

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

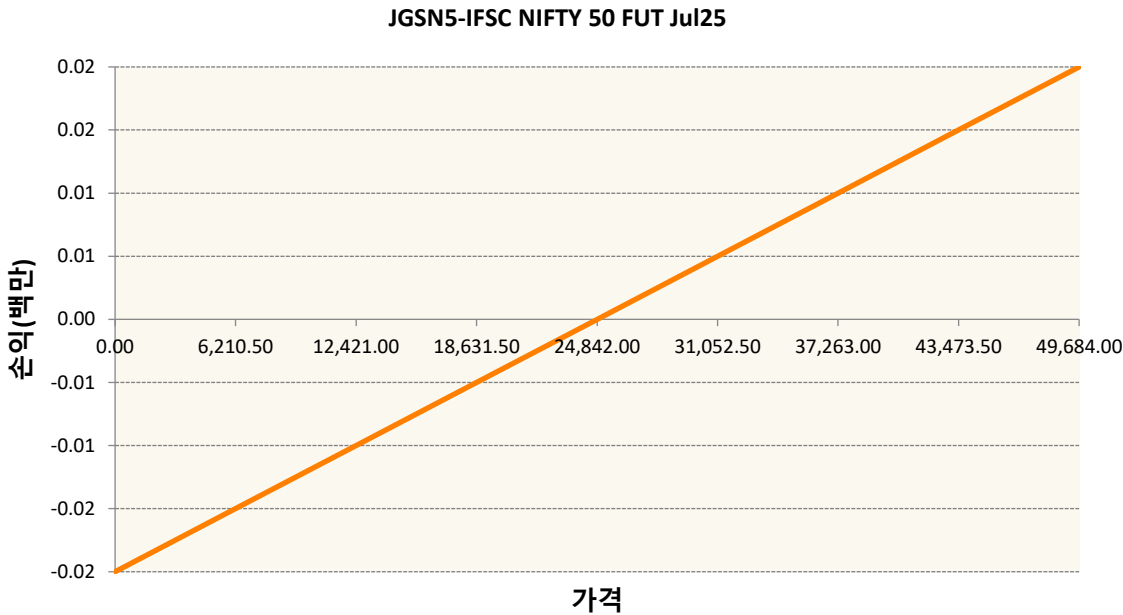
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	609	0	609	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSN5	IFSC NIFTY 50 FUT Jul25	49
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

35

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

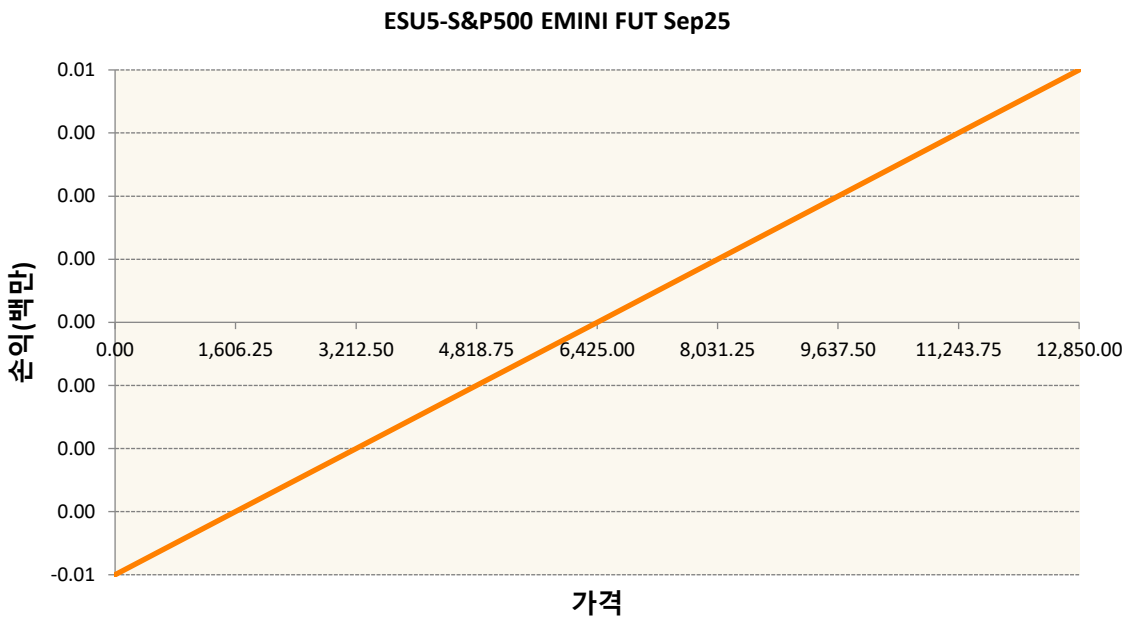
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	883	0	883	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	71
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

62

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

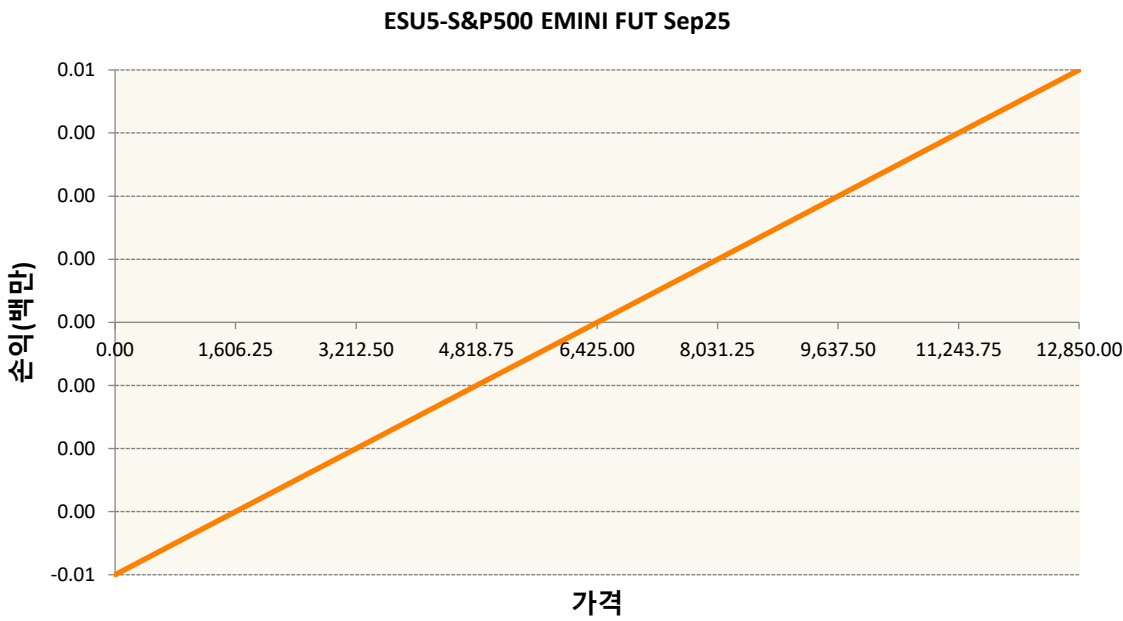
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,330	0	1,330	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	106
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

94

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

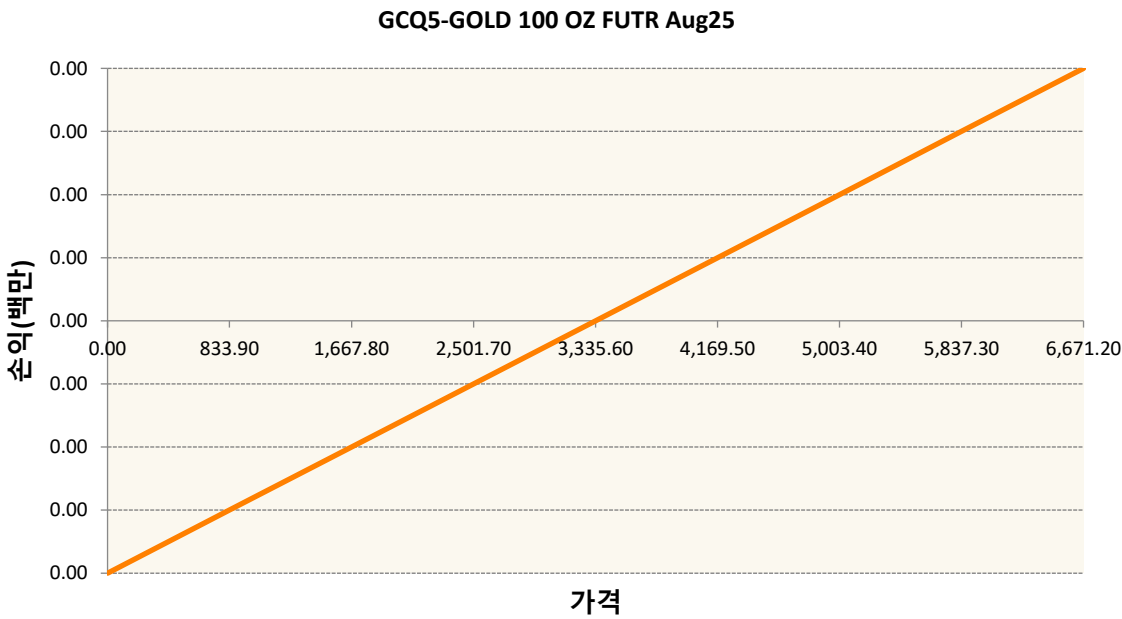
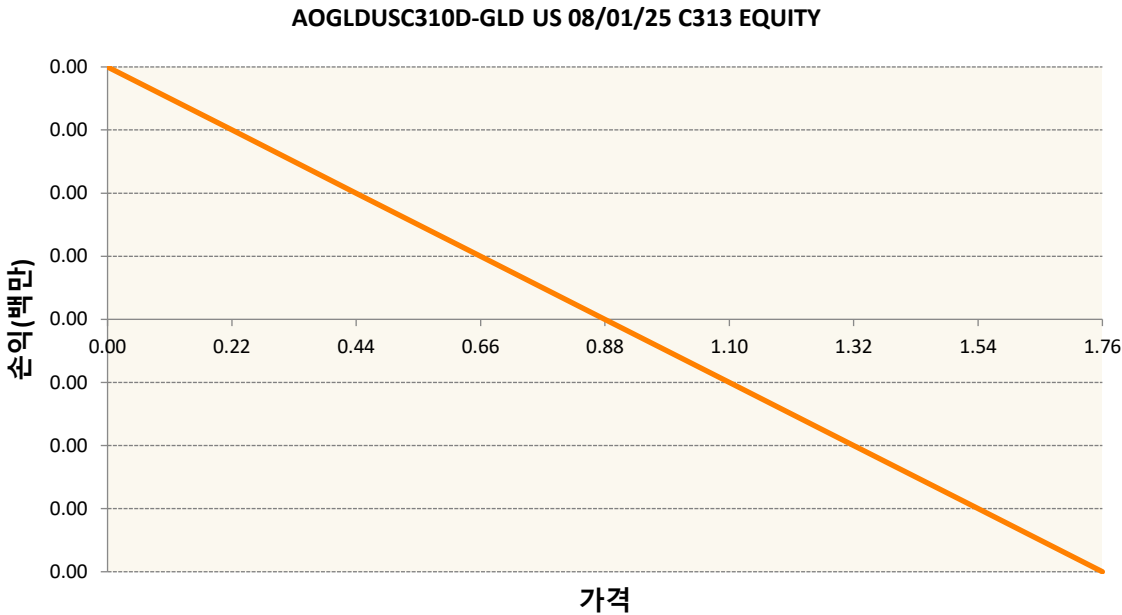
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,835	0	1,835	
누계	실물자산	옵션	0	11	-11	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSC3 GLD US 08/01/25 C313 EQUITY		1
GCQ5 GOLD 100 OZ FUTR Aug25		147

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	127

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

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)

AOPLTRAAC PLTR US 08/01/25 C160 EQUITY	26
AOPLTRAAP PLTR US 08/01/25 P160 EQUITY	8

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

(단위:백만원)

139

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

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)

AOTLTUSAA\TLT US 08/01/25 C87 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

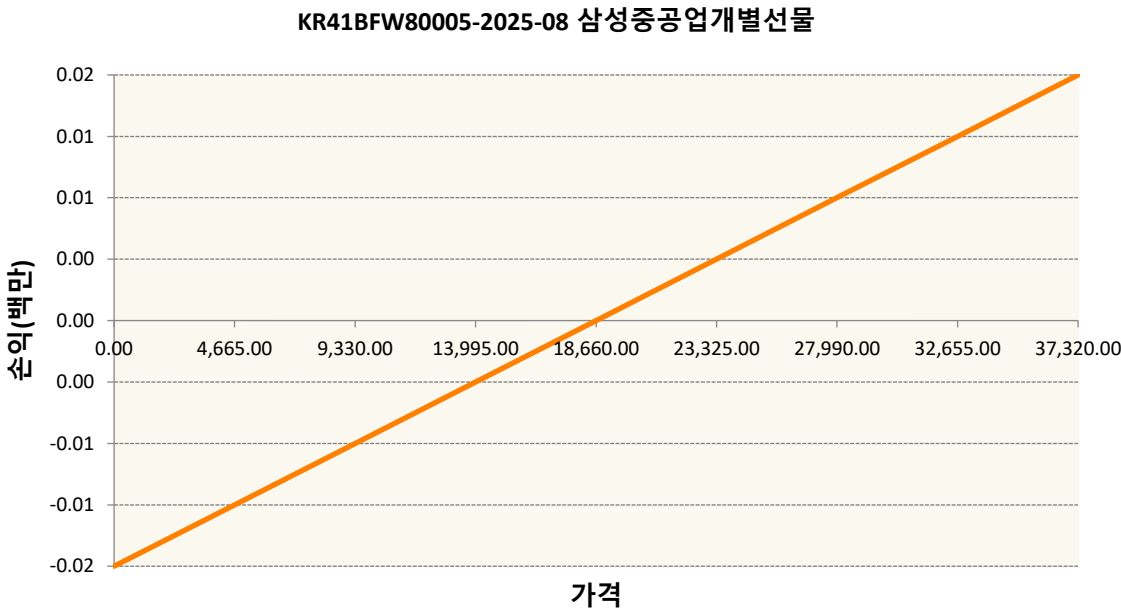
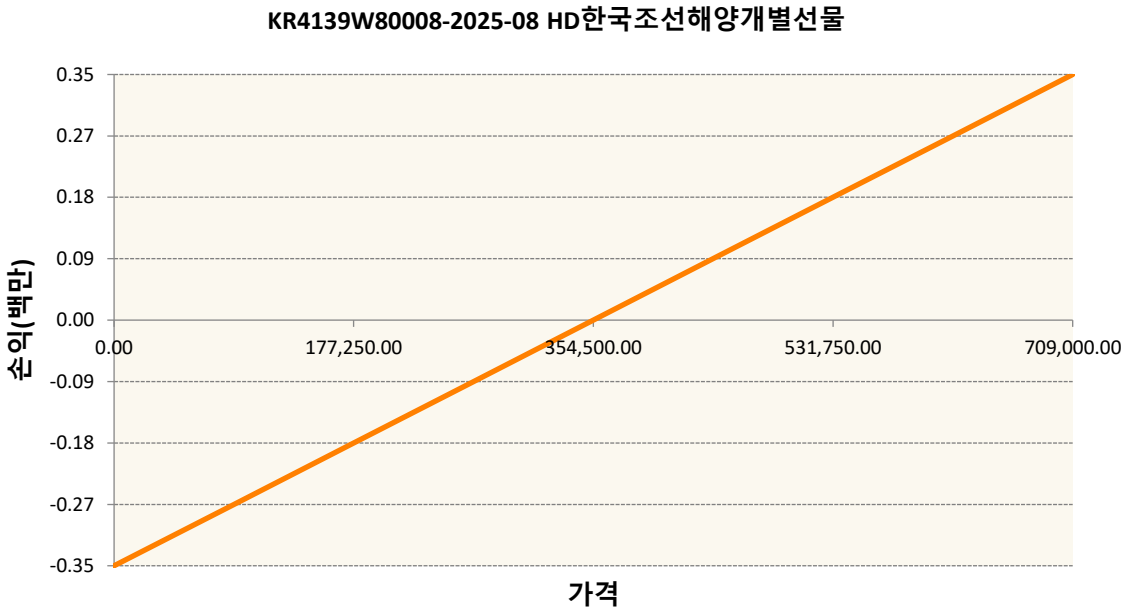
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

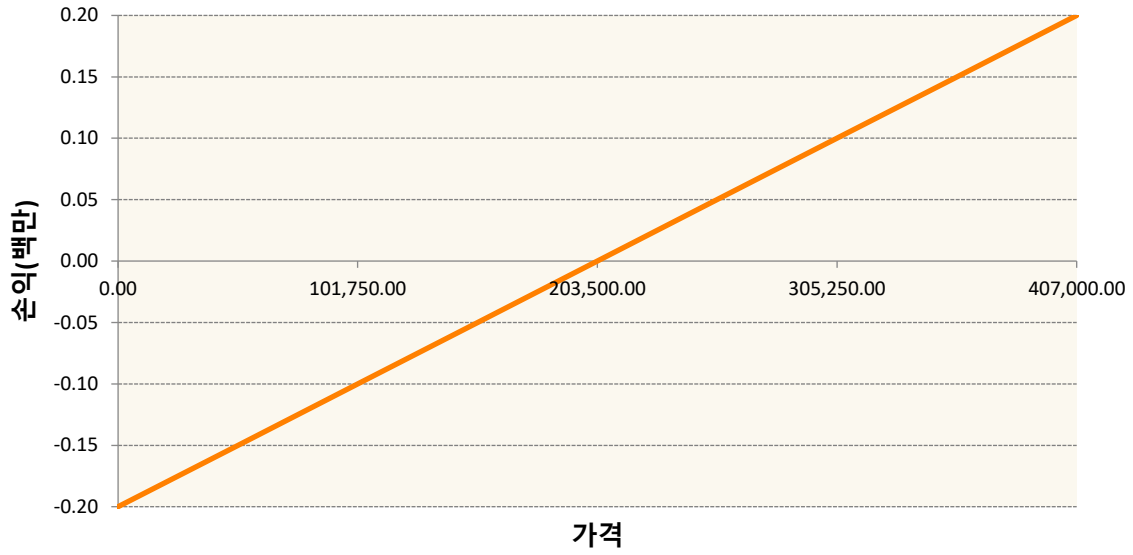
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	20,774	0	20,774	장내

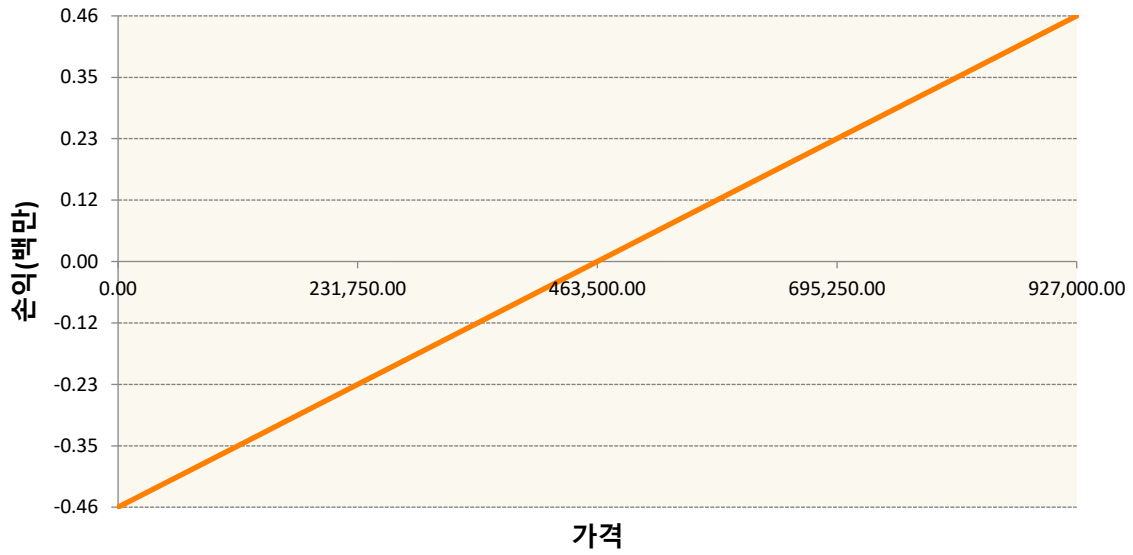
2. 만기시점의 손익구조



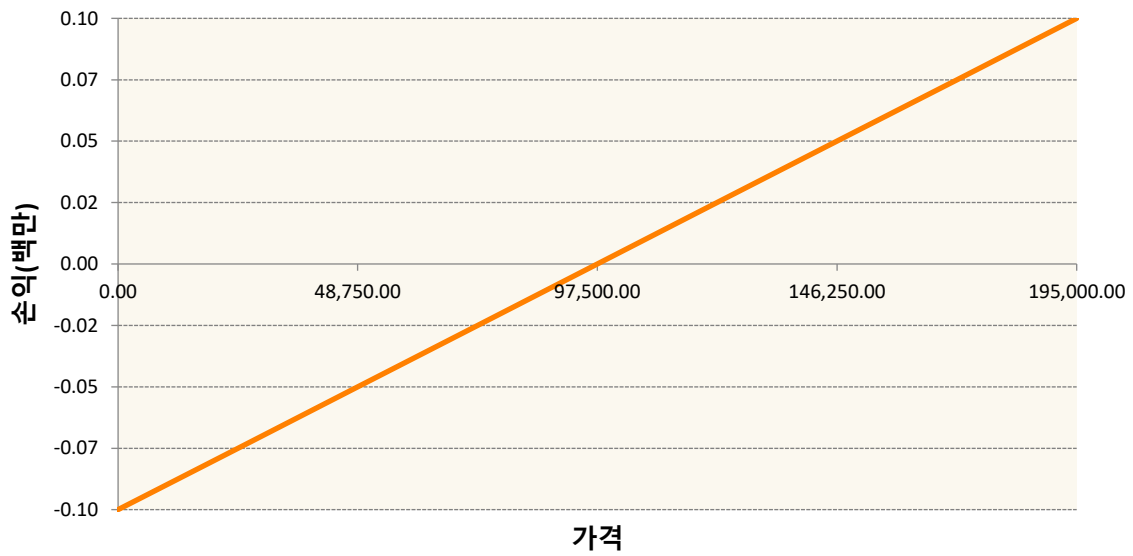
KR41CDW80008-2025-08 HD현대미포개별선물



KR41FDW80001-2025-08 HD현대중공업개별선물



KR41FVW80003-2025-08 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139W80008			2025-08 HD한국조선해양개별선물				396
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396
-5.33%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
-2.67%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	132	132	132	132	132	132	132
5.33%	264	264	264	264	264	264	264
8.00%	396	396	396	396	396	396	396
KR41BFW80005			2025-08 삼성중공업개별선물				385
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385
-5.33%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256
-2.67%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	128	128	128	128	128	128	128
5.33%	256	256	256	256	256	256	256
8.00%	385	385	385	385	385	385	385
KR41CDW80008			2025-08 HD현대미포개별선물				259
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	173	173	173	173	173	173	173
8.00%	259	259	259	259	259	259	259
KR41FDW80001			2025-08 HD현대중공업개별선물				167
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-5.33%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	56	56	56	56	56	56	56
5.33%	111	111	111	111	111	111	111
8.00%	167	167	167	167	167	167	167
KR41FVW80003			2025-08 한화오션개별선물				453
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-453	-453	-453	-453	-453	-453	-453
-5.33%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302
-2.67%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	151	151	151	151	151	151	151
5.33%	302	302	302	302	302	302	302
8.00%	453	453	453	453	453	453	453

