

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

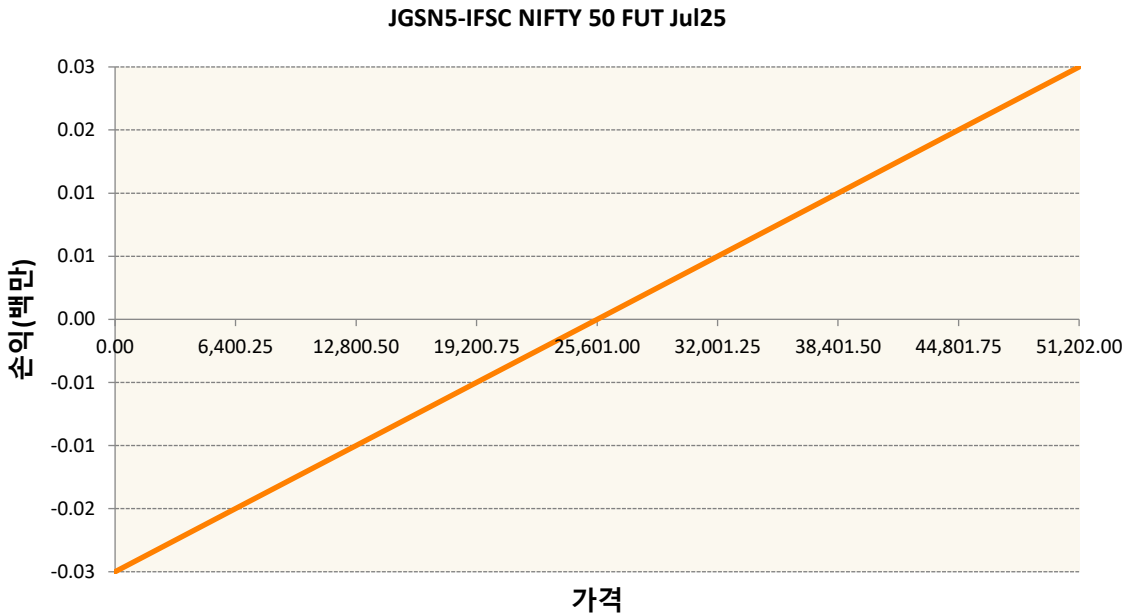
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 628   | 0     | 628       |    |

### 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 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

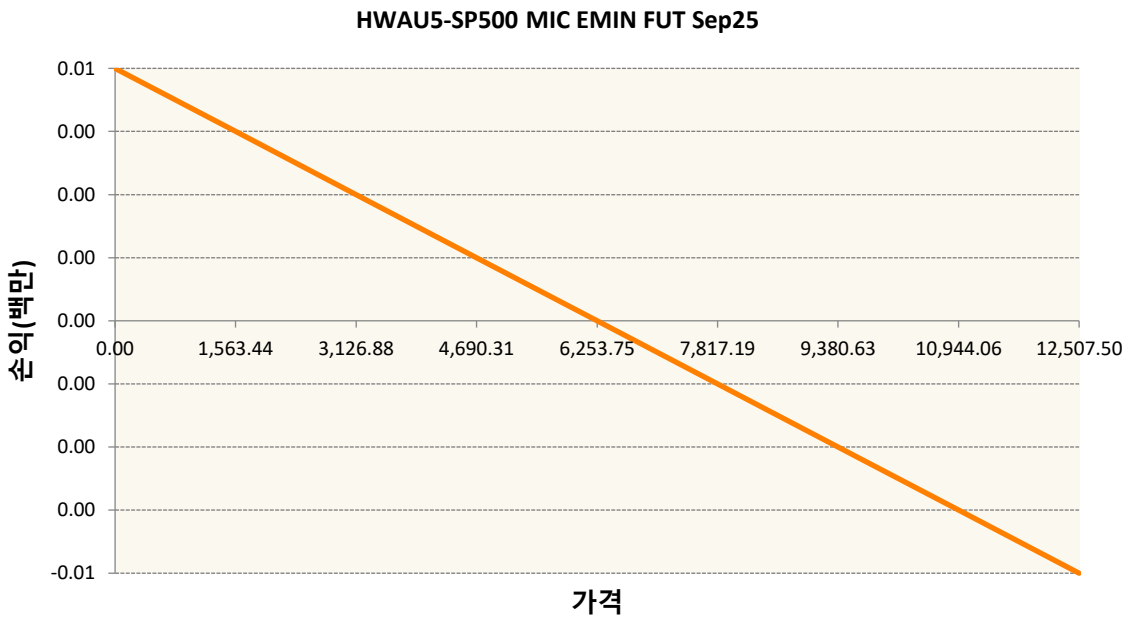
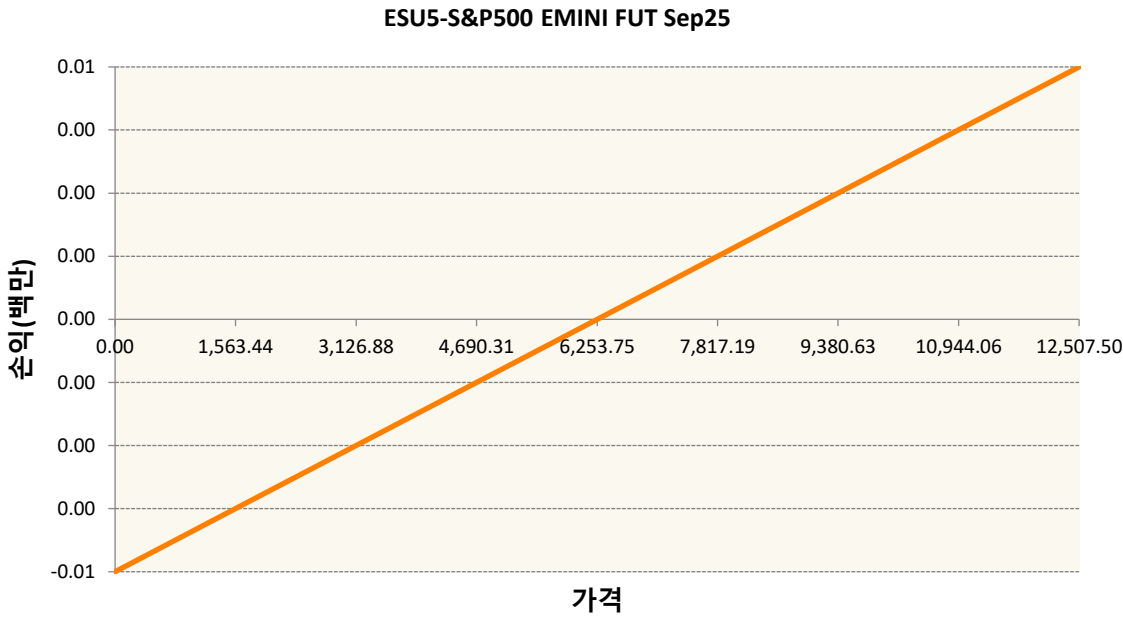
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 431   | 0     | 431       |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 0     | 121   | -121      | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESU5                      | S&P500 EMINI FUT Sep25   | 35       |
| HWAU5                     | SP500 MIC EMIN FUT Sep25 | 10       |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

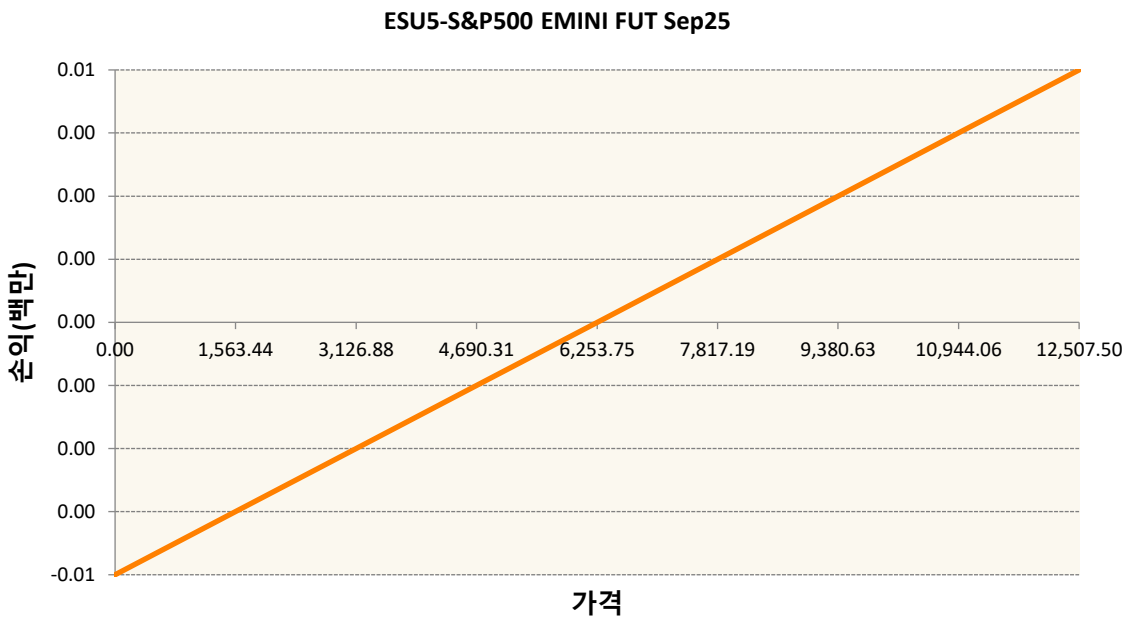
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| ESU5 | S&P500 EMINI FUT Sep25 | 104 |
|------|------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 92 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

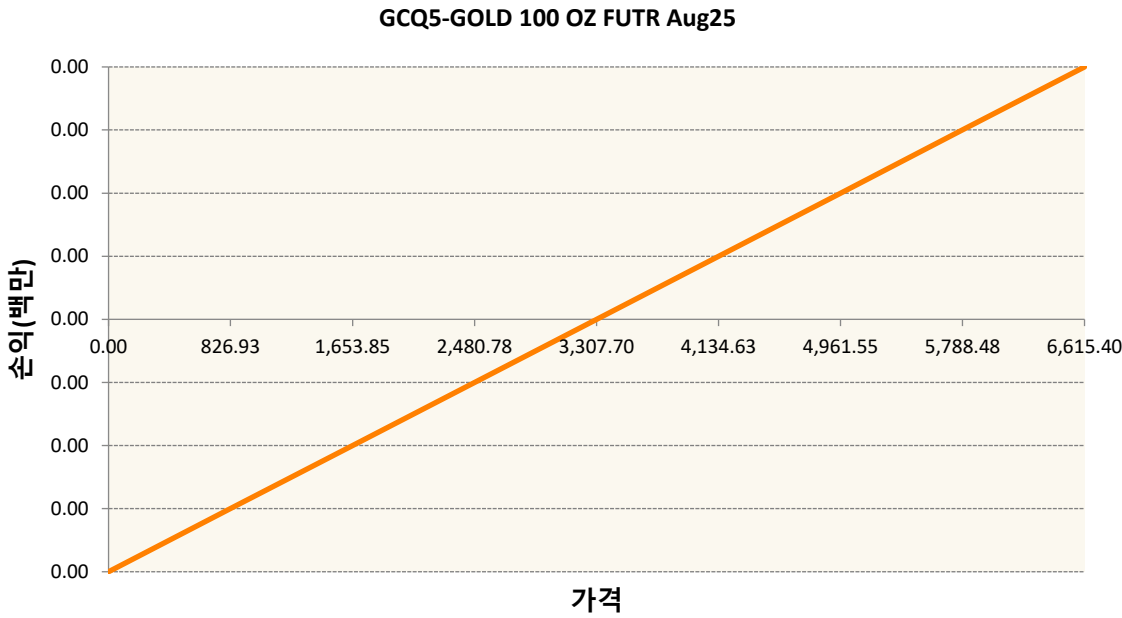
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 1,820 | 0     | 1,820     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |      |
|---------------------------------------|------|
| AOGLDUSC3 GLD US 07/03/25 C307 EQUITY | 0.04 |
| GCQ5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25           | 146  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 125 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

## 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 C143 EQUITY  | 0.26 |
| AOPLTRUSC`PLTR US 07/03/25 C149 EQUITY  | 2    |
| AOPLTRUSP1`PLTR US 07/03/25 P143 EQUITY | 1    |
| AOPLTRUSP1`PLTR US 07/03/25 P149 EQUITY | 7    |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 44 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

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

0.01

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

(단위:백만원)

0

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

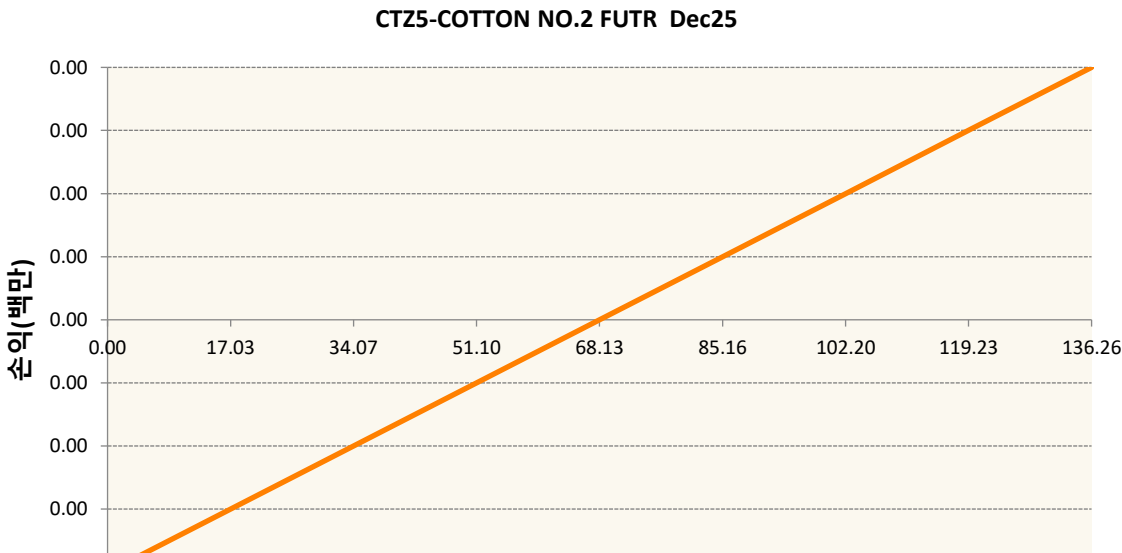
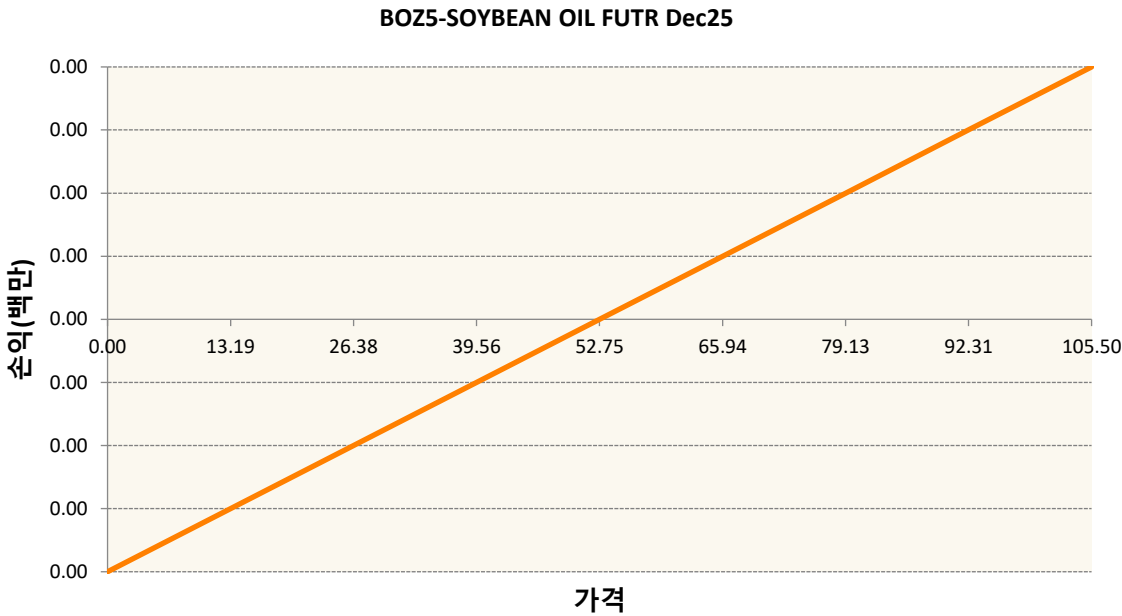
## 포커스농산물모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

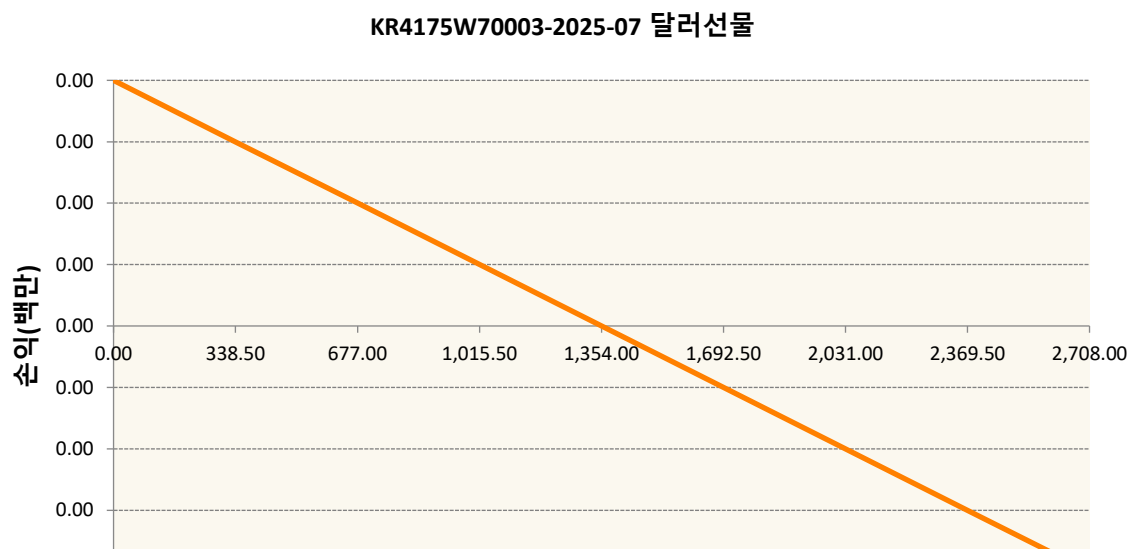
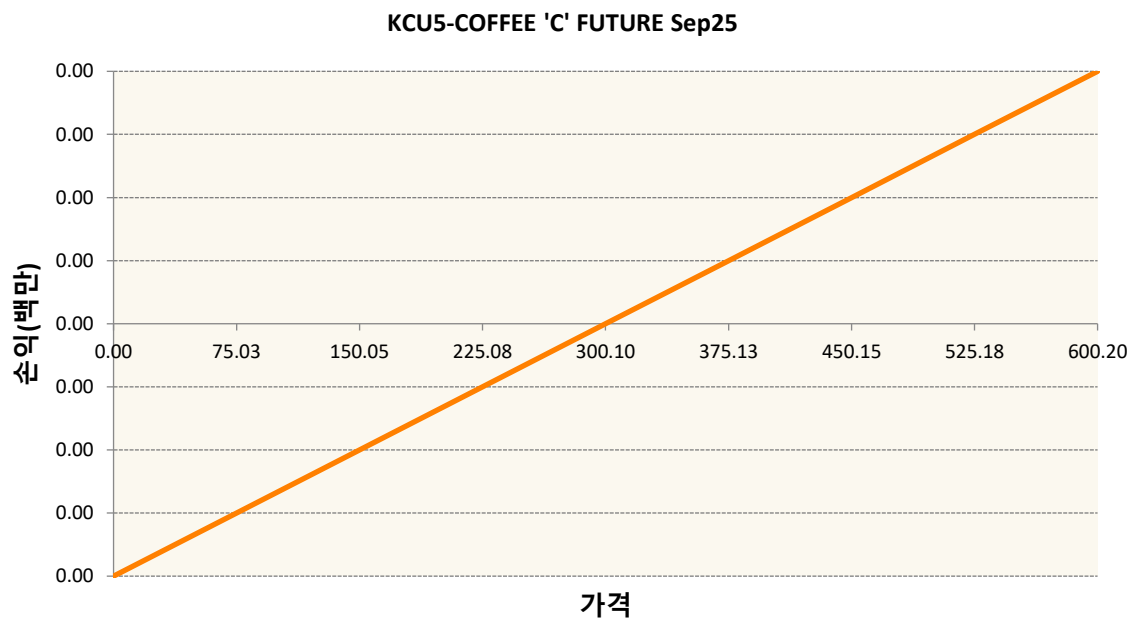
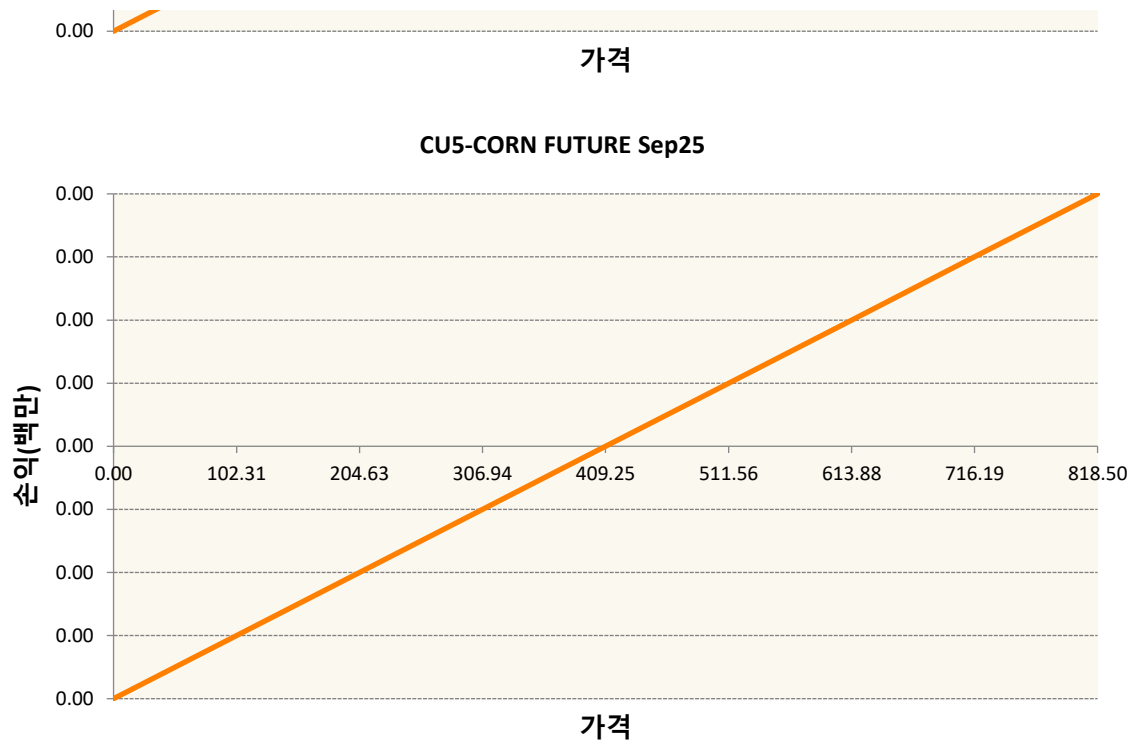
(단위:USD 백만)

