

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

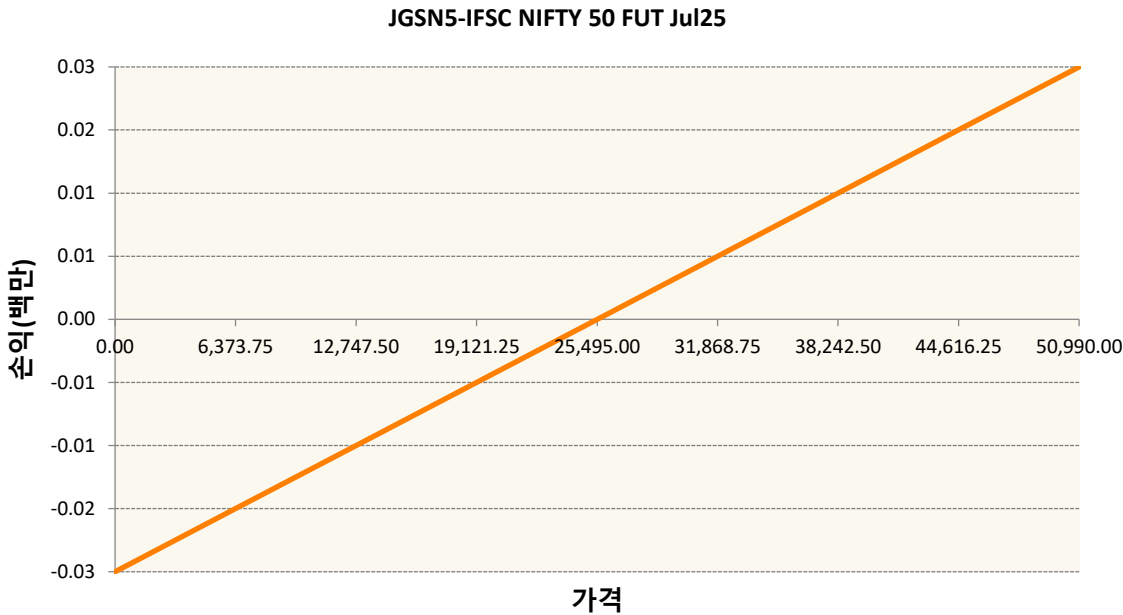
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	625	0	625	

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	2025-07-07
기준일	2025-07-04

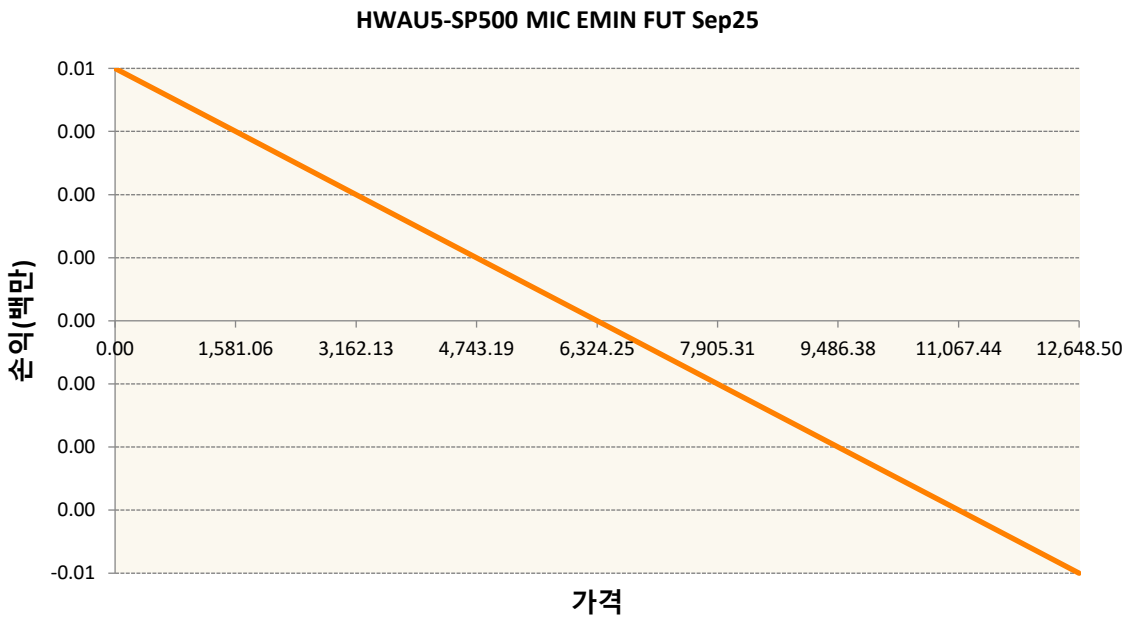
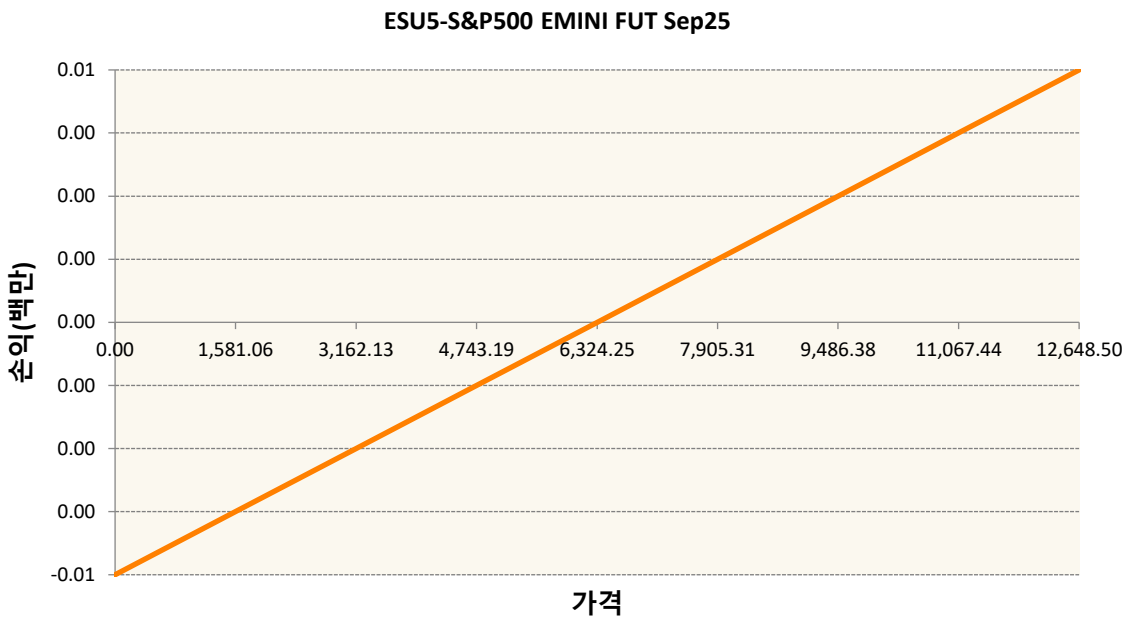
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	436	0	436	
누계	지수	선물	0	119	-119	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	2025-07-07
기준일	2025-07-04

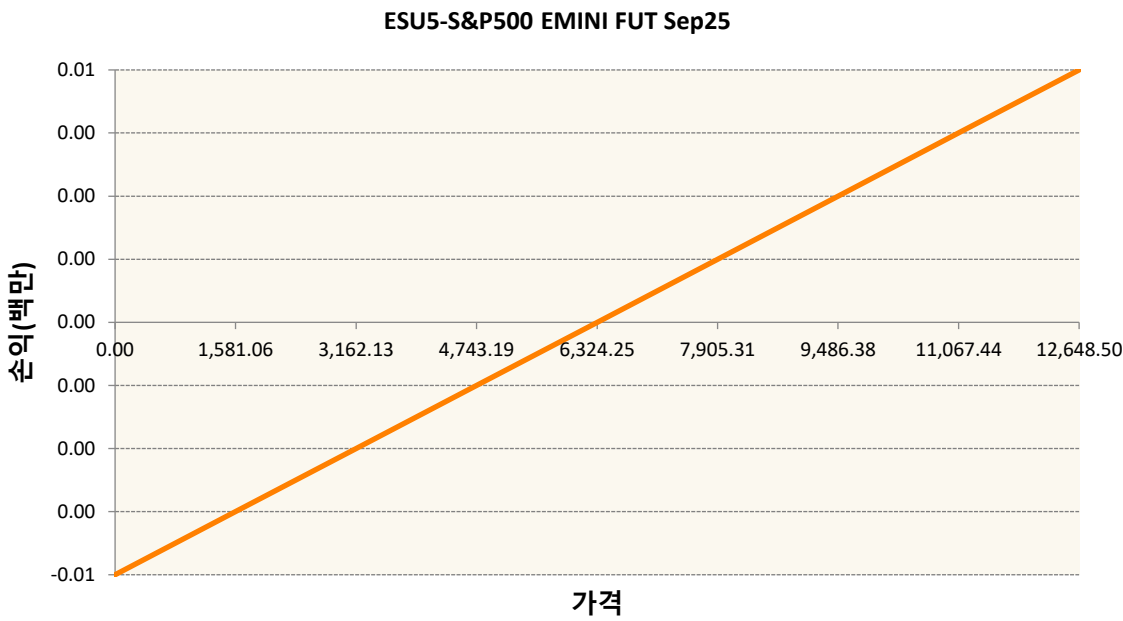
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,309	0	1,309	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	105
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

93

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

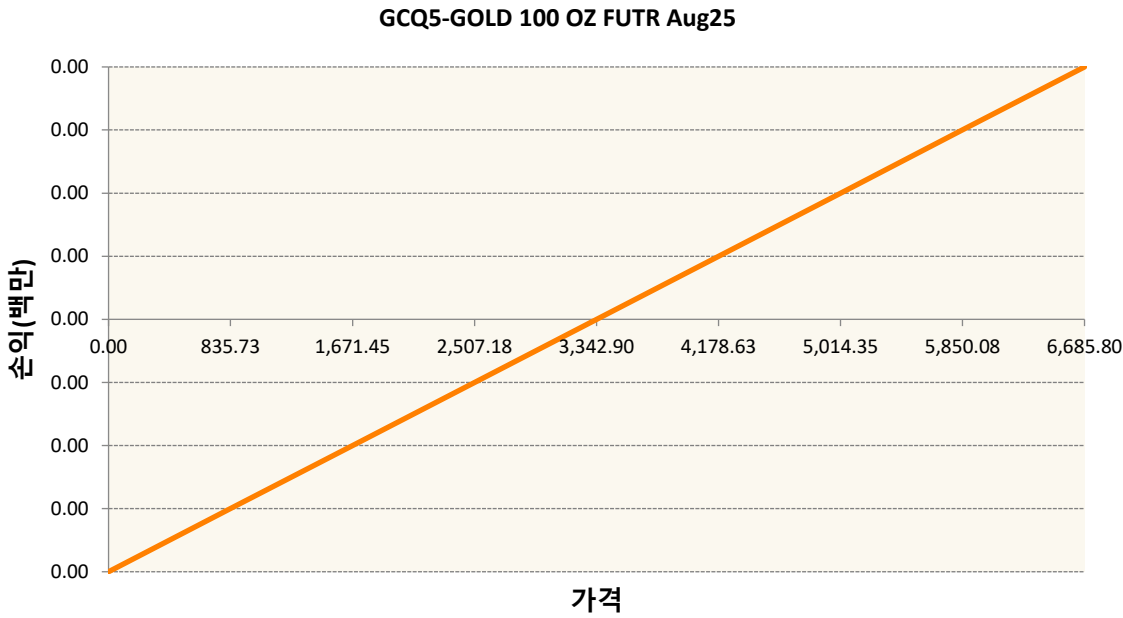
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,839	0	1,839	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 07/11/25 C310 EQUITY	1
GQC5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25	147

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

(단위:백만원)

127

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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)

AUPLTRUSC1PLTR US 07/11/25 C137 EQUITY	11
AUPLTRUSP1PLTR US 07/11/25 P137 EQUITY	6

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

(단위:백만원)

71

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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)

AOTLTUSC8TLT US 07/11/25 C88 EQUITY

0.49

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

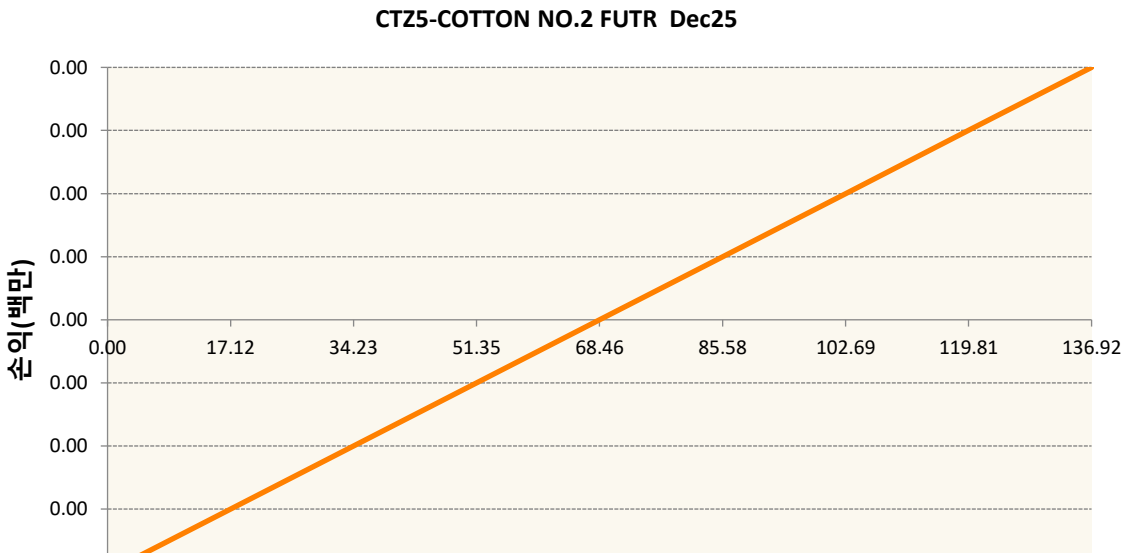
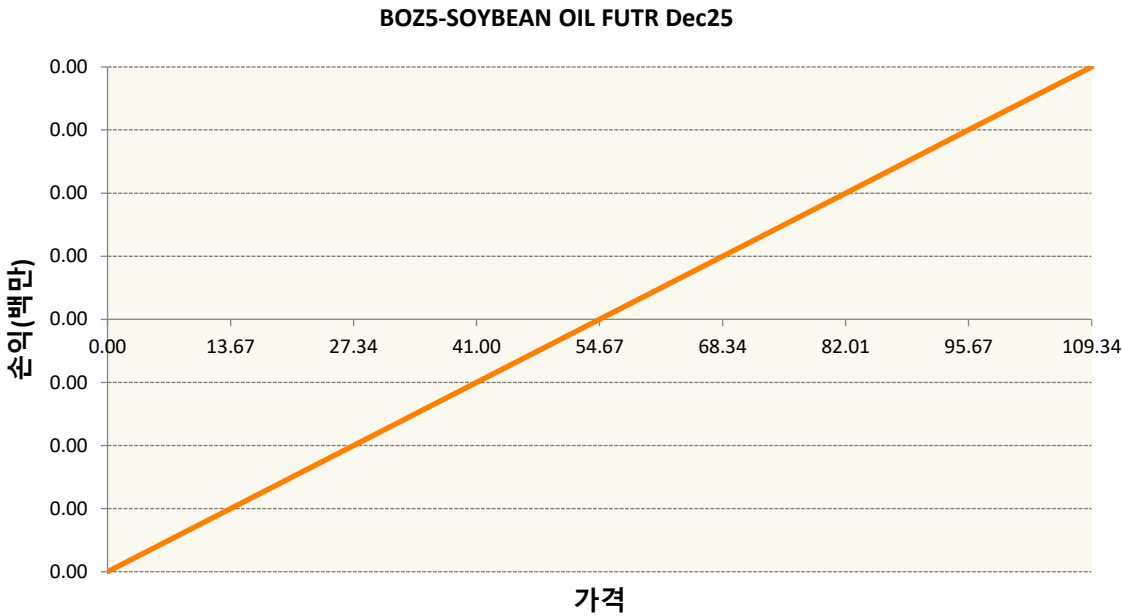
포커스농산물모(채권-파생형)

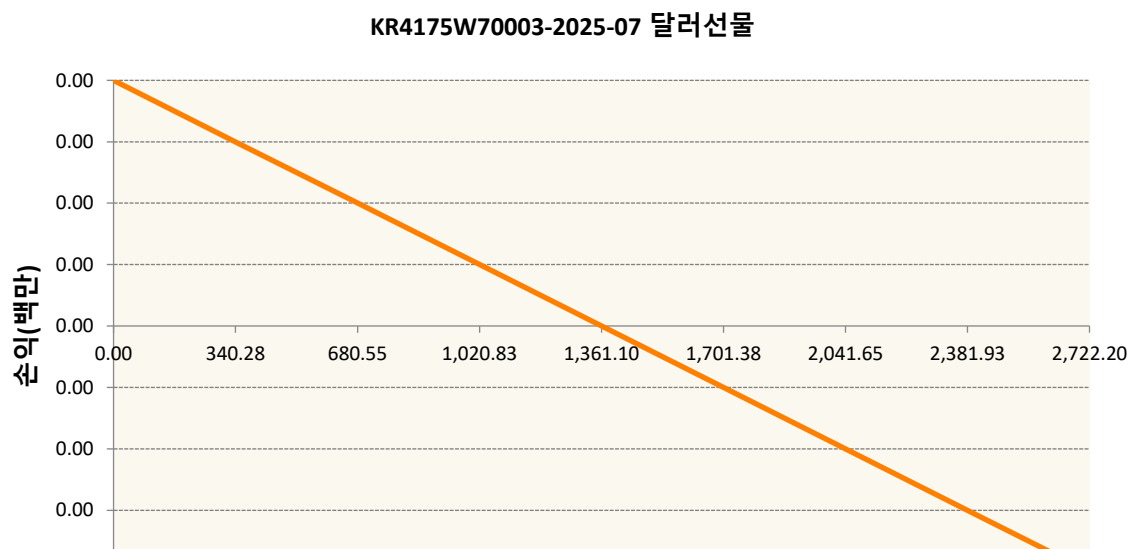
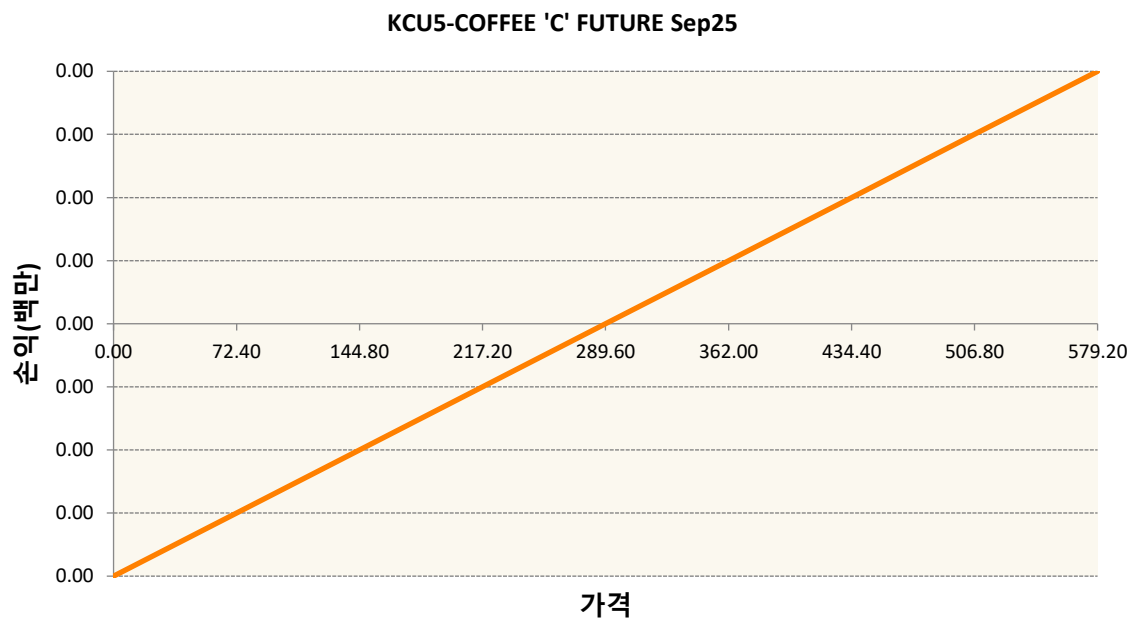
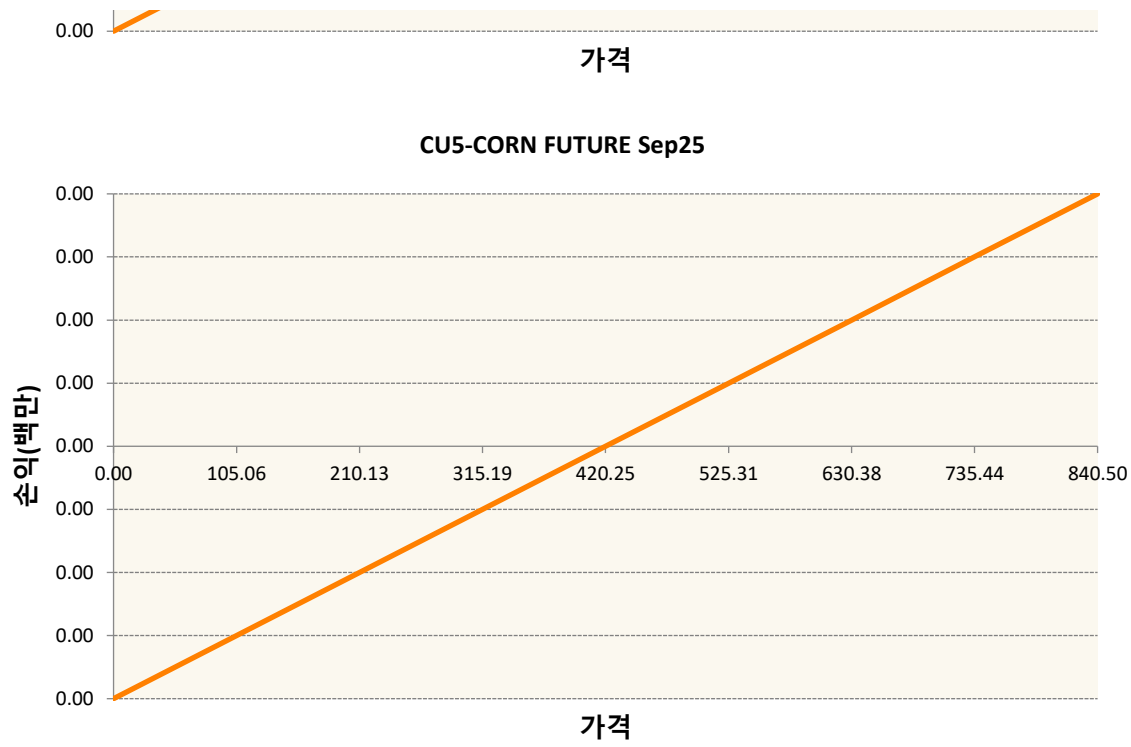
1. 계약금액

