

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

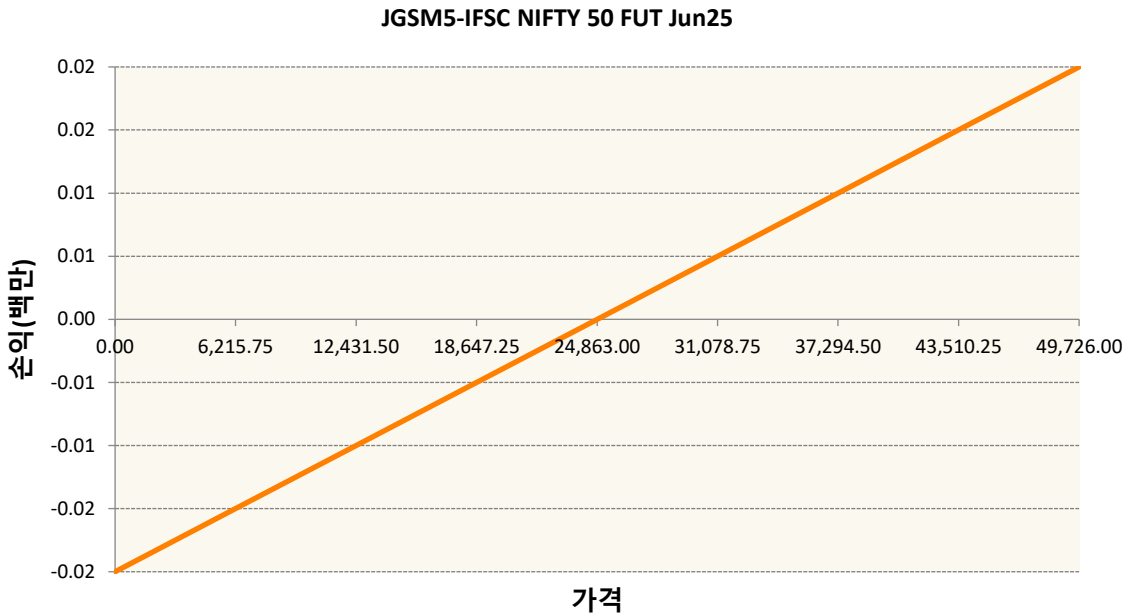
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,294	0	1,294	

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)

76

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

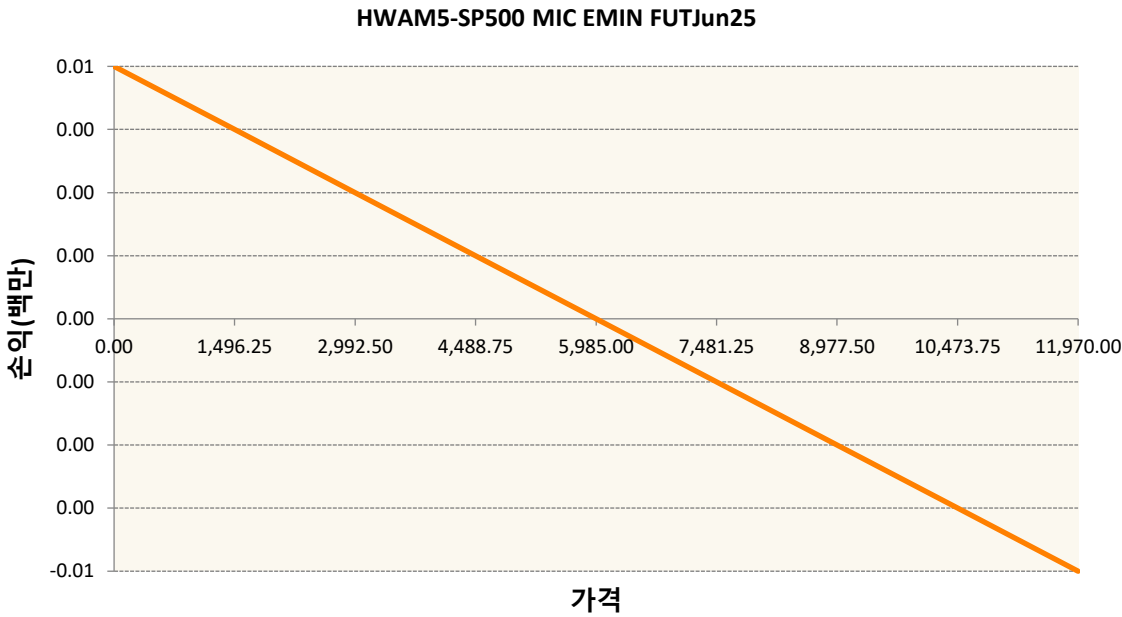
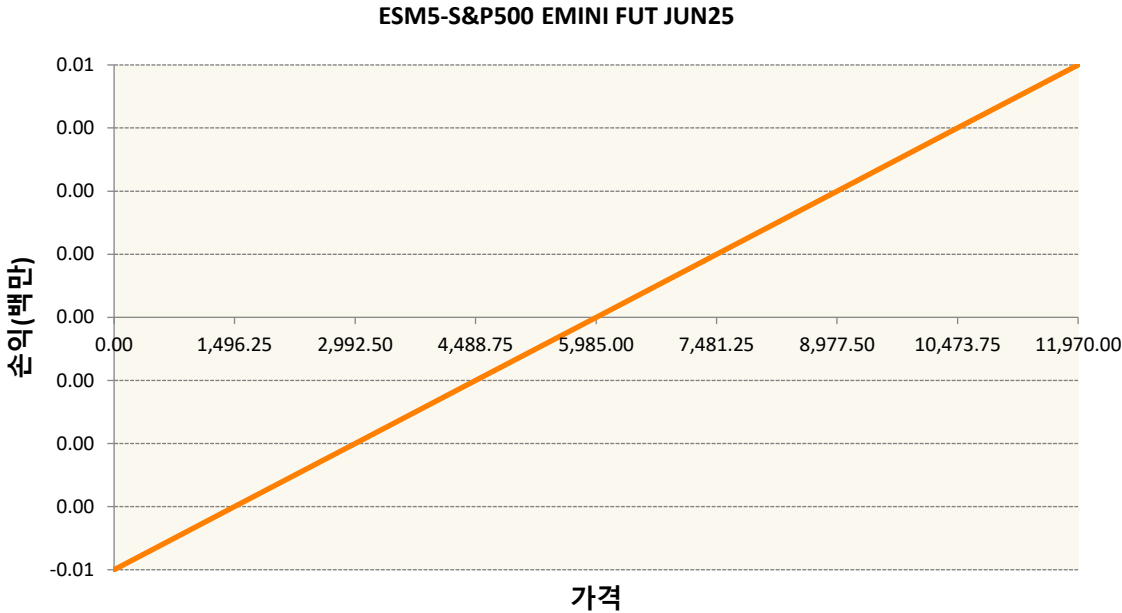
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	437	0	437	

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	2025-06-19
기준일	2025-06-18

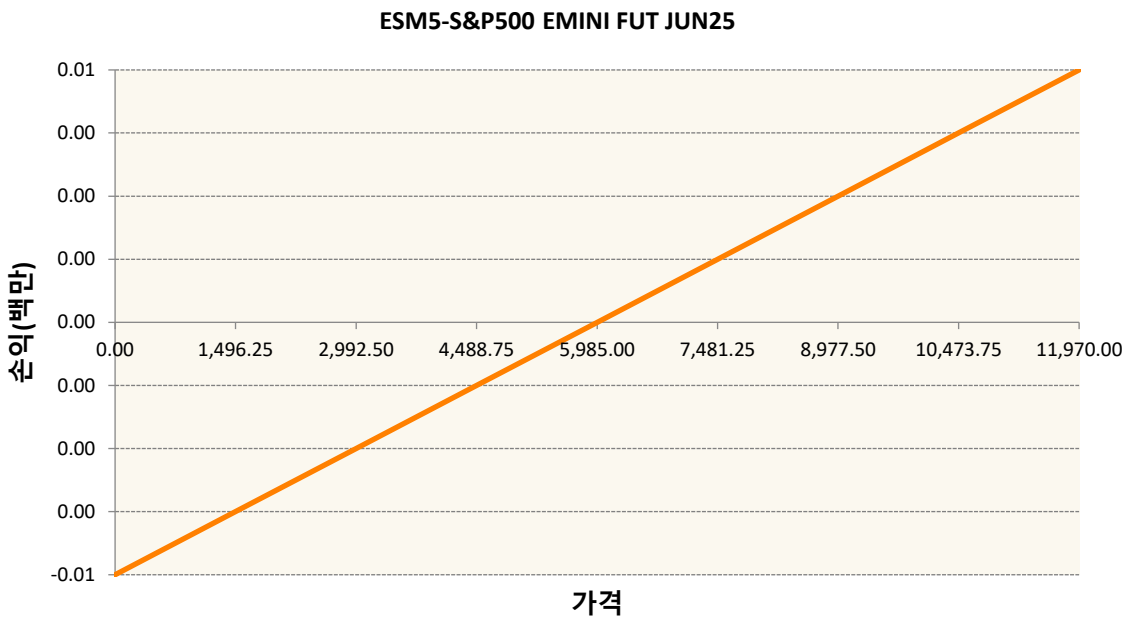
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,310	0	1,310	

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	2025-06-19
기준일	2025-06-18

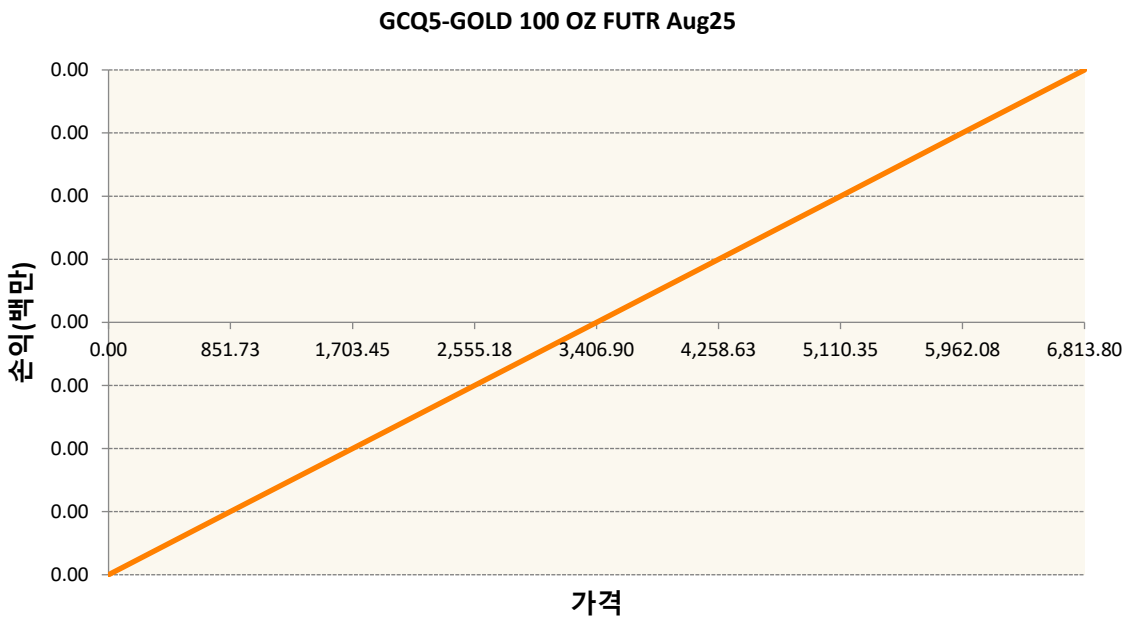
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,343	0	2,343	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 06/20/25 C315 EQUITY	5
GQC5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25	187

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

(단위:백만원)

164

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

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 06/20/25 C137 EQUITY	10
AOPLTRUSP1 PLTR US 06/20/25 P137 EQUITY	2

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

(단위:백만원)

51

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

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)

AOTLTUSC87TLT US 06/20/25 C87.5 EQUITY

0.36

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

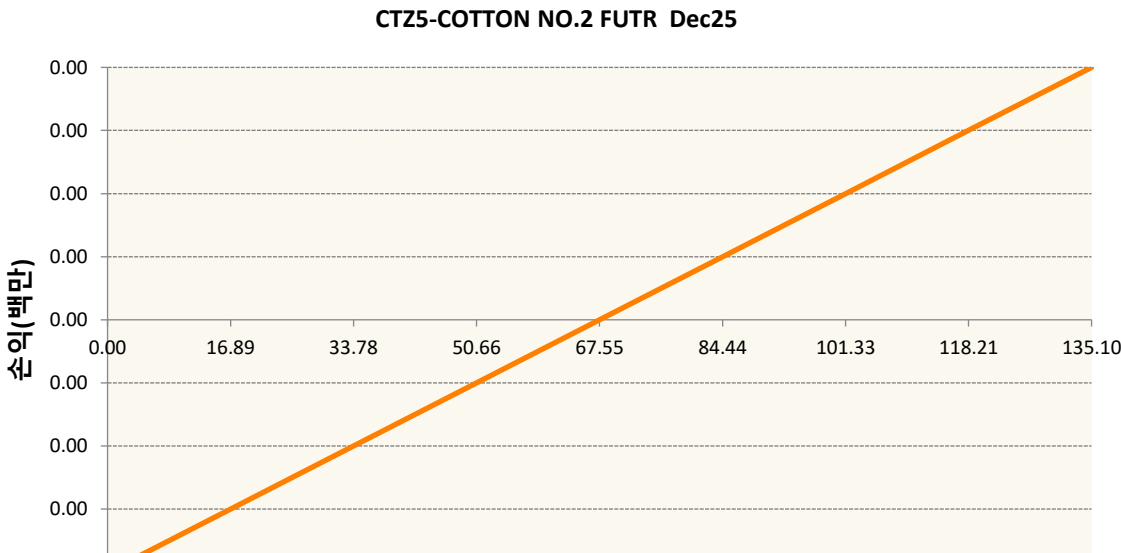
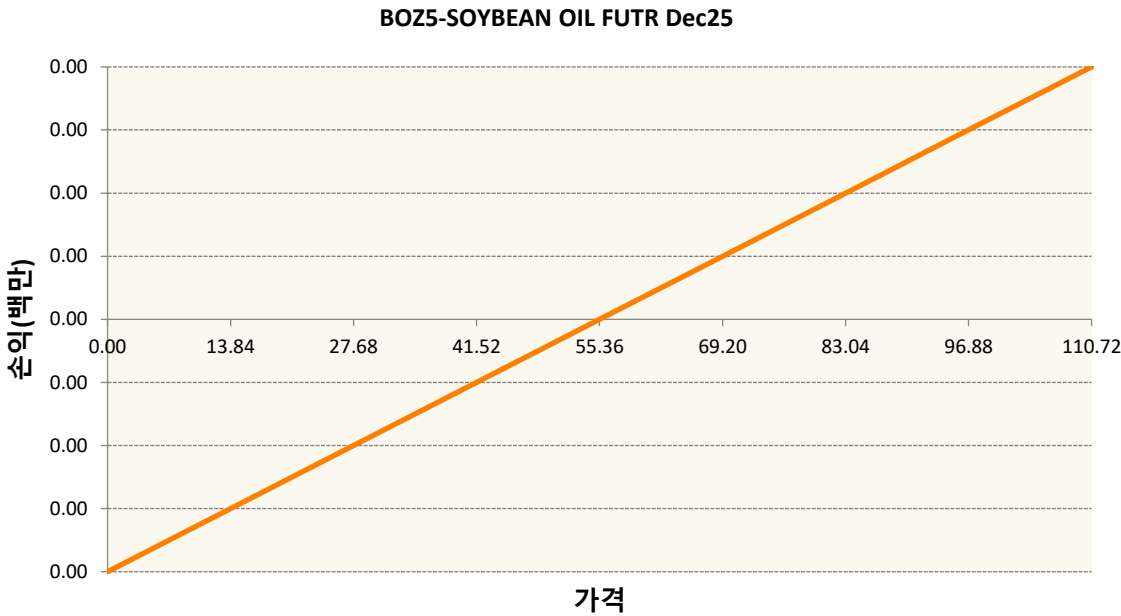
포커스농산물모(채권-파생형)