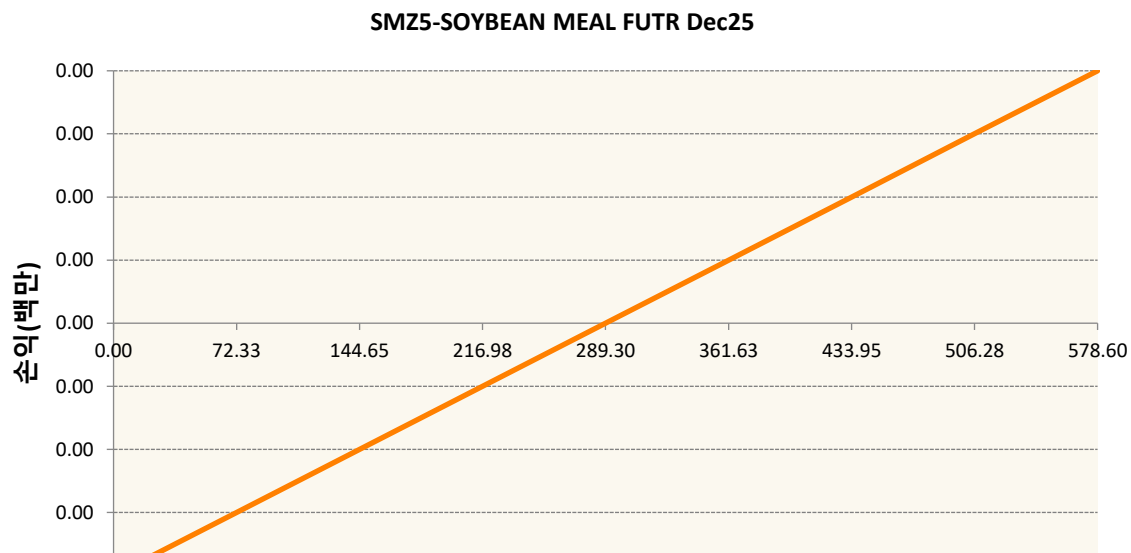
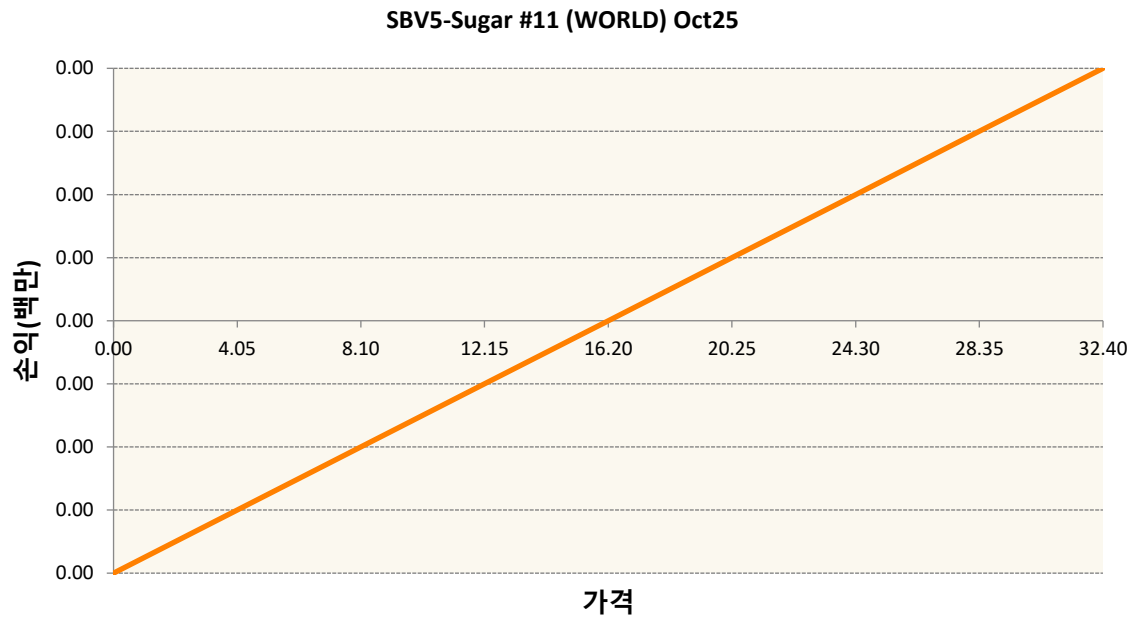
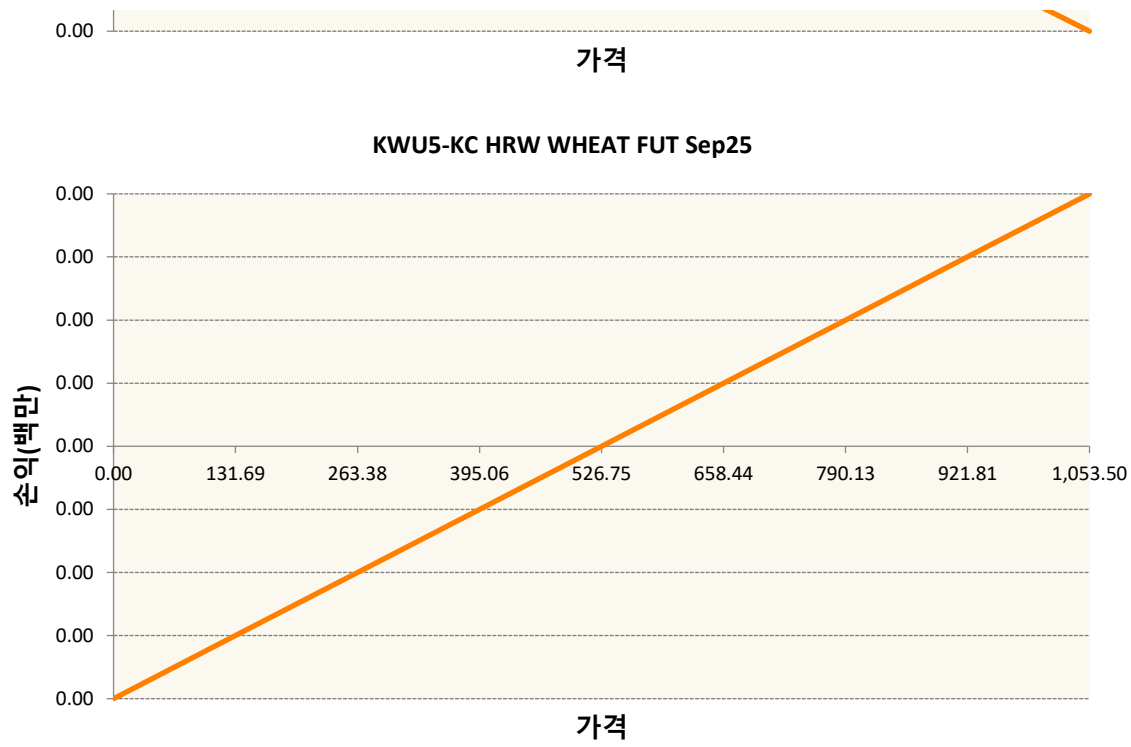
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,561 | 0     | 1,561     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,018 | 0     | 2,018     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 257   | -257      | 장내 |

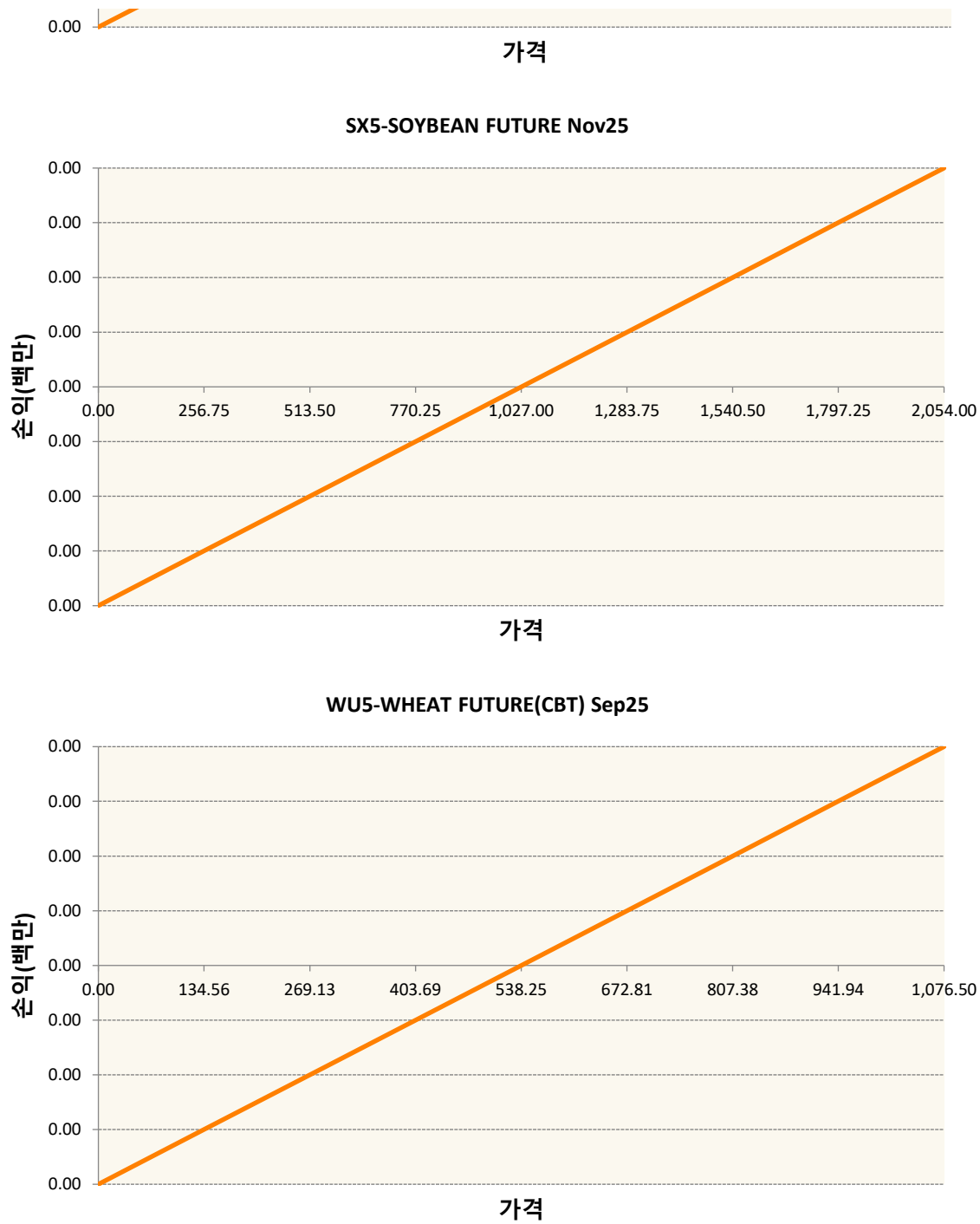
### 2. 만기시점의 손익구조











### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

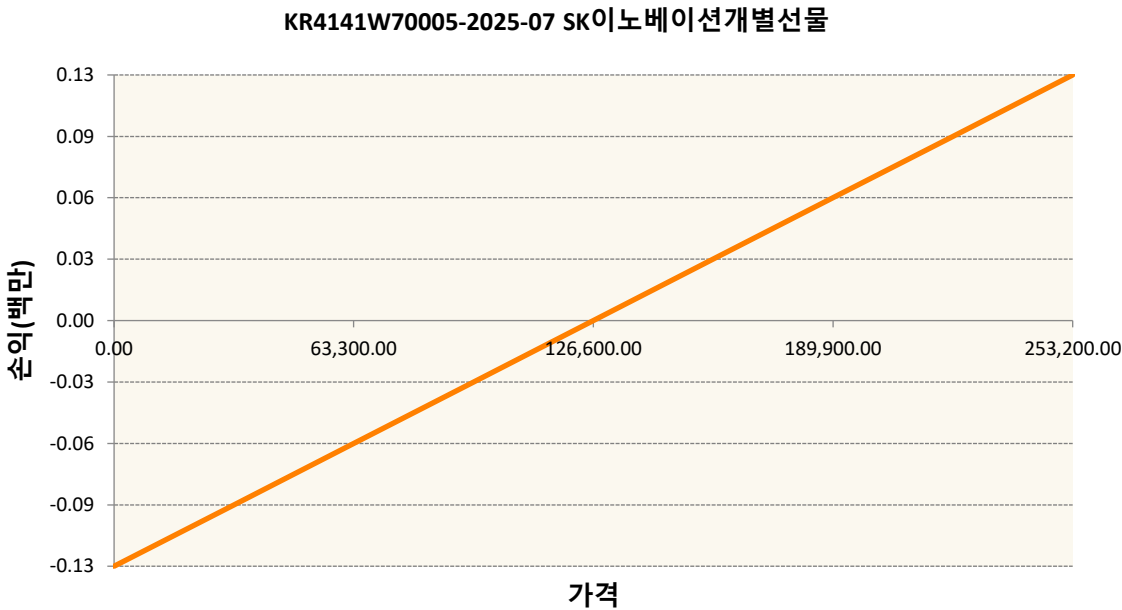
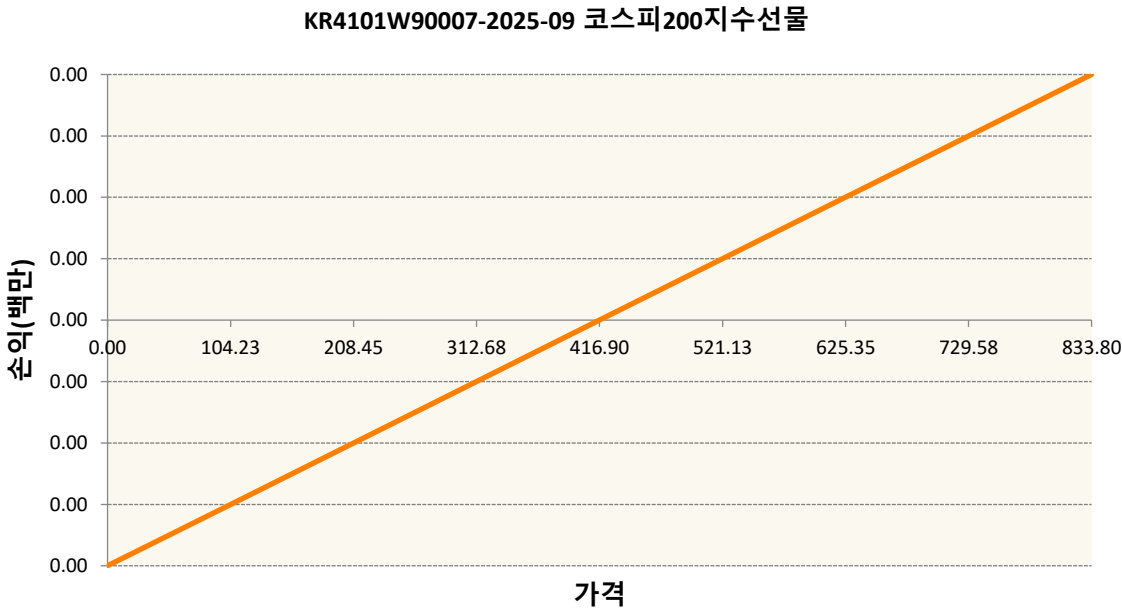
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

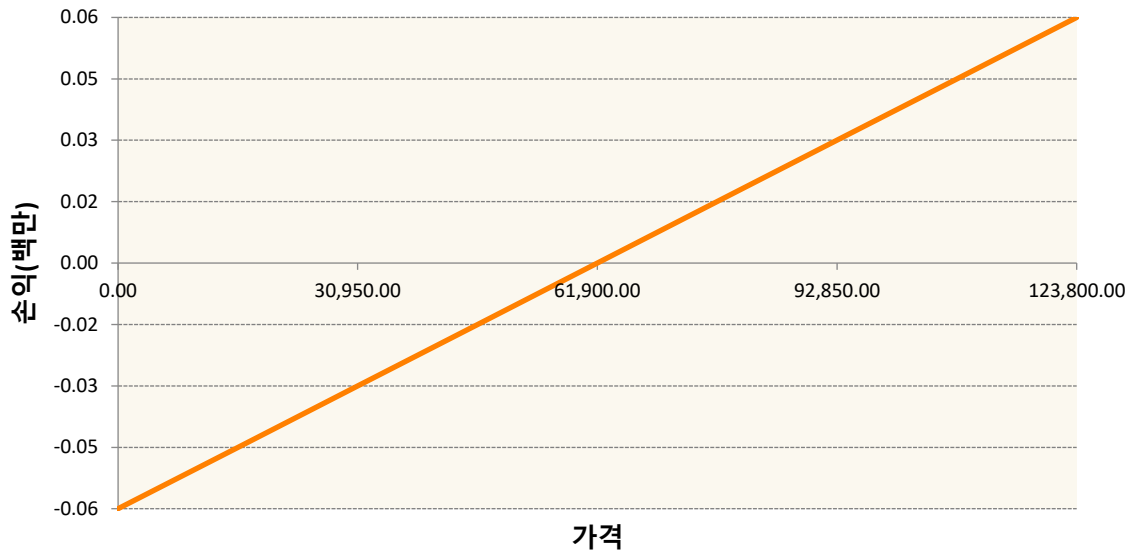
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,435 | 0     | 1,435     | 장내 |

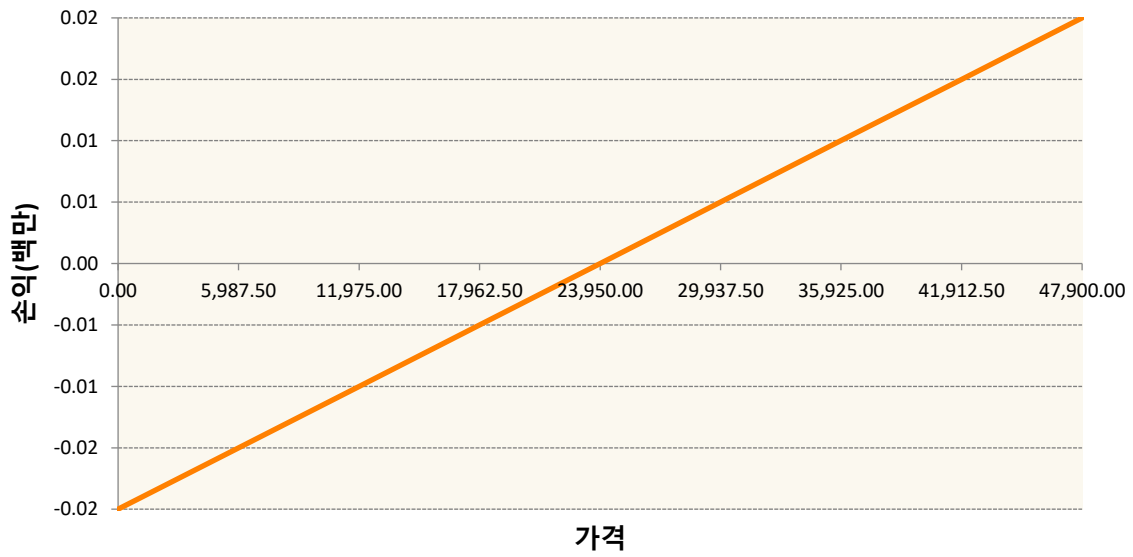
### 2. 만기시점의 손익구조



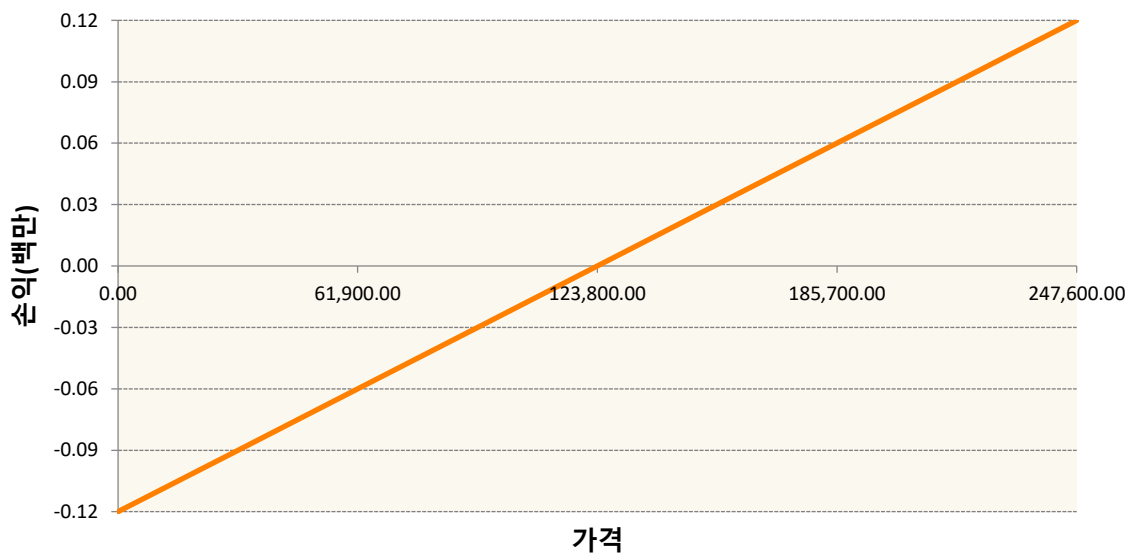
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



