

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

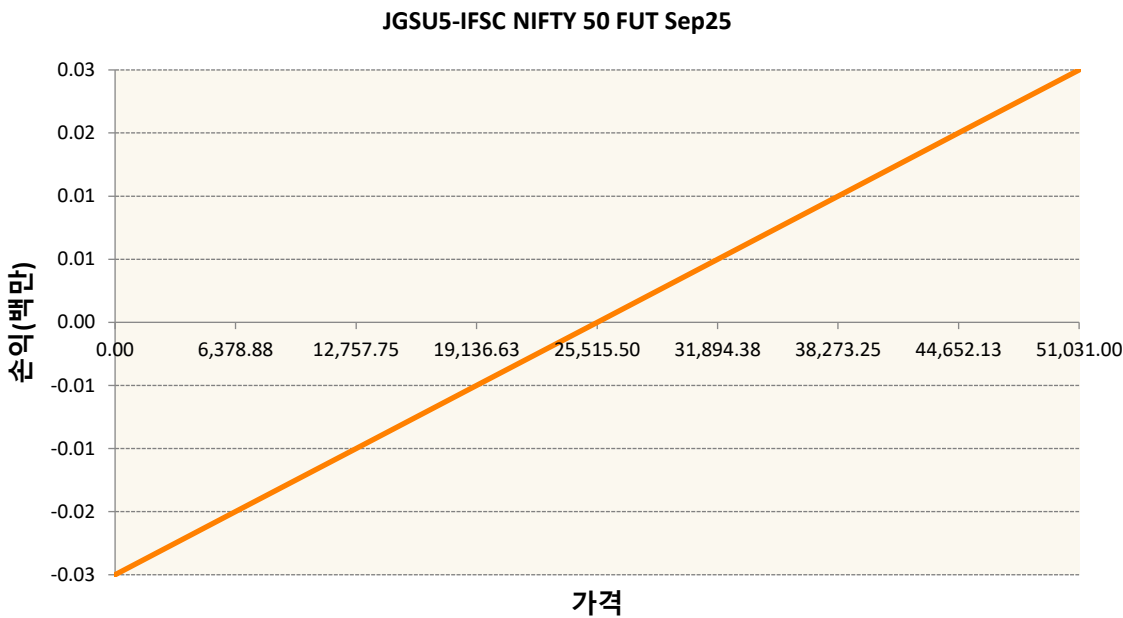
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	570	0	570	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSU5	IFSC NIFTY 50 FUT Sep25	46
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

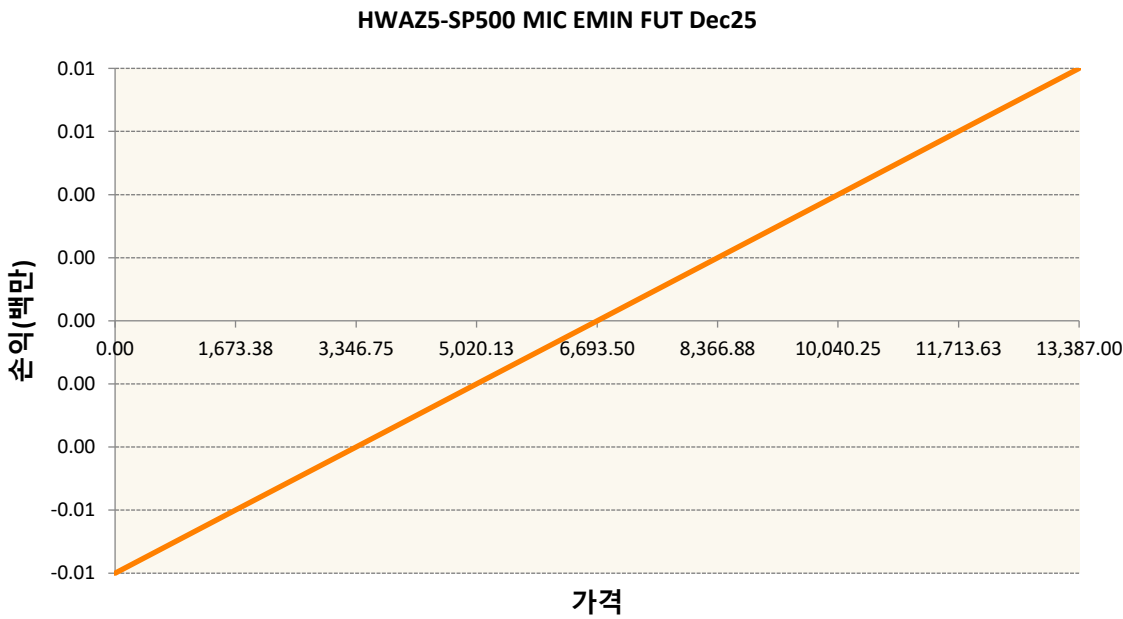
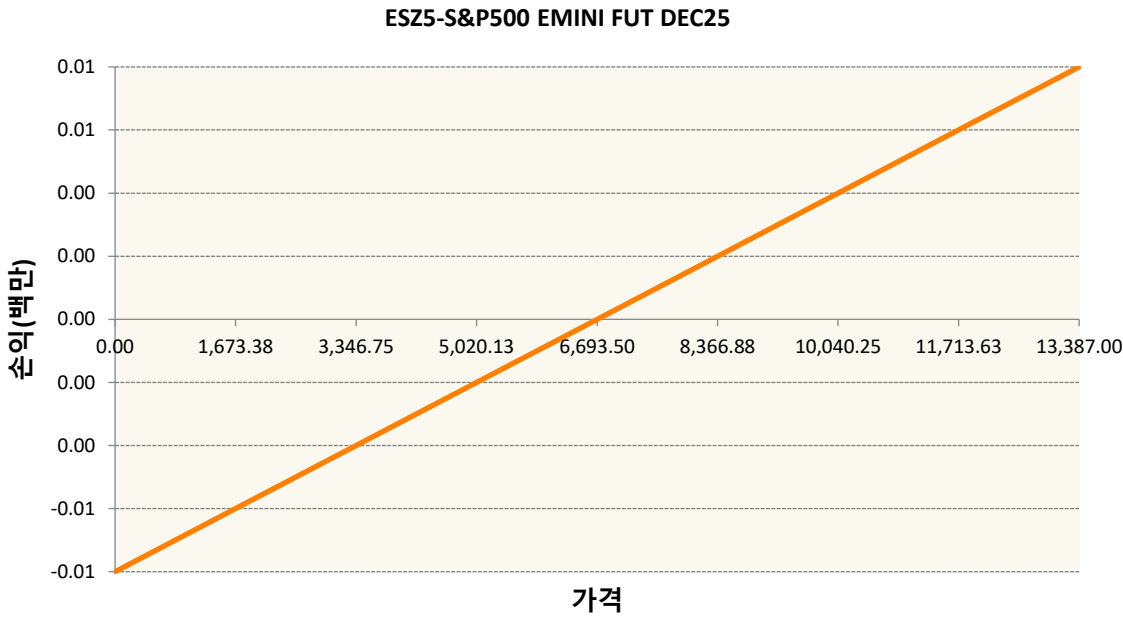
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	장내
누계	유가증권	선물	464	0	464	
누계	유가증권	선물	232	0	232	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	37
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	19

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	69

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

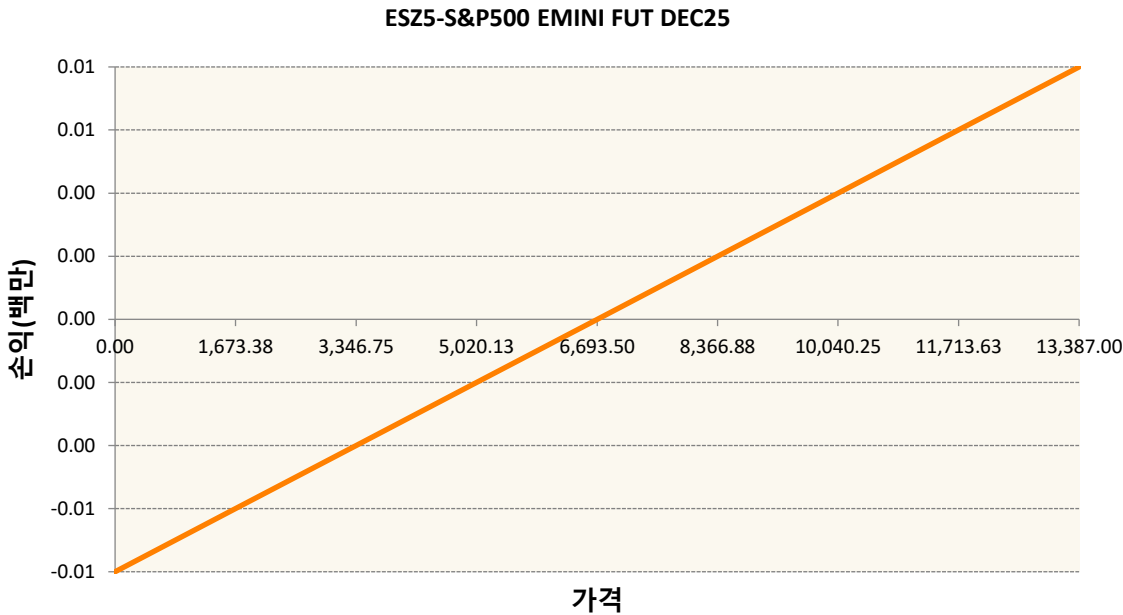
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,393	0	1,393	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	111
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

160

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

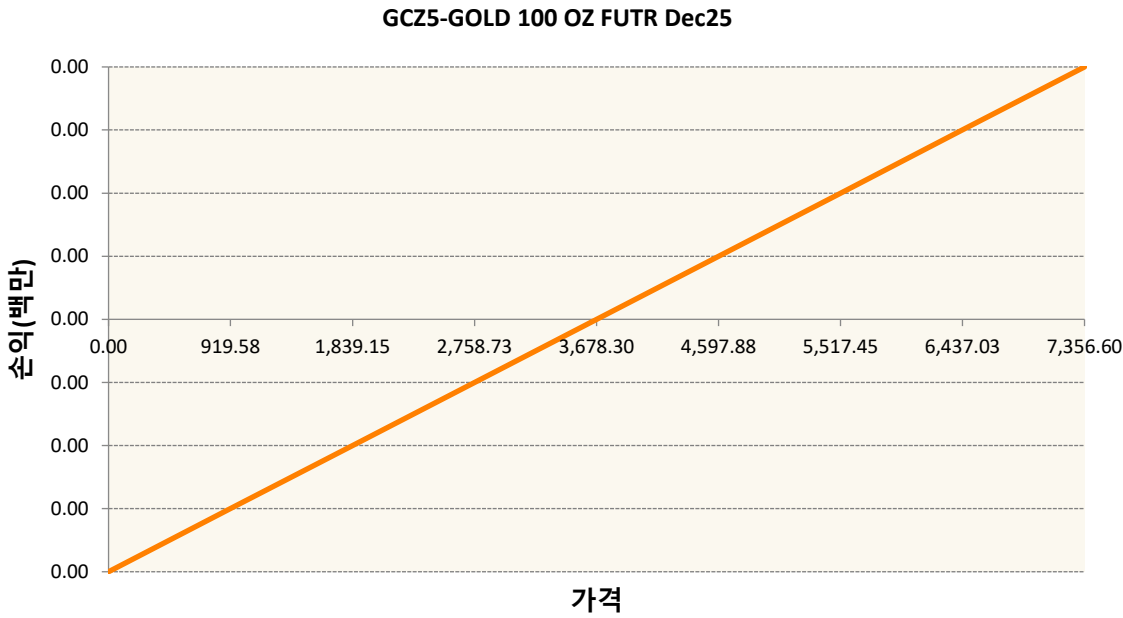
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,529	0	1,529	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 09/19/25 C336 EQUITY	3
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	122

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

(단위:백만원)

109

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

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)

AOPLTRUAC PLTR US 09/19/25 C170 EQUITY	49
AOPLTRUSP1 PLTR US 09/19/25 P170 EQUITY	30

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

(단위:백만원)

319

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSAC!TLT US 09/19/25 C90.5 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

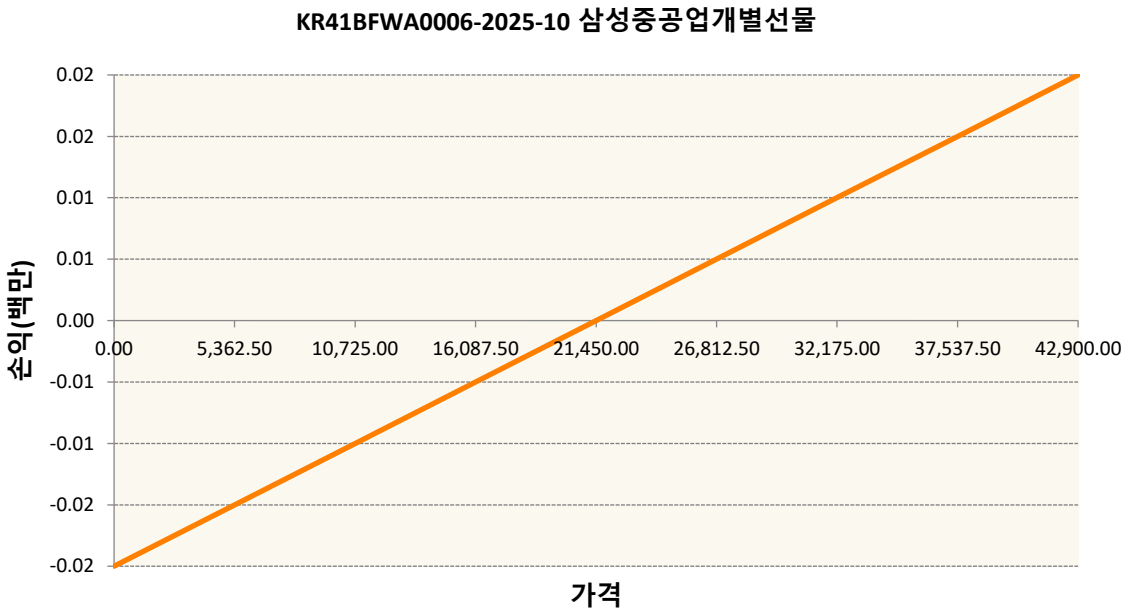
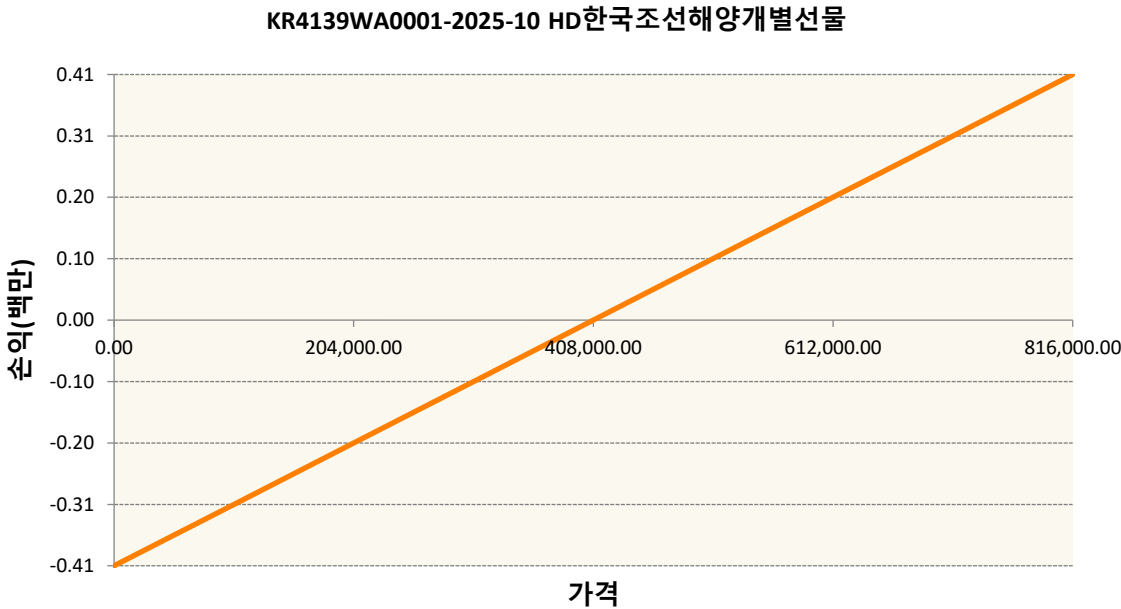
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

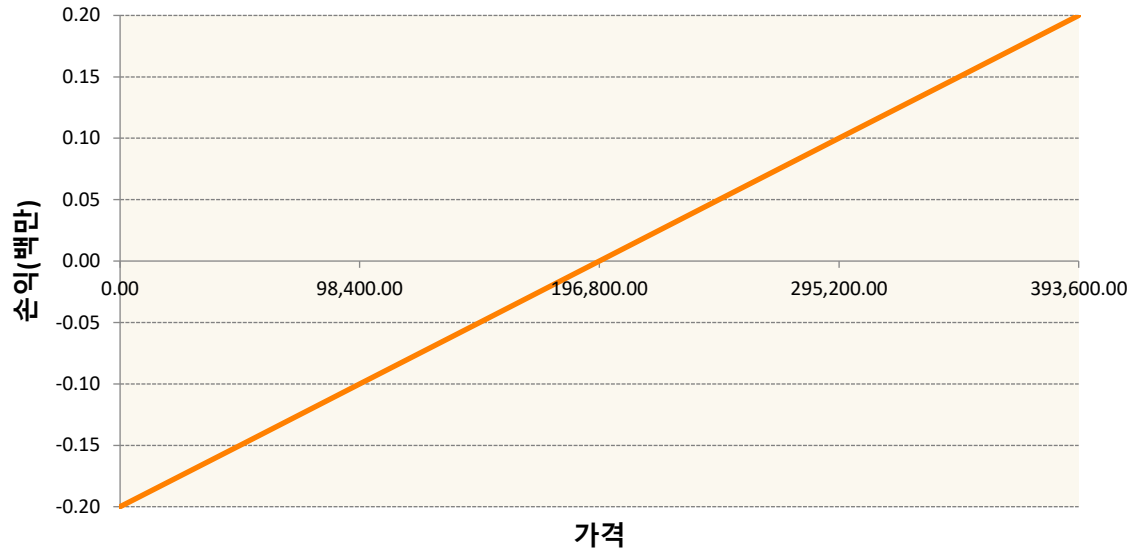
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	36,144	0	36,144	장내

