

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

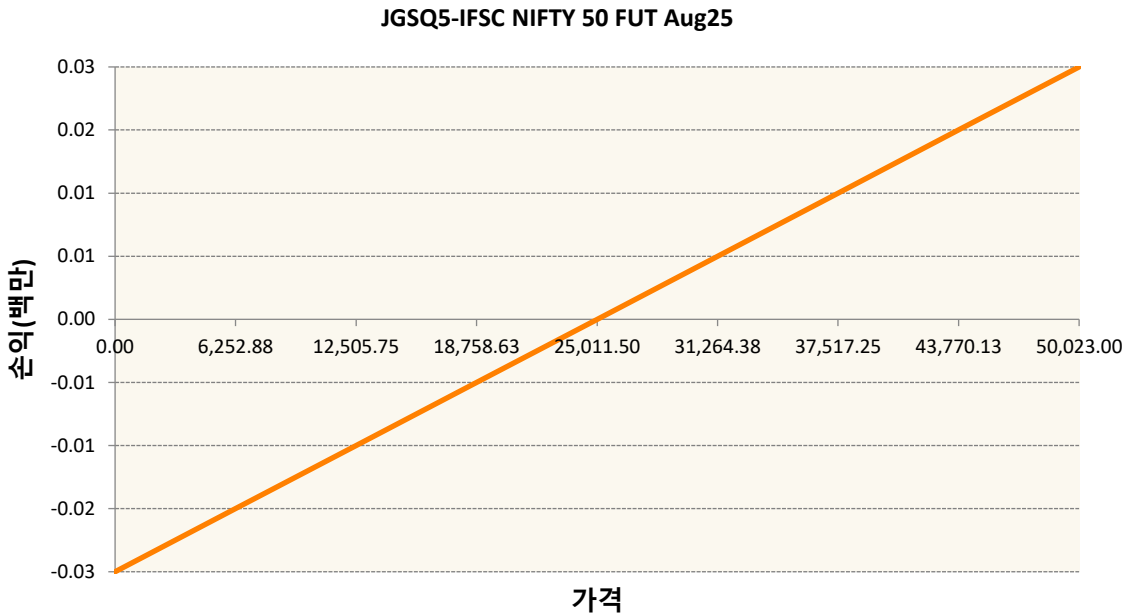
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSQ5	IFSC NIFTY 50 FUT Aug25	50
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

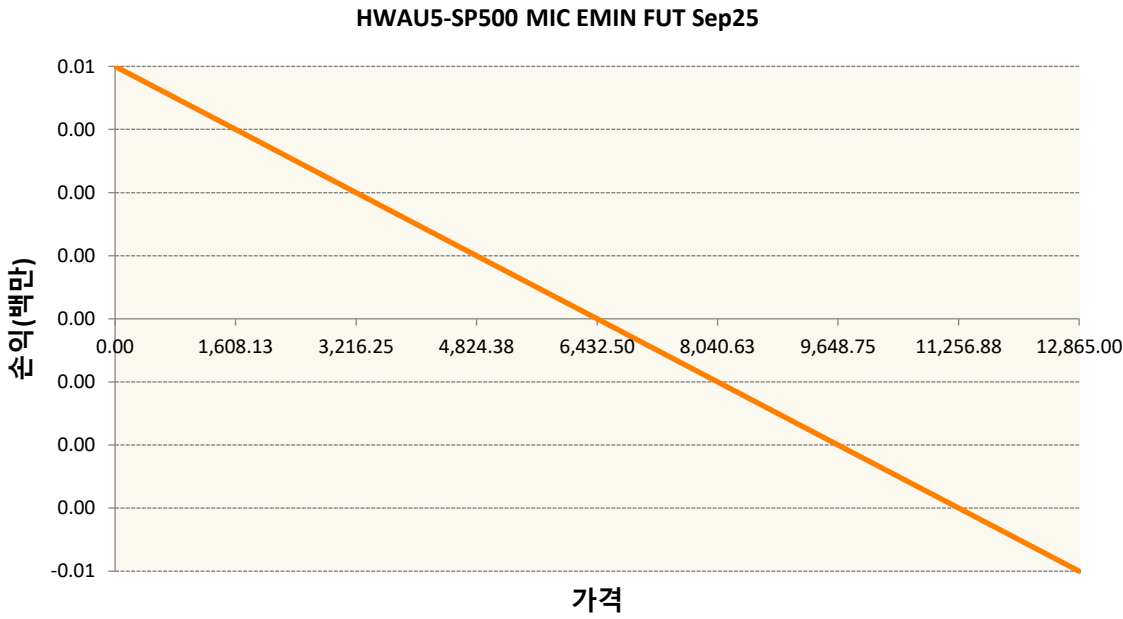
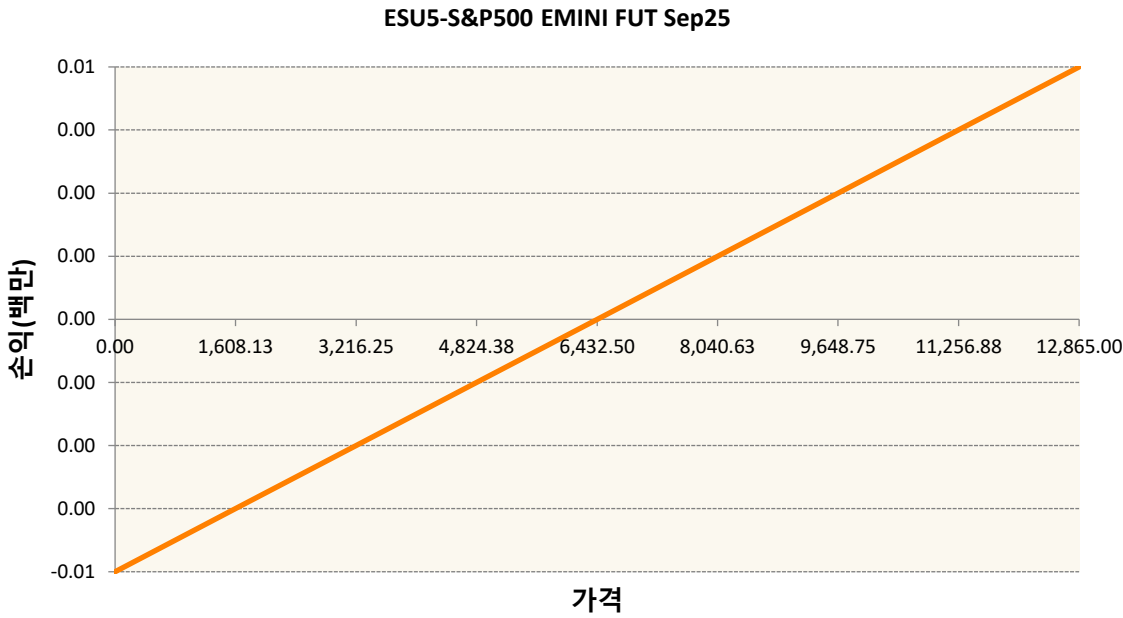
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	884	0	884	
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)
	68

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

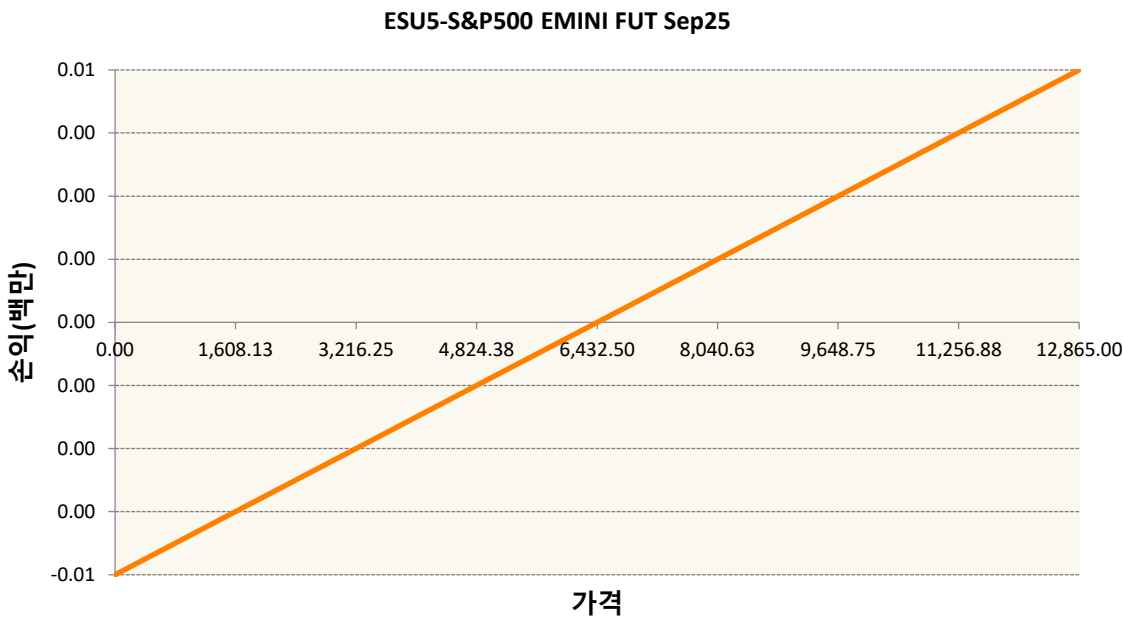
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,333	0	1,333	

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	2025-08-21
기준일	2025-08-20

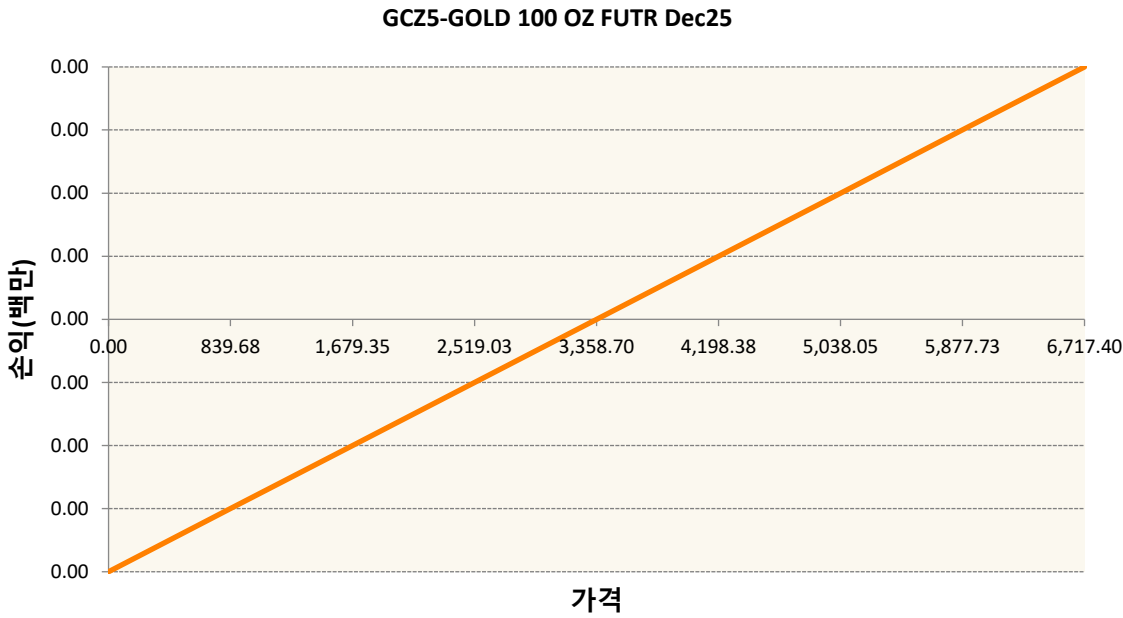
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,863	0	1,863	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 08/22/25 C311 EQUITY	4
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	149

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

(단위:백만원)

133

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

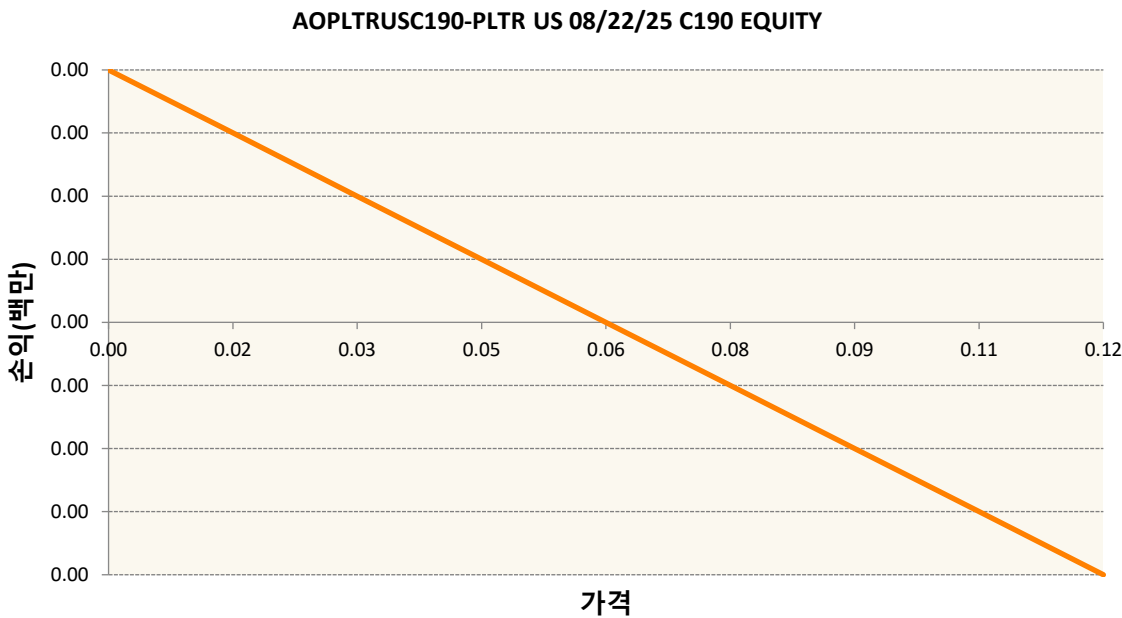
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	1,117	-1,117	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC1 PLTR US 08/22/25 C185 EQUITY	1
AOPLTRUSC1 PLTR US 08/22/25 C190 EQUITY	89
AOPLTRUSP1 PLTR US 08/22/25 P185 EQUITY	2
AOPLTRUSP1 PLTR US 08/22/25 P190 EQUITY	34

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

(단위:백만원)

516

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

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	2025-08-21
기준일	2025-08-20

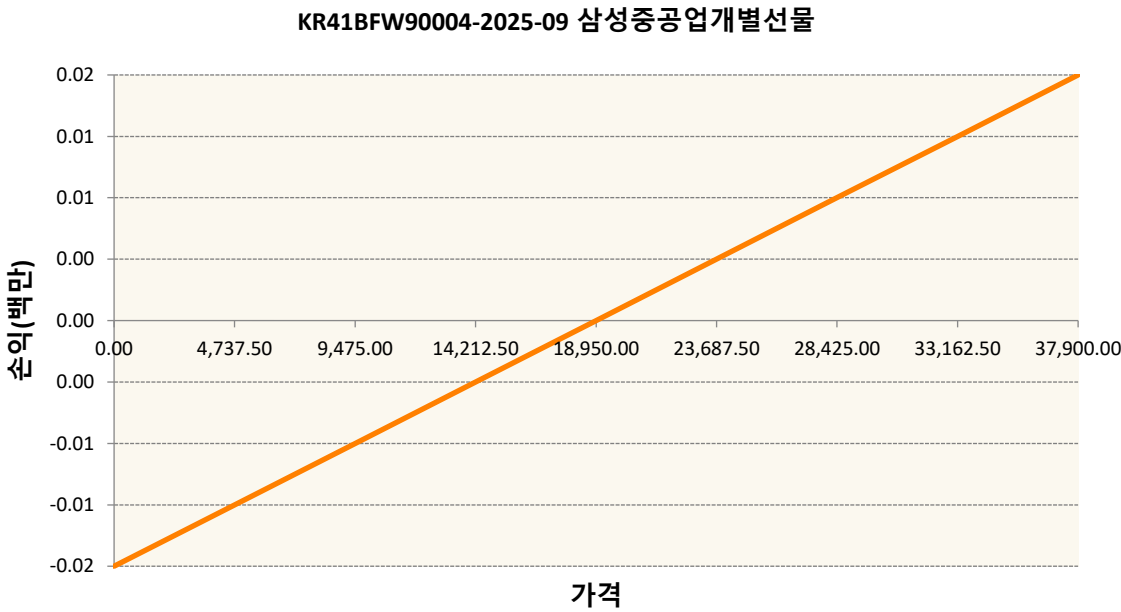
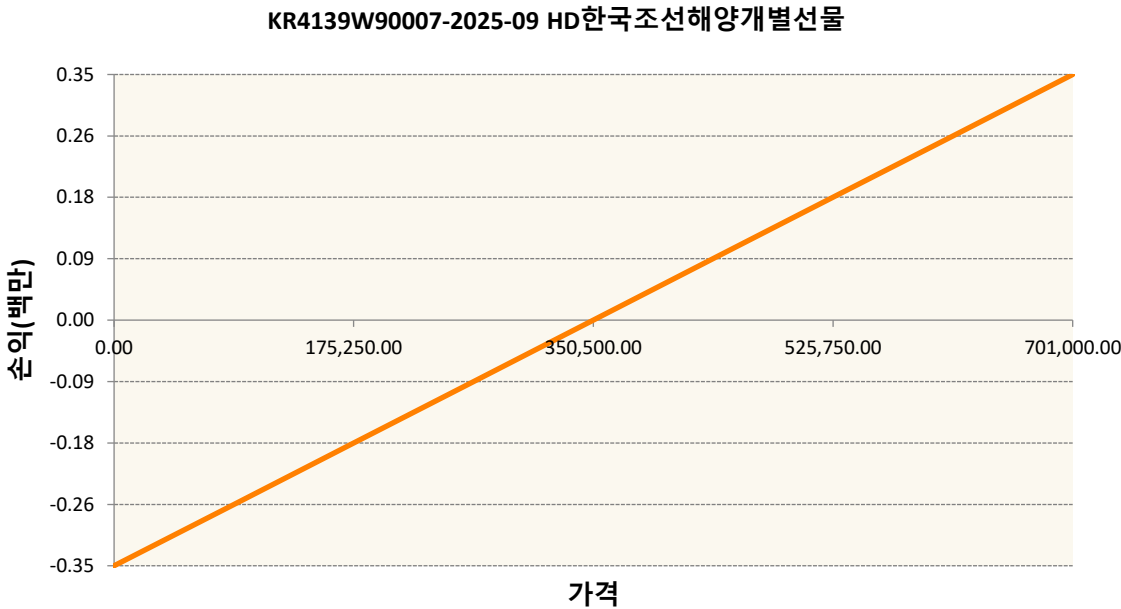
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

