

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

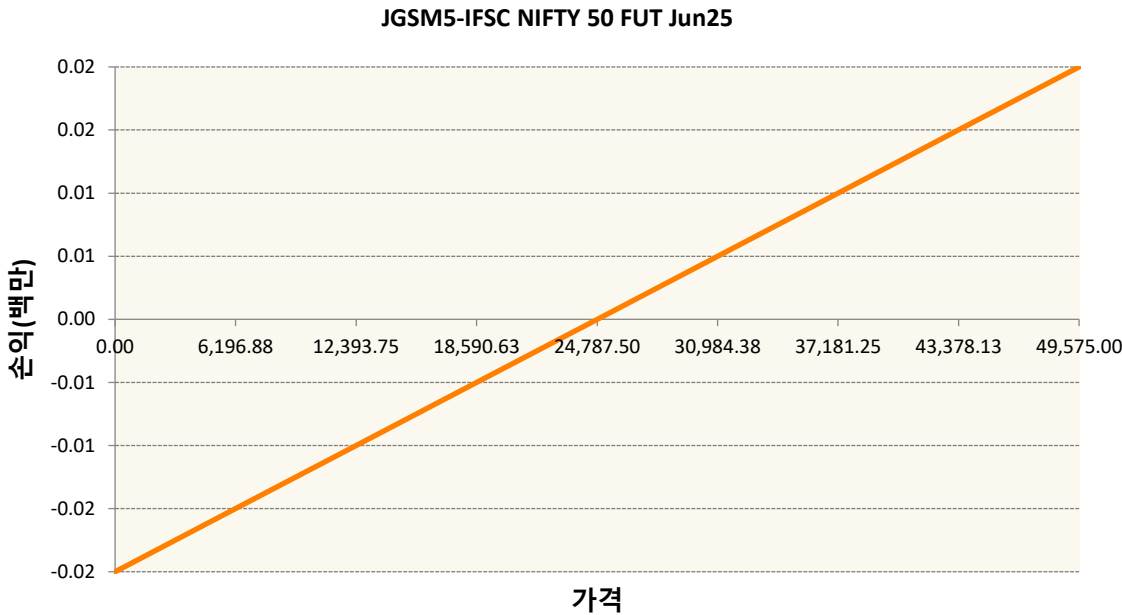
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	609	0	609	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSM5	IFSC NIFTY 50 FUT Jun25	49
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

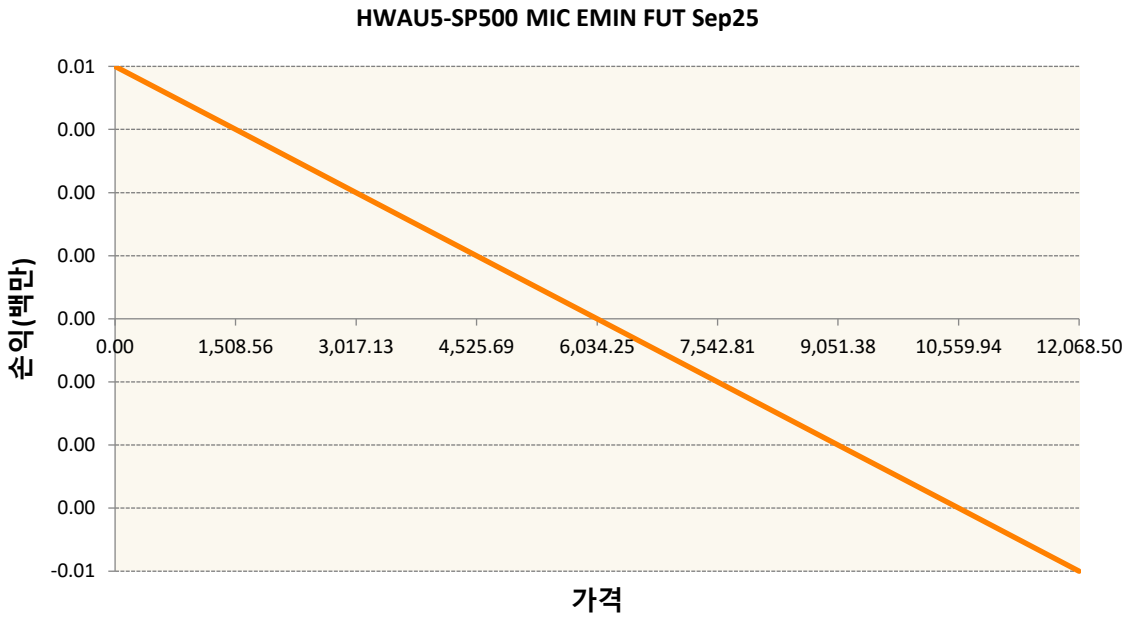
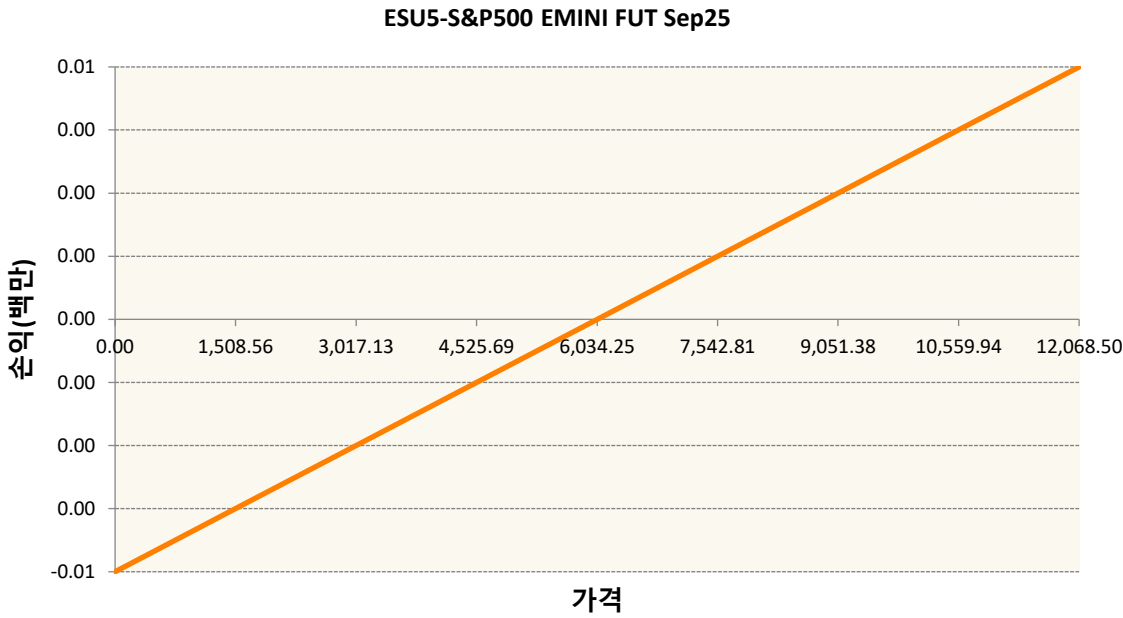
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	416	0	416	
누계	지수	선물	0	125	-125	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	33
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	38

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

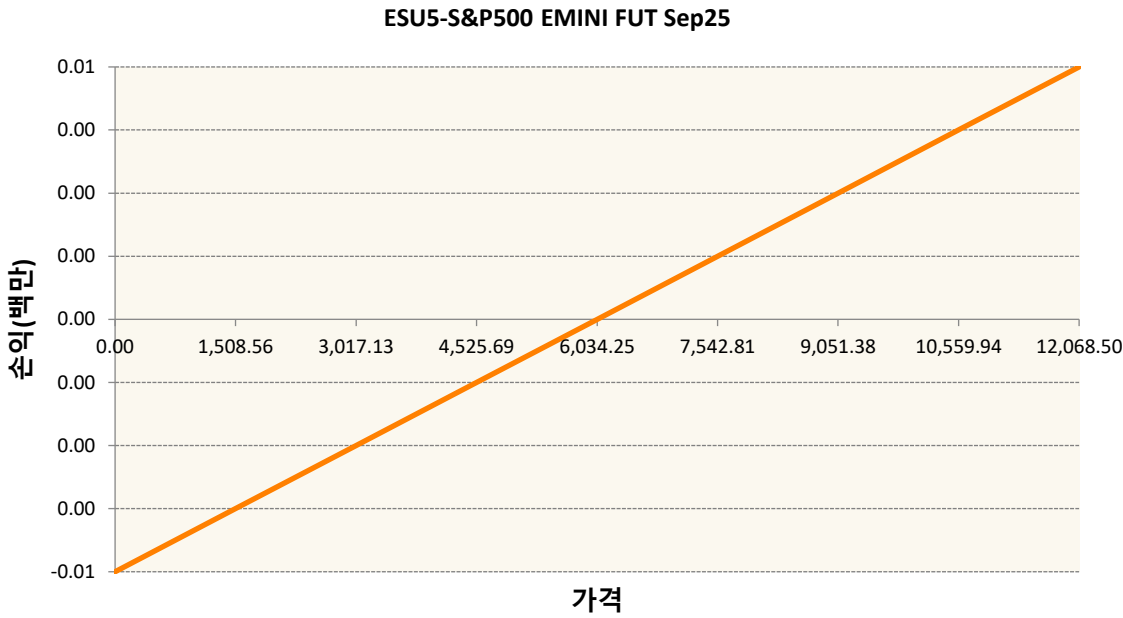
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,249	0	1,249	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	100
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

89

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

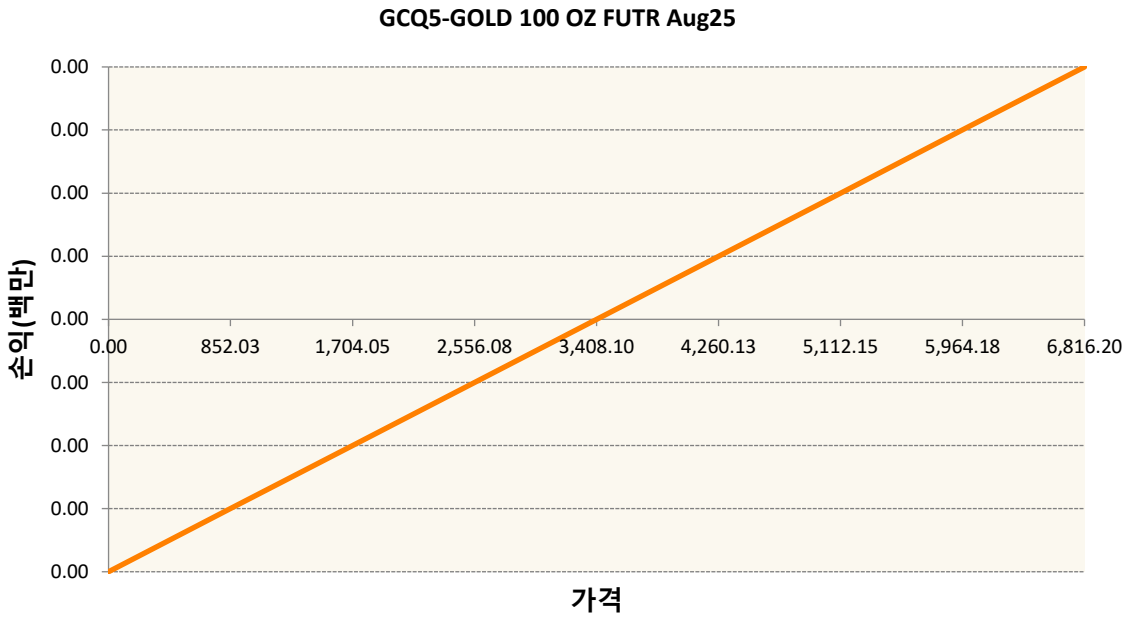
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,344	0	2,344	
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)

218

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

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	11
AOPLTRUSP1 PLTR US 06/20/25 P137 EQUITY	3

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

(단위:백만원)

57

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

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

0.47

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

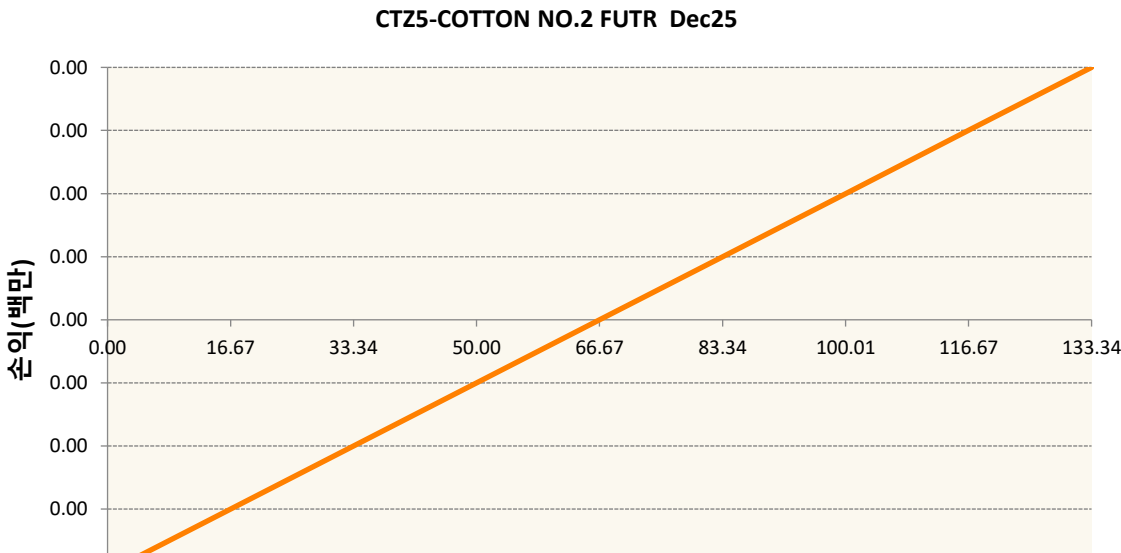
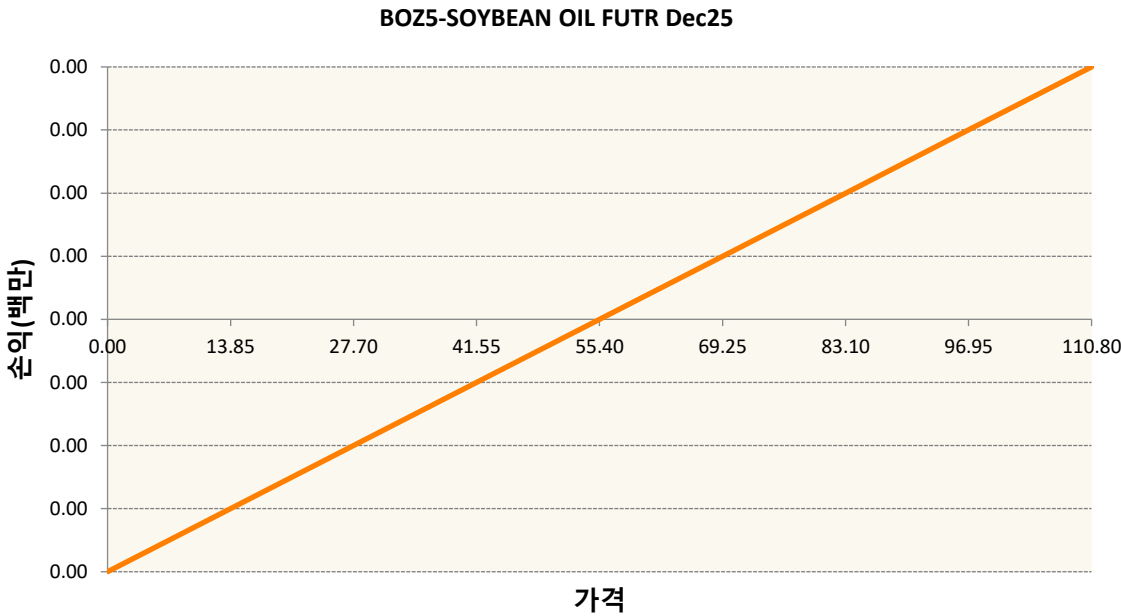
포커스농산물모(채권-파생형)