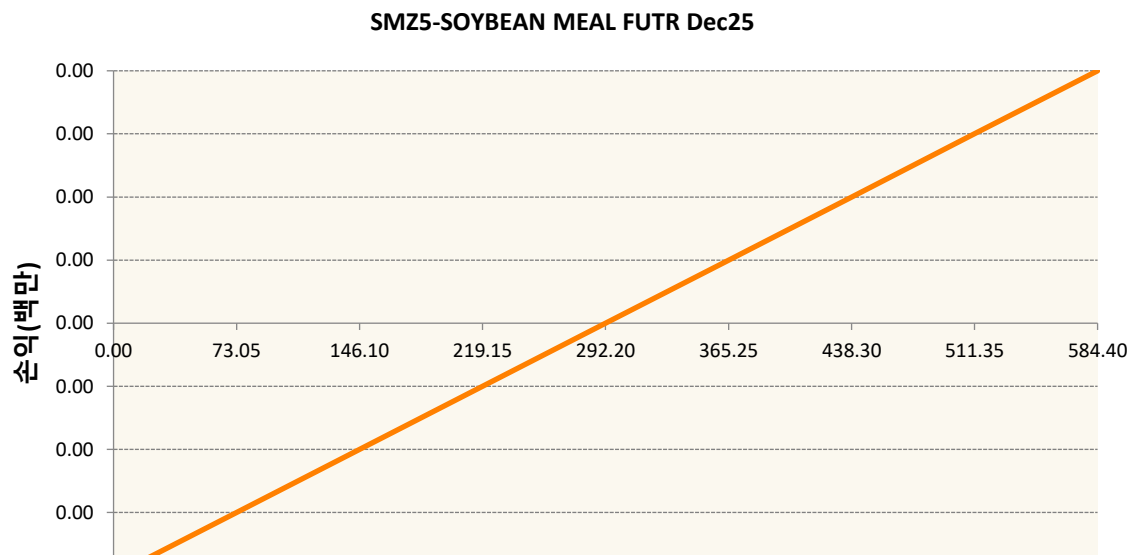
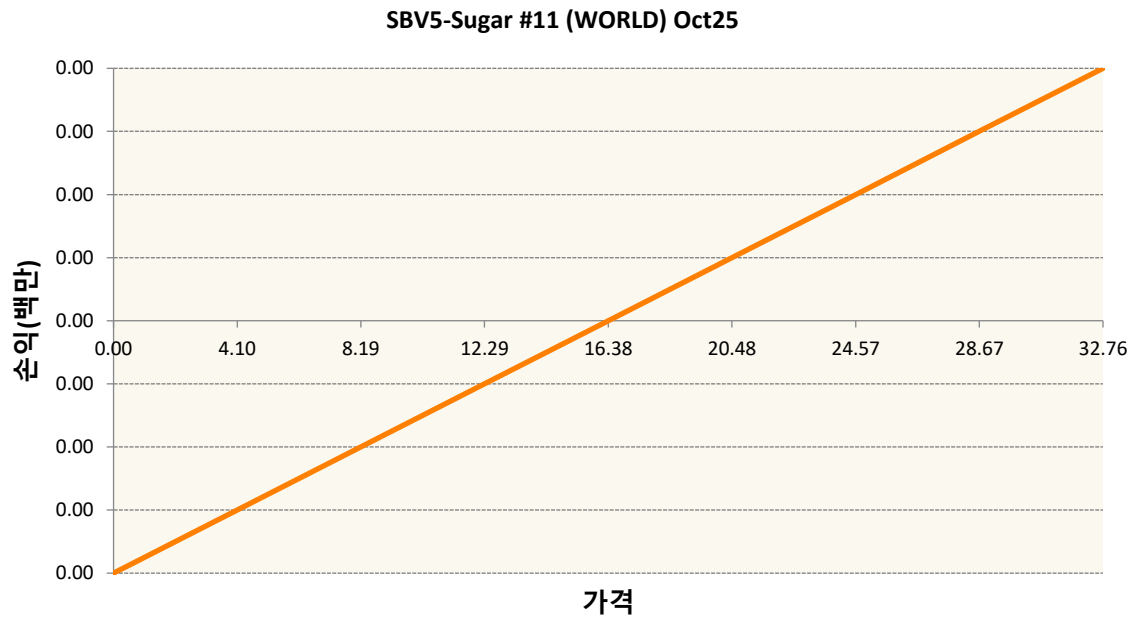
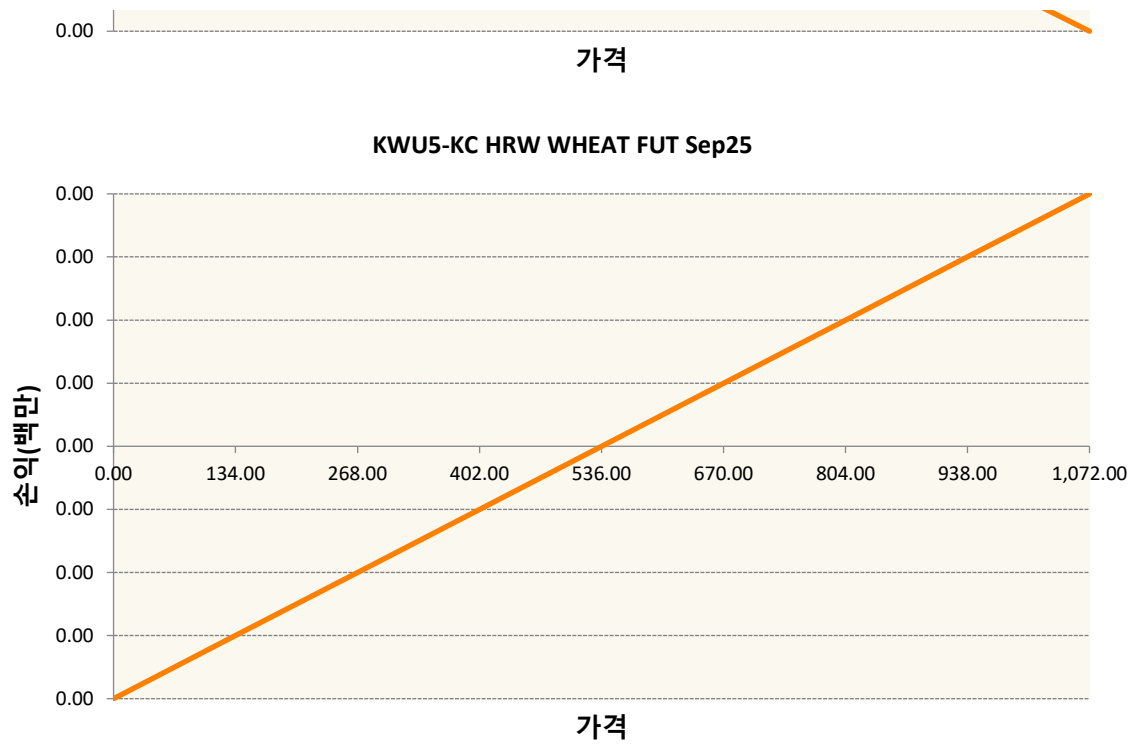
(단위:USD 백만)

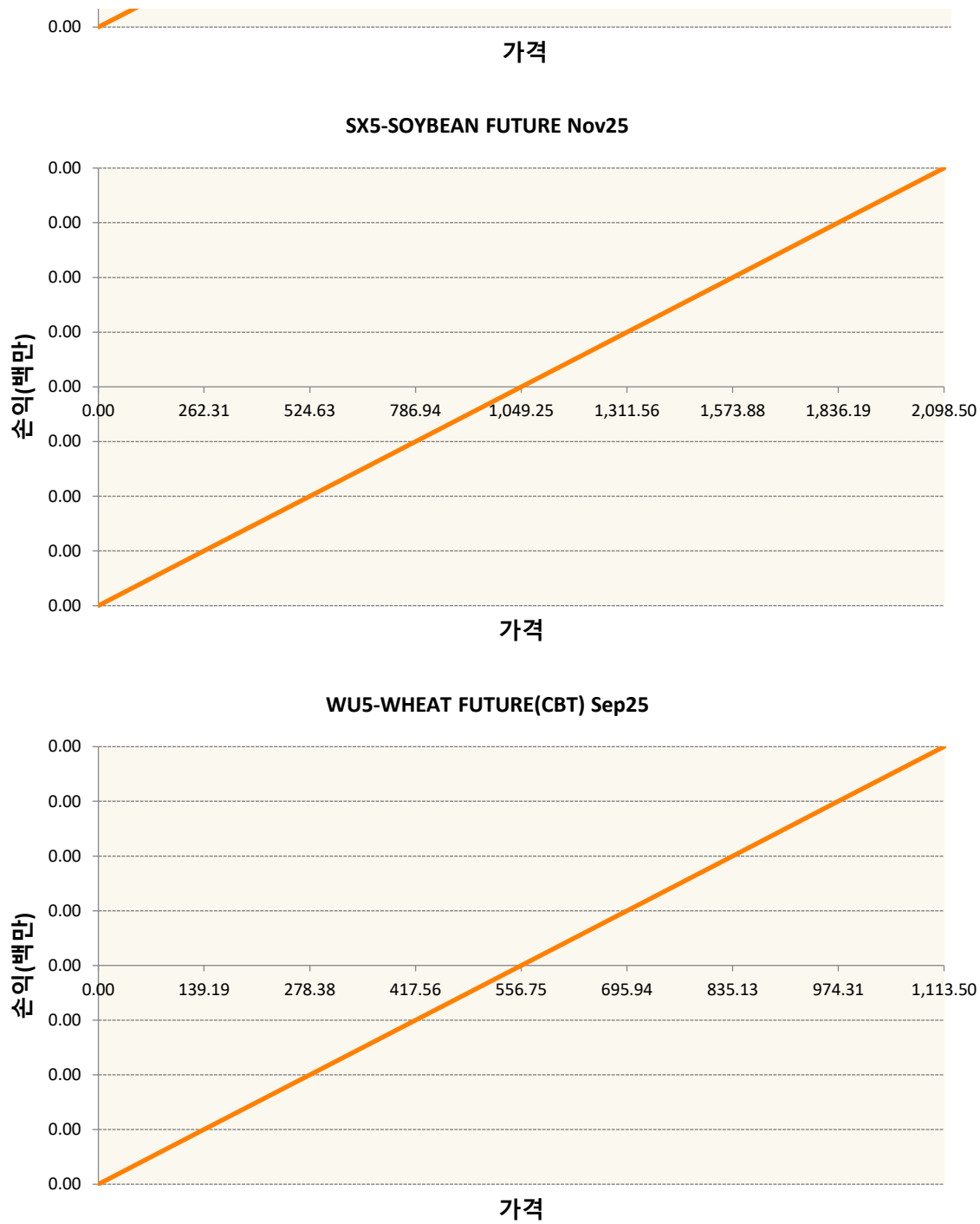
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,606	0	1,606	
누계	유가증권	선물	2,034	0	2,034	
누계	통화	선물	0	259	-259	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

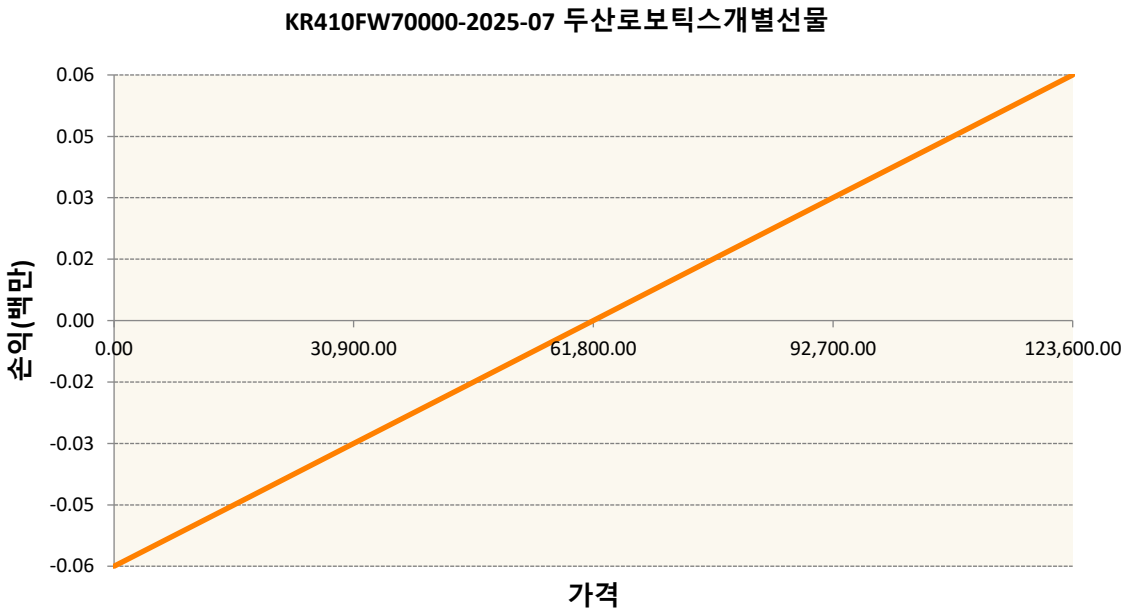
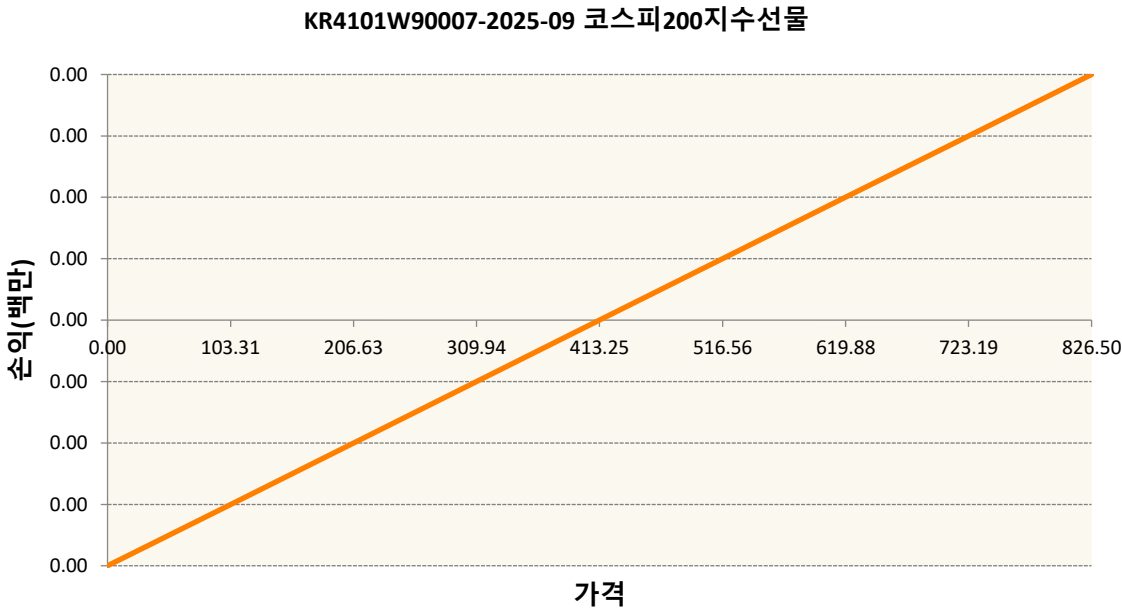
스마트인덱스모

1. 계약금액

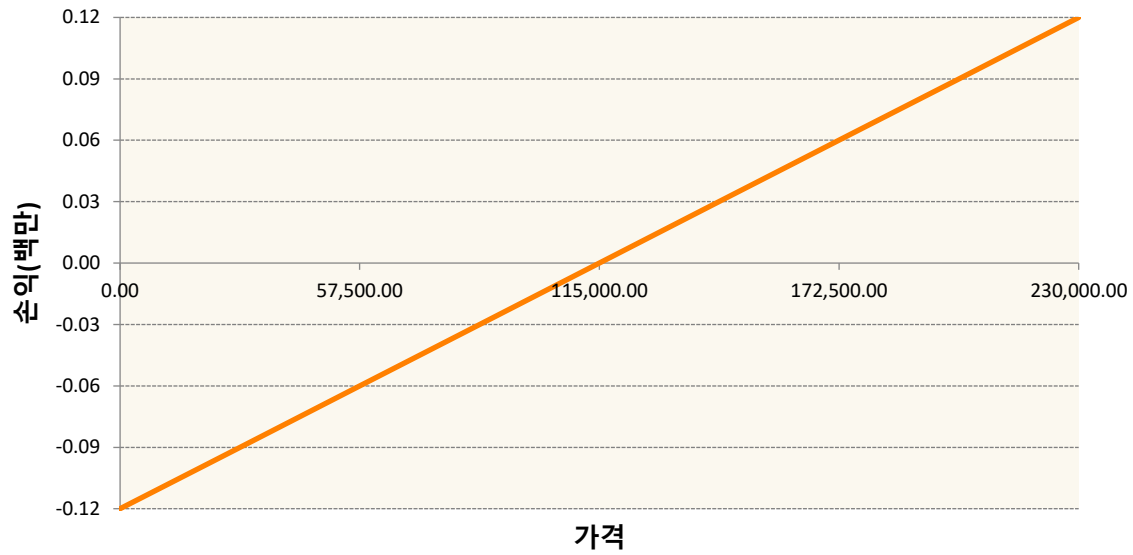
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	106	-106	장내
누계	유가증권	선물	1,256	0	1,256	장내