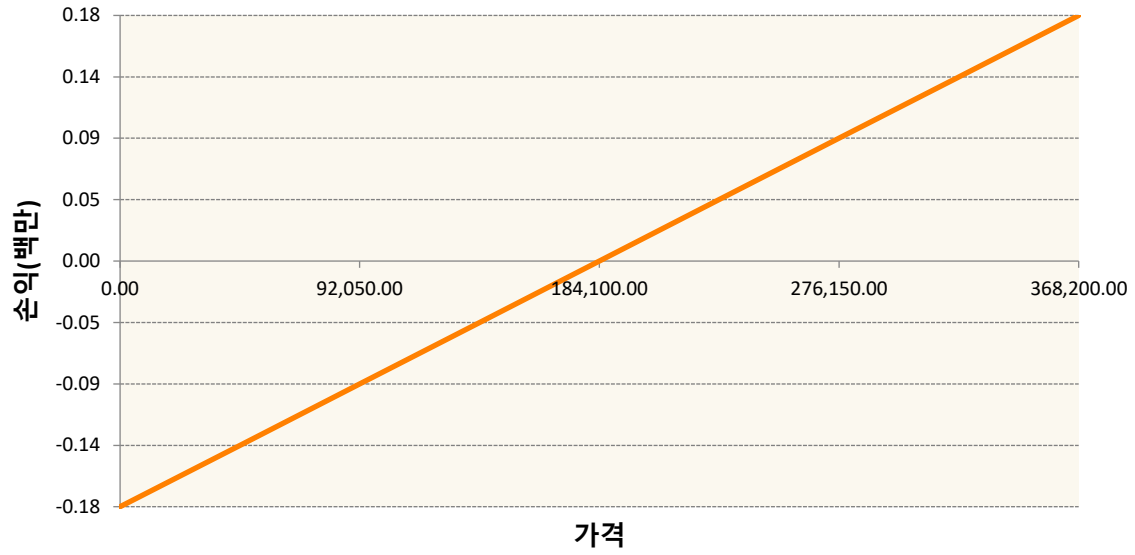
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	29,981	0	29,981	장내

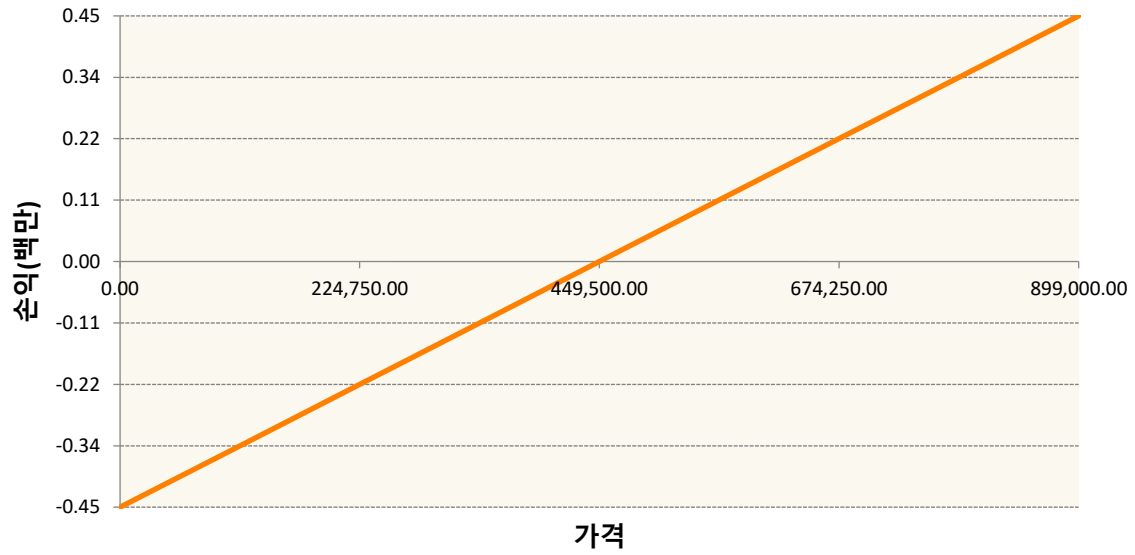
2. 만기시점의 손익구조



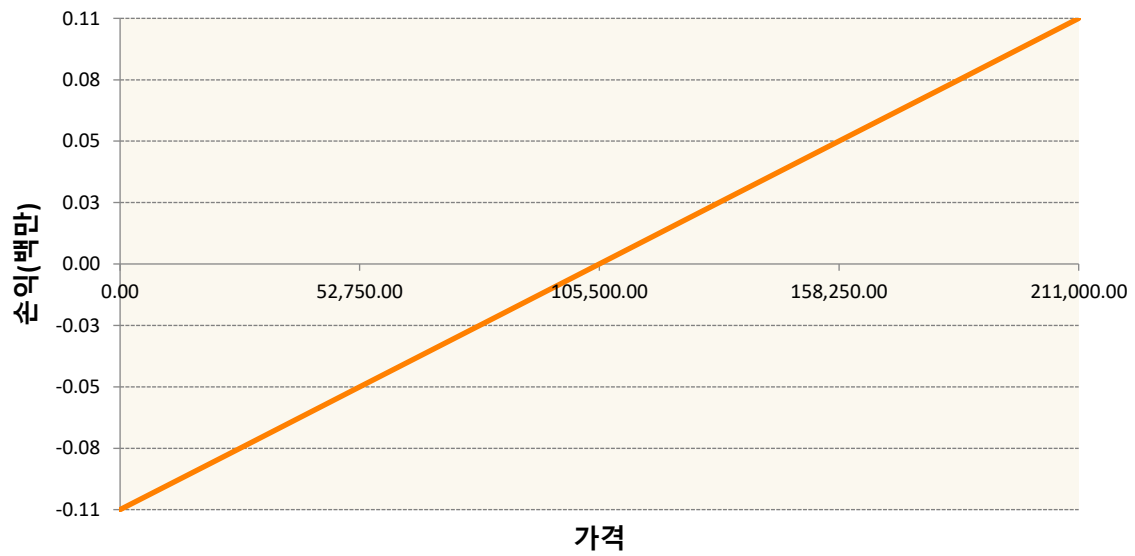
KR41CDW90007-2025-09 HD현대미포개별선물



KR41FDW90000-2025-09 HD현대중공업개별선물



KR41FVW90002-2025-09 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139W90007							2025-09 HD한국조선해양개별선물		506	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-506	-506	-506	-506	-506	-506	-506			
-5.33%	-337	-337	-337	-337	-337	-337	-337			
-2.67%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	169	169	169	169	169	169	169			
5.33%	337	337	337	337	337	337	337			
8.00%	506	506	506	506	506	506	506			
KR41BFW90004							2025-09 삼성중공업개별선물		483	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-483	-483	-483	-483	-483	-483	-483			
-5.33%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322			
-2.67%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	161	161	161	161	161	161	161			
5.33%	322	322	322	322	322	322	322			
8.00%	483	483	483	483	483	483	483			
KR41CDW90007							2025-09 HD현대미포개별선물		328	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-328	-328	-328	-328	-328	-328	-328			
-5.33%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219			
-2.67%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	109	109	109	109	109	109	109			
5.33%	219	219	219	219	219	219	219			
8.00%	328	328	328	328	328	328	328			
KR41FDW90000							2025-09 HD현대중공업개별선물		390	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-390	-390	-390	-390	-390	-390	-390			
-5.33%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260			
-2.67%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	130	130	130	130	130	130	130			
5.33%	260	260	260	260	260	260	260			
8.00%	390	390	390	390	390	390	390			
KR41FVW90002							2025-09 한화오션개별선물		689	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-689	-689	-689	-689	-689	-689	-689
-5.33%	-459	-459	-459	-459	-459	-459	-459
-2.67%	-230	-230	-230	-230	-230	-230	-230
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	230	230	230	230	230	230	230
5.33%	459	459	459	459	459	459	459
8.00%	689	689	689	689	689	689	689

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

(단위:백만원)

1,598

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

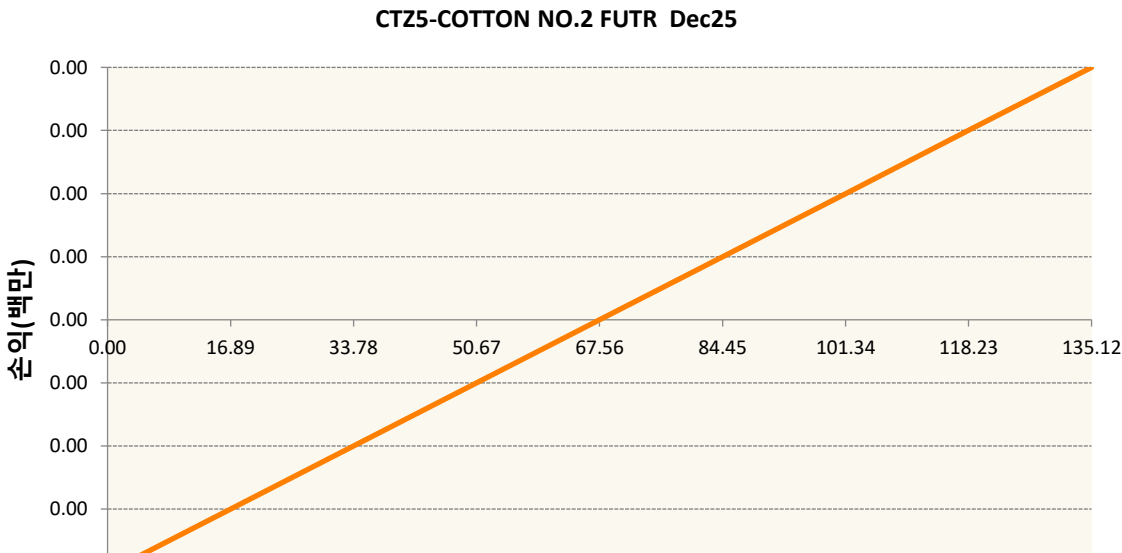
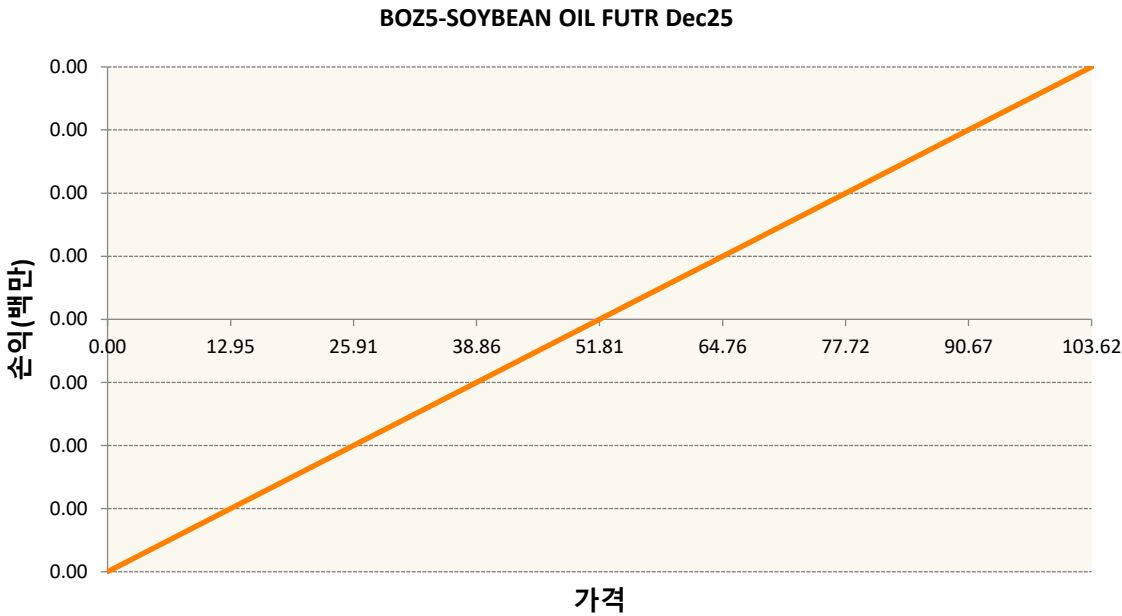
포커스농산물모(채권-파생형)

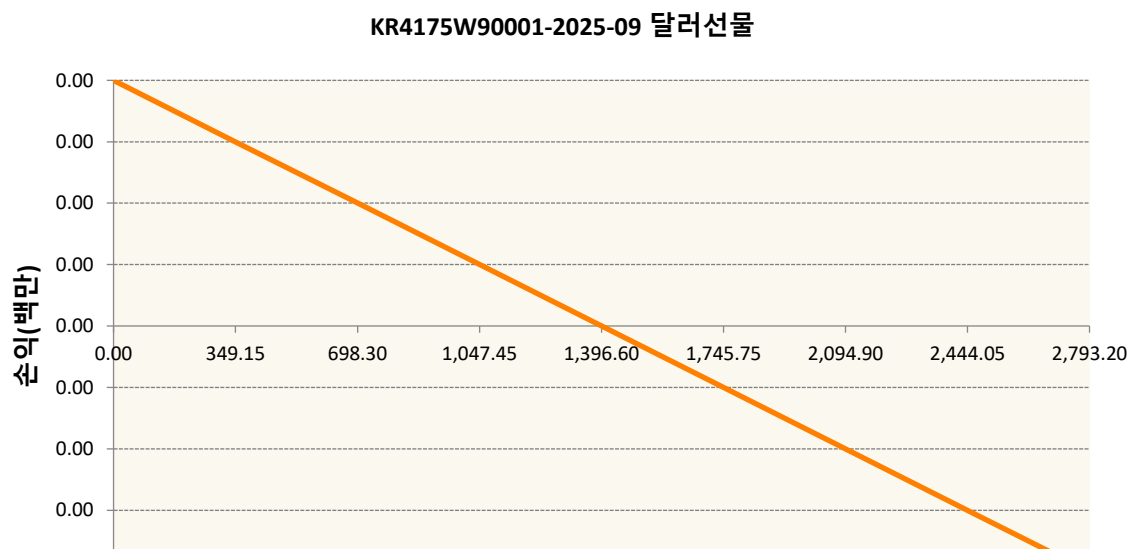
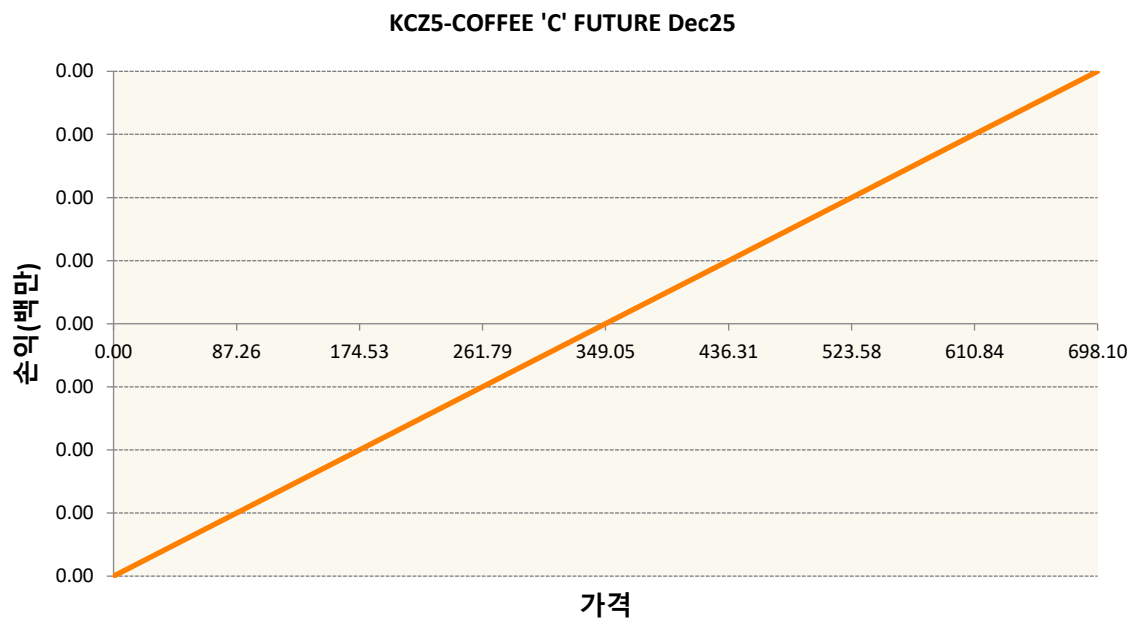
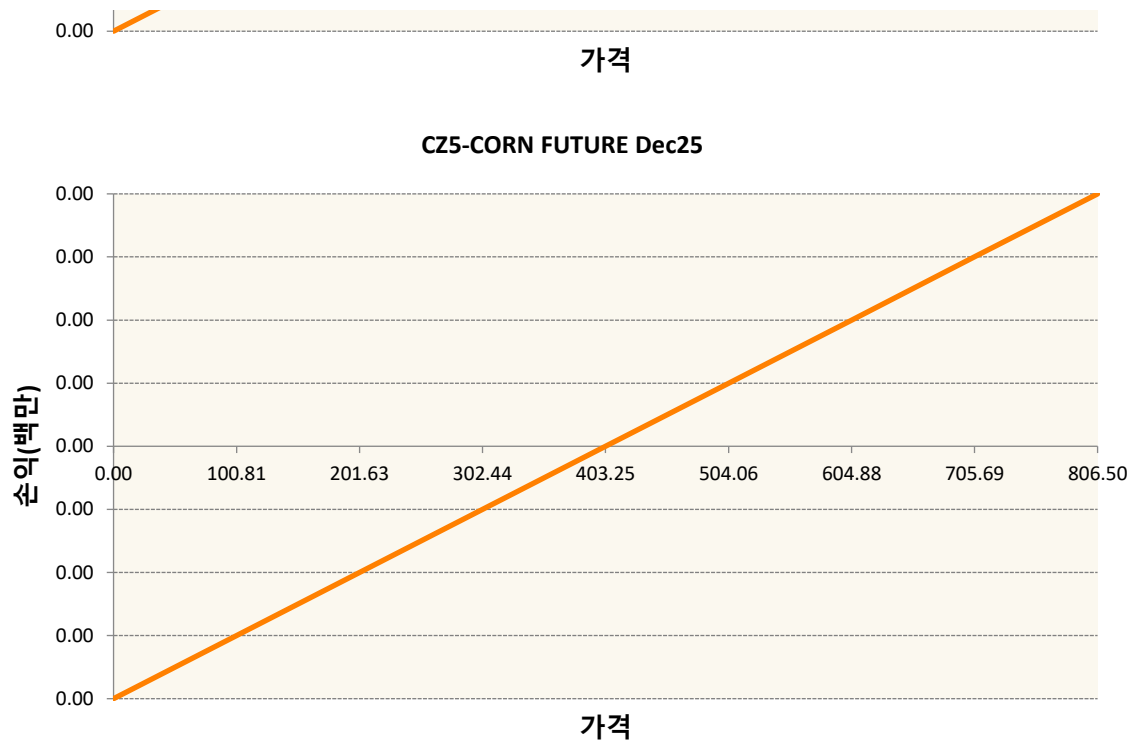
1. 계약금액