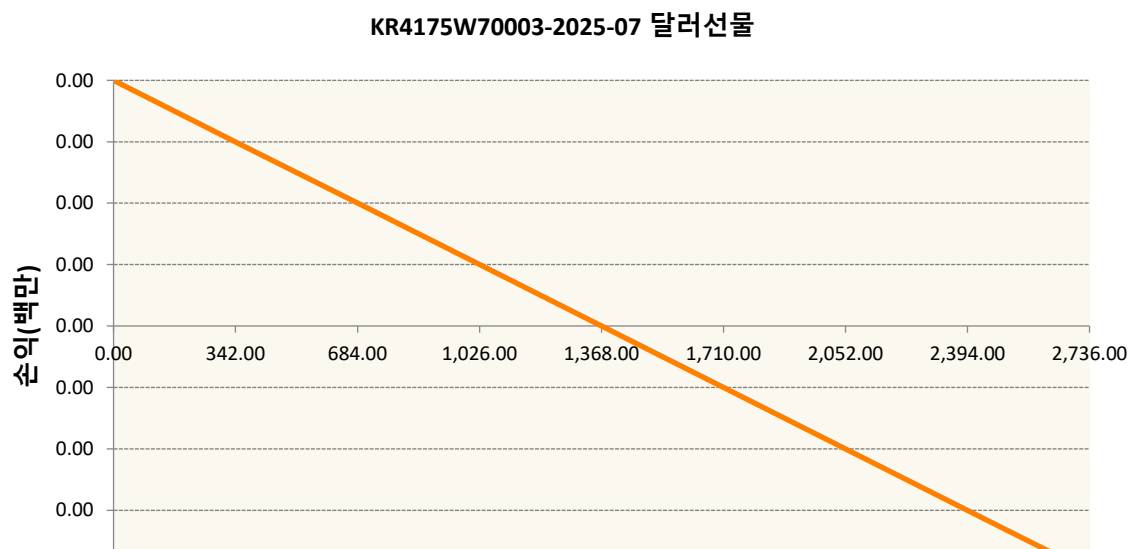
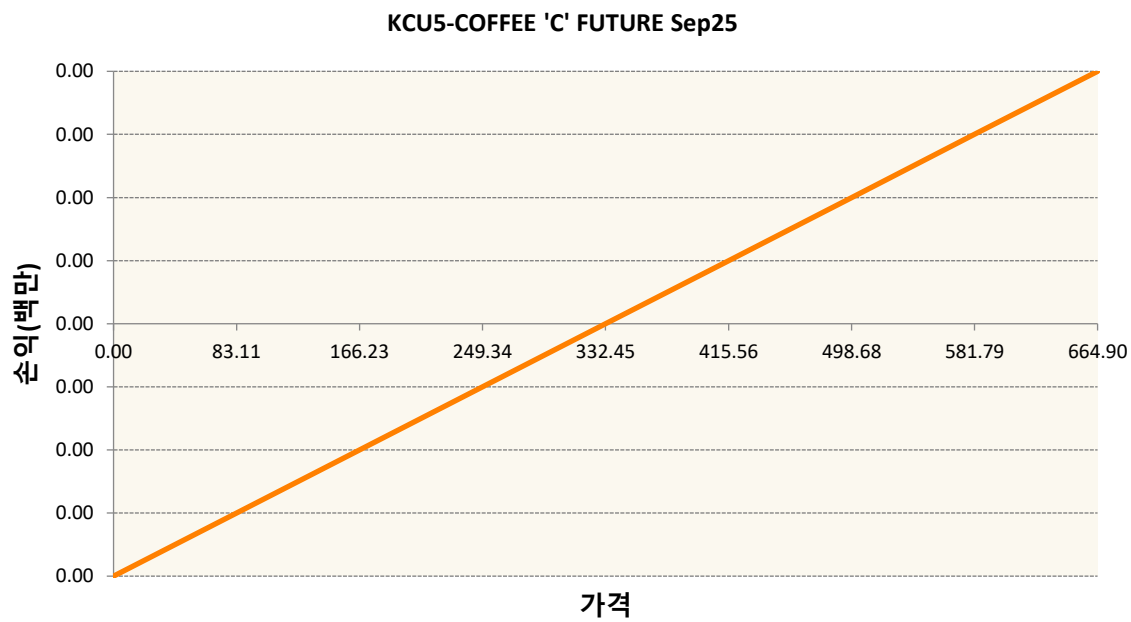
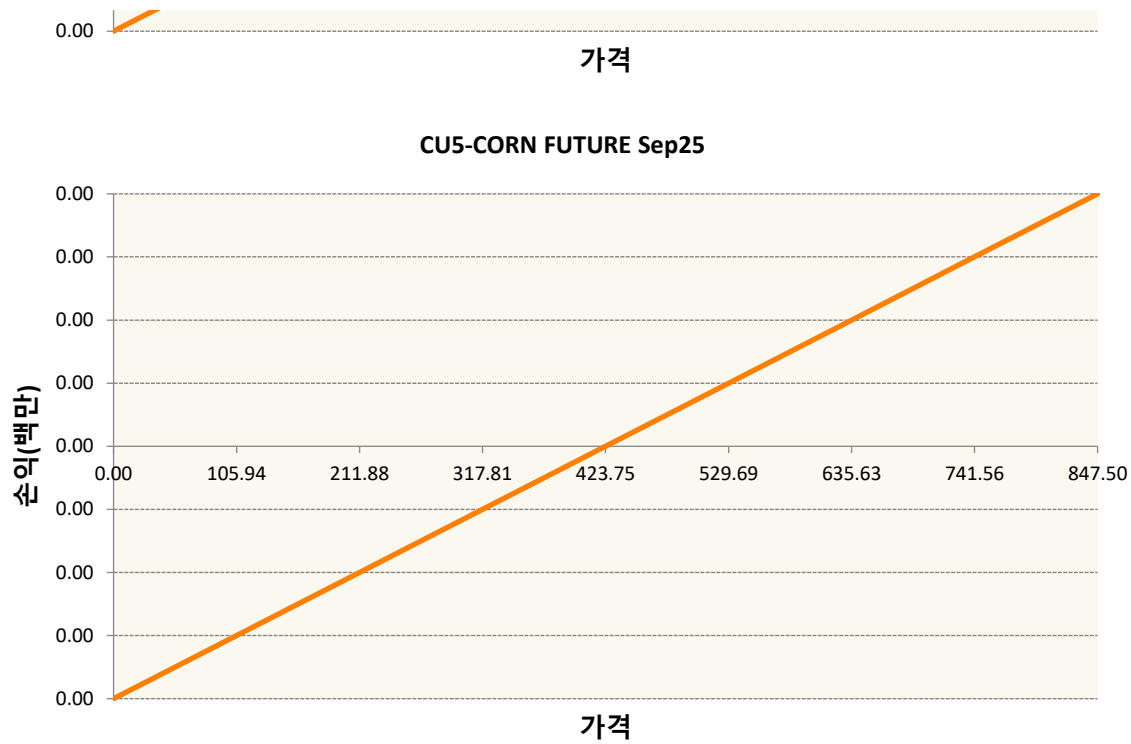
1. 계약금액

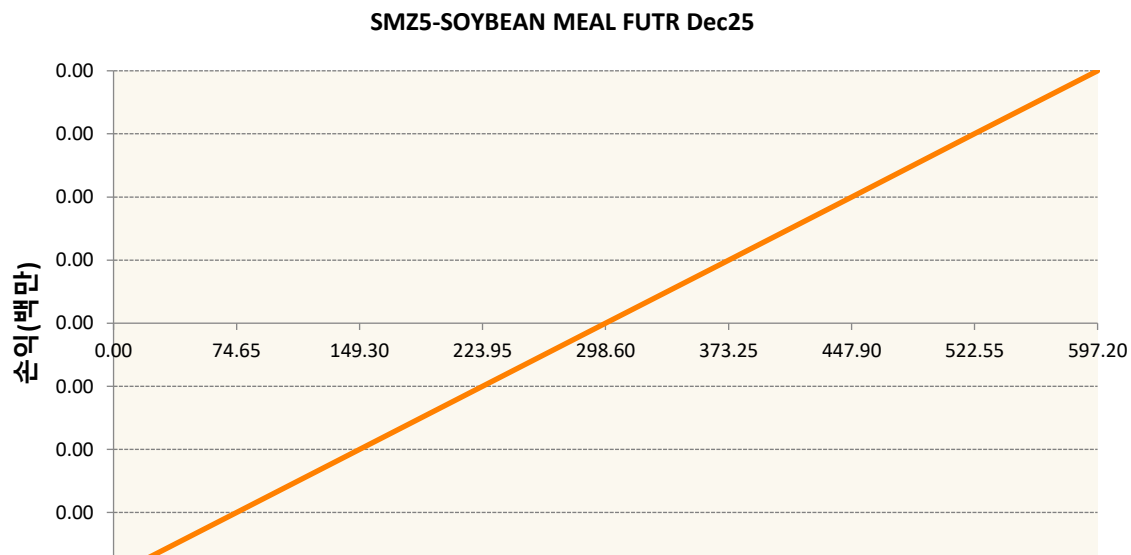
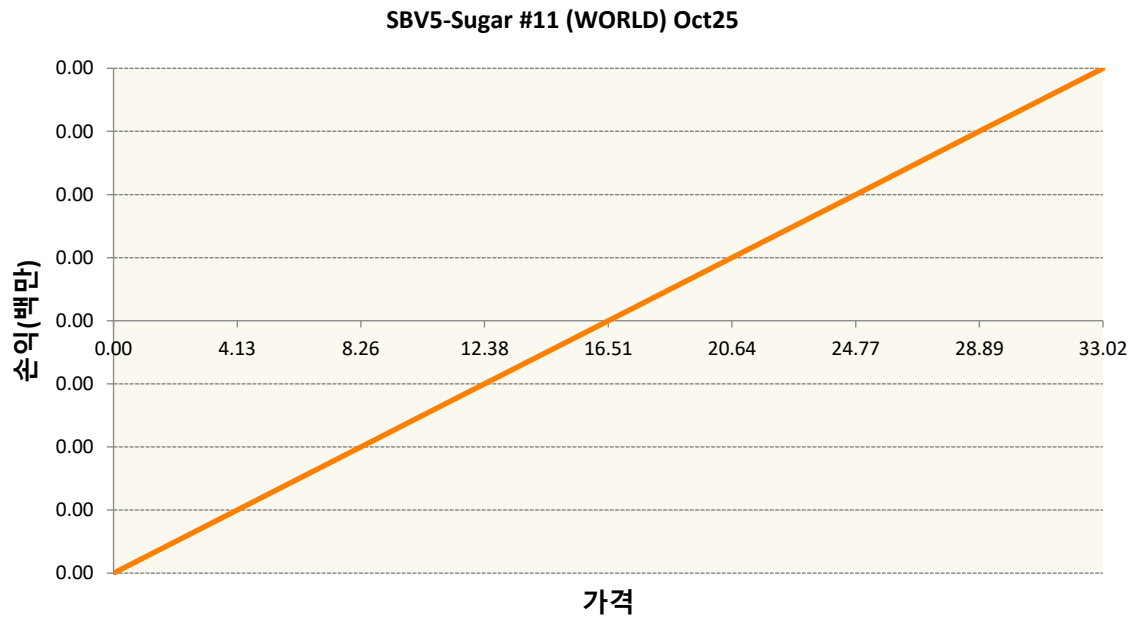
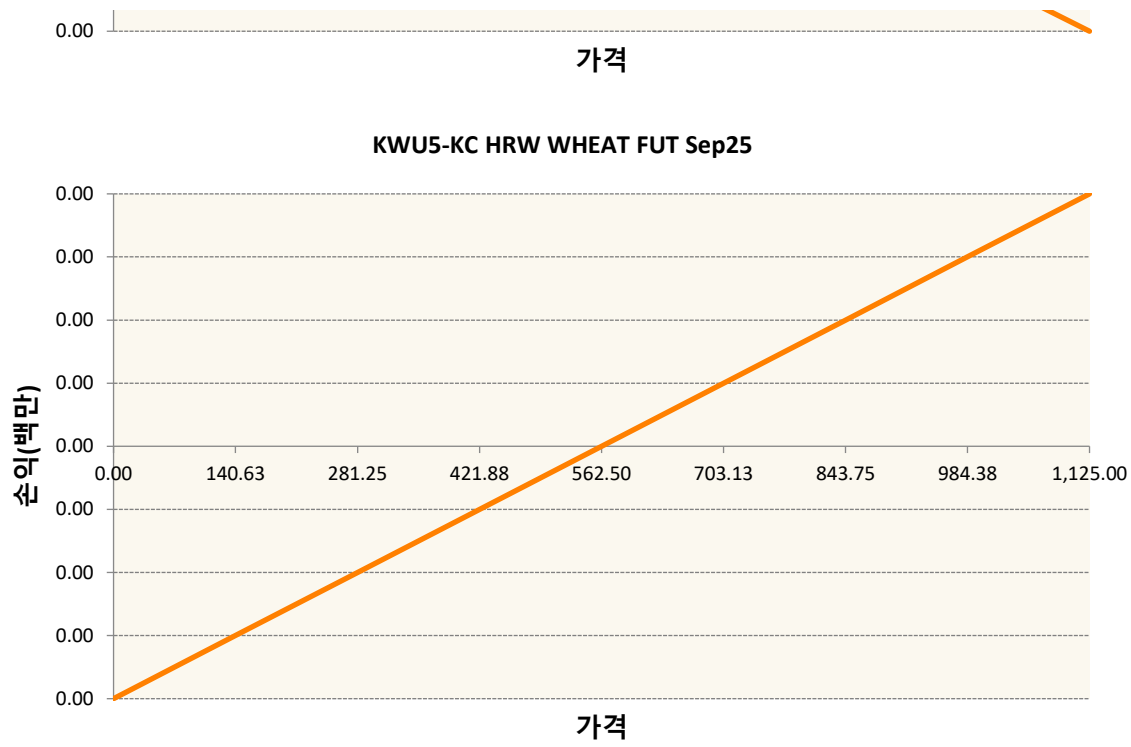
(단위:USD 백만)

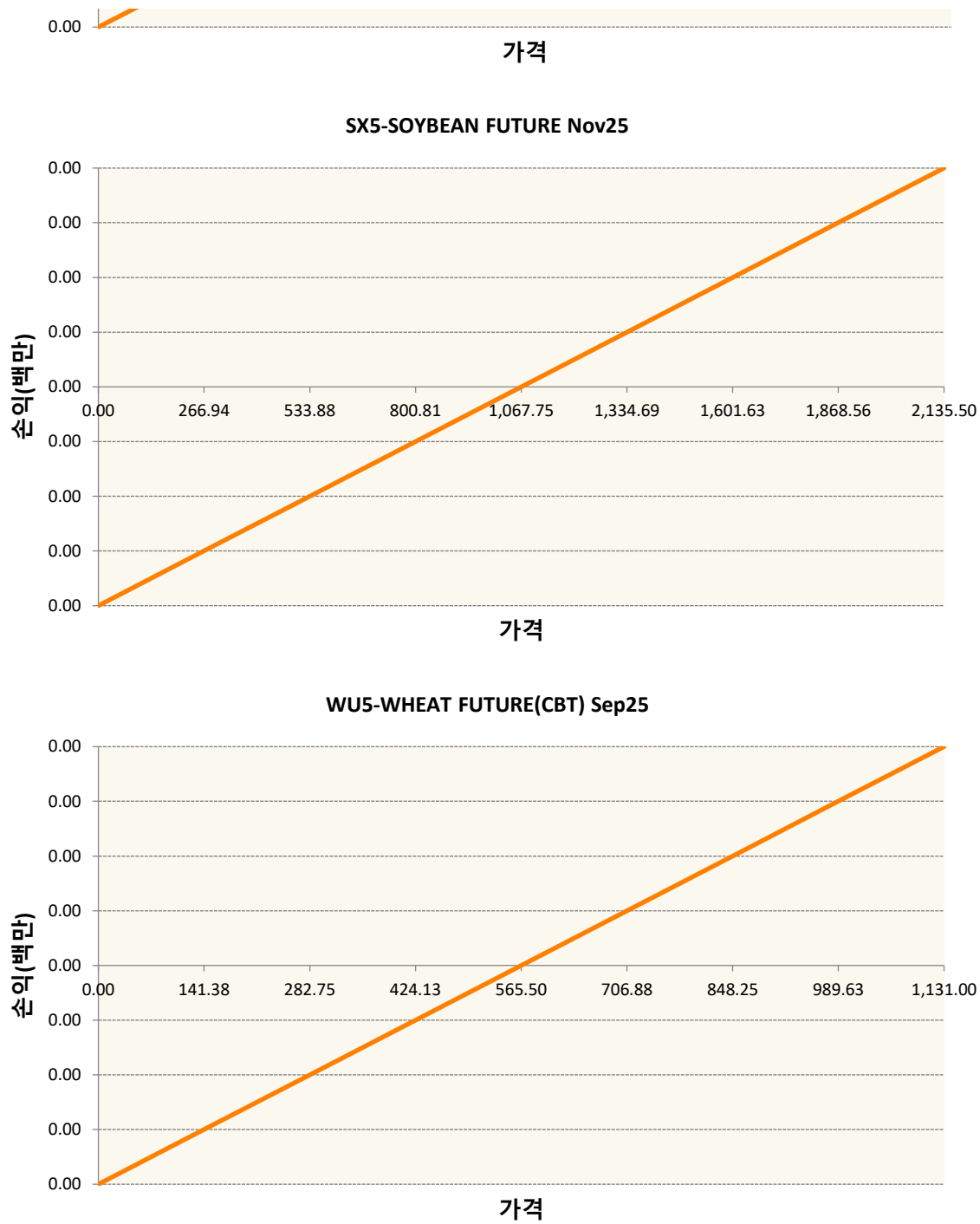
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	55	-55	장내
누계	실물자산	선물	1,632	0	1,632	
누계	유가증권	선물	2,103	0	2,103	
누계	통화	선물	0	260	-260	장내

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	2025-06-19
기준일	2025-06-18

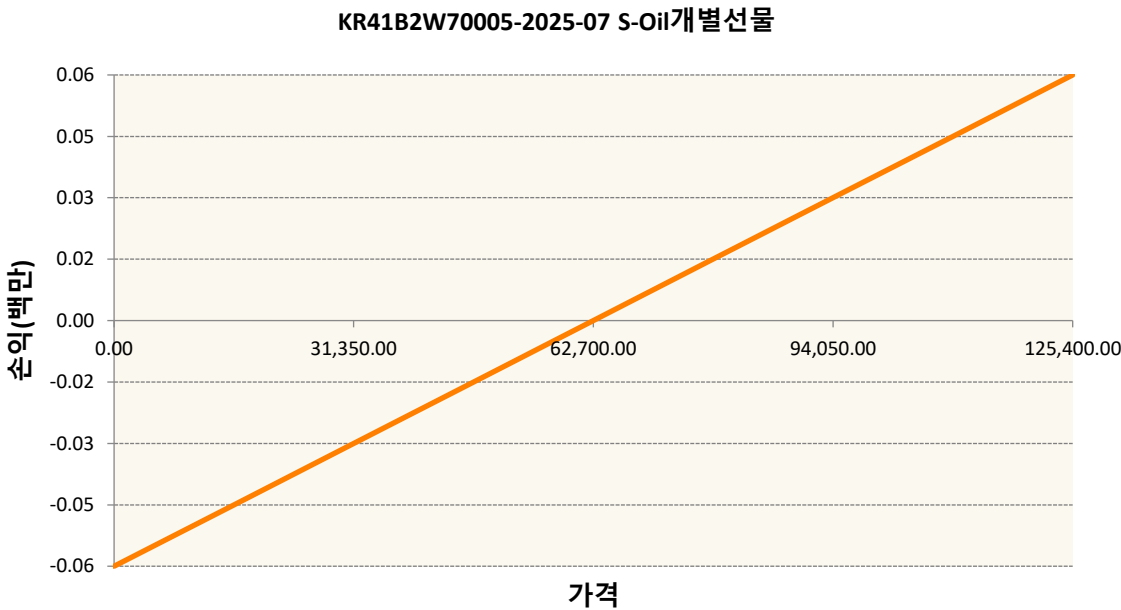
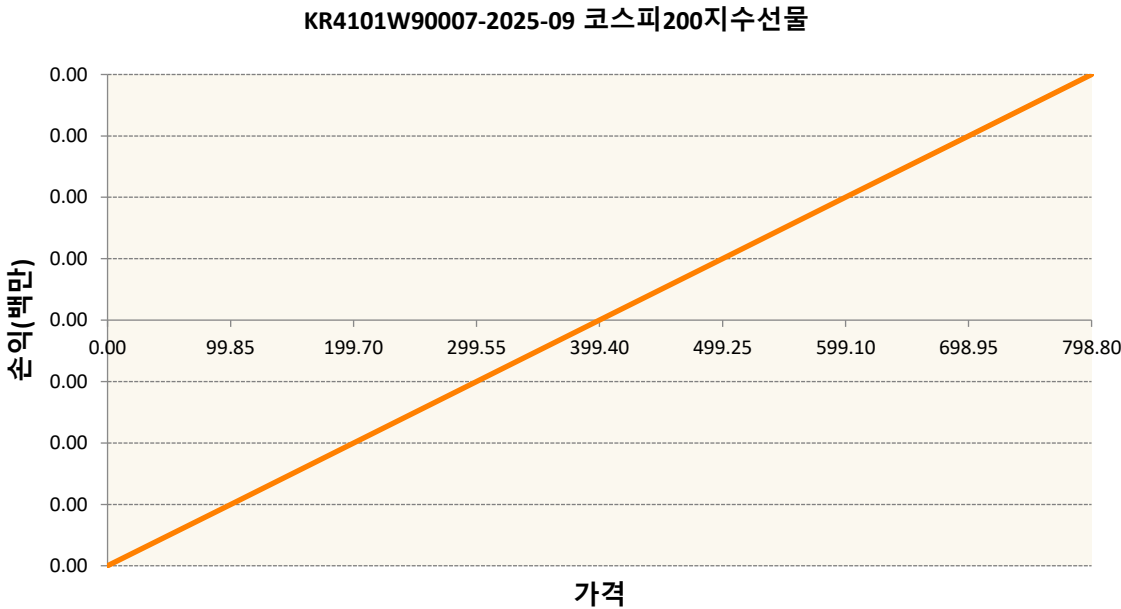
스마트인덱스모

