

공시일	2025-06-13
기준일	2025-06-12

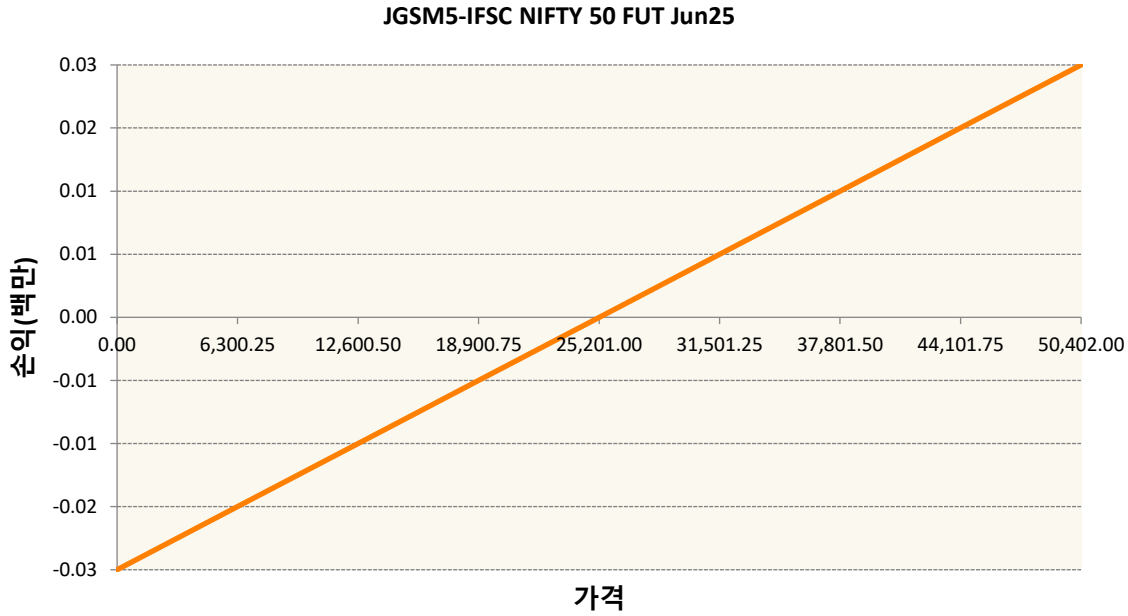
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,312	0	1,312	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSM5	IFSC NIFTY 50 FUT Jun25	105
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

77
----

공시일	2025-06-13
기준일	2025-06-12

## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

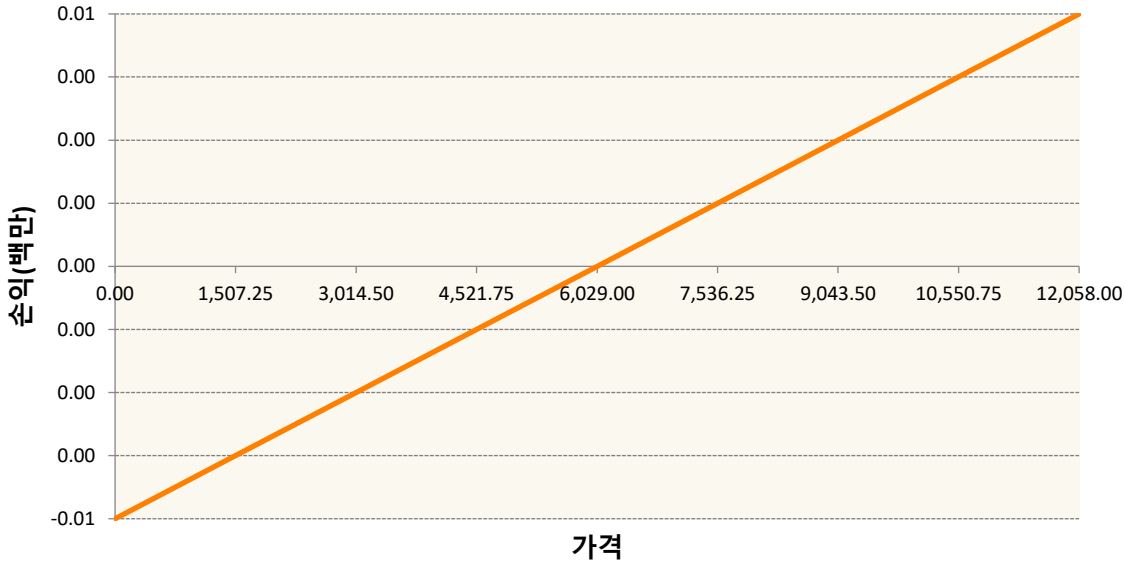
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

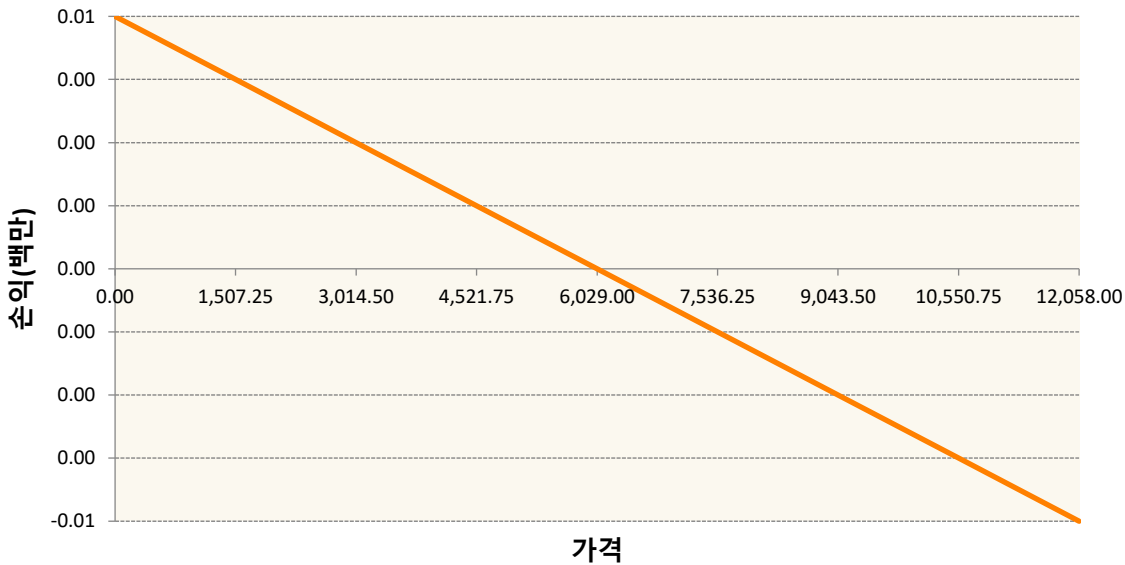
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	110	-110	장내
누계	지수	선물	439	0	439	

### 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	2025-06-13
기준일	2025-06-12

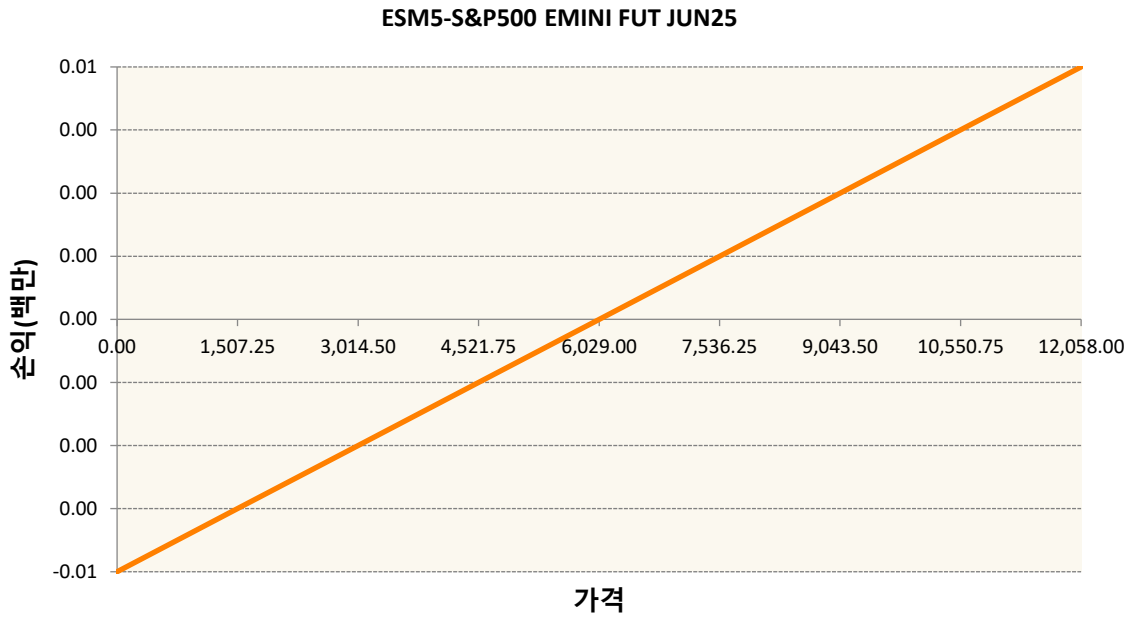
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,318	0	1,318	

### 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 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

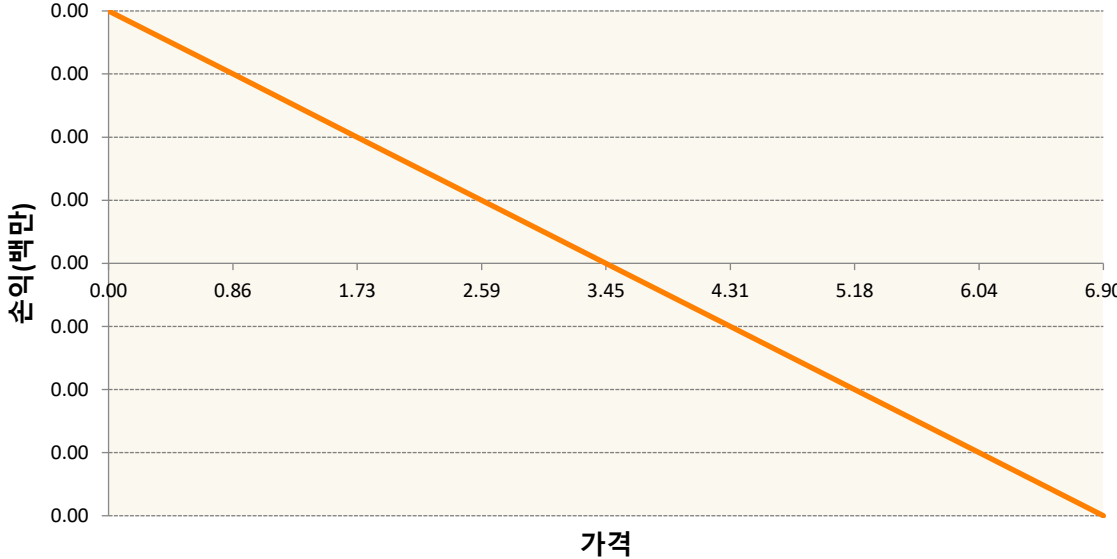
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

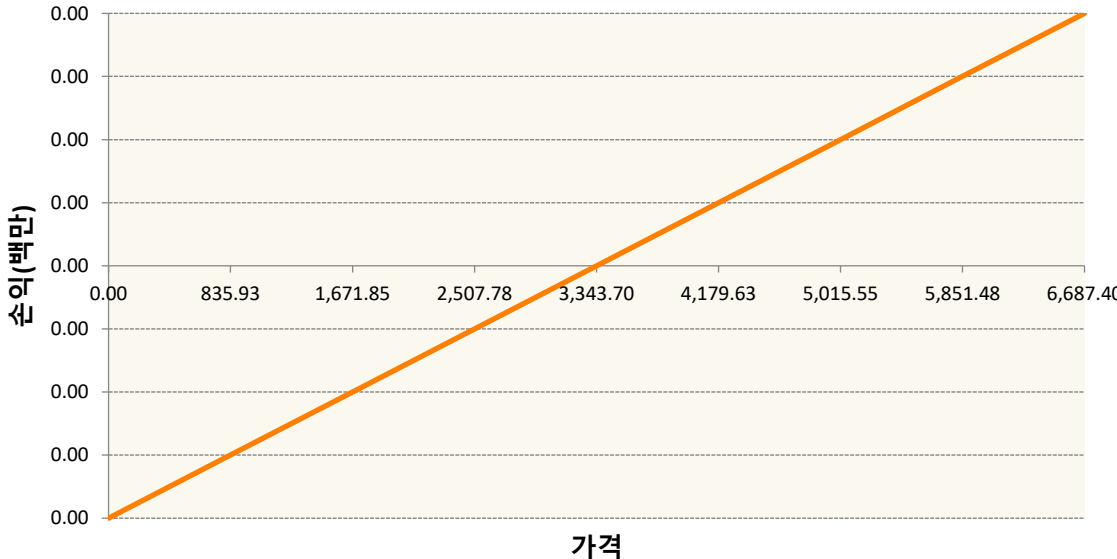
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	2,300	0	2,300	
누계	실물자산	옵션	0	21	-21	

### 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	184

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

공시일	2025-06-13
기준일	2025-06-12

## 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	6
AOPLTRUSP1 PLTR US 06/13/25 P125 EQUITY	3

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

(단위:백만원)

<b>38</b>
-----------

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 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 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 포커스농산물모(채권-파생형)

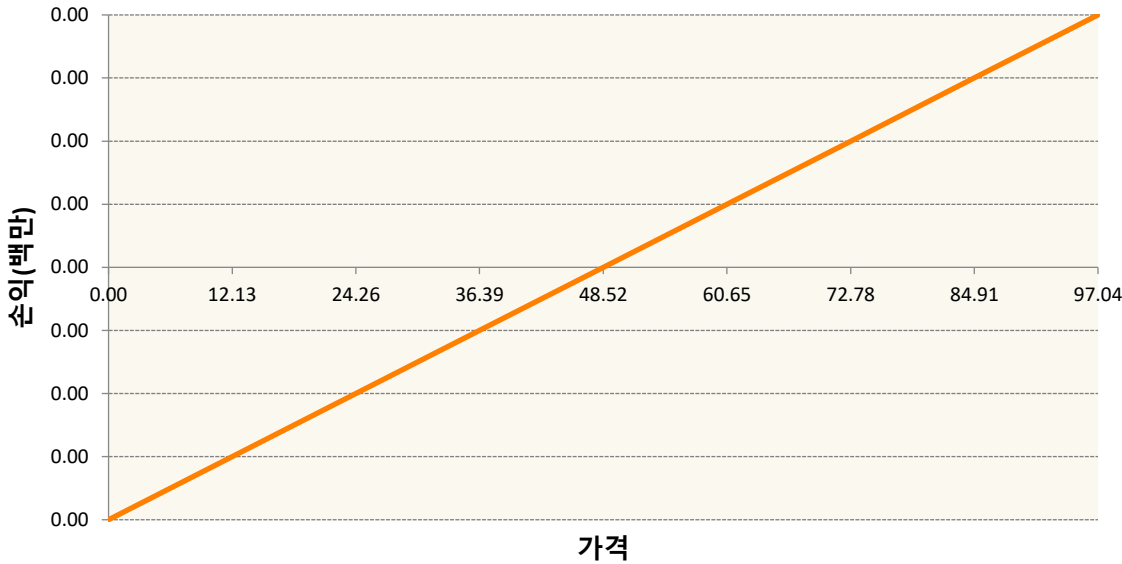
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

