

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

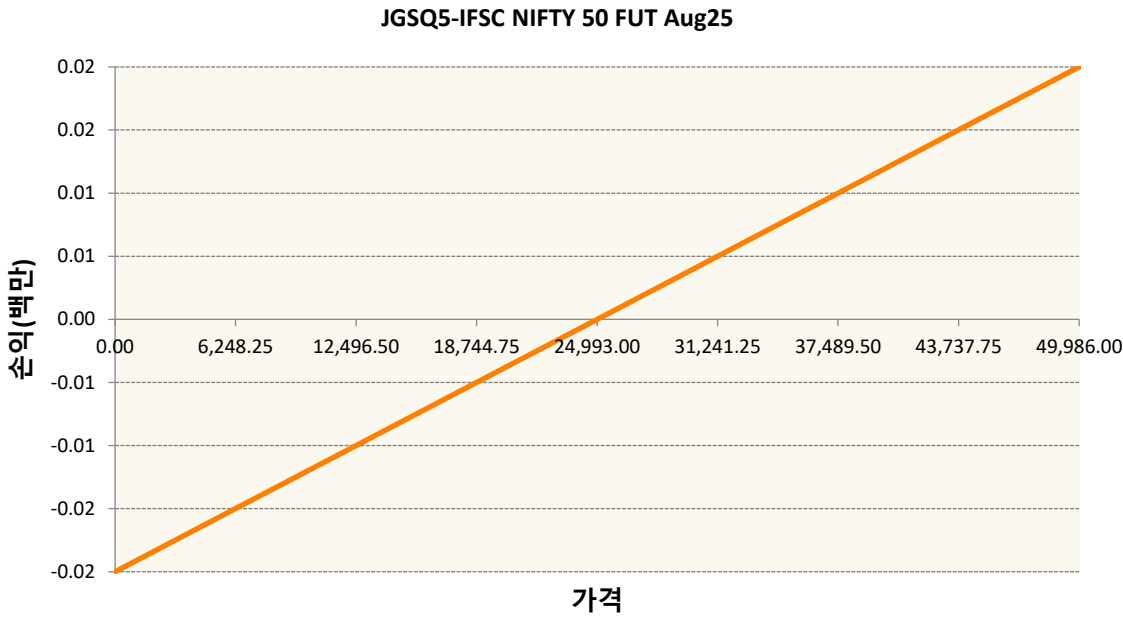
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	556	0	556	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSQ5	IFSC NIFTY 50 FUT Aug25	45
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

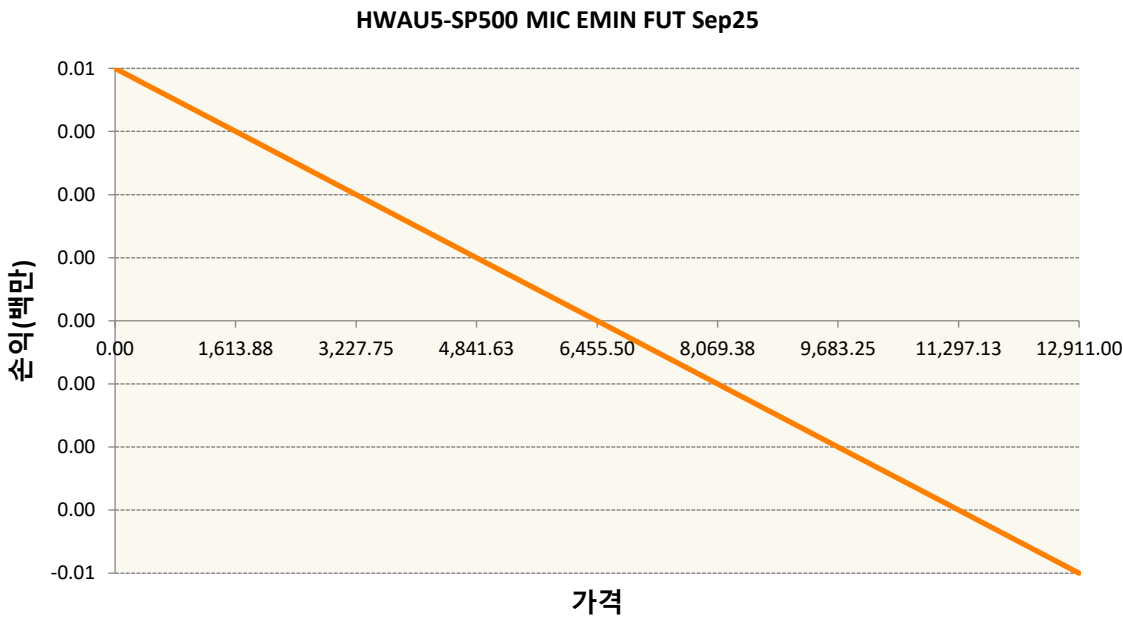
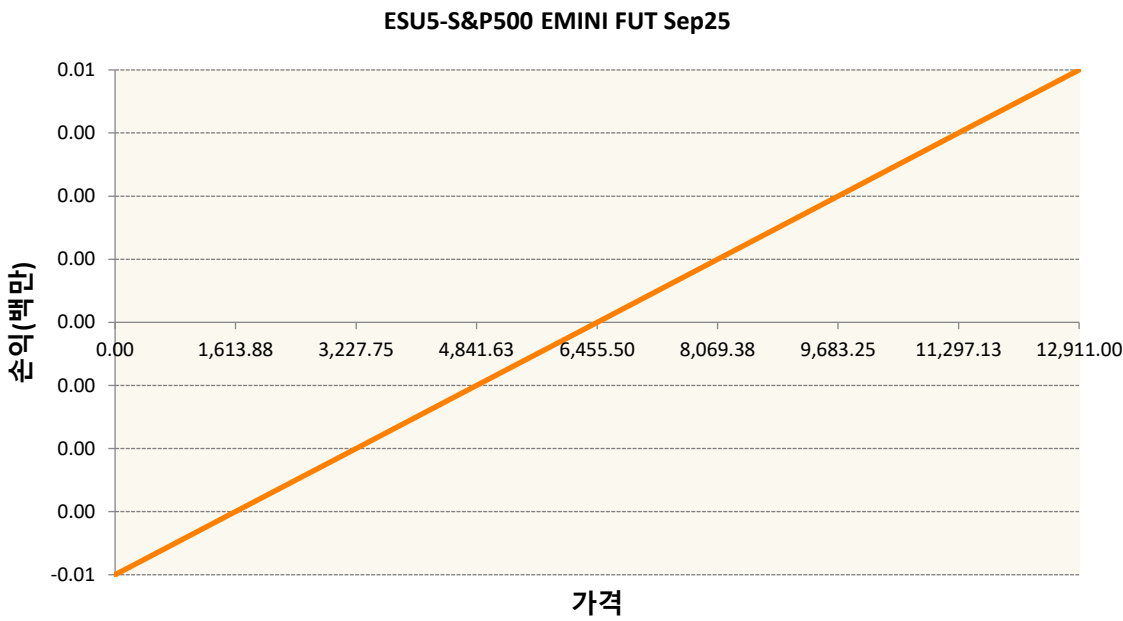
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	888	0	888	
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	2025-08-27
기준일	2025-08-26

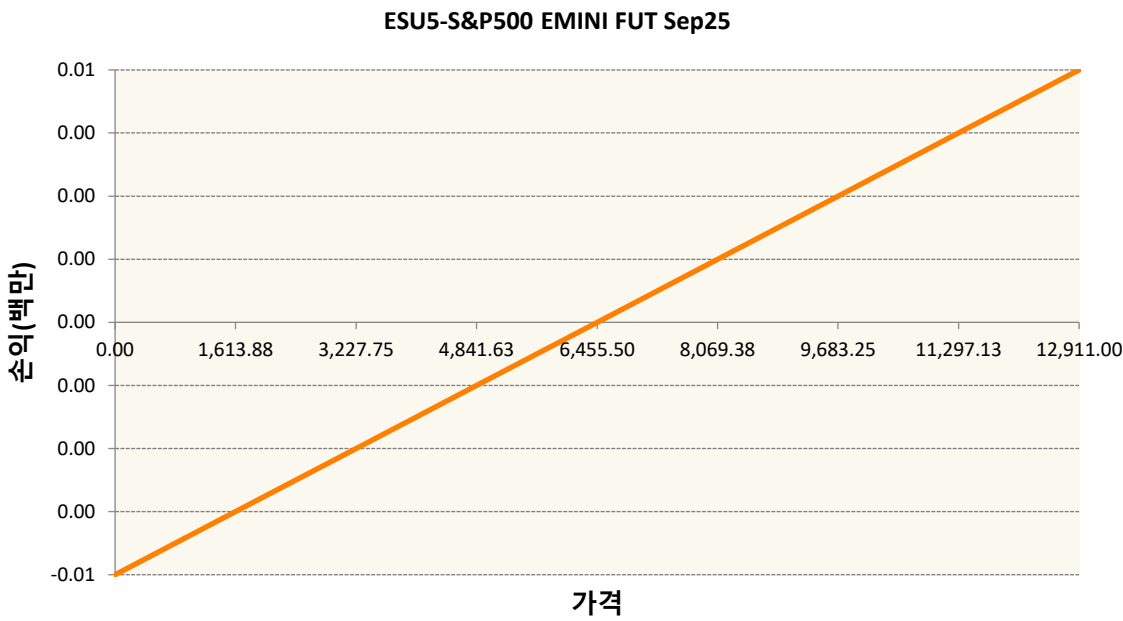
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,337	0	1,337	

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	2025-08-27
기준일	2025-08-26

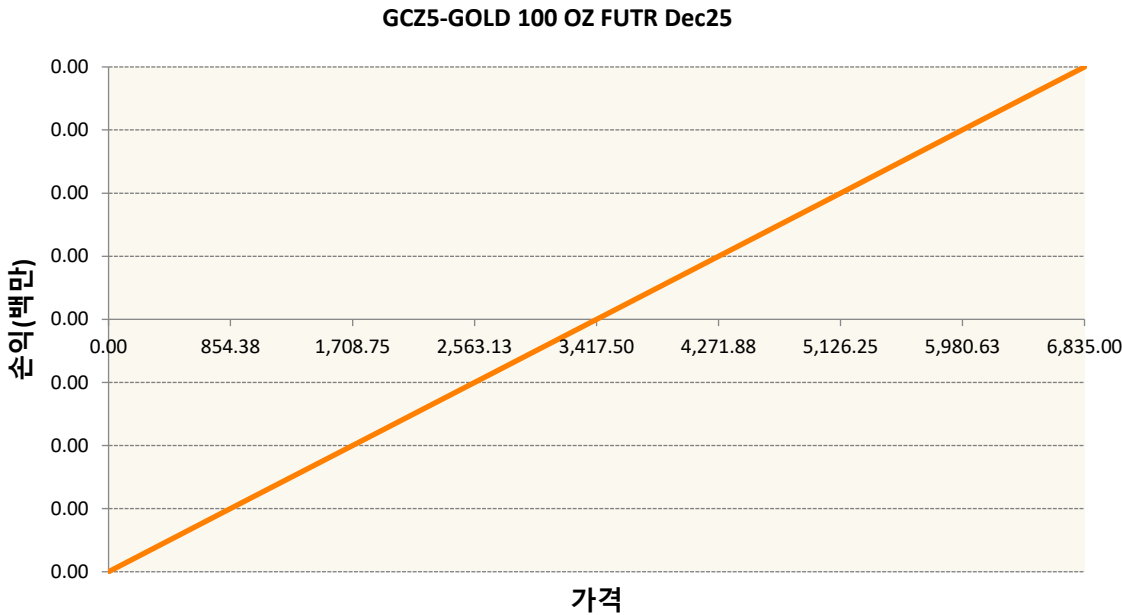
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,895	0	1,895	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 08/29/25 C309 EQUITY	4
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	152

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

(단위:백만원)

135

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

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)

AOPLTRUSC' PLTR US 08/29/25 C165 EQUITY	34
AOPLTRUSP1 PLTR US 08/29/25 P165 EQUITY	28

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

(단위:백만원)

253

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

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)

AOTLTUSC0TLT US 08/29/25 C87 EQUITY

3

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

(단위:백만원)

2

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

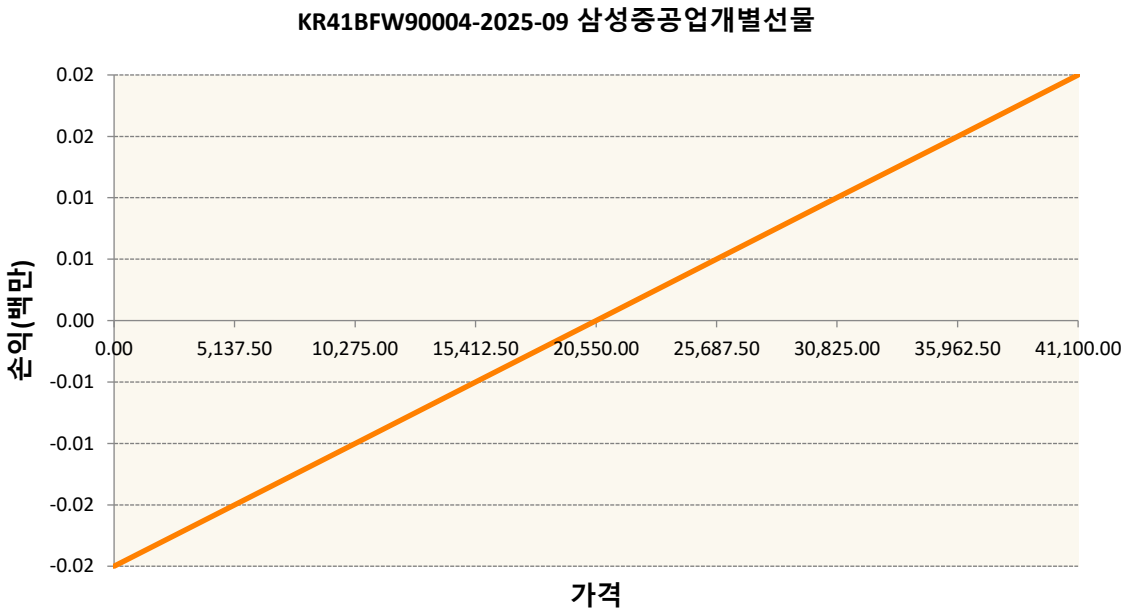
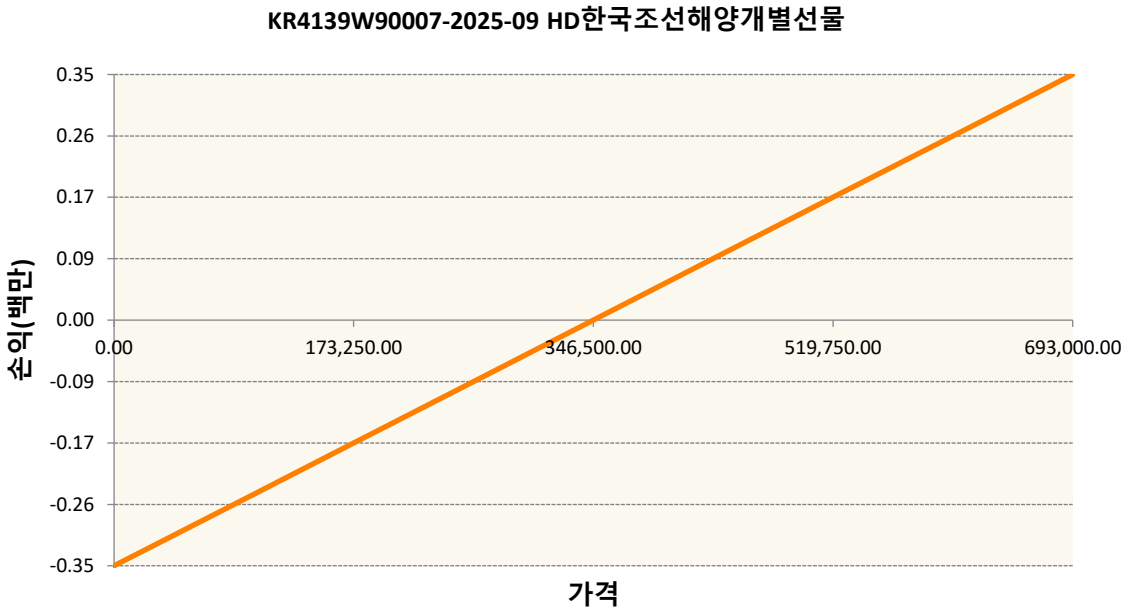
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

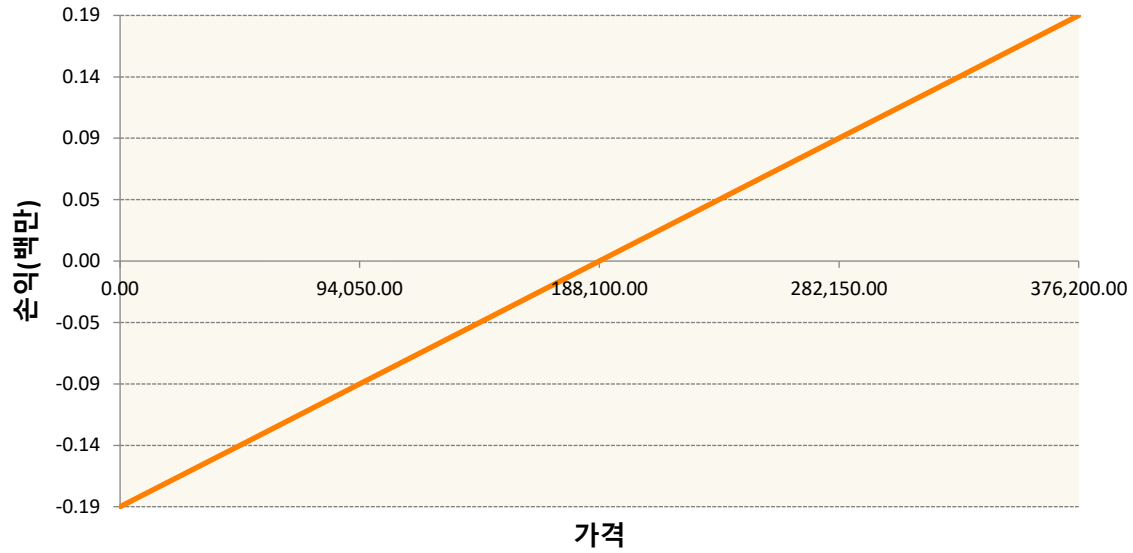
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,877	0	30,877	장내

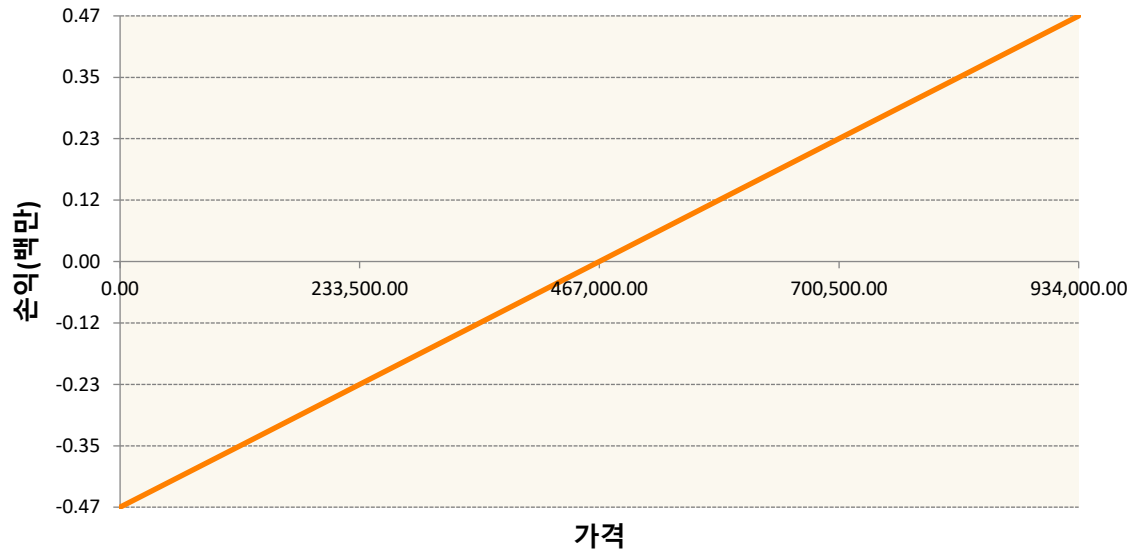
2. 만기시점의 손익구조



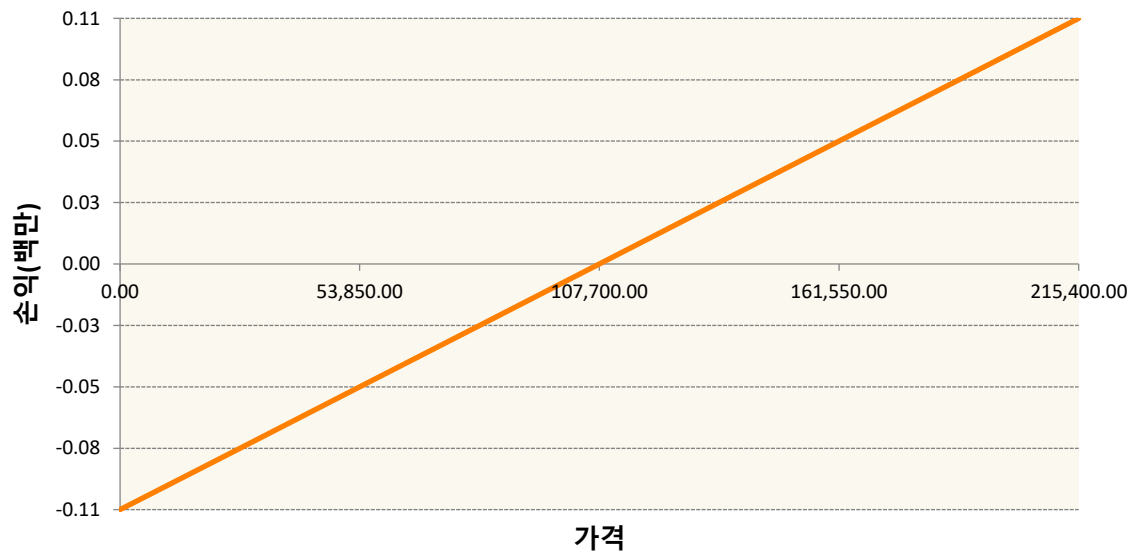
KR41CDW90007-2025-09 HD현대미포개별선물



KR41FDW90000-2025-09 HD현대중공업개별선물



KR41FVW90002-2025-09 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139W90007							2025-09 HD한국조선해양개별선물		502	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-502	-502	-502	-502	-502	-502	-502			
-5.33%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335			
-2.67%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	167	167	167	167	167	167	167			
5.33%	335	335	335	335	335	335	335			
8.00%	502	502	502	502	502	502	502			
KR41BFW90004							2025-09 삼성중공업개별선물		526	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-526	-526	-526	-526	-526	-526	-526			
-5.33%	-351	-351	-351	-351	-351	-351	-351			
-2.67%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	175	175	175	175	175	175	175			
5.33%	351	351	351	351	351	351	351			
8.00%	526	526	526	526	526	526	526			
KR41CDW90007							2025-09 HD현대미포개별선물		336	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-336	-336	-336	-336	-336	-336	-336			
-5.33%	-224	-224	-224	-224	-224	-224	-224			
-2.67%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	112	112	112	112	112	112	112			
5.33%	224	224	224	224	224	224	224			
8.00%	336	336	336	336	336	336	336			
KR41FDW90000							2025-09 HD현대중공업개별선물		405	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-405	-405	-405	-405	-405	-405	-405			
-5.33%	-270	-270	-270	-270	-270	-270	-270			
-2.67%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	135	135	135	135	135	135	135			
5.33%	270	270	270	270	270	270	270			
8.00%	405	405	405	405	405	405	405			
KR41FVW90002							2025-09 한화오션개별선물		706	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-706	-706	-706	-706	-706	-706	-706
-5.33%	-470	-470	-470	-470	-470	-470	-470
-2.67%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	235	235	235	235	235	235	235
5.33%	470	470	470	470	470	470	470
8.00%	706	706	706	706	706	706	706

