

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

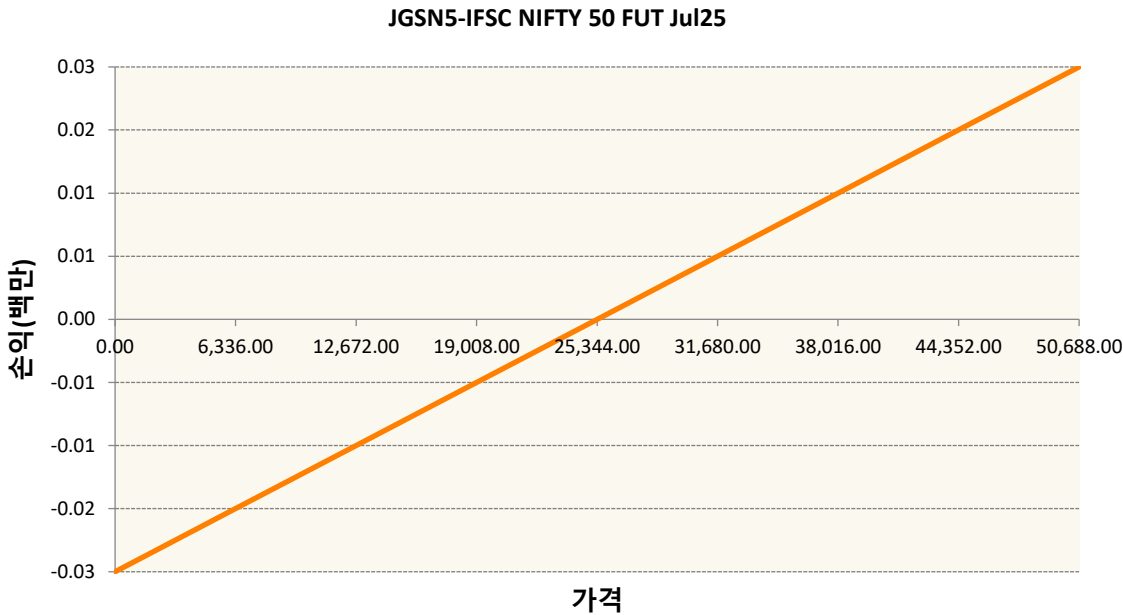
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	622	0	622	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSN5	IFSC NIFTY 50 FUT Jul25	50
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

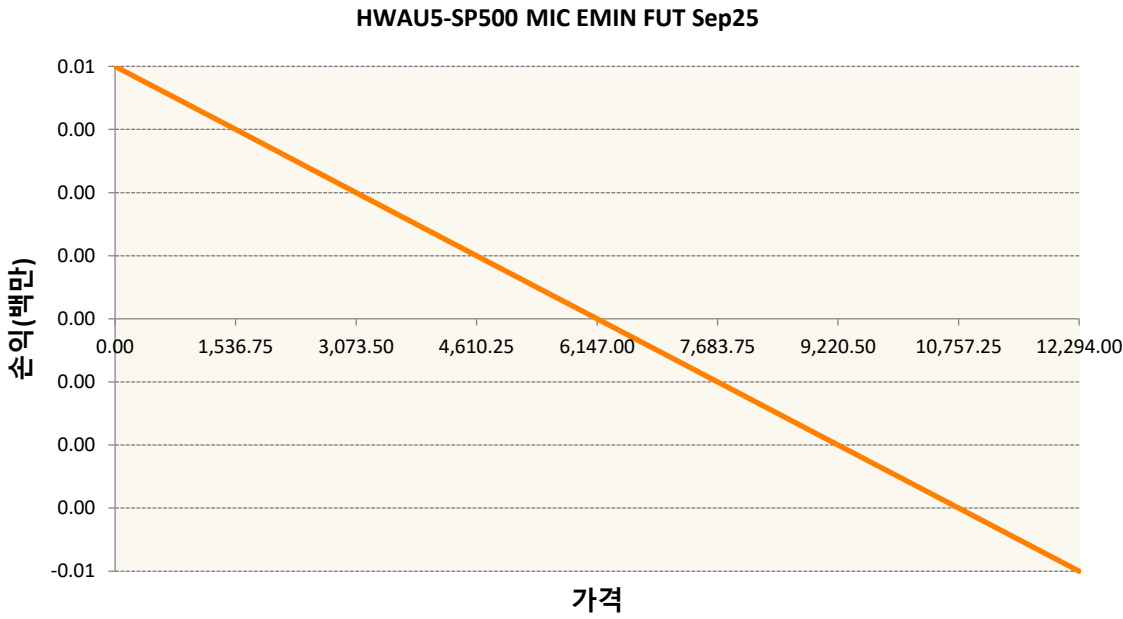
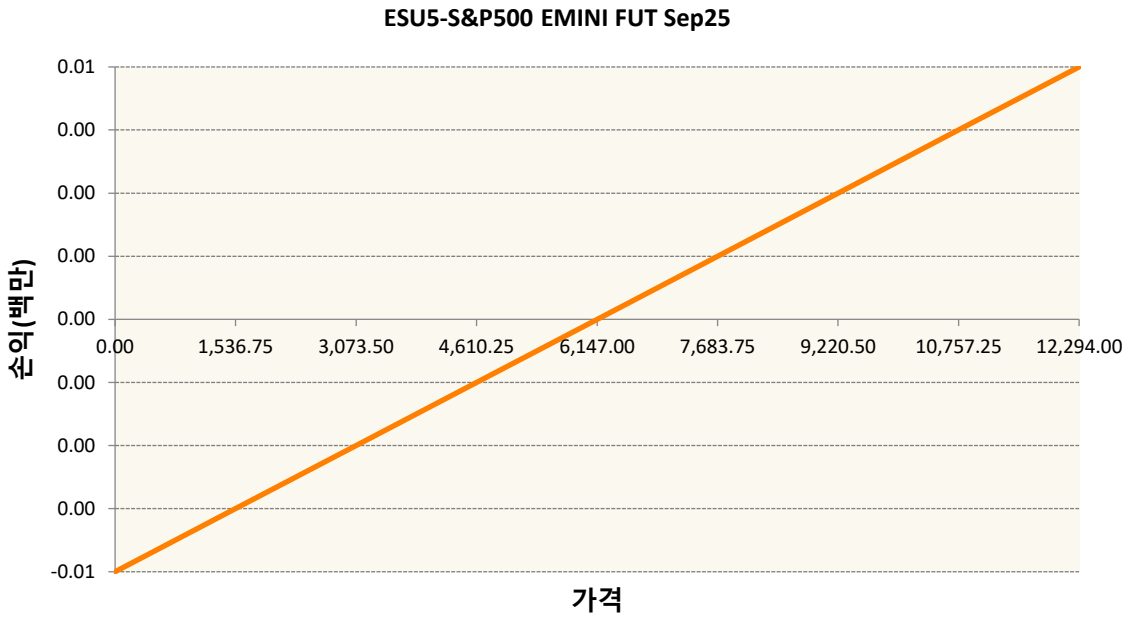
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	424	0	424	
누계	지수	선물	0	123	-123	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	34
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	39

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

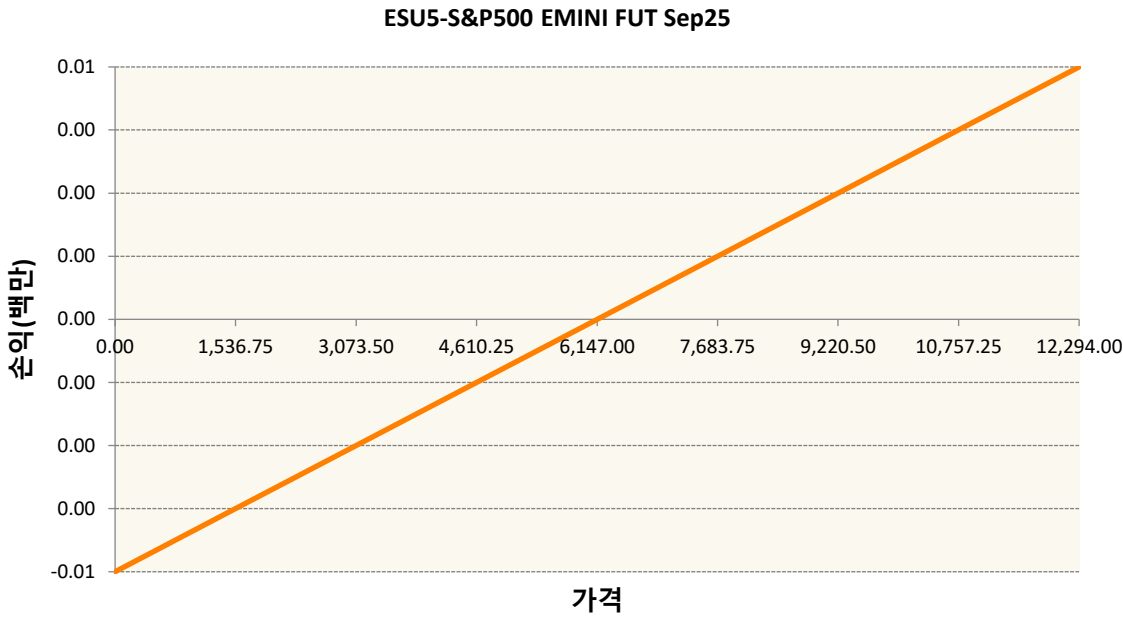
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,272	0	1,272	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	102
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

90

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

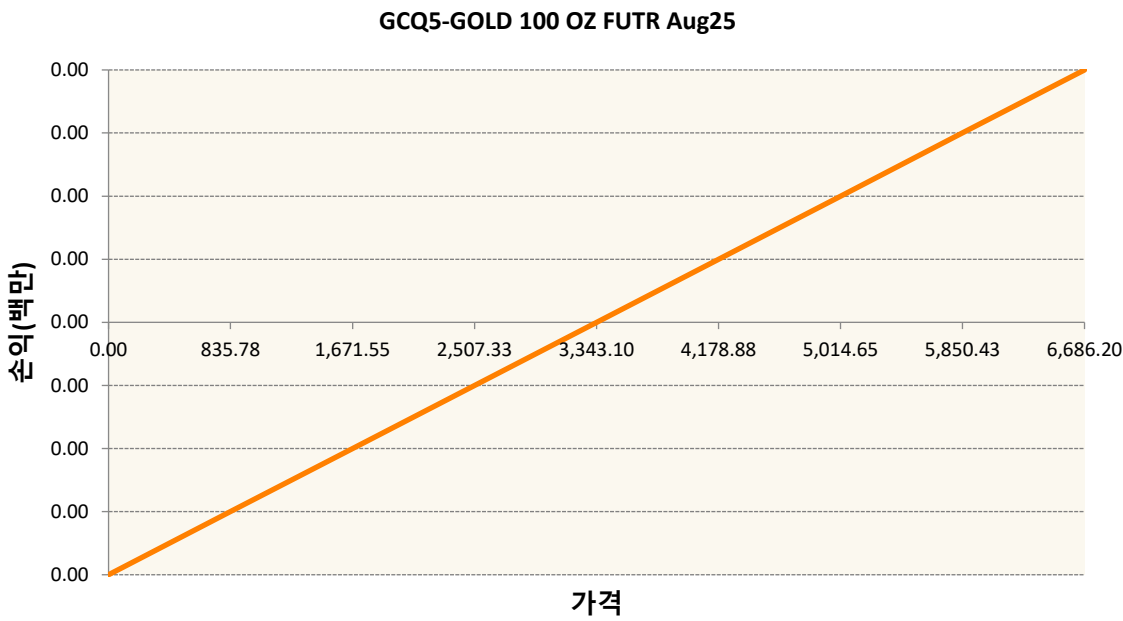
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,299	0	2,299	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 06/27/25 C311 EQUITY	3
GQC5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25	184

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

(단위:백만원)

159

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

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 06/27/25 C144 EQUITY	3
AOPLTRUSP1 PLTR US 06/27/25 P144 EQUITY	6

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

(단위:백만원)

37

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

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 06/27/25 C87 EQUITY

0.12

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

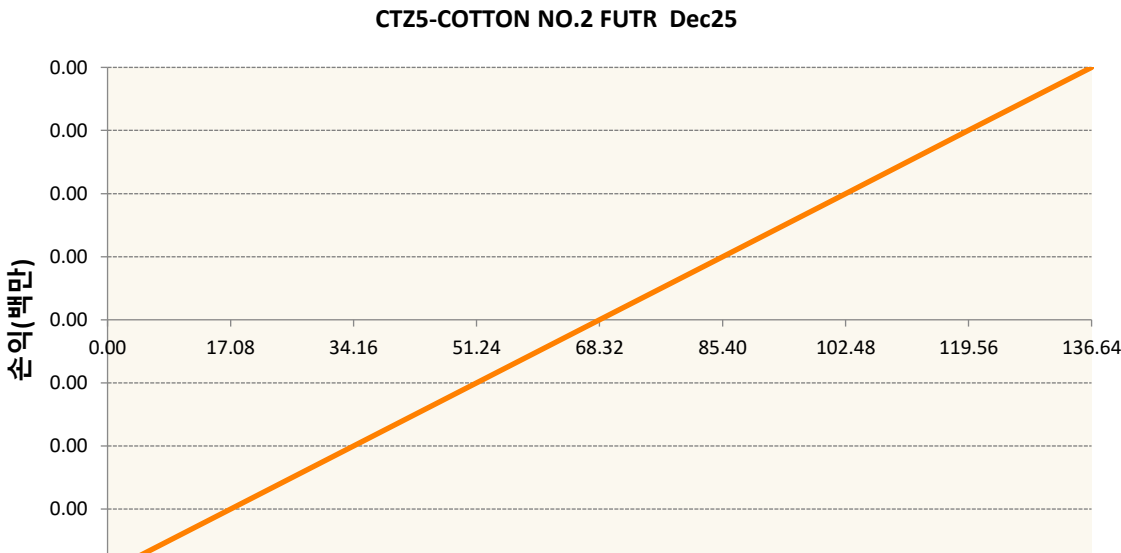
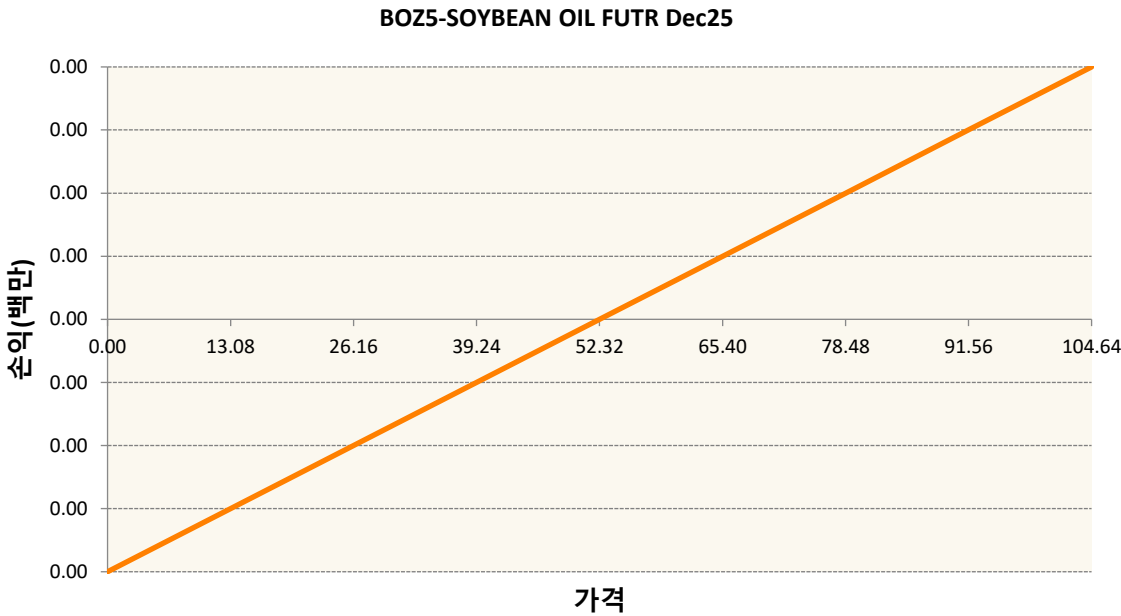
포커스농산물모(채권-파생형)

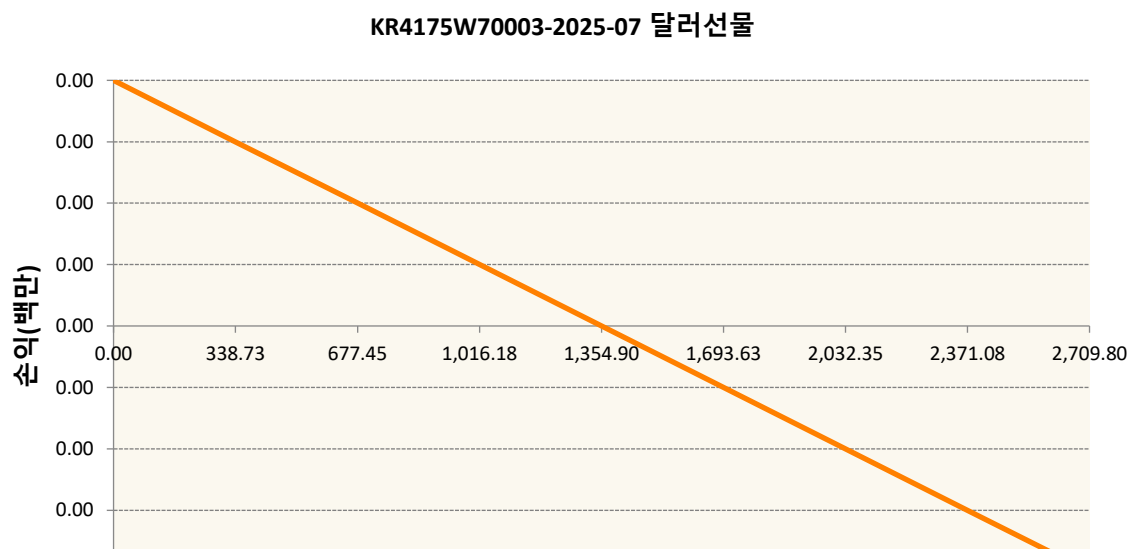
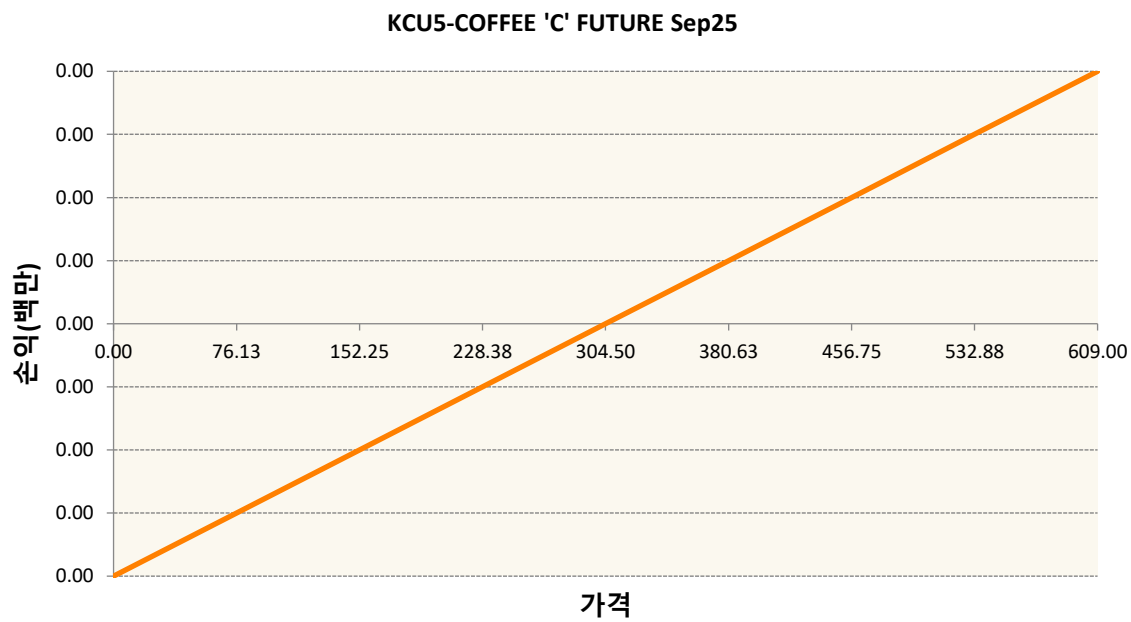
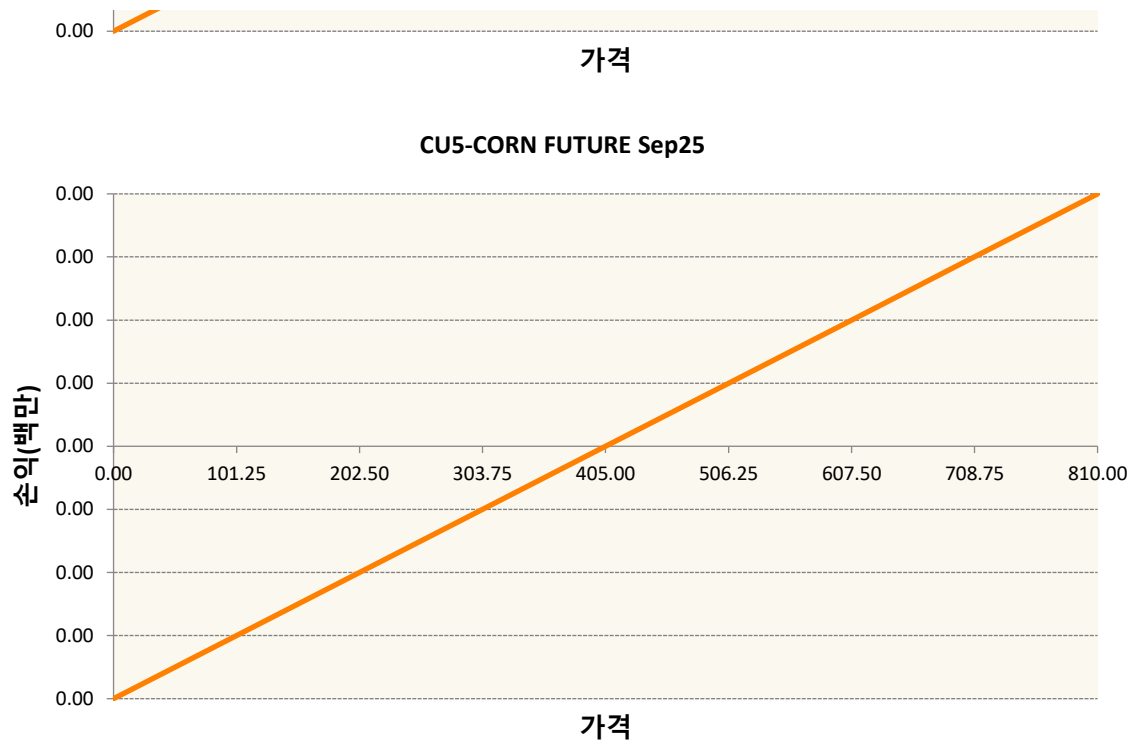
1. 계약금액