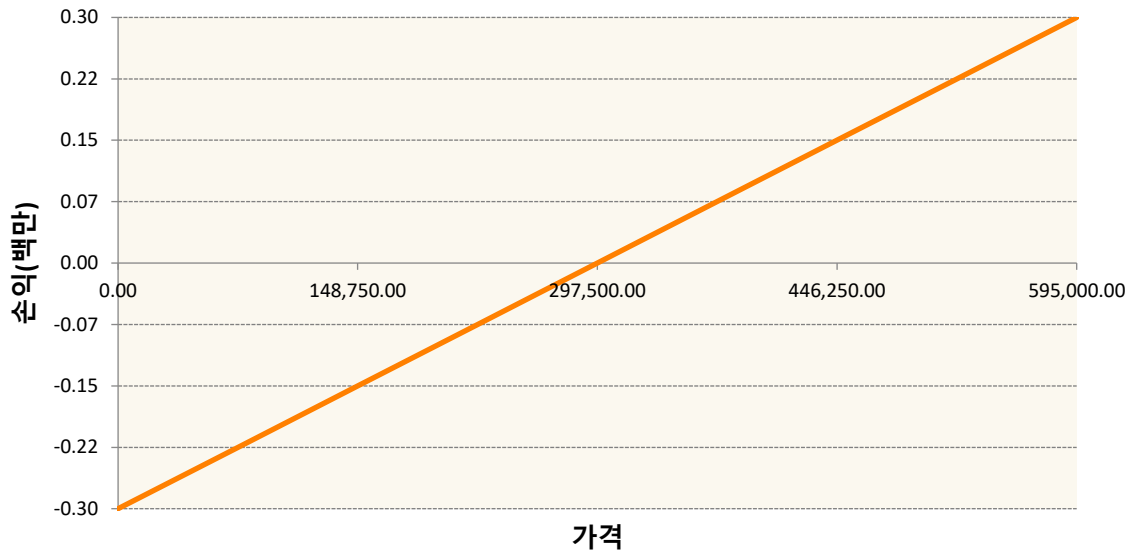
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



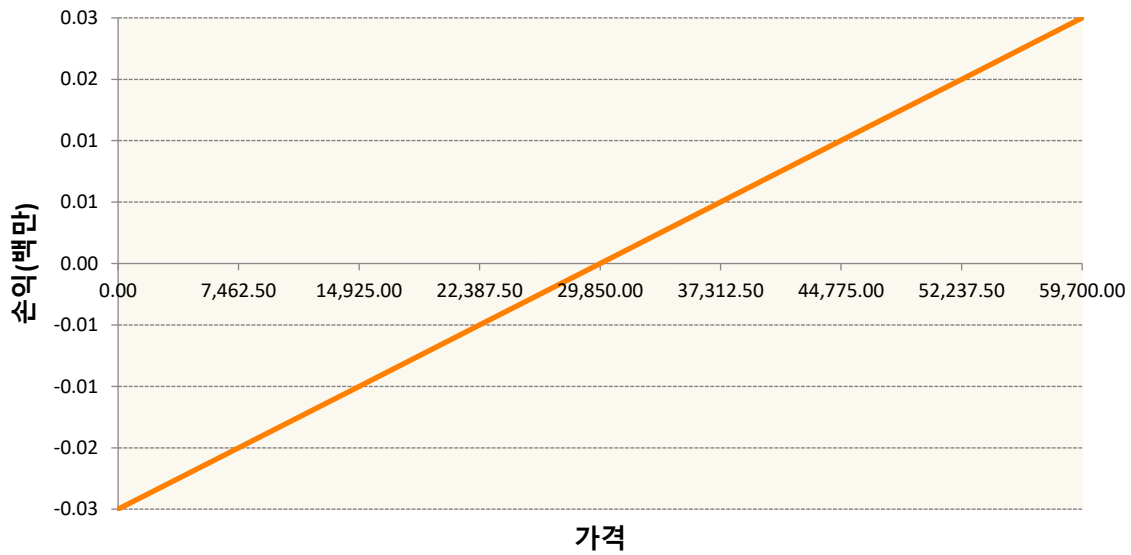
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



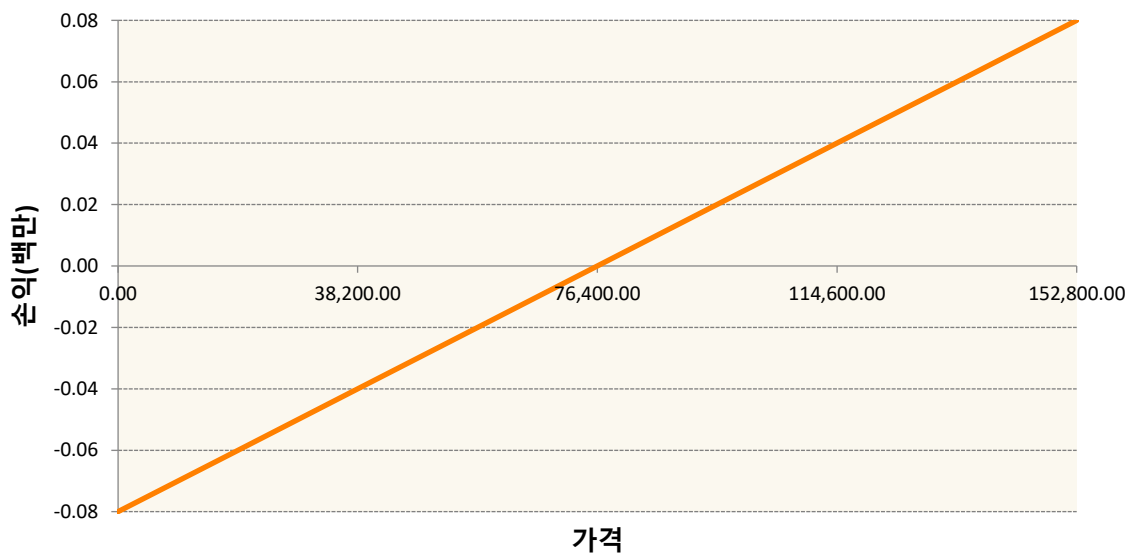
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



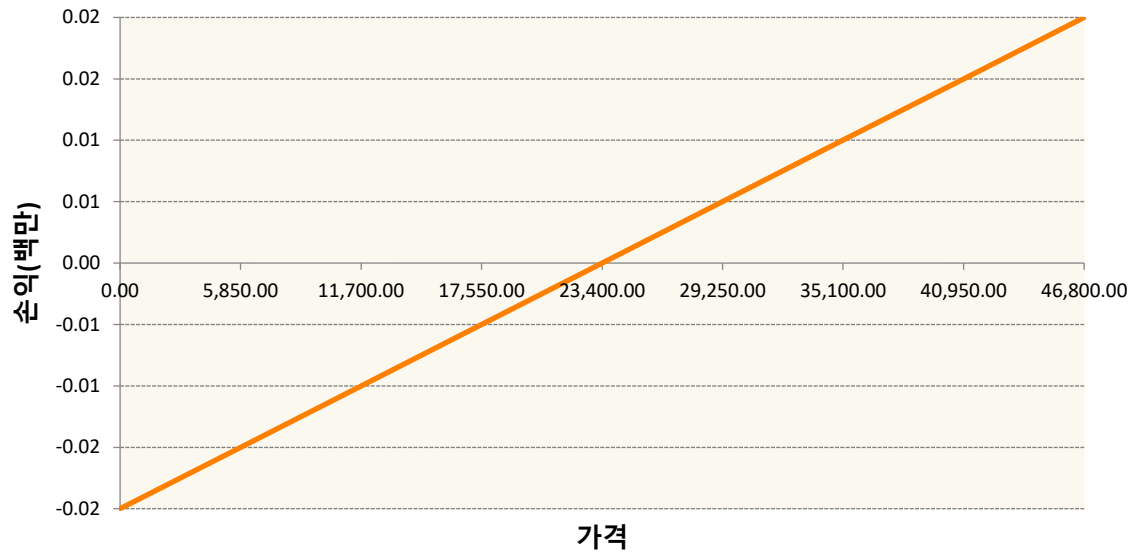
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



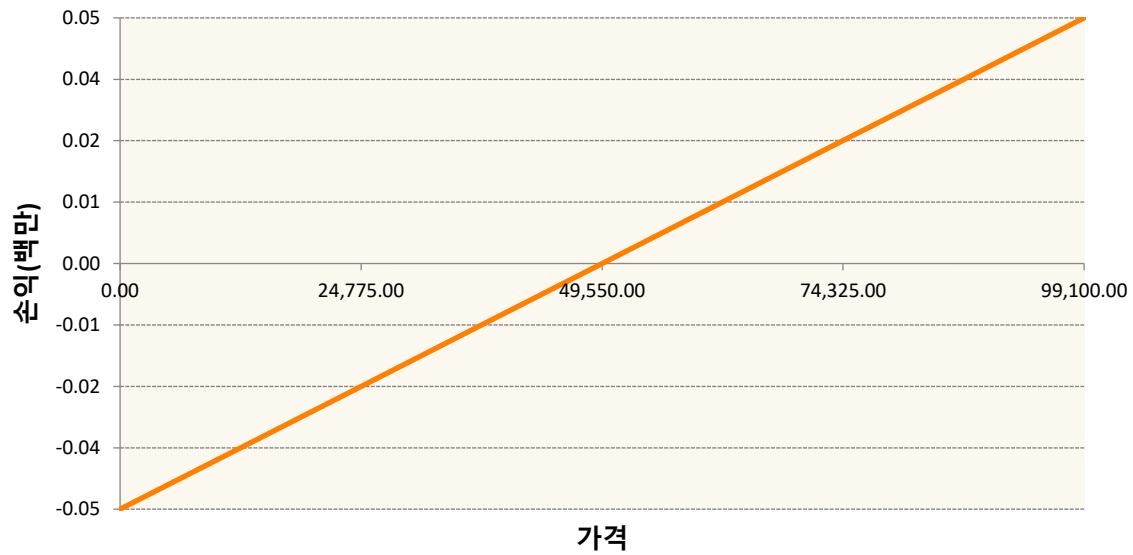
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



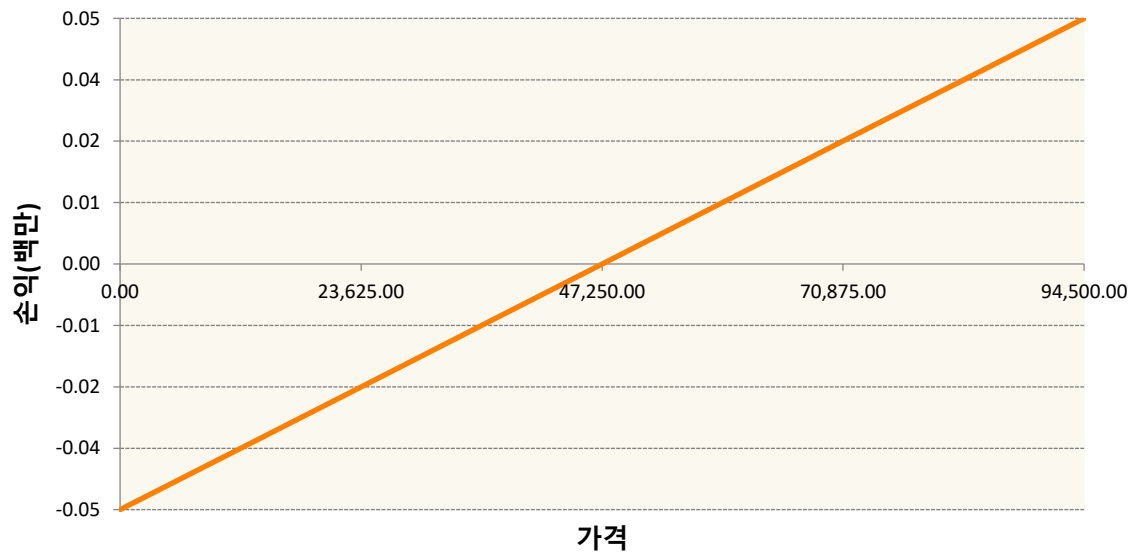
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



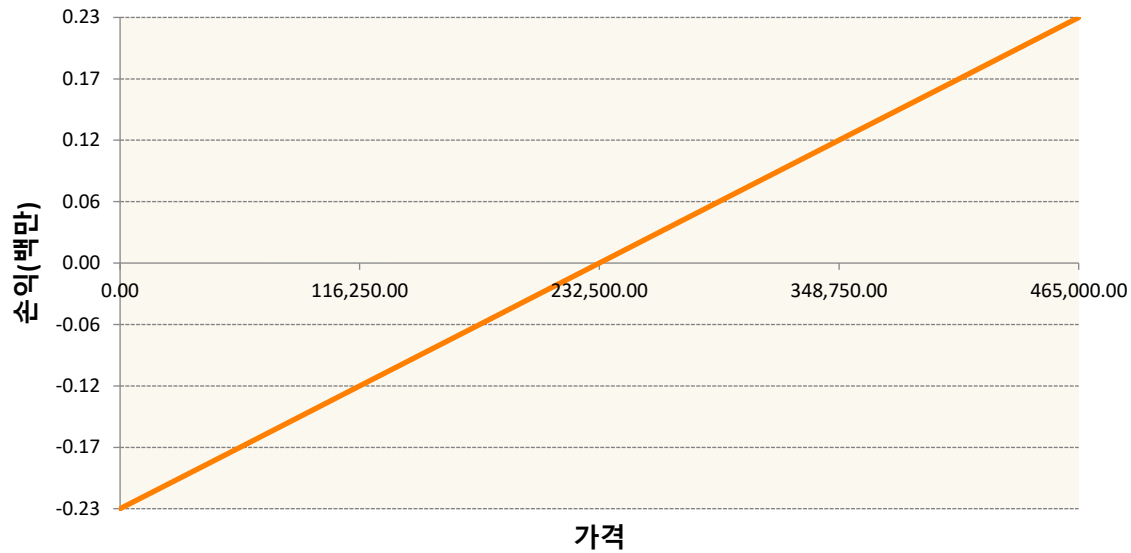
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41GOW70004-2025-07 씨에스원드개별선물



### KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                 |      |
|---------------------------------|------|
| KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물   | 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)

216



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

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

308

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

497

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

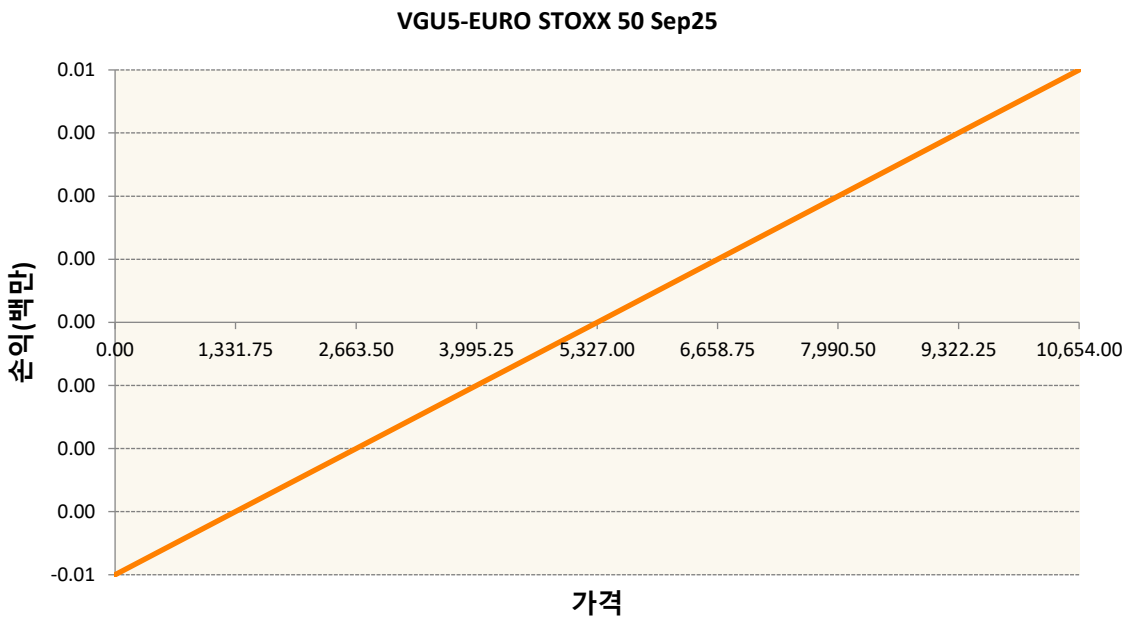
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 927   | 0     | 927       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 61 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

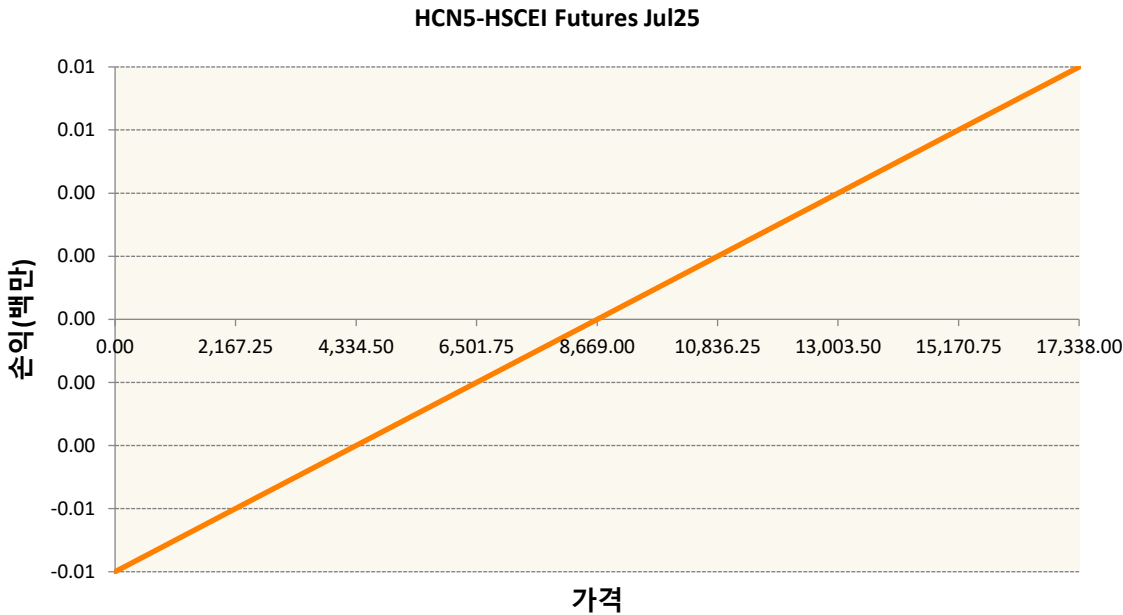
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 2,181 | 0     | 2,181     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCN5 | HSCEI Futures Jul25 | 175 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

253

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

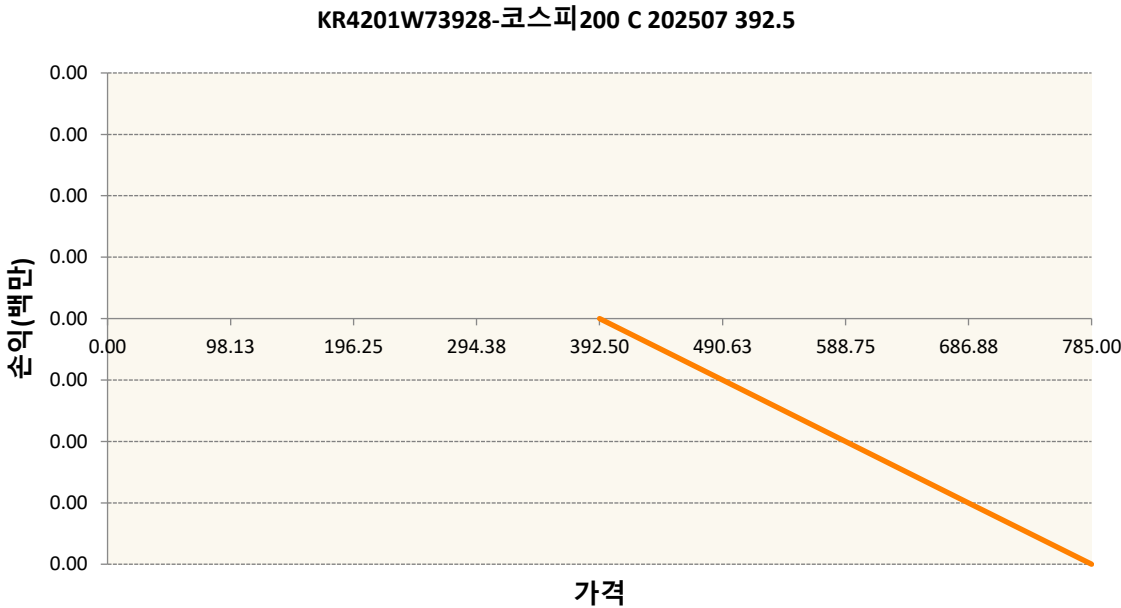
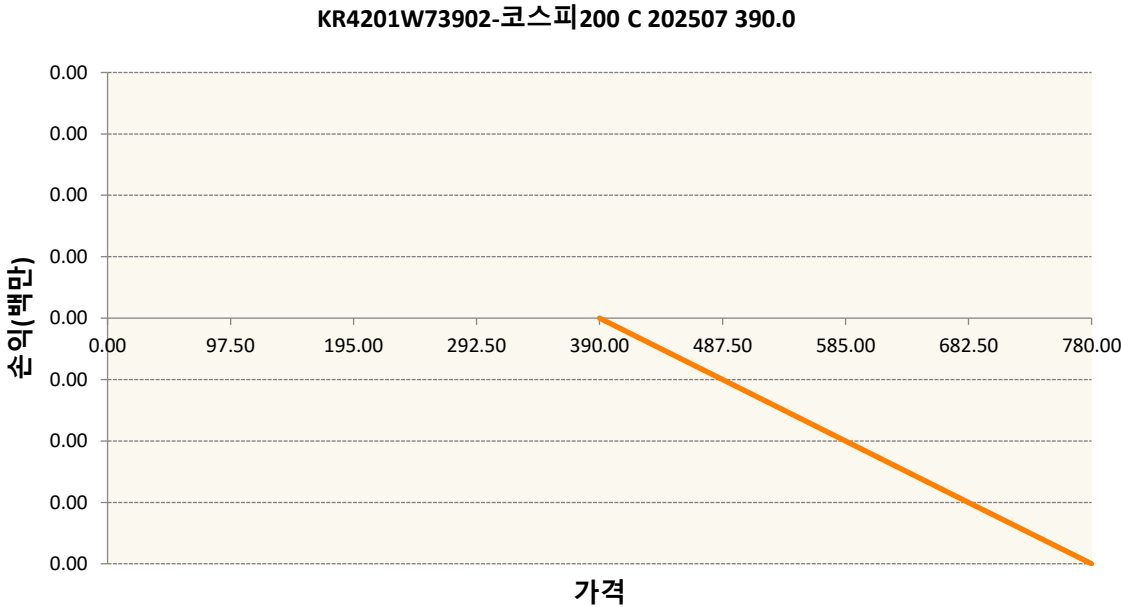
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 361   | 0      | 361       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 34,179 | -34,179   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 780.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at (0, 0) and ends at (390, 0), indicating that profit is zero for prices up to 390 million won.