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

(단위:백만원)

1,696

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

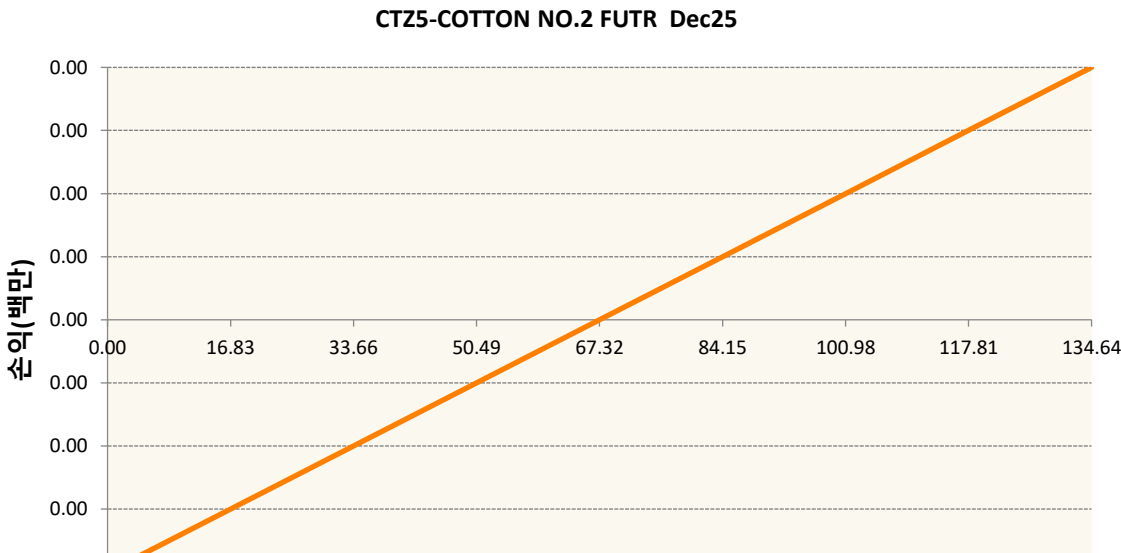
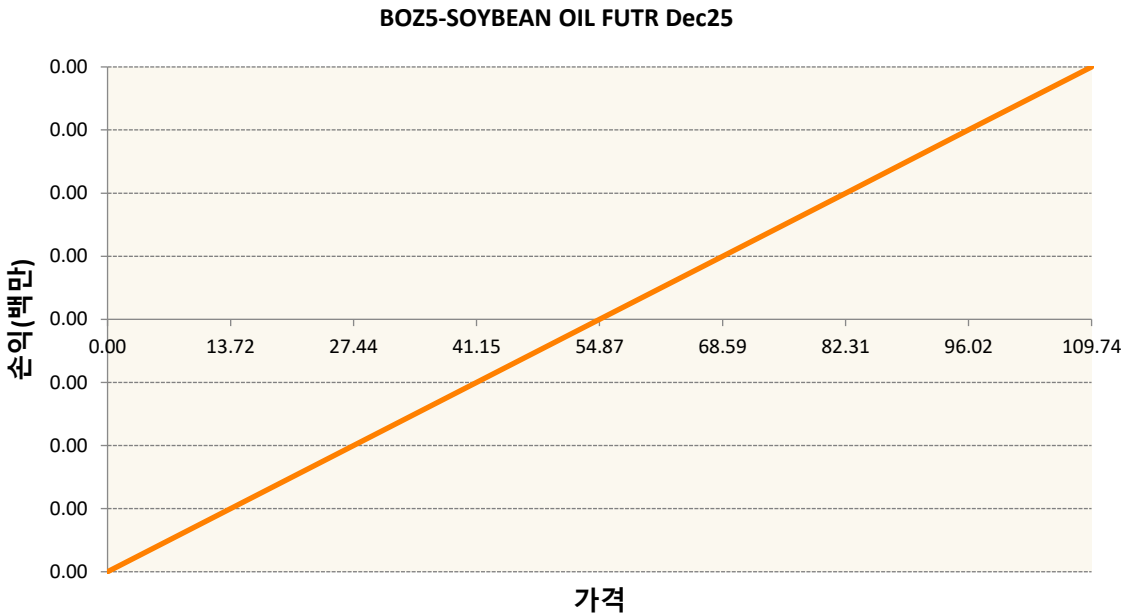
포커스농산물모(채권-파생형)

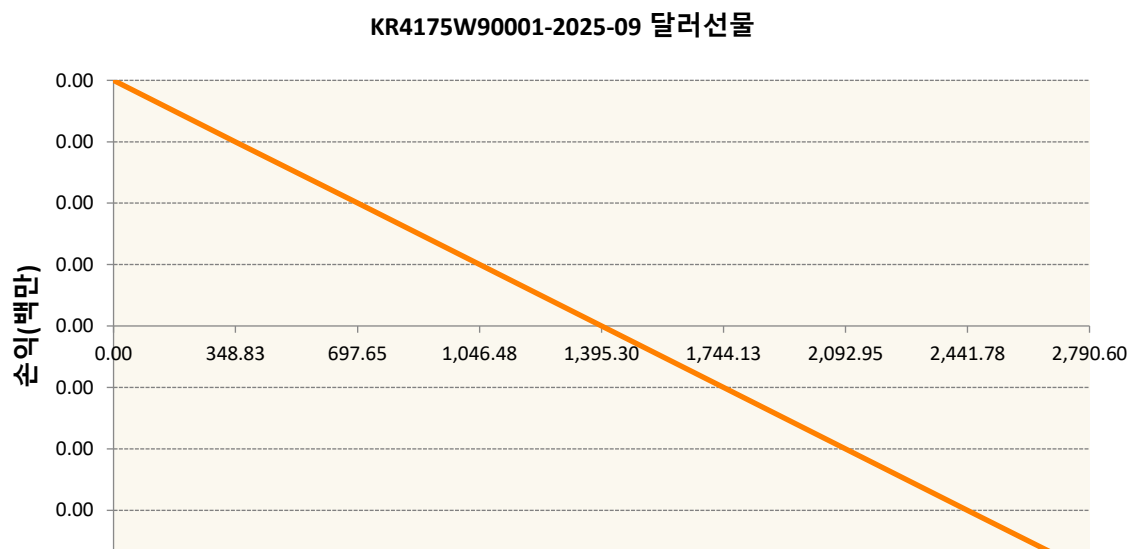
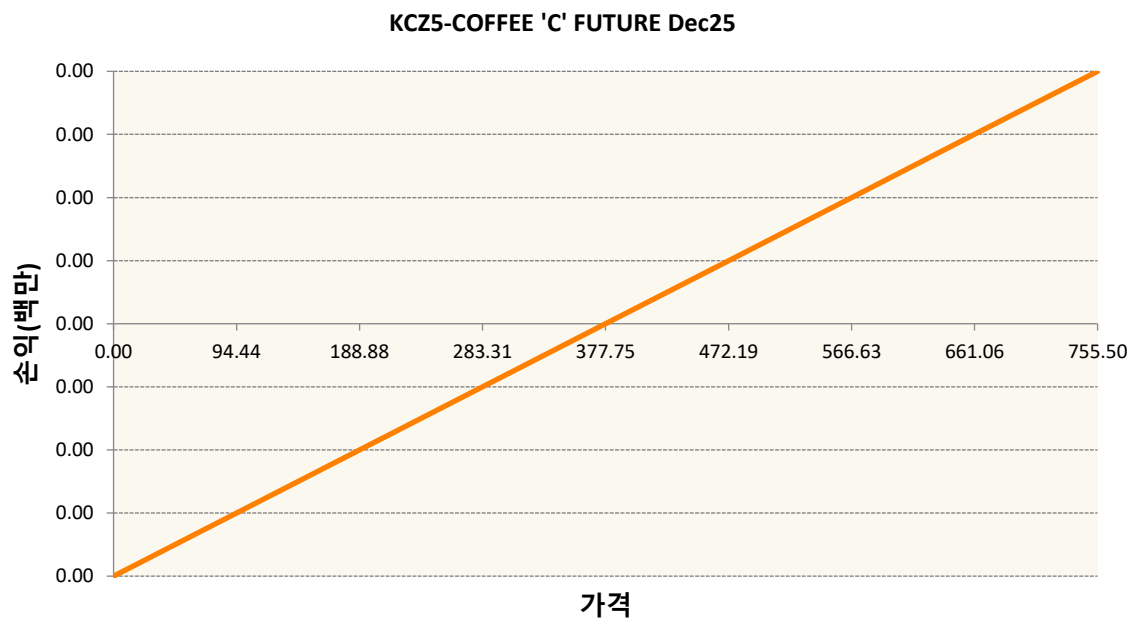
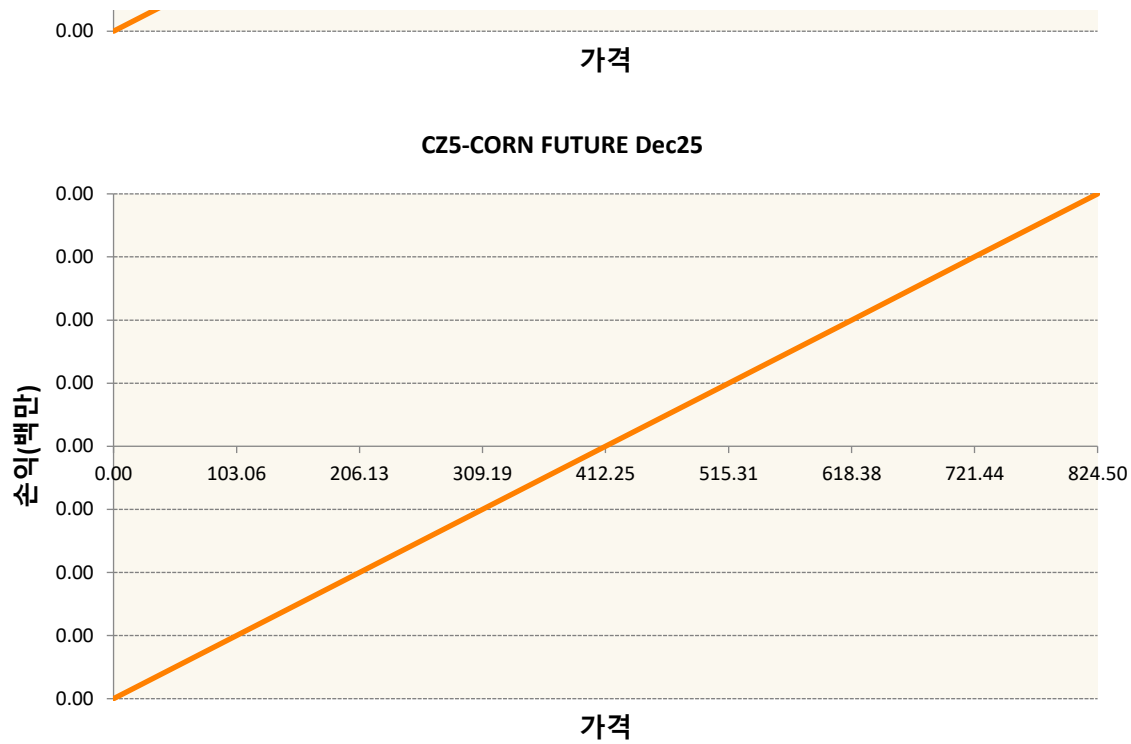
1. 계약금액

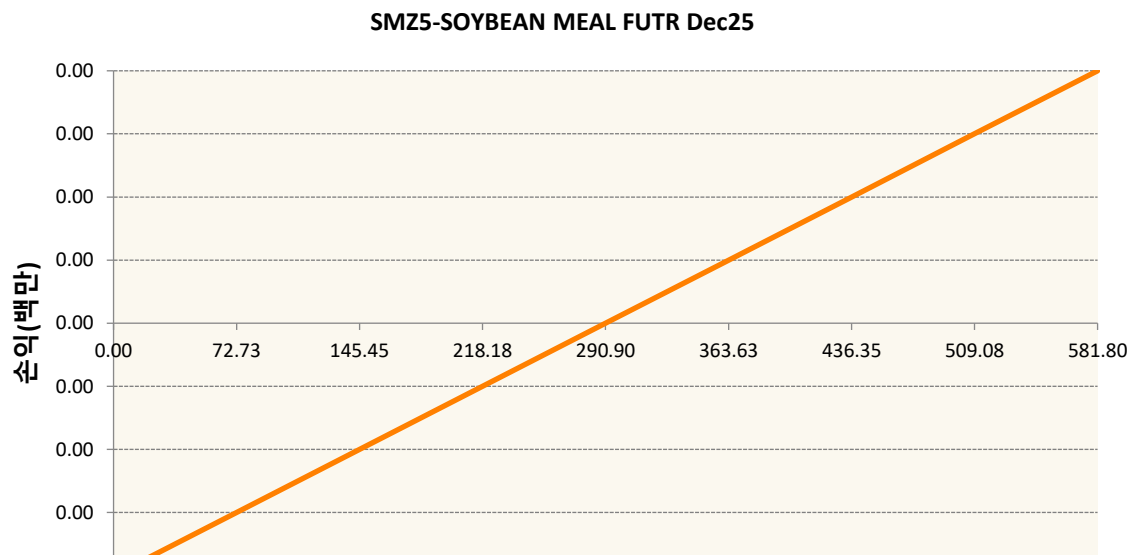
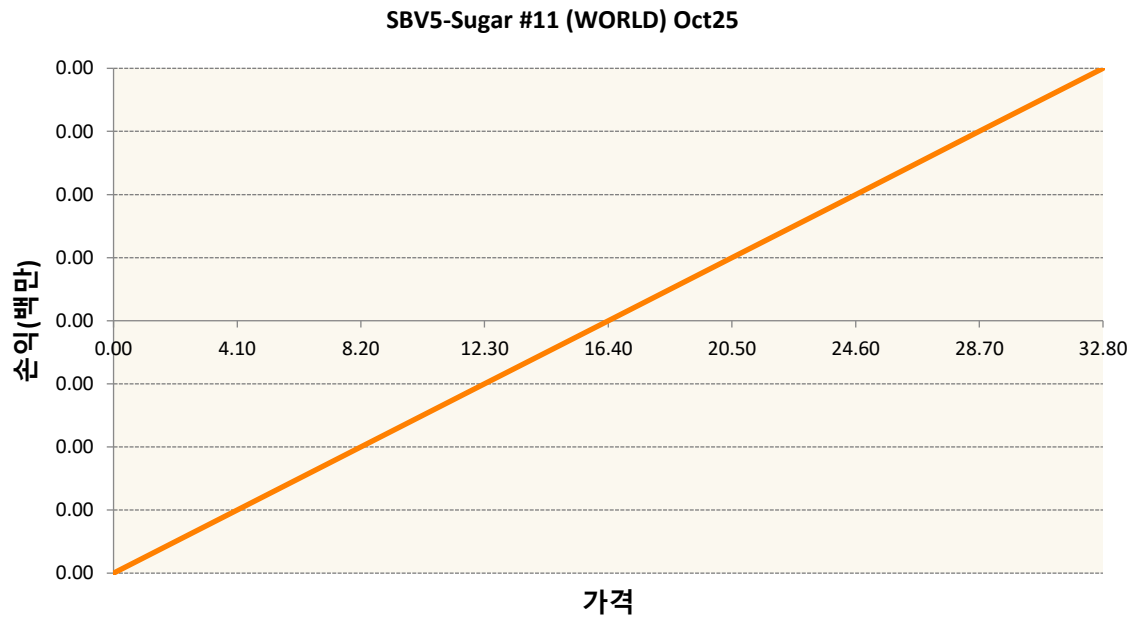
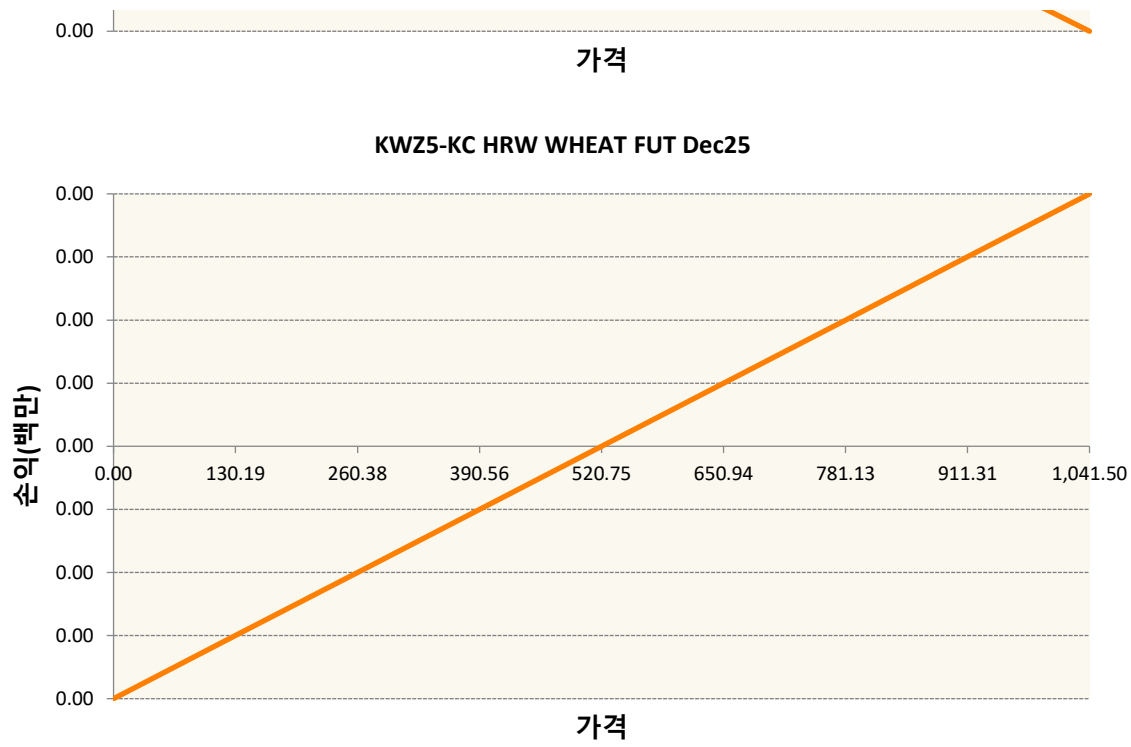
(단위:USD 백만)

