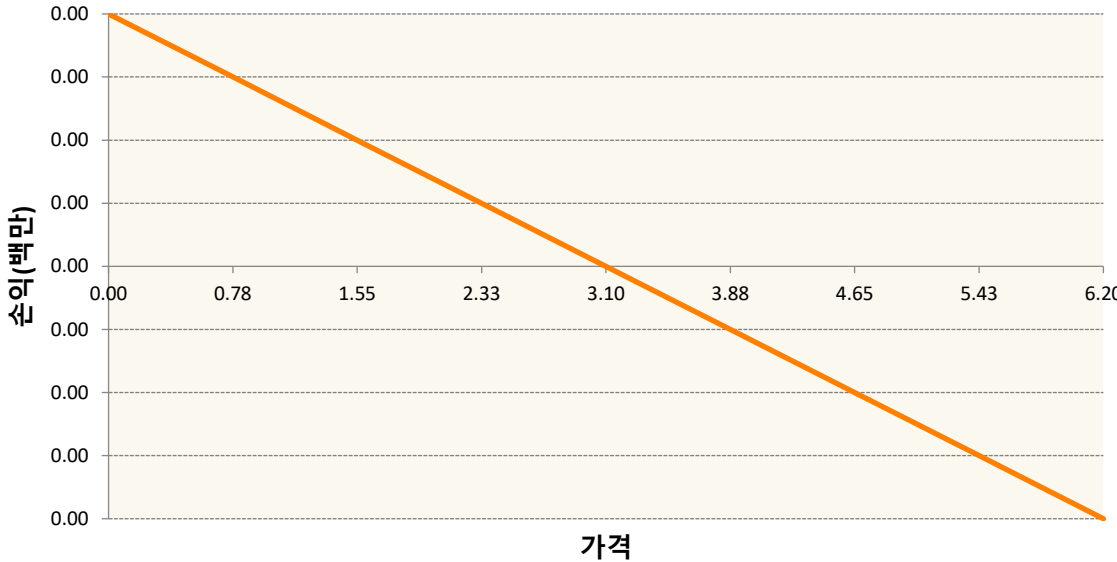
1. 계약금액

(단위:백만원)

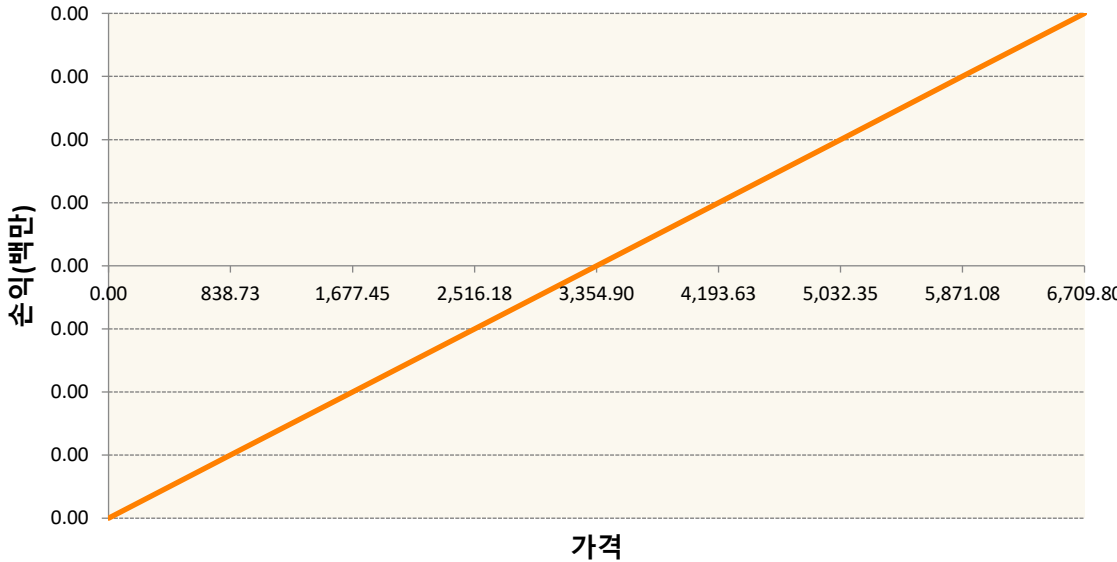
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	2,307	0	2,307	
누계	실물자산	옵션	0	23	-23	

2. 만기시점의 손익구조

AOGLDUSC306C-GLD US 06/13/25 C306 EQUITY



GCQ5-GOLD 100 OZ FUTR Aug25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSC3 GLD US 06/13/25 C306 EQUITY		2
GCQ5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25		185

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	158

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

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	12
AOPLTRUSP1 PLTR US 06/13/25 P125 EQUITY	3

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

(단위:백만원)

59

공시일 2025-06-11

기준일 2025-06-10

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 2025-06-11

기준일 2025-06-10

포커스농산물모(채권-파생형)

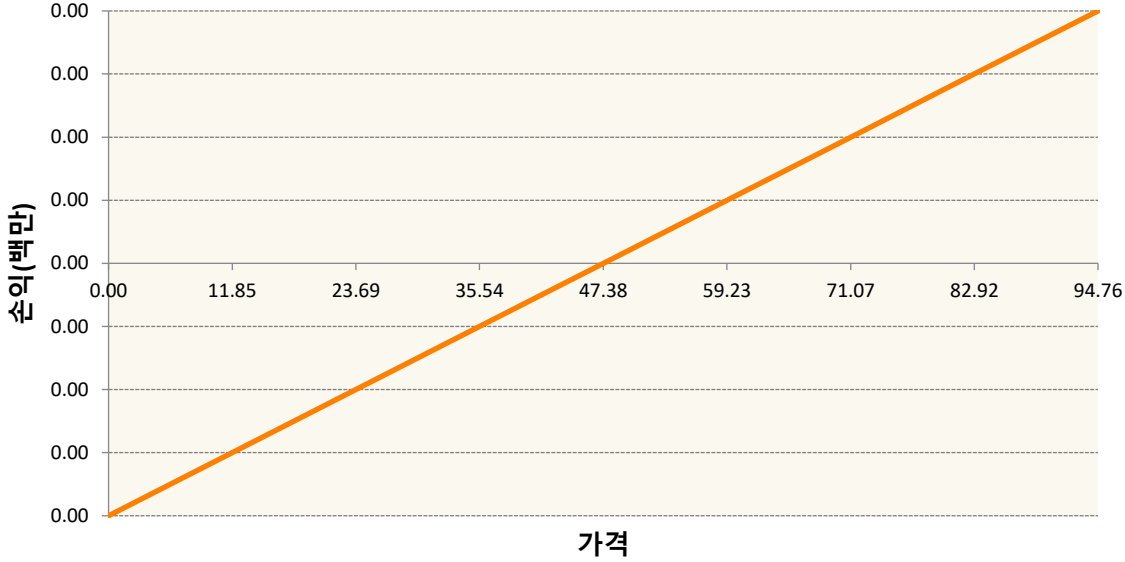
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

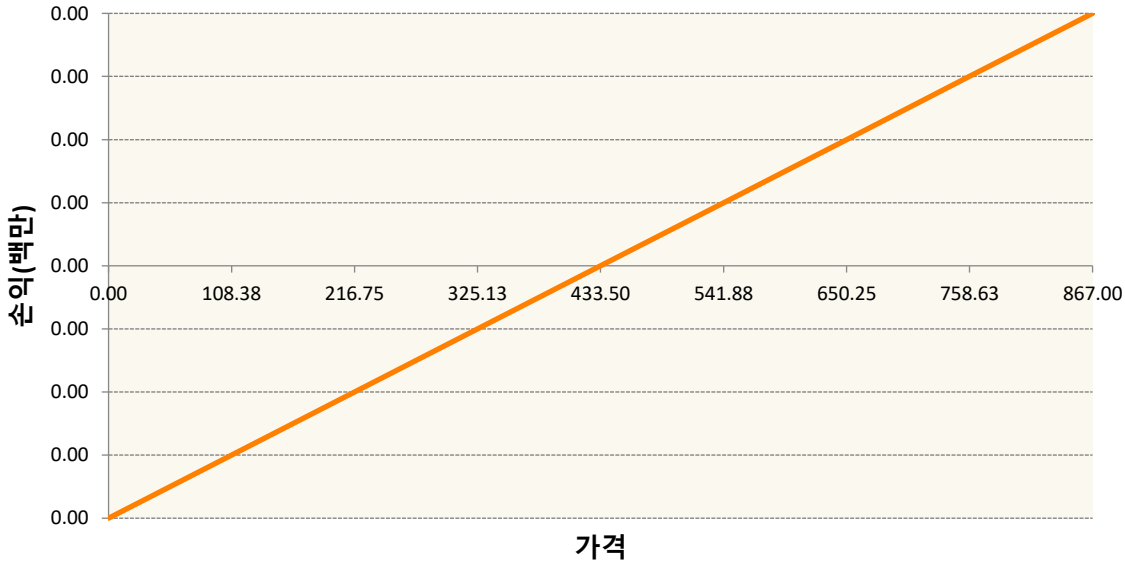
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,869	0	3,869	
누계	통화	선물	0	259	-259	장내

