

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

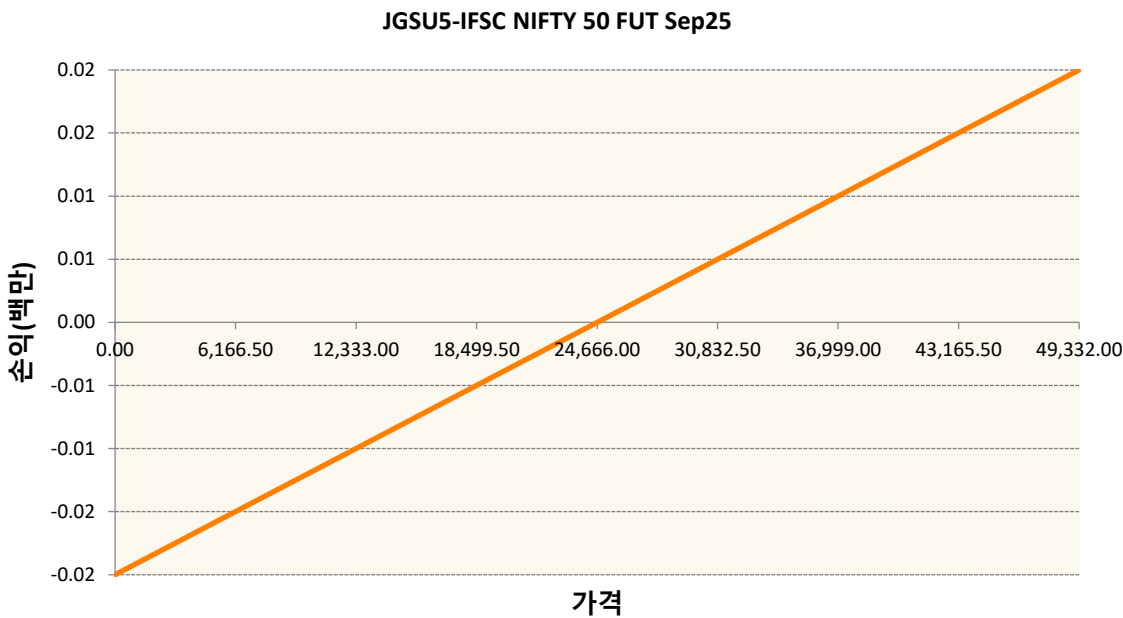
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 551   | 0     | 551       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |    |
|-------|-------------------------|----|
| JGSU5 | IFSC NIFTY 50 FUT Sep25 | 44 |
|-------|-------------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 31 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

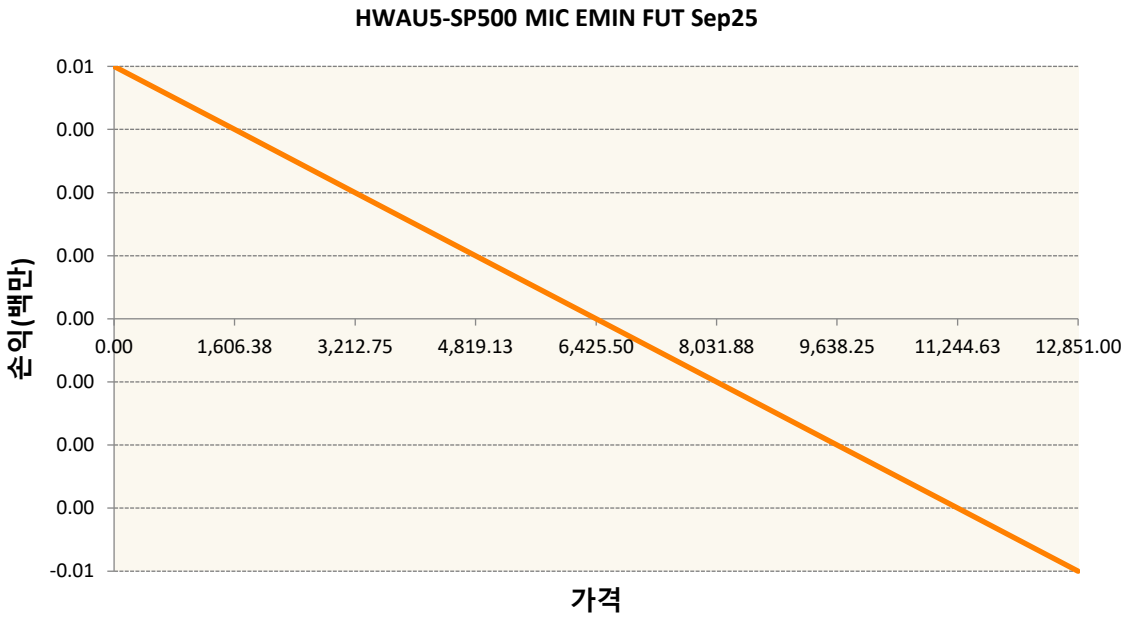
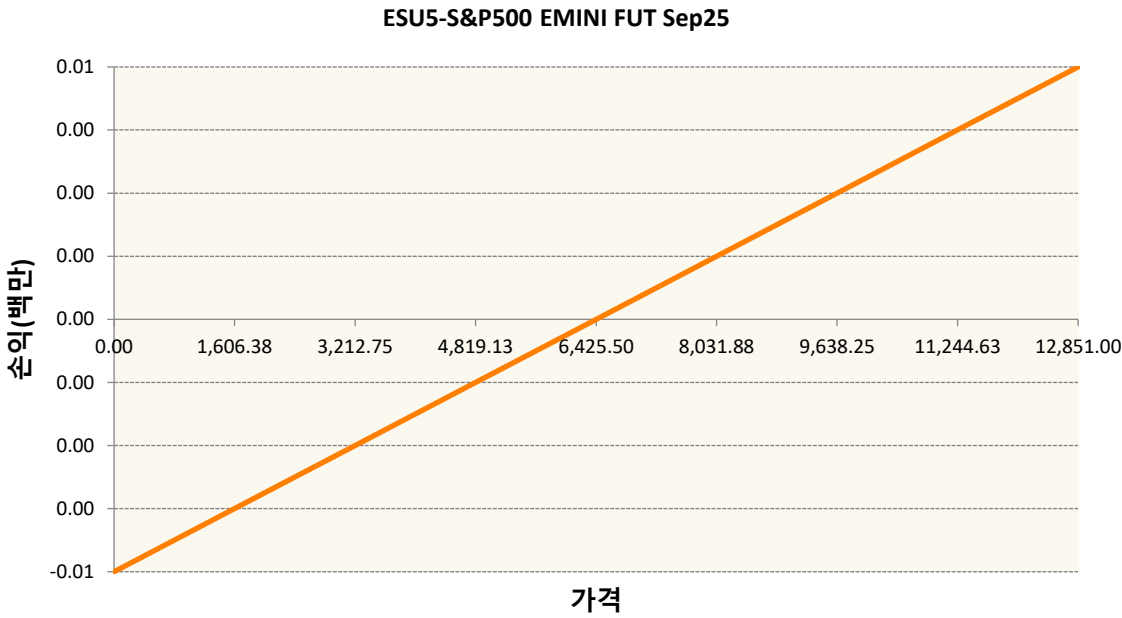
# SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

## 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   | 883   | 0     | 883       |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 0     | 226   | -226      | 장내 |

## 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESU5                      | S&P500 EMINI FUT Sep25   | 71       |
| HWAU5                     | SP500 MIC EMIN FUT Sep25 | 18       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 78       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

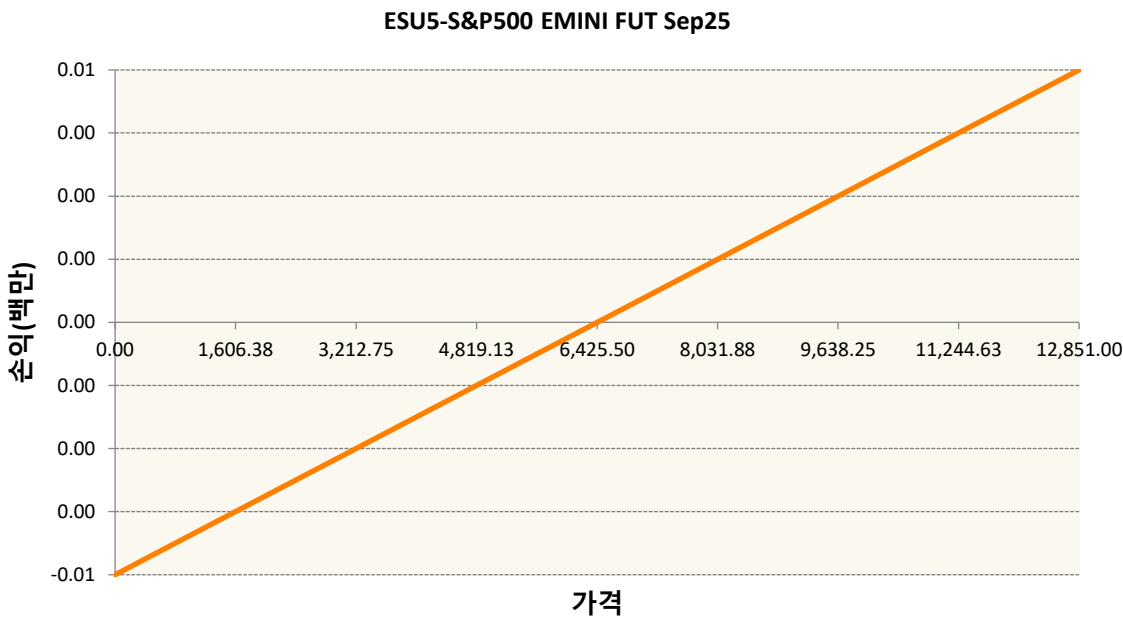
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,331 | 0     | 1,331     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

93

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

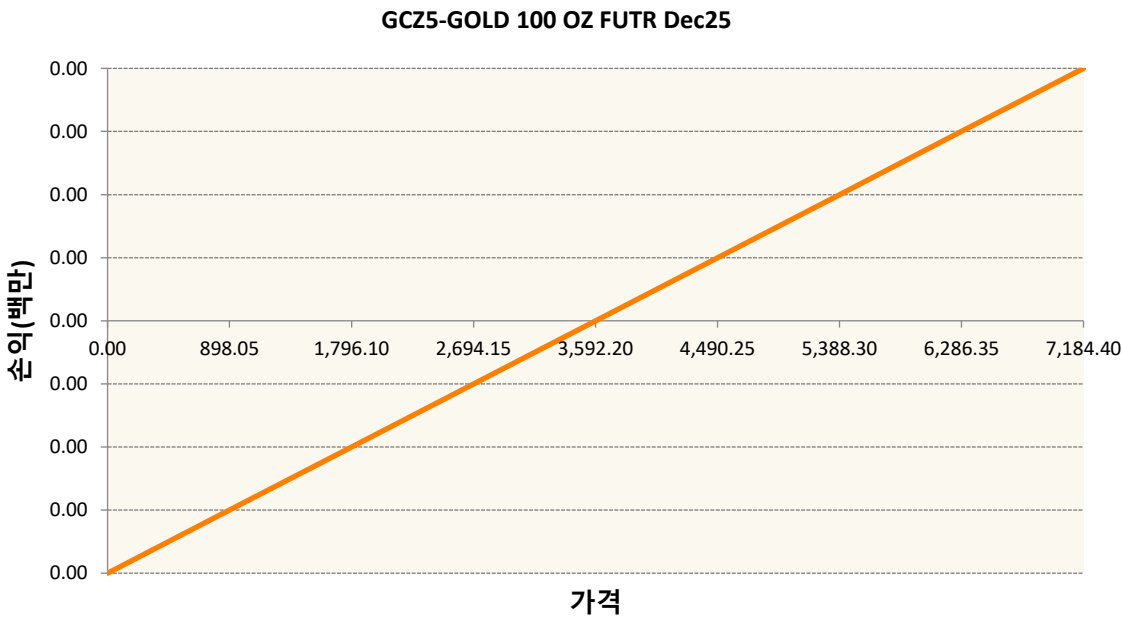
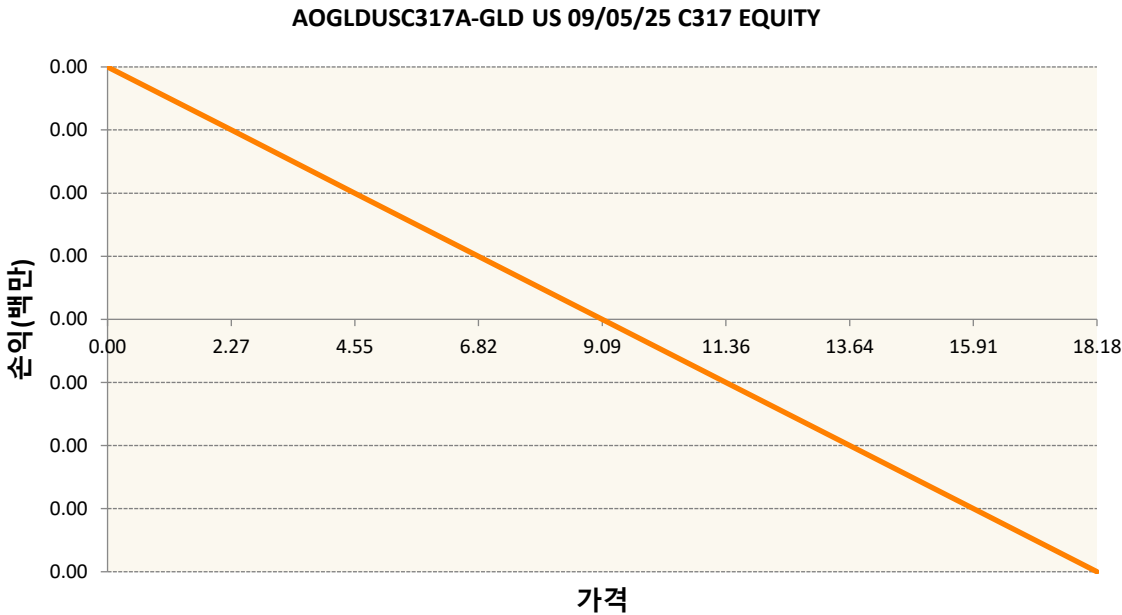
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 1,993 | 0     | 1,993     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | -36   | 36        |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

|                                        |     |
|----------------------------------------|-----|
| AOGLDUSC3 GLD US 09/05/25 C317 EQUITY  | 3   |
| GCZ5            GOLD 100 OZ FUTR Dec25 | 159 |

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

141

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

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)

|                                        |    |
|----------------------------------------|----|
| AOPLTRUAP PLTR US 09/05/25 P165 EQUITY | 34 |
| AOPLTRUCC PLTR US 09/05/25 C165 EQUITY | 22 |

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

(단위:백만원)

226

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

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)

AOTLTUSCC\TLT US 09/05/25 C87.5 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

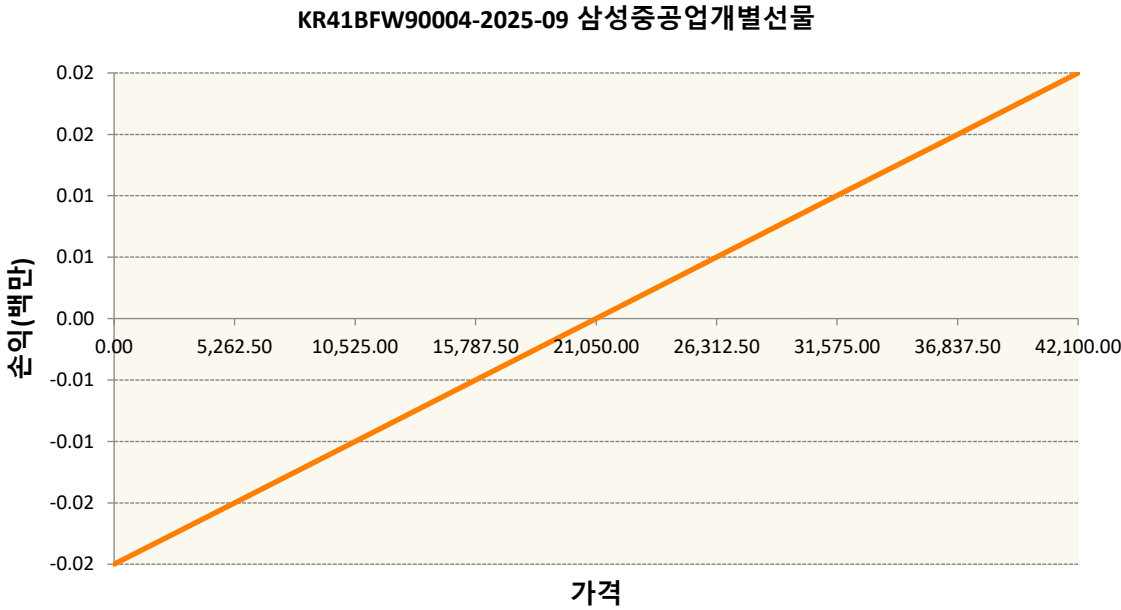
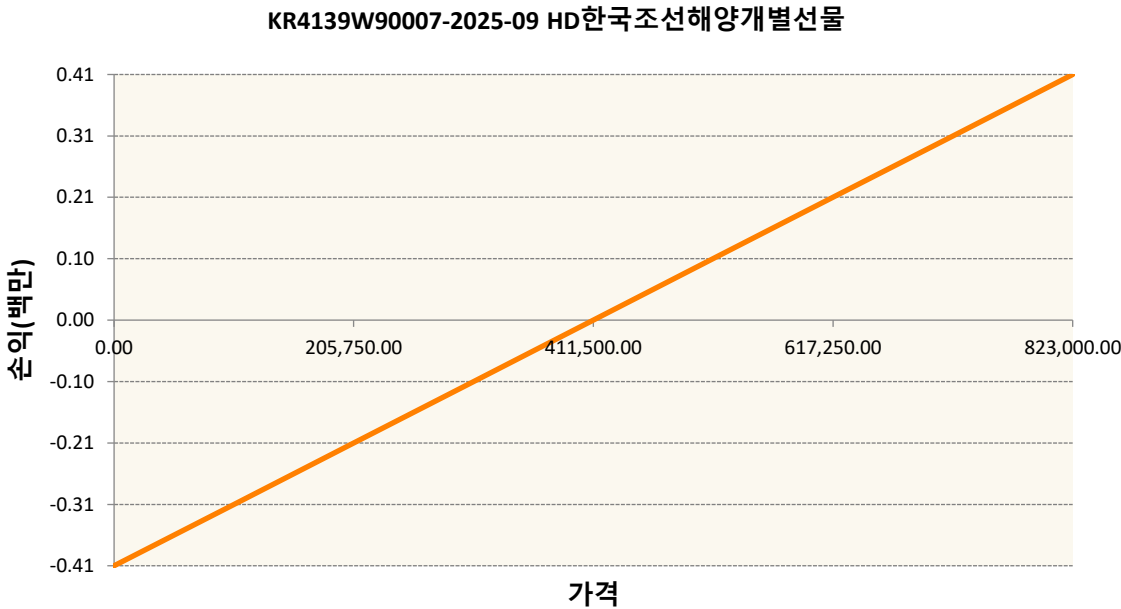
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 1. 계약금액

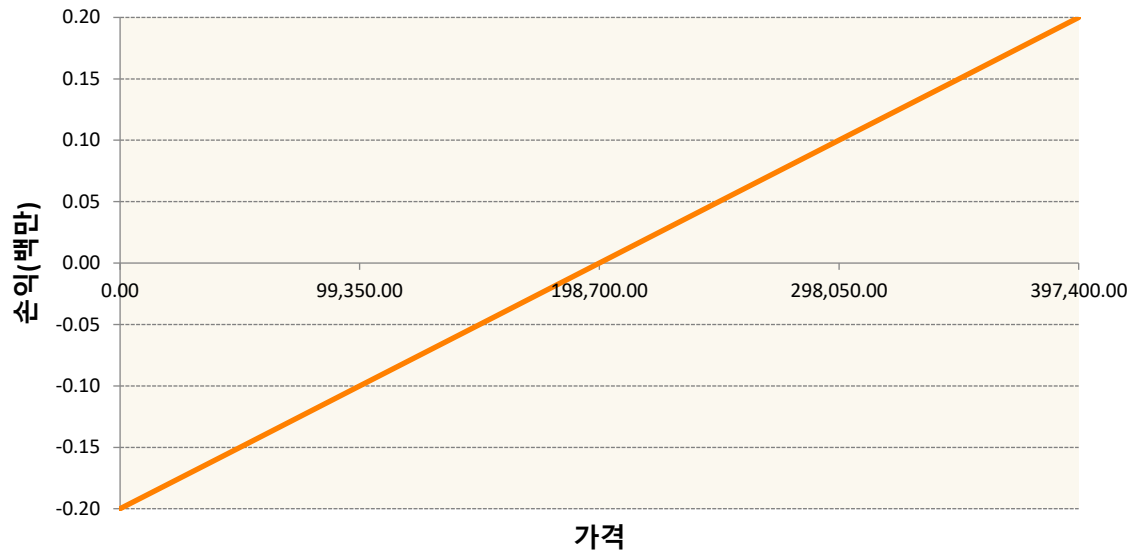
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 36,884 | 0     | 36,884    | 장내 |

