

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

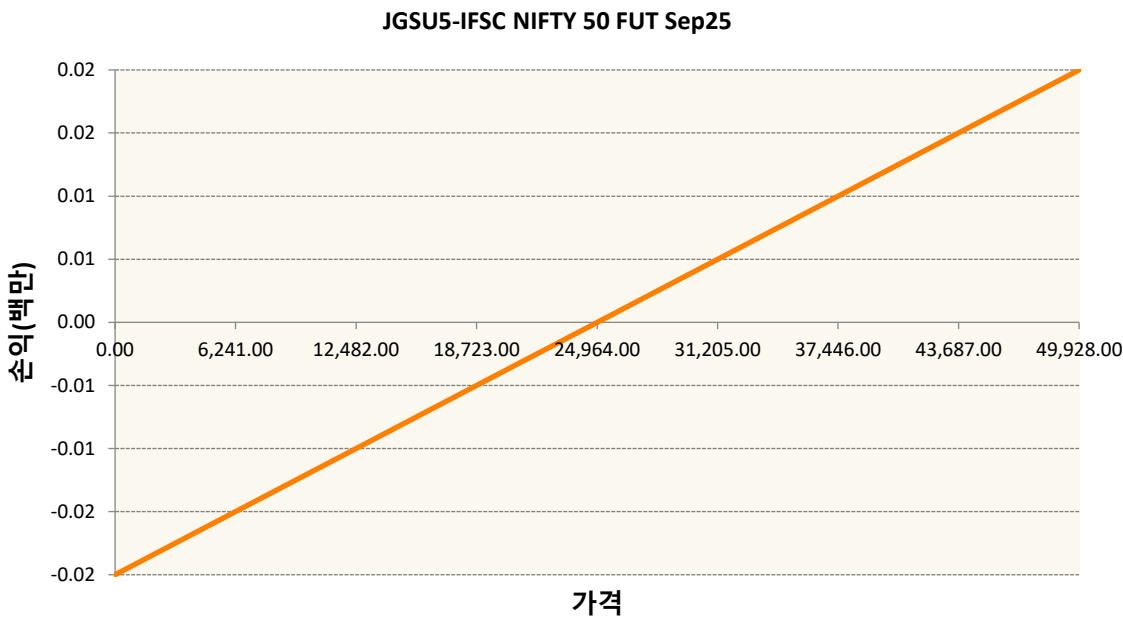
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	558	0	558	

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	2025-09-29
기준일	2025-09-26

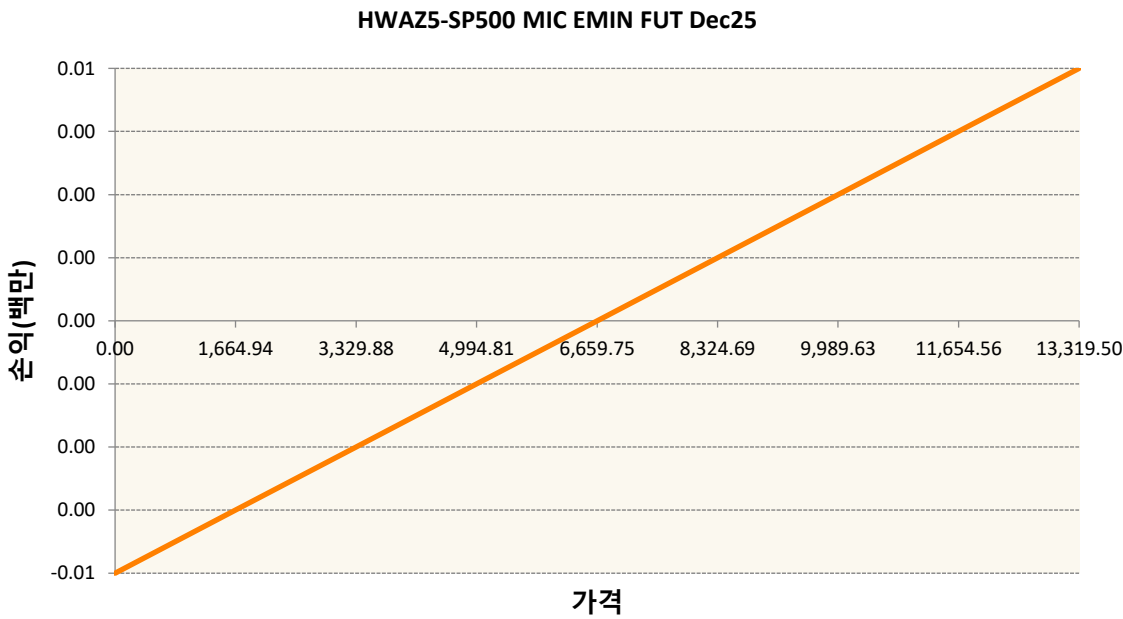
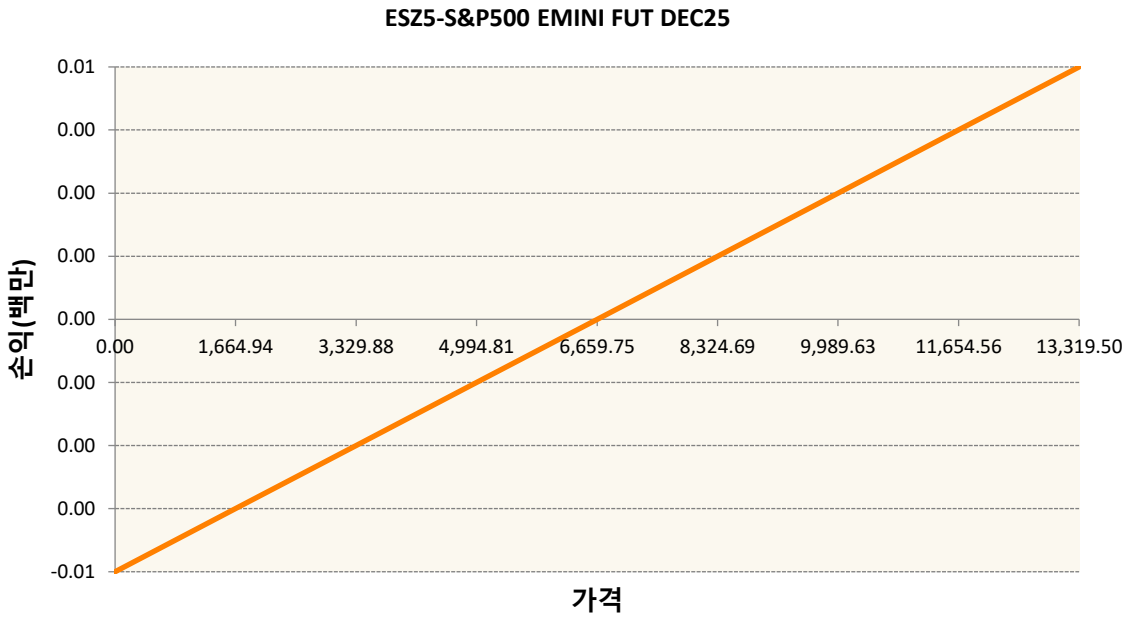
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	462	0	462	
누계	유가증권	선물	185	0	185	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	37
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	66

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

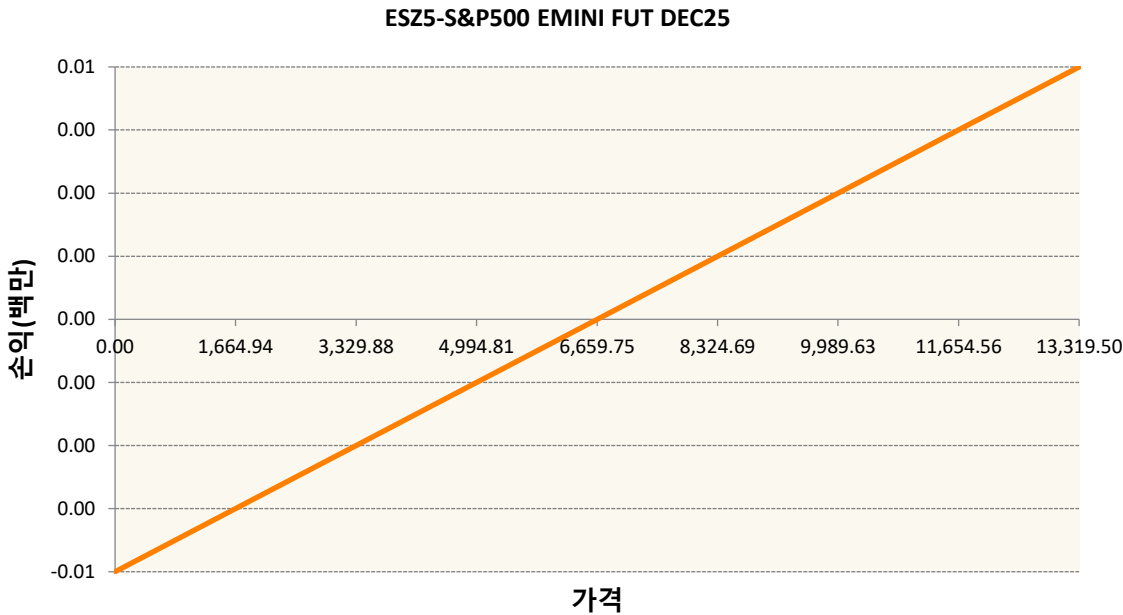
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,386	0	1,386	

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)

159

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

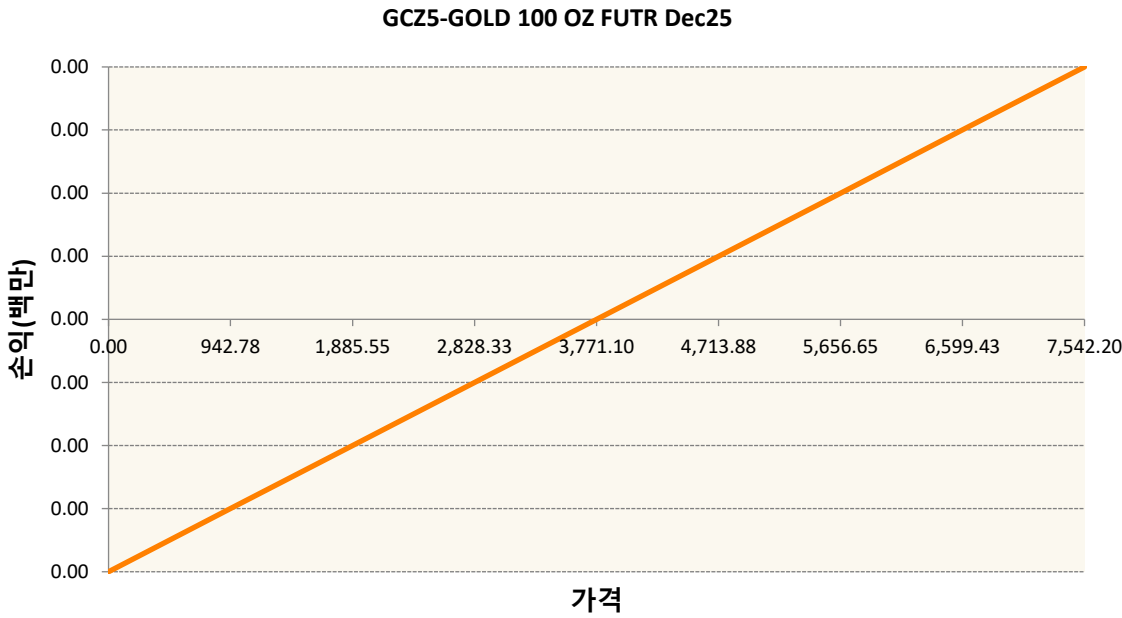
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 09/26/25 C337 EQUITY	1
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	126

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

(단위:백만원)

109

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC' PLTR US 09/26/25 C182.5 EQUITY	159
AOPLTRUSP1 PLTR US 09/26/25 P182.5 EQUITY	19

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

(단위:백만원)

713

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSC0TLT US 09/26/25 C89.5 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

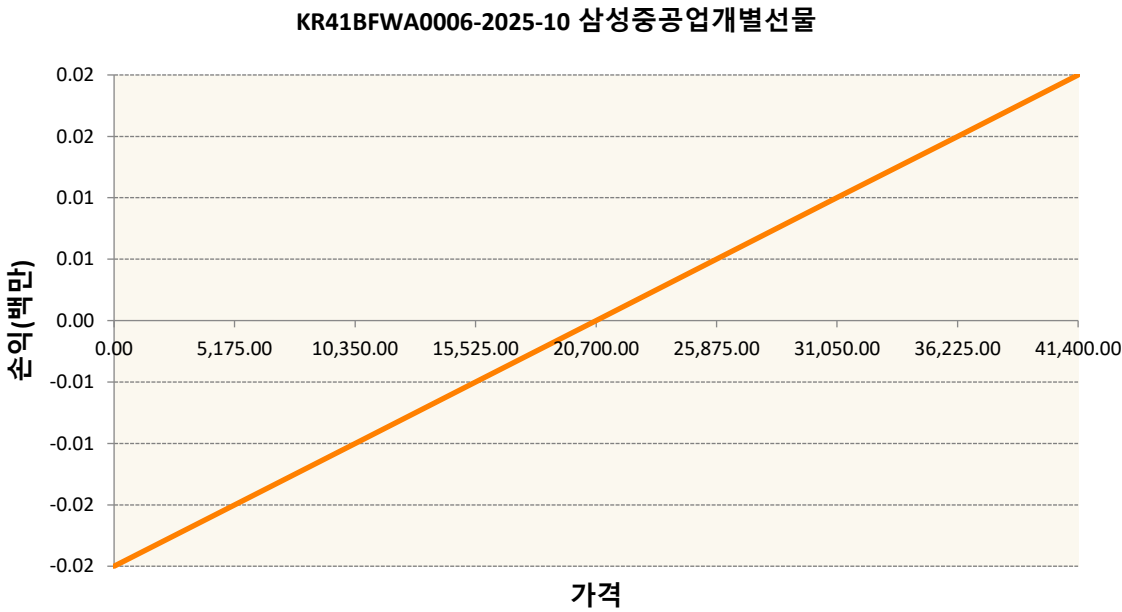
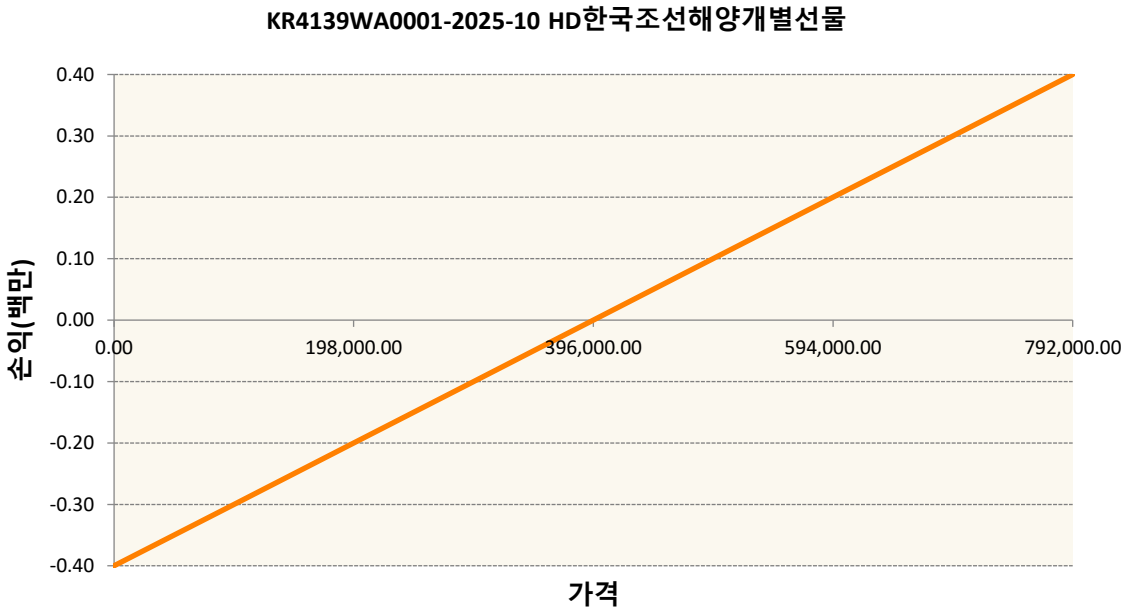
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

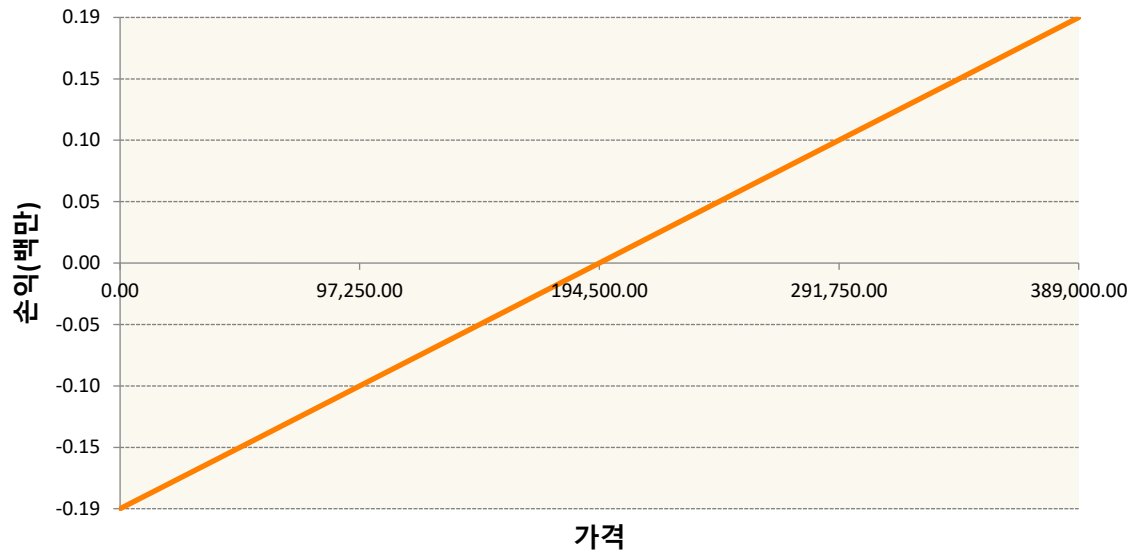
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	50,679	0	50,679	장내

