

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

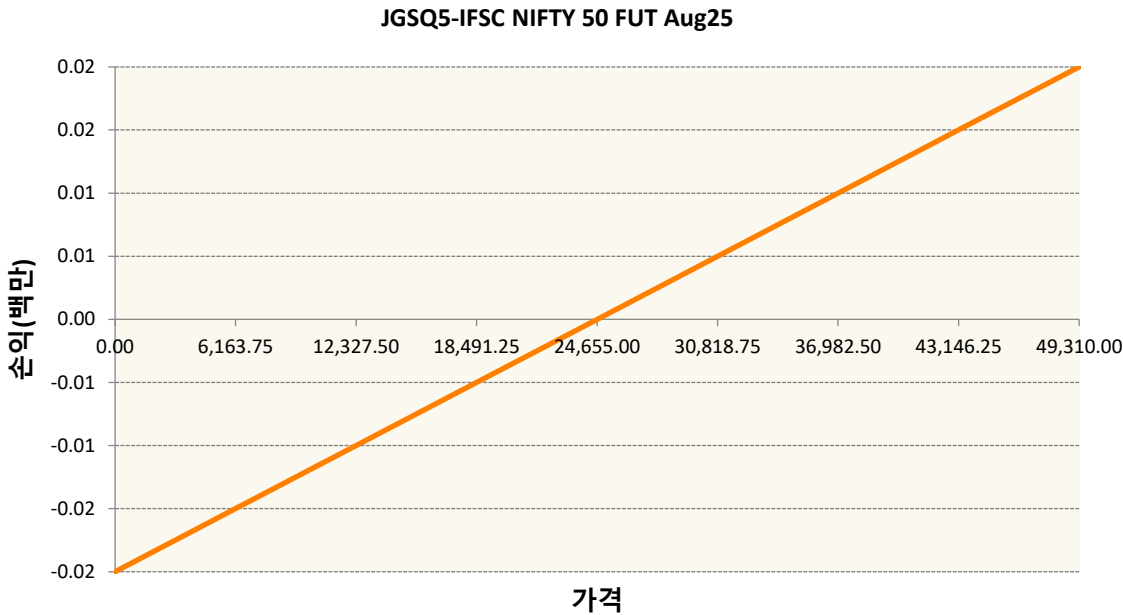
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 617   | 0     | 617       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |    |
|-------|-------------------------|----|
| JGSQ5 | IFSC NIFTY 50 FUT Aug25 | 49 |
|-------|-------------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 35 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

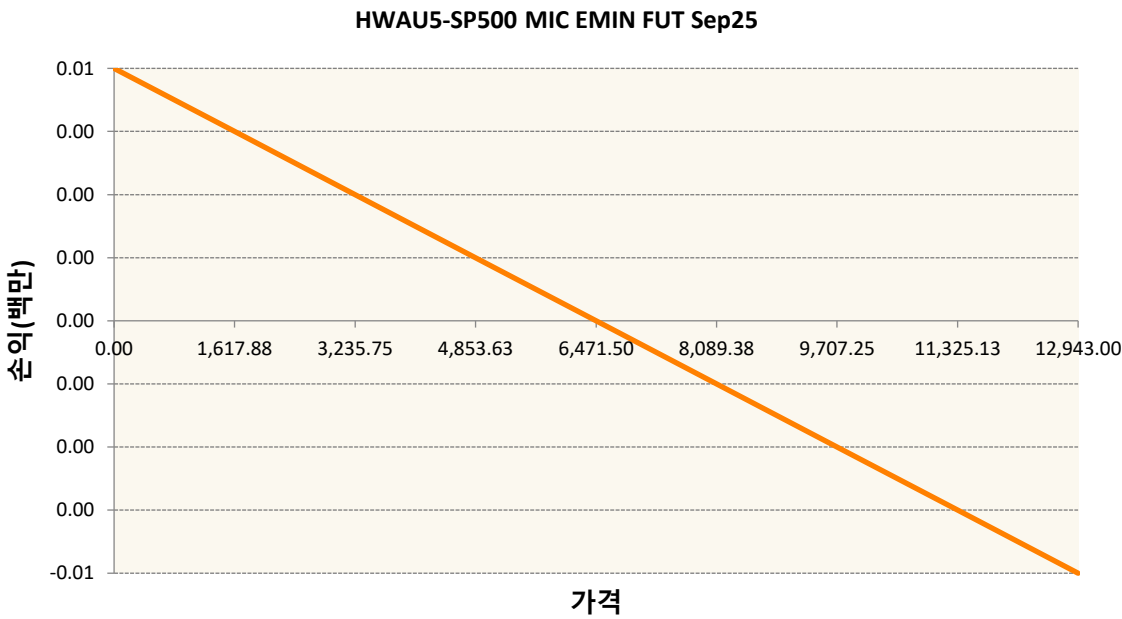
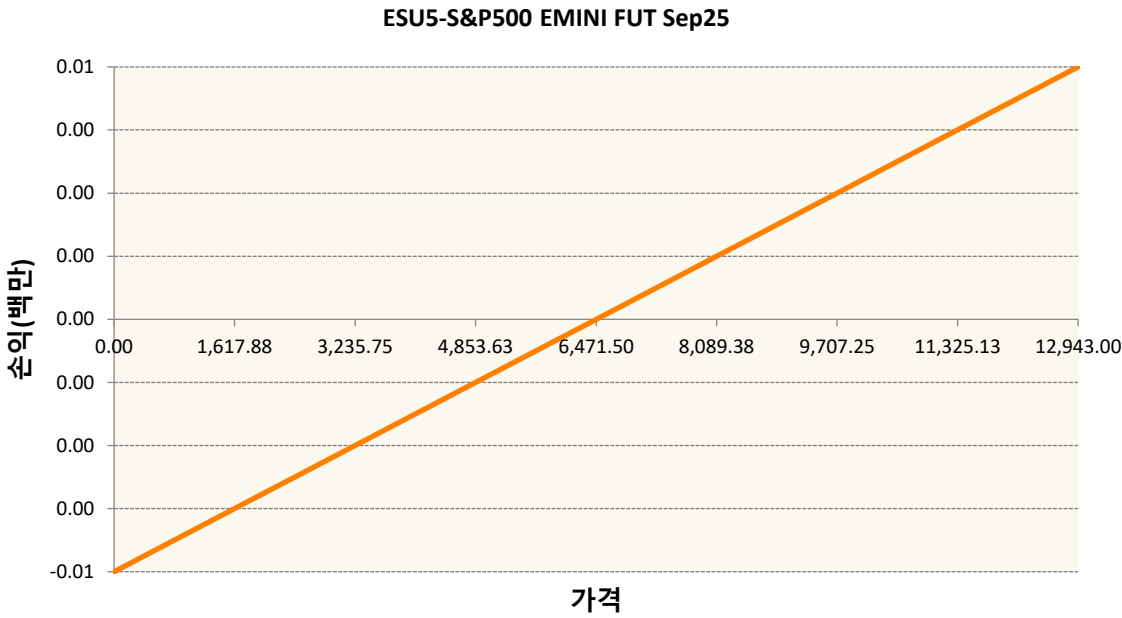
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 889   | 0     | 889       |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 0     | 89    | -89       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESU5                      | S&P500 EMINI FUT Sep25   | 71       |
| HWAU5                     | SP500 MIC EMIN FUT Sep25 | 7        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 69       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

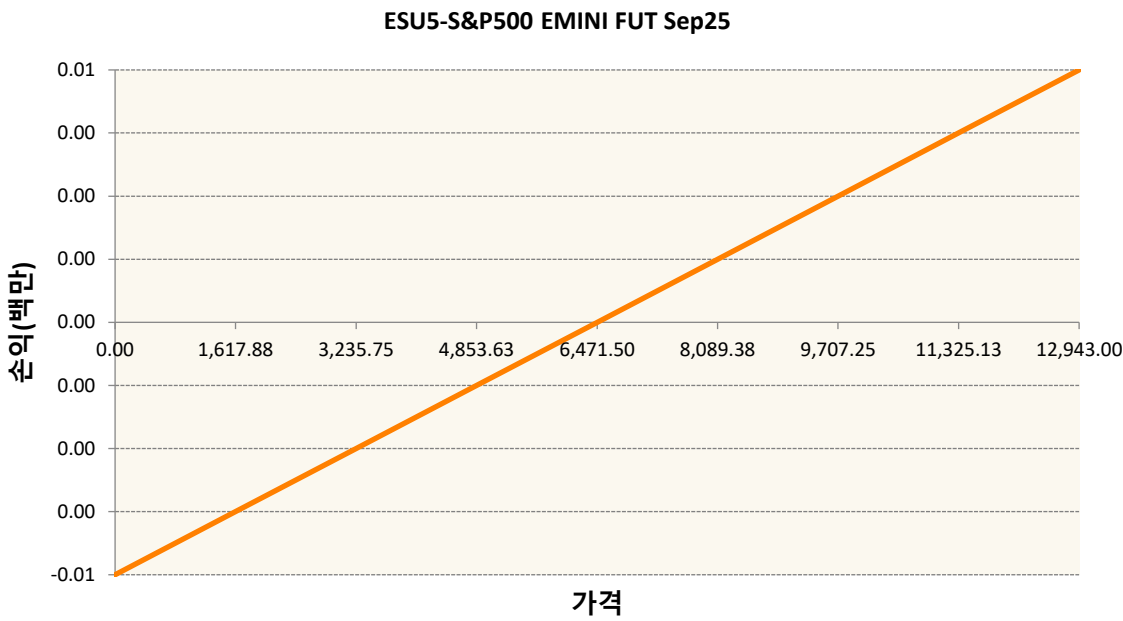
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,340 | 0     | 1,340     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| ESU5 | S&P500 EMINI FUT Sep25 | 107 |
|------|------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

94

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

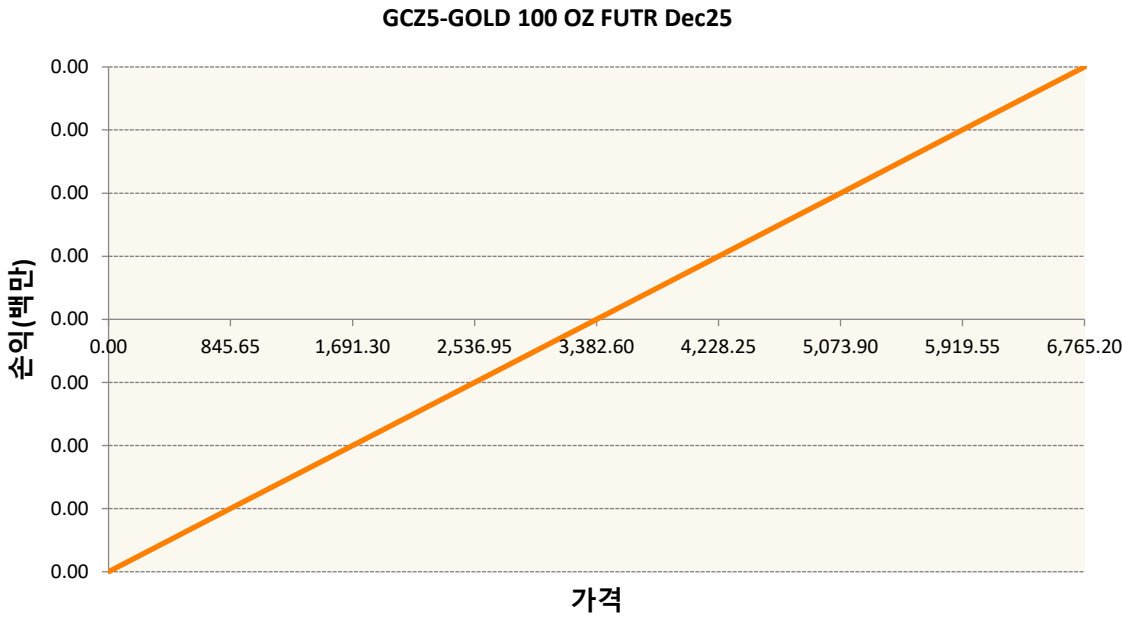
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 2,817 | 0     | 2,817     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| AOGLDUSCC GLD US 08/22/25 C311 EQUITY | 3   |
| GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25           | 225 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 198 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

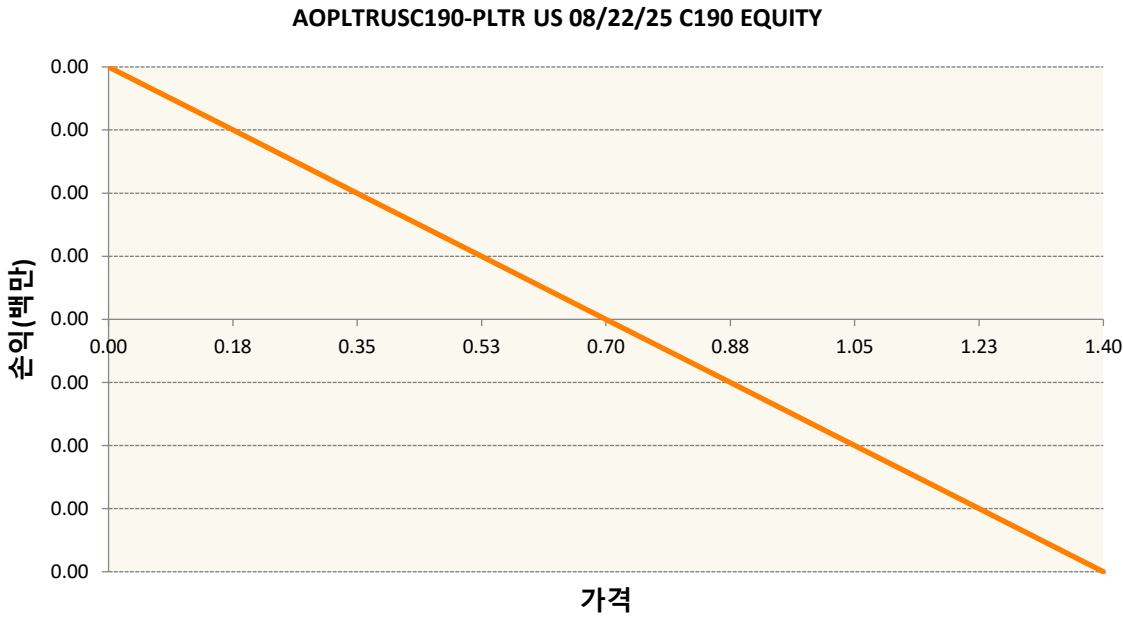
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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     | 1,042 | -1,042    |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                           |    |
|-------------------------------------------|----|
| AOPLTRUSC190-PLTR US 08/22/25 C190 EQUITY | 83 |
| AOPLTRUSP190-PLTR US 08/22/25 P190 EQUITY | 8  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 375 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

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)

AOTLTUSAC\TLT US 08/22/25 C87.5 EQUITY

6

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

(단위:백만원)

5

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

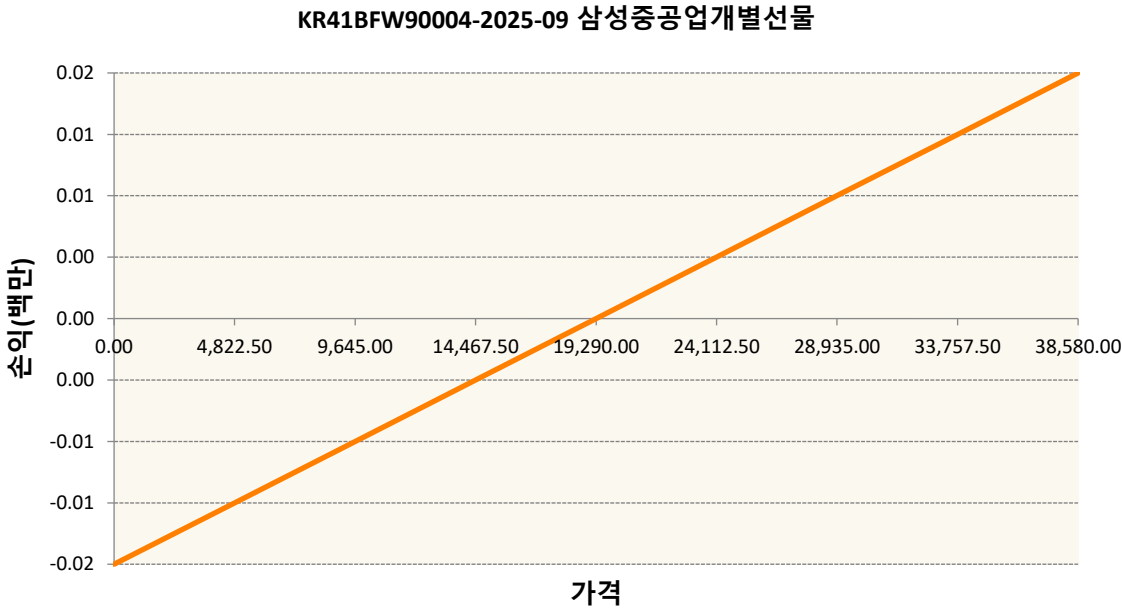
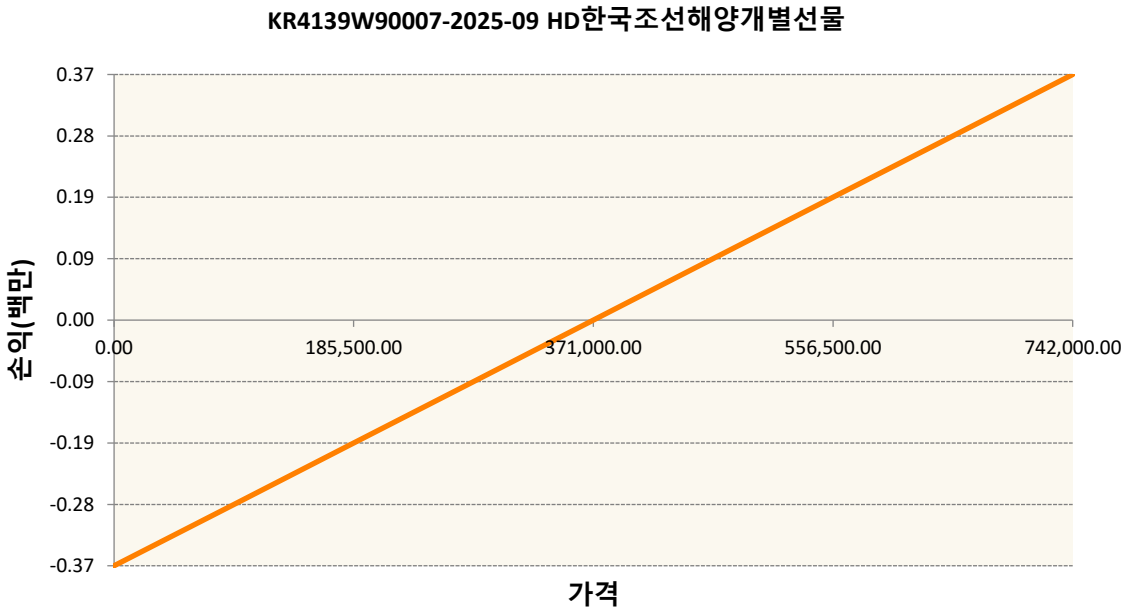
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