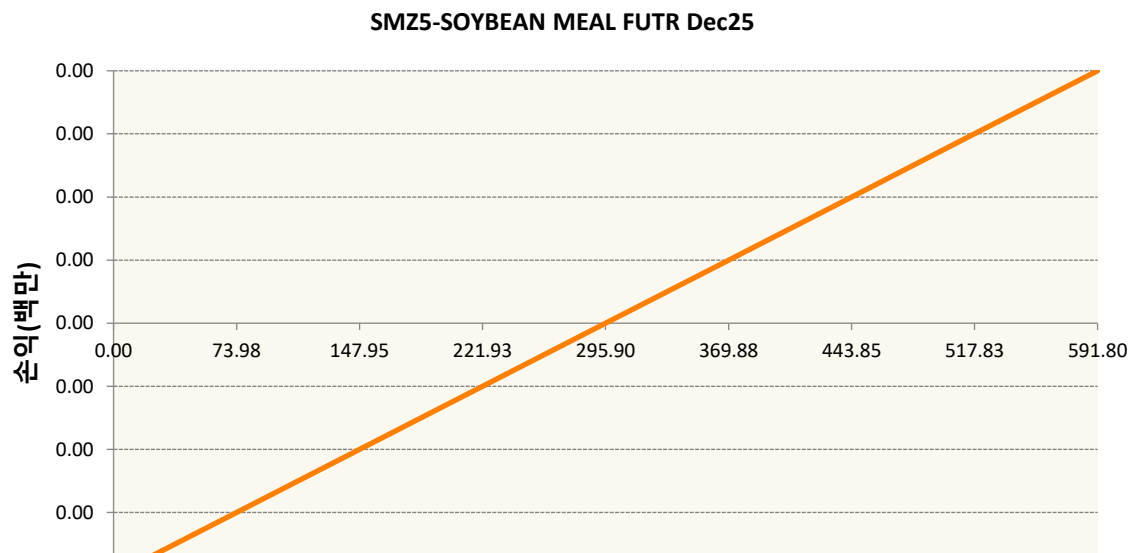
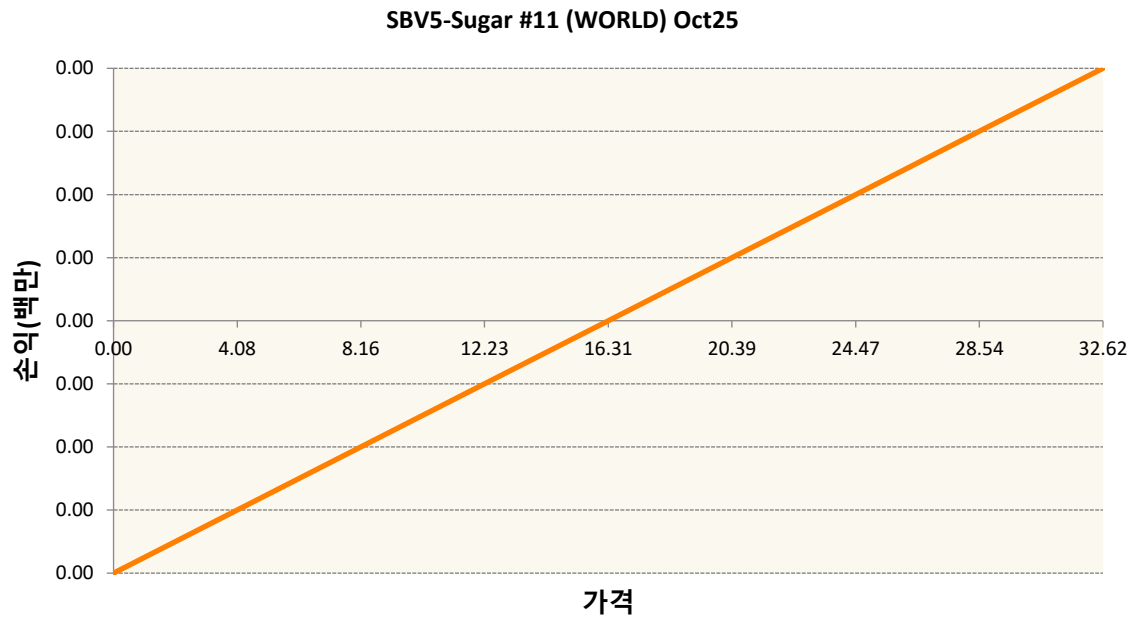
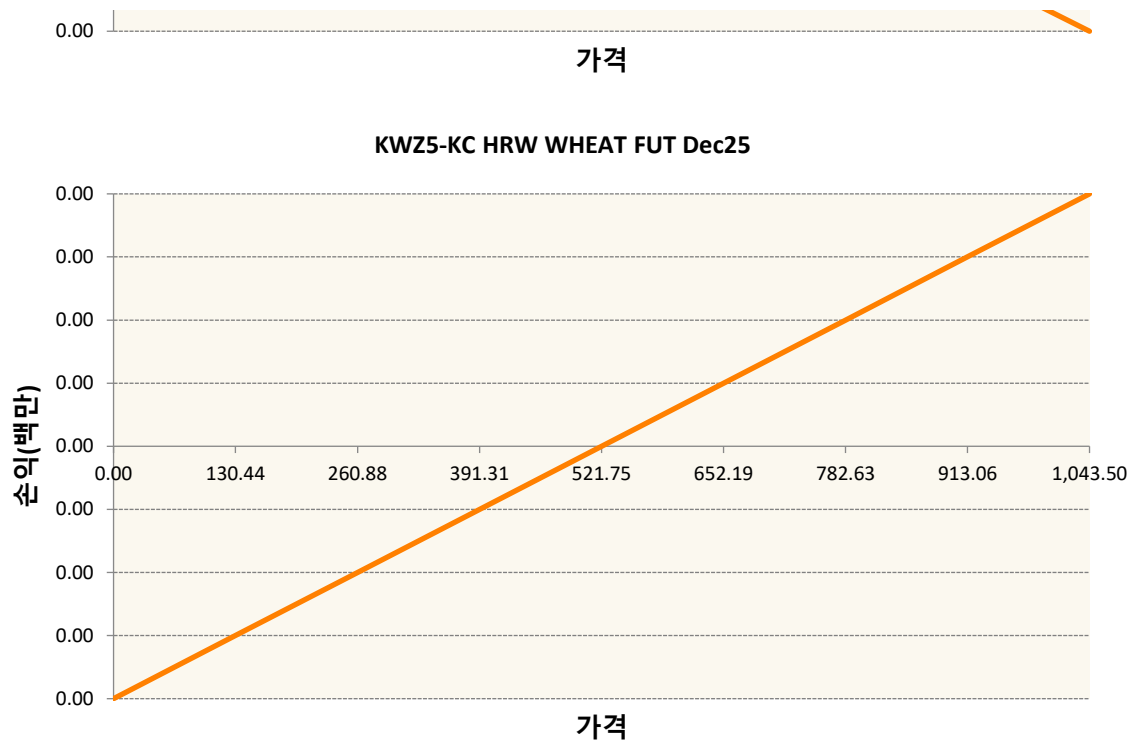
(단위:USD 백만)

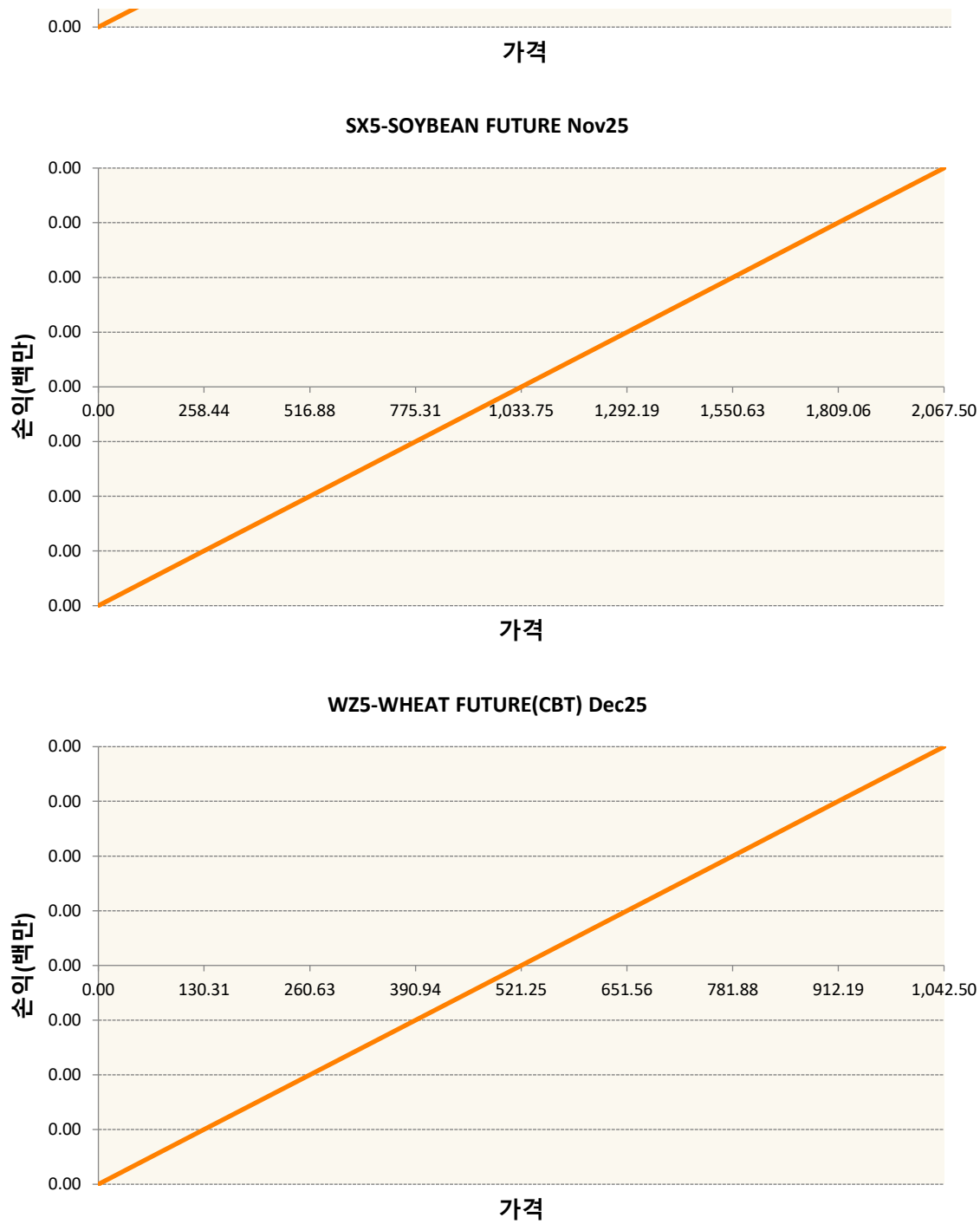
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,181	0	1,181	
누계	유가증권	선물	2,264	0	2,264	
누계	통화	선물	0	321	-321	장내

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	2025-08-21
기준일	2025-08-20

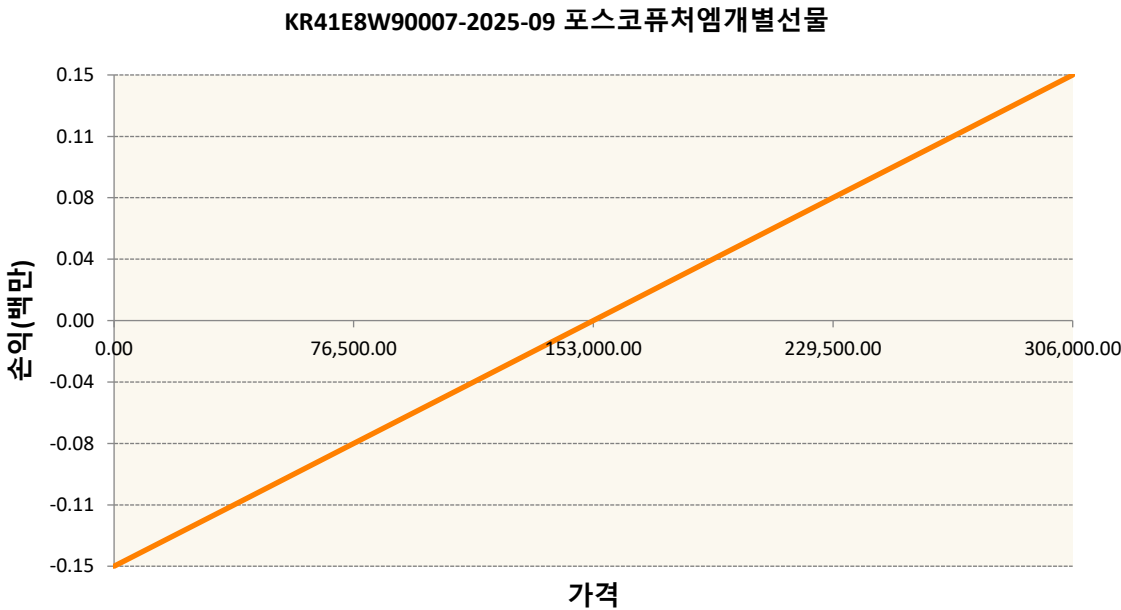
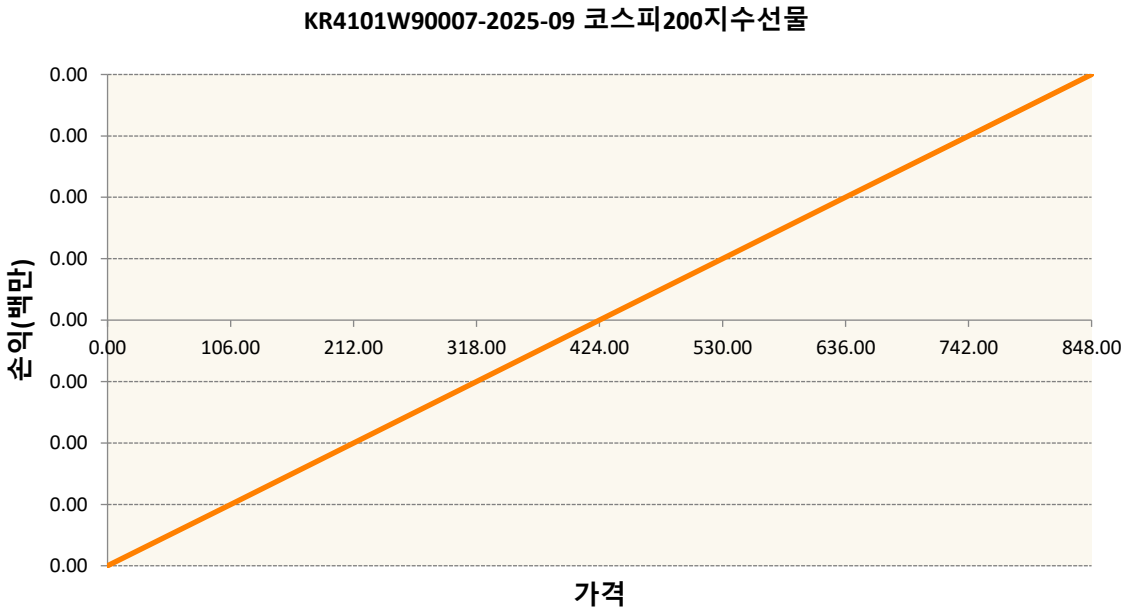
스마트인덱스모

1. 계약금액

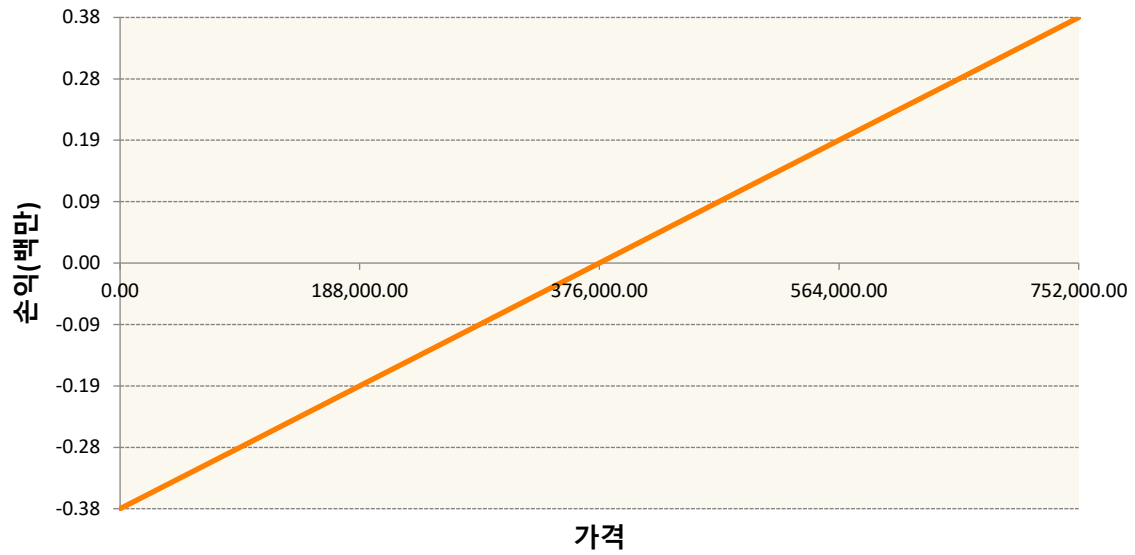
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	726	0	726	장내

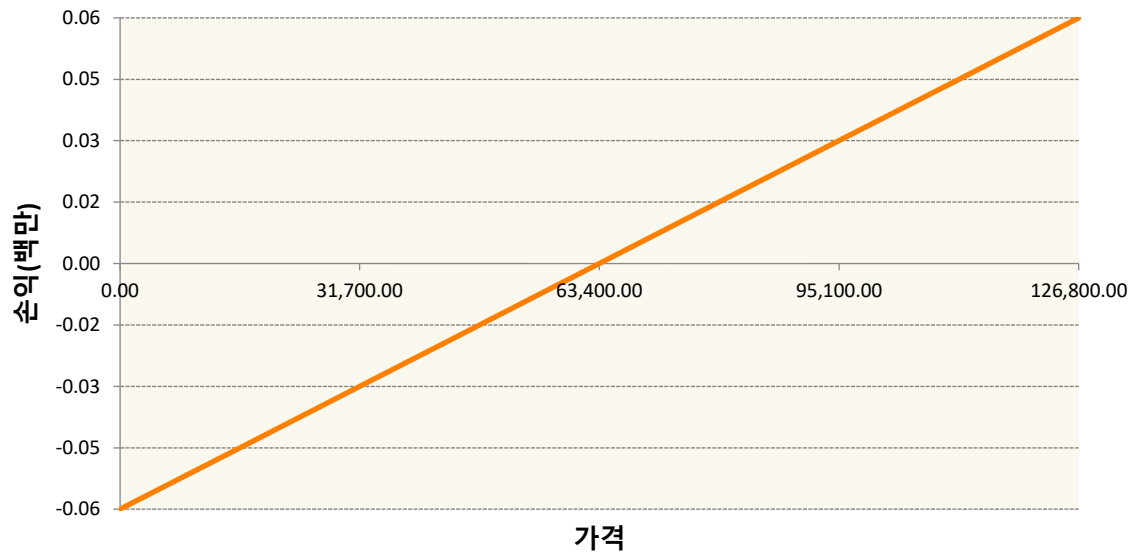
2. 만기시점의 손익구조



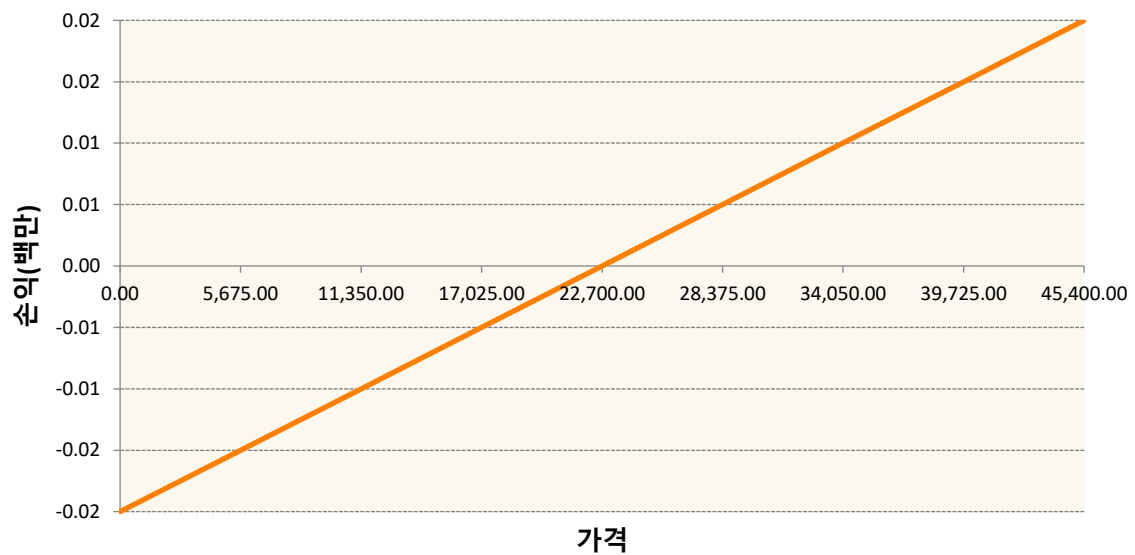
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