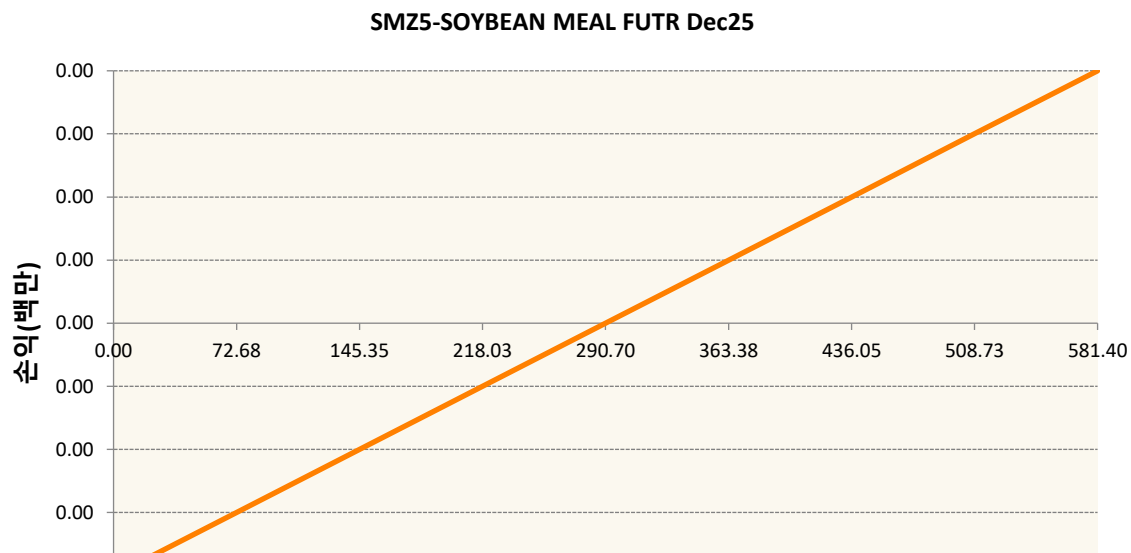
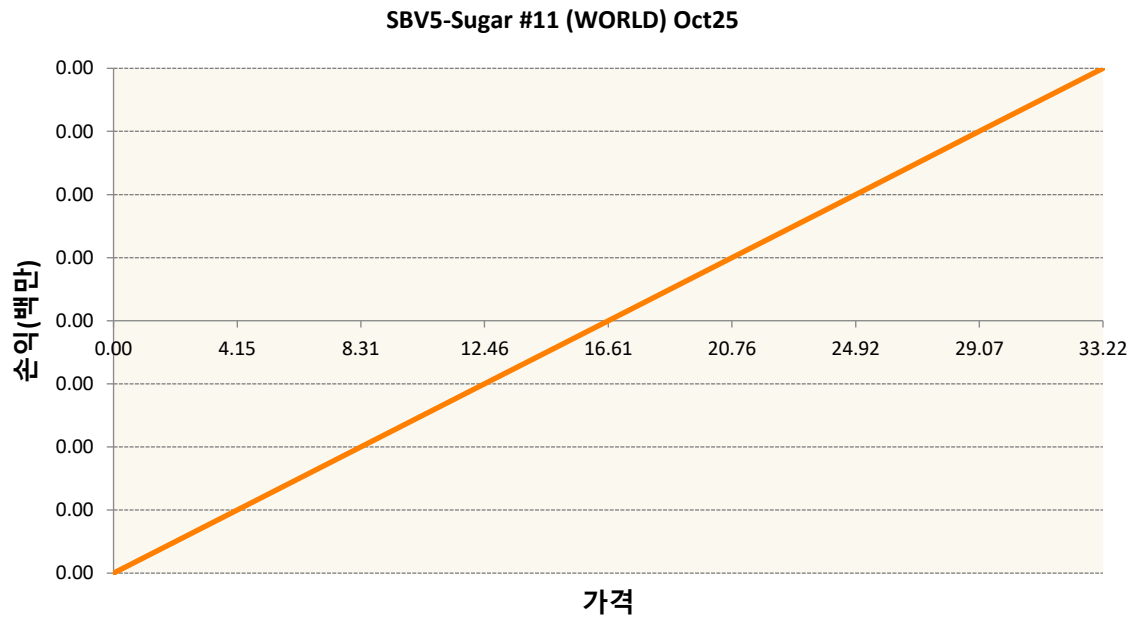
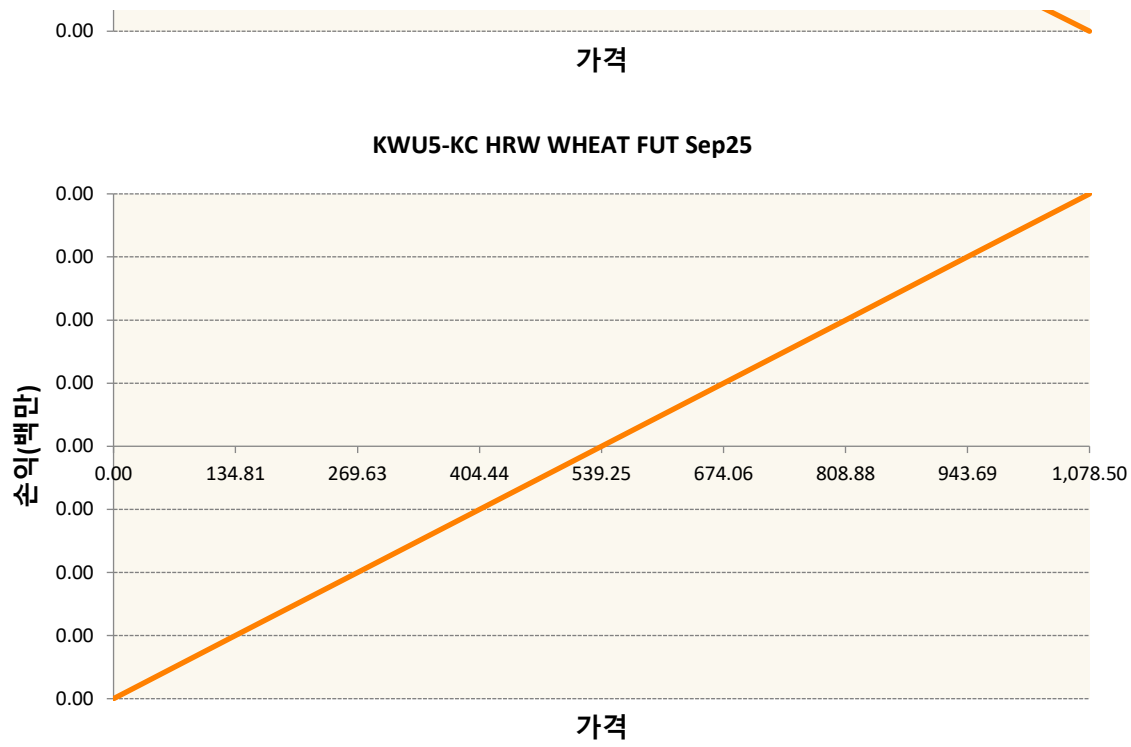
(단위:USD 백만)

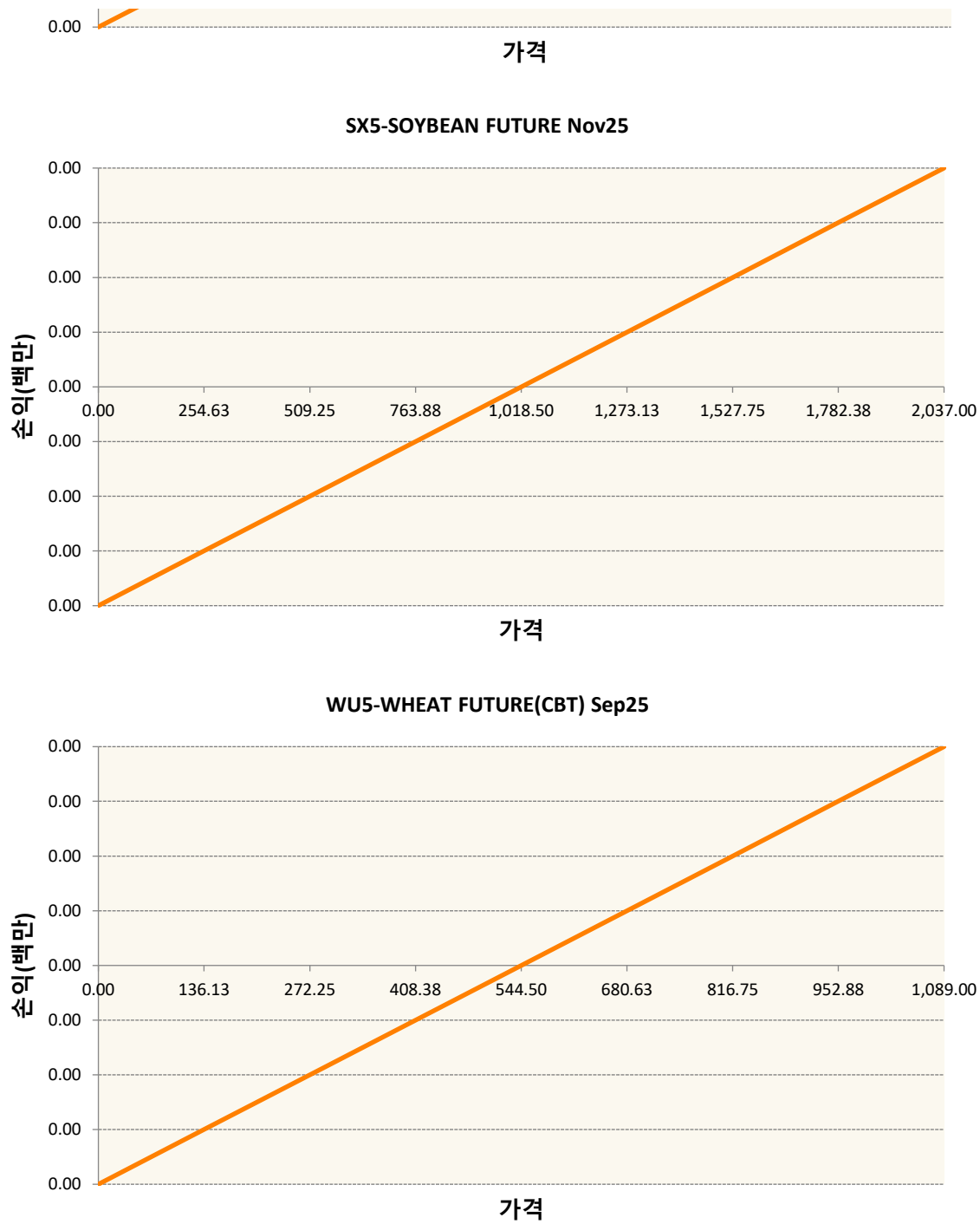
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,555	0	1,555	
누계	유가증권	선물	2,003	0	2,003	
누계	통화	선물	0	257	-257	장내

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	2025-06-27
기준일	2025-06-26

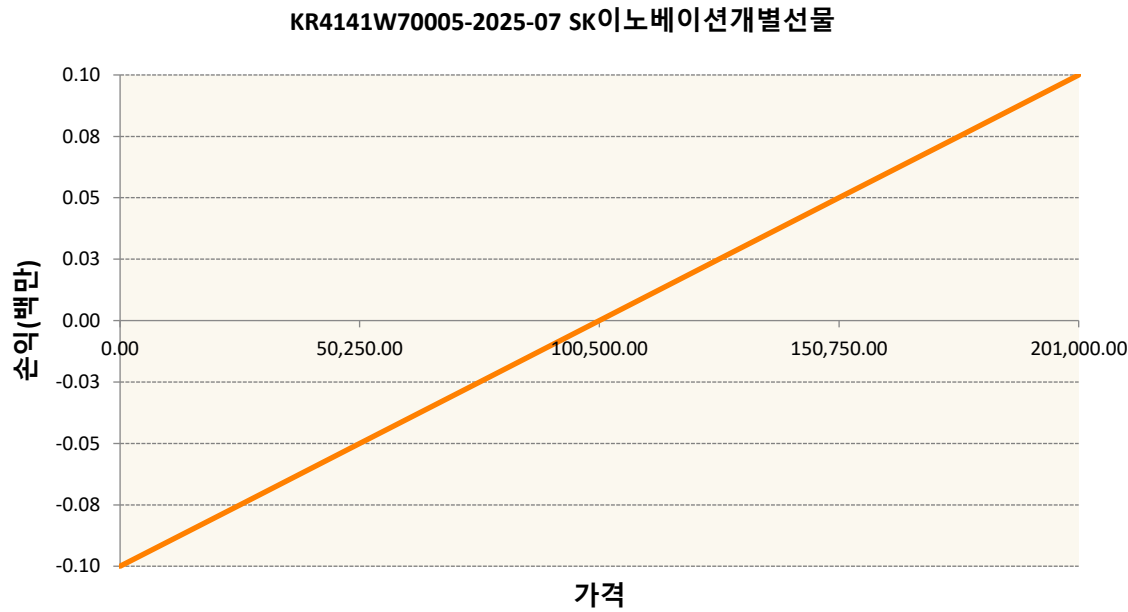
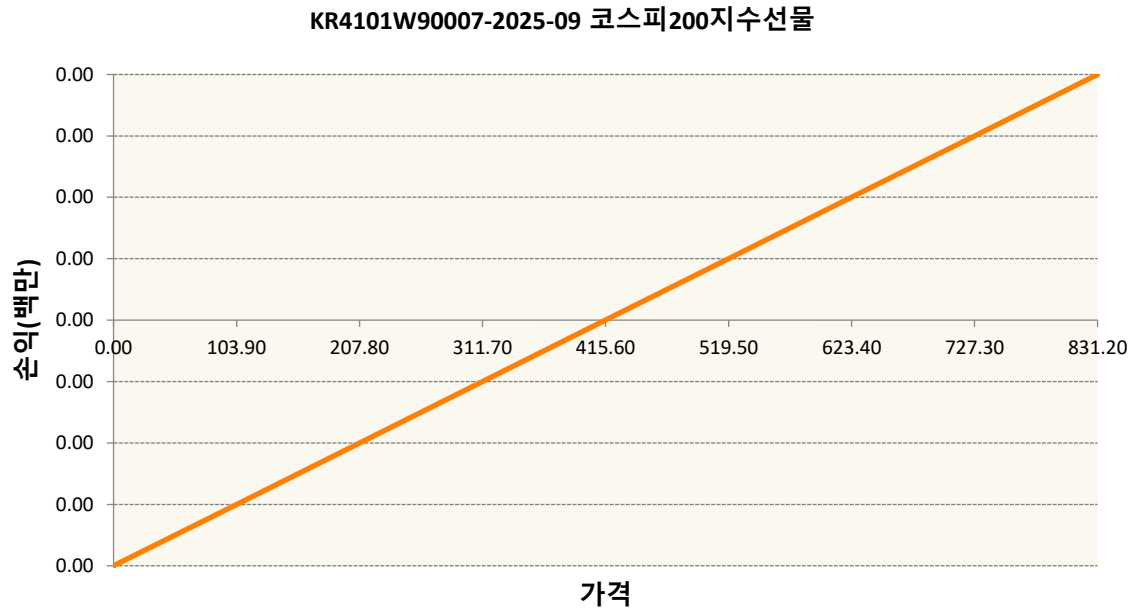
스마트인덱스모

1. 계약금액

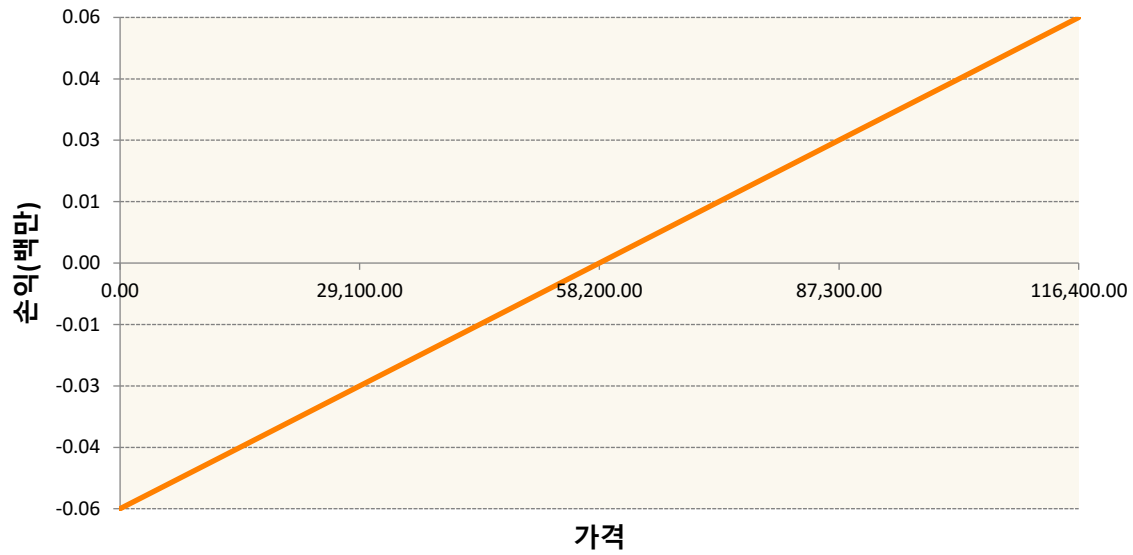
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	105	-105	장내
누계	유가증권	선물	1,428	0	1,428	장내