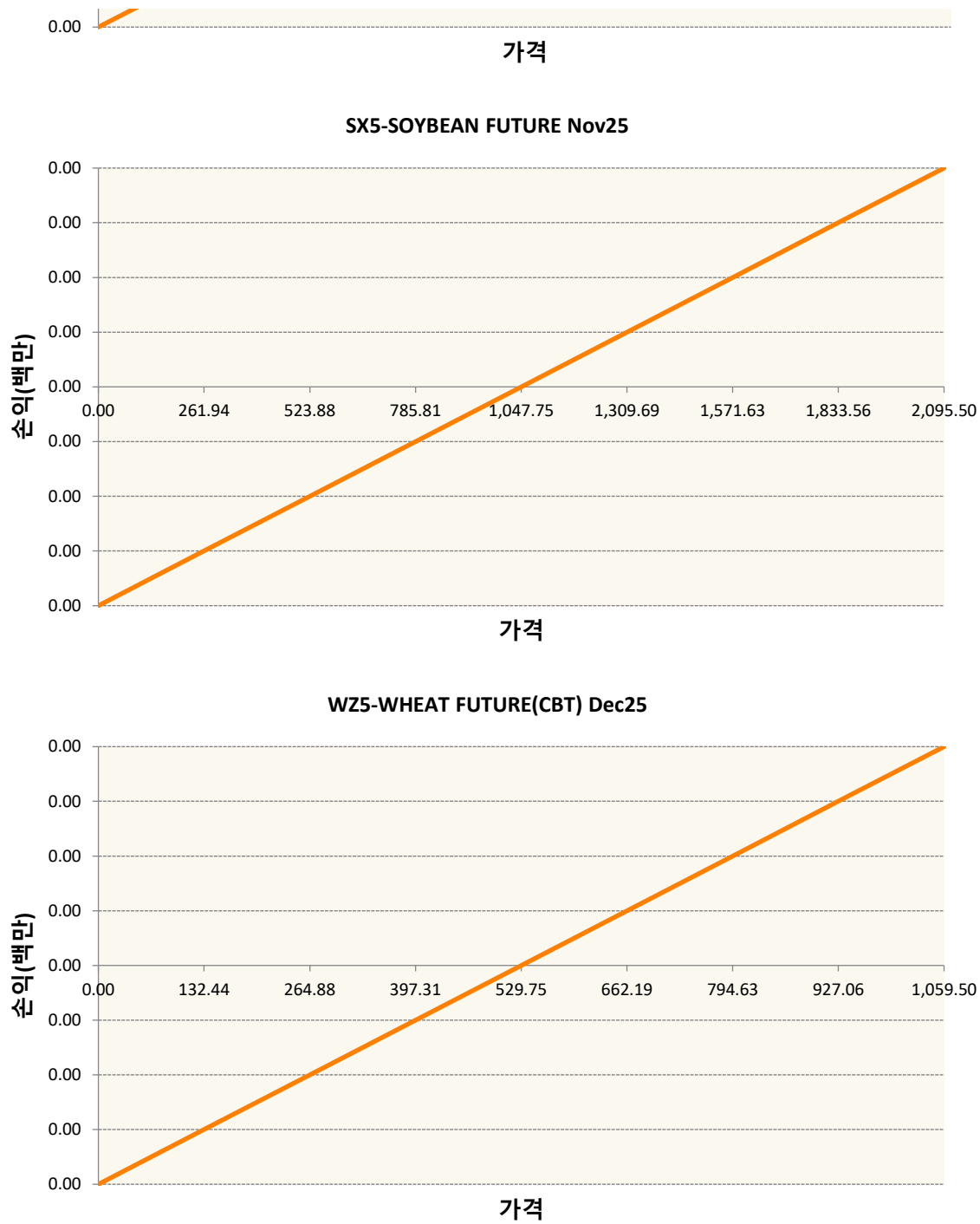
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	56	-56	장내
누계	실물자산	선물	1,219	0	1,219	
누계	유가증권	선물	2,304	0	2,304	
누계	통화	선물	0	377	-377	장내

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	2025-08-27
기준일	2025-08-26

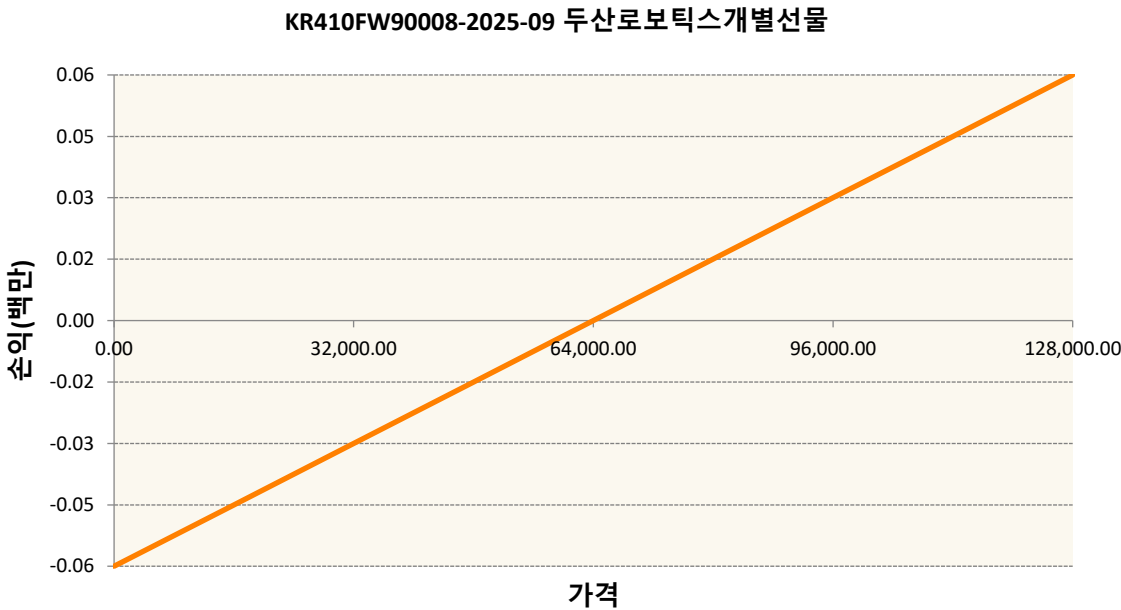
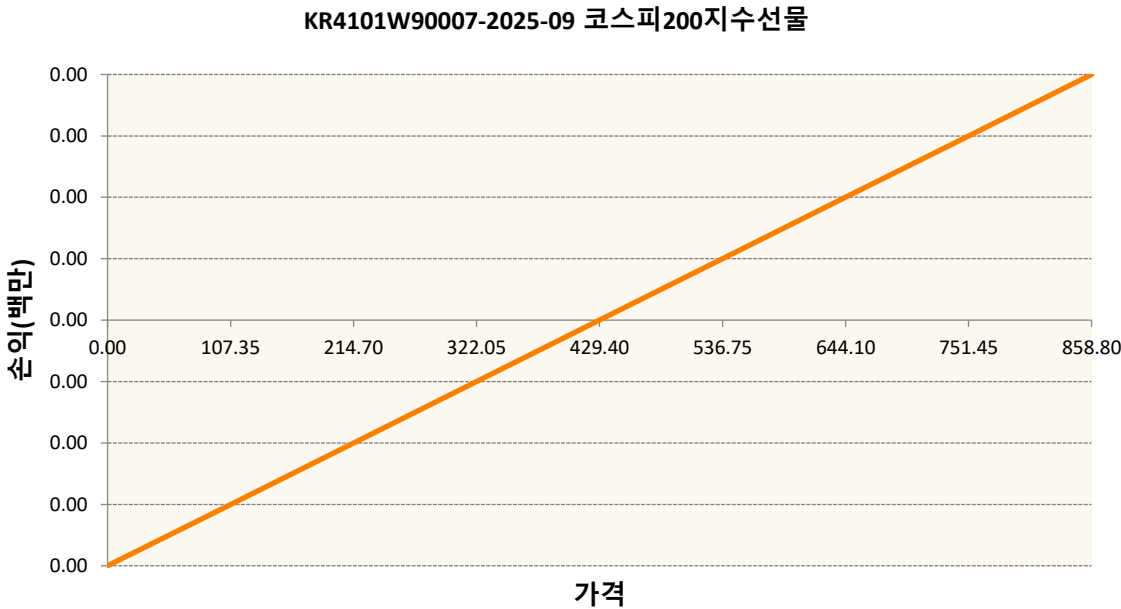
스마트인덱스모

1. 계약금액

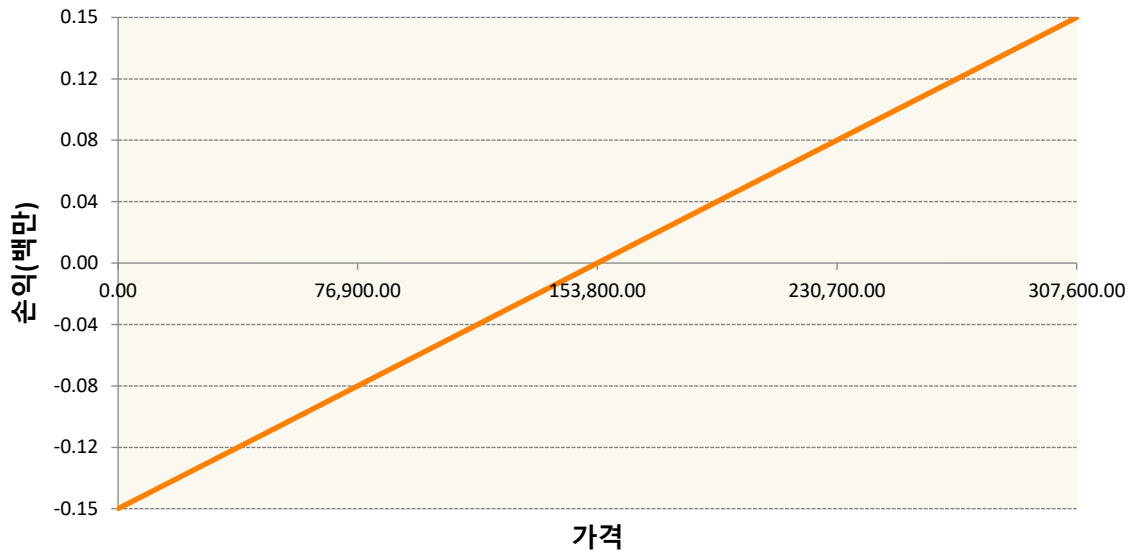
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	849	0	849	장내

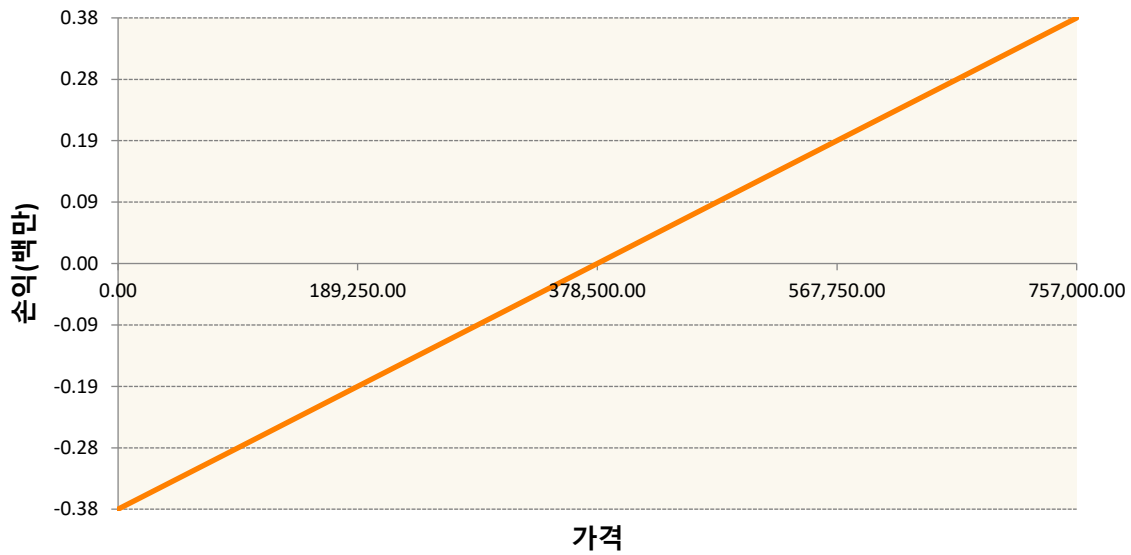
2. 만기시점의 손익구조



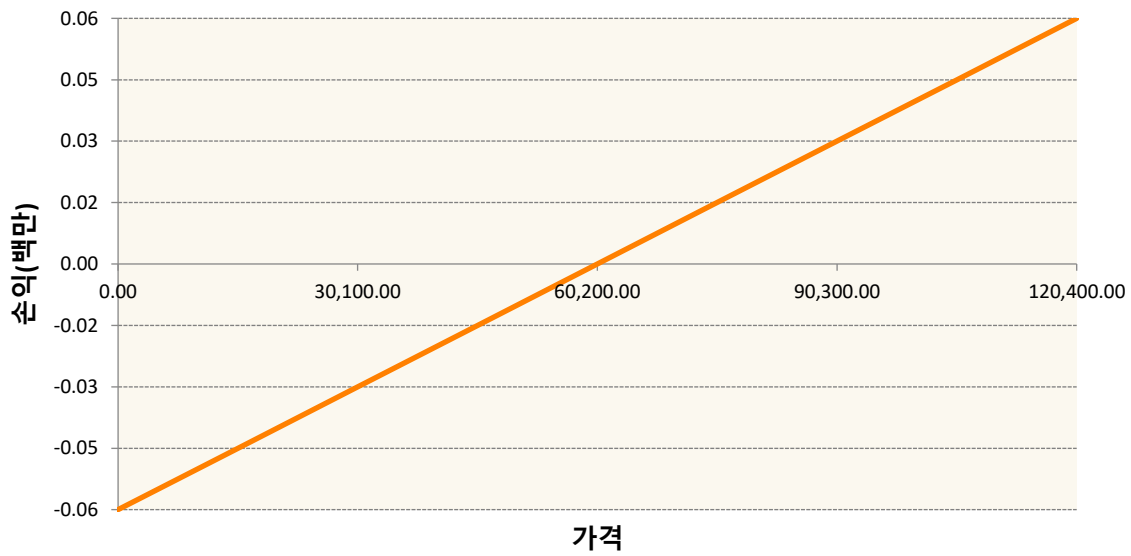
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



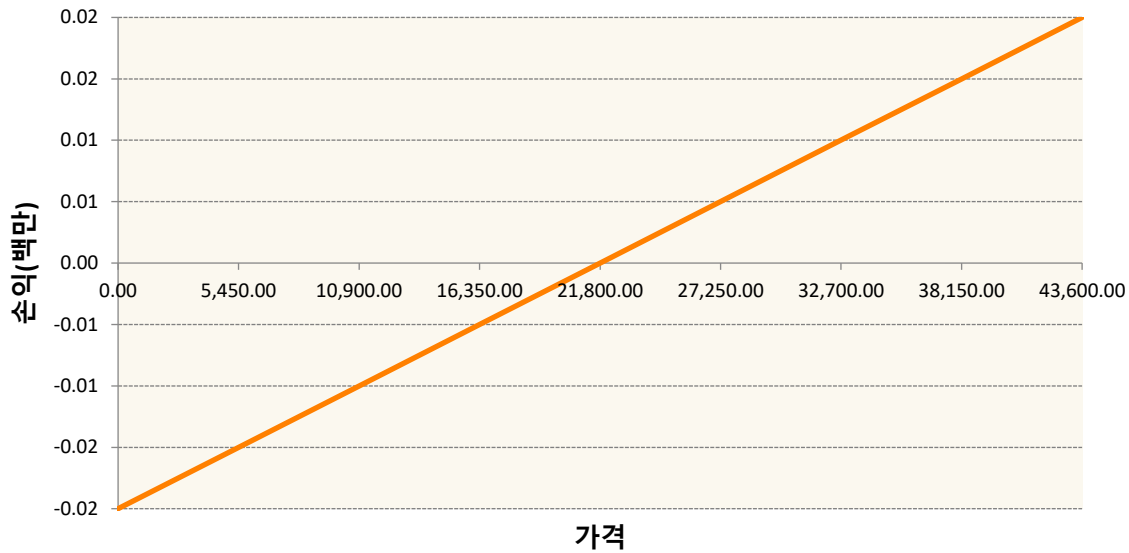
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



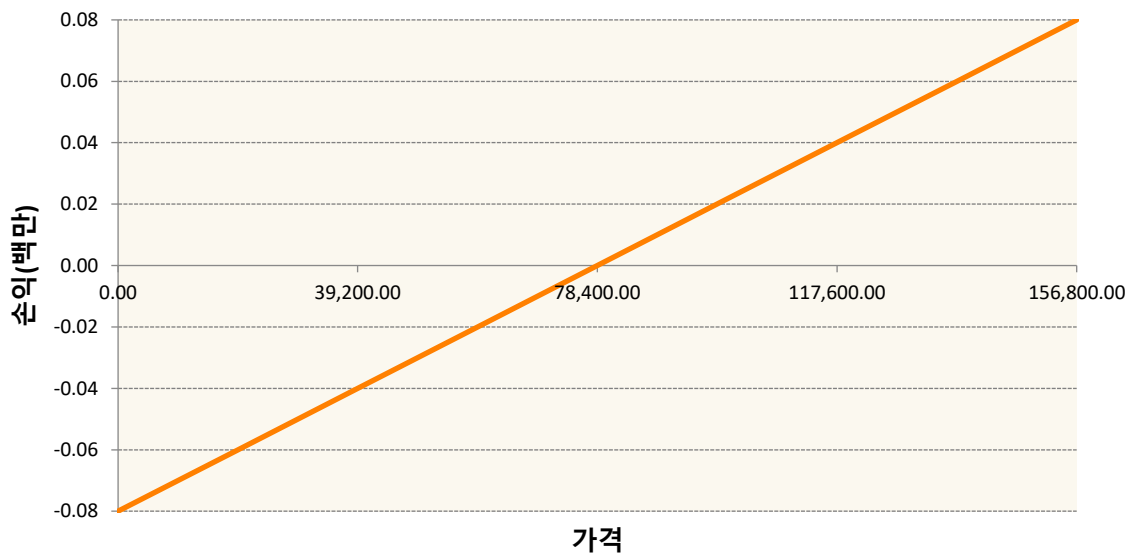
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	34
KR410FW90(2025-09 두산로보틱스개별선물	1
KR41E8W90(2025-09 포스코퓨처엠개별선물	5
KR41F5W90(2025-09 LG에너지솔루션개별선물	15
KR41F7W90(2025-09 카카오페이개별선물	2
KR41FAW90(2025-09 HMM개별선물	8
KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물	2

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

(단위:백만원)

78

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

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

365

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

576

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

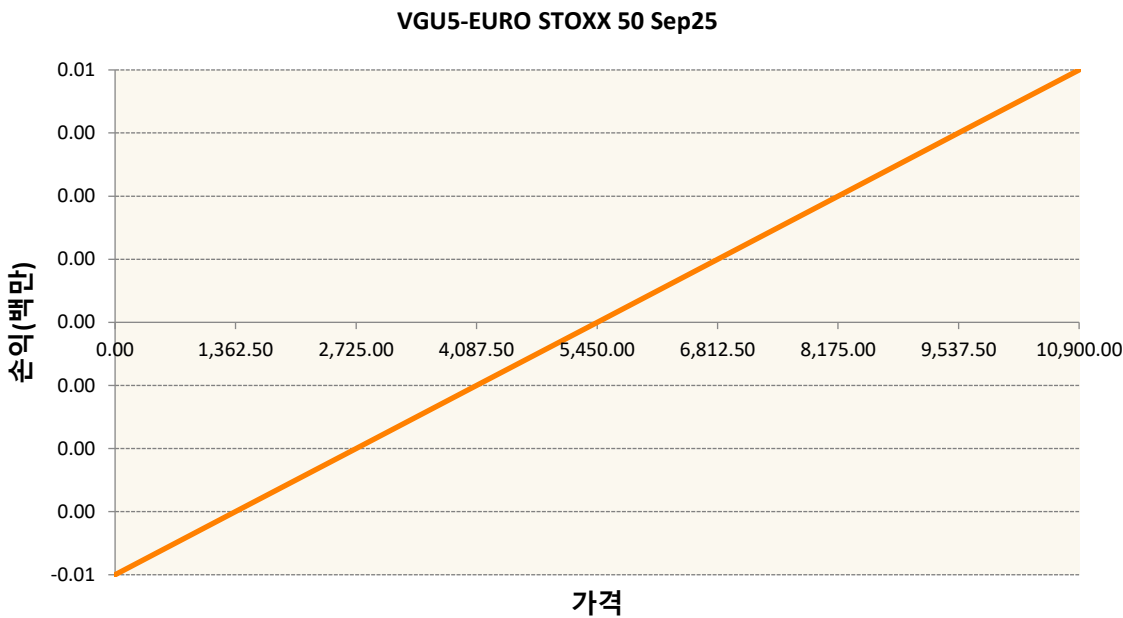
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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	2025-08-27
기준일	2025-08-26

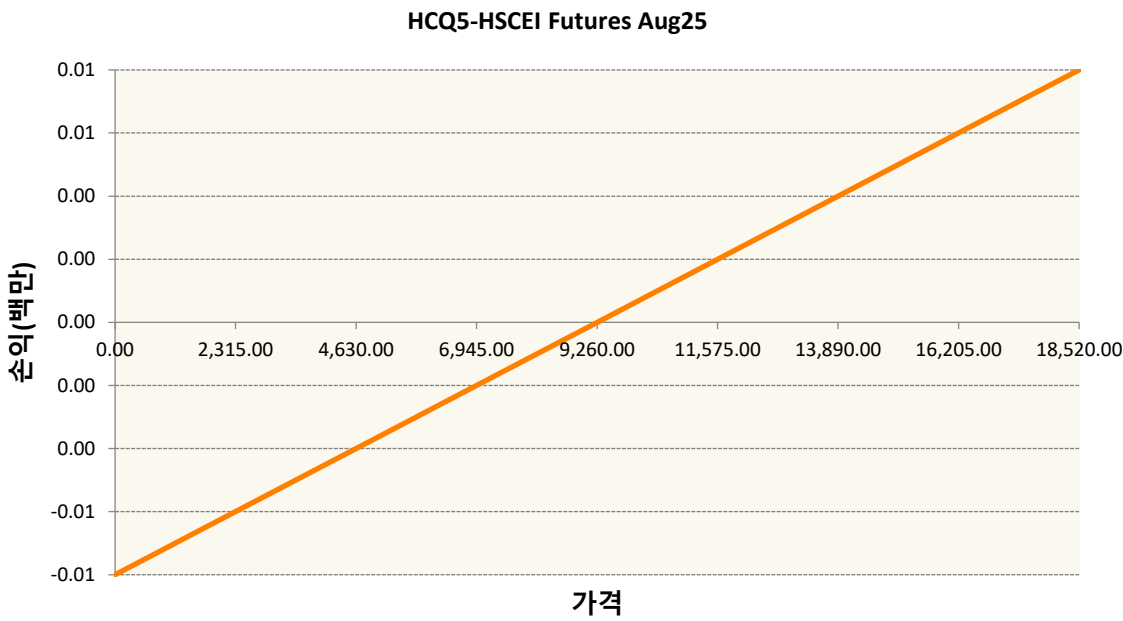
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,051	0	2,051	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ5	HSCEI Futures Aug25	164
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