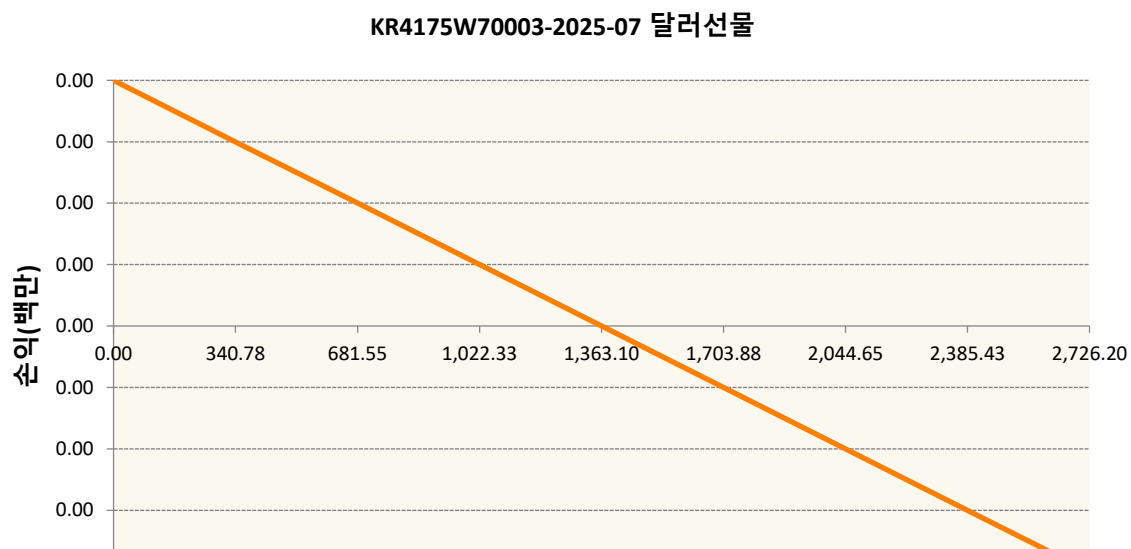
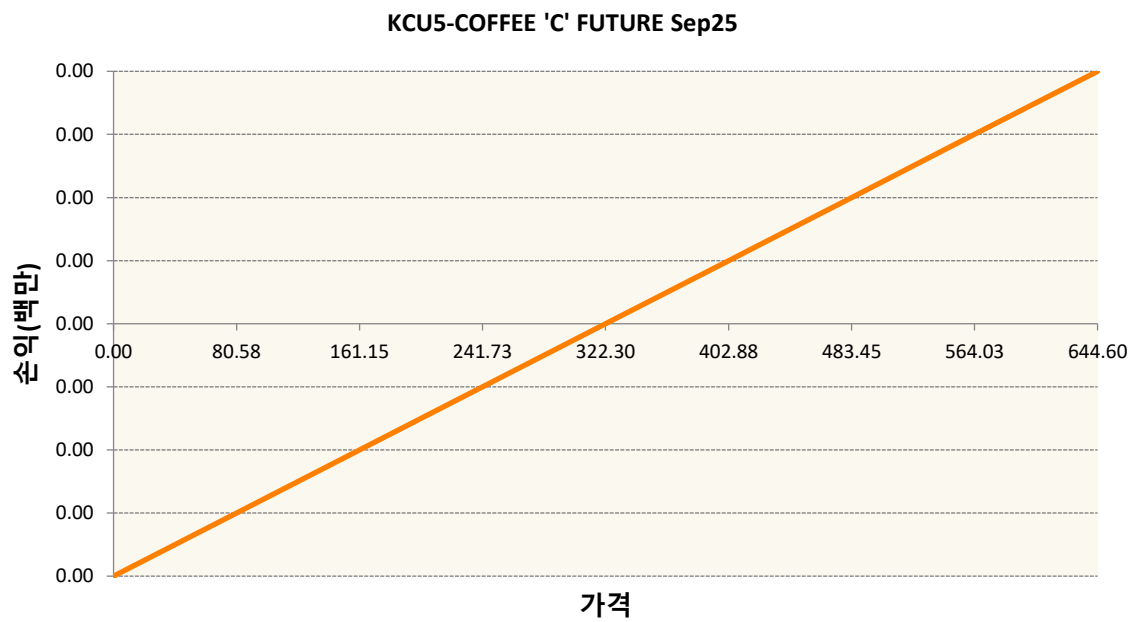
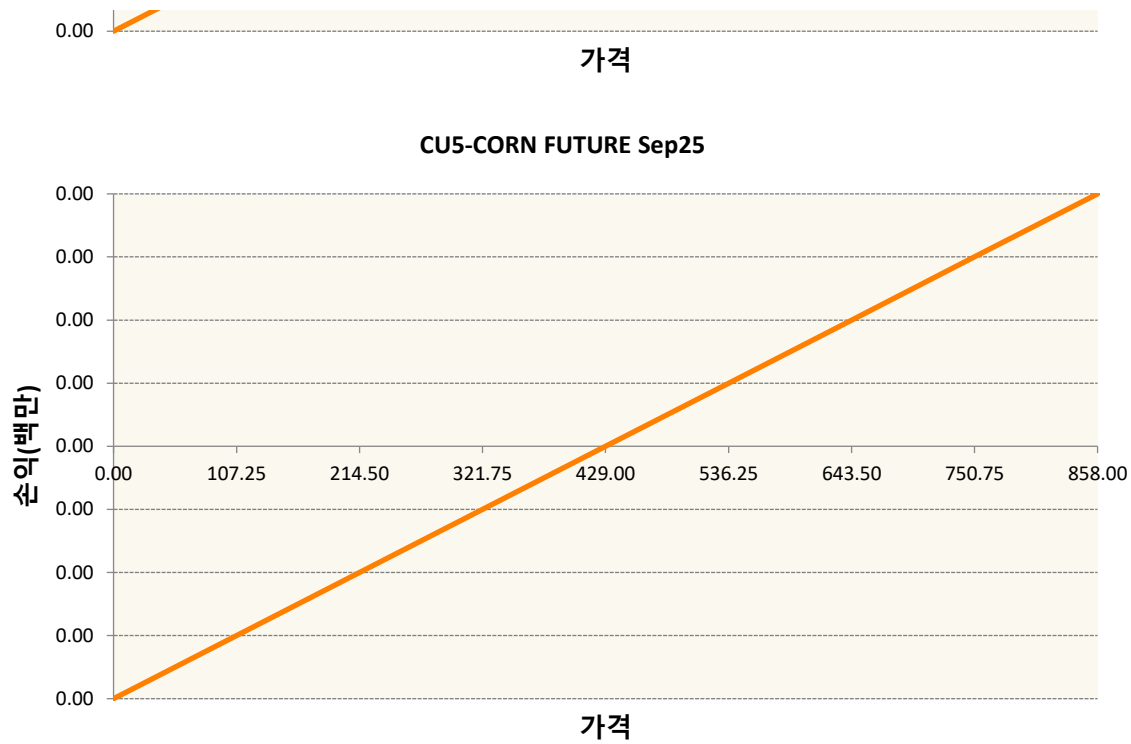
1. 계약금액

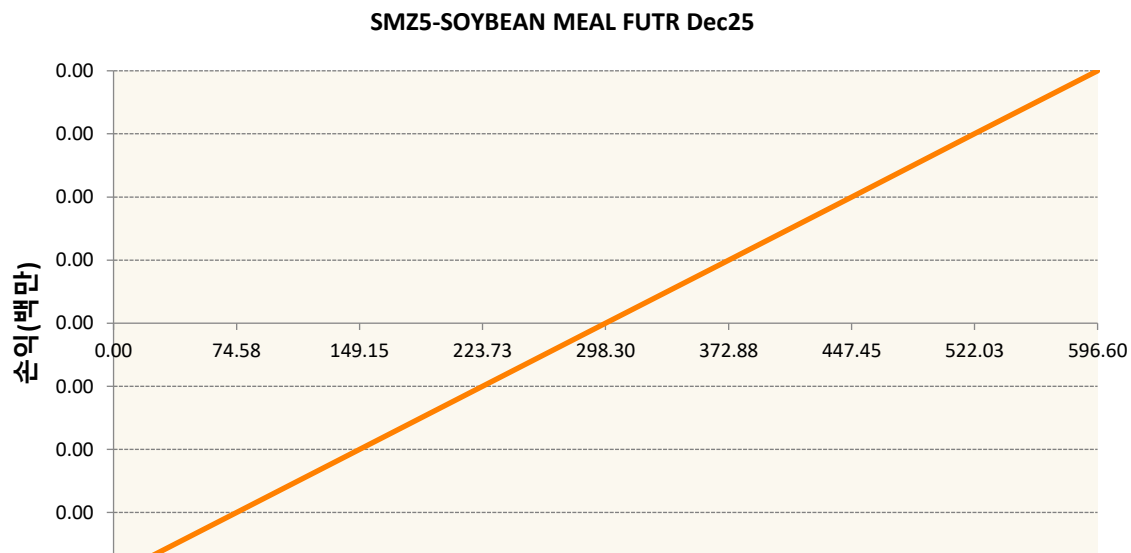
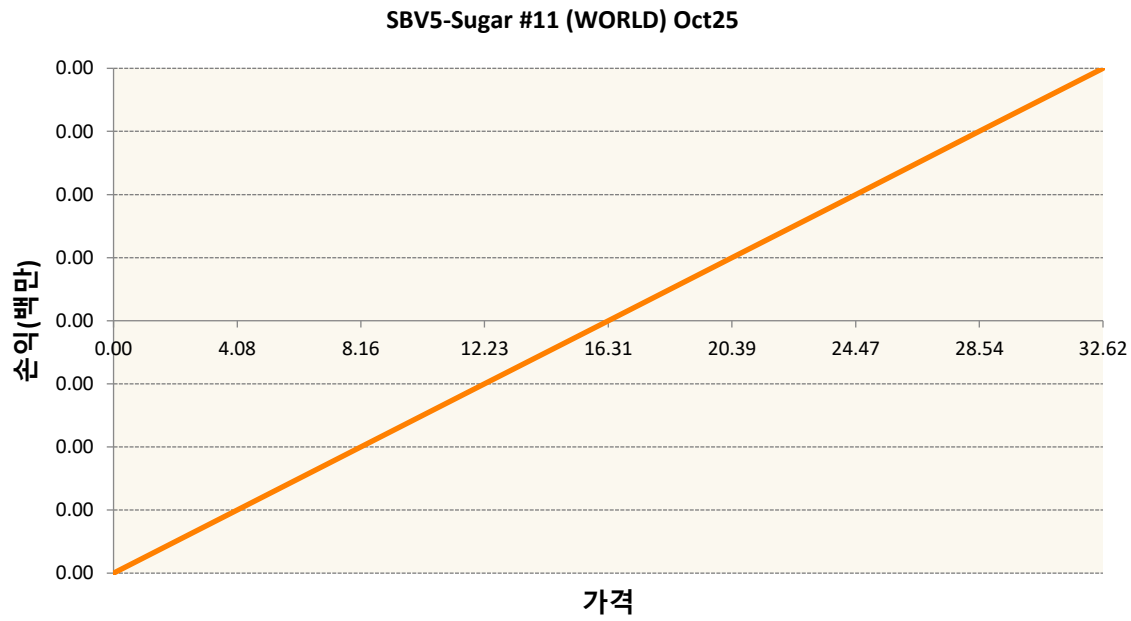
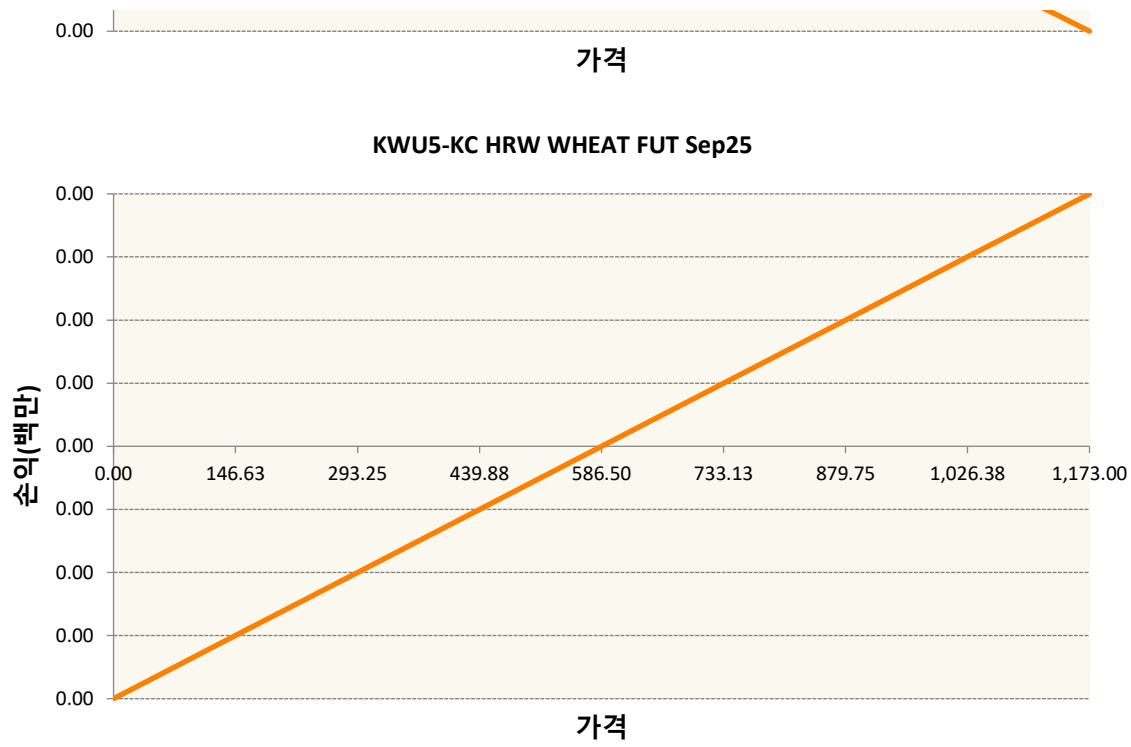
(단위:USD 백만)

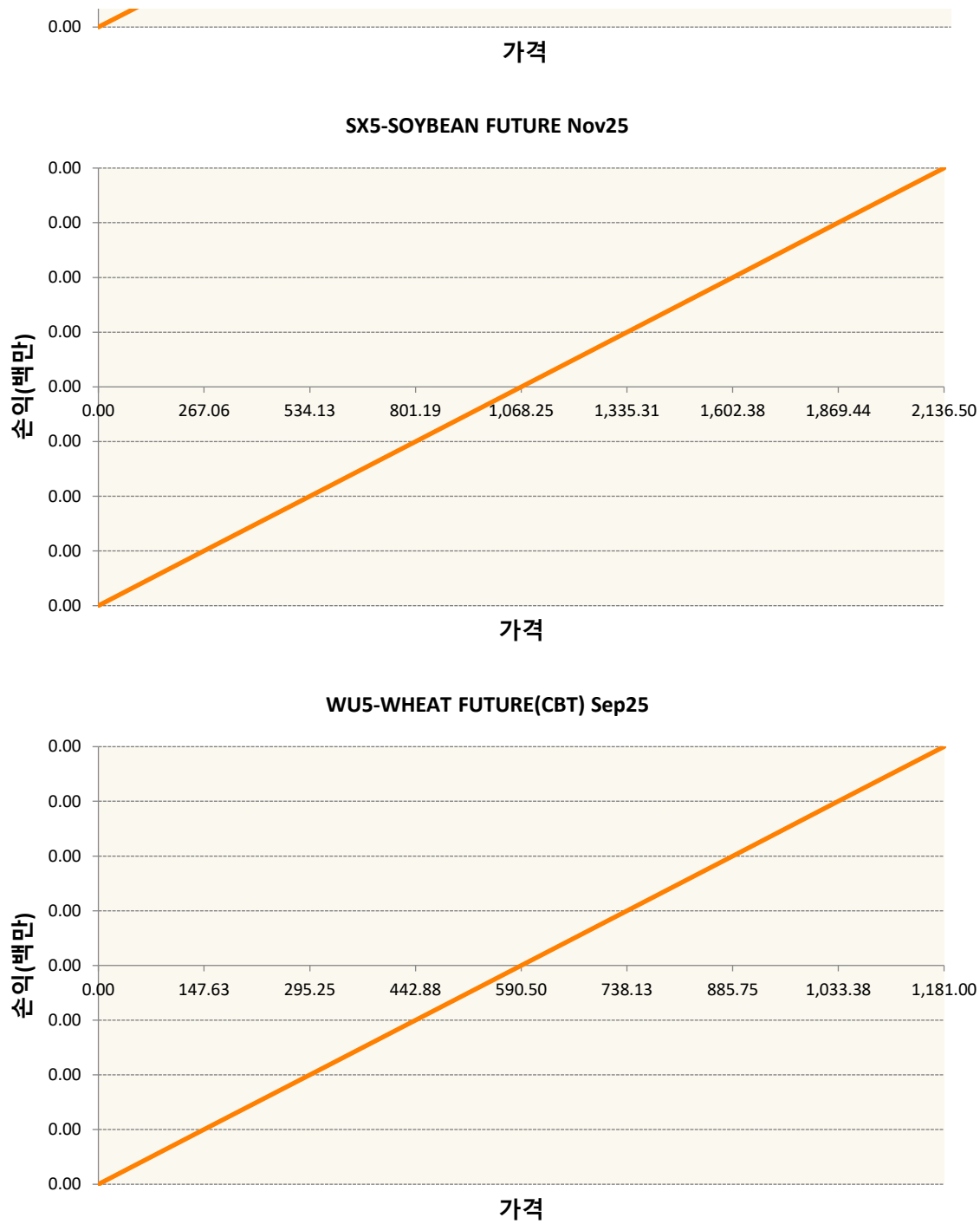
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,647	0	1,647	
누계	유가증권	선물	2,104	0	2,104	
누계	통화	선물	0	259	-259	장내

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	2025-06-23
기준일	2025-06-20

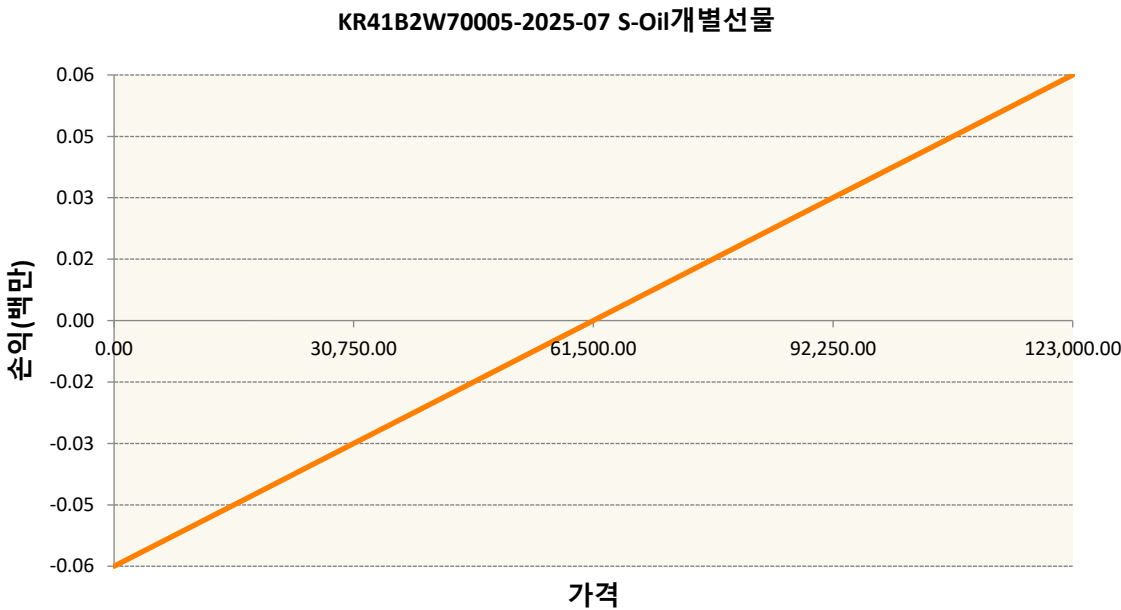
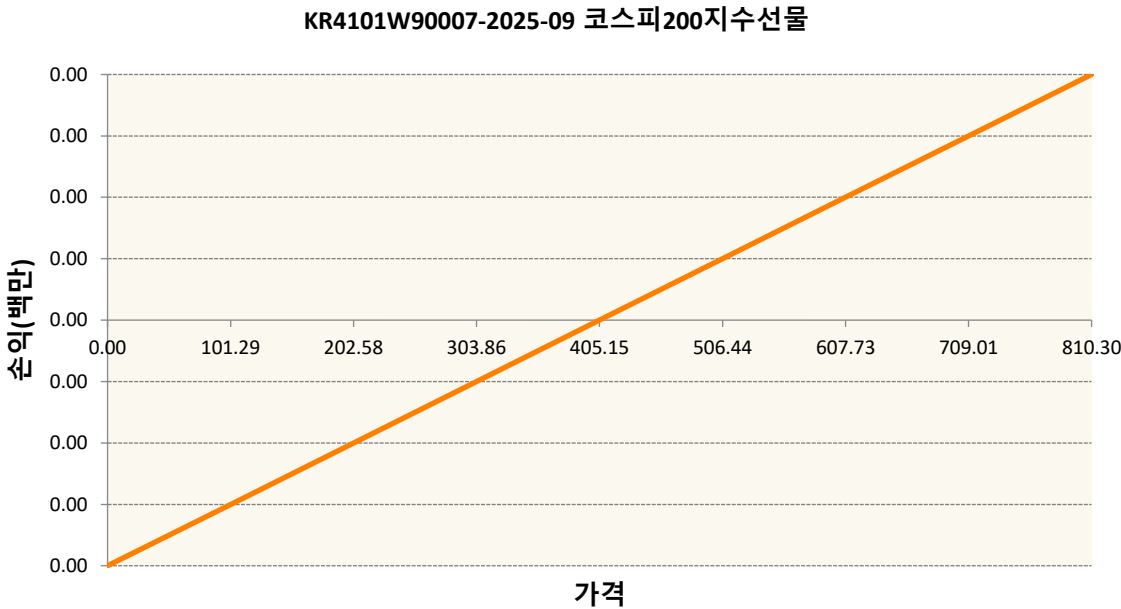
스마트인덱스모