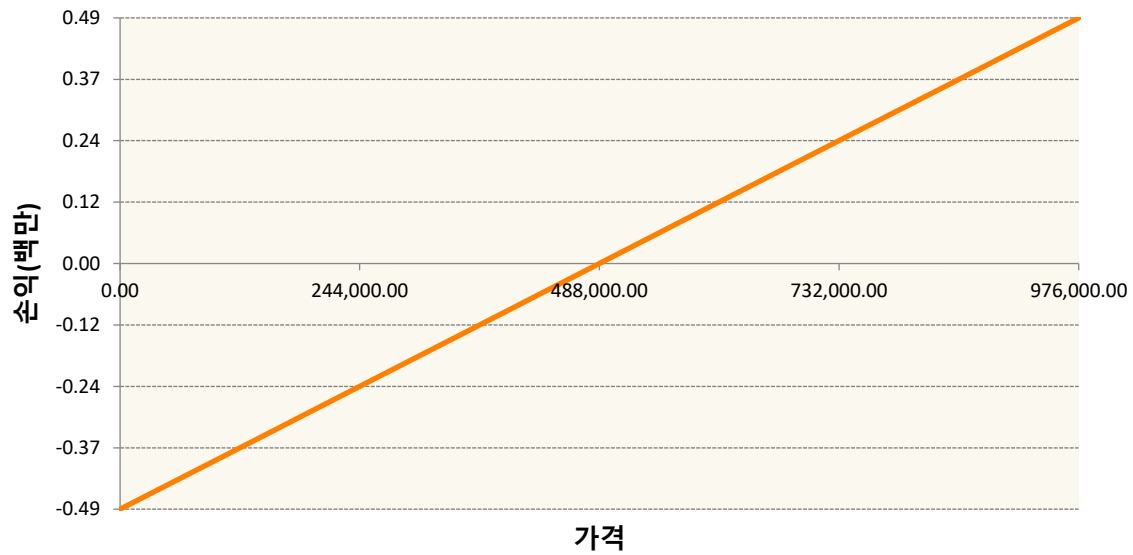
2. 만기시점의 손익구조



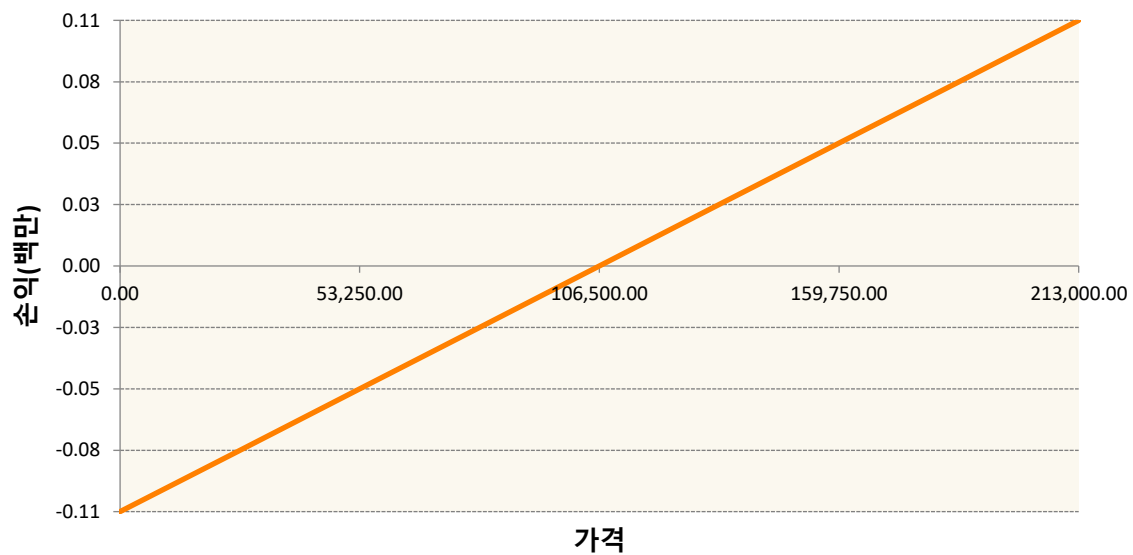
KR41CDWA0007-2025-10 HD현대미포개별선물



KR41FDWA0004-2025-10 HD현대중공업개별선물



KR41FVWA0002-2025-10 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139WA0001			2025-10 HD한국조선해양개별선물				1,148
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148	-1,148
-5.33%	-765	-765	-765	-765	-765	-765	-765
-2.67%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	383	383	383	383	383	383	383
5.33%	765	765	765	765	765	765	765
8.00%	1,148	1,148	1,148	1,148	1,148	1,148	1,148
KR41BFWA0006			2025-10 삼성중공업개별선물				1,033
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,033	-1,033	-1,033	-1,033	-1,033	-1,033	-1,033
-5.33%	-689	-689	-689	-689	-689	-689	-689
-2.67%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	344	344	344	344	344	344	344
5.33%	689	689	689	689	689	689	689
8.00%	1,033	1,033	1,033	1,033	1,033	1,033	1,033
KR41CDWA0007			2025-10 HD현대미포개별선물				439
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-439	-439	-439	-439	-439	-439	-439
-5.33%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293
-2.67%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	146	146	146	146	146	146	146
5.33%	293	293	293	293	293	293	293
8.00%	439	439	439	439	439	439	439
KR41FDWA0004			2025-10 HD현대중공업개별선물				582
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-582	-582	-582	-582	-582	-582	-582
-5.33%	-388	-388	-388	-388	-388	-388	-388
-2.67%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	194	194	194	194	194	194	194
5.33%	388	388	388	388	388	388	388
8.00%	582	582	582	582	582	582	582
KR41FVWA0002			2025-10 한화오션개별선물				872
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-872	-872	-872	-872	-872	-872	-872
-5.33%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581
-2.67%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-291
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	291	291	291	291	291	291	291
5.33%	581	581	581	581	581	581	581
8.00%	872	872	872	872	872	872	872

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

(단위:백만원)

2,151

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

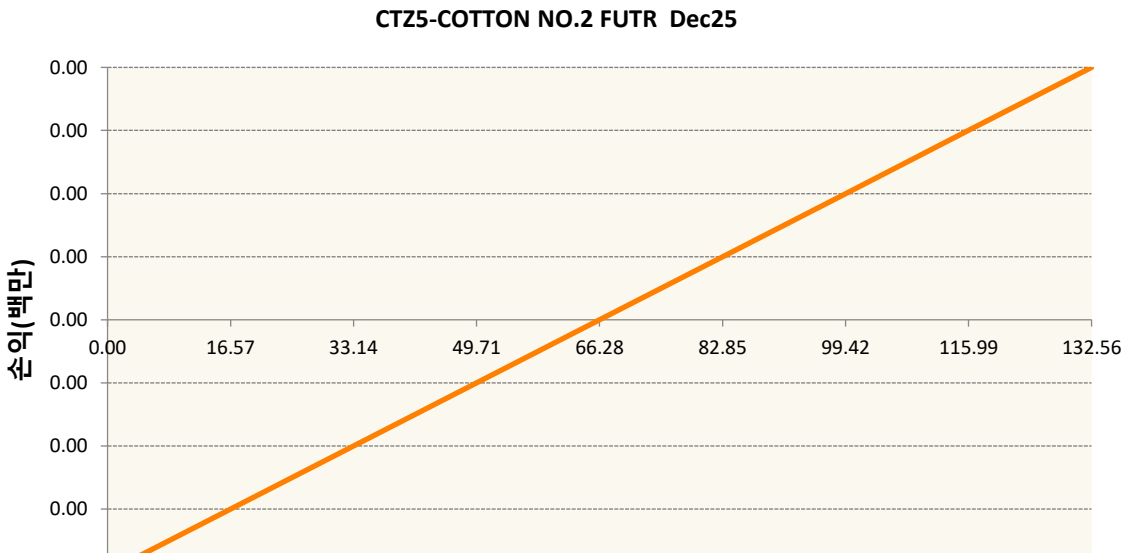
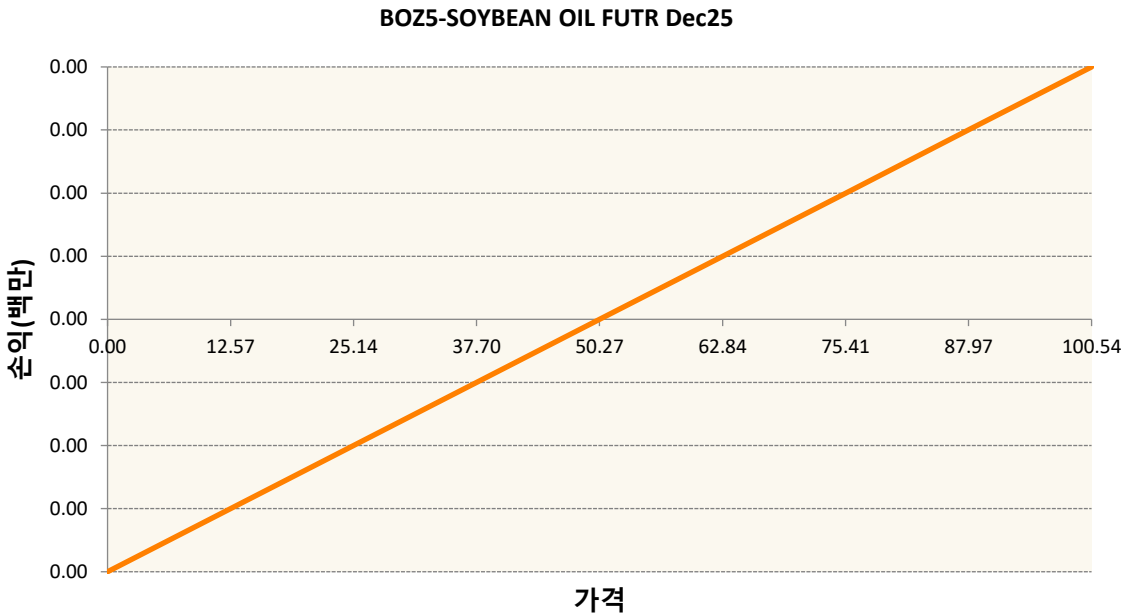
포커스농산물모(채권-파생형)

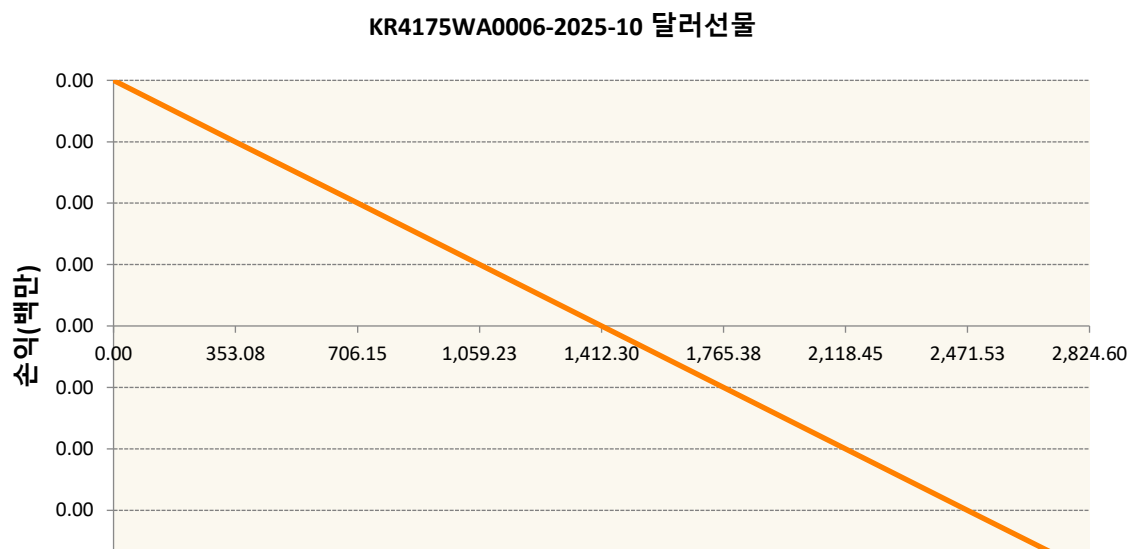
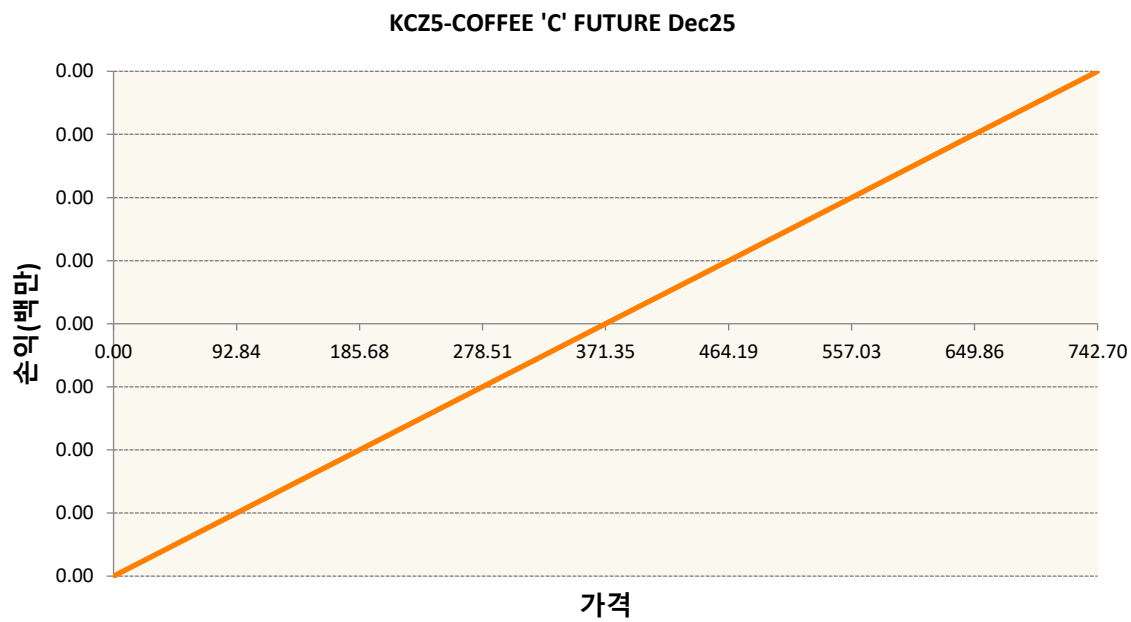
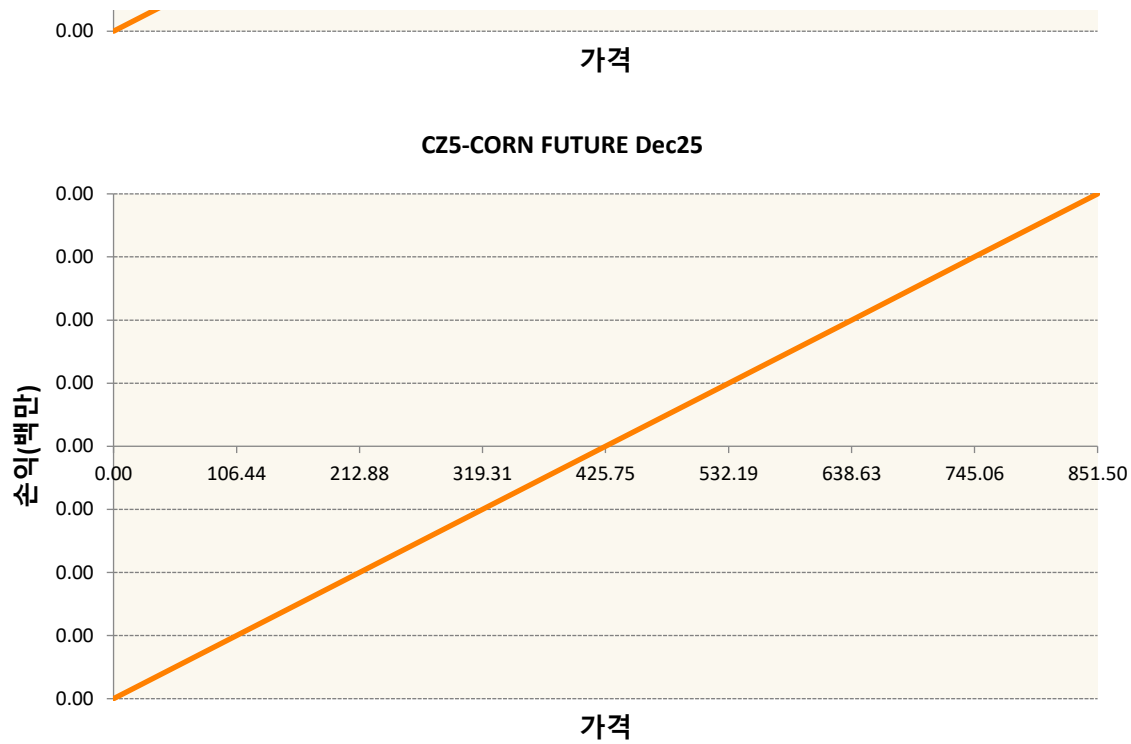
1. 계약금액

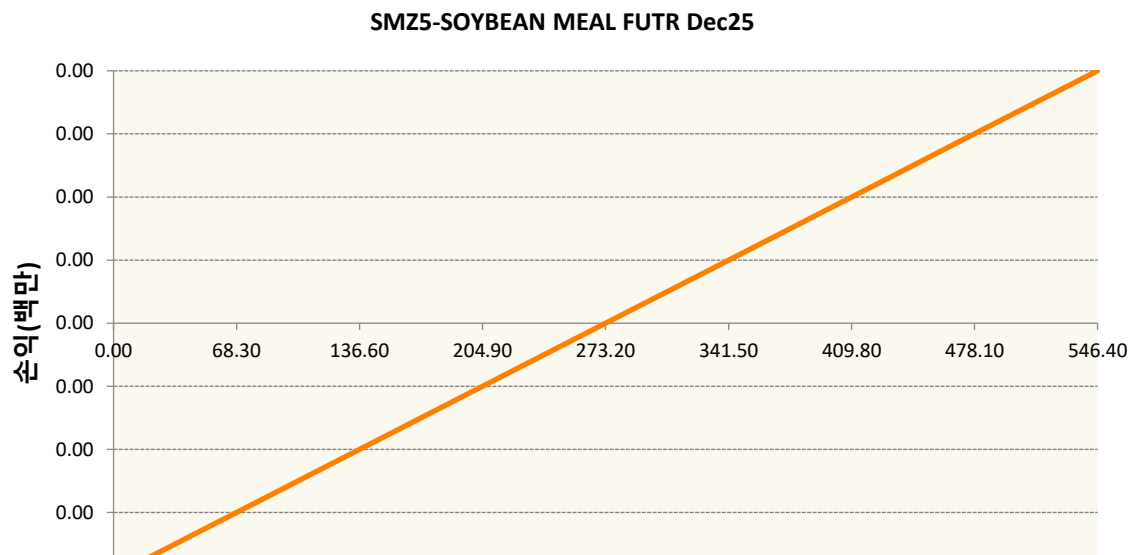
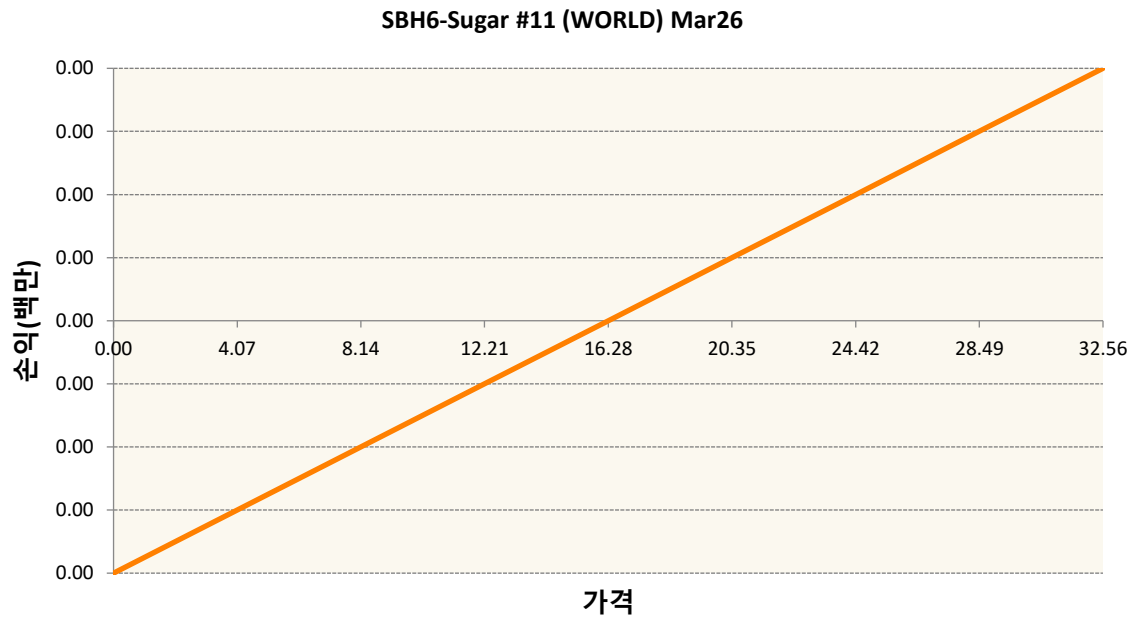
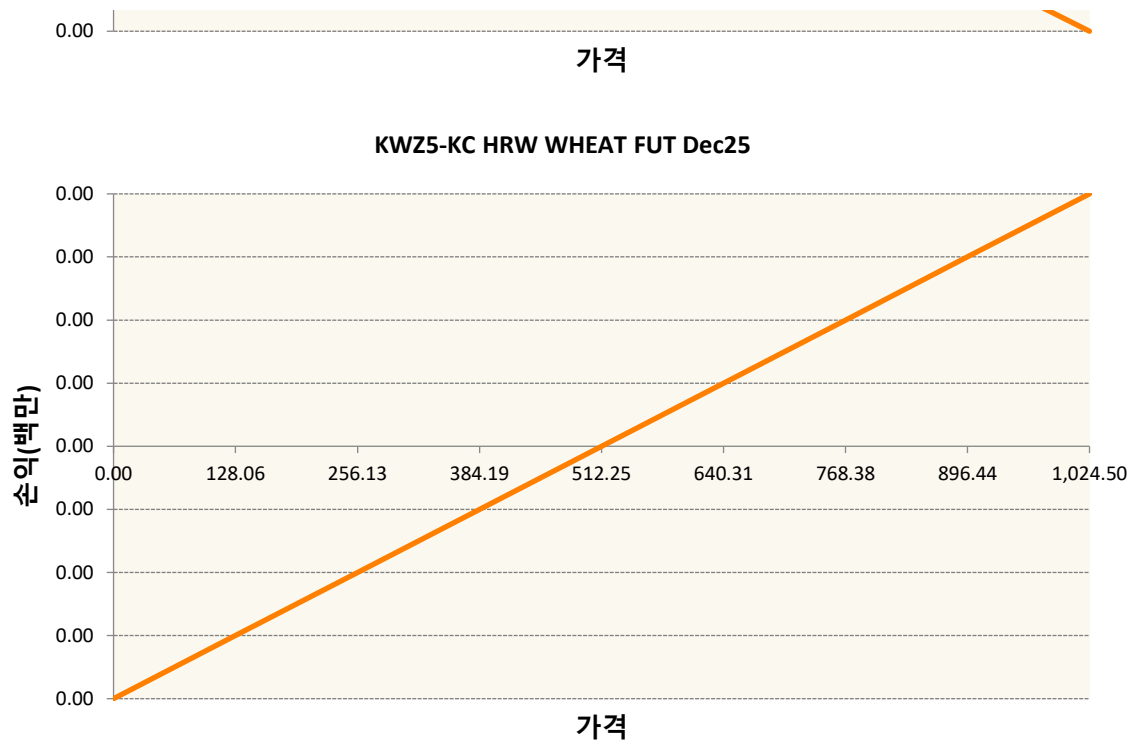
(단위:USD 백만)

