

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

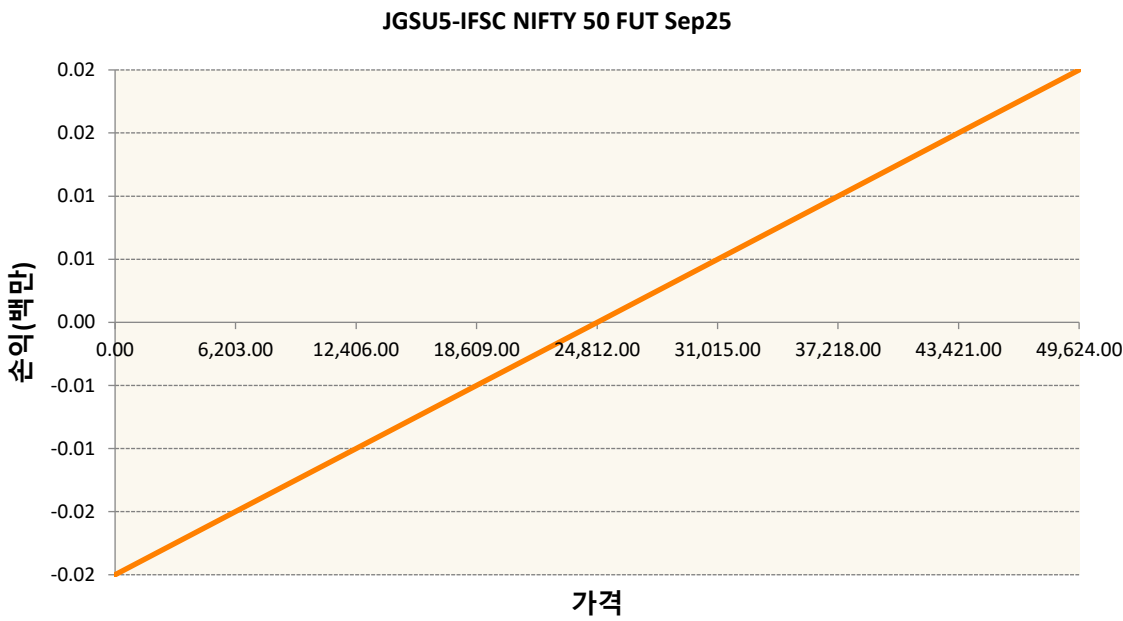
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	554	0	554	

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)

32

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

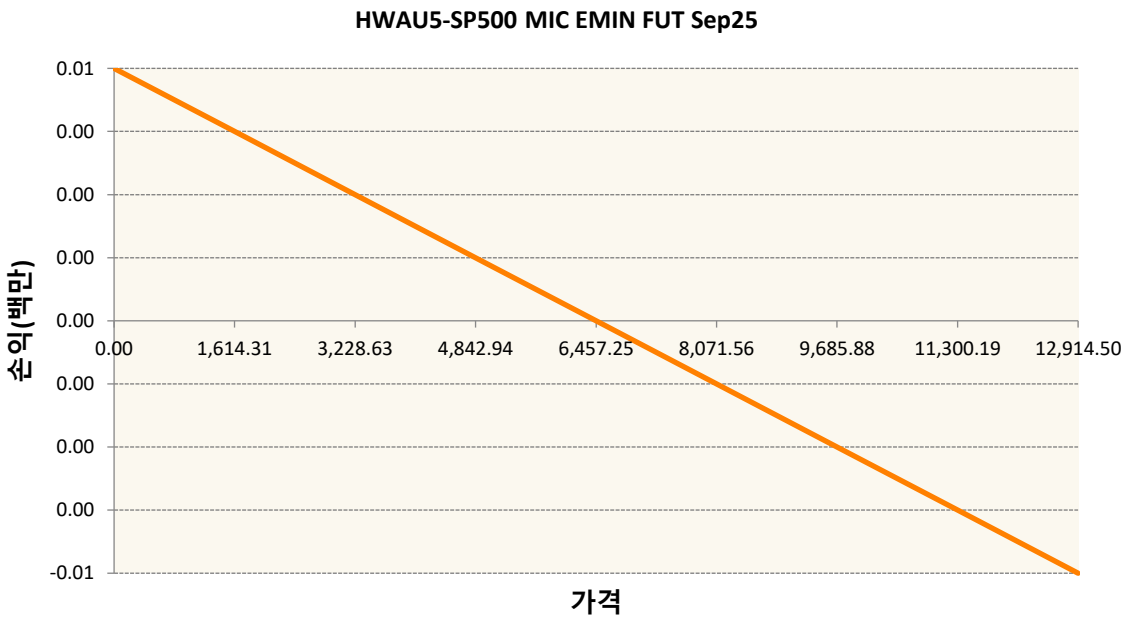
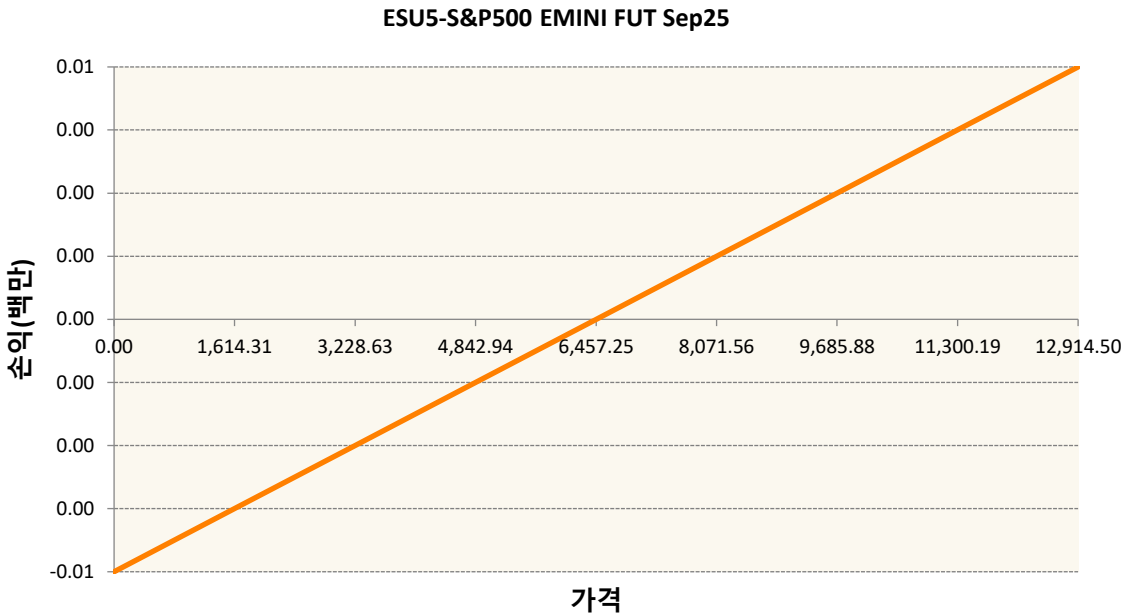
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	225	-225	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	2025-09-05
기준일	2025-09-04

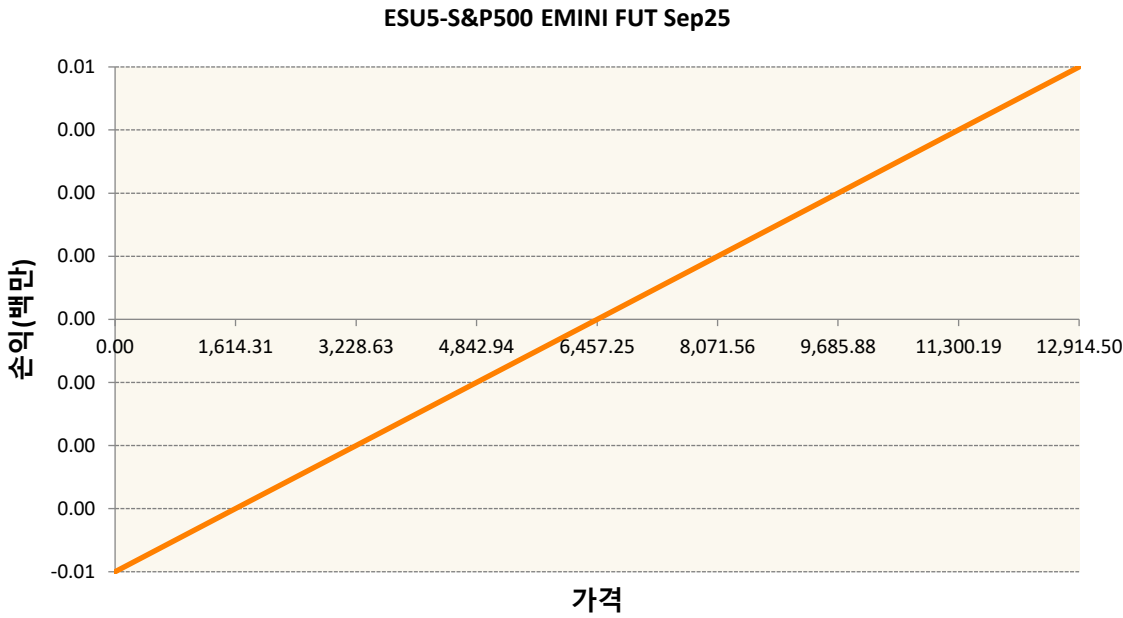
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,338	0	1,338	

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	2025-09-05
기준일	2025-09-04

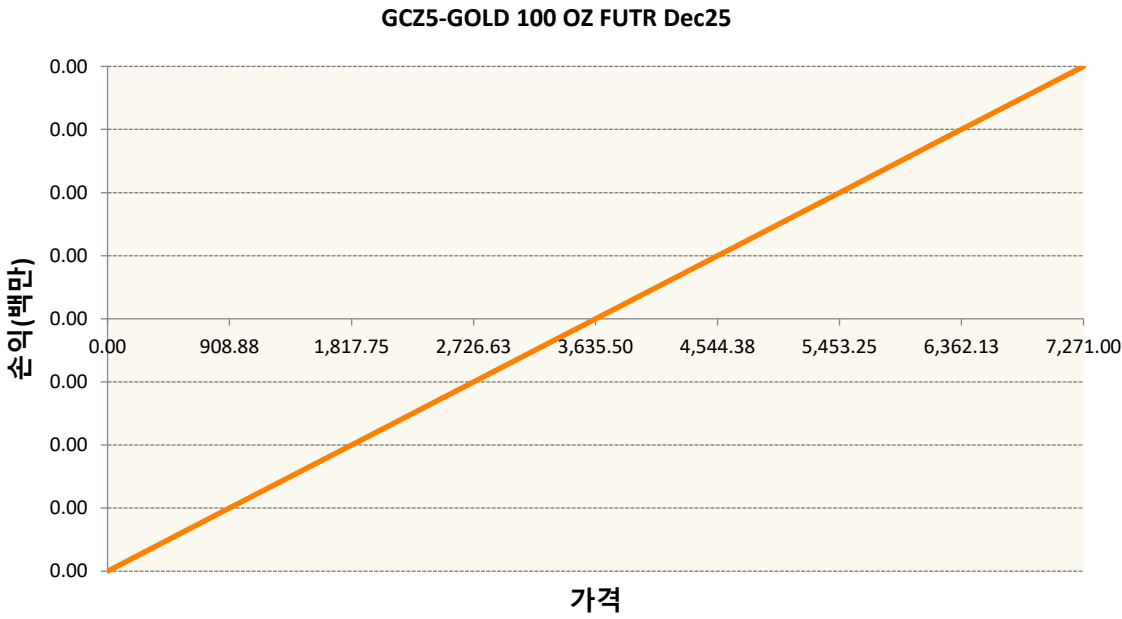
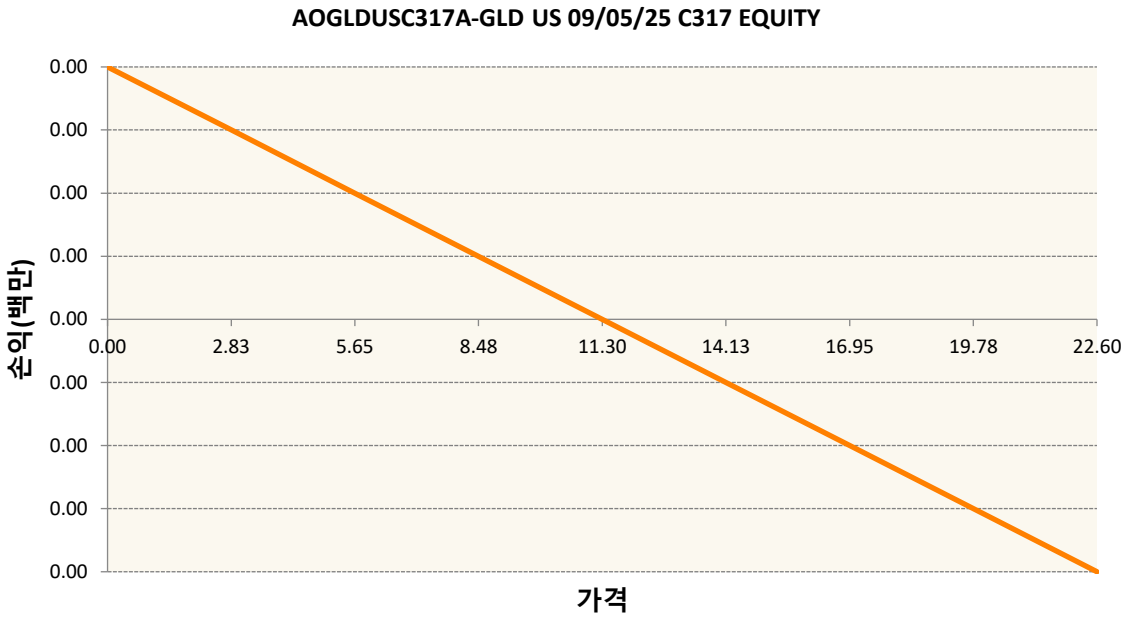
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	2,017	0	2,017	
누계	실물자산	옵션	0	-63	63	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSC3 GLD US 09/05/25 C317 EQUITY		5
GCZ5	GOLD 100 OZ FUTR Dec25	161

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	145

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

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	31
AOPLTRUCC PLTR US 09/05/25 C165 EQUITY	28

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

(단위:백만원)

241

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

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)

0

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

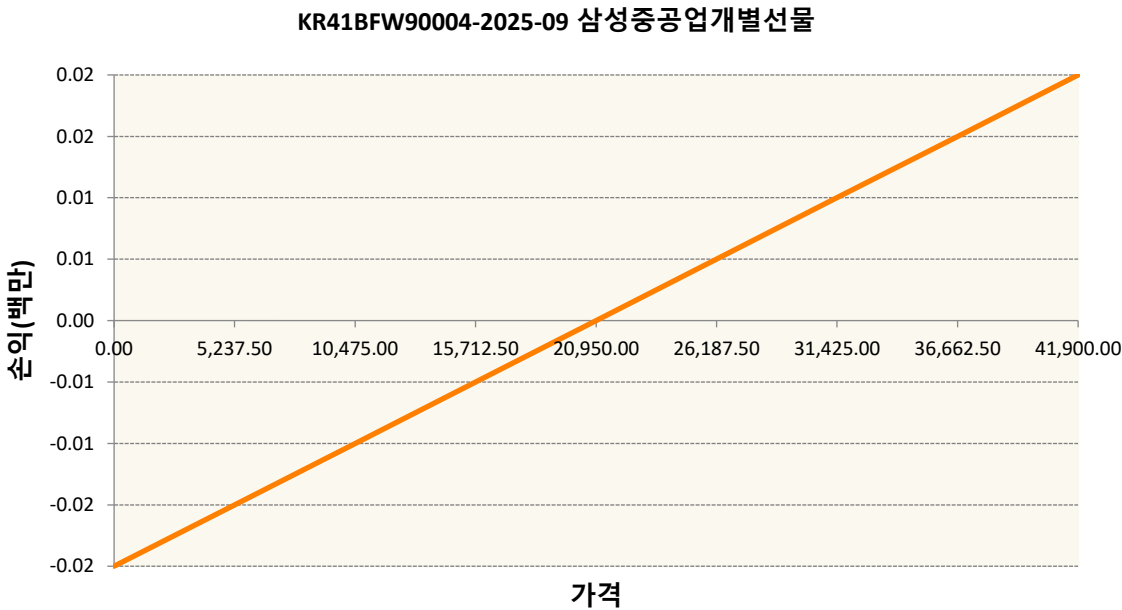
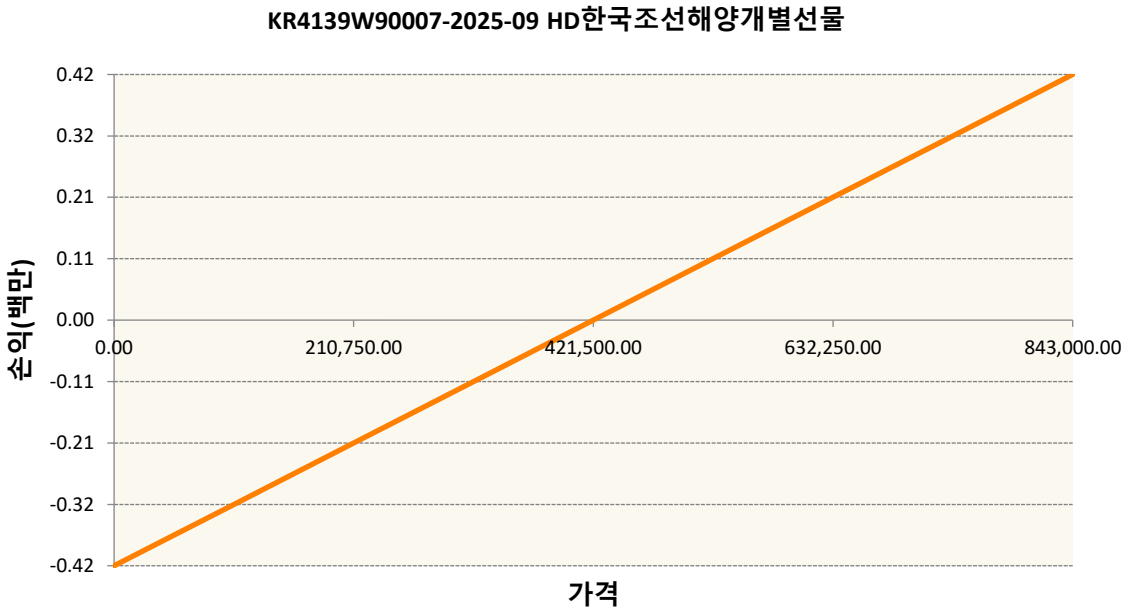
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

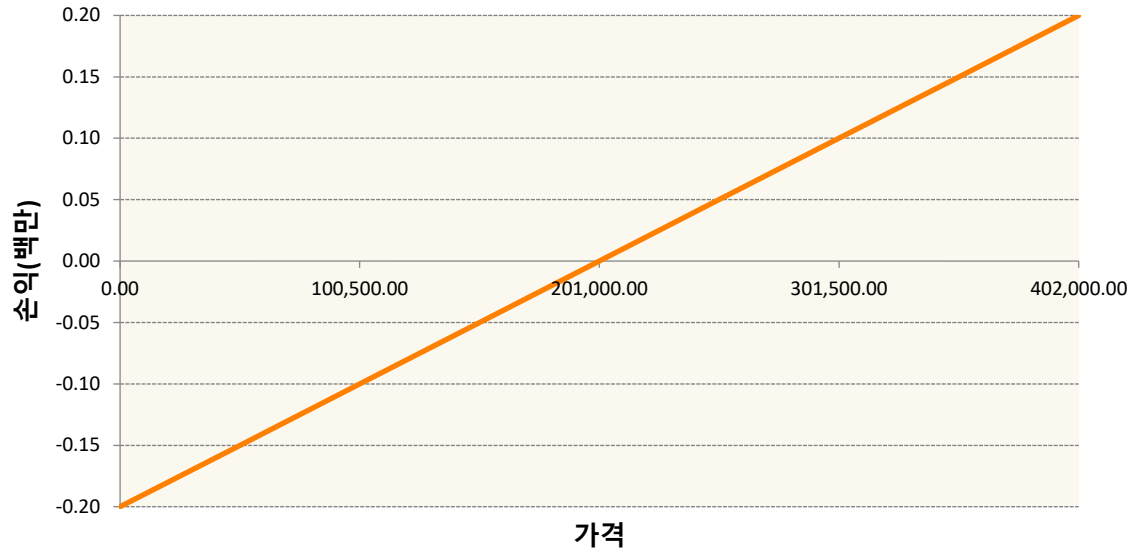
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	37,291	0	37,291	장내

