

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

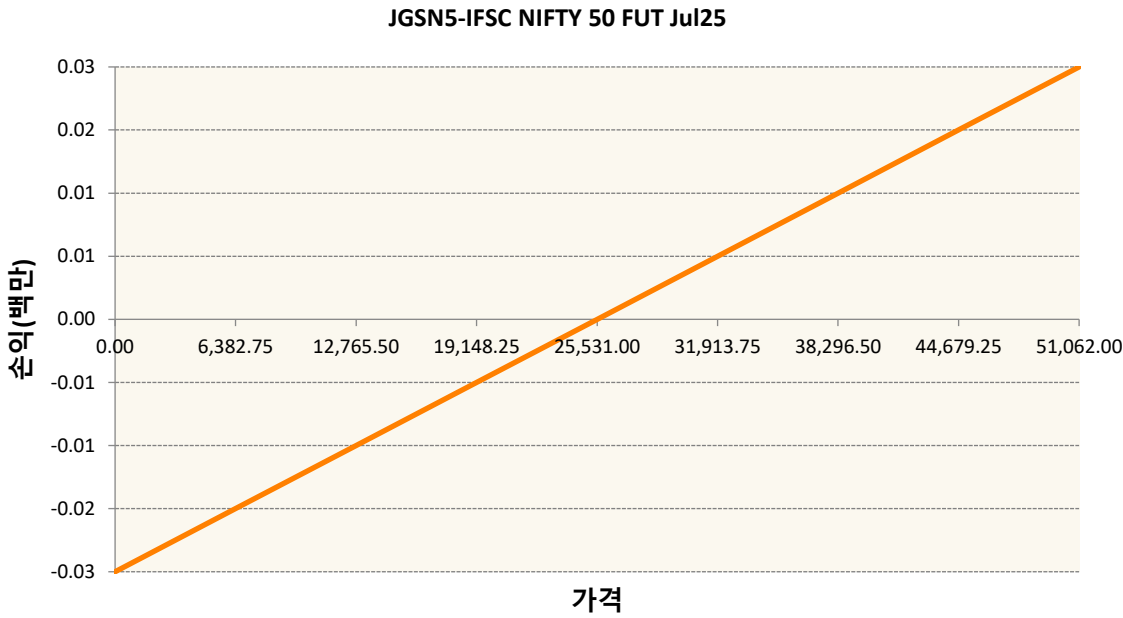
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	626	0	626	

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	2025-07-04
기준일	2025-07-03

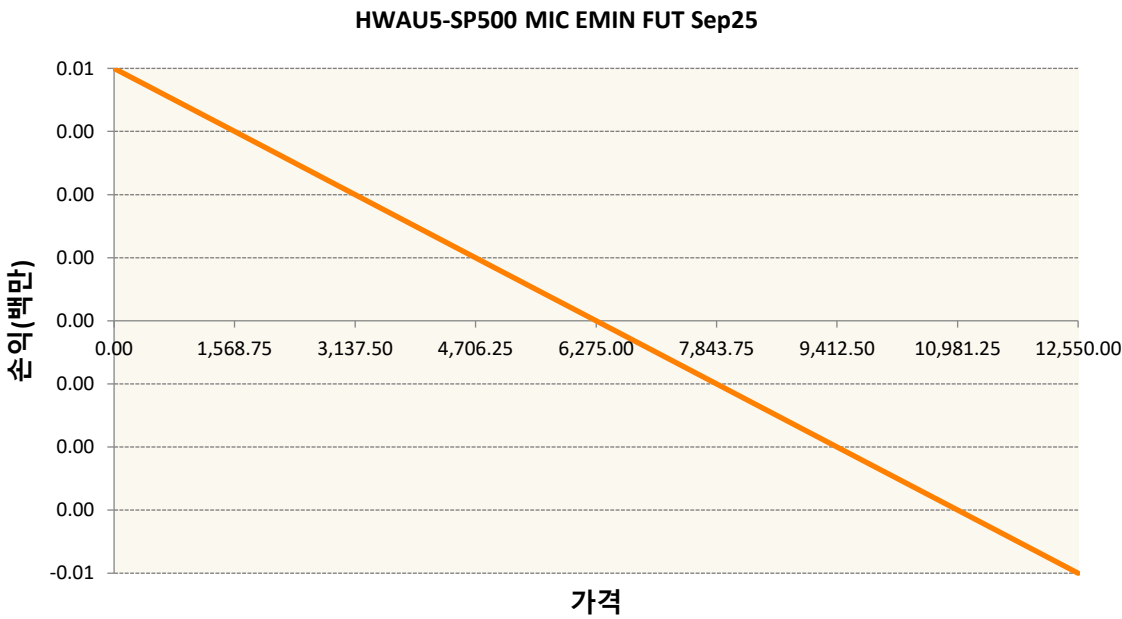
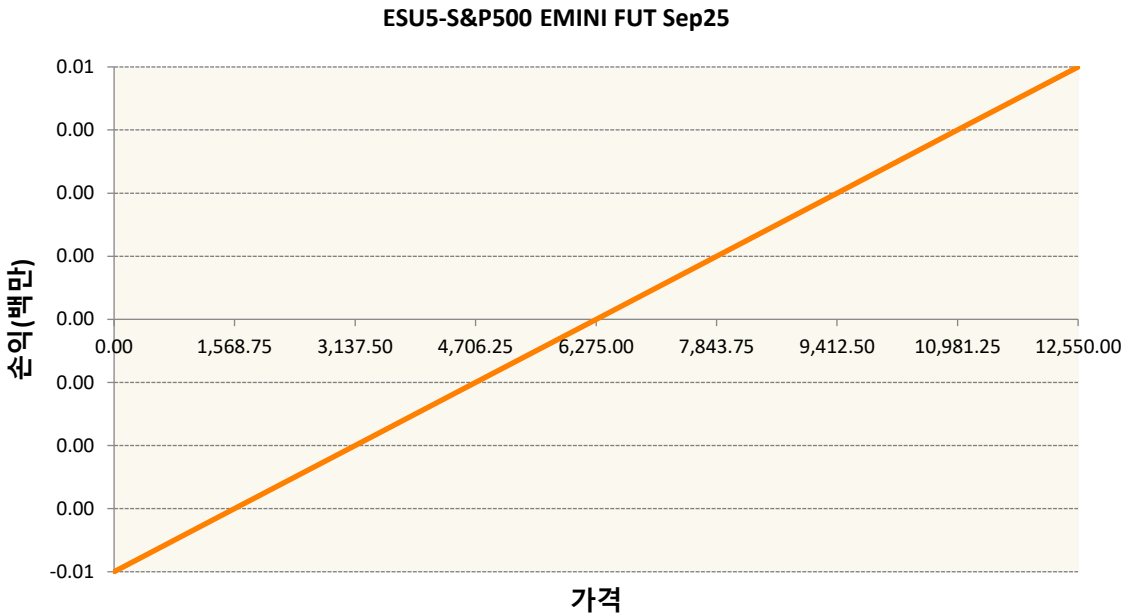
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	433	0	433	
누계	지수	선물	0	120	-120	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	2025-07-04
기준일	2025-07-03

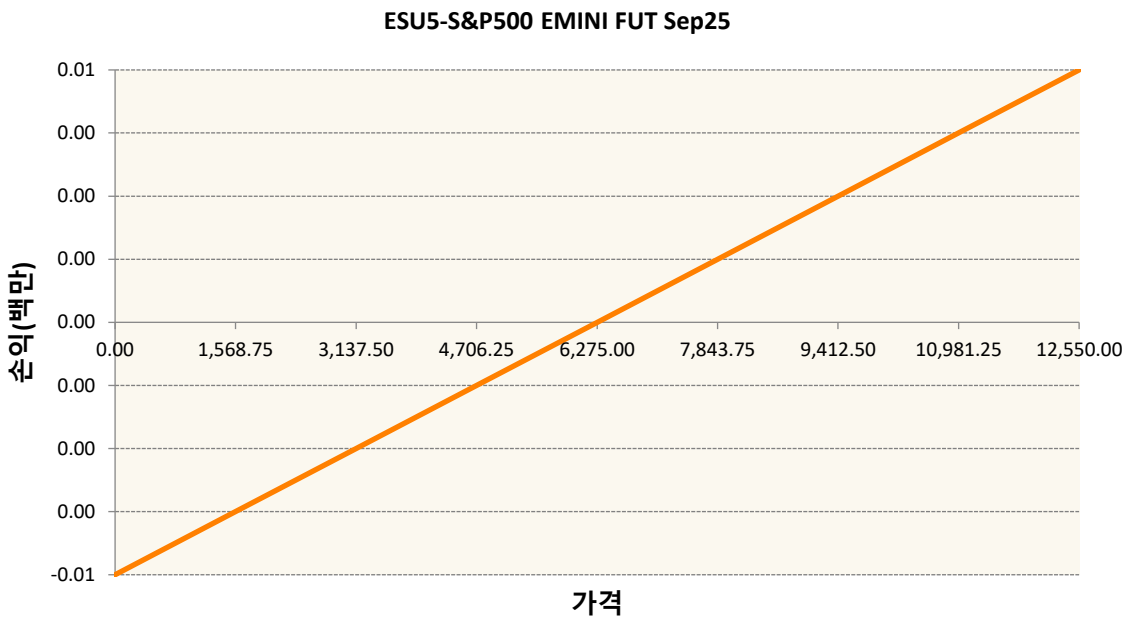
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,298	0	1,298	

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	2025-07-04
기준일	2025-07-03

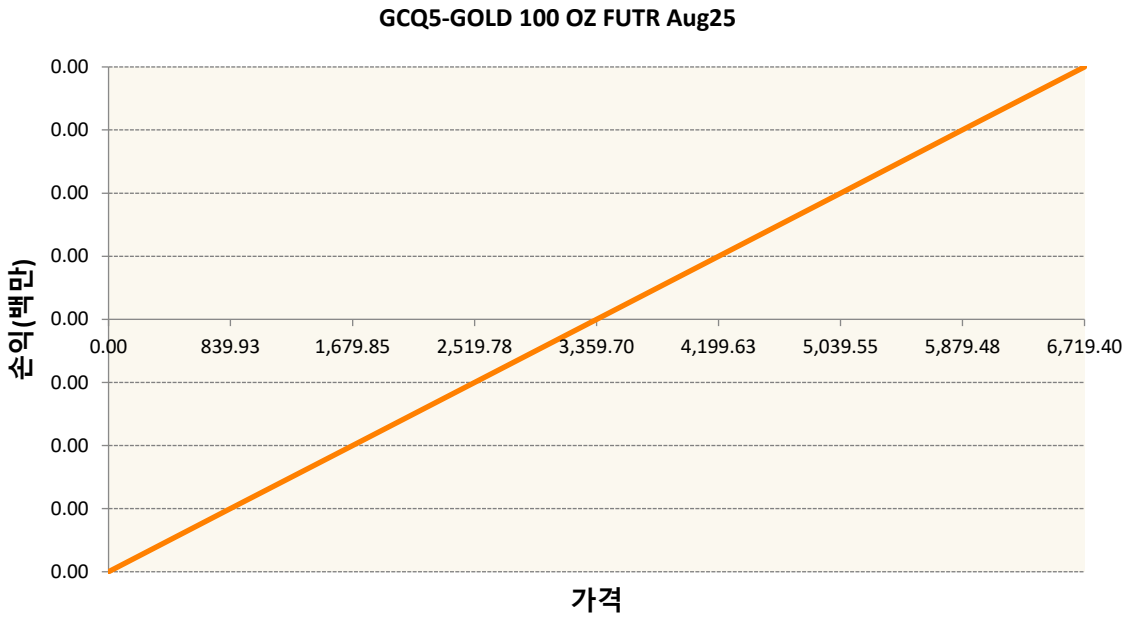
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,848	0	1,848	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 07/03/25 C307 EQUITY	2
GCQ5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25	148

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

(단위:백만원)

128

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

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 C141 EQUITY	0.01
AOPLTRUSC`PLTR US 07/03/25 C143 EQUITY	1
AOPLTRUSC`PLTR US 07/03/25 C149 EQUITY	3
AOPLTRUSP1`PLTR US 07/03/25 P141 EQUITY	2
AOPLTRUSP1`PLTR US 07/03/25 P143 EQUITY	1
AOPLTRUSP1`PLTR US 07/03/25 P149 EQUITY	0.06

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

(단위:백만원)

27

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

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

0.24

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

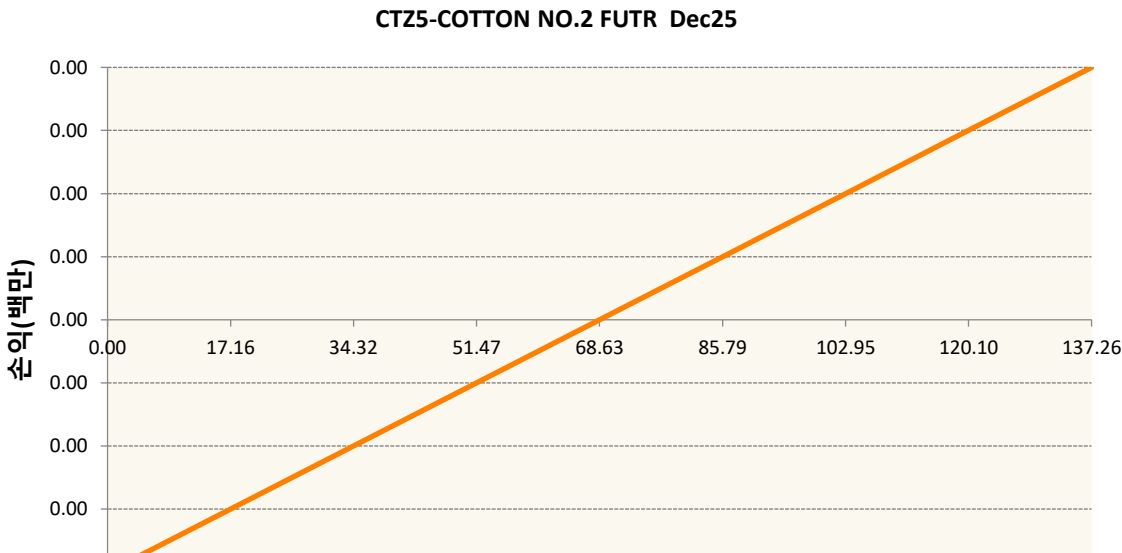
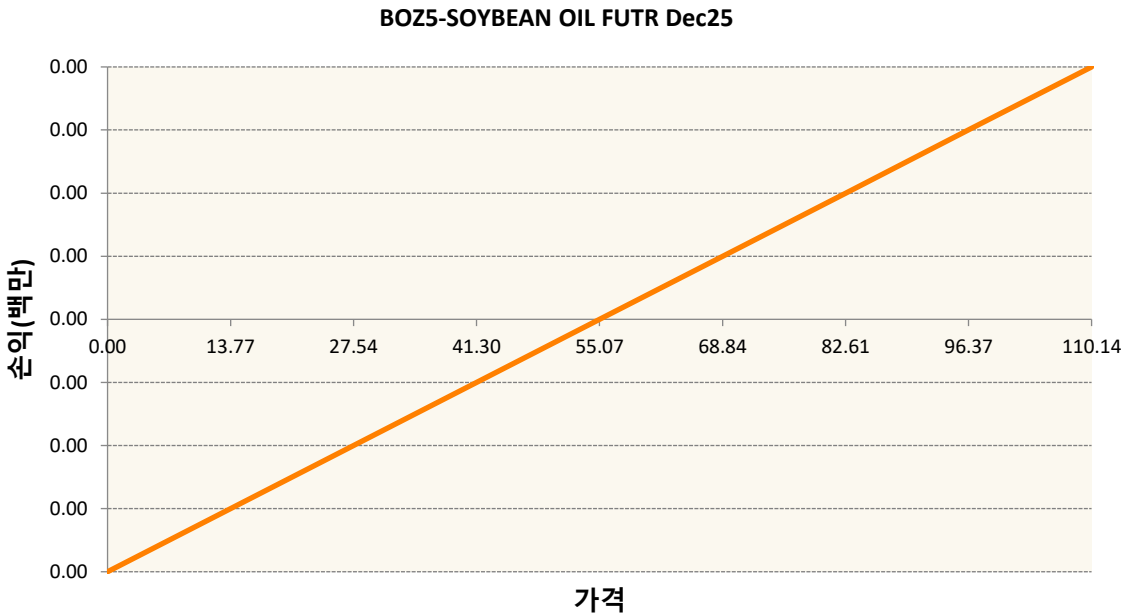
포커스농산물모(채권-파생형)

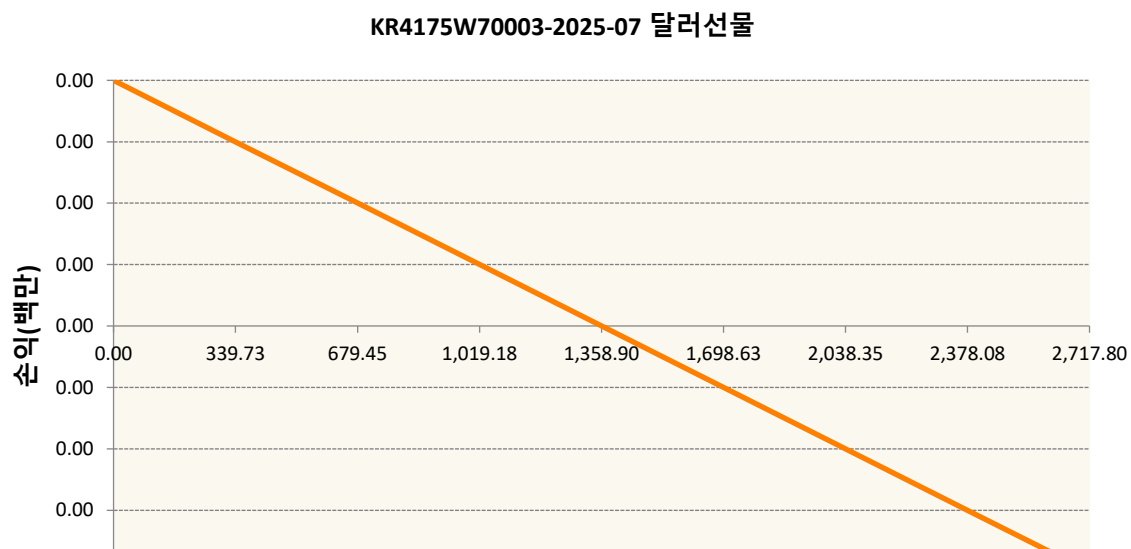
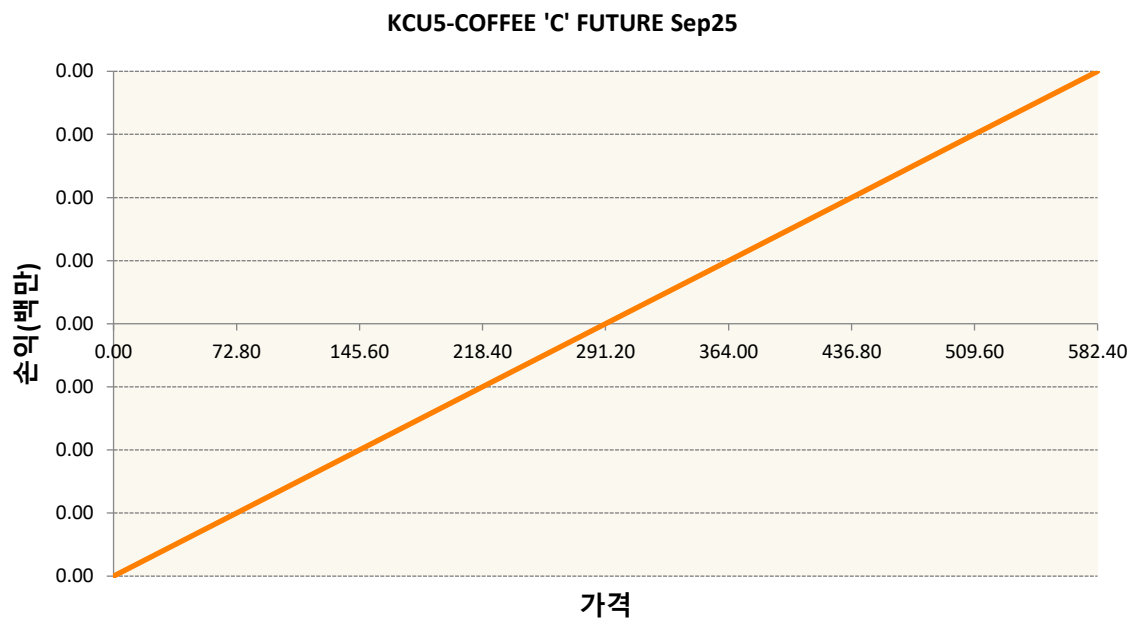
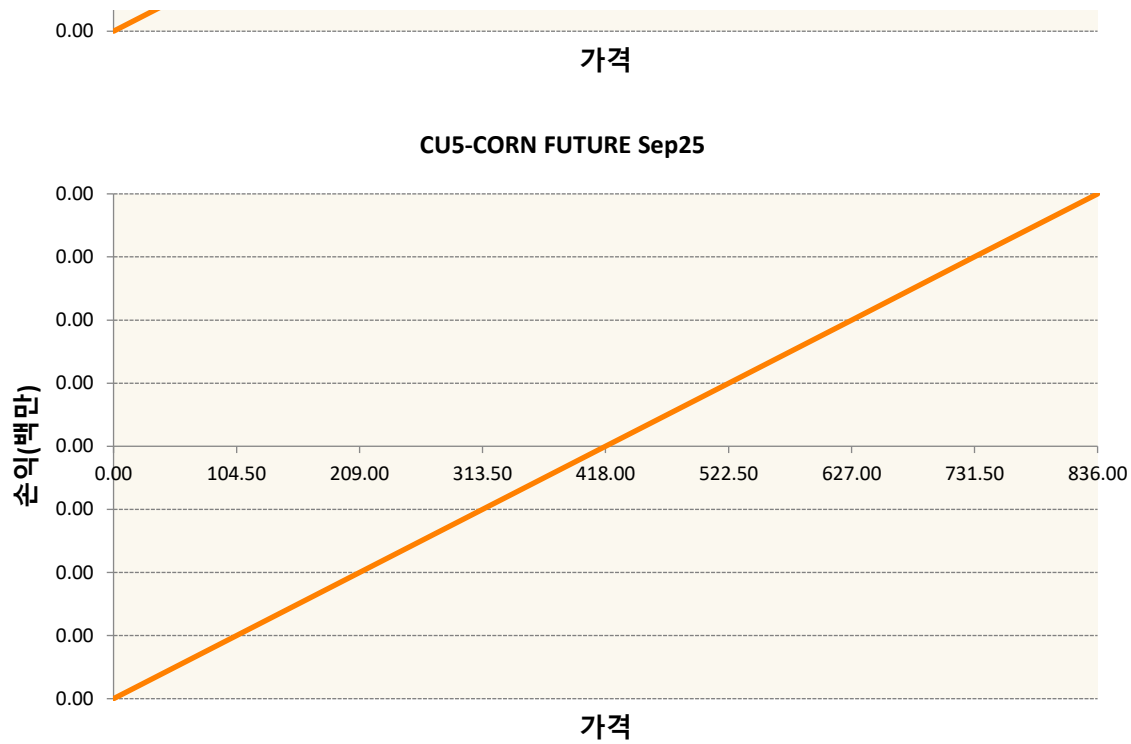
1. 계약금액

