

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

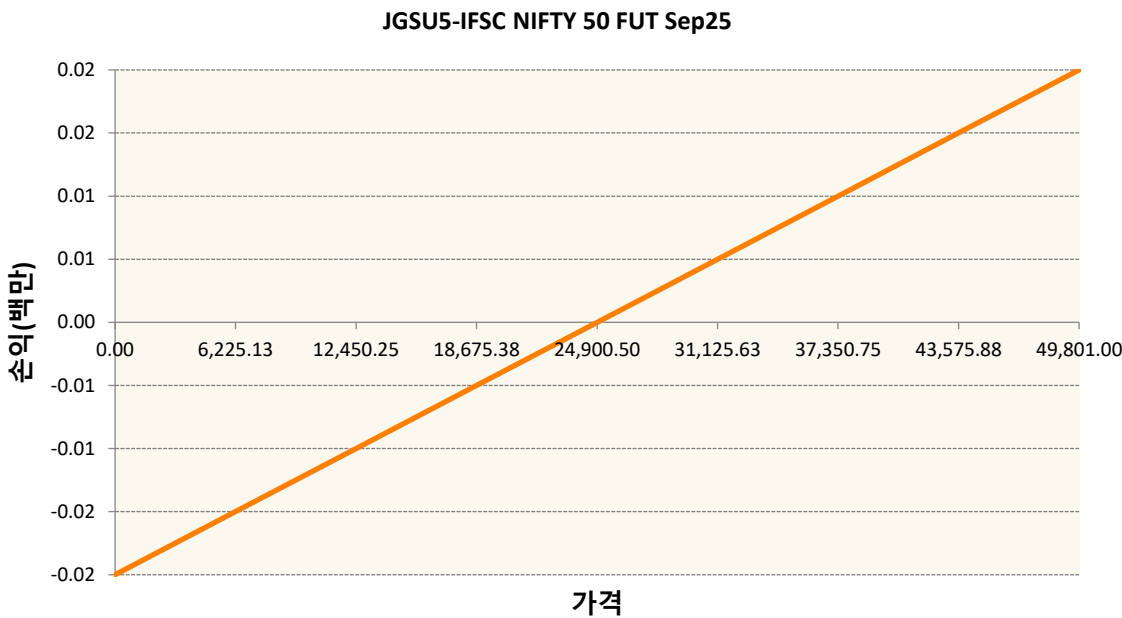
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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)

JGSU5	IFSC NIFTY 50 FUT Sep25	45
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

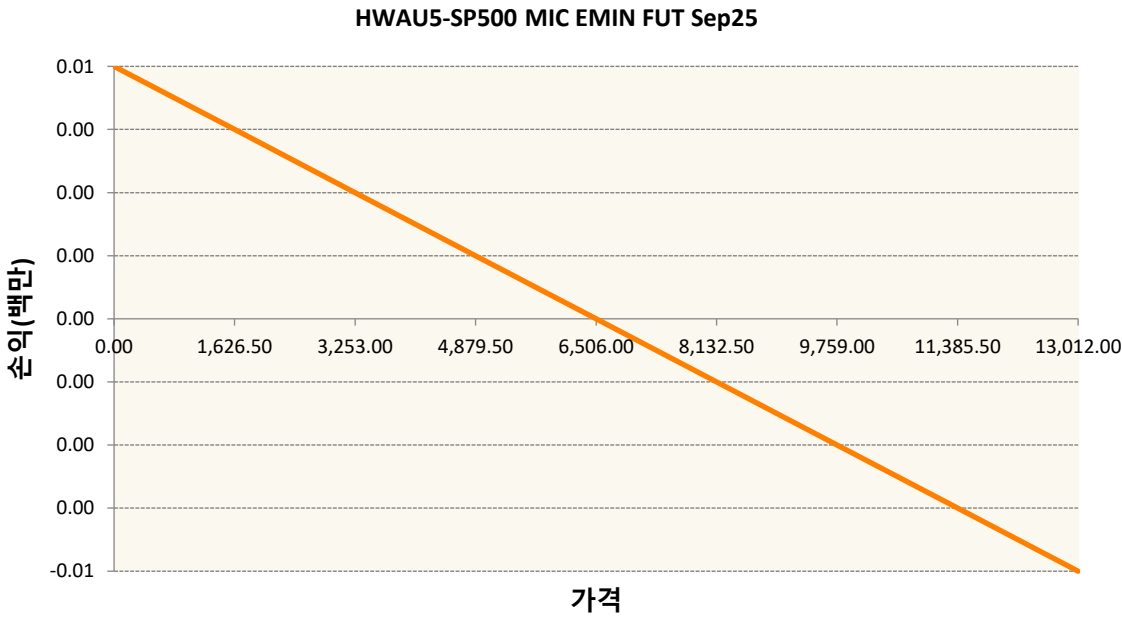
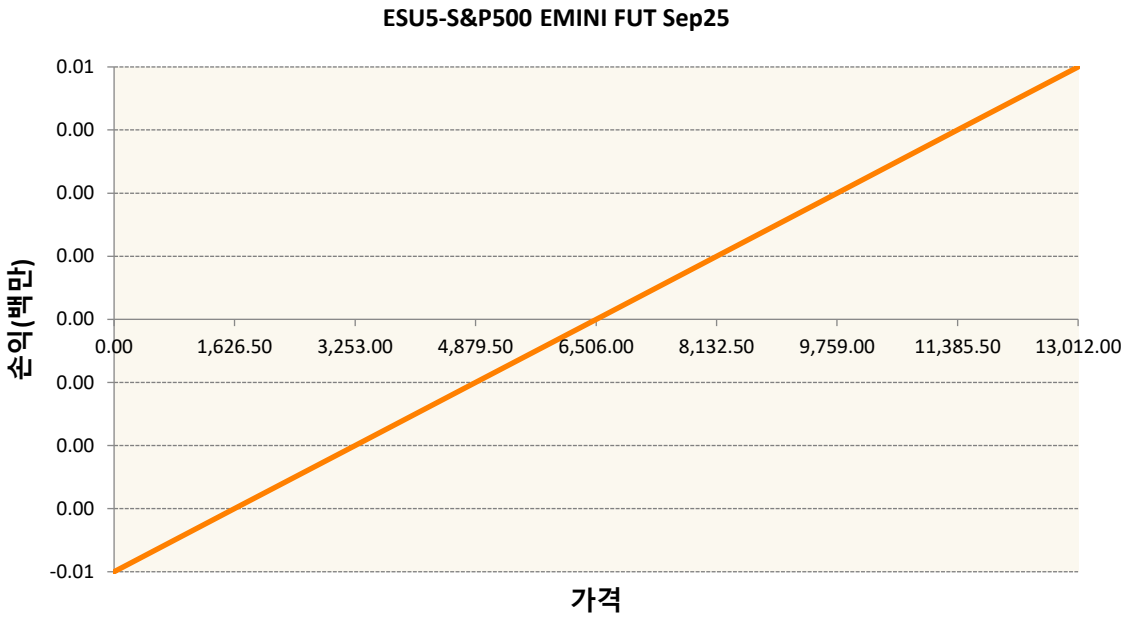
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	894	0	894	
누계	지수	선물	0	223	-223	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	72
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	18

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

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

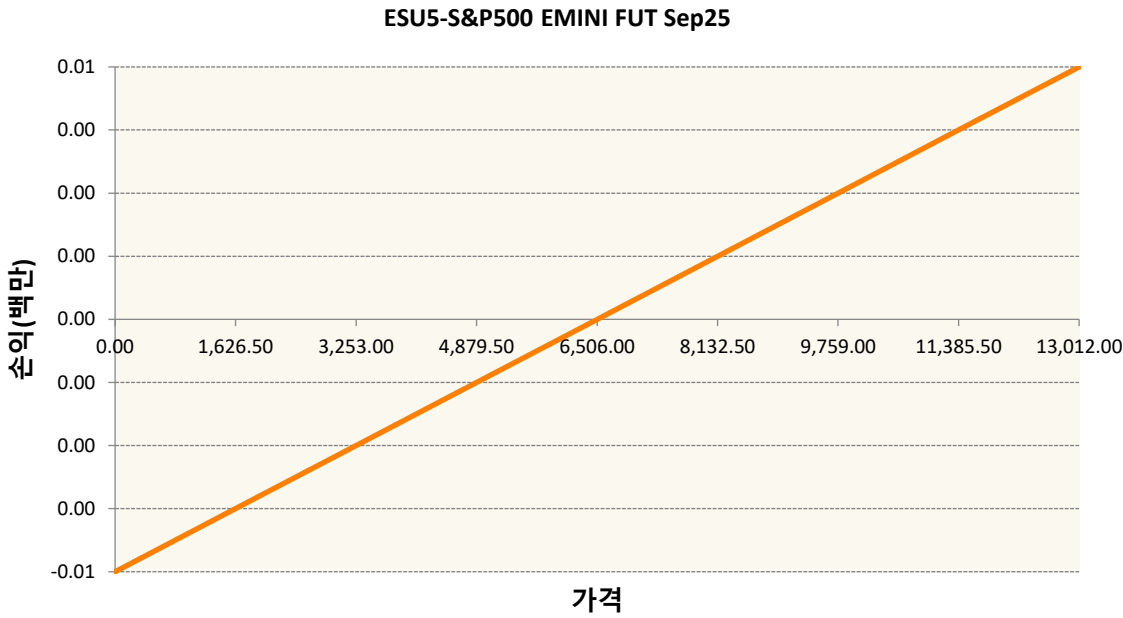
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,347	0	1,347	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	108
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

94

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

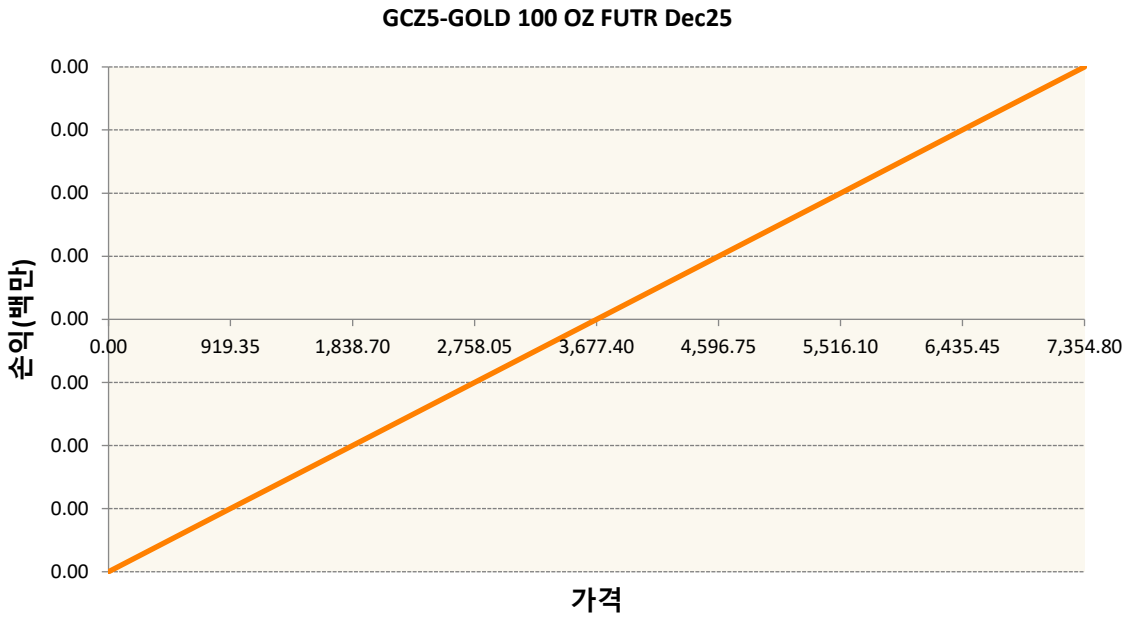
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,040	0	2,040	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 09/12/25 C327 EQUITY	2
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	163

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

(단위:백만원)

144

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

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)

AOPLTRAAP' PLTR US 09/12/25 P162.5 EQUITY	47
AOPLTRUDC PLTR US 09/12/25 C162.5 EQUITY	19

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

(단위:백만원)

270

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

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)

AOTLTUSDC:TLT US 09/12/25 C87.5 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

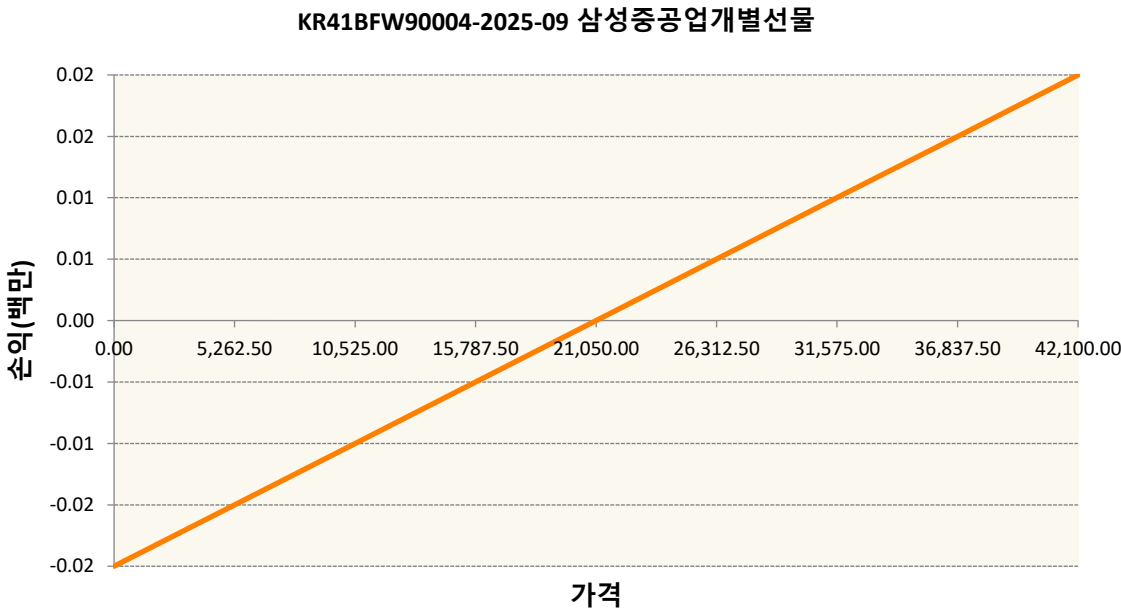
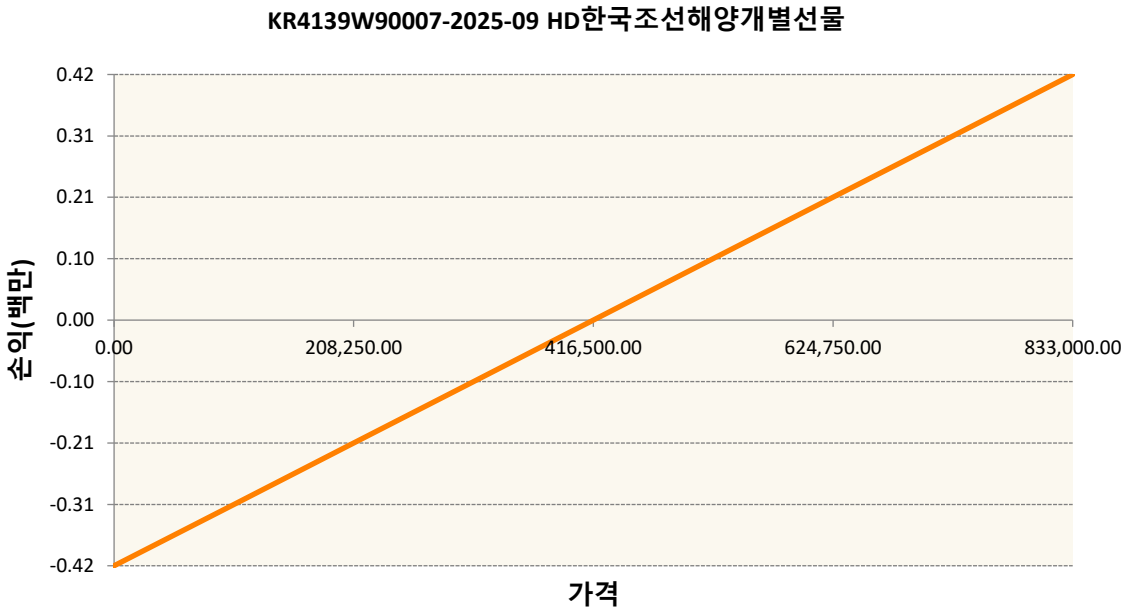
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

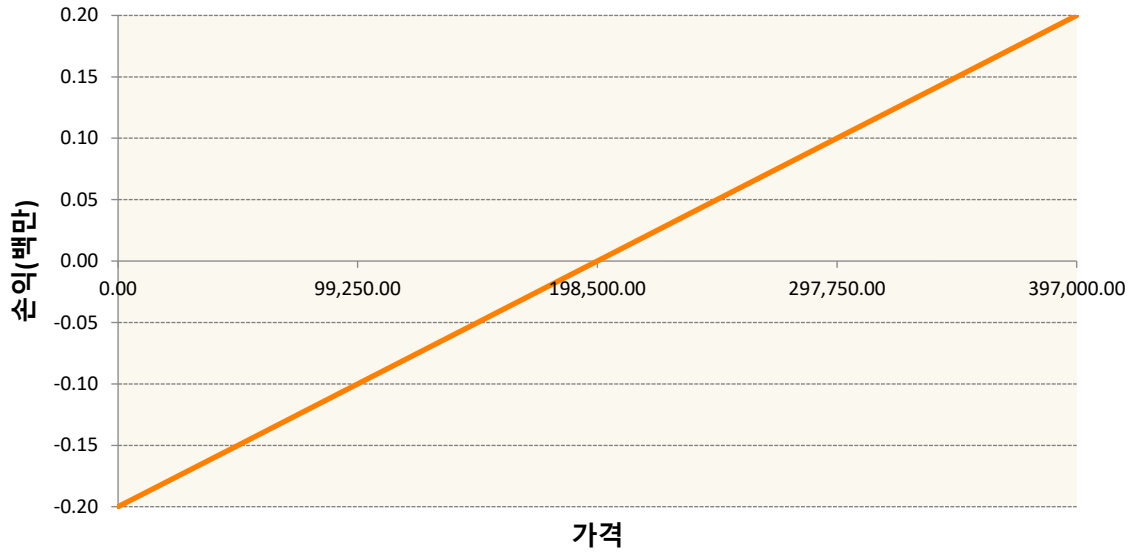
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1	1	0	장내
누계	유가증권	선물	36,271	0	36,271	장내

