

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

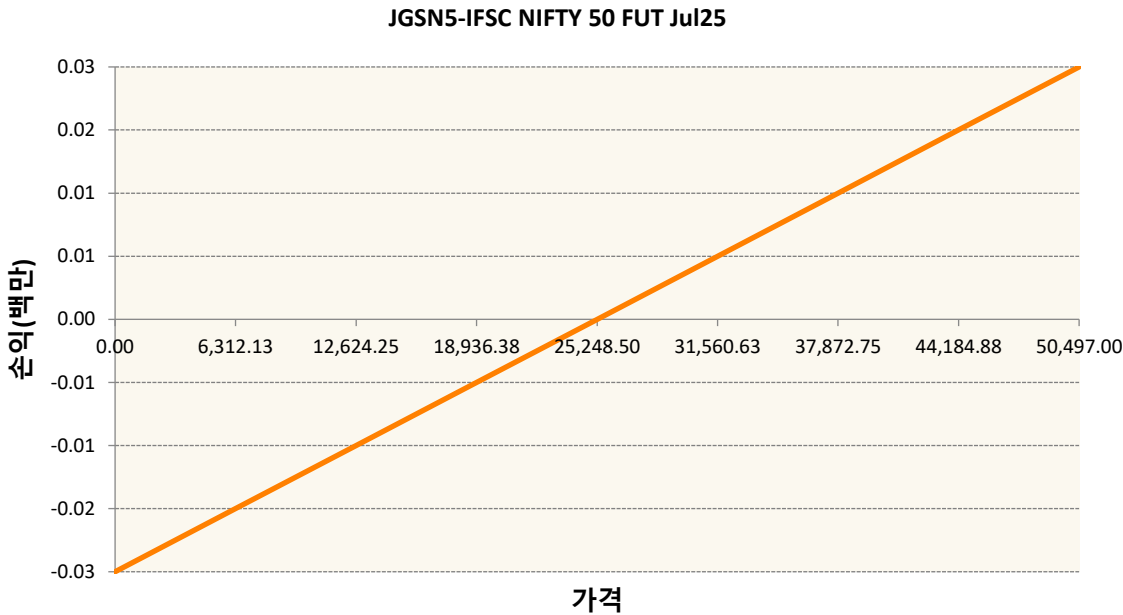
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	619	0	619	

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	2025-07-25
기준일	2025-07-24

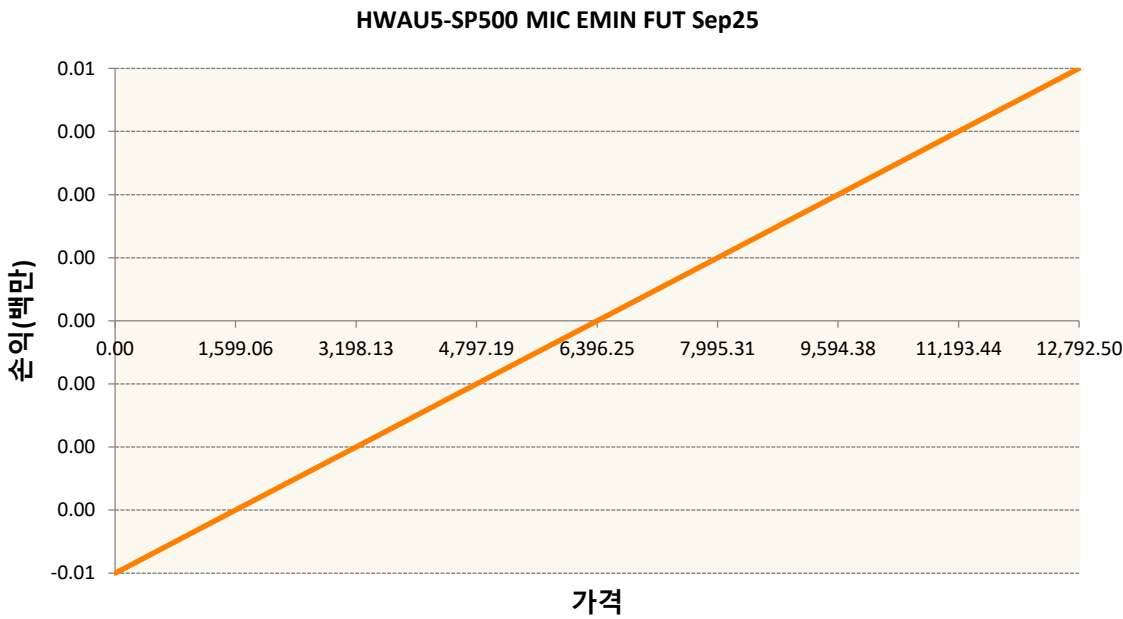
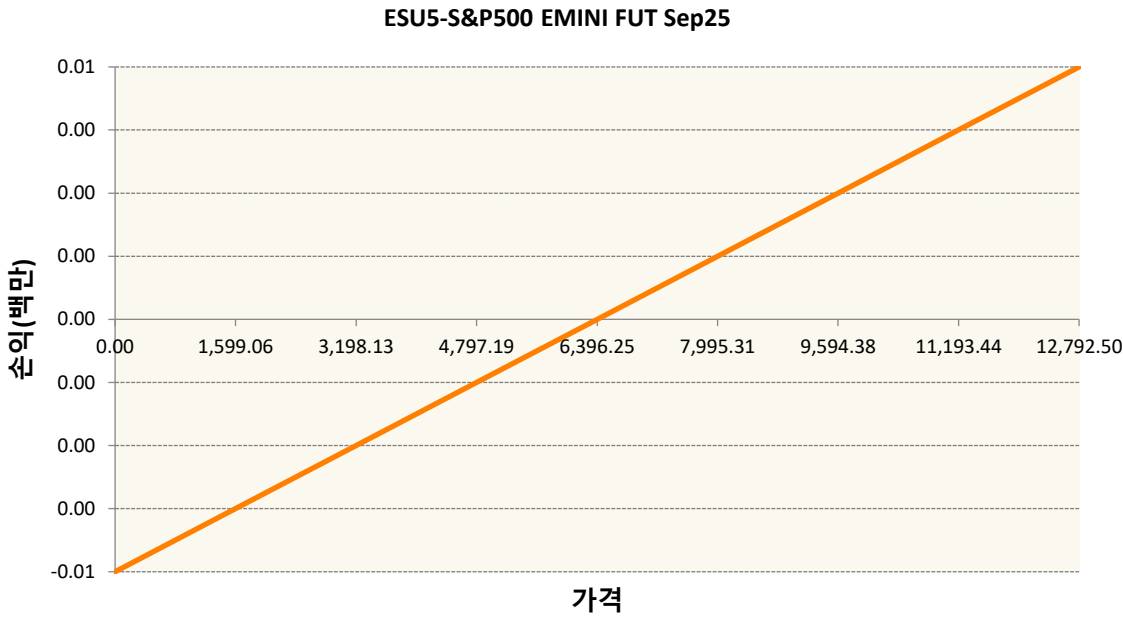
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	879	0	879	
누계	지수	선물	44	0	44	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	70
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	65

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

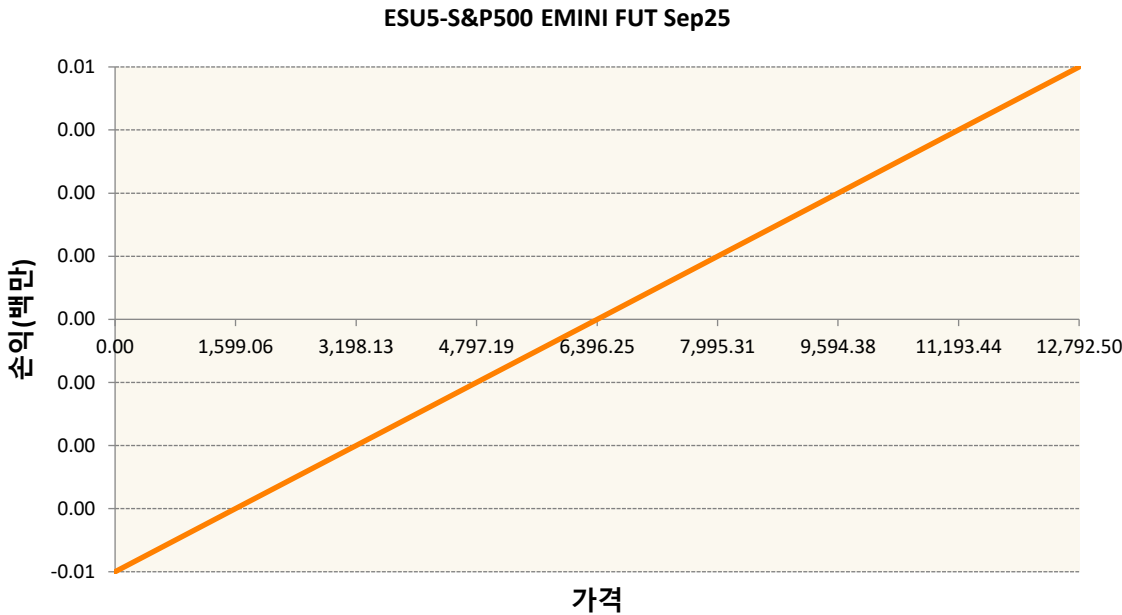
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	지수	선물	1,324	0	1,324	
누계	통화	선도	7,274	7,274	0	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	106
FXW213F79C	KRW/USD 25-07-25E	582
FXW213F7A	(USD/KRW 25-07-25E	582

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

(단위:백만원)

671

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

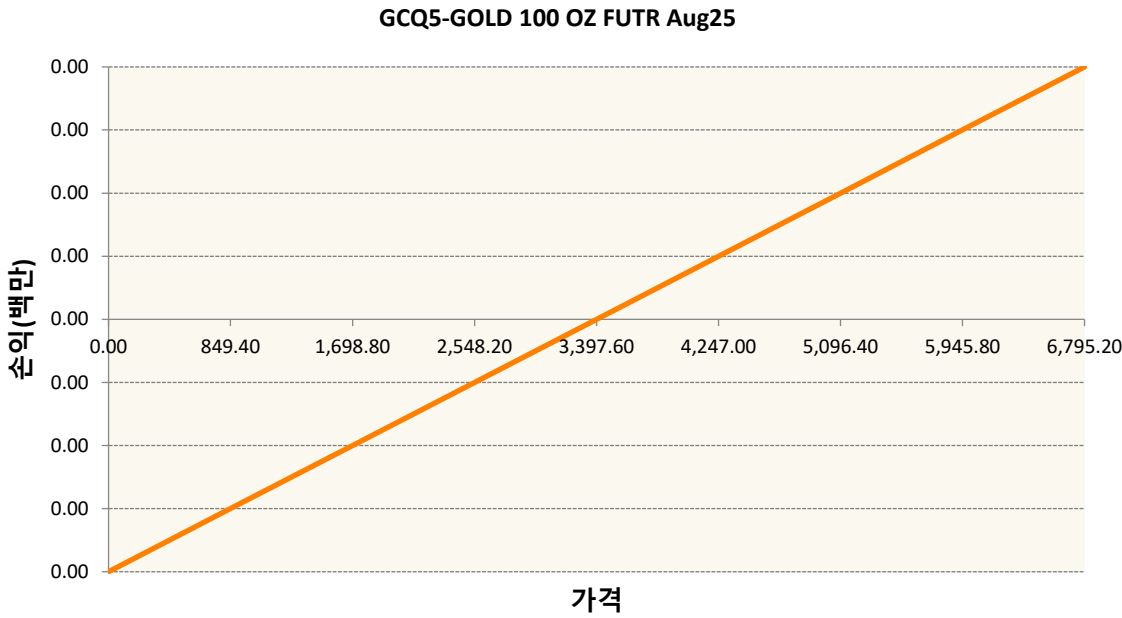
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,869	0	1,869	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 07/25/25 C310 EQUITY	0.33
GQC5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25	150

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

(단위:백만원)

129

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

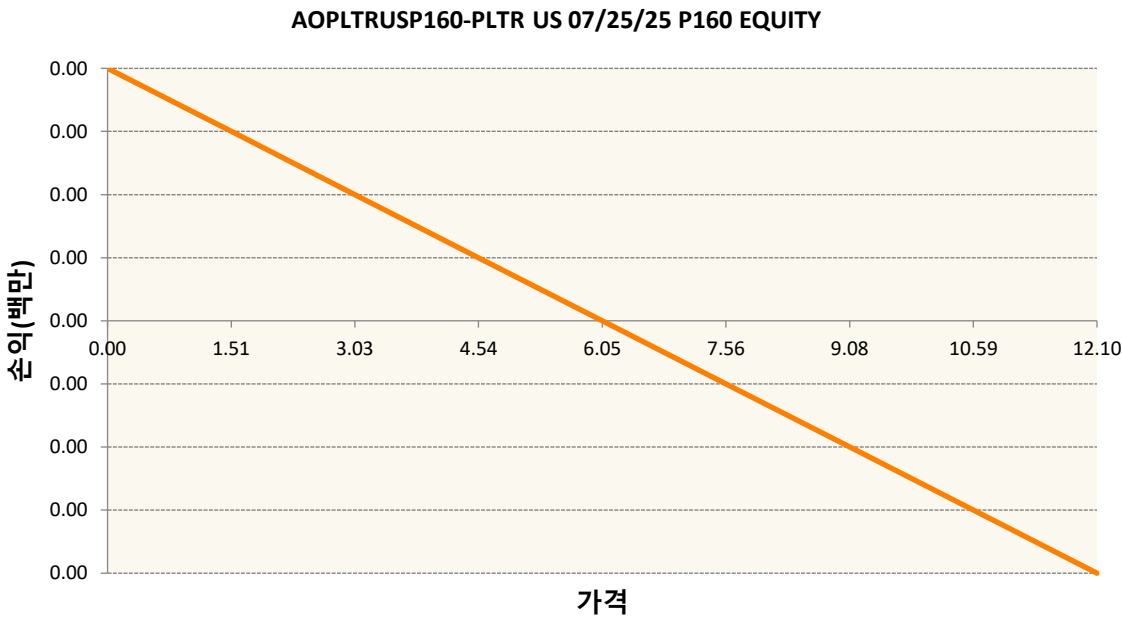
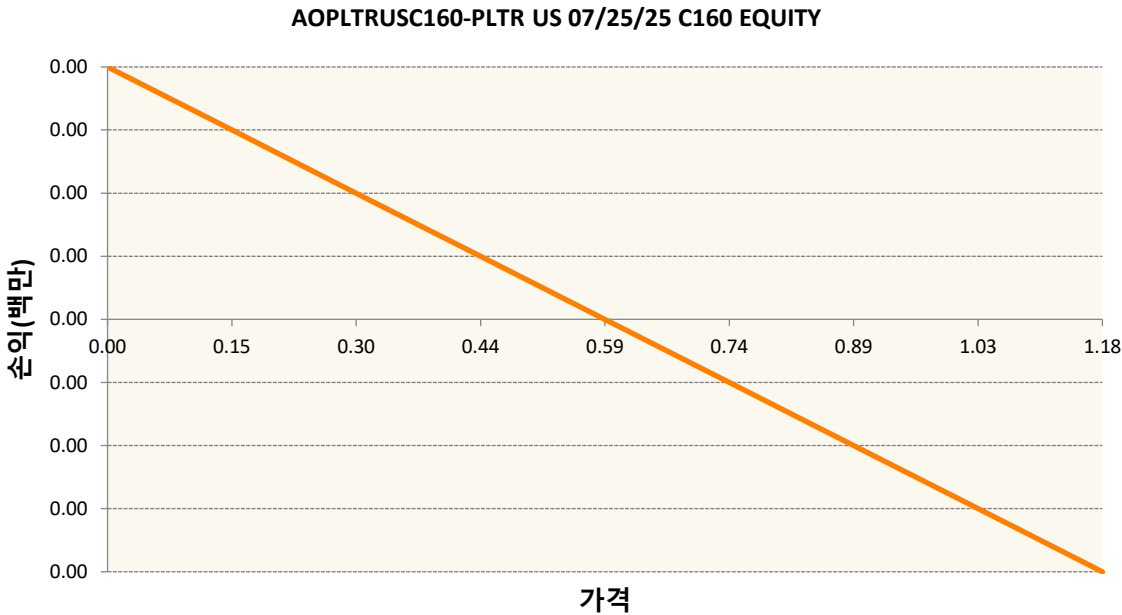
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	353	-353	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOPLTRUSC' PLTR US 07/25/25 C155 EQUITY		1
AOPLTRUSC' PLTR US 07/25/25 C160 EQUITY		12
AOPLTRUSP1 PLTR US 07/25/25 P155 EQUITY		0.33
AOPLTRUSP1 PLTR US 07/25/25 P160 EQUITY		16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	120

공시일 2025-07-25

기준일 2025-07-24

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

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	2025-07-25
기준일	2025-07-24

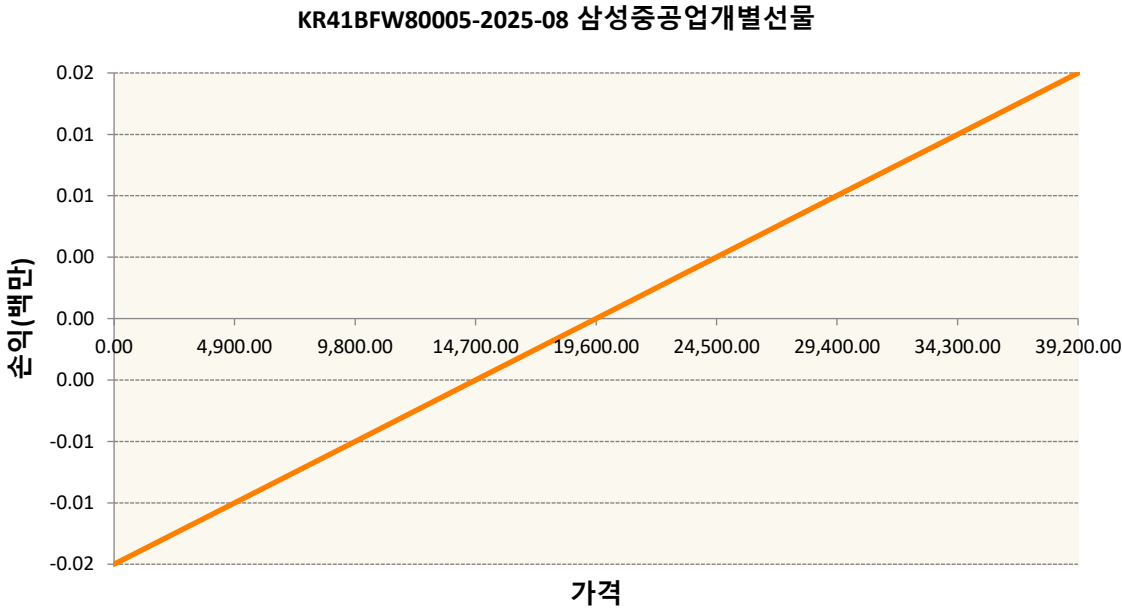
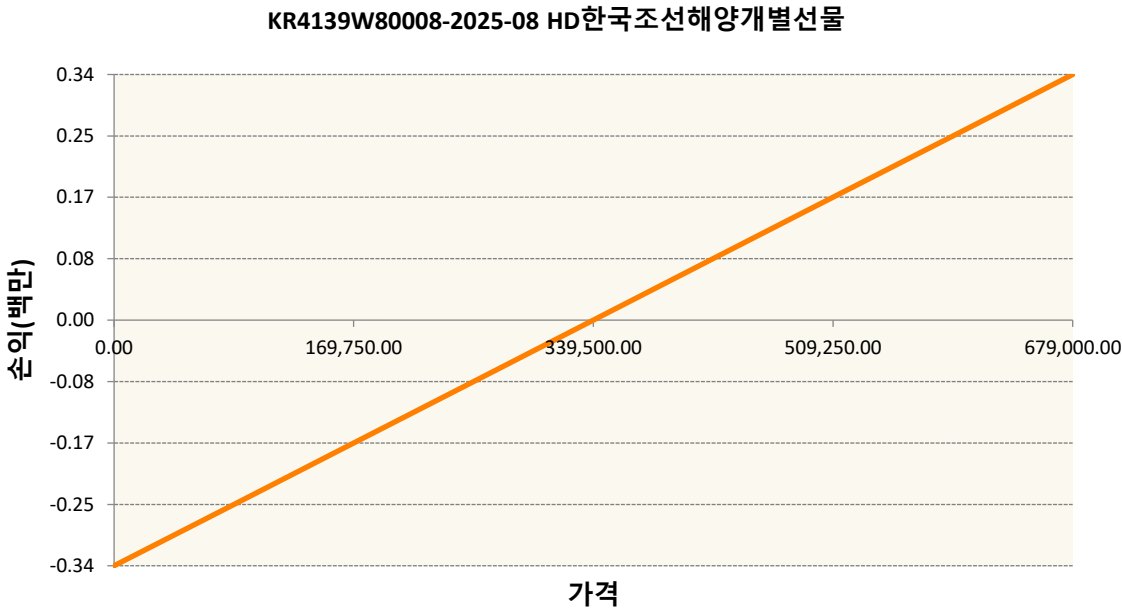
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	18,104	0	18,104	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격	순이익(백만)
0.00	-0.20
98,800.00	-0.10
197,600.00	0.00
296,400.00	0.10
395,200.00	0.20