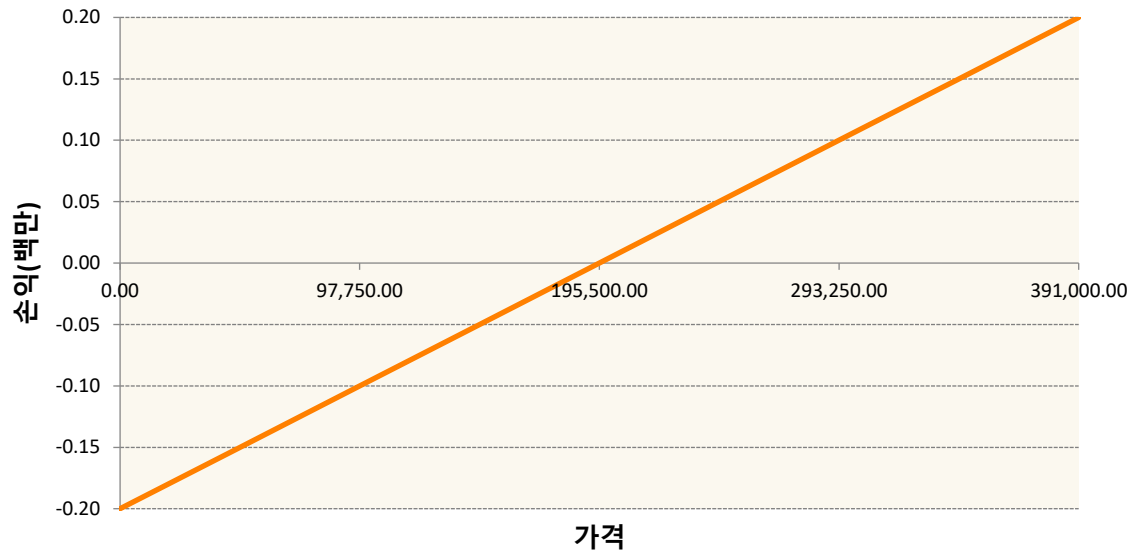
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 31,344 | 0     | 31,344    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

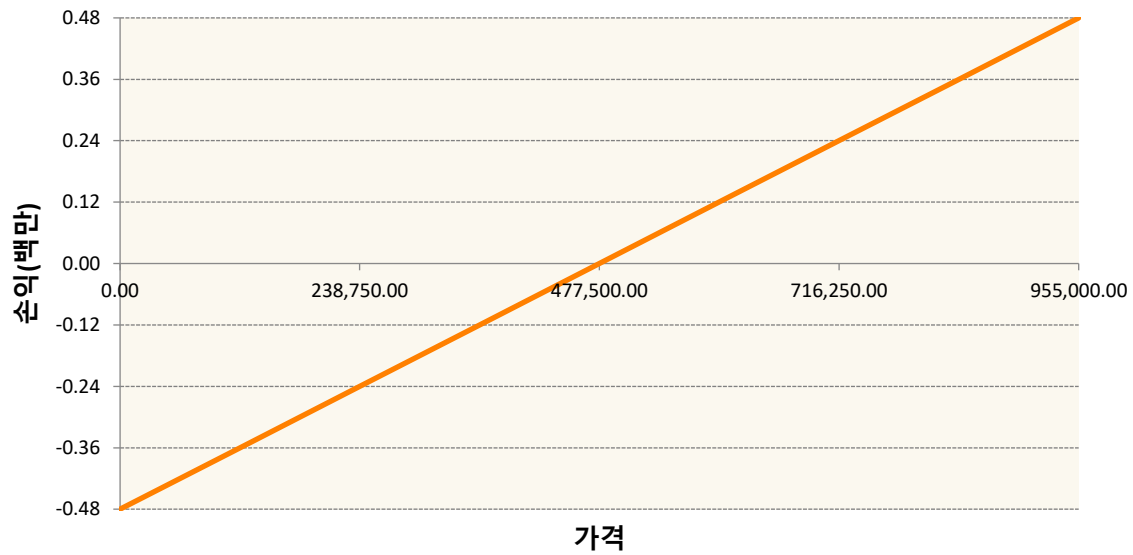




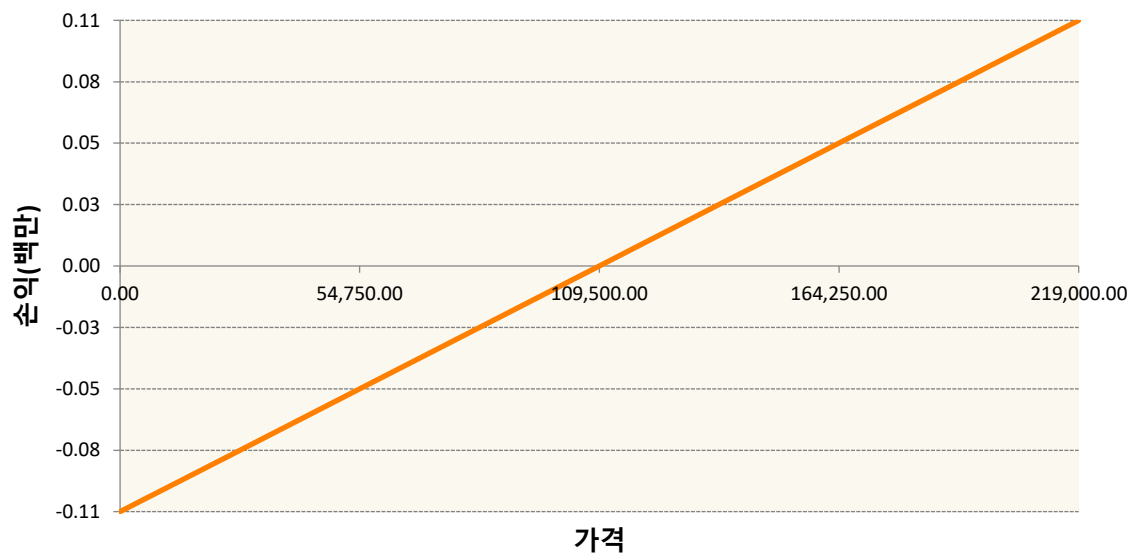
KR41CDW90007-2025-09 HD현대미포개별선물



KR41FDW90000-2025-09 HD현대중공업개별선물



KR41FVW90002-2025-09 한화오션개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |
|--------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|----------------------|------|-----|--|
| KR4139W90007 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 HD한국조선해양개별선물 |      | 535 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |      |     |  |
| -8.00%       | -535      | -535    | -535   | -535 | -535  | -535   | -535                 | -535 |     |  |
| -5.33%       | -356      | -356    | -356   | -356 | -356  | -356   | -356                 | -356 |     |  |
| -2.67%       | -178      | -178    | -178   | -178 | -178  | -178   | -178                 | -178 |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    | 0    |     |  |
| 2.67%        | 178       | 178     | 178    | 178  | 178   | 178    | 178                  | 178  |     |  |
| 5.33%        | 356       | 356     | 356    | 356  | 356   | 356    | 356                  | 356  |     |  |
| 8.00%        | 535       | 535     | 535    | 535  | 535   | 535    | 535                  | 535  |     |  |
| KR41BFW90004 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 삼성중공업개별선물    |      | 493 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |      |     |  |
| -8.00%       | -493      | -493    | -493   | -493 | -493  | -493   | -493                 | -493 |     |  |
| -5.33%       | -328      | -328    | -328   | -328 | -328  | -328   | -328                 | -328 |     |  |
| -2.67%       | -164      | -164    | -164   | -164 | -164  | -164   | -164                 | -164 |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    | 0    |     |  |
| 2.67%        | 164       | 164     | 164    | 164  | 164   | 164    | 164                  | 164  |     |  |
| 5.33%        | 328       | 328     | 328    | 328  | 328   | 328    | 328                  | 328  |     |  |
| 8.00%        | 493       | 493     | 493    | 493  | 493   | 493    | 493                  | 493  |     |  |
| KR41CDW90007 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 HD현대미포개별선물   |      | 348 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |      |     |  |
| -8.00%       | -348      | -348    | -348   | -348 | -348  | -348   | -348                 | -348 |     |  |
| -5.33%       | -232      | -232    | -232   | -232 | -232  | -232   | -232                 | -232 |     |  |
| -2.67%       | -116      | -116    | -116   | -116 | -116  | -116   | -116                 | -116 |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    | 0    |     |  |
| 2.67%        | 116       | 116     | 116    | 116  | 116   | 116    | 116                  | 116  |     |  |
| 5.33%        | 232       | 232     | 232    | 232  | 232   | 232    | 232                  | 232  |     |  |
| 8.00%        | 348       | 348     | 348    | 348  | 348   | 348    | 348                  | 348  |     |  |
| KR41FDW90000 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 HD현대중공업개별선물  |      | 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                 | -412 |     |  |
| -5.33%       | -274      | -274    | -274   | -274 | -274  | -274   | -274                 | -274 |     |  |
| -2.67%       | -137      | -137    | -137   | -137 | -137  | -137   | -137                 | -137 |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    | 0    |     |  |
| 2.67%        | 137       | 137     | 137    | 137  | 137   | 137    | 137                  | 137  |     |  |
| 5.33%        | 274       | 274     | 274    | 274  | 274   | 274    | 274                  | 274  |     |  |
| 8.00%        | 412       | 412     | 412    | 412  | 412   | 412    | 412                  | 412  |     |  |
| KR41FVW90002 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 한화오션개별선물     |      | 715 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |

|        |         |         |        |      |       |        |        |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -715    | -715    | -715   | -715 | -715  | -715   | -715   |
| -5.33% | -477    | -477    | -477   | -477 | -477  | -477   | -477   |
| -2.67% | -238    | -238    | -238   | -238 | -238  | -238   | -238   |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 238     | 238     | 238    | 238  | 238   | 238    | 238    |
| 5.33%  | 477     | 477     | 477    | 477  | 477   | 477    | 477    |
| 8.00%  | 715     | 715     | 715    | 715  | 715   | 715    | 715    |

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

(단위:백만원)

1,675

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

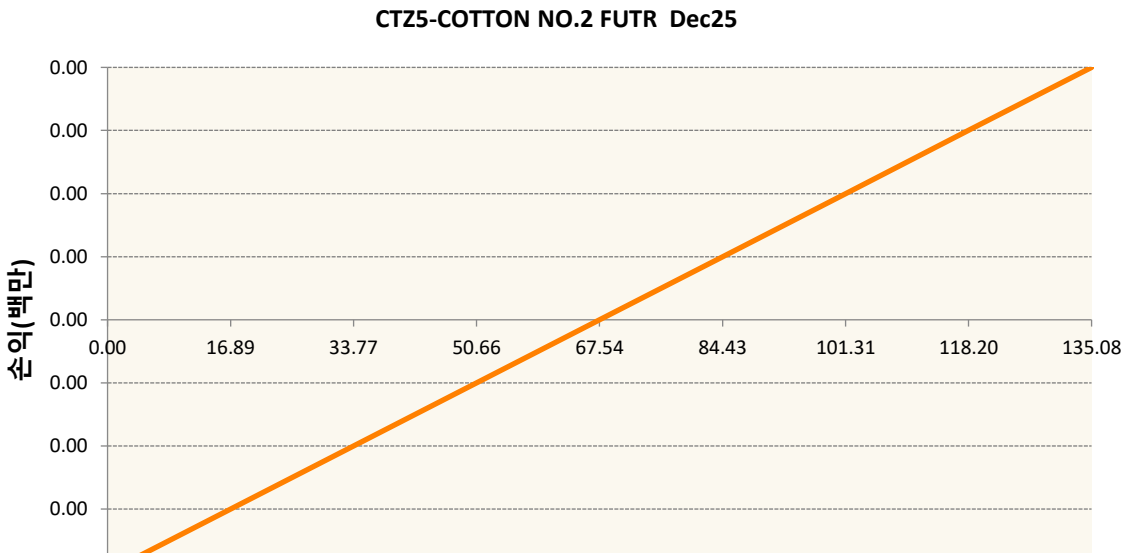
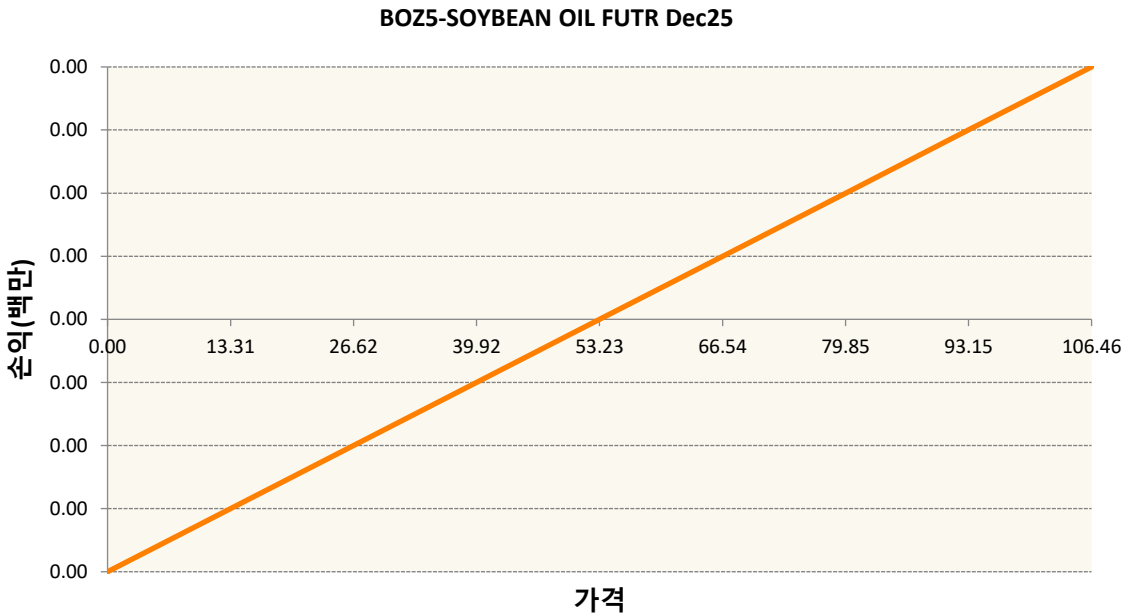
## 포커스농산물모(채권-파생형)

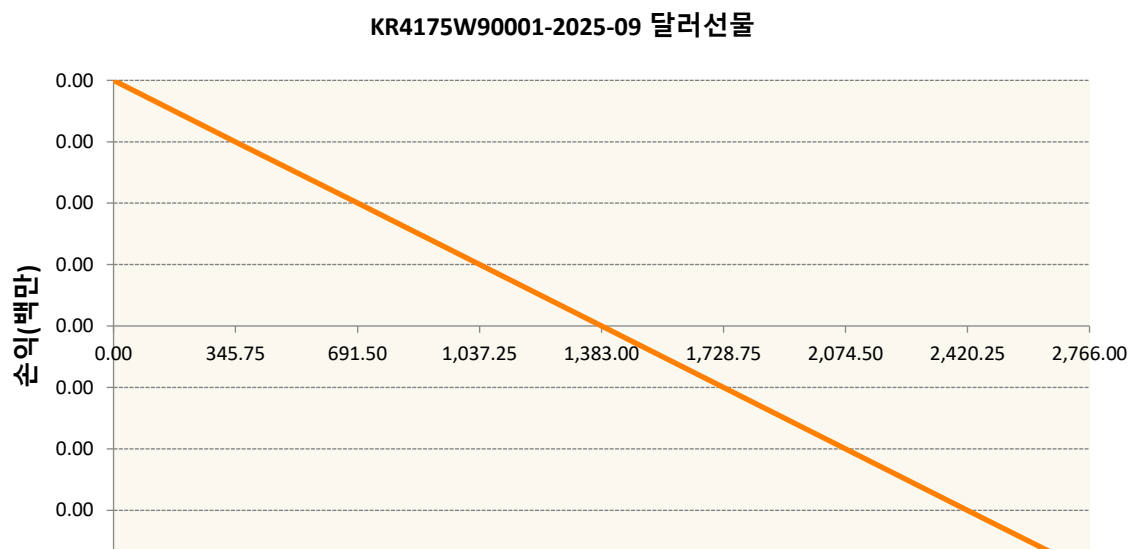
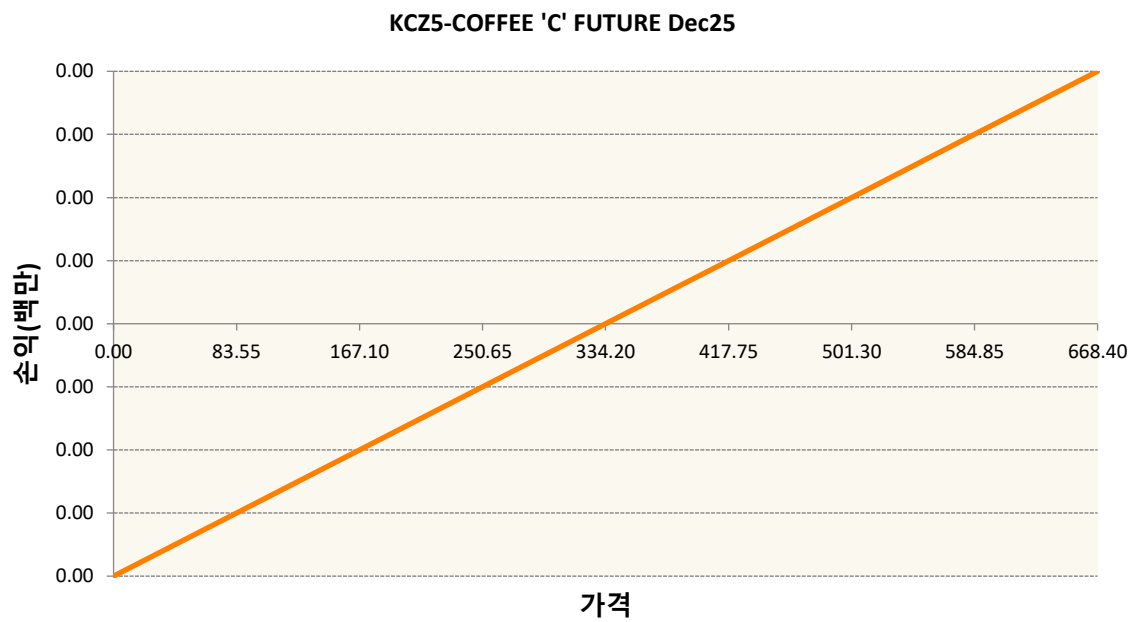
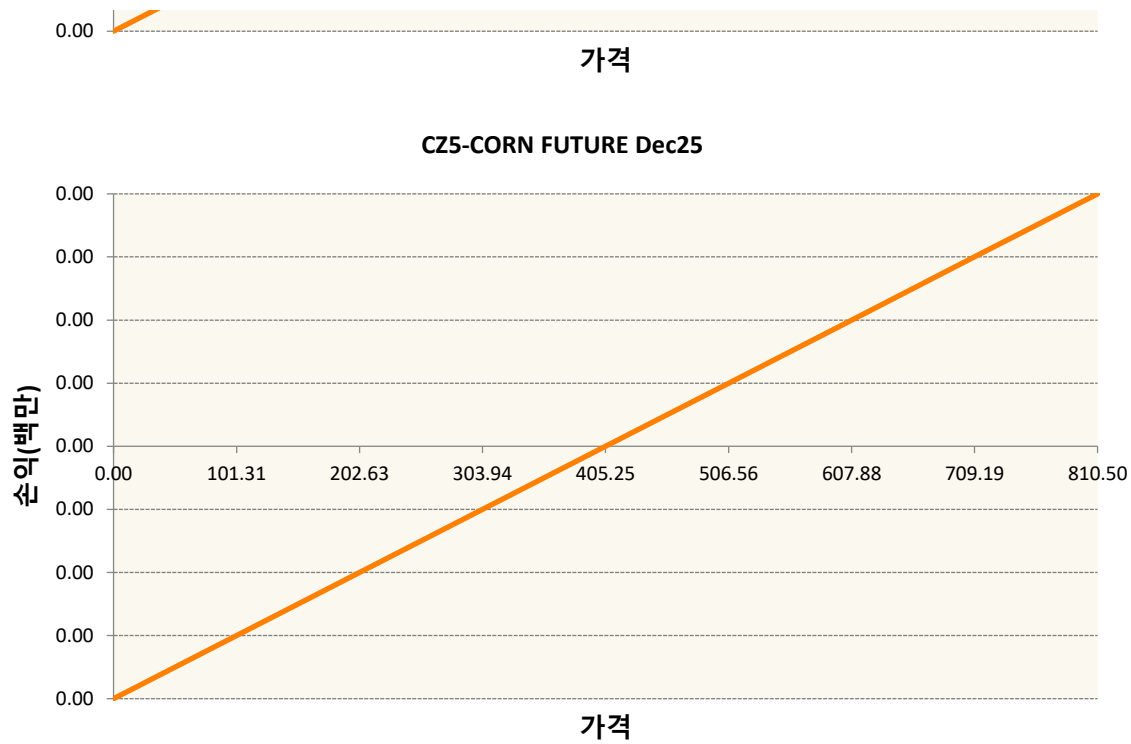
### 1. 계약금액