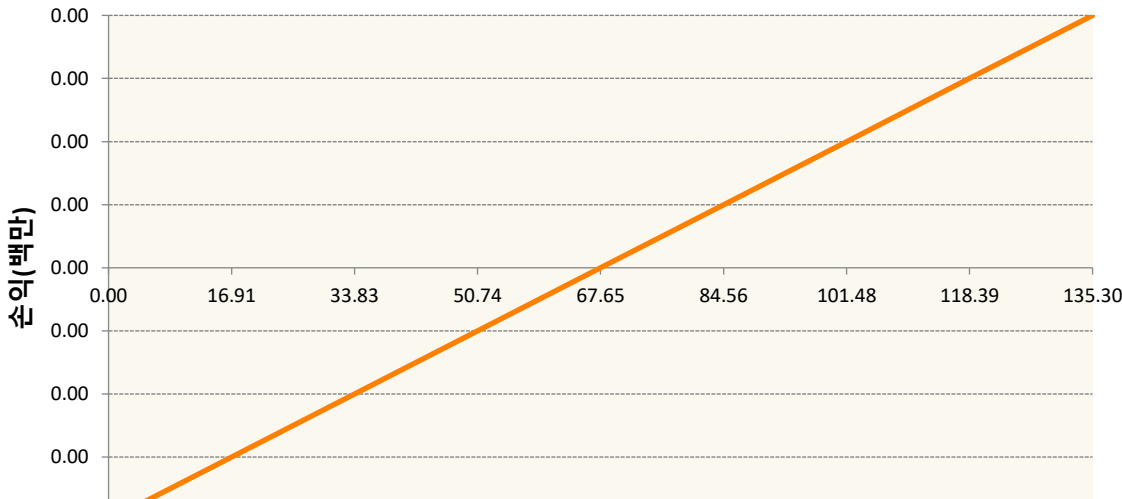
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	258	-258	장내
누계	실물자산	선물	1,528	0	1,528	
누계	유가증권	선물	2,088	0	2,088	
누계	통화	선물	0	257	-257	장내

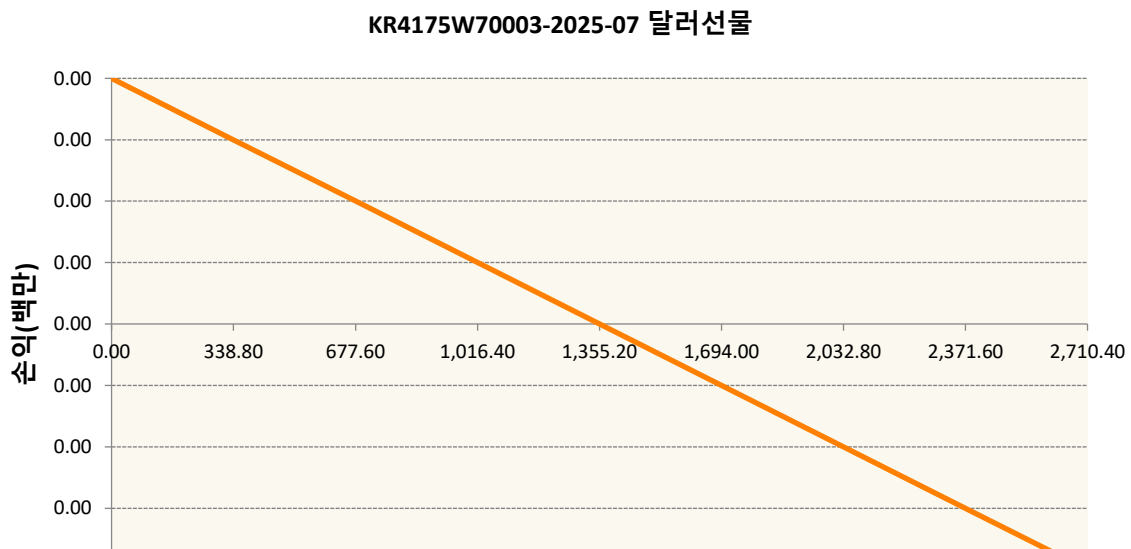
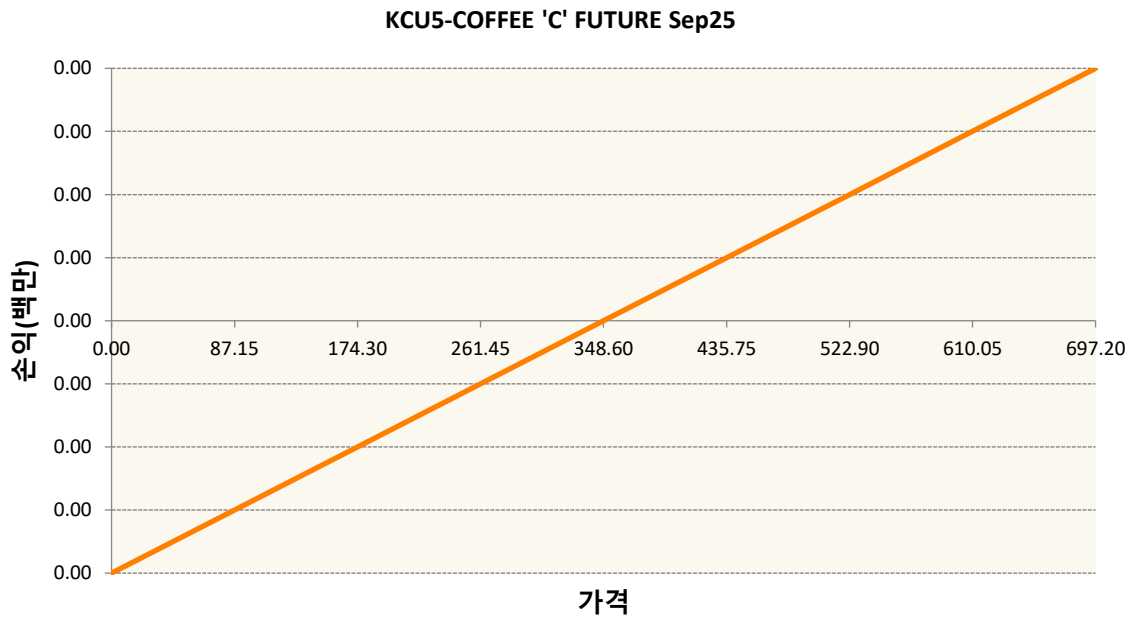
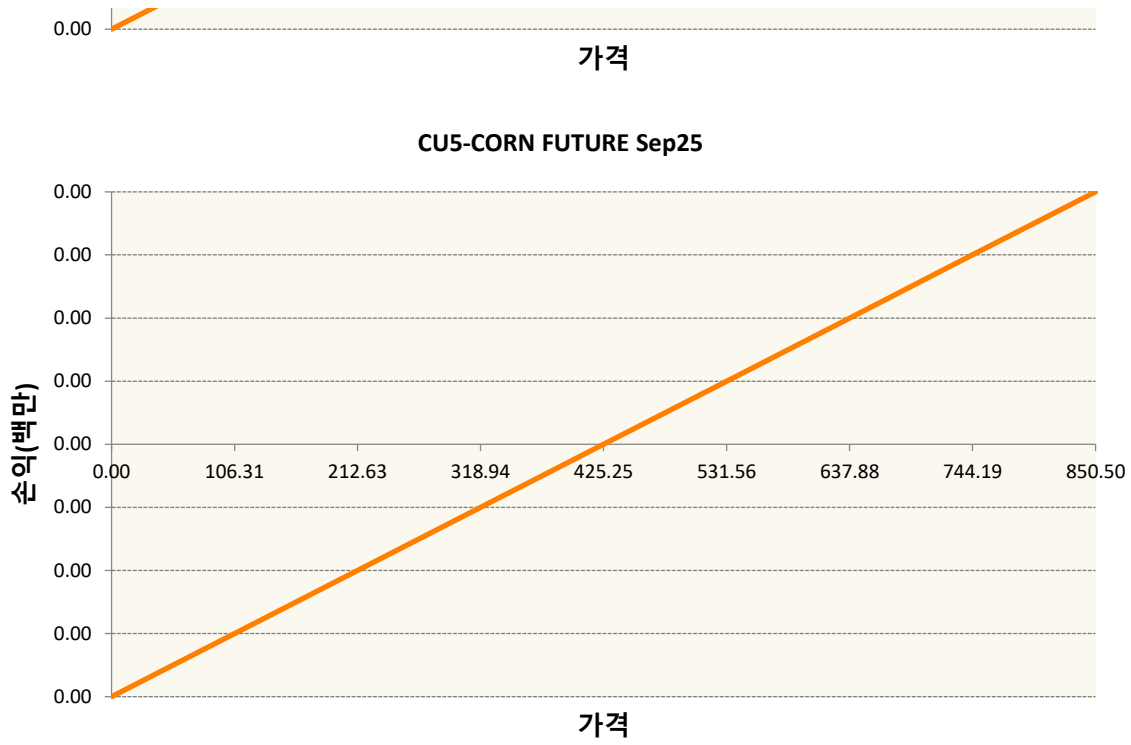
### 2. 만기시점의 손익구조

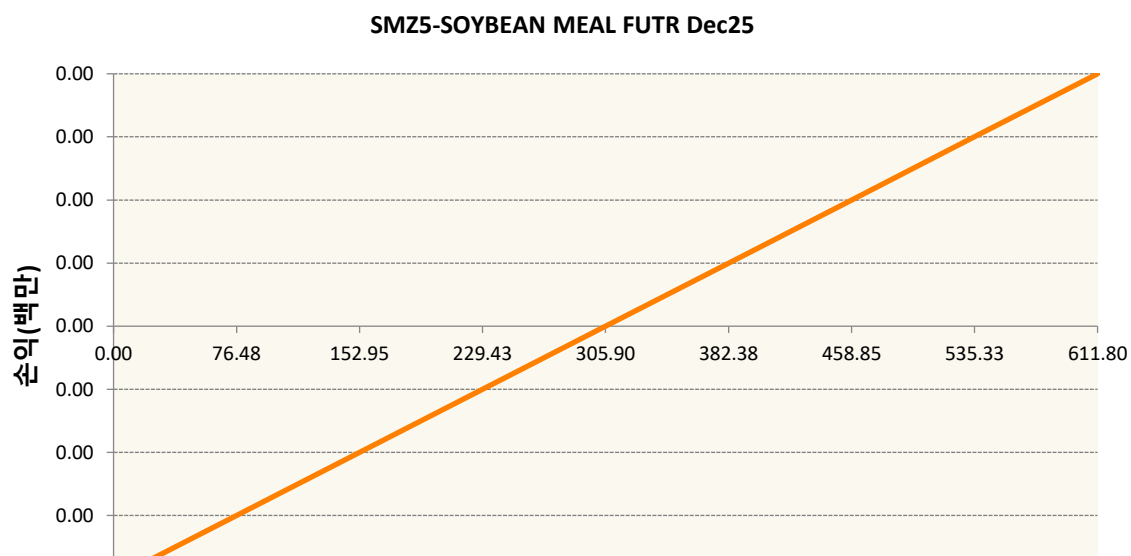
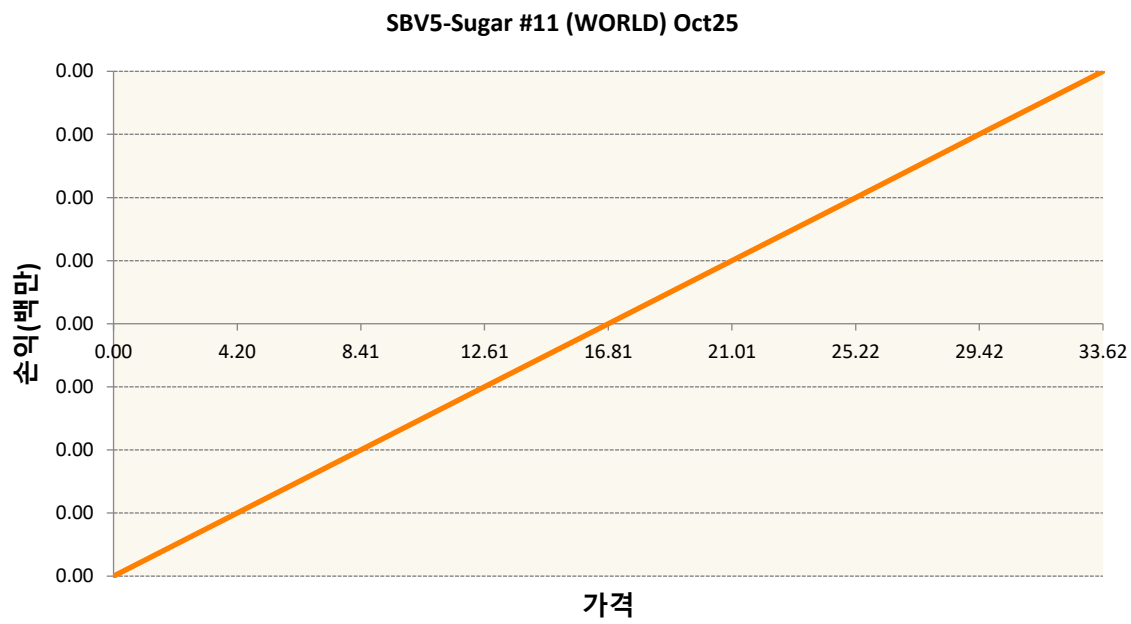
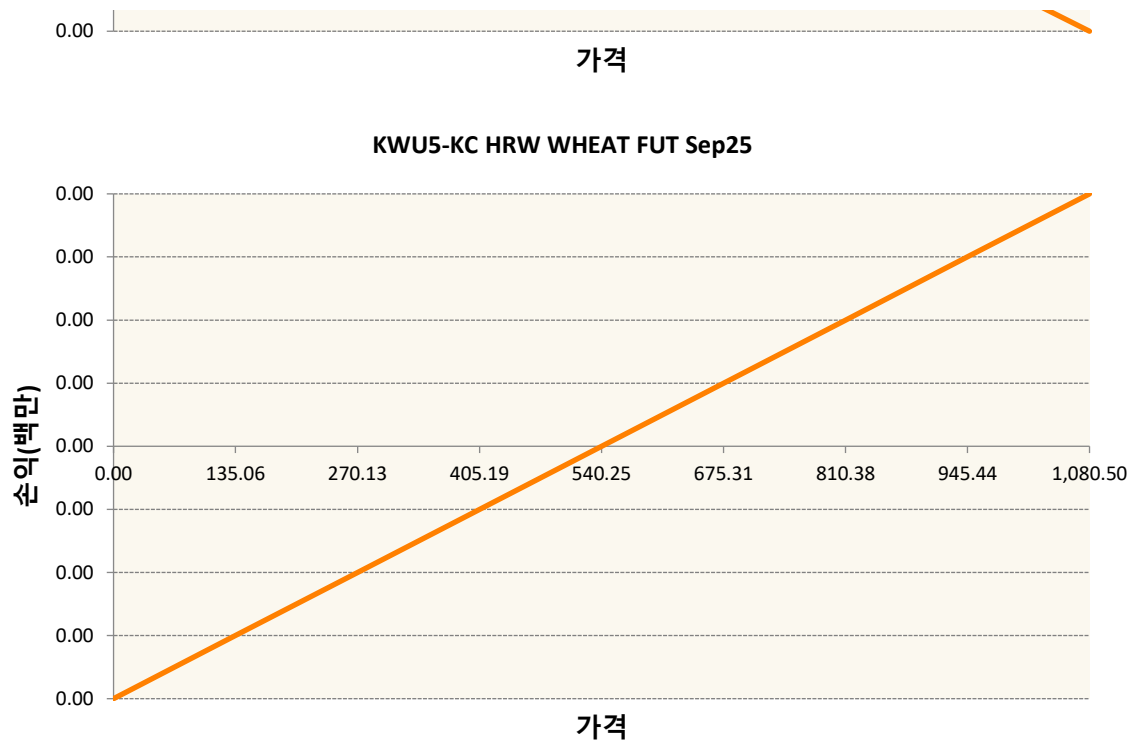
BO25-SOYBEAN OIL FUTR Dec25