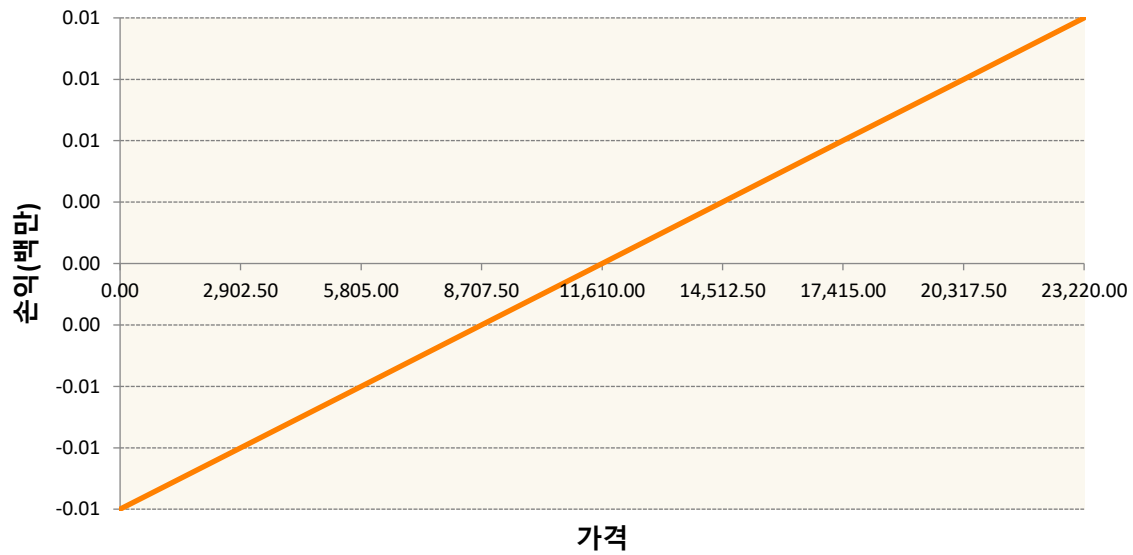
2. 만기시점의 손익구조



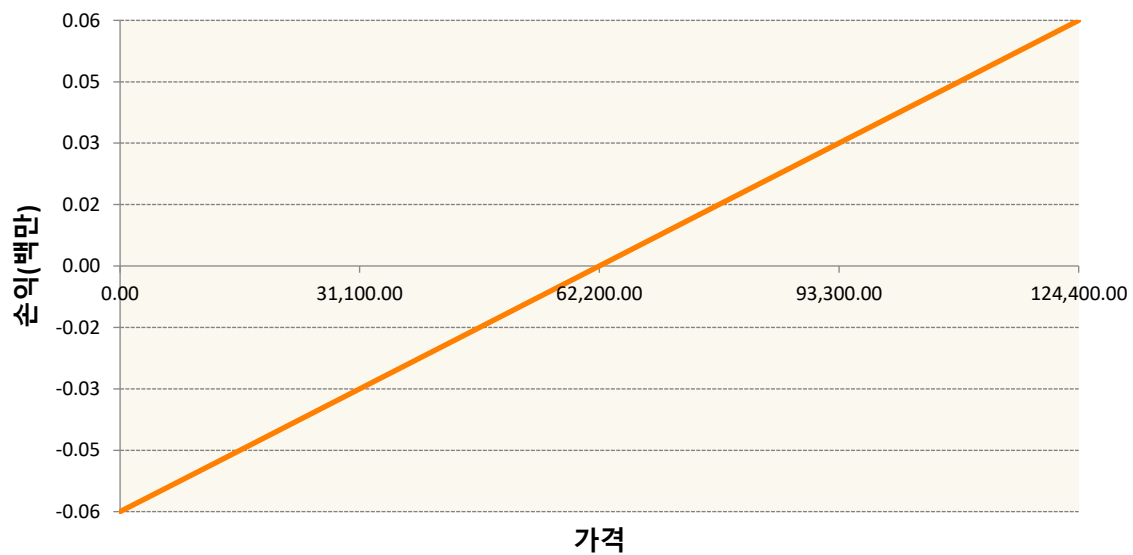
KR4141W70005-2025-07 SK이노베이션개별선물



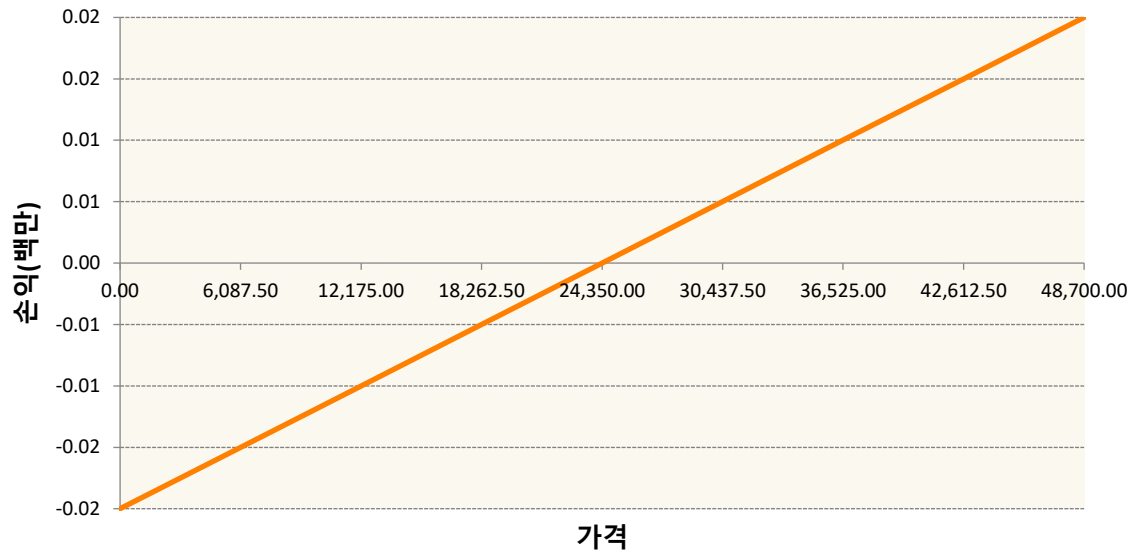
KR4149W70008-2025-07 HD현대인프라코어개별선물



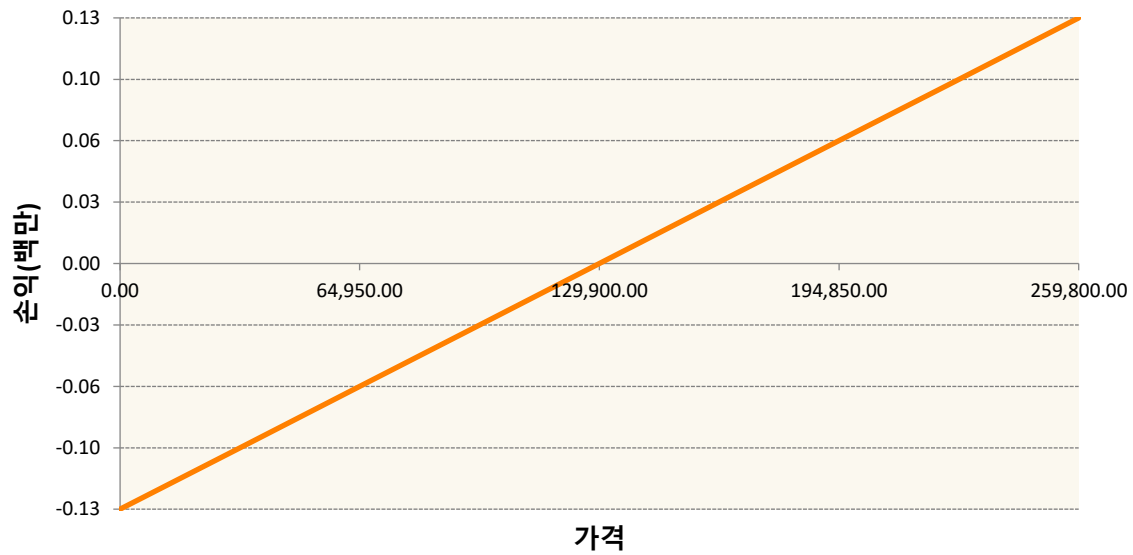
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



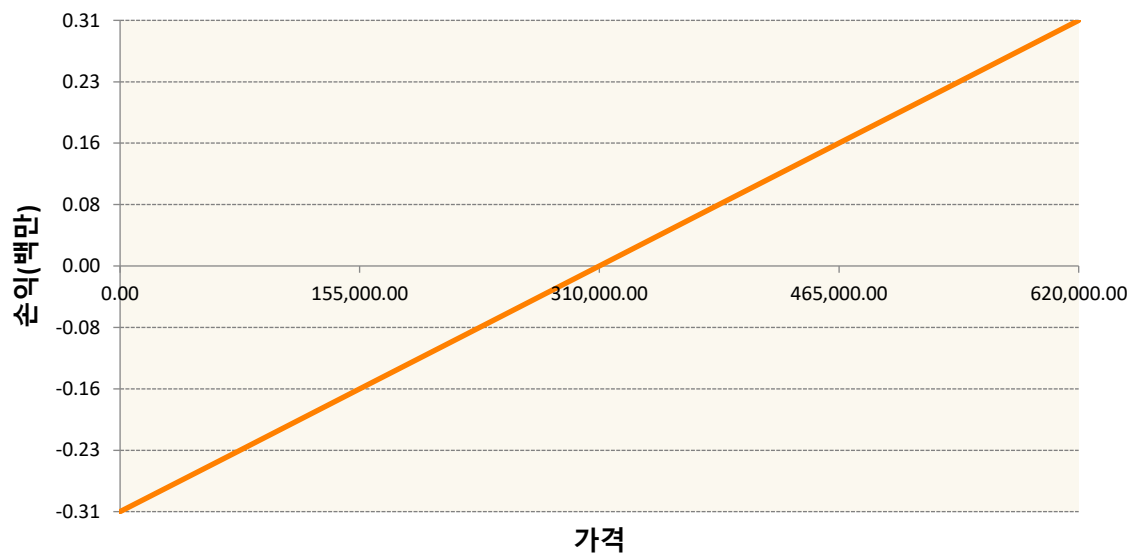
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



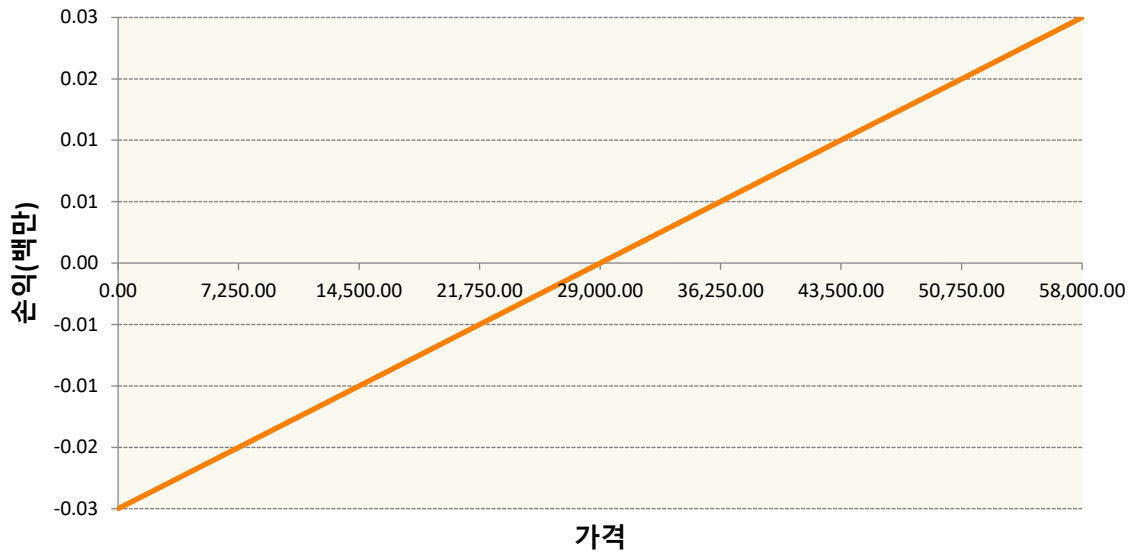
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



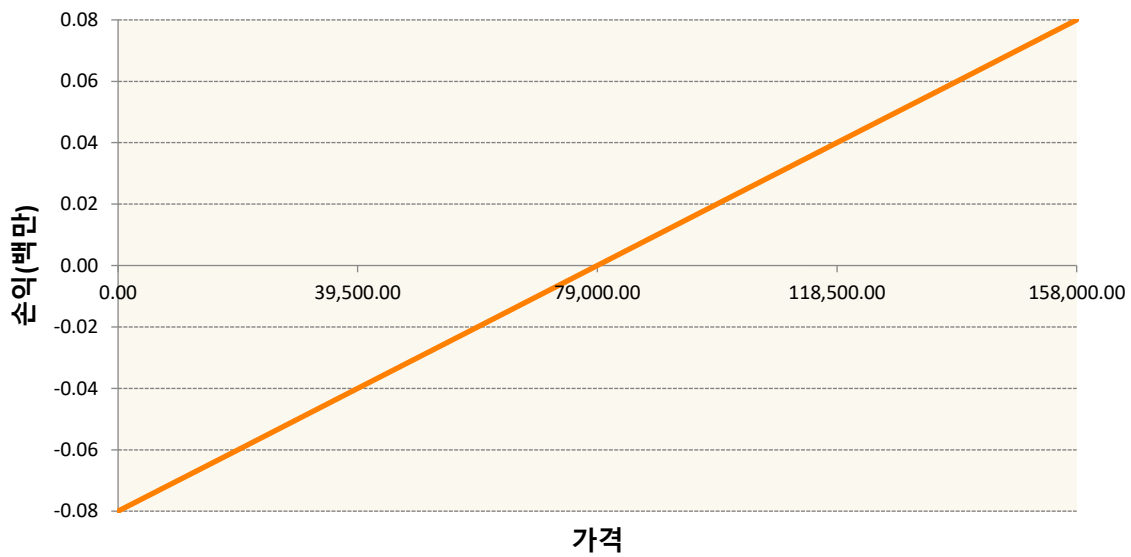
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



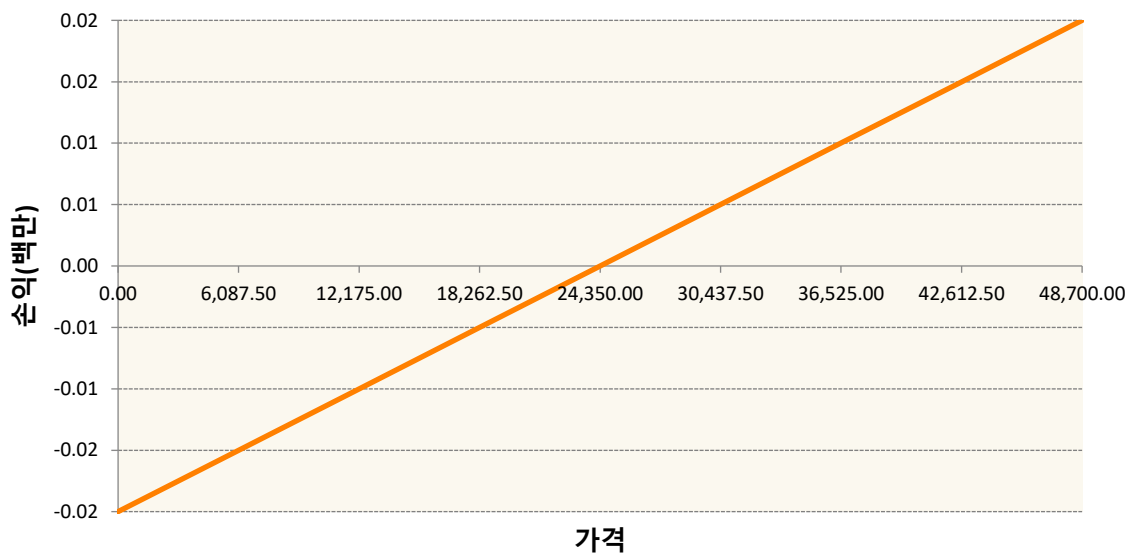
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



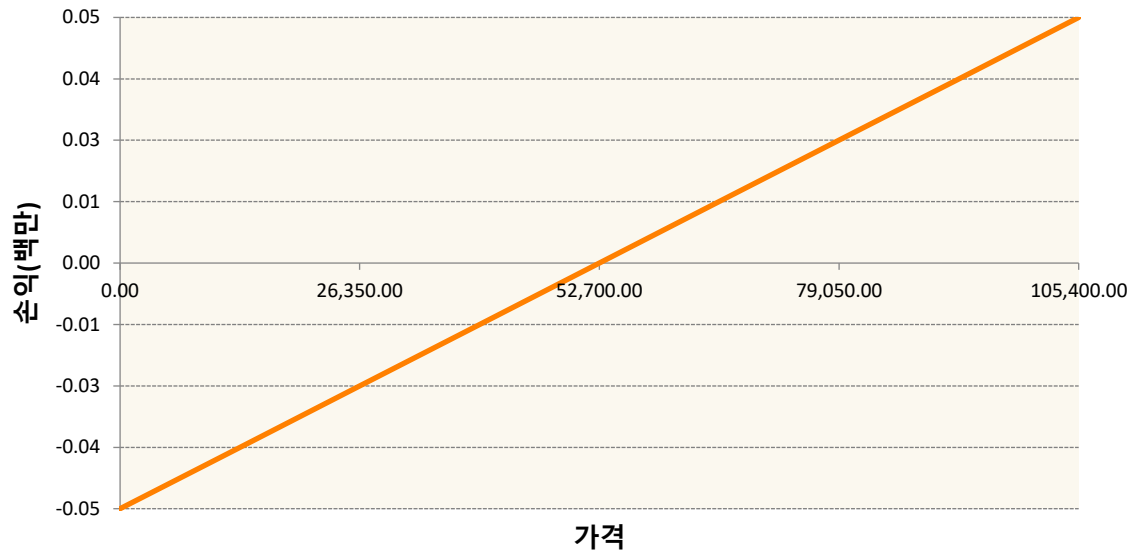
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



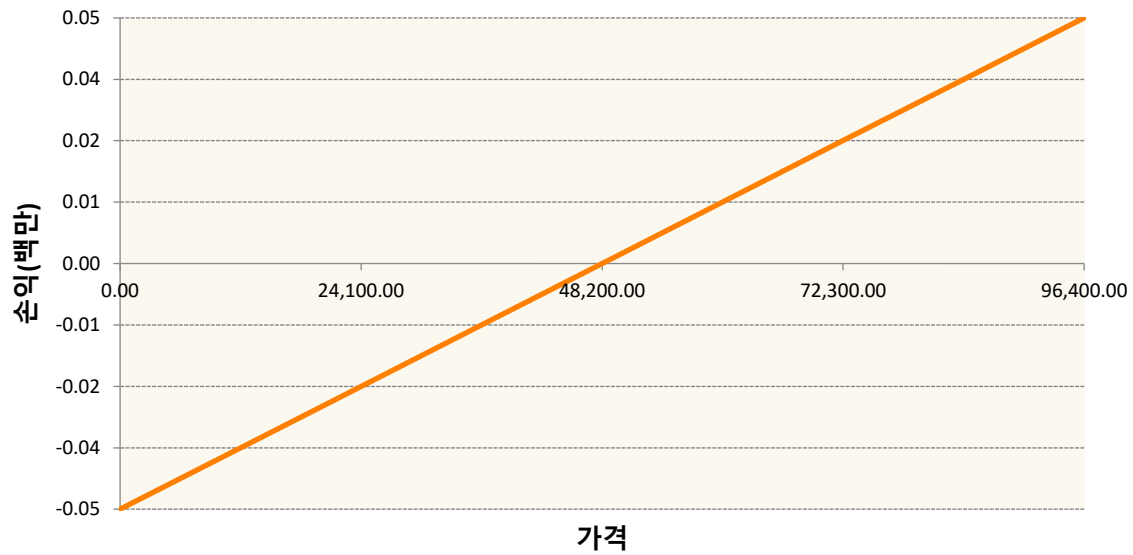
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



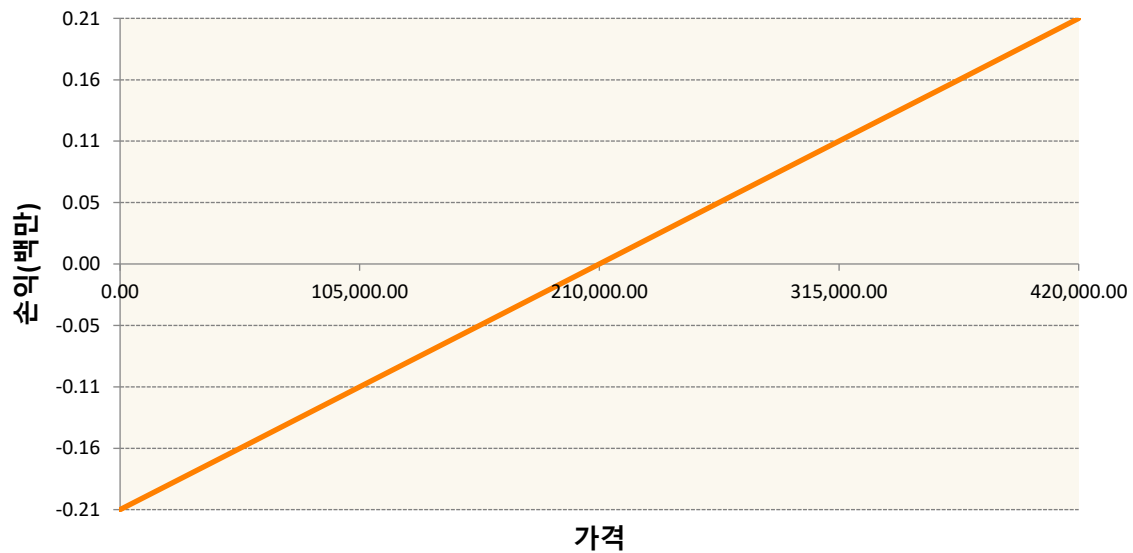
KR41FMW70003-2025-07 엘애프개별선물



KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물		50
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		10
KR41F7W70(2025-07 카카오페이개별선물		3
KR41FAW70(2025-07 HMM개별선물		3
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물		2
KR41G0W70 2025-07 씨에스윈드개별선물		0.27
KR41HEW70 2025-07 키움증권개별선물		3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	201

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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)