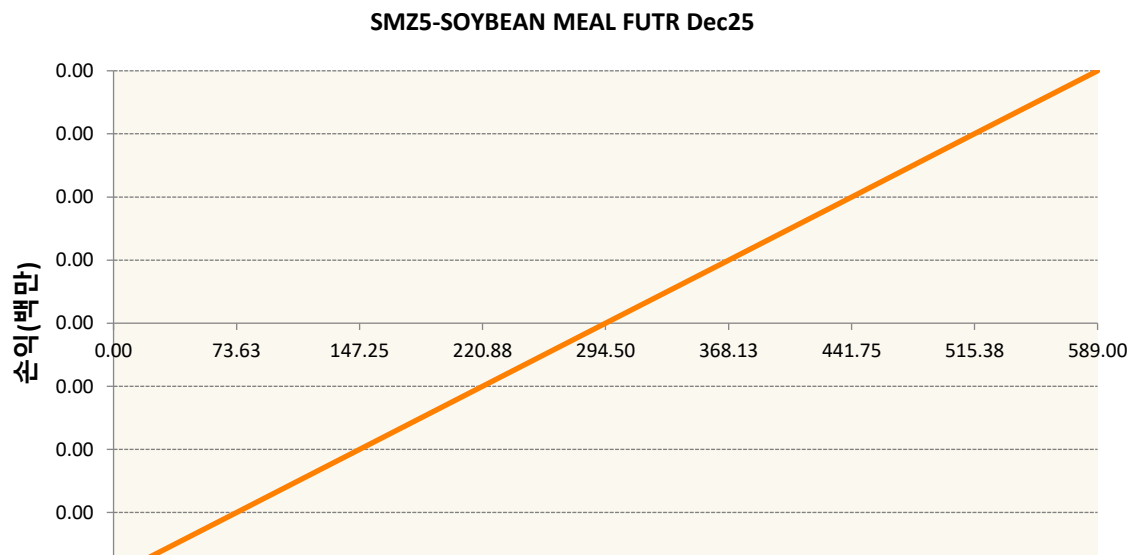
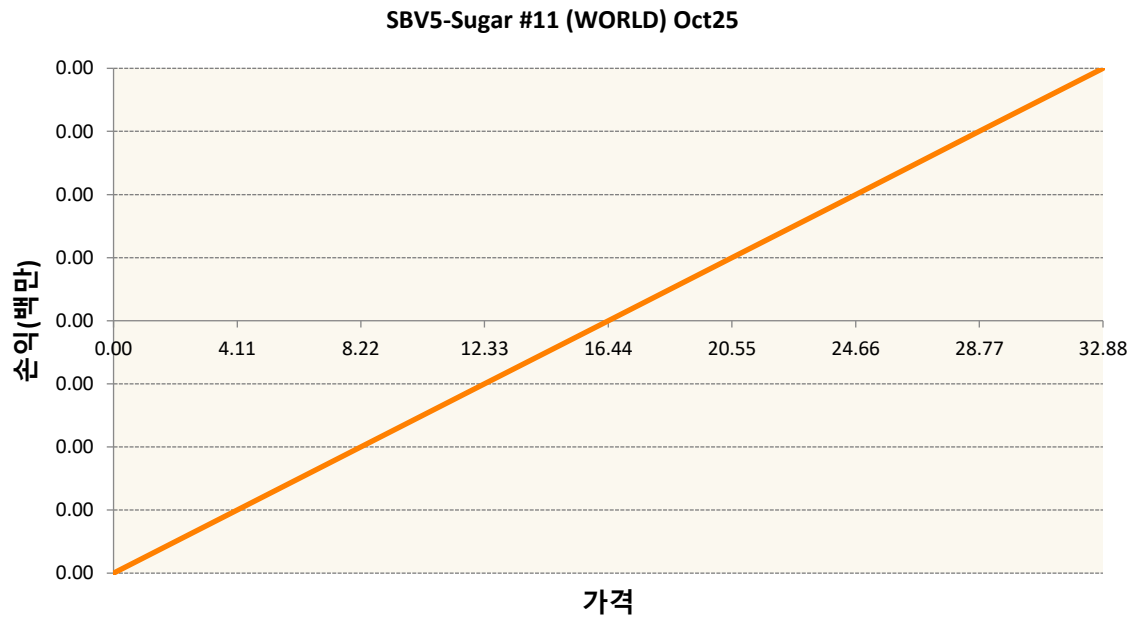
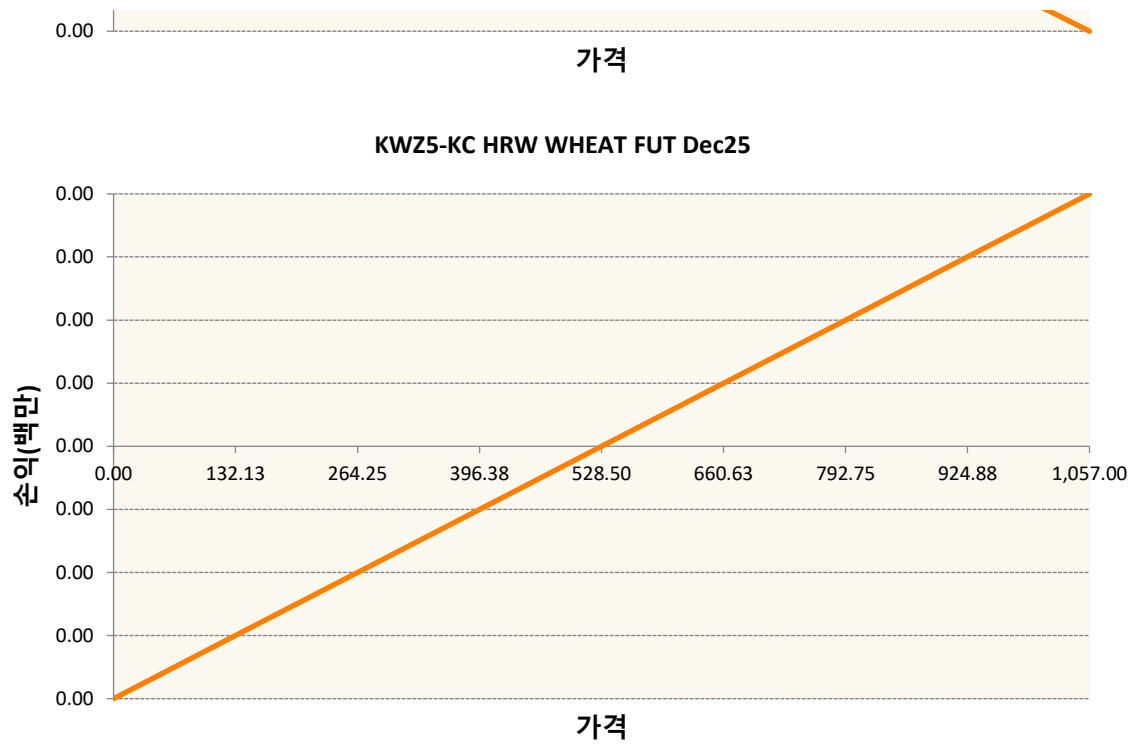
(단위:USD 백만)

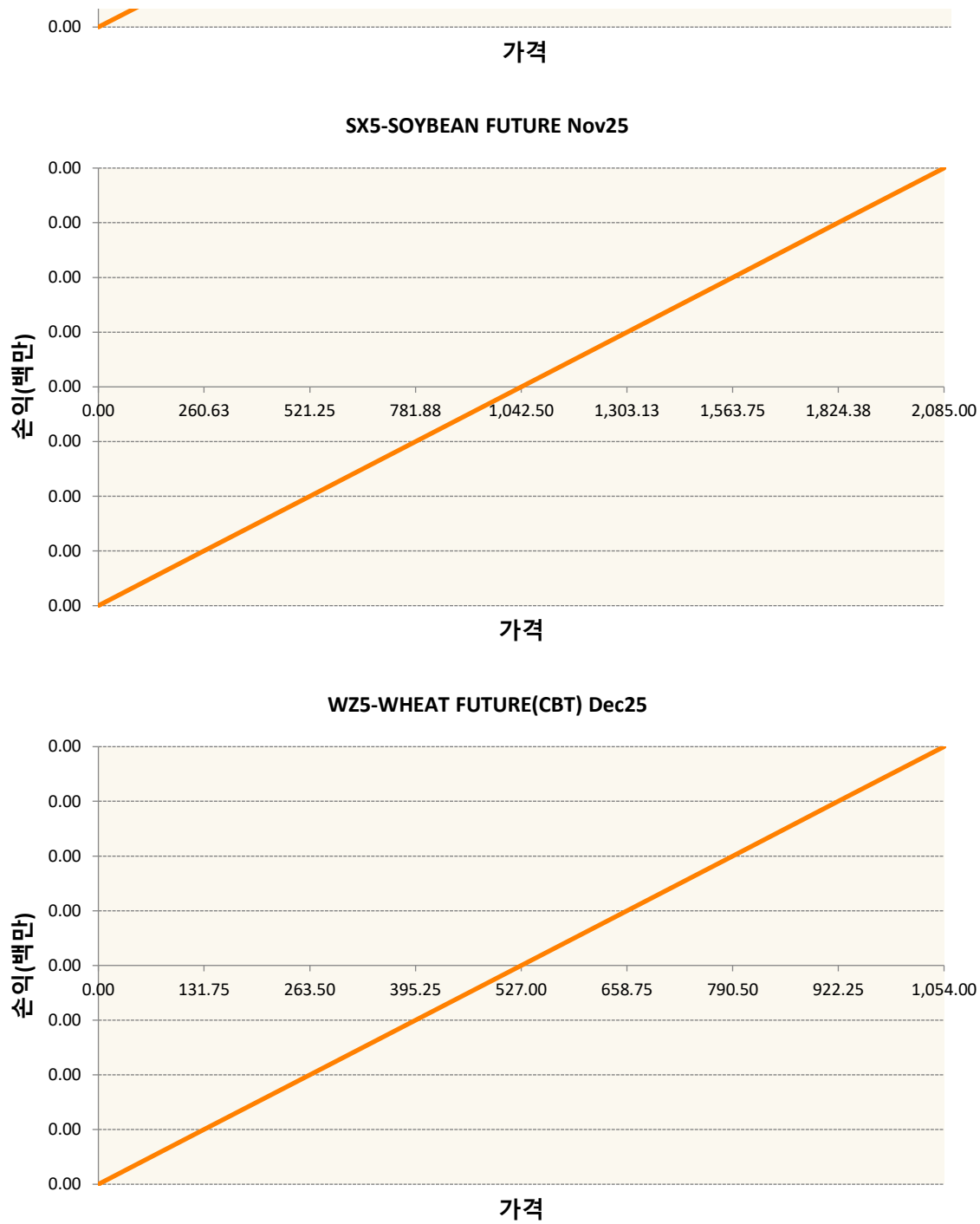
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,200 | 0     | 1,200     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,257 | 0     | 2,257     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 318   | -318      | 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 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

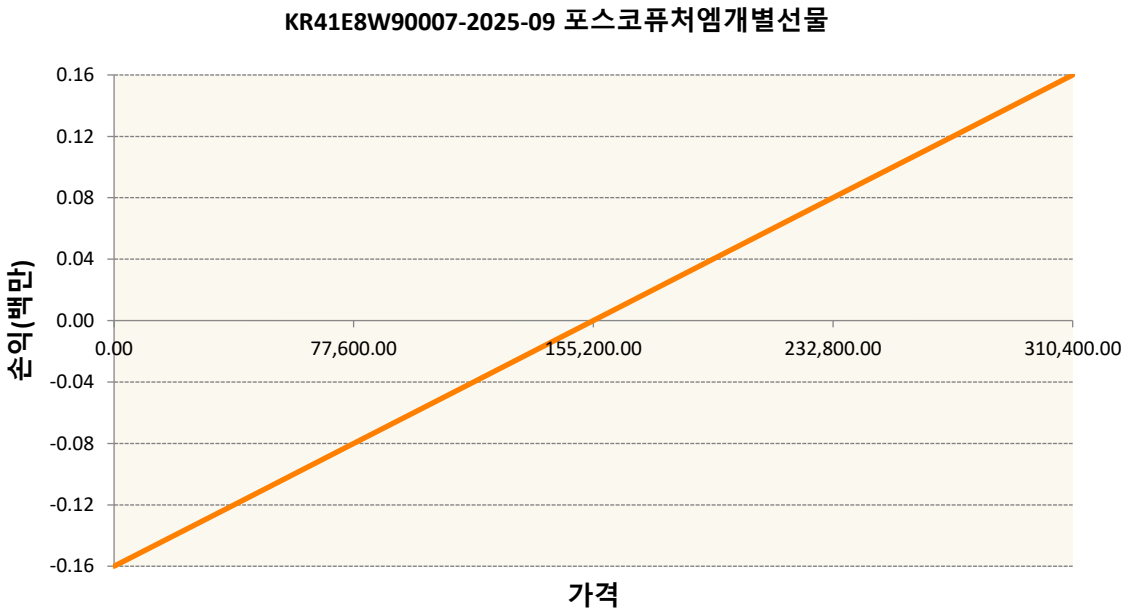
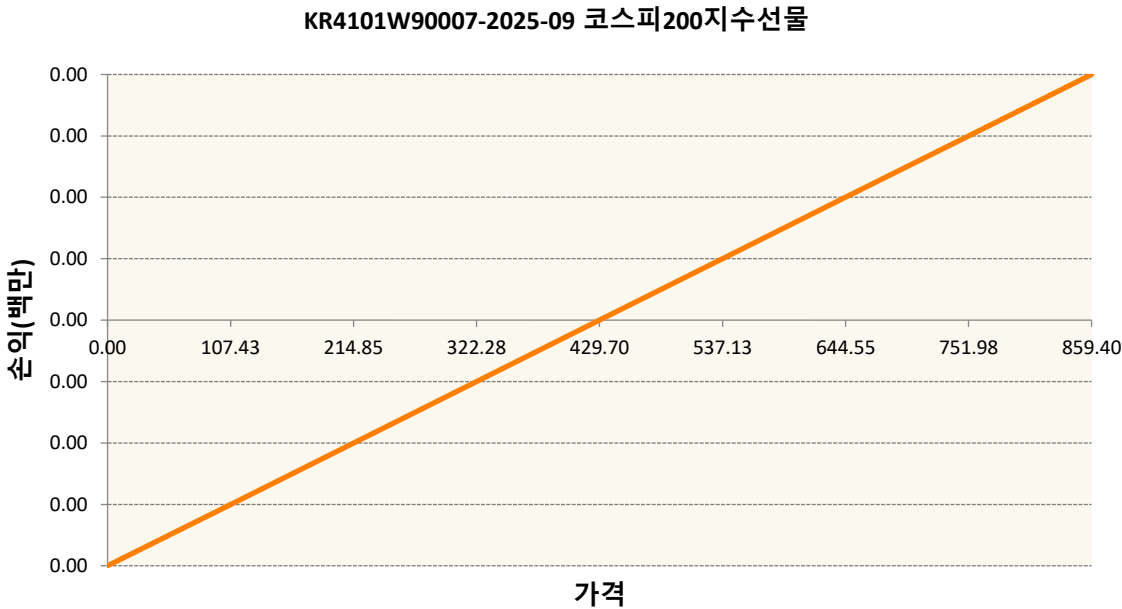
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

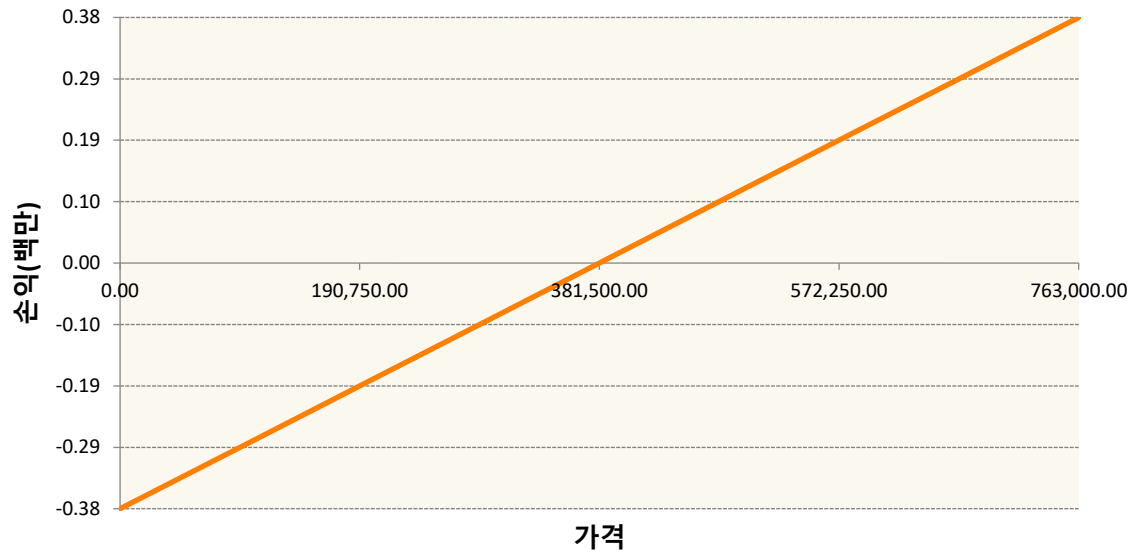
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 104   | 108   | -4        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 736   | 0     | 736       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

