

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

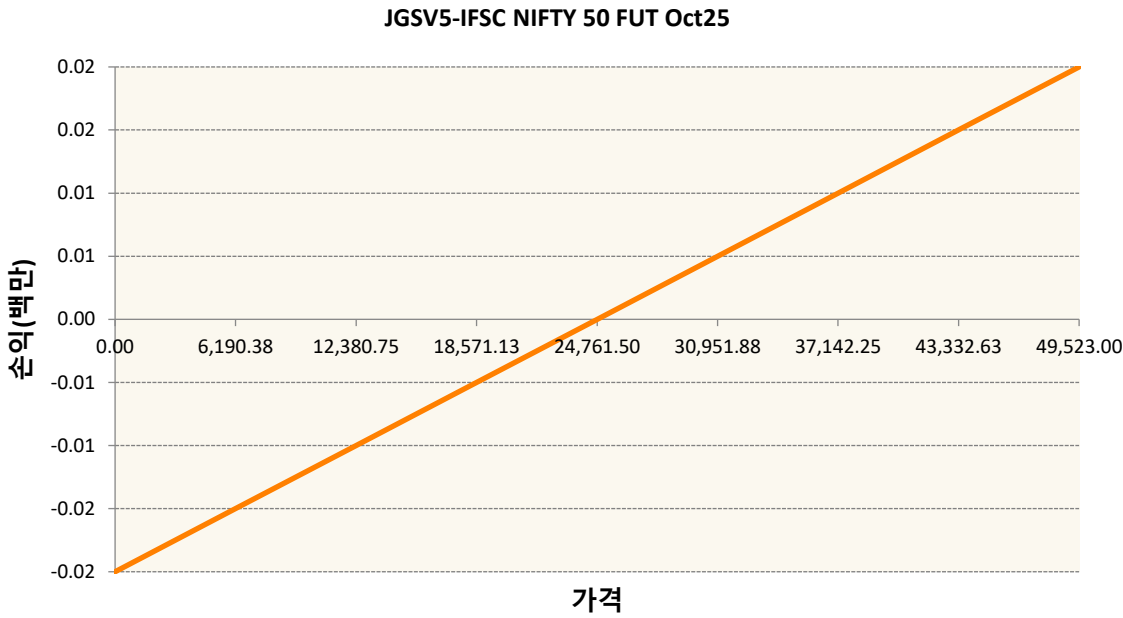
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	554	0	554	

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	2025-10-02
기준일	2025-10-01

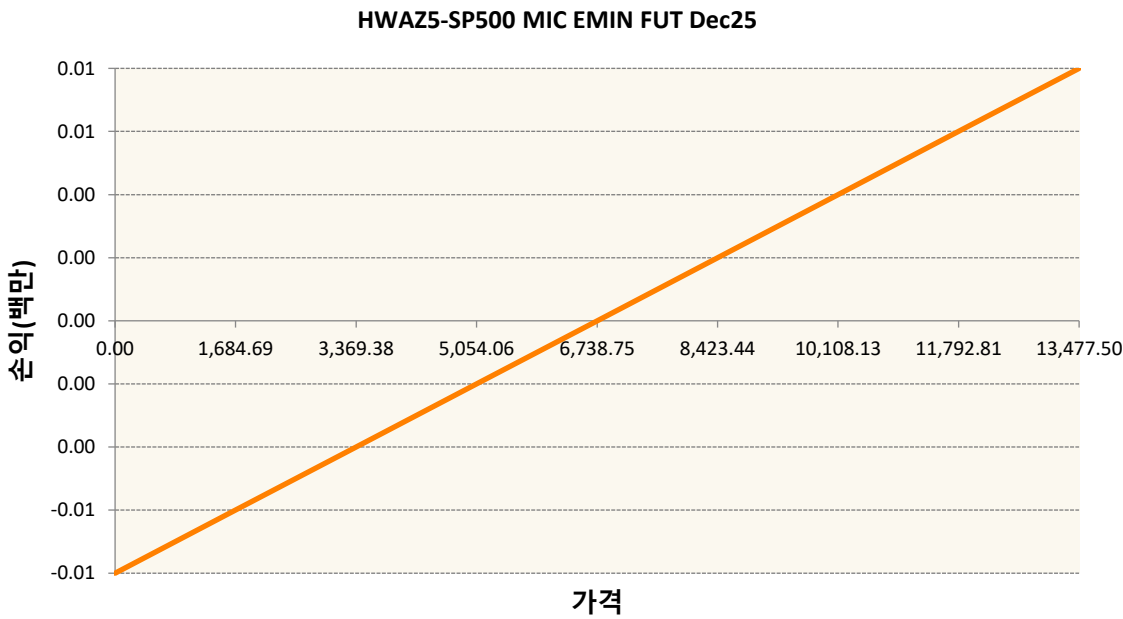
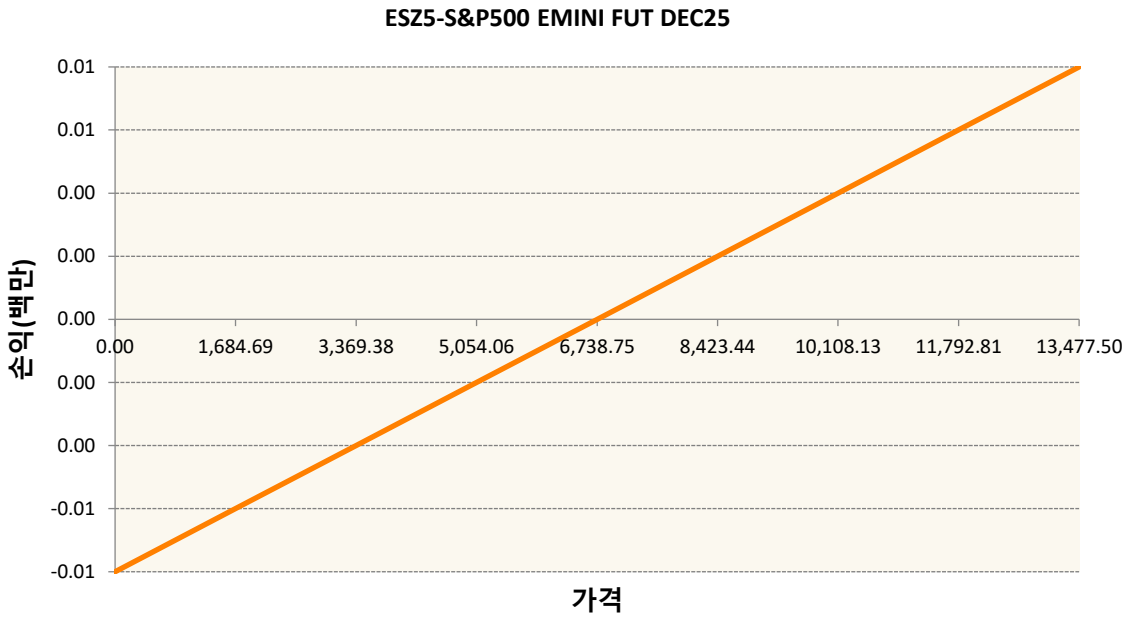
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	468	0	468	
누계	유가증권	선물	187	0	187	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	2025-10-02
기준일	2025-10-01