1. 계약금액

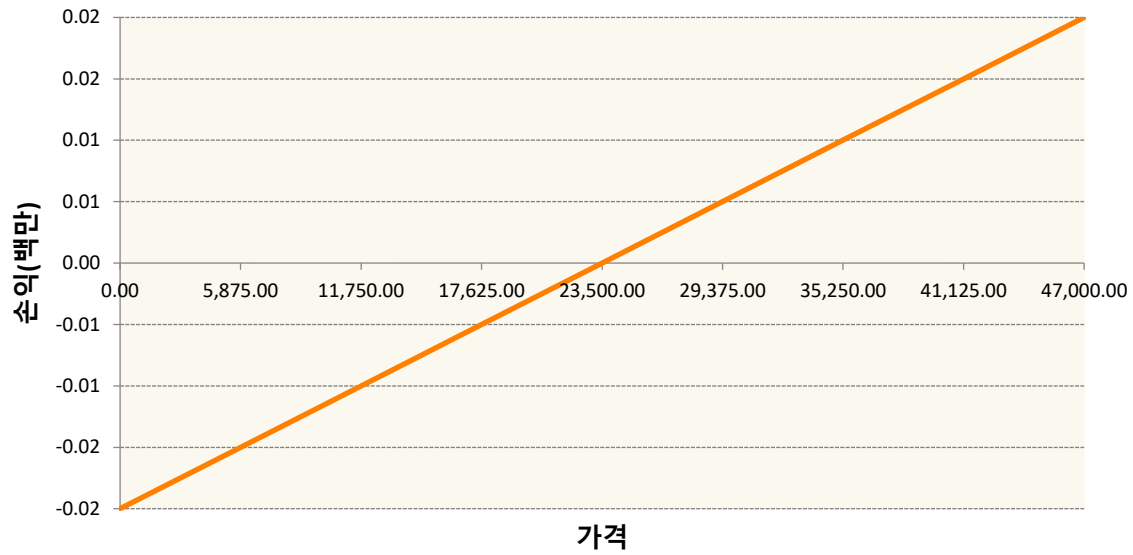
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	853	0	853	장내

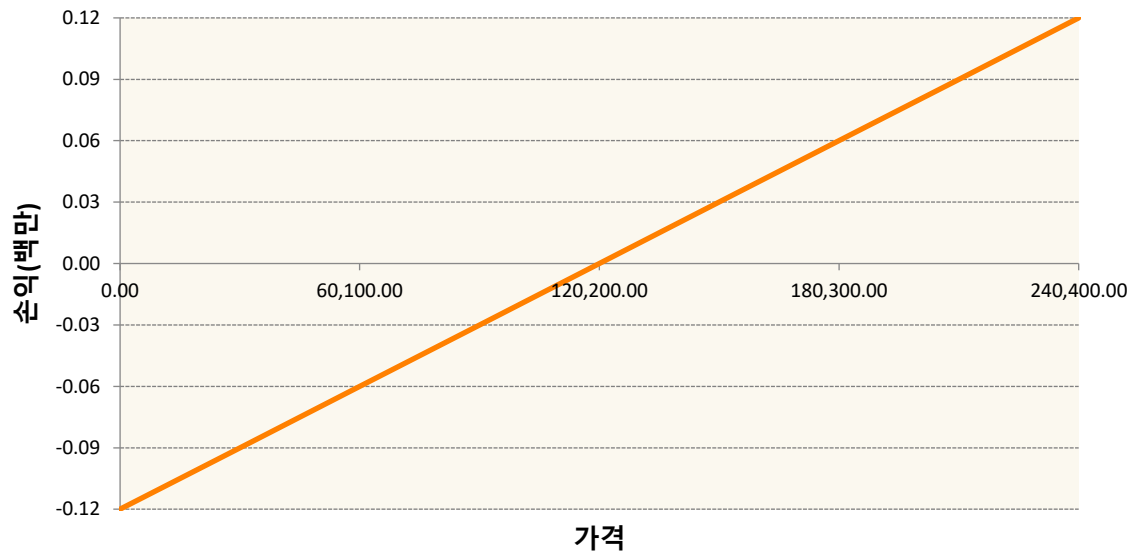
2. 만기시점의 손익구조



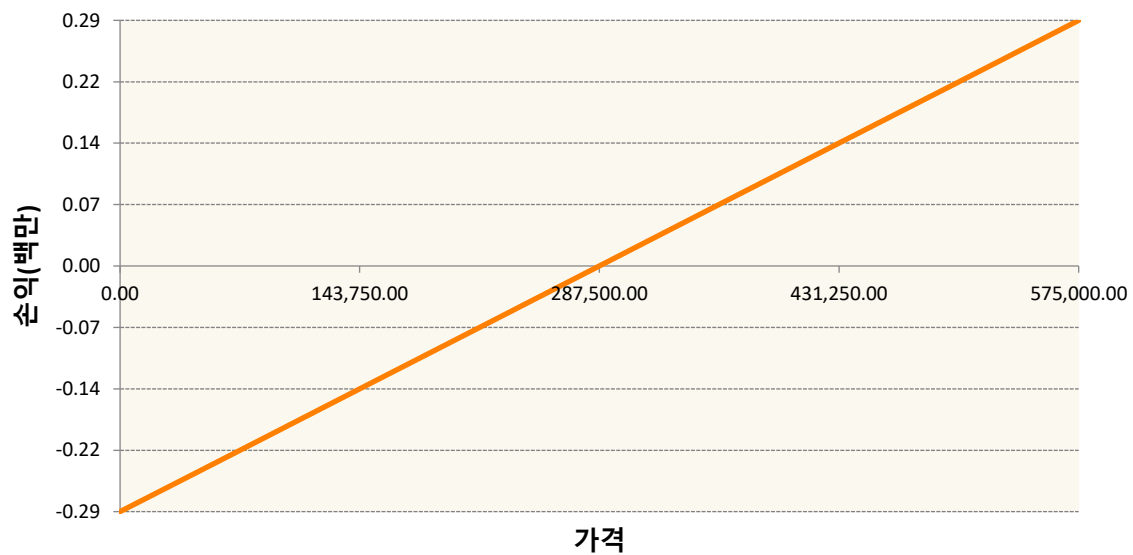
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



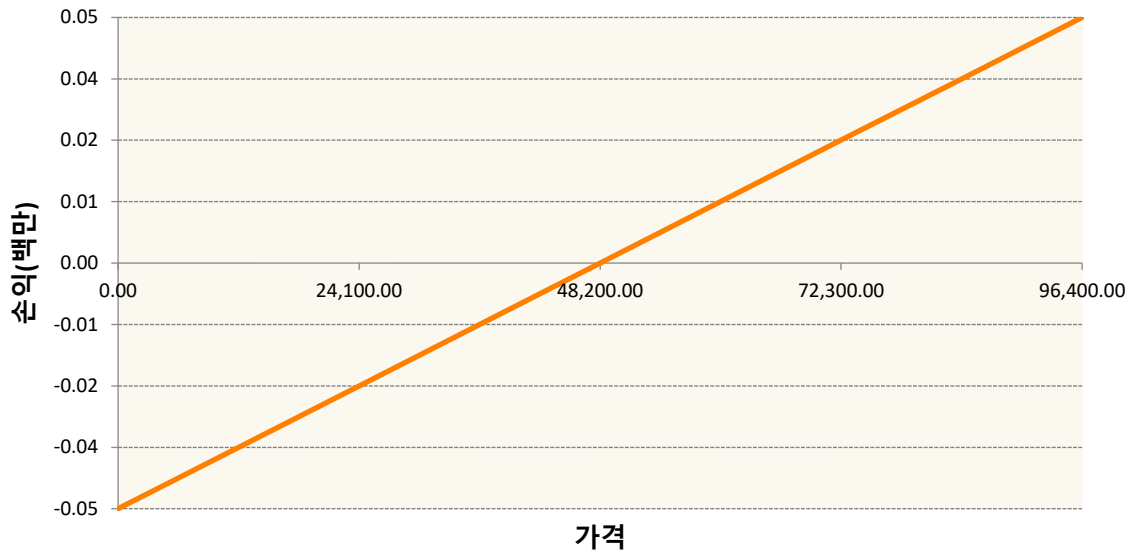
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



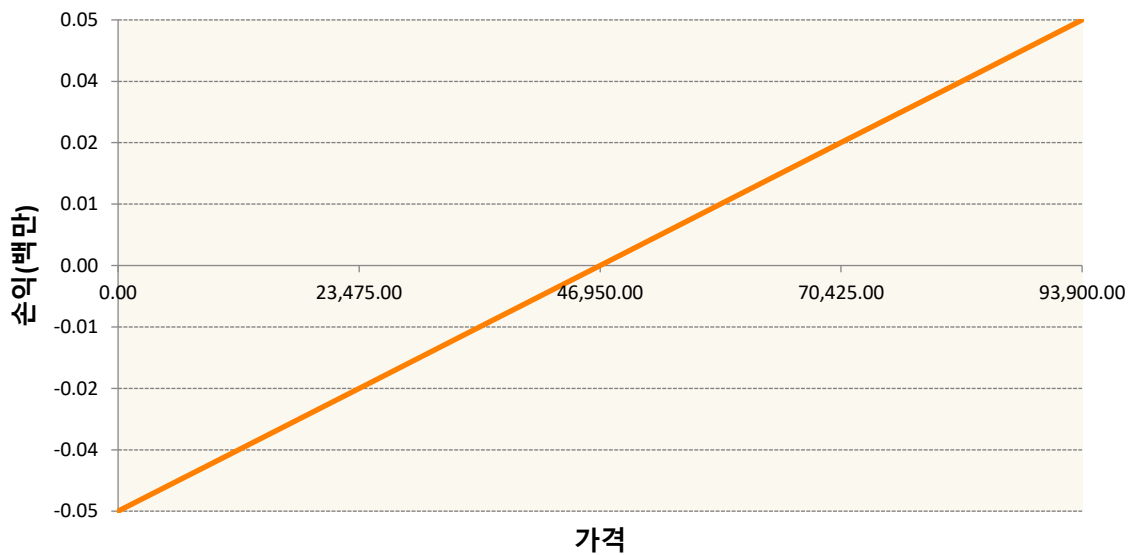
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	48
KR41B2W70(2025-07 S-Oil개별선물	1
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	1
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	12
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	1
KR41G0W70 2025-07 씨에스원드개별선물	0.26

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

(단위:백만원)

114

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

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	298
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

480

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

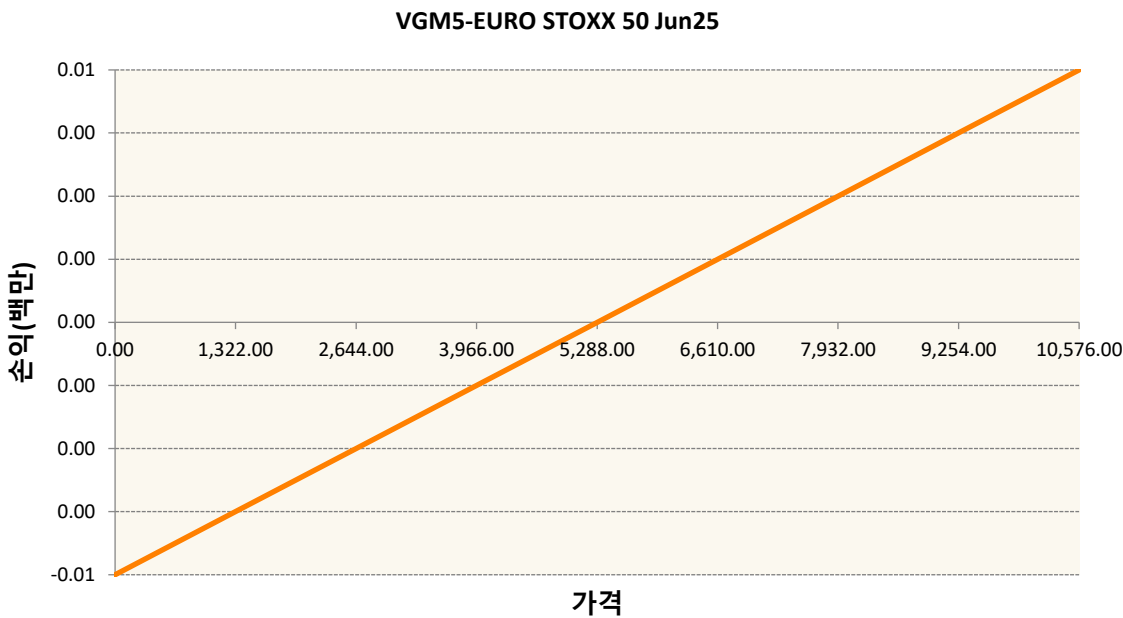
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,010	0	1,010	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM5	EURO STOXX 50 Jun25	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

67

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

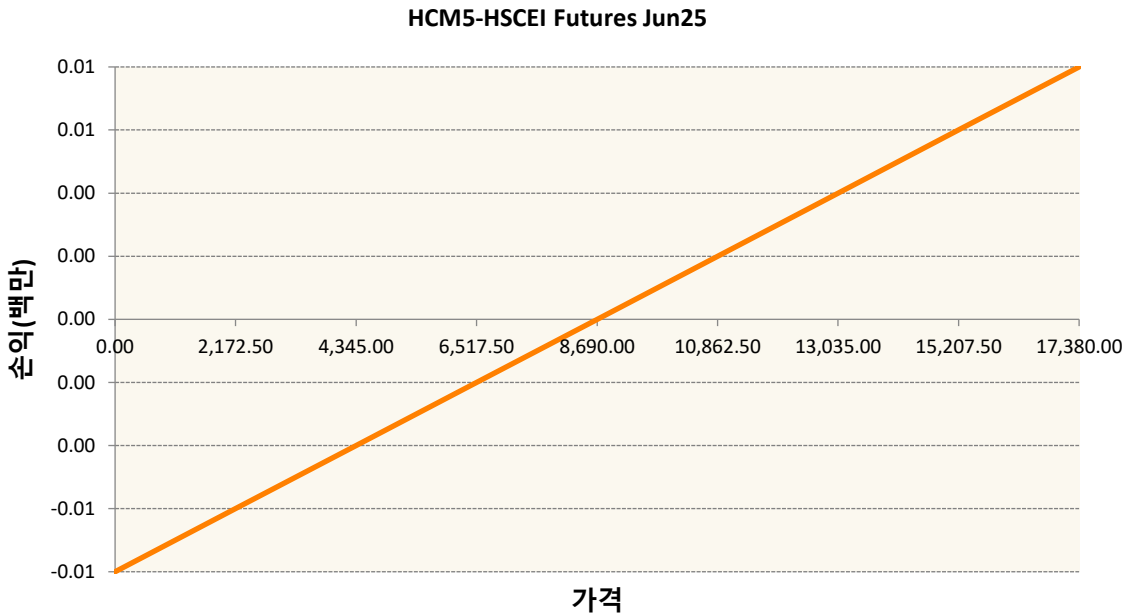
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,365	0	2,365	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM5	HSCEI Futures Jun25	189
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