The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 785.00. The y-axis, labeled '순이익 (백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the net income function, starting at the origin (0, 0) and ending at (392.50, 0.00). This indicates that net income is zero at a price of 392.50.

| 가격 (Price) | 순이익 (백만) (Net Income in millions) |
|------------|-----------------------------------|
| 0.00       | 0.00                              |
| 392.50     | 0.00                              |

(단위:백만원)

|              |           |                       |        |        |        |        |        |
|--------------|-----------|-----------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| KR4201W73902 |           | 코스피200 C 202507 390.0 |        |        |        |        | 1,781  |
|              | 기초자산의 변동성 |                       |        |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%               | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 1,345     | 1,326                 | 1,306  | 1,286  | 1,265  | 1,243  | 1,222  |
| -5.33%       | 1,077     | 1,054                 | 1,032  | 1,009  | 986    | 962    | 939    |
| -2.67%       | 588       | 579                   | 568    | 555    | 542    | 527    | 511    |
| 0%           | 7         | 6                     | 3      | 0      | -5     | -11    | -18    |
| 2.67%        | -588      | -588                  | -588   | -589   | -590   | -591   | -594   |
| 5.33%        | -1,184    | -1,184                | -1,184 | -1,184 | -1,185 | -1,185 | -1,185 |
| 8.00%        | -1,781    | -1,781                | -1,781 | -1,781 | -1,781 | -1,781 | -1,781 |
| KR4201W73928 |           | 코스피200 C 202507 392.5 |        |        |        |        | 586    |
|              | 기초자산의 변동성 |                       |        |        |        |        |        |

| 가격                                 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|------------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%                             | 410     | 405     | 399    | 393  | 387   | 381    | 374    |
| -5.33%                             | 340     | 332     | 324    | 316  | 308   | 300    | 292    |
| -2.67%                             | 192     | 188     | 183    | 178  | 173   | 167    | 161    |
| 0%                                 | 4       | 3       | 2      | 0    | -2    | -5     | -8     |
| 2.67%                              | -193    | -193    | -193   | -193 | -194  | -194   | -195   |
| 5.33%                              | -389    | -389    | -389   | -390 | -390  | -390   | -390   |
| 8.00%                              | -586    | -586    | -586   | -586 | -586  | -586   | -586   |
| KR4301W73900 코스피200 P 202507 390.0 |         |         |        |      |       |        | 133    |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |      |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -102    | -107    | -112   | -117 | -122  | -127   | -133   |
| -5.33%    | -29     | -35     | -40    | -46  | -52   | -58    | -63    |
| -2.67%    | -2      | -5      | -8     | -12  | -15   | -19    | -24    |
| 0%        | 3       | 2       | 1      | 0    | -2    | -3     | -6     |
| 2.67%     | 3       | 3       | 3      | 3    | 2     | 2      | 1      |
| 5.33%     | 3       | 3       | 3      | 3    | 3     | 3      | 3      |
| 8.00%     | 3       | 3       | 3      | 3    | 3     | 3      | 3      |

| KR4301W73926 코스피200 P 202507 392.5 |         |         |        |     |       |        | 51     |
|------------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                          |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                                 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                             | -41     | -43     | -44    | -46 | -47   | -49    | -51    |
| -5.33%                             | -13     | -15     | -17    | -19 | -21   | -23    | -25    |
| -2.67%                             | -1      | -3      | -4     | -5  | -7    | -8     | -10    |
| 0%                                 | 1       | 1       | 1      | 0   | -1    | -1     | -2     |
| 2.67%                              | 2       | 2       | 1      | 1   | 1     | 1      | 0      |
| 5.33%                              | 2       | 2       | 2      | 2   | 2     | 1      | 1      |
| 8.00%                              | 2       | 2       | 2      | 2   | 2     | 2      | 2      |

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

(단위:백만원)

2,582

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

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 | 503   | 0     | 503       |    |

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 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

## 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 | 4,202 | 0     | 4,202     |    |

### 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 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

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 | 12,396 | 0      | 12,396    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 176    | 11,756 | -11,579   | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)    |                                 | (단위:백만원) |
|------------------------------|---------------------------------|----------|
| FXW213F4V( KRW/USD 31-07-25E |                                 | 404      |
| FXW213F5V( KRW/USD 29-08-25E |                                 | 317      |
| FXW213F6SC KRW/USD 29-08-25E |                                 | 220      |
| FXW213F6XC USD/KRW 31-07-25E |                                 | 14       |
| IE00BD8RGM75                 | * 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음 |          |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 474      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

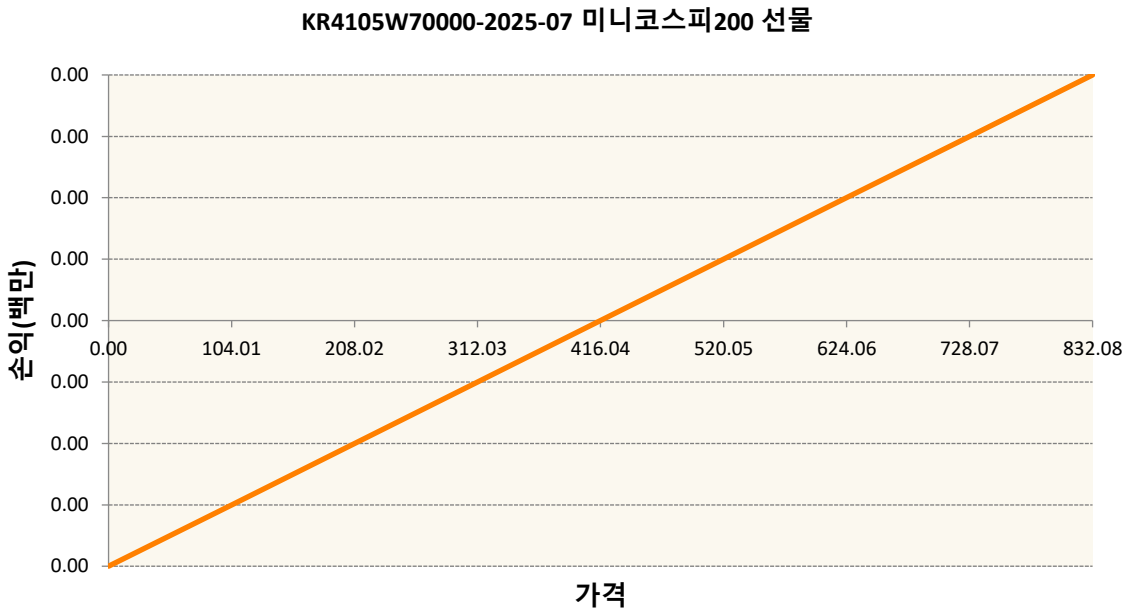
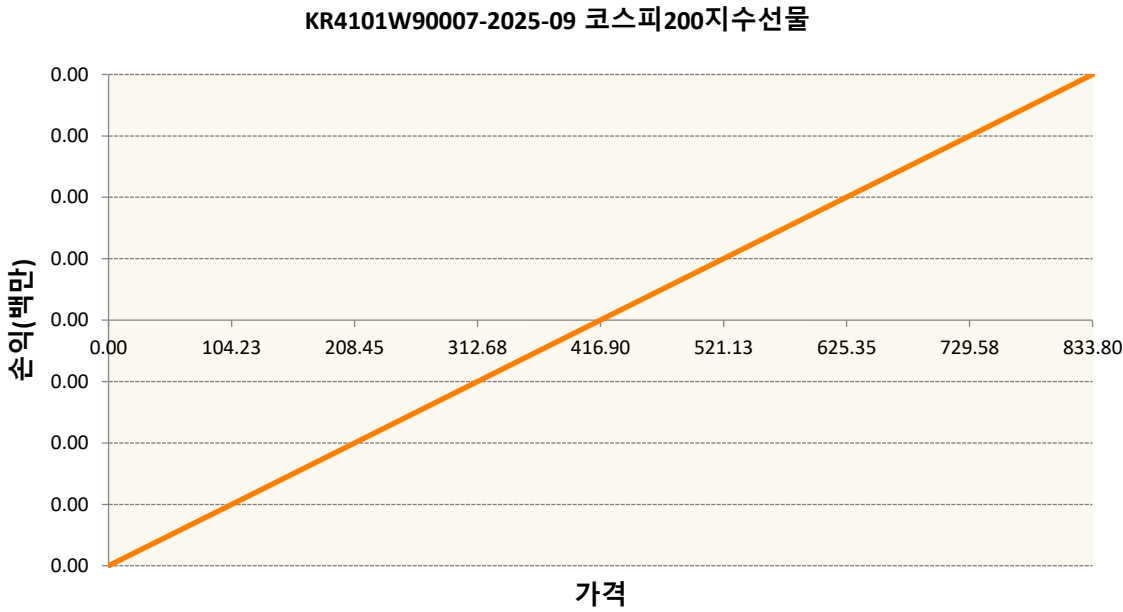
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

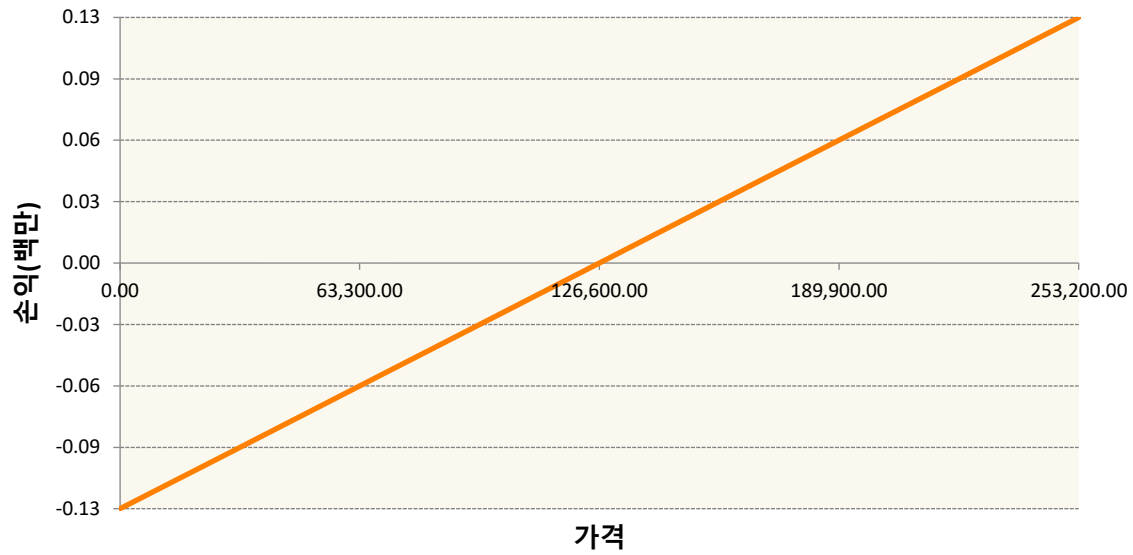
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 120   | 0     | 120       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 931   | 0     | 931       | 장내 |

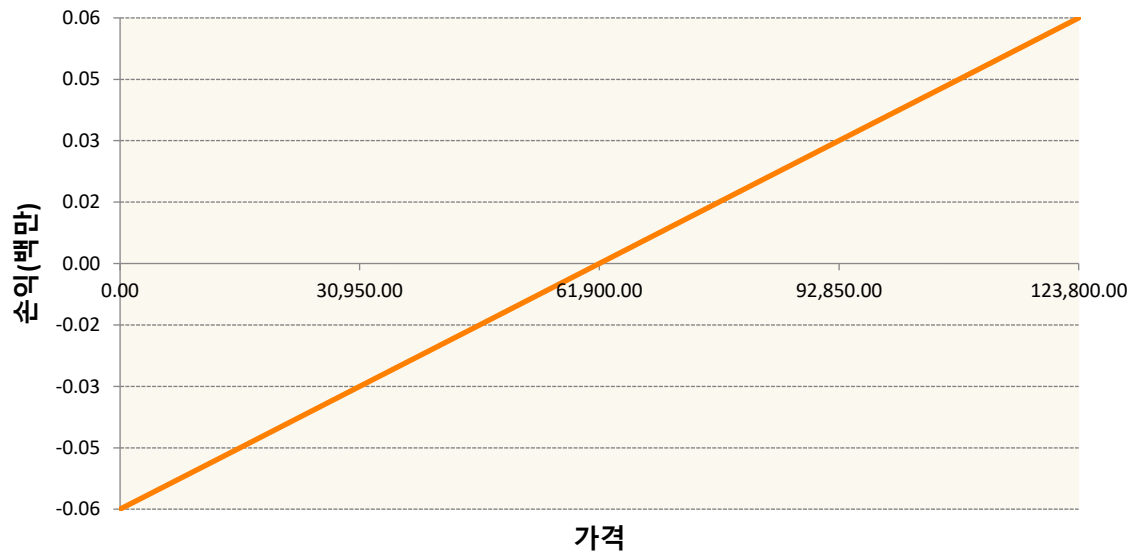
2. 만기시점의 손익구조



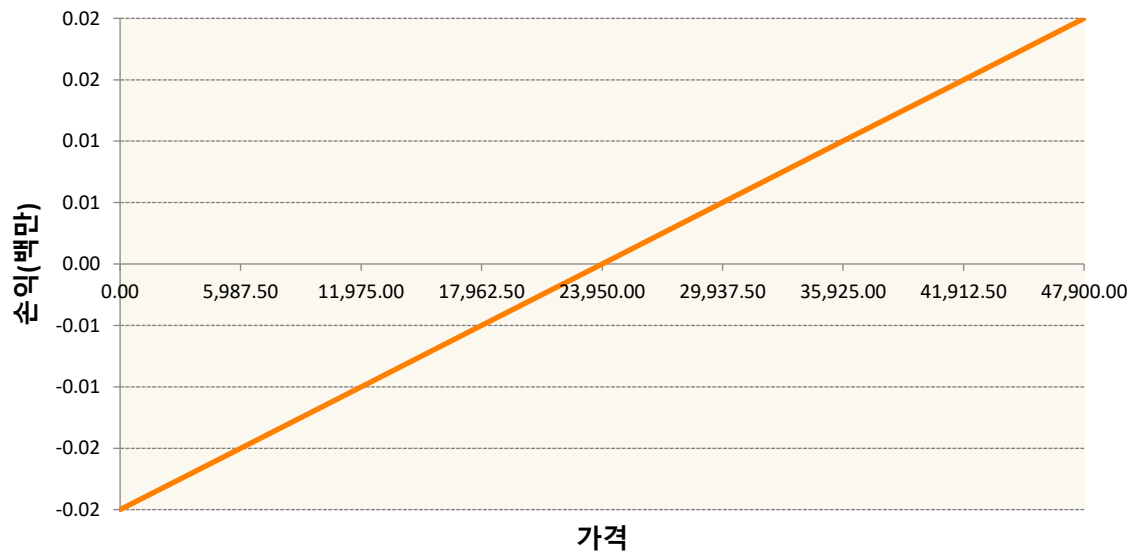
KR4141W70005-2025-07 SK이노베이션개별선물



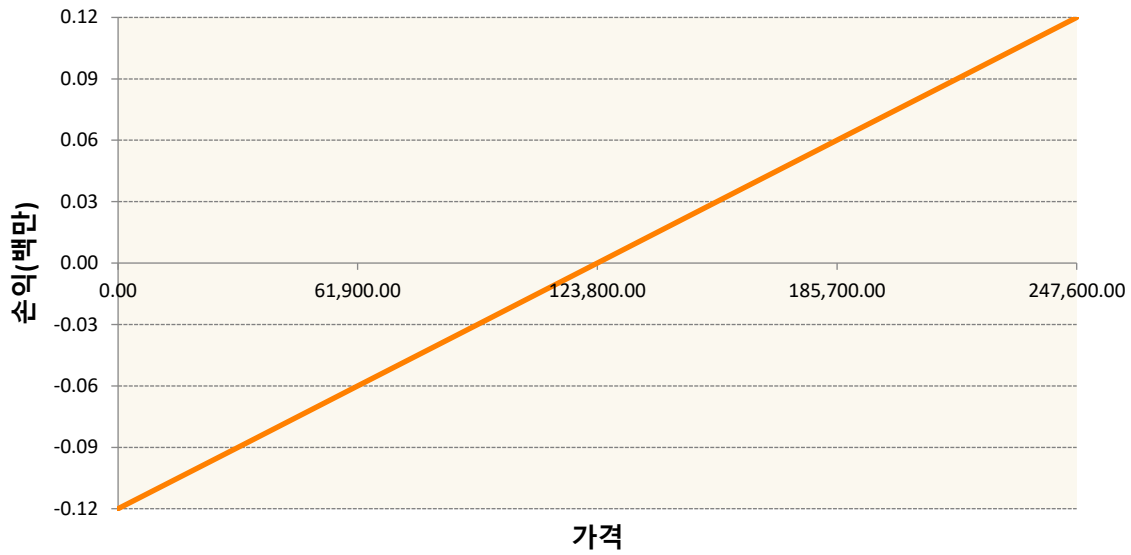
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



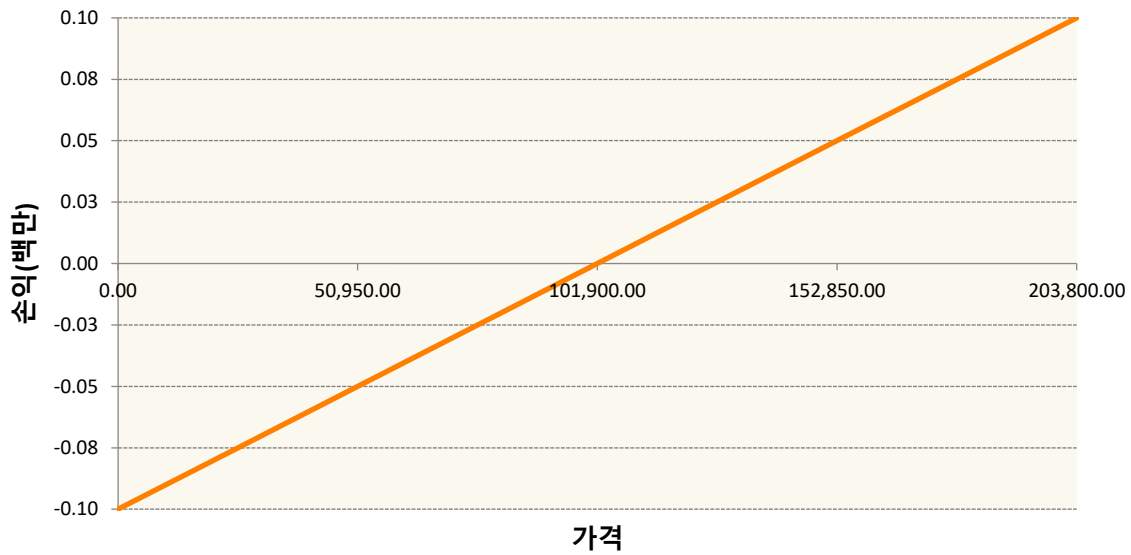
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



