

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

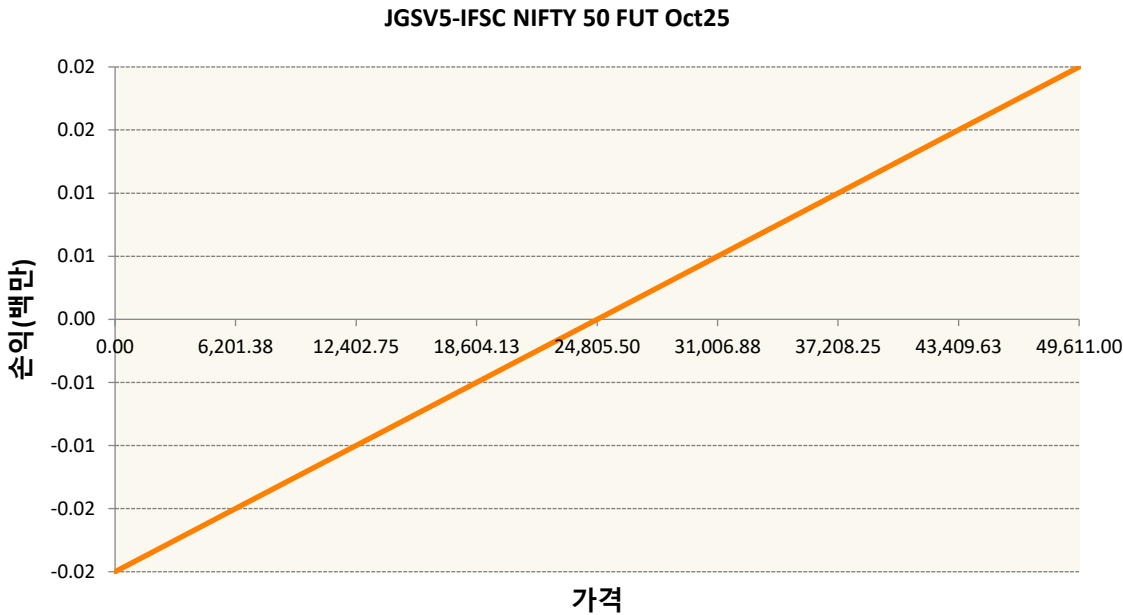
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	555	0	555	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSV5	IFSC NIFTY 50 FUT Oct25	44
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

31

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

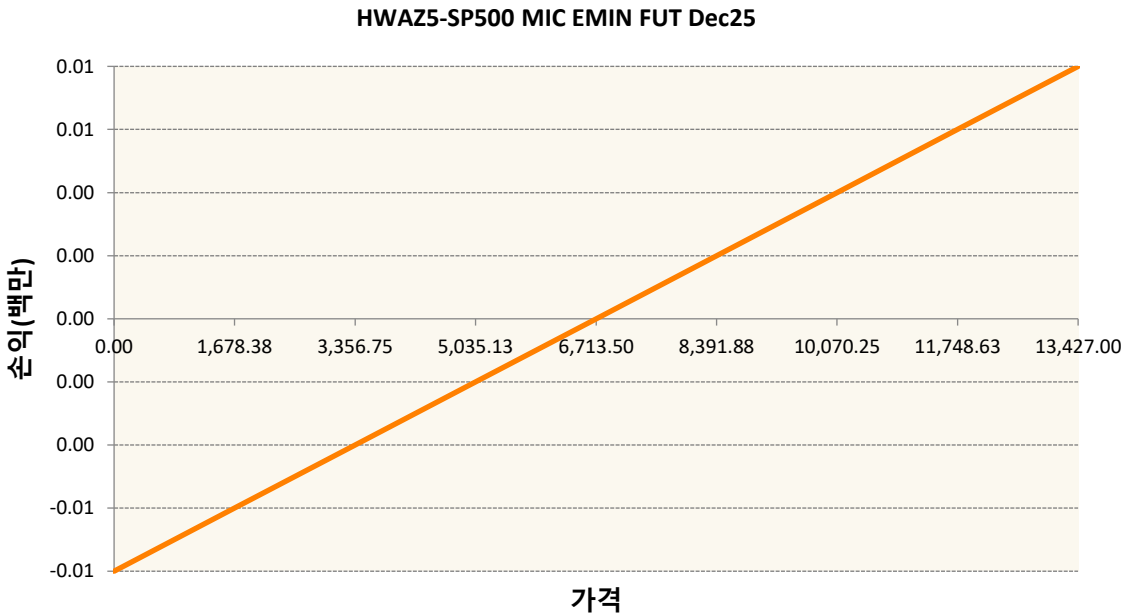
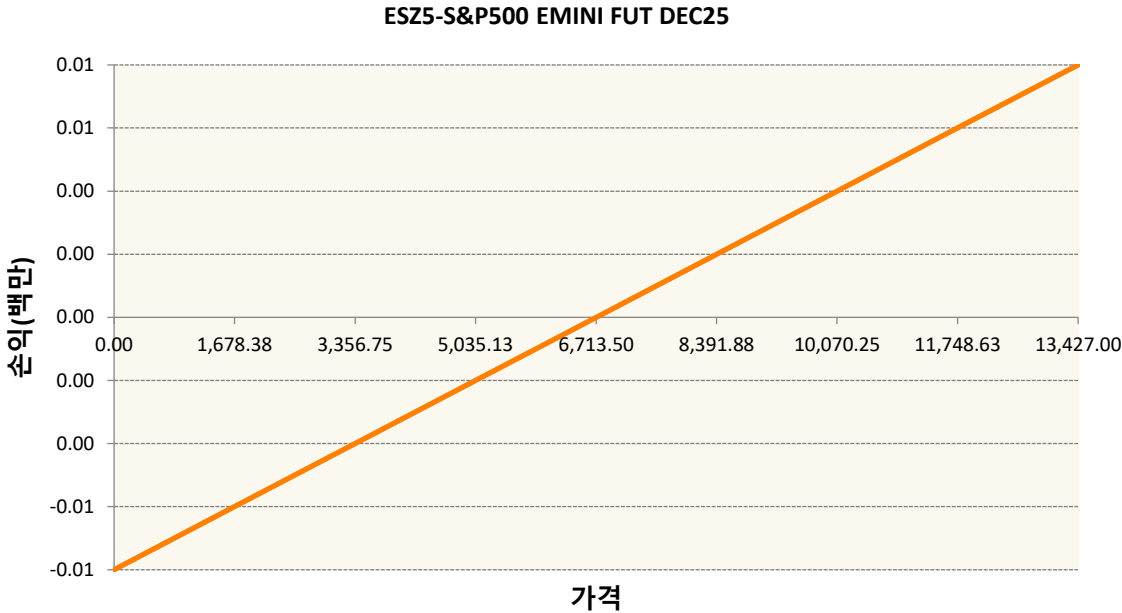
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	466	0	466	
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)
	67

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

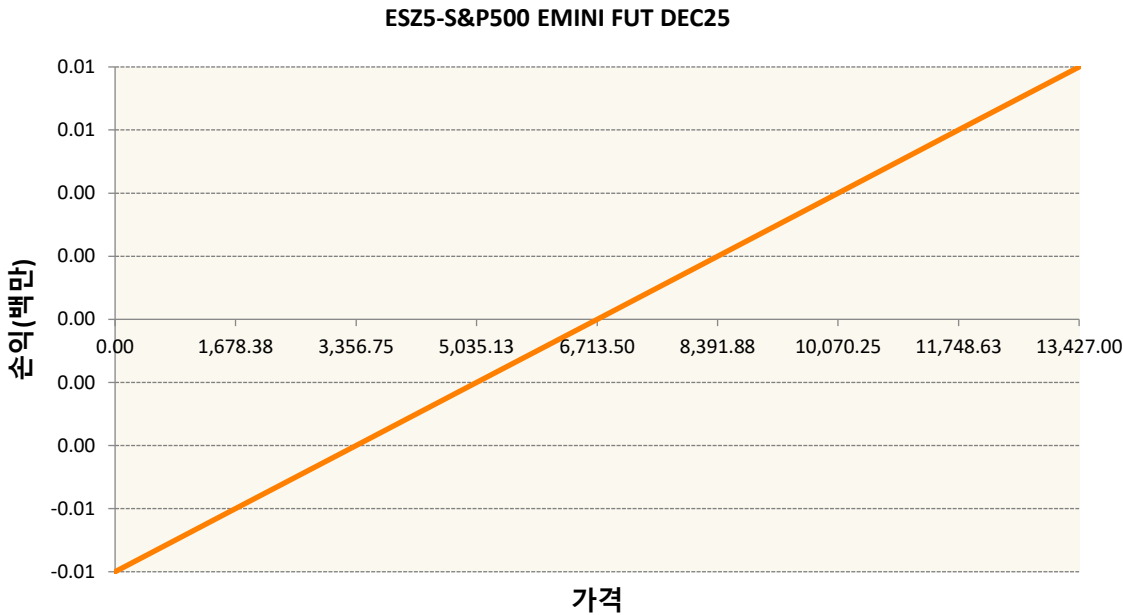
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,398	0	1,398	

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)

161

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

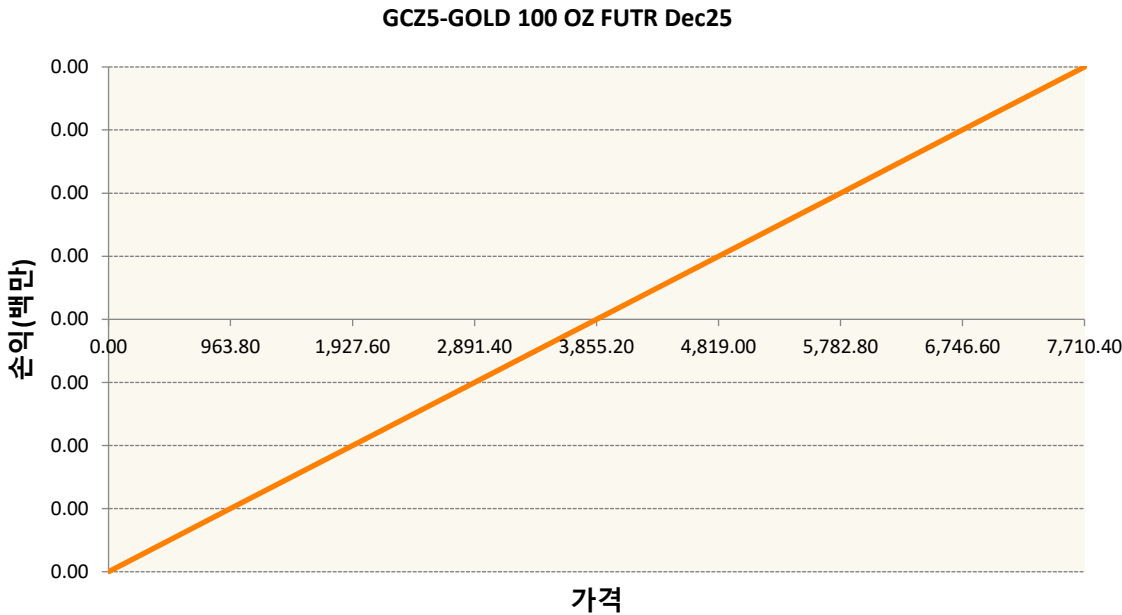
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,604	0	1,604	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 10/10/25 C350 EQUITY	0.34
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	128

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

(단위:백만원)

111

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

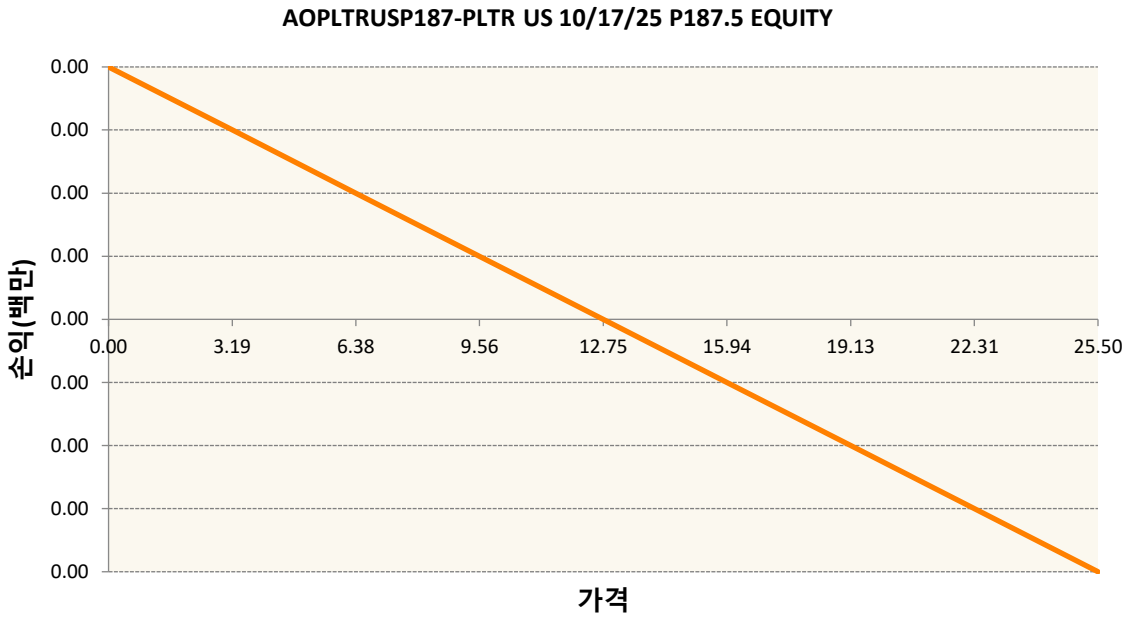
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	834	-834	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC PLTR US 10/17/25 C187.5 EQUITY	84
AOPLTRUSP PLTR US 10/17/25 P187.5 EQUITY	67

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

(단위:백만원)

608

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

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

0.45

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

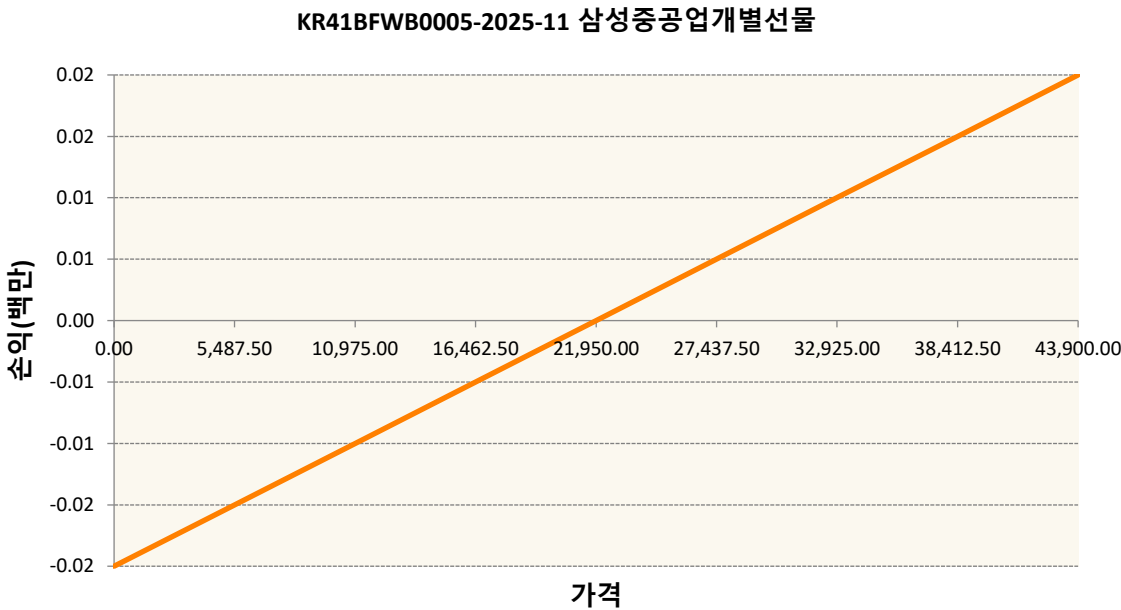
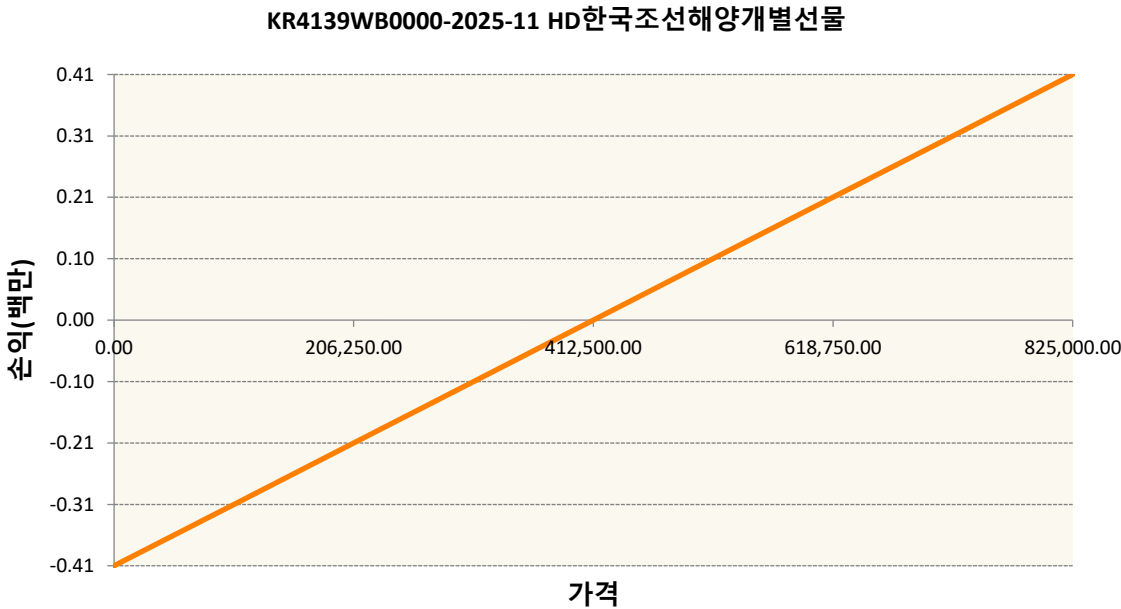
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

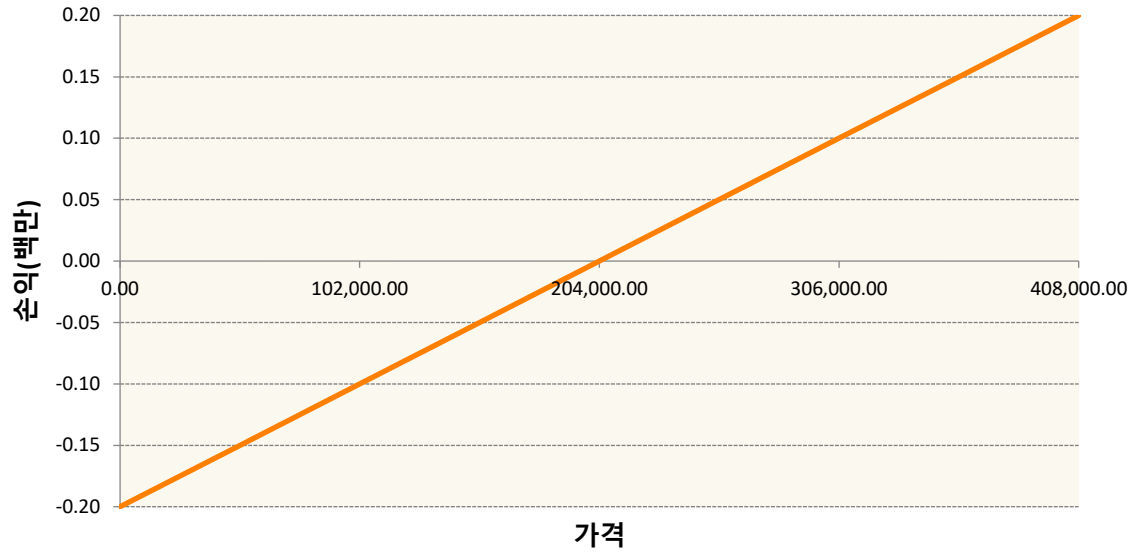
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	32,628	0	32,628	장내
누계	유가증권	선물	53,160	0	53,160	장내