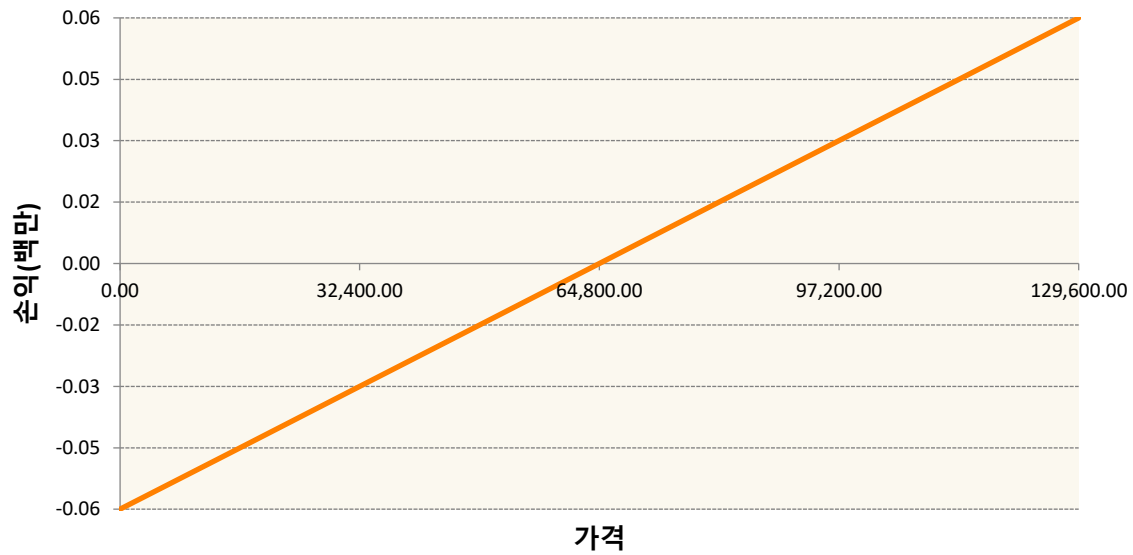




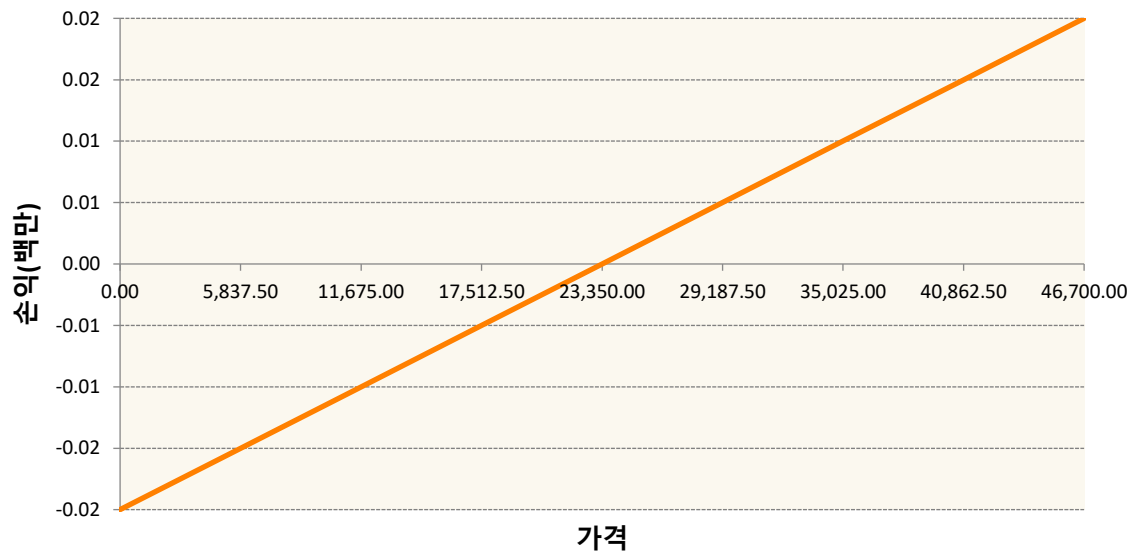
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



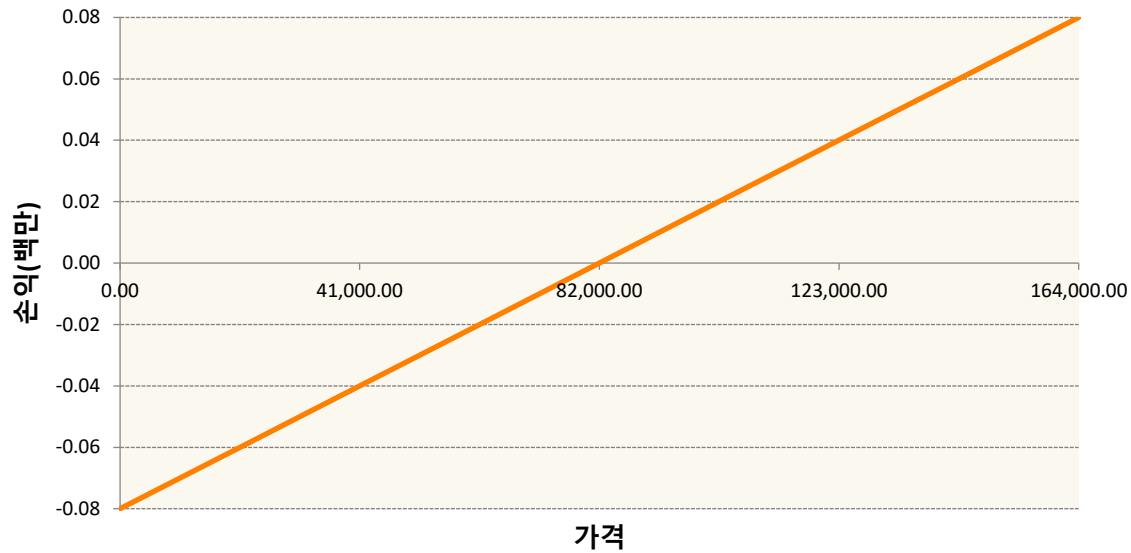
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



### KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                 |
|---------------------------------|
| KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물   |
| KR41E8W90( 2025-09 포스코퓨처엠개별선물   |
| KR41F5W90( 2025-09 LG에너지솔루션개별선물 |
| KR41F7W90( 2025-09 카카오페이개별선물    |
| KR41FAW90( 2025-09 HMM개별선물      |
| KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물      |

|    |
|----|
| 26 |
| 5  |
| 15 |
| 2  |
| 8  |
| 2  |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 76 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

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

342

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

535

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

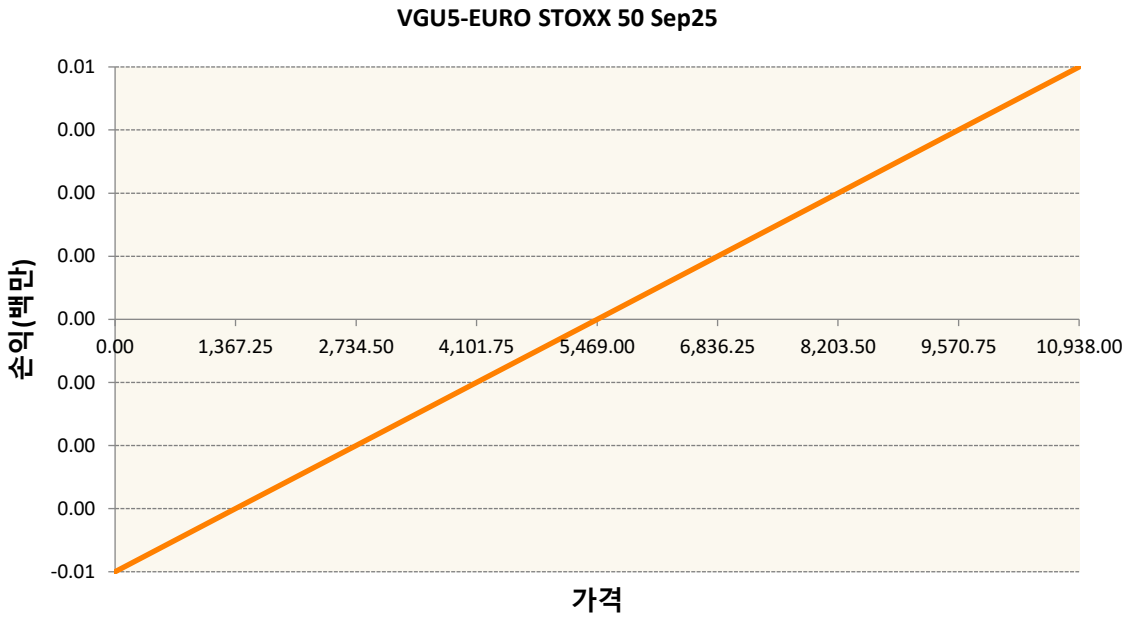
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 779   | 0     | 779       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGU5 | EURO STOXX 50 Sep25 | 62 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 52 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

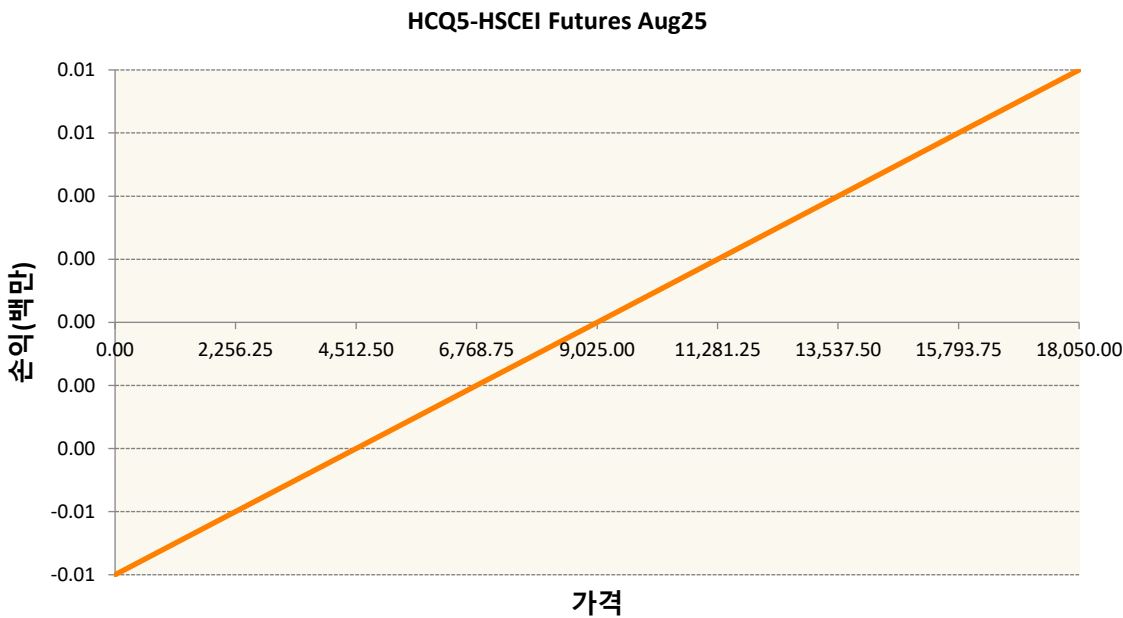
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 2,079 | 0     | 2,079     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCQ5 | HSCEI Futures Aug25 | 166 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 237 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

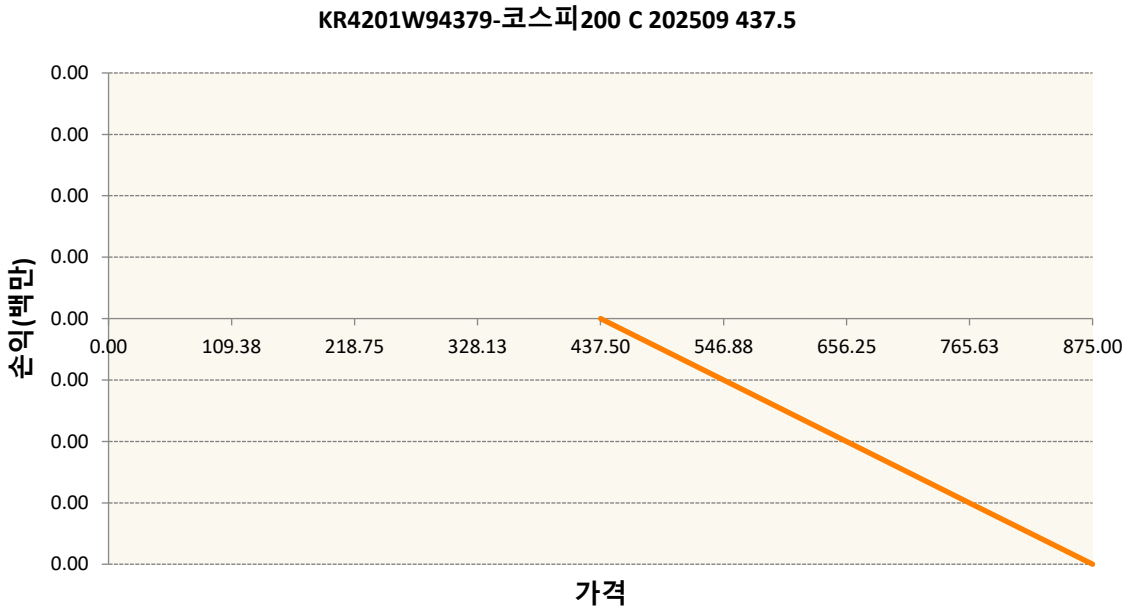
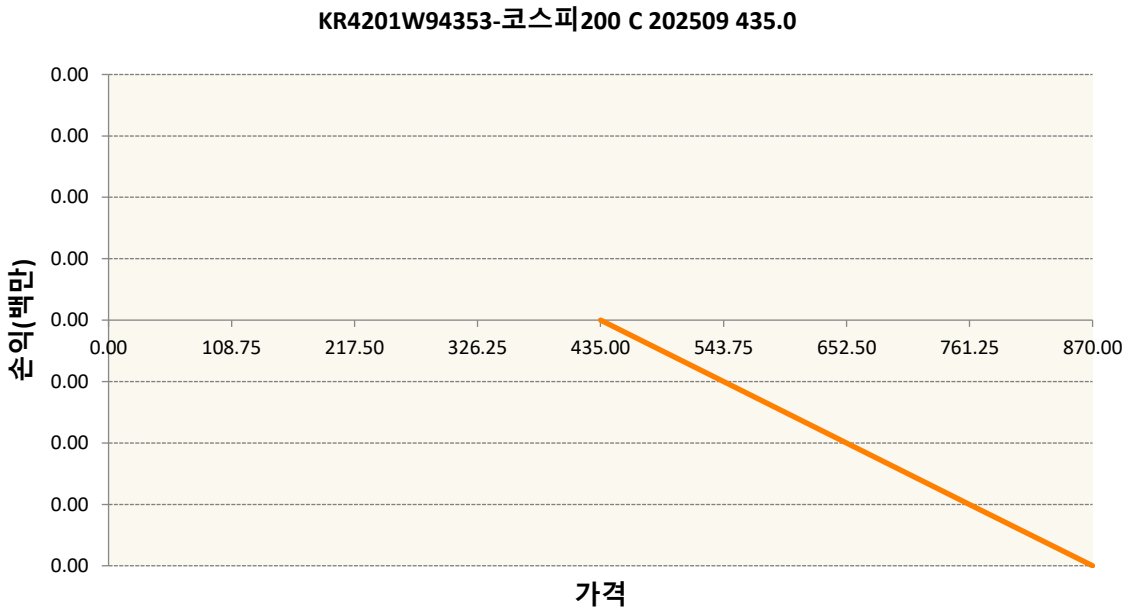
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

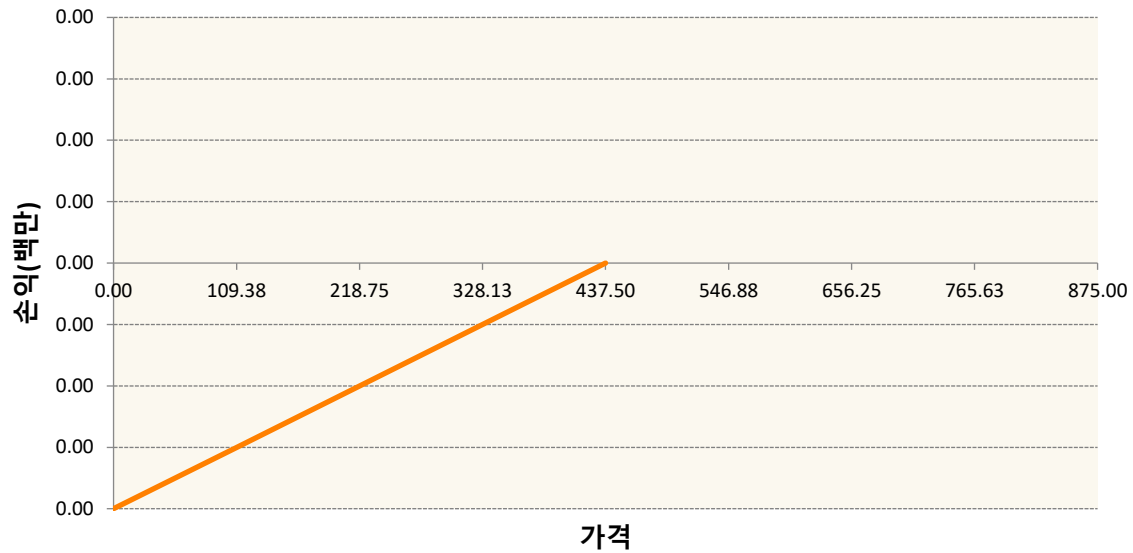
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 13,167 | -13,167   | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 35,144 | -35,144   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301W94377-코스피200 P 202509 437.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201W94: 코스피200 C 202509 435.0

1,044

KR4201W94: 코스피200 C 202509 437.5

1,251

KR4301W94: 코스피200 P 202509 437.5

516

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

(단위:백만원)

0

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

## 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 | 9,636 | 0      | 9,636     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 1,662 | 11,482 | -9,820    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FXW213F5V( KRW/USD 29-08-25E | 324 |
| FXW213F6SC KRW/USD 29-08-25E | 225 |
| FXW213F7W KRW/USD 29-08-25E  | 370 |
| FXW213F81C USD/KRW 29-08-25E | 89  |
| FXW213F87C USD/KRW 29-08-25E | 44  |
| IE00BD8RGM75                 |     |

\* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 529 |
|-----|



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

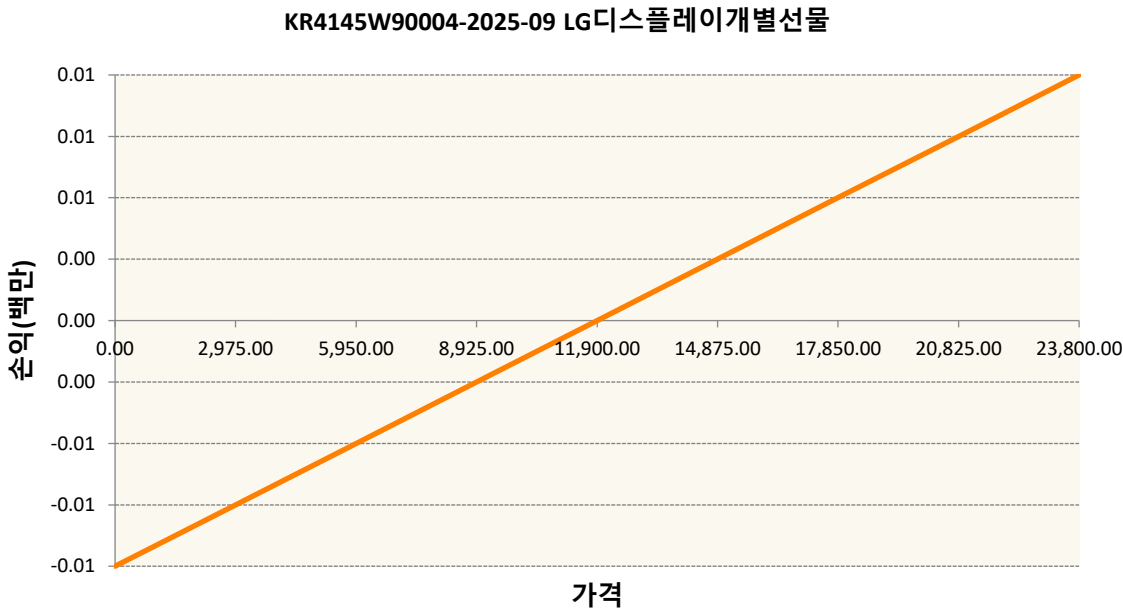
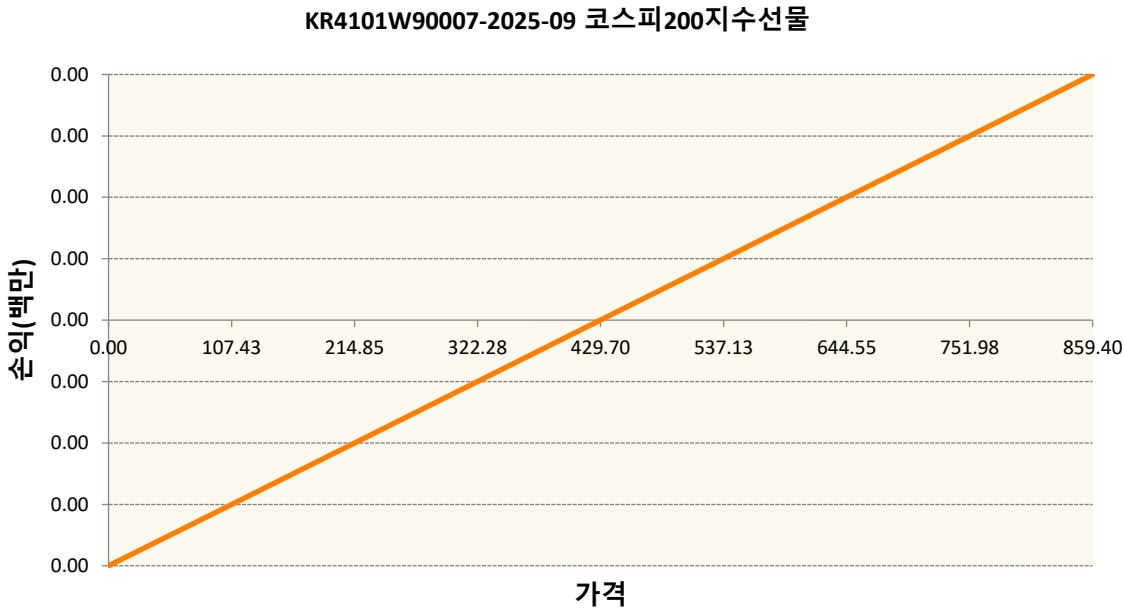
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