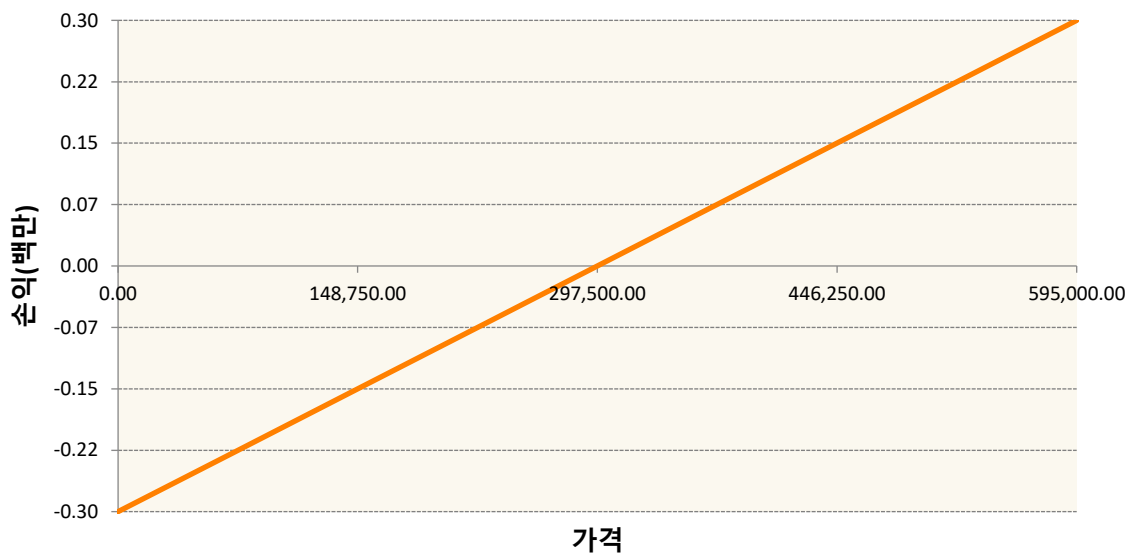
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



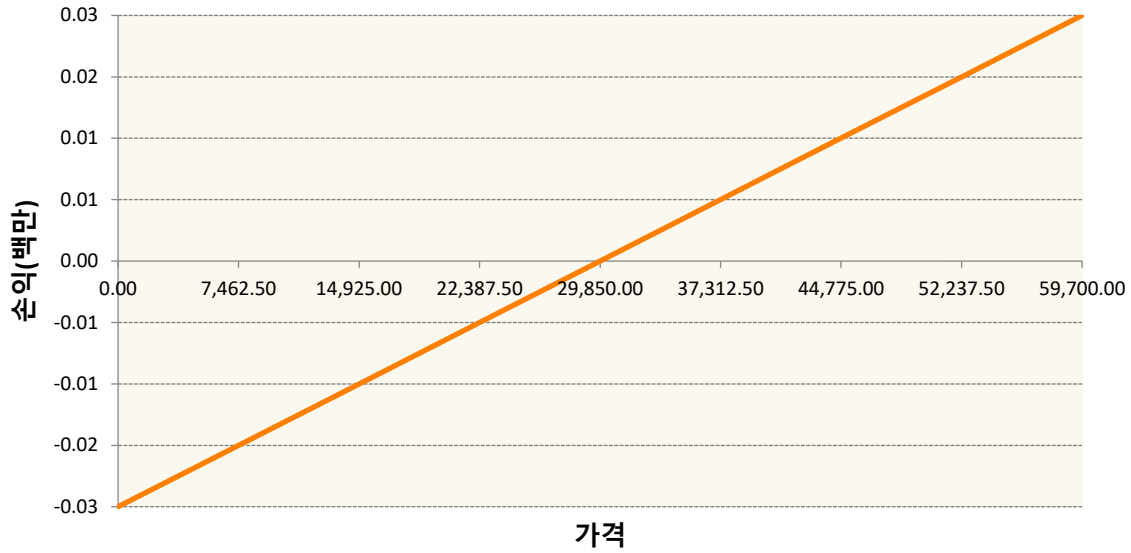
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



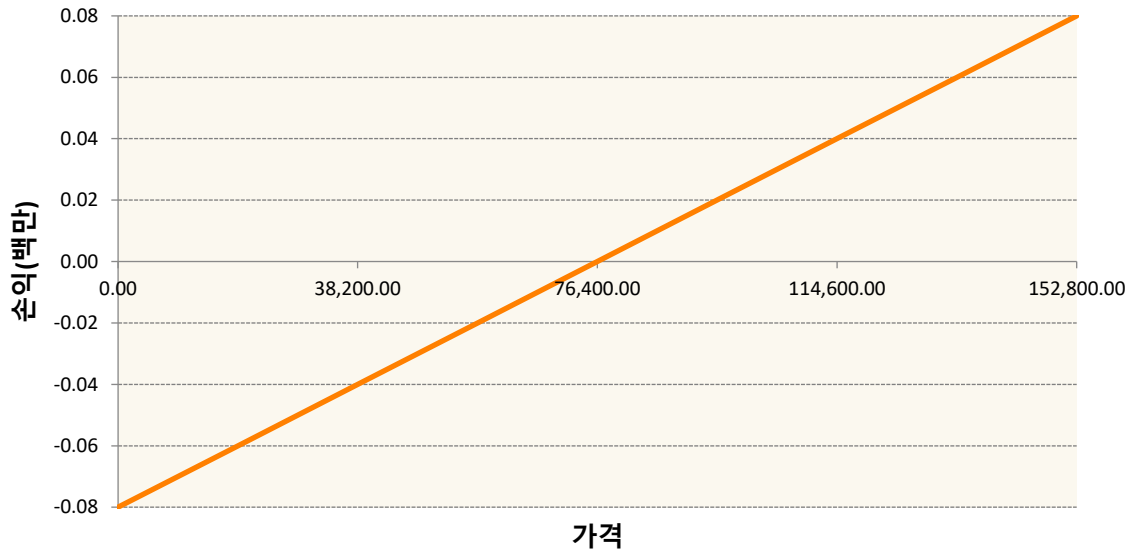
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



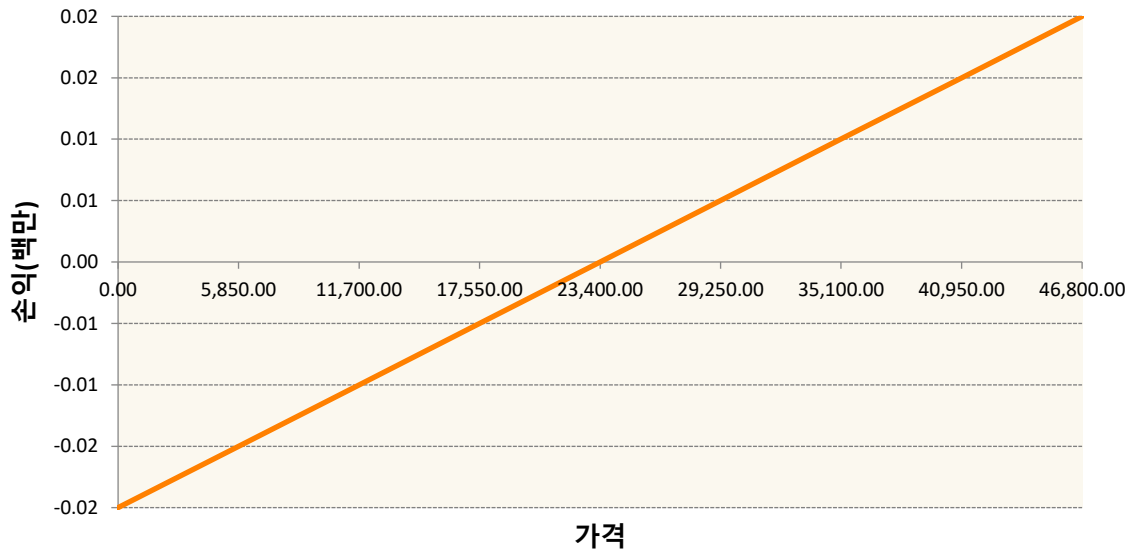
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



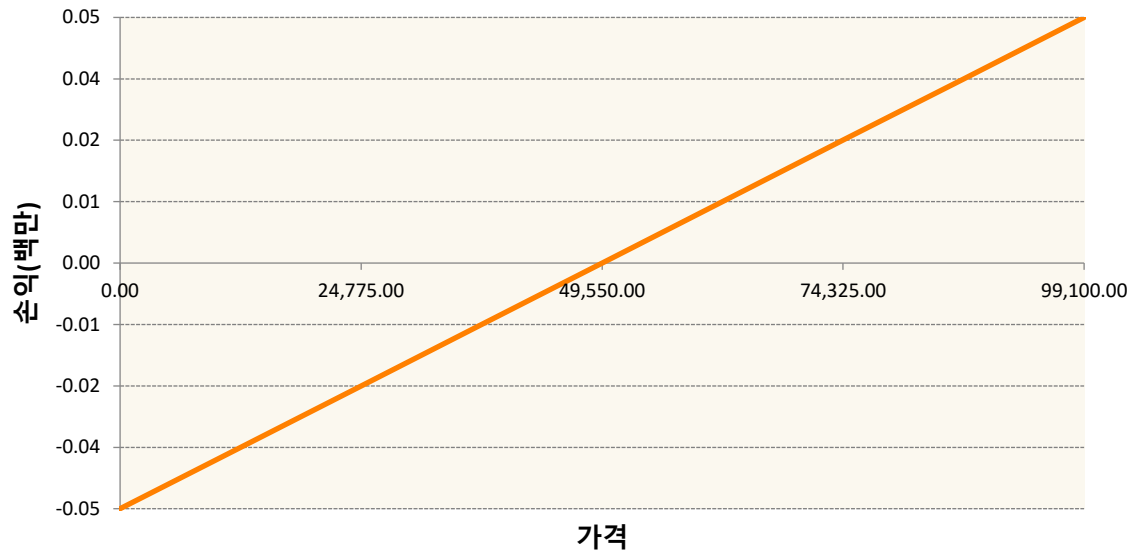
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



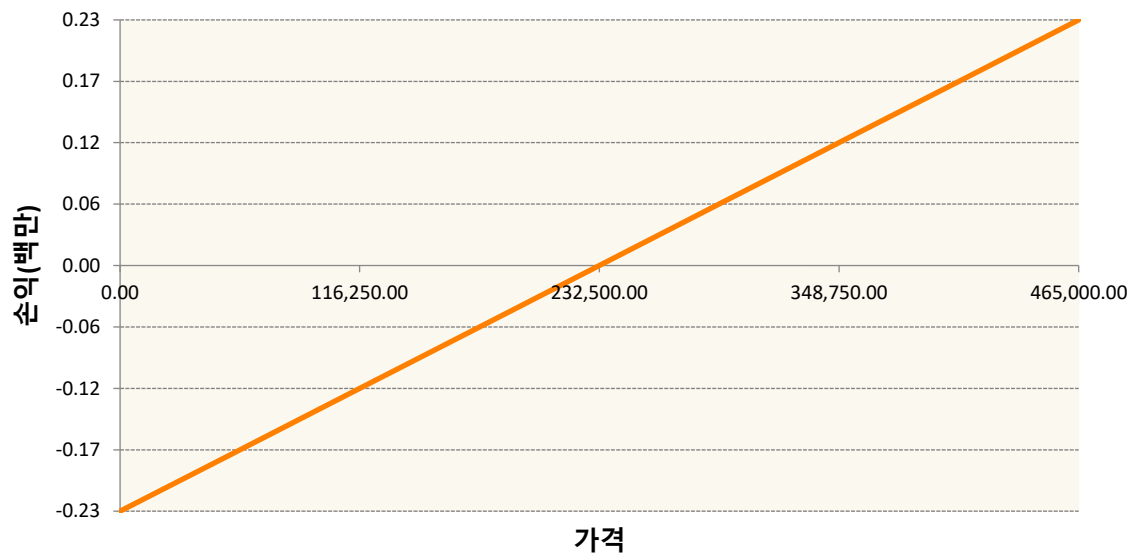
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                 |    |
|---------------------------------|----|
| KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물   | 42 |
| KR4105W70( 2025-07 미니코스피200 선물  | 2  |
| KR4141W70( 2025-07 SK이노베이션개별선물  | 1  |
| 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  |

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

(단위:백만원)

122

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

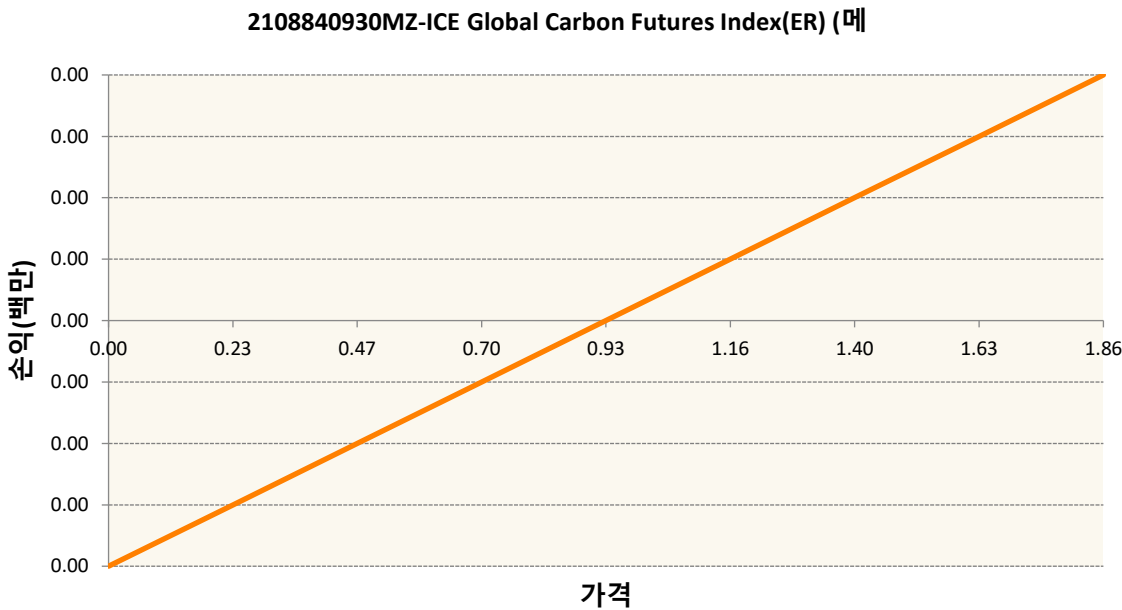
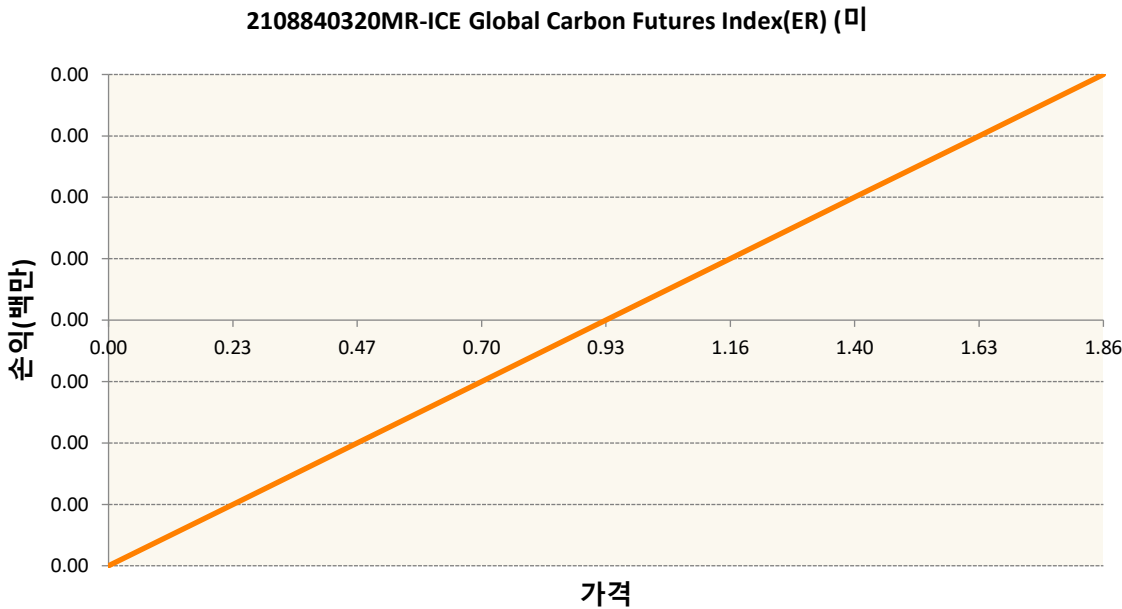
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 9,360 | 0     | 9,360     |    |

2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                                        | (단위:백만원) |
|---------------------------|----------------------------------------|----------|
| 2108840320                | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 | 561      |
| 2108840930                | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 | 188      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 846      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

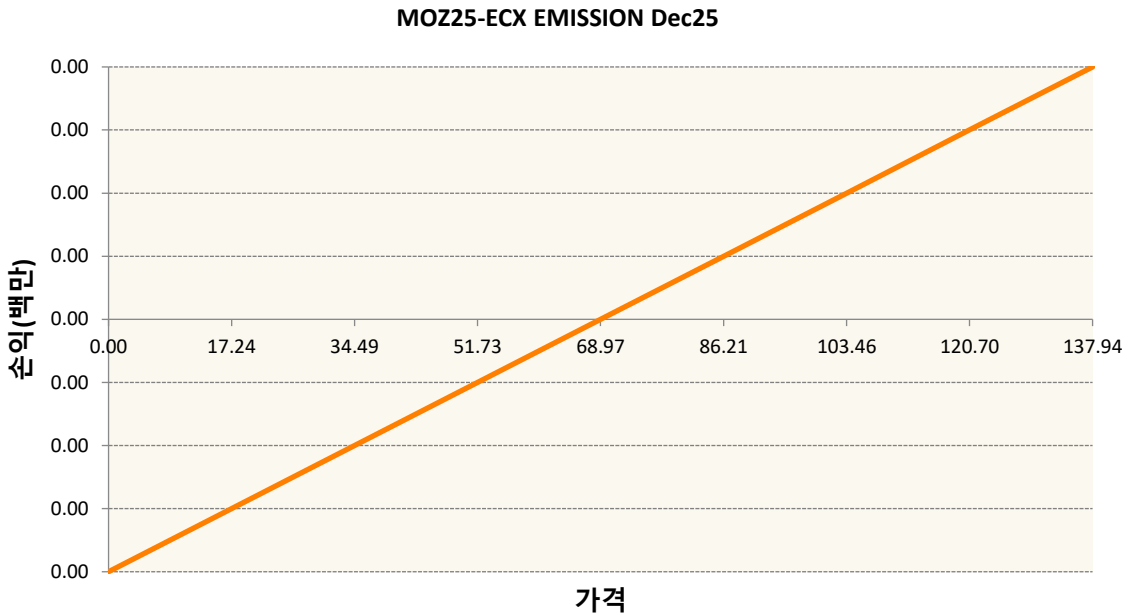
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 6,220 | 0     | 6,220     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,354 | -1,354    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |     |
|-----------------------------------------------------|-----|
| 2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index | 2   |
| FXW213F71C KRW/EUR 31-07-25E                        | 108 |
| MOZ25 ECX EMISSION Dec25                            | 500 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 913 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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   | 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)            | 2 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 2 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 1 |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 2 |

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

(단위:백만원)

12

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

## 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)  | 4 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(메리츠) | 5 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)  | 3 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 1 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 22 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

## 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 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

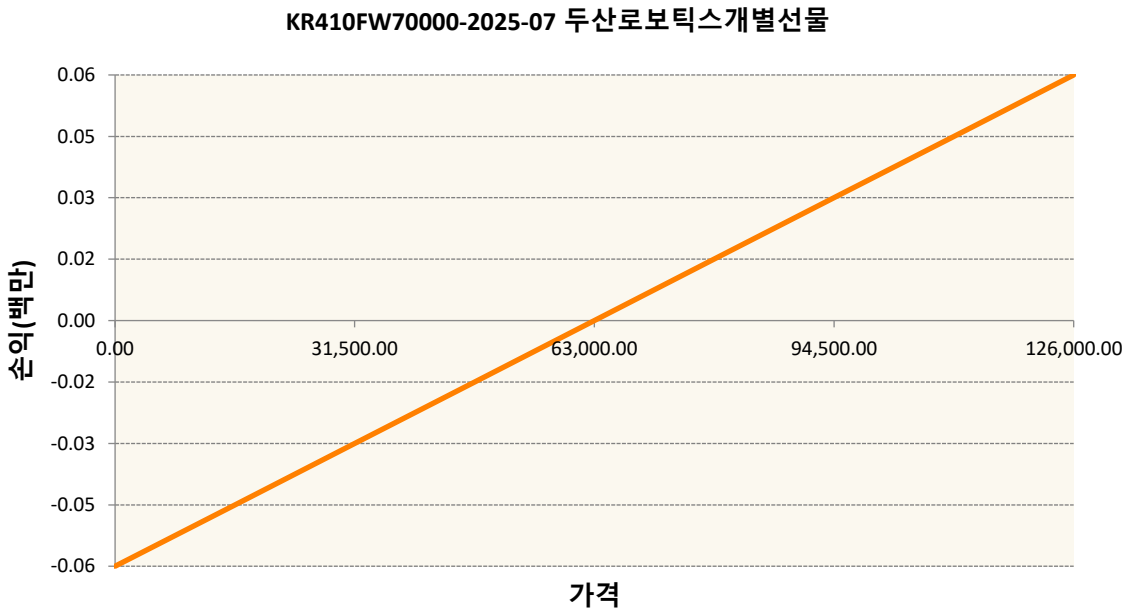
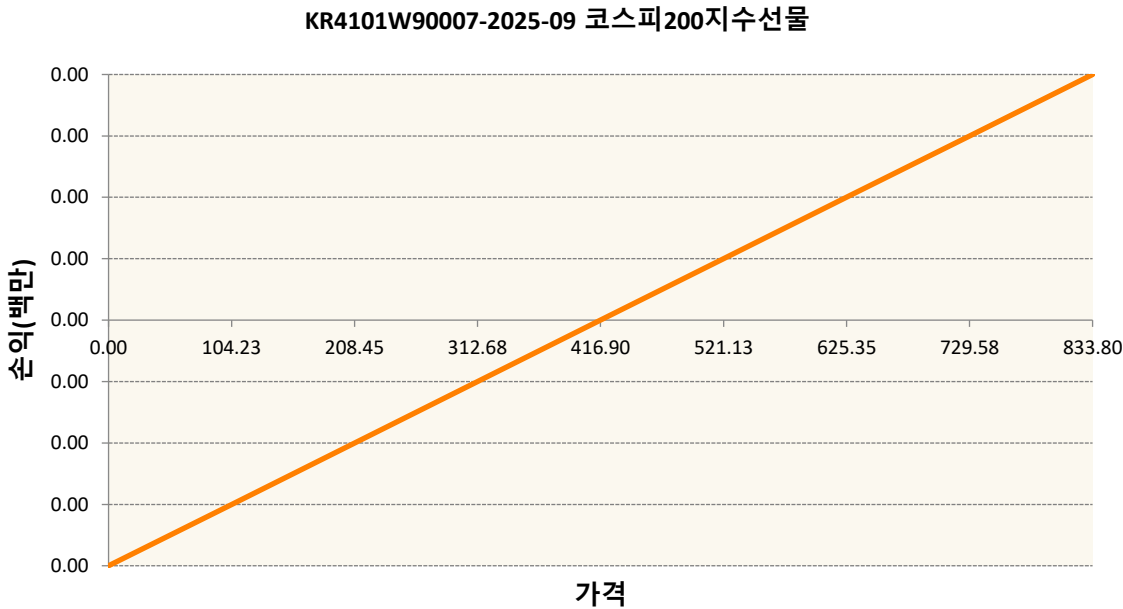
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

