

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

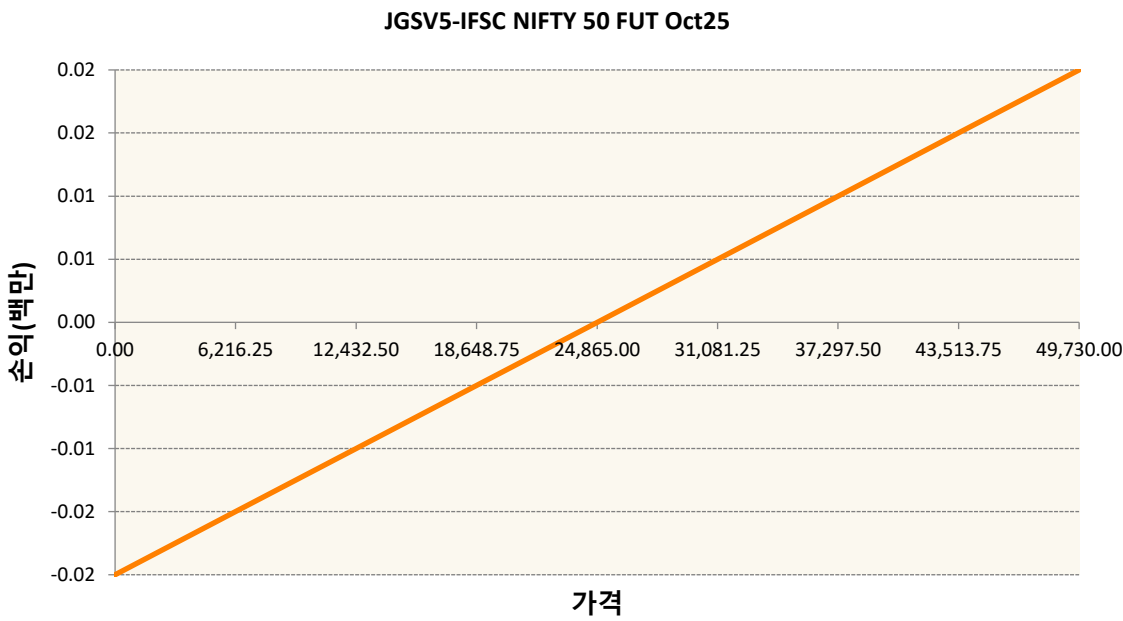
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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)

JGSV5	IFSC NIFTY 50 FUT Oct25	45
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

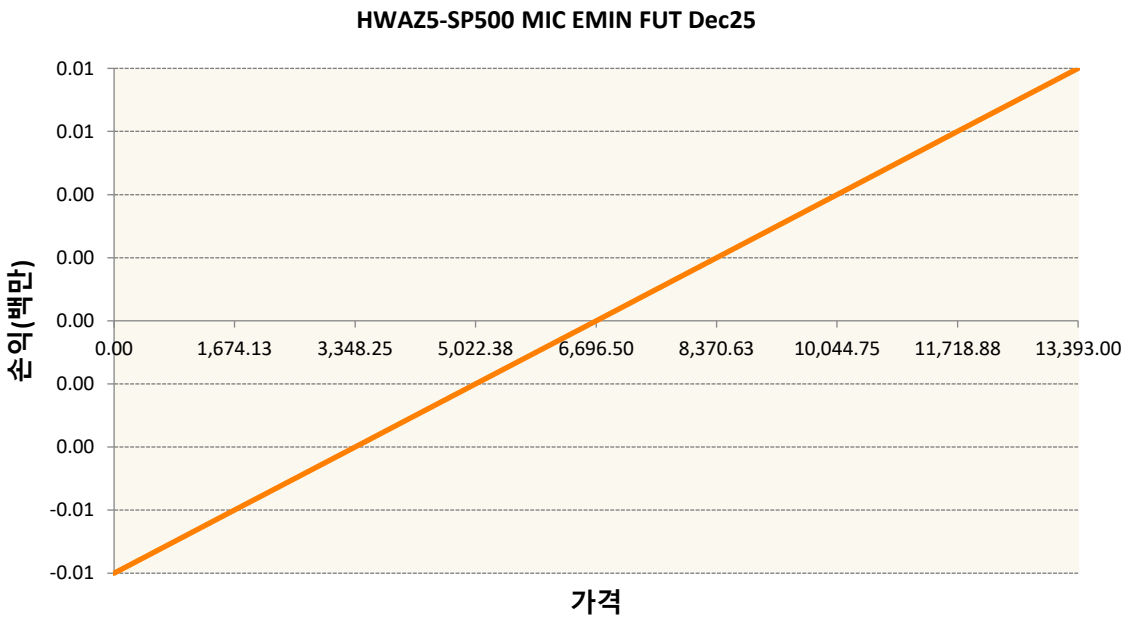
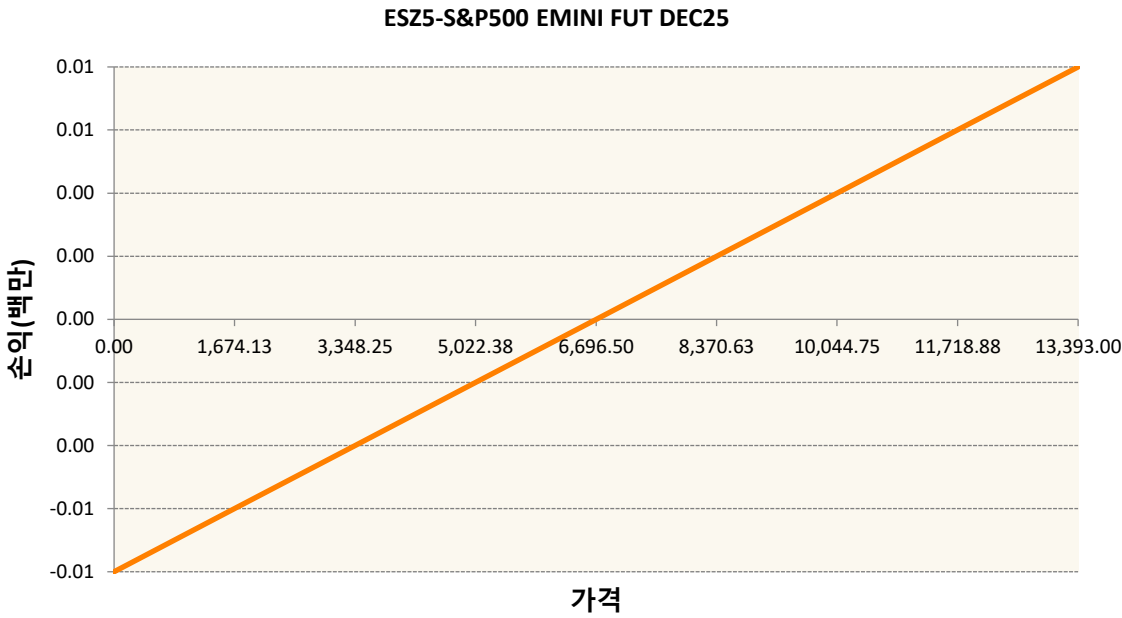
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	465	0	465	
누계	유가증권	선물	186	0	186	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	2025-09-30
기준일	2025-09-29

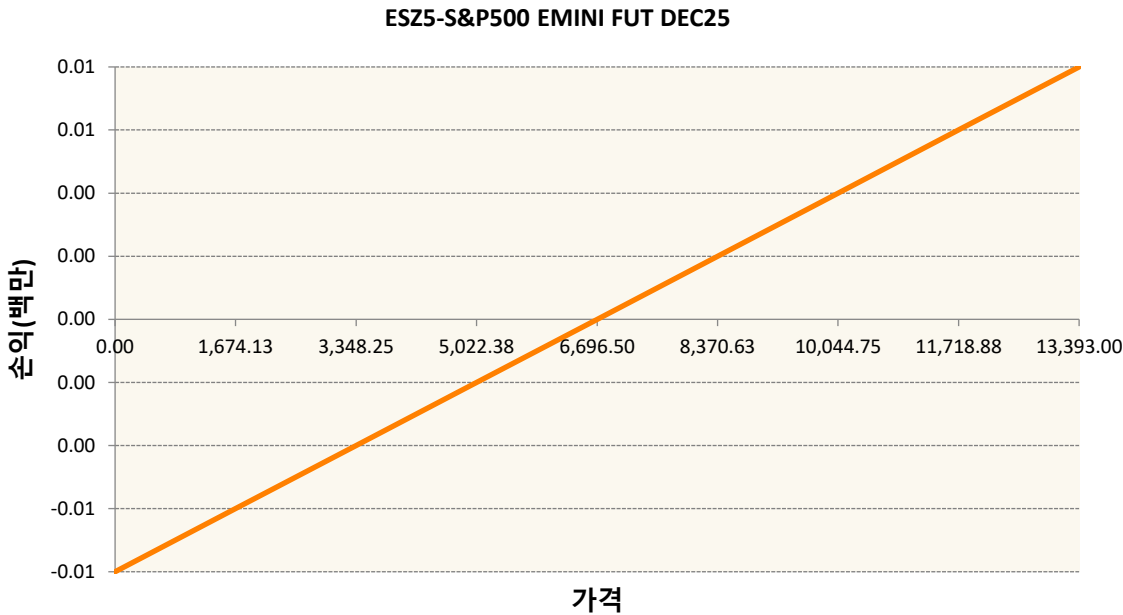
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,394	0	1,394	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	112
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

160

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

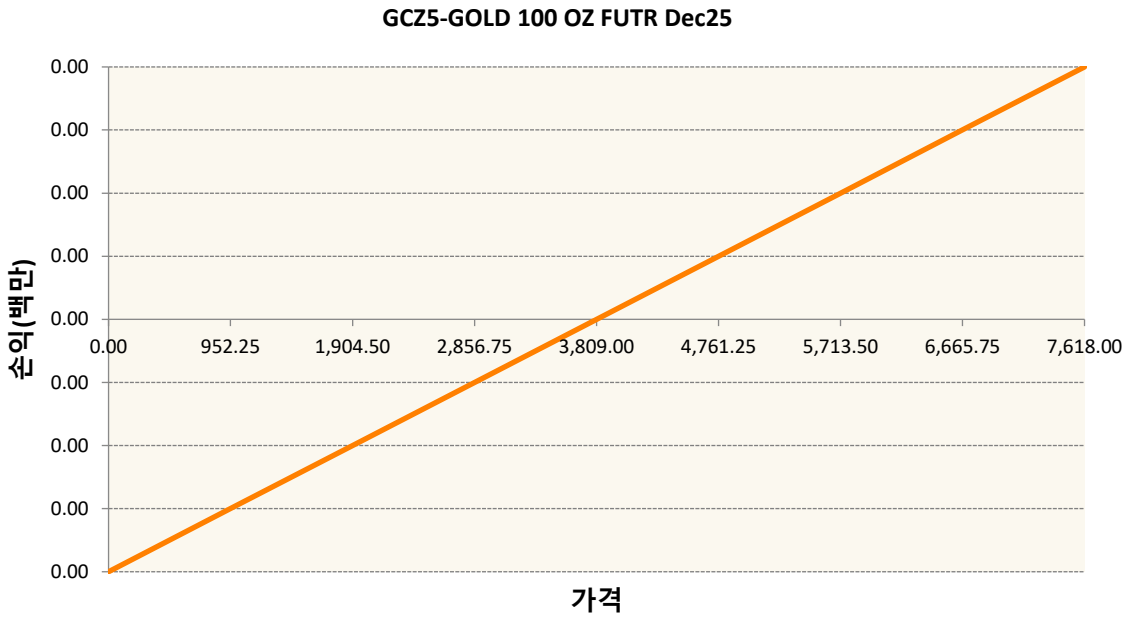
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,584	0	1,584	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 10/10/25 C350 EQUITY	2
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	127

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

(단위:백만원)

112

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

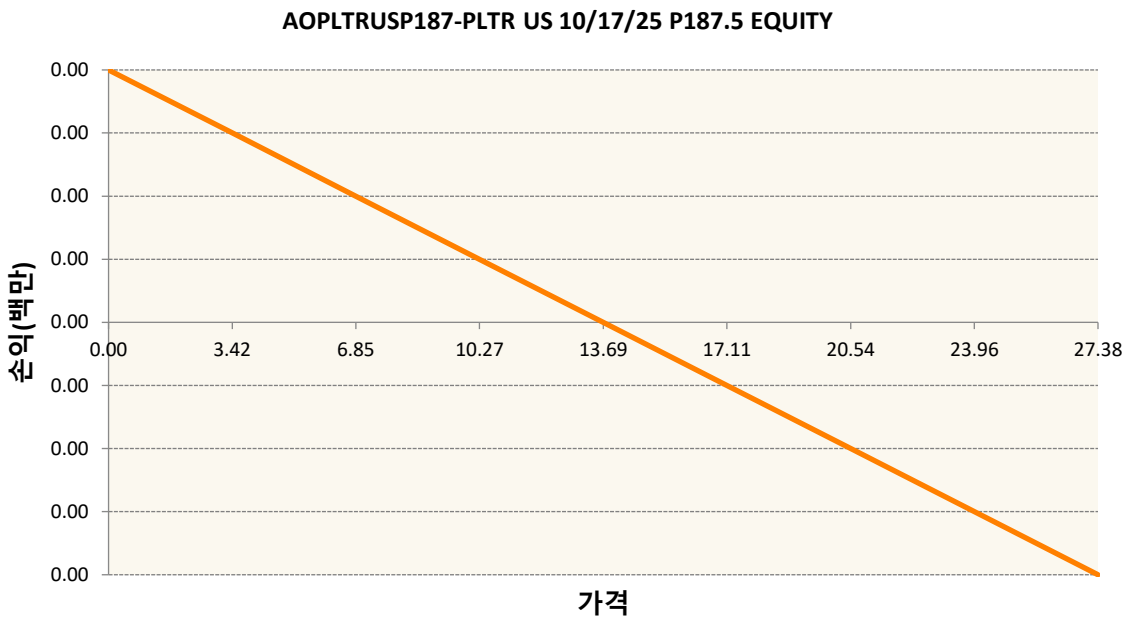
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	753	-753	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC PLTR US 10/17/25 C187.5 EQUITY

79

AOPLTRUSP PLTR US 10/17/25 P187.5 EQUITY

60

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

(단위:백만원)

559

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

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)

AOTLTUSC09TLT US 10/10/25 C90 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

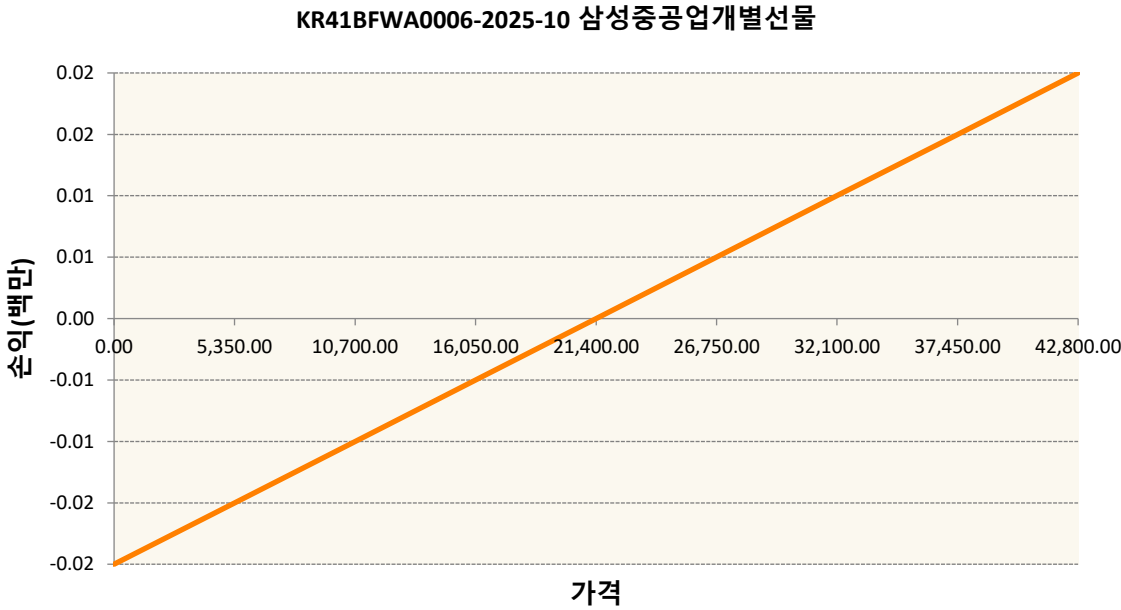
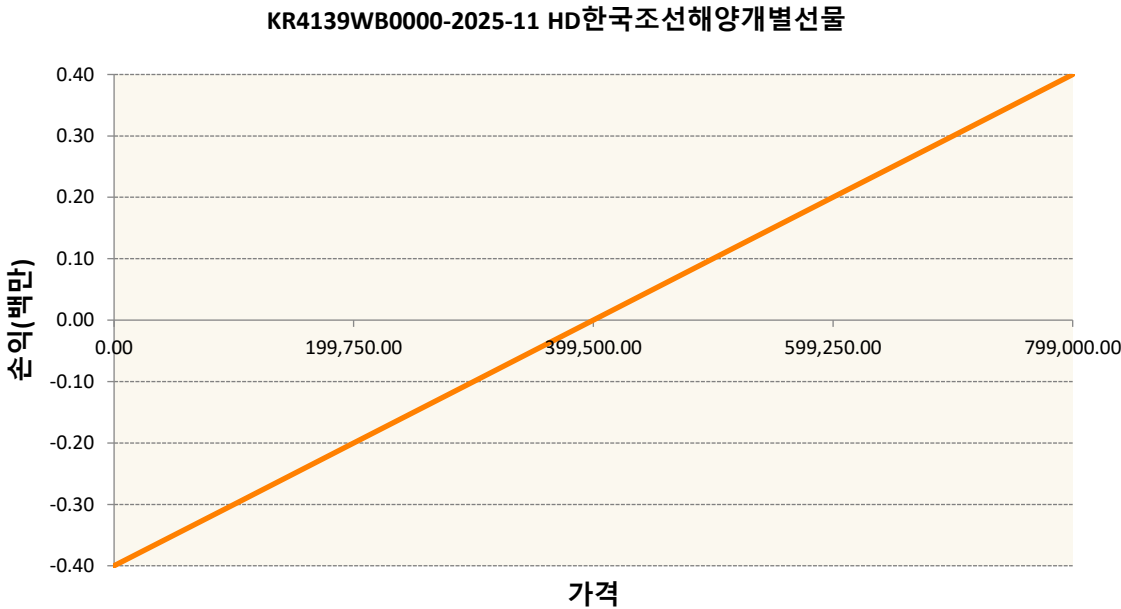
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

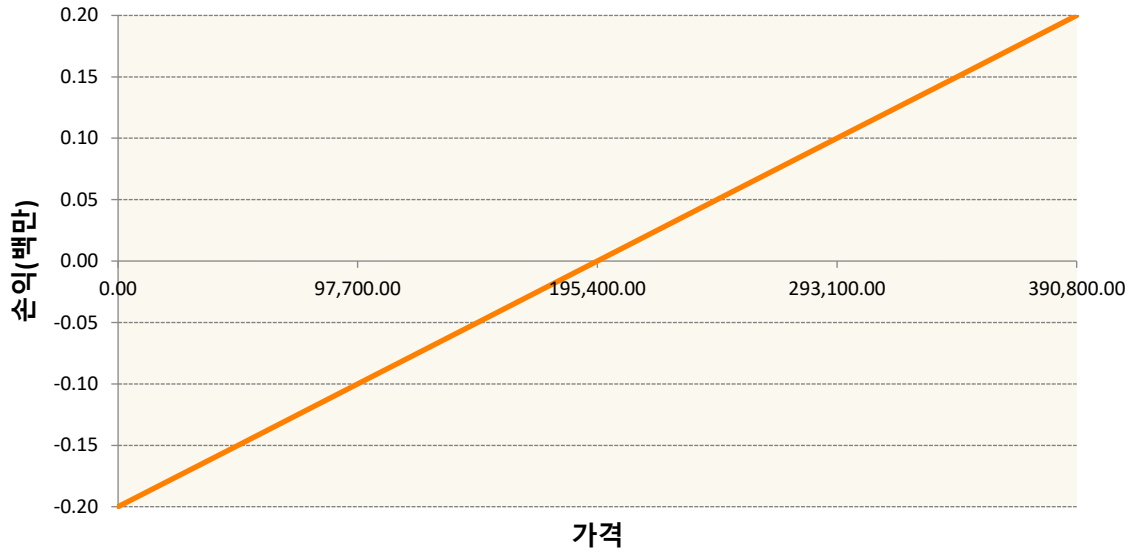
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	19,918	5,475	14,443	장내
누계	유가증권	선물	51,402	0	51,402	장내