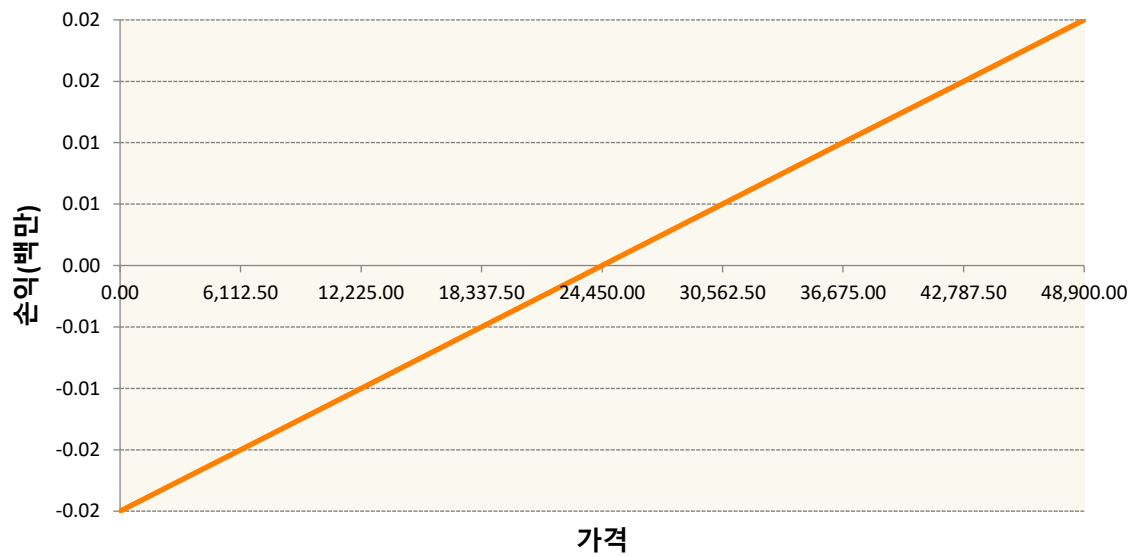
2. 만기시점의 손익구조



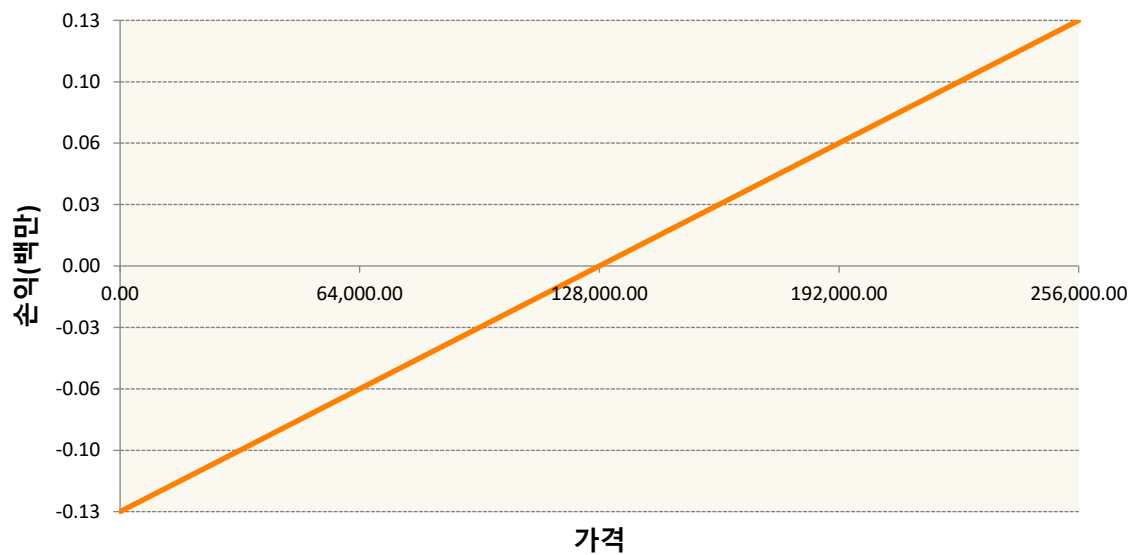
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



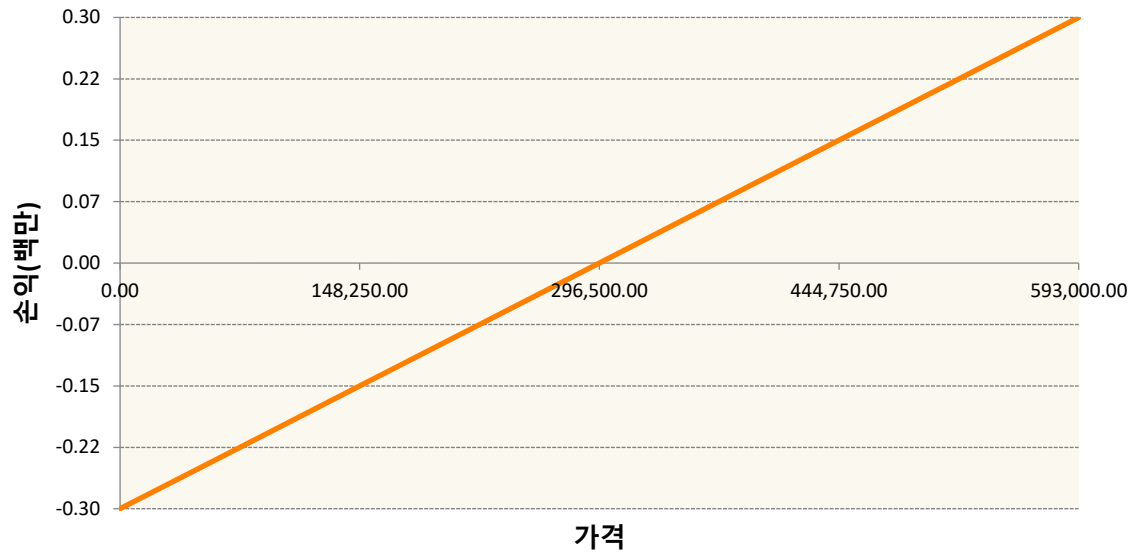
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



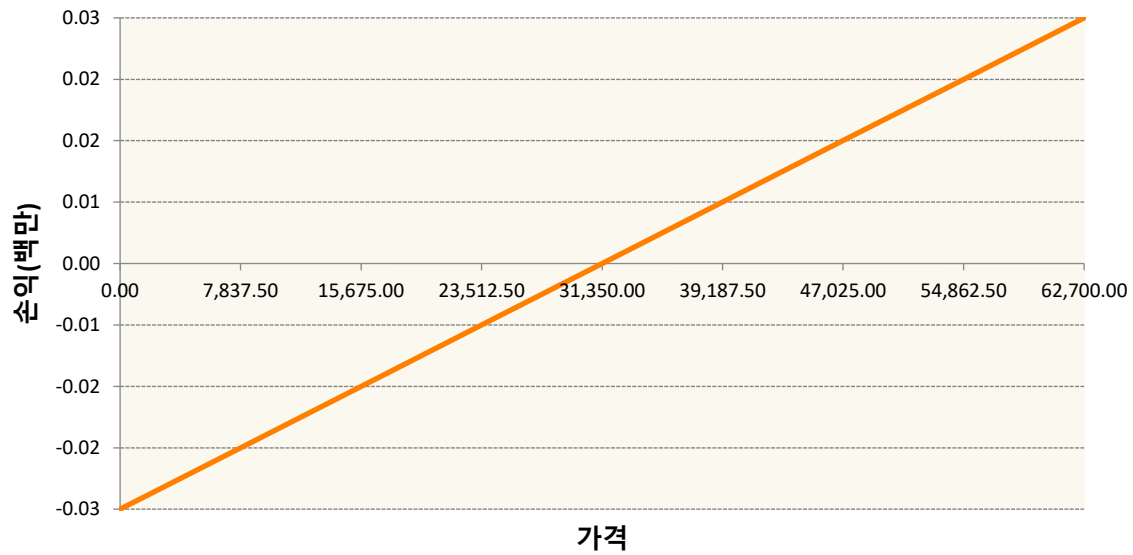
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



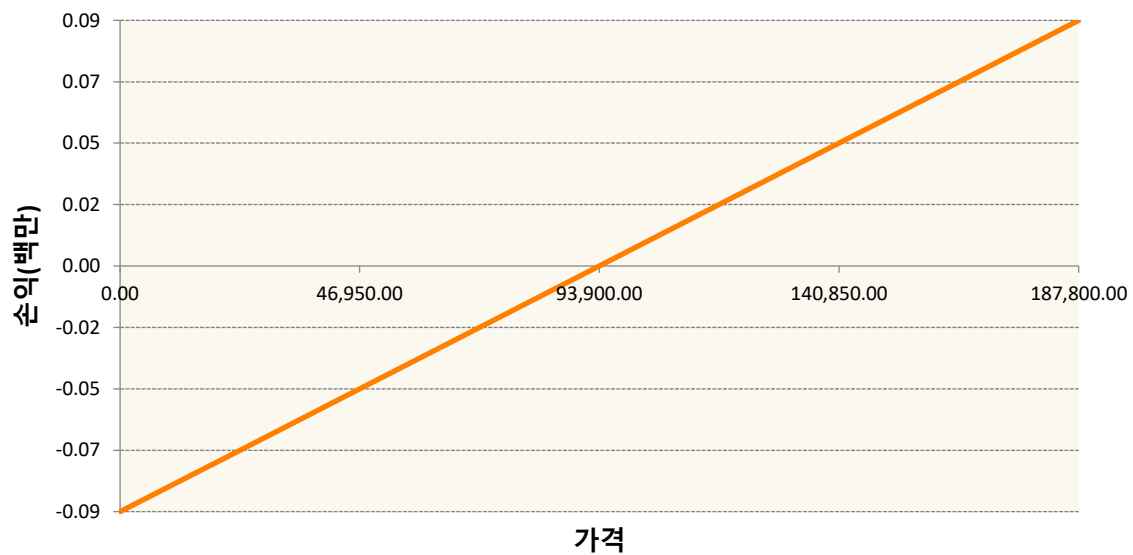
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



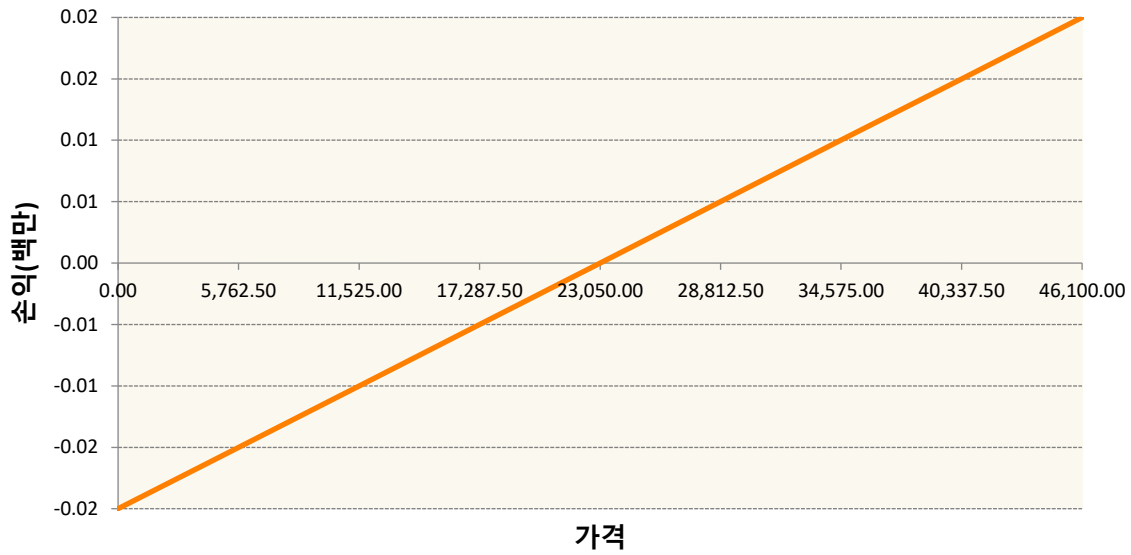
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



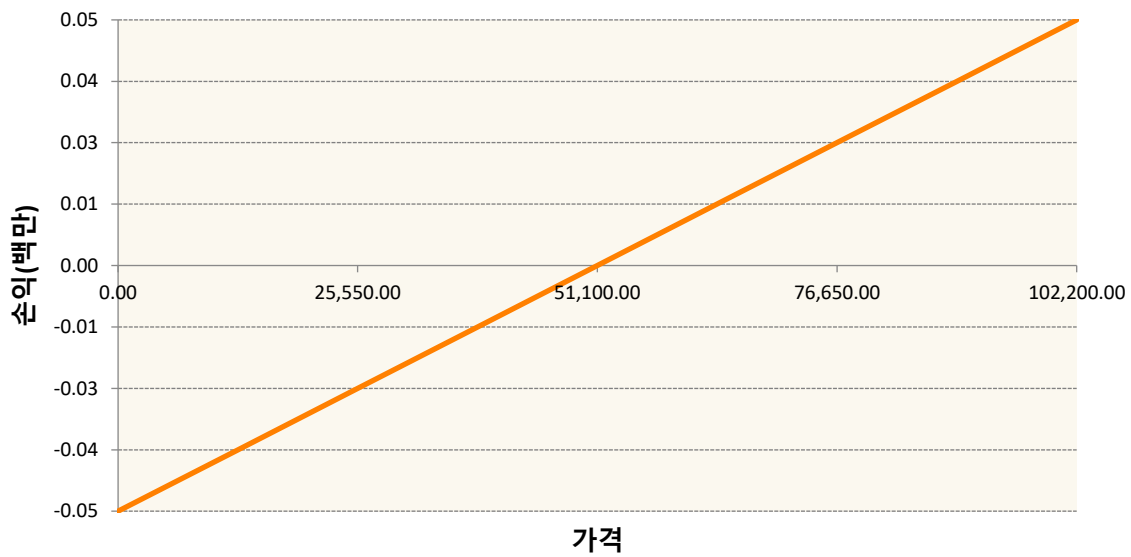
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



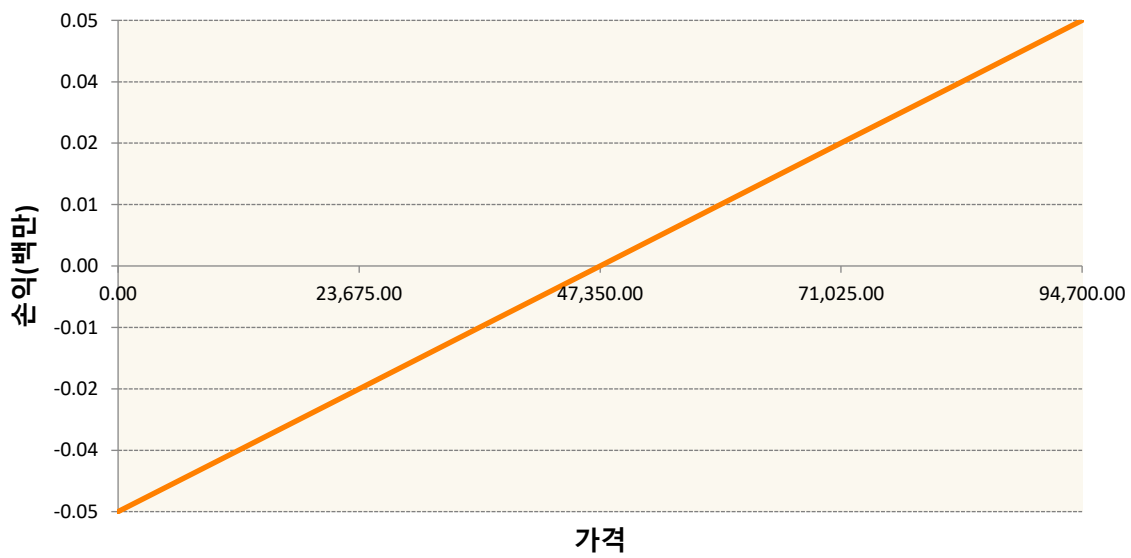
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



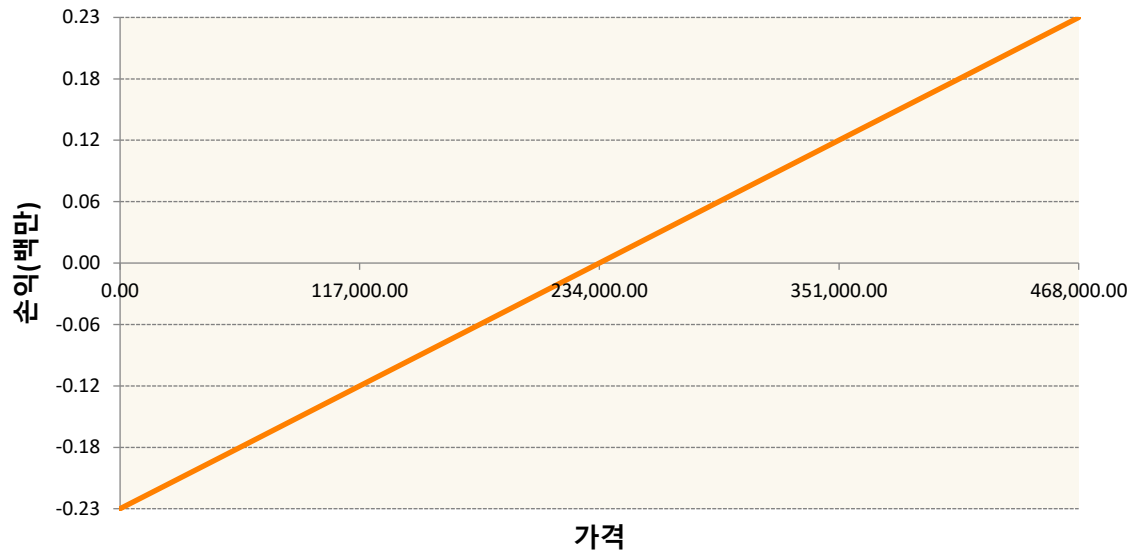
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41GOW70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	66
KR4141W70(2025-07 SK이노베이션개별선물	6
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	11
KR41F7W70(2025-07 카카오페이개별선물	3
KR41FAW70(2025-07 HMM개별선물	3
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	2
KR41G0W70 2025-07 씨에스윈드개별선물	0.27
KR41HEW70 2025-07 키움증권개별선물	3

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

(단위:백만원)

211

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

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	3,720	0	3,720	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래250320	305
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

492

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

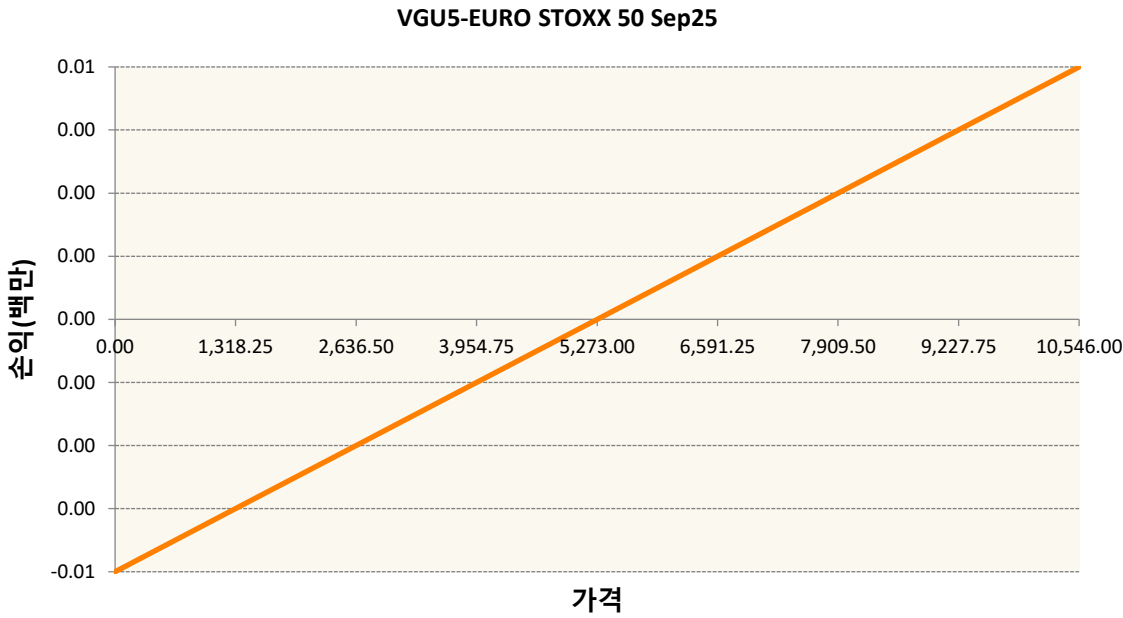
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	917	0	917	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU5	EURO STOXX 50 Sep25	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

61

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

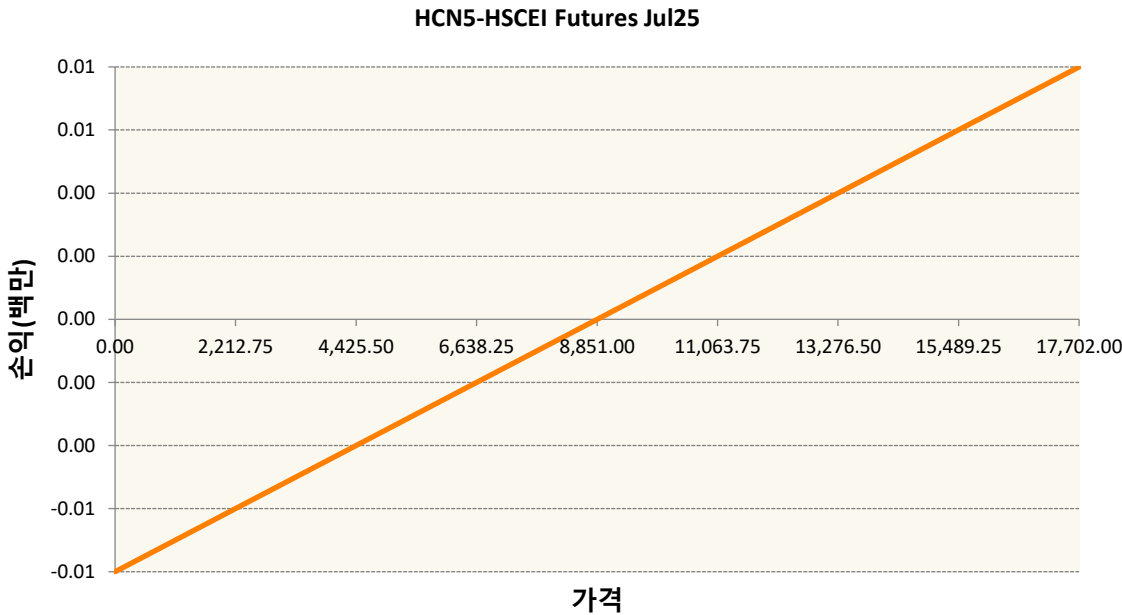
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,151	0	2,151	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN5	HSCEI Futures Jul25	172
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