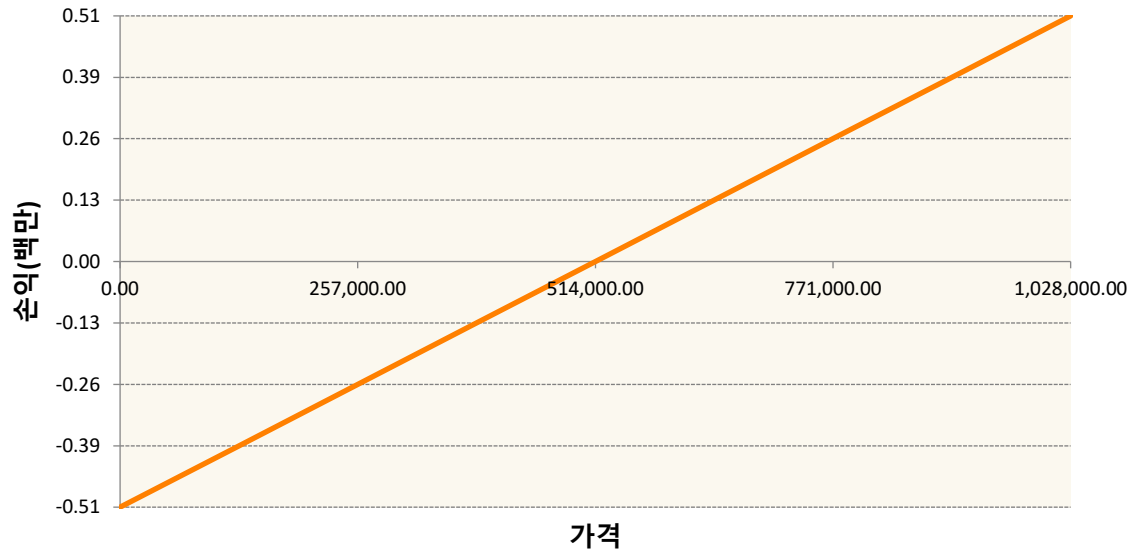
2. 만기시점의 손익구조



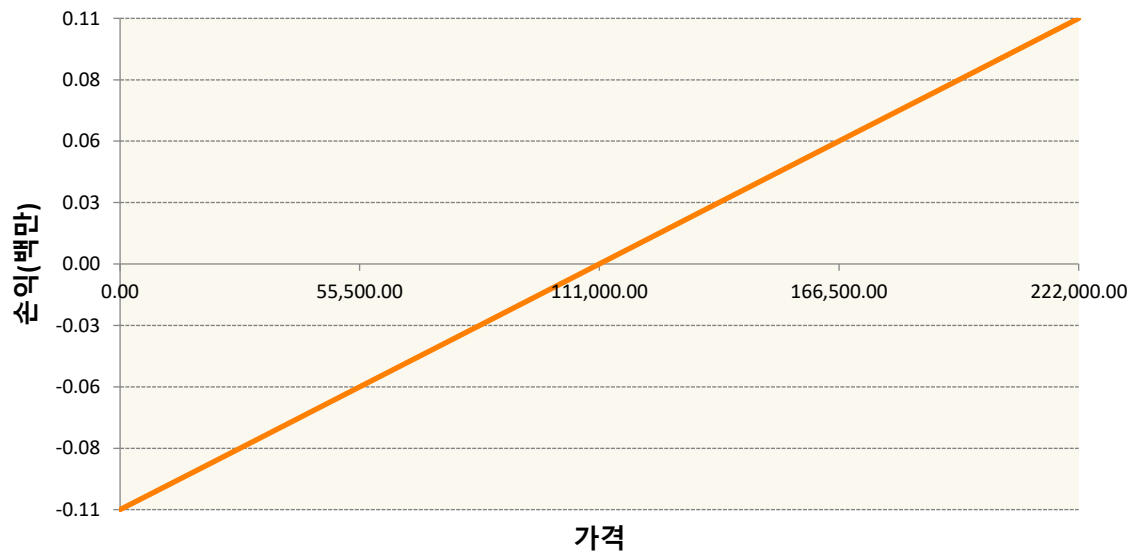
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139WB0000			2025-11 HD한국조선해양개별선물				1,187
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,187	-1,187	-1,187	-1,187	-1,187	-1,187	-1,187
-5.33%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791
-2.67%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	396	396	396	396	396	396	396
5.33%	791	791	791	791	791	791	791
8.00%	1,187	1,187	1,187	1,187	1,187	1,187	1,187
KR41BFWB0005			2025-11 삼성중공업개별선물				1,085
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085
-5.33%	-723	-723	-723	-723	-723	-723	-723
-2.67%	-362	-362	-362	-362	-362	-362	-362
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	362	362	362	362	362	362	362
5.33%	723	723	723	723	723	723	723
8.00%	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085
KR41CDWB0006			2025-11 HD현대미포개별선물				460
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-460	-460	-460	-460	-460	-460	-460
-5.33%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307
-2.67%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	153	153	153	153	153	153	153
5.33%	307	307	307	307	307	307	307
8.00%	460	460	460	460	460	460	460
KR41FDWB0003			2025-11 HD현대중공업개별선물				610
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-610	-610	-610	-610	-610	-610	-610
-5.33%	-407	-407	-407	-407	-407	-407	-407
-2.67%	-203	-203	-203	-203	-203	-203	-203
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	203	203	203	203	203	203	203
5.33%	407	407	407	407	407	407	407
8.00%	610	610	610	610	610	610	610
KR41FVWB0001			2025-11 한화오션개별선물				898
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-898	-898	-898	-898	-898	-898	-898
-5.33%	-599	-599	-599	-599	-599	-599	-599
-2.67%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	299	299	299	299	299	299	299
5.33%	599	599	599	599	599	599	599
8.00%	898	898	898	898	898	898	898

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

(단위:백만원)

2,288

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

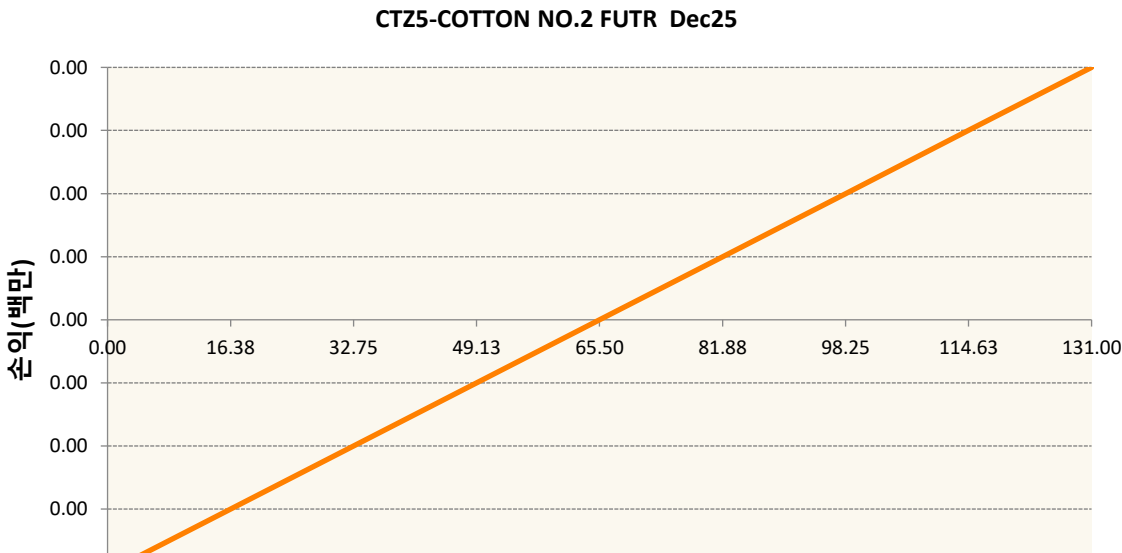
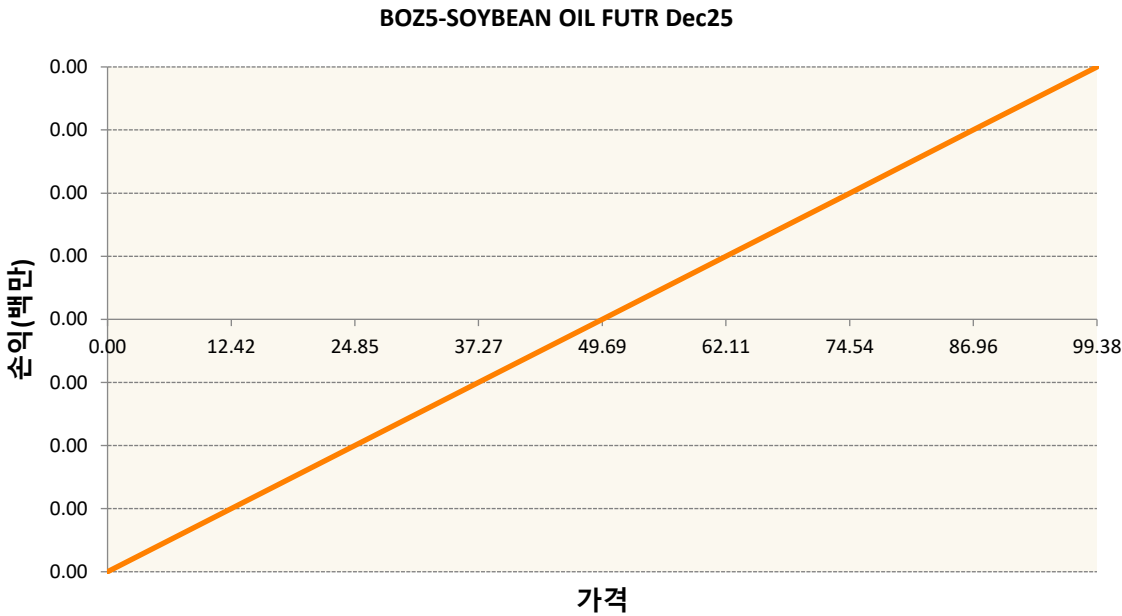
포커스농산물모(채권-파생형)

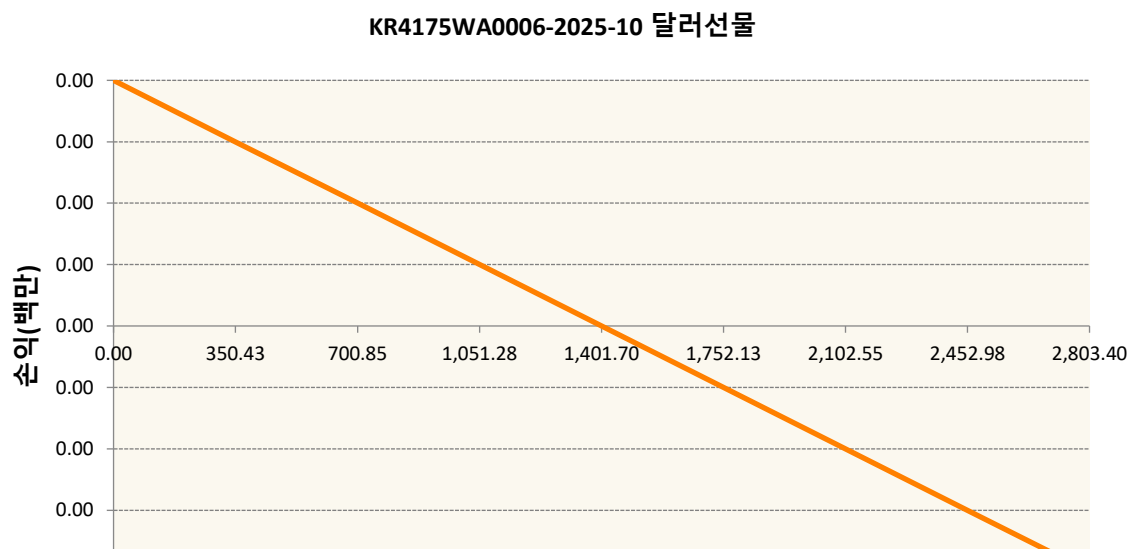
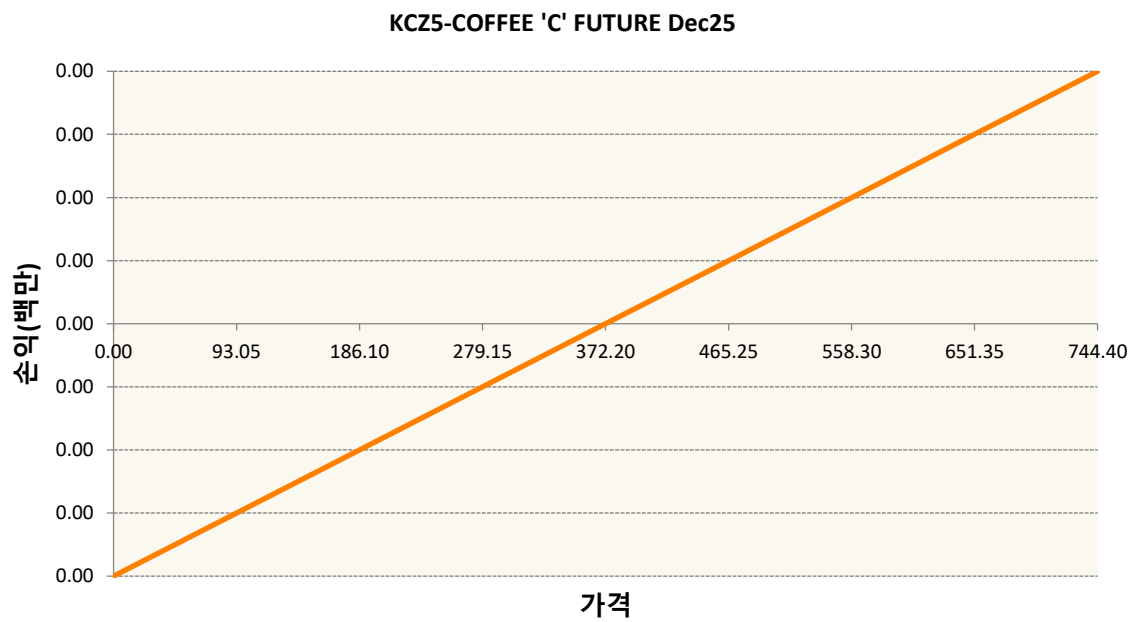
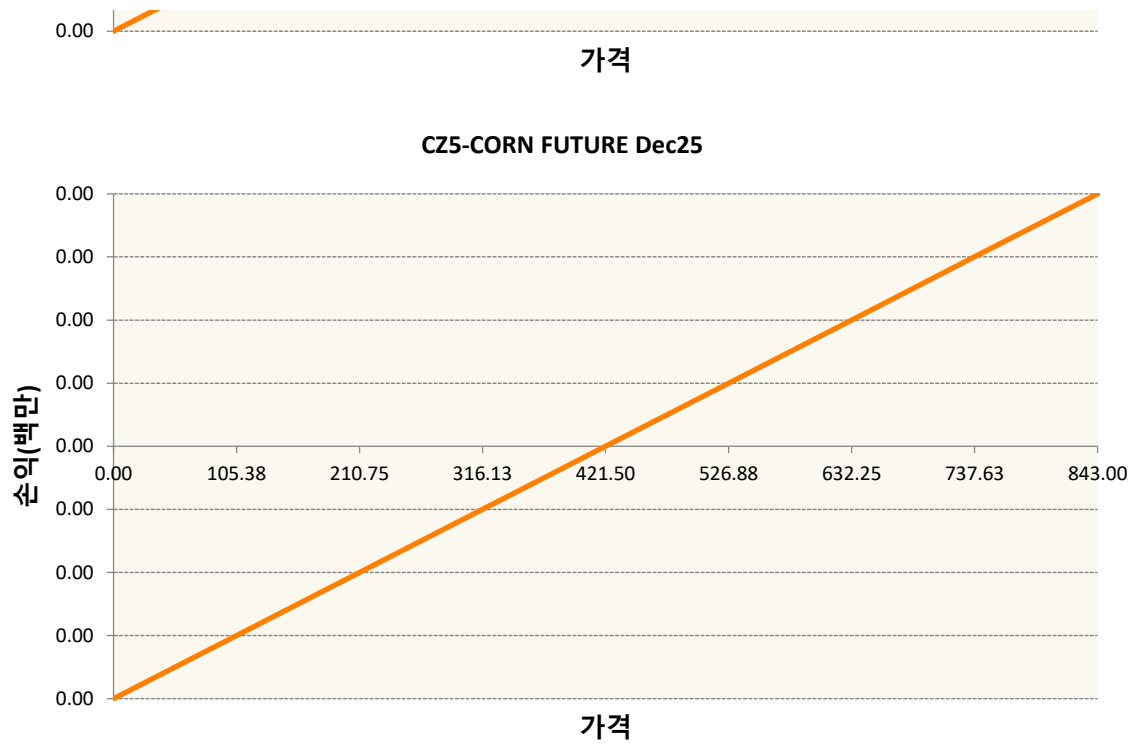
1. 계약금액