276

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

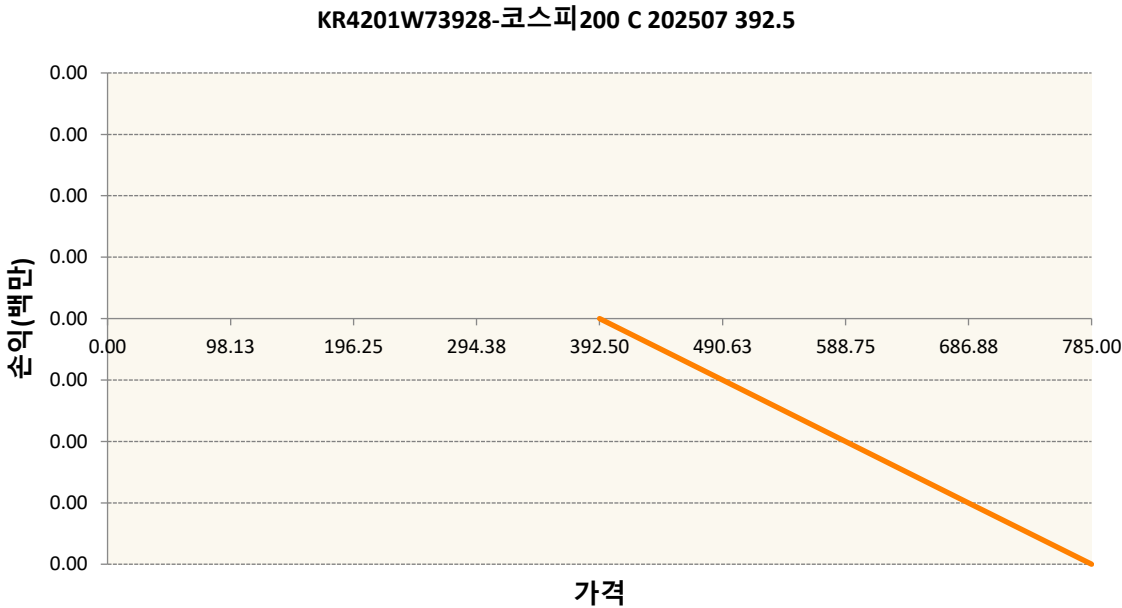
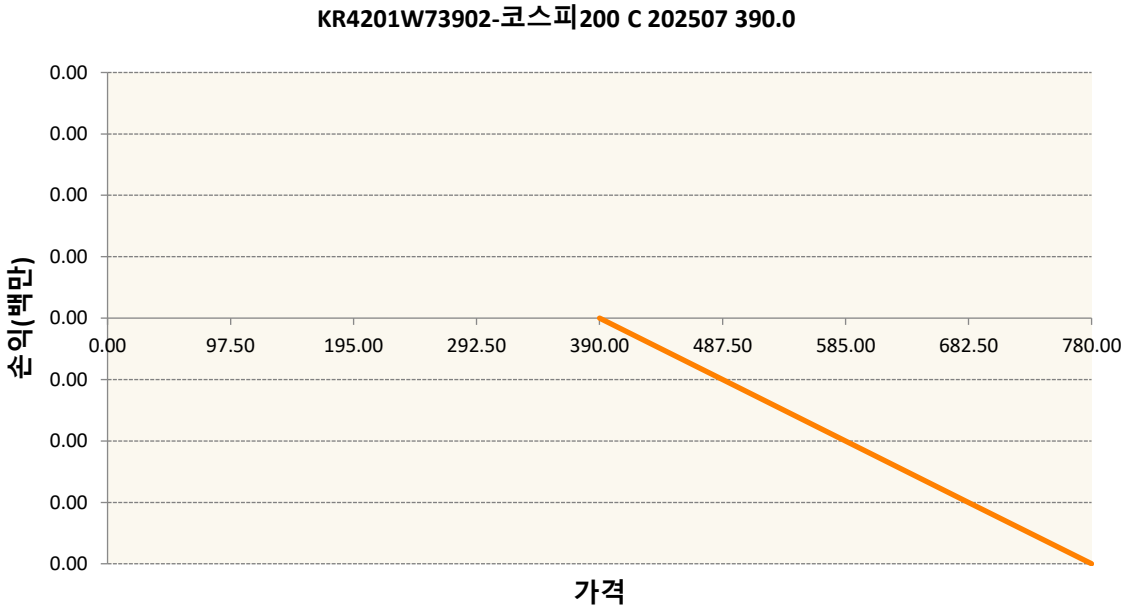
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	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

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 785.00. The y-axis, labeled '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. An orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (392.50, 0.00).

가격	손익 (백만)
0.00	0.00
392.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201W73902코스피200 C 202507 390.0							1,594
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	766	751	732	712	689	664	637
-5.33%	680	649	616	583	548	513	477
-2.67%	473	432	391	350	309	268	227
0%	112	75	38	0	-39	-78	-117
2.67%	-379	-402	-427	-455	-484	-515	-547
5.33%	-945	-955	-968	-984	-1,003	-1,024	-1,047
8.00%	-1,542	-1,545	-1,550	-1,558	-1,568	-1,580	-1,594
KR4201W73928코스피200 C 202507 392.5							516
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	227	223	218	212	205	198	190
-5.33%	205	196	186	176	165	154	142
-2.67%	147	134	120	107	94	80	67
0%	39	26	13	0	-13	-27	-40
2.67%	-115	-123	-133	-143	-154	-165	-177
5.33%	-298	-302	-308	-314	-321	-329	-337
8.00%	-494	-496	-498	-501	-505	-510	-516
KR4301W73900 코스피200 P 202507 390.0							249

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-225	-229	-233	-238	-243	-249
-5.33%	-112	-119	-126	-133	-140	-147	-155
-2.67%	-28	-37	-46	-54	-63	-71	-80
0%	23	16	8	0	-8	-16	-24
2.67%	48	43	38	32	26	20	13
5.33%	57	55	52	49	45	40	36
8.00%	59	59	57	56	54	51	48

KR4301W73926 코스피200 P 202507 392.5							87
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-82	-83	-84	-86	-87
-5.33%	-42	-44	-46	-48	-50	-53	-55
-2.67%	-12	-14	-17	-20	-23	-26	-28
0%	8	6	3	0	-3	-6	-8
2.67%	18	16	14	12	10	8	5
5.33%	22	21	20	19	17	16	14
8.00%	23	23	23	22	21	20	19

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

(단위:백만원)

2,522

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

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	2025-06-19
기준일	2025-06-18

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	4,286	0	4,286	

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	2025-06-19
기준일	2025-06-18

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	12,525	0	12,525	
누계	통화	선도	0	11,914	-11,914	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)
	464

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

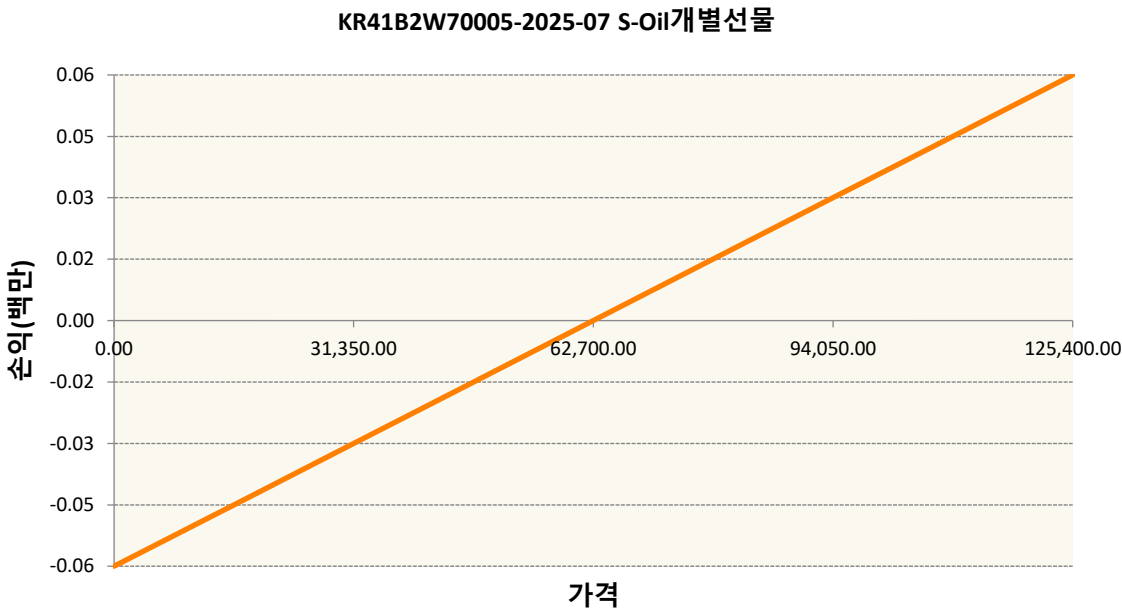
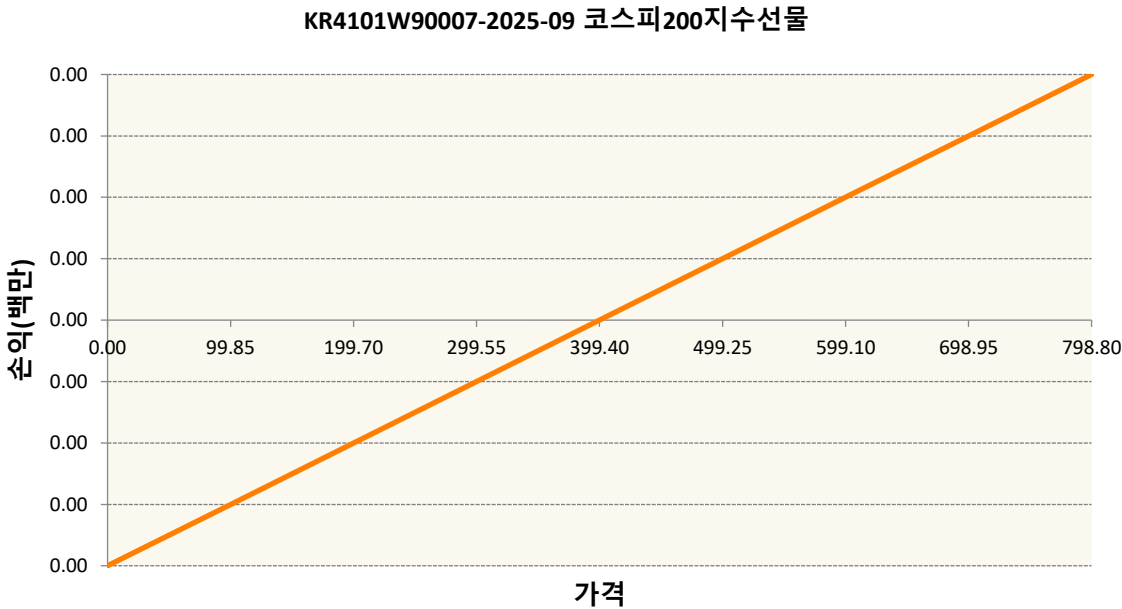
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

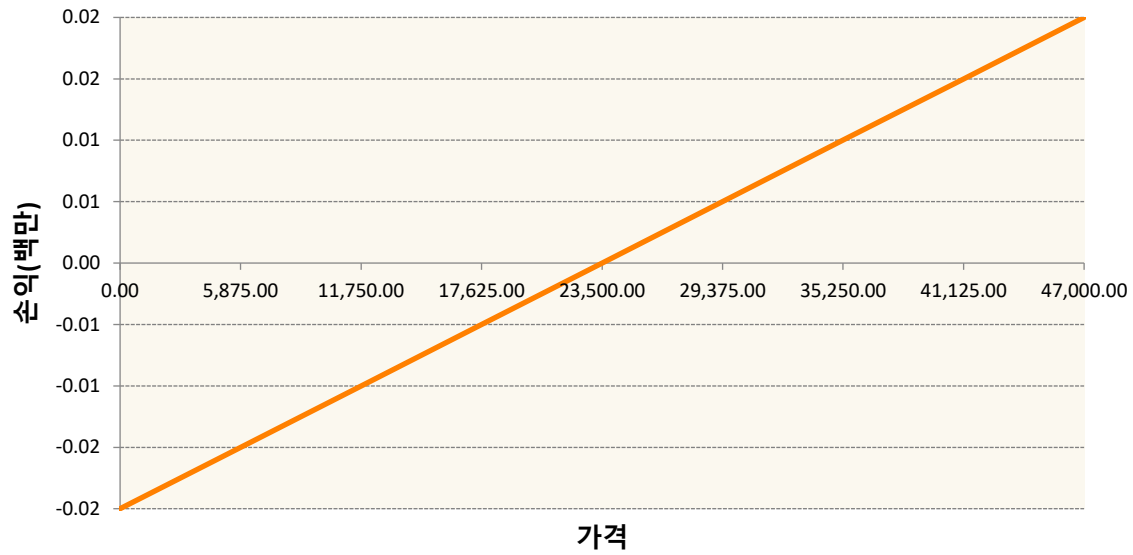
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	642	0	642	장내

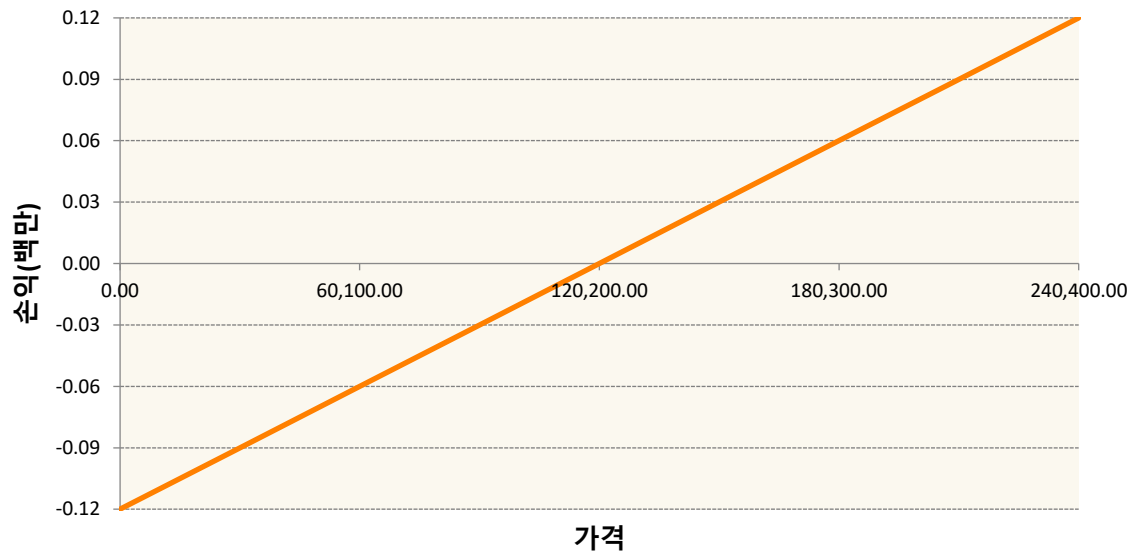
2. 만기시점의 손익구조



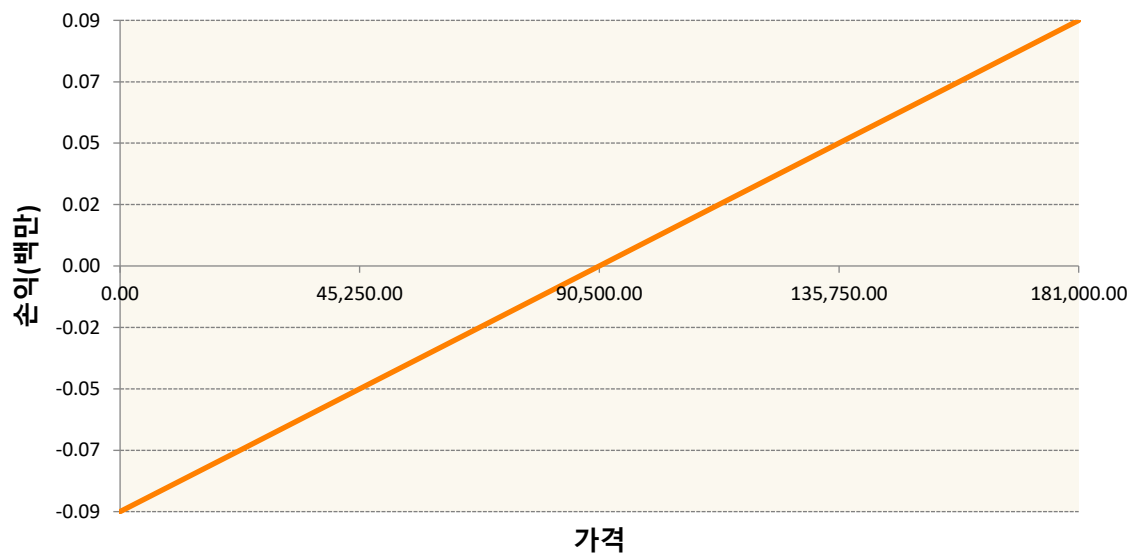
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



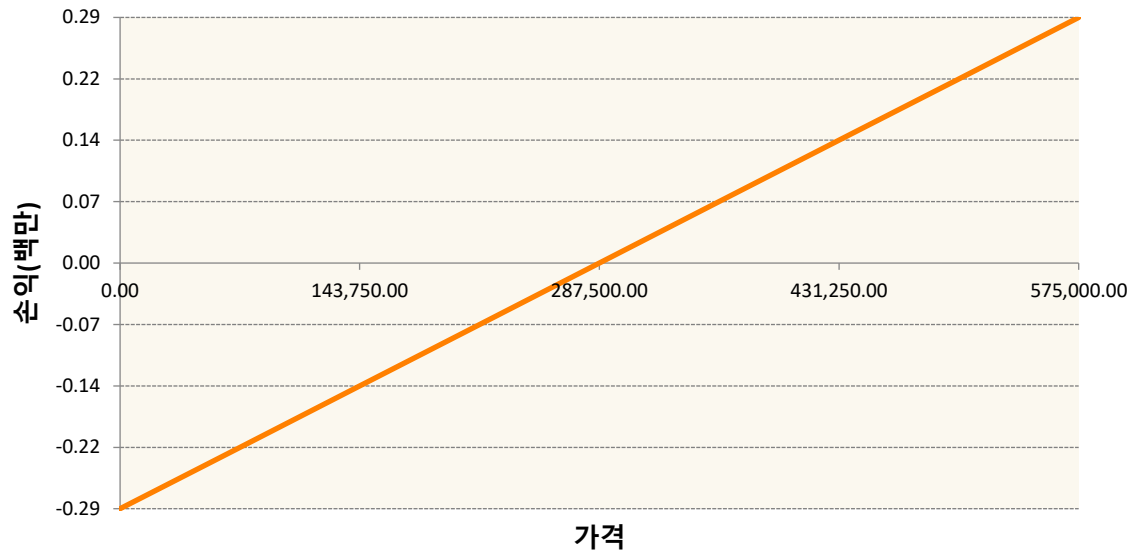
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



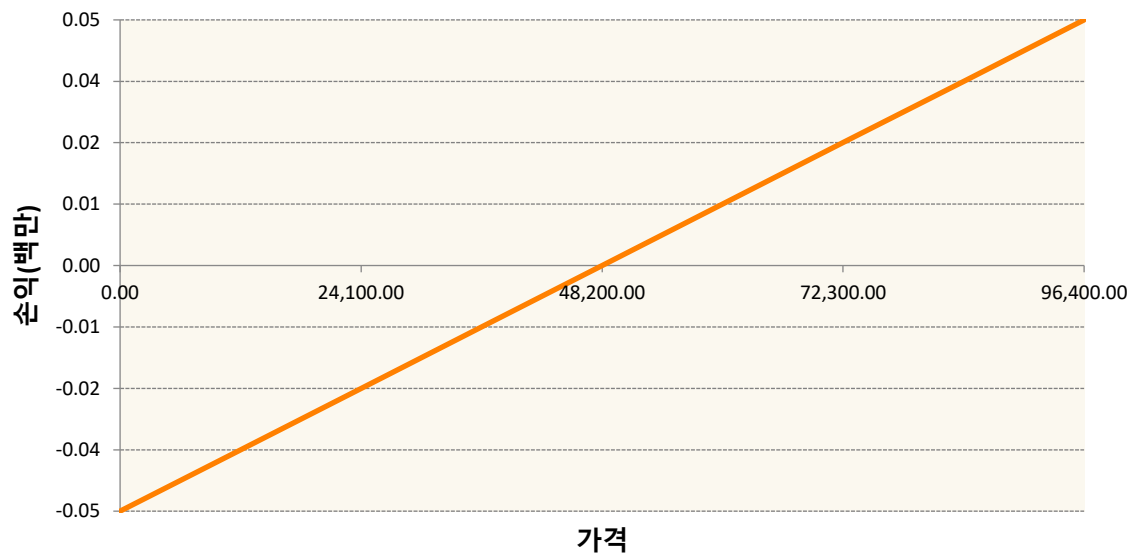
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	40
KR41B2W70(2025-07 S-Oil개별선물	1
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)