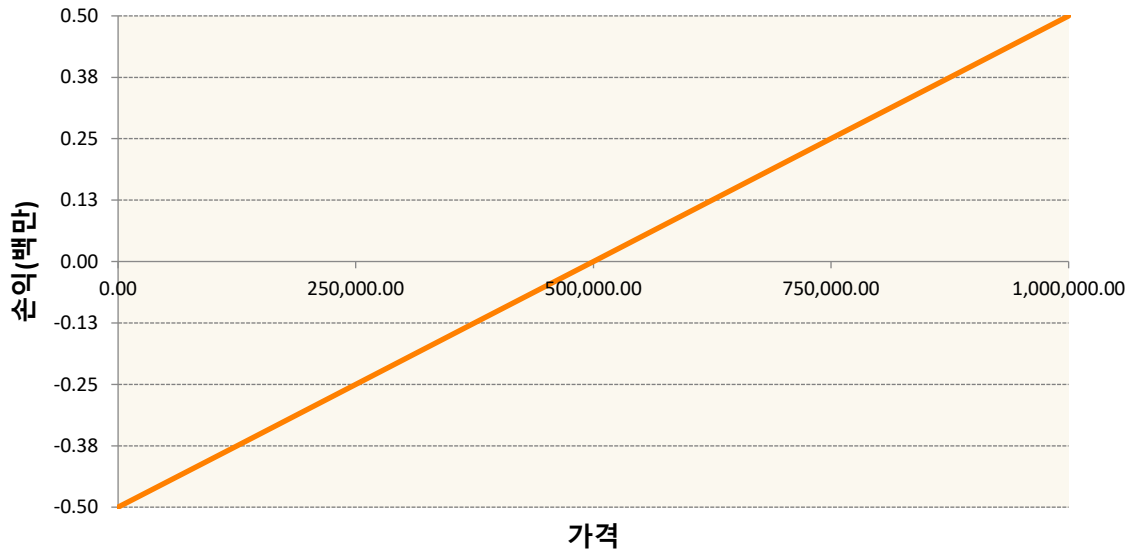
2. 만기시점의 손익구조



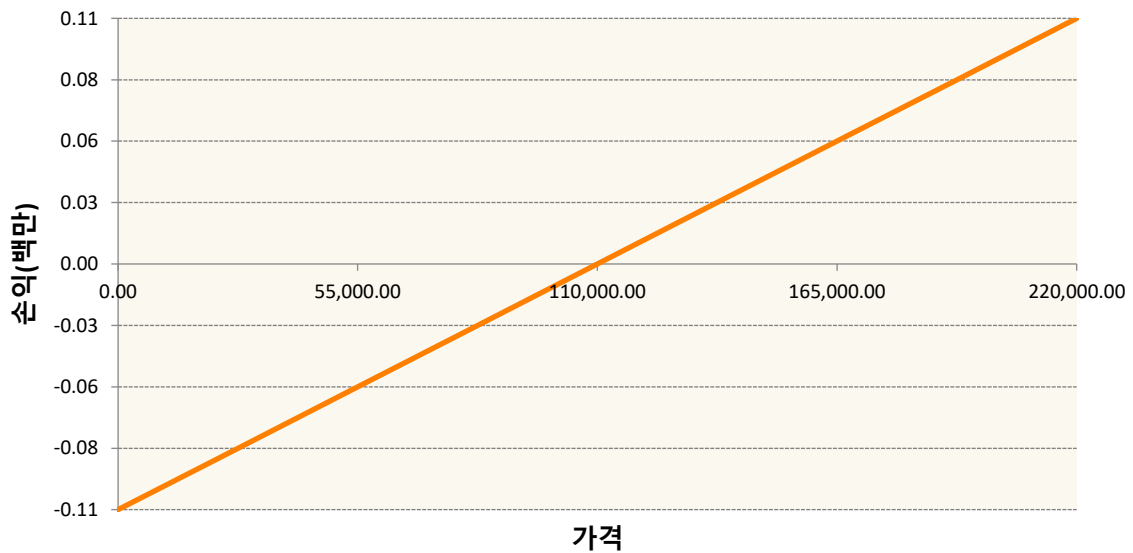
KR41CDW90007-2025-09 HD현대미포개별선물



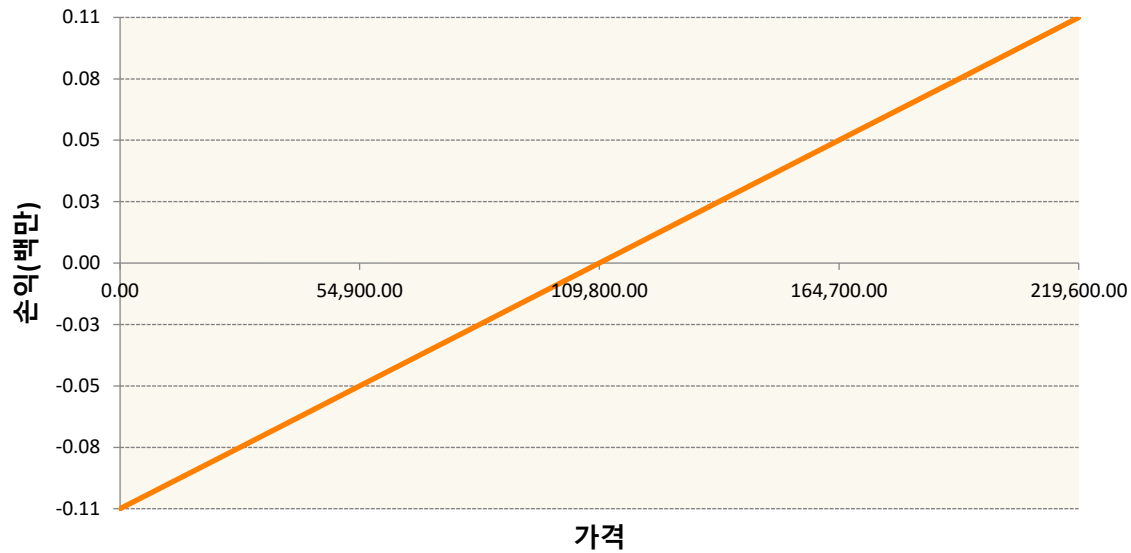
KR41FDWA0004-2025-10 HD현대중공업개별선물



KR41FVW90002-2025-09 한화오션개별선물



KR41FVWA0002-2025-10 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4139W90007		2025-09 HD한국조선해양개별선물						599
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-599	-599	-599	-599	-599	-599	-599	
-5.33%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399	
-2.67%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	200	200	200	200	200	200	200	
5.33%	399	399	399	399	399	399	399	
8.00%	599	599	599	599	599	599	599	
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	
-5.33%	-358	-358	-358	-358	-358	-358	-358	
-2.67%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	179	179	179	179	179	179	179	
5.33%	358	358	358	358	358	358	358	
8.00%	538	538	538	538	538	538	538	
KR41CDW90007		2025-09 HD현대미포개별선물						446
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-446	-446	-446	-446	-446	-446	-446	
-5.33%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298	
-2.67%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149	
0%	0	0	0	0	0	0	0	

2.67%	149	149	149	149	149	149	149
5.33%	298	298	298	298	298	298	298
8.00%	446	446	446	446	446	446	446

KR41FDWA0004

2025-10 HD현대중공업개별선물

597

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-597	-597	-597	-597	-597	-597	-597
-5.33%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
-2.67%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	199	199	199	199	199	199	199
5.33%	398	398	398	398	398	398	398
8.00%	597	597	597	597	597	597	597

KR41FVW90002

2025-09 한화오션개별선물

720

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-720	-720	-720	-720	-720	-720	-720
-5.33%	-480	-480	-480	-480	-480	-480	-480
-2.67%	-240	-240	-240	-240	-240	-240	-240
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	240	240	240	240	240	240	240
5.33%	480	480	480	480	480	480	480
8.00%	720	720	720	720	720	720	720

KR41FVWA0002

2025-10 한화오션개별선물

0

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

1,740

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

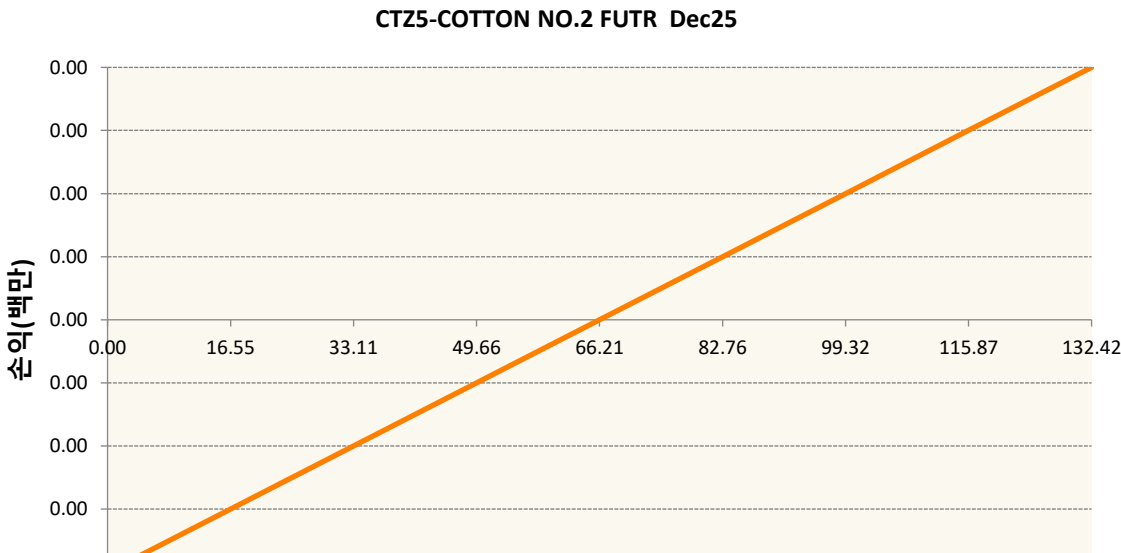
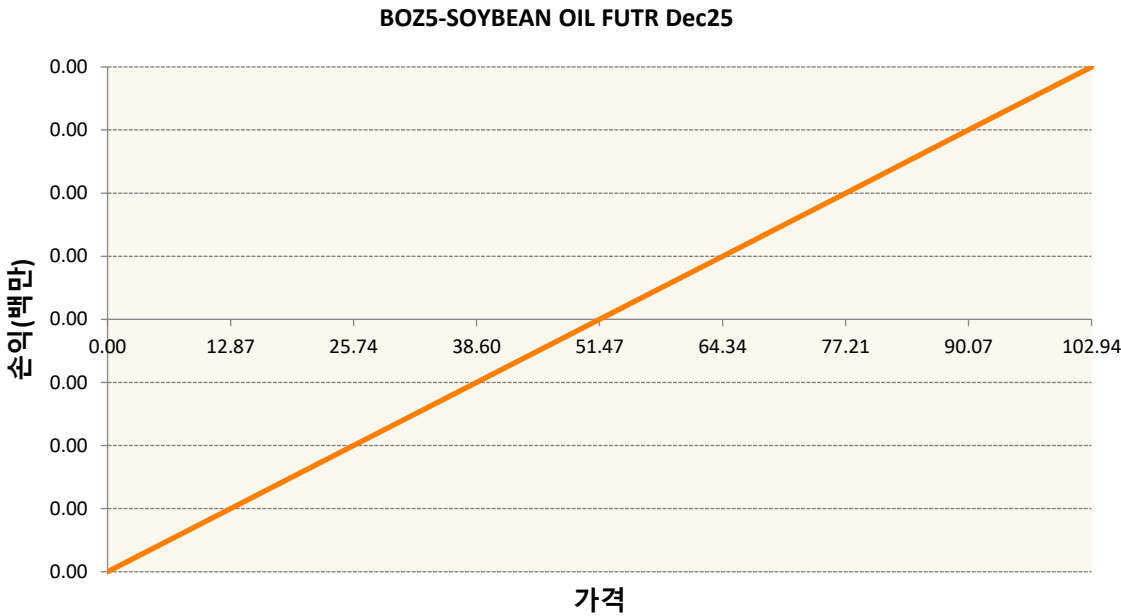
포커스농산물모(채권-파생형)

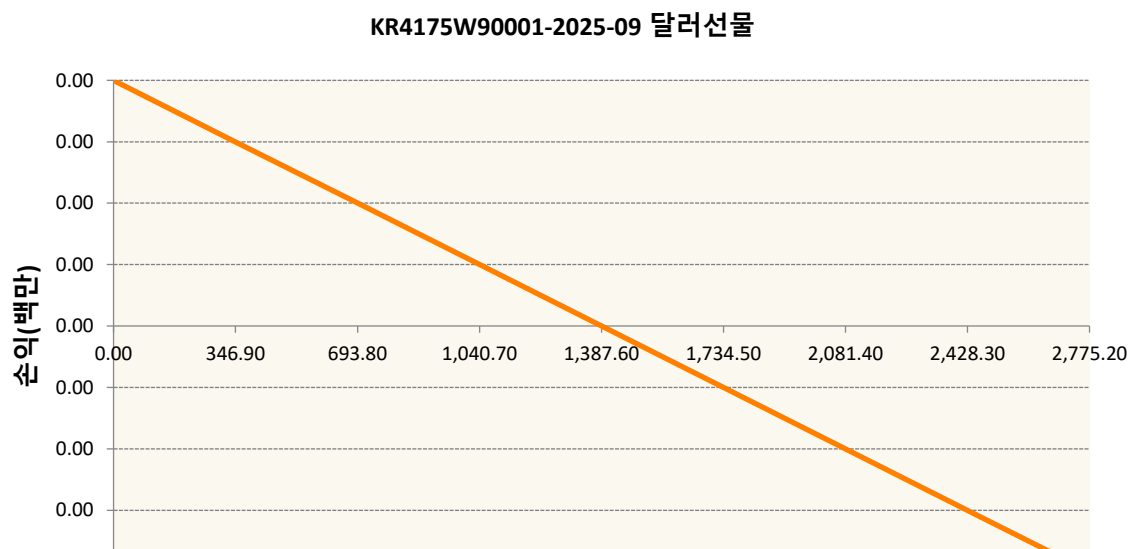
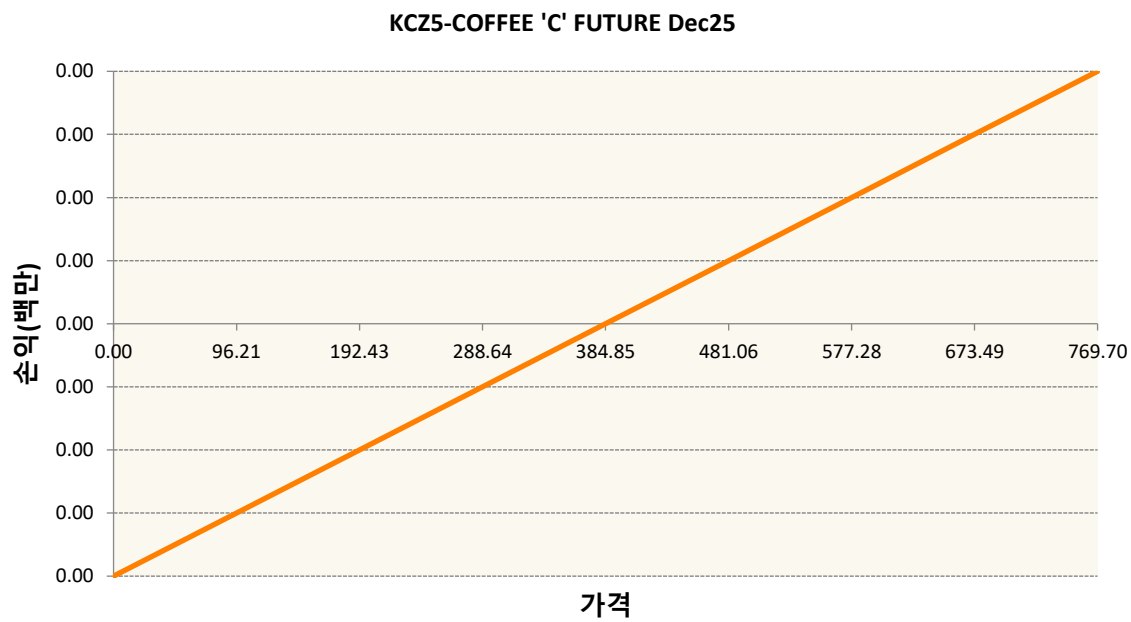
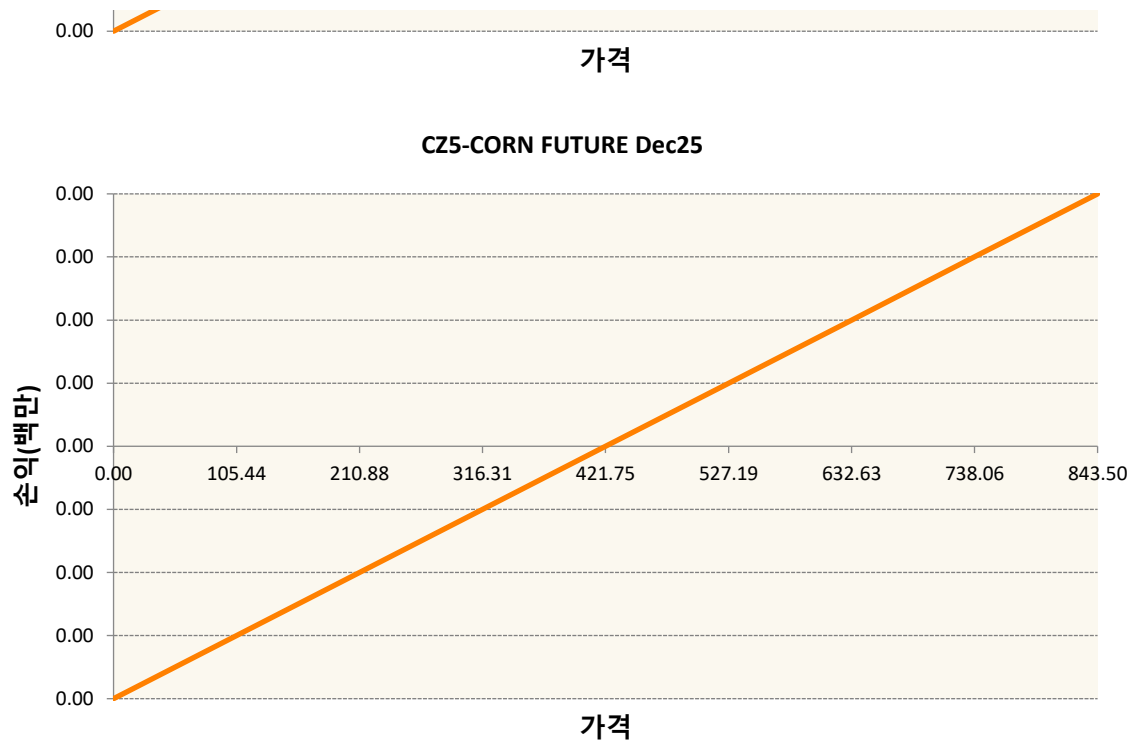
1. 계약금액

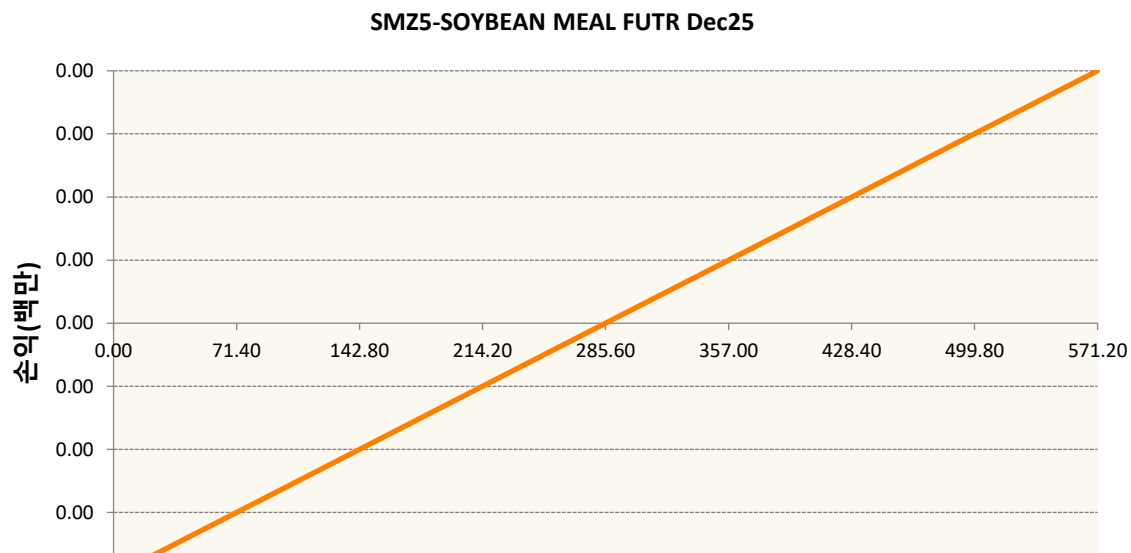
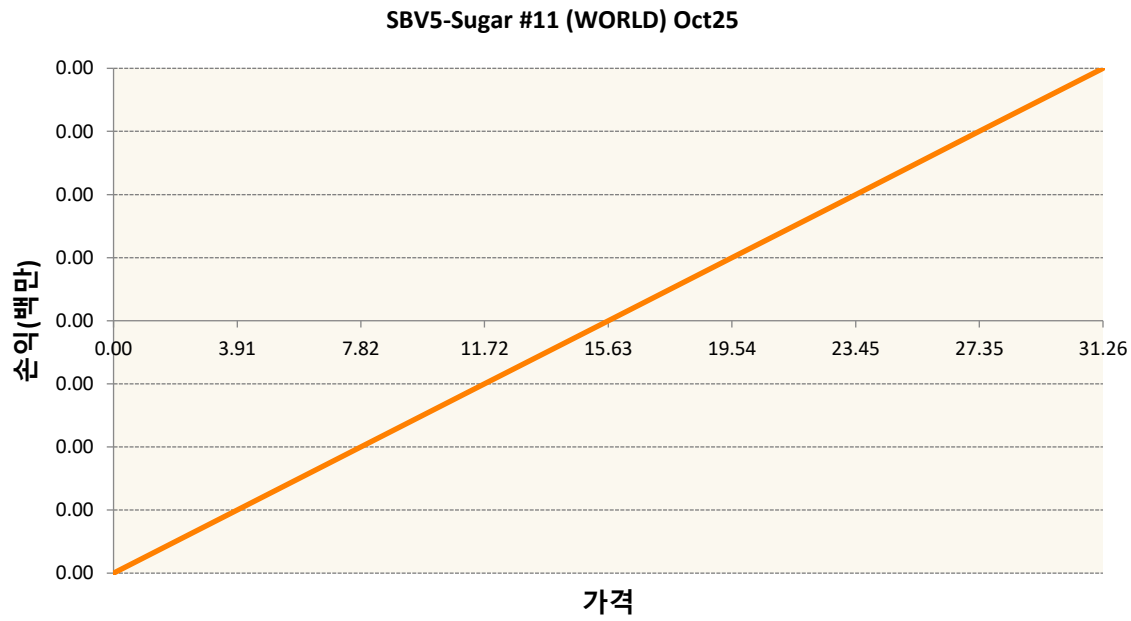
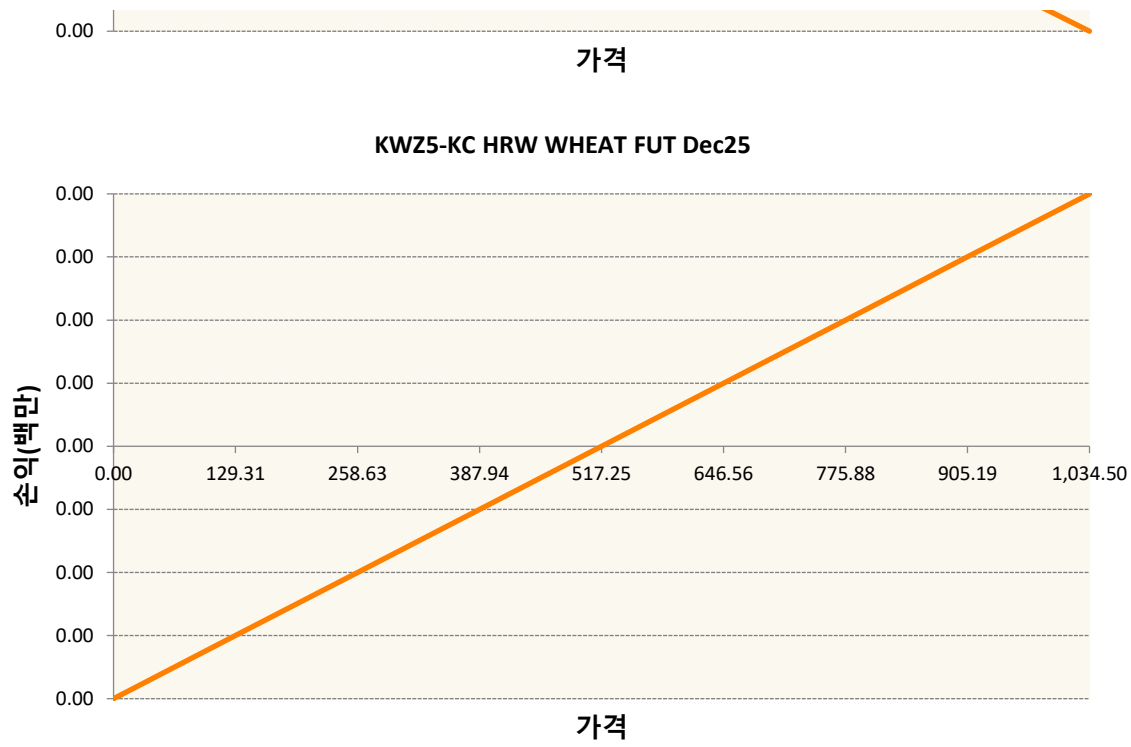
(단위:USD 백만)