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

(단위:백만원)

1,217

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

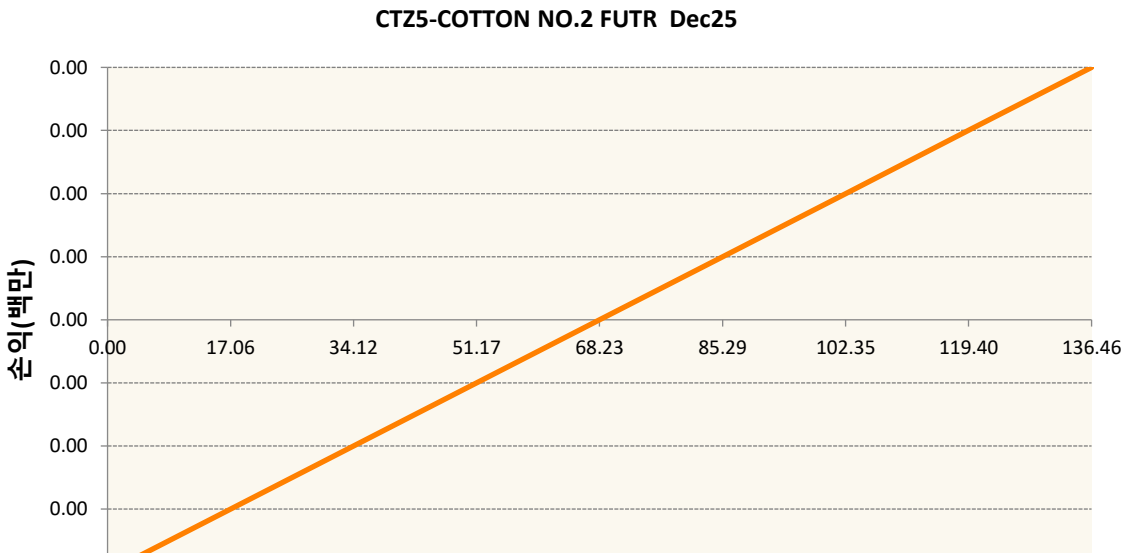
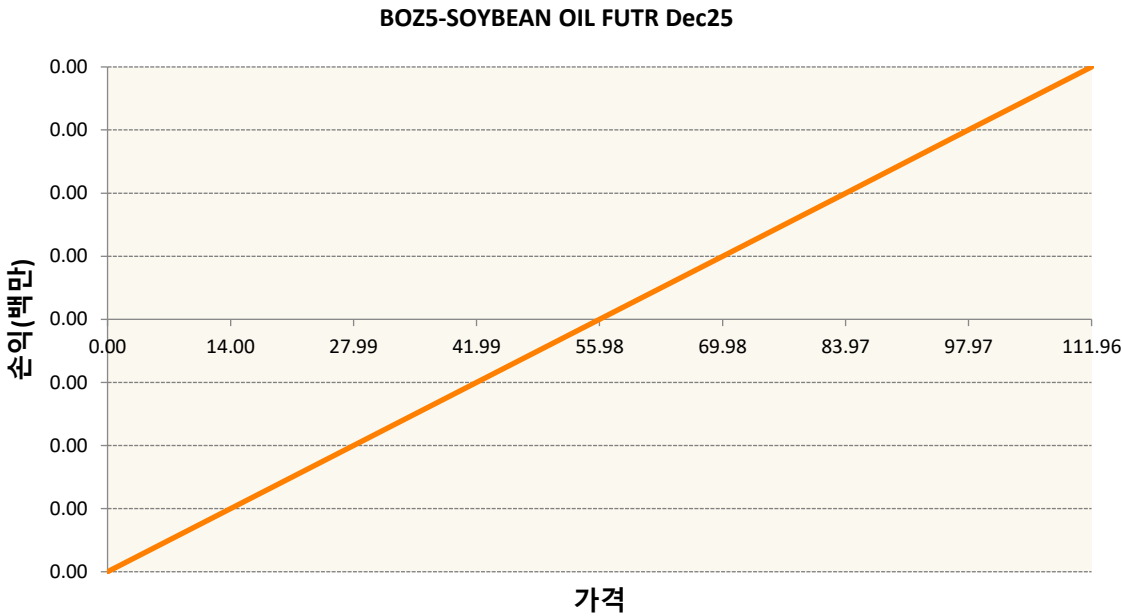
포커스농산물모(채권-파생형)

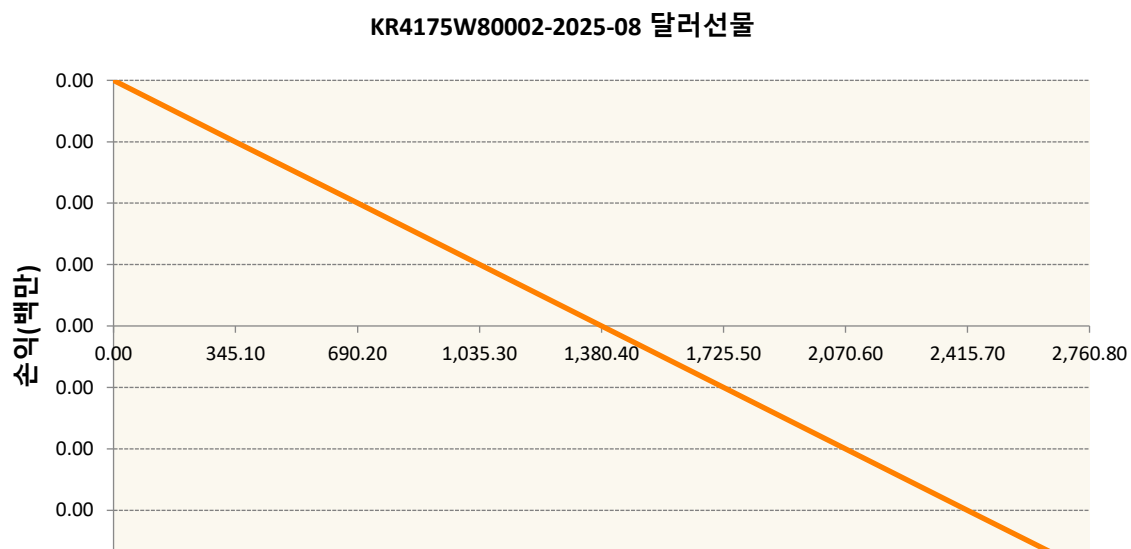
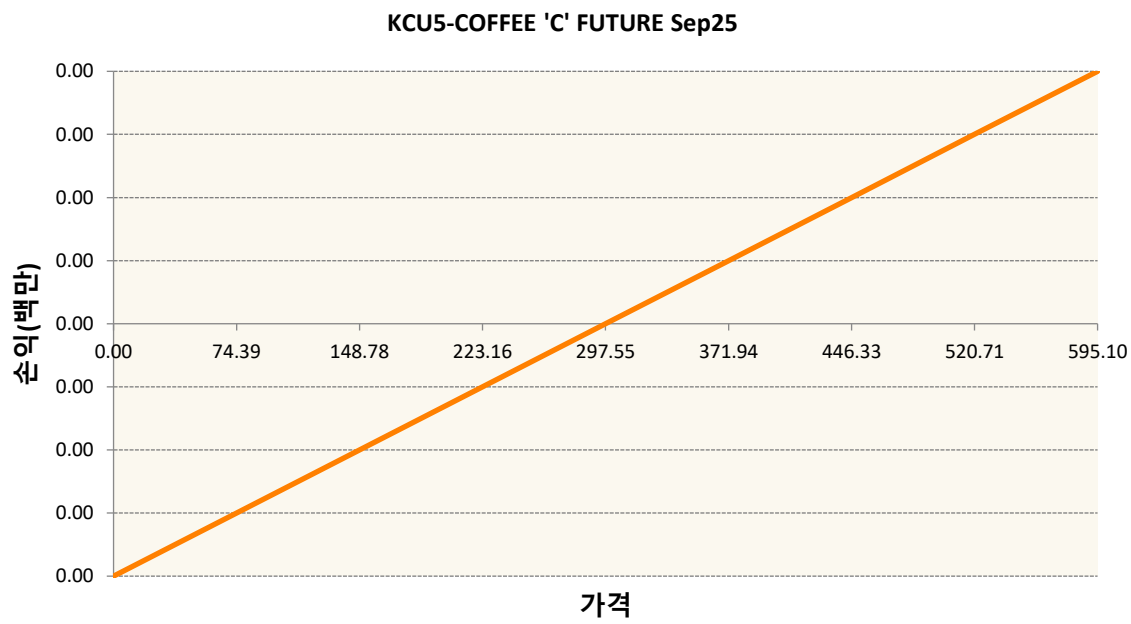
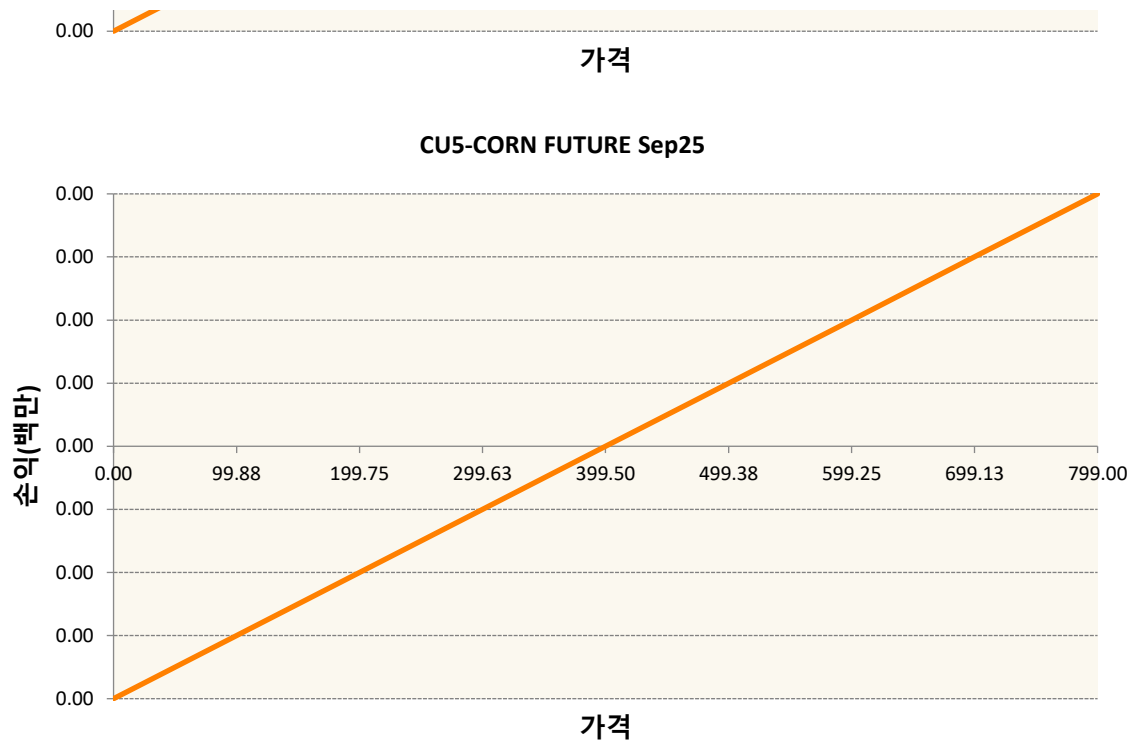
1. 계약금액

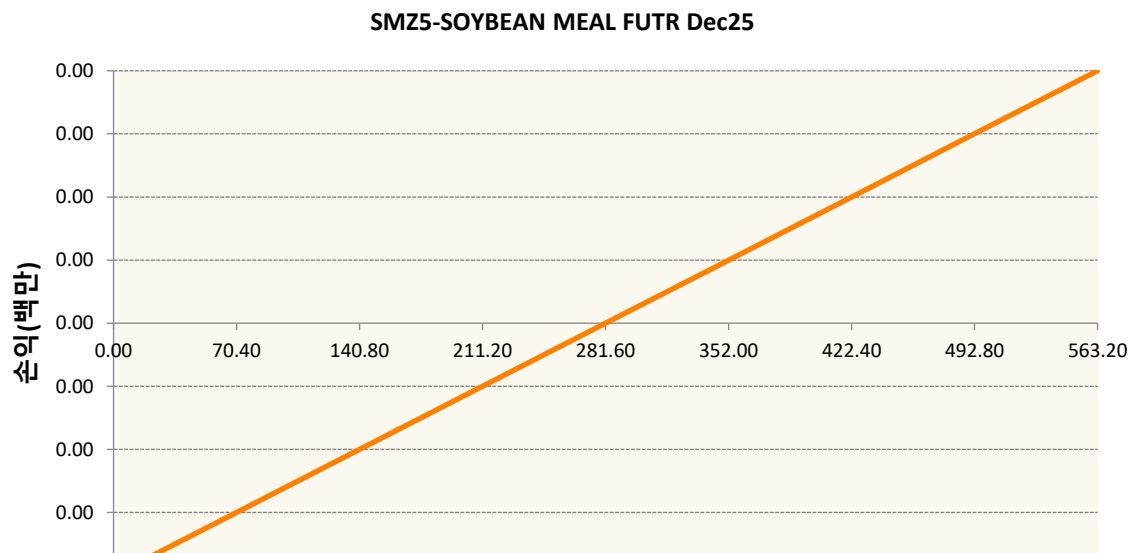
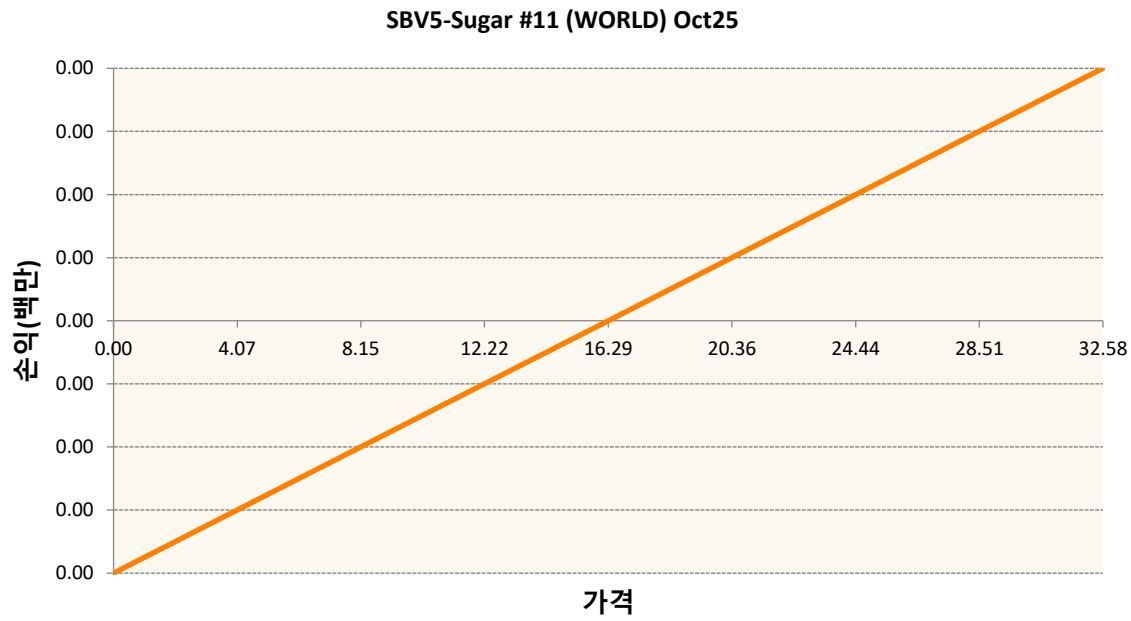
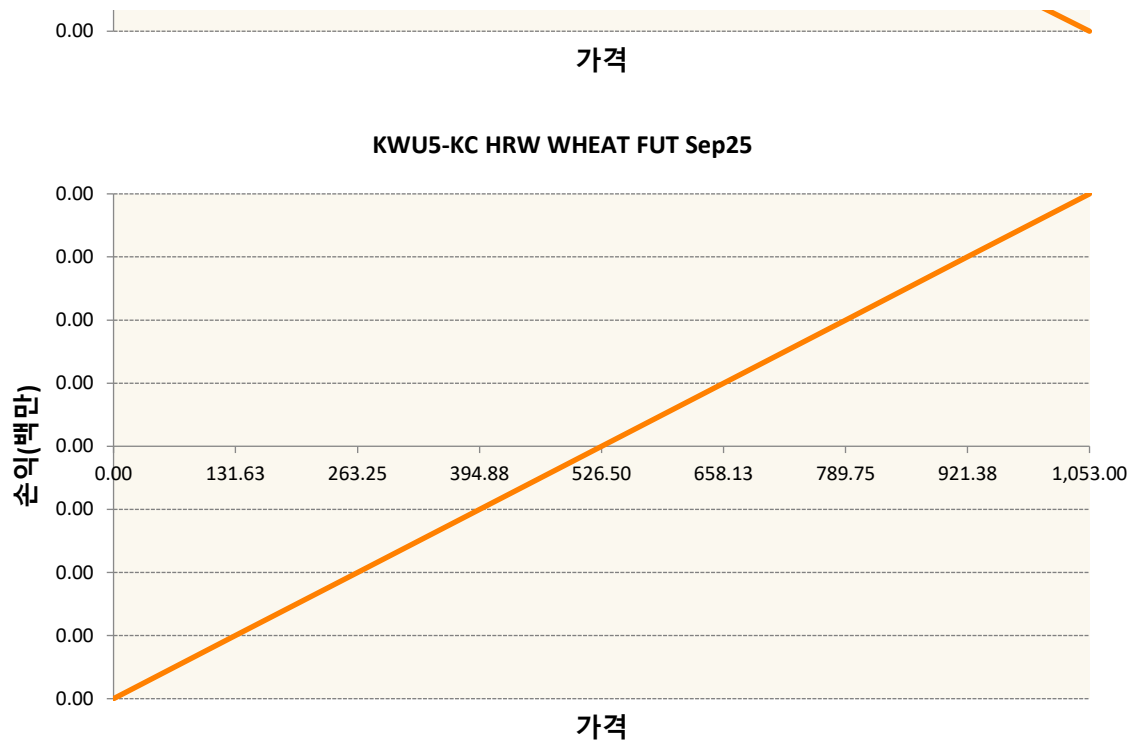
(단위:USD 백만)

