

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

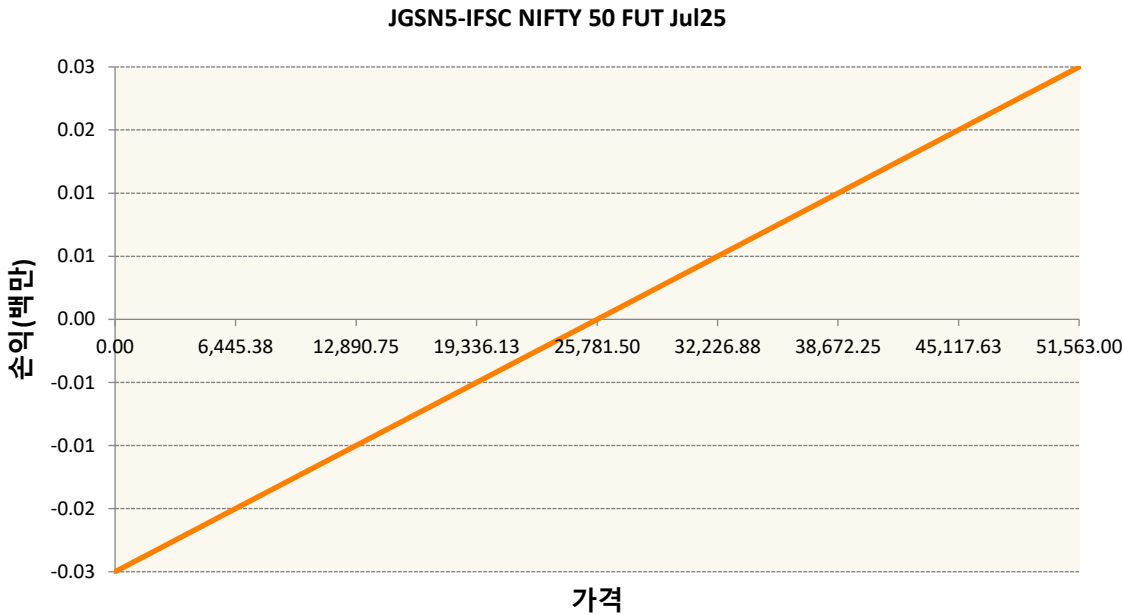
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	632	0	632	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSN5	IFSC NIFTY 50 FUT Jul25	51
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

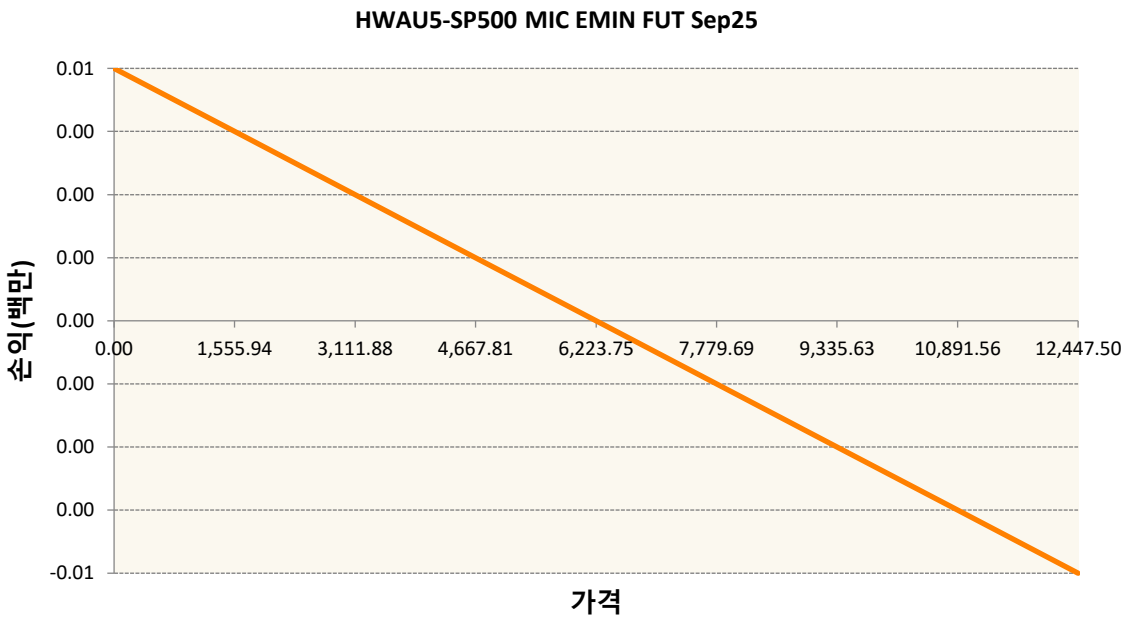
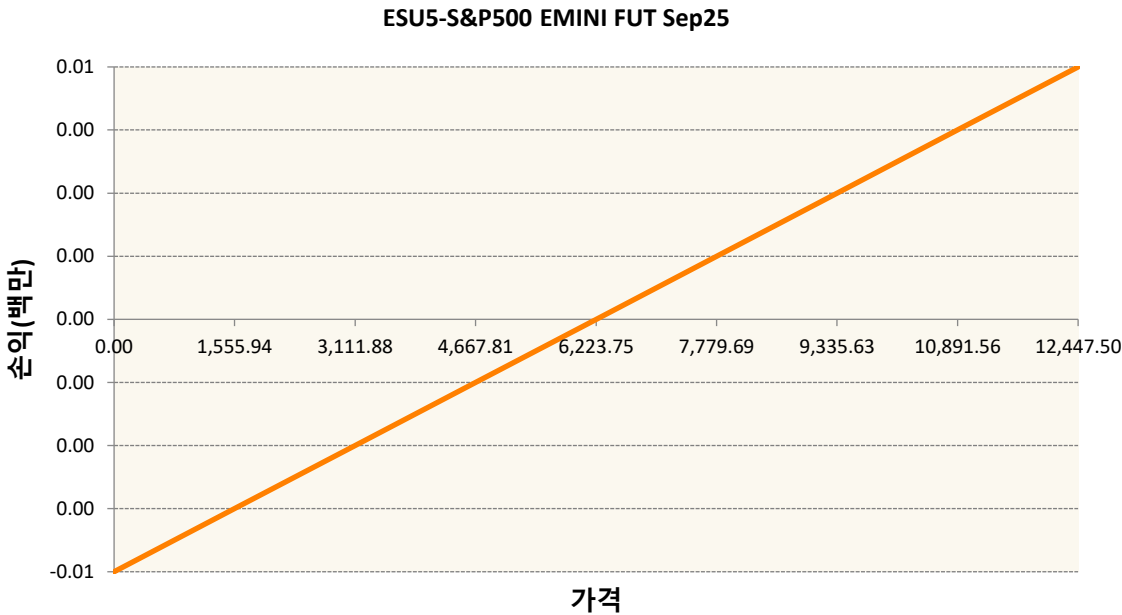
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	429	0	429	
누계	지수	선물	0	121	-121	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	2025-07-01
기준일	2025-06-30

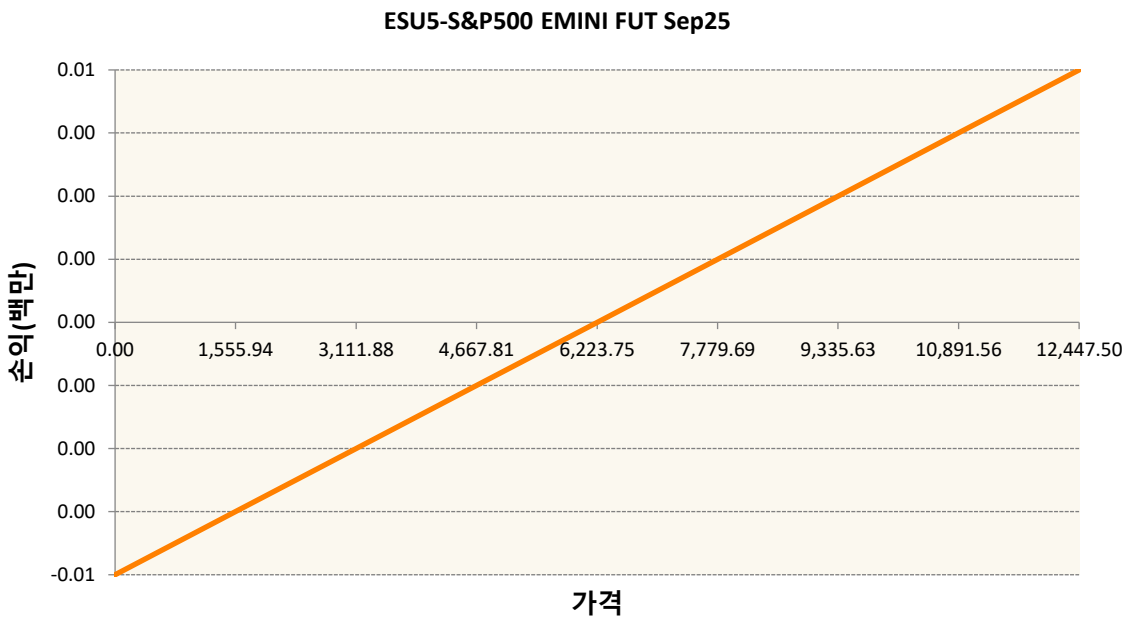
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,288	0	1,288	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	103
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

91

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

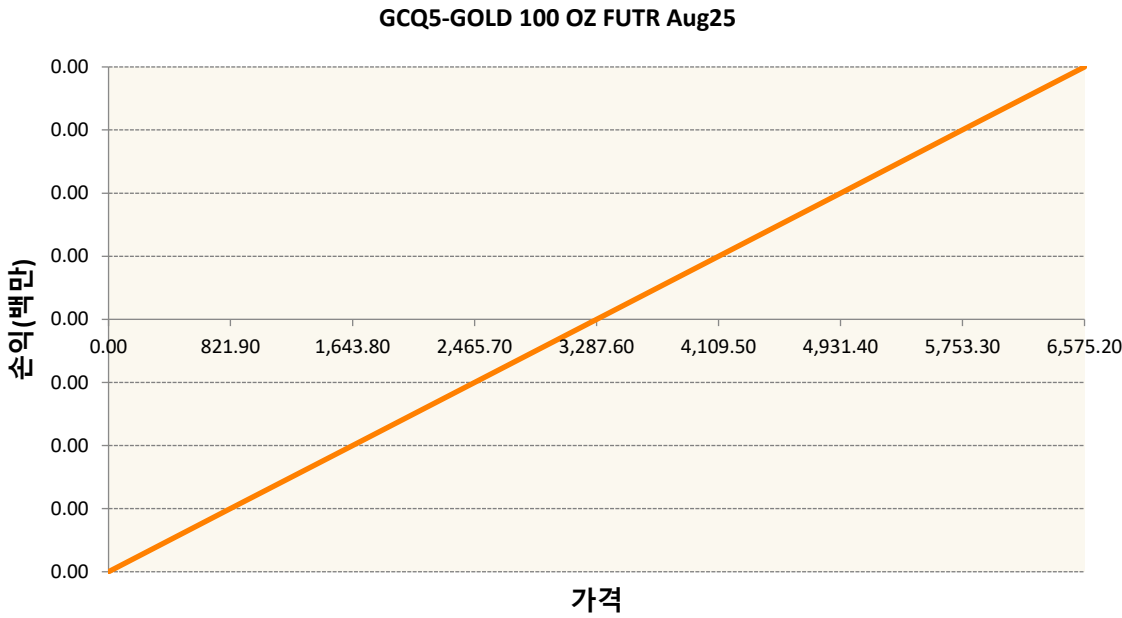
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,809	0	1,809	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 07/03/25 C307 EQUITY	0.41
GQC5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25	145

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

(단위:백만원)

124

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

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 07/03/25 C149 EQUITY	2
AOPLTRUSP1 PLTR US 07/03/25 P149 EQUITY	6

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

(단위:백만원)

31

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

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)

AOTLTUSC0TLT US 07/03/25 C89 EQUITY

0.12

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

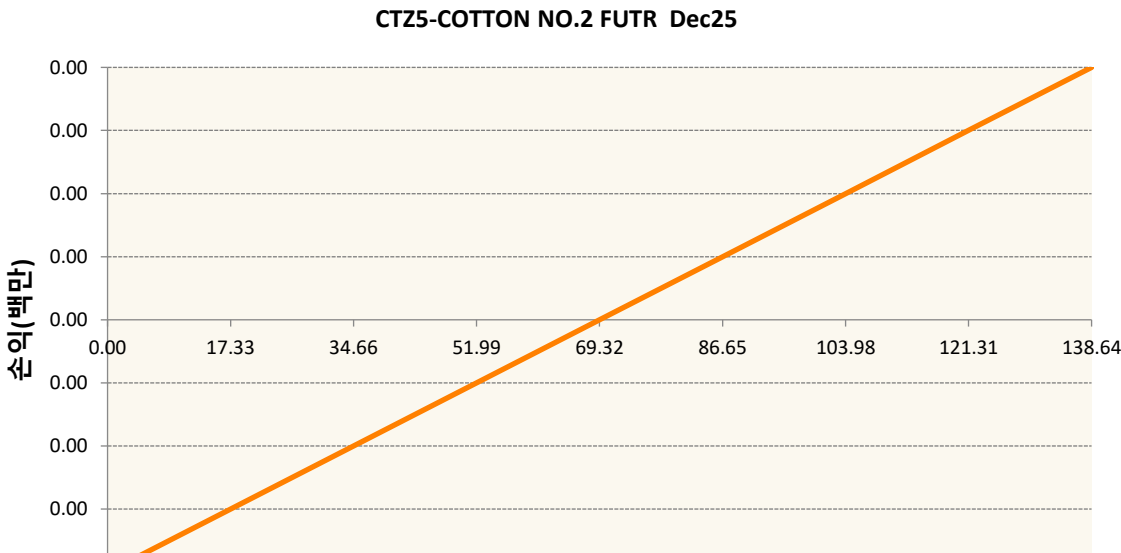
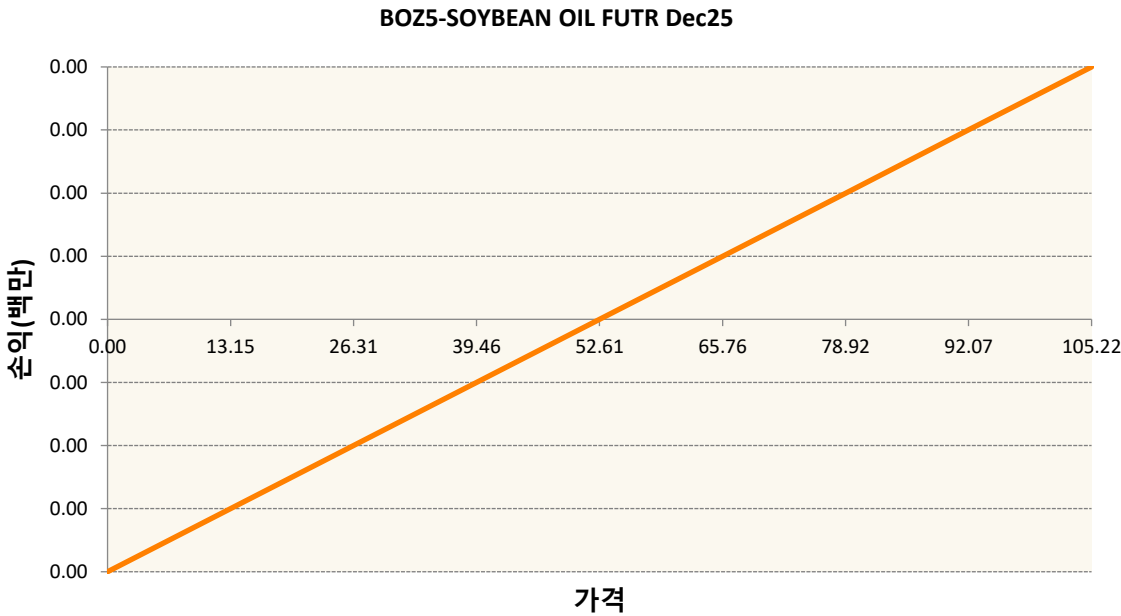
포커스농산물모(채권-파생형)

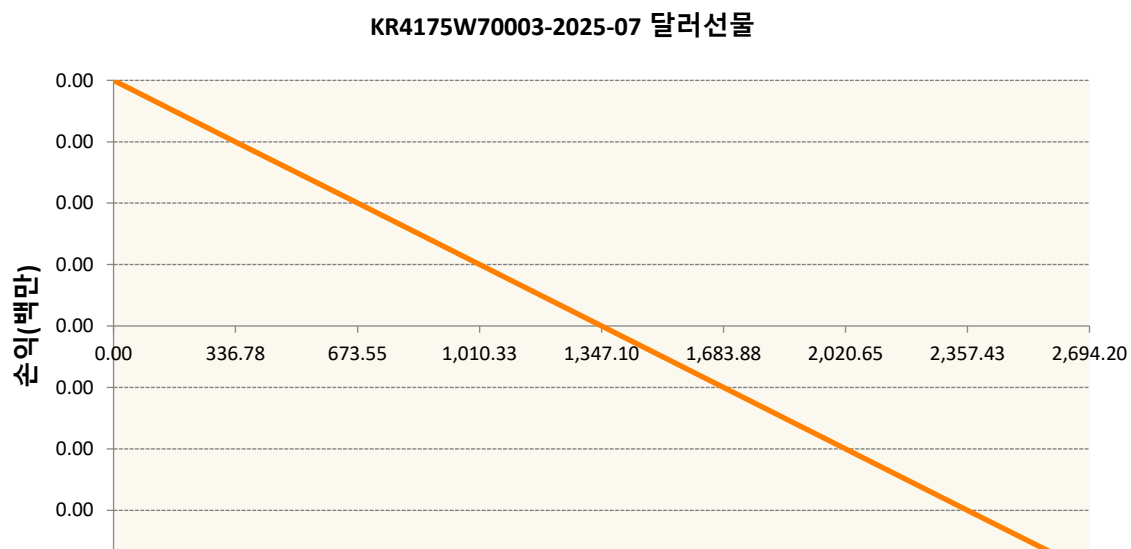
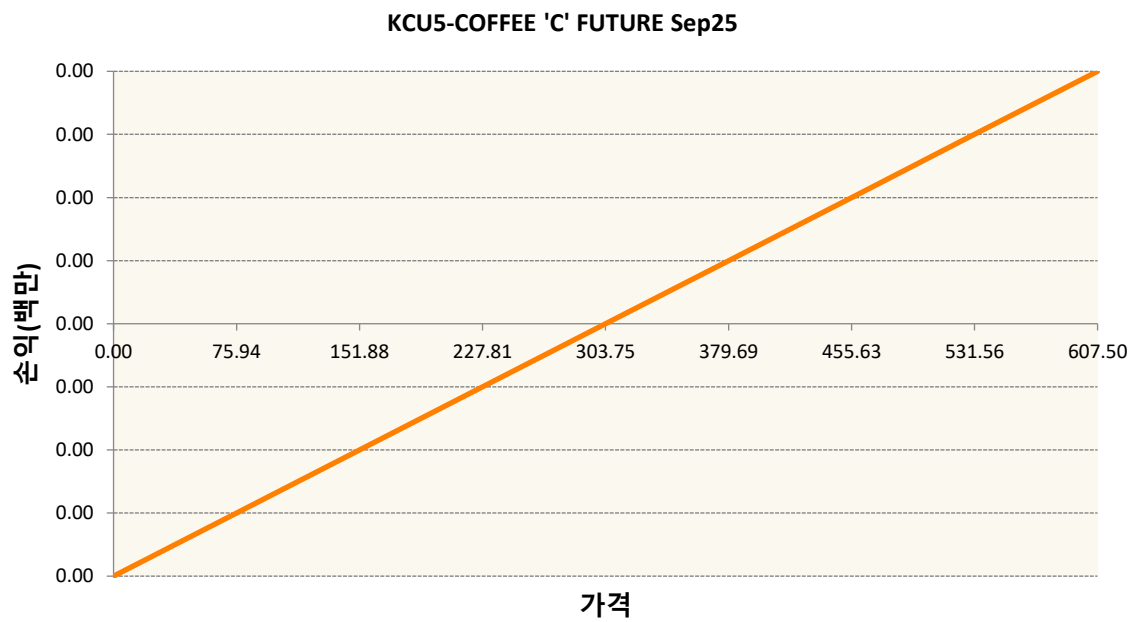
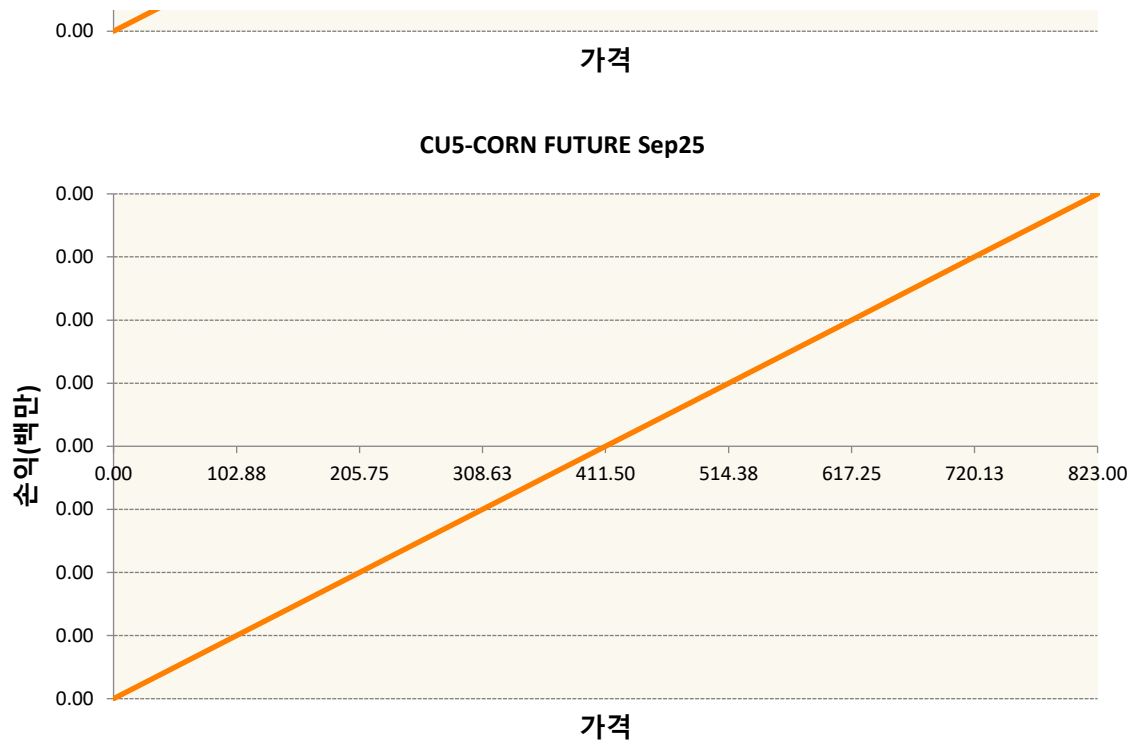
1. 계약금액