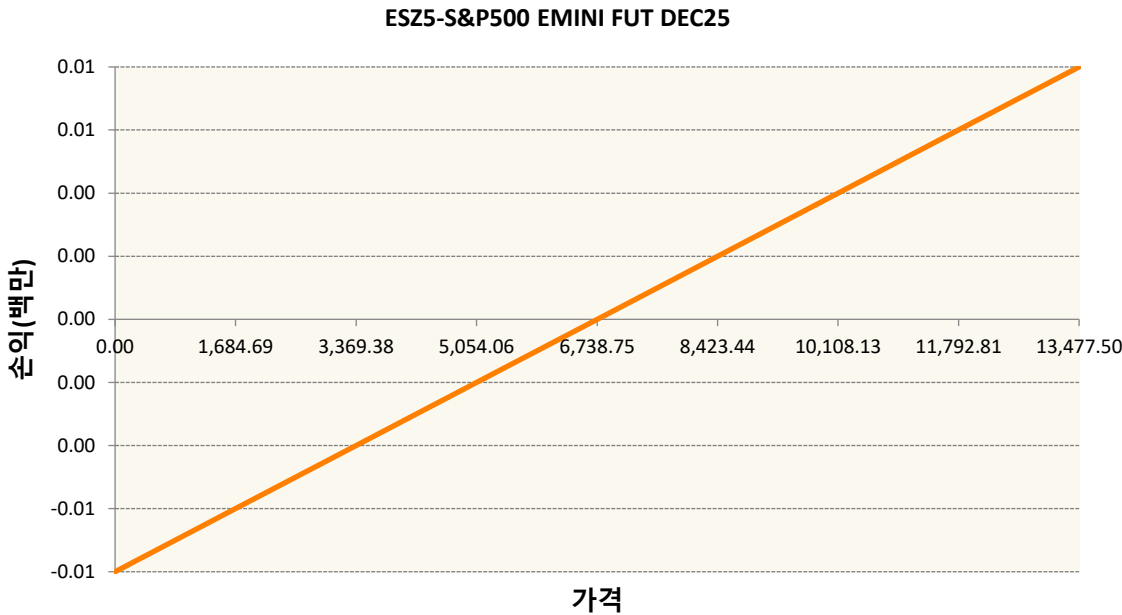
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,403	0	1,403	

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)

162

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

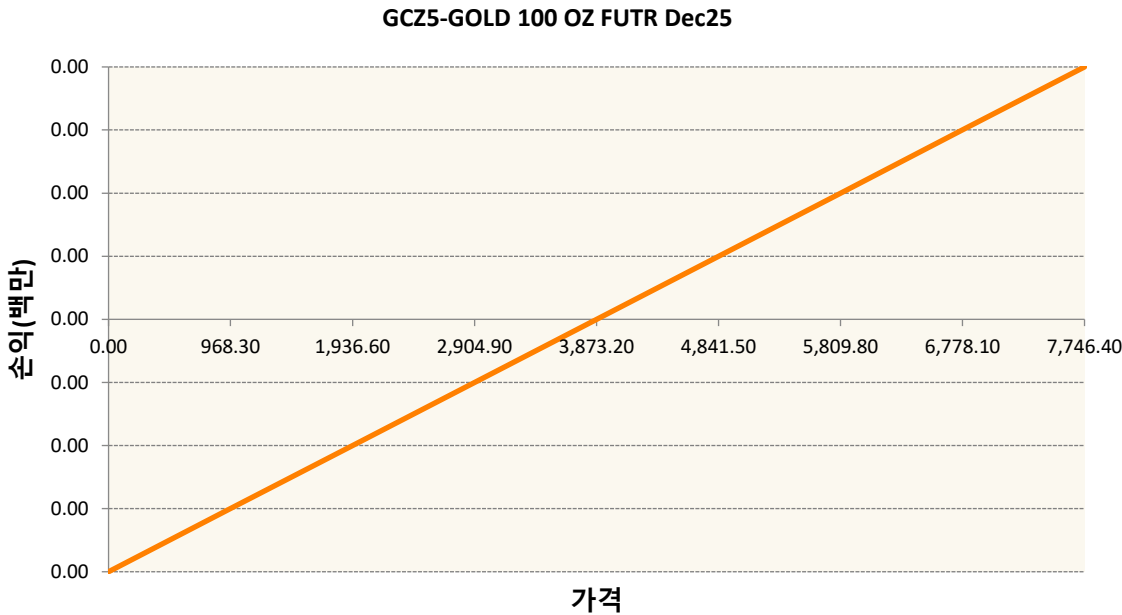
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	1,612	0	1,612	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 10/10/25 C350 EQUITY	1
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	129

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

(단위:백만원)