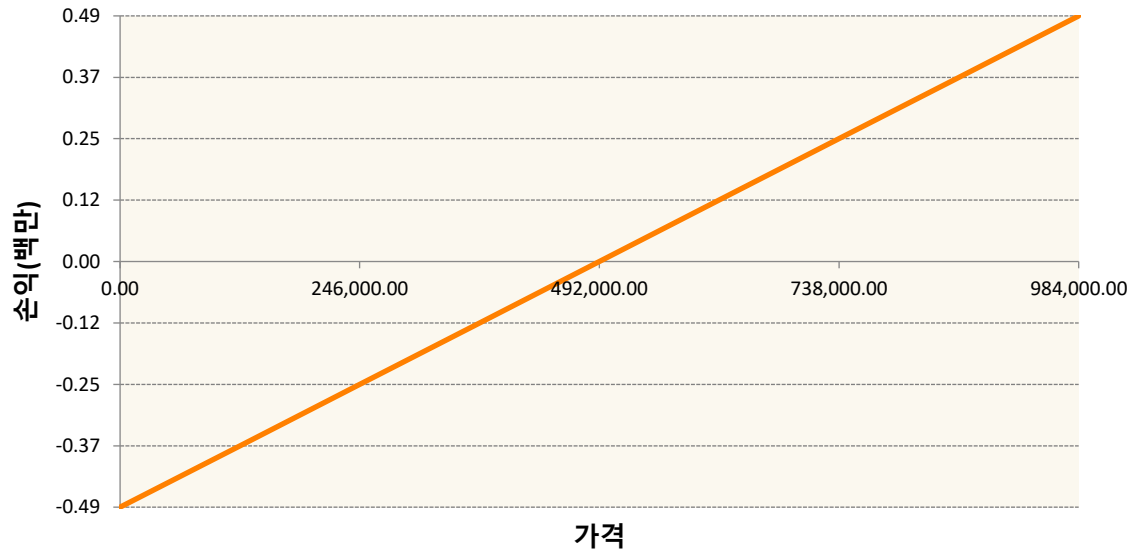
2. 만기시점의 손익구조



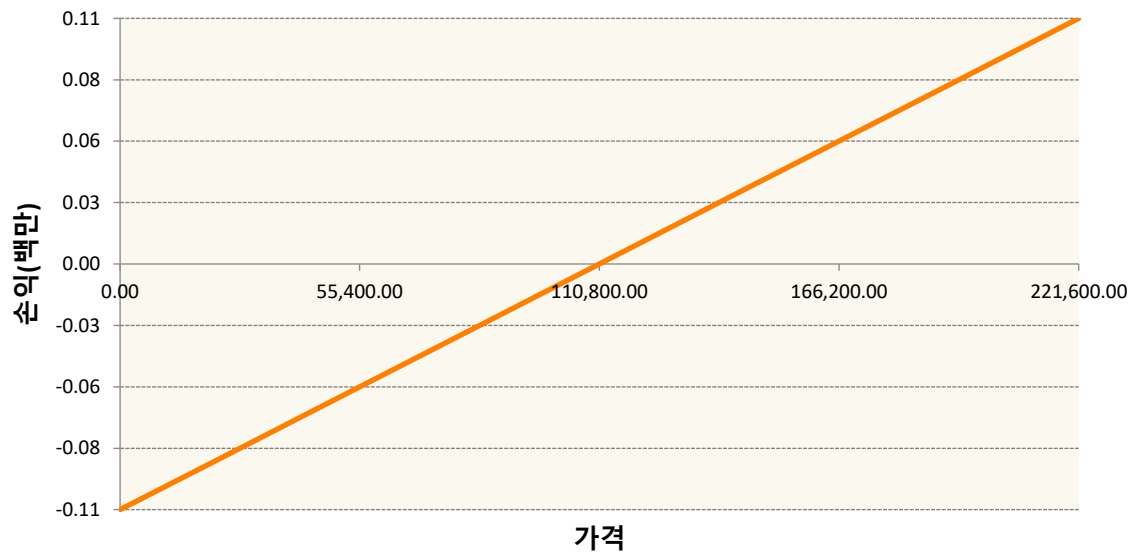
KR41CDWA0007-2025-10 HD현대미포개별선물



KR41FDWA0004-2025-10 HD현대중공업개별선물



KR41FVWA0002-2025-10 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139WA0001							2025-10 HD한국조선해양개별선물		590	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-590	-590	-590	-590	-590	-590	-590			
-5.33%	-393	-393	-393	-393	-393	-393	-393			
-2.67%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	197	197	197	197	197	197	197			
5.33%	393	393	393	393	393	393	393			
8.00%	590	590	590	590	590	590	590			
KR41BFWA0006							2025-10 삼성중공업개별선물		548	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548			
-5.33%	-365	-365	-365	-365	-365	-365	-365			
-2.67%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	183	183	183	183	183	183	183			
5.33%	365	365	365	365	365	365	365			
8.00%	548	548	548	548	548	548	548			
KR41CDWA0007							2025-10 HD현대미포개별선물		445	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-445	-445	-445	-445	-445	-445	-445			
-5.33%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297			
-2.67%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	148	148	148	148	148	148	148			
5.33%	297	297	297	297	297	297	297			
8.00%	445	445	445	445	445	445	445			
KR41FDWA0004							2025-10 HD현대중공업개별선물		584	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-584	-584	-584	-584	-584	-584	-584			
-5.33%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389			
-2.67%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	195	195	195	195	195	195	195			
5.33%	389	389	389	389	389	389	389			
8.00%	584	584	584	584	584	584	584			
KR41FVWA0002							2025-10 한화오션개별선물		731	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-731	-731	-731	-731	-731	-731	-731
-5.33%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487
-2.67%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	244	244	244	244	244	244	244
5.33%	487	487	487	487	487	487	487
8.00%	731	731	731	731	731	731	731

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

(단위:백만원)

1,663

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

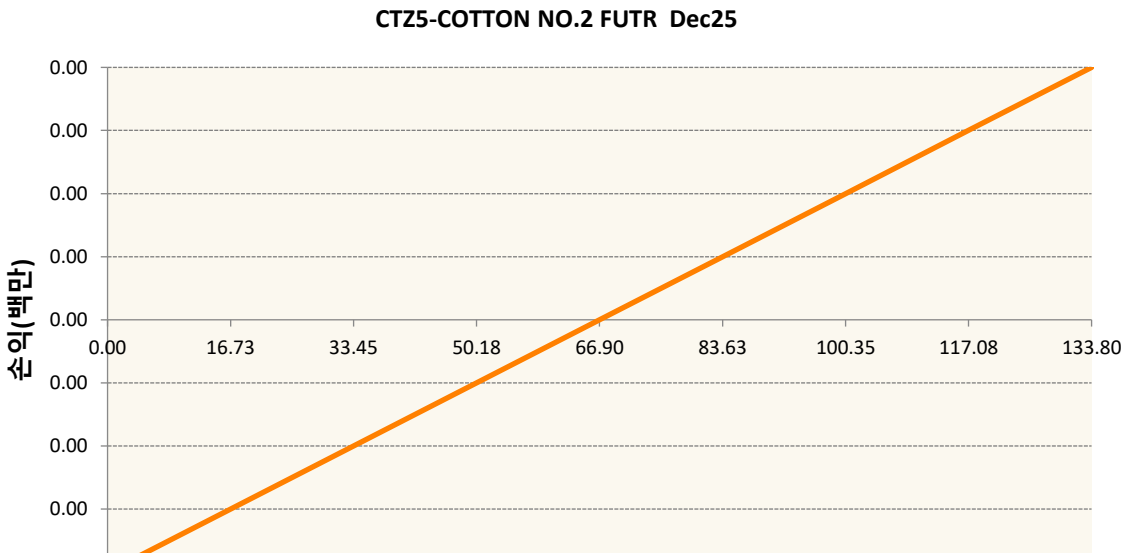
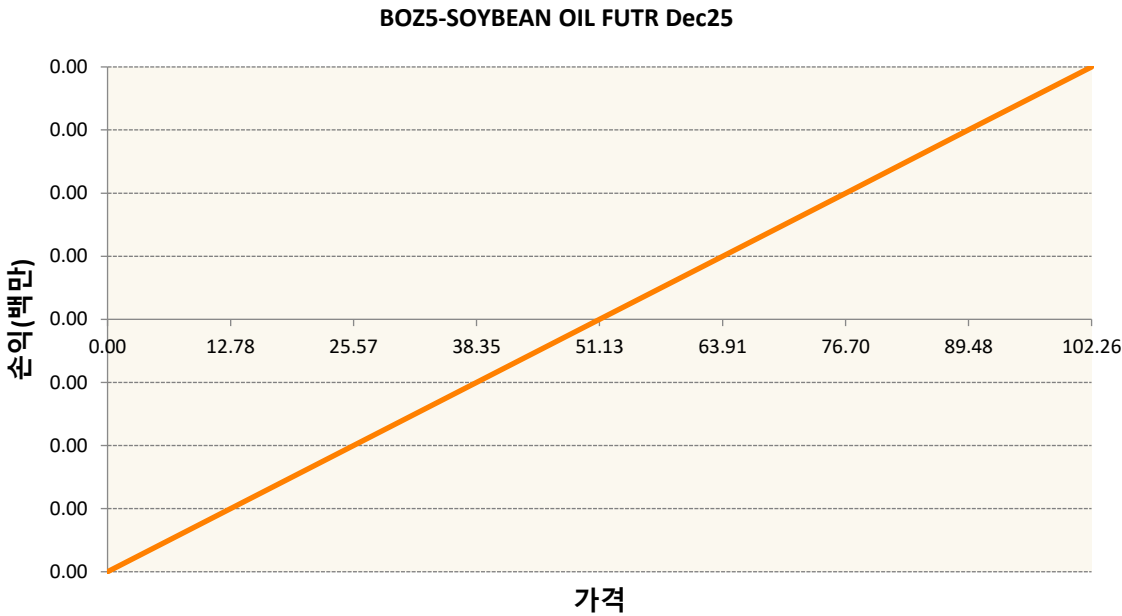
포커스농산물모(채권-파생형)

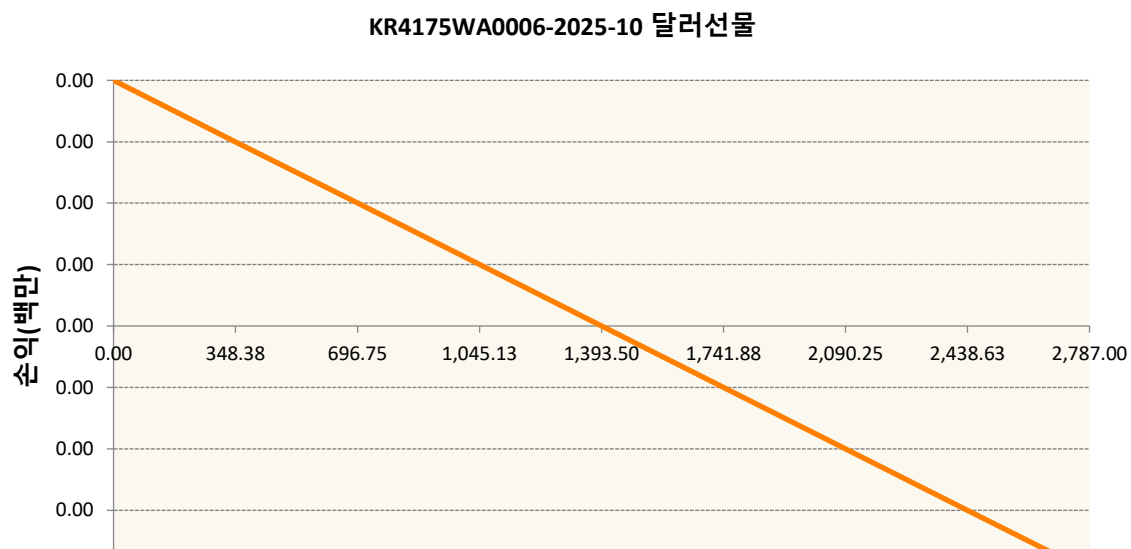
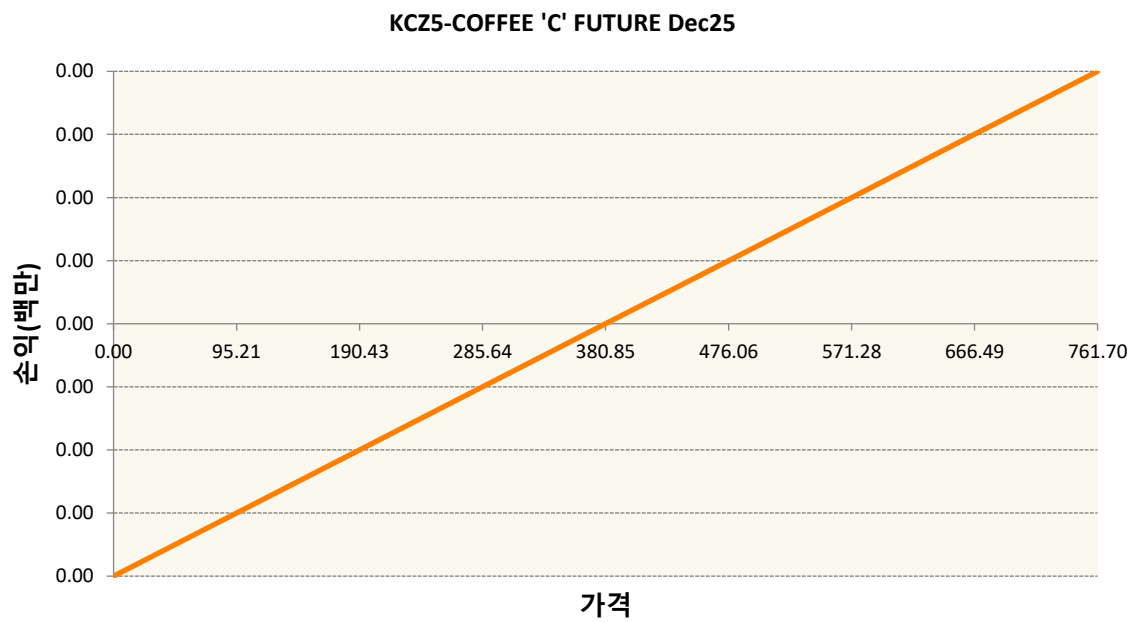
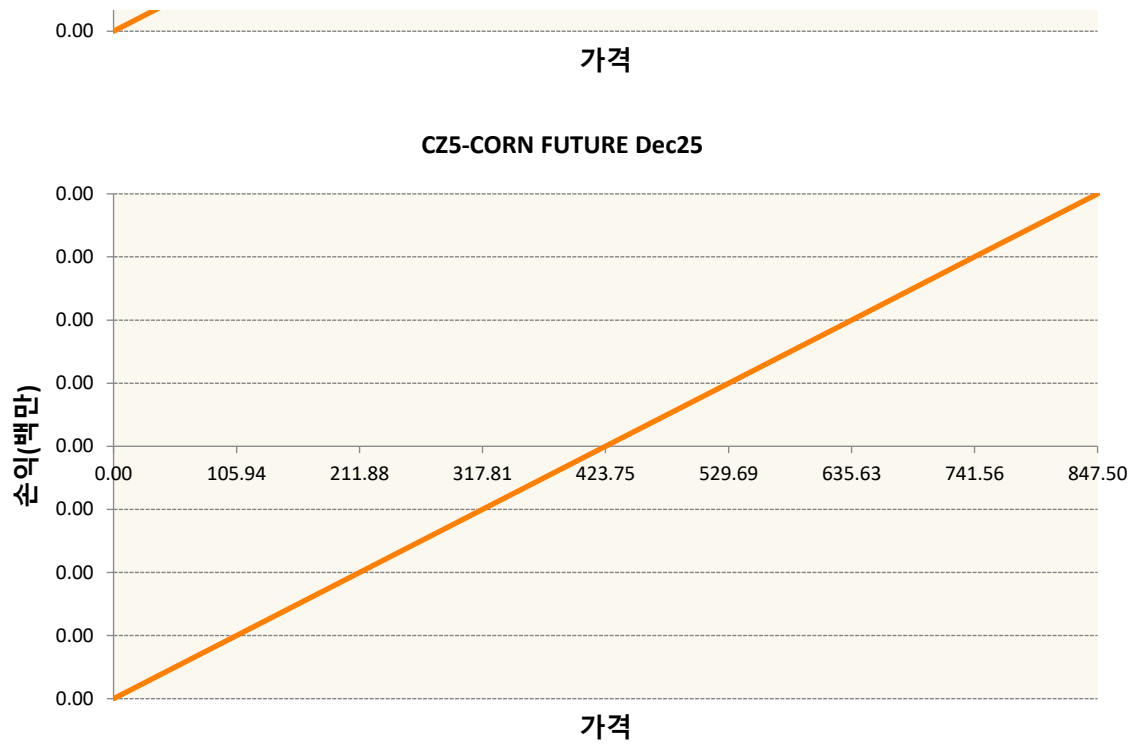
1. 계약금액