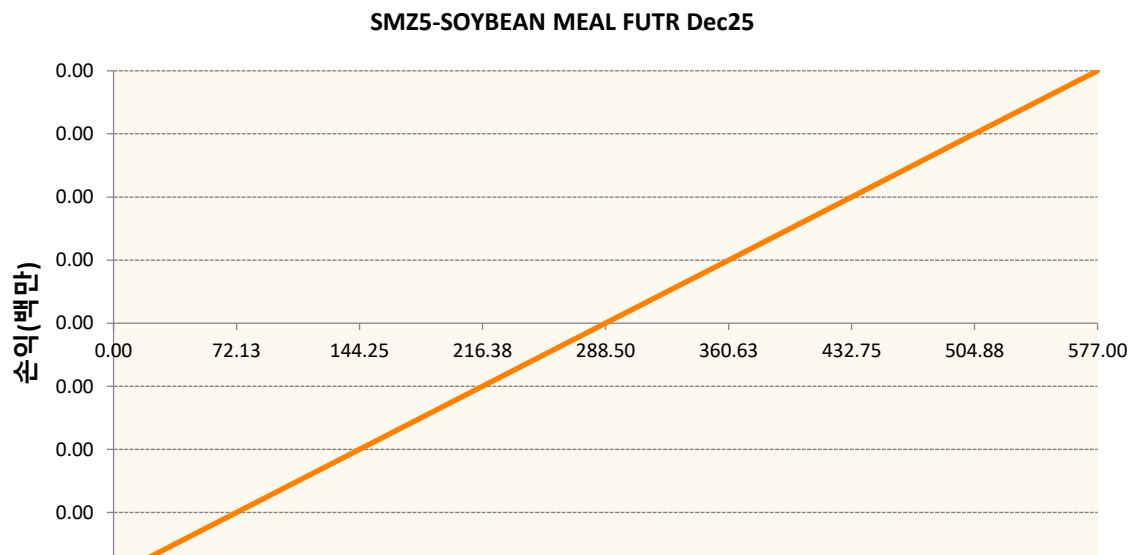
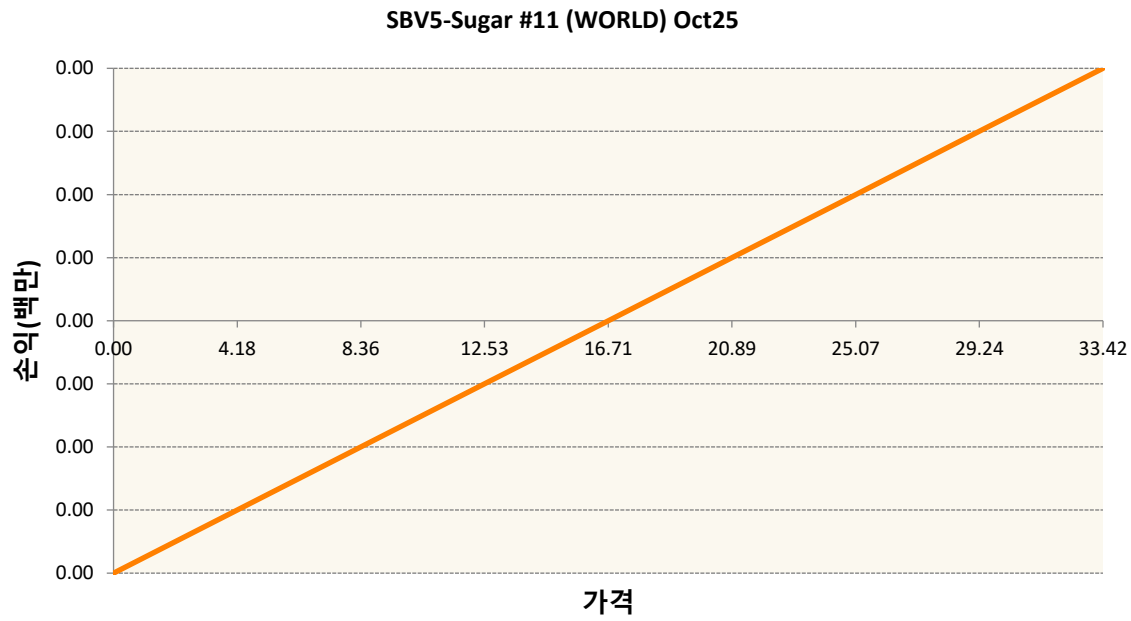
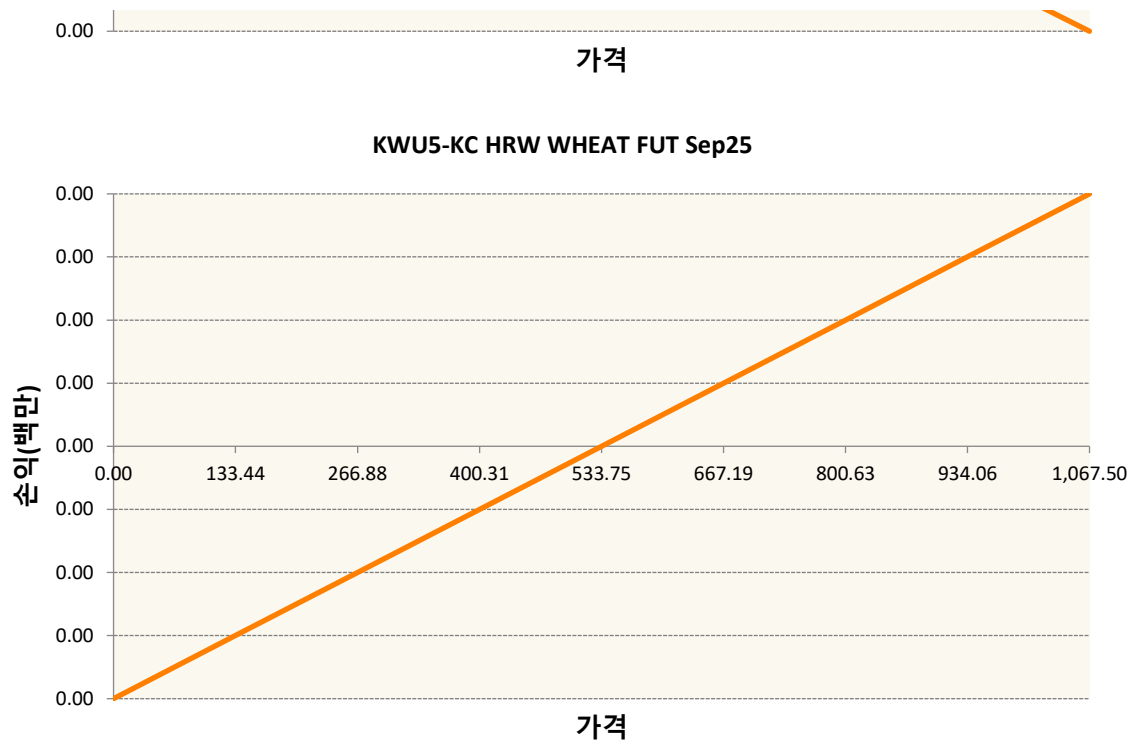
(단위:USD 백만)

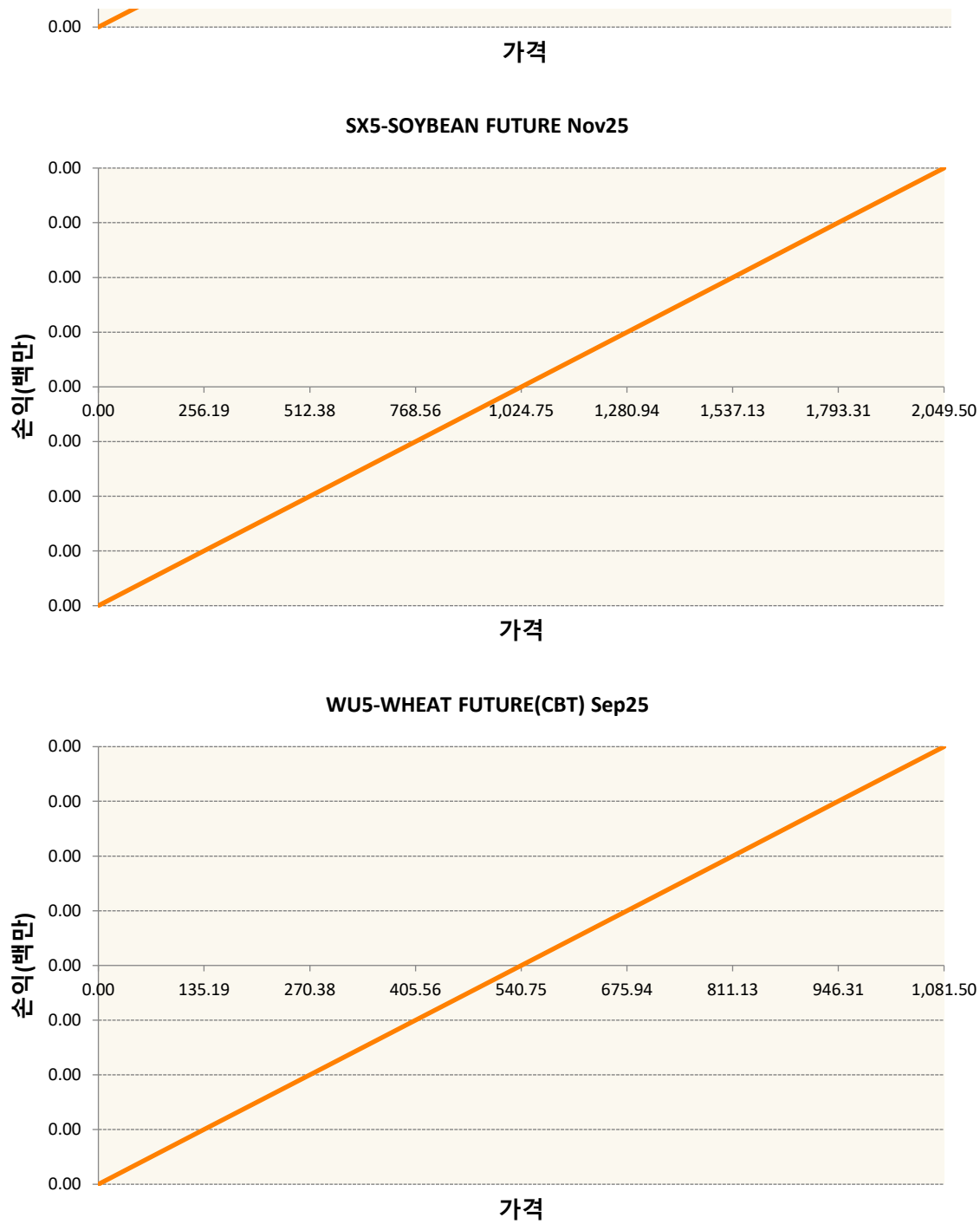
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,559	0	1,559	
누계	유가증권	선물	2,011	0	2,011	
누계	통화	선물	0	256	-256	장내

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	2025-07-01
기준일	2025-06-30

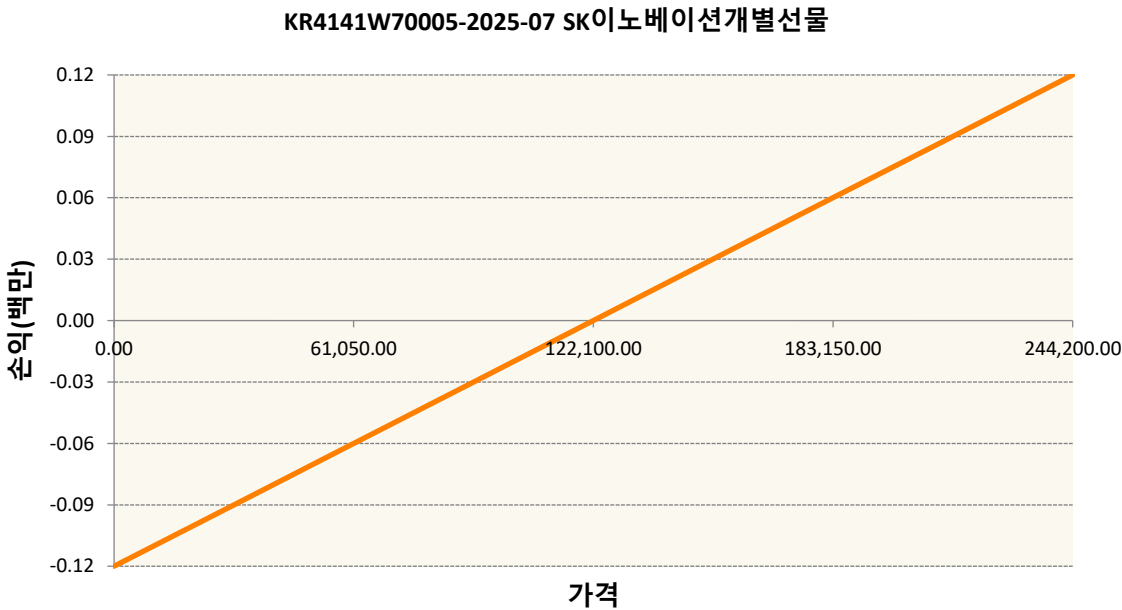
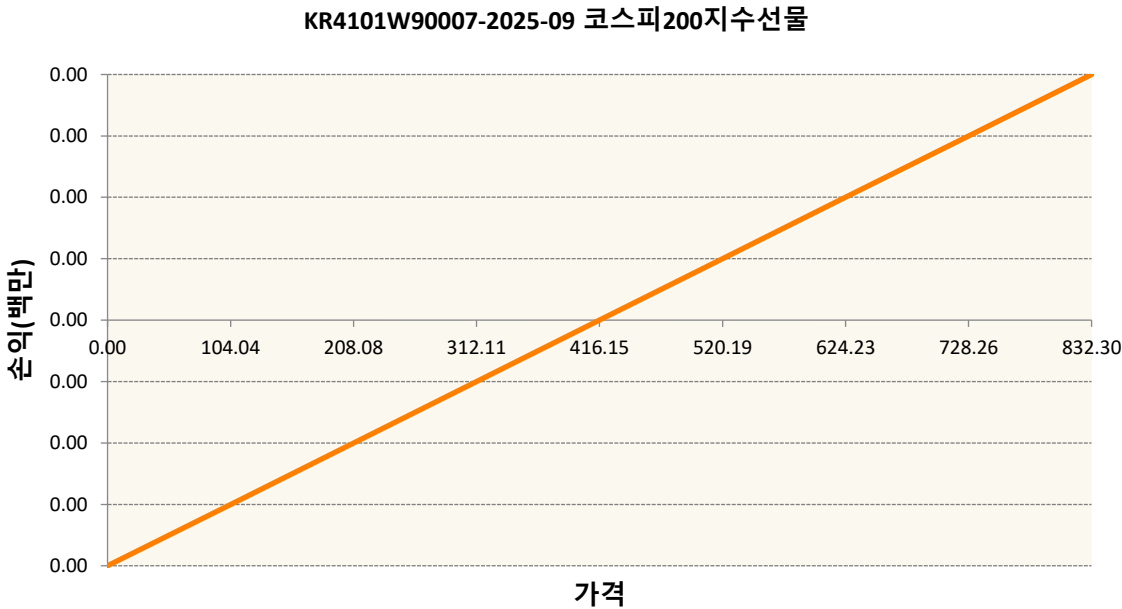
스마트인덱스모

1. 계약금액

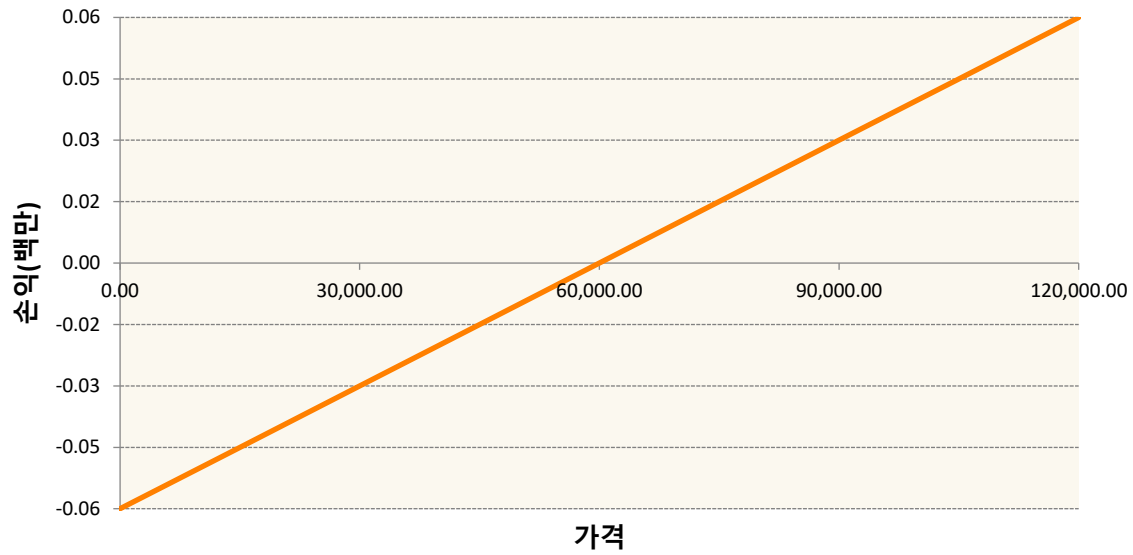
(단위:백만원)