496

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

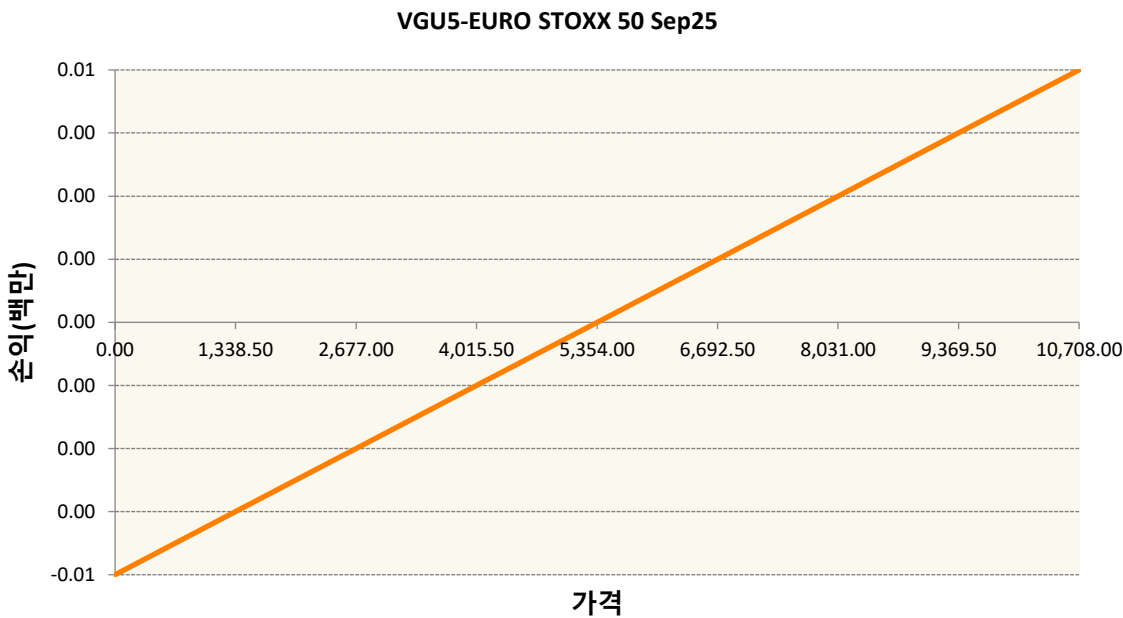
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU5	EURO STOXX 50 Sep25	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

62

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

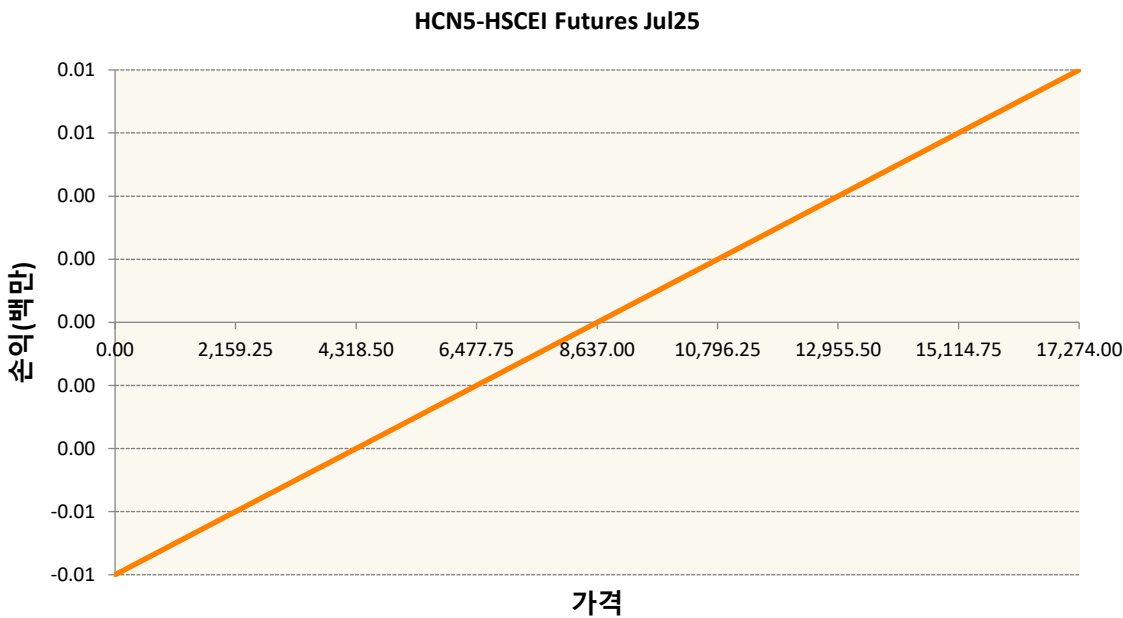
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,098	0	2,098	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN5	HSCEI Futures Jul25	168
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

243

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

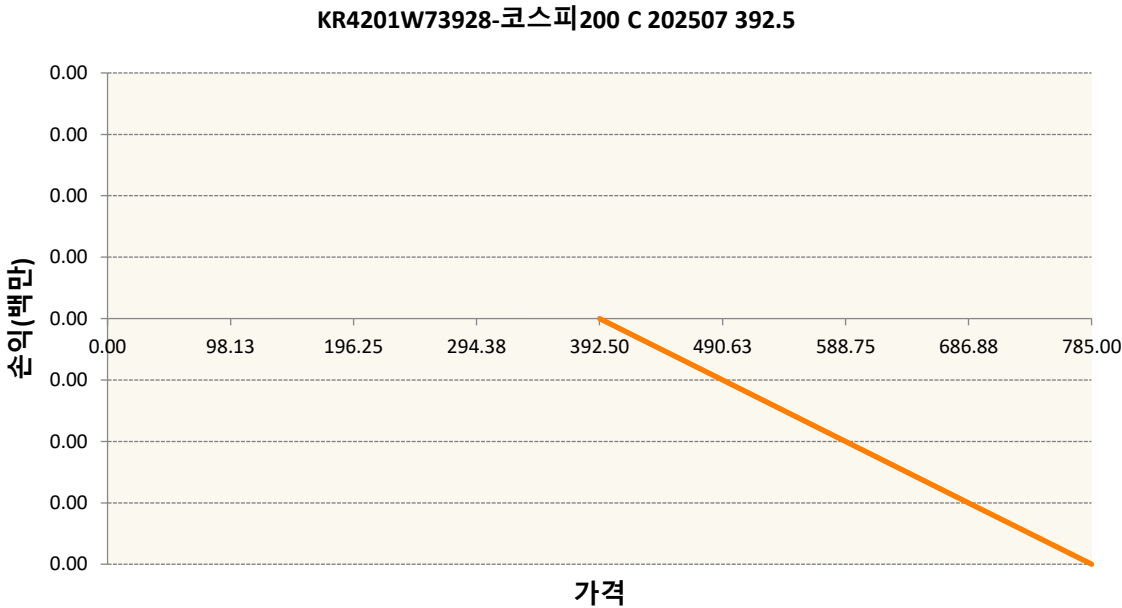
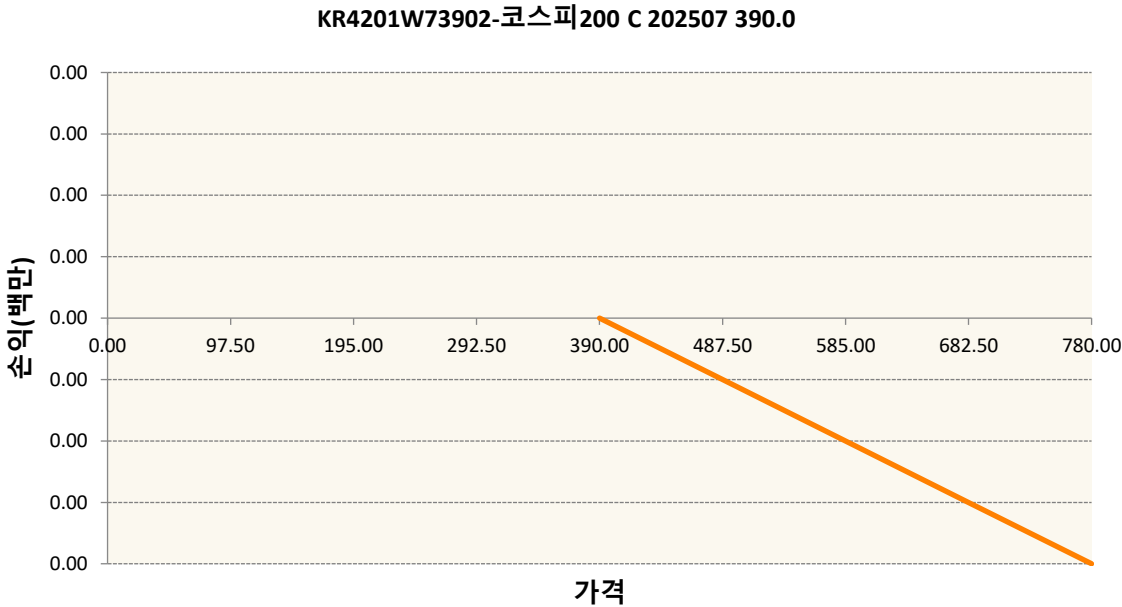
커버드콜모(주식혼합-파생형)

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

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

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 785.00. The y-axis, labeled '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. An orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (392.50, 0.00).

가격	손익 (백만)
0.00	0.00
392.50	0.00

(단위:백만원)

KR4201W73902		코스피200 C 202507 390.0					1,768
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,205	1,195	1,183	1,171	1,157	1,143	1,128
-5.33%	1,026	1,006	986	966	946	925	905
-2.67%	579	570	560	548	536	522	508
0%	5	4	3	0	-4	-8	-14
2.67%	-585	-585	-586	-586	-586	-587	-588
5.33%	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177
8.00%	-1,768	-1,768	-1,768	-1,768	-1,768	-1,768	-1,768
KR4201W73928		코스피200 C 202507 392.5					582
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	359	356	354	350	347	343	339
-5.33%	317	310	304	297	291	284	277
-2.67%	188	184	179	174	169	164	159
0%	3	2	1	0	-2	-4	-6
2.67%	-192	-192	-192	-192	-192	-193	-193
5.33%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
8.00%	-582	-582	-582	-582	-582	-582	-582
KR4301W73900 코스피200 P 202507 390.0							144

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-127	-129	-132	-135	-138	-141	-144
-5.33%	-35	-39	-44	-48	-53	-57	-62
-2.67%	-3	-5	-7	-10	-12	-15	-19
0%	1	1	1	0	-1	-2	-3
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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%	-51	-52	-52	-53	-54	-55	-56
-5.33%	-17	-18	-20	-21	-23	-24	-26
-2.67%	-2	-3	-4	-5	-6	-7	-8
0%	1	1	0	0	0	-1	-1
2.67%	1	1	1	1	1	1	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

2,583

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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	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	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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	4,146	0	4,146	

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	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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	12,497	0	12,497	
누계	통화	선도	177	11,879	-11,702	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
FXW213F6X(USD/KRW 31-07-25E	14
FXW213F74C KRW/USD 31-07-25E	5
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	479

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

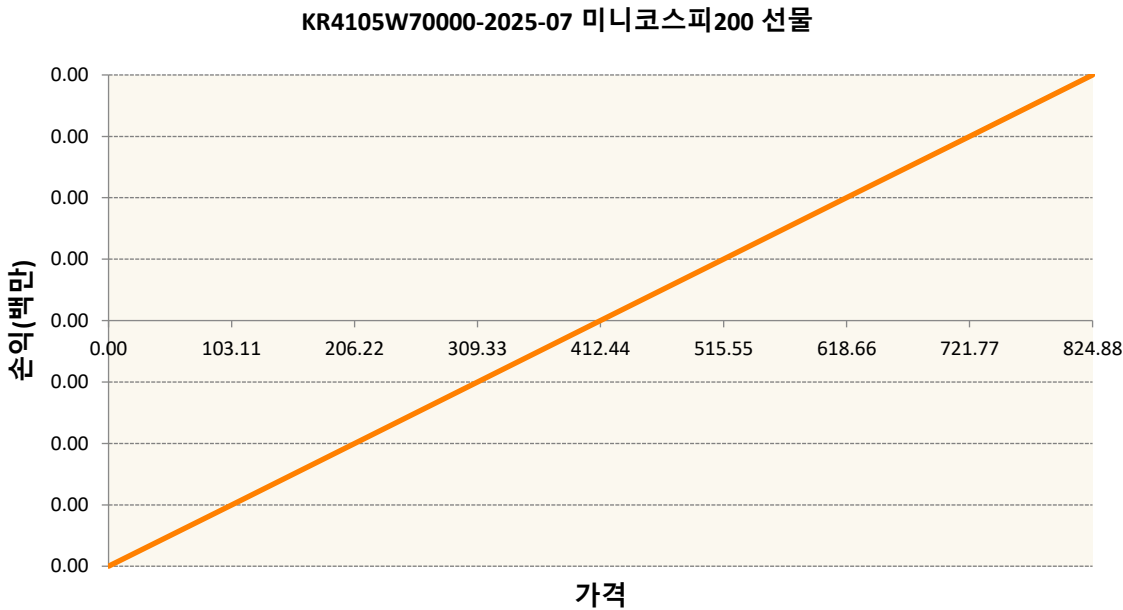
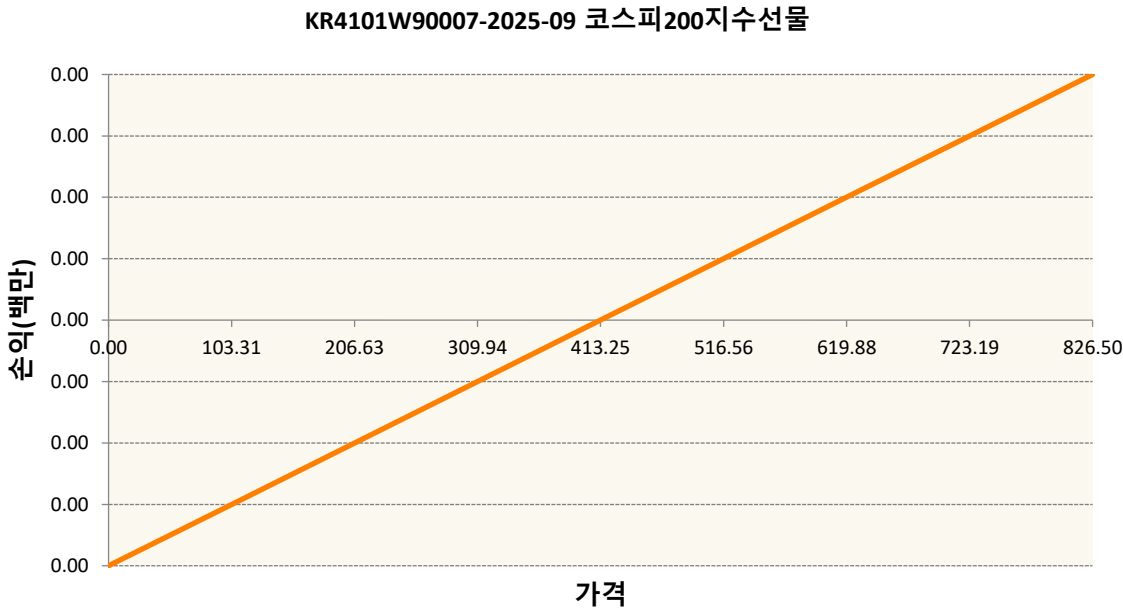
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

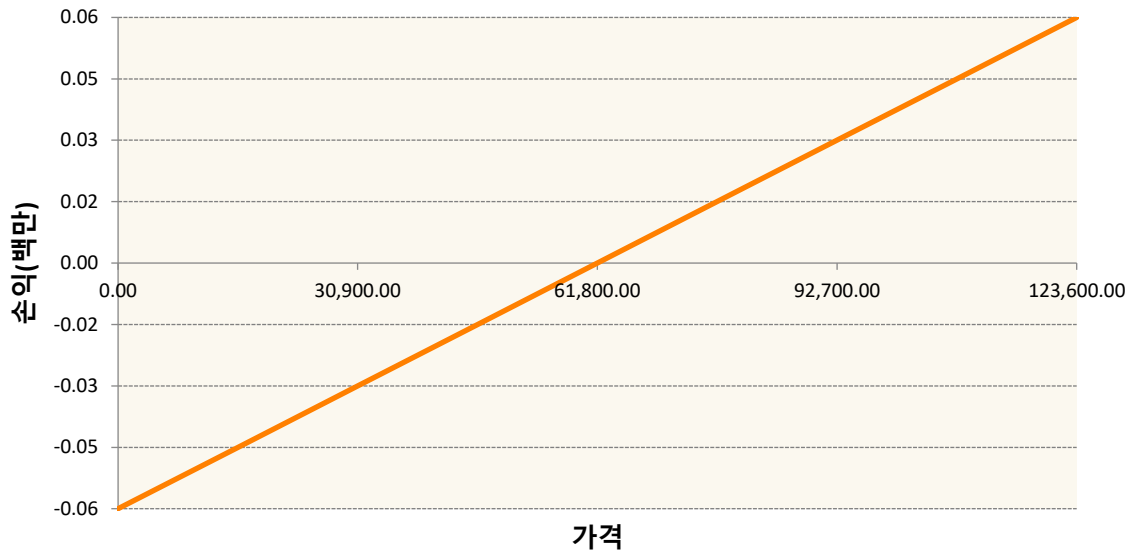
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,152	0	1,152	장내