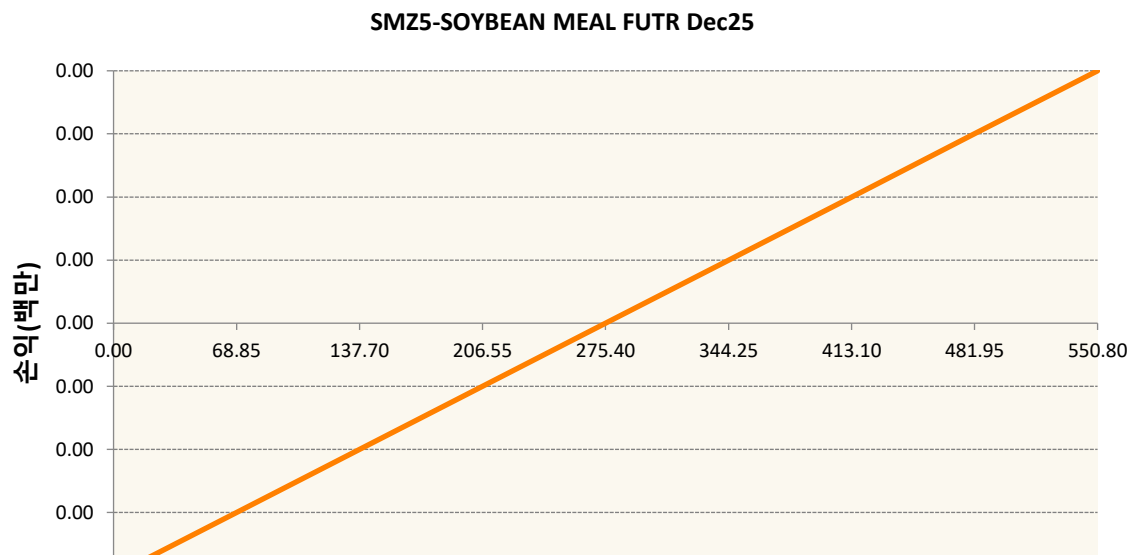
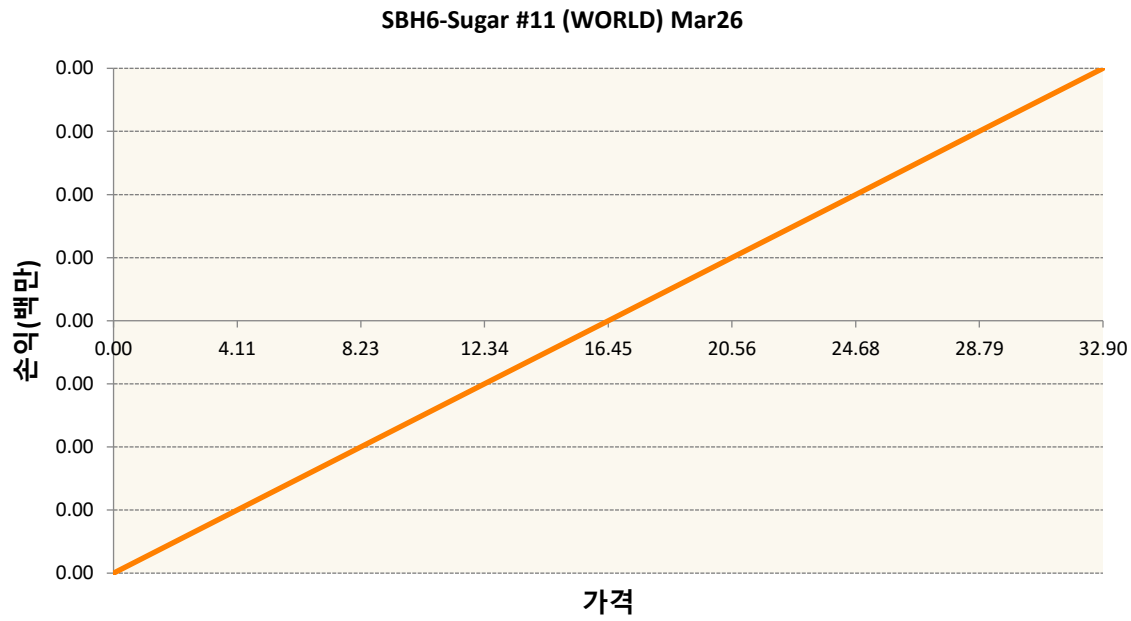
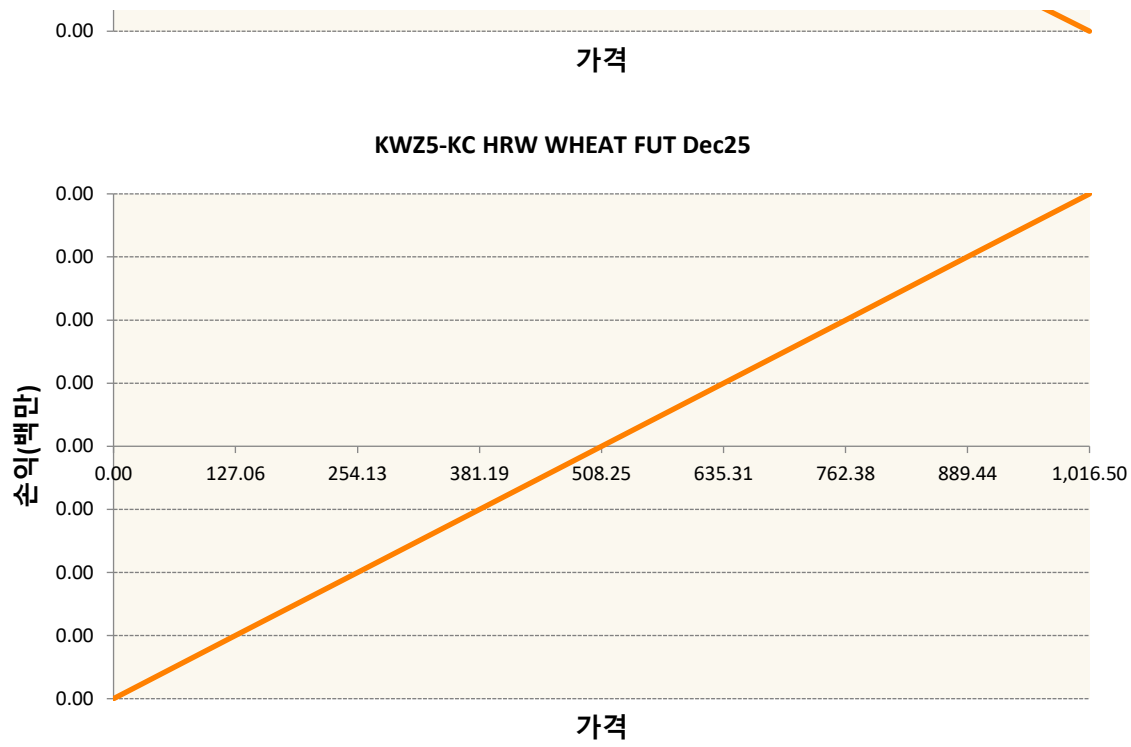
(단위:USD 백만)

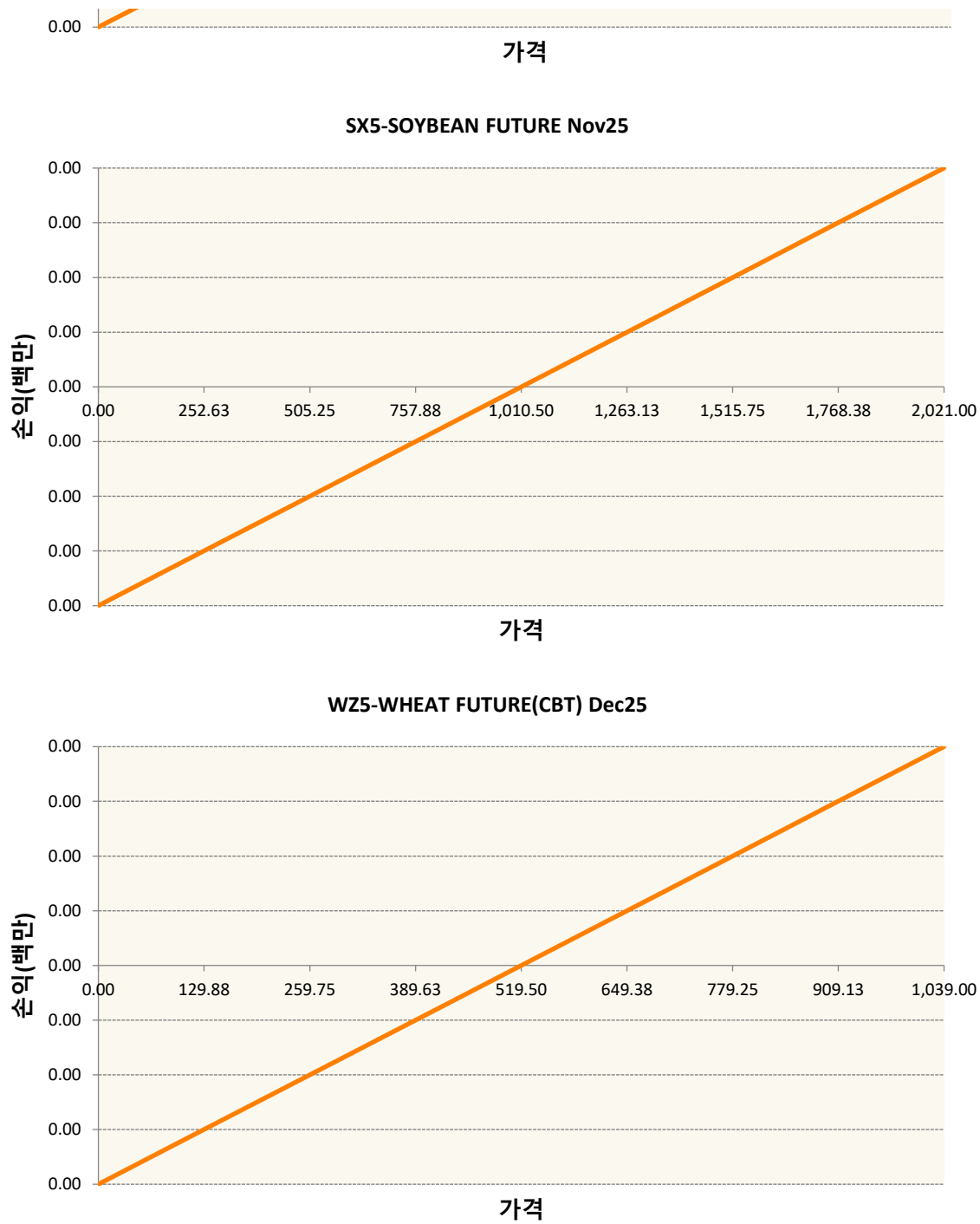
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,146	0	1,146	
누계	유가증권	선물	2,150	0	2,150	
누계	통화	선물	0	322	-322	장내

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	2025-10-01
기준일	2025-09-30

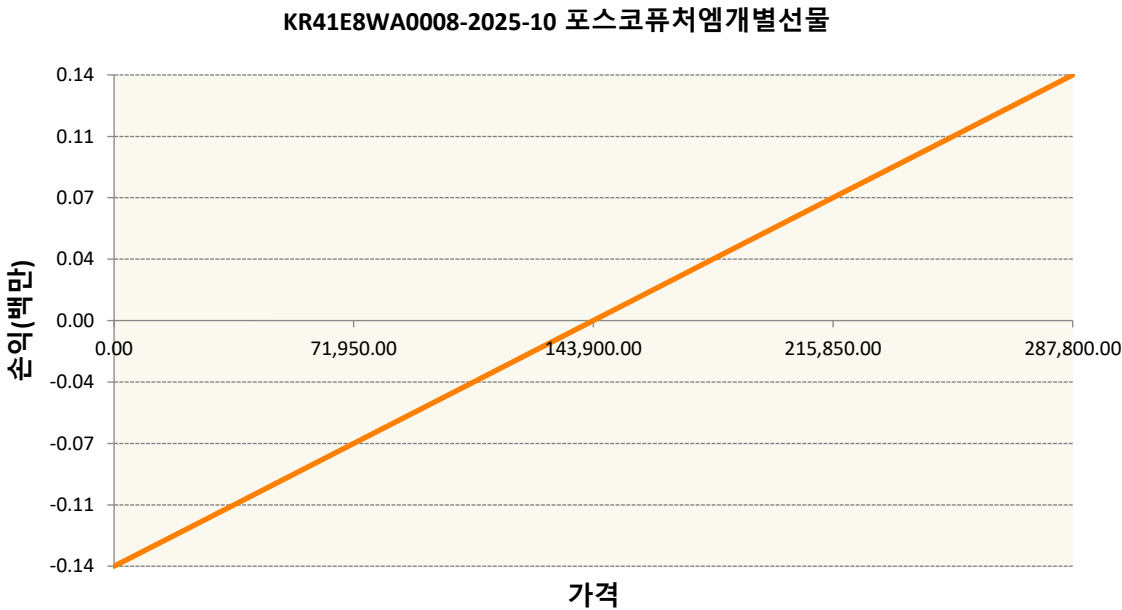
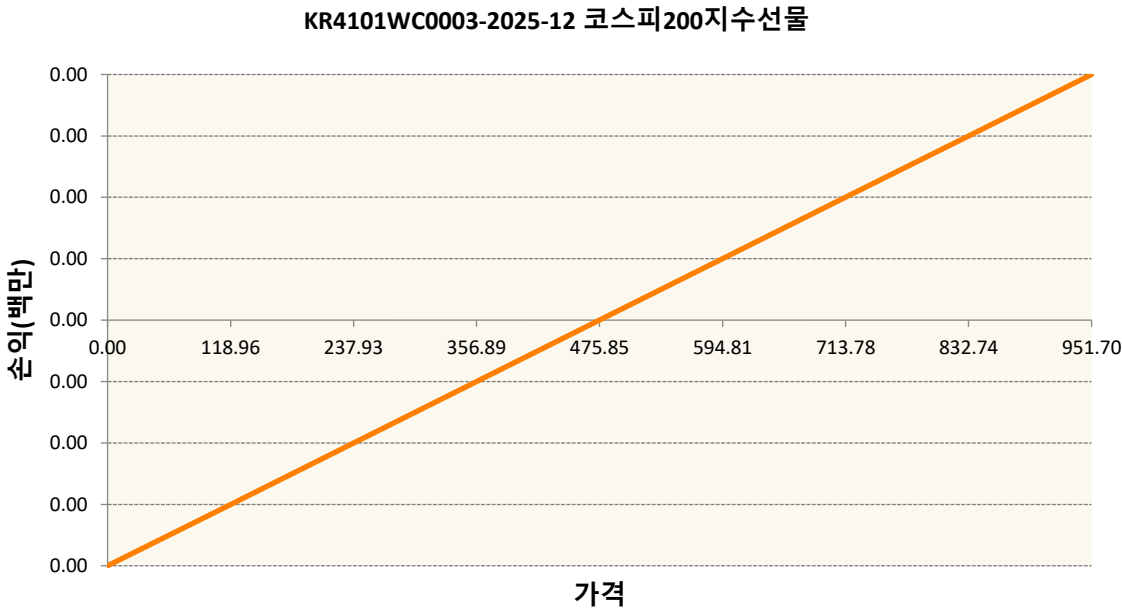
스마트인덱스모

1. 계약금액

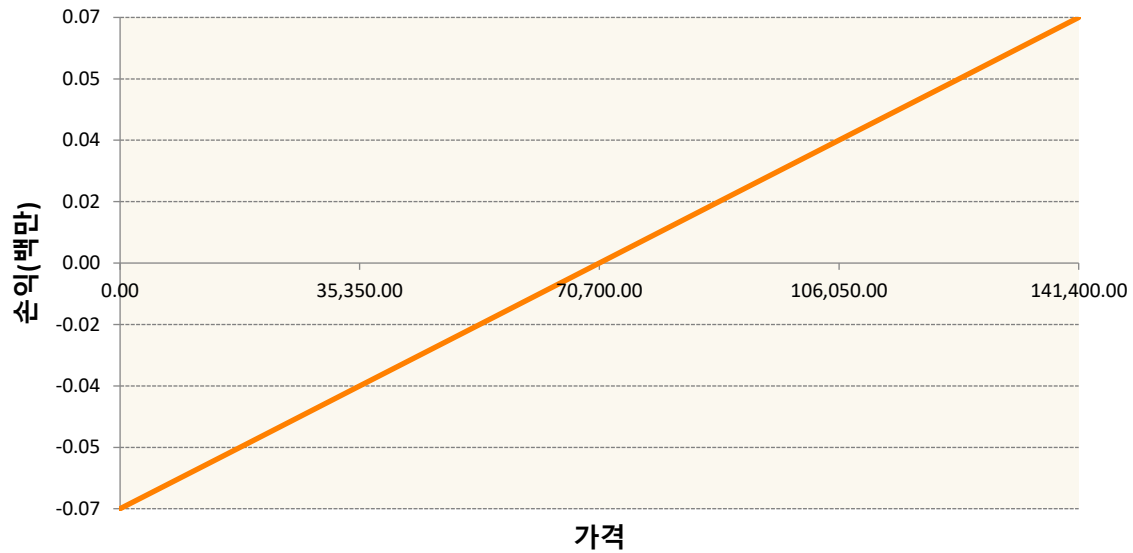
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	23	0	23	장내
누계	유가증권	선물	1,267	0	1,267	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물
 KR41E8WA01 2025-10 포스코퓨처엠개별선물
 KR41FMWB01 2025-11 엘앤에프개별선물

95
4
2

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

(단위:백만원)

6

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

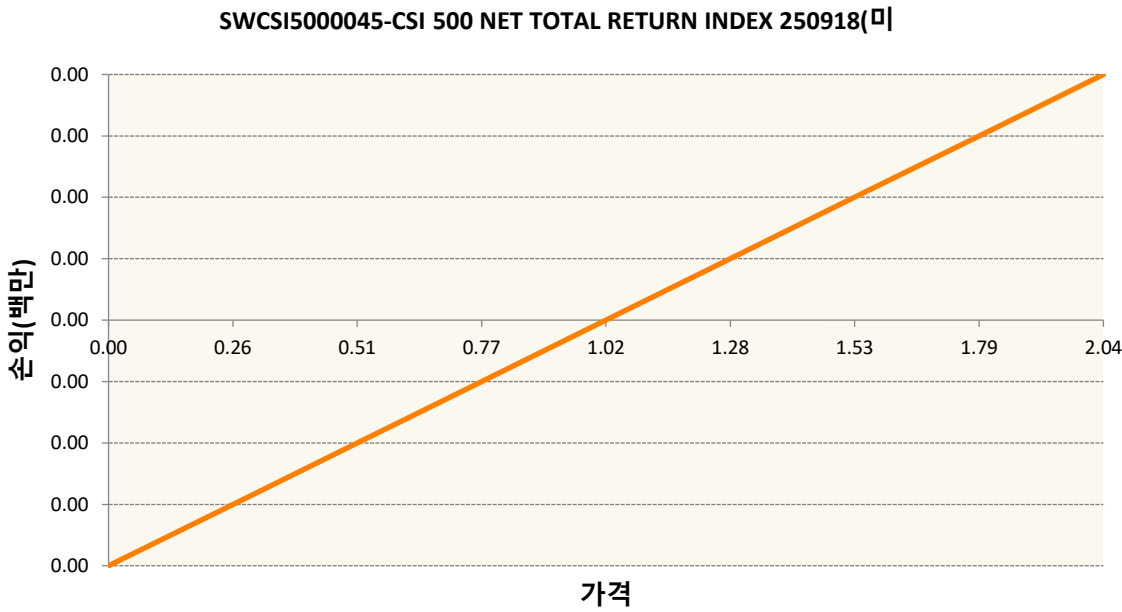
SOL차이나강소기업CSI500상장

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 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

617

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

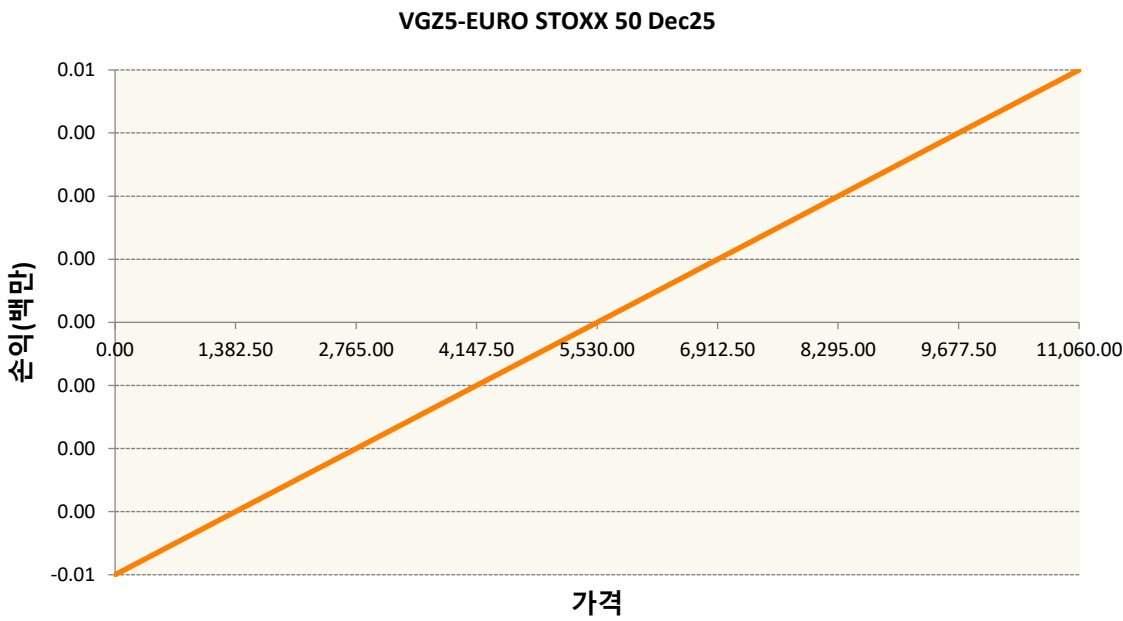
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	724	0	724	