249

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

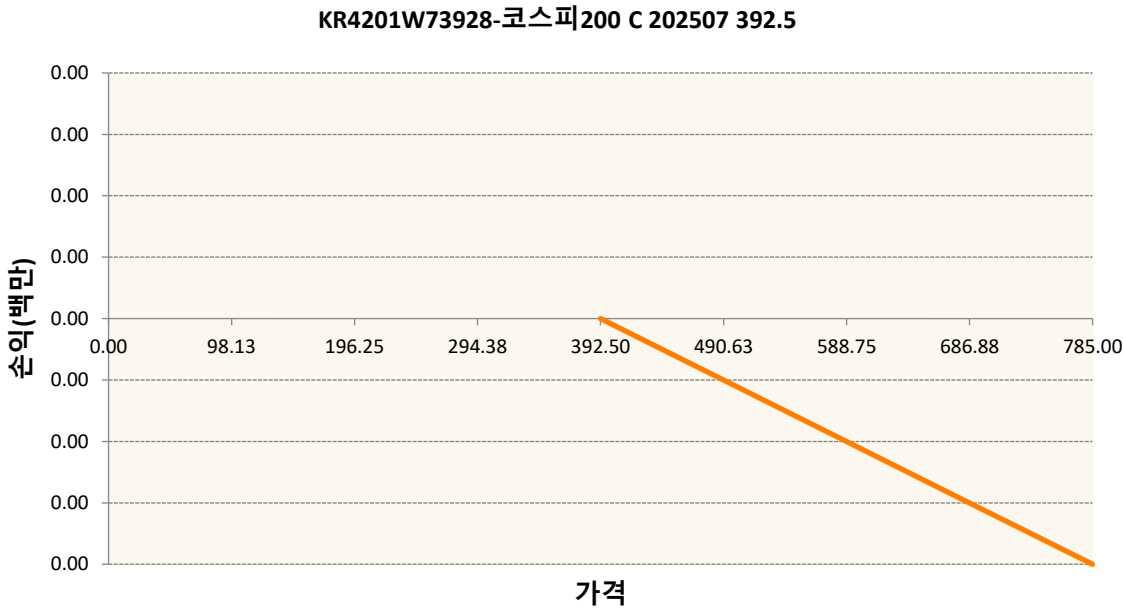
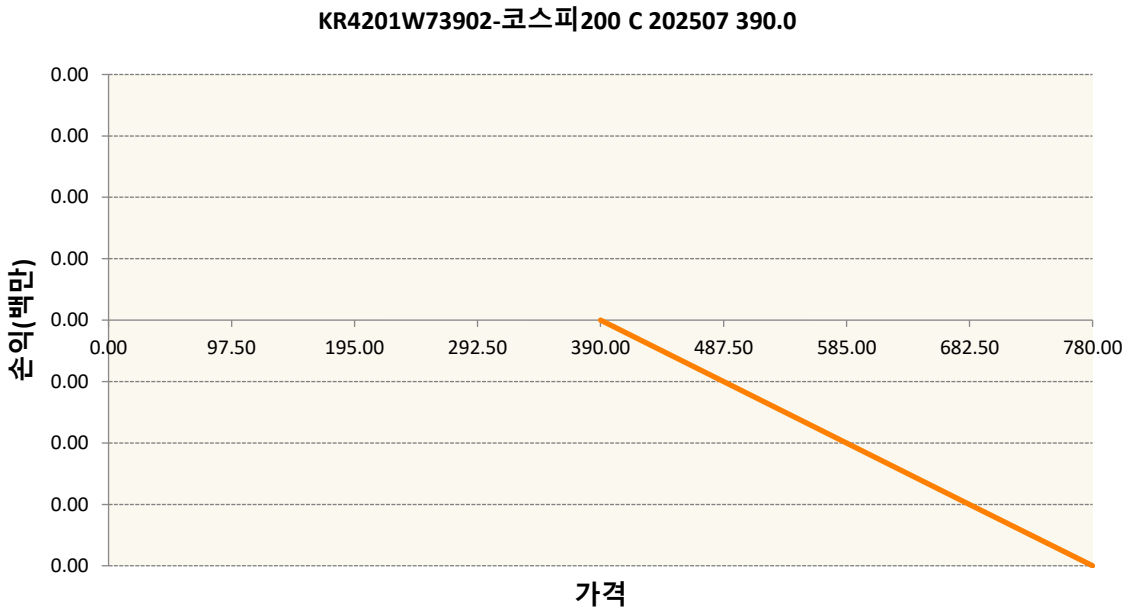
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	34,569	-34,569	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

가액	순익 (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					1,770
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,306	1,275	1,242	1,210	1,176	1,143	1,109
-5.33%	1,031	996	960	925	889	853	818
-2.67%	589	565	539	511	482	453	422
0%	39	29	16	0	-18	-38	-59
2.67%	-553	-556	-561	-568	-577	-588	-600
5.33%	-1,158	-1,158	-1,159	-1,162	-1,165	-1,170	-1,176
8.00%	-1,764	-1,764	-1,764	-1,765	-1,766	-1,768	-1,770
KR4201W73928		코스피200 C 202507 392.5					569
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	396	387	377	367	357	347	336
-5.33%	320	308	296	285	273	261	249
-2.67%	188	179	169	159	149	139	129
0%	16	11	6	0	-7	-14	-22
2.67%	-175	-176	-178	-181	-184	-188	-193
5.33%	-370	-370	-371	-372	-373	-375	-378
8.00%	-566	-566	-567	-567	-567	-568	-569
KR4301W73900 코스피200 P 202507 390.0							147

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-116	-122	-128	-134	-140	-147
-5.33%	-36	-43	-49	-56	-63	-70	-77
-2.67%	-4	-8	-12	-17	-22	-27	-33
0%	5	4	2	0	-3	-6	-9
2.67%	7	7	6	5	4	3	1
5.33%	7	7	7	7	6	6	5
8.00%	7	7	7	7	7	7	7

KR4301W73926 코스피200 P 202507 392.5							55
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-45	-47	-49	-51	-53	-55
-5.33%	-16	-18	-20	-22	-25	-27	-29
-2.67%	-2	-3	-5	-7	-9	-11	-13
0%	2	2	1	0	-1	-2	-4
2.67%	3	3	3	2	2	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

2,598

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

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	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	2025-06-27
기준일	2025-06-26

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	4,208	0	4,208	

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	2025-06-27
기준일	2025-06-26

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	12,413	0	12,413	
누계	통화	선도	0	14,560	-14,560	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
FXW213F6D(KRW/USD 30-06-25E	9
FXW213F6SC KRW/USD 29-08-25E	220
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

579

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

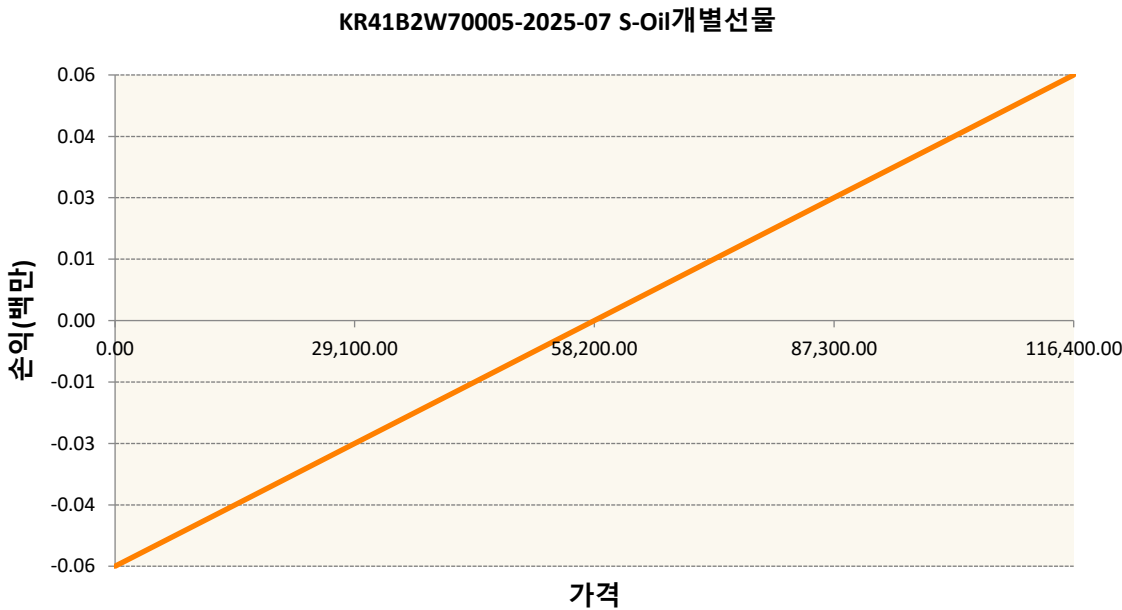
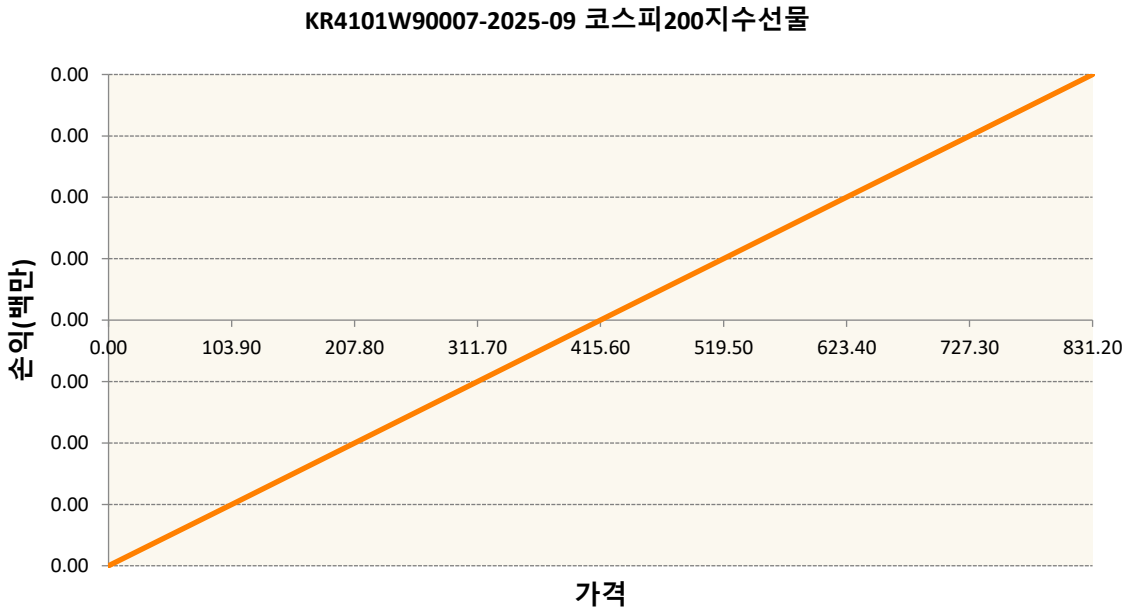
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

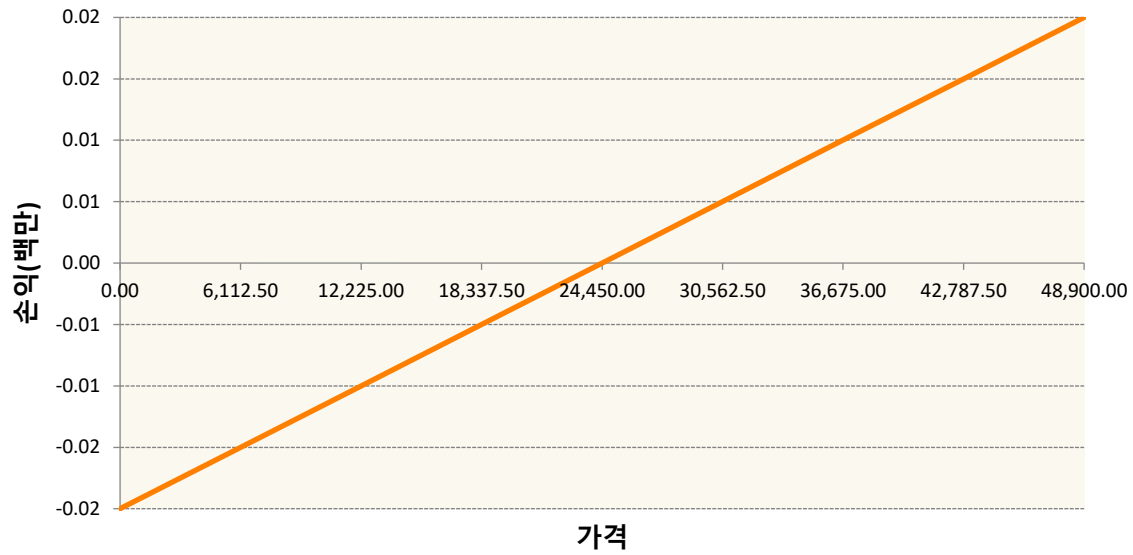
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	817	0	817	장내

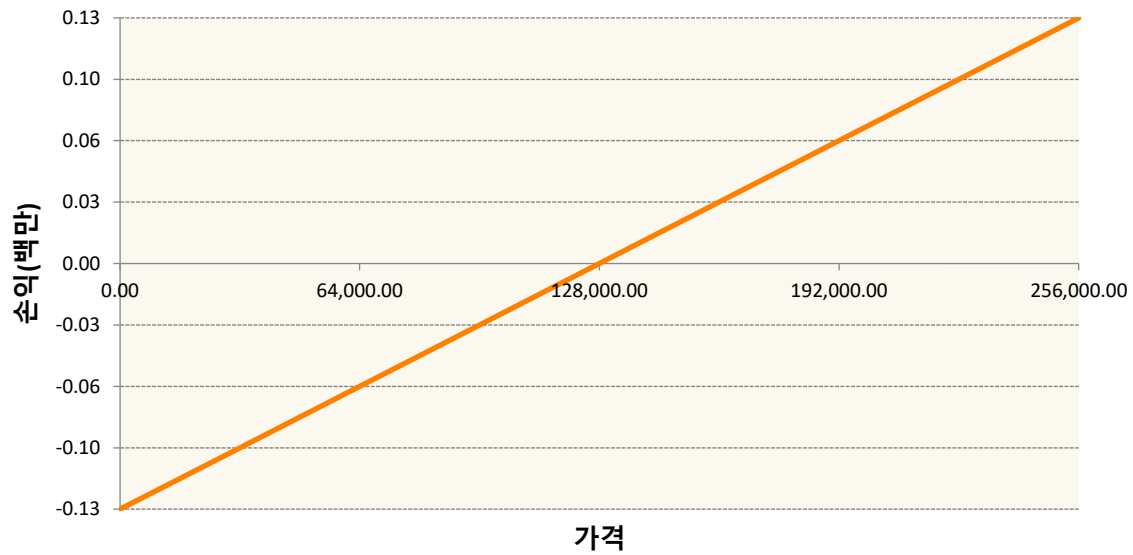
2. 만기시점의 손익구조



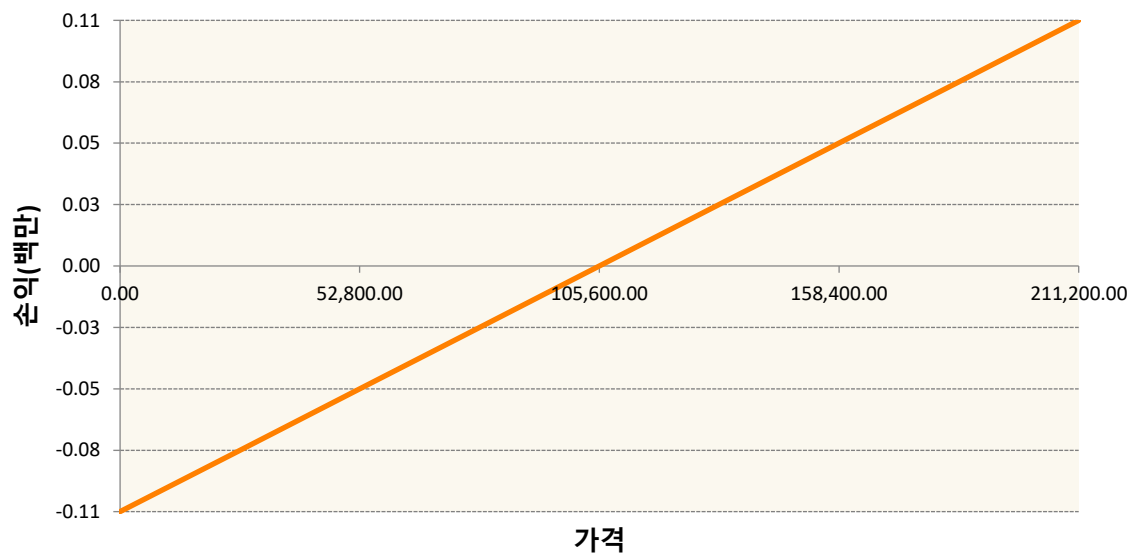
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



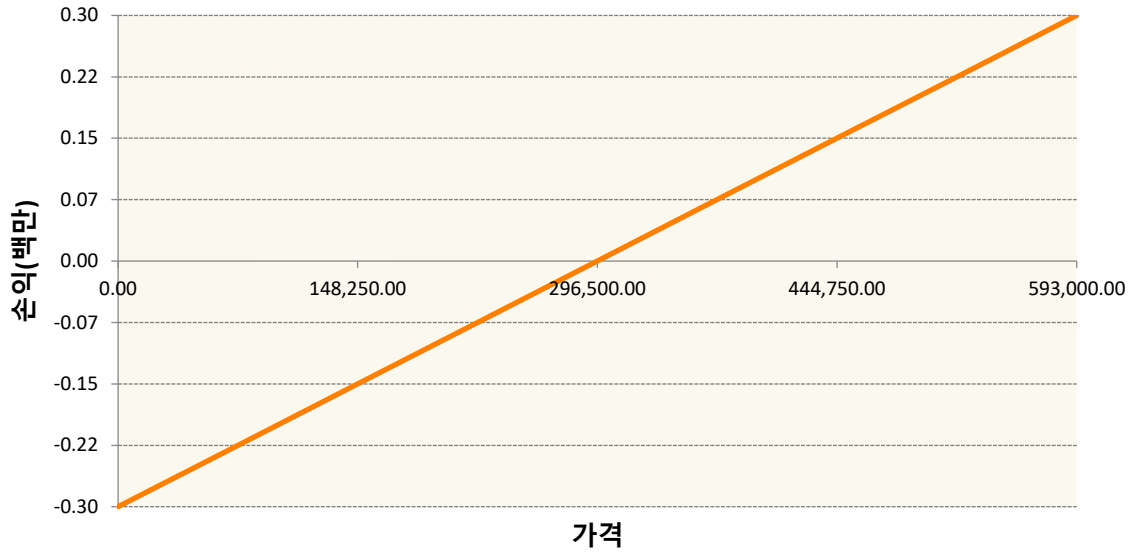
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



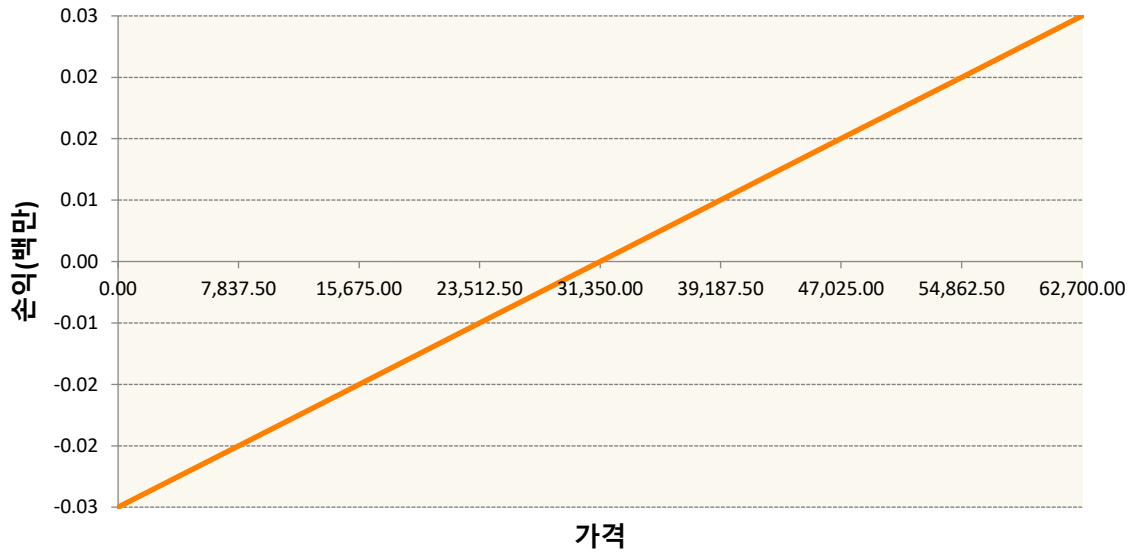
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