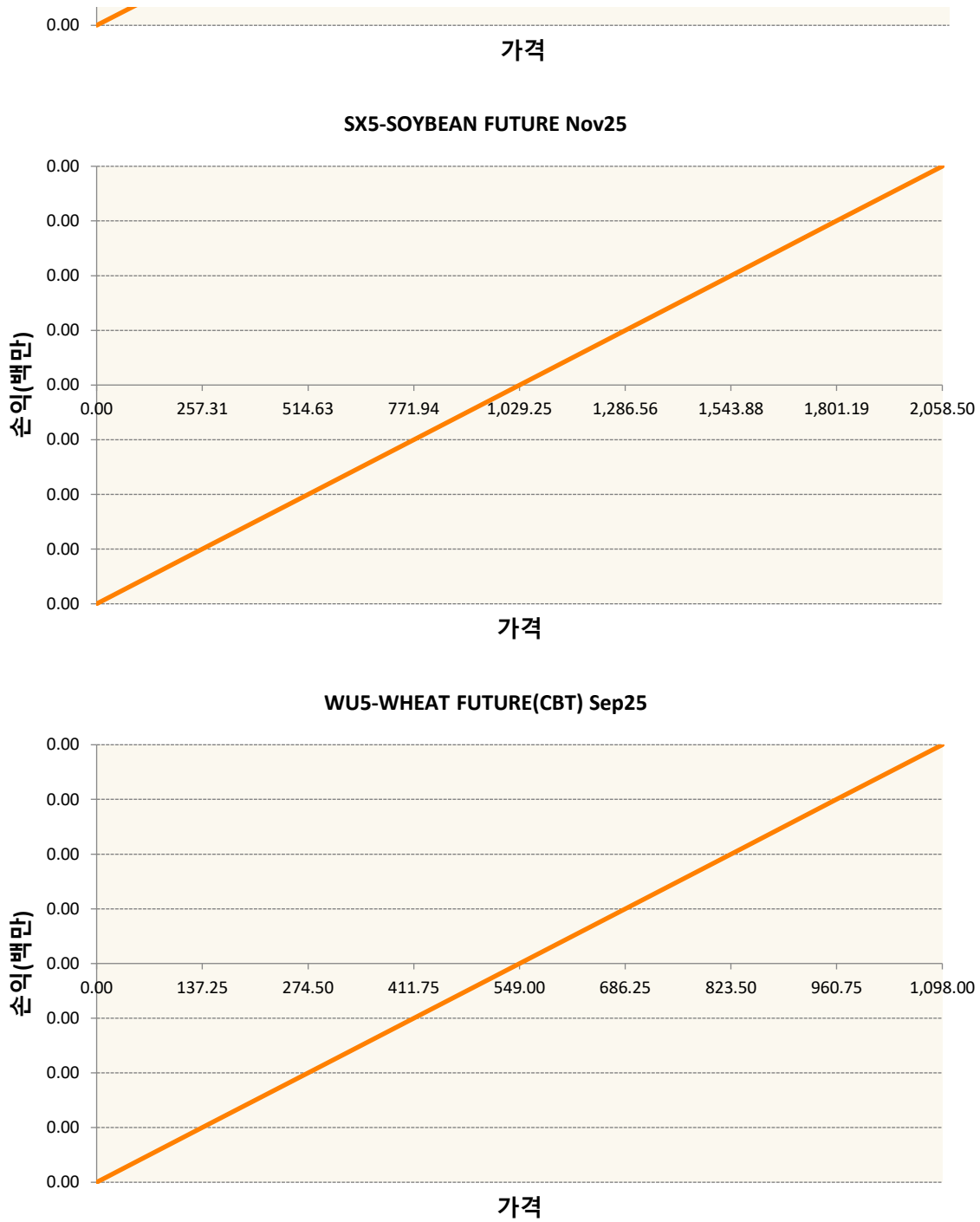


CT25-COTTON NO.2 FUTR Dec25









### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 스마트인덱스모

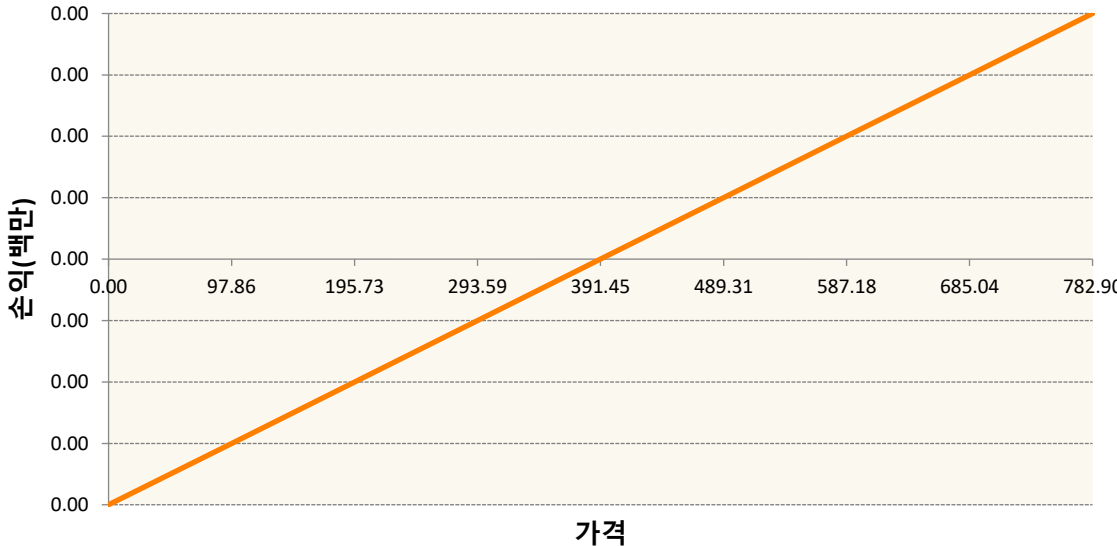
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

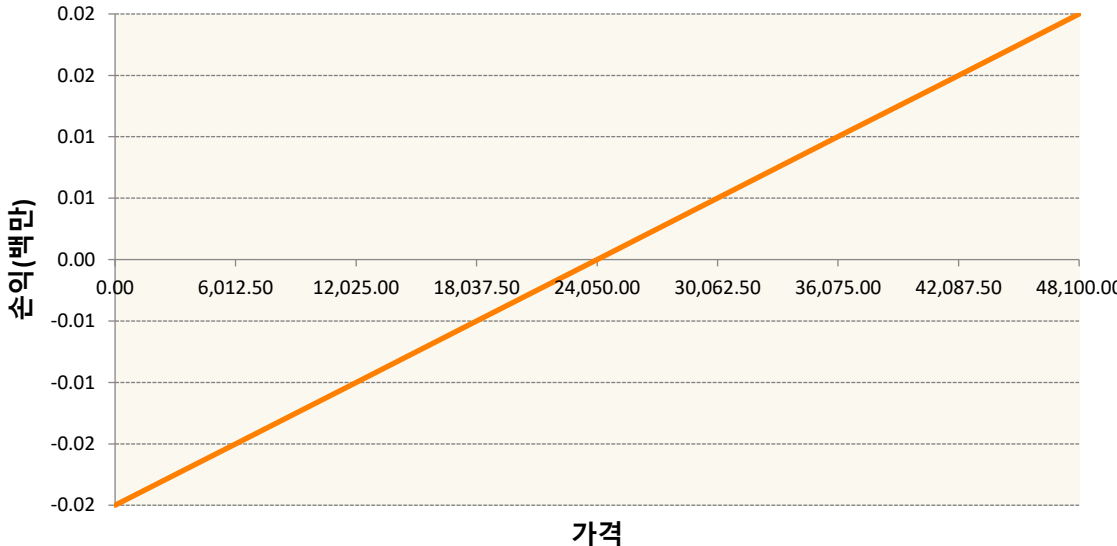
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	196	-196	장내
누계	유가증권	선물	835	0	835	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

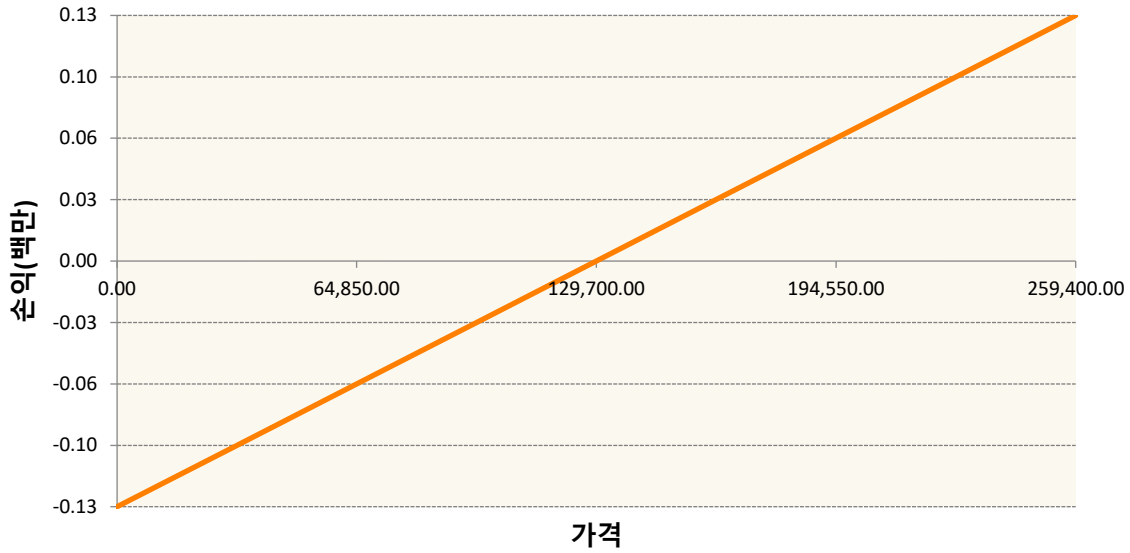
KR4101W90007-2025-09 코스피200지수선물



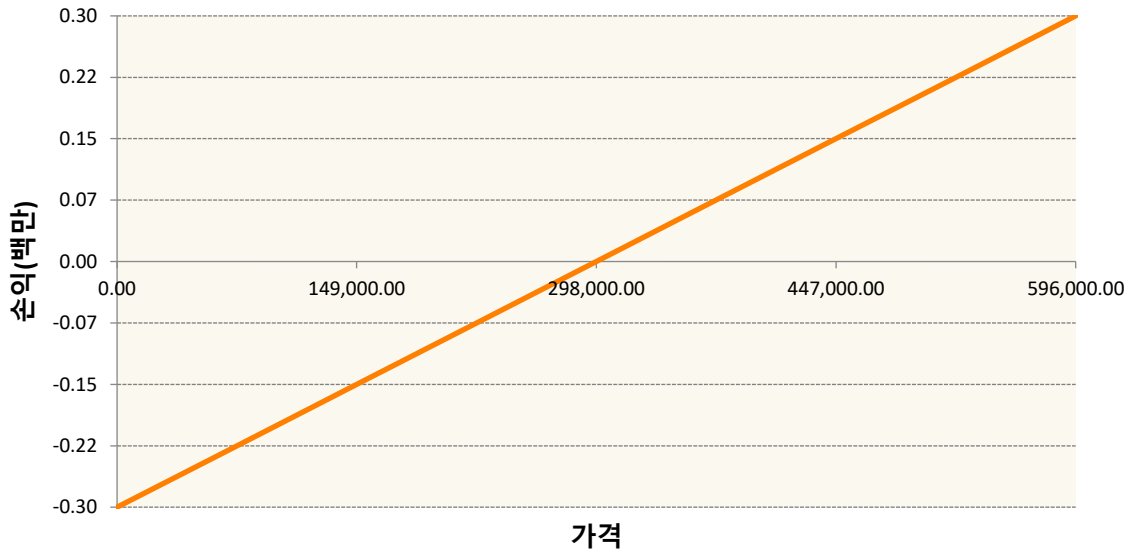
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



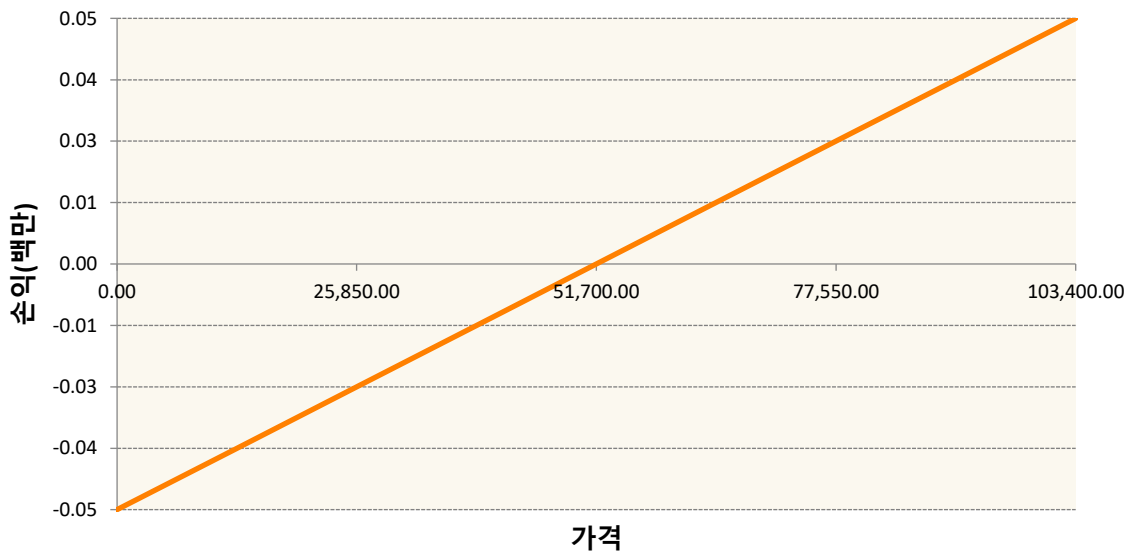
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