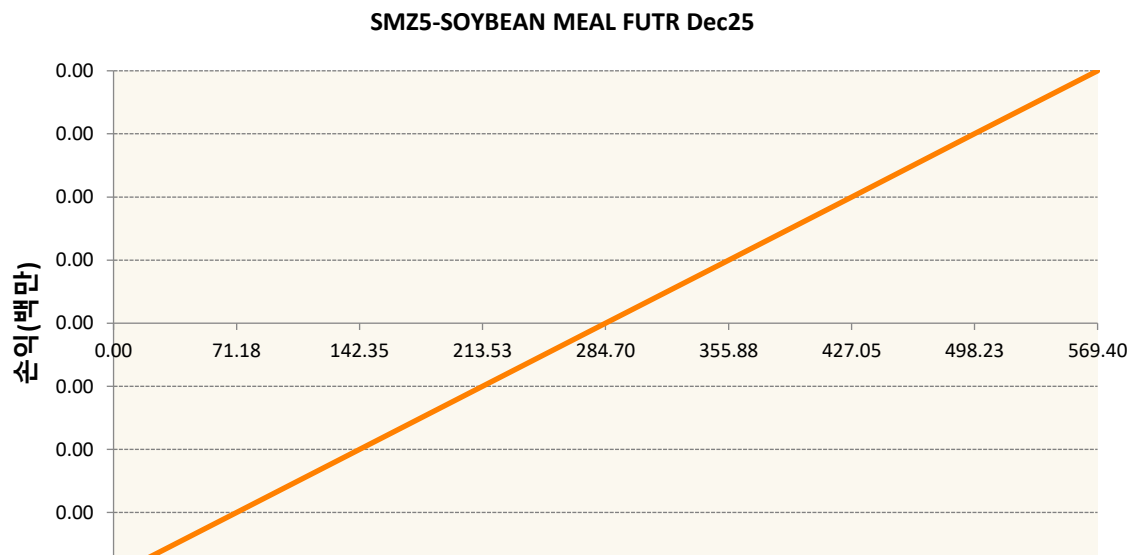
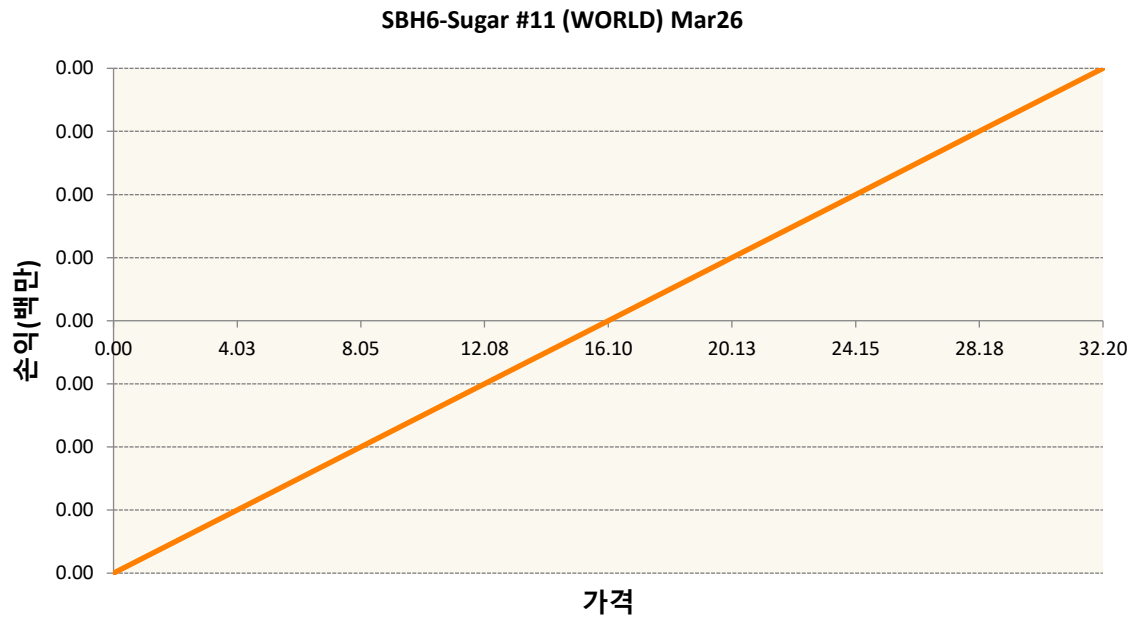
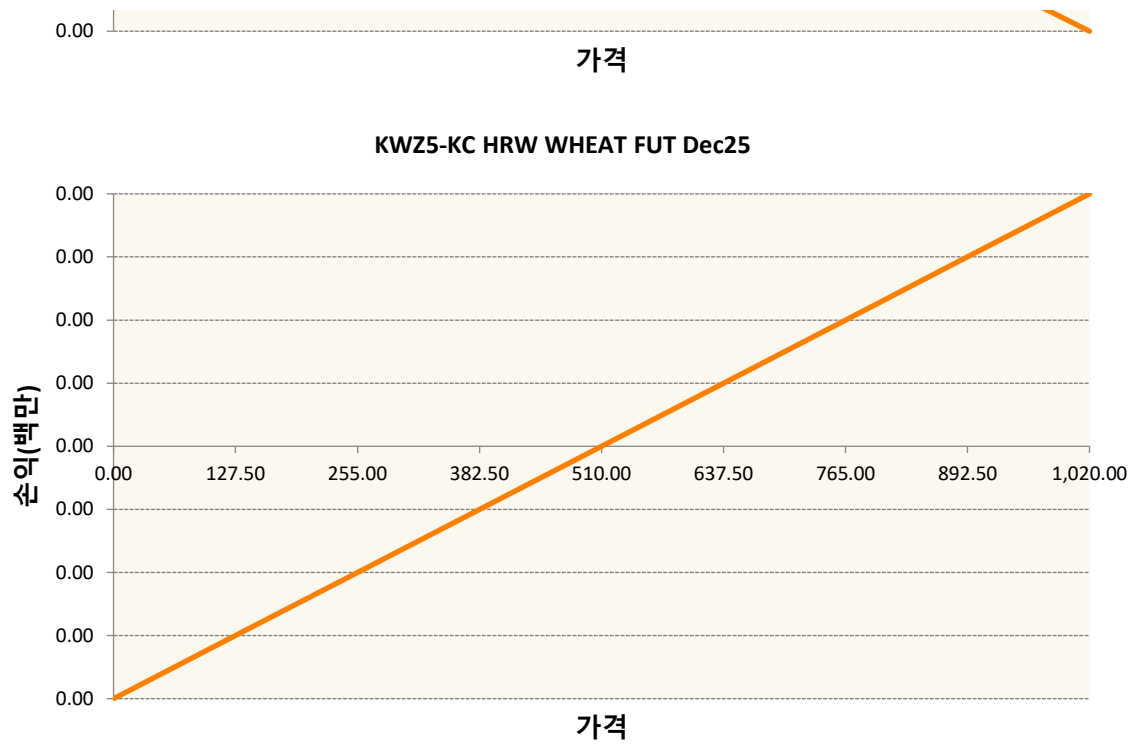
(단위:USD 백만)

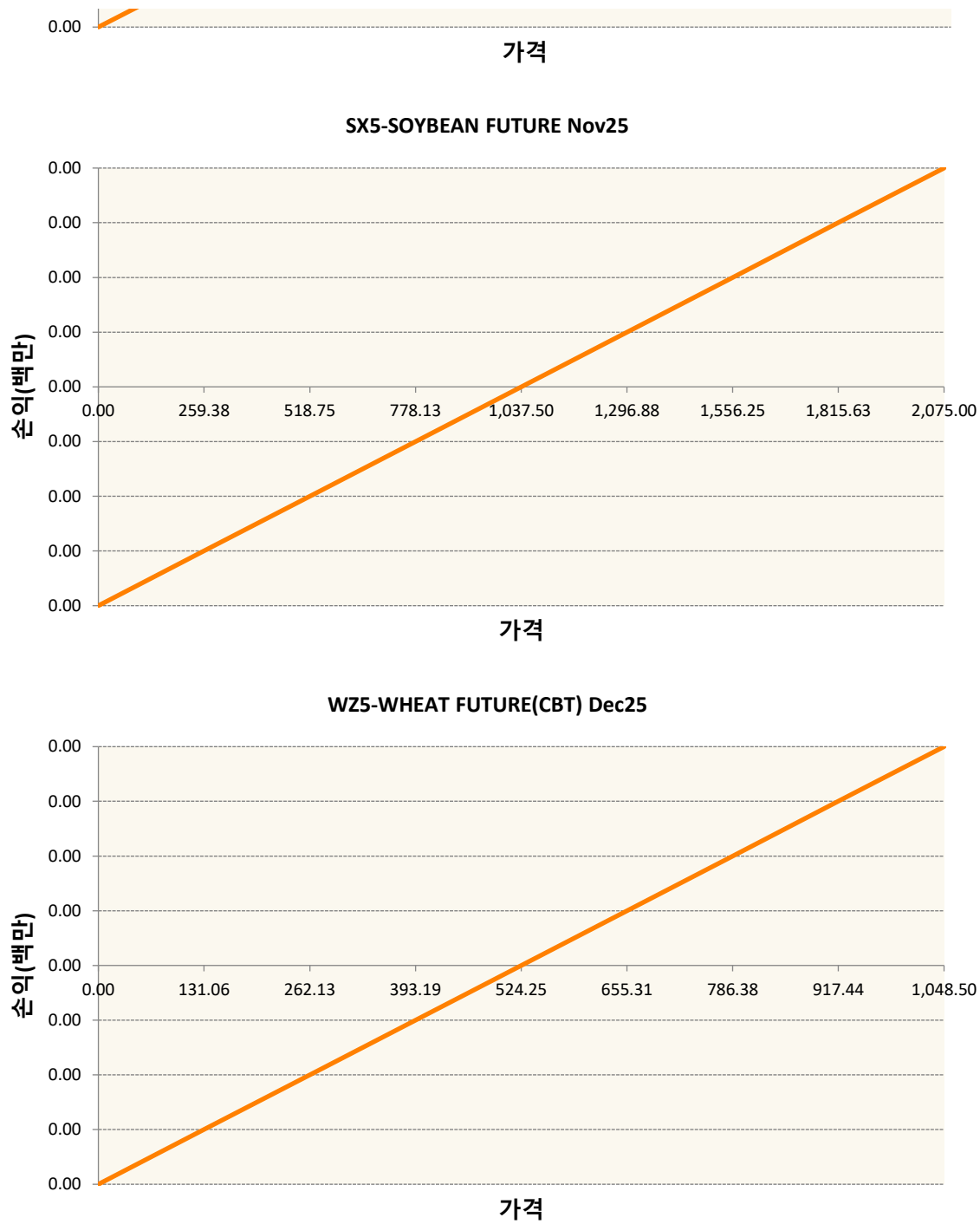
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,178	0	1,178	
누계	유가증권	선물	2,214	0	2,214	
누계	통화	선물	0	376	-376	장내

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	2025-09-22
기준일	2025-09-19

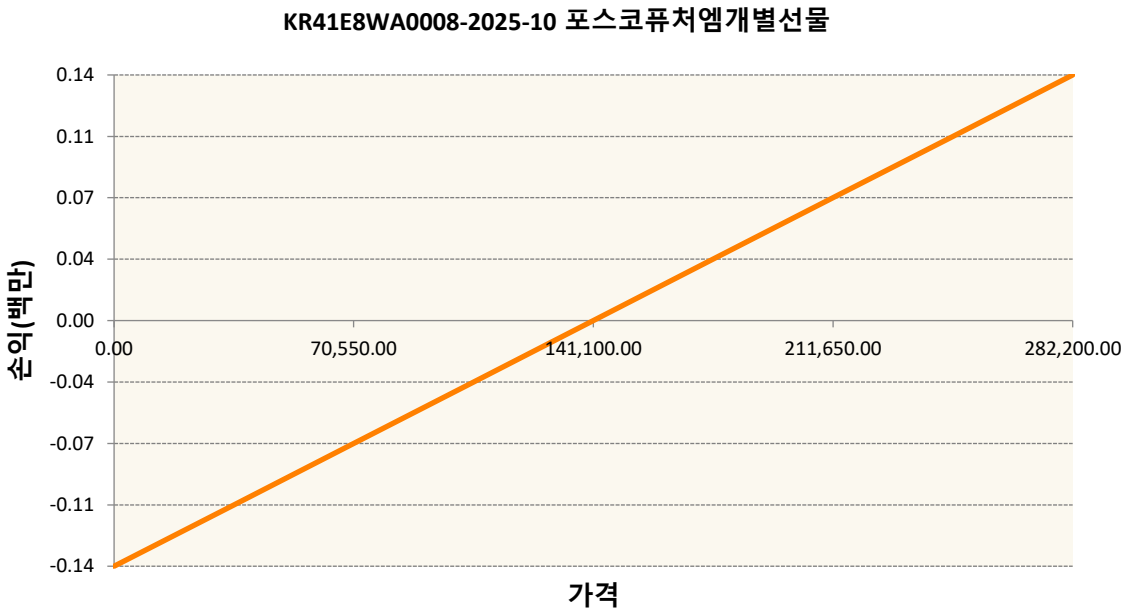
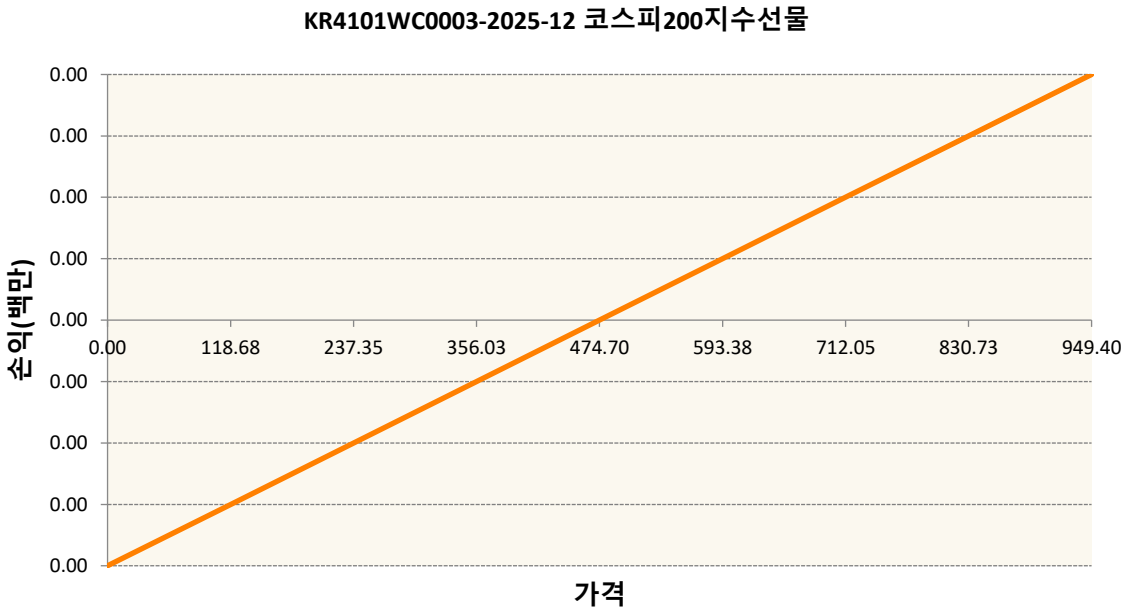
스마트인덱스모

1. 계약금액

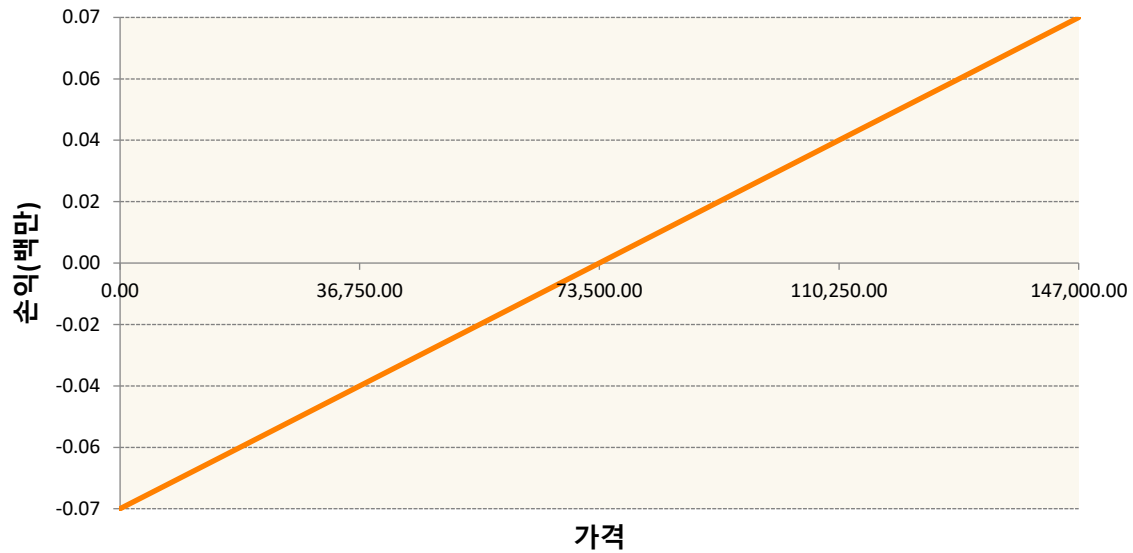
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	118	-118	장내
누계	유가증권	선물	1,145	0	1,145	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41FMWA0003-2025-10 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물
 KR41E8WA01 2025-10 포스코퓨처엠개별선물
 KR41FMWAC 2025-10 엘앤에프개별선물

85
4
2

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

(단위:백만원)

6

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

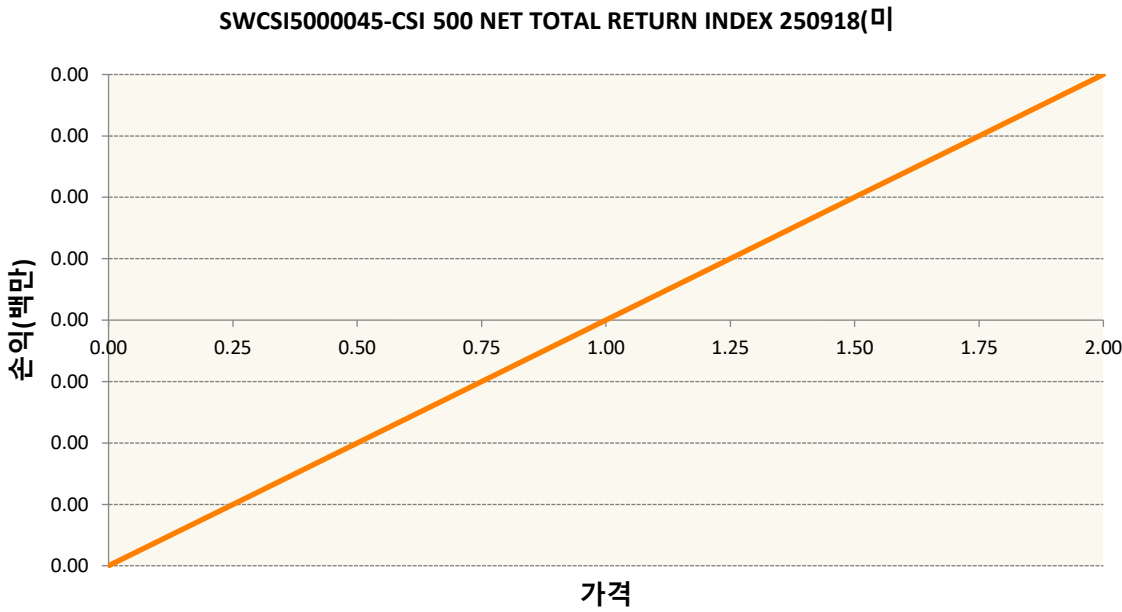
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,700	0	4,700	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

377

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

603

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

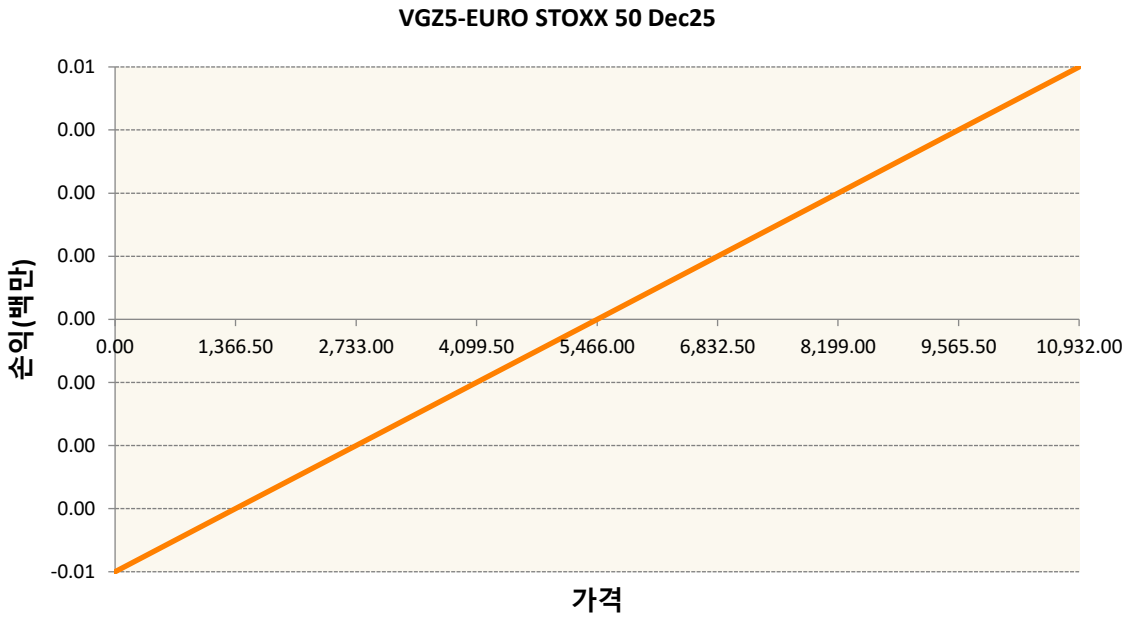
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	716	0	716	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ5	EURO STOXX 50 Dec25	57
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