1. 계약금액

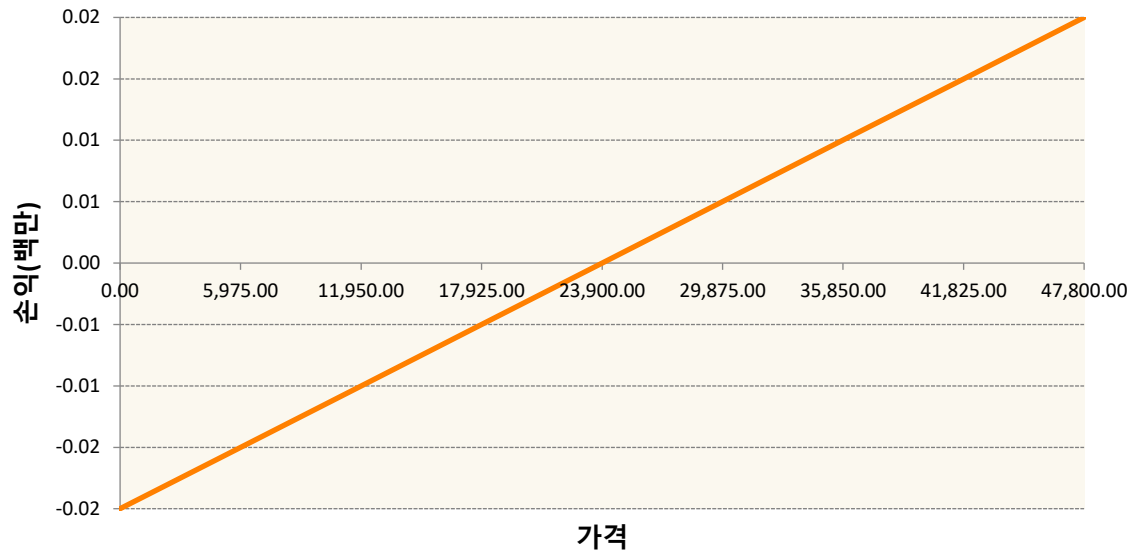
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	845	0	845	장내
누계	유가증권	선물	1,626	0	1,626	장내

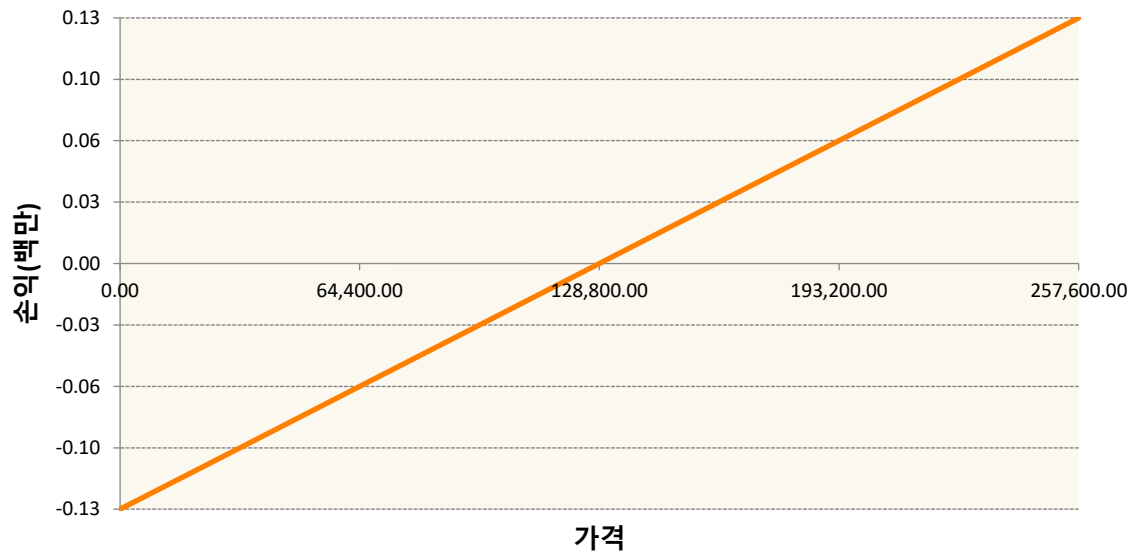
2. 만기시점의 손익구조



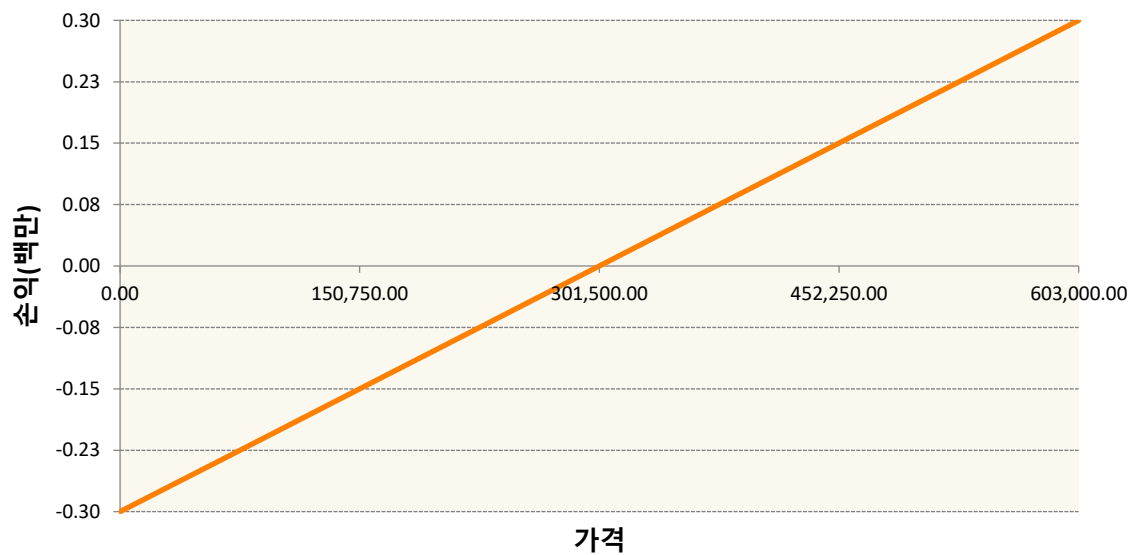
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



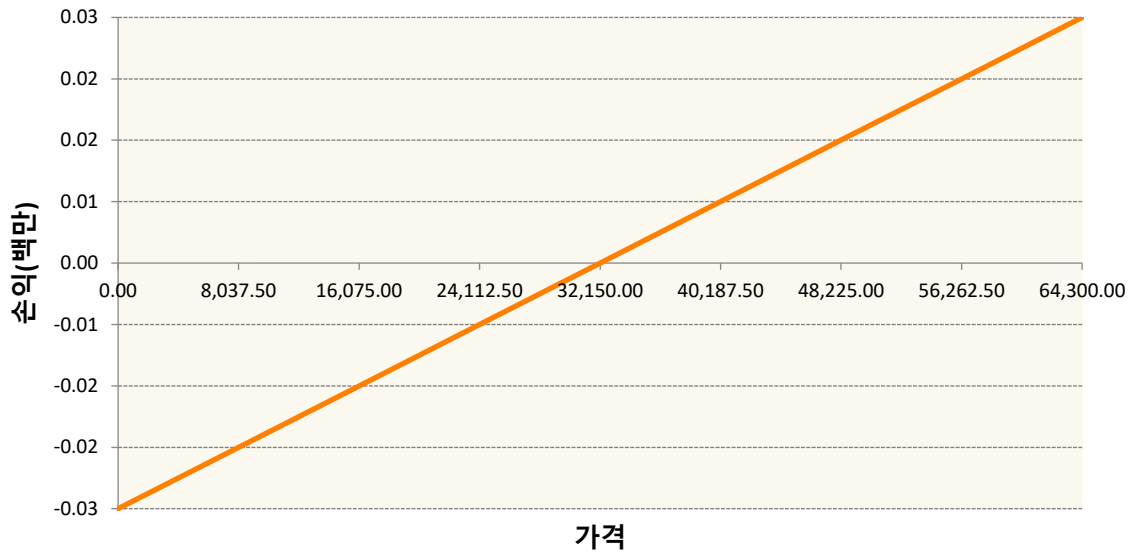
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



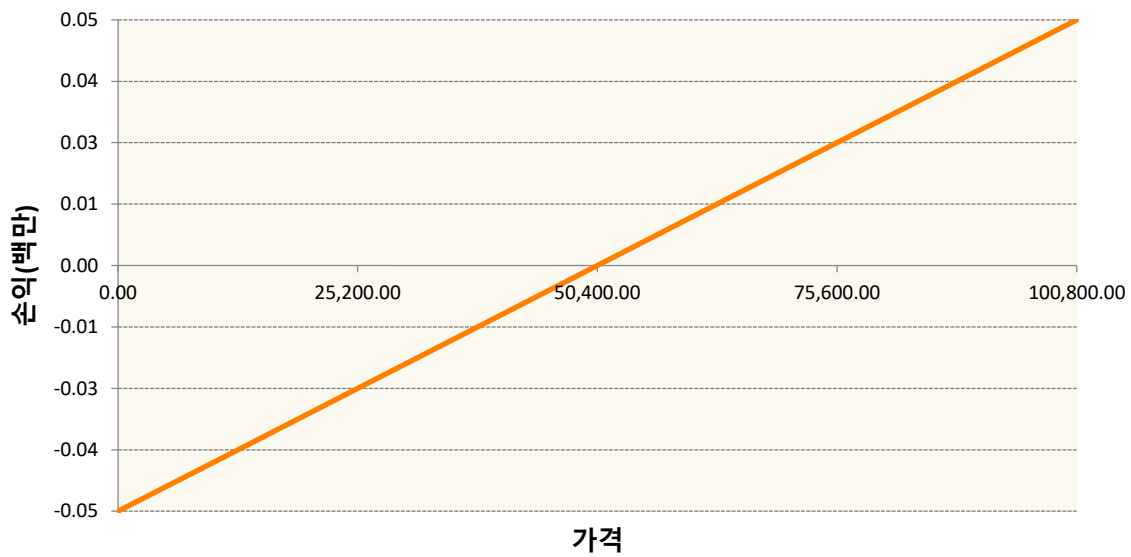
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



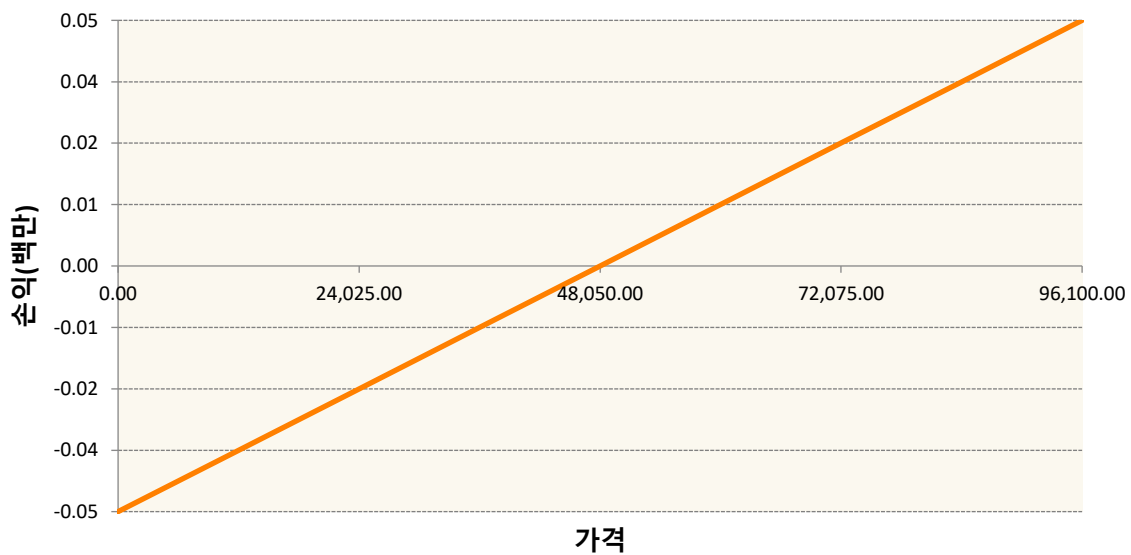
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	97
KR41B2W70(2025-07 S-Oil개별선물	1
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	1
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	13
KR41F6W70(2025-07 카카오뱅크개별선물	12
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	1
KR41G0W70 2025-07 씨에스윈드개별선물	0.27

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

208

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	3,720	3,904	-184	장외
누계	지수	스왑	3,720	0	3,720	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래250320

294

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

473

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

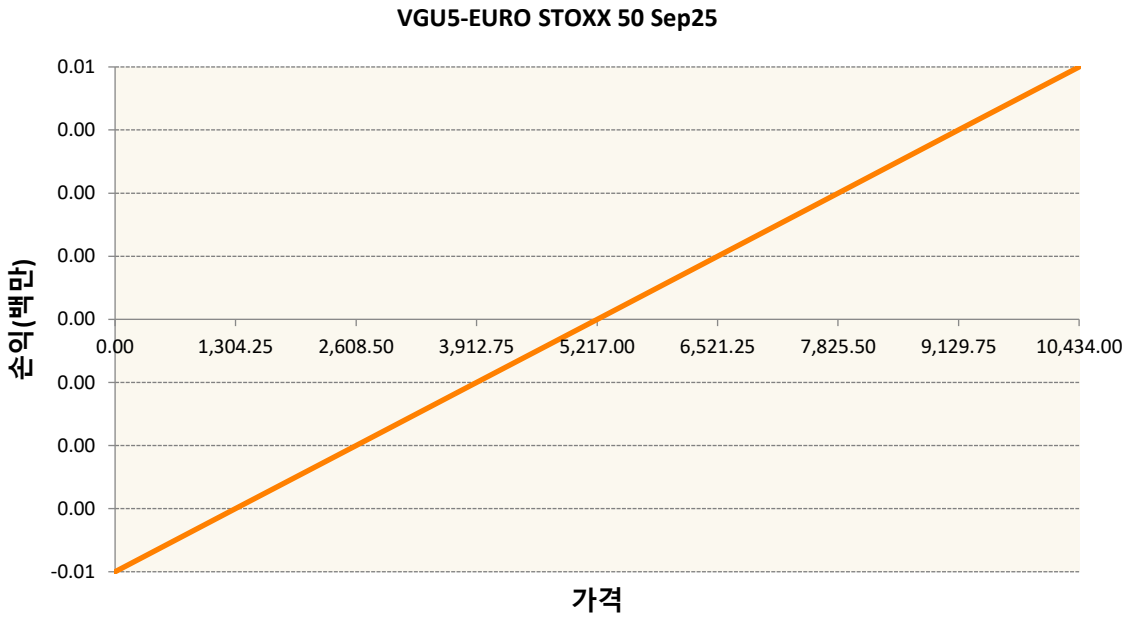
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	990	0	990	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU5	EURO STOXX 50 Sep25	79
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

66

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

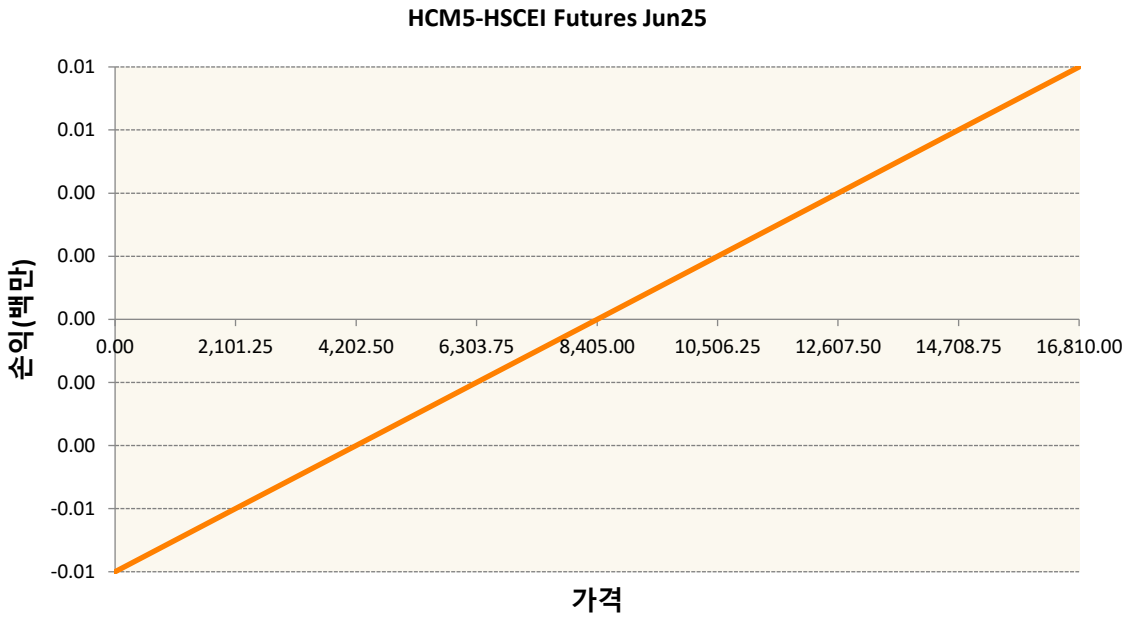
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,140	0	2,140	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM5	HSCEI Futures Jun25	171
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