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

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물)	47
KR41CNW70(2025-07 포스코DX개별선물)	1
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물)	4
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물)	13
KR41FMW70(2025-07 엘앤에프개별선물)	2

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

<b>113</b>
------------

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 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	2025-06-13
기준일	2025-06-12

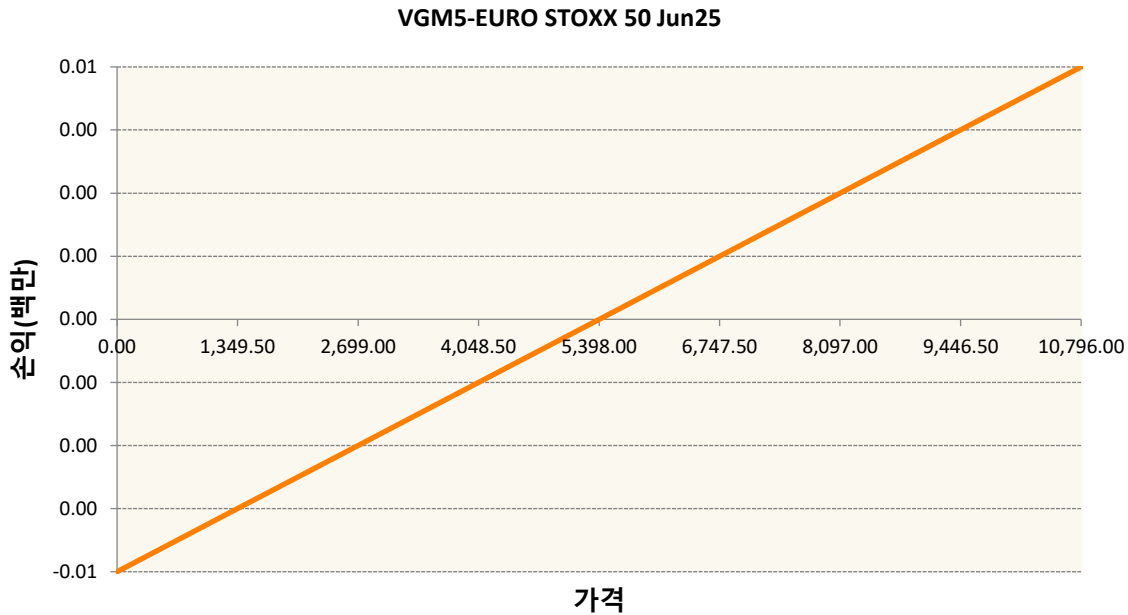
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,031	0	1,031	

### 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	2025-06-13
기준일	2025-06-12

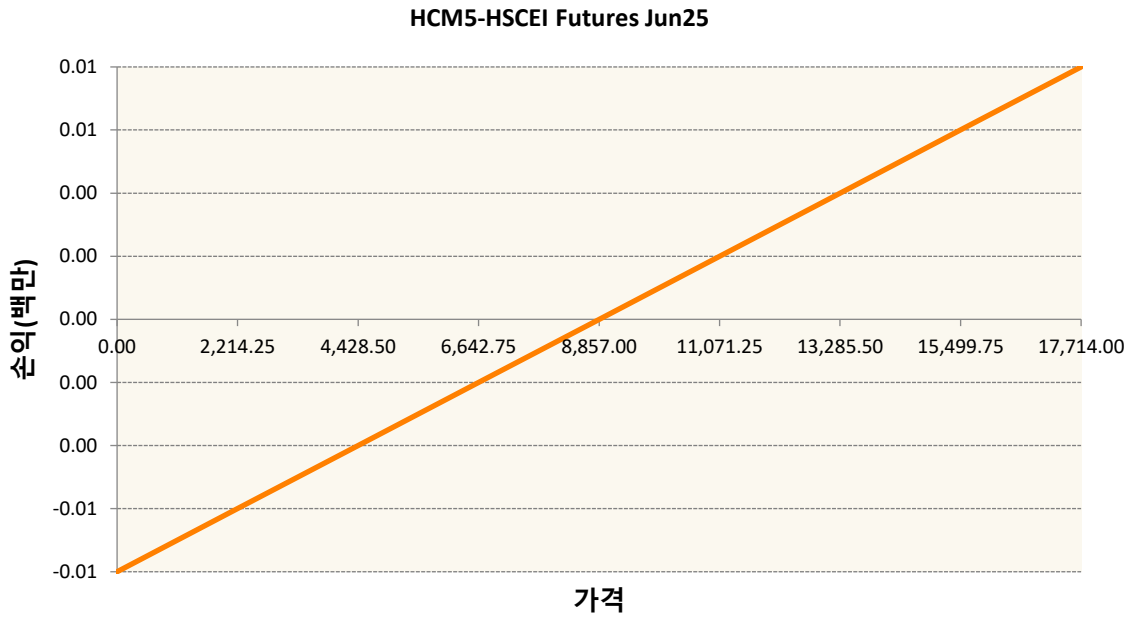
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	2,487	0	2,487	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM5	HSCEI Futures Jun25	199
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

291



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

(단위:백만원)

1,590

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	33	-33	
누계	유가증권	수익증권	504	0	504	

### 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 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	68	-68	
누계	유가증권	수익증권	4,246	0	4,246	

### 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	2025-06-13
기준일	2025-06-12

## 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	12,407	0	12,407	
누계	통화	선도	0	11,712	-11,712	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E	215
FXW213F4V( KRW/USD 31-07-25E	404
FXW213F5V( KRW/USD 29-08-25E	317
IE00BD8RGM75	*

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

459
-----

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

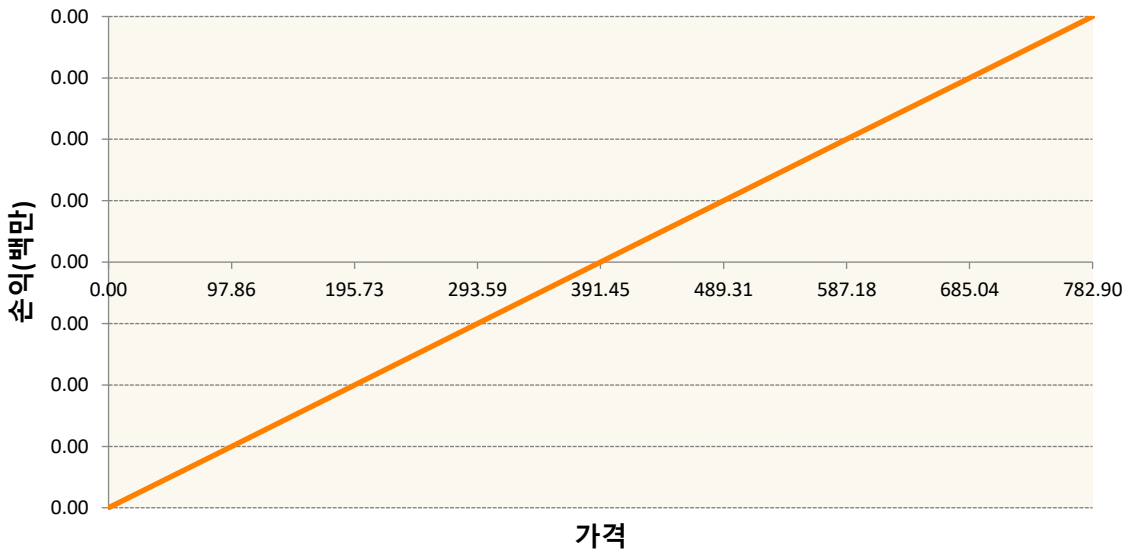
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

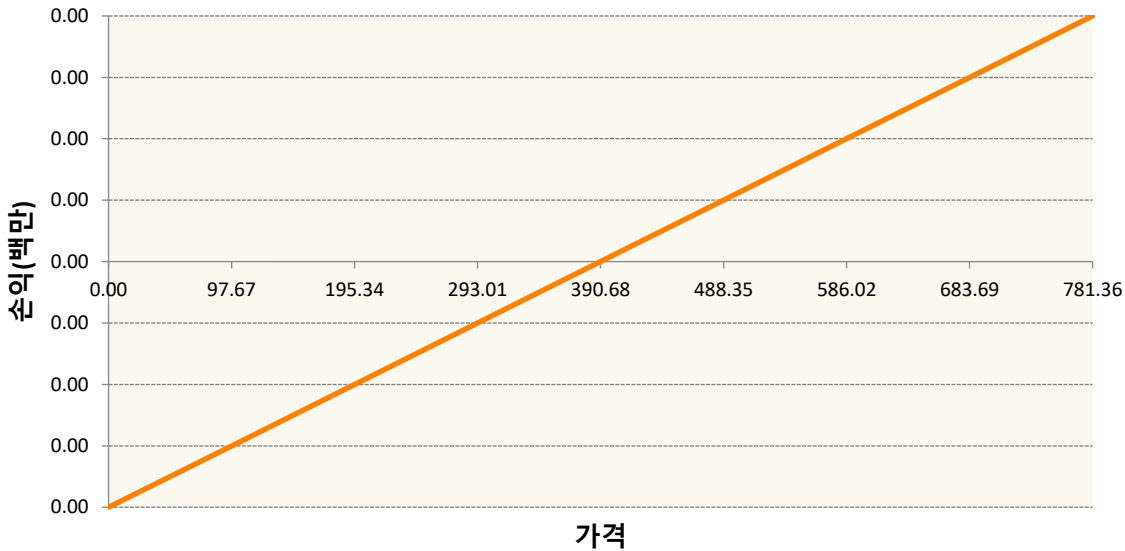
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	98	-98	장내
누계	유가증권	선물	1,110	0	1,110	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

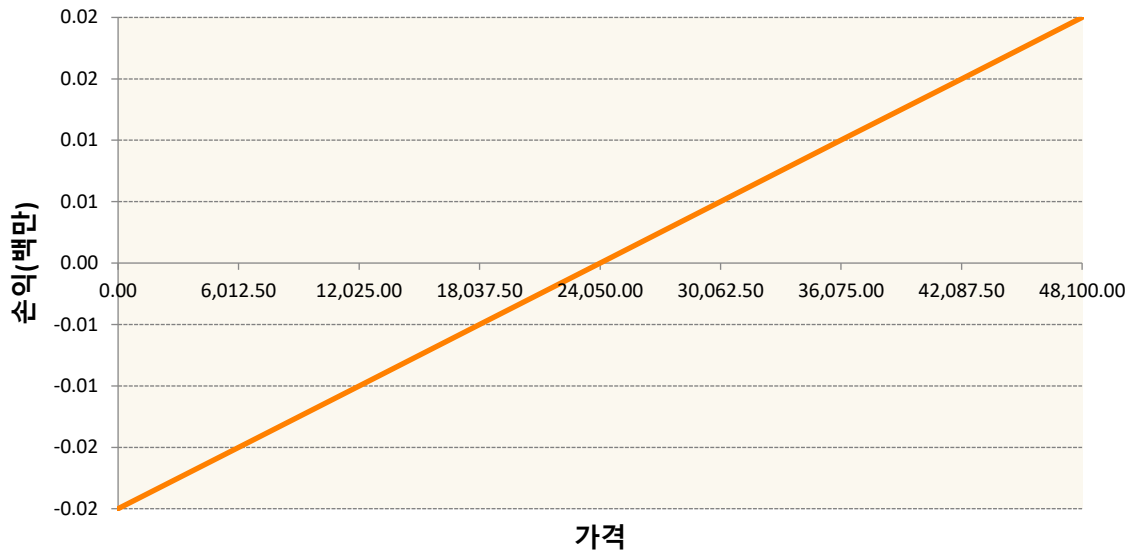
KR4101W90007-2025-09 코스피200지수선물



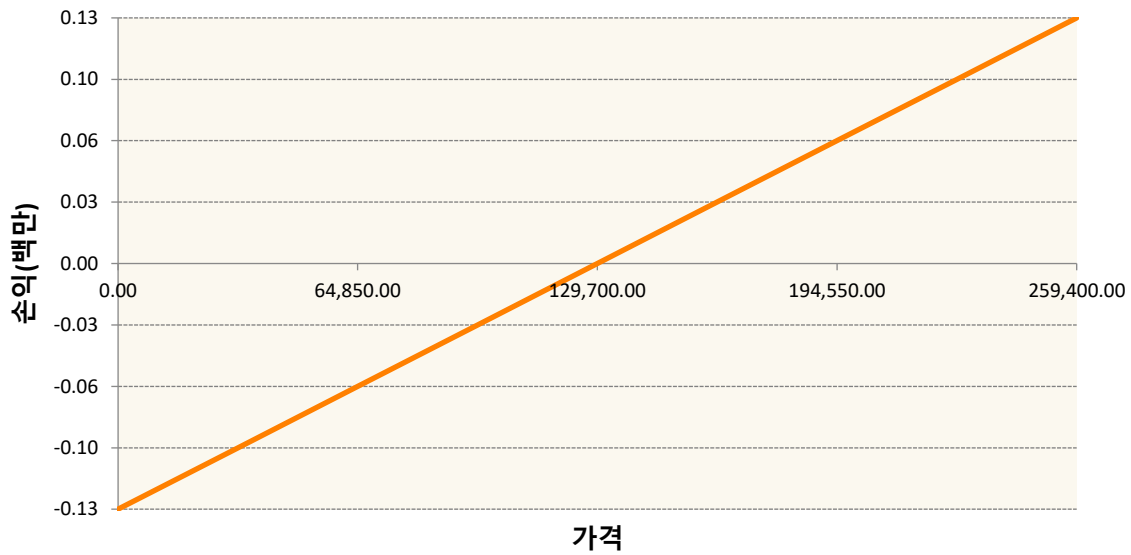
KR4105W70000-2025-07 미니코스피200 선물



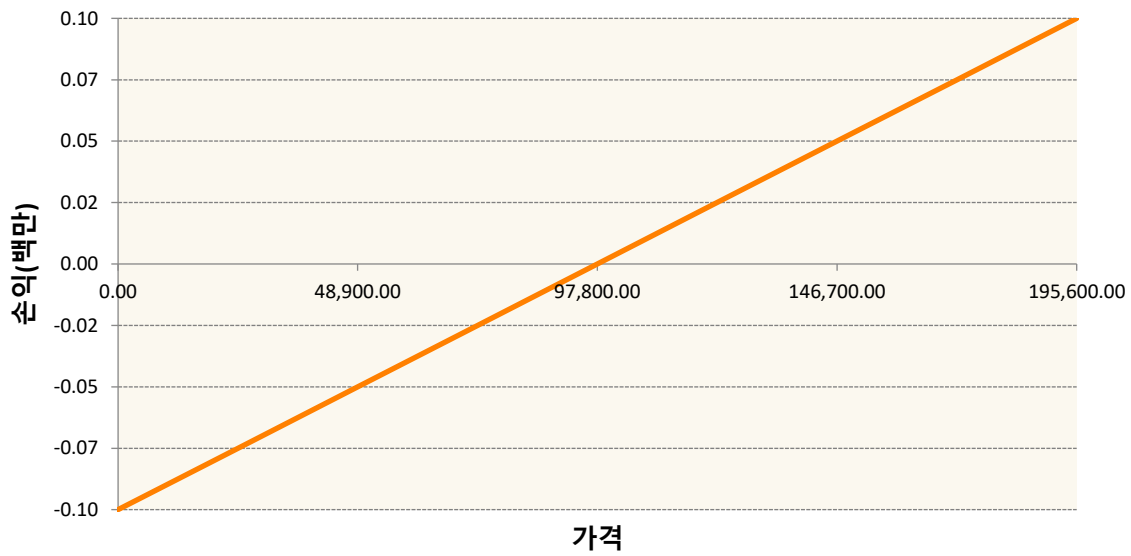
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