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	2025-10-01
기준일	2025-09-30

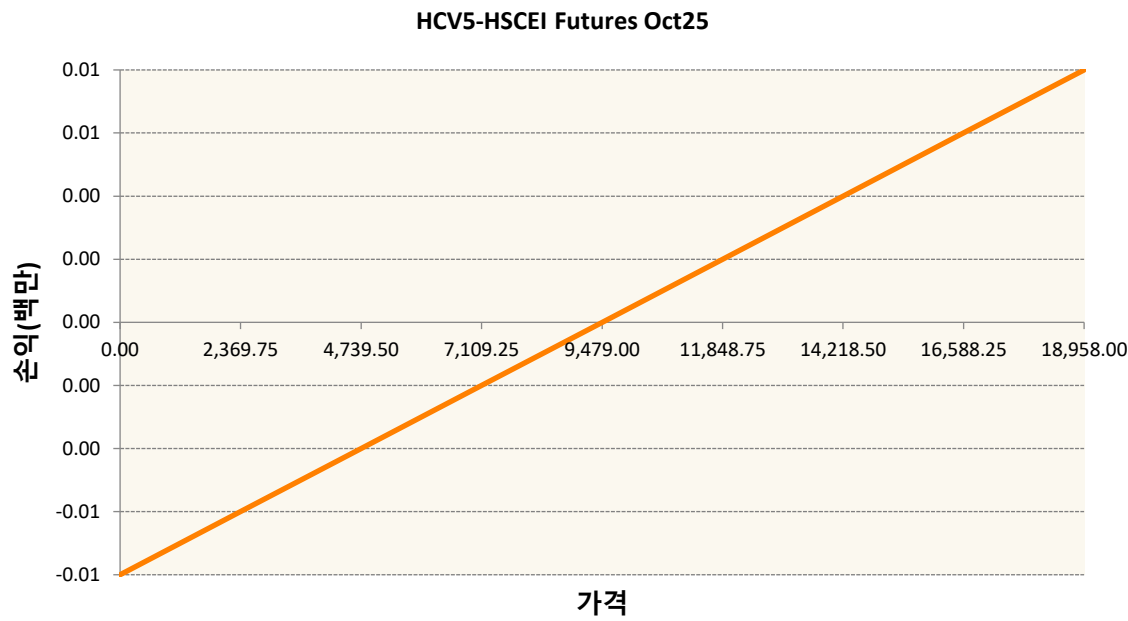
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,151	0	2,151	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	2025-10-01
기준일	2025-09-30

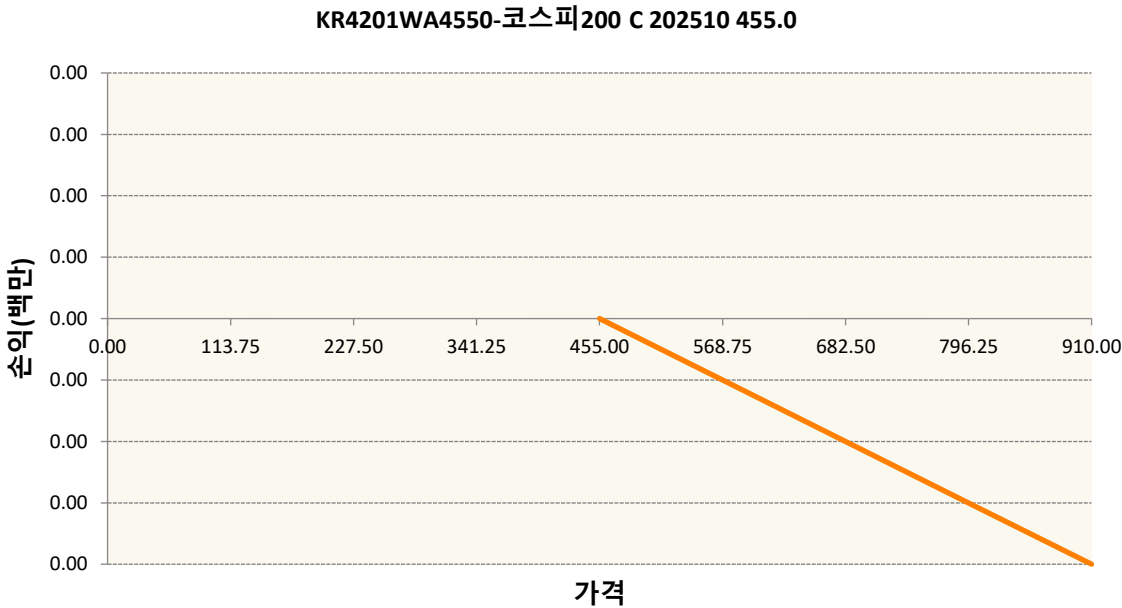
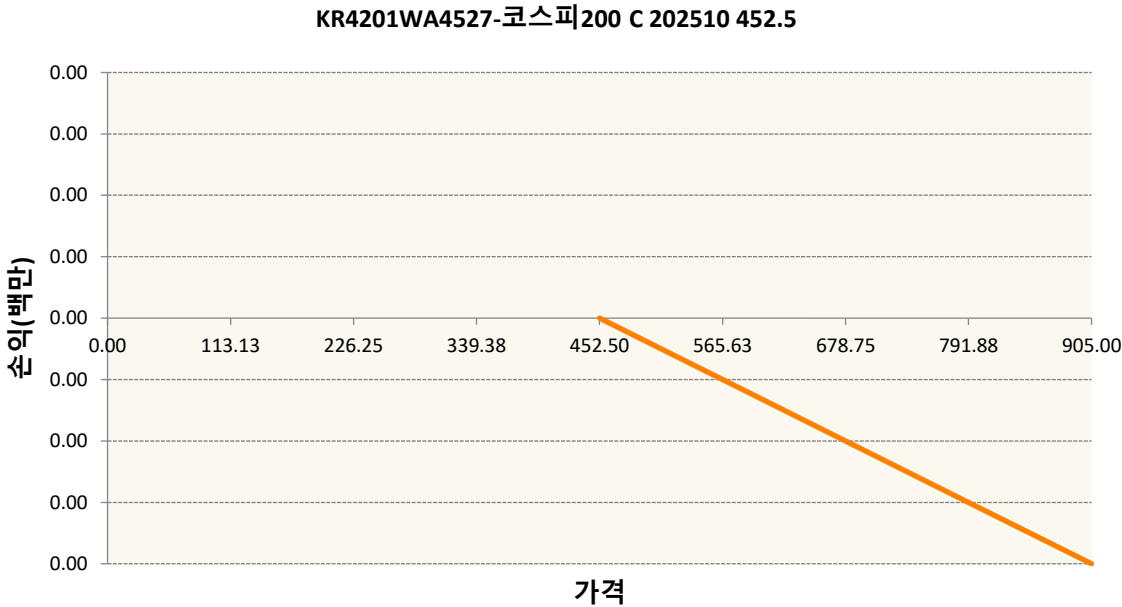
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

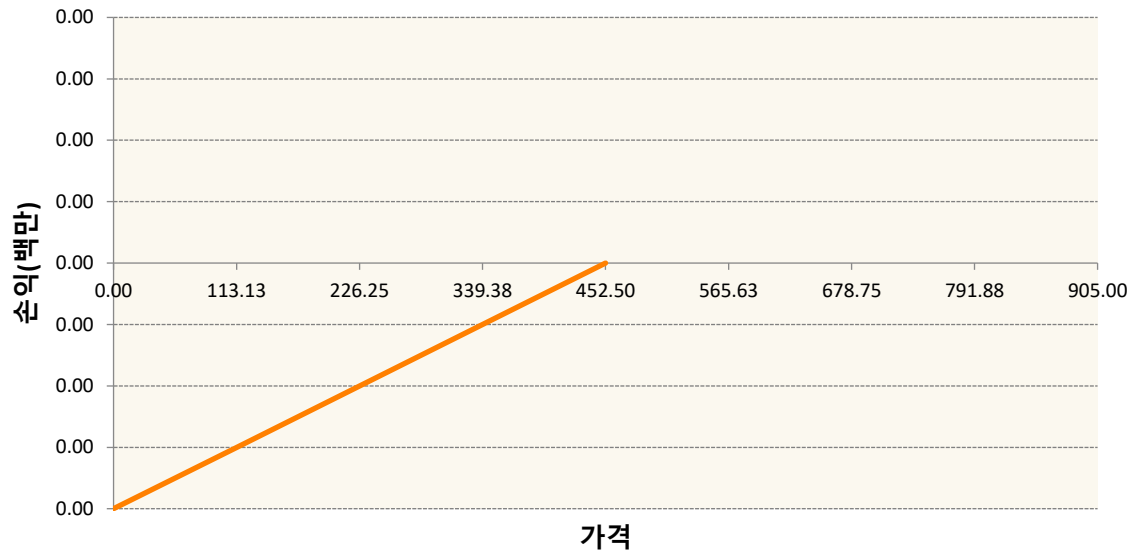
(단위:백만원)

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

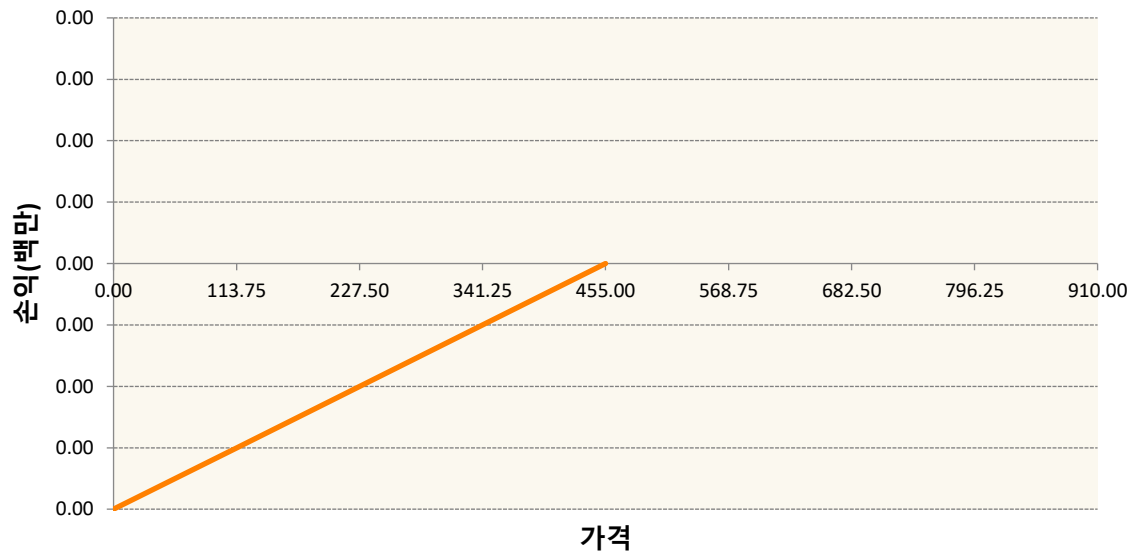
2. 만기시점의 손익구조



KR4301WA4526-코스피200 P 202510 452.5



KR4301WA4559-코스피200 P 202510 455.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WA4: 코스피200 C 202510 452.5	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 2025-10-01

기준일 2025-09-30

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	2025-10-01
기준일	2025-09-30

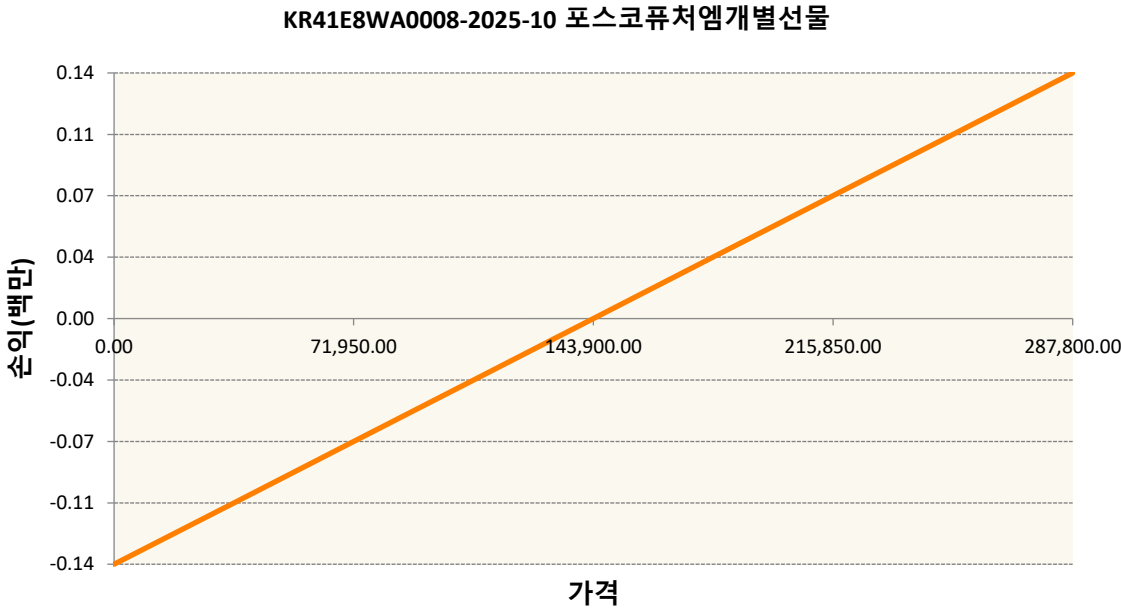
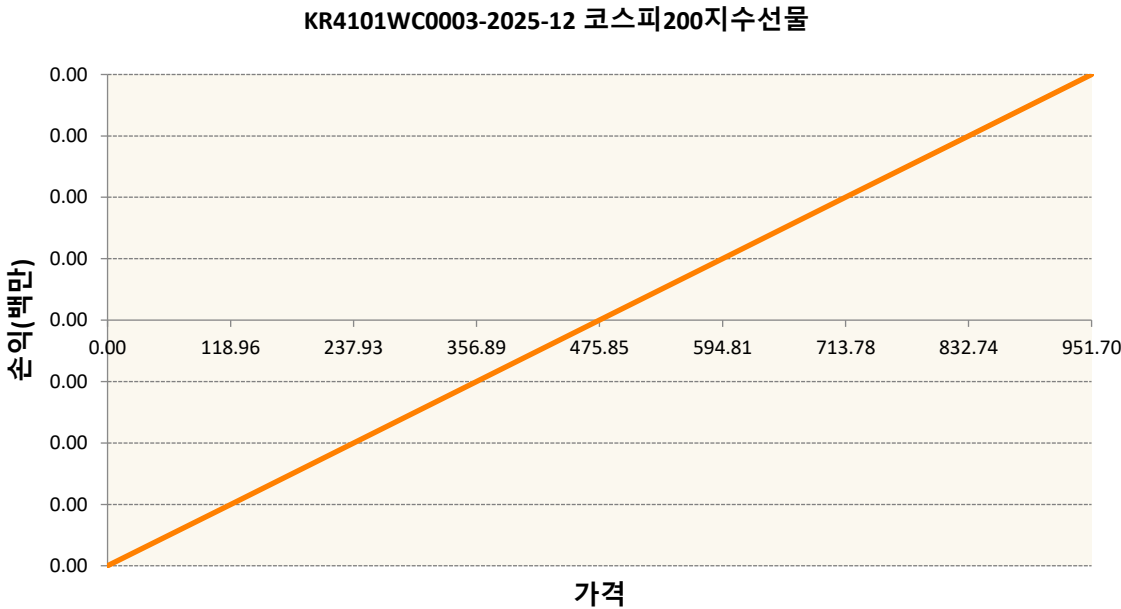
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

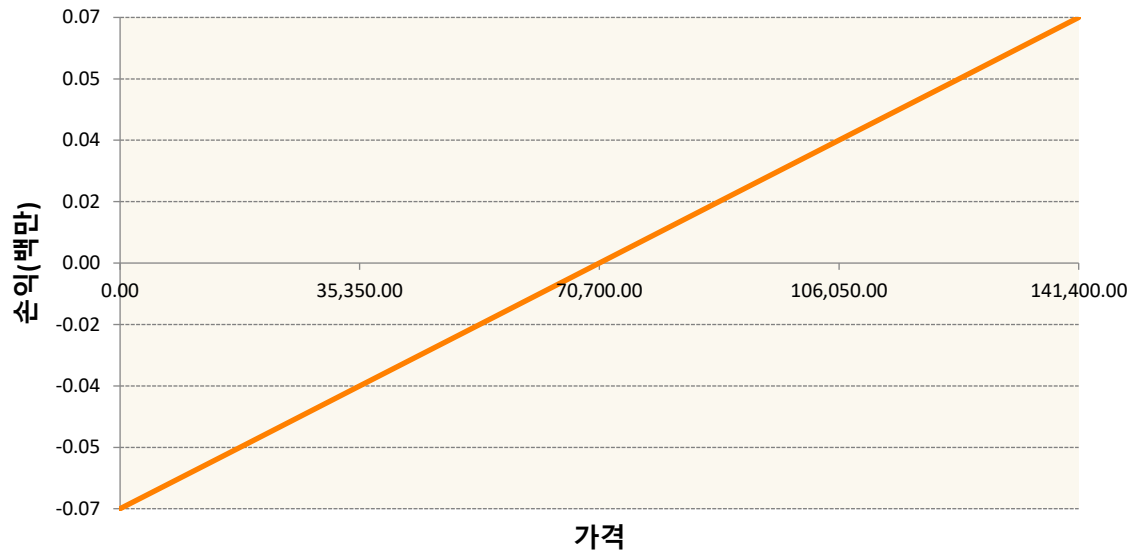
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10	119	-109	장내
누계	유가증권	선물	391	0	391	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물
 KR41E8WA01 2025-10 포스코퓨처엠개별선물
 KR41FMWB01 2025-11 엘앤에프개별선물

29
2
1

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

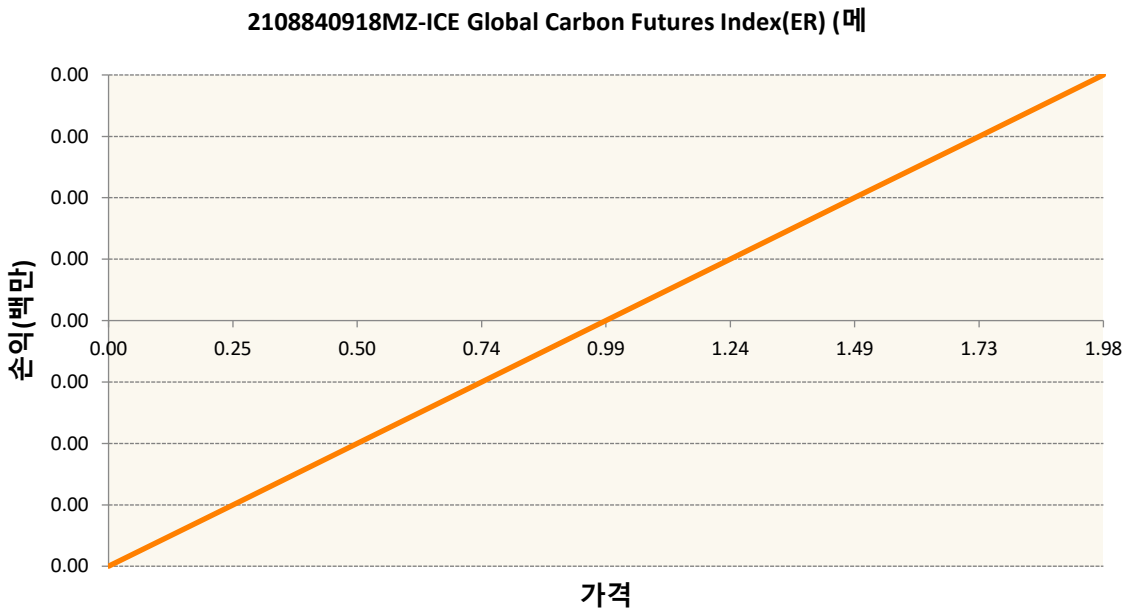
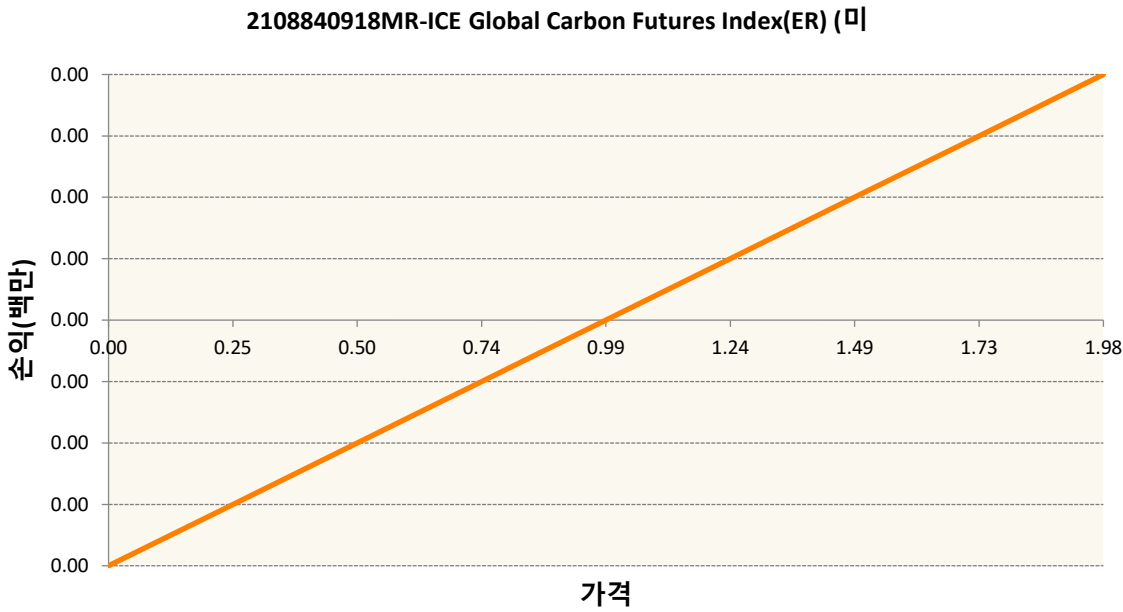
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	2025-10-01
기준일	2025-09-30

