

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

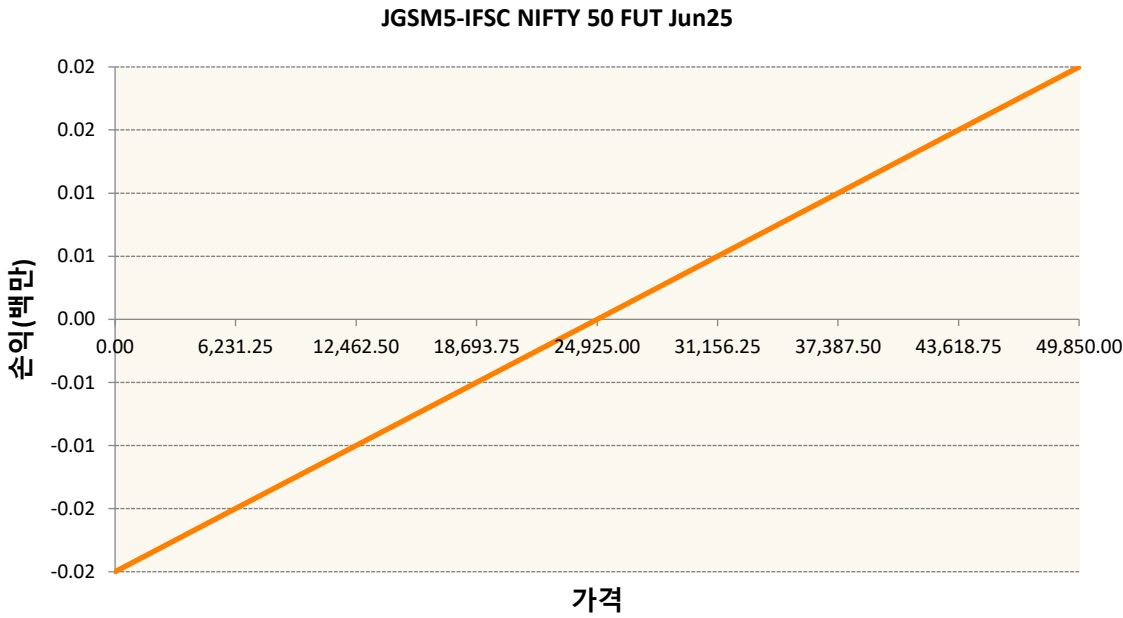
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,298	0	1,298	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSM5	IFSC NIFTY 50 FUT Jun25	104
-------	-------------------------	-----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

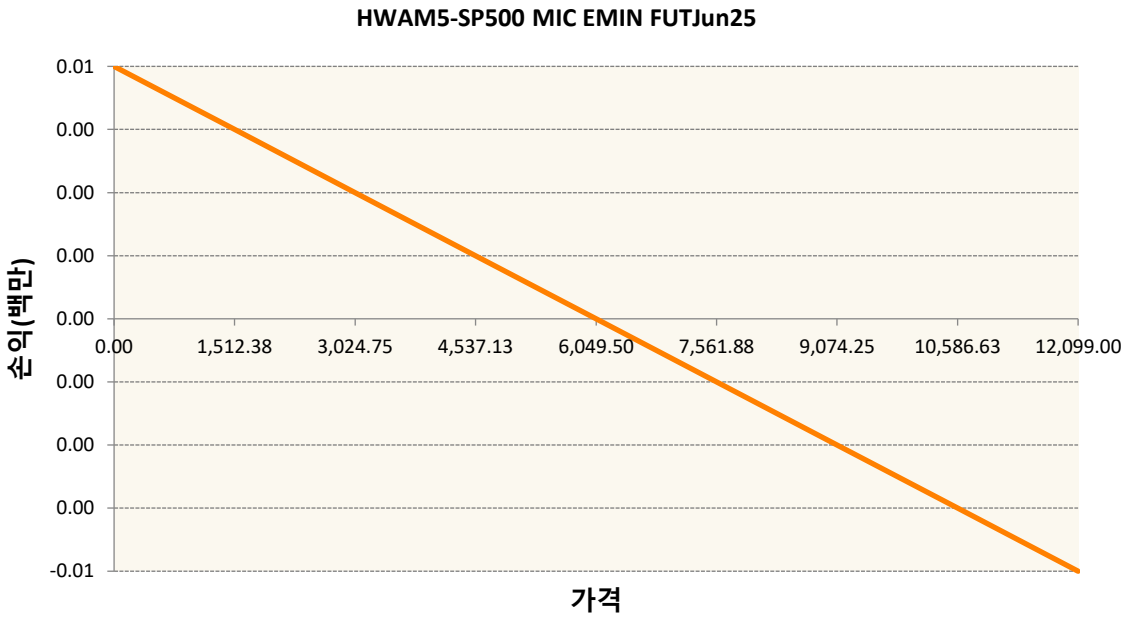
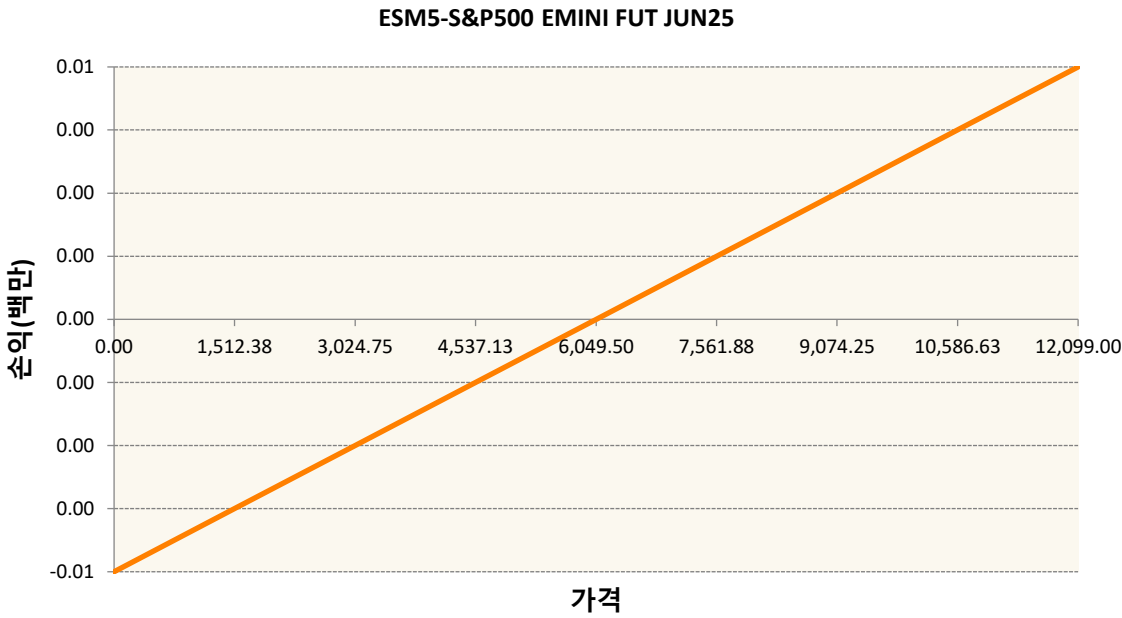
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	441	0	441	

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	2025-06-16
기준일	2025-06-13

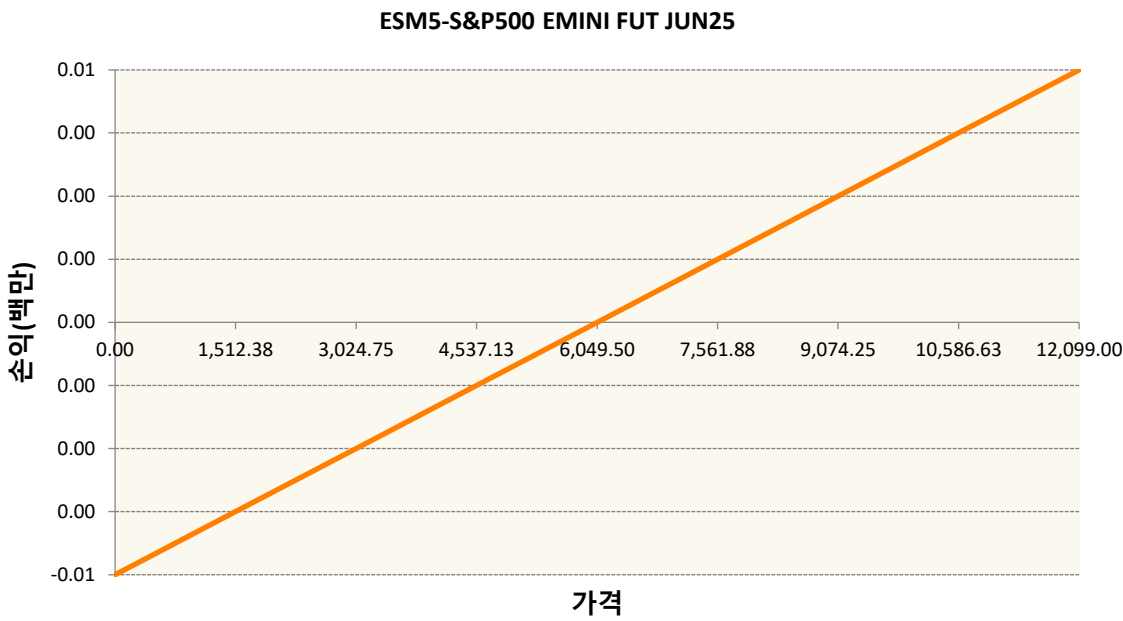
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,323	0	1,323	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	106
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

93

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

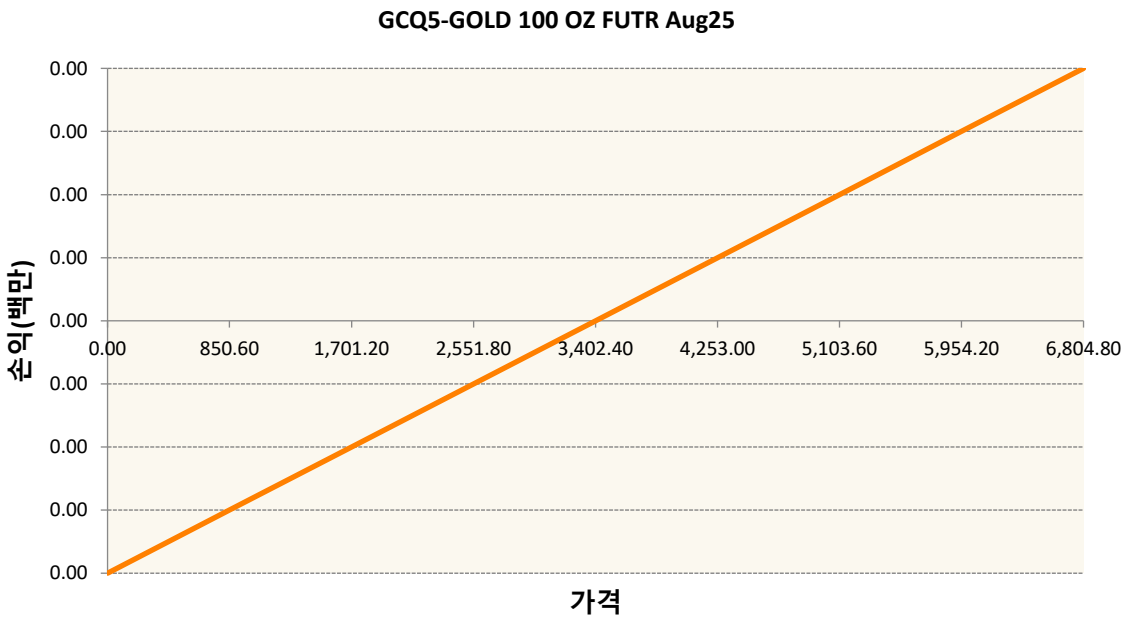
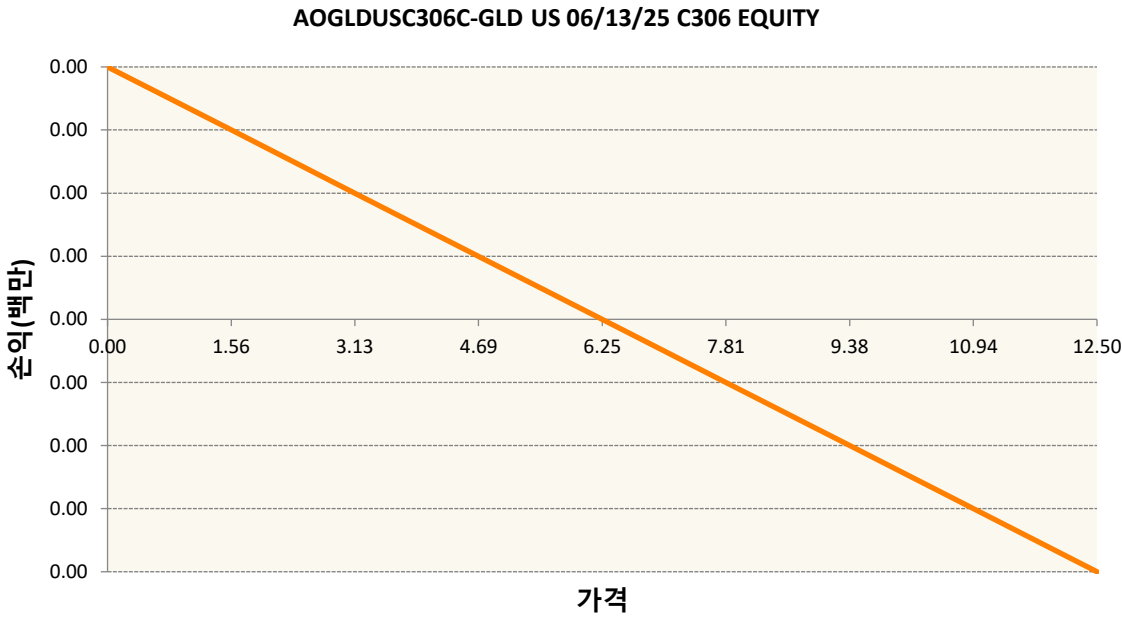
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,340	0	2,340	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSC3 GLD US 06/13/25 C306 EQUITY		0.03
GCQ5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25		187

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	159

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

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	9
AOPLTRUSC`PLTR US 06/13/25 C129 EQUITY	1
AOPLTRUSP1`PLTR US 06/13/25 P125 EQUITY	3
AOPLTRUSP1`PLTR US 06/13/25 P129 EQUITY	0.01

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

(단위:백만원)