233

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

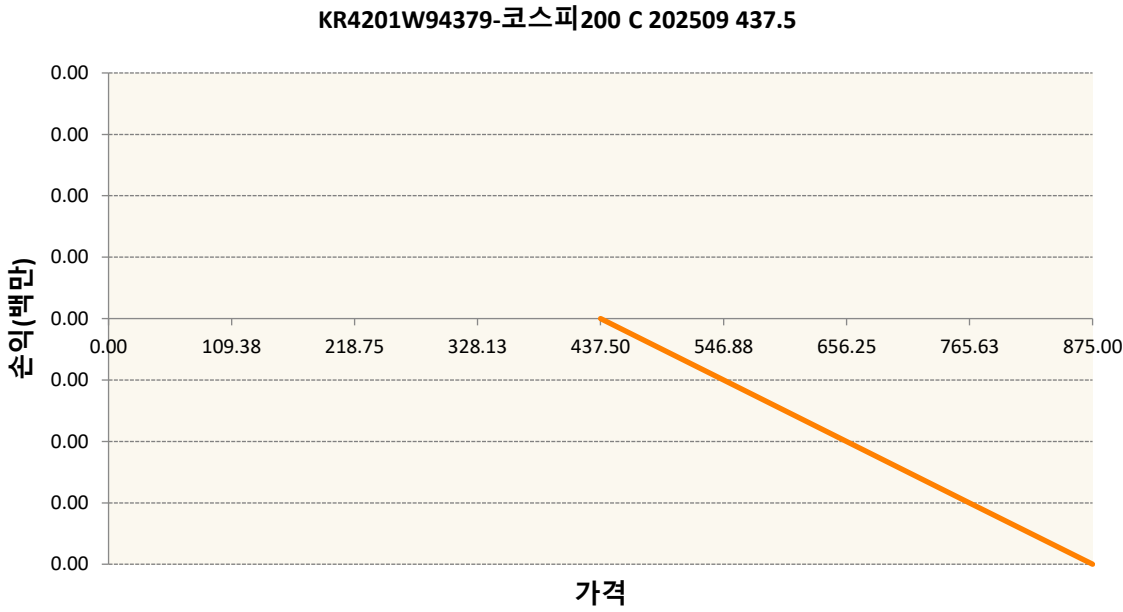
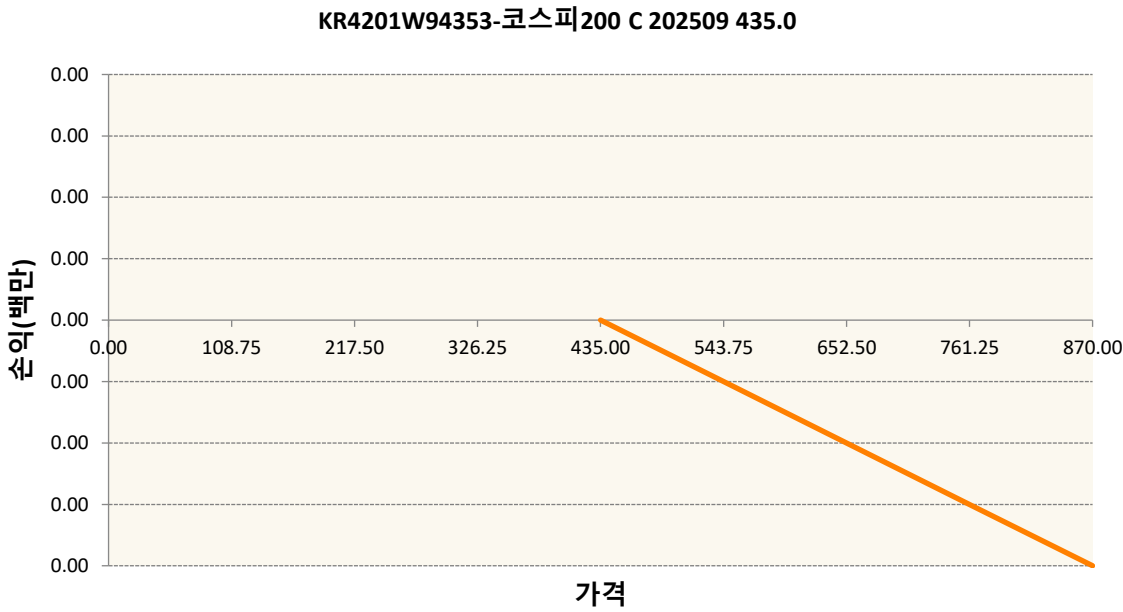
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

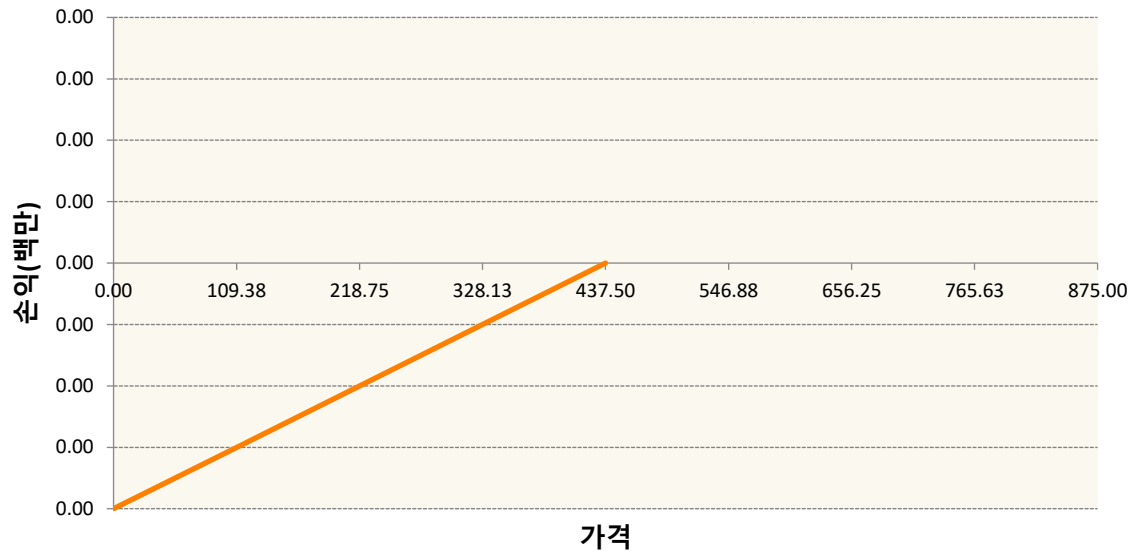
(단위:백만원)

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	2025-08-27
기준일	2025-08-26

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	13,246	13,246	0	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213F5V(KRW/USD 29-08-25E	326
FXW213F6SC KRW/USD 29-08-25E	227
FXW213F7W KRW/USD 29-08-25E	373
FXW213F81C USD/KRW 29-08-25E	89
FXW213F87C USD/KRW 29-08-25E	45
FXW213F8K(KRW/USD 29-08-25E	45
FXW213F8K(KRW/USD 29-08-25E	89
FXW213F8K(USD/KRW 29-08-25E	227
FXW213F8K(USD/KRW 29-08-25E	326
FXW213F8K(USD/KRW 29-08-25E	373

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

(단위:백만원)

1,059

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

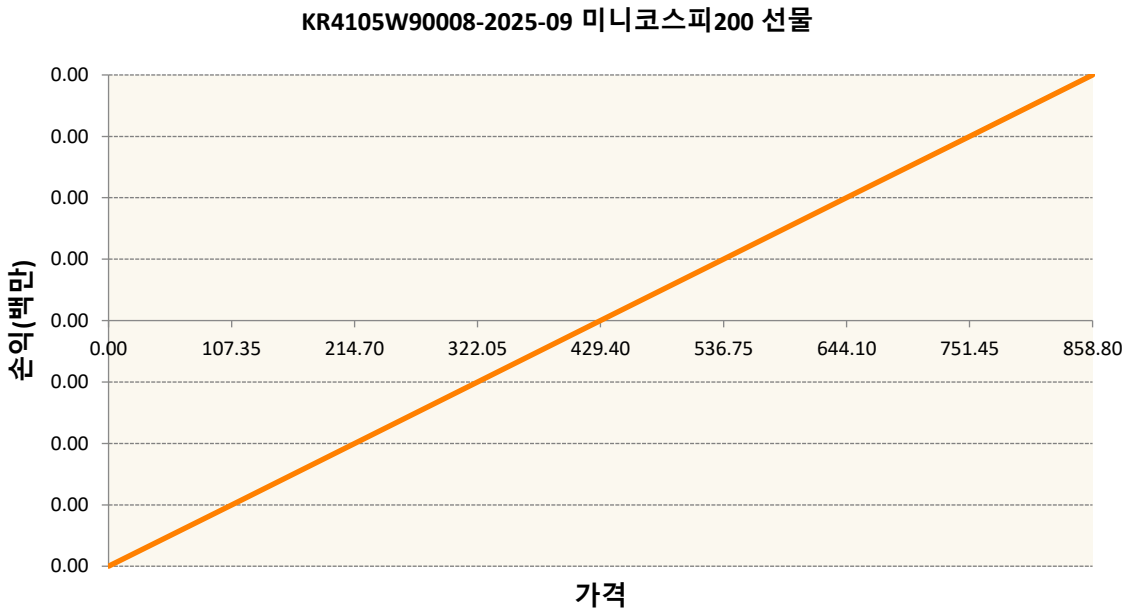
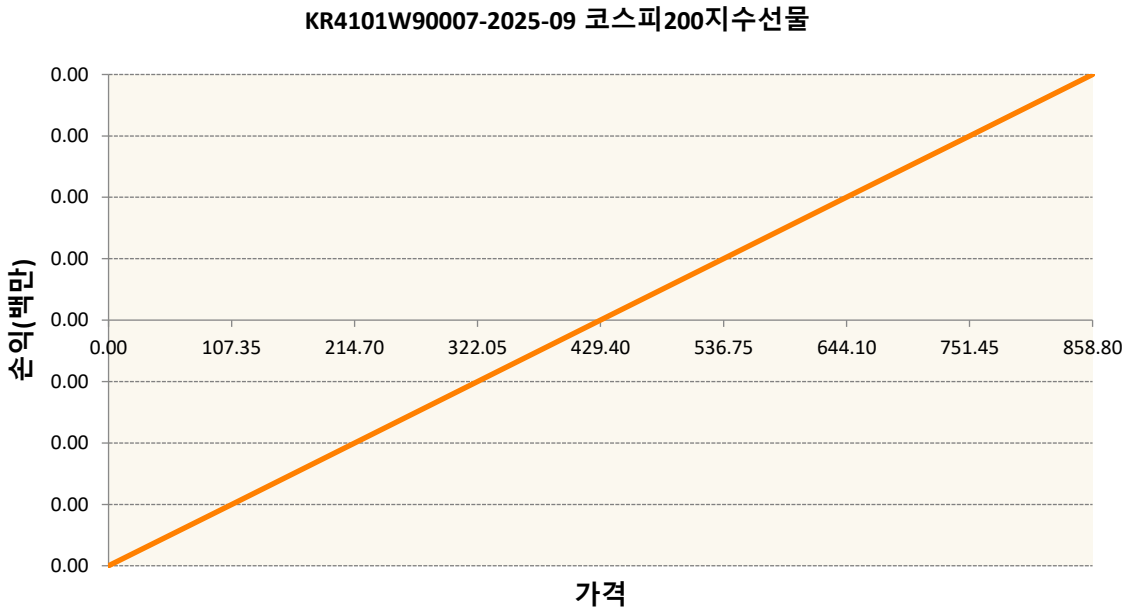
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

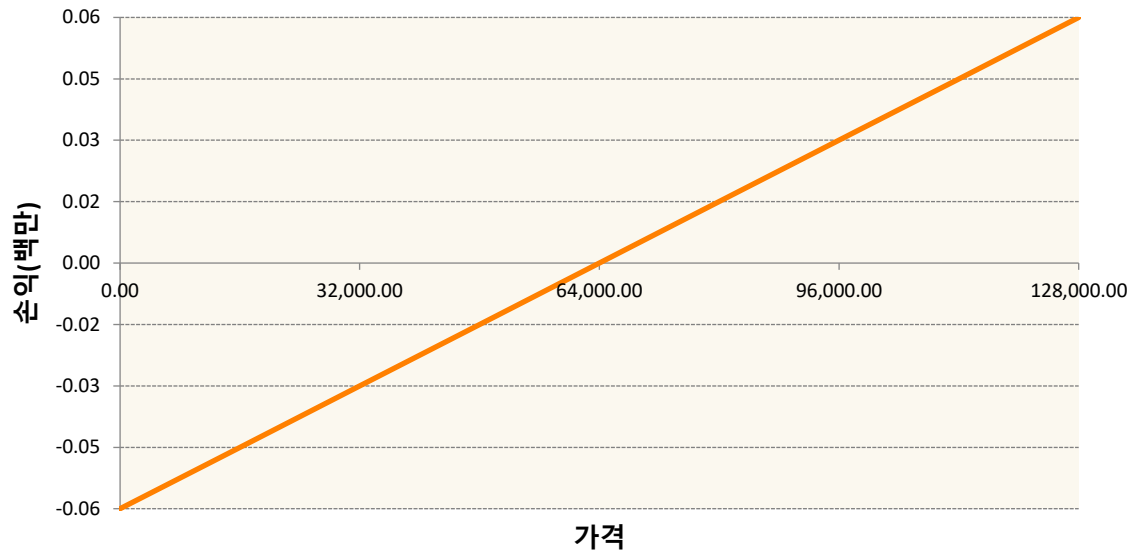
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	842	0	842	장내

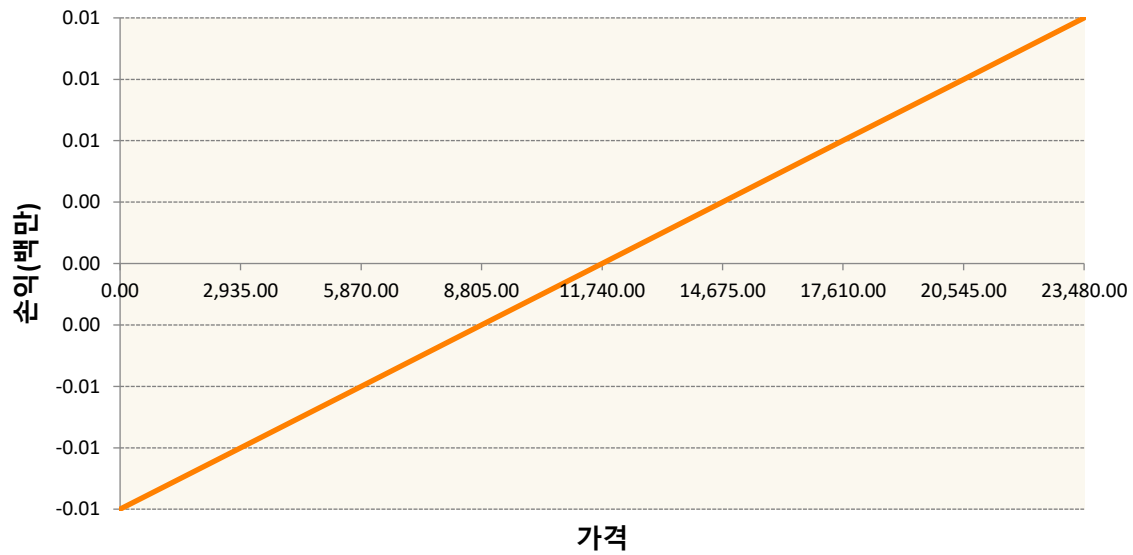
2. 만기시점의 손익구조



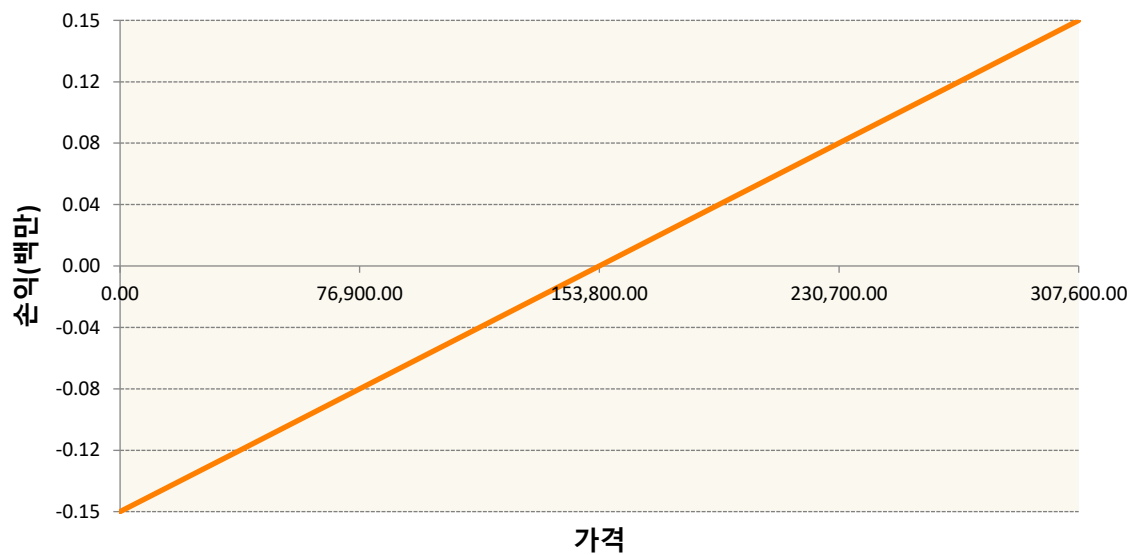
KR410FW90008-2025-09 두산로보틱스개별선물



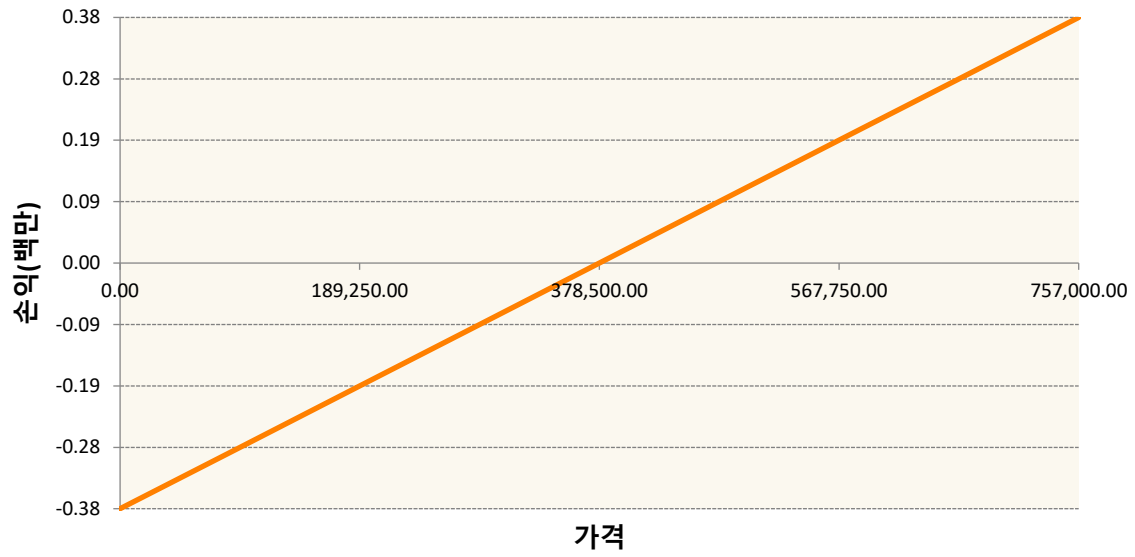
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



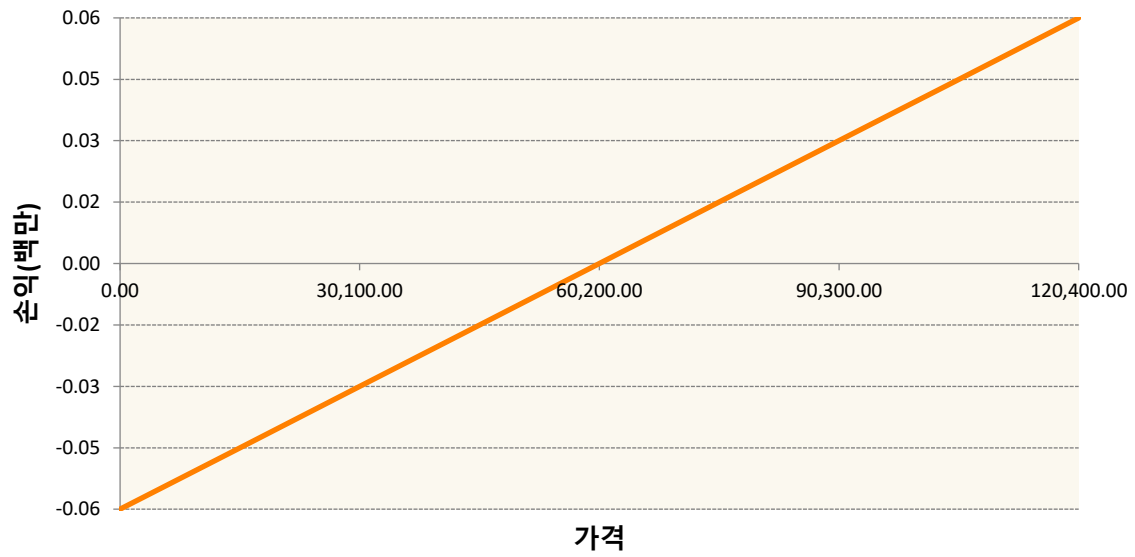
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