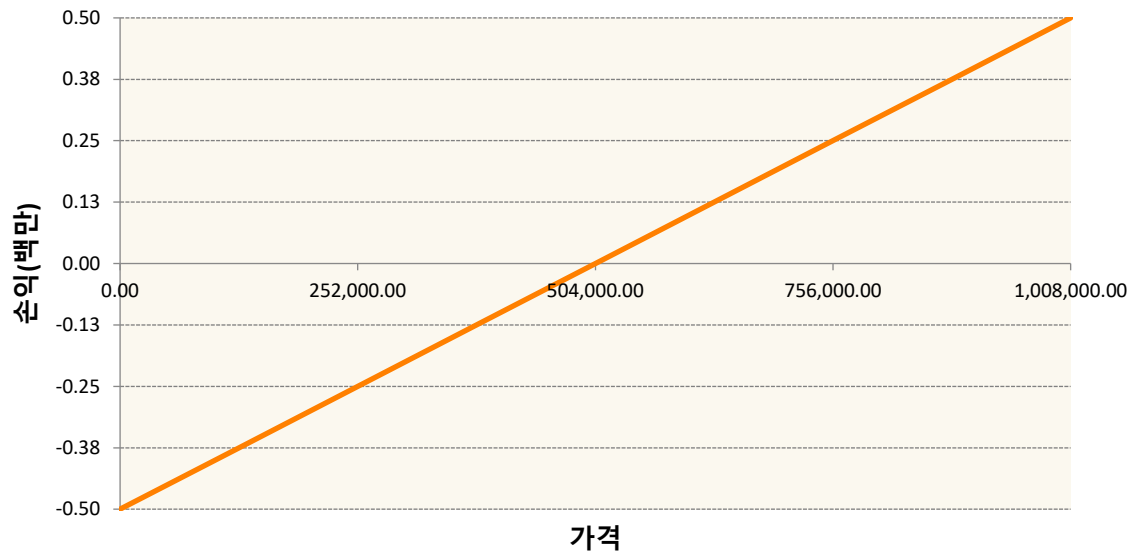
### 2. 만기시점의 손익구조



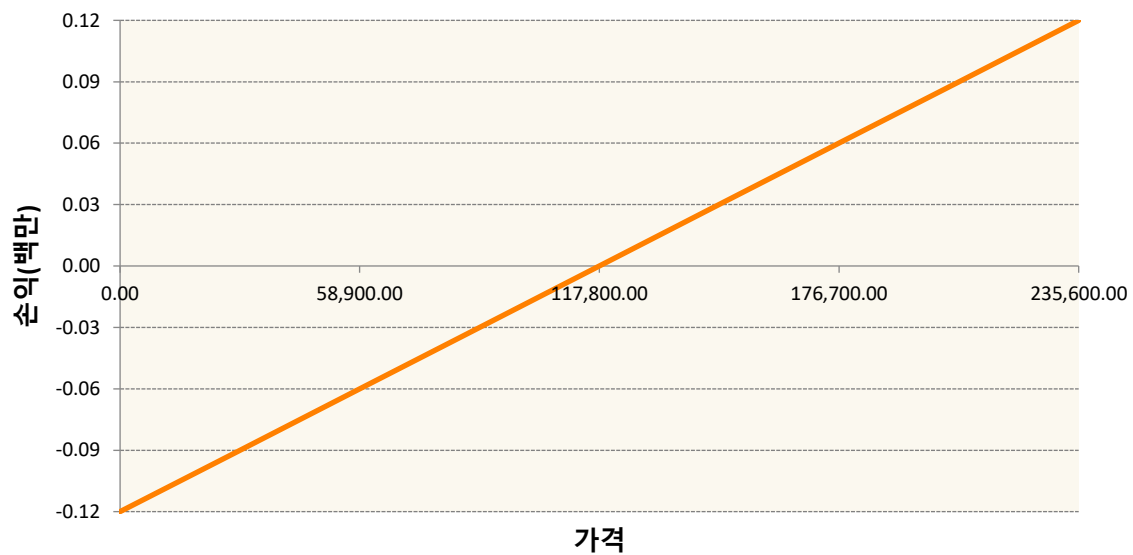
KR41CDW90007-2025-09 HD현대미포개별선물



KR41FDW90000-2025-09 HD현대중공업개별선물



KR41FVW90002-2025-09 한화오션개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |
|--------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|----------------------|------|-----|--|
| KR4139W90007 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 HD한국조선해양개별선물 |      | 595 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |      |     |  |
| -8.00%       | -595      | -595    | -595   | -595 | -595  | -595   | -595                 | -595 |     |  |
| -5.33%       | -397      | -397    | -397   | -397 | -397  | -397   | -397                 | -397 |     |  |
| -2.67%       | -198      | -198    | -198   | -198 | -198  | -198   | -198                 | -198 |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    | 0    |     |  |
| 2.67%        | 198       | 198     | 198    | 198  | 198   | 198    | 198                  | 198  |     |  |
| 5.33%        | 397       | 397     | 397    | 397  | 397   | 397    | 397                  | 397  |     |  |
| 8.00%        | 595       | 595     | 595    | 595  | 595   | 595    | 595                  | 595  |     |  |
| KR41BFW90004 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 삼성중공업개별선물    |      | 538 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |      |     |  |
| -8.00%       | -538      | -538    | -538   | -538 | -538  | -538   | -538                 | -538 |     |  |
| -5.33%       | -358      | -358    | -358   | -358 | -358  | -358   | -358                 | -358 |     |  |
| -2.67%       | -179      | -179    | -179   | -179 | -179  | -179   | -179                 | -179 |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    | 0    |     |  |
| 2.67%        | 179       | 179     | 179    | 179  | 179   | 179    | 179                  | 179  |     |  |
| 5.33%        | 358       | 358     | 358    | 358  | 358   | 358    | 358                  | 358  |     |  |
| 8.00%        | 538       | 538     | 538    | 538  | 538   | 538    | 538                  | 538  |     |  |
| KR41CDW90007 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 HD현대미포개별선물   |      | 450 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |      |     |  |
| -8.00%       | -450      | -450    | -450   | -450 | -450  | -450   | -450                 | -450 |     |  |
| -5.33%       | -300      | -300    | -300   | -300 | -300  | -300   | -300                 | -300 |     |  |
| -2.67%       | -150      | -150    | -150   | -150 | -150  | -150   | -150                 | -150 |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    | 0    |     |  |
| 2.67%        | 150       | 150     | 150    | 150  | 150   | 150    | 150                  | 150  |     |  |
| 5.33%        | 300       | 300     | 300    | 300  | 300   | 300    | 300                  | 300  |     |  |
| 8.00%        | 450       | 450     | 450    | 450  | 450   | 450    | 450                  | 450  |     |  |
| KR41FDW90000 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 HD현대중공업개별선물  |      | 598 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%               |      |     |  |
| -8.00%       | -598      | -598    | -598   | -598 | -598  | -598   | -598                 | -598 |     |  |
| -5.33%       | -399      | -399    | -399   | -399 | -399  | -399   | -399                 | -399 |     |  |
| -2.67%       | -199      | -199    | -199   | -199 | -199  | -199   | -199                 | -199 |     |  |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                    | 0    |     |  |
| 2.67%        | 199       | 199     | 199    | 199  | 199   | 199    | 199                  | 199  |     |  |
| 5.33%        | 399       | 399     | 399    | 399  | 399   | 399    | 399                  | 399  |     |  |
| 8.00%        | 598       | 598     | 598    | 598  | 598   | 598    | 598                  | 598  |     |  |
| KR41FVW90002 |           |         |        |      |       |        | 2025-09 한화오션개별선물     |      | 770 |  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                      |      |     |  |

|        |         |         |        |      |       |        |        |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -770    | -770    | -770   | -770 | -770  | -770   | -770   |
| -5.33% | -514    | -514    | -514   | -514 | -514  | -514   | -514   |
| -2.67% | -257    | -257    | -257   | -257 | -257  | -257   | -257   |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 257     | 257     | 257    | 257  | 257   | 257    | 257    |
| 5.33%  | 514     | 514     | 514    | 514  | 514   | 514    | 514    |
| 8.00%  | 770     | 770     | 770    | 770  | 770   | 770    | 770    |

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

(단위:백만원)

1,924

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

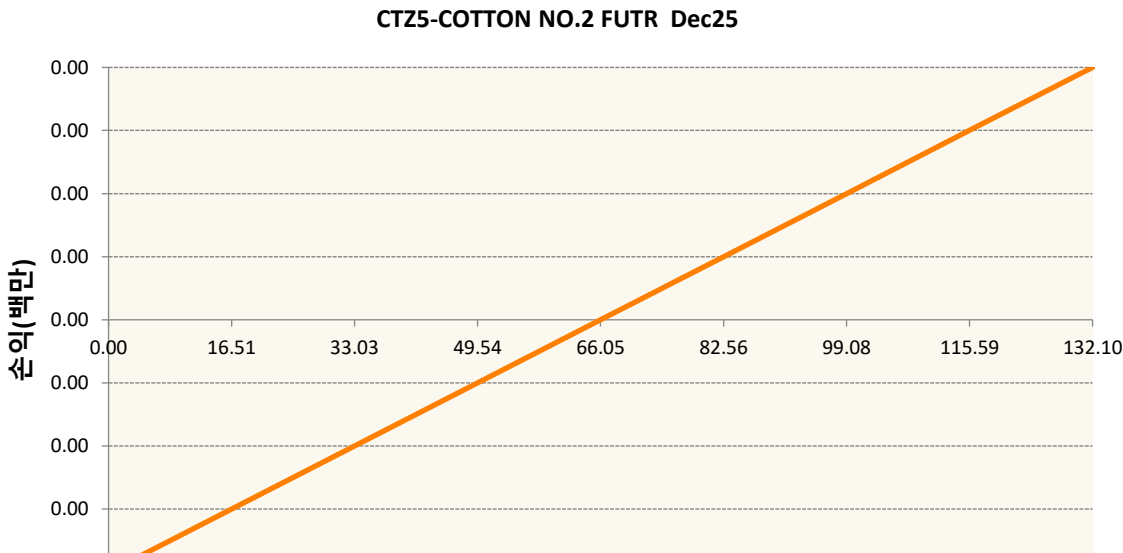
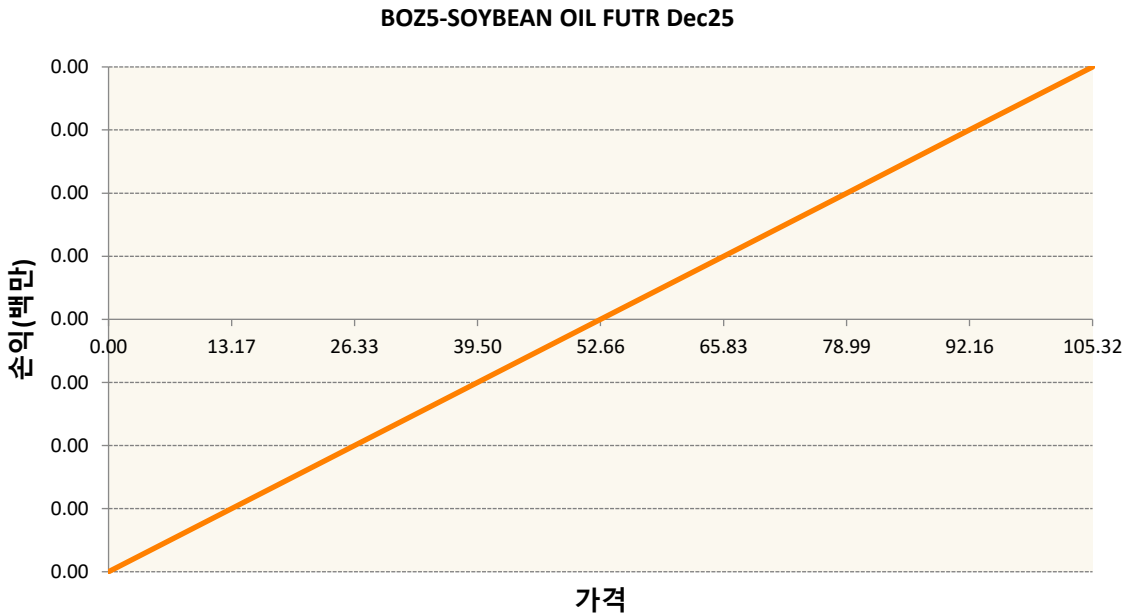
## 포커스농산물모(채권-파생형)

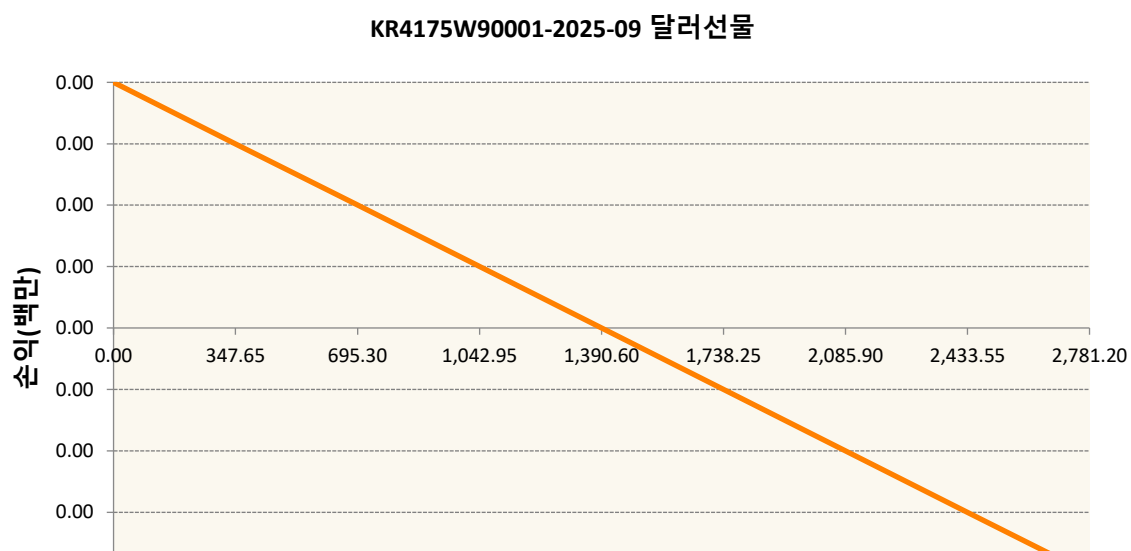
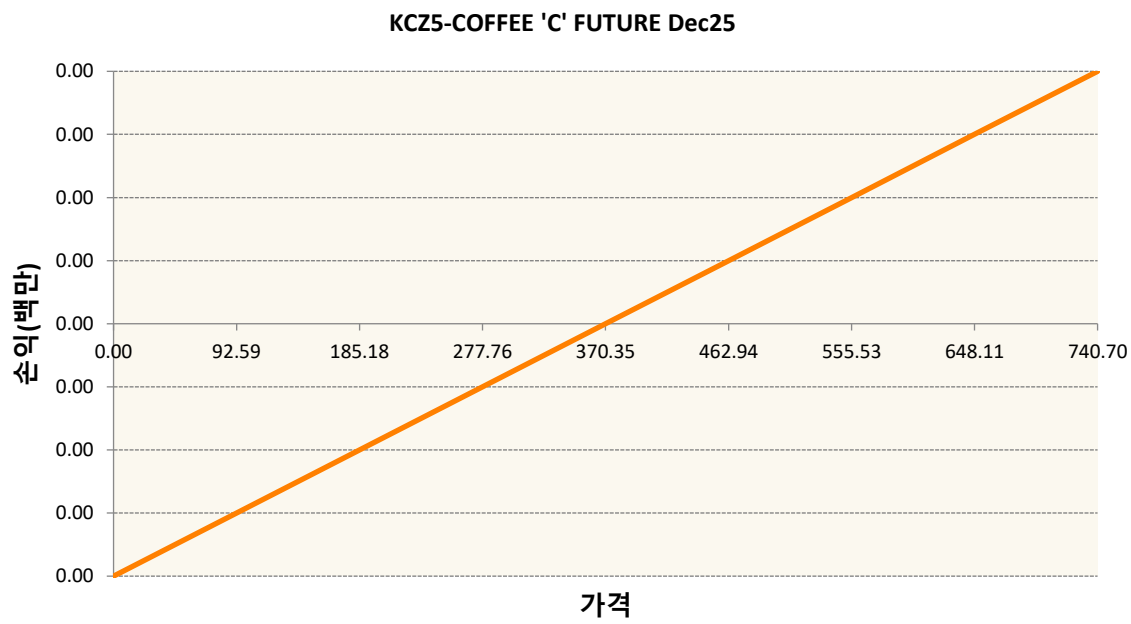
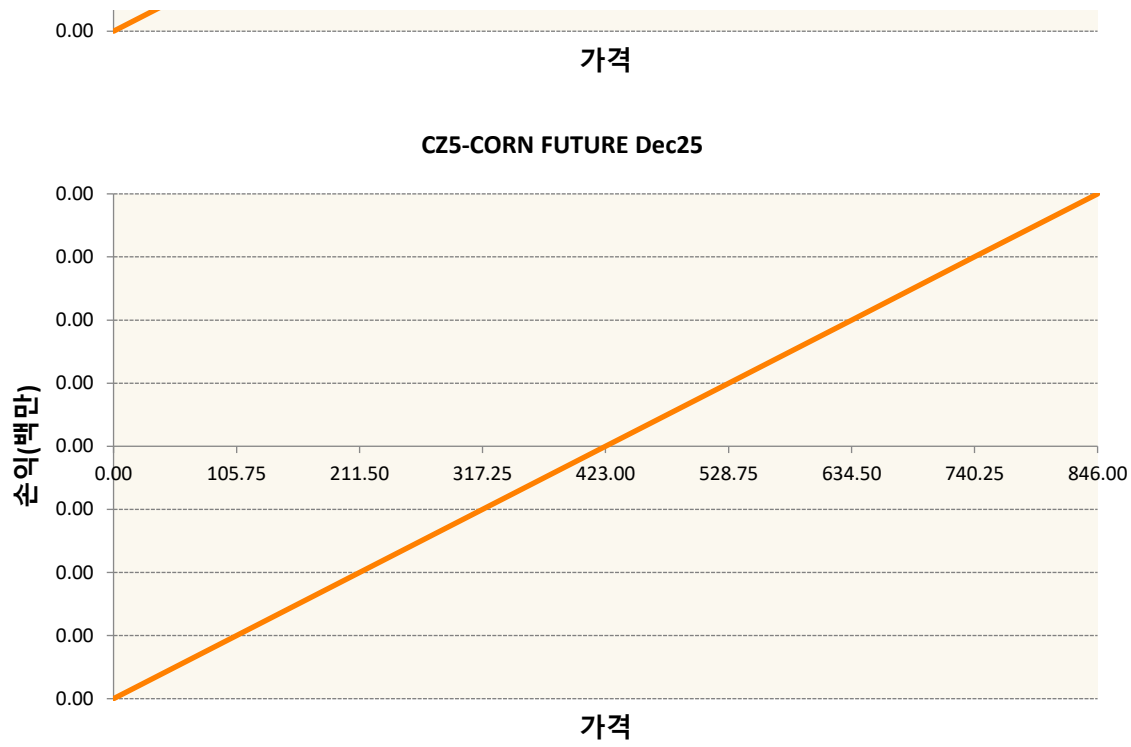
### 1. 계약금액

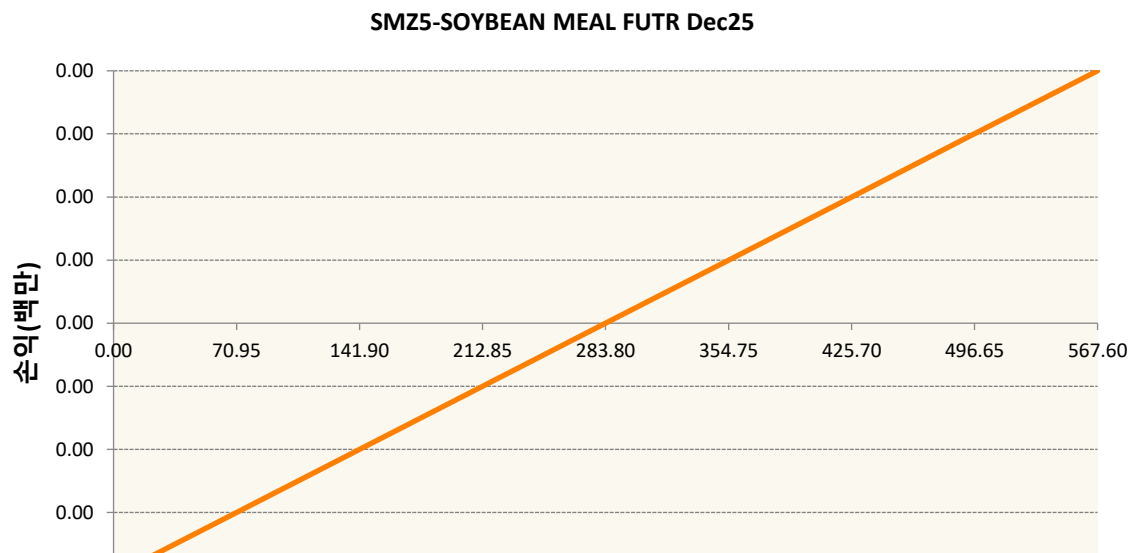
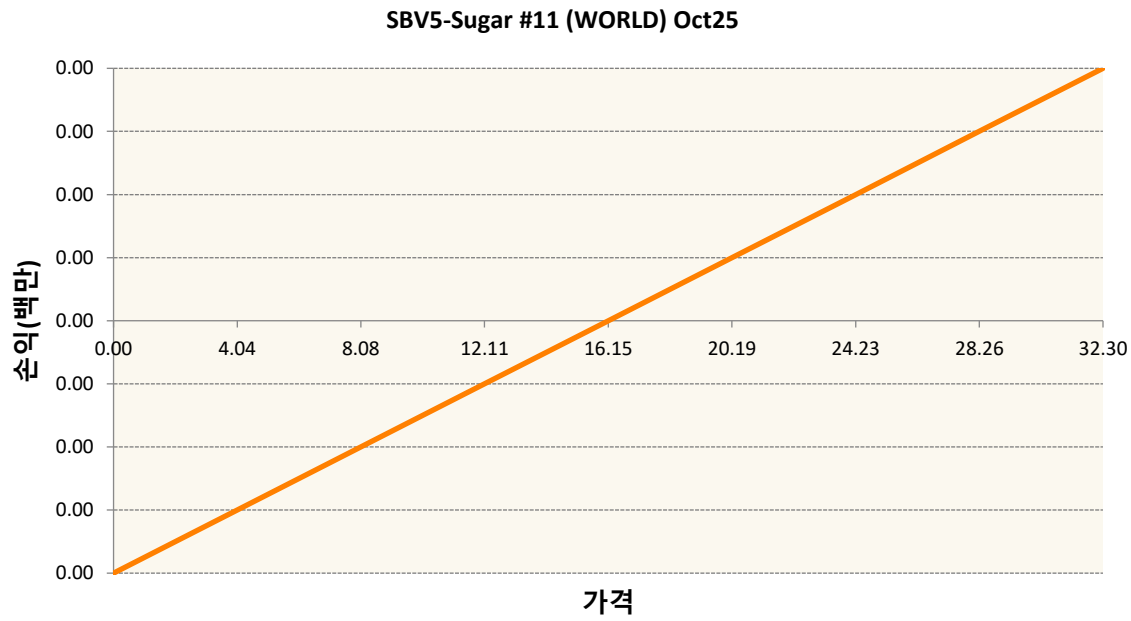
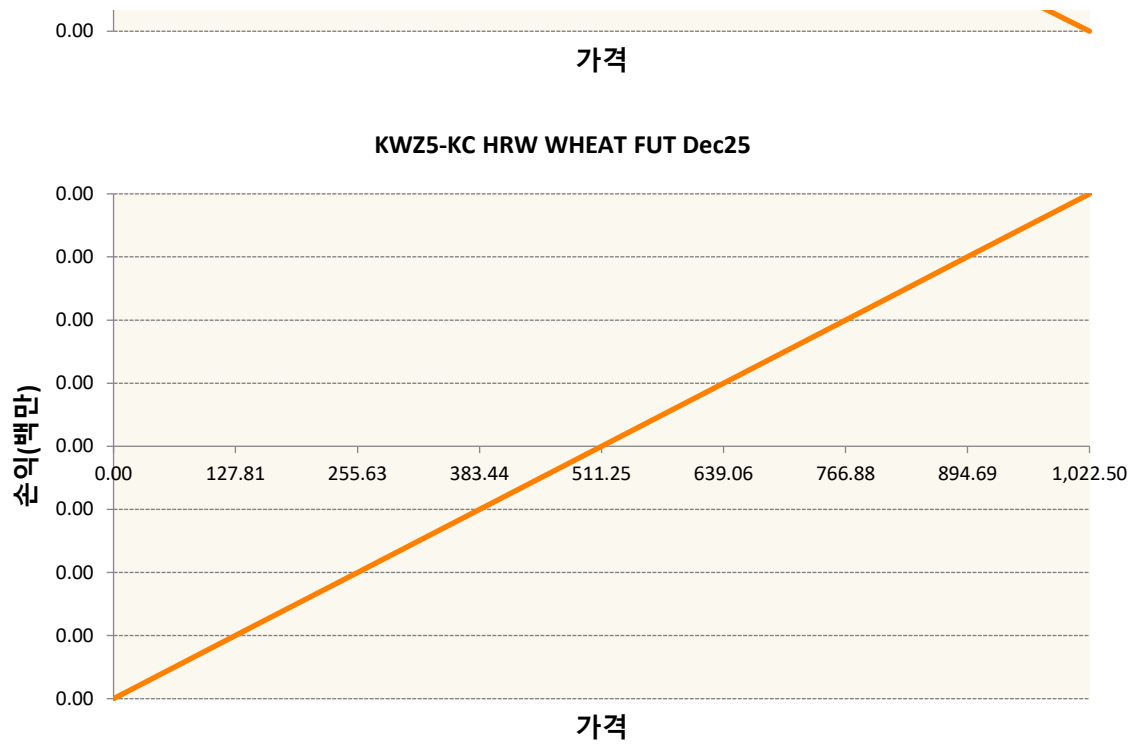
(단위:USD 백만)