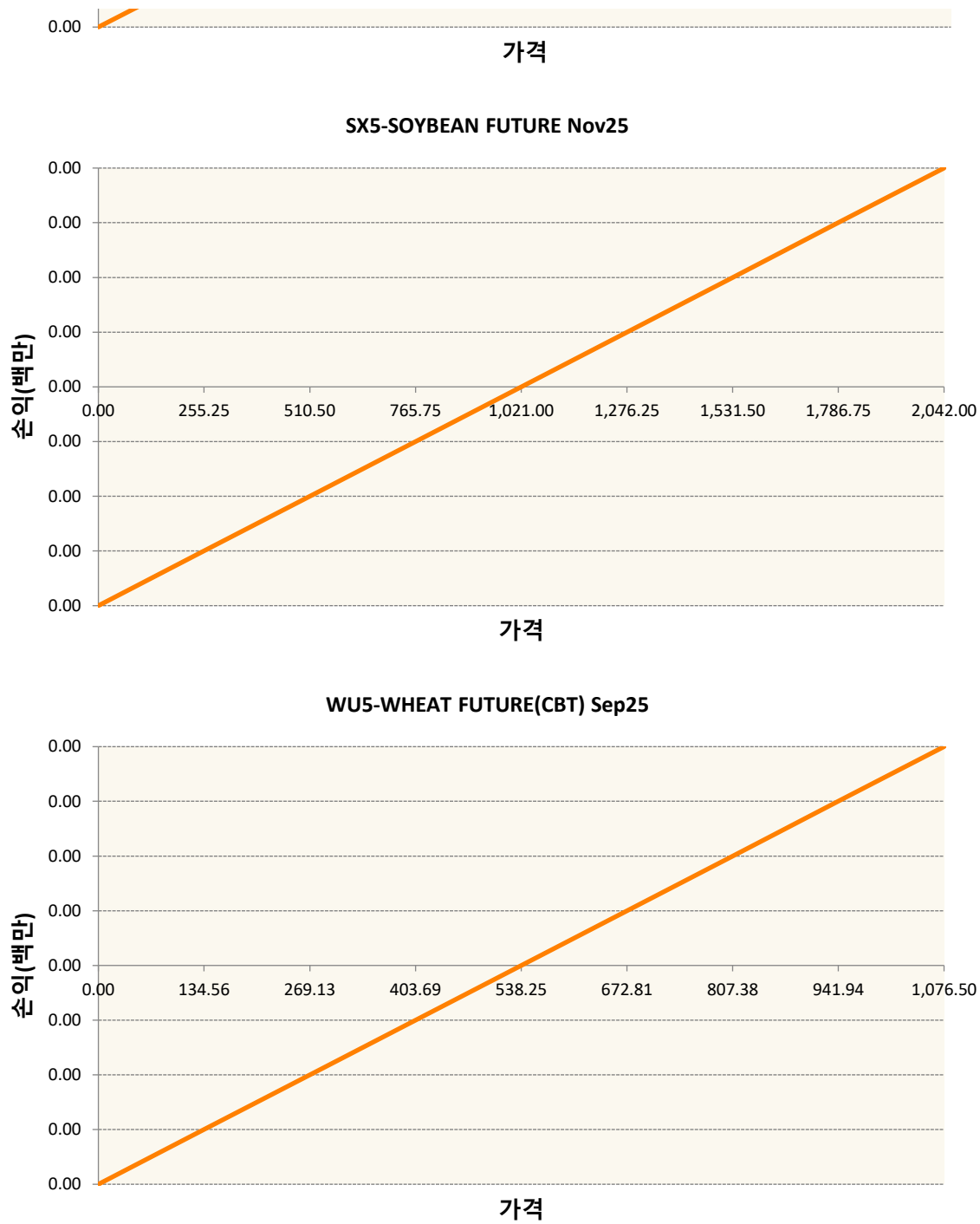
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,590	0	1,590	
누계	유가증권	선물	1,923	0	1,923	
누계	통화	선물	0	262	-262	장내

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	2025-07-29
기준일	2025-07-28

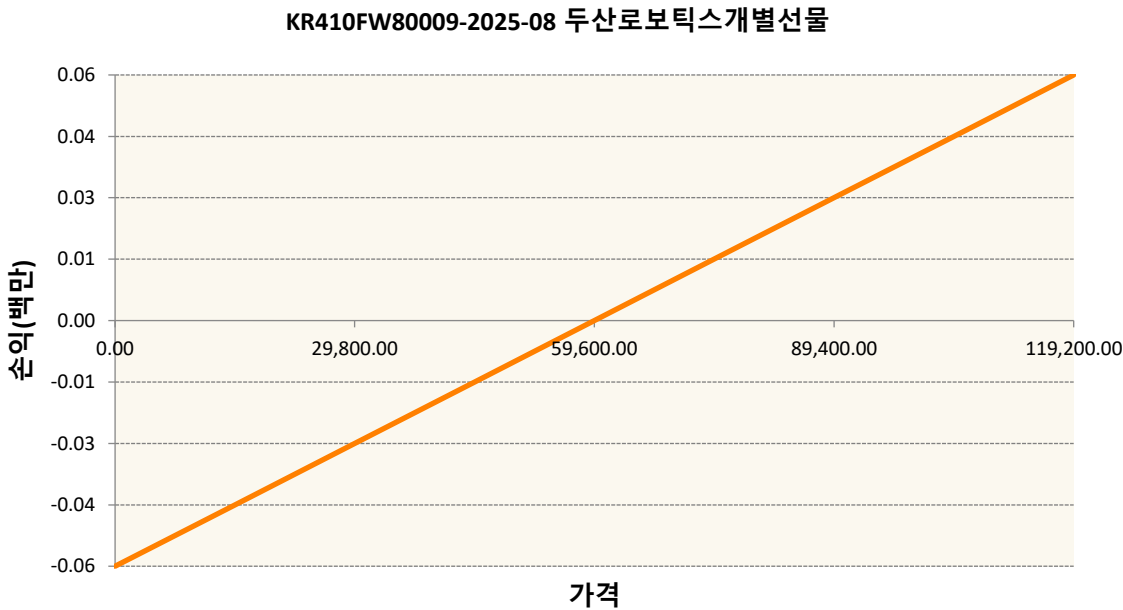
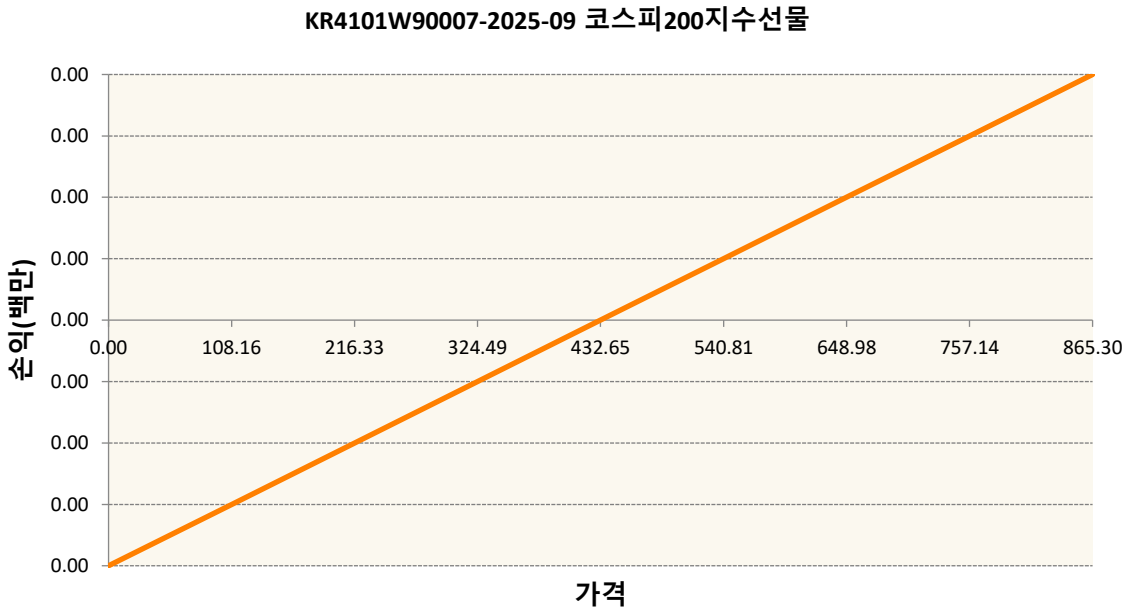
스마트인덱스모

1. 계약금액

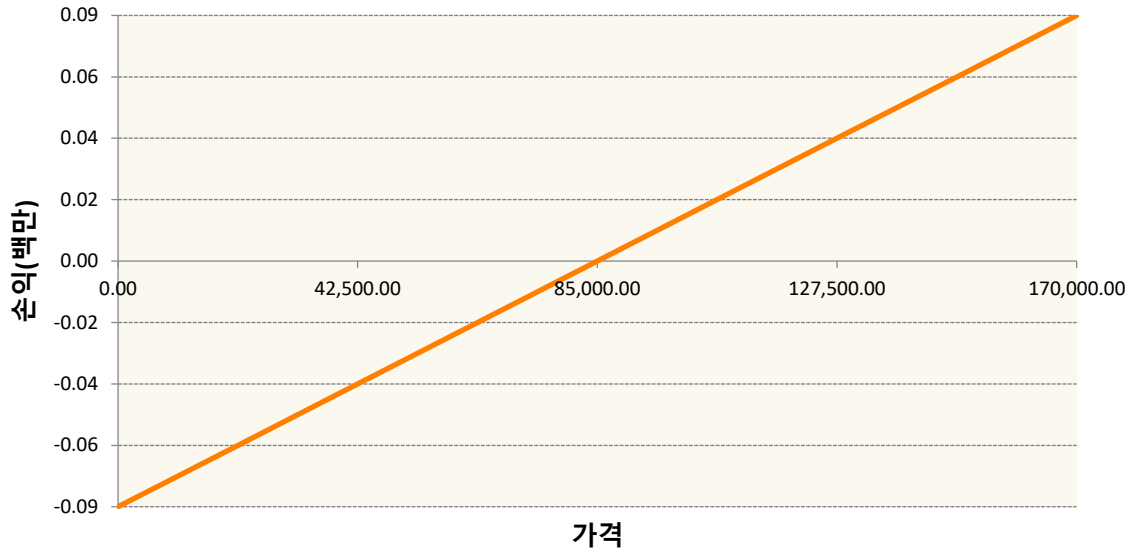
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5	0	5	장내
누계	유가증권	선물	1,061	0	1,061	장내

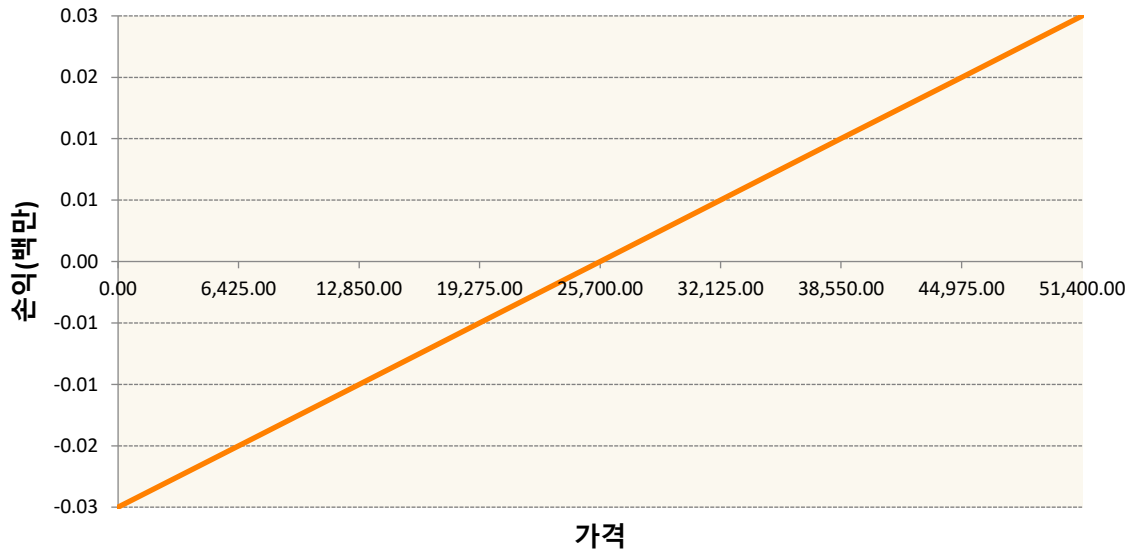
2. 만기시점의 손익구조



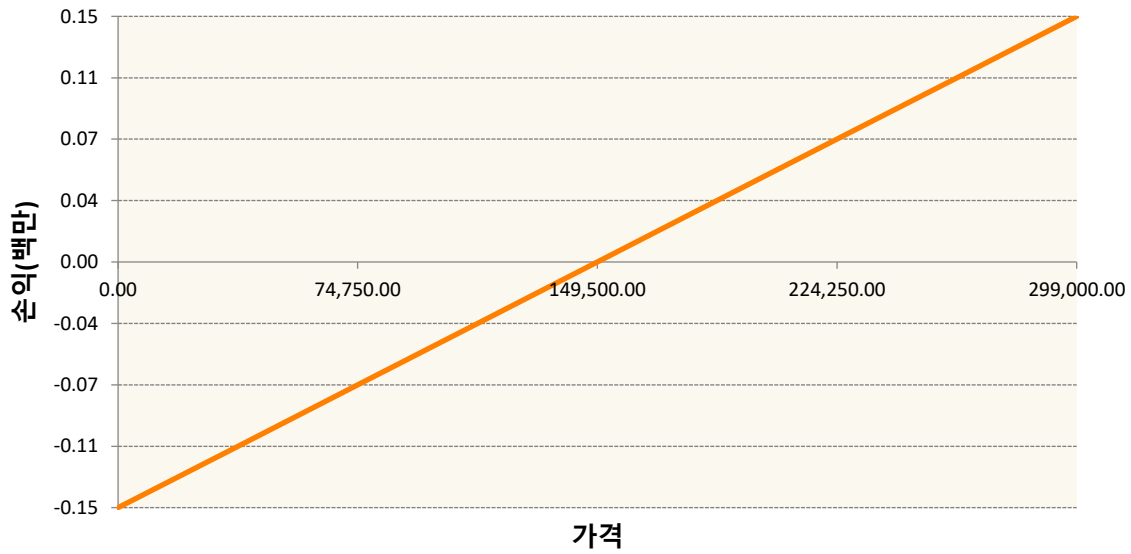
KR410ZW80007-2025-08 한미반도체개별선물



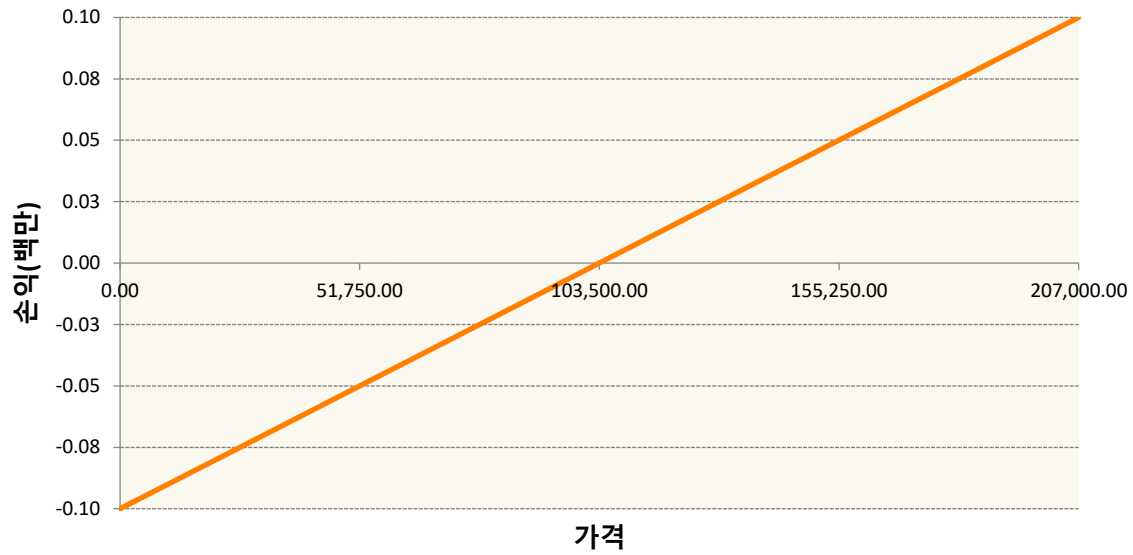
KR41CNW80007-2025-08 포스코DX개별선물



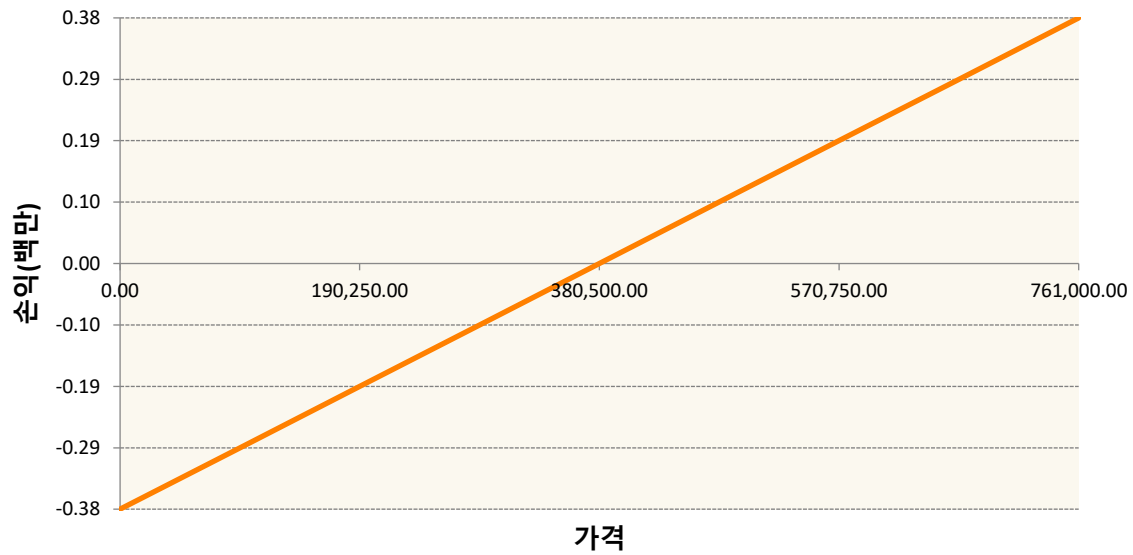
KR41E8W80008-2025-08 포스코퓨처엠개별선물



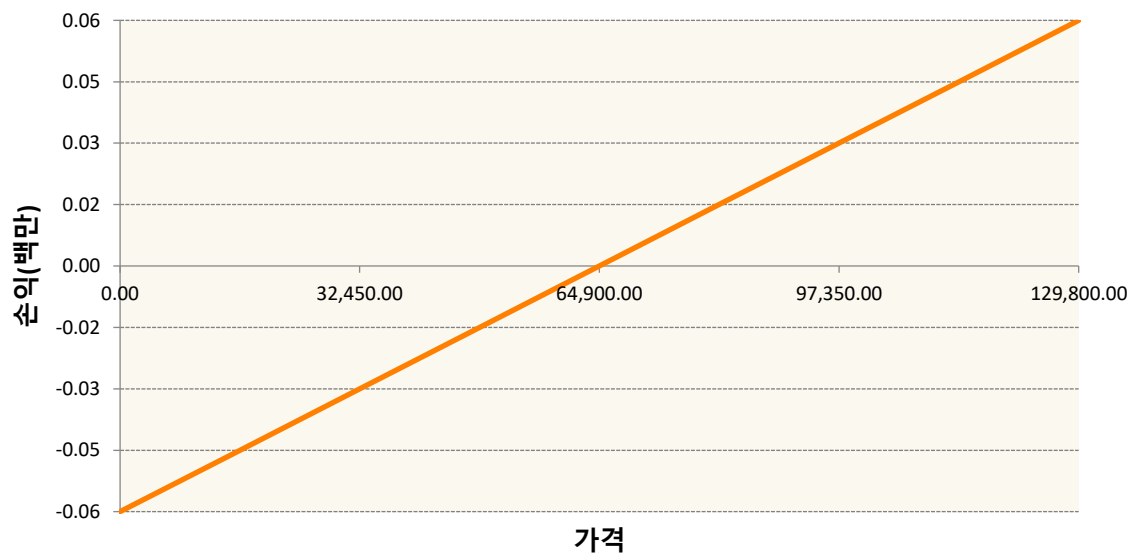
KR41EJW80001-2025-08 SKC개별선물



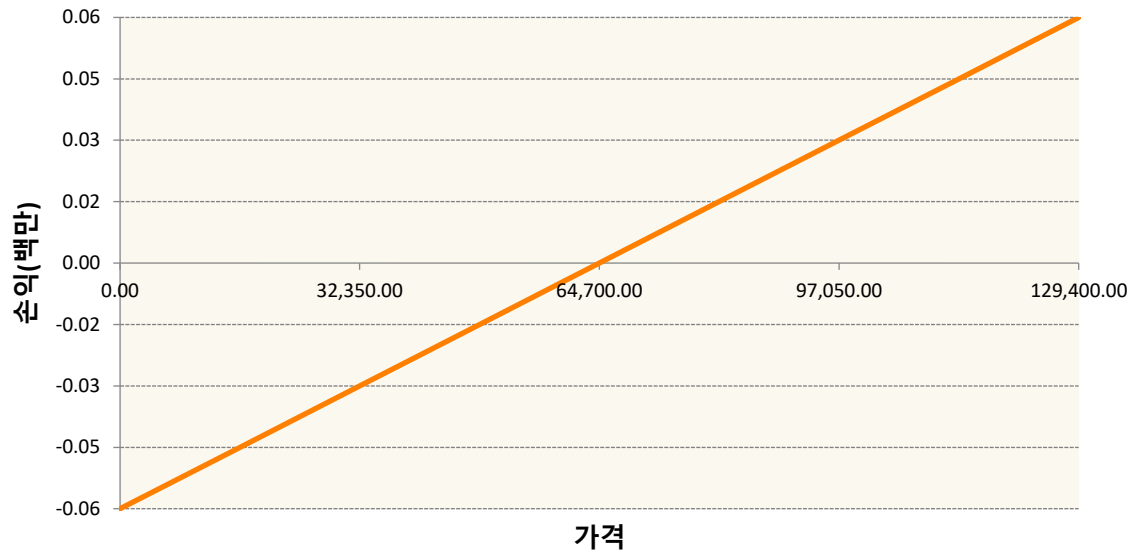
KR41F5W80003-2025-08 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7W80009-2025-08 카카오페이개별선물



KR41FMW80002-2025-08 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	52
KR410FW80(2025-08 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW80(2025-08 한미반도체개별선물	4
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)

104

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

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	329
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