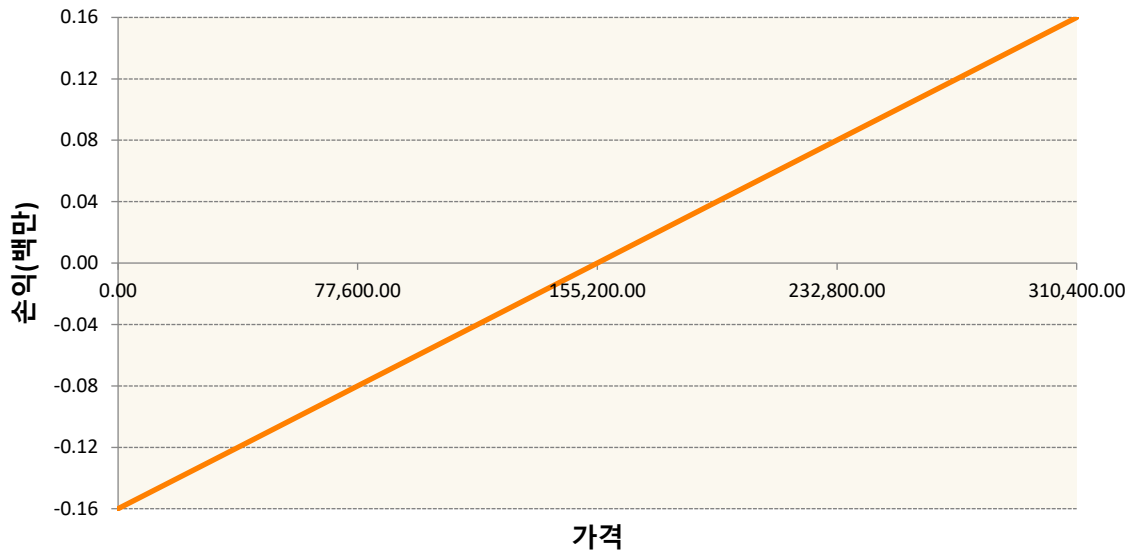
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 46    | 0     | 46        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 518   | 0     | 518       | 장내 |

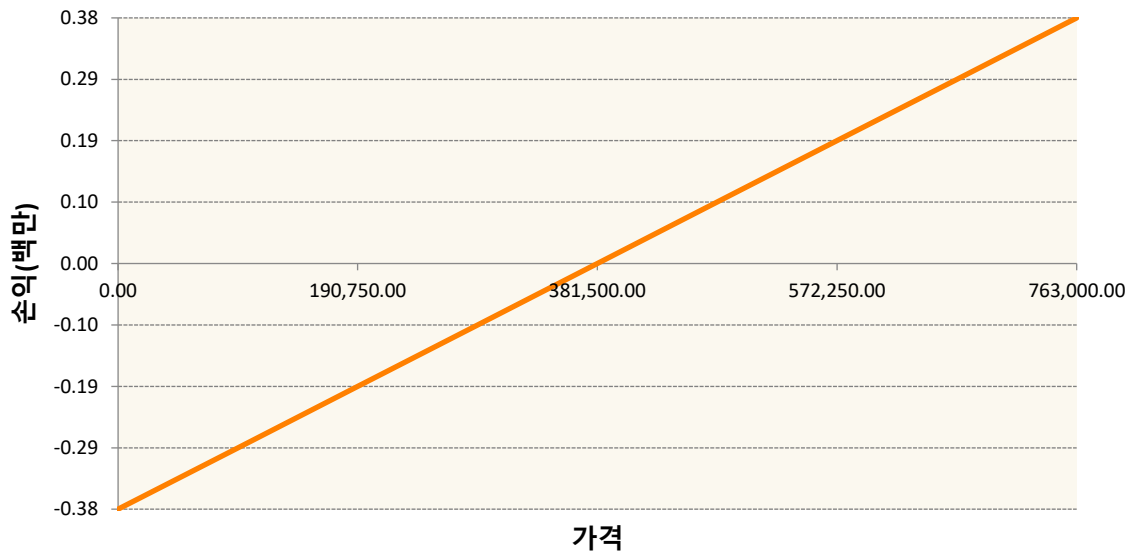
2. 만기시점의 손익구조



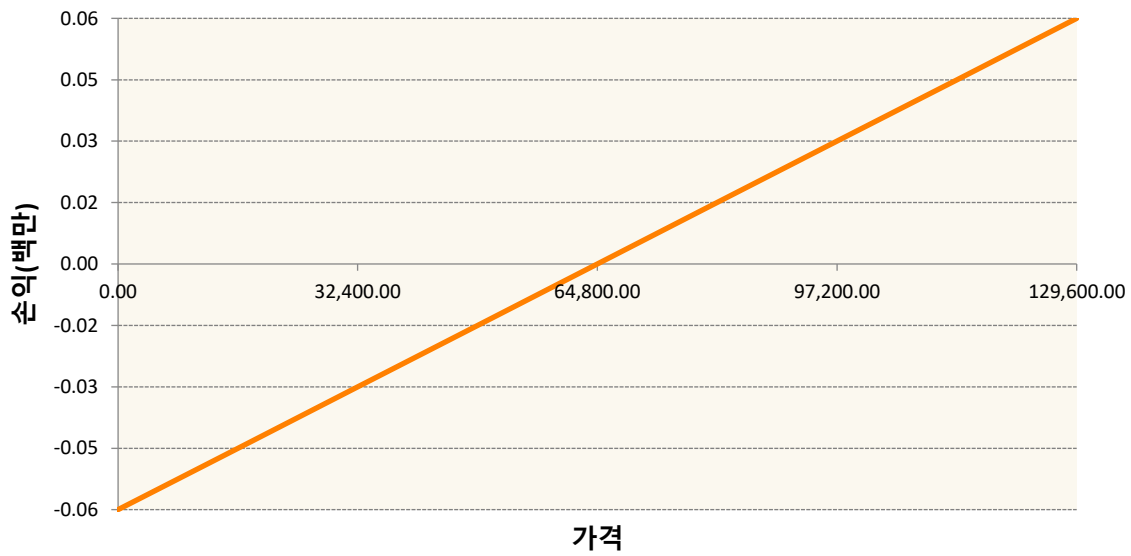
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



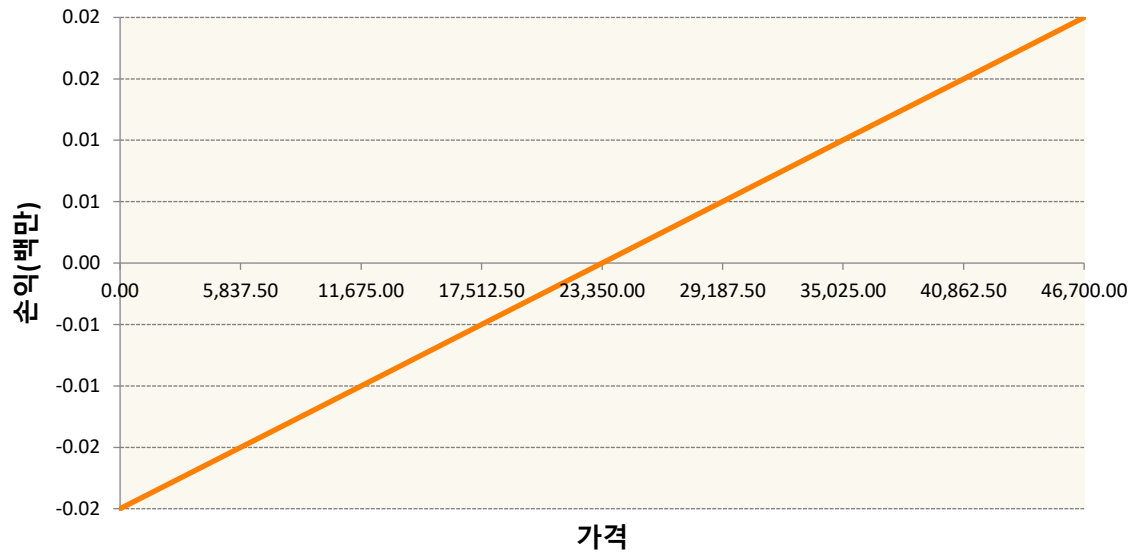
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



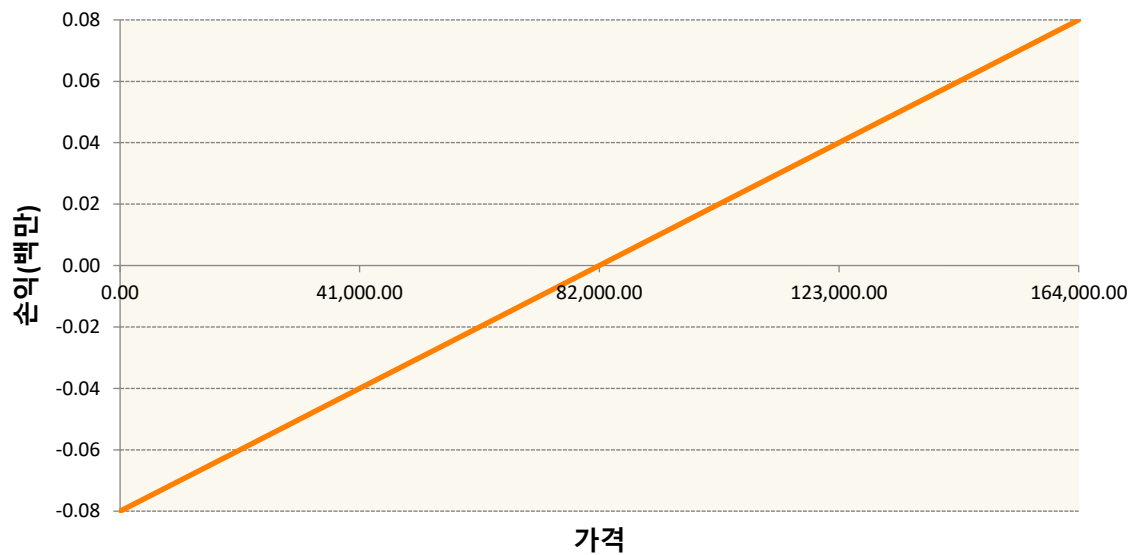
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                 |    |
|---------------------------------|----|
| KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물   | 26 |
| KR4145W90( 2025-09 LG디스플레이개별선물  | 1  |
| KR41E8W90( 2025-09 포스코퓨처엠개별선물   | 2  |
| KR41F5W90( 2025-09 LG에너지솔루션개별선물 | 6  |
| KR41F7W90( 2025-09 카카오페이개별선물    | 1  |
| KR41FAW90( 2025-09 HMM개별선물      | 4  |
| KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물      | 1  |

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

(단위:백만원)

36

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

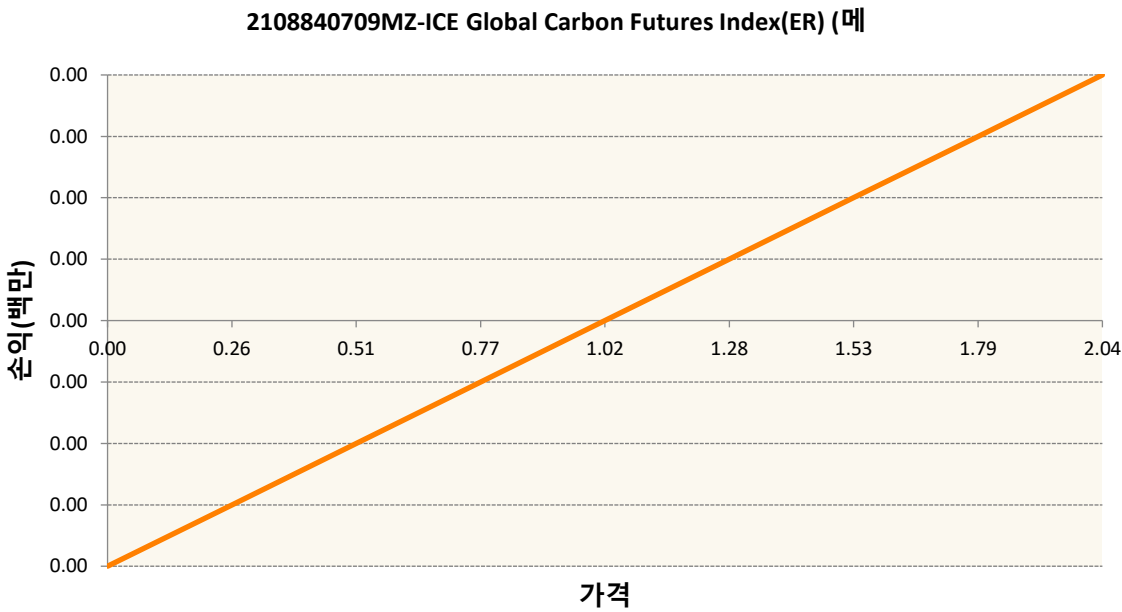
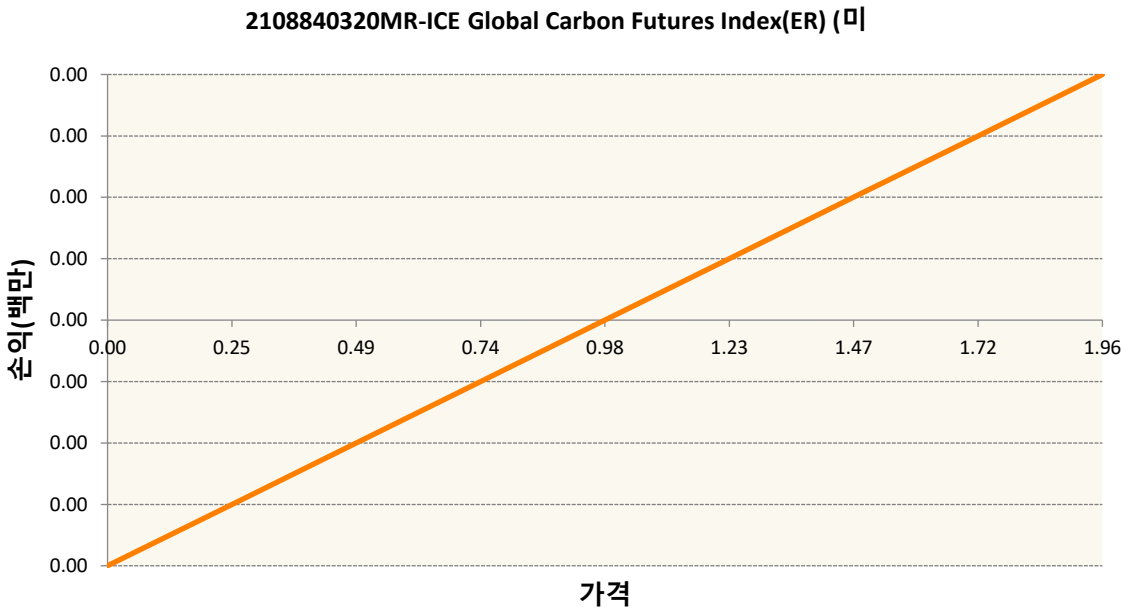
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 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 | 591      |
| 2108840709                | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 | 99       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 757      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

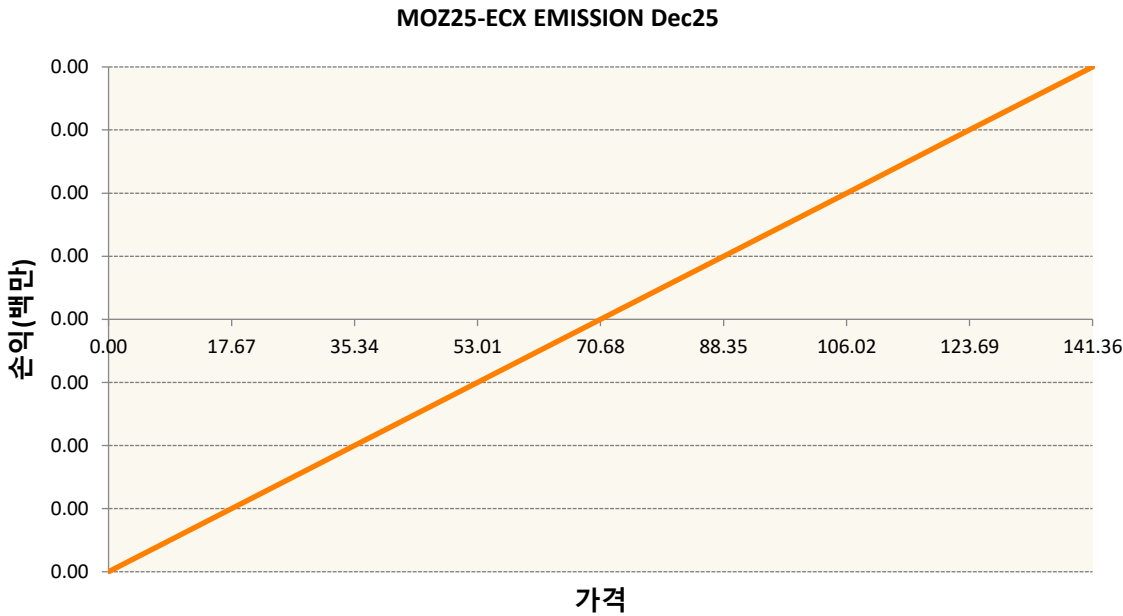
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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   | 6,208 | 0     | 6,208     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | -20   | 0     | -20       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,355 | -1,355    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |     |
|-----------------------------------------------------|-----|
| 2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index | 2   |
| FXW213F7W KRW/EUR 29-08-25E                         | 108 |
| MOZ25 ECX EMISSION Dec25                            | 497 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 847 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