48

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

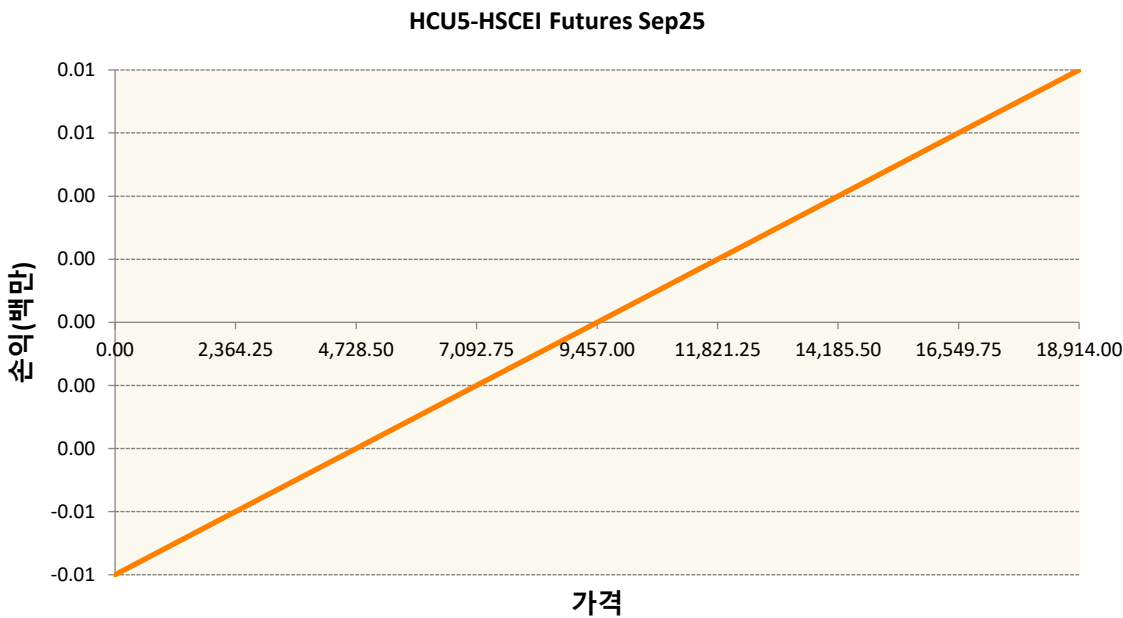
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,123	0	2,123	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU5	HSCEI Futures Sep25	170
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

240

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

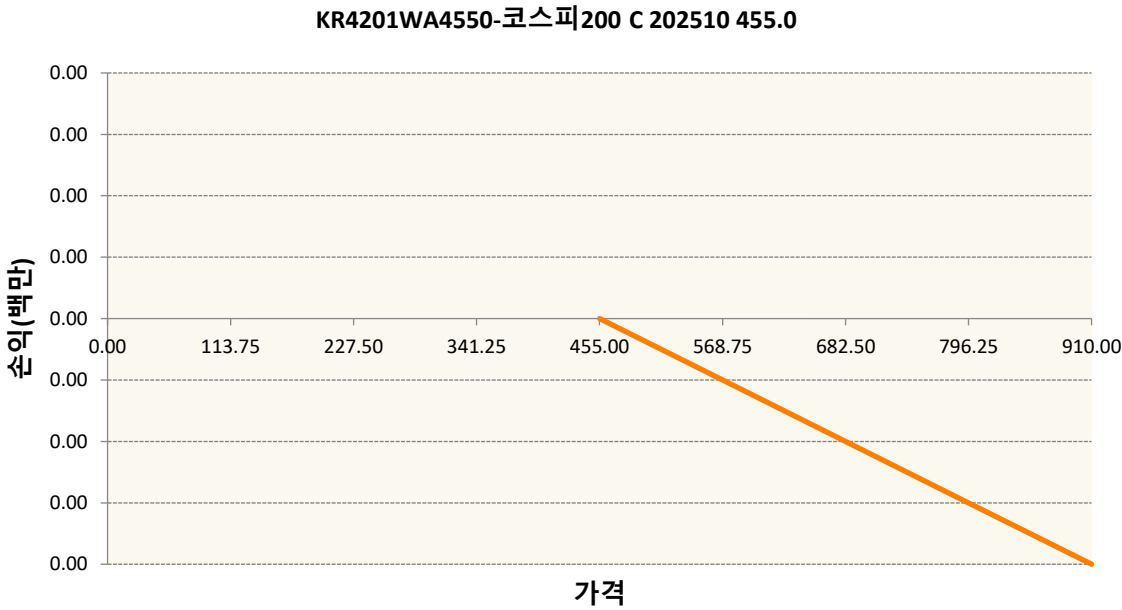
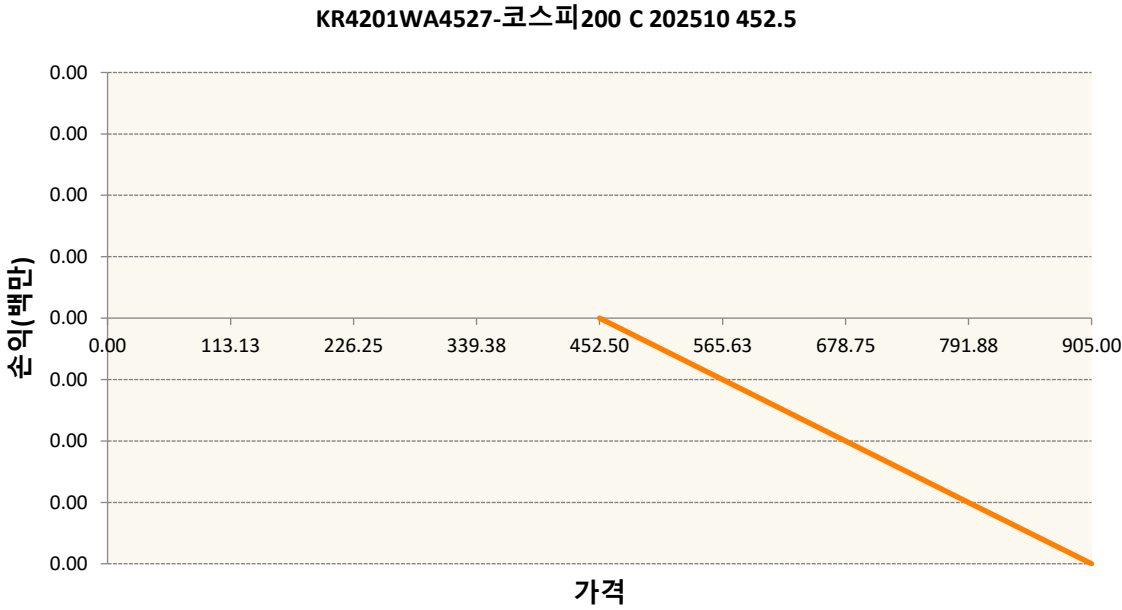
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

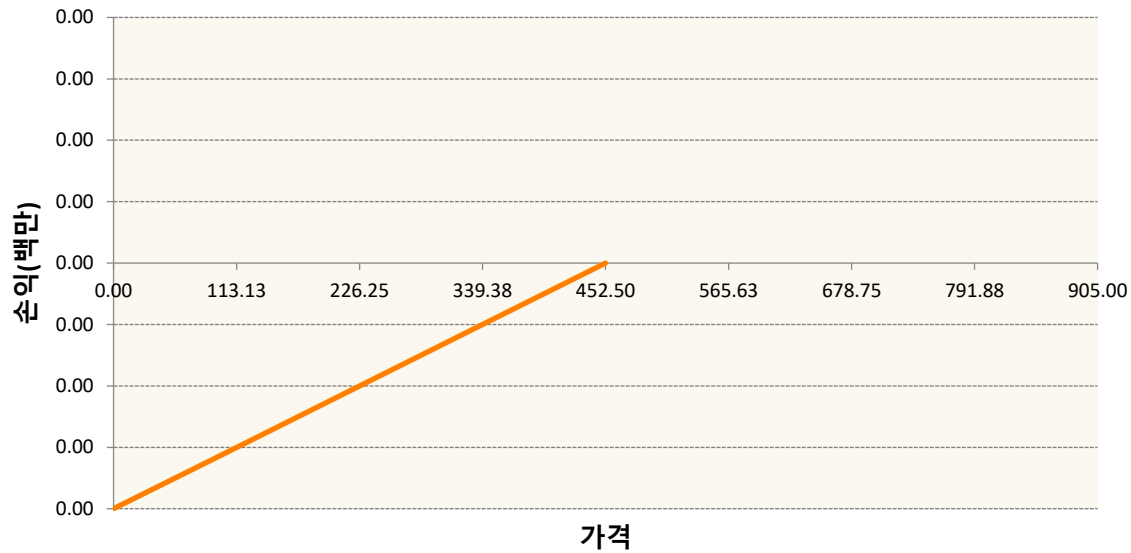
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,731	-34,731	장내

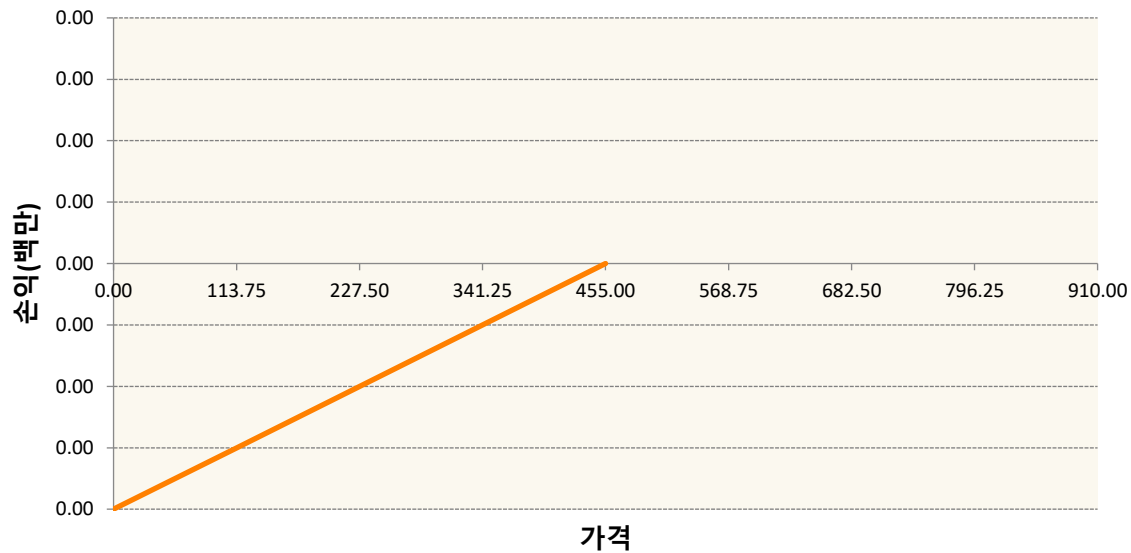
2. 만기시점의 손익구조



KR4301WA4526-코스피200 P 202510 452.5



KR4301WA4559-코스피200 P 202510 455.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WA4: 코스피200 C 202510 452.5	905
KR4201WA4: 코스피200 C 202510 455.0	1,356
KR4301WA4: 코스피200 P 202510 452.5	199
KR4301WA4: 코스피200 P 202510 455.0	319

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-09-22

기준일 2025-09-19

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	2025-09-22
기준일	2025-09-19

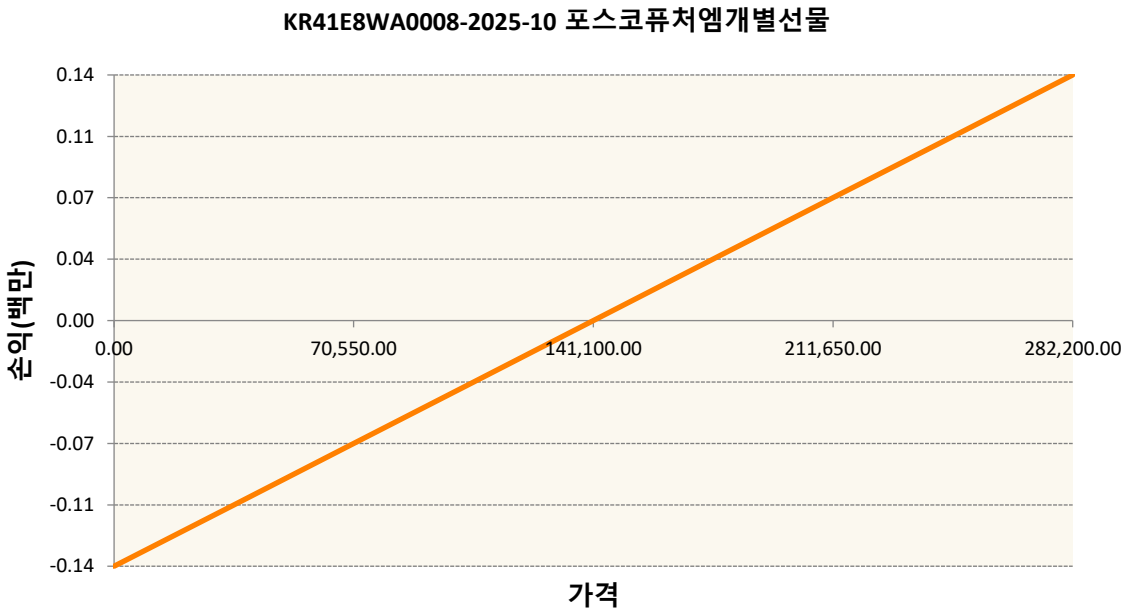
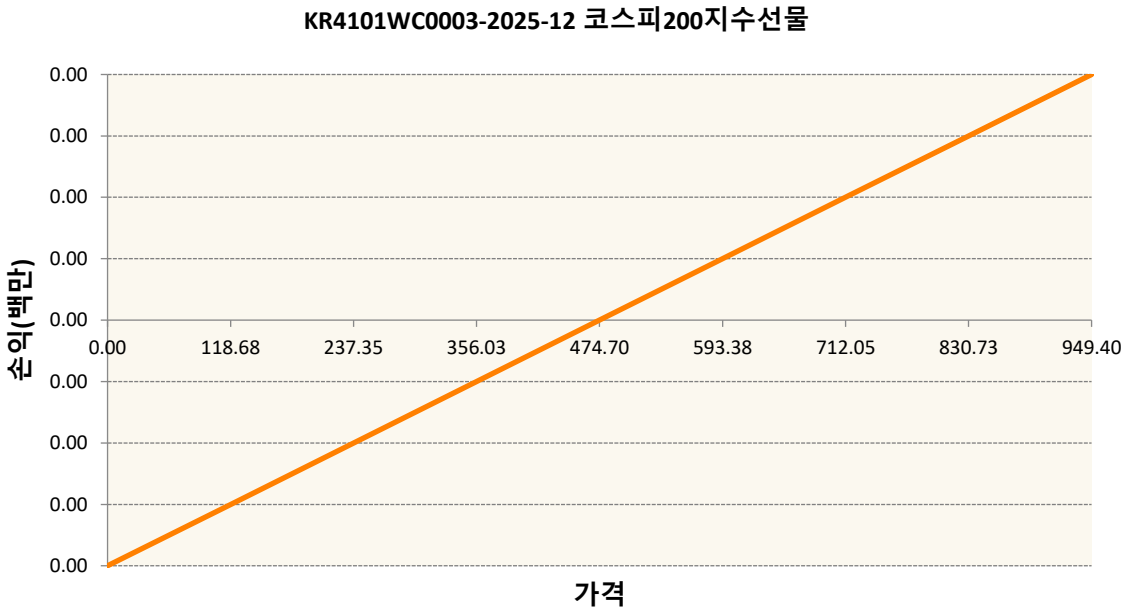
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

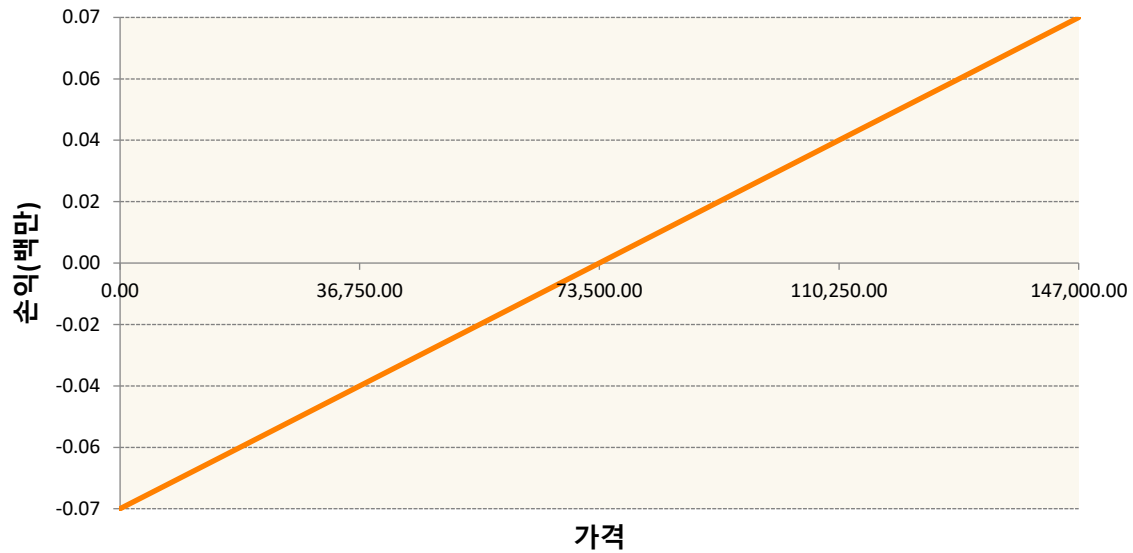
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	628	0	628	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41FMWA0003-2025-10 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물
 KR41E8WA01 2025-10 포스코퓨처엠개별선물
 KR41FMWAC 2025-10 엘앤에프개별선물