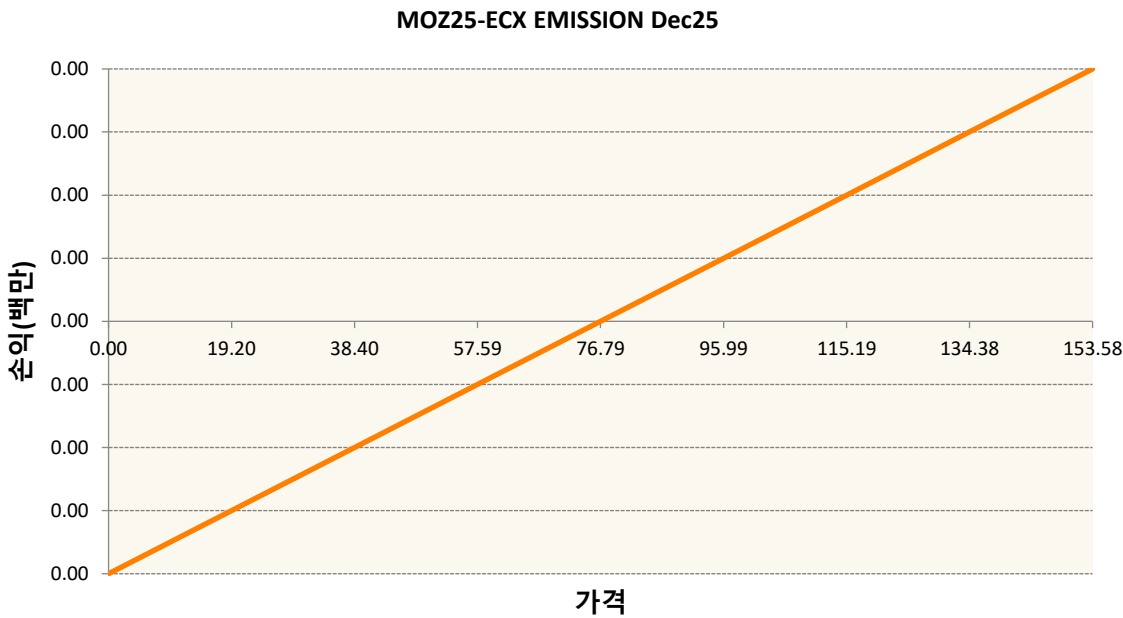
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,755	0	5,755	
누계	지수	스왑	-4	0	-4	장외
누계	통화	선도	0	2,273	-2,273	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.31
FXW213F9SC KRW/EUR 31-10-25E	182
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	460

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

(단위:백만원)

746

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

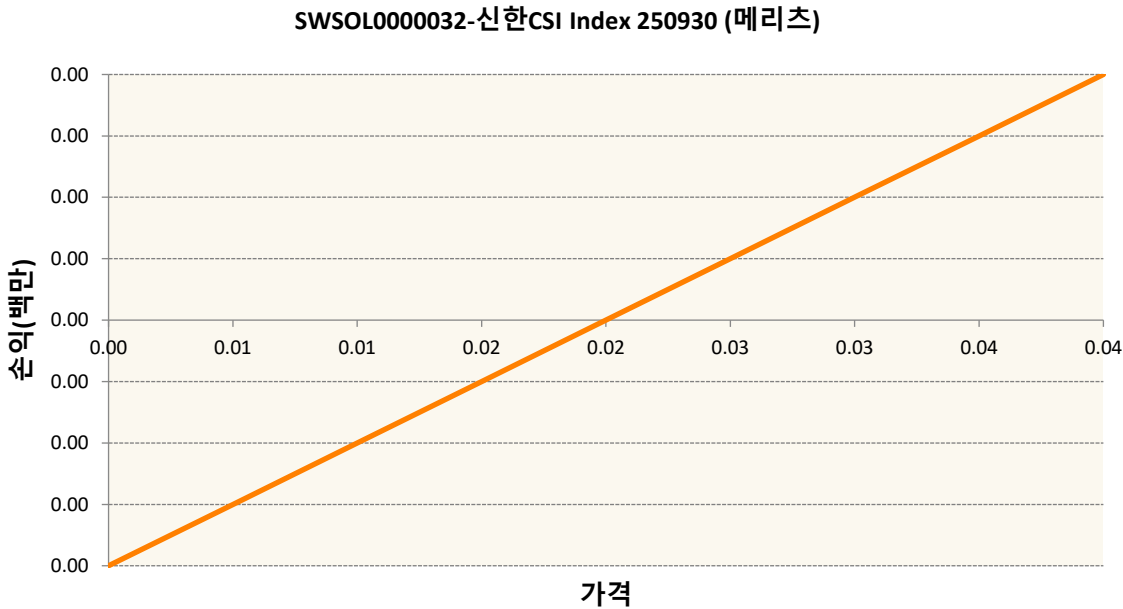
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	320	0	320	장외
신규	지수	스왑	770	0	770	장외
누계	유가증권	스왑	1,012	0	1,012	장외
누계	지수	스왑	2,546	0	2,546	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	3
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	2
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	2
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	5

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

(단위:백만원)

19

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

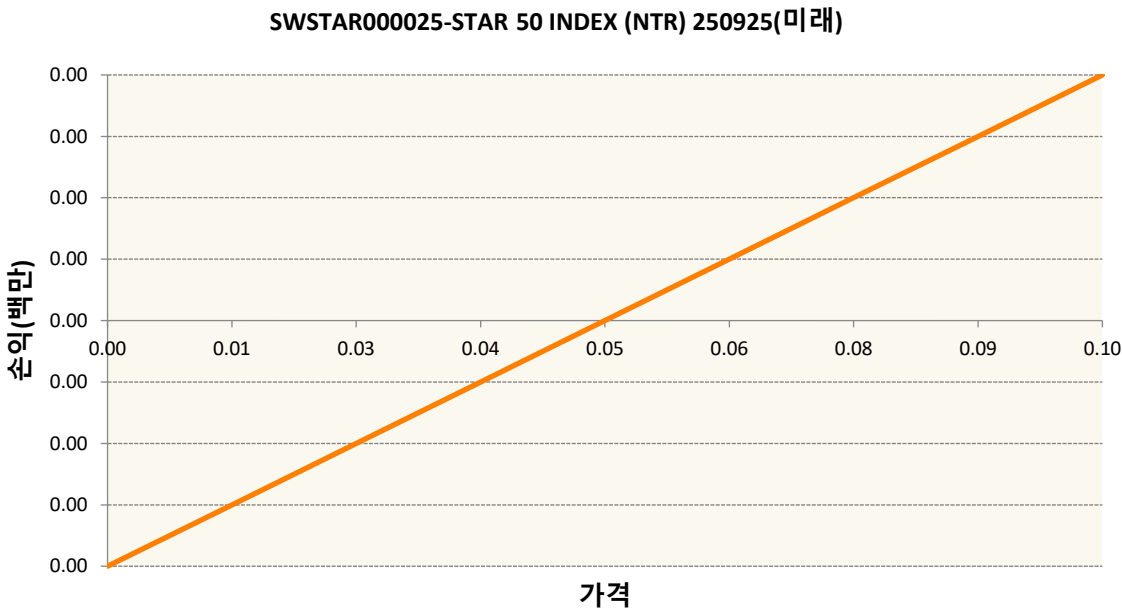
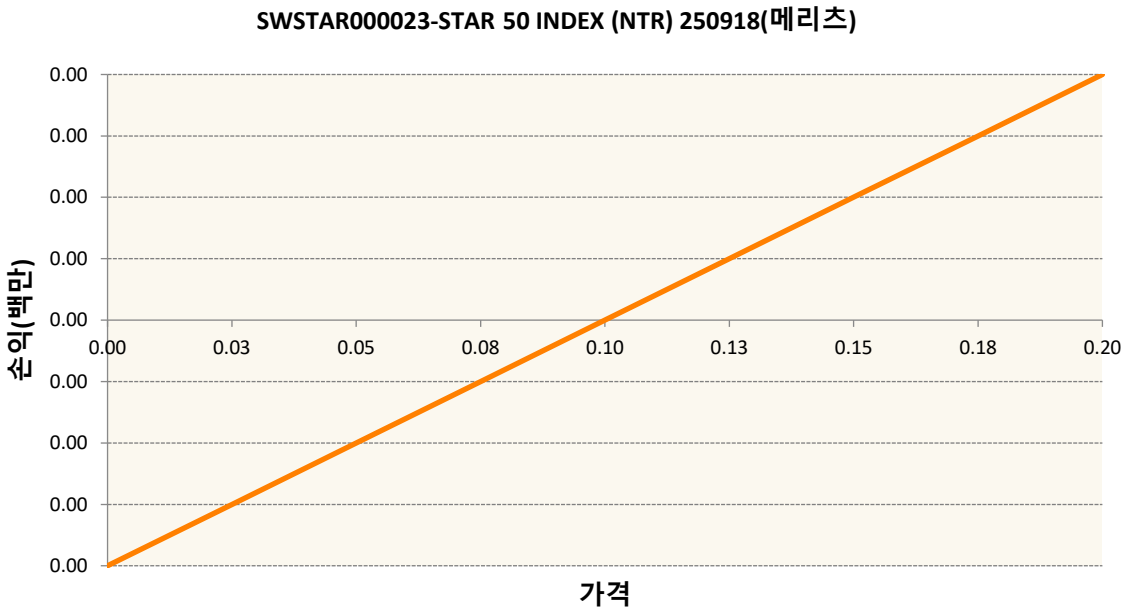
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	4,883	0	4,883	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		22
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		6
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		79
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		22

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	228

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

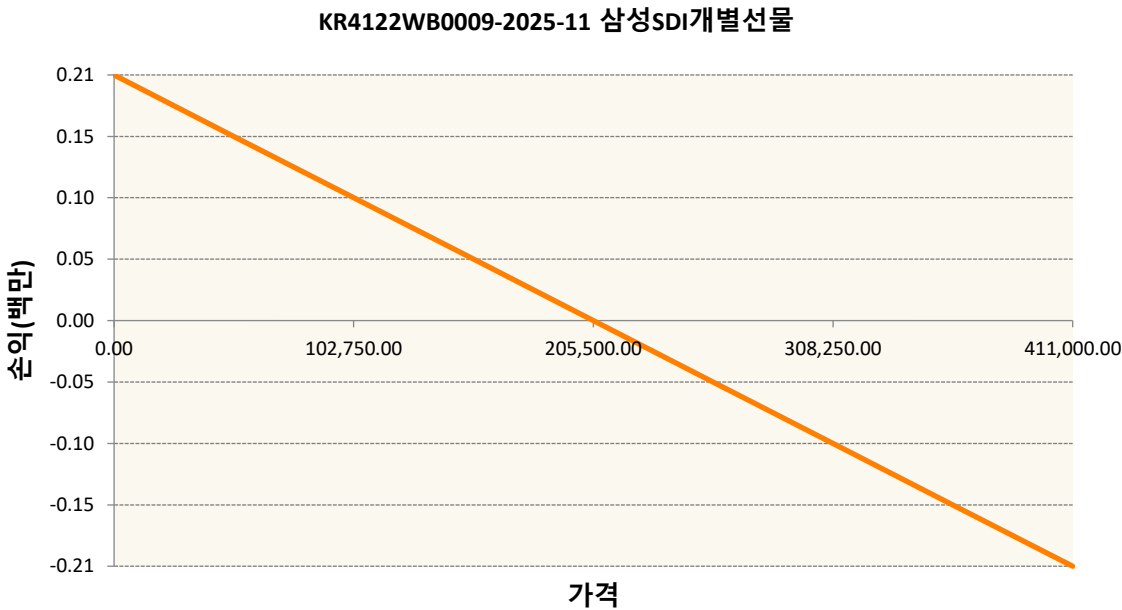
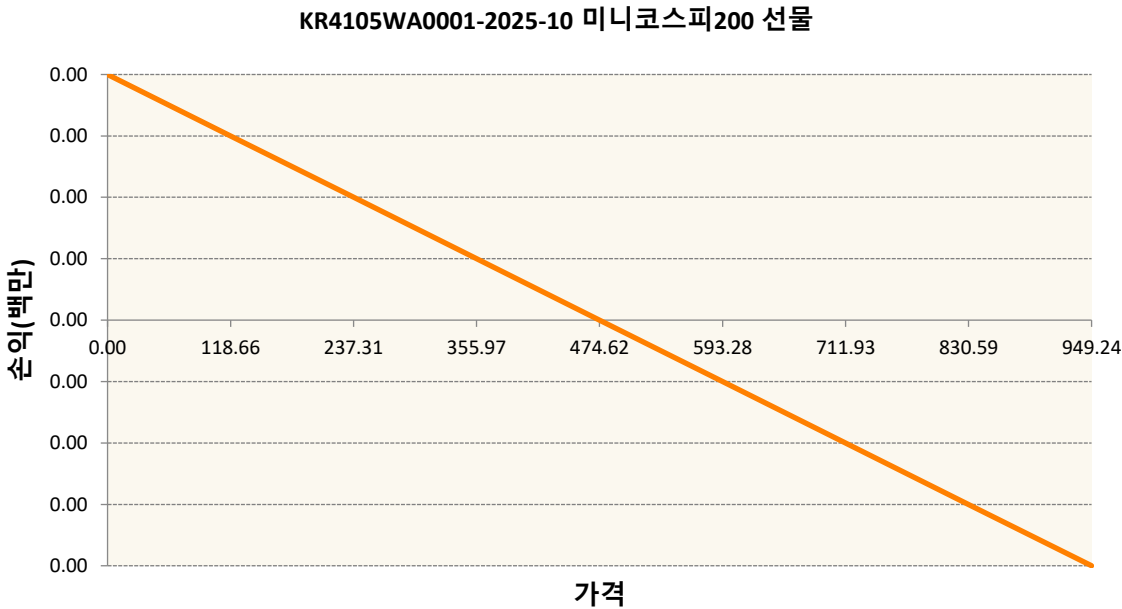
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

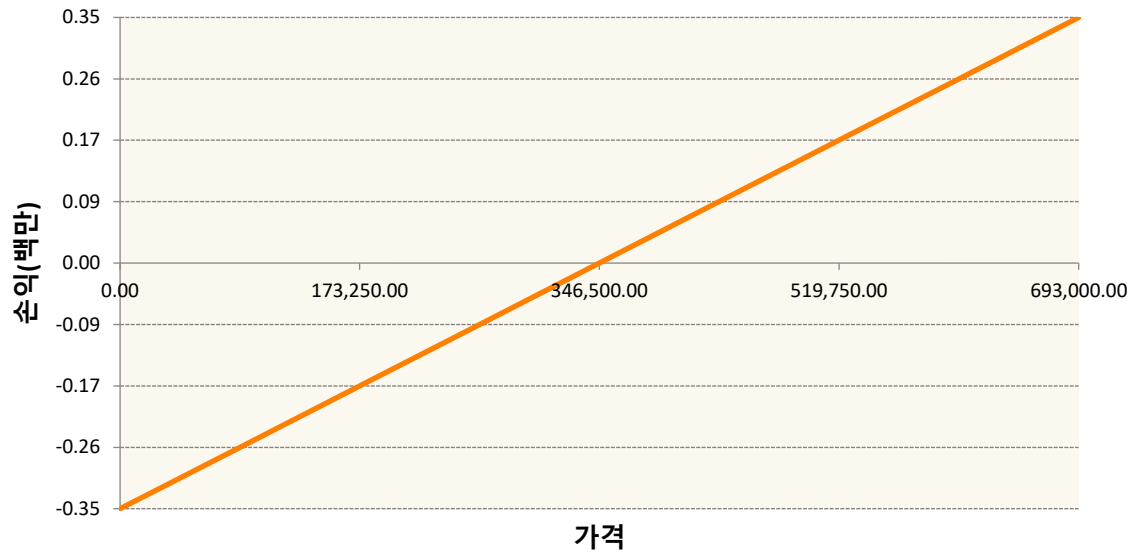
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7	4	3	장내
누계	유가증권	선물	21	970	-949	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41F5WB0007-2025-11 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105WA0(2025-10 미니코스피200 선물	15
KR4122WB0(2025-11 삼성SDI개별선물	2
KR41F5WB0(2025-11 LG에너지솔루션개별선물	2

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

(단위:백만원)