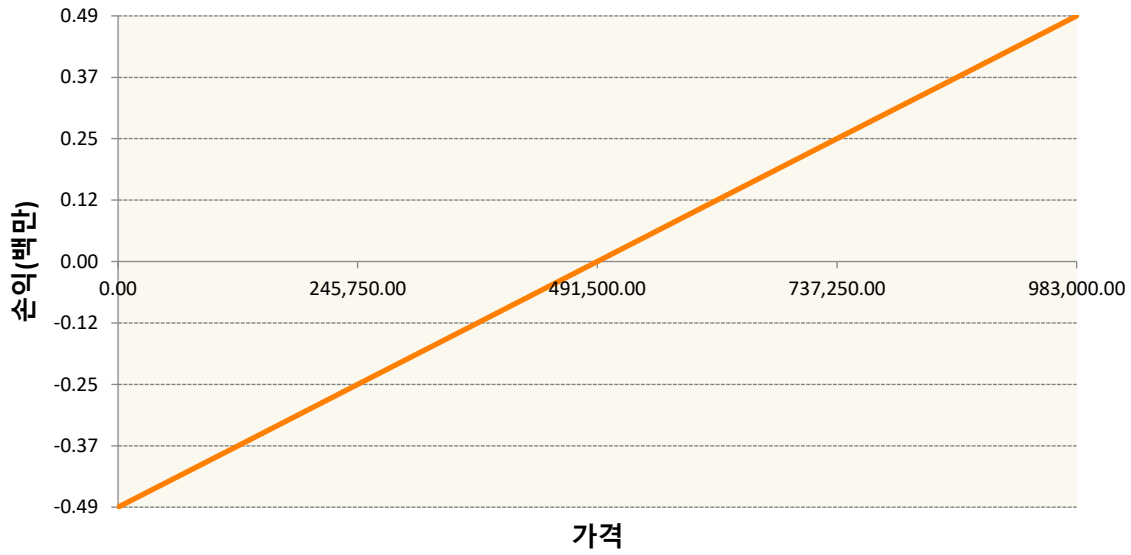
2. 만기시점의 손익구조



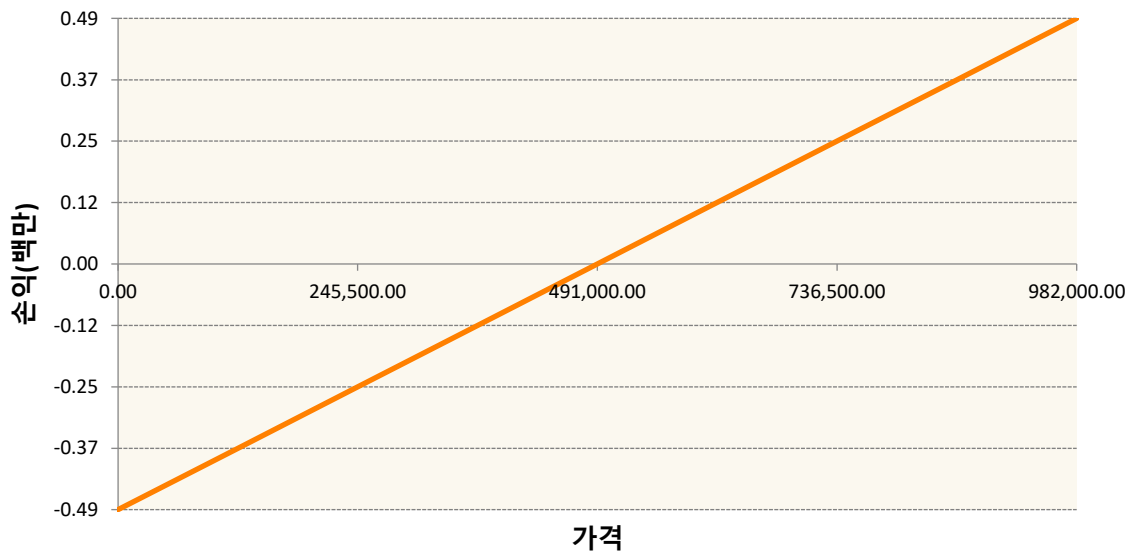
KR41CDWA0007-2025-10 HD현대미포개별선물



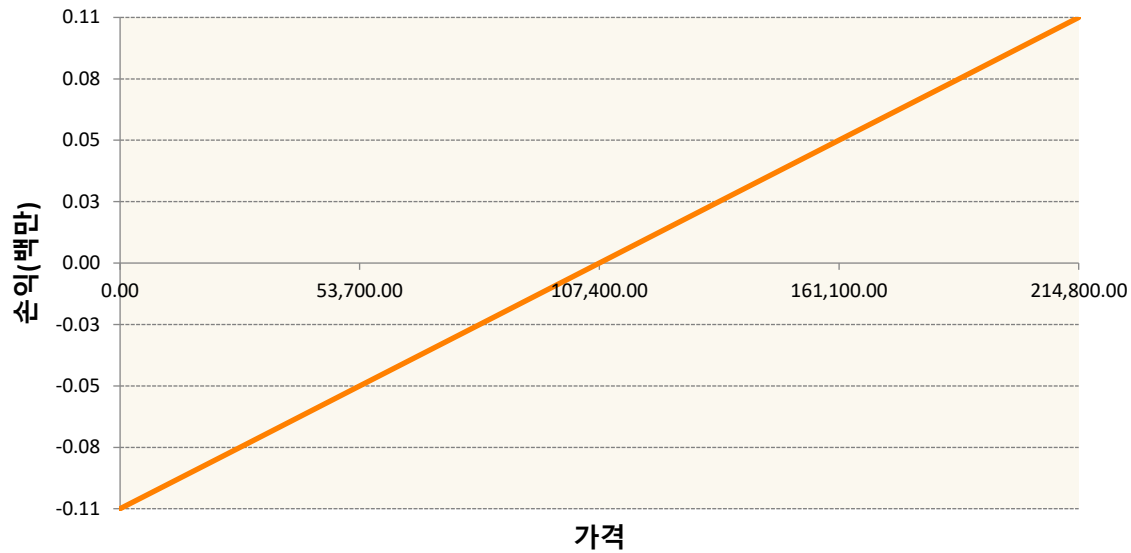
KR41FDWA0004-2025-10 HD현대중공업개별선물



KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWA0002-2025-10 한화오션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4139WB0000		2025-11 HD한국조선해양개별선물					1,155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,155	-1,155	-1,155	-1,155	-1,155	-1,155	-1,155
-5.33%	-770	-770	-770	-770	-770	-770	-770
-2.67%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	385	385	385	385	385	385	385
5.33%	770	770	770	770	770	770	770
8.00%	1,155	1,155	1,155	1,155	1,155	1,155	1,155
KR41BFWA0006		2025-10 삼성중공업개별선물					1,058
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,058	-1,058	-1,058	-1,058	-1,058	-1,058	-1,058
-5.33%	-705	-705	-705	-705	-705	-705	-705
-2.67%	-353	-353	-353	-353	-353	-353	-353
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	353	353	353	353	353	353	353
5.33%	705	705	705	705	705	705	705
8.00%	1,058	1,058	1,058	1,058	1,058	1,058	1,058
KR41CDWA0007		2025-10 HD현대미포개별선물					440
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-440	-440	-440	-440	-440	-440	-440
-5.33%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293
-2.67%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	147	147	147	147	147	147	147
5.33%	293	293	293	293	293	293	293
8.00%	440	440	440	440	440	440	440
KR41FDWA0004 2025-10 HD현대중공업개별선물							144
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
-5.33%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
-2.67%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	48	48	48	48	48	48	48
5.33%	96	96	96	96	96	96	96
8.00%	144	144	144	144	144	144	144
KR41FDWB0003 2025-11 HD현대중공업개별선물							438
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-438	-438	-438	-438	-438	-438	-438
-5.33%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292
-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%	292	292	292	292	292	292	292
8.00%	438	438	438	438	438	438	438
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)

2,183

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

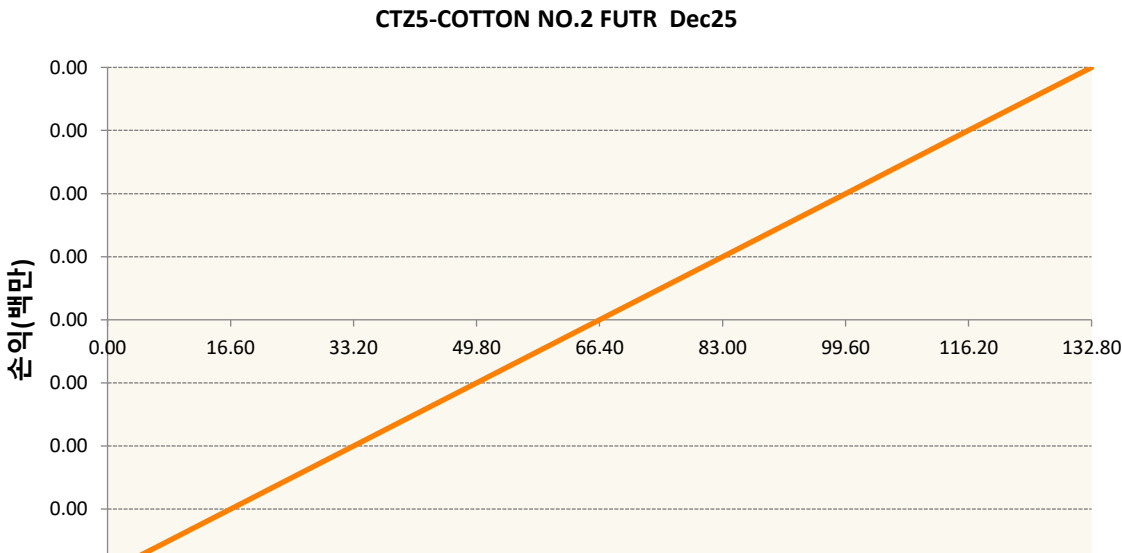
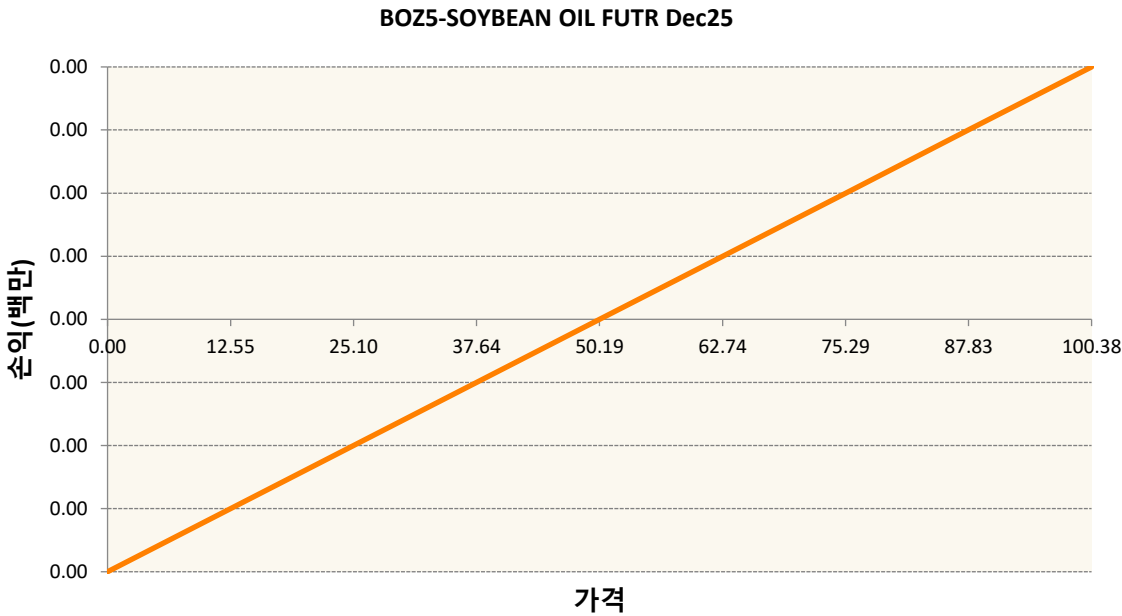
포커스농산물모(채권-파생형)

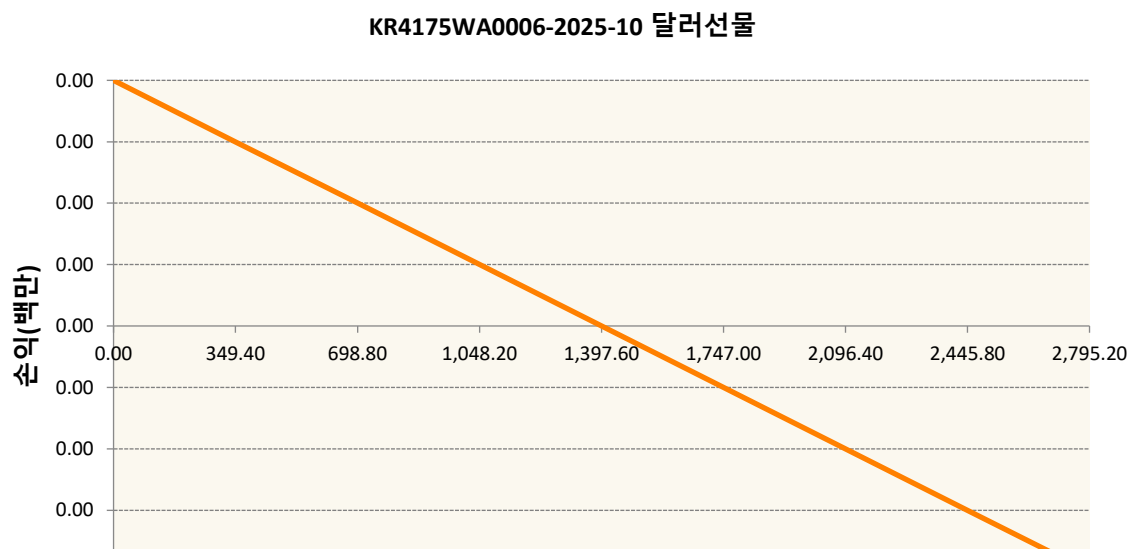
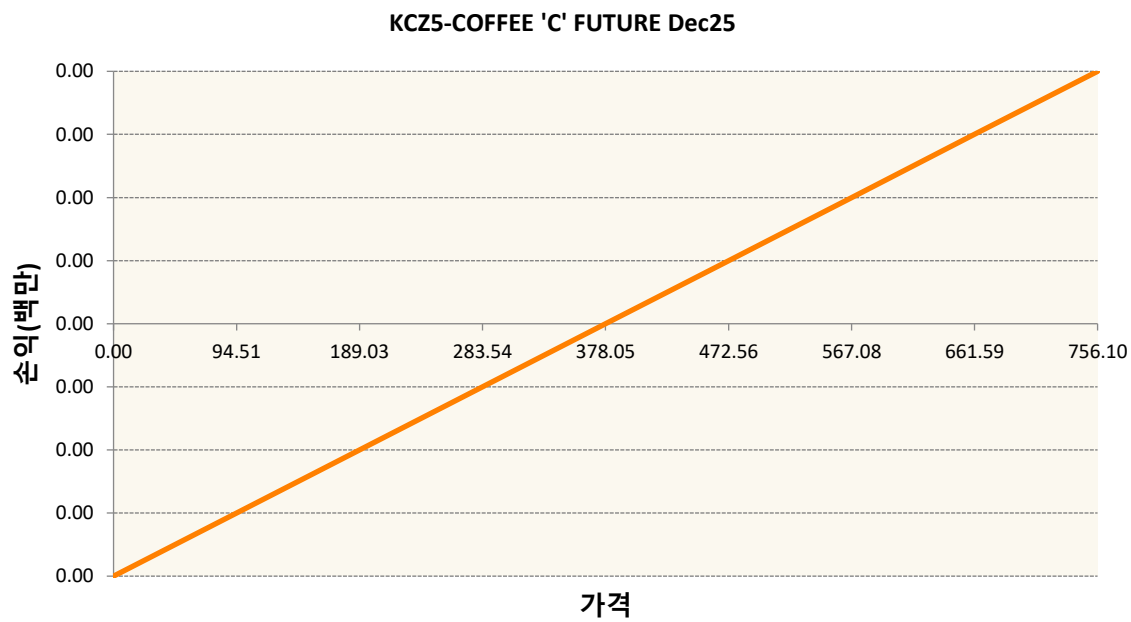
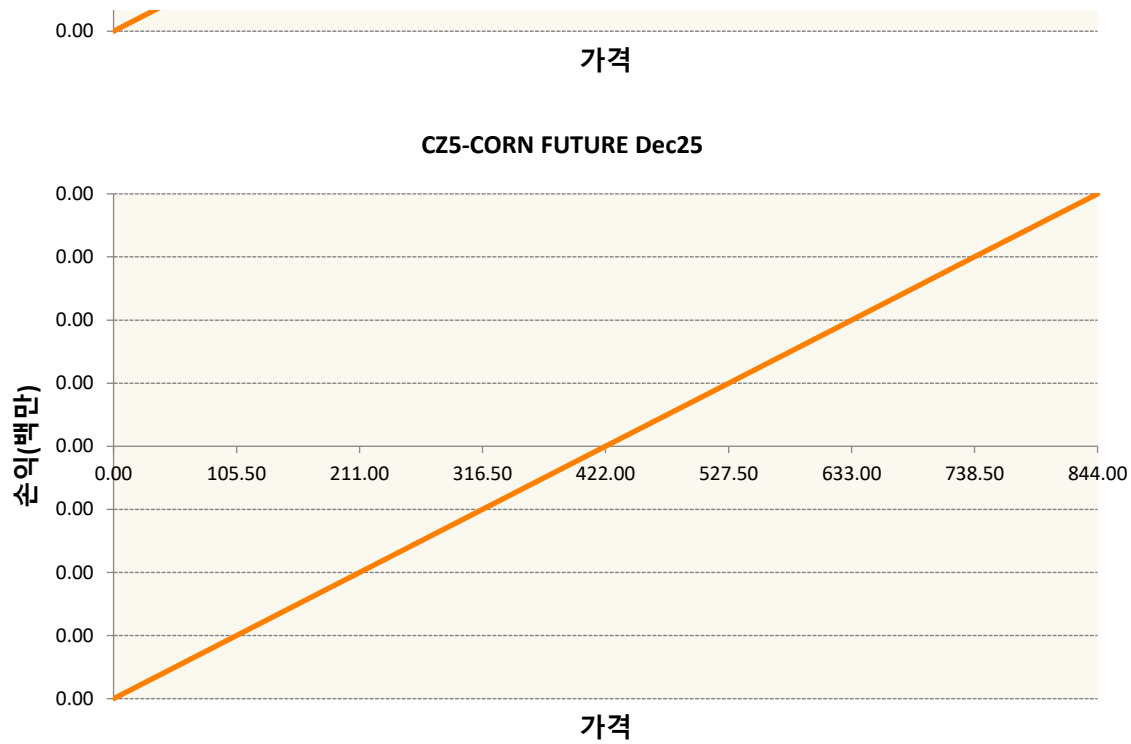
1. 계약금액