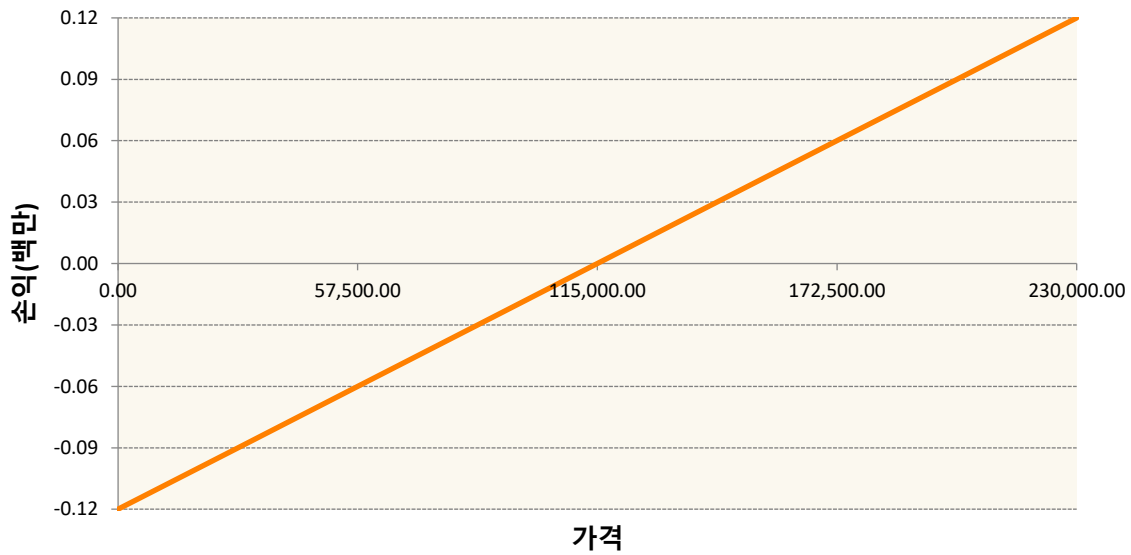
2. 만기시점의 손익구조



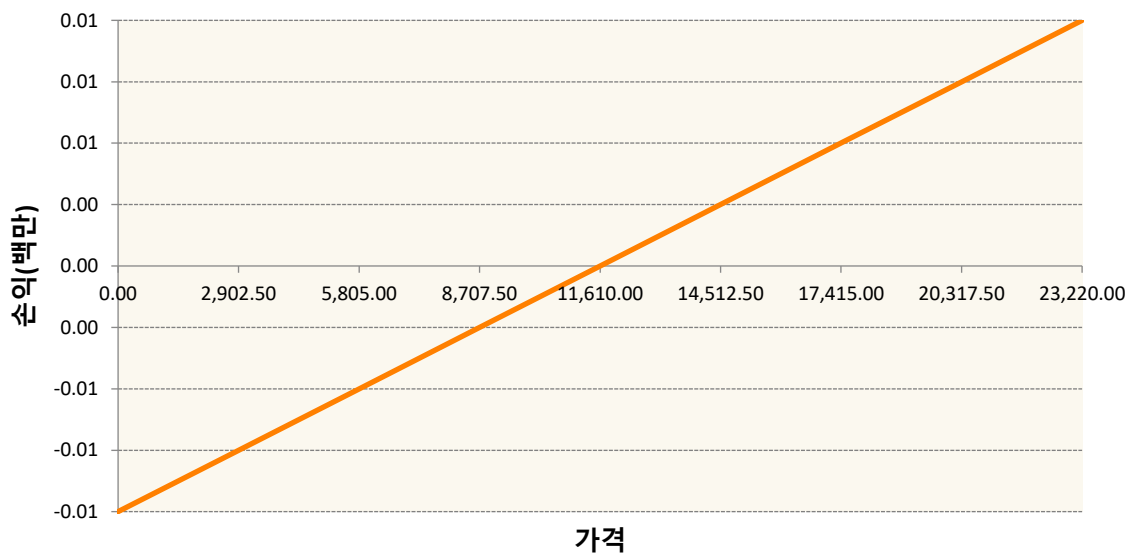
KR410FW70000-2025-07 두산로보틱스개별선물



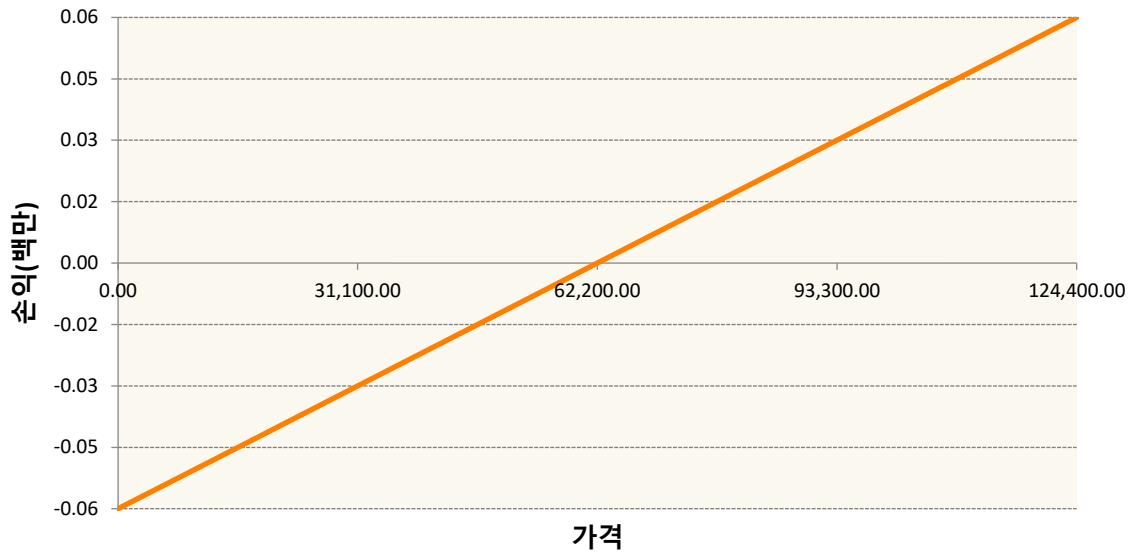
KR4141W70005-2025-07 SK이노베이션개별선물



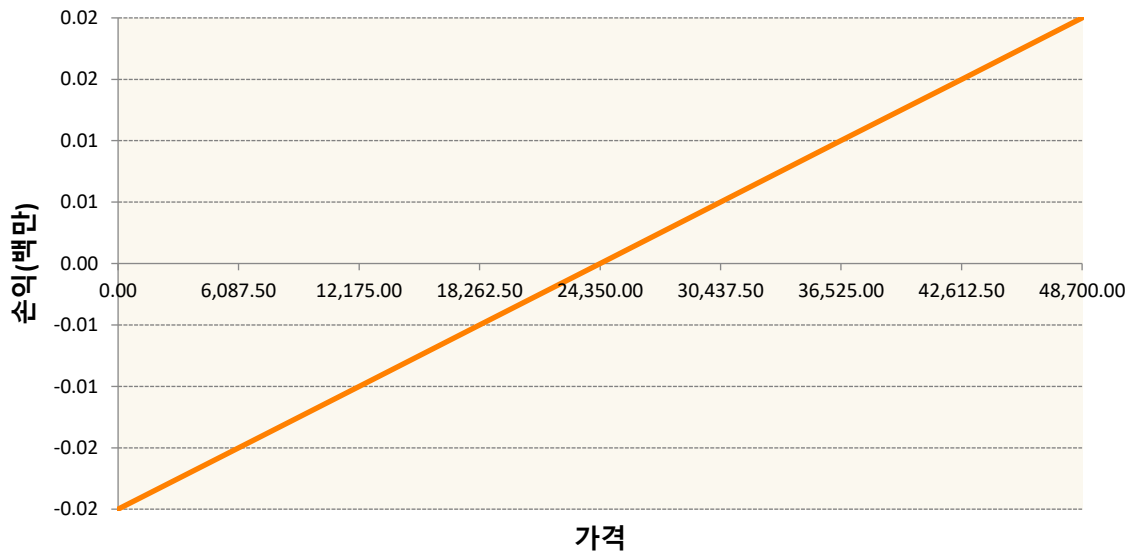
KR4149W70008-2025-07 HD현대인프라코어개별선물



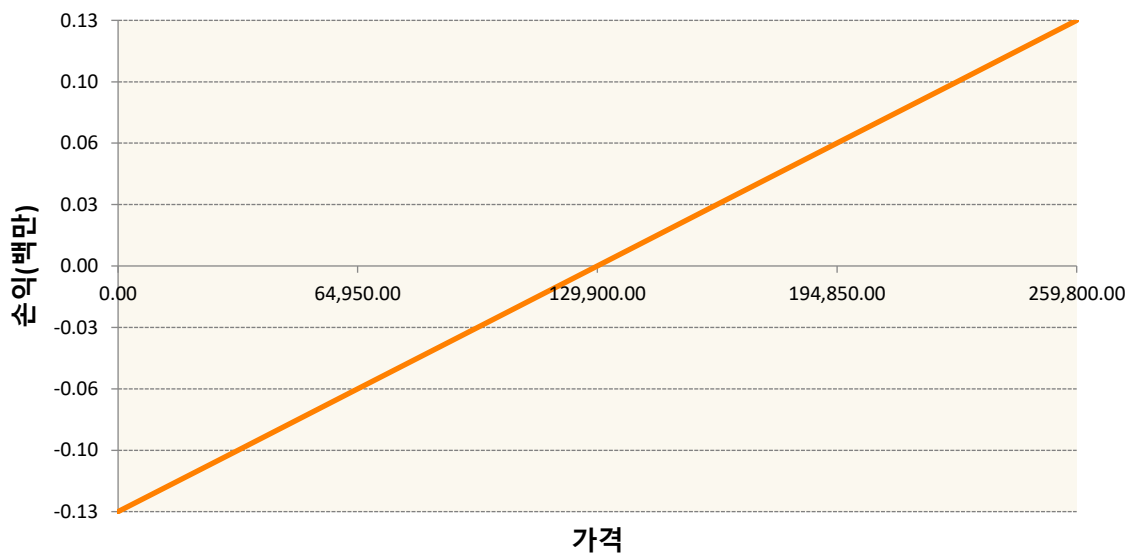
KR41B2W70005-2025-07 S-Oil개별선물



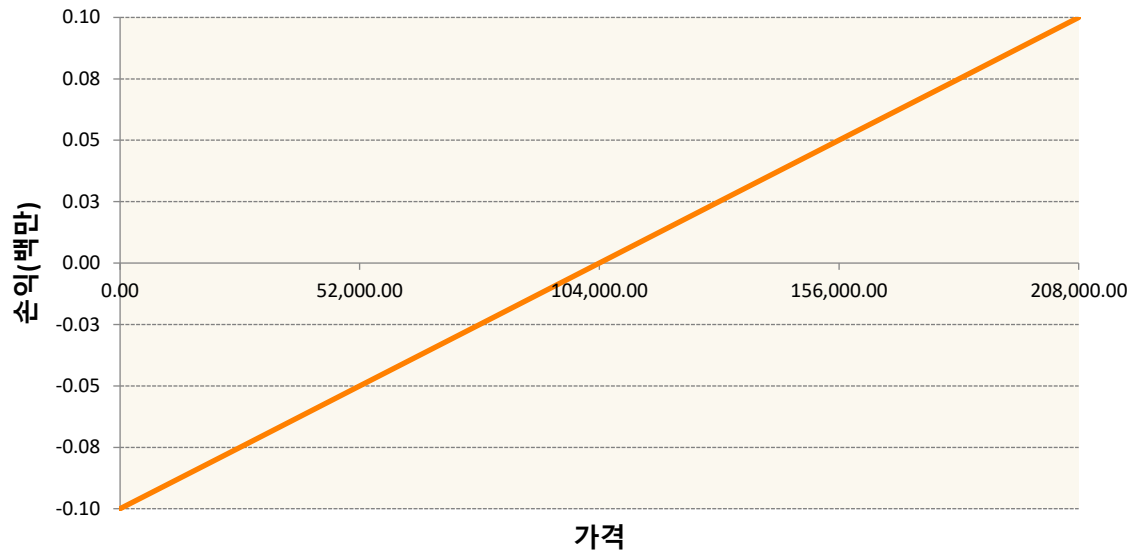
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



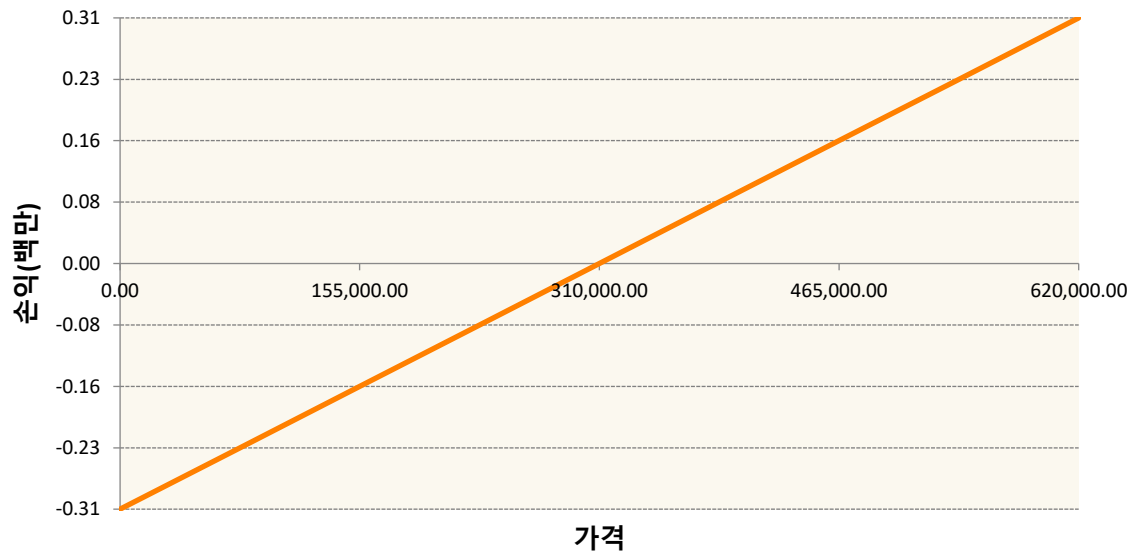
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



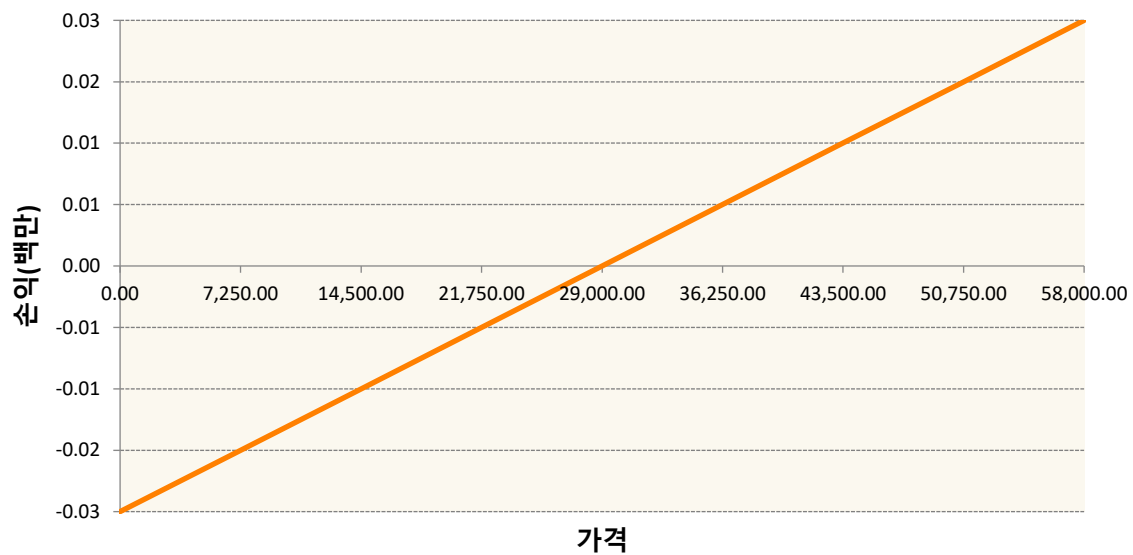
KR41EYW70001-2025-07 에코프로비엠개별선물



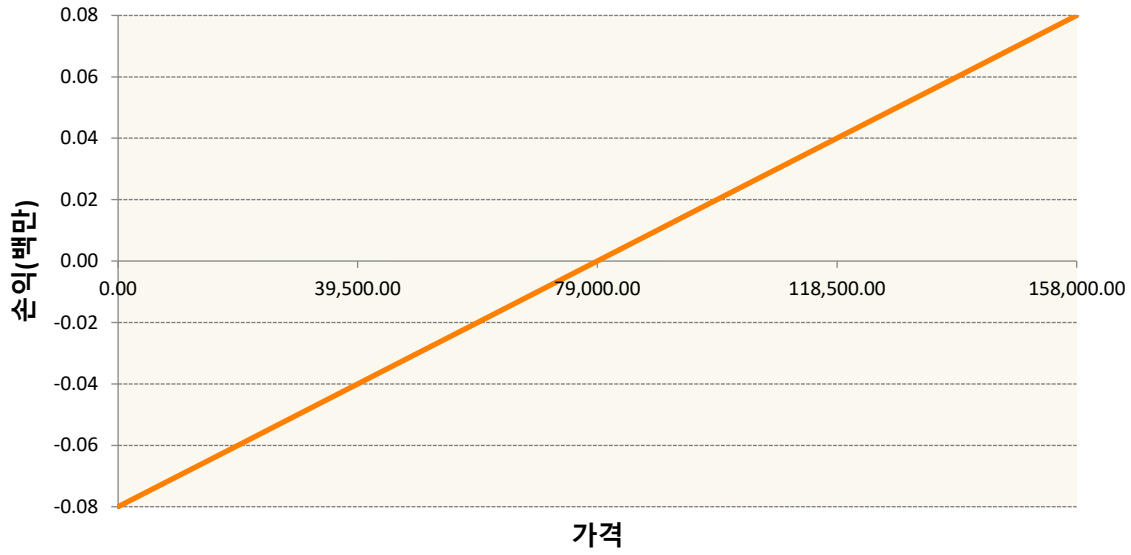
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



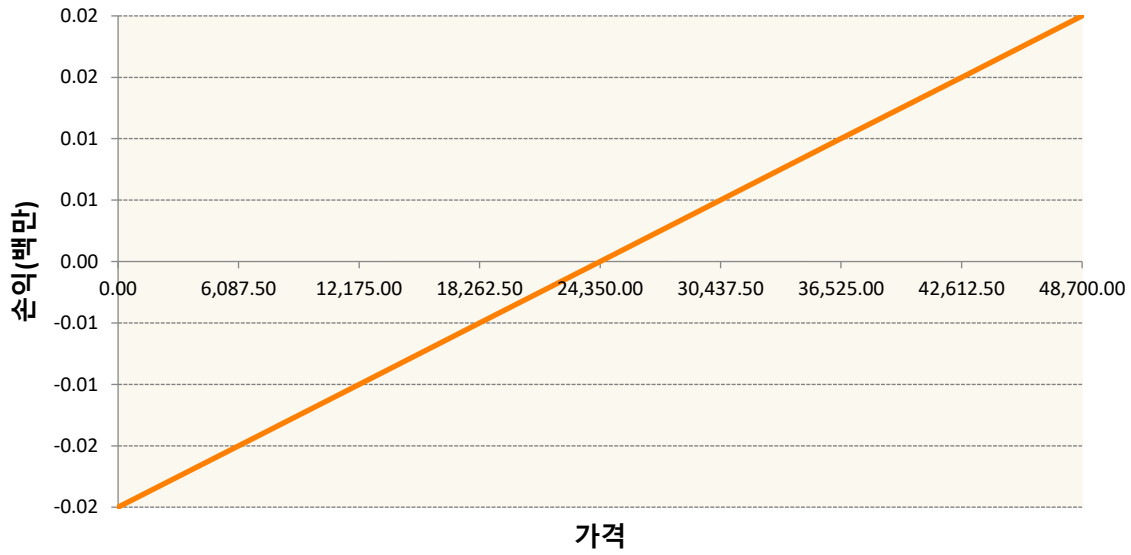
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



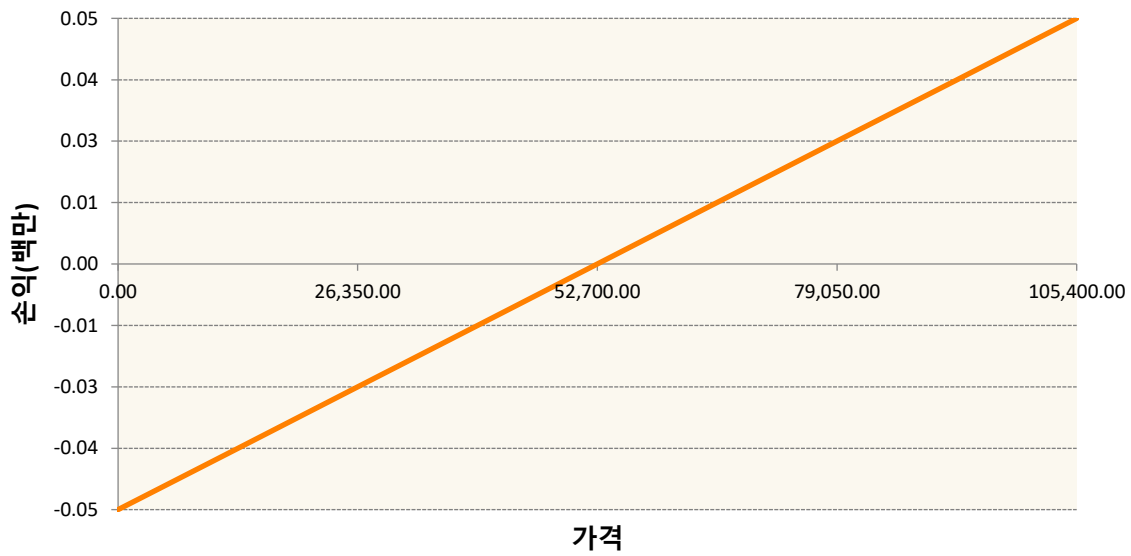
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



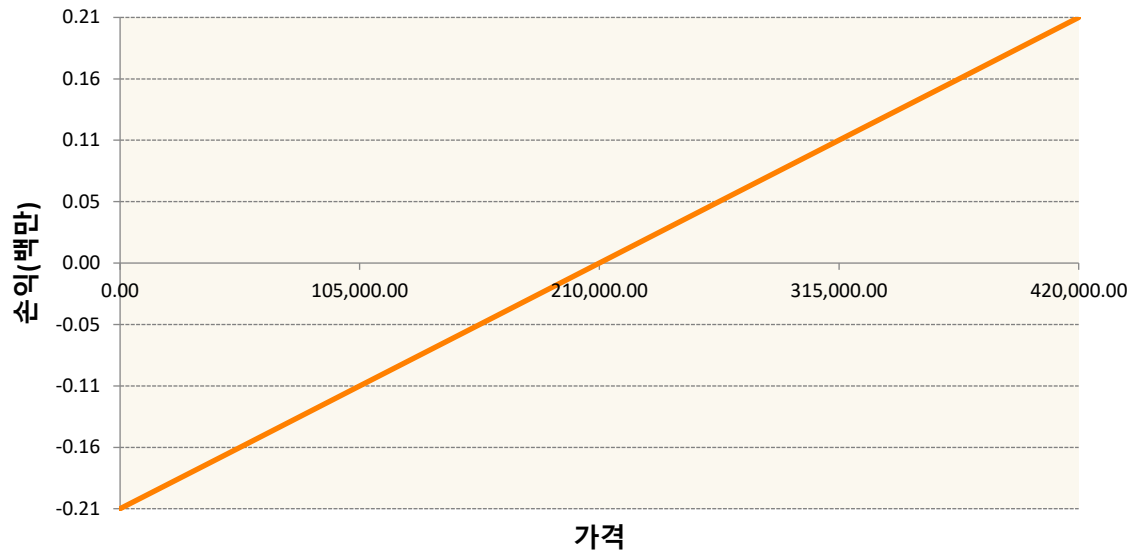
KR41FAW70008-2025-07 HMM개별선물



KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	41
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	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)