113

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

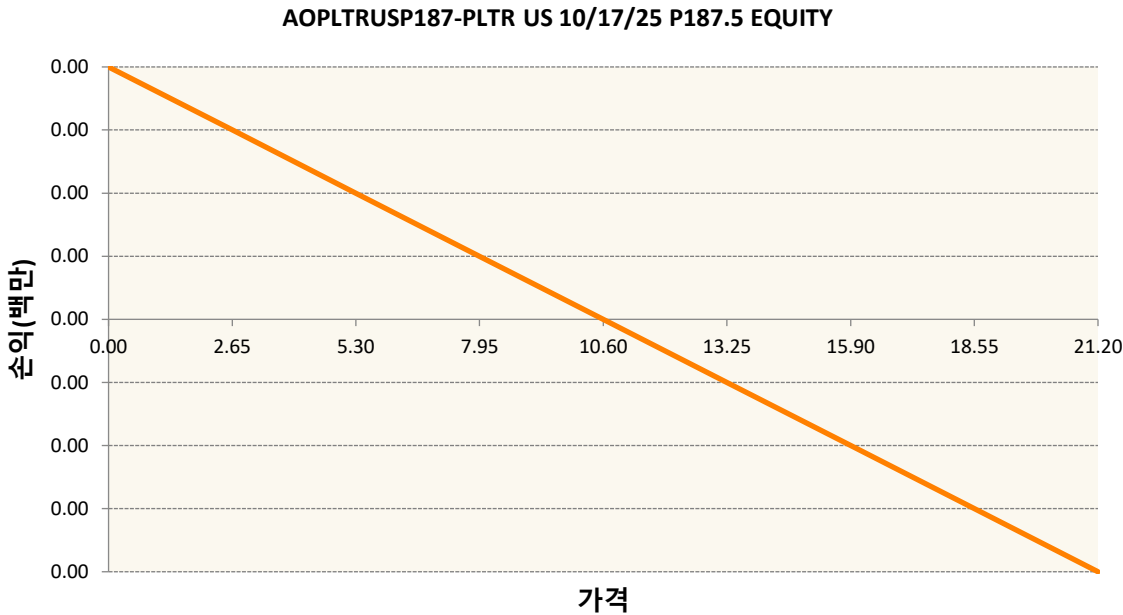
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	958	-958	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC PLTR US 10/17/25 C187.5 EQUITY	58
AOPLTRUSP PLTR US 10/17/25 P187.5 EQUITY	77

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

(단위:백만원)

541

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

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	2025-10-02
기준일	2025-10-01

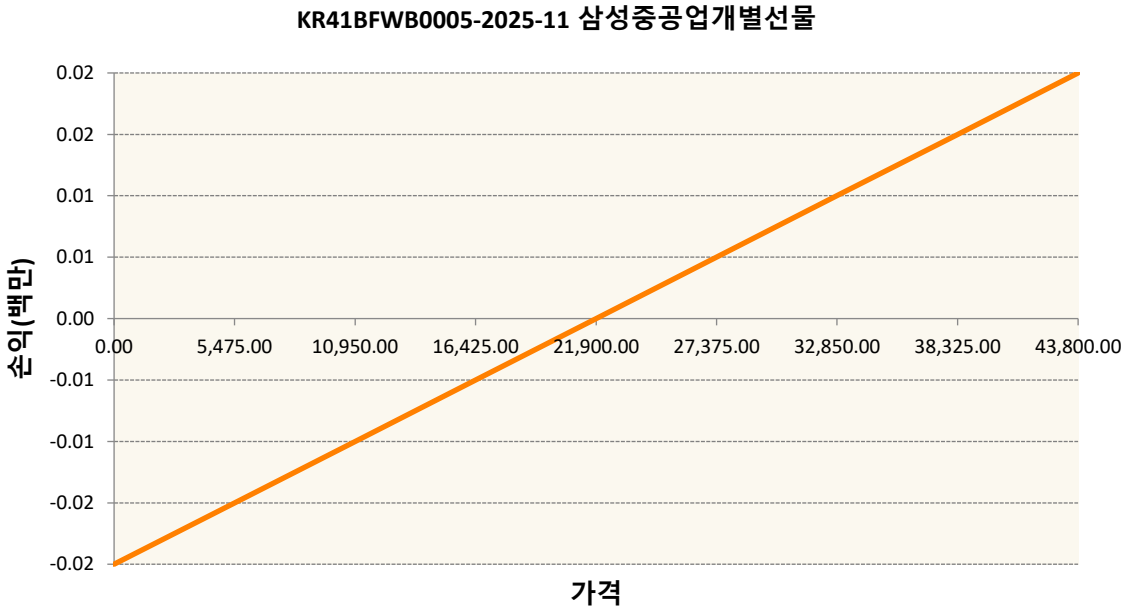
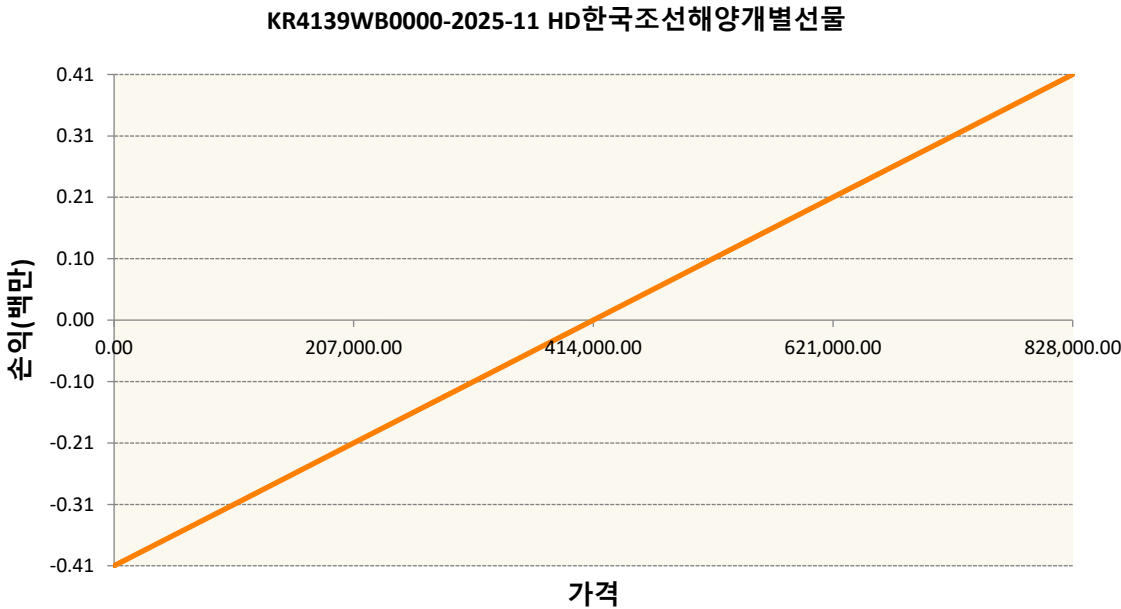
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