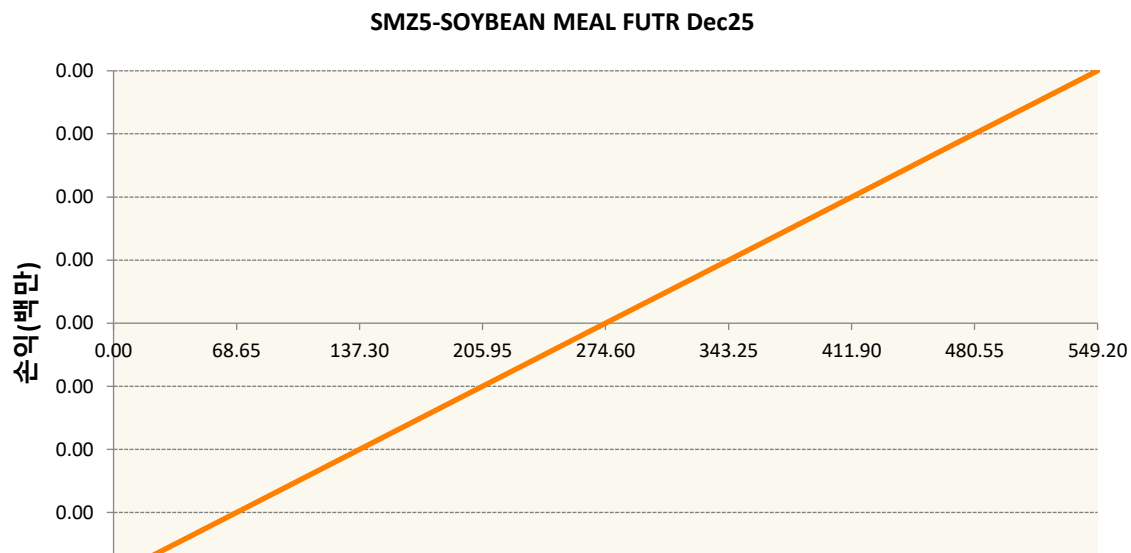
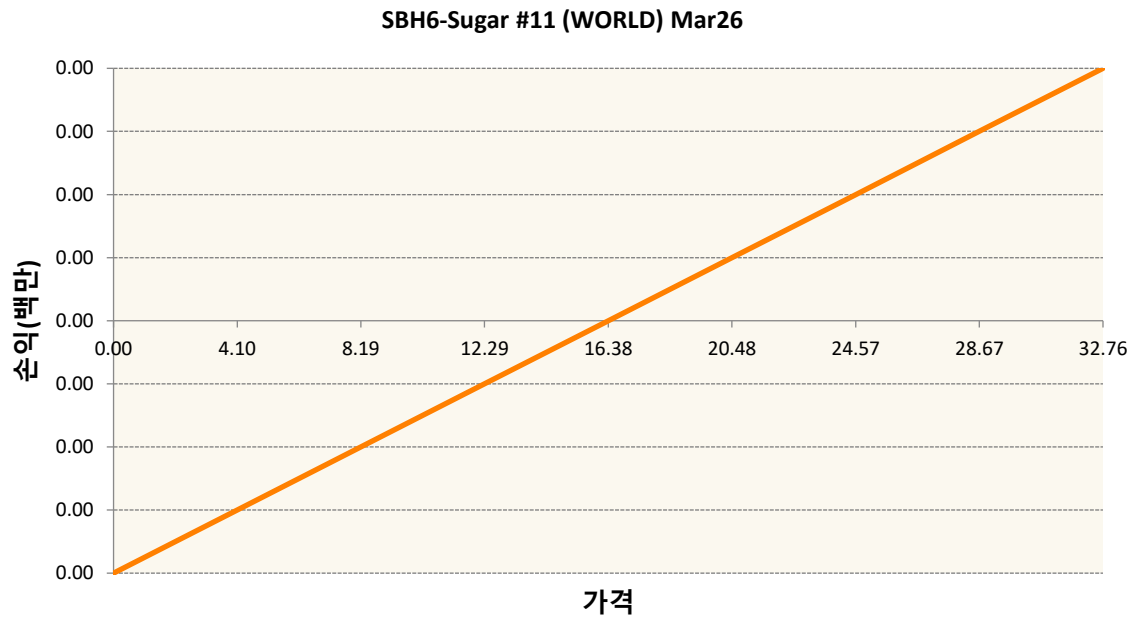
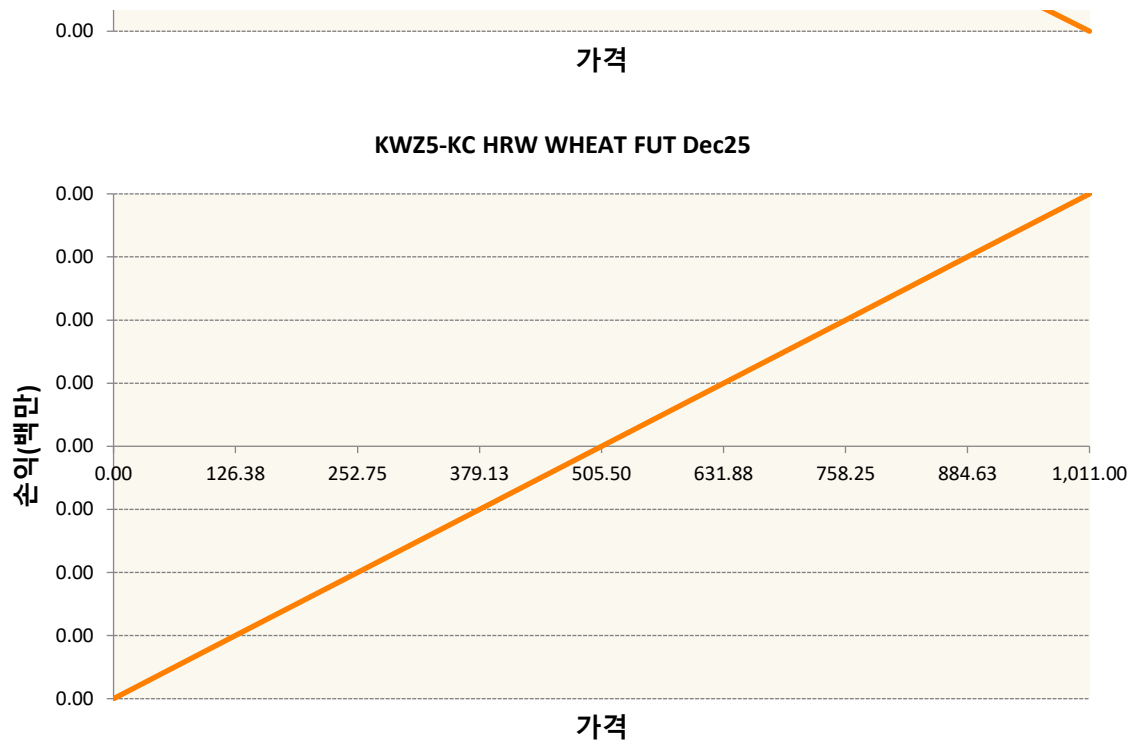
(단위:USD 백만)

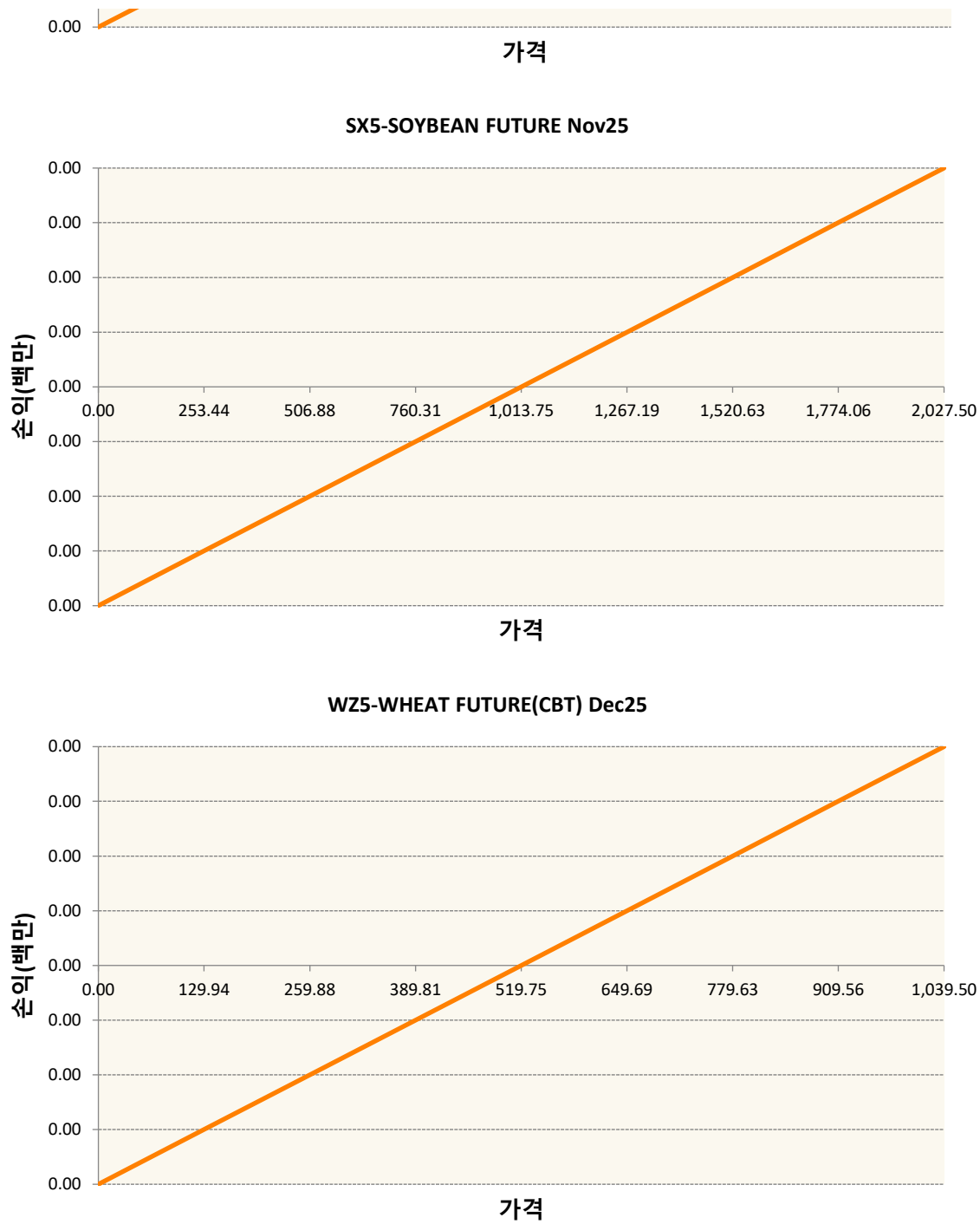
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,153	0	1,153	
누계	유가증권	선물	2,157	0	2,157	
누계	통화	선물	0	321	-321	장내

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	2025-09-30
기준일	2025-09-29

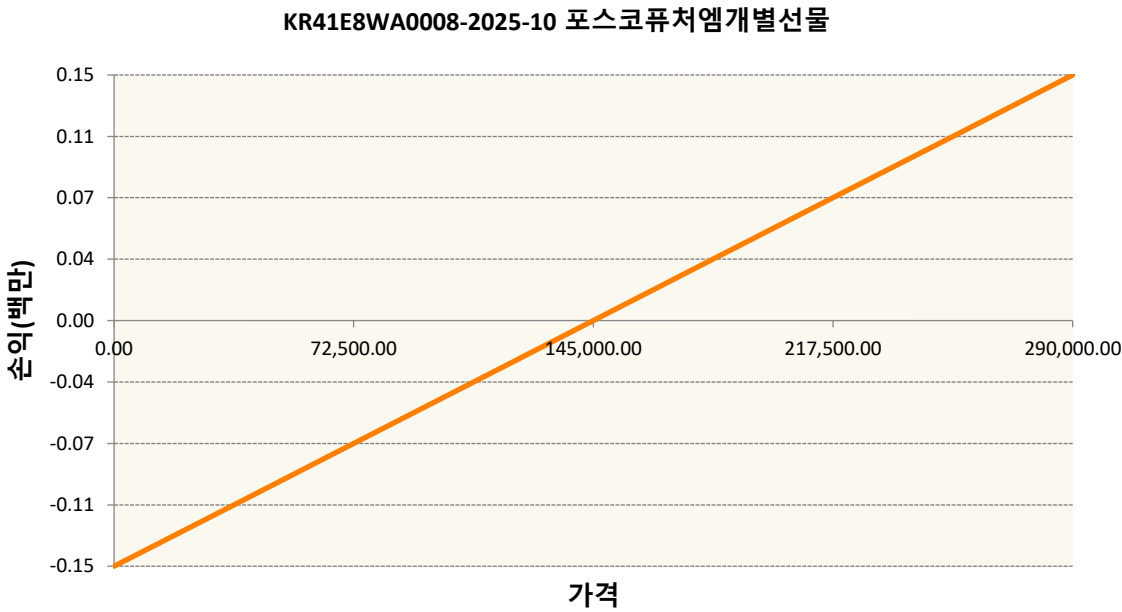
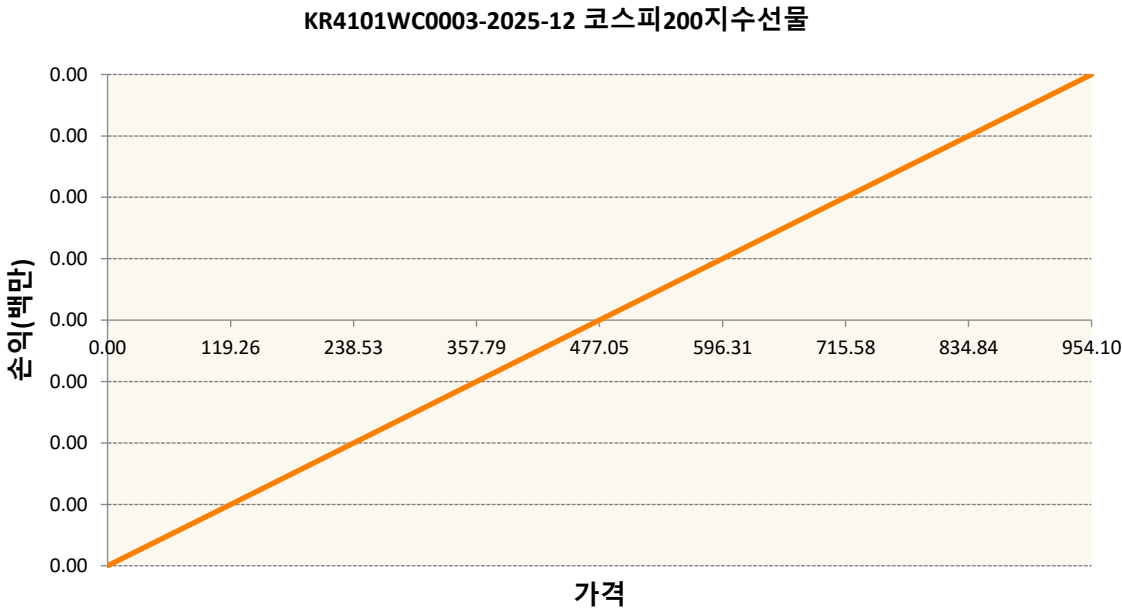
스마트인덱스모

1. 계약금액

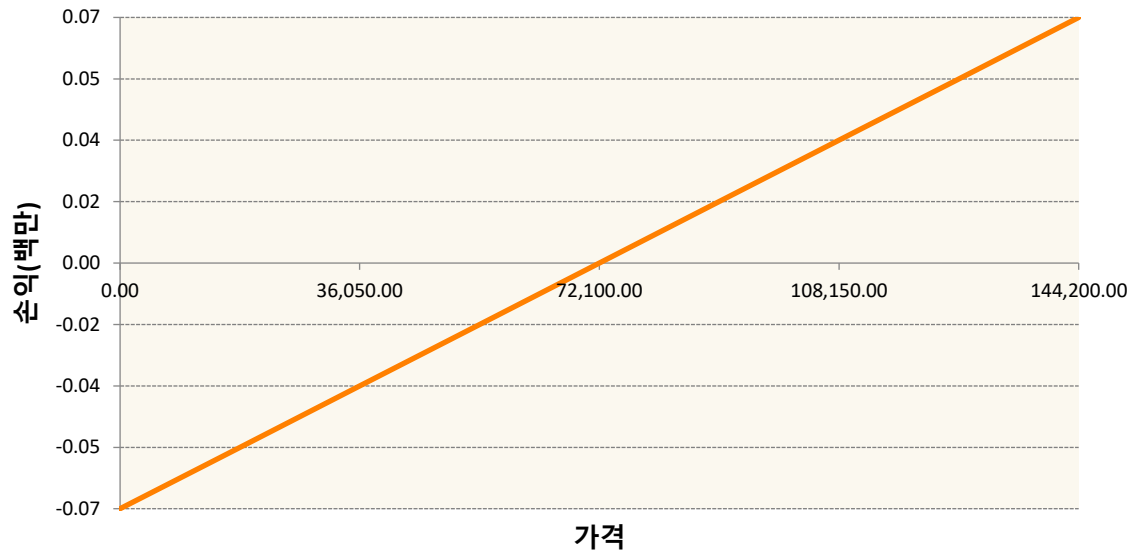
(단위:백만원)

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

95
 4
 2

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

(단위:백만원)

6

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

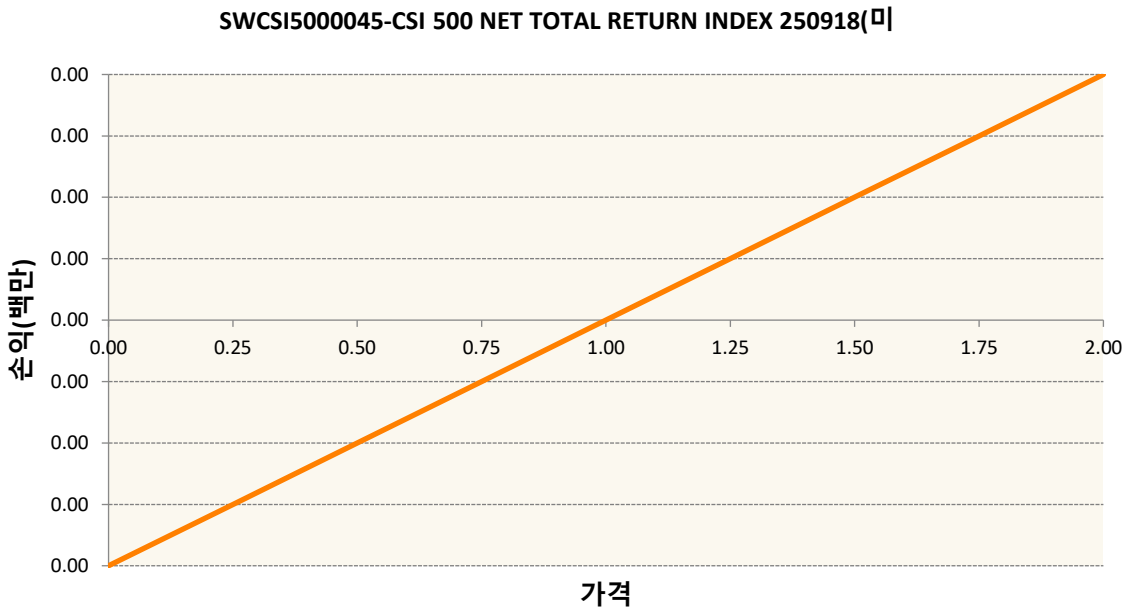
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

378

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

605

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

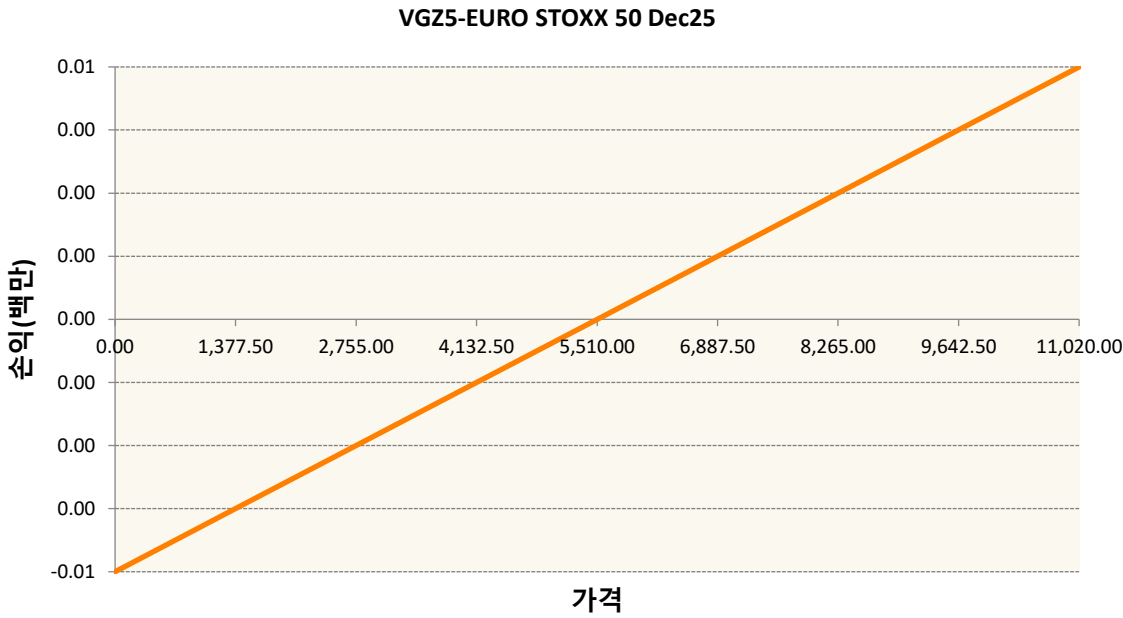
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	722	0	722	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ5	EURO STOXX 50 Dec25	58
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