131

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

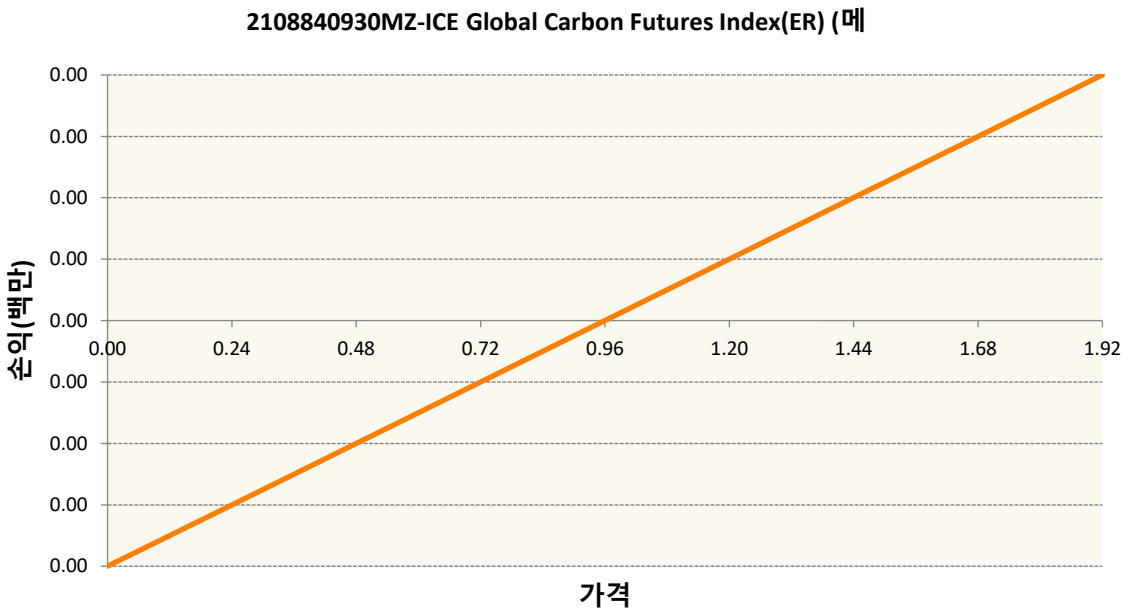
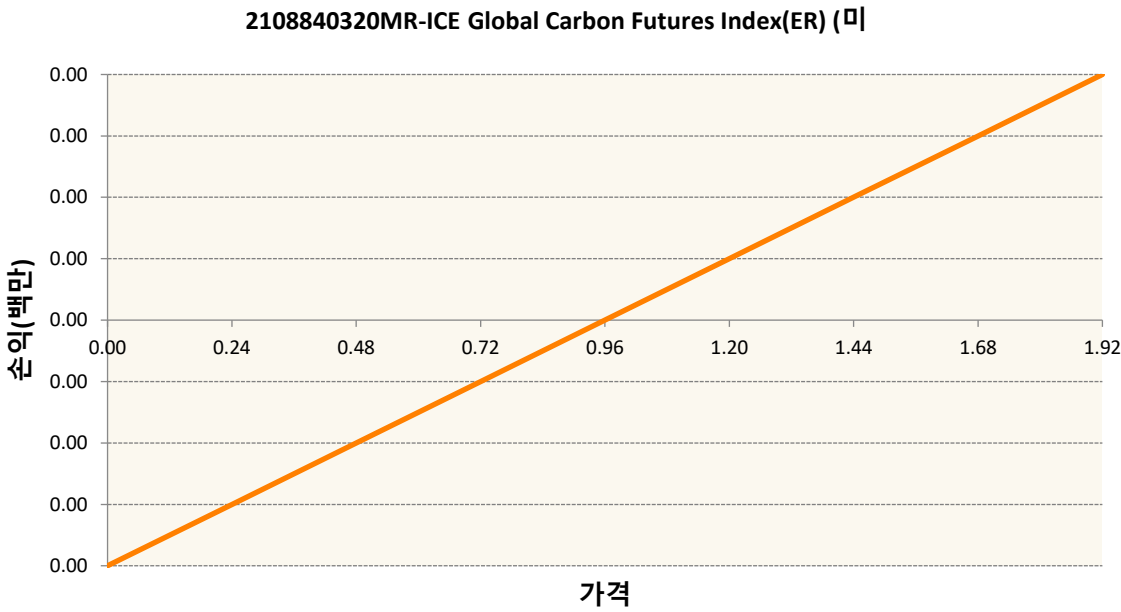
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	581
2108840930	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	194

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	872

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

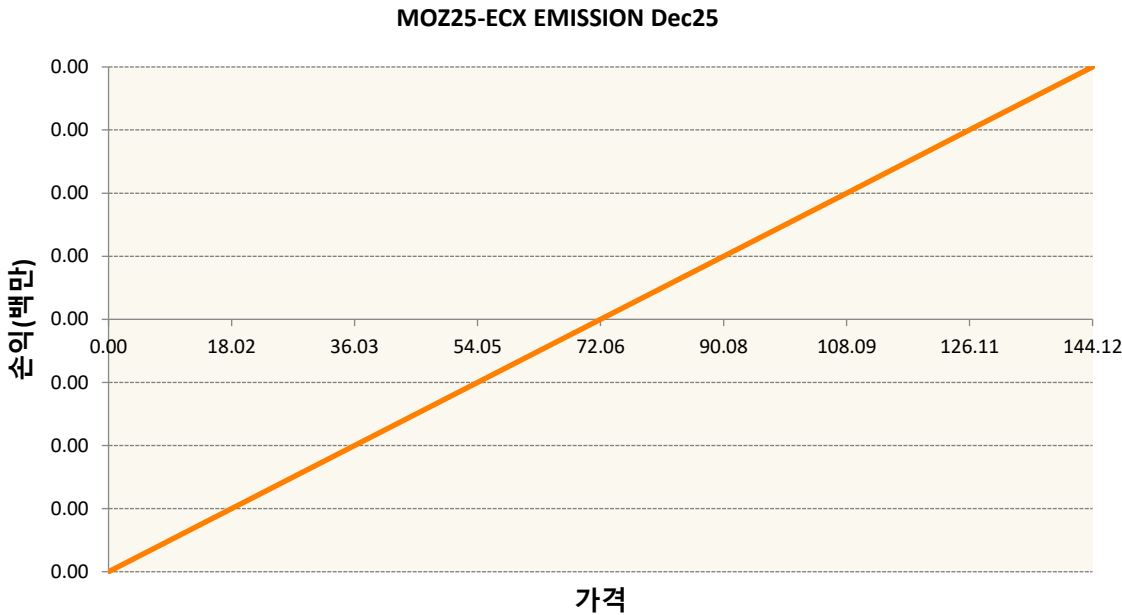
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,538	0	6,538	
누계	통화	선도	0	1,360	-1,360	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	524

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

(단위:백만원)

949

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	5
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	3
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	4

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

(단위:백만원)

28

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	1
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	0.33

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

(단위:백만원)

8

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

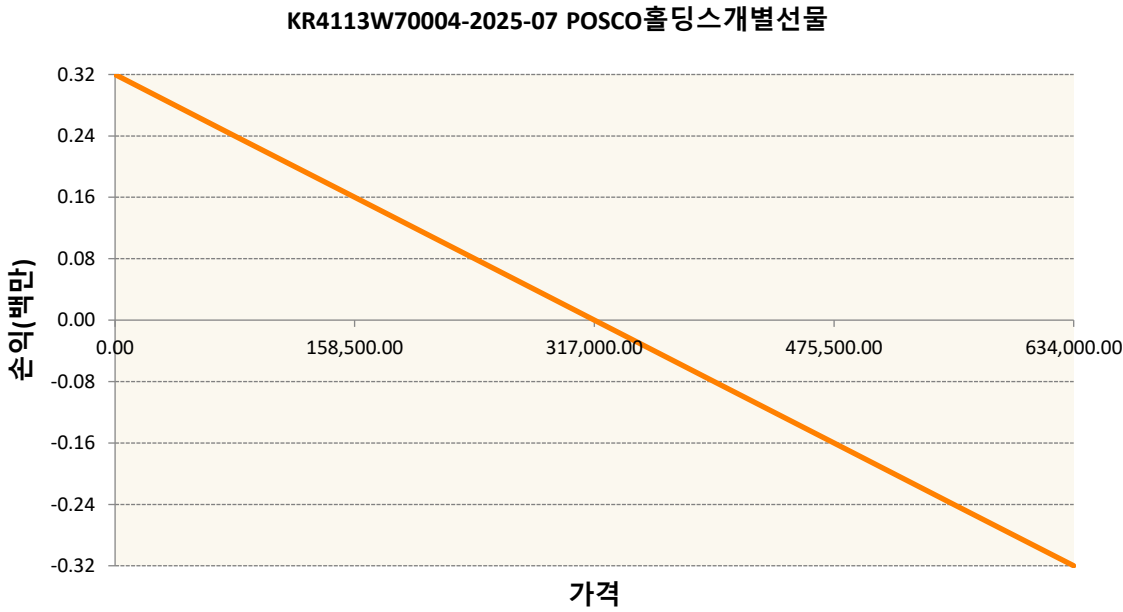
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	0	6	-6	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4113W70(2025-07 POSCO홀딩스개별선물

1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

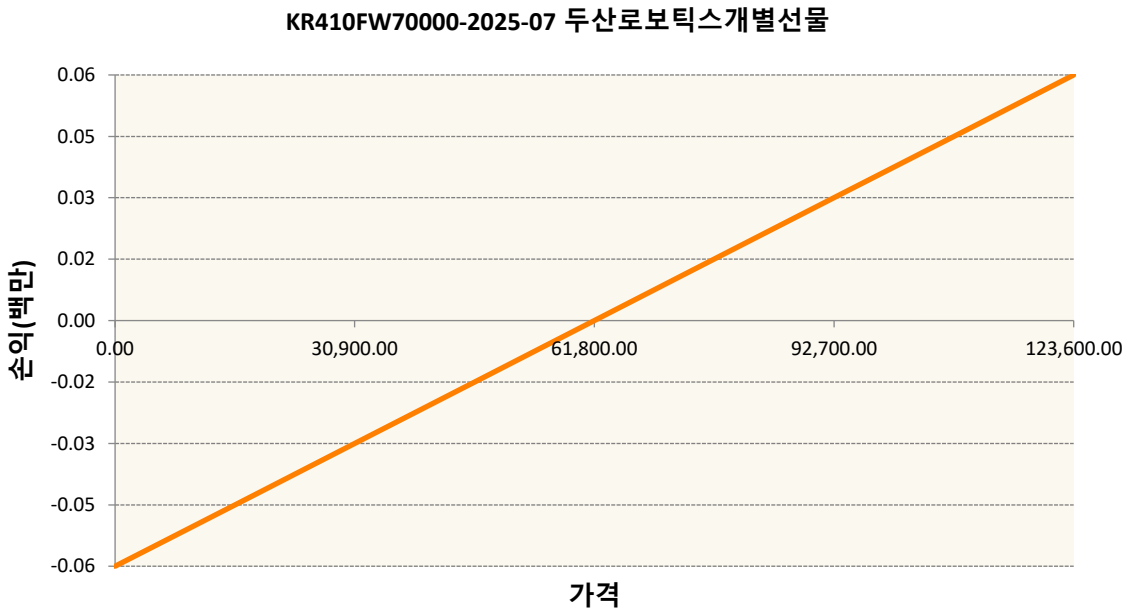
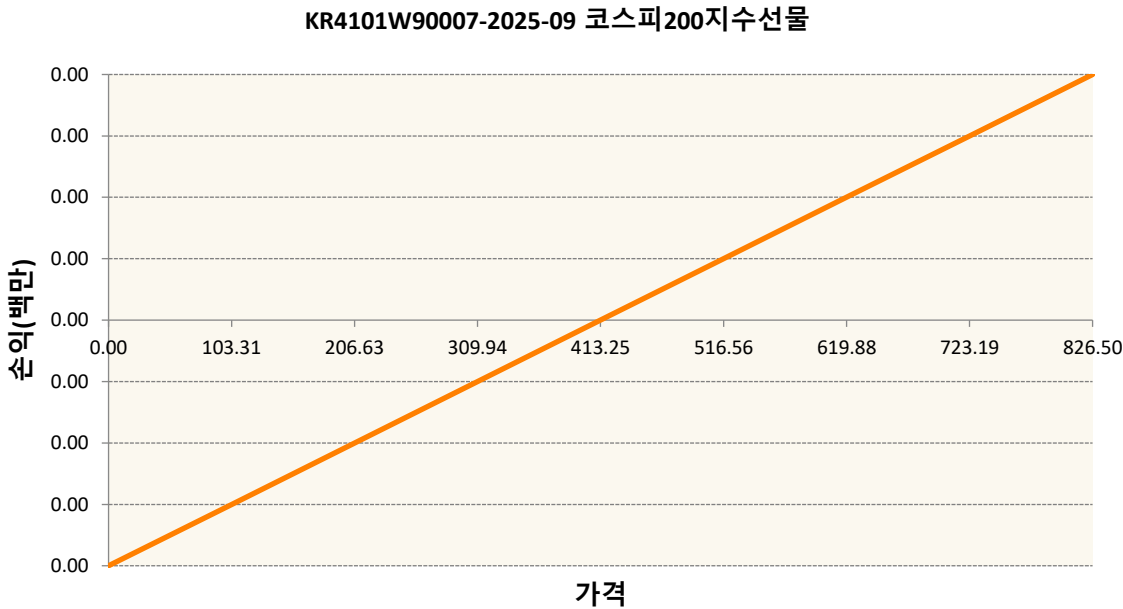
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

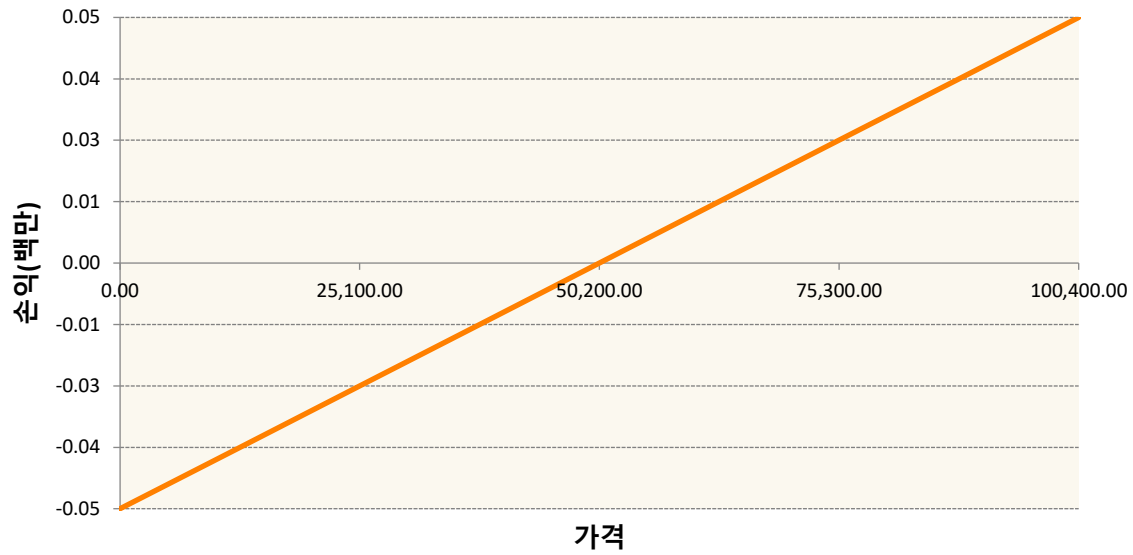
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,846	0	12,846	장내