4

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

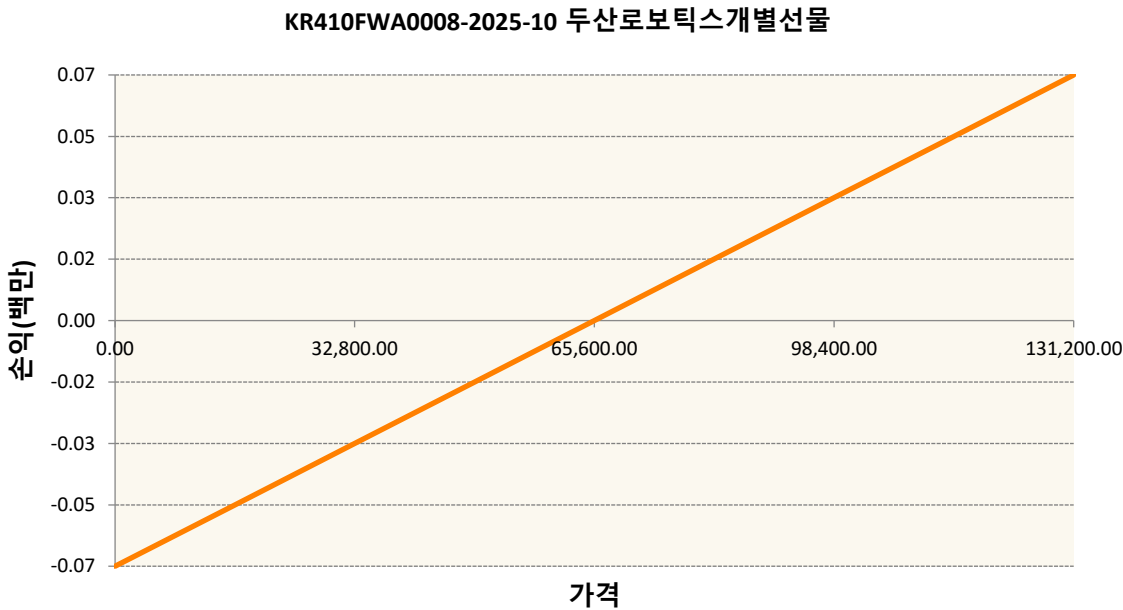
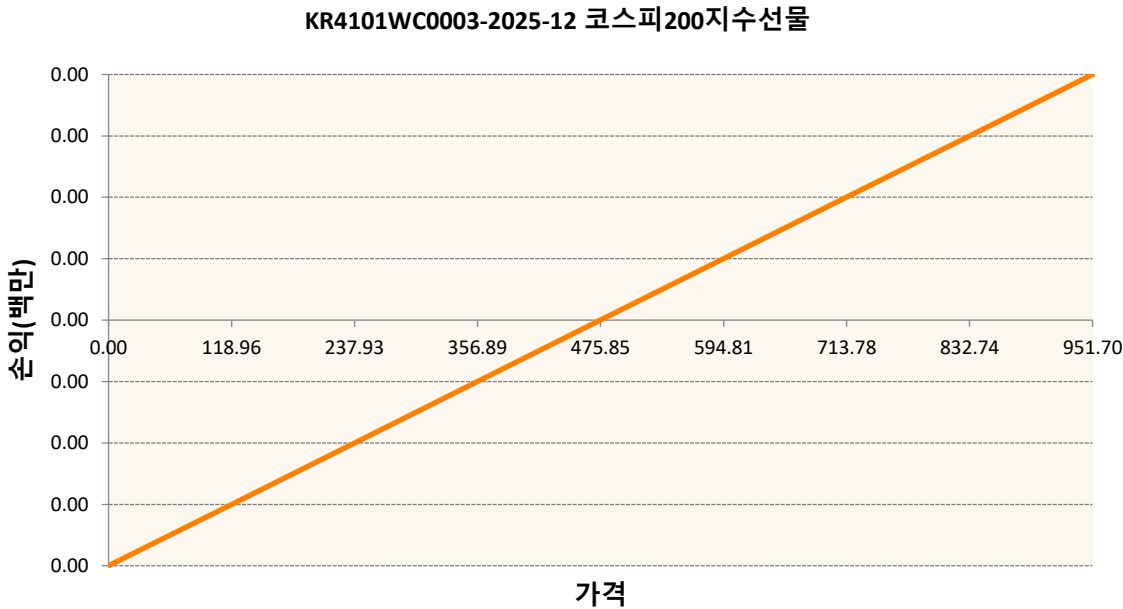
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

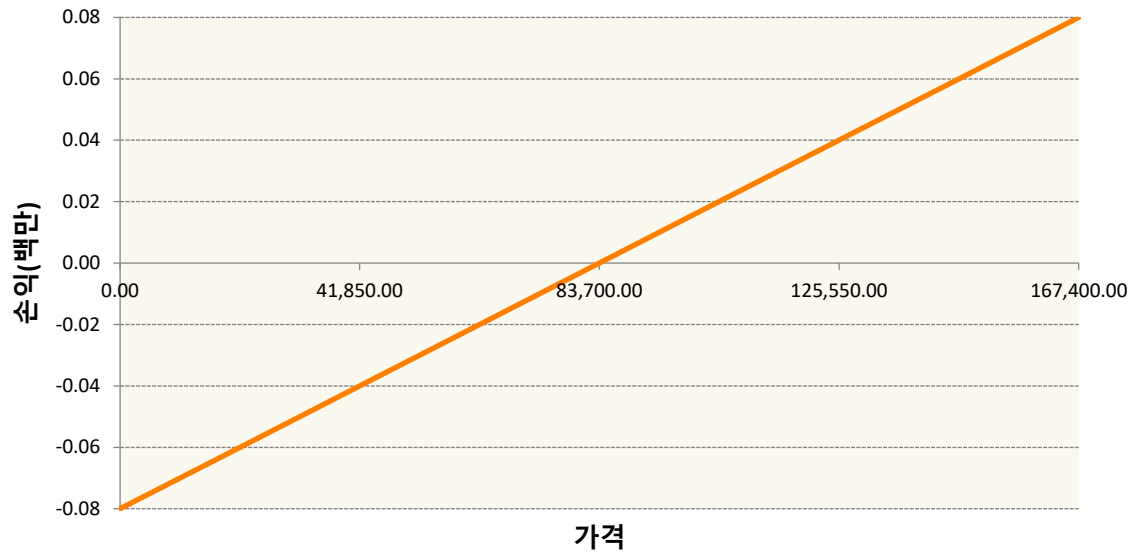
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	685	0	685	장내
누계	유가증권	선물	10,838	1,220	9,618	장내