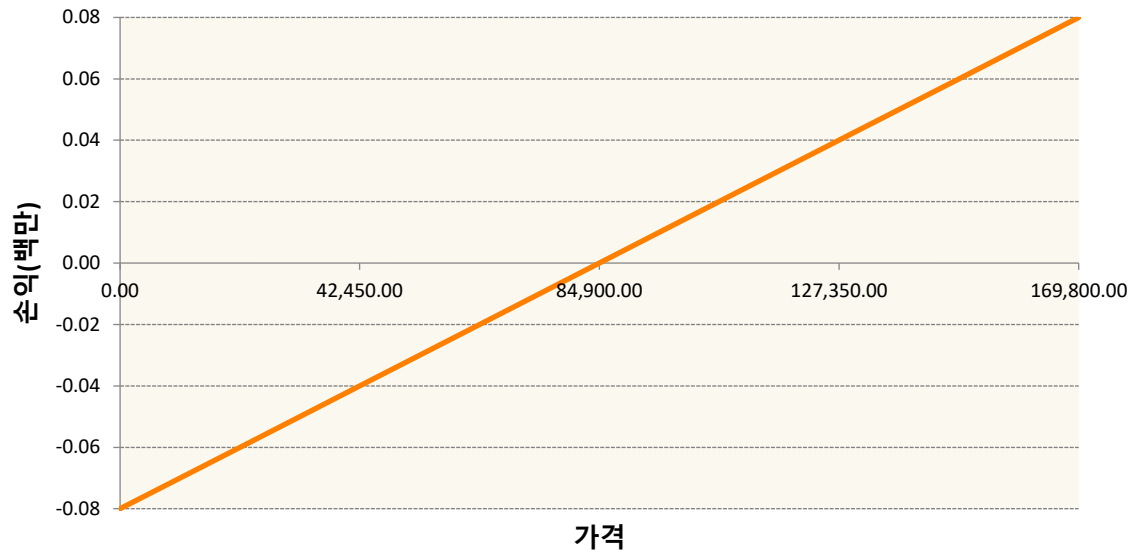
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



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

25
5
15
2
8
2

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

(단위:백만원)

75

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

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	348
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

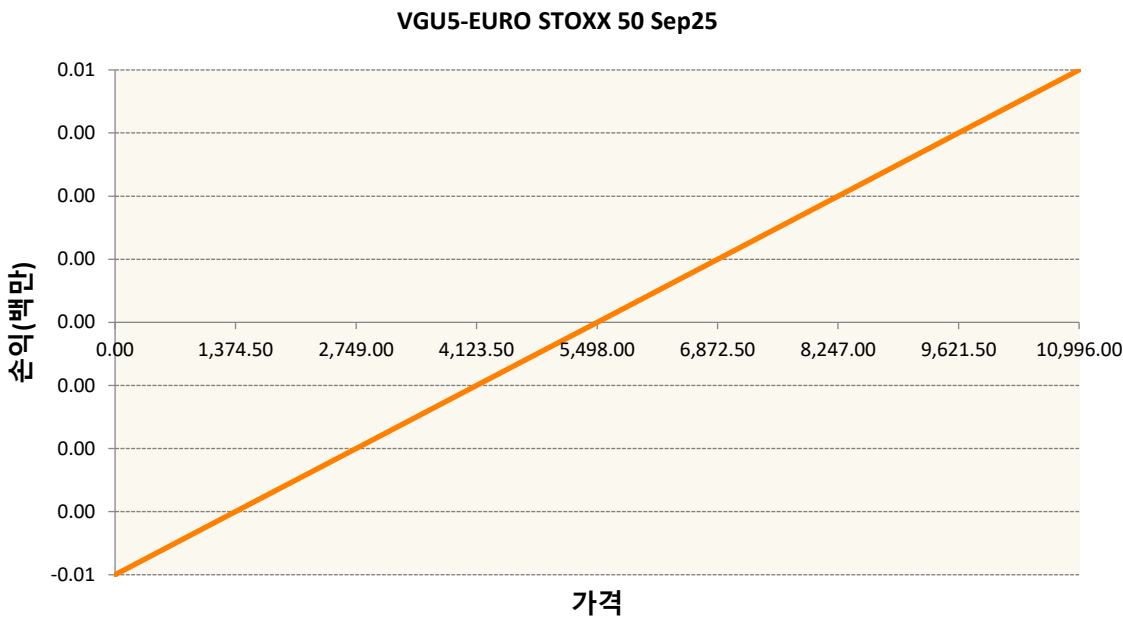
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	783	0	783	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU5	EURO STOXX 50 Sep25	63
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

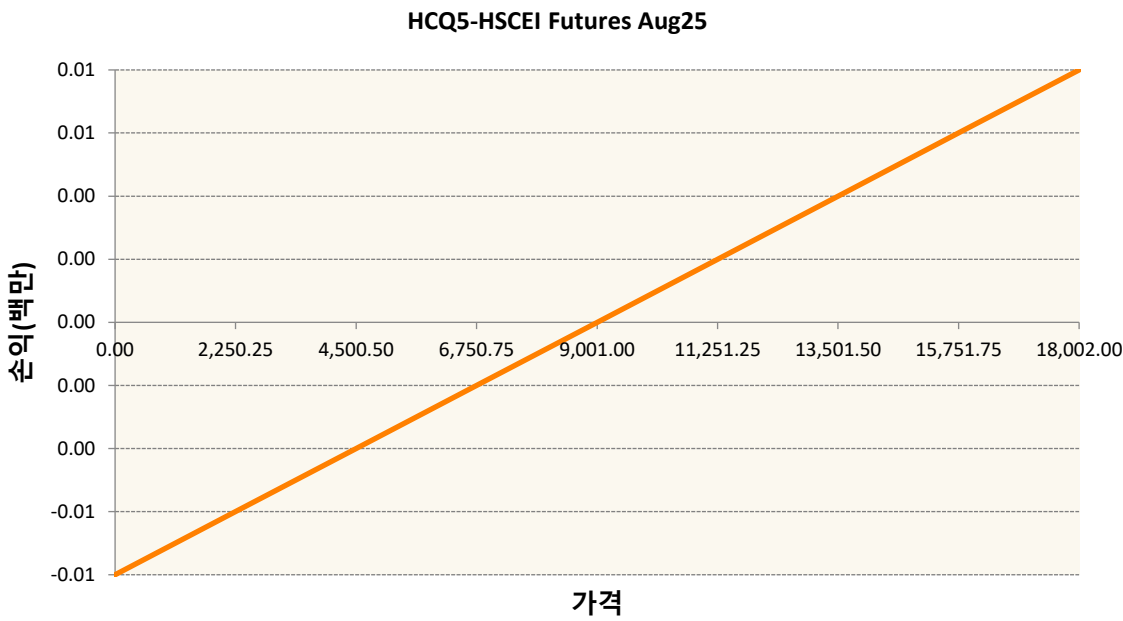
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,073	0	2,073	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

236

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

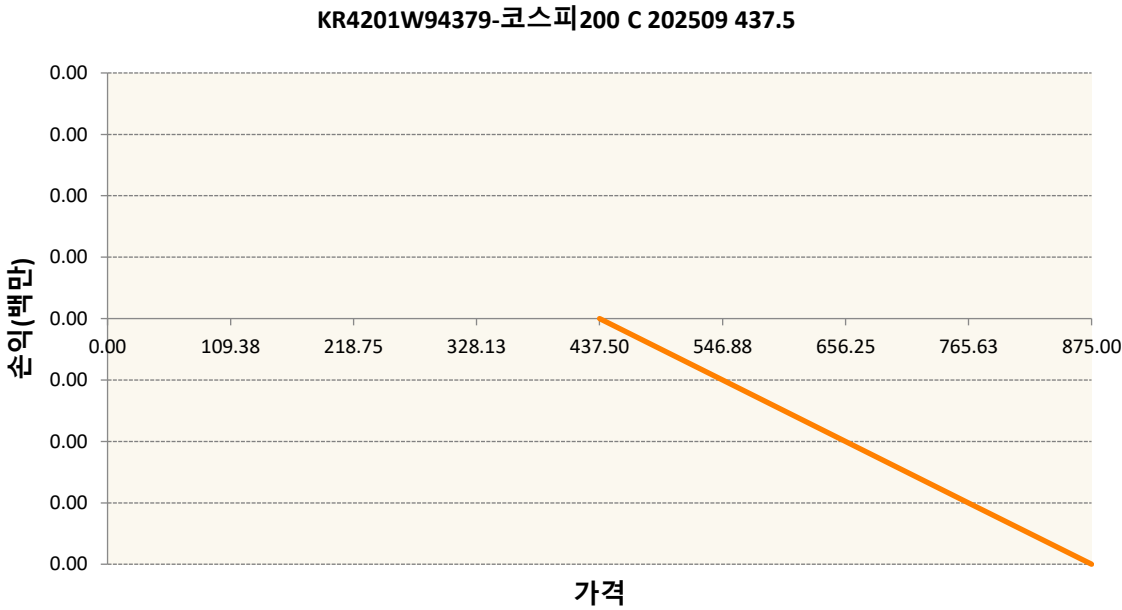
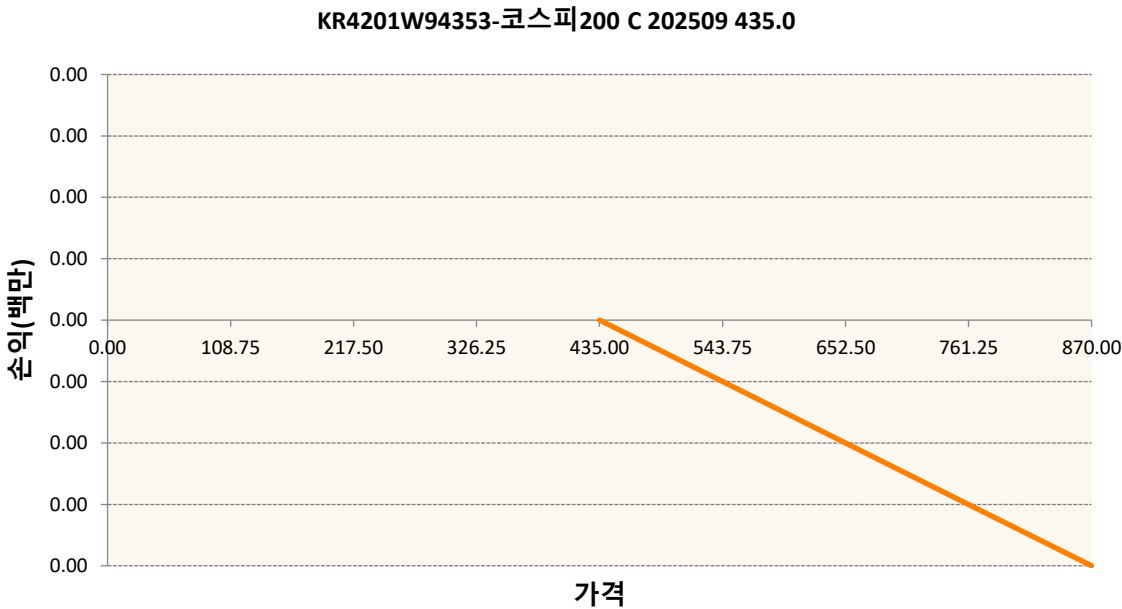
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

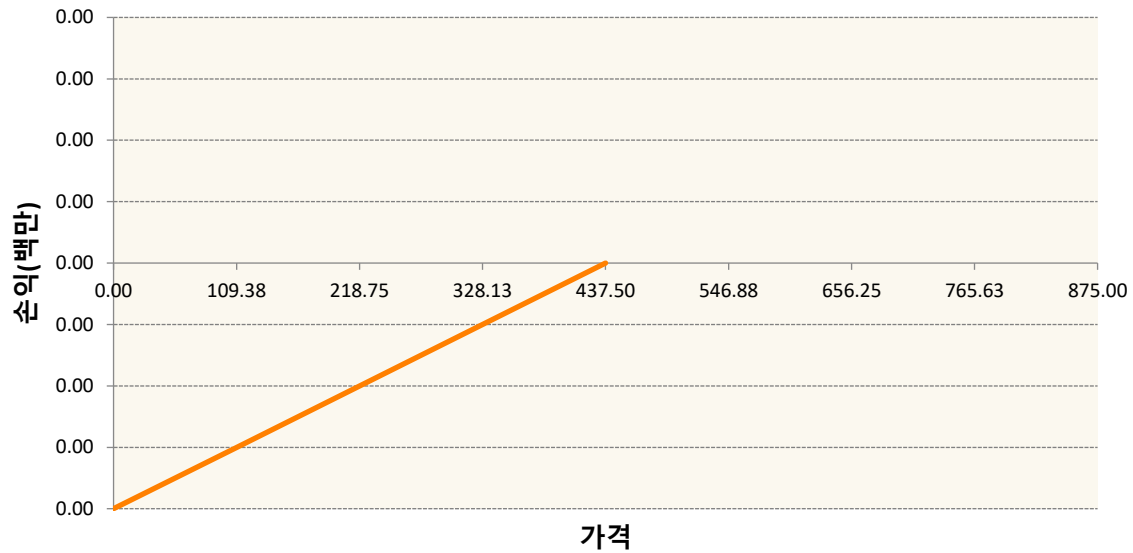
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,144	-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	2025-08-21
기준일	2025-08-20

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	13,271	13,271	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F5V(KRW/USD 29-08-25E	327
FXW213F6SC KRW/USD 29-08-25E	227
FXW213F7W KRW/USD 29-08-25E	374
FXW213F81C USD/KRW 29-08-25E	89
FXW213F87C USD/KRW 29-08-25E	45
FXW213F8KC KRW/USD 29-08-25E	45
FXW213F8KC KRW/USD 29-08-25E	89
FXW213F8KC USD/KRW 29-08-25E	227
FXW213F8KC USD/KRW 29-08-25E	327
FXW213F8KC USD/KRW 29-08-25E	374

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

(단위:백만원)

1,059

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

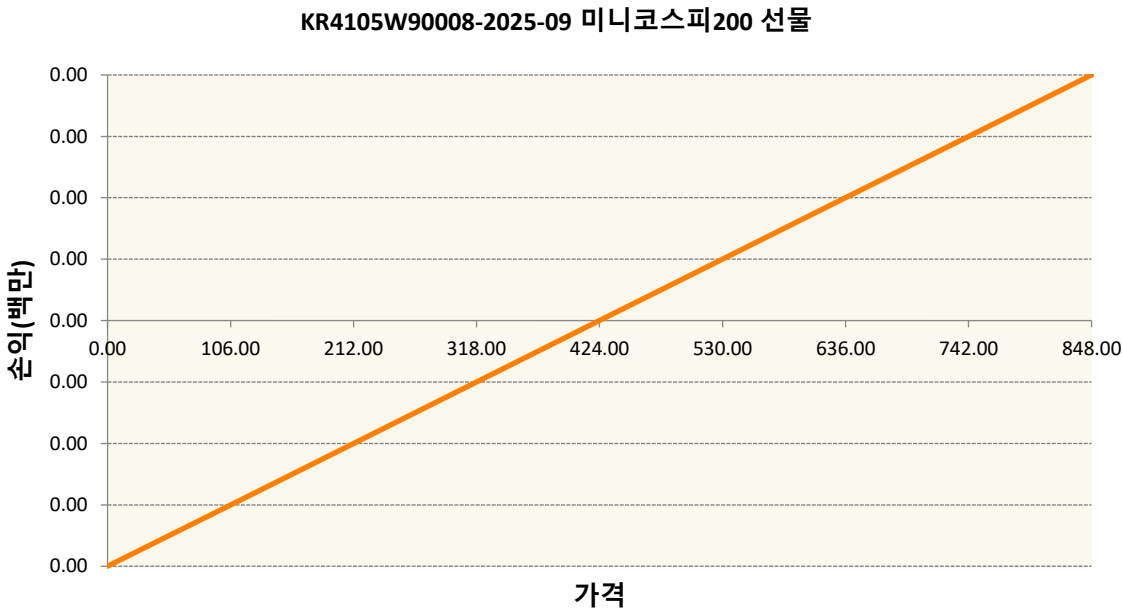
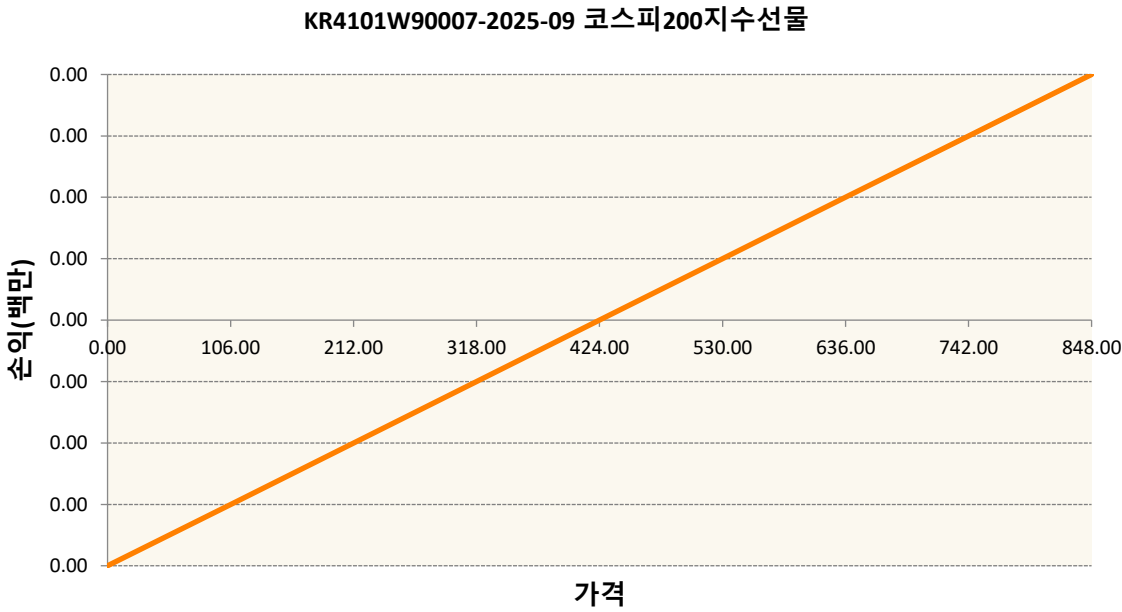
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

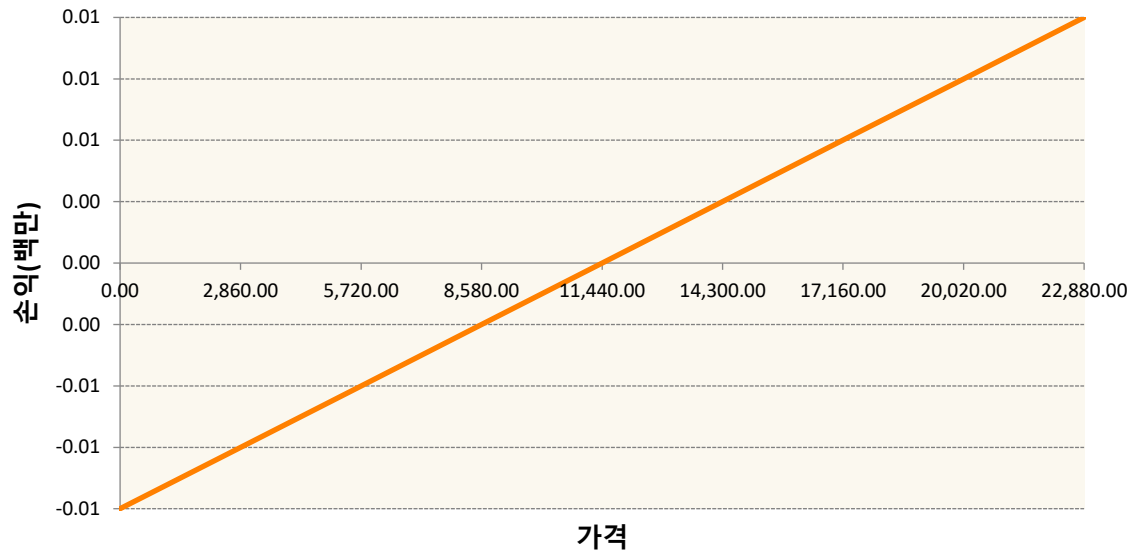
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	829	0	829	장내