가액	순익 (백만)
0.00	-0.09
44,250.00	-0.04
88,500.00	0.00
132,750.00	0.04
177,000.00	0.09

(단위:백만원)

KR4139W80008			2025-08 HD한국조선해양개별선물				378
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378
-5.33%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	126	126	126	126	126	126	126
5.33%	252	252	252	252	252	252	252
8.00%	378	378	378	378	378	378	378
KR41BFW80005			2025-08 삼성중공업개별선물				401
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-401	-401	-401	-401	-401	-401	-401
-5.33%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268
-2.67%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	134	134	134	134	134	134	134
5.33%	268	268	268	268	268	268	268
8.00%	401	401	401	401	401	401	401

KR41CDW80008

2025-08 HD현대미포개별선물

250

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	250	250	250	250	250	250	250

KR41FVW80003

2025-08 한화오션개별선물

412

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-412	-412	-412	-412	-412	-412	-412
-5.33%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-2.67%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	137	137	137	137	137	137	137
5.33%	275	275	275	275	275	275	275
8.00%	412	412	412	412	412	412	412

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

(단위:백만원)

981

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

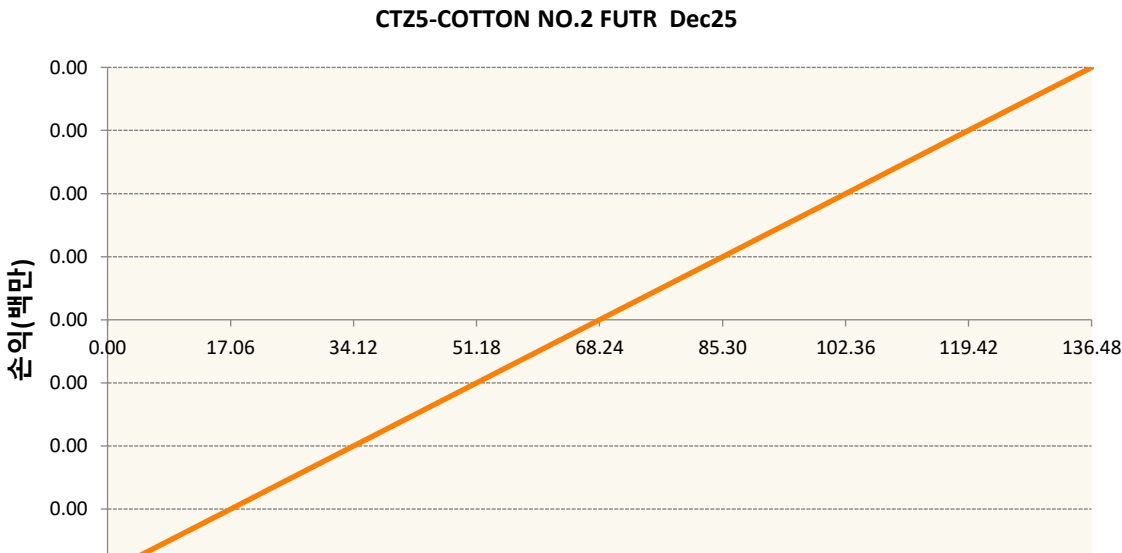
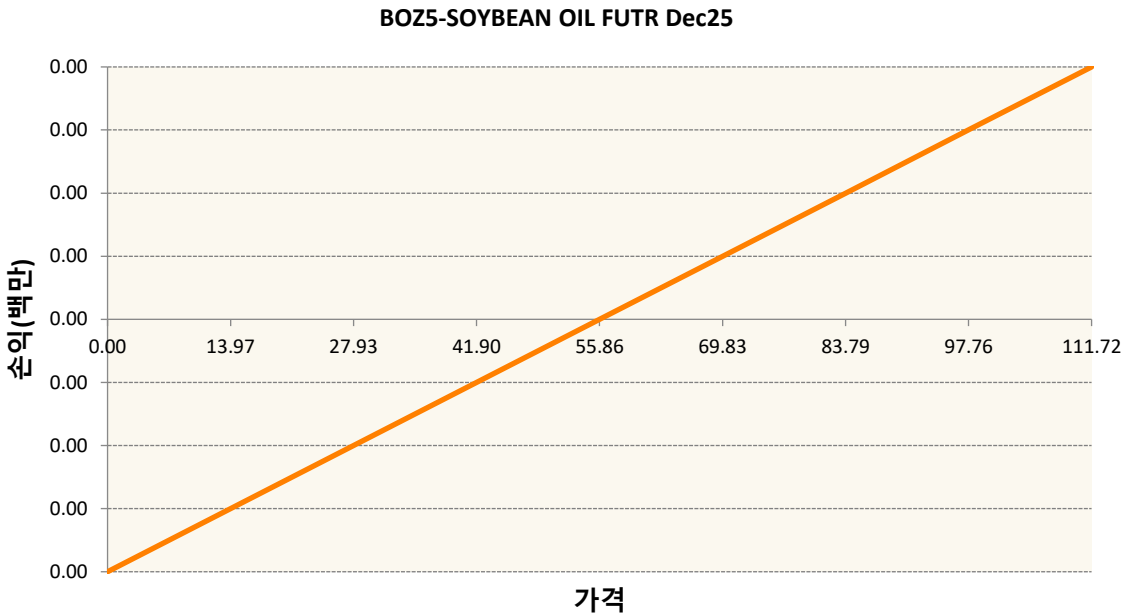
포커스농산물모(채권-파생형)

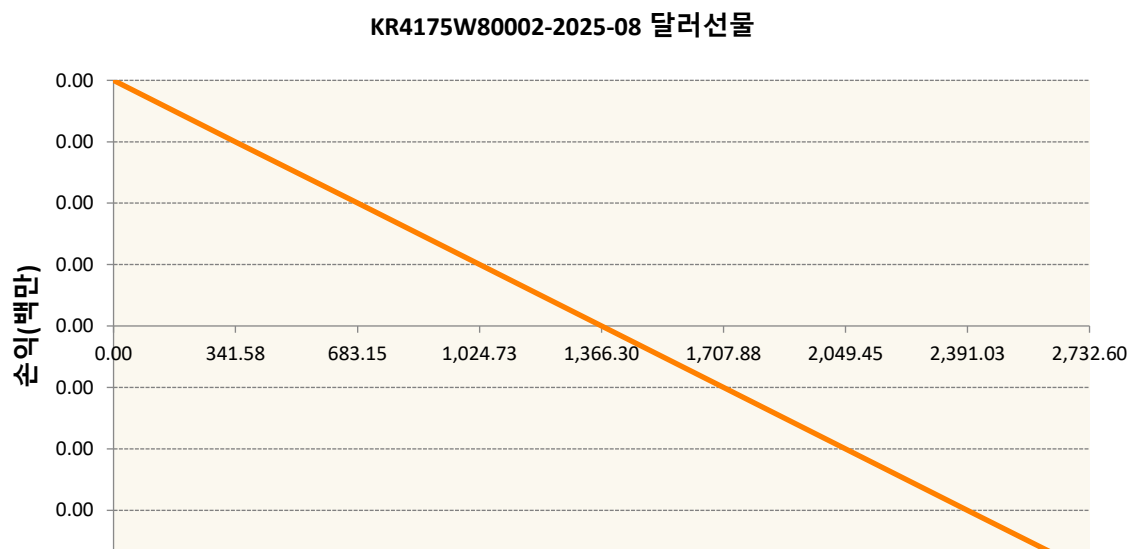
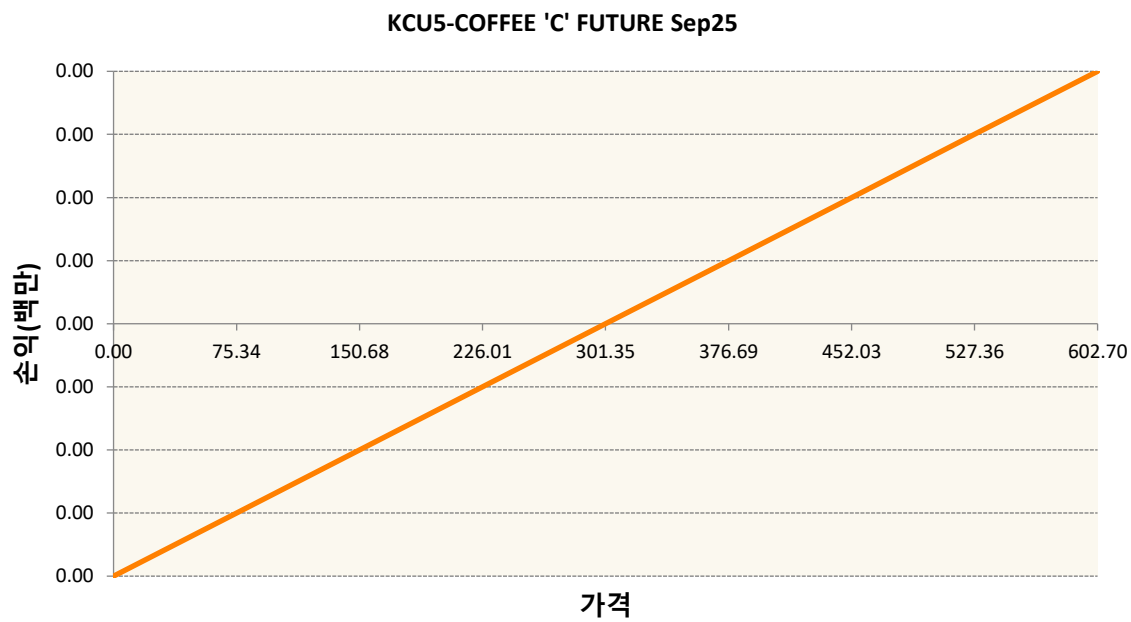
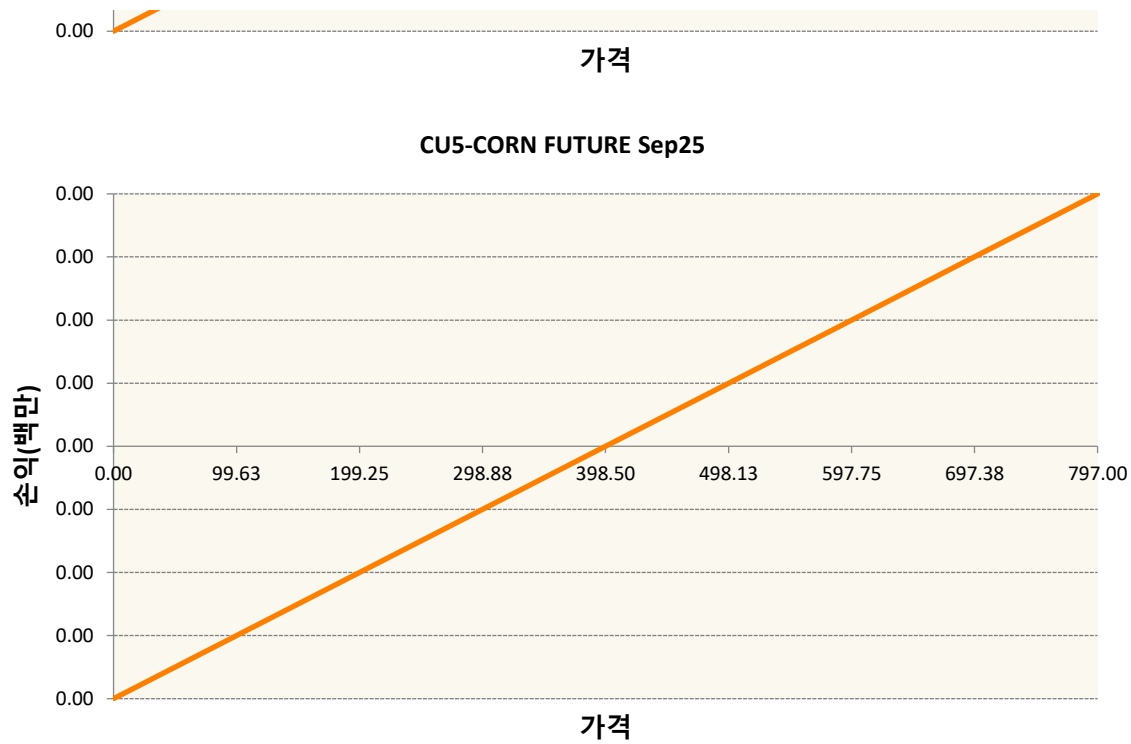
1. 계약금액

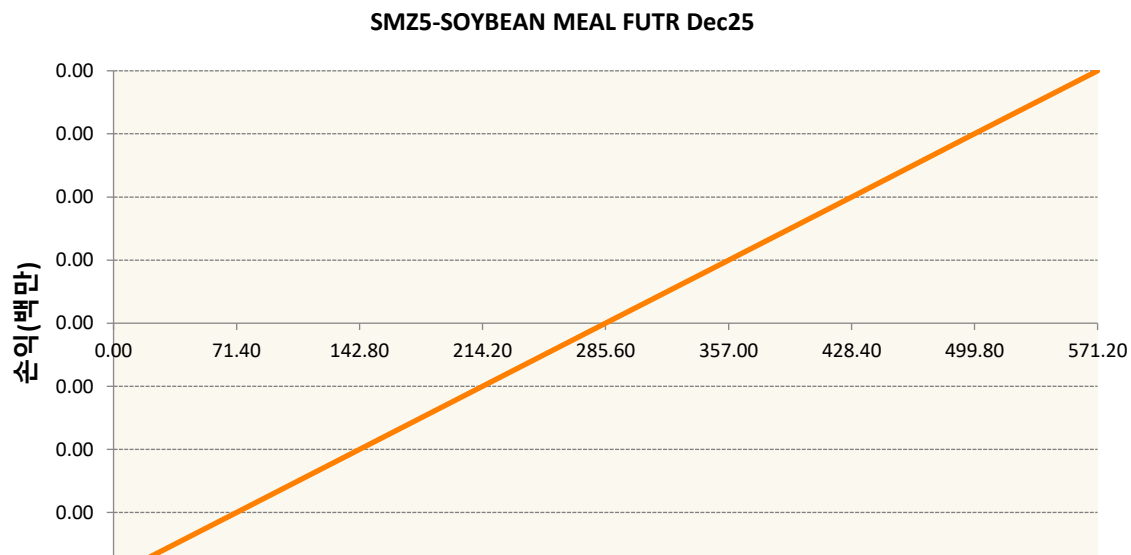
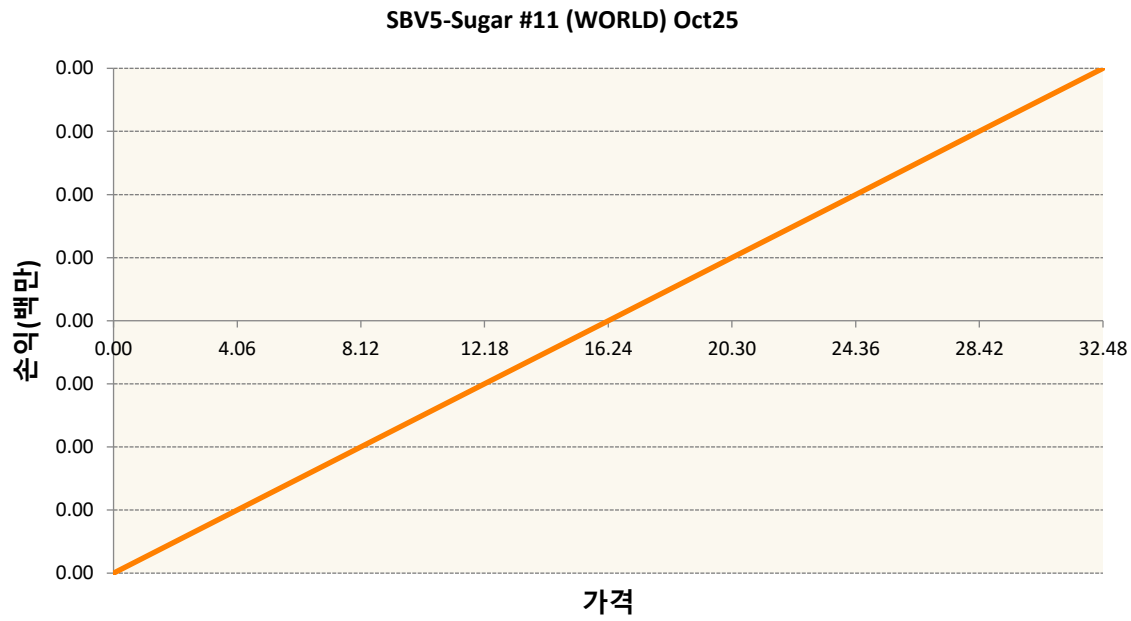
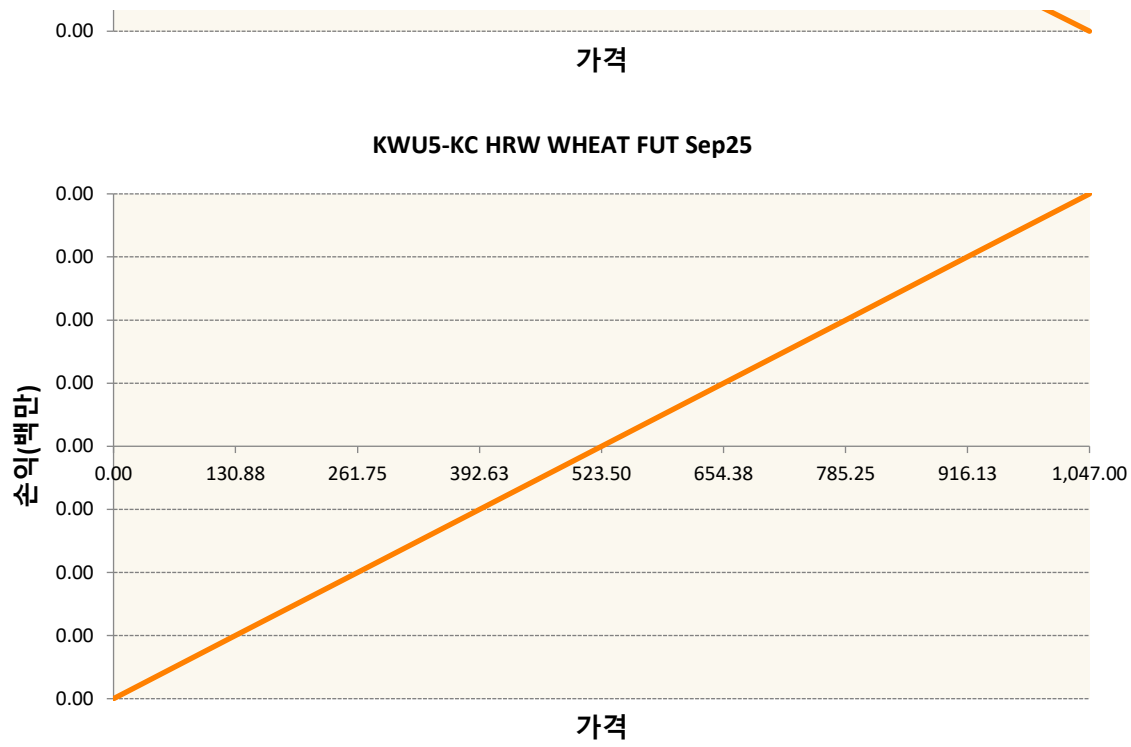
(단위:USD 백만)