82

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

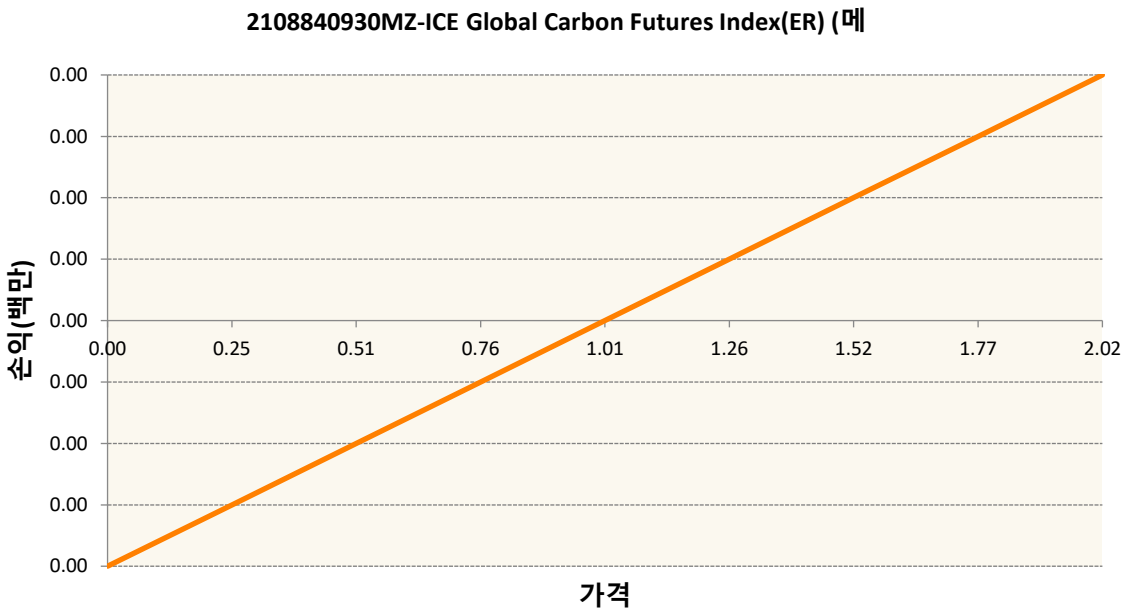
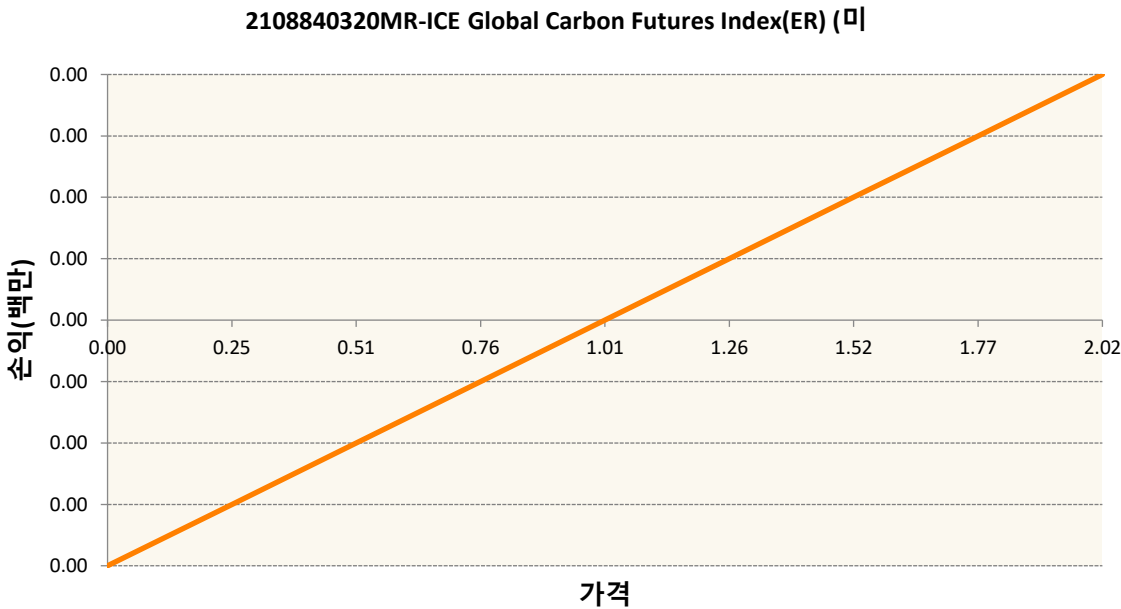
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,937	0	9,937	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	596
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	199

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	908

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

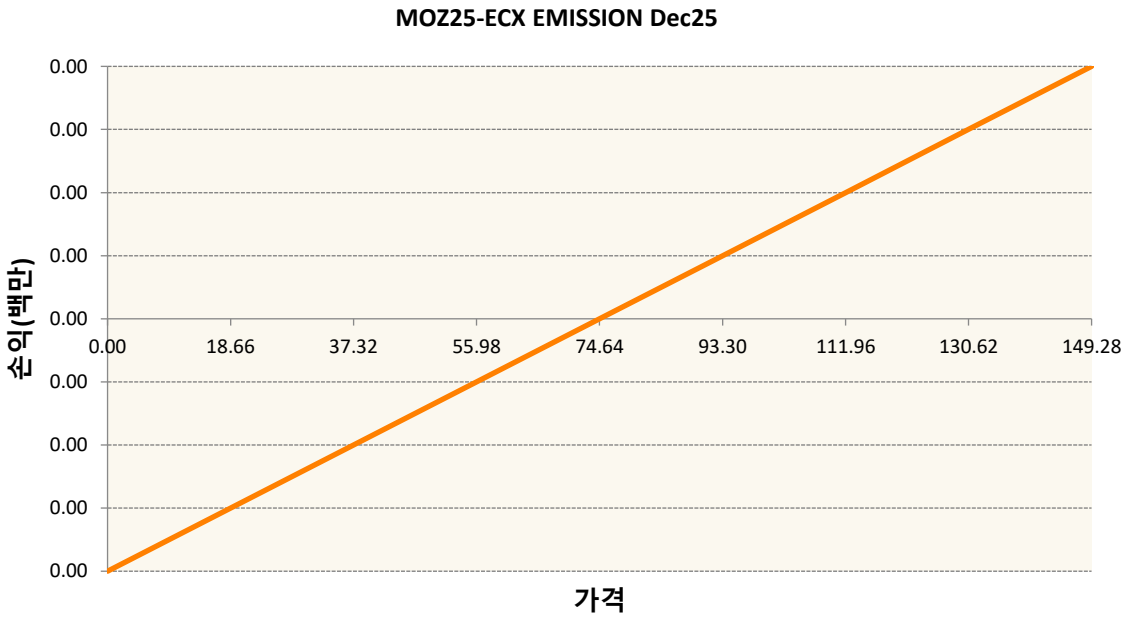
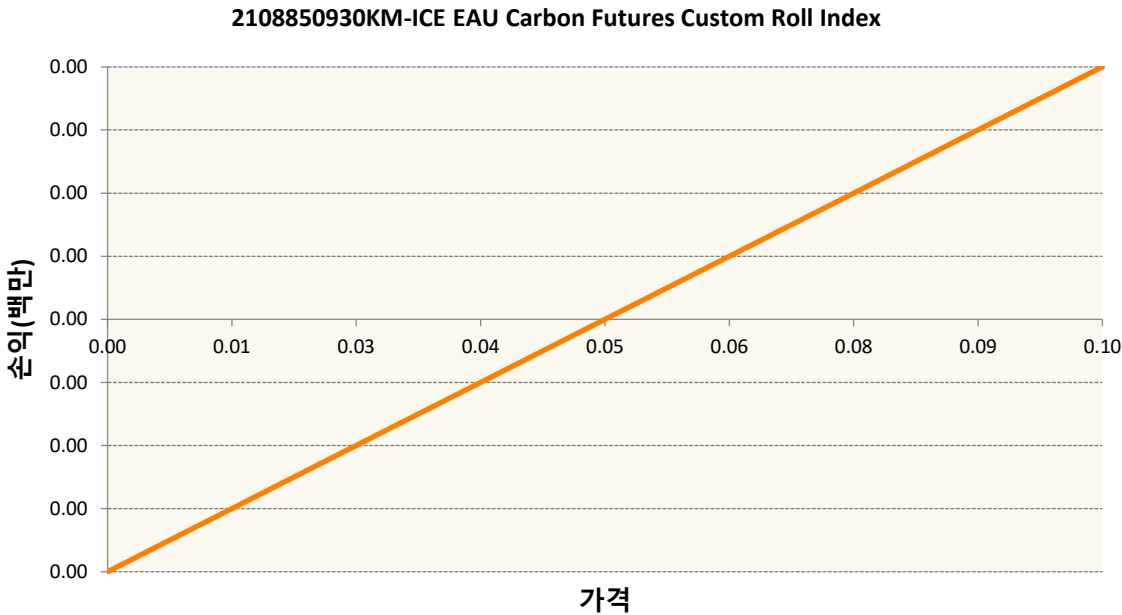
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,805	0	6,805	
누계	통화	선도	0	1,395	-1,395	장외

2. 만기시점의 손익구조



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	543

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

991

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

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)

133

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

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)	36
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	43
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	31
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	9

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

(단위:백만원)

209

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

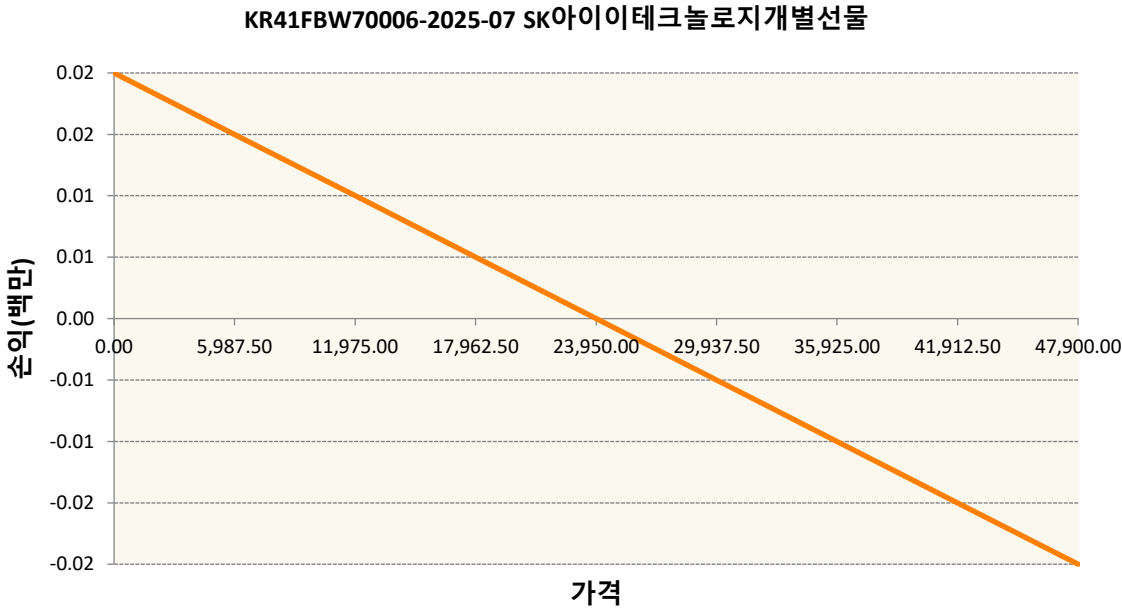
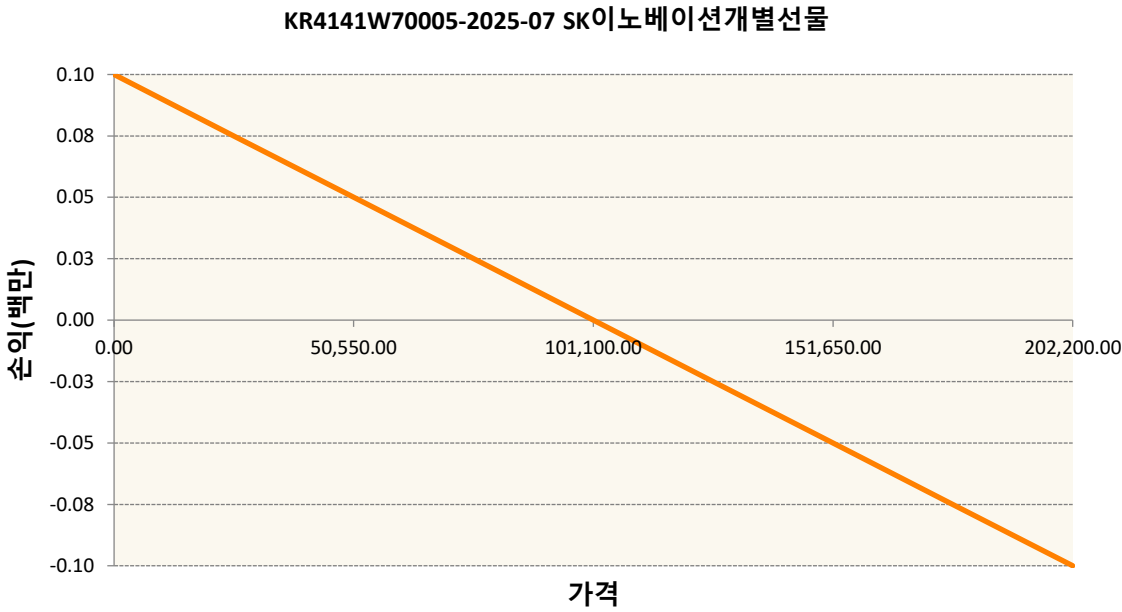
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	6	-6	장내
누계	유가증권	선물	0	6	-6	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4141W70(2025-07 SK이노베이션개별선물		0.24
KR41FBW70(2025-07 SK아이이테크놀로지개별선물		0.27

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

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

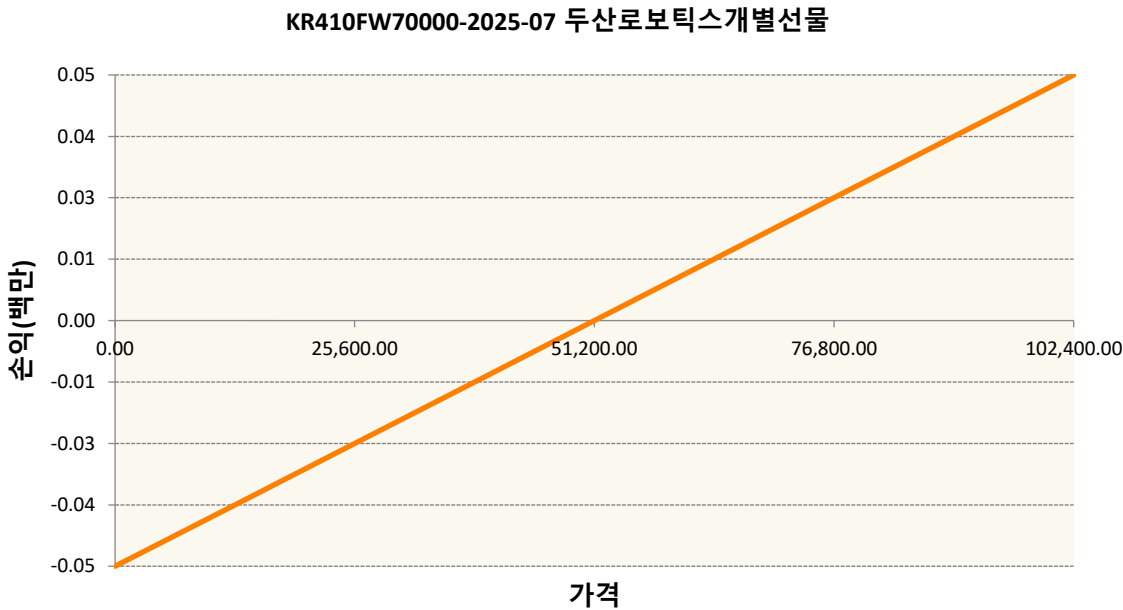
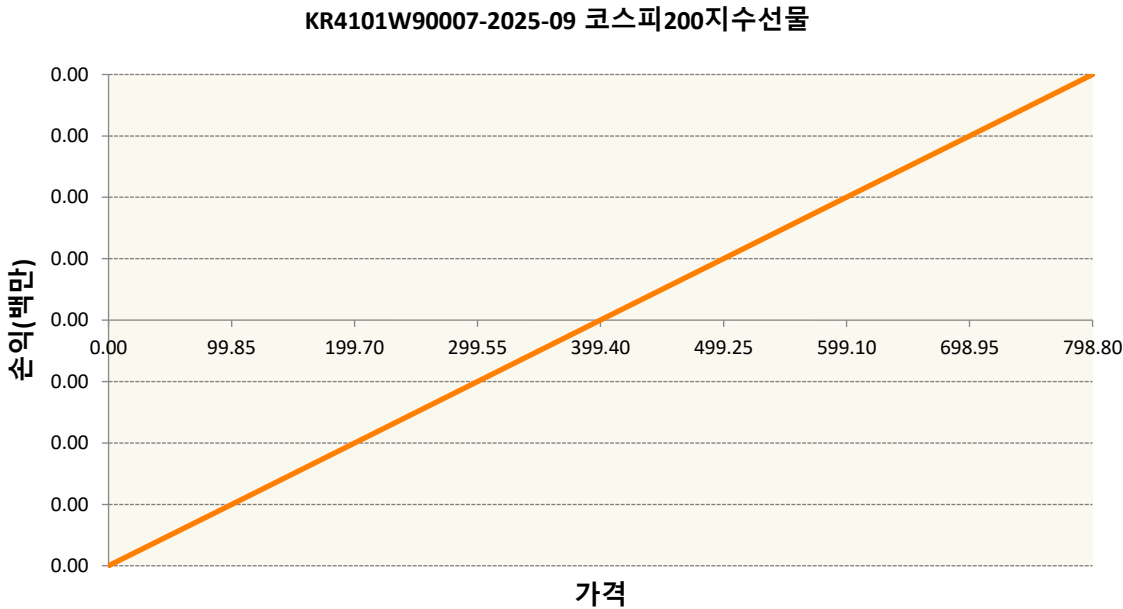
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