523

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

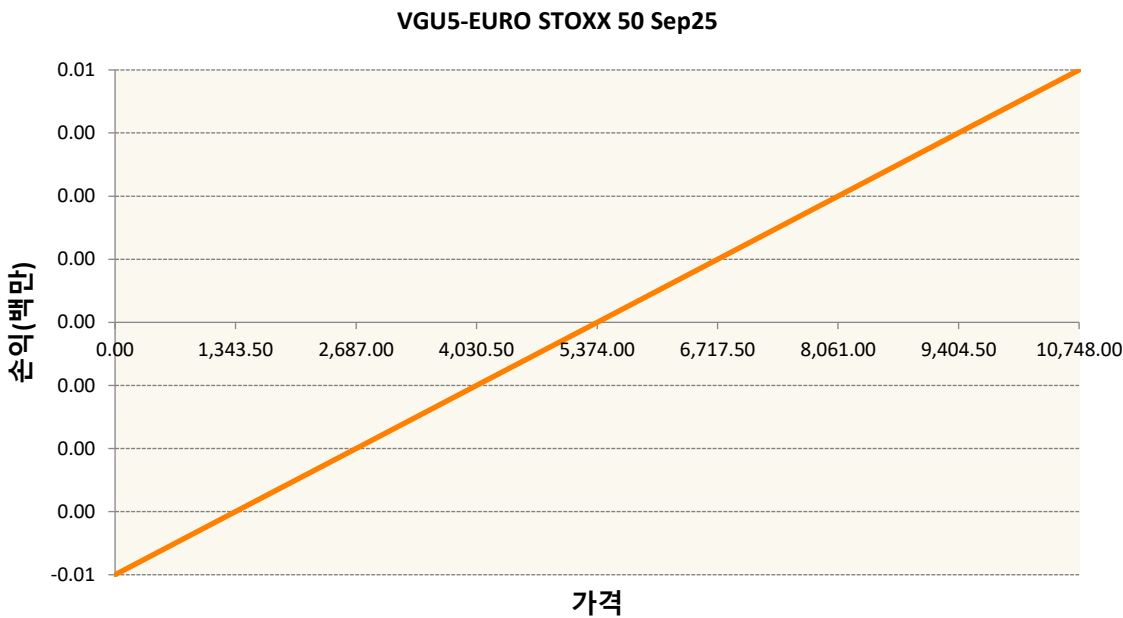
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	850	0	850	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

57

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

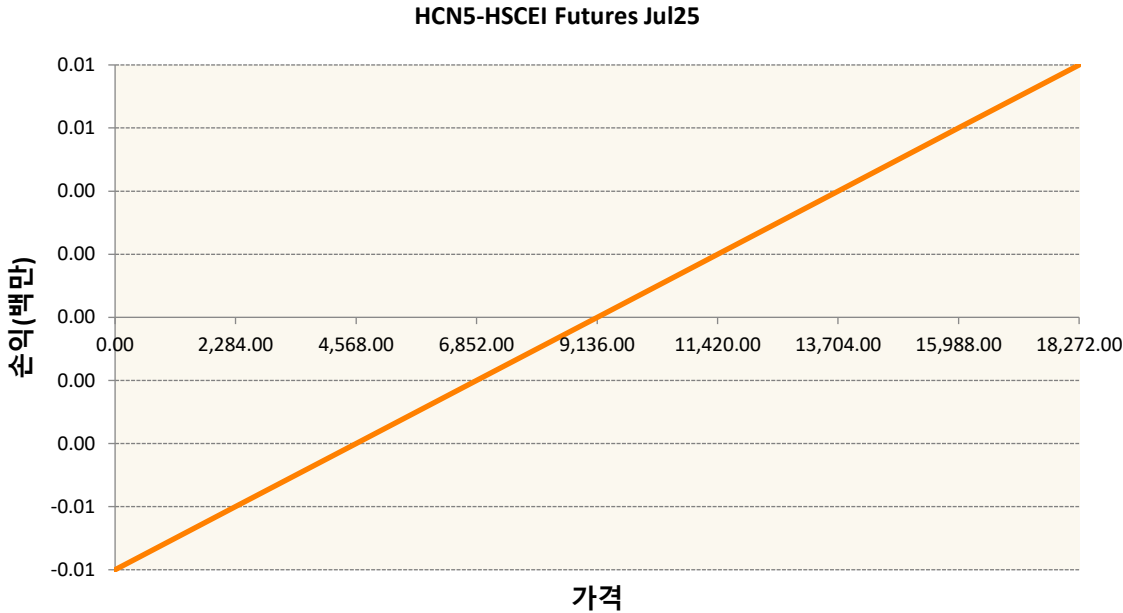
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,062	0	2,062	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN5	HSCEI Futures Jul25	165
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

236

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

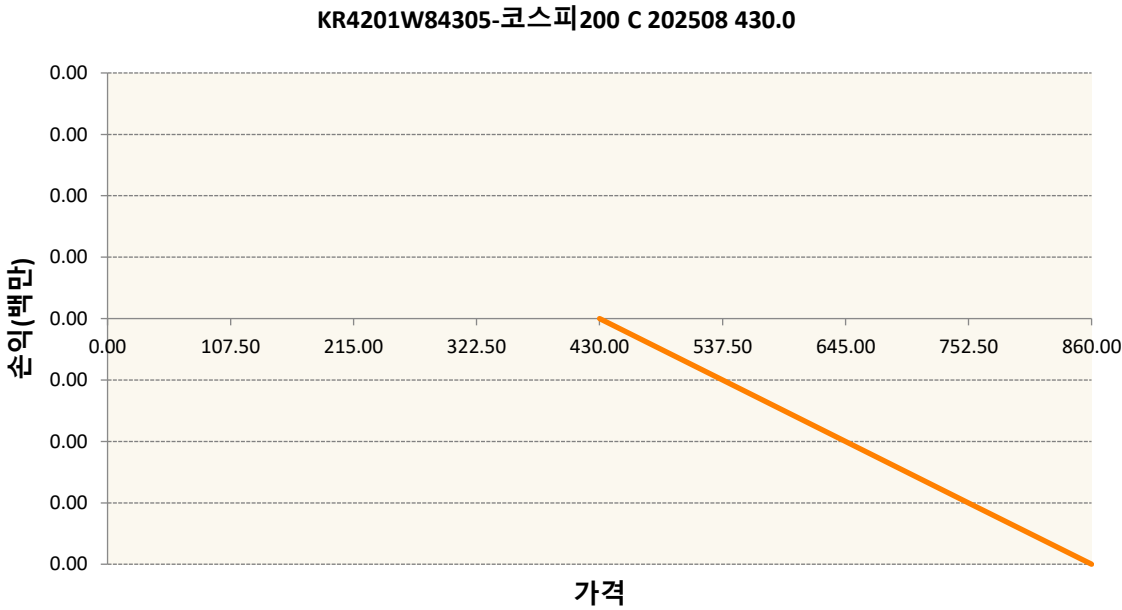
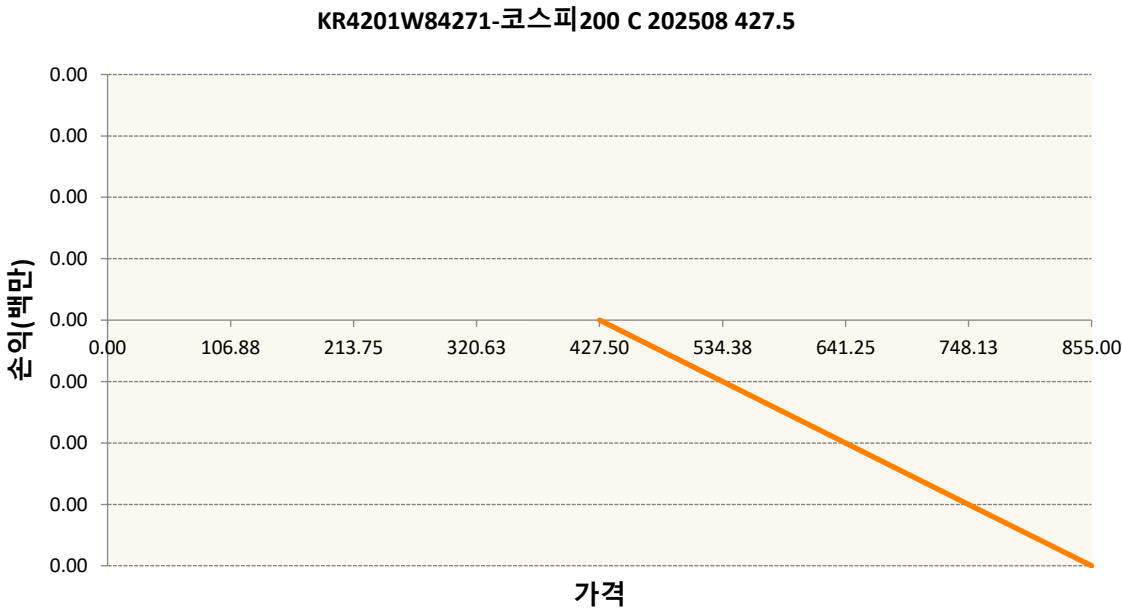
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

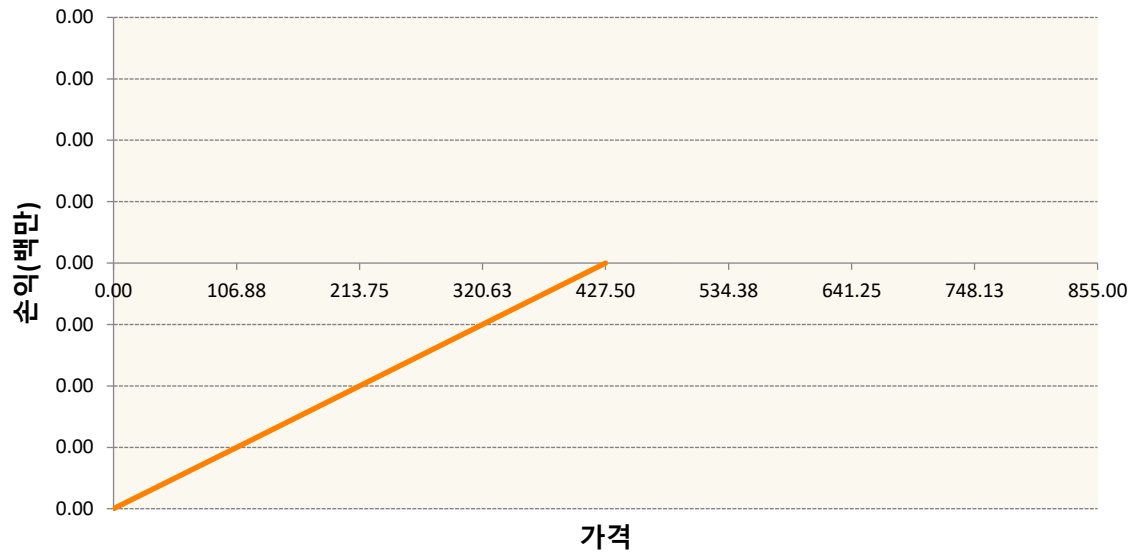
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	210	0	210	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,451	-35,451	장내

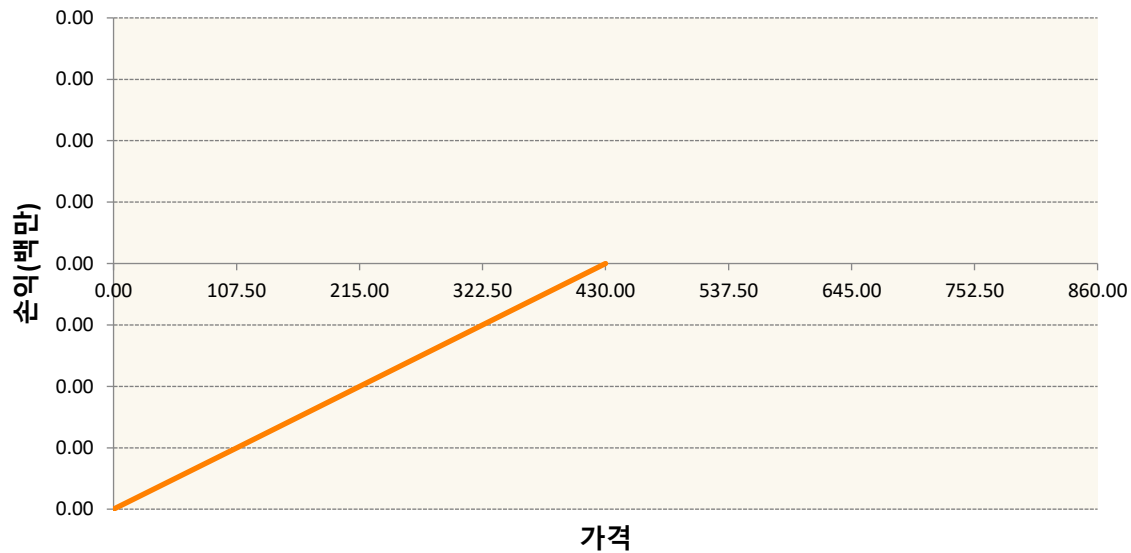
2. 만기시점의 손익구조



KR4301W84279-코스피200 P 202508 427.5



KR4301W84303-코스피200 P 202508 430.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201W84: 코스피200 C 202508 427.5	1,471
KR4201W84: 코스피200 C 202508 430.0	851
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 2025-07-29

기준일 2025-07-28

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 2025-07-29

기준일 2025-07-28

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	2025-07-29
기준일	2025-07-28

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	12,152	0	12,152	
누계	통화	선도	594	12,051	-11,457	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
FXW213F4V(KRW/USD 31-07-25E		411
FXW213F5V(KRW/USD 29-08-25E		323
FXW213F6SC KRW/USD 29-08-25E		224
FXW213F6XC USD/KRW 31-07-25E		14
FXW213F74C KRW/USD 31-07-25E		6
FXW213F7PC USD/KRW 31-07-25E		33
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	504

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

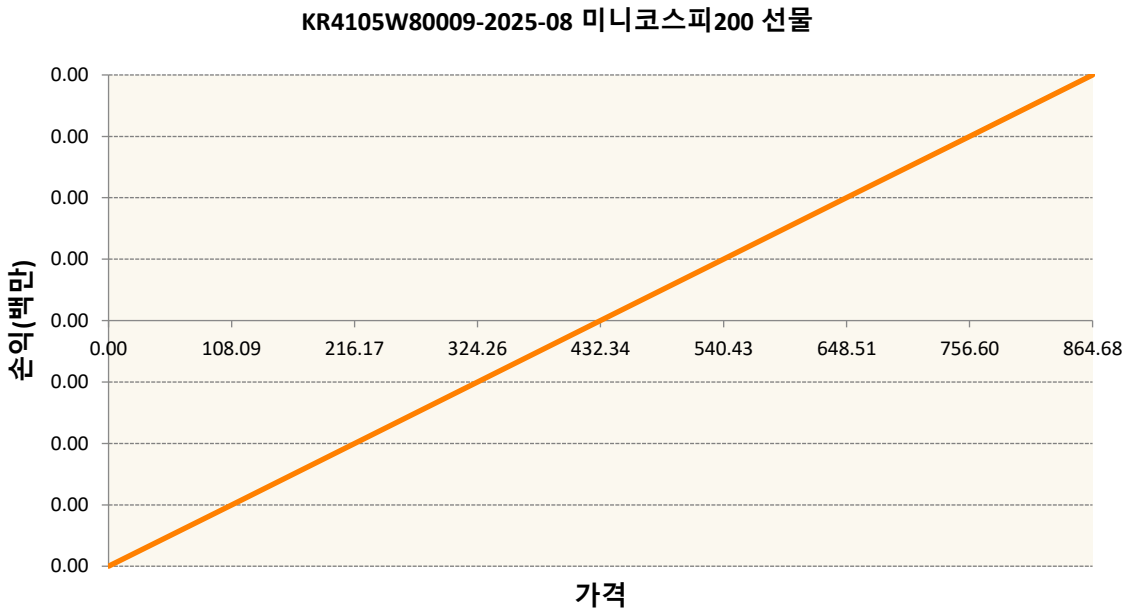
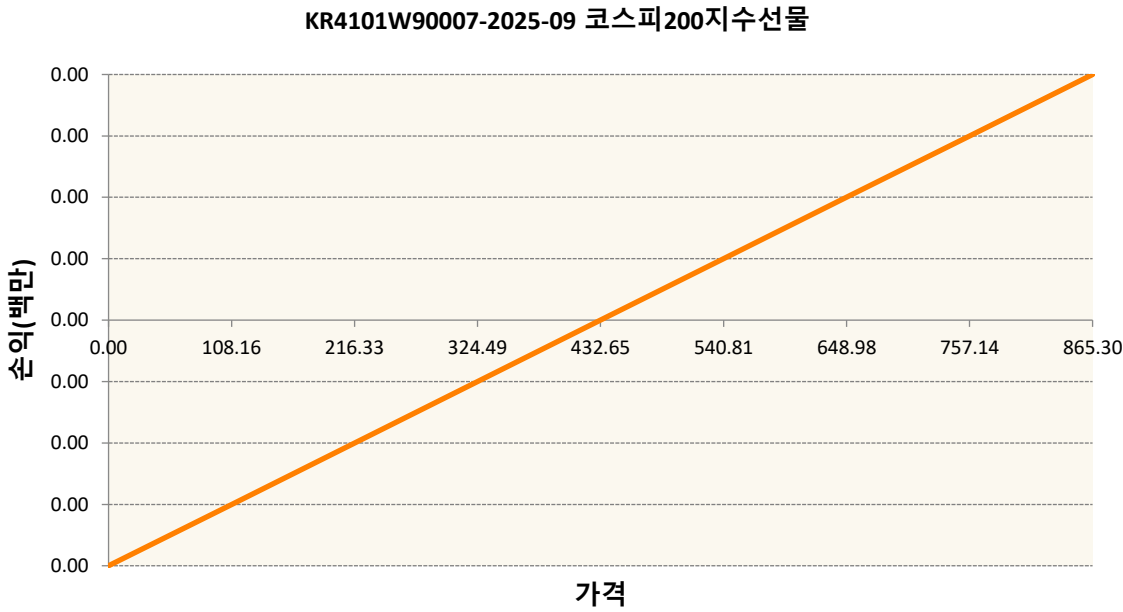
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

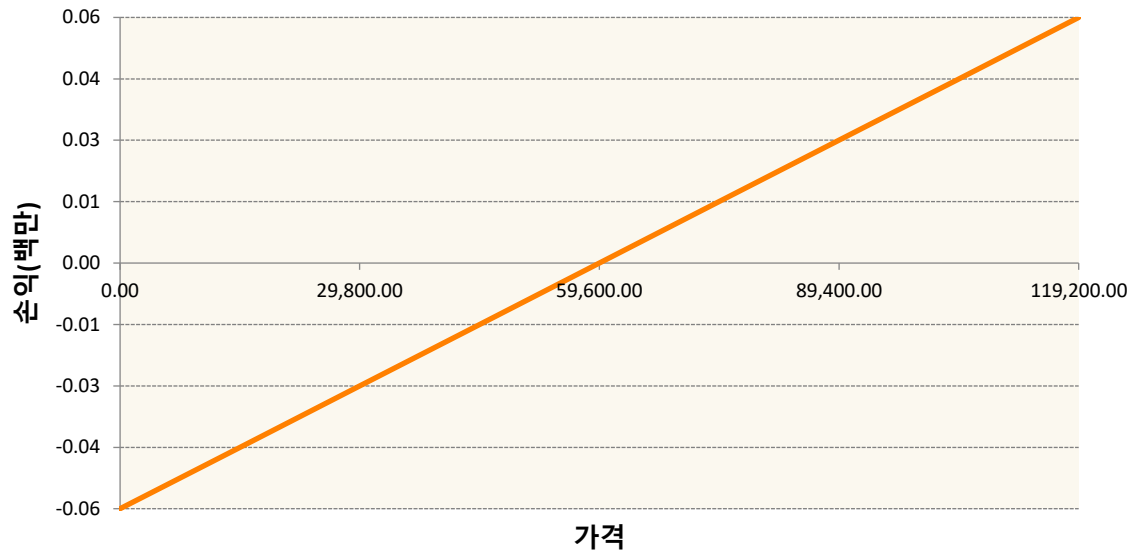
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2	109	-107	장내
누계	유가증권	선물	635	0	635	장내