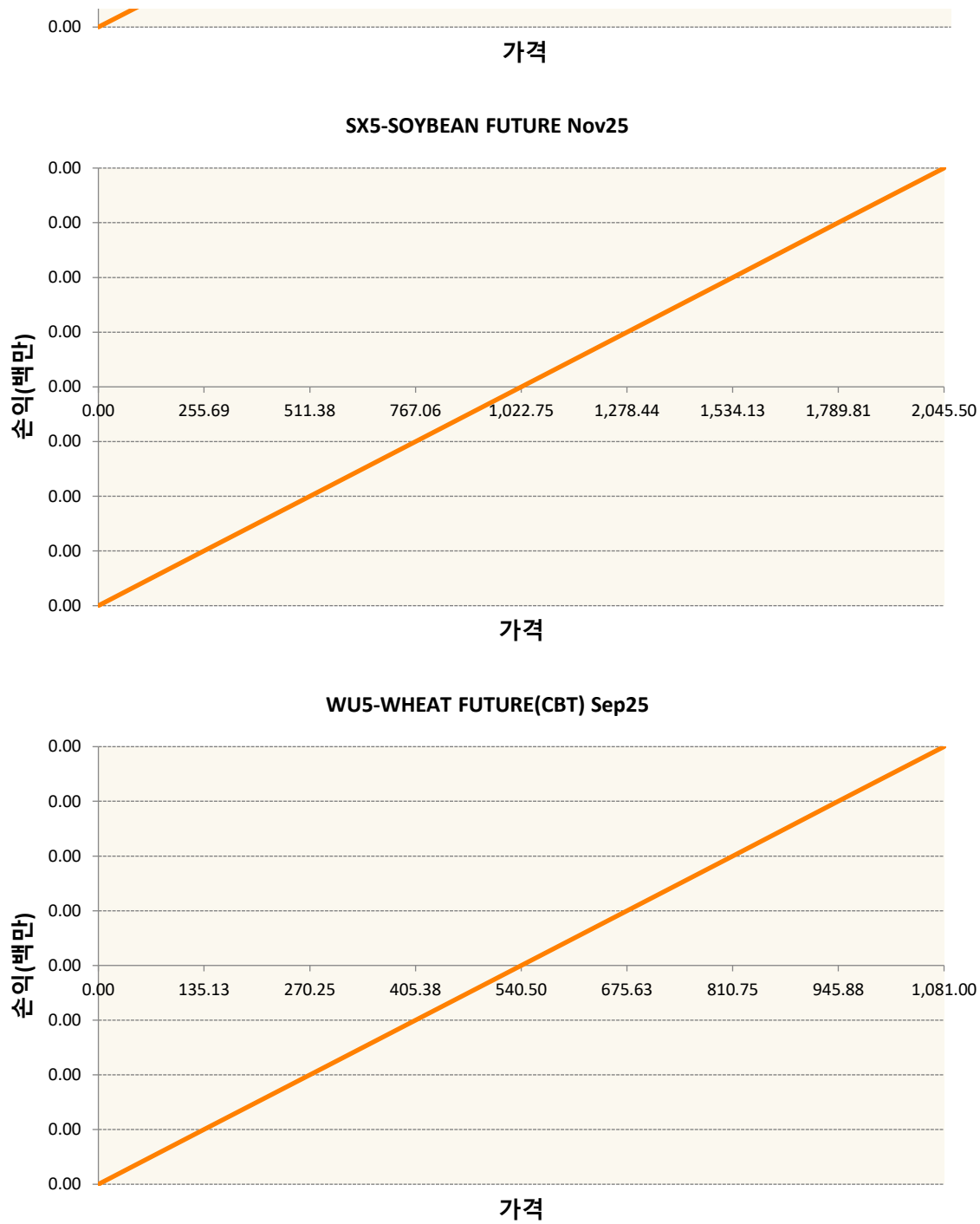
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,553	0	1,553	
누계	유가증권	선물	1,930	0	1,930	
누계	통화	선물	0	260	-260	장내

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	2025-07-25
기준일	2025-07-24

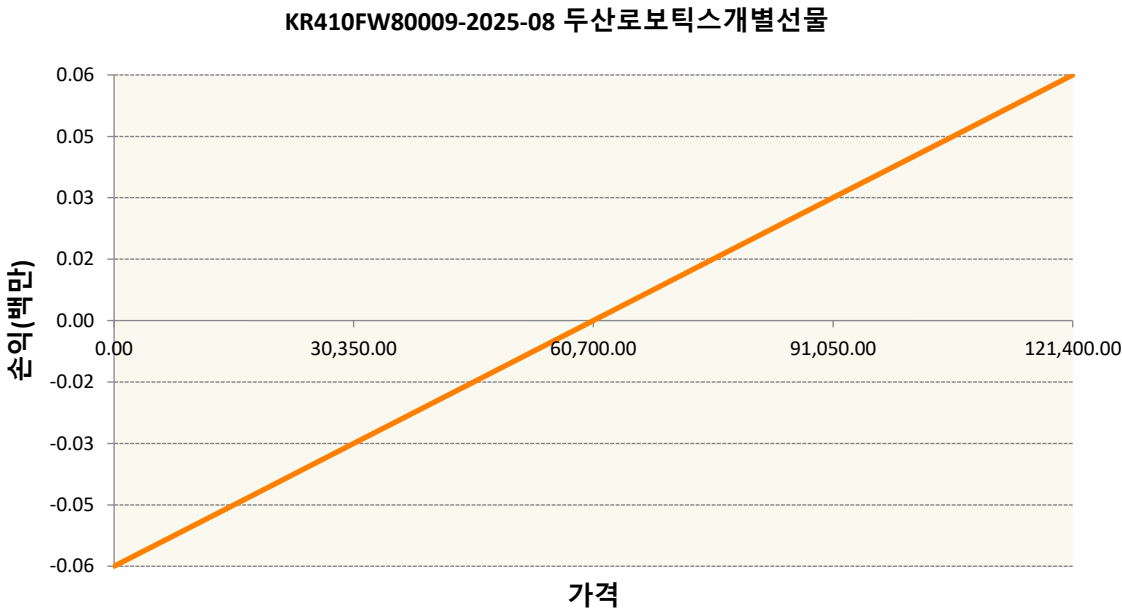
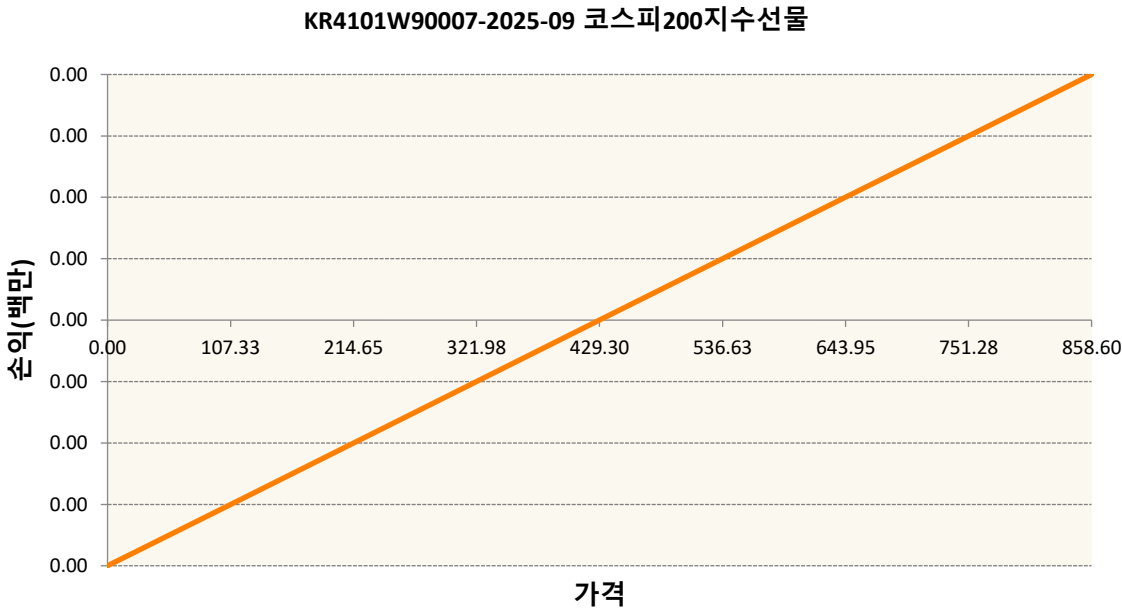
스마트인덱스모

1. 계약금액

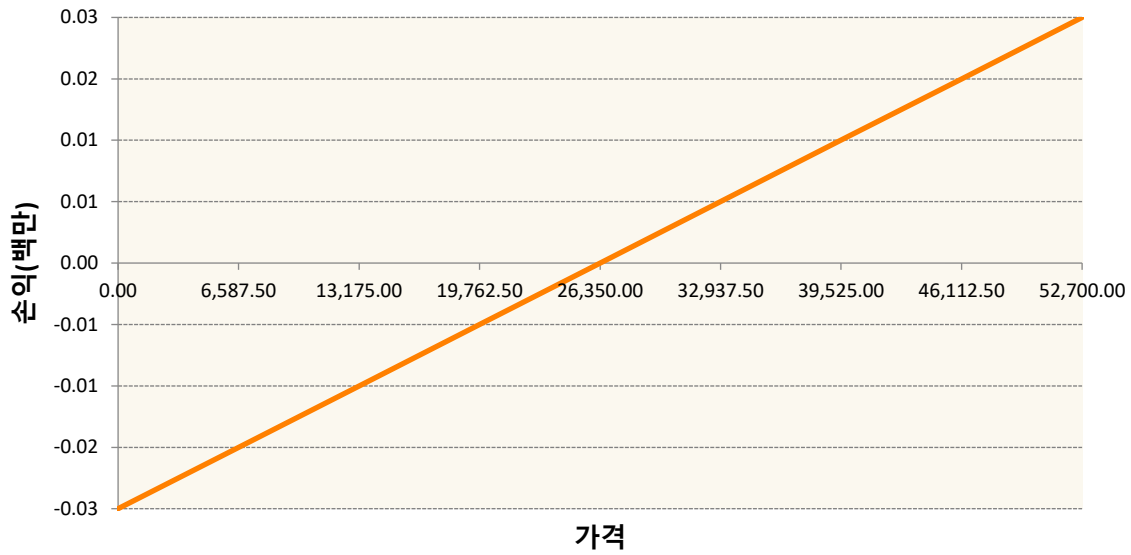
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	892	0	892	장내

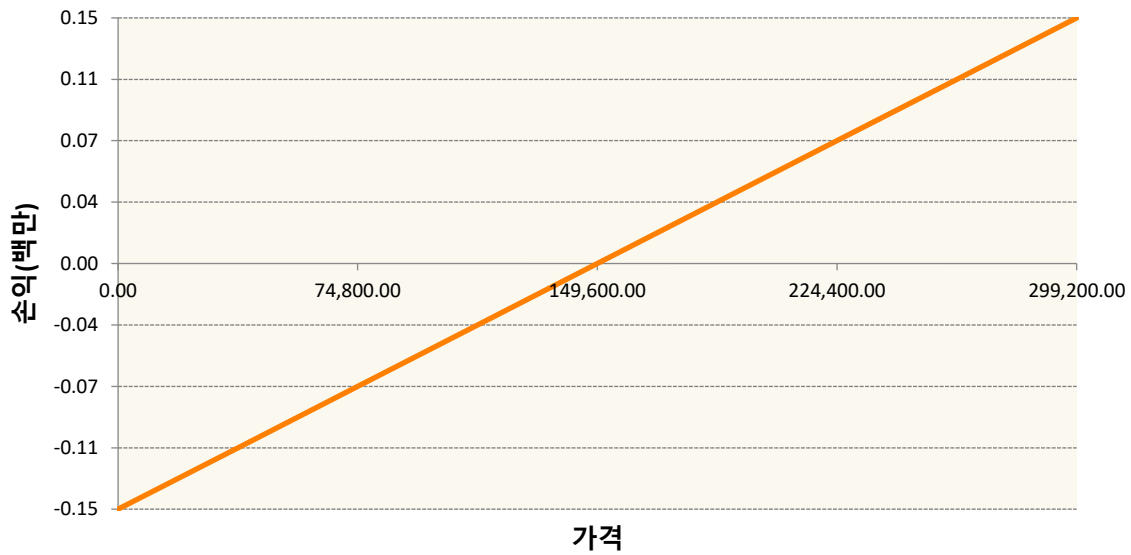
2. 만기시점의 손익구조



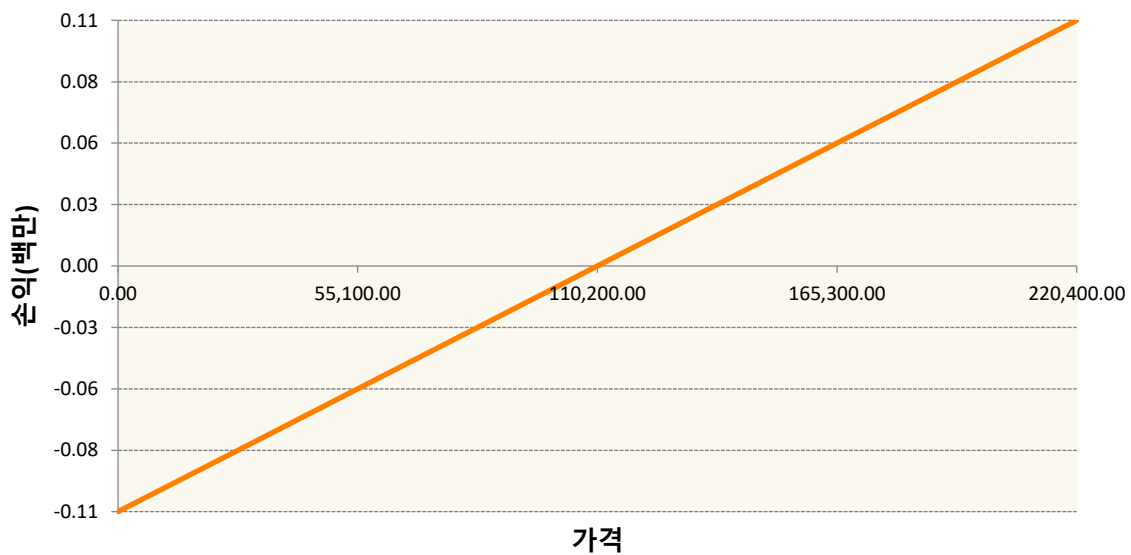
KR41CNW80007-2025-08 포스코DX개별선물



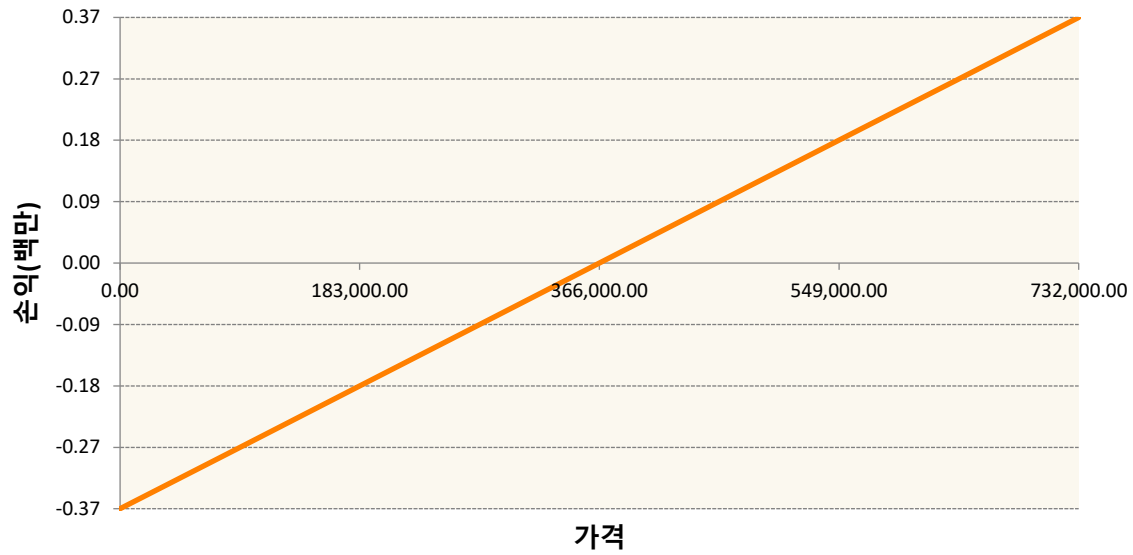
KR41E8W80008-2025-08 포스코퓨처엠개별선물



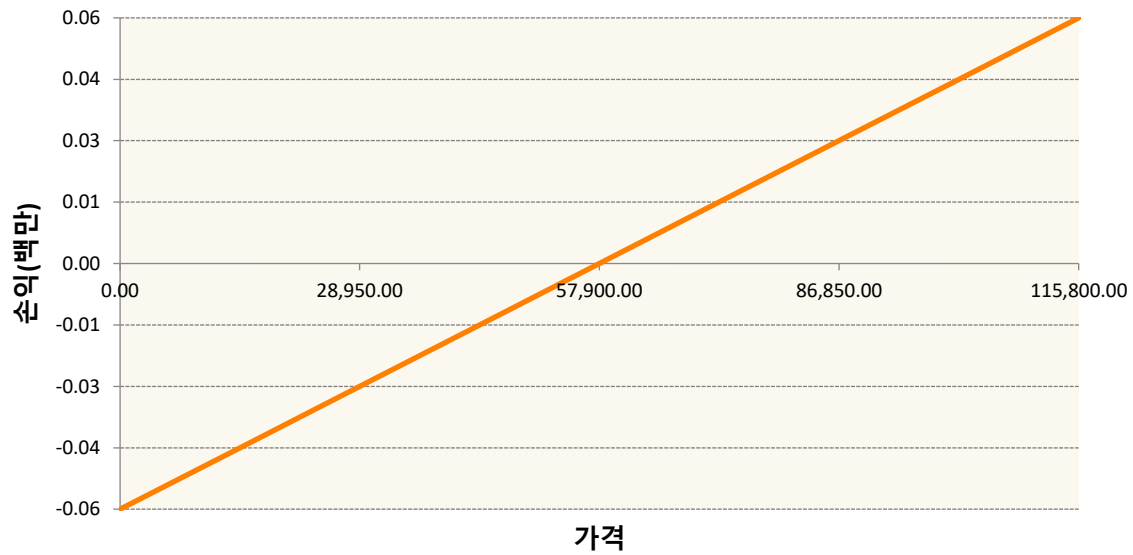
KR41EJW80001-2025-08 SKC개별선물



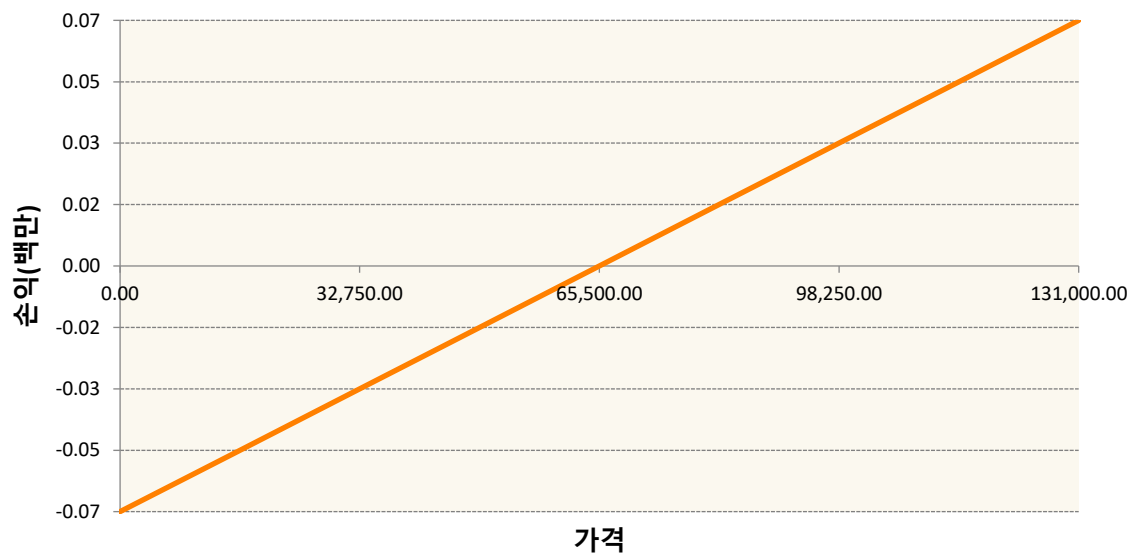
KR41F5W80003-2025-08 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7W80009-2025-08 카카오페이개별선물