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

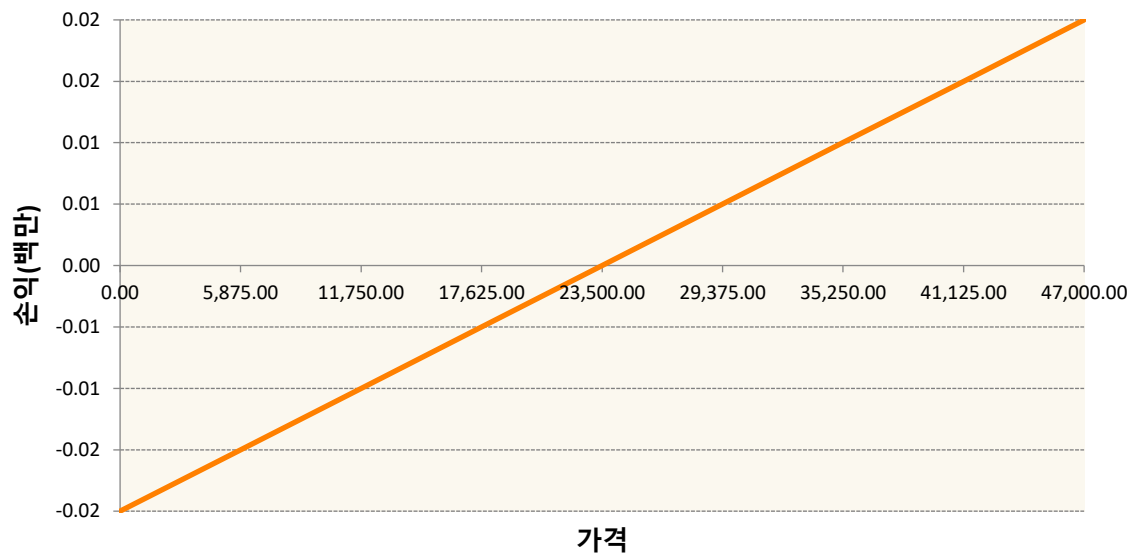
2. 만기시점의 손익구조



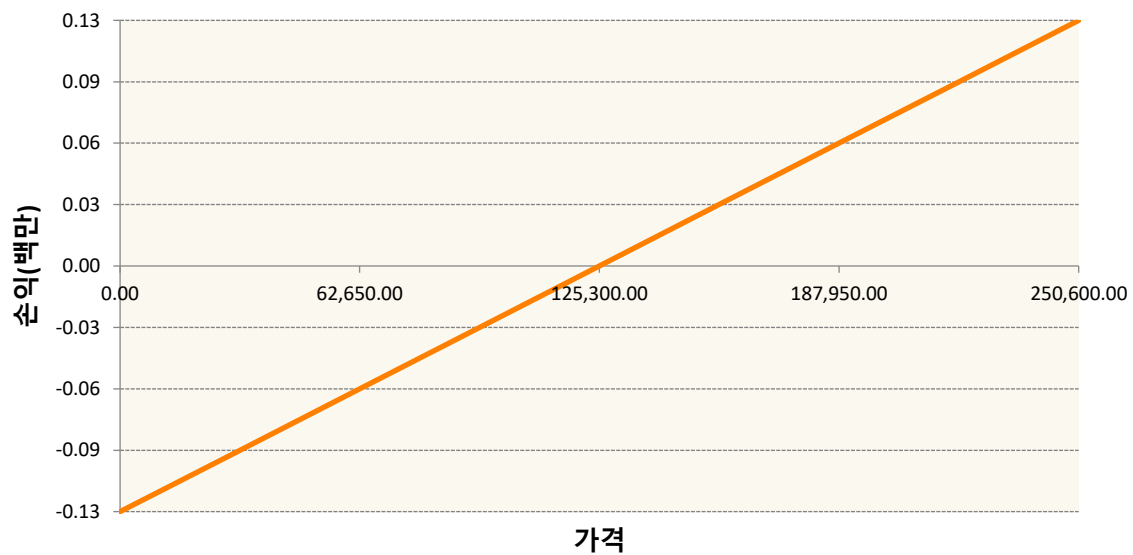
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



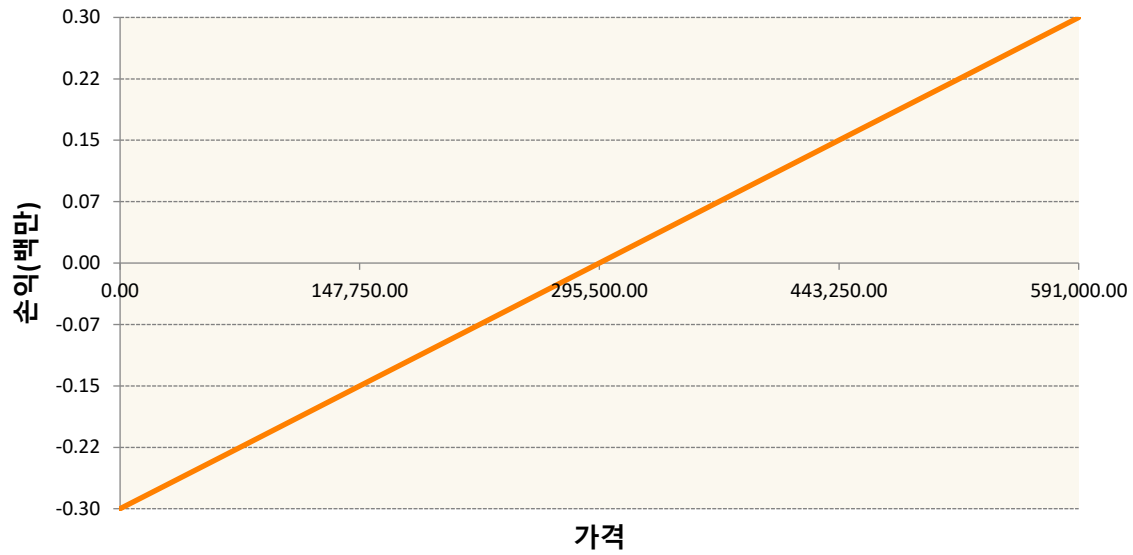
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



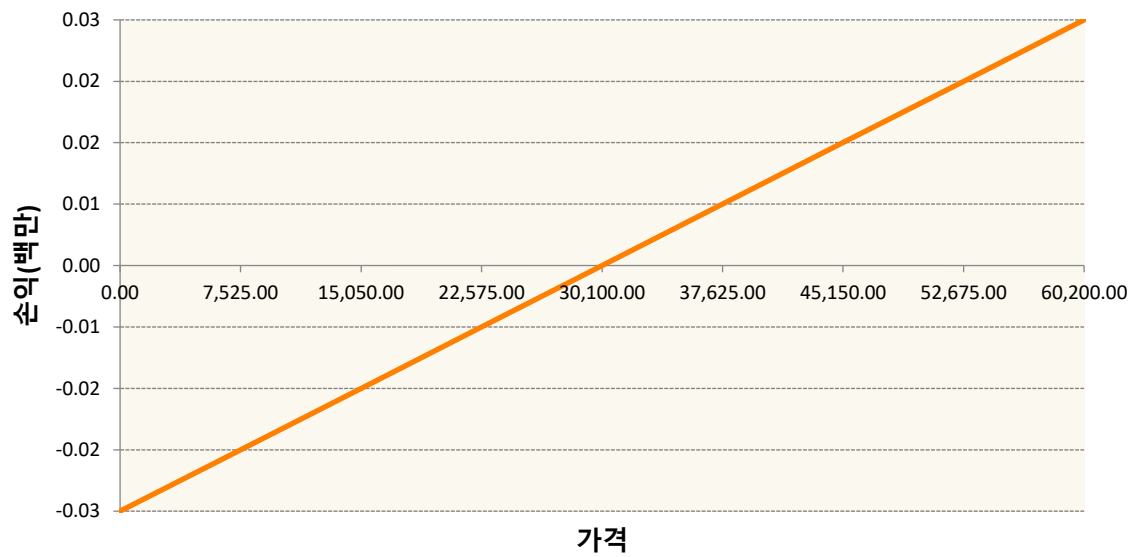
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



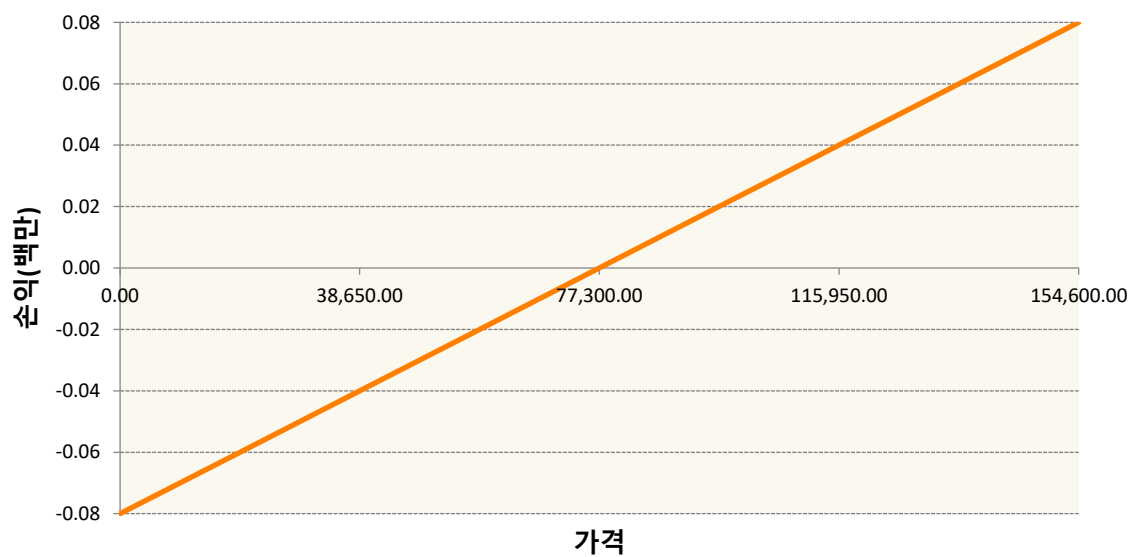
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



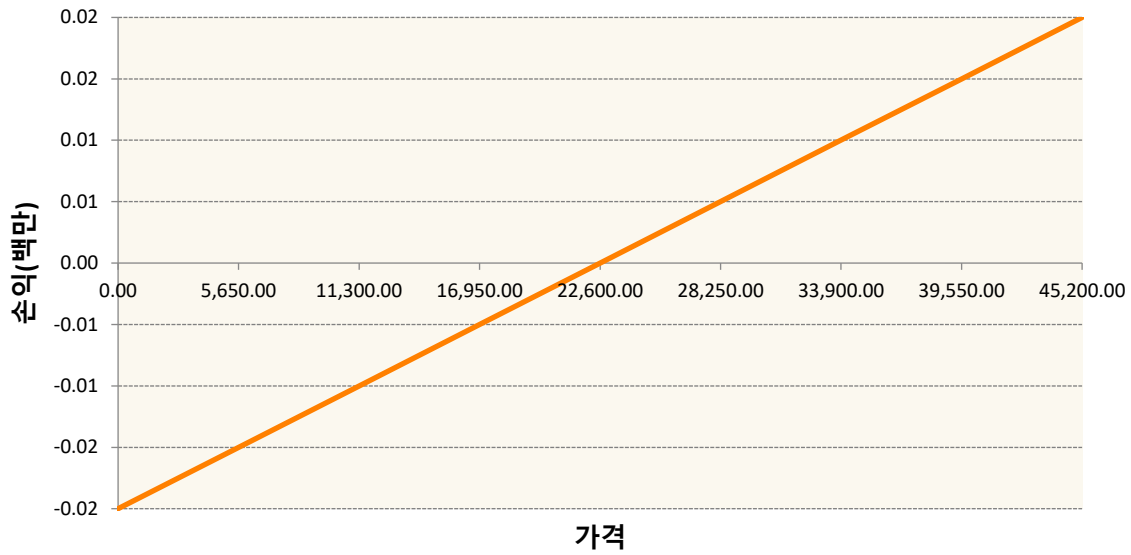
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



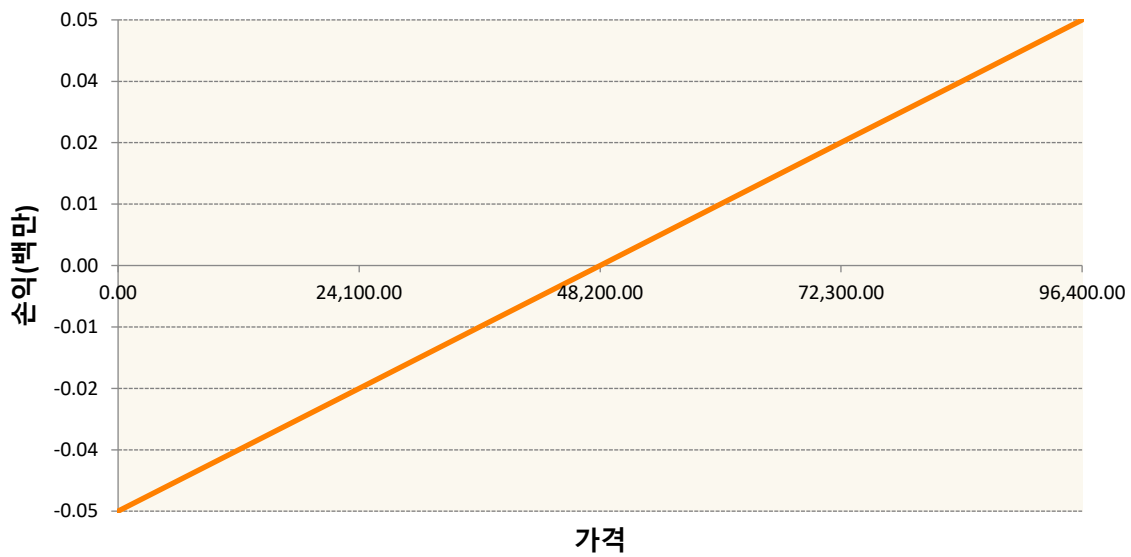
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



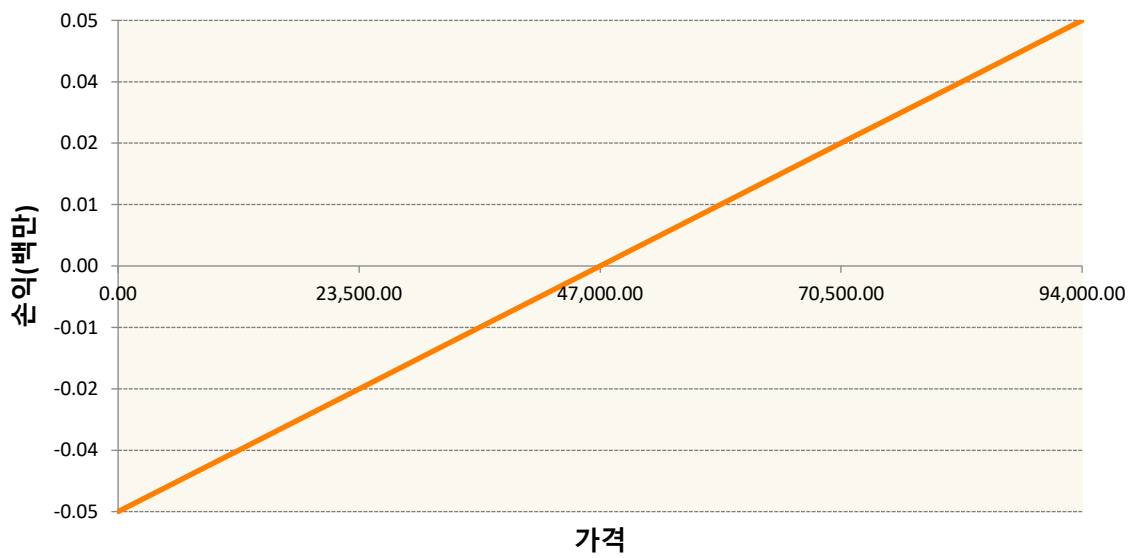
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



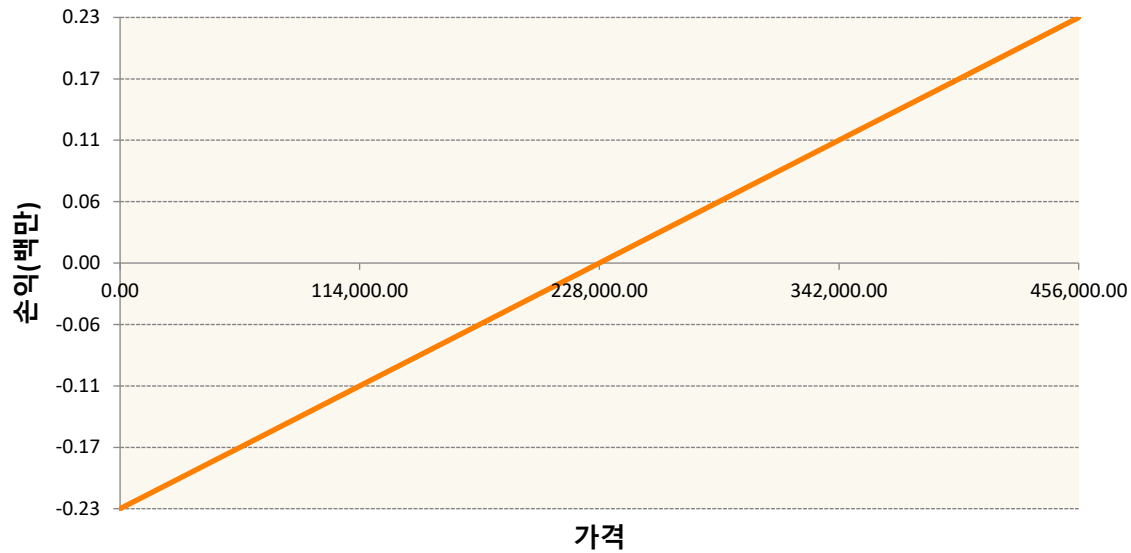
KR41FMW70003-2025-07 엘애펬개별선물



KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	67
KR4141W70(2025-07 SK이노베이션개별선물	7
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	2
KR41FAW70(2025-07 HMM개별선물	3
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	1
KR41G0W70 2025-07 씨에스윈드개별선물	0.26
KR41HEW70 2025-07 키움증권개별선물	3

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

(단위:백만원)

214

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

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)

493

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

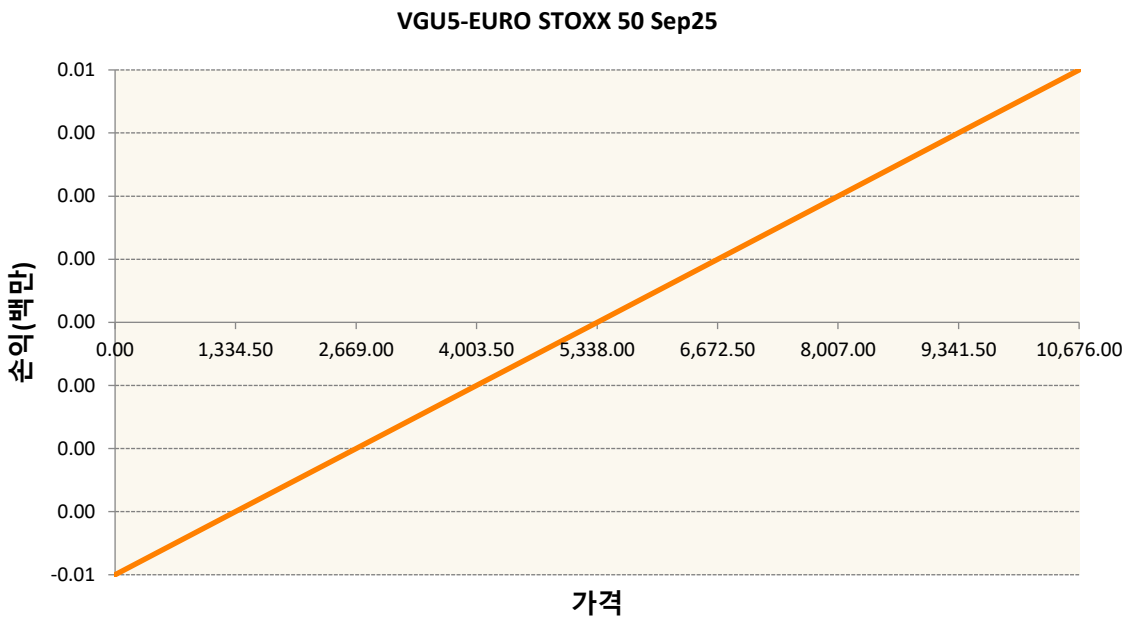
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	929	0	929	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU5	EURO STOXX 50 Sep25	74
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