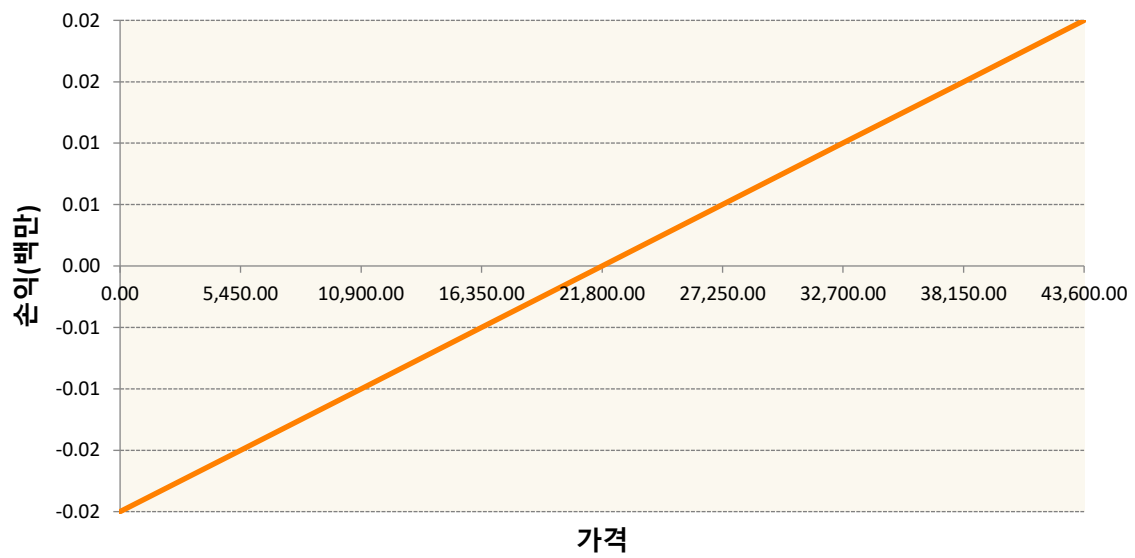
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



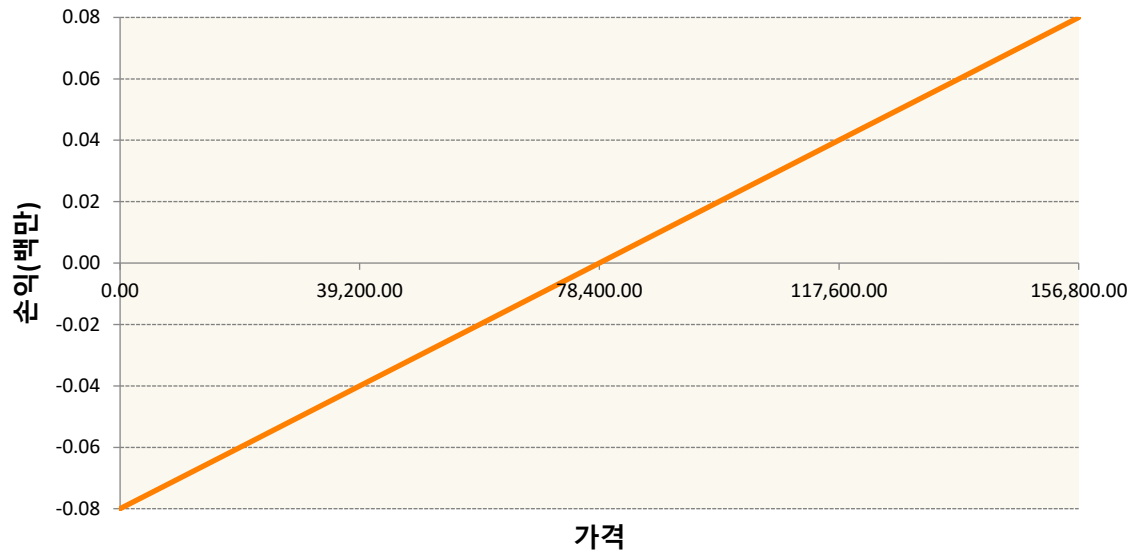
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물	26
KR4105W90(2025-09 미니코스피200 선물	5
KR410FW90(2025-09 두산로보틱스개별선물	1
KR4145W90(2025-09 LG디스플레이개별선물	1
KR41E8W90(2025-09 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41F5W90(2025-09 LG에너지솔루션개별선물	6
KR41F7W90(2025-09 카카오페이개별선물	1
KR41FAW90(2025-09 HMM개별선물	3
KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물	1

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

(단위:백만원)

37

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

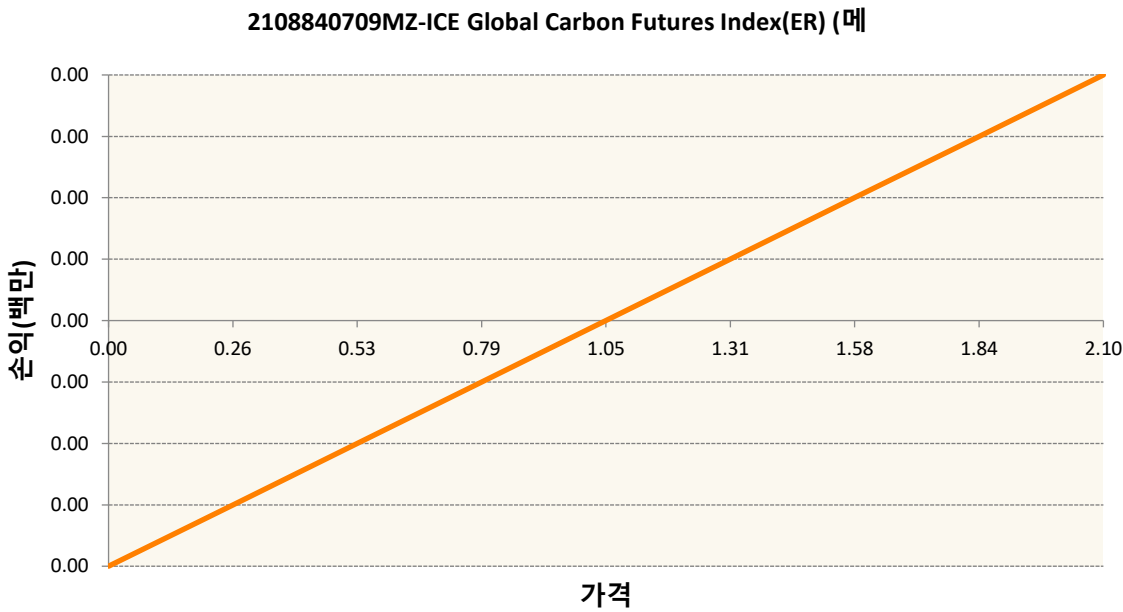
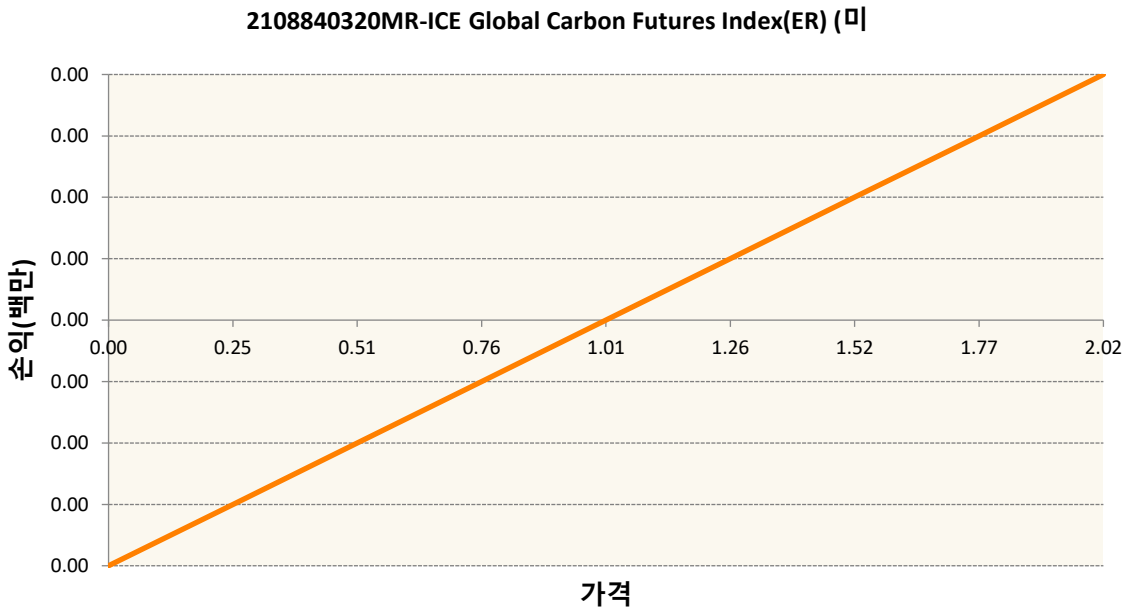
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	1,266	0	1,266	장외
누계	유가증권	선물	7,617	0	7,617	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	606
2108840709	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	101

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

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

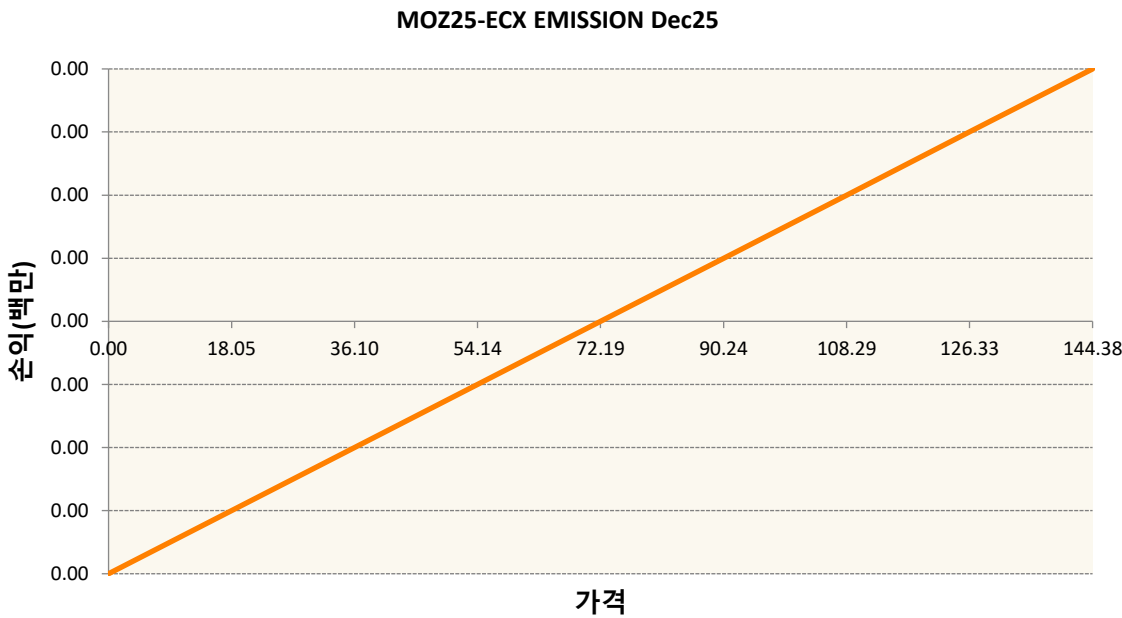
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,351	0	6,351	
누계	유가증권	선물	-12	0	-12	장외
누계	통화	선도	0	1,357	-1,357	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	508

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

(단위:백만원)

850

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

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)	23
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	23
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	16
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	16

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

(단위:백만원)

133

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

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)	63
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	76
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	54
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	16

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

(단위:백만원)

359

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

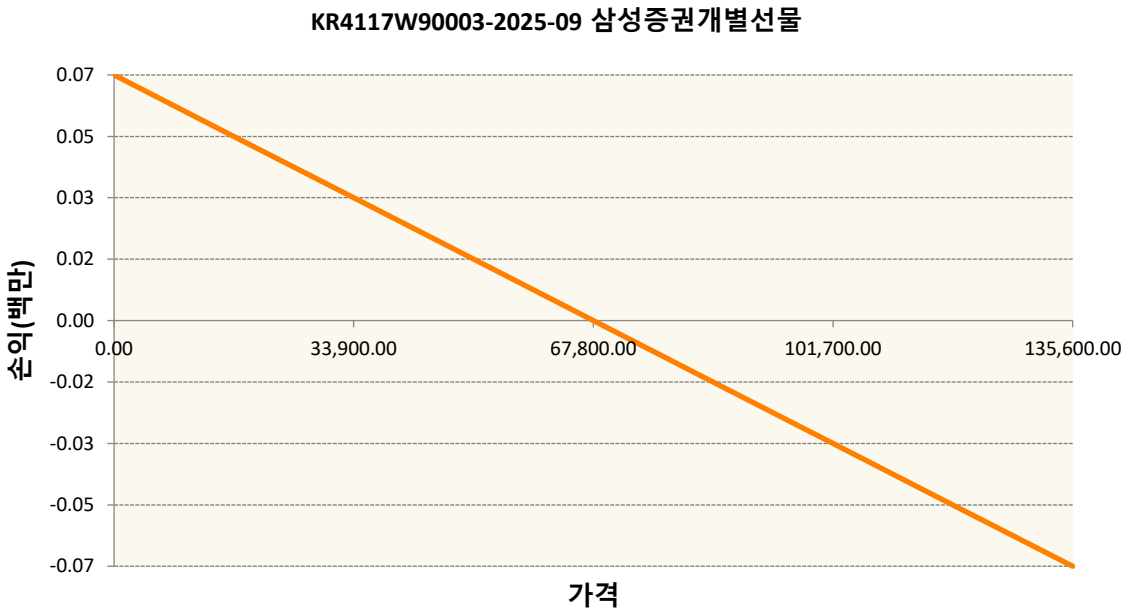
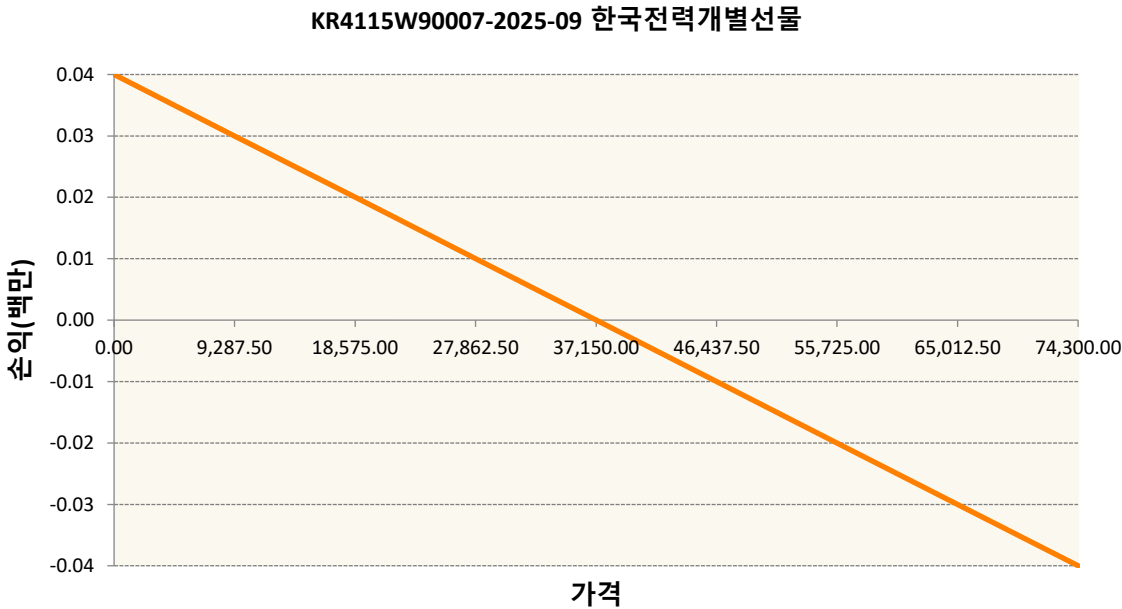
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

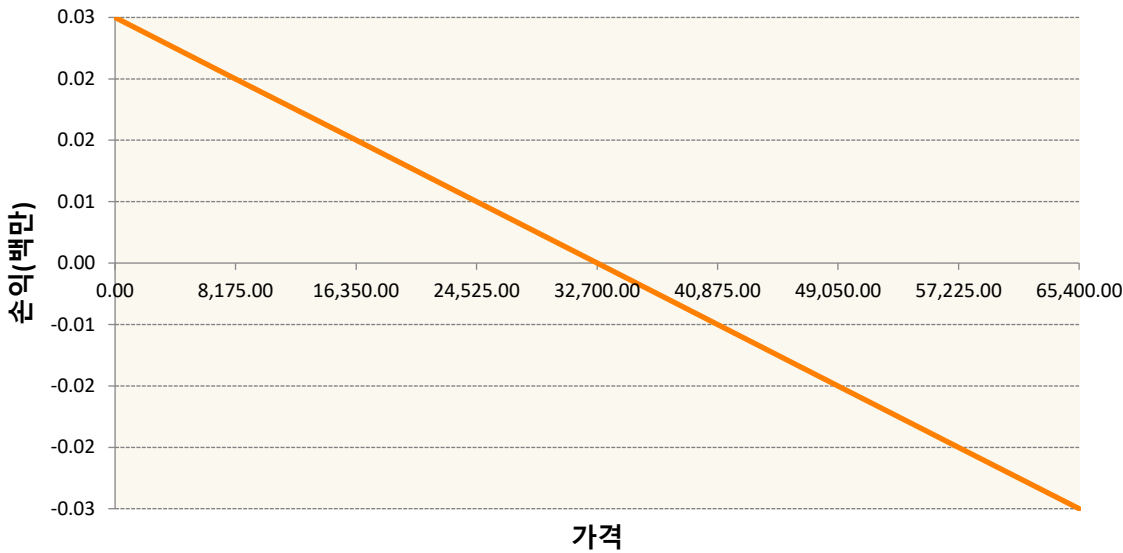
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5	0	5	장내
누계	유가증권	선물	0	31	-31	장내

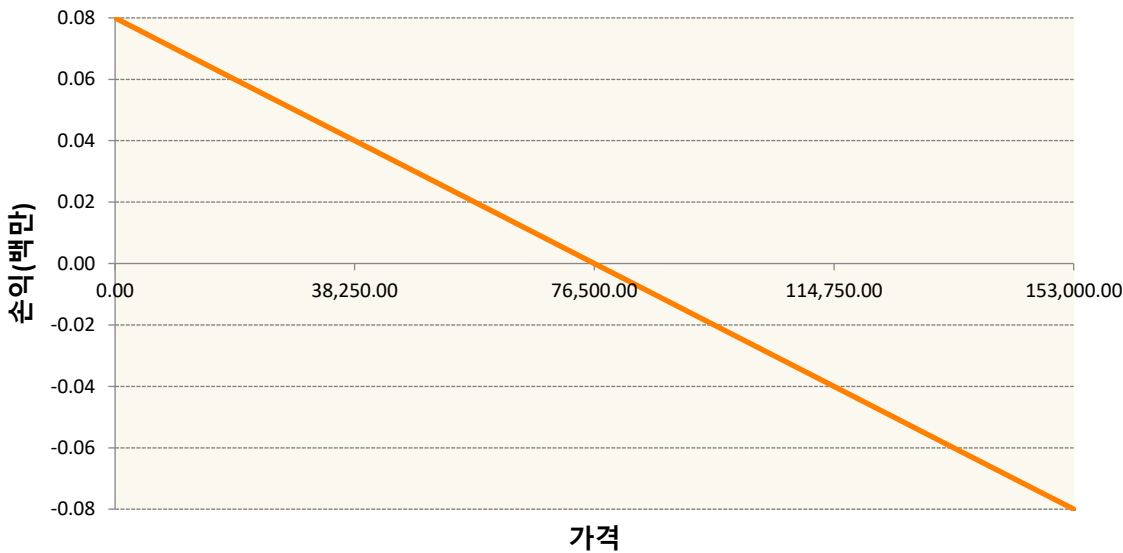
2. 만기시점의 손익구조



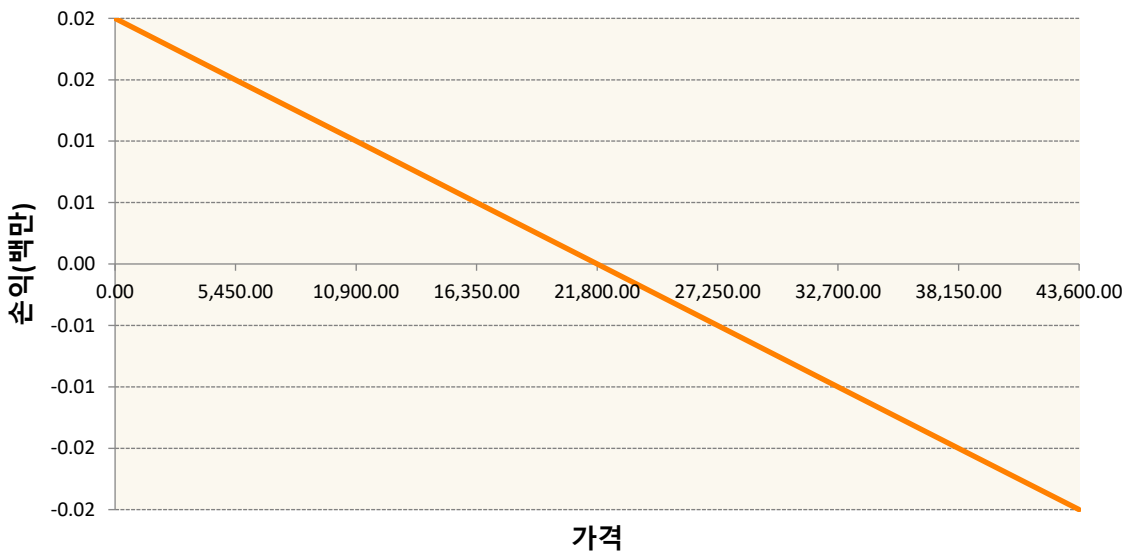
KR4132W90002-2025-09 현대제철개별선물



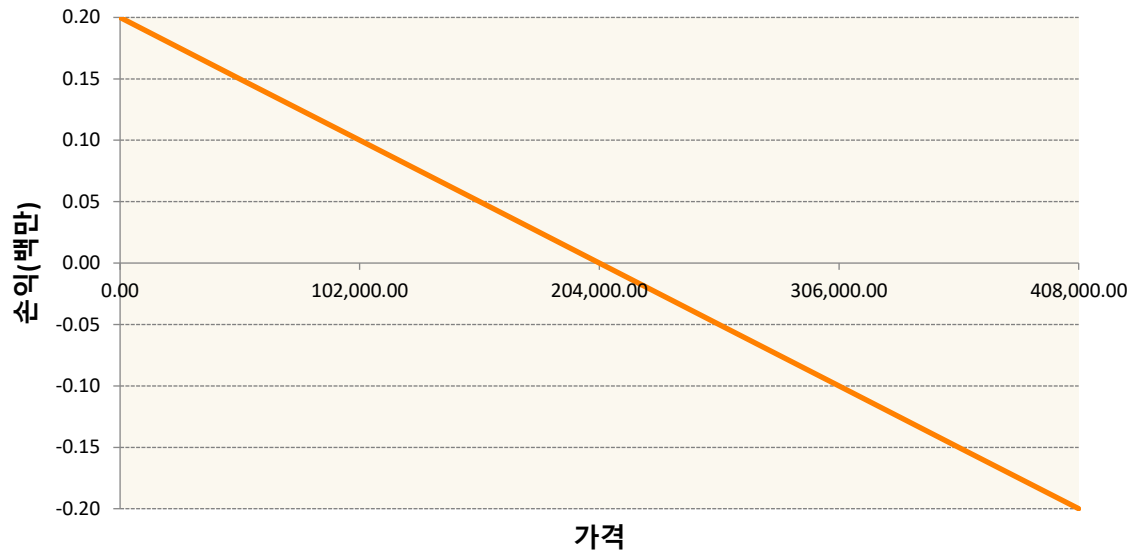
KR41DTW90001-2025-09 CJ ENM개별선물



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



KR41HEW90004-2025-09 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4115W90(2025-09 한국전력개별선물	1
KR4117W90(2025-09 삼성증권개별선물	1
KR4132W90(2025-09 현대제철개별선물	0.37
KR41DTW90(2025-09 CJ ENM개별선물	0.31
KR41FAW90(2025-09 HMM개별선물	0.26
KR41HEW90(2025-09 키움증권개별선물	0.33