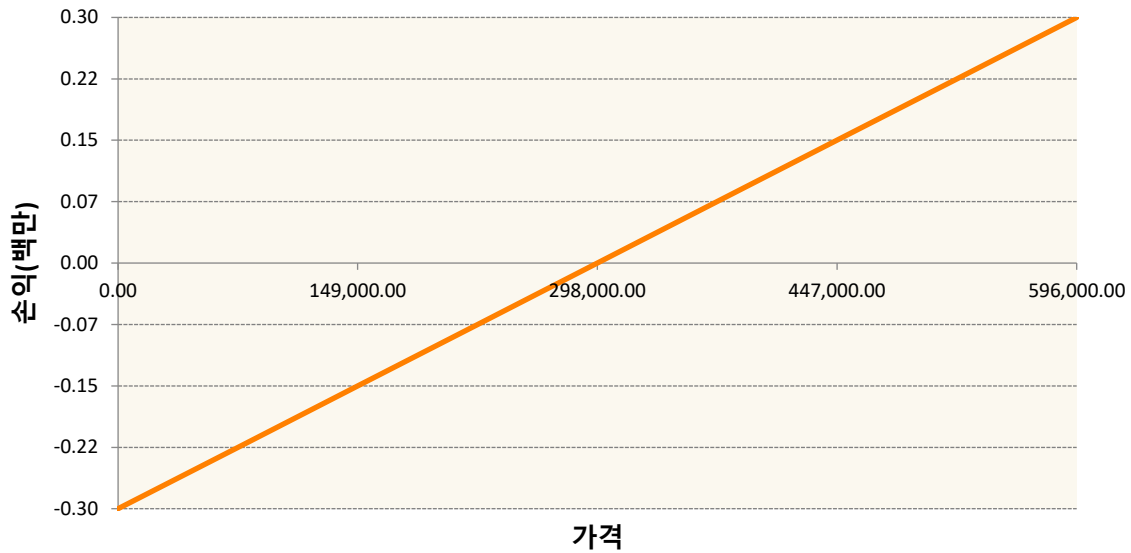
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



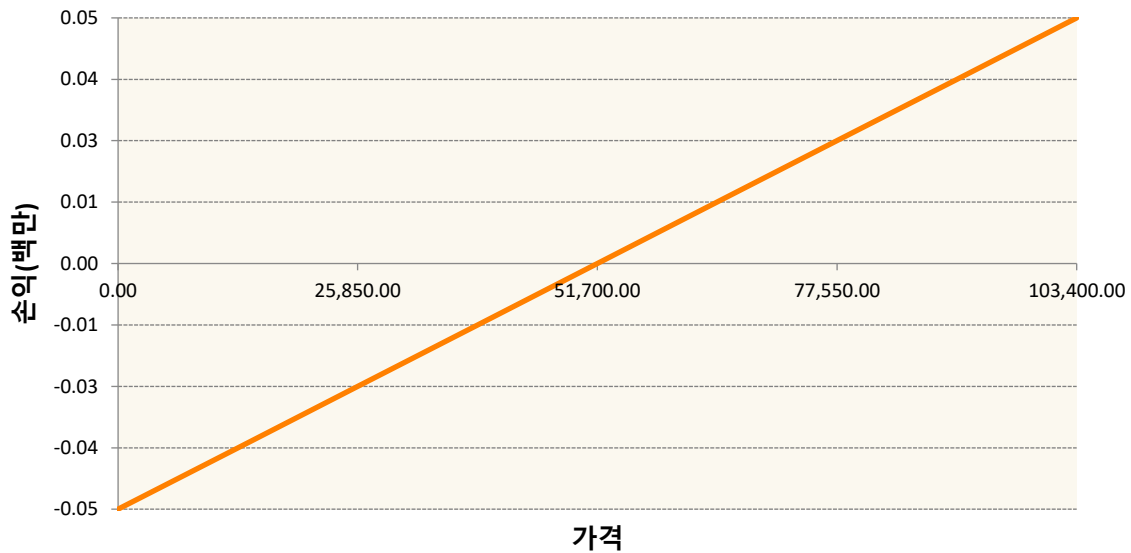
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물	55
KR4105W70( 2025-07 미니코스피200 선물	5
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	1
KR41E8W70( 2025-07 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EYW70( 2025-07 에코프로비엠개별선물	2
KR41F5W70( 2025-07 LG에너지솔루션개별선물	5
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	1

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

(단위:백만원)

108

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

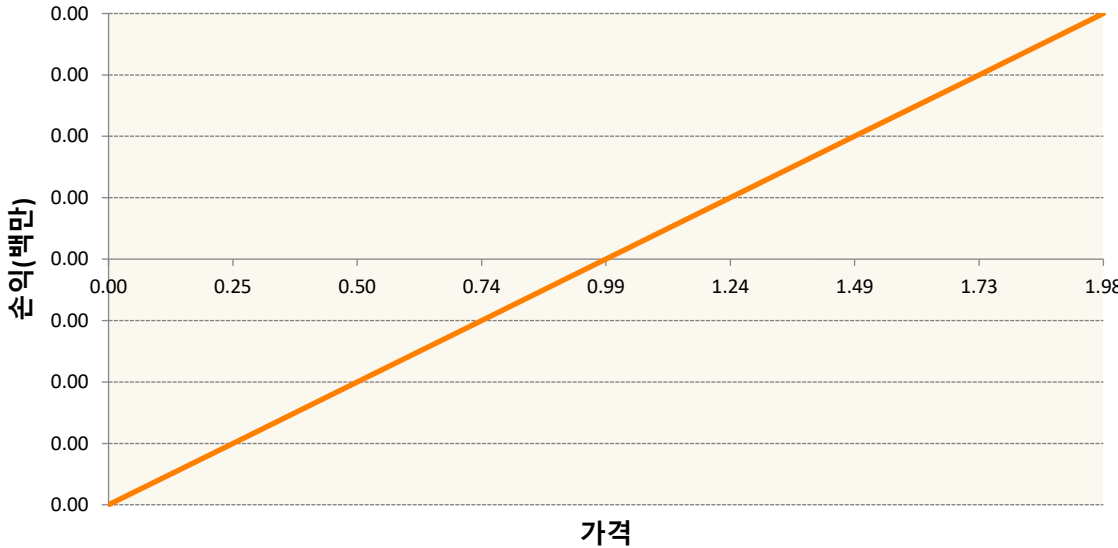
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

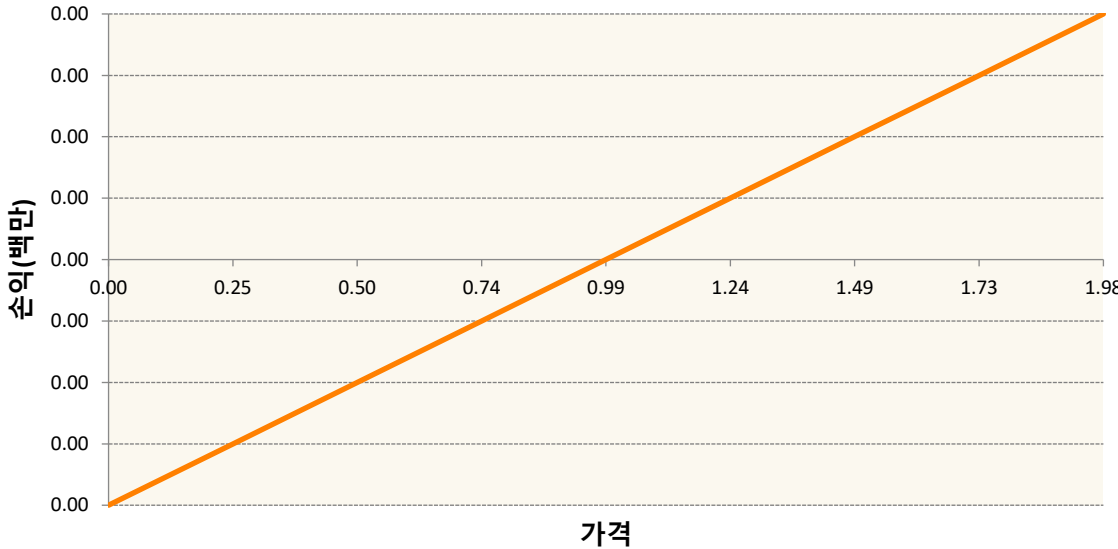
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,740	0	9,740	

### 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	586
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	196

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		900

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

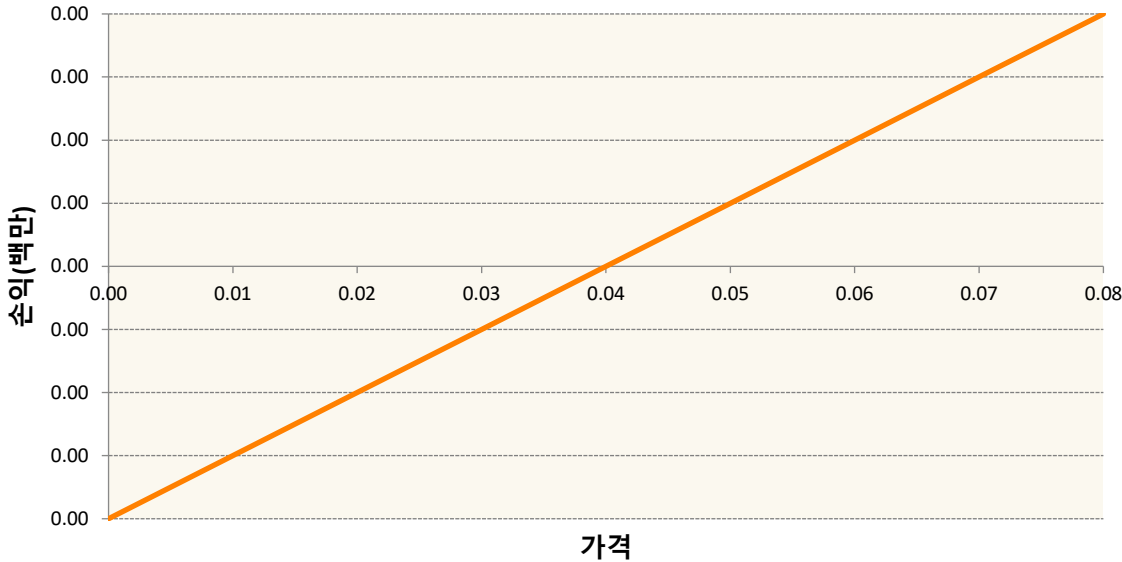
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

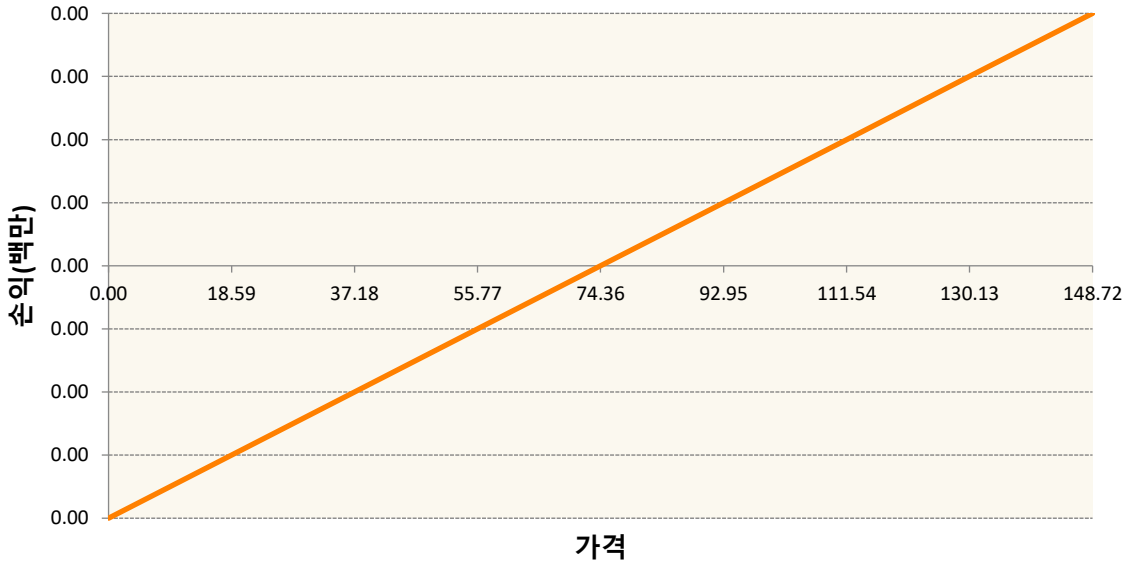
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,771	0	6,771	
누계	통화	선도	0	1,386	-1,386	장외

### 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	78
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	540

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

<b>994</b>
------------

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,362	0	4,362	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (키움)	14
SWCSI00000 신한CSI Index 240620 (NH)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (메리츠)	22
SWCSI00000 신한CSI Index 240923 (미래)	22

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

(단위:백만원)

128

공시일	2025-06-13
기준일	2025-06-12

## SOL차이나육성산업액티브상장지

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8,845	0	8,845	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(미래)	34
SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	41
SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)	29
SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)	9

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

(단위:백만원)

197

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 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 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

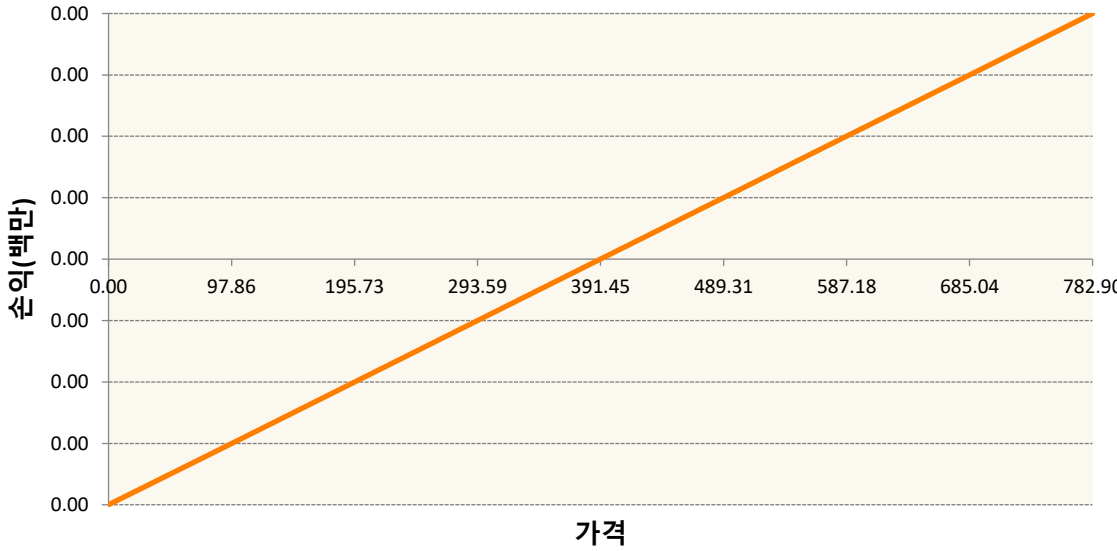
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