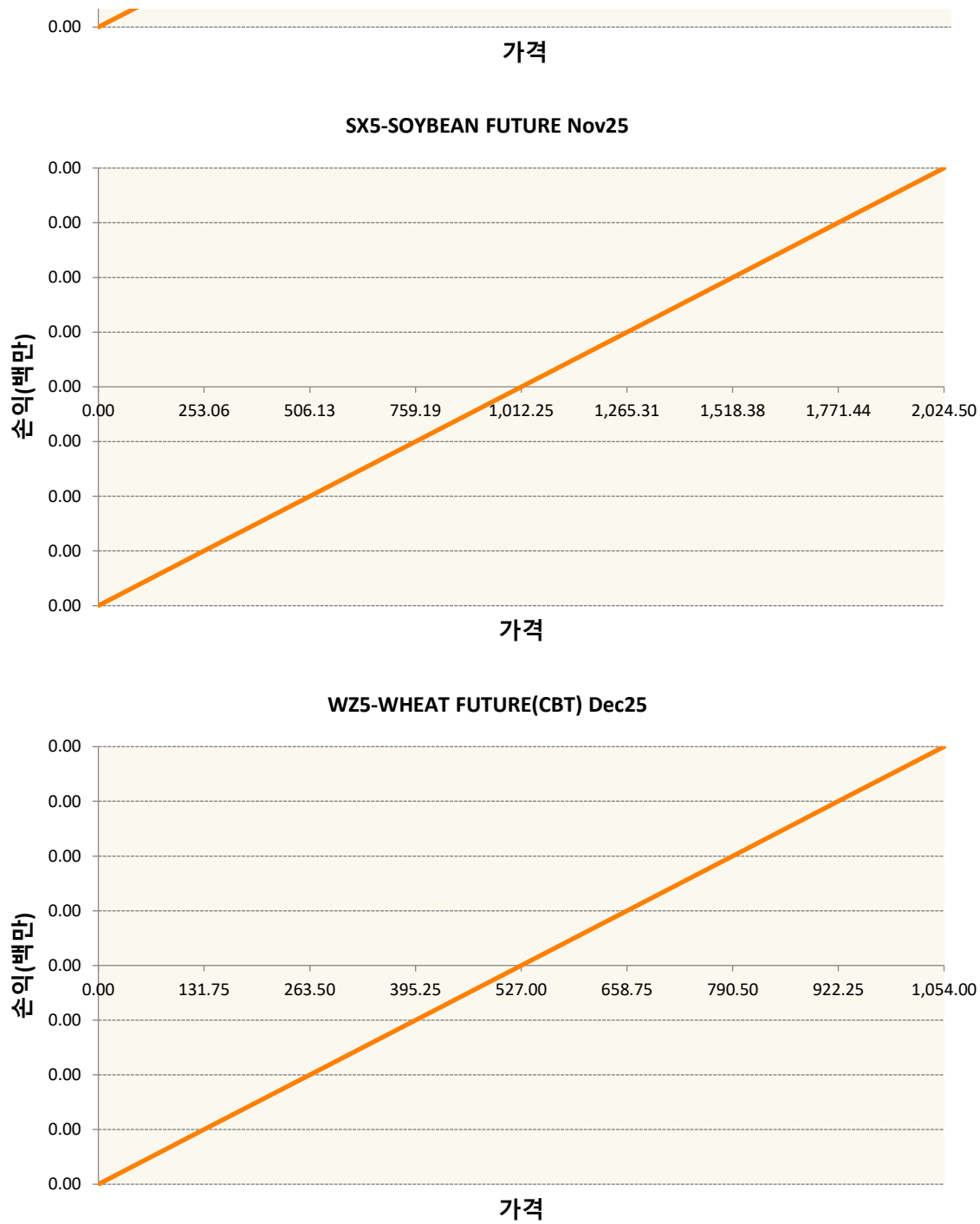
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,152	0	1,152	
누계	유가증권	선물	2,157	0	2,157	
누계	통화	선물	0	325	-325	장내

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	2025-09-29
기준일	2025-09-26

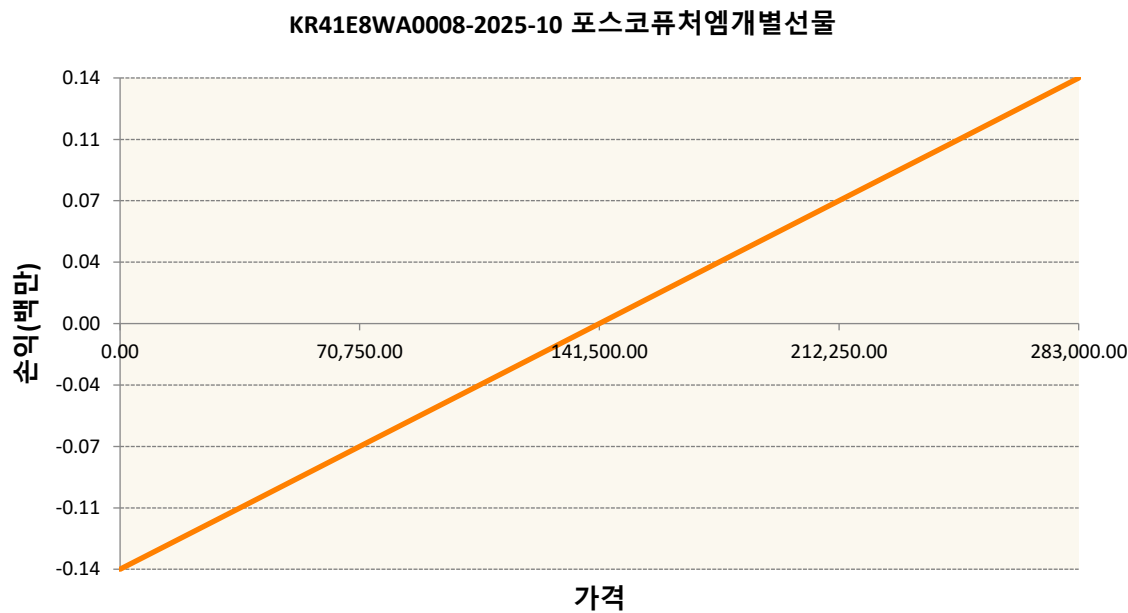
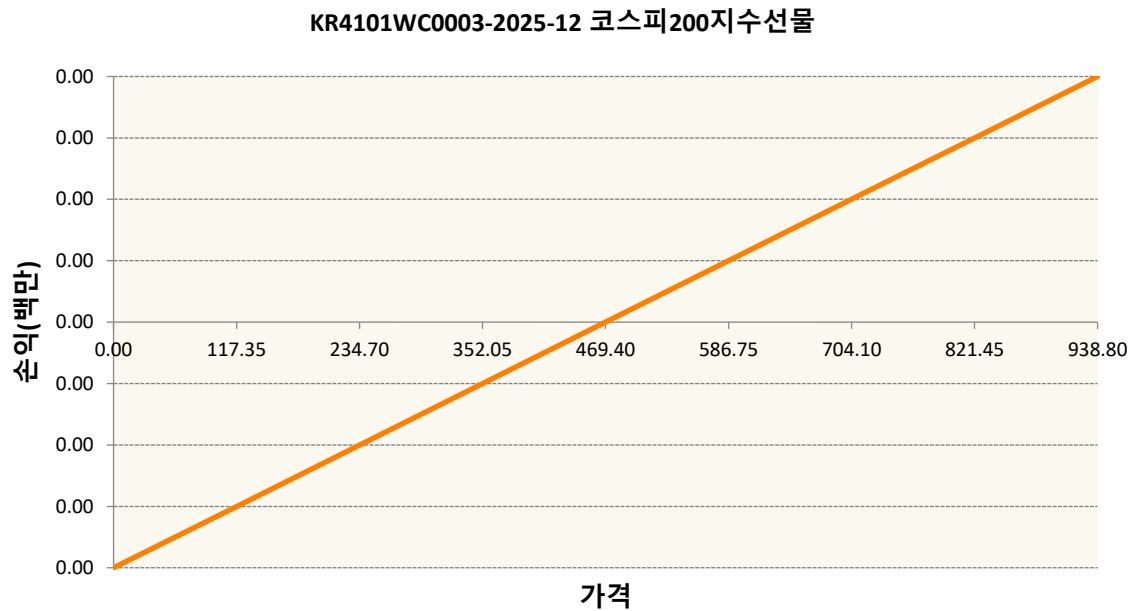
스마트인덱스모

1. 계약금액

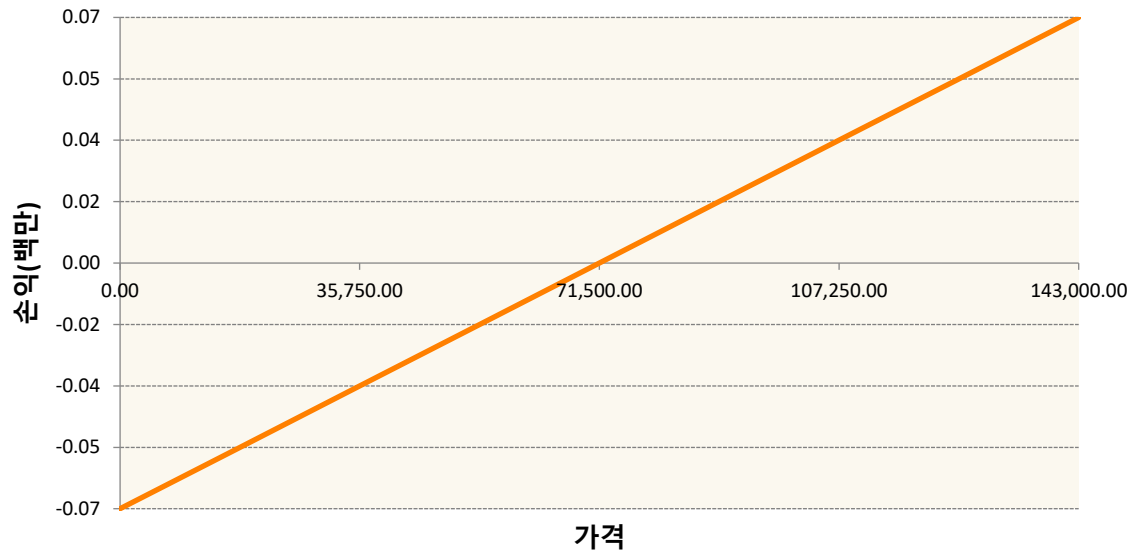
(단위:백만원)

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

94
4
2

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

(단위:백만원)

6

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

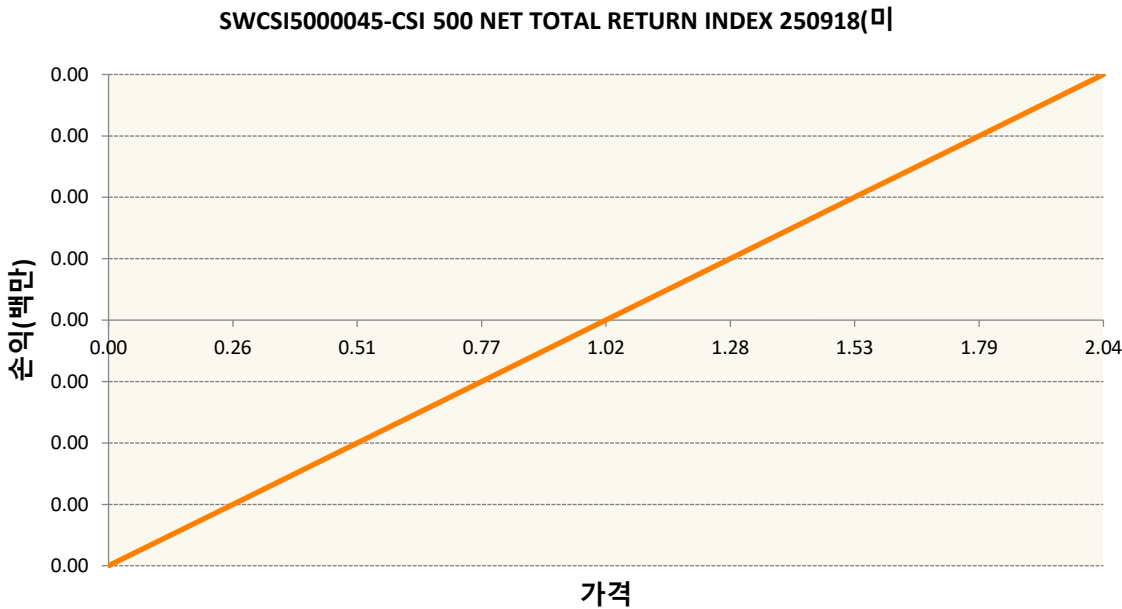
SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,794	0	4,794	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

614

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

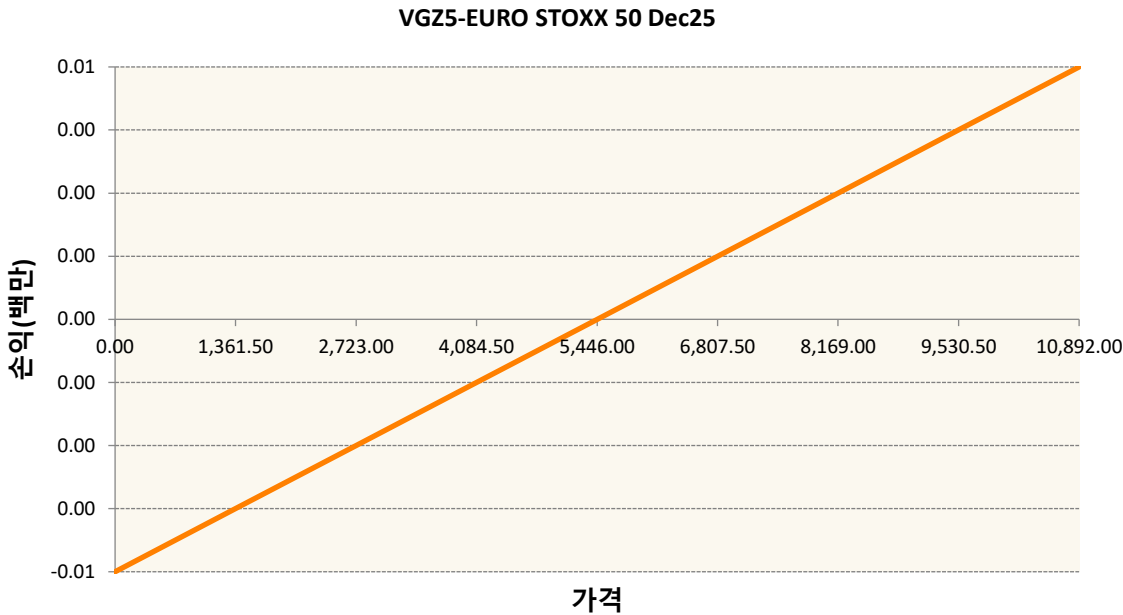
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	713	0	713	

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	2025-09-29
기준일	2025-09-26

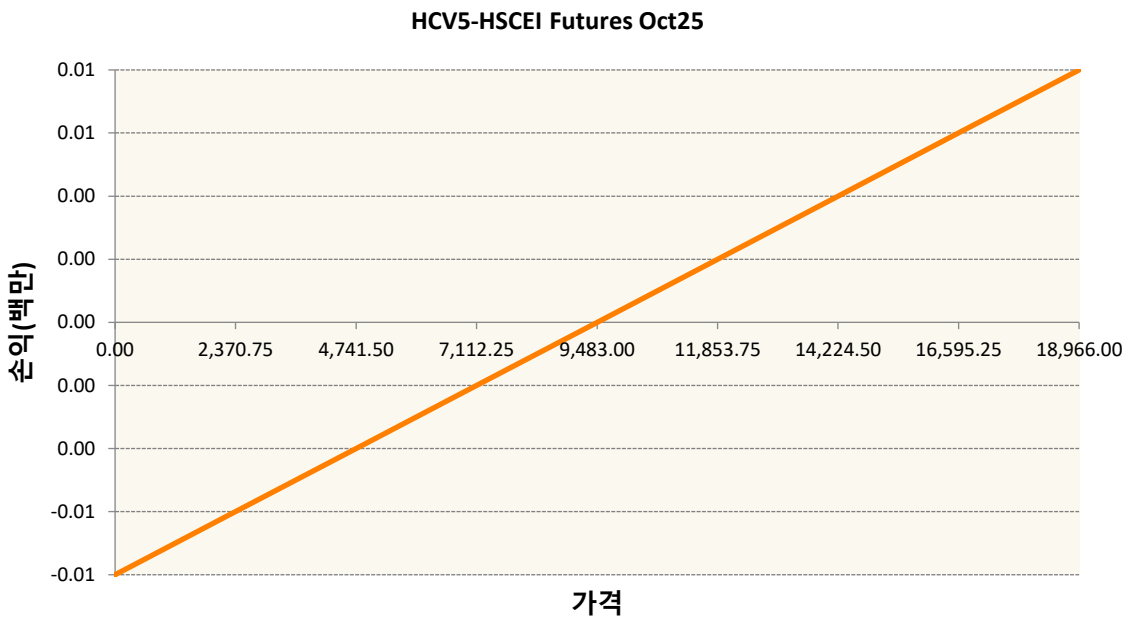
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,152	0	2,152	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV5	HSCEI Futures Oct25	172
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