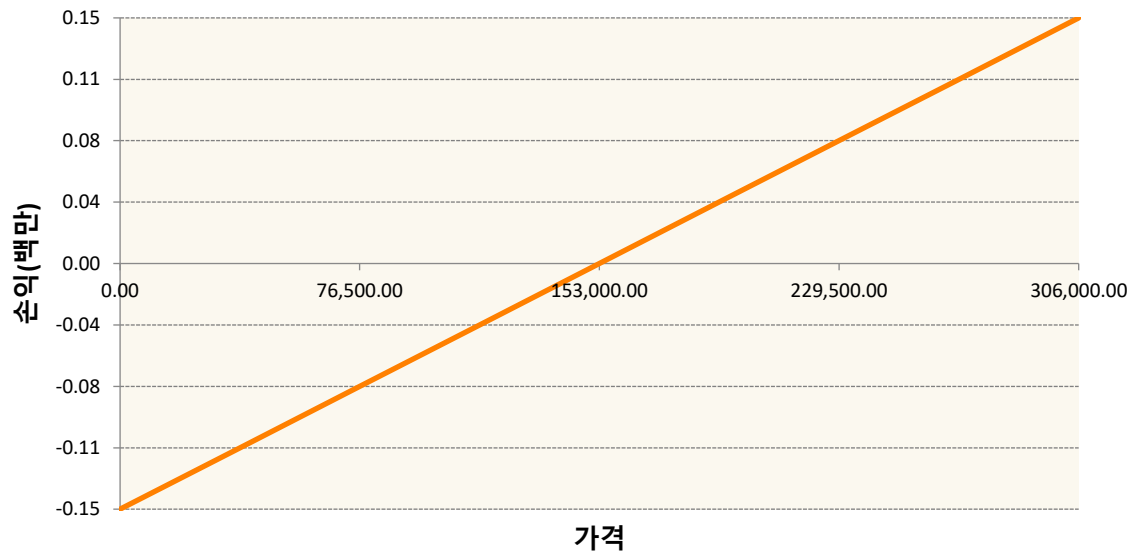
2. 만기시점의 손익구조



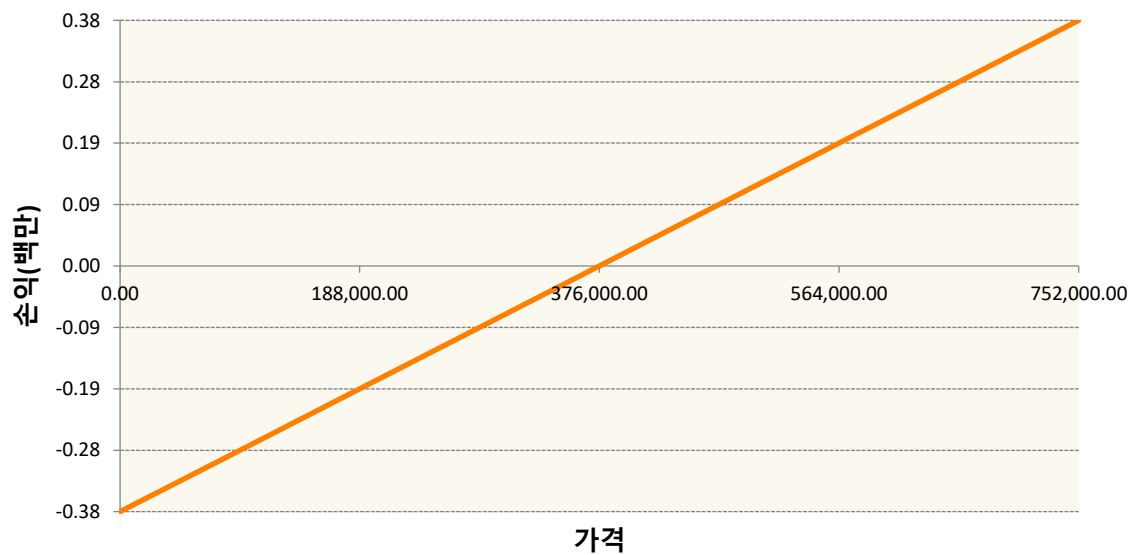
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



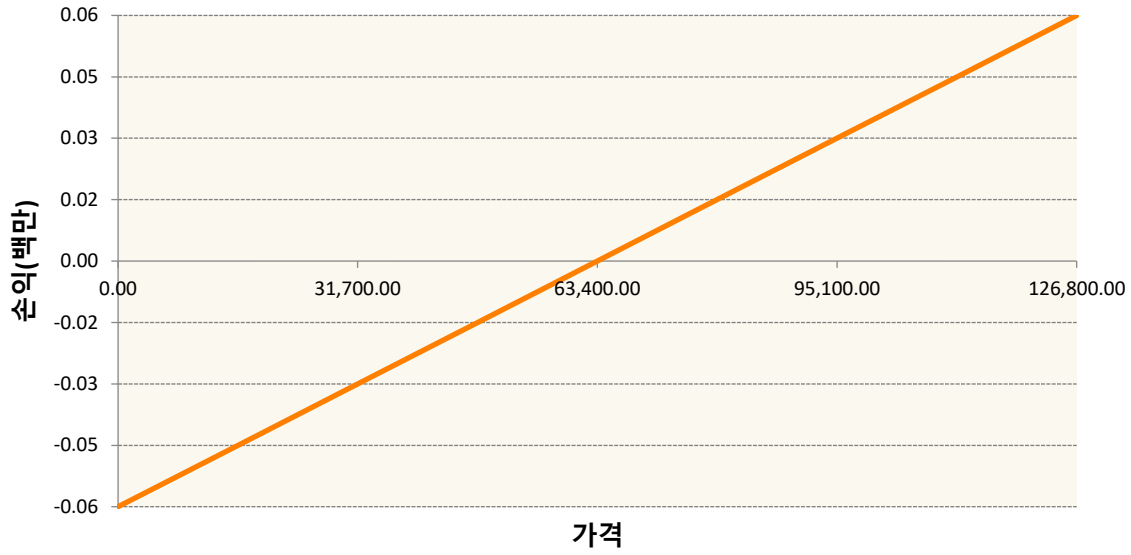
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



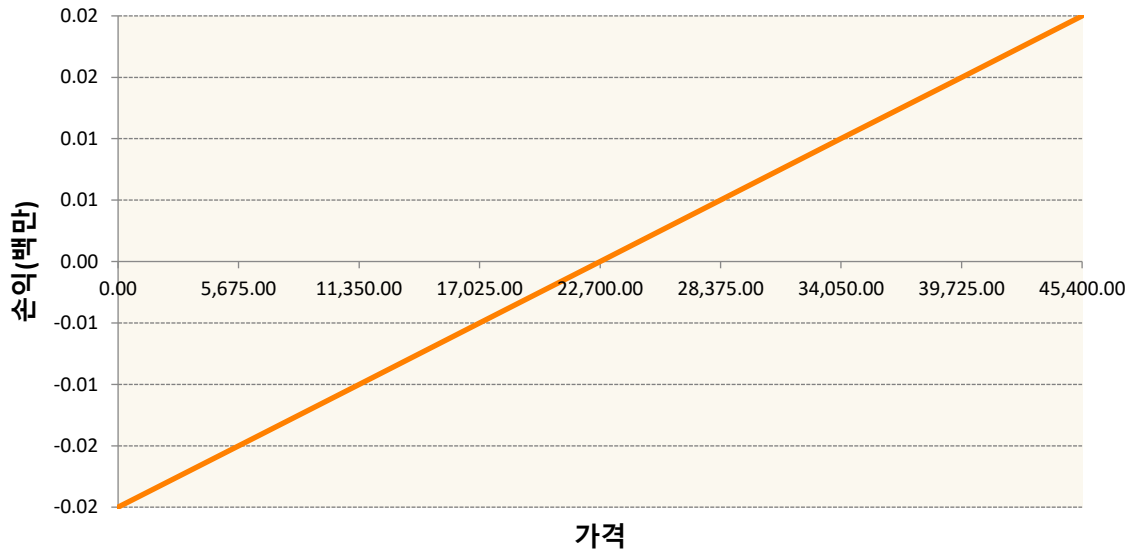
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



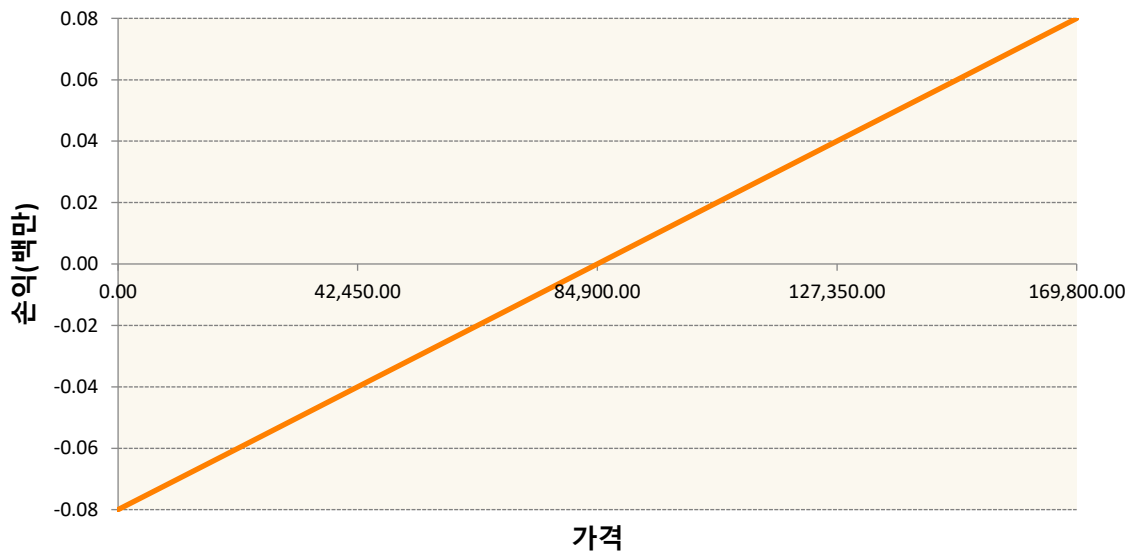
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	25
KR4105W90(2025-09 미니코스피200 선물	5
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)

35

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

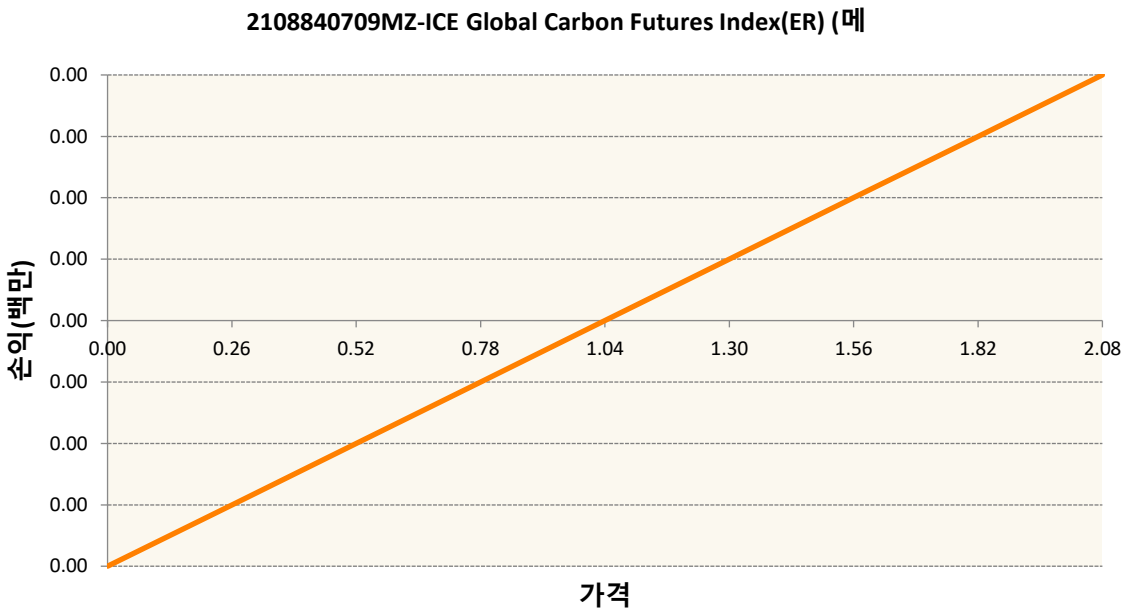
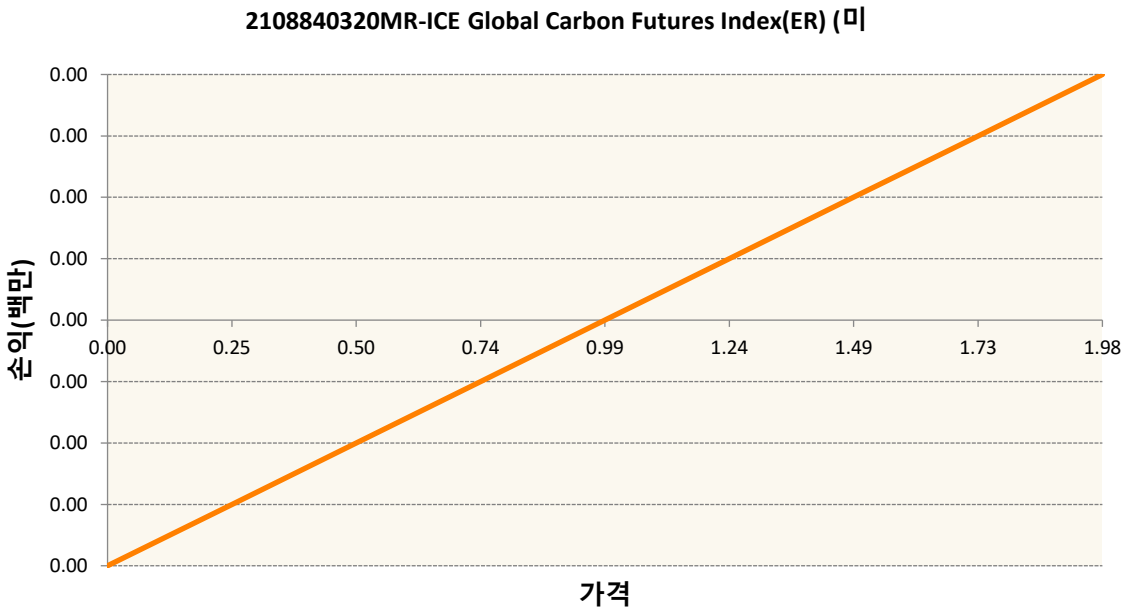
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	1,254	0	1,254	장외
누계	유가증권	선물	7,466	0	7,466	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	599
2108840709	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	756

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

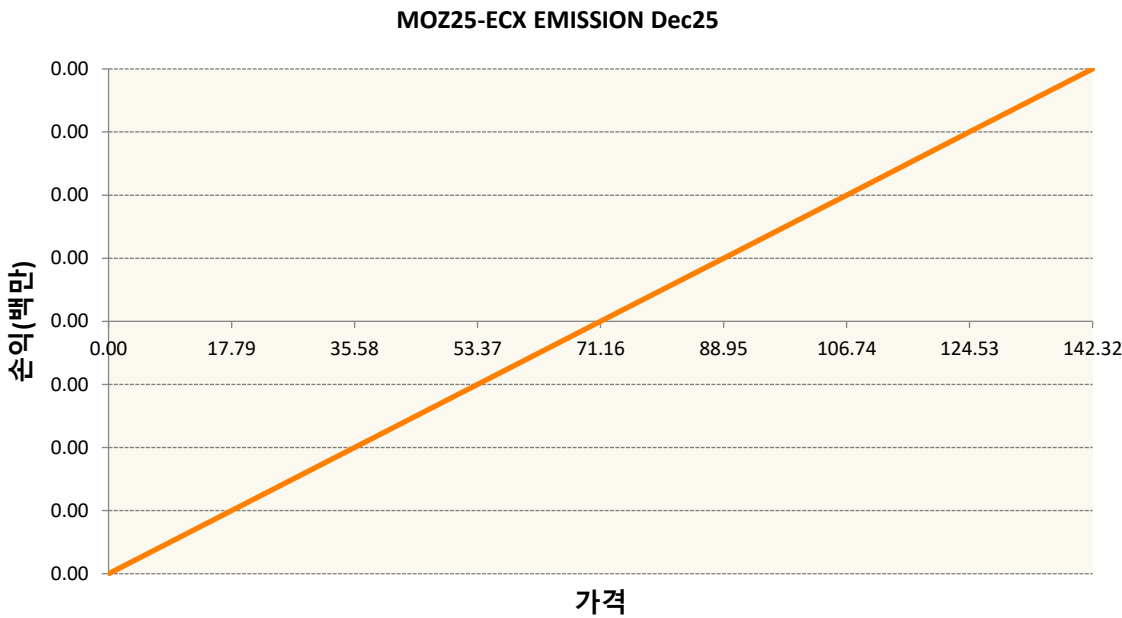
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,255	0	6,255	
누계	유가증권	선물	-20	0	-20	장외
누계	통화	선도	0	1,361	-1,361	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index	1
FXW213F7W KRW/EUR 29-08-25E	109
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	500

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

(단위:백만원)

848

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

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)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	12
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	13

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

(단위:백만원)

102

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

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)	29
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	35
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	25
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	7

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

(단위:백만원)

164

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

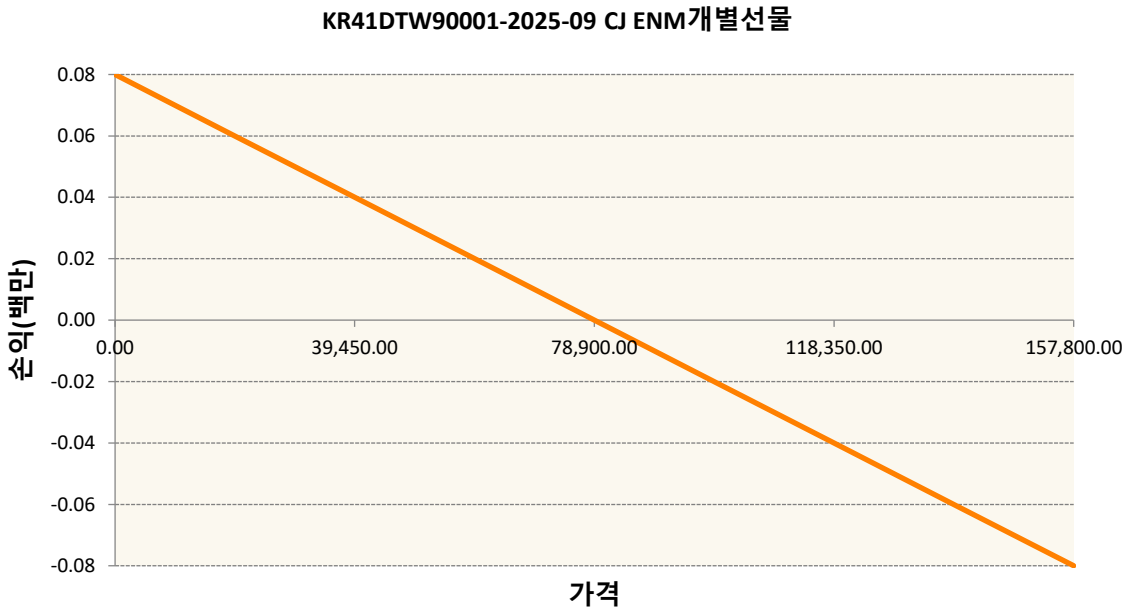
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR41DTW90 2025-09 CJ ENM개별선물