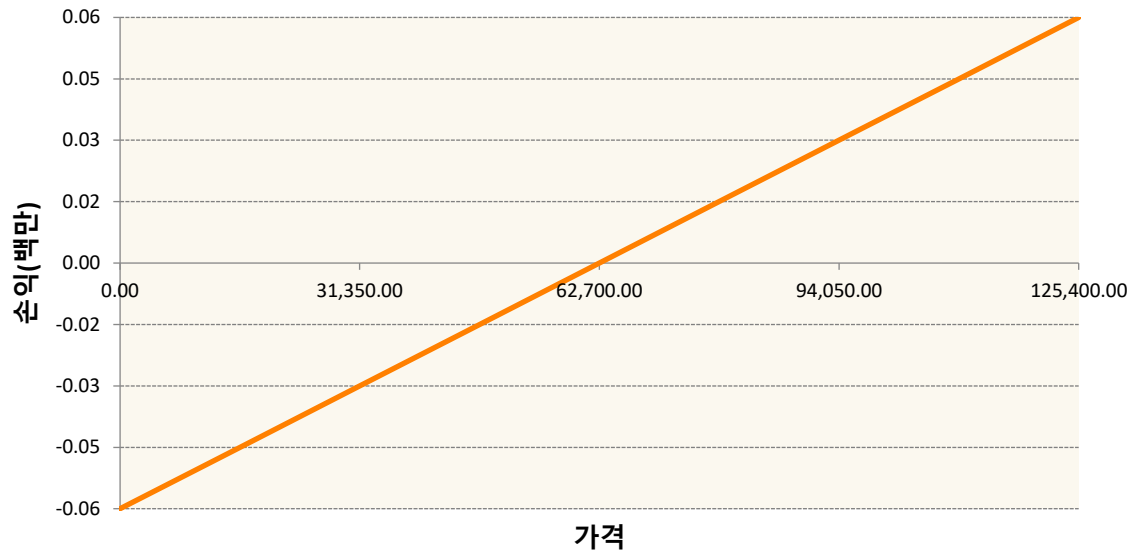
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	33	0	33	장내
누계	유가증권	선물	10,430	0	10,430	장내

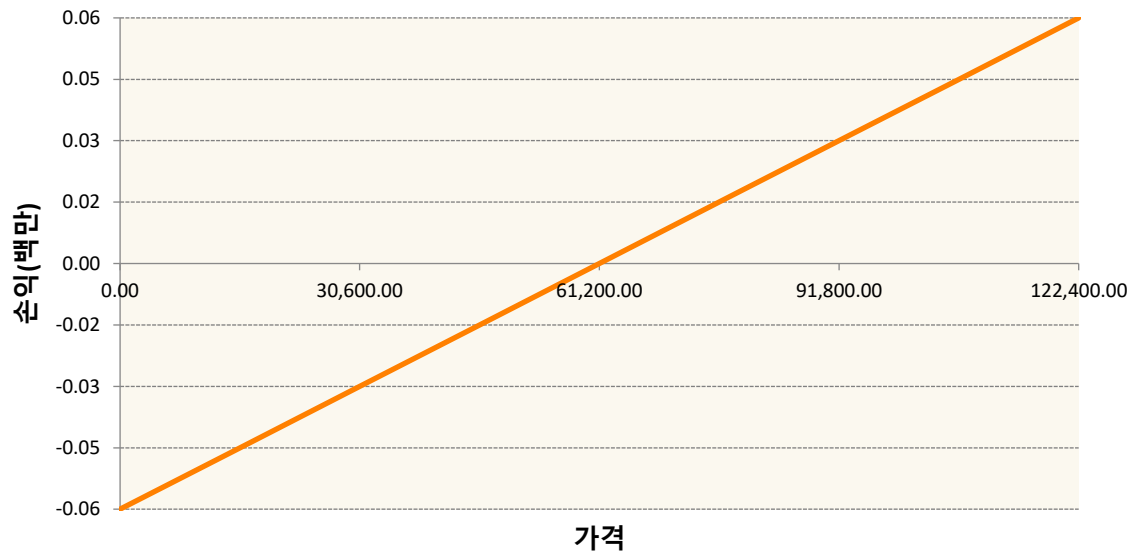
2. 만기시점의 손익구조



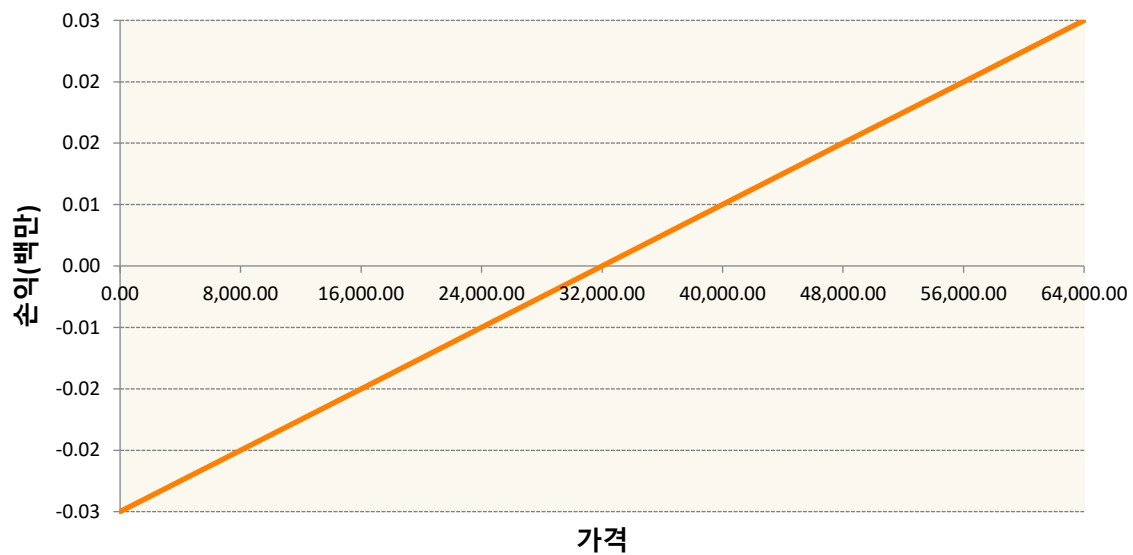
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



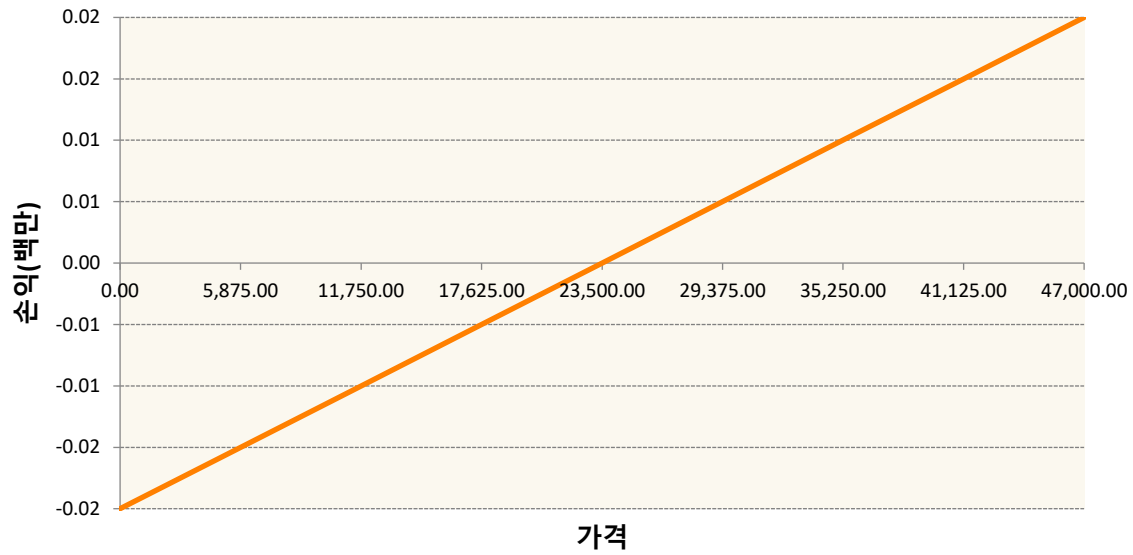
KR41B9W70000-2025-07 두산에너지빌리티개별선물



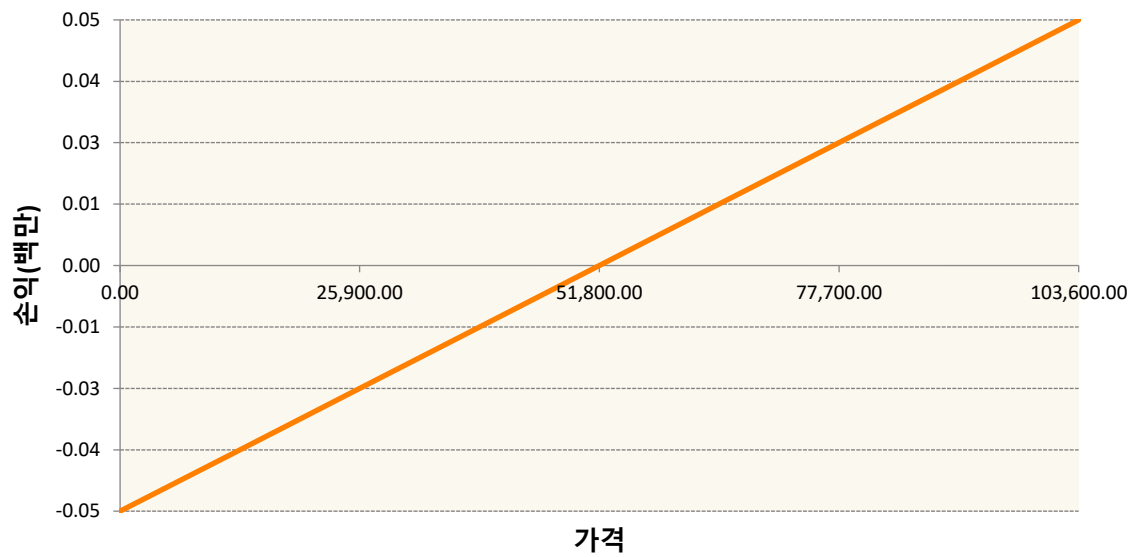
KR41CBW70003-2025-07 한화솔루션개별선물



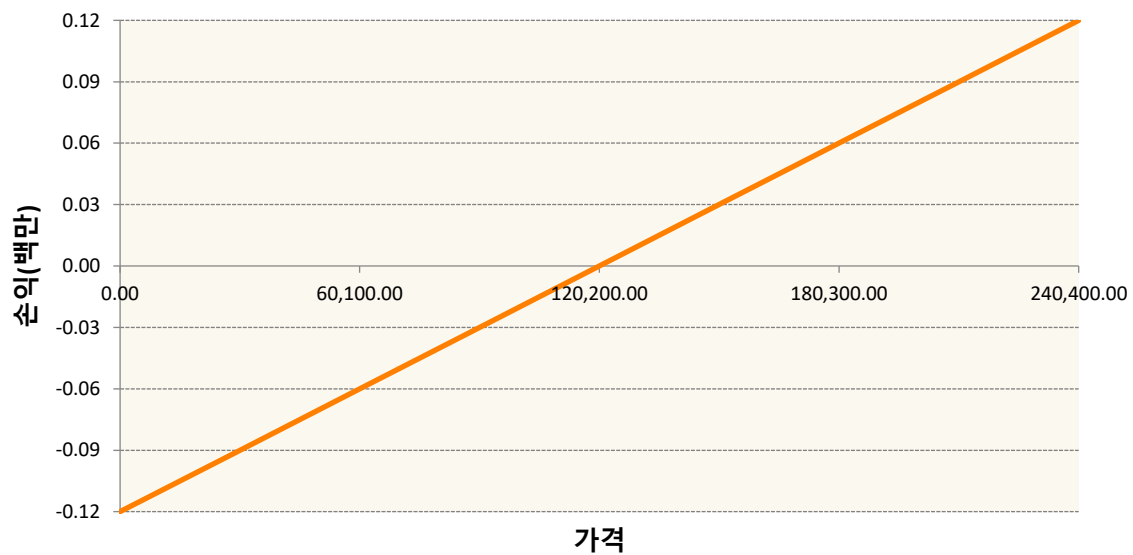
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



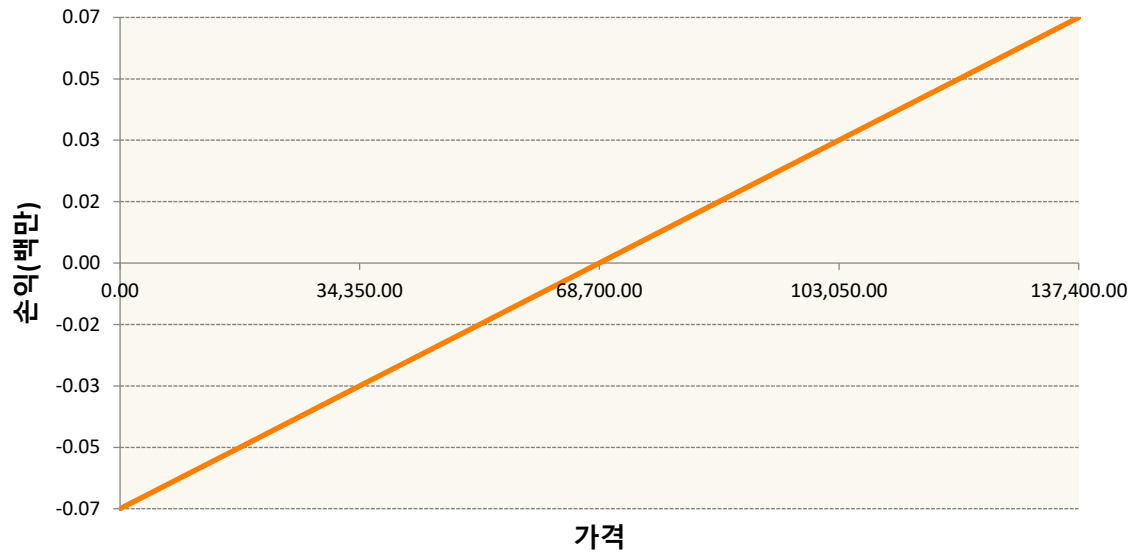
KR41D7W70002-2025-07 한전KPS개별선물



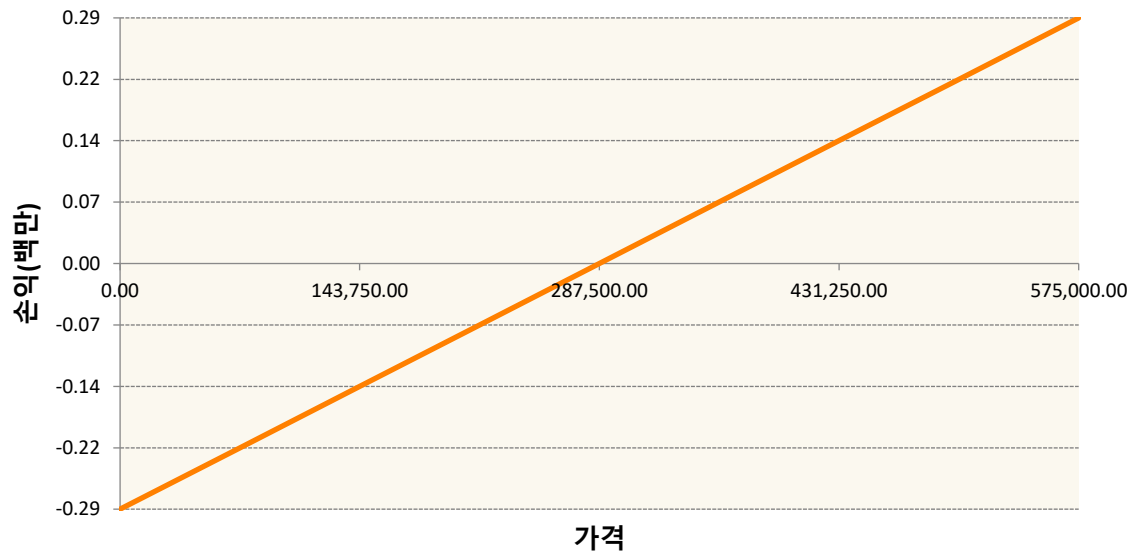
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