243

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

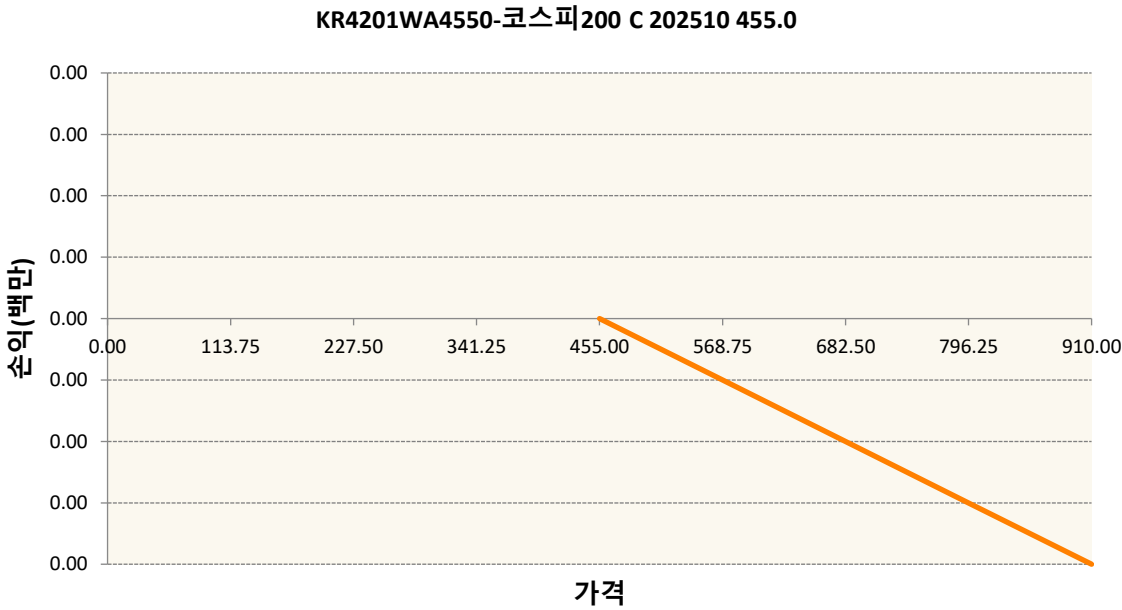
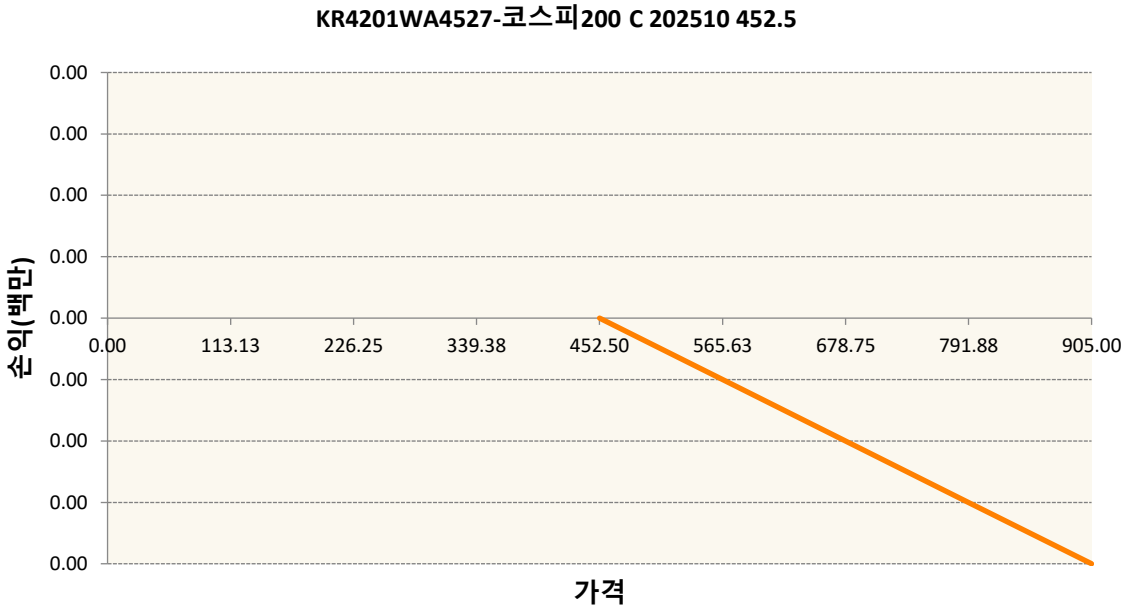
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

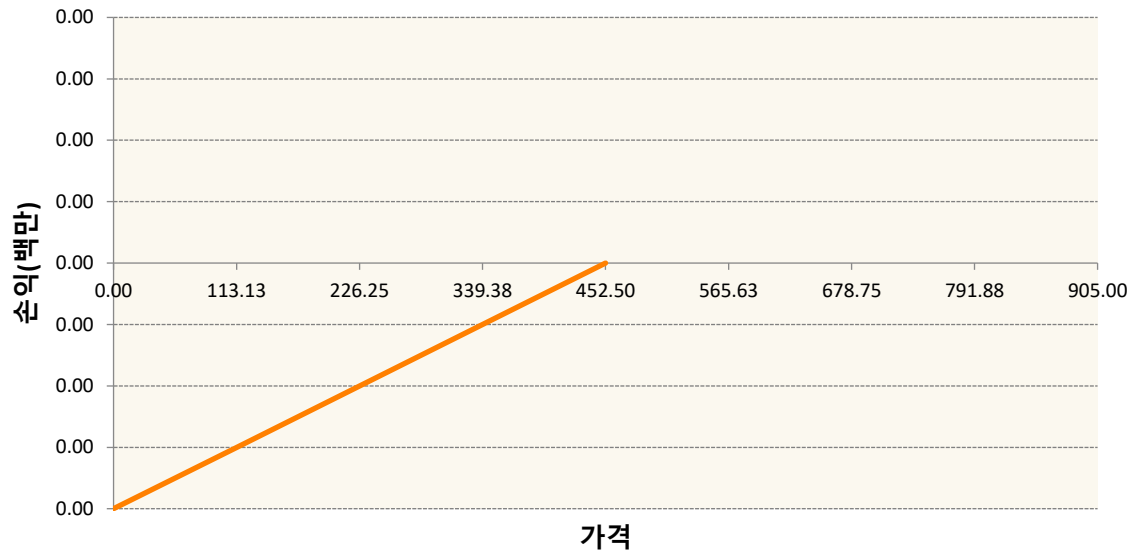
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	234	-234	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,391	-34,391	장내

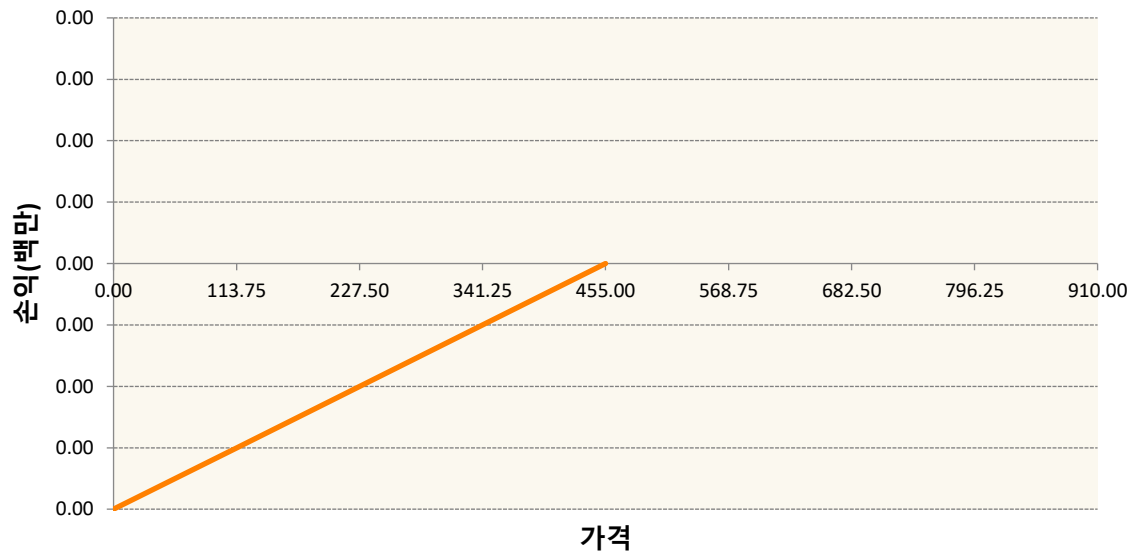
2. 만기시점의 손익구조



KR4301WA4526-코스피200 P 202510 452.5



KR4301WA4559-코스피200 P 202510 455.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WA4: 코스피200 C 202510 452.5	896
KR4201WA4: 코스피200 C 202510 455.0	1,338
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 2025-09-29

기준일 2025-09-26

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	2025-09-29
기준일	2025-09-26

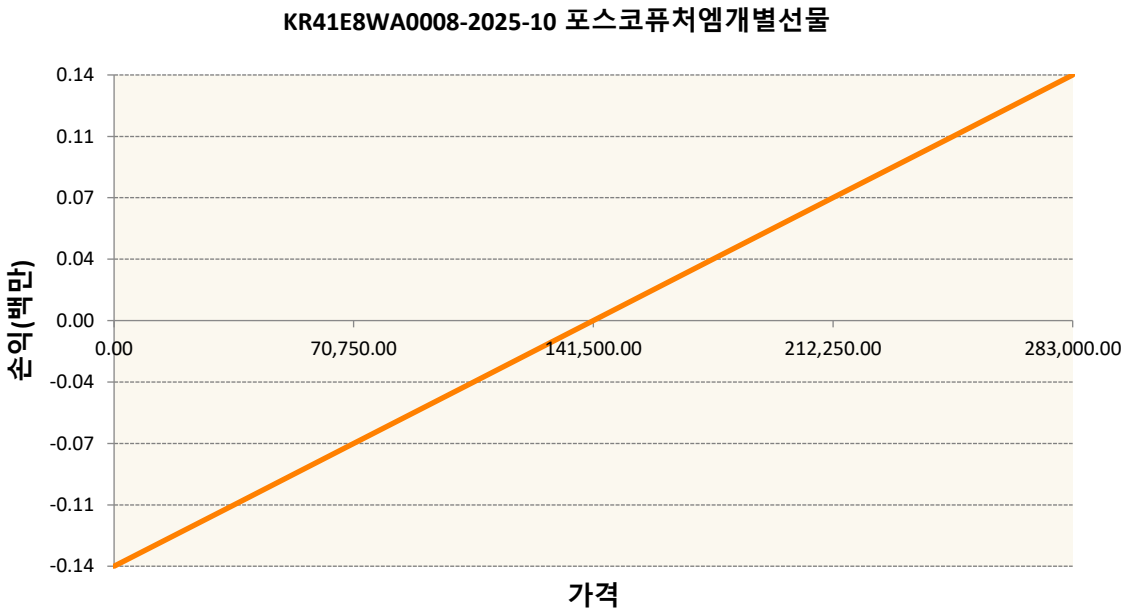
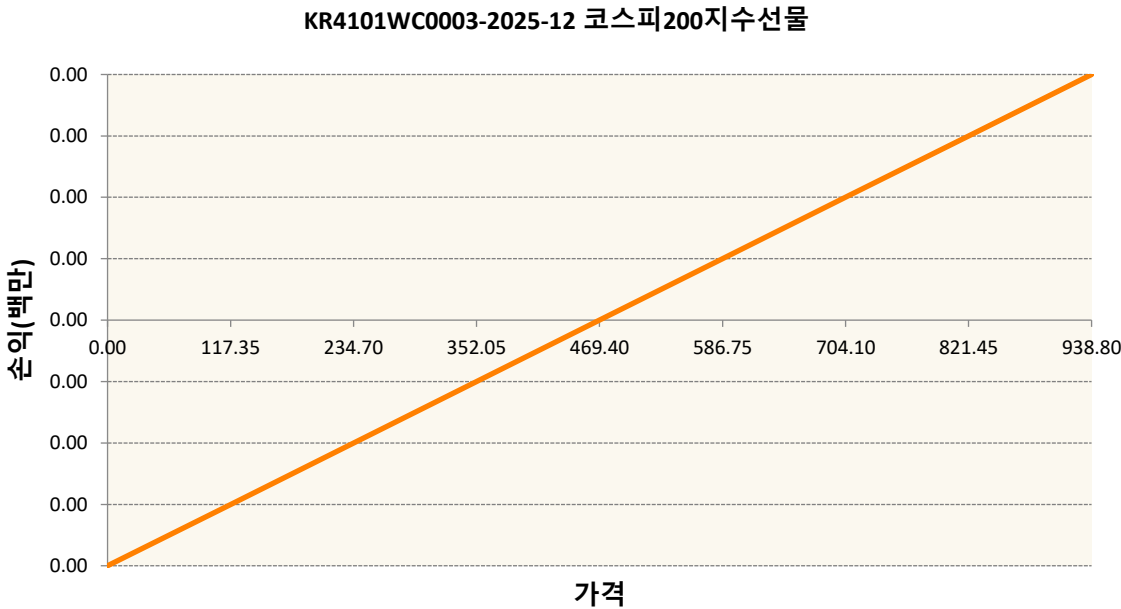
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

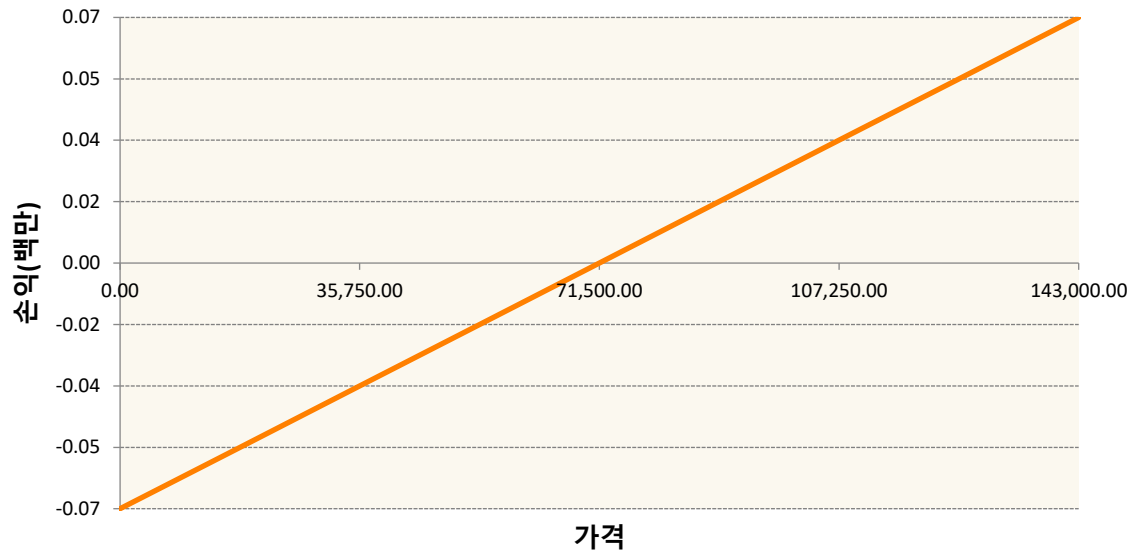
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	503	0	503	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

38
2
1

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

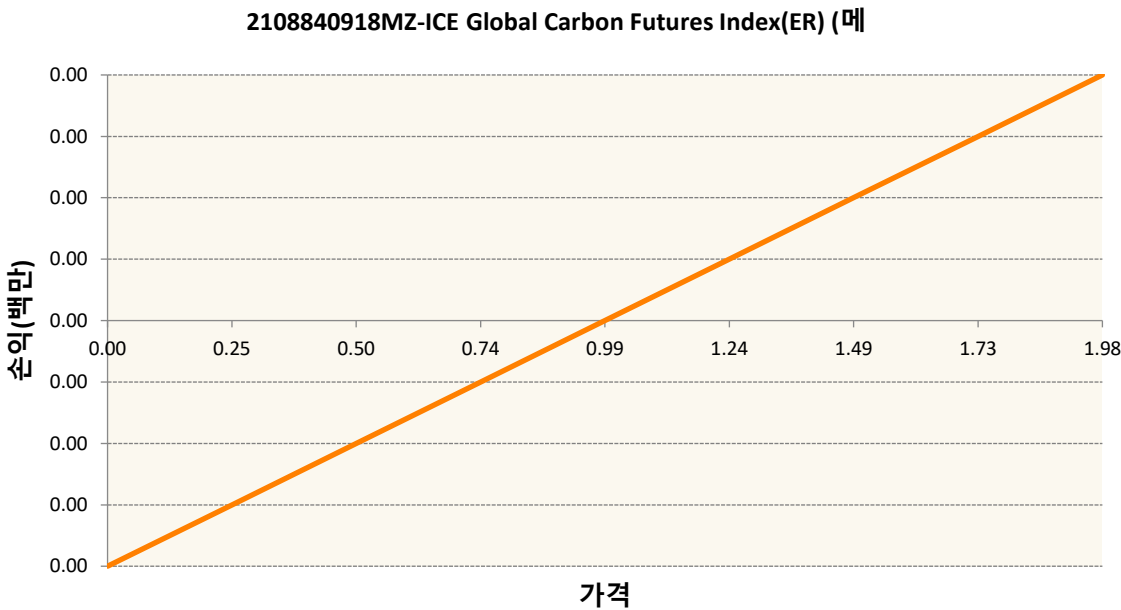
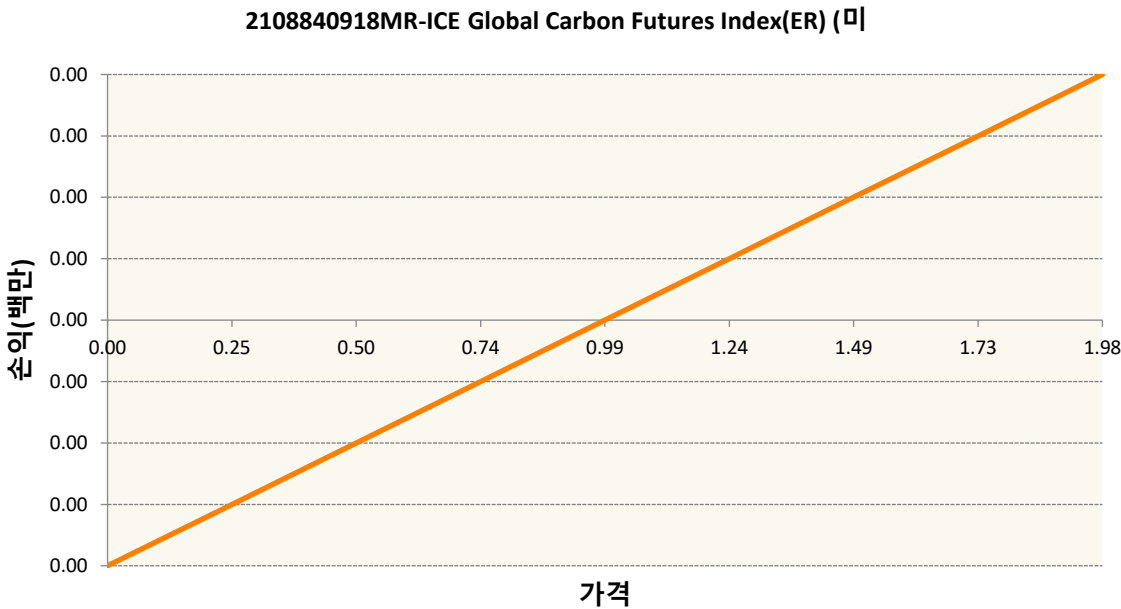
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	9,405	0	9,405	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		644
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		108