62

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

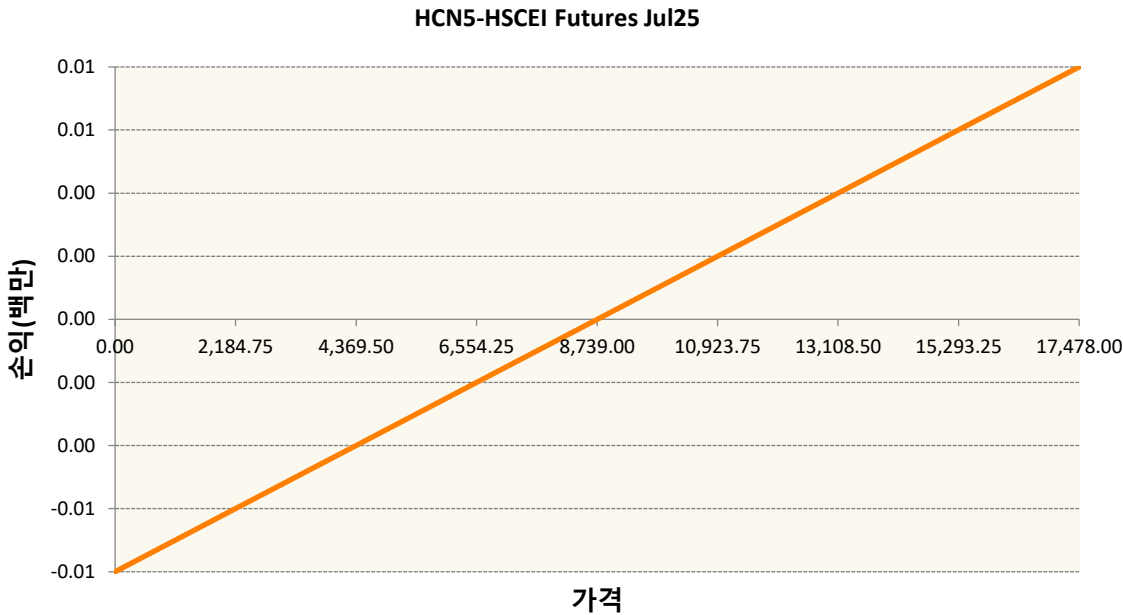
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,123	0	2,123	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN5	HSCEI Futures Jul25	170
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

246

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

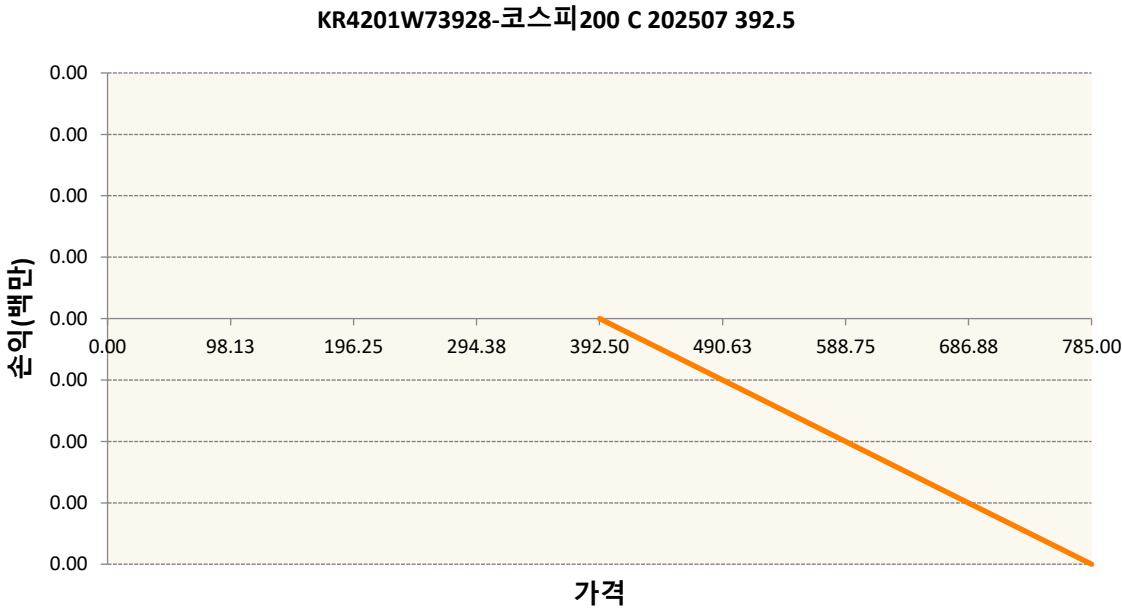
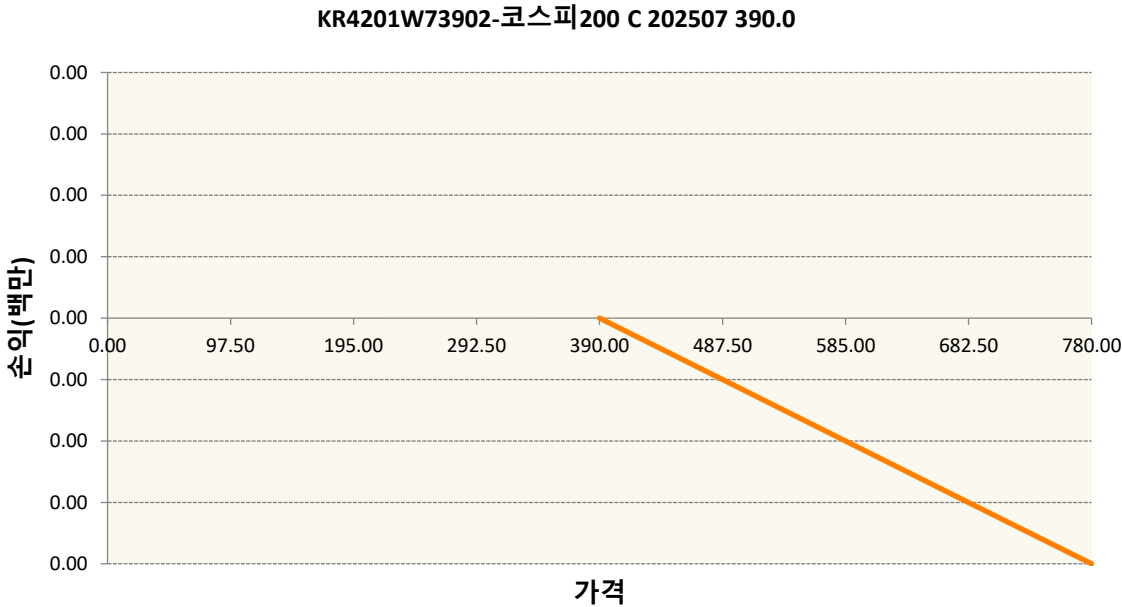
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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)

KR4201W73902코스피200 C 202507 390.0							1,799
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,295	1,275	1,255	1,234	1,212	1,190	1,167
-5.33%	1,053	1,028	1,002	977	951	925	899
-2.67%	590	577	562	546	528	509	490
0%	13	10	6	0	-7	-16	-27
2.67%	-589	-590	-590	-591	-593	-596	-600
5.33%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,195	-1,195	-1,196
8.00%	-1,799	-1,799	-1,799	-1,799	-1,799	-1,799	-1,799
KR4201W73928코스피200 C 202507 392.5							581
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	386	381	375	369	363	356	349
-5.33%	324	315	307	298	290	281	273
-2.67%	188	183	177	170	164	157	150
0%	6	5	3	0	-3	-7	-11
2.67%	-188	-189	-189	-190	-191	-192	-193
5.33%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-386
8.00%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581
KR4301W73900 코스피200 P 202507 390.0							149

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-121	-126	-132	-137	-143	-149
-5.33%	-38	-44	-51	-57	-63	-70	-76
-2.67%	-4	-8	-12	-16	-21	-26	-31
0%	5	4	2	0	-2	-5	-8
2.67%	6	6	5	5	4	3	1
5.33%	6	6	6	6	6	5	5
8.00%	6	6	6	6	6	6	6

KR4301W73926 코스피200 P 202507 392.5							56
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-47	-49	-51	-52	-54	-56
-5.33%	-16	-19	-21	-23	-25	-27	-29
-2.67%	-2	-4	-5	-7	-9	-11	-12
0%	2	2	1	0	-1	-2	-3
2.67%	3	3	2	2	2	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

2,655

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

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	502	0	502	

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	2025-07-01
기준일	2025-06-30

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	4,192	0	4,192	

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	2025-07-01
기준일	2025-06-30

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	12,367	0	12,367	
누계	통화	선도	176	11,705	-11,529	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F4V(KRW/USD 31-07-25E	402
FXW213F5V(KRW/USD 29-08-25E	315
FXW213F6SC KRW/USD 29-08-25E	219
FXW213F6XC USD/KRW 31-07-25E	14
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

472

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

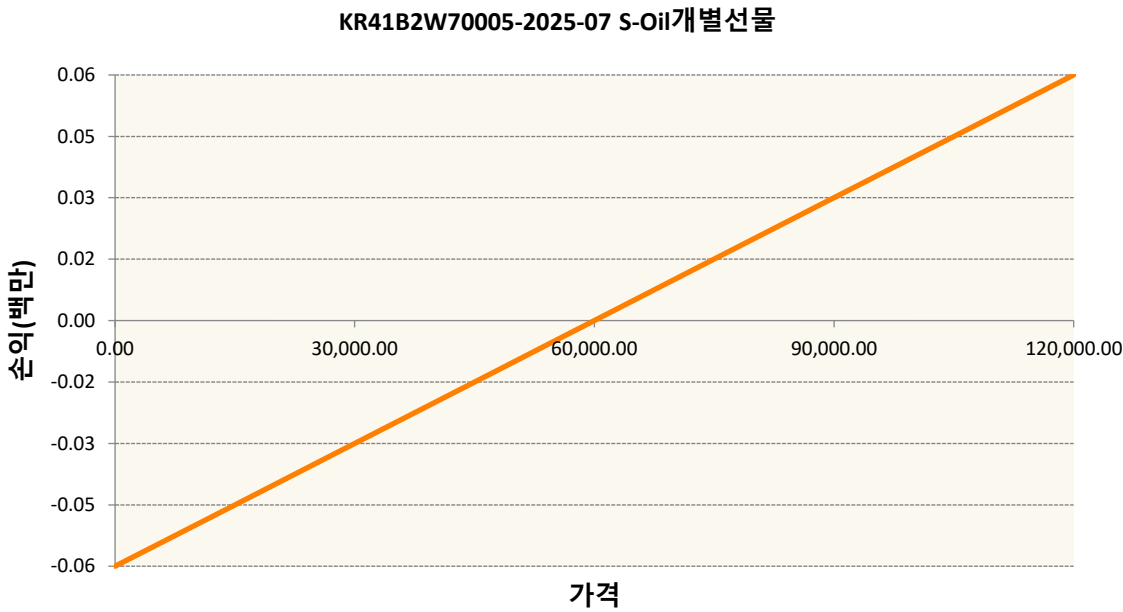
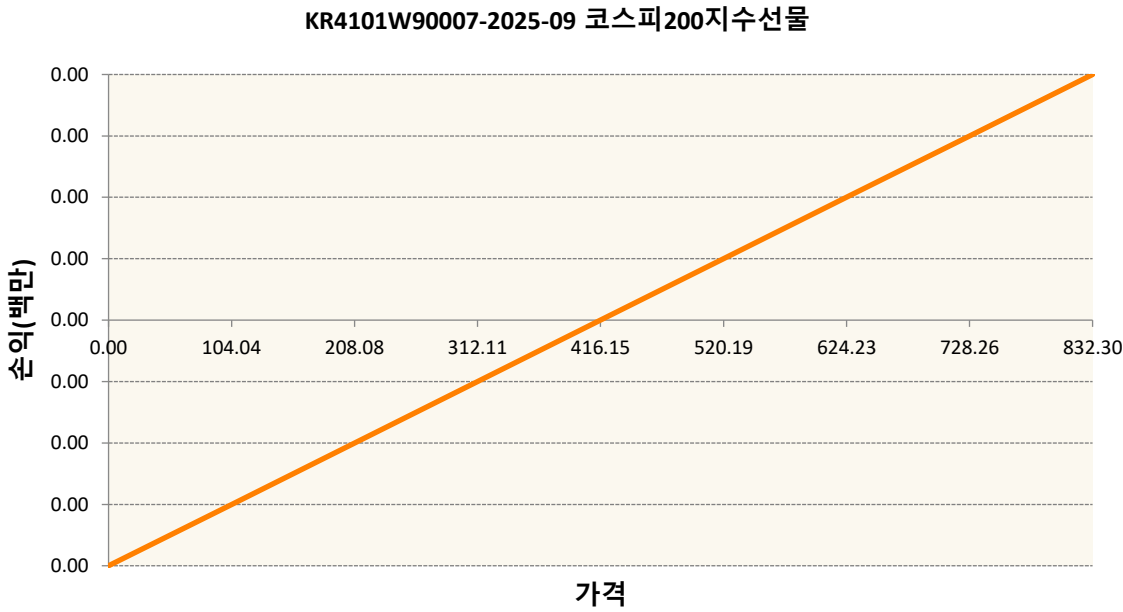
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

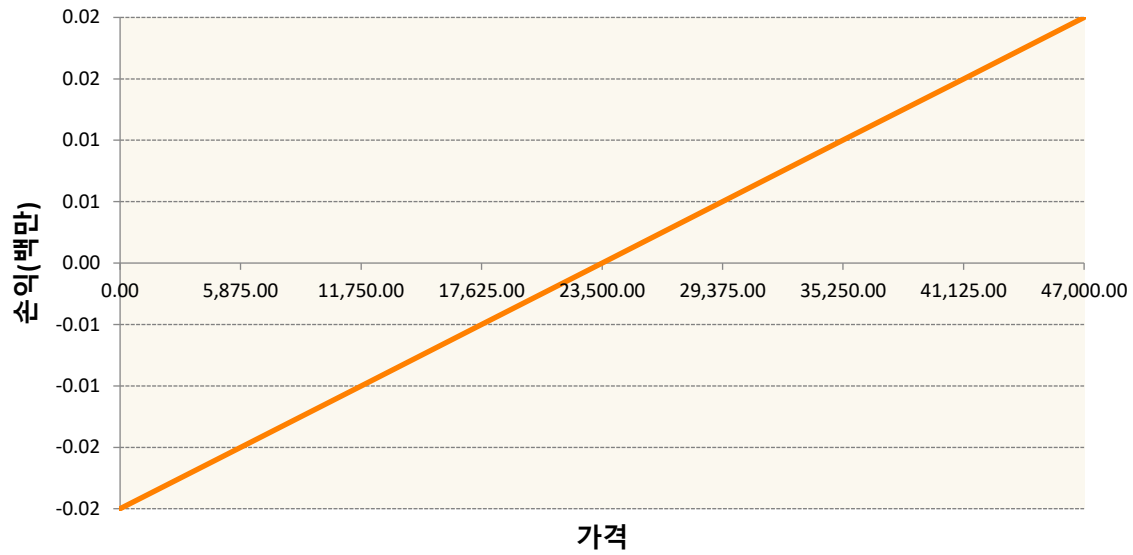
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	808	0	808	장내

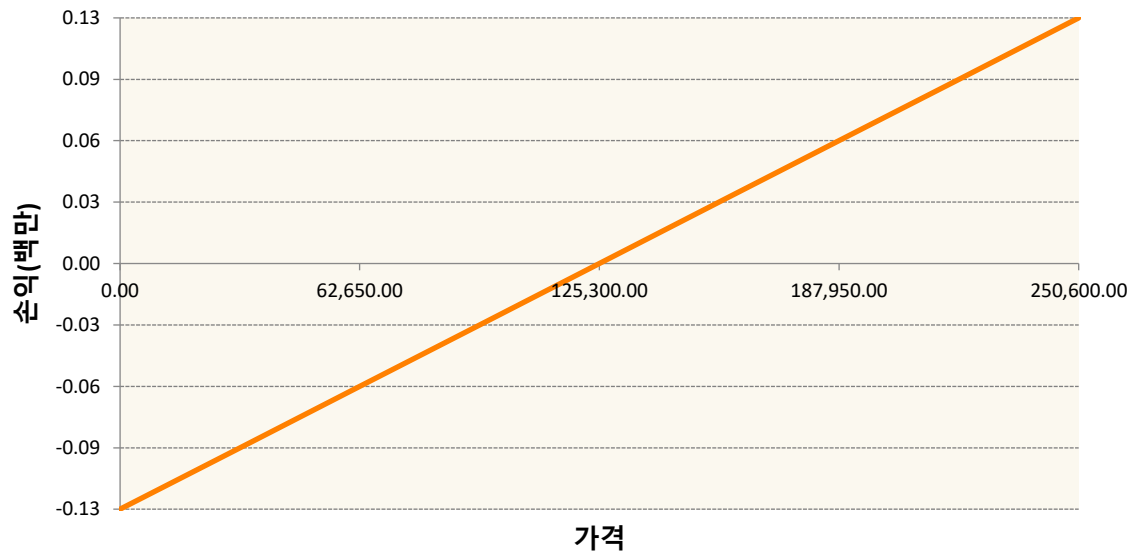
2. 만기시점의 손익구조



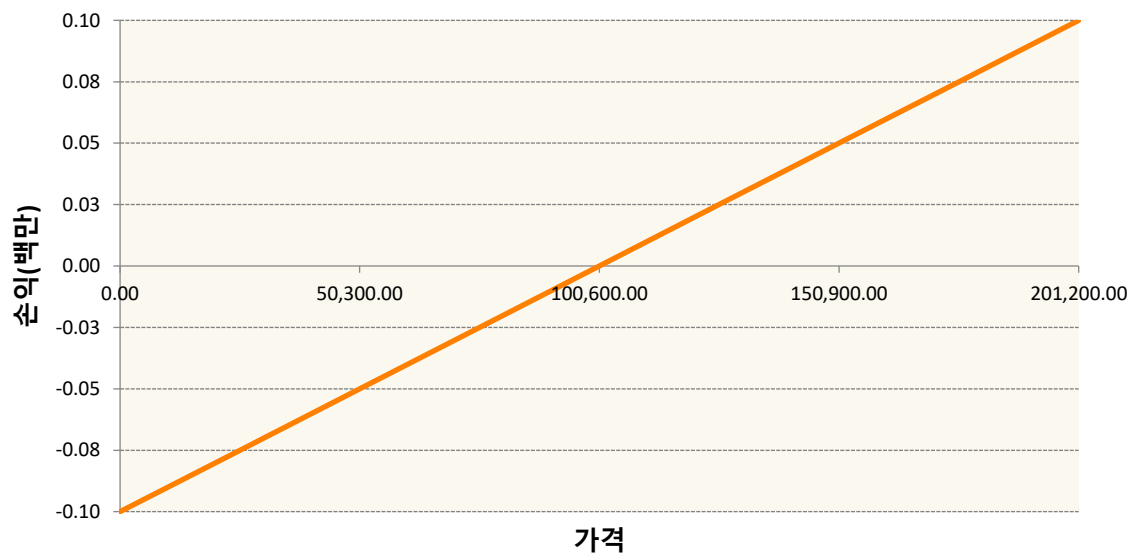
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



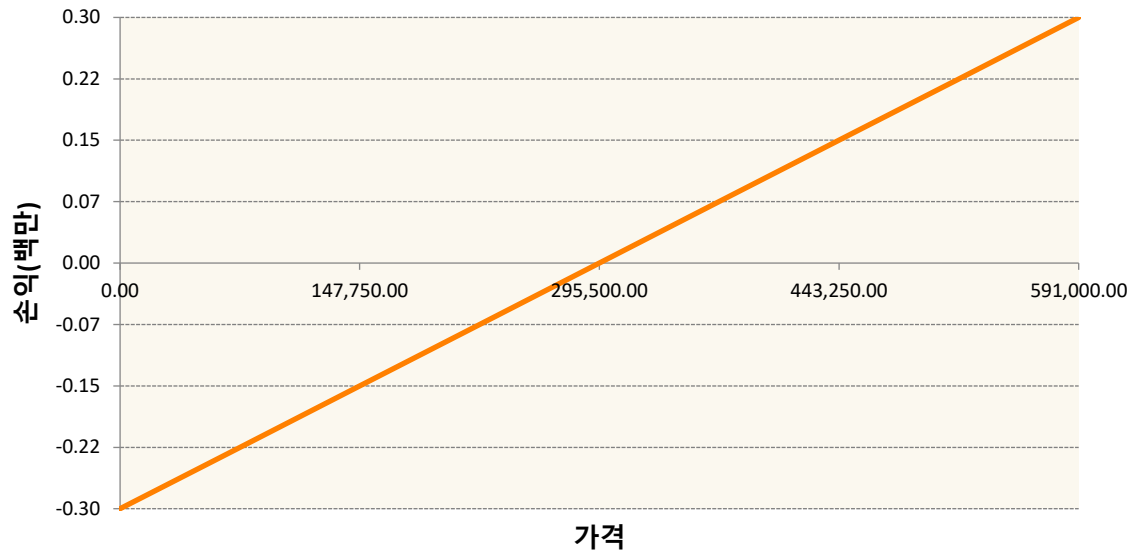
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