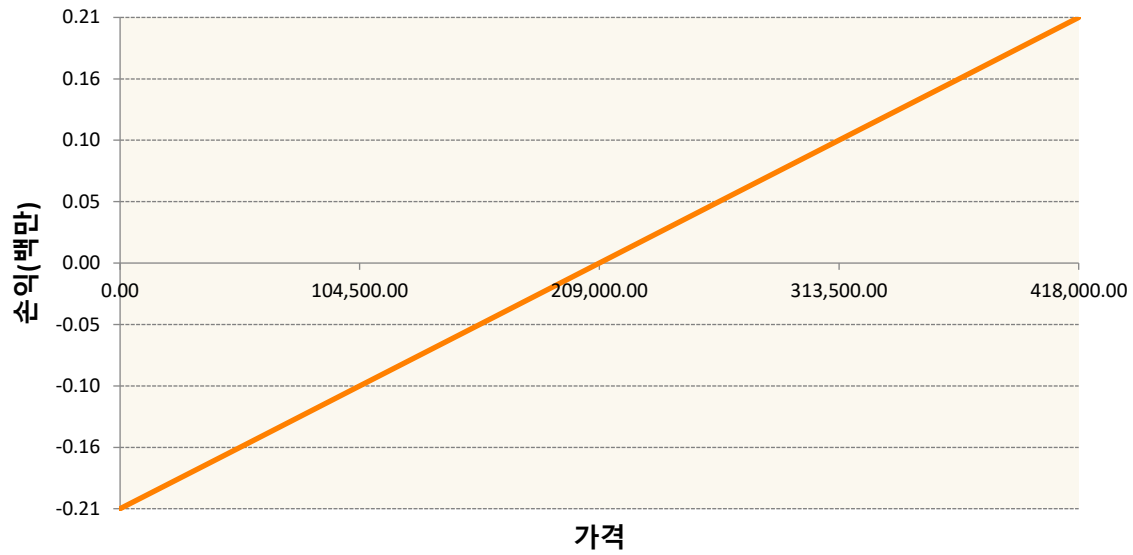
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	53,468	0	53,468	장내

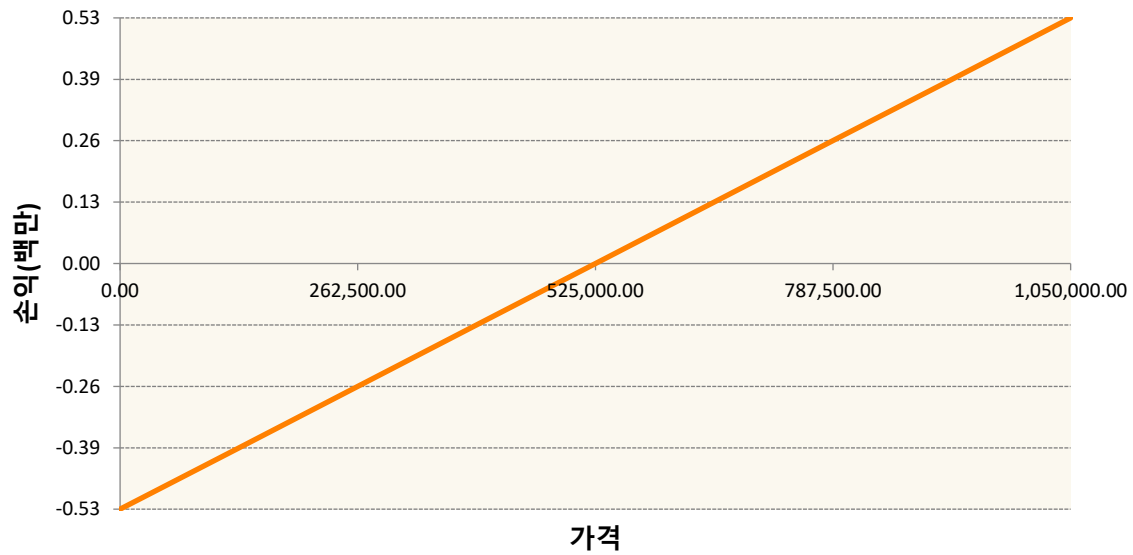
2. 만기시점의 손익구조



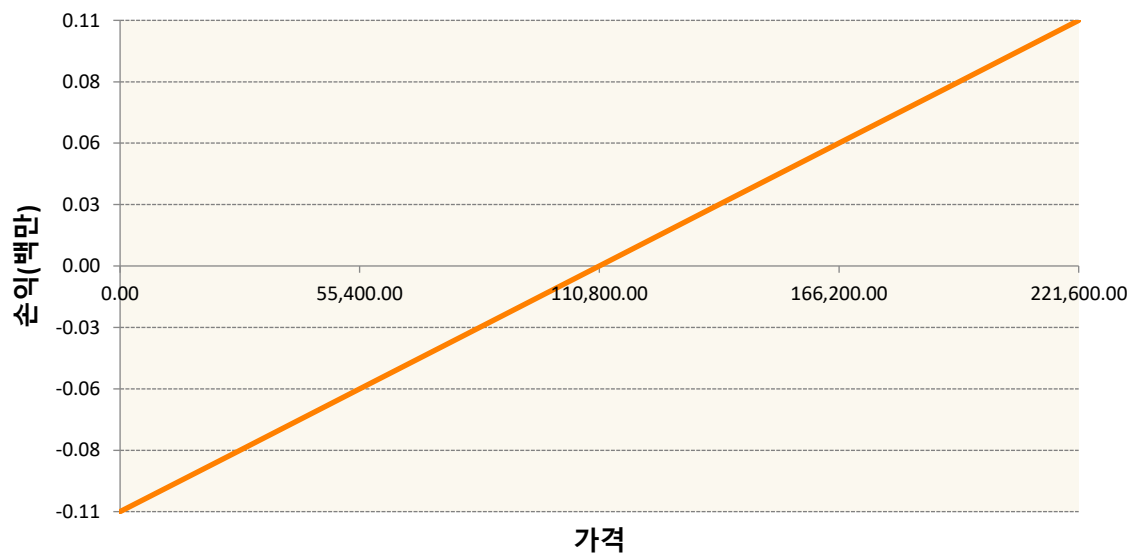
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139WB0000			2025-11 HD한국조선해양개별선물				1,197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197	-1,197
-5.33%	-798	-798	-798	-798	-798	-798	-798
-2.67%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	399	399	399	399	399	399	399
5.33%	798	798	798	798	798	798	798
8.00%	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197	1,197
KR41BFWB0005			2025-11 삼성중공업개별선물				1,082
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082
-5.33%	-722	-722	-722	-722	-722	-722	-722
-2.67%	-361	-361	-361	-361	-361	-361	-361
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	361	361	361	361	361	361	361
5.33%	722	722	722	722	722	722	722
8.00%	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082
KR41CDWB0006			2025-11 HD현대미포개별선물				472
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-5.33%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	472	472	472	472	472	472	472
KR41FDWB0003			2025-11 HD현대중공업개별선물				626
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-5.33%	-417	-417	-417	-417	-417	-417	-417
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	209	209	209	209	209	209	209
5.33%	417	417	417	417	417	417	417
8.00%	626	626	626	626	626	626	626
KR41FVWB0001			2025-11 한화오션개별선물				899
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-899	-899	-899	-899	-899	-899	-899
-5.33%	-600	-600	-600	-600	-600	-600	-600
-2.67%	-300	-300	-300	-300	-300	-300	-300
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	300	300	300	300	300	300	300
5.33%	600	600	600	600	600	600	600
8.00%	899	899	899	899	899	899	899