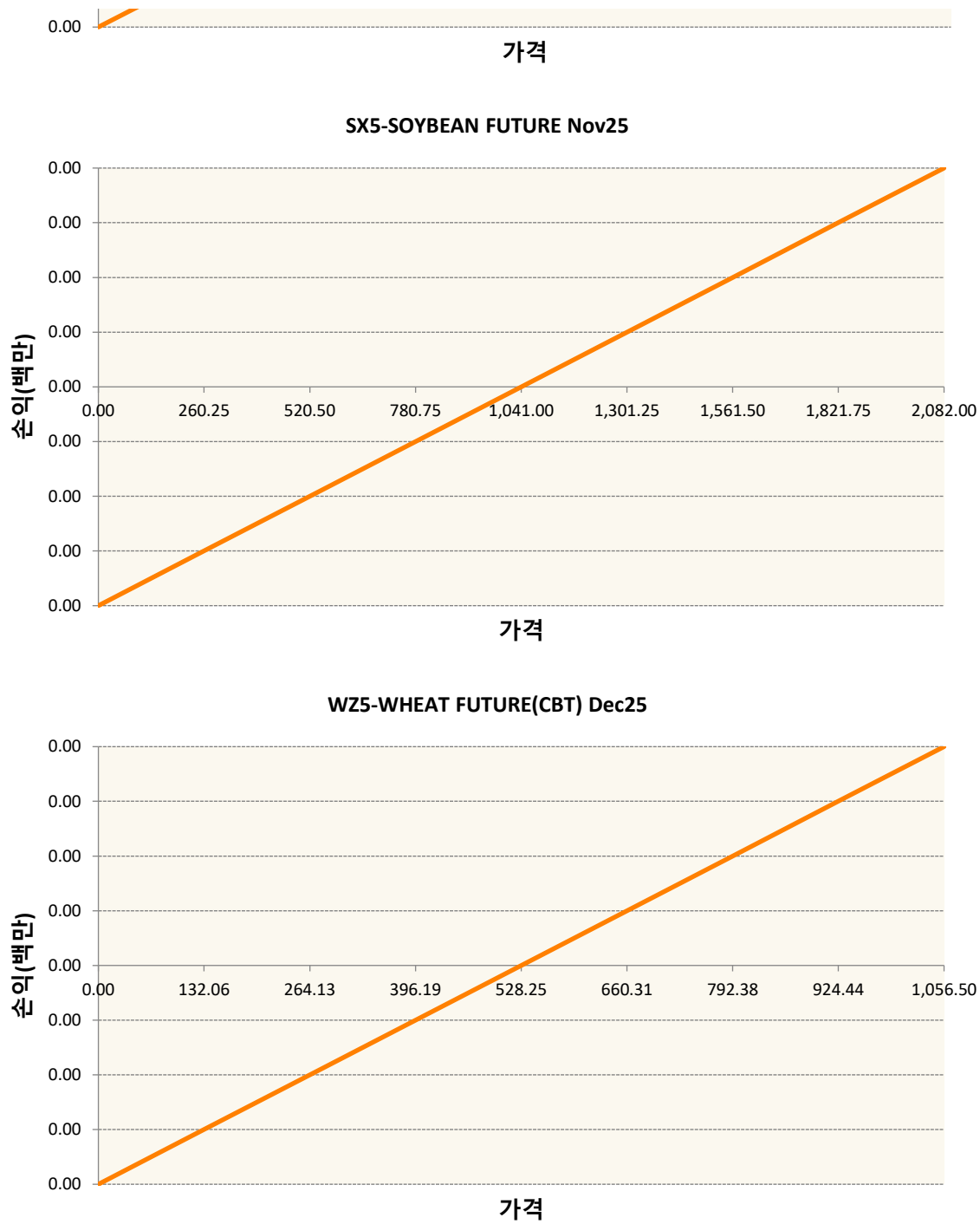
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,194 | 0     | 1,194     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,290 | 0     | 2,290     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 375   | -375      | 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 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

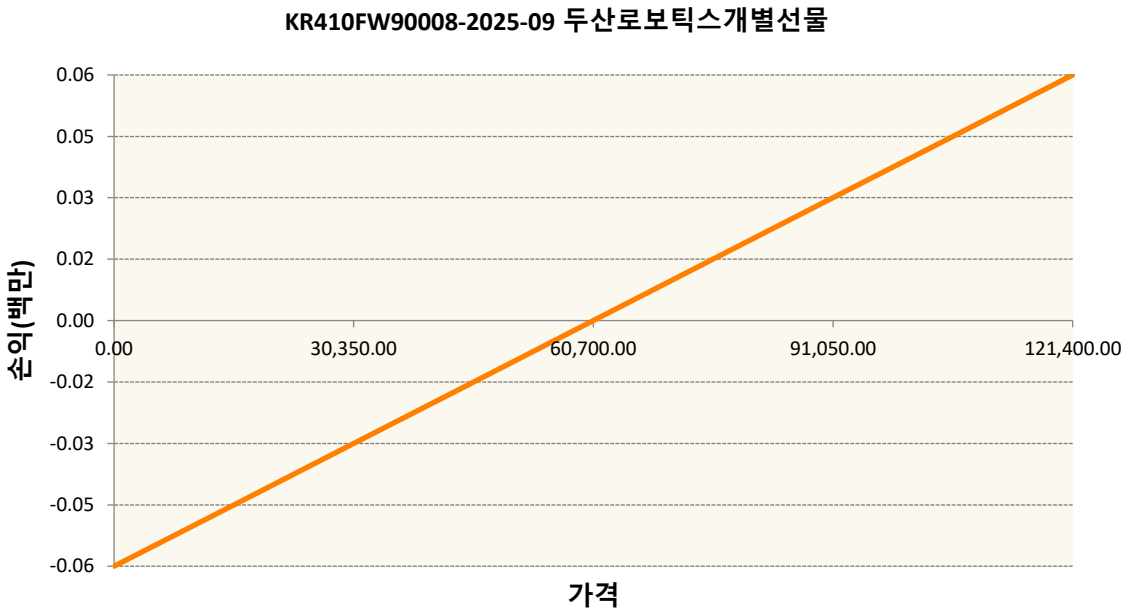
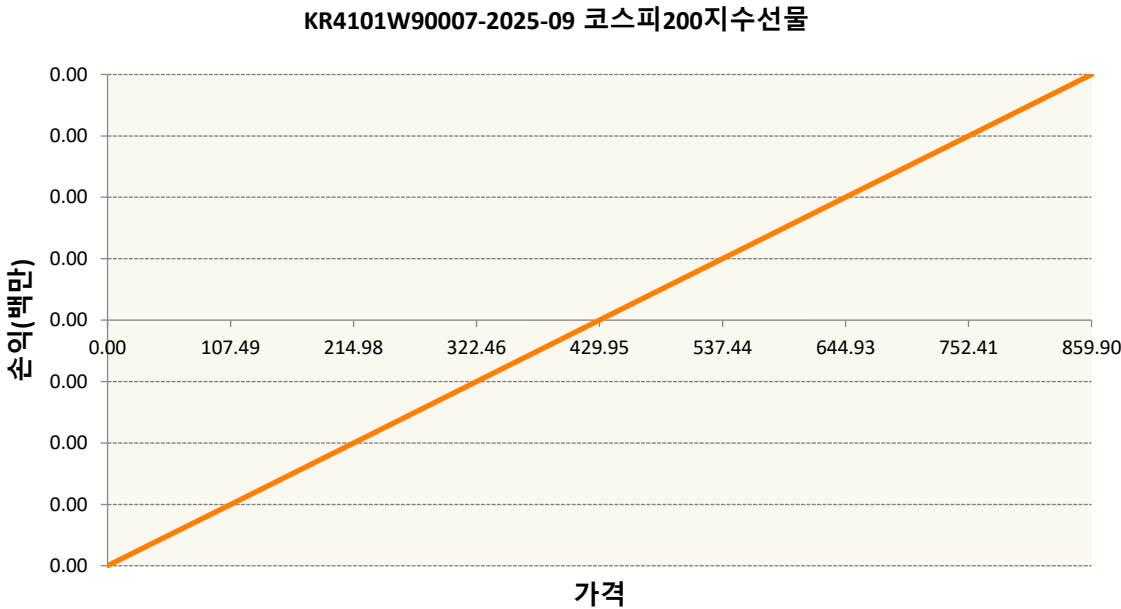
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

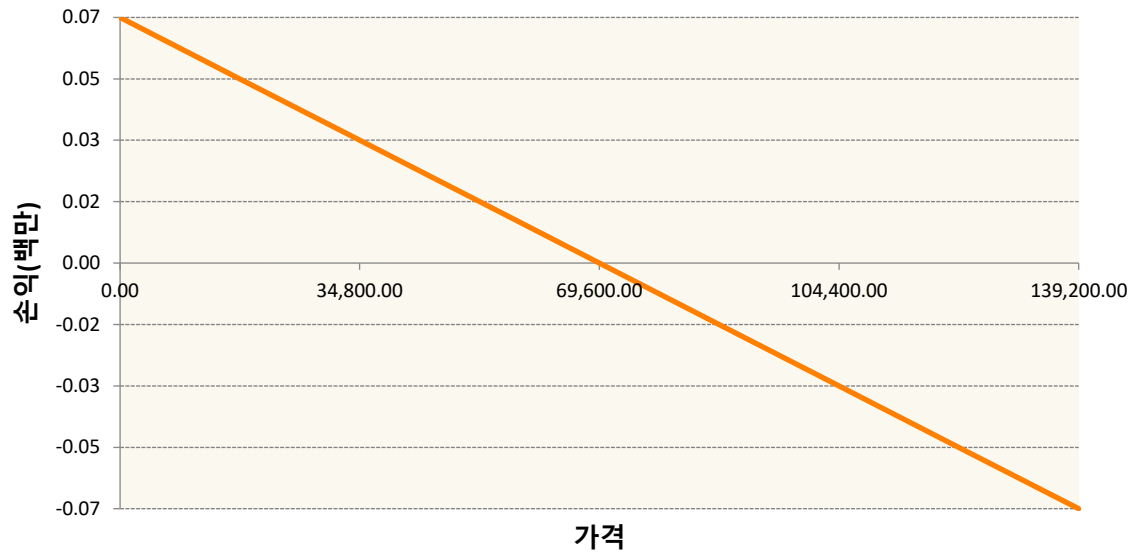
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 966   | 9     | 957       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,634 | 97    | 1,536     | 장내 |

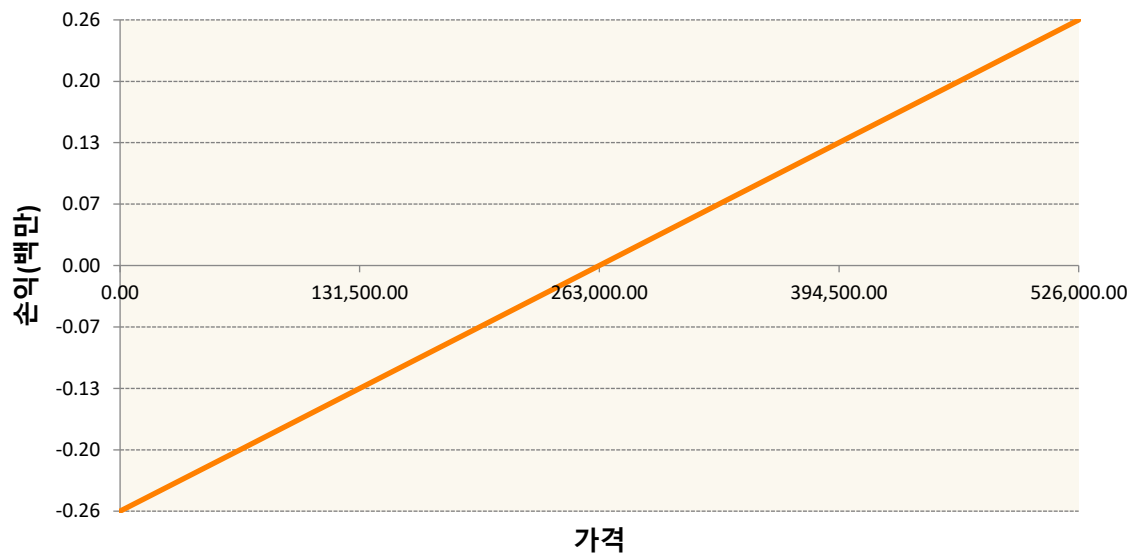
### 2. 만기시점의 손익구조



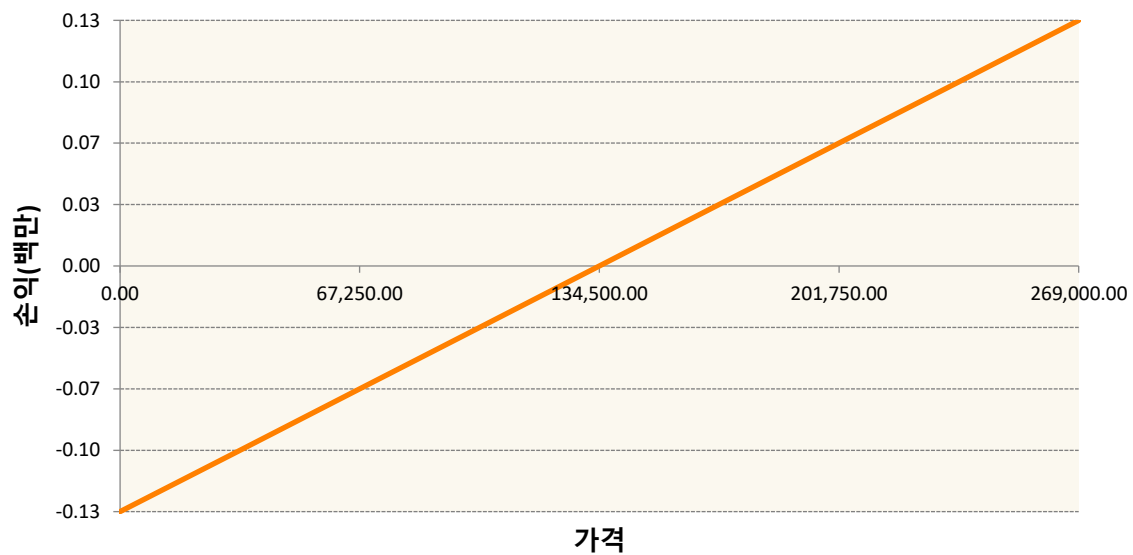
KR4111W90006-2025-09 삼성전자개별선물



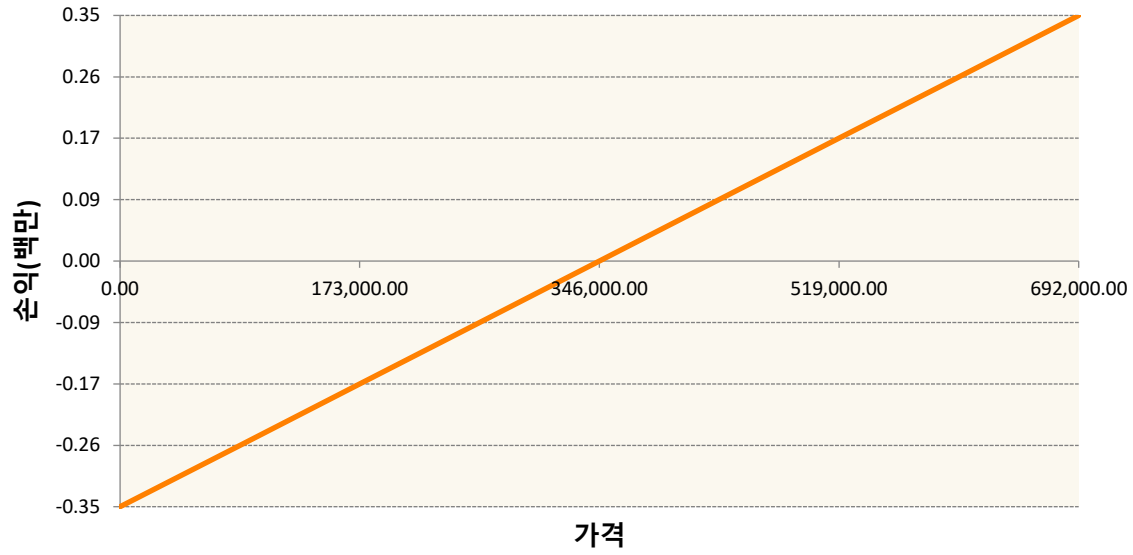
KR4150W90004-2025-09 SK하이닉스개별선물



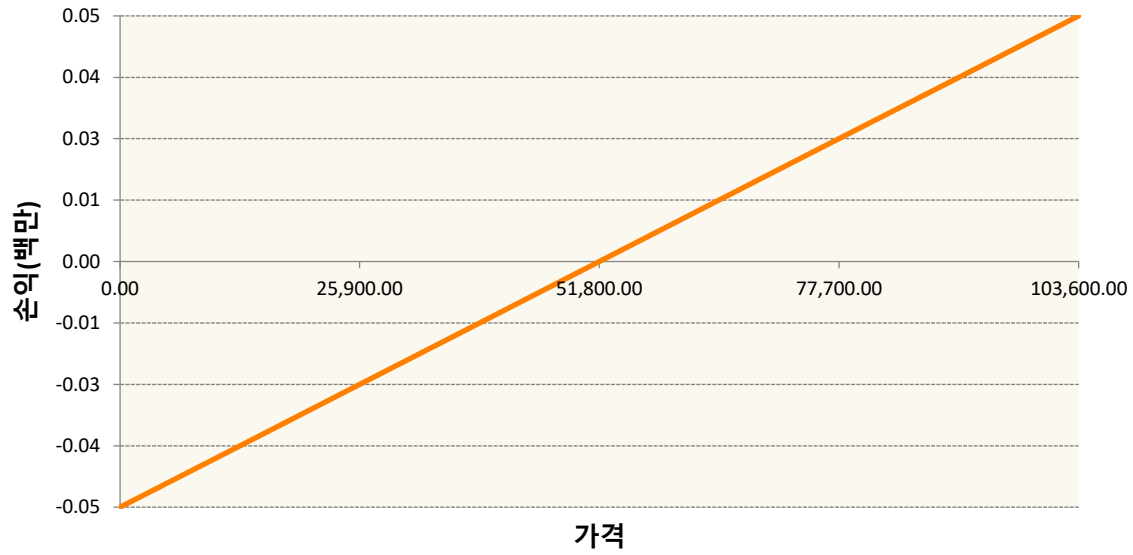
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



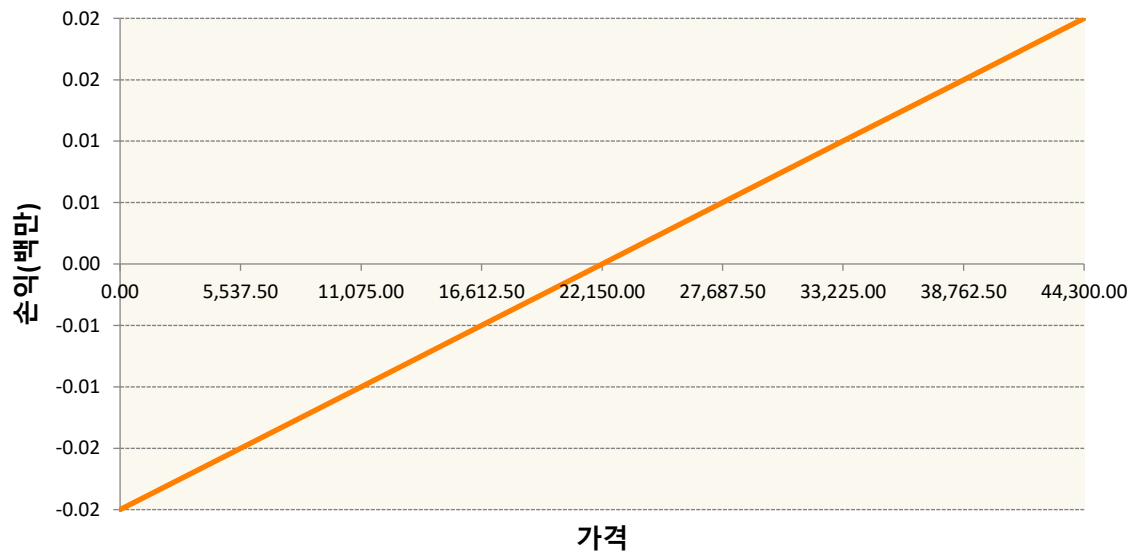
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