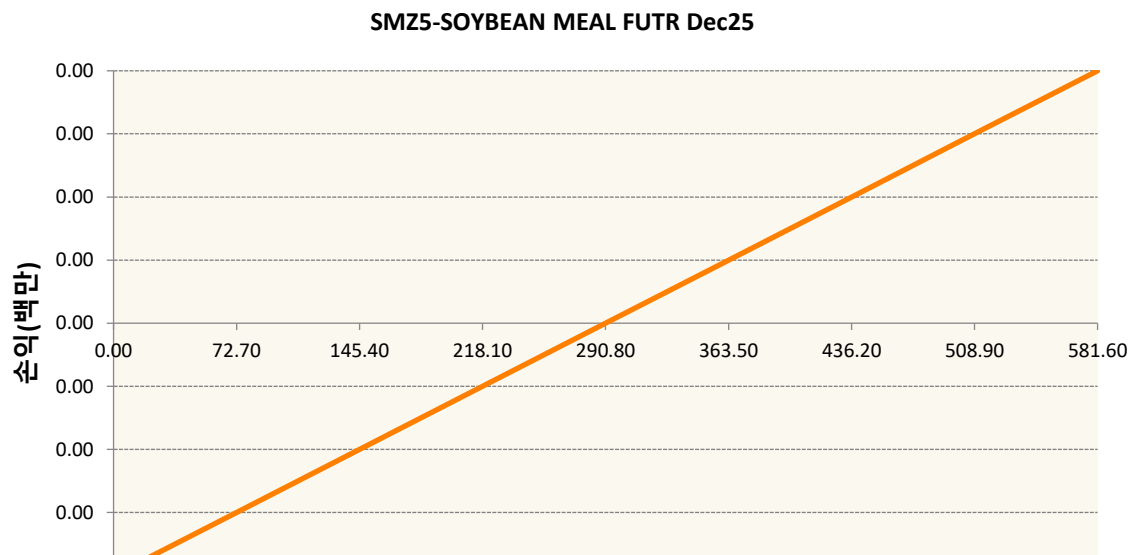
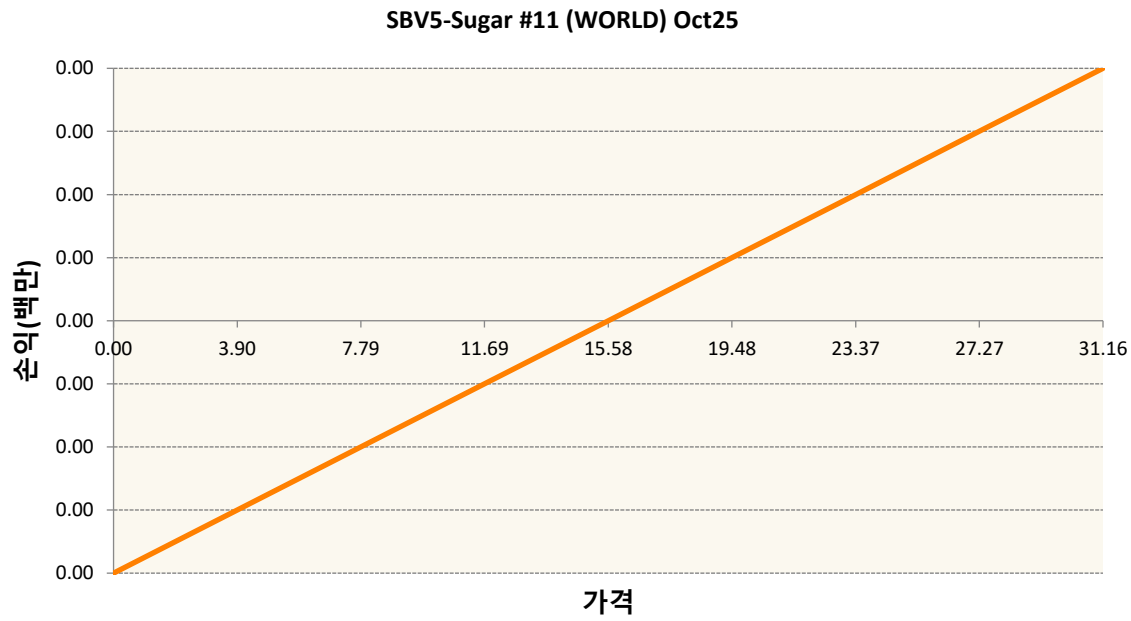
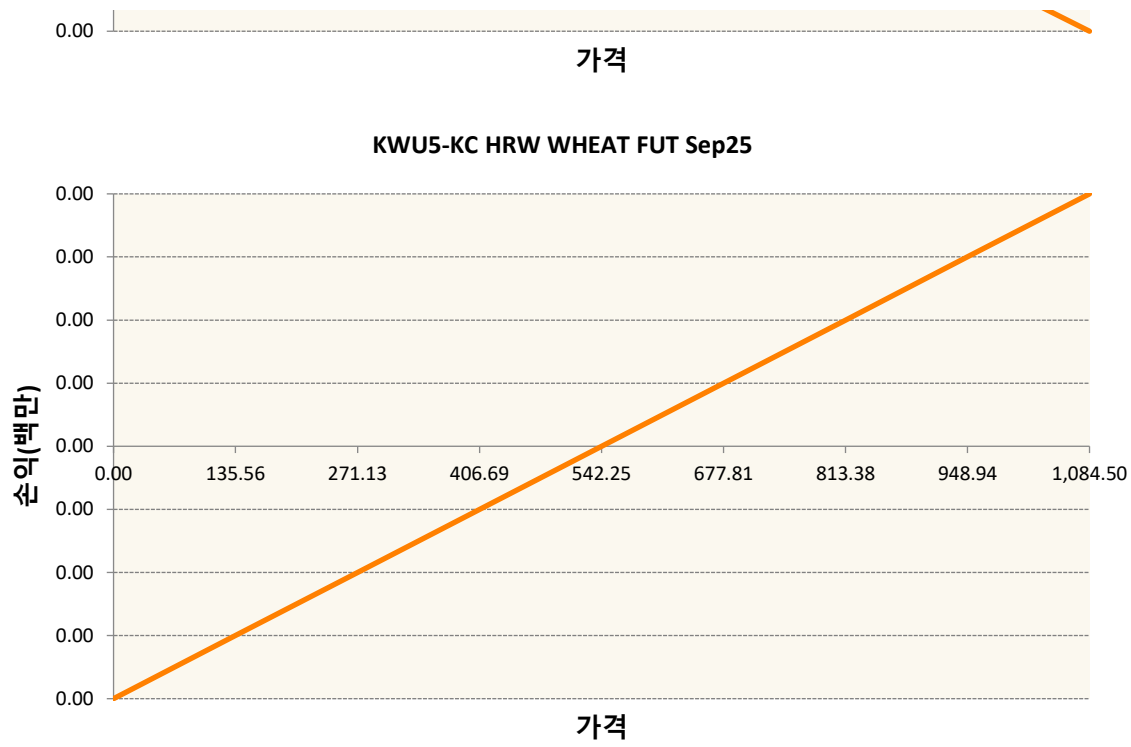
(단위:USD 백만)

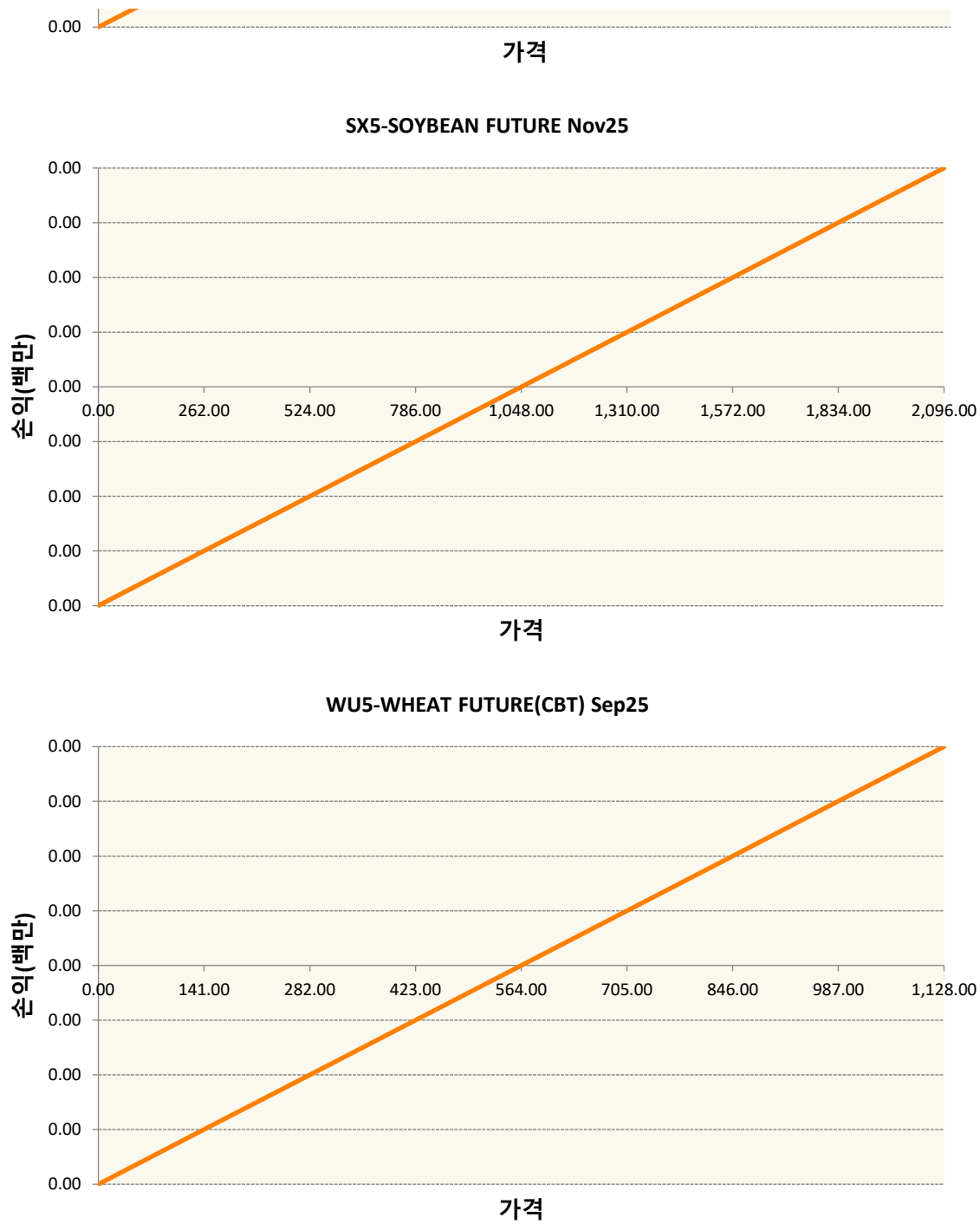
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,614	0	1,614	
누계	유가증권	선물	2,021	0	2,021	
누계	통화	선물	0	258	-258	장내

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	2025-07-04
기준일	2025-07-03

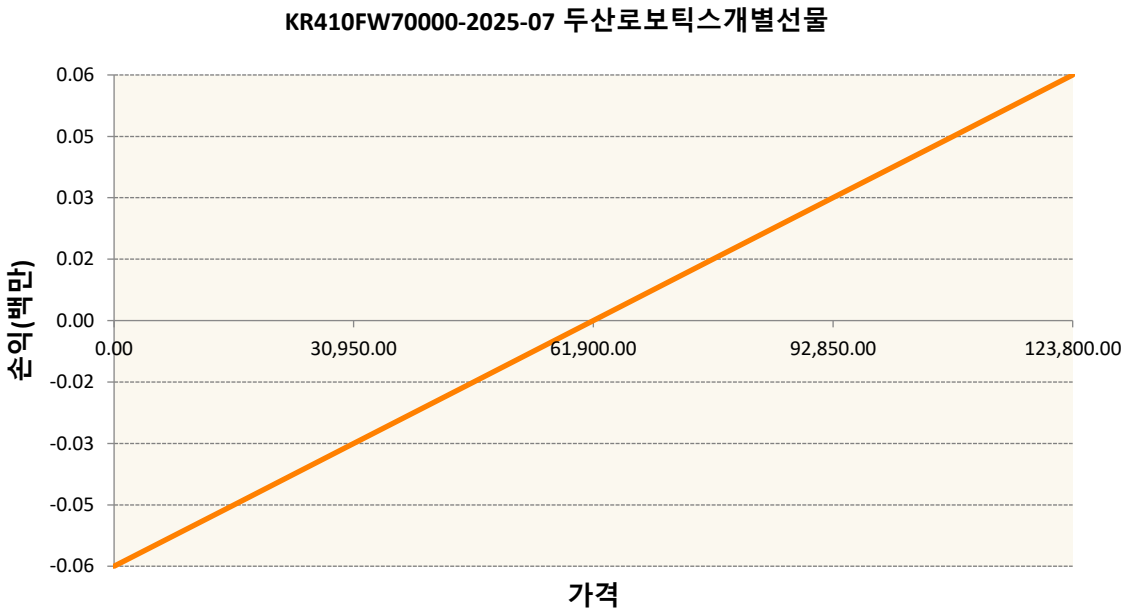
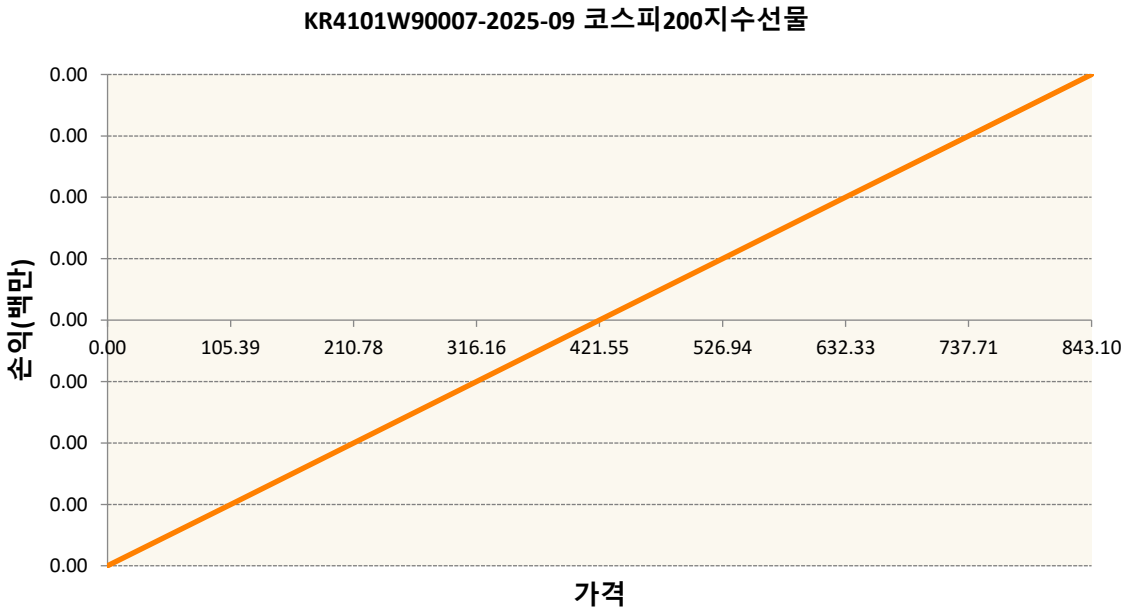
스마트인덱스모

1. 계약금액

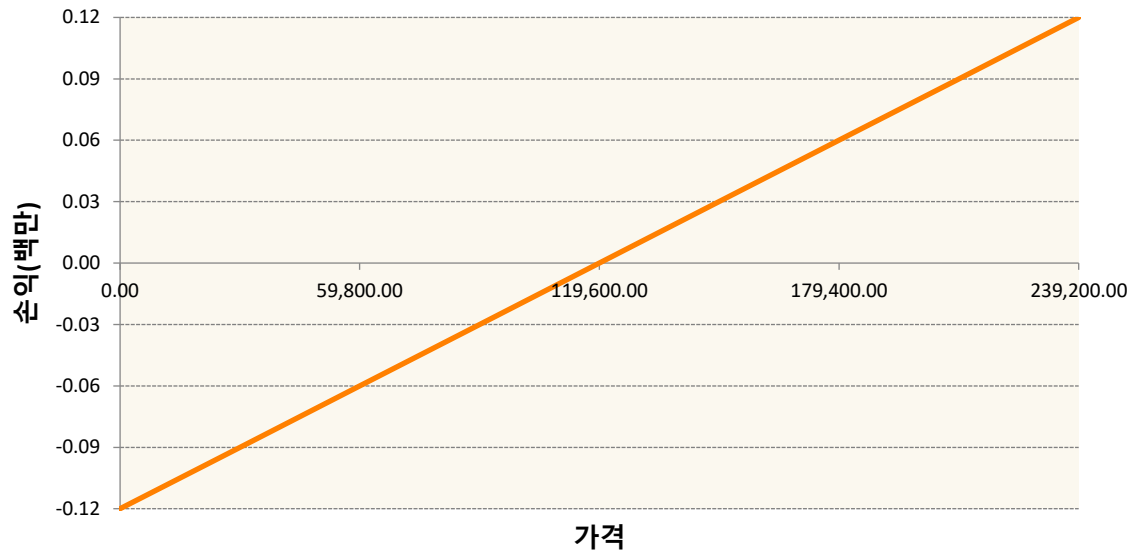
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,386	0	1,386	장내