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

(단위:백만원)

2,331

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

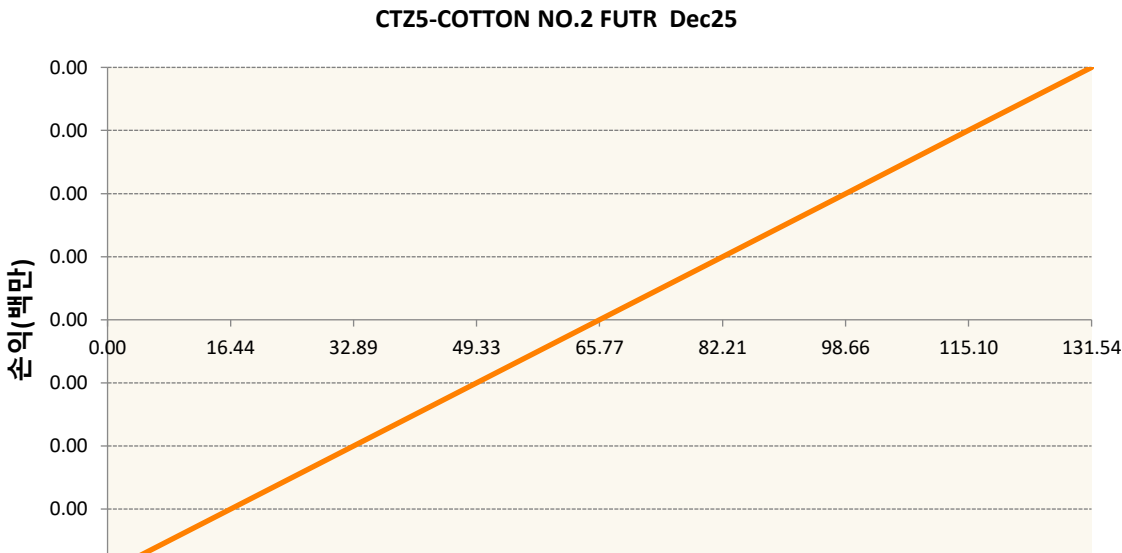
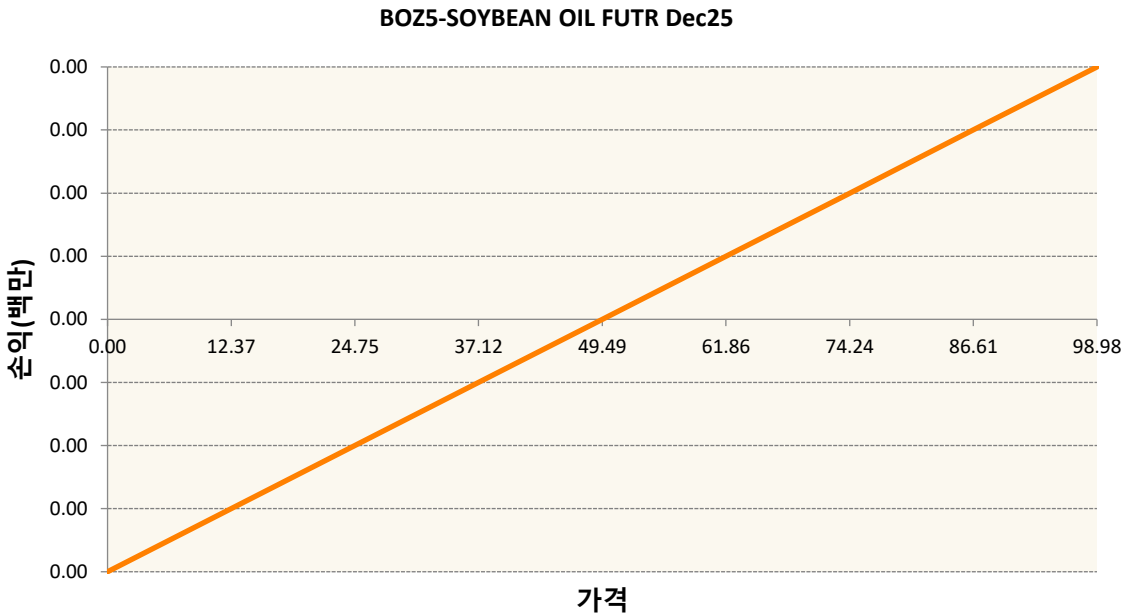
포커스농산물모(채권-파생형)