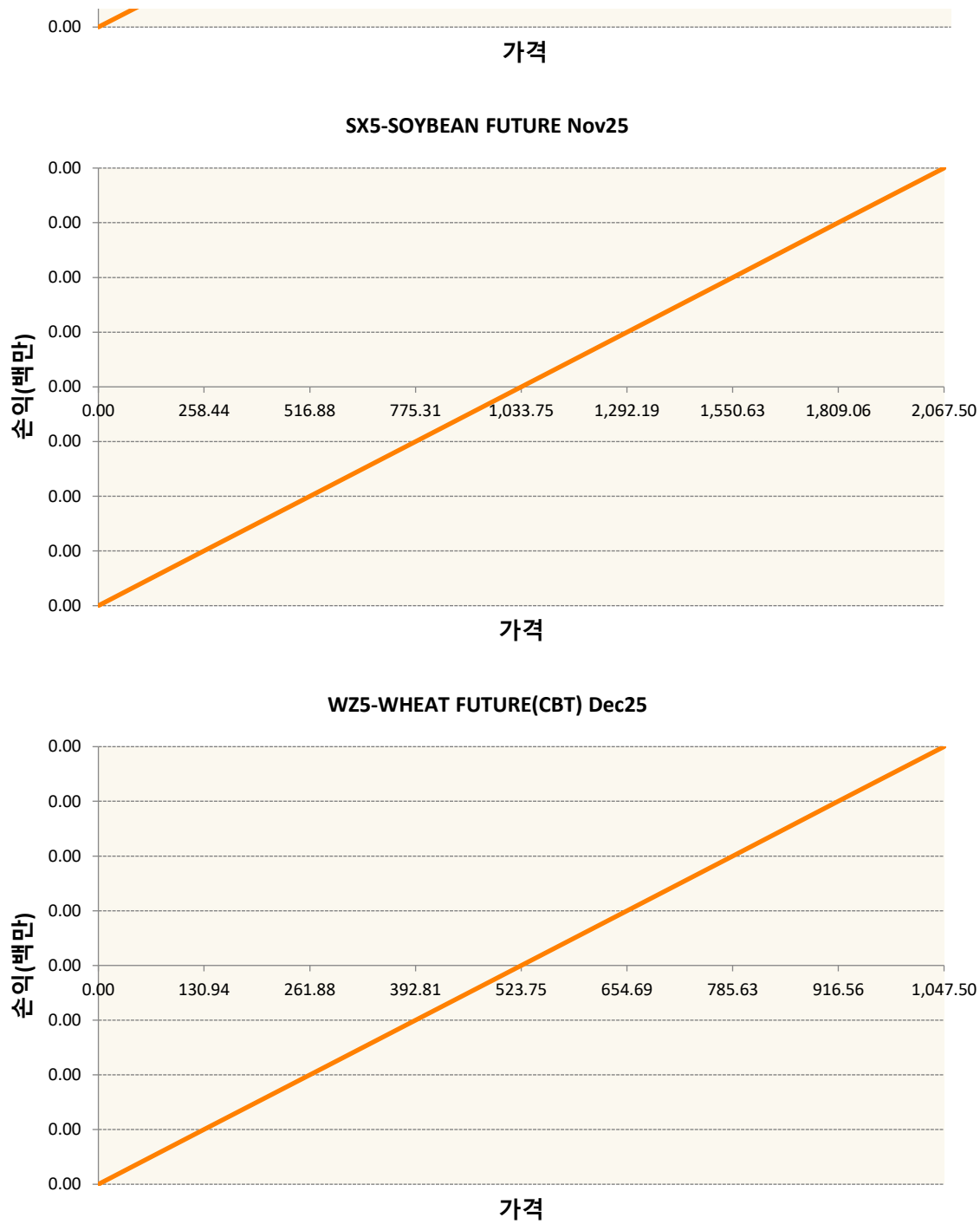
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,178	0	1,178	
누계	유가증권	선물	2,267	0	2,267	
누계	통화	선물	0	375	-375	장내

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	2025-09-10
기준일	2025-09-09

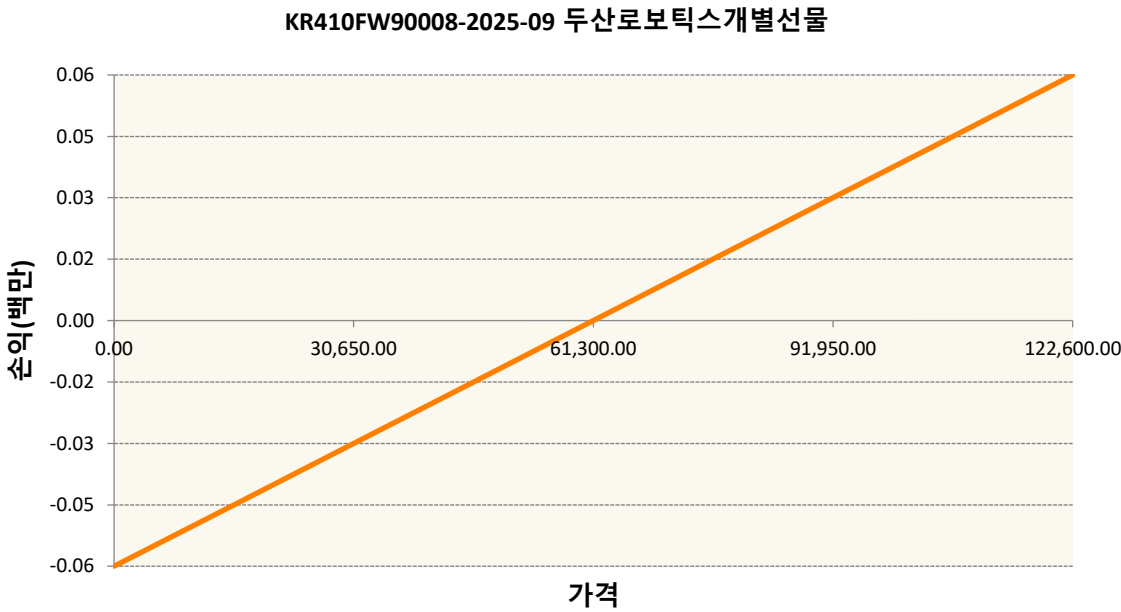
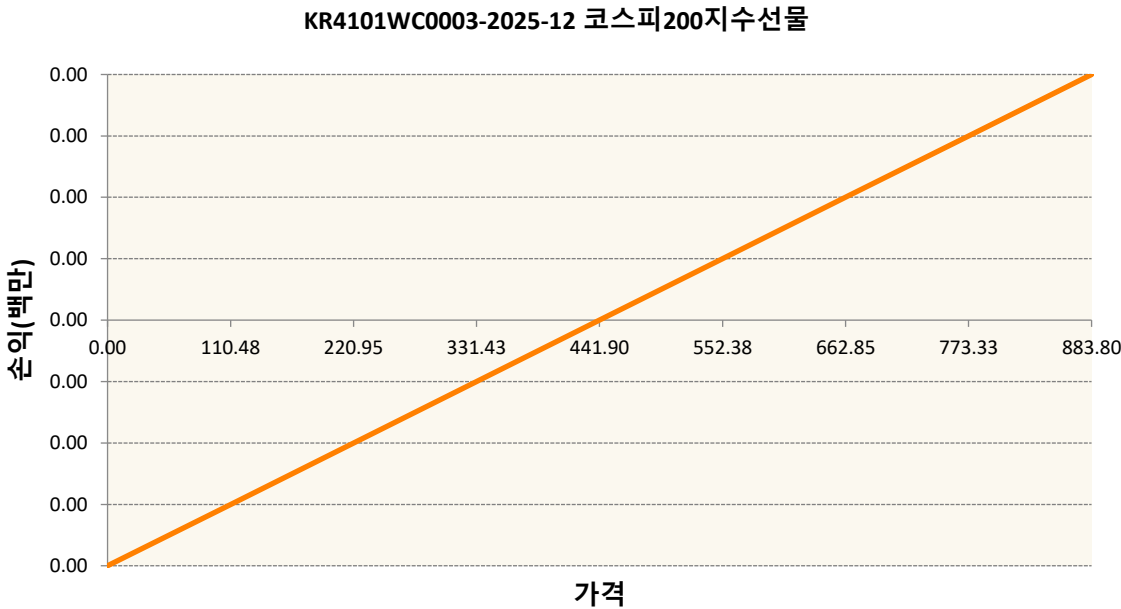
스마트인덱스모

1. 계약금액

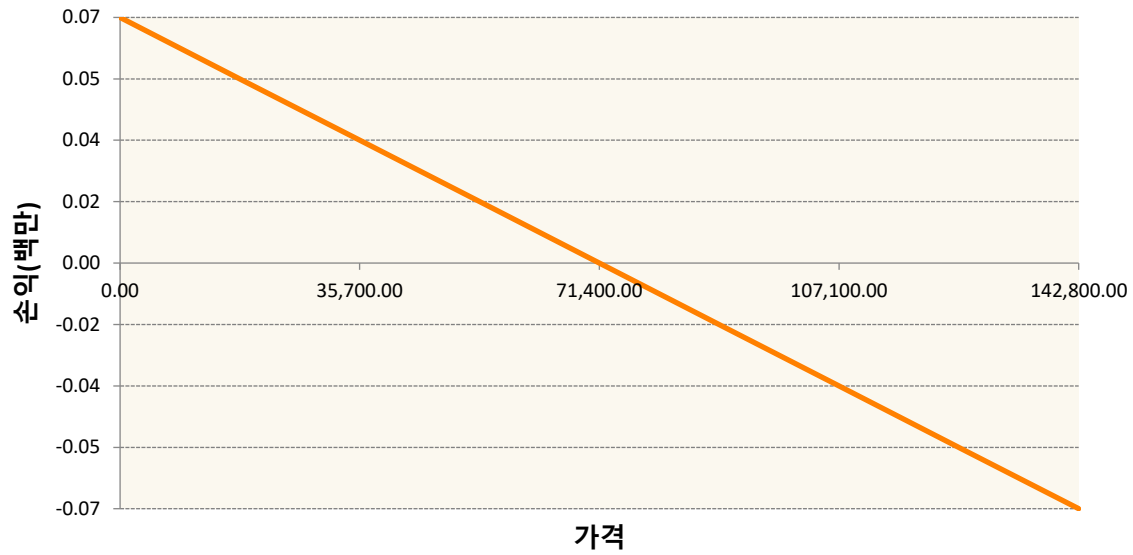
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,115	0	1,115	장내
누계	유가증권	선물	1,472	100	1,372	장내

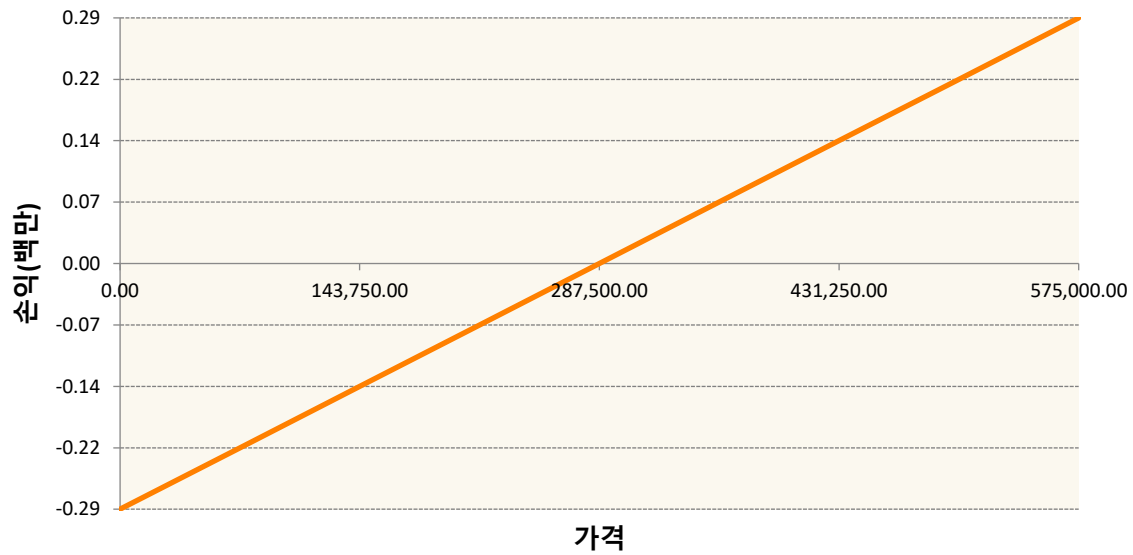
2. 만기시점의 손익구조



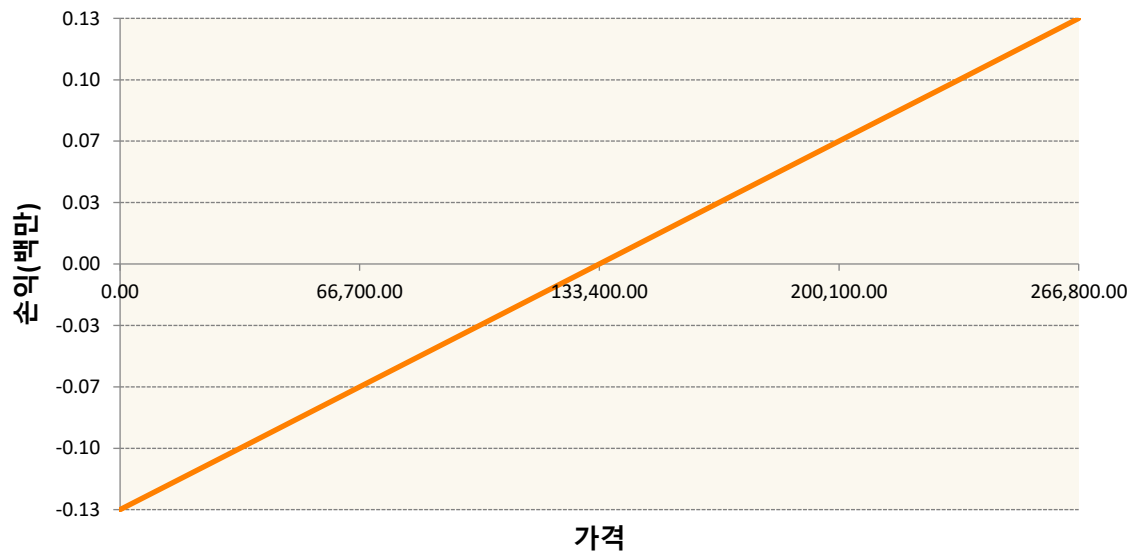
KR4111W90006-2025-09 삼성전자개별선물



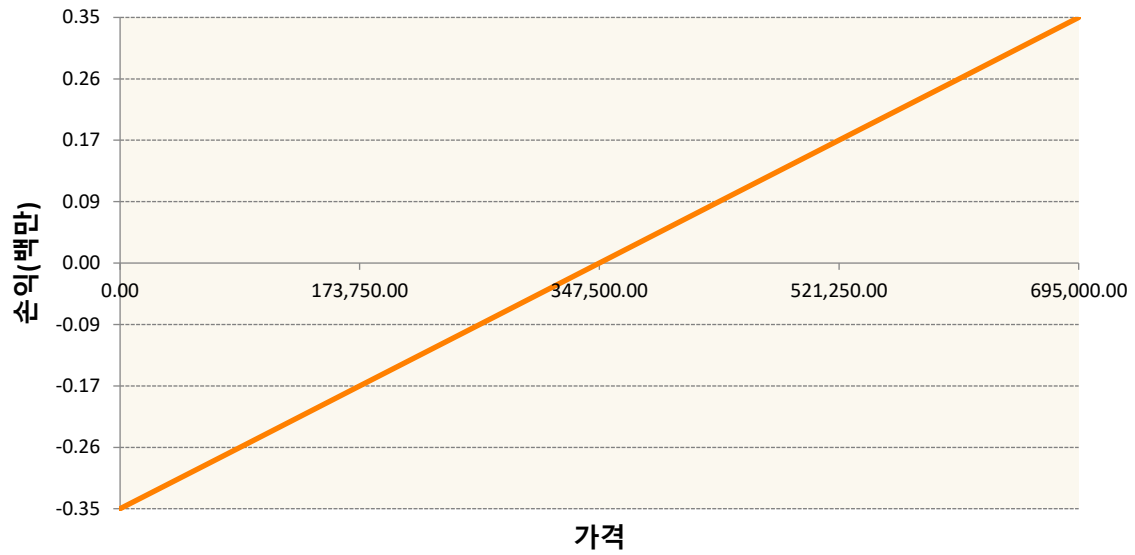
KR4150W90004-2025-09 SK하이닉스개별선물



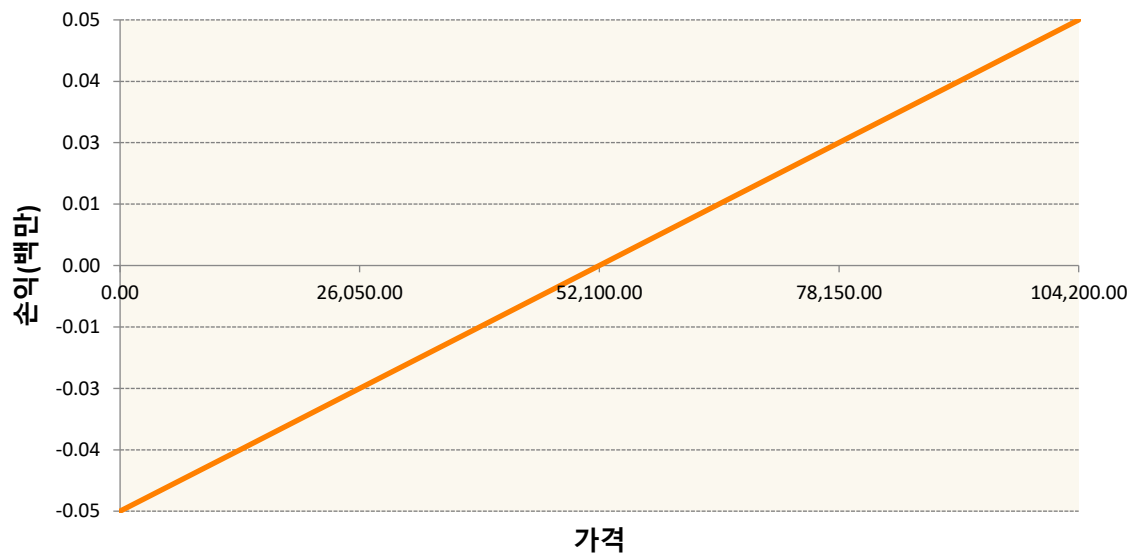
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



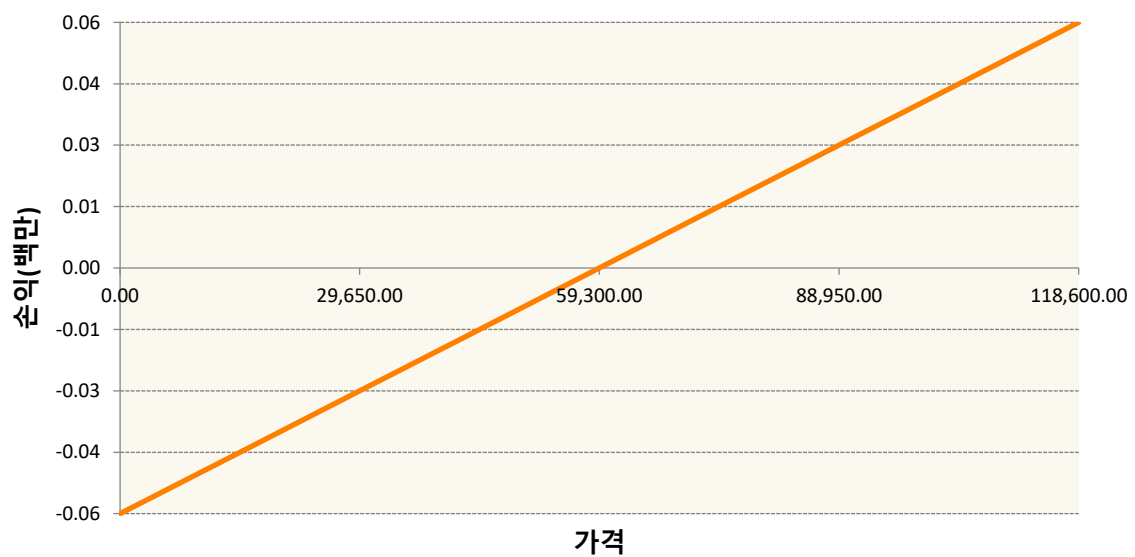
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FMWA0003-2025-10 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물		88
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
KR41FMWAC 2025-10 엘앤에프개별선물		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	76

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

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	368
-----------------------------	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