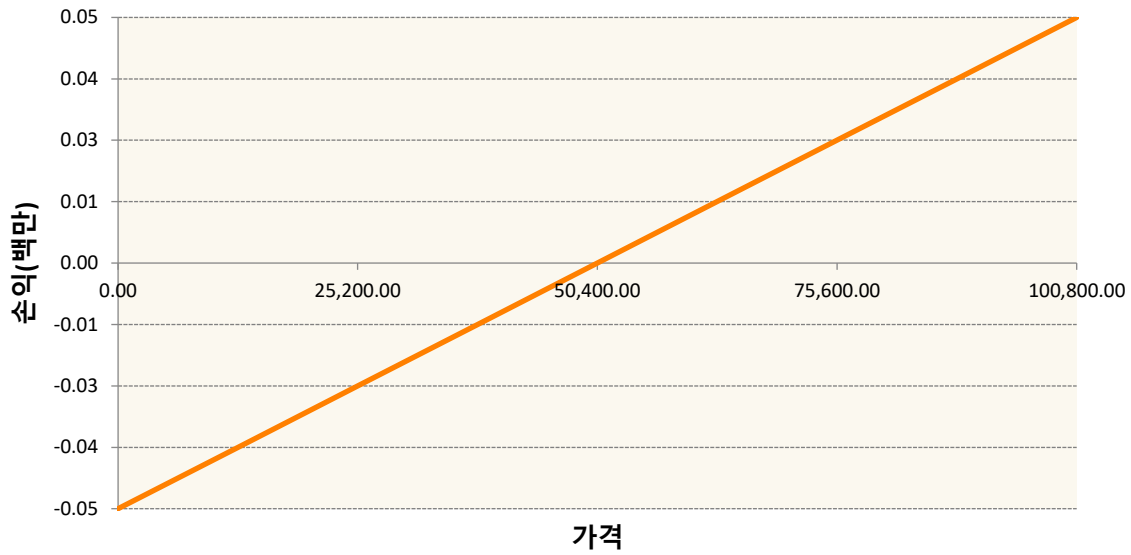
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 35     | 0     | 35        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 12,330 | 0     | 12,330    | 장내 |

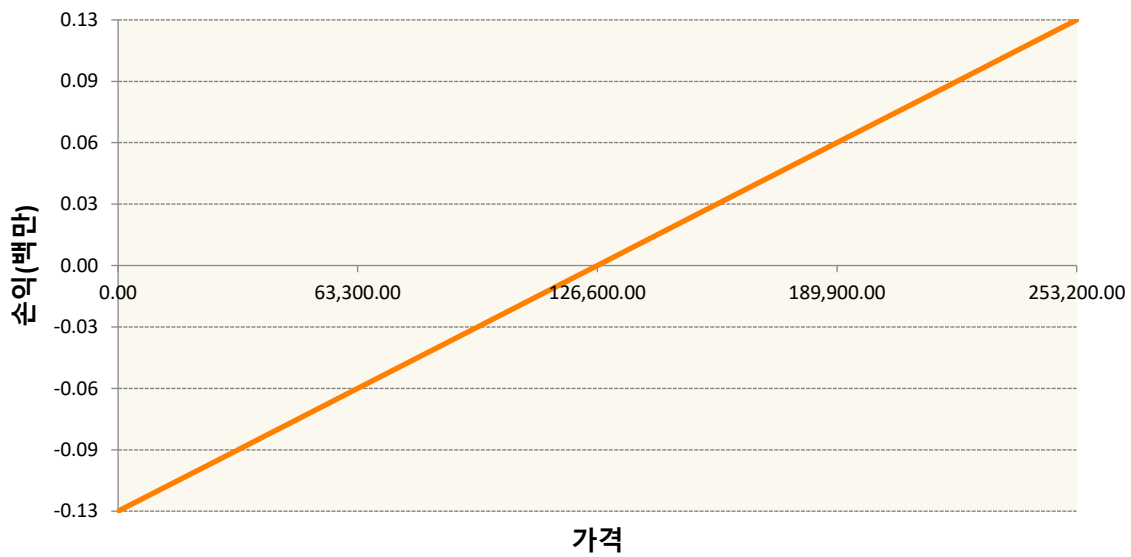
2. 만기시점의 손익구조



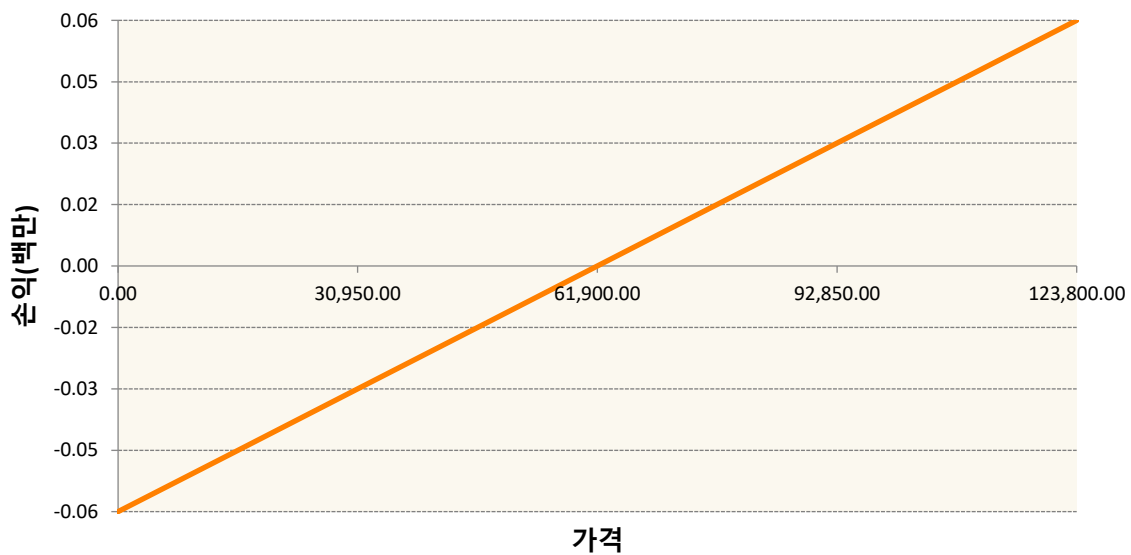
KR411RW70003-2025-07 한화비전개별선물



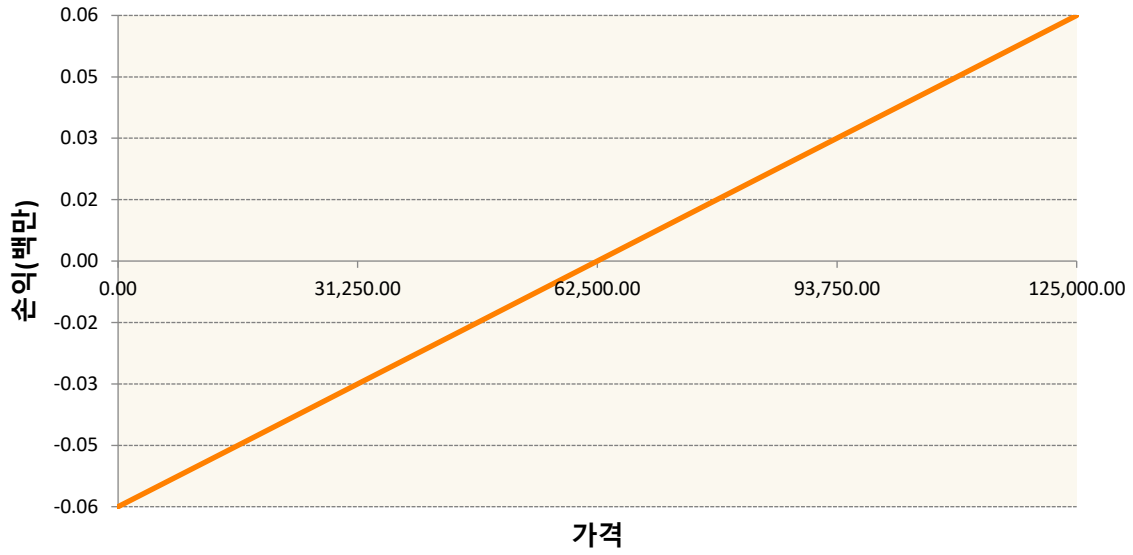
KR4141W70005-2025-07 SK이노베이션개별선물



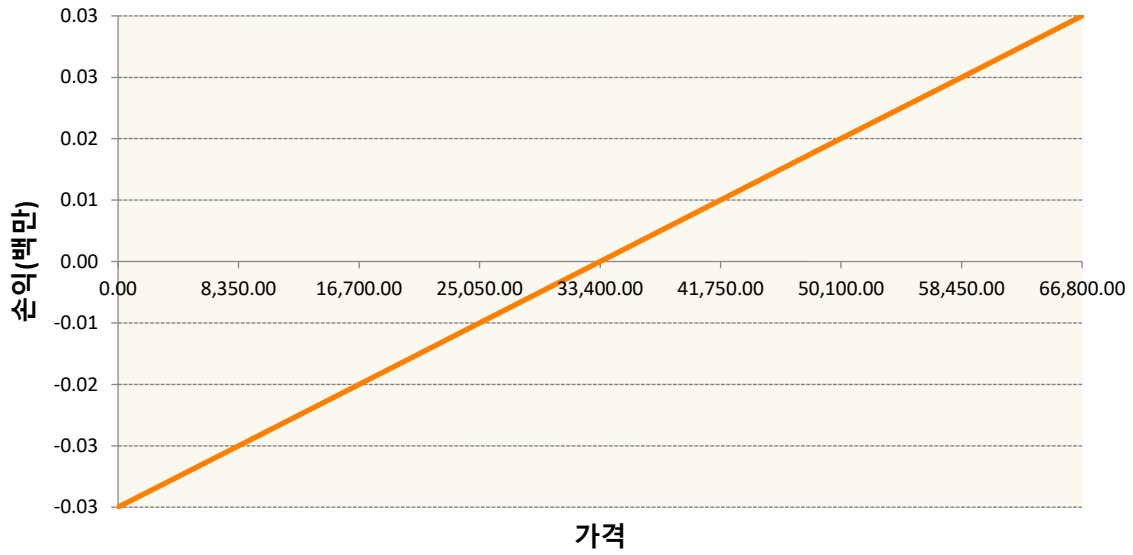
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



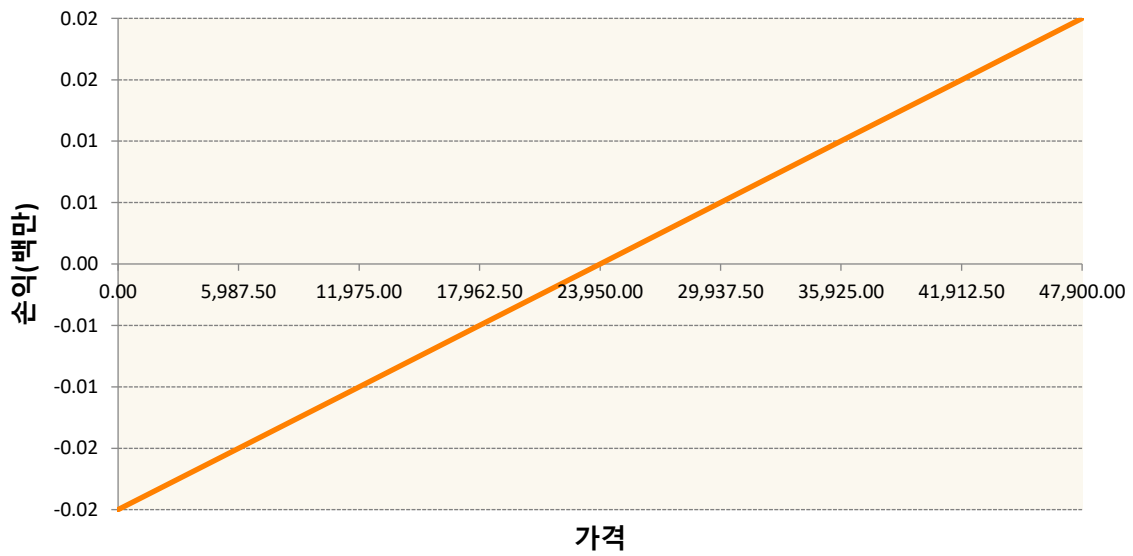
KR41B9W70000-2025-07 두산에너지개별선물



KR41CBW70003-2025-07 한화솔루션개별선물

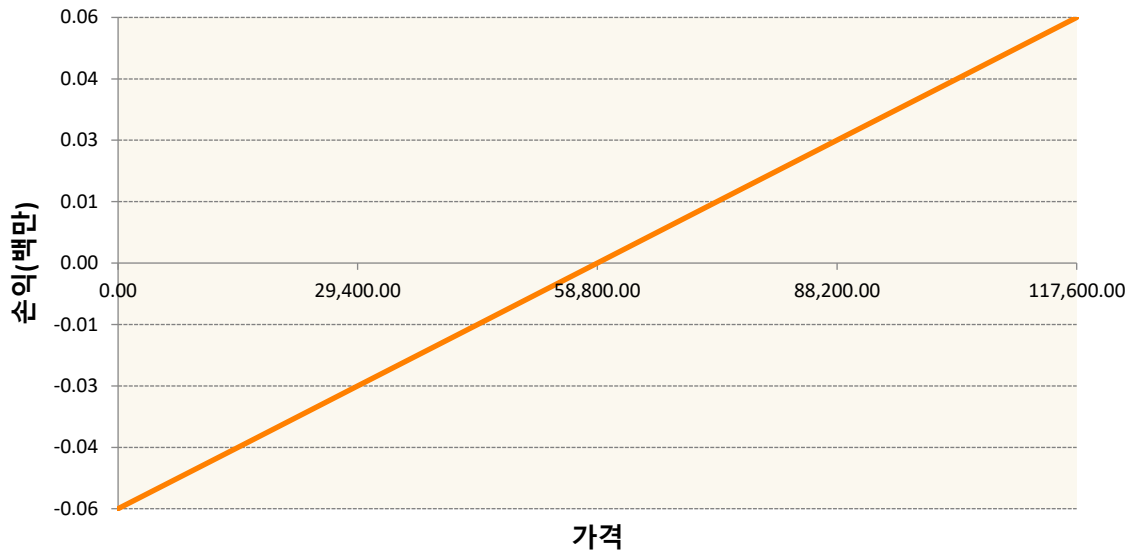


KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물

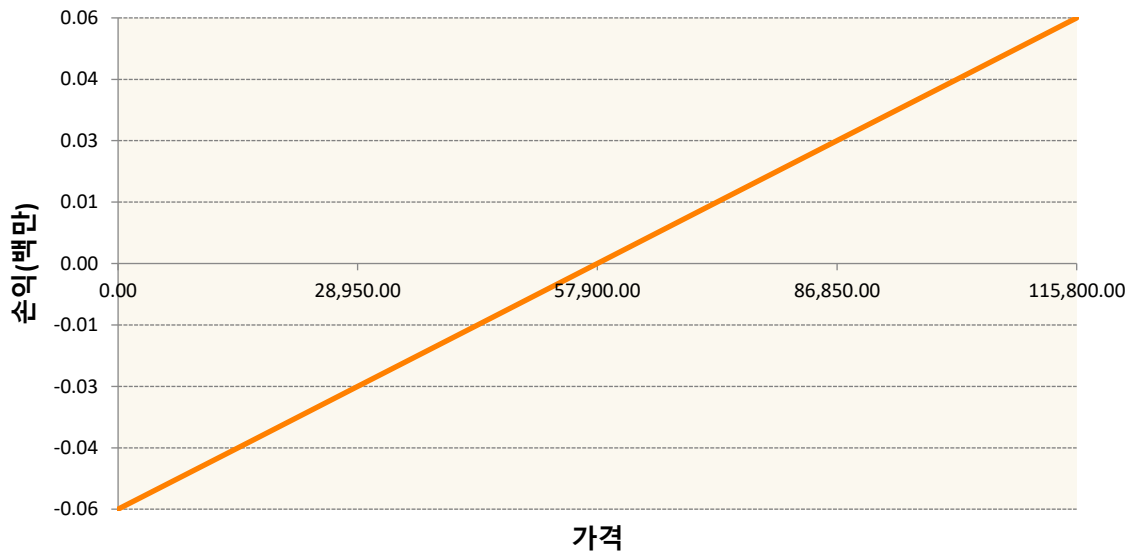




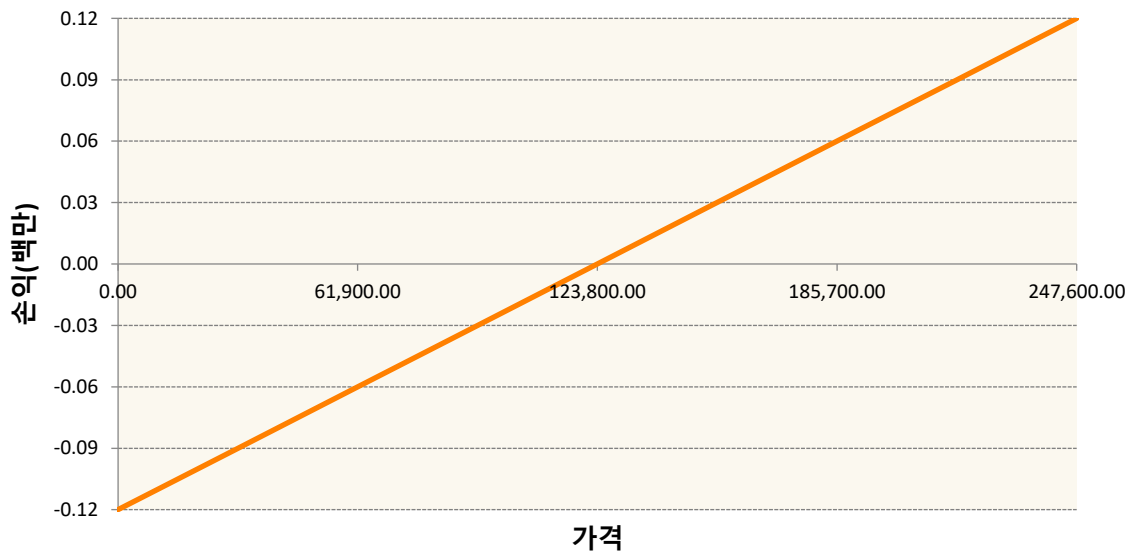
KR41D7W70002-2025-07 한전KPS개별선물



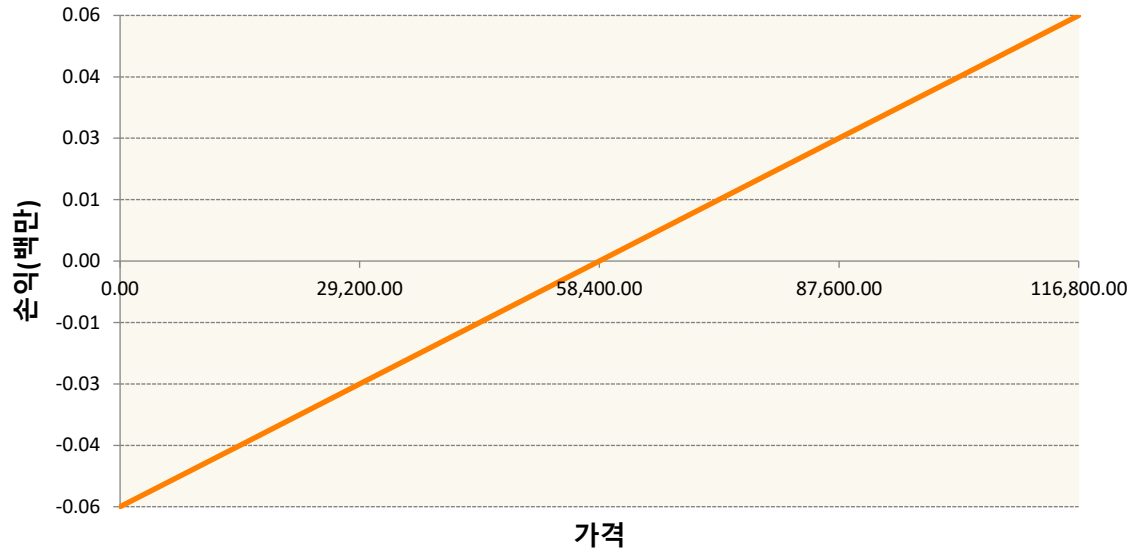
KR41DWW70007-2025-07 두산밥캣개별선물



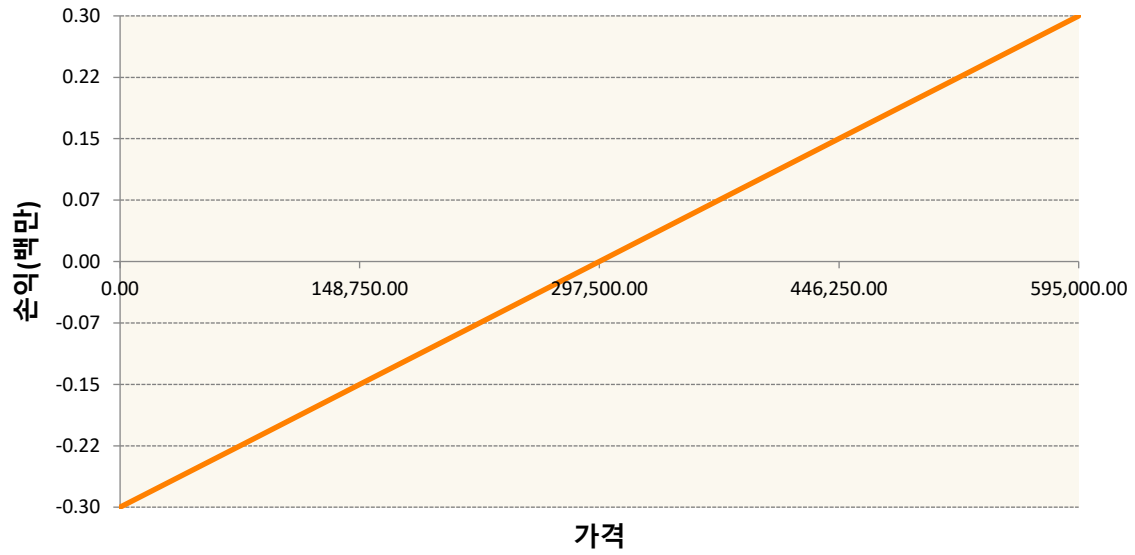
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