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	758

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

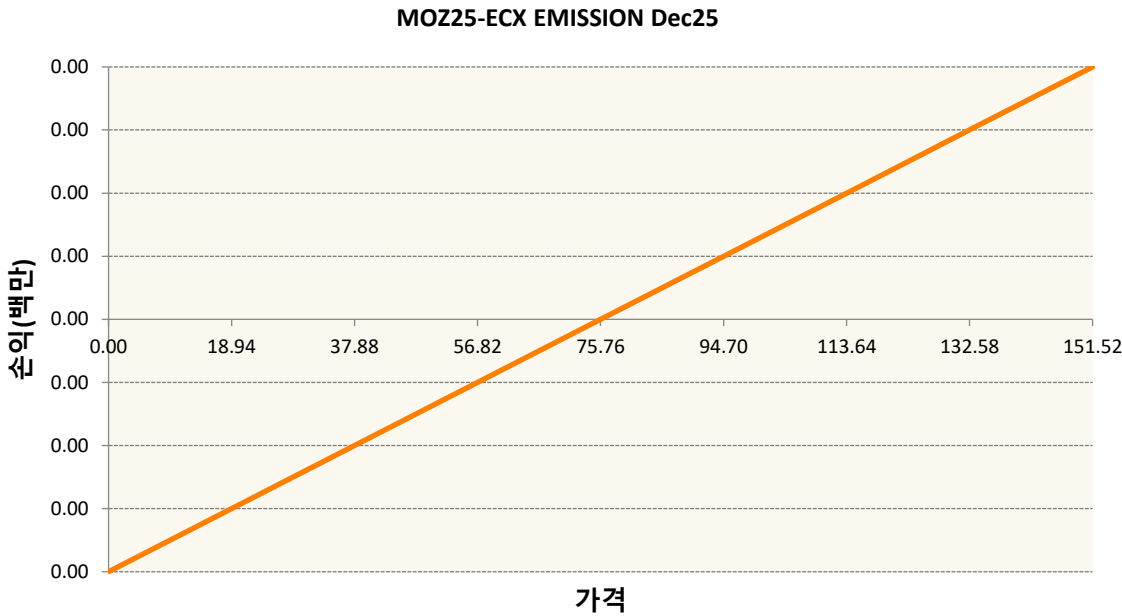
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	5,672	0	5,672	
누계	지수	스왑	-8	0	-8	장외
누계	통화	선도	0	4,303	-4,303	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E	162
FXW213F9SC KRW/EUR 31-10-25E	182
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	454

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

(단위:백만원)

846

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

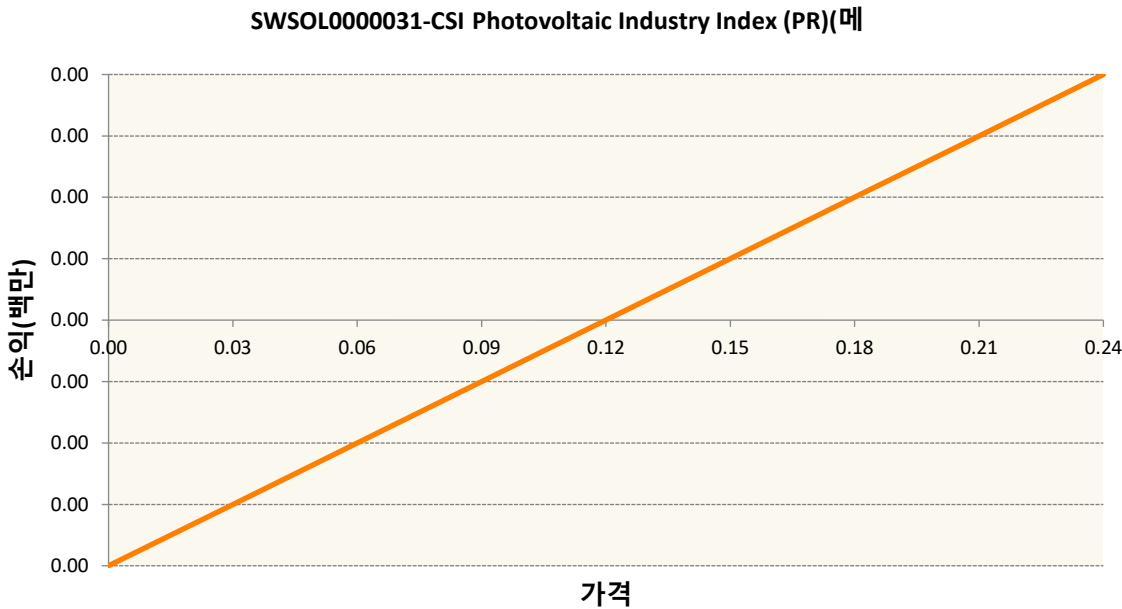
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	692	0	692	장외
누계	지수	스왑	2,872	0	2,872	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (메리츠)	39
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	39
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	26
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	27
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)(메	9

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

(단위:백만원)

240

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

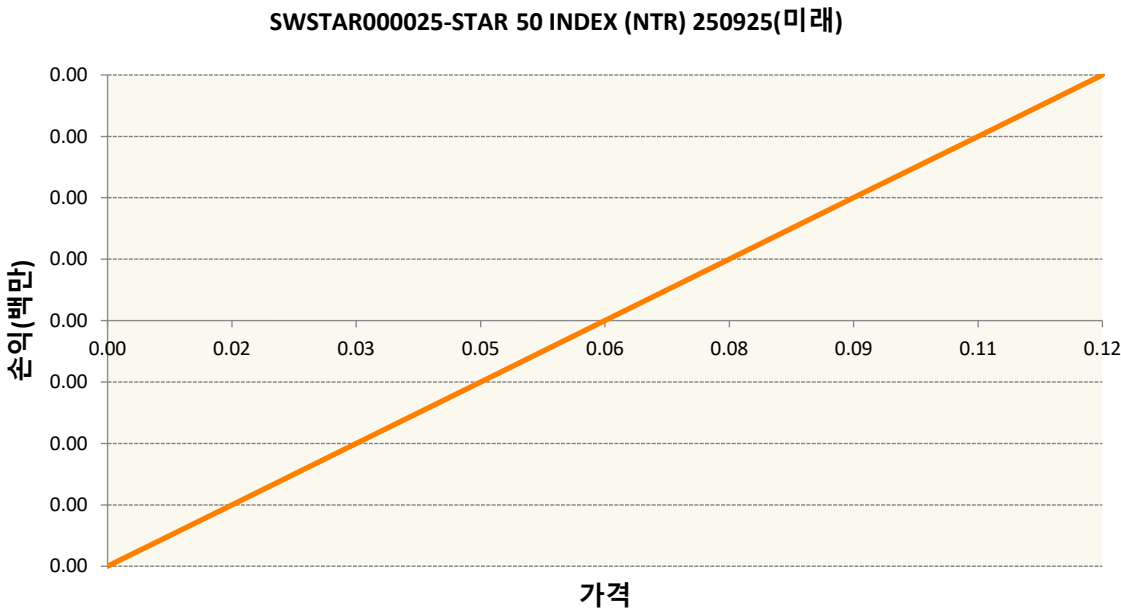
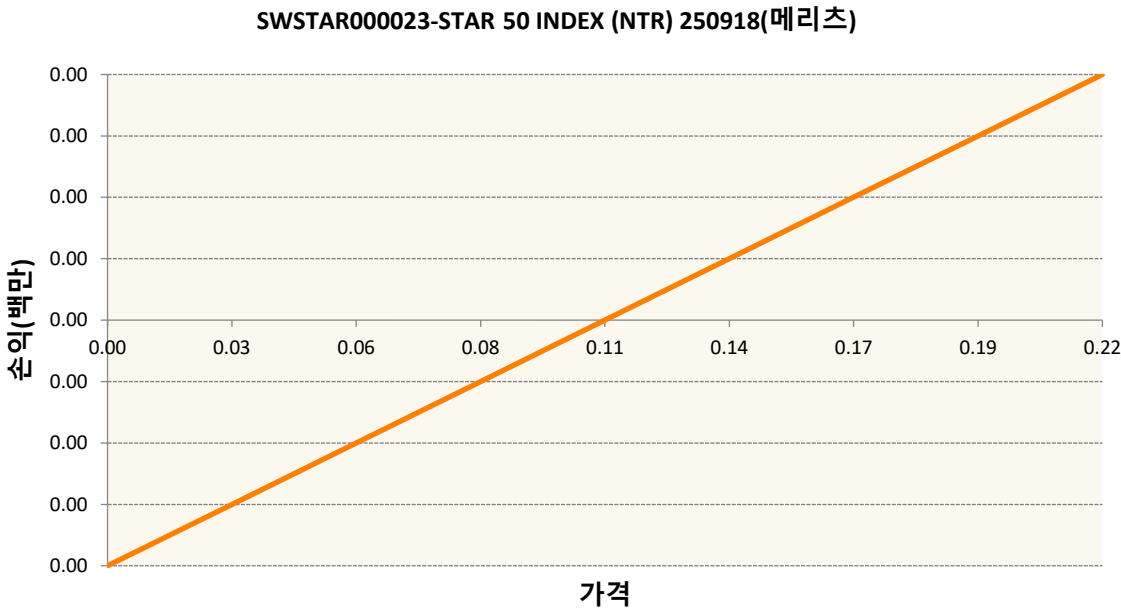
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	5,040	0	5,040	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		24
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		7
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		86
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		25

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	253

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

에퀴티알파일반사모혼합자산

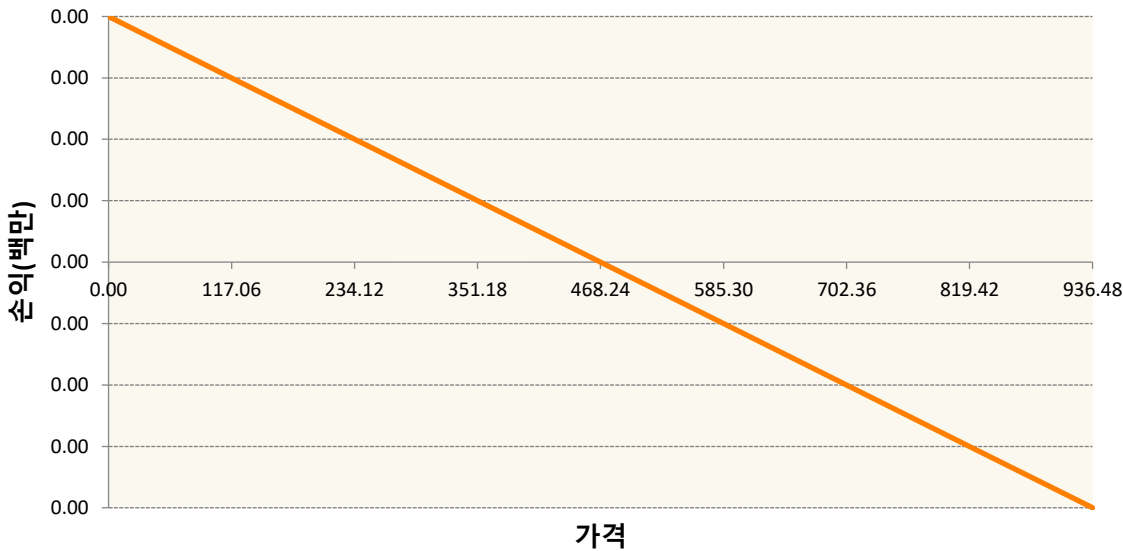
1. 계약금액

(단위:백만원)

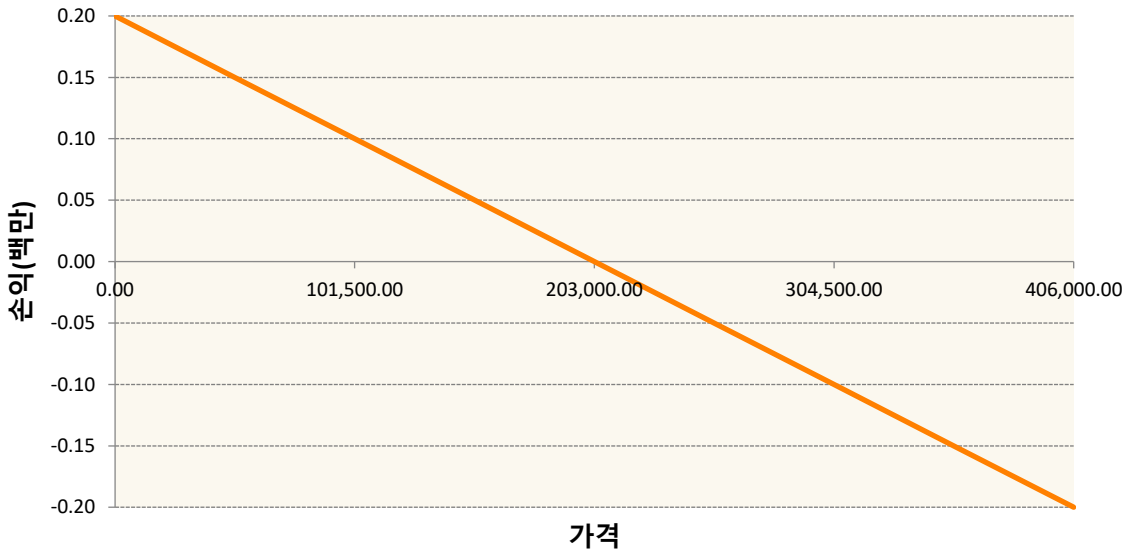
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	13	8	5	장내
누계	유가증권	선물	19	945	-926	장내

2. 만기시점의 손익구조

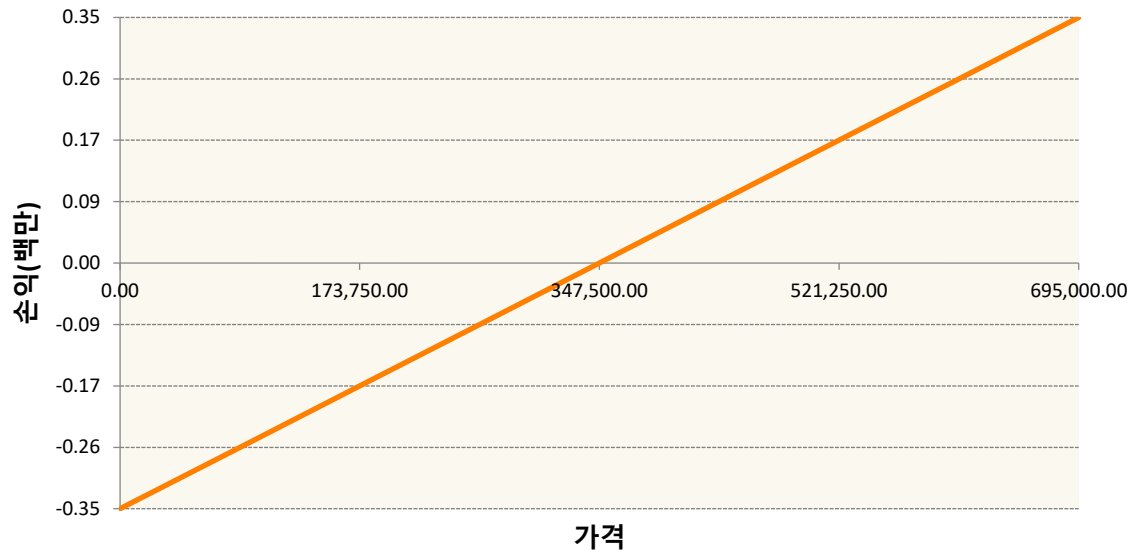
KR4105WA0001-2025-10 미니코스피200 선물



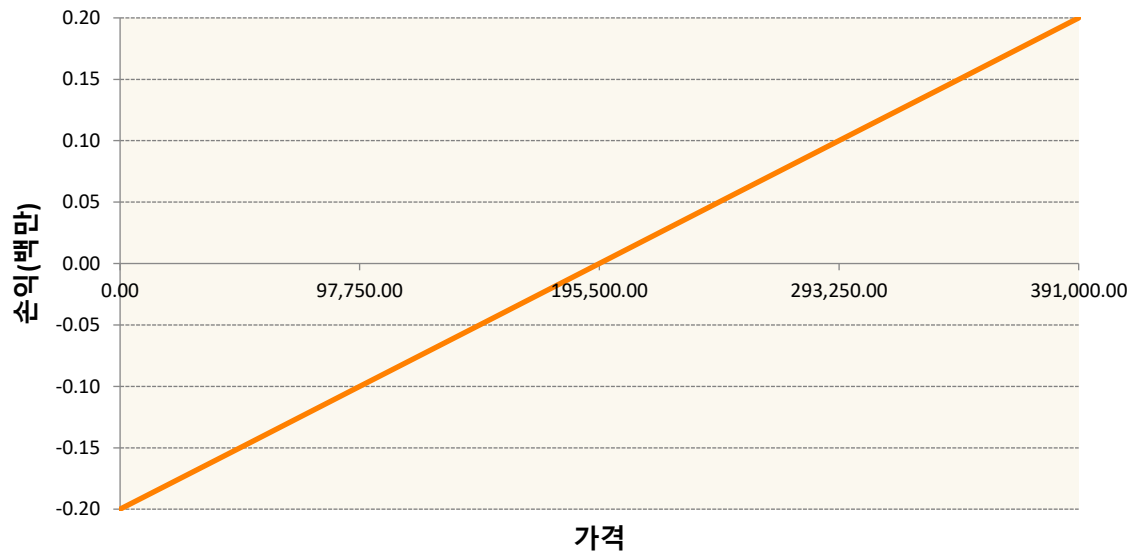
KR4122WB0009-2025-11 삼성SDI개별선물



KR41F5WB0007-2025-11 LG에너지솔루션개별선물



KR41FEWA0003-2025-10 SK스퀘어개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105WA0(2025-10 미니코스피200 선물	15
KR4122WB0(2025-11 삼성SDI개별선물	1
KR41F5WB0(2025-11 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41FEWA0(2025-10 SK스퀘어개별선물	1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