0.32

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

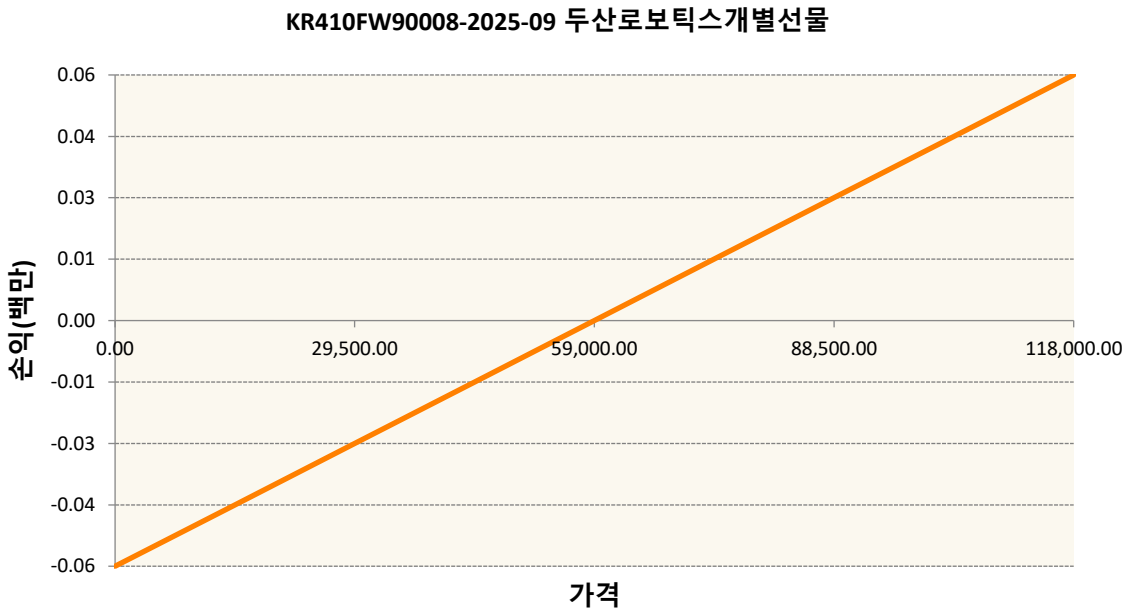
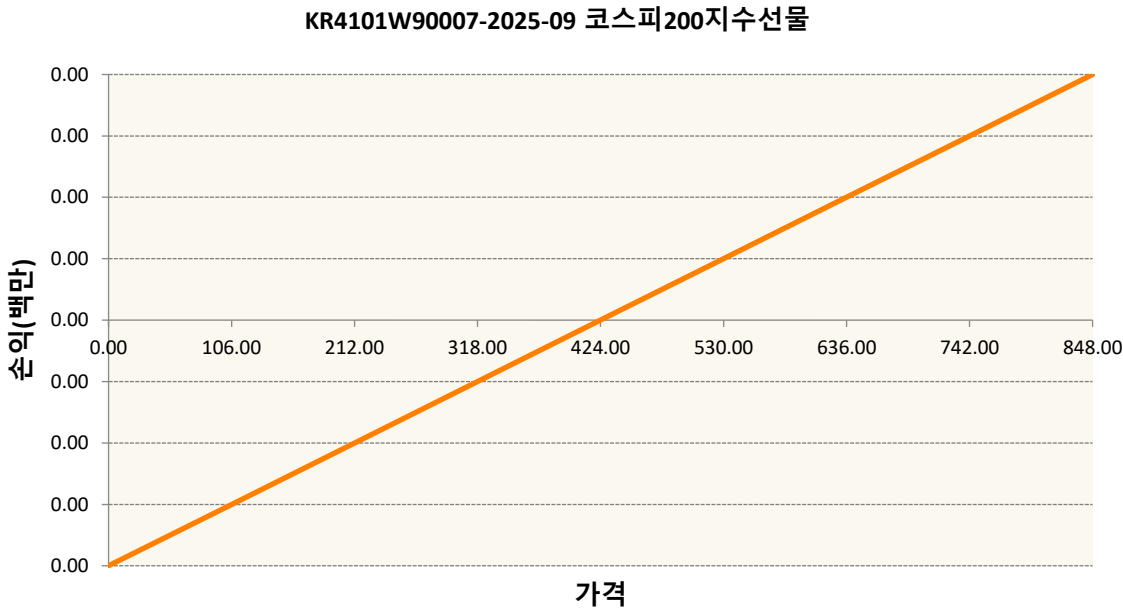
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

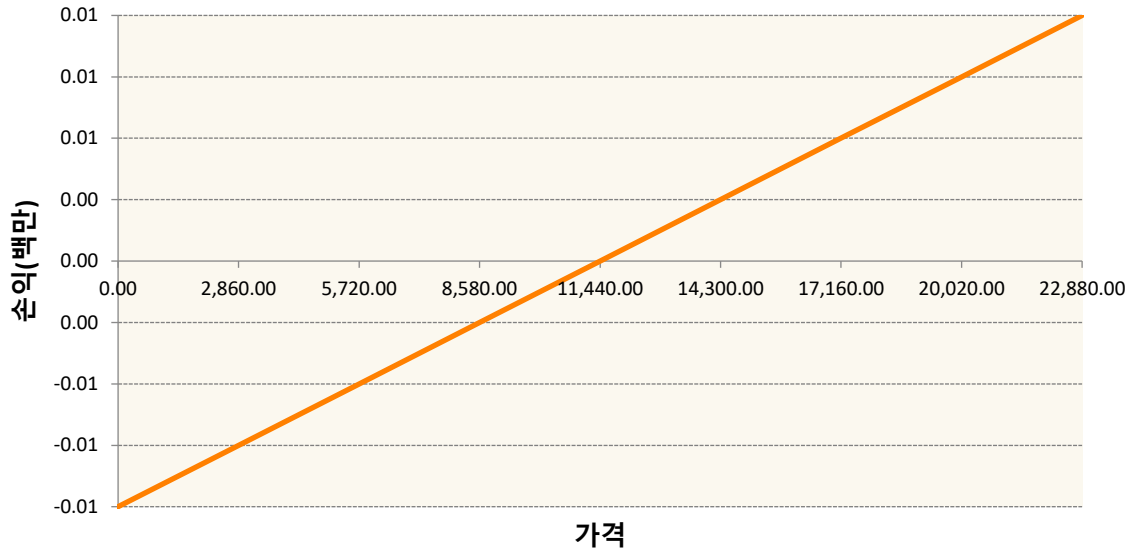
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,269	634	635	장내
누계	유가증권	선물	11,134	0	11,134	장내

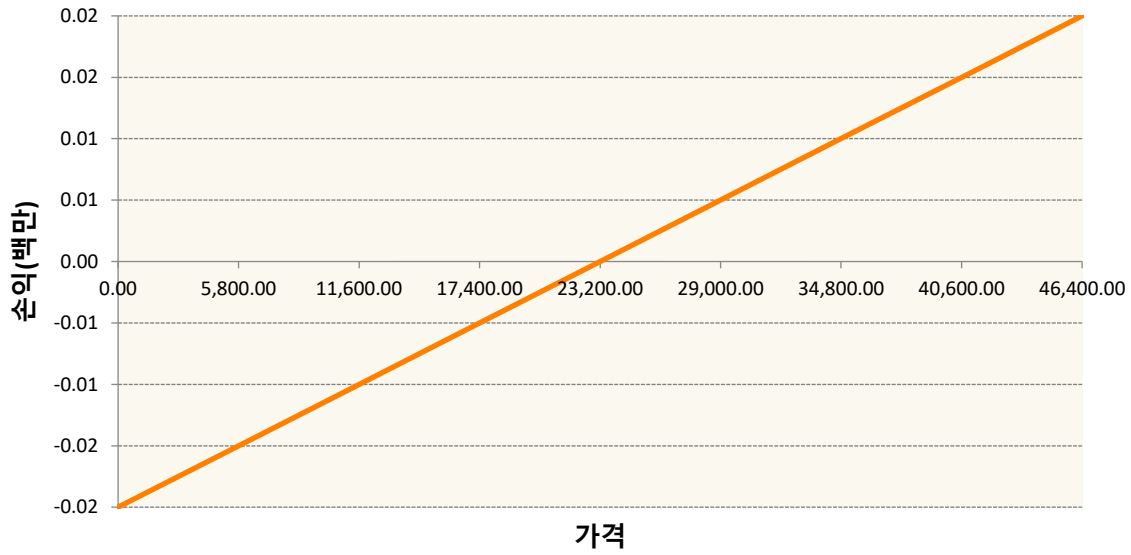
2. 만기시점의 손익구조



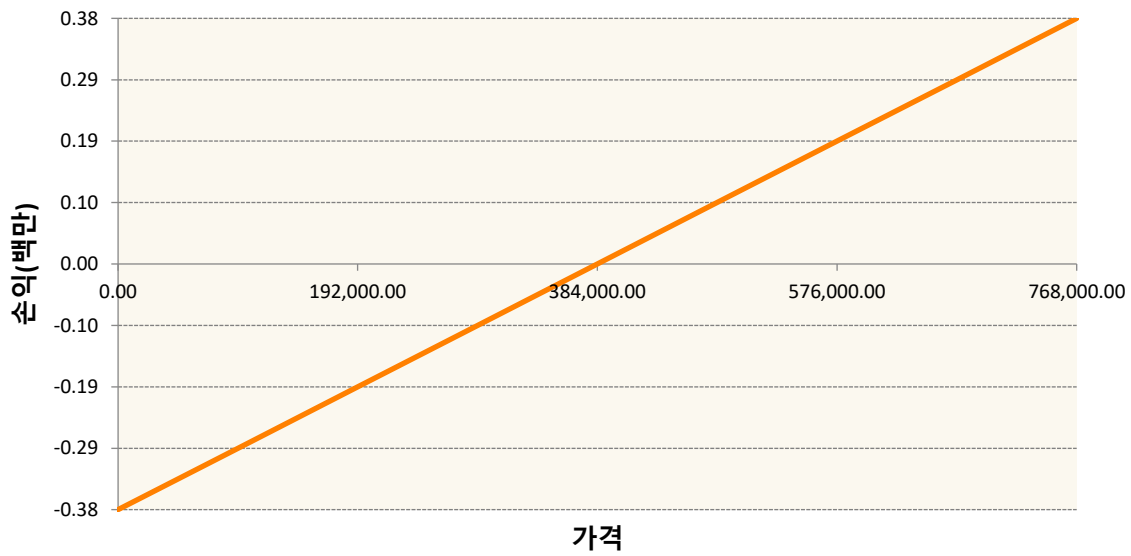
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



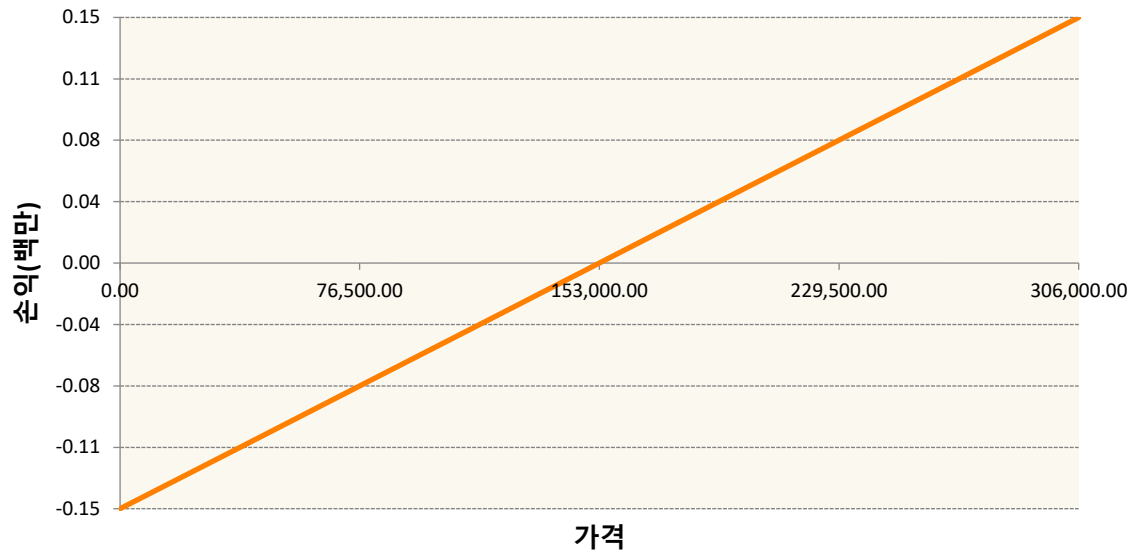
KR41CNW90006-2025-09 포스코DX개별선물



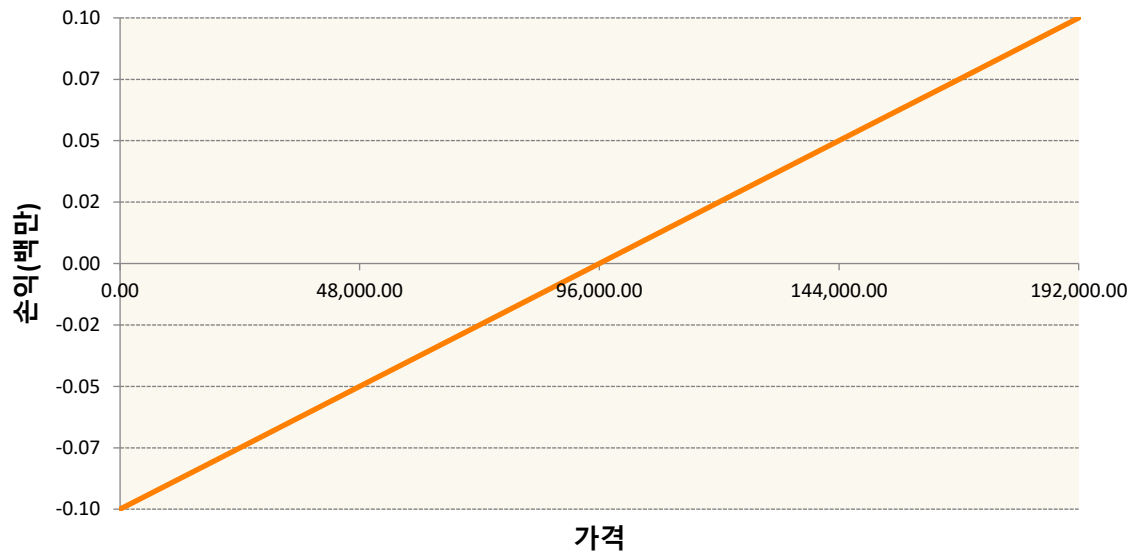
KR41DAW90001-2025-09 농심개별선물



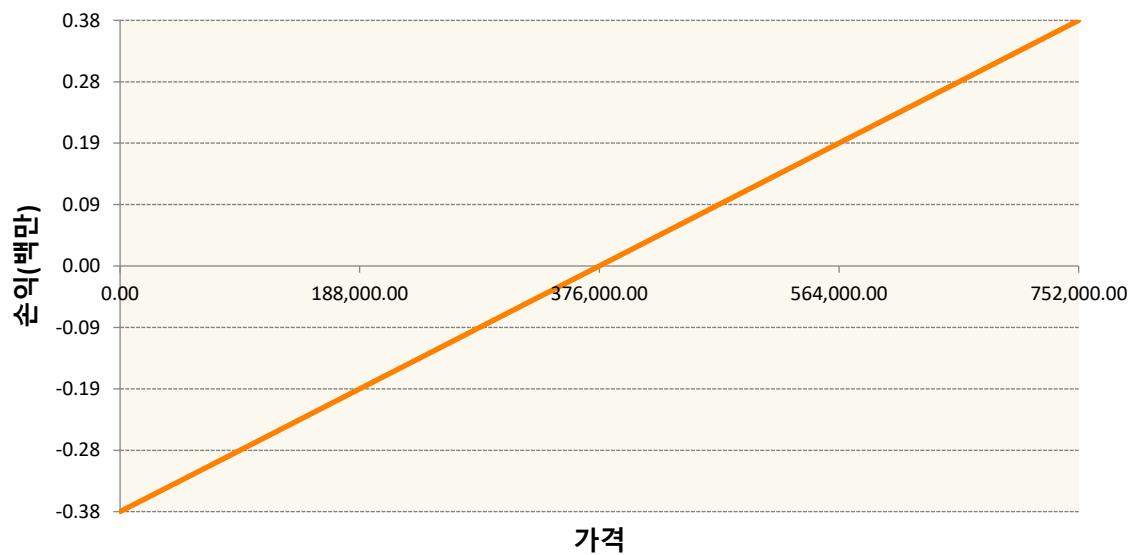
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



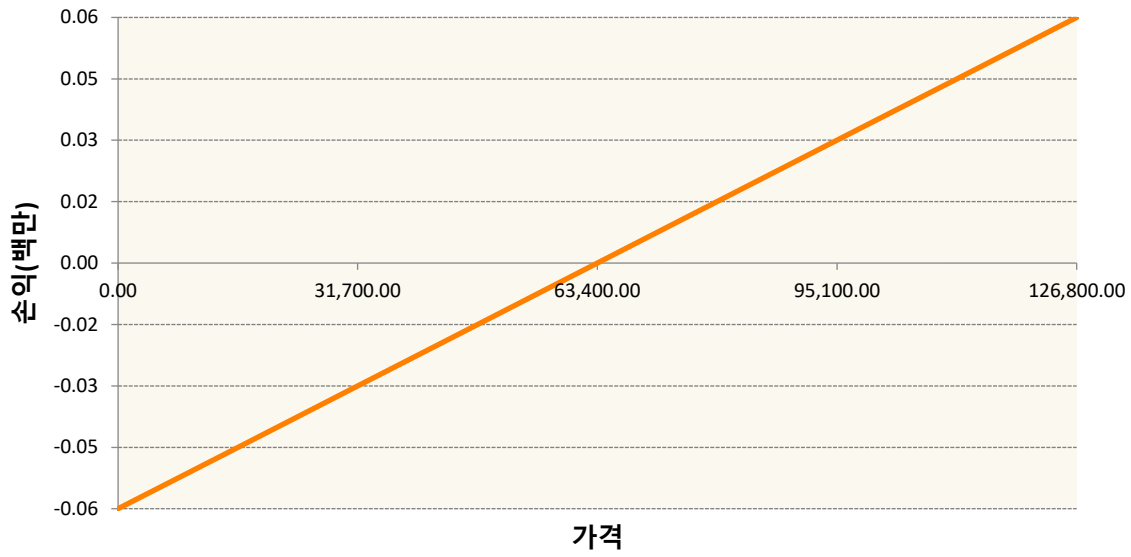
KR41EJW90000-2025-09 SKC개별선물



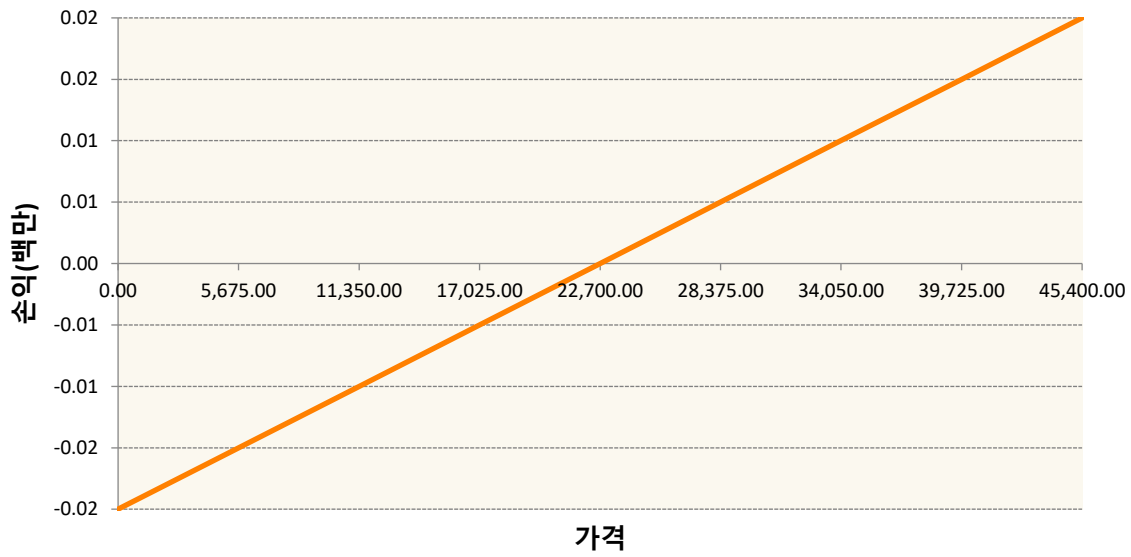
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