2. 만기시점의 손익구조

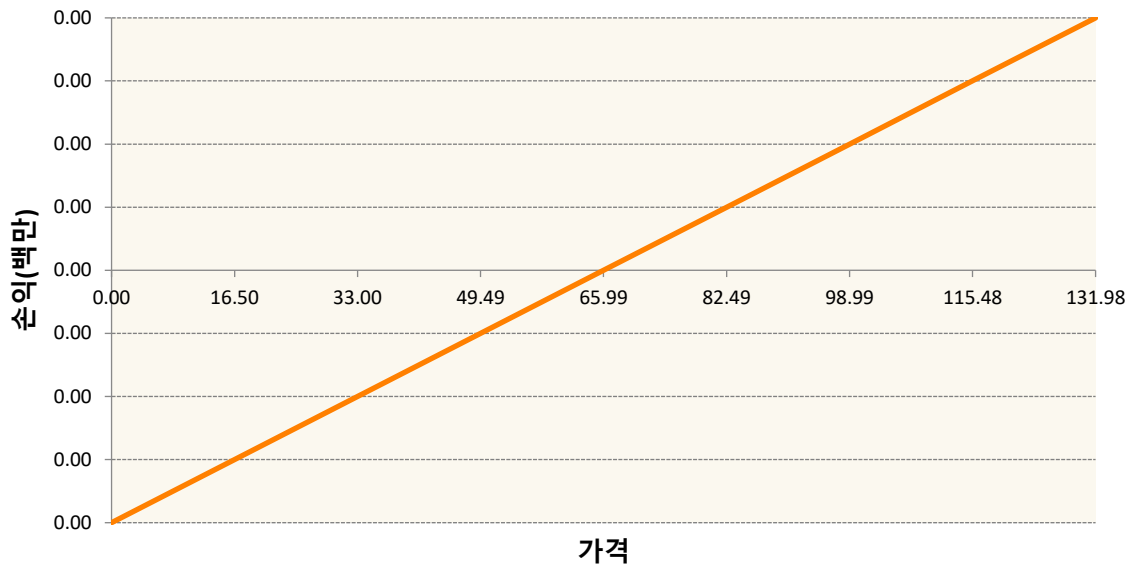
BON5-SOYBEAN OIL FUTR Jul25



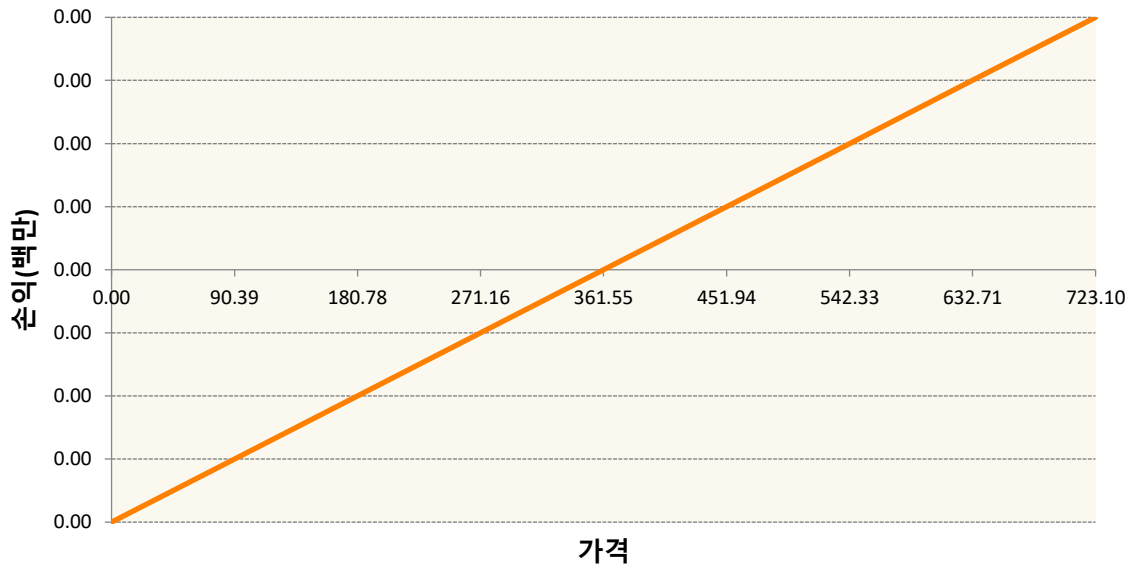
CN5-CORN FUTURE Jul25



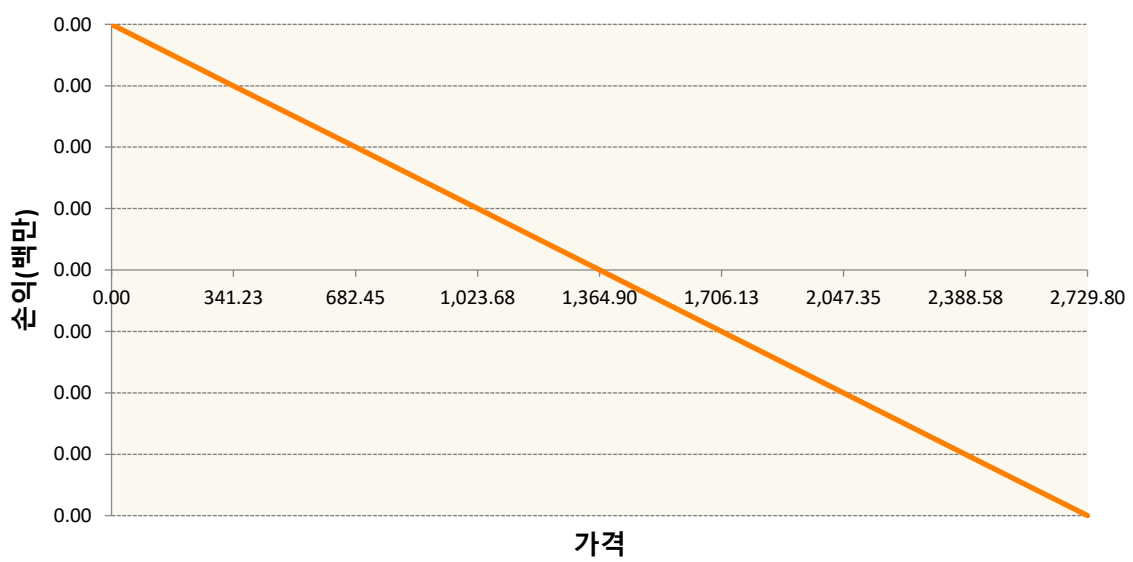
CTN5-COTTON NO.2 FUTR Jul25



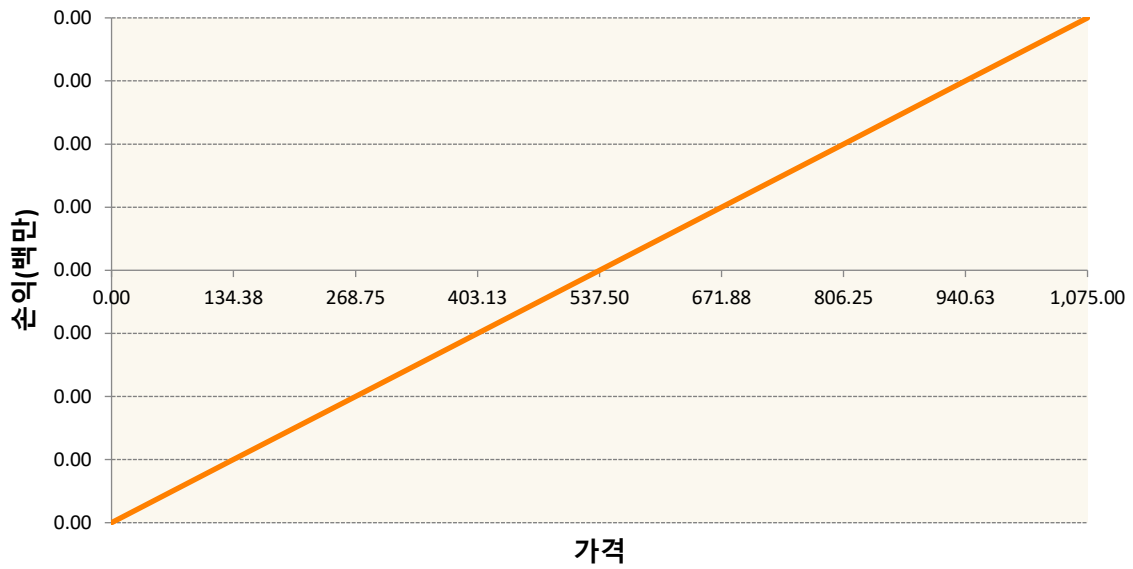
KCN5-COFFEE 'C' FUTURE Jul25



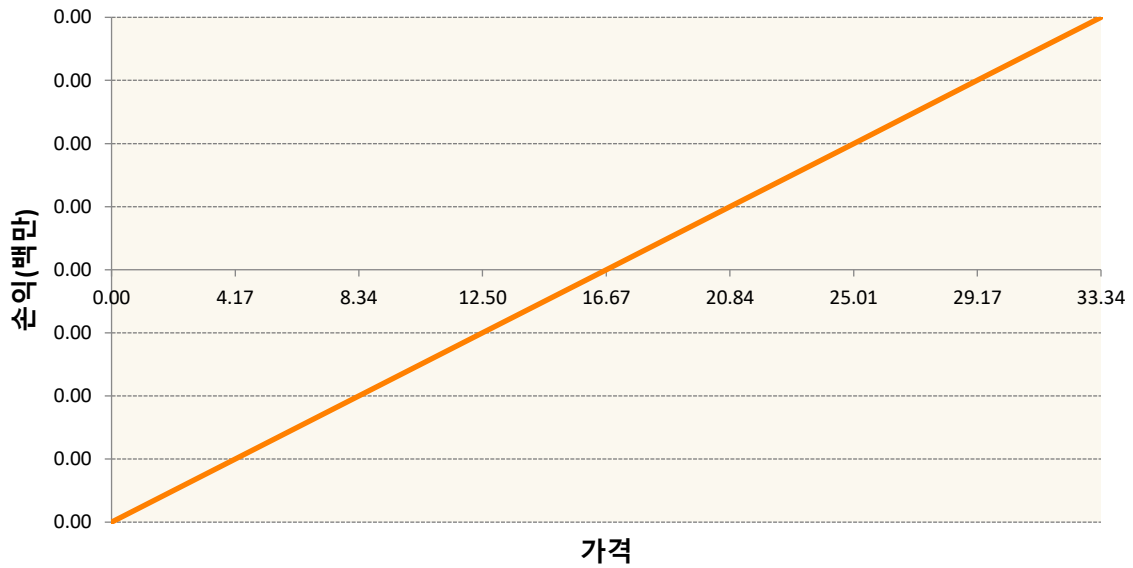
KR4175W60004-2025-06 달러선물



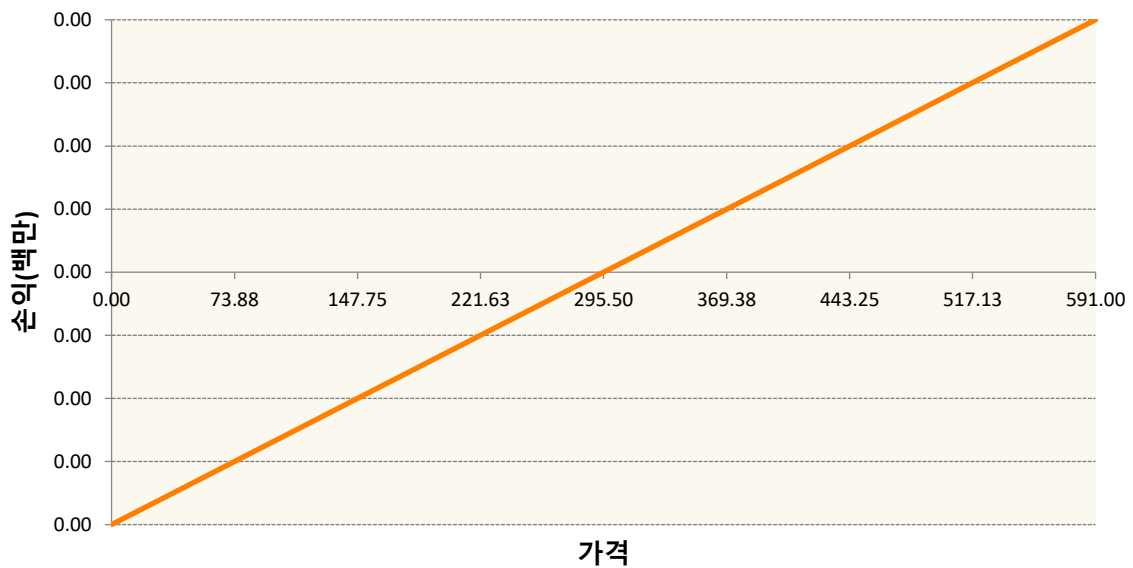
KWN5-KC HRW WHEAT FUT Jul25



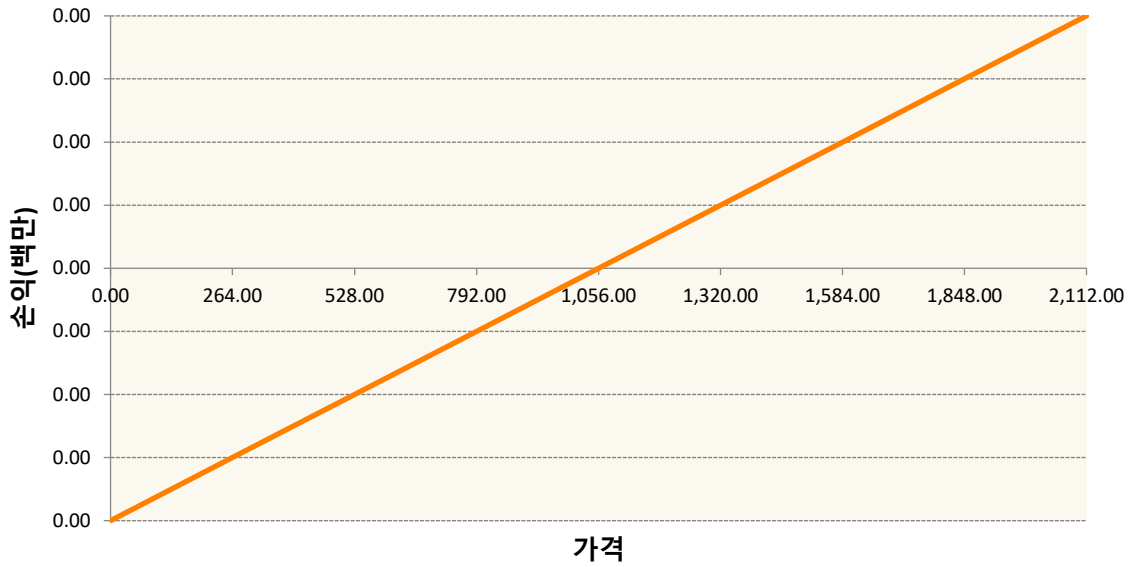
SBN5-Sugar #11 (WORLD) Jul25



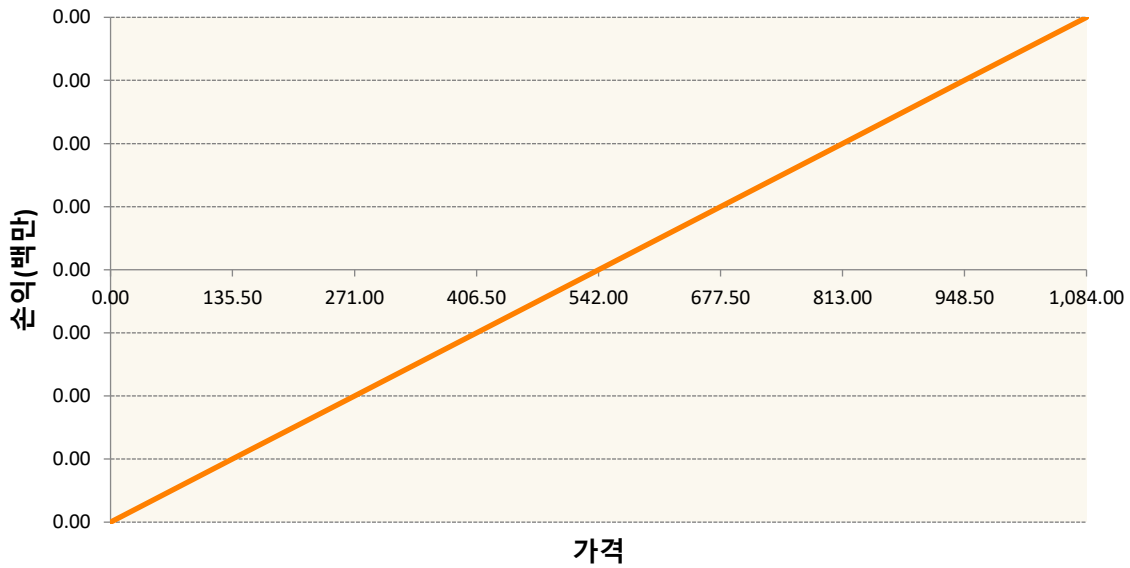
SMN5-SOYBEAN MEAL FUTR Jul25



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 2025-06-11

기준일 2025-06-10

스마트인덱스모

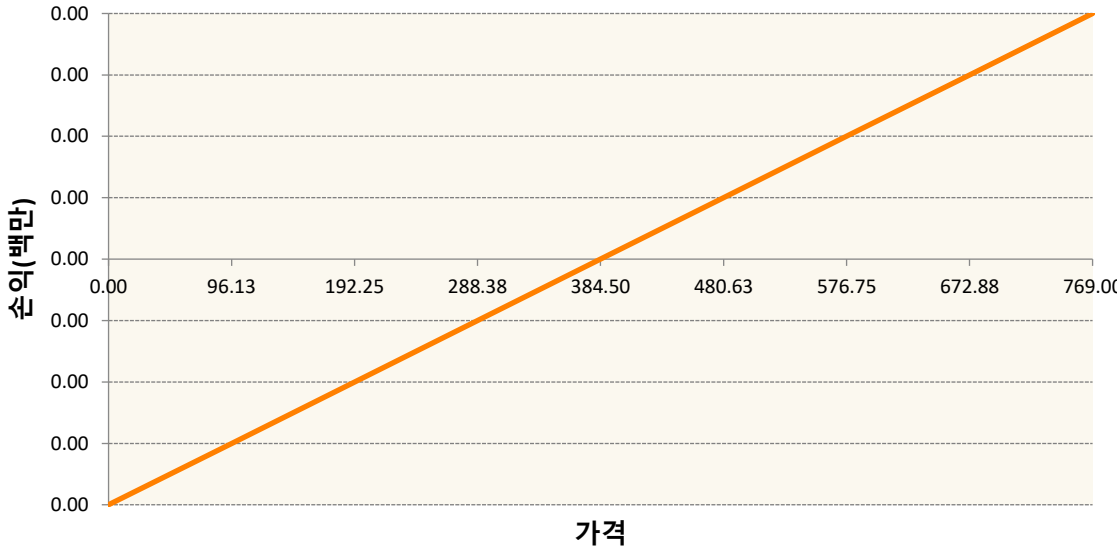
1. 계약금액

(단위:백만원)

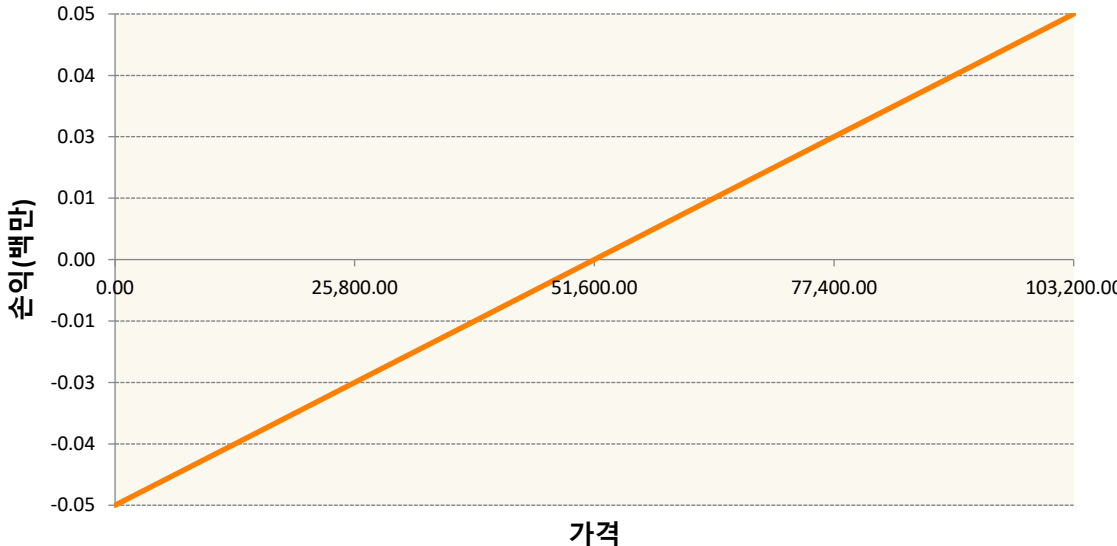
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	151	0	151	장내
누계	유가증권	선물	1,180	0	1,180	장내

2. 만기시점의 손익구조

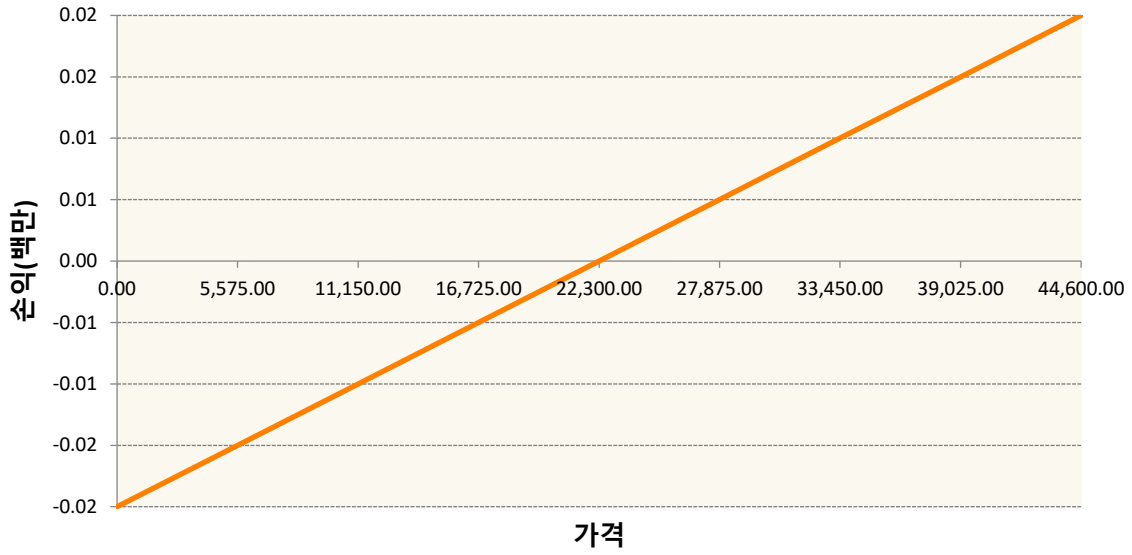
KR4101W60000-2025-06 코스피200지수선물



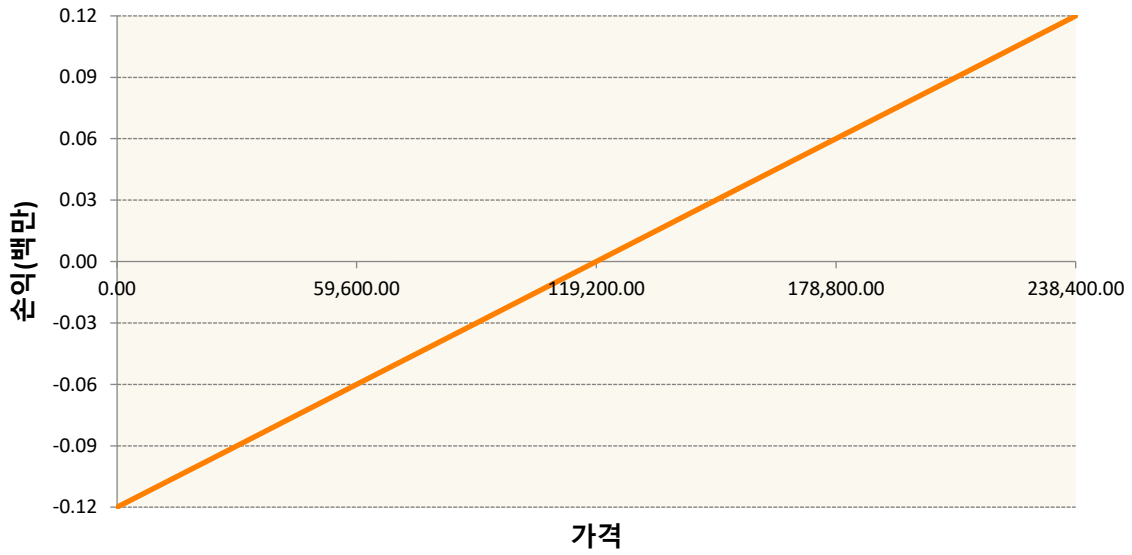
KR410FW60001-2025-06 두산로보틱스개별선물



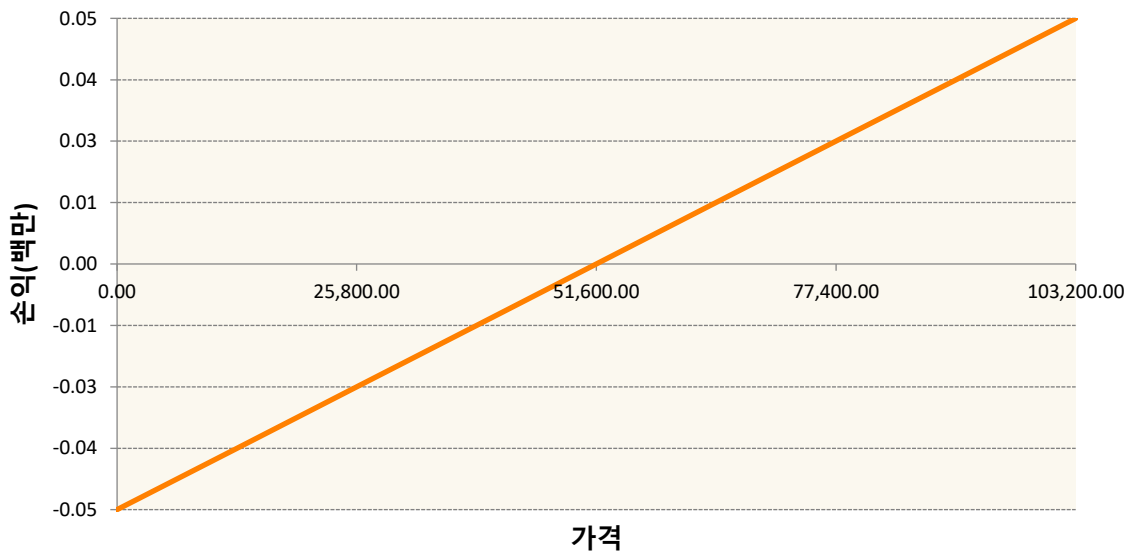
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