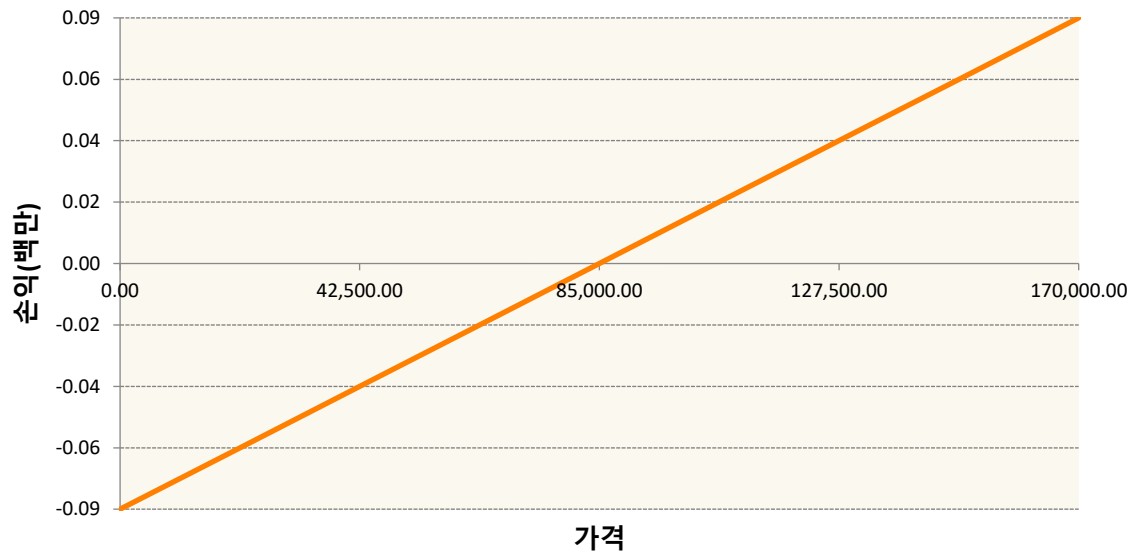
2. 만기시점의 손익구조



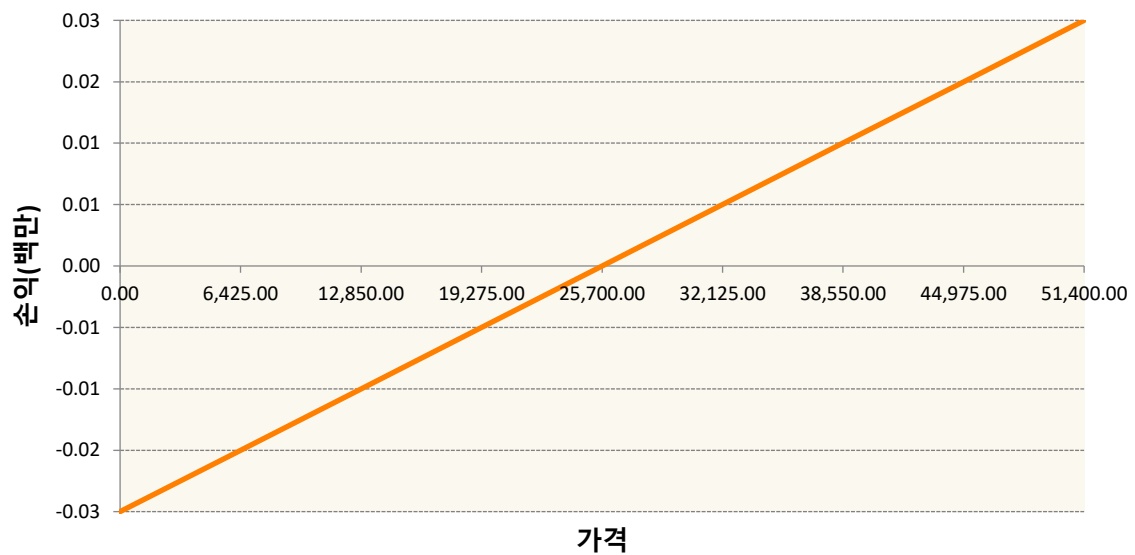
KR410FW80009-2025-08 두산로보틱스개별선물



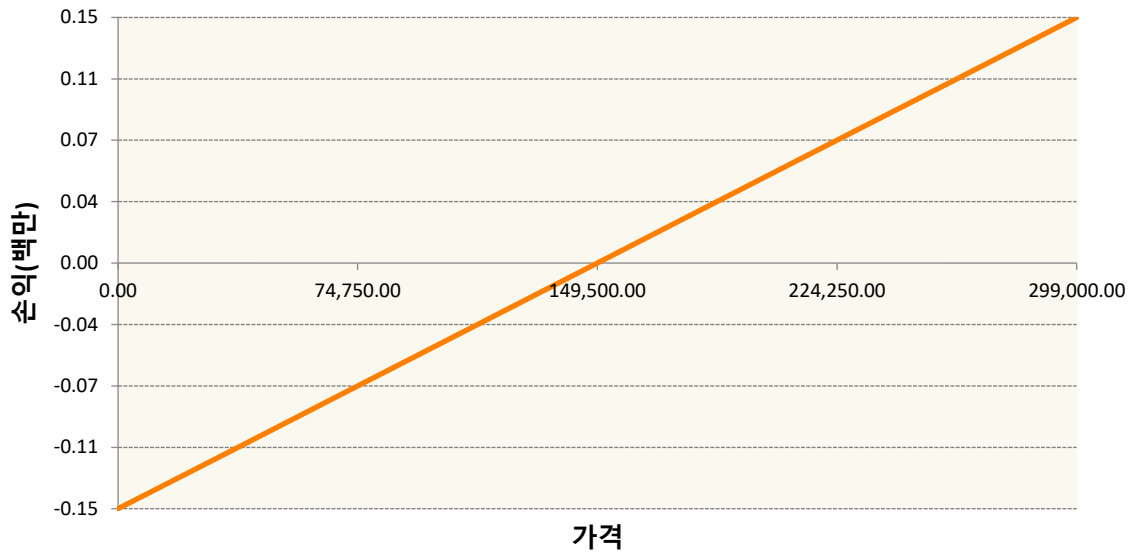
KR410ZW80007-2025-08 한미반도체개별선물



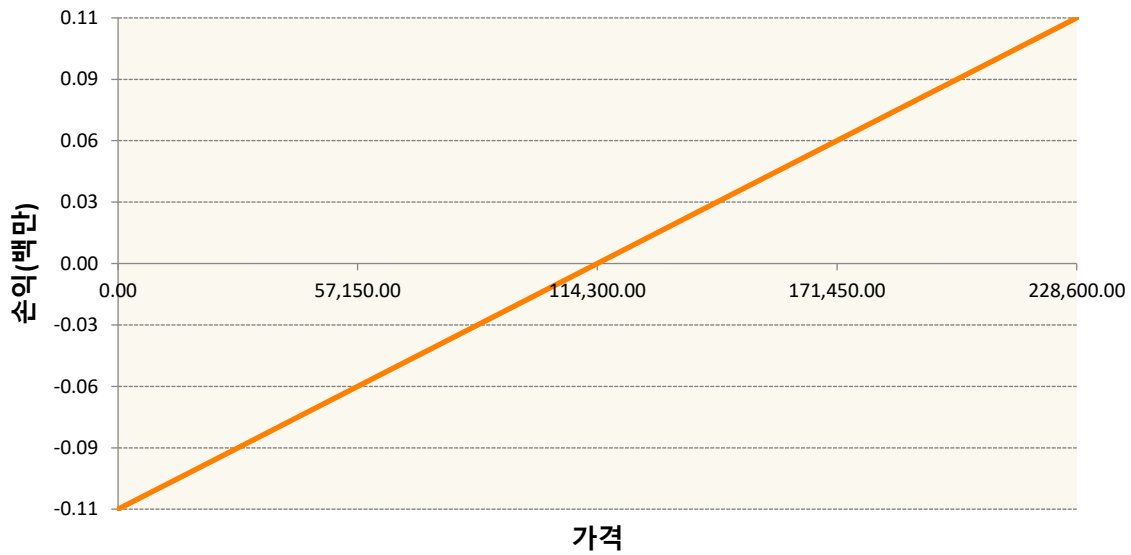
KR41CNW80007-2025-08 포스코DX개별선물



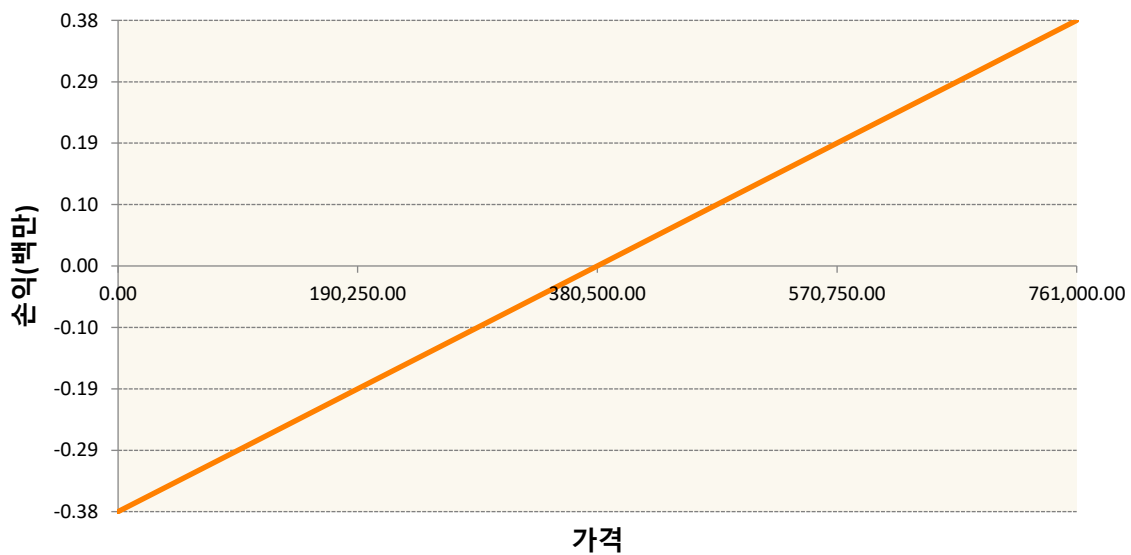
KR41E8W80008-2025-08 포스코퓨처엠개별선물



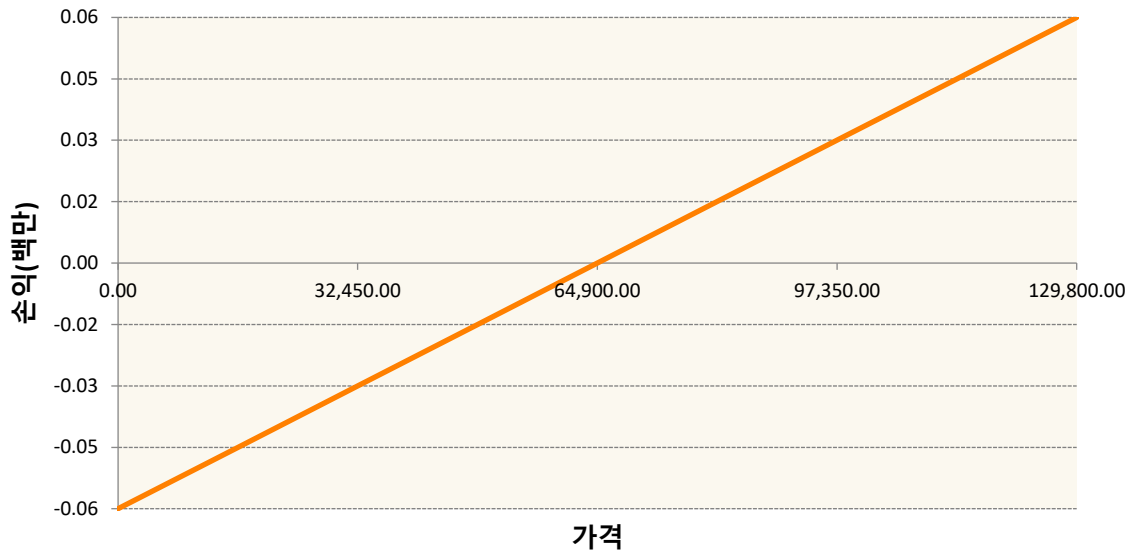
KR41EYW80000-2025-08 에코프로비엠개별선물



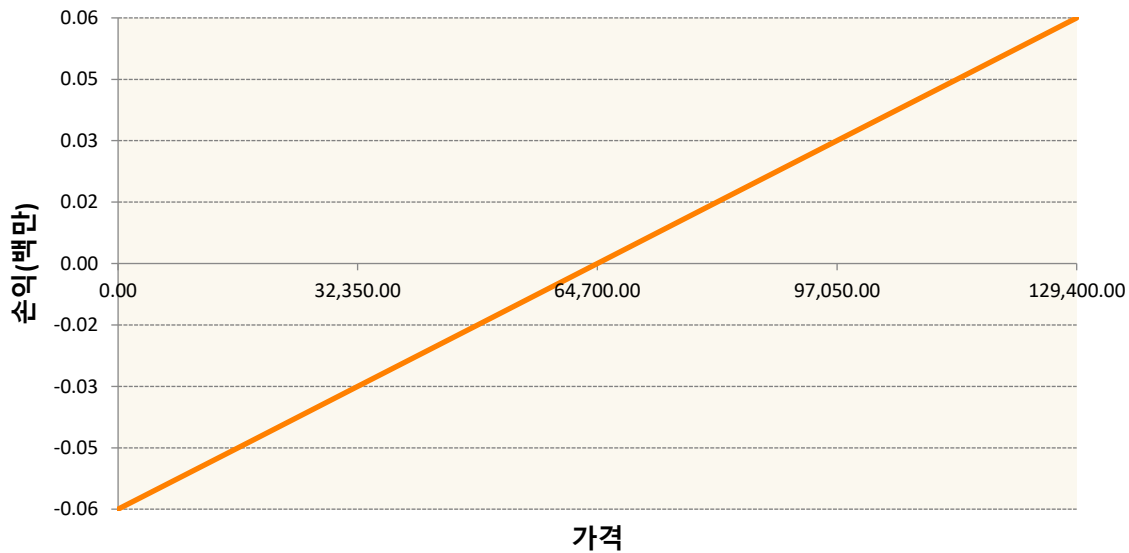
KR41F5W80003-2025-08 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7W80009-2025-08 카카오페이개별선물



KR41FMW80002-2025-08 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	26
KR4105W80(2025-08 미니코스피200 선물	2
KR410FW80(2025-08 두산로보틱스개별선물	1
KR410ZW80(2025-08 한미반도체개별선물	2
KR41CNW80 2025-08 포스코DX개별선물	1
KR41E8W80(2025-08 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EYW80(2025-08 에코프로비엠개별선물	3
KR41F5W80(2025-08 LG에너지솔루션개별선물	7
KR41F7W80(2025-08 카카오페이개별선물	1
KR41FMW80 2025-08 엘앤에프개별선물	1

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

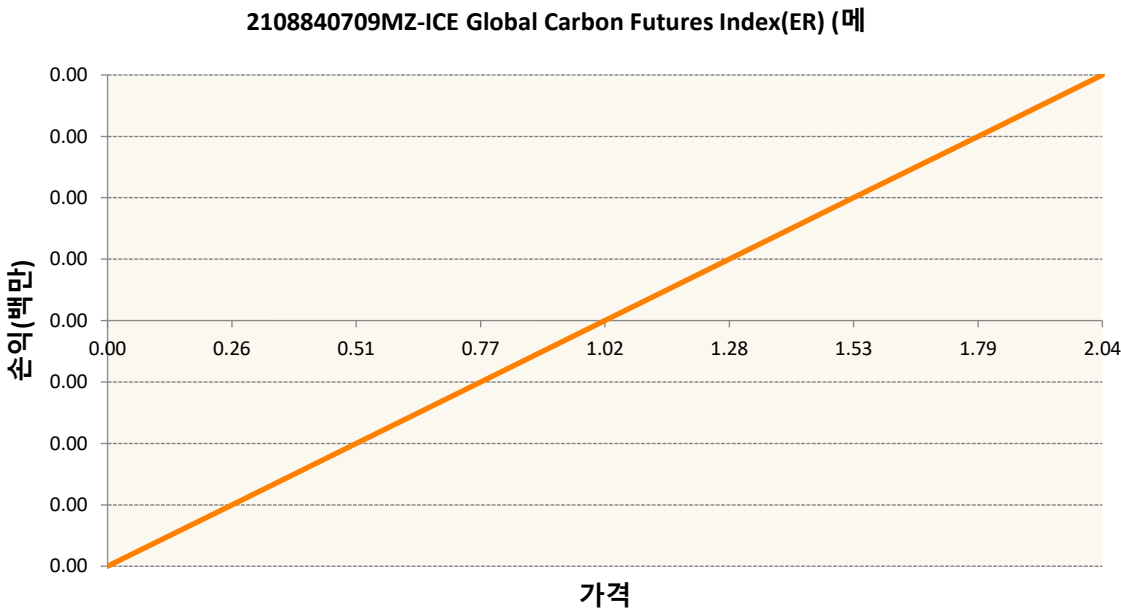
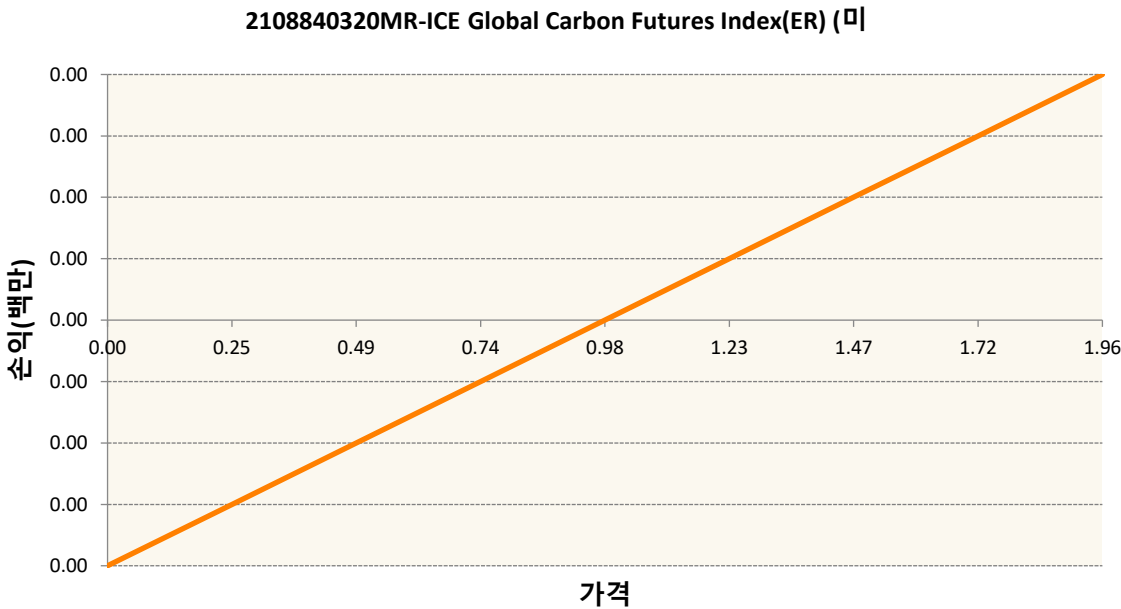
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	1,229	0	1,229	장외
누계	유가증권	선물	7,391	0	7,391	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	590
2108840709	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	777

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

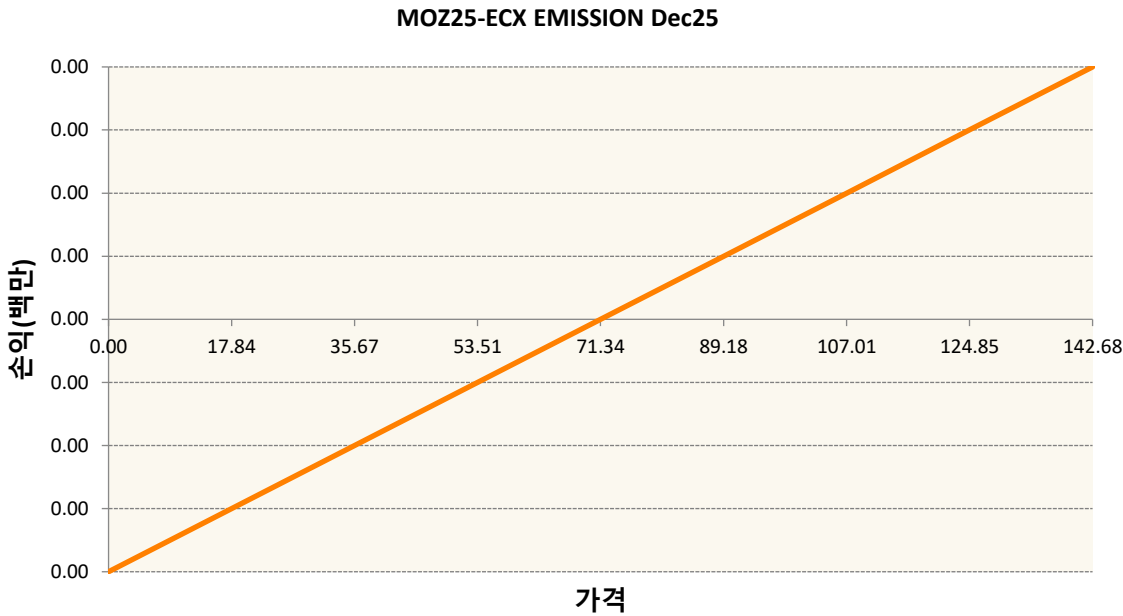
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,483	0	6,483	
누계	유가증권	선물	-16	0	-16	장외
누계	통화	선도	0	1,372	-1,372	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	1
FXW213F71C KRW/EUR 31-07-25E	110
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	519

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

(단위:백만원)

912

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

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)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	12
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	8
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	9

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

(단위:백만원)

71

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

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)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	20
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	14
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	4

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

(단위:백만원)

95

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

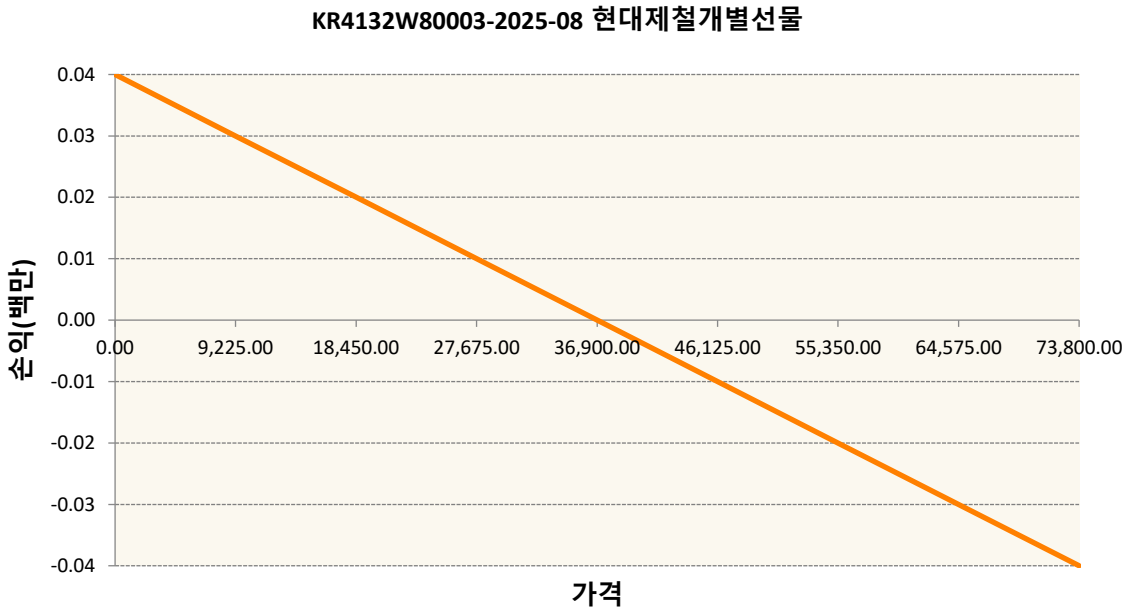
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	4	-4	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4132W80(2025-08 현대제철개별선물