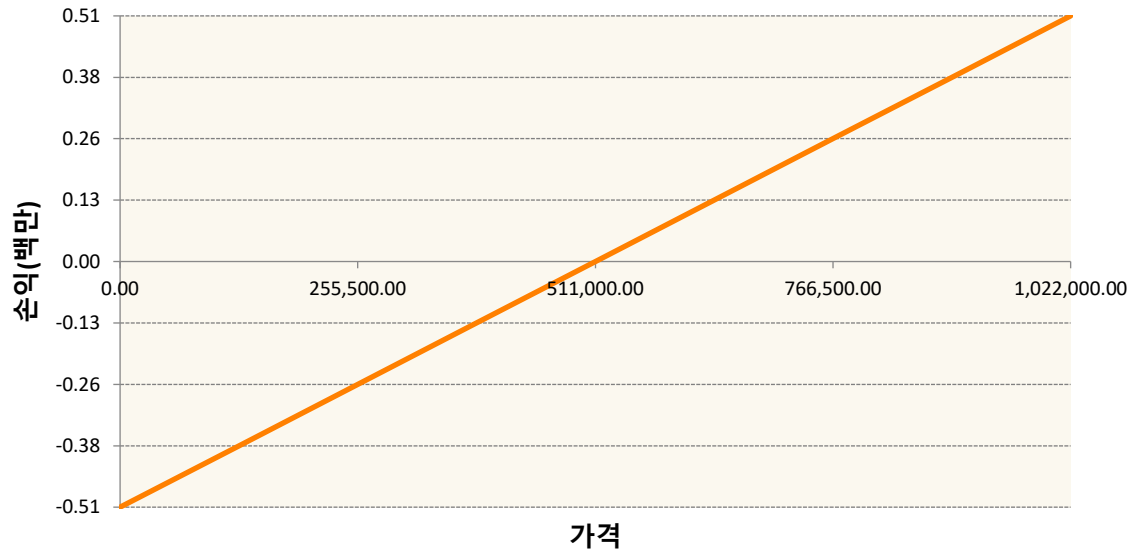
2. 만기시점의 손익구조



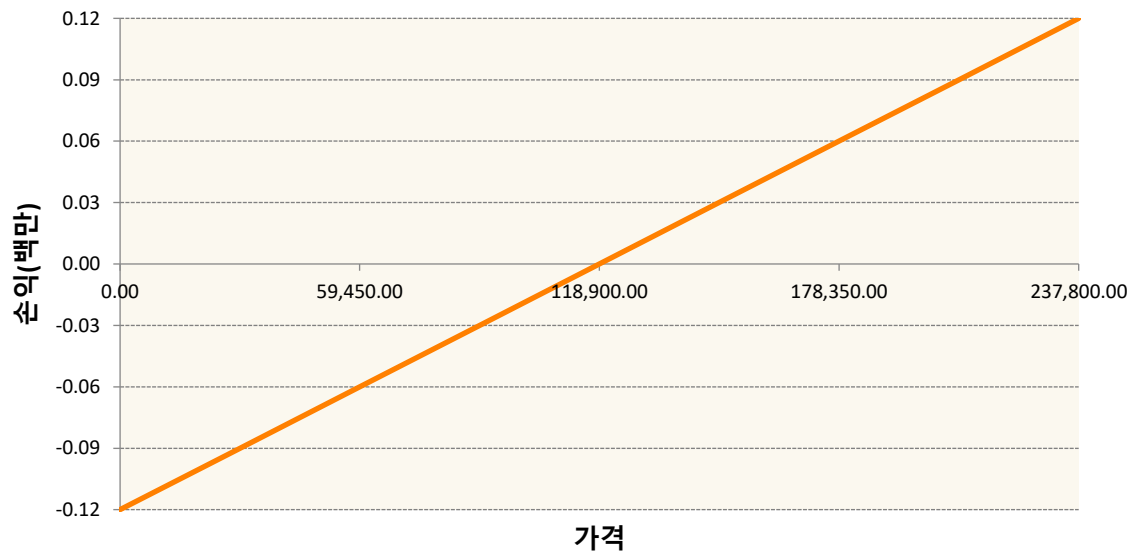
KR41CDW90007-2025-09 HD현대미포개별선물



KR41FDW90000-2025-09 HD현대중공업개별선물



KR41FVW90002-2025-09 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139W90007							2025-09 HD한국조선해양개별선물		611	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-611	-611	-611	-611	-611	-611	-611			
-5.33%	-407	-407	-407	-407	-407	-407	-407			
-2.67%	-204	-204	-204	-204	-204	-204	-204			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	204	204	204	204	204	204	204			
5.33%	407	407	407	407	407	407	407			
8.00%	611	611	611	611	611	611	611			
KR41BFW90004							2025-09 삼성중공업개별선물		535	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-535	-535	-535	-535	-535	-535	-535			
-5.33%	-357	-357	-357	-357	-357	-357	-357			
-2.67%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	178	178	178	178	178	178	178			
5.33%	357	357	357	357	357	357	357			
8.00%	535	535	535	535	535	535	535			
KR41CDW90007							2025-09 HD현대미포개별선물		455	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-455	-455	-455	-455	-455	-455	-455			
-5.33%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303			
-2.67%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	152	152	152	152	152	152	152			
5.33%	303	303	303	303	303	303	303			
8.00%	455	455	455	455	455	455	455			
KR41FDW90000							2025-09 HD현대중공업개별선물		604	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604			
-5.33%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403			
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	201	201	201	201	201	201	201			
5.33%	403	403	403	403	403	403	403			
8.00%	604	604	604	604	604	604	604			
KR41FVW90002							2025-09 한화오션개별선물		778	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-778	-778	-778	-778	-778	-778	-778
-5.33%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519
-2.67%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	259	259	259	259	259	259	259
5.33%	519	519	519	519	519	519	519
8.00%	778	778	778	778	778	778	778

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

(단위:백만원)

1,892

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

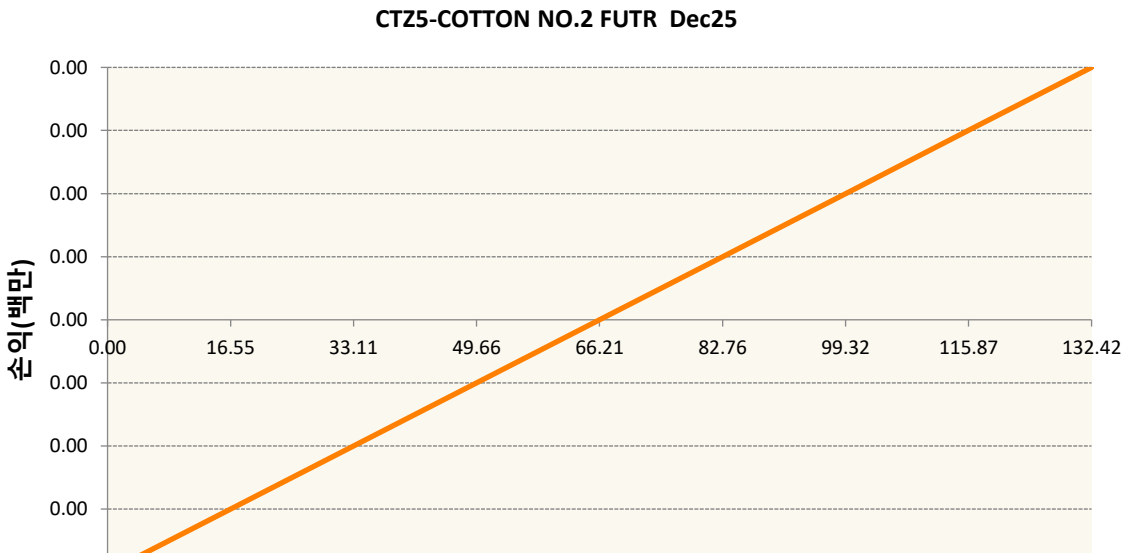
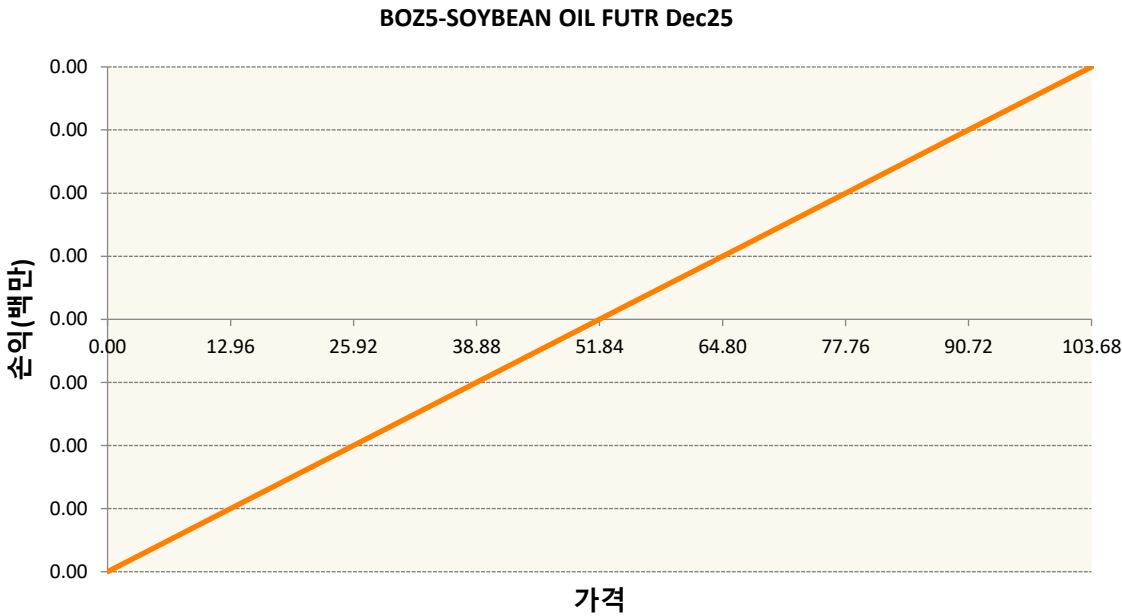
포커스농산물모(채권-파생형)

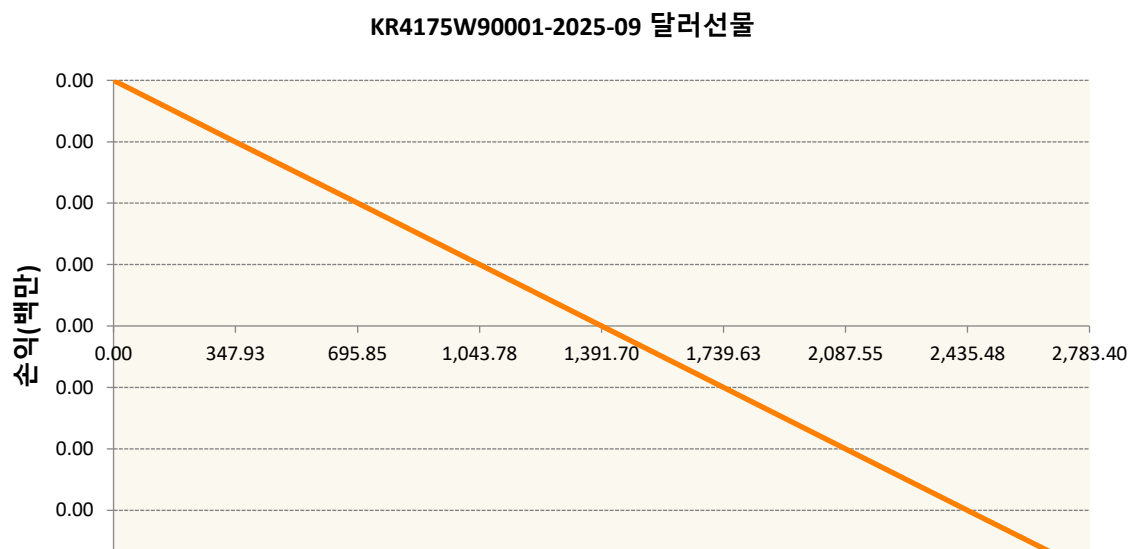
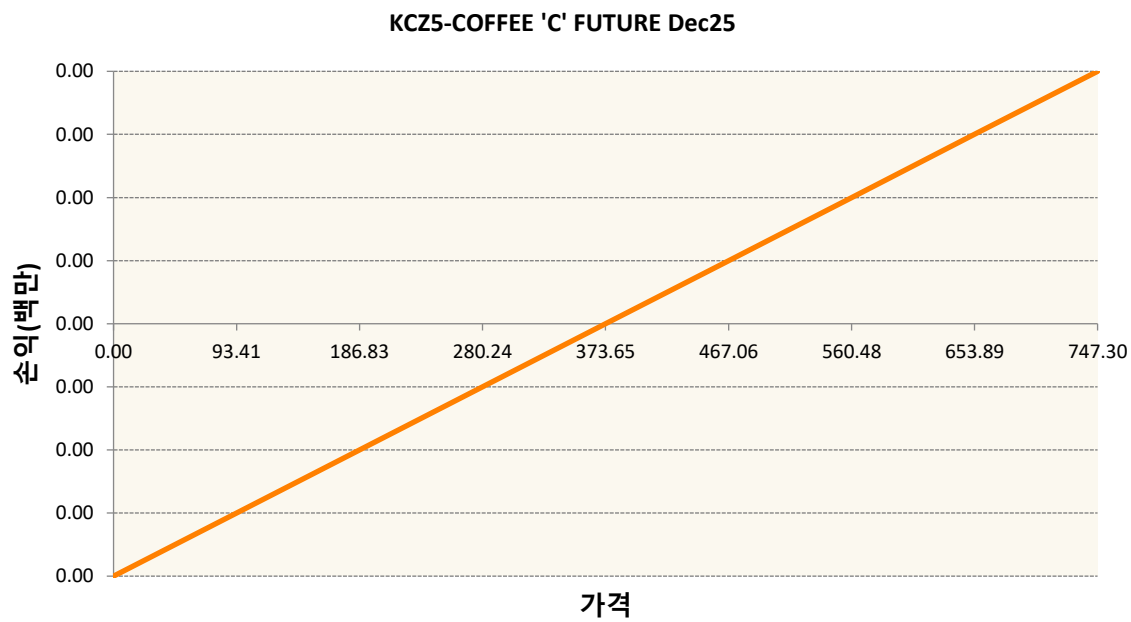
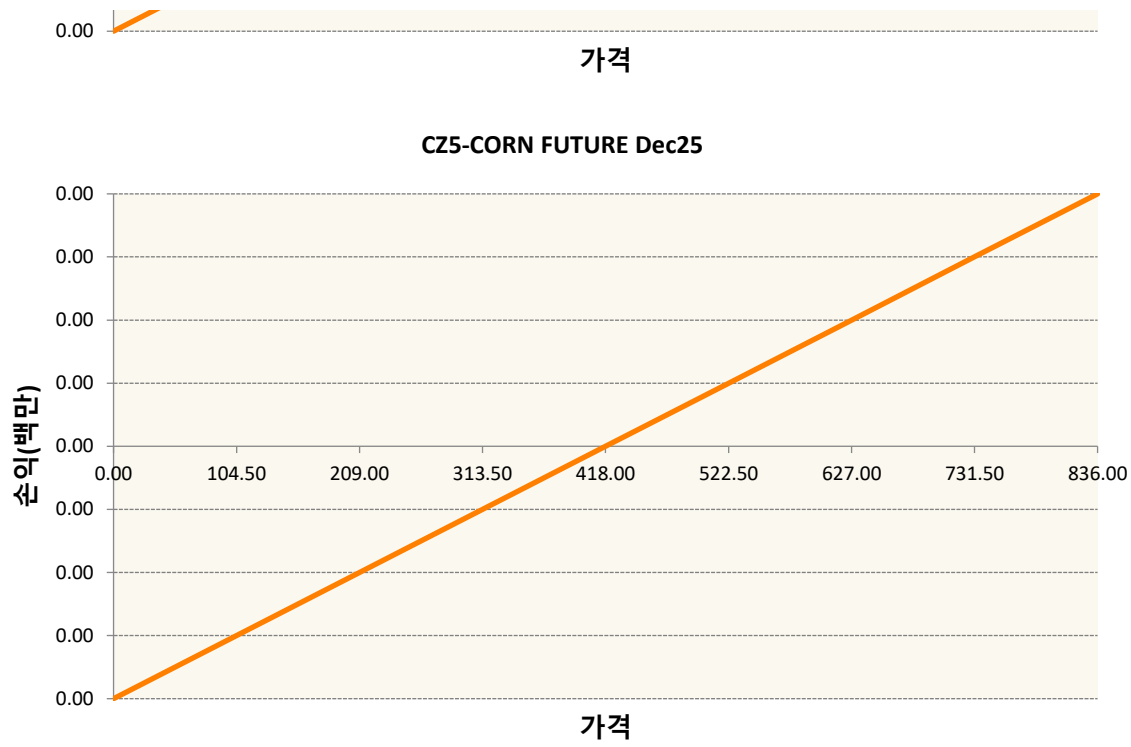
1. 계약금액

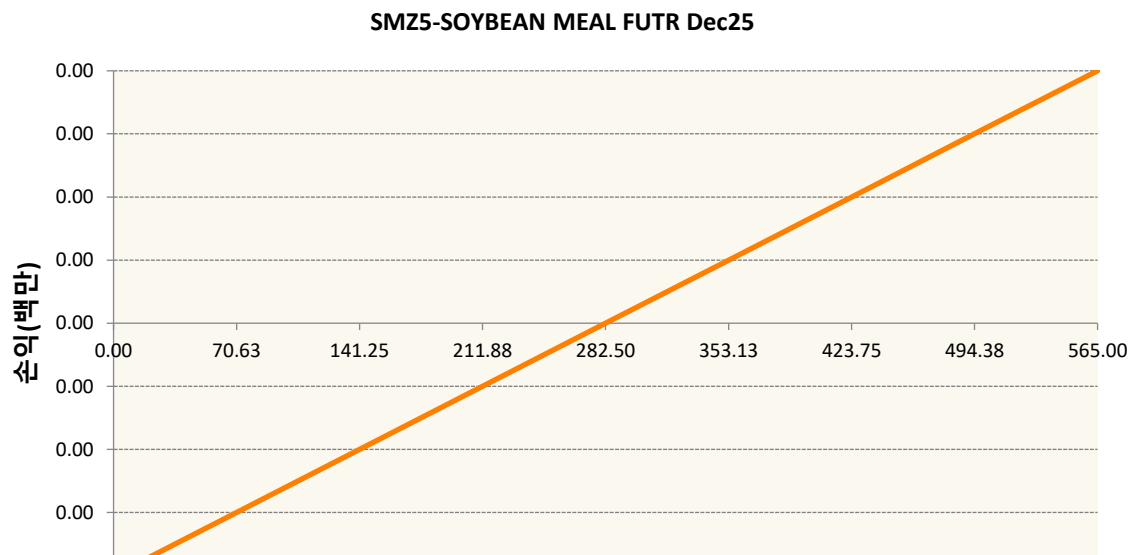
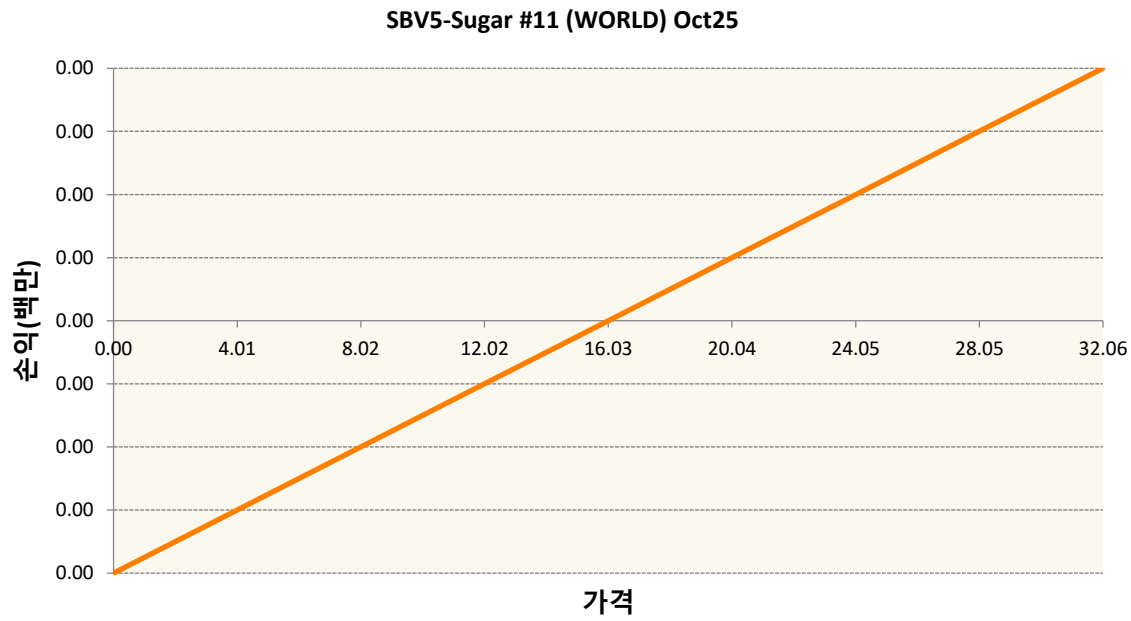
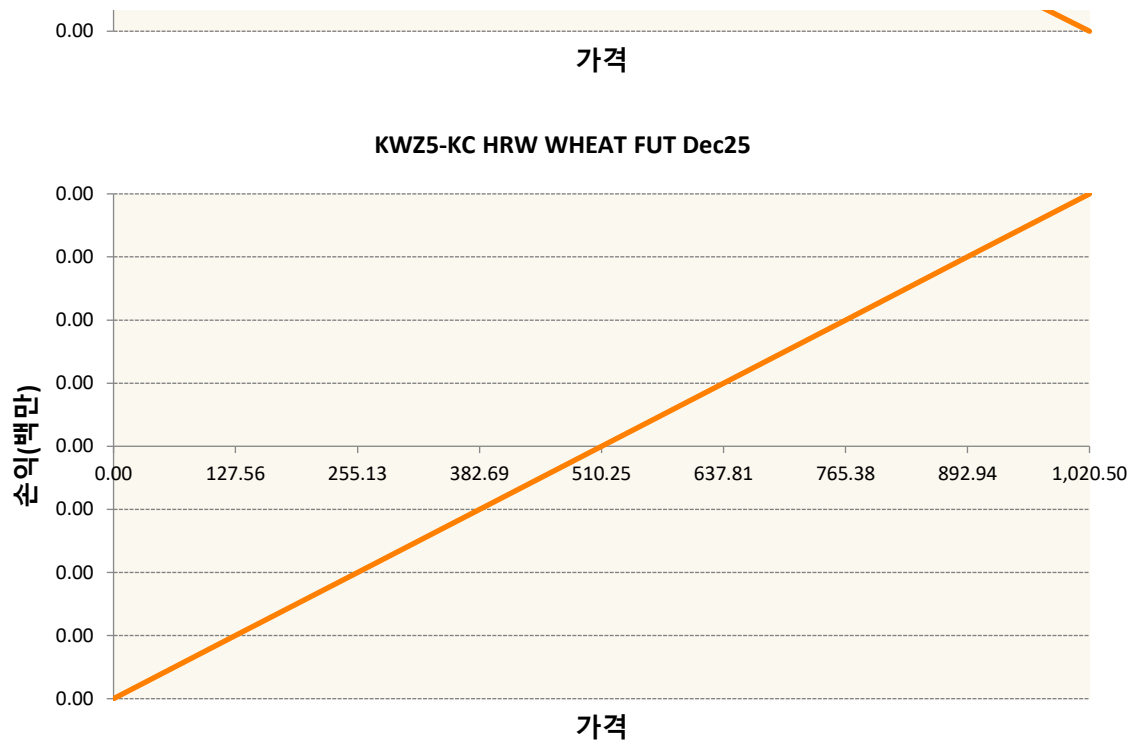
(단위:USD 백만)