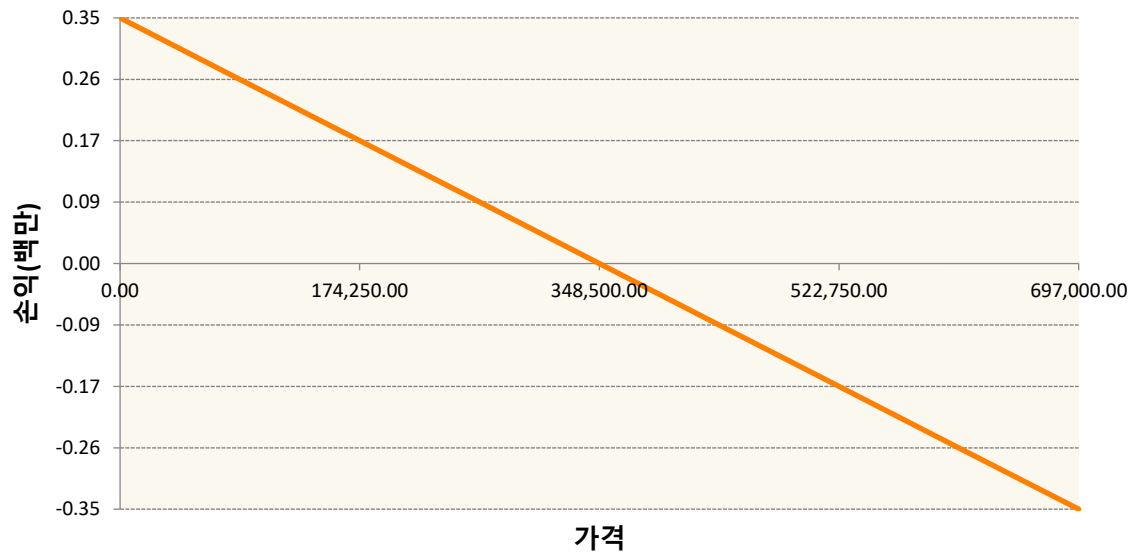
2. 만기시점의 손익구조



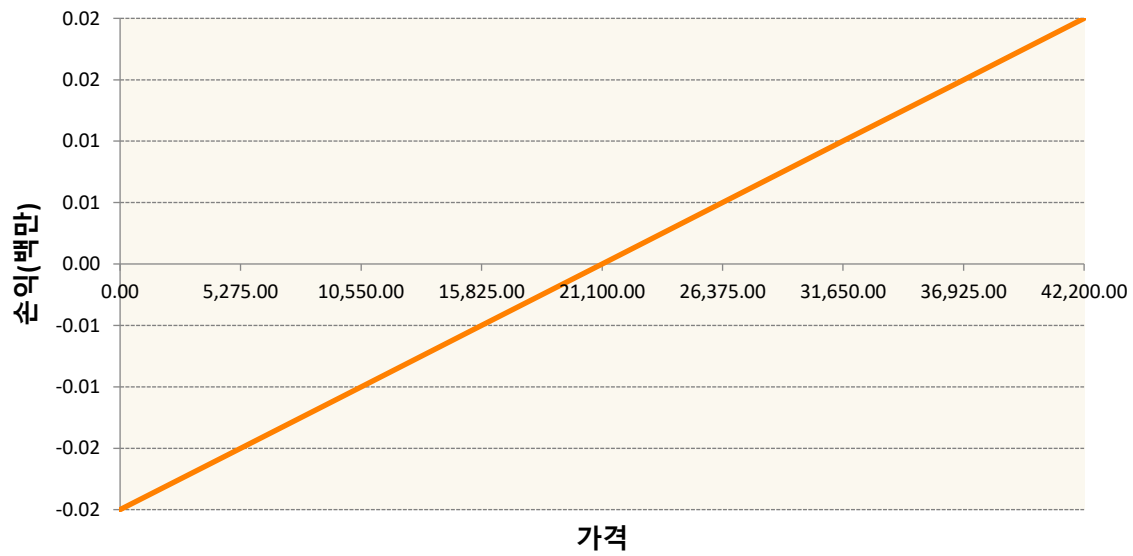
KR4111WA0003-2025-10 삼성전자개별선물



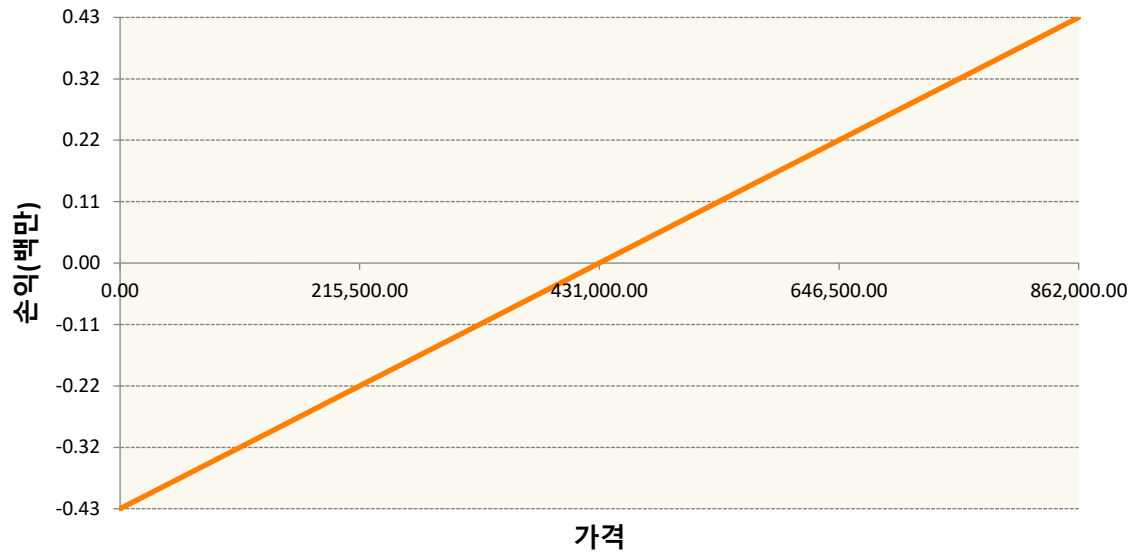
KR4150WA0005-2025-10 SK하이닉스개별선물



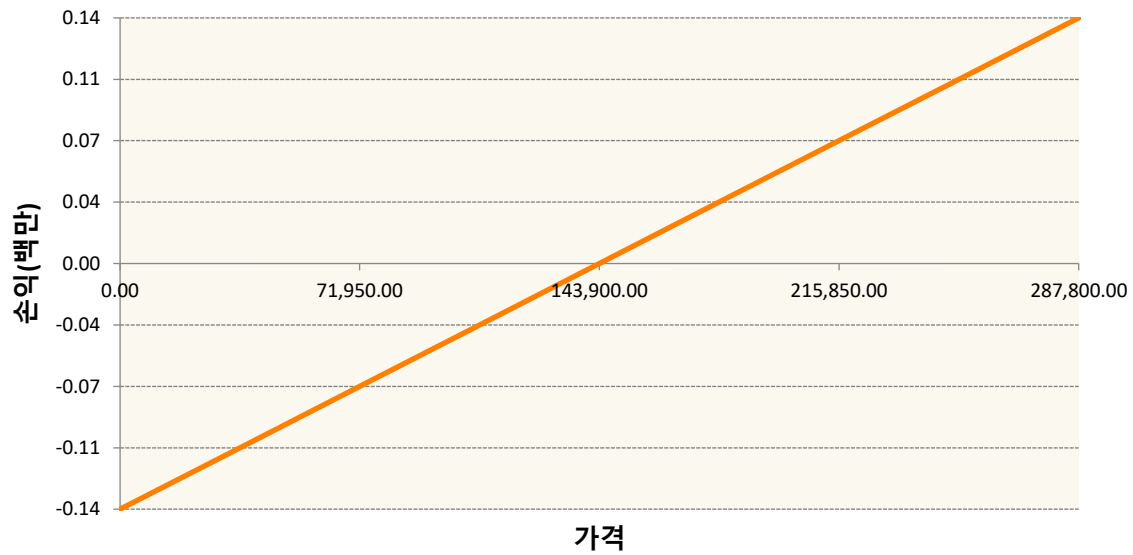
KR41CNWA0005-2025-10 포스코DX개별선물



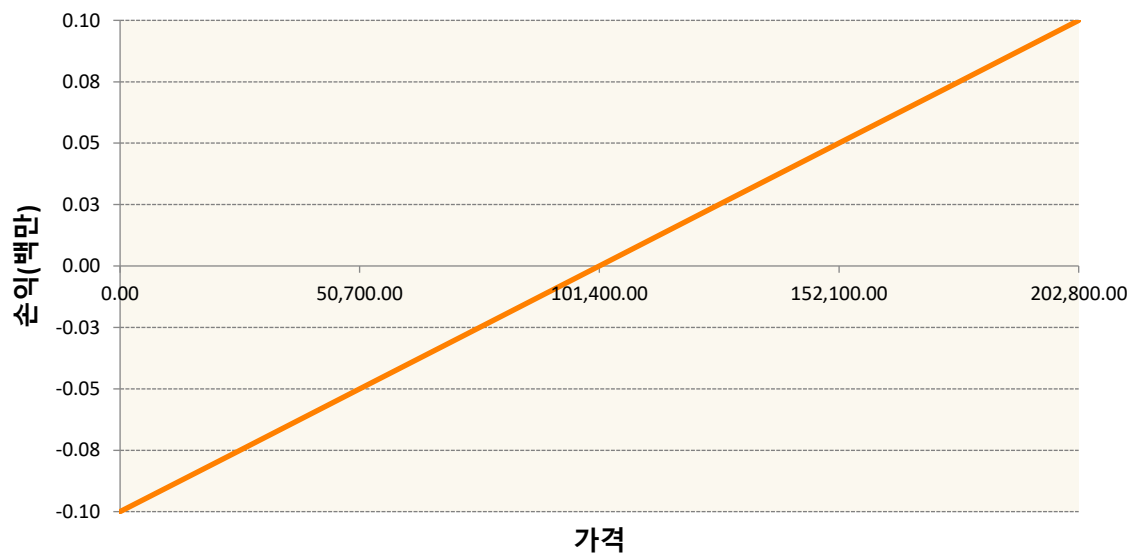
KR41DAWA0009-2025-10 농심개별선물



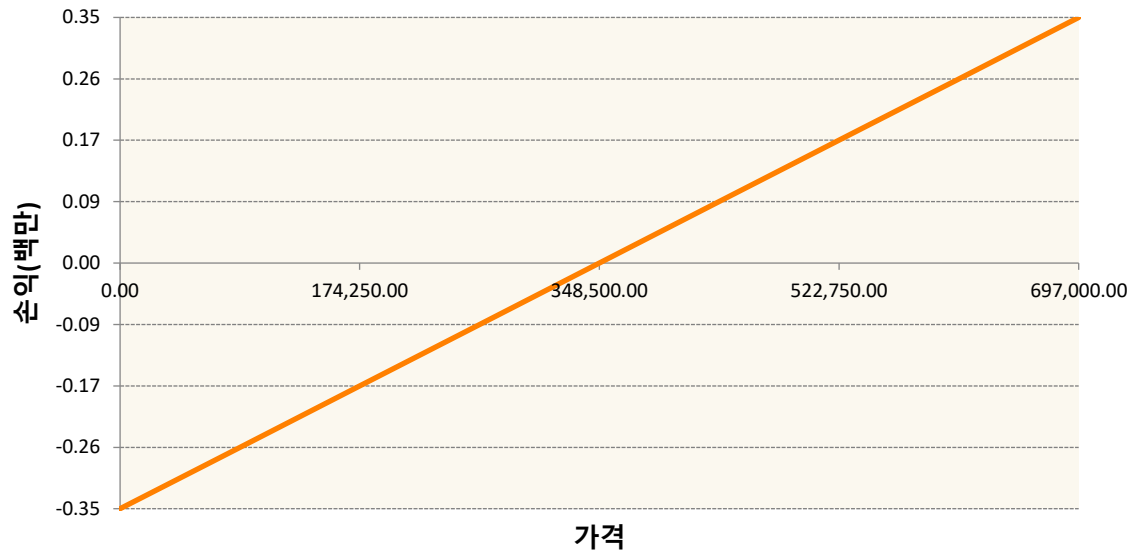
KR41E8WA0008-2025-10 포스코퓨처엠개별선물



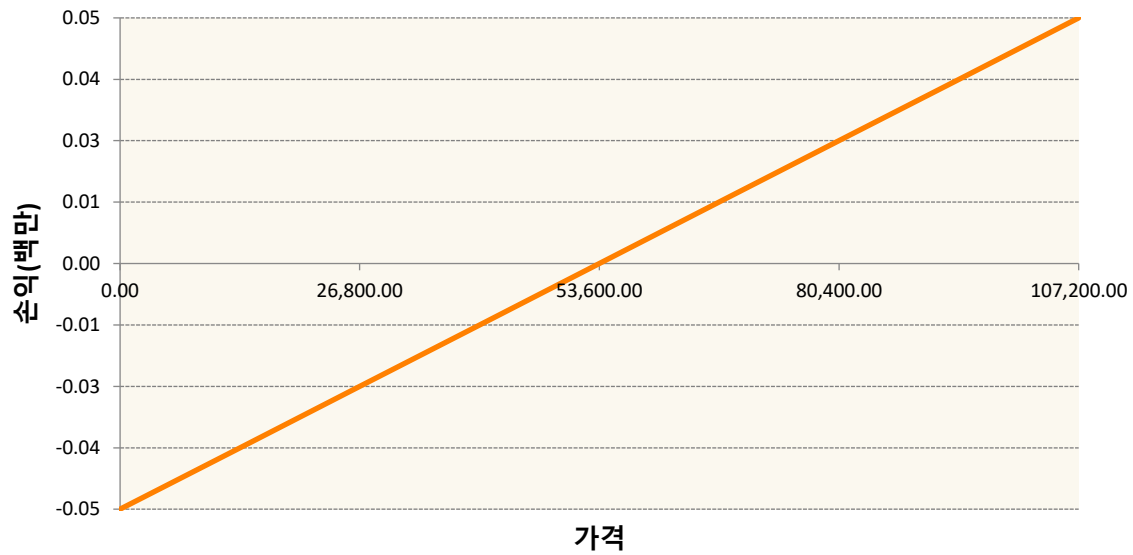
KR41EJWA0009-2025-10 SKC개별선물



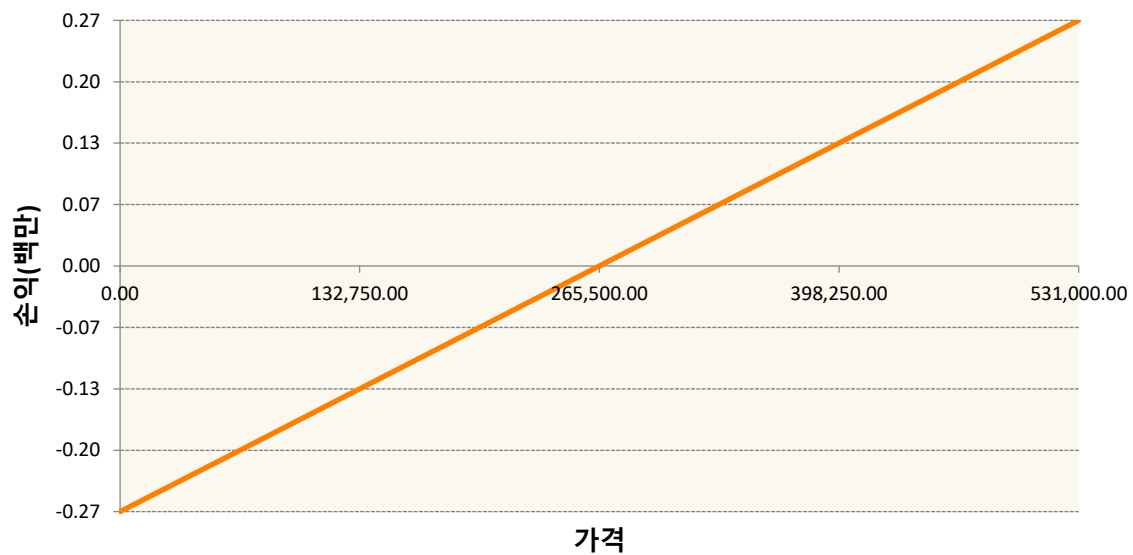
KR41F5WA0008-2025-10 LG에너지솔루션개별선물



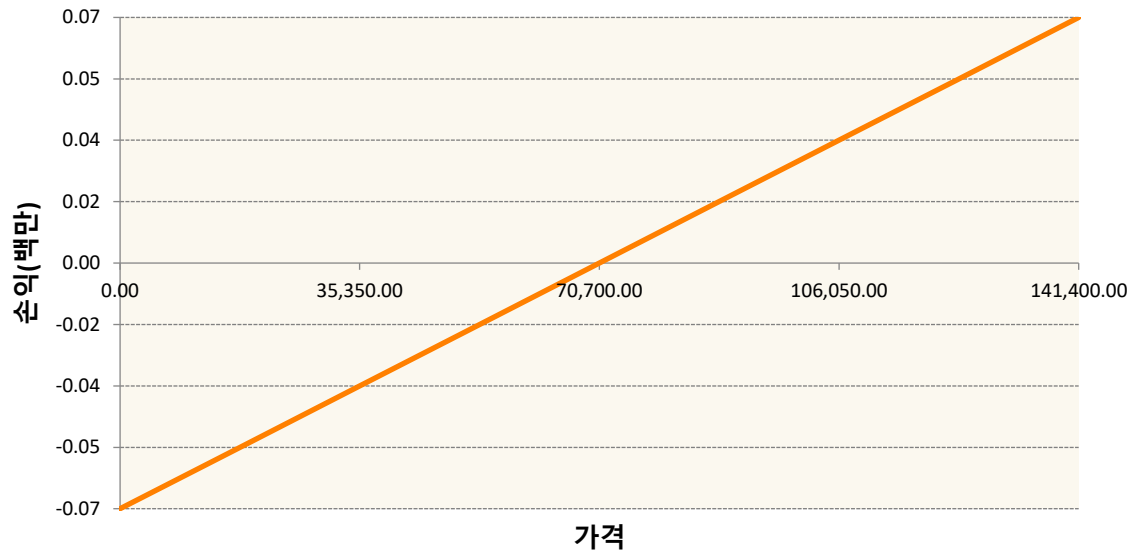
KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



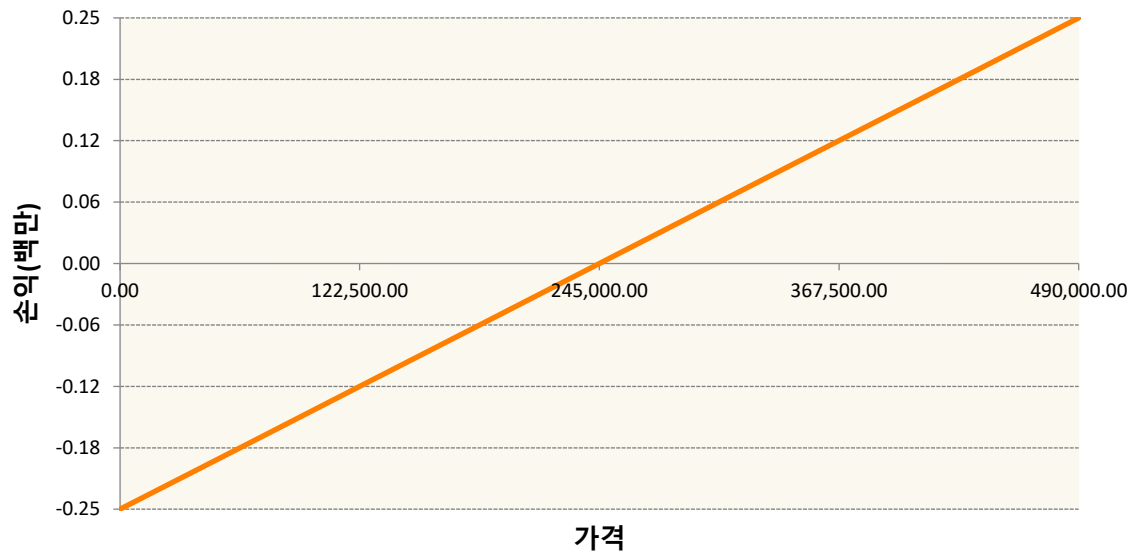
KR41FCWA0005-2025-10 하이브개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



KR41HEWA0001-2025-10 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	542
KR410FWA0(2025-10 두산로보틱스개별선물	14
KR4111WA0(2025-10 삼성전자개별선물	100
KR4150WA0(2025-10 SK하이닉스개별선물	98
KR41CNWAC 2025-10 포스코DX개별선물	10
KR41DAWAC 2025-10 농심개별선물	4
KR41E8WA0(2025-10 포스코퓨처엠개별선물	40
KR41EJWA0(2025-10 SKC개별선물	21
KR41F5WA0(2025-10 LG에너지솔루션개별선물	1
KR41F7WB0(2025-11 카카오페이개별선물	16
KR41FCWA0(2025-10 하이브개별선물	62
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물	20

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

(단위:백만원)

499

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

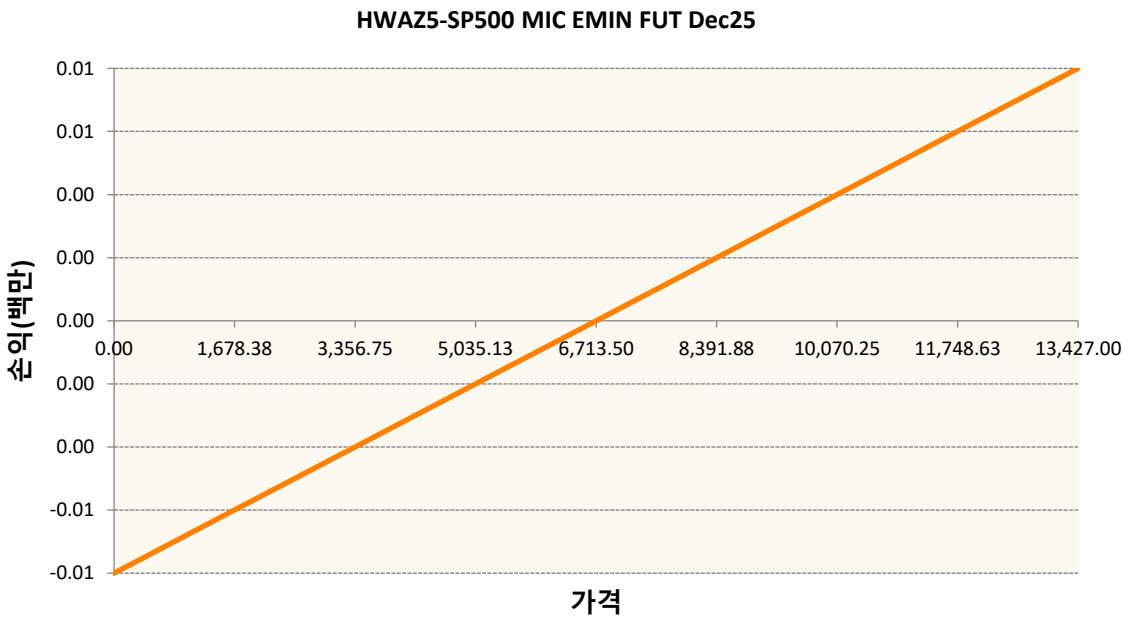
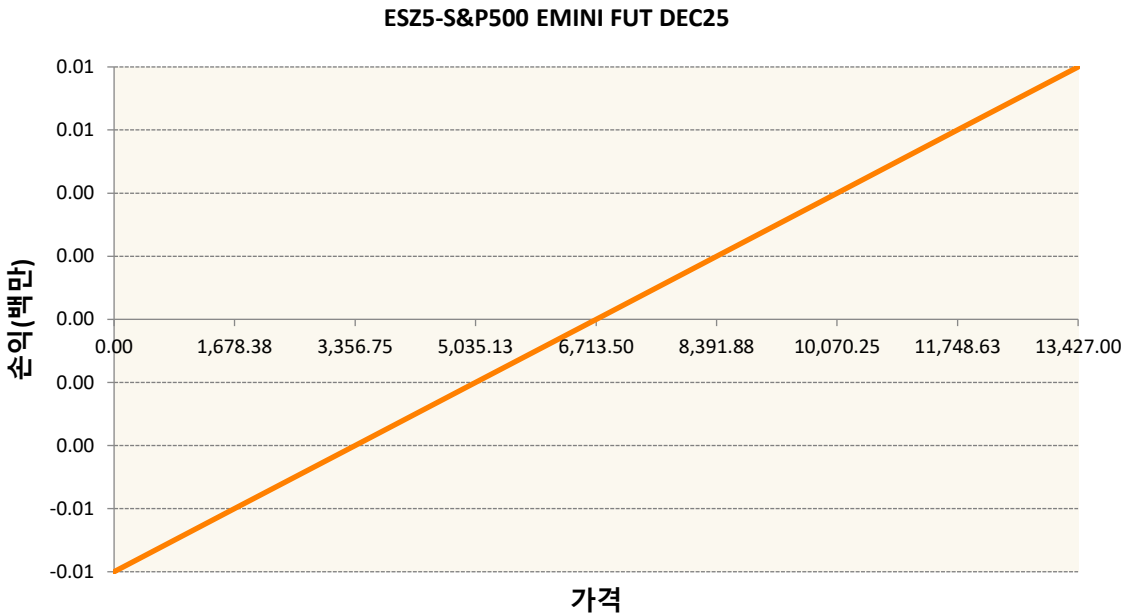
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	37,747	0	37,747	
누계	유가증권	선물	1,258	0	1,258	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,020
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,432

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

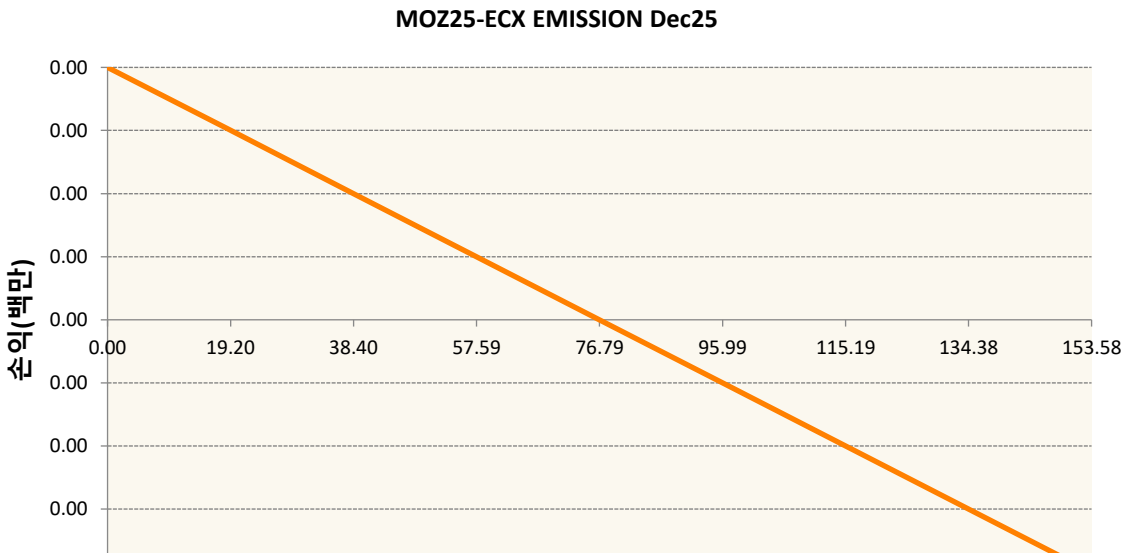
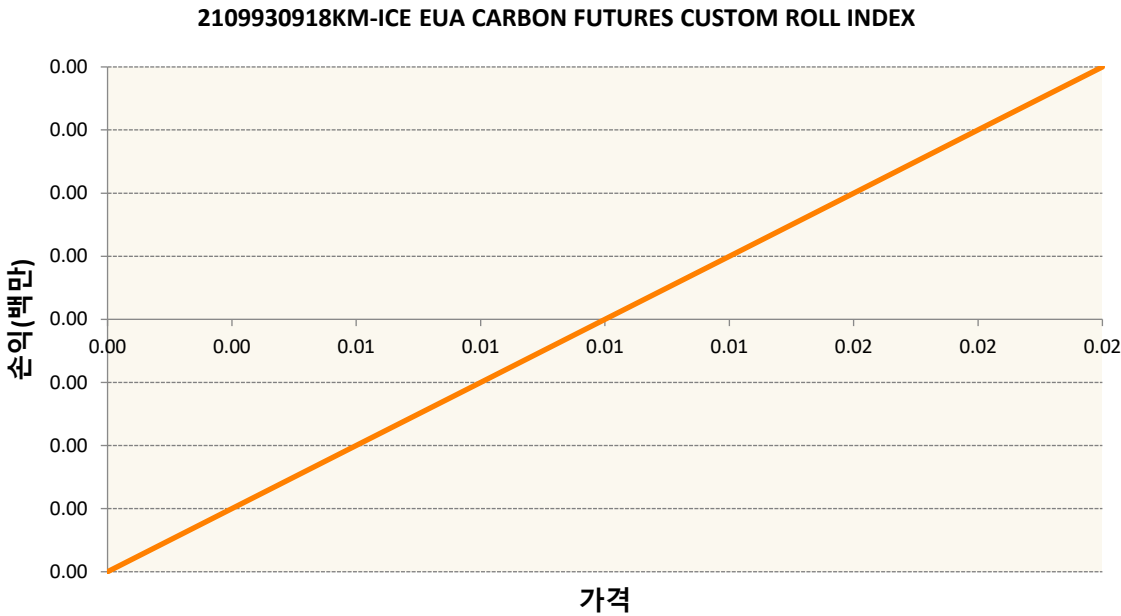
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,108	-4,108	
누계	지수	스왑	4	0	4	장외
누계	통화	선도	0	1,226	-1,226	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX
FXW213F9SC KRW/EUR 31-10-25E
MOZ25 ECX EMISSION Dec25

0.3

98

329

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

(단위:백만원)

512

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

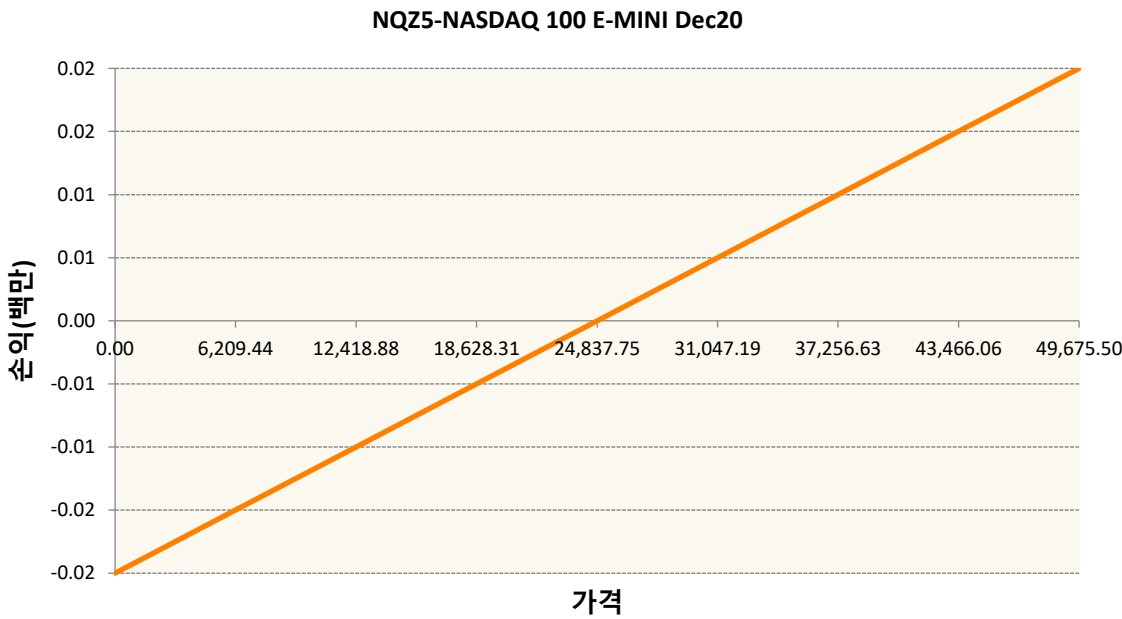
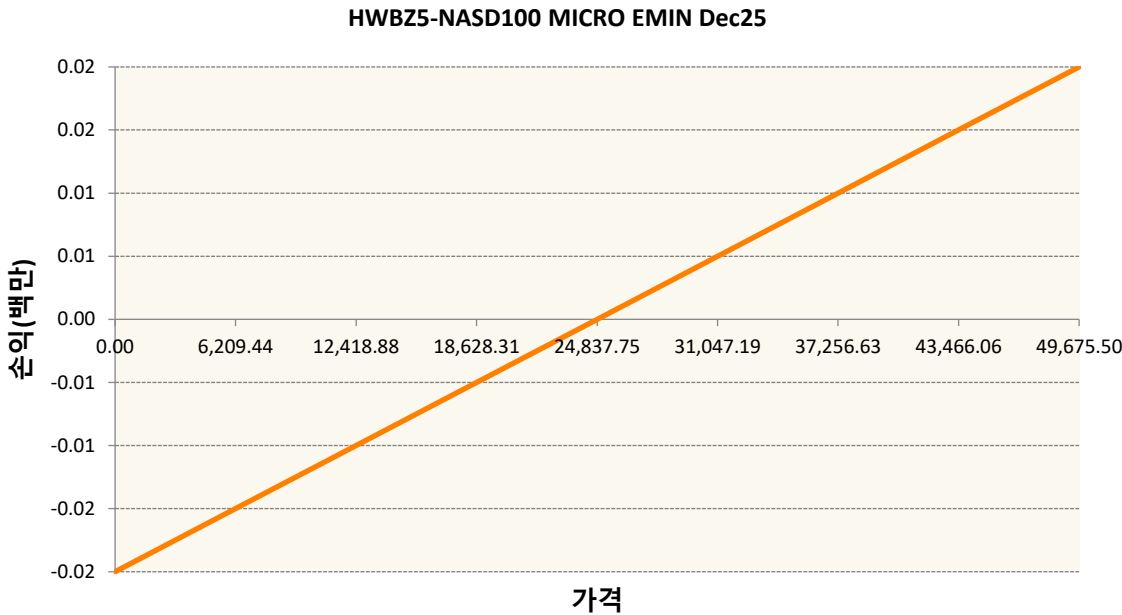
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	15,864	0	15,864	
누계	유가증권	선물	2,001	0	2,001	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25	160
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,269