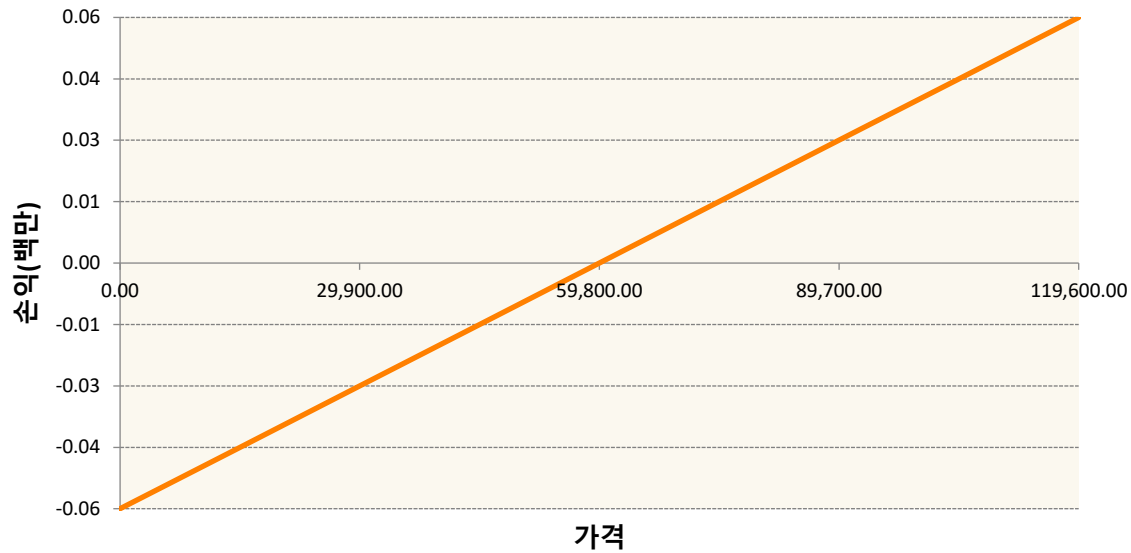
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



### KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                 |    |
|---------------------------------|----|
| KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물   | 95 |
| KR410FW90( 2025-09 두산로보틱스개별선물   | 1  |
| KR4111W90( 2025-09 삼성전자개별선물     | 8  |
| KR4150W90( 2025-09 SK하이닉스개별선물   | 8  |
| KR41E8W90( 2025-09 포스코퓨처엠개별선물   | 4  |
| KR41F5W90( 2025-09 LG에너지솔루션개별선물 | 13 |
| KR41F7W90( 2025-09 카카오페이개별선물    | 2  |
| KR41FAW90( 2025-09 HMM개별선물      | 7  |
| KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물      | 2  |

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

(단위:백만원)

76

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

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

366

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

580

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

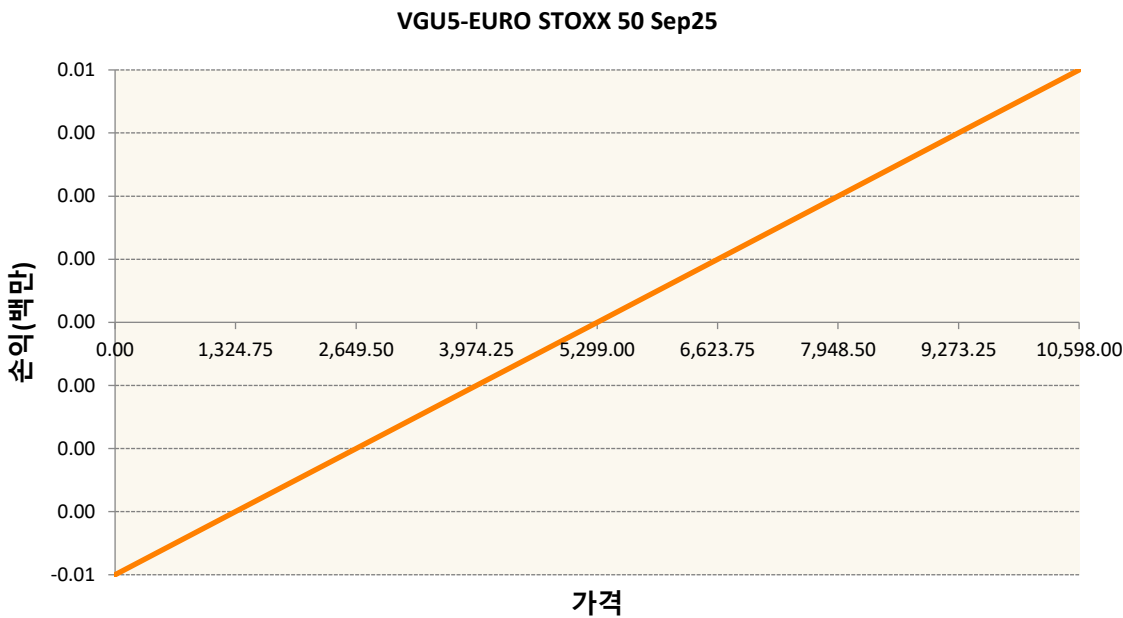
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 670   | 0     | 670       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGU5 | EURO STOXX 50 Sep25 | 54 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 45 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

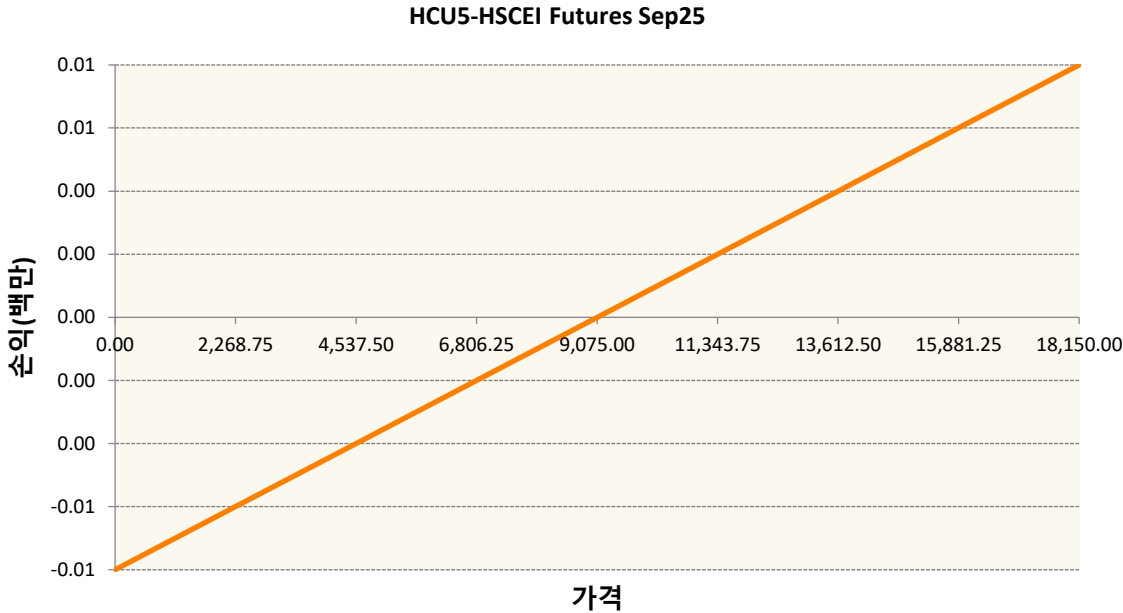
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 2,037 | 0     | 2,037     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCU5 | HSCEI Futures Sep25 | 163 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

231

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

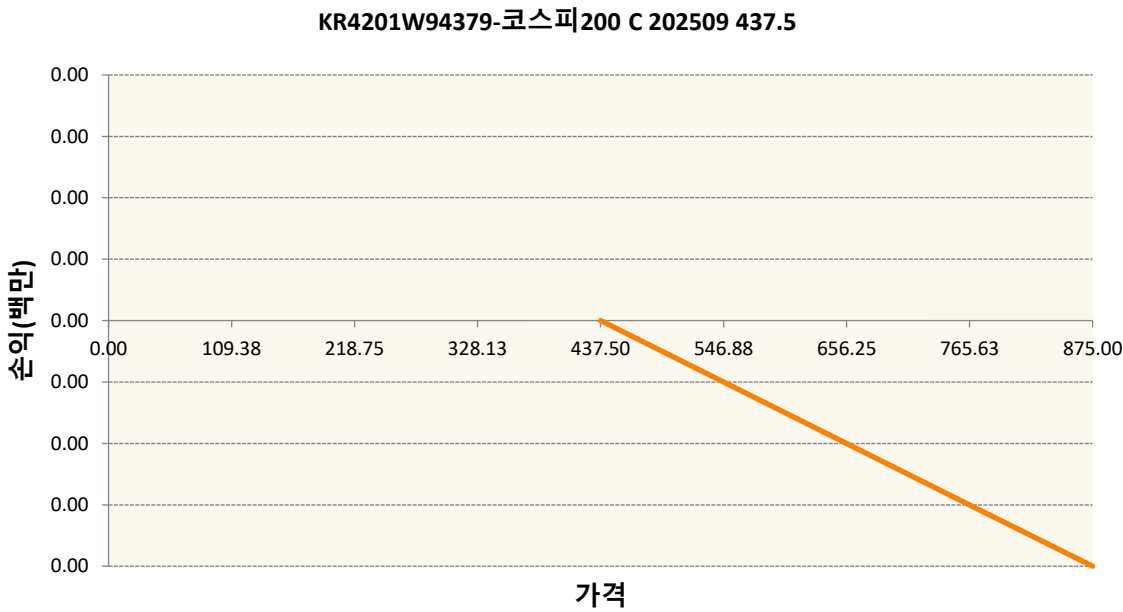
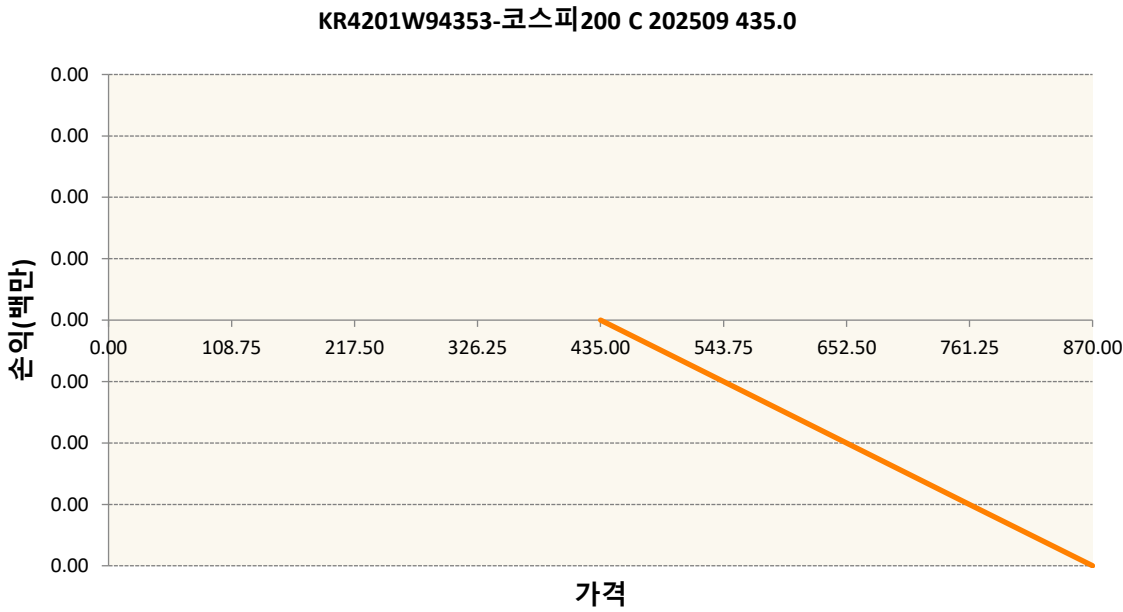
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

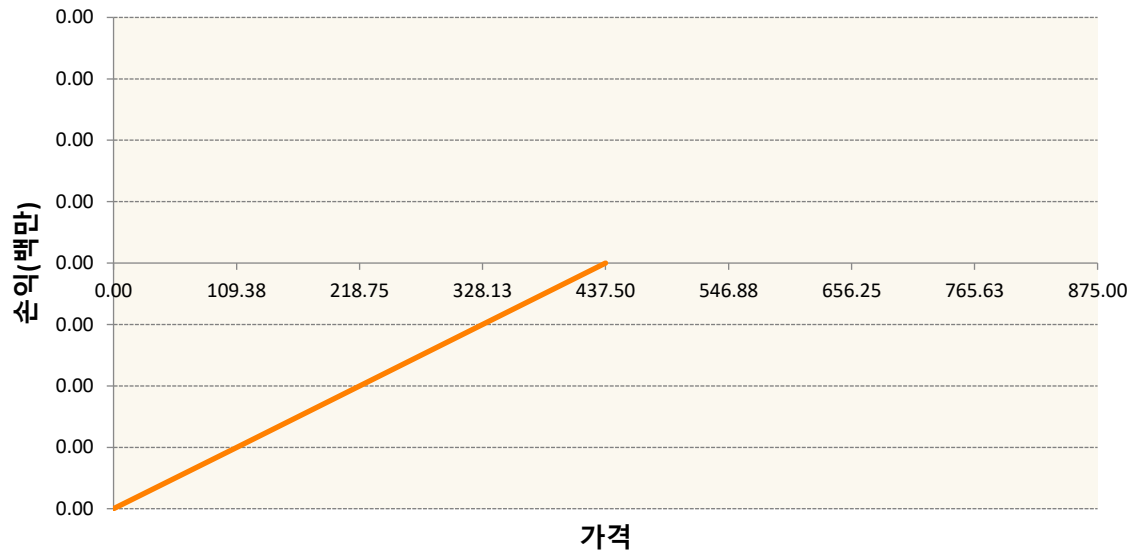
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 35,581 | -35,581   | 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

1,260

KR4301W94: 코스피200 P 202509 437.5

543

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-09-04

기준일 2025-09-03

## H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

### 1. 계약금액

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 2. 만기시점의 손익구조

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

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

\* 해당 펀드는 파생상품을 포함하지 않음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

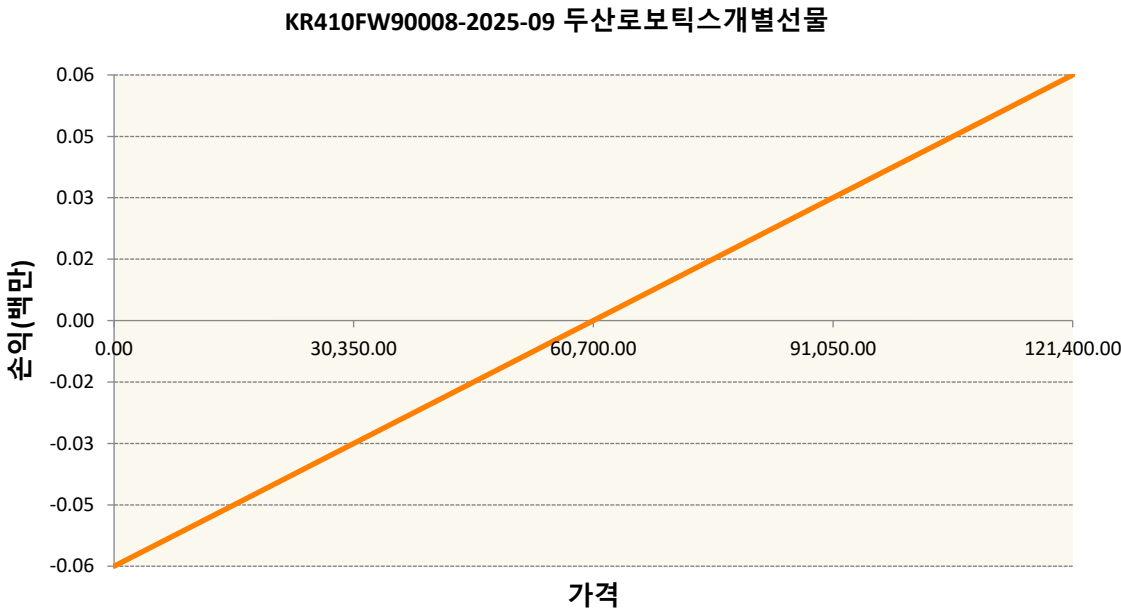
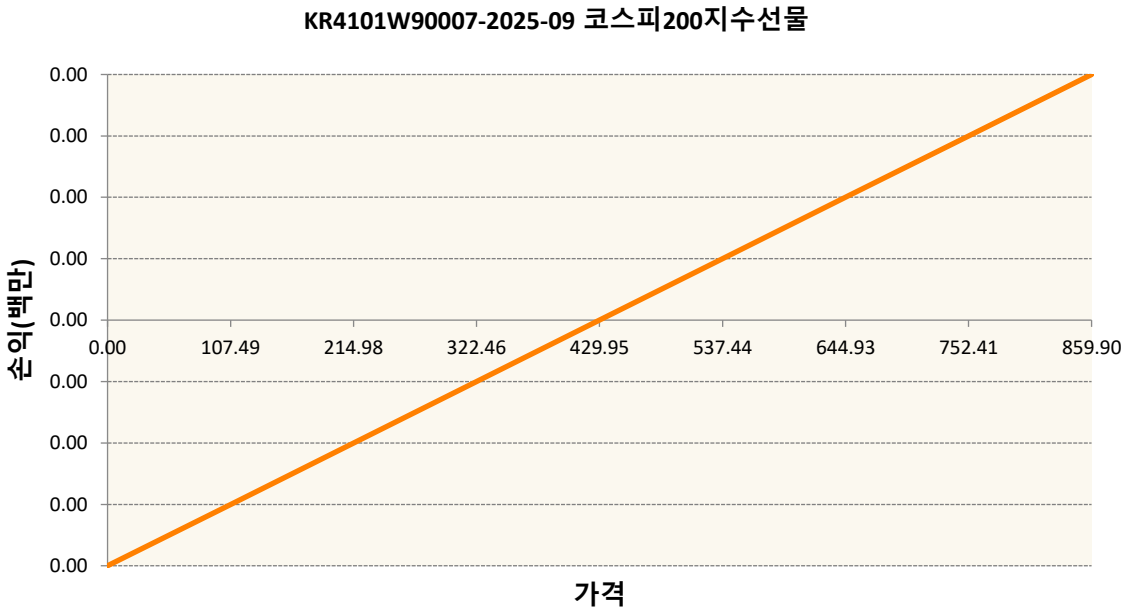
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

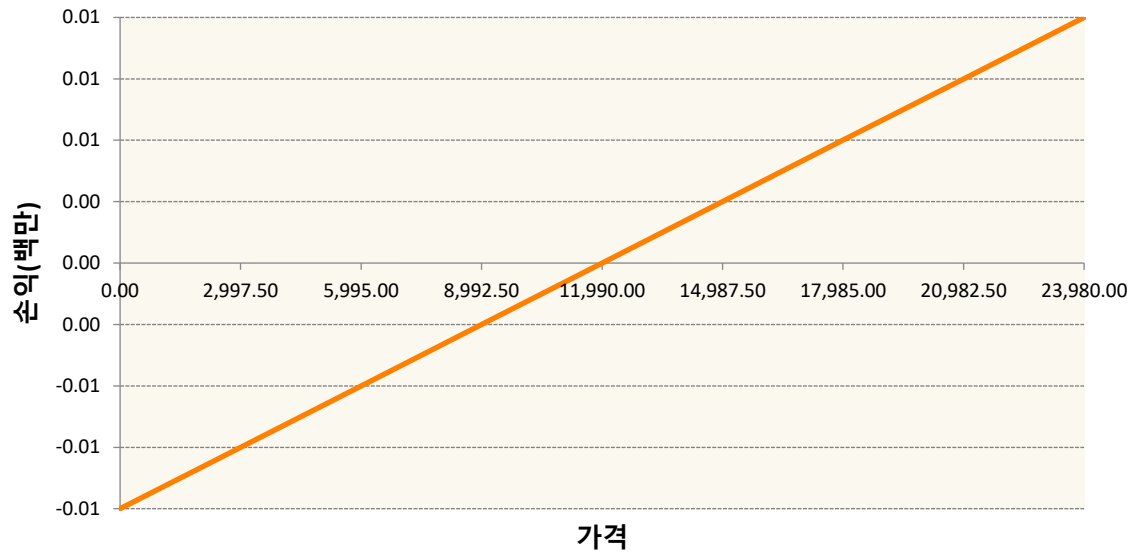
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 399   | 0     | 399       | 장내 |