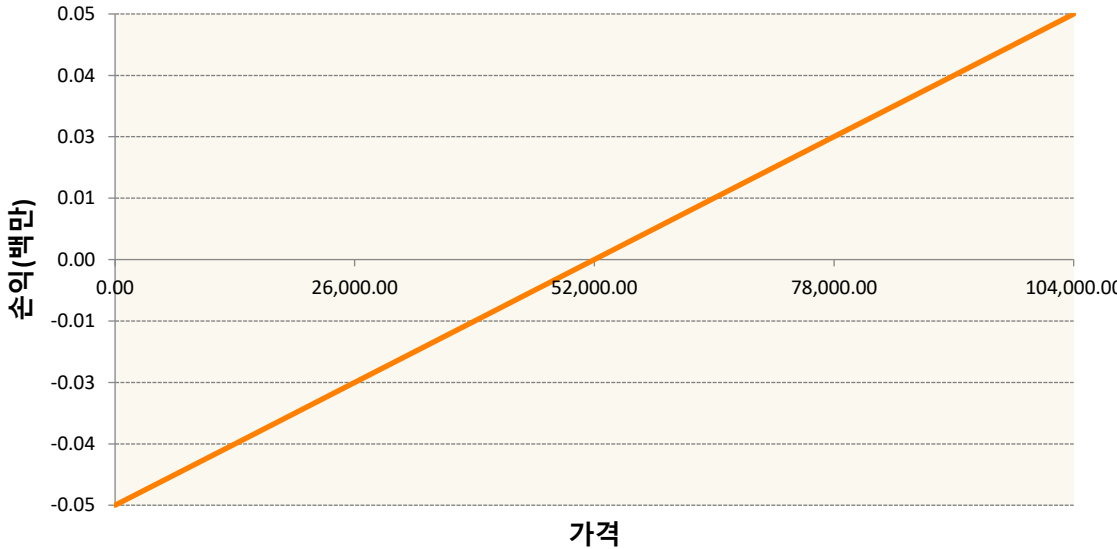
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,339	0	1,339	장내
누계	유가증권	선물	9,329	0	9,329	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

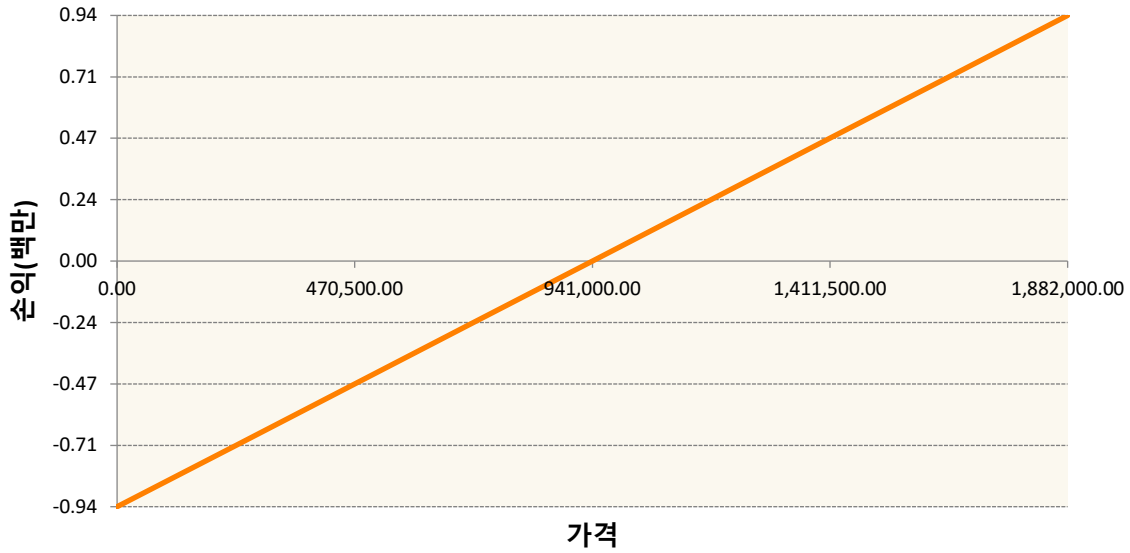
KR4101W90007-2025-09 코스피200지수선물



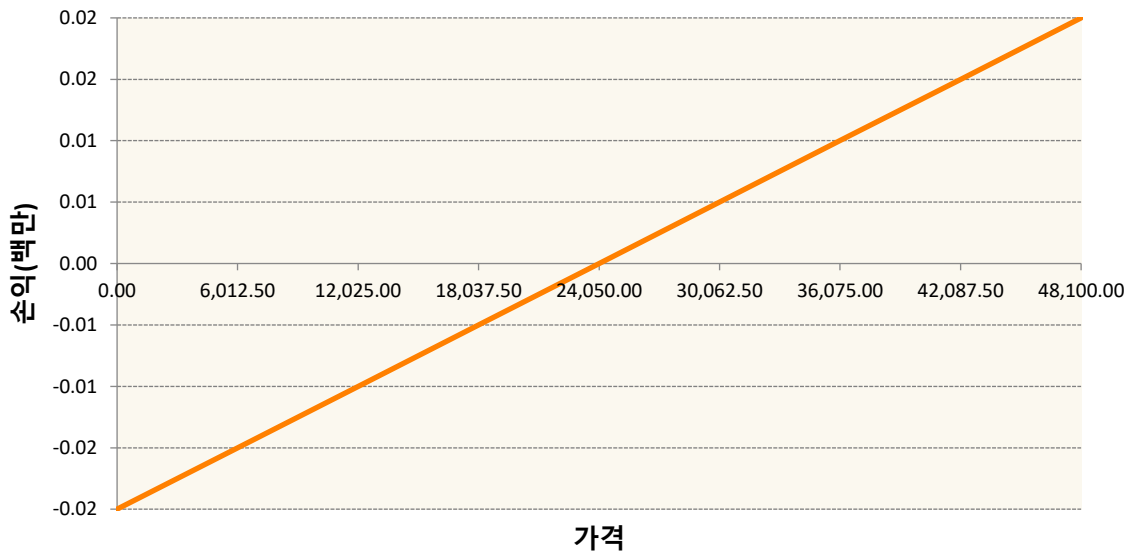
KR410FW70000-2025-07 두산로보틱스개별선물



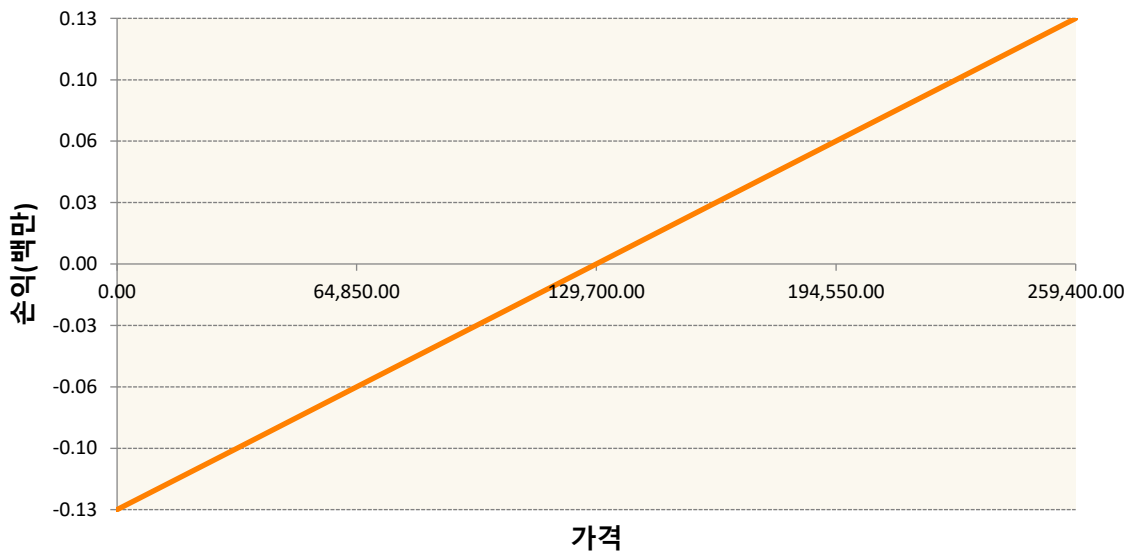
KR41BHW70002-2025-07 한화에어로스페이스개별선물



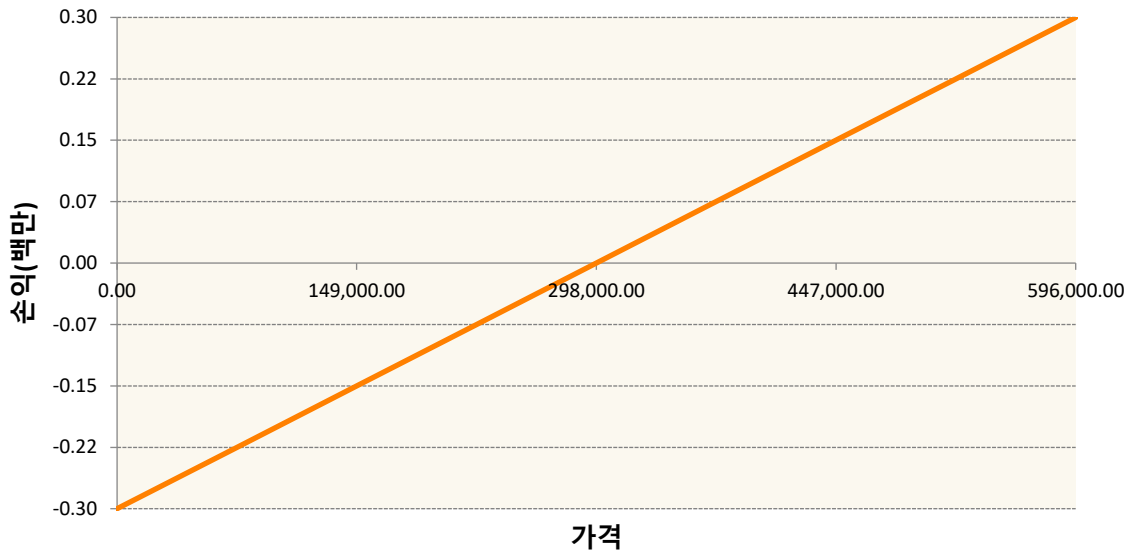
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



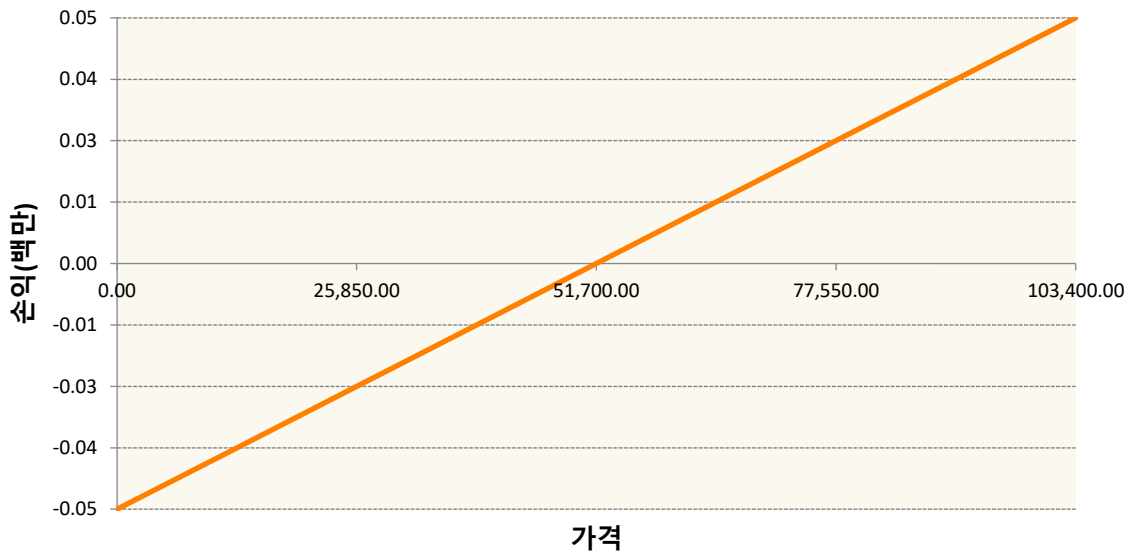
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



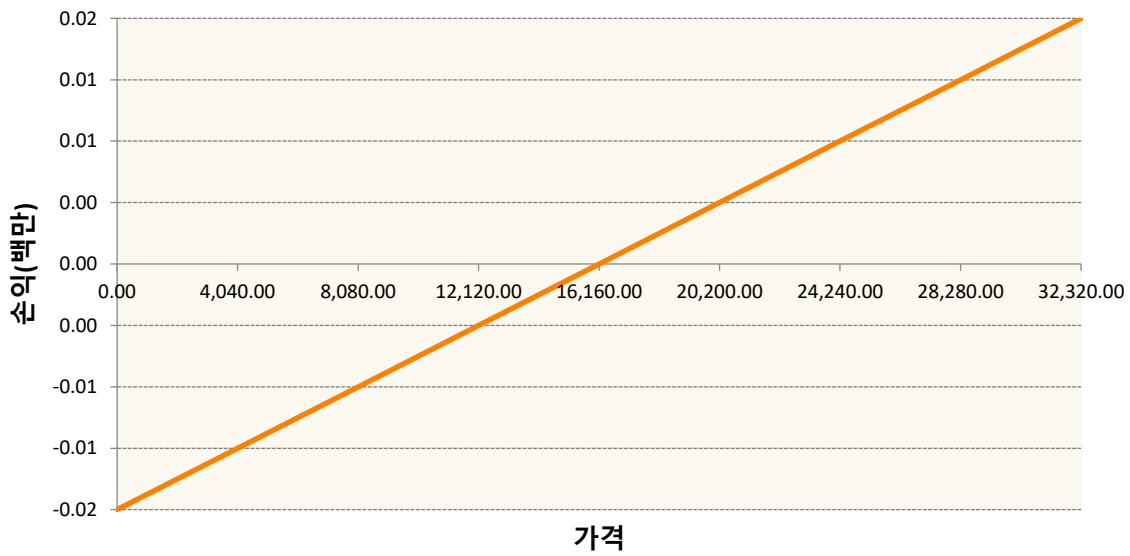
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