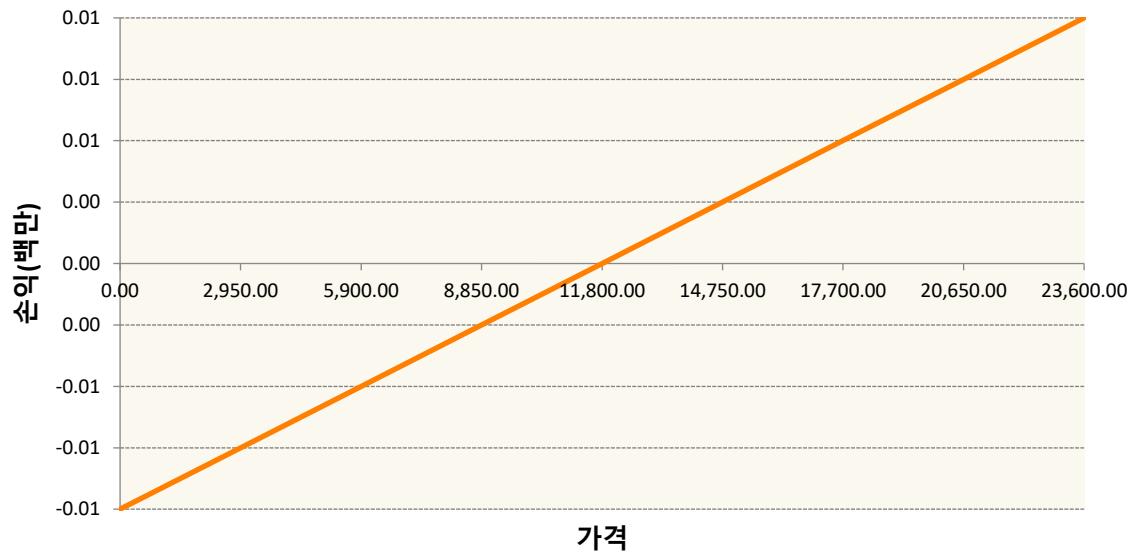
2. 만기시점의 손익구조



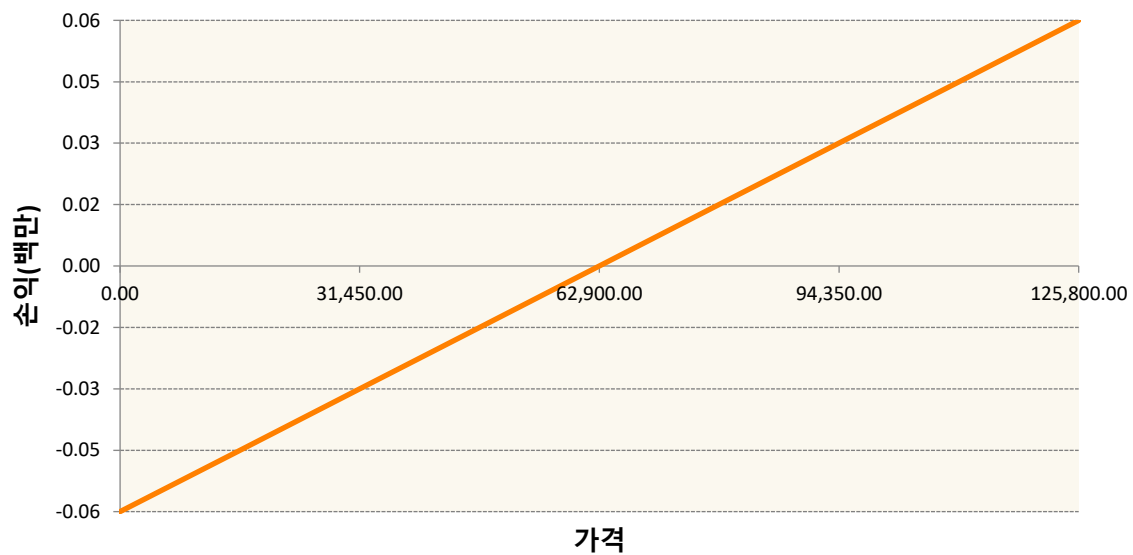
KR4141W70005-2025-07 SK이노베이션개별선물



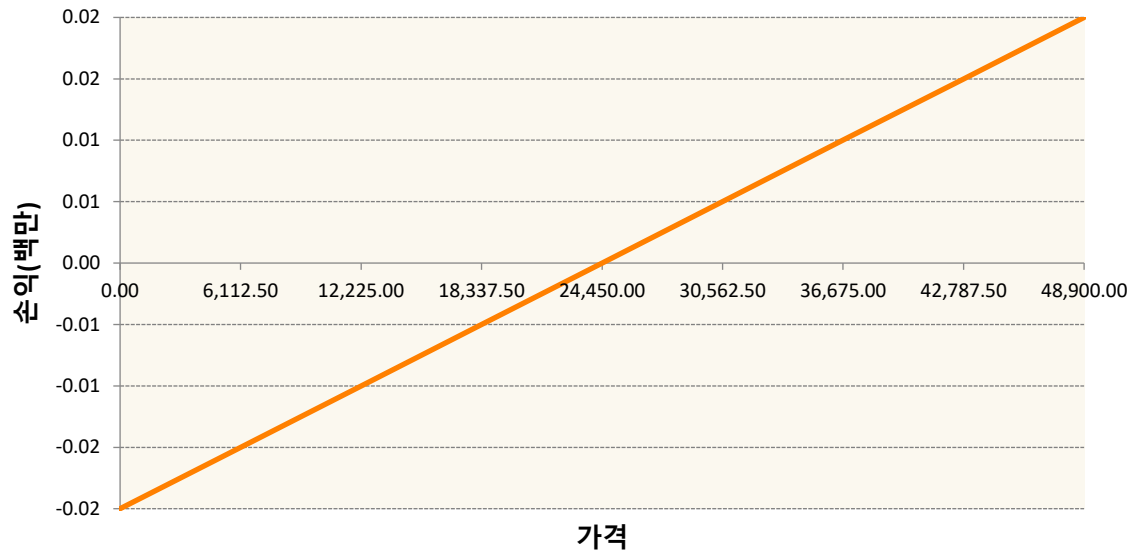
KR4149W70008-2025-07 HD현대인프라코어개별선물



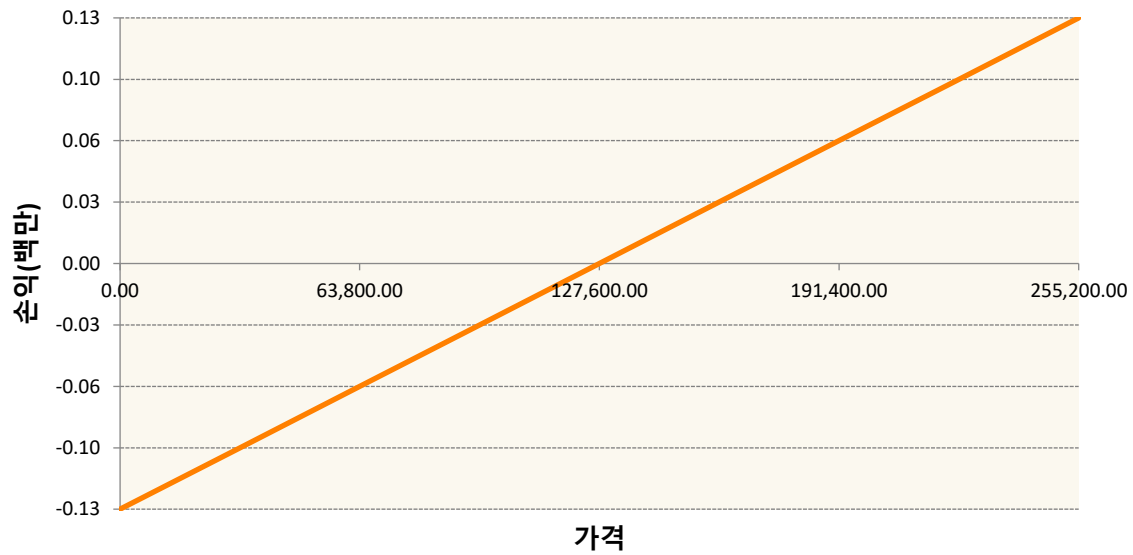
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



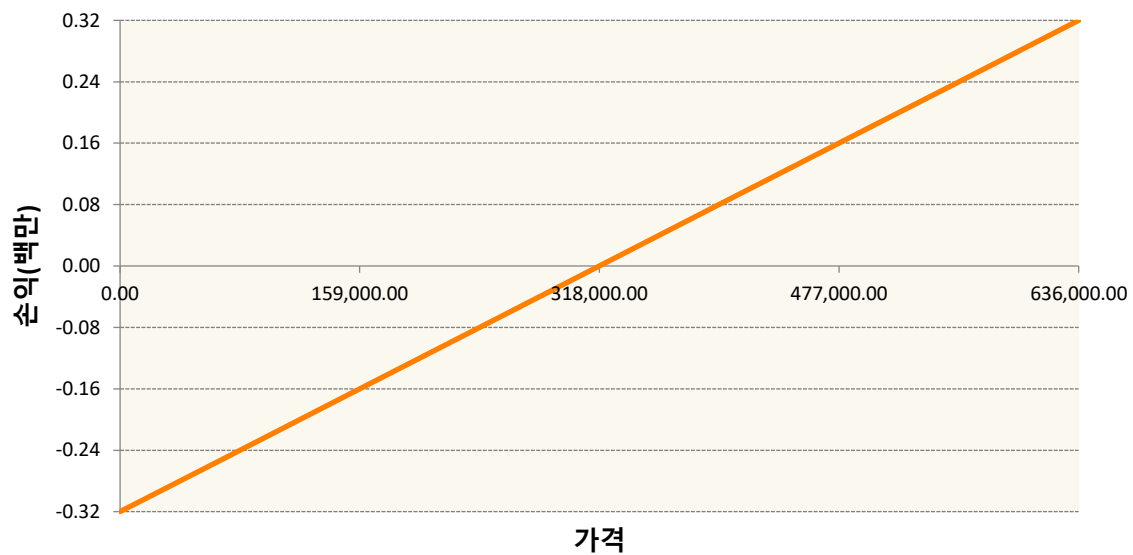
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



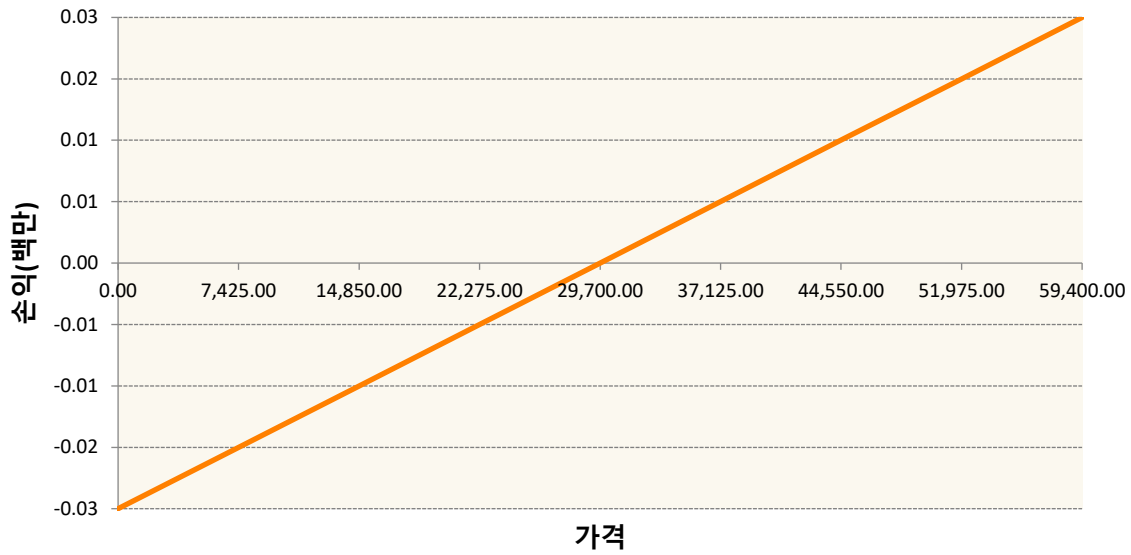
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



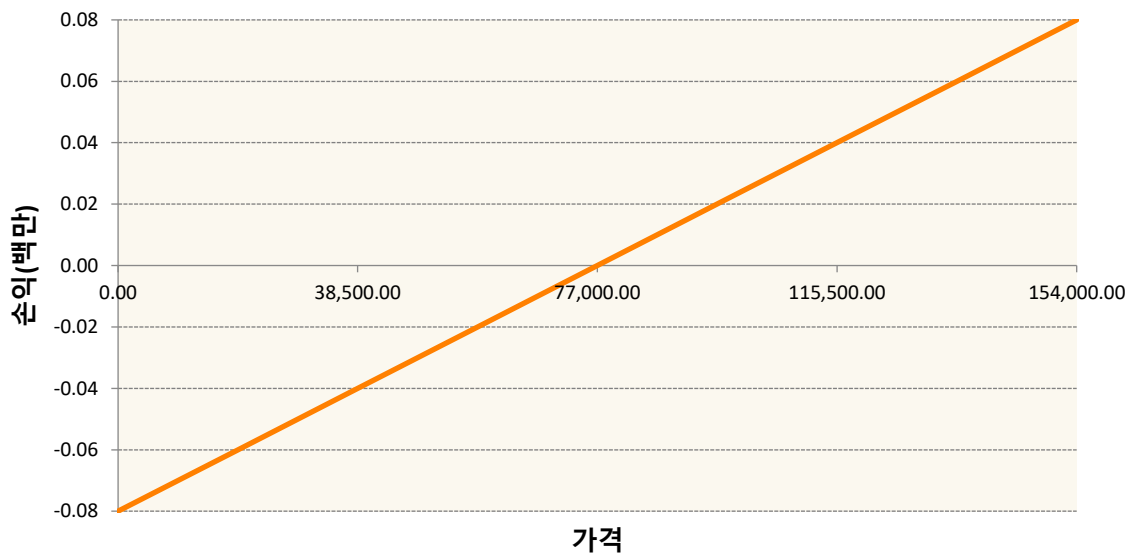
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



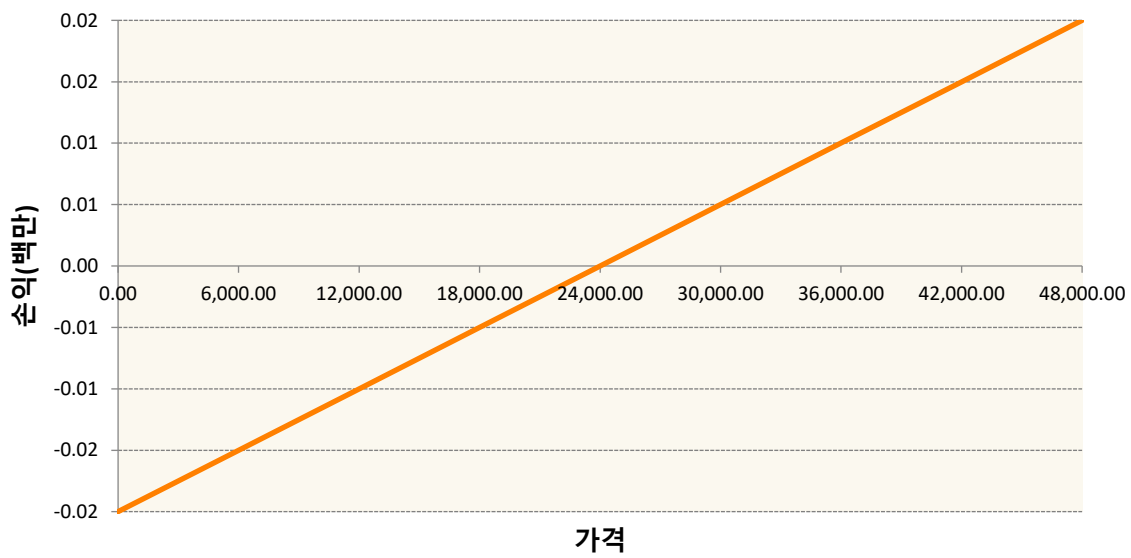
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



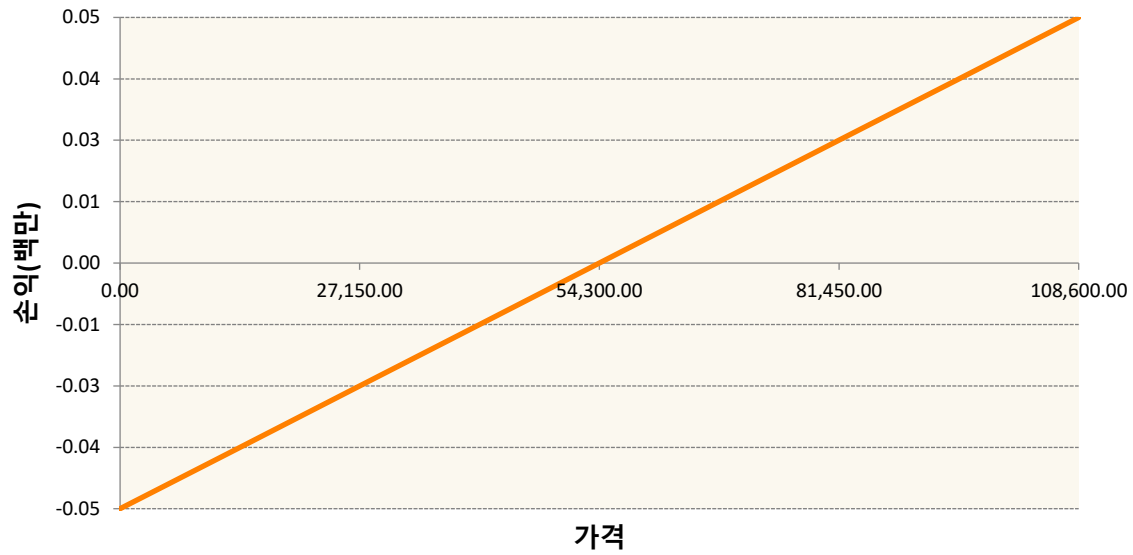
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



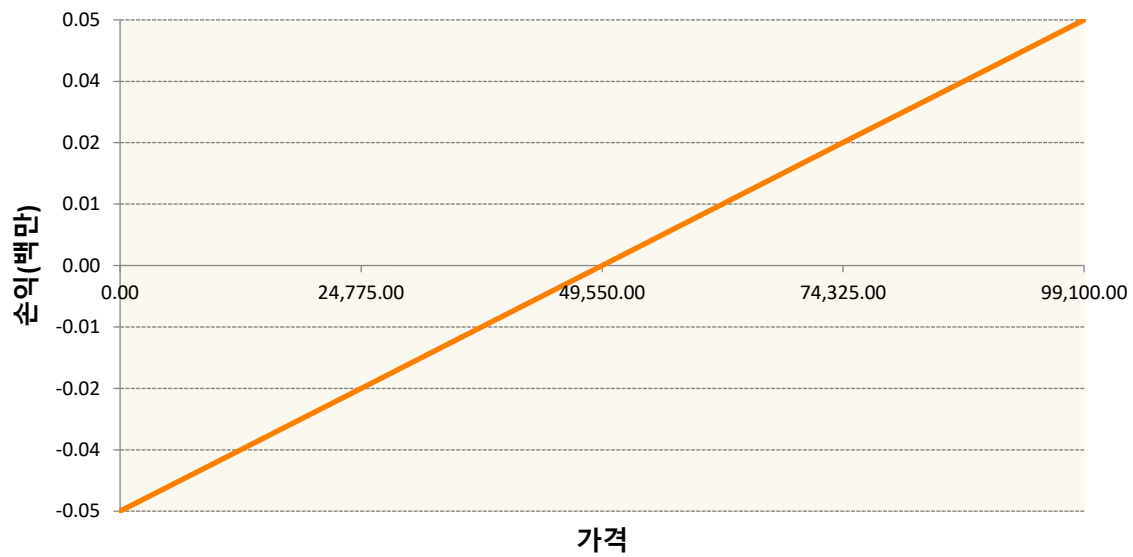
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



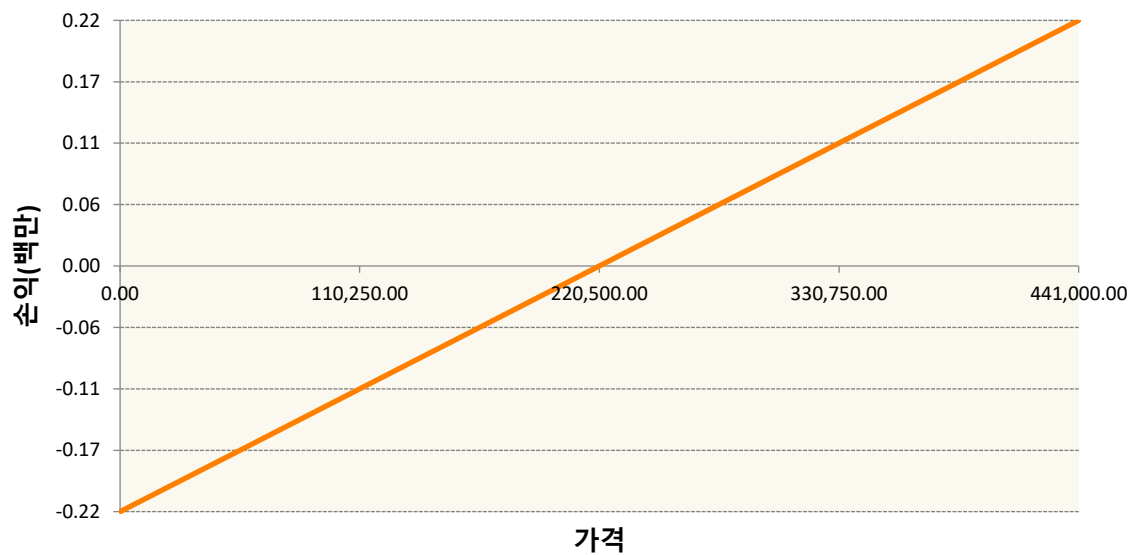
KR41FMW70003-2025-07 엘애프개별선물



KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물		59
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물		1
KR4141W70(2025-07 SK이노베이션개별선물		7
KR4149W70(2025-07 HD현대인프라코어개별선물		2
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		2
KR41G0W70 2025-07 씨에스윈드개별선물		0.28
KR41HEW70 2025-07 키움증권개별선물		3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	215