591

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

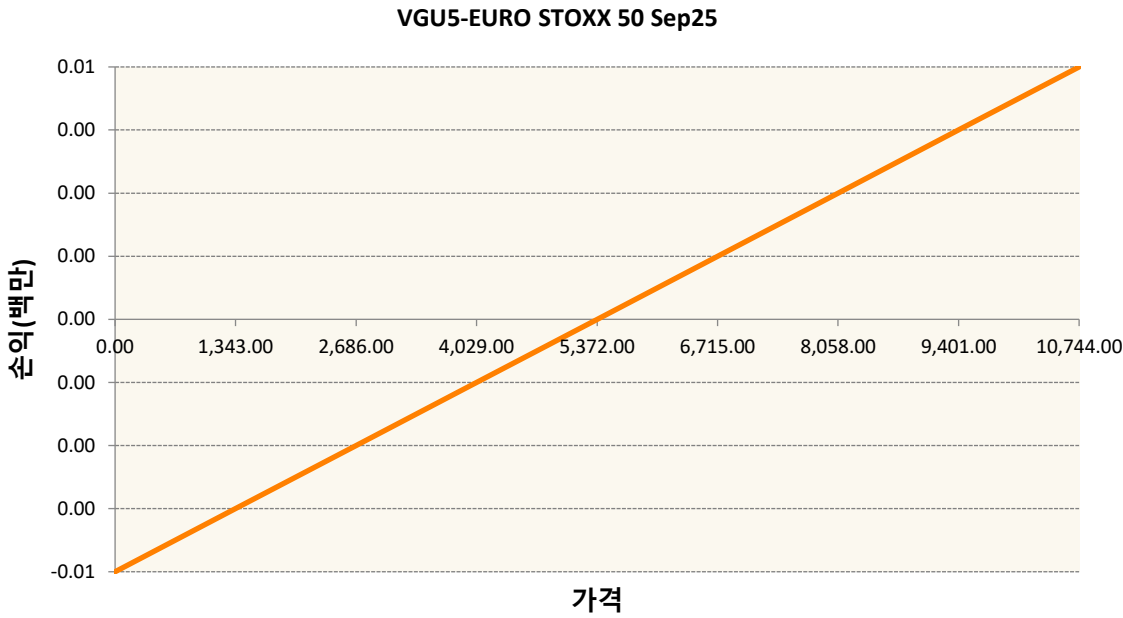
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	680	0	680	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

46

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

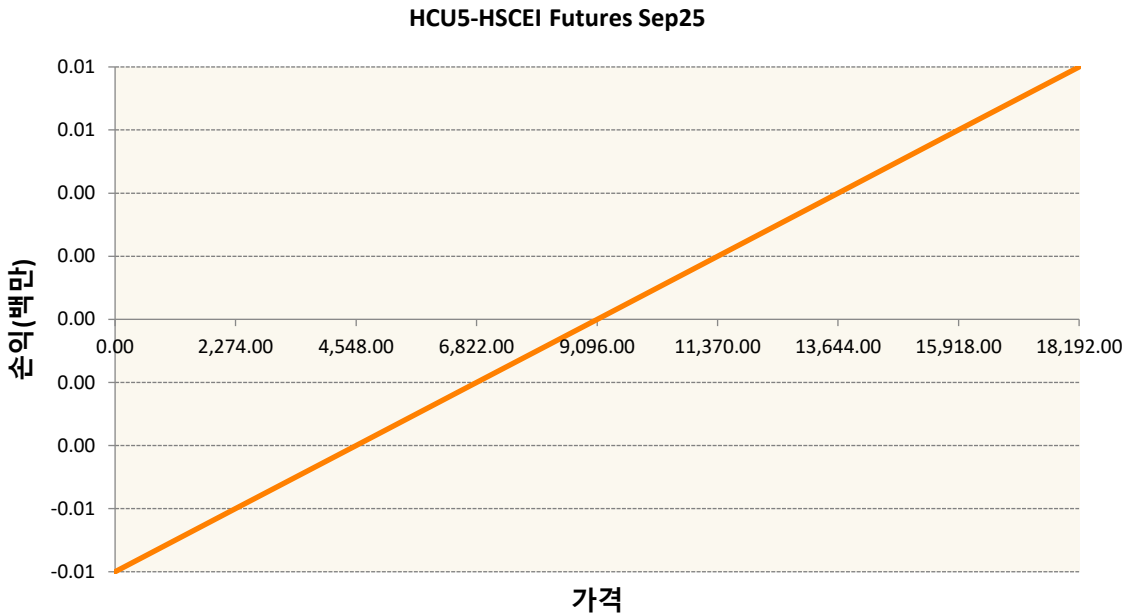
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,042	0	2,042	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

232

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

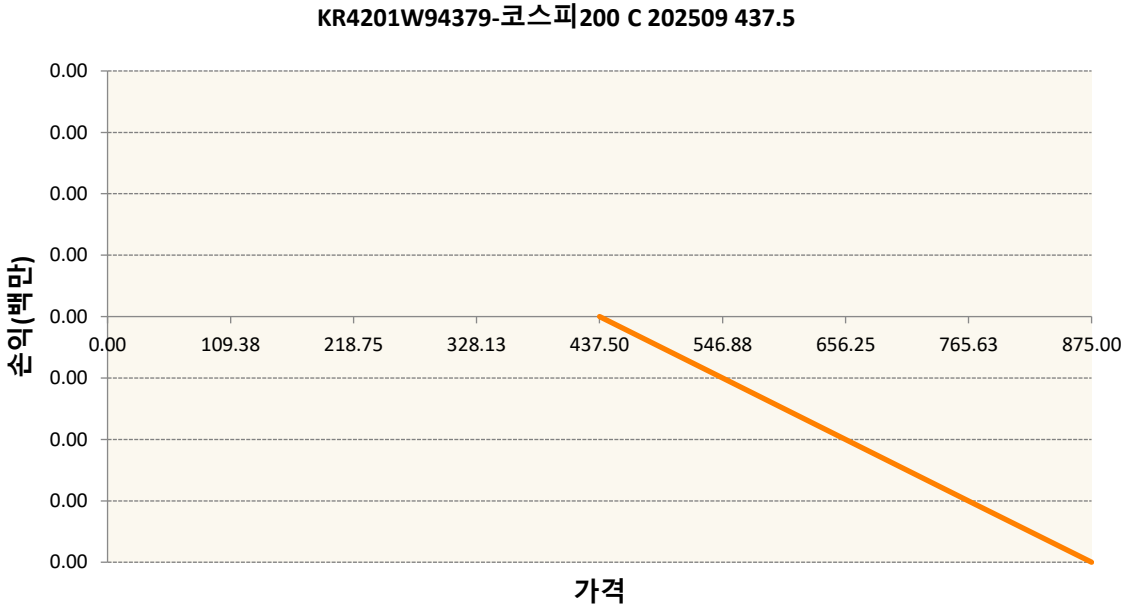
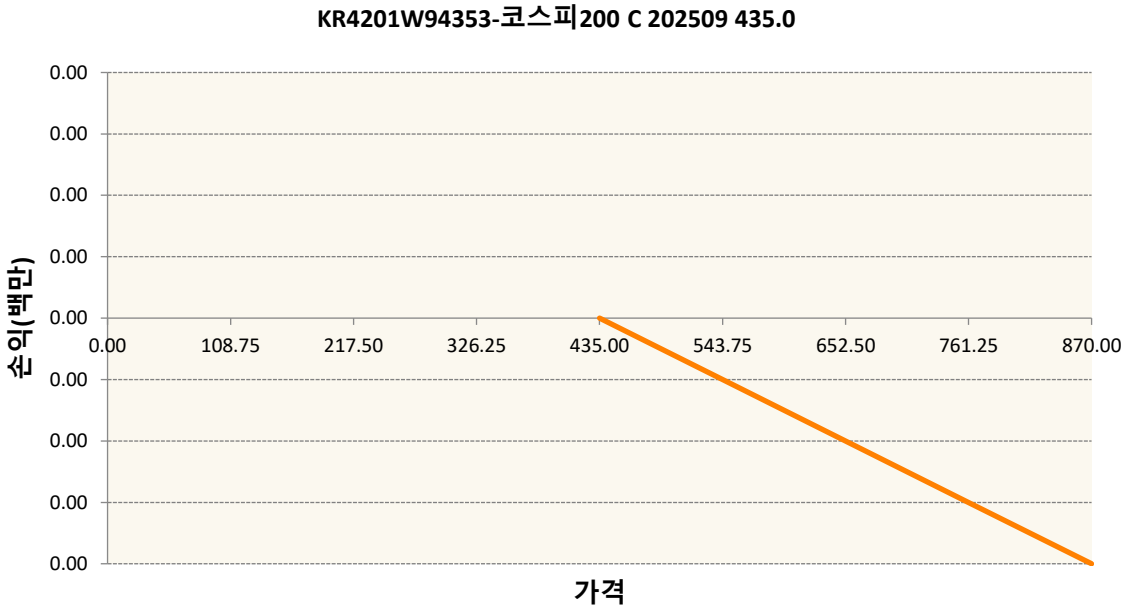
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

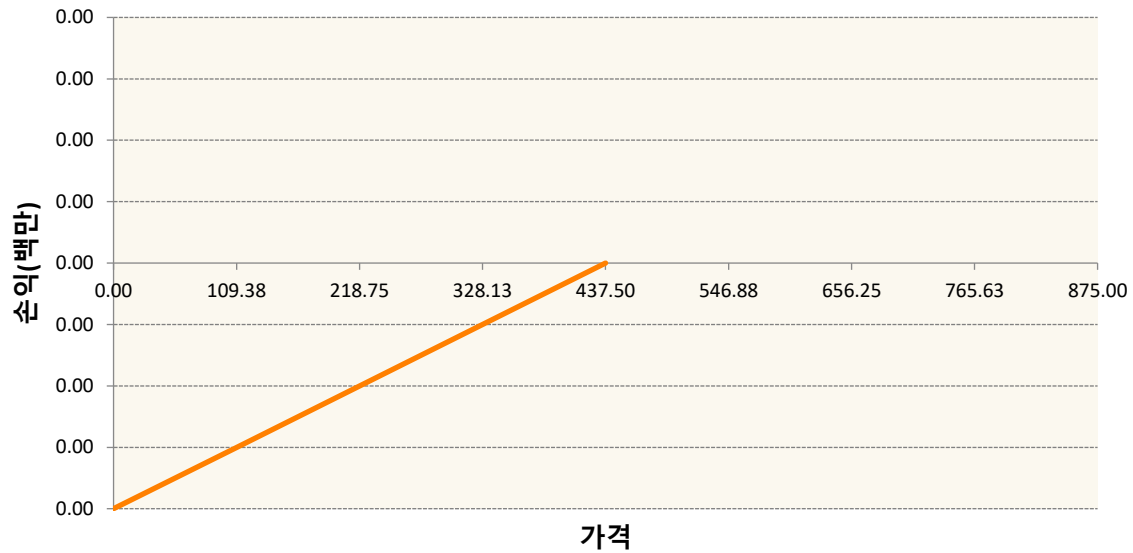
(단위:백만원)

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 2025-09-10

기준일 2025-09-09

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	2025-09-10
기준일	2025-09-09

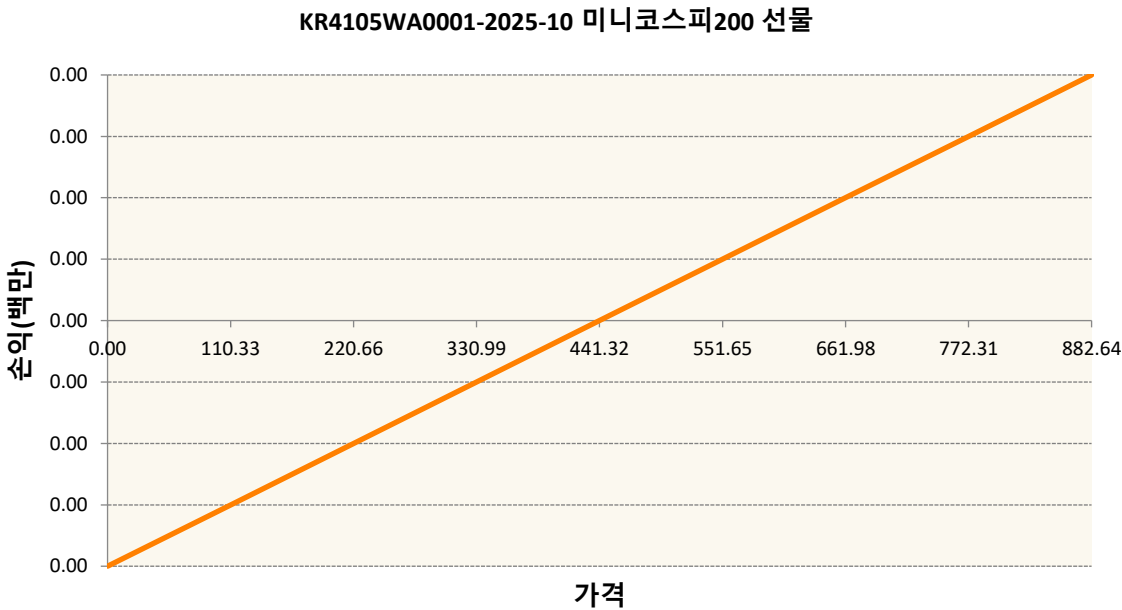
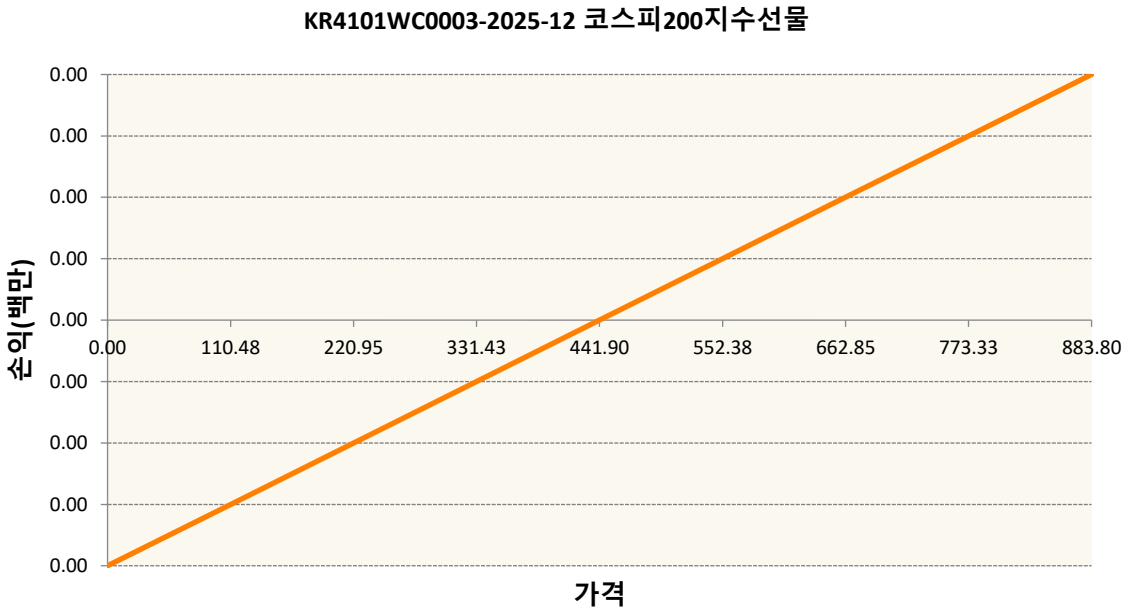
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

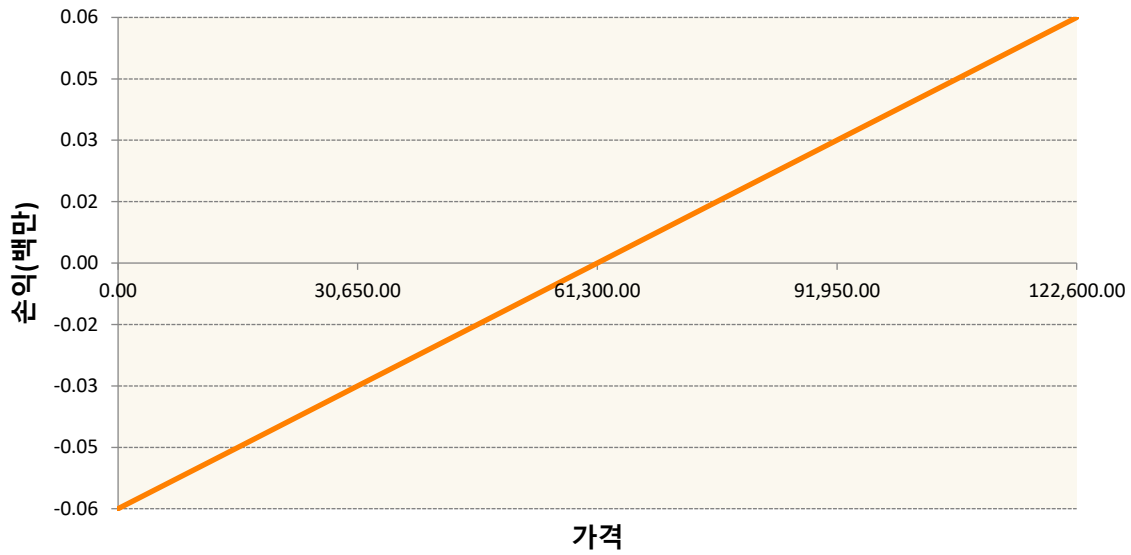
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	668	0	668	장내
누계	유가증권	선물	797	0	797	장내

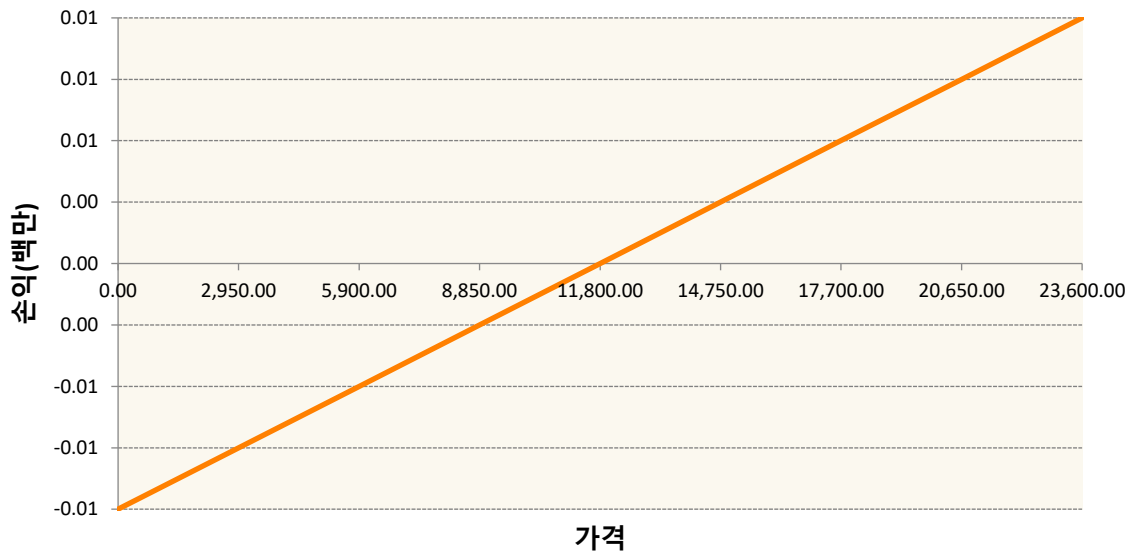
2. 만기시점의 손익구조



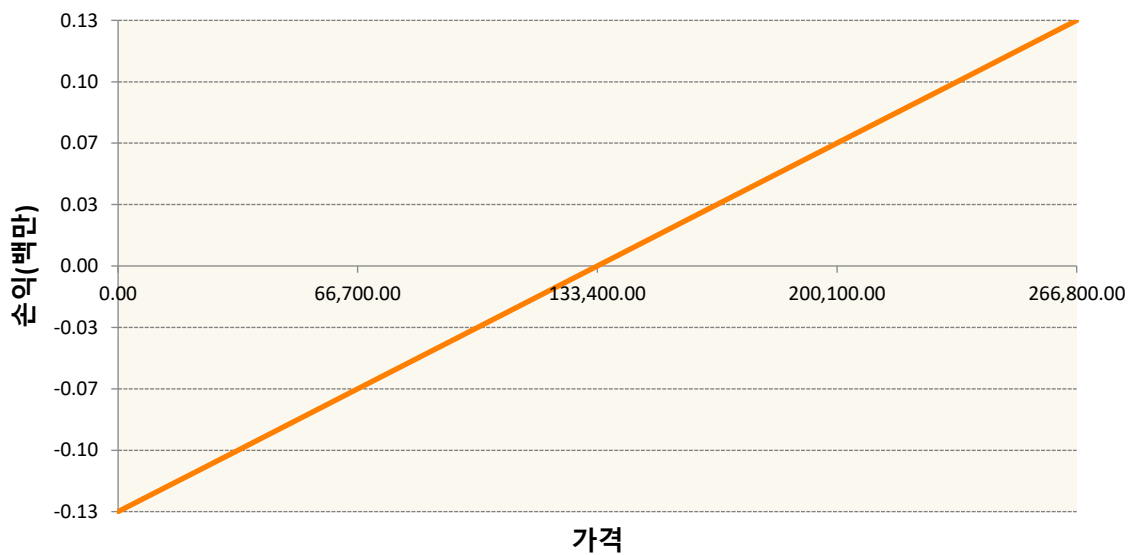
KR410FW90008-2025-09 두산로보틱스개별선물



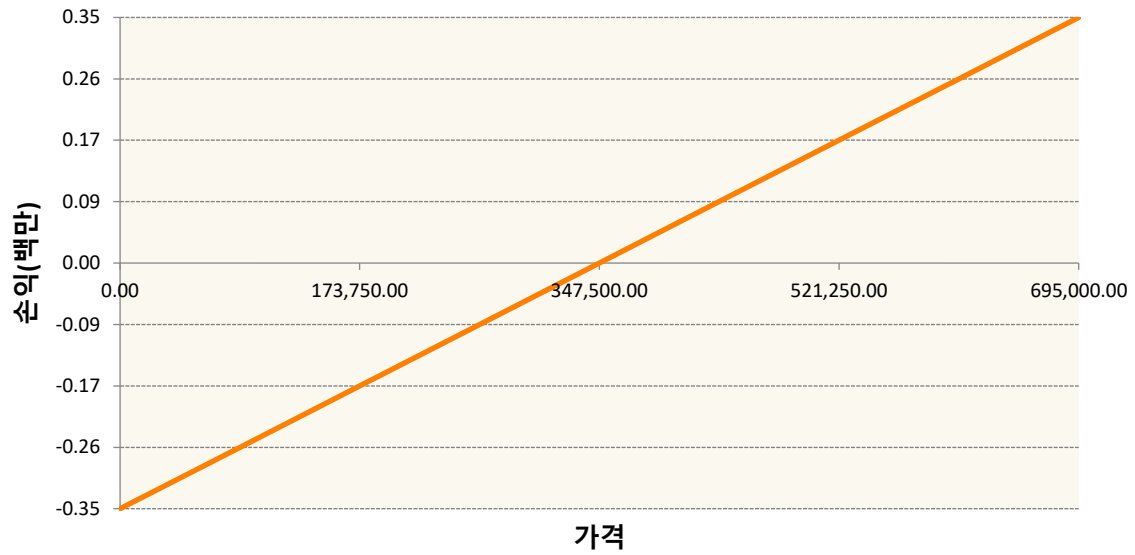
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