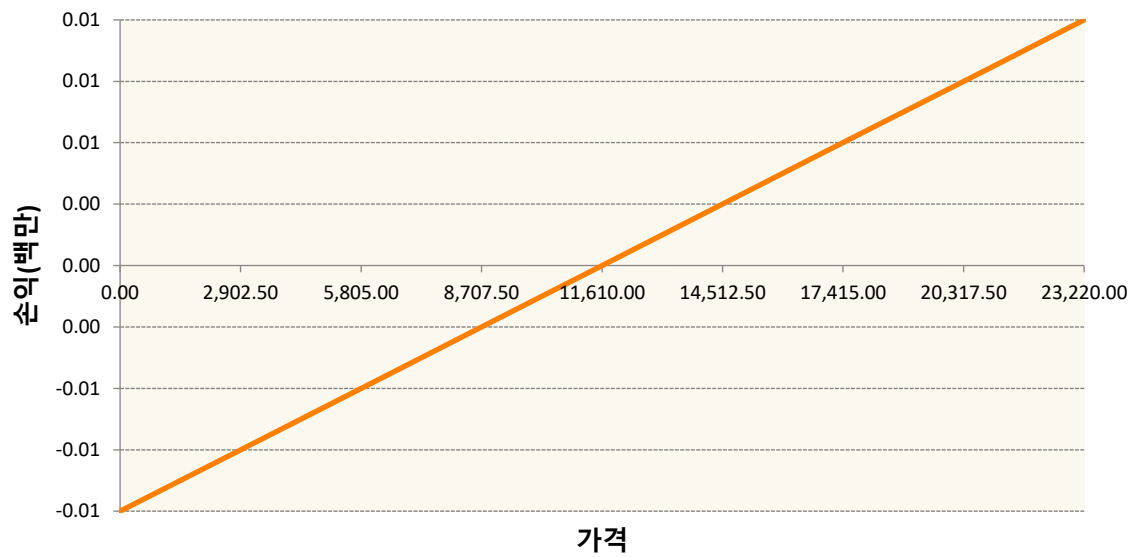
2. 만기시점의 손익구조



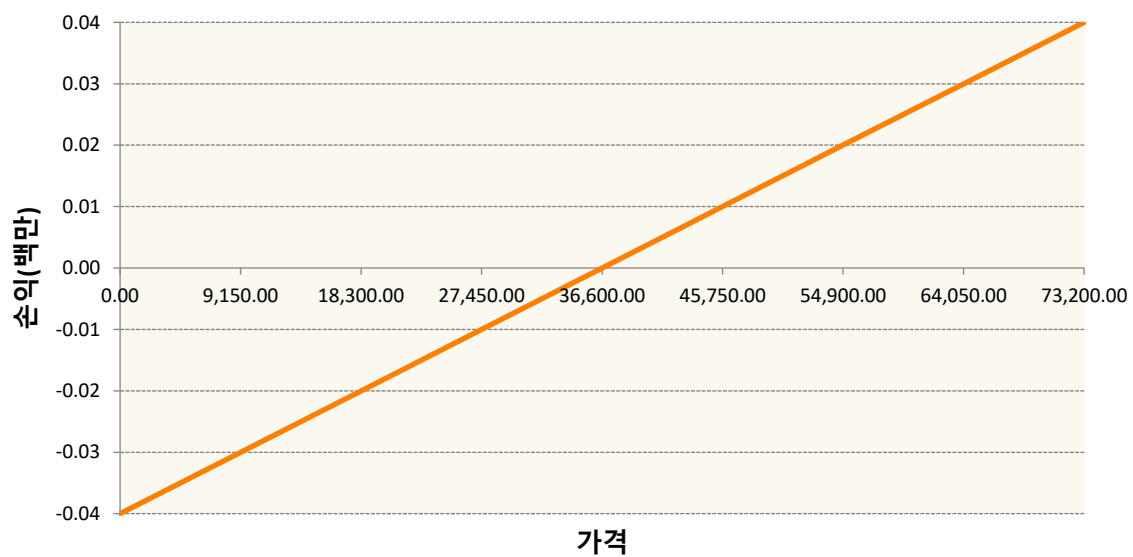
KR411RW70003-2025-07 한화비전개별선물



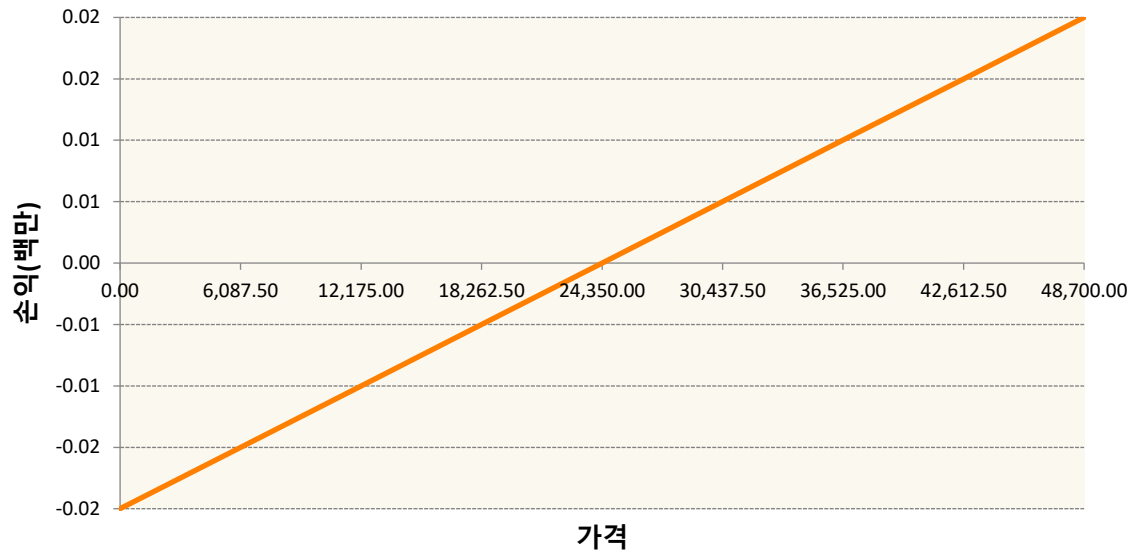
KR4149W70008-2025-07 HD현대인프라코어개별선물



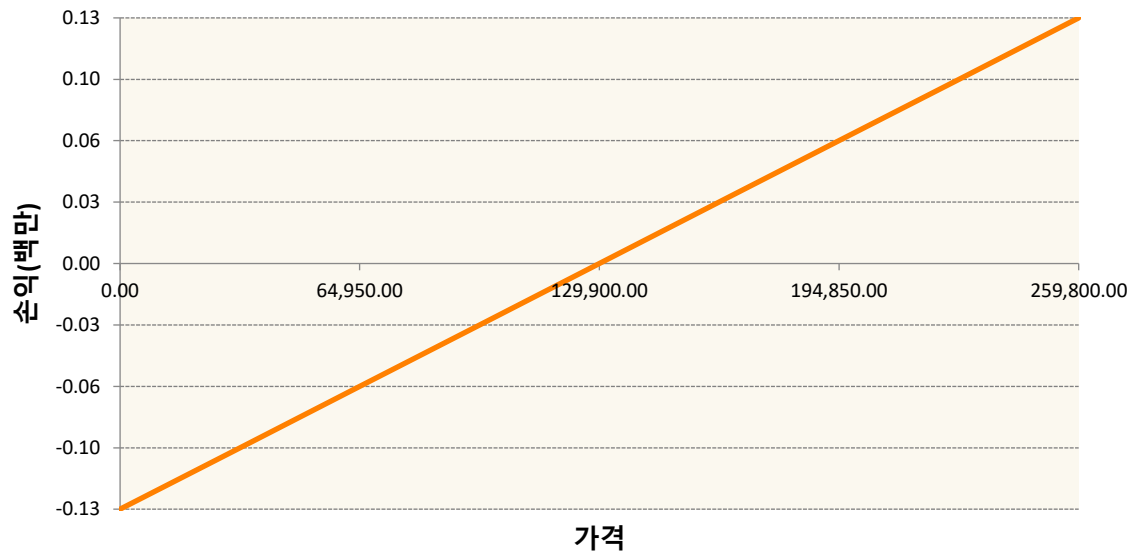
KR41CBW70003-2025-07 한화솔루션개별선물



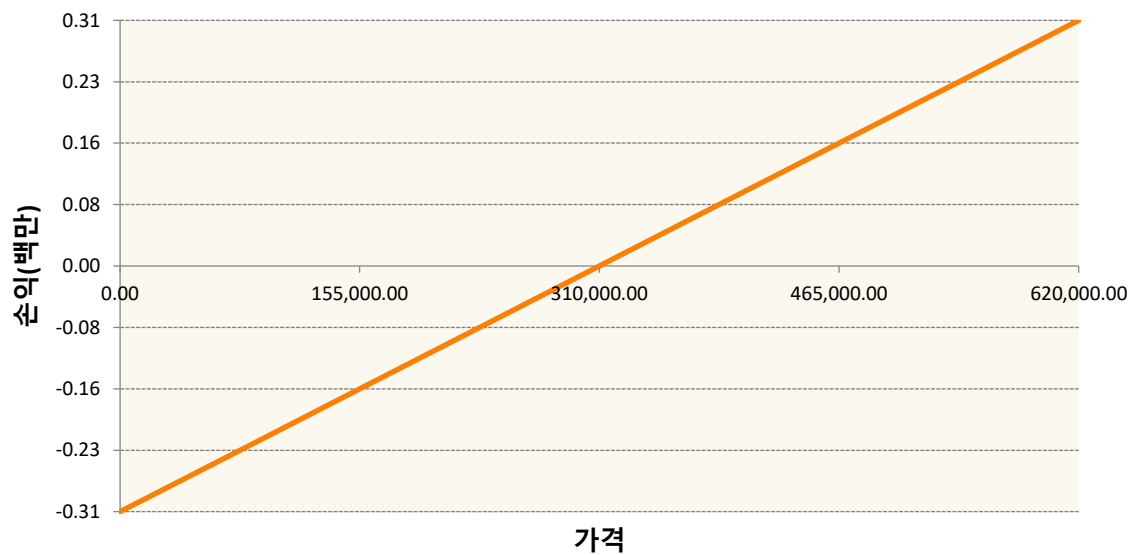
KR41CNW70008-2025-07 포스코DX개별선물



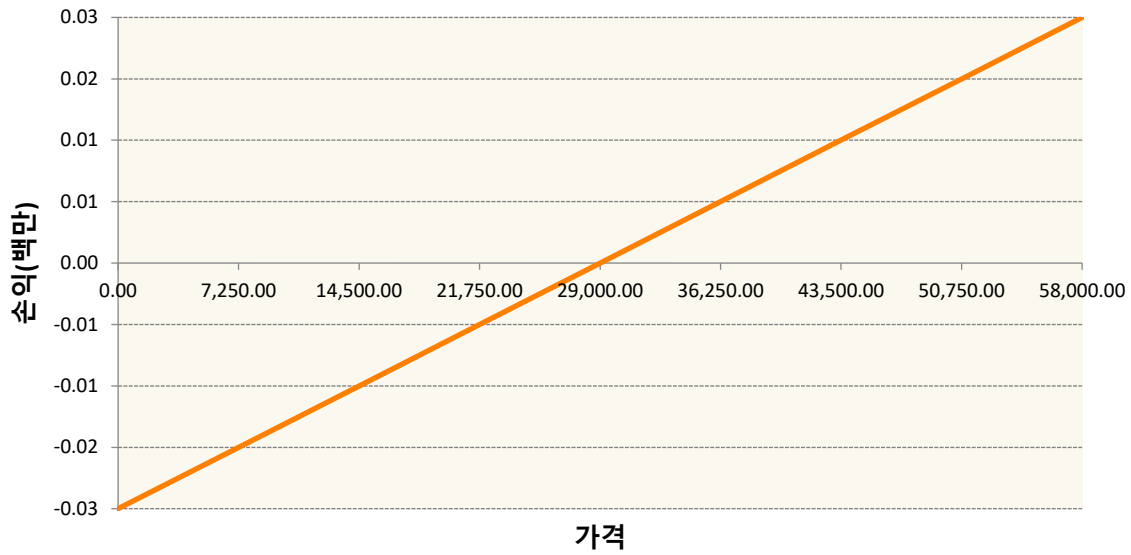
KR41E8W70009-2025-07 포스코퓨처엠개별선물



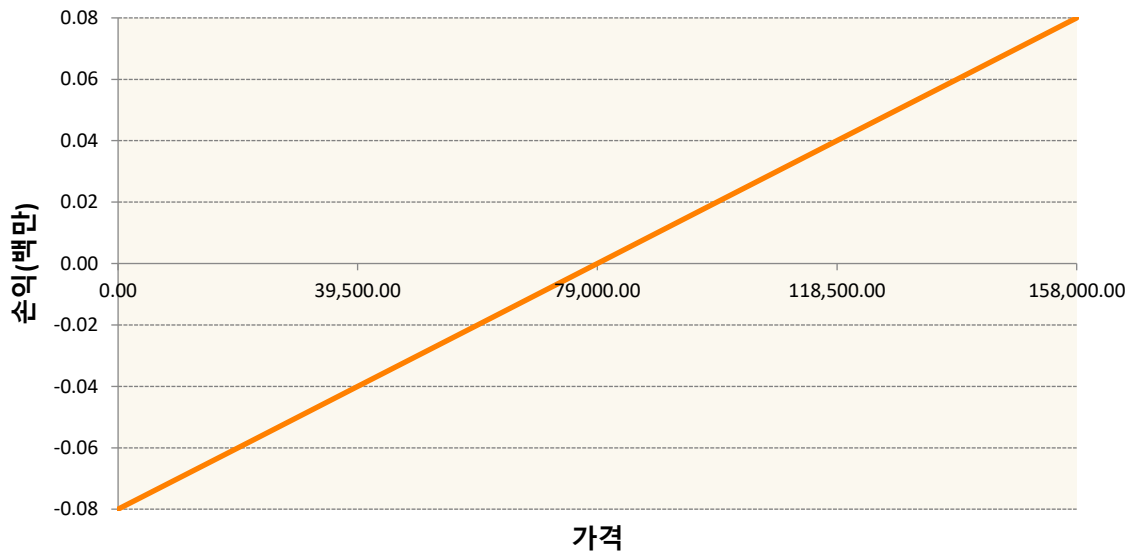
KR41F5W70004-2025-07 LG에너지솔루션개별선물



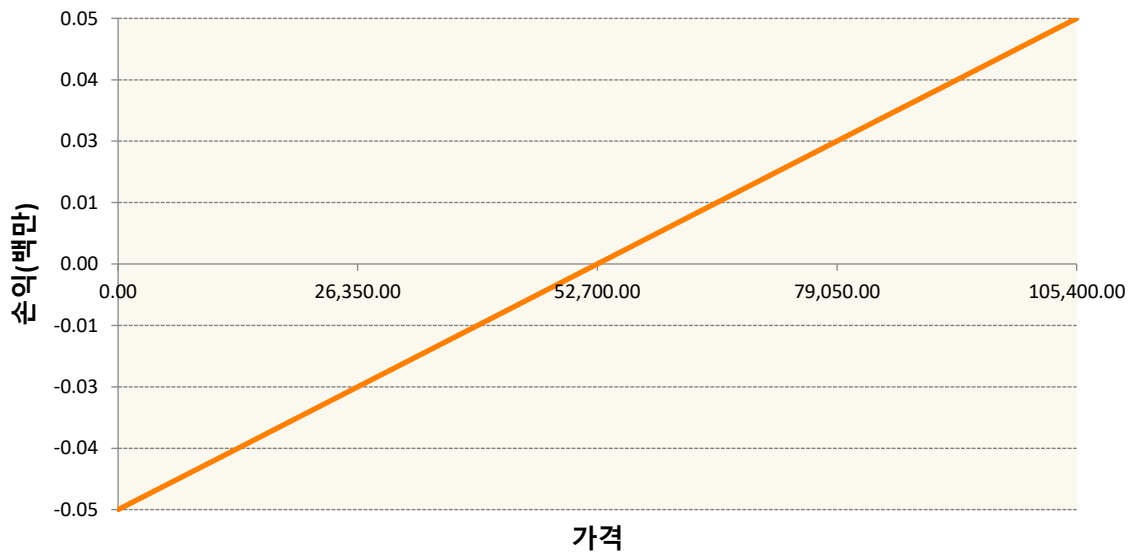
KR41F6W70002-2025-07 카카오뱅크개별선물



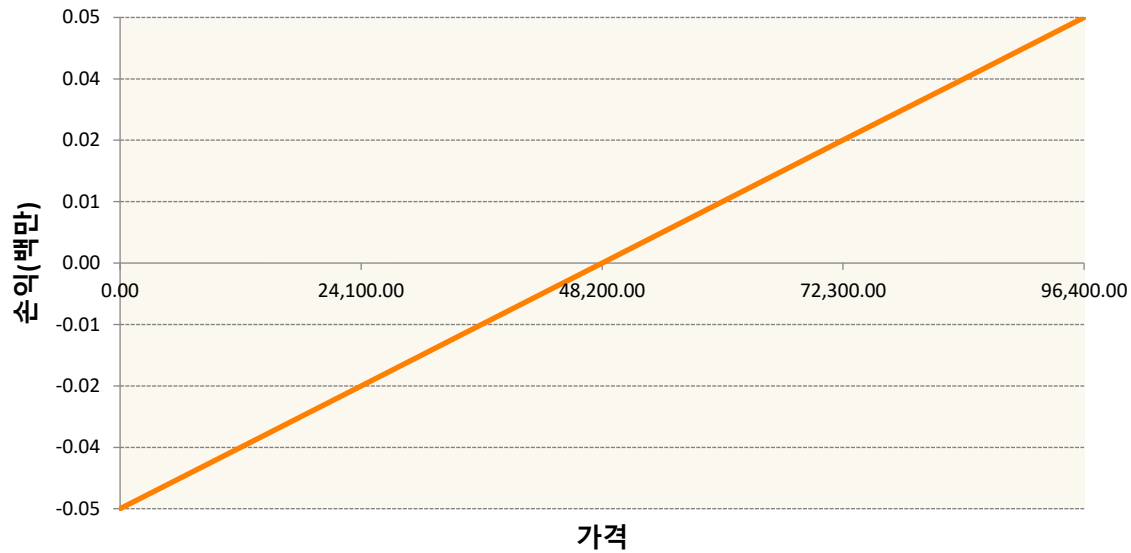
KR41F7W70000-2025-07 카카오페이개별선물



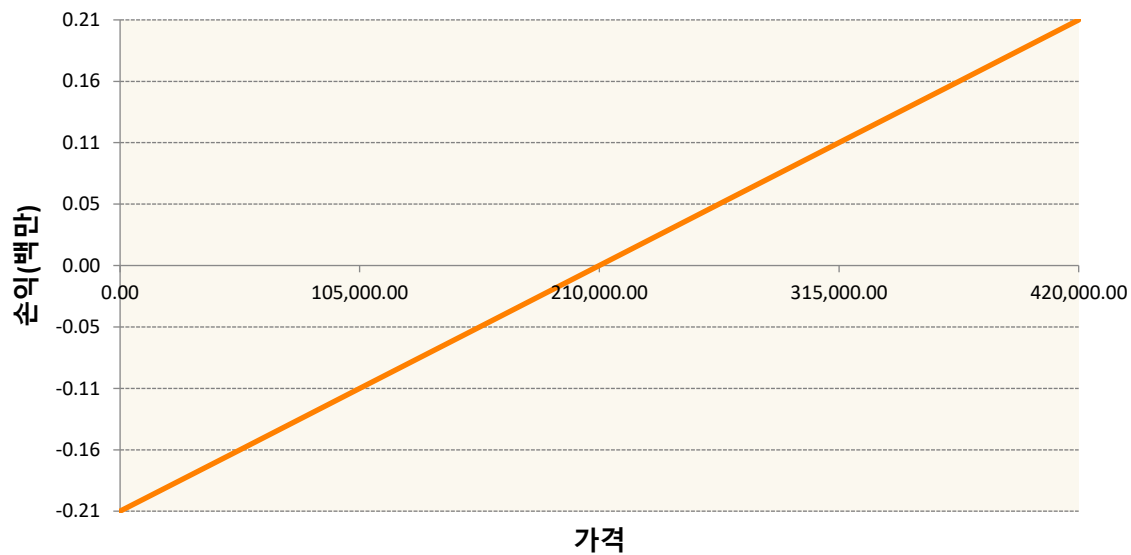
KR41FMW70003-2025-07 엘앤에프개별선물



KR41G0W70004-2025-07 씨에스원드개별선물



KR41HEW70006-2025-07 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	612
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	113
KR41F6W70(2025-07 카카오뱅크개별선물	101
KR41F7W70(2025-07 카카오페이개별선물	23
KR41FMW70 2025-07 엘앤에프개별선물	14
KR41G0W70(2025-07 씨에스원드개별선물	7

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

(단위:백만원)

1,992

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

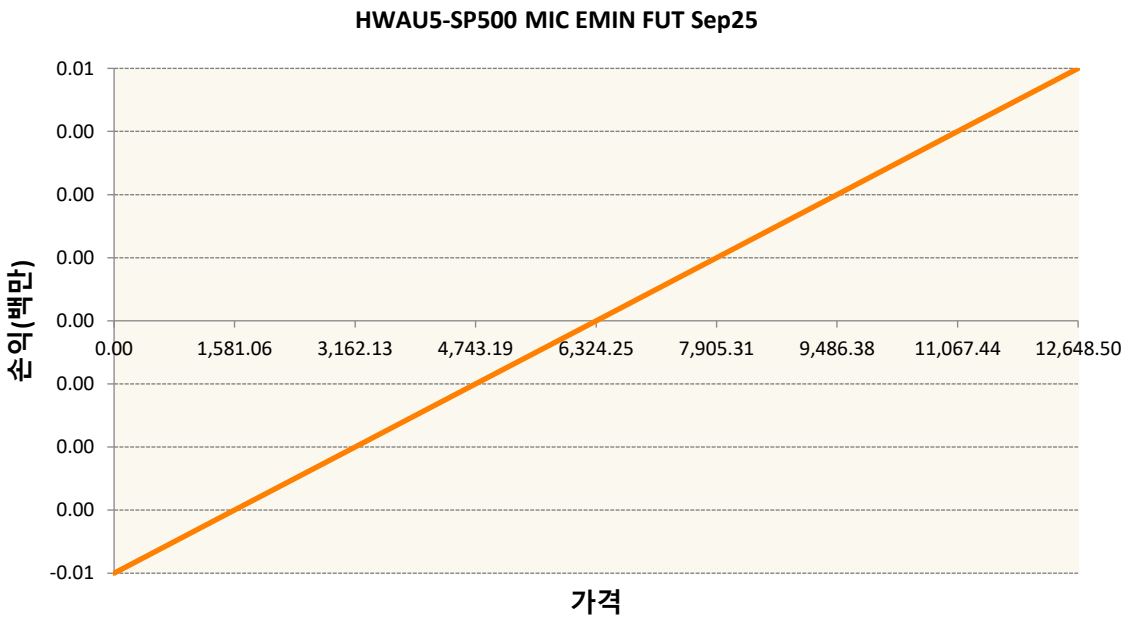
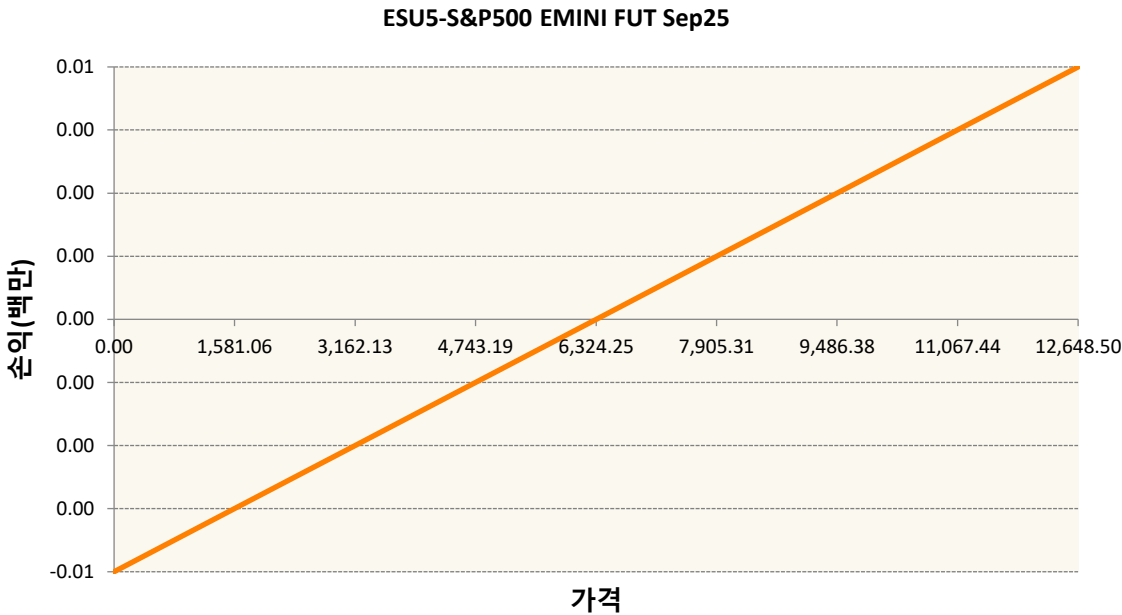
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	30,520	0	30,520	
누계	지수	선물	1,438	0	1,438	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,442
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	115