53

공시일 2025-06-16

기준일 2025-06-13

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	2025-06-16
기준일	2025-06-13

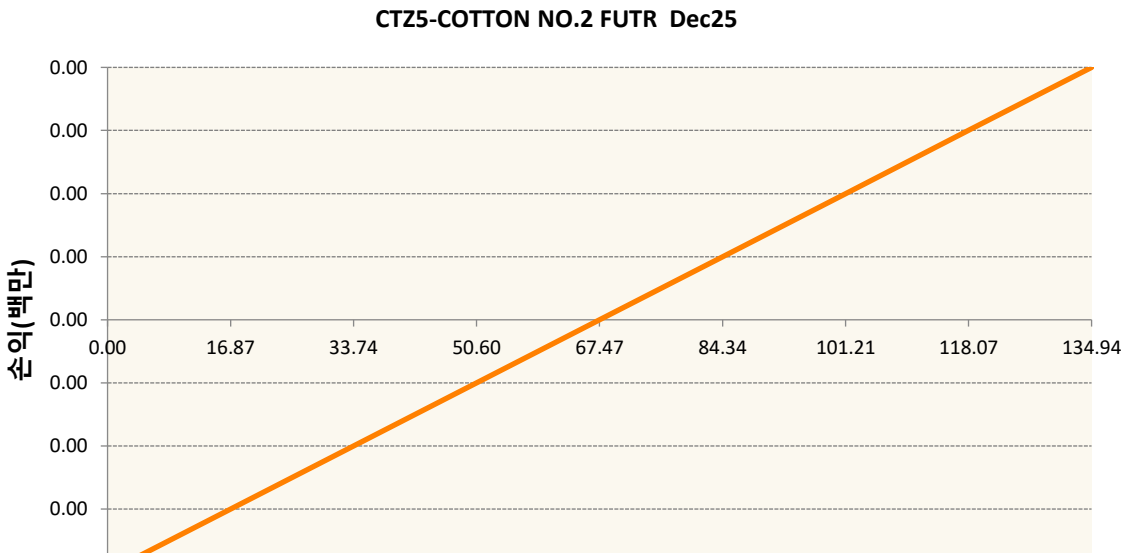
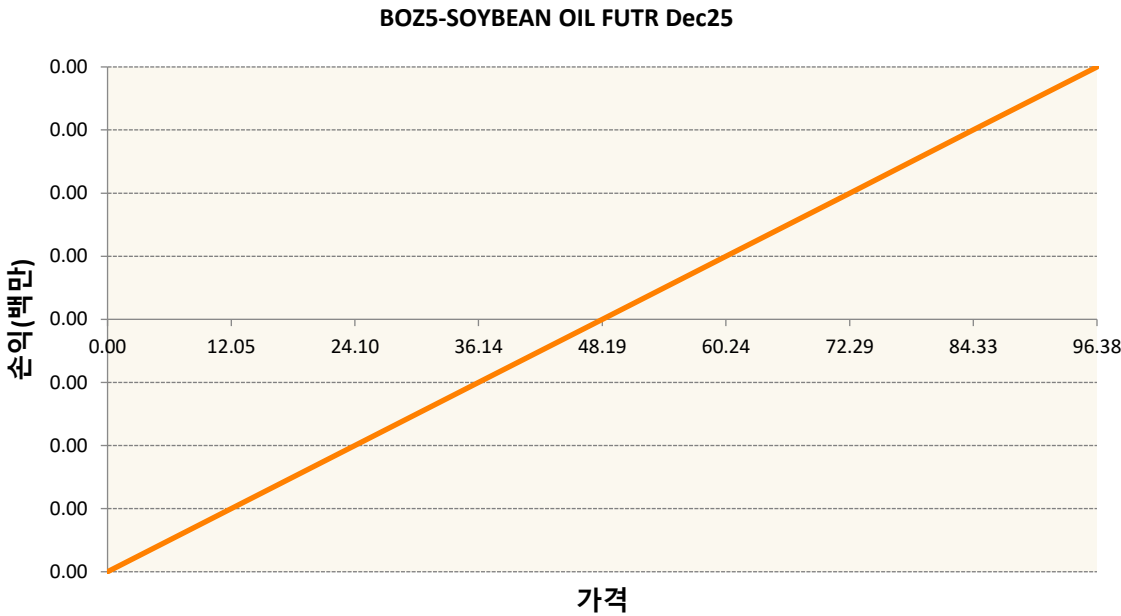
포커스농산물모(채권-파생형)

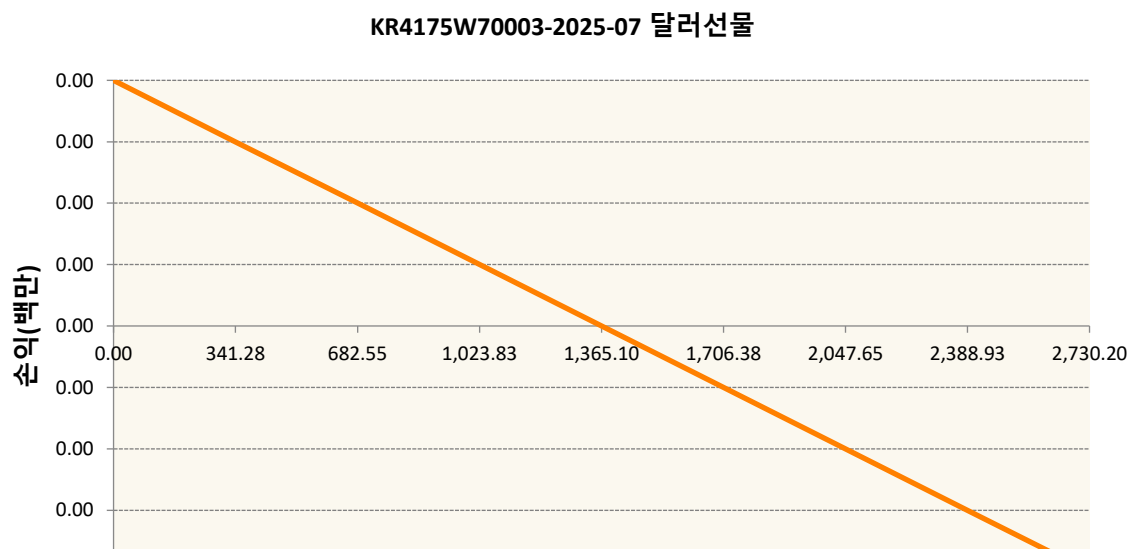
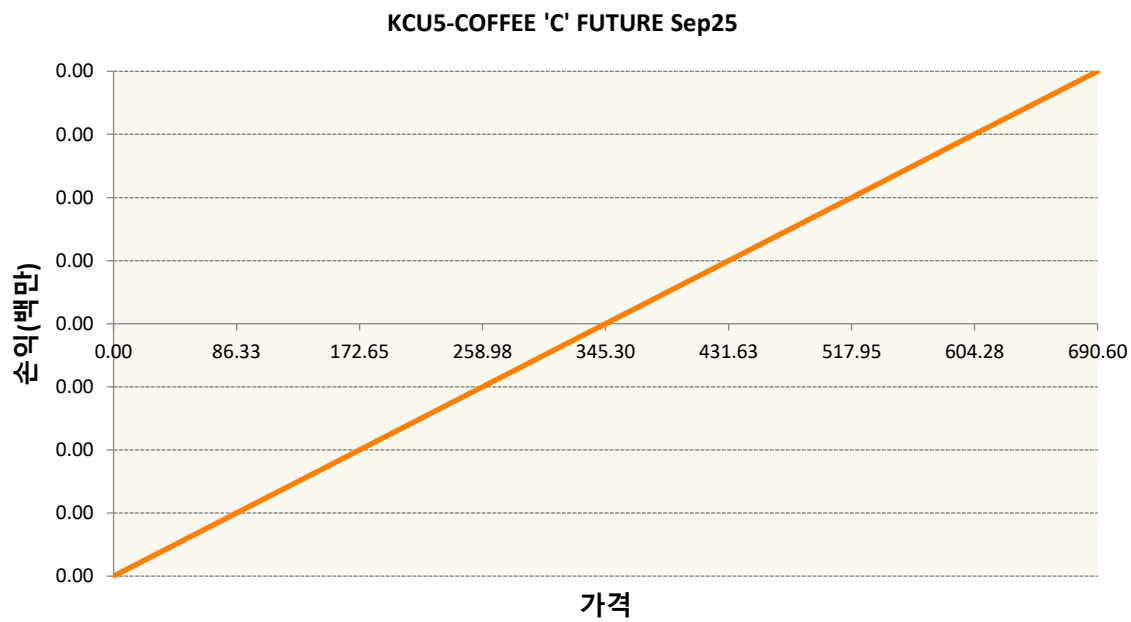
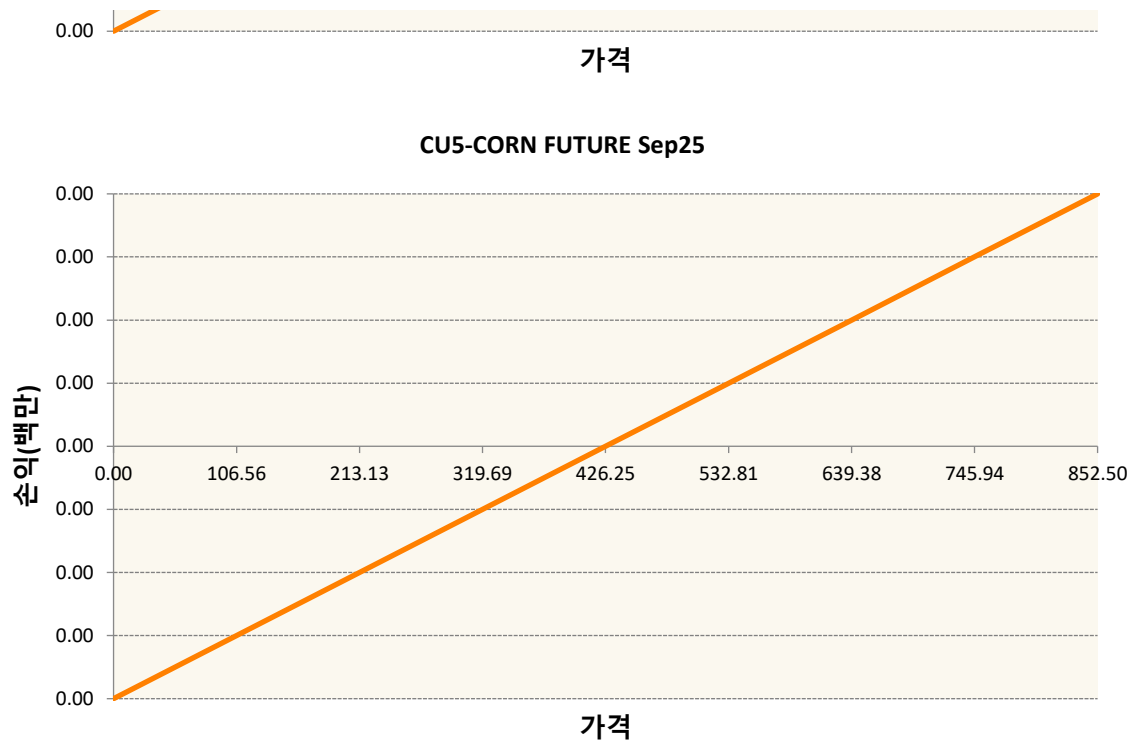
1. 계약금액

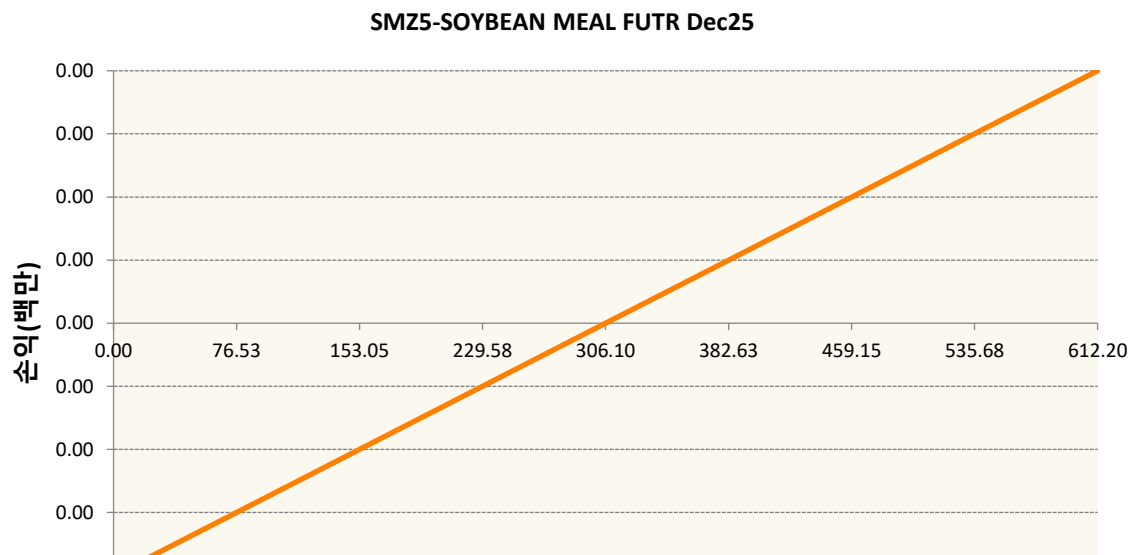
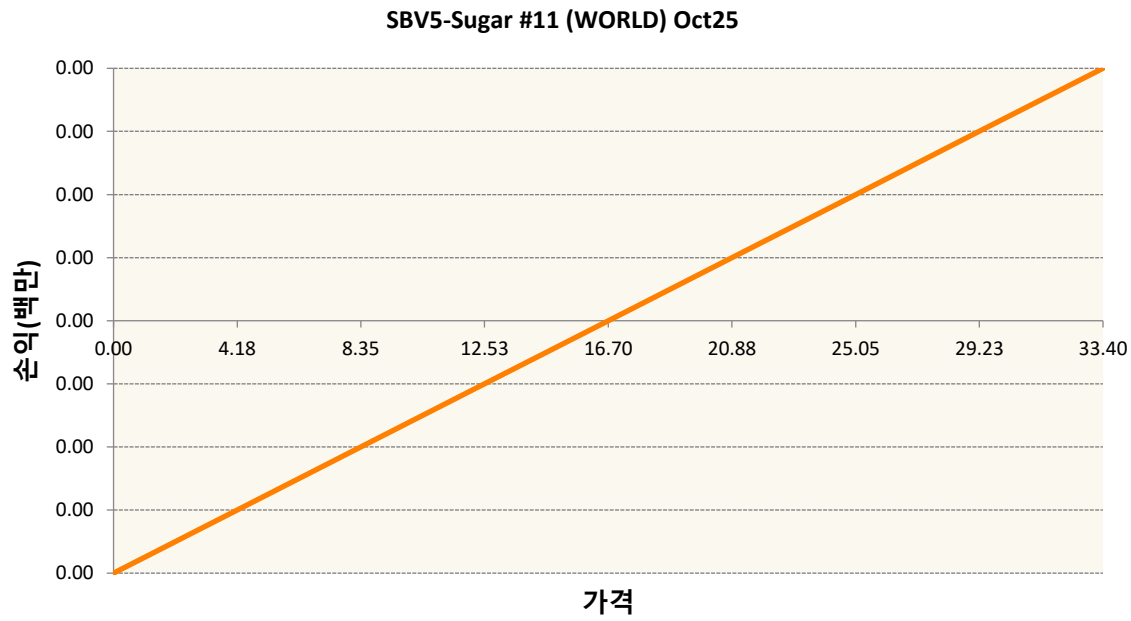
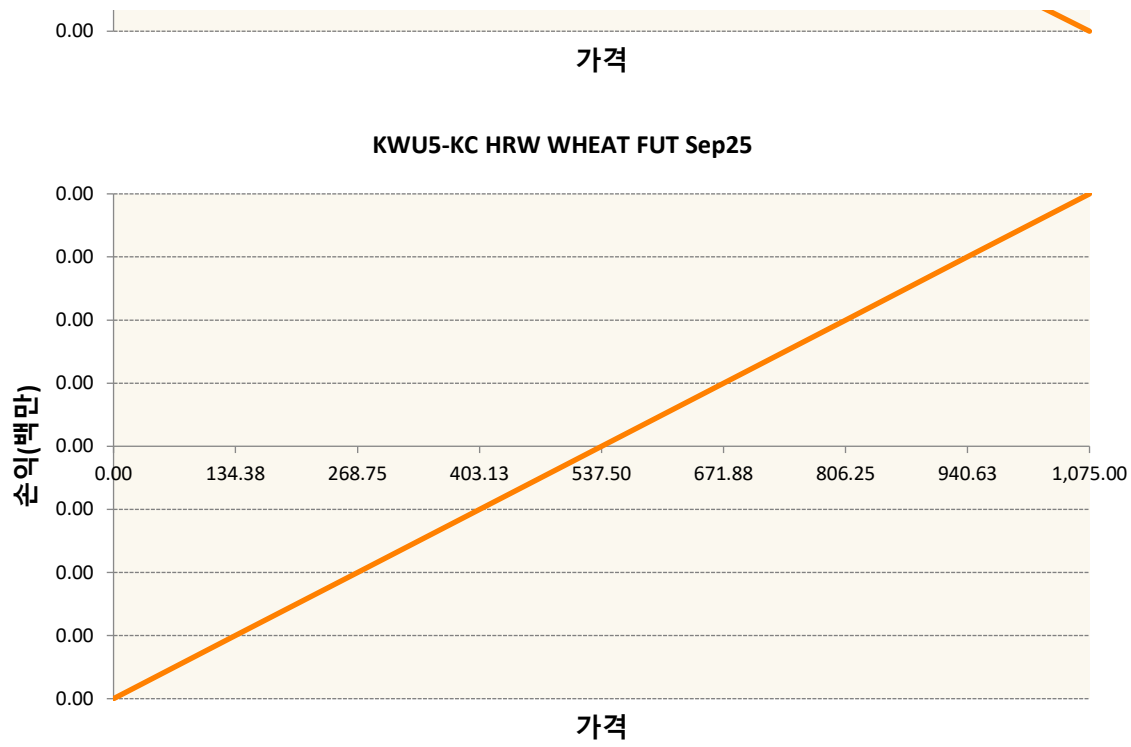
(단위:USD 백만)