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

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

307

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

495

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

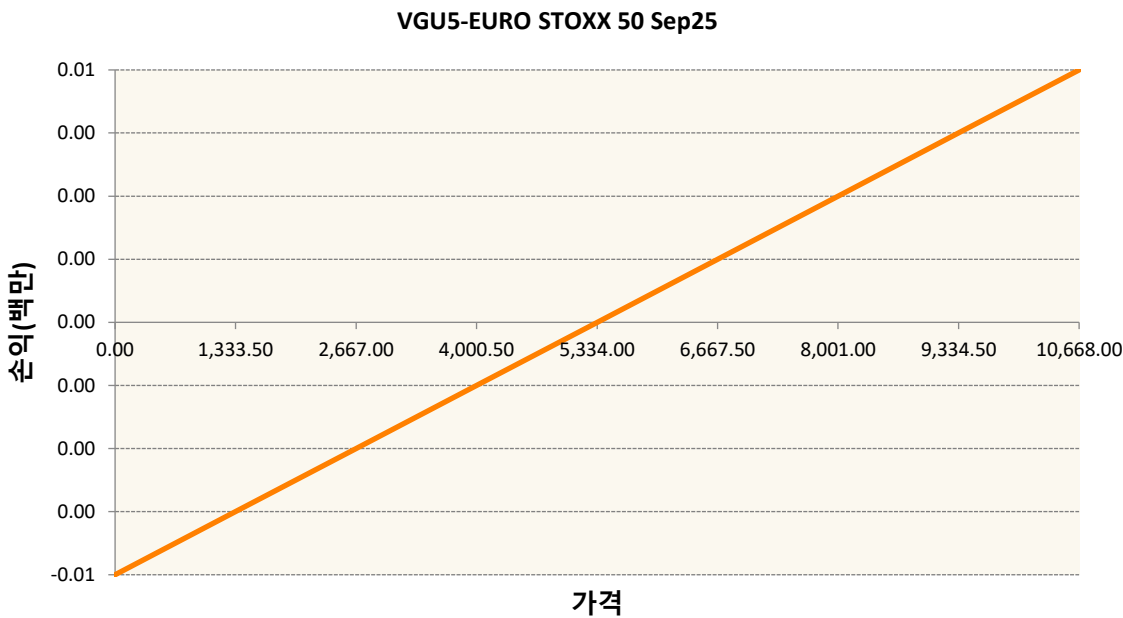
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	928	0	928	

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	2025-07-04
기준일	2025-07-03

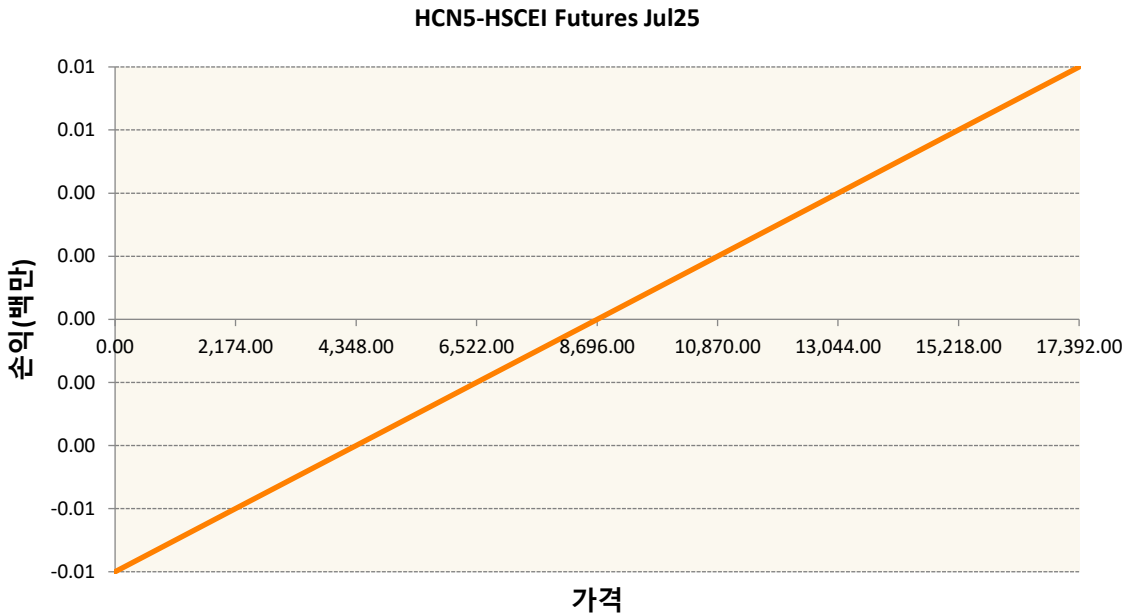
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,113	0	2,113	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN5	HSCEI Futures Jul25	169
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

244

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

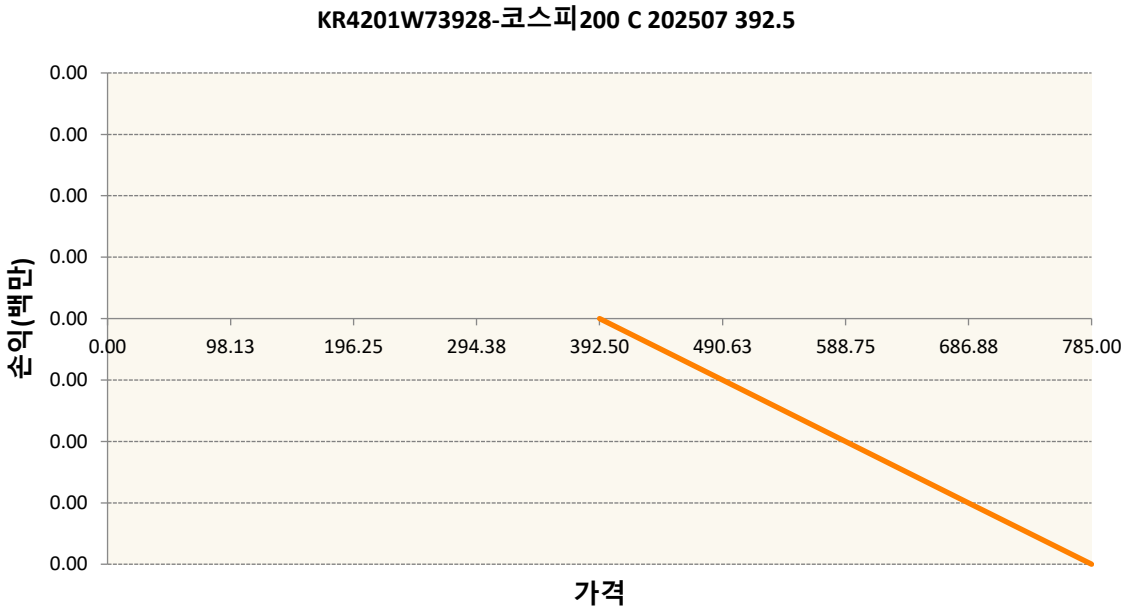
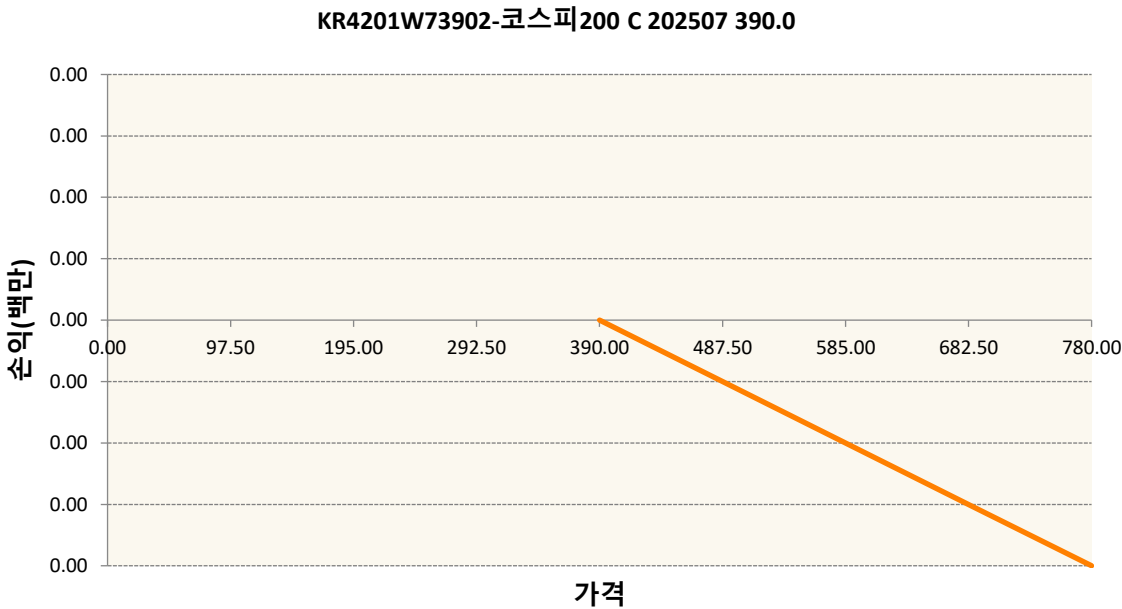
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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	34,179	-34,179	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The profit is zero for prices from 0 to 390,000 won. For prices above 390,000 won, the profit is negative, indicating a loss.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	0.00
390.00	0.00
487.50	-0.00
585.00	-0.00
682.50	-0.00
780.00	-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					1,808
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,538	1,517	1,497	1,476	1,455	1,434	1,414
-5.33%	1,162	1,148	1,132	1,116	1,098	1,081	1,062
-2.67%	602	599	595	590	583	575	566
0%	1	1	1	0	-1	-3	-6
2.67%	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-603
5.33%	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205
8.00%	-1,808	-1,808	-1,808	-1,808	-1,808	-1,808	-1,808
KR4201W73928		코스피200 C 202507 392.5					597
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	478	472	466	460	453	447	440
-5.33%	375	369	363	356	350	344	337
-2.67%	198	197	195	192	189	186	182
0%	1	1	0	0	-1	-2	-3
2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-199	-199
5.33%	-397	-397	-397	-397	-398	-398	-398
8.00%	-597	-597	-597	-597	-597	-597	-597
KR4301W73900 코스피200 P 202507 390.0							88

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-65	-70	-74	-79	-84	-88
-5.33%	-10	-13	-17	-20	-24	-28	-32
-2.67%	0	-1	-2	-3	-4	-6	-8
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4301W73926 코스피200 P 202507 392.5							35
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-28	-30	-31	-33	-34	-35
-5.33%	-5	-7	-8	-9	-11	-12	-14
-2.67%	0	-1	-1	-2	-2	-3	-4
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

2,486

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	25	-25	
누계	유가증권	수익증권	483	0	483	

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	2025-07-04
기준일	2025-07-03

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	90	-90	
누계	유가증권	수익증권	4,150	0	4,150	

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	2025-07-04
기준일	2025-07-03

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	12,509	0	12,509	
누계	통화	선도	177	11,786	-11,609	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213F4V(KRW/USD 31-07-25E		405
FXW213F5V(KRW/USD 29-08-25E		318
FXW213F6SC KRW/USD 29-08-25E		221
FXW213F6XC USD/KRW 31-07-25E		14
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	476

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

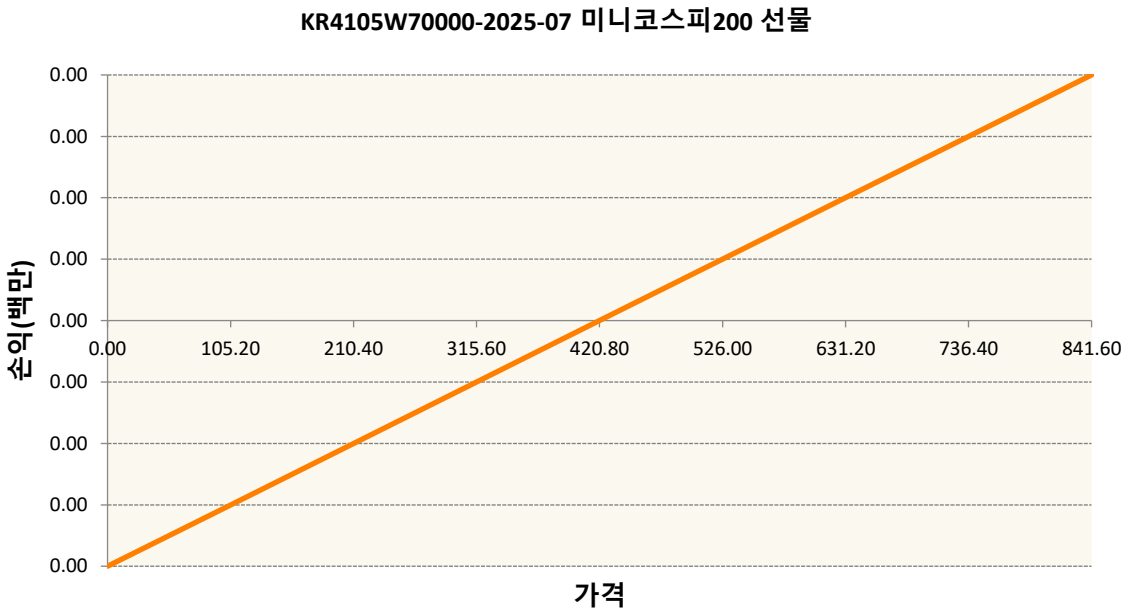
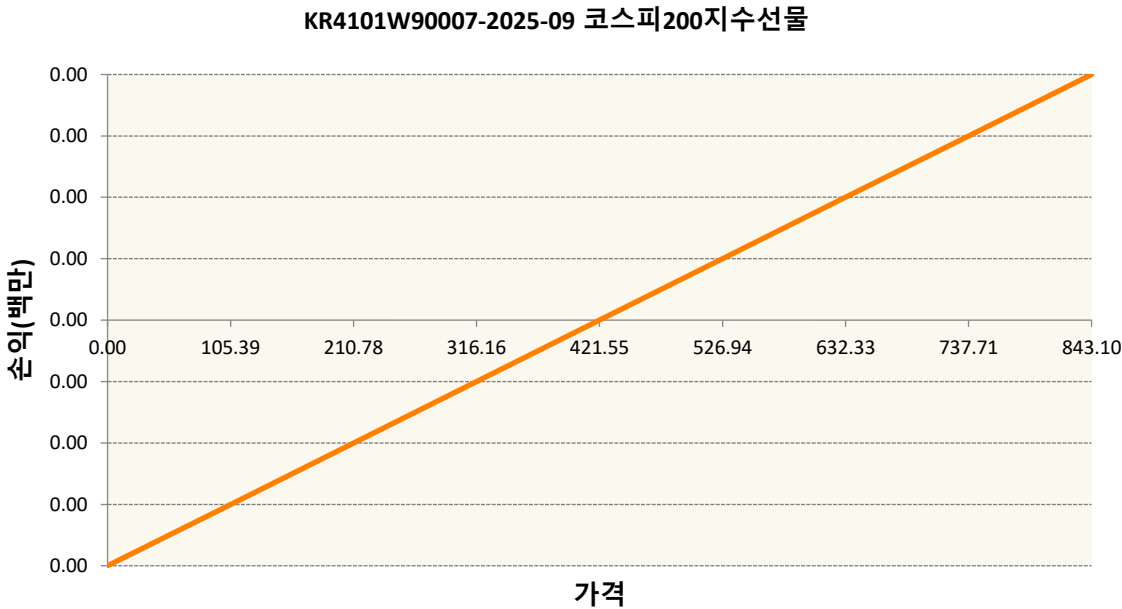
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

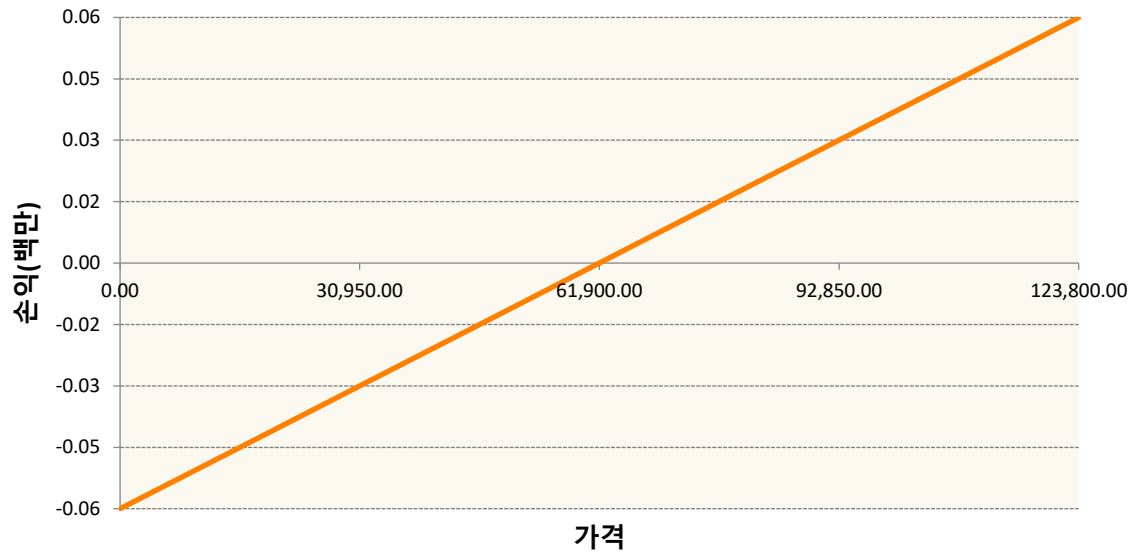
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	208	0	208	장내
누계	유가증권	선물	1,173	0	1,173	장내