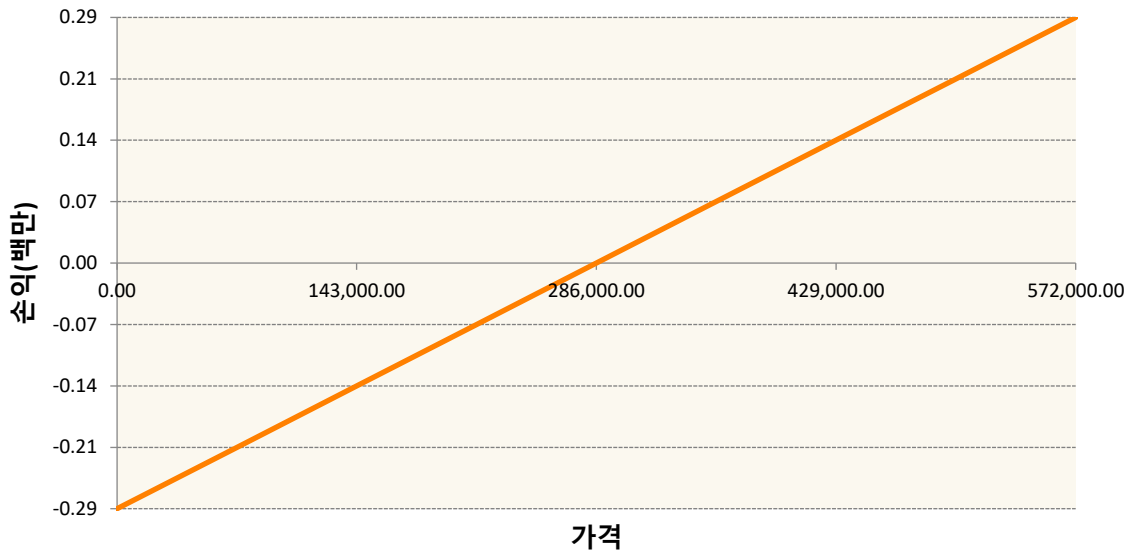
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



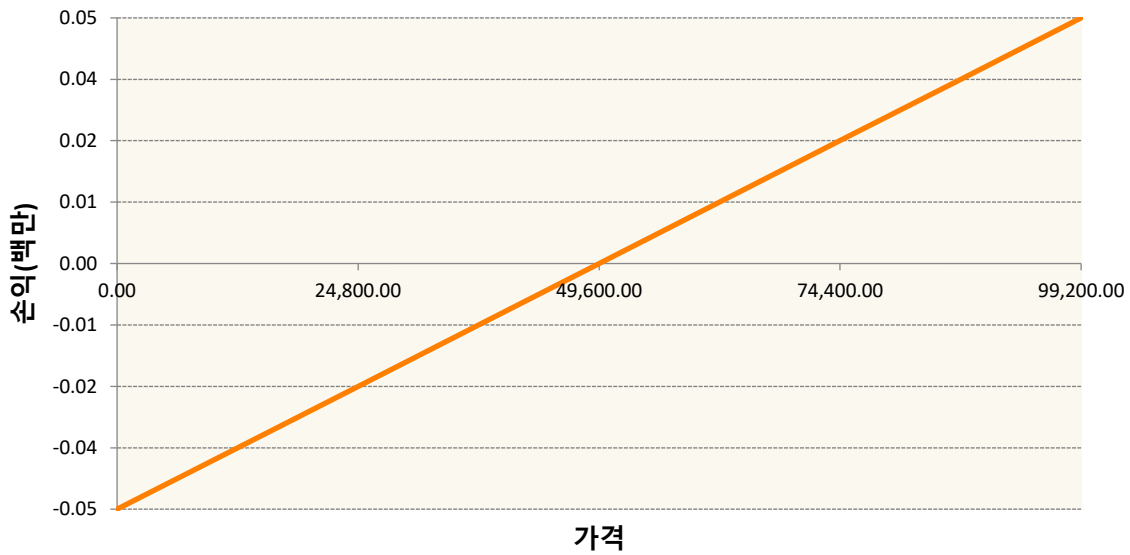
KR41EVW60008-2025-06 한화시스템개별선물



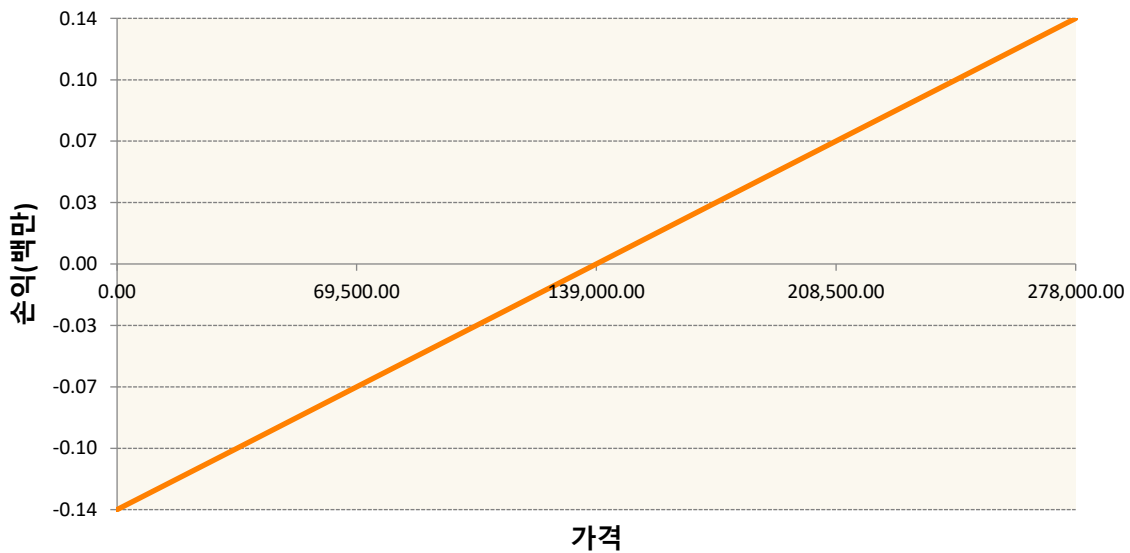
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



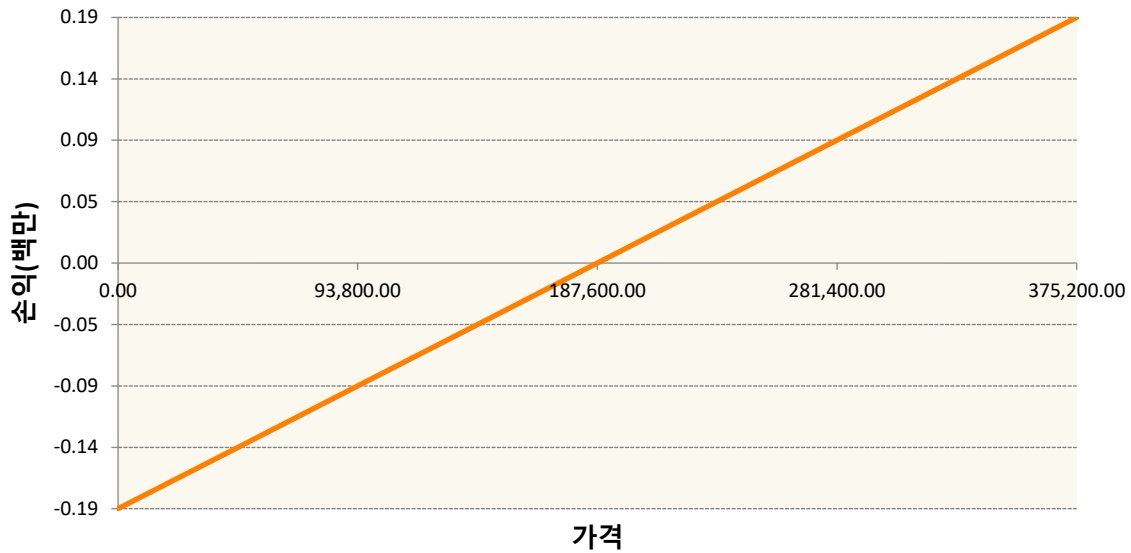
KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물



KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



KR41HEW60007-2025-06 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	62
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물	1
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물	1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41EVW60(2025-06 한화시스템개별선물	4
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	12
KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물	1
KR41G5W60 2025-06 한진칼개별선물	8
KR41HEW60(2025-06 키움증권개별선물	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	172

공시일 2025-06-11

기준일 2025-06-10

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

300

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

483

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

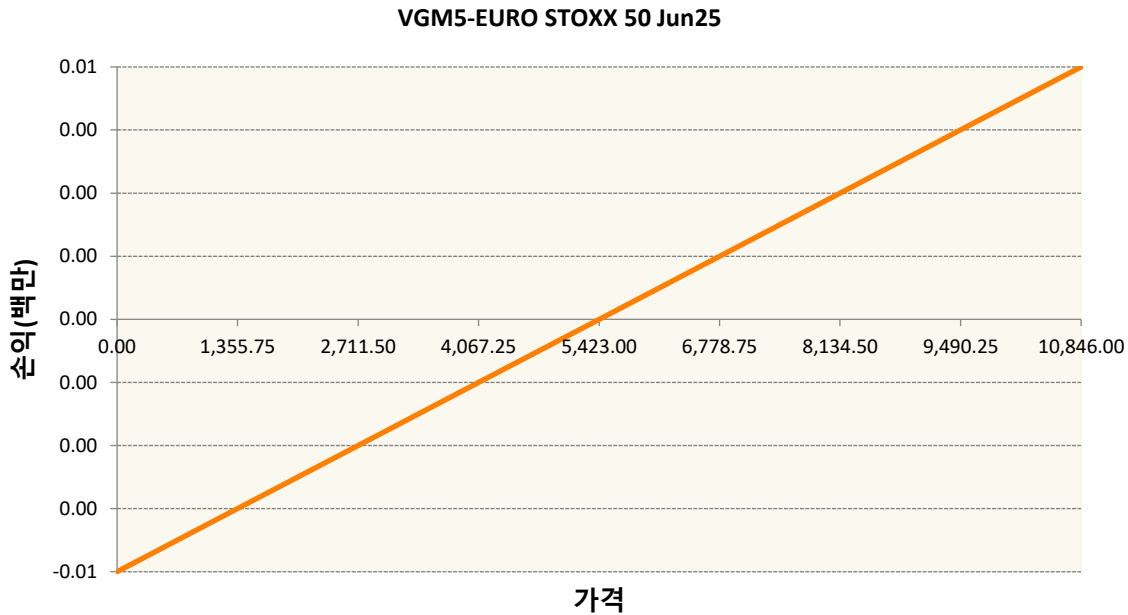
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,035	0	1,035	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

68

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

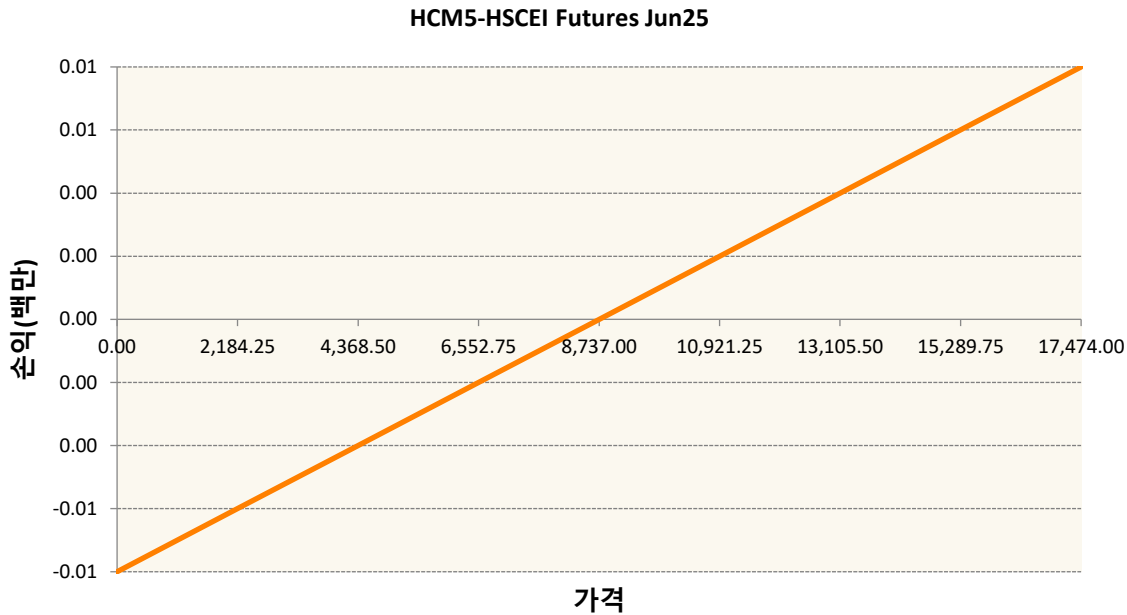
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,531	0	2,531	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM5	HSCEI Futures Jun25	202
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

298

공시일 2025-06-11

기준일 2025-06-10

커버드콜모(주식혼합-파생형)

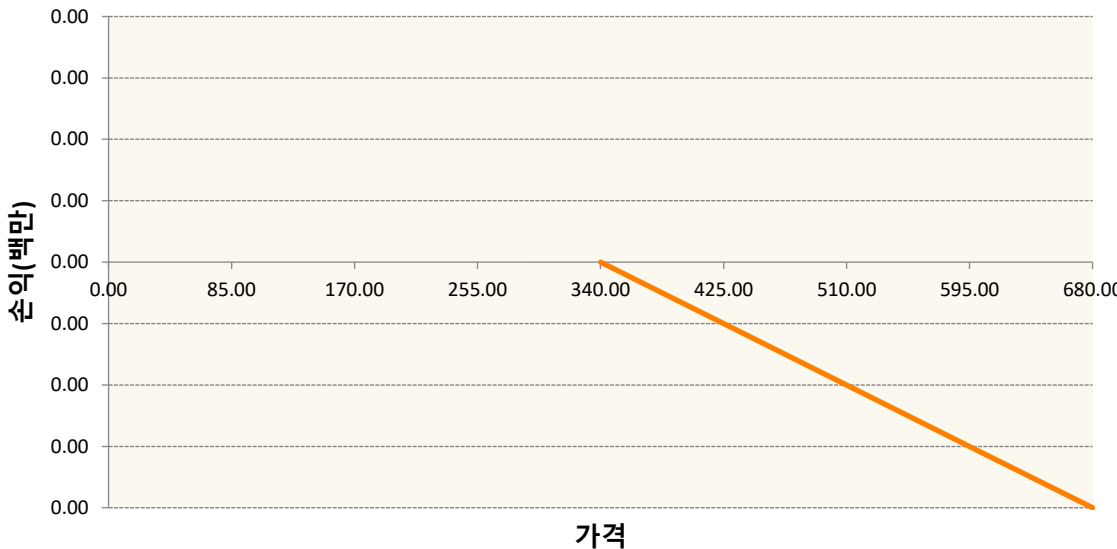
1. 계약금액

(단위:백만원)

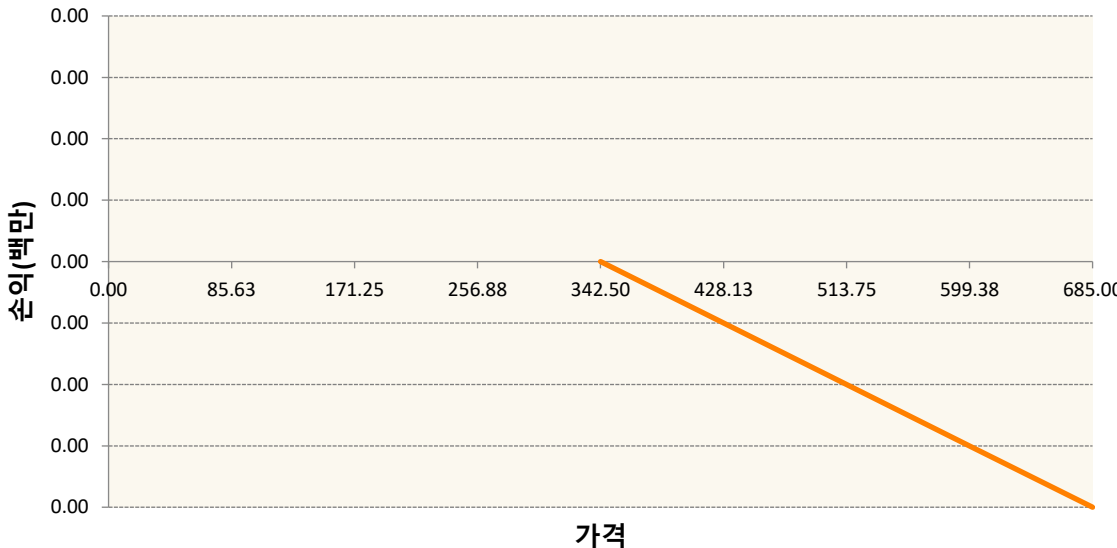
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,867	-32,867	장내