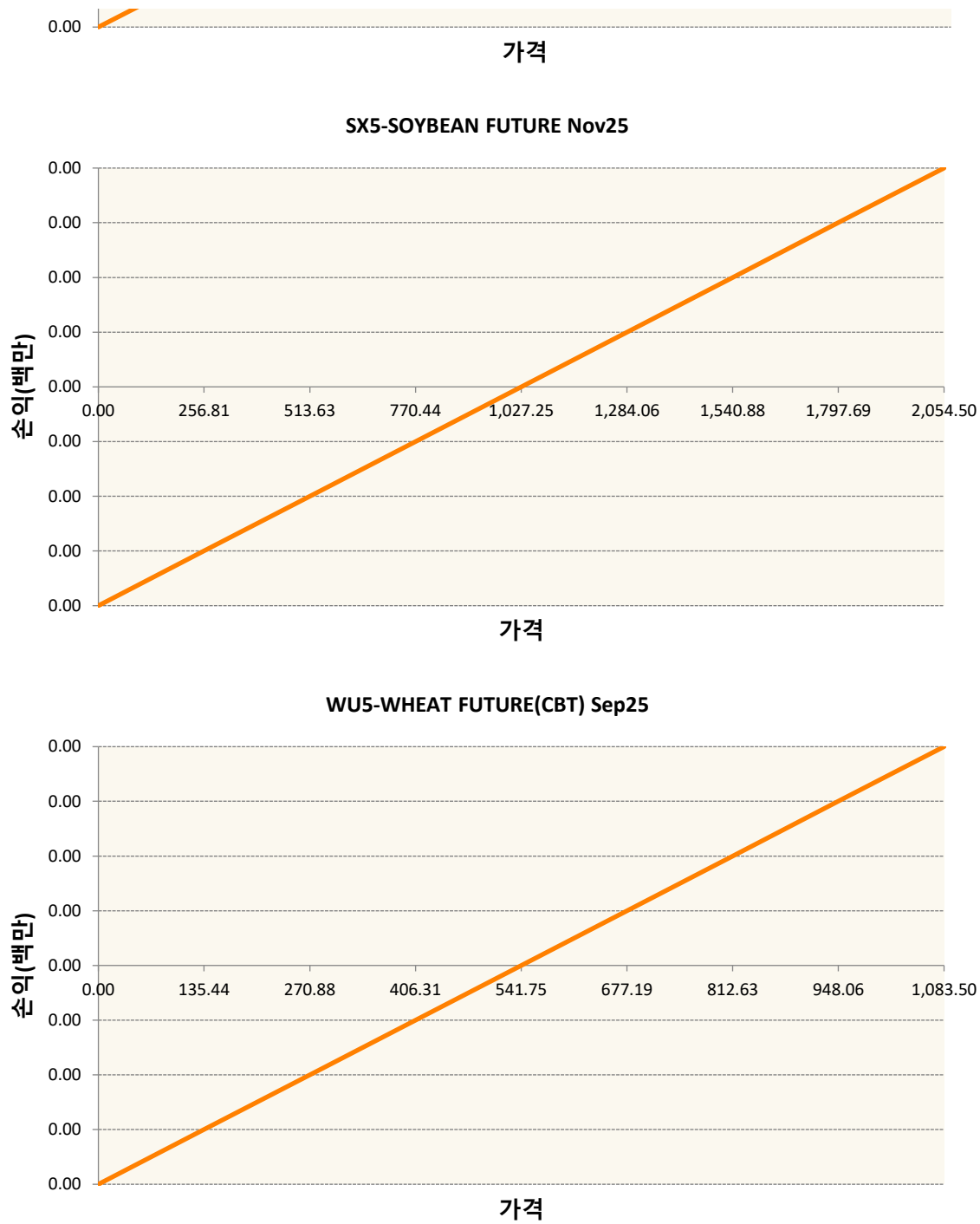
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	55	0	55	장내
누계	실물자산	선물	1,519	0	1,519	
누계	유가증권	선물	2,083	0	2,083	
누계	통화	선물	0	205	-205	장내

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	2025-06-16
기준일	2025-06-13

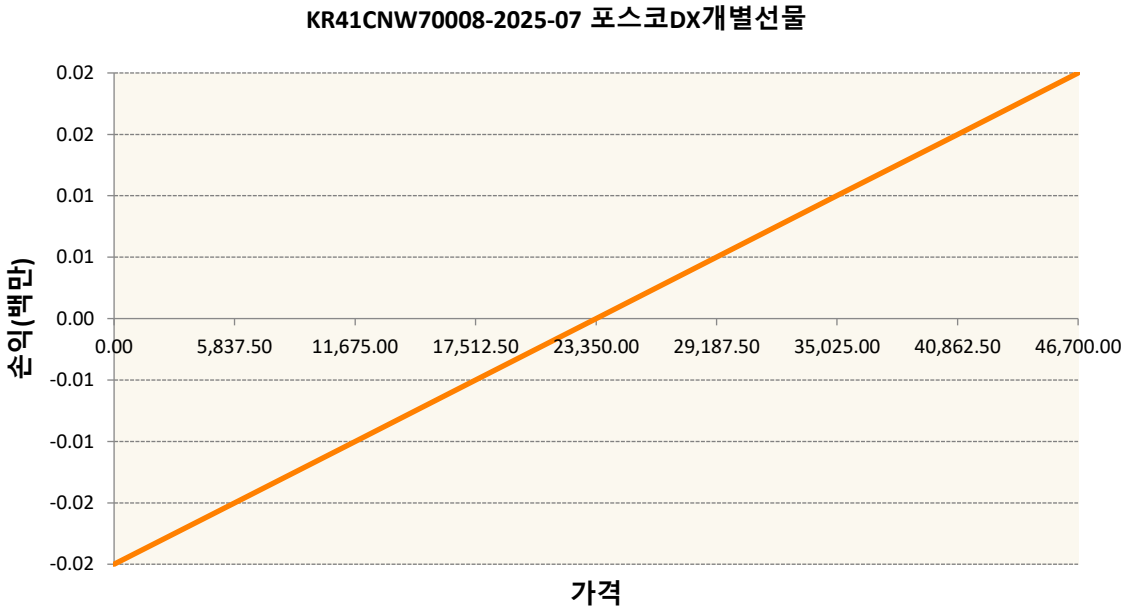
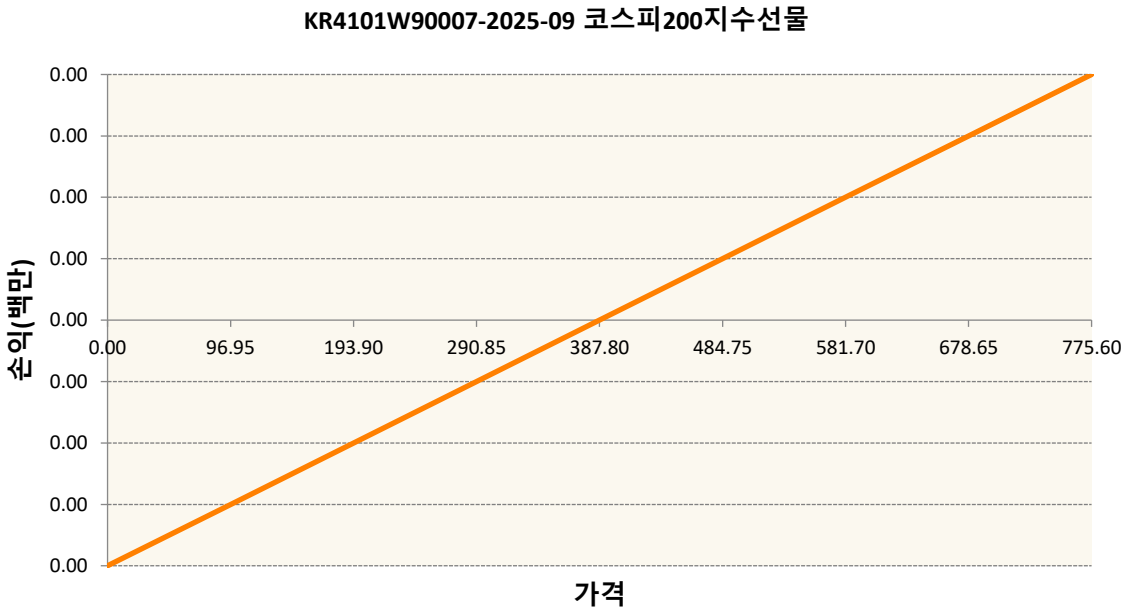
스마트인덱스모

1. 계약금액

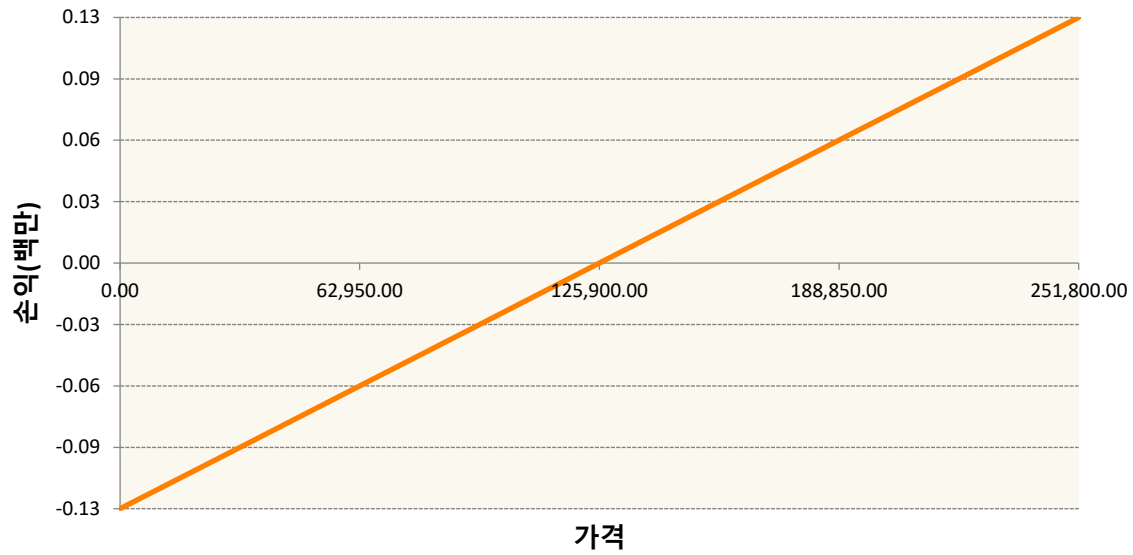
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3	0	3	장내
누계	유가증권	선물	826	0	826	장내

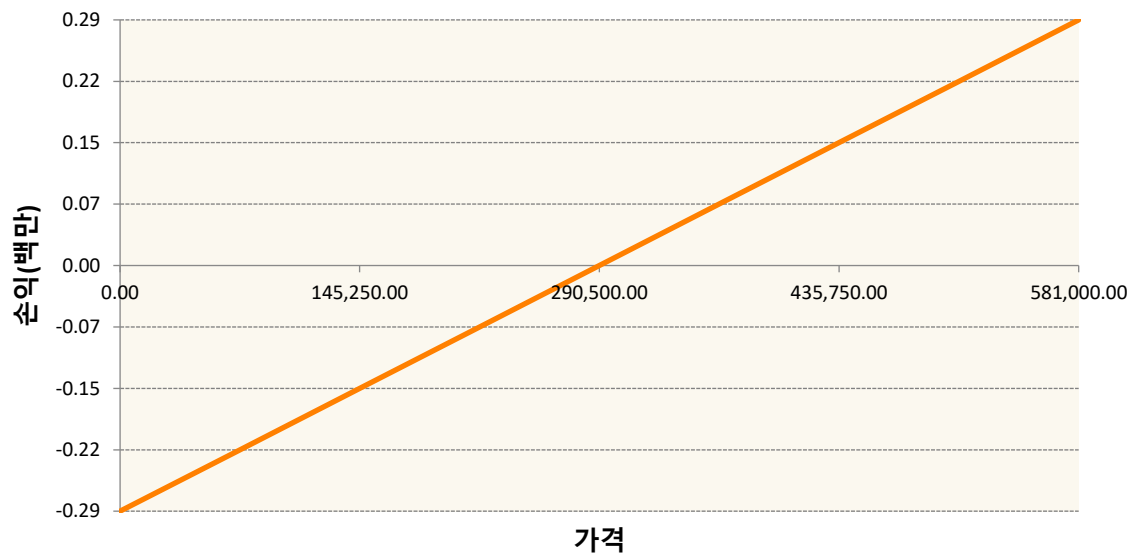
2. 만기시점의 손익구조



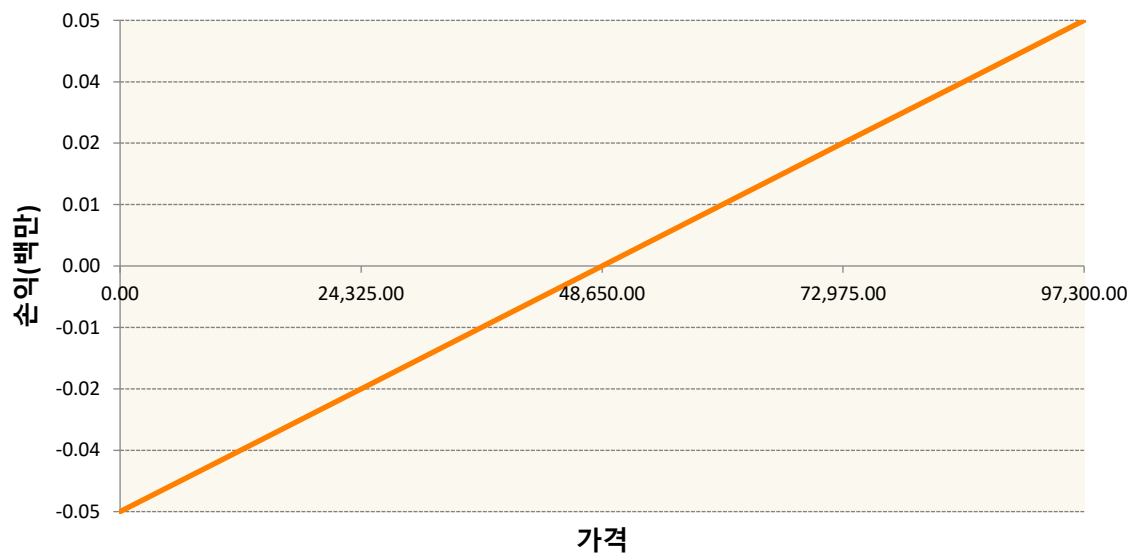
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



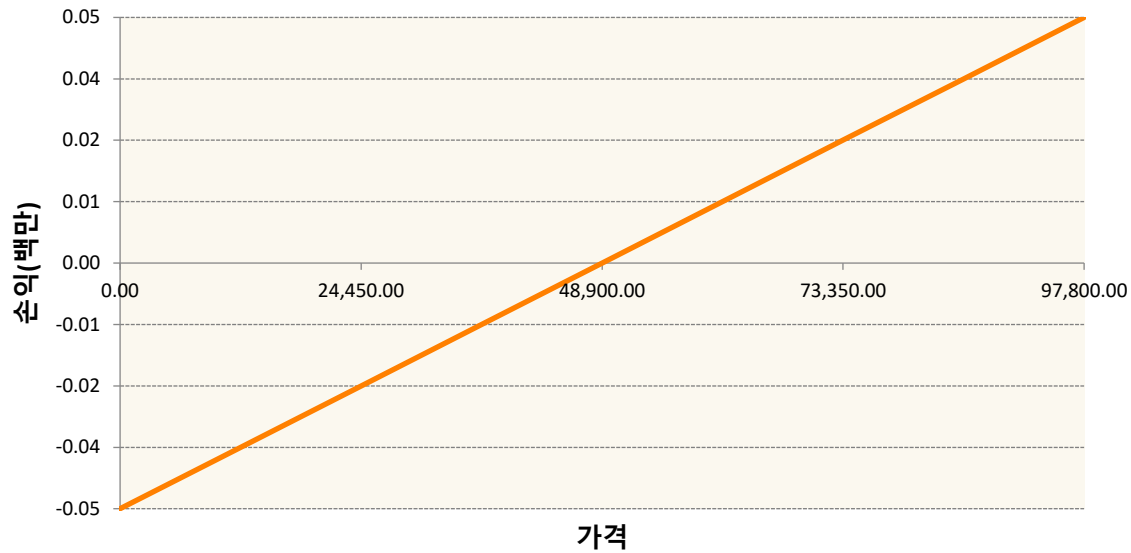
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물
KR41G0W70 2025-07 씨에스원드개별선물