KR41FMW80002-2025-08 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	43
KR410FW80(2025-08 두산로보틱스개별선물	1
KR41CNW80 2025-08 포스코DX개별선물	1
KR41E8W80(2025-08 포스코퓨처엠개별선물	5
KR41EJW800 2025-08 SKC개별선물	2
KR41F5W80(2025-08 LG에너지솔루션개별선물	15
KR41F7W80(2025-08 카카오페이개별선물	2
KR41FMW80 2025-08 엘앤에프개별선물	2

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

88

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

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	323
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

513

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

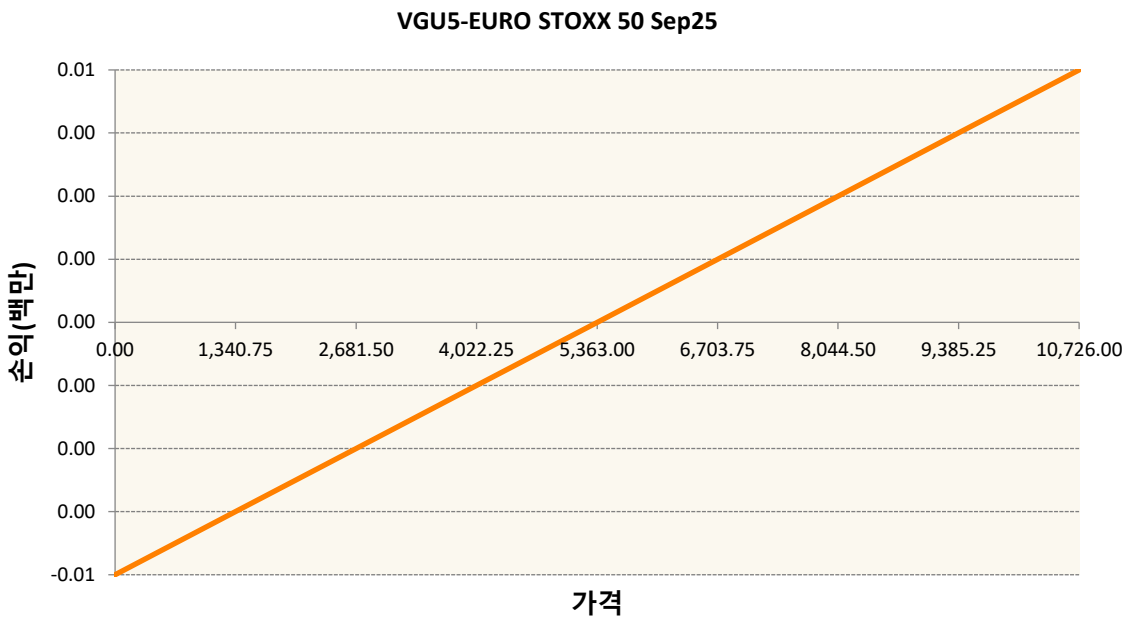
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	848	0	848	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU5	EURO STOXX 50 Sep25	68
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

56

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

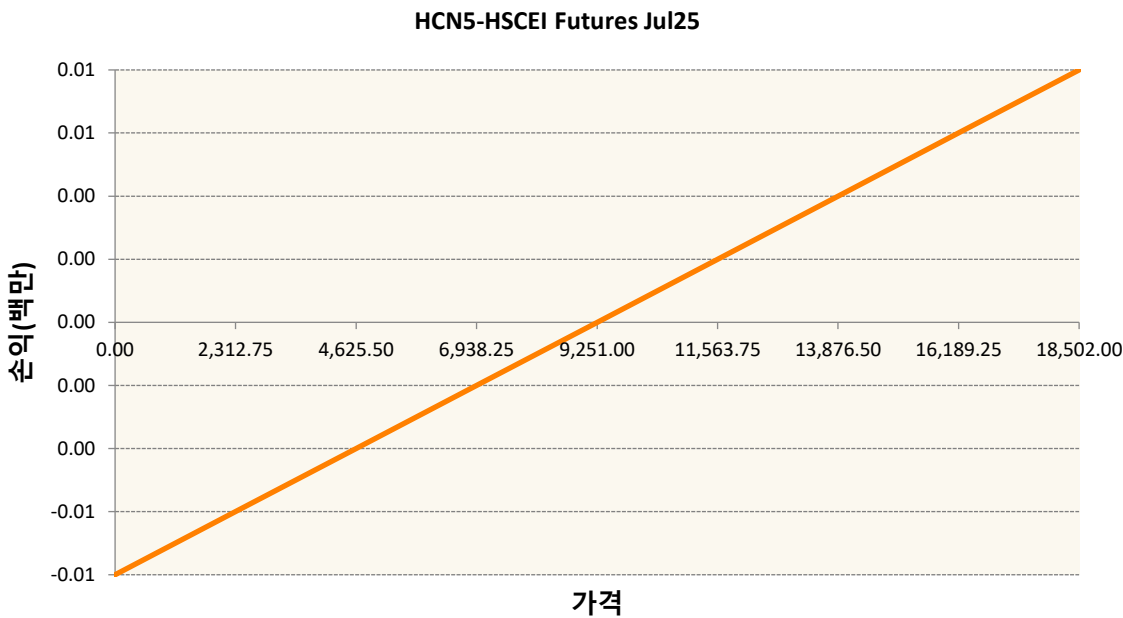
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,087	0	2,087	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN5	HSCEI Futures Jul25	167
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

239

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

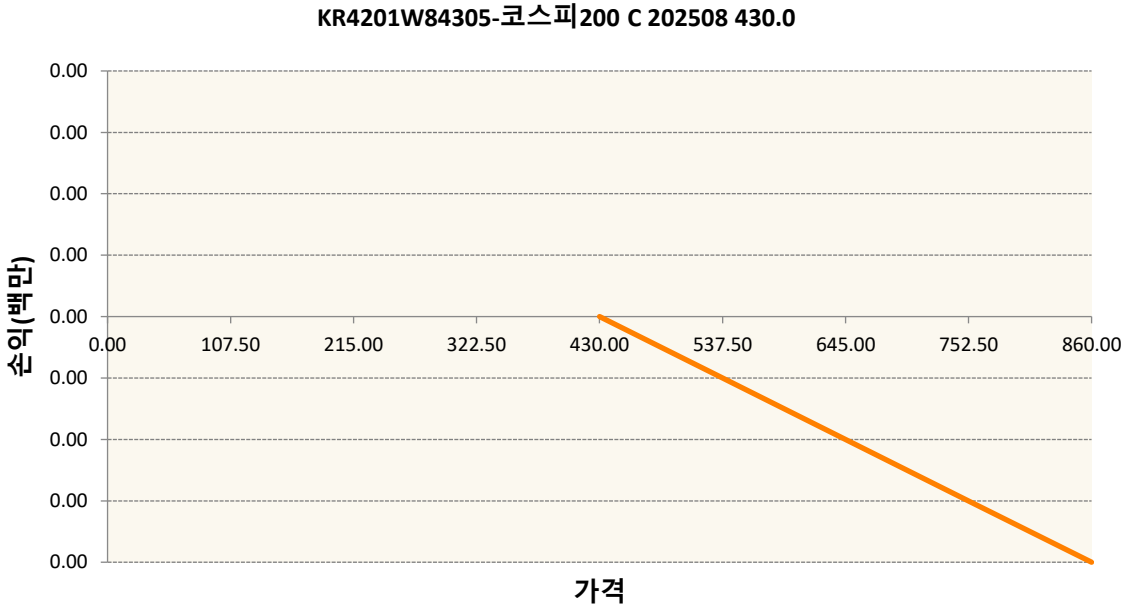
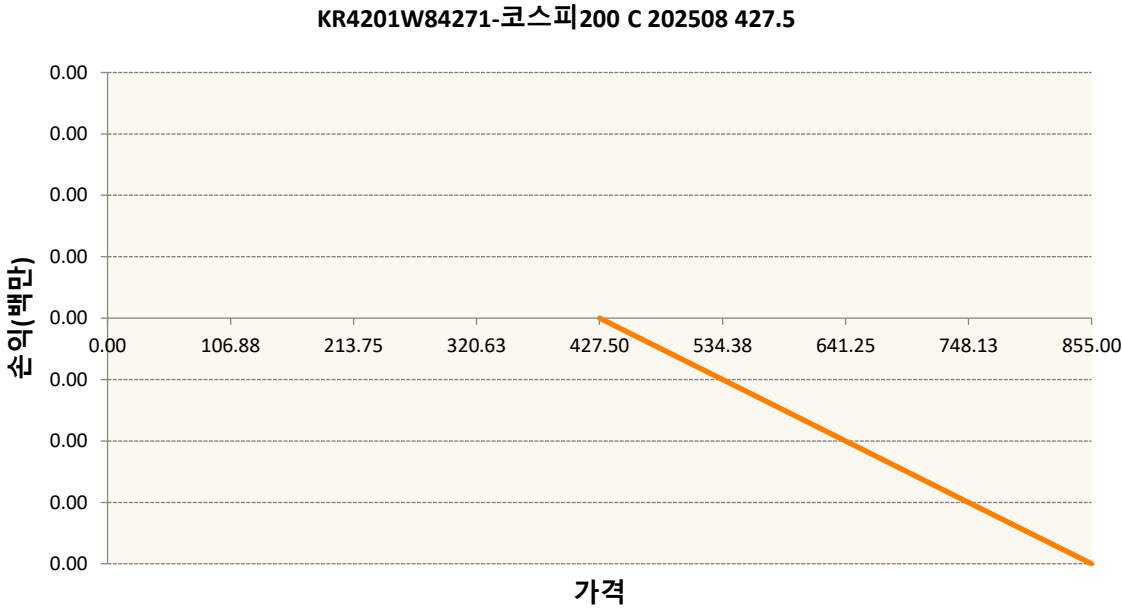
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

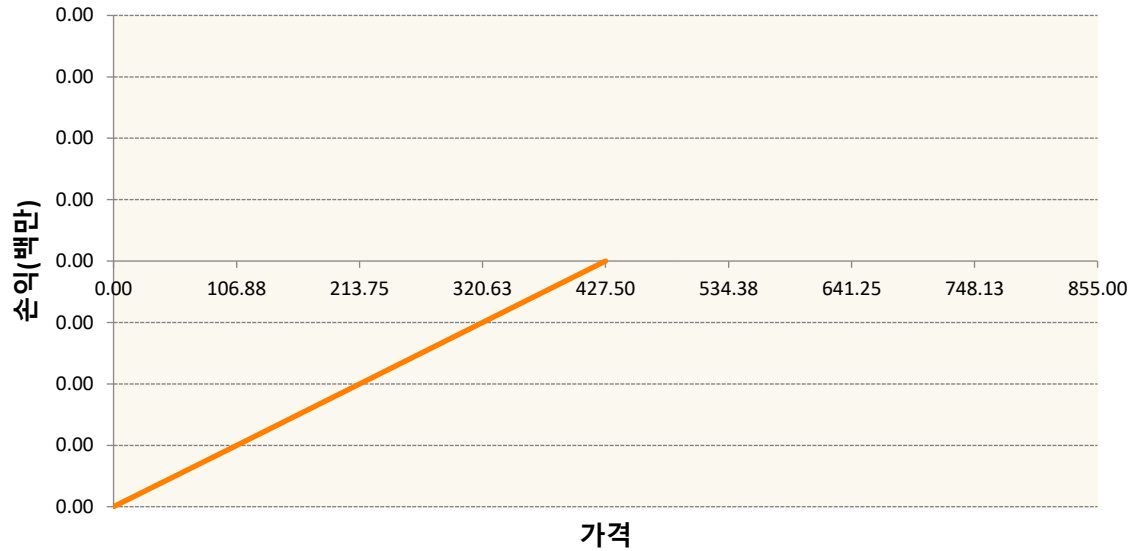
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,666	-35,666	장내

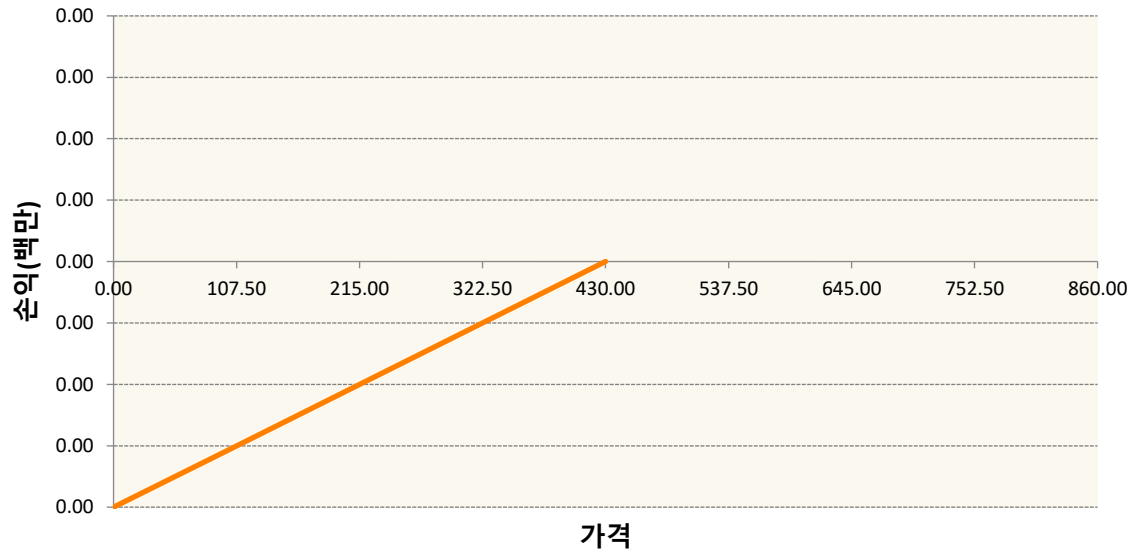
2. 만기시점의 손익구조



KR4301W84279-코스피200 P 202508 427.5



KR4301W84303-코스피200 P 202508 430.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201W84: 코스피200 C 202508 427.5	1,479
KR4201W84: 코스피200 C 202508 430.0	860
KR4301W84: 코스피200 P 202508 427.5	325
KR4301W84: 코스피200 P 202508 430.0	189

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-07-25

기준일 2025-07-24

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일 2025-07-25

기준일 2025-07-24

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파

1. 계약금액

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

2. 만기시점의 손익구조

* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

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	12,045	0	12,045	
누계	통화	선도	588	11,922	-11,334	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F4V(KRW/USD 31-07-25E	407
FXW213F5V(KRW/USD 29-08-25E	319
FXW213F6SC KRW/USD 29-08-25E	222
FXW213F6XC USD/KRW 31-07-25E	14
FXW213F74C KRW/USD 31-07-25E	5
FXW213F7PC USD/KRW 31-07-25E	33
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