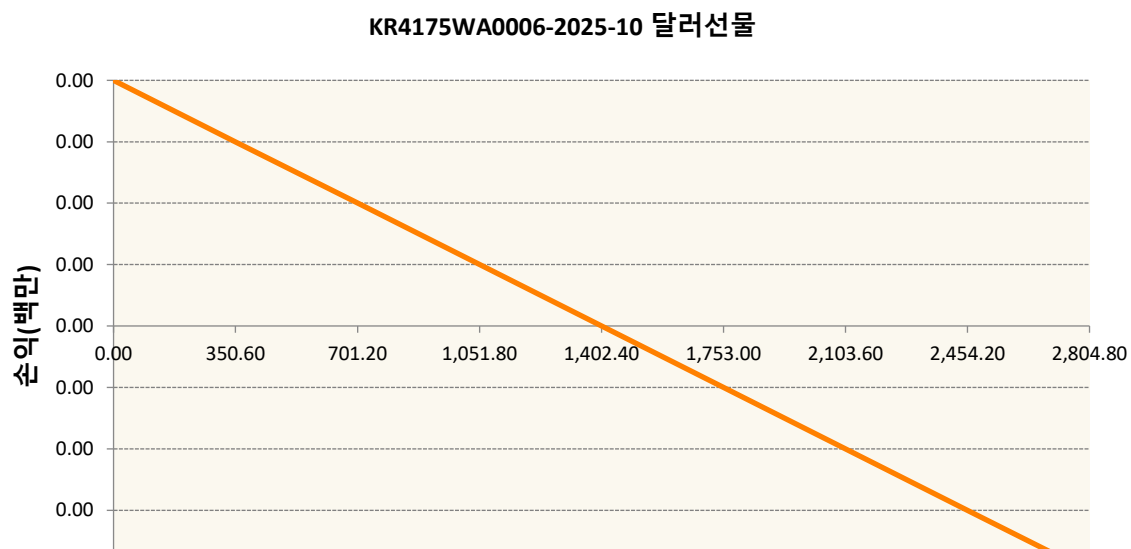
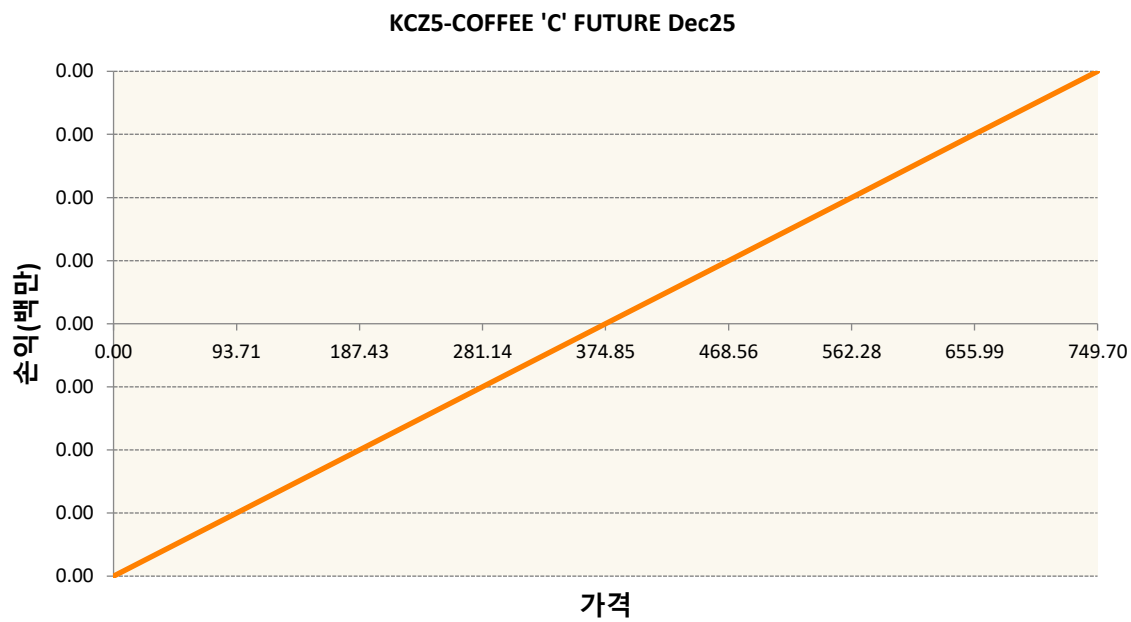
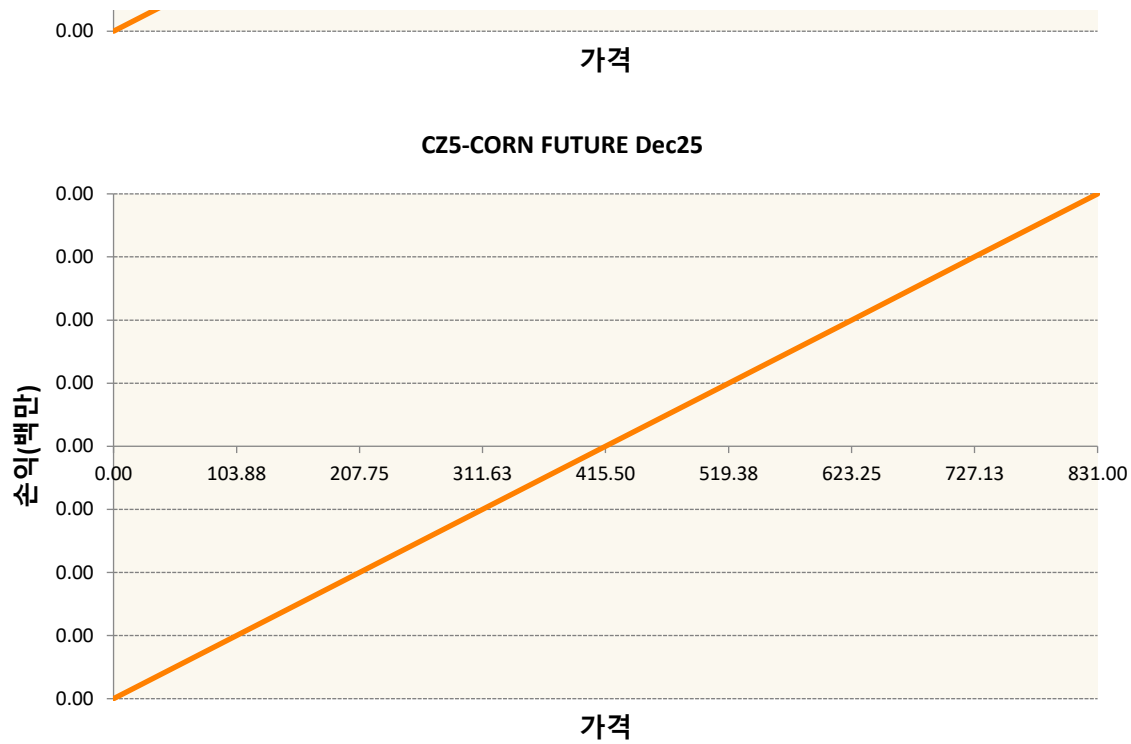
1. 계약금액