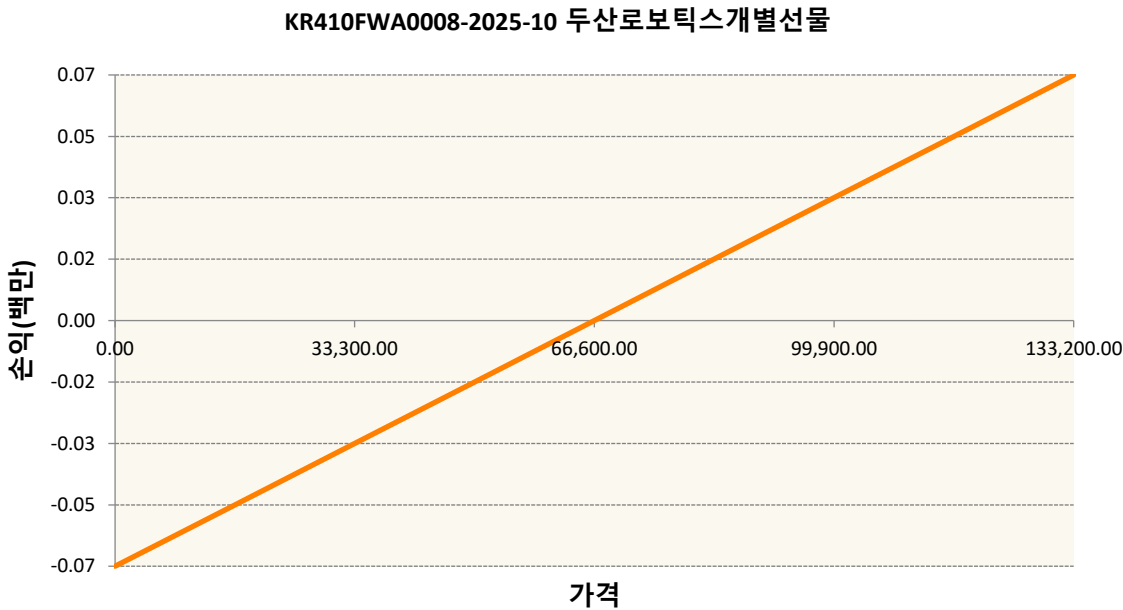
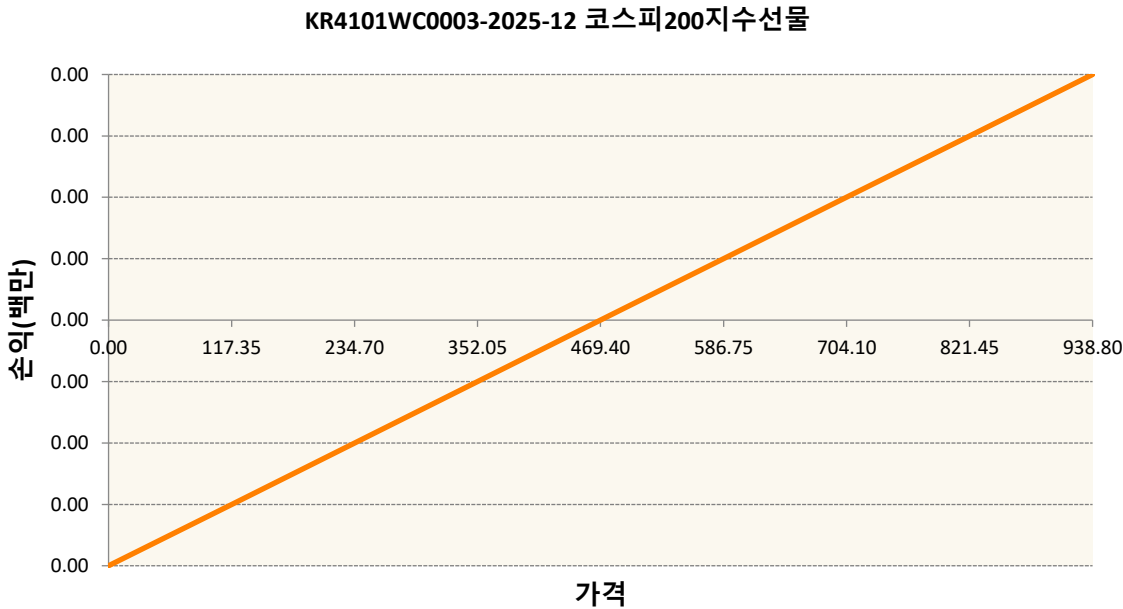
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

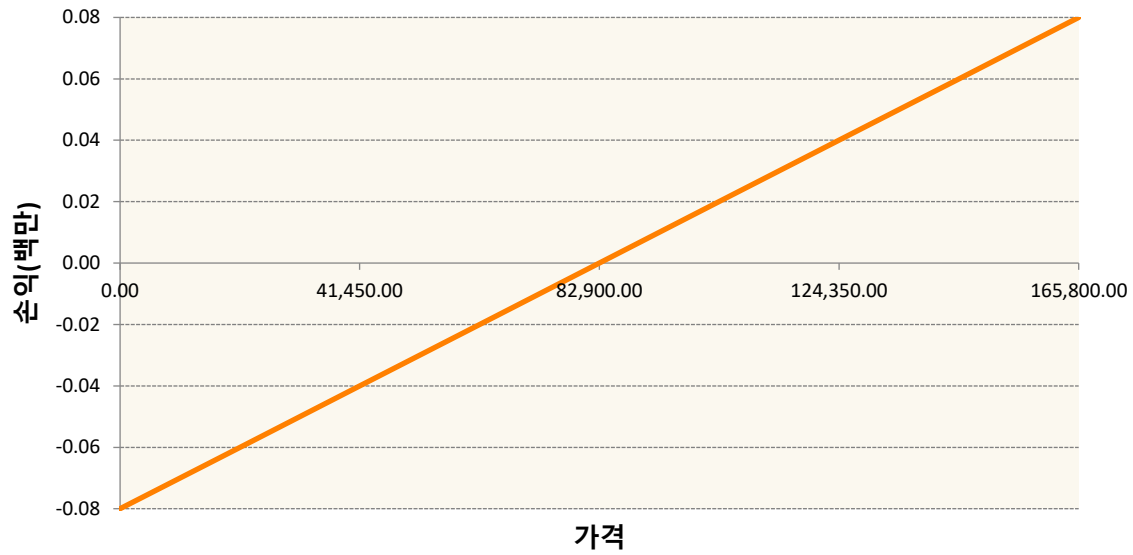
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	10,737	1,180	9,558	장내