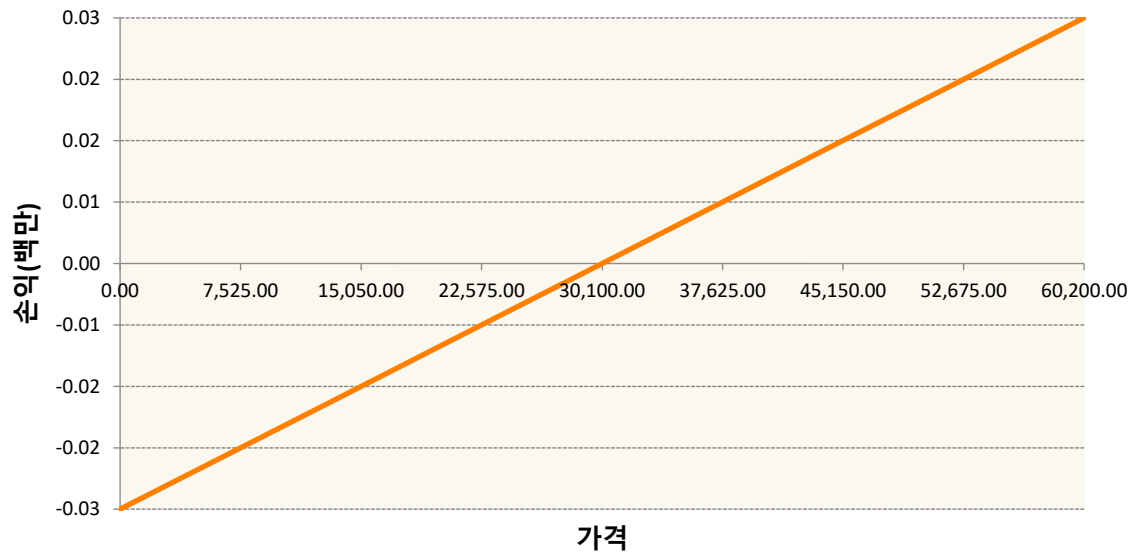
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



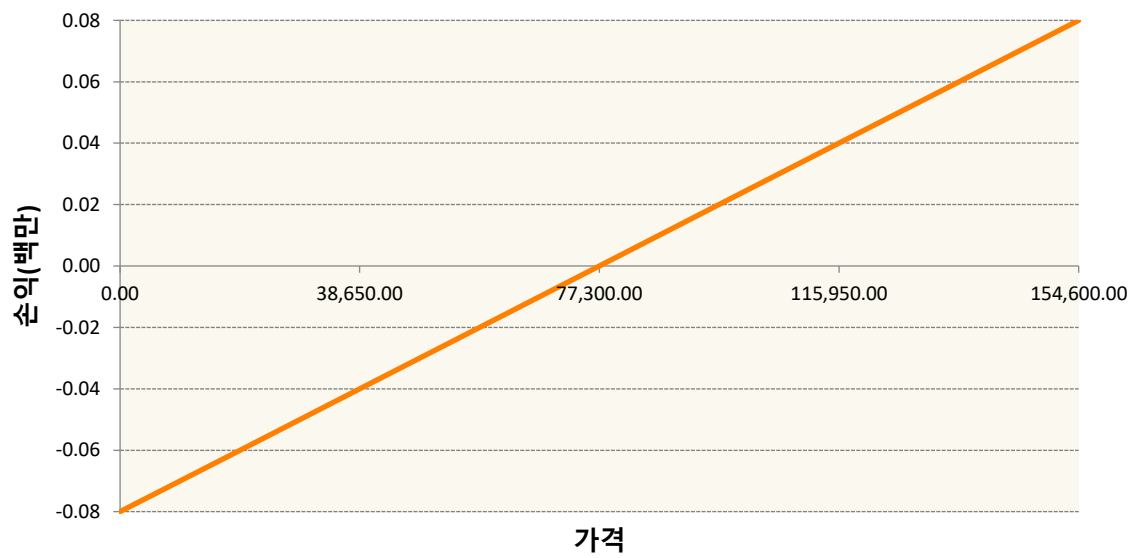
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



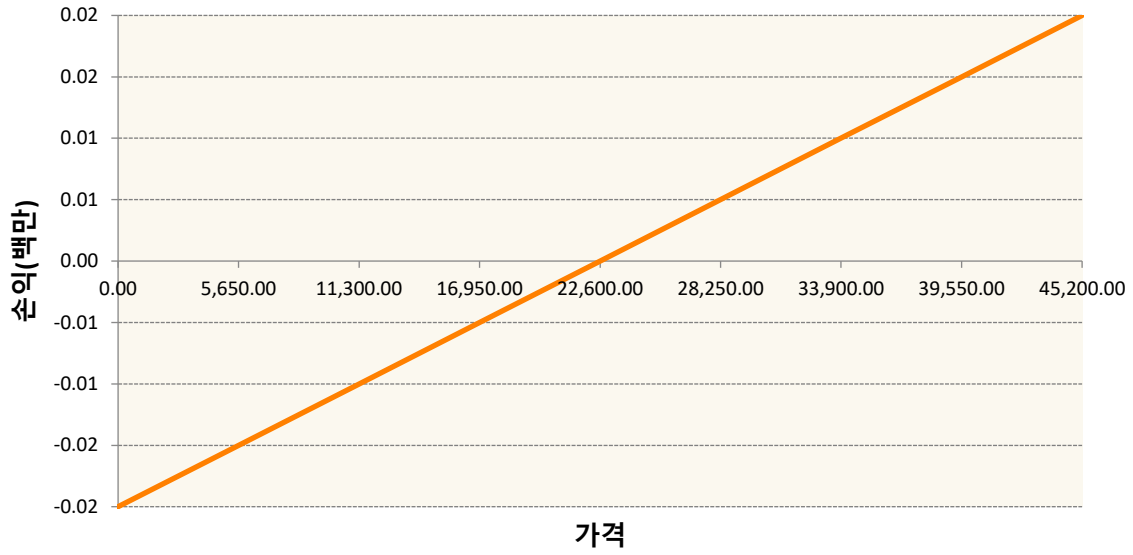
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



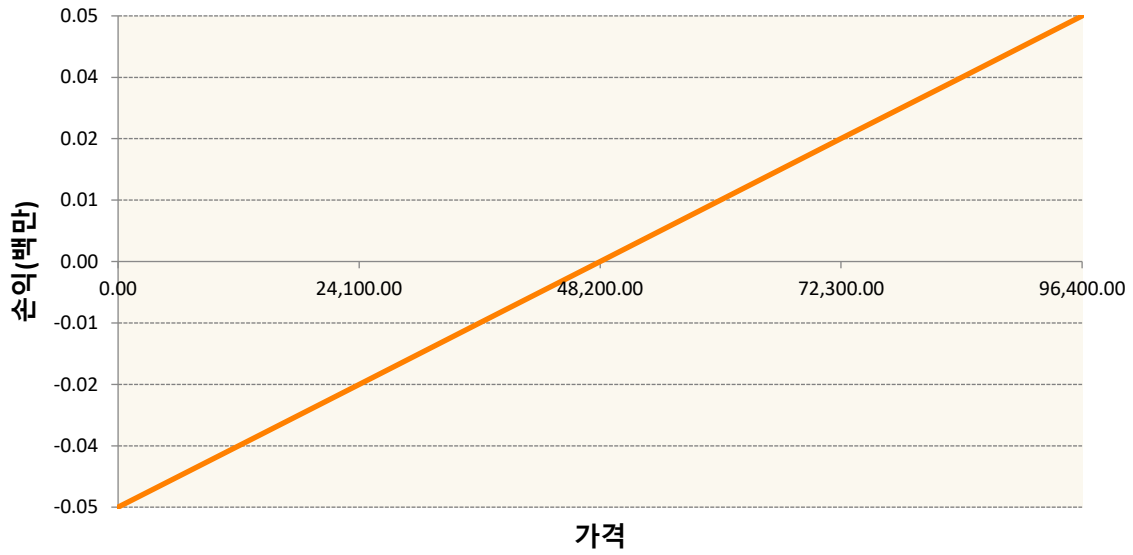
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



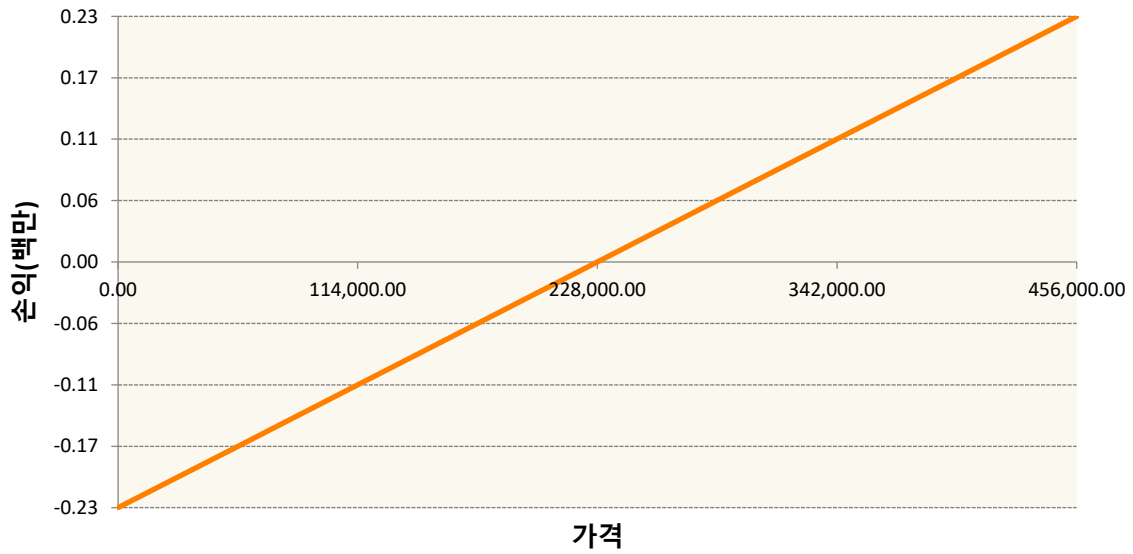
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



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)

115

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

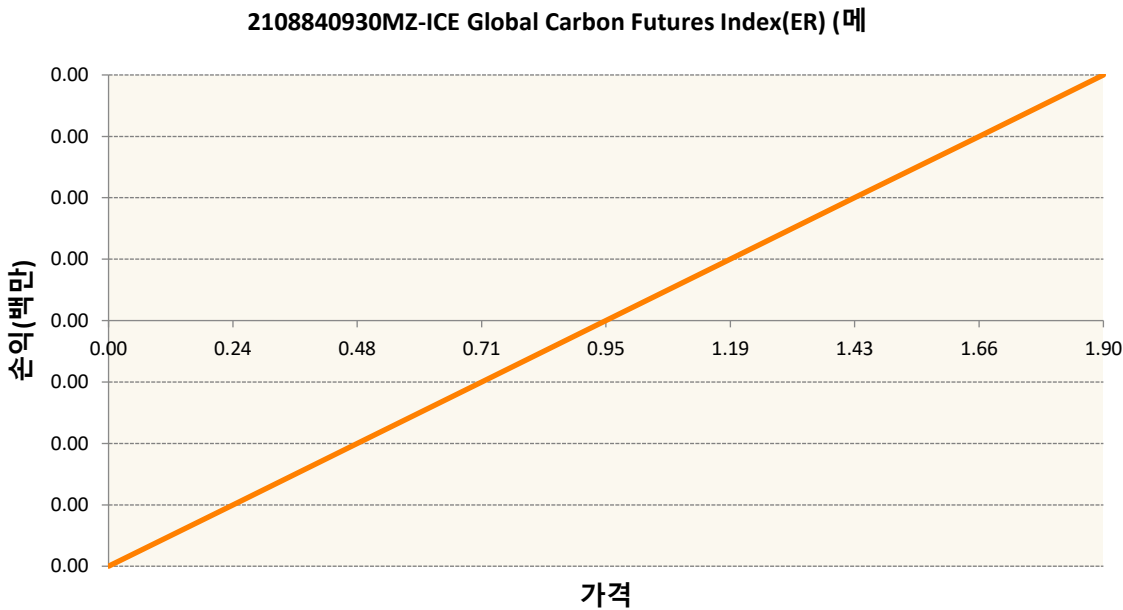
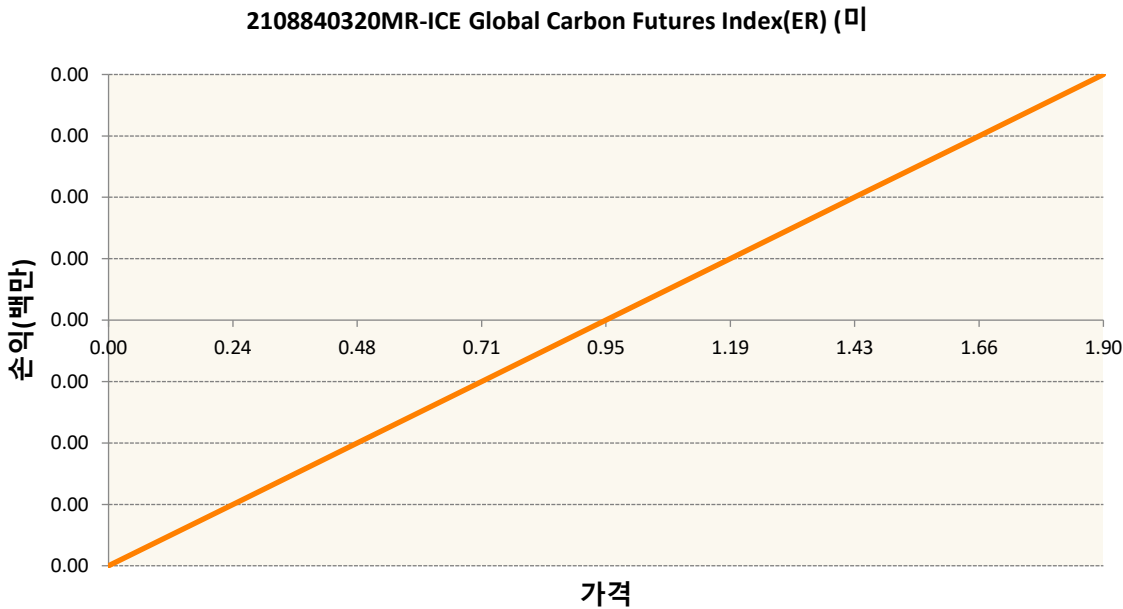
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	9,561	0	9,561	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	571
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	191

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		865

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

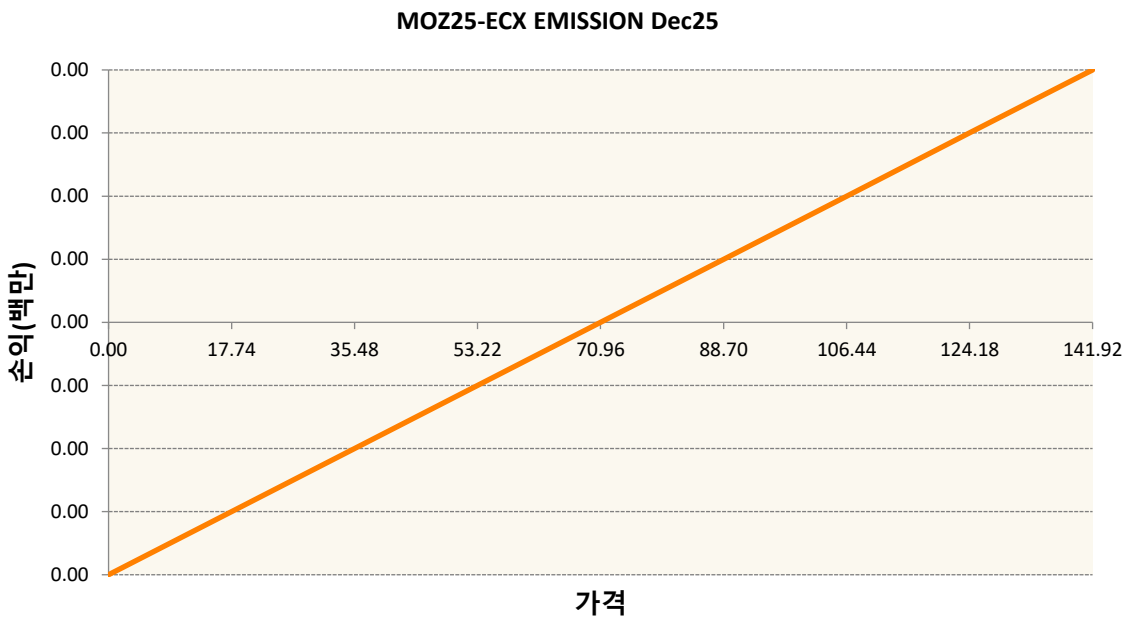
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	6,420	0	6,420	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	2
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	515

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

(단위:백만원)

865

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	692	0	692	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	692	0	692	장외
누계	지수	스왑	2,762	0	2,762	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (메리츠)	0.45
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	0.45
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	0.3
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	0.34

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

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)	0.3
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	0.35
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	0.25
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.07

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

(단위:백만원)

2

공시일 2025-07-01

기준일 2025-06-30

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	2025-07-01
기준일	2025-06-30

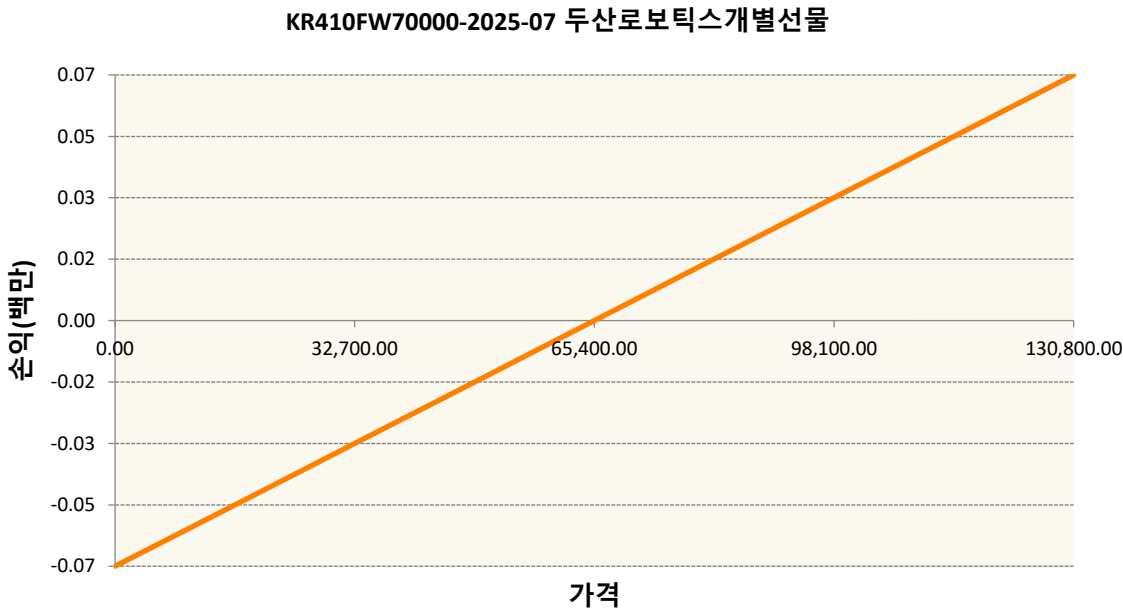
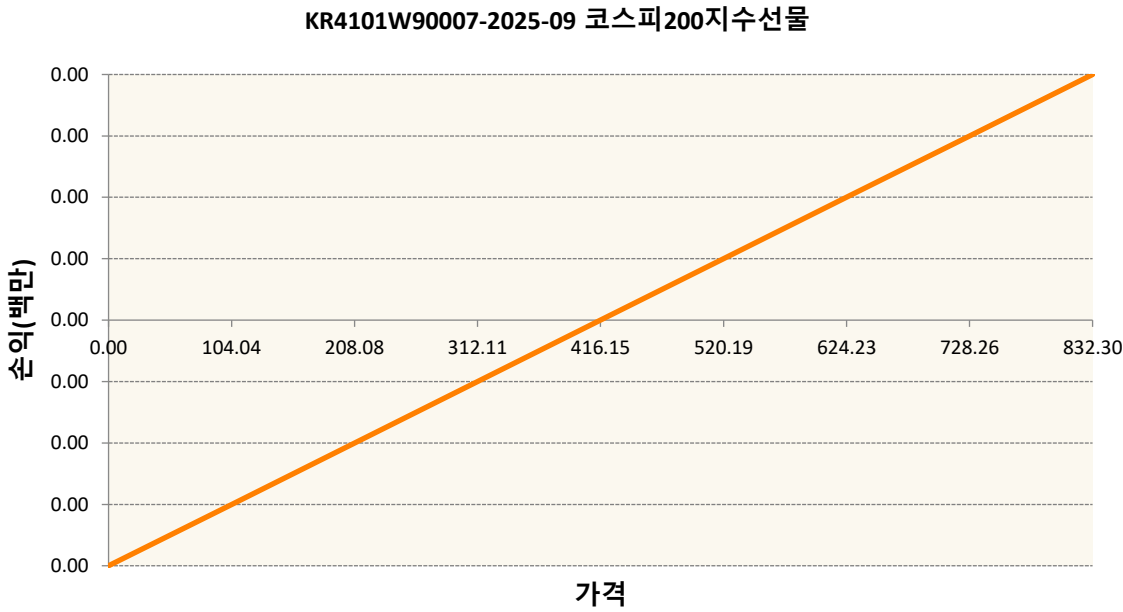
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