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,267

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

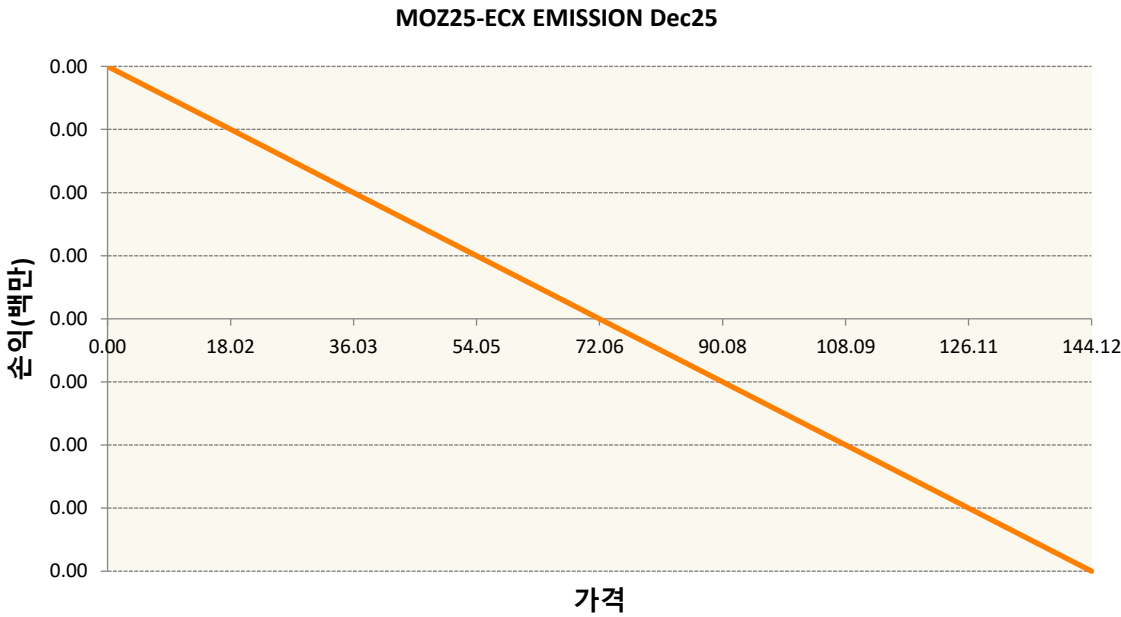
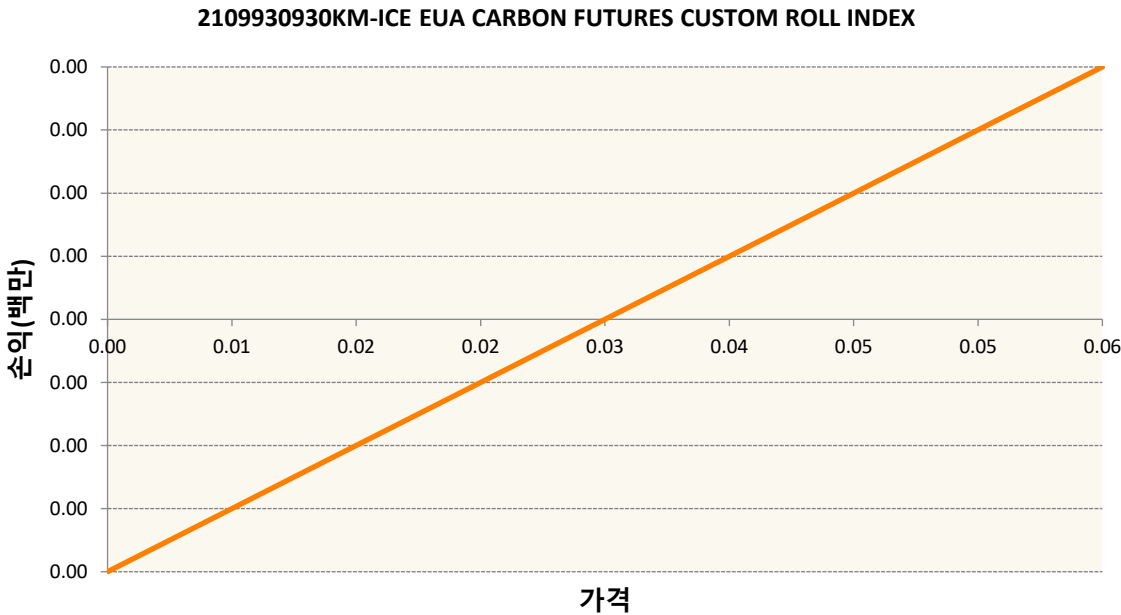
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	12	4,601	-4,590	
누계	통화	선도	0	1,007	-1,007	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		368

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	669

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

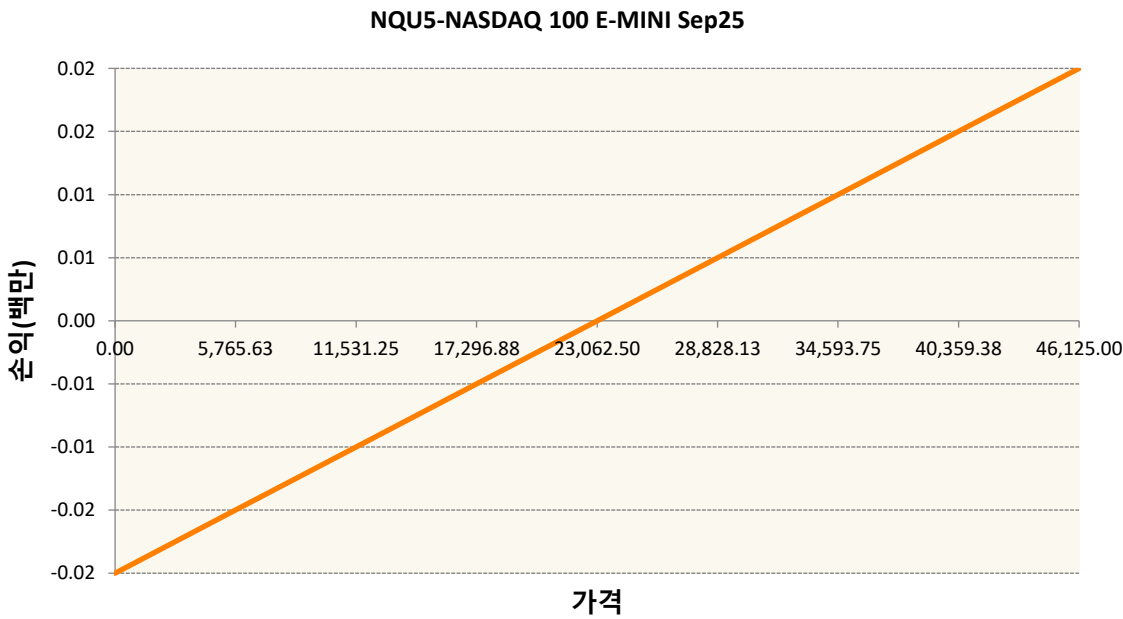
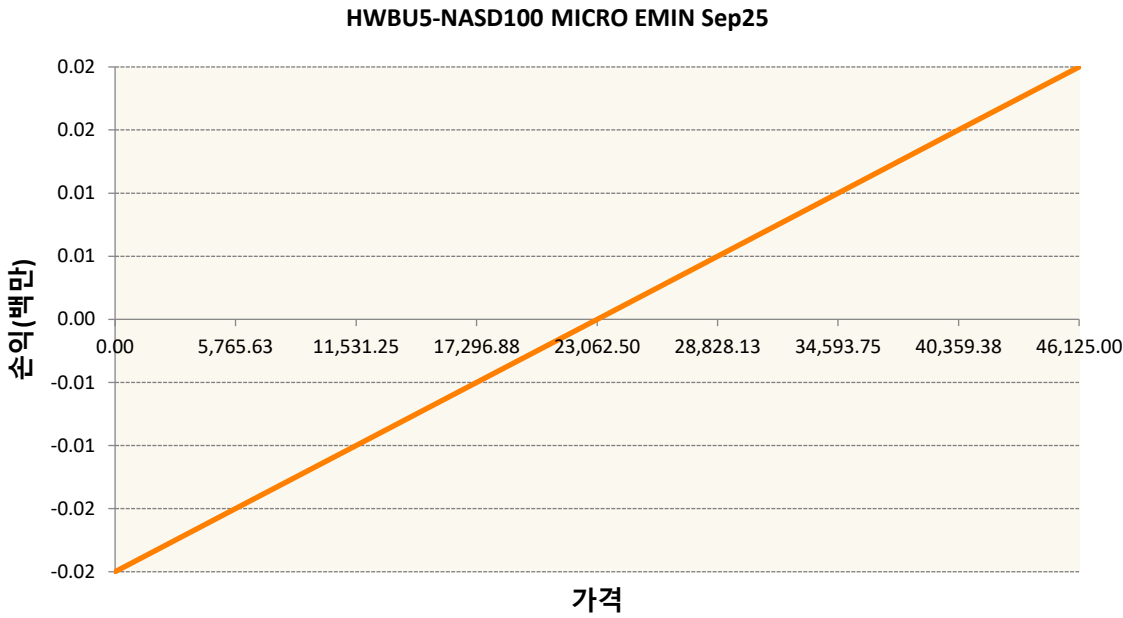
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,354	0	13,354	
누계	지수	선물	316	0	316	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25		25
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		1,068

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,257

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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	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	3,242
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,902
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,620

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

(단위:백만원)

10,716

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

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	5
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	5
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	5
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	5

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

(단위:백만원)

28

공시일	2025-07-07
기준일	2025-07-04

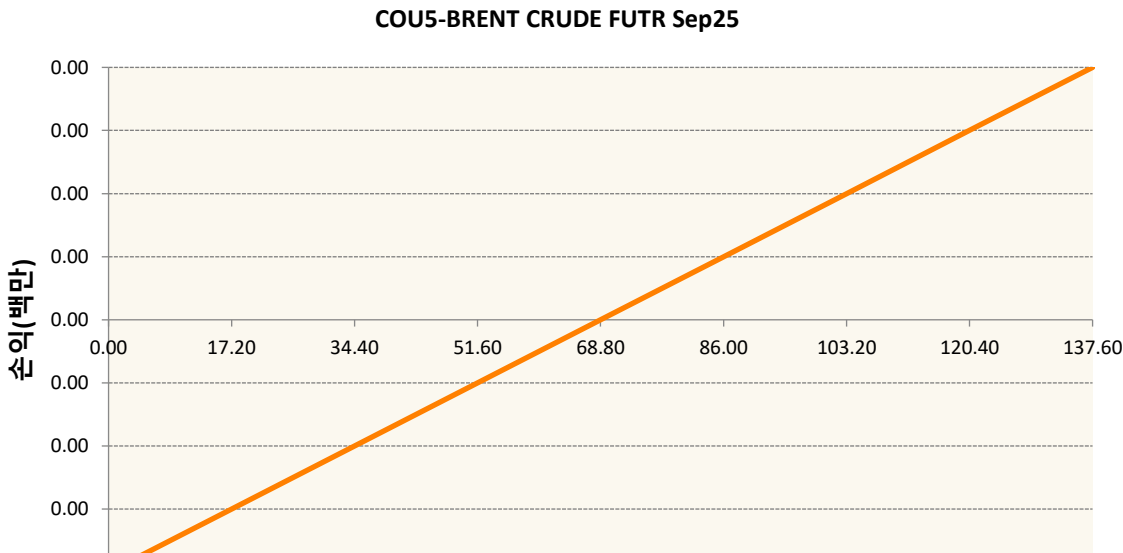
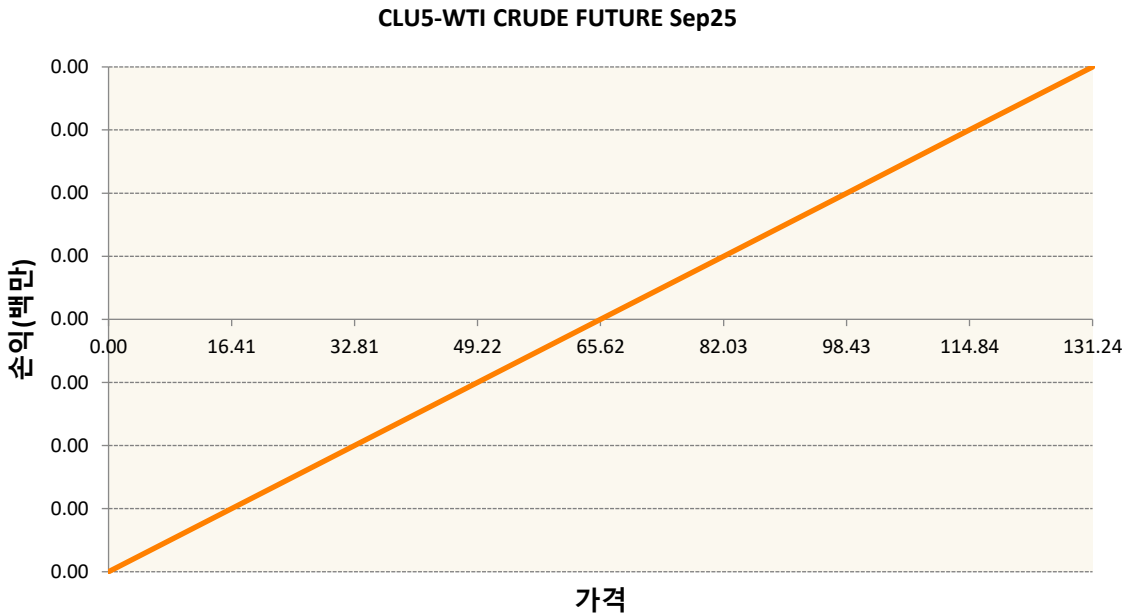
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

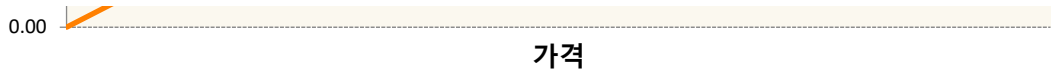
1. 계약금액

(단위:백만원)

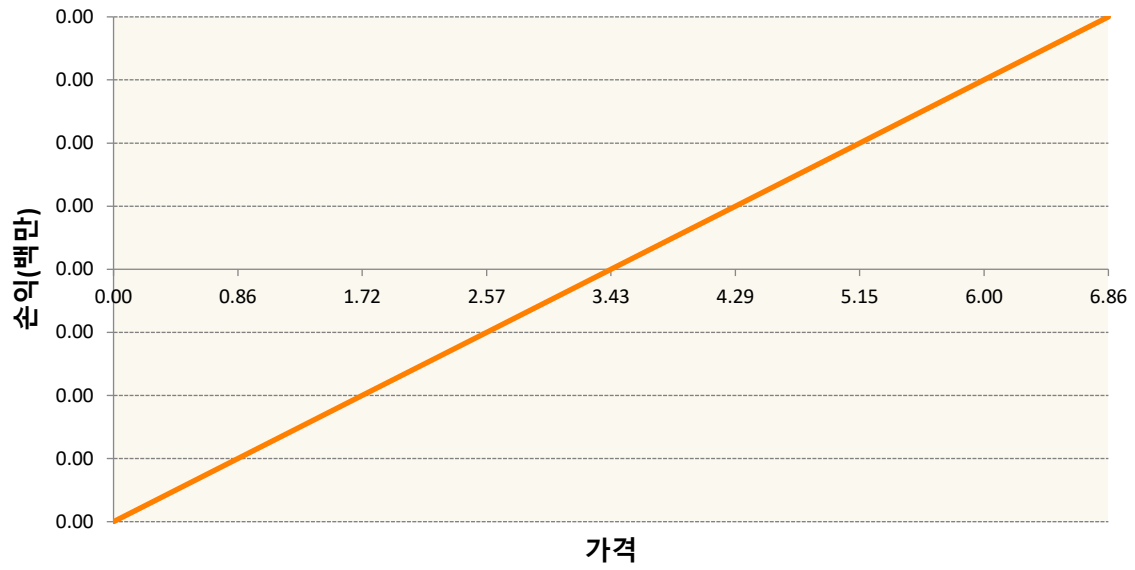
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	329	0	329	
누계	유가증권	선물	285	0	285	
누계	통화	선물	0	109	-109	장내

2. 만기시점의 손익구조

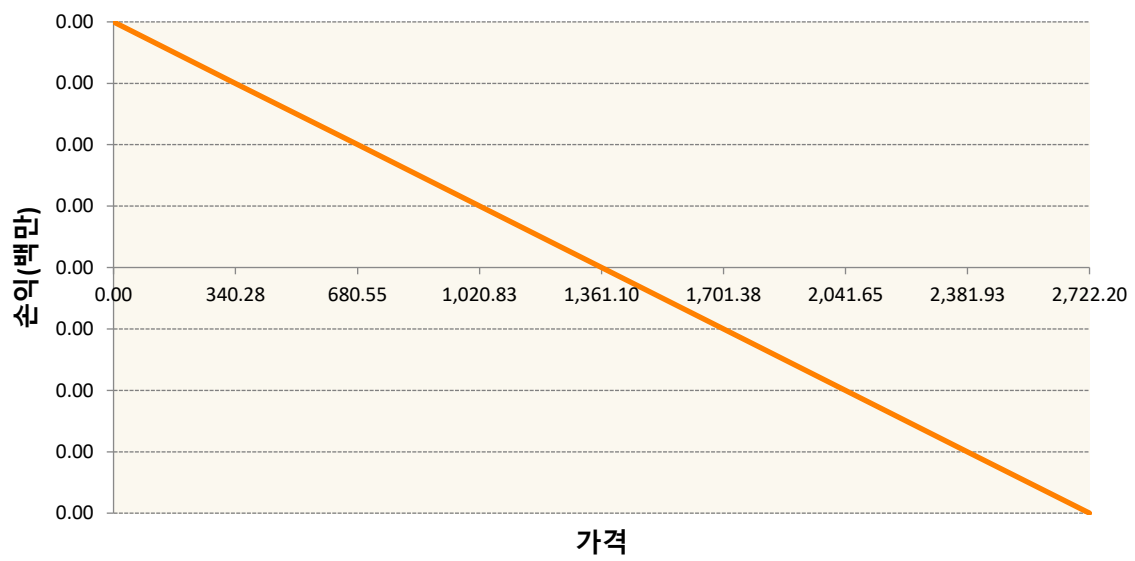




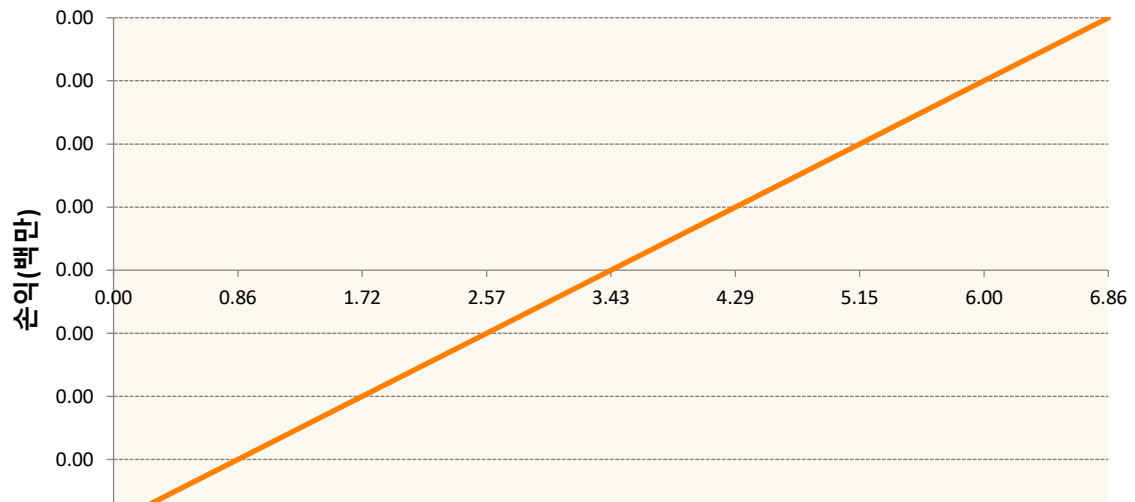
EOU5-E-MINI NATURAL GAS Sep25

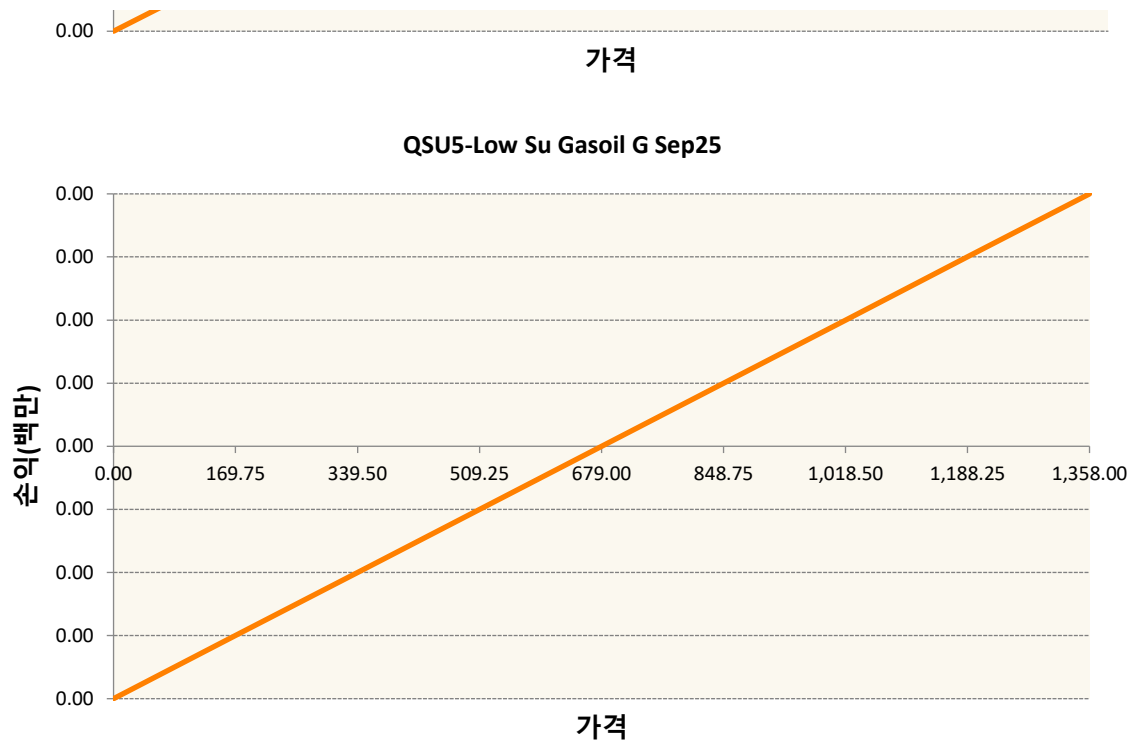


KR4175W70003-2025-07 달러선물



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	11
QSU5	Low Su Gasoil G Sep25	7

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

(단위:백만원)

122