497

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

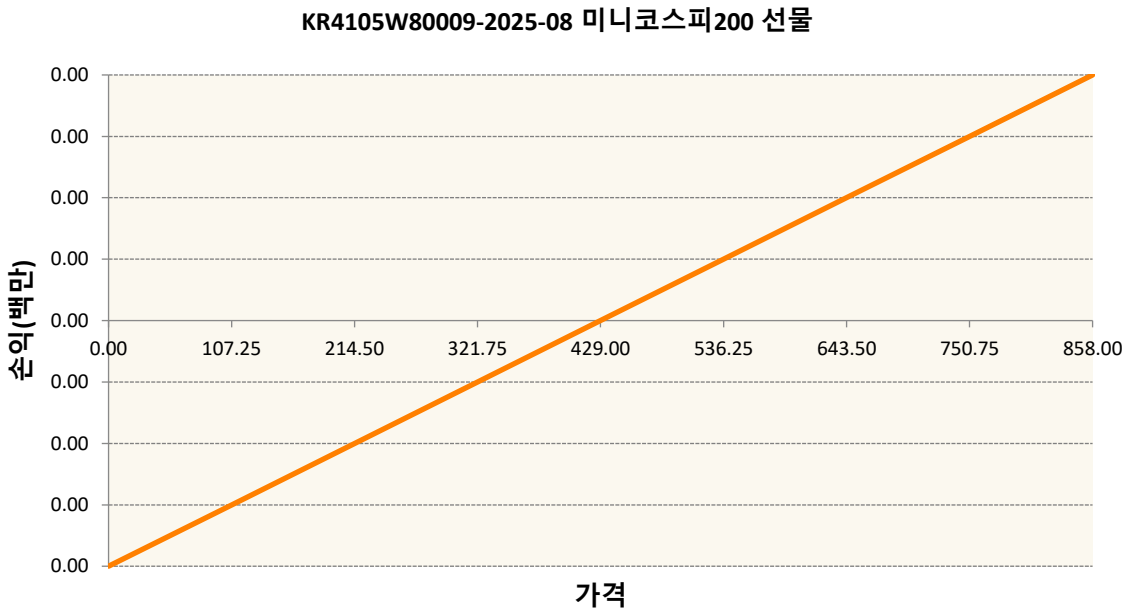
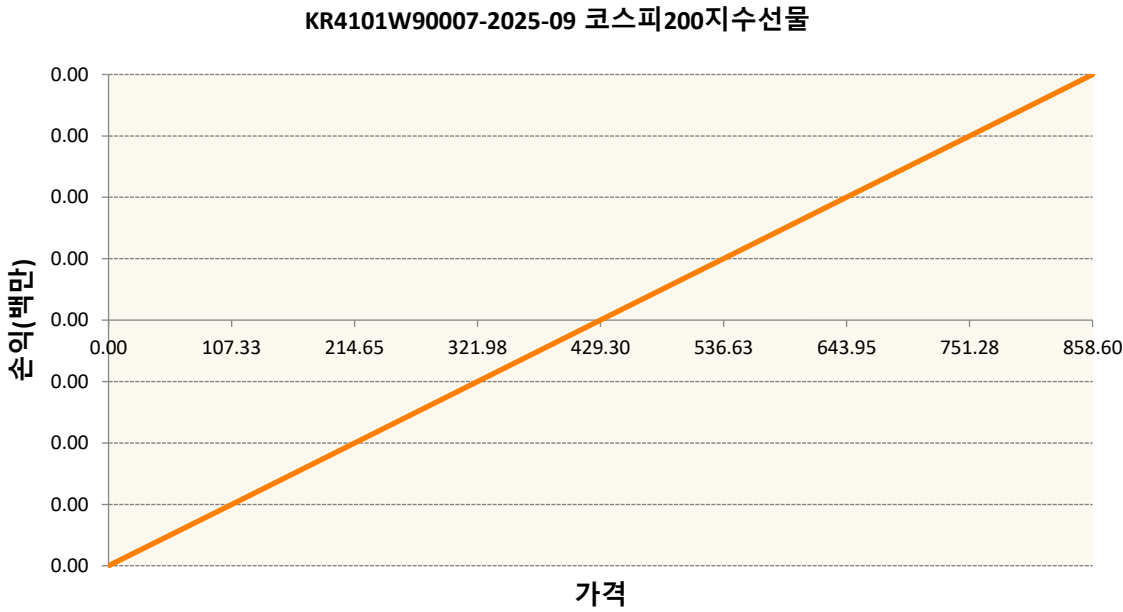
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

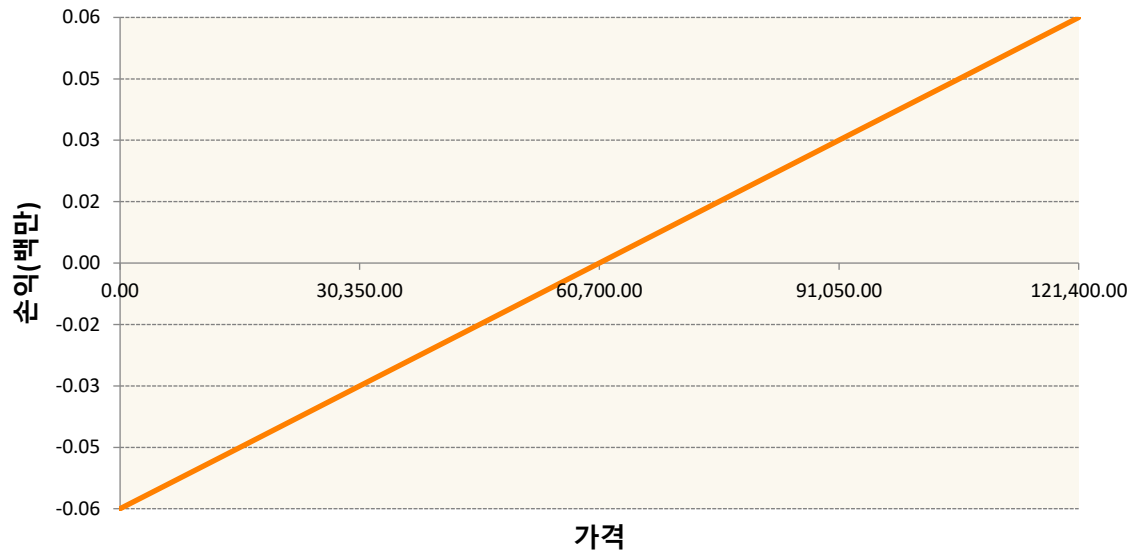
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	712	0	712	장내

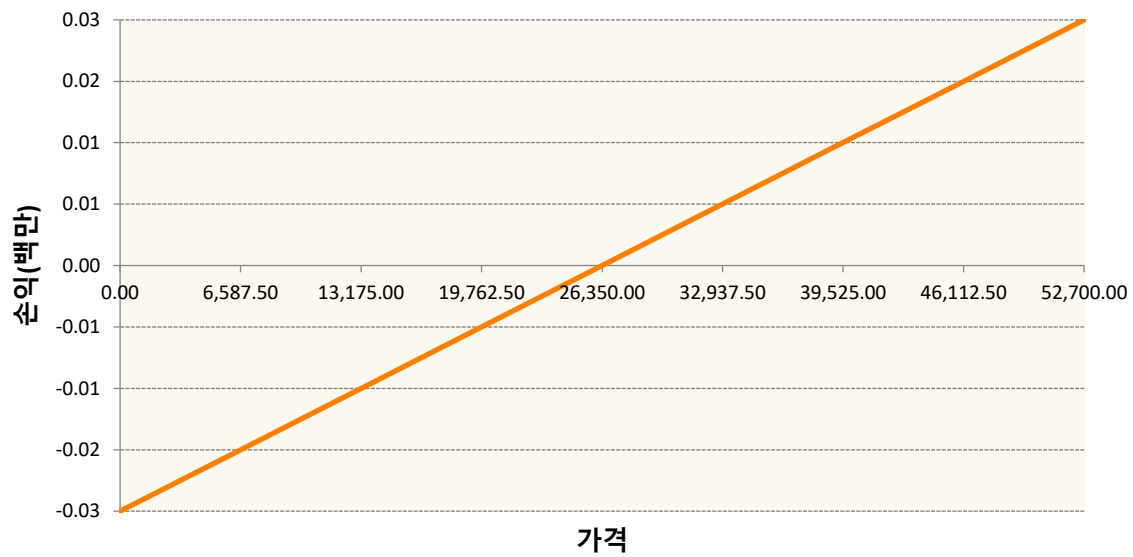
2. 만기시점의 손익구조



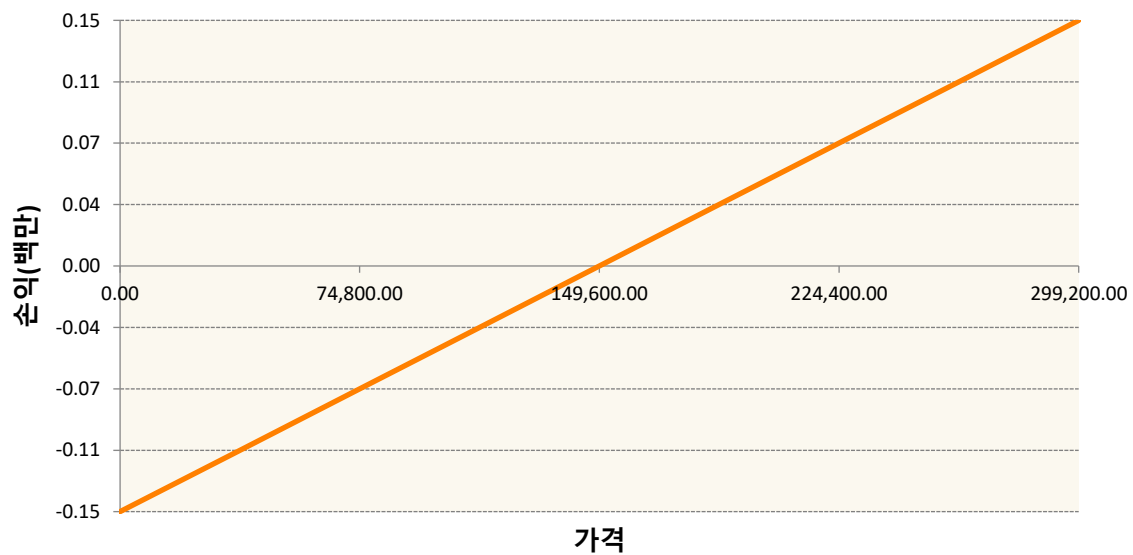
KR410FW80009-2025-08 두산로보틱스개별선물



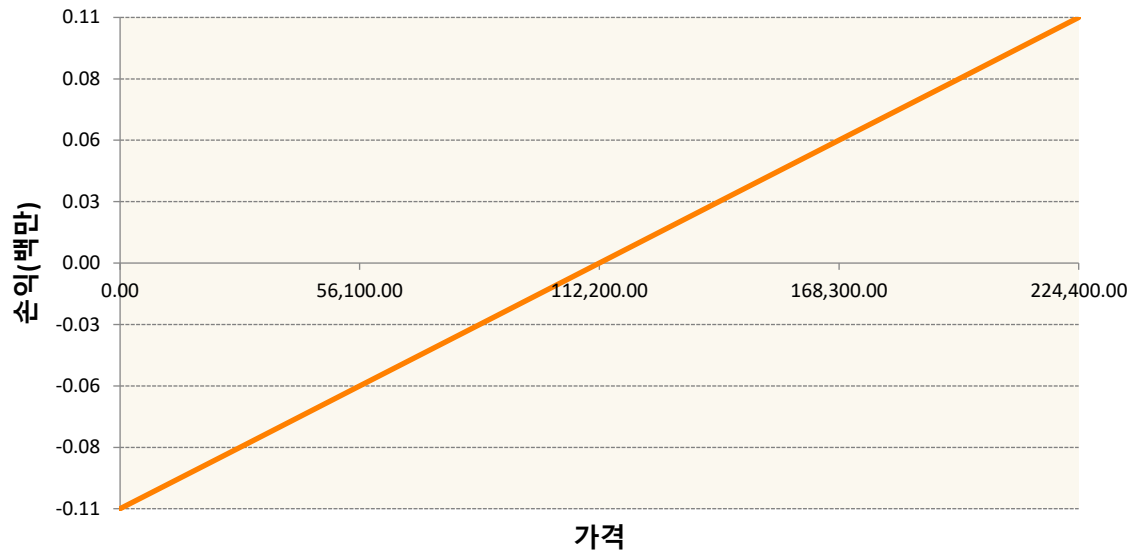
KR41CNW80007-2025-08 포스코DX개별선물



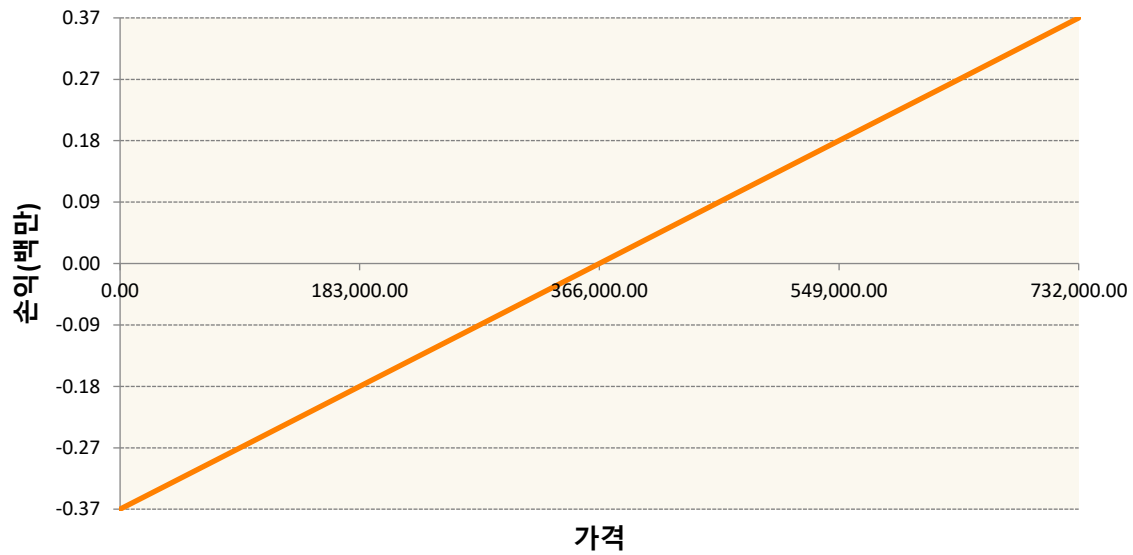
KR41E8W80008-2025-08 포스코퓨처엠개별선물



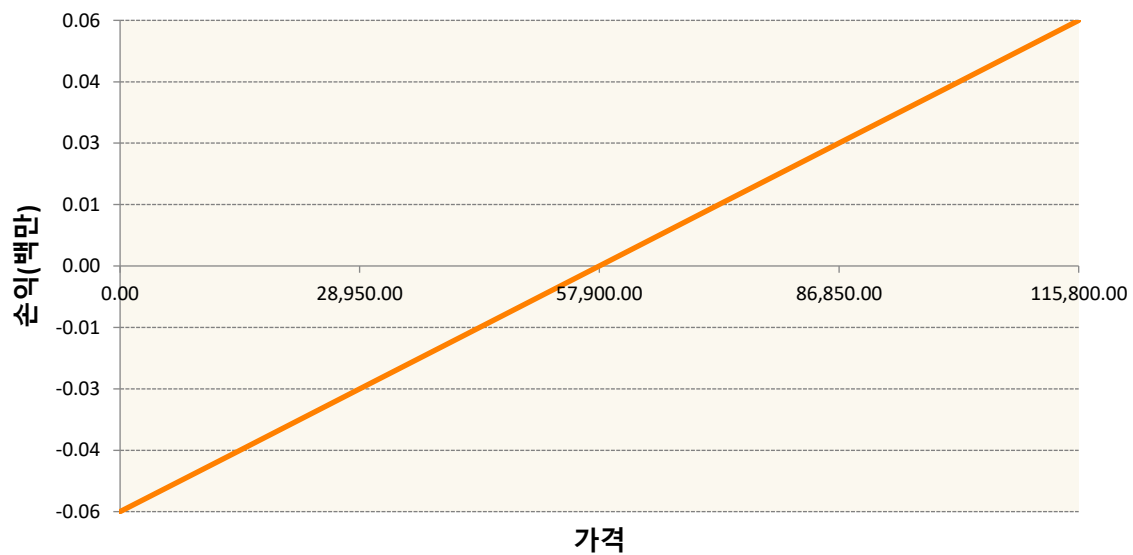
KR41EYW80000-2025-08 에코프로비엠개별선물



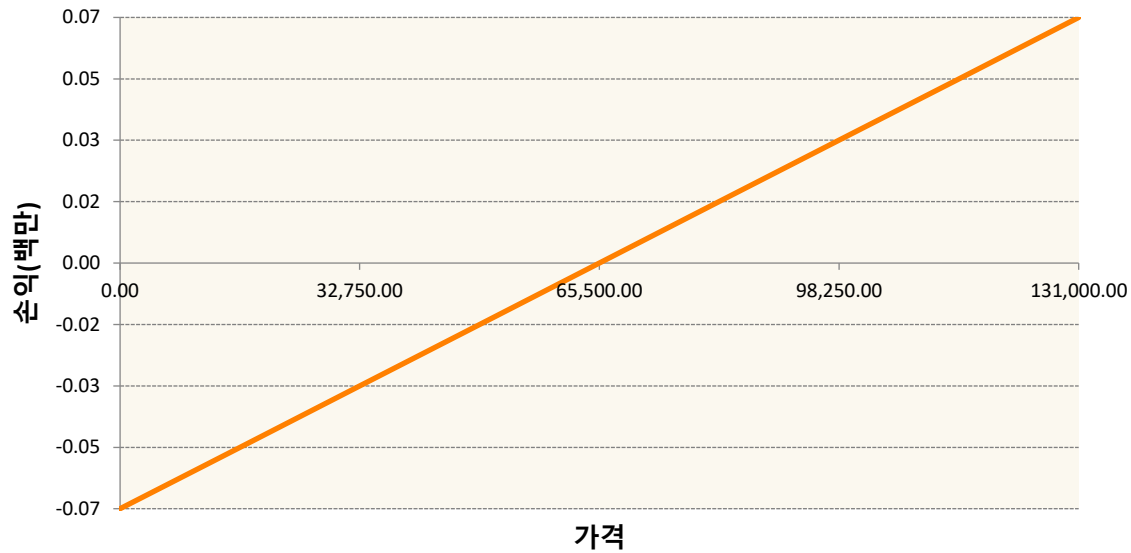
KR41F5W80003-2025-08 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7W80009-2025-08 카카오페이개별선물



KR41FMW80002-2025-08 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	34
KR4105W80(2025-08 미니코스피200 선물	2
KR410FW80(2025-08 두산로보틱스개별선물	1
KR41CNW80 2025-08 포스코DX개별선물	1
KR41E8W80(2025-08 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EYW80(2025-08 에코프로비엠개별선물	3
KR41F5W80(2025-08 LG에너지솔루션개별선물	6
KR41F7W80(2025-08 카카오페이개별선물	1
KR41FMW80 2025-08 엘앤에프개별선물	1

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

(단위:백만원)