47
2
1

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

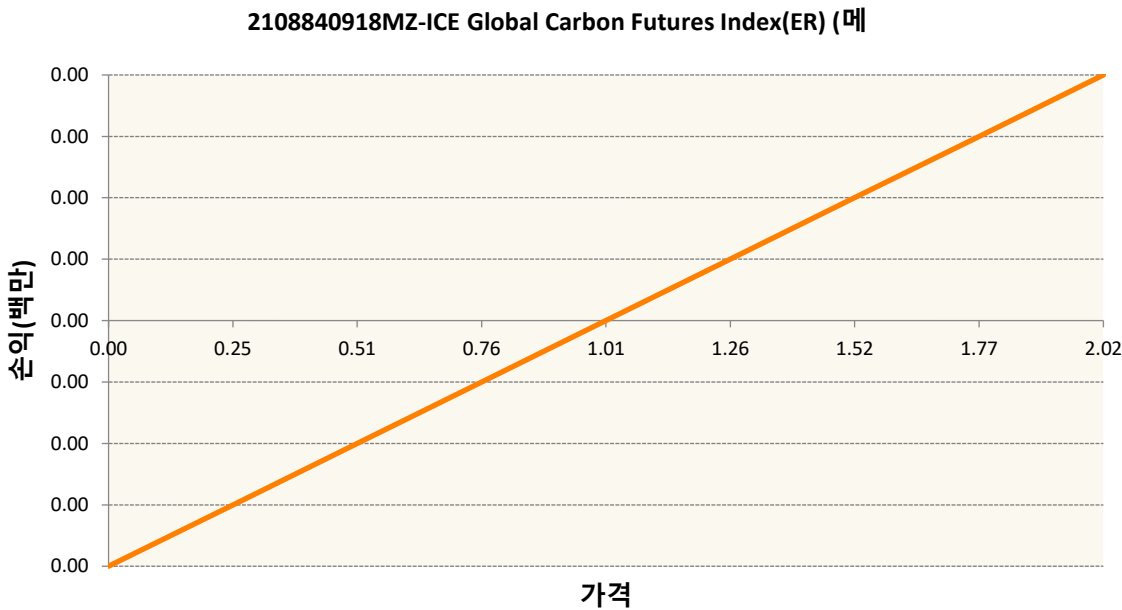
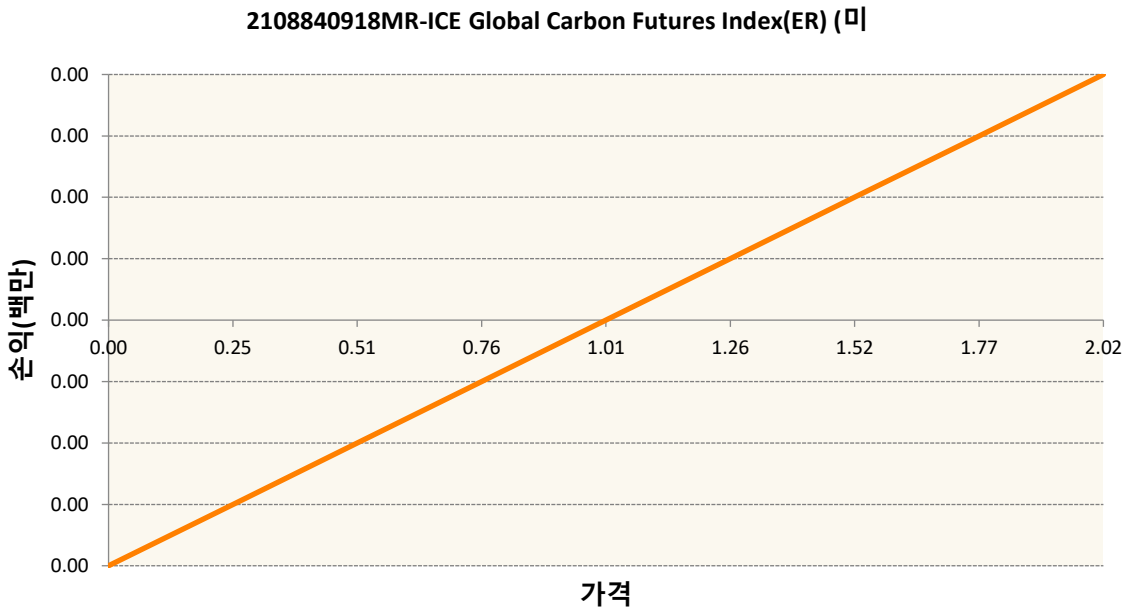
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	9,595	0	9,595	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		654
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		109

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		780

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

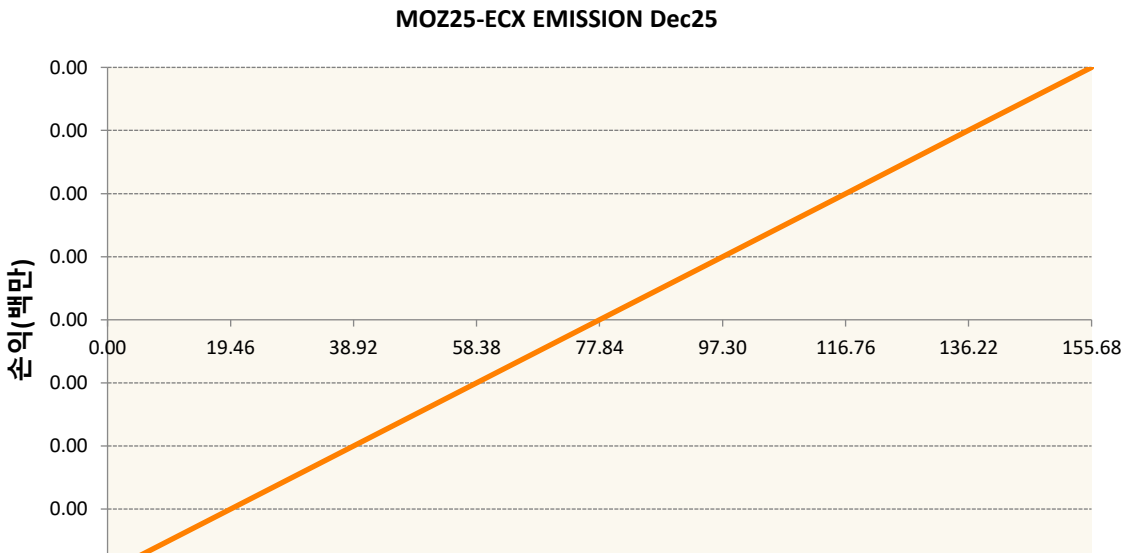
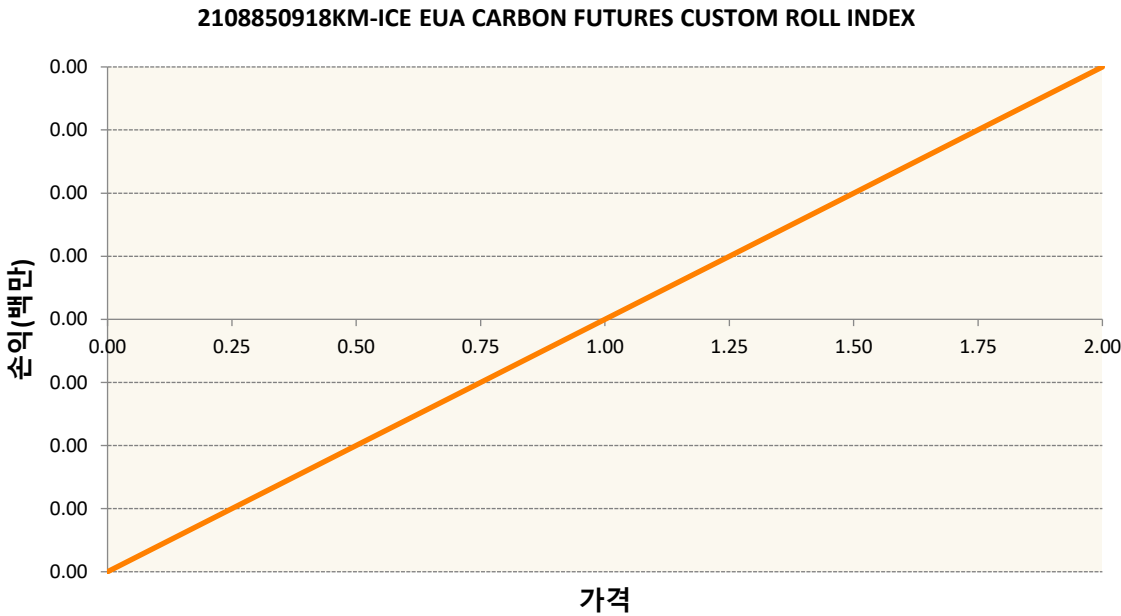
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,893	0	6,893	
누계	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	2,018	-2,018	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX
FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E
MOZ25 ECX EMISSION Dec25

0.14

161

551

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

(단위:백만원)

876

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

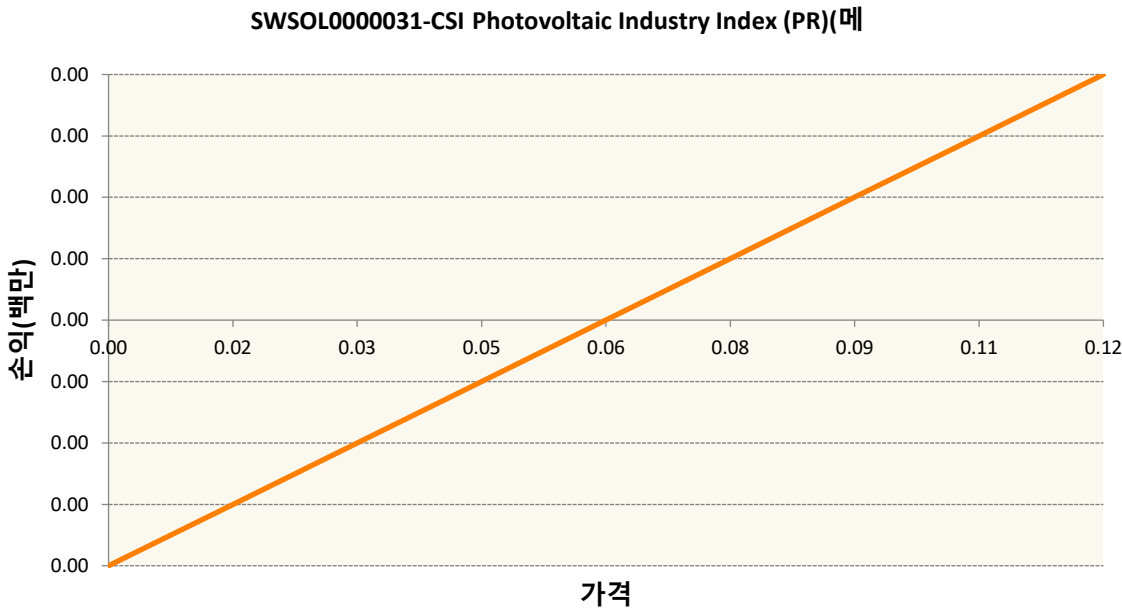
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,817	0	2,817	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (메리츠)	33
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	33
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	22
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	23
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)(메	5

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

(단위:백만원)

198

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

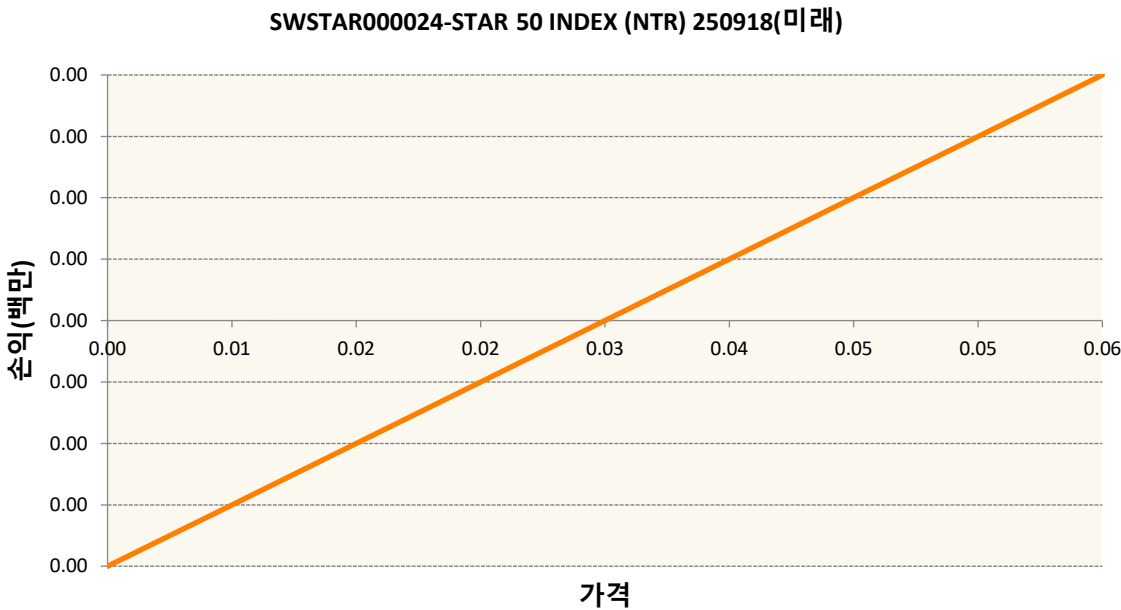
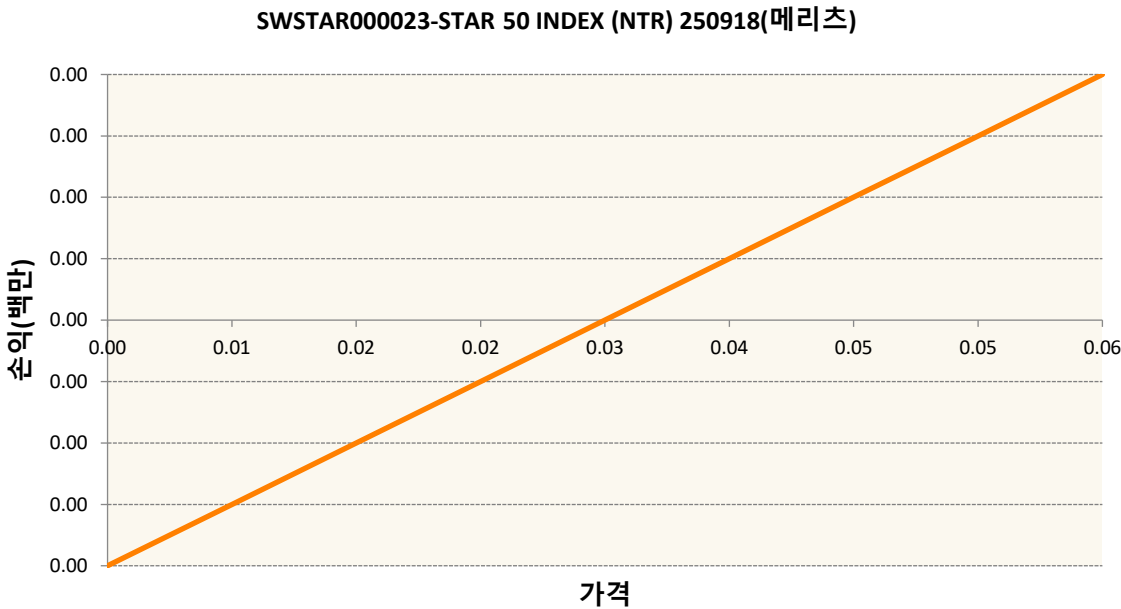
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	3,992	0	3,992	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		2
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		21
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(미래)		7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	62

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

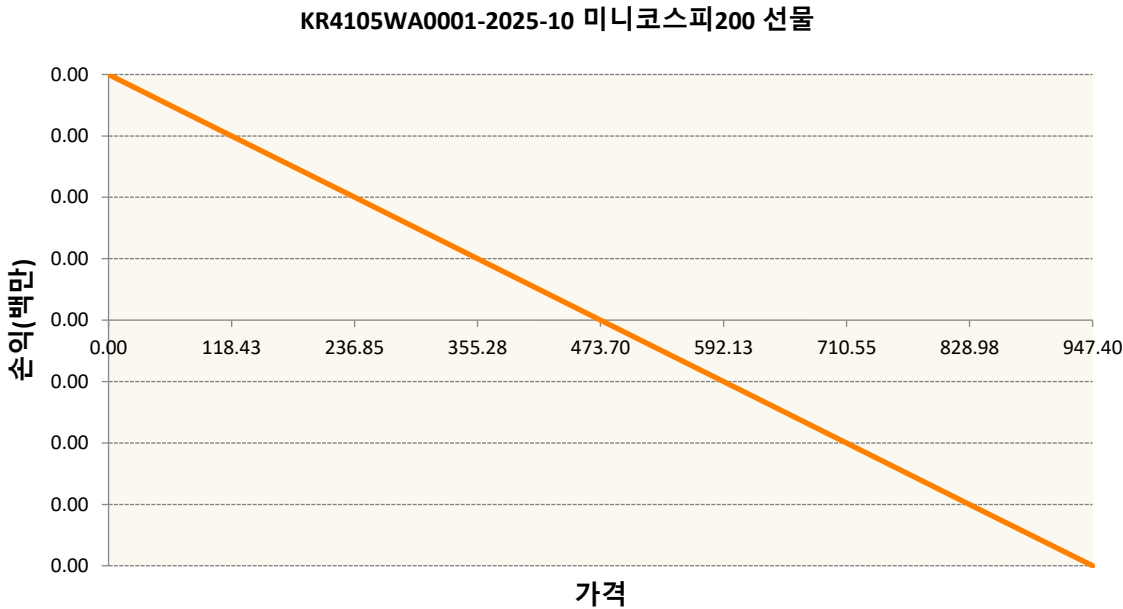
에퀴티알파일반사모혼합자산

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	947	-947	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105WA01 2025-10 미니코스피200 선물	15
--------------------------------	----

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

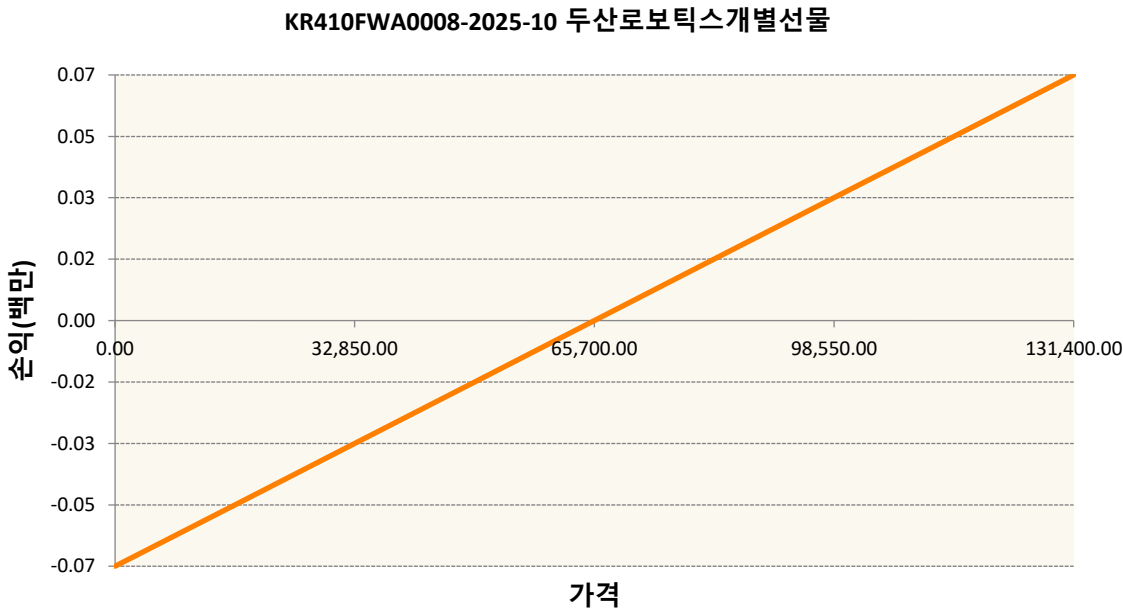
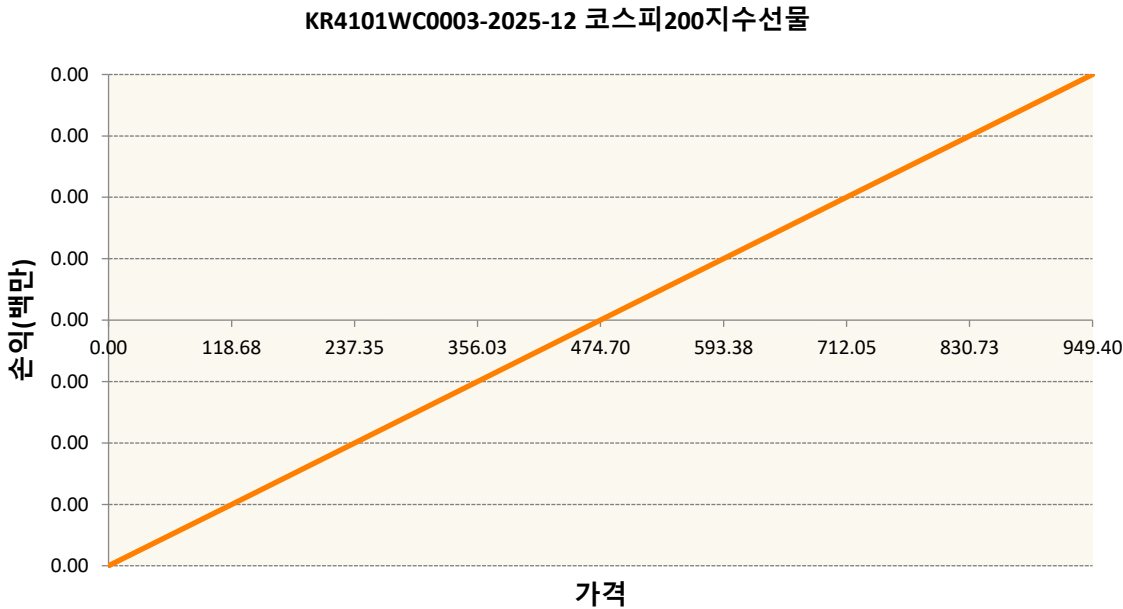
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