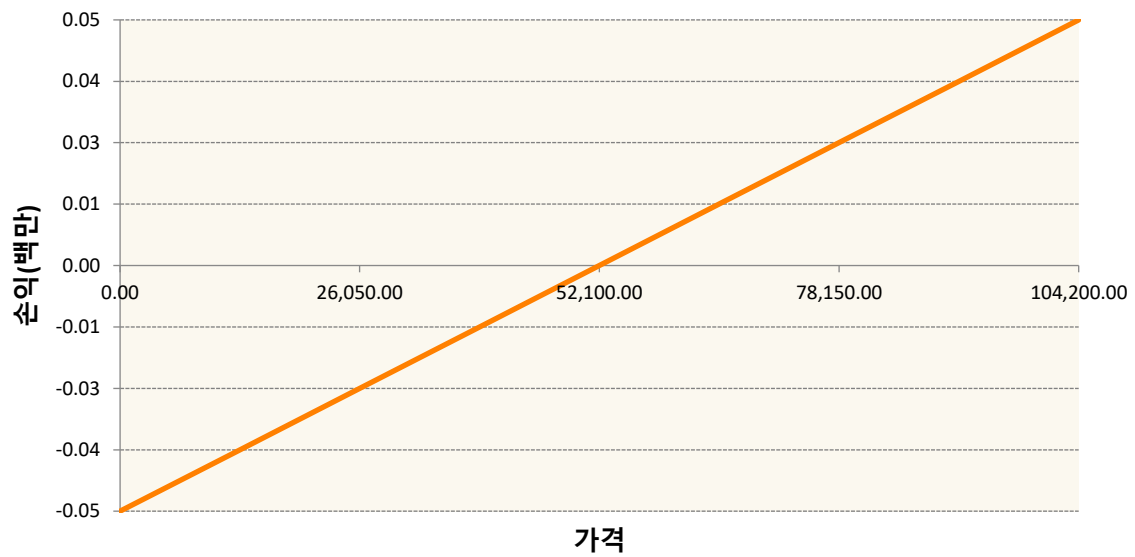
KR41E8W90007-2025-09 포스코퓨처엠개별선물



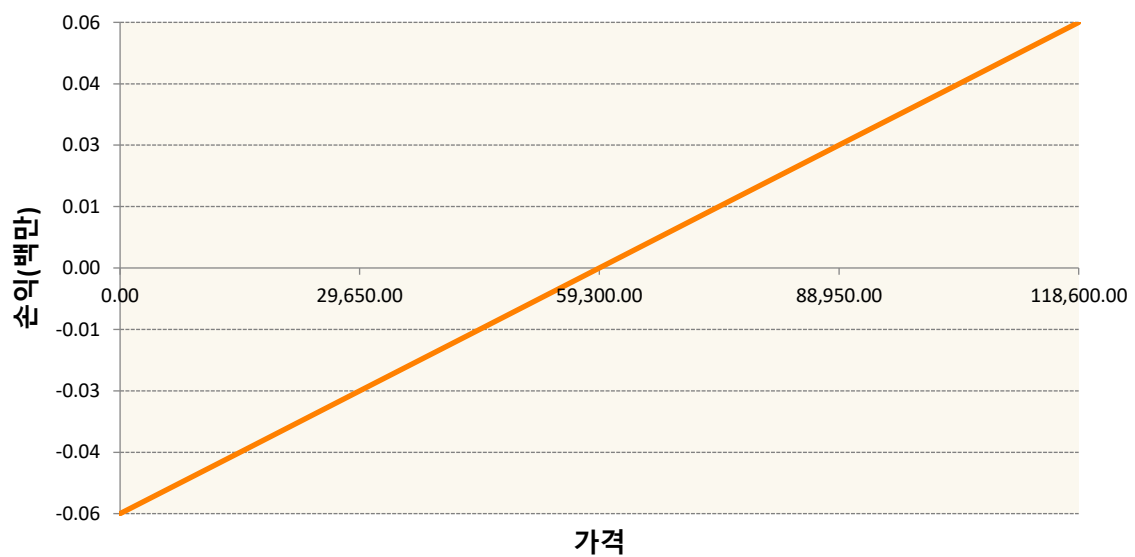
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



KR41F7W90008-2025-09 카카오페이개별선물



KR41FMWA0003-2025-10 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	44
KR4105WA0(2025-10 미니코스피200 선물	2
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
KR41FMWAC 2025-10 엘앤에프개별선물	1

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

32

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

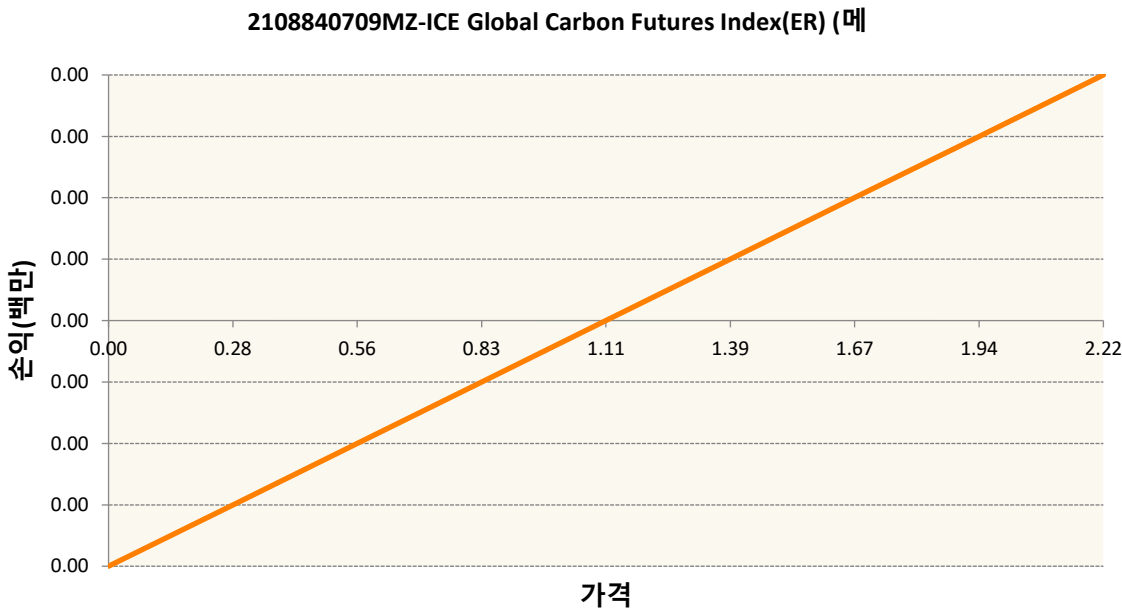
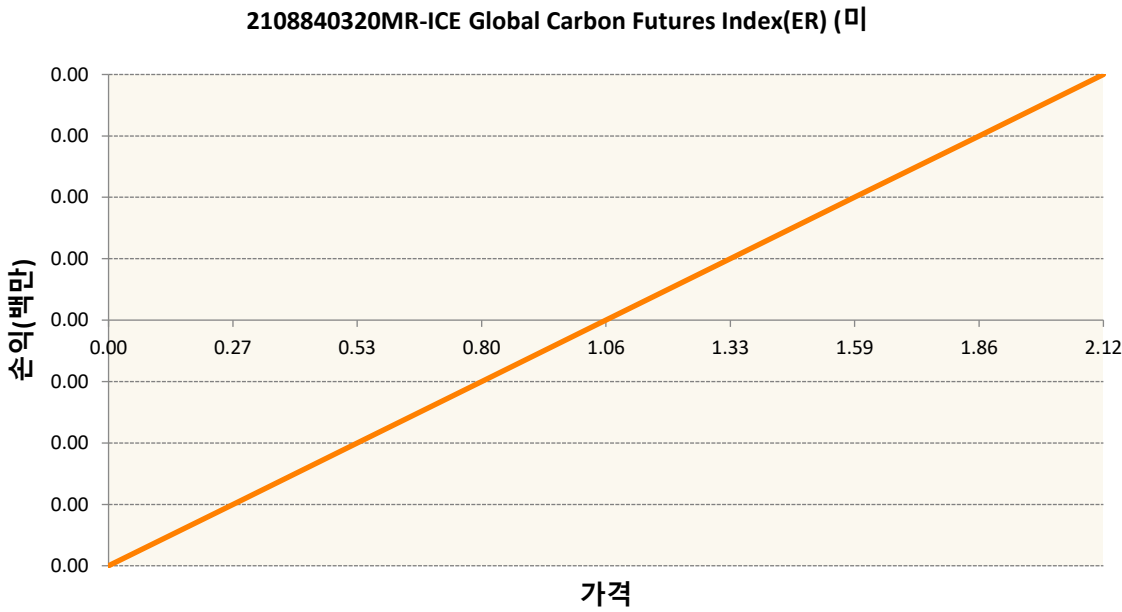
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	1,338	0	1,338	장외
누계	유가증권	선물	7,994	0	7,994	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840320	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	640
2108840709	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	766

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

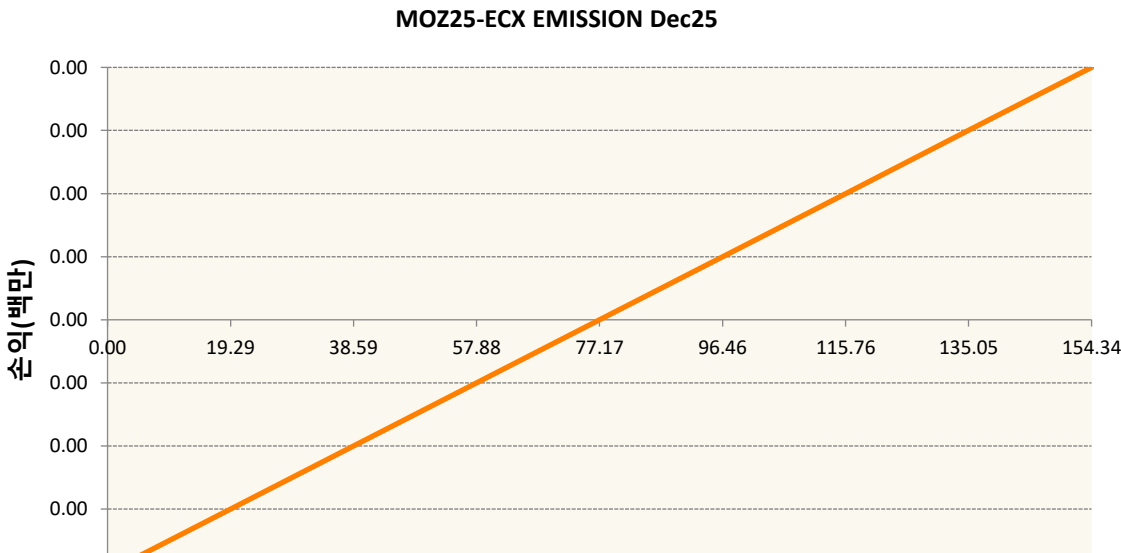
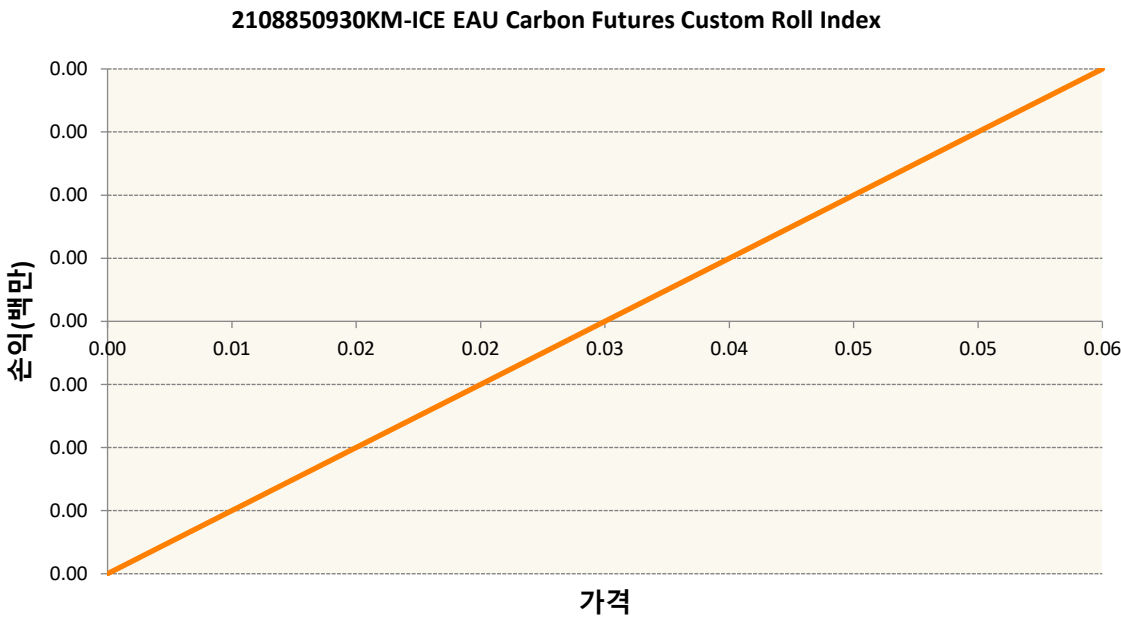
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	6,824	0	6,824	
누계	유가증권	선물	12	0	12	장외
누계	통화	선도	0	2,007	-2,007	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

1

161

546

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

(단위:백만원)

889

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

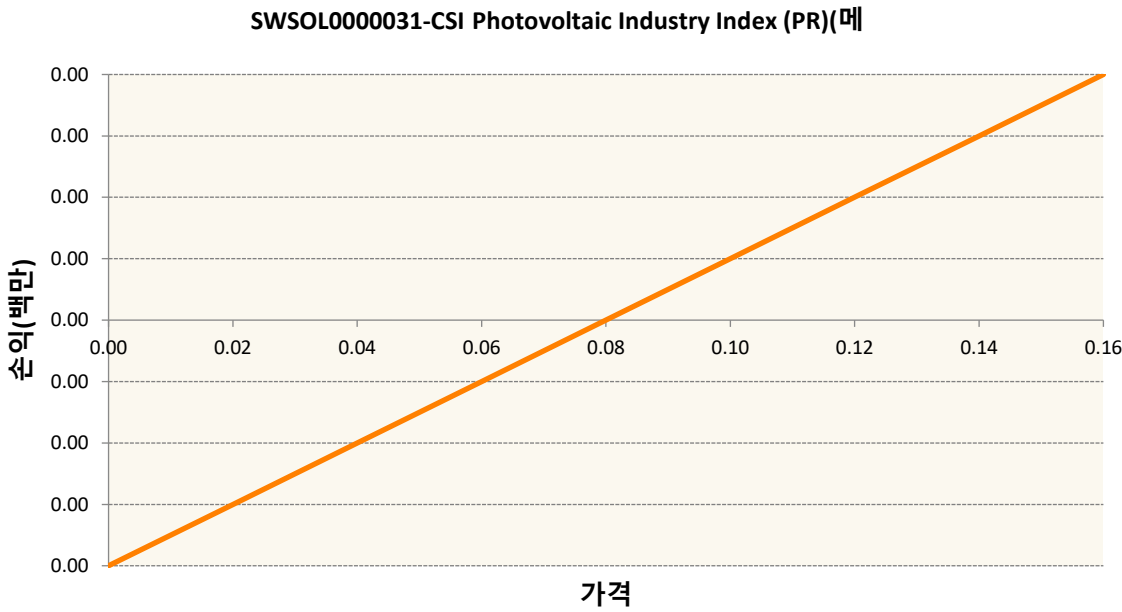
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,835	0	2,835	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (메리츠)	34
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	34
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	23
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	24
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)(메	6

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

(단위:백만원)

207

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

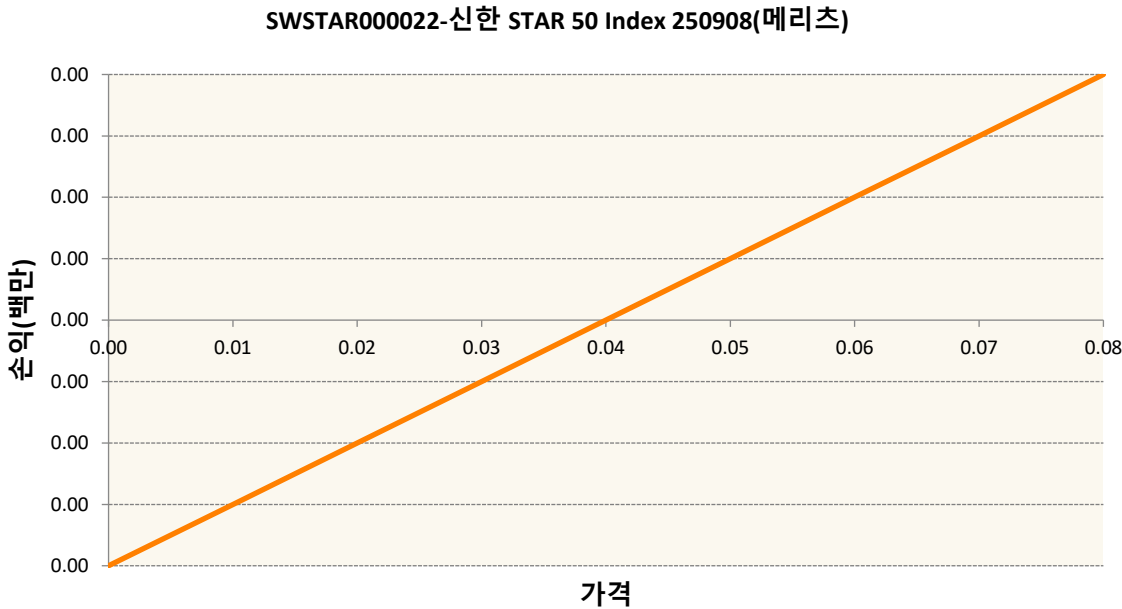
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	7,553	0	7,553	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(미래)	61
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(메리츠)	73
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	52
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 250903(메리츠)	10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 250908(메리츠)	12

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

(단위:백만원)

390

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

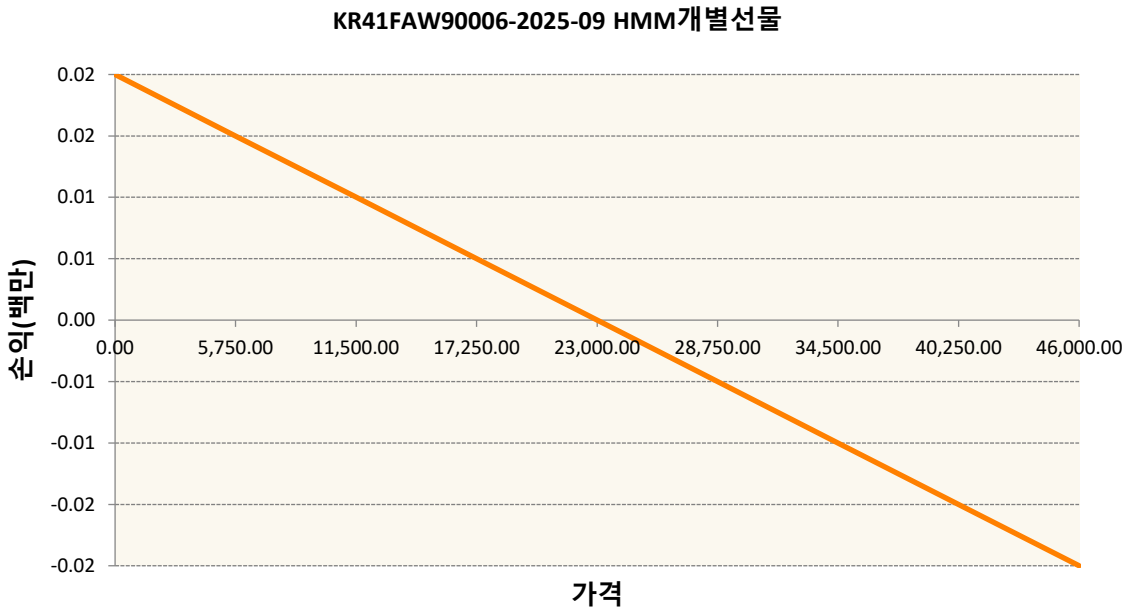
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	4	-4	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR41FAW90(2025-09 HMM개별선물