2. 만기시점의 손익구조

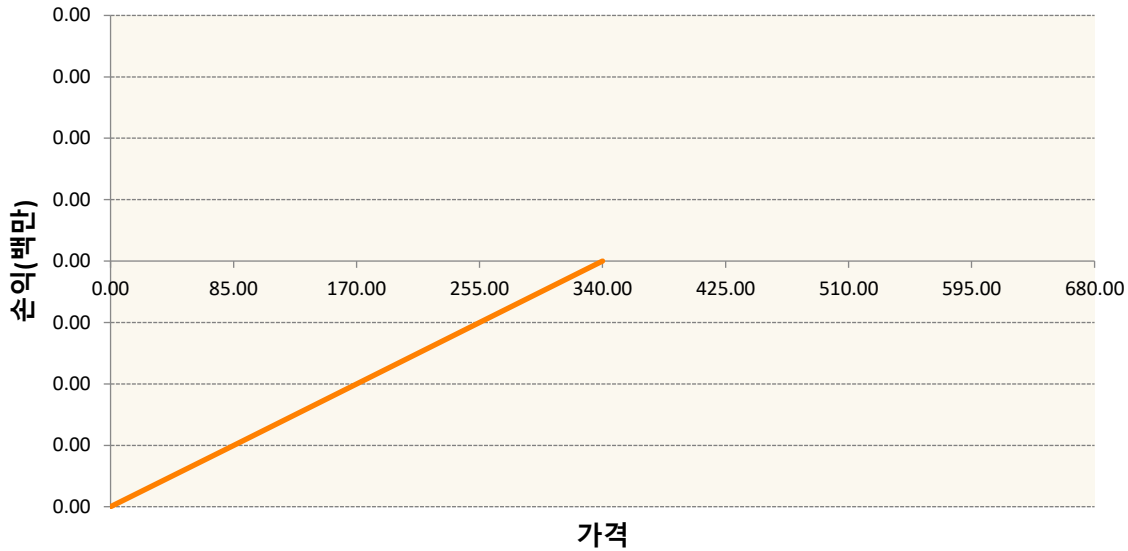
KR4201W63408-코스피200 C 202506 340.0



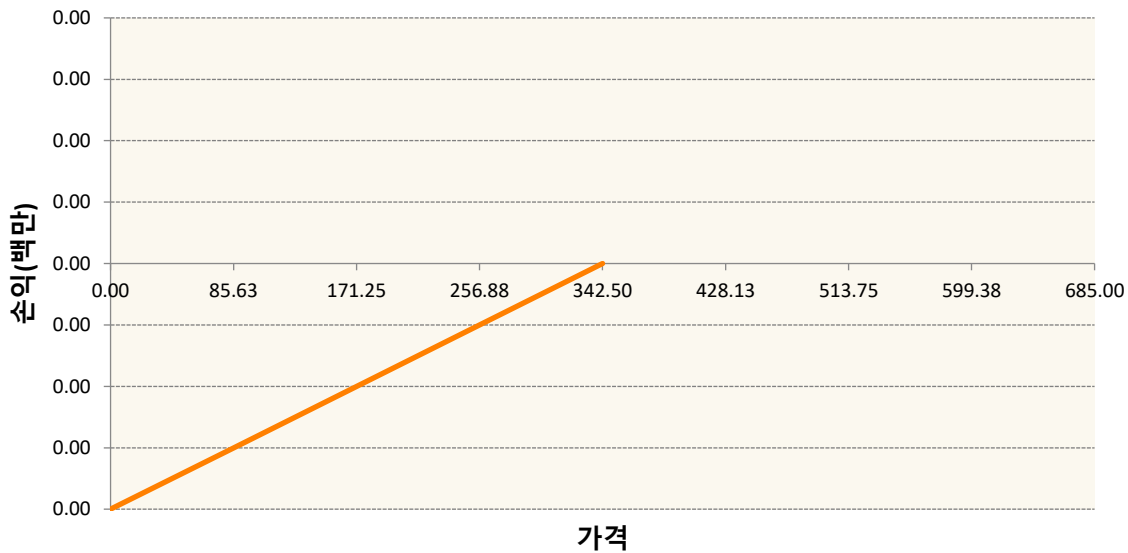
KR4201W63424-코스피200 C 202506 342.5



KR4301W63406-코스피200 P 202506 340.0



KR4301W63422-코스피200 P 202506 342.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201W63408		코스피200 C 202506 340.0					993
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	993	993	992	992	992	992	991
-5.33%	662	662	662	662	662	662	662
-2.67%	331	331	331	331	331	331	331
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-331	-331	-331	-331	-331	-331	-331
5.33%	-662	-662	-662	-662	-662	-662	-662
8.00%	-993	-993	-993	-993	-993	-993	-993
KR4201W63424		코스피200 C 202506 342.5					1,431
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,431	1,431	1,430	1,429	1,428	1,427	1,425
-5.33%	954	954	954	954	954	954	954
-2.67%	477	477	477	477	477	477	477
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-477	-477	-477	-477	-477	-477	-477
5.33%	-954	-954	-954	-954	-954	-954	-954
8.00%	-1,431	-1,431	-1,431	-1,431	-1,431	-1,431	-1,431

KR4301W63406 코스피200 P 202506 340.0 0

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301W63422 코스피200 P 202506 342.5 1

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	-1	-1	-1
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

2,424

공시일 2025-06-11

기준일 2025-06-10

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 2025-06-11

기준일 2025-06-10

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	2025-06-11
기준일	2025-06-10

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	12,368	0	12,368	
누계	통화	선도	0	11,760	-11,760	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E	216
FXW213F4V(KRW/USD 31-07-25E	406
FXW213F5V(KRW/USD 29-08-25E	319
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

460

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

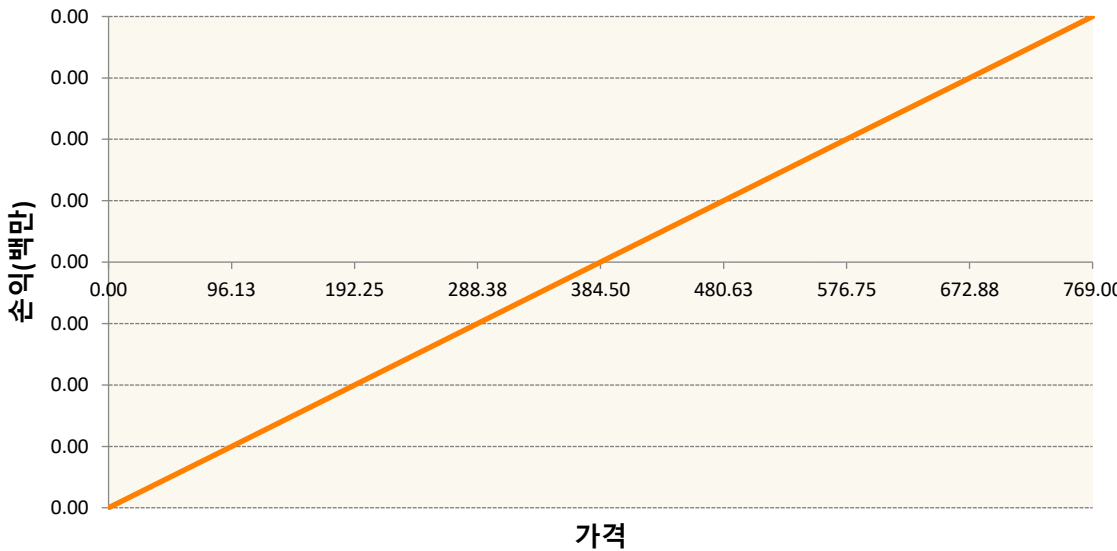
1. 계약금액

(단위:백만원)

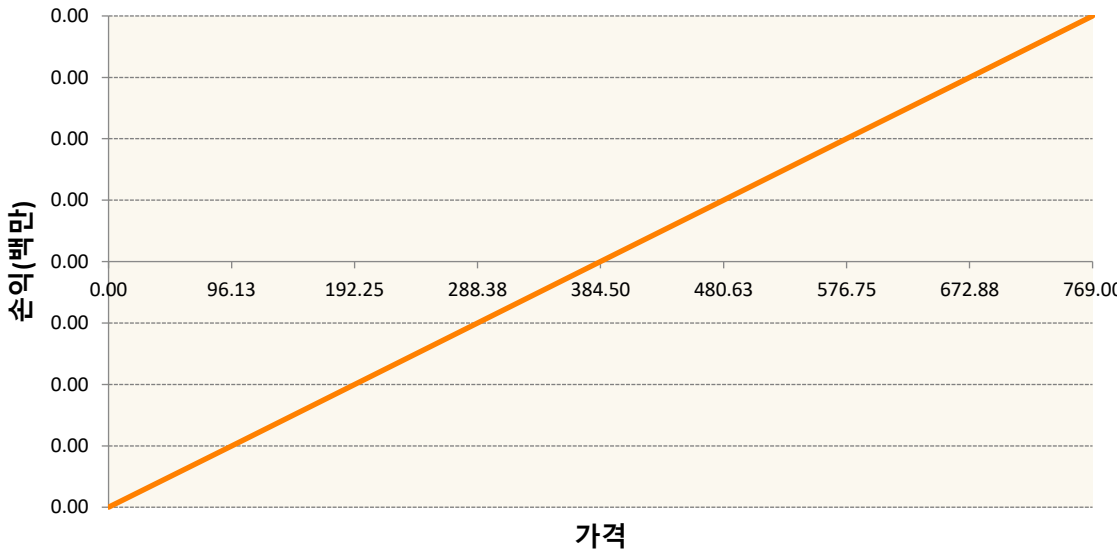
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	89	0	89	장내
누계	유가증권	선물	1,256	0	1,256	장내

2. 만기시점의 손익구조

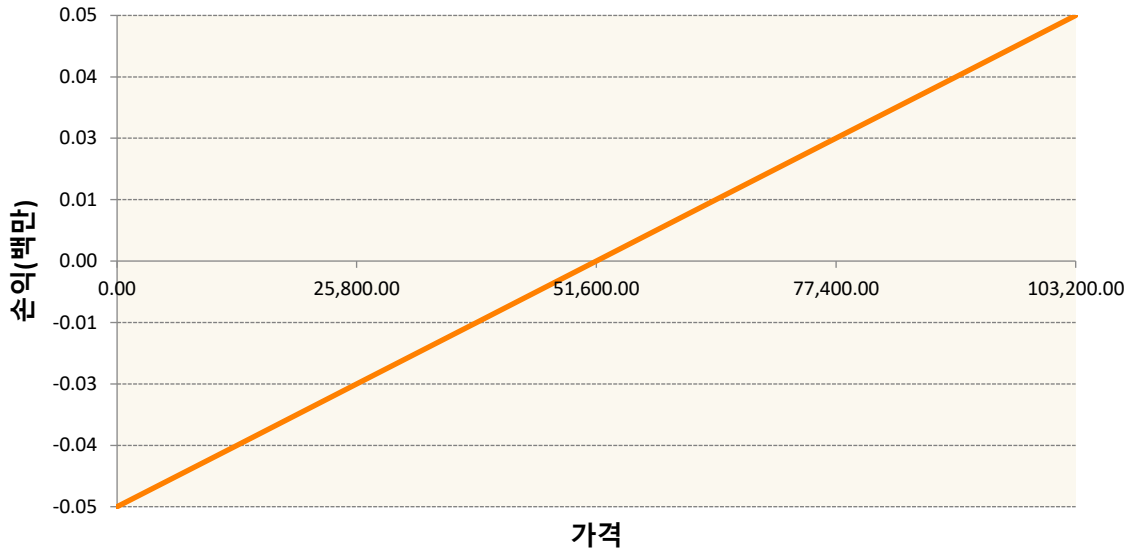
KR4101W60000-2025-06 코스피200지수선물



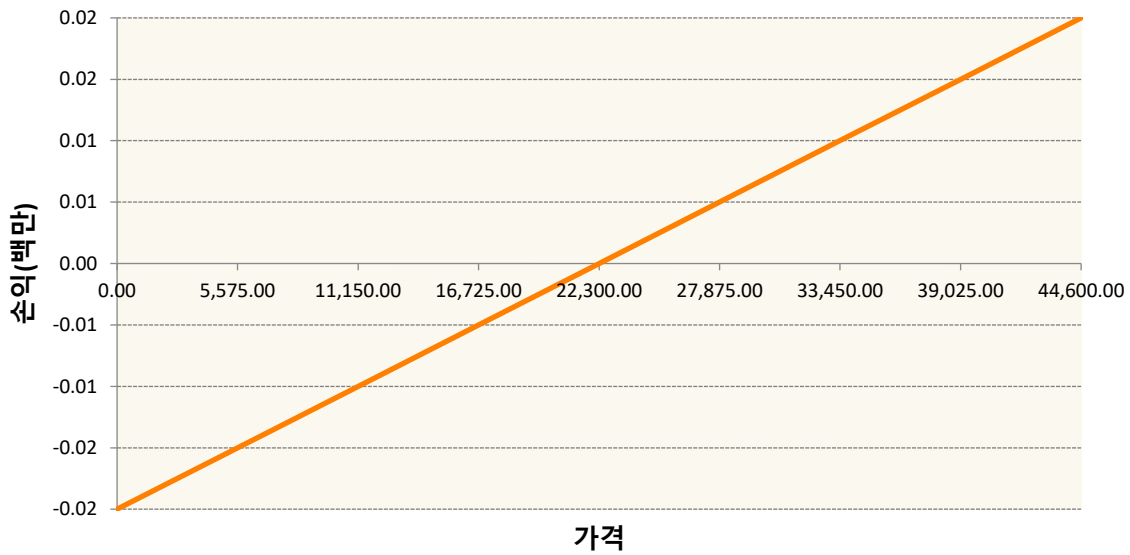
KR4105W60001-2025-06 미니코스피200 선물



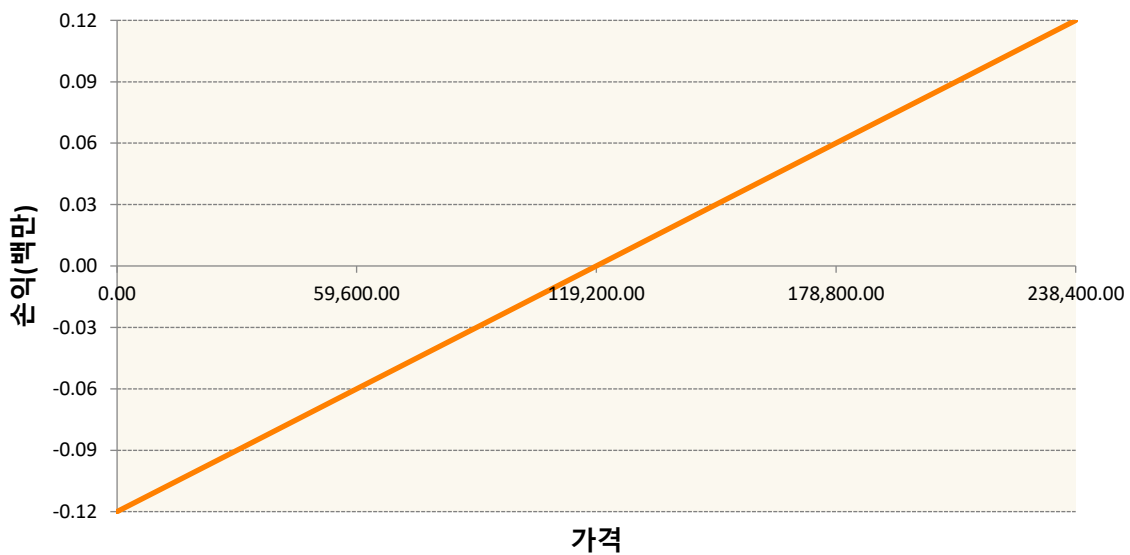
KR410FW60001-2025-06 두산로보틱스개별선물



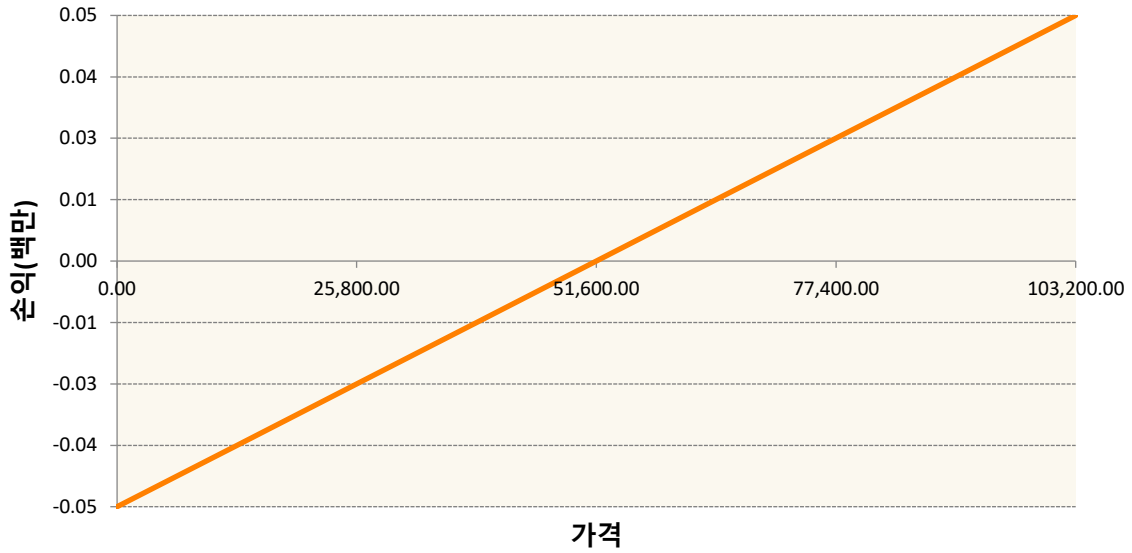
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