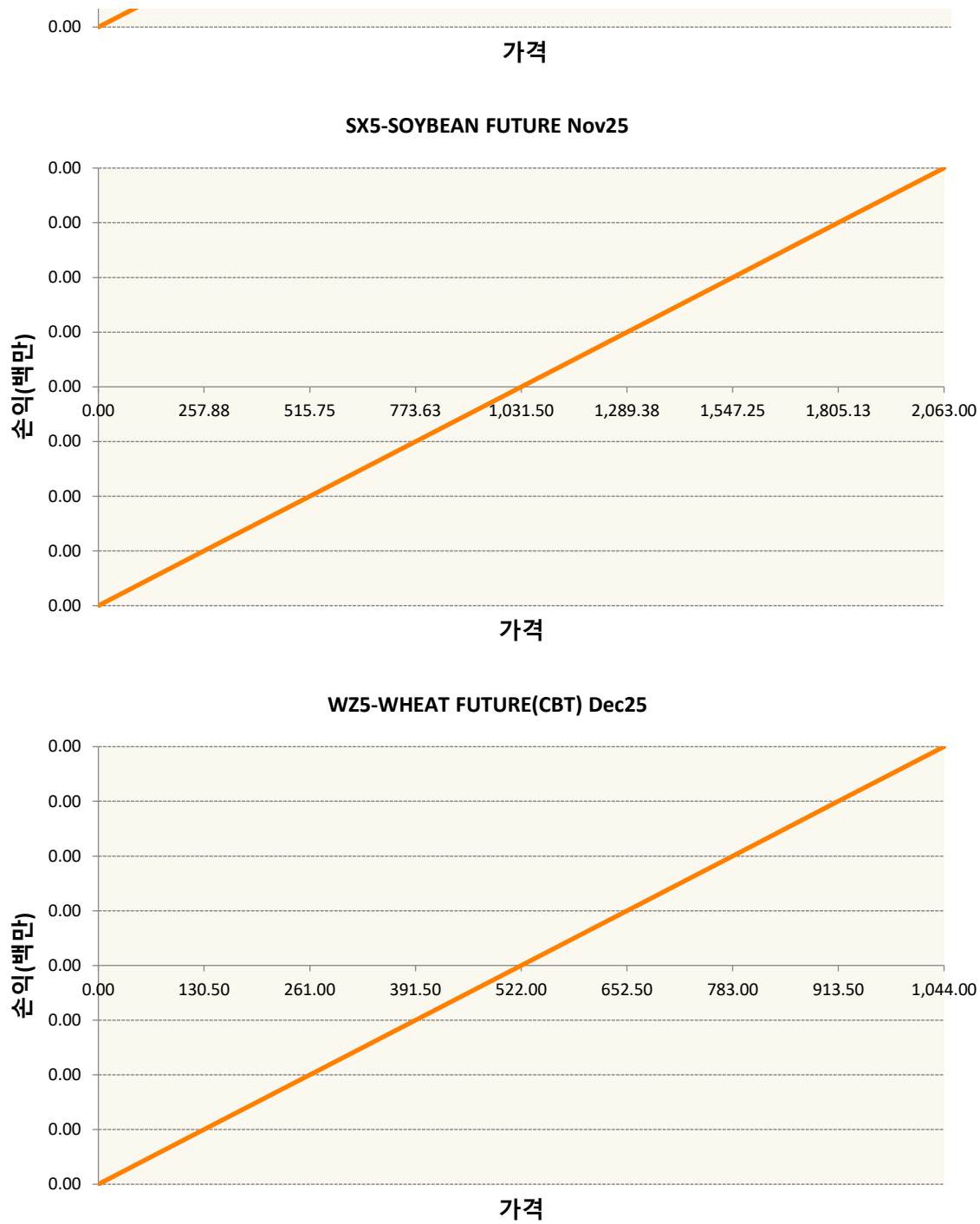
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,180	0	1,180	
누계	유가증권	선물	2,250	0	2,250	
누계	통화	선물	0	376	-376	장내

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	2025-09-05
기준일	2025-09-04

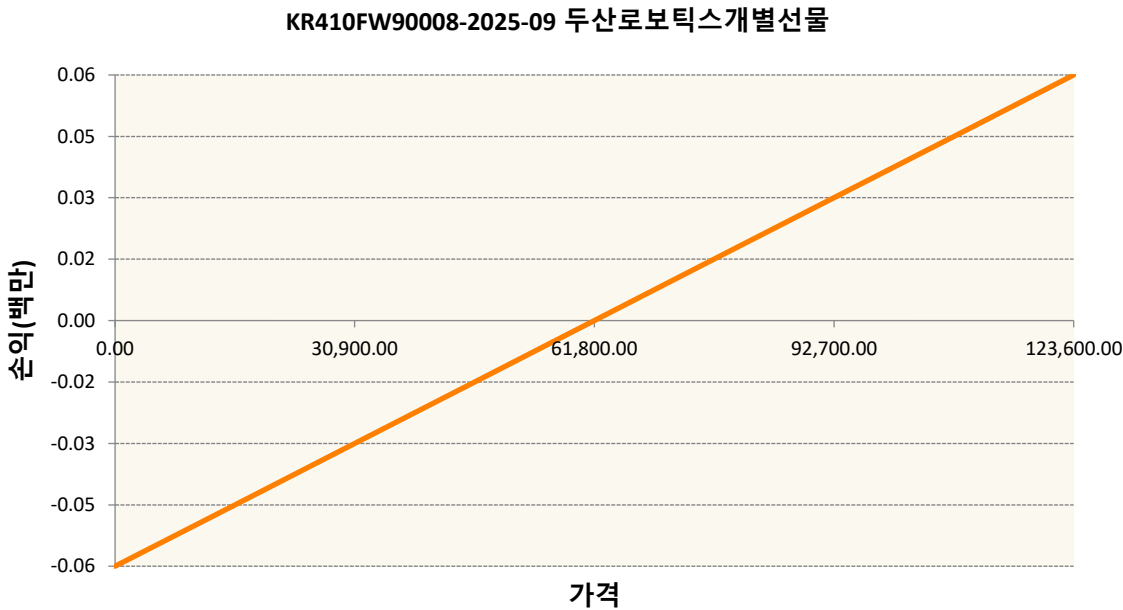
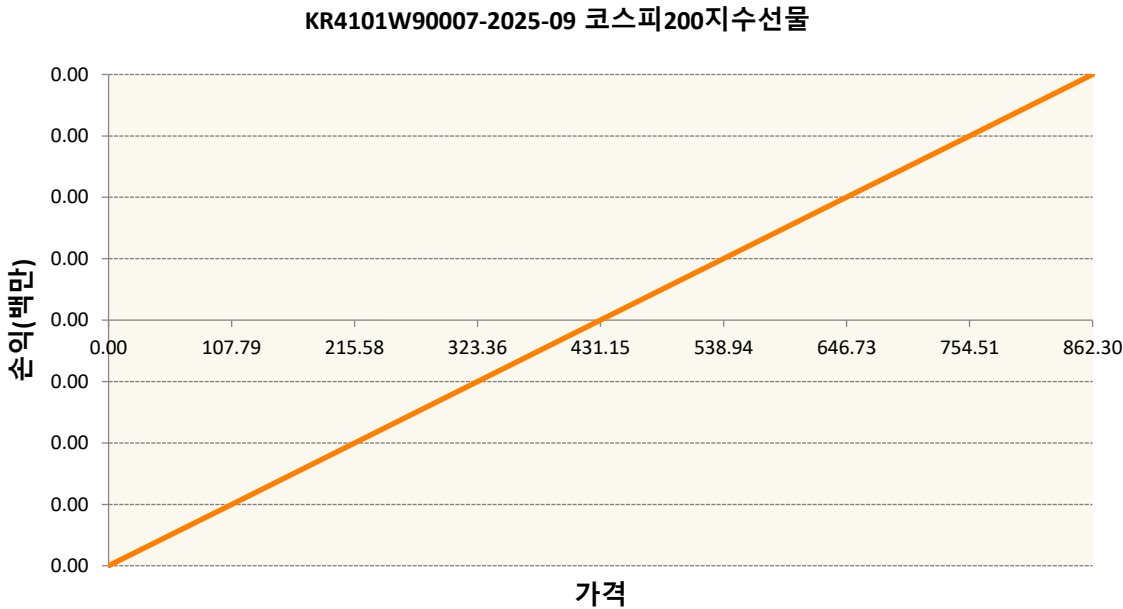
스마트인덱스모

1. 계약금액

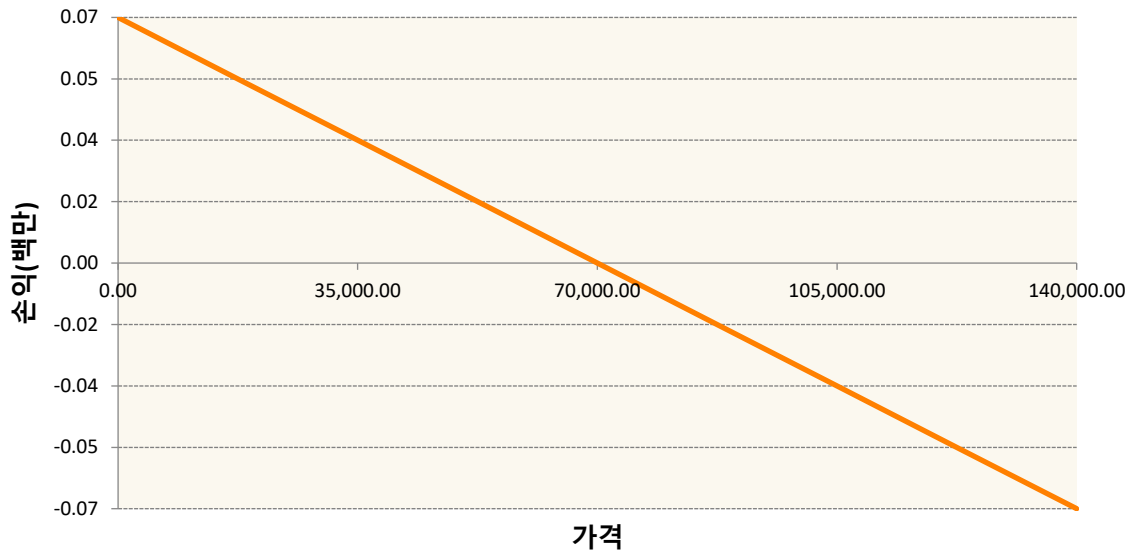
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,640	98	1,542	장내

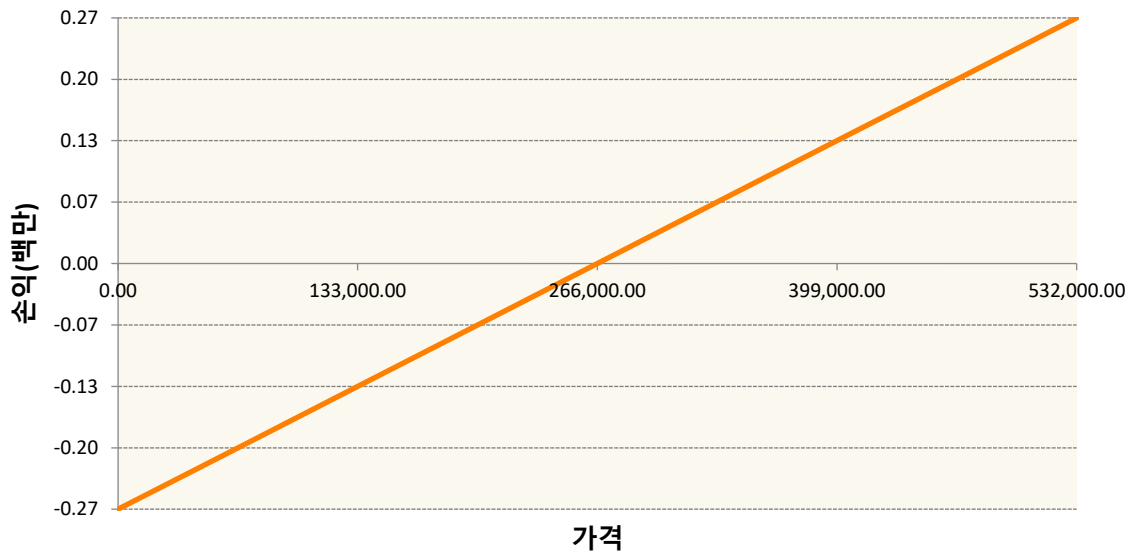
2. 만기시점의 손익구조



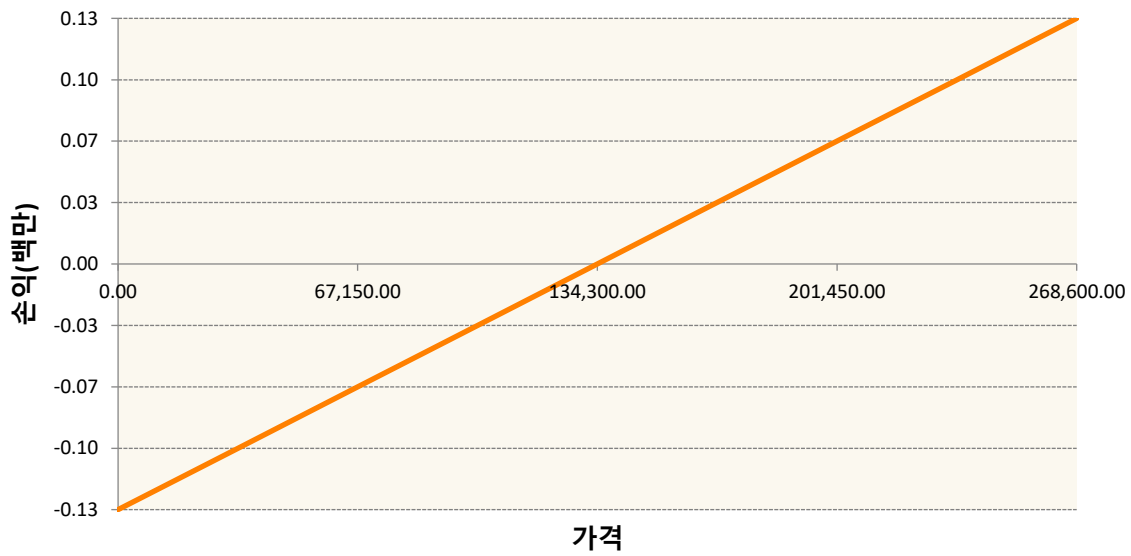
KR4111W90006-2025-09 삼성전자개별선물



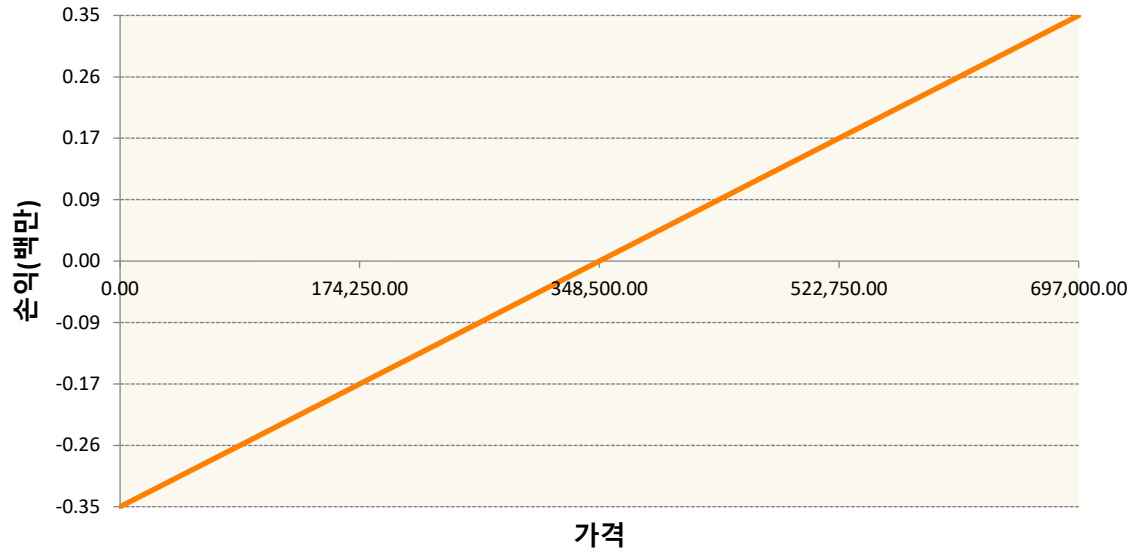
KR4150W90004-2025-09 SK하이닉스개별선물



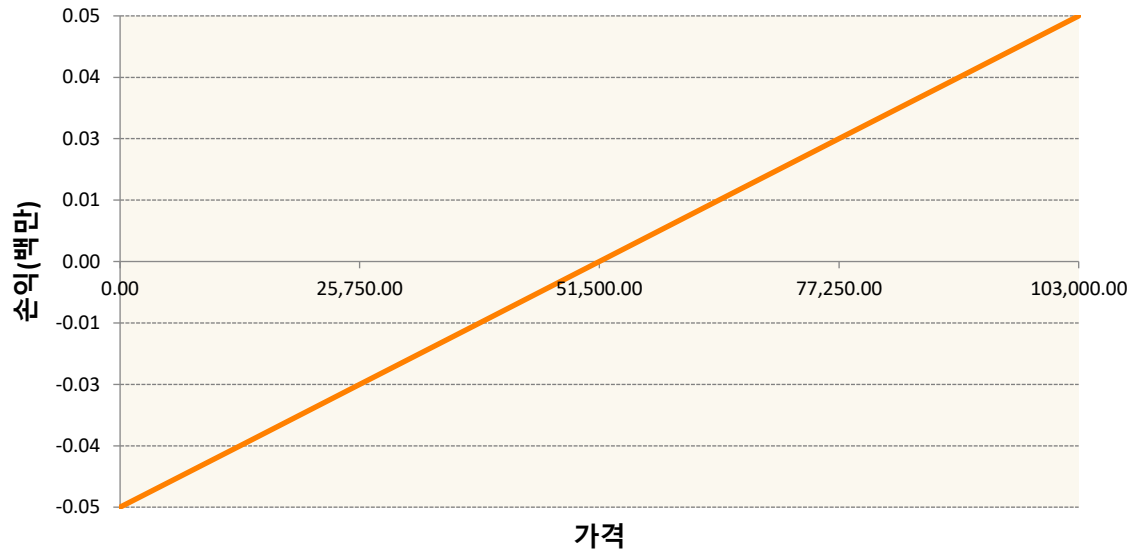
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



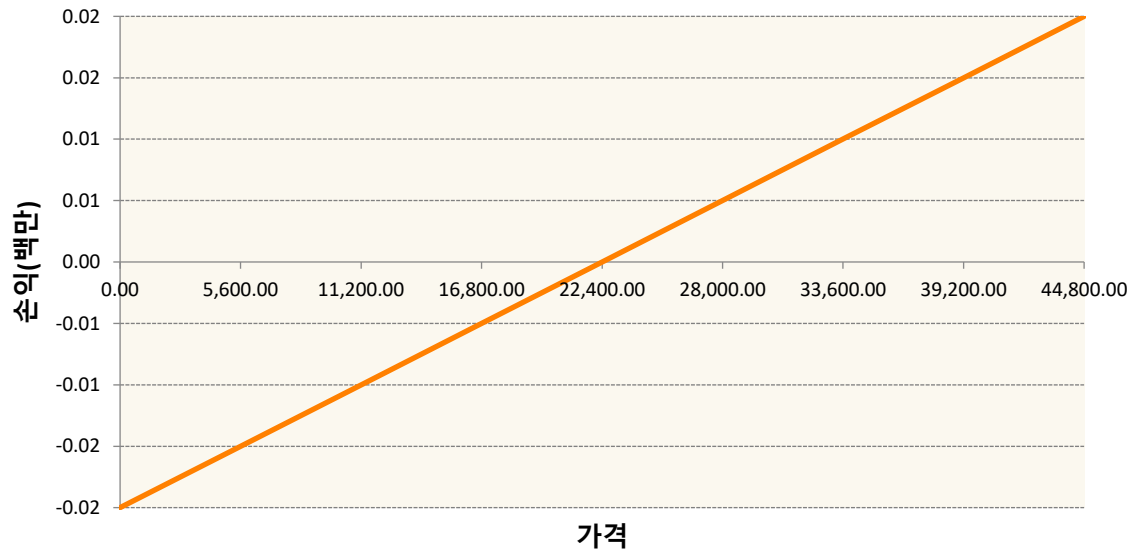
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



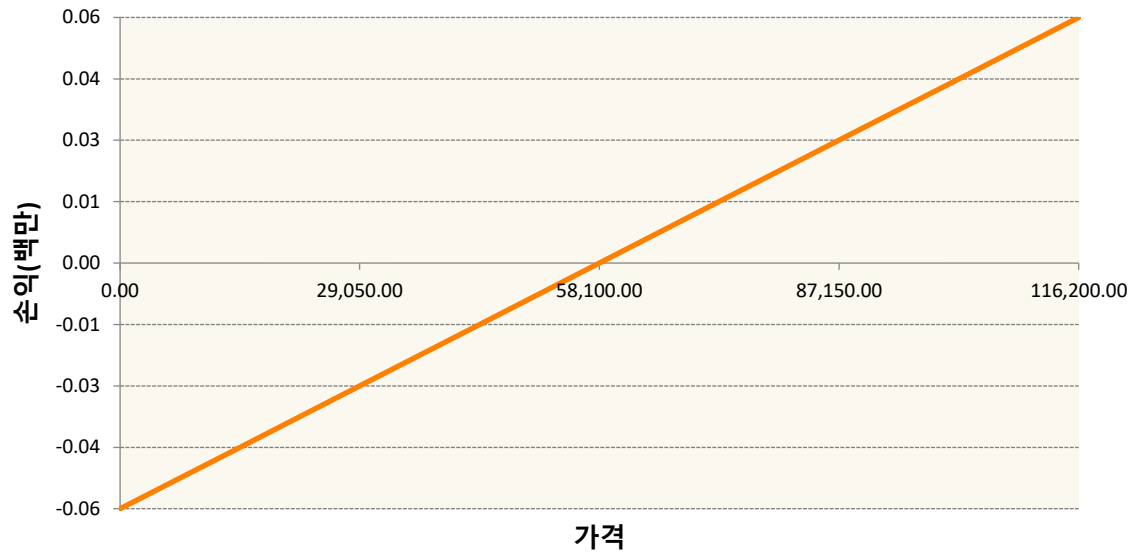
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