0.33

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

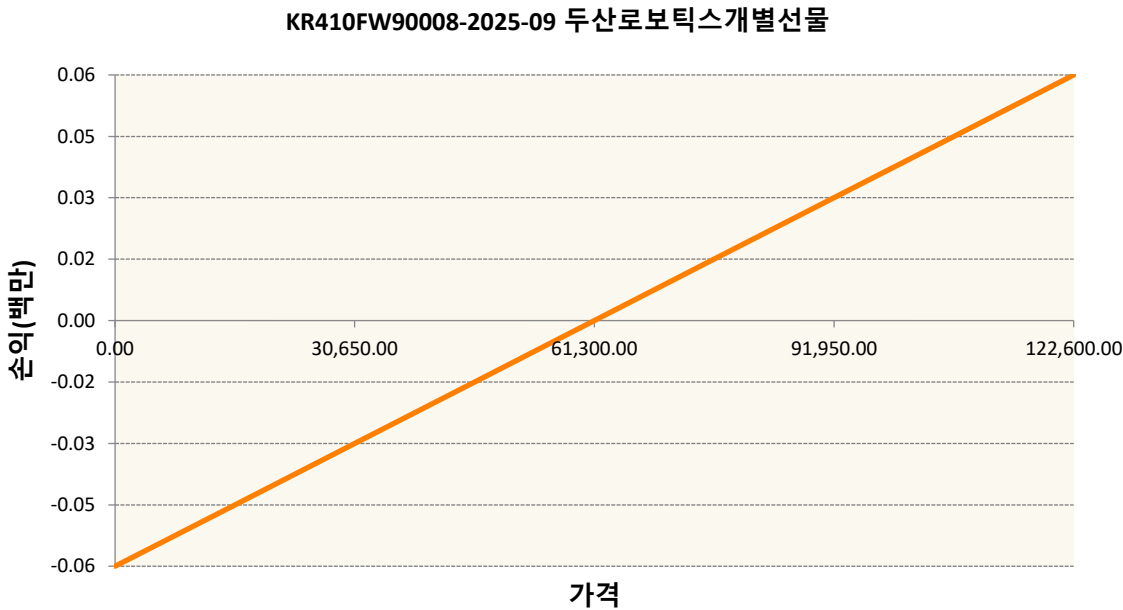
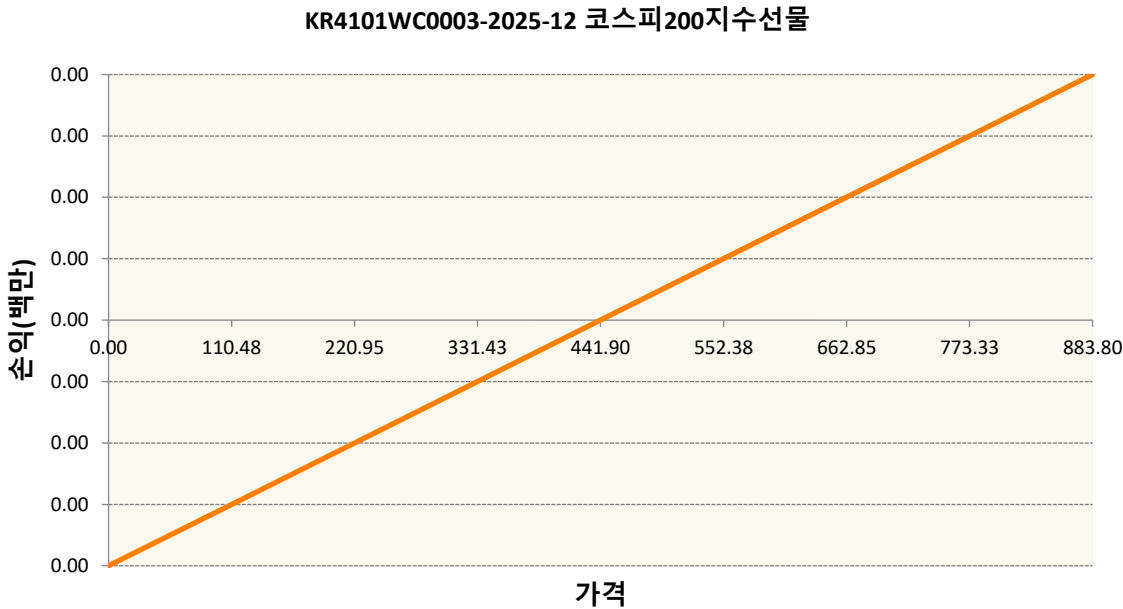
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

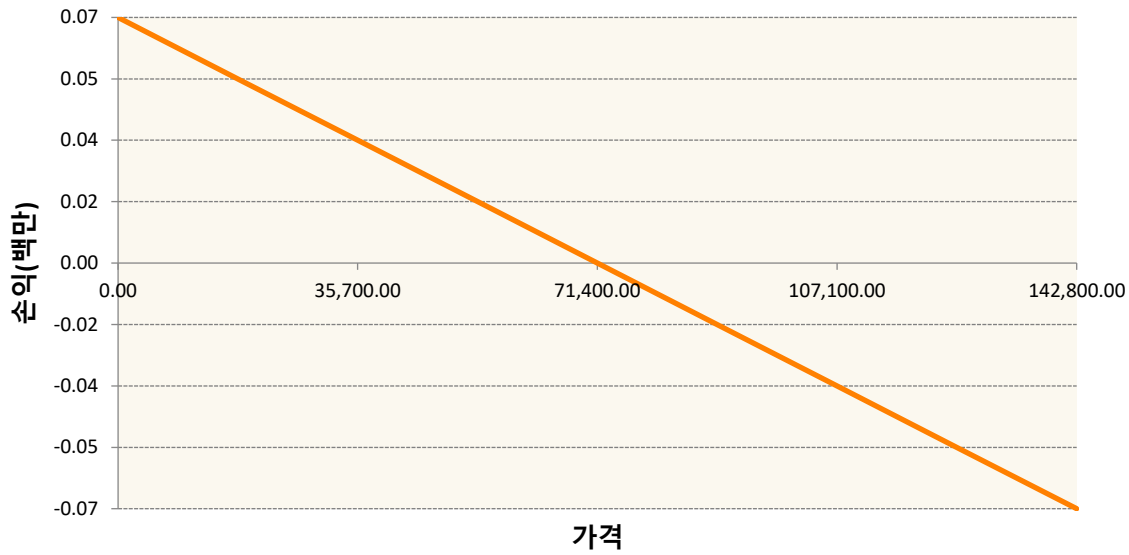
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	8,885	772	8,112	장내
누계	유가증권	선물	12,373	1,071	11,302	장내