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,560

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

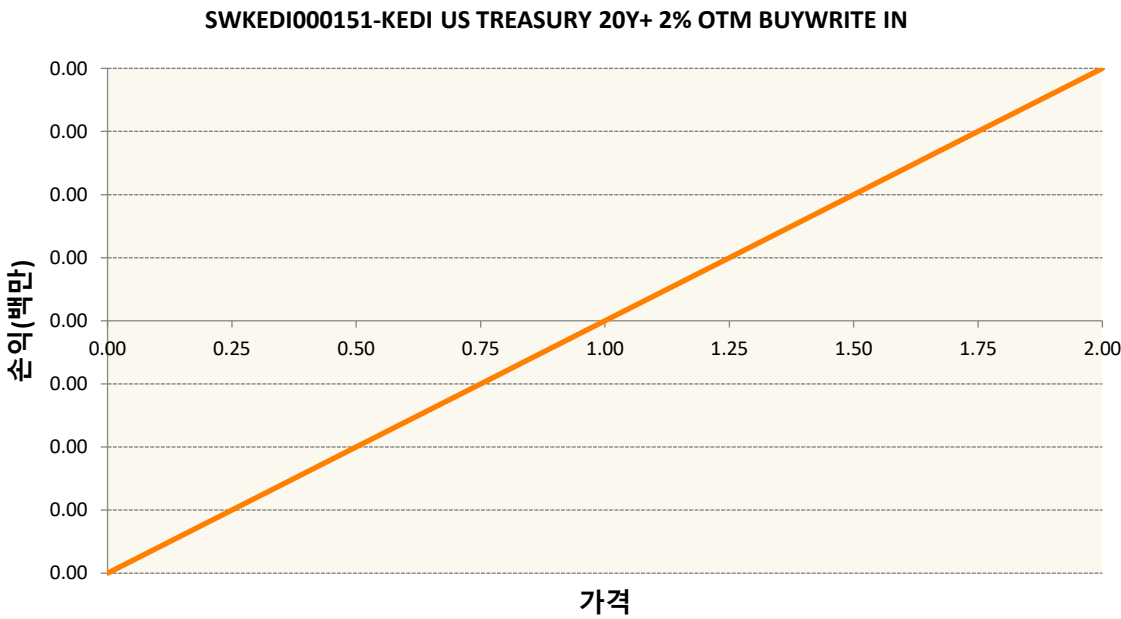
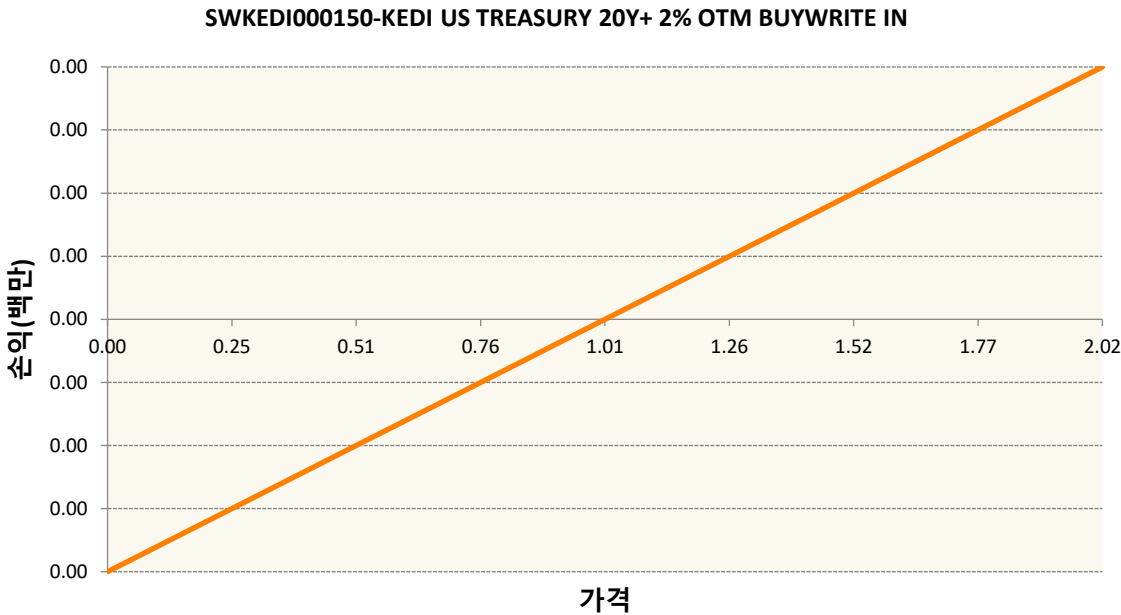
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

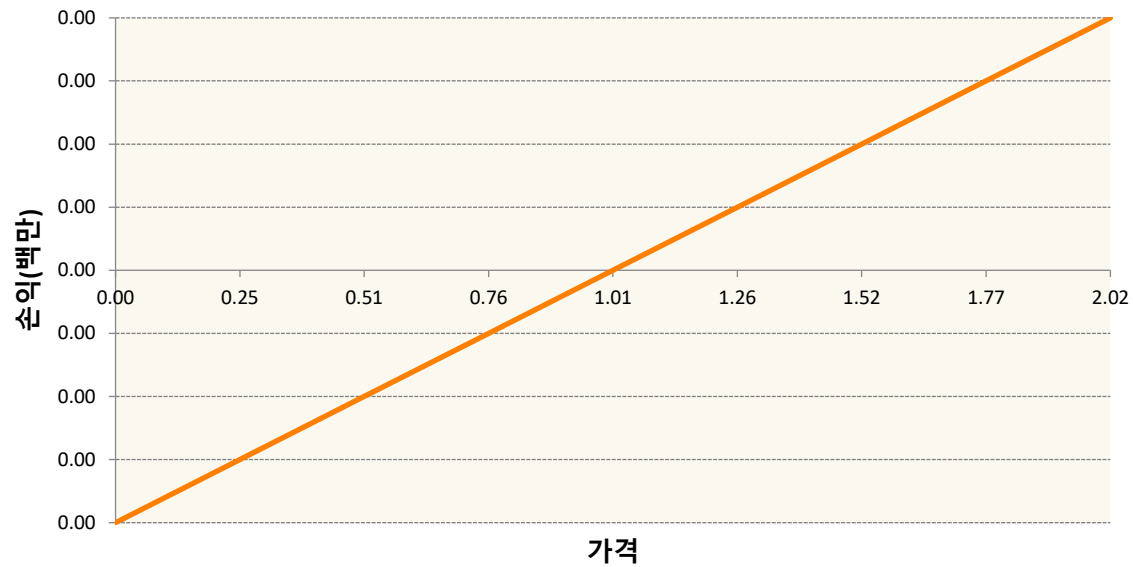
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	101,303	95,501	5,802	장외
누계	지수	스왑	365,044	0	365,044	장외

2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000152-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
7,770
3,606
9,737

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

(단위:백만원)

14,395

공시일	2025-10-01
기준일	2025-09-30

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	2025-10-01
기준일	2025-09-30

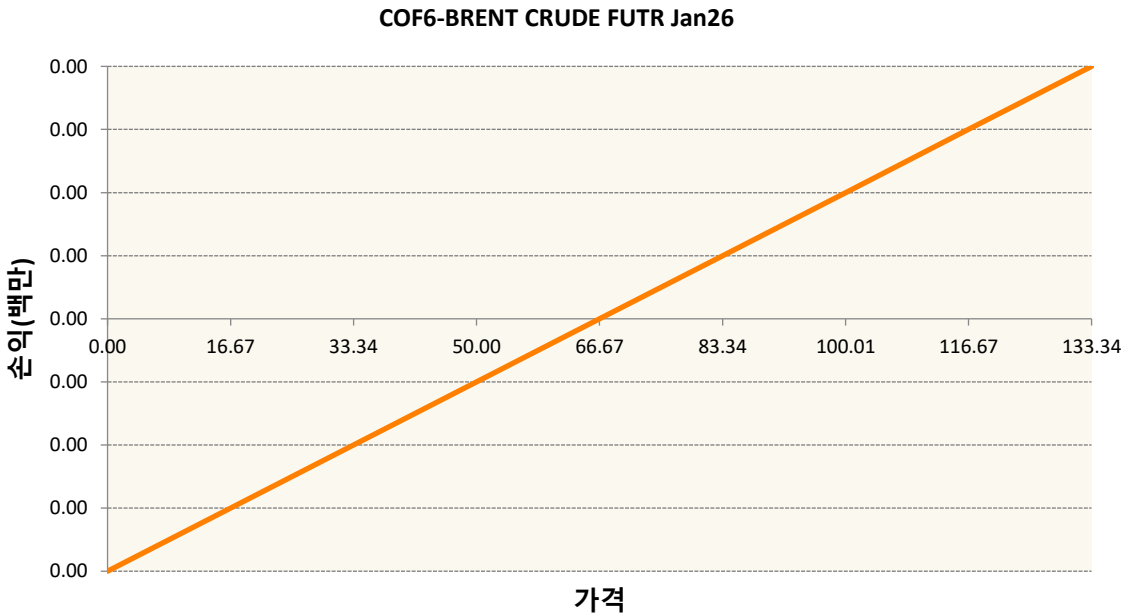
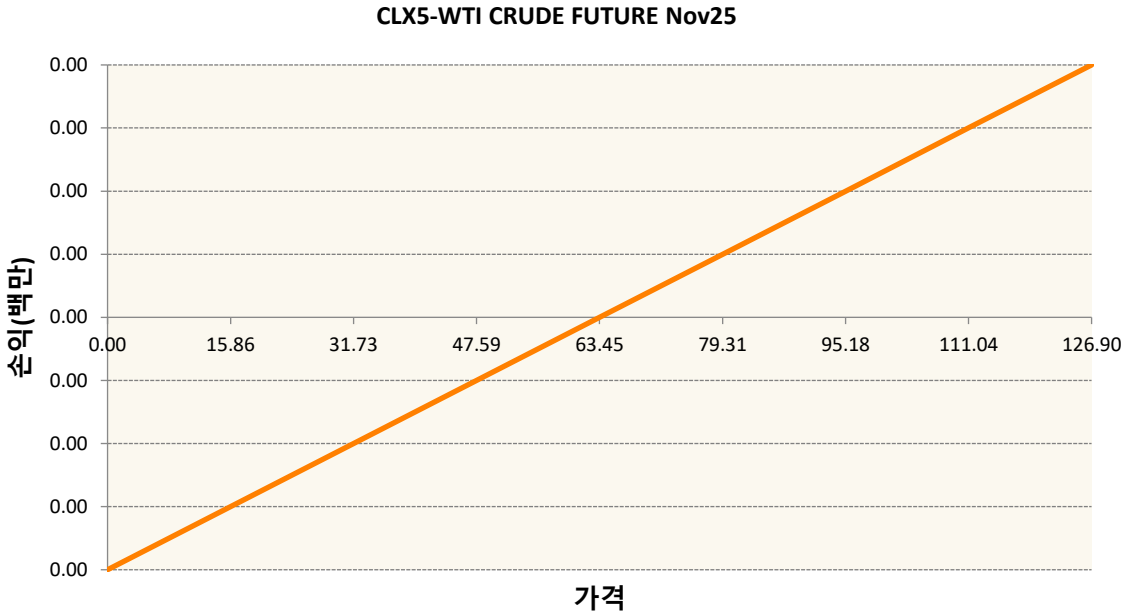
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

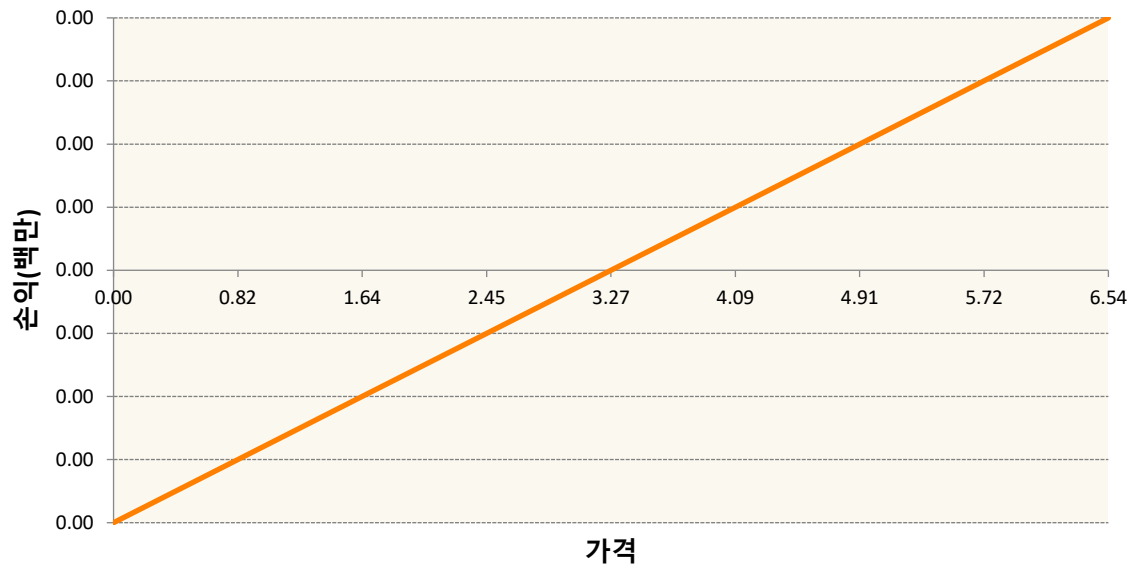
(단위:백만원)

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	540	0	540	
누계	통화	선물	0	70	-70	장내

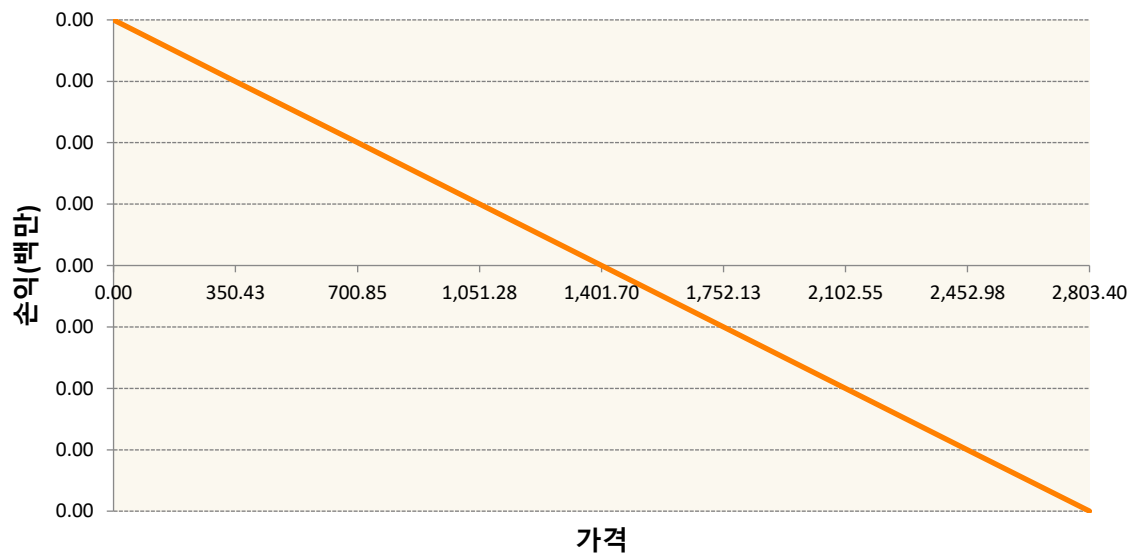
2. 만기시점의 손익구조



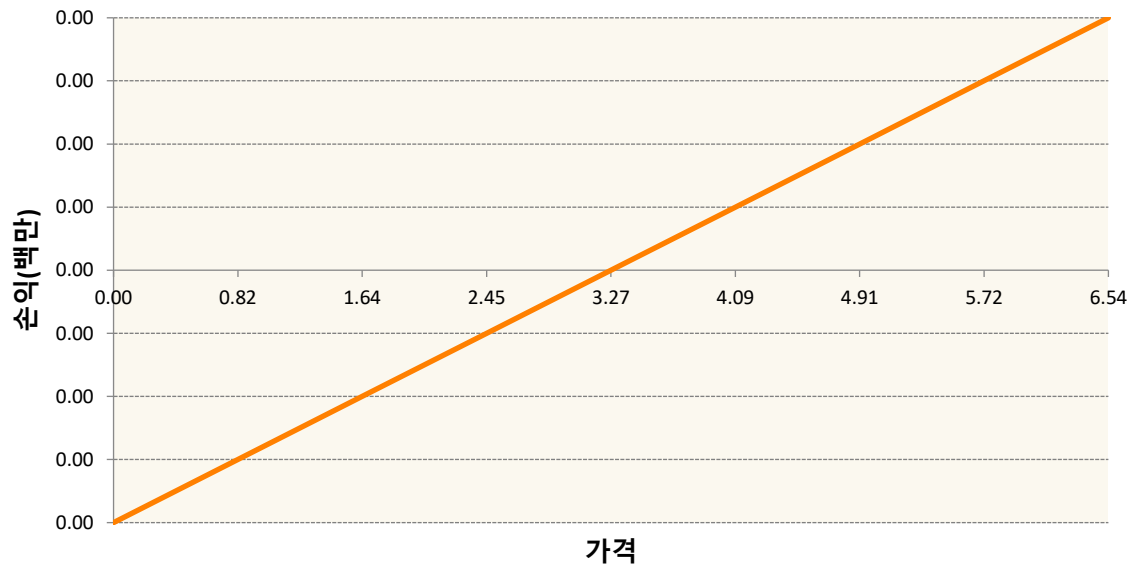
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

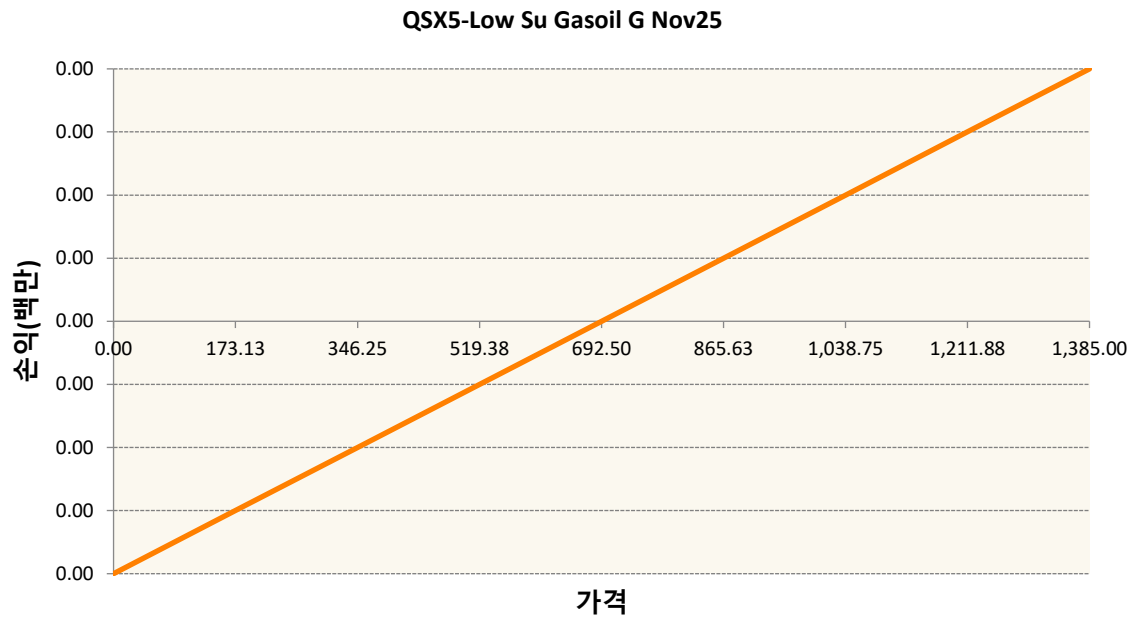


KR4175WA0006-2025-10 달러선물



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)
	97