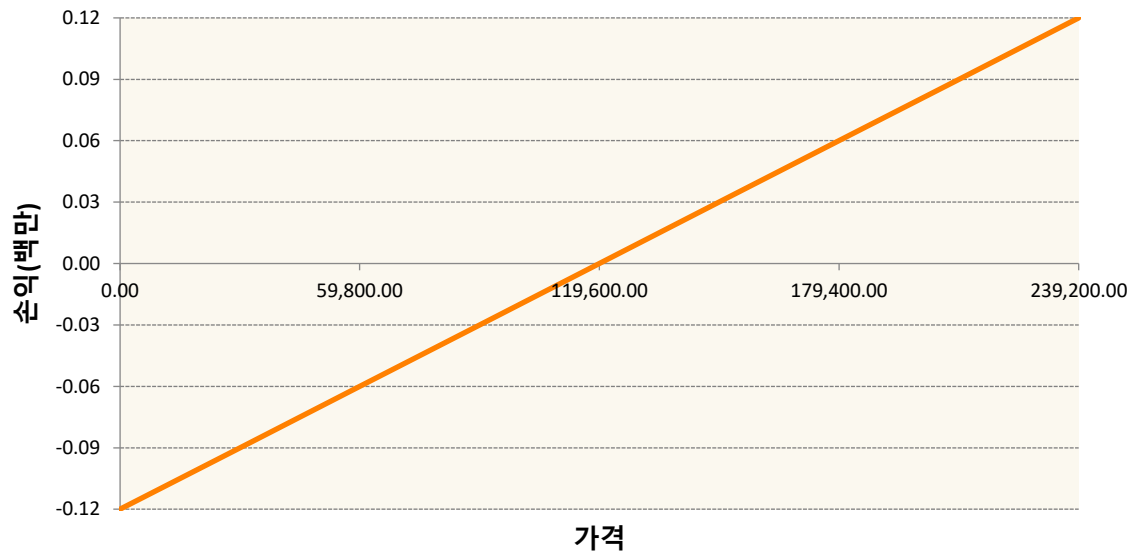
2. 만기시점의 손익구조



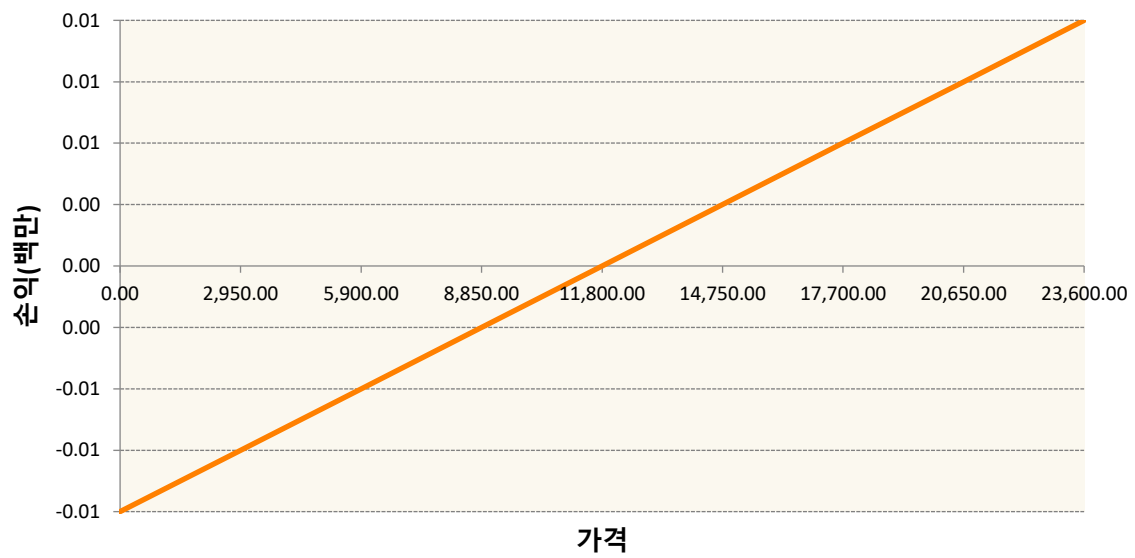
KR410FW70000-2025-07 두산로보틱스개별선물



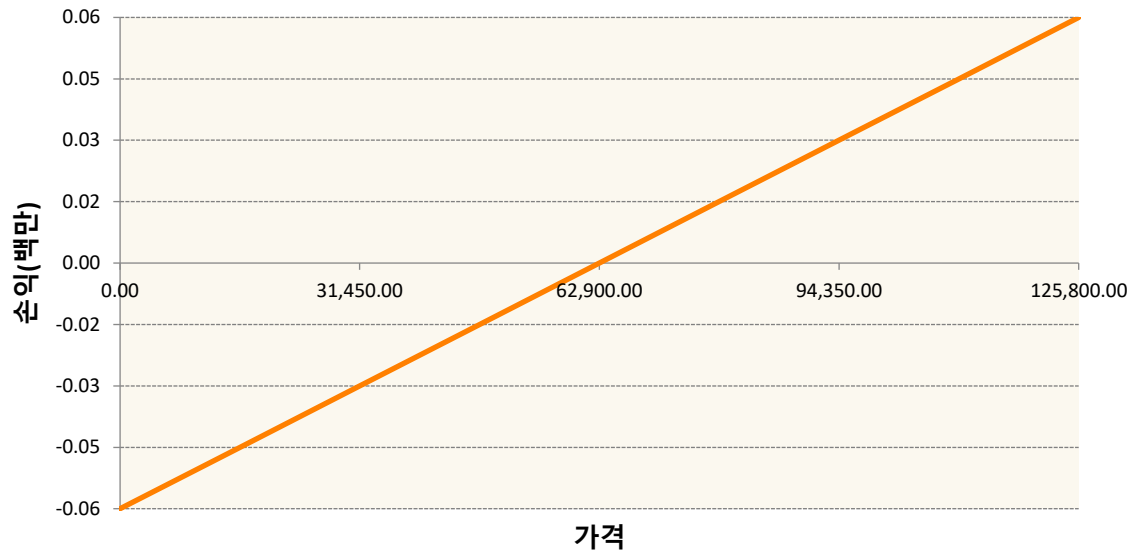
KR4141W70005-2025-07 SK이노베이션개별선물



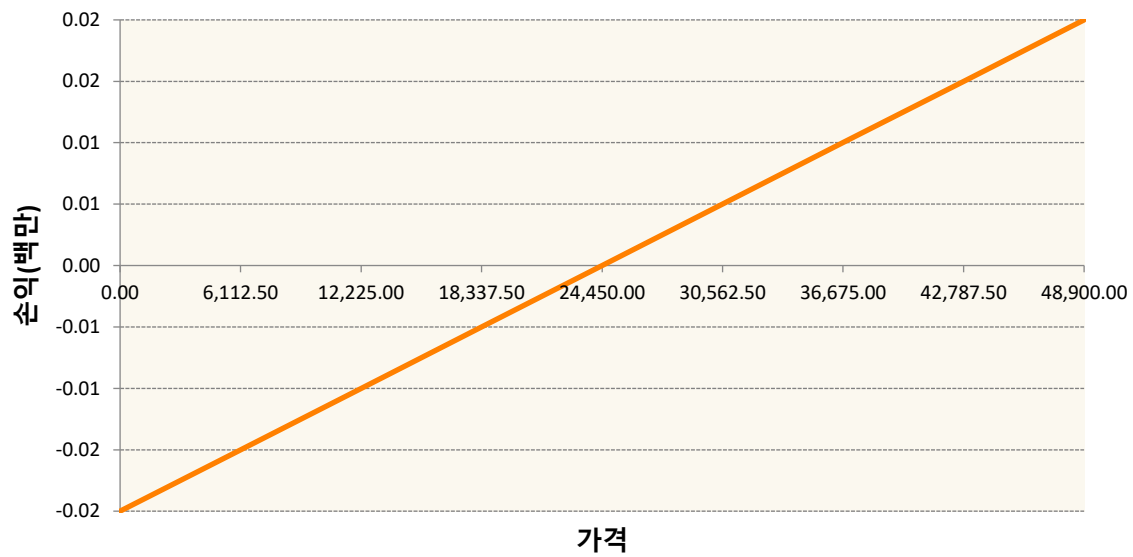
KR4149W70008-2025-07 HD현대인프라코어개별선물



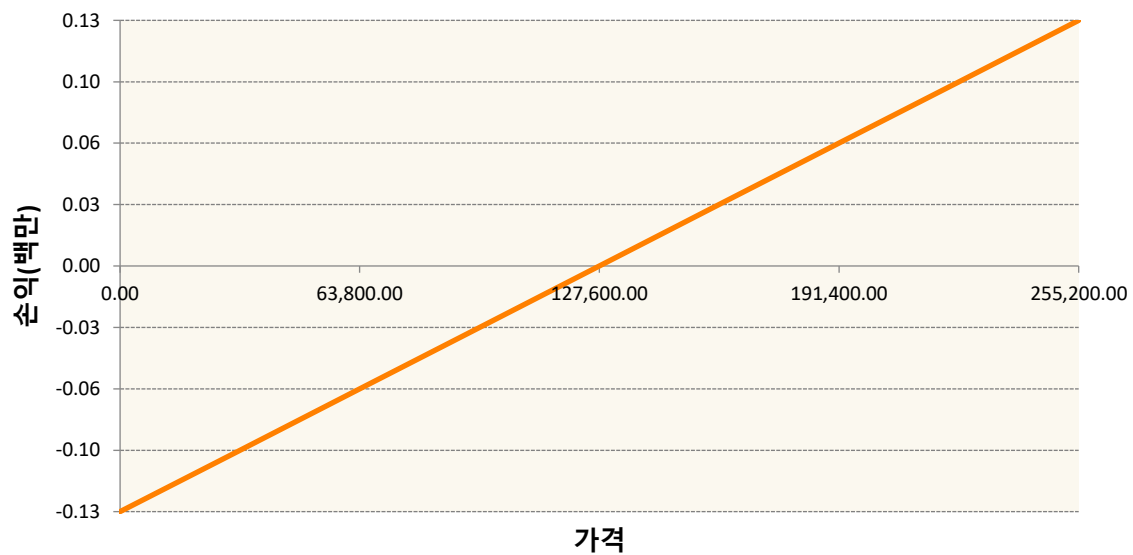
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



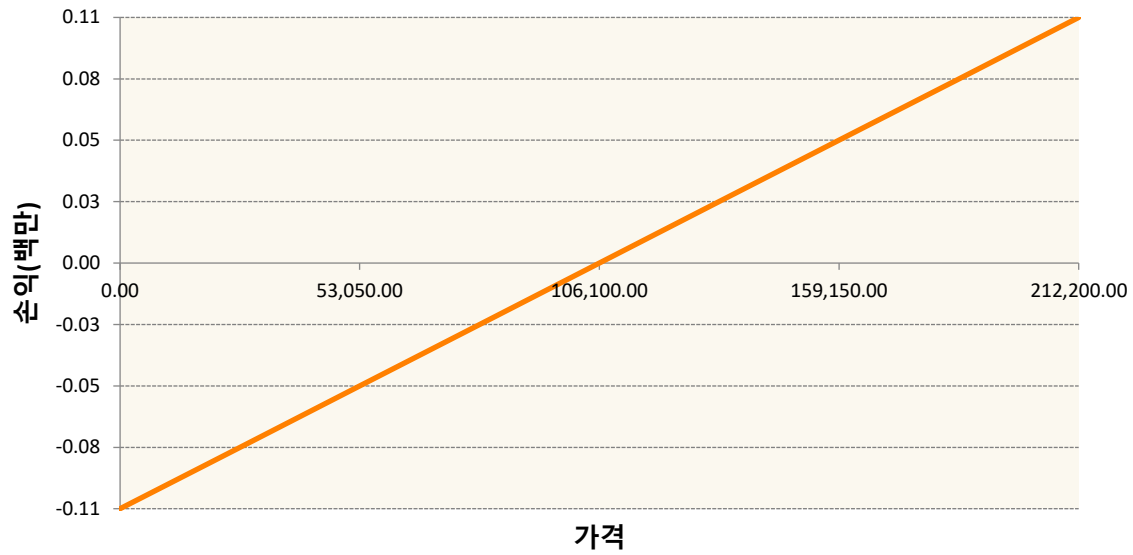
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



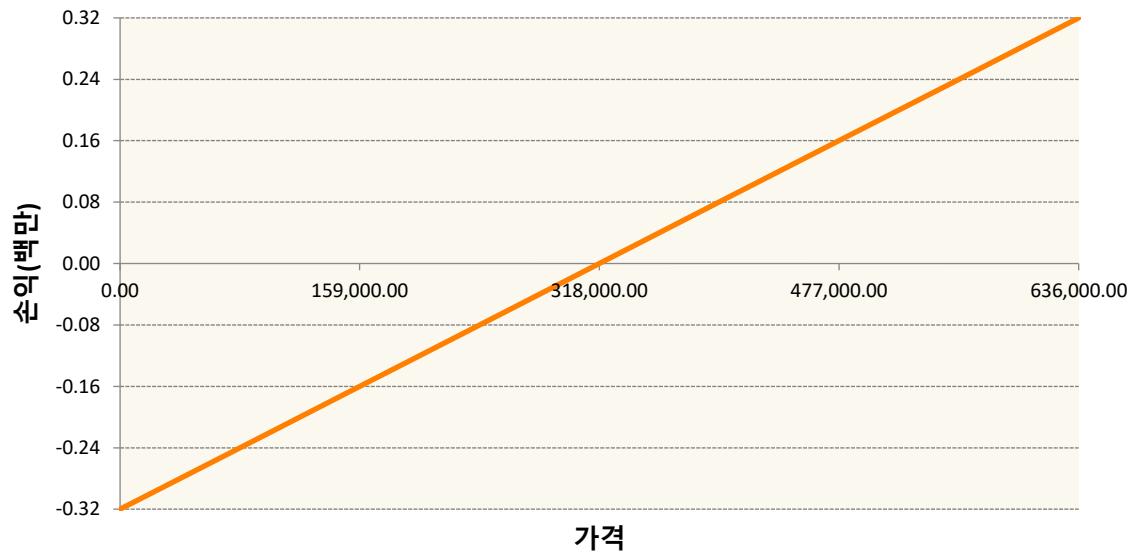
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



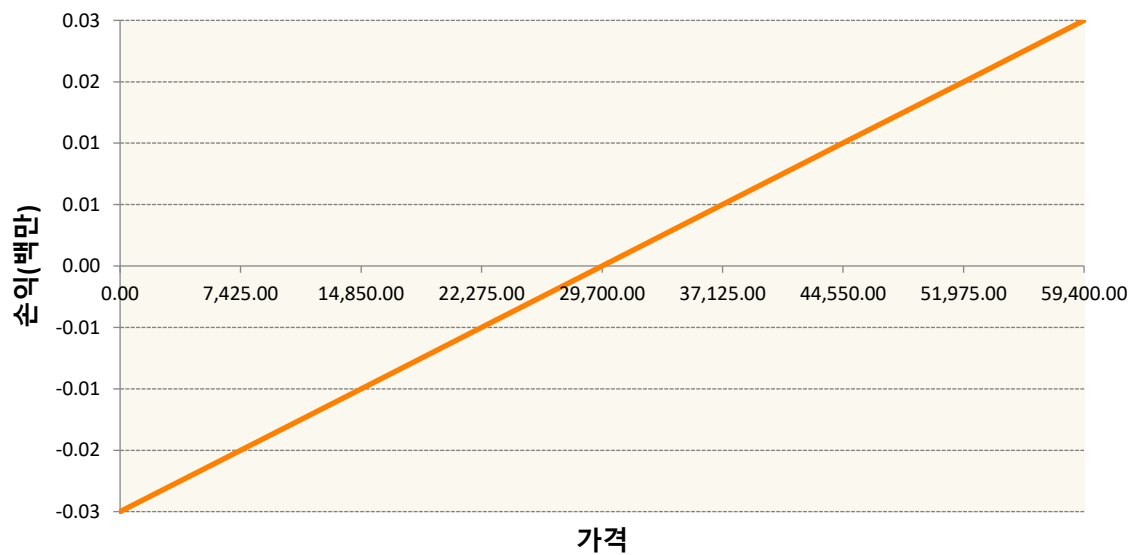
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



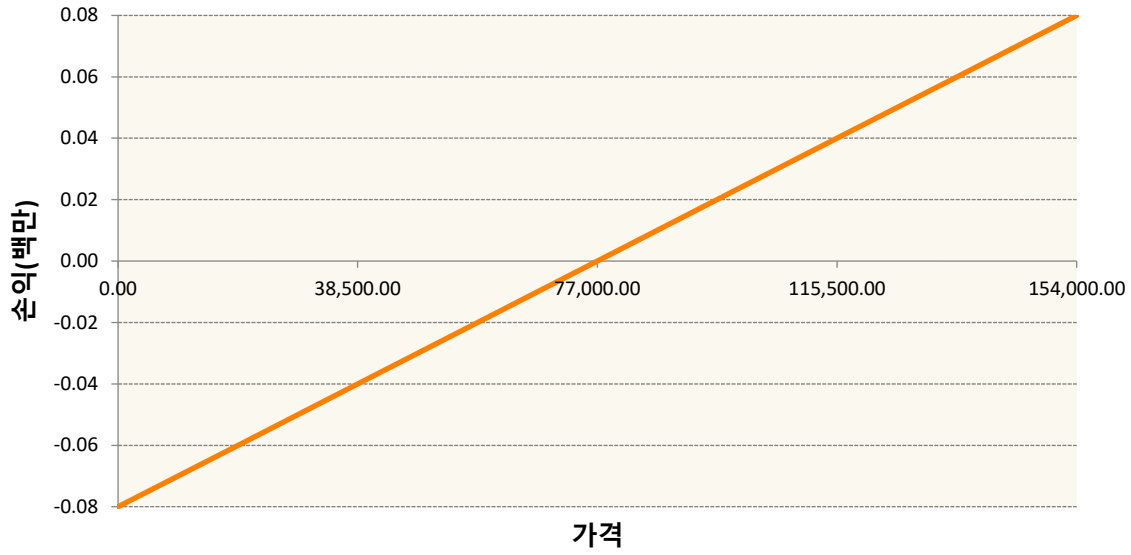
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



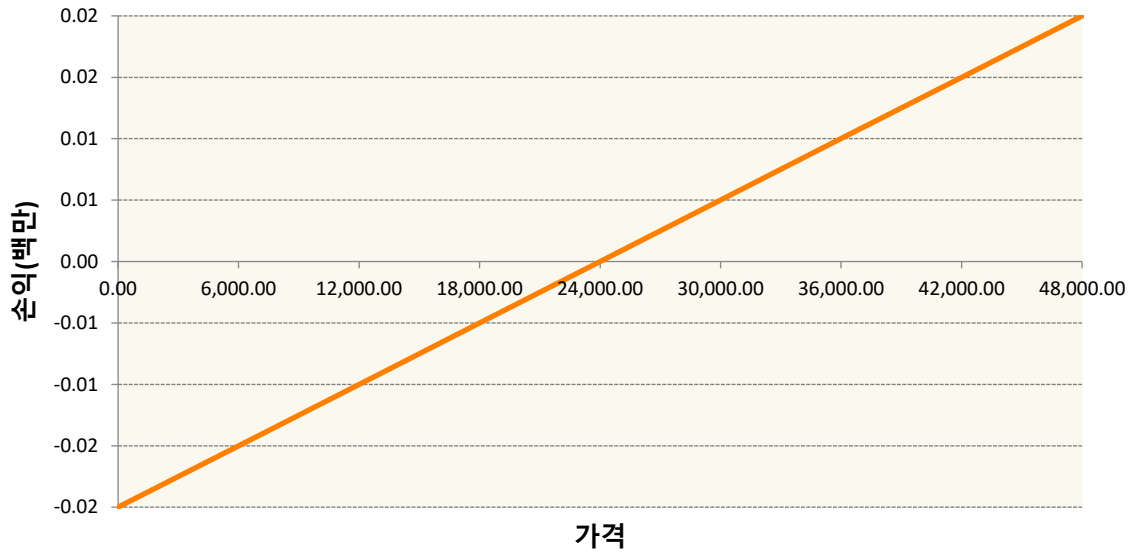
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



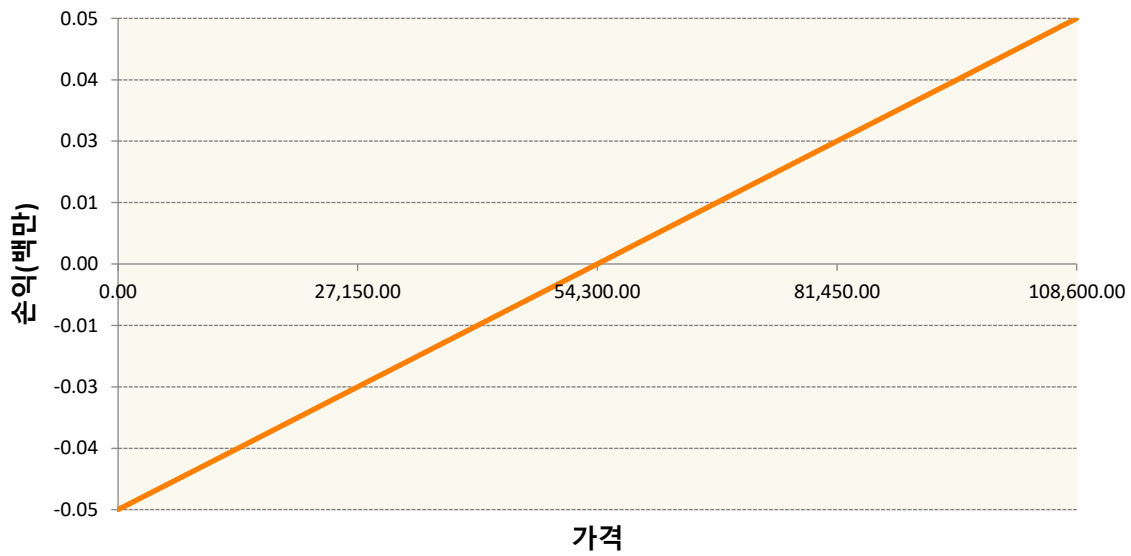
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



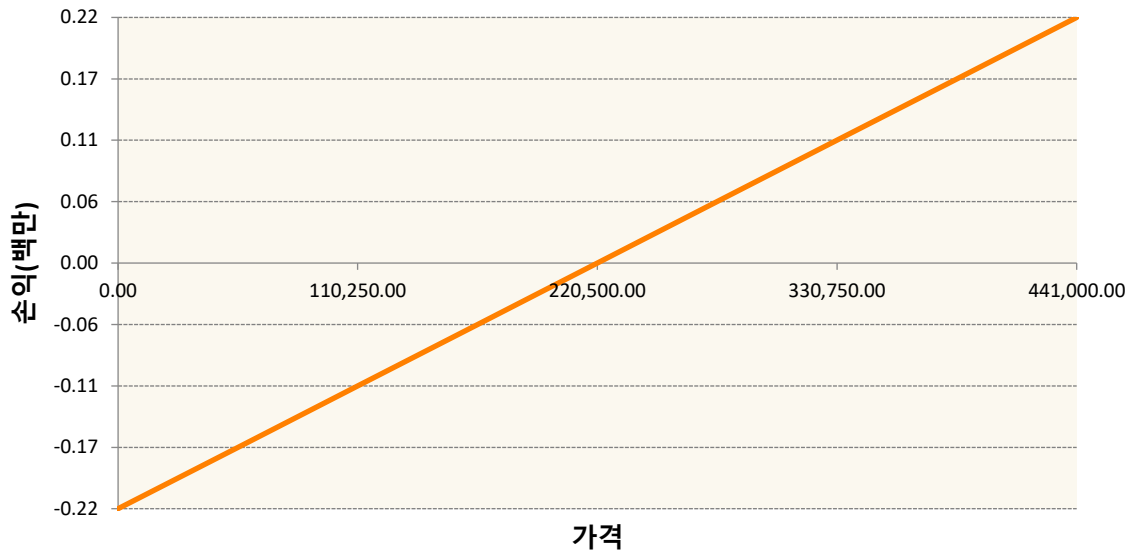
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	42
KR4105W70(2025-07 미니코스피200 선물	5
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물	1
KR4141W70(2025-07 SK이노베이션개별선물	1
KR4149W70(2025-07 HD현대인프라코어개별선물	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	6
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)