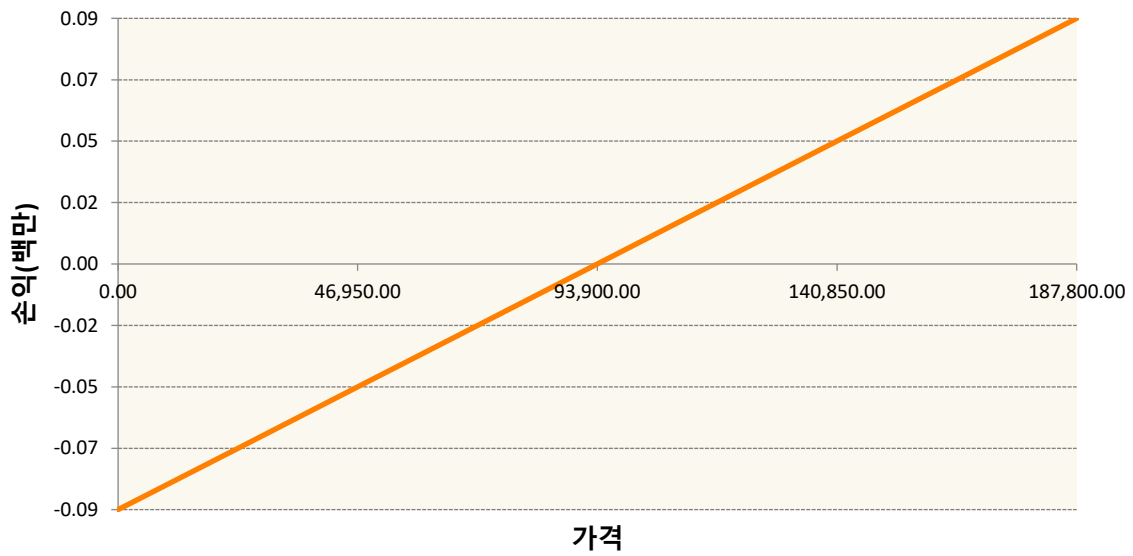
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



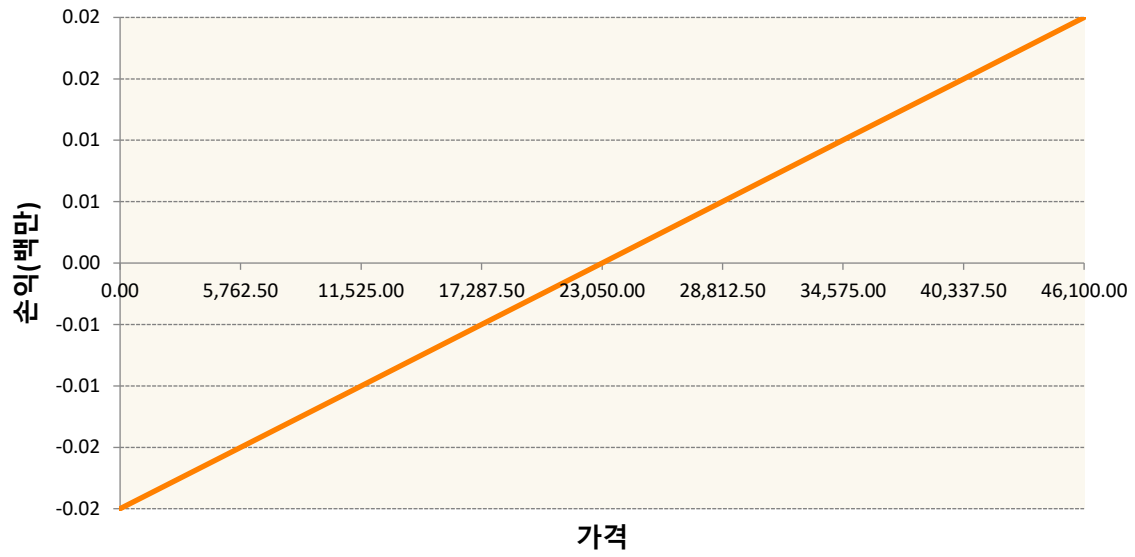
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



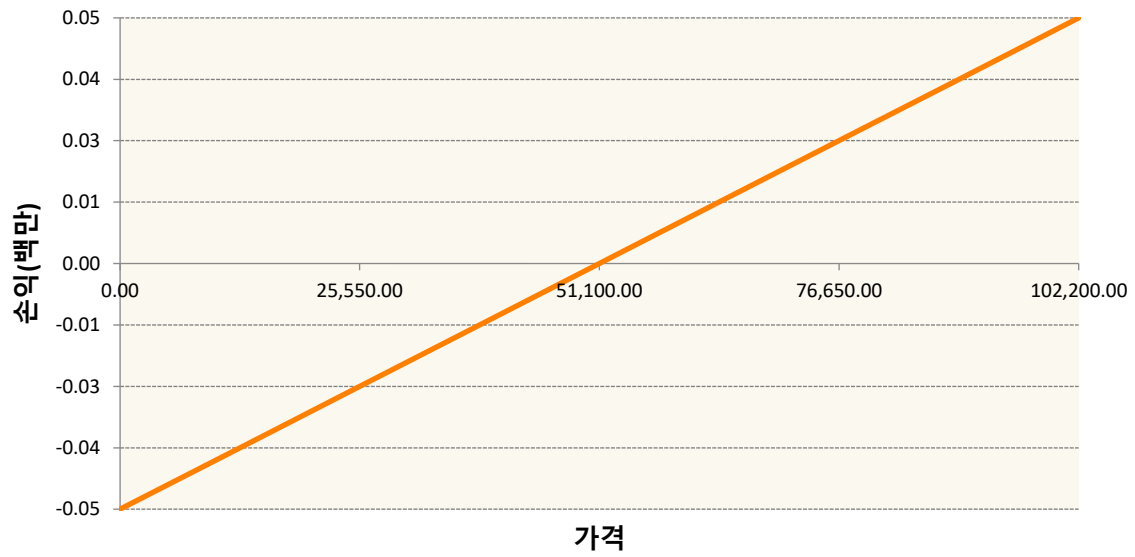
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



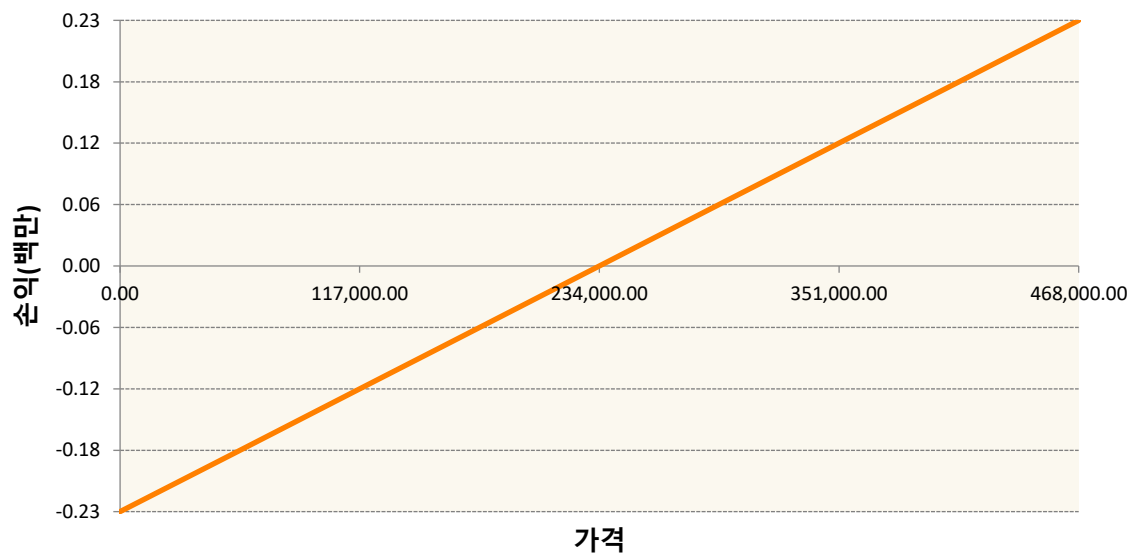
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	42
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
KR41F7W70(2025-07 카카오페이개별선물	1
KR41FAW70(2025-07 HMM개별선물	4
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	1
KR41HEW70(2025-07 키움증권개별선물	1

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

117

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

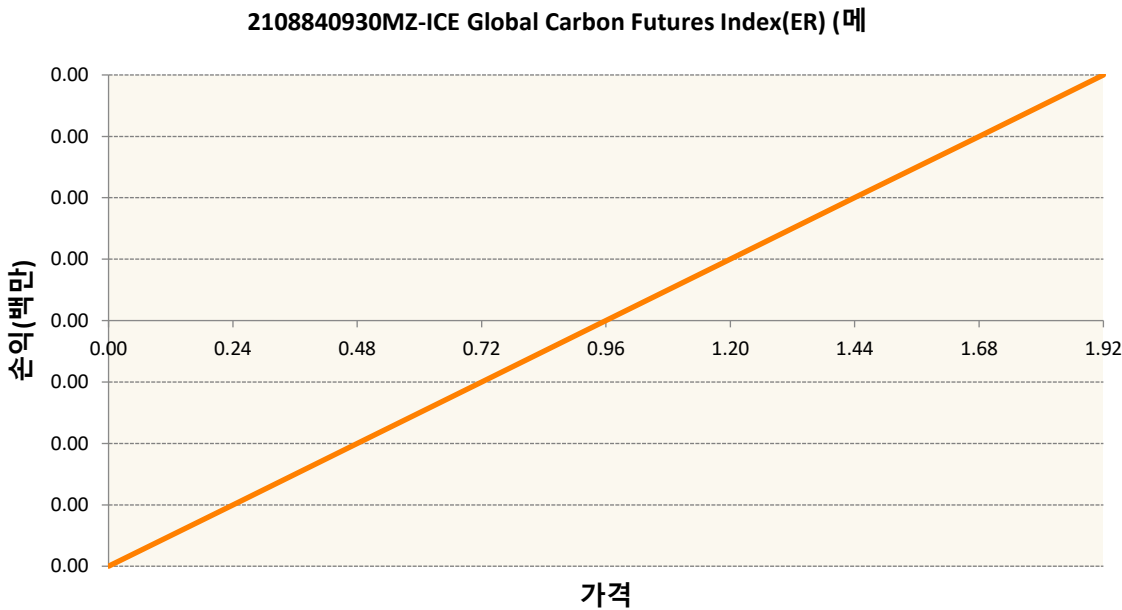
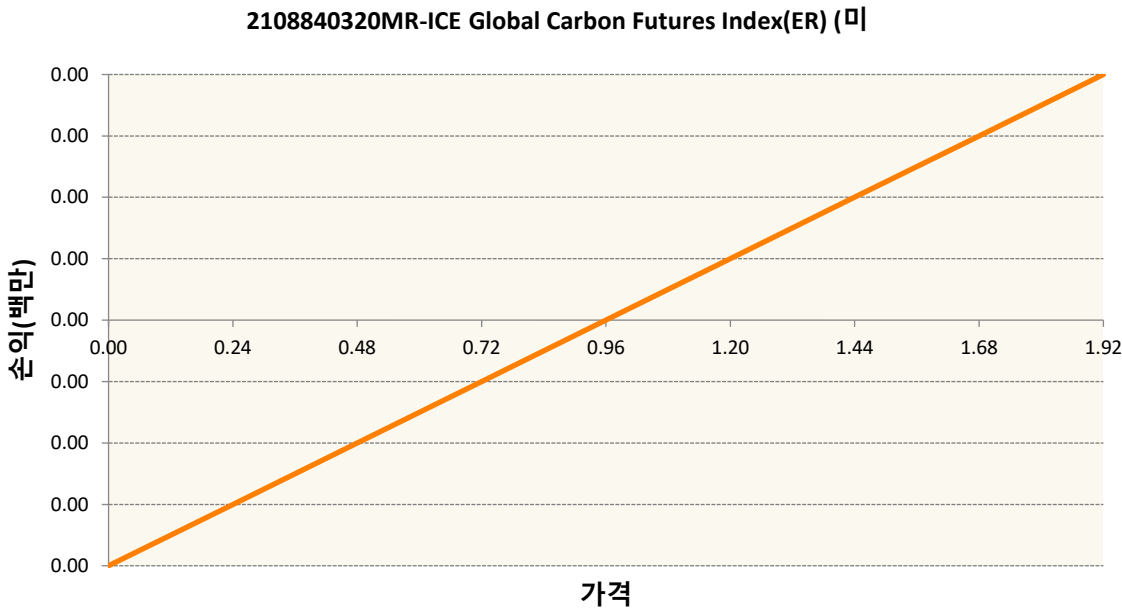
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,662	0	9,662	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	578
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	193

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	877

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

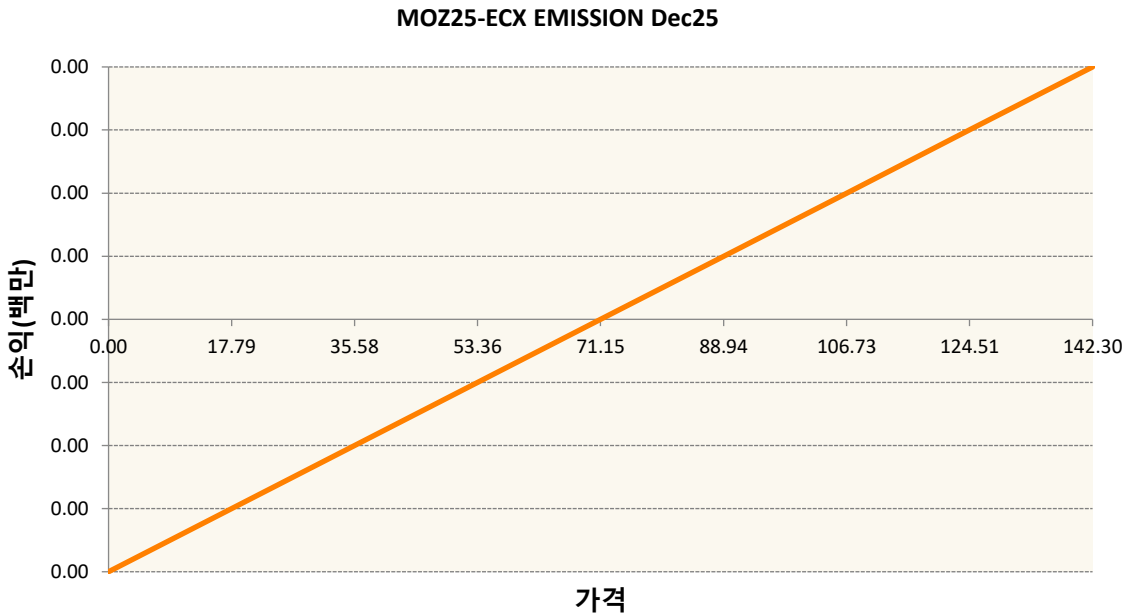
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,439	0	6,439	
누계	통화	선도	0	1,404	-1,404	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	1
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	34
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	79
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	517

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

(단위:백만원)

941

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

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	3,462	0	3,462	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (NH)	0.02
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (메리츠)	0.03
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	0.03
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	0.02

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

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	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)

15

공시일 2025-06-27

기준일 2025-06-26

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	2025-06-27
기준일	2025-06-26

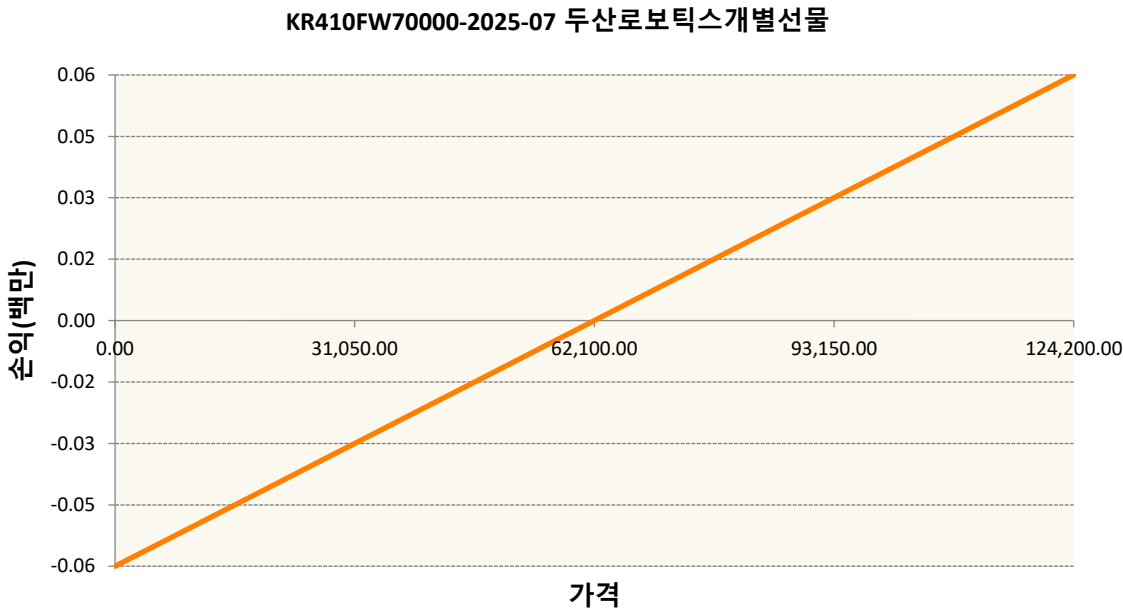
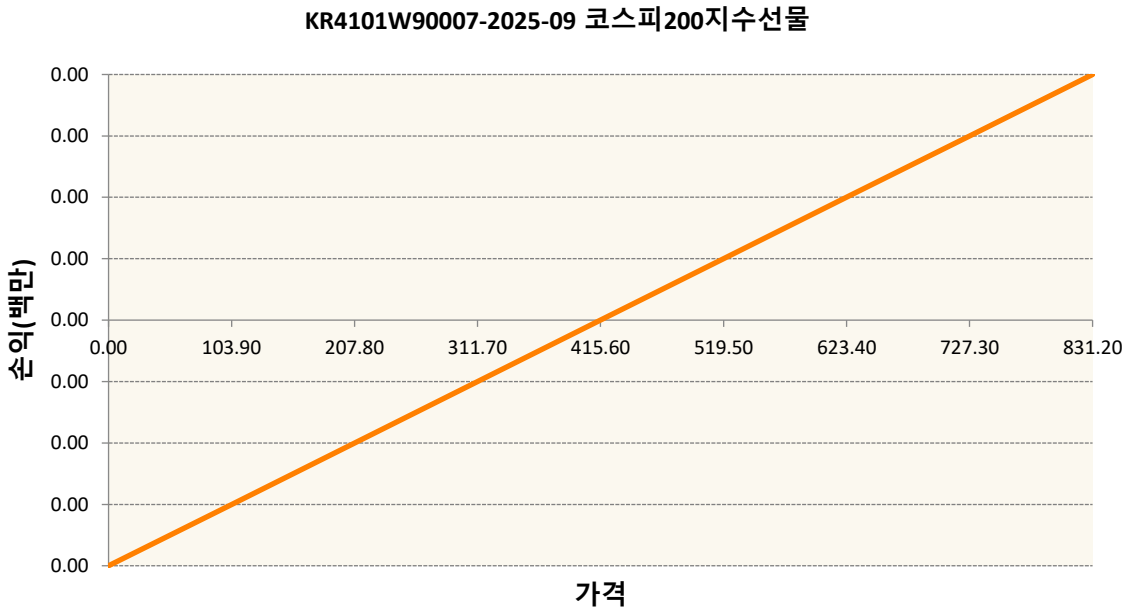
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