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	8
KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물	1

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

(단위:백만원)

76

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

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	361
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

573

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

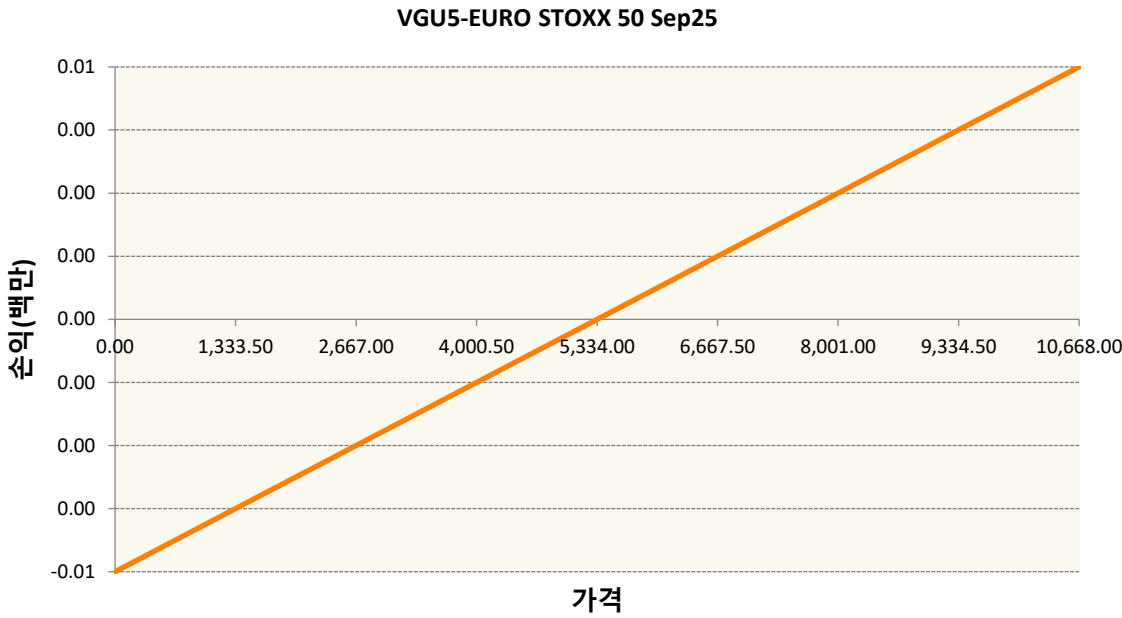
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	675	0	675	

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	2025-09-05
기준일	2025-09-04

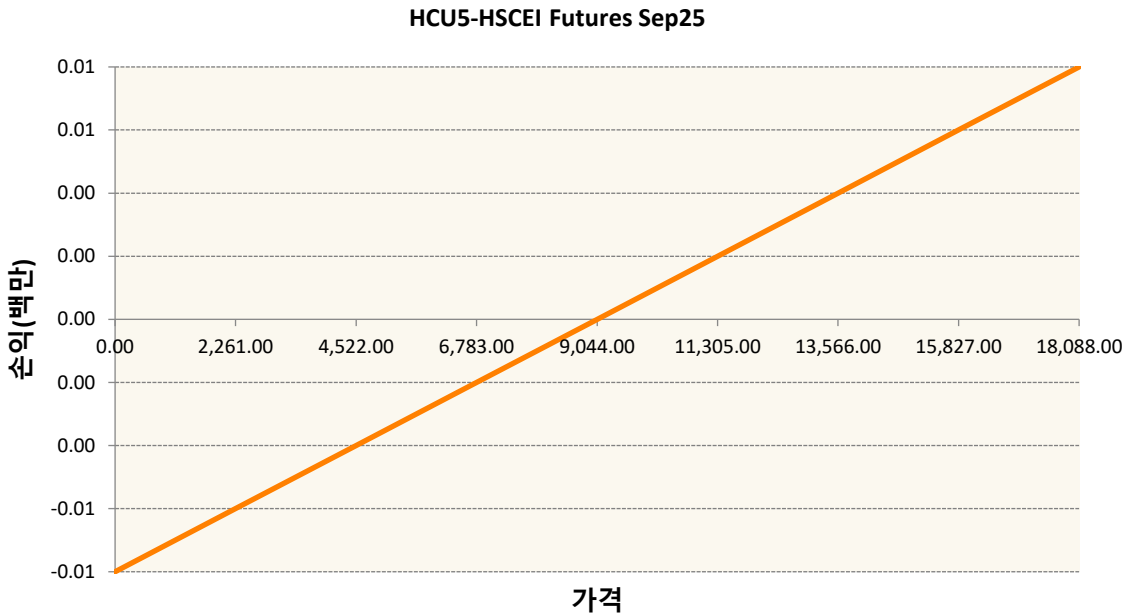
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,030	0	2,030	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU5	HSCEI Futures Sep25	162
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

230

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

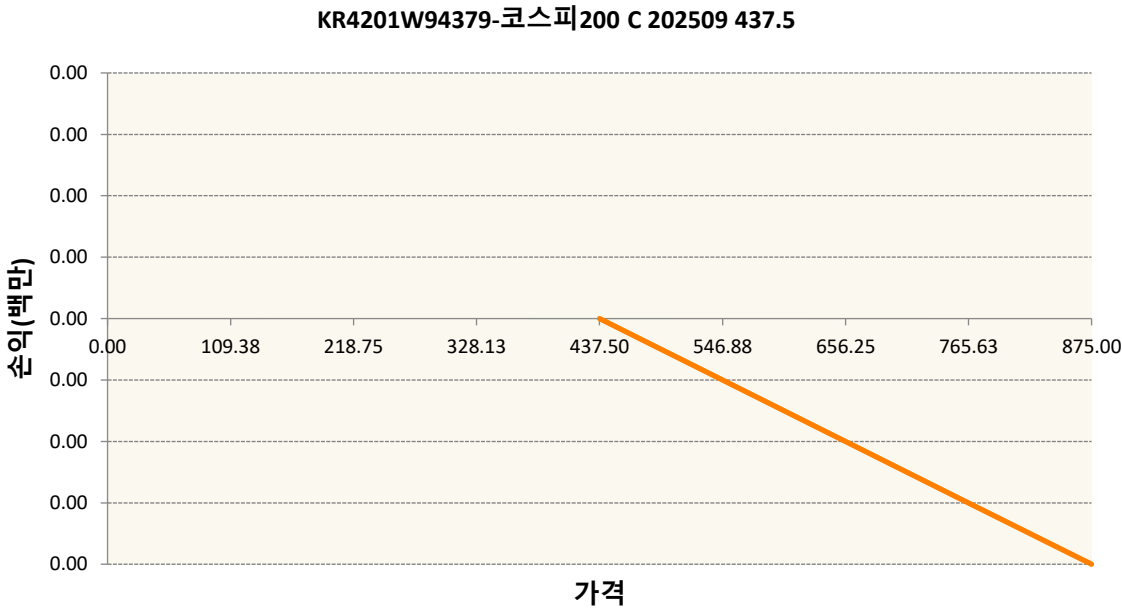
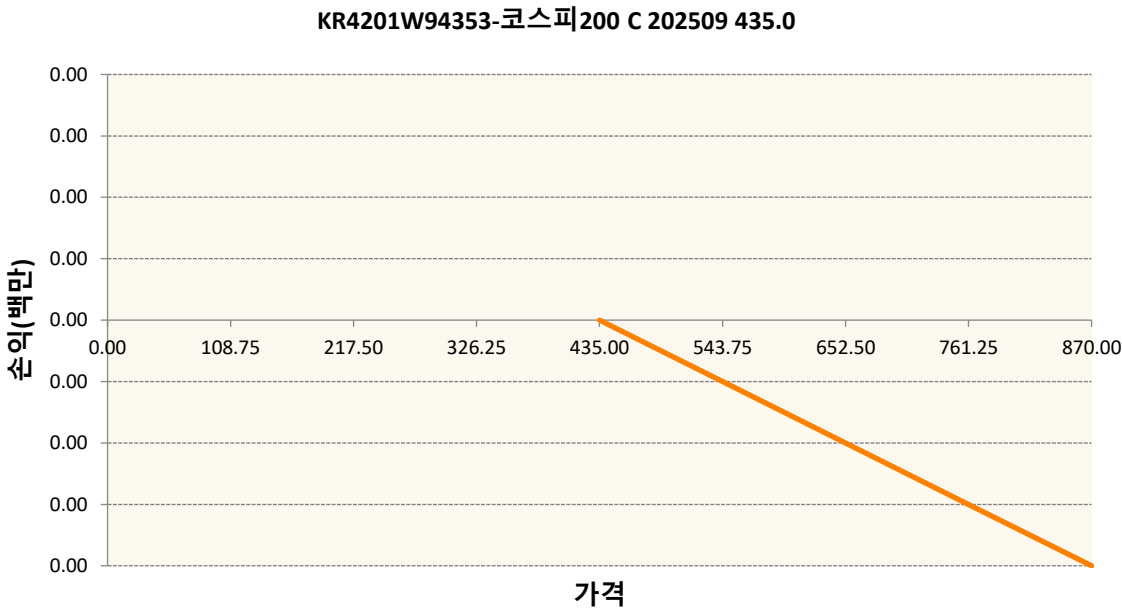
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

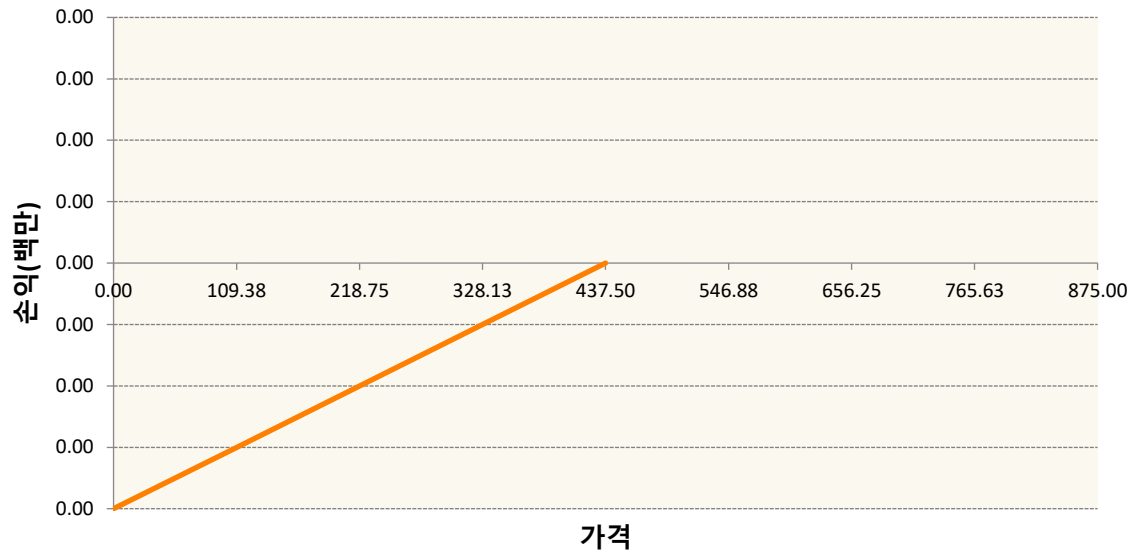
(단위:백만원)

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 2025-09-05

기준일 2025-09-04

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	2025-09-05
기준일	2025-09-04

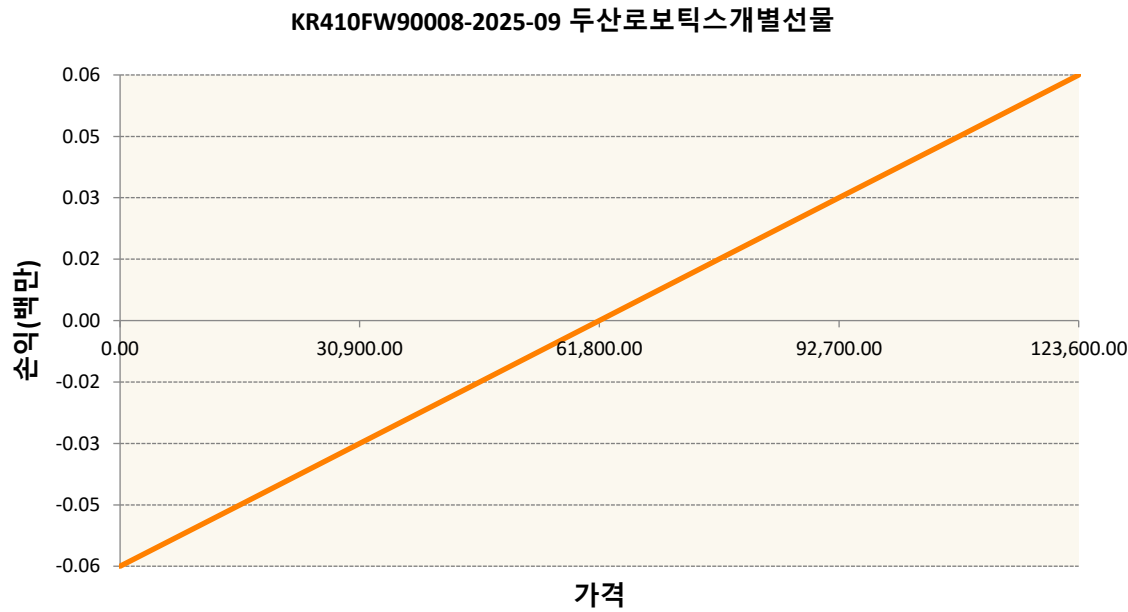
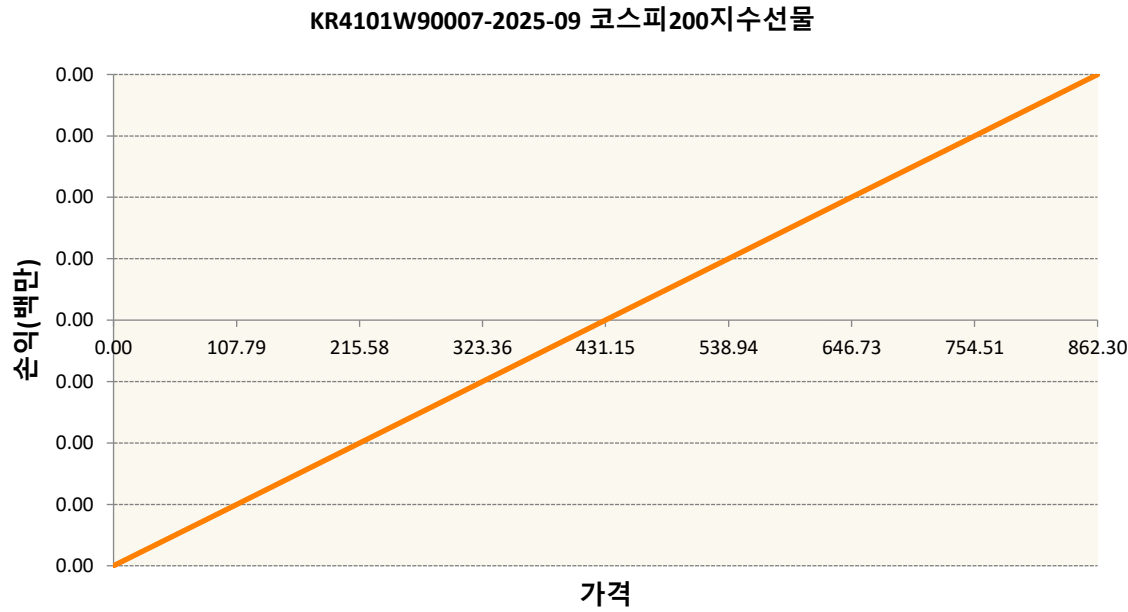
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

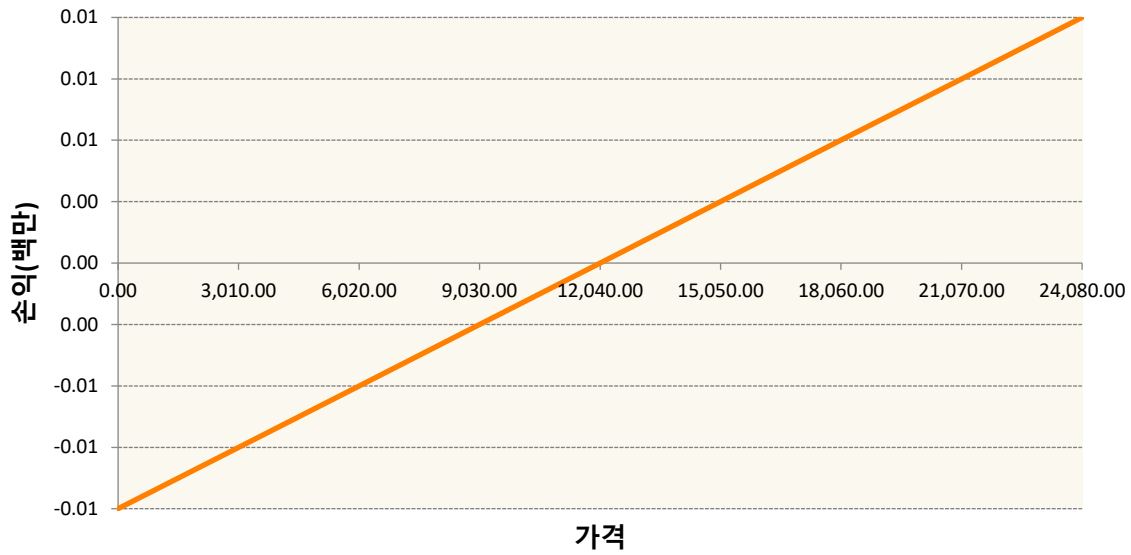
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	400	0	400	장내

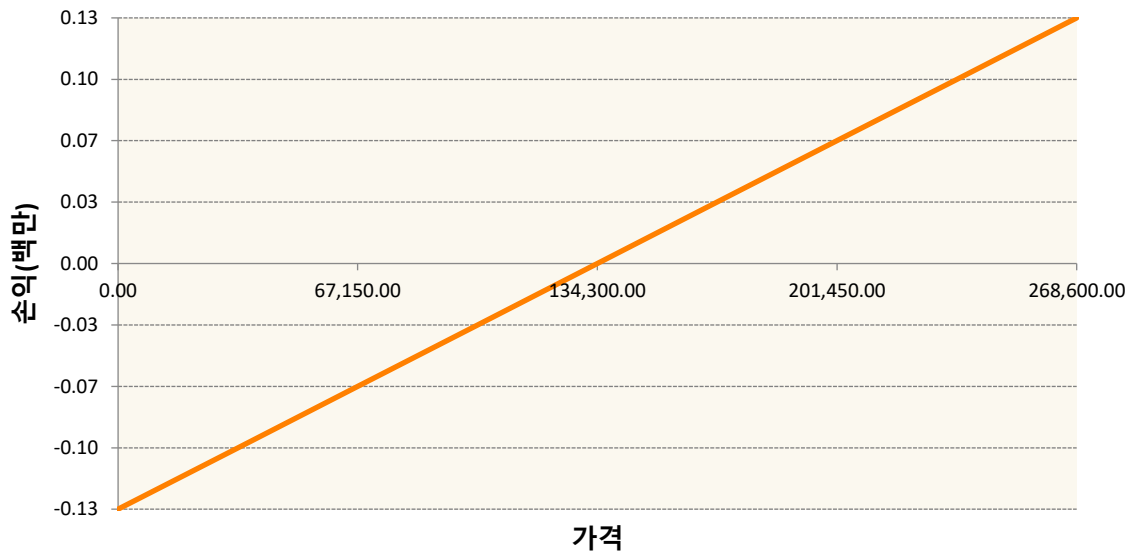
2. 만기시점의 손익구조



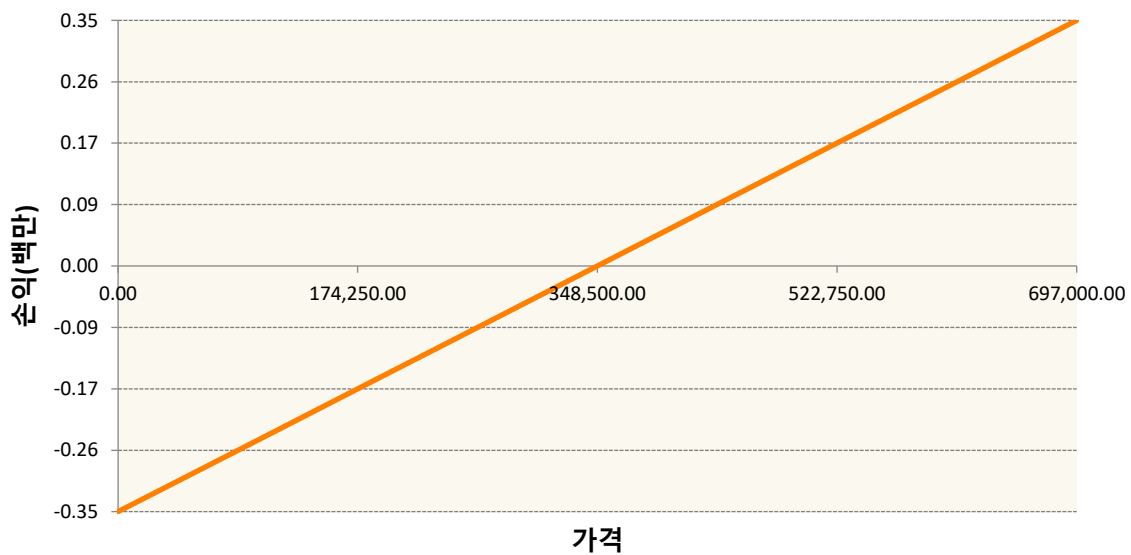
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