49

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

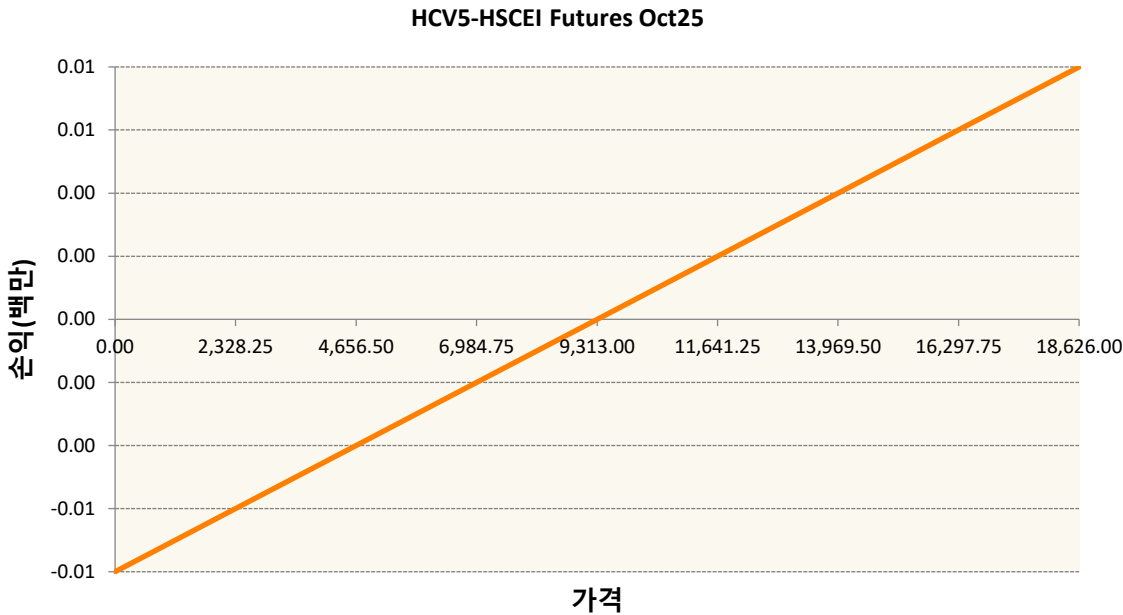
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,114	0	2,114	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV5	HSCEI Futures Oct25	169
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

239

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

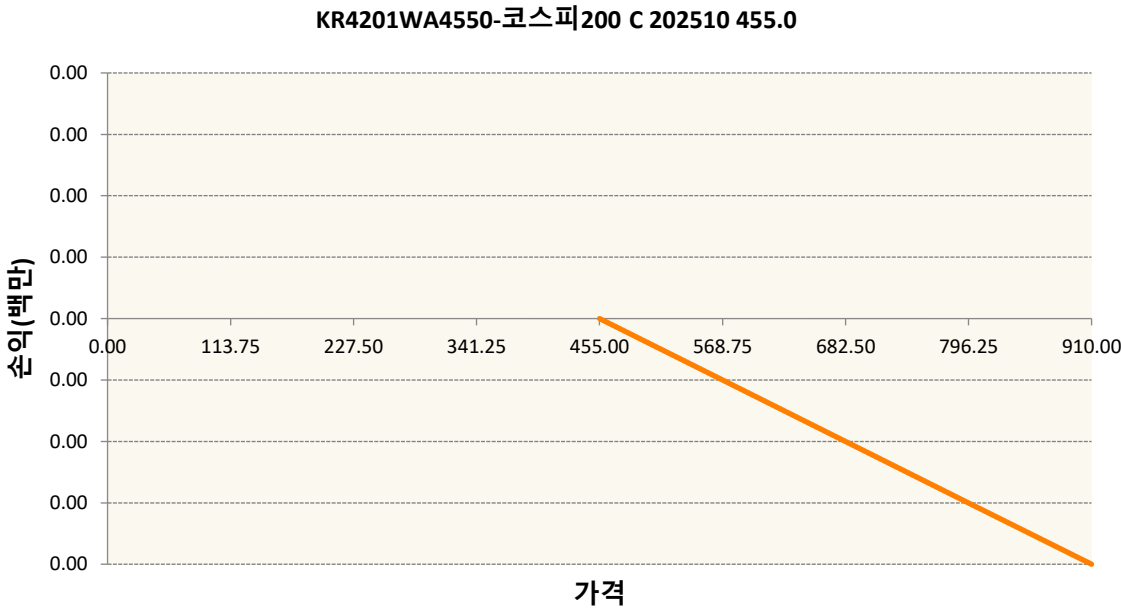
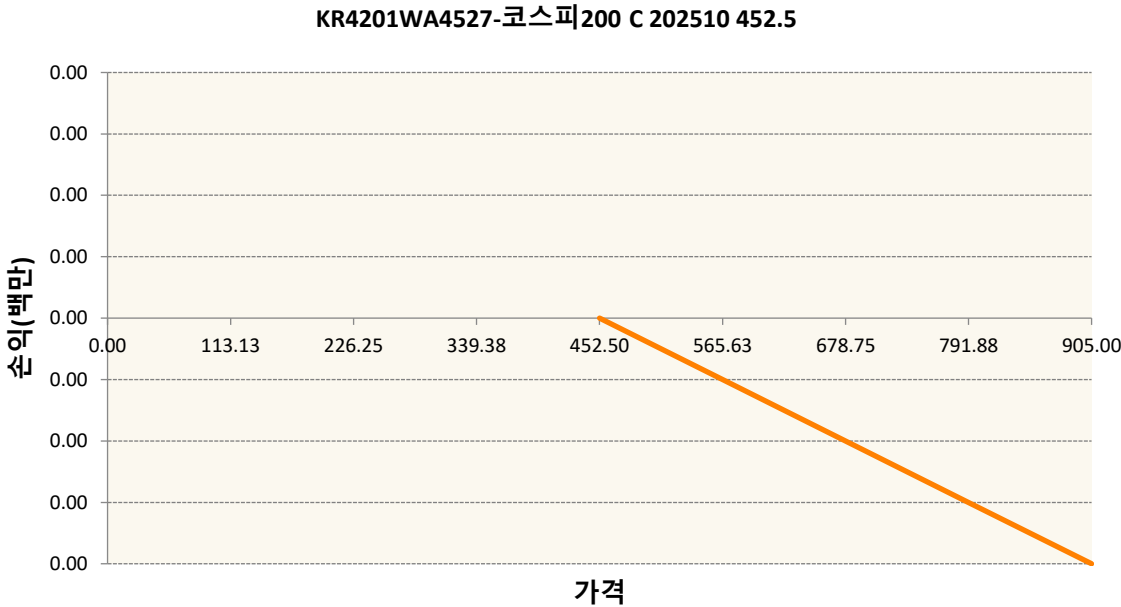
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

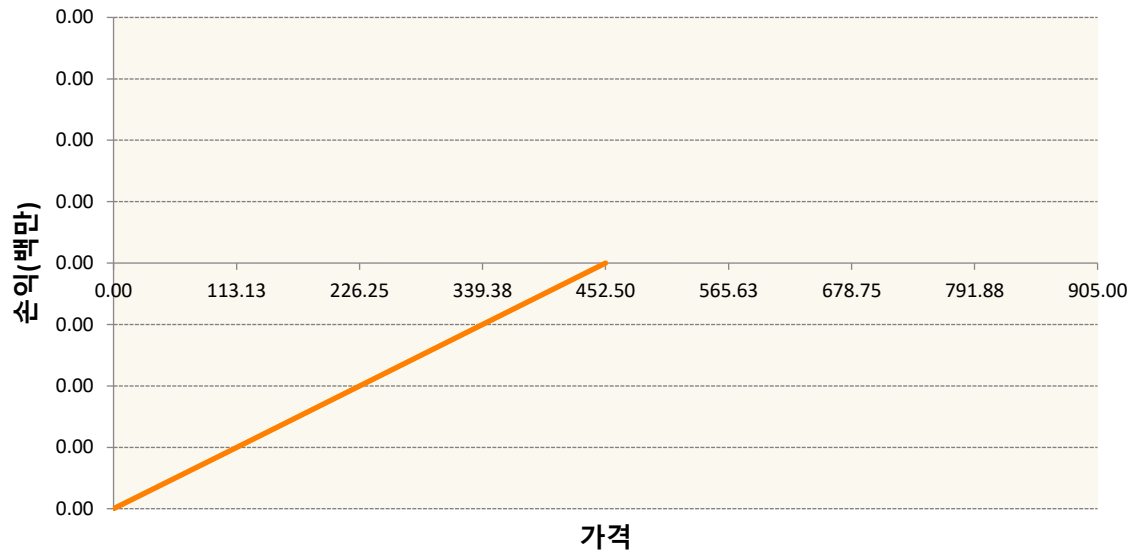
(단위:백만원)

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

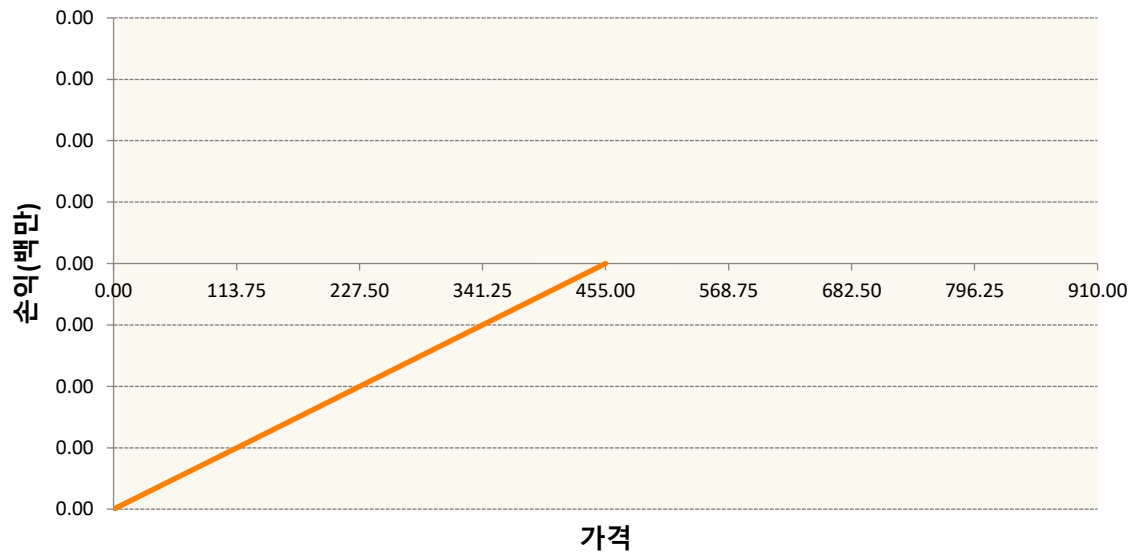
2. 만기시점의 손익구조



KR4301WA4526-코스피200 P 202510 452.5



KR4301WA4559-코스피200 P 202510 455.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WA4: 코스피200 C 202510 452.5
 KR4201WA4: 코스피200 C 202510 455.0
 KR4301WA4: 코스피200 P 202510 452.5
 KR4301WA4: 코스피200 P 202510 455.0

896
1,338
199
319

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-09-30

기준일 2025-09-29

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	2025-09-30
기준일	2025-09-29

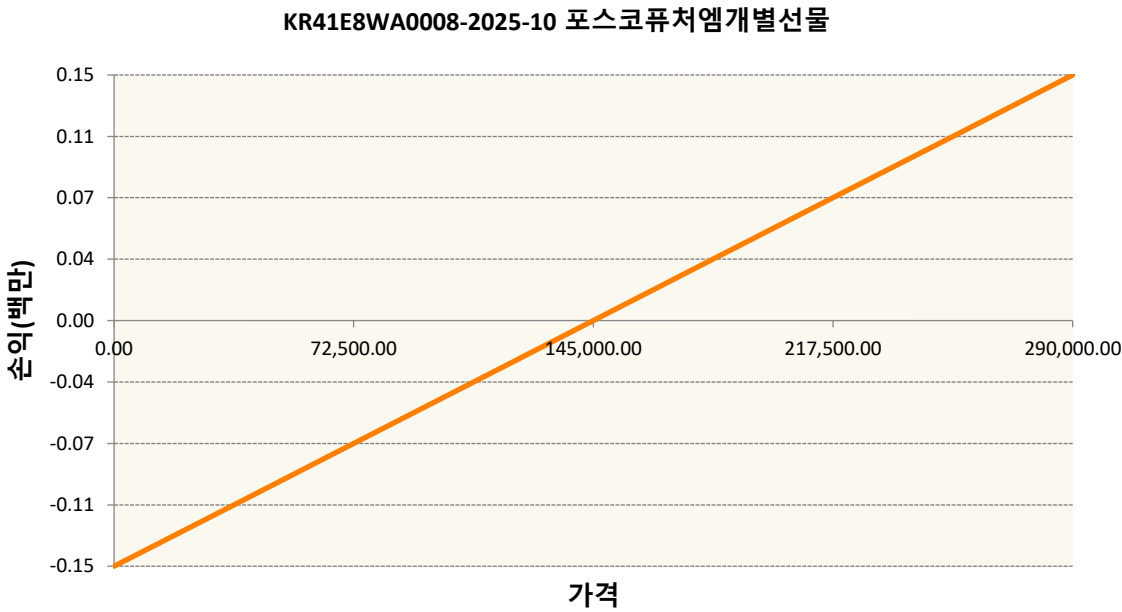
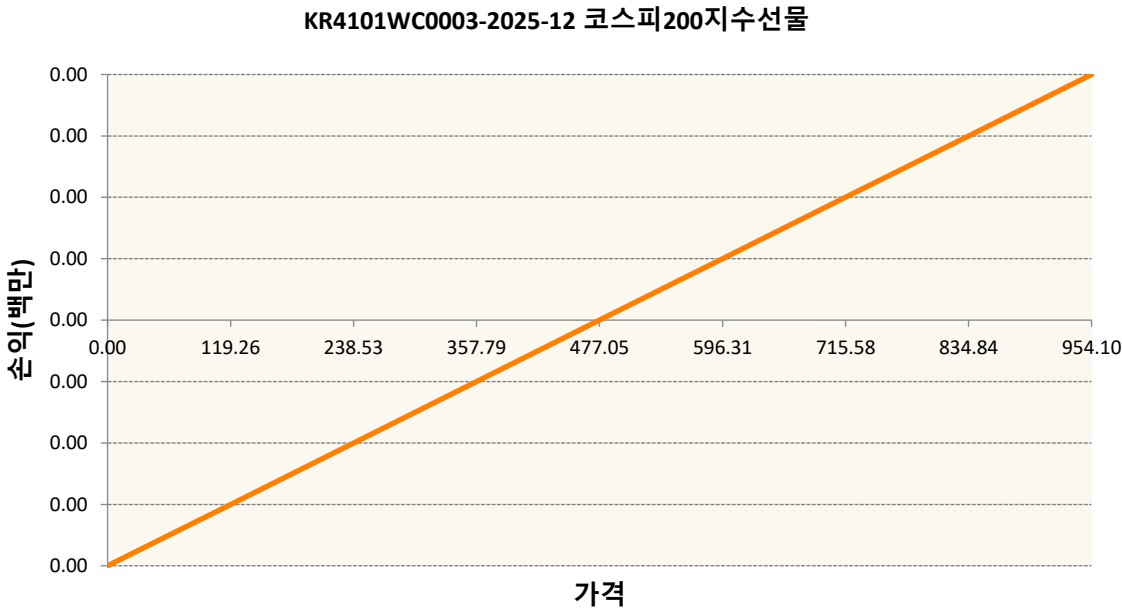
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

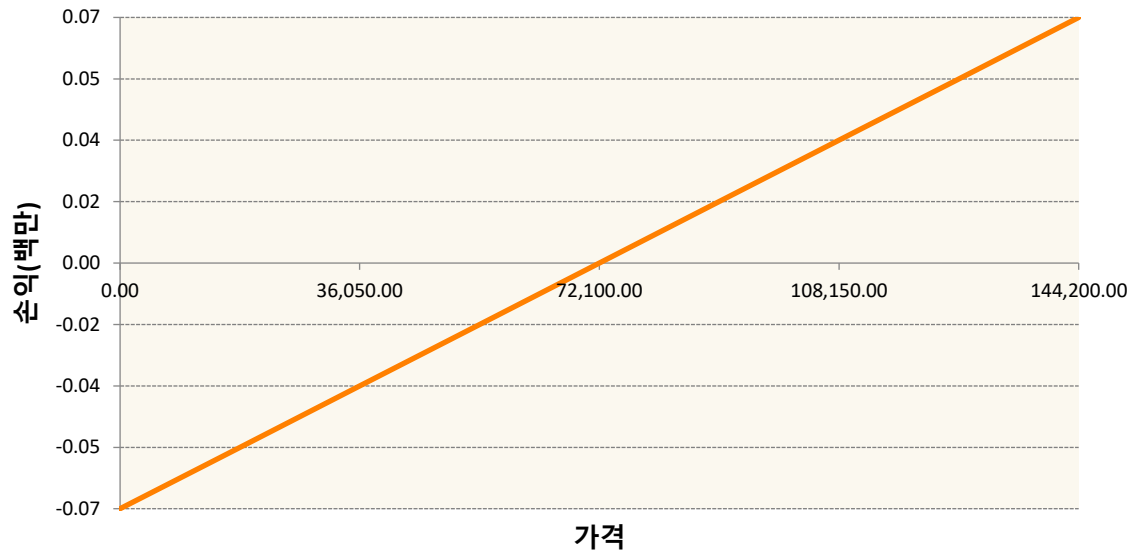
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	512	0	512	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	2025-09-30
기준일	2025-09-29