## 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)            | 16 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 16 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 11 |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 11 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 91 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

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)  | 25 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(메리츠) | 30 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)  | 22 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 6  |

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

(단위:백만원)

142



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

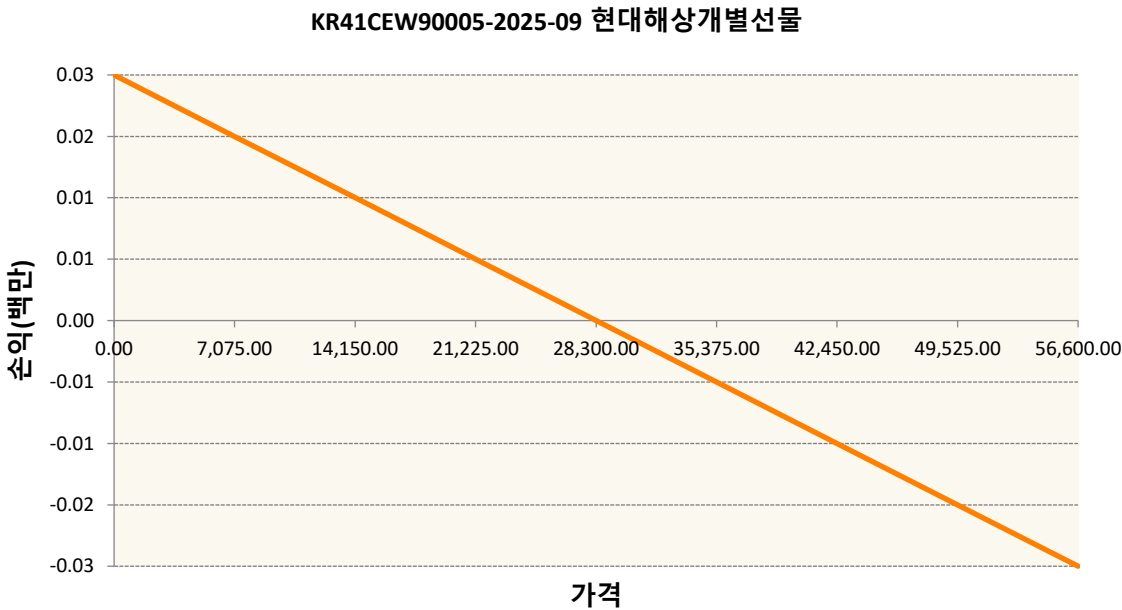
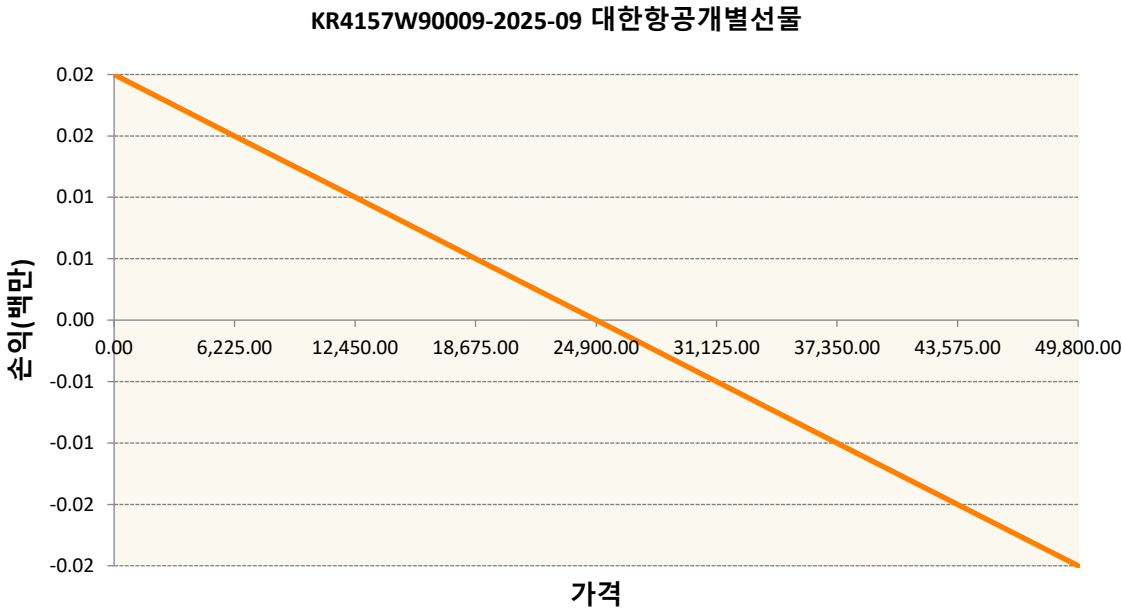
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

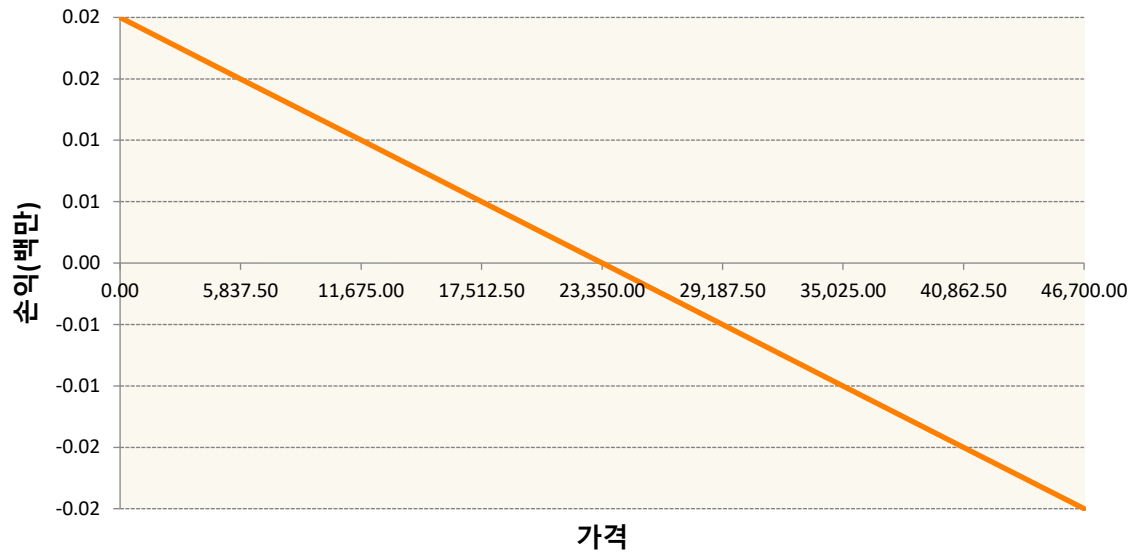
(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4157W90( 2025-09 대한항공개별선물  
 KR41CEW90( 2025-09 현대해상개별선물  
 KR41FAW90( 2025-09 HMM개별선물

|      |
|------|
| 0.32 |
| 0.32 |
| 0.32 |

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

(단위:백만원)

|   |
|---|
| 1 |
|---|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

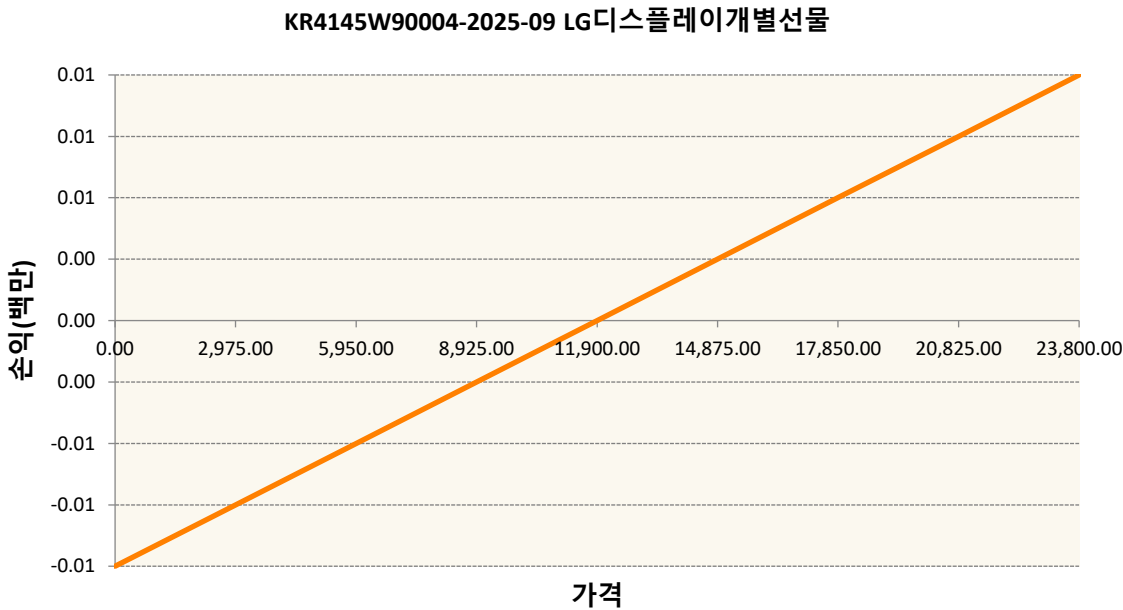
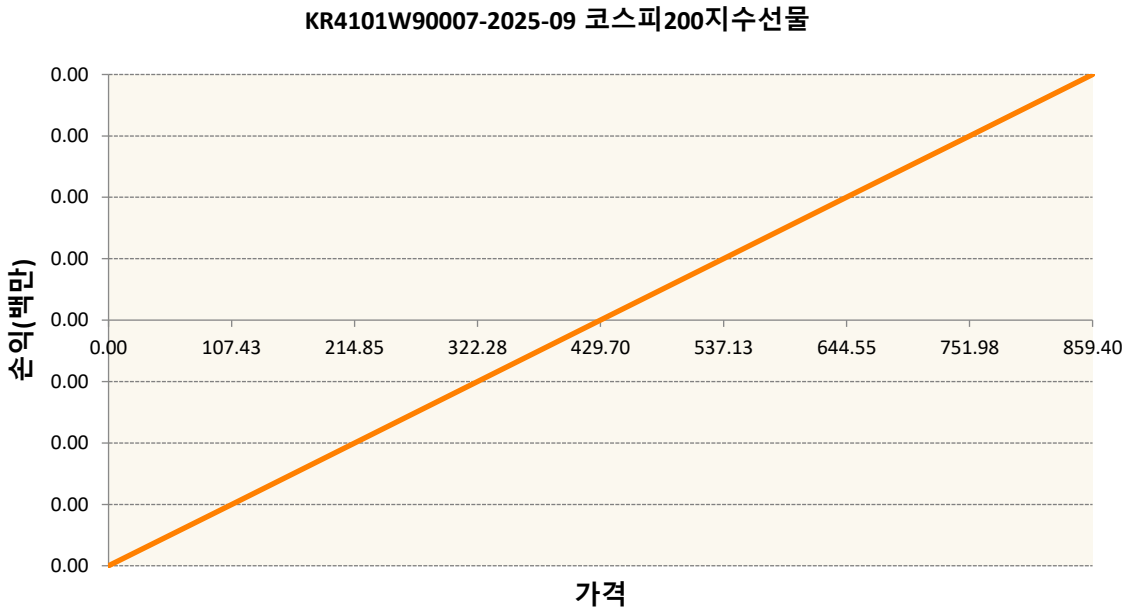
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

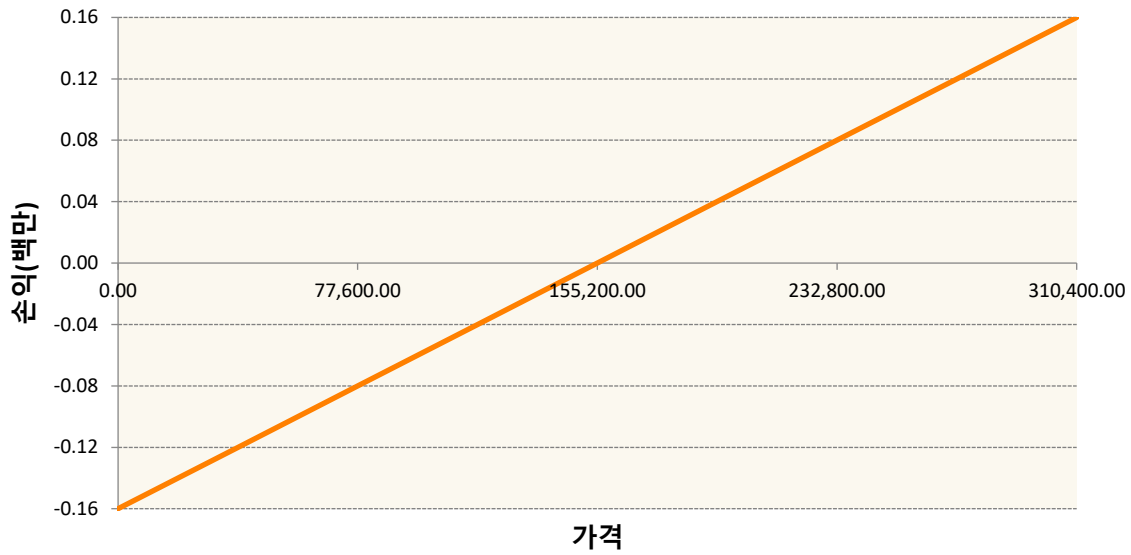
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 2,483  | 0     | 2,483     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 12,072 | 0     | 12,072    | 장내 |

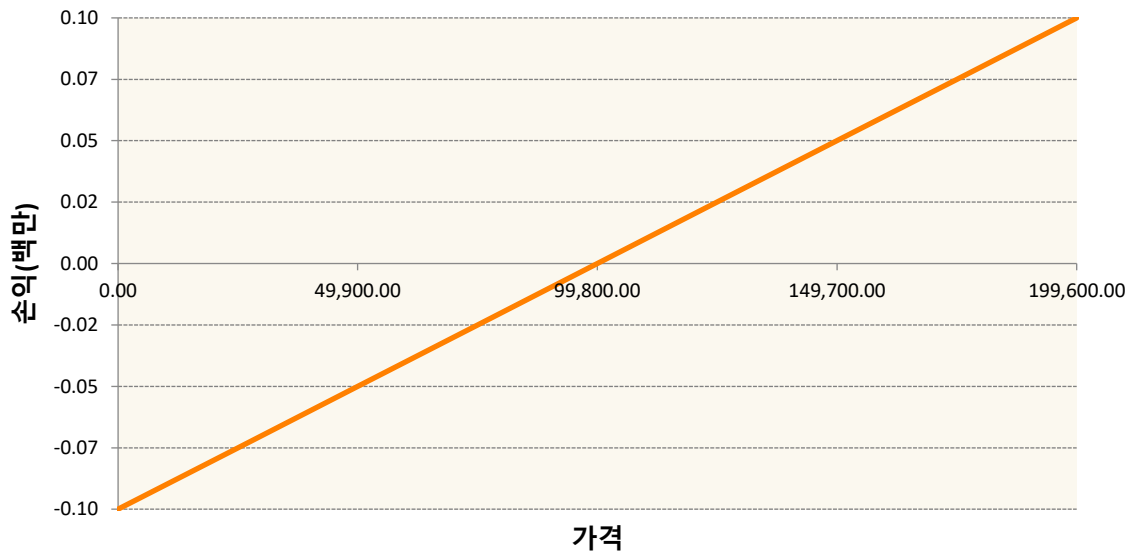
2. 만기시점의 손익구조



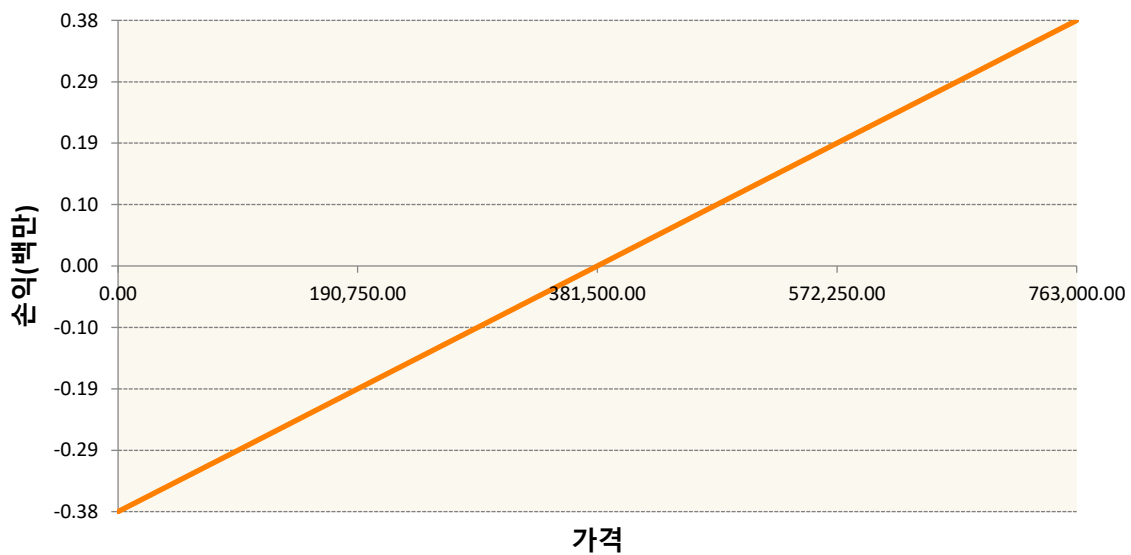
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



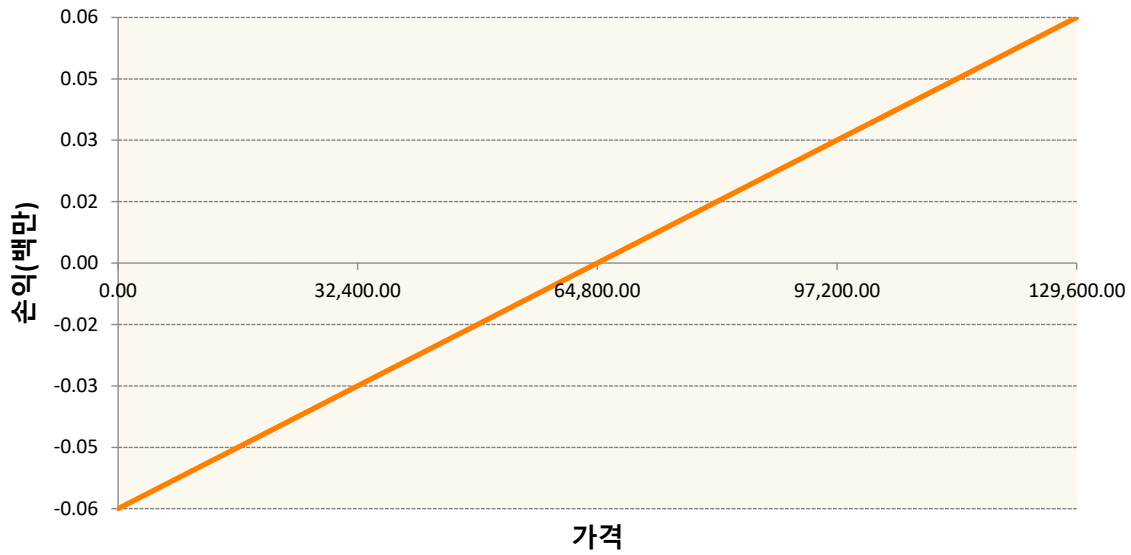
KR41EJW90000-2025-09 SKC개별선물



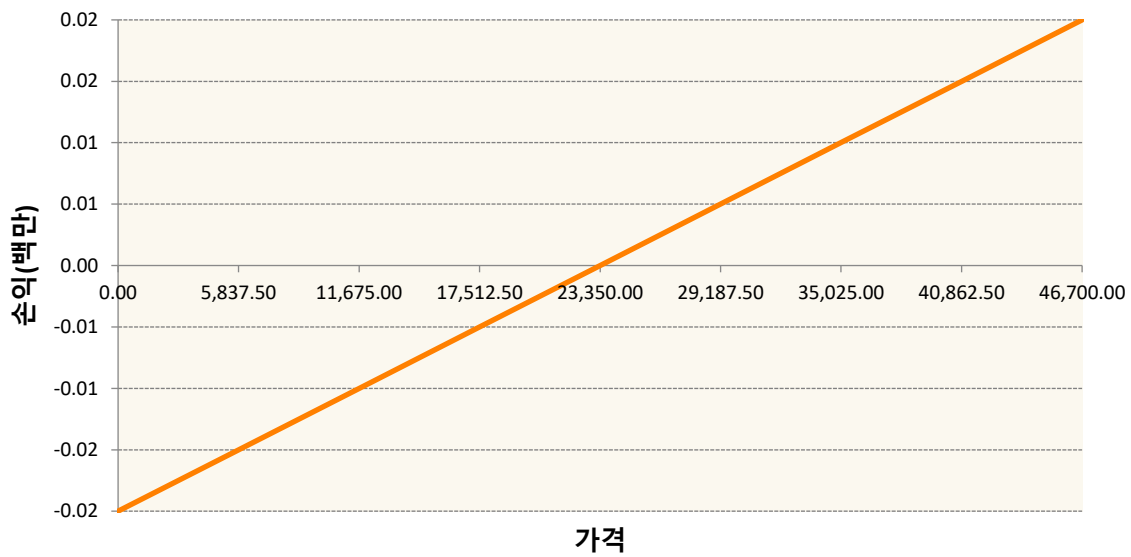
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