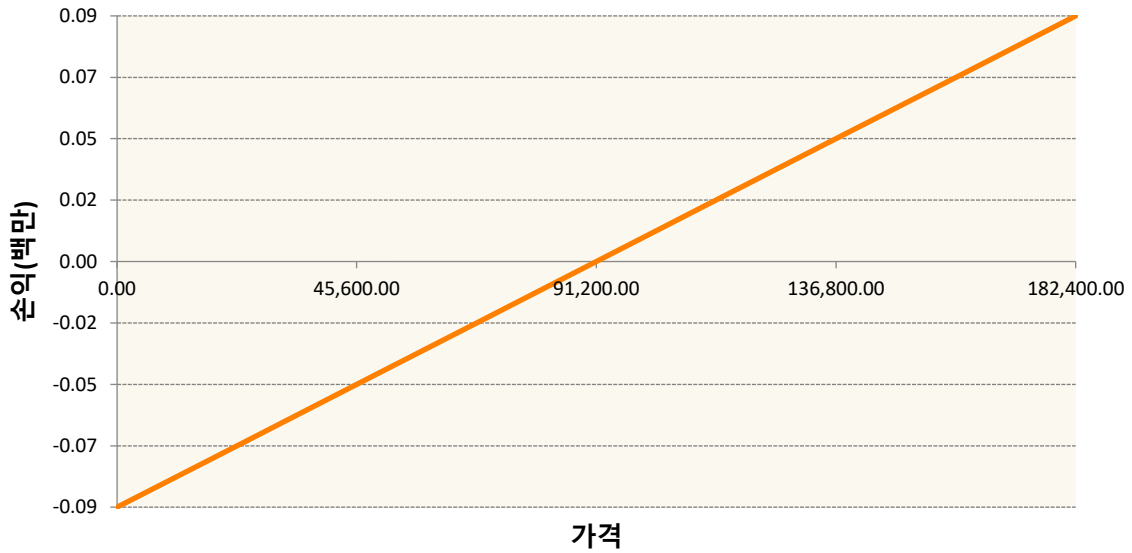
KR41E8W60000-2025-06 포스코퓨처엠개별선물



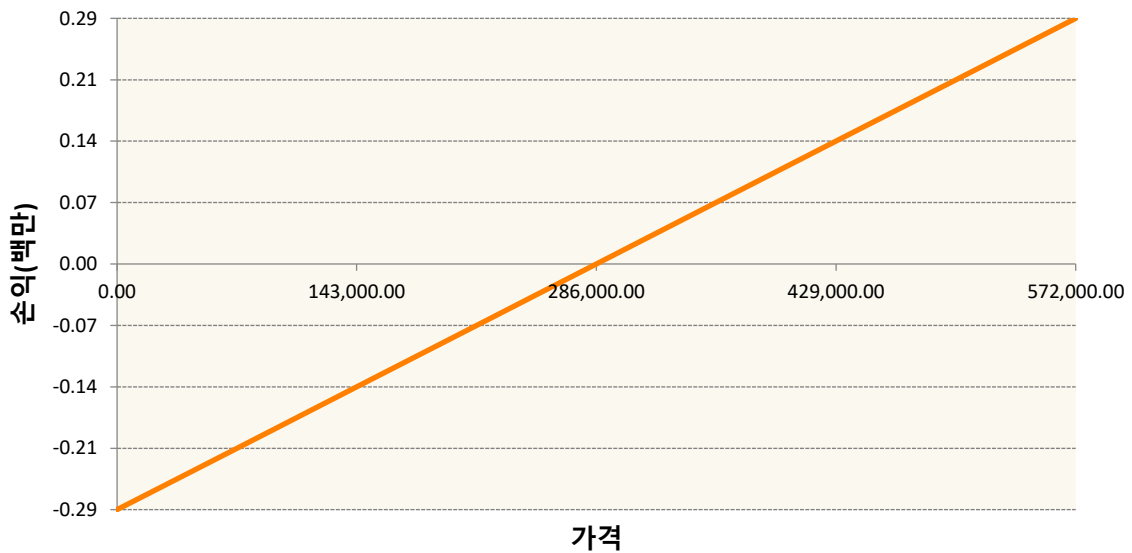
KR41EVW60008-2025-06 한화시스템개별선물



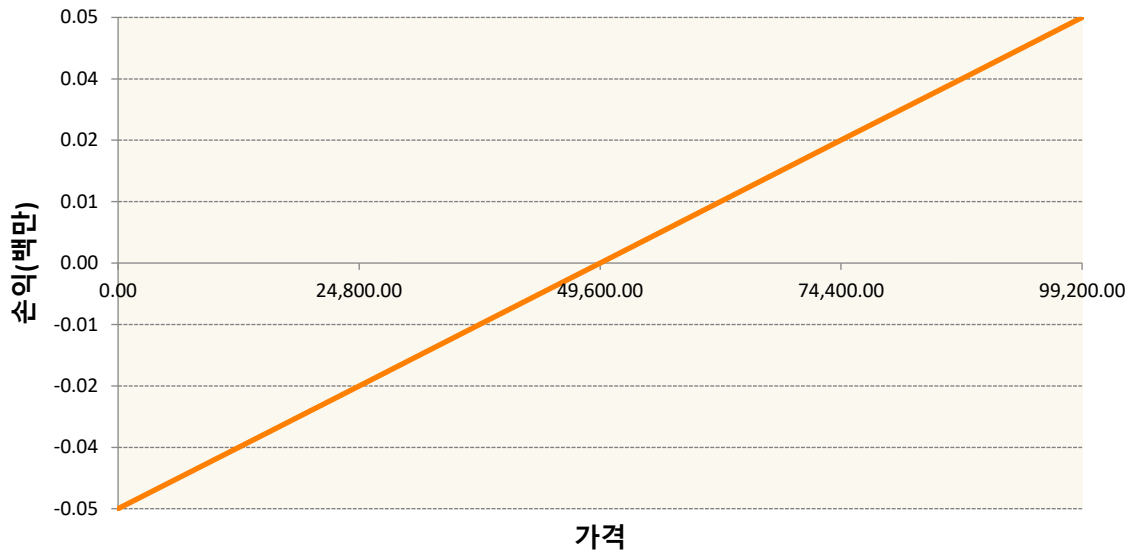
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



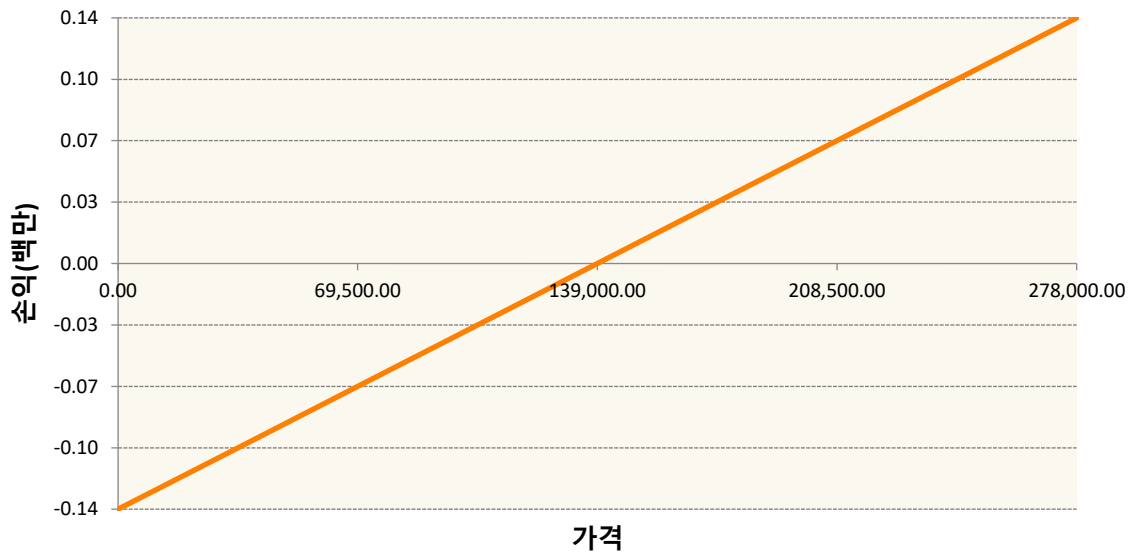
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



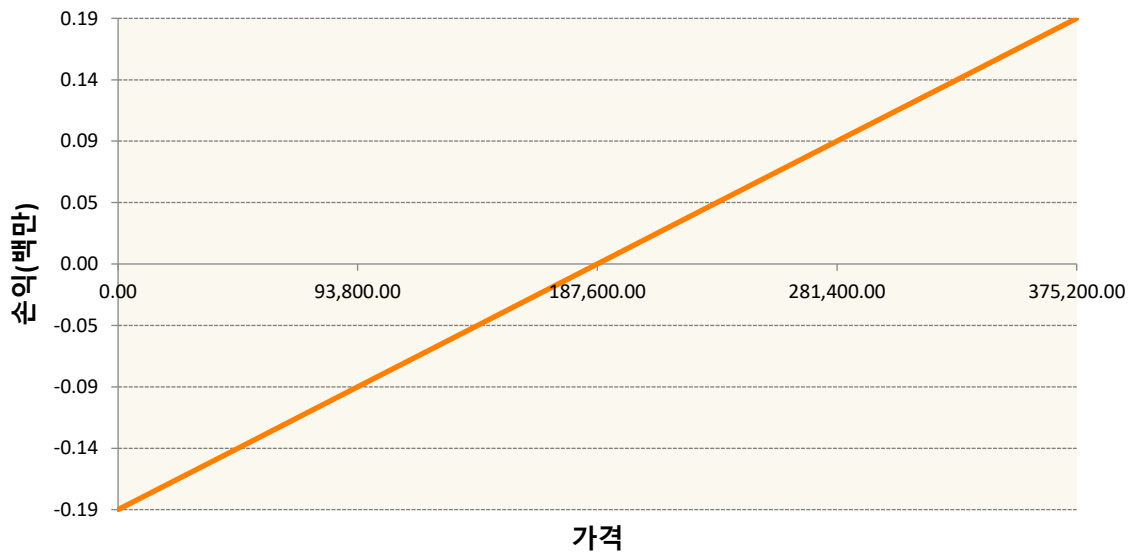
KR41FMW60004-2025-06 엘앤에프개별선물



KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



KR41HEW60007-2025-06 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물	62
KR4105W60(2025-06 미니코스피200 선물	5
KR410FW60(2025-06 두산로보틱스개별선물	0.5
KR41CNW60 2025-06 포스코DX개별선물	1
KR41E8W60(2025-06 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EVW60(2025-06 한화시스템개별선물	2
KR41EYW70(2025-07 에코프로비엠개별선물	2
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	5
KR41FMW60 2025-06 엘앤에프개별선물	1
KR41G5W60 2025-06 한진칼개별선물	3
KR41HEW60 2025-06 키움증권개별선물	0.3

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

134

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

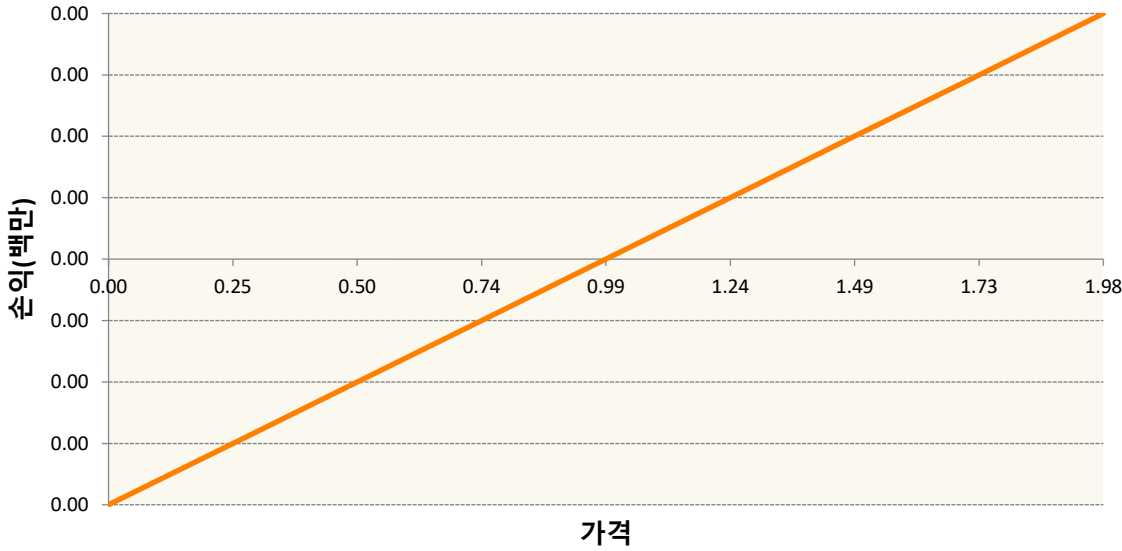
1. 계약금액

(단위:백만원)

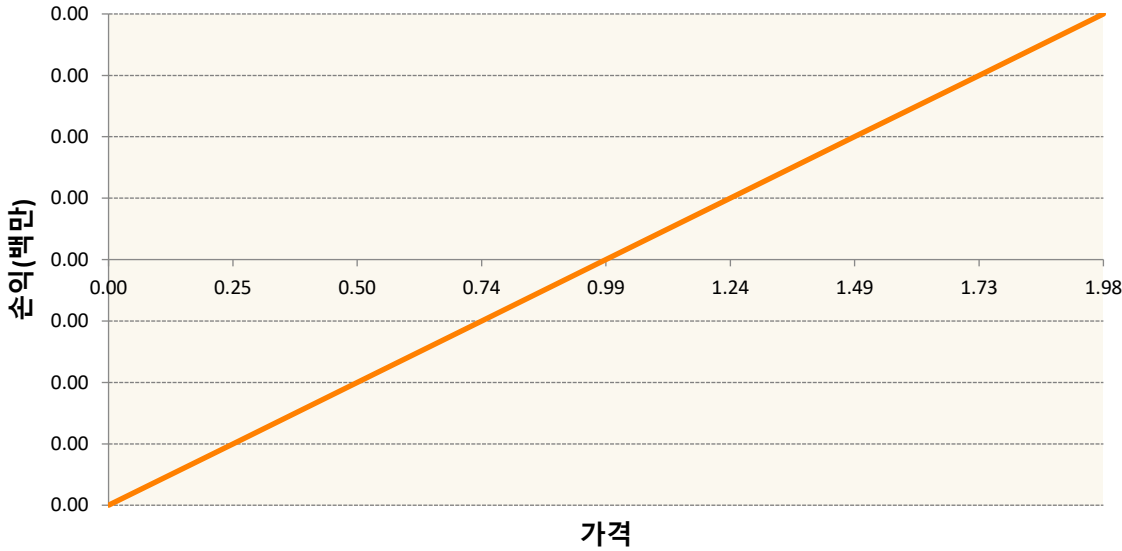
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,740	0	9,740	

2. 만기시점의 손익구조

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



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	582
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	195

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		892

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

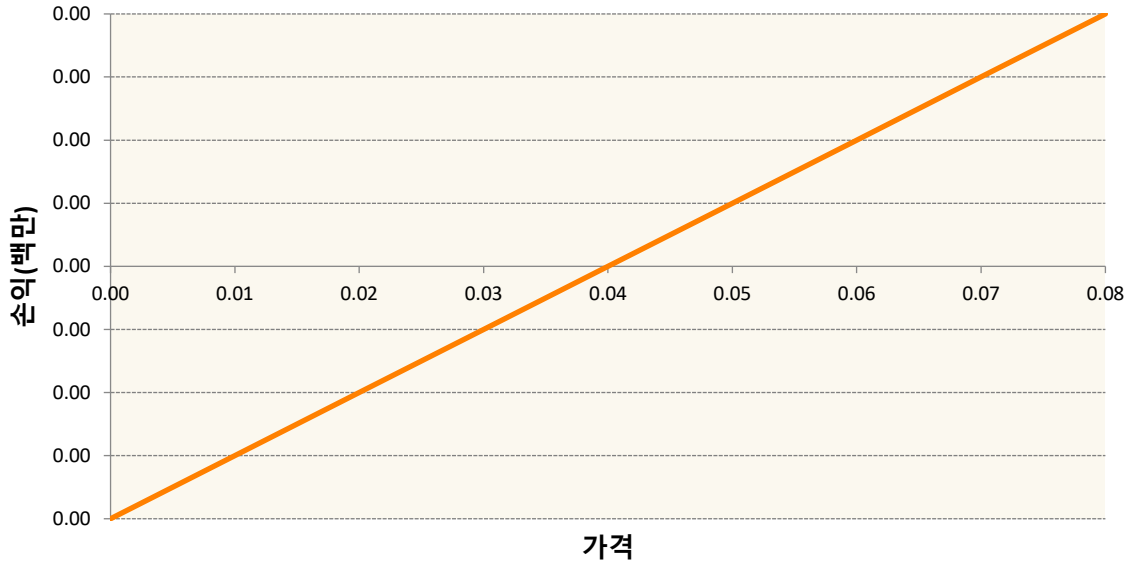
1. 계약금액

(단위:백만원)