35

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

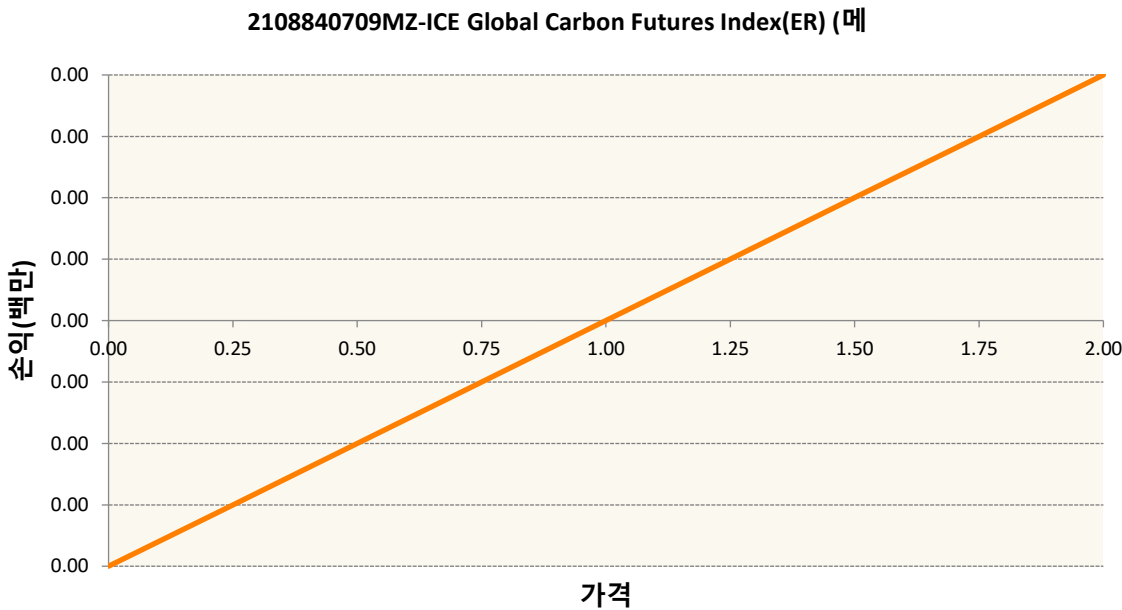
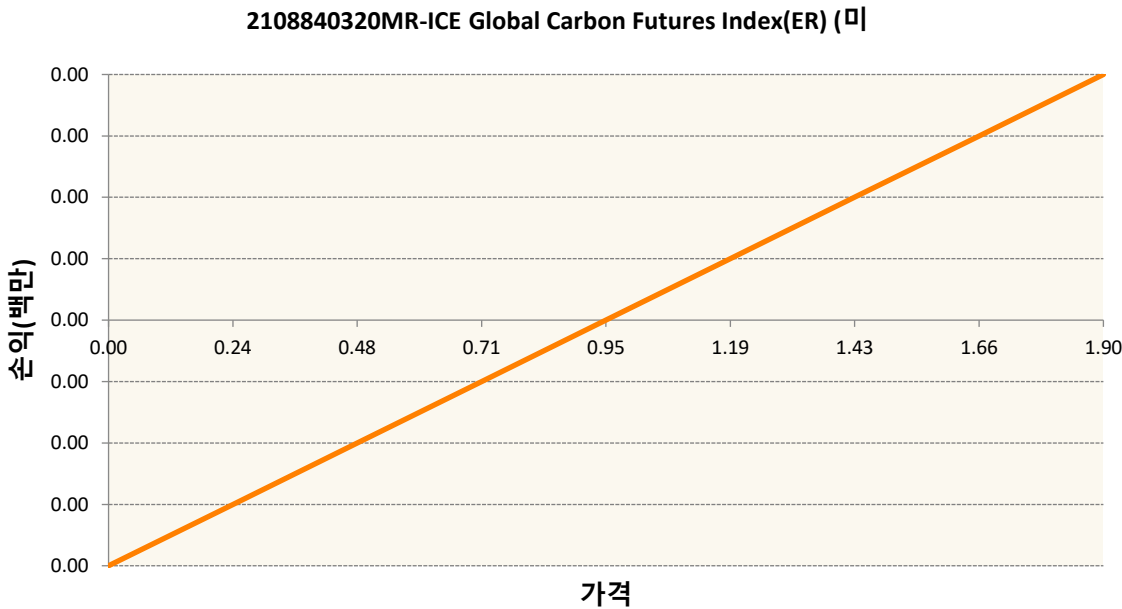
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	장외
신규	유가증권	선물	0	0	0	장외
누계	실물자산	선물	1,205	0	1,205	장외
누계	유가증권	선물	7,165	0	7,165	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	574
2108840709	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	96

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	758

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

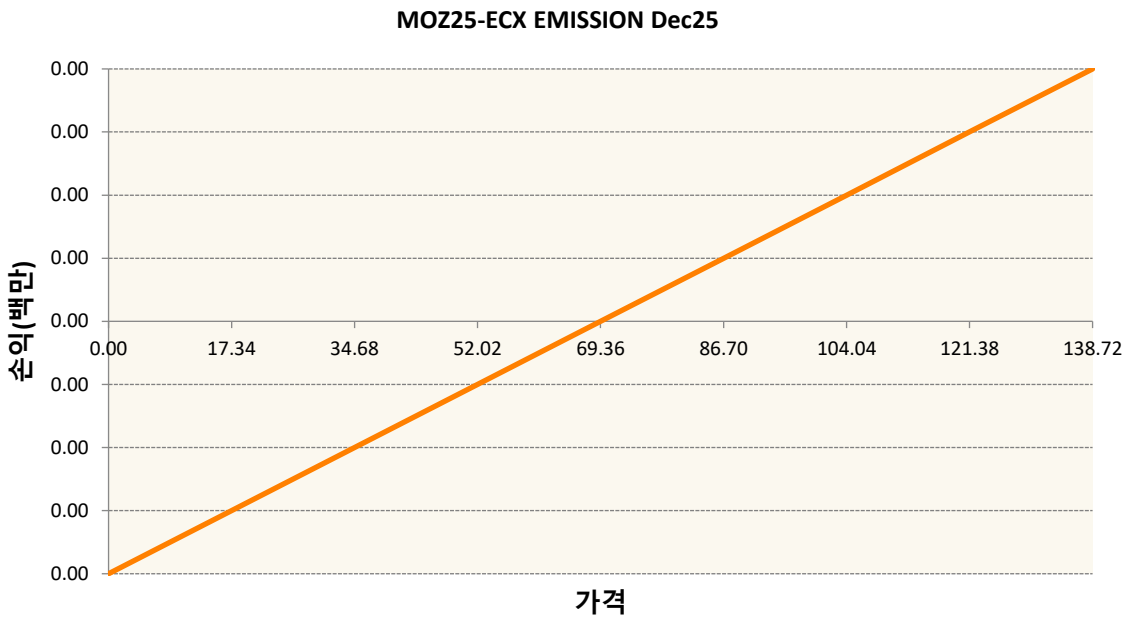
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,290	0	6,290	
누계	유가증권	선물	-28	0	-28	장외
누계	통화	선도	0	1,363	-1,363	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	2
FXW213F71C KRW/EUR 31-07-25E	109
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	503

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

(단위:백만원)

887

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

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)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	7
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	8

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

(단위:백만원)

62

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

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)	9
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	7
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2

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

(단위:백만원)

50

공시일 2025-07-25

기준일 2025-07-24

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	2025-07-25
기준일	2025-07-24

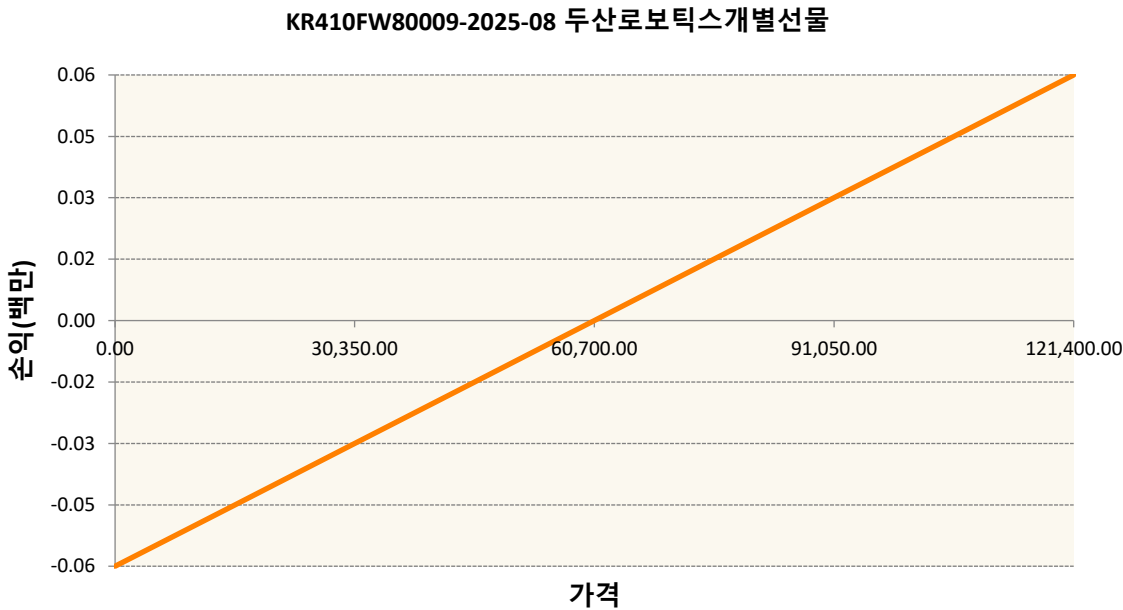
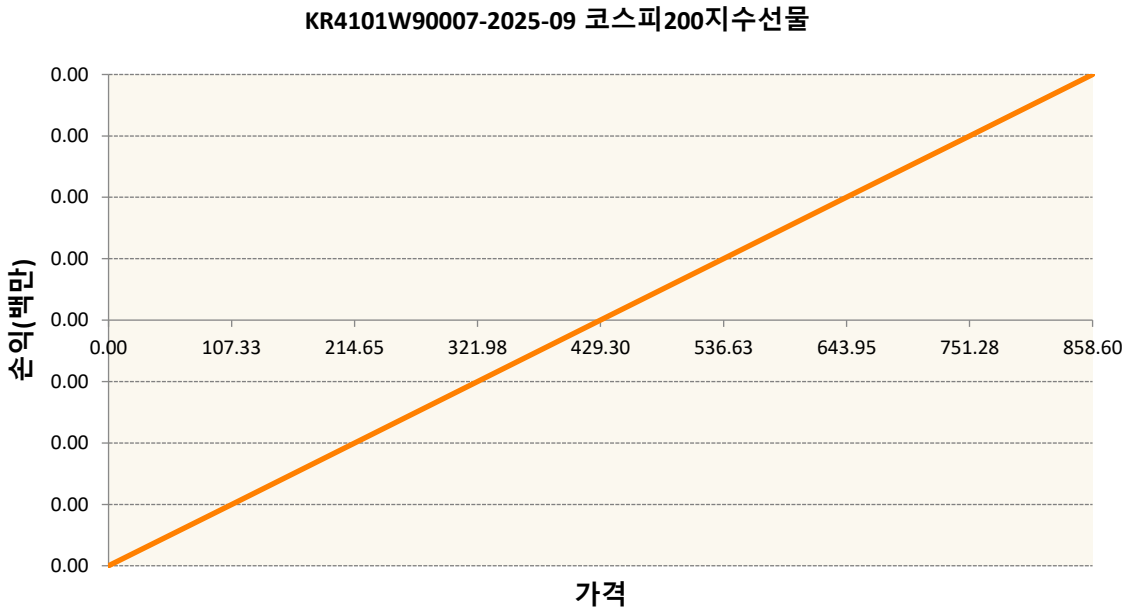
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

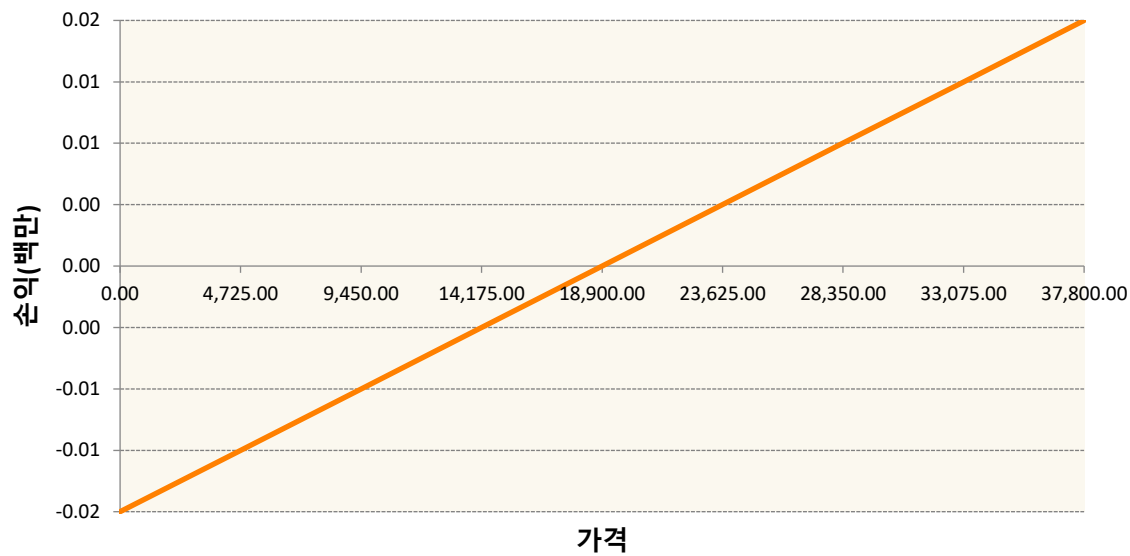
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	595	0	595	장내
누계	유가증권	선물	10,777	0	10,777	장내