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

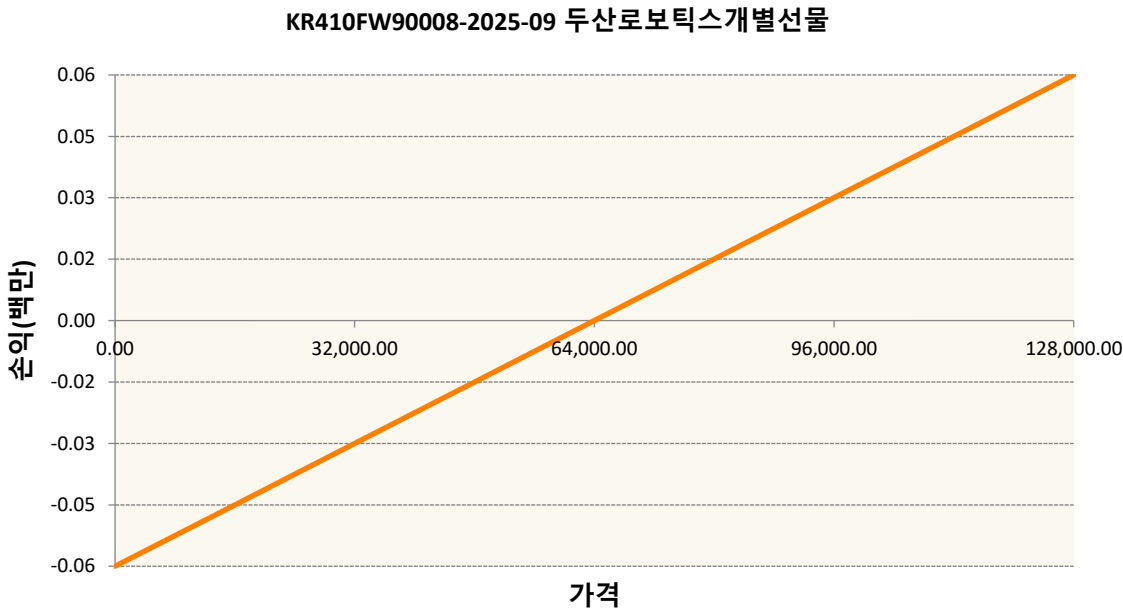
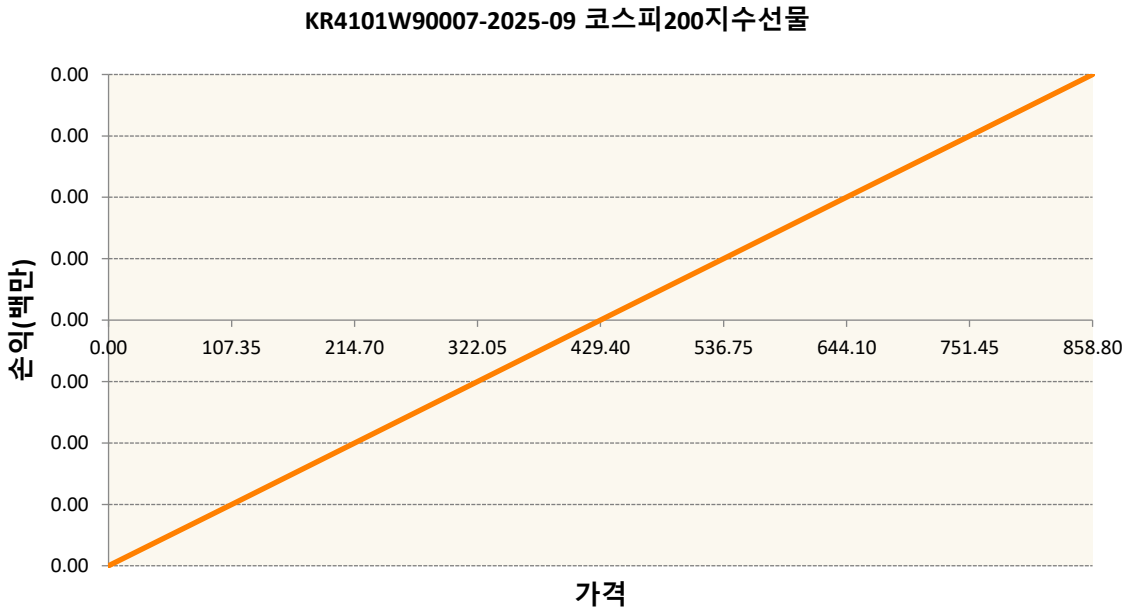
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

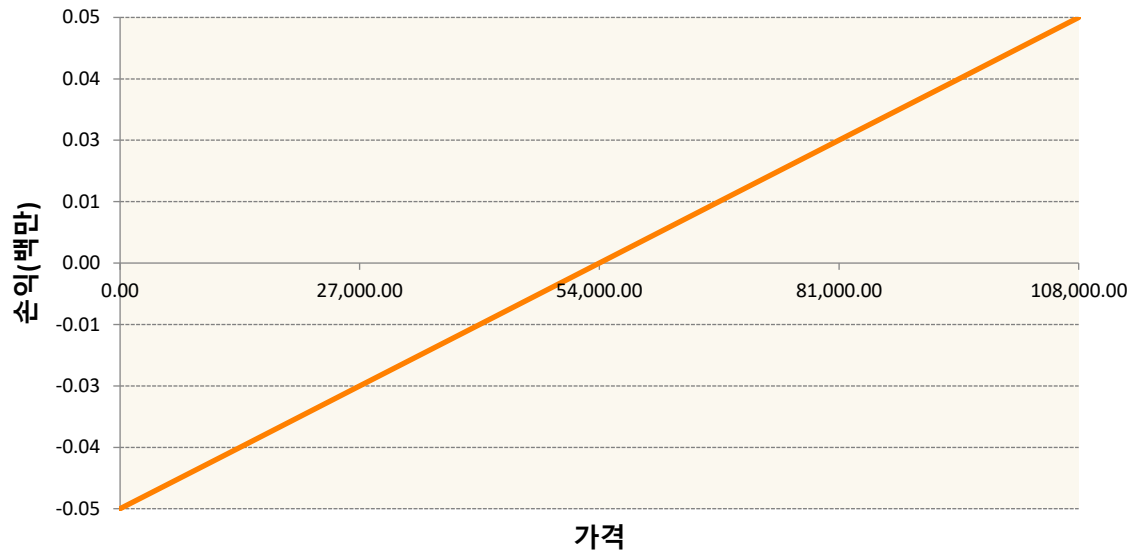
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	485	0	485	장내
누계	유가증권	선물	11,874	0	11,874	장내

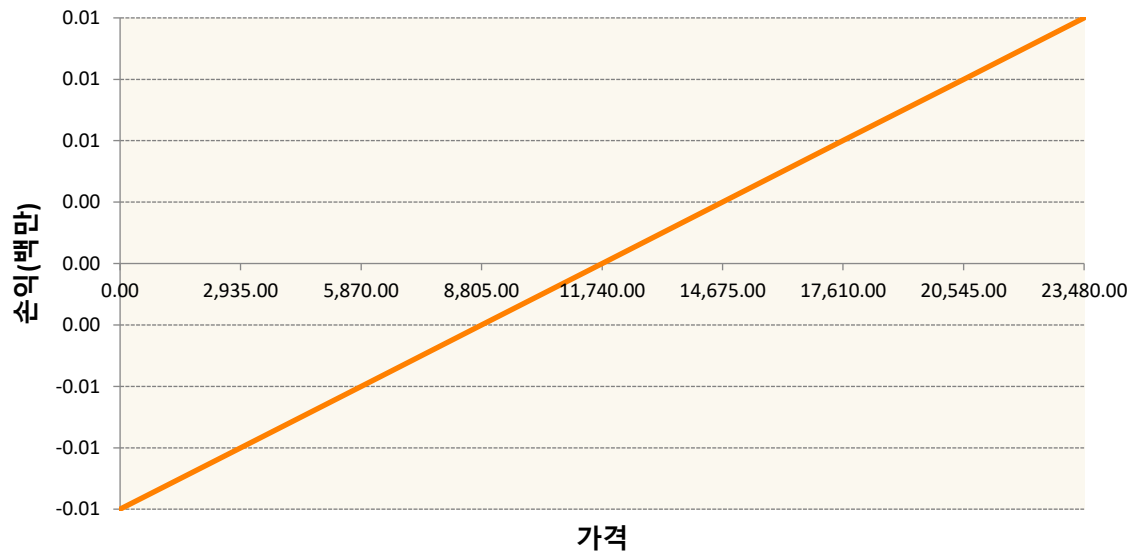
2. 만기시점의 손익구조



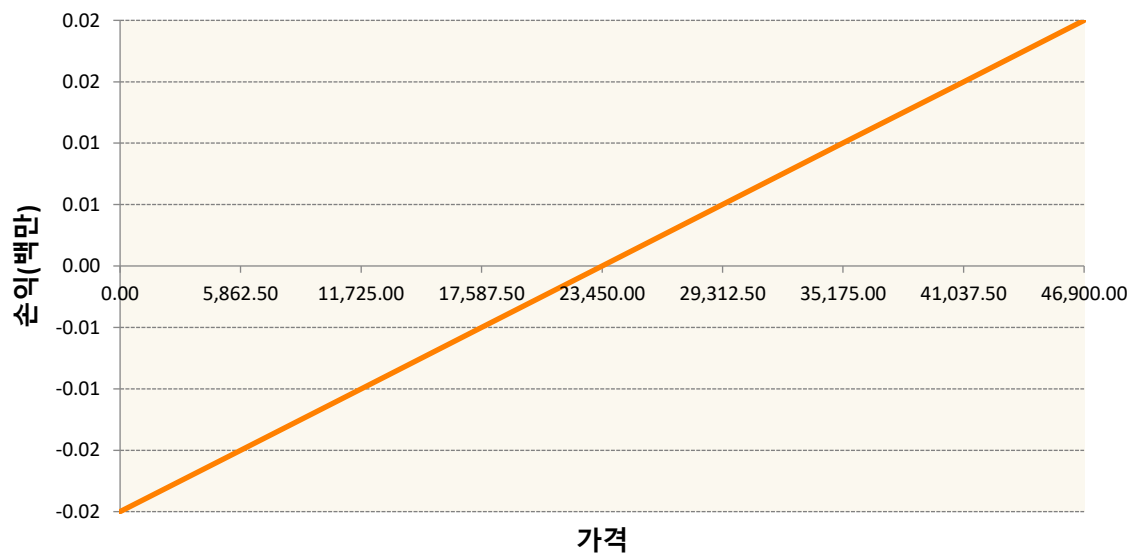
KR411RW90001-2025-09 한화비전개별선물



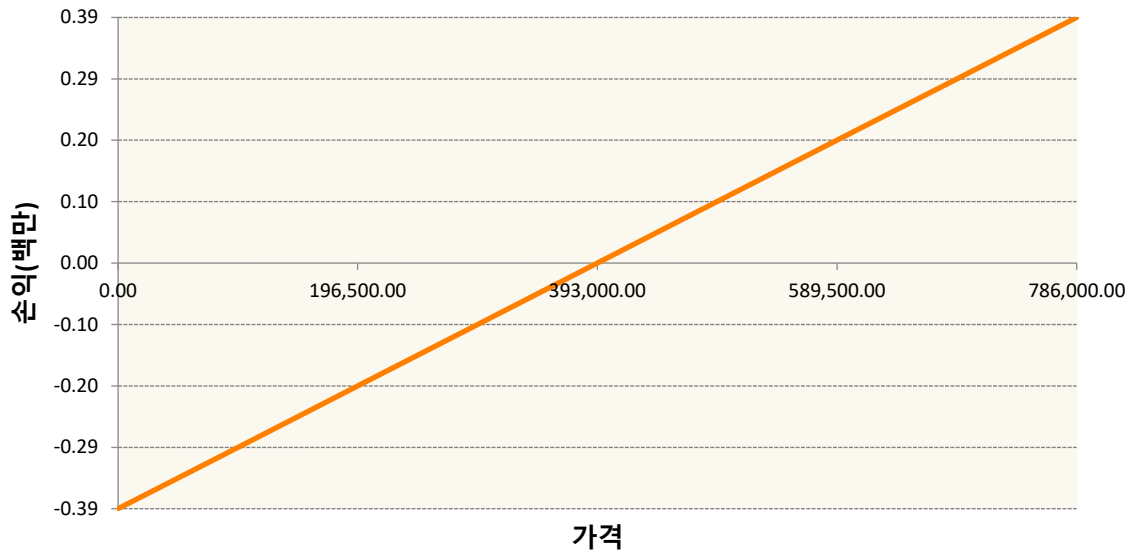
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



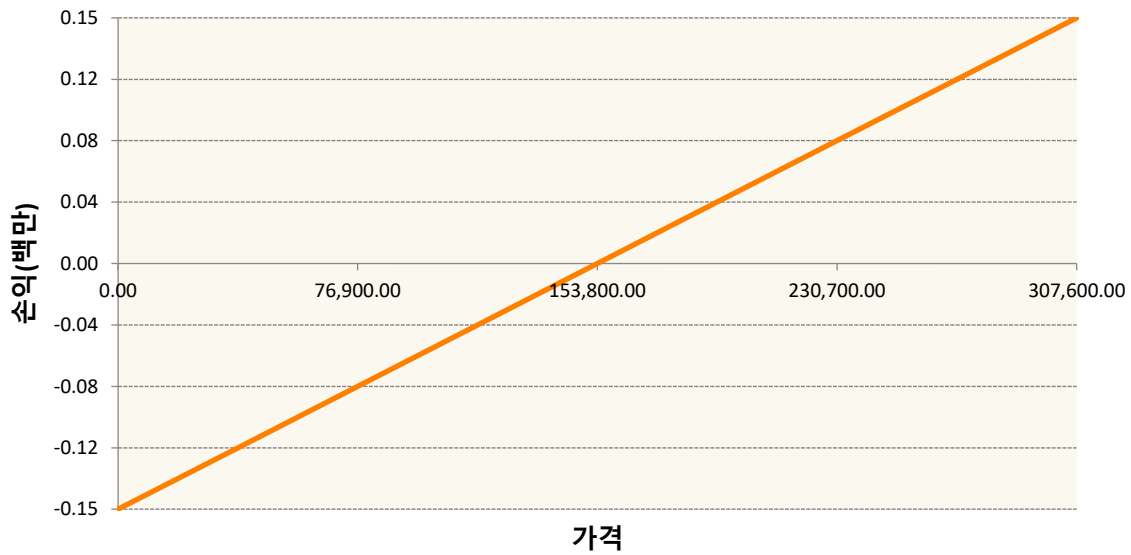
KR41CNW90006-2025-09 포스코DX개별선물



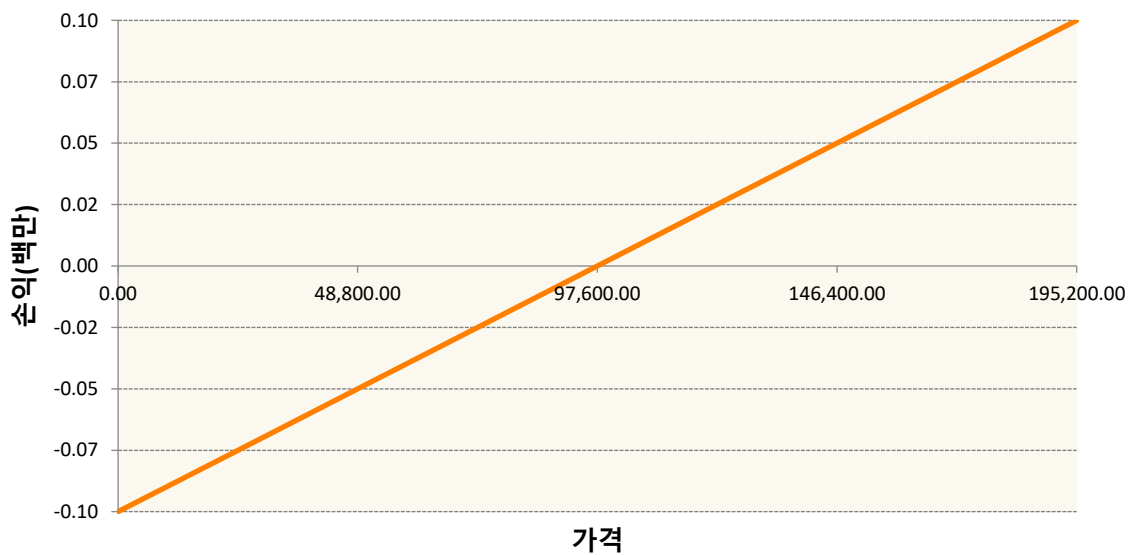
KR41DAW90001-2025-09 농심개별선물



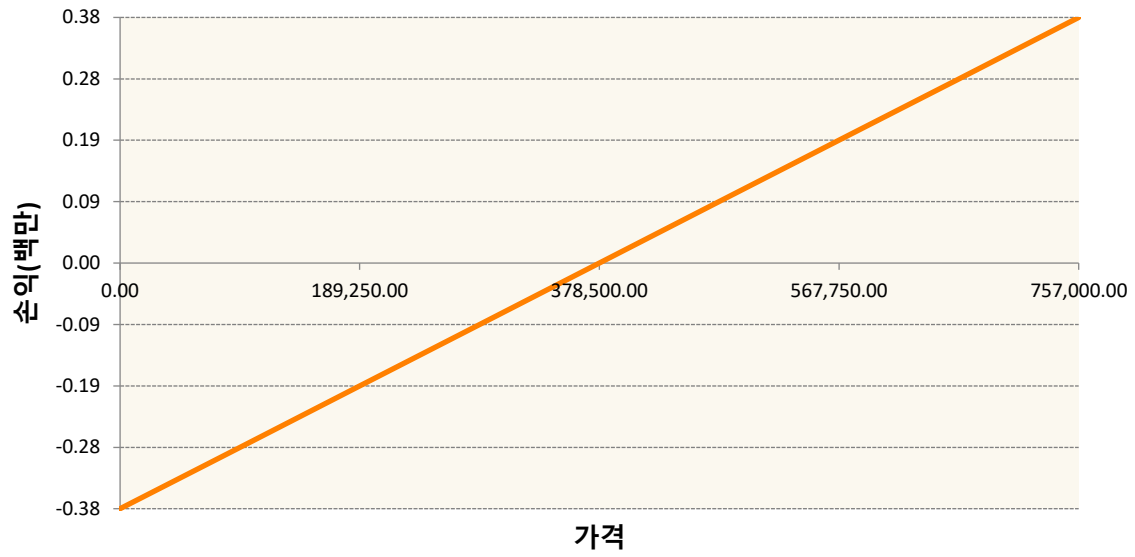
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