47
1
4
12
1
0.27

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

(단위:백만원)

111

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

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 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

484

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

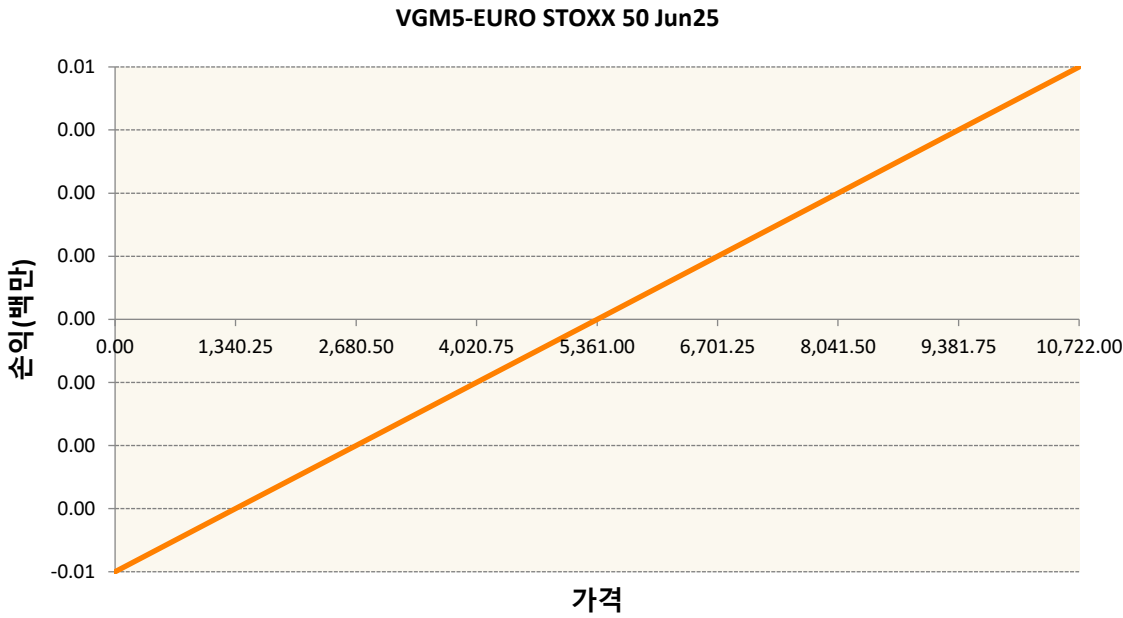
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,024	0	1,024	

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	2025-06-16
기준일	2025-06-13

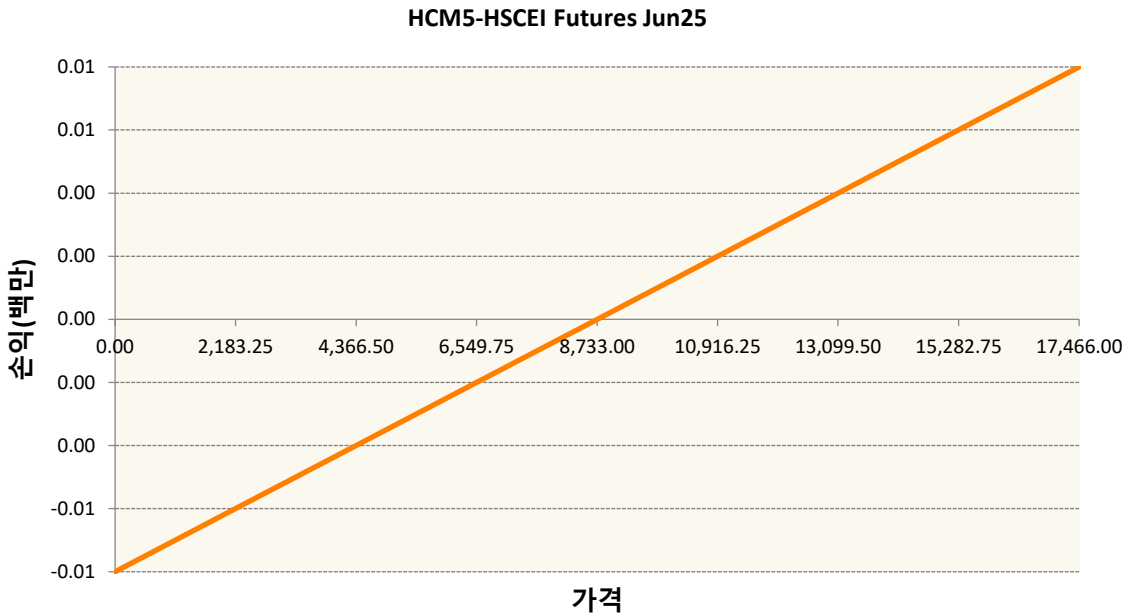
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,453	0	2,453	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM5	HSCEI Futures Jun25	196
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

287

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

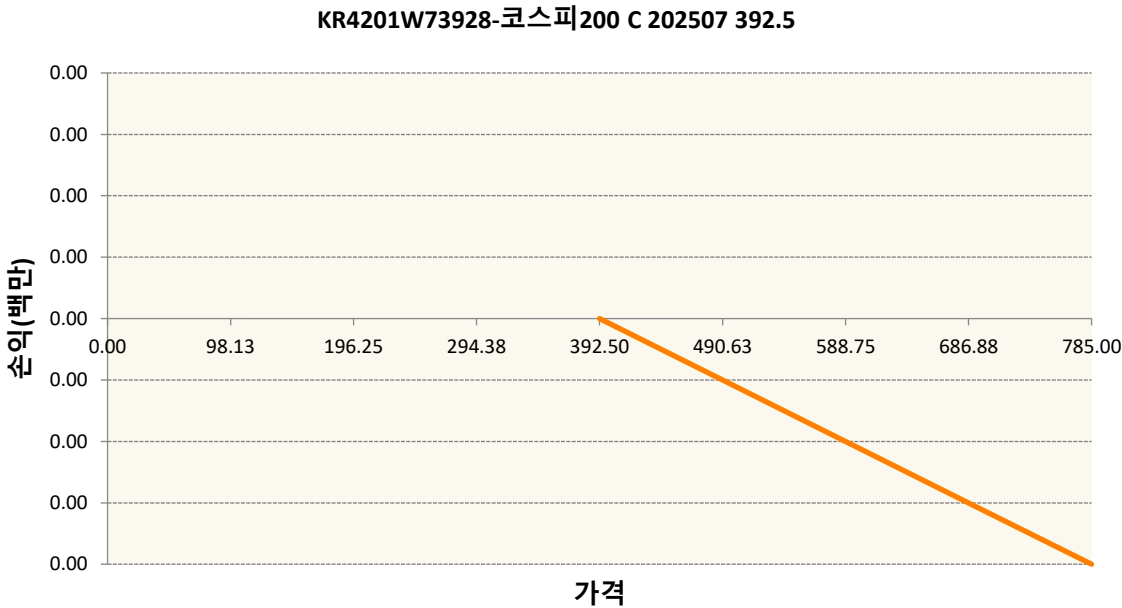
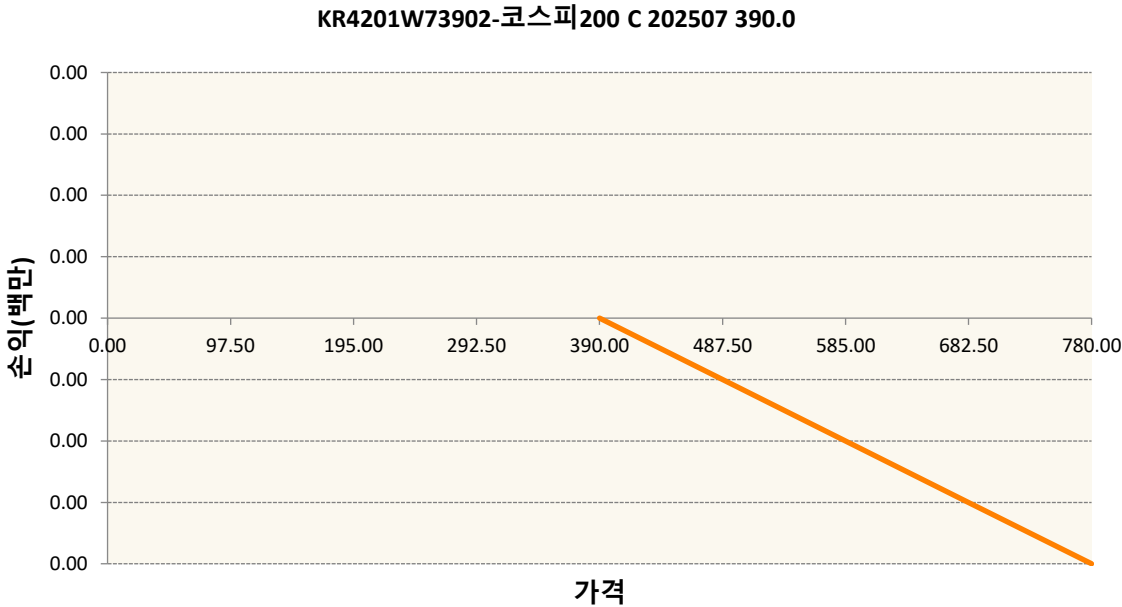
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	36,831	-36,831	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,035	-36,035	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price (가격) and profit (이익) in millions of won. The x-axis represents price, ranging from 0.00 to 780.00. The y-axis represents profit, ranging from 0.00 to 0.00. A single orange line is plotted, starting at (0, 0) and ending at (390, 0). This indicates that the profit is zero for all prices in this range.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	0.00
390.00	0.00

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
98.13	0.00
196.25	0.00
294.38	0.00
392.50	0.00
490.63	0.00
588.75	0.00
686.88	0.00
785.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201W73902				코스피200 C 202507 390.0				1,324
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	443	436	427	416	402	385	366	
-5.33%	415	397	376	353	327	300	271	
-2.67%	326	293	259	223	186	148	110	
0%	129	86	43	0	-43	-87	-130	
2.67%	-204	-244	-286	-327	-369	-411	-454	
5.33%	-659	-687	-718	-750	-784	-820	-856	
8.00%	-1,193	-1,208	-1,226	-1,247	-1,270	-1,296	-1,324	
KR4201W73928				코스피200 C 202507 392.5				421
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	128	126	124	121	117	112	106
-5.33%	121	116	110	103	96	87	78
-2.67%	98	88	77	66	55	43	30
0%	42	28	14	0	-14	-28	-43
2.67%	-58	-72	-86	-100	-115	-129	-143
5.33%	-200	-210	-222	-233	-245	-258	-271
8.00%	-372	-378	-385	-393	-402	-411	-421
KR4301W73900 코스피200 P 202507 390.0							294

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-278	-280	-282	-284	-287	-291	-294
-5.33%	-161	-164	-169	-174	-179	-185	-191
-2.67%	-55	-62	-70	-77	-85	-93	-101
0%	27	18	9	0	-9	-18	-27
2.67%	81	72	64	55	46	38	29
5.33%	109	103	97	90	83	76	68
8.00%	121	118	114	110	105	100	94

KR4301W73926 코스피200 P 202507 392.5							101
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-98	-98	-99	-100	-101
-5.33%	-57	-58	-59	-61	-62	-64	-66
-2.67%	-21	-23	-25	-27	-30	-32	-35
0%	9	6	3	0	-3	-6	-9
2.67%	29	26	23	20	17	14	11
5.33%	40	38	36	33	31	28	25
8.00%	45	44	43	41	39	37	35

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

(단위:백만원)

2,096

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

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	508	0	508	

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	2025-06-16
기준일	2025-06-13

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	4,285	0	4,285	

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	2025-06-16
기준일	2025-06-13

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	12,520	0	12,520	
누계	통화	선도	0	11,916	-11,916	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213F3TC KRW/USD 30-06-25E		217
FXW213F4V(KRW/USD 31-07-25E		408
FXW213F5V(KRW/USD 29-08-25E		320
FXW213F6D(KRW/USD 30-06-25E		9
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	465

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

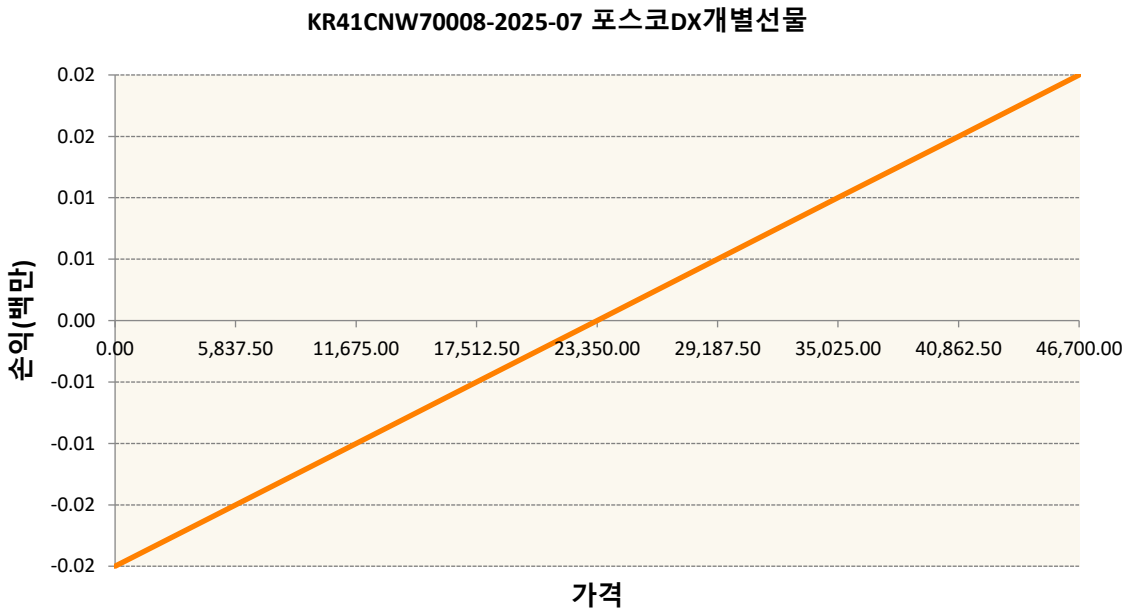
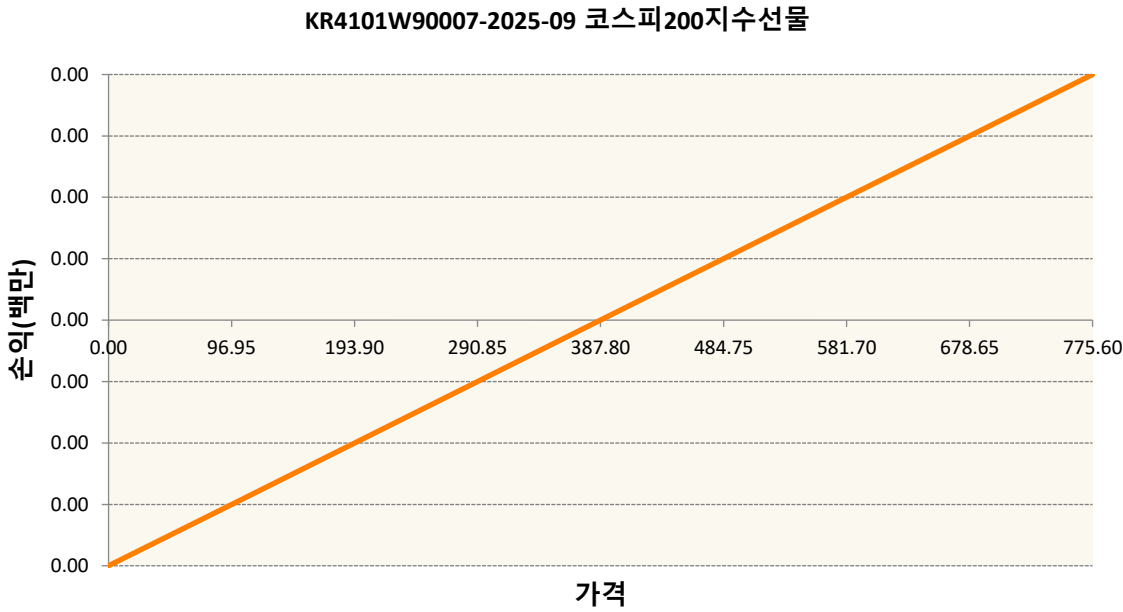
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