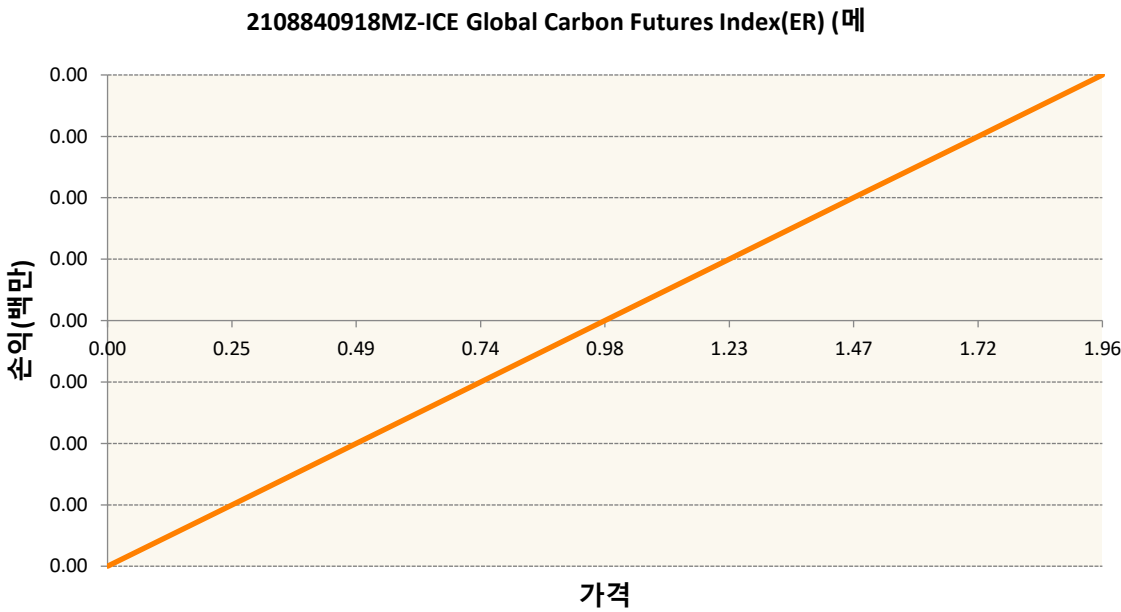
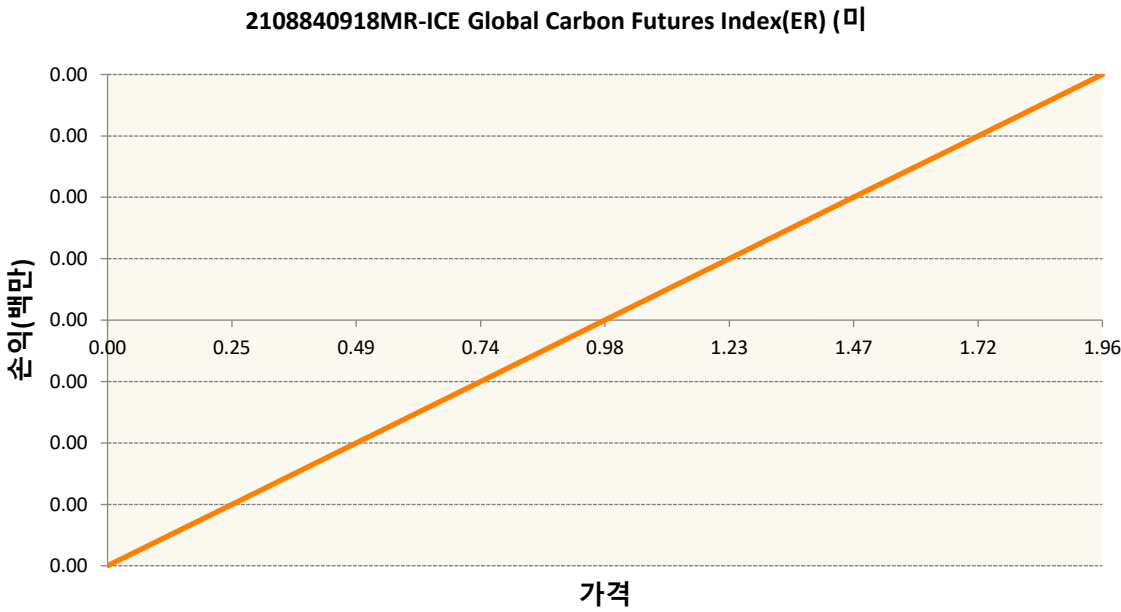
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	9,310	0	9,310	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		636
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		106

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	747

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

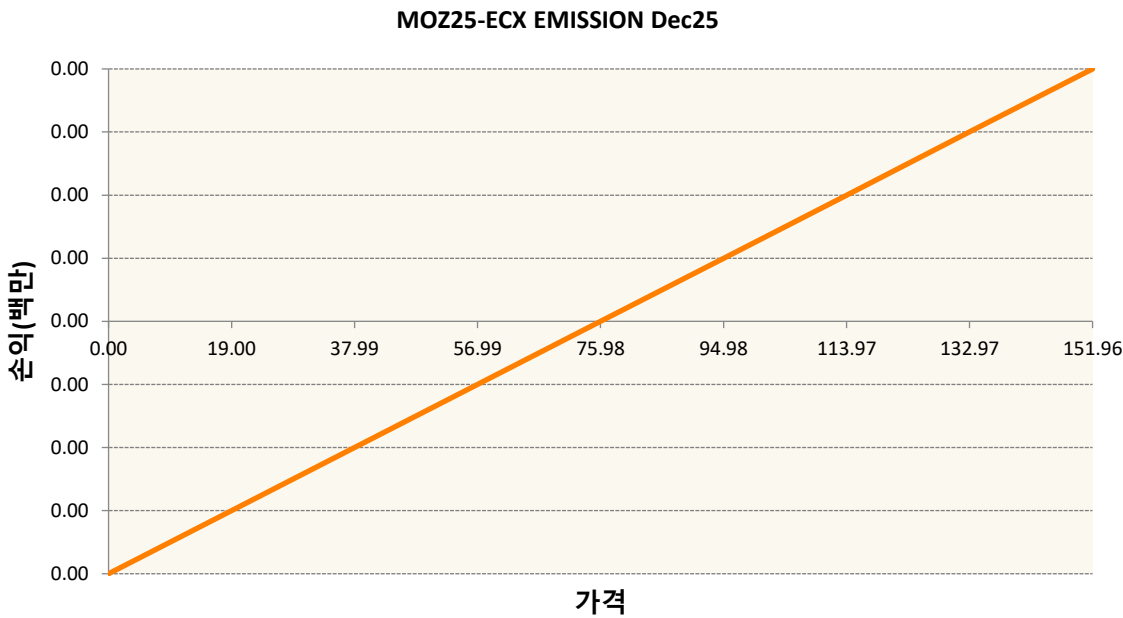
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,686	0	5,686	
누계	지수	스왑	-8	0	-8	장외
누계	통화	선도	0	4,279	-4,279	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F8TC KRW/EUR 30-09-25E	161
FXW213F9SC KRW/EUR 31-10-25E	181
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	455

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

(단위:백만원)

847

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

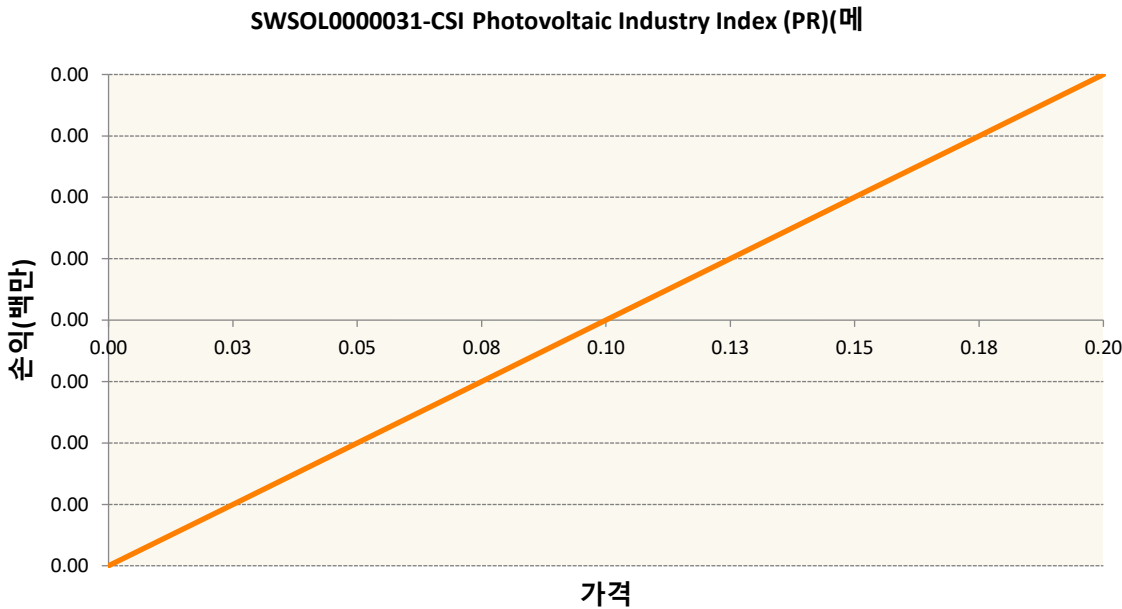
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,854	0	2,854	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (메리츠)	37
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	37
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	25
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	26
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)(메	7

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

(단위:백만원)

224

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

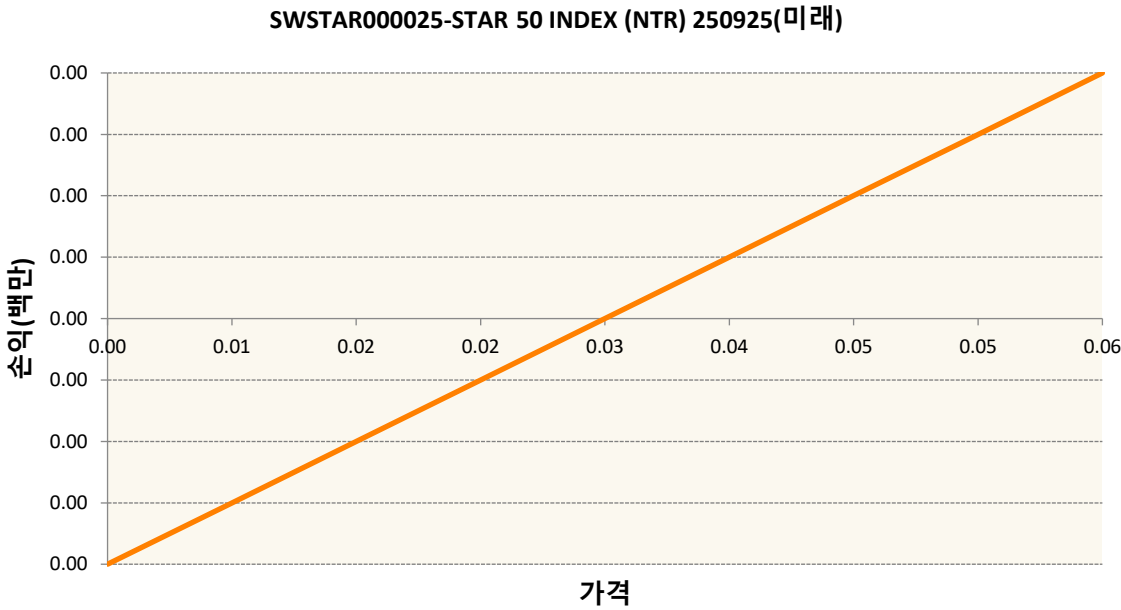
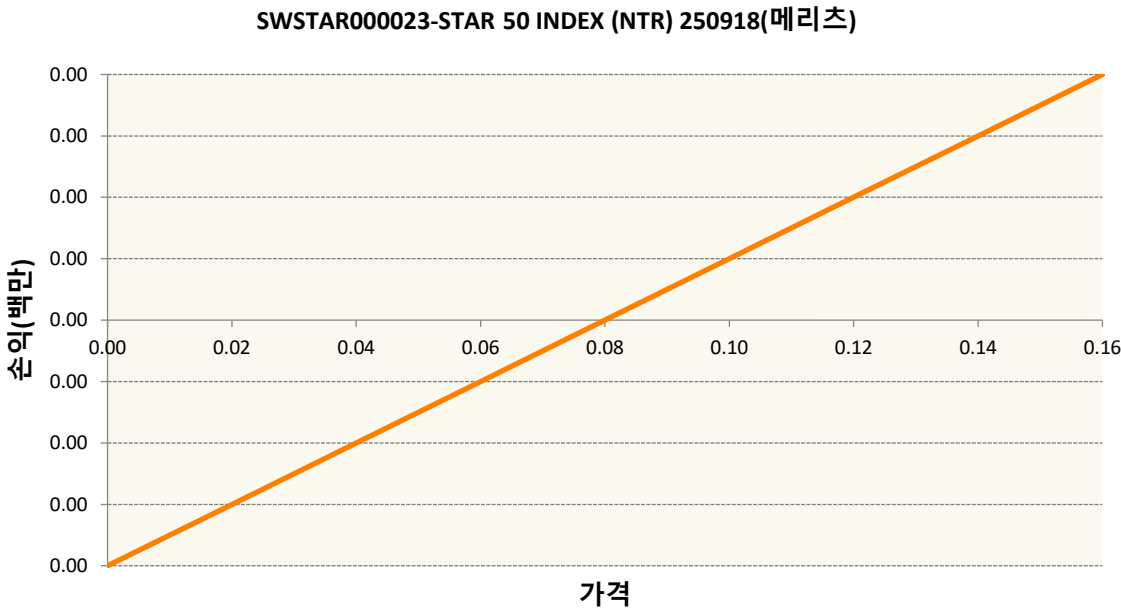
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	4,568	0	4,568	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		18
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		5
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		65
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		14

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	181

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

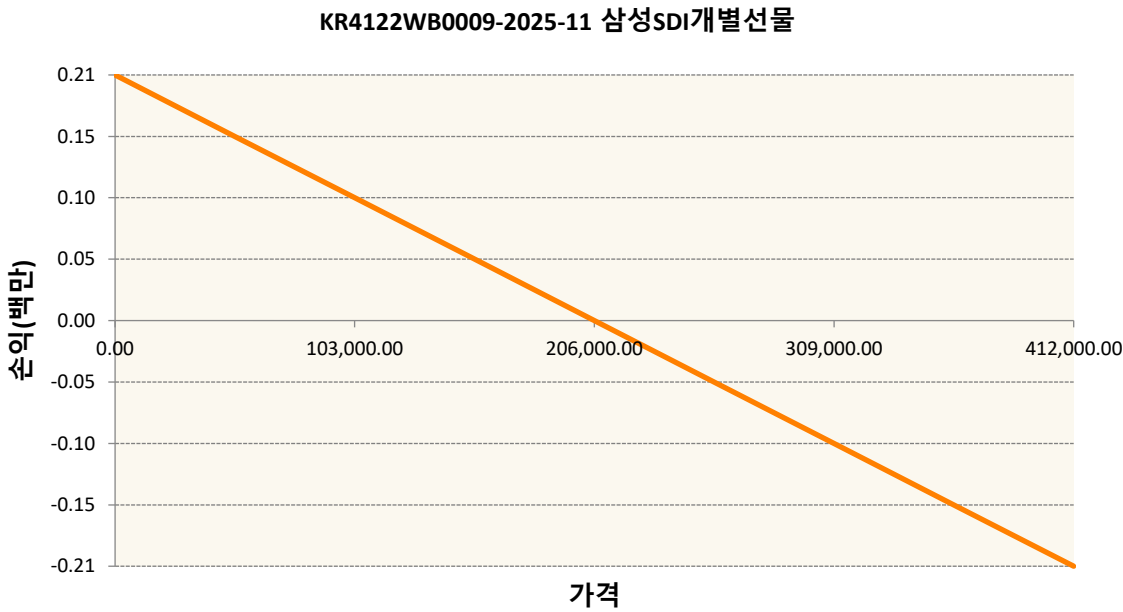
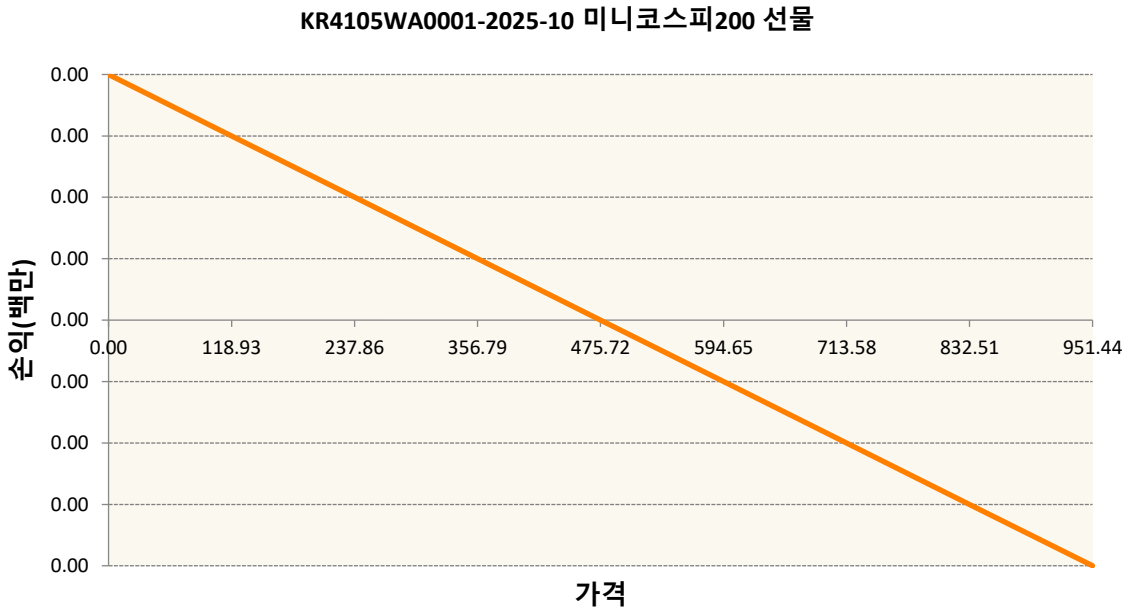
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

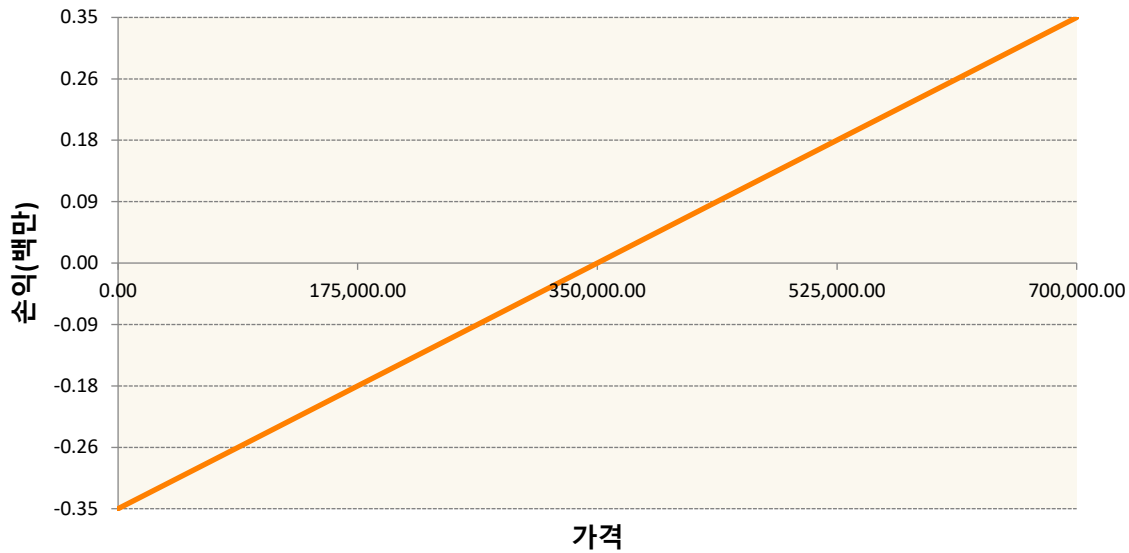
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7	8	-1	장내
누계	유가증권	선물	26	968	-942	장내

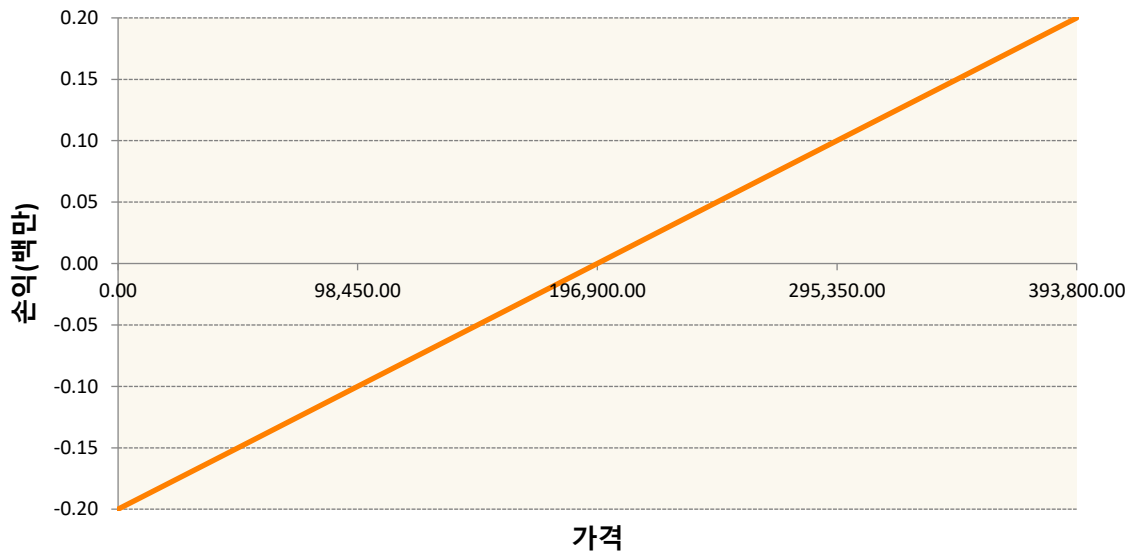
2. 만기시점의 손익구조



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

15
1
1
1

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

(단위:백만원)