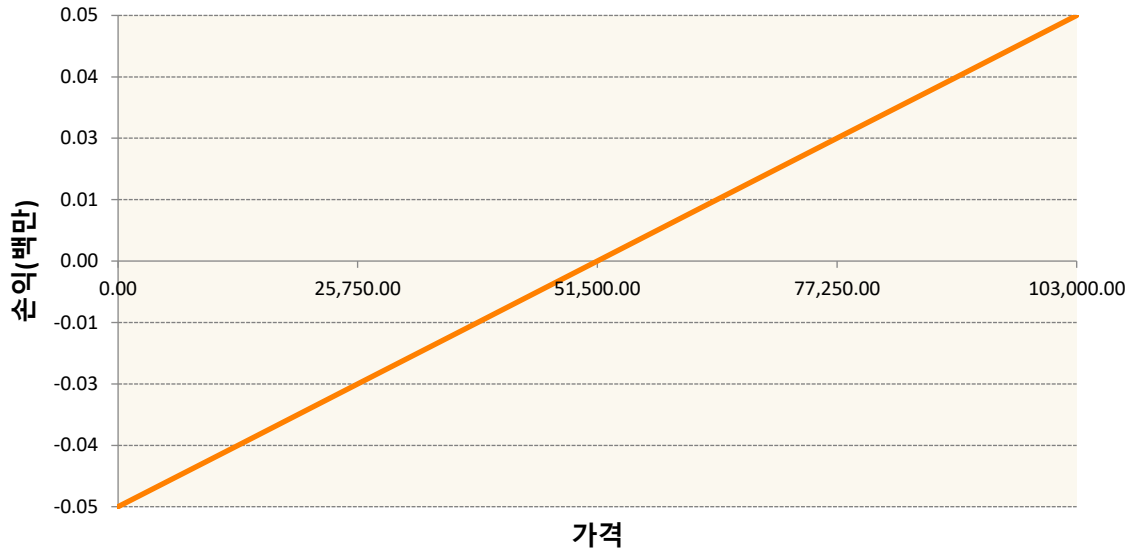
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



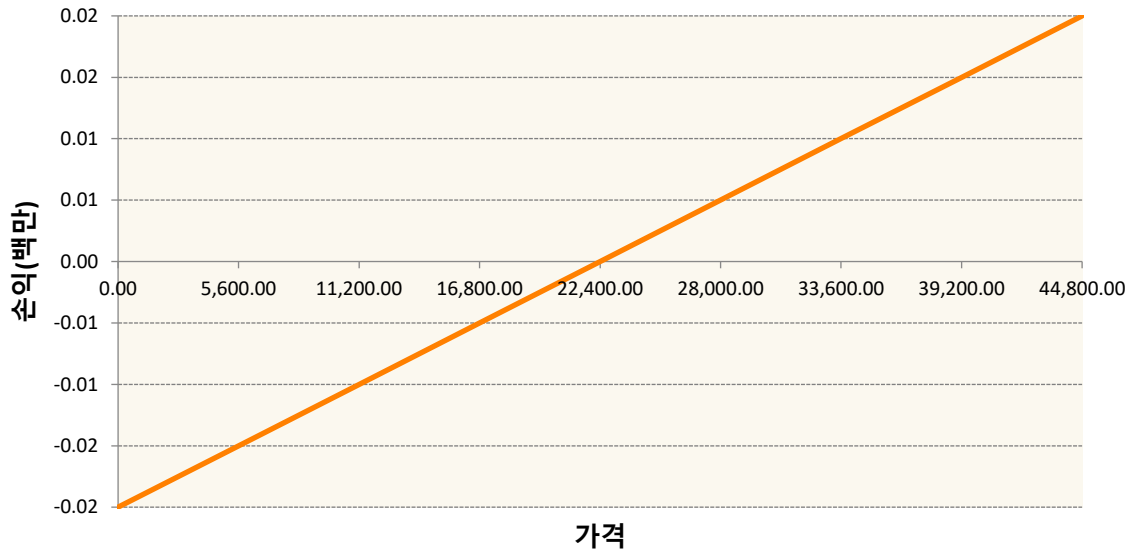
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



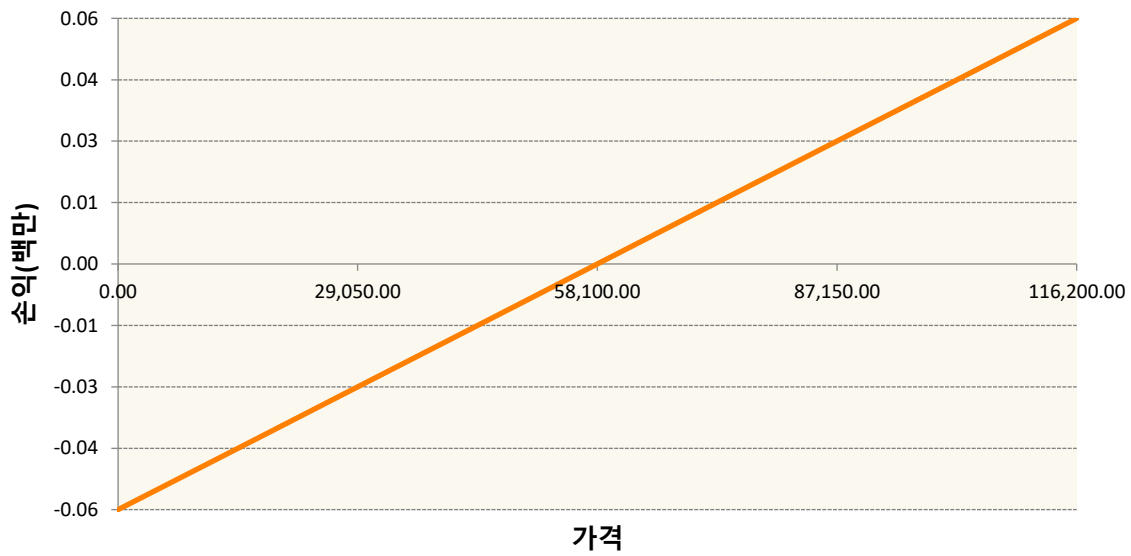
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



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	2025-09-05
기준일	2025-09-04

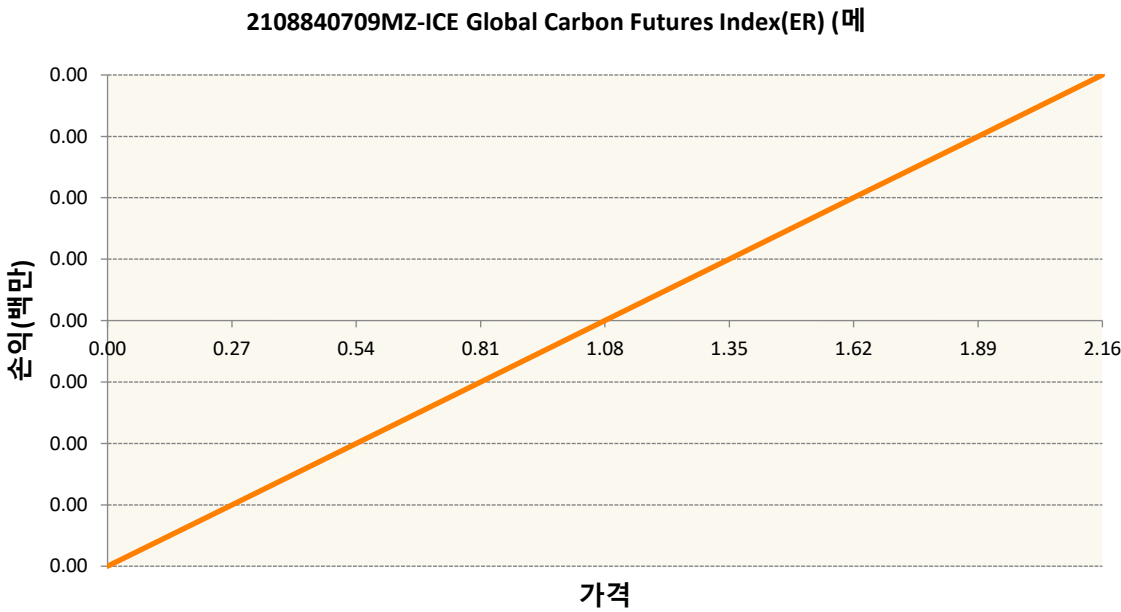
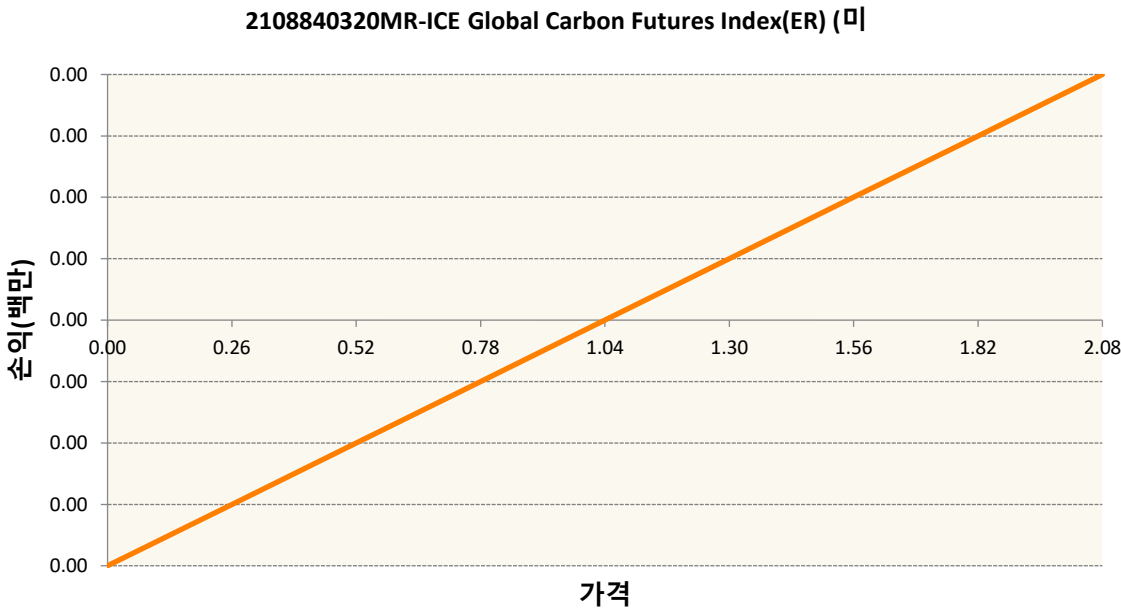
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	1,302	0	1,302	장외
누계	유가증권	선물	7,843	0	7,843	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	625
2108840709	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	759

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

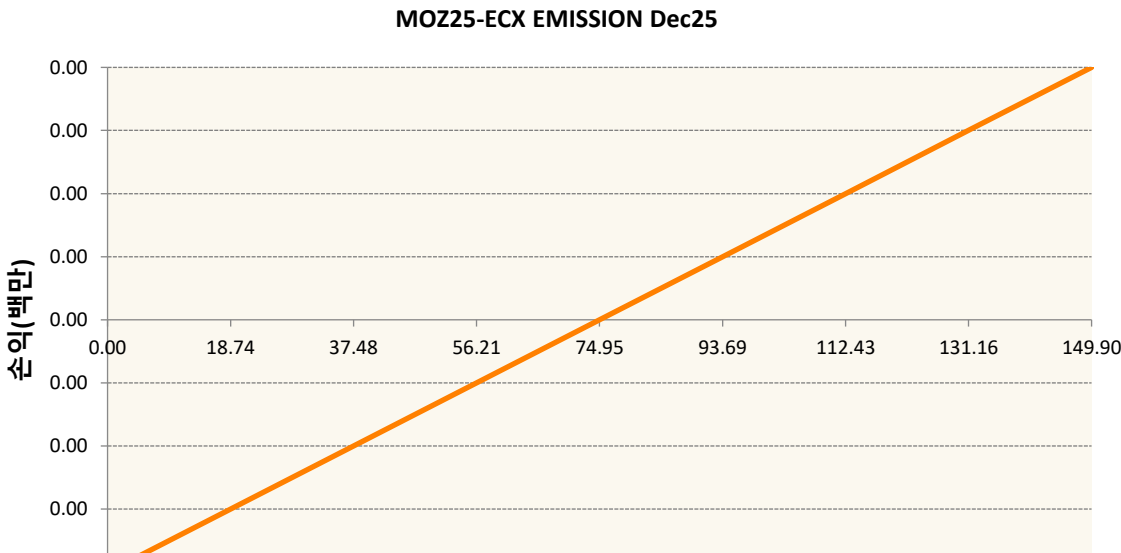
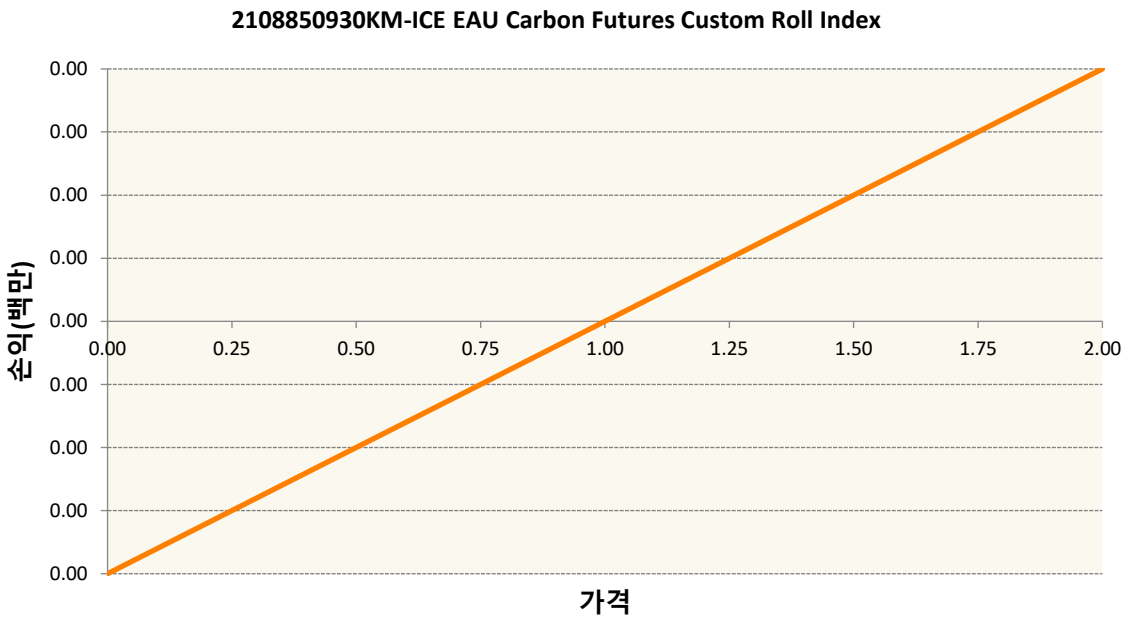
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,610	0	6,610	
누계	유가증권	선물	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	1,996	-1,996	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850930IICE EAU Carbon Futures Custom Roll Index

0.11

FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E

160

MOZ25 ECX EMISSION Dec25

529

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

(단위:백만원)

878

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

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)	25
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	25
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	17
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	18

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

(단위:백만원)

144

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

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	7,441	0	7,441	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	67
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	80
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	57
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	17
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 250903(메리츠)	6

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

(단위:백만원)

394

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

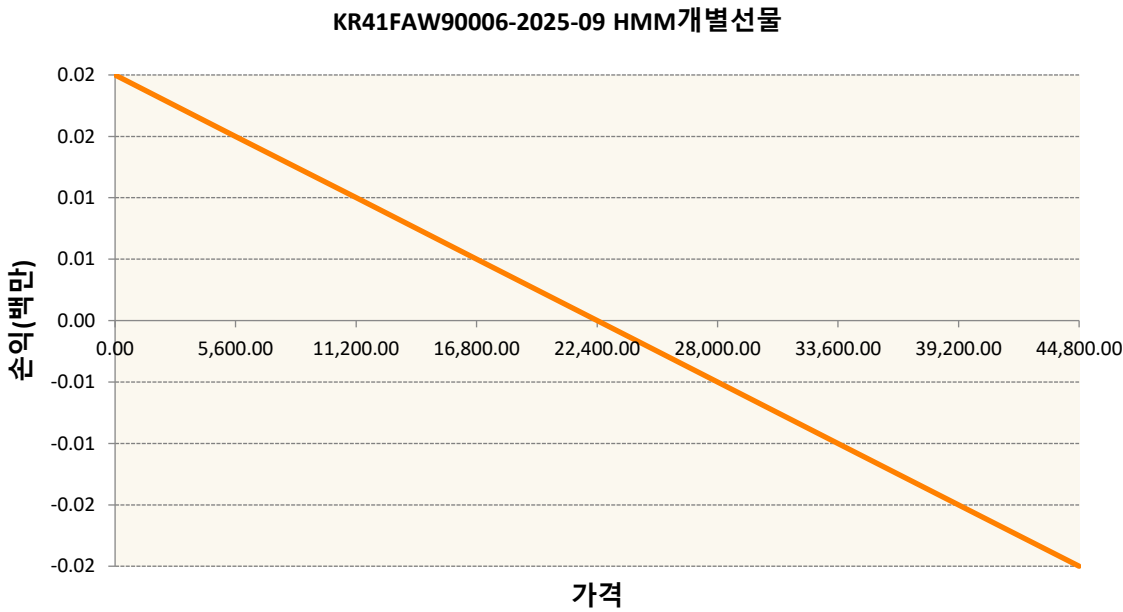
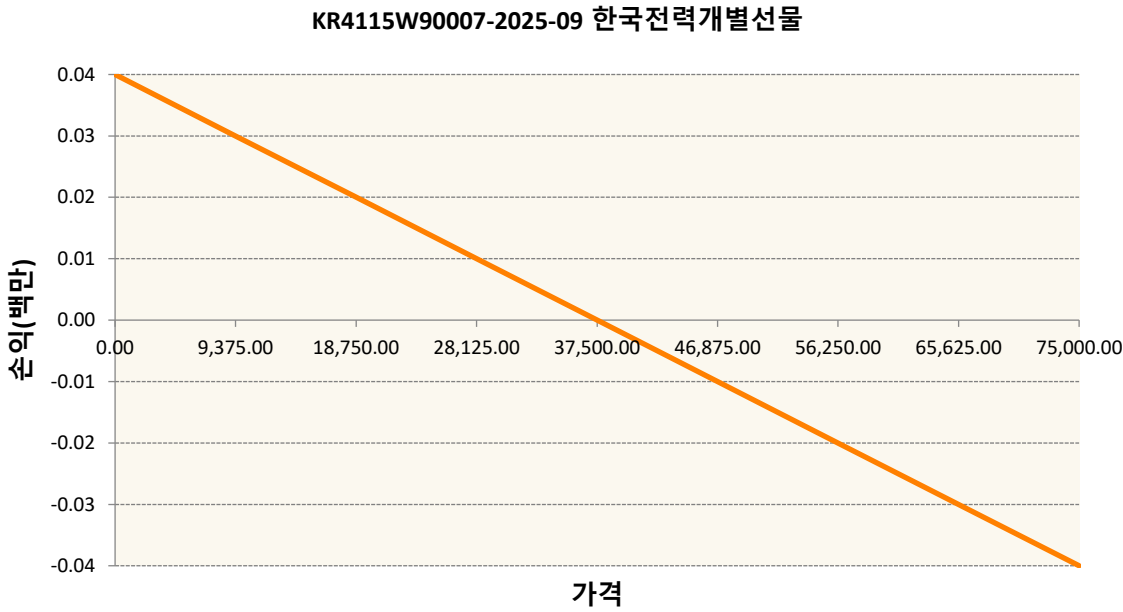
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	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	2025-09-05
기준일	2025-09-04