132

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

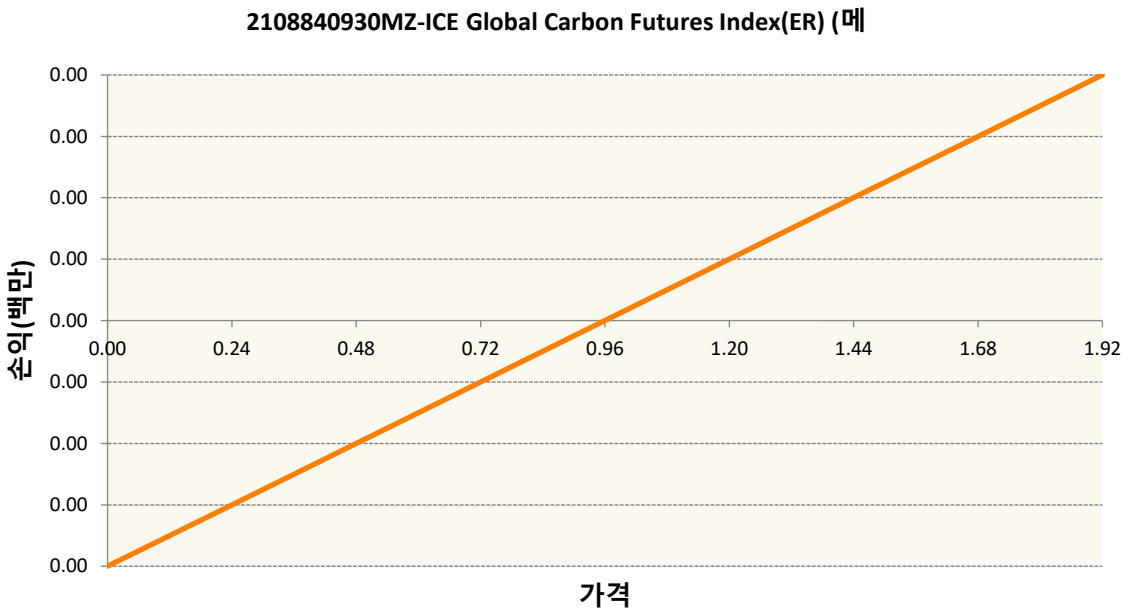
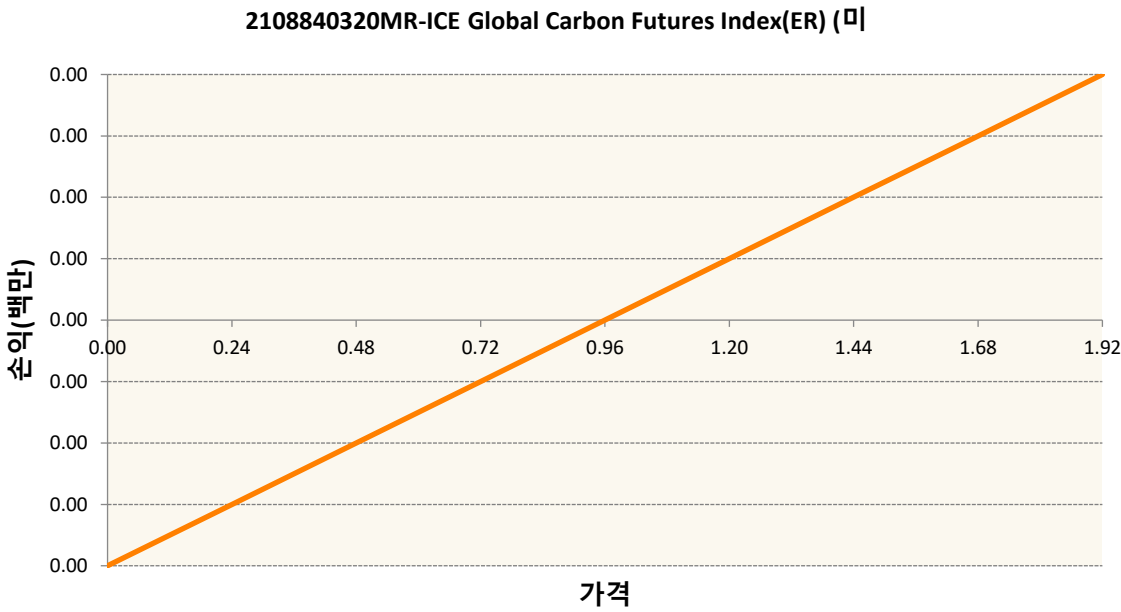
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	582
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	195

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	875

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

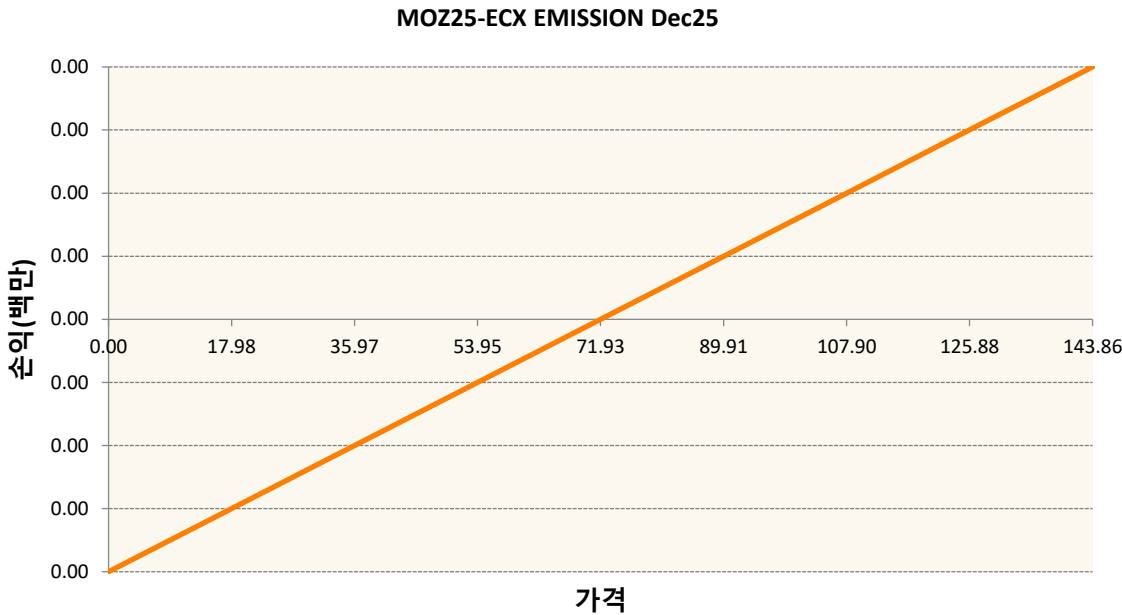
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,521	0	6,521	
누계	통화	선도	0	1,359	-1,359	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	1
FXW213F71C KRW/EUR 31-07-25E	109
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	523

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

(단위:백만원)

950

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

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)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	3
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	3

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

(단위:백만원)

25

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

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)	0.48
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	0.41
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.12

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

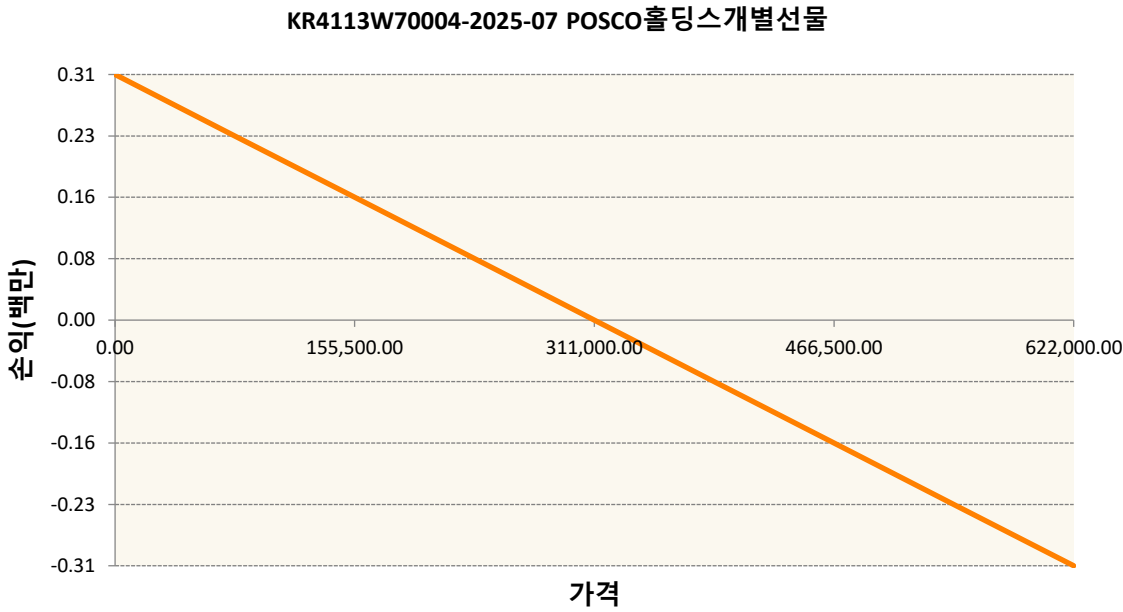
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4113W70(2025-07 POSCO홀딩스개별선물

0.5

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

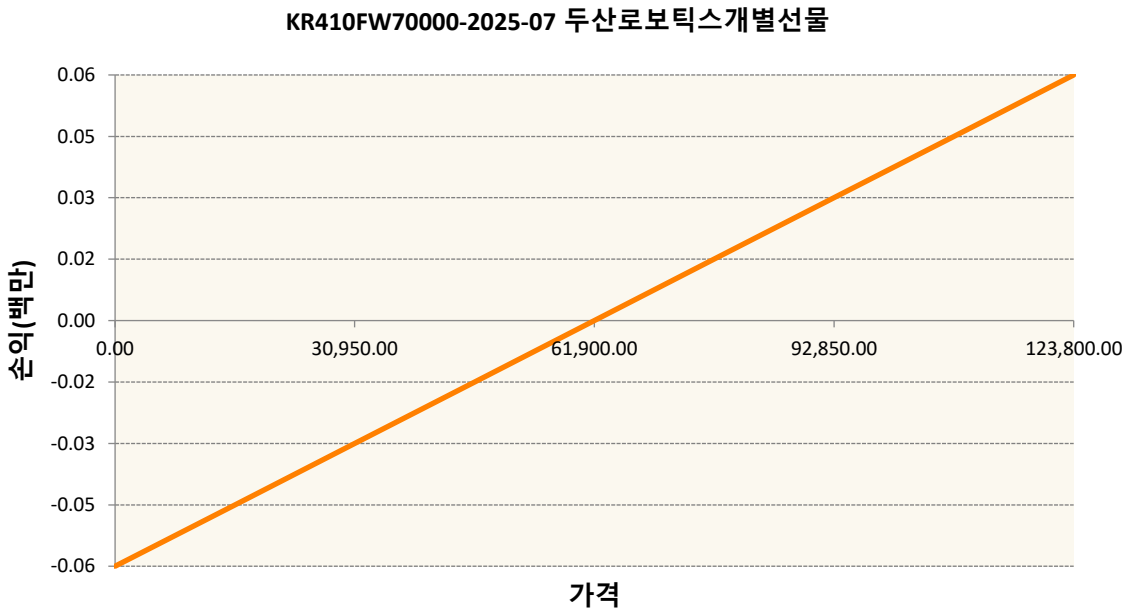
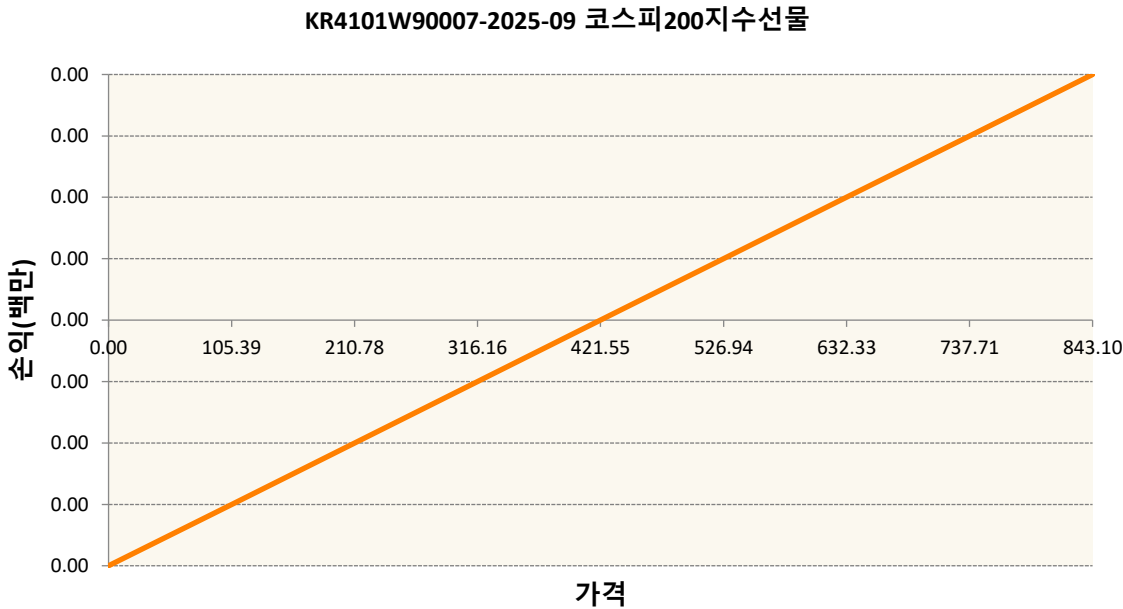
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

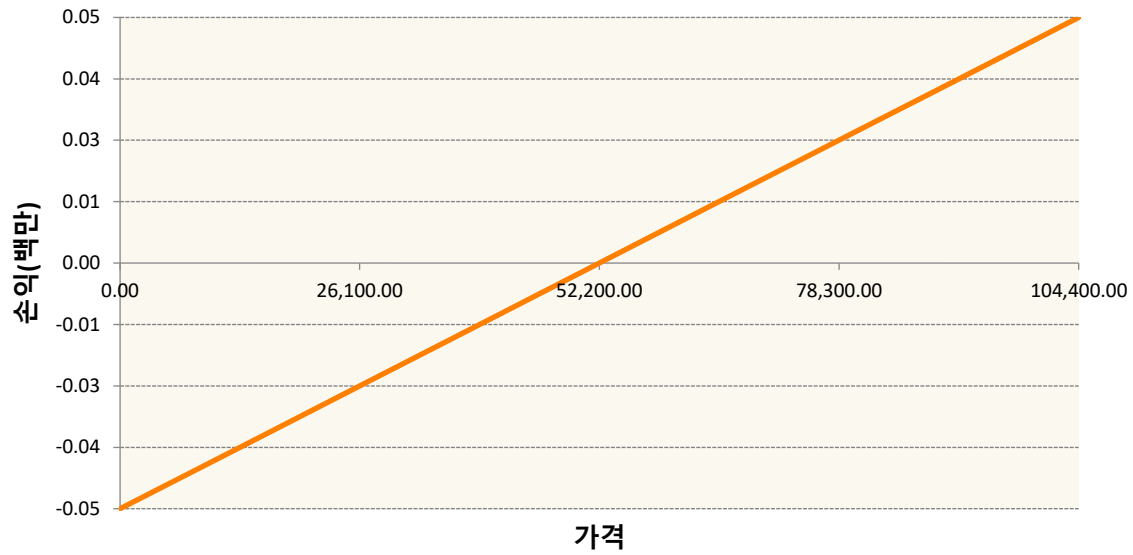
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	496	0	496	장내
누계	유가증권	선물	13,085	0	13,085	장내