2

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

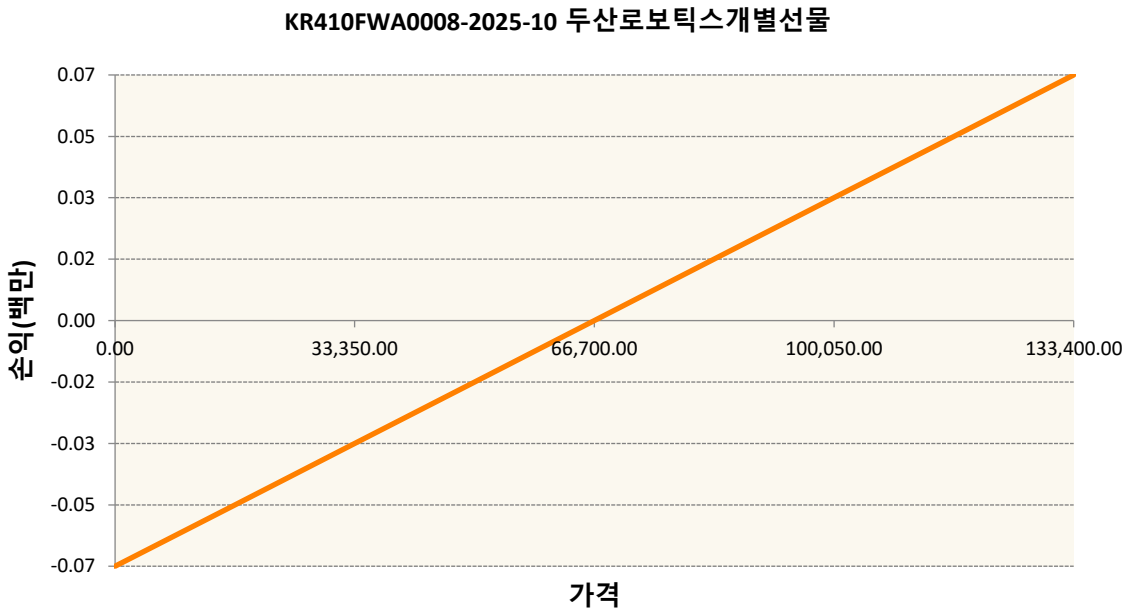
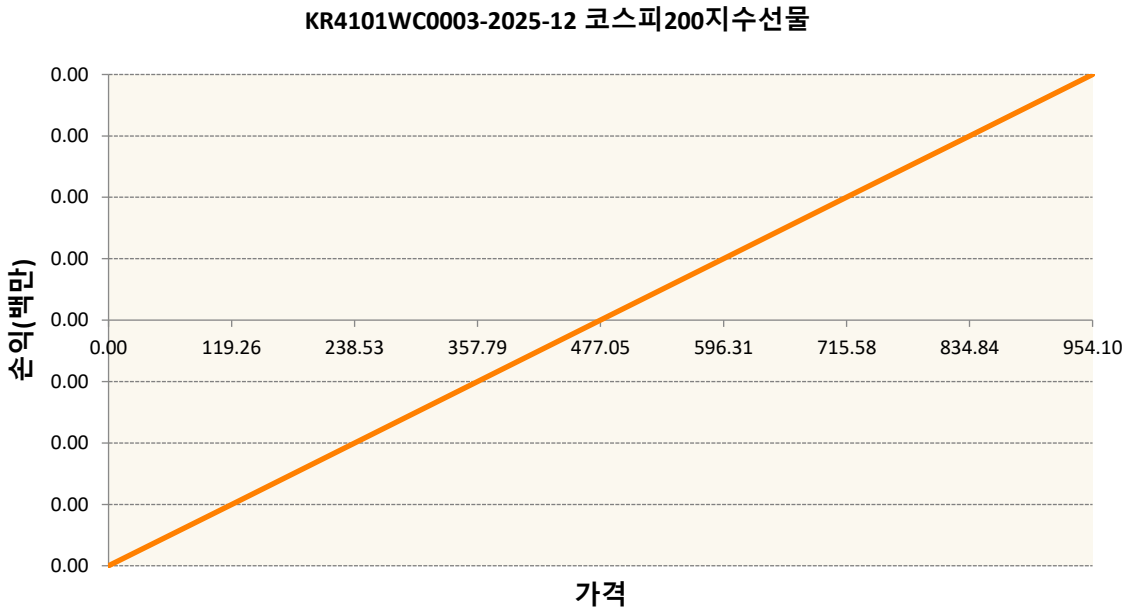
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

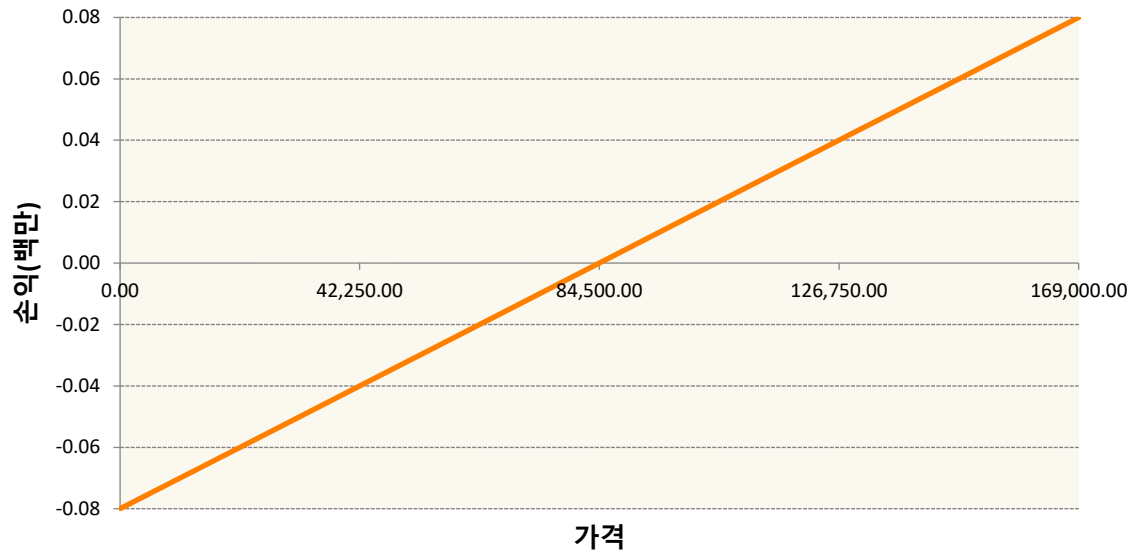
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	239	-239	장내
누계	유가증권	선물	10,666	1,223	9,443	장내