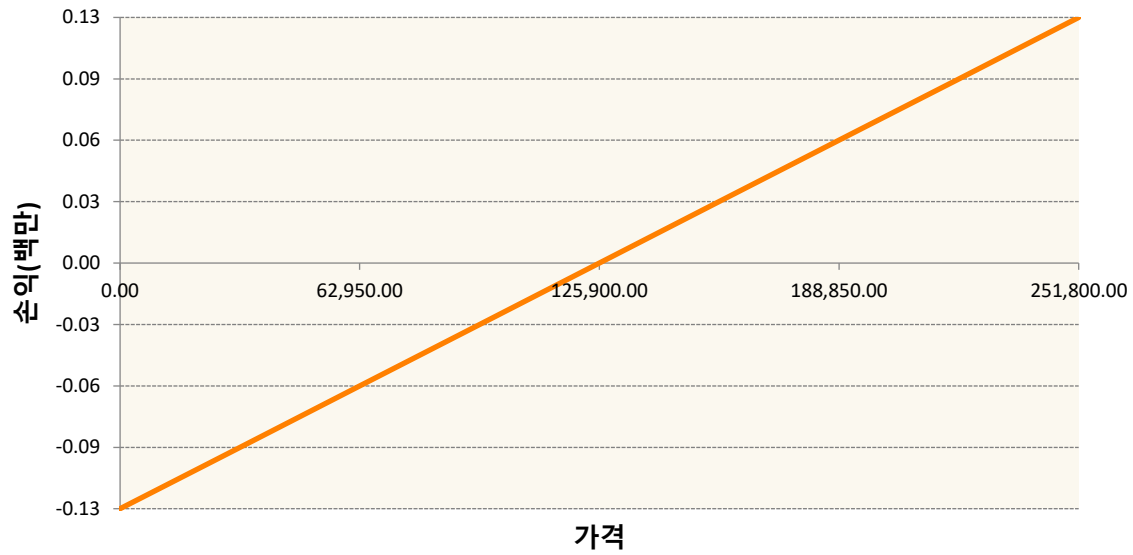
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	98	-98	장내
누계	유가증권	선물	709	0	709	장내

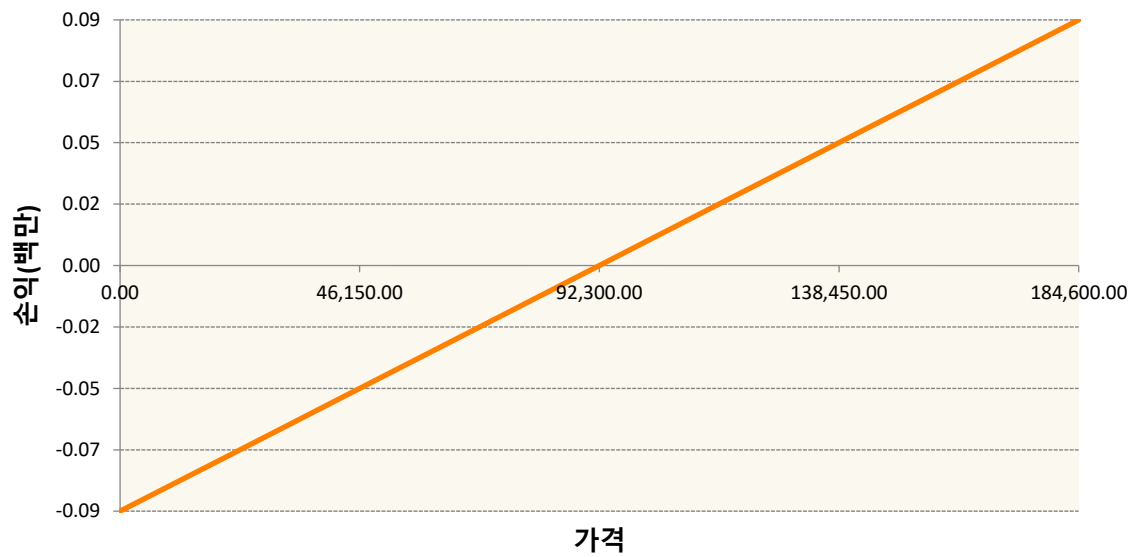
2. 만기시점의 손익구조



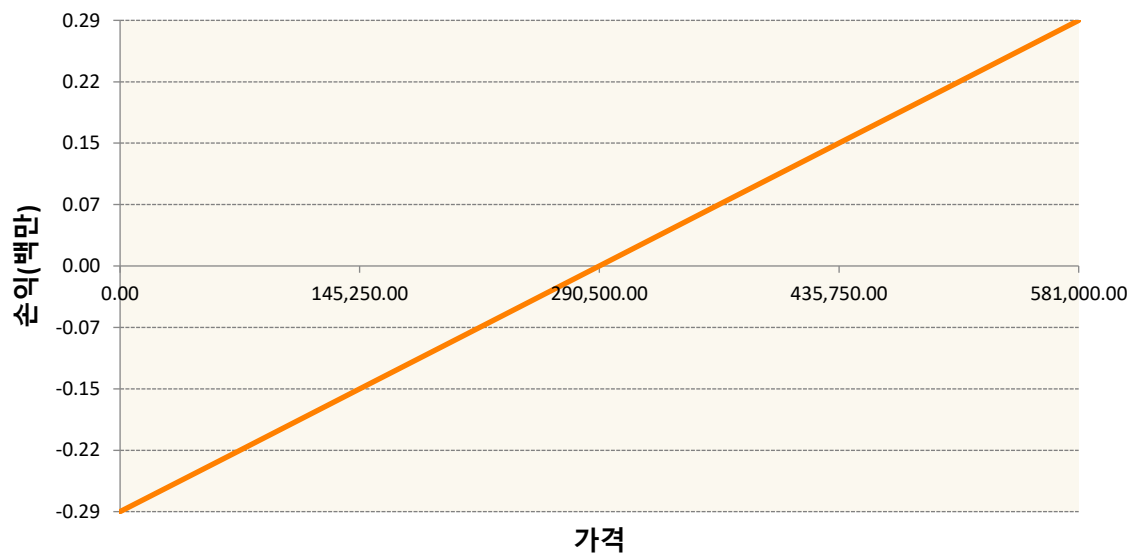
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



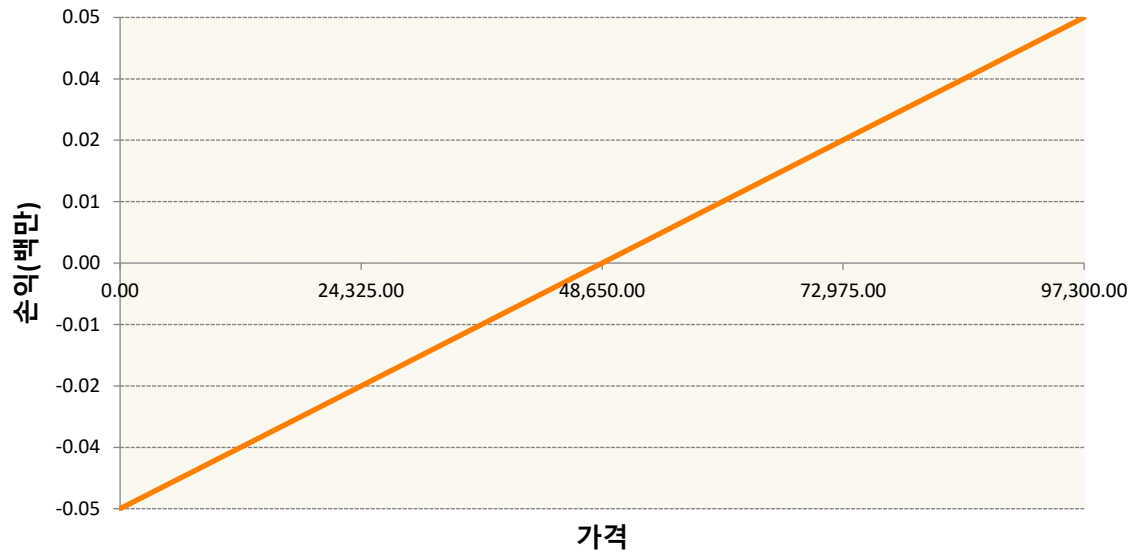
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물
KR41EYW70(2025-07 에코프로비엠개별선물
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물

47
1
2
2
5
1

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

(단위:백만원)

90

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

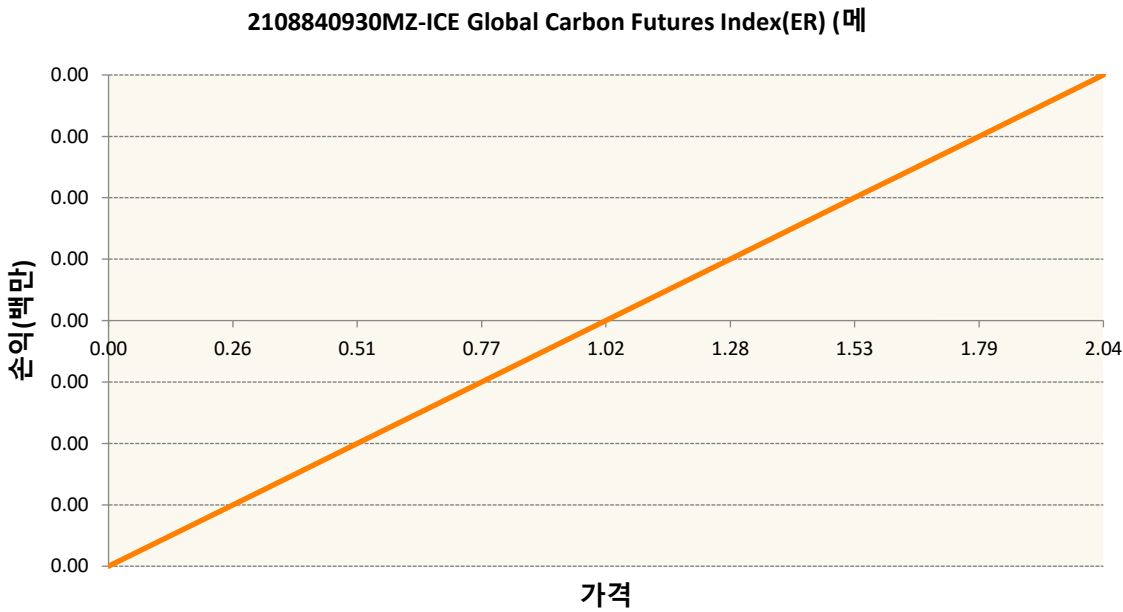
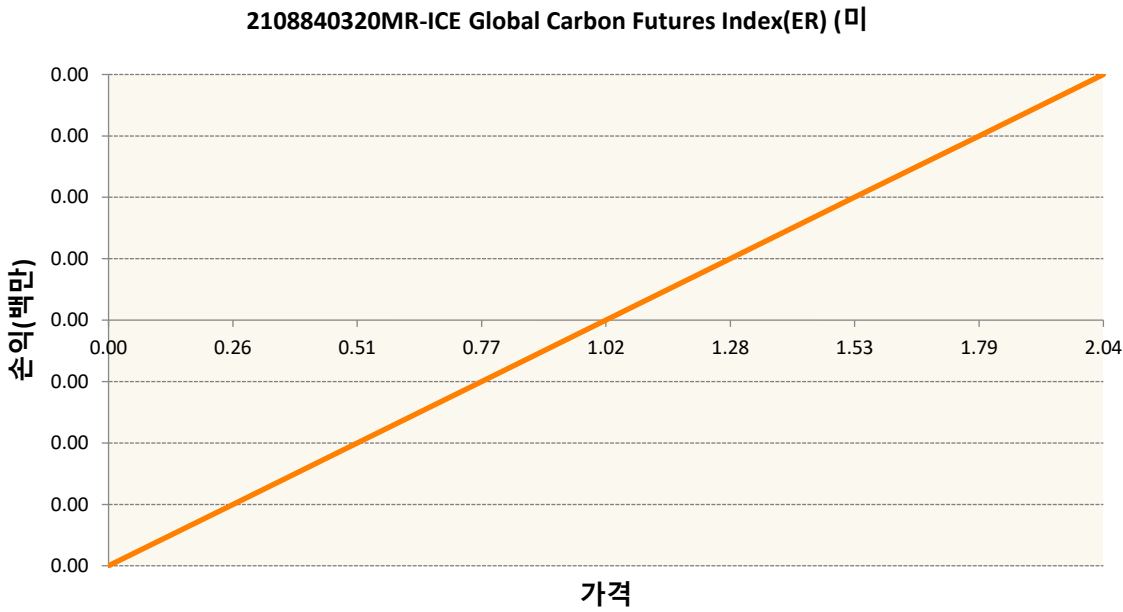
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	10,035	0	10,035	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	601
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	201

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	920

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

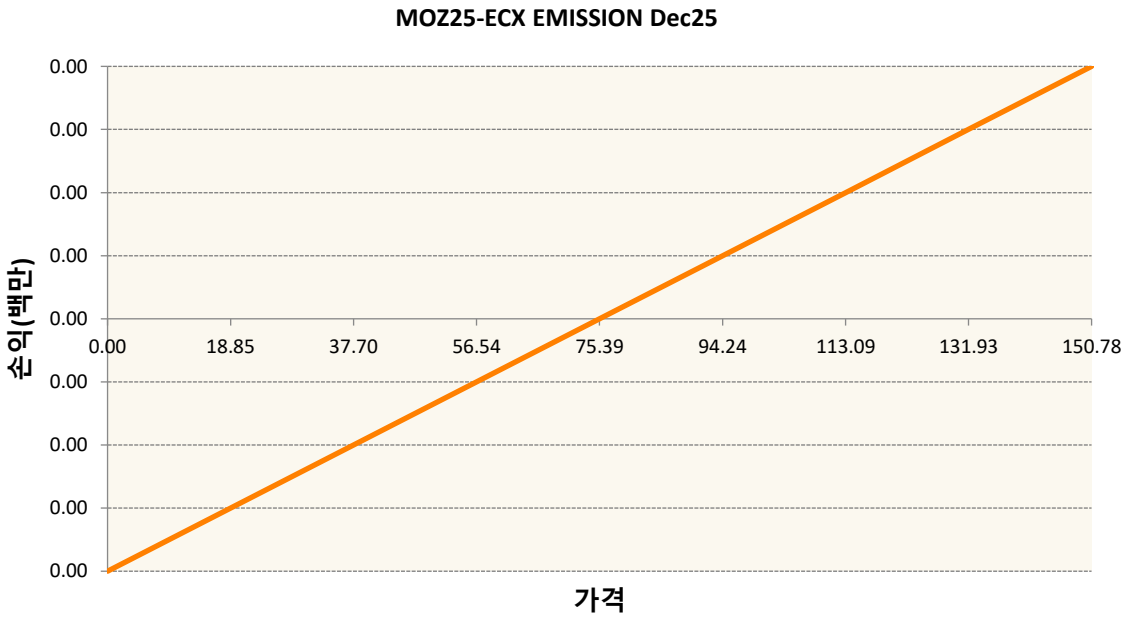
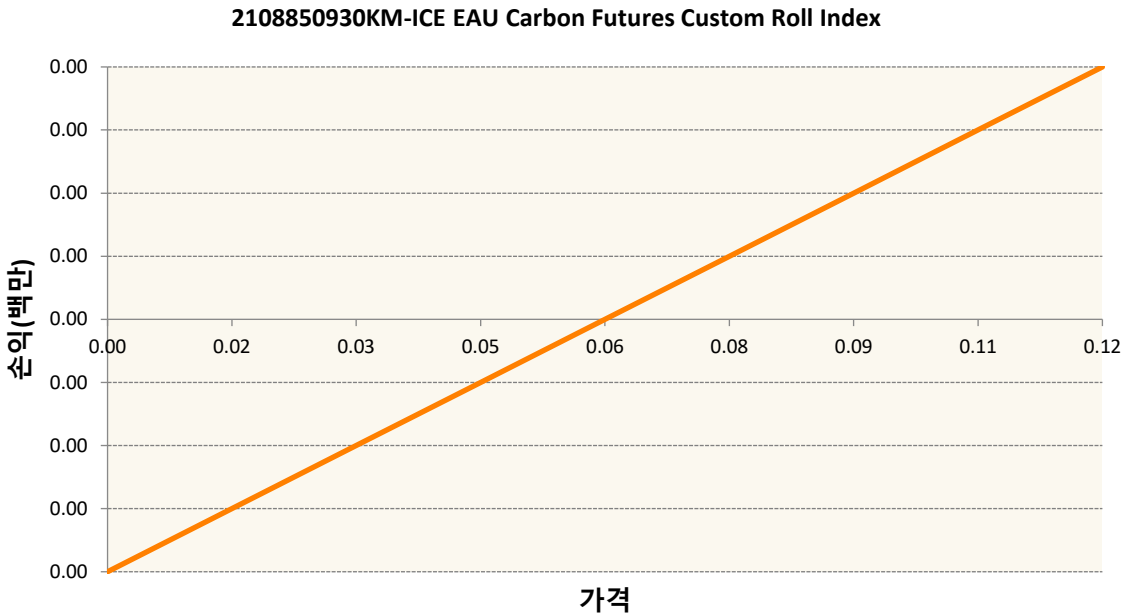
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,882	0	6,882	
누계	통화	선도	0	1,398	-1,398	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index		2
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E		33
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E		78
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		549