0.3

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

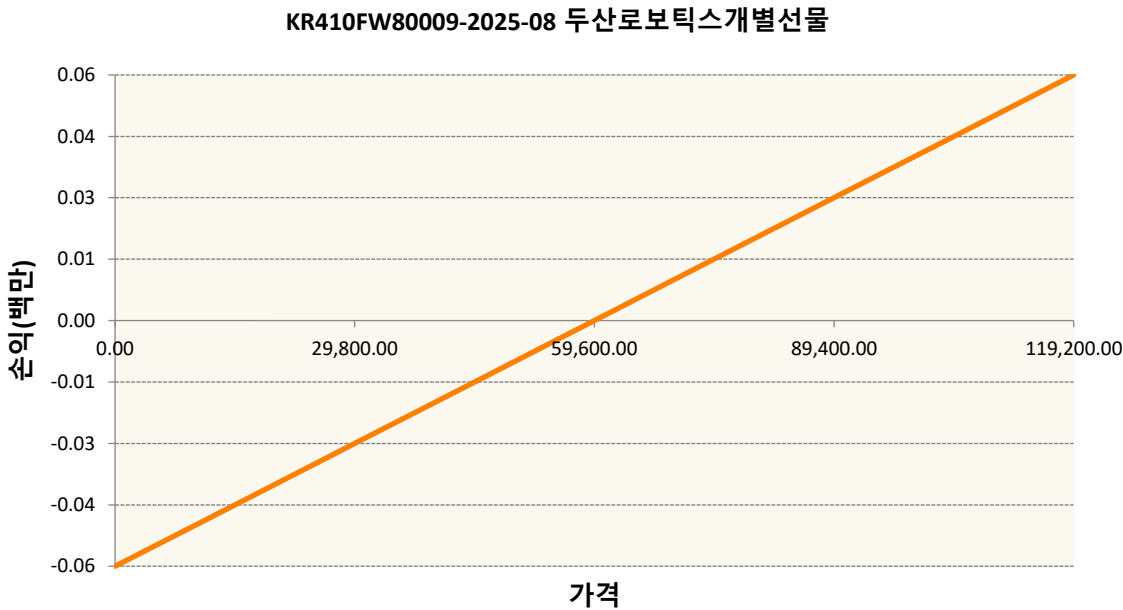
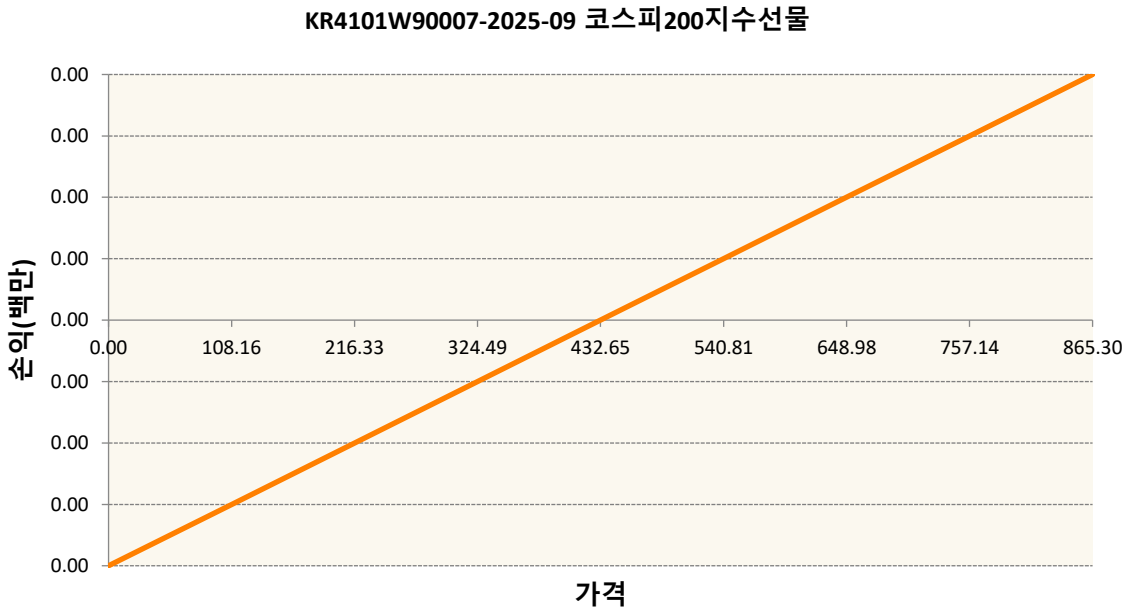
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

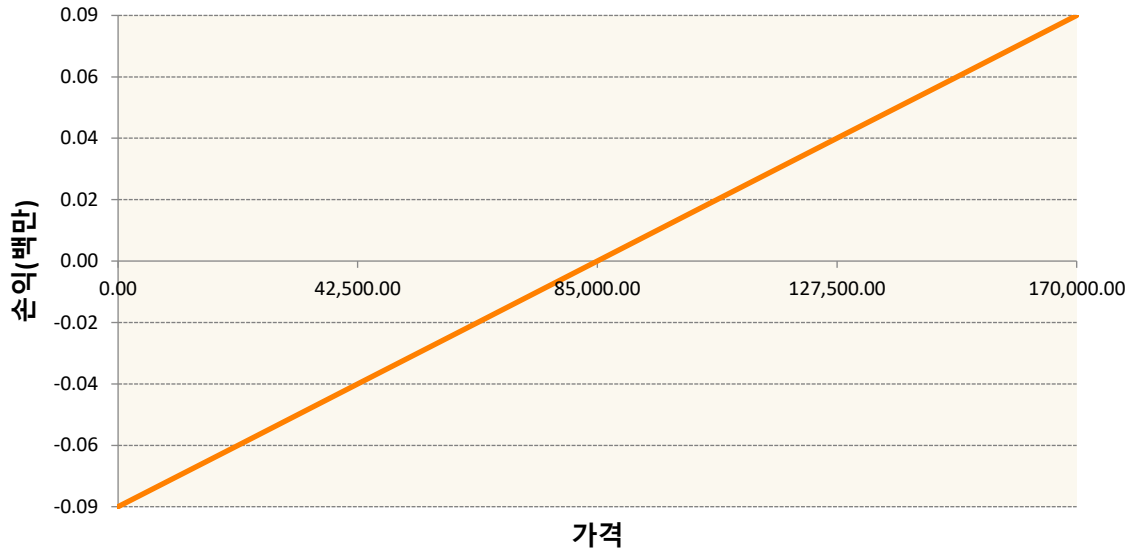
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,488	0	1,488	장내
누계	유가증권	선물	12,776	0	12,776	장내