250

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

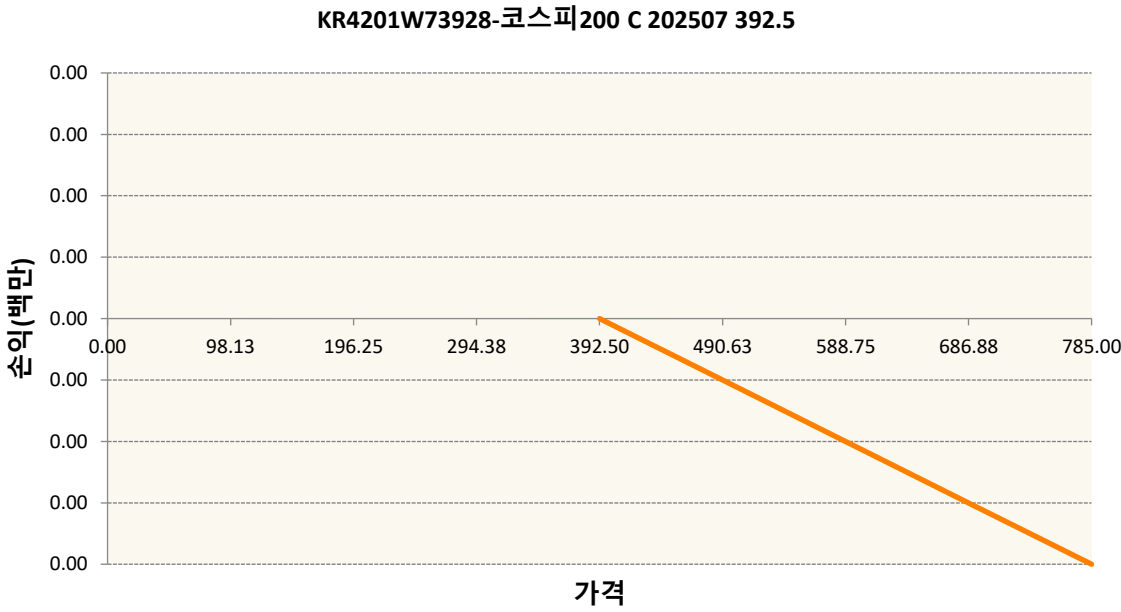
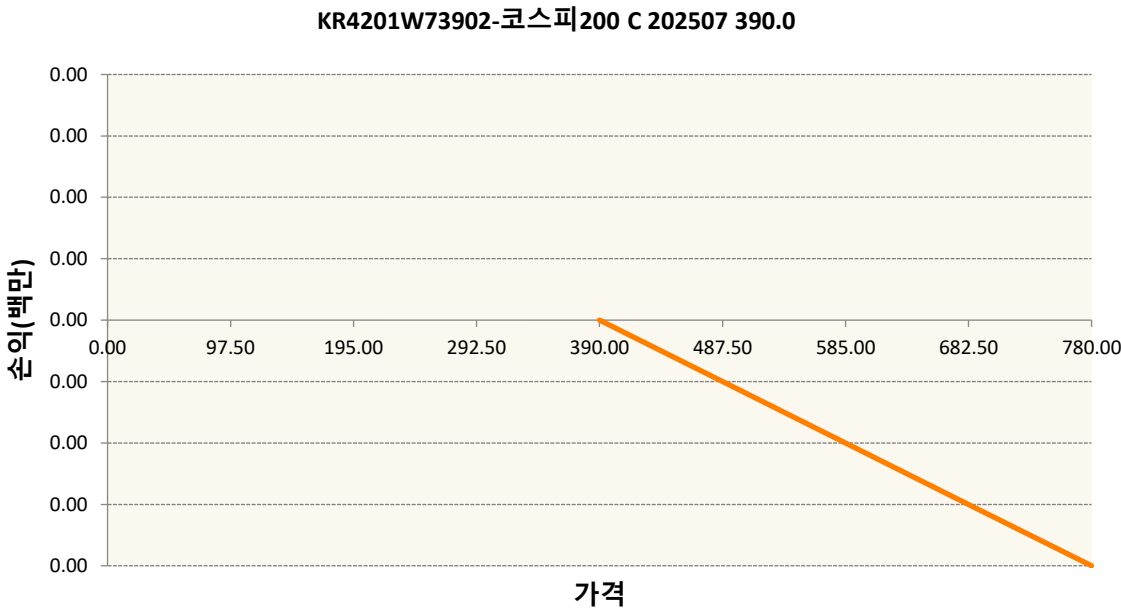
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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 displays a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 780.00 with major ticks every 97.50 units. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A single orange line is plotted, starting at the origin (0, 0) and ending at (390, 0). This indicates that the profit is zero for all prices in the range from 0 to 390.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
97.50	0.00
195.00	0.00
292.50	0.00
390.00	0.00

(단위:백만원)

KR4201W73902코스피200 C 202507 390.0						1,726	
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	978	958	936	912	887	860	831
-5.33%	840	806	771	736	700	664	628
-2.67%	540	504	468	431	394	357	320
0%	78	54	28	0	-29	-60	-91
2.67%	-486	-496	-510	-525	-544	-564	-586
5.33%	-1,091	-1,094	-1,099	-1,106	-1,115	-1,126	-1,139
8.00%	-1,707	-1,707	-1,709	-1,711	-1,715	-1,720	-1,726
KR4201W73928코스피200 C 202507 392.5						563	
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	294	288	282	275	267	259	251
-5.33%	257	247	236	225	213	202	190
-2.67%	171	159	146	134	121	109	96
0%	29	20	10	0	-11	-21	-33
2.67%	-152	-156	-162	-168	-175	-183	-191
5.33%	-351	-352	-354	-357	-361	-365	-370
8.00%	-555	-555	-556	-557	-558	-560	-563
KR4301W73900 코스피200 P 202507 390.0							214

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-184	-188	-192	-197	-203	-209	-214
-5.33%	-83	-90	-98	-105	-112	-120	-127
-2.67%	-16	-24	-32	-39	-47	-55	-63
0%	16	11	6	0	-6	-13	-19
2.67%	28	26	23	19	16	11	7
5.33%	30	30	29	27	25	23	20
8.00%	31	31	31	30	29	28	27

KR4301W73926 코스피200 P 202507 392.5							77
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-69	-70	-72	-73	-75	-77
-5.33%	-32	-34	-37	-39	-41	-44	-46
-2.67%	-7	-10	-12	-15	-18	-20	-23
0%	6	4	2	0	-2	-5	-7
2.67%	11	10	9	8	6	5	3
5.33%	13	12	12	11	10	9	8
8.00%	13	13	13	12	12	12	11

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

(단위:백만원)

2,705

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

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	2025-06-23
기준일	2025-06-20

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	4,282	0	4,282	

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	2025-06-23
기준일	2025-06-20

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	12,513	0	12,513	
누계	통화	선도	0	11,881	-11,881	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
FXW213F6D(KRW/USD 30-06-25E		9
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	466

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

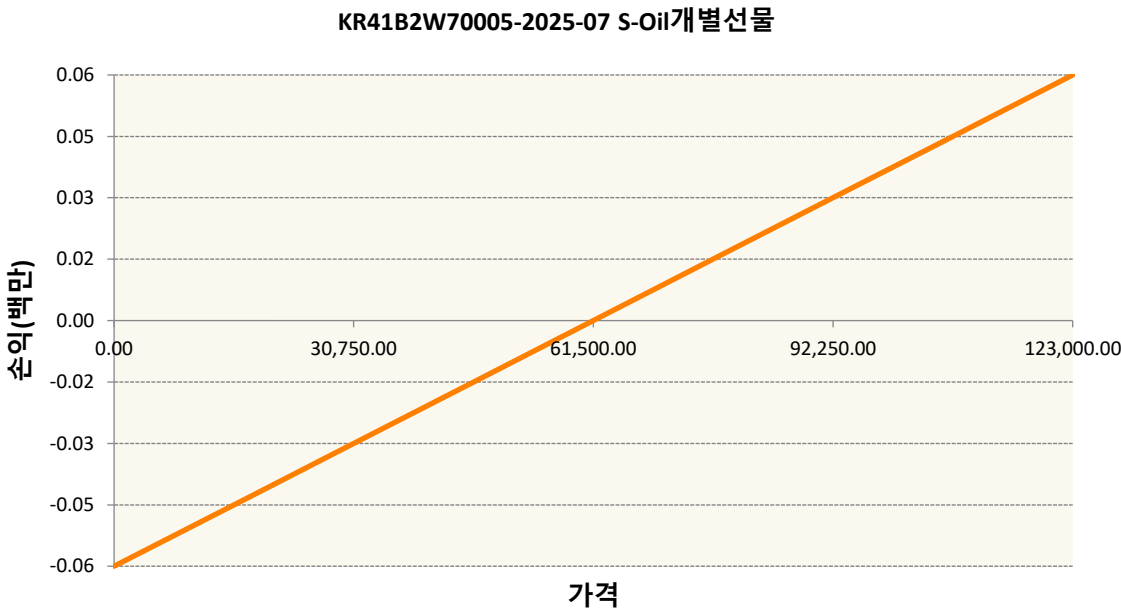
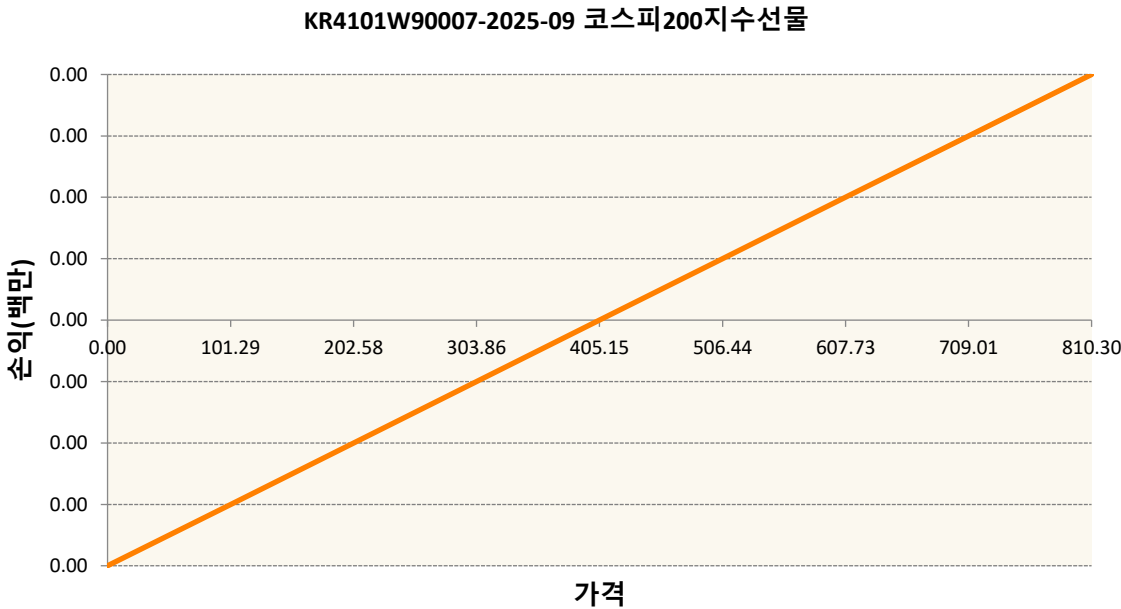
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

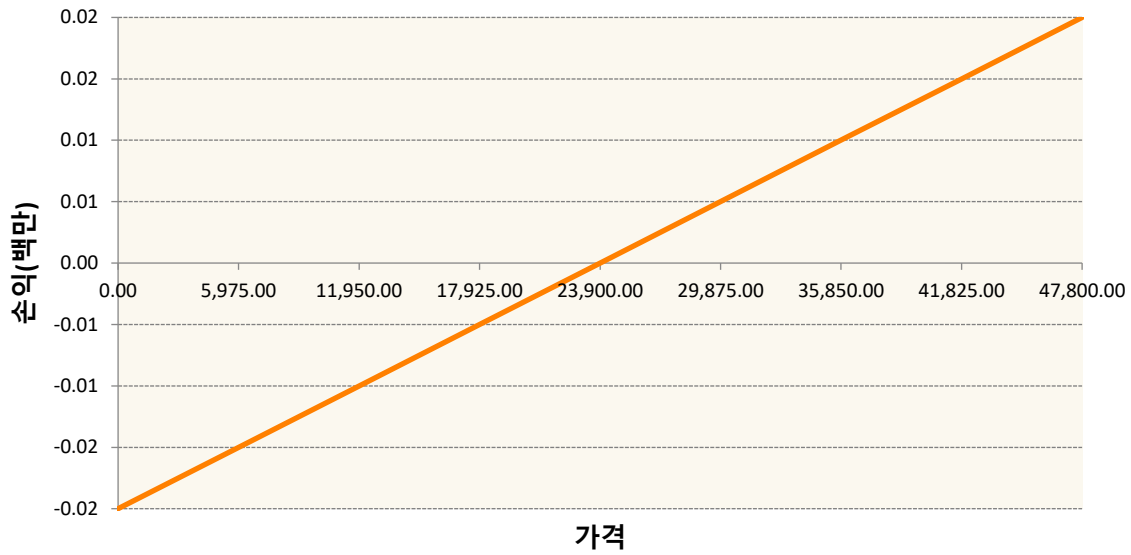
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	161	0	161	장내
누계	유가증권	선물	721	0	721	장내

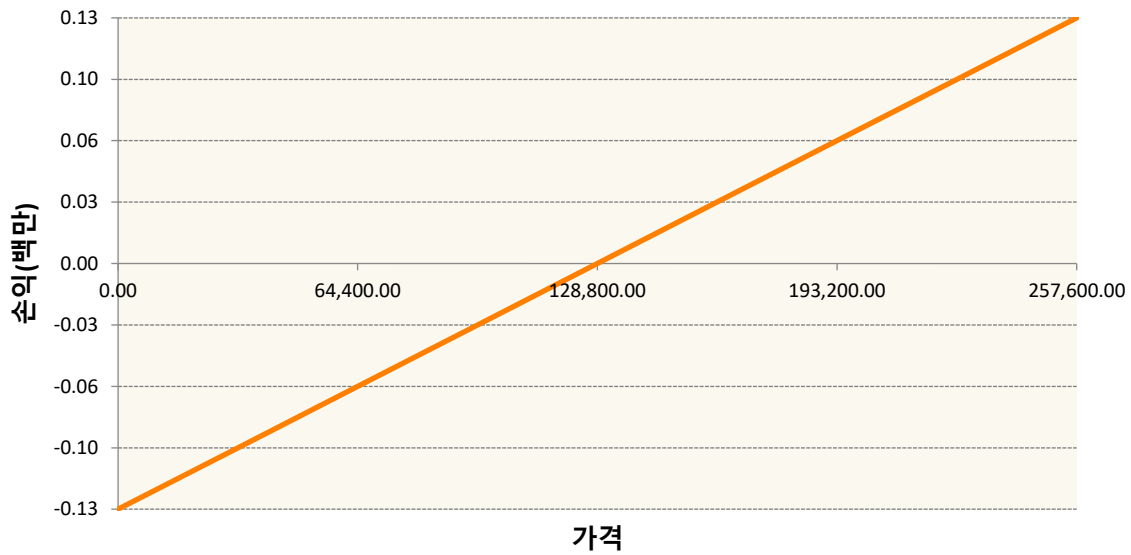
2. 만기시점의 손익구조



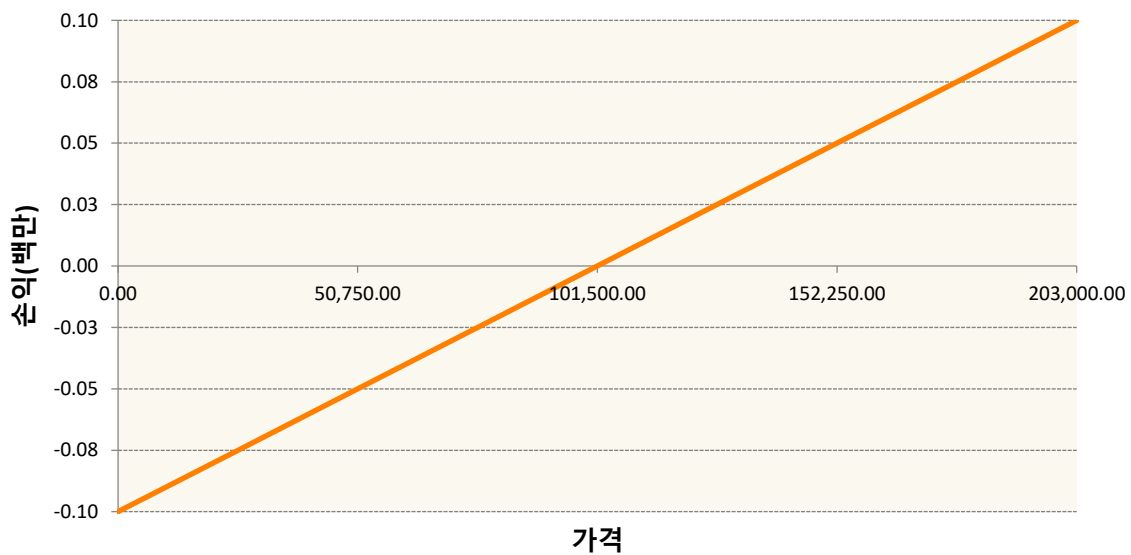
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



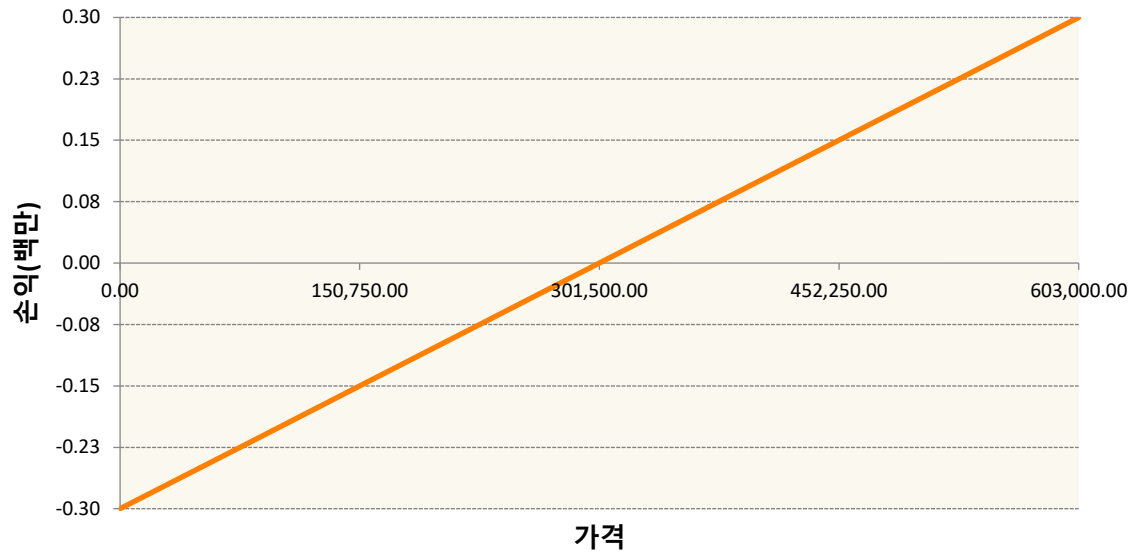
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