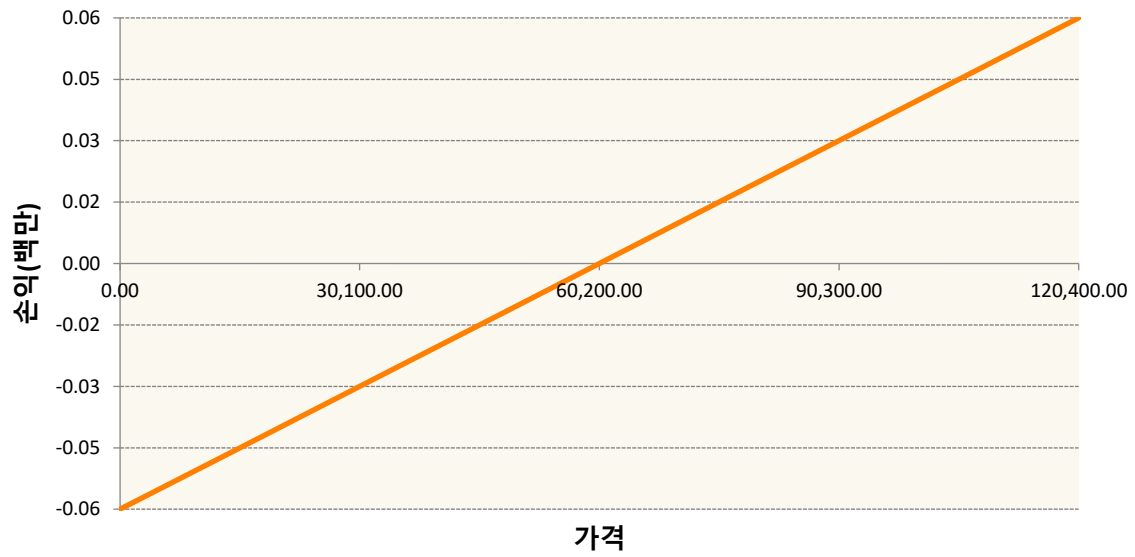
KR41EJW90000-2025-09 SKC개별선물



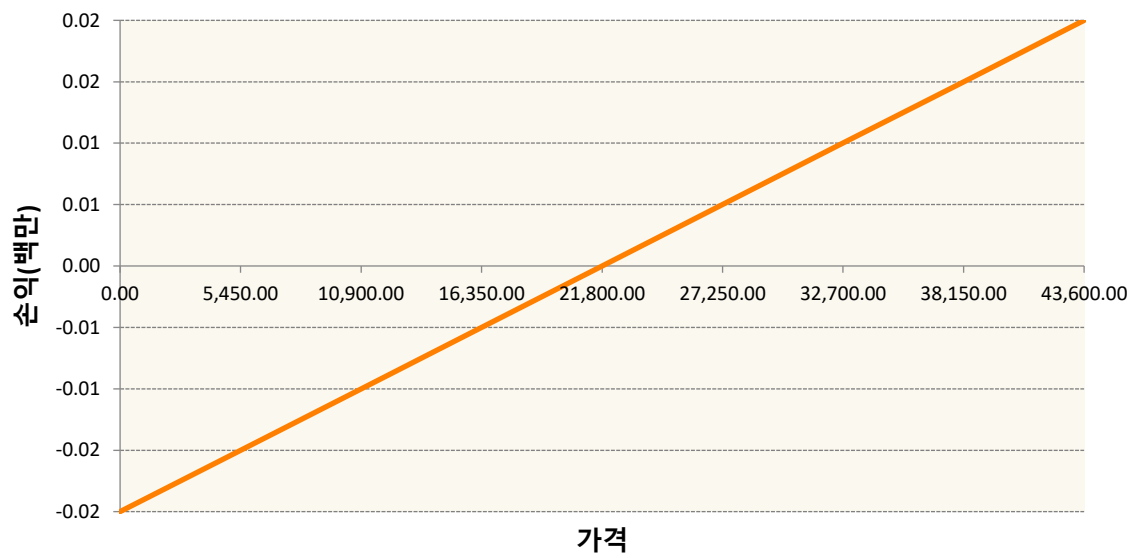
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



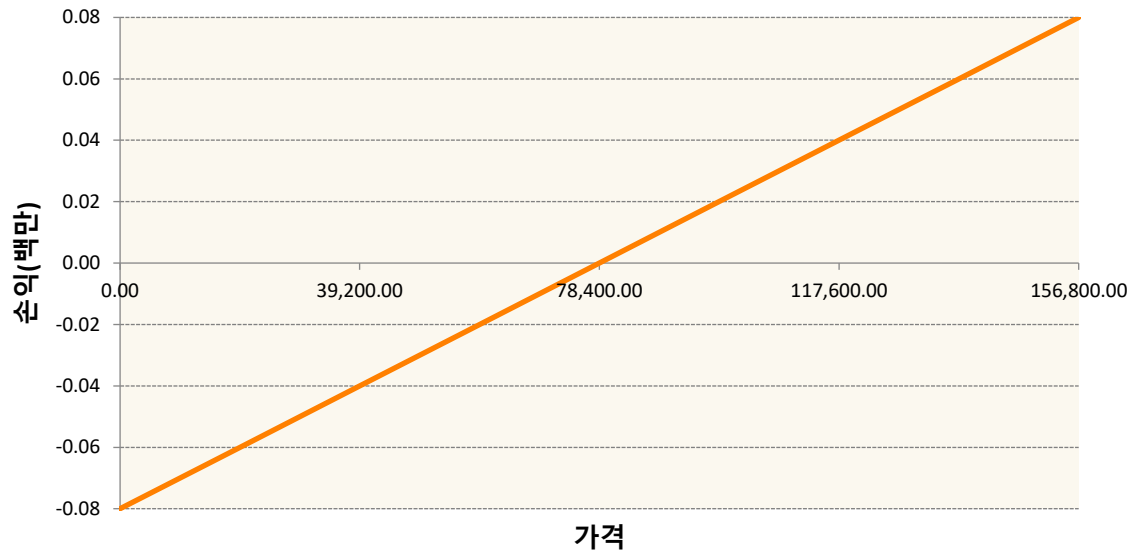
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



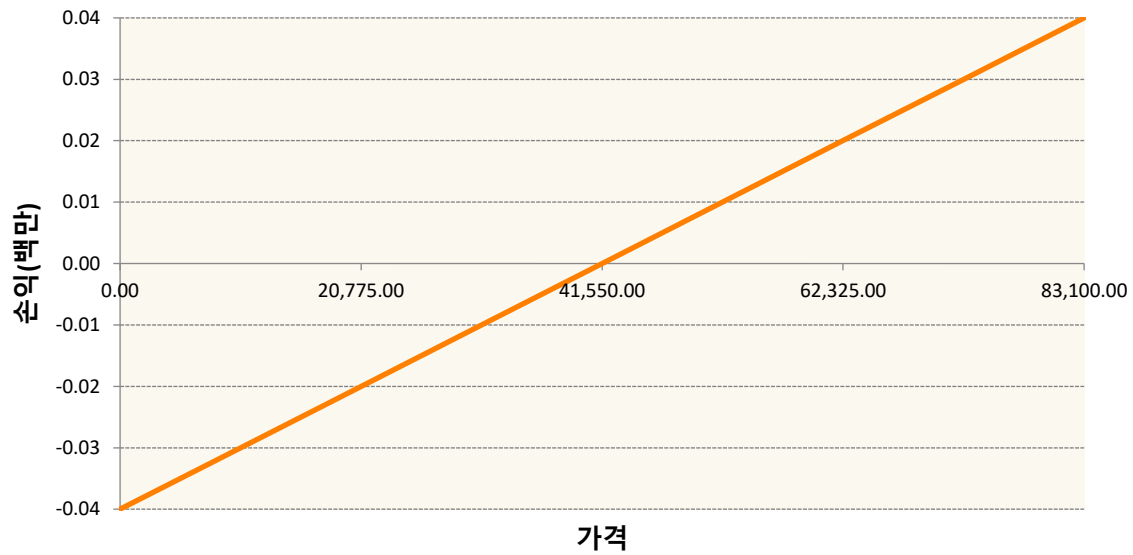
KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



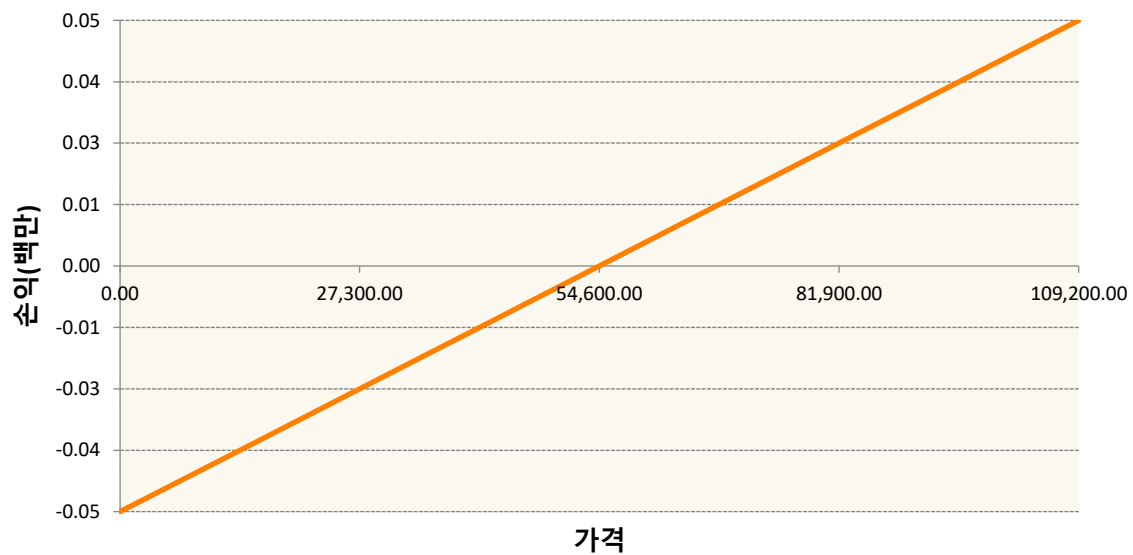
KR41FMW90001-2025-09 엘애프개별선물



KR41G0W90002-2025-09 씨에스원드개별선물



KR41GZW90001-2025-09 에코프로머티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물		756
KR410FW90(2025-09 두산로보틱스개별선물		14
KR411RW90(2025-09 한화비전개별선물		1
KR4145W90(2025-09 LG디스플레이개별선물		24
KR41CNW90 2025-09 포스코DX개별선물		13
KR41DAW90 2025-09 농심개별선물		4
KR41E8W90(2025-09 포스코퓨처엠개별선물		43
KR41EJW900 2025-09 SKC개별선물		20
KR41F5W90(2025-09 LG에너지솔루션개별선물		14
KR41F7W90(2025-09 카카오페이개별선물		17
KR41FAW90(2025-09 HMM개별선물		8
KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물		20
KR41G0W90 2025-09 씨에스윈드개별선물		3
KR41GZW90 2025-09 에코프로머티개별선물		13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	599

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

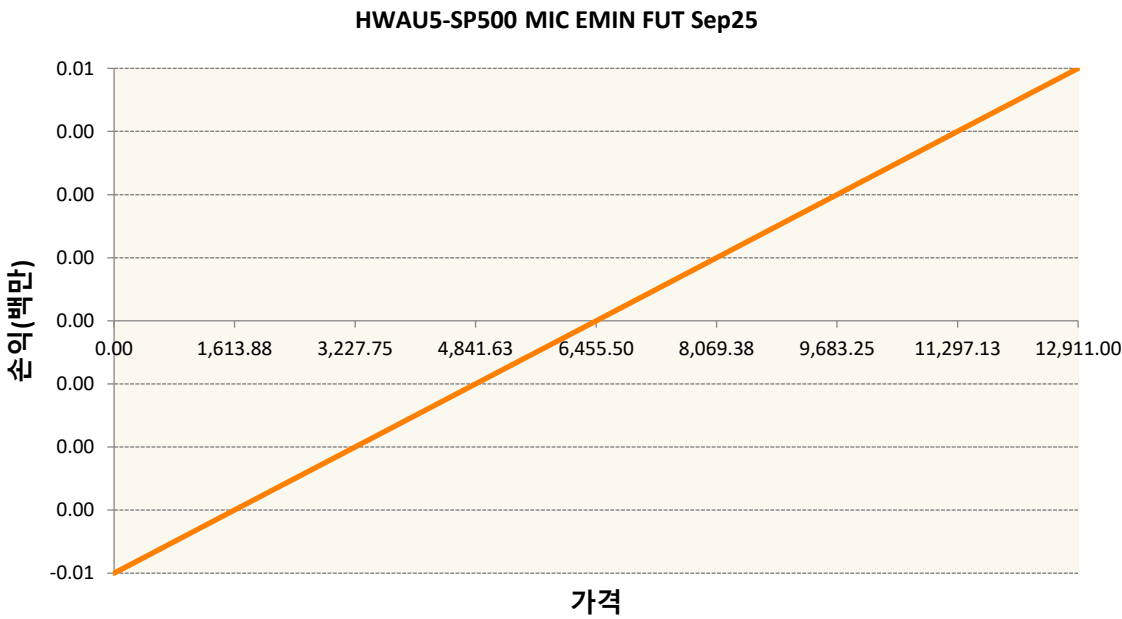
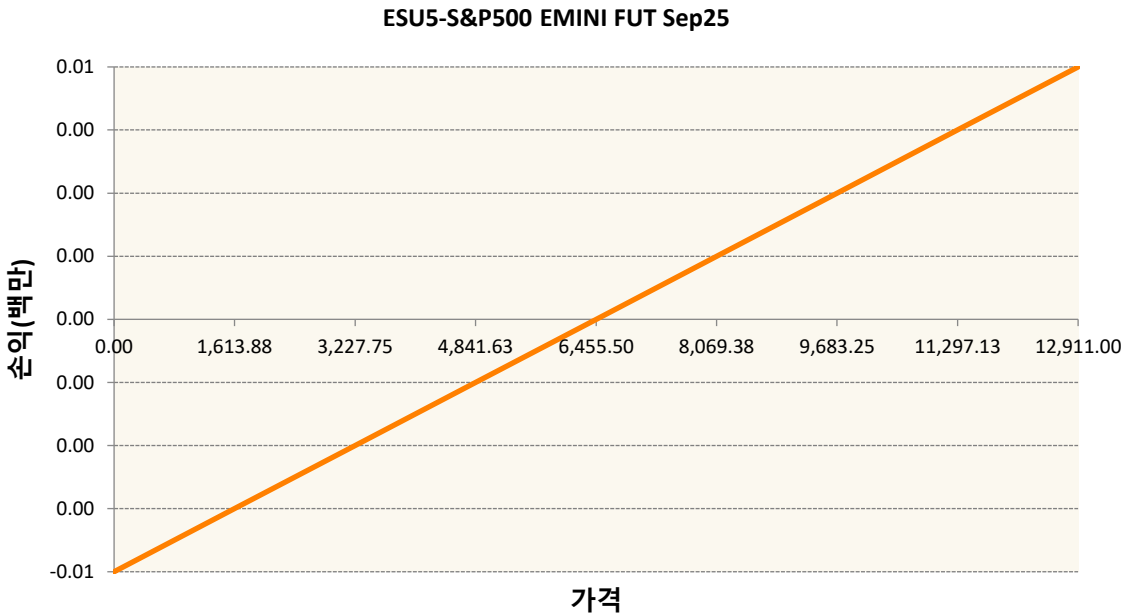
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	32,534	0	32,534	
누계	지수	선물	1,111	0	1,111	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,603
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	89

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,356

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

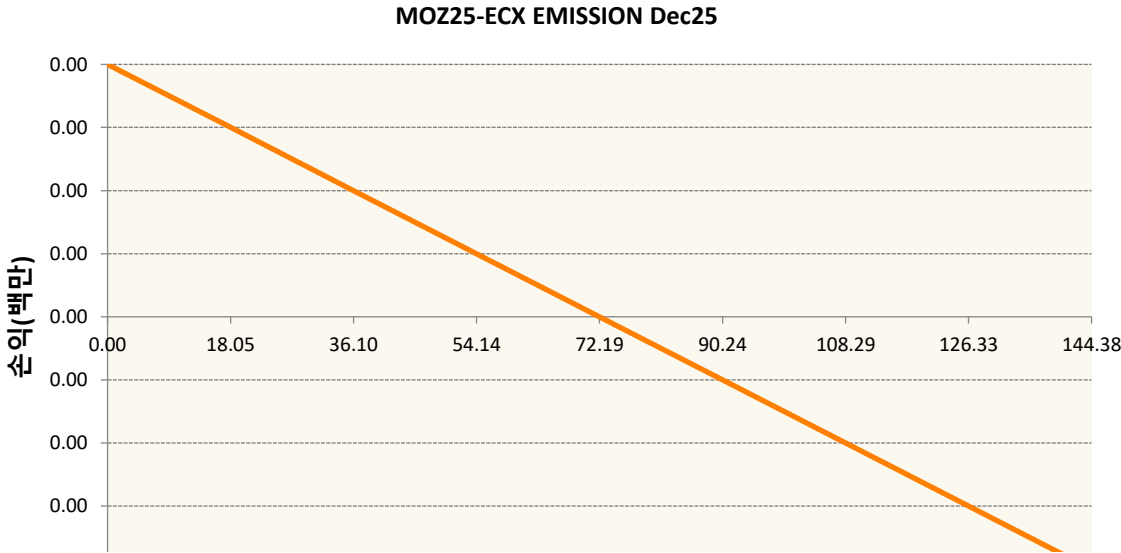
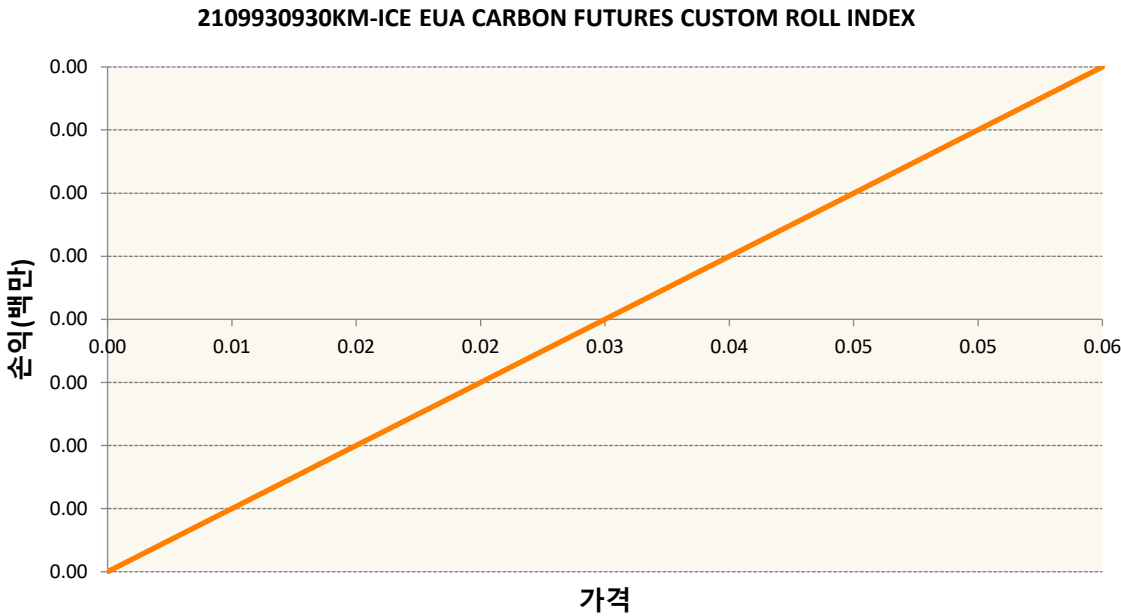
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,888	-4,888	
누계	유가증권	선물	12	0	12	장외
누계	통화	선도	0	1,028	-1,028	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	81
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	391

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

(단위:백만원)

654

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

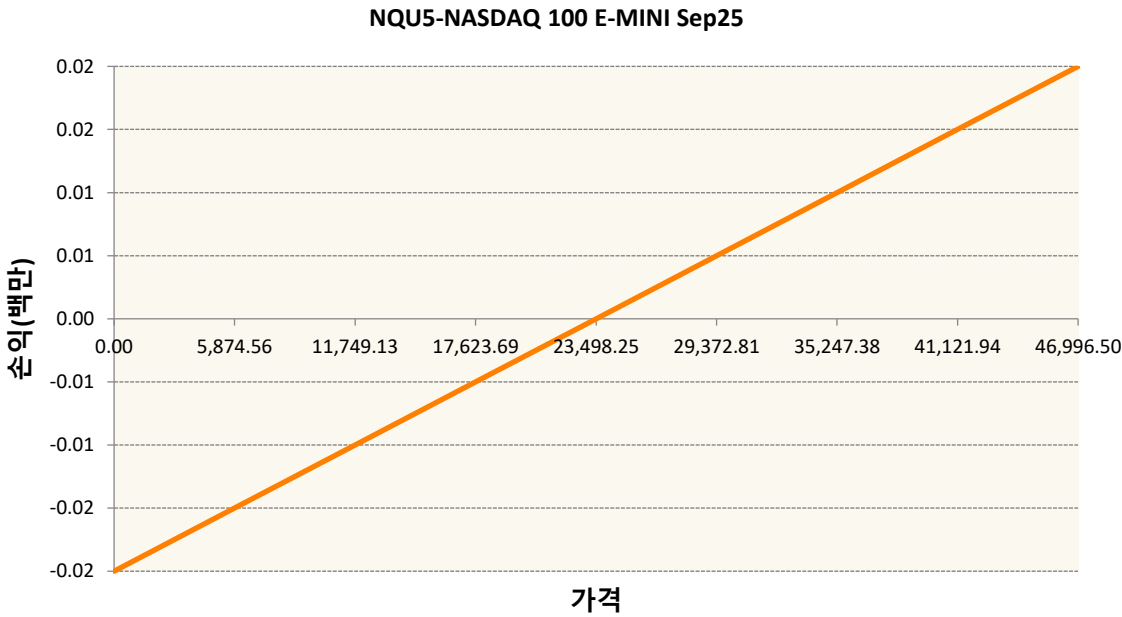
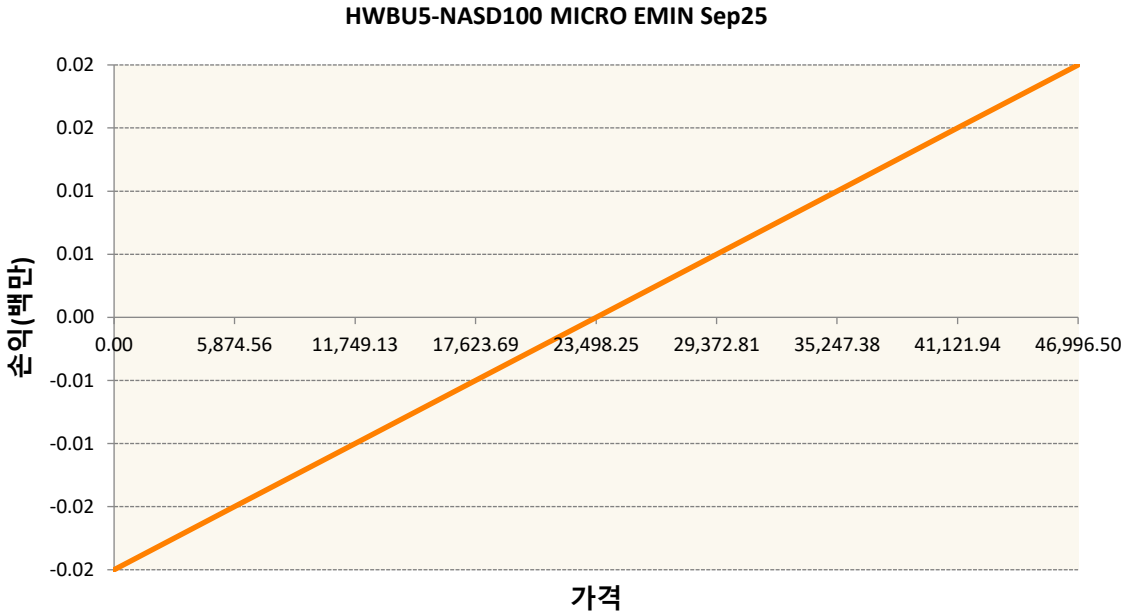
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,628	0	13,628	
누계	지수	선물	1,174	0	1,174	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25		94
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		1,090