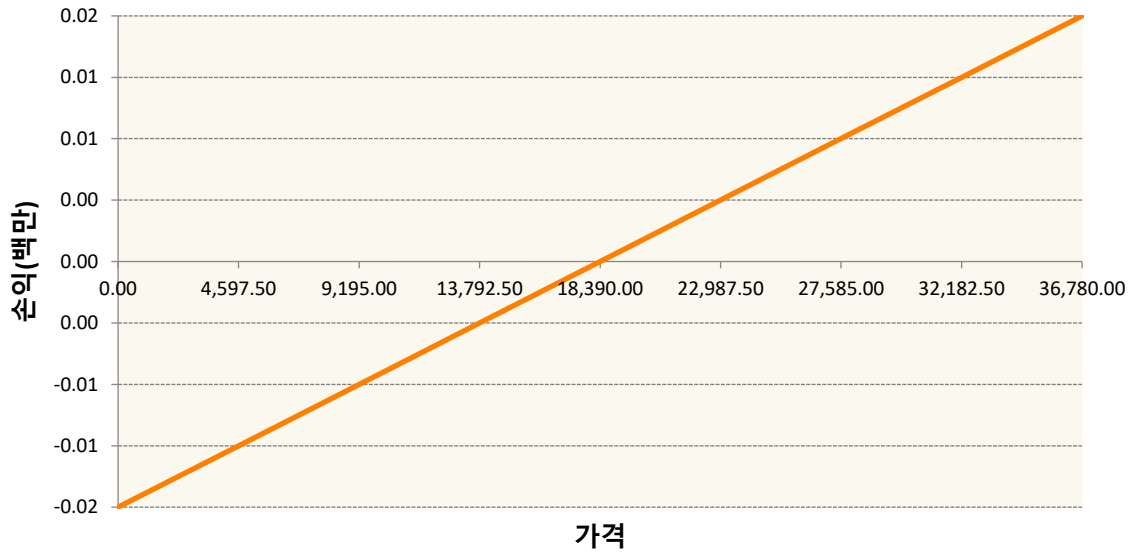
2. 만기시점의 손익구조



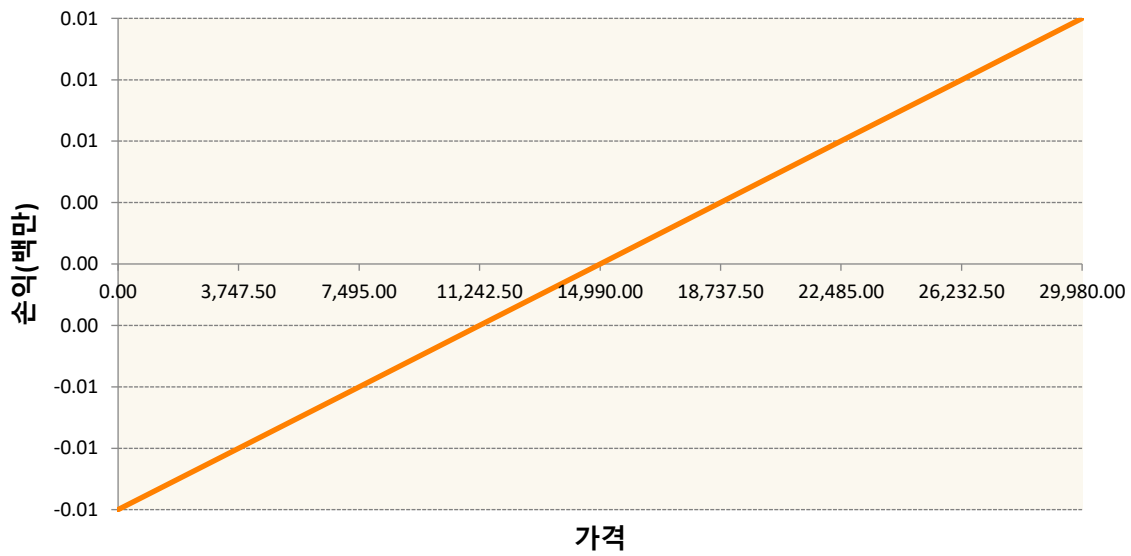
KR410ZW80007-2025-08 한미반도체개별선물



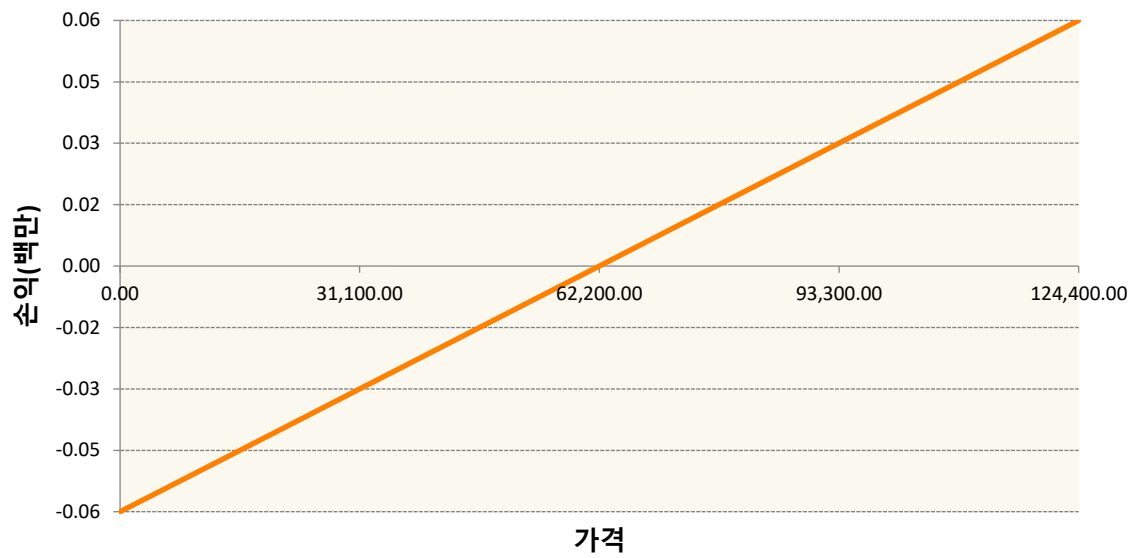
KR411AW80008-2025-08 한일시멘트개별선물



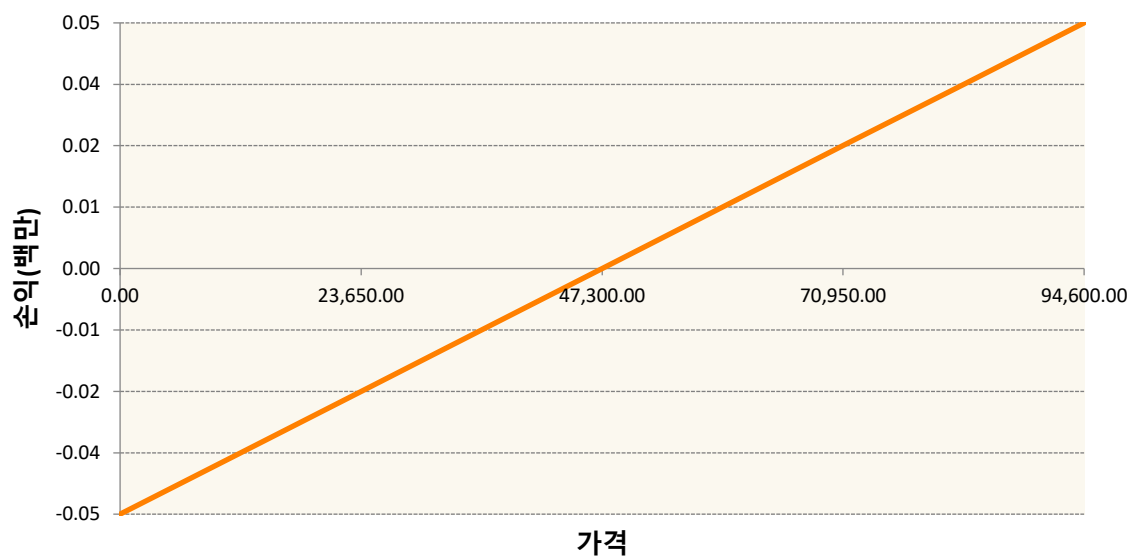
KR4149W80007-2025-08 HD현대인프라코어개별선물



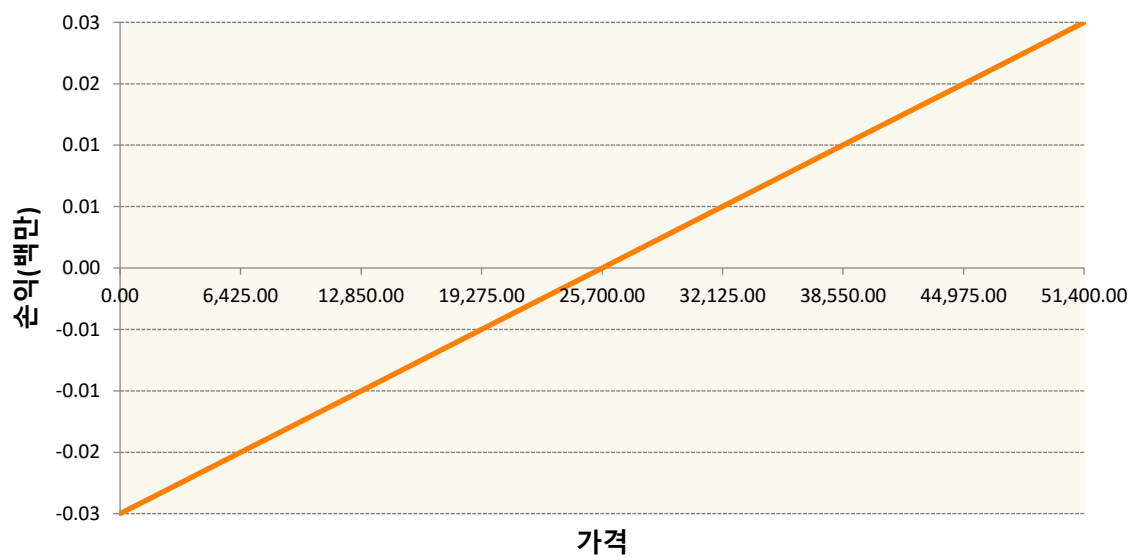
KR41B2W80004-2025-08 S-Oil개별선물



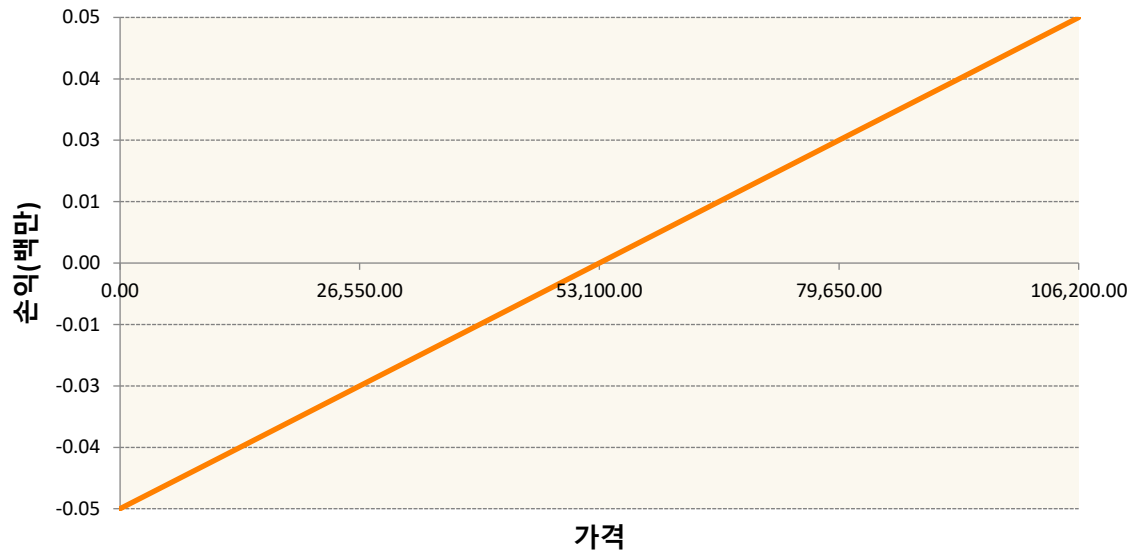
KR41BQW80002-2025-08 호텔신라개별선물



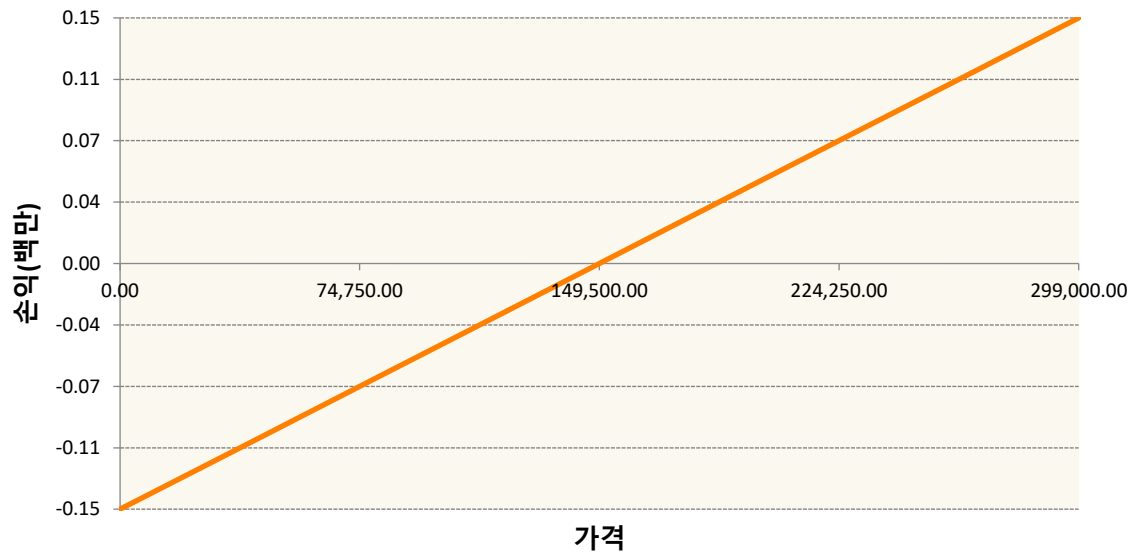
KR41CNW80007-2025-08 포스코DX개별선물



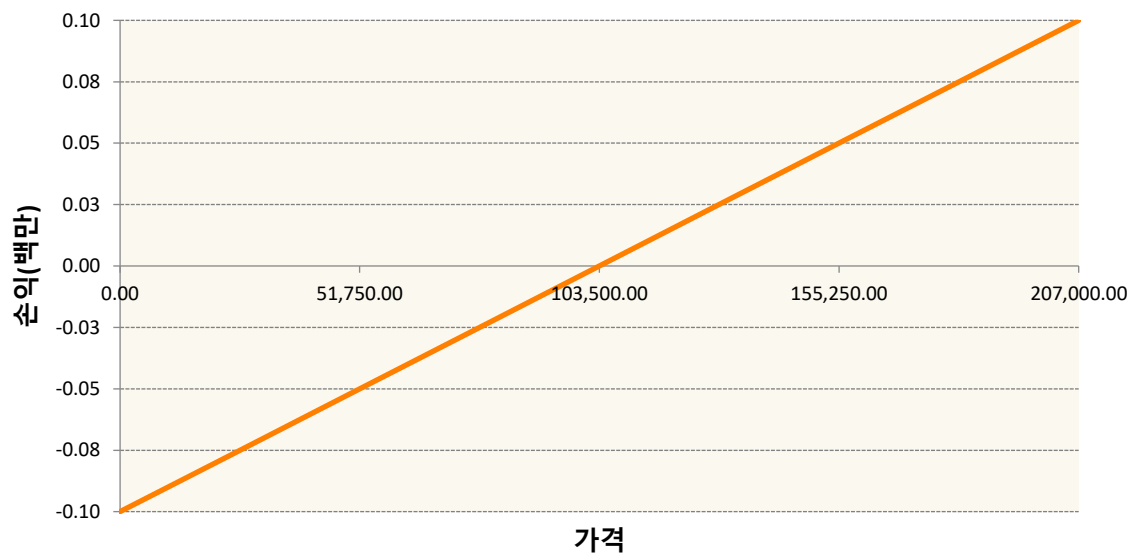
KR41DWW80006-2025-08 두산밥캣개별선물



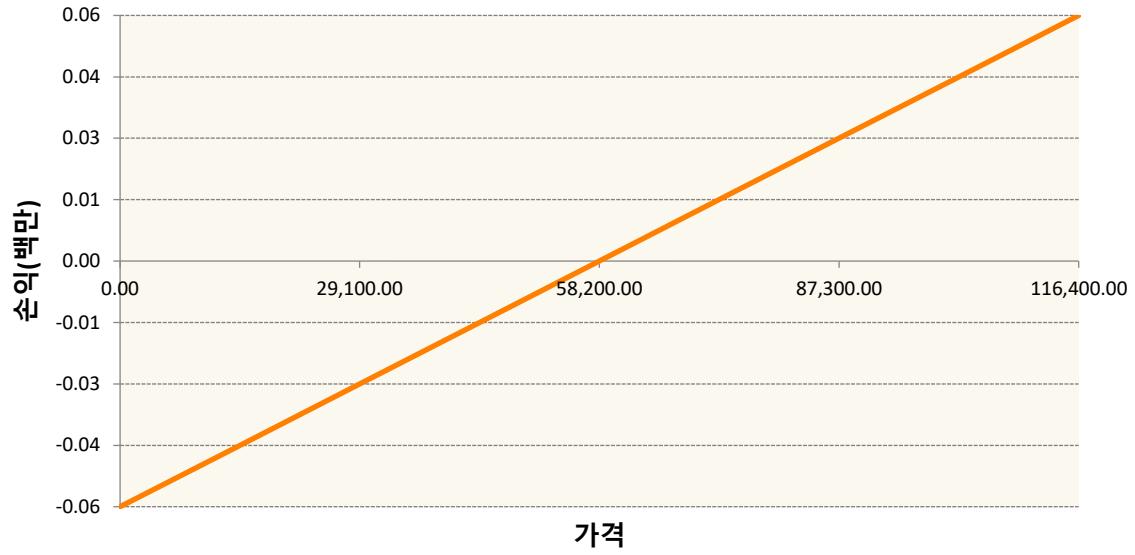
KR41E8W80008-2025-08 포스코퓨처엠개별선물



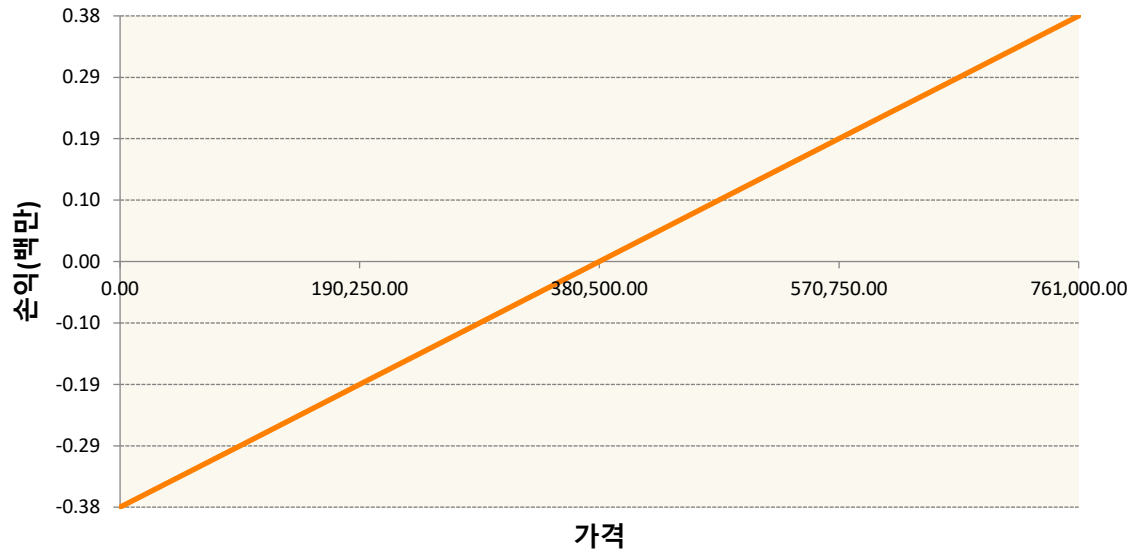
KR41EJW80001-2025-08 SKC개별선물



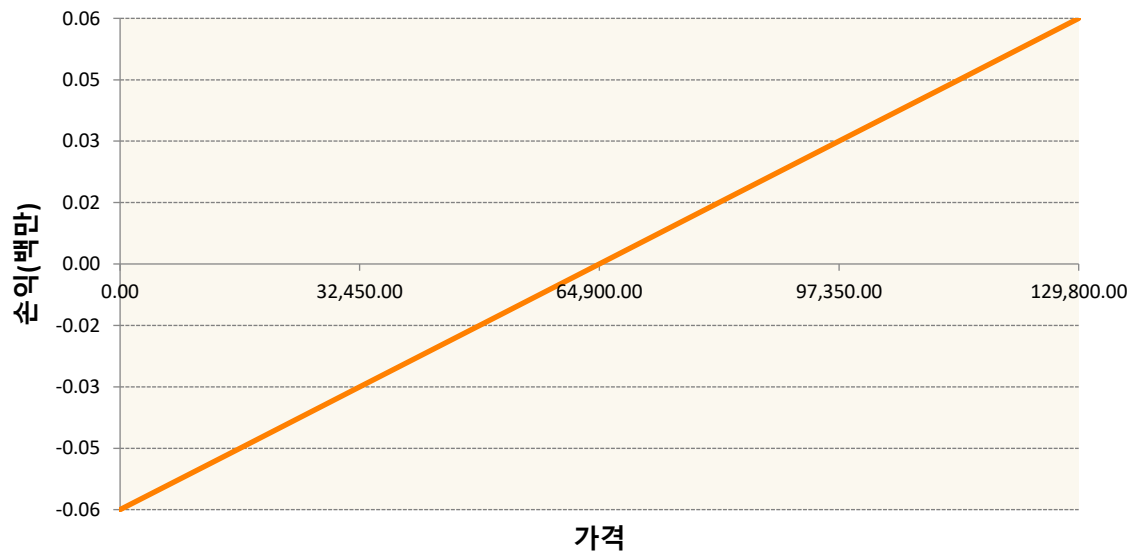
KR41EVW80006-2025-08 한화시스템개별선물



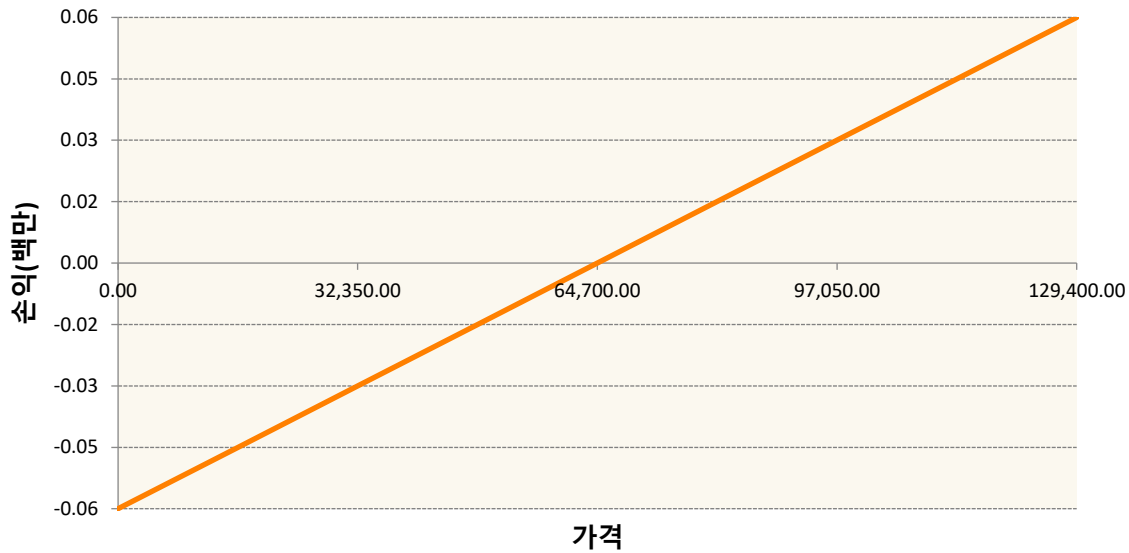
KR41F5W80003-2025-08 LG에너지솔루션개별선물



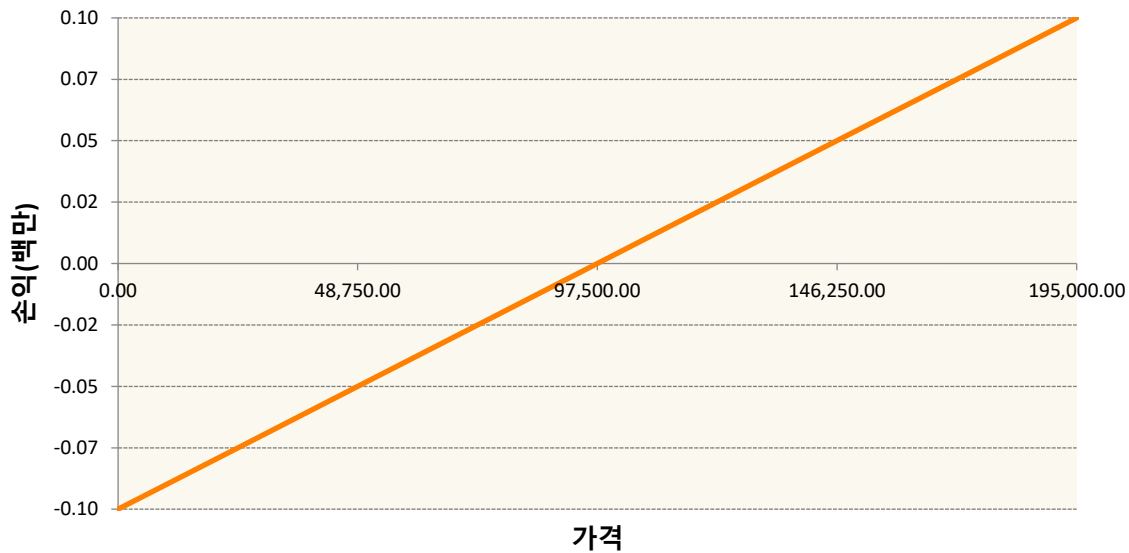
KR41F7W80009-2025-08 카카오페이개별선물



KR41FMW80002-2025-08 엘앤에프개별선물



KR41FVW80003-2025-08 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	779
KR410FW80(2025-08 두산로보틱스개별선물	12
KR410ZW80(2025-08 한미반도체개별선물	37
KR411AW80(2025-08 한일시멘트개별선물	3
KR4149W80(2025-08 HD현대인프라코어개별선물	19
KR41B2W80(2025-08 S-Oil개별선물	13
KR41BQW80 2025-08 호텔신라개별선물	16
KR41CNW80 2025-08 포스코DX개별선물	13
KR41DWW8(2025-08 두산밥캣개별선물	28
KR41E8W80(2025-08 포스코퓨처엠개별선물	42
KR41EJW800 2025-08 SKC개별선물	21
KR41EVW80(2025-08 한화시스템개별선물	1

KR41F5W80(2025-08 LG에너지솔루션개별선물
KR41F7W80(2025-08 카카오페이개별선물
KR41FMW80 2025-08 엘앤에프개별선물
KR41FVW80(2025-08 한화오션개별선물

2
19
17
1

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

(단위:백만원)

756

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

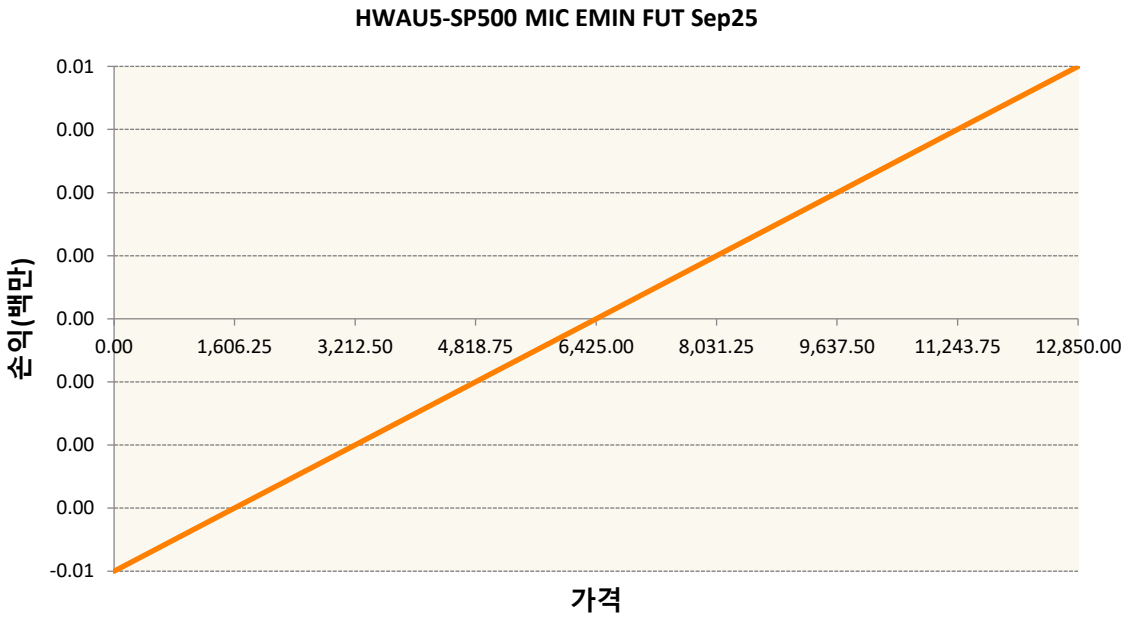
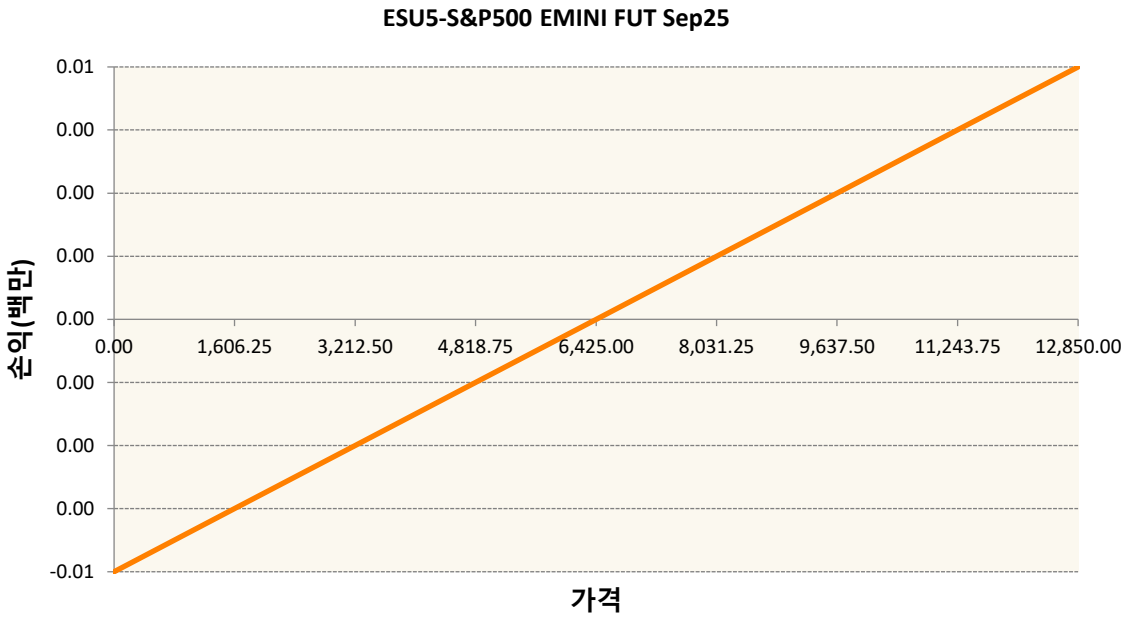
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	31,465	0	31,465	
누계	지수	선물	1,682	0	1,682	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,517
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	135

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,331

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

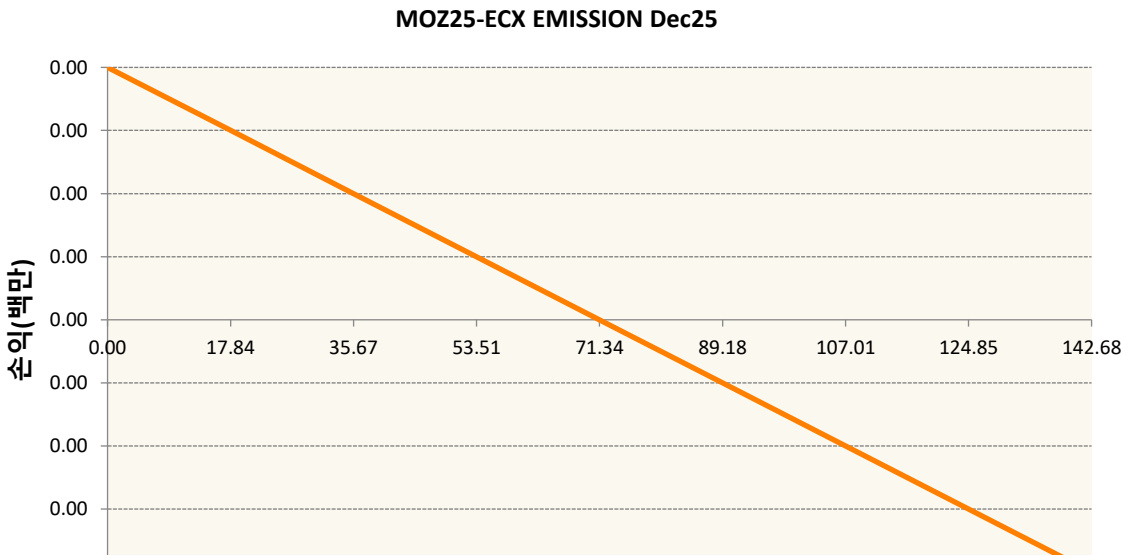
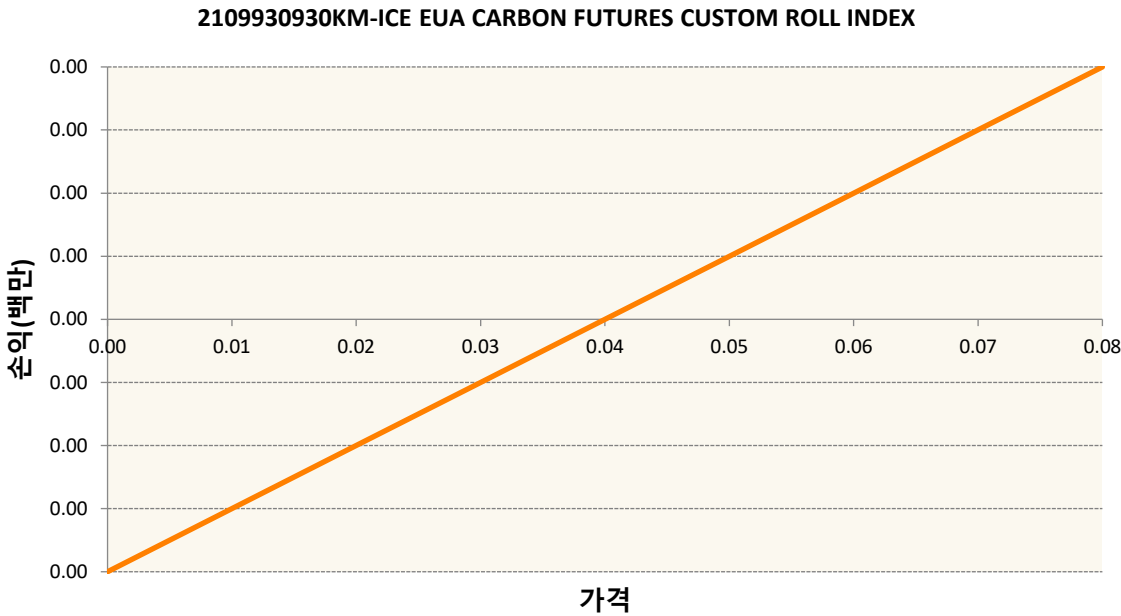
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,892	-4,892	
누계	유가증권	선물	16	0	16	장외
누계	통화	선도	0	1,016	-1,016	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F71C KRW/EUR 31-07-25E	3
FXW213F71C KRW/EUR 31-07-25E	79
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	391