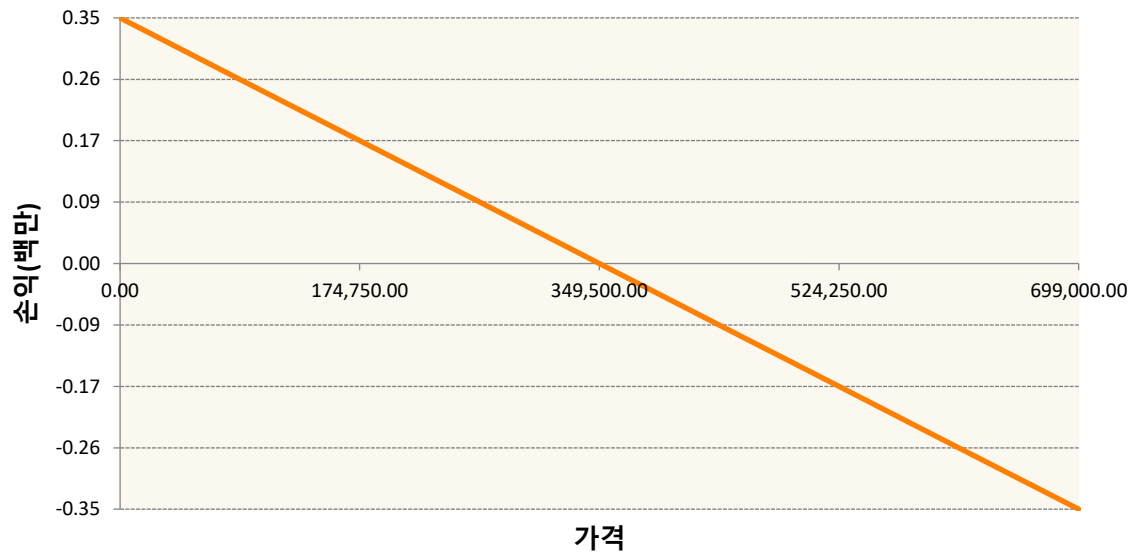
2. 만기시점의 손익구조



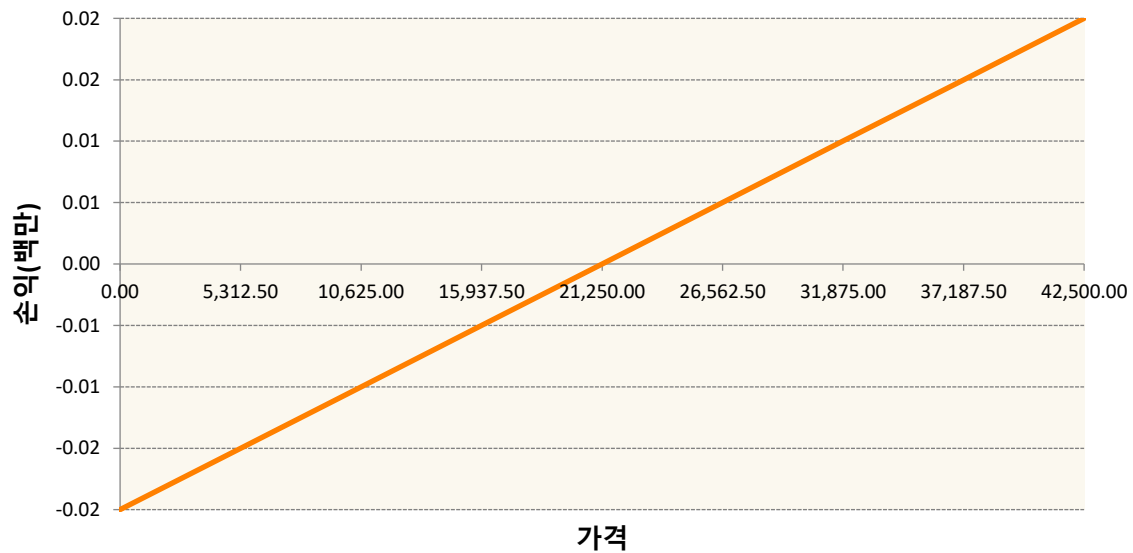
KR4111WA0003-2025-10 삼성전자개별선물



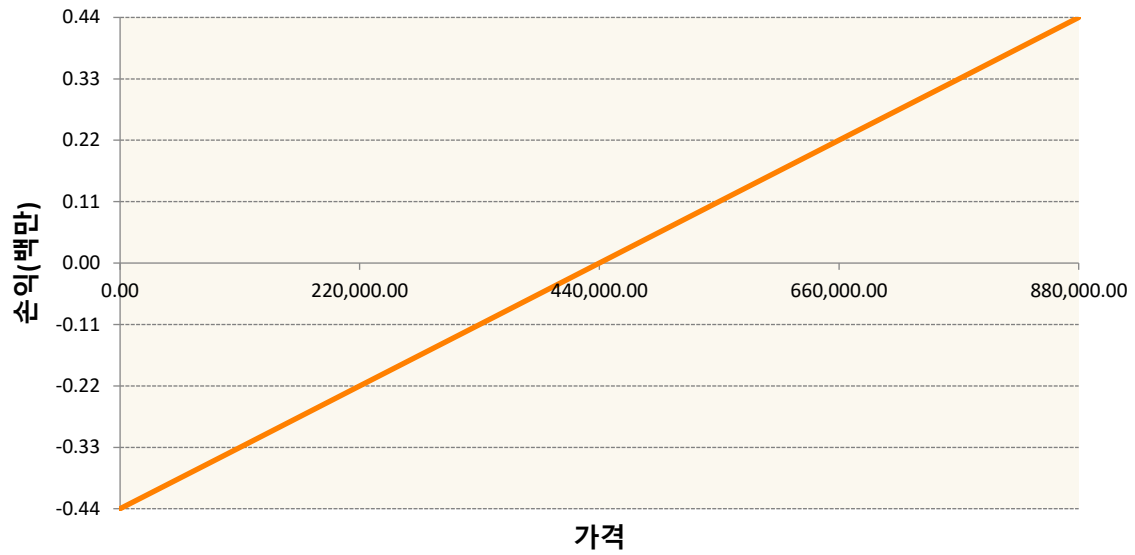
KR4150WA0005-2025-10 SK하이닉스개별선물



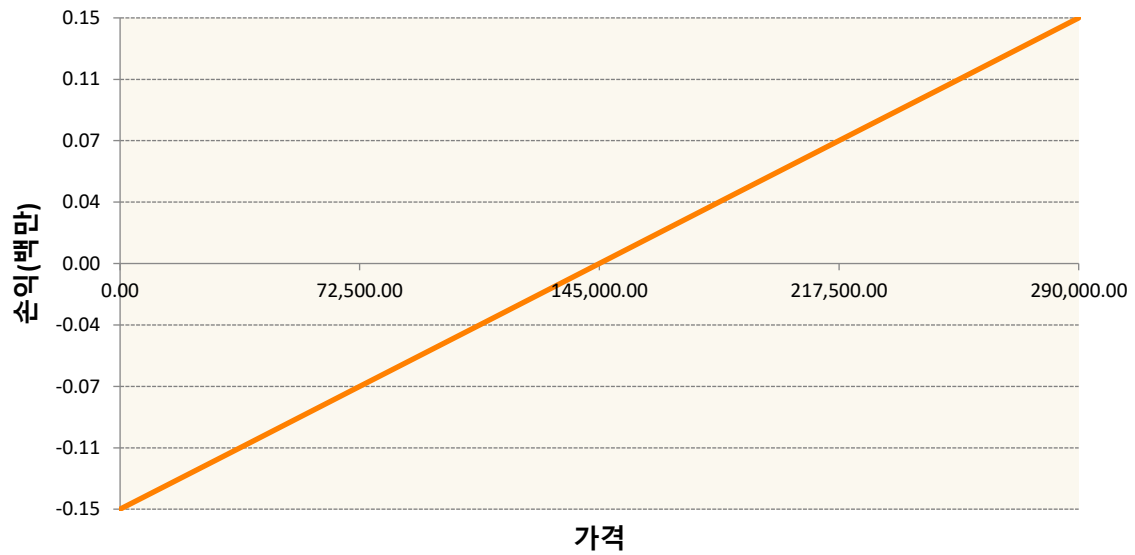
KR41CNWA0005-2025-10 포스코DX개별선물



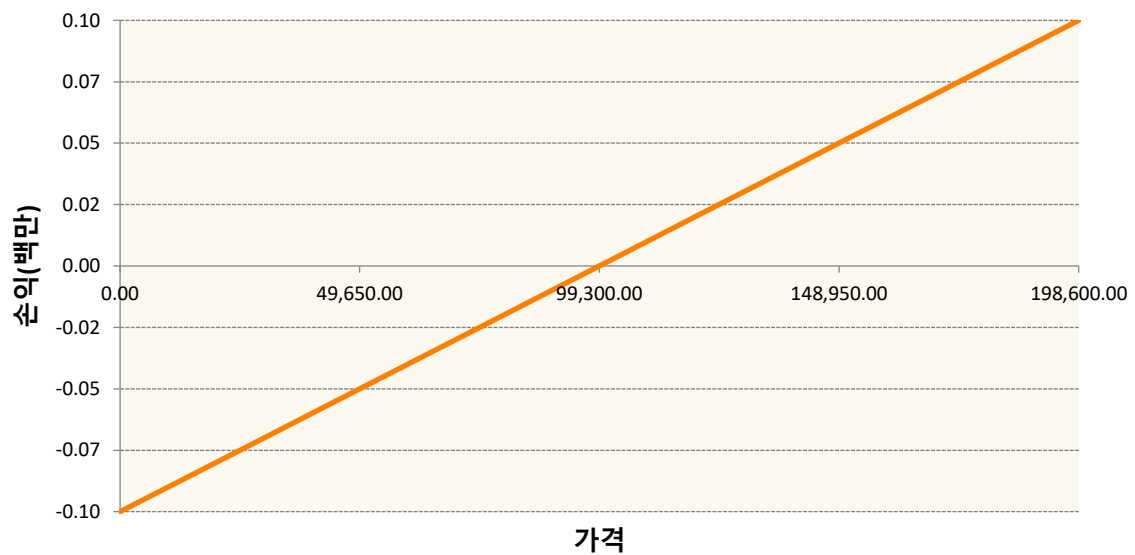
KR41DAWA0009-2025-10 농심개별선물



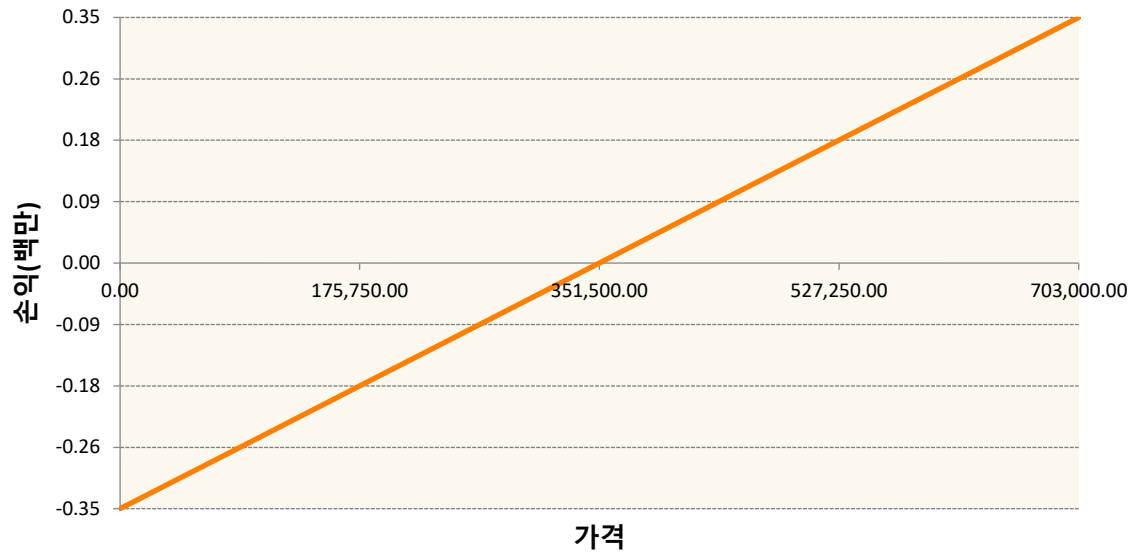
KR41E8WA0008-2025-10 포스코퓨처엠개별선물



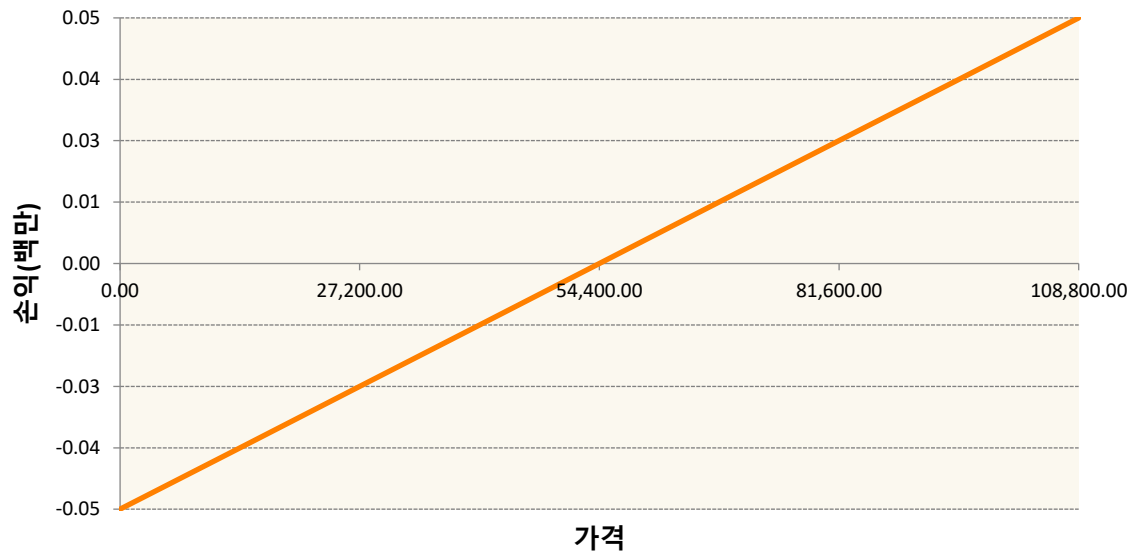
KR41EJWA0009-2025-10 SKC개별선물



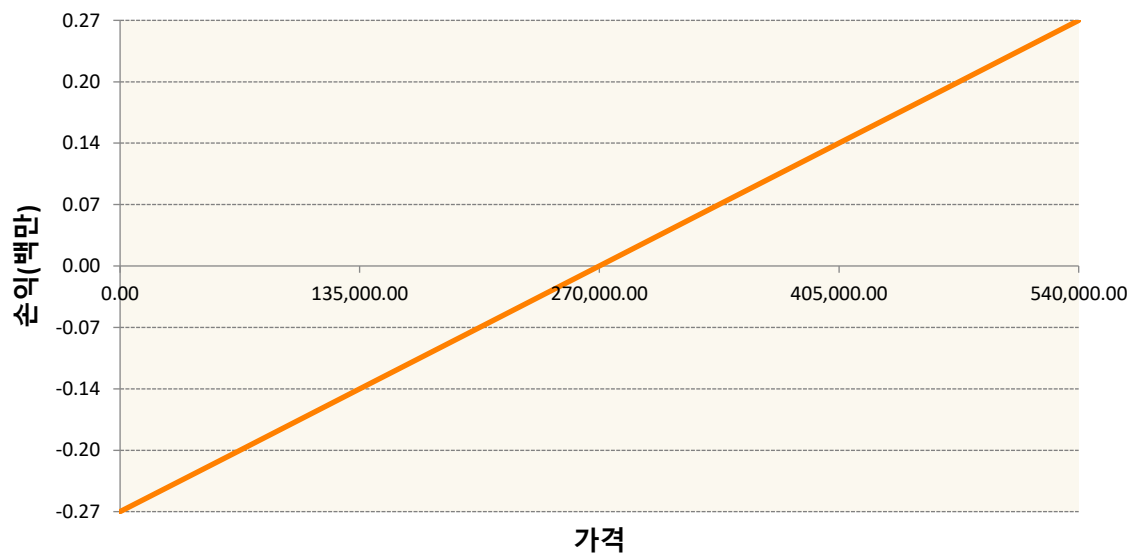
KR41F5WA0008-2025-10 LG에너지솔루션개별선물



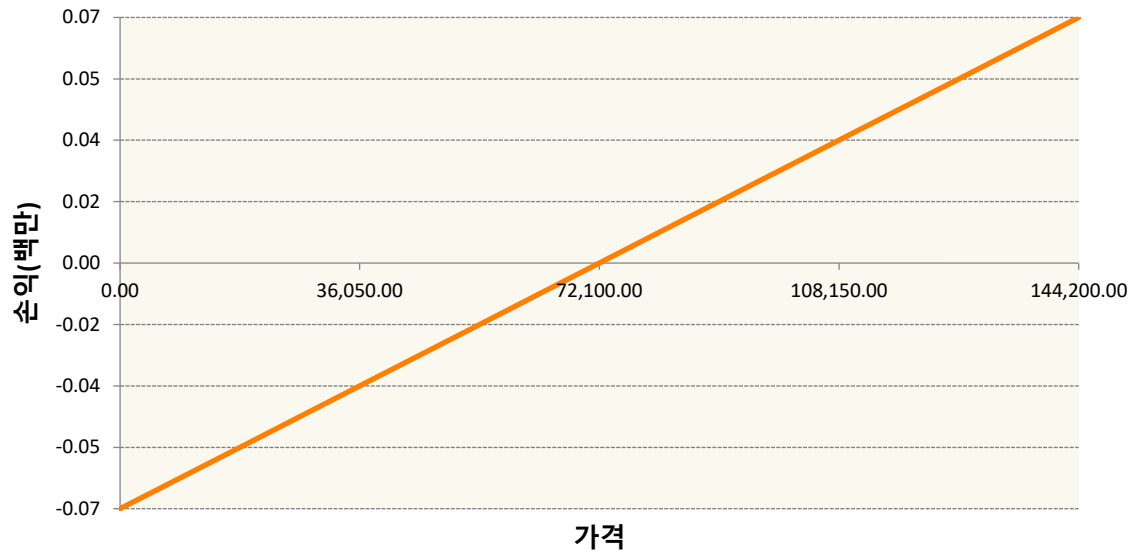
KR41F7WA0006-2025-10 카카오페이개별선물



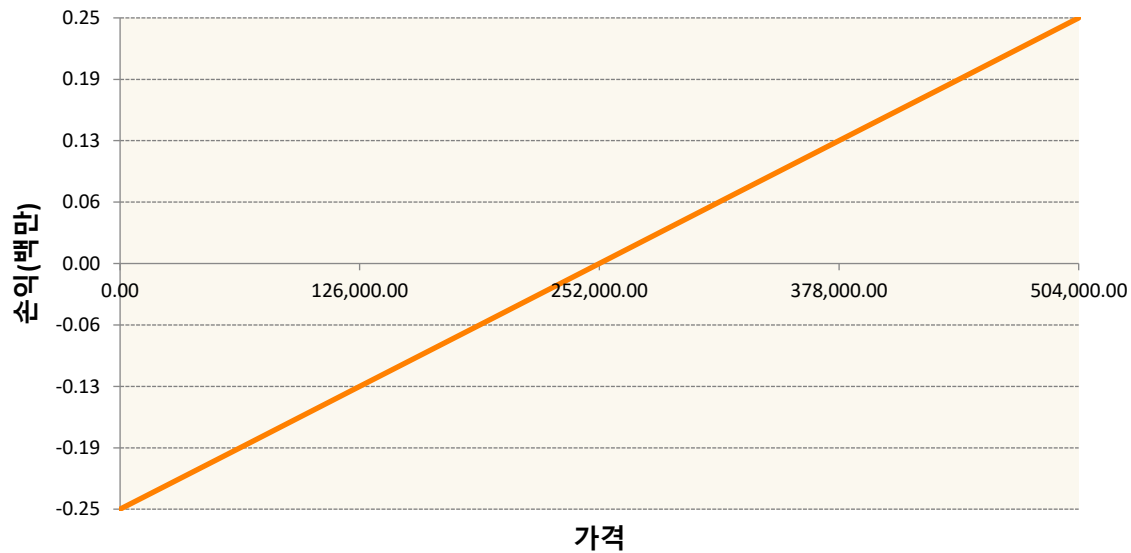
KR41FCWA0005-2025-10 하이브개별선물



KR41FMWA0003-2025-10 엘앤에프개별선물



KR41HEWA0001-2025-10 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	525
KR410FWA0(2025-10 두산로보틱스개별선물	14
KR4111WA0(2025-10 삼성전자개별선물	101
KR4150WA0(2025-10 SK하이닉스개별선물	98
KR41CNWAC 2025-10 포스코DX개별선물	10
KR41DAWAC 2025-10 농심개별선물	4
KR41E8WA0(2025-10 포스코퓨처엠개별선물	41
KR41EJWA0(2025-10 SKC개별선물	20
KR41F5WA0(2025-10 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F7WA0(2025-10 카카오페이개별선물	16
KR41FCWA0(2025-10 하이브개별선물	63
KR41FMWAC 2025-10 엘앤에프개별선물	20

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

(단위:백만원)

505

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

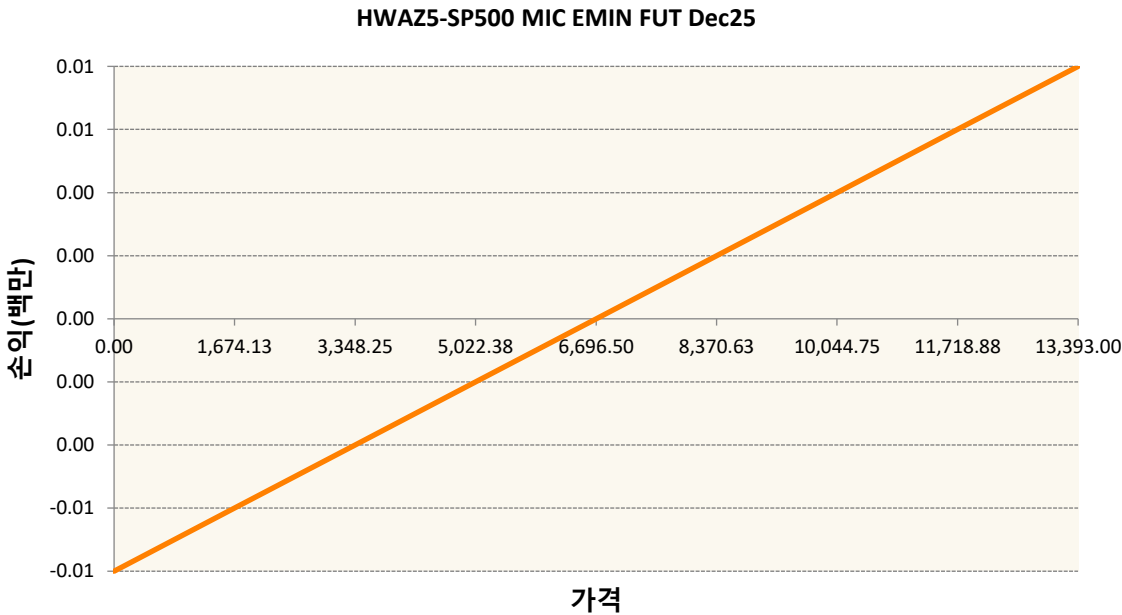
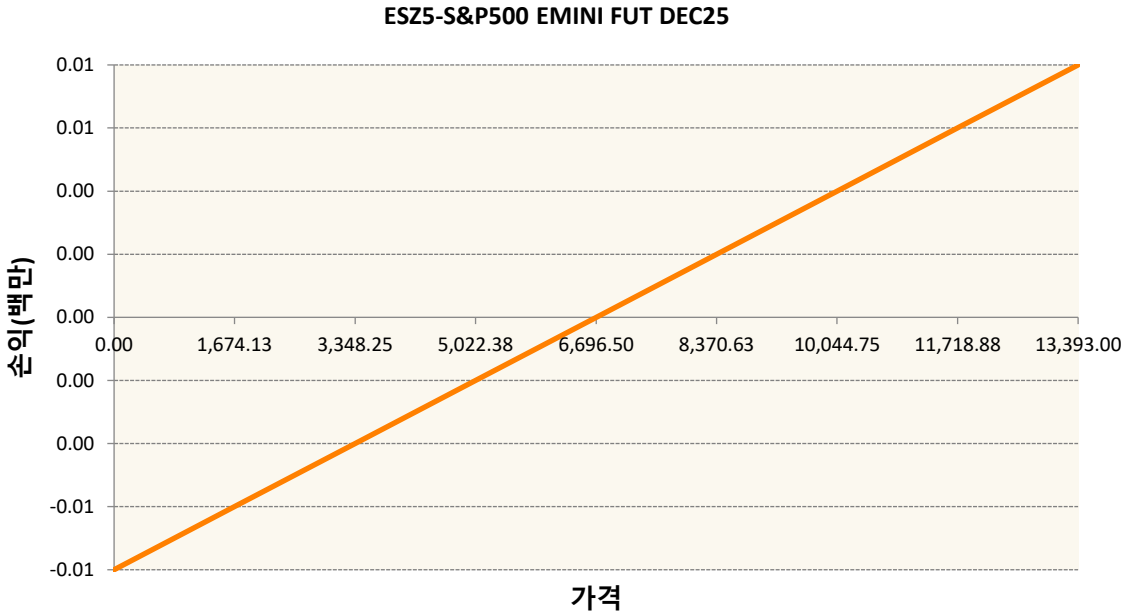
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	36,711	0	36,711	
누계	유가증권	선물	1,255	0	1,255	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	2,937
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,296

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

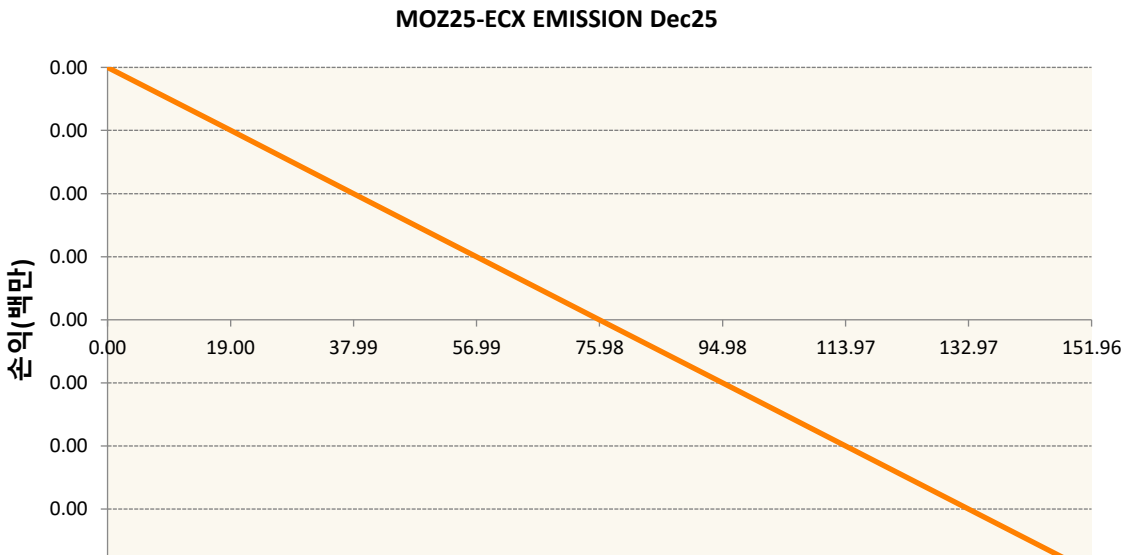
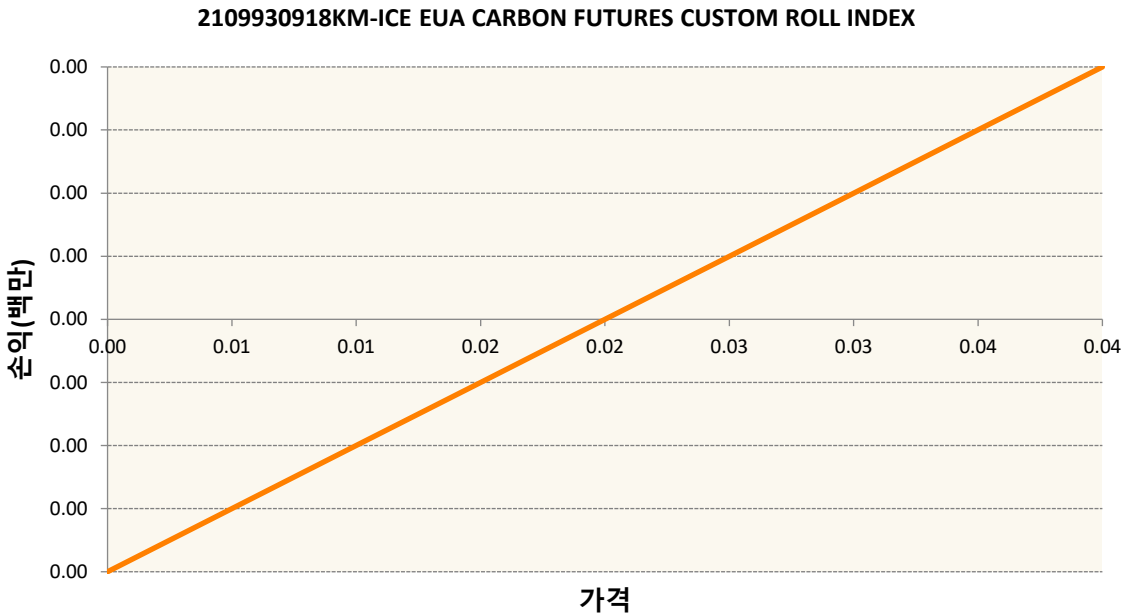
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,262	-4,262	
누계	지수	스왑	8	0	8	장외
누계	통화	선도	0	2,440	-2,440	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	341

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

(단위:백만원)

594

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

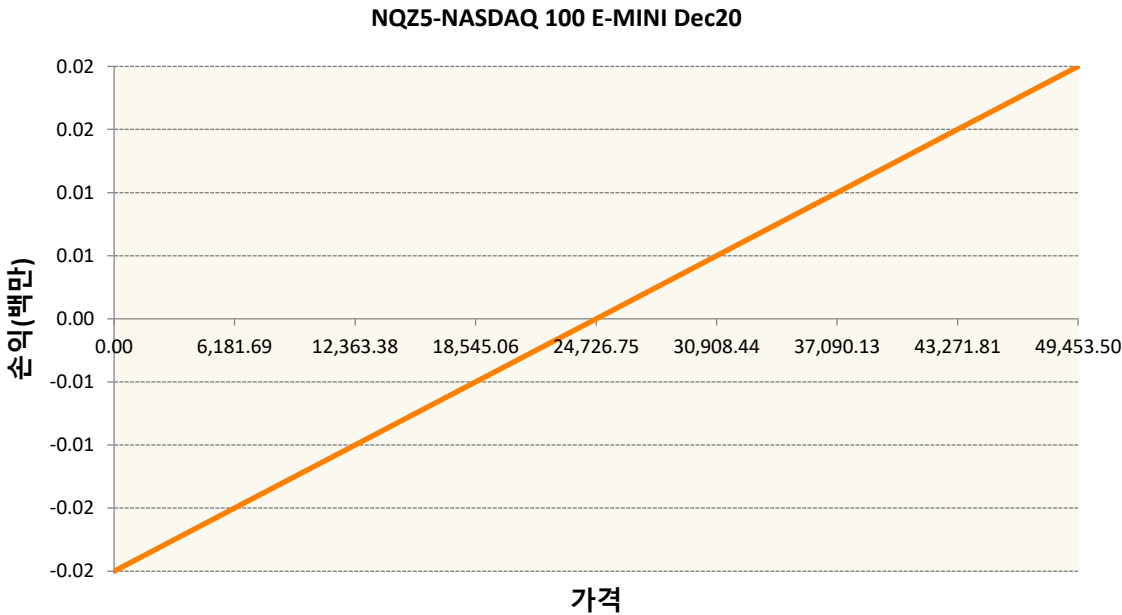
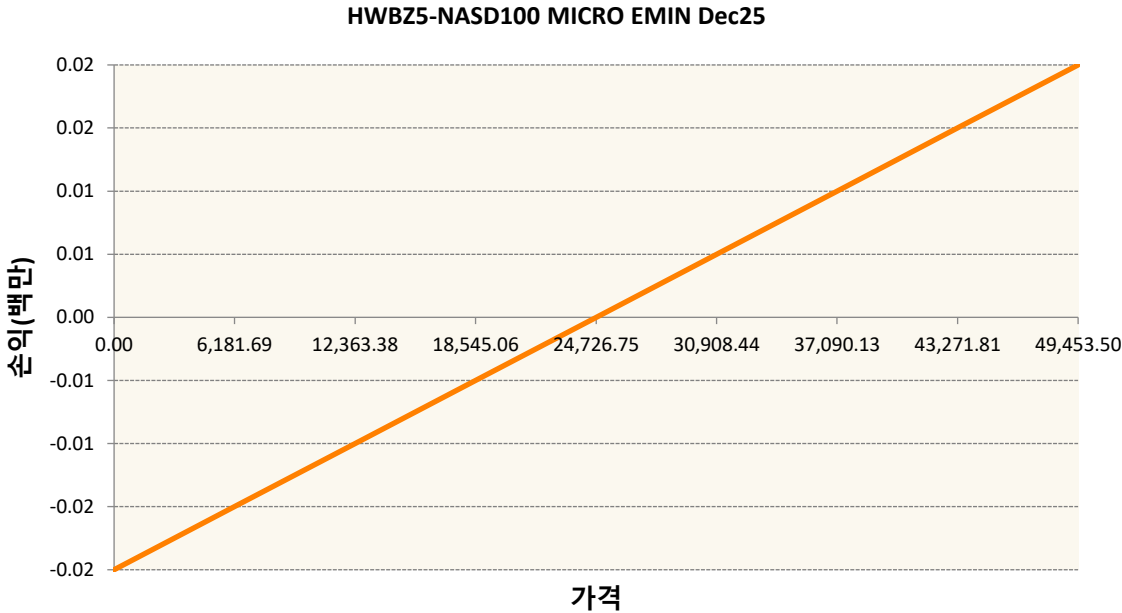
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	15,792	0	15,792	
누계	유가증권	선물	1,992	0	1,992	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25		159
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,263