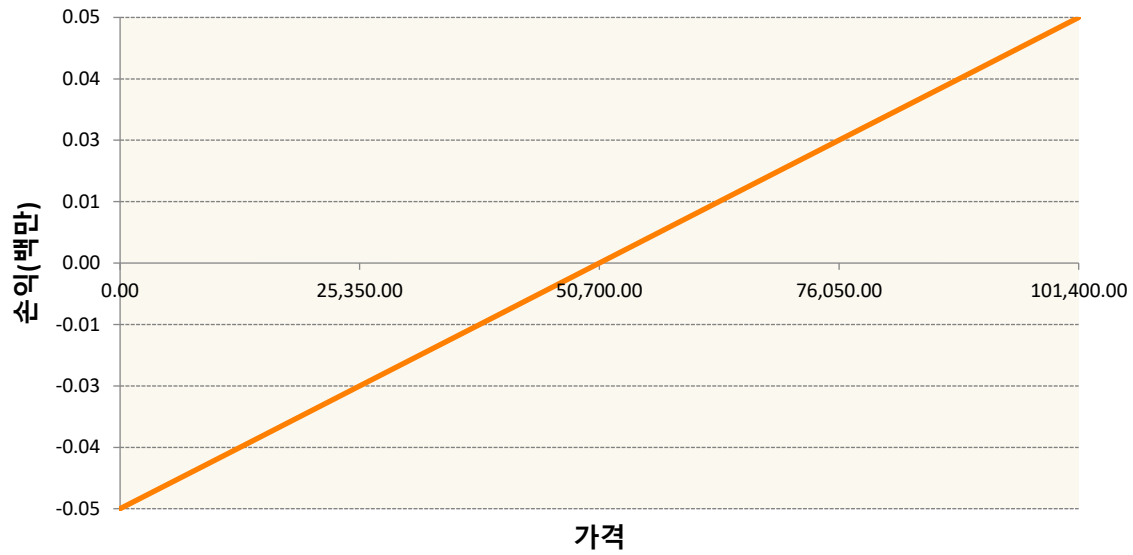
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	439	0	439	장내
누계	유가증권	선물	12,216	0	12,216	장내

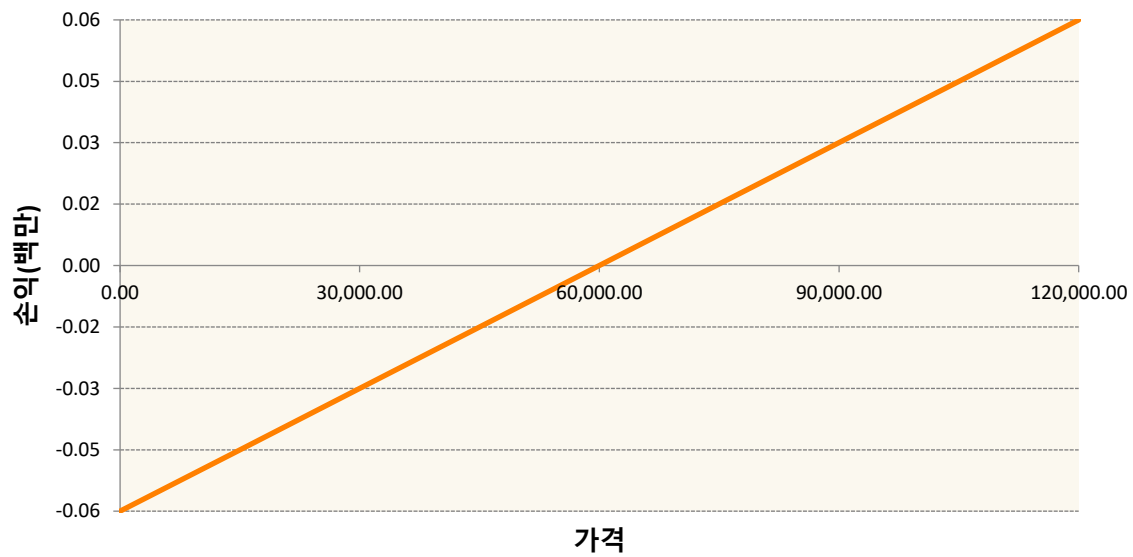
2. 만기시점의 손익구조



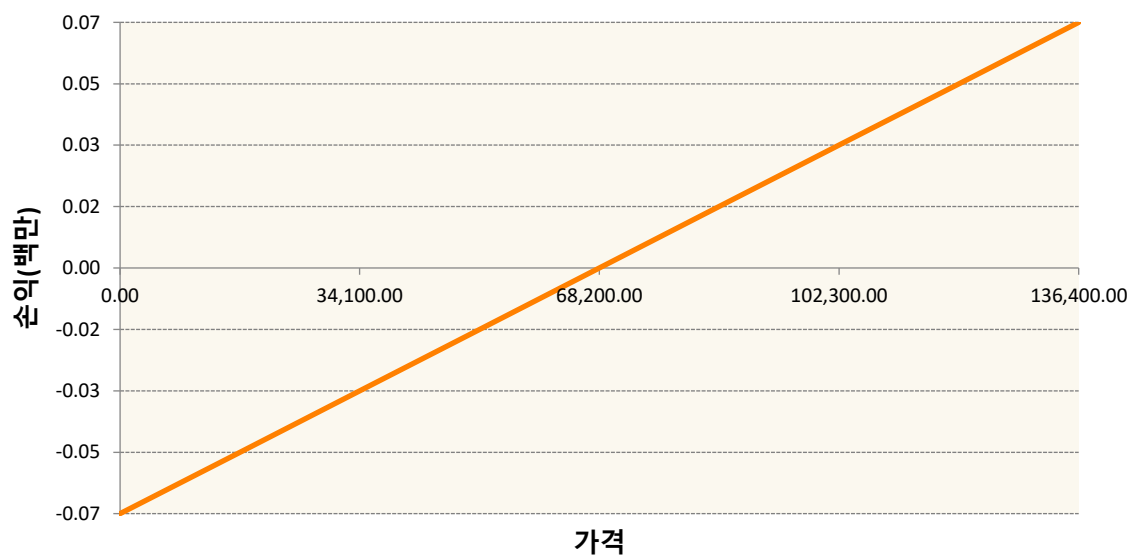
KR411RW70003-2025-07 한화비전개별선물



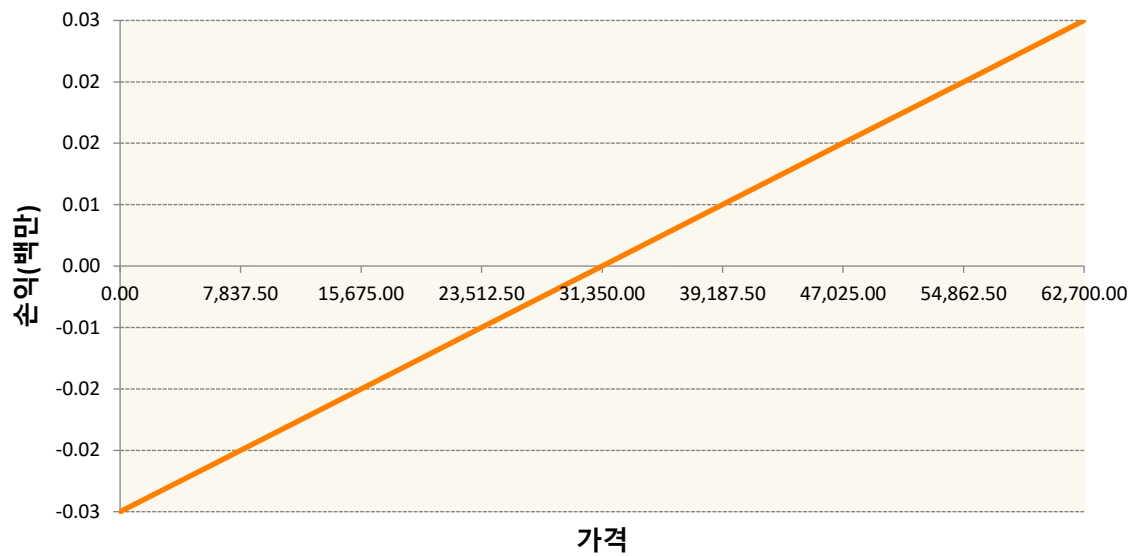
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



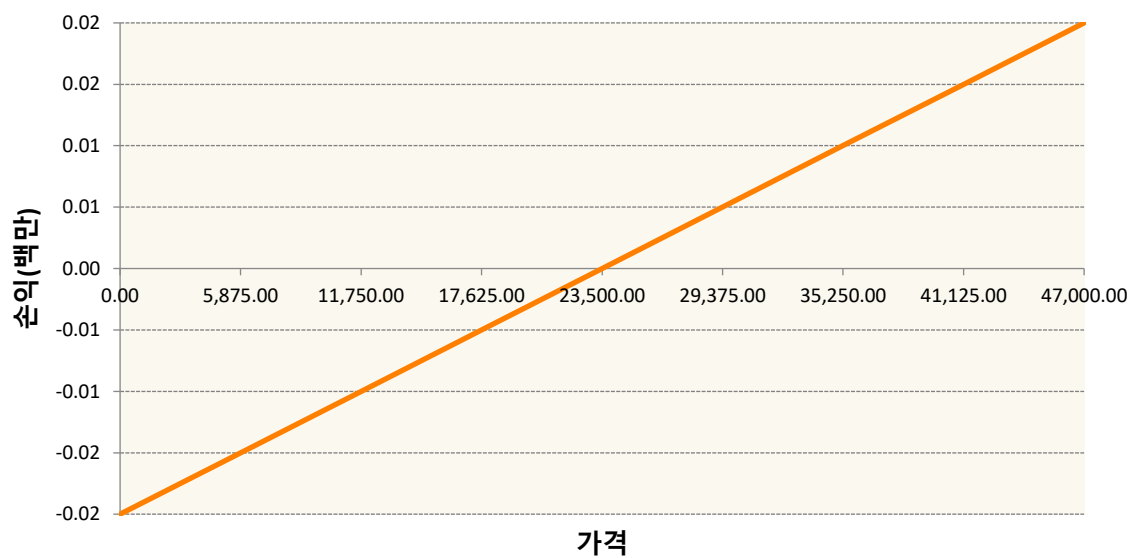
KR41B9W70000-2025-07 두산에너지개별선물



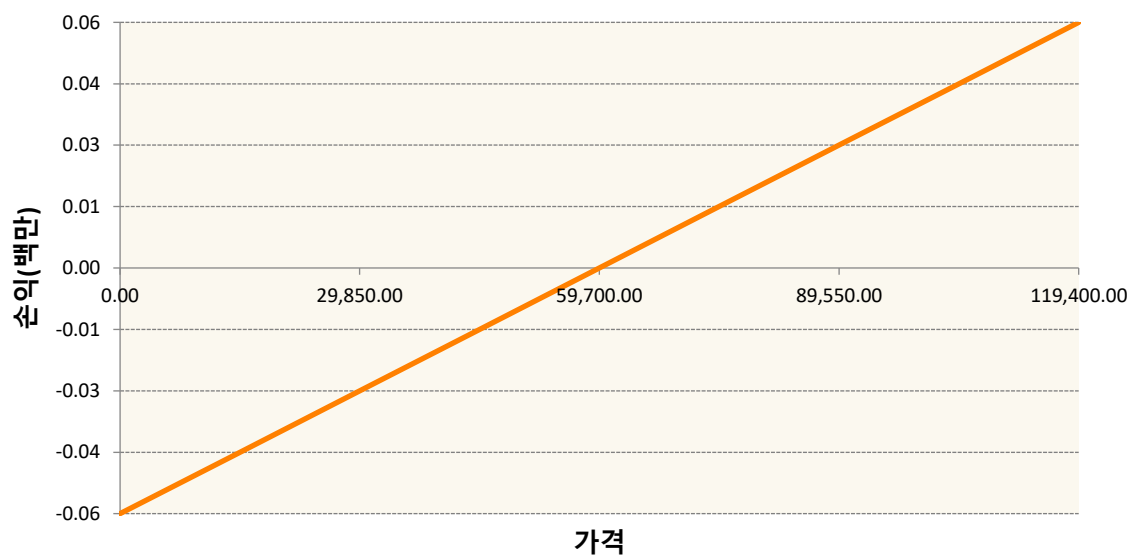
KR41CBW70003-2025-07 한화솔루션개별선물



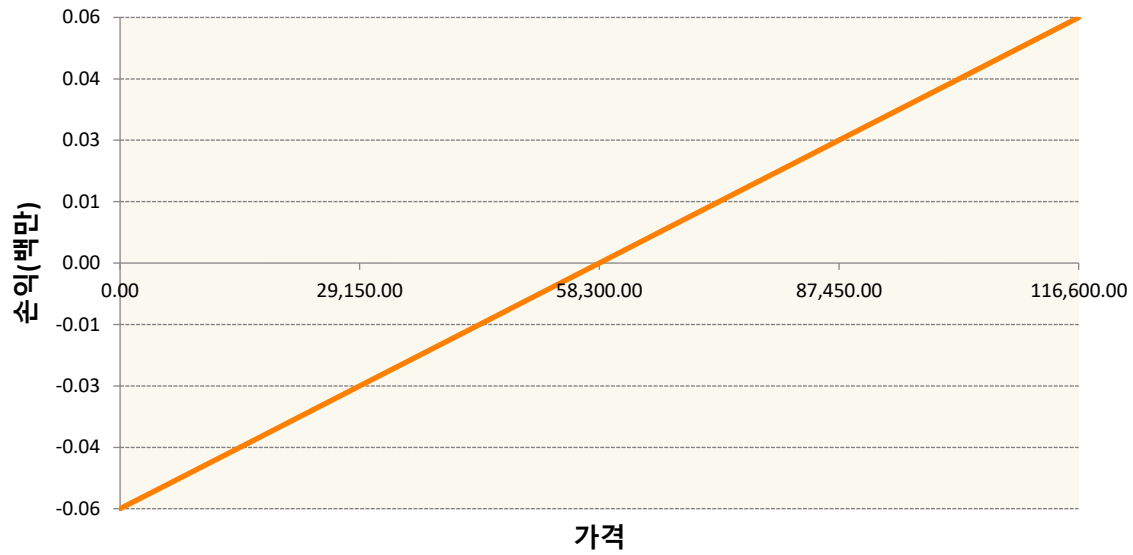
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



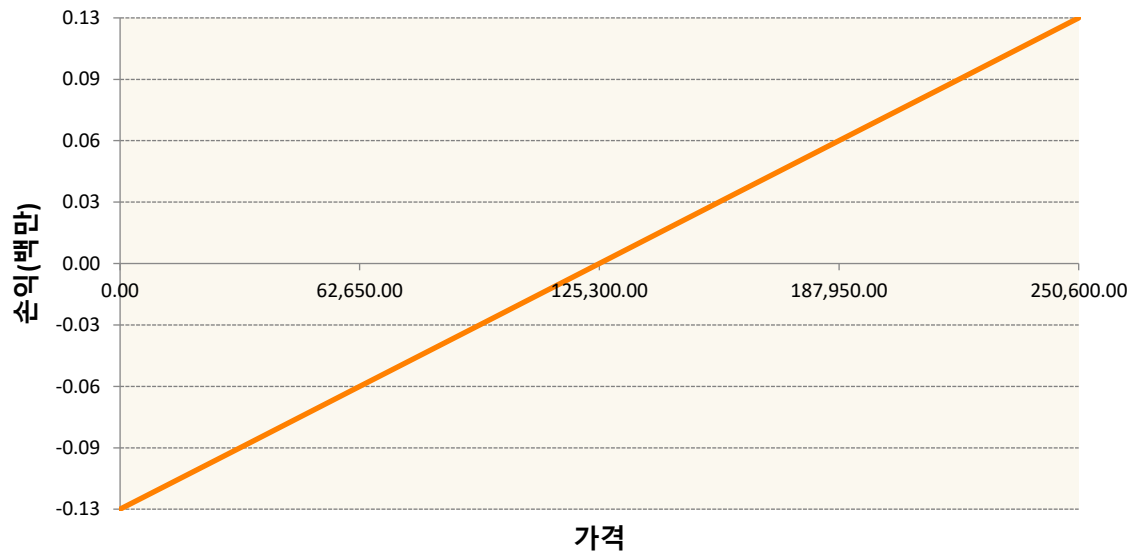
KR41D7W70002-2025-07 한전KPS개별선물



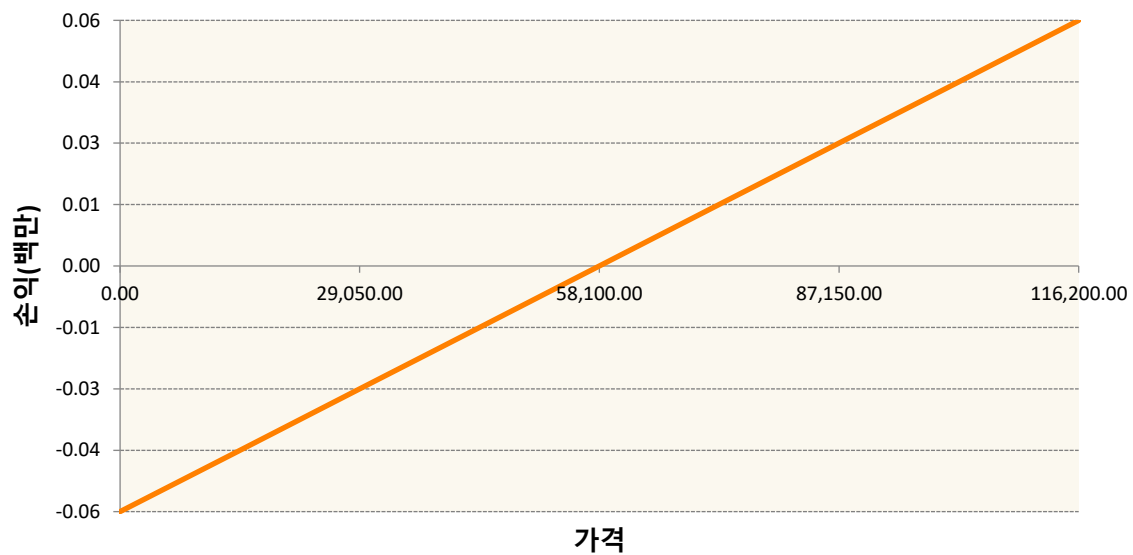
KR41DWW70007-2025-07 두산밥캣개별선물



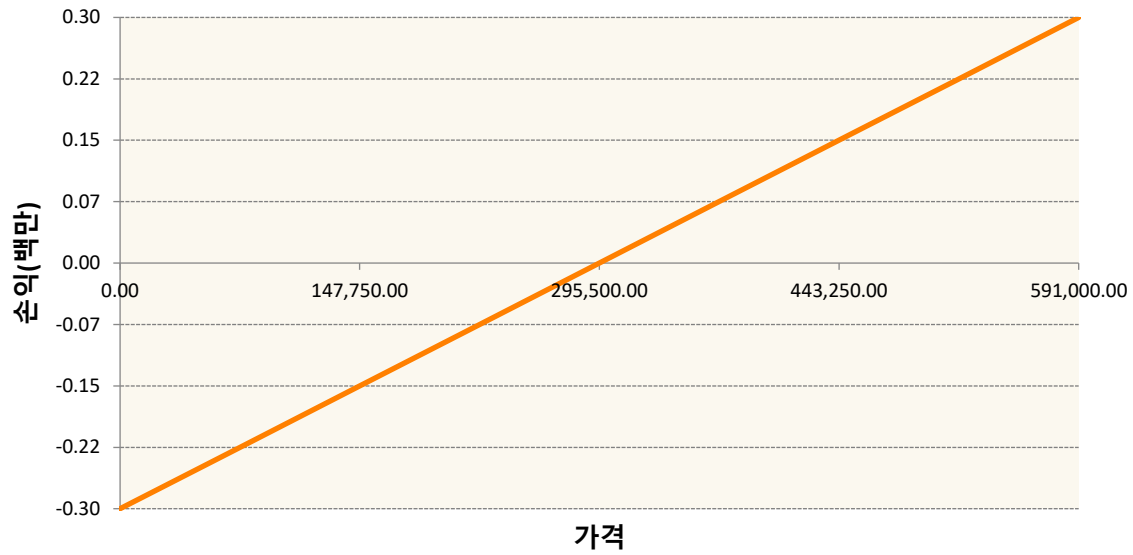
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