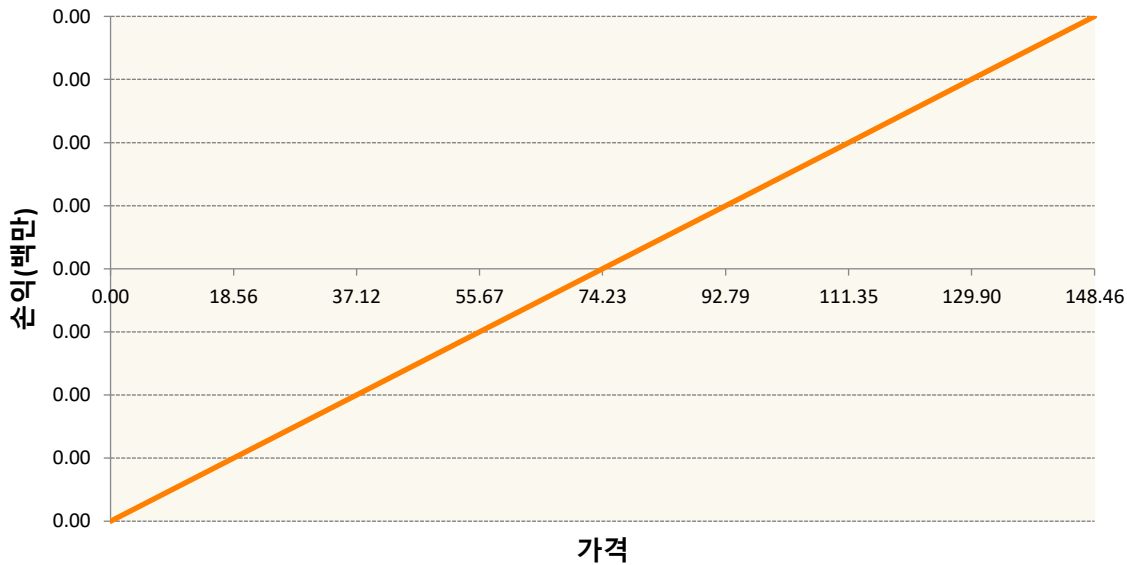
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,755	0	6,755	
누계	통화	선도	0	1,378	-1,378	장외

2. 만기시점의 손익구조

2108850930KM-ICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index



MOZ25-ECX EMISSION Dec25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	1
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	33
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	77
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	539

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

992

공시일 2025-06-11

기준일 2025-06-10

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)

126

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

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)

175

공시일 2025-06-11

기준일 2025-06-10

에쿼티알파일반사모혼합자산

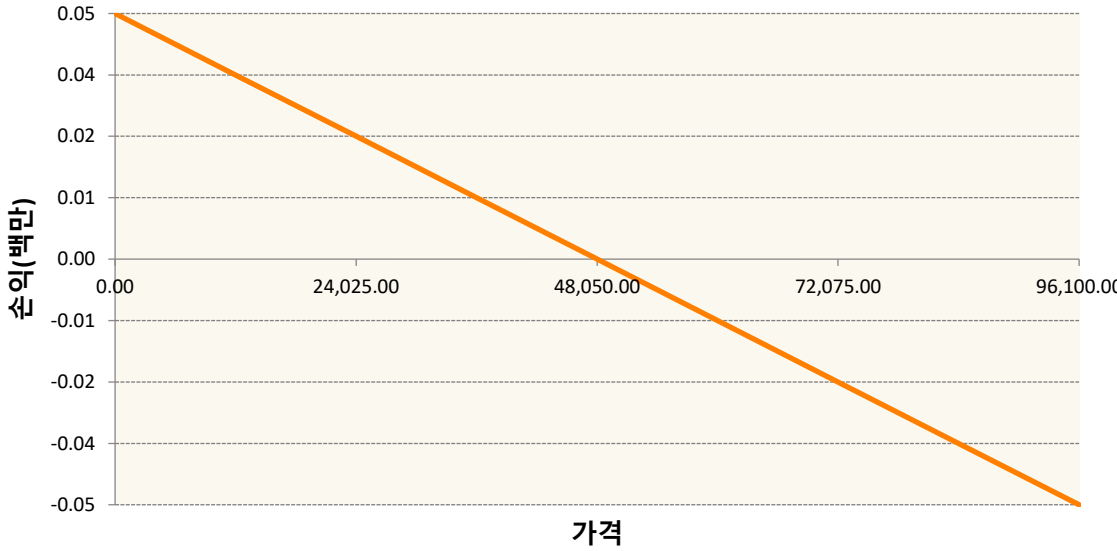
1. 계약금액

(단위:백만원)

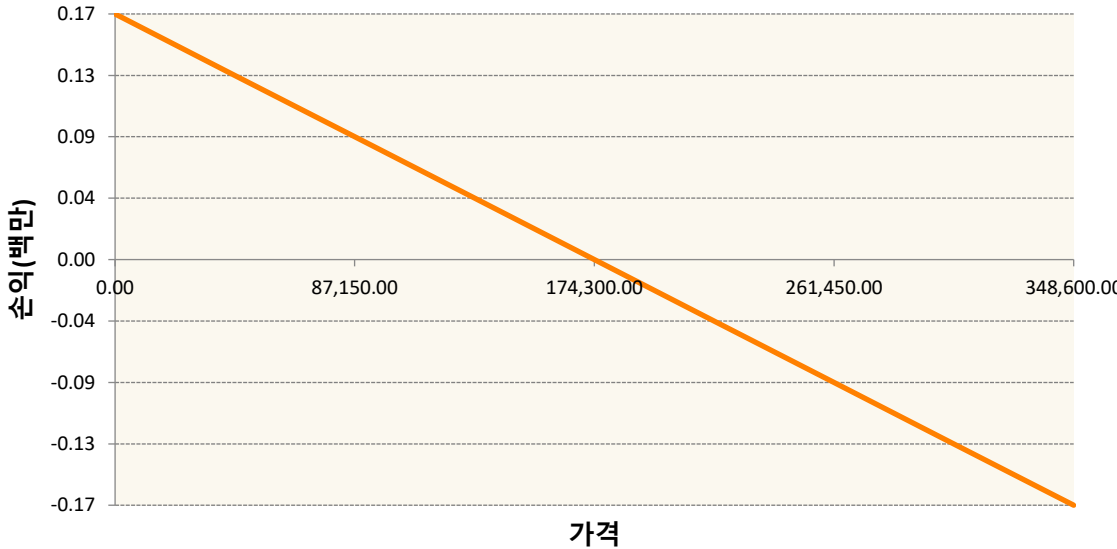
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	9	-9	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR41B9W70000-2025-07 두산에너지빌리티개별선물



KR41BJW60009-2025-06 엔씨소프트개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR41B9W70(2025-07 두산에너지빌리티개별선물)		0.31
KR41BJW60C(2025-06 엔씨소프트개별선물)		0.42

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

공시일 2025-06-11

기준일 2025-06-10

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

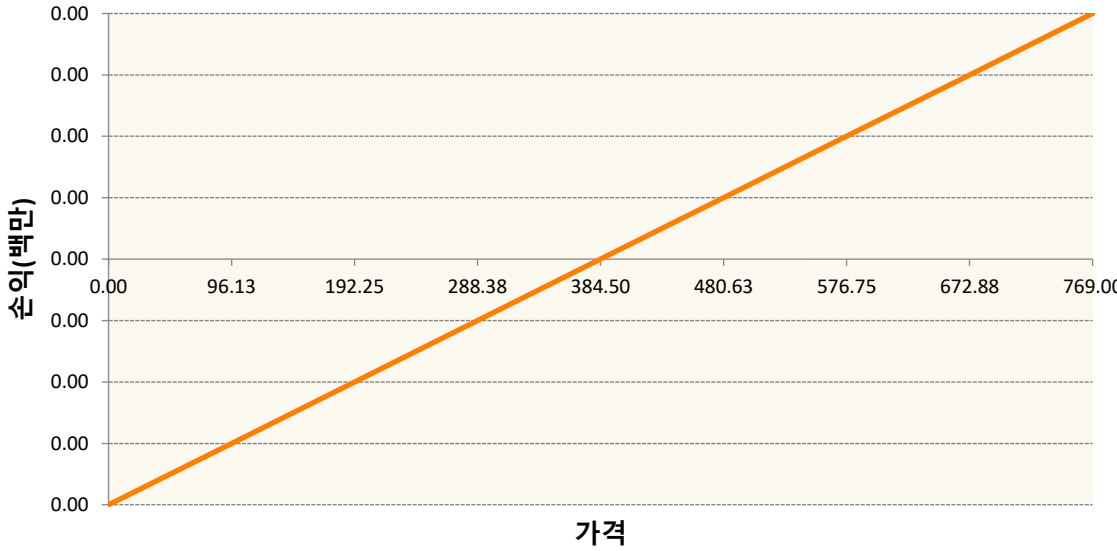
1. 계약금액

(단위:백만원)

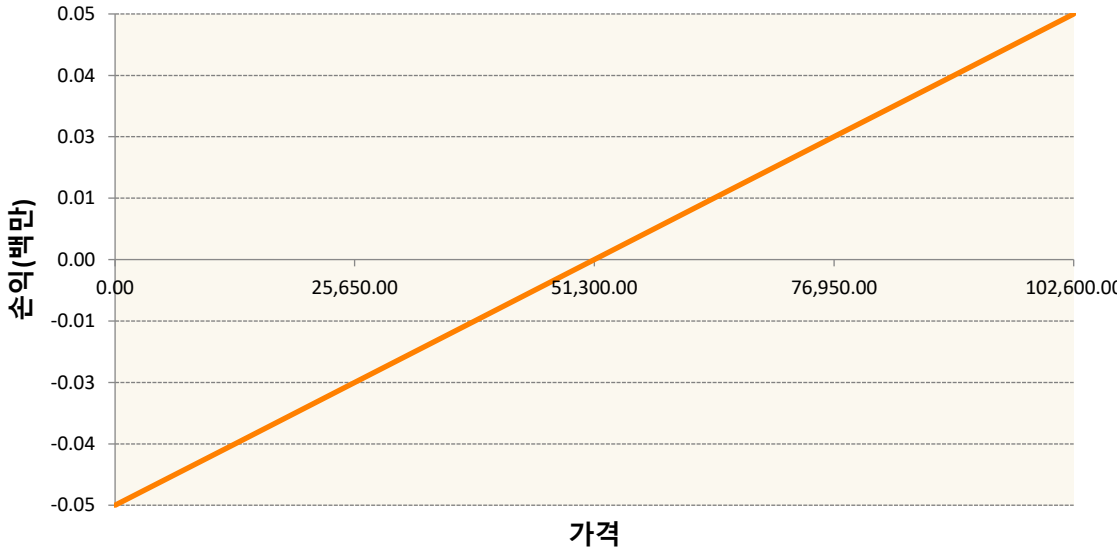
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	292	107	184	장내
누계	유가증권	선물	7,983	0	7,983	장내

2. 만기시점의 손익구조

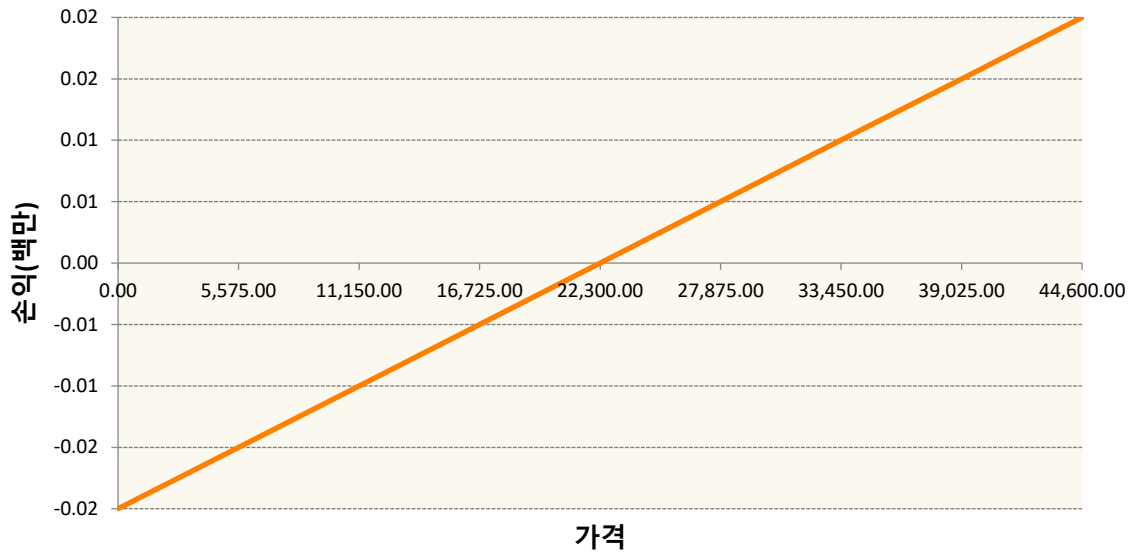
KR4101W60000-2025-06 코스피200지수선물



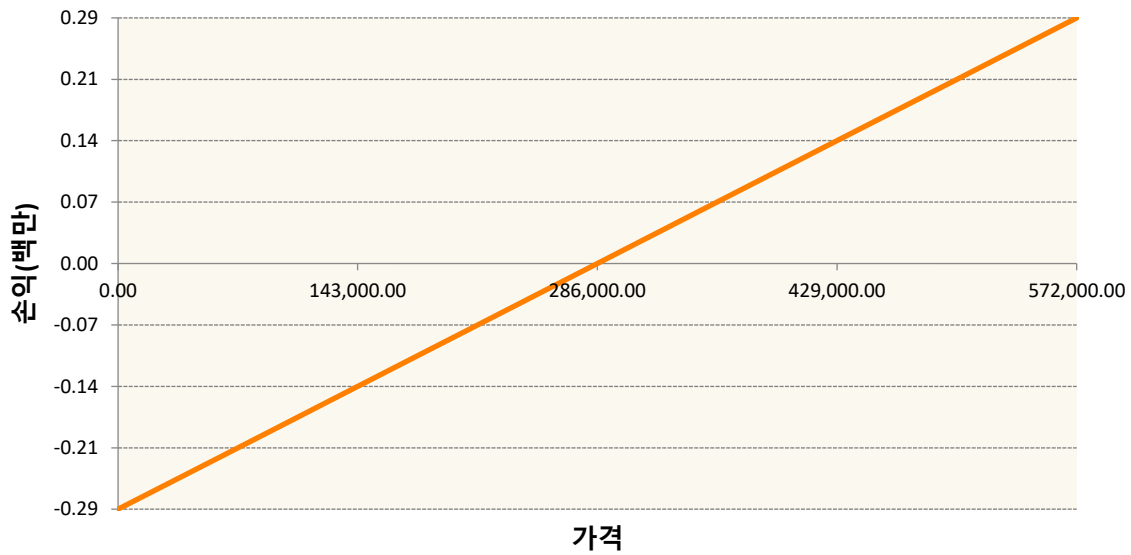
KR410FW70000-2025-07 두산로보틱스개별선물



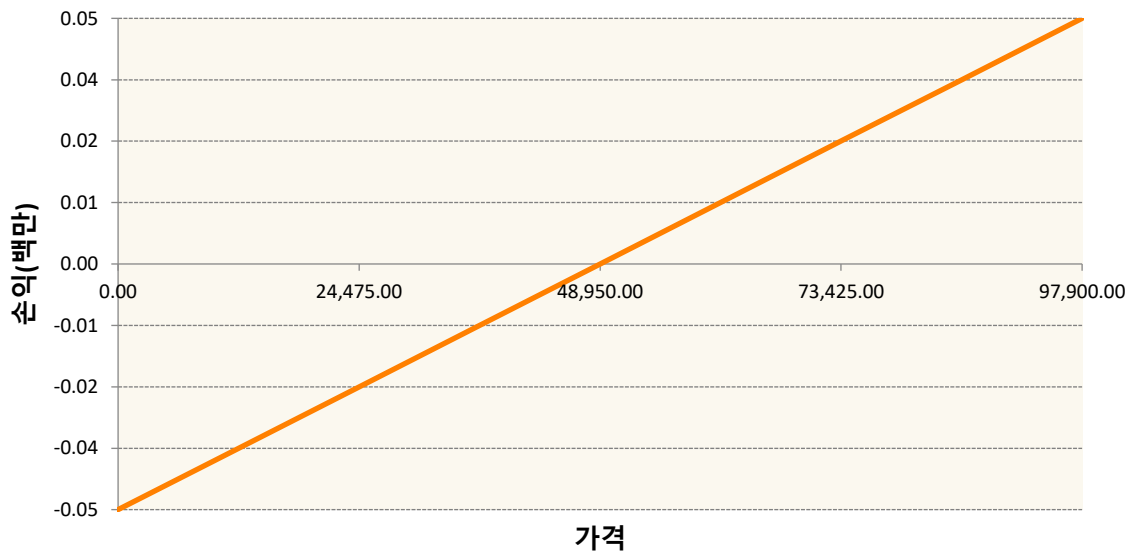
KR41CNW60009-2025-06 포스코DX개별선물



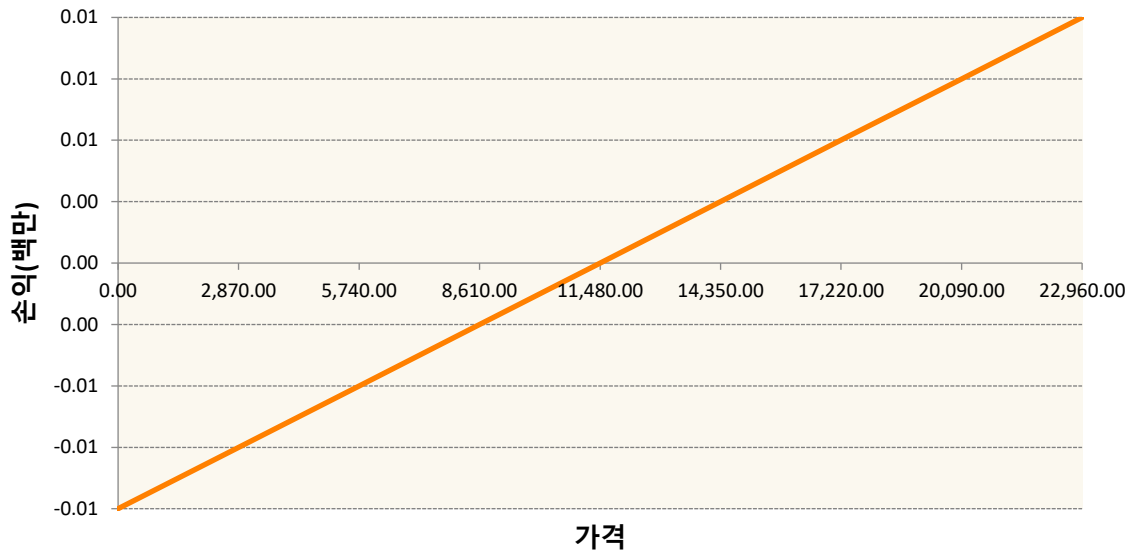
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