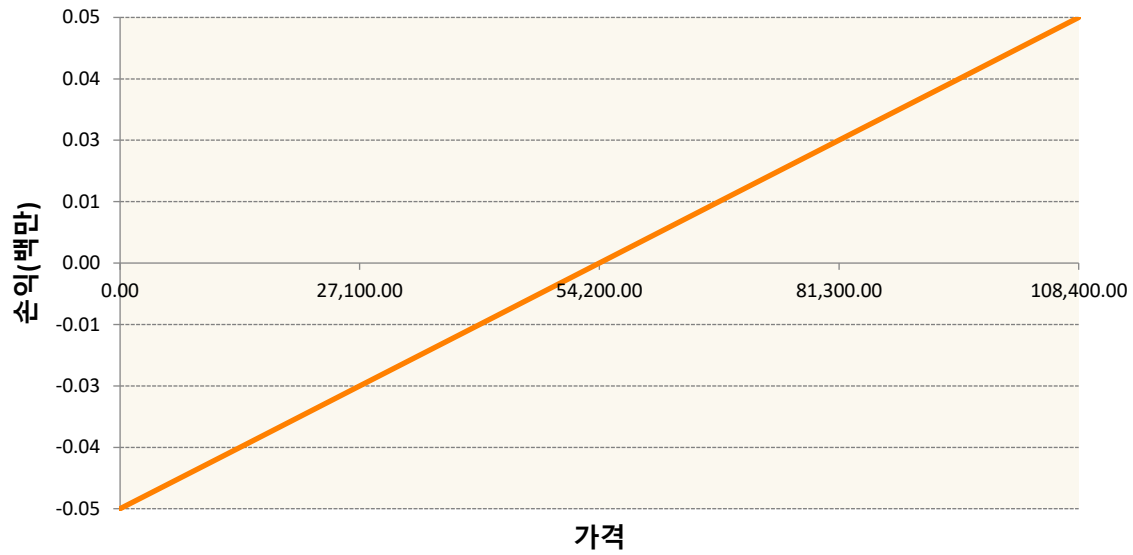
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,611	0	12,611	장내

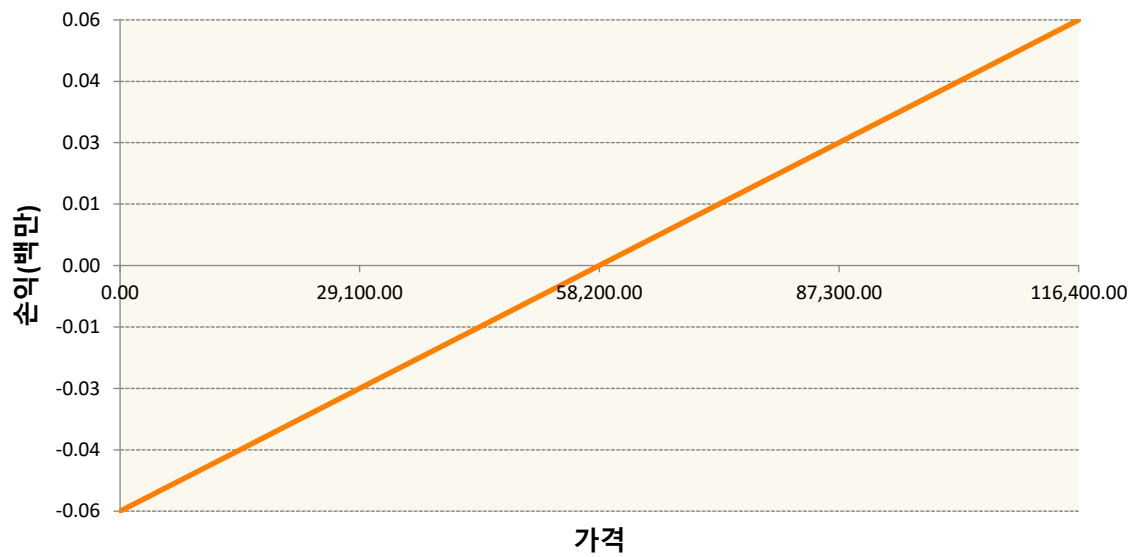
2. 만기시점의 손익구조



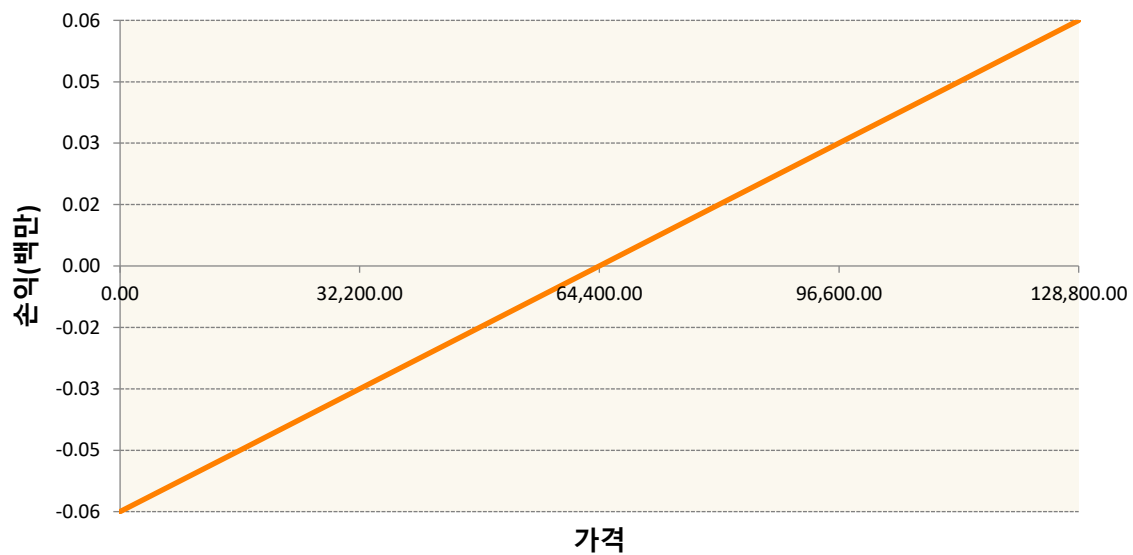
KR411RW70003-2025-07 한화비전개별선물



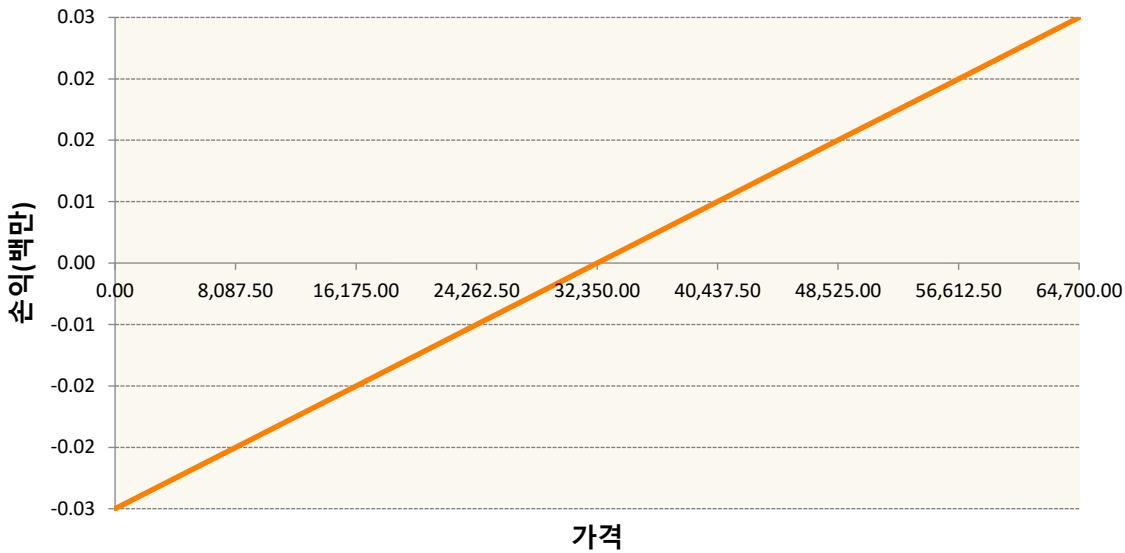
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



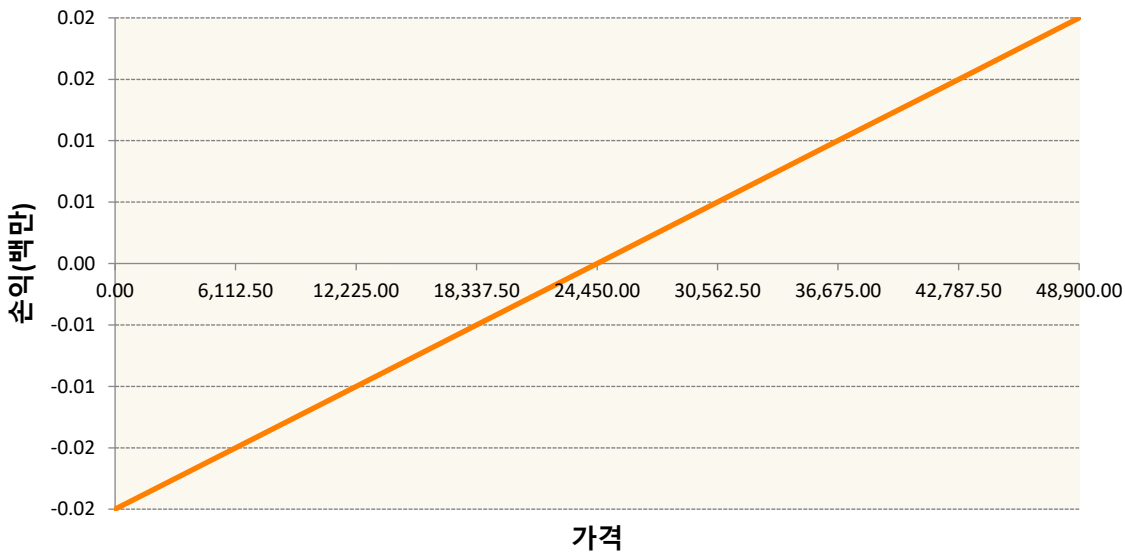
KR41B9W70000-2025-07 두산에너지개별선물



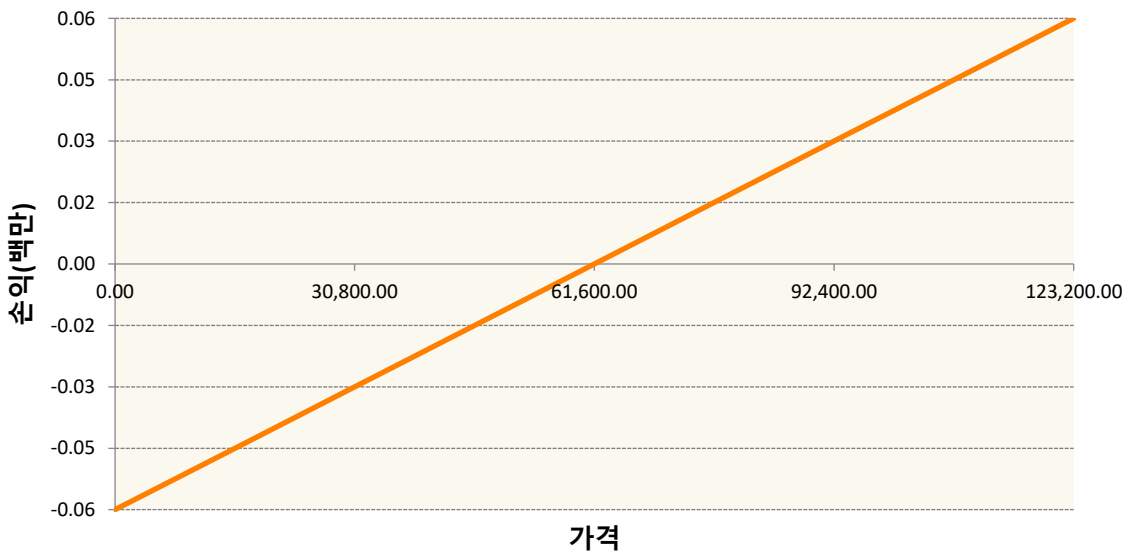
KR41CBW70003-2025-07 한화솔루션개별선물



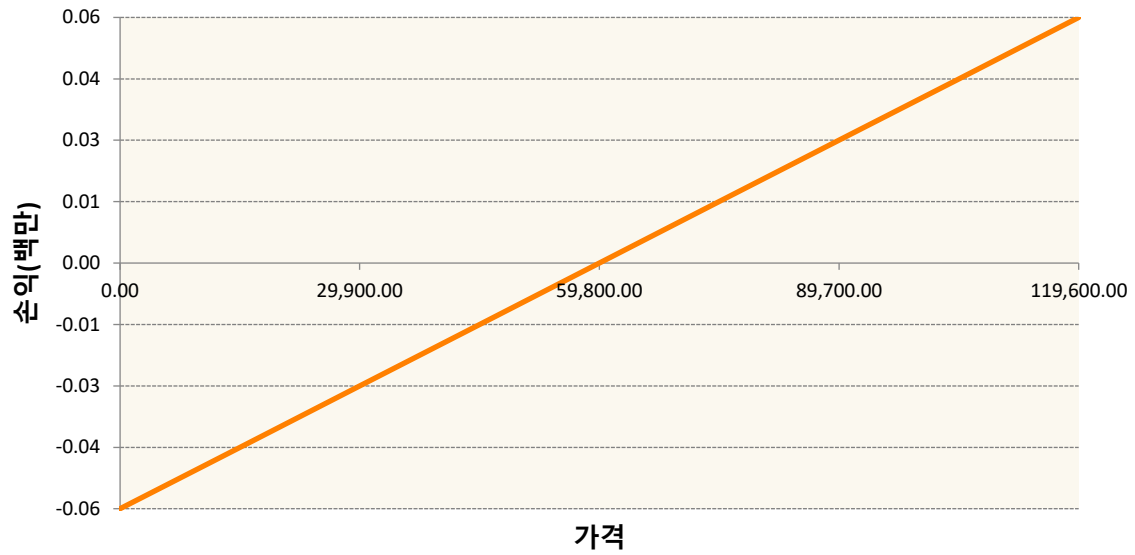
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



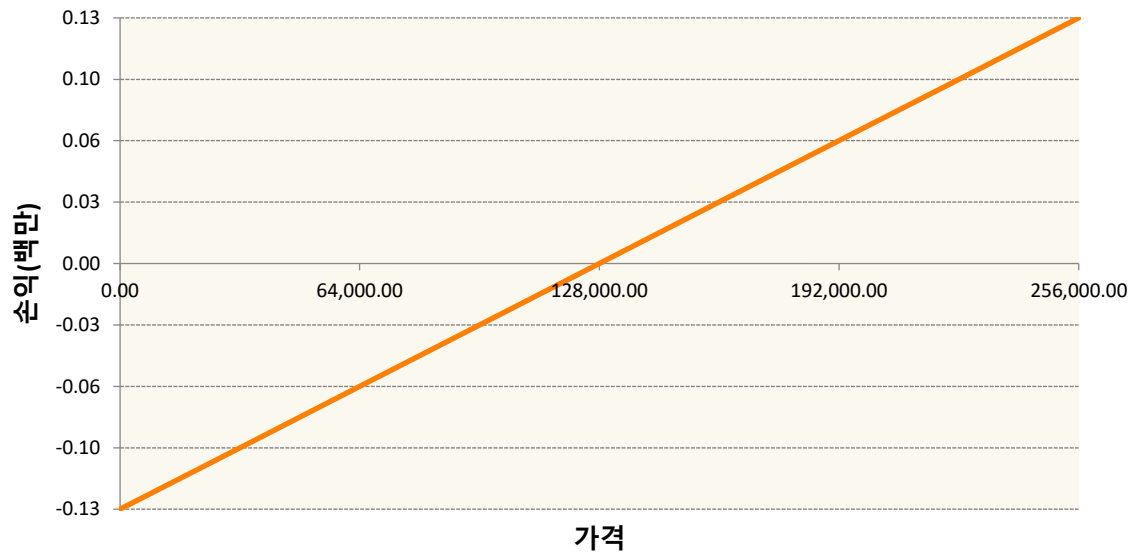
KR41D7W70002-2025-07 한전KPS개별선물



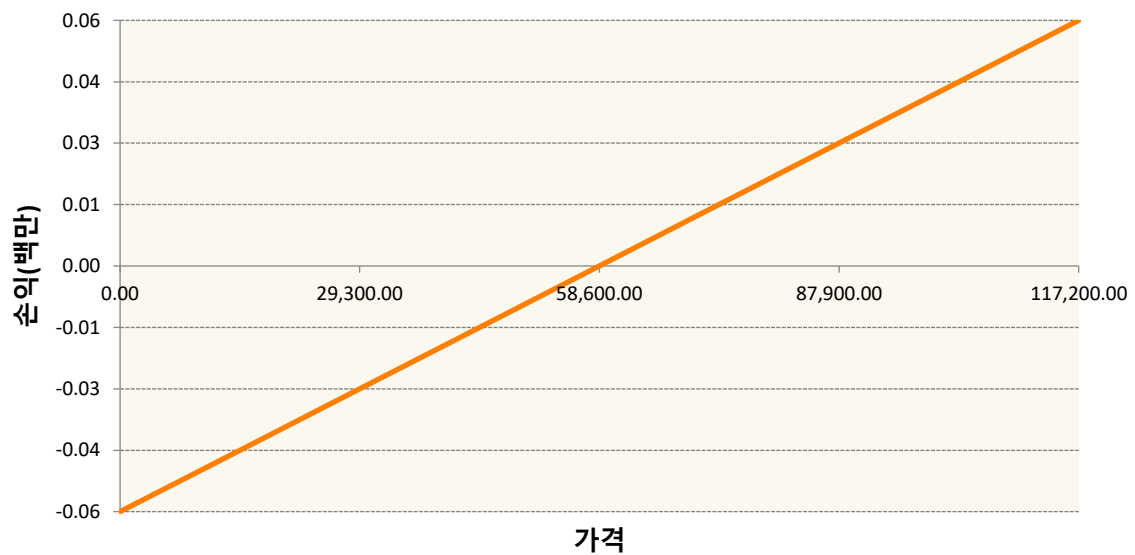
KR41DWW70007-2025-07 두산밥캣개별선물



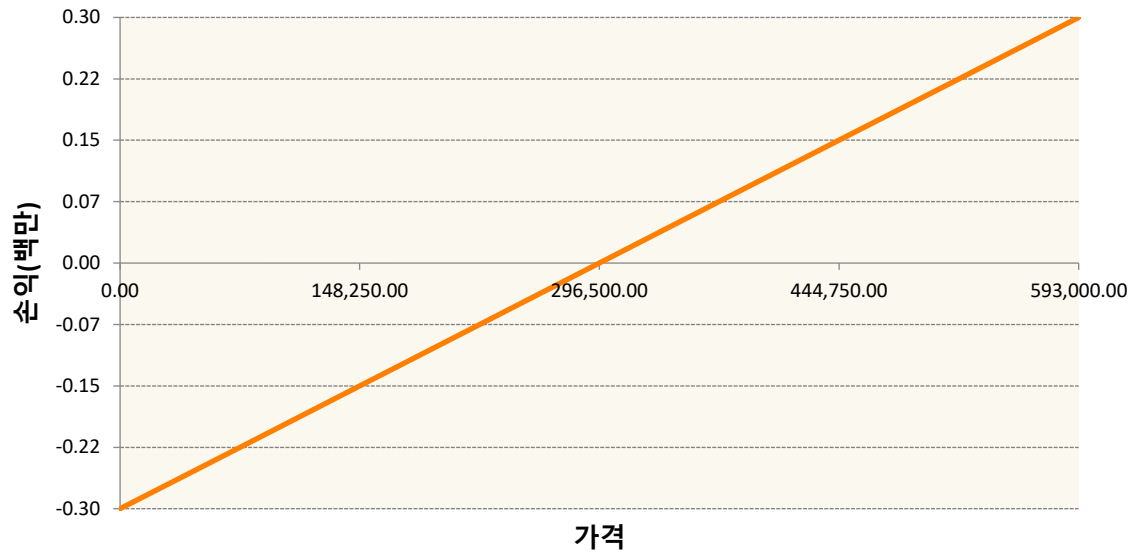
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