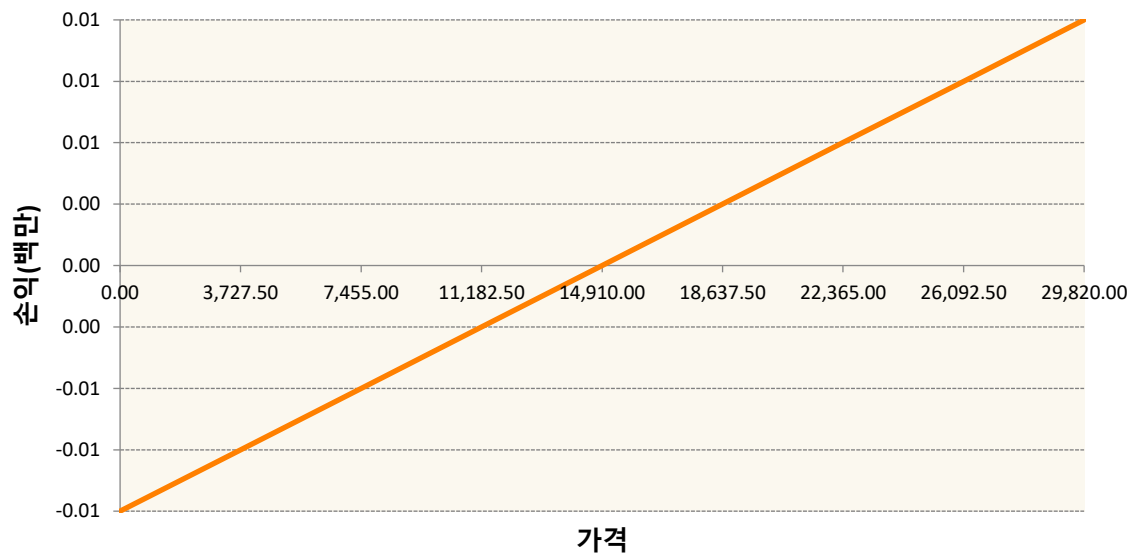
2. 만기시점의 손익구조



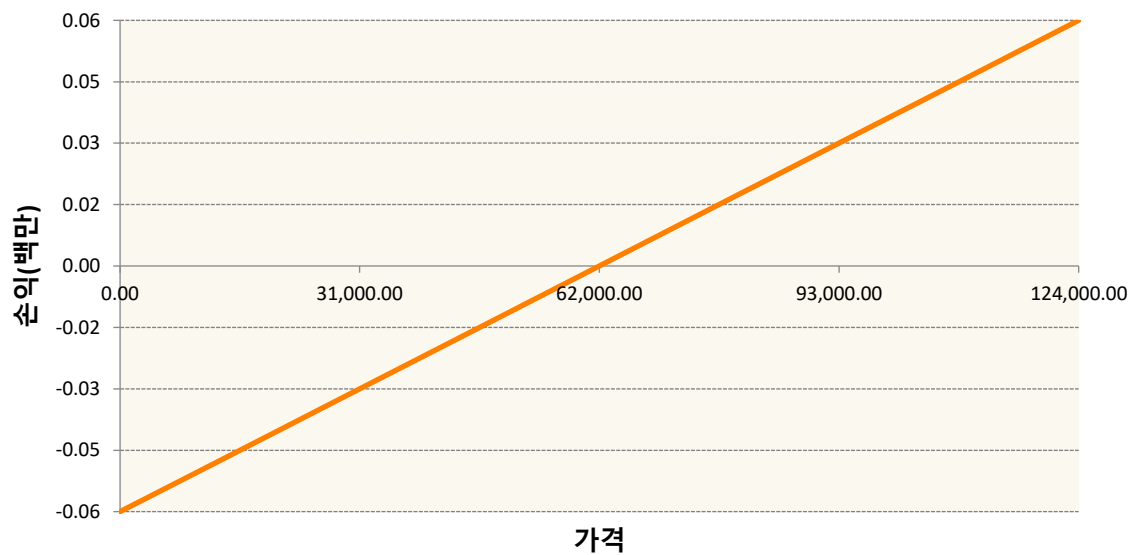
KR411AW80008-2025-08 한일시멘트개별선물



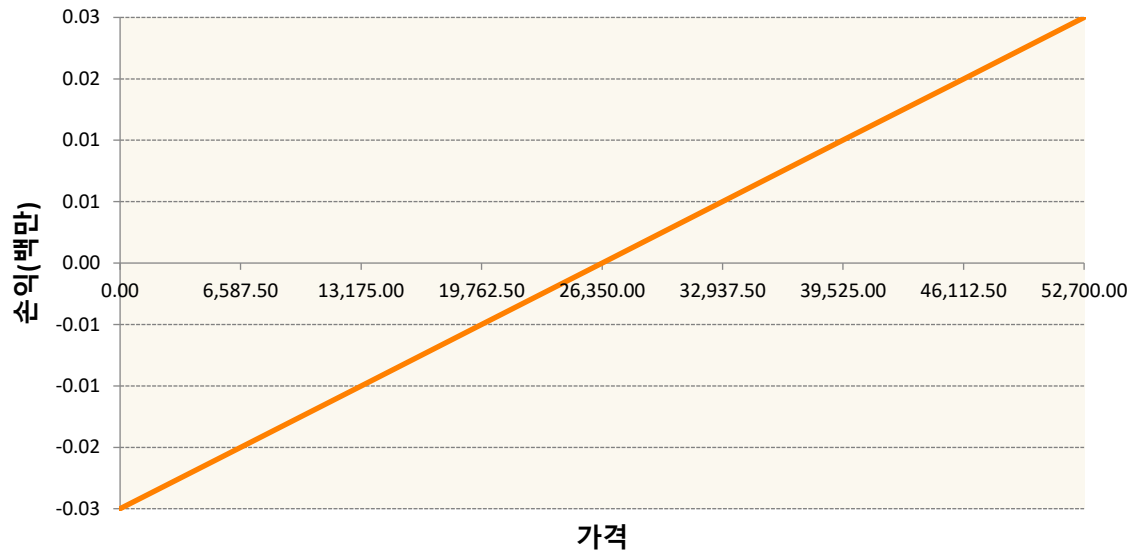
KR4149W80007-2025-08 HD현대인프라코어개별선물



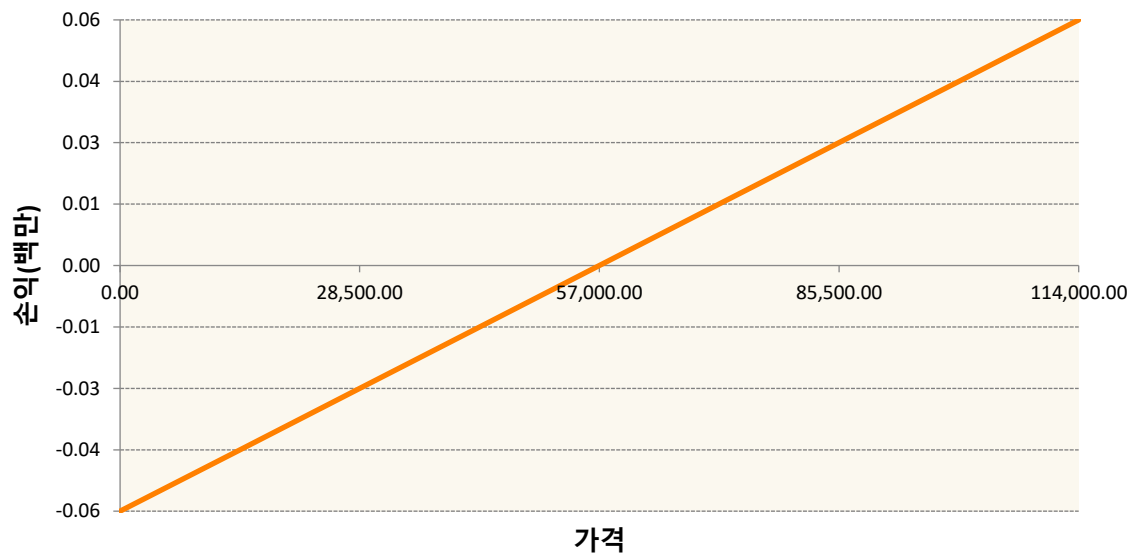
KR41B2W80004-2025-08 S-Oil개별선물



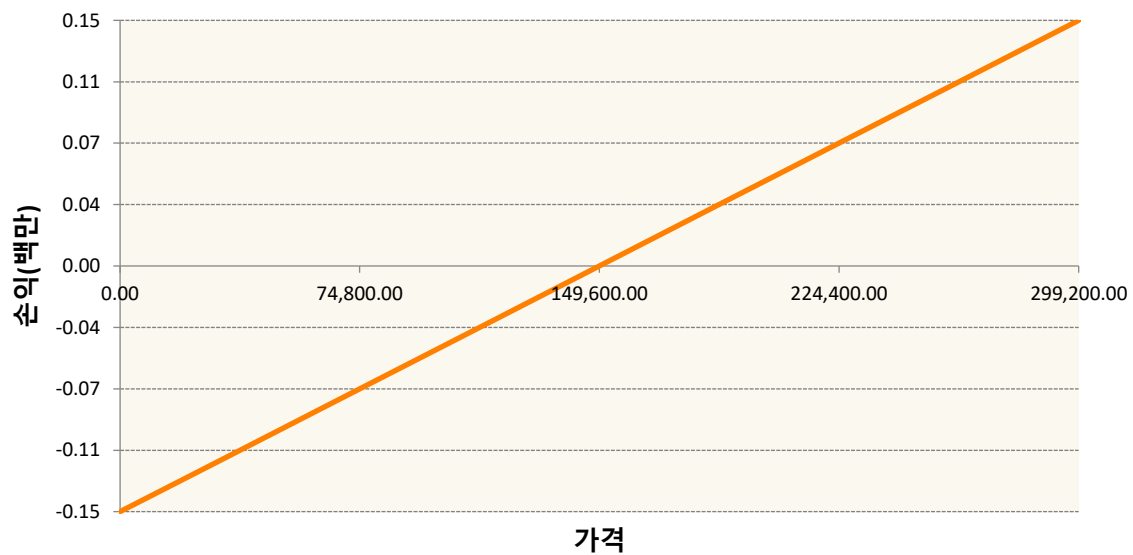
KR41CNW80007-2025-08 포스코DX개별선물



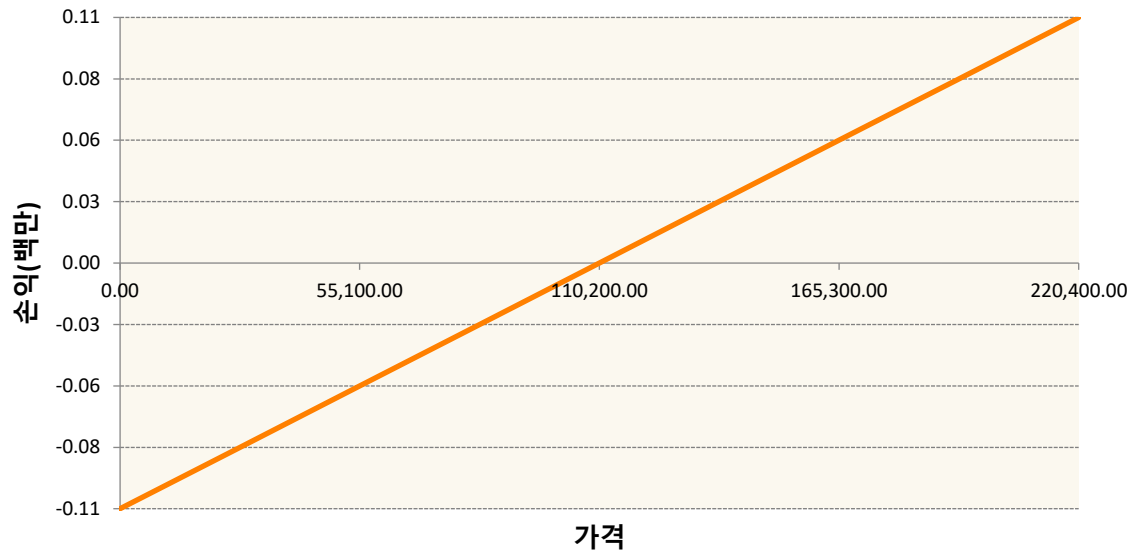
KR41DWW80006-2025-08 두산밥캣개별선물



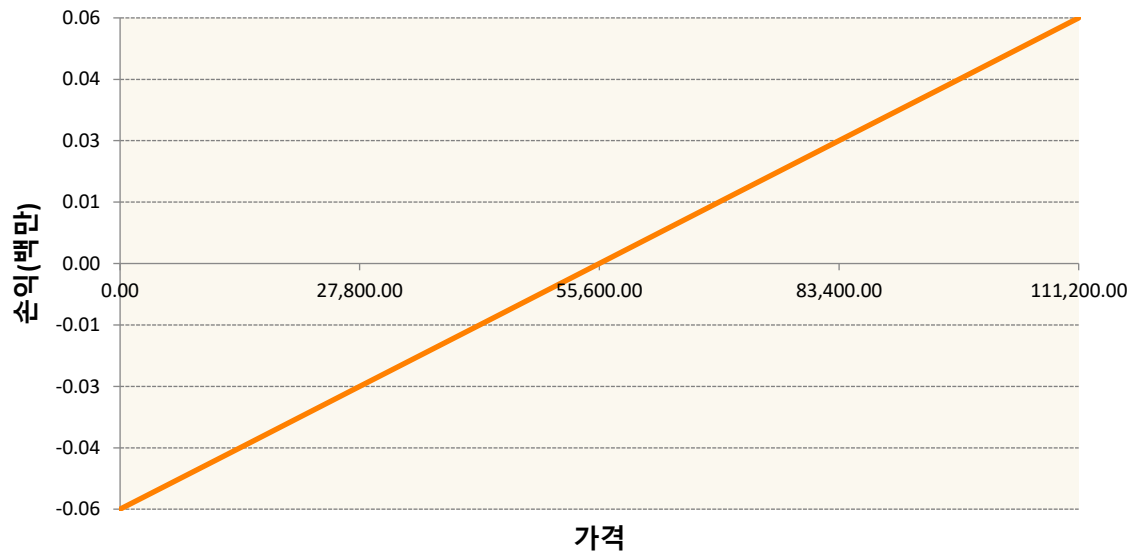
KR41E8W80008-2025-08 포스코퓨처엠개별선물



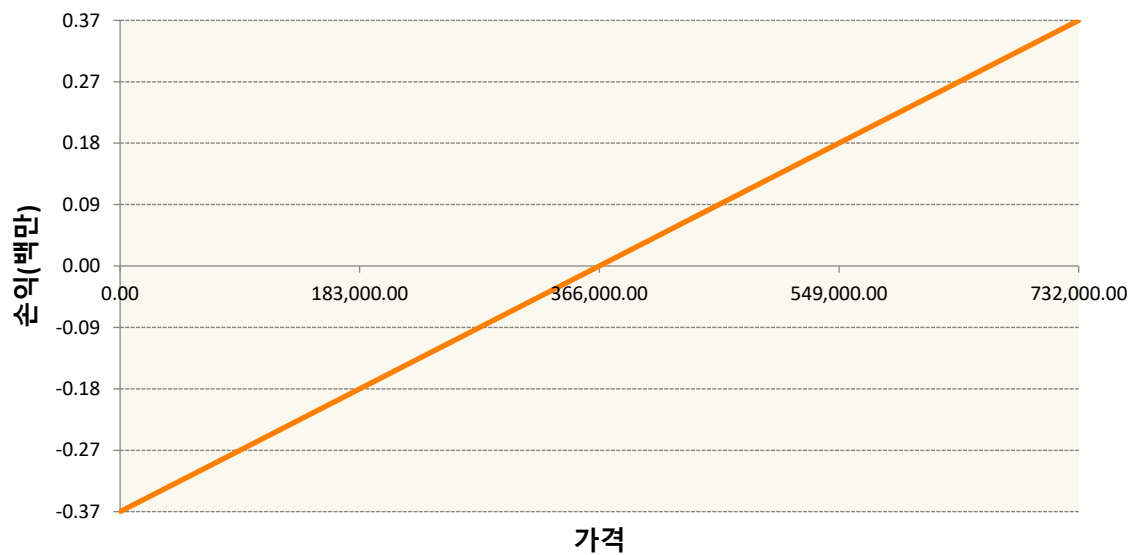
KR41EJW80001-2025-08 SKC개별선물



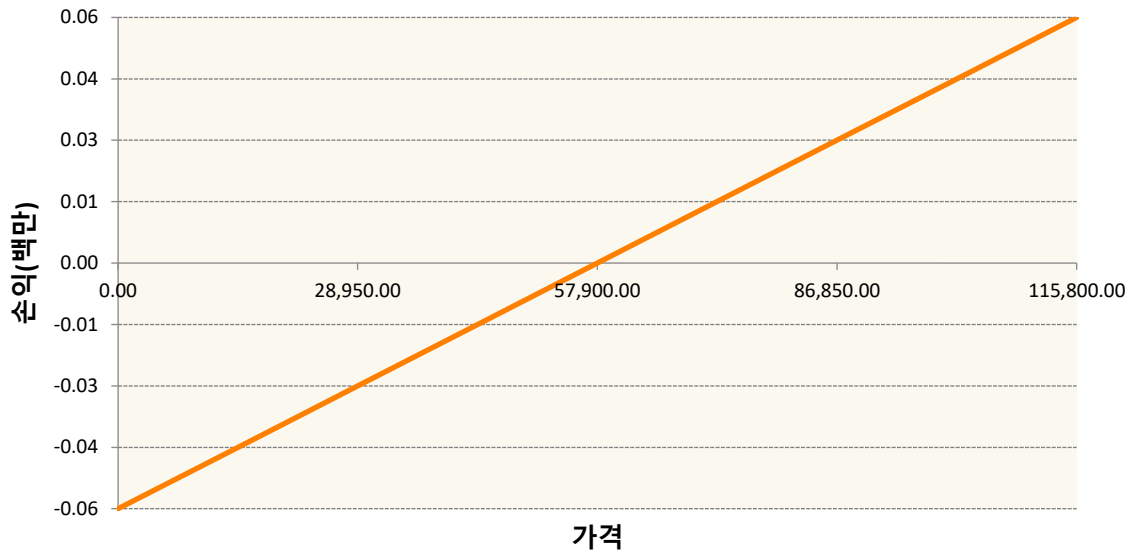
KR41EVW80006-2025-08 한화시스템개별선물



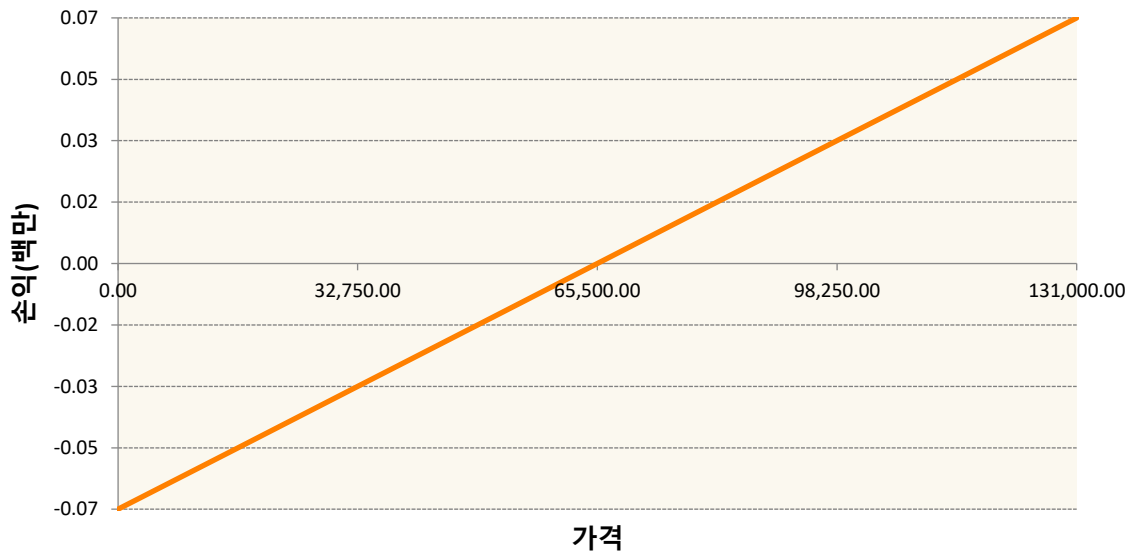
KR41F5W80003-2025-08 LG에너지솔루션개별선물



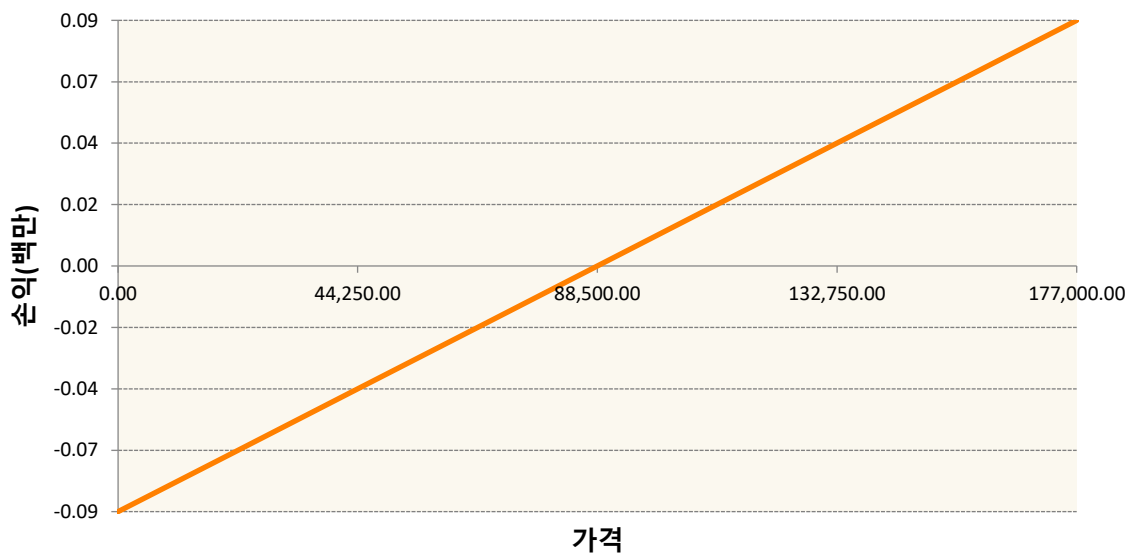
KR41F7W80009-2025-08 카카오페이개별선물



KR41FMW80002-2025-08 엘앤에프개별선물



KR41FVW80003-2025-08 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물		670
KR410FW80(2025-08 두산로보틱스개별선물		12
KR411AW80(2025-08 한일시멘트개별선물		3
KR4149W80(2025-08 HD현대인프라코어개별선물		19
KR41B2W80(2025-08 S-Oil개별선물		13
KR41CNW80 2025-08 포스코DX개별선물		14
KR41DWW8(2025-08 두산밥캣개별선물		30
KR41E8W80(2025-08 포스코퓨처엠개별선물		42
KR41EJW800 2025-08 SKC개별선물		22
KR41EVW80(2025-08 한화시스템개별선물		1
KR41F5W80(2025-08 LG에너지솔루션개별선물		1
KR41F7W80(2025-08 카카오페이개별선물		17
KR41FMW80 2025-08 엘앤에프개별선물		17
KR41FVW80(2025-08 한화오션개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	610

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

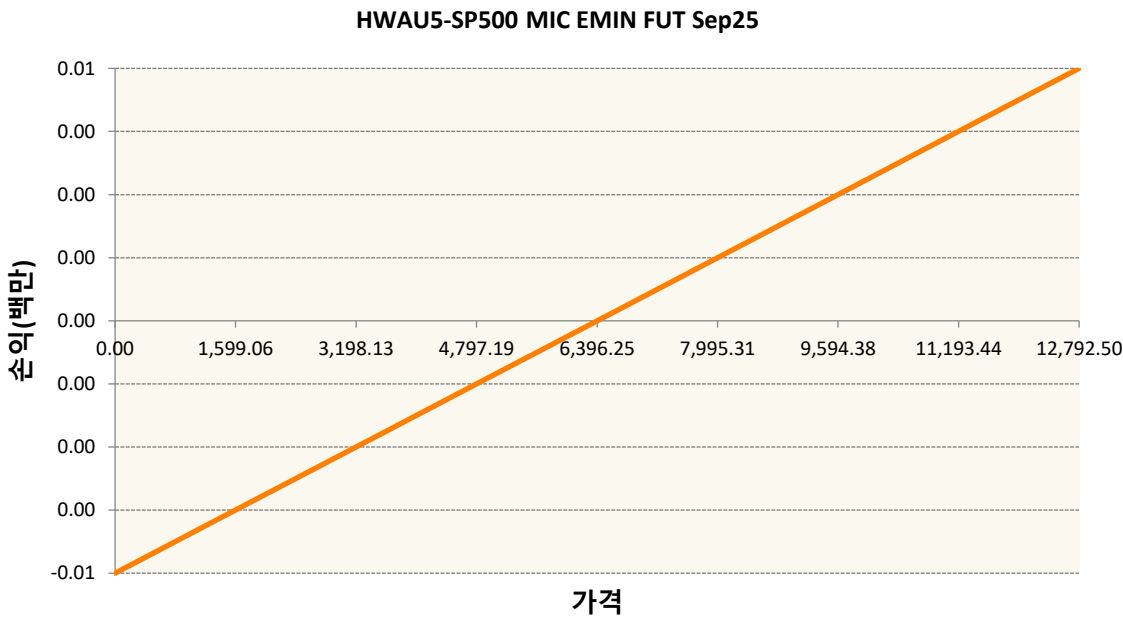
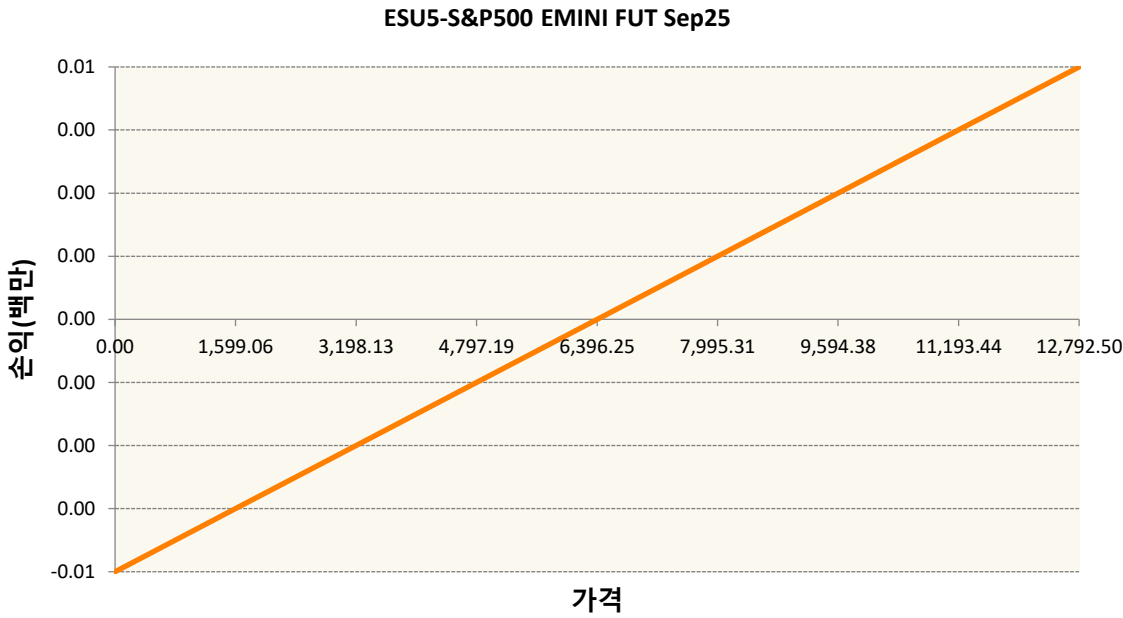
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	31,306	0	31,306	
누계	지수	선물	1,673	0	1,673	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,504
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	134