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,009

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

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	2025-06-16
기준일	2025-06-13

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)

192

공시일 2025-06-16

기준일 2025-06-13

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	2025-06-16
기준일	2025-06-13

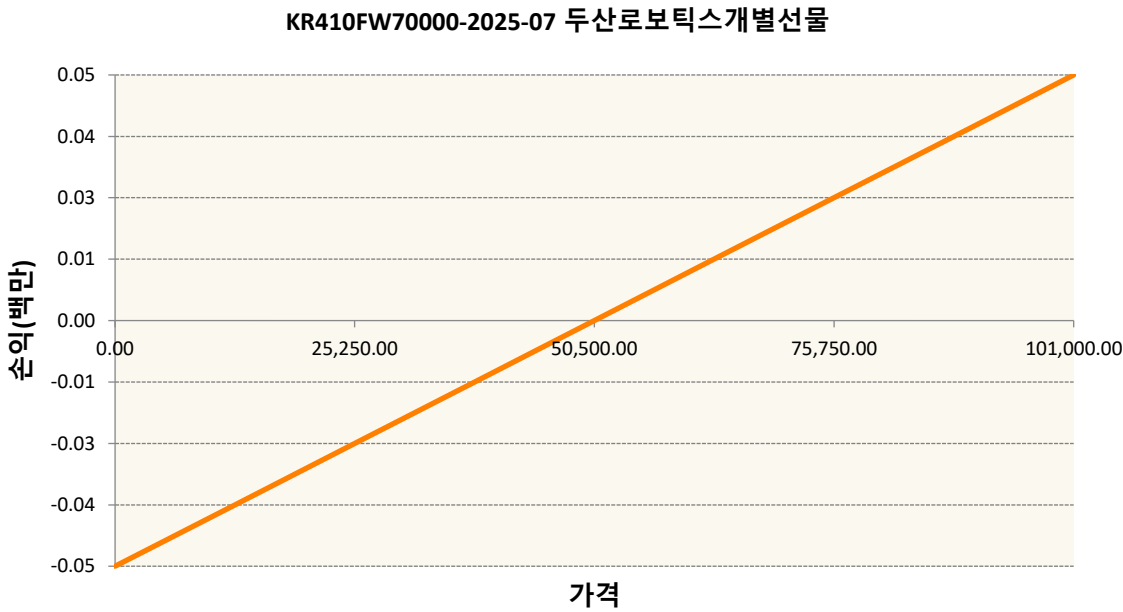
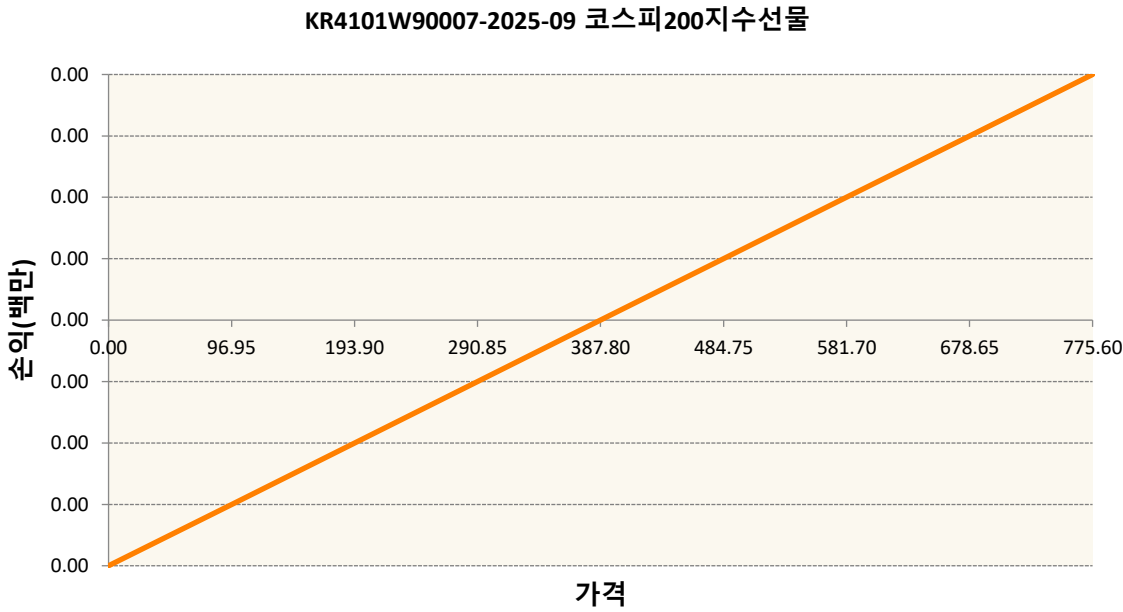
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

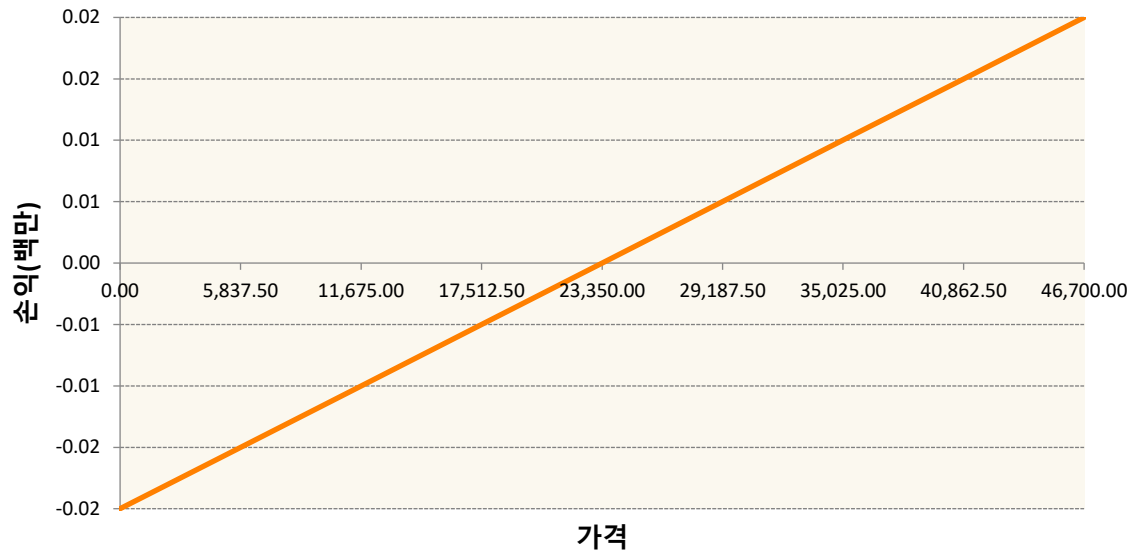
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	56	0	56	장내
누계	유가증권	선물	8,961	0	8,961	장내

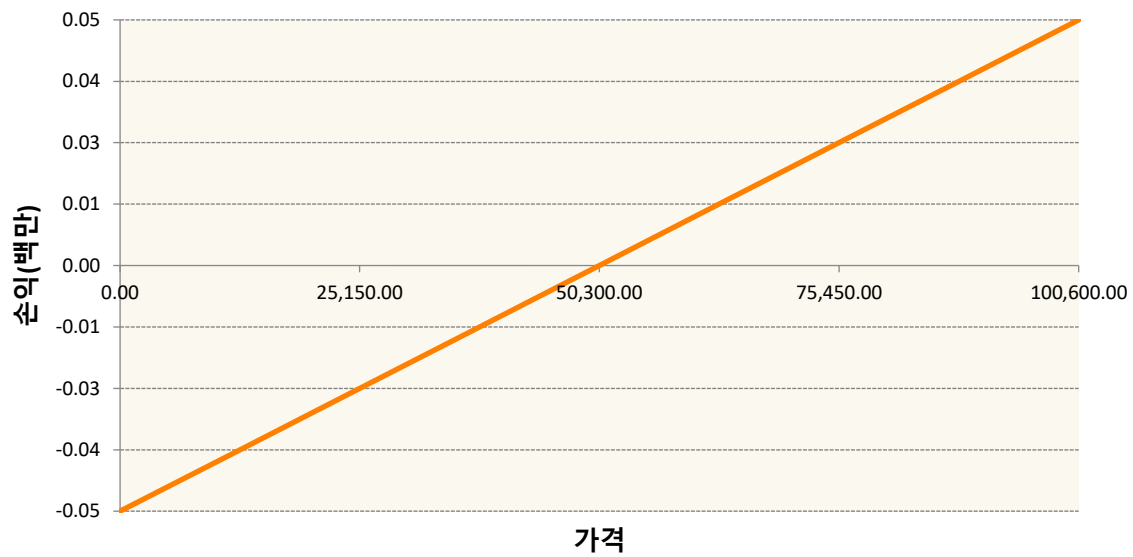
2. 만기시점의 손익구조



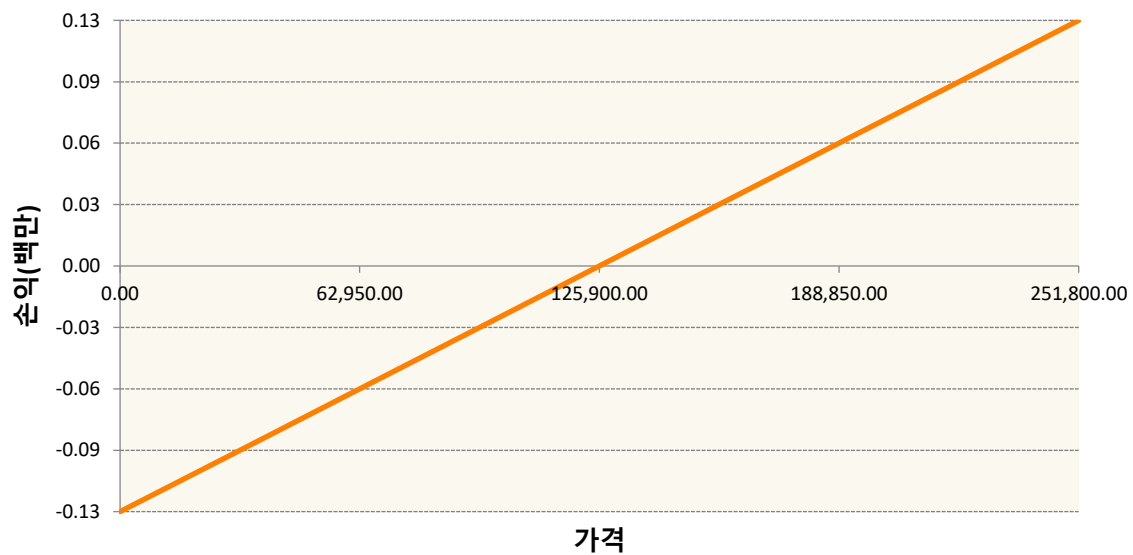
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



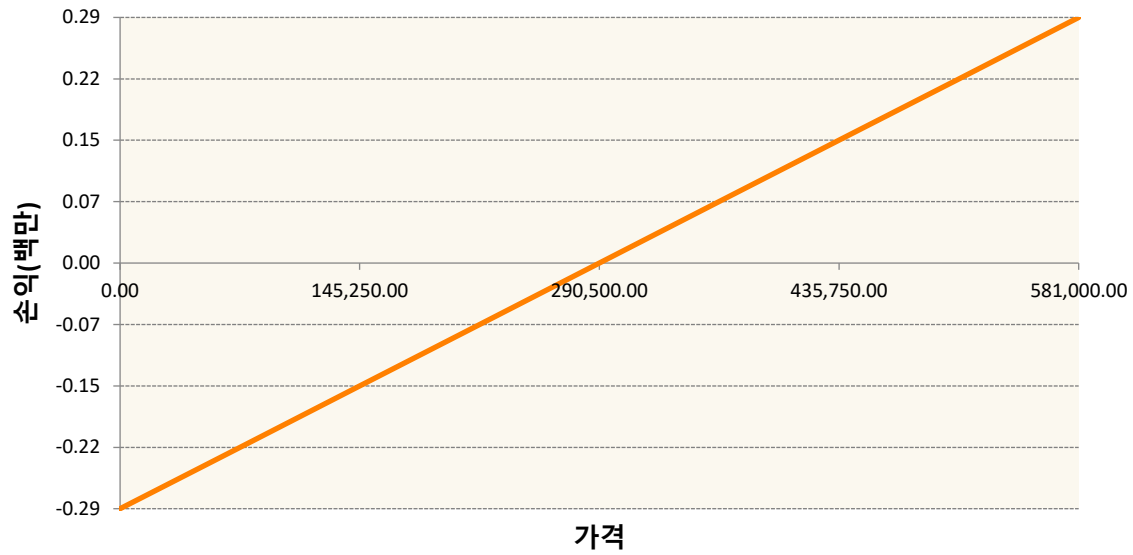
KR41D7W70002-2025-07 한전KPS개별선물



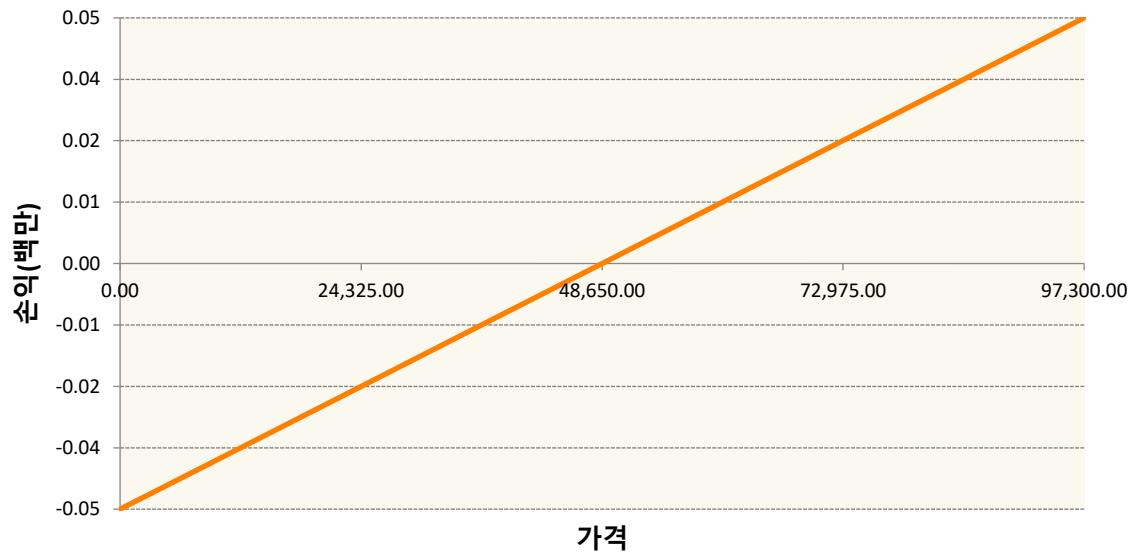
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