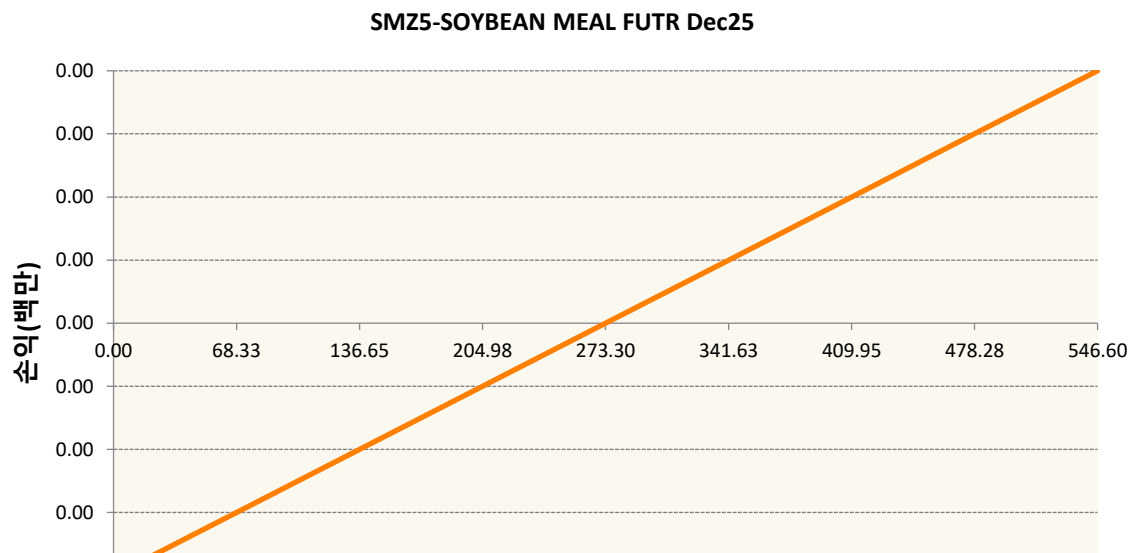
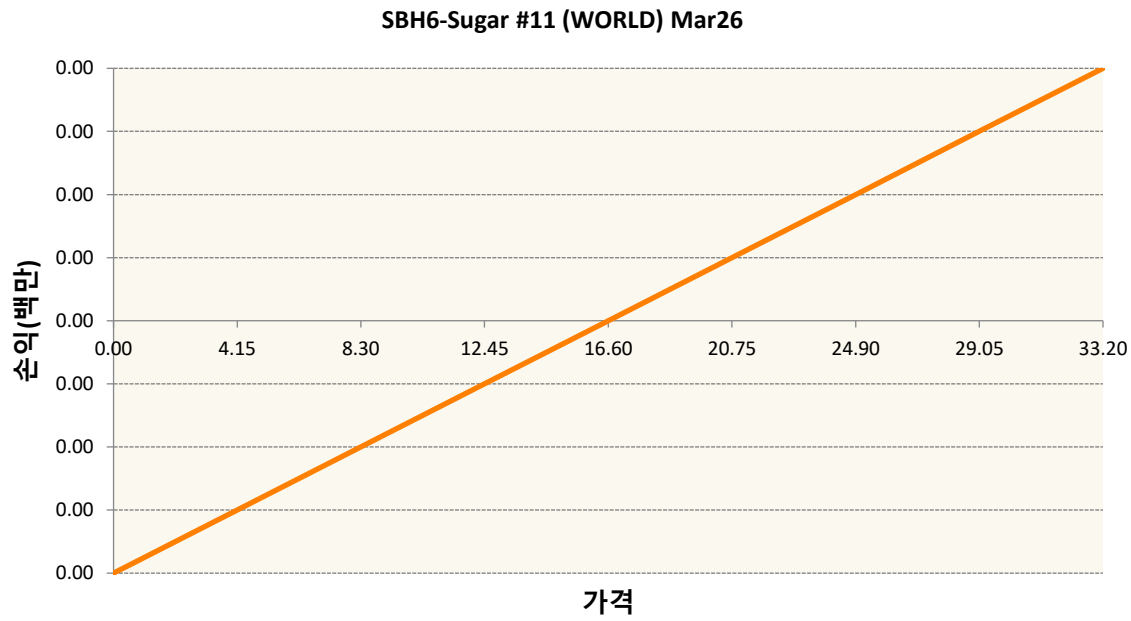
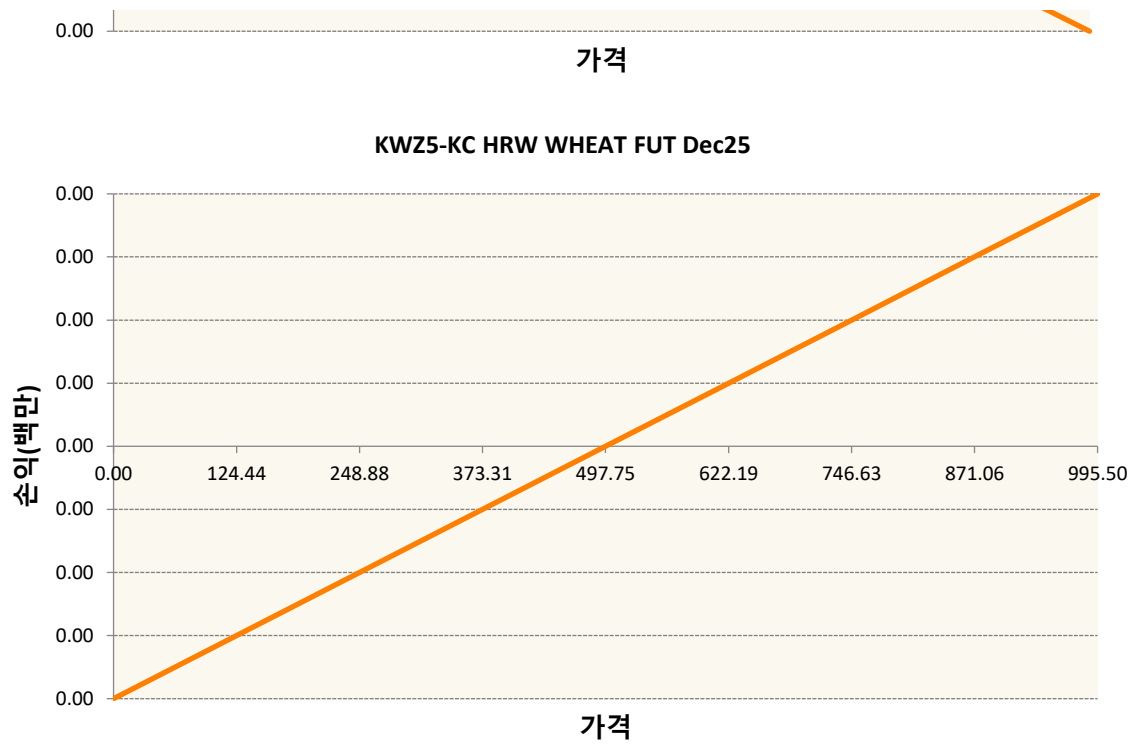
(단위:USD 백만)