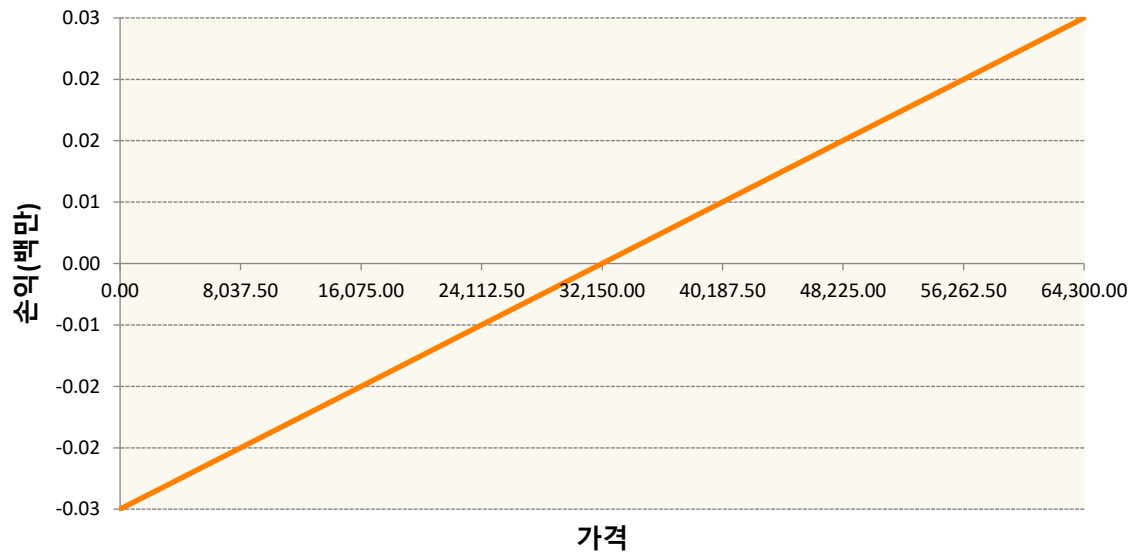
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



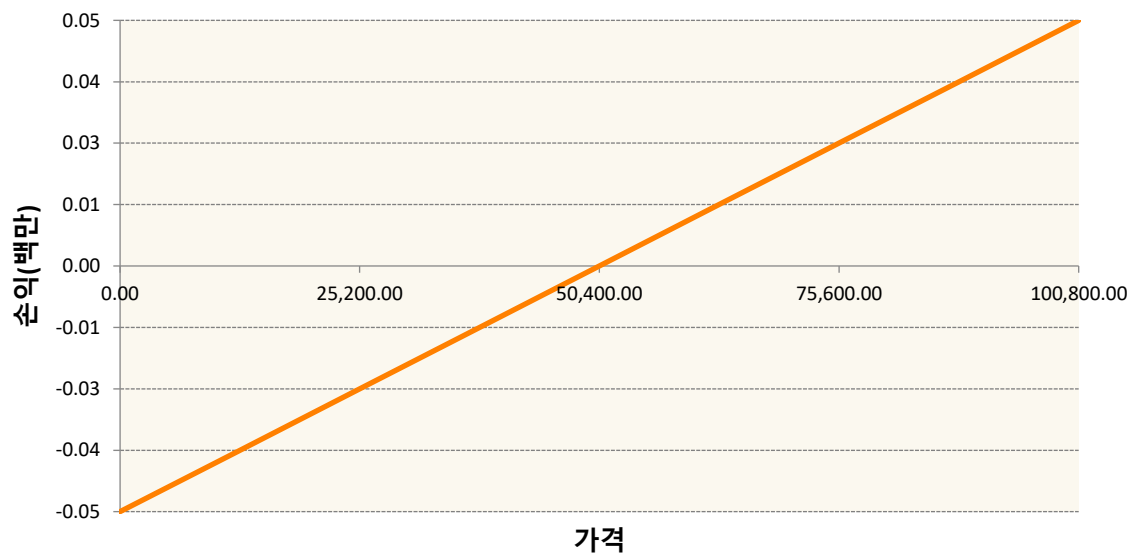
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	41
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
KR41F6W70(2025-07 카카오뱅크개별선물	5
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	1

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

97

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

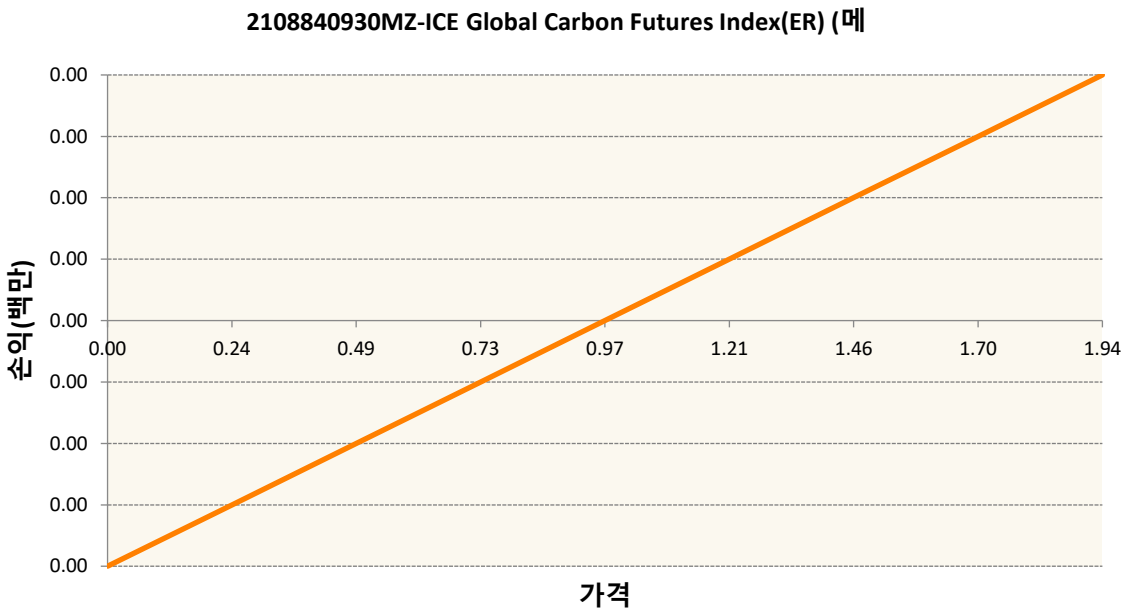
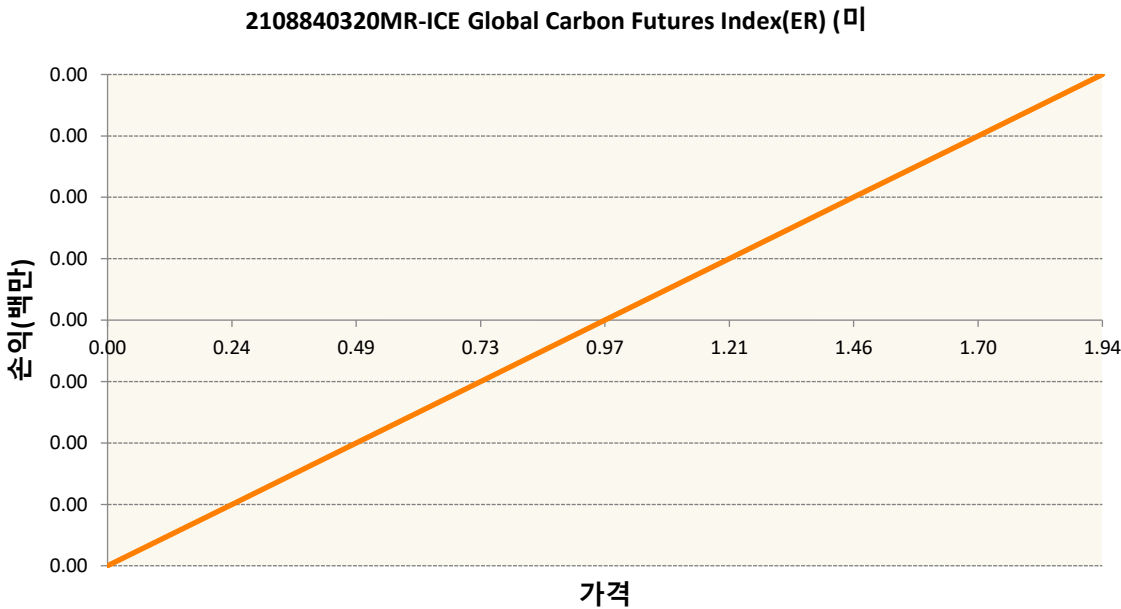
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,064	10,035	29	
누계	유가증권	선물	9,763	0	9,763	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	583
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	195

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	886

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

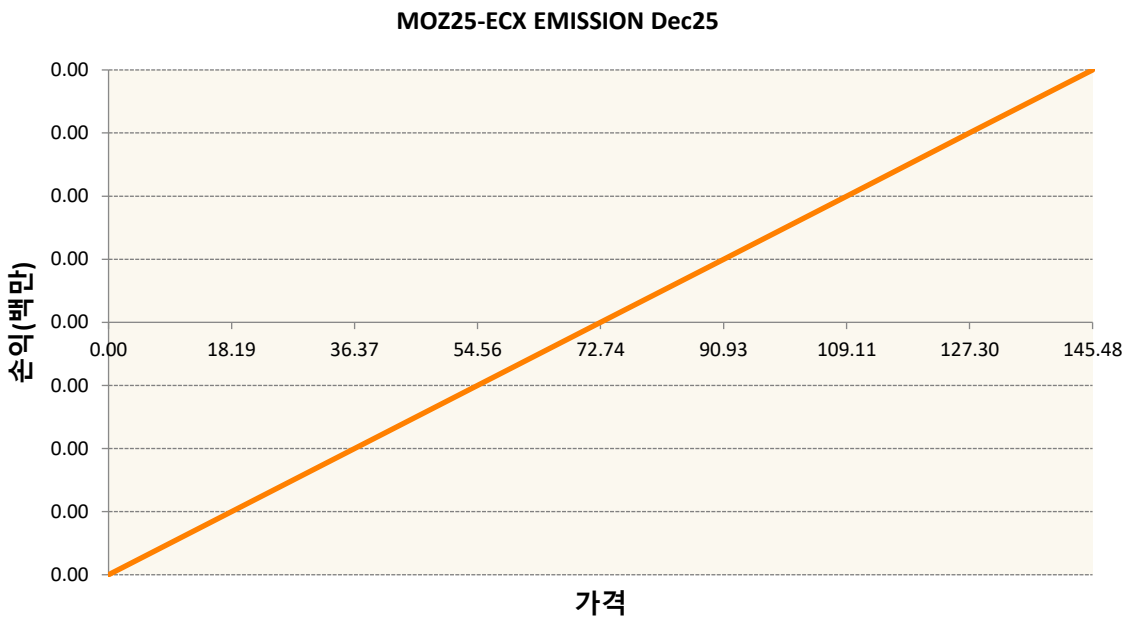
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	15	-15	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,594	0	6,594	
누계	통화	선도	0	1,393	-1,393	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	528

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

(단위:백만원)

963

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	3,462	0	3,462	장외
누계	지수	스왑	3,462	0	3,462	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (NH)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (메리츠)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	2

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

(단위:백만원)

14

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	7,521	8,845	-1,324	장외
누계	지수	스왑	7,521	0	7,521	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	1

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

(단위:백만원)

16

공시일 2025-06-23

기준일 2025-06-20

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	2025-06-23
기준일	2025-06-20

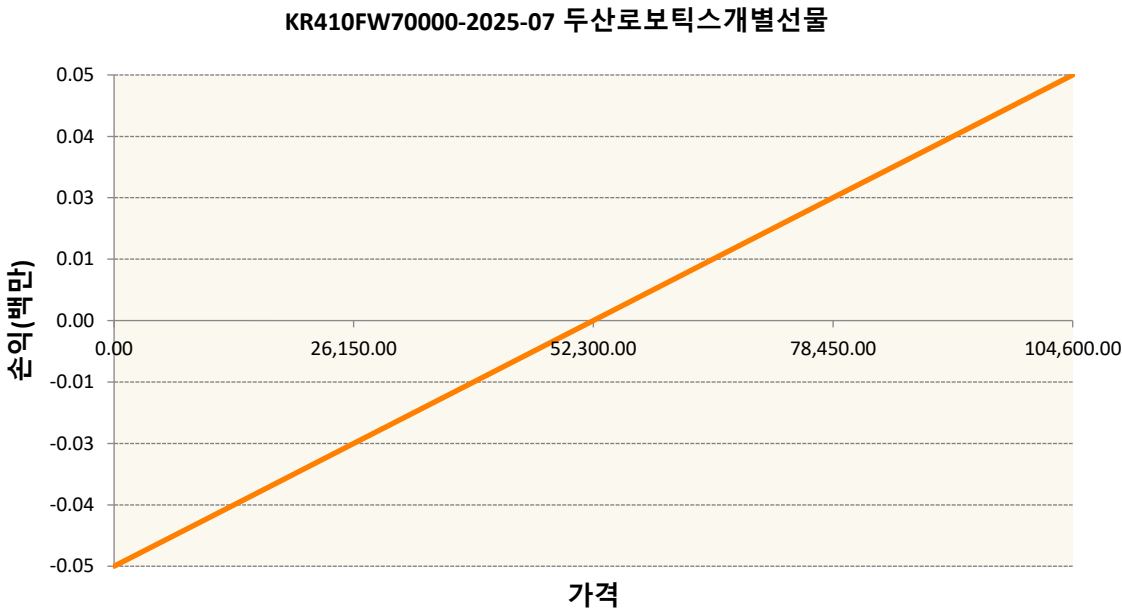
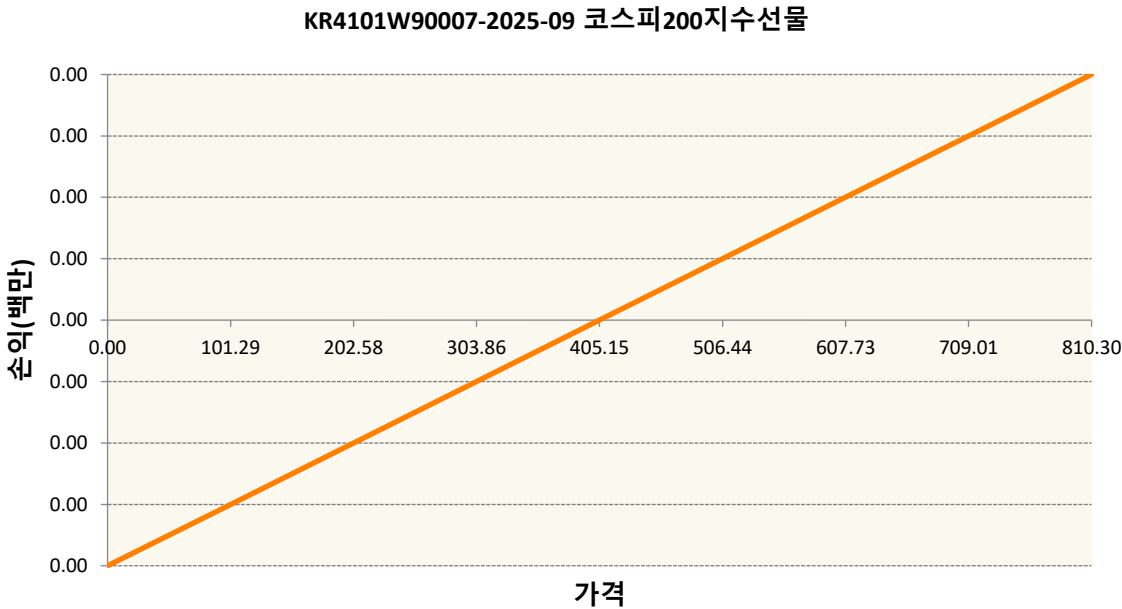
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

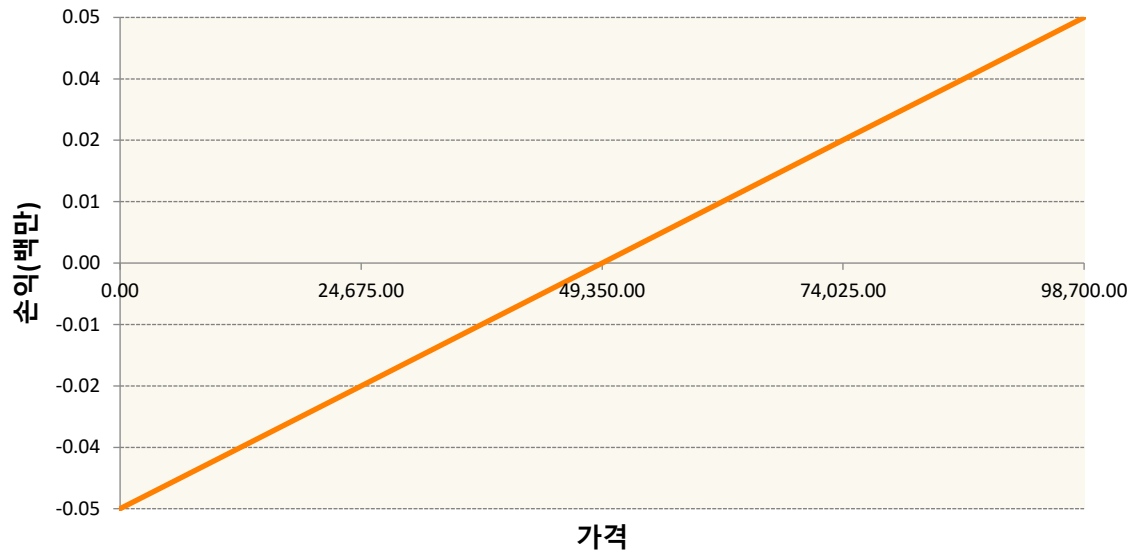
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,513	607	906	장내
누계	유가증권	선물	11,965	0	11,965	장내