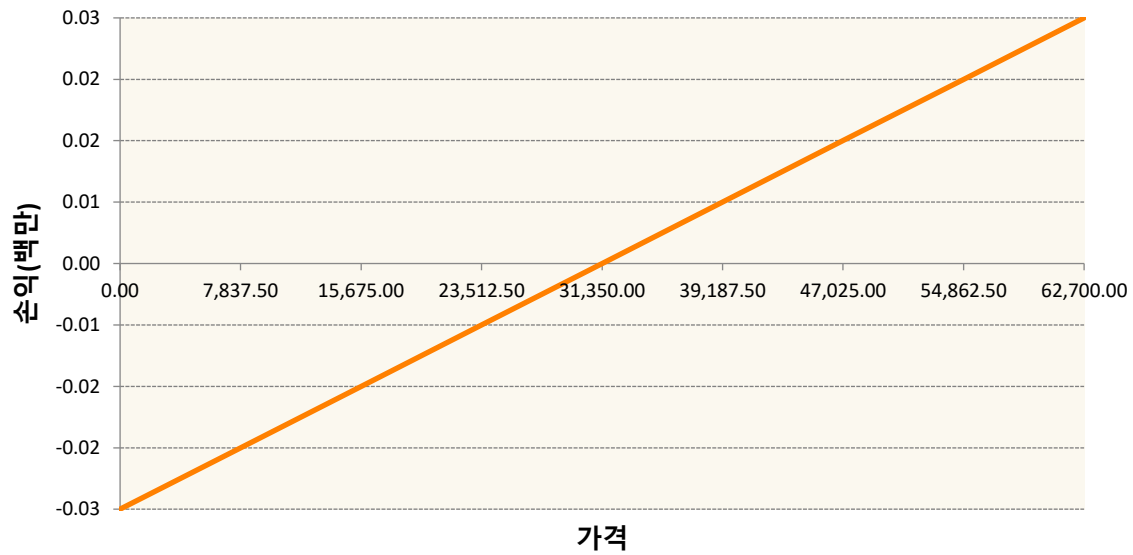
KR41EVW70007-2025-07 한화시스템개별선물



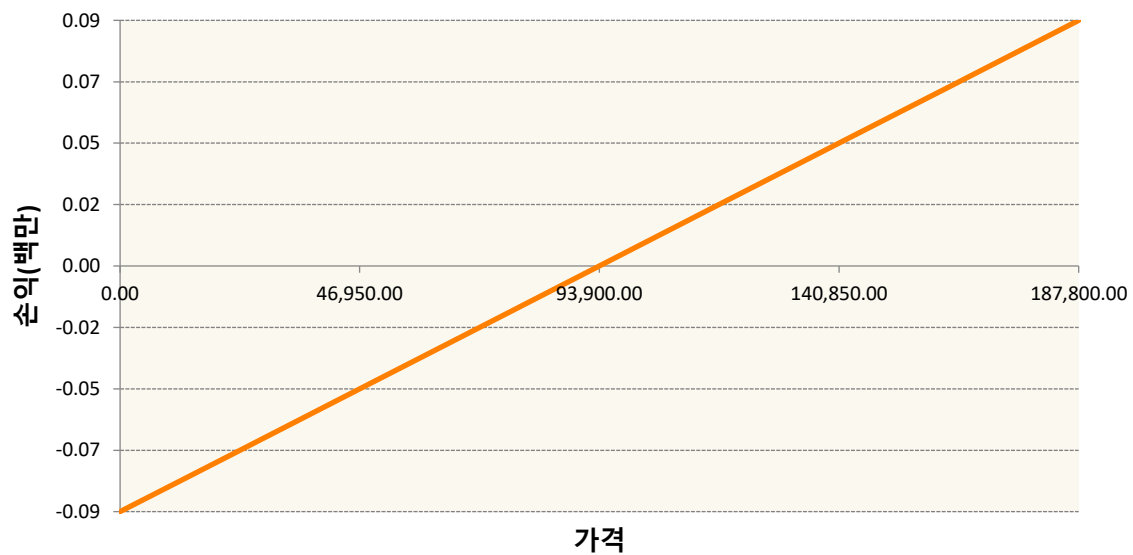
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



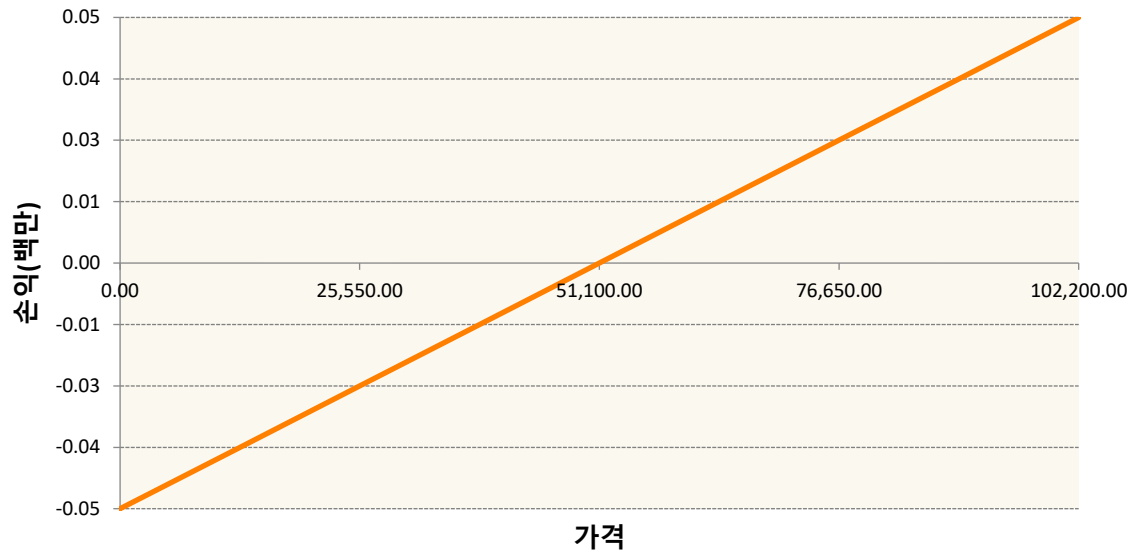
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



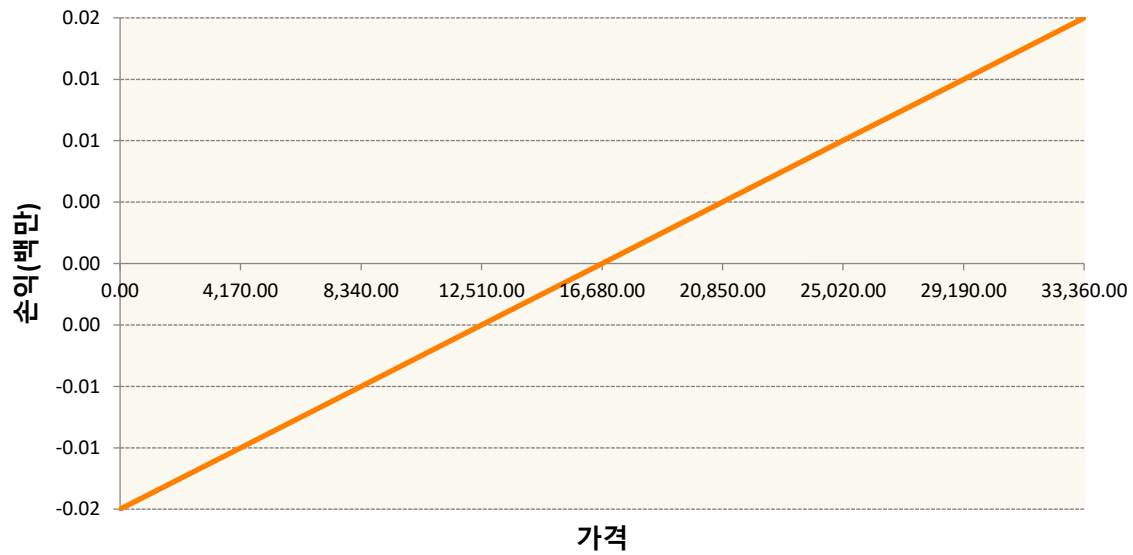
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



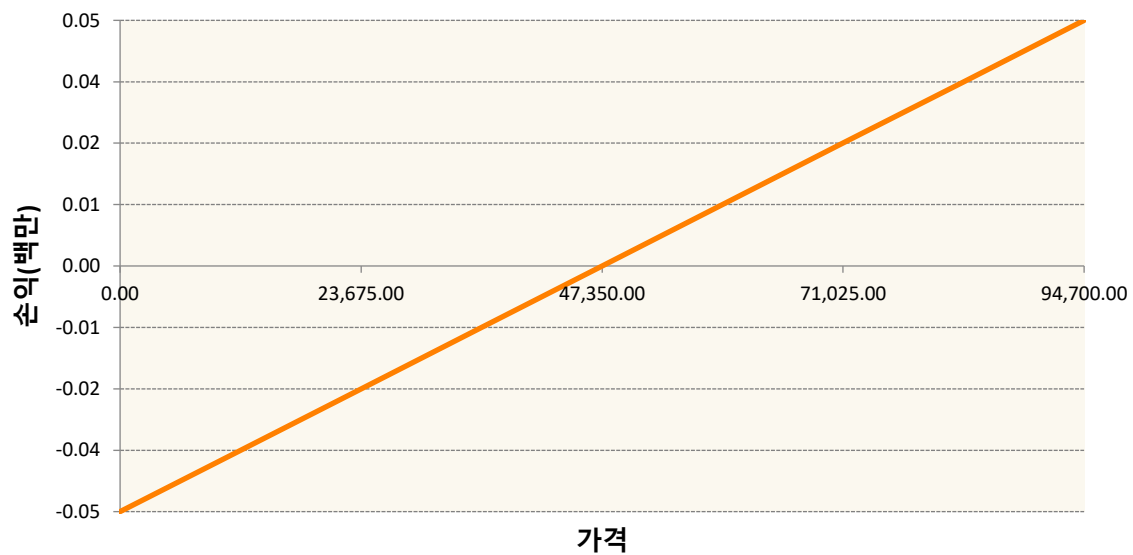
KR41FMW70003-2025-07 엘애프개별선물



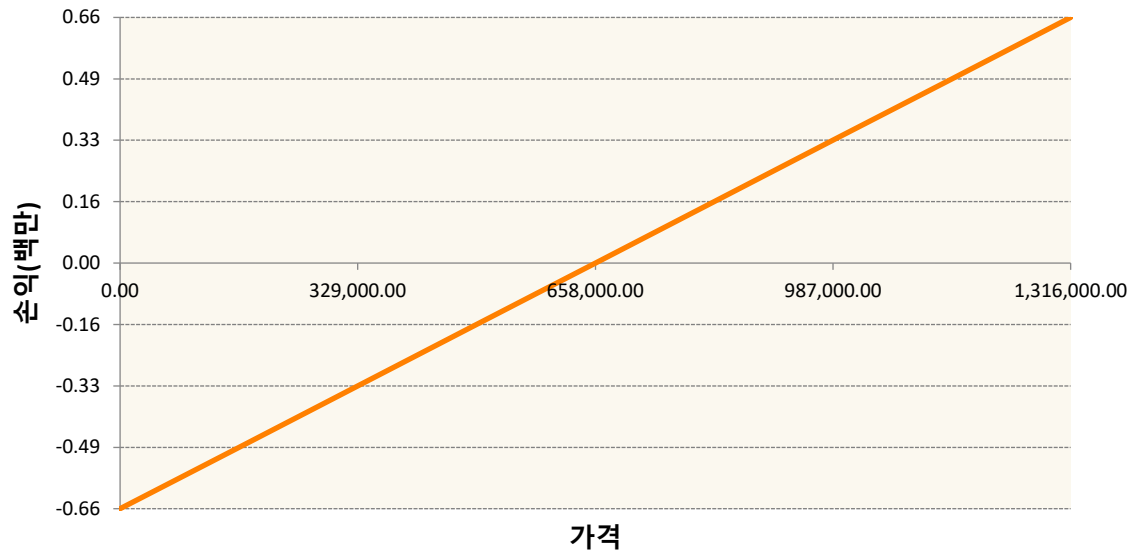
KR41FWW70002-2025-07 대한전선개별선물



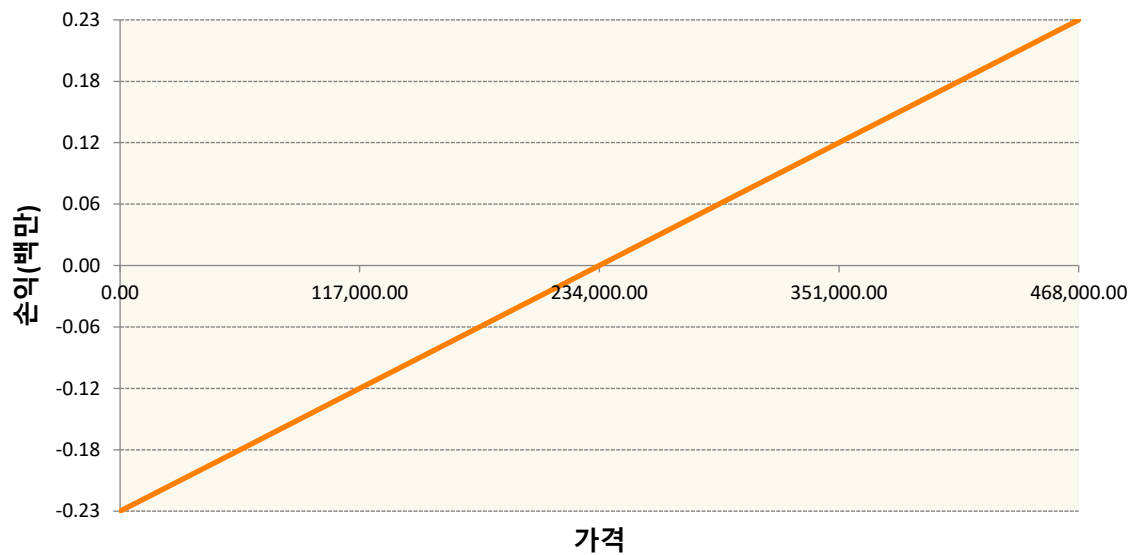
KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41GTW70006-2025-07 두산개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	598
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물	9
KR411RW70(2025-07 한화비전개별선물	19
KR41B2W70(2025-07 S-Oil개별선물	4
KR41B9W70(2025-07 두산에너지개별선물	1
KR41CBW70(2025-07 한화솔루션개별선물	31
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	13
KR41D7W70 2025-07 한전KPS개별선물	0.05
KR41DWW7(2025-07 두산밥캣개별선물	1
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물	36
KR41EVW70(2025-07 한화시스템개별선물	2
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	108

KR41F6W70(2025-07 카카오뱅크개별선물	109
KR41F7W70(2025-07 카카오페이개별선물	27
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	13
KR41FWW70 2025-07 대한전선개별선물	0.05
KR41G0W70(2025-07 씨에스원드개별선물	5
KR41GTW70(2025-07 두산개별선물	1
KR41HEW70(2025-07 키움증권개별선물	31

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

(단위:백만원)

1,927

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

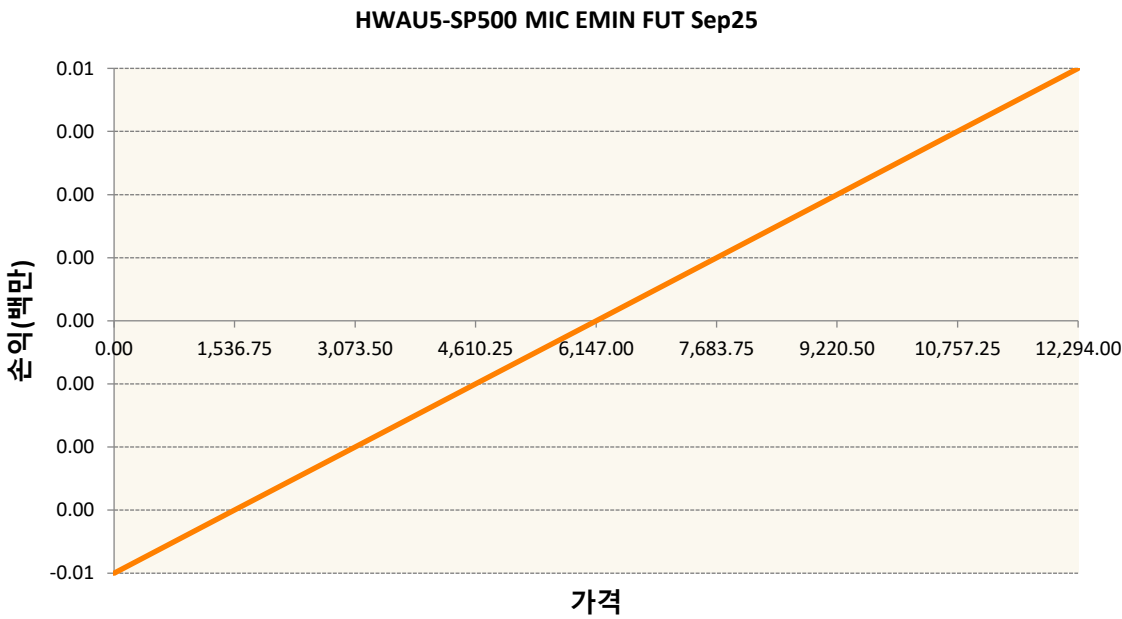
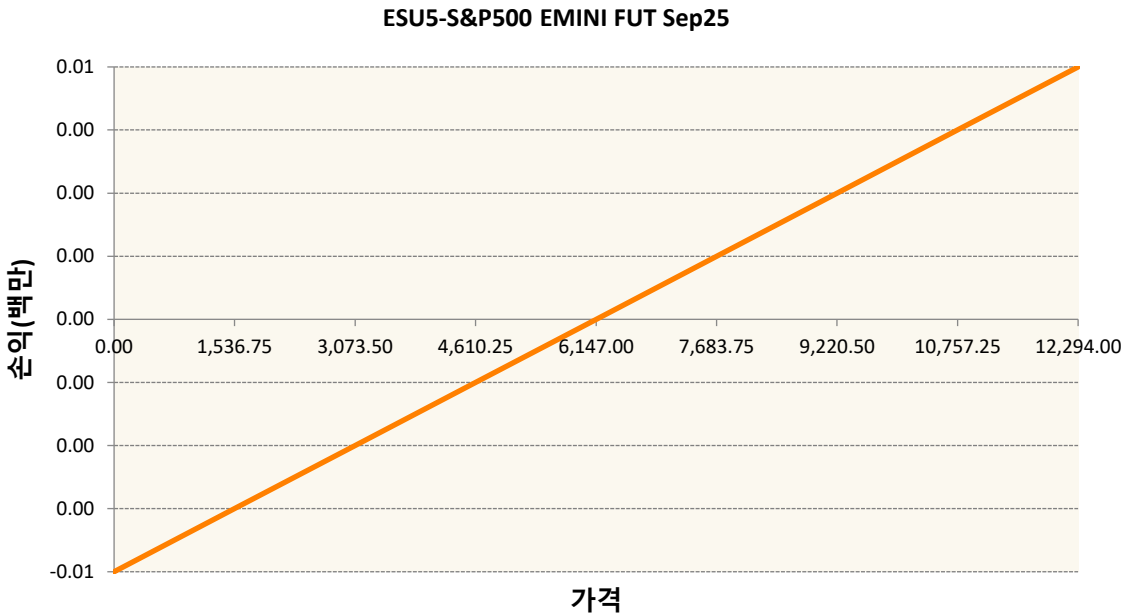
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	30,521	0	30,521	
누계	지수	선물	1,610	0	1,610	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,442
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	129

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,277

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

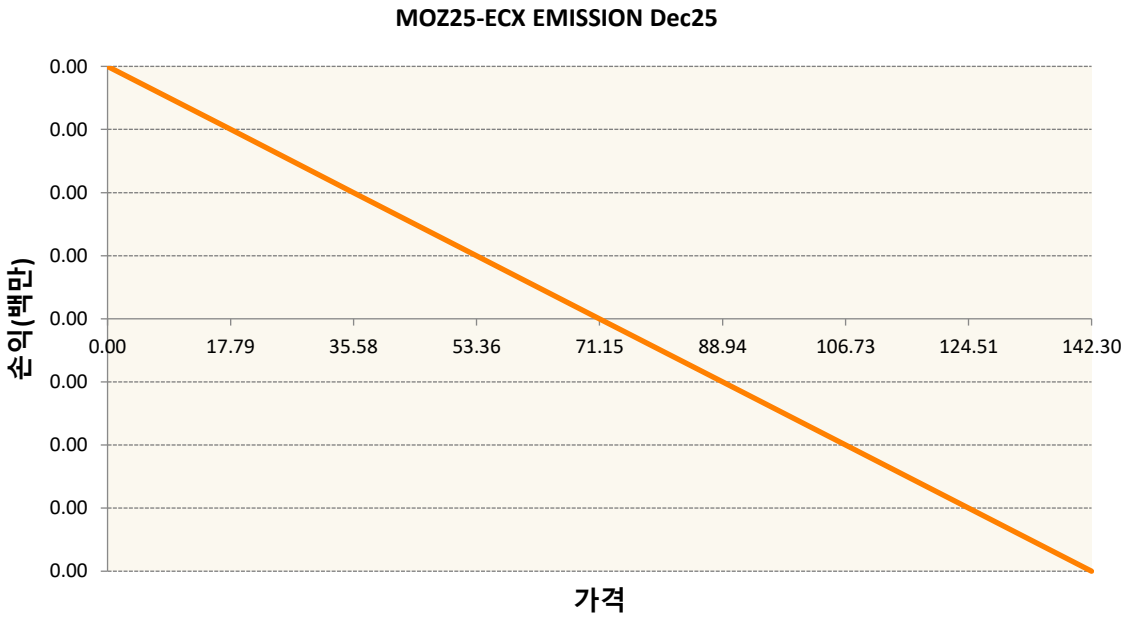
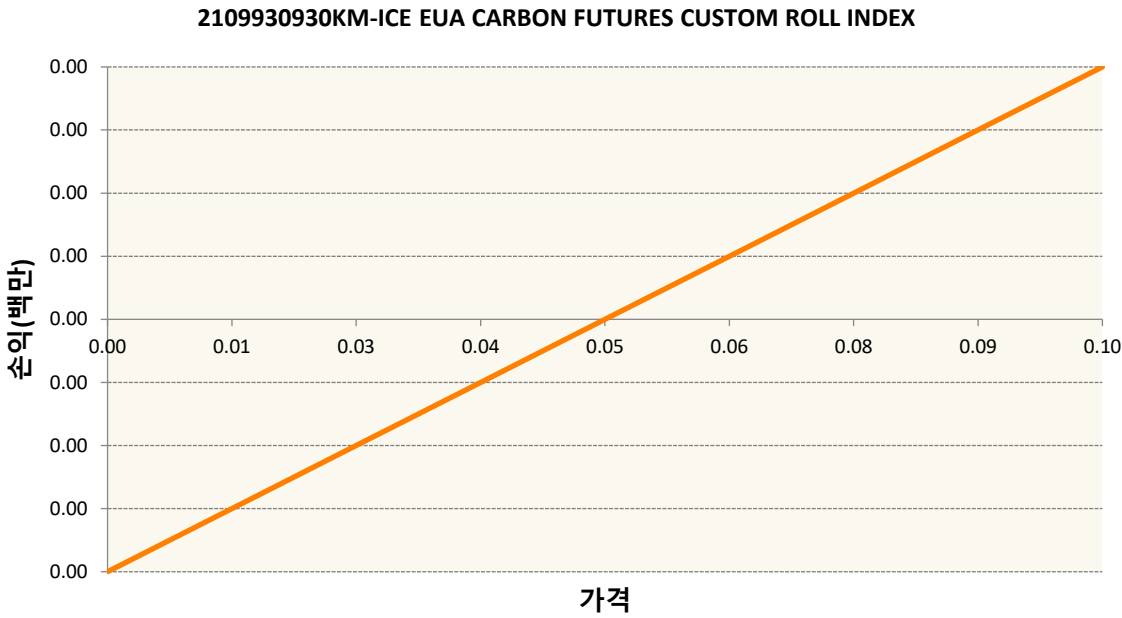
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	20	4,852	-4,832	
누계	통화	선도	0	962	-962	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F5V(KRW/EUR 30-06-25E	77
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	388