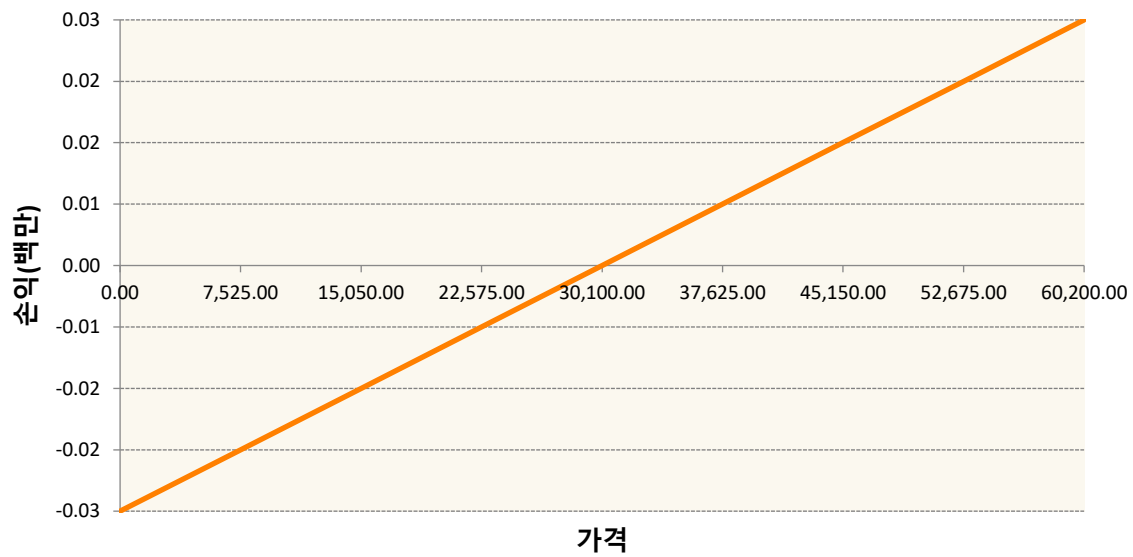
KR41EVW70007-2025-07 한화시스템개별선물



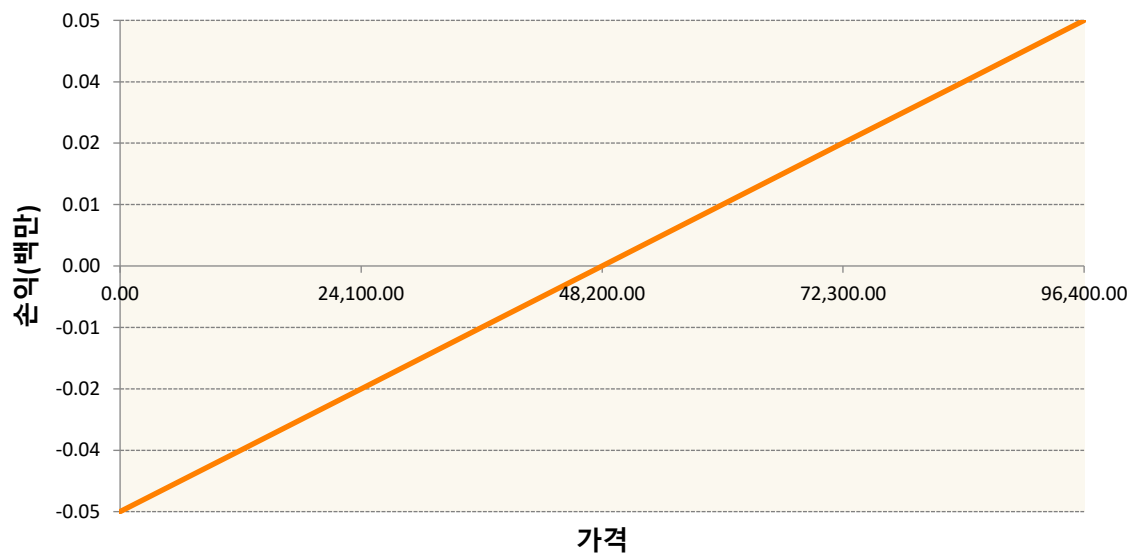
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



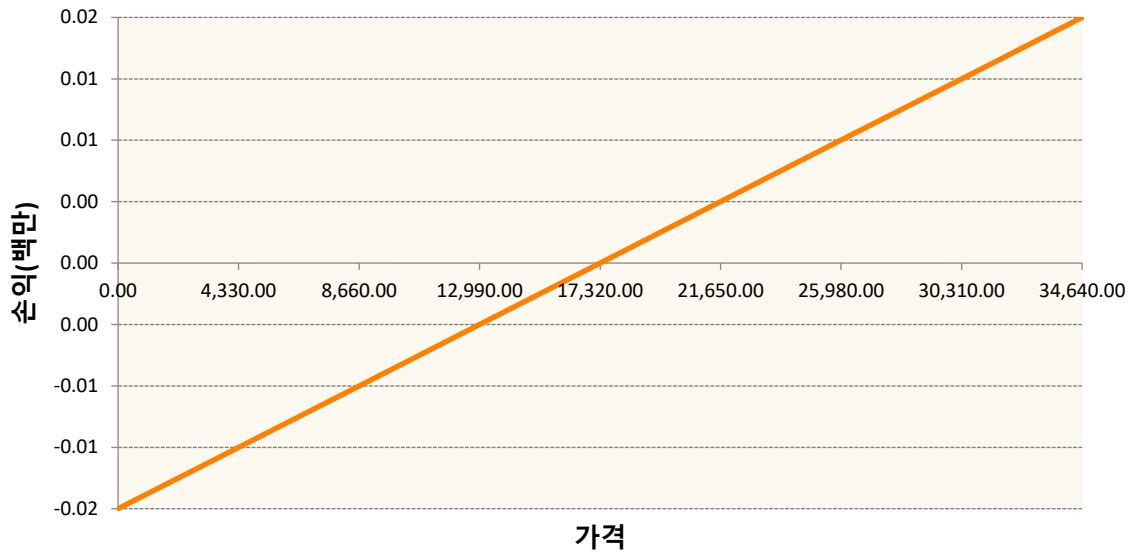
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



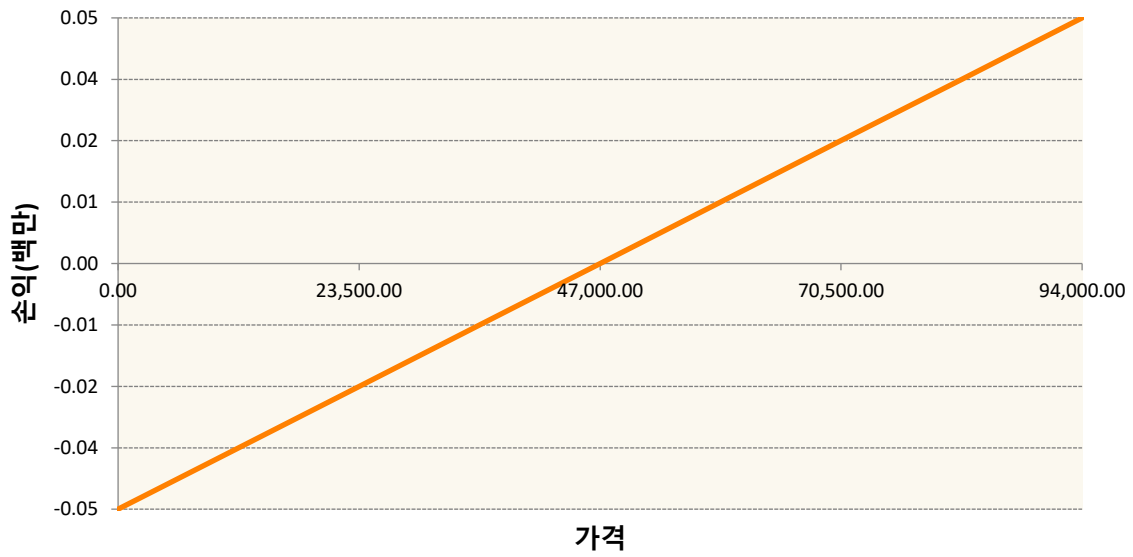
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



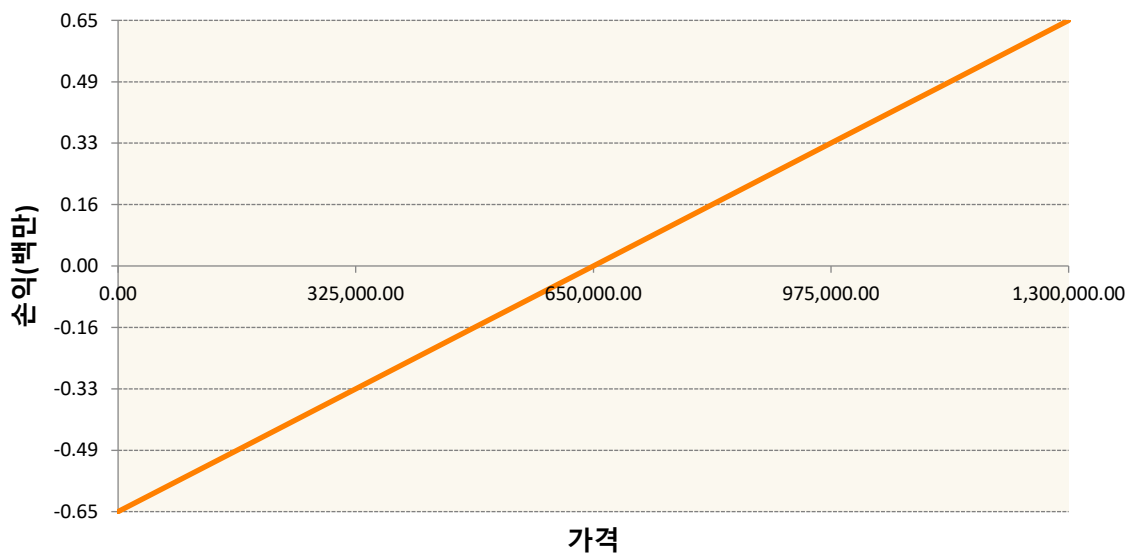
KR41FWW70002-2025-07 대한전선개별선물



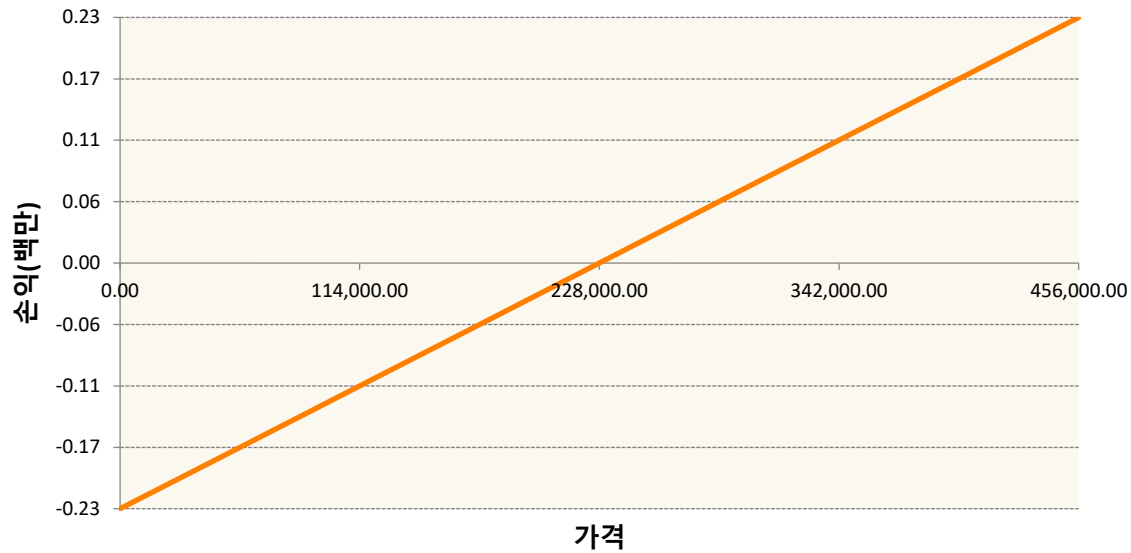
KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41GTW70006-2025-07 두산개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	599
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물	10
KR411RW70(2025-07 한화비전개별선물	18
KR41B2W70(2025-07 S-Oil개별선물	4
KR41B9W70(2025-07 두산에너지개별선물	1
KR41CBW70(2025-07 한화솔루션개별선물	30
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	12
KR41D7W70 2025-07 한전KPS개별선물	0.05
KR41DWW7(2025-07 두산밥캣개별선물	1
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물	35
KR41EVW70(2025-07 한화시스템개별선물	2
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	108
KR41F6W70(2025-07 카카오뱅크개별선물	105
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	12
KR41FWW70 2025-07 대한전선개별선물	0.06
KR41G0W70 2025-07 씨에스윈드개별선물	7
KR41GTW70(2025-07 두산개별선물	2
KR41HEW70(2025-07 키움증권개별선물	30

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

(단위:백만원)

1,841

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

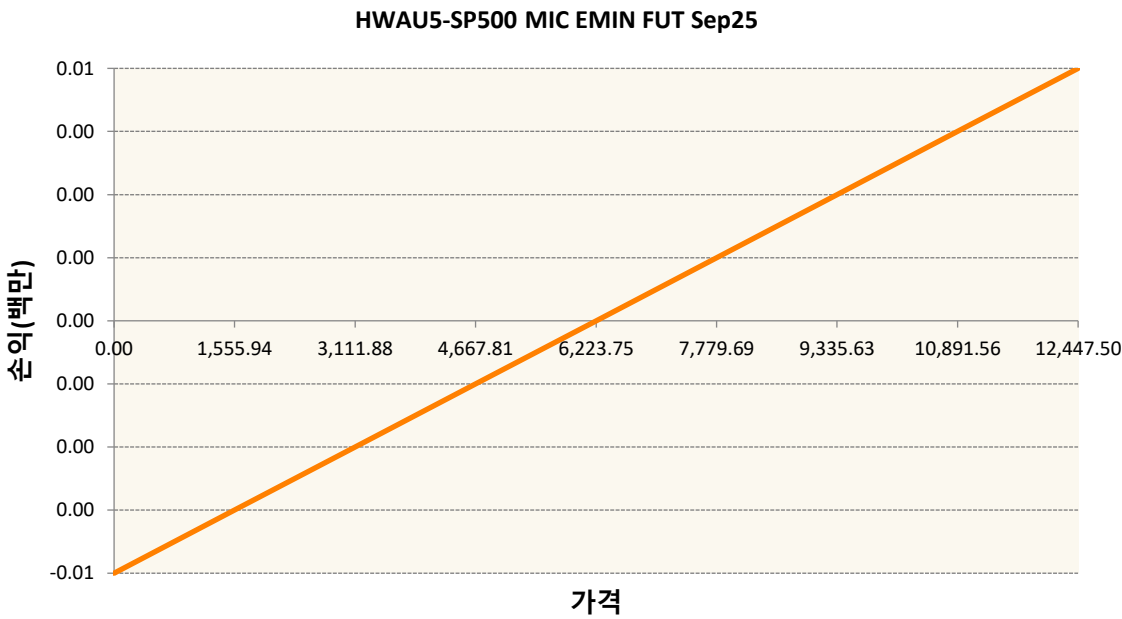
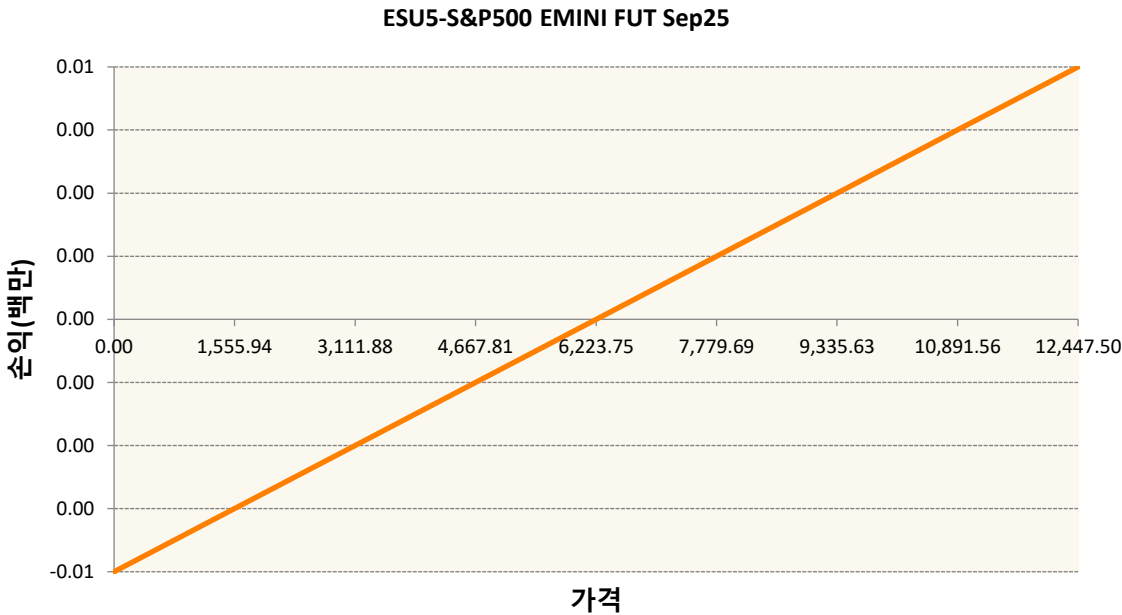
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	30,892	0	30,892	
누계	지수	선물	1,630	0	1,630	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,471
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	130

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,307

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

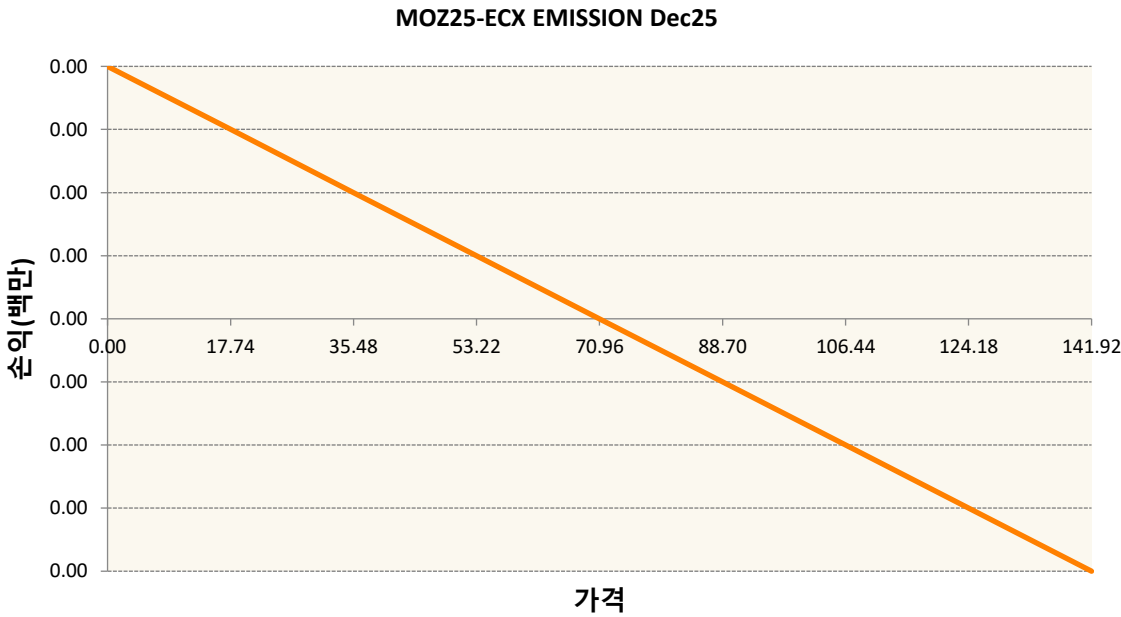
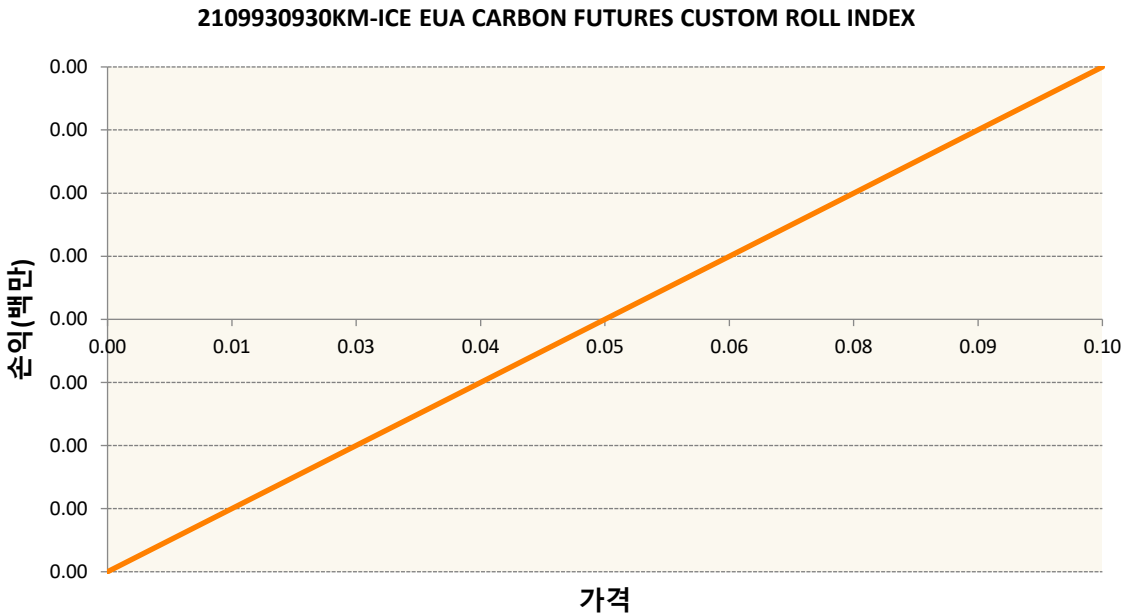
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	20	4,872	-4,853	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		2
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		390