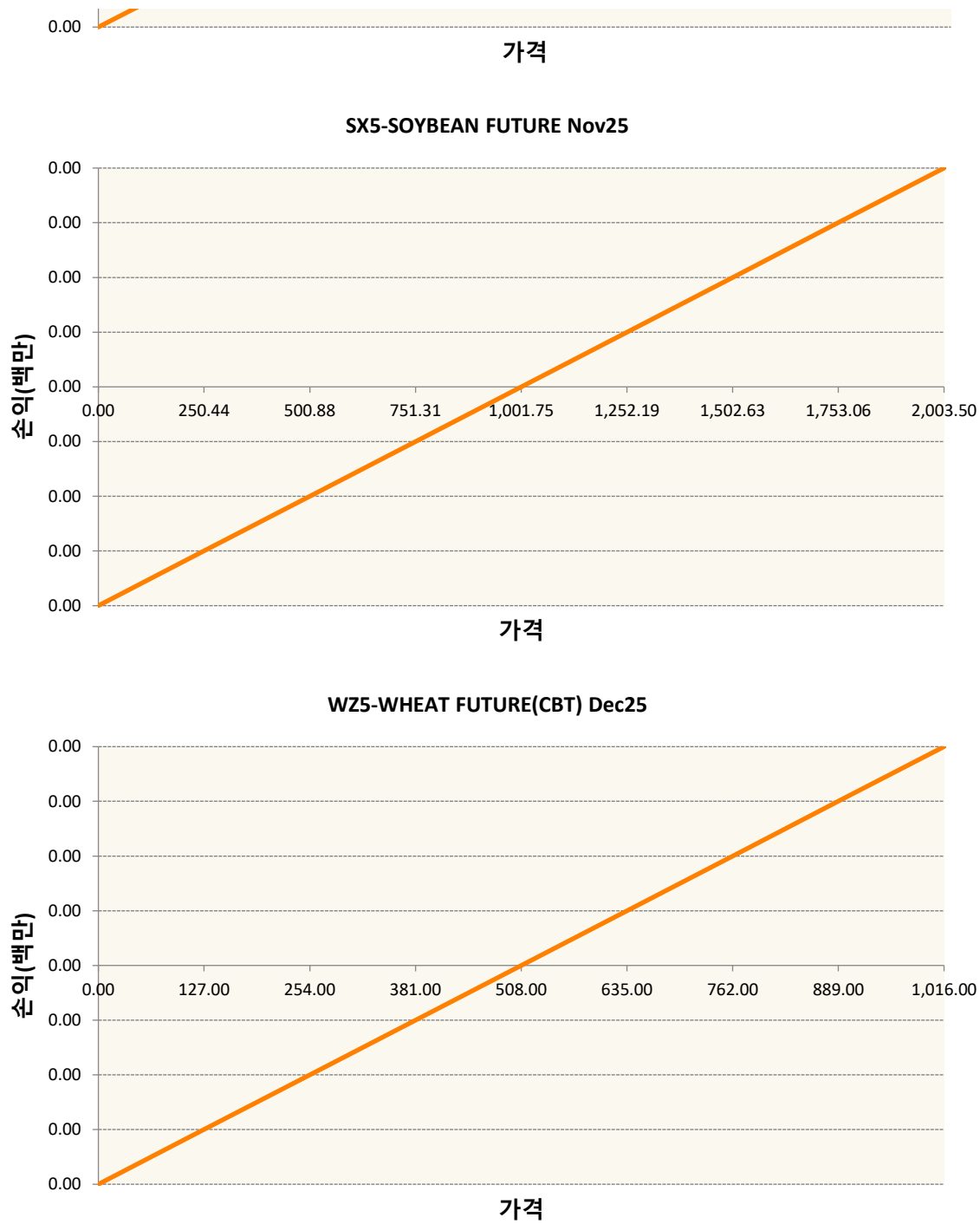
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	42	0	42	장내
누계	실물자산	선물	1,138	0	1,138	
누계	유가증권	선물	2,091	0	2,091	
누계	통화	선물	0	280	-280	장내

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	2025-10-02
기준일	2025-10-01

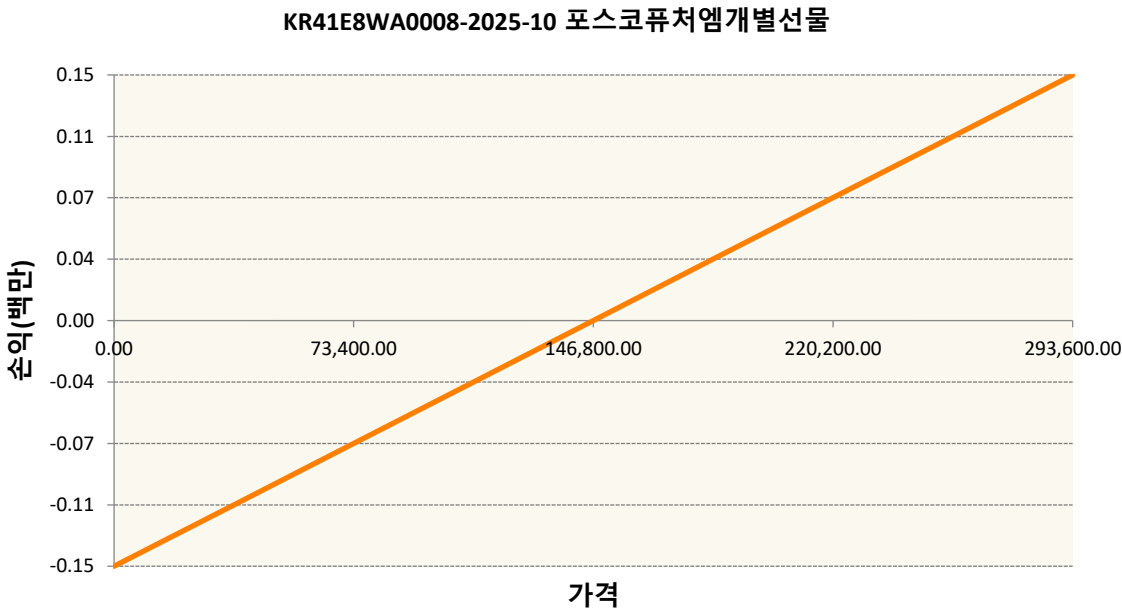