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

703

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

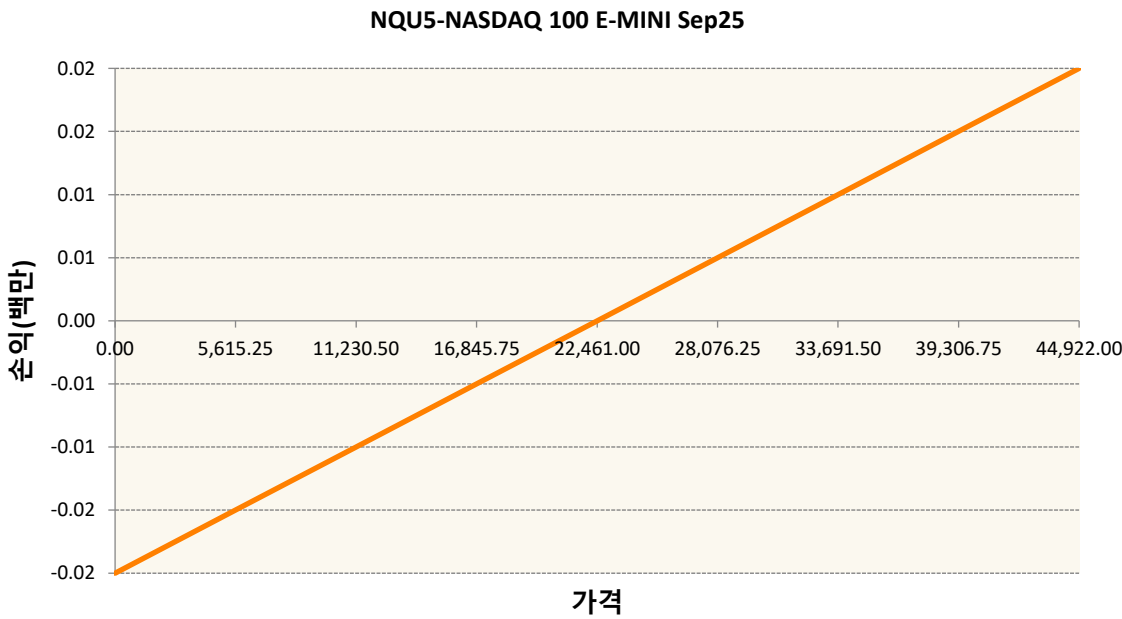
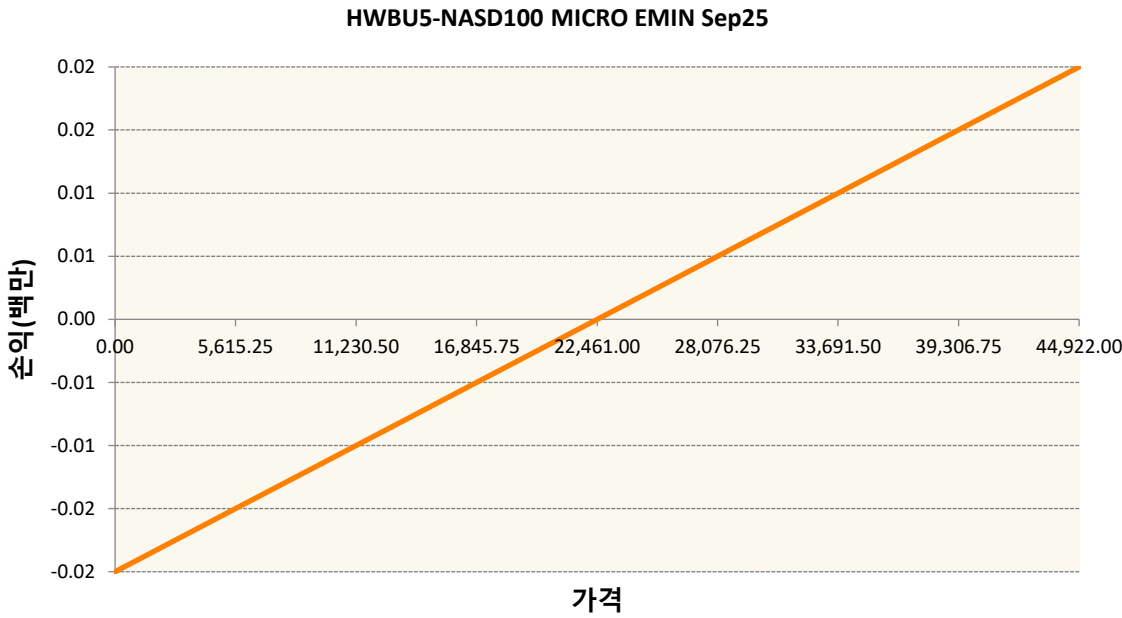
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,629	0	13,629	
누계	지수	선물	308	0	308	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25		25
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		1,090

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,281

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	40,395	0	40,395	장외
누계	지수	스왑	258,058	0	258,058	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,492
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,114
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,067
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,220

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

(단위:백만원)

10,805

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

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	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)

5

공시일	2025-06-27
기준일	2025-06-26

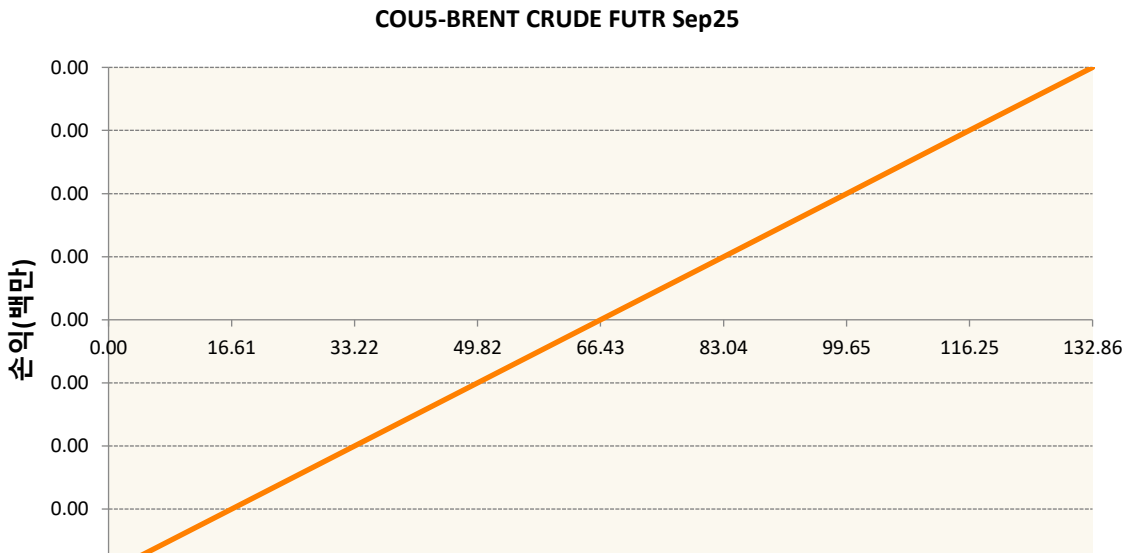
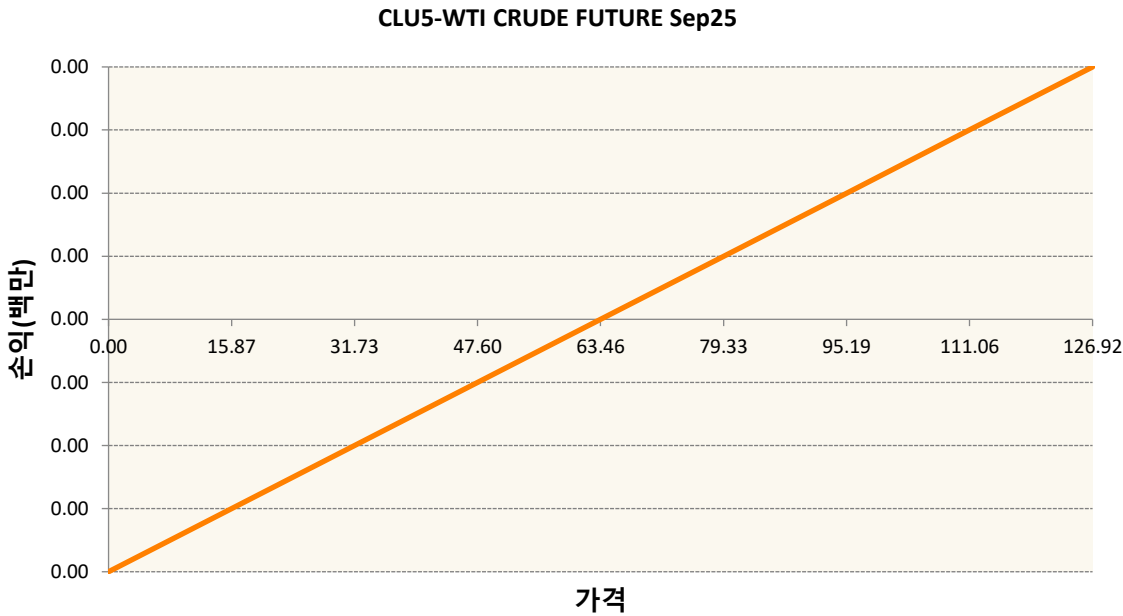
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

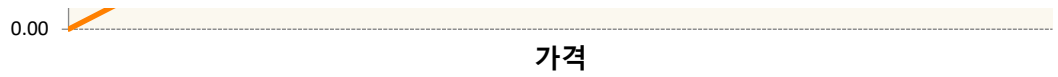
1. 계약금액

(단위:백만원)

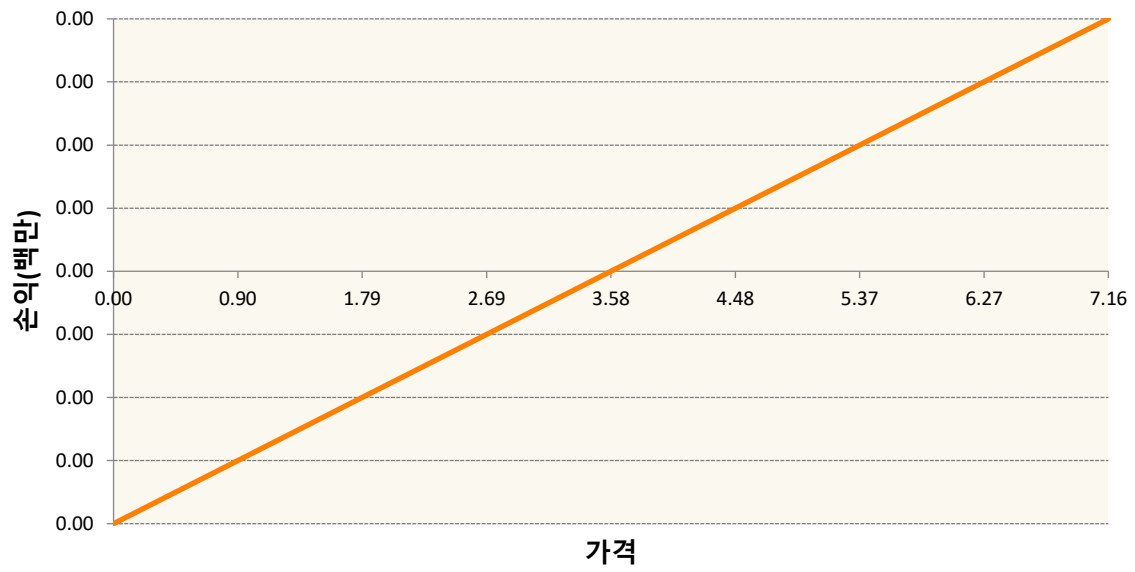
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	337	0	337	
누계	유가증권	선물	275	0	275	
누계	통화	선물	0	108	-108	장내

2. 만기시점의 손익구조

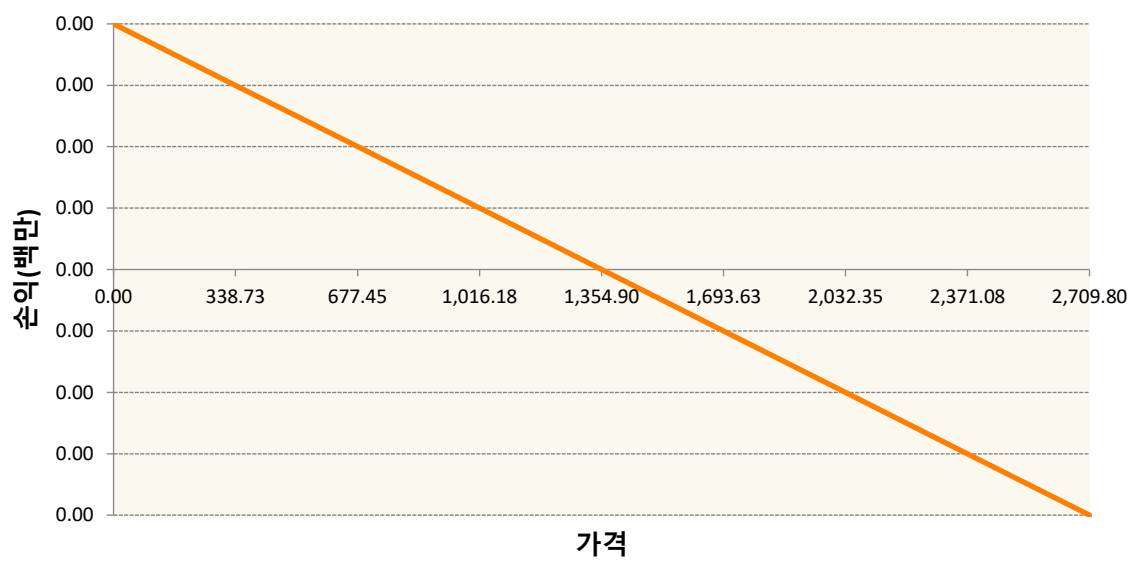




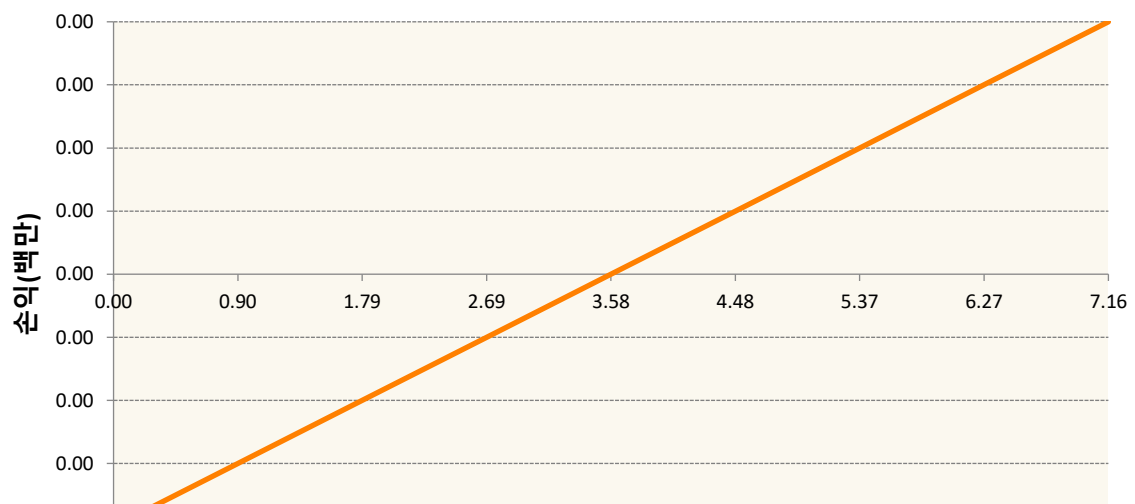
EOU5-E-MINI NATURAL GAS Sep25

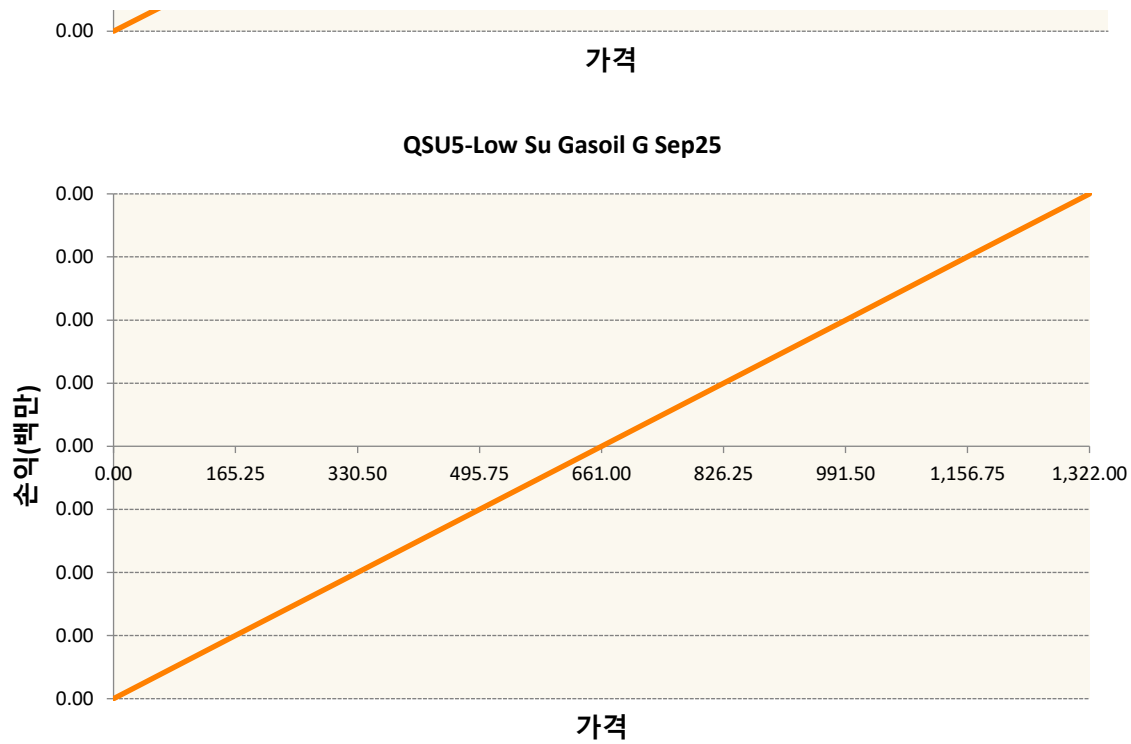


KR4175W70003-2025-07 달러선물



NGU25-NATURAL GAS FUTR Sep25





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLU5	WTI CRUDE FUTURE Sep25		7
COU5	BRENT CRUDE FUTR Sep25		15
EOU5	E-MINI NATURAL GAS Sep25		8
KR4175W70(2025-07 달러선물			9
NGU25	NATURAL GAS FUTR Sep25		12
QSU5	Low Su Gasoil G Sep25		7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	123