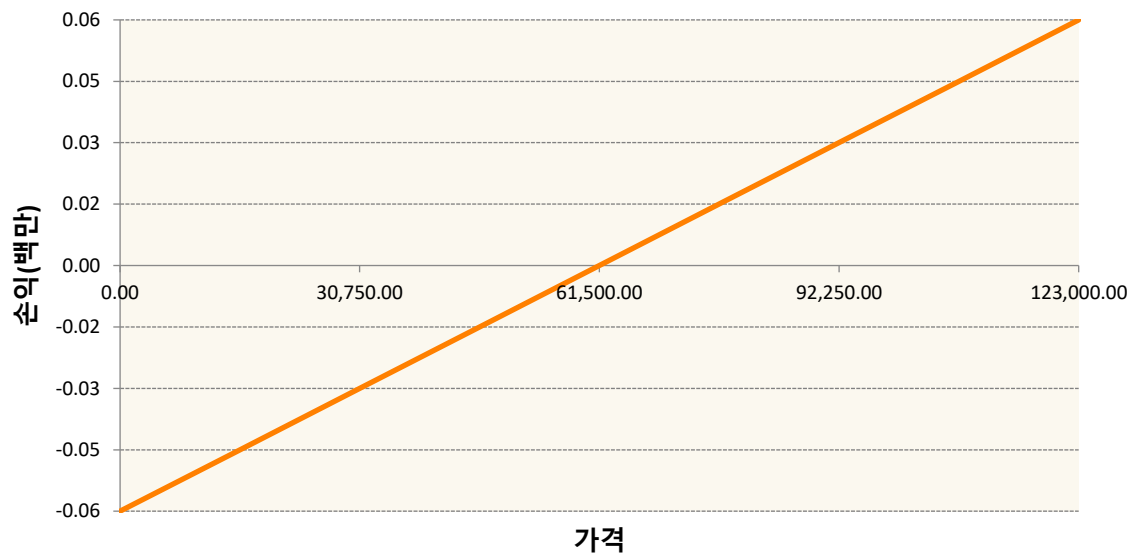
2. 만기시점의 손익구조



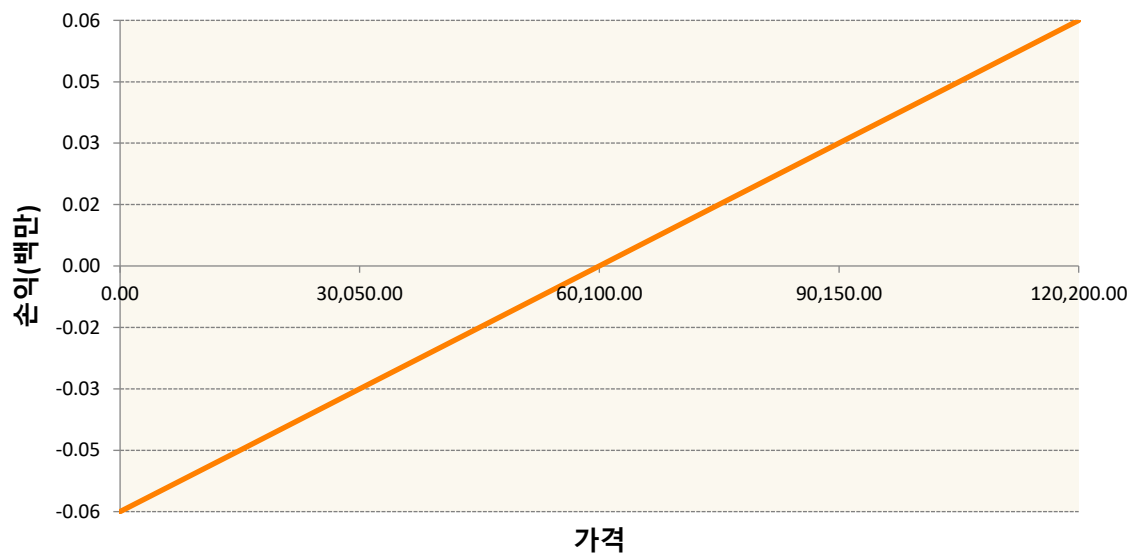
KR411RW70003-2025-07 한화비전개별선물



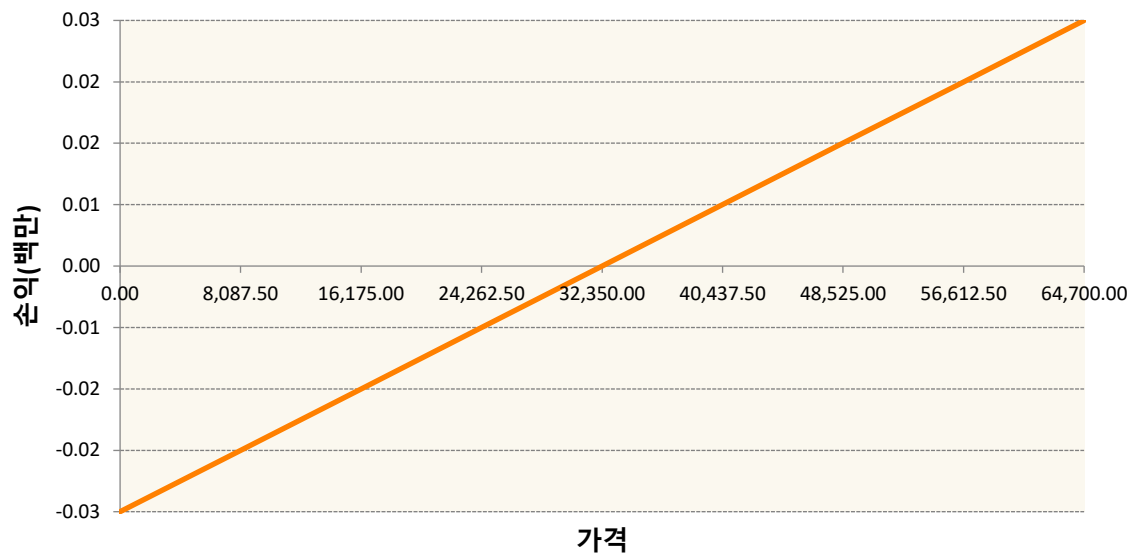
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



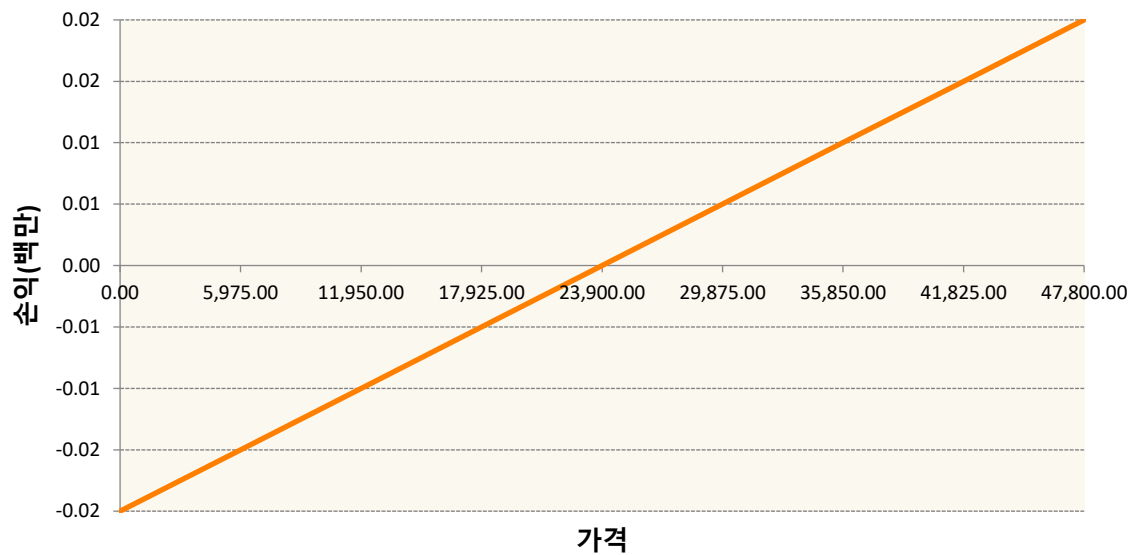
KR41B9W70000-2025-07 두산에너지빌리티개별선물



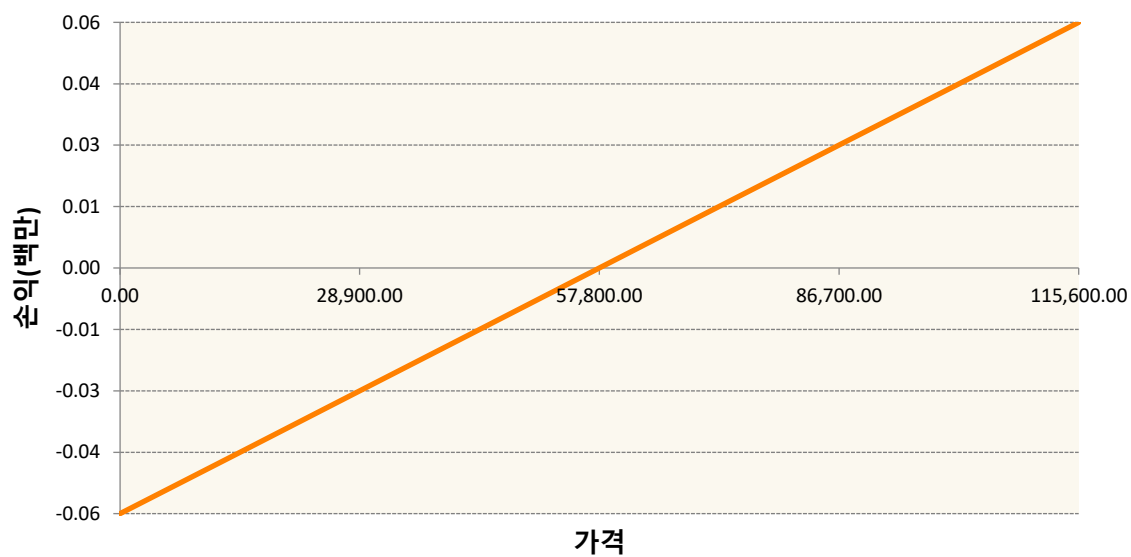
KR41CBW70003-2025-07 한화솔루션개별선물



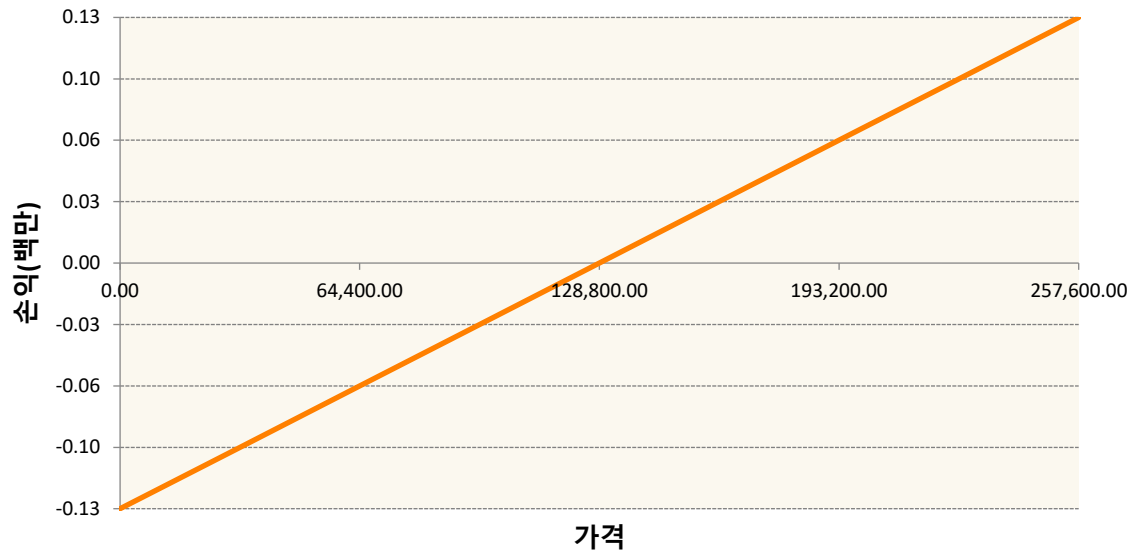
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



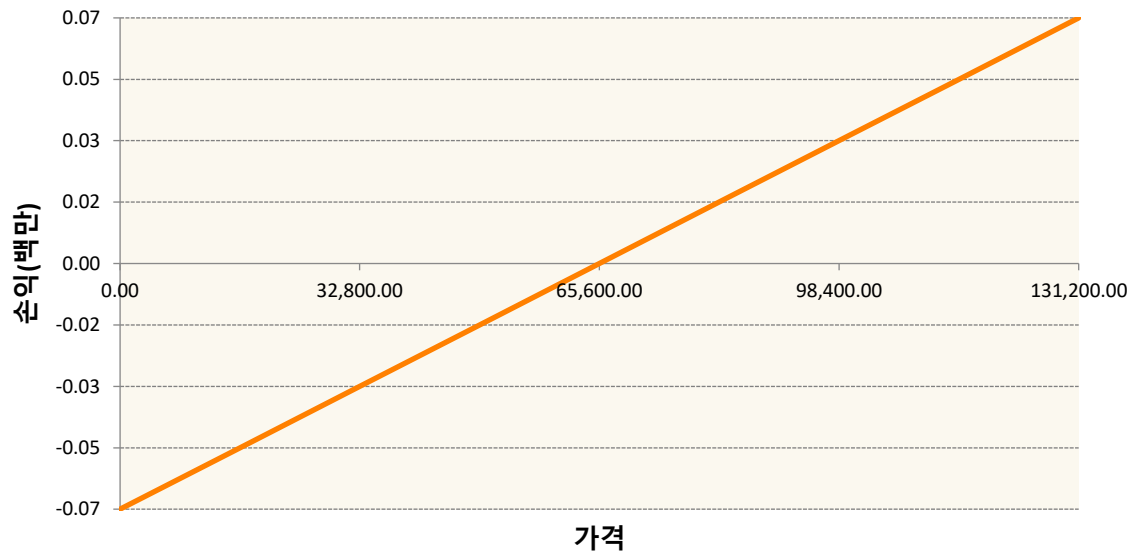
KR41D7W70002-2025-07 한전KPS개별선물



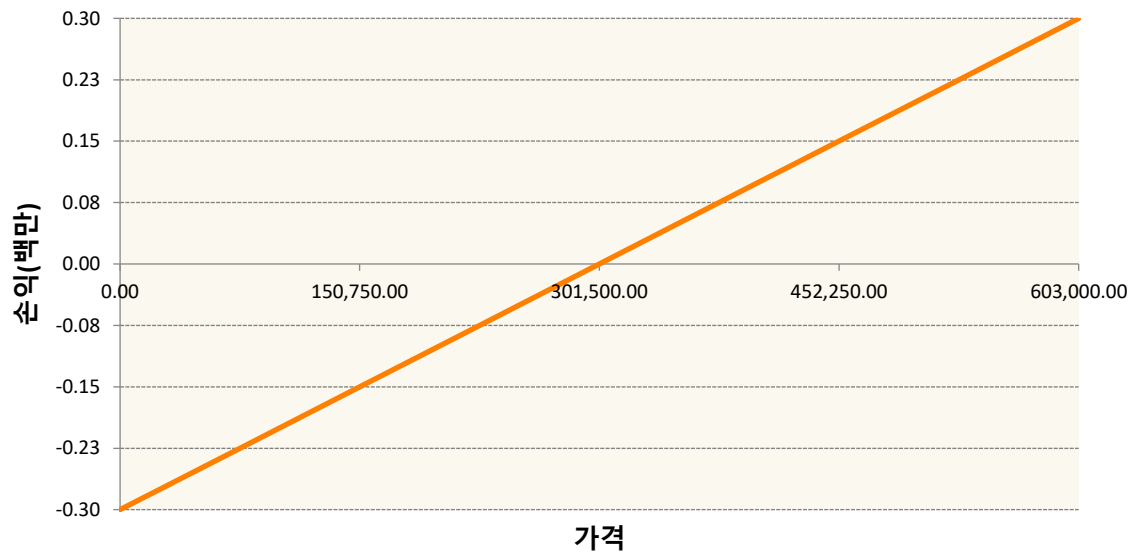
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



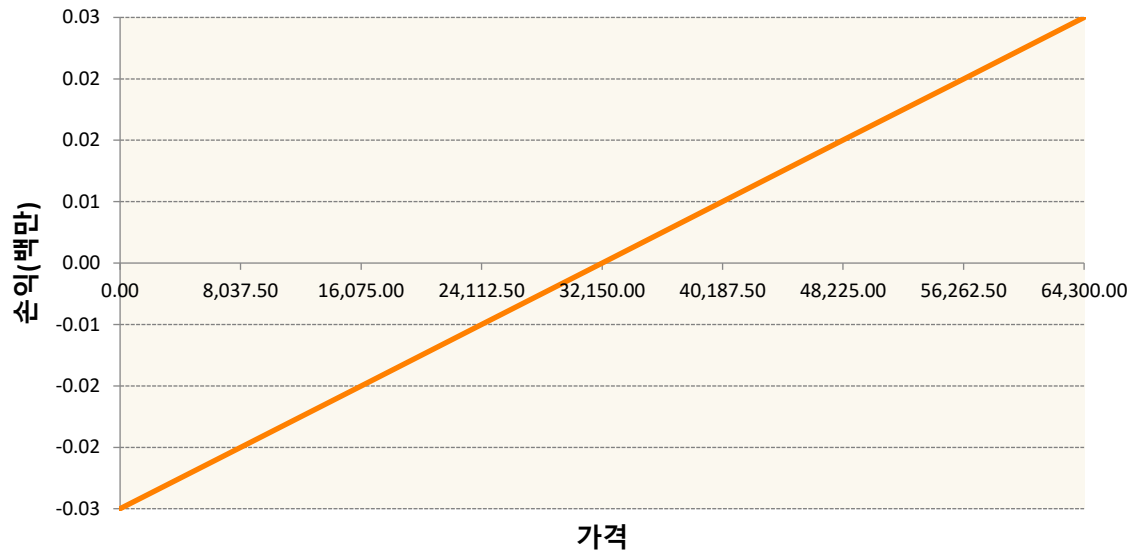
KR41EVW70007-2025-07 한화시스템개별선물



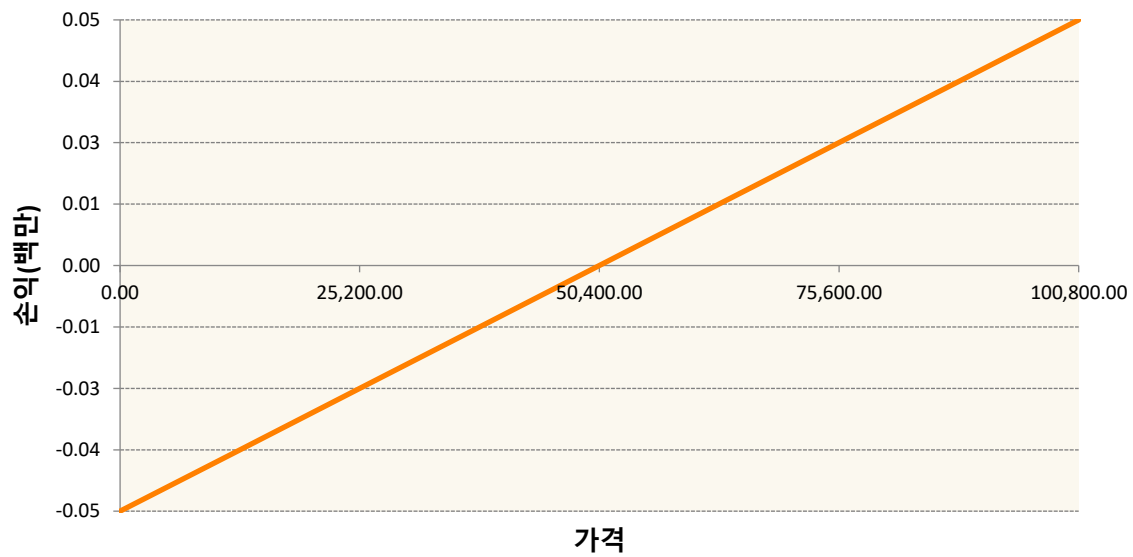
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