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	655

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

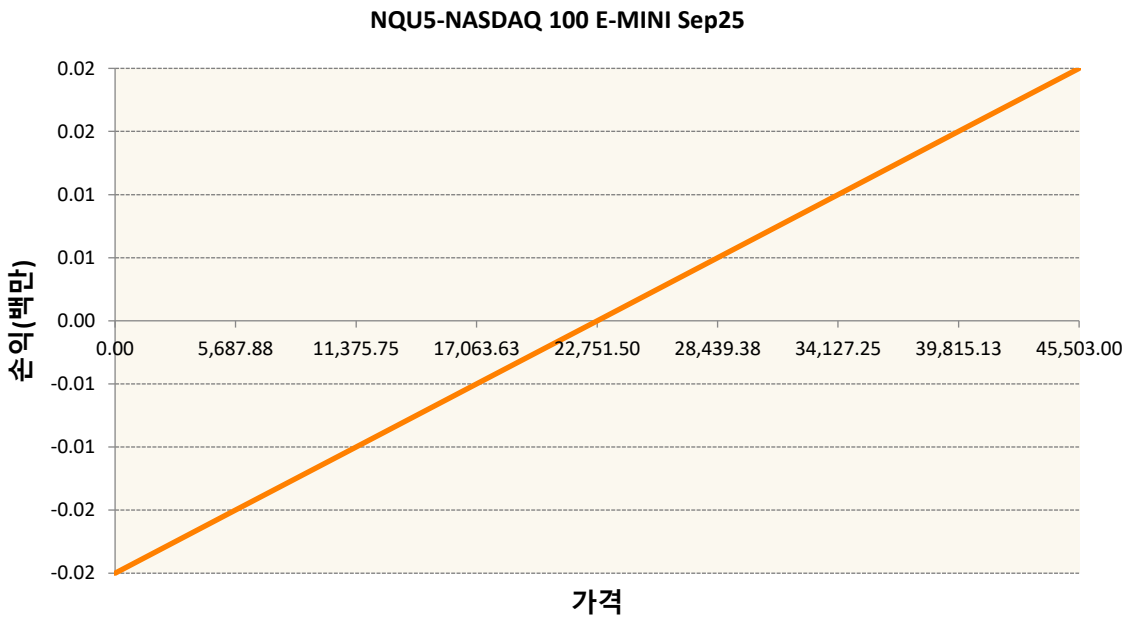
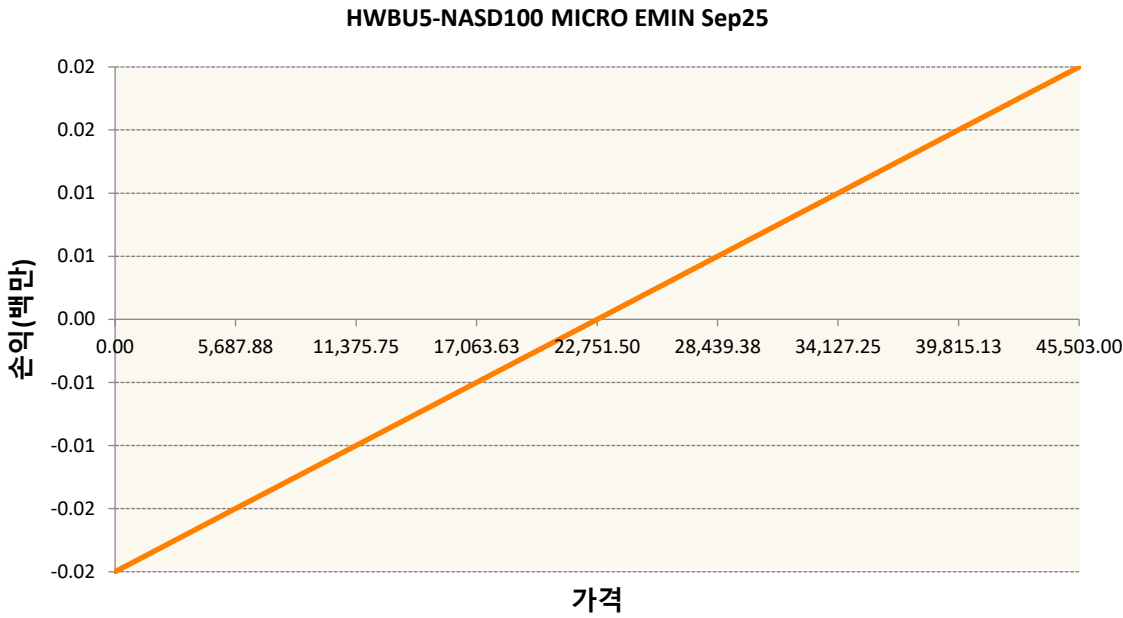
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,800	0	13,800	
누계	지수	선물	312	0	312	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25	25
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	1,104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,297

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

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	256,707	0	256,707	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,445
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,102
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,202
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,817

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

(단위:백만원)

10,643

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

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	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3

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

(단위:백만원)

15

공시일	2025-07-01
기준일	2025-06-30

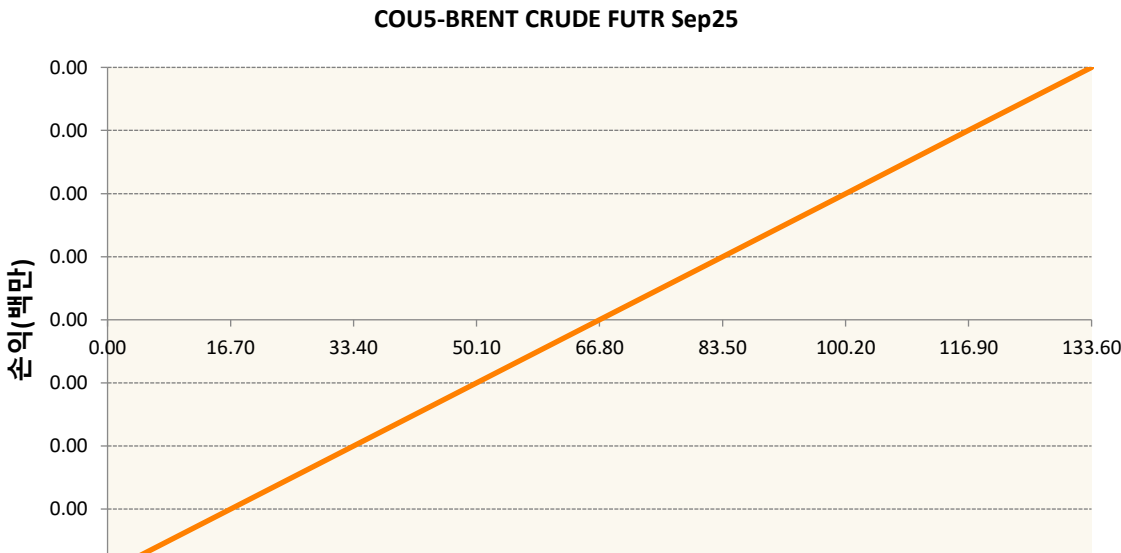
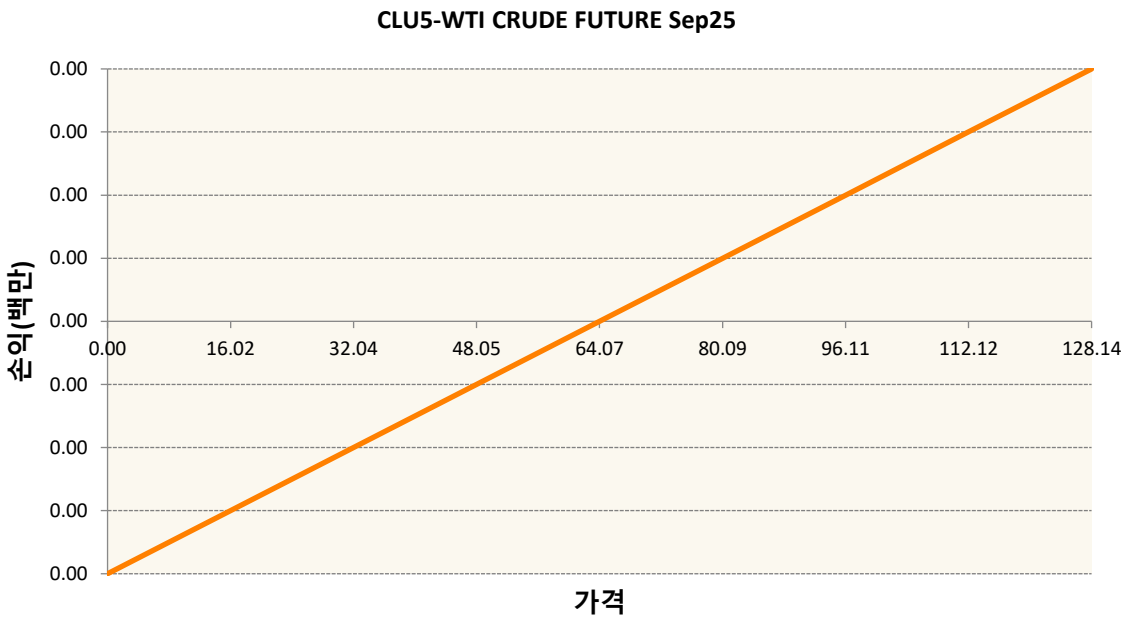
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

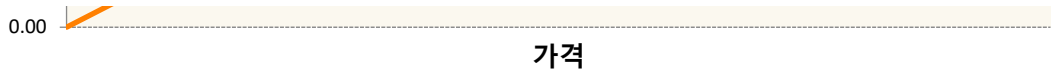
1. 계약금액

(단위:백만원)

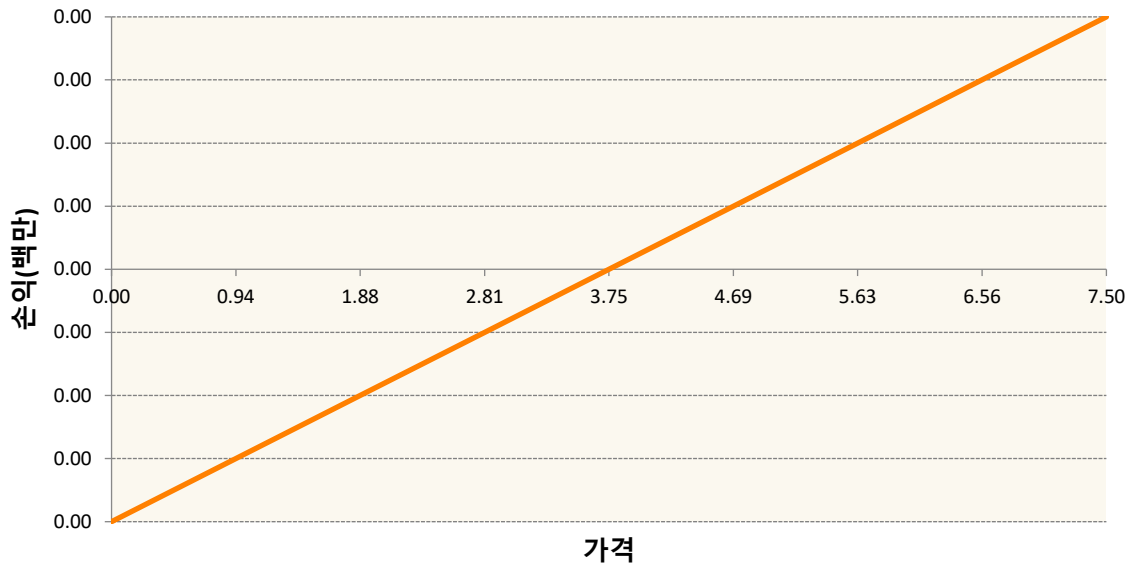
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	348	0	348	
누계	유가증권	선물	277	0	277	
누계	통화	선물	0	108	-108	장내

2. 만기시점의 손익구조

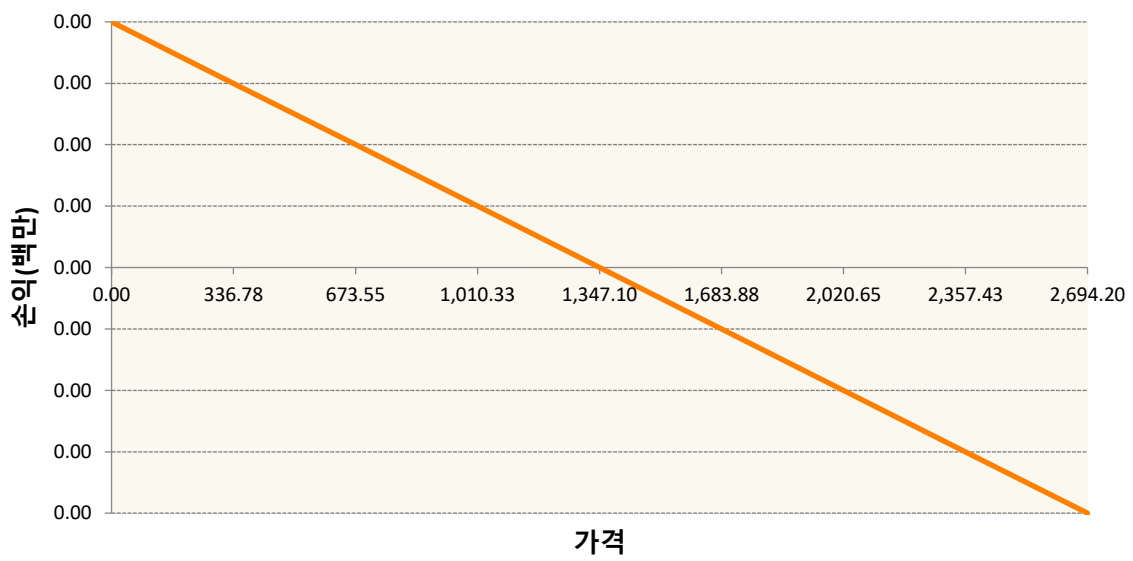




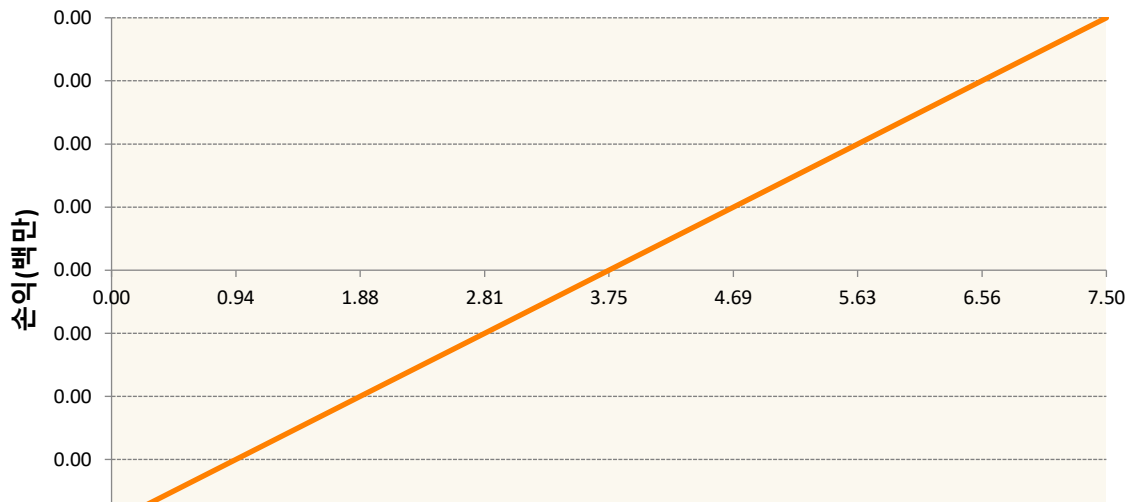
EOU5-E-MINI NATURAL GAS Sep25

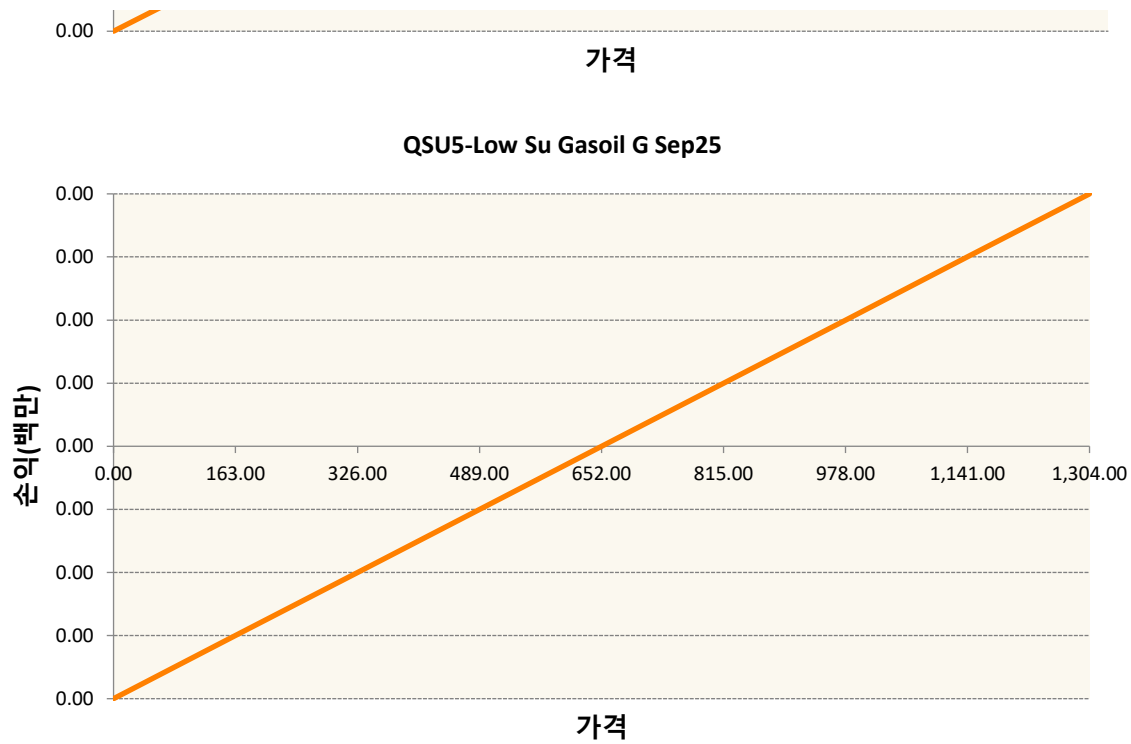


KR4175W70003-2025-07 달러선물



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)
	127