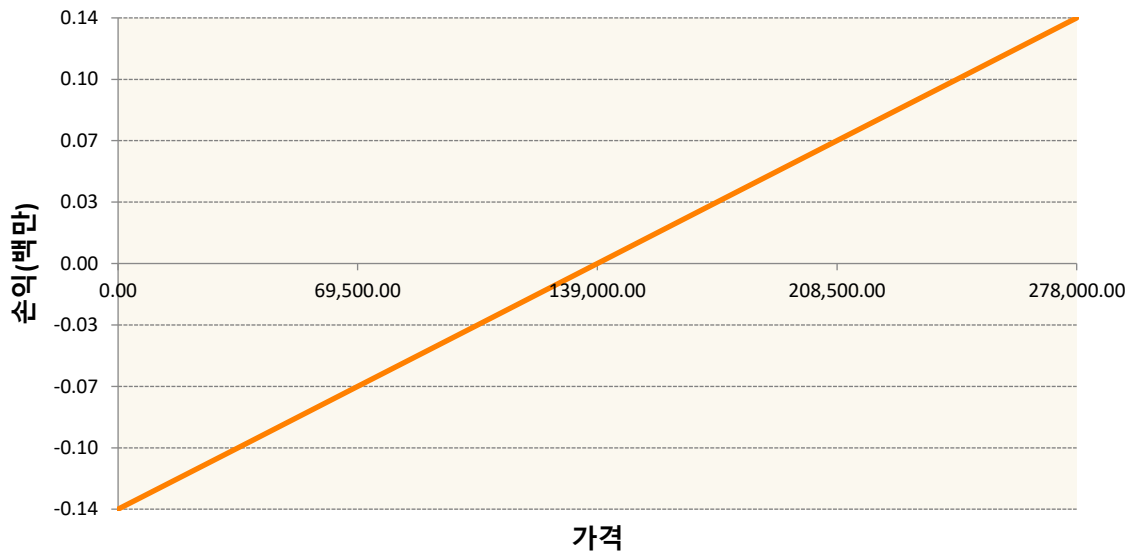
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



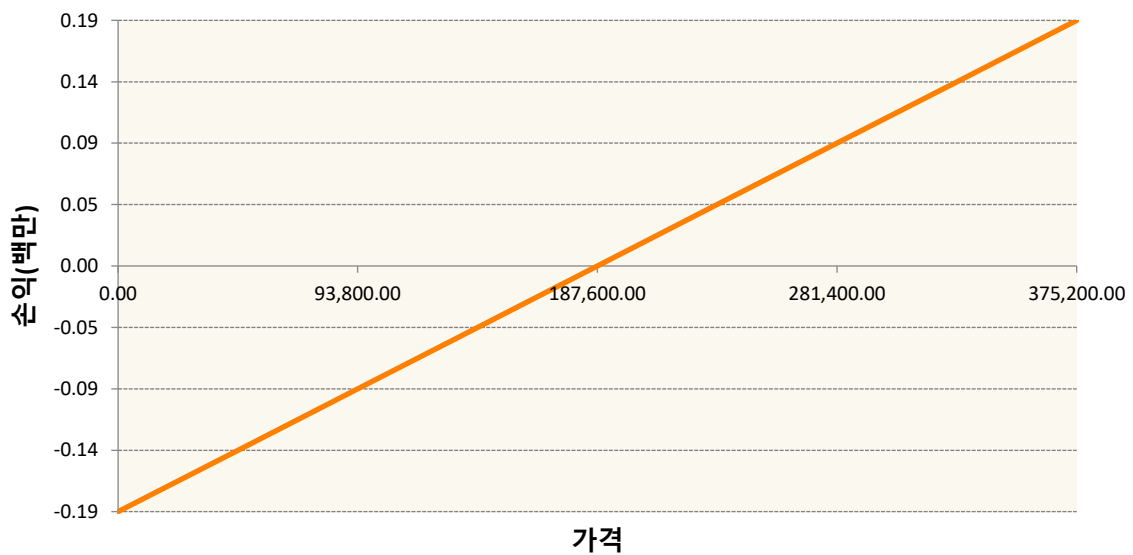
KR41G2W60001-2025-06 에스디바이오센서개별선물



KR41G5W60004-2025-06 한진칼개별선물



KR41HEW60007-2025-06 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W60(2025-06 코스피200지수선물)	523
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물)	0.08
KR41CNW60(2025-06 포스코DX개별선물)	3
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물)	10
KR41FMW70(2025-07 엘앤에프개별선물)	13
KR41G2W60(2025-06 에스디바이오센서개별선물)	1
KR41G5W60(2025-06 한진칼개별선물)	65
KR41HEW60(2025-06 키움증권개별선물)	24

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

1,027

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

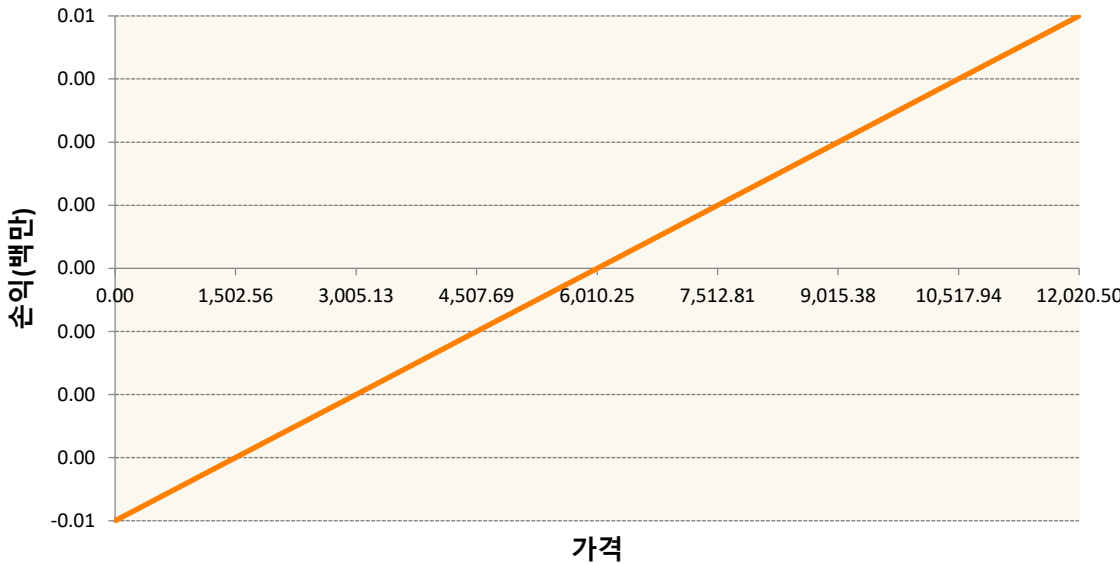
1. 계약금액

(단위:백만원)

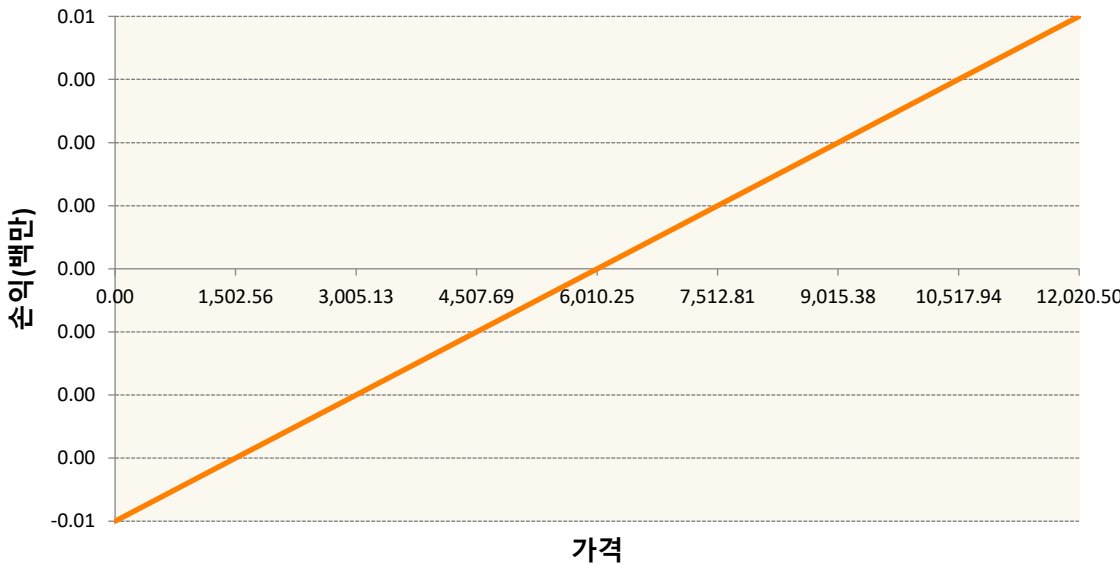
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,921	0	1,921	장내
누계	지수	선물	31,731	0	31,731	

2. 만기시점의 손익구조

ESM5-S&P500 EMINI FUT JUN25



HWAM5-SP500 MIC EMIN FUTJun25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,539
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	154

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,382

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

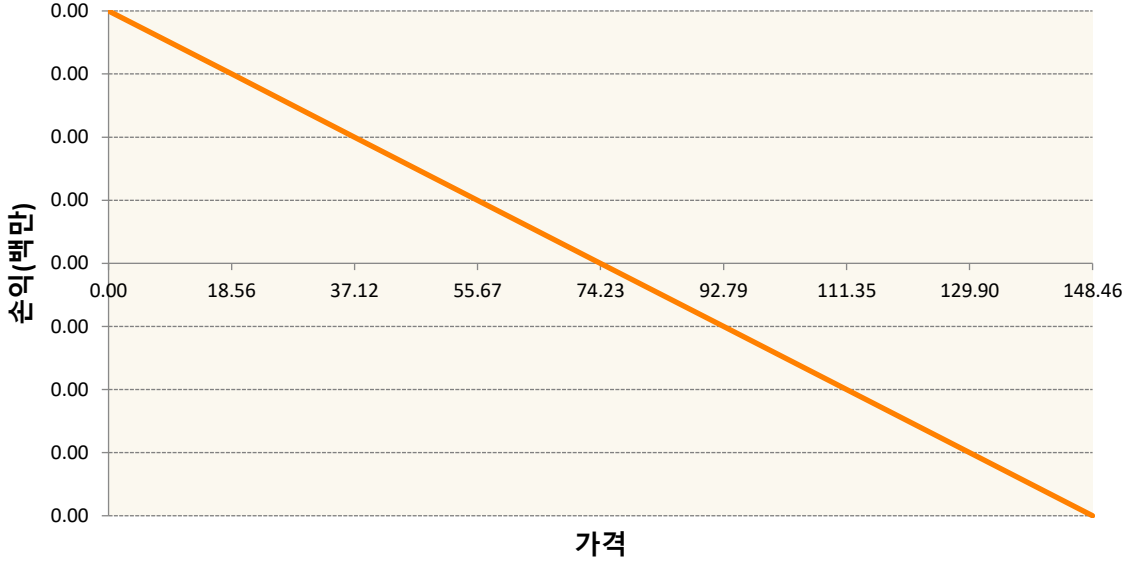
1. 계약금액

(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	-15	4,356	-4,371	
누계	통화	선도	0	943	-943	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ25-ECX EMISSION Dec25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	75
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	348

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

(단위:백만원)

644

공시일 2025-06-11

기준일 2025-06-10

미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

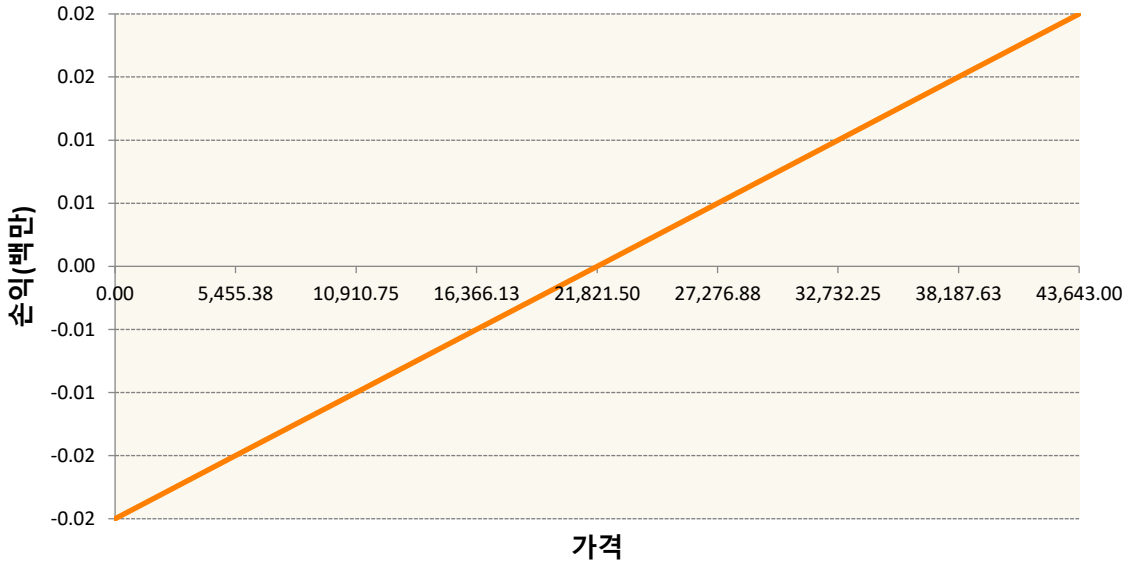
1. 계약금액

(단위:백만원)

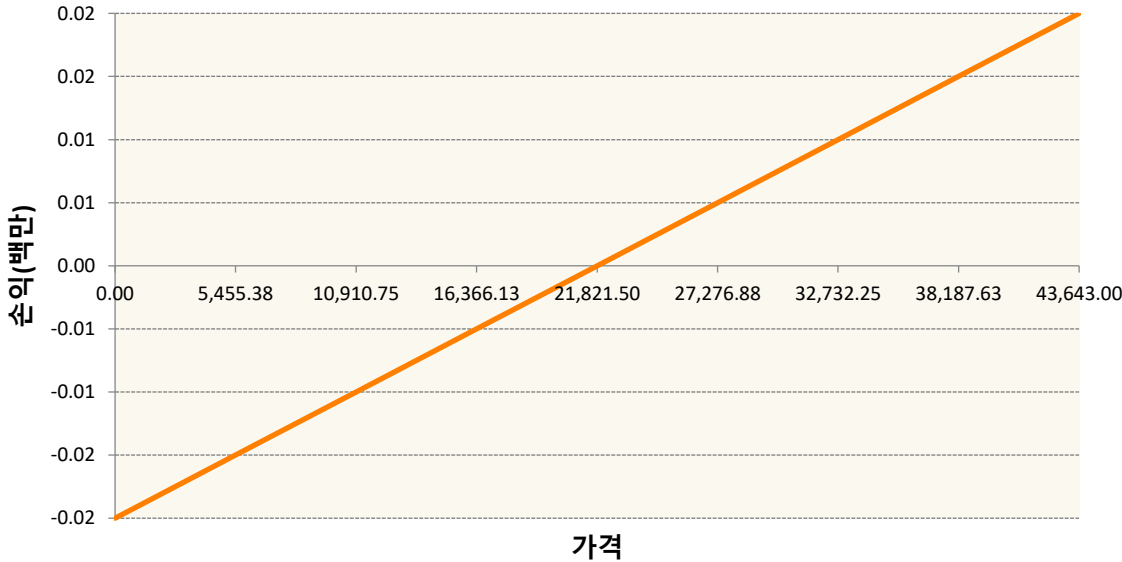
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	14,537	0	14,537	
누계	유가증권	선물	659	0	659	장내

2. 만기시점의 손익구조

HWBM5-NASD100 MICRO EMIN JUN25



NQM5-NASDAQ 100 E-MINI Dec20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25	53
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,163

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,383

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

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	2,946
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,504
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,660
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	903
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	157

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

(단위:백만원)

9,655

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

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	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15

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

(단위:백만원)