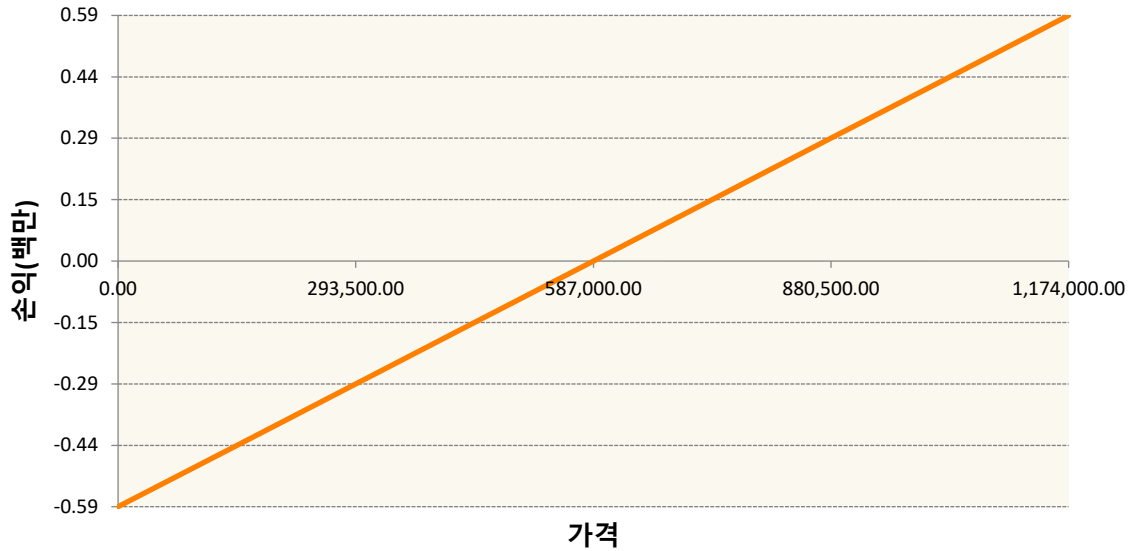
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41FWW70002-2025-07 대한전선개별선물



KR41GTW70006-2025-07 두산개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물)	548
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물)	0.08
KR41BHW70 2025-07 한화에어로스페이스개별선물	26
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	13
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물)	36
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물)	109
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	13
KR41FWW70 2025-07 대한전선개별선물	0.05
KR41GTW70(2025-07 두산개별선물)	1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,263

공시일	2025-06-13
기준일	2025-06-12

## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

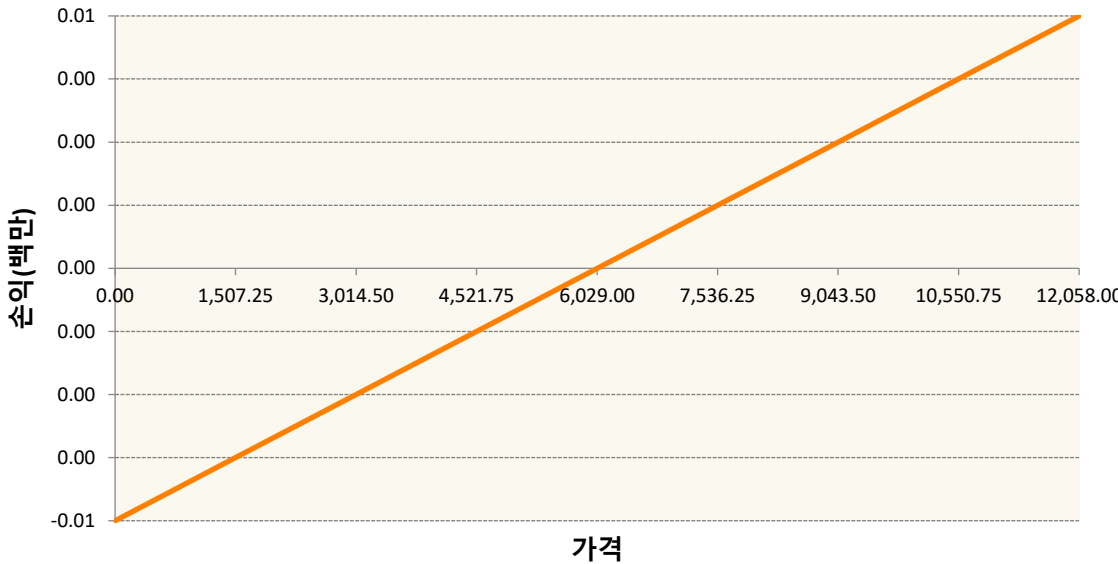
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

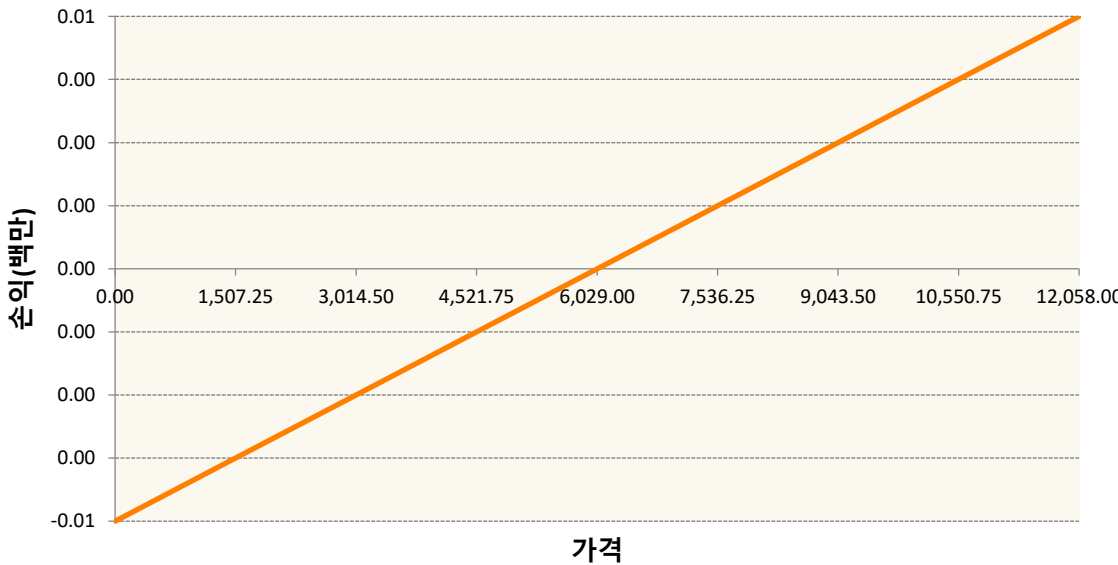
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,576	0	1,576	장내
누계	지수	선물	31,818	0	31,818	

### 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	2,545
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	126

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,364

공시일	2025-06-13
기준일	2025-06-12

## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

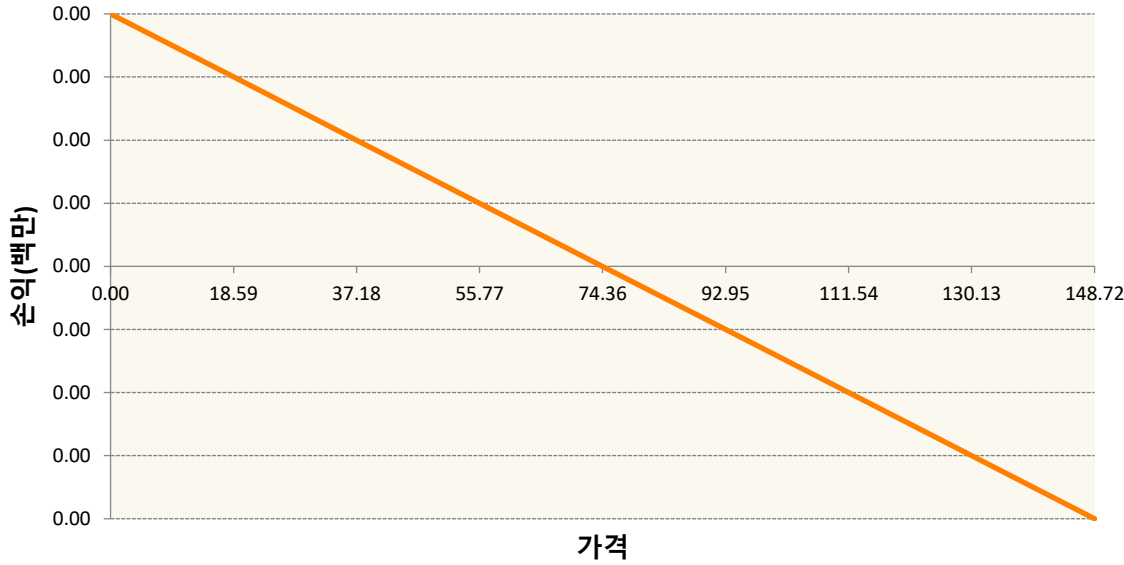
### 1. 계약금액

(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	4,237	-4,252	
누계	통화	선도	0	949	-949	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

MOZ25-ECX EMISSION Dec25



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	76
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	339

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

(단위:백만원)

628

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

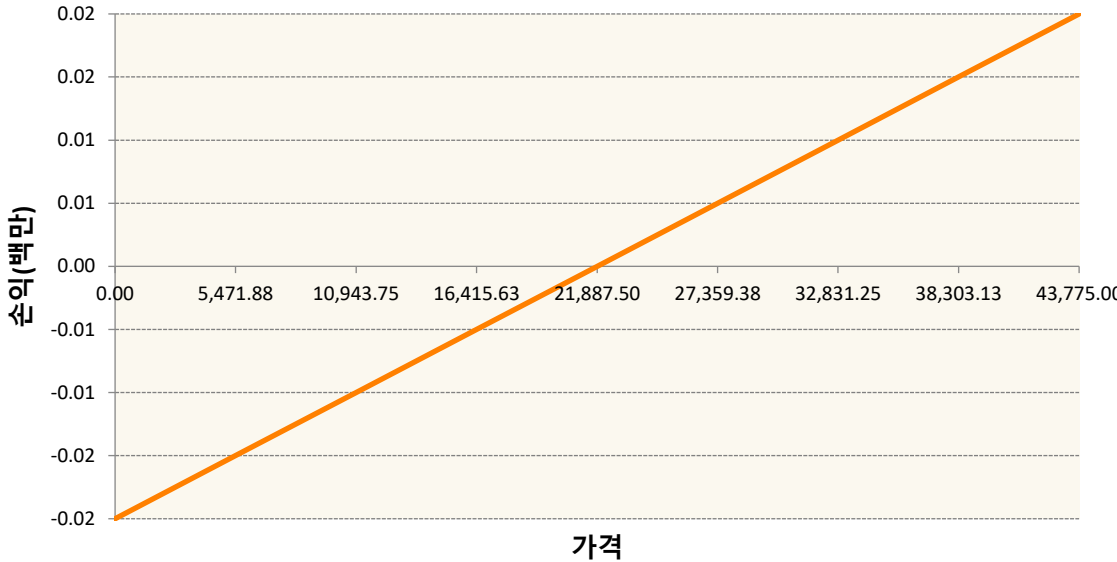
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

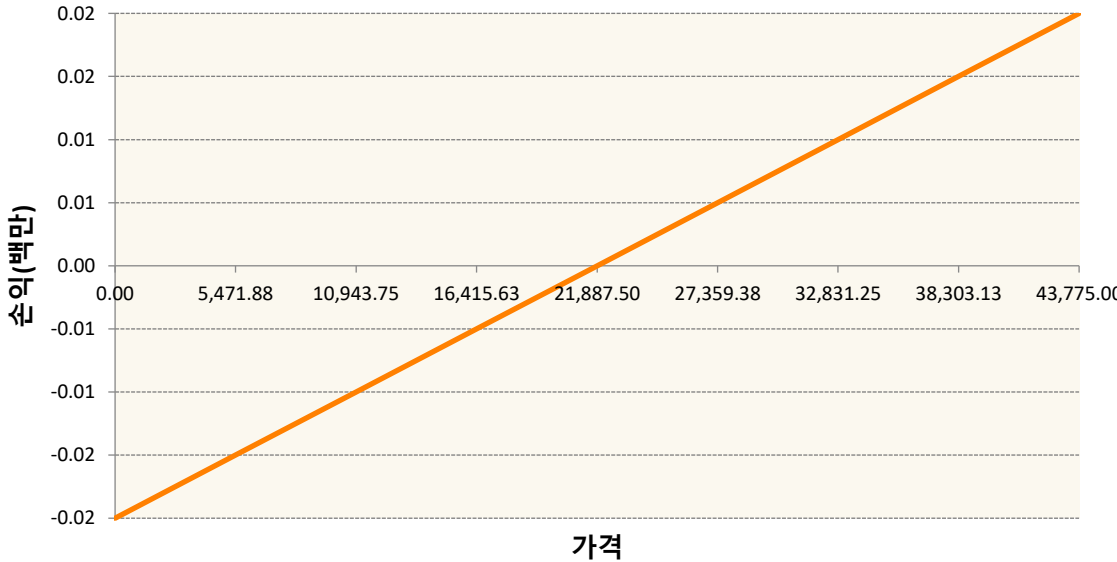
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13,938	0	13,938	
누계	유가증권	선물	300	0	300	장내

### 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	24
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,115

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>1,303</b>

공시일	2025-06-13
기준일	2025-06-12

## 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	2,957
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,533
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,685
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	906
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	158

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

(단위:백만원)

9,683

공시일 2025-06-13

기준일 2025-06-12

## 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)

82

공시일	2025-06-13
기준일	2025-06-12

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

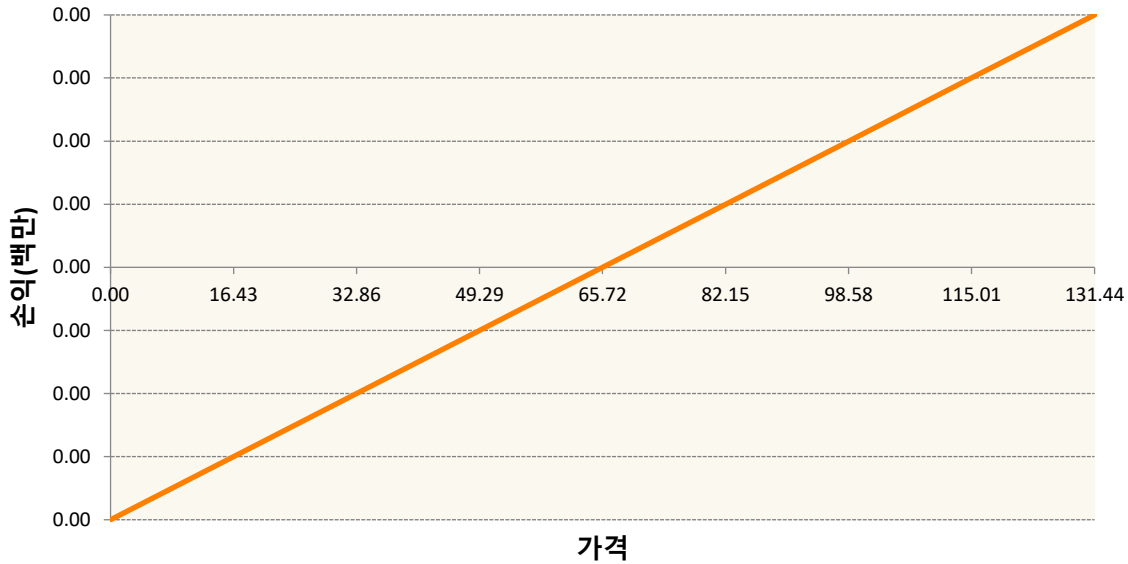
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