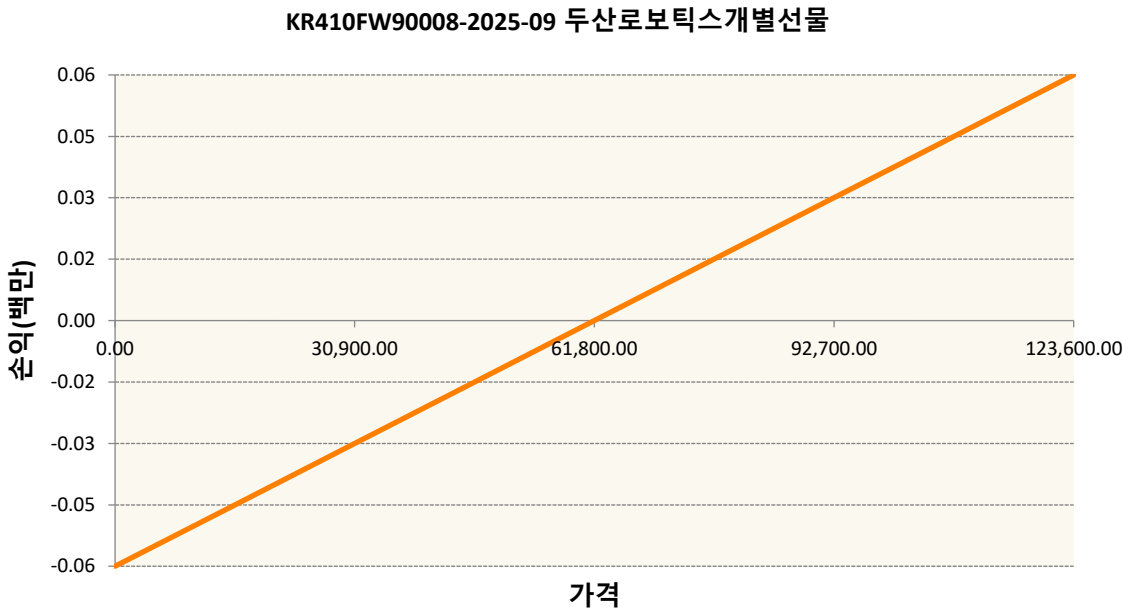
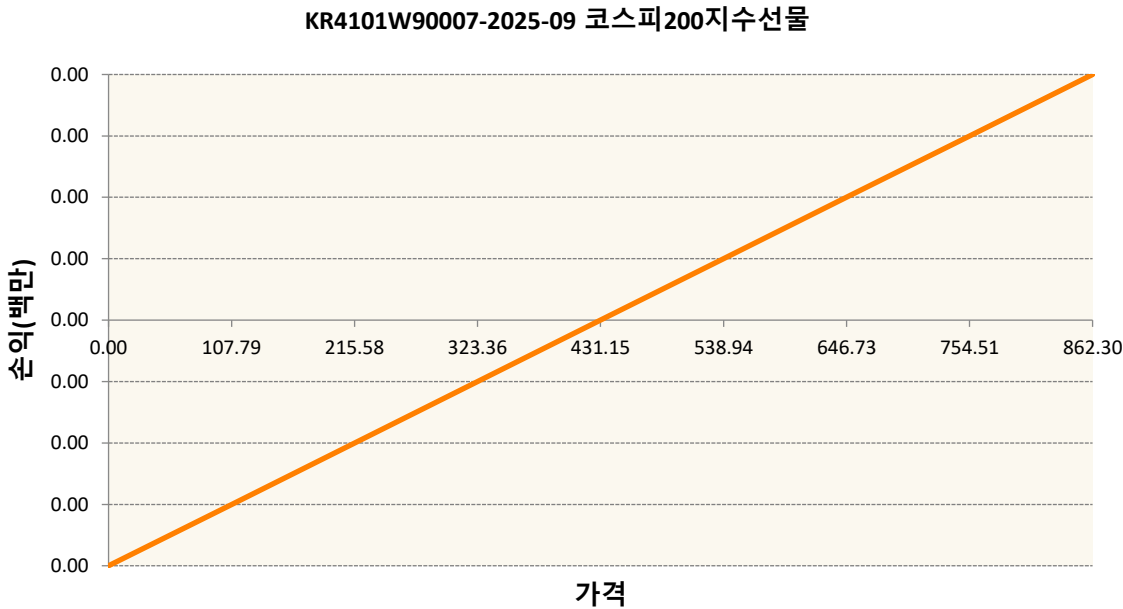
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

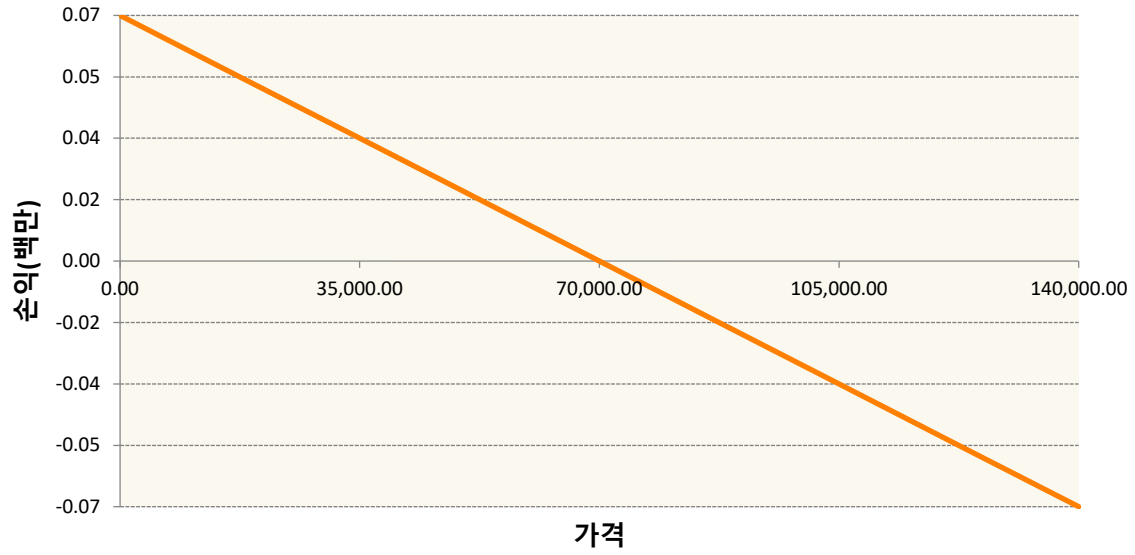
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	157	0	157	장내
누계	유가증권	선물	13,949	1,050	12,899	장내

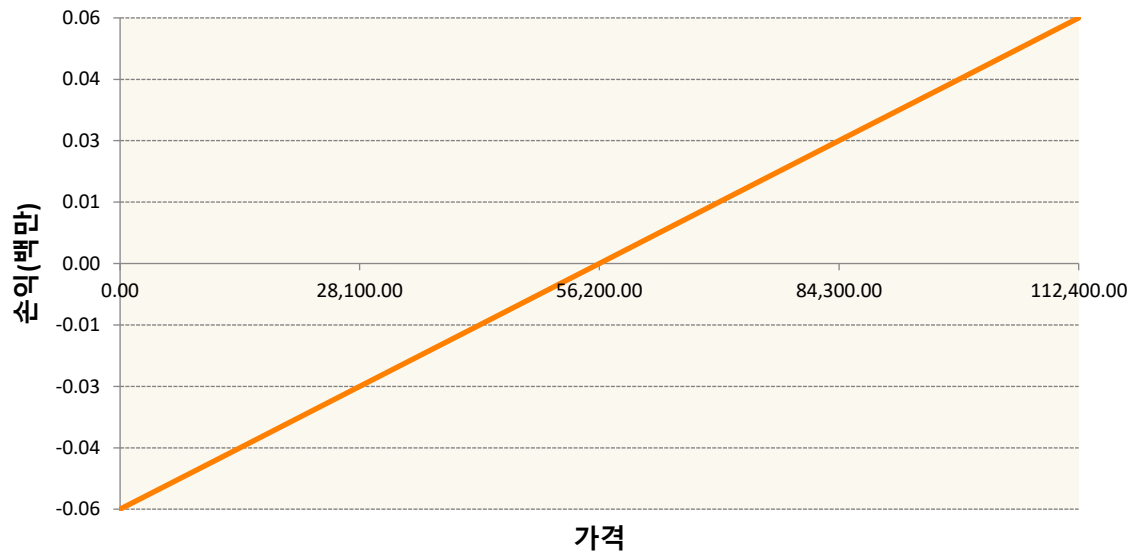
2. 만기시점의 손익구조



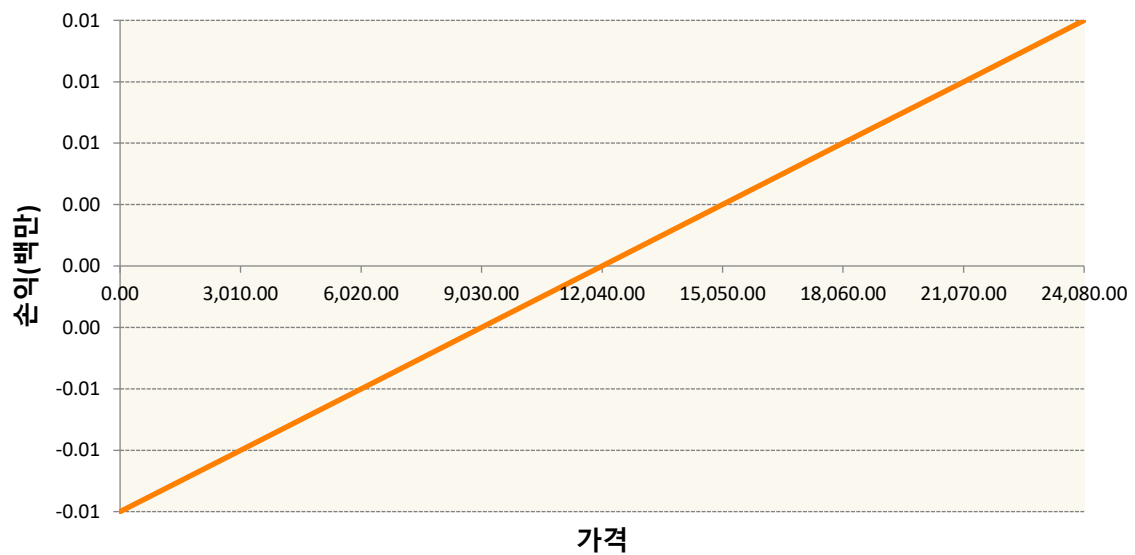
KR4111W90006-2025-09 삼성전자개별선물



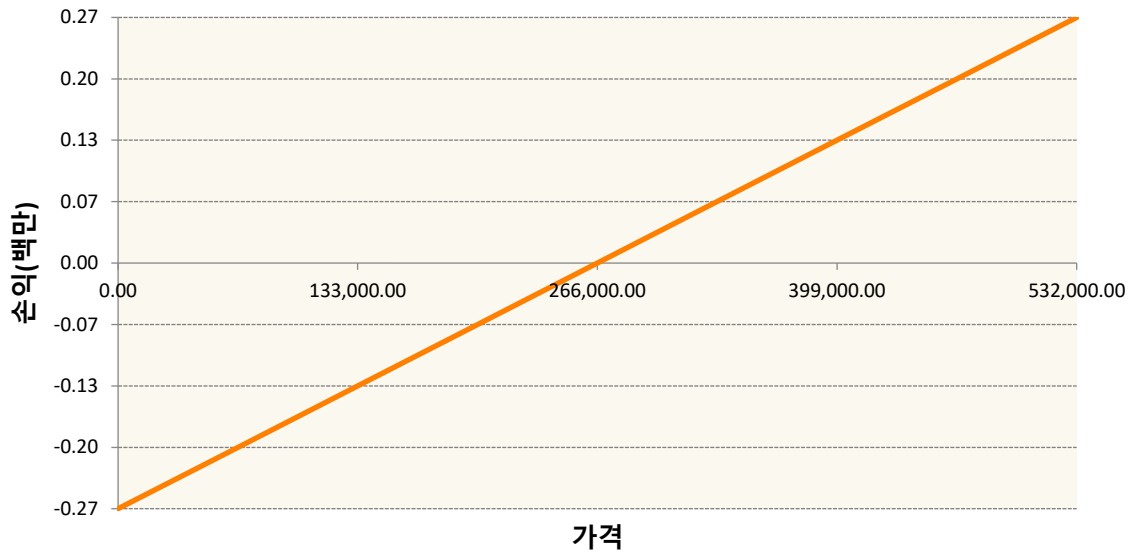
KR411RW90001-2025-09 한화비전개별선물



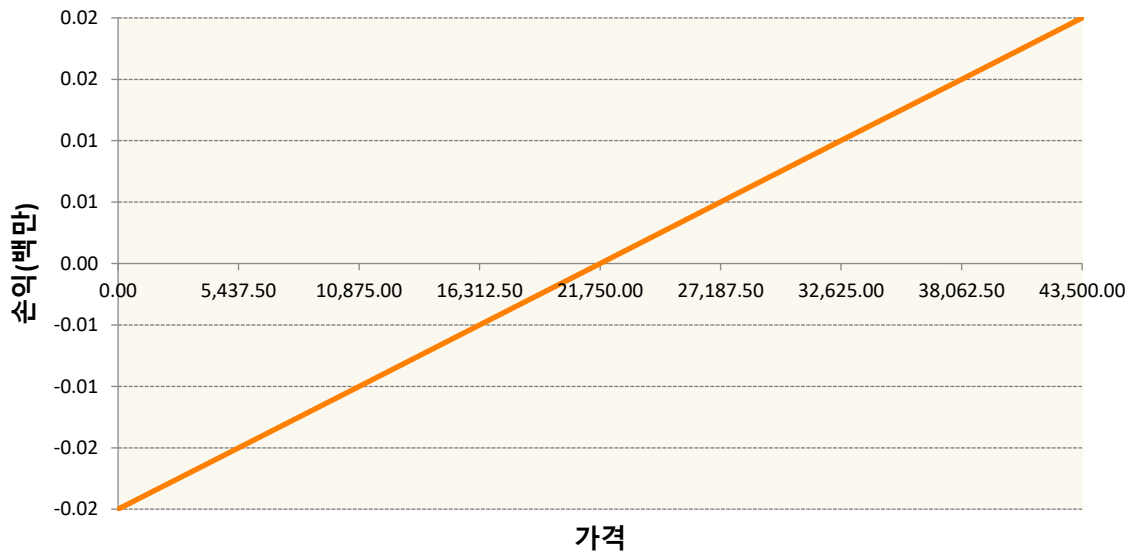
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



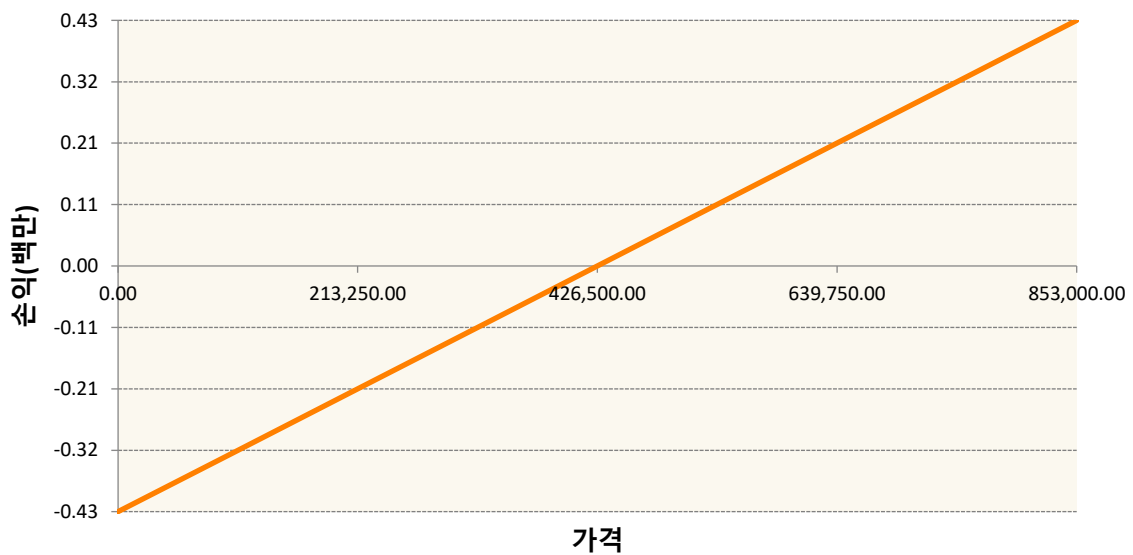
KR4150W90004-2025-09 SK하이닉스개별선물



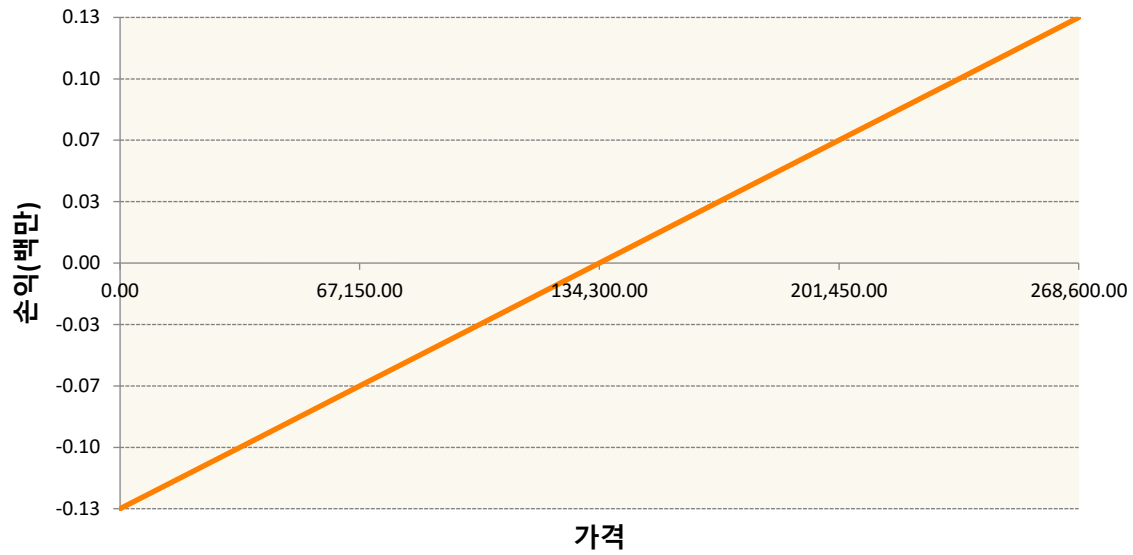
KR41CNW90006-2025-09 포스코DX개별선물



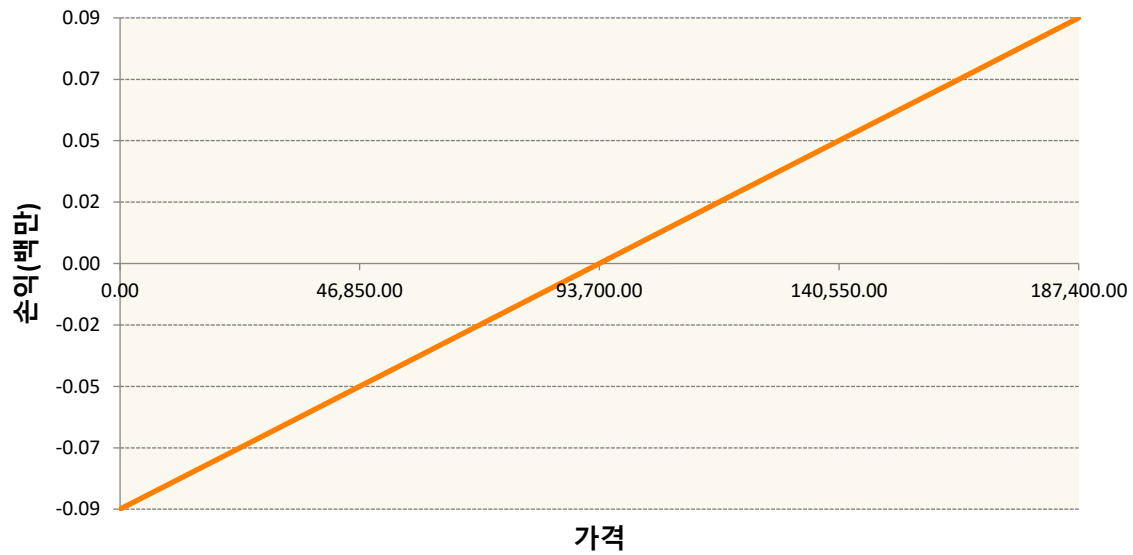
KR41DAW90001-2025-09 농심개별선물



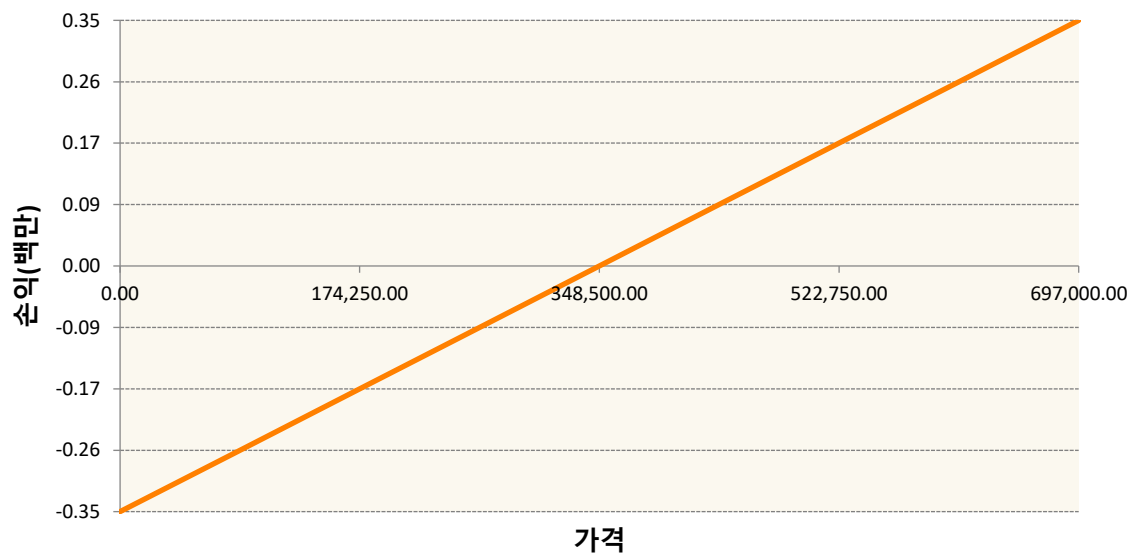
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