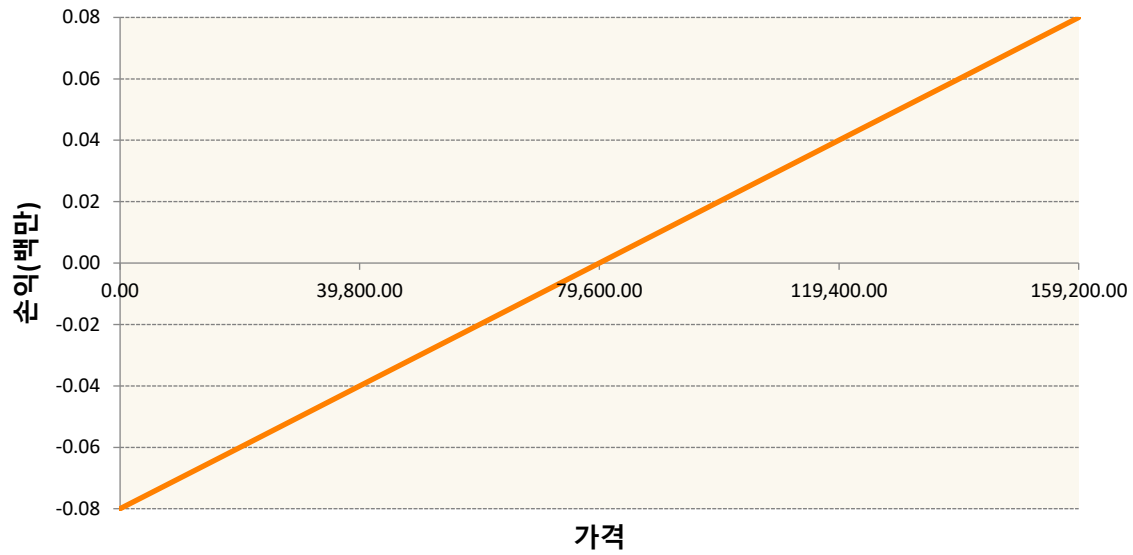
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,436	1,239	9,197	장내