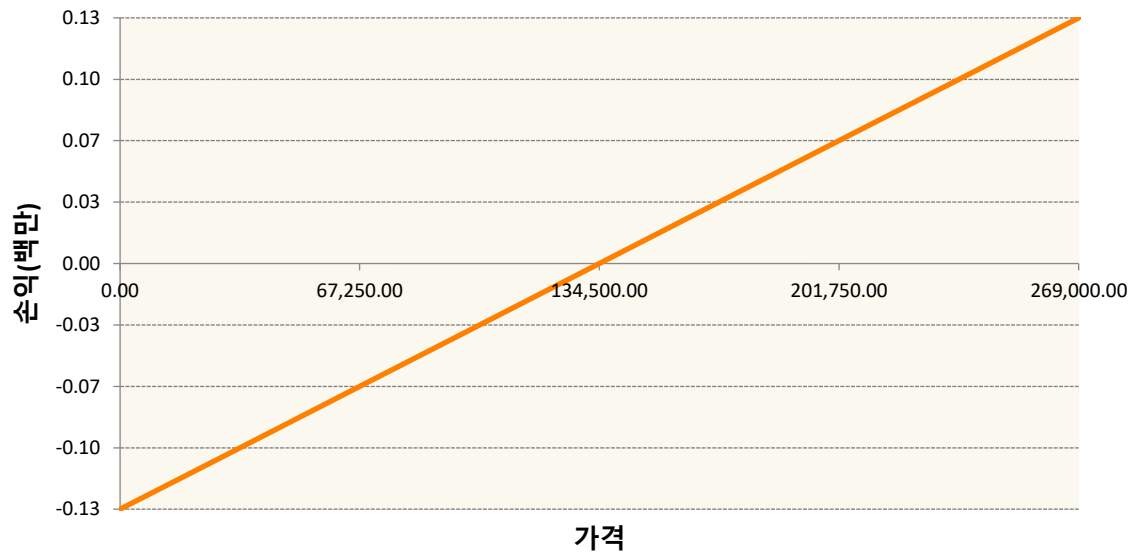
2. 만기시점의 손익구조



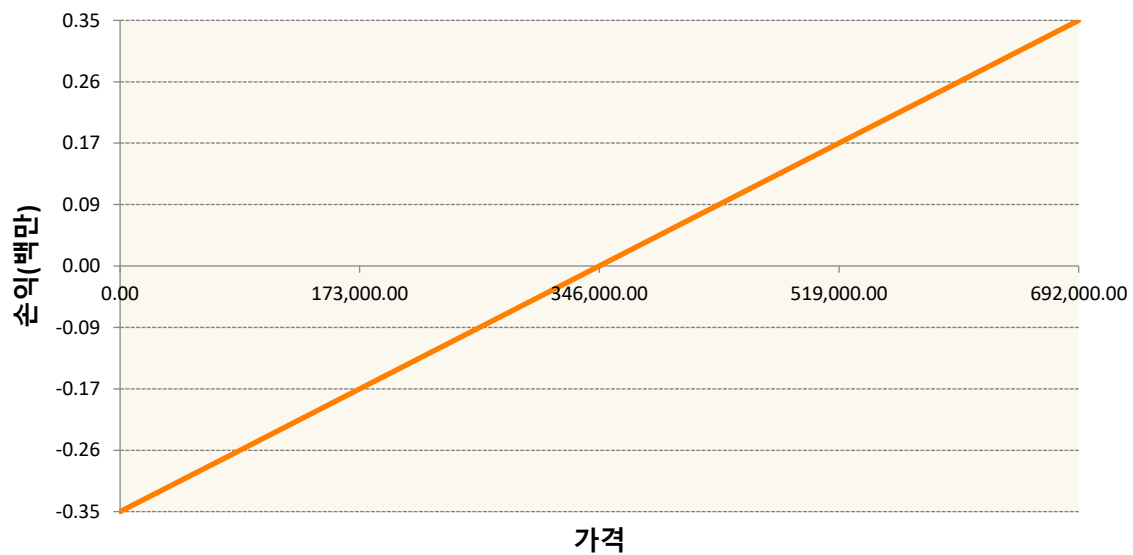
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



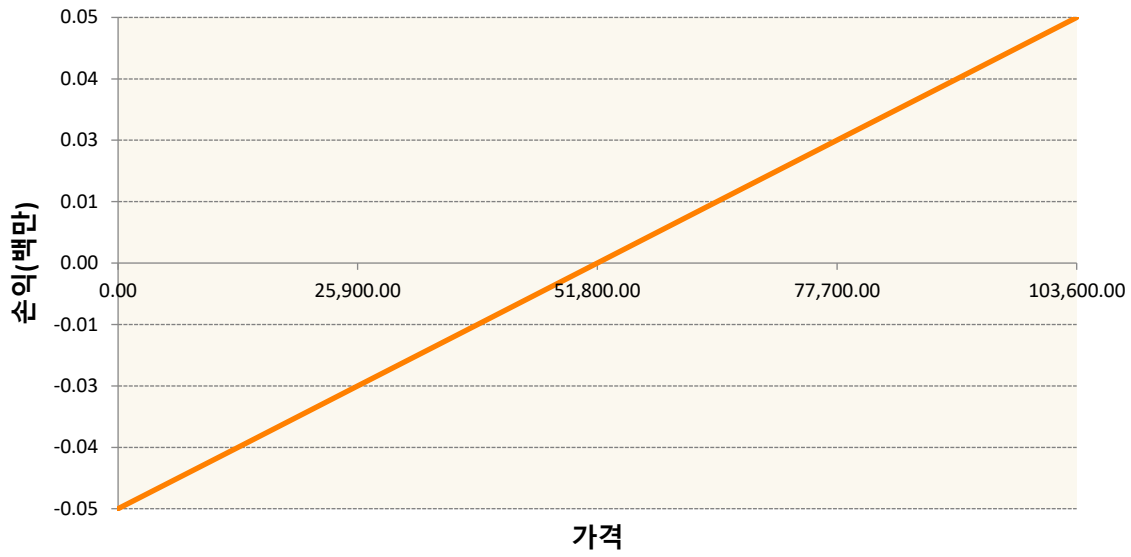
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



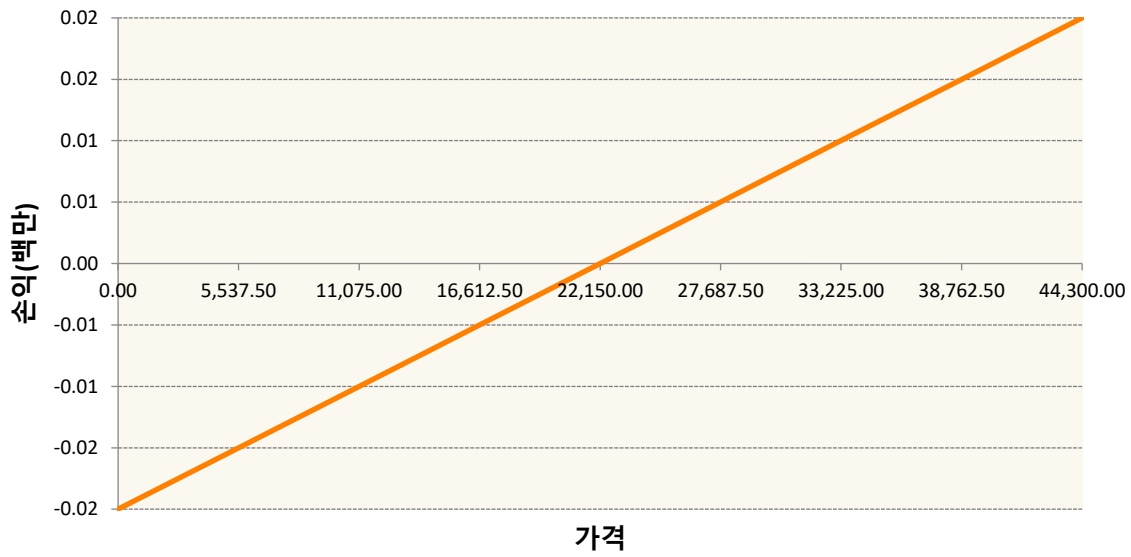
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



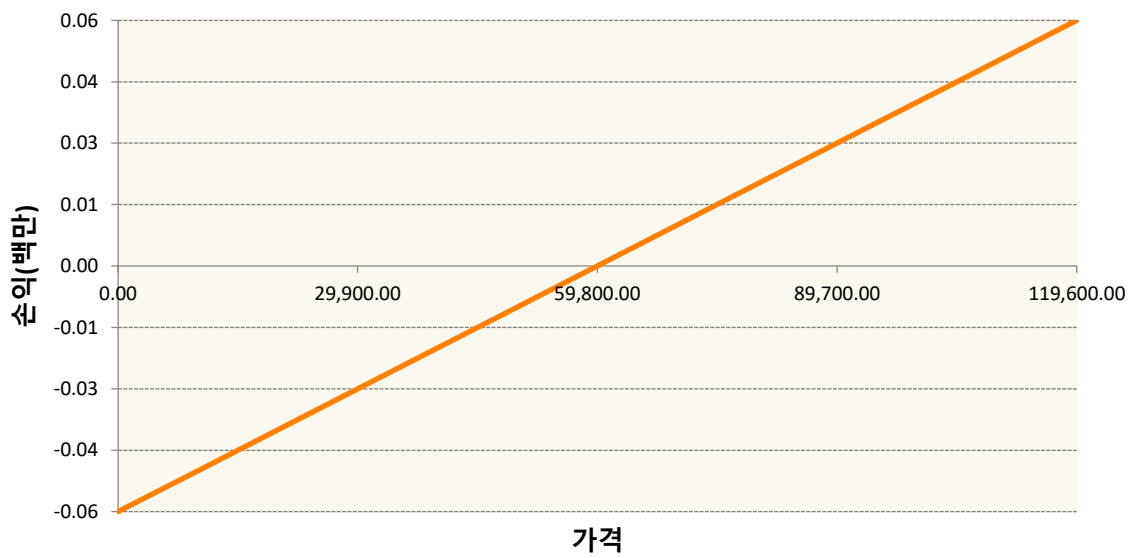
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)       |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------|--|----------|
| KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물   |  | 17       |
| 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      |  | 4        |
| KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물      |  | 1        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 33       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

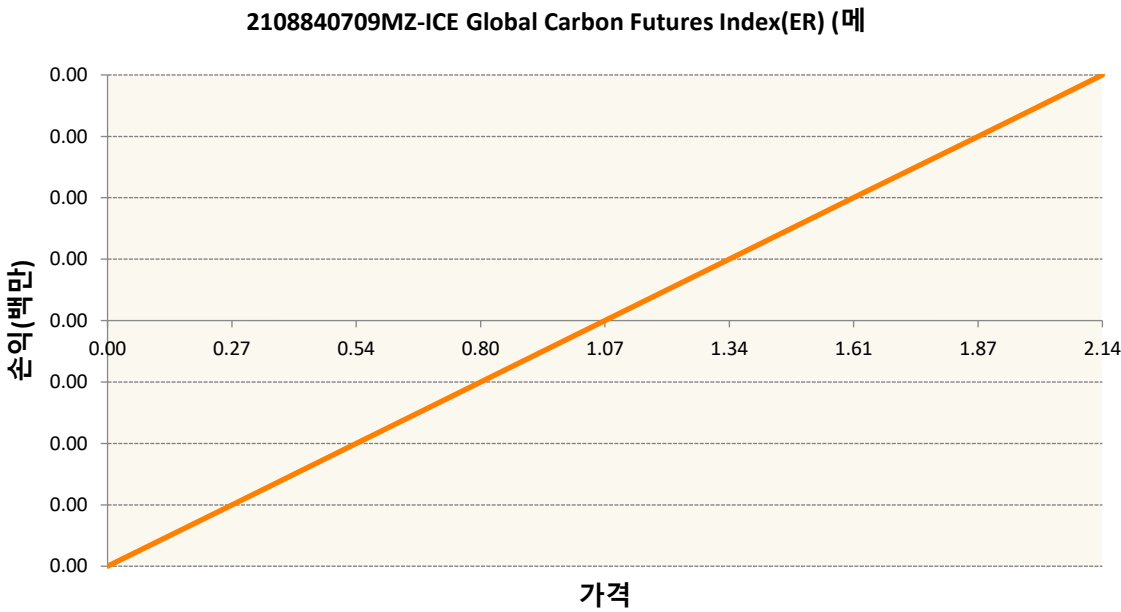
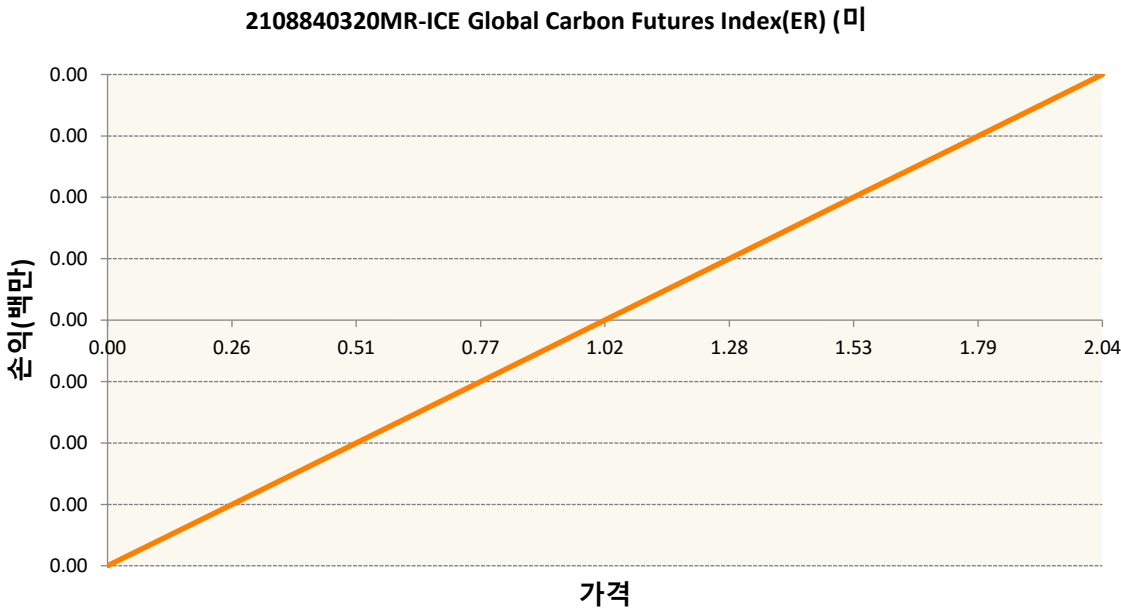
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 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   | 1,290 | 0     | 1,290     | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 7,693 | 0     | 7,693     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                                        | (단위:백만원) |
|---------------------------|----------------------------------------|----------|
| 2108840320                | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 | 617      |
| 2108840709                | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 | 103      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 752      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

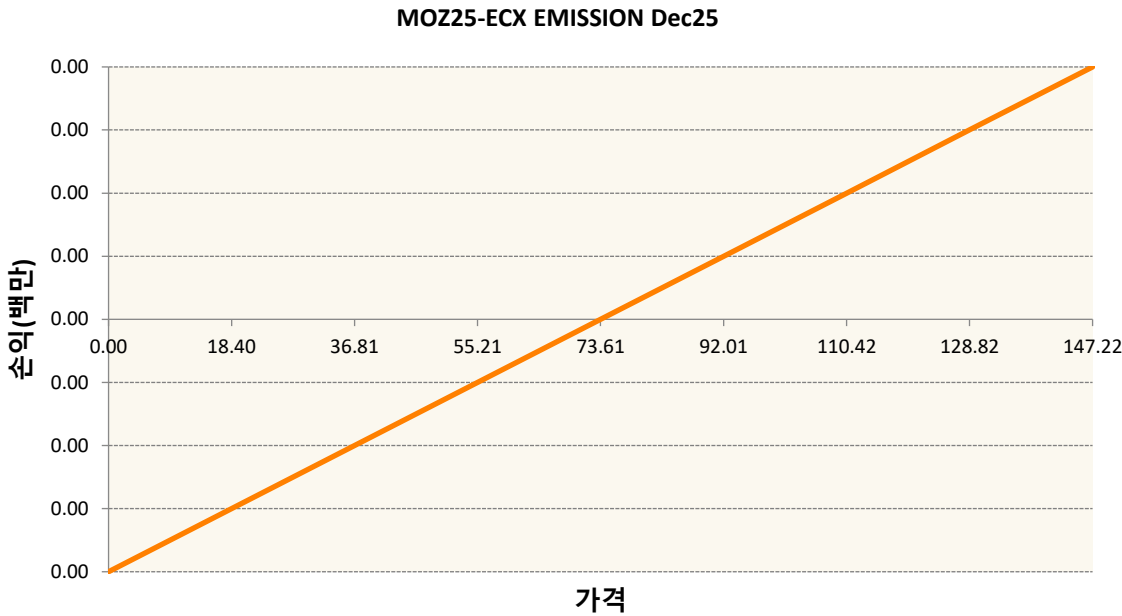
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,483 | 0     | 6,483     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | -4    | 0     | -4        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,993 | -1,993    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |      |
|-----------------------------------------------------|------|
| 2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index | 0.46 |
| FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E                        | 159  |
| MOZ25 ECX EMISSION Dec25                            | 519  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 863 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

## 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)             | 15 |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 16 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 127 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

SOL차이나육성산업엑티브상장지

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   | 7,481 | 0     | 7,481     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(미래)  | 71 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(메리츠) | 85 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)  | 60 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)  | 18 |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 250903(메리츠) | 3  |

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

(단위:백만원)

412

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

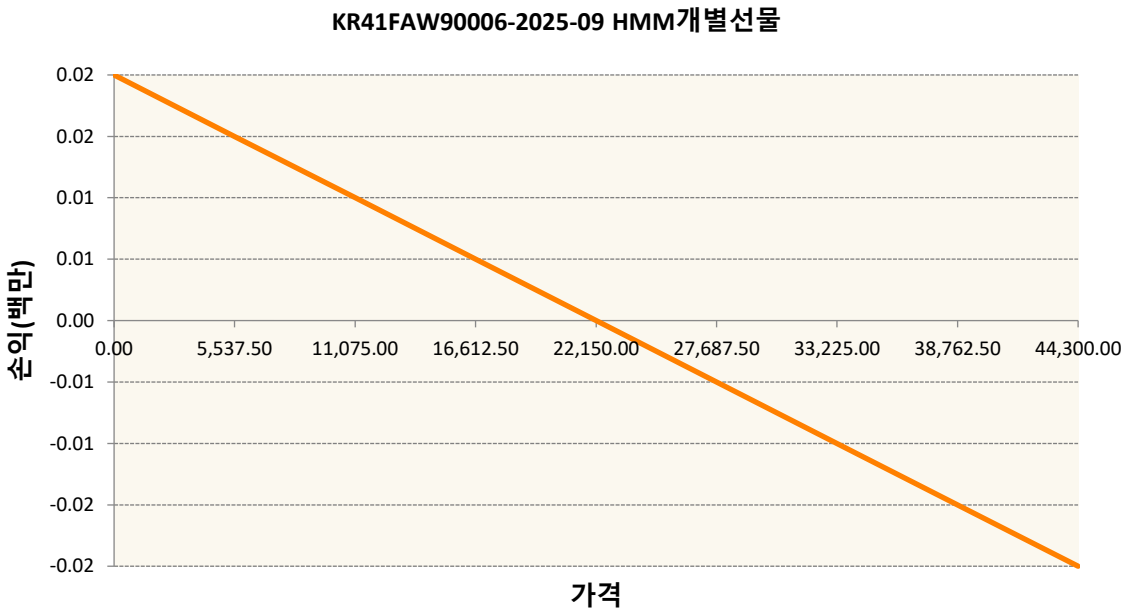
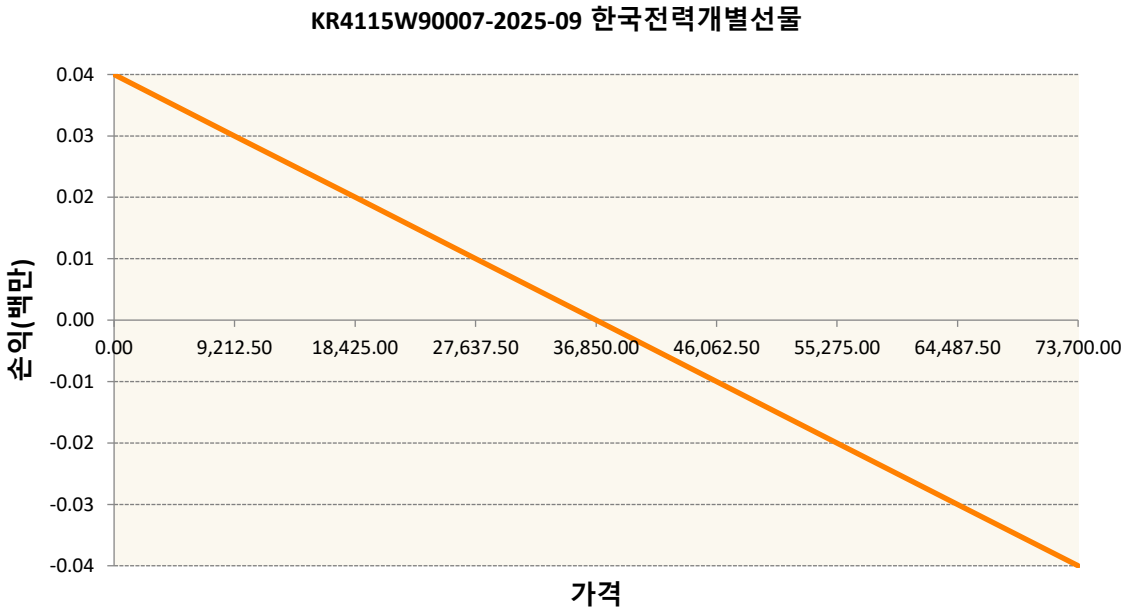
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 3     | -3        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 11    | -11       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------|--|----------|
| KR4115W90( 2025-09 한국전력개별선물 |  | 1        |
| KR41FAW90( 2025-09 HMM개별선물  |  | 0.32     |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 0        |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

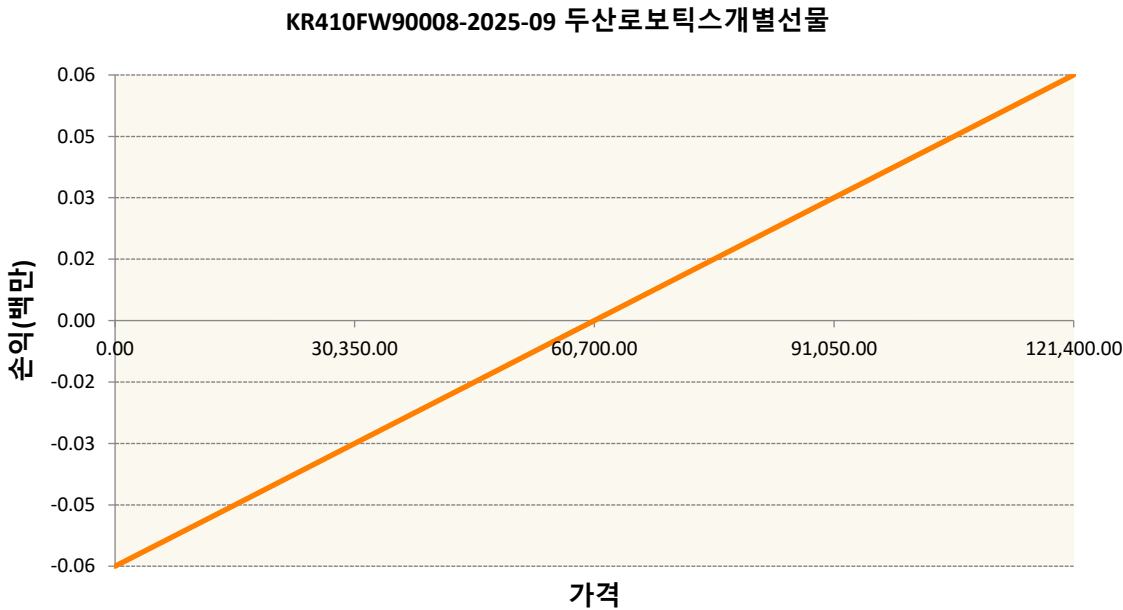
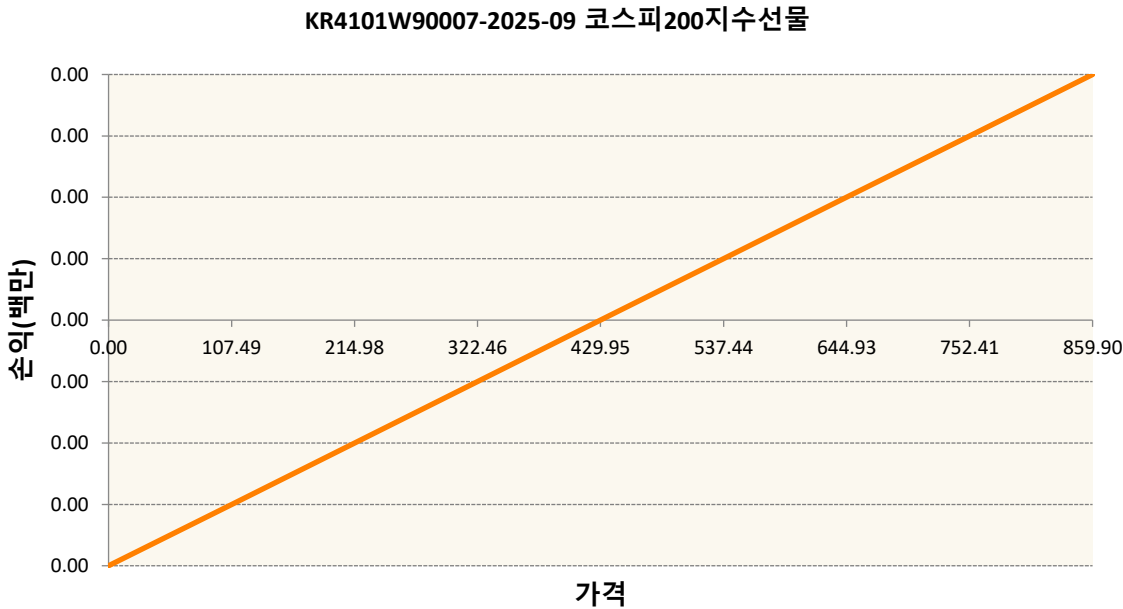
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