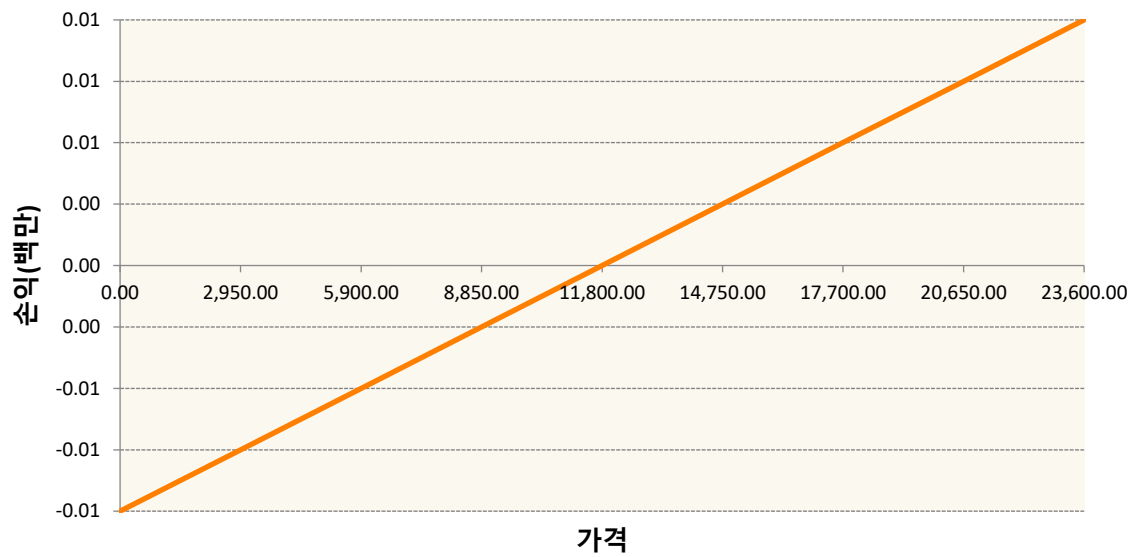
2. 만기시점의 손익구조



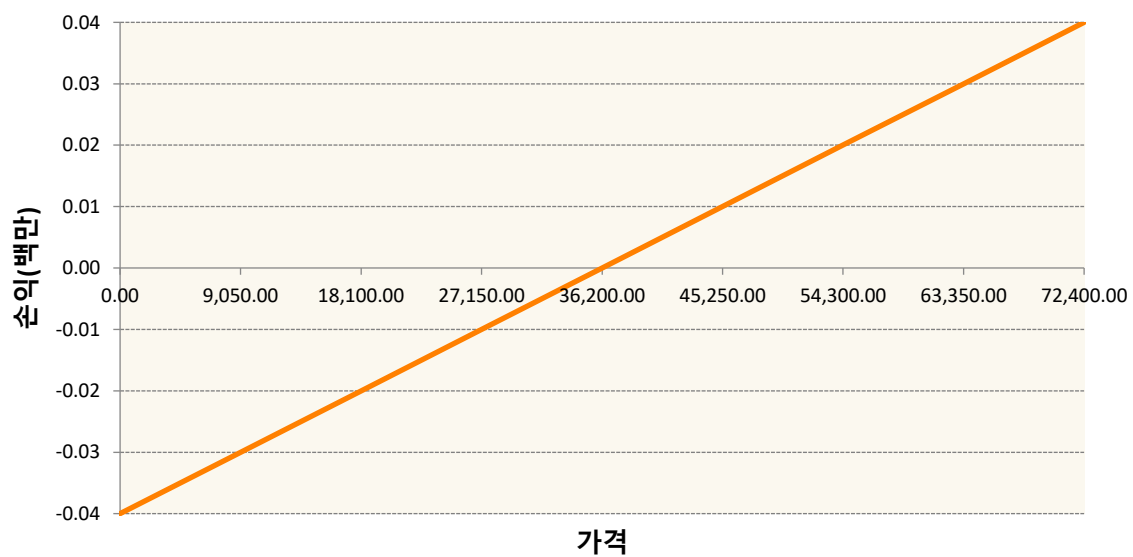
KR411RW70003-2025-07 한화비전개별선물



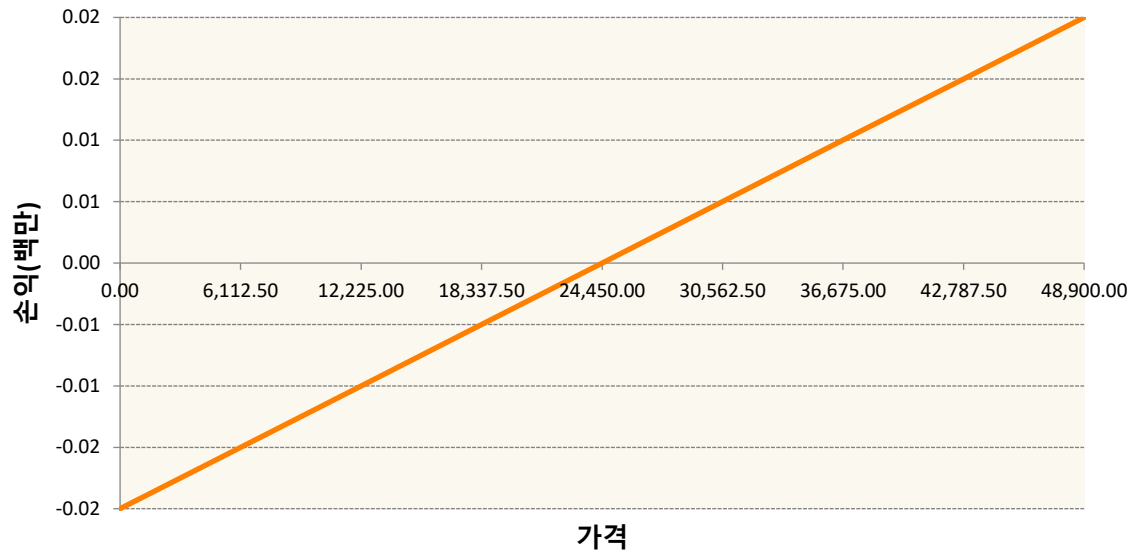
KR4149W70008-2025-07 HD현대인프라코어개별선물



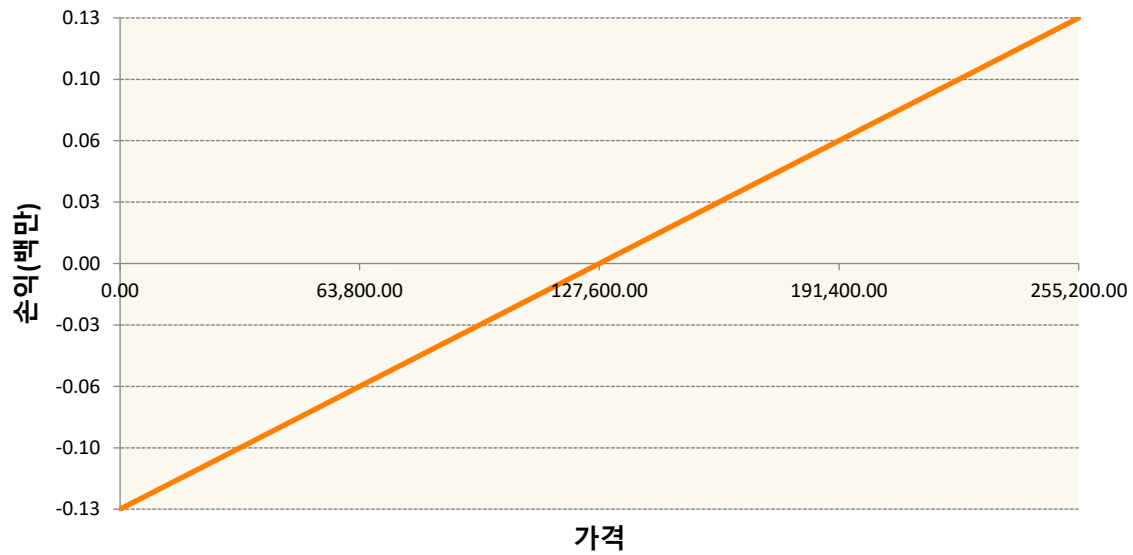
KR41CBW70003-2025-07 한화솔루션개별선물



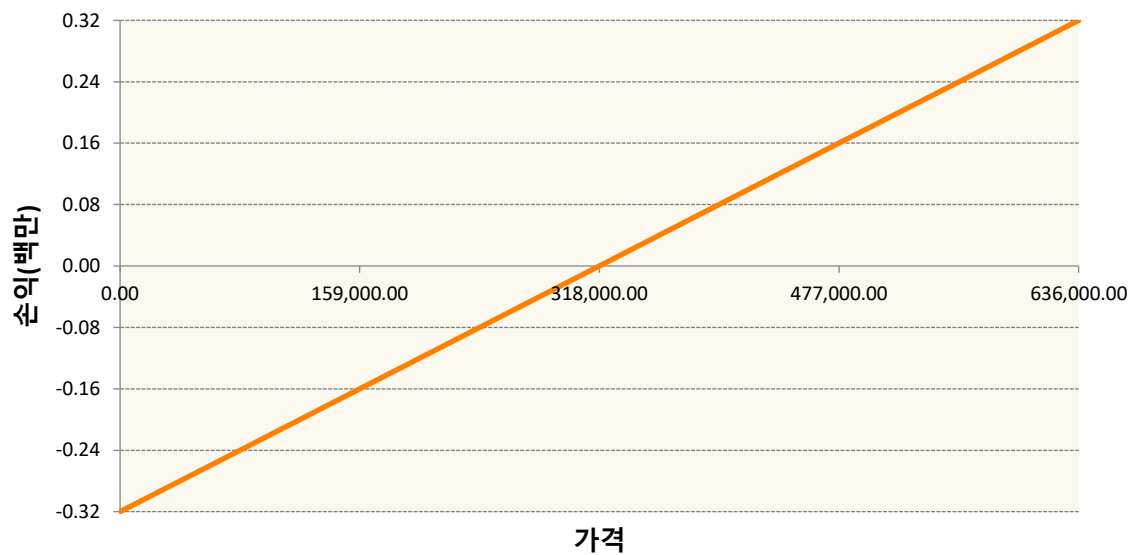
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



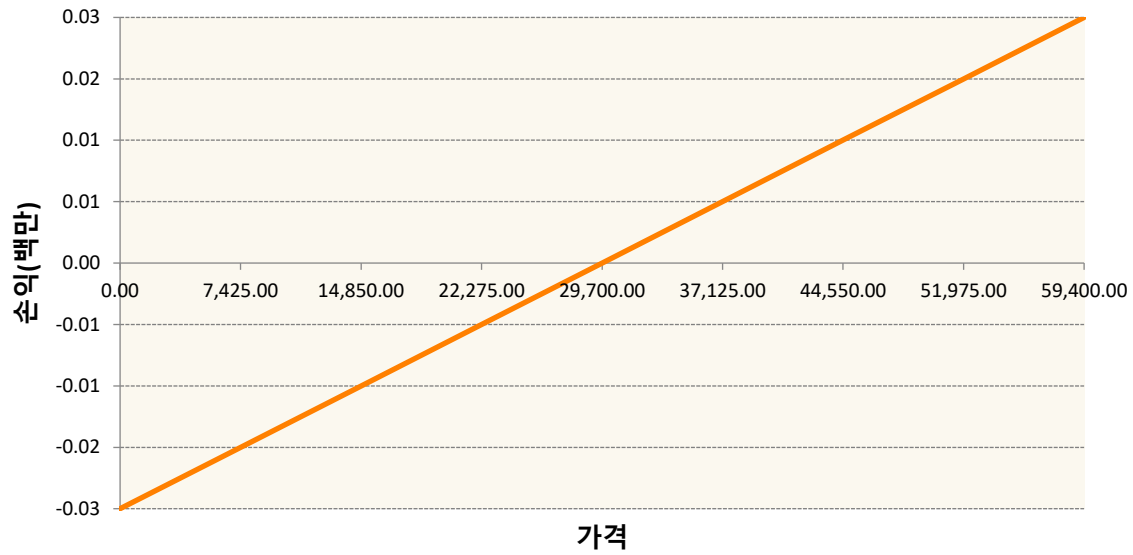
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



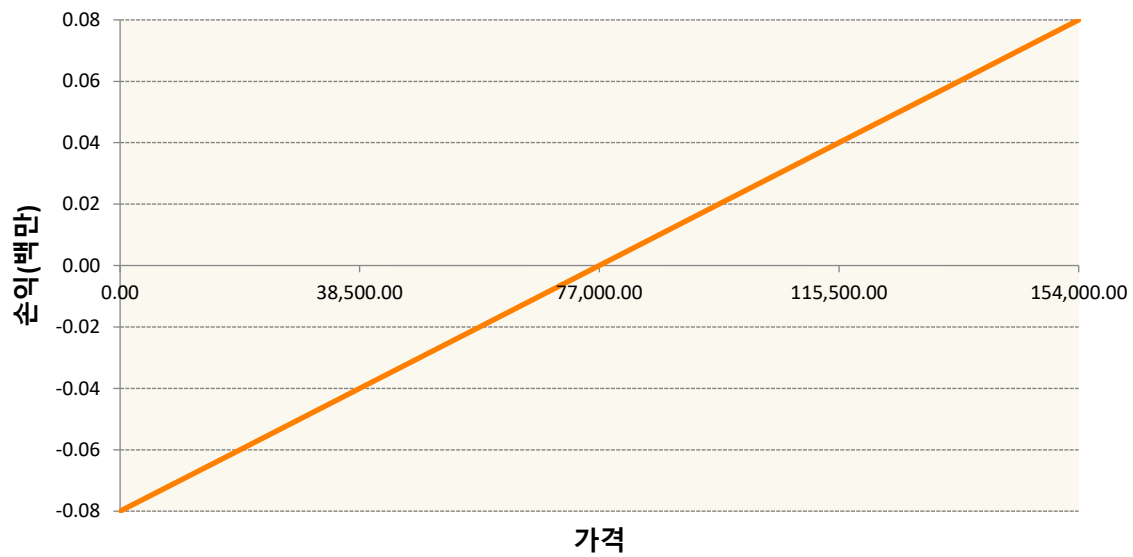
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



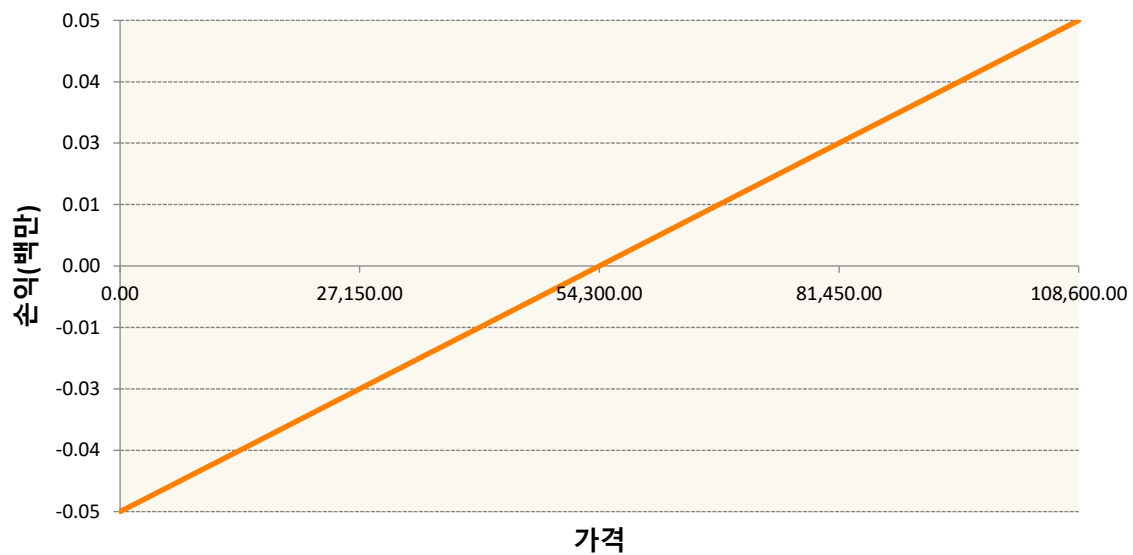
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



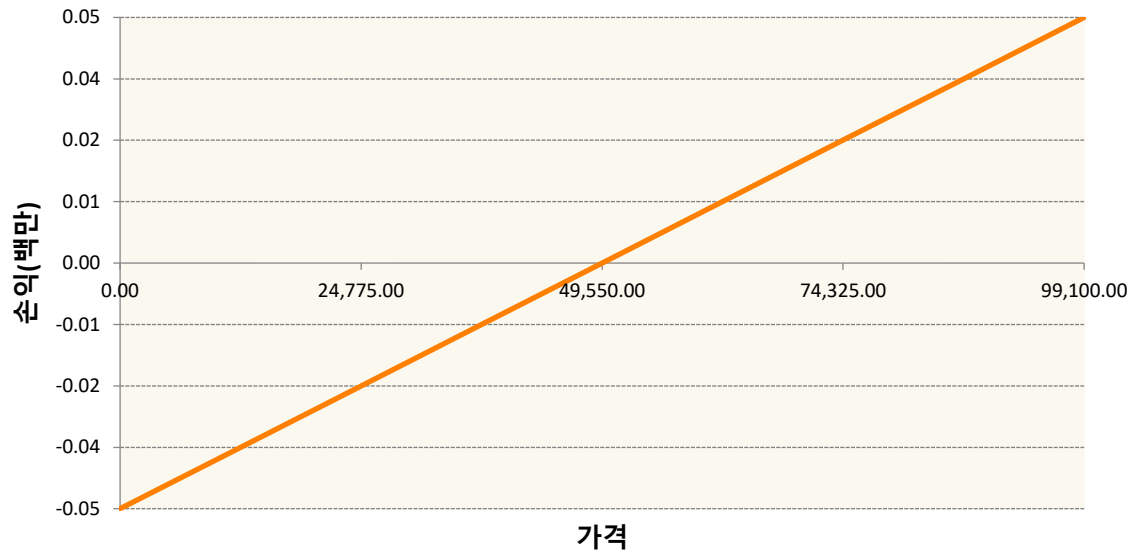
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



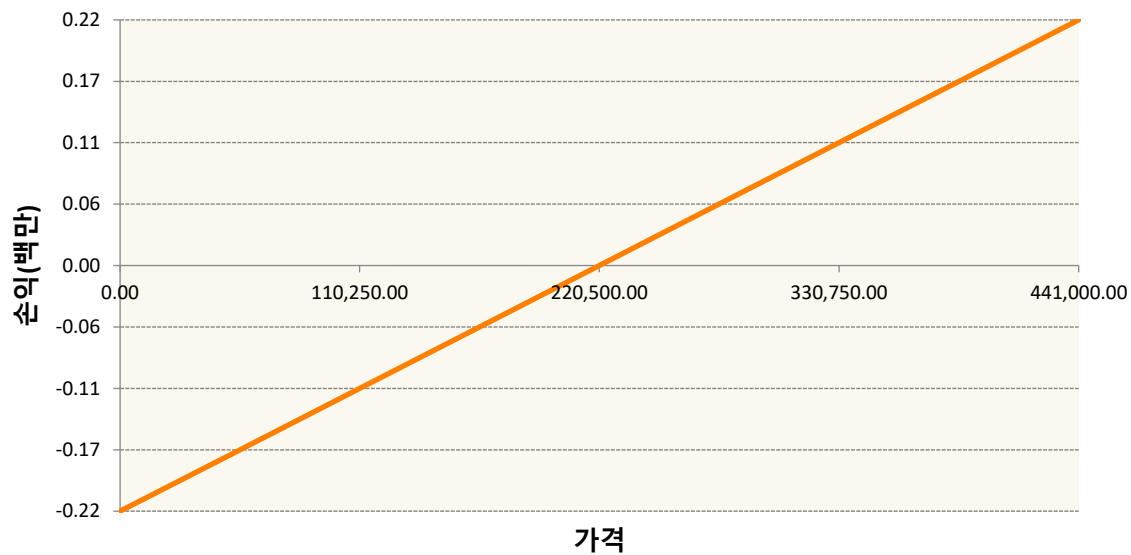
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	624
KR410FW70(2025-07 두산로보틱스개별선물	12
KR411RW70(2025-07 한화비전개별선물	18
KR4149W70(2025-07 HD현대인프라코어개별선물	15
KR41CBW70(2025-07 한화솔루션개별선물	36
KR41CNW70 2025-07 포스코DX개별선물	13
KR41E8W70(2025-07 포스코퓨처엠개별선물	36
KR41F5W70(2025-07 LG에너지솔루션개별선물	116
KR41F6W70(2025-07 카카오뱅크개별선물	103
KR41F7W70(2025-07 카카오페이개별선물	22
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	14
KR41G0W70(2025-07 씨에스원드개별선물	8

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

(단위:백만원)

2,020

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

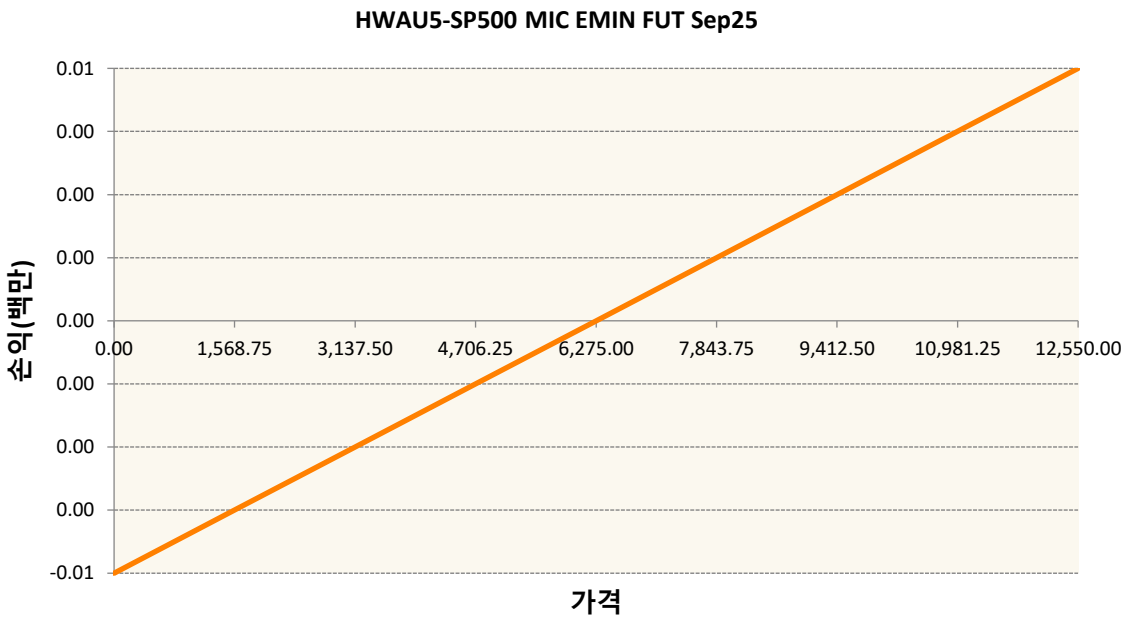
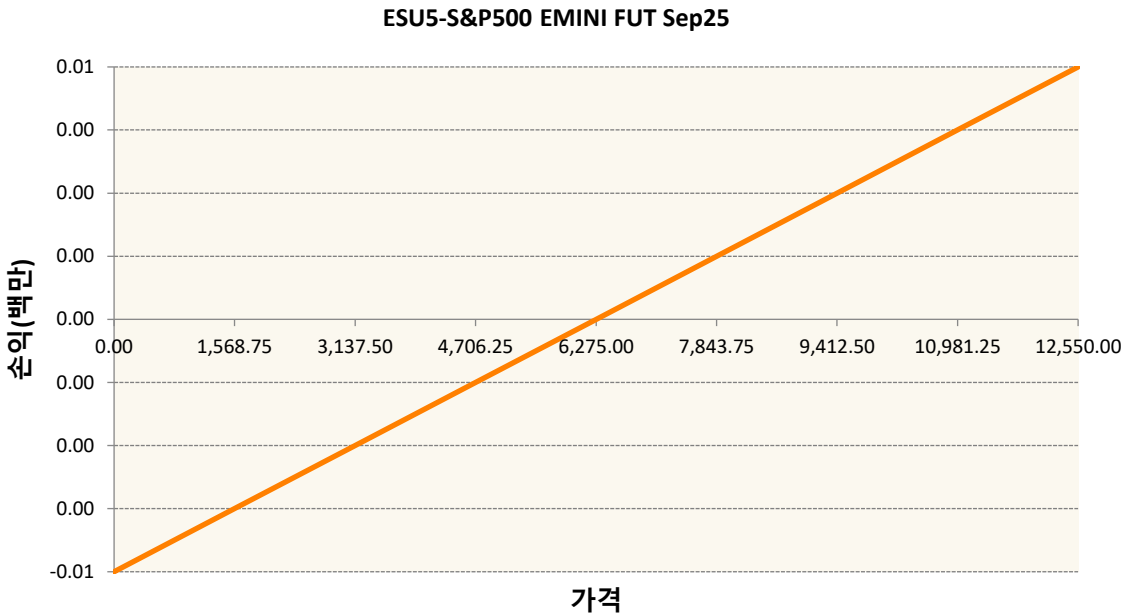
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	30,283	0	30,283	
누계	지수	선물	1,427	0	1,427	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,423
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	114