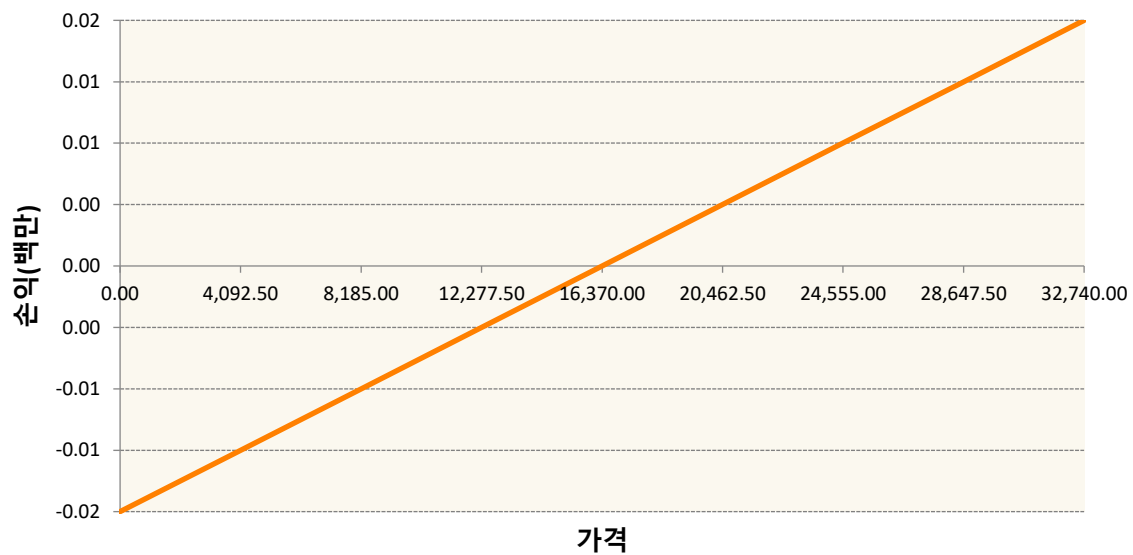
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



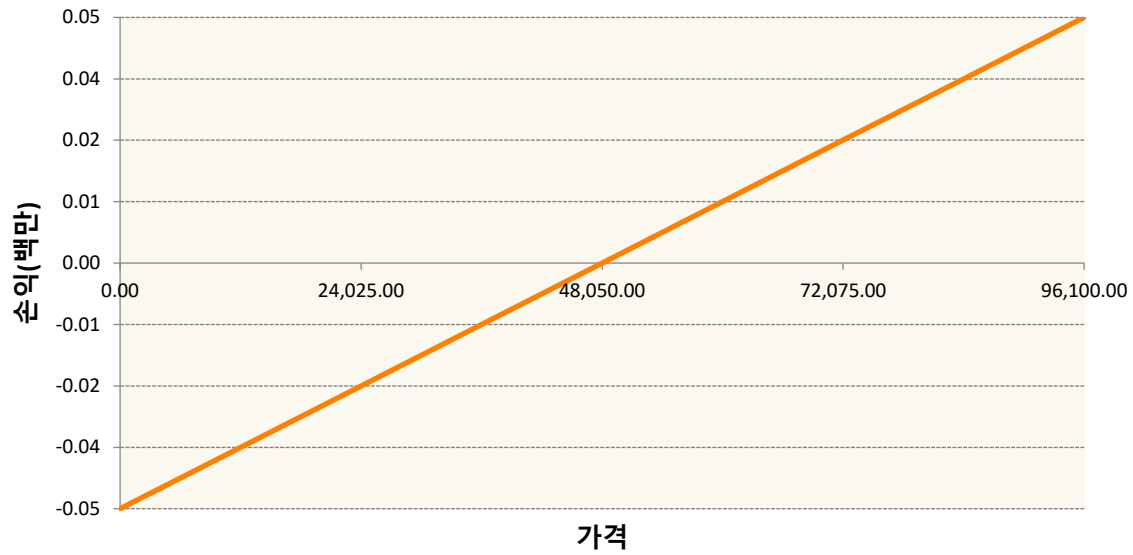
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



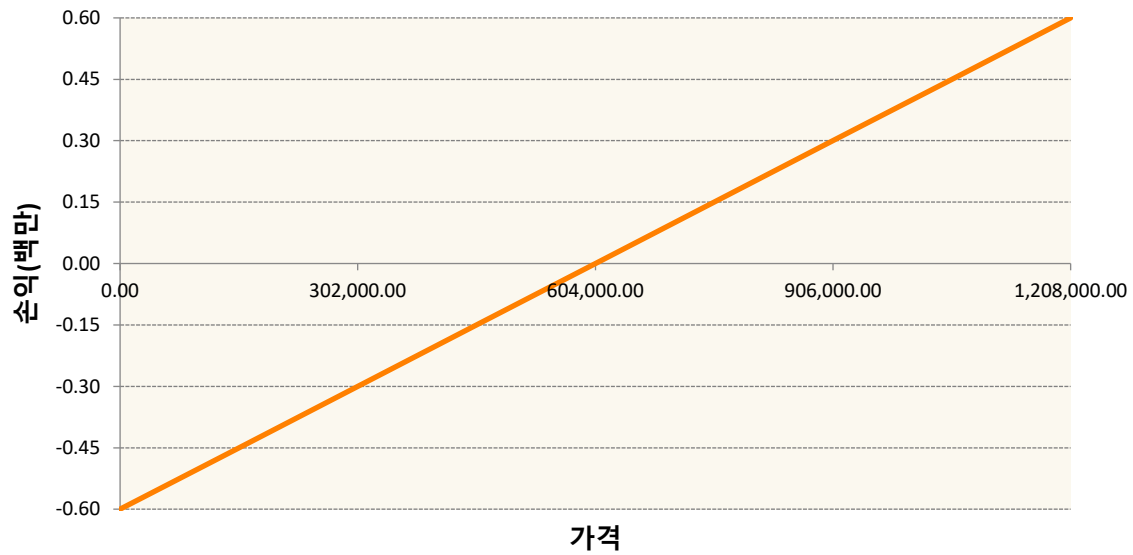
KR41FWW70002-2025-07 대한전선개별선물



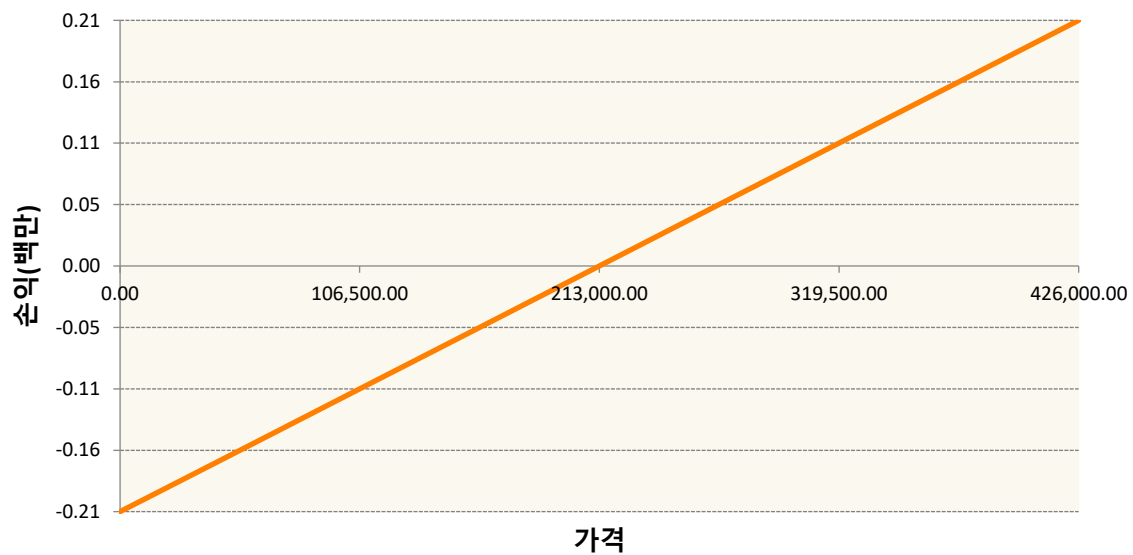
KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41GTW70006-2025-07 두산개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	608
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물	3
KR411RW70(2025-07 한화비전개별선물	17
KR41B2W70(2025-07 S-Oil개별선물	3
KR41B9W70(2025-07 두산에너지개별선물	1
KR41CBW70(2025-07 한화솔루션개별선물	31
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	12
KR41D7W70 2025-07 한전KPS개별선물	0.05
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물	36
KR41EVW70(2025-07 한화시스템개별선물	2
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	110
KR41F6W70(2025-07 카카오뱅크개별선물	112
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	13
KR41FWW70 2025-07 대한전선개별선물	0.05
KR41G0W70 2025-07 씨에스원드개별선물	4
KR41GTW70(2025-07 두산개별선물	1
KR41HEW70(2025-07 키움증권개별선물	3

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

1,734

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

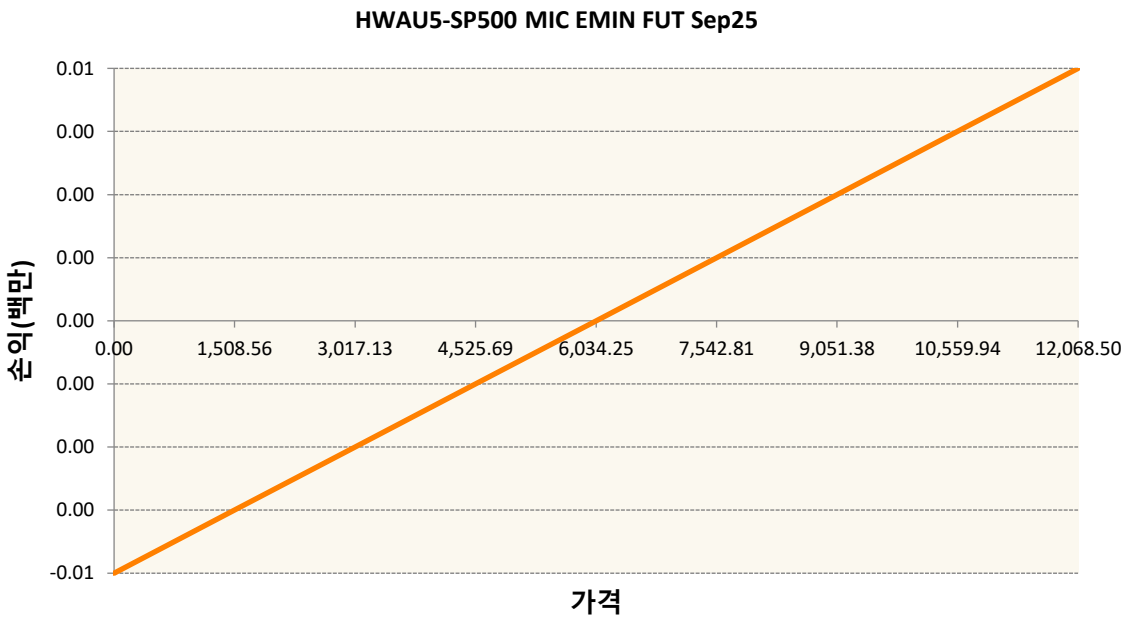
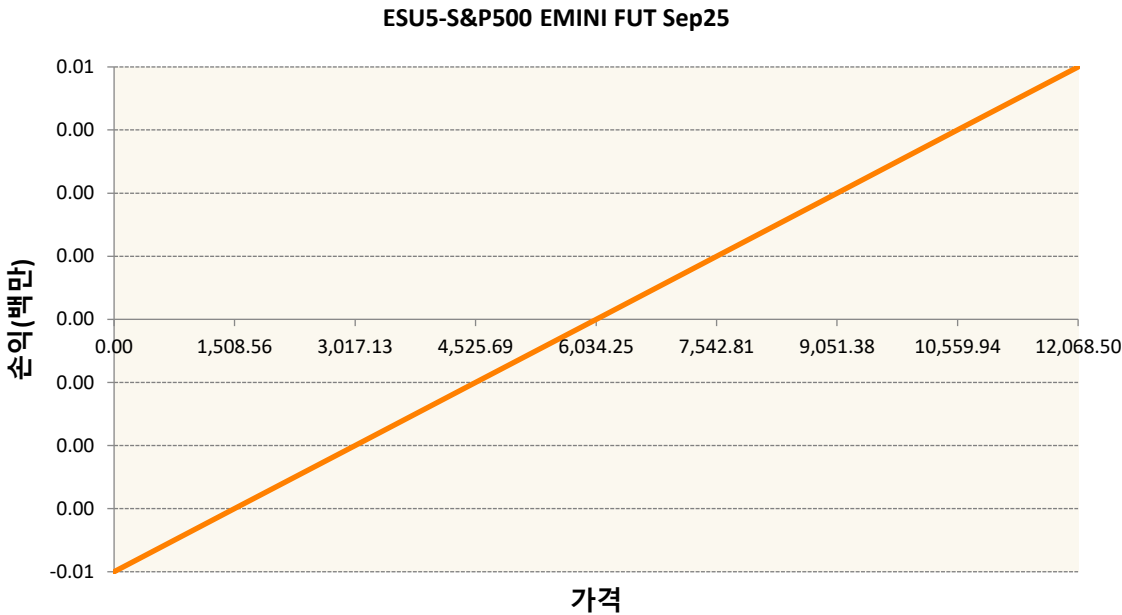
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	28,734	0	28,734	
누계	지수	선물	1,333	0	1,333	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,299
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,132

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

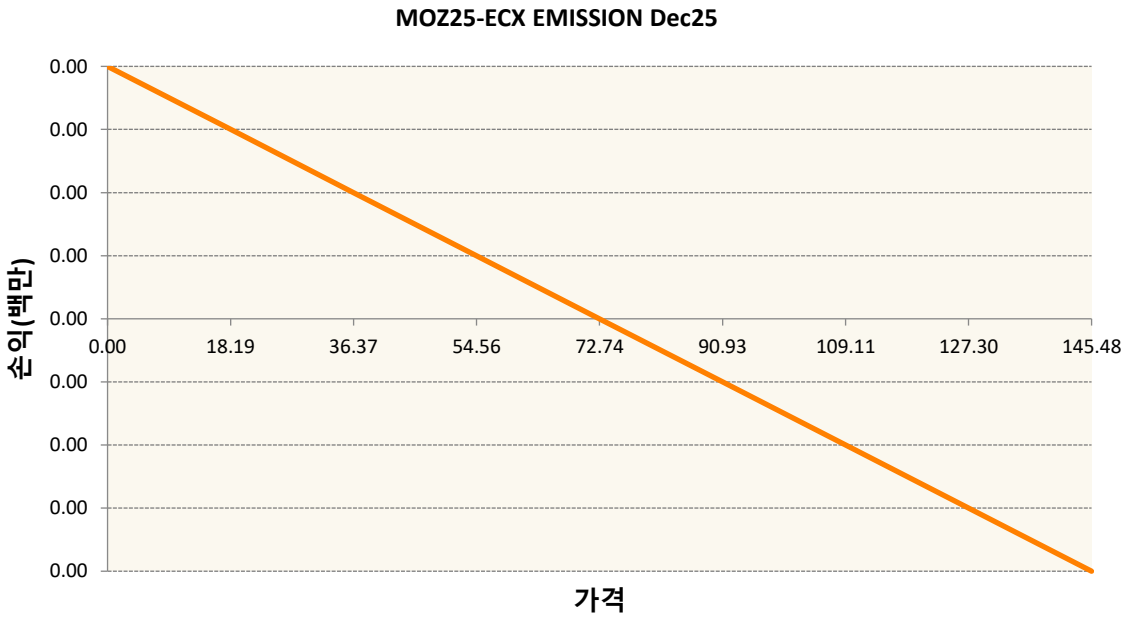
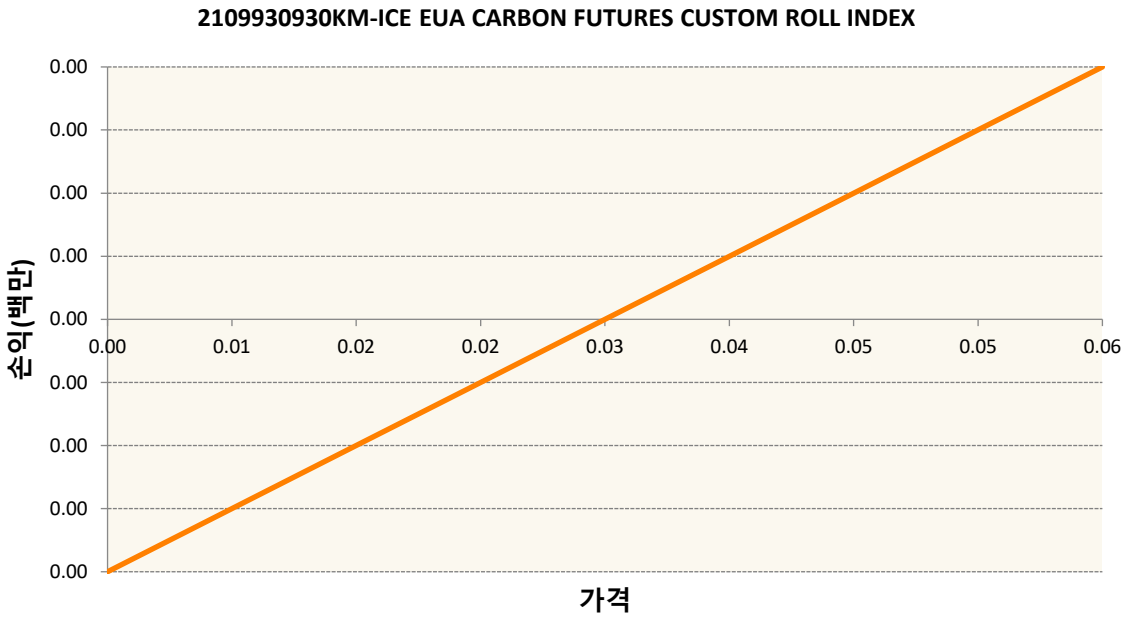
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	-19	19	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	12	4,507	-4,495	
누계	통화	선도	0	954	-954	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	361