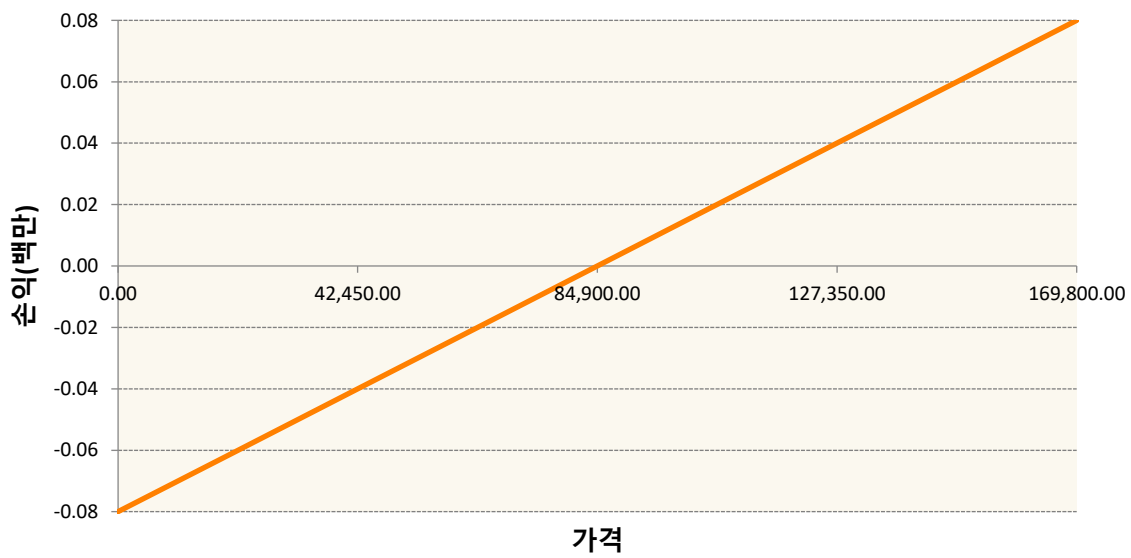
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



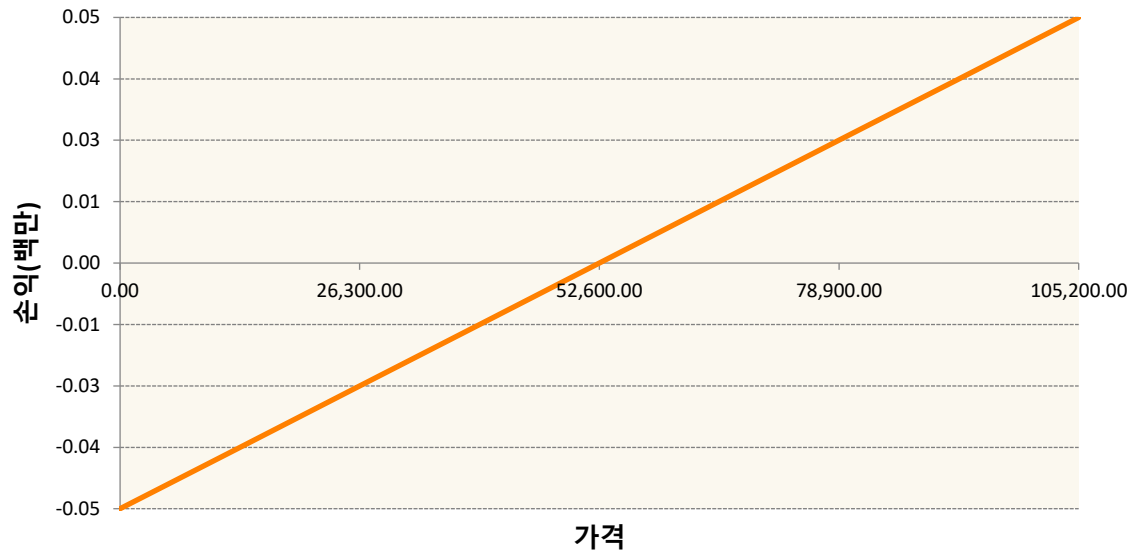
KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



KR41GZW90001-2025-09 에코프로머티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	712
KR410FW90(2025-09 두산로보틱스개별선물	1
KR4145W90(2025-09 LG디스플레이개별선물	23
KR41CNW90 2025-09 포스코DX개별선물	13
KR41DAW90 2025-09 농심개별선물	4
KR41E8W90(2025-09 포스코퓨처엠개별선물	43
KR41EJW900 2025-09 SKC개별선물	19
KR41F5W90(2025-09 LG에너지솔루션개별선물	14
KR41F7W90(2025-09 카카오페이개별선물	18
KR41FAW90(2025-09 HMM개별선물	9
KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물	22
KR41GZW90 2025-09 에코프로머티개별선물	13

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

(단위:백만원)

555

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

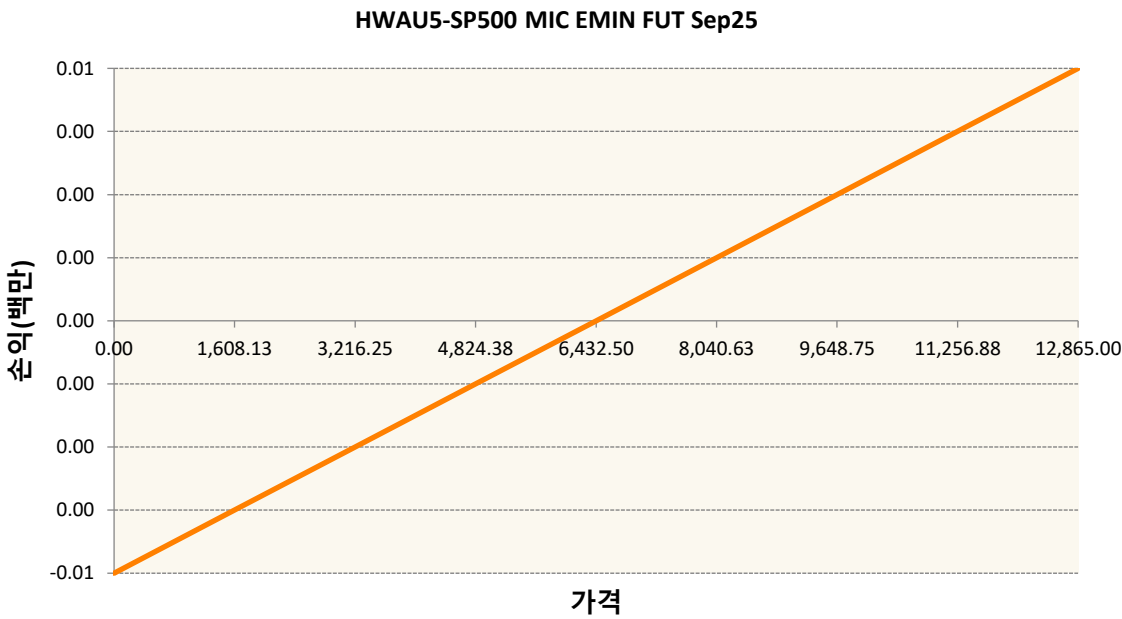
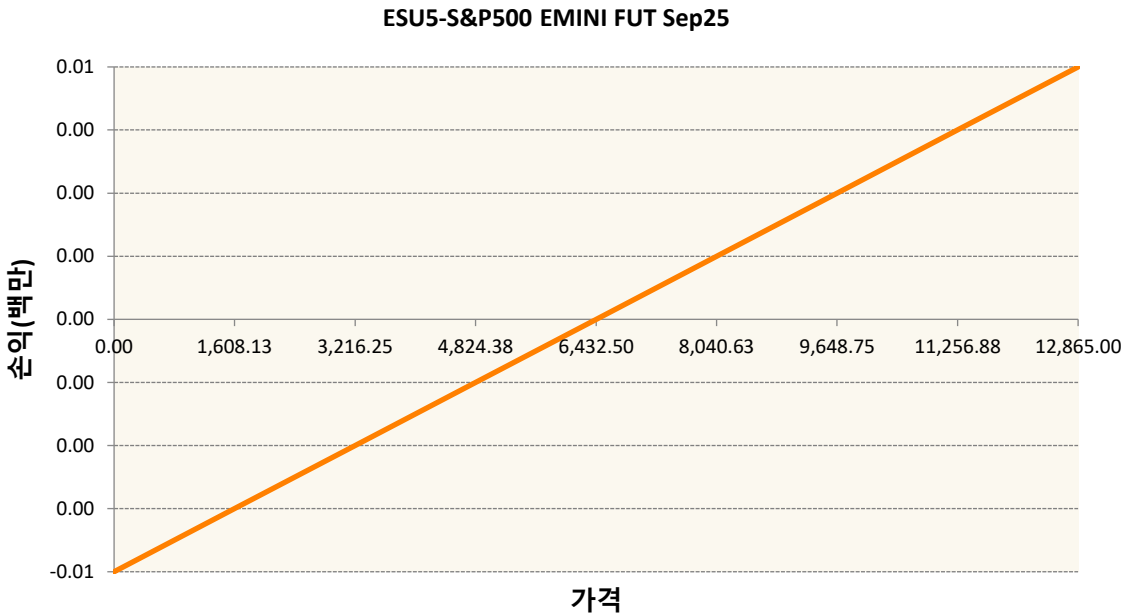
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	32,420	0	32,420	
누계	지수	선물	1,107	0	1,107	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,594
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	89

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,358

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

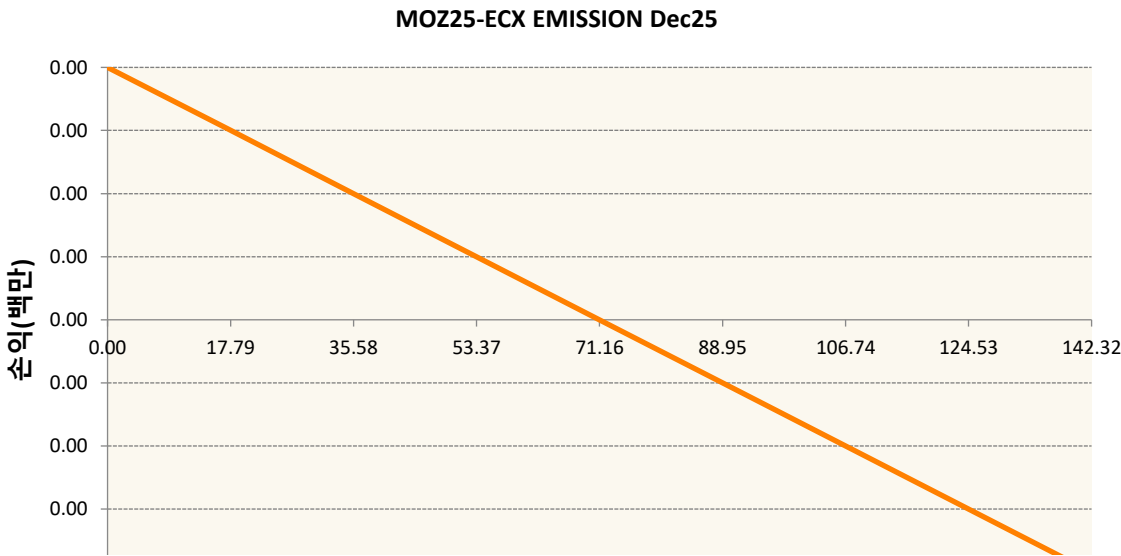
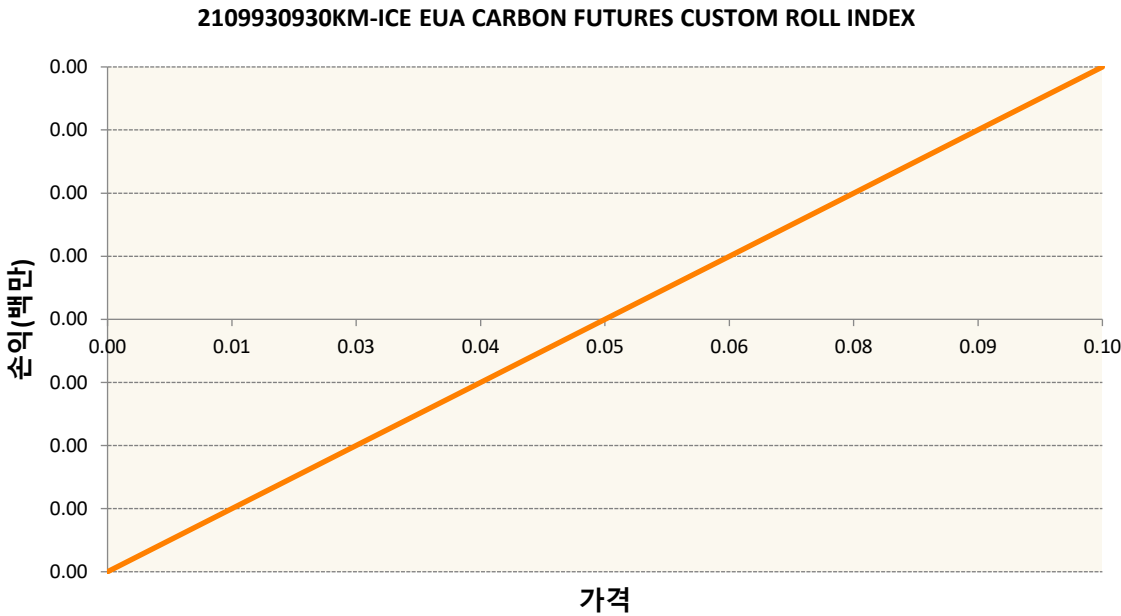
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	5,159	-5,159	
누계	유가증권	선물	20	0	20	장외
누계	통화	선도	0	1,031	-1,031	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F7W KRW/EUR 29-08-25E	1
FXW213F7W KRW/EUR 29-08-25E	82
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	413

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

(단위:백만원)

695

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

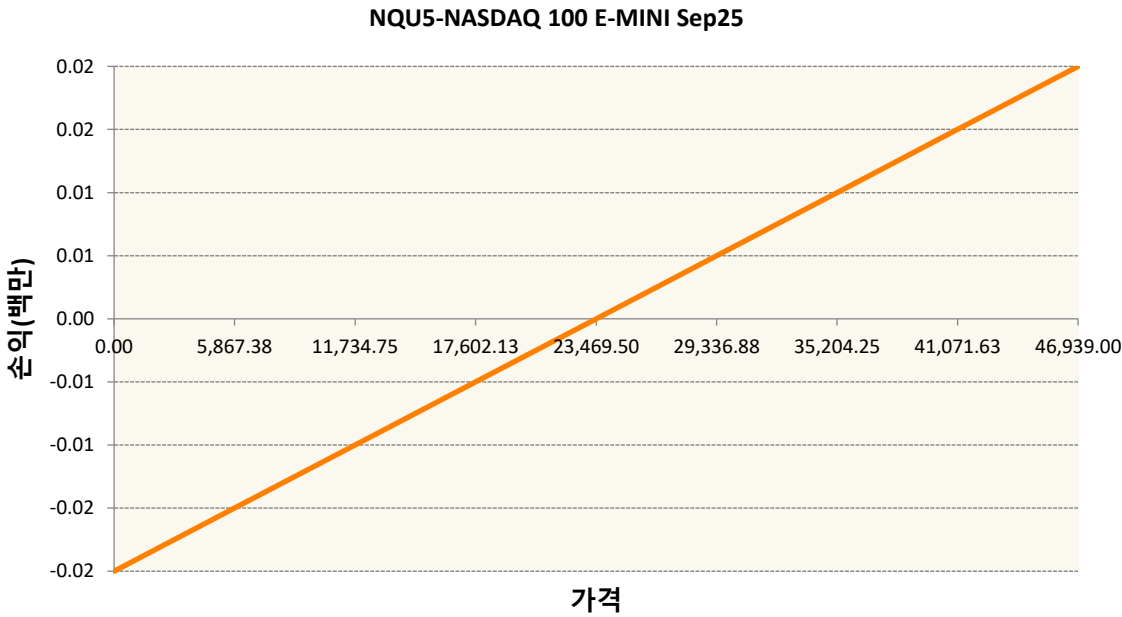
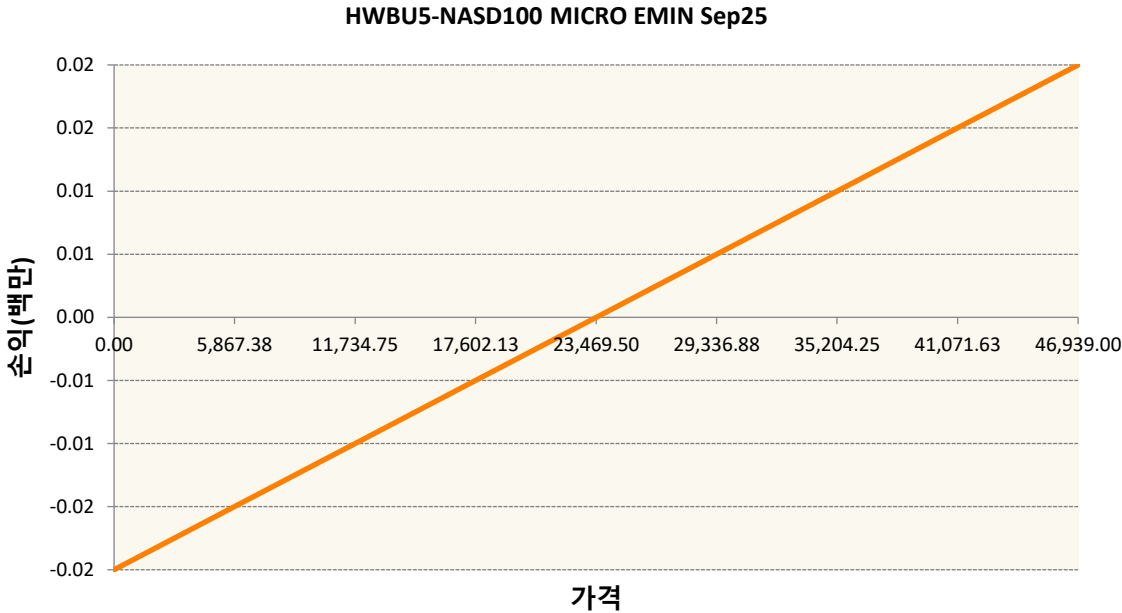
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,613	0	13,613	
누계	지수	선물	1,172	0	1,172	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25		94
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		1,089