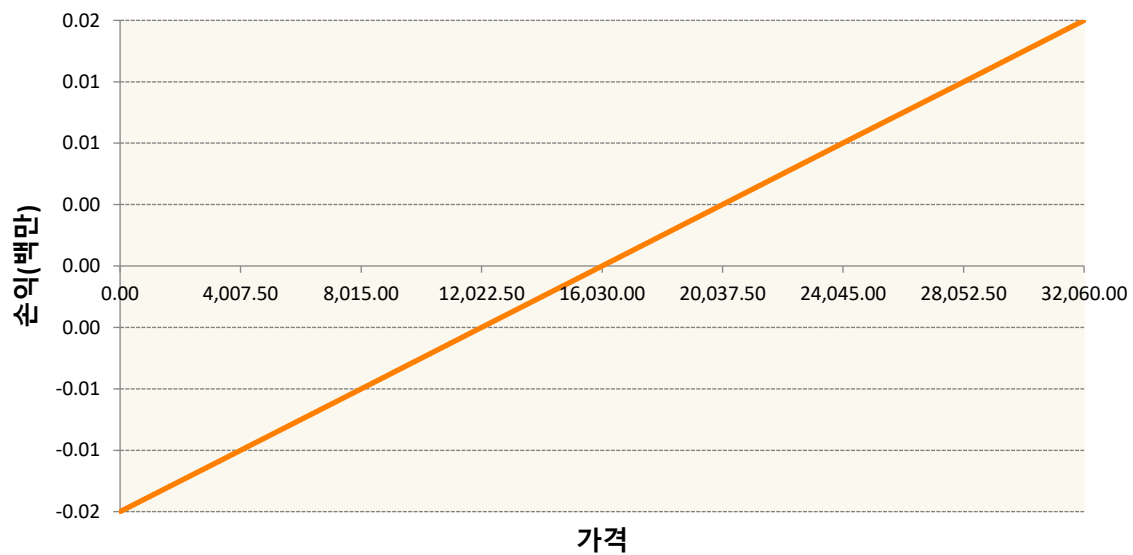
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



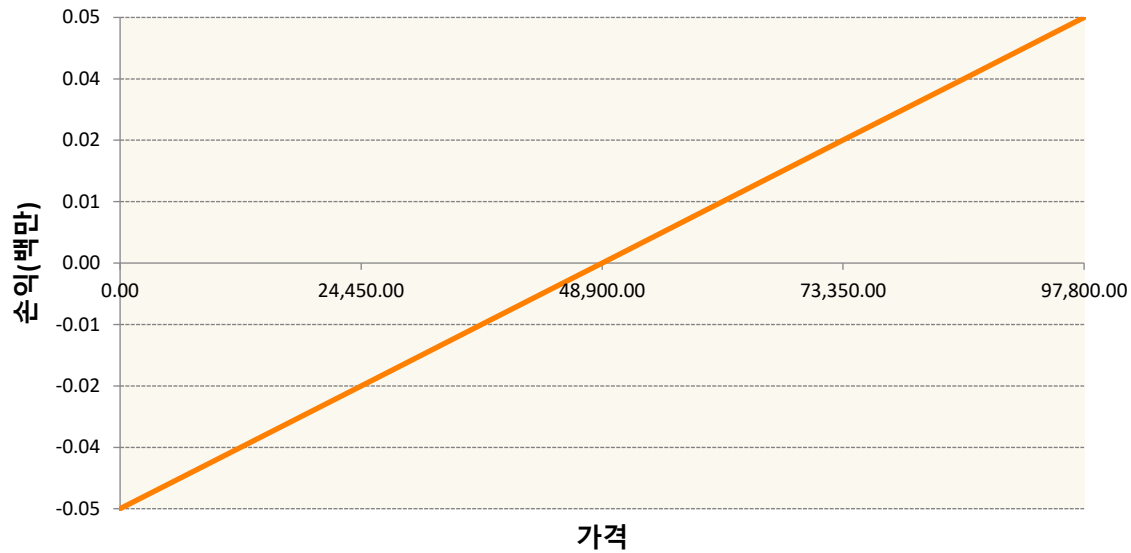
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



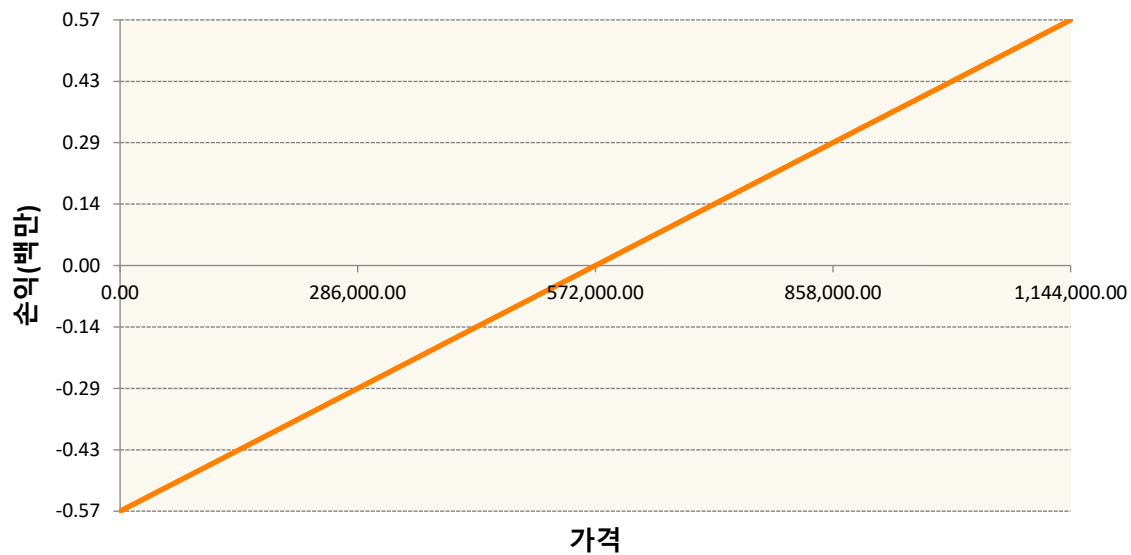
KR41FWW70002-2025-07 대한전선개별선물



KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41GTW70006-2025-07 두산개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	543
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물	3
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	12
KR41D7W70 2025-07 한전KPS개별선물	0.04
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물	35
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	106
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	13
KR41FWW70 2025-07 대한전선개별선물	0.05
KR41G0W70(2025-07 씨에스원드개별선물	4
KR41GTW70(2025-07 두산개별선물	1

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

(단위:백만원)

1,165

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

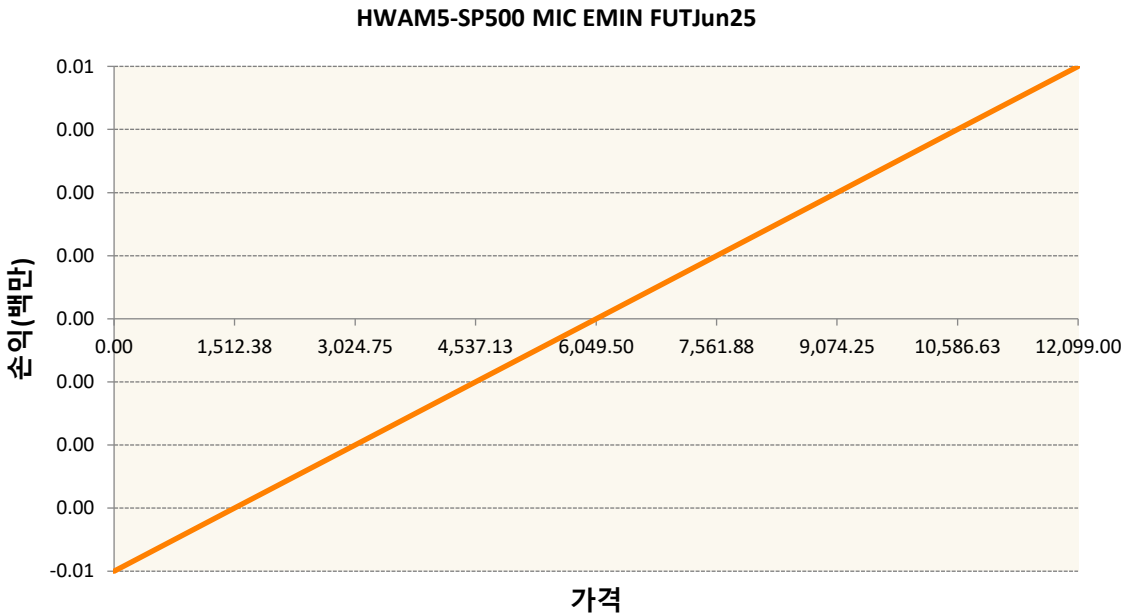
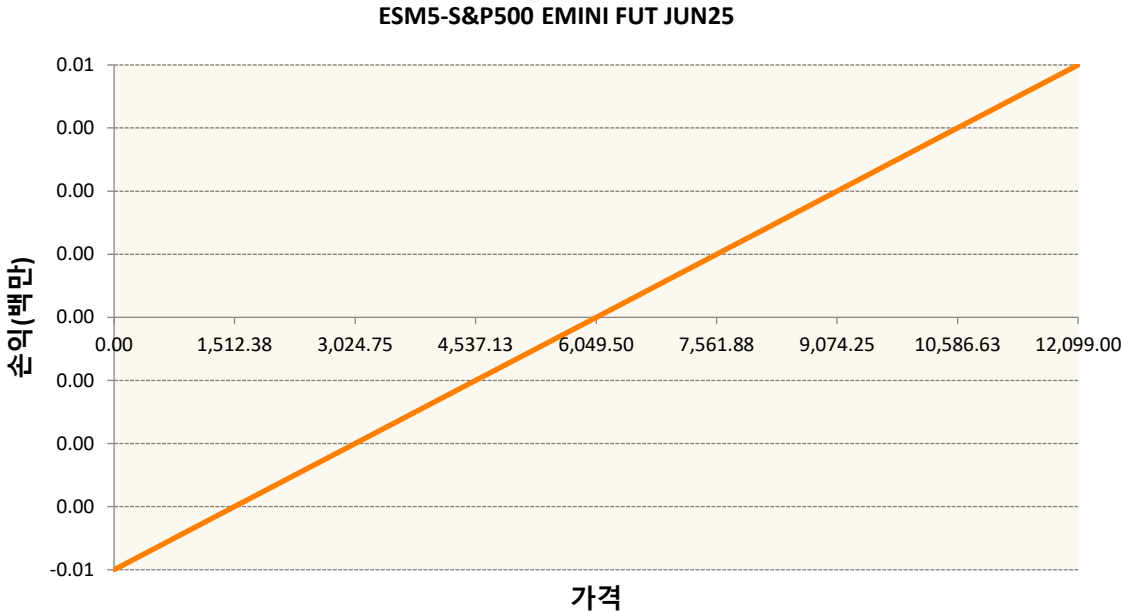
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,582	0	1,582	장내
누계	지수	선물	31,934	0	31,934	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,555
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	127

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,369

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

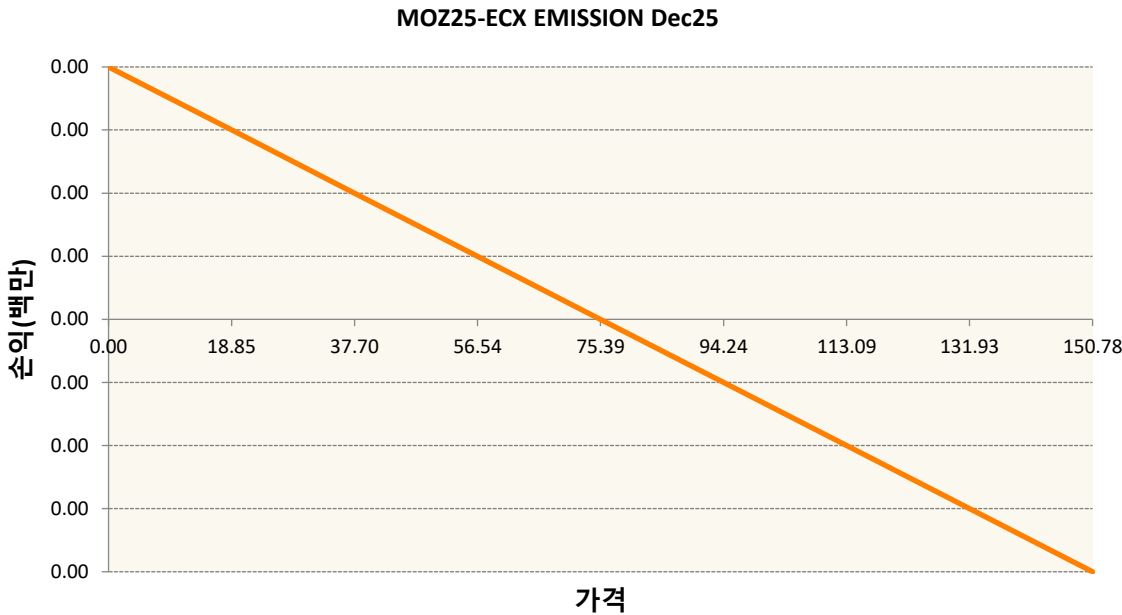
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-23	3,959	-3,982	
누계	통화	선도	0	958	-958	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	77
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	317

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

(단위:백만원)

591

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

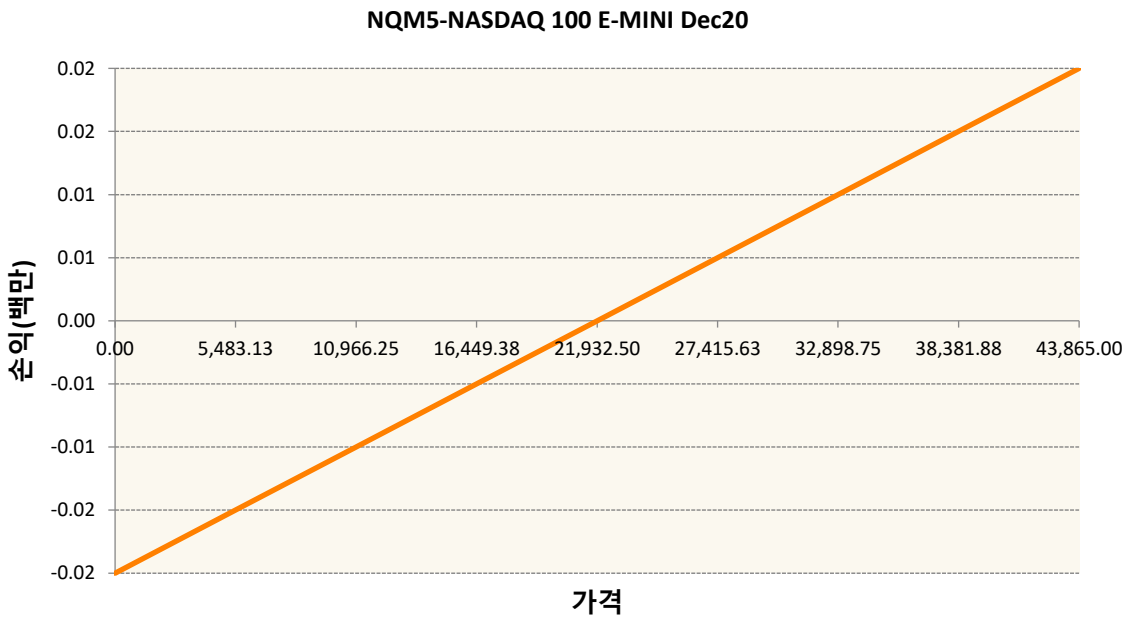
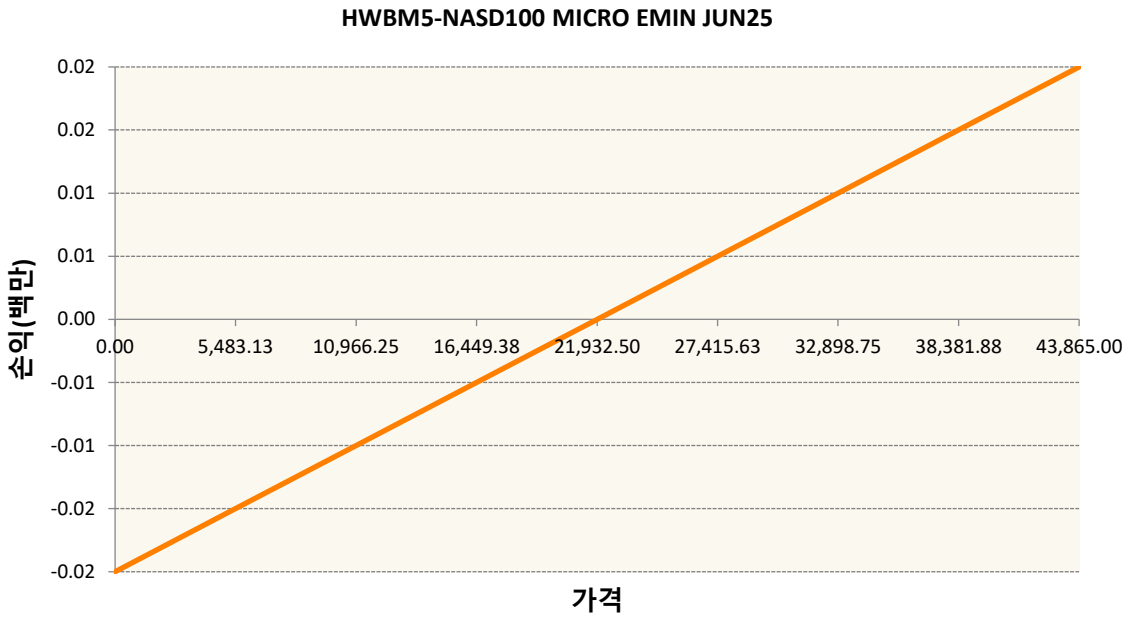
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,577	0	14,577	
누계	유가증권	선물	301	0	301	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		24
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,166