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,322

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

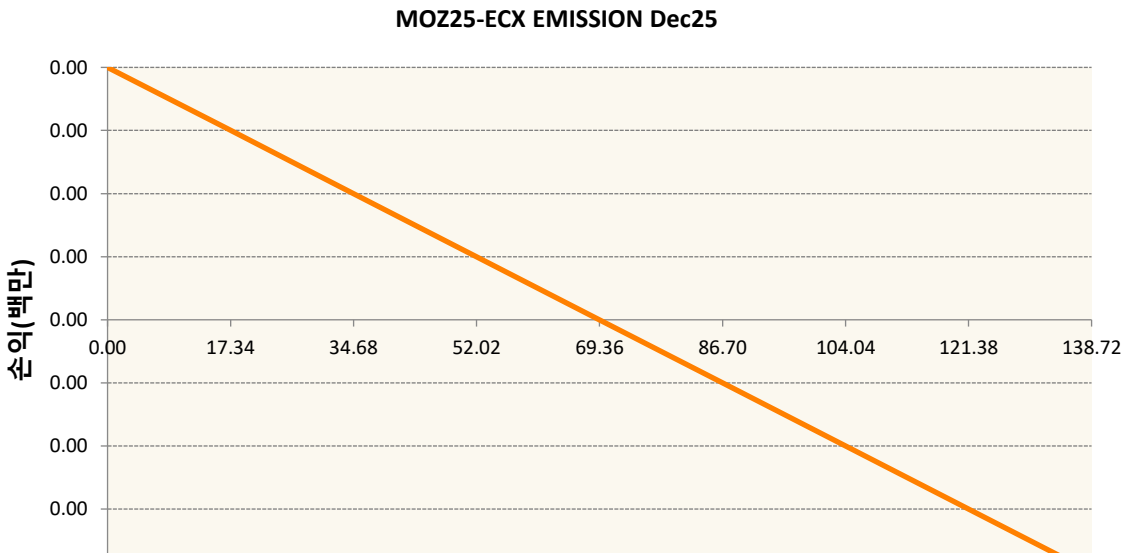
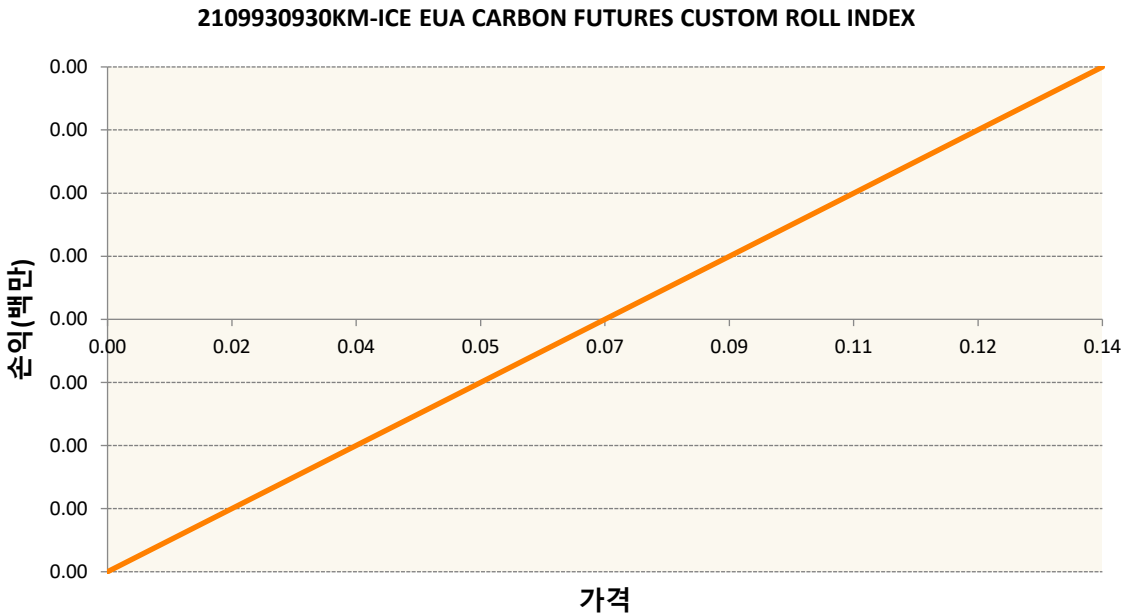
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	5,322	-5,322	
누계	유가증권	선물	28	0	28	장외
누계	통화	선도	0	1,009	-1,009	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

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	426

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

(단위:백만원)

743

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

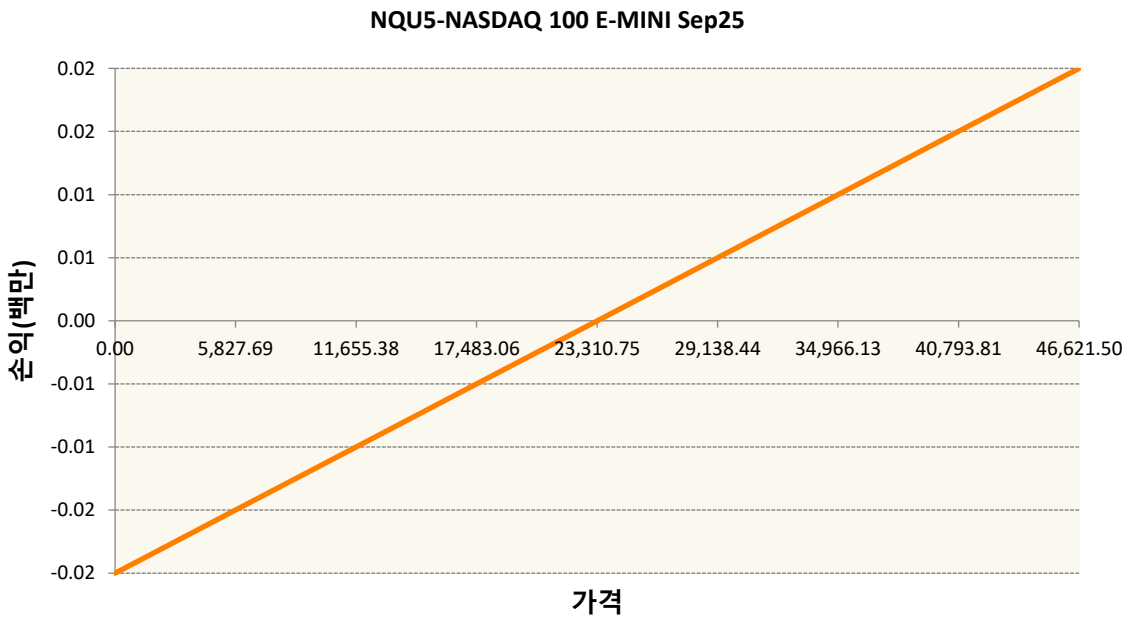
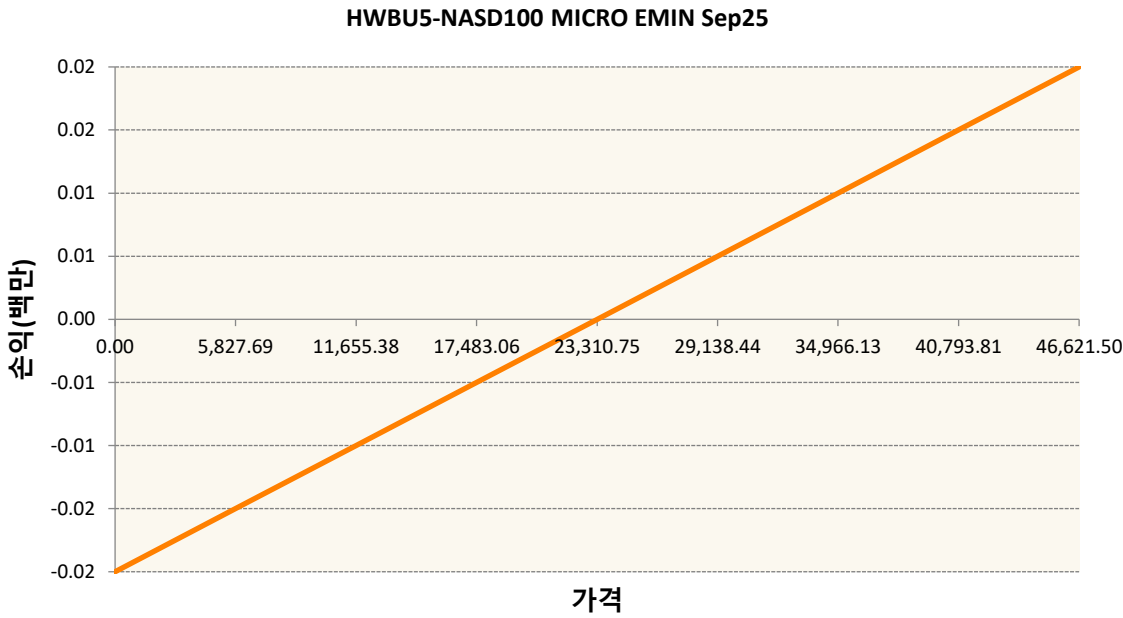
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	14,147	0	14,147	
누계	지수	선물	709	0	709	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25	57
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	1,132

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,355

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

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	279,322	0	279,322	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,225
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,574
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,813
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,562

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

(단위:백만원)

11,408

공시일	2025-07-25
기준일	2025-07-24

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)

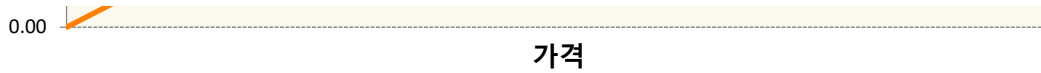
(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	8

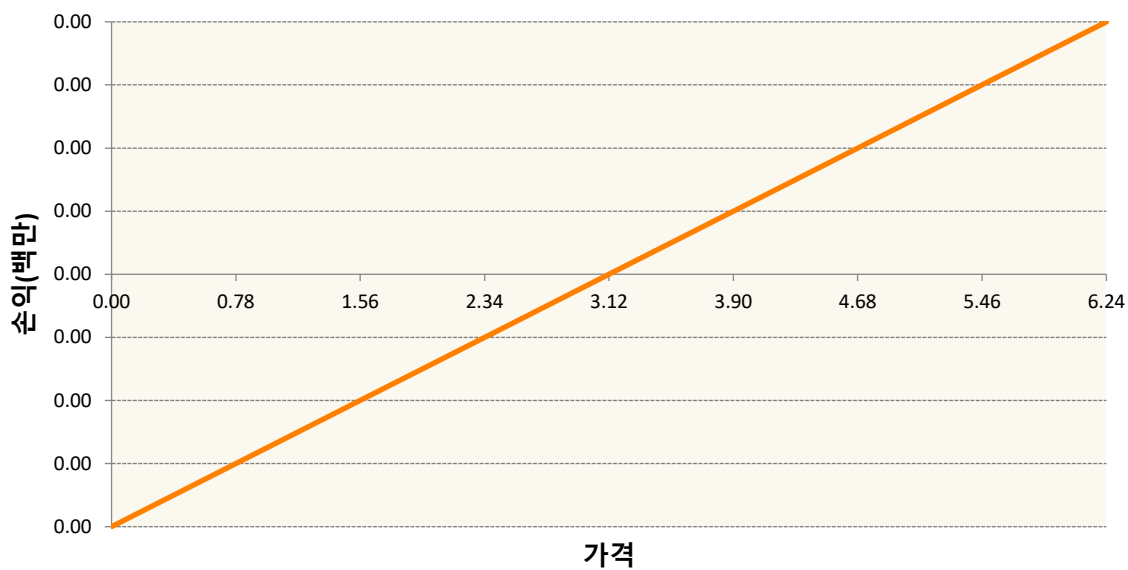
4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

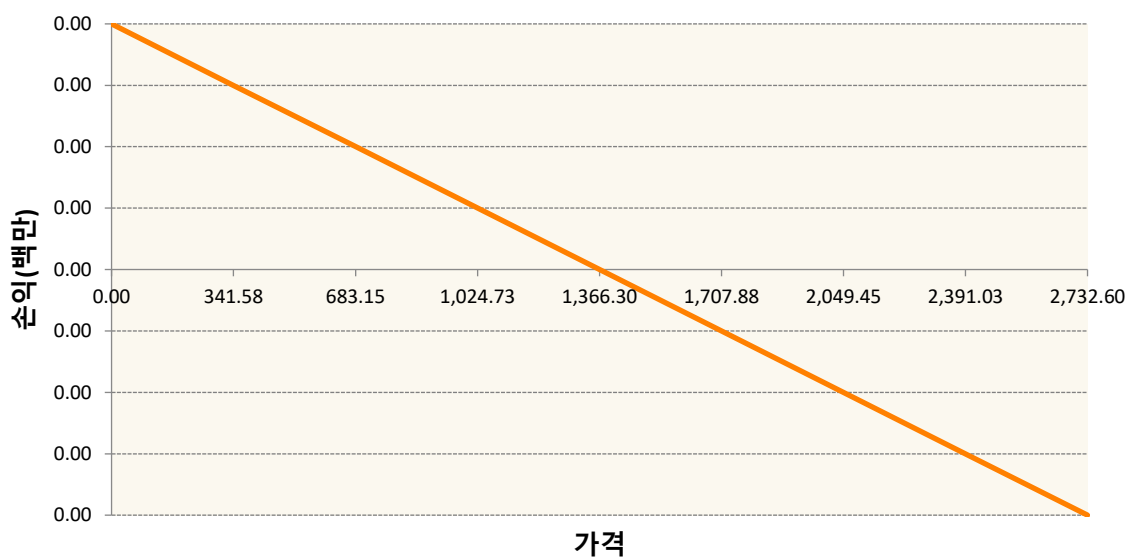
46



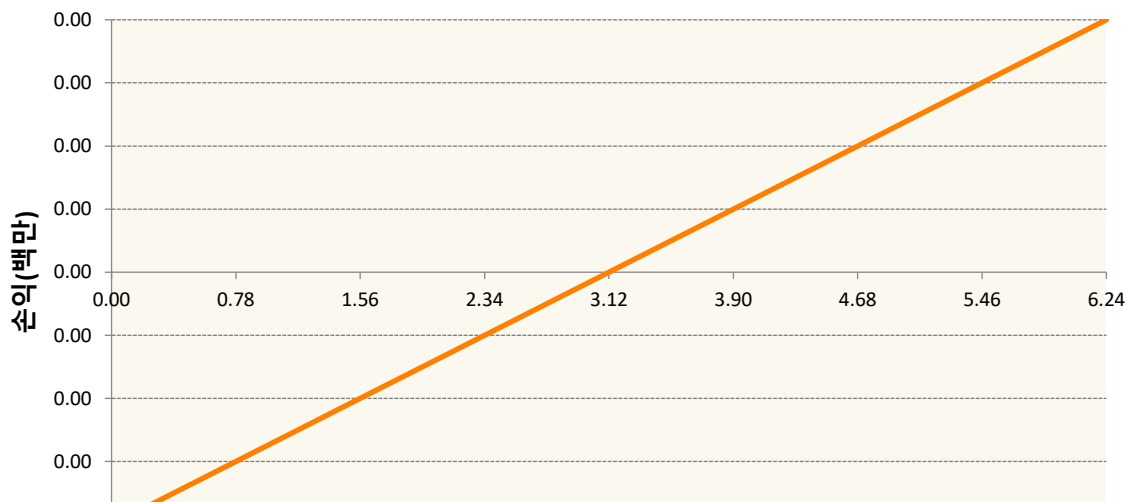
EOU5-E-MINI NATURAL GAS Sep25

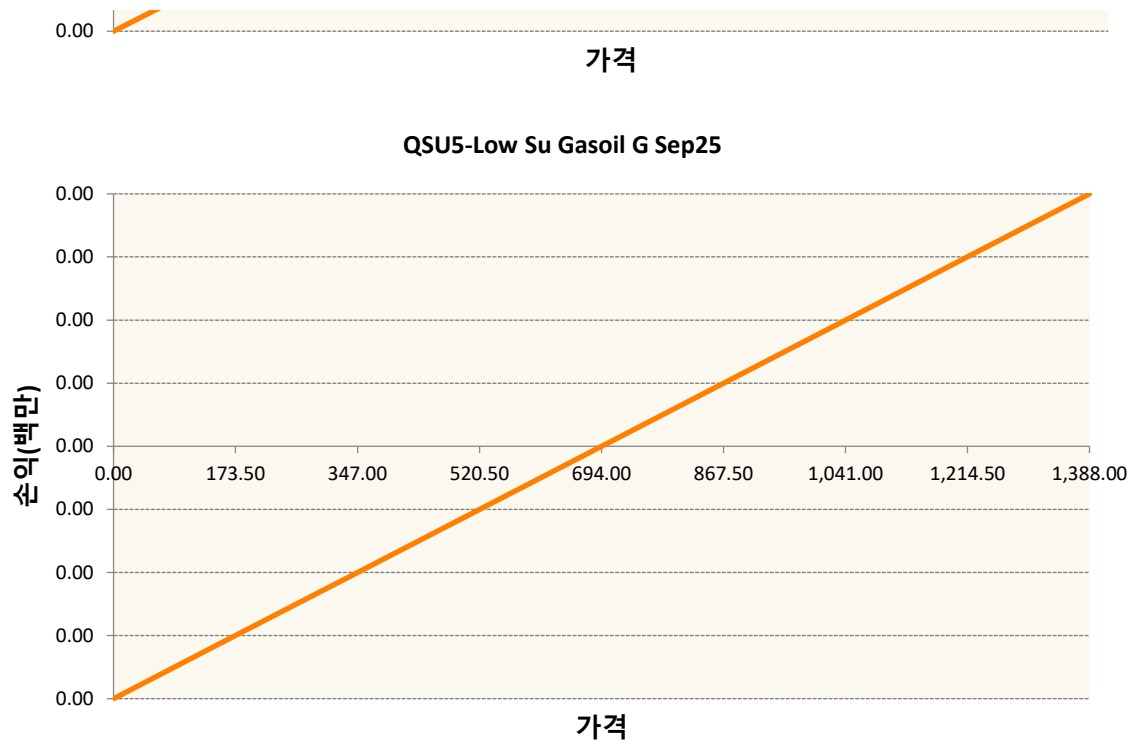


KR4175W80002-2025-08 달러선물



NGU25-NATURAL GAS FUTR Sep25





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLU5	WTI CRUDE FUTURE Sep25	7
COX5	BRENT CRUDE FUTR Nov25	15
EOU5	E-MINI NATURAL GAS Sep25	6
KR4175W80(2025-08 달러선물		9
NGU25	NATURAL GAS FUTR Sep25	10
QSU5	Low Su Gasoil G Sep25	8

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

(단위:백만원)

108