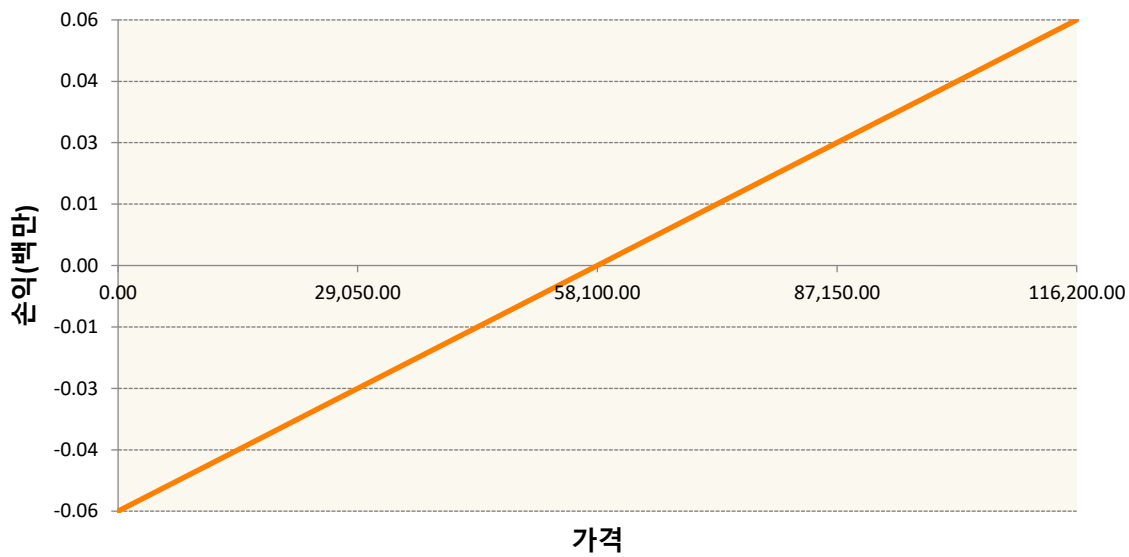
2. 만기시점의 손익구조



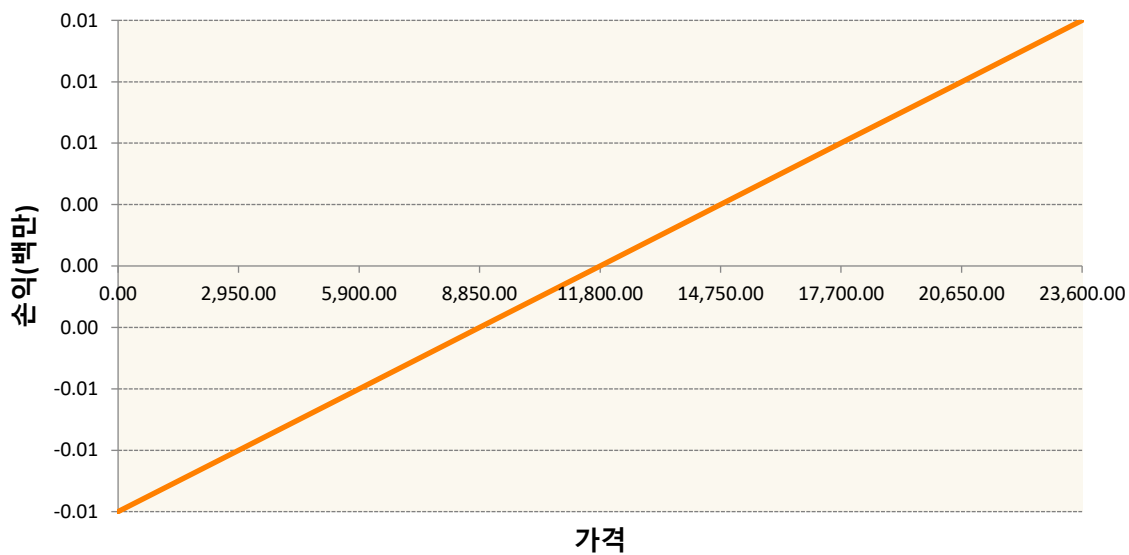
KR4111W90006-2025-09 삼성전자개별선물



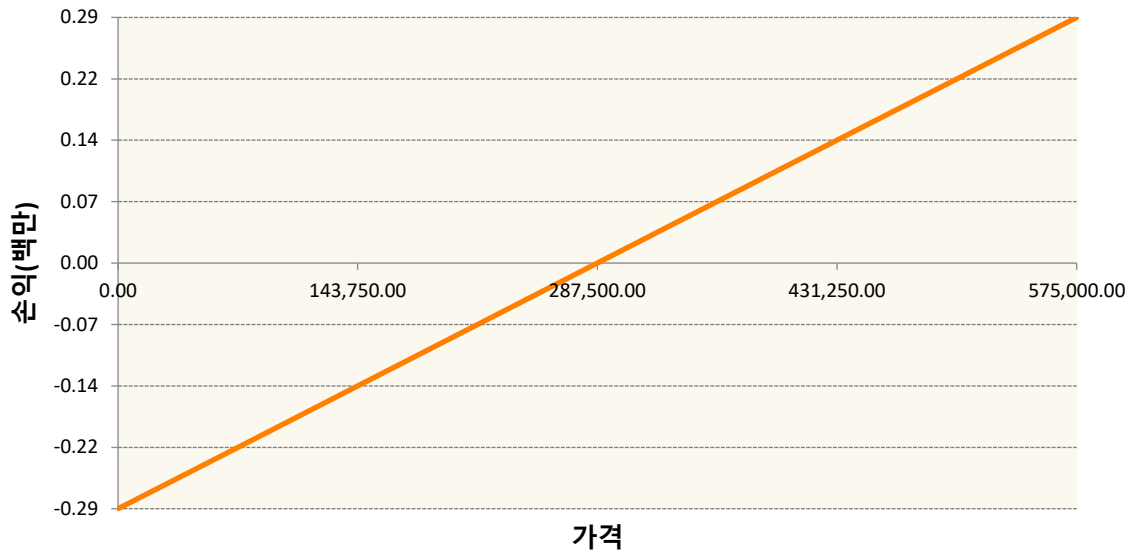
KR411RW90001-2025-09 한화비전개별선물



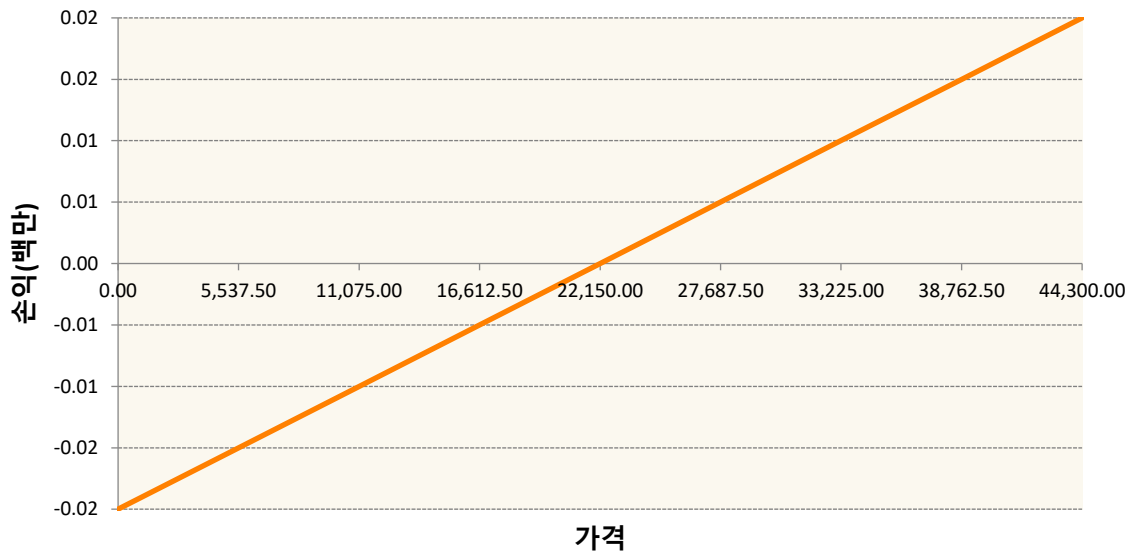
KR4145W90004-2025-09 LG디스플레이개별선물



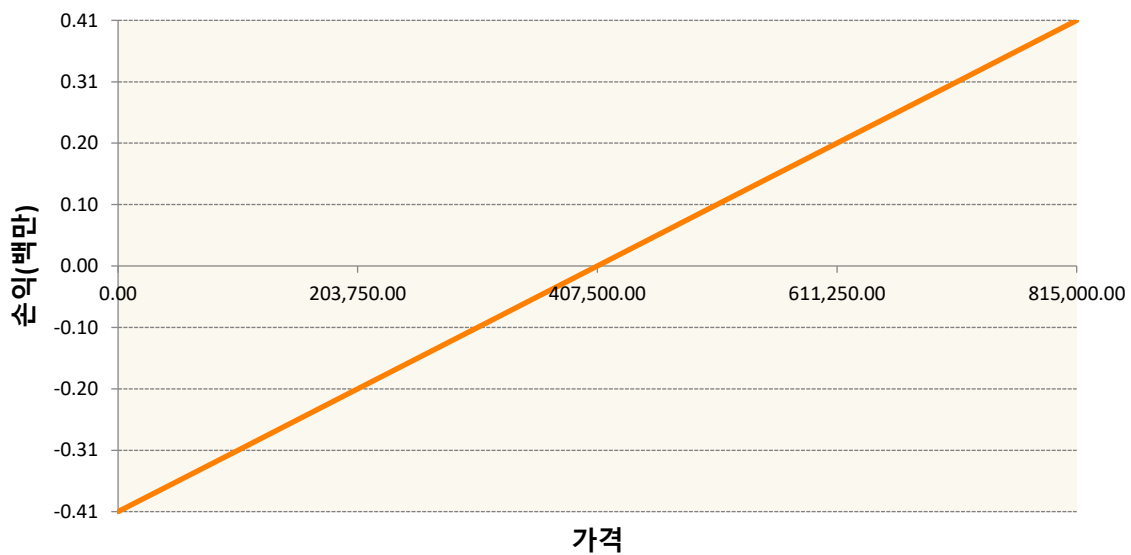
KR4150W90004-2025-09 SK하이닉스개별선물



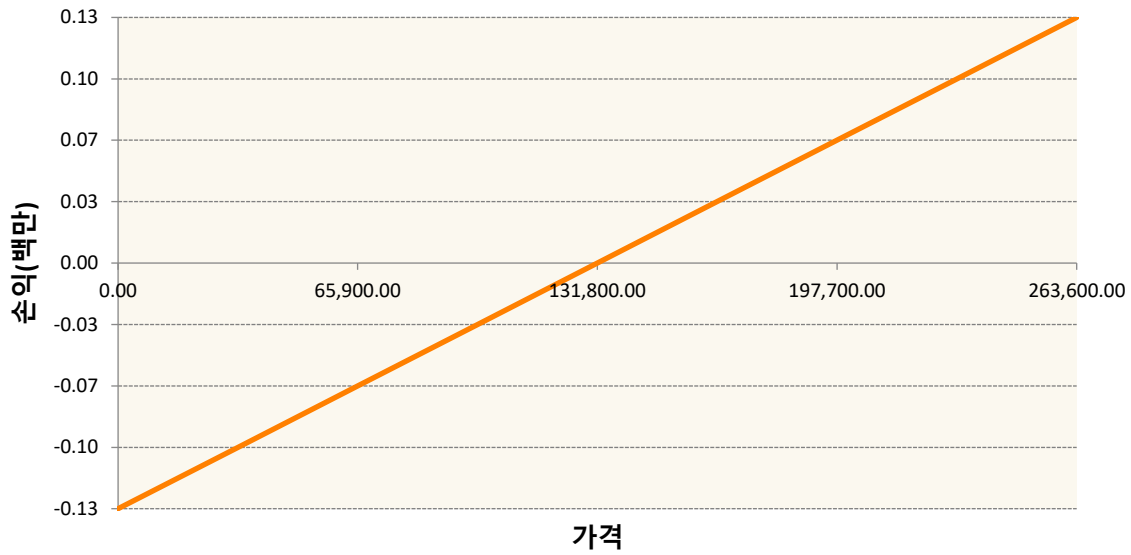
KR41CNW90006-2025-09 포스코DX개별선물



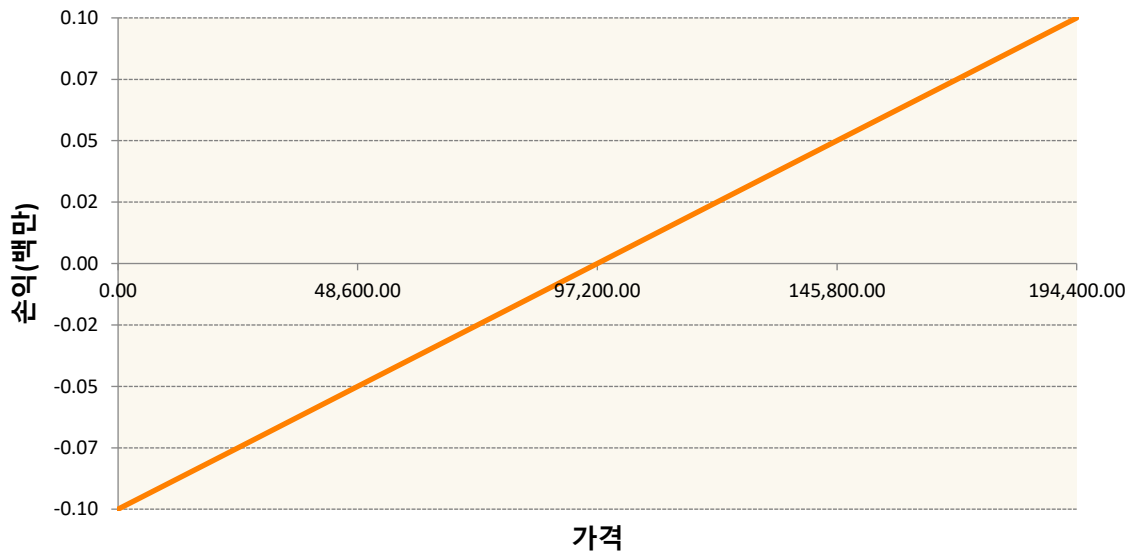
KR41DAW90001-2025-09 농심개별선물



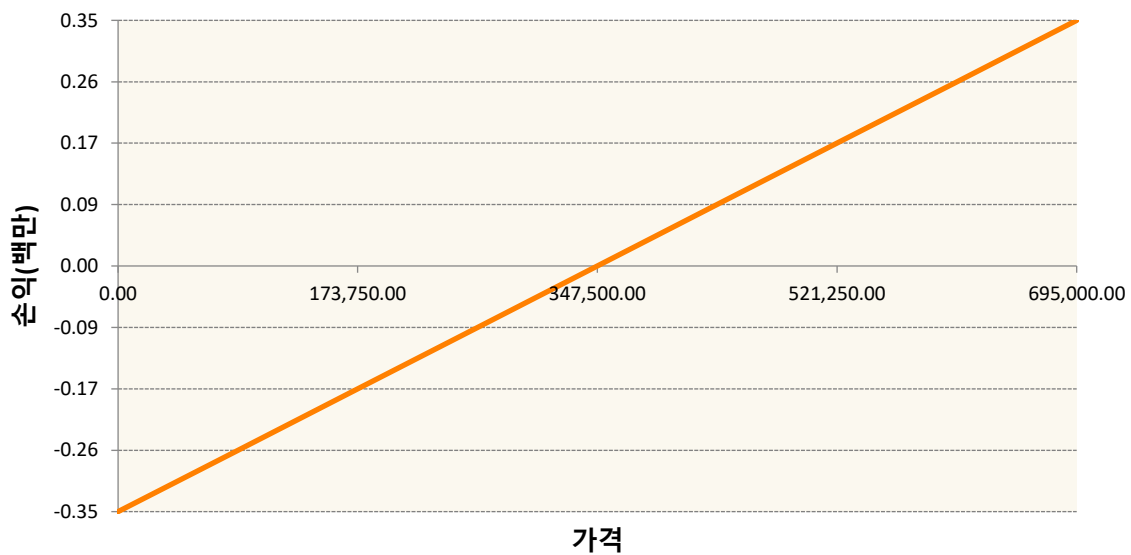
KR41E8WA0008-2025-10 포스코퓨처엠개별선물



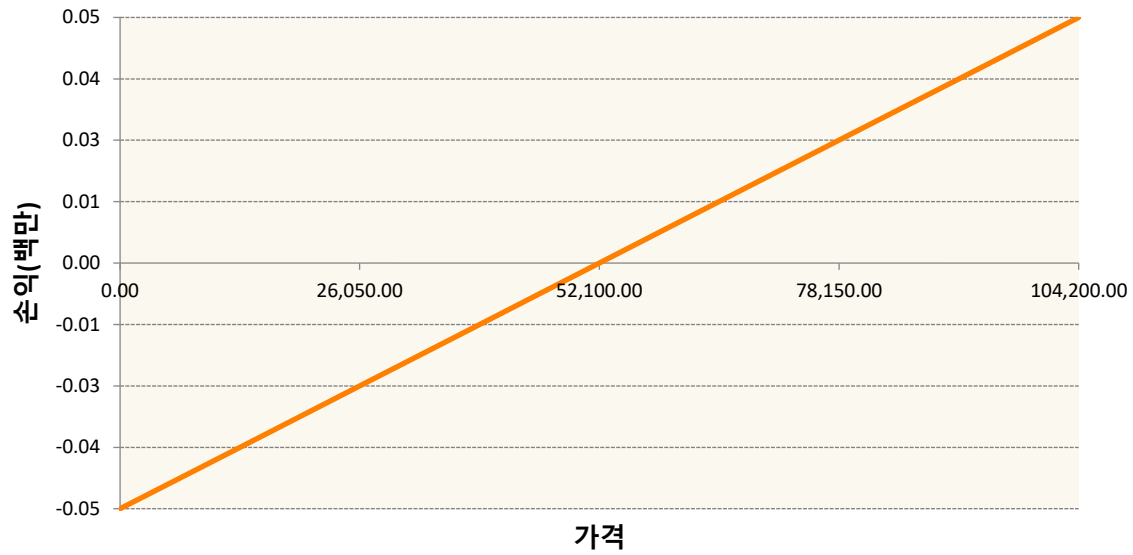
KR41EJWA0009-2025-10 SKC개별선물



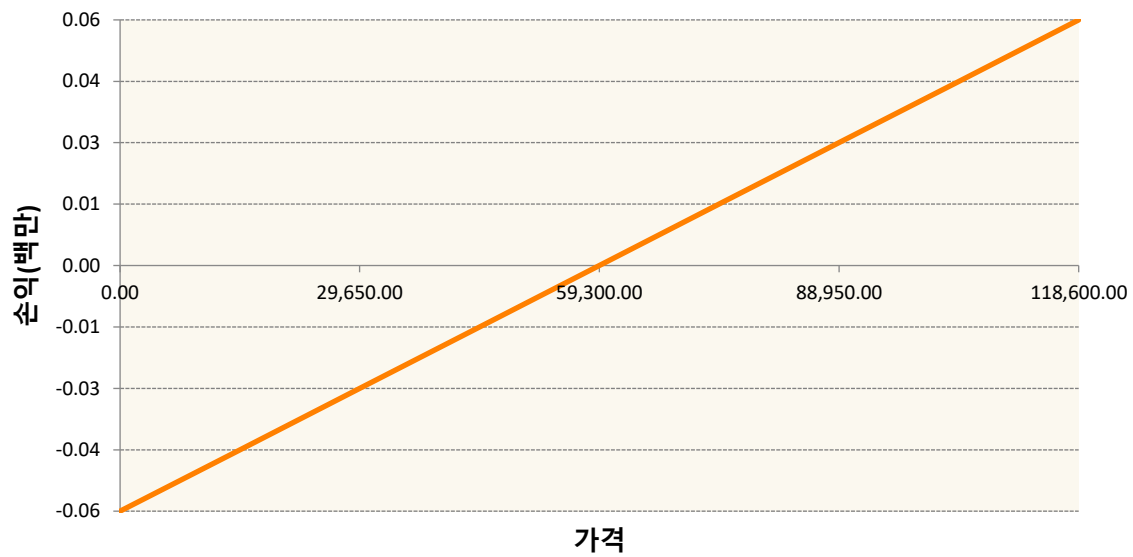
KR41F5W90002-2025-09 LG에너지솔루션개별선물



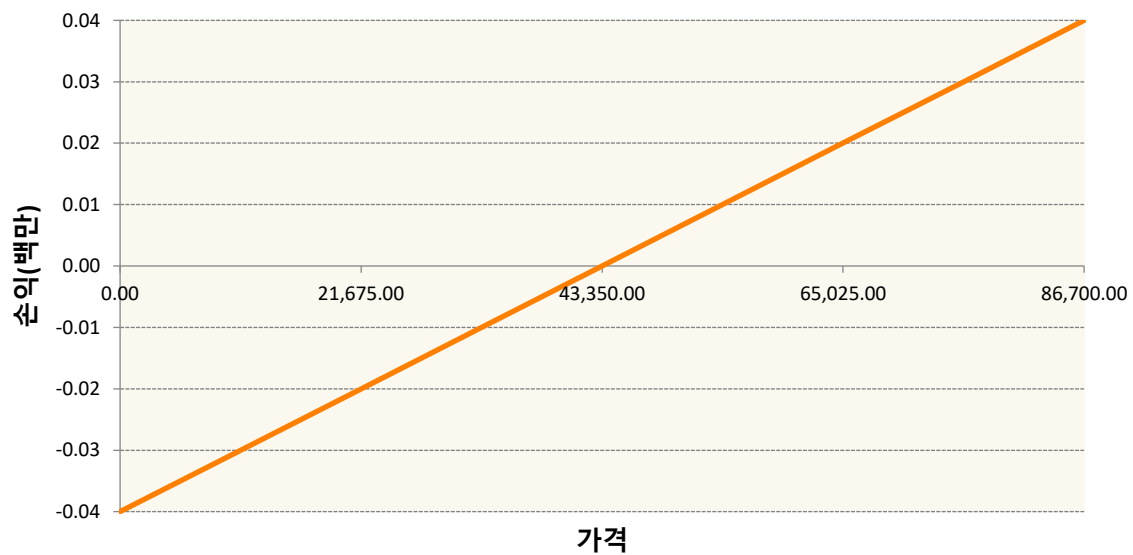
KR41F7WA0006-2025-10 카카오페이개별선물



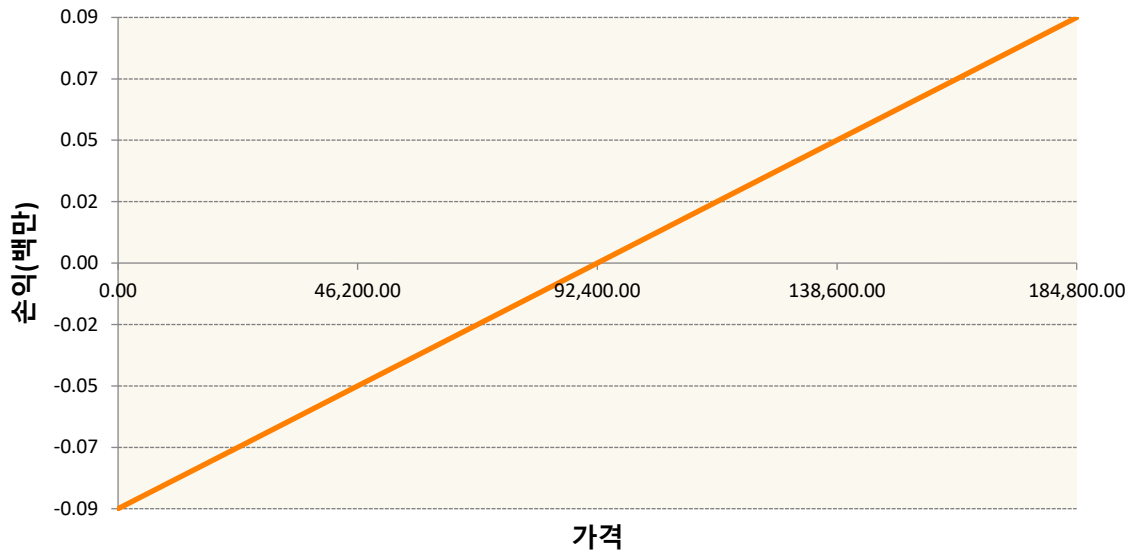
KR41FMWA0003-2025-10 엘앤에프개별선물



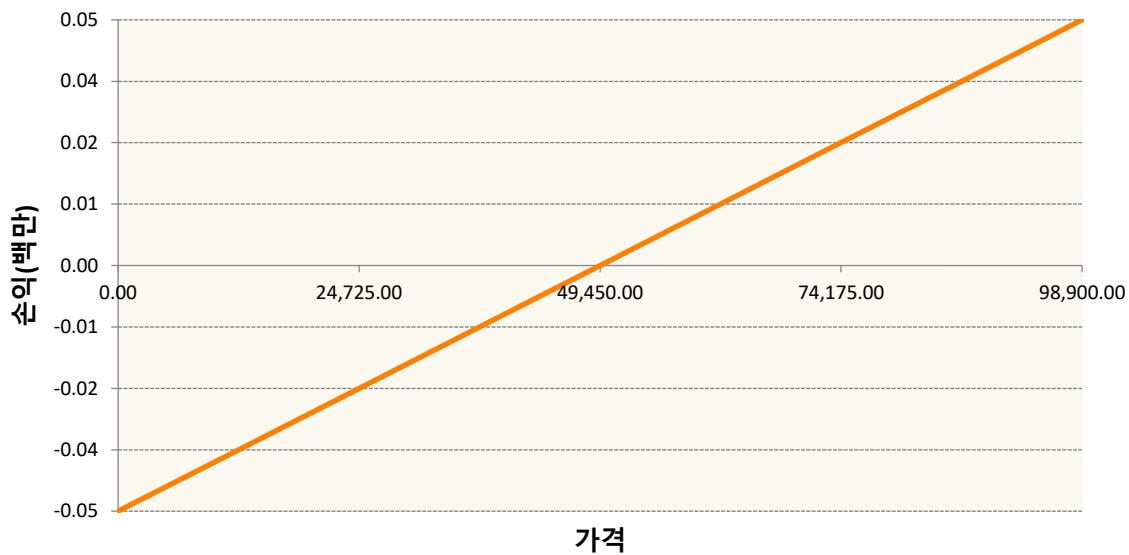
KR41G0W90002-2025-09 씨에스원드개별선물



KR41G3W90006-2025-09 한전기술개별선물



KR41GZW90001-2025-09 에코프로머티개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	583
KR410FW90(2025-09 두산로보틱스개별선물	13
KR4111W90(2025-09 삼성전자개별선물	86
KR411RW90(2025-09 한화비전개별선물	2
KR4145W90(2025-09 LG디스플레이개별선물	24
KR4150W90(2025-09 SK하이닉스개별선물	92
KR41CNW90 2025-09 포스코DX개별선물	12
KR41DAW90 2025-09 농심개별선물	4
KR41E8WA0(2025-10 포스코퓨처엠개별선물	37
KR41EJWA0(2025-10 SKC개별선물	20
KR41F5W90(2025-09 LG에너지솔루션개별선물	138
KR41F7WA0(2025-10 카카오페이개별선물	15

KR41FMWAC 2025-10 엘앤에프개별선물
 KR41G0W90 2025-09 씨에스원드개별선물
 KR41G3W90 2025-09 한전기술개별선물
 KR41GZW90 2025-09 에코프로머티개별선물

15
4
19
12

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

(단위:백만원)

912

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

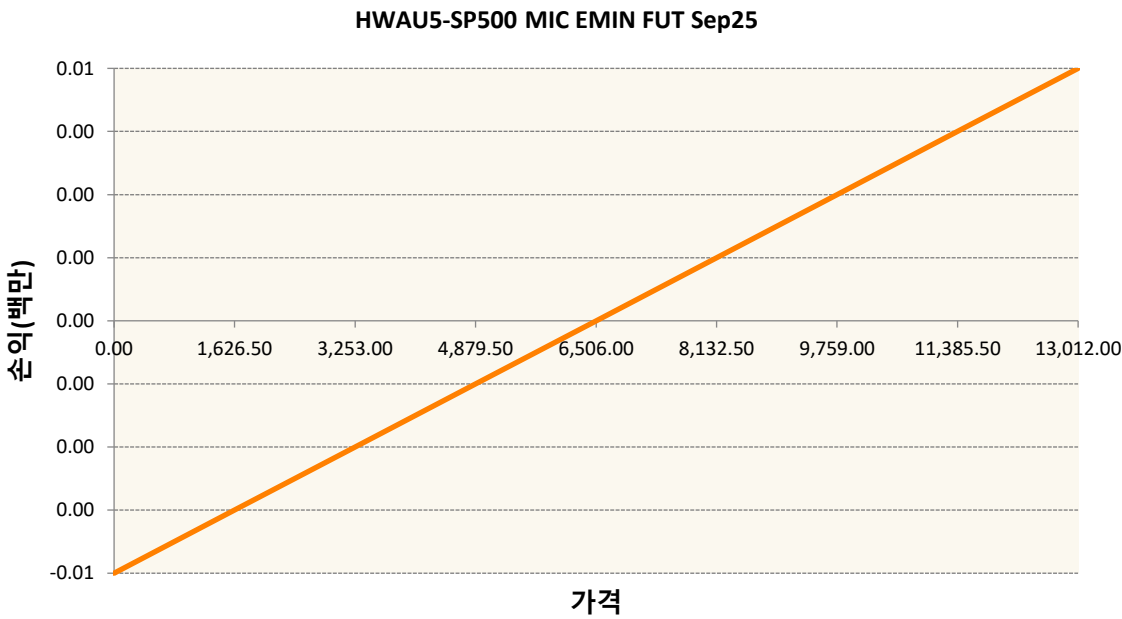
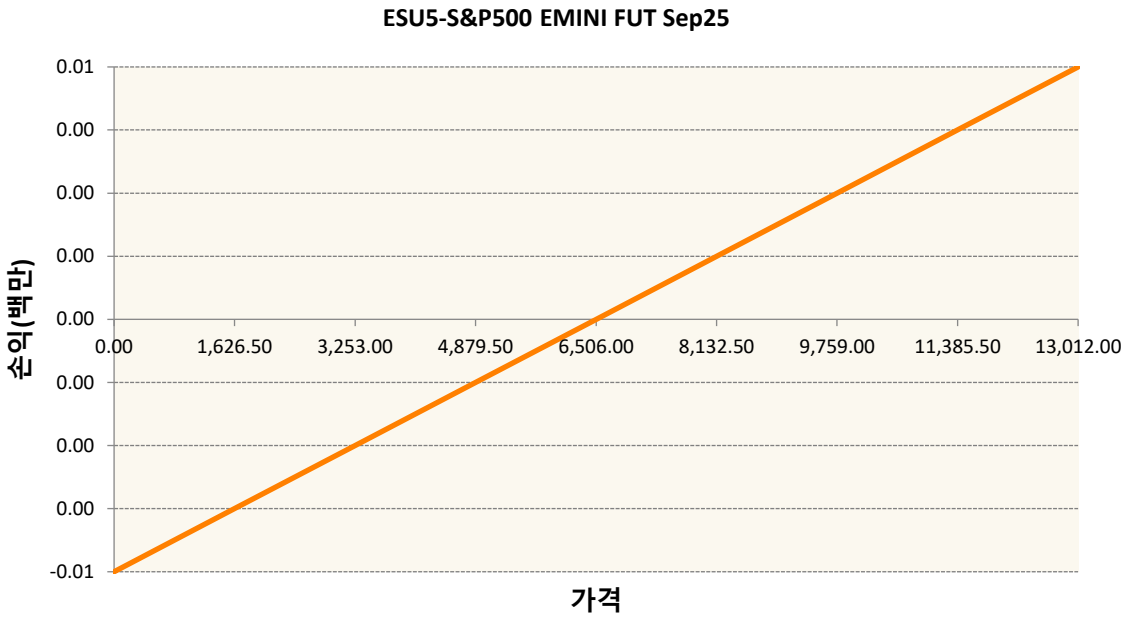
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	34,138	0	34,138	
누계	지수	선물	1,210	0	1,210	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU5	S&P500 EMINI FUT Sep25	2,731
HWAU5	SP500 MIC EMIN FUT Sep25	97

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,476

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

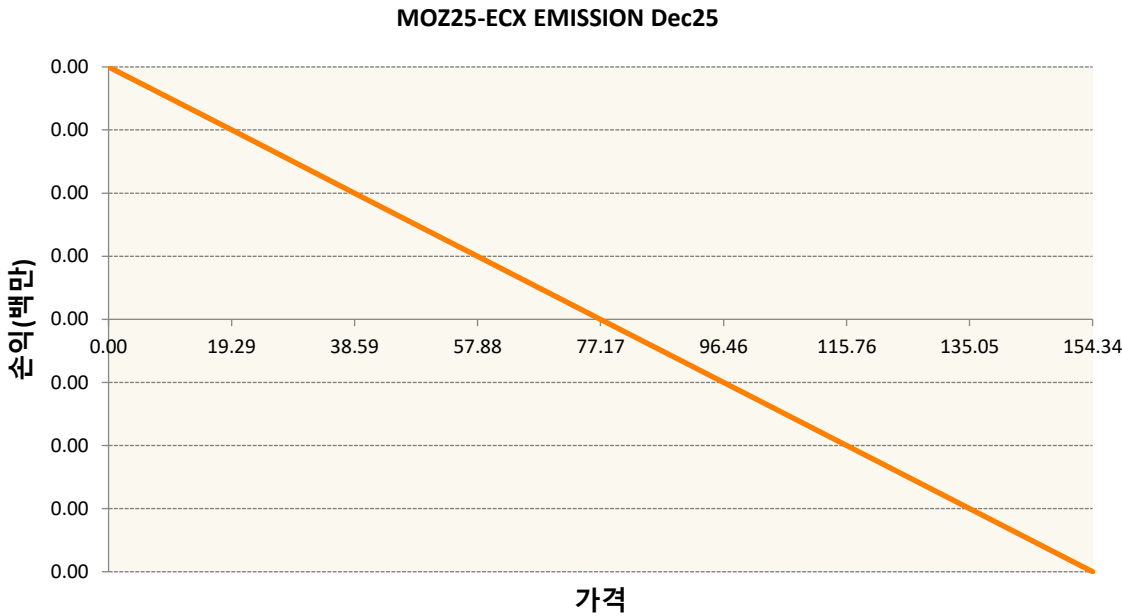
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	3,964	-3,964	
누계	유가증권	선물	-16	0	-16	장외
누계	통화	선도	0	1,214	-1,214	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930930IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E	97
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	317

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

(단위:백만원)

520

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

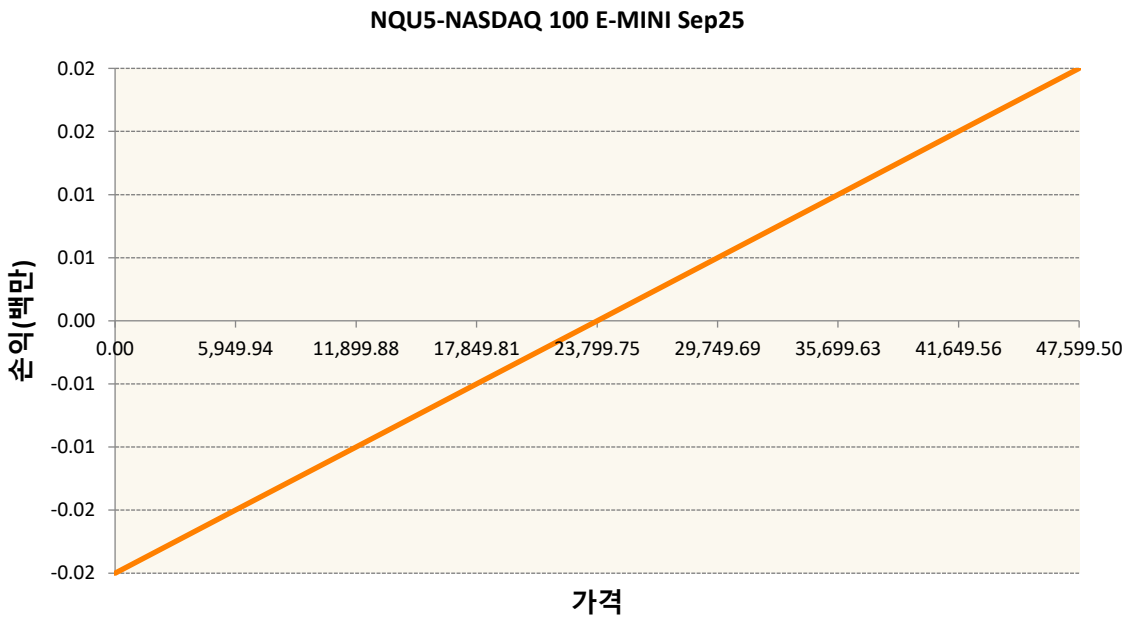
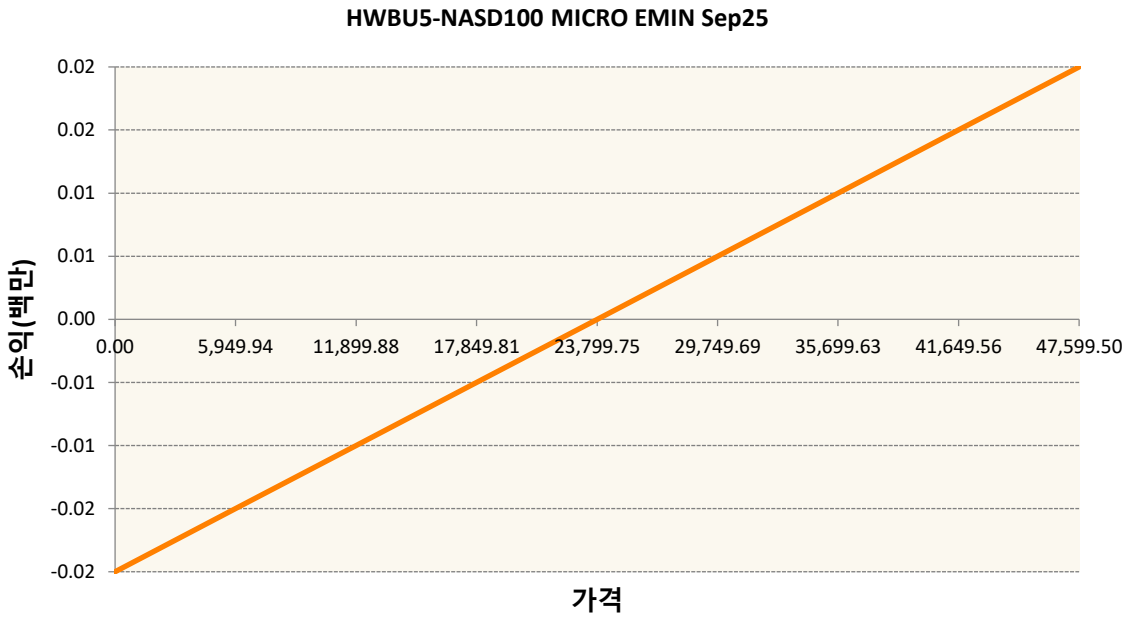
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	13,799	0	13,799	
누계	지수	선물	1,717	0	1,717	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU5	NASD100 MICRO EMIN Sep25		137
NQU5	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		1,104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,406