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,359

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

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	217,663	0	217,663	장외
누계	유가증권	스왑	2,055	0	2,055	장외
누계	지수	스왑	257,745	0	257,745	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,001
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,493
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		2,114
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,068
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		160

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	11,060

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

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	16
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	16
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	16
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	16

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

(단위:백만원)

90

공시일	2025-06-16
기준일	2025-06-13

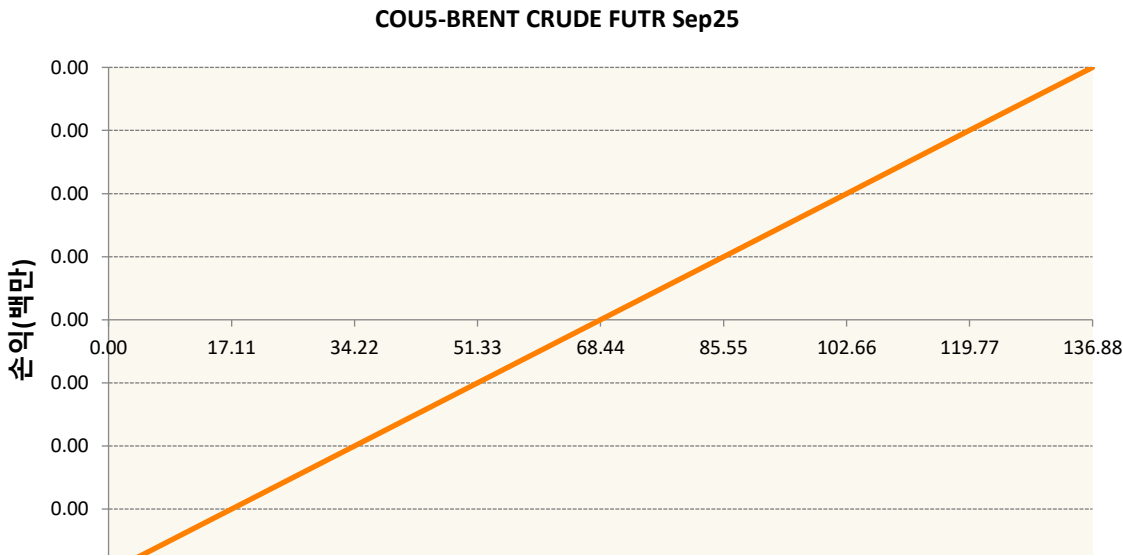
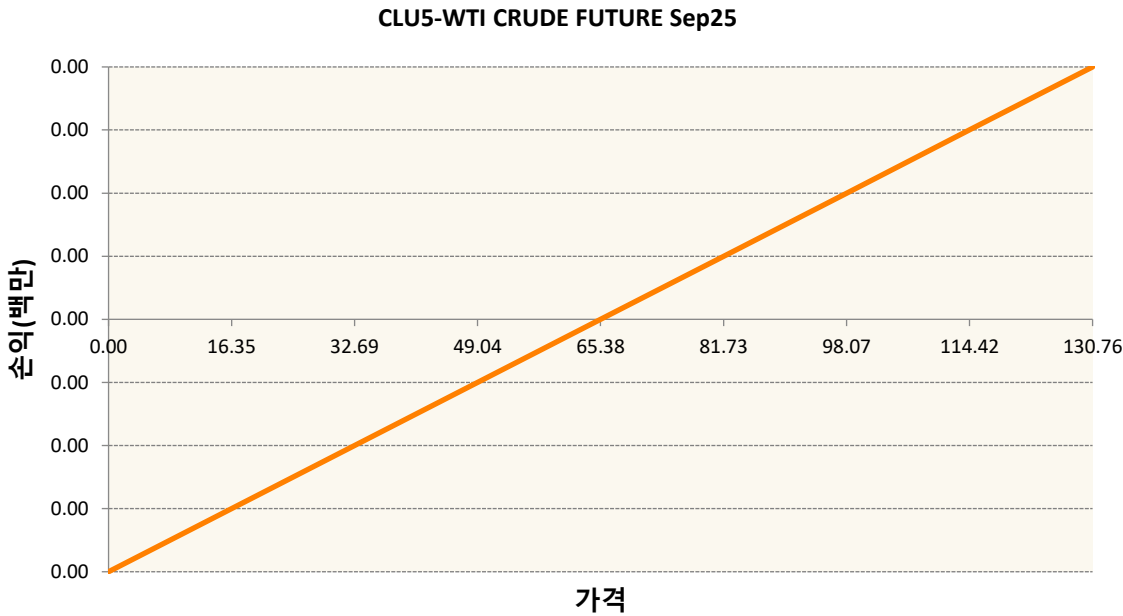
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

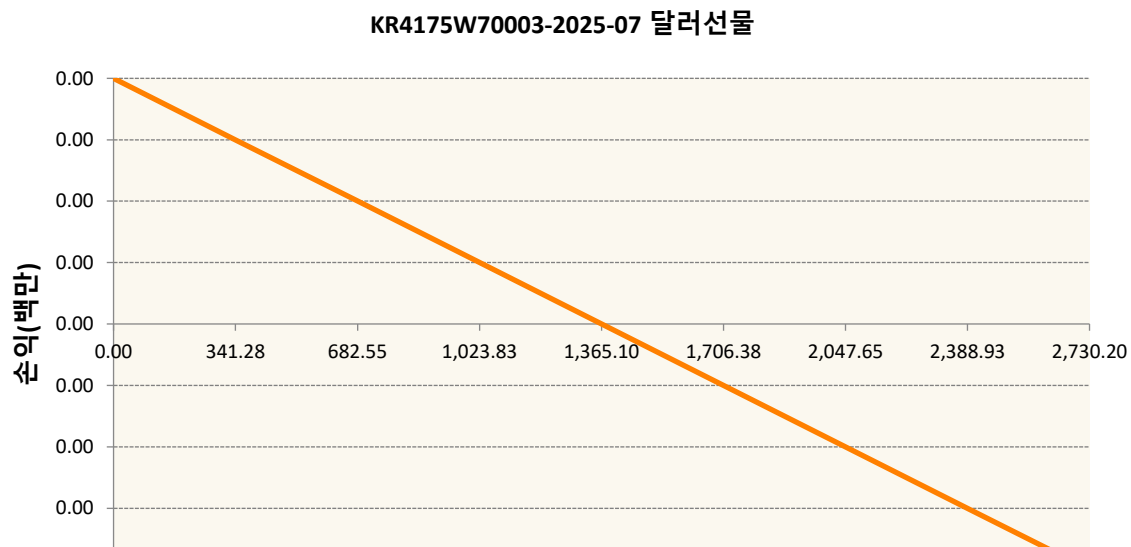
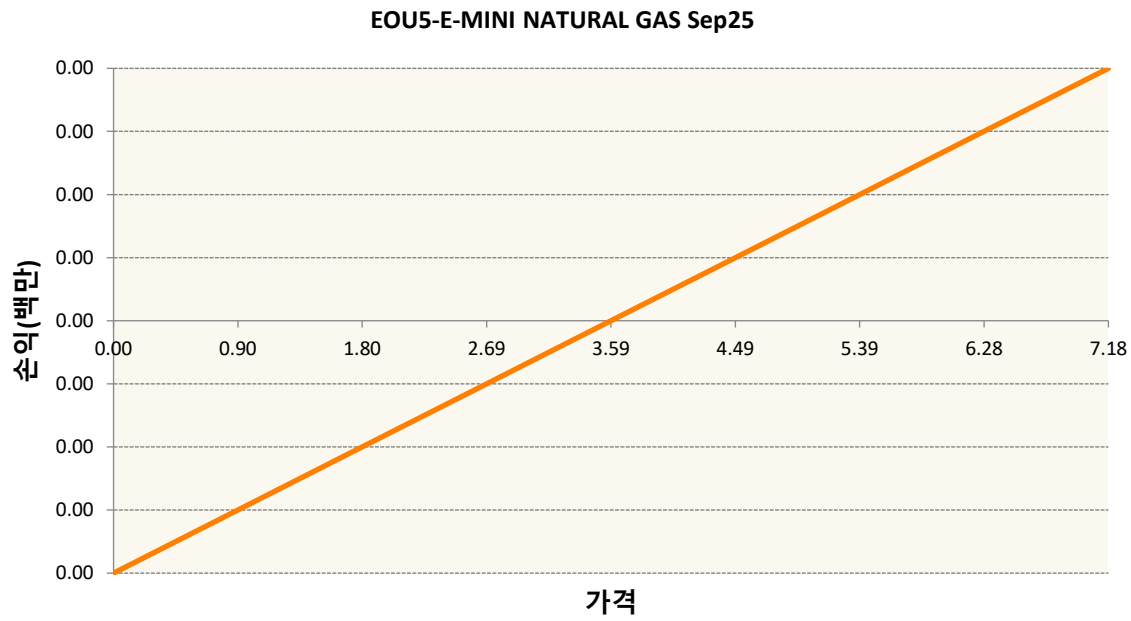
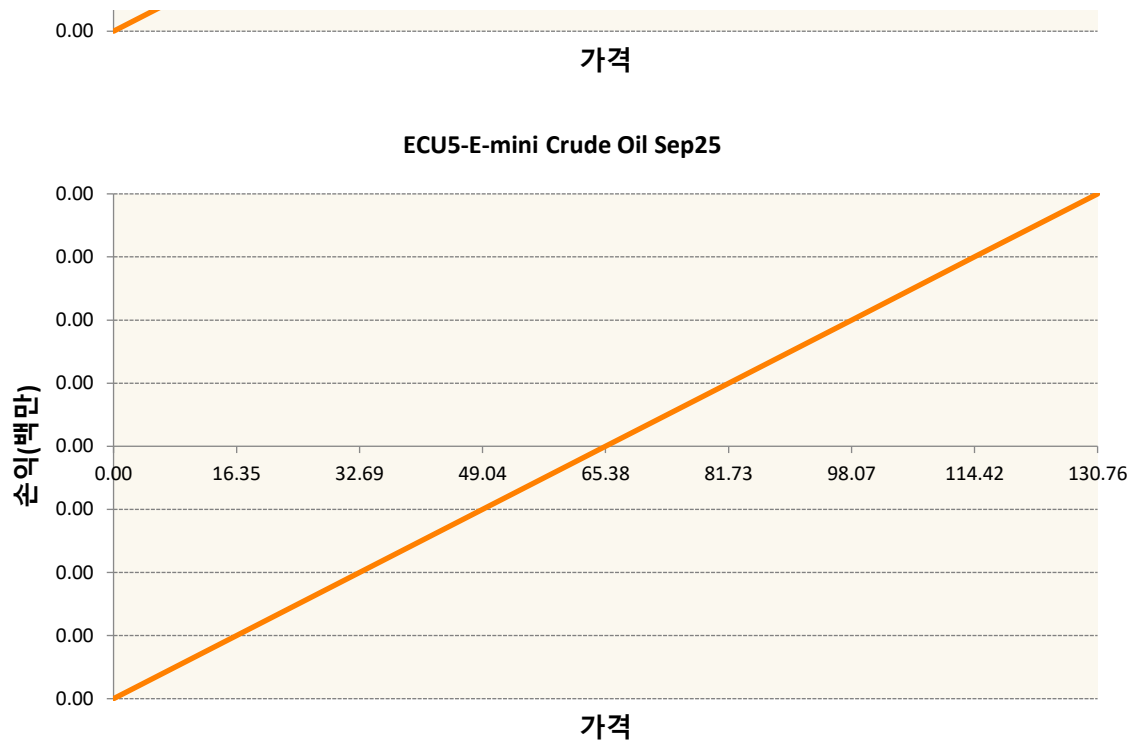
1. 계약금액

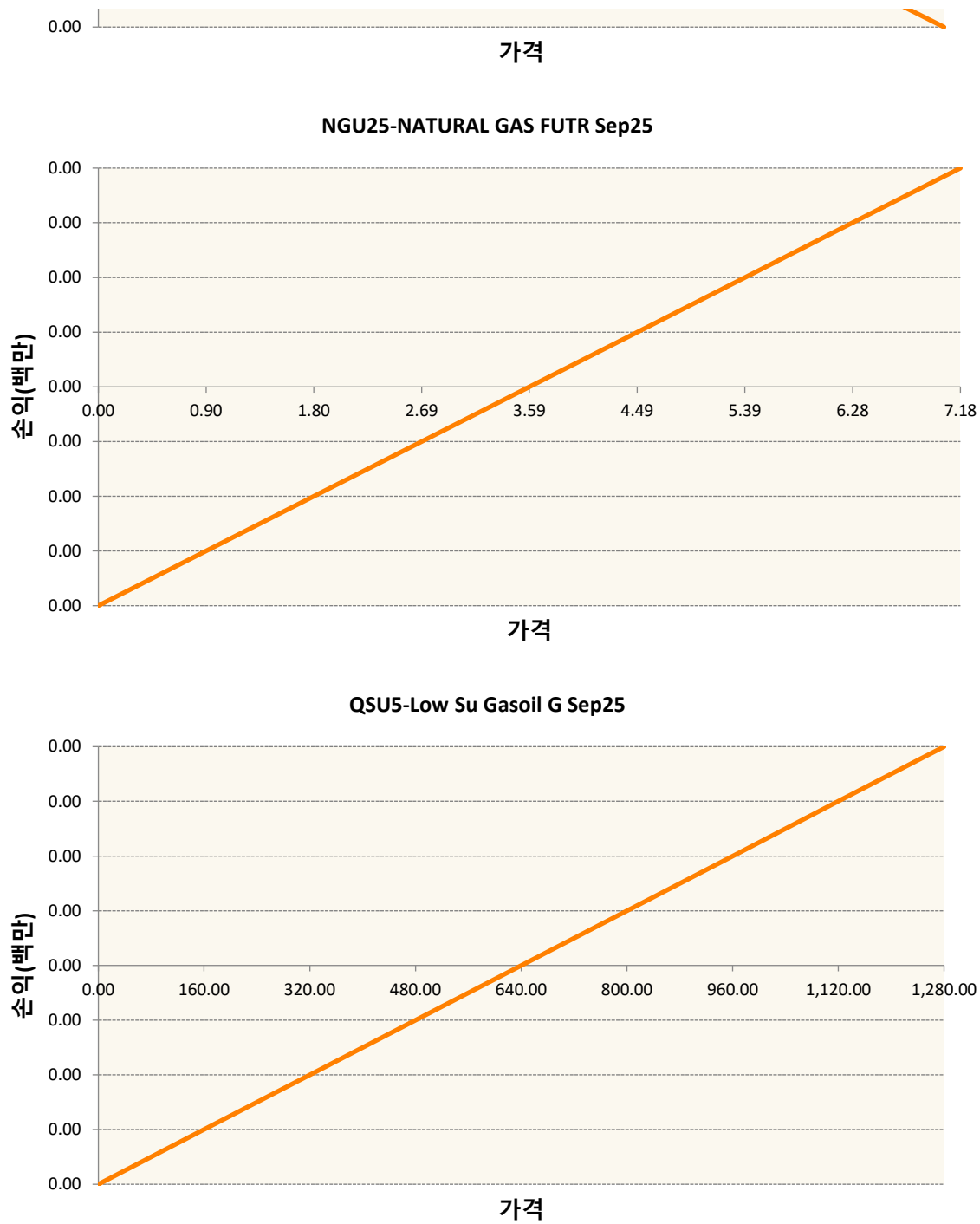
(단위:백만원)

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	379	0	379	
누계	유가증권	선물	283	0	283	
누계	통화	선물	0	96	-96	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU5	WTI CRUDE FUTURE Sep25	7
COU5	BRENT CRUDE FUTR Sep25	15
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