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

657

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

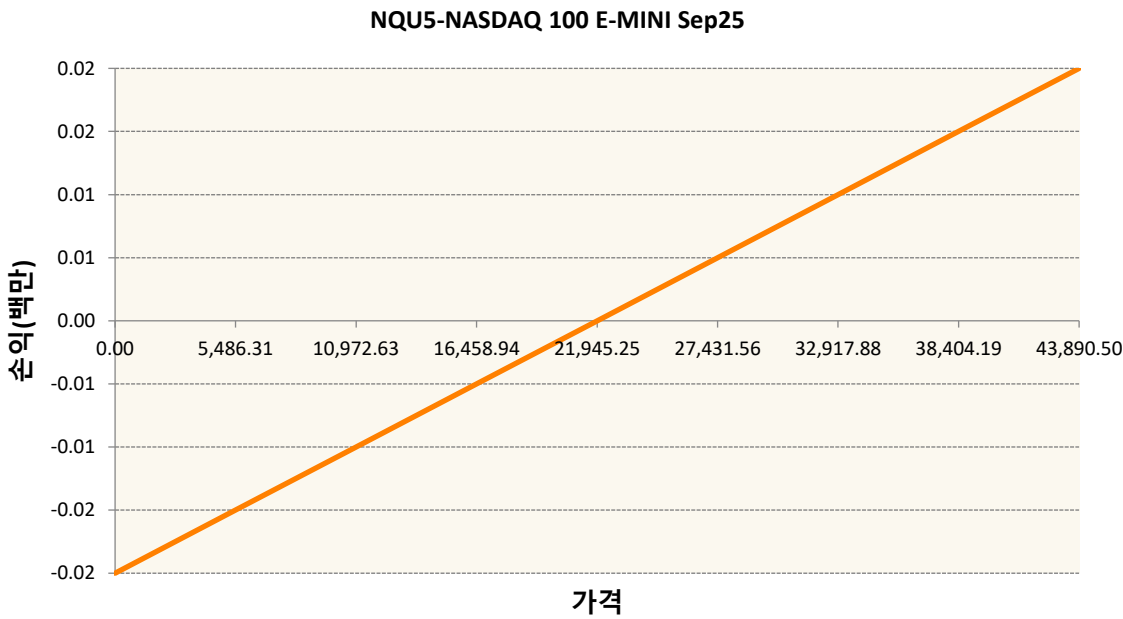
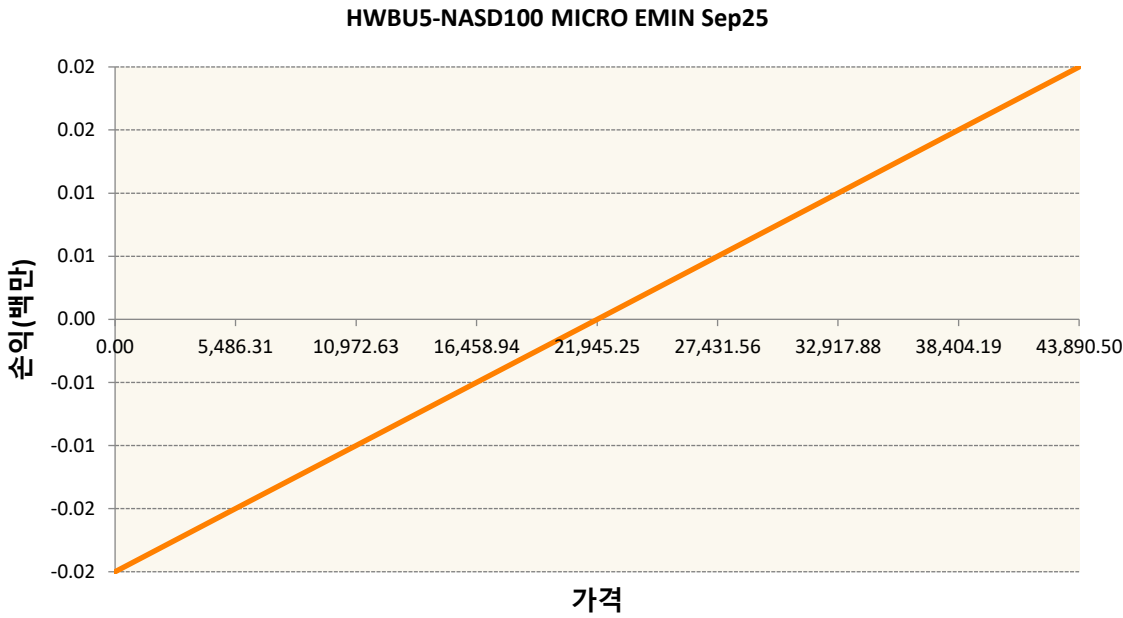
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	12,721	0	12,721	
누계	지수	선물	121	0	121	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25		10
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		1,018

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,181

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

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	2,997
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,479
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,111
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,057
SWSOL3000(KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	160

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

(단위:백만원)

10,992

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	5,814	0	5,814	장외
누계	지수	스왑	5,814	0	5,814	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1

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

(단위:백만원)

7

공시일	2025-06-23
기준일	2025-06-20

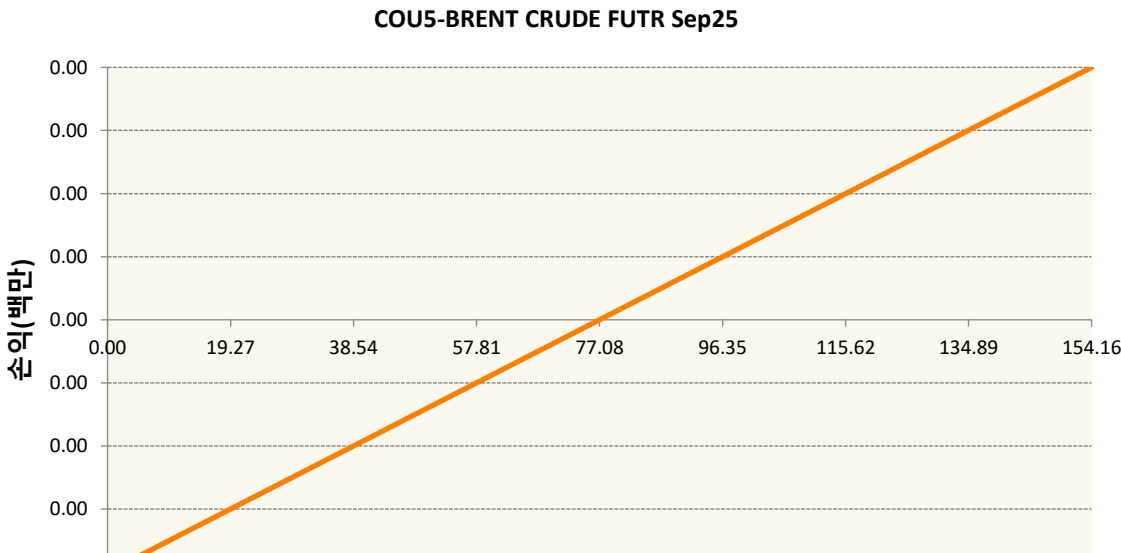
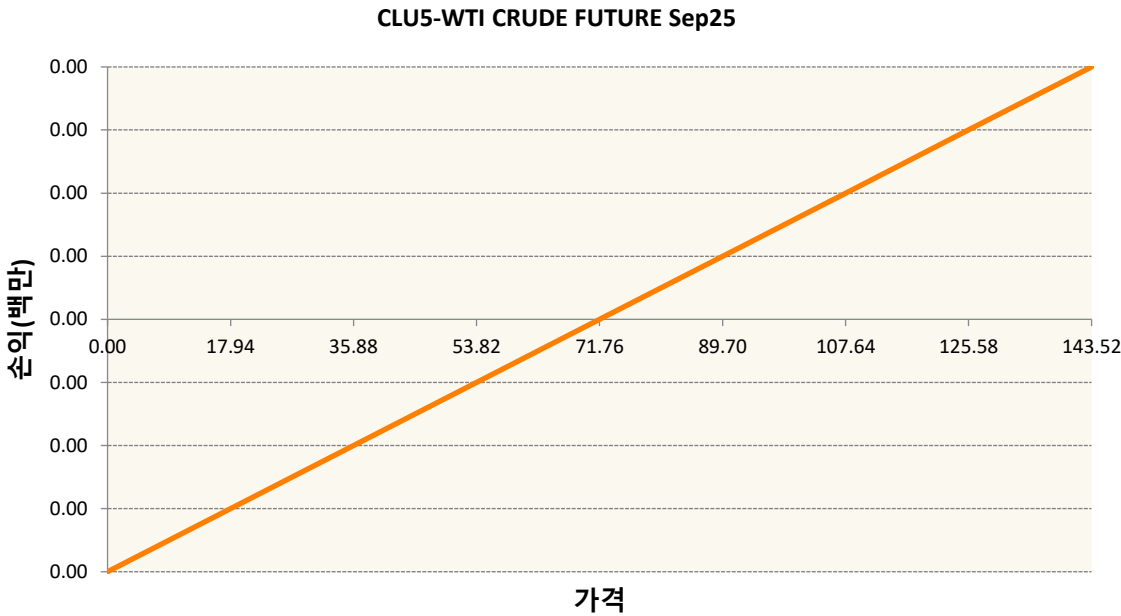
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

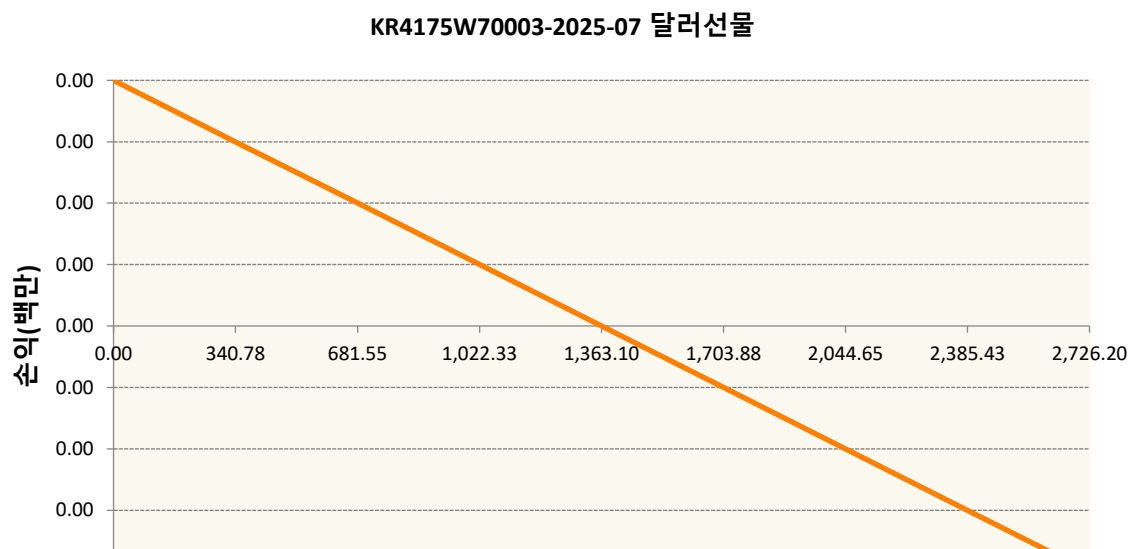
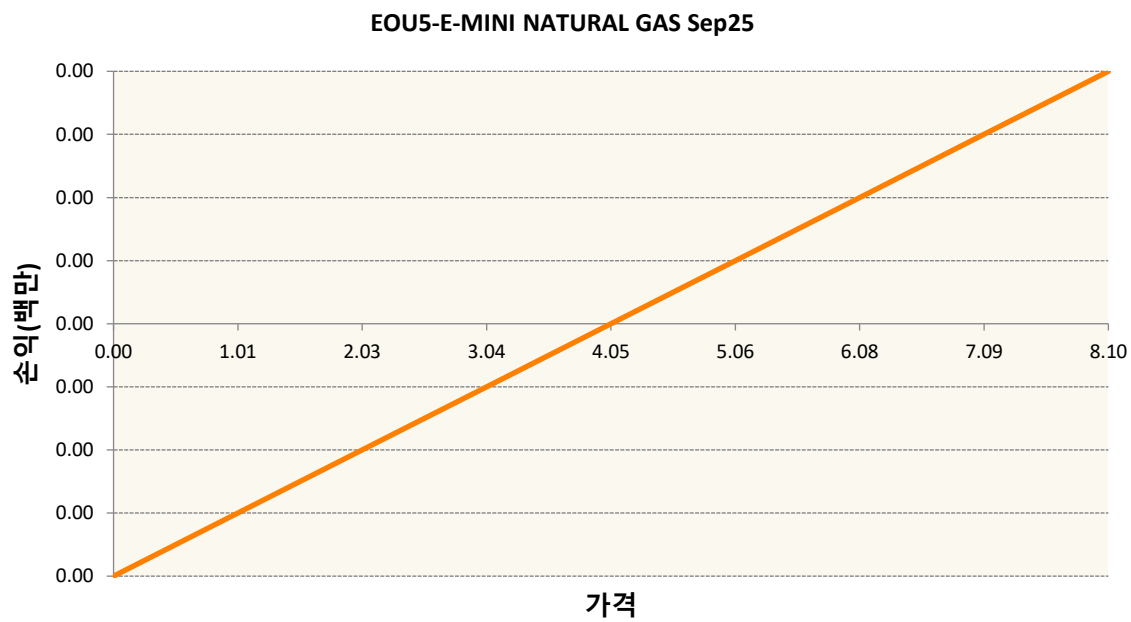
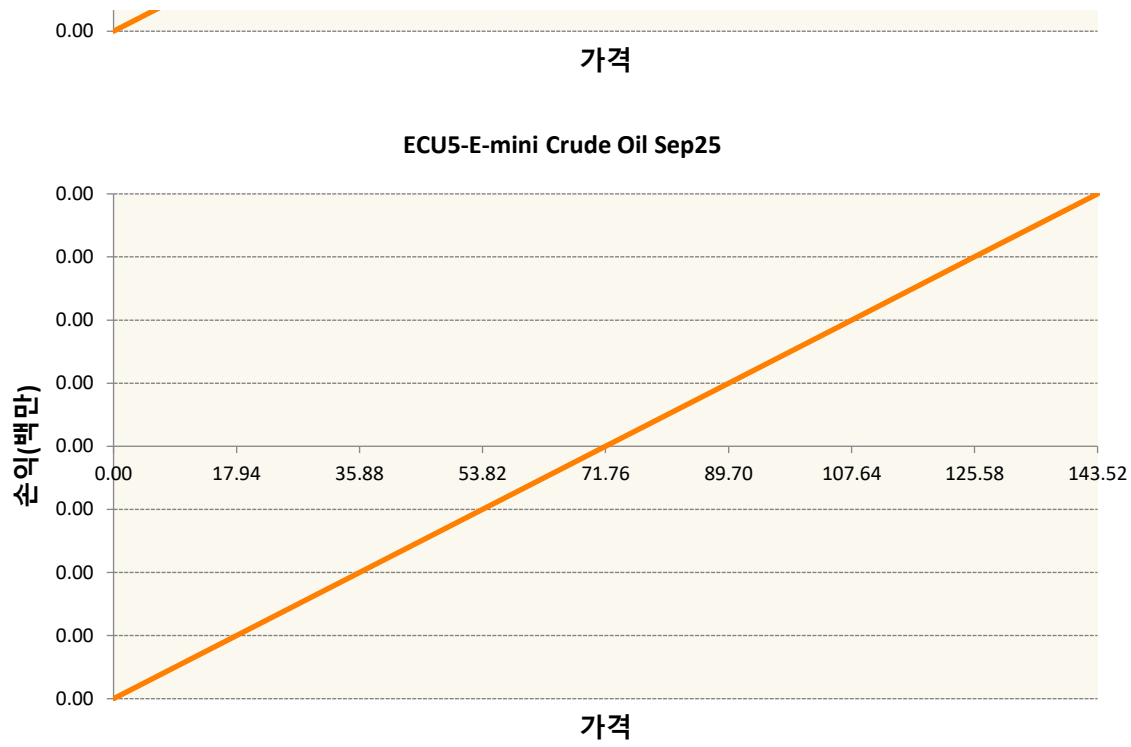
1. 계약금액

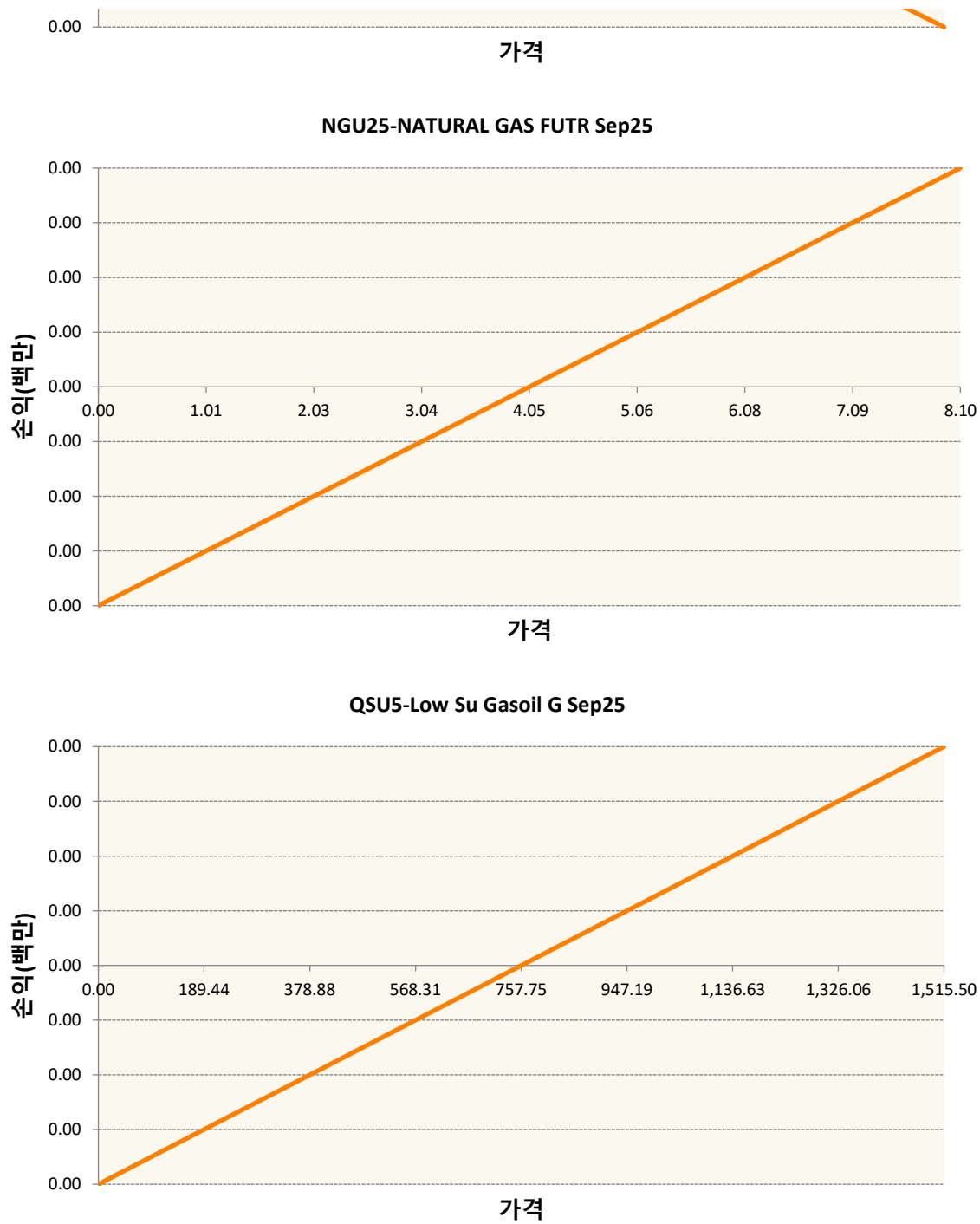
(단위:백만원)

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	432	0	432	
누계	유가증권	선물	316	0	316	
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