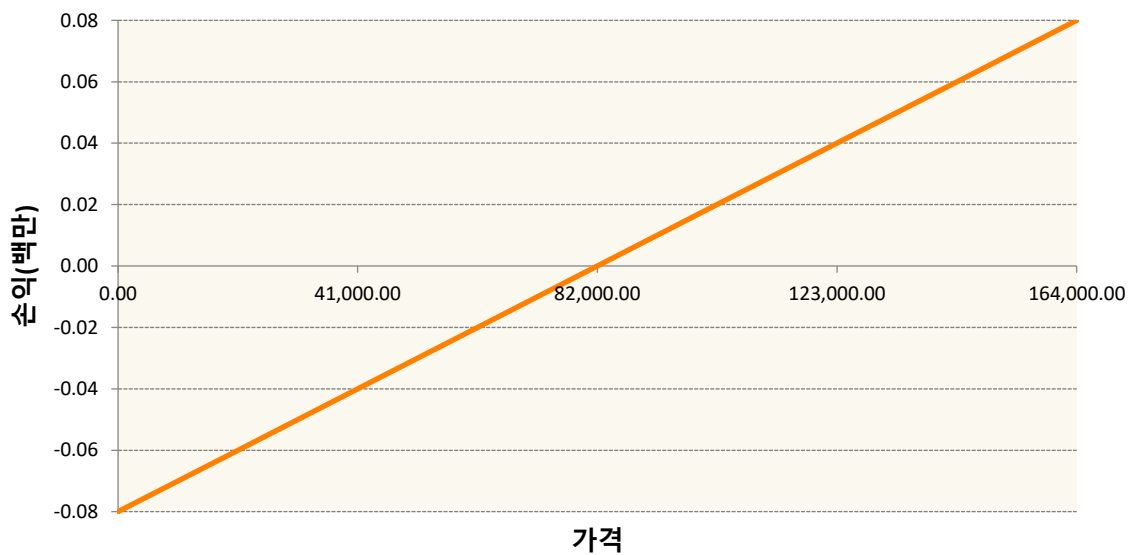
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

|                                 |     |
|---------------------------------|-----|
| KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물   | 816 |
| KR4145W90( 2025-09 LG디스플레이개별선물  | 24  |
| KR41E8W90( 2025-09 포스코퓨처엠개별선물   | 43  |
| KR41EJW900 2025-09 SKC개별선물      | 20  |
| KR41F5W90( 2025-09 LG에너지솔루션개별선물 | 13  |
| KR41F7W90( 2025-09 카카오페이개별선물    | 19  |
| KR41FAW90( 2025-09 HMM개별선물      | 9   |
| KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물      | 21  |

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

**469**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

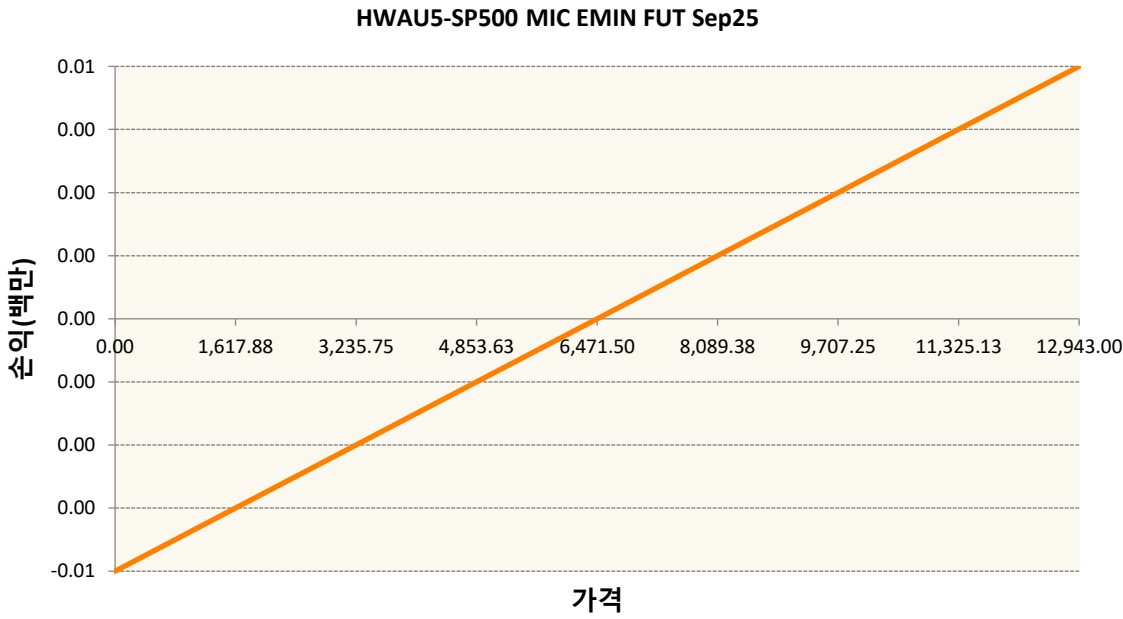
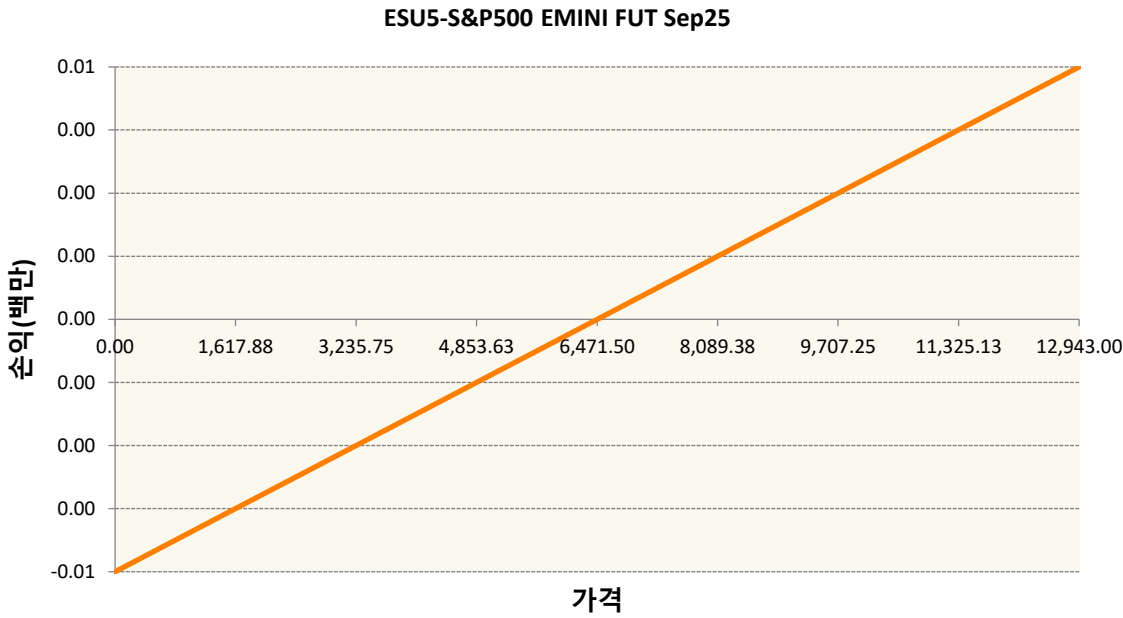
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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   | 32,149 | 0     | 32,149    |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,113  | 0     | 1,113     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESU5                      | S&P500 EMINI FUT Sep25   | 2,572    |
| HWAU5                     | SP500 MIC EMIN FUT Sep25 | 89       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 2,338    |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

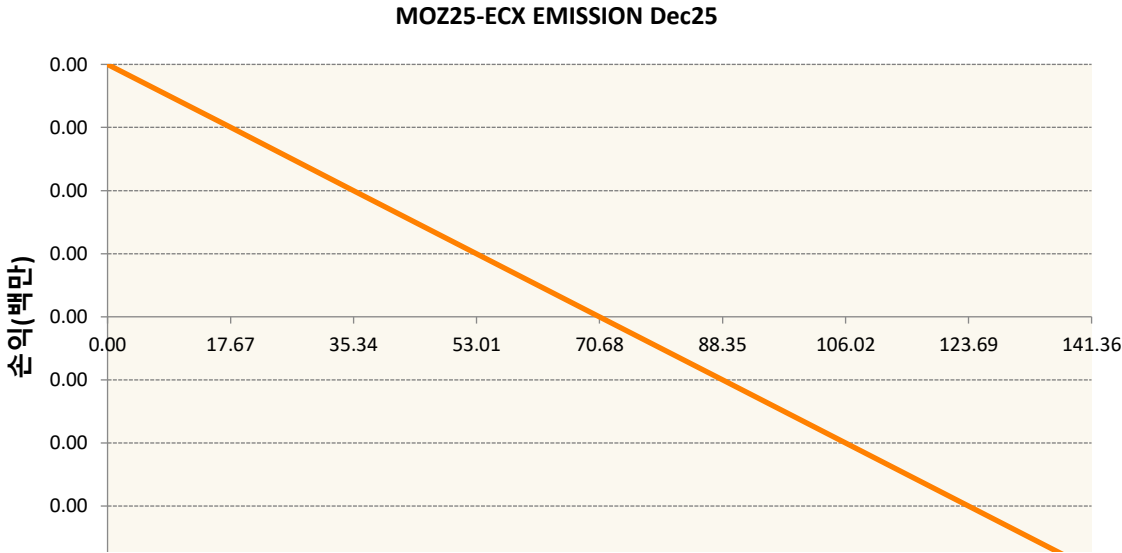
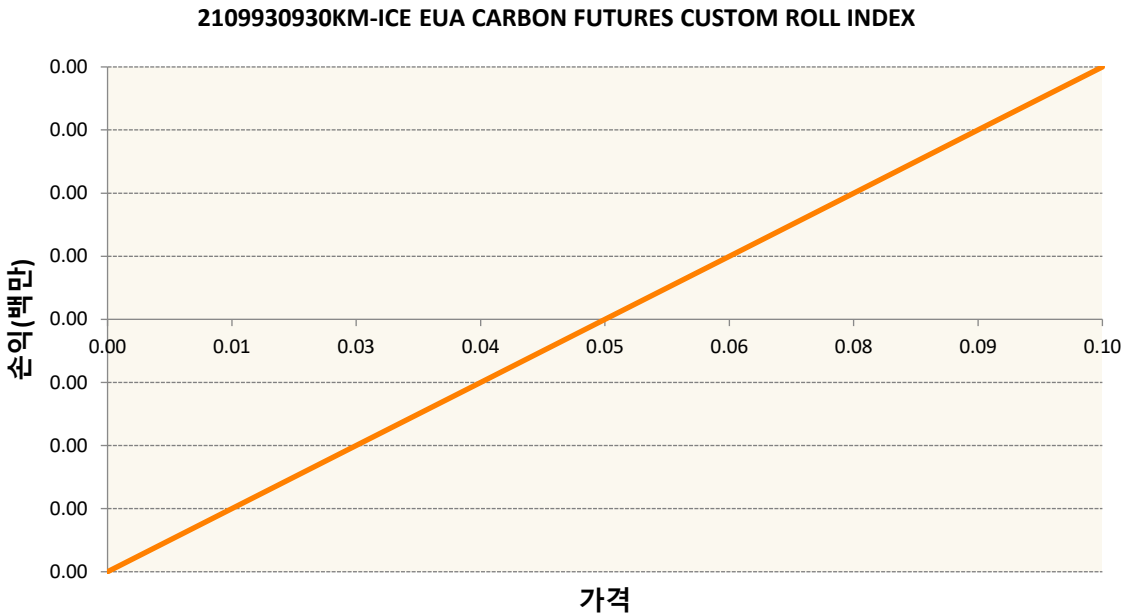
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 5,289 | -5,289    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 20    | 0     | 20        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,027 | -1,027    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

|                                                     |     |
|-----------------------------------------------------|-----|
| 2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 2   |
| FXW213F7W KRW/EUR 29-08-25E                         | 1   |
| FXW213F7W KRW/EUR 29-08-25E                         | 81  |
| MOZ25      ECX EMISSION Dec25                       | 423 |

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

(단위:백만원)

**715**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

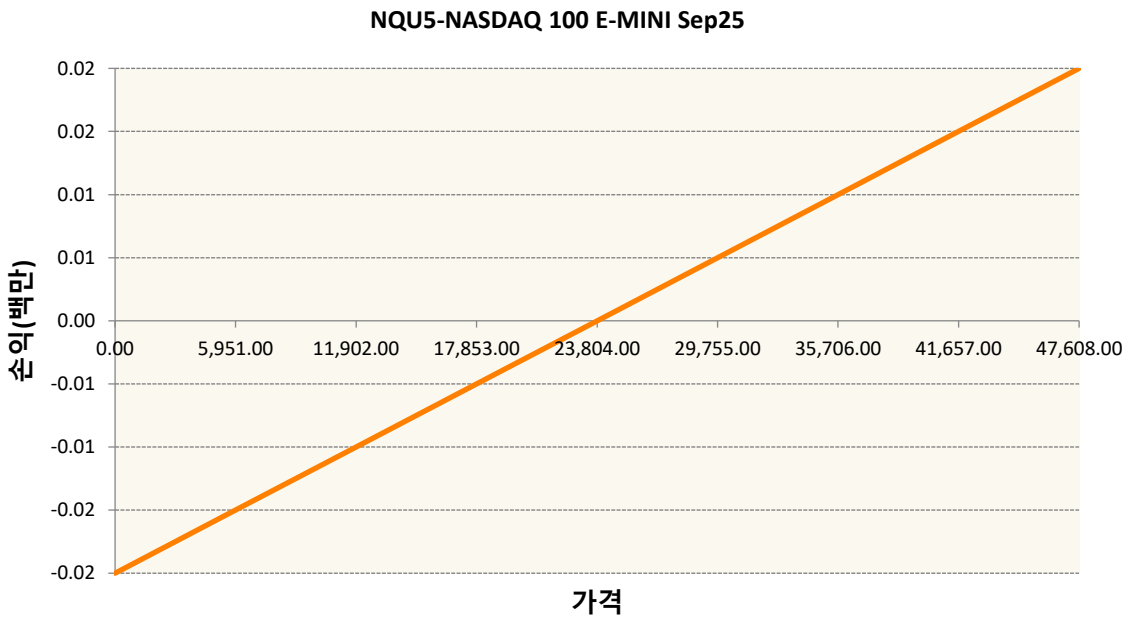
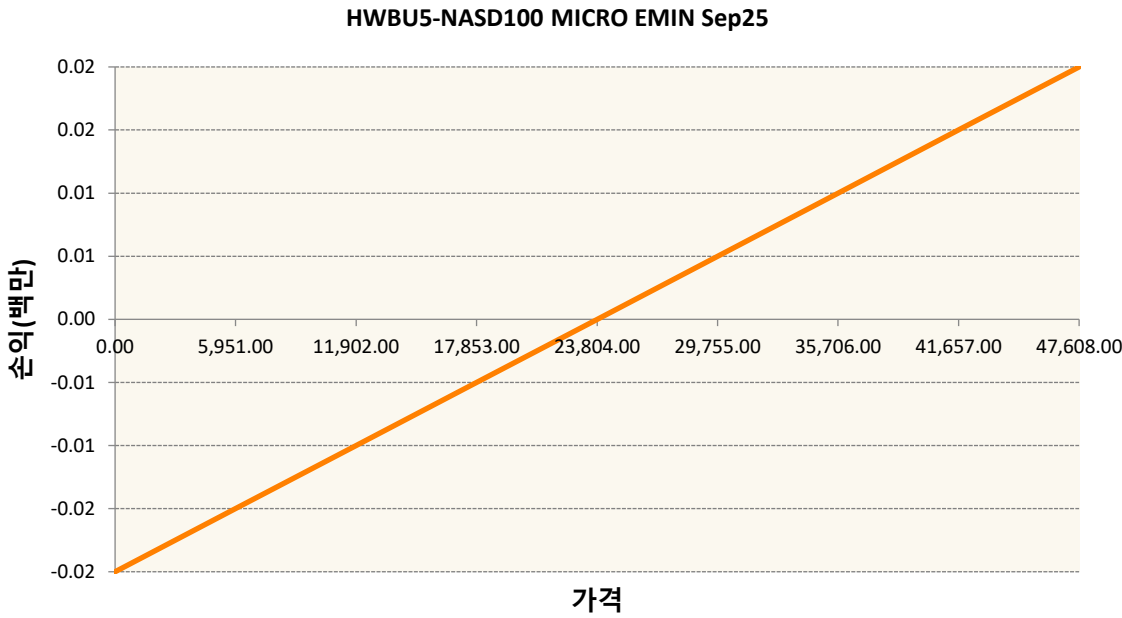
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 13,800 | 0     | 13,800    |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,189  | 0     | 1,189     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| HWBU5                     | NASD100 MICRO EMIN Sep25 | 95       |
| NQU5                      | NASDAQ 100 E-MINI Sep25  | 1,104    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,357    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