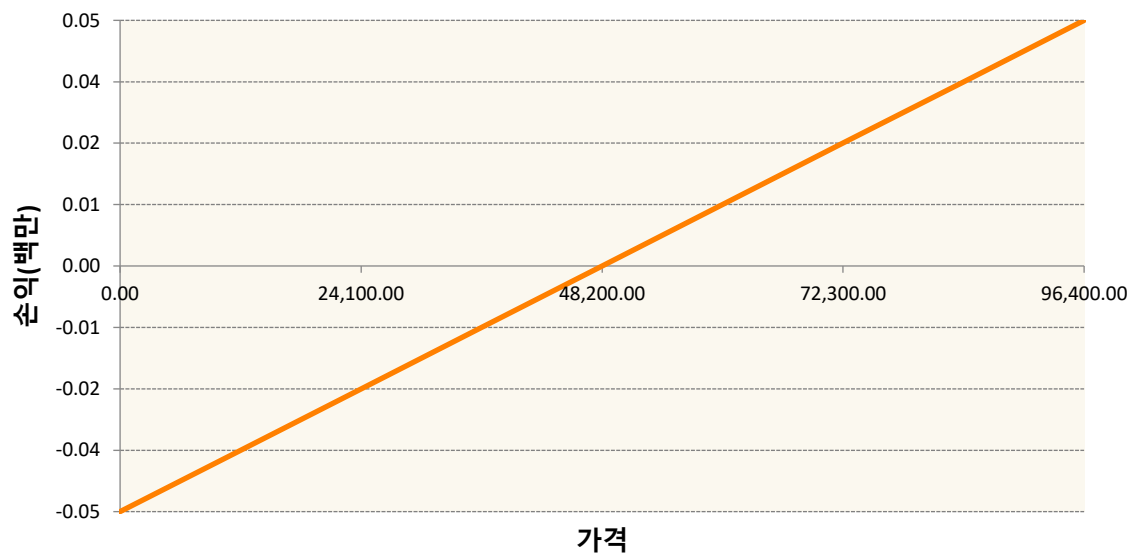
KR41EVW70007-2025-07 한화시스템개별선물



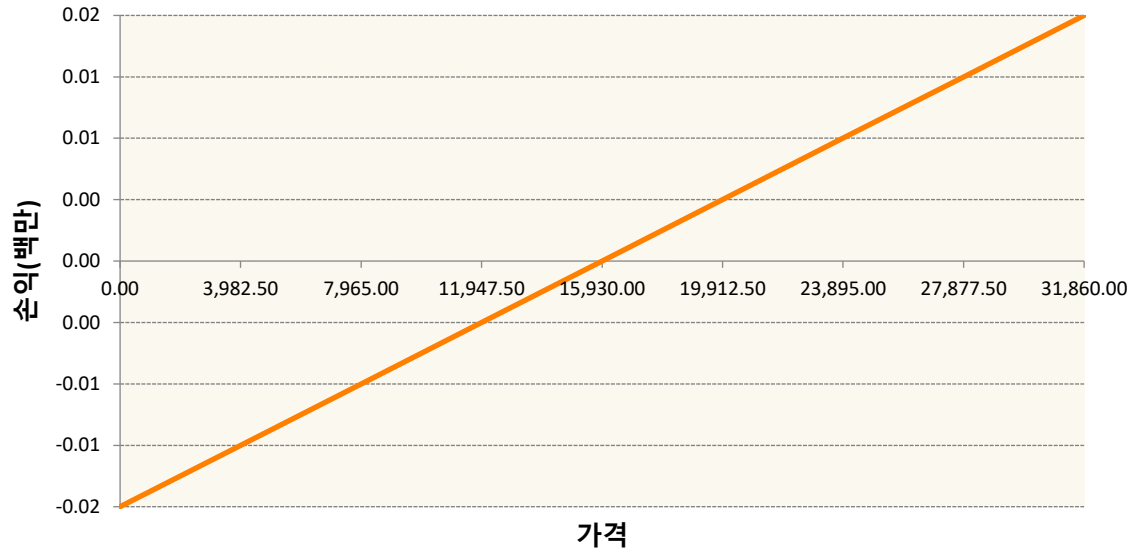
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



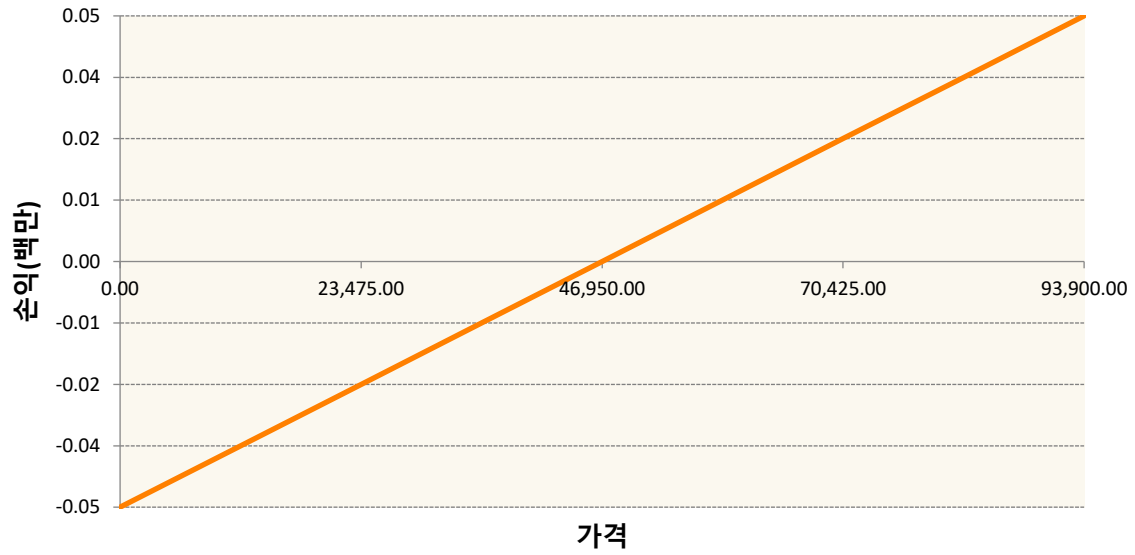
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



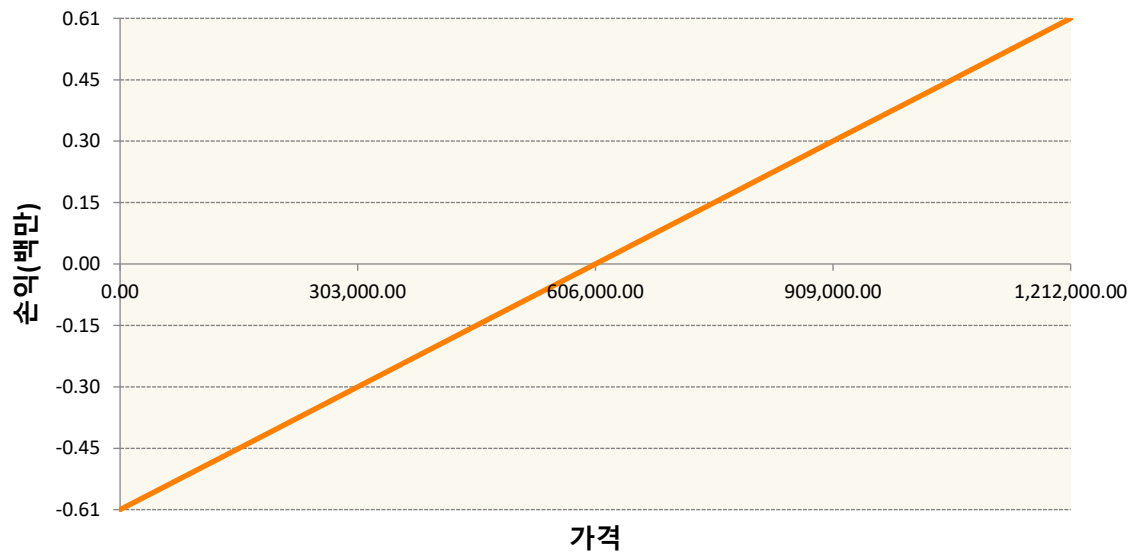
KR41FWW70002-2025-07 대한전선개별선물



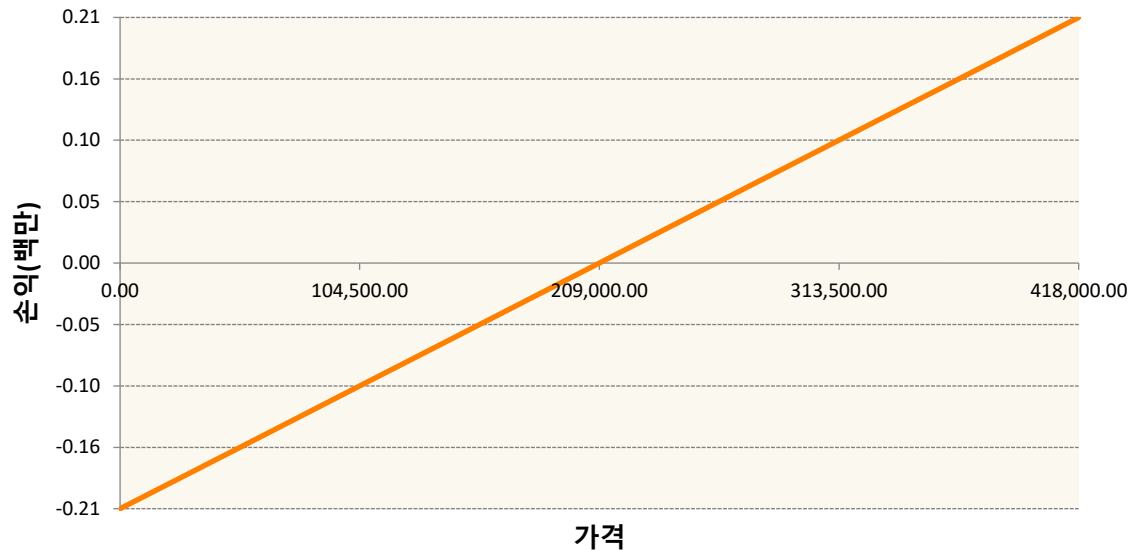
KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41GTW70006-2025-07 두산개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	623
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물	3
KR41B2W70(2025-07 S-Oil개별선물	3
KR41B9W70(2025-07 두산에너지빌리티개별선물	1
KR41CBW70(2025-07 한화솔루션개별선물	31
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	12
KR41D7W70 2025-07 한전KPS개별선물	0.04
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물	34
KR41EVW70(2025-07 한화시스템개별선물	2
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	105
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	12
KR41FWW70 2025-07 대한전선개별선물	0.05
KR41G0W70 2025-07 씨에스윈드개별선물	4
KR41GTW70(2025-07 두산개별선물	1
KR41HEW70(2025-07 키움증권개별선물	3

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

(단위:백만원)

1,401

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

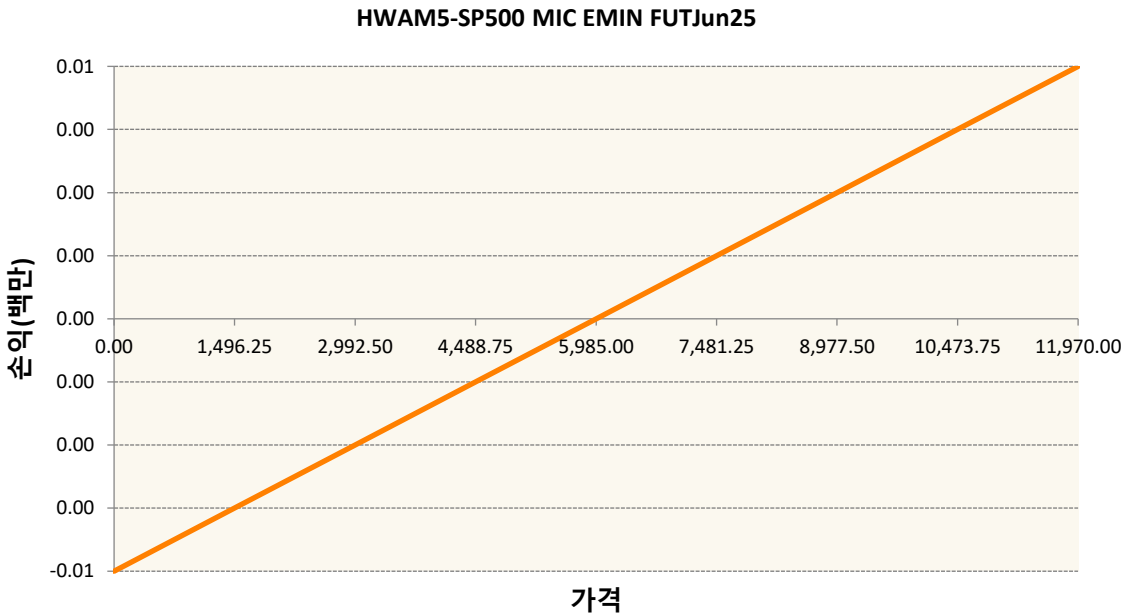
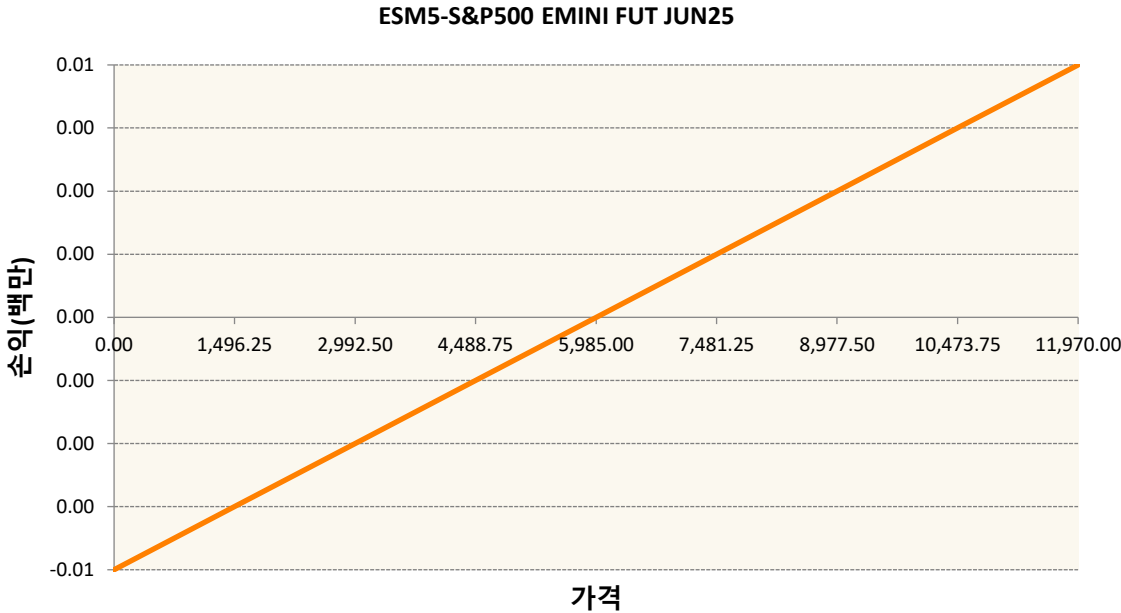
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,566	0	1,566	장내
누계	지수	선물	30,685	0	30,685	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM5	S&P500 EMINI FUT JUN25	2,455
HWAM5	SP500 MIC EMIN FUTJun25	125

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,286

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

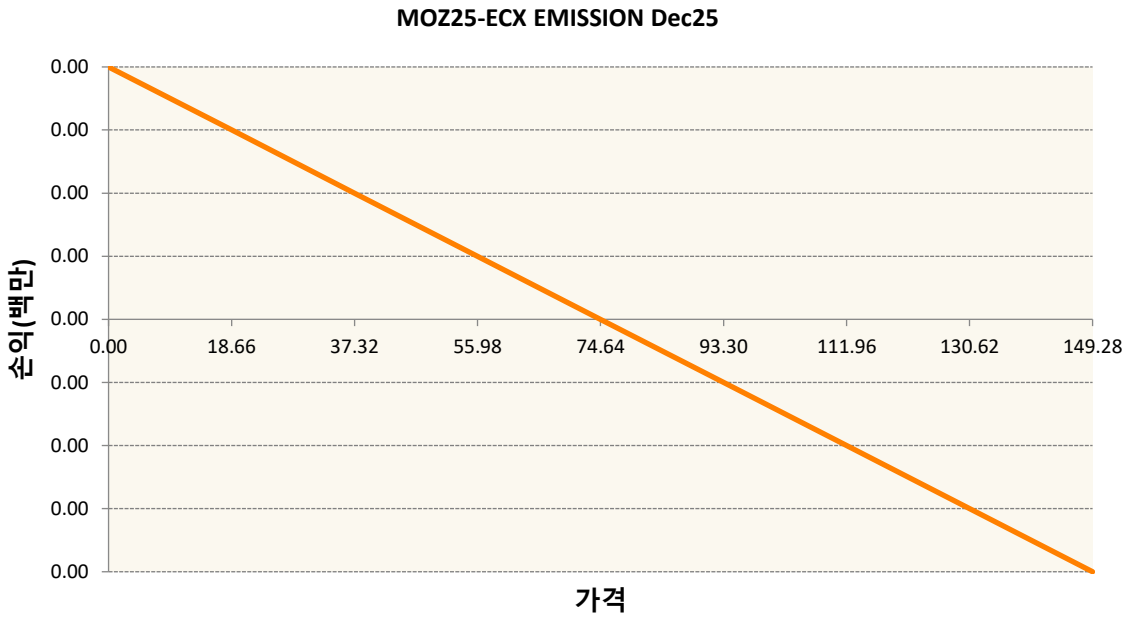
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	-19	4,149	-4,168	
누계	통화	선도	0	956	-956	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	76
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	332

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

(단위:백만원)