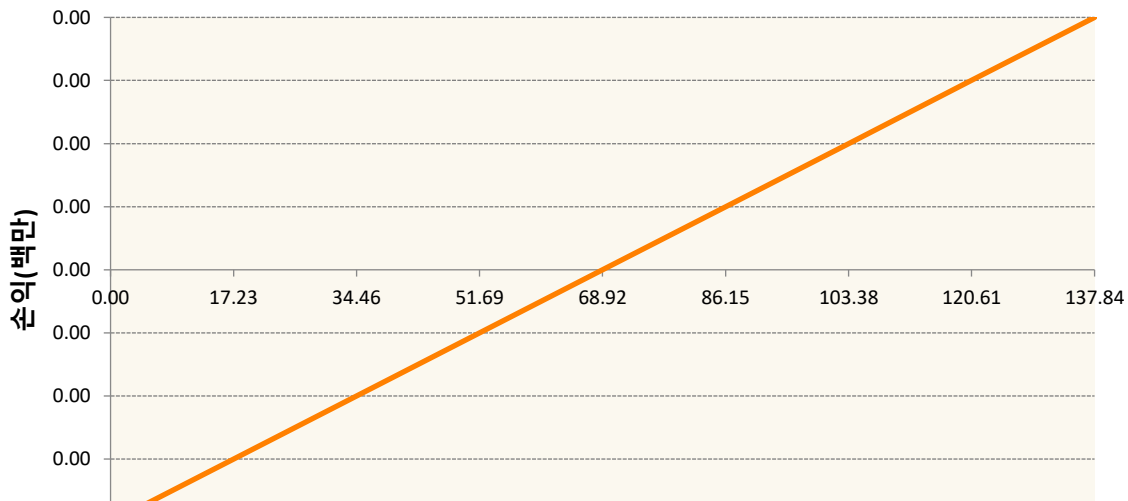
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	95	-95	장내
누계	실물자산	선물	380	0	380	
누계	유가증권	선물	285	0	285	
누계	통화	선물	0	95	-95	장내

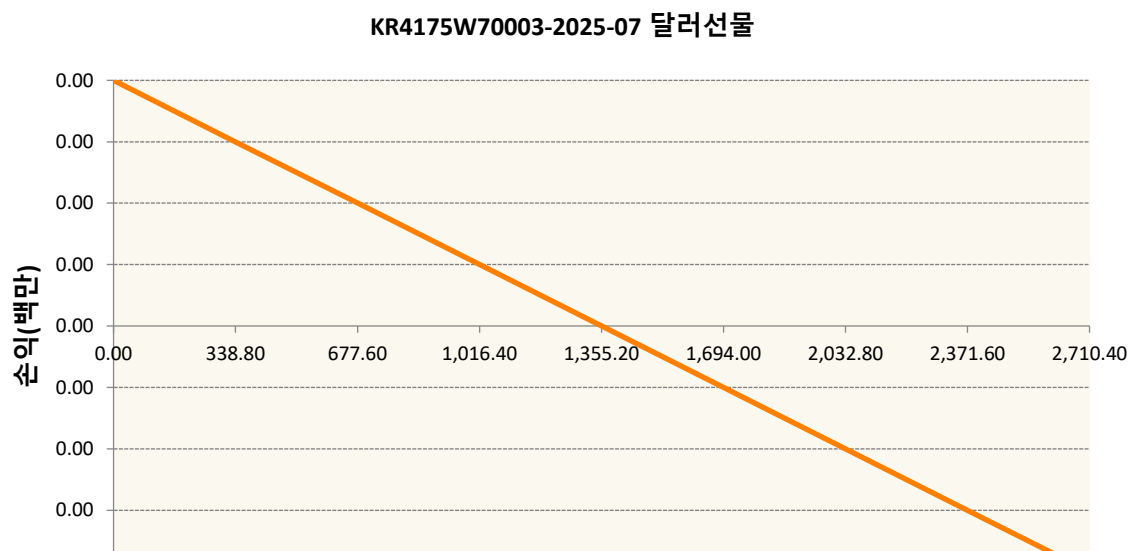
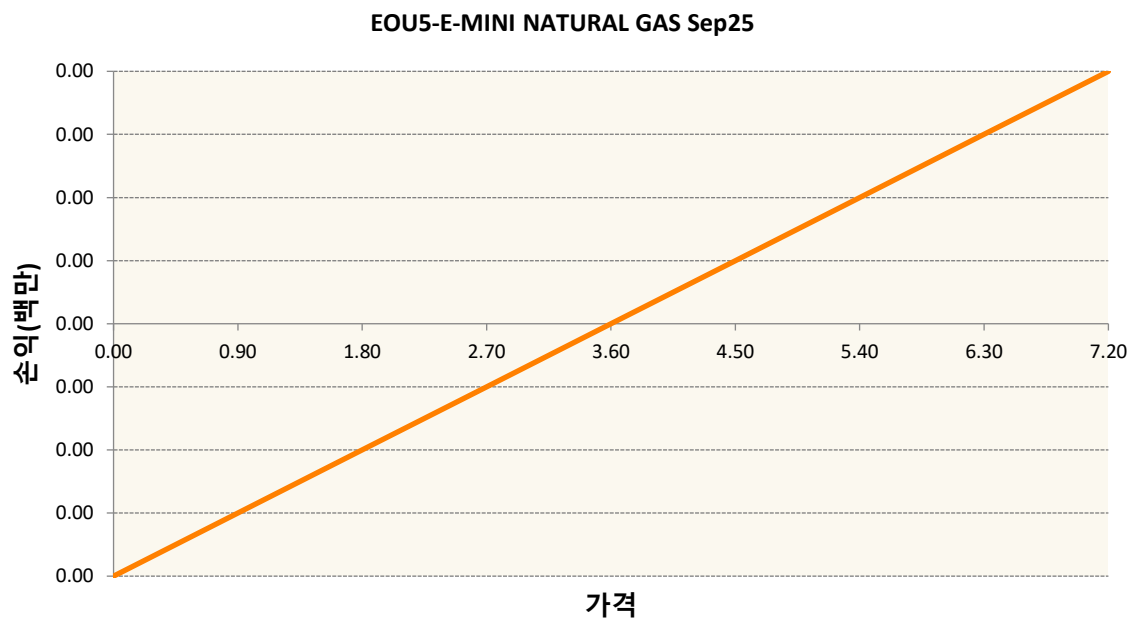
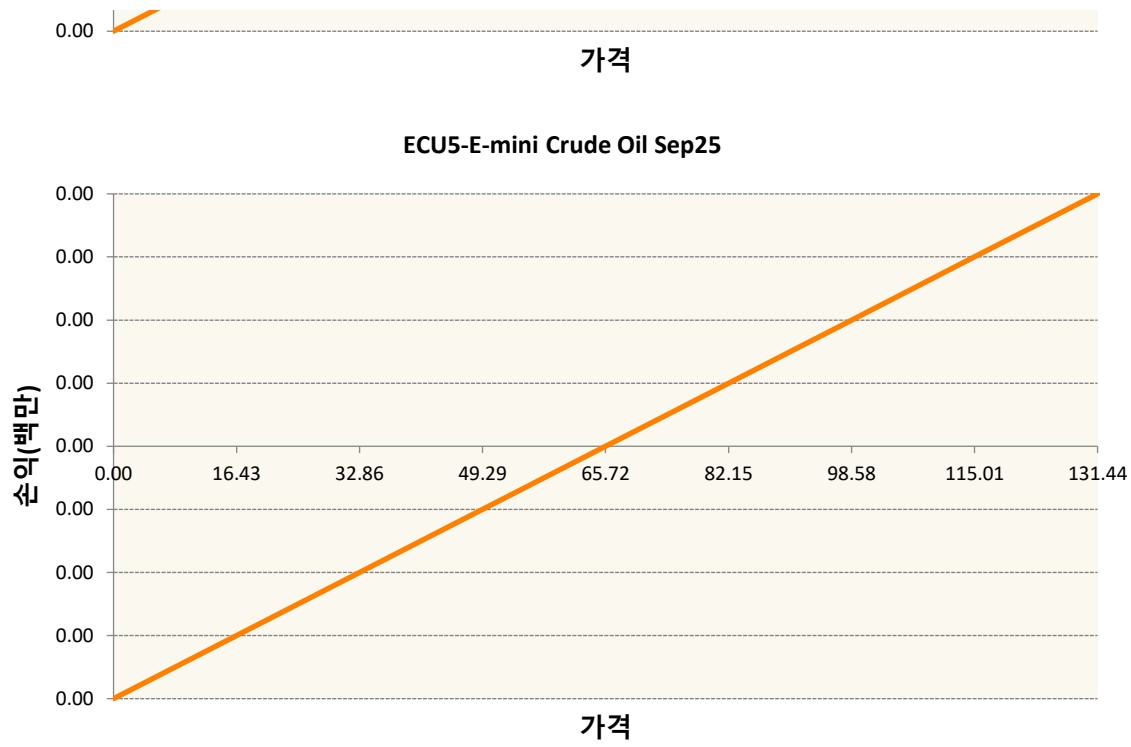
### 2. 만기시점의 손익구조

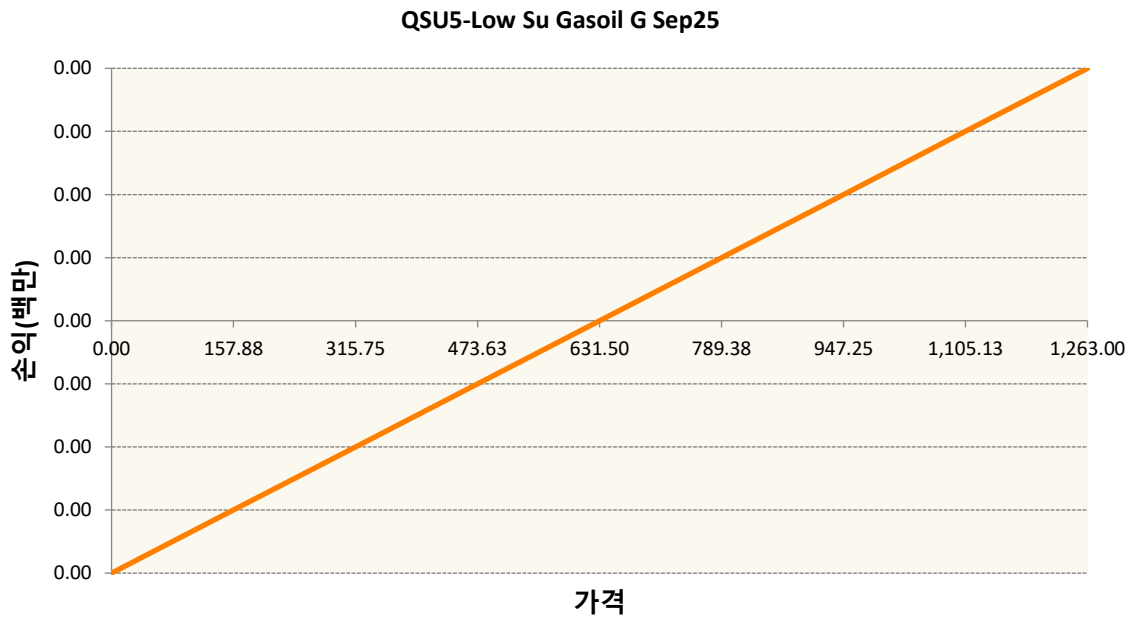
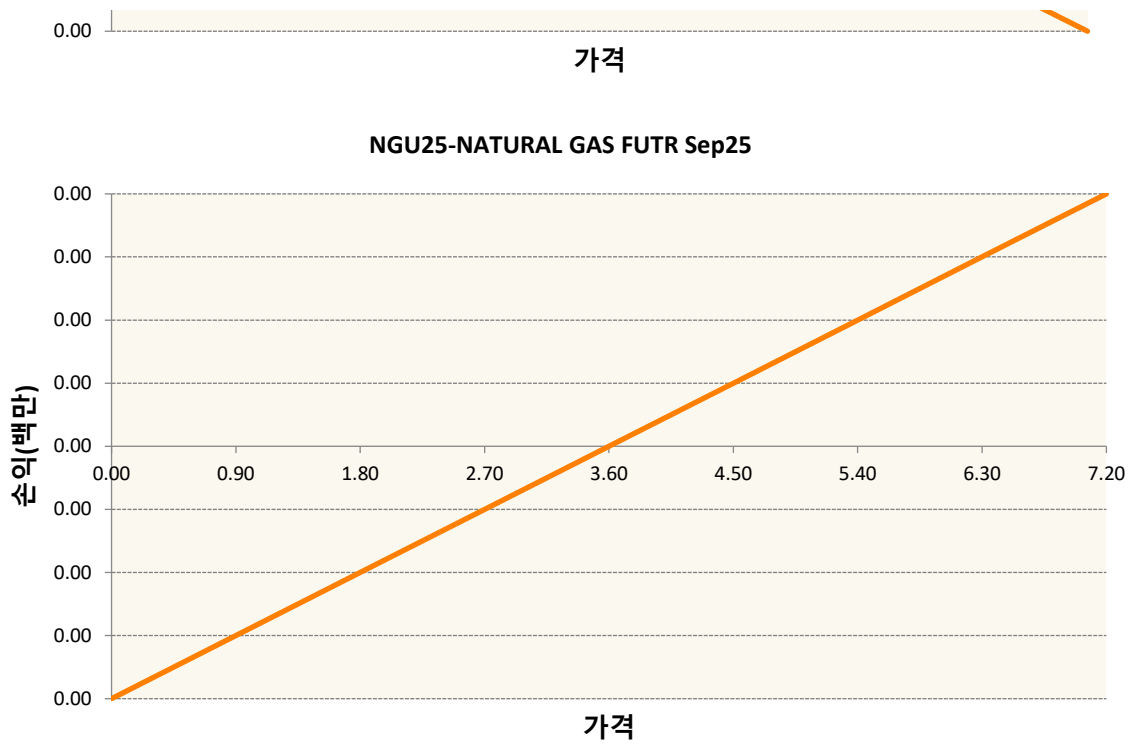
**CLU5-WTI CRUDE FUTURE Sep25**



**COU5-BRENT CRUDE FUTR Sep25**







### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU5	WTI CRUDE FUTURE Sep25	7
COU5	BRENT CRUDE FUTR Sep25	16
ECU5	E-mini Crude Oil Sep25	4
EOU5	E-MINI NATURAL GAS Sep25	8
KR4175W70(2025-07 달러선물		8
NGU25	NATURAL GAS FUTR Sep25	12
QSU5	Low Su Gasoil G Sep25	7