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,552

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

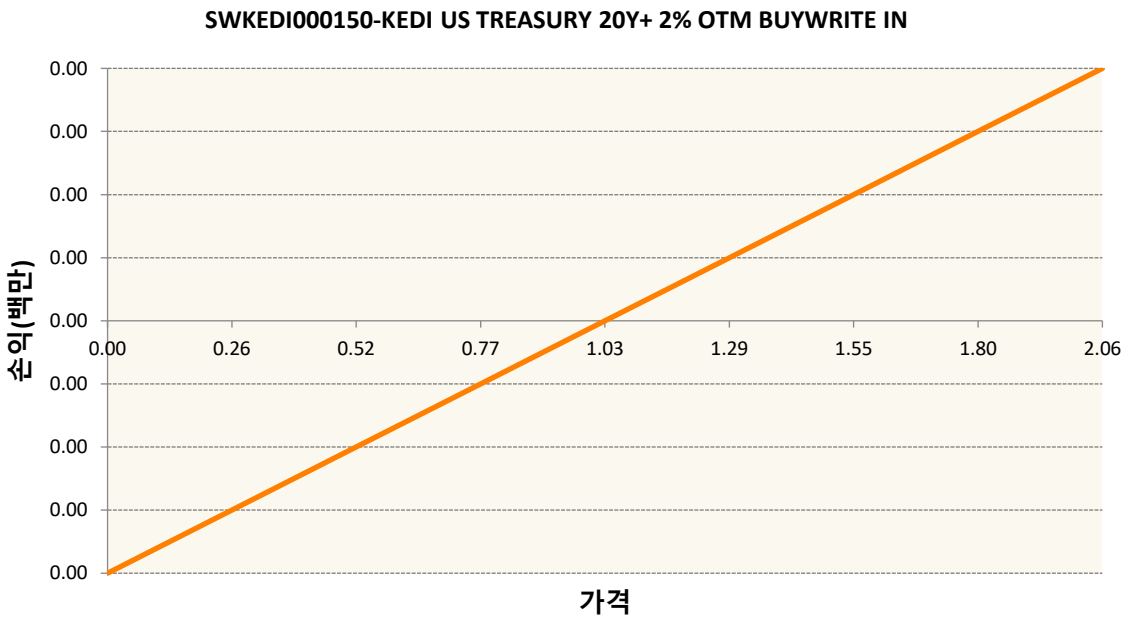
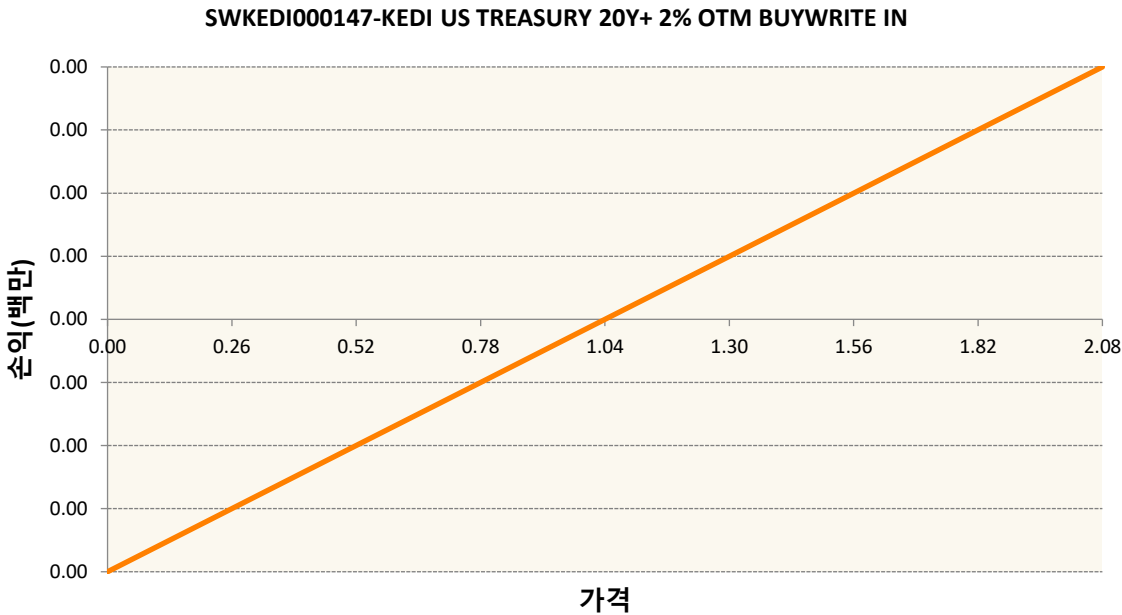
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

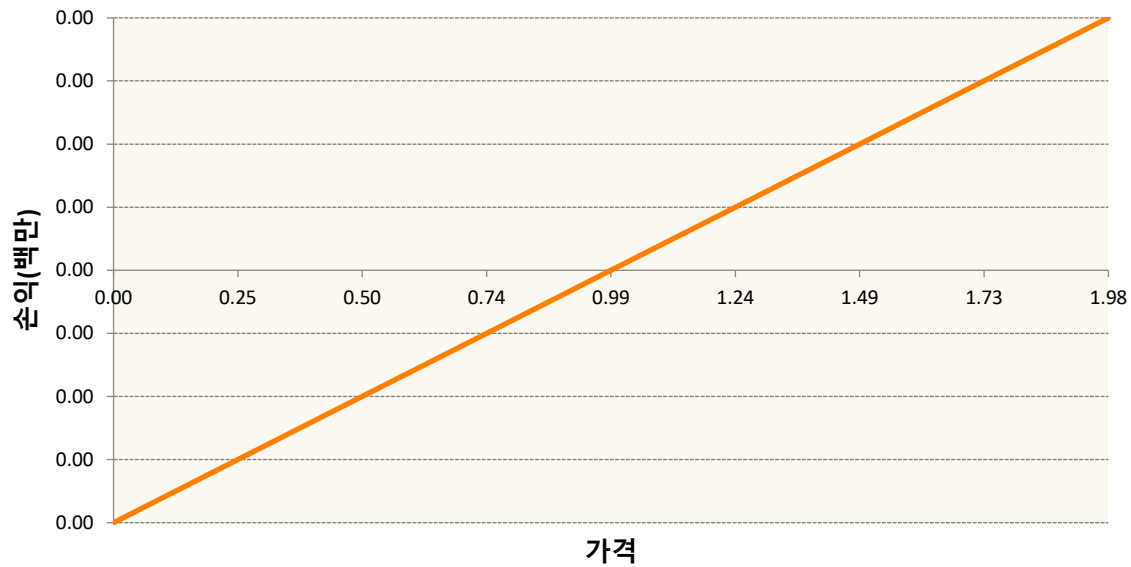
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	358,257	0	358,257	장외

2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000151-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

8,104
9,730
7,688
3,567

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

(단위:백만원)

14,262

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

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)

7

공시일	2025-09-30
기준일	2025-09-29

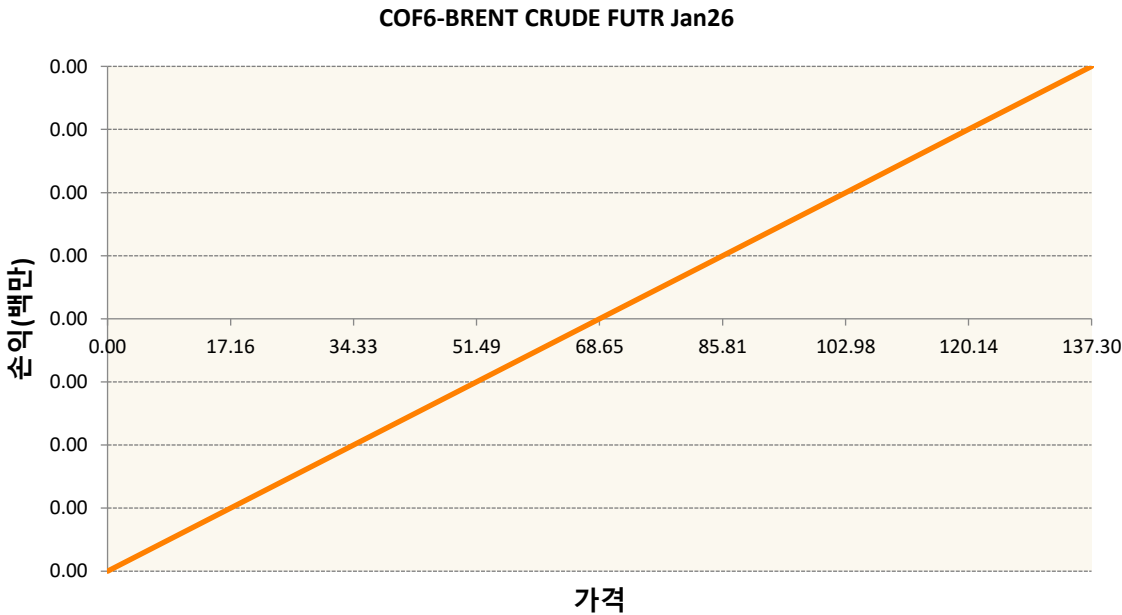
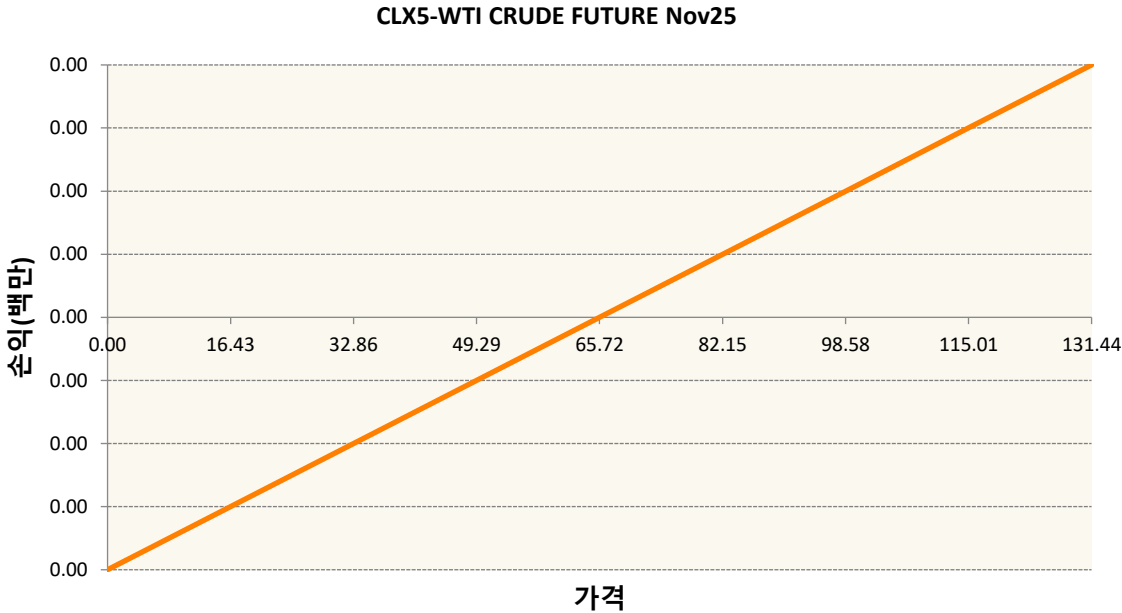
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

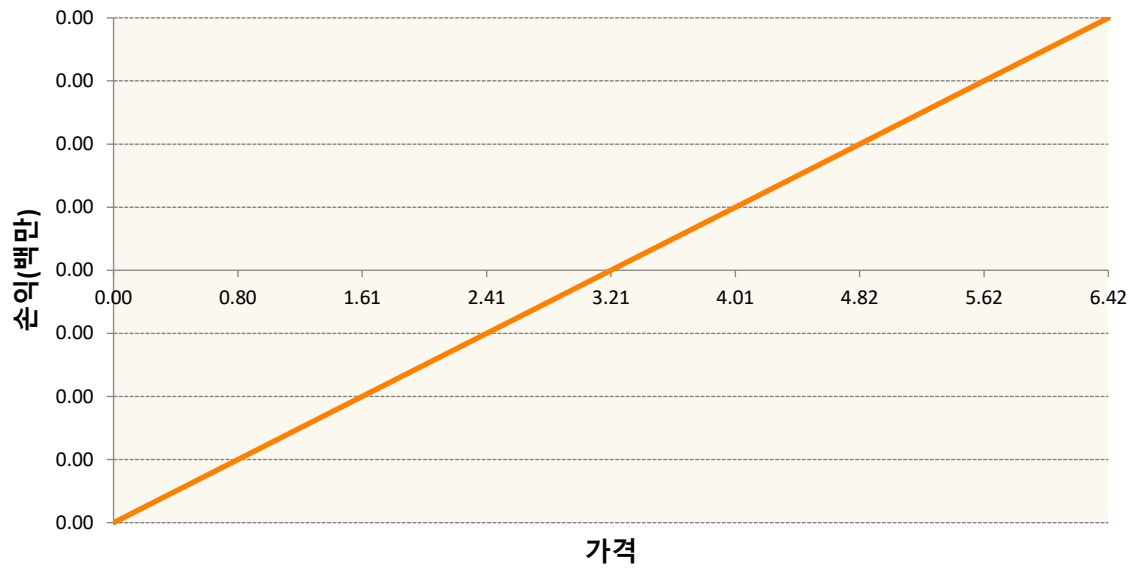
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	550	0	550	
누계	통화	선물	0	70	-70	장내

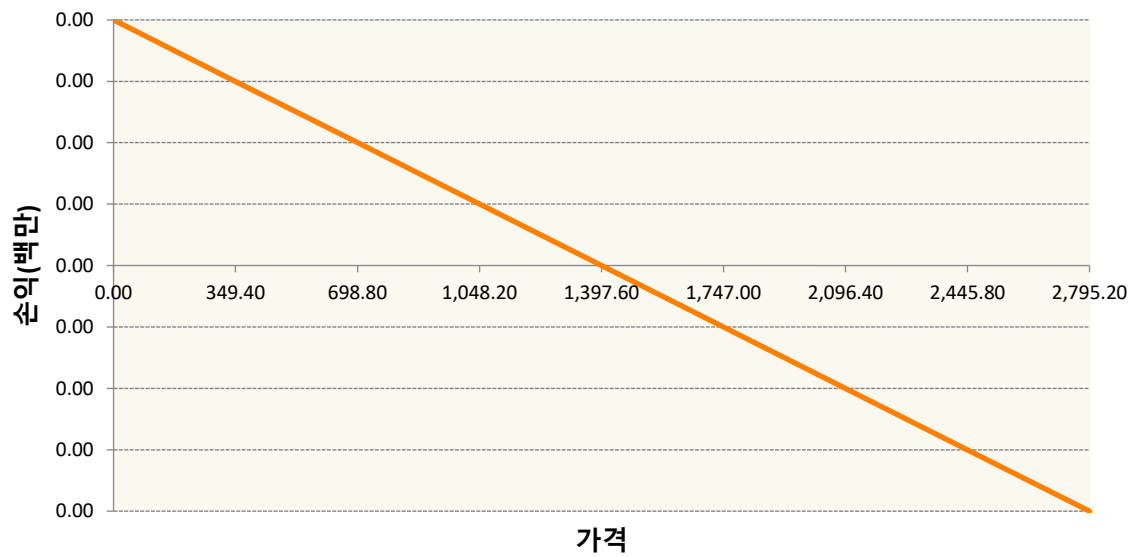
2. 만기시점의 손익구조



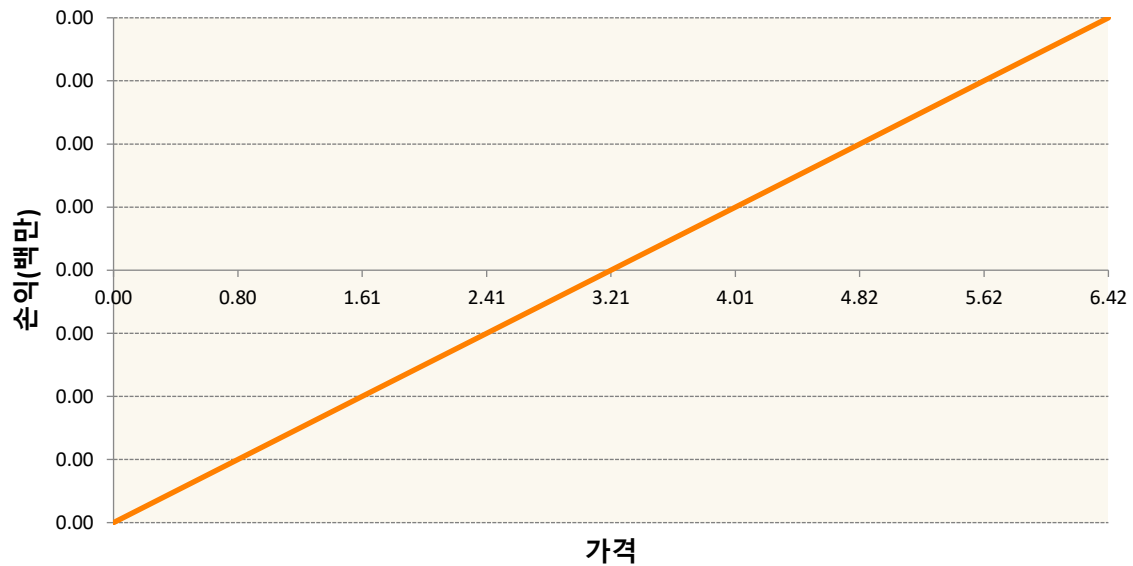
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

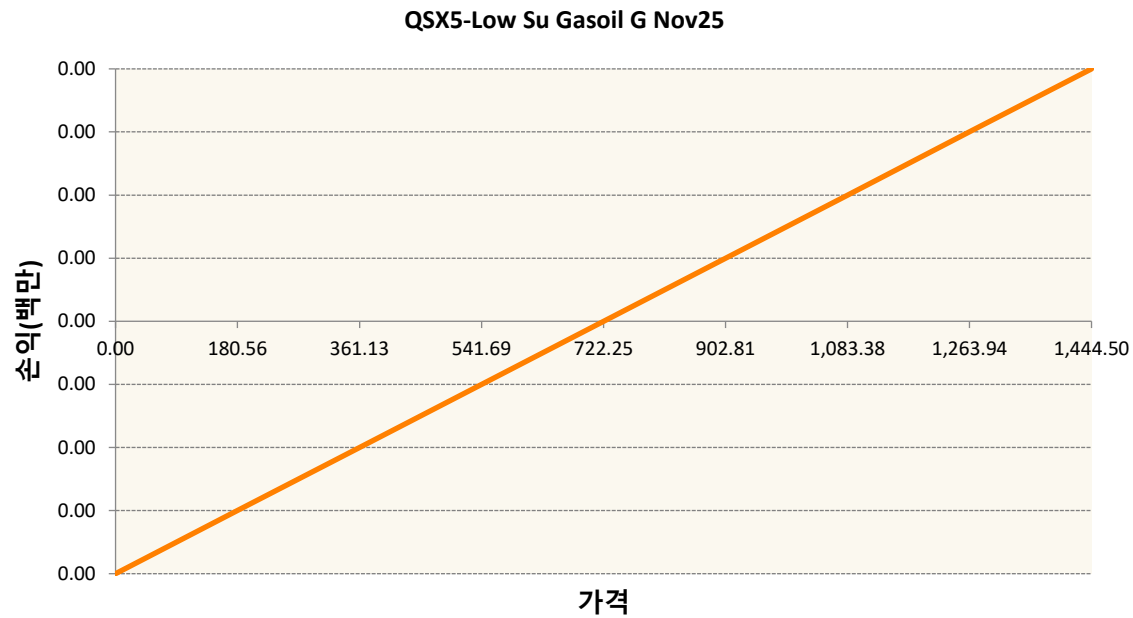


KR4175WA0006-2025-10 달러선물



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)
	98