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

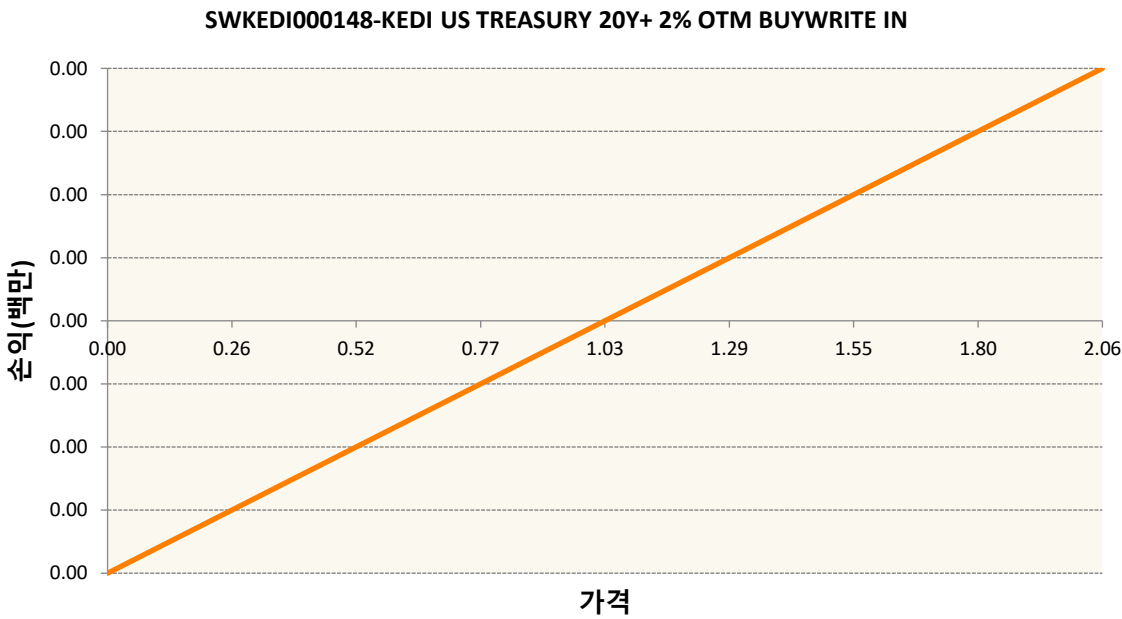
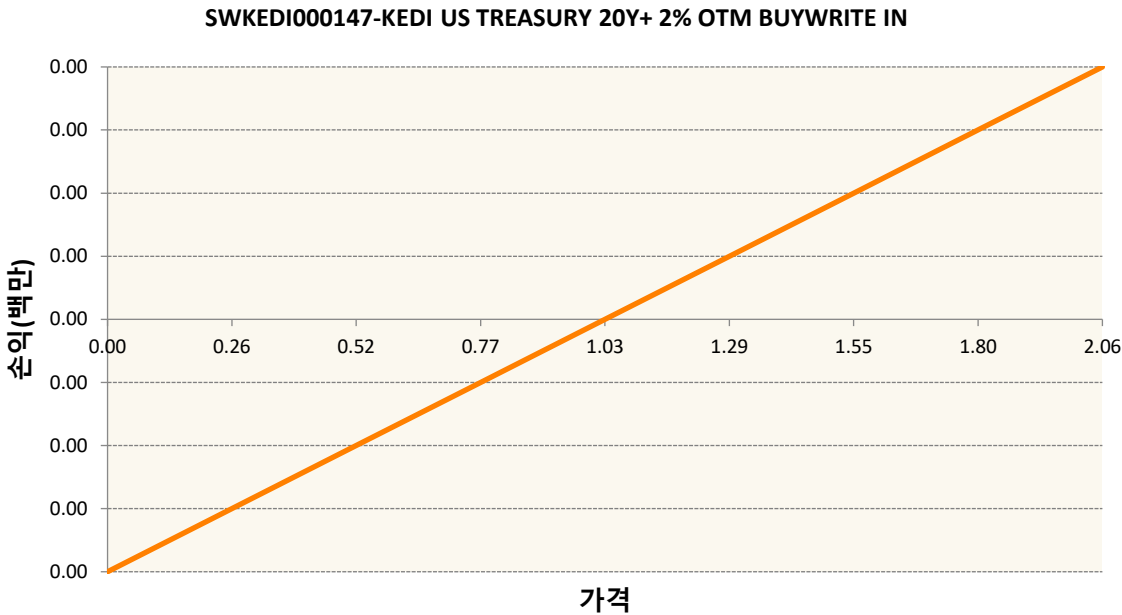
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

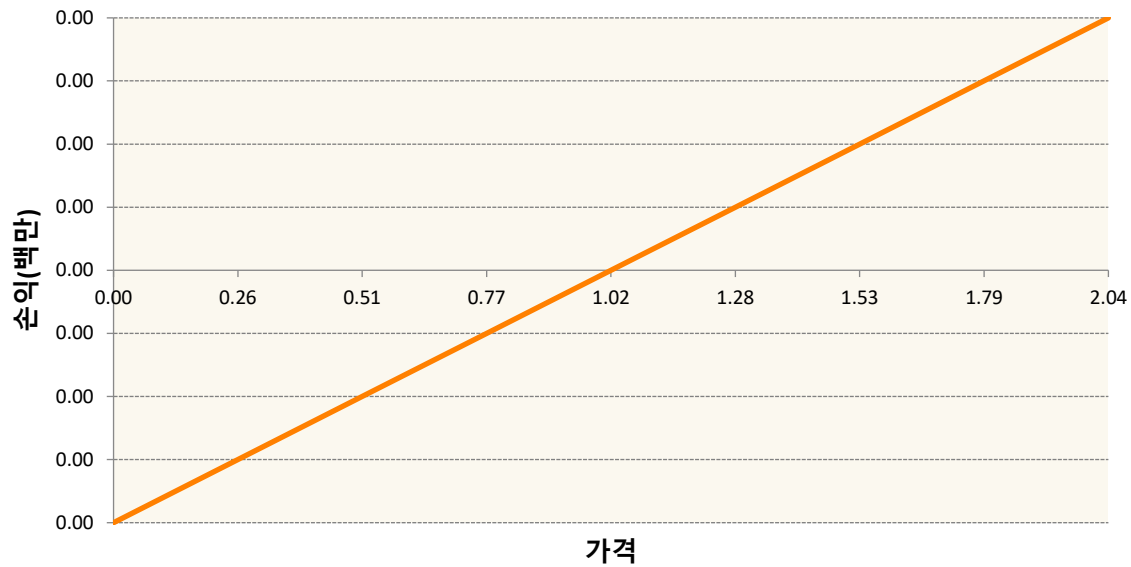
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	356,294	0	356,294	장외

2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000150-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

8,029
9,640
3,570
7,617

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

(단위:백만원)

14,273

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

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	17
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	17
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	17
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	17

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

(단위:백만원)

92

공시일	2025-09-10
기준일	2025-09-09

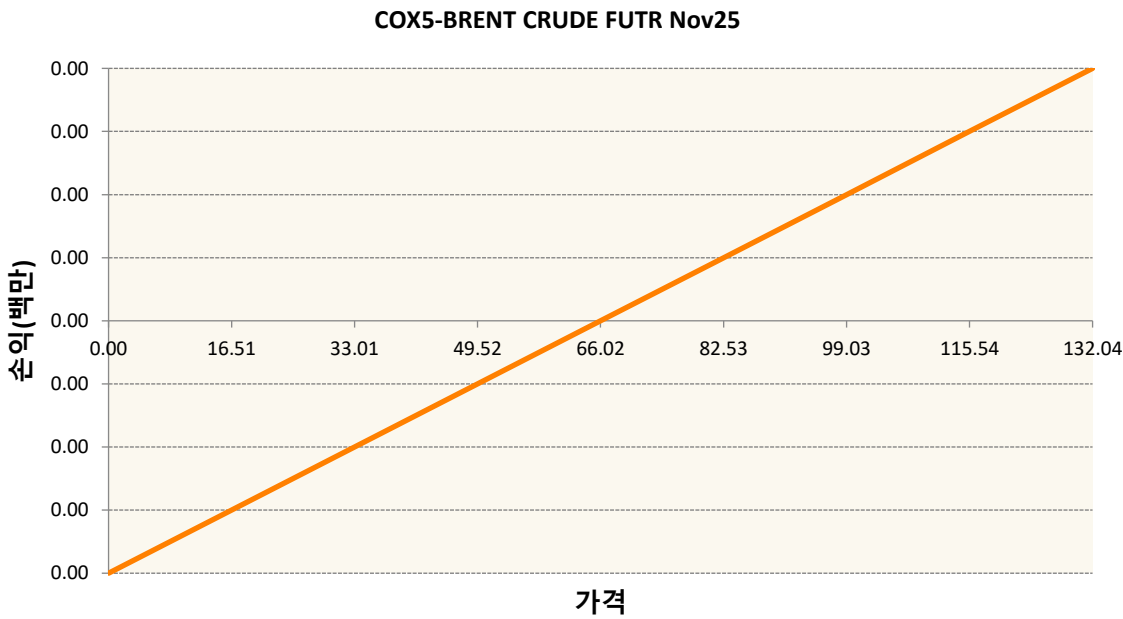
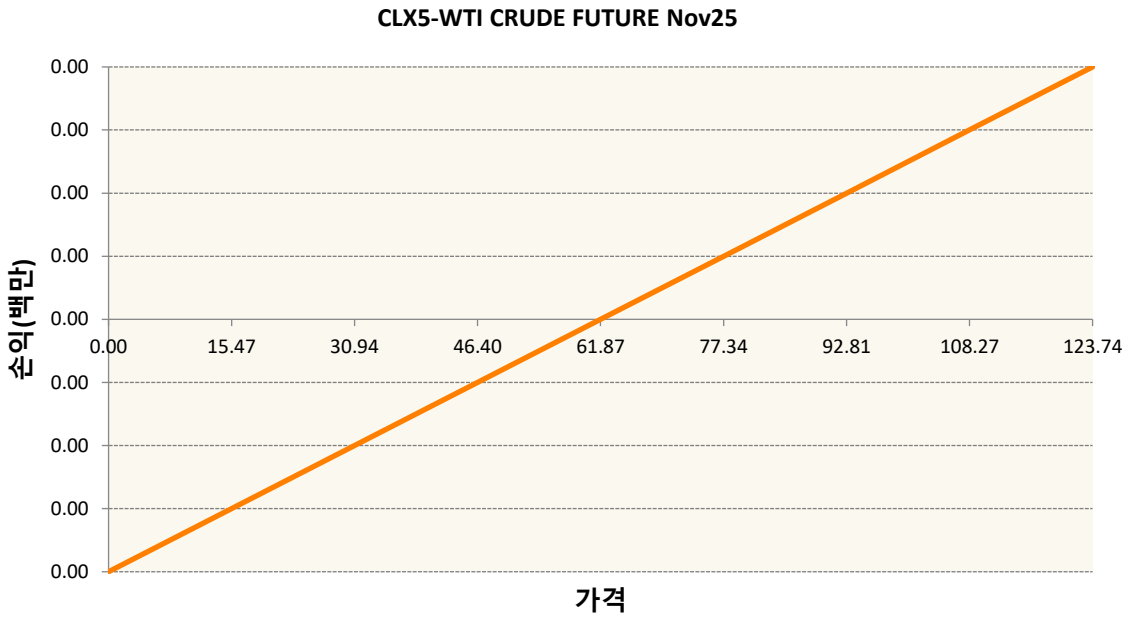
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

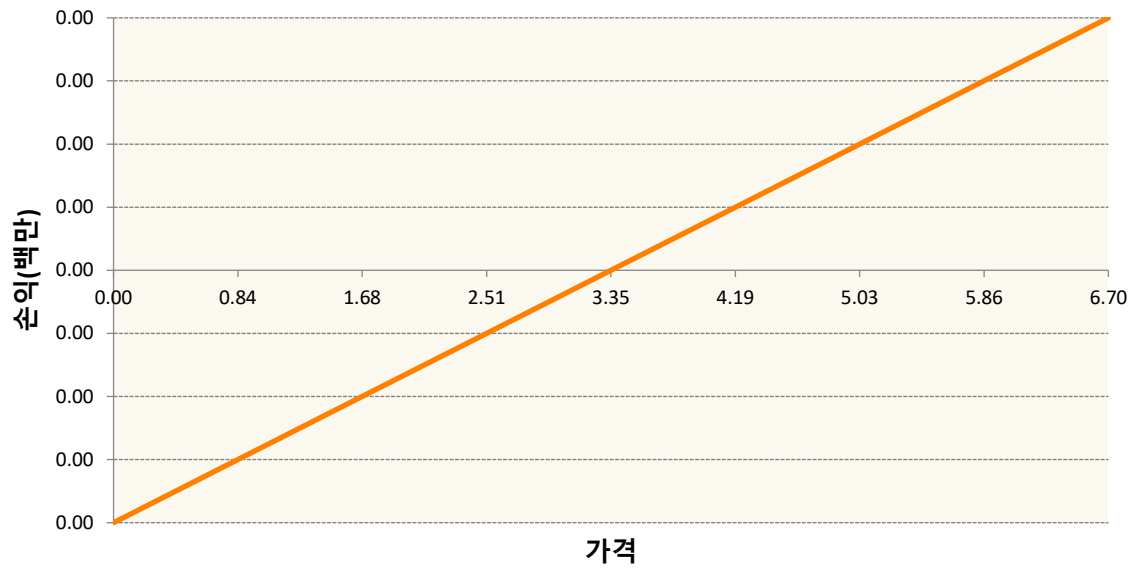
(단위:백만원)

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	536	0	536	
누계	통화	선물	0	69	-69	장내

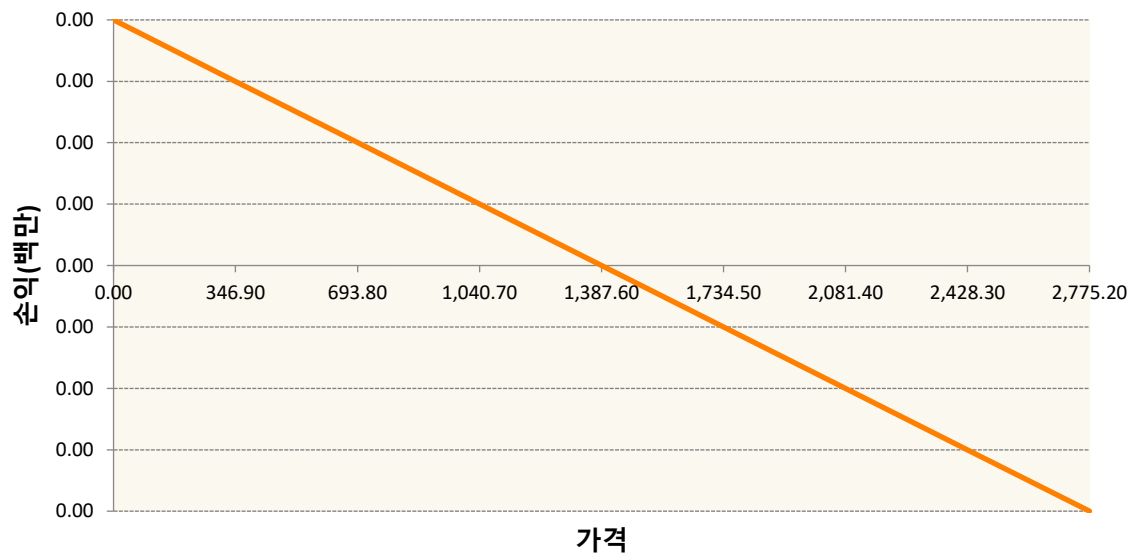
2. 만기시점의 손익구조



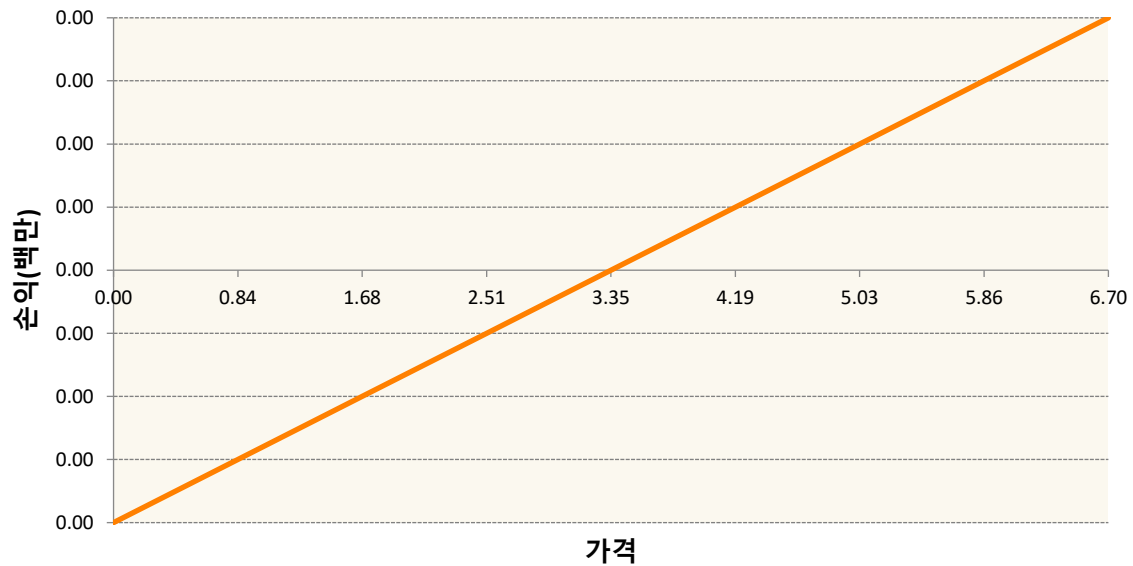
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

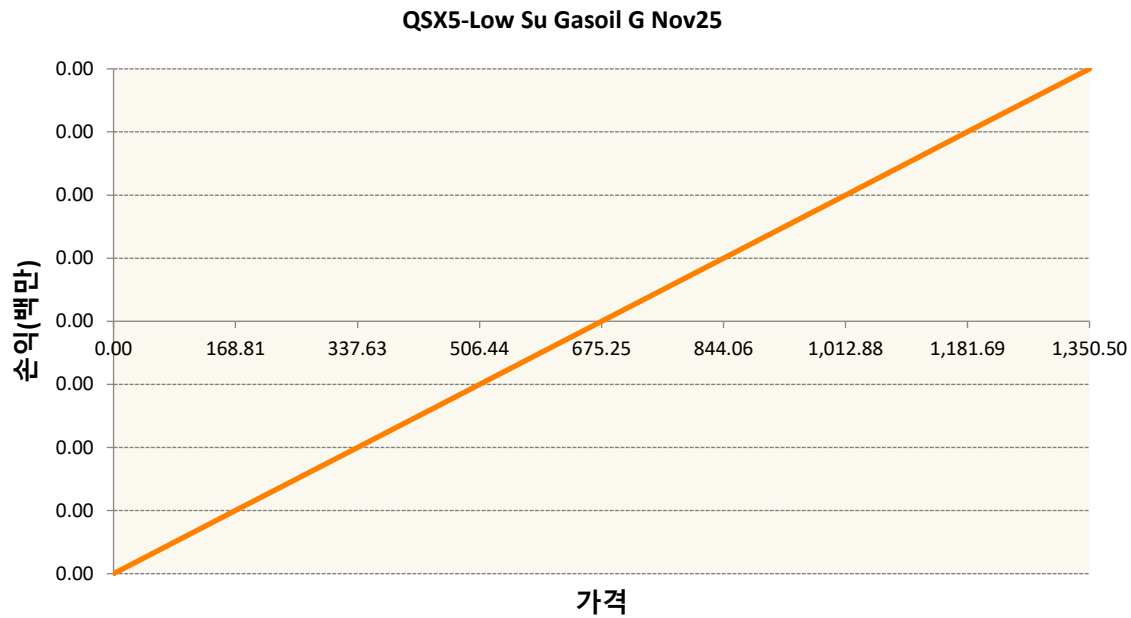


KR4175W90001-2025-09 달러선물



NGX25-NATURAL GAS FUTR Nov25





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLX5	WTI CRUDE FUTURE Nov25		7
COX5	BRENT CRUDE FUTR Nov25		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)
	98