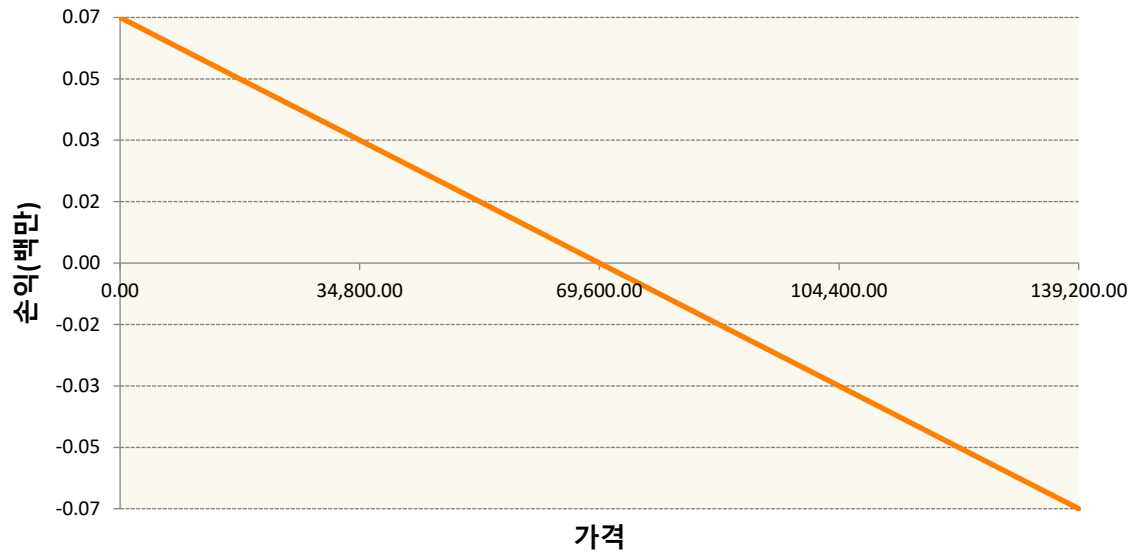
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 214   | -214      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 12,333 | 1,044 | 11,289    | 장내 |

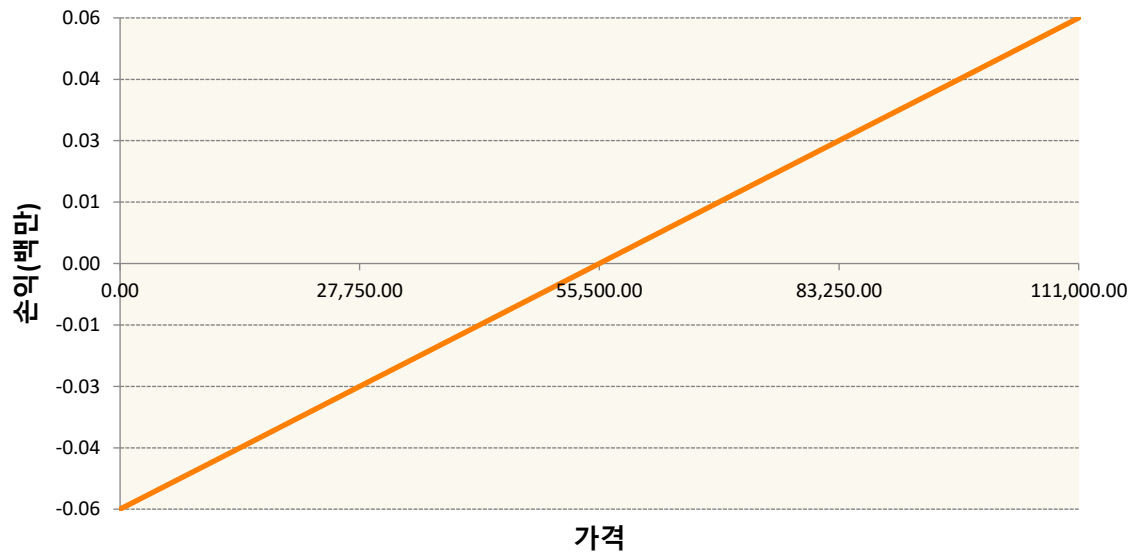
2. 만기시점의 손익구조



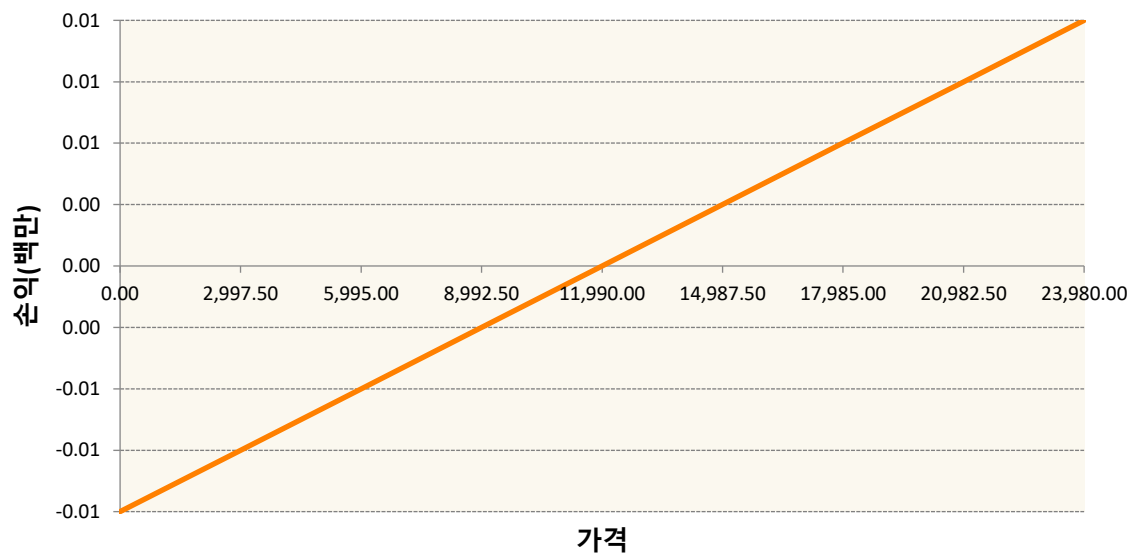
KR4111W90006-2025-09 삼성전자개별선물



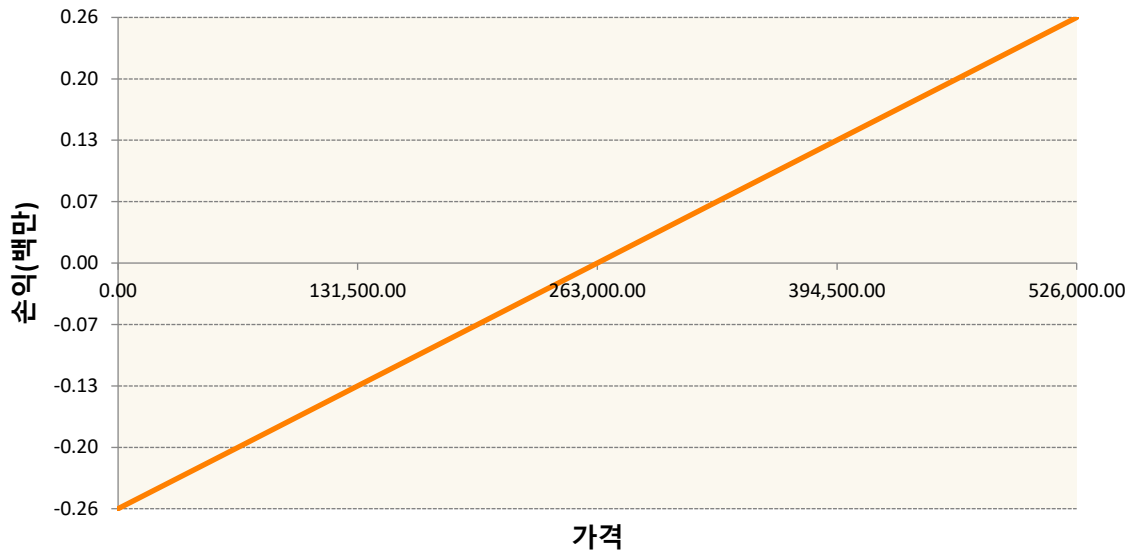
KR411RW90001-2025-09 한화비전개별선물



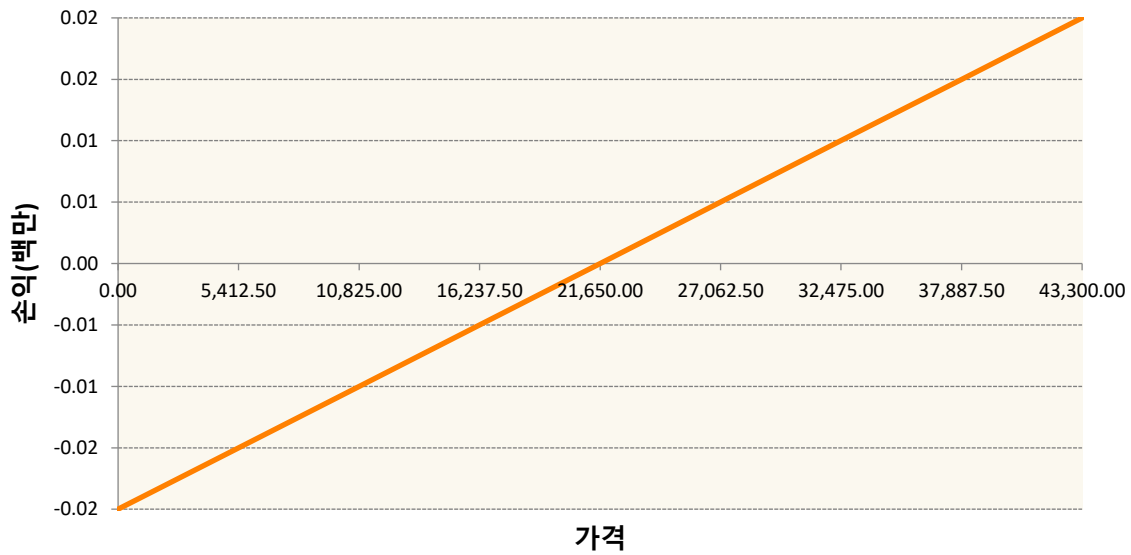
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



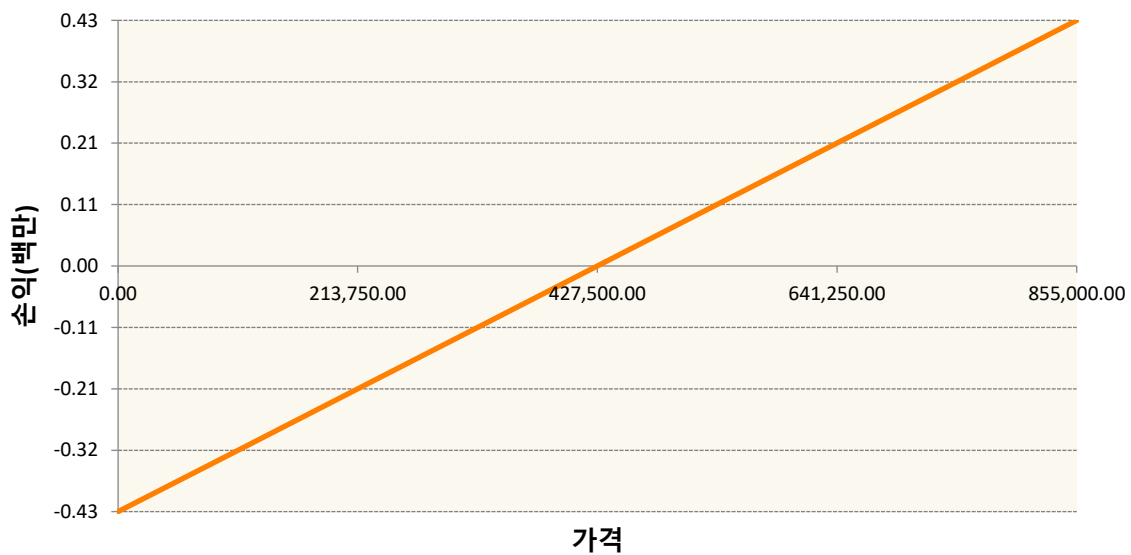
KR4150W90004-2025-09 SK하이닉스개별선물



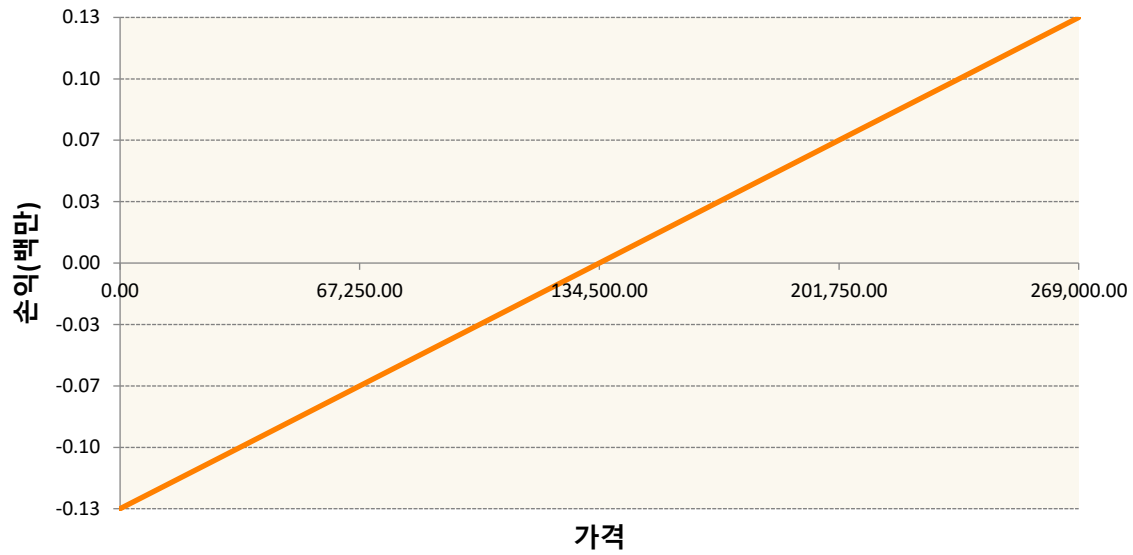
KR41CNW90006-2025-09 포스코DX개별선물



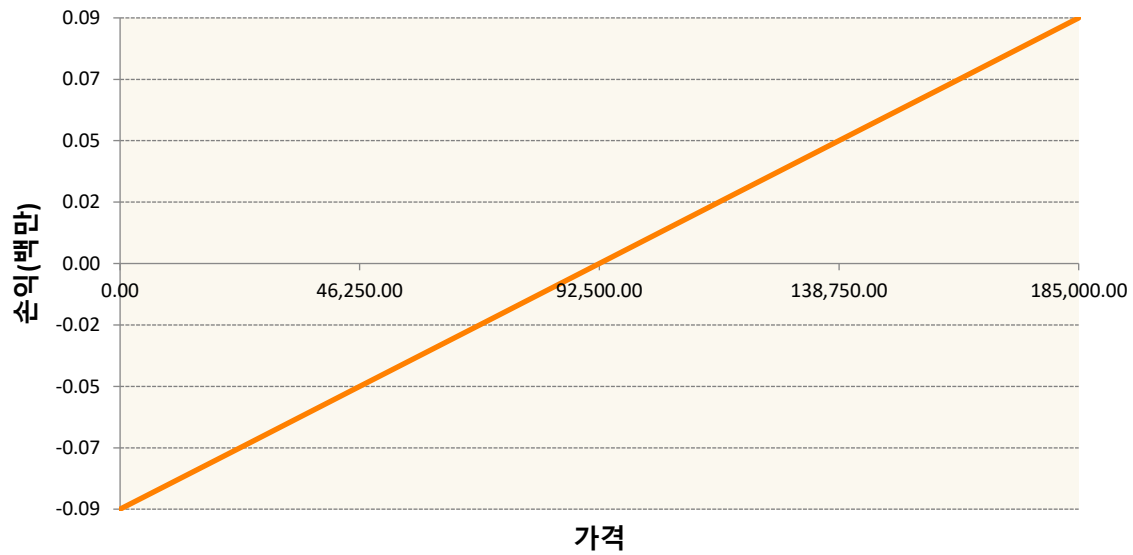
KR41DAW90001-2025-09 농심개별선물



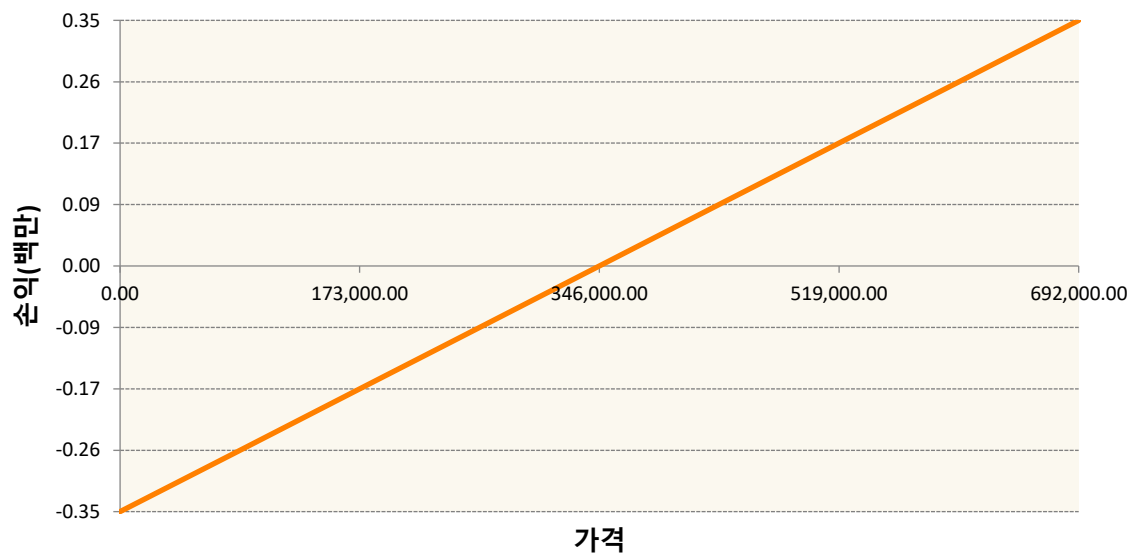
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



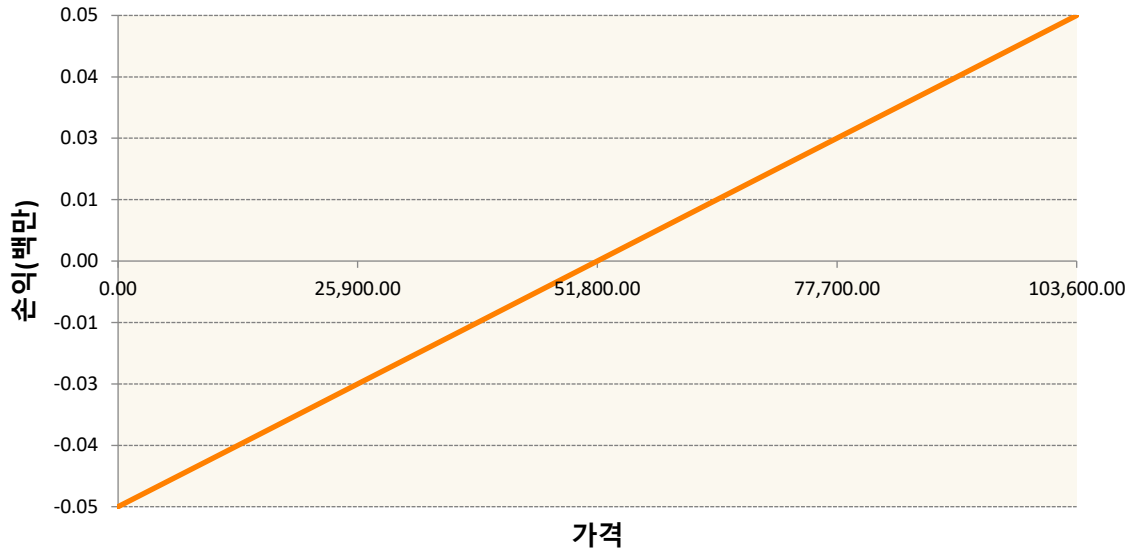
KR41EJW90000-2025-09 SKC개별선물



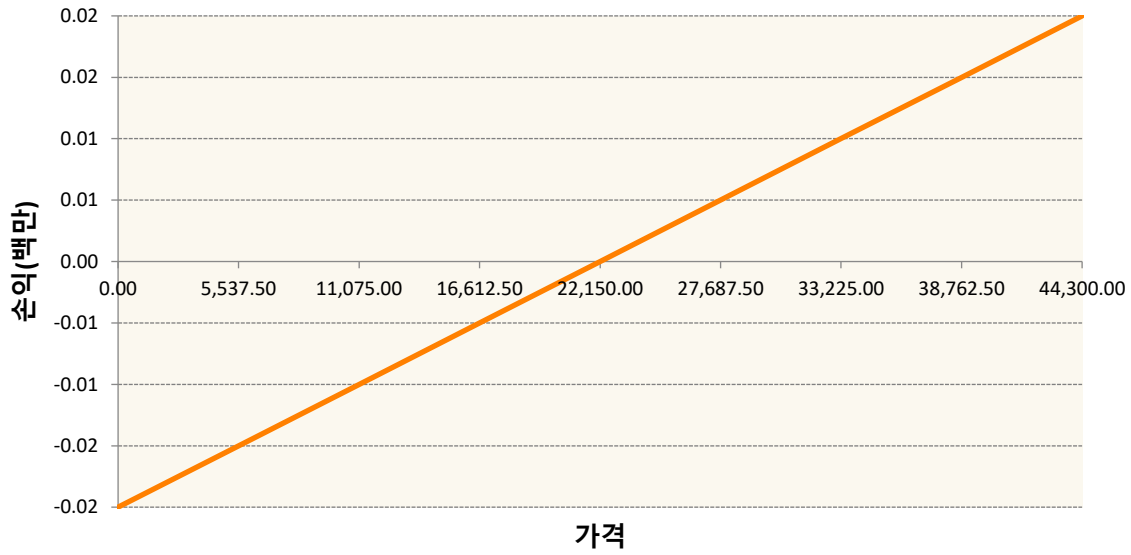
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