83

공시일	2025-06-11
기준일	2025-06-10

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

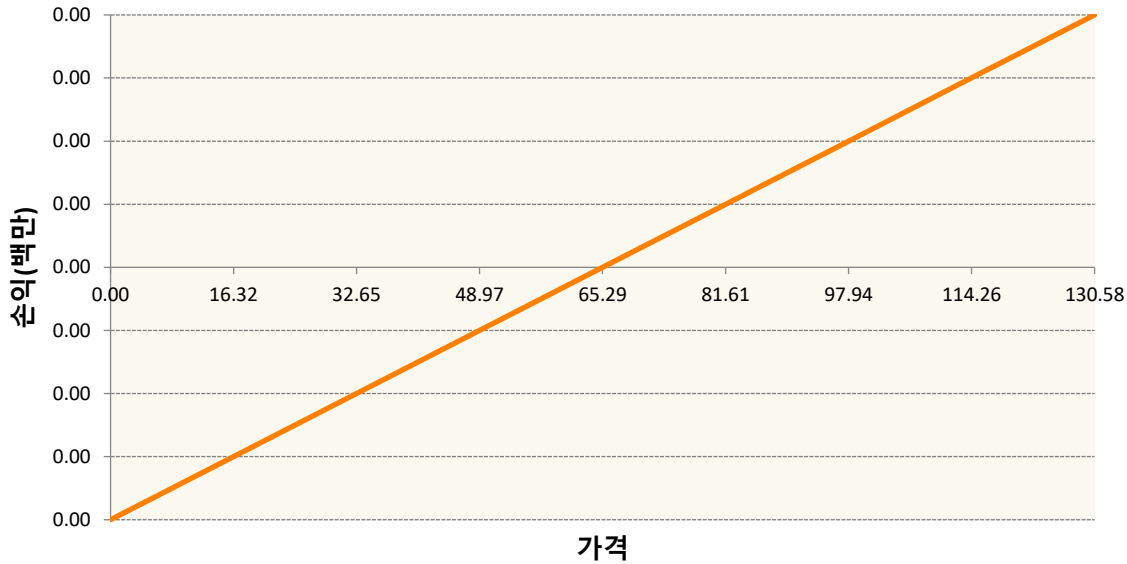
1. 계약금액

(단위:백만원)

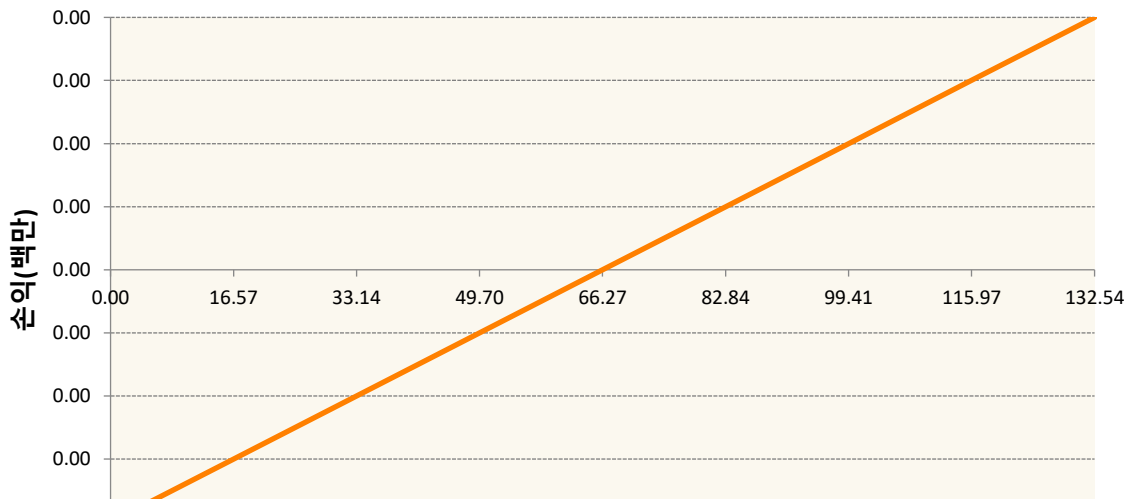
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	13	0	13	
누계	유가증권	선물	685	0	685	
누계	통화	선물	0	96	-96	장내

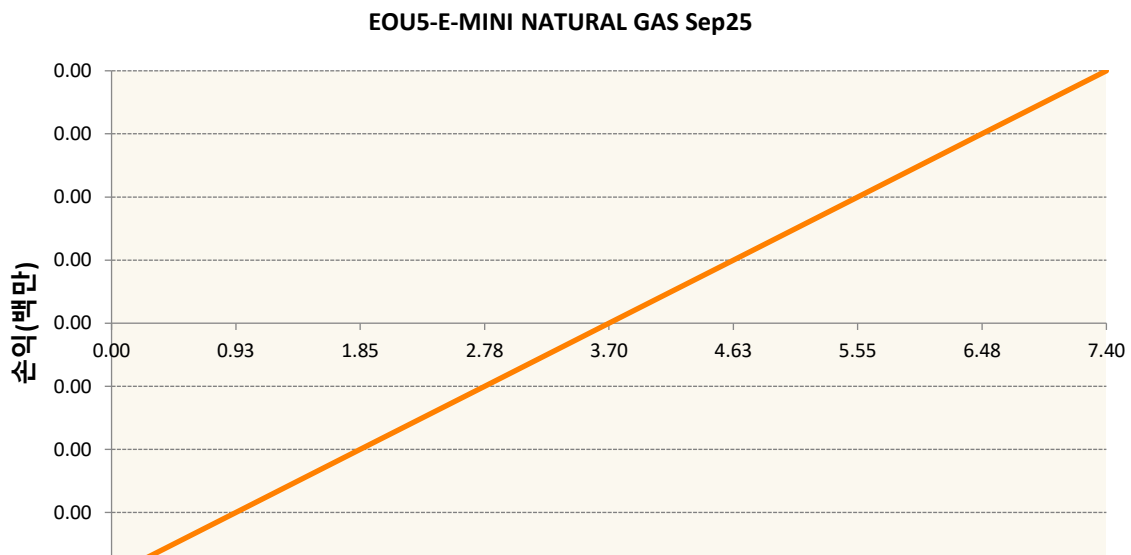
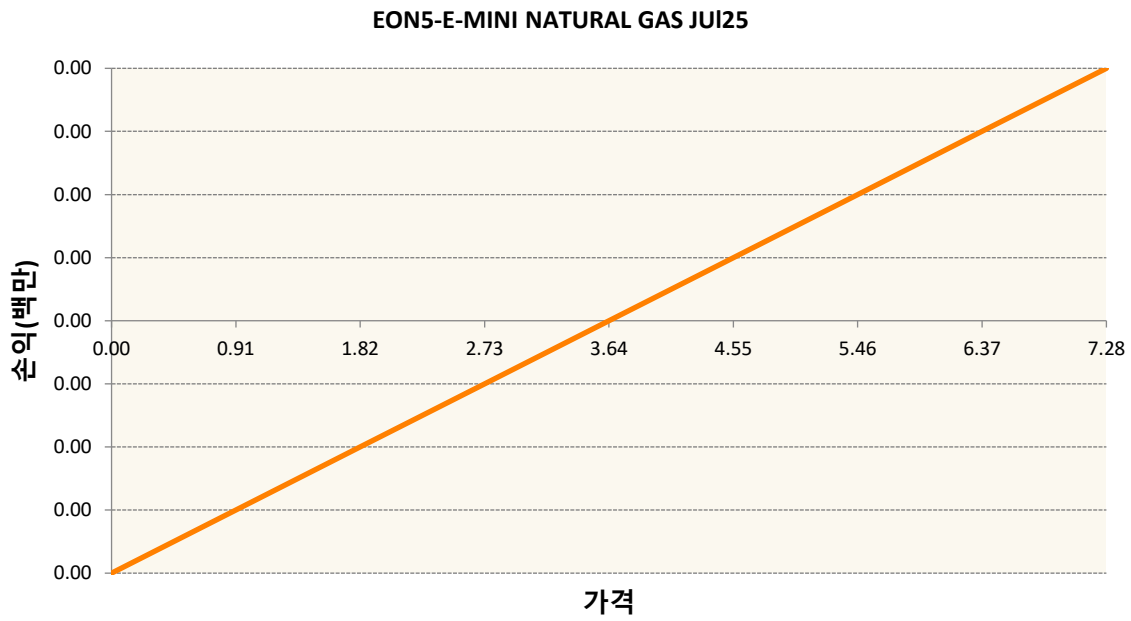
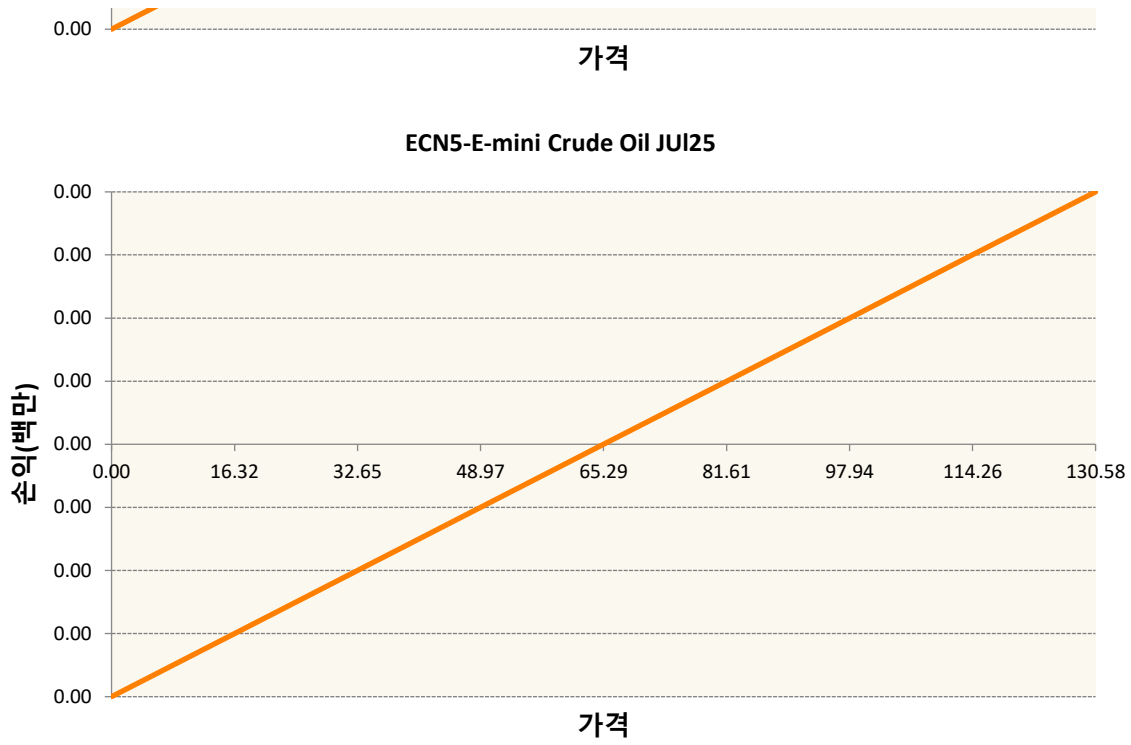
2. 만기시점의 손익구조

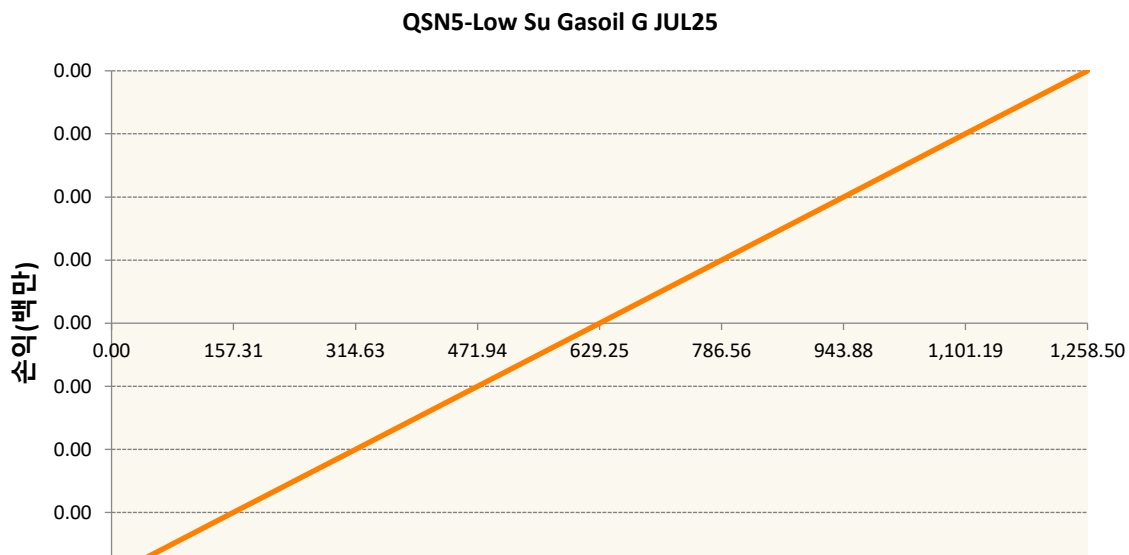
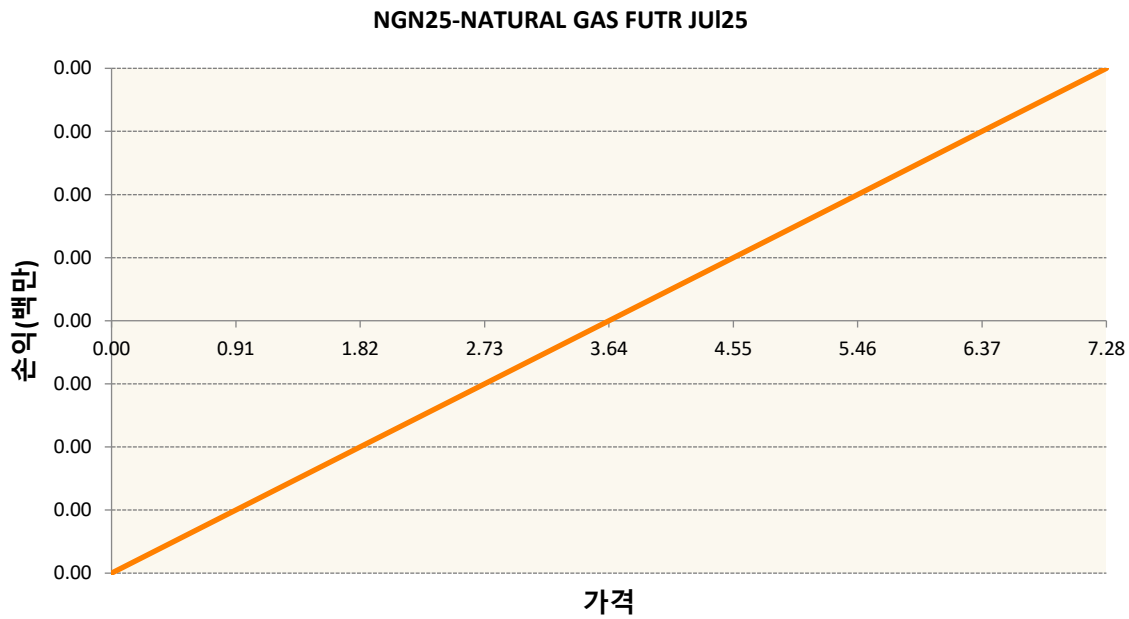
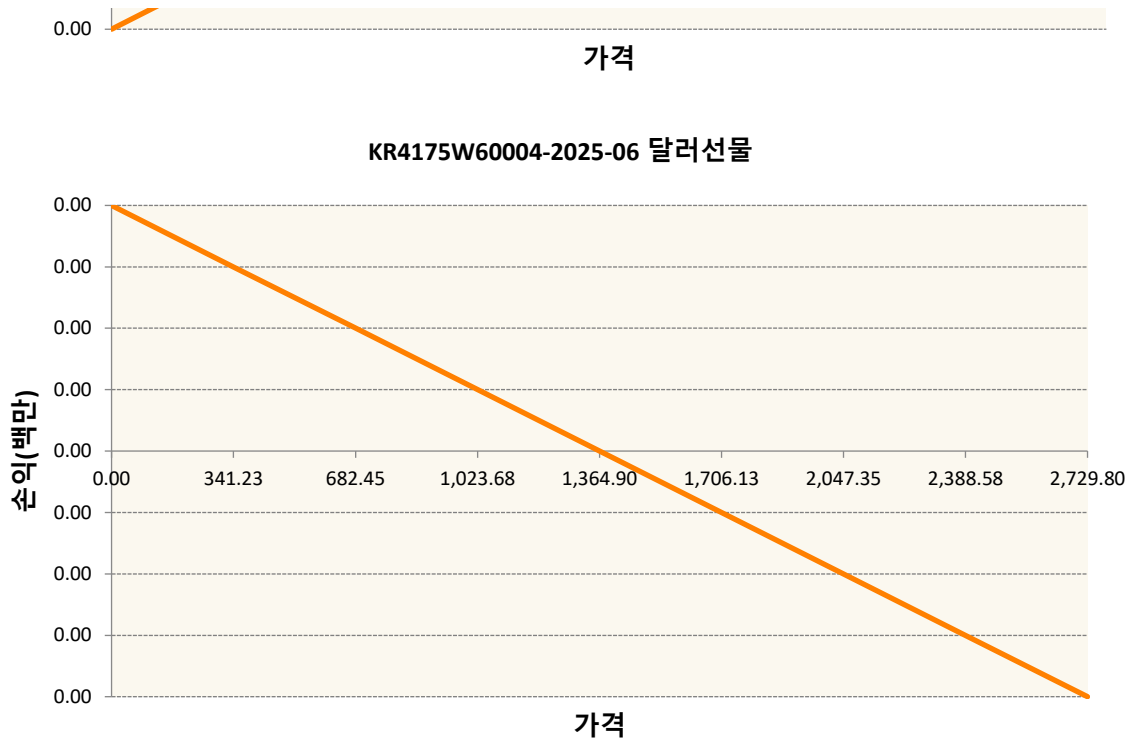
CLN5-WTI CRUDE FUTURE JUL25



COU5-BRENT CRUDE FUTR Sep25







0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
CLN5	WTI CRUDE FUTURE JUL25	8
COU5	BRENT CRUDE FUTR Sep25	15
ECN5	E-mini Crude Oil JUL25	4
EON5	E-MINI NATURAL GAS JUL25	8
EOU5	E-MINI NATURAL GAS Sep25	1
KR4175W60(2025-06 달러선물		8
NGN25	NATURAL GAS FUTR JUL25	13
QSN5	Low Su Gasoil G JUL25	7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	133