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,340

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

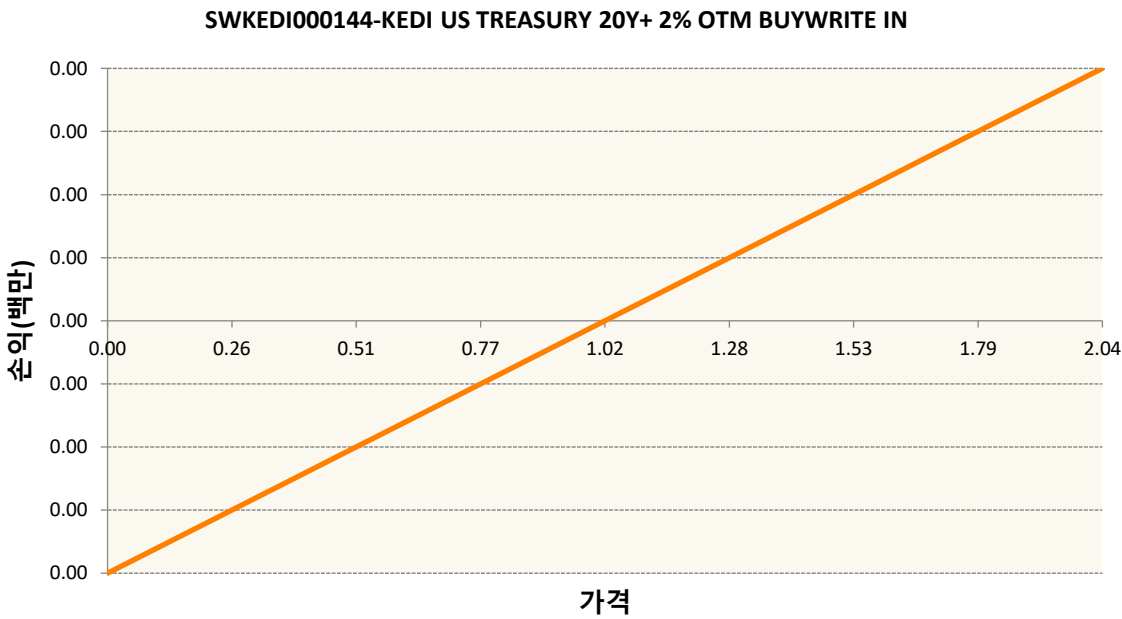
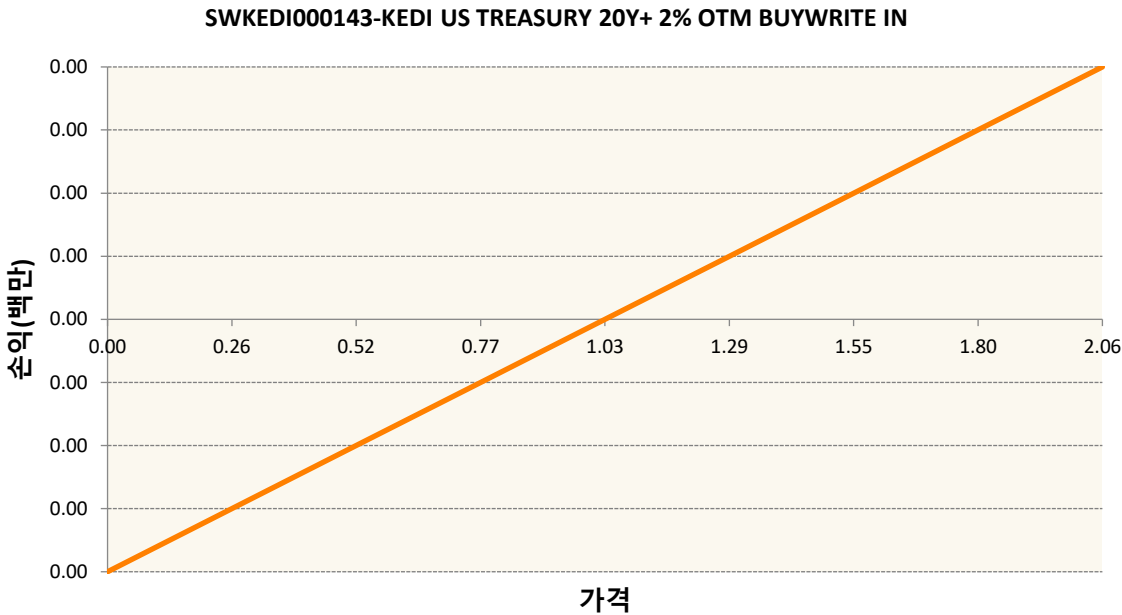
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

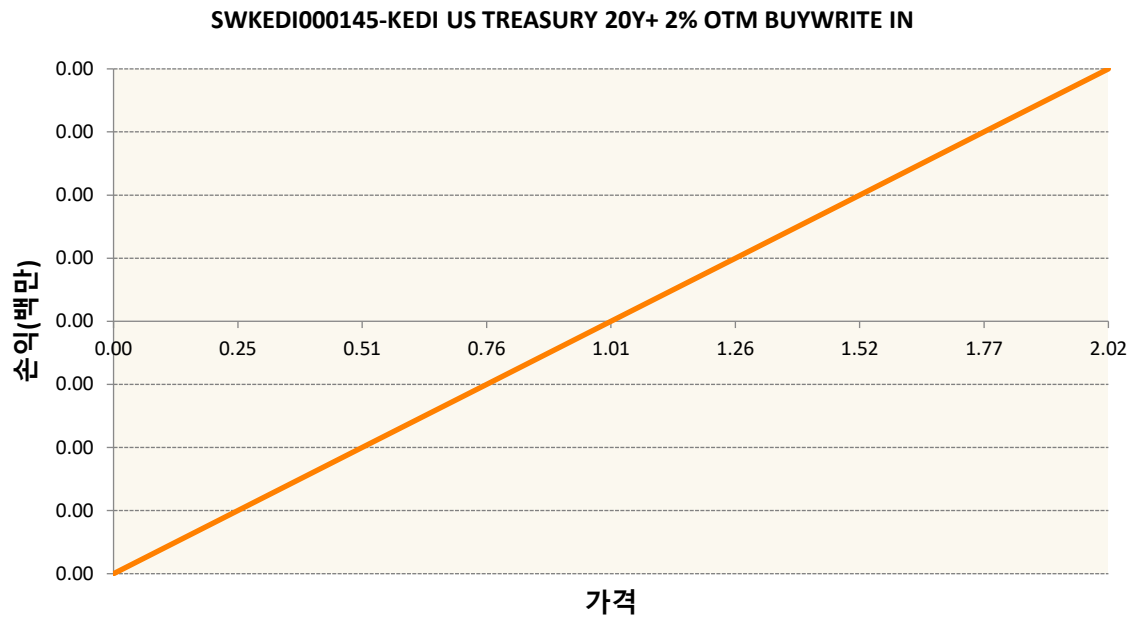
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	316,096	0	316,096	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,358
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,873
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		175
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,511
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		4,690

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,002

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

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	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	80

공시일	2025-08-21
기준일	2025-08-20

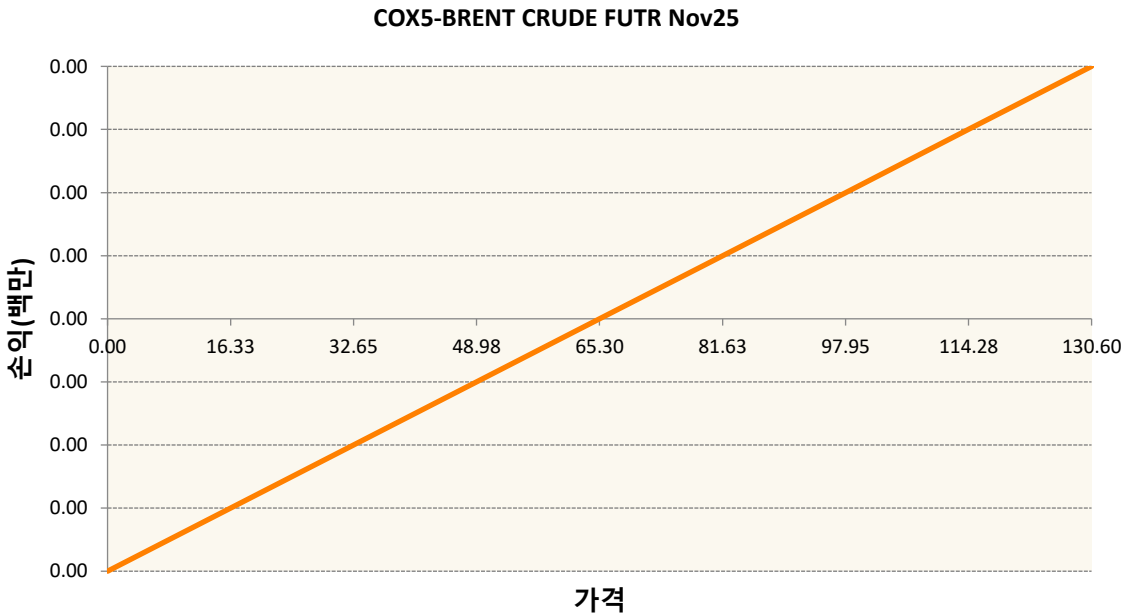
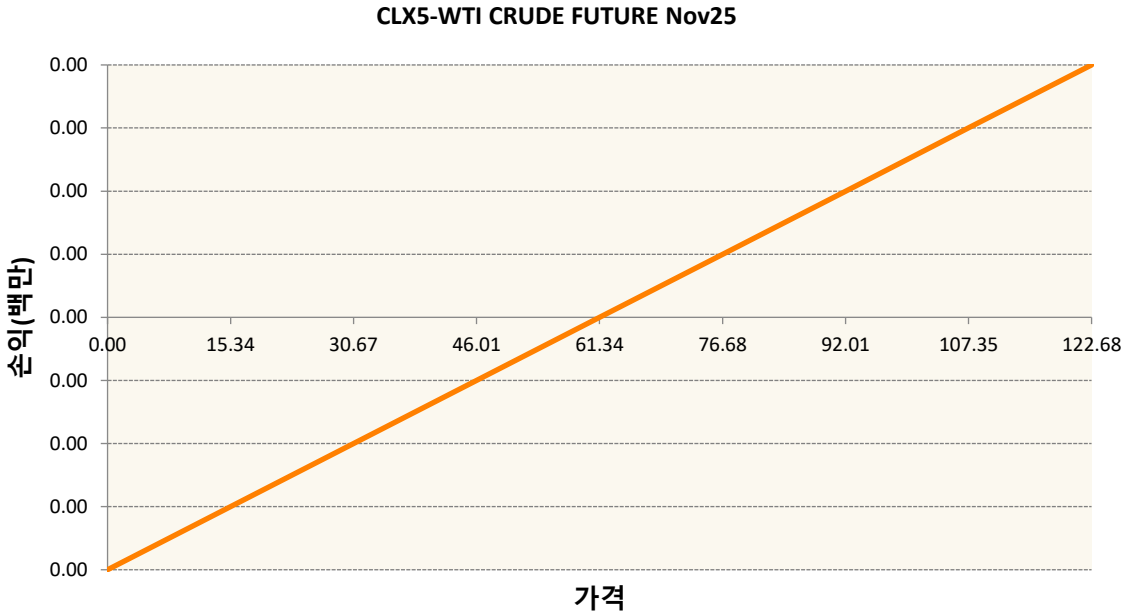
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

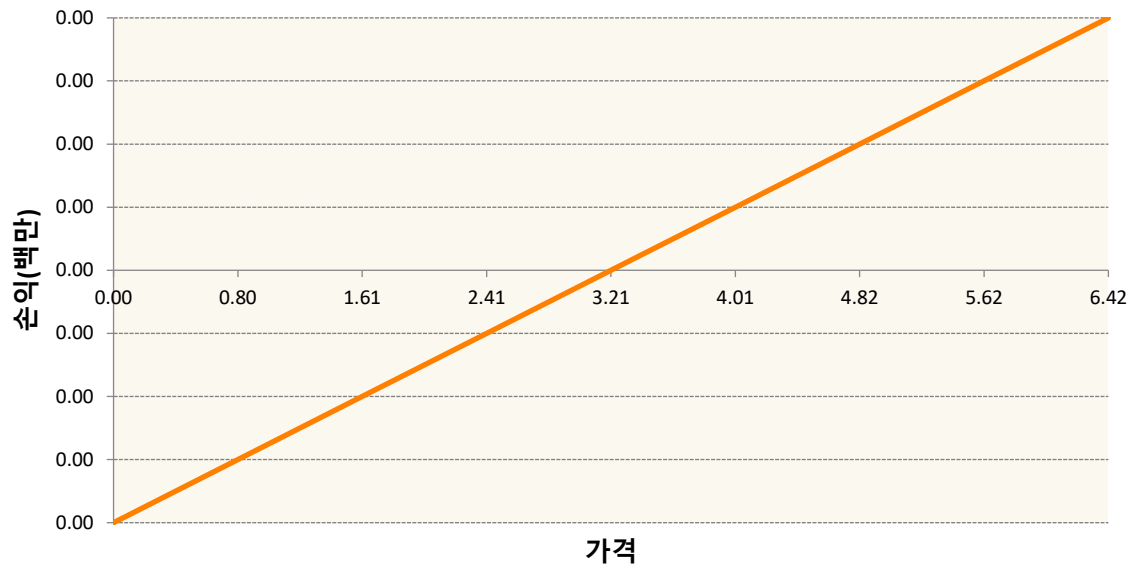
(단위:백만원)

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	522	0	522	
누계	통화	선물	0	70	-70	장내

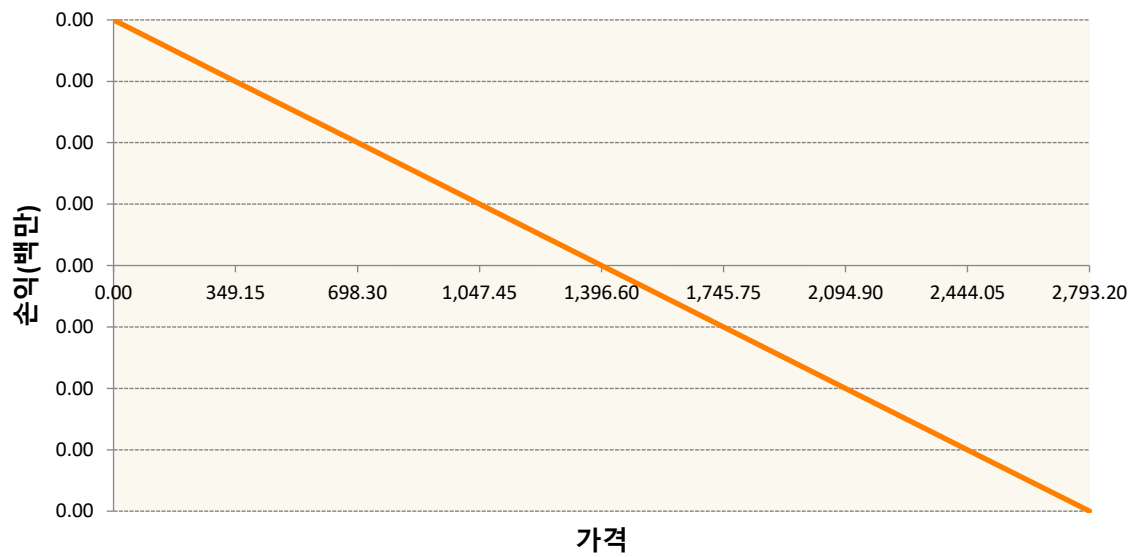
2. 만기시점의 손익구조



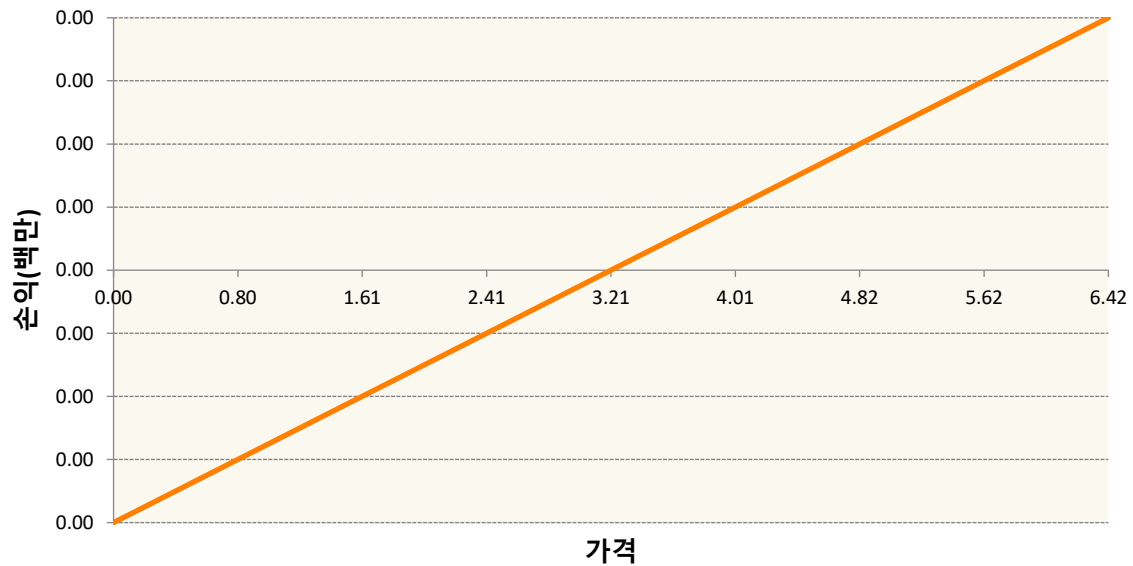
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

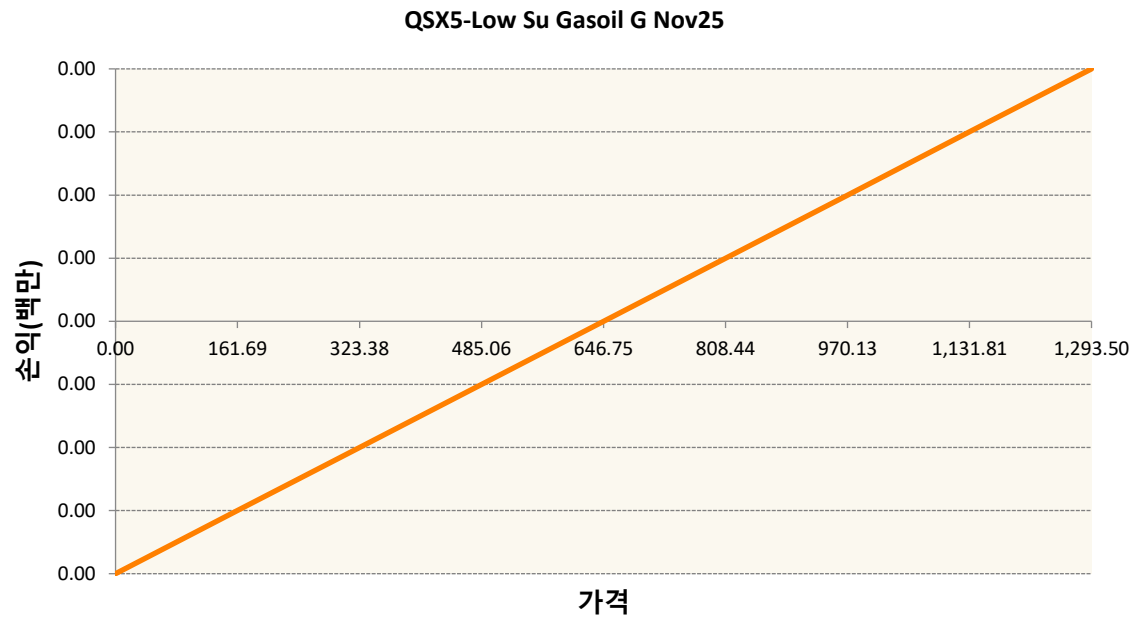


KR4175W90001-2025-09 달러선물



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)
	96