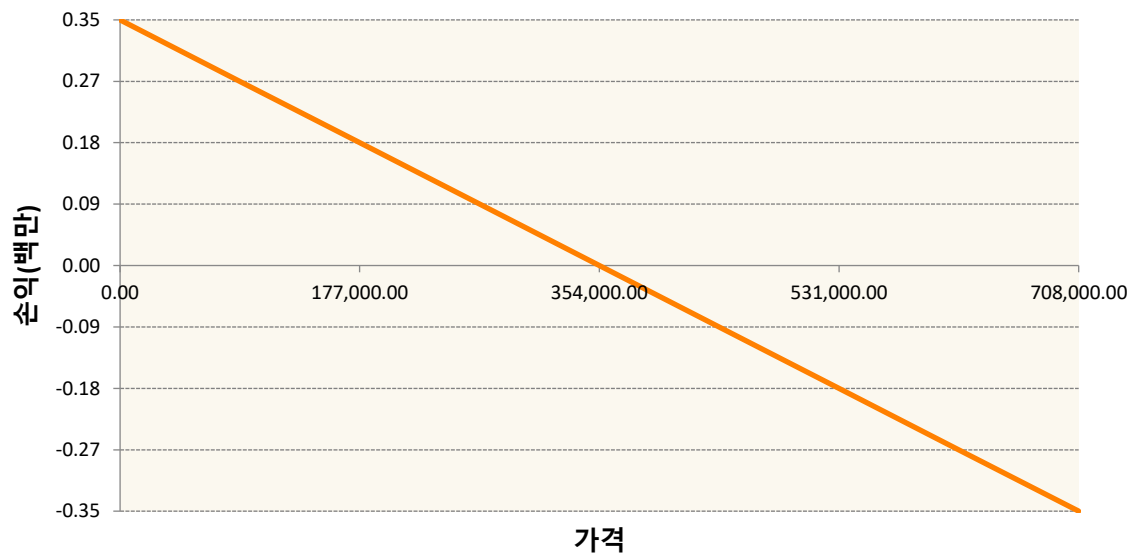
2. 만기시점의 손익구조



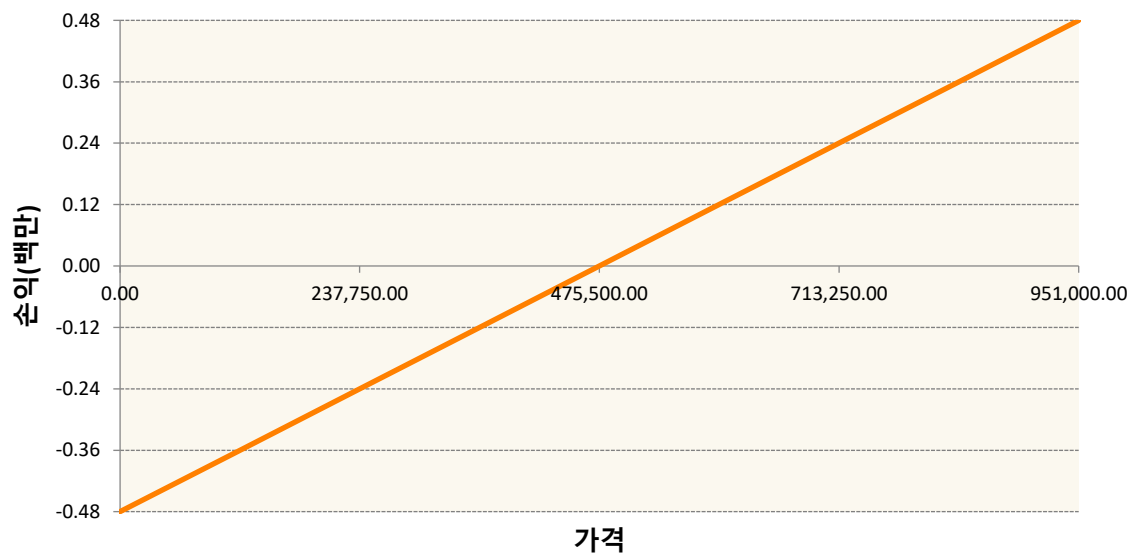
KR4111WA0003-2025-10 삼성전자개별선물



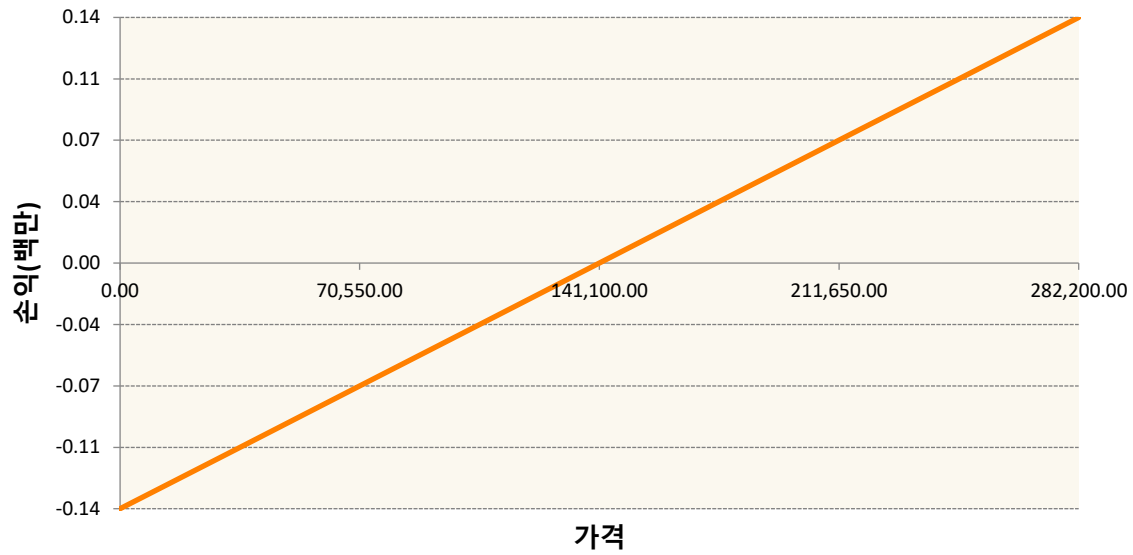
KR4150WA0005-2025-10 SK하이닉스개별선물



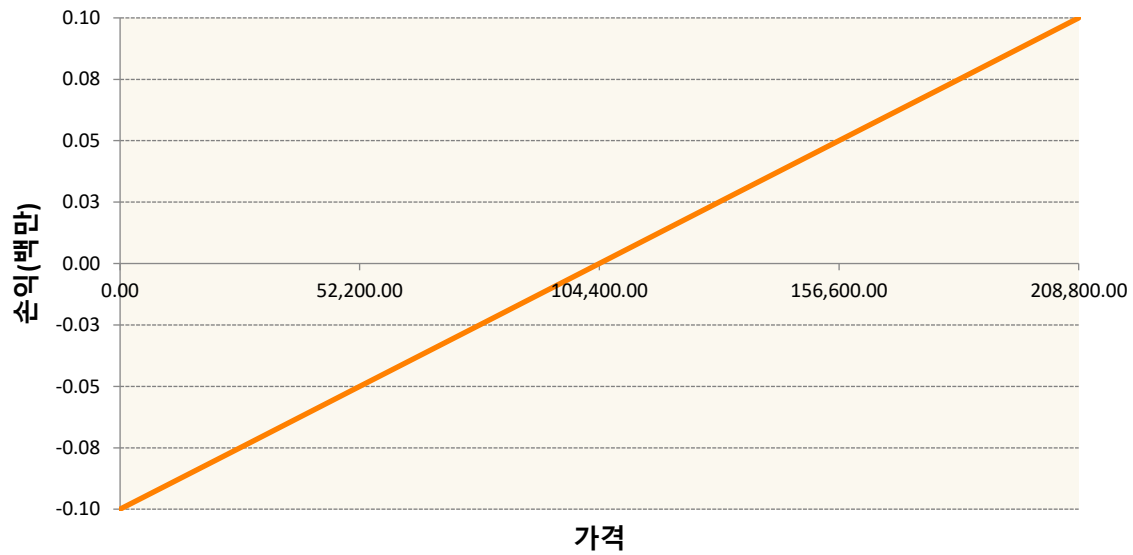
KR41DAWA0009-2025-10 농심개별선물



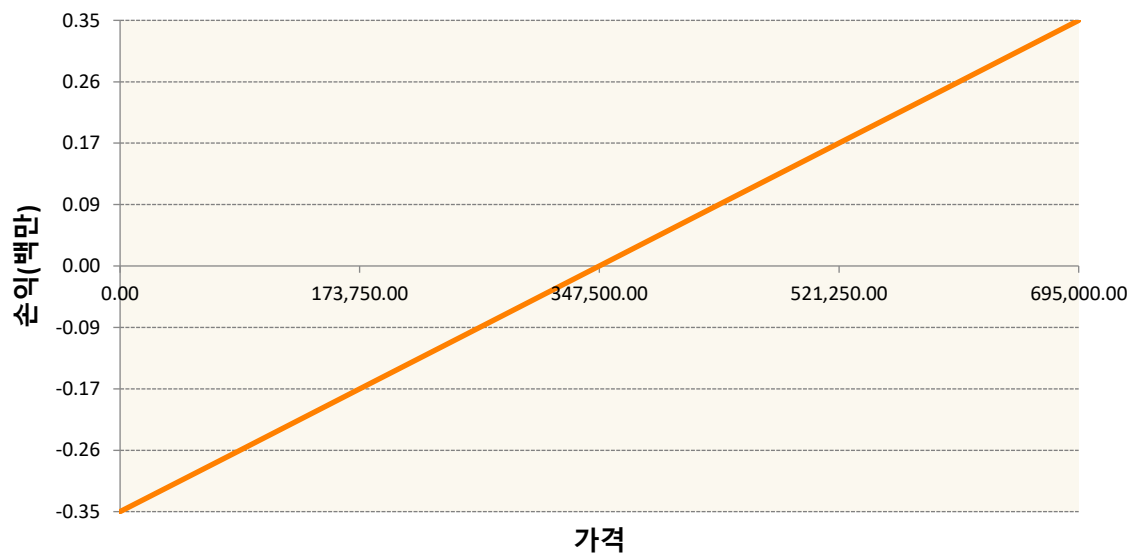
KR41E8WA0008-2025-10 포스코퓨처엠개별선물



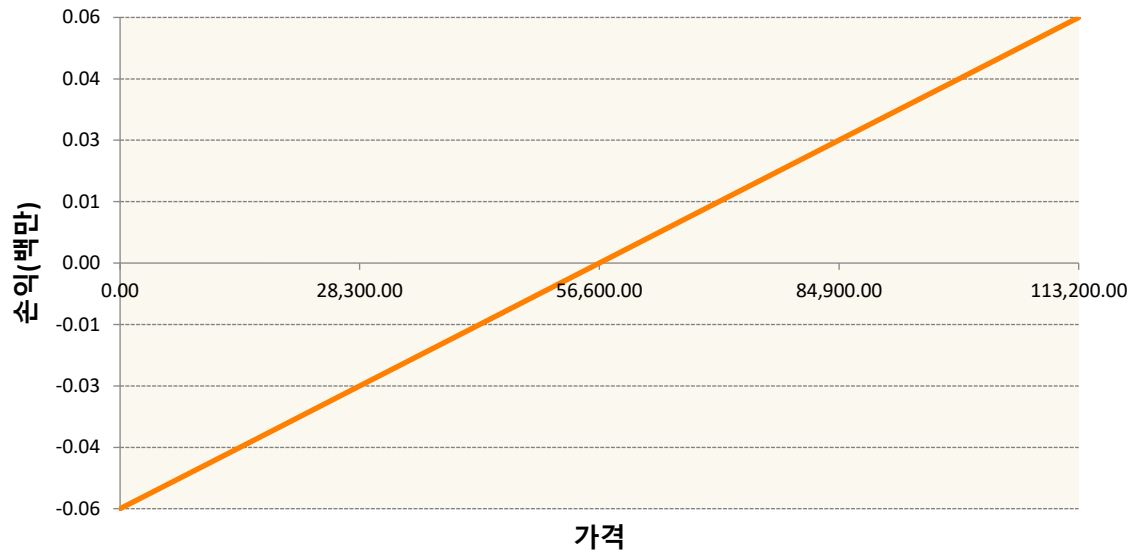
KR41EJWA0009-2025-10 SKC개별선물



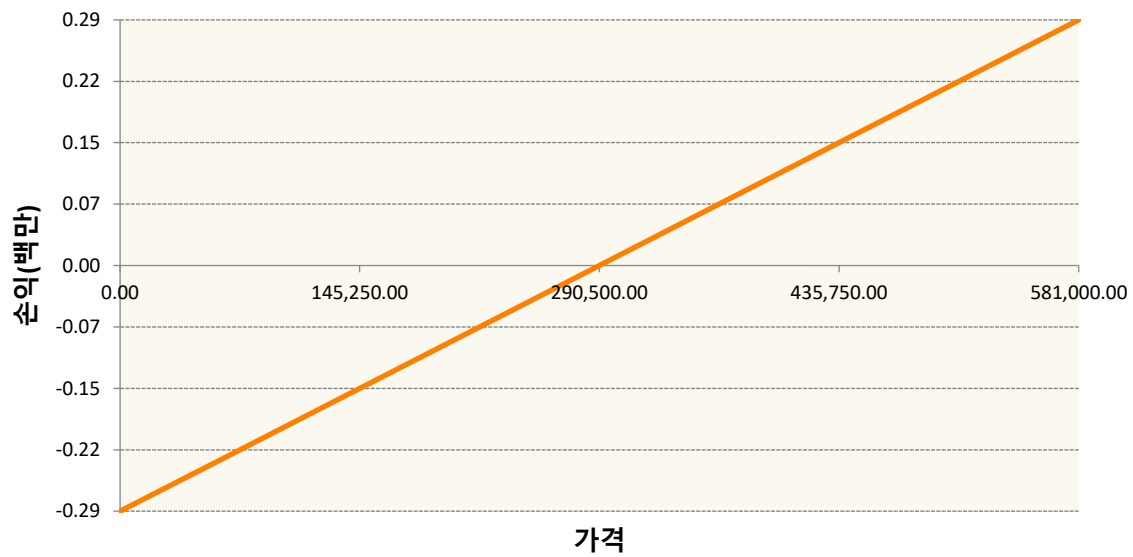
KR41F5WA0008-2025-10 LG에너지솔루션개별선물



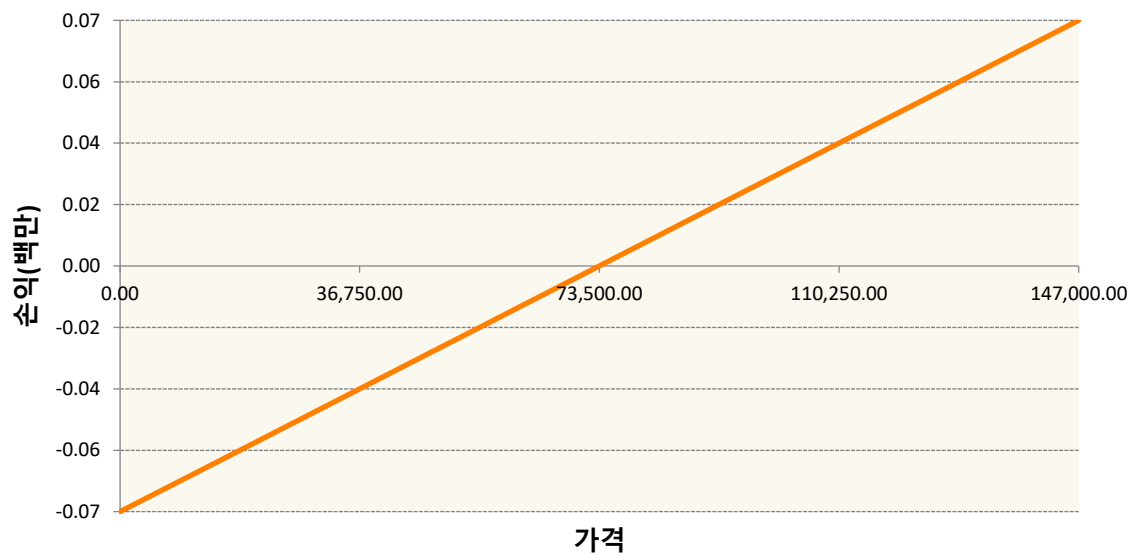
KR41F7WA0006-2025-10 카카오페이개별선물



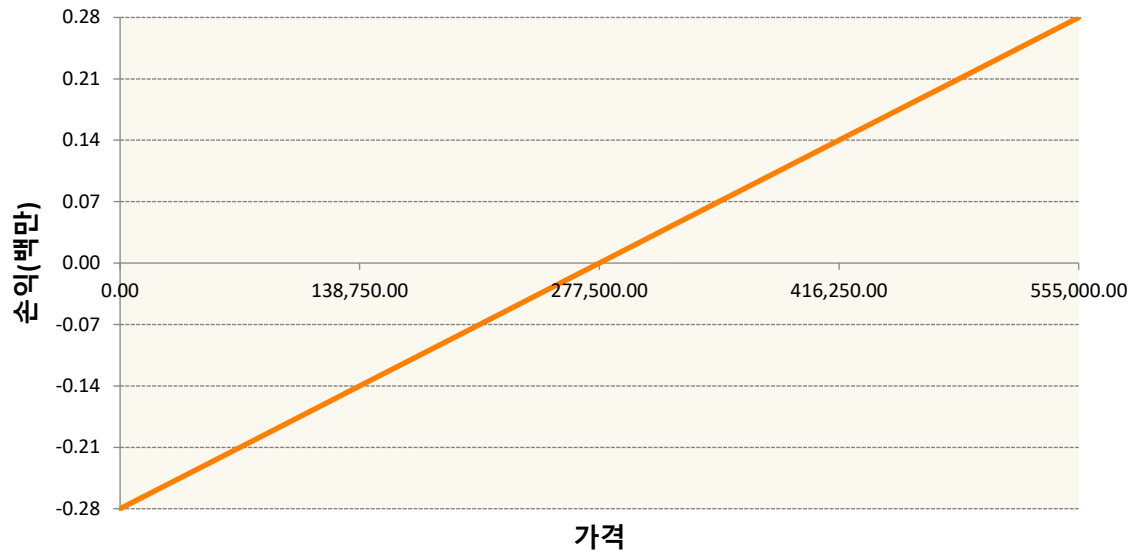
KR41FCWA0005-2025-10 하이브개별선물



KR41FMWA0003-2025-10 엘앤에프개별선물



KR41HEWA0001-2025-10 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	513
KR410FWA0(2025-10 두산로보틱스개별선물	14
KR4111WA0(2025-10 삼성전자개별선물	96
KR4150WA0(2025-10 SK하이닉스개별선물	99
KR41DAWAC 2025-10 농심개별선물	5
KR41E8WA0(2025-10 포스코퓨처엠개별선물	40
KR41EJWA0(2025-10 SKC개별선물	21
KR41F5WA0(2025-10 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F7WA0(2025-10 카카오페이개별선물	16
KR41FCWA0(2025-10 하이브개별선물	67
KR41FMWAC 2025-10 엘앤에프개별선물	21
KR41HEWA0 2025-10 키움증권개별선물	42

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

(단위:백만원)

482

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

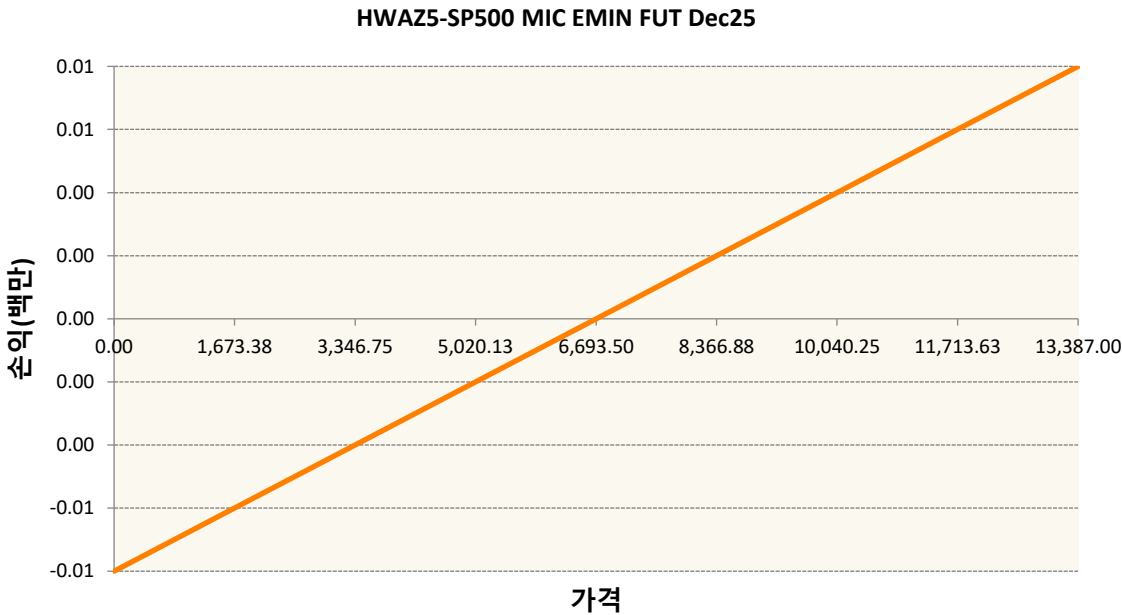
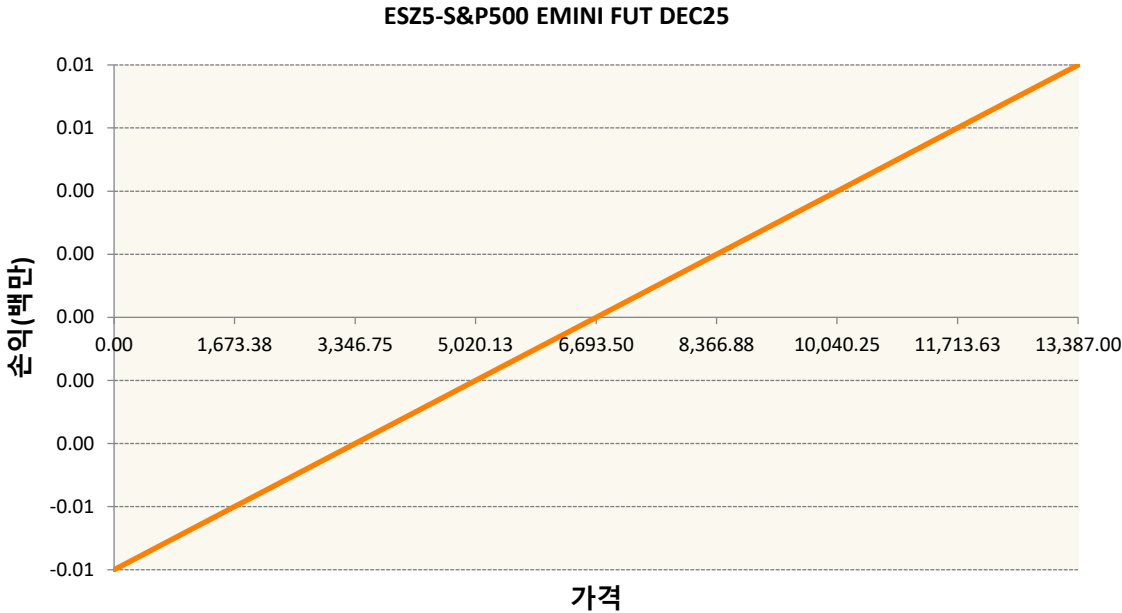
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	장내
누계	유가증권	선물	36,693	0	36,693	
누계	유가증권	선물	1,254	0	1,254	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	2,935
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,299

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

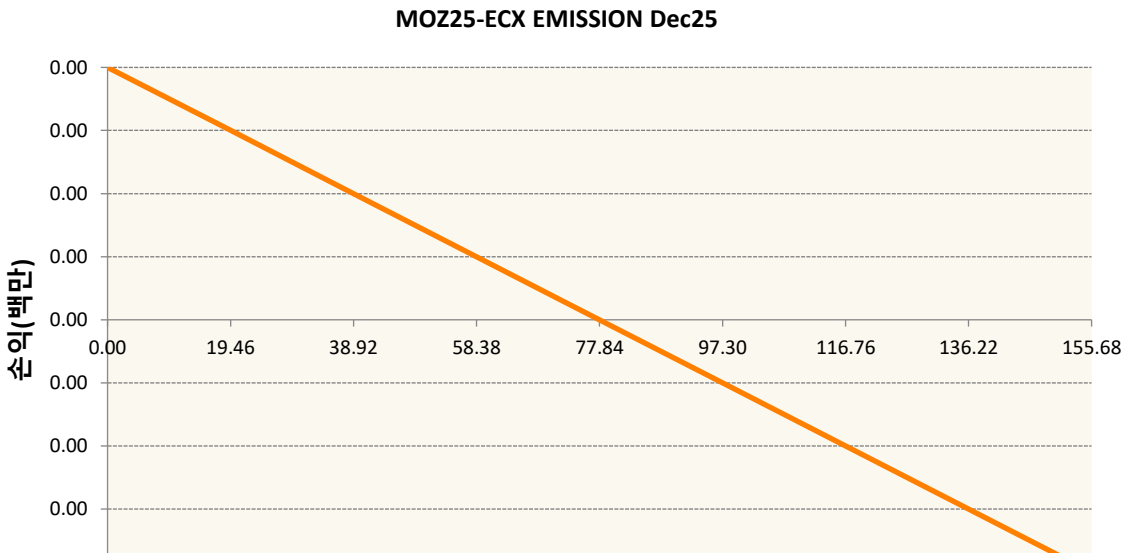
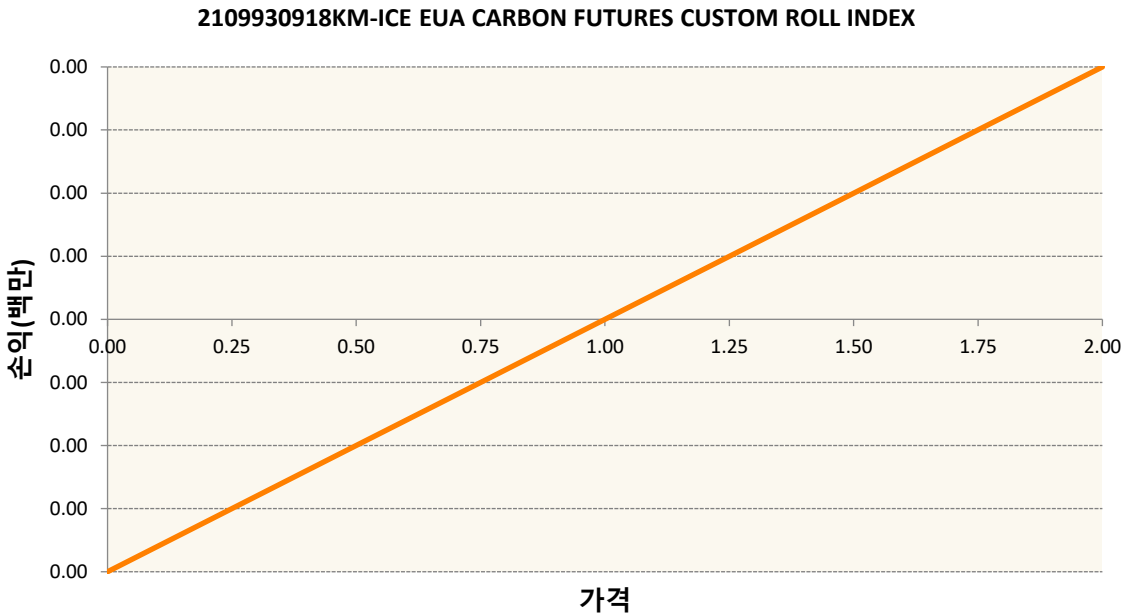
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	3,874	-3,874	
누계	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	1,221	-1,221	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.14
FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E	98
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	310

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

(단위:백만원)

497

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

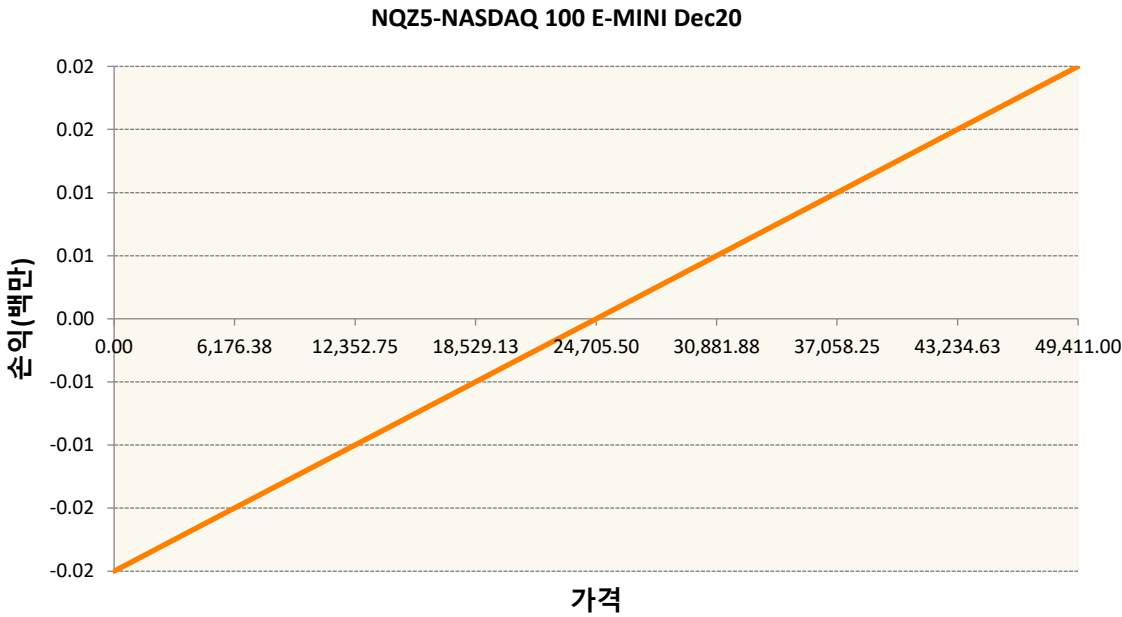
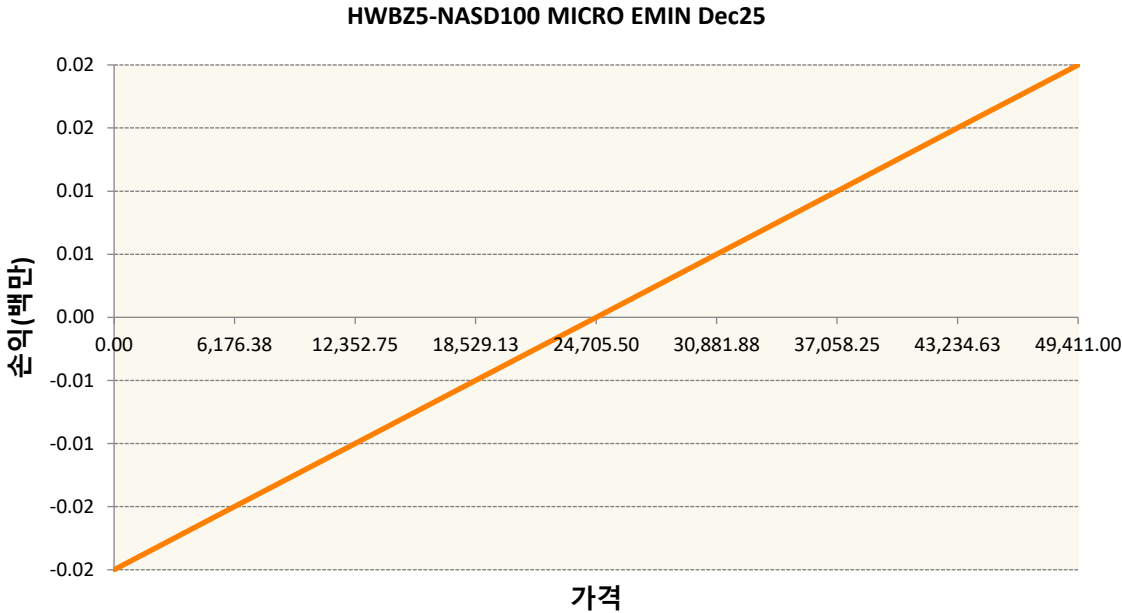
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	장내
누계	유가증권	선물	15,087	0	15,087	
누계	유가증권	선물	1,783	0	1,783	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25		143
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,207