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,339

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

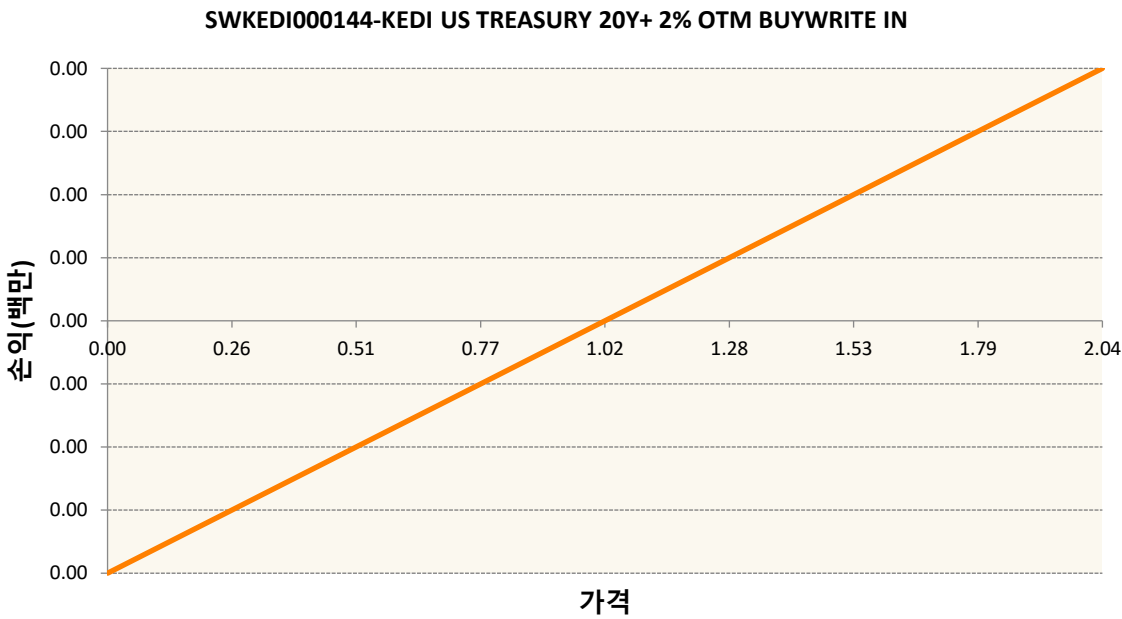
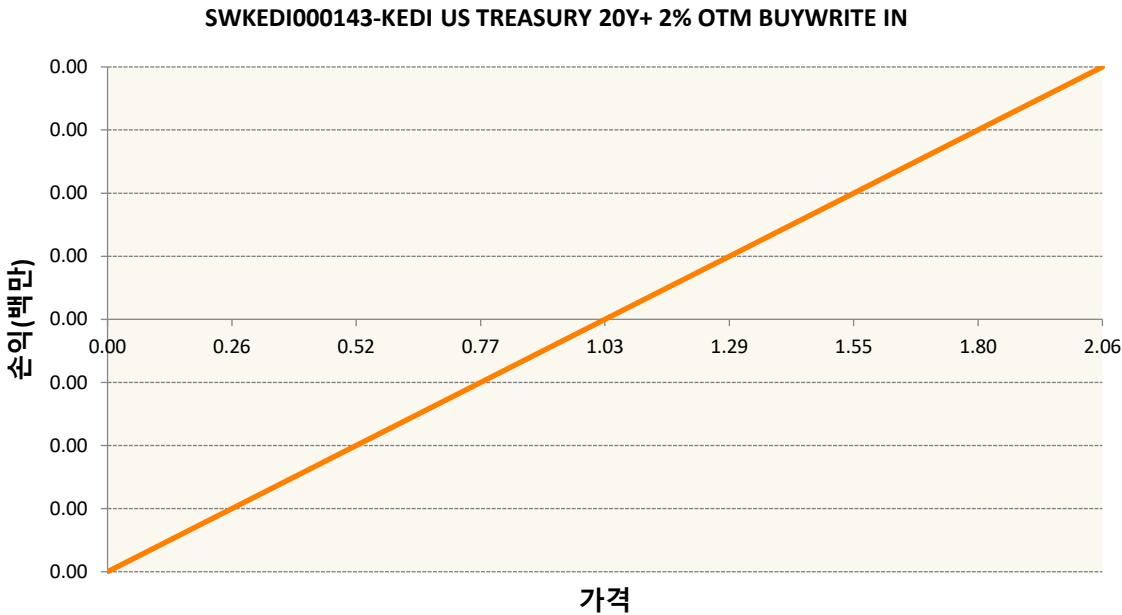
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

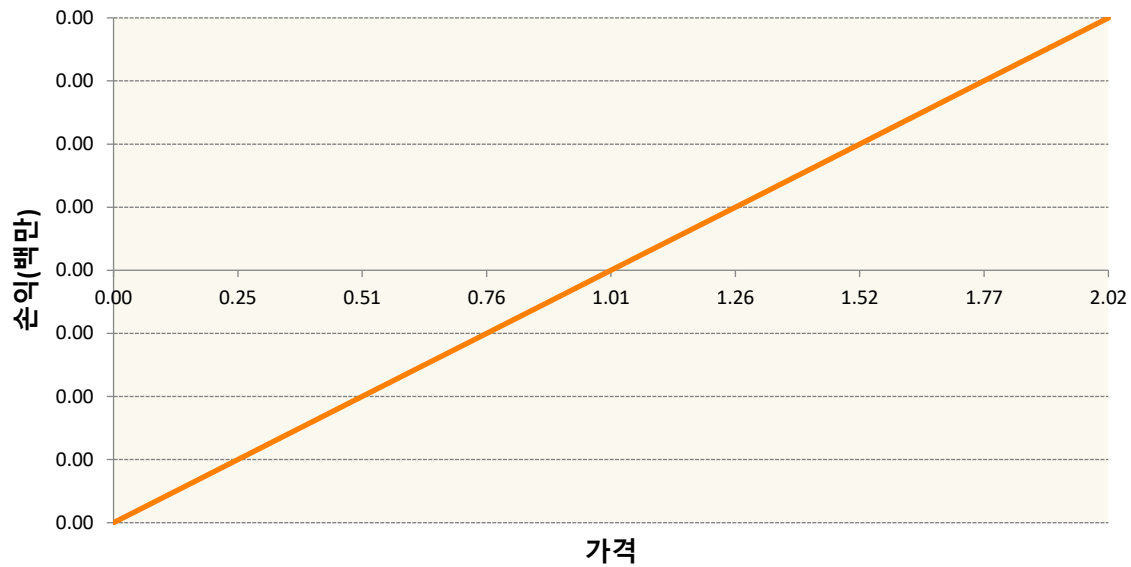
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	333,162	0	333,162	장외

2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000146-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

3,360
7,878
175
9,517
6,058

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

(단위:백만원)

13,611

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

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)

83

공시일	2025-08-27
기준일	2025-08-26

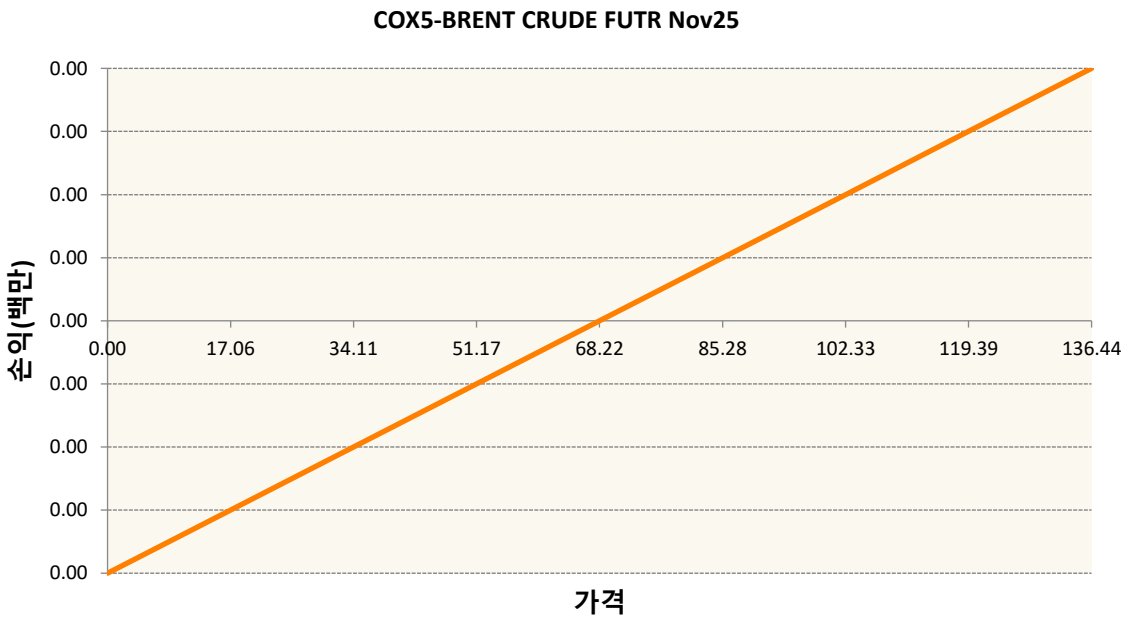
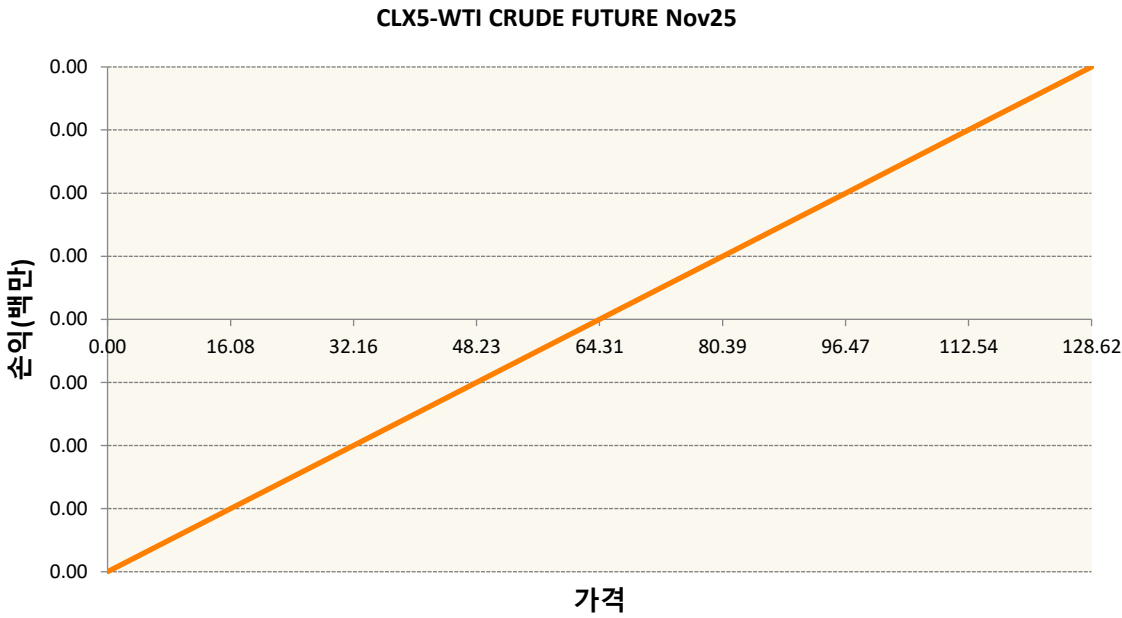
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

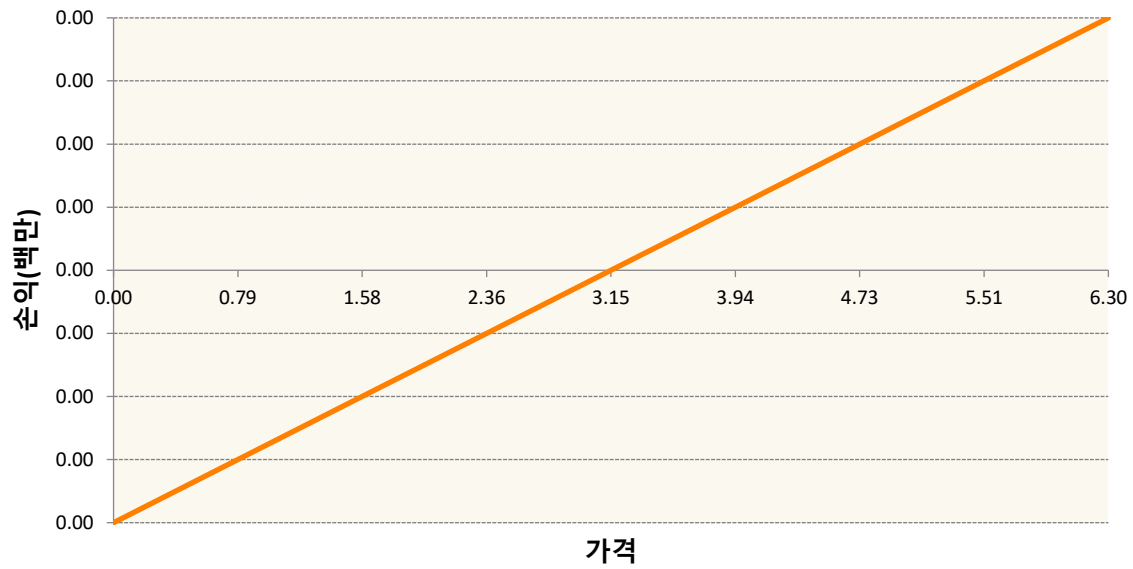
(단위:백만원)

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	535	0	535	
누계	통화	선물	0	70	-70	장내

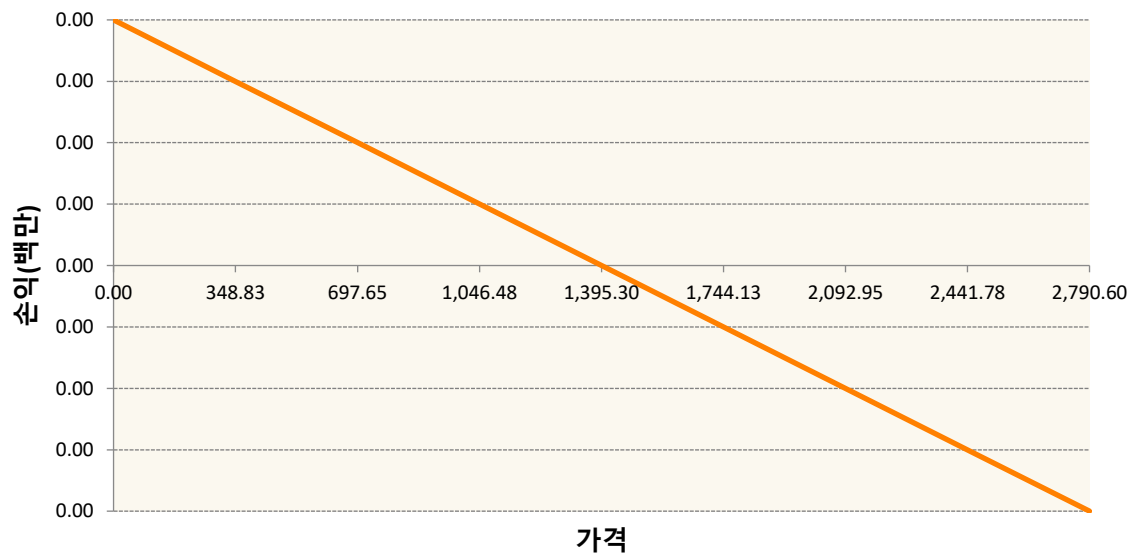
2. 만기시점의 손익구조



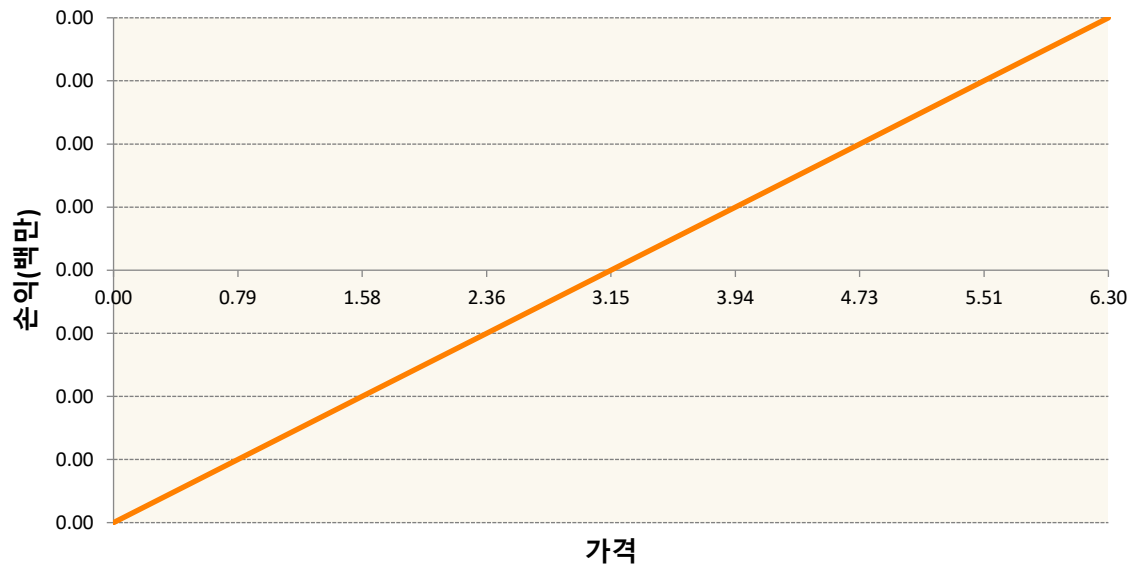
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

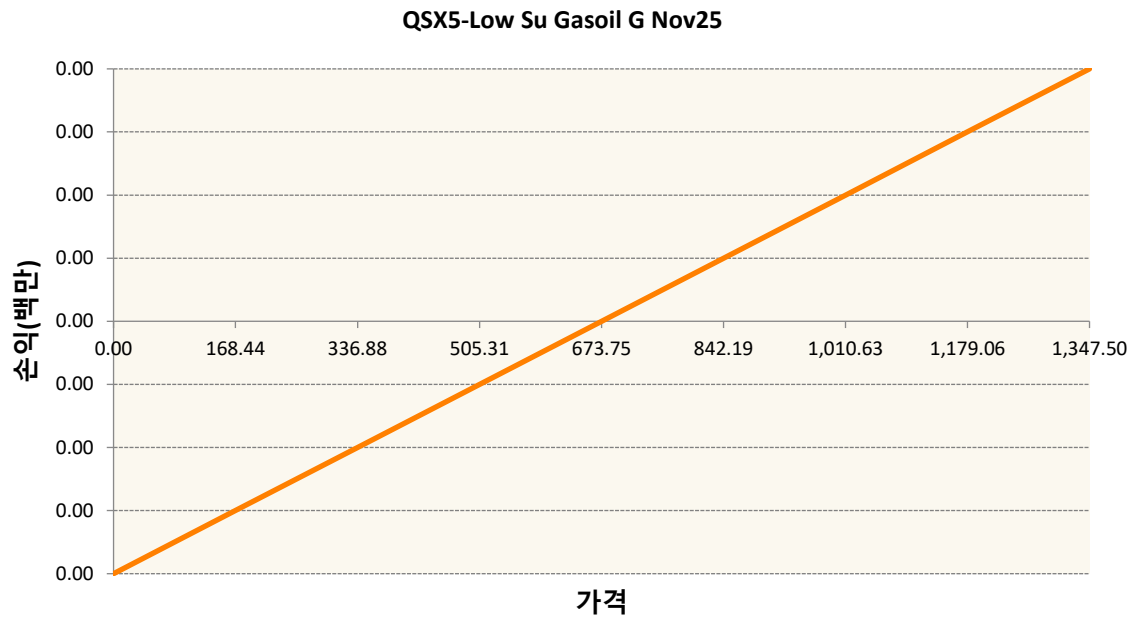


KR4175W90001-2025-09 달러선물



NGX25-NATURAL GAS FUTR Nov25





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLX5	WTI CRUDE FUTURE Nov25		7
COX5	BRENT CRUDE FUTR Nov25		15
EOX5	E-MINI NATURAL GA Nov25		3
KR4175W90(2025-09 달러선물			6
NGX25	NATURAL GAS FUTR Nov25		10
QX5	Low Su Gasoil G Nov25		7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	97