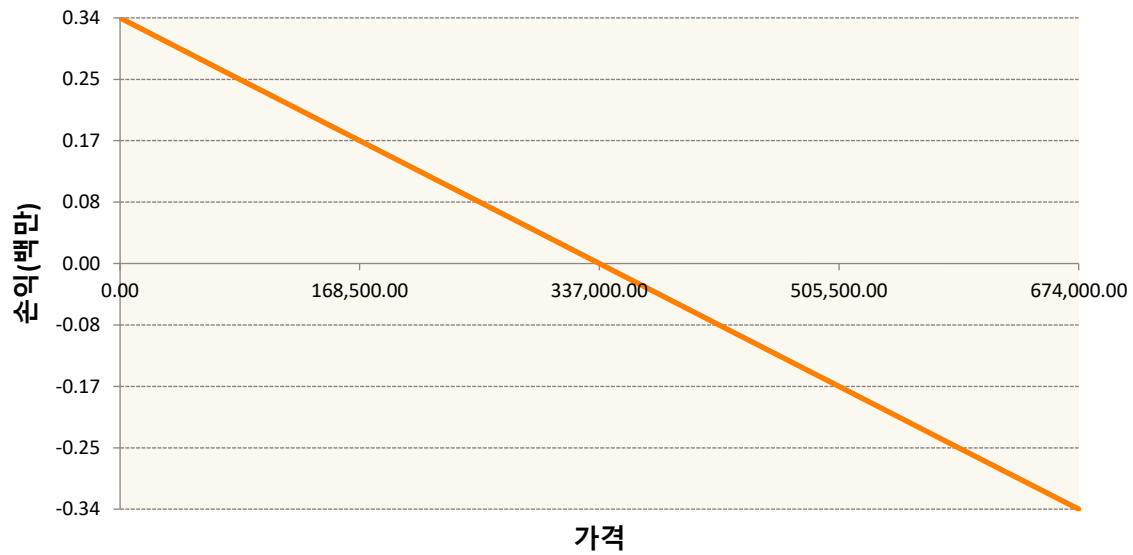
2. 만기시점의 손익구조



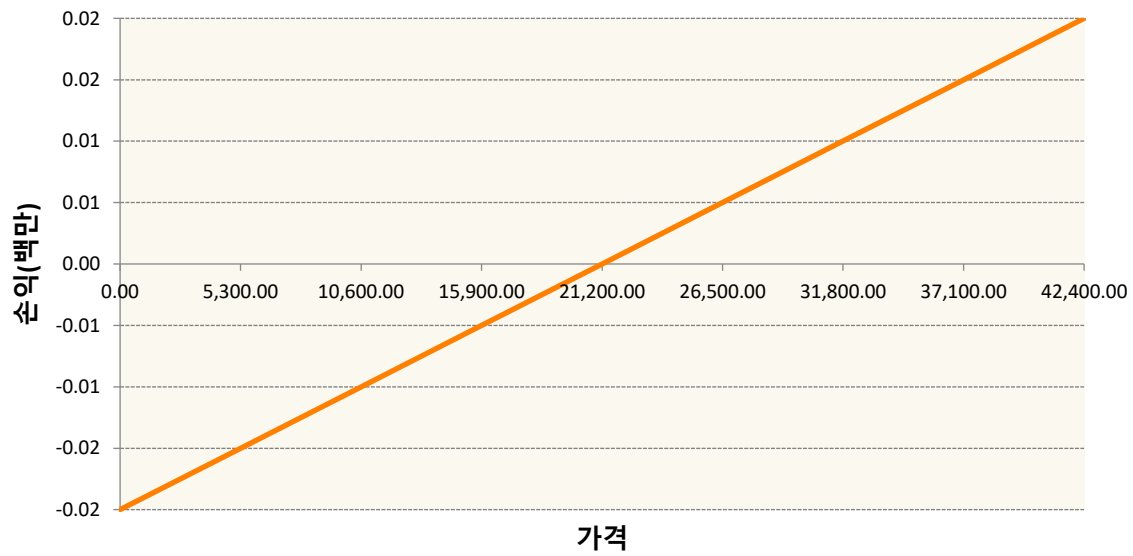
KR4111WA0003-2025-10 삼성전자개별선물



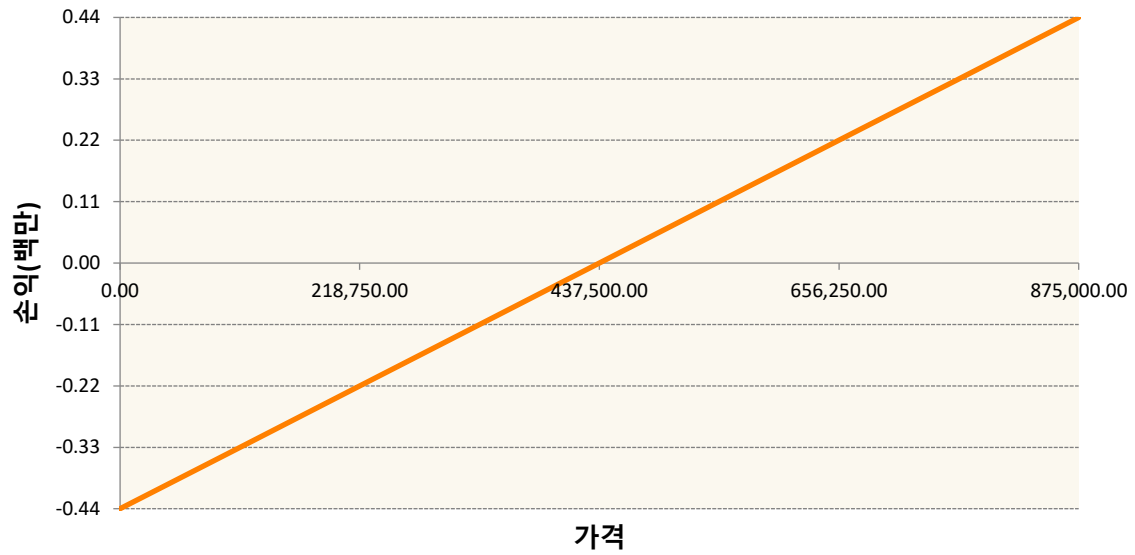
KR4150WA0005-2025-10 SK하이닉스개별선물



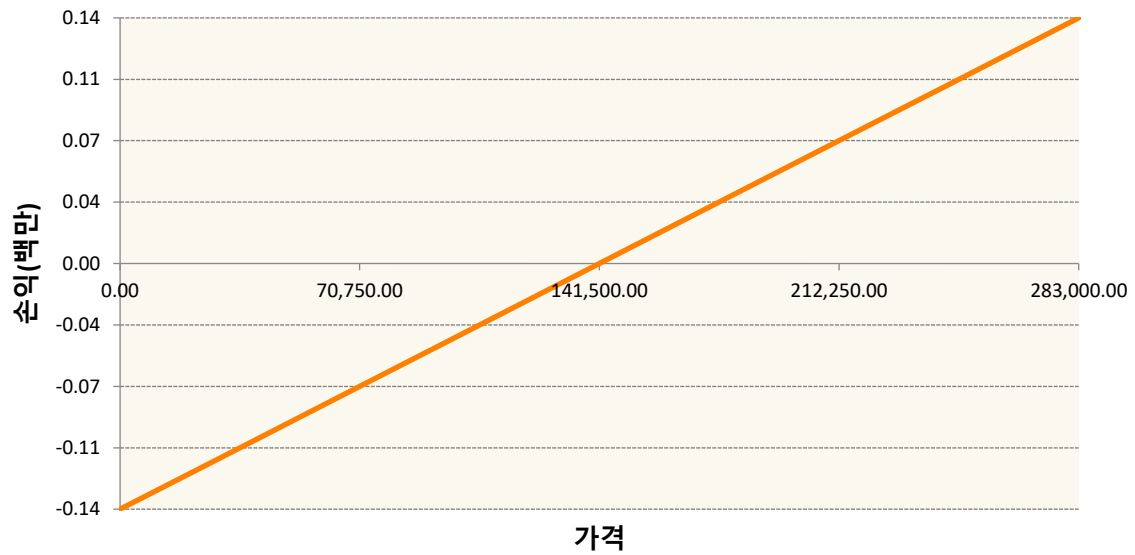
KR41CNWA0005-2025-10 포스코DX개별선물



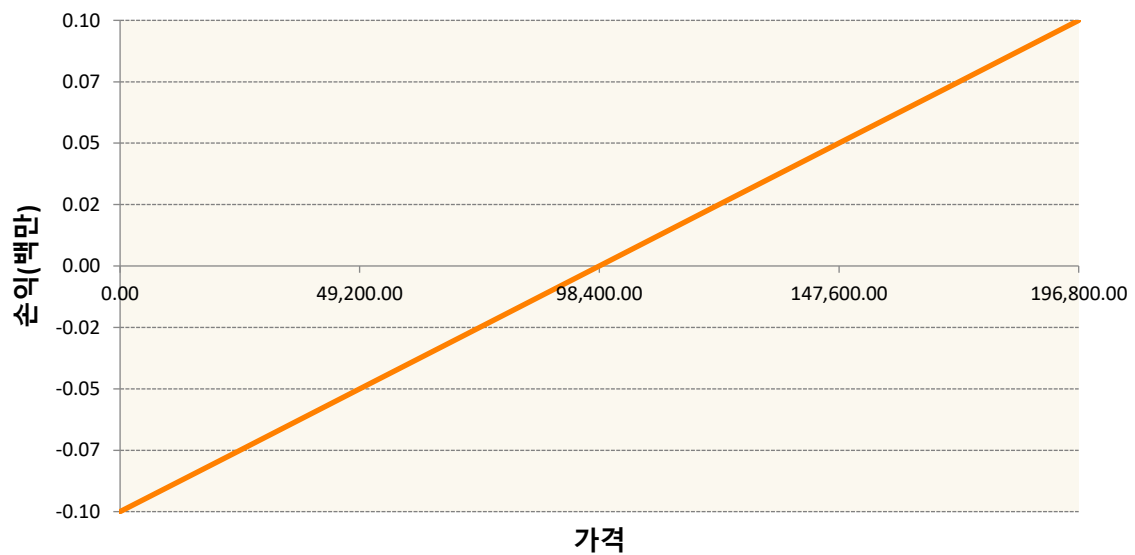
KR41DAWA0009-2025-10 농심개별선물



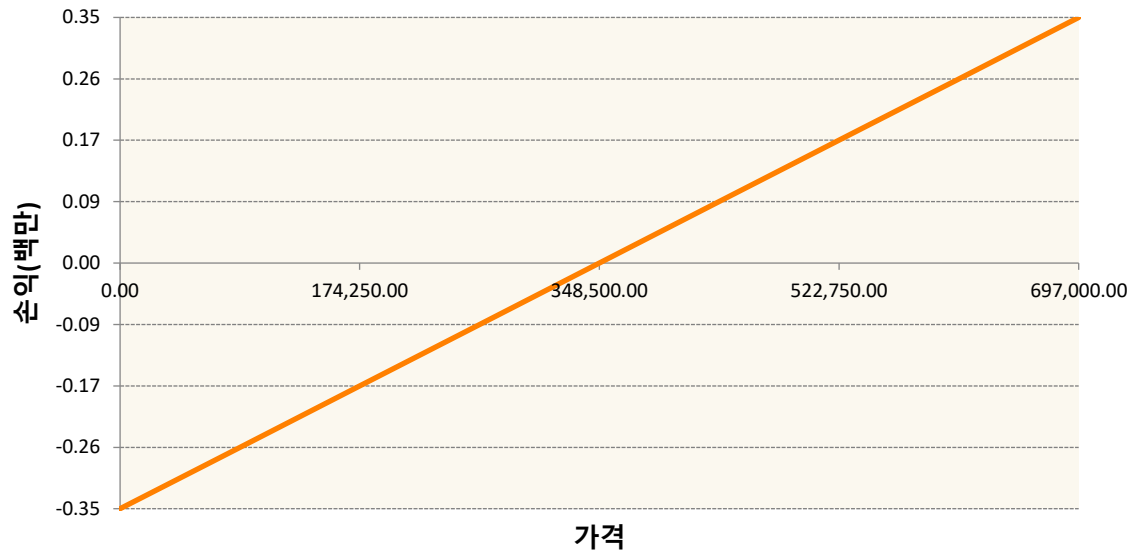
KR41E8WA0008-2025-10 포스코퓨처엠개별선물



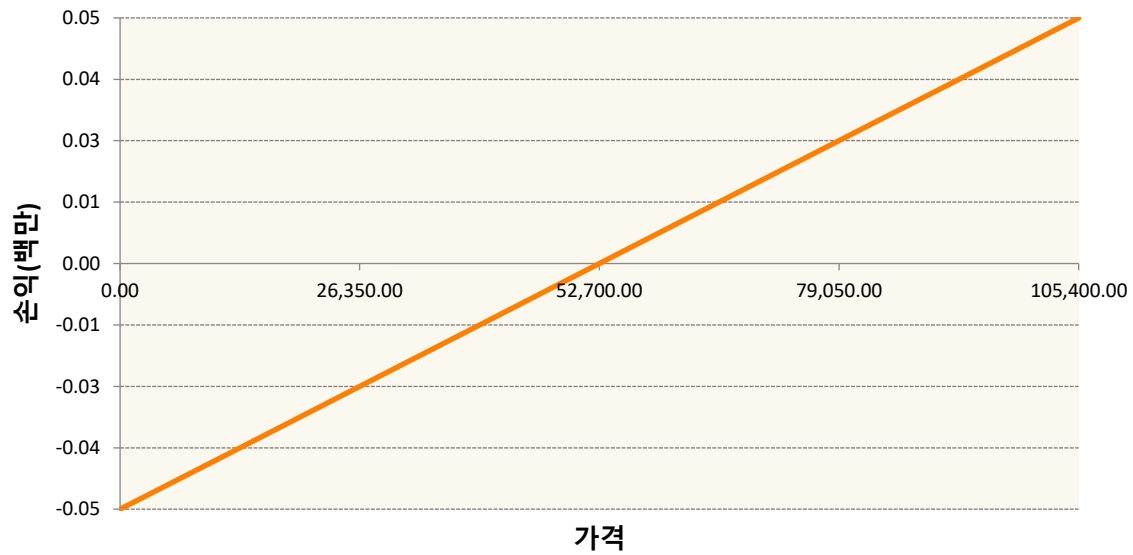
KR41EJWA0009-2025-10 SKC개별선물



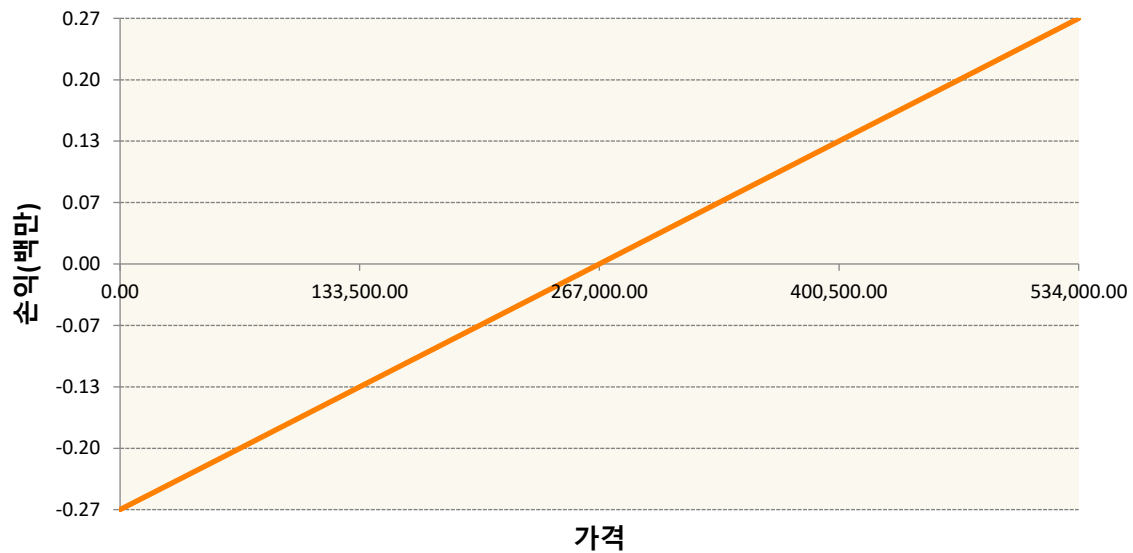
KR41F5WA0008-2025-10 LG에너지솔루션개별선물



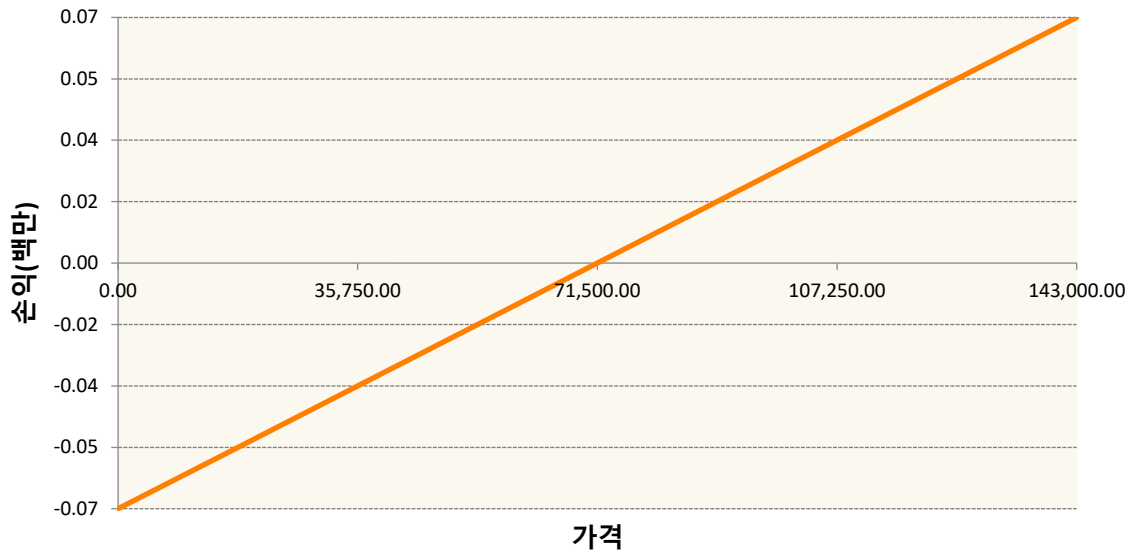
KR41F7WA0006-2025-10 카카오페이개별선물



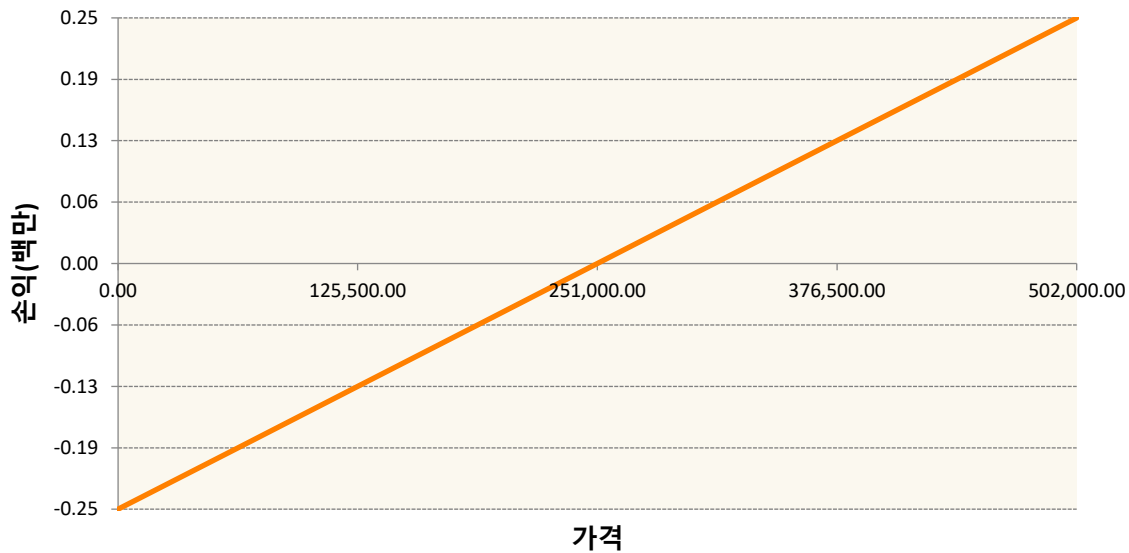
KR41FCWA0005-2025-10 하이브개별선물



KR41FMWA0003-2025-10 엘앤에프개별선물



KR41HEWA0001-2025-10 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물	535
KR410FWA01 2025-10 두산로보틱스개별선물	14
KR4111WA01 2025-10 삼성전자개별선물	99
KR4150WA01 2025-10 SK하이닉스개별선물	94
KR41CNWAC 2025-10 포스코DX개별선물	10
KR41DAWAC 2025-10 농심개별선물	4
KR41E8WA01 2025-10 포스코퓨처엠개별선물	40
KR41EJWA01 2025-10 SKC개별선물	20
KR41F5WA01 2025-10 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F7WA01 2025-10 카카오페이개별선물	15
KR41FCWA01 2025-10 하이브개별선물	62
KR41FMWAC 2025-10 엘앤에프개별선물	20

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

(단위:백만원)

498

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

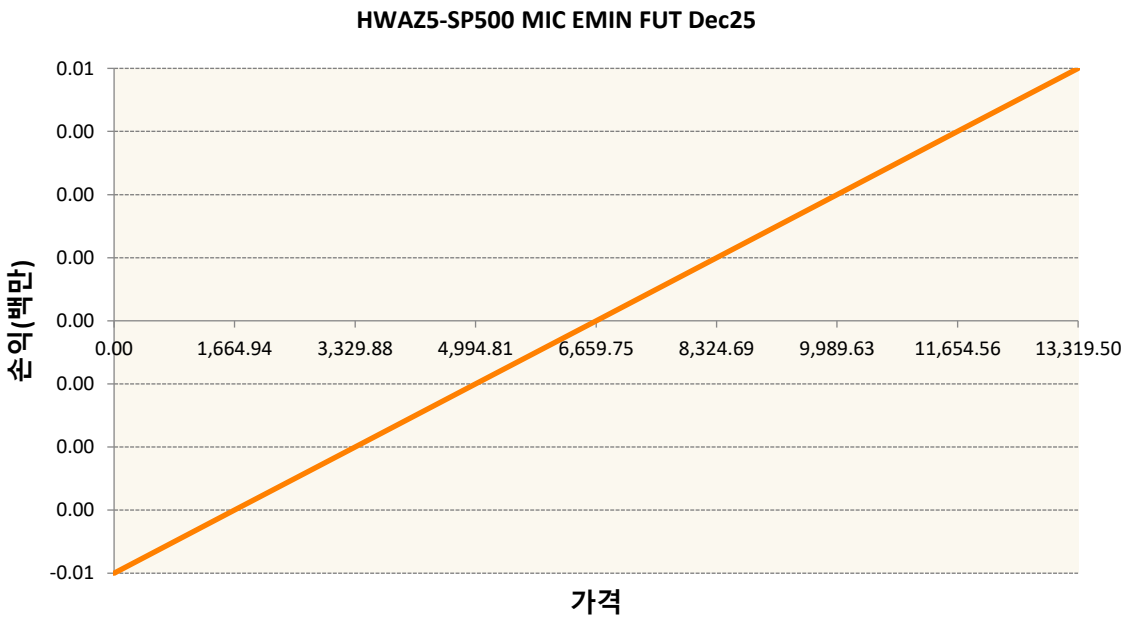
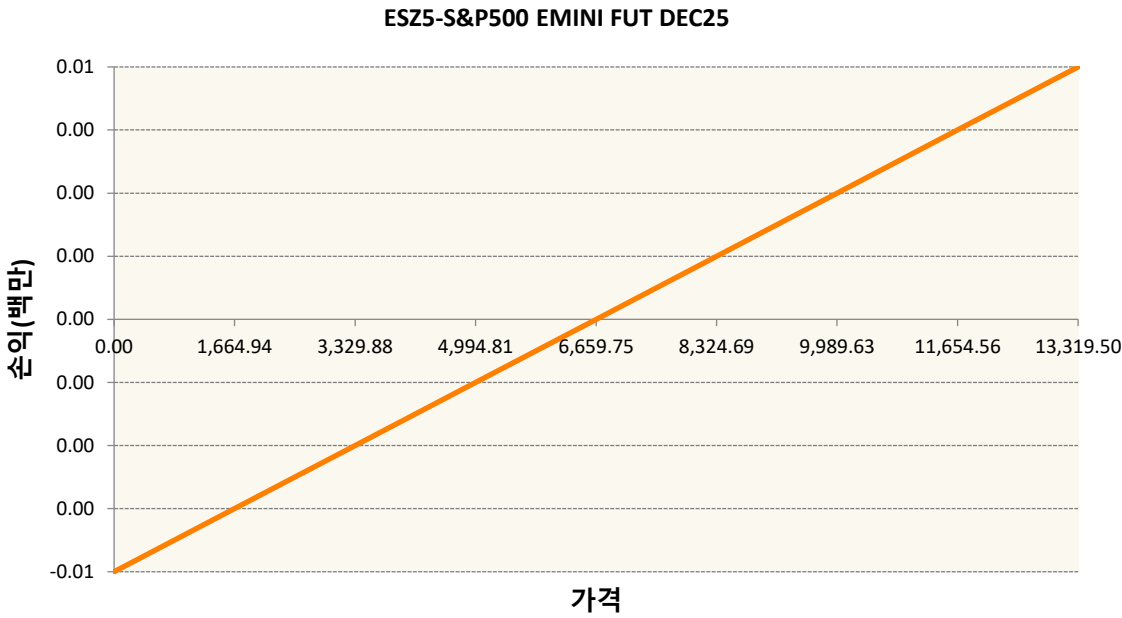
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	36,507	0	36,507	
누계	유가증권	선물	1,248	0	1,248	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	2,921
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,275

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

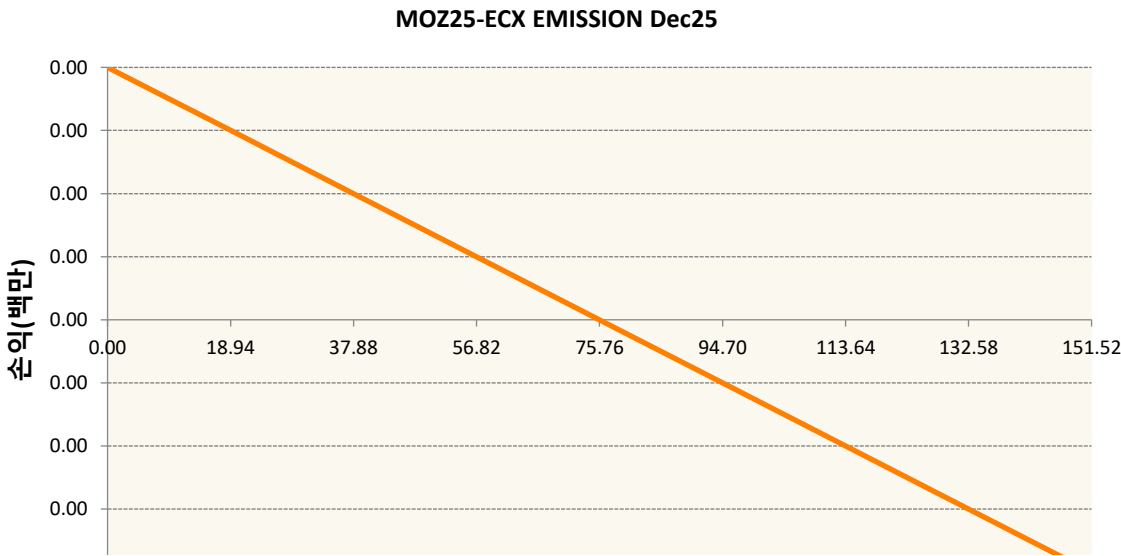
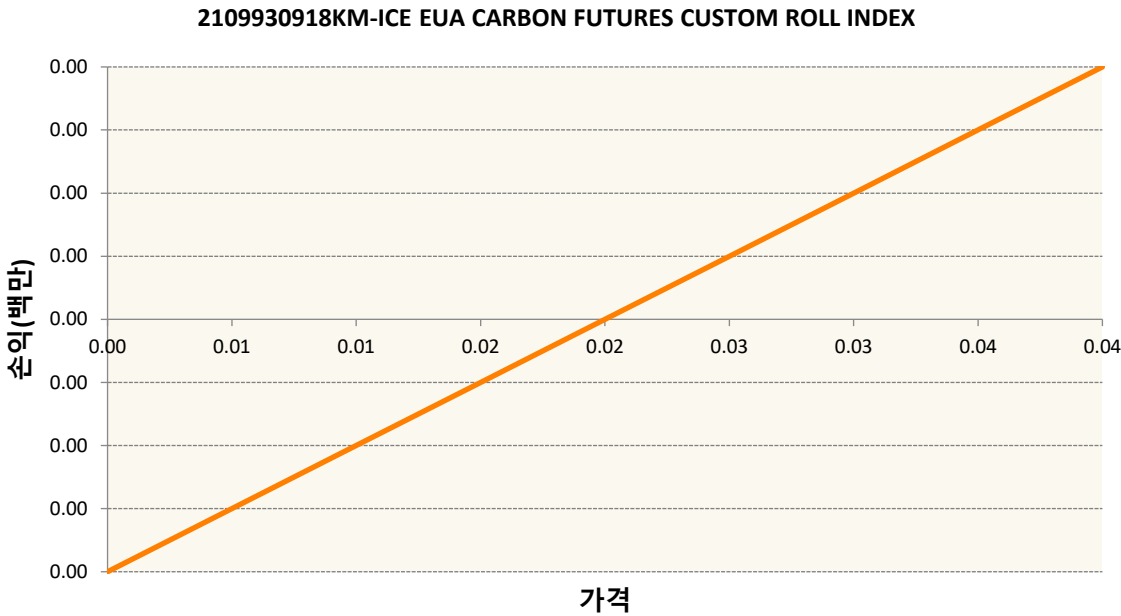
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,275	-4,275	
누계	지수	스왑	8	0	8	장외
누계	통화	선도	0	2,453	-2,453	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E	98
FXW213F9SC KRW/EUR 31-10-25E	98
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	342

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

(단위:백만원)

596

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

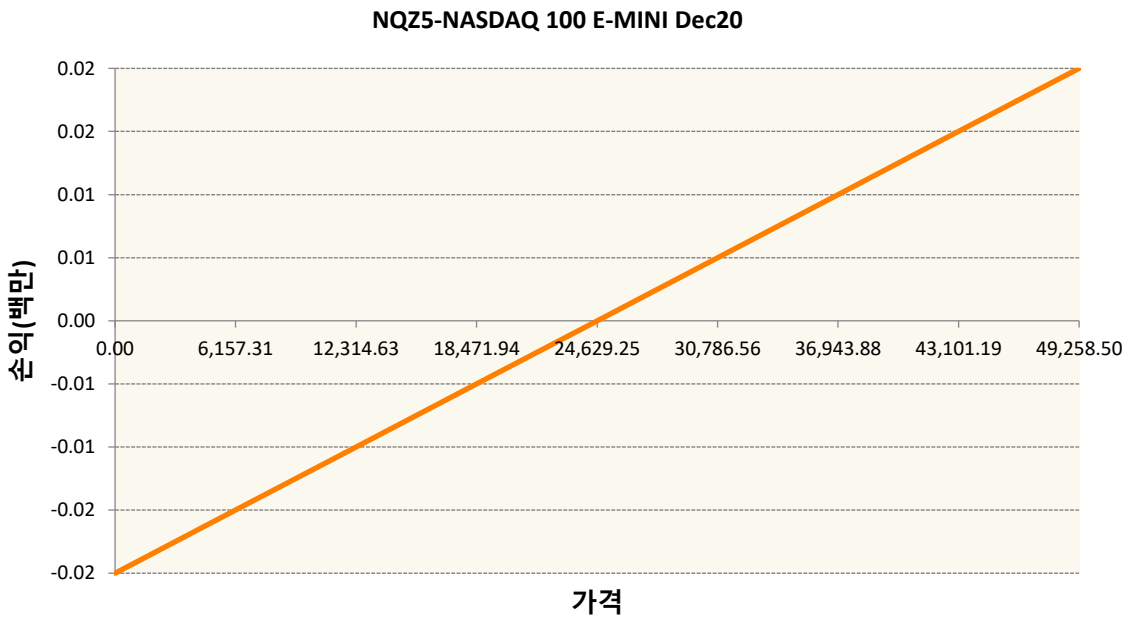
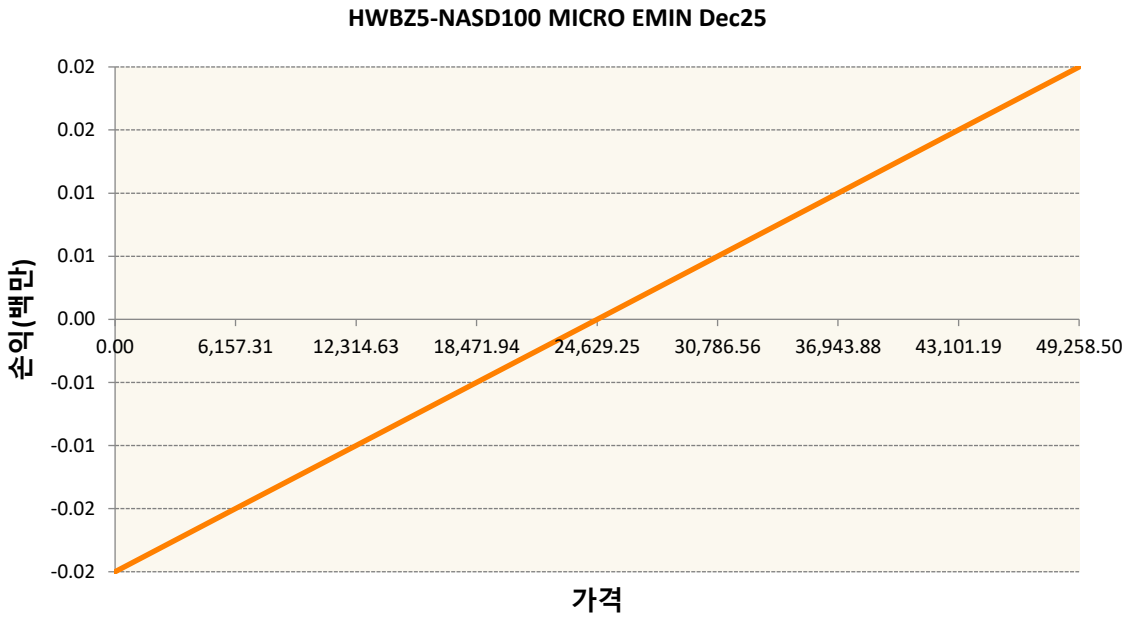
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	15,729	0	15,729	
누계	유가증권	선물	1,984	0	1,984	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25		159
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,258