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

(단위:백만원)

687

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

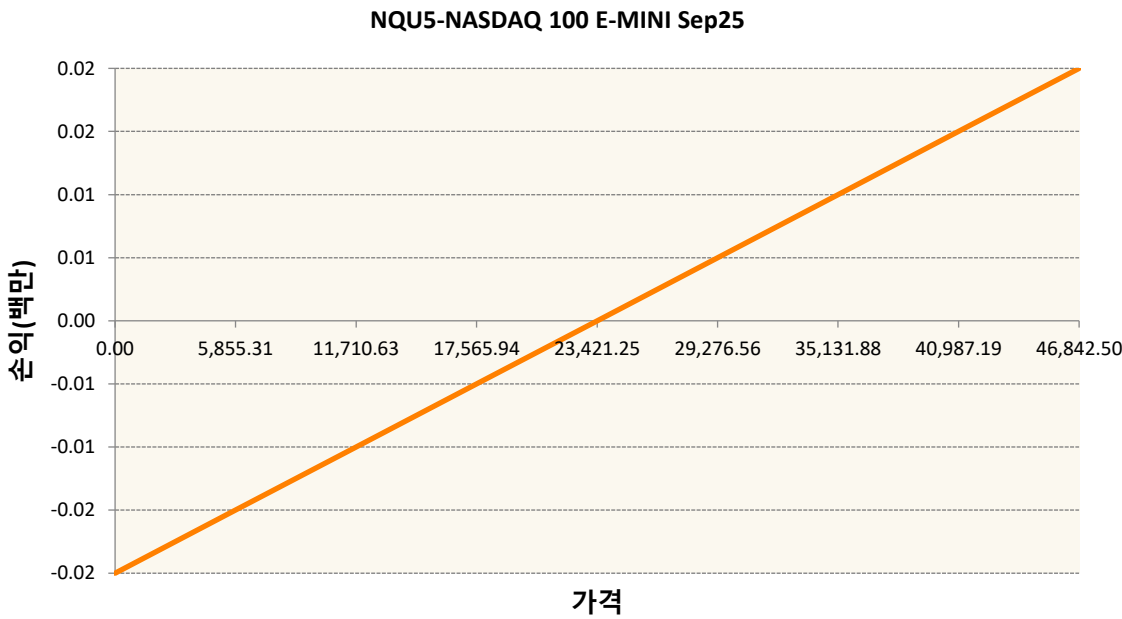
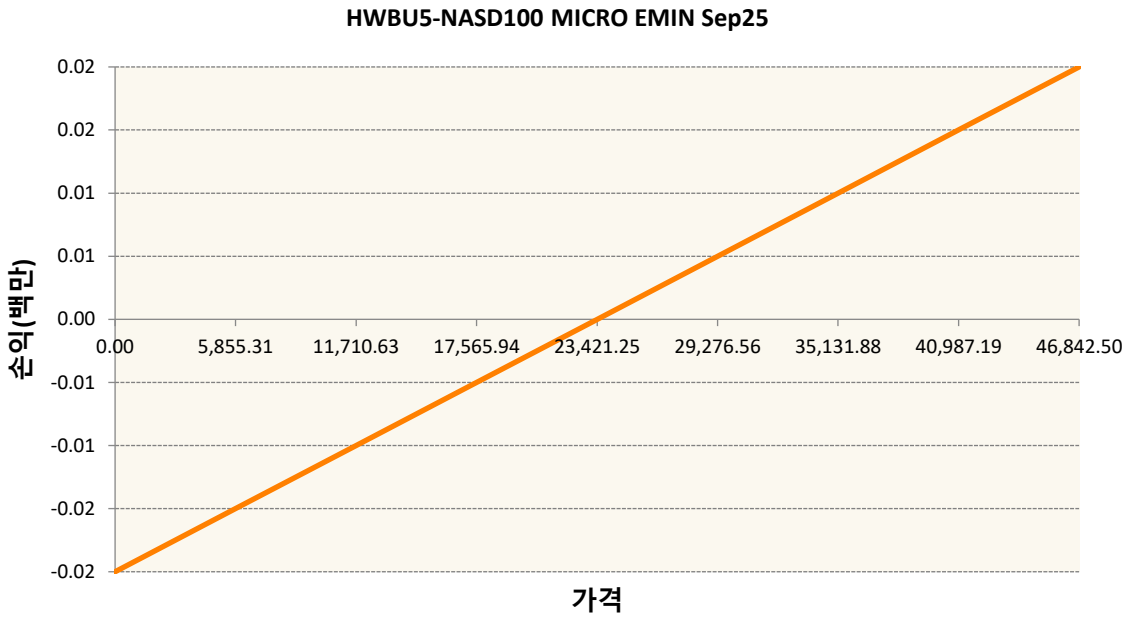
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,575	0	13,575	
누계	지수	선물	584	0	584	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25	47
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	1,086

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,290

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

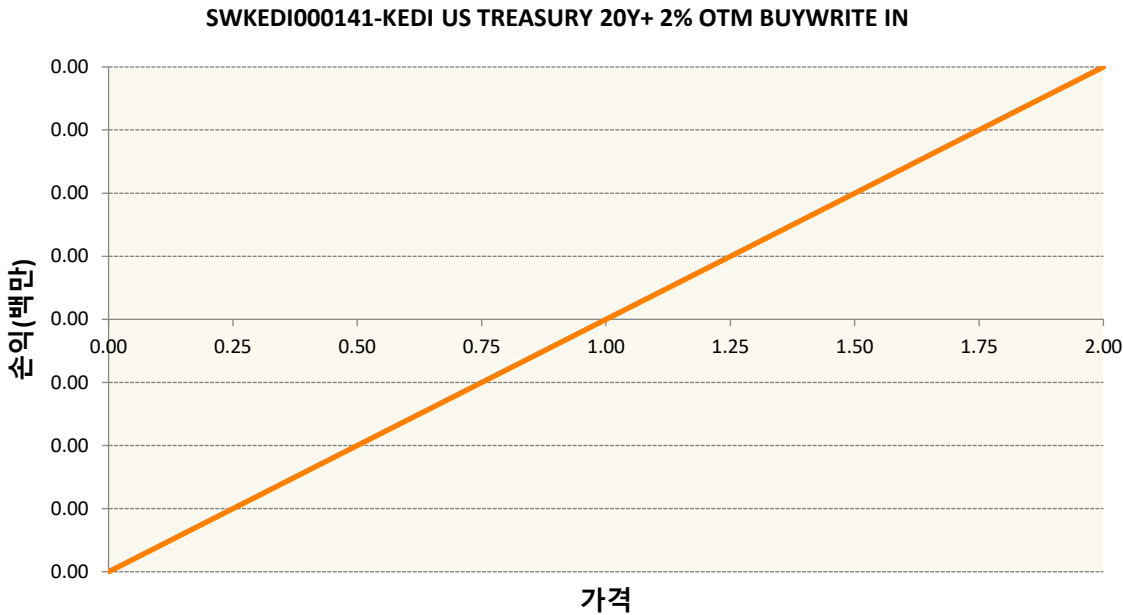
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

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	288,051	0	288,051	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,257
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,841
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,637
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	9,366

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

(단위:백만원)

11,885

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

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	11
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11

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

(단위:백만원)

58

공시일	2025-07-29
기준일	2025-07-28

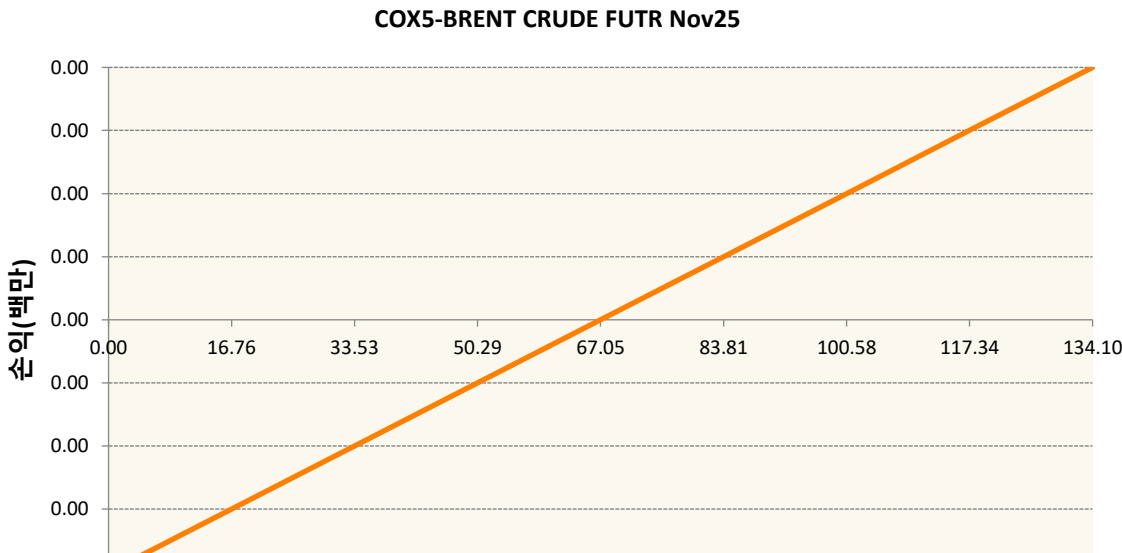
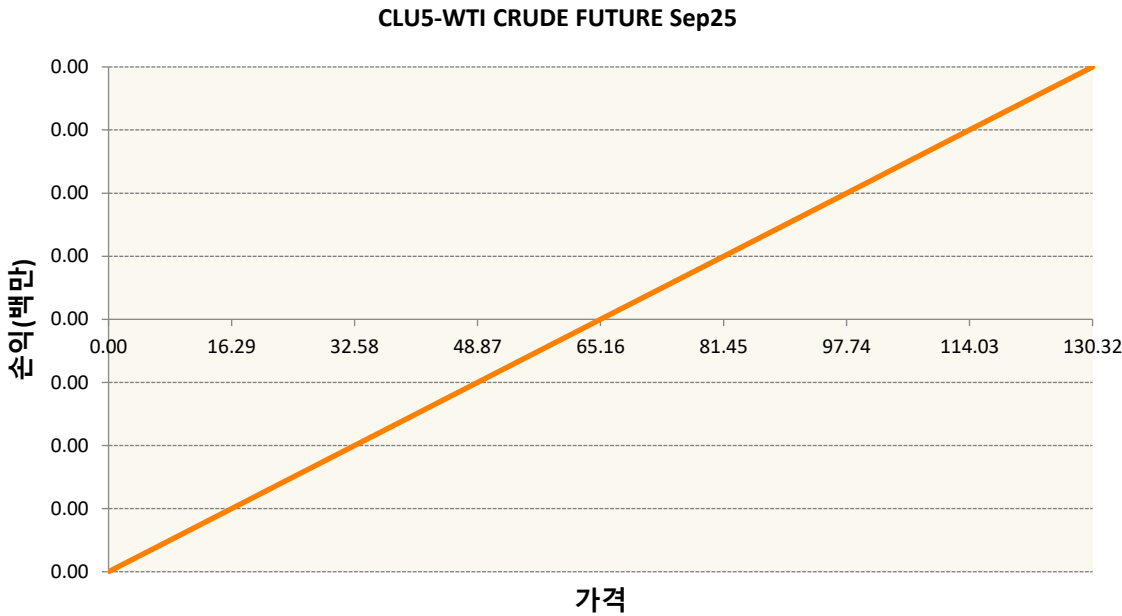
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

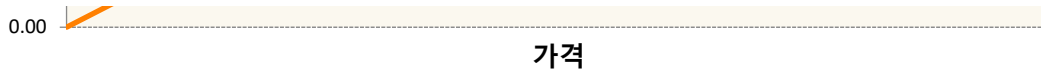
1. 계약금액

(단위:백만원)

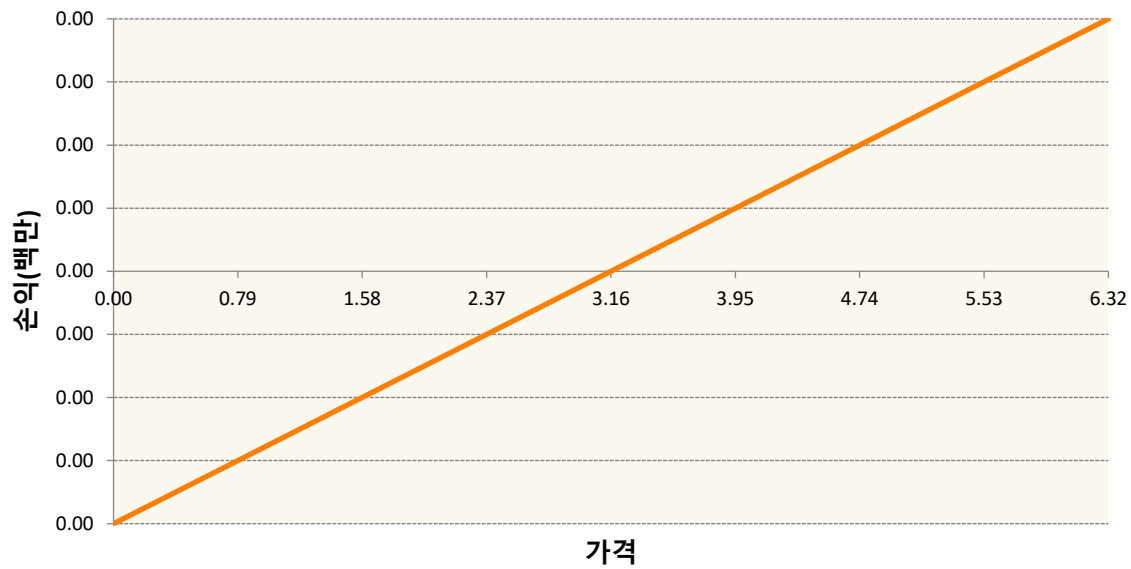
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	302	0	302	
누계	유가증권	선물	274	0	274	
누계	통화	선물	0	97	-97	장내

2. 만기시점의 손익구조

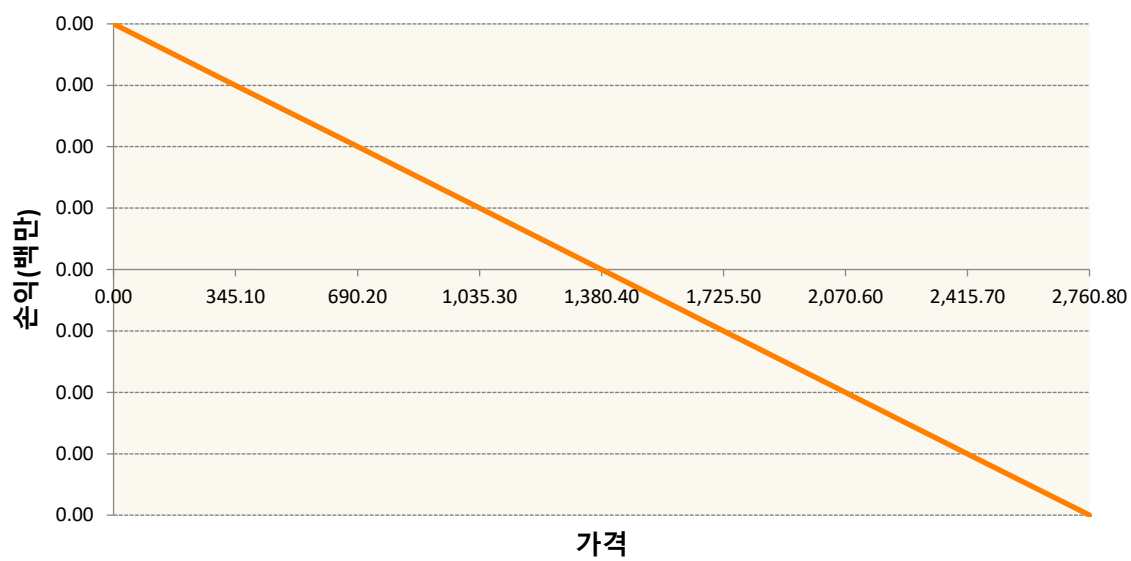




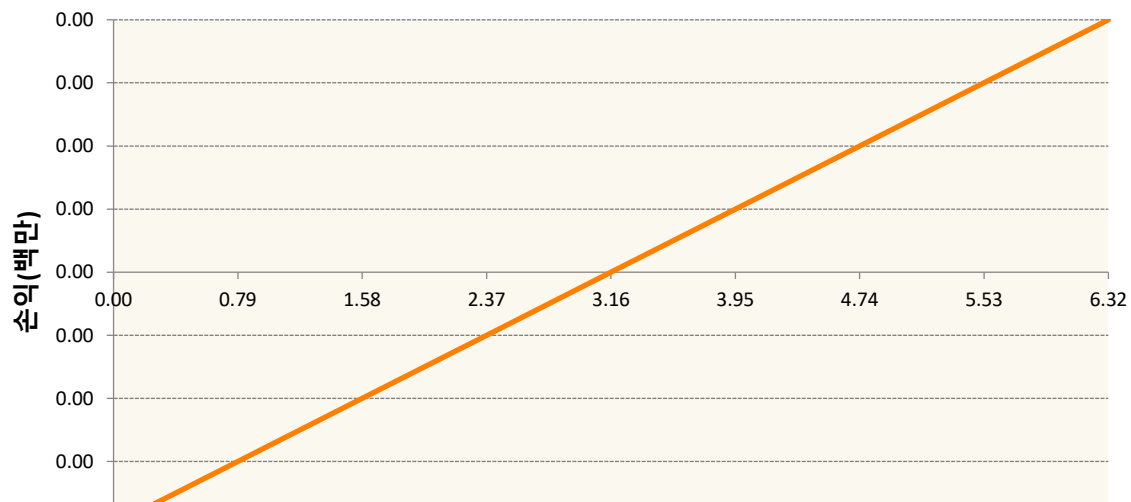
EOU5-E-MINI NATURAL GAS Sep25

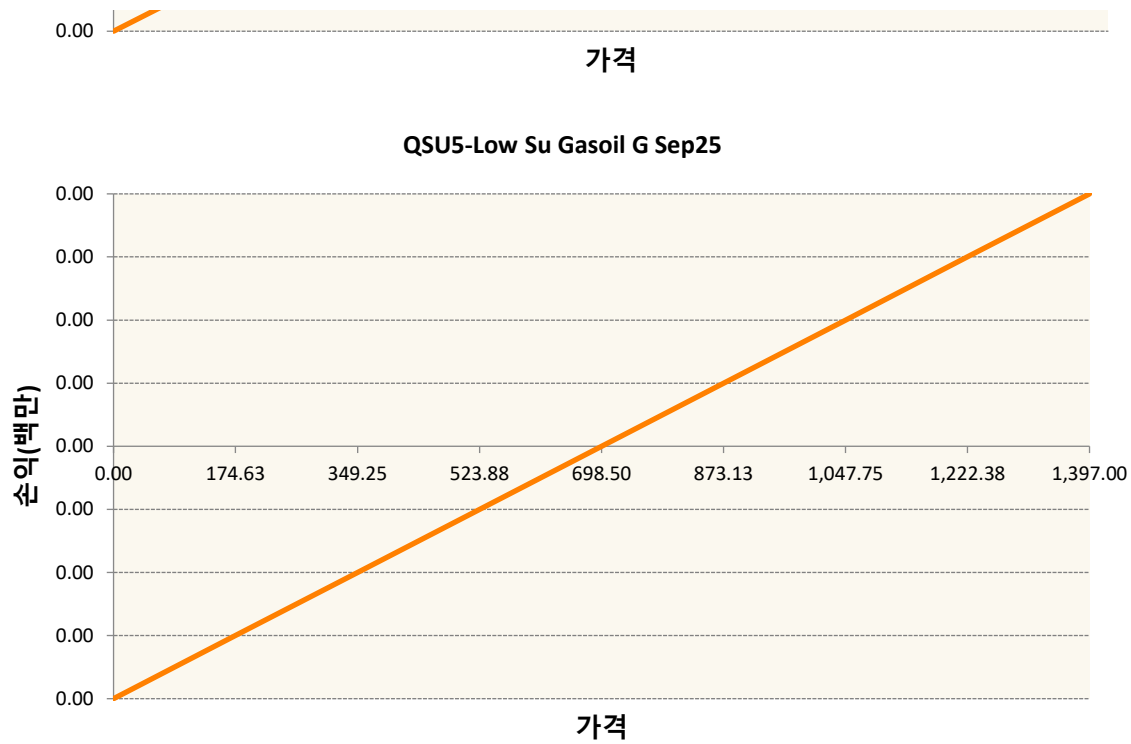


KR4175W80002-2025-08 달러선물



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		8
NGU25	NATURAL GAS FUTR Sep25	10
QSU5	Low Su Gasoil G Sep25	8

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

(단위:백만원)

108