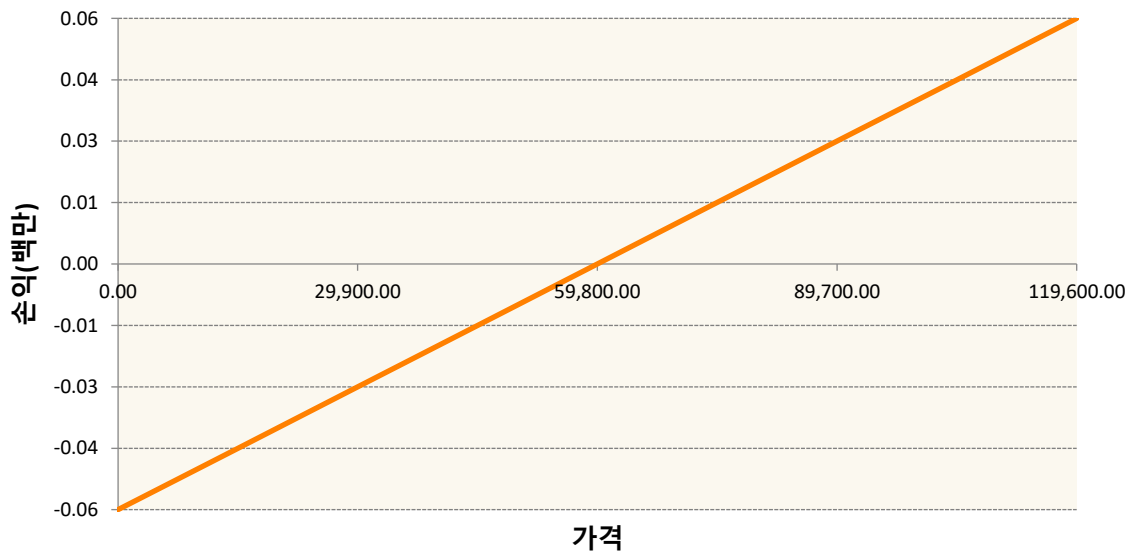
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



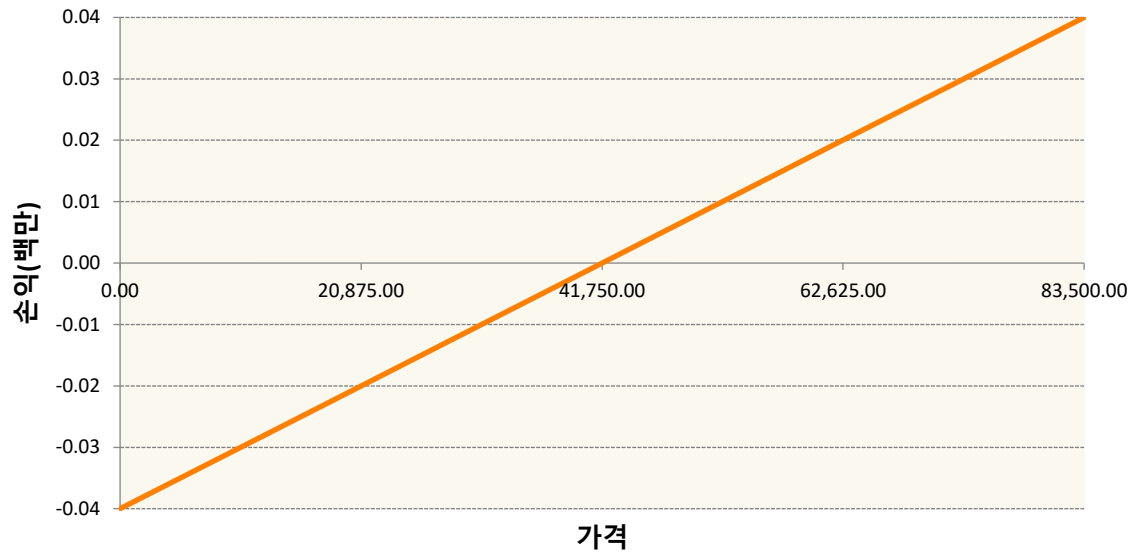
KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



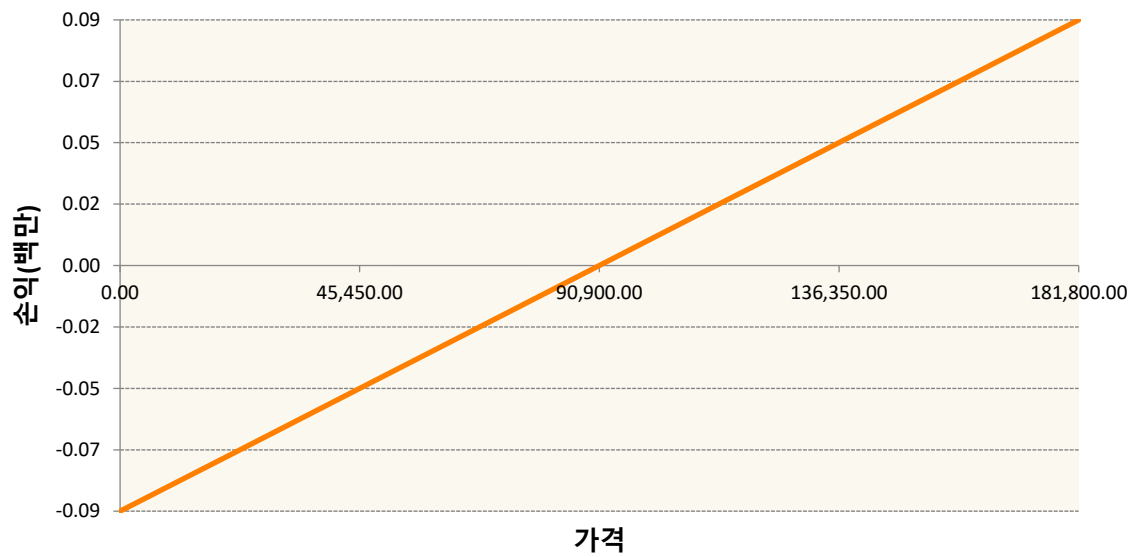
KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



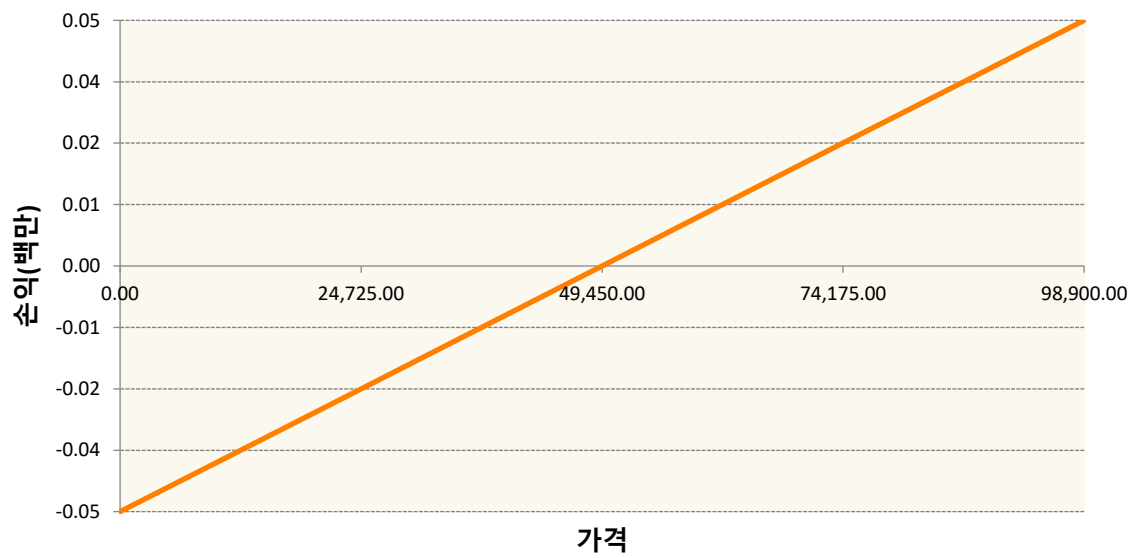
KR41G0W90002-2025-09 씨에스원드개별선물



KR41G3W90006-2025-09 한전기술개별선물



KR41GZW90001-2025-09 에코프로머티개별선물



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)       | (단위:백만원) |
|---------------------------------|----------|
| KR4101W90( 2025-09 코스피200지수선물   | 705      |
| KR410FW90( 2025-09 두산로보틱스개별선물   | 13       |
| KR4111W90( 2025-09 삼성전자개별선물     | 84       |
| KR411RW90( 2025-09 한화비전개별선물     | 2        |
| KR4145W90( 2025-09 LG디스플레이개별선물  | 24       |
| KR4150W90( 2025-09 SK하이닉스개별선물   | 85       |
| KR41CNW90 2025-09 포스코DX개별선물     | 12       |
| KR41DAW90 2025-09 농심개별선물        | 4        |
| KR41E8W90( 2025-09 포스코퓨처엠개별선물   | 38       |
| KR41EJW900 2025-09 SKC개별선물      | 19       |
| KR41F5W90( 2025-09 LG에너지솔루션개별선물 | 12       |
| KR41F7W90( 2025-09 카카오페이개별선물    | 15       |
| KR41FAW90( 2025-09 HMM개별선물      | 9        |
| KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물      | 15       |
| KR41G0W90 2025-09 씨에스원드개별선물     | 3        |
| KR41G3W90 2025-09 한전기술개별선물      | 19       |
| KR41GZW90 2025-09 에코프로머티개별선물    | 12       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 727      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

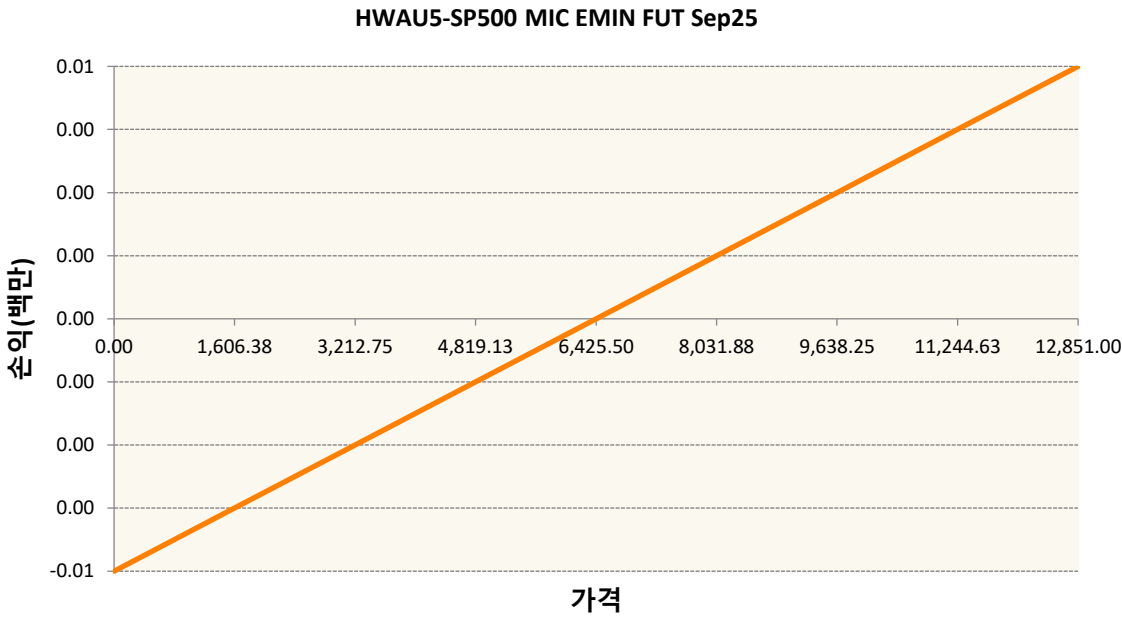
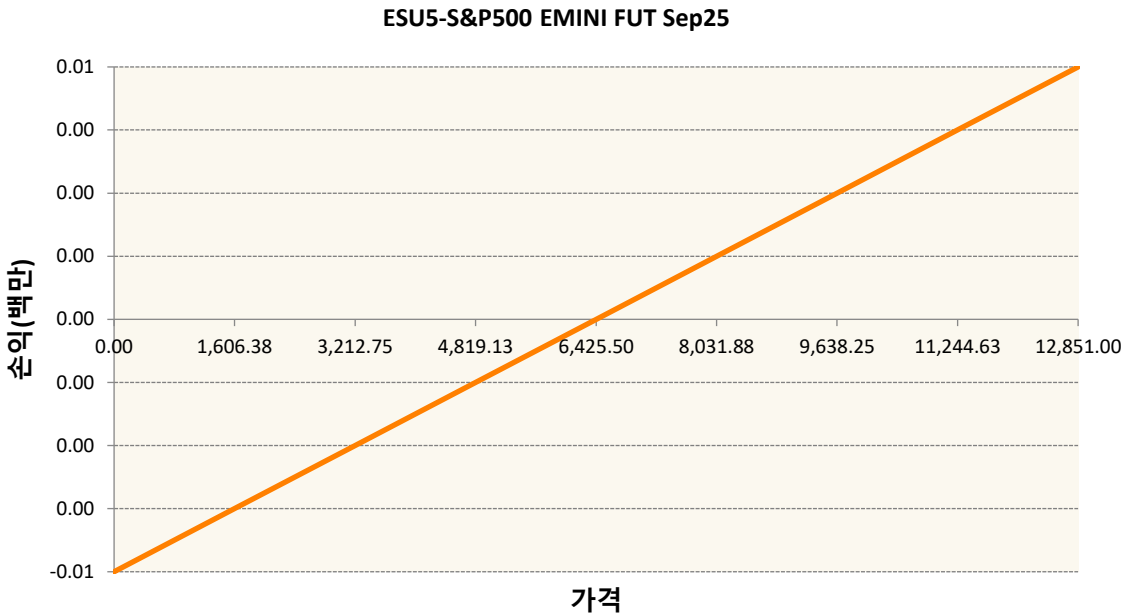
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 33,719 | 0     | 33,719    |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,195  | 0     | 1,195     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESU5                      | S&P500 EMINI FUT Sep25   | 2,697    |
| HWAU5                     | SP500 MIC EMIN FUT Sep25 | 96       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 2,446    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

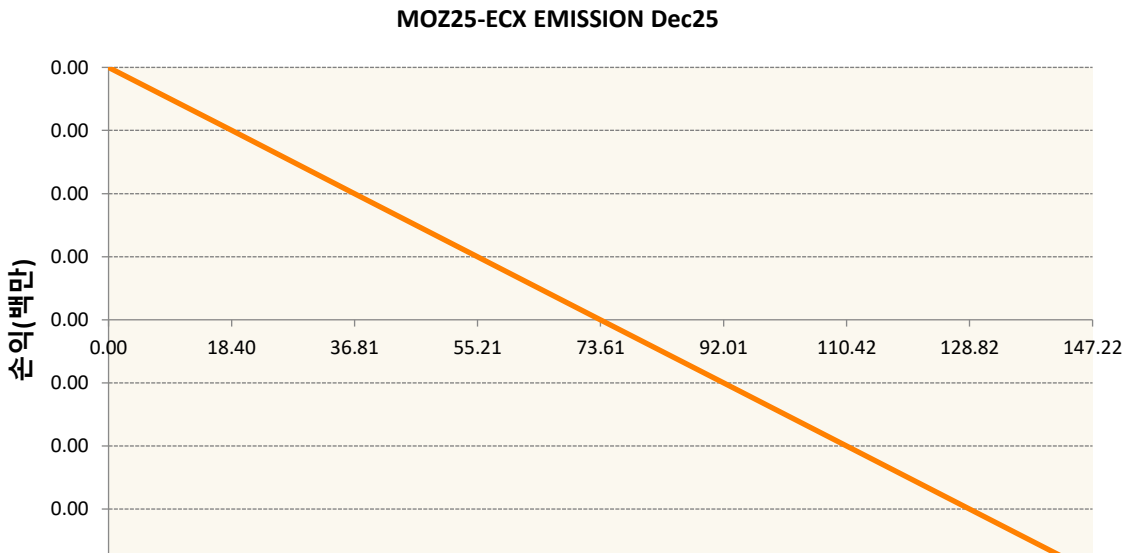
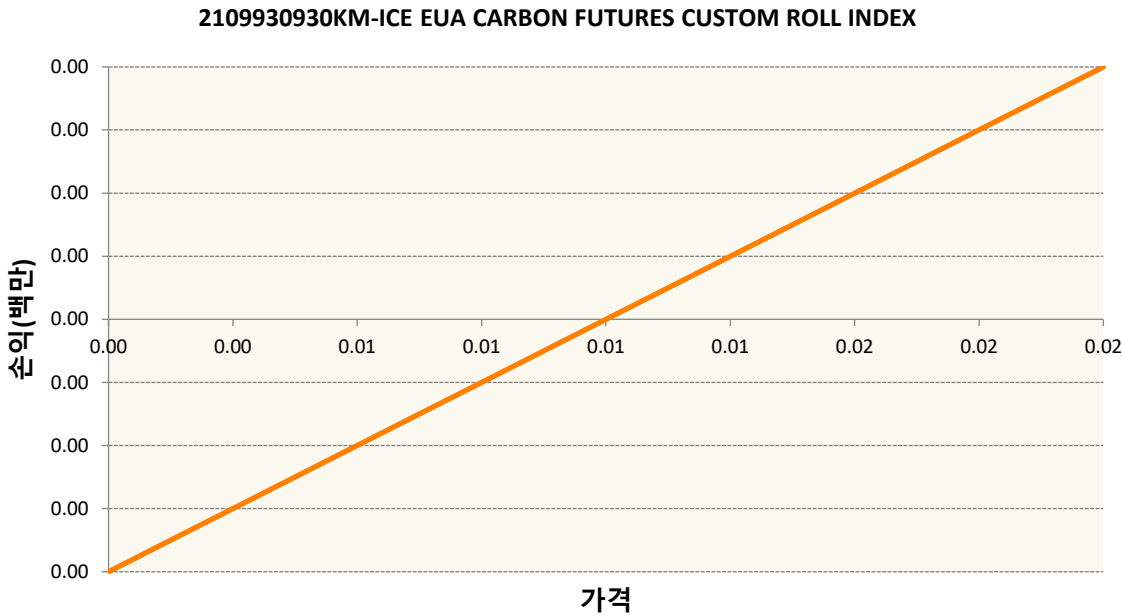
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 4,722 | -4,722    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 4     | 0     | 4         | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,205 | -1,205    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

|                                                     |      |
|-----------------------------------------------------|------|
| 2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 0.39 |
| FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E                        | 96   |
| MOZ25      ECX EMISSION Dec25                       | 378  |

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

(단위:백만원)