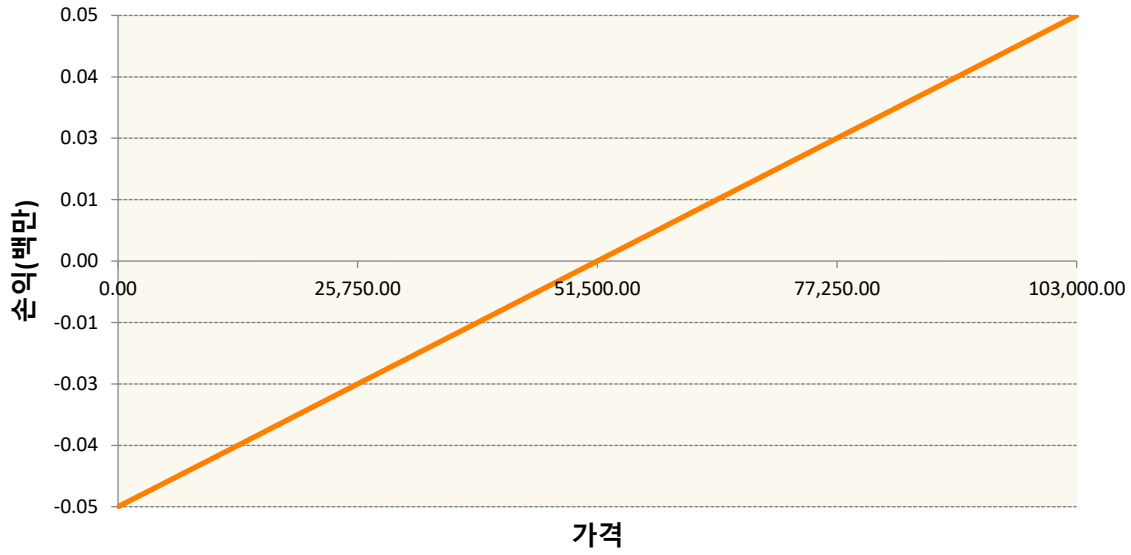
KR41EJW90000-2025-09 SKC개별선물



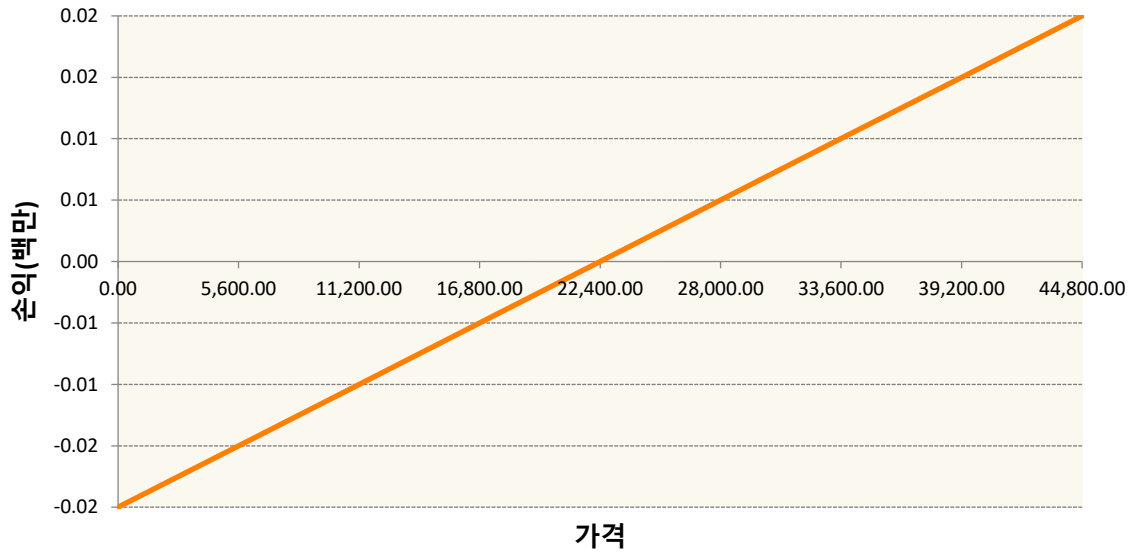
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



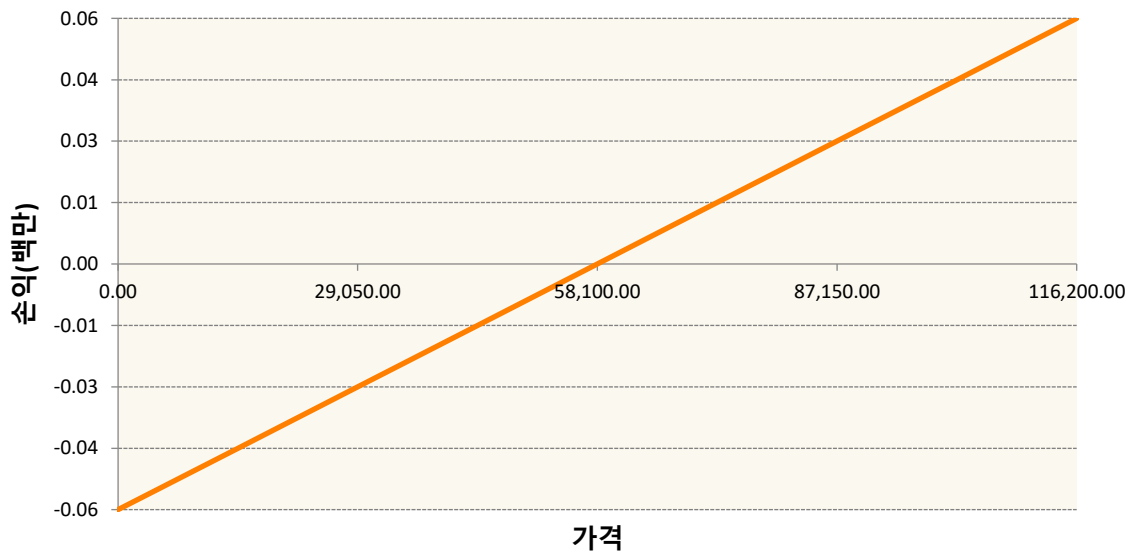
KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



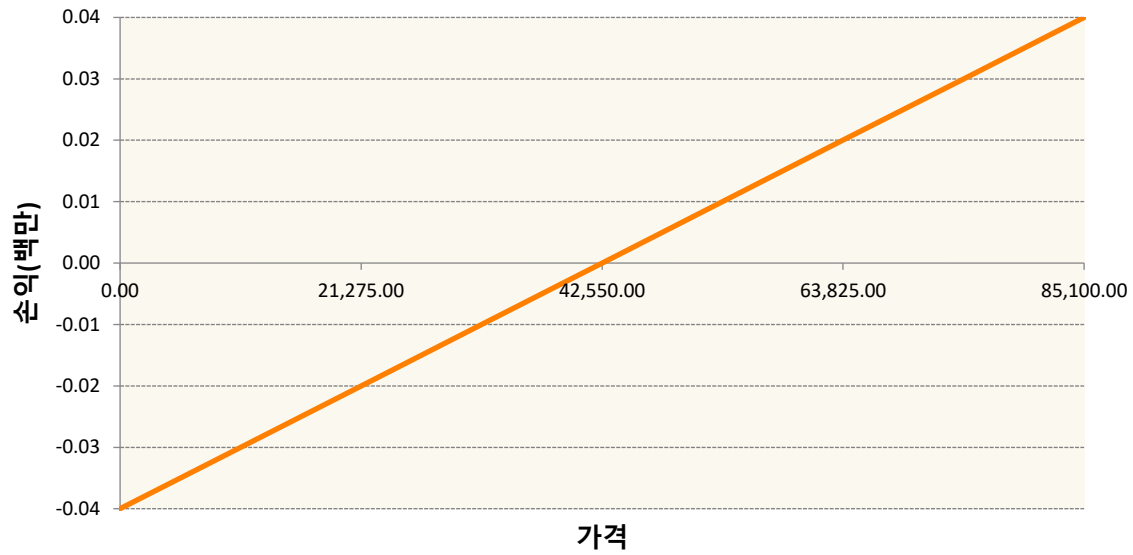
KR41FAW90006-2025-09 HMM개별선물



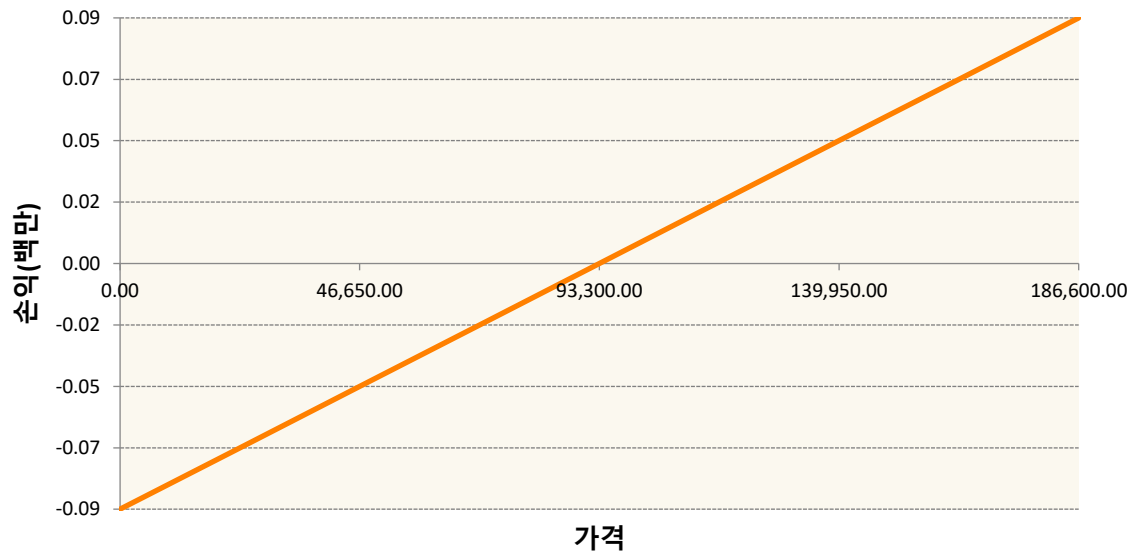
KR41FMW90001-2025-09 엘앤에프개별선물



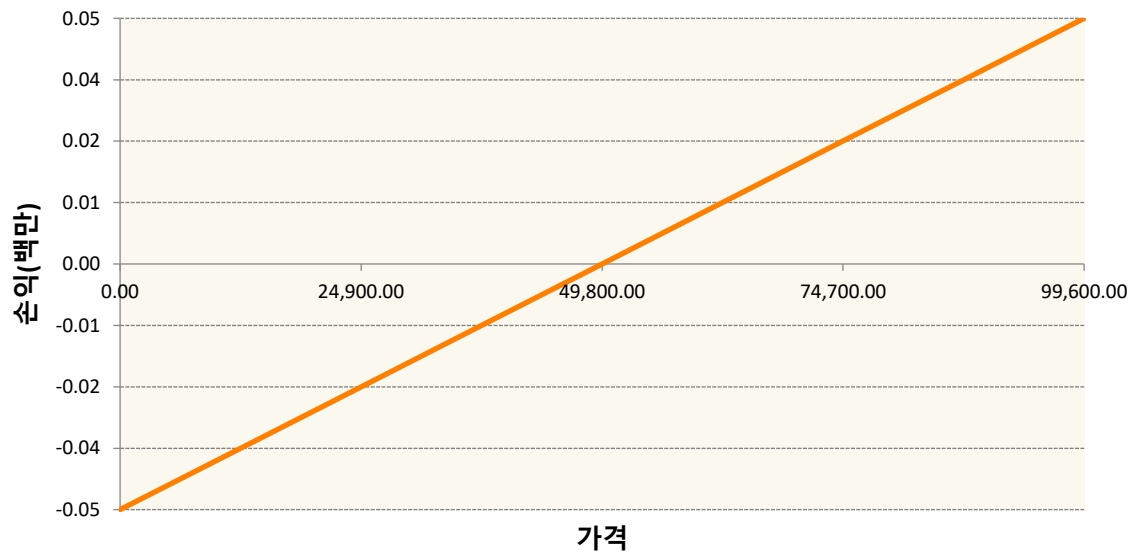
KR41G0W90002-2025-09 씨에스원드개별선물



KR41G3W90006-2025-09 한전기술개별선물



KR41GZW90001-2025-09 에코프로머티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101W90(2025-09 코스피200지수선물		707
KR410FW90(2025-09 두산로보틱스개별선물		13
KR4111W90(2025-09 삼성전자개별선물		84
KR411RW90(2025-09 한화비전개별선물		2
KR4145W90(2025-09 LG디스플레이개별선물		24
KR4150W90(2025-09 SK하이닉스개별선물		86
KR41CNW90 2025-09 포스코DX개별선물		12
KR41DAW90 2025-09 농심개별선물		4
KR41E8W90(2025-09 포스코퓨처엠개별선물		38
KR41EJW900 2025-09 SKC개별선물		19
KR41F5W90(2025-09 LG에너지솔루션개별선물		138
KR41F7W90(2025-09 카카오페이개별선물		15
KR41FAW90(2025-09 HMM개별선물		9
KR41FMW90 2025-09 엘앤에프개별선물		15
KR41G0W90 2025-09 씨에스원드개별선물		4
KR41G3W90 2025-09 한전기술개별선물		19
KR41GZW90 2025-09 에코프로머티개별선물		12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,062

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

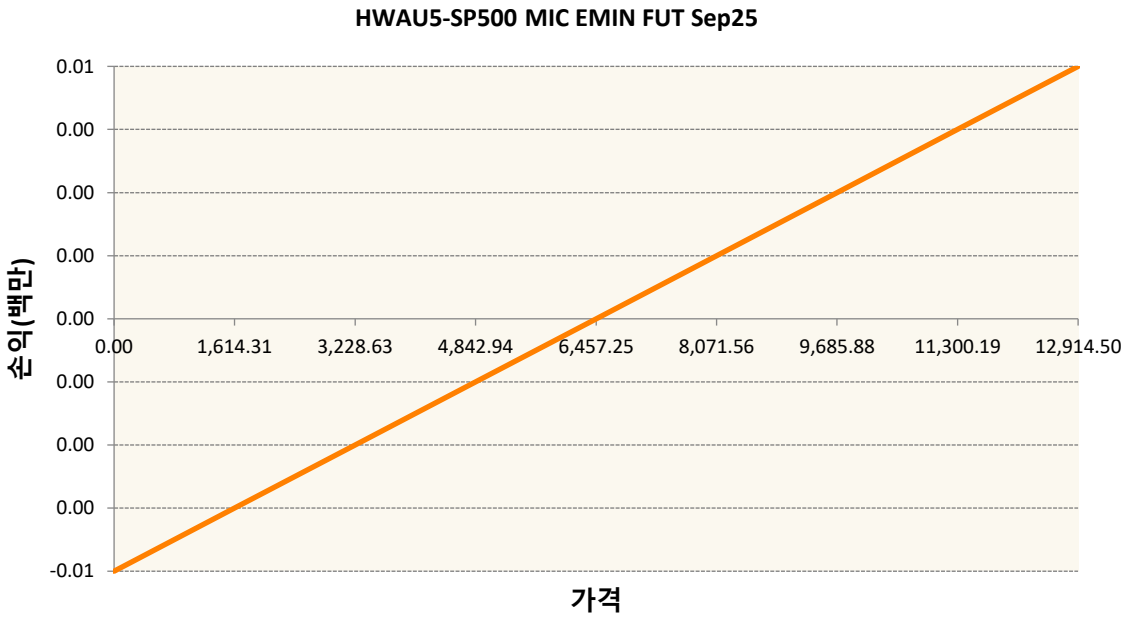
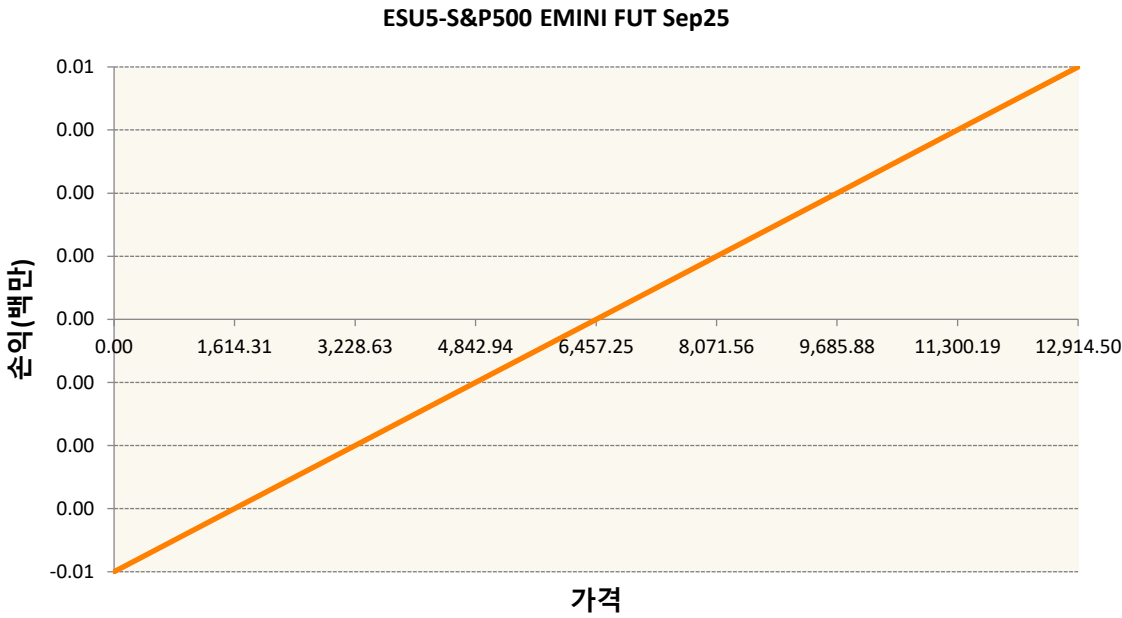
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	33,887	0	33,887	
누계	지수	선물	1,201	0	1,201	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,711
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	96

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,458

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

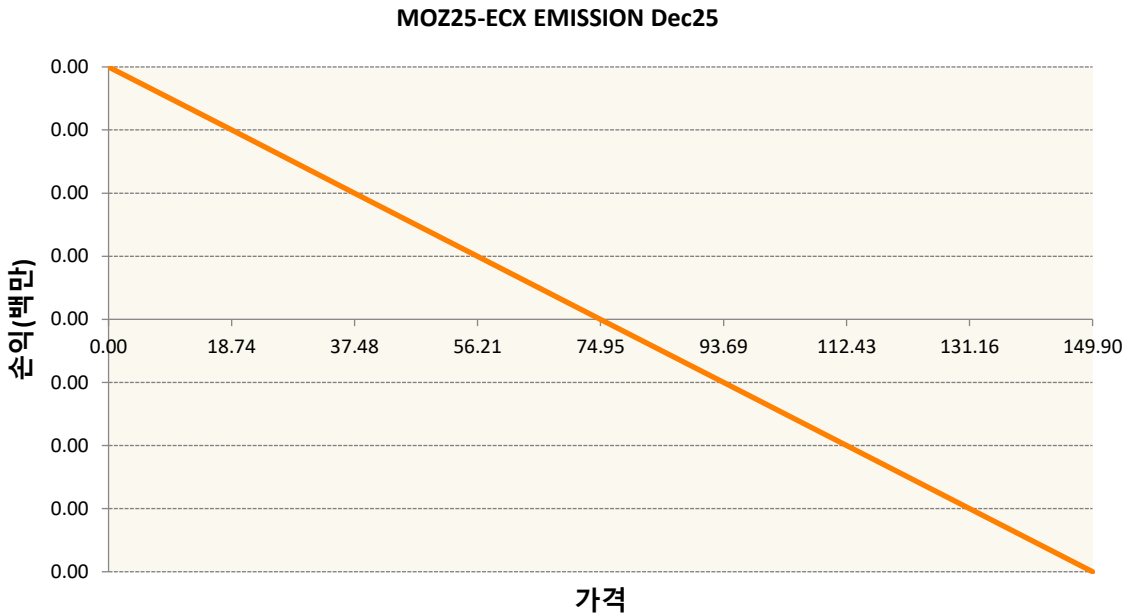
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,415	-4,415	
누계	유가증권	선물	-4	0	-4	장외
누계	통화	선도	0	1,207	-1,207	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.18
FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E	97
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	353

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

(단위:백만원)

580

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

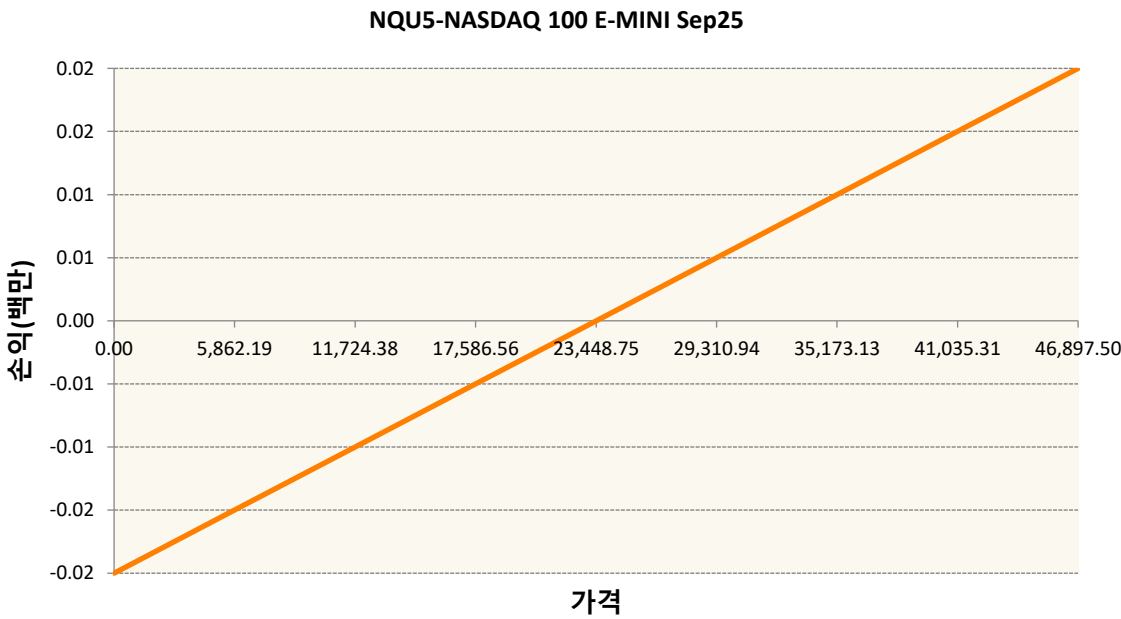
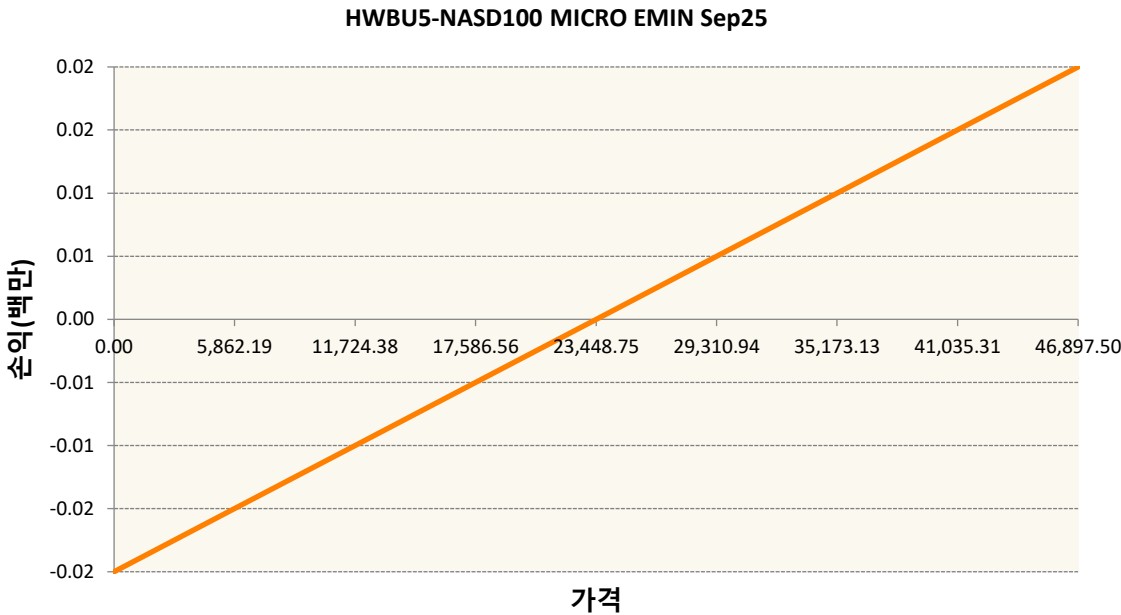
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,597	0	13,597	
누계	지수	선물	1,301	0	1,301	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25		104
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		1,088