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,250

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

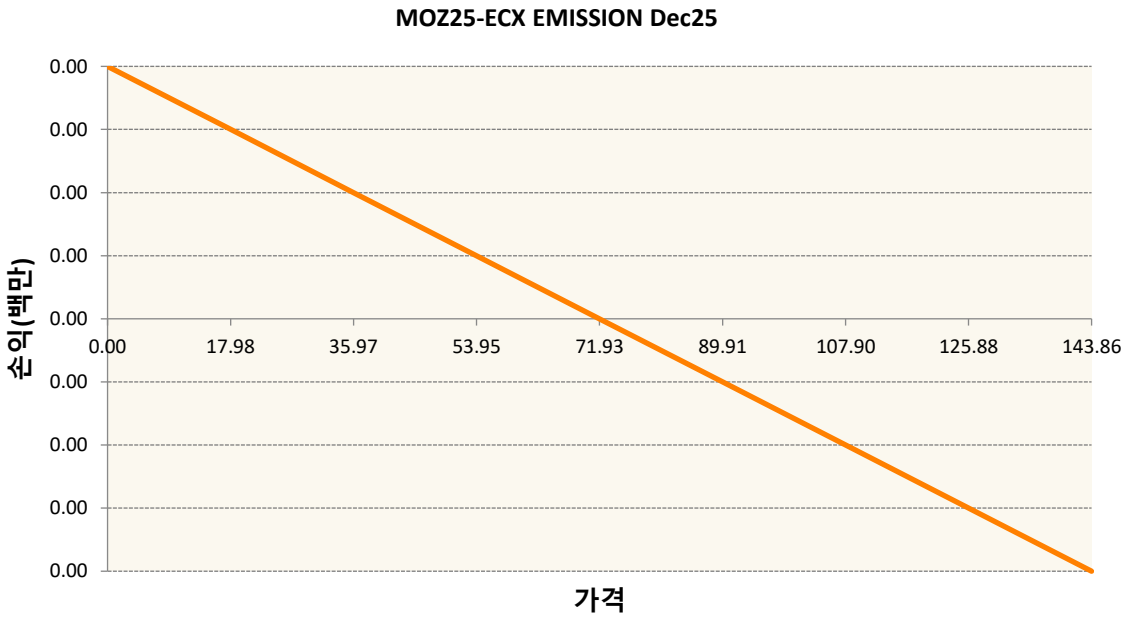
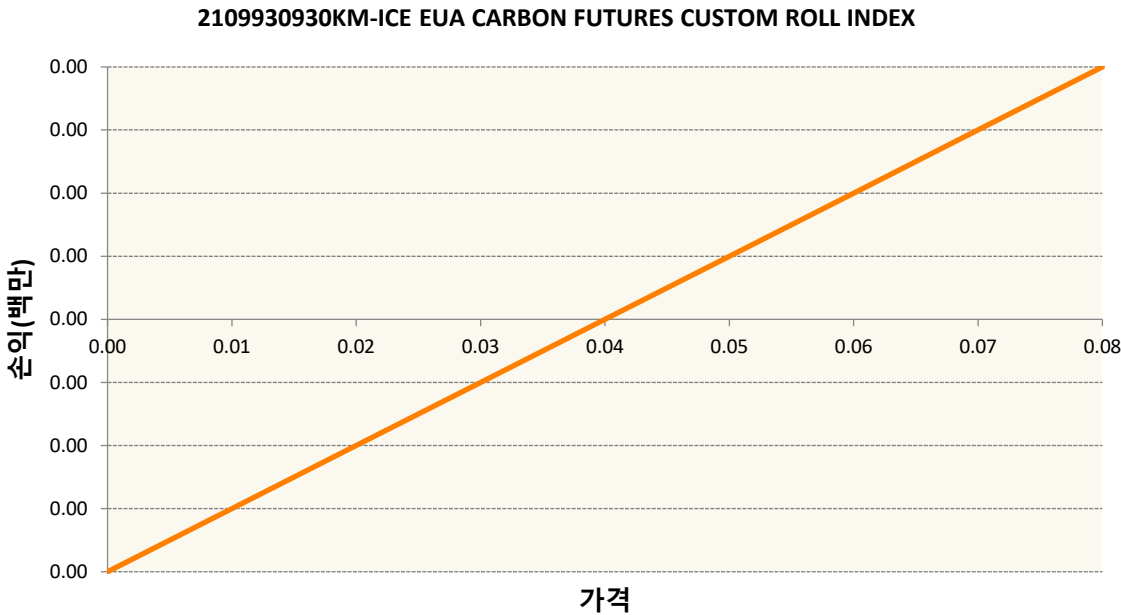
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	16	4,706	-4,691	
누계	통화	선도	0	1,006	-1,006	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F71CKRW/EUR 31-07-25E	3
FXW213F71CKRW/EUR 31-07-25E	78
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	377

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

686

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

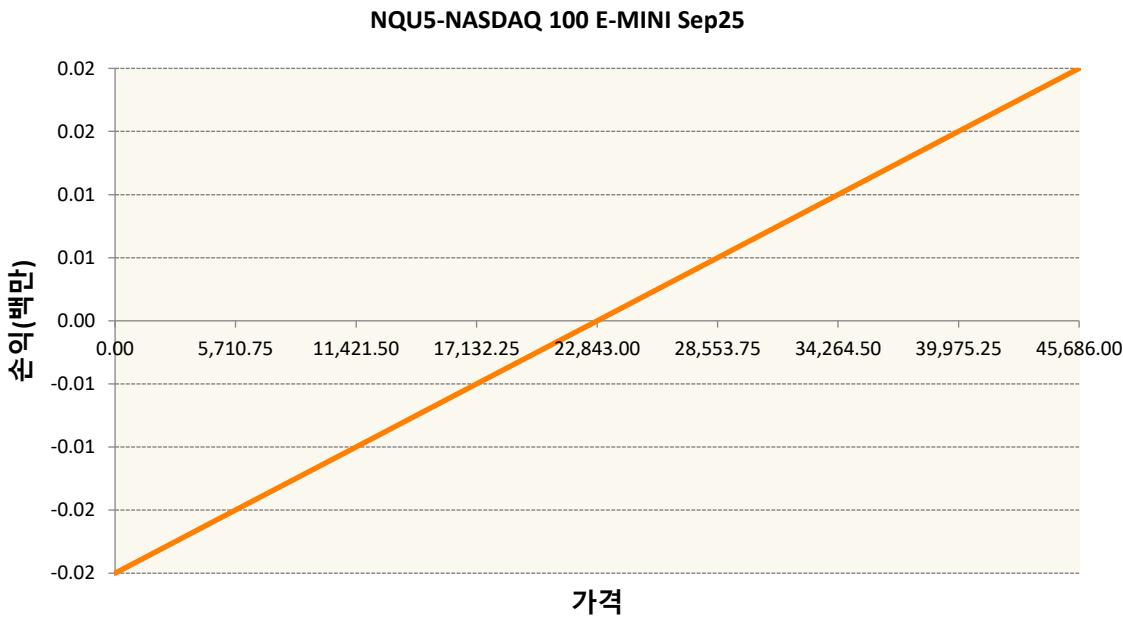
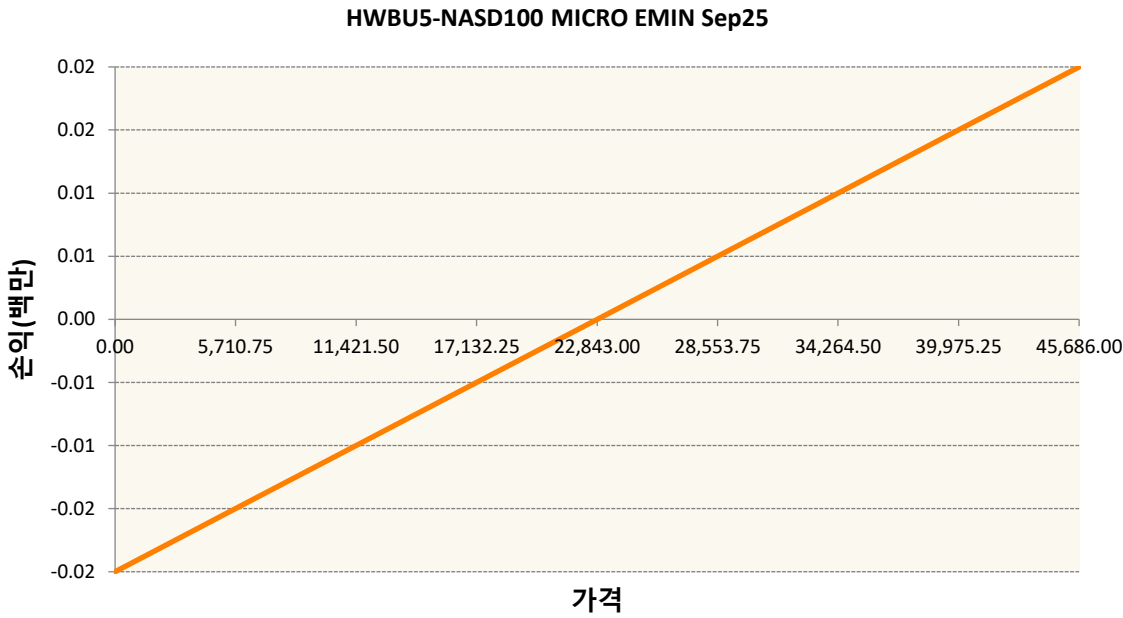
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,228	0	13,228	
누계	지수	선물	313	0	313	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25		25
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		1,058

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,245

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	108,014	0	108,014	장외
누계	지수	스왑	260,134	0	260,134	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,128
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,241
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,900
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,618

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

(단위:백만원)

10,716

공시일	2025-07-04
기준일	2025-07-03

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	2025-07-04
기준일	2025-07-03

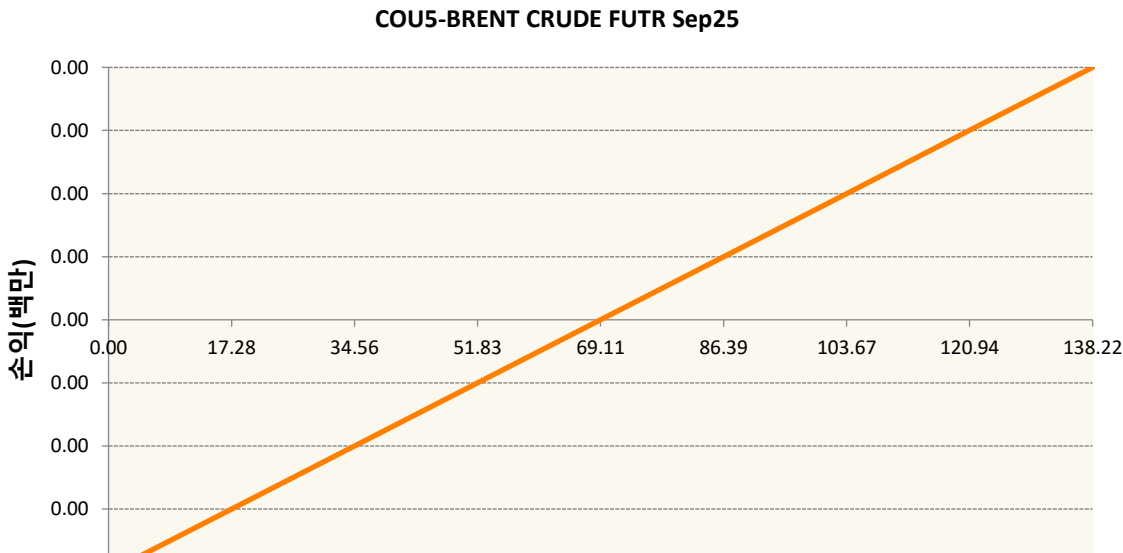
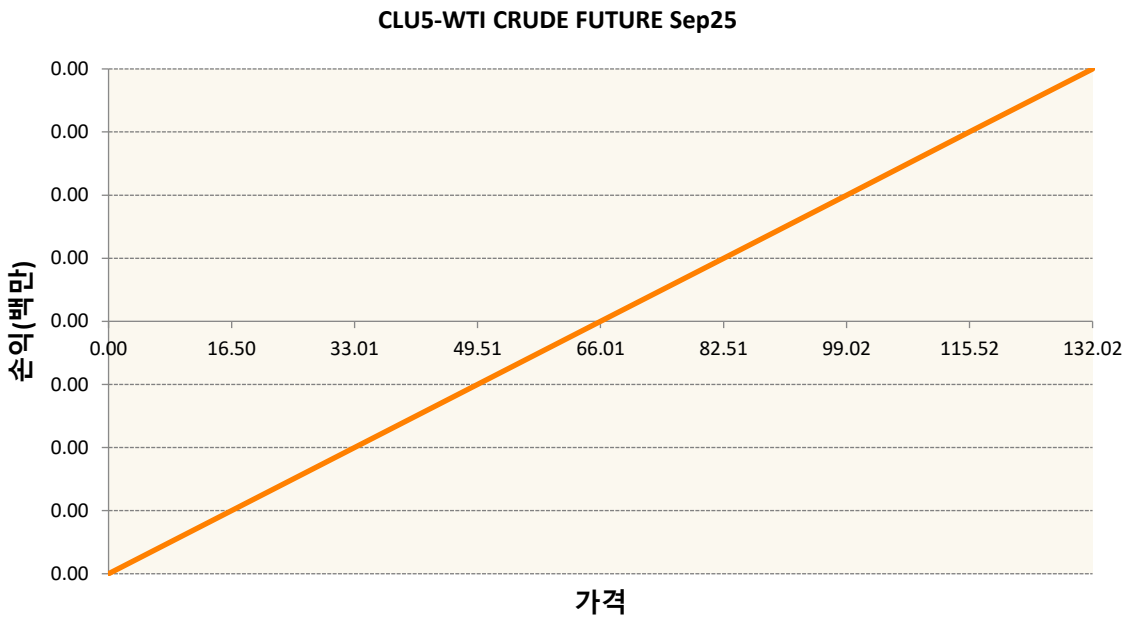
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

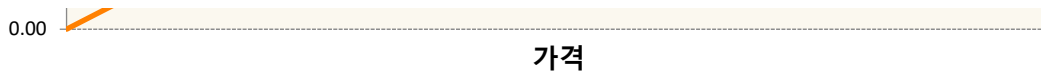
1. 계약금액

(단위:백만원)

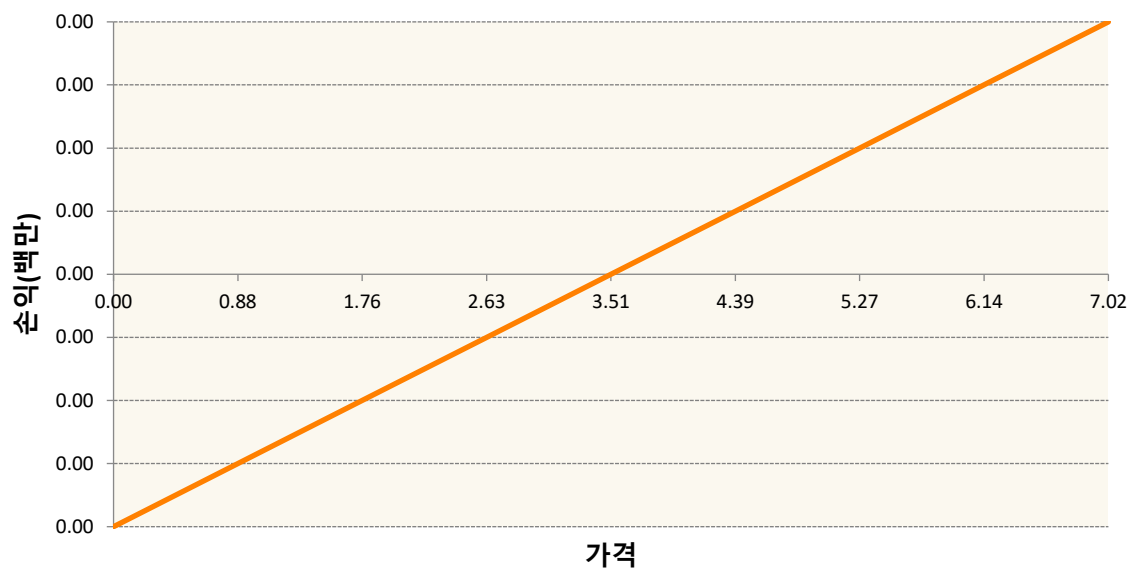
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	334	0	334	
누계	유가증권	선물	286	0	286	
누계	통화	선물	0	109	-109	장내

2. 만기시점의 손익구조

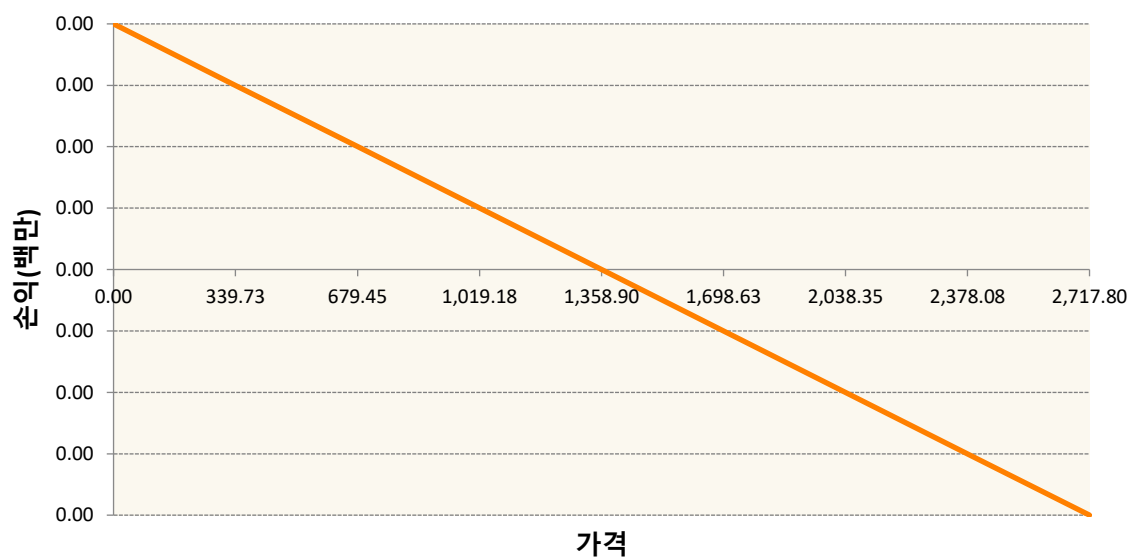




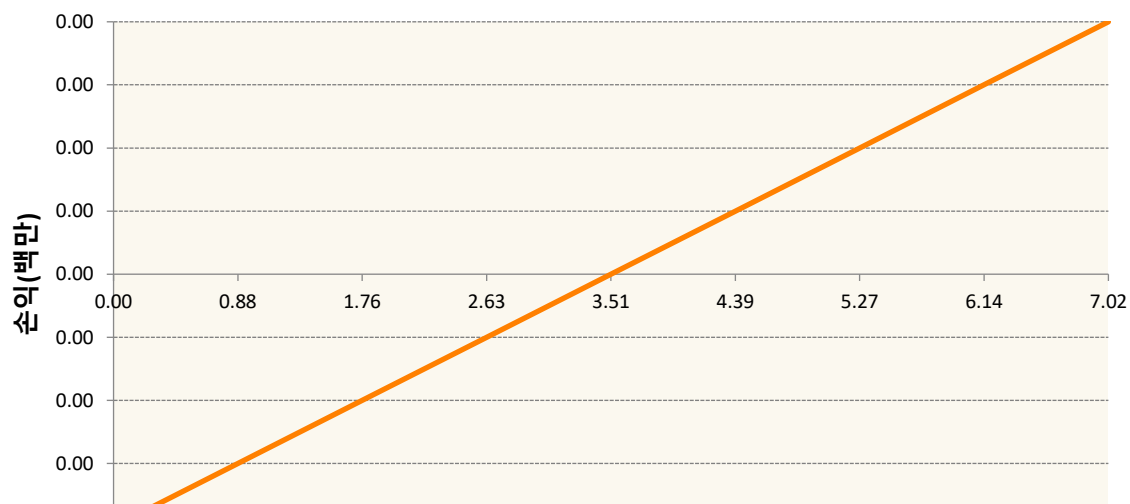
EOU5-E-MINI NATURAL GAS Sep25

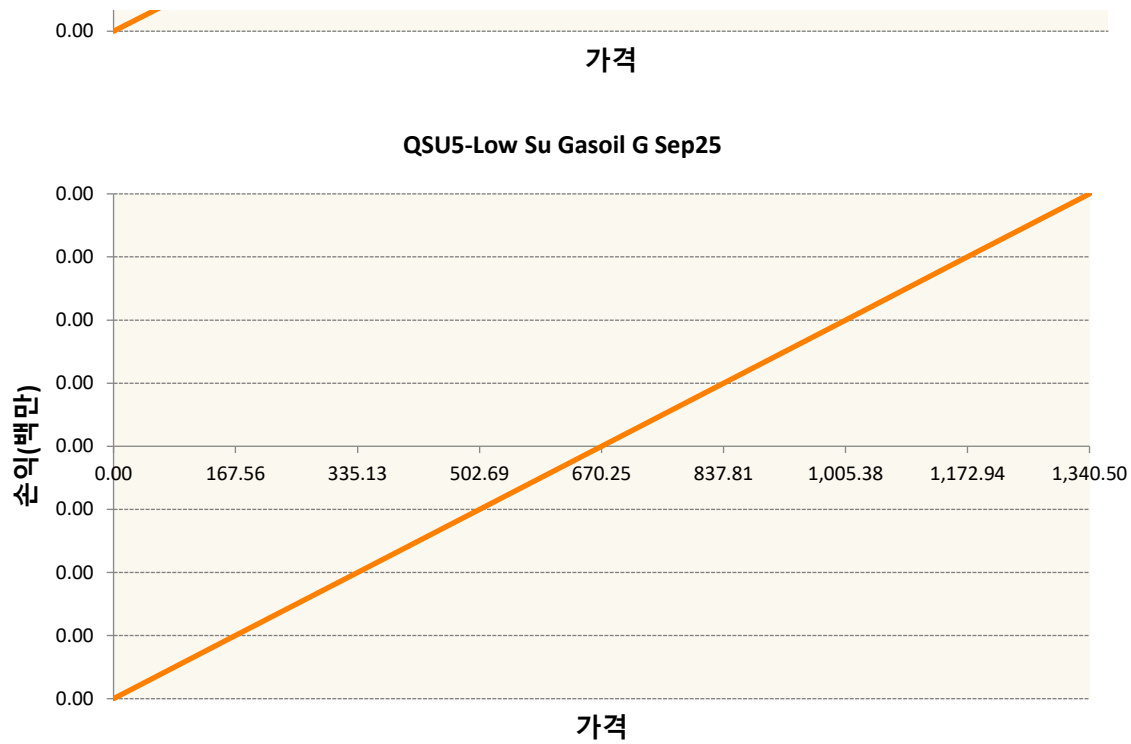


KR4175W70003-2025-07 달러선물



NGU25-NATURAL GAS FUTR Sep25





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU5	WTI CRUDE FUTURE Sep25	7
COU5	BRENT CRUDE FUTR Sep25	16
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)

124