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,548

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

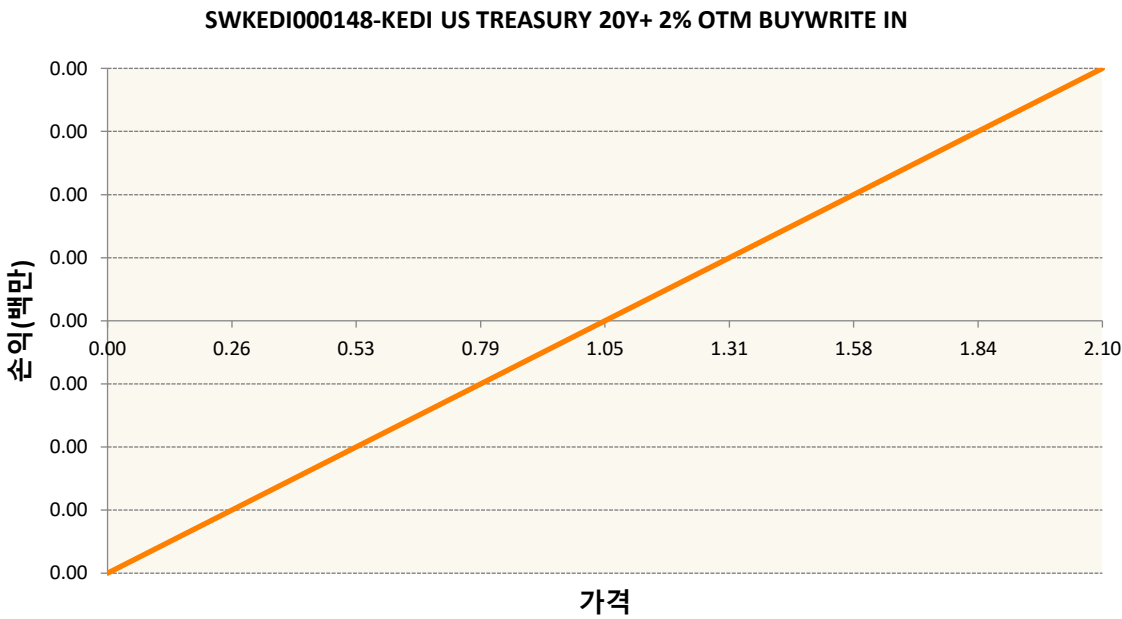
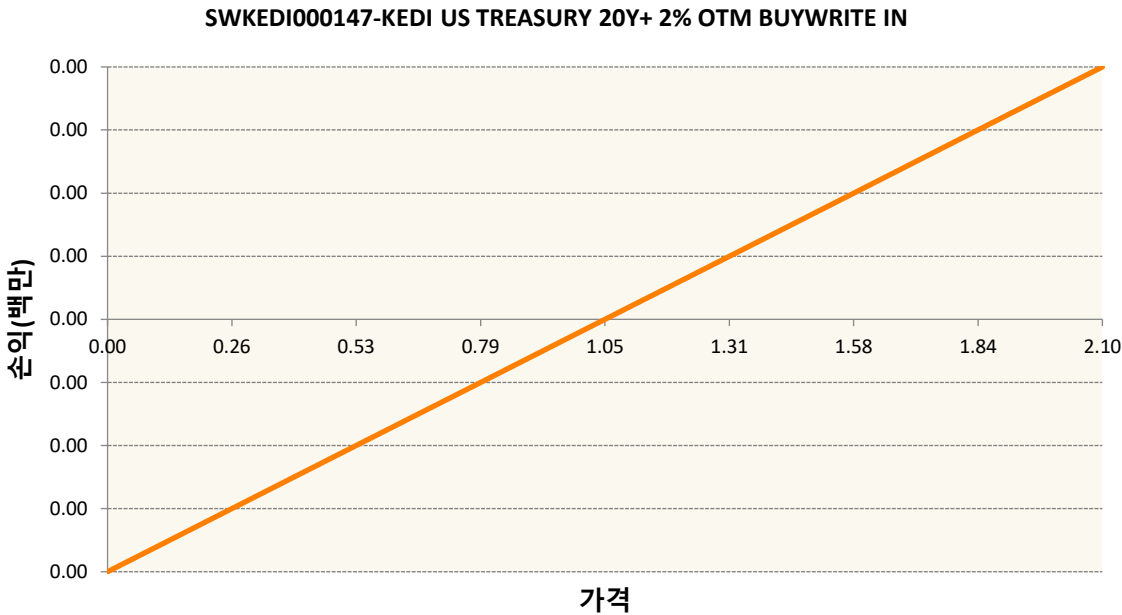
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

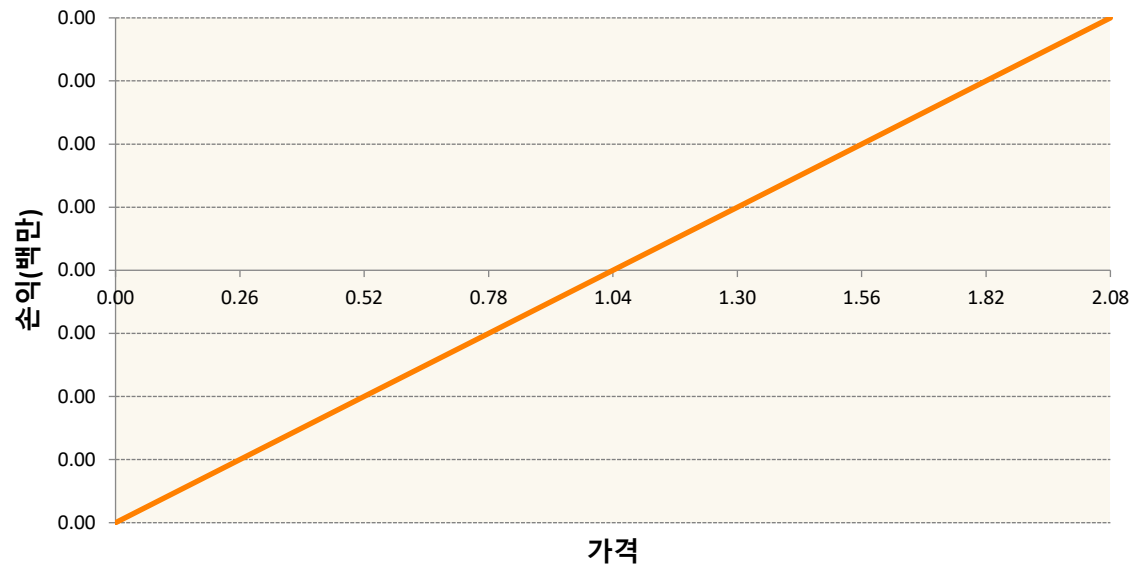
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	361,376	0	361,376	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

8,191
9,835
3,642
7,770

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

(단위:백만원)

14,433

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,501	0	2,501	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	2

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

(단위:백만원)

11

공시일	2025-09-29
기준일	2025-09-26

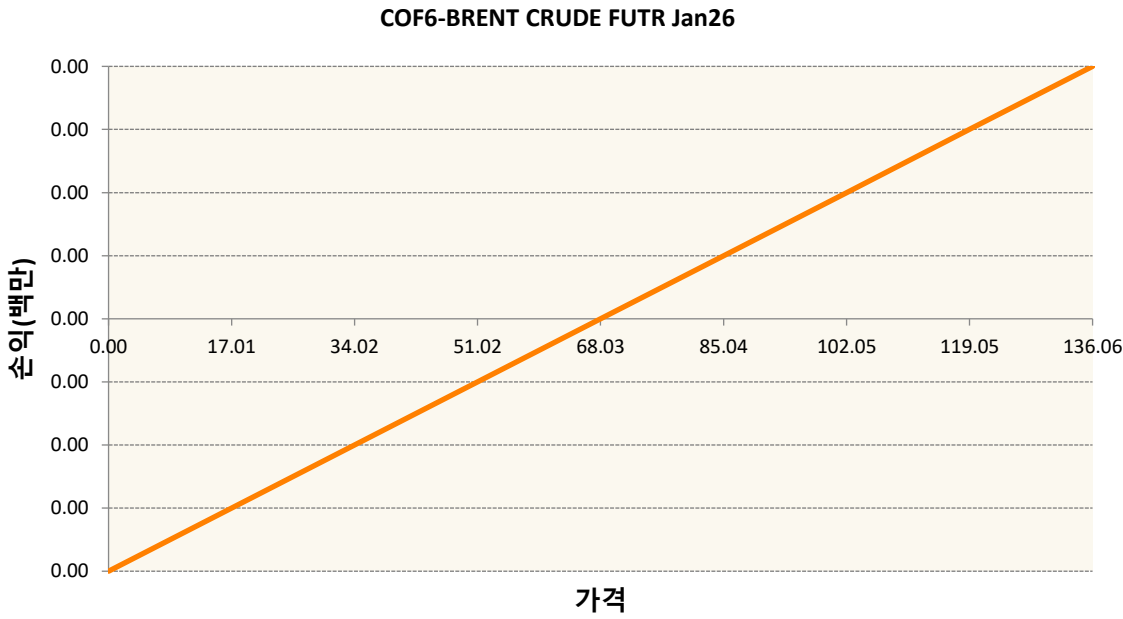
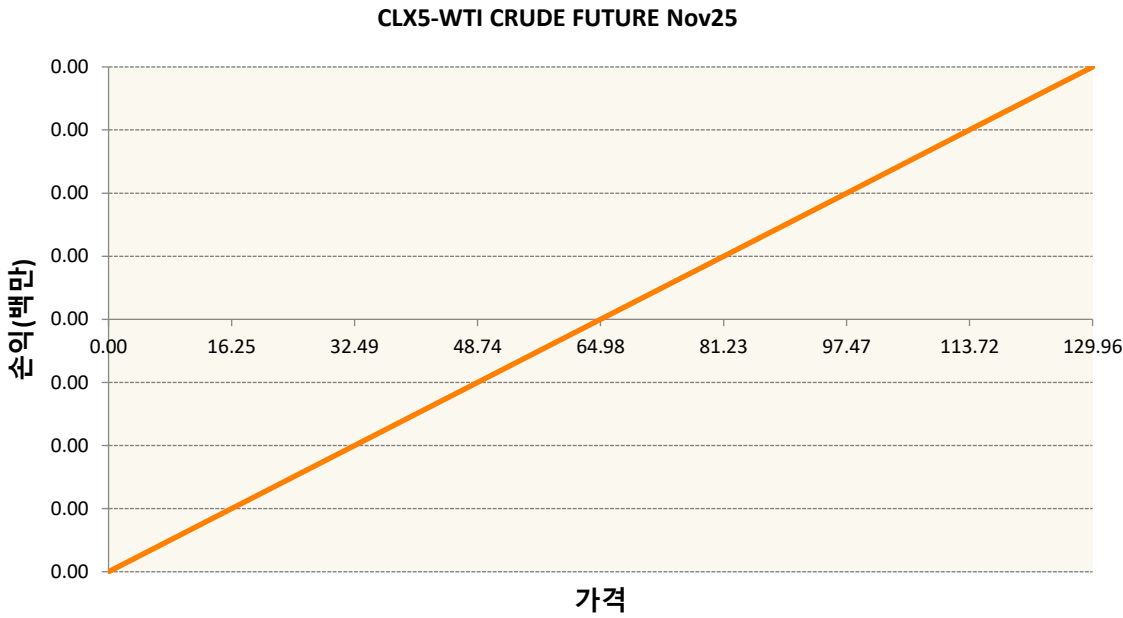
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

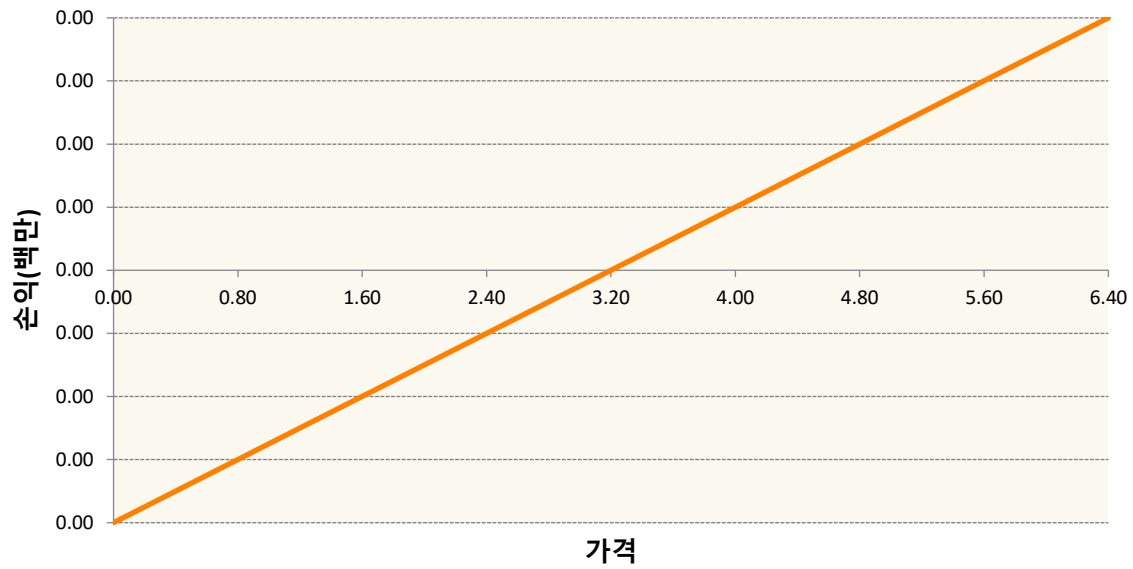
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	545	0	545	
누계	통화	선물	0	71	-71	장내

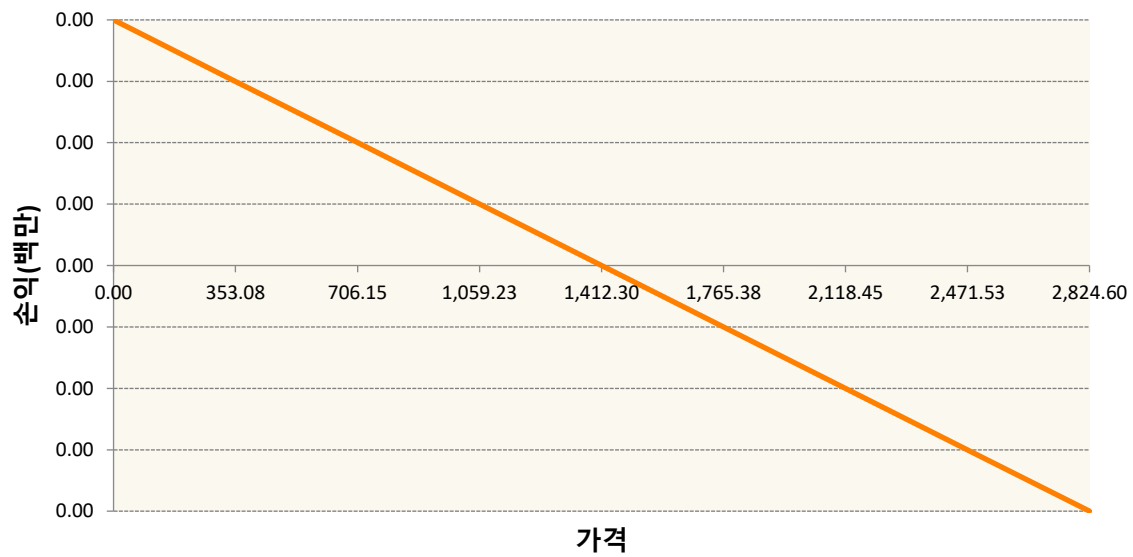
2. 만기시점의 손익구조



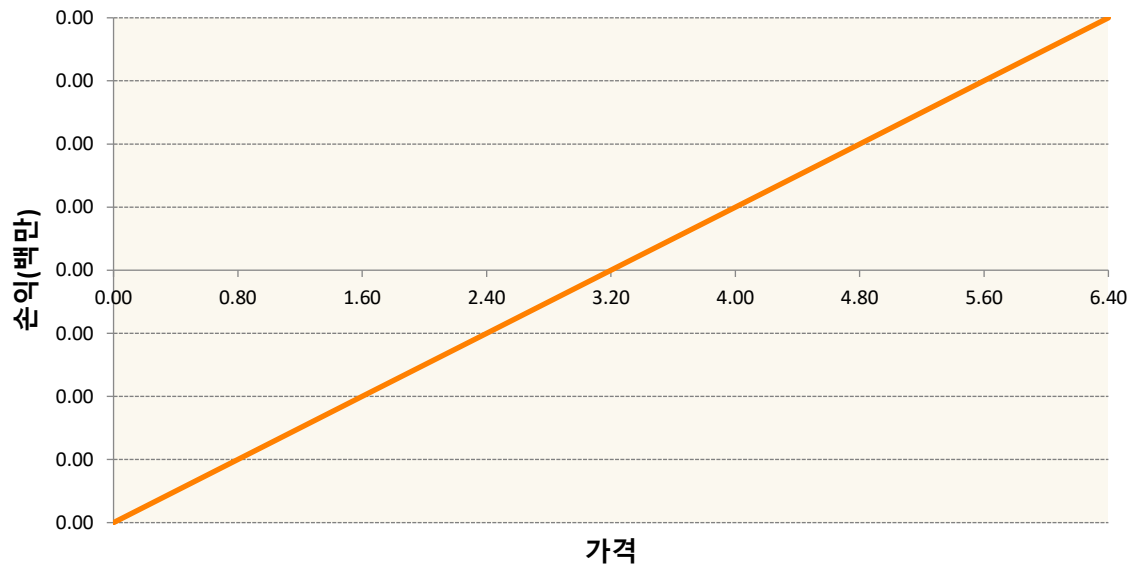
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

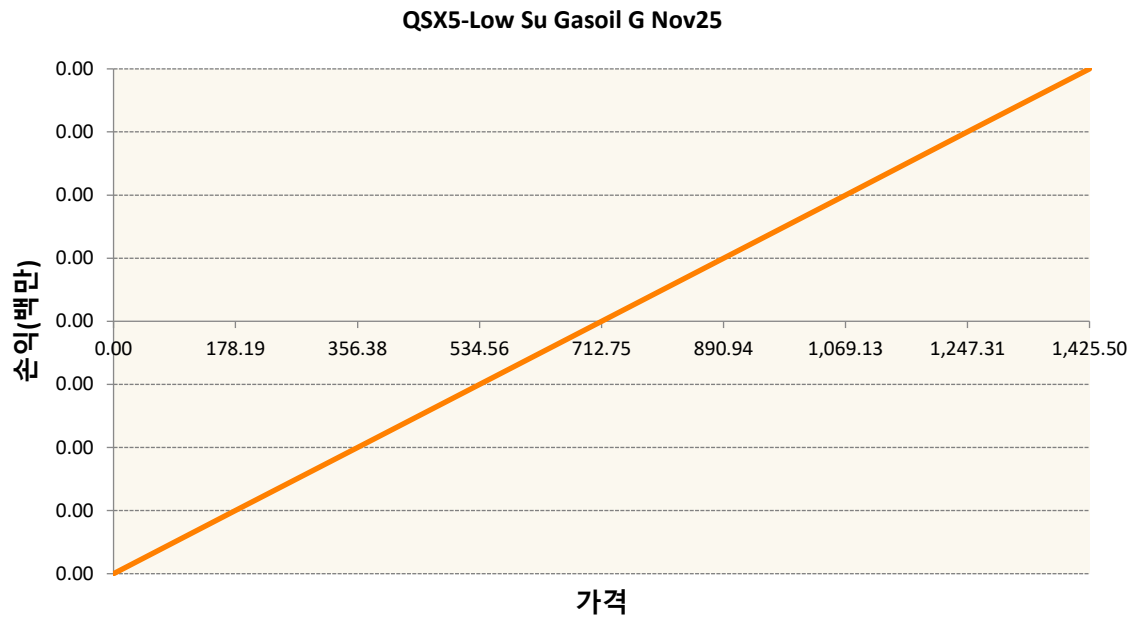


KR4175WA0006-2025-10 달러선물



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		6
NGX25	NATURAL GAS FUTR Nov25		11
QX5	Low Su Gasoil G Nov25		8

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