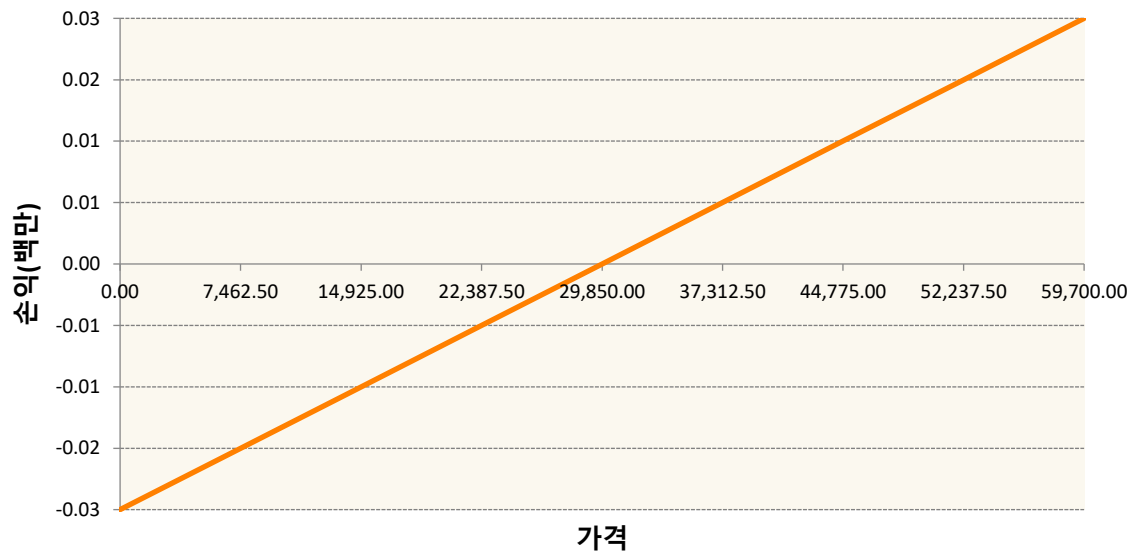
KR41EVW70007-2025-07 한화시스템개별선물



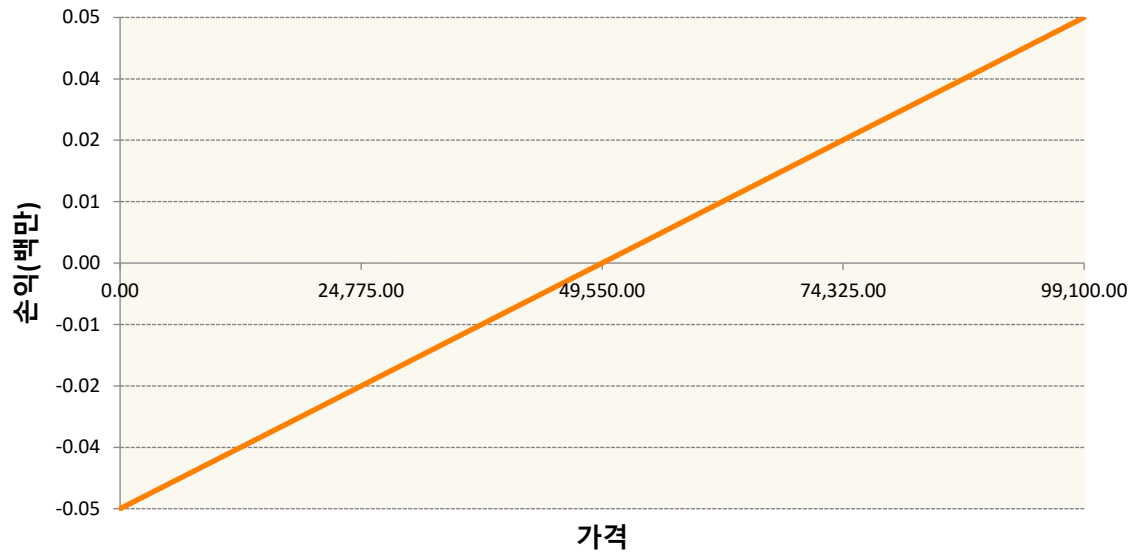
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



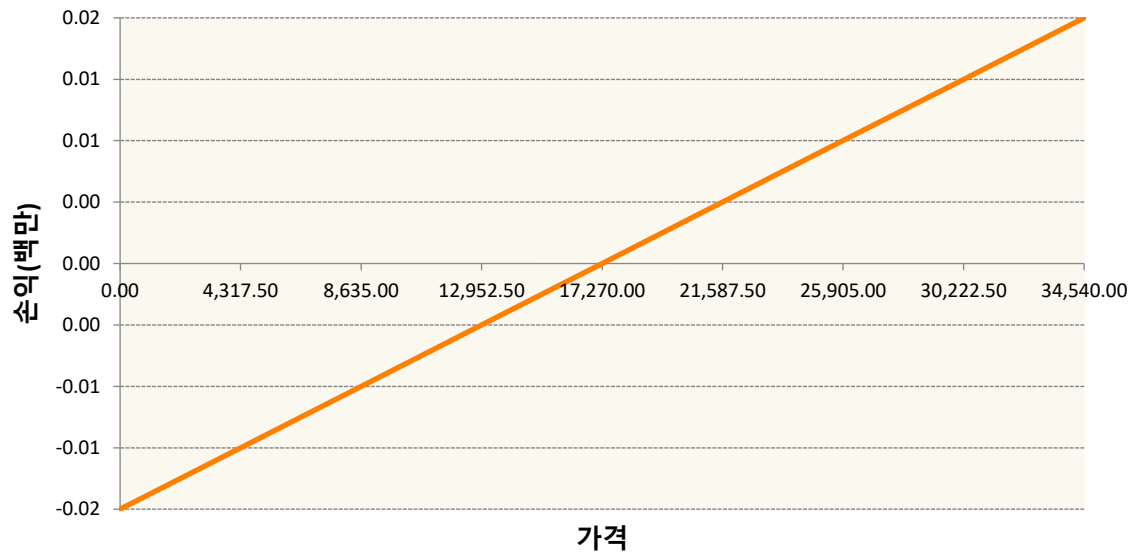
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



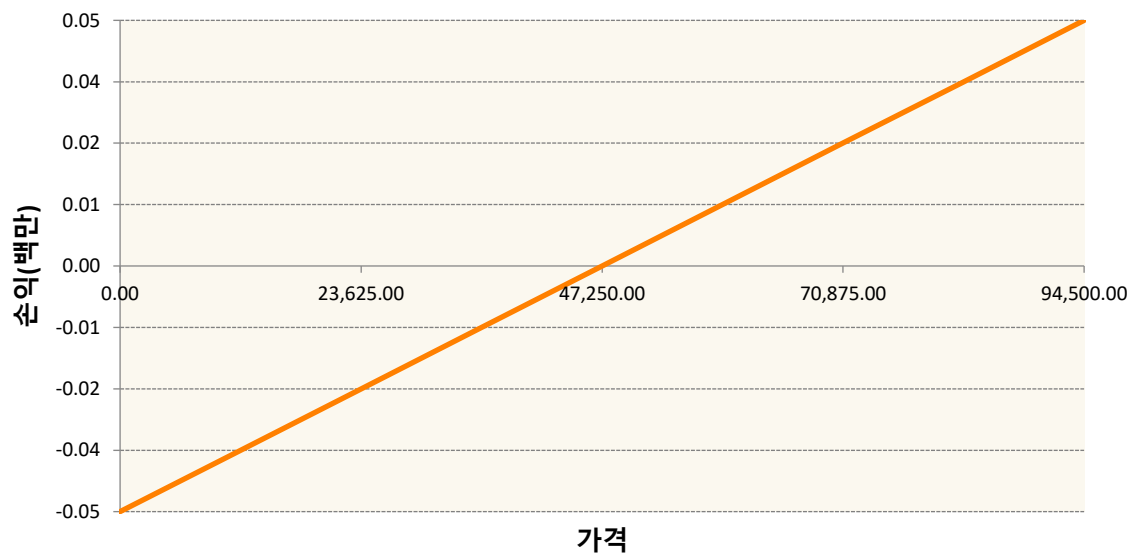
KR41FMW70003-2025-07 엘애프개별선물



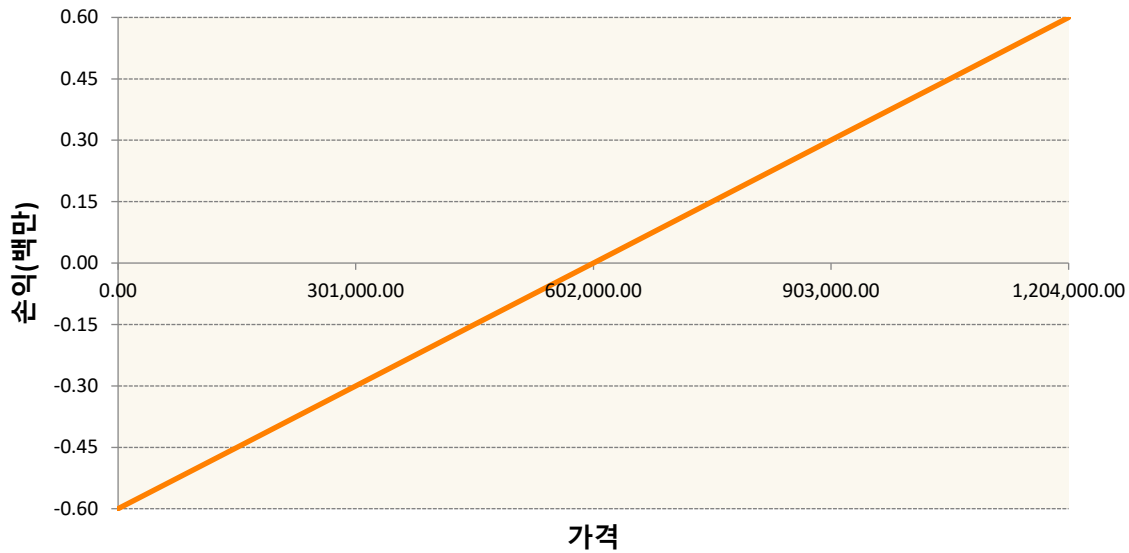
KR41FWW70002-2025-07 대한전선개별선물



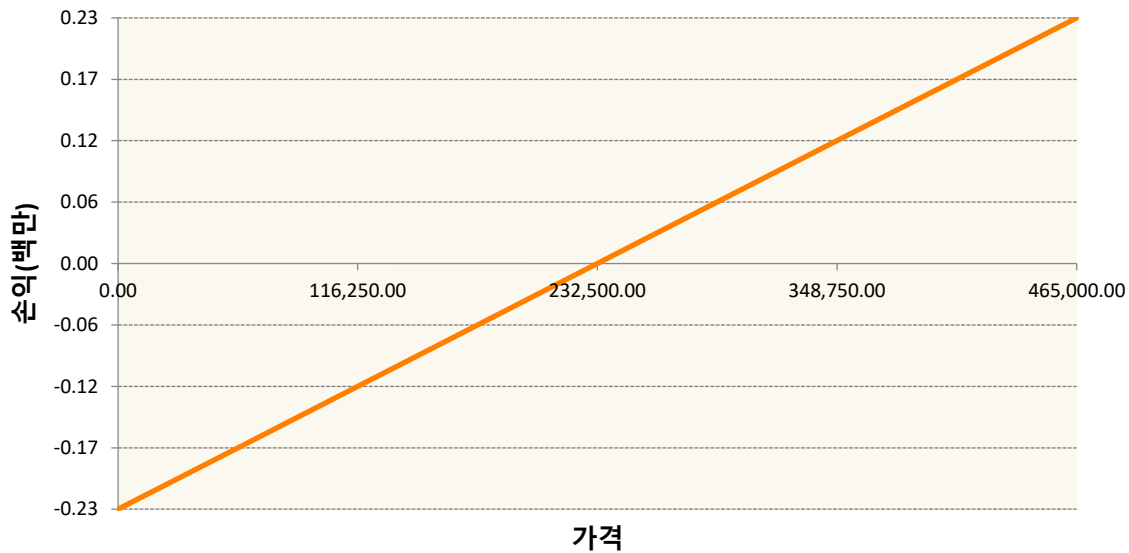
KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41GTW70006-2025-07 두산개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                |      |
|--------------------------------|------|
| KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물  | 600  |
| KR410FW70( 2025-07 두산로보틱스개별선물  | 13   |
| KR411RW70( 2025-07 한화비전개별선물    | 18   |
| KR4141W70( 2025-07 SK이노베이션개별선물 | 3    |
| KR41B2W70( 2025-07 S-Oil개별선물   | 4    |
| KR41B9W70( 2025-07 두산에너지개별선물   | 1    |
| KR41CBW70( 2025-07 한화솔루션개별선물   | 32   |
| 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 | 109  |
| KR41F6W70( 2025-07 카카오뱅크개별선물    | 104  |
| KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물      | 13   |
| KR41FWW70 2025-07 대한전선개별선물      | 0.06 |
| KR41G0W70( 2025-07 씨에스원드개별선물    | 7    |
| KR41GTW70( 2025-07 두산개별선물       | 2    |
| KR41HEW70( 2025-07 키움증권개별선물     | 31   |

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

(단위:백만원)

1,866

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

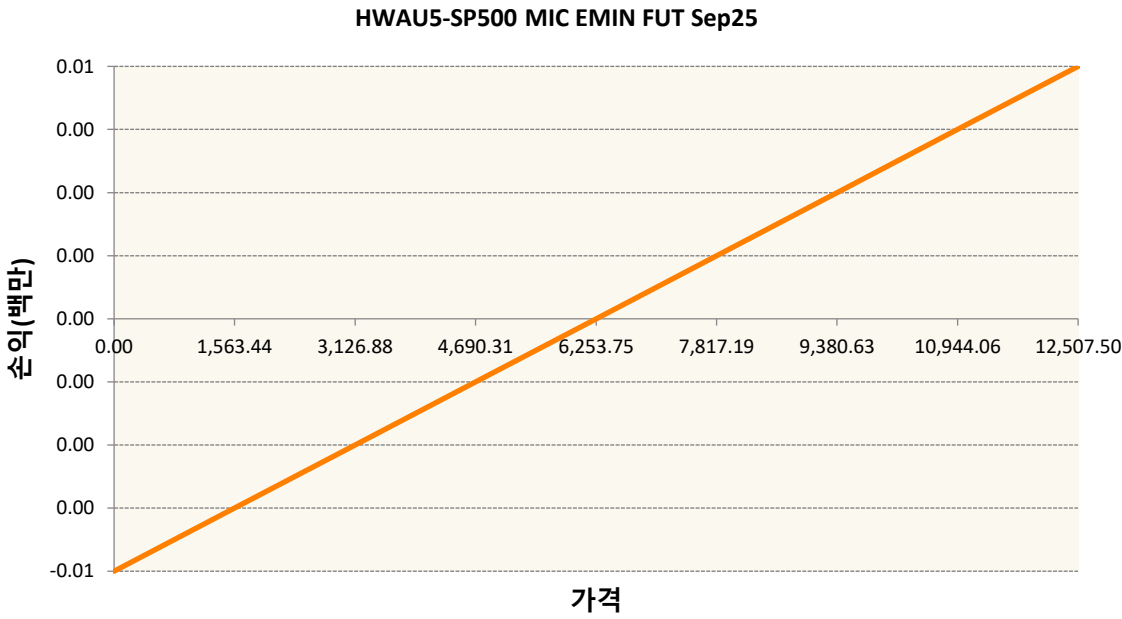
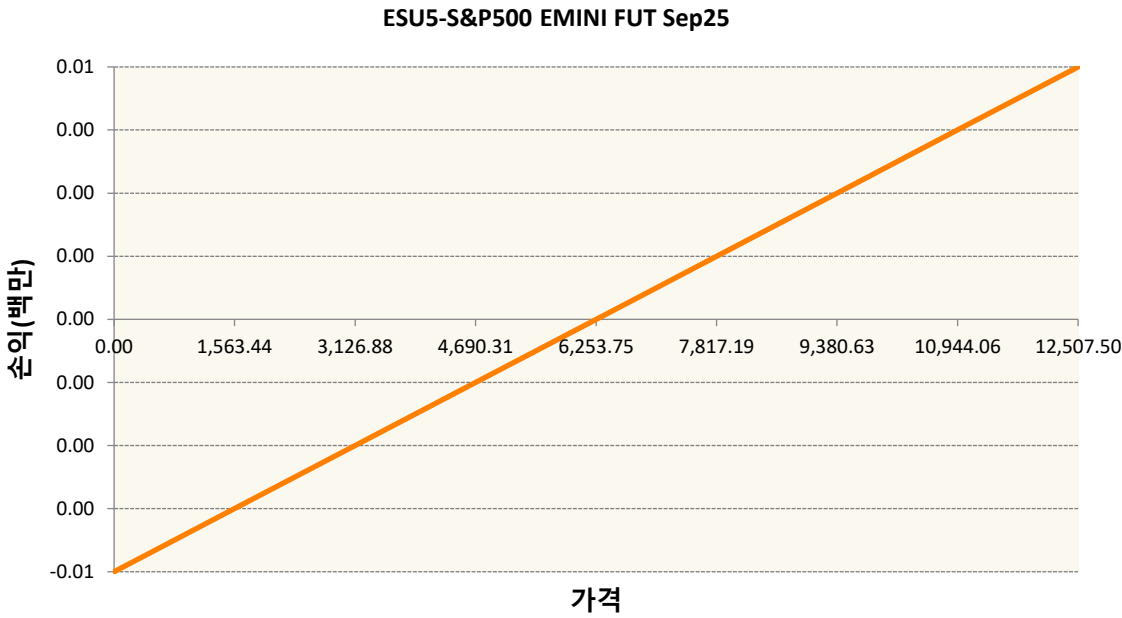
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 31,042 | 0     | 31,042    |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,638  | 0     | 1,638     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESU5                      | S&P500 EMINI FUT Sep25   | 2,483    |
| HWAU5                     | SP500 MIC EMIN FUT Sep25 | 131      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 2,319    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