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,480

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

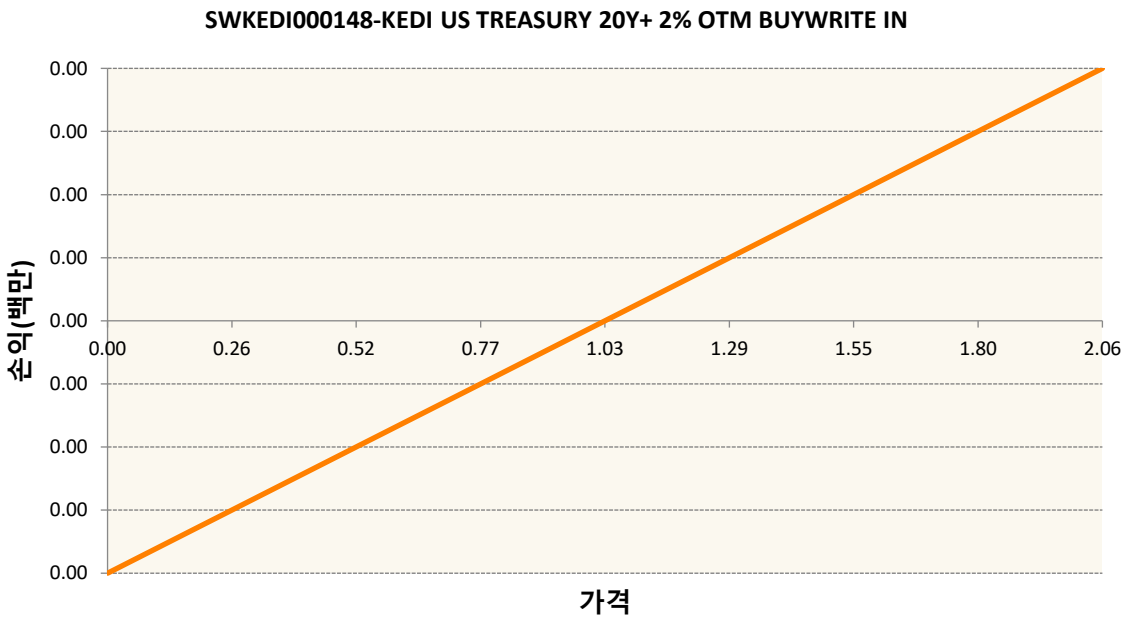
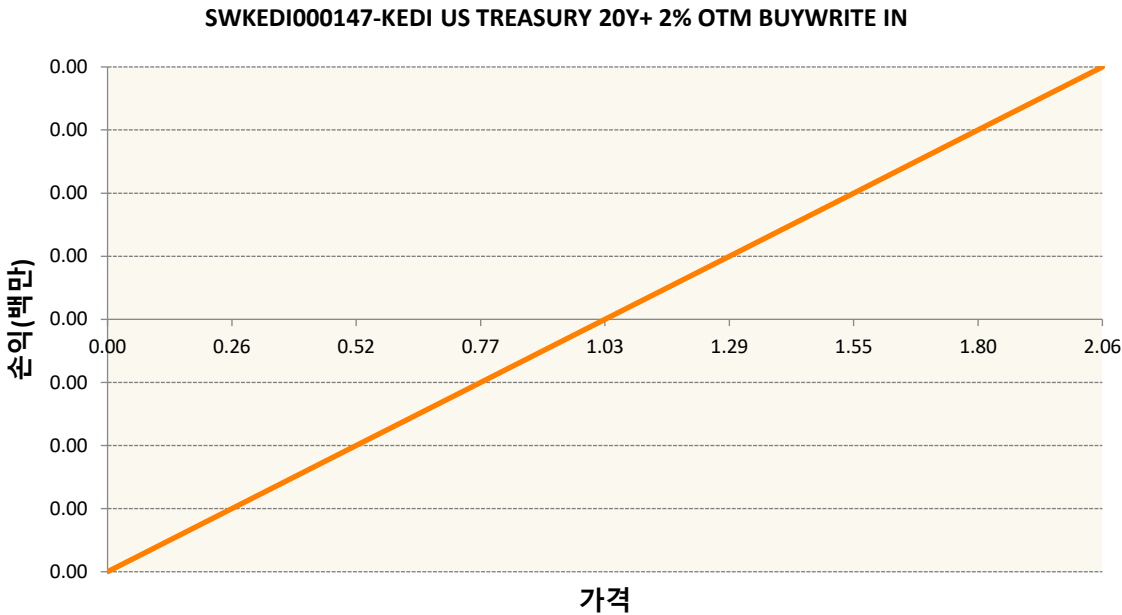
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

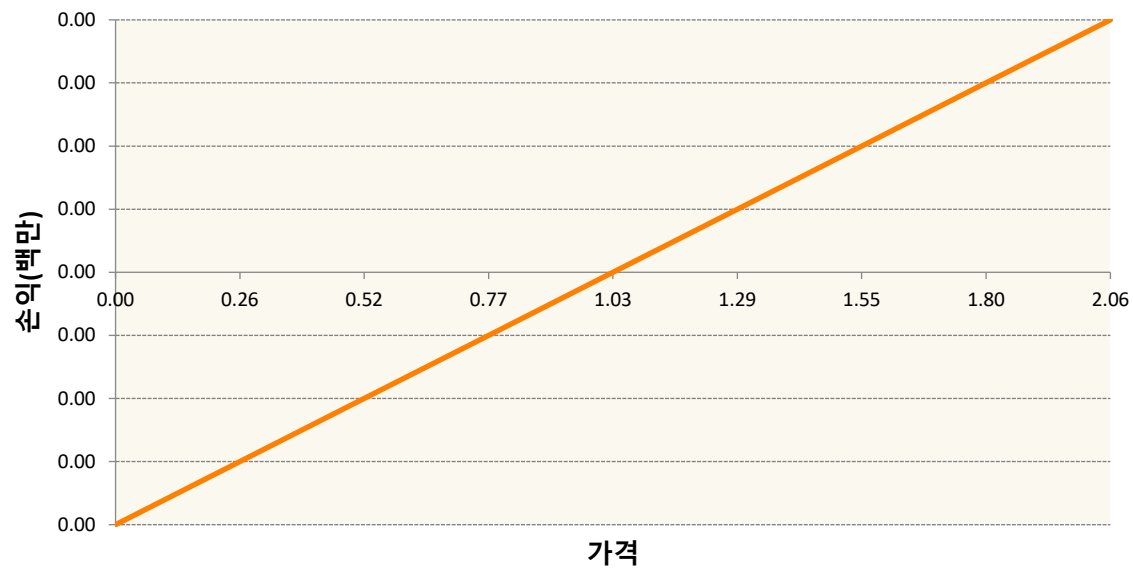
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	357,227	0	357,227	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

8,091
9,714
3,597
7,675

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

(단위:백만원)

14,255

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

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	2,526	0	2,526	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1

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

(단위:백만원)

4

공시일	2025-09-22
기준일	2025-09-19

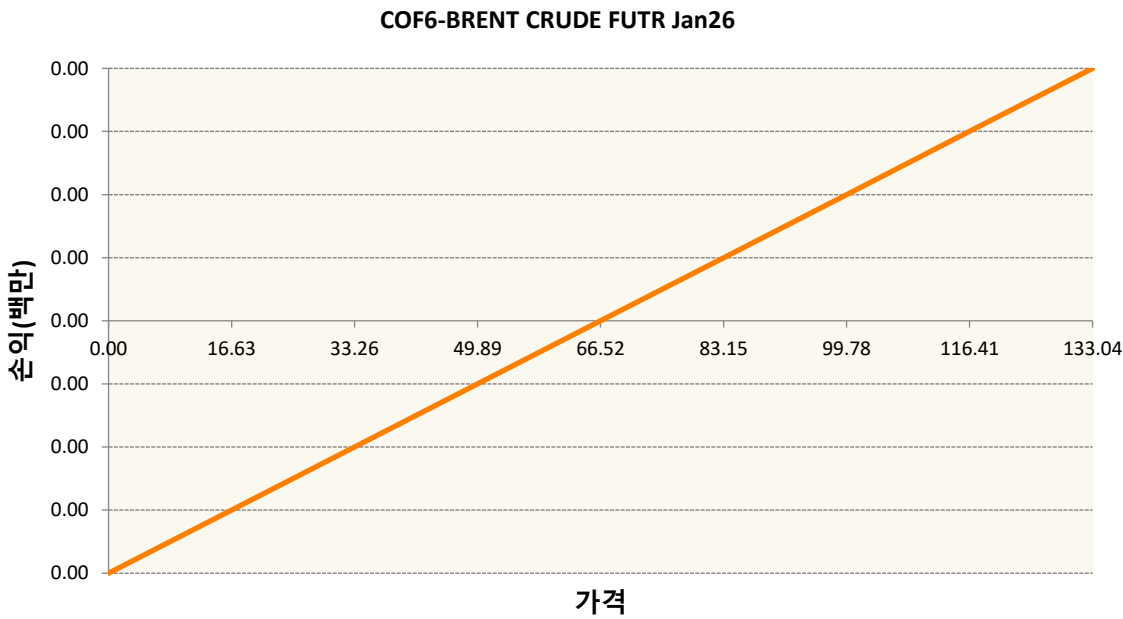
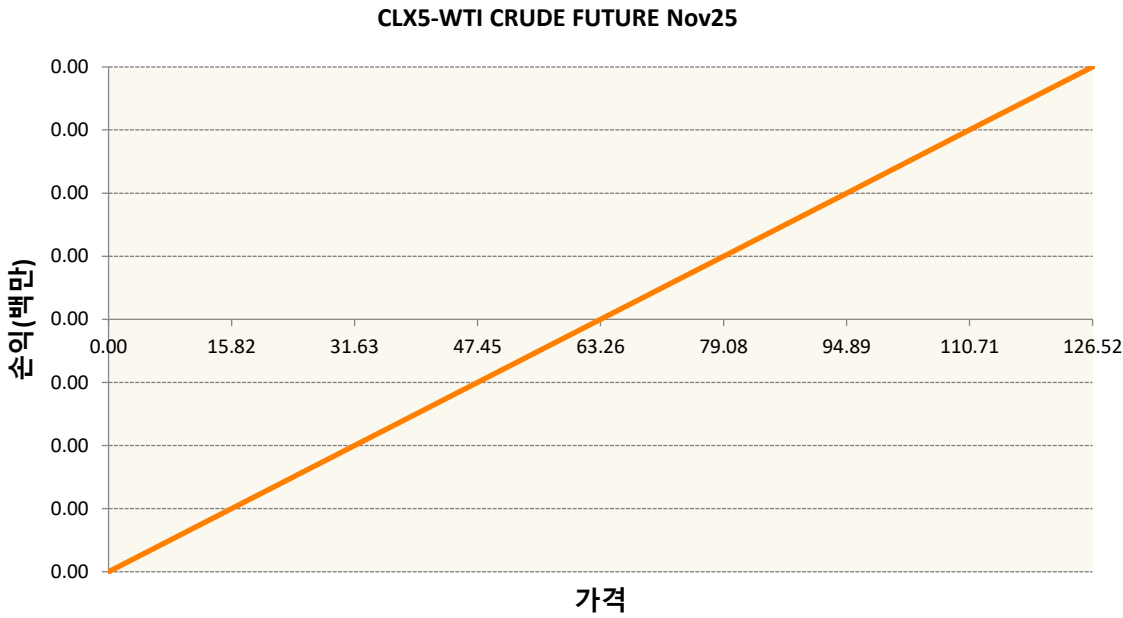
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

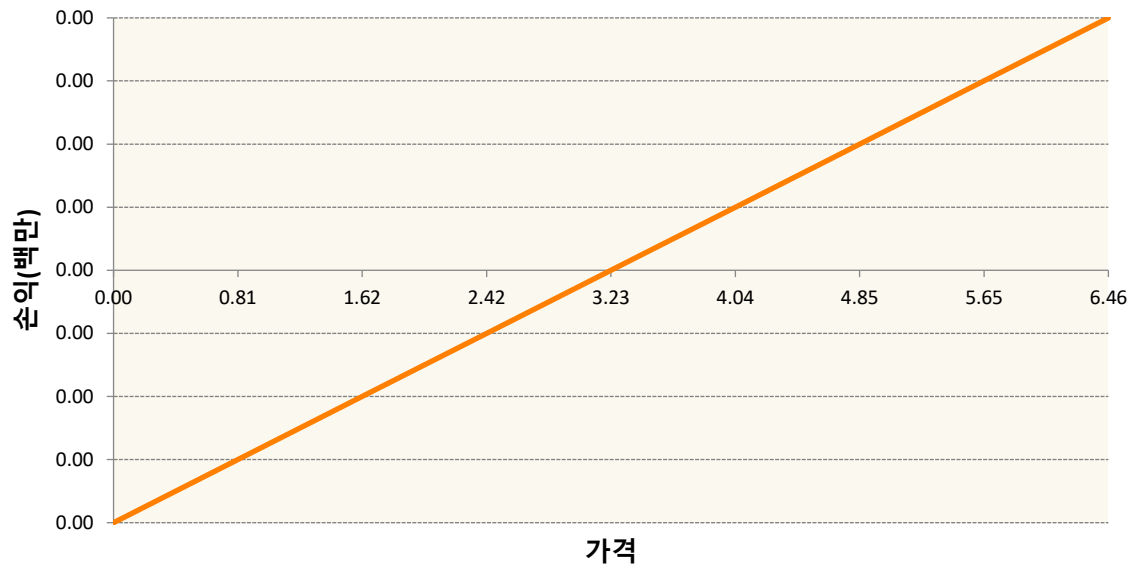
(단위:백만원)

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	538	0	538	
누계	통화	선물	0	84	-84	장내

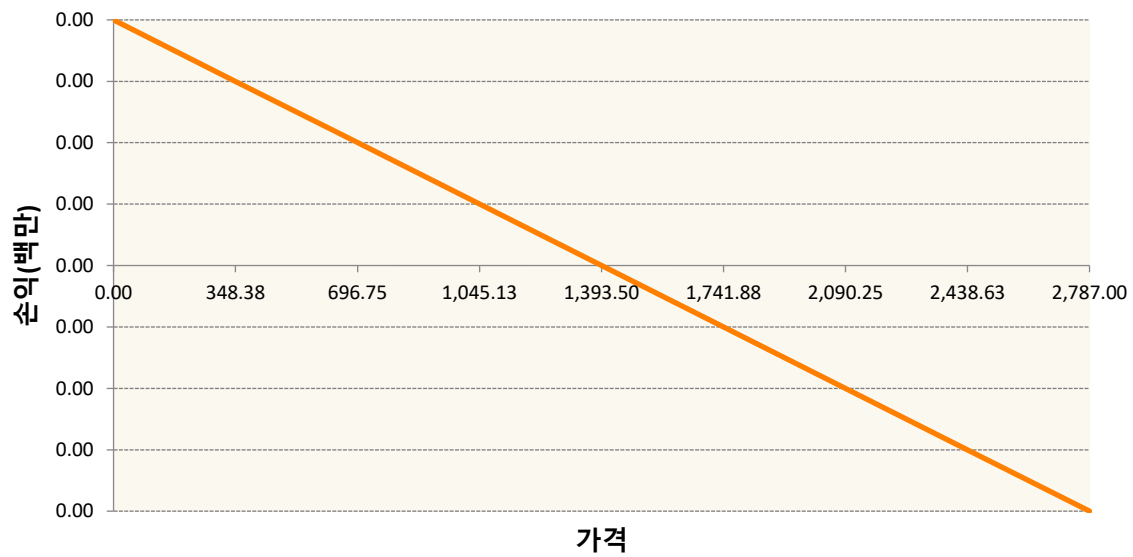
2. 만기시점의 손익구조



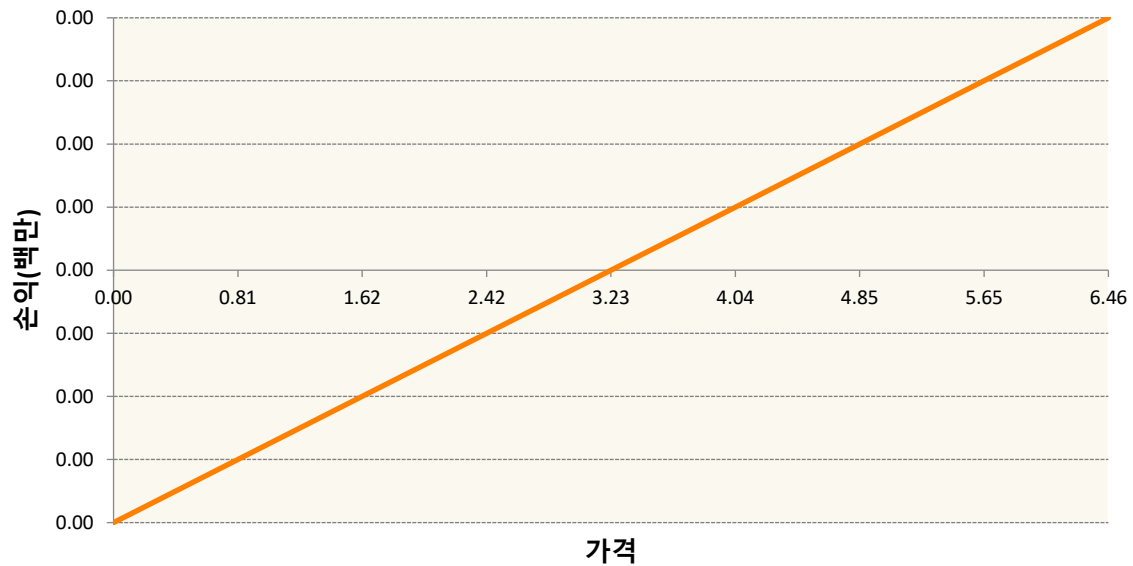
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

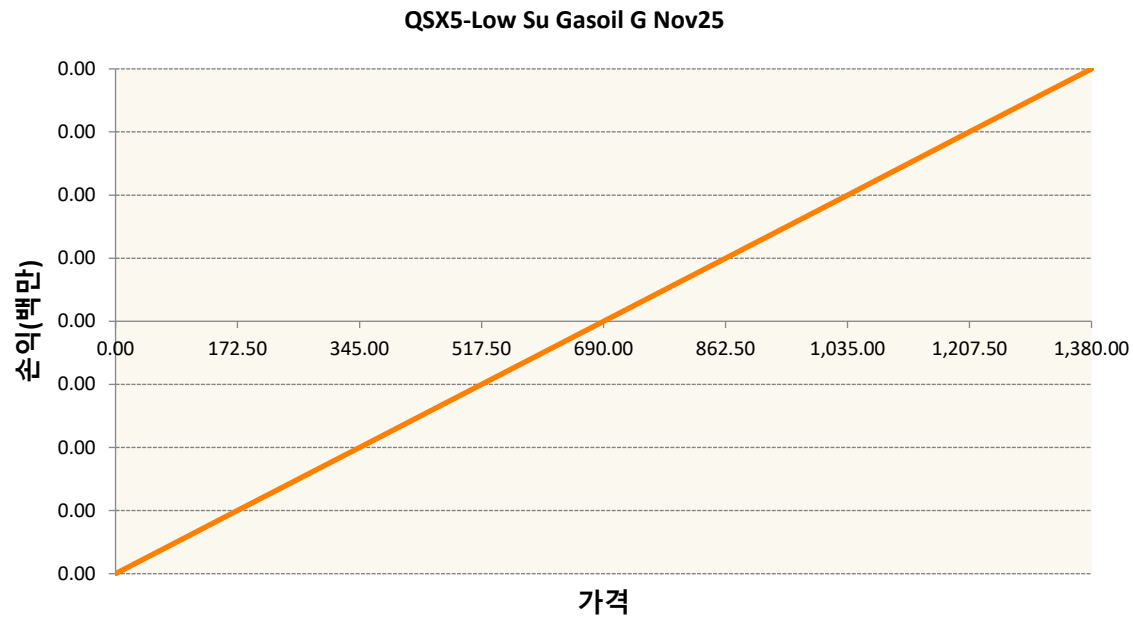


KR4175WA0006-2025-10 달러선물



NGX25-NATURAL GAS FUTR Nov25





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLX5	WTI CRUDE FUTURE Nov25		7
COF6	BRENT CRUDE FUTR Jan26		15
EOX5	E-MINI NATURAL GA Nov25		3
KR4175WA01	2025-10 달러선물		7
NGX25	NATURAL GAS FUTR Nov25		11
QXS5	Low Su Gasoil G Nov25		8

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