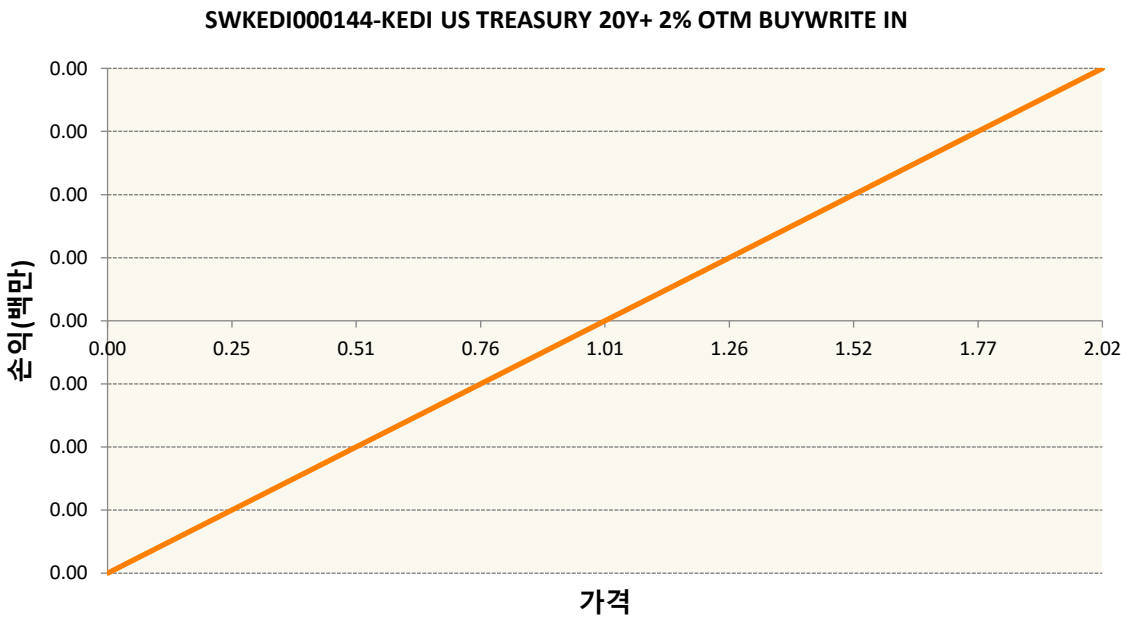
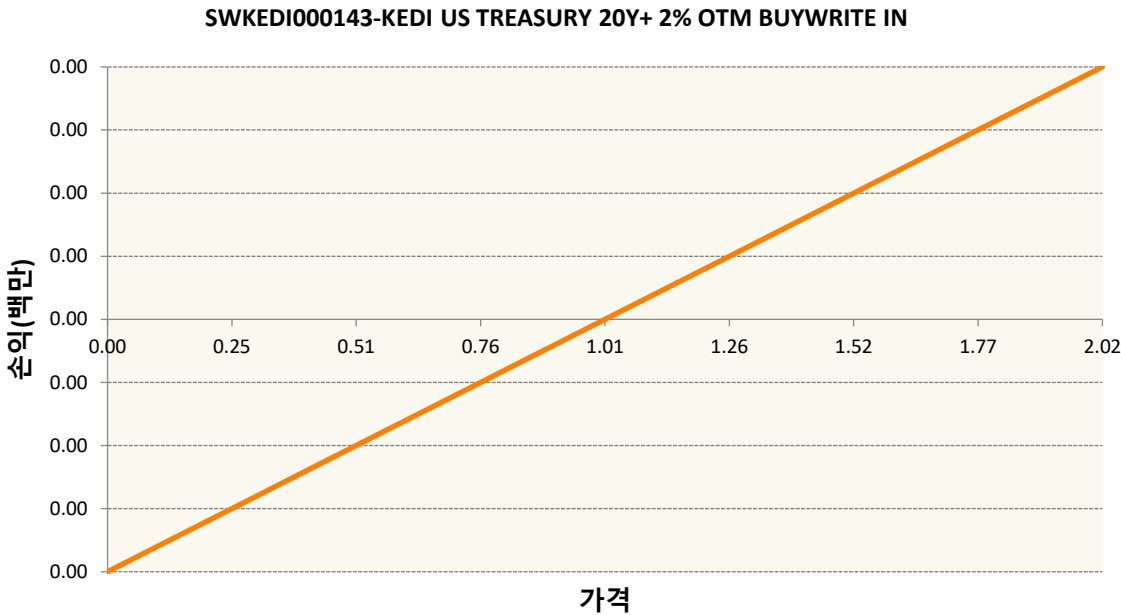
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

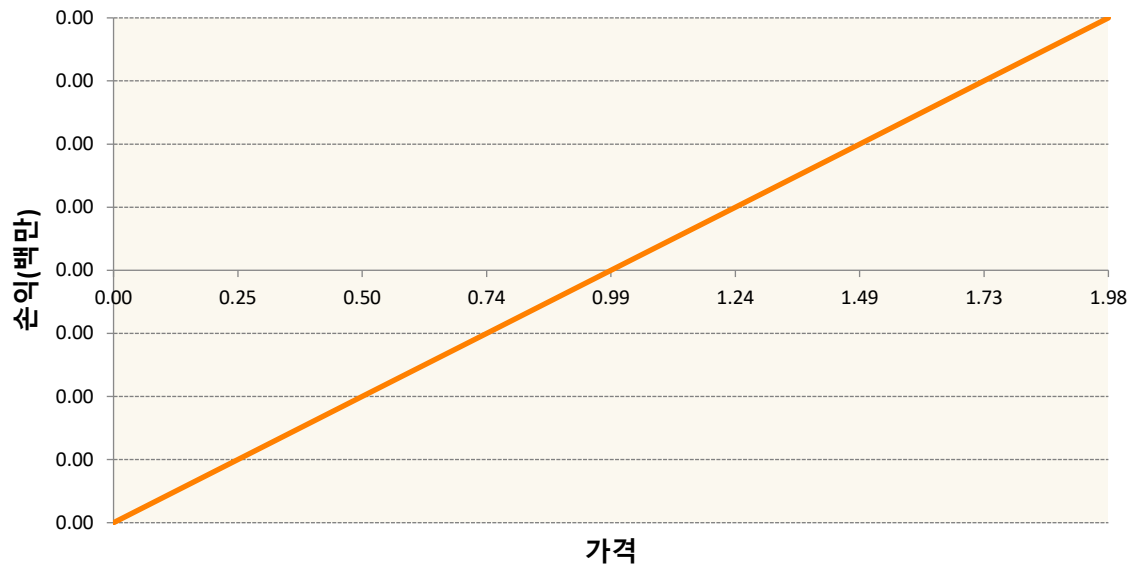
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 313,719 | 0     | 313,719   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### SWKEDI000145-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN  
 SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN  
 SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN  
 SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN  
 SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN

|       |
|-------|
| 3,316 |
| 7,776 |
| 173   |
| 9,393 |
| 4,631 |

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

(단위:백만원)

12,841

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

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 | 16 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 16 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 16 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 16 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 86 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-08-19 |
| 기준일 | 2025-08-18 |

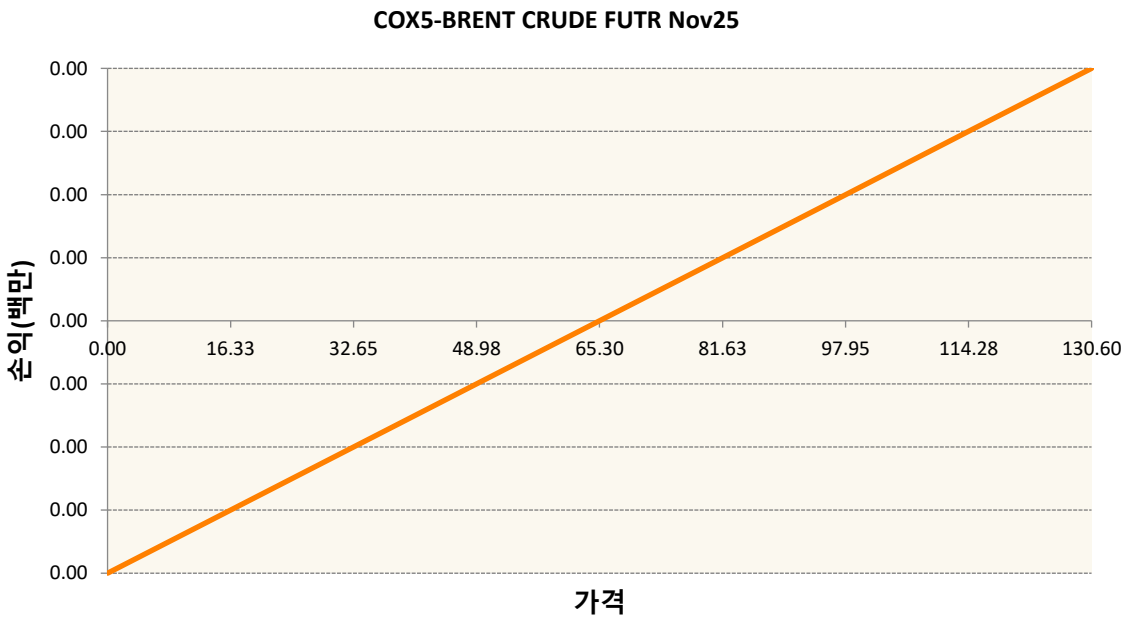
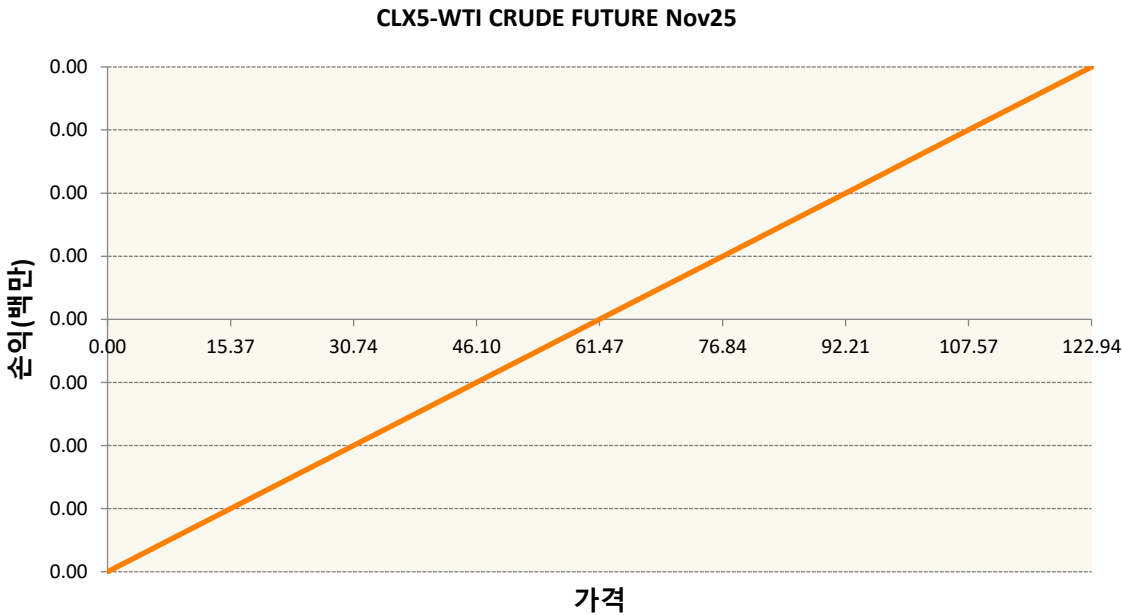
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

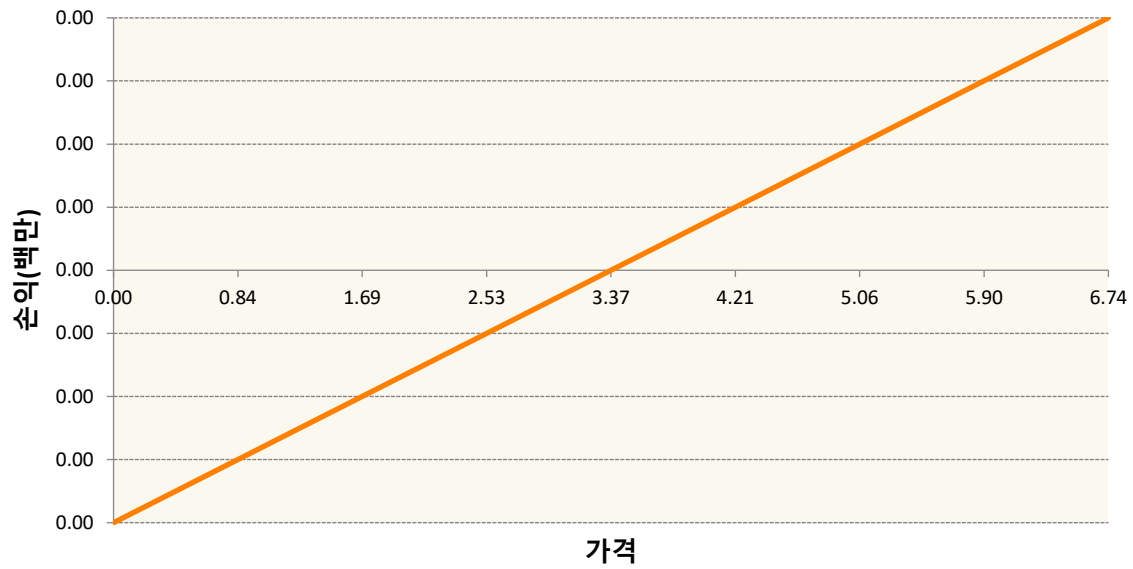
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 531   | 0     | 531       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 69    | -69       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

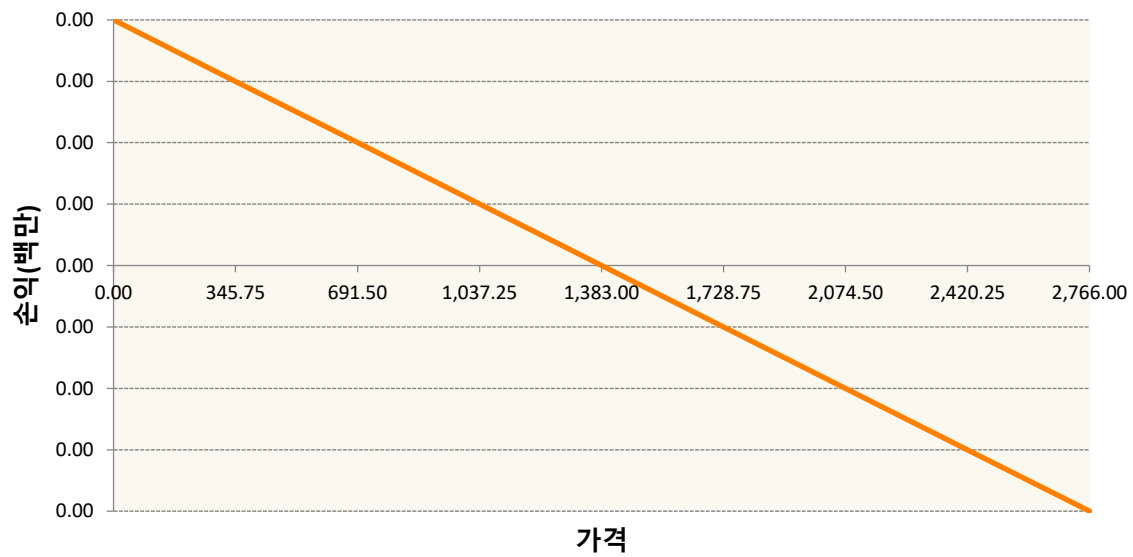




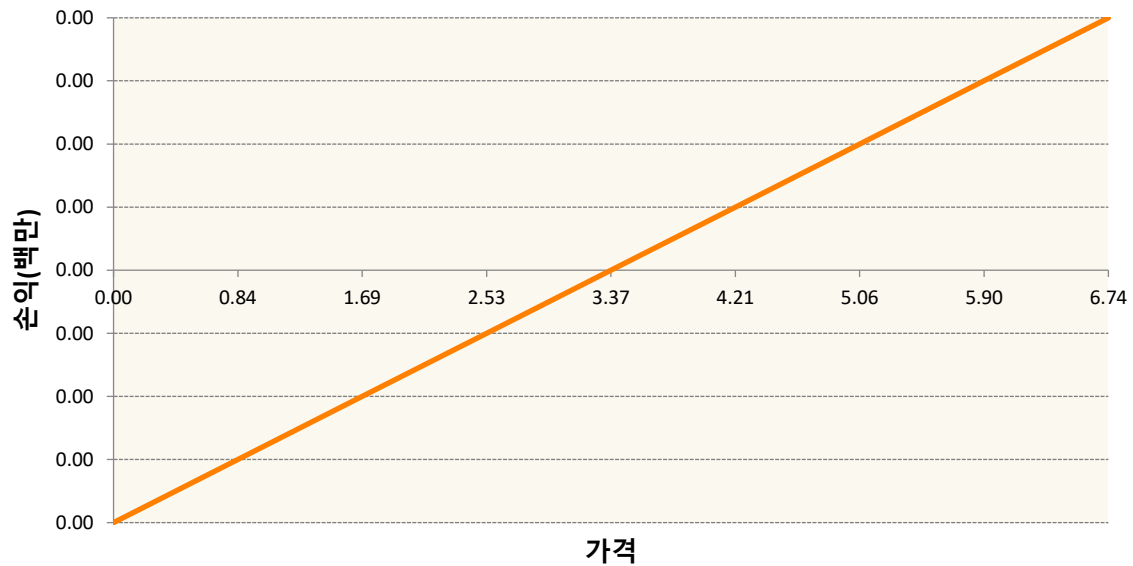
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

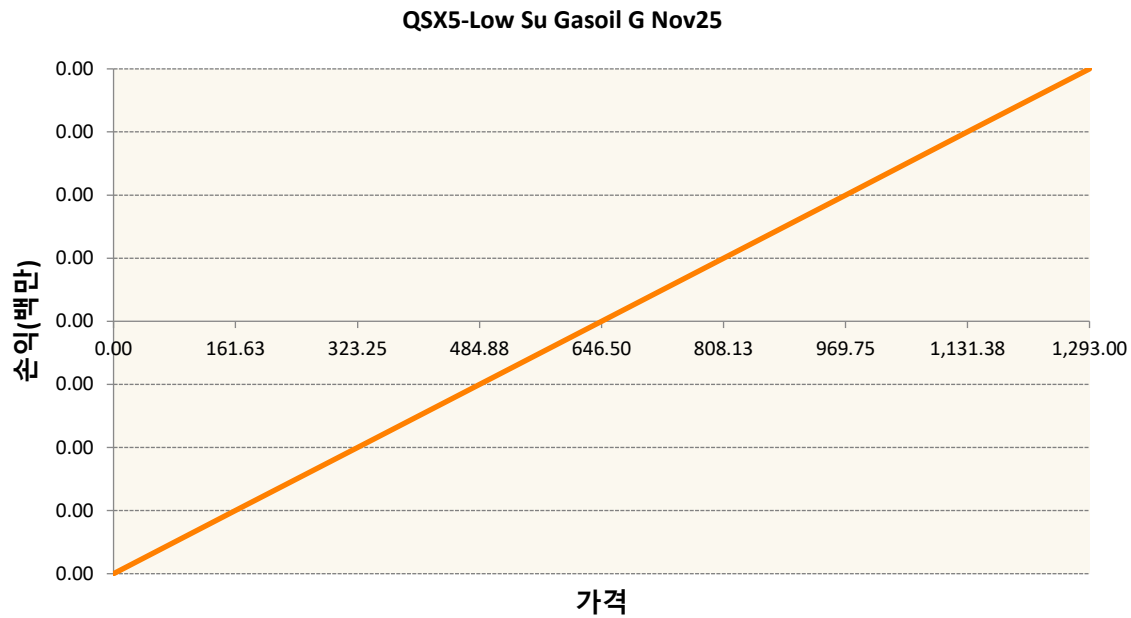


KR4175W90001-2025-09 달러선물



NGX25-NATURAL GAS FUTR Nov25





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| CLX5                      | WTI CRUDE FUTURE Nov25  |  | 7        |
| COX5                      | BRENT CRUDE FUTR Nov25  |  | 14       |
| EOX5                      | E-MINI NATURAL GA Nov25 |  | 3        |
| KR4175W90( 2025-09 달러선물   |                         |  | 6        |
| NGX25                     | NATURAL GAS FUTR Nov25  |  | 11       |
| QX5                       | Low Su Gasoil G Nov25   |  | 7        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 98       |