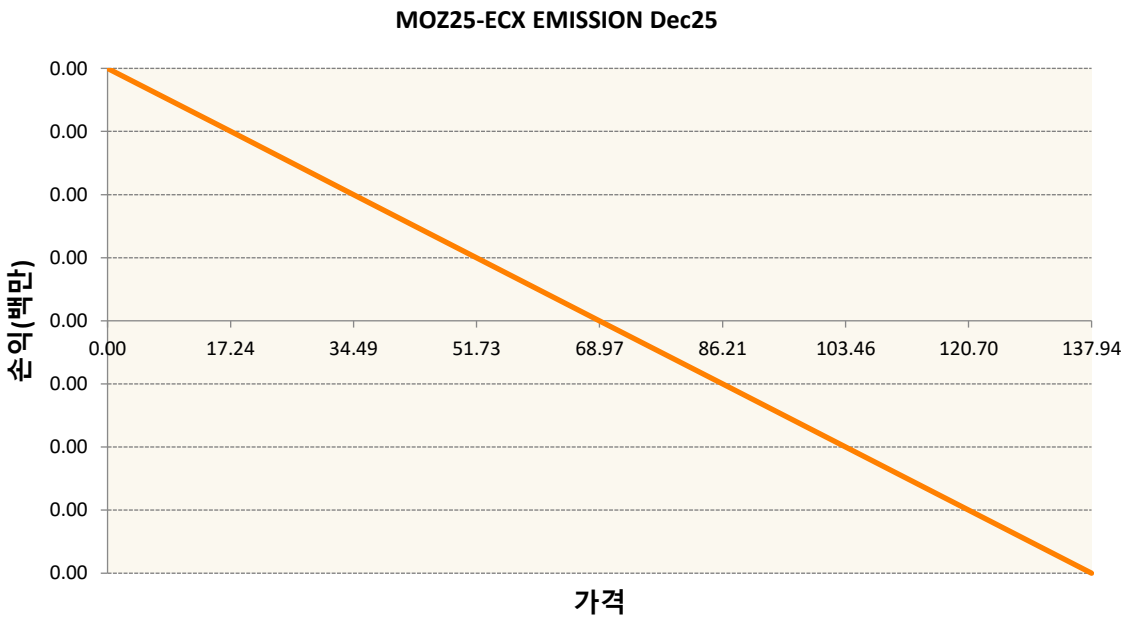
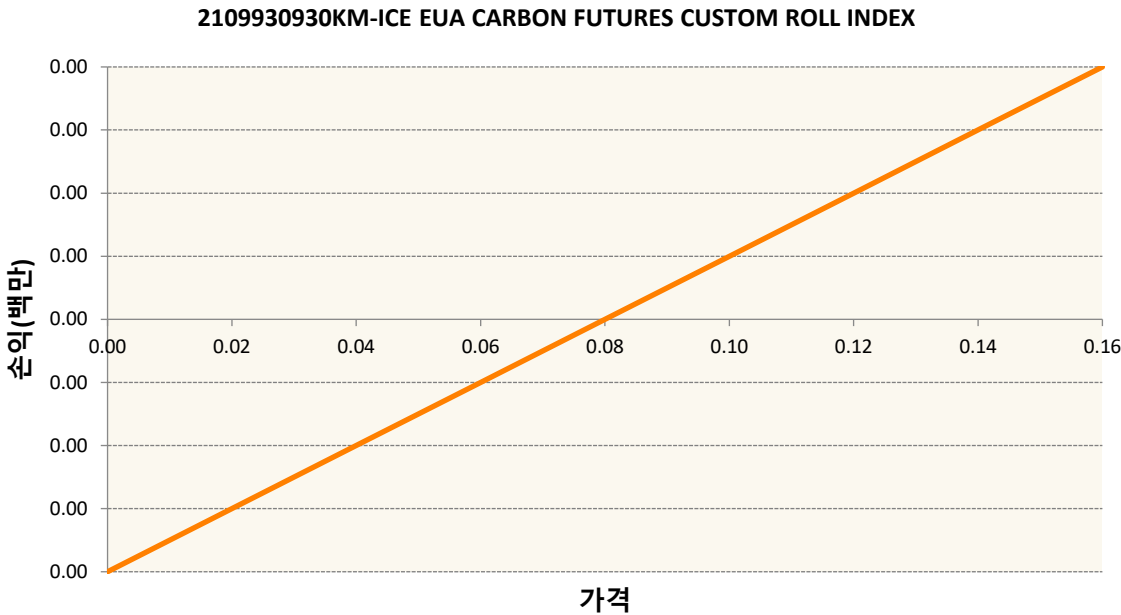
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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   | 32    | 5,461 | -5,429    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,002 | -1,002    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|--|----------|
| 2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX |  | 2        |
| FXW213F71CKRW/EUR 31-07-25E                         |  | 3        |
| FXW213F71CKRW/EUR 31-07-25E                         |  | 78       |
| MOZ25      ECX EMISSION Dec25                       |  | 437      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 788      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

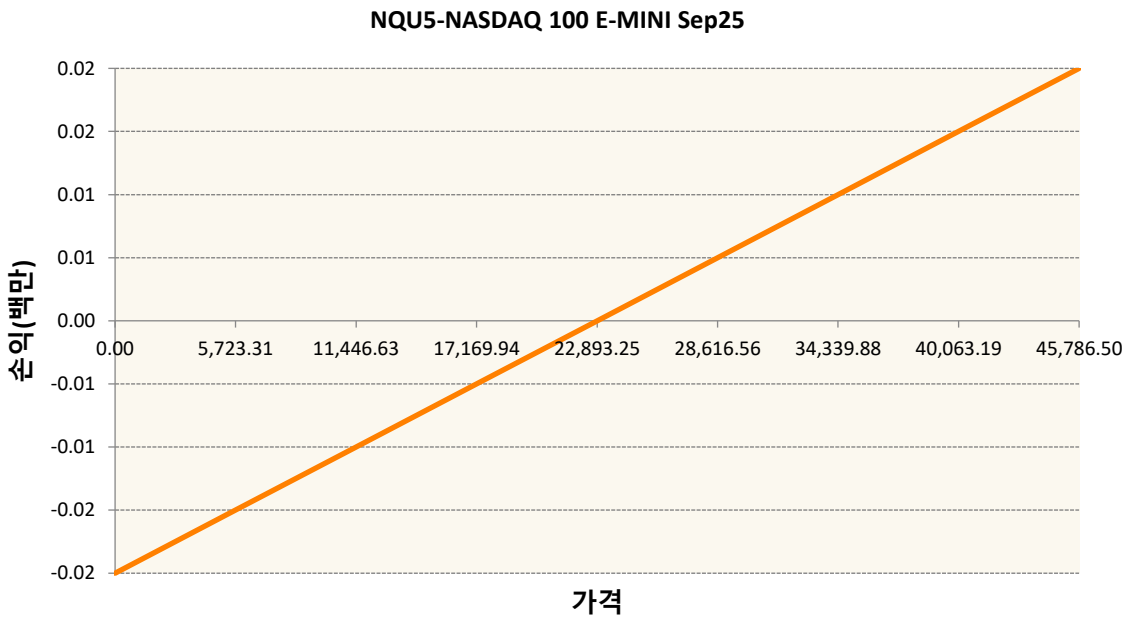
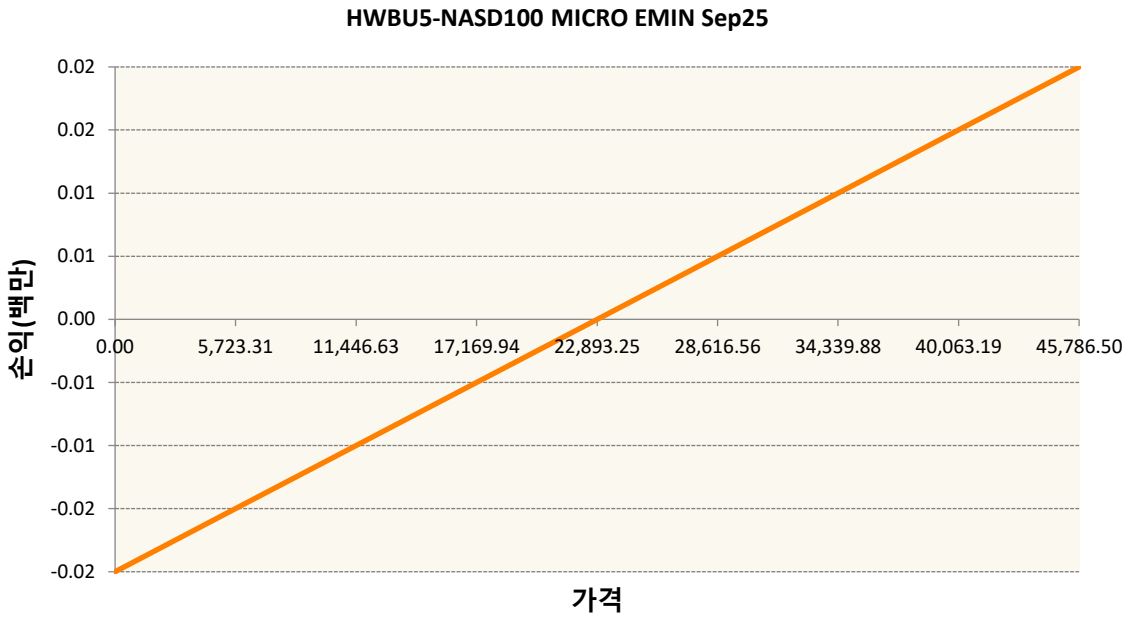
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 13,887 | 0     | 13,887    |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 314    | 0     | 314       | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBU5                     | NASD100 MICRO EMIN Sep25 |  | 25       |
| NQU5                      | NASDAQ 100 E-MINI Sep25  |  | 1,111    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 1,305    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

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 | 8,546 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 2,127 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 3,241 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 6,899 |

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

(단위:백만원)

10,689

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

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 | 4 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 4 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 4 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 4 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 20 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-07-02 |
| 기준일 | 2025-07-01 |

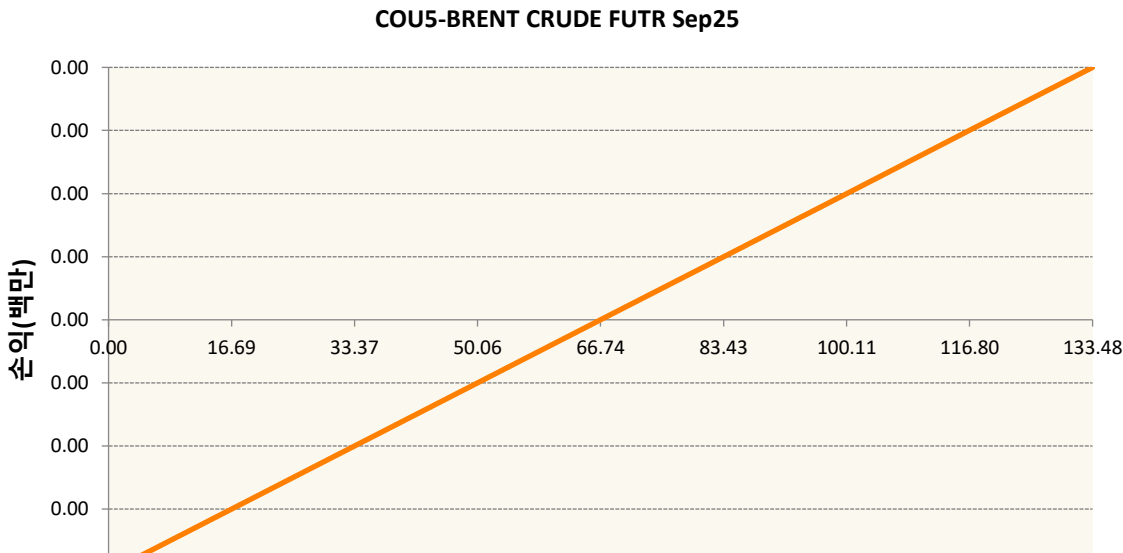
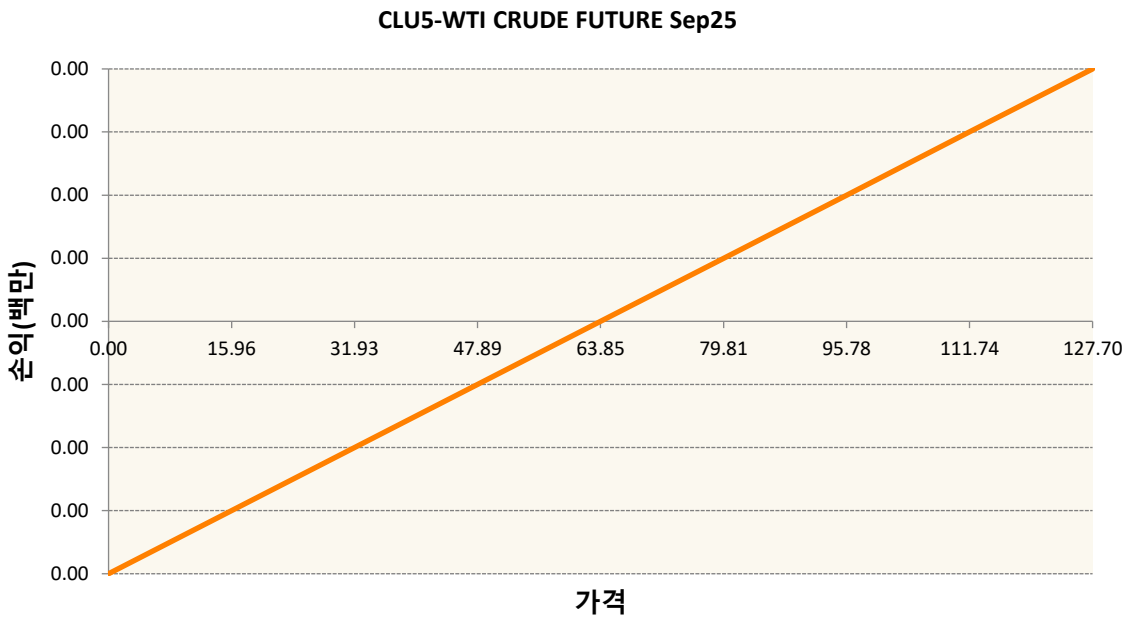
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

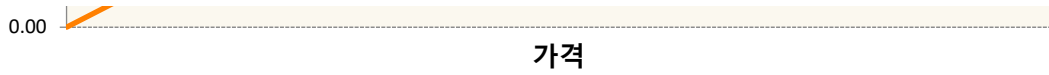
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

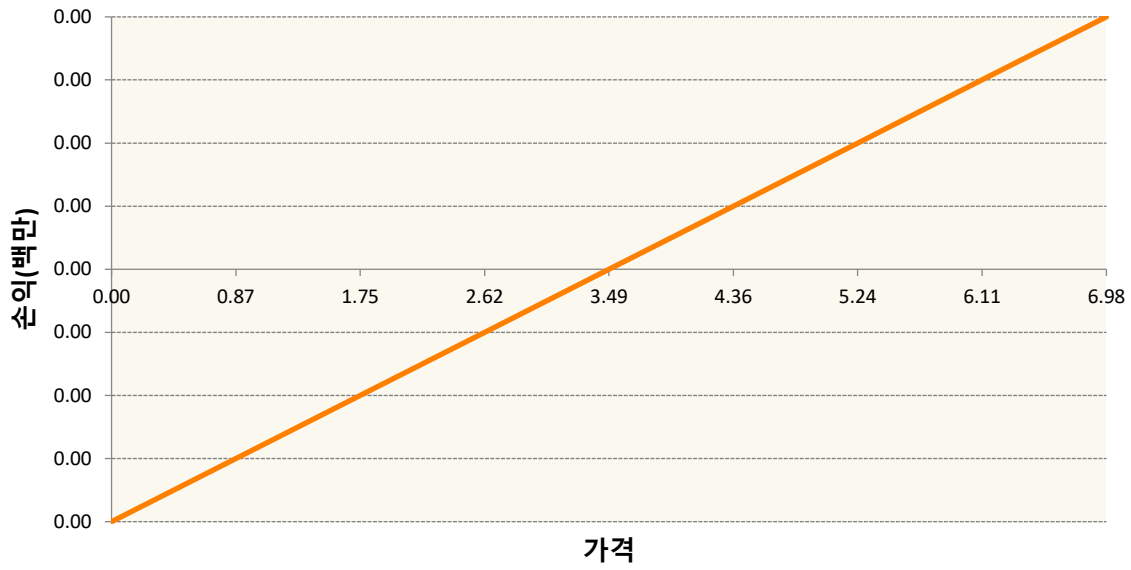
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 330   | 0     | 330       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 276   | 0     | 276       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 108   | -108      | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

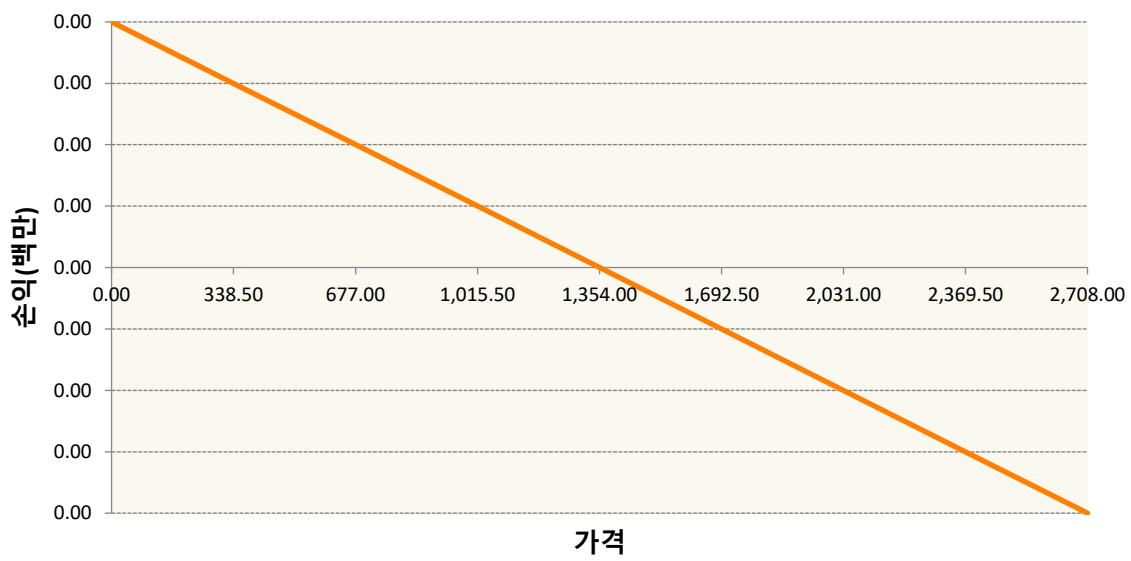




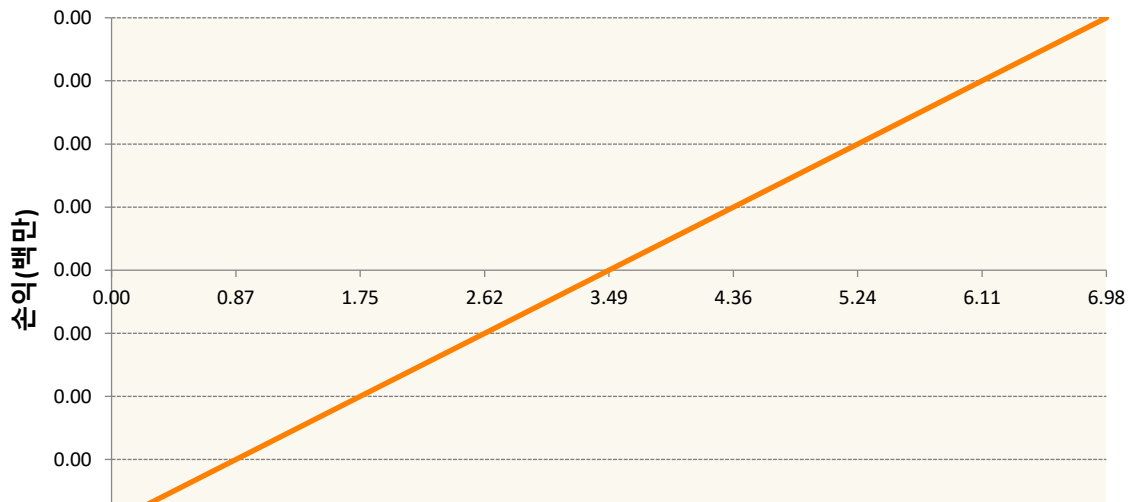
EOU5-E-MINI NATURAL GAS Sep25

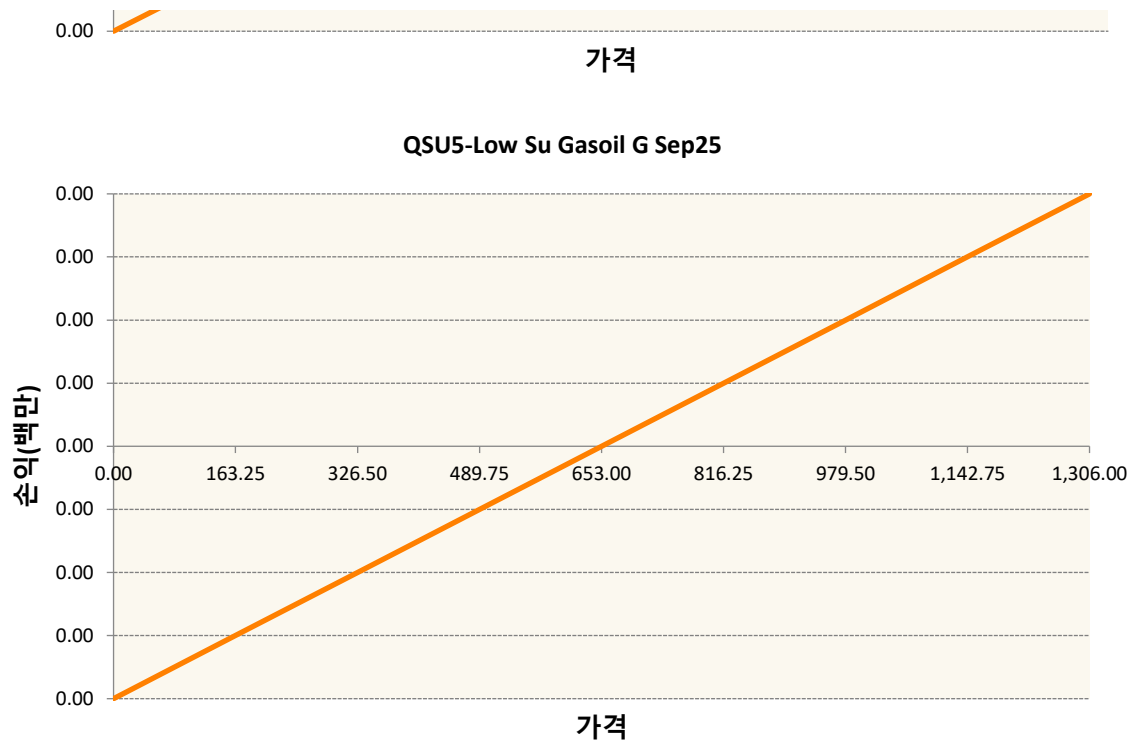


KR4175W70003-2025-07 달러선물



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)

122