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,350

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

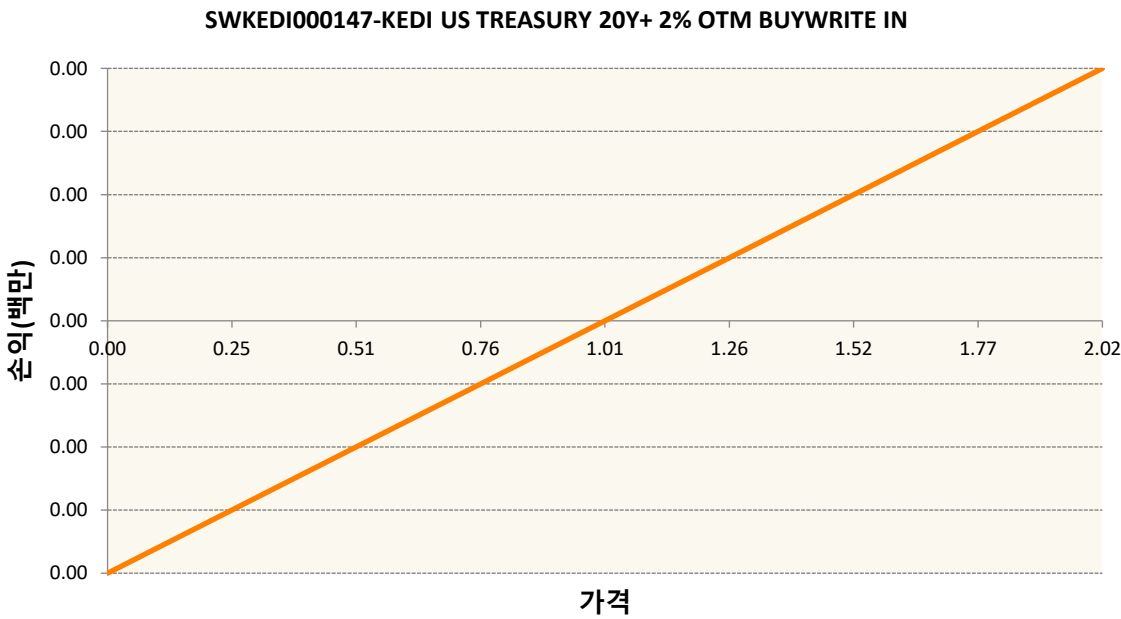
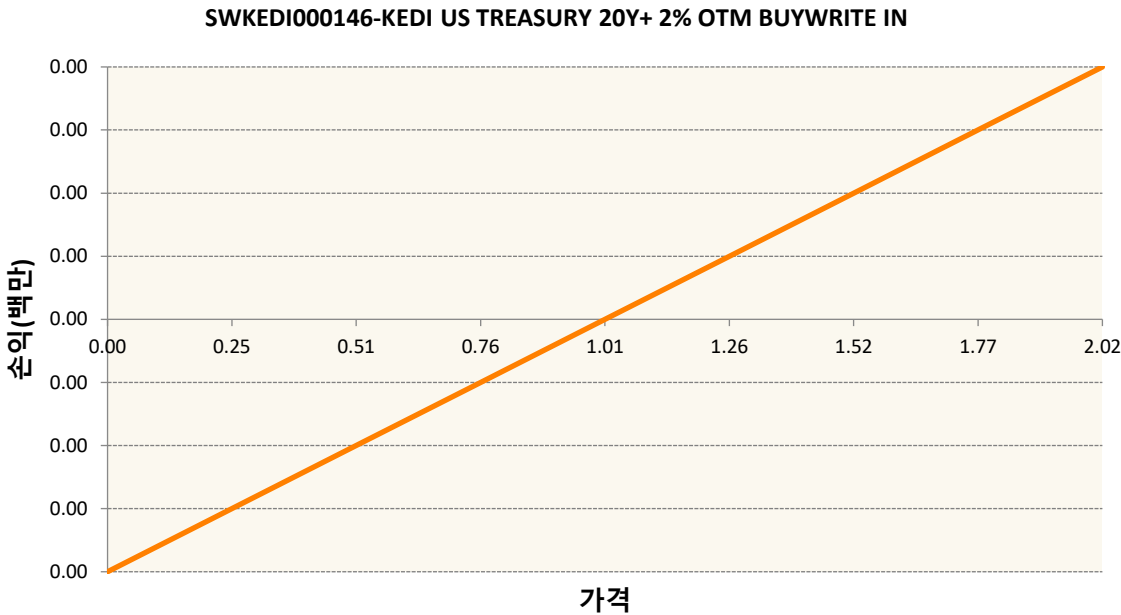
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

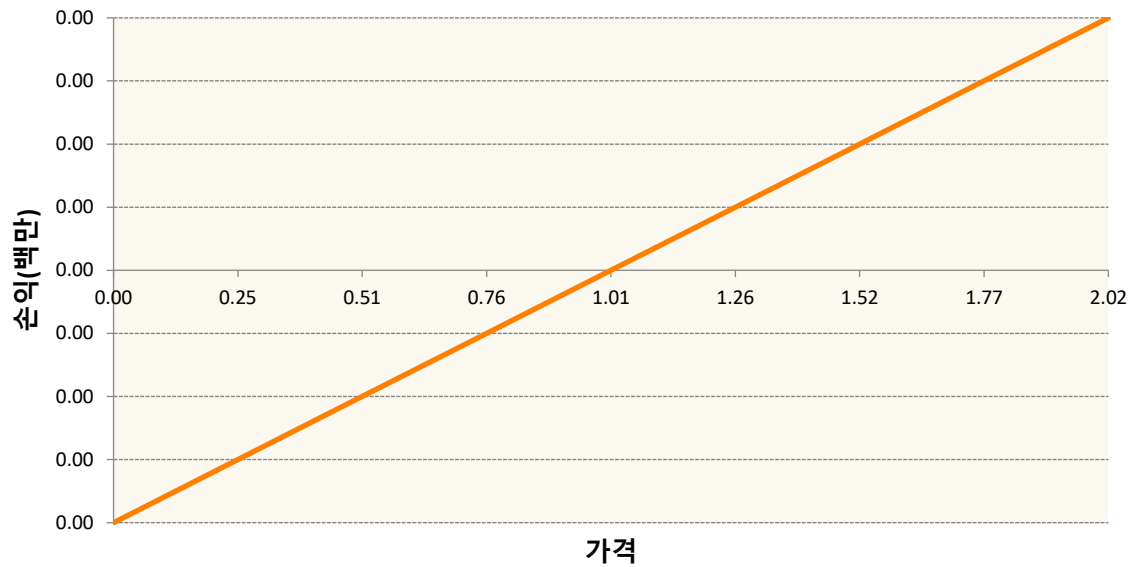
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	333,866	0	333,866	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

7,867
6,049
9,446
3,498

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

(단위:백만원)

13,208

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,814	0	5,814	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

87

공시일	2025-09-05
기준일	2025-09-04

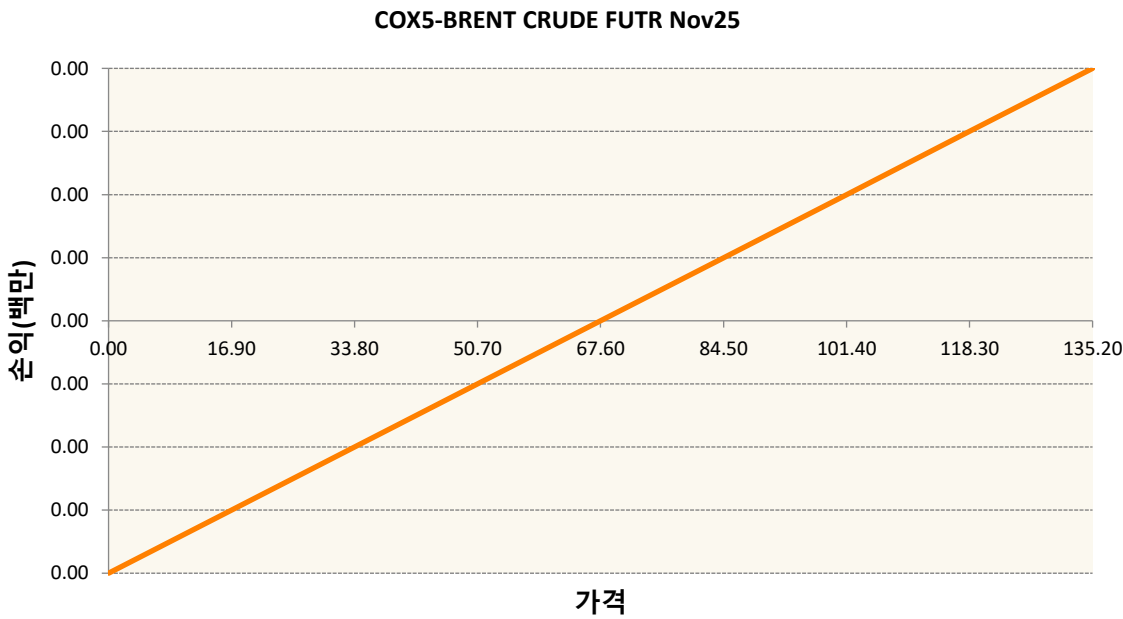
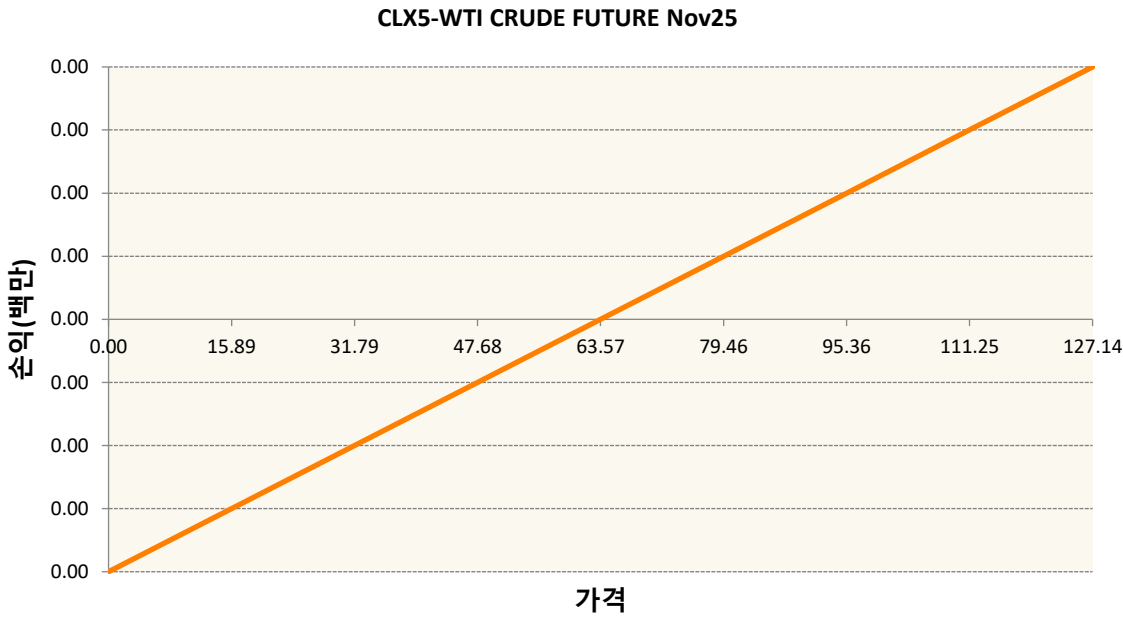
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

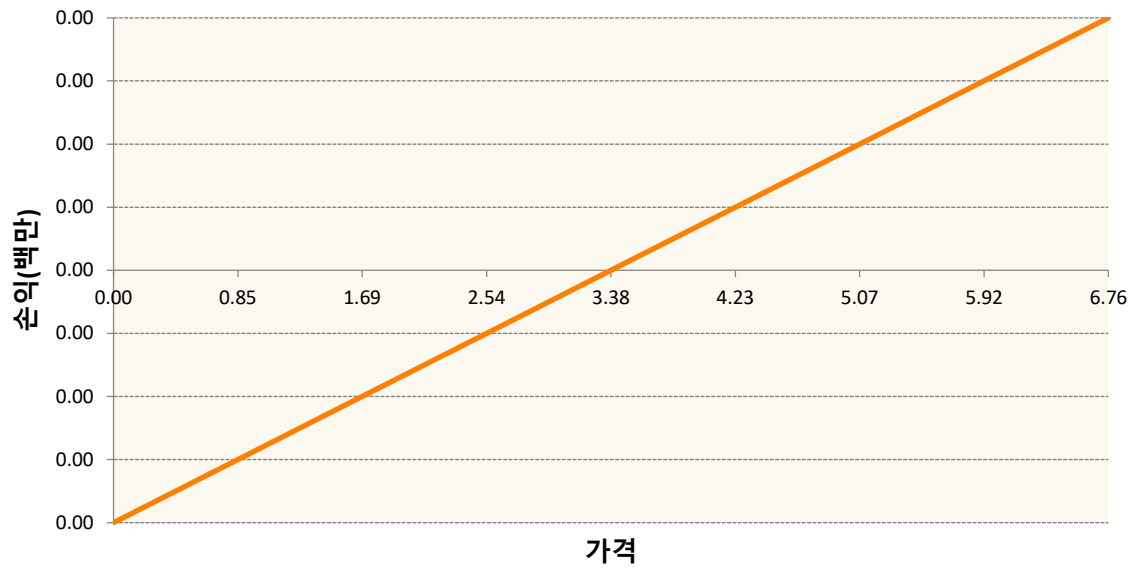
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	14	-14	장내
누계	유가증권	선물	546	0	546	
누계	통화	선물	0	84	-84	장내

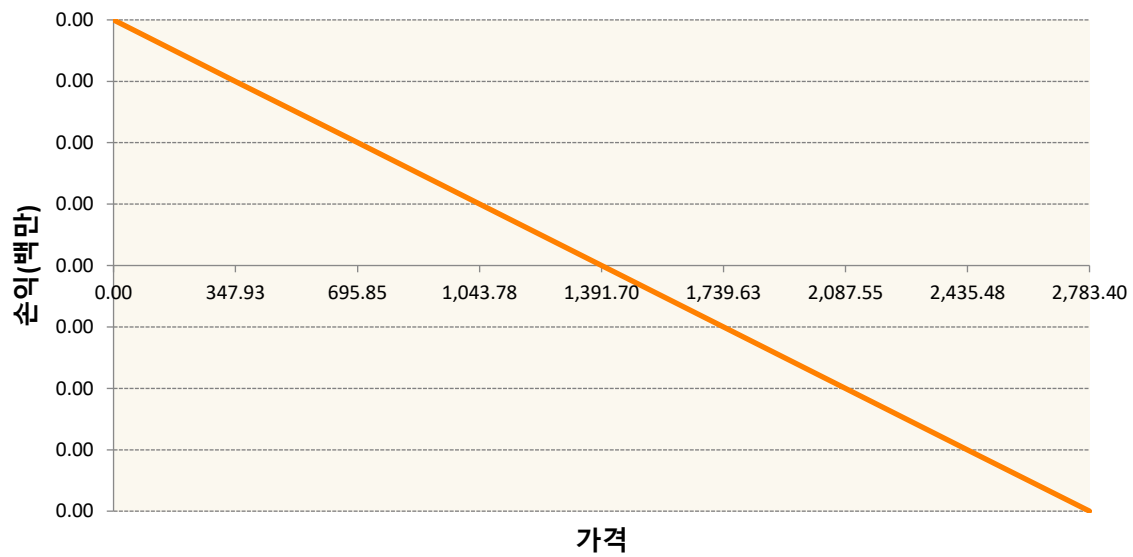
2. 만기시점의 손익구조



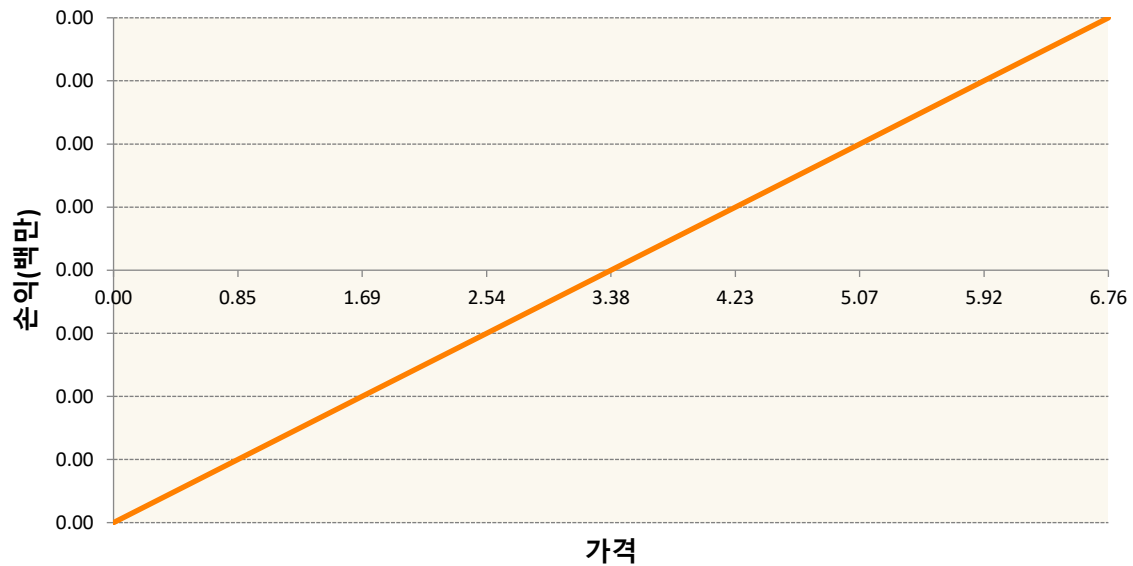
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

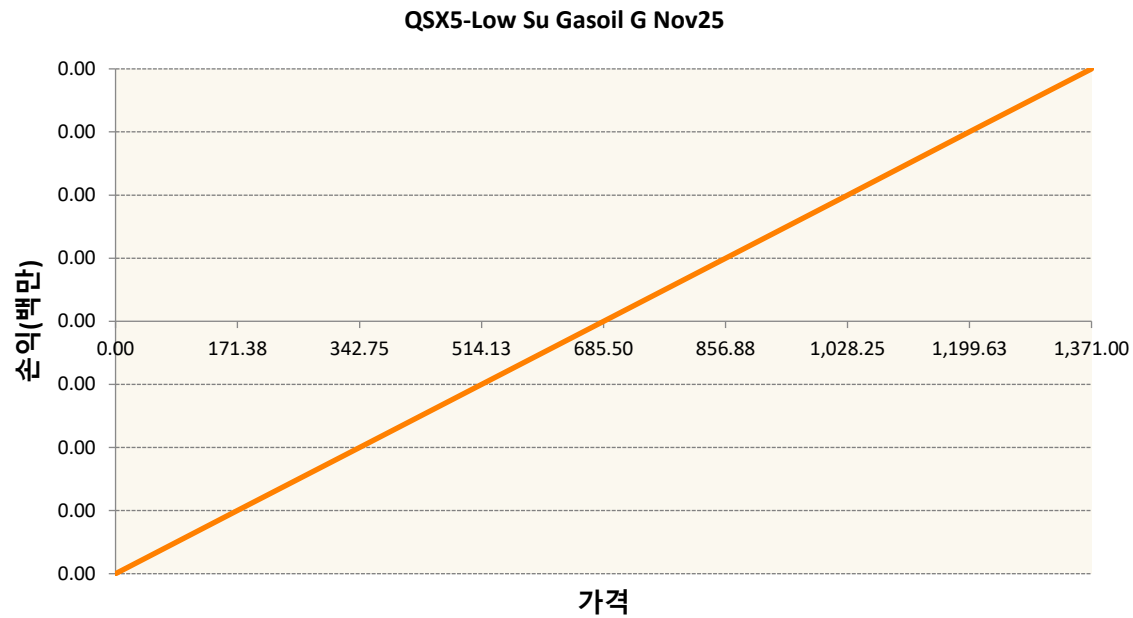


KR4175W90001-2025-09 달러선물



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		7
NGX25	NATURAL GAS FUTR Nov25	11
QX5	Low Su Gasoil G Nov25	8

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