612

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

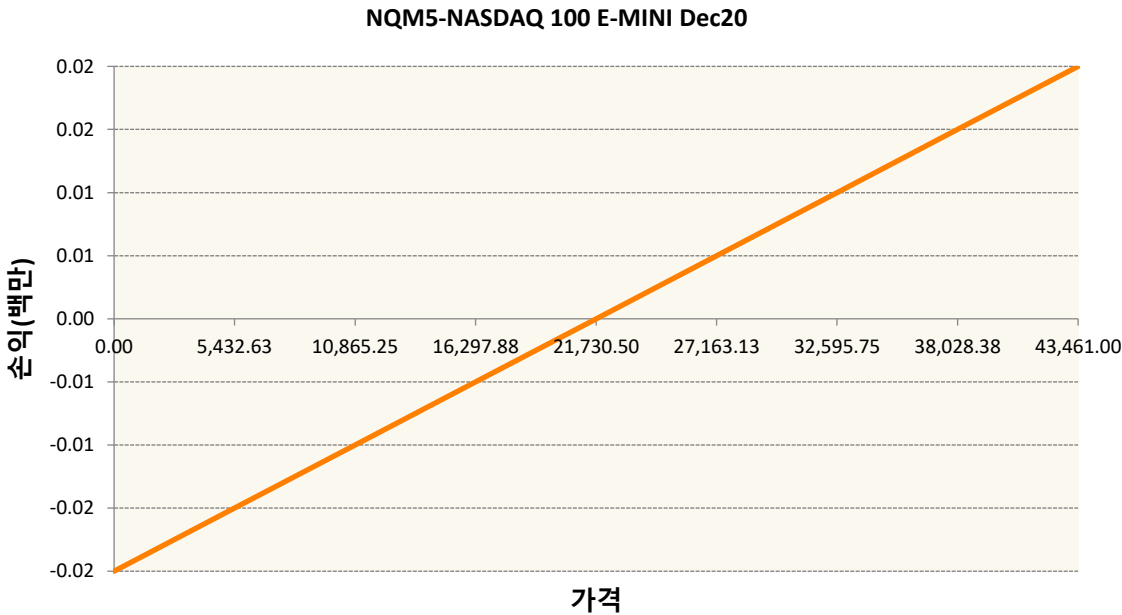
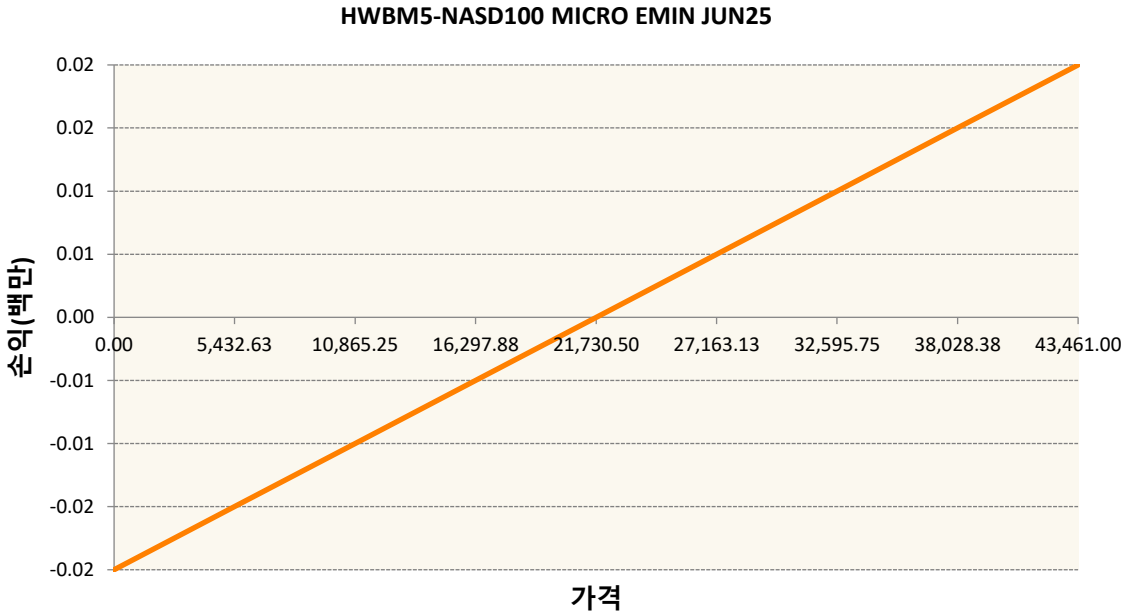
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,818	0	13,818	
누계	유가증권	선물	119	0	119	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM5	NASD100 MICRO EMIN JUN25		10
NQM5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,105

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,280

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

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	257,745	0	257,745	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,996
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,477
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,110
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,055
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	160

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

(단위:백만원)

11,031

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

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)

87

공시일	2025-06-19
기준일	2025-06-18

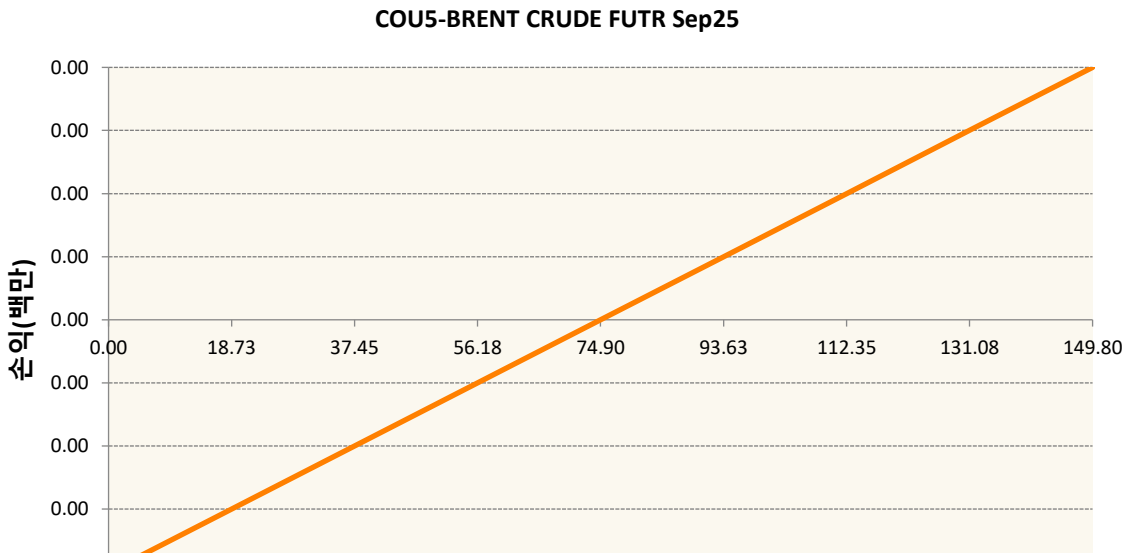
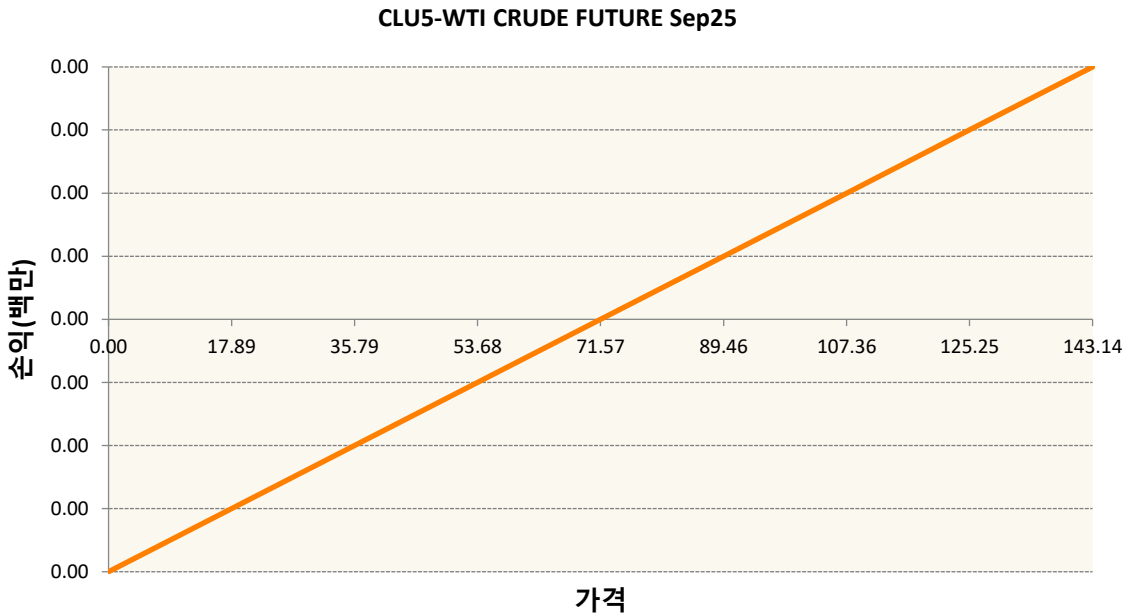
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

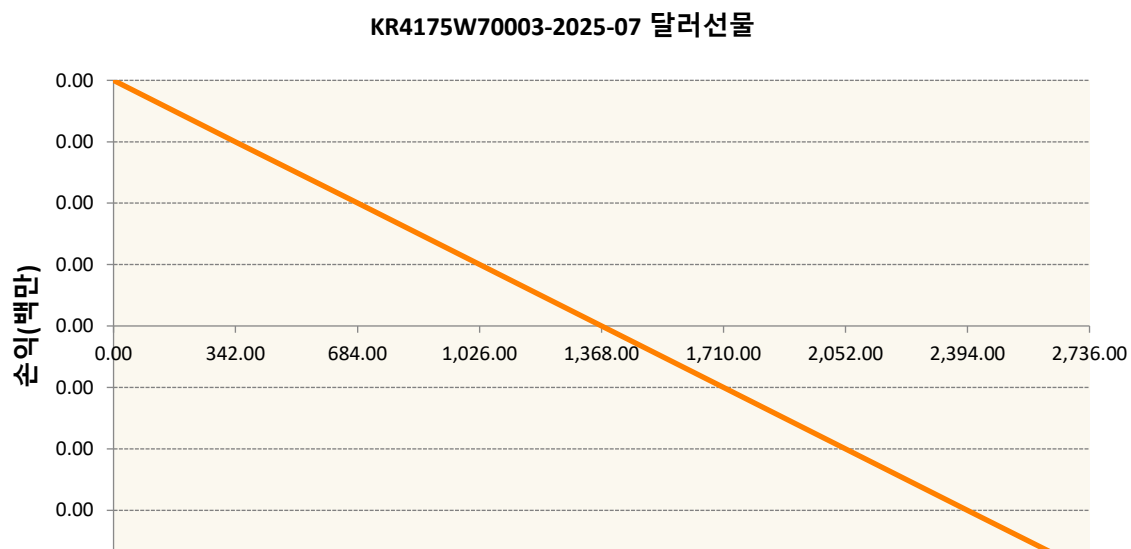
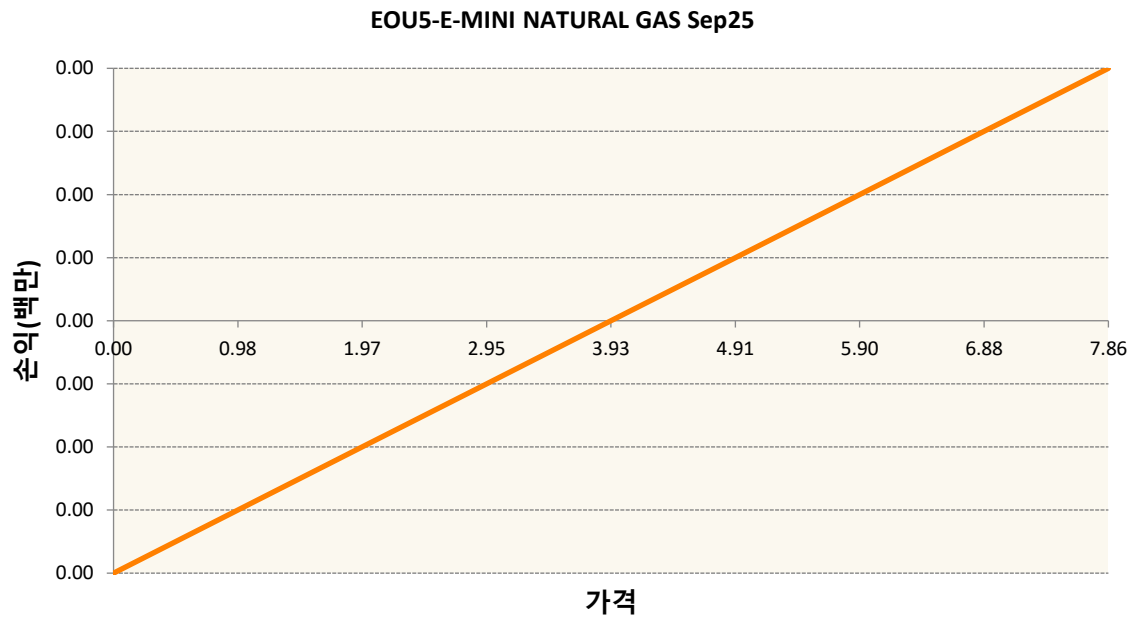
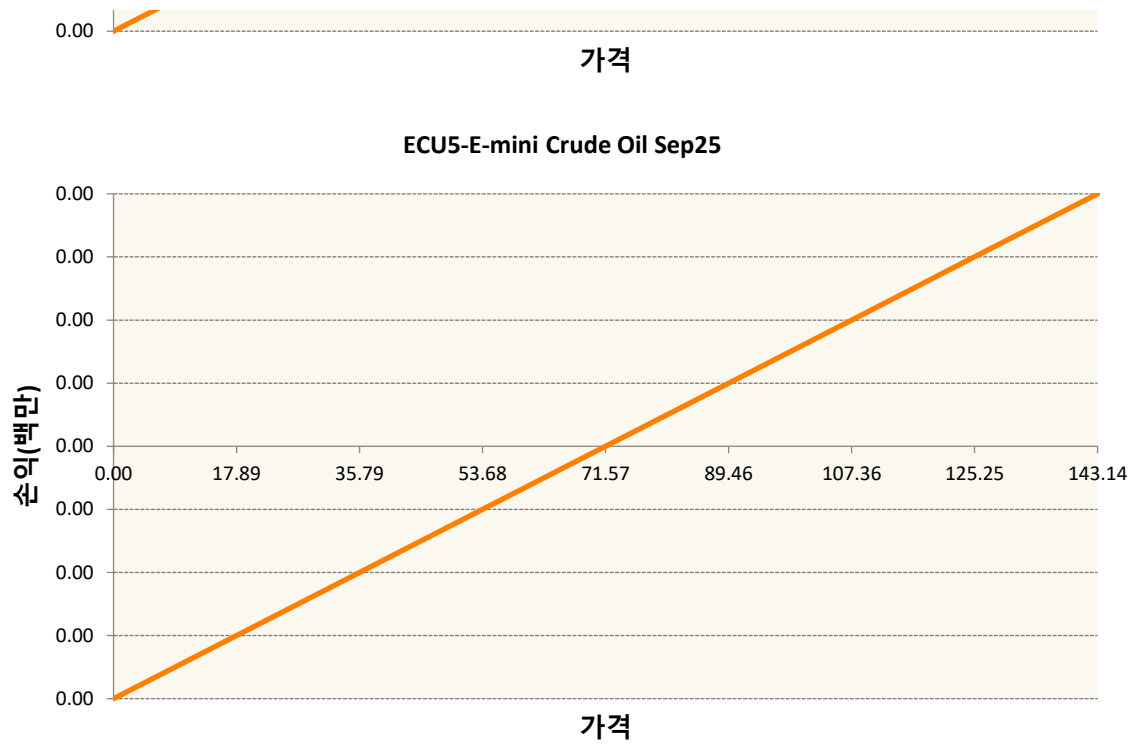
1. 계약금액

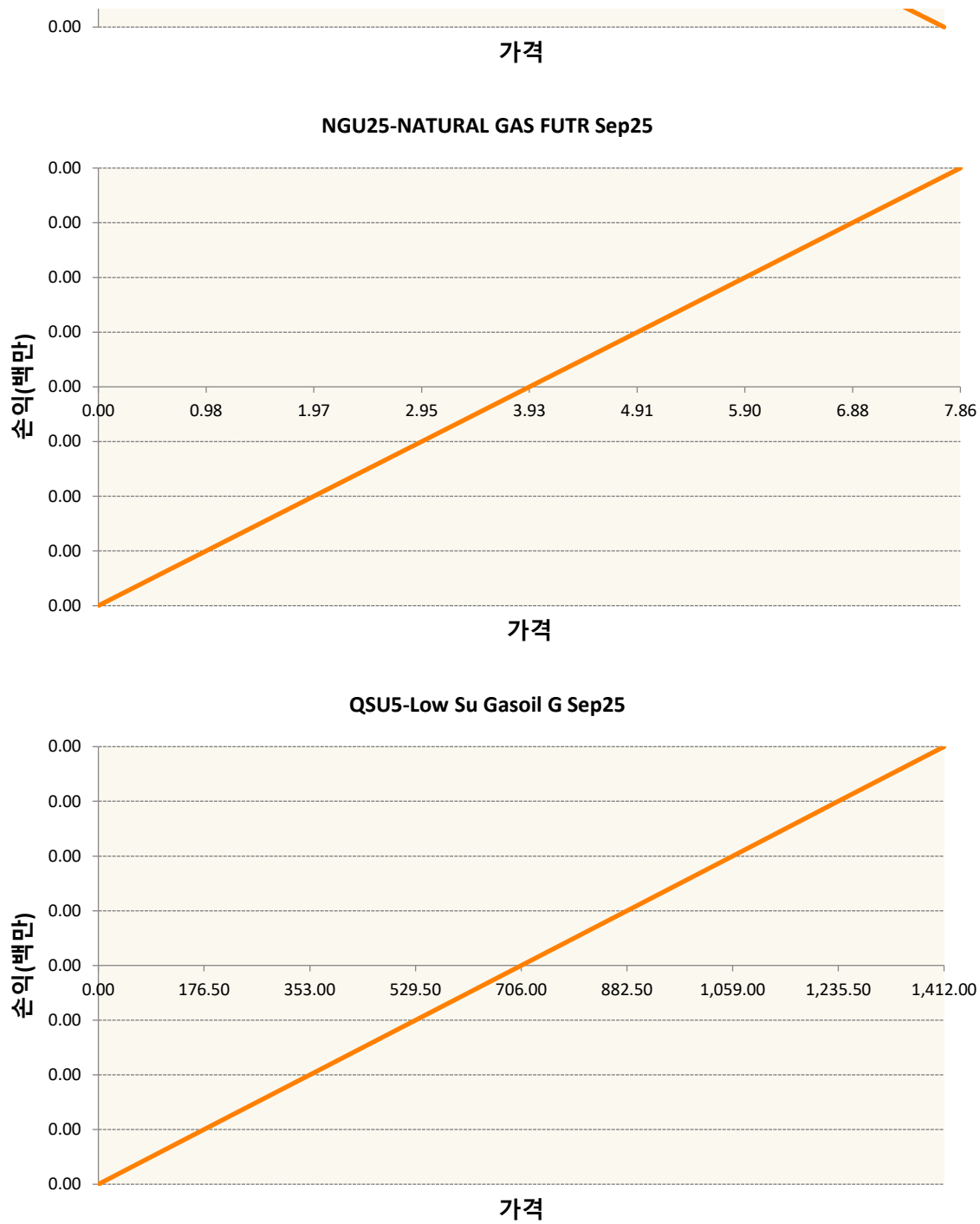
(단위:백만원)

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	27	-27	장내
누계	실물자산	선물	417	0	417	
누계	유가증권	선물	309	0	309	
누계	통화	선물	0	150	-150	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU5	WTI CRUDE FUTURE Sep25	8
COU5	BRENT CRUDE FUTR Sep25	17
ECU5	E-mini Crude Oil Sep25	4
EOU5	E-MINI NATURAL GAS Sep25	9
KR4175W70(2025-07 달러선물		12
NGU25	NATURAL GAS FUTR Sep25	13
QSU5	Low Su Gasoil G Sep25	8