**615**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

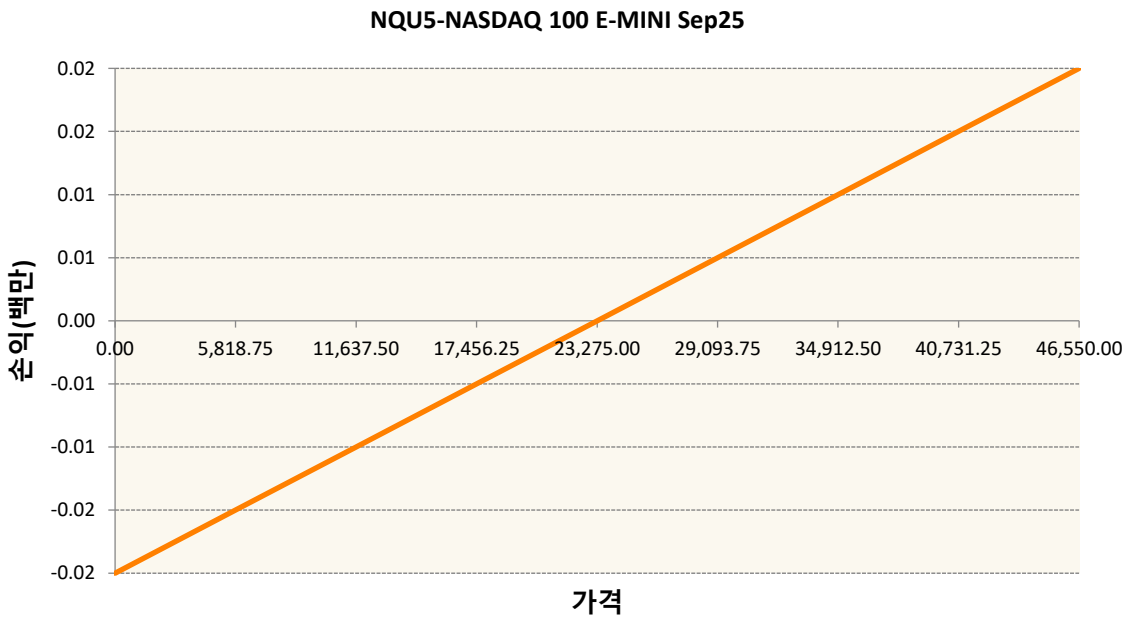
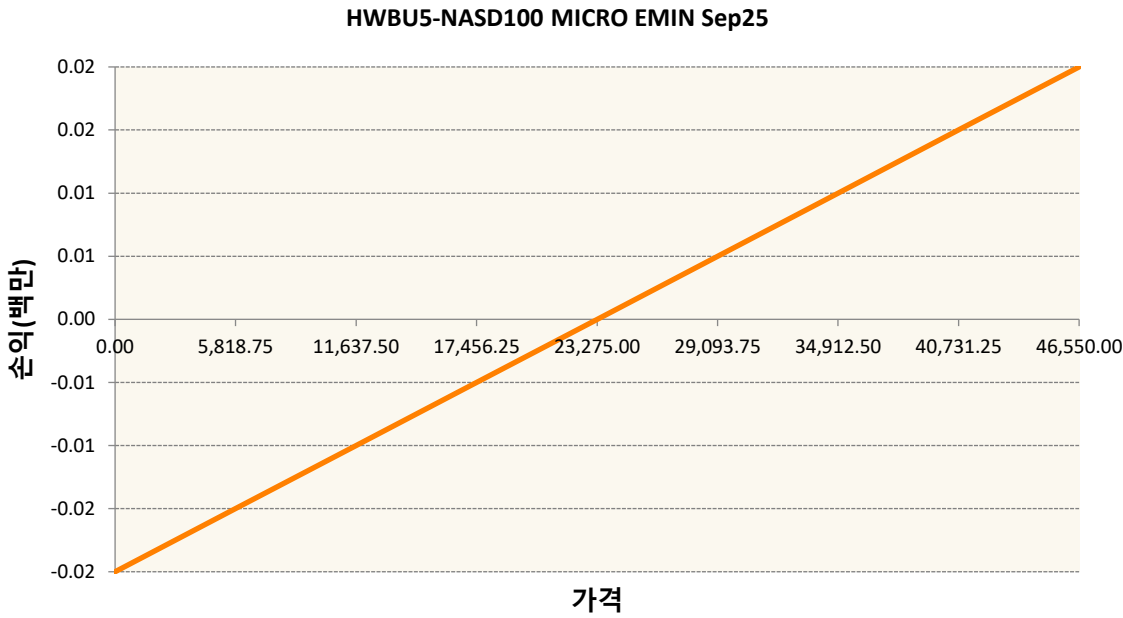
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 13,496 | 0     | 13,496    |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,292  | 0     | 1,292     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBU5                     | NASD100 MICRO EMIN Sep25 |  | 103      |
| NQU5                      | NASDAQ 100 E-MINI Sep25  |  | 1,080    |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

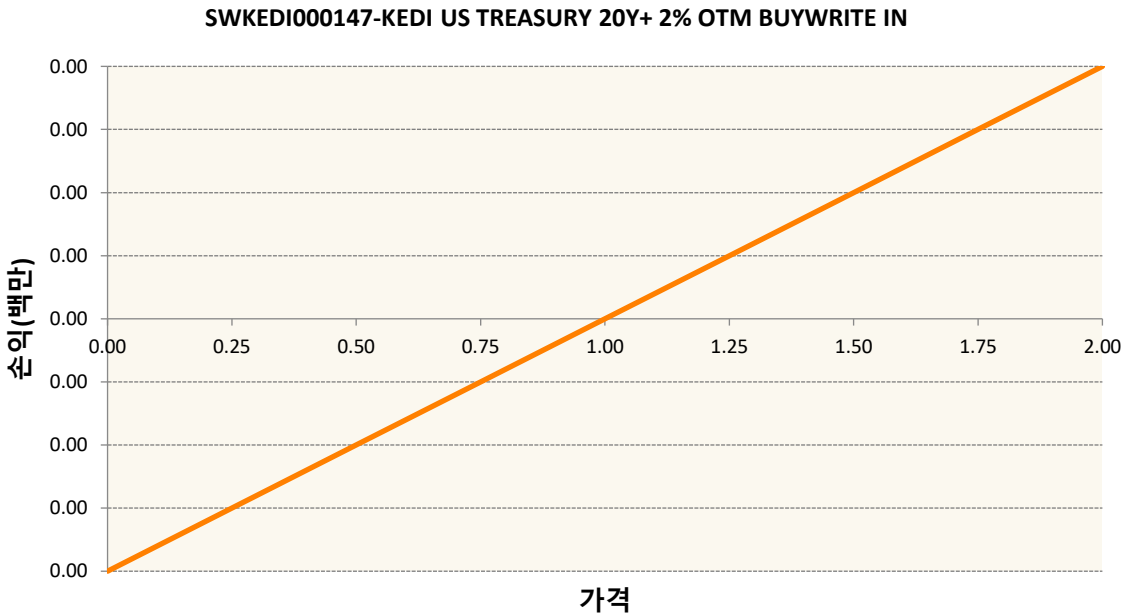
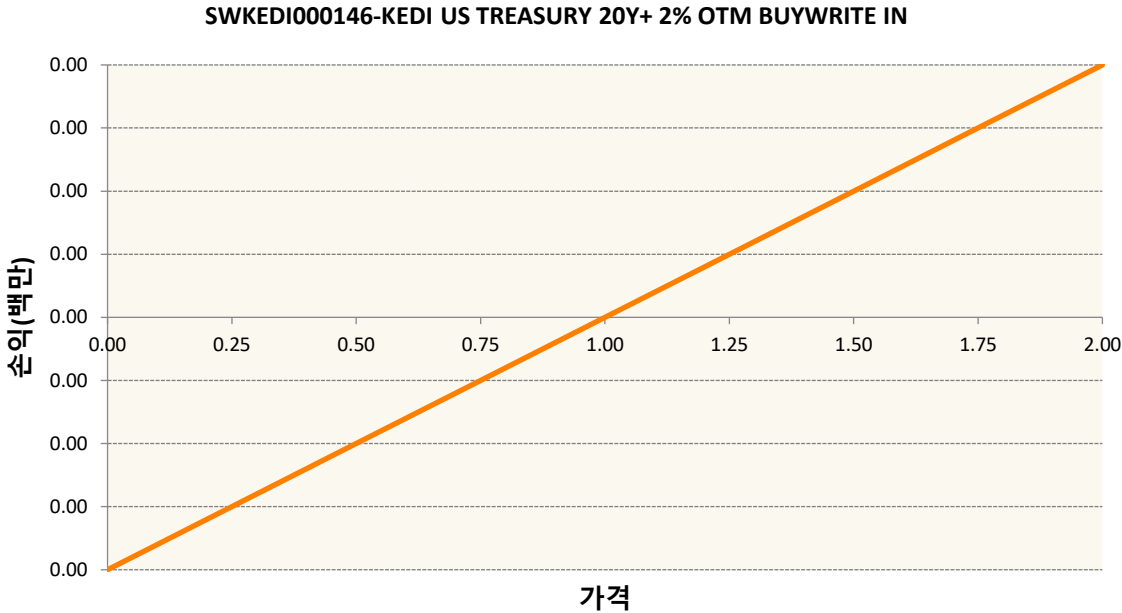
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

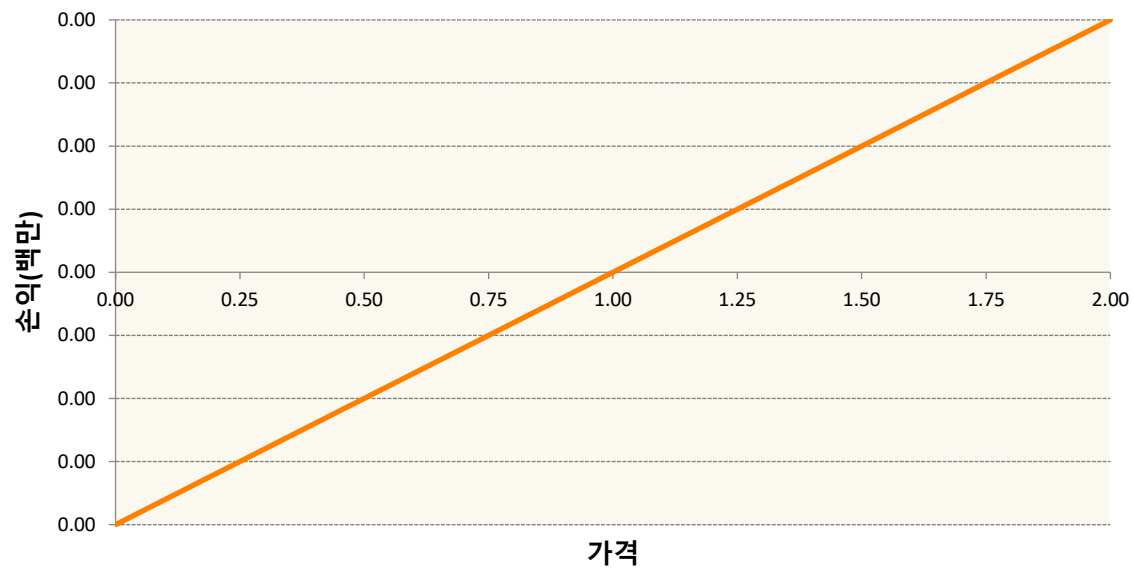
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 331,506 | 0     | 331,506   | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### SWKEDI000148-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 |

|       |
|-------|
| 7,789 |
| 5,989 |
| 9,352 |
| 3,463 |

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

(단위:백만원)

13,051

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

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 | 14 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 14 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 14 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 14 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 75 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-09-04 |
| 기준일 | 2025-09-03 |

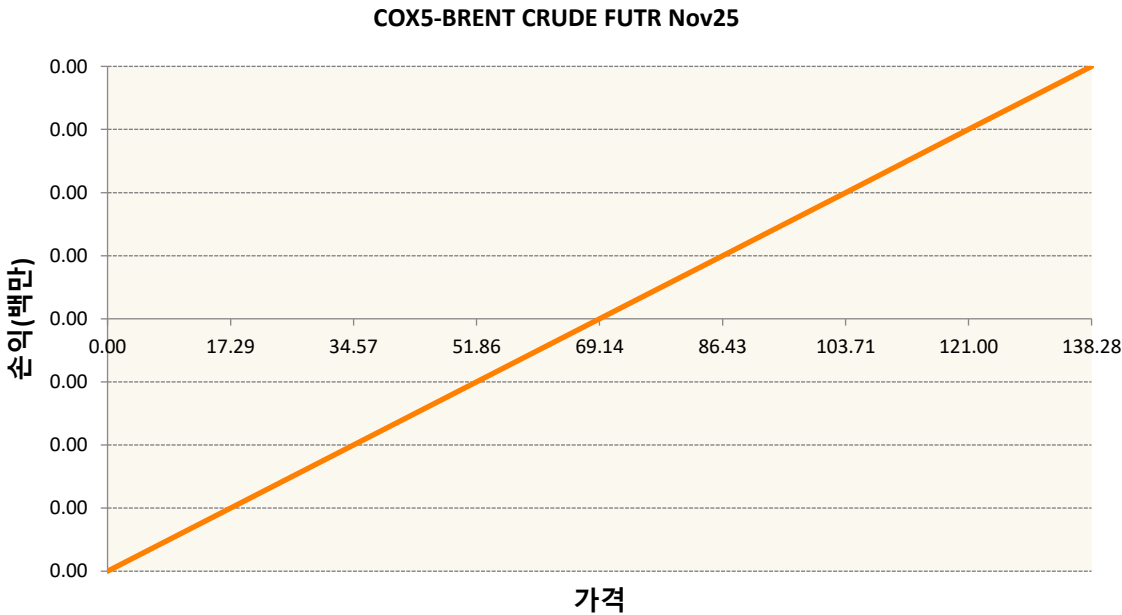
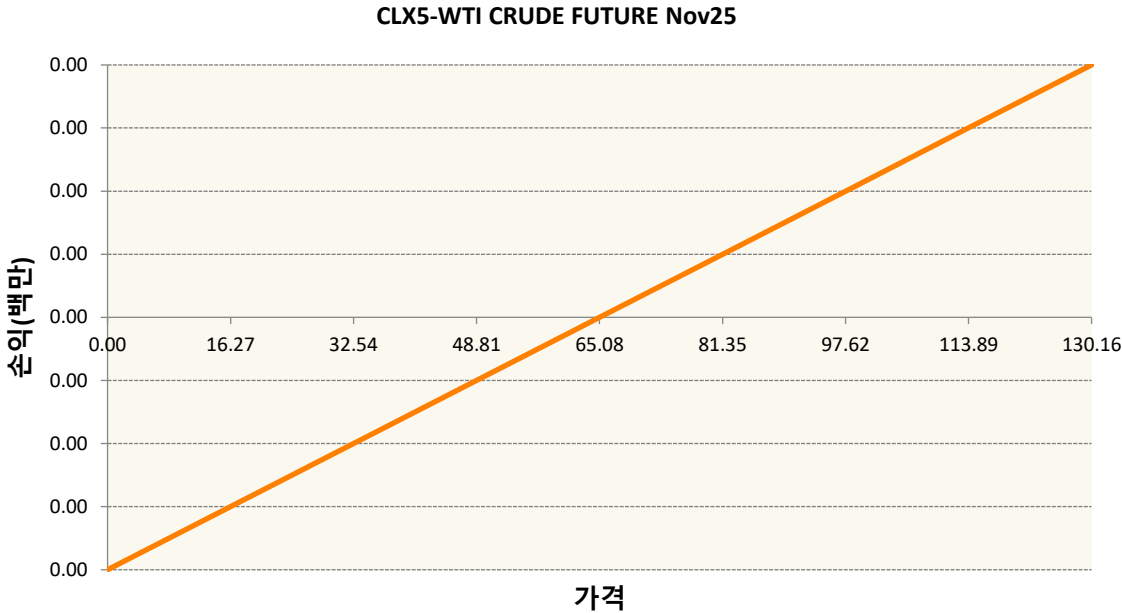
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

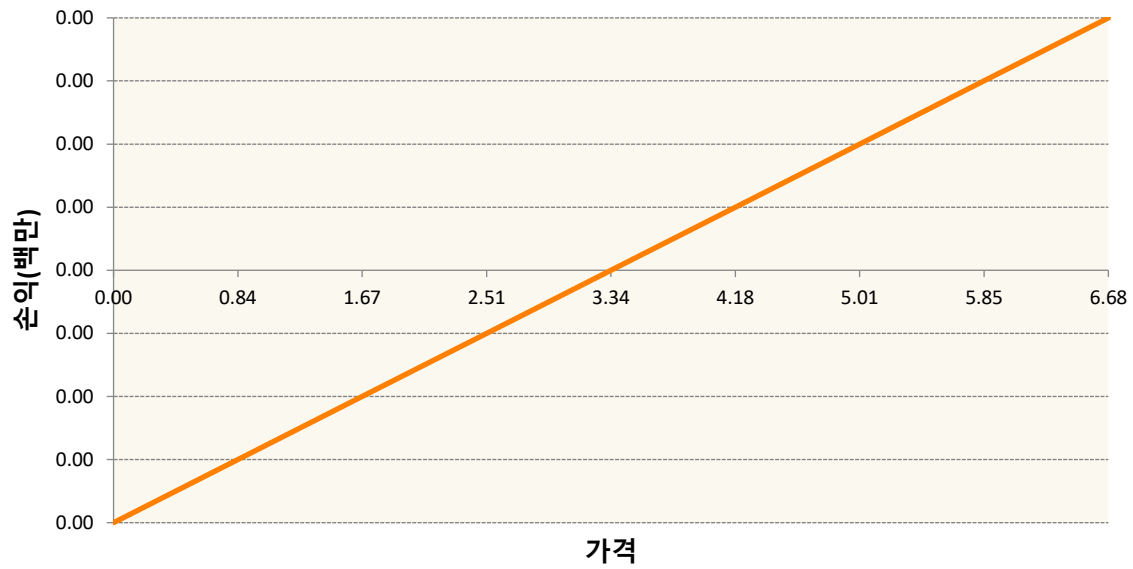
(단위:백만원)

| 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   | 550   | 0     | 550       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 70    | -70       | 장내 |

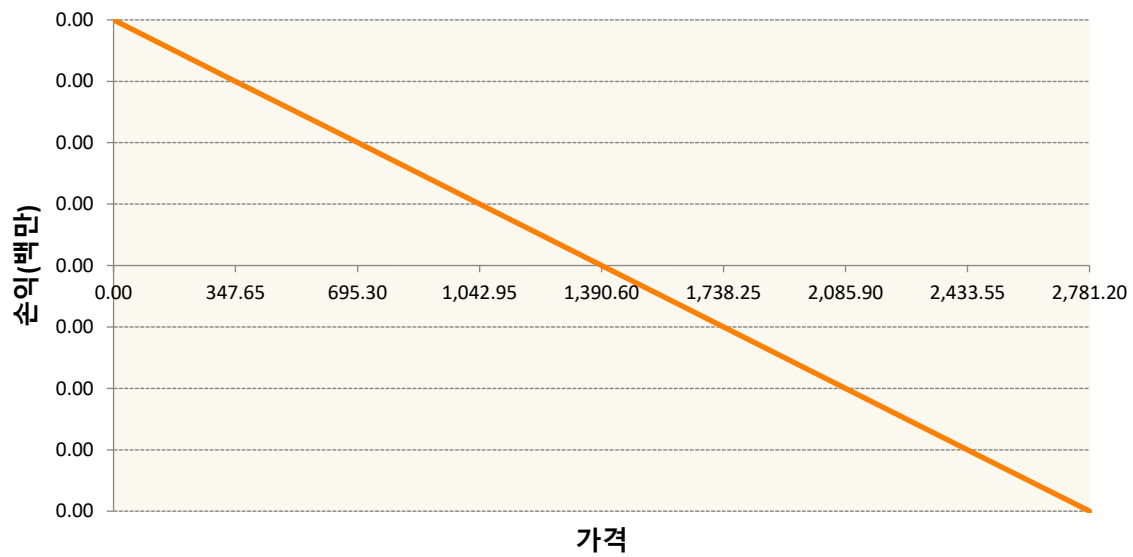
### 2. 만기시점의 손익구조



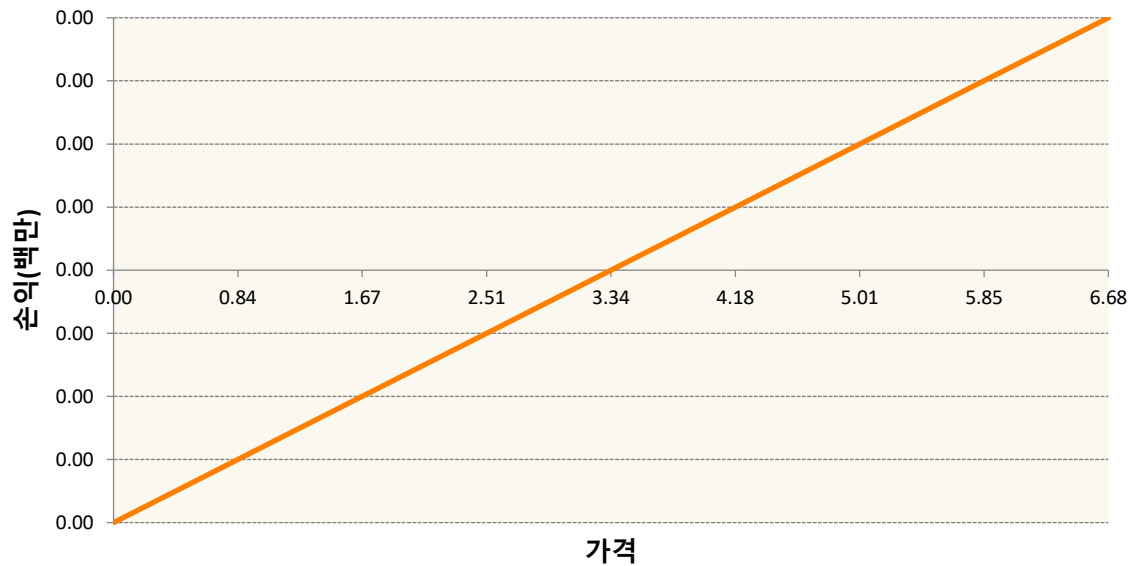
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

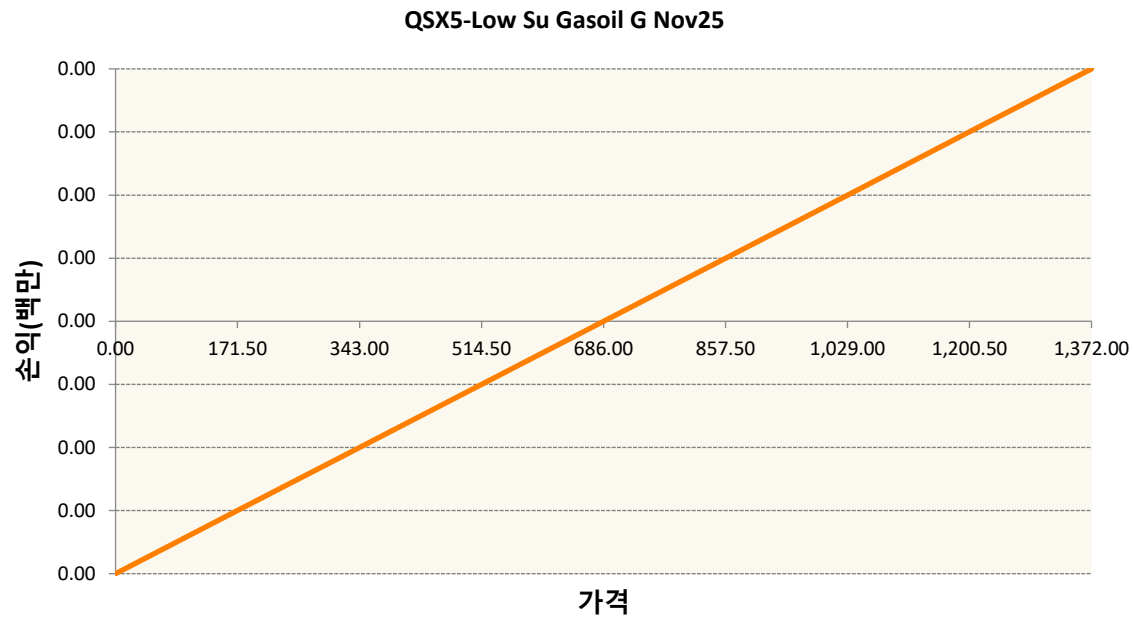


KR4175W90001-2025-09 달러선물



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  |  | 11       |
| QX5                       | Low Su Gasoil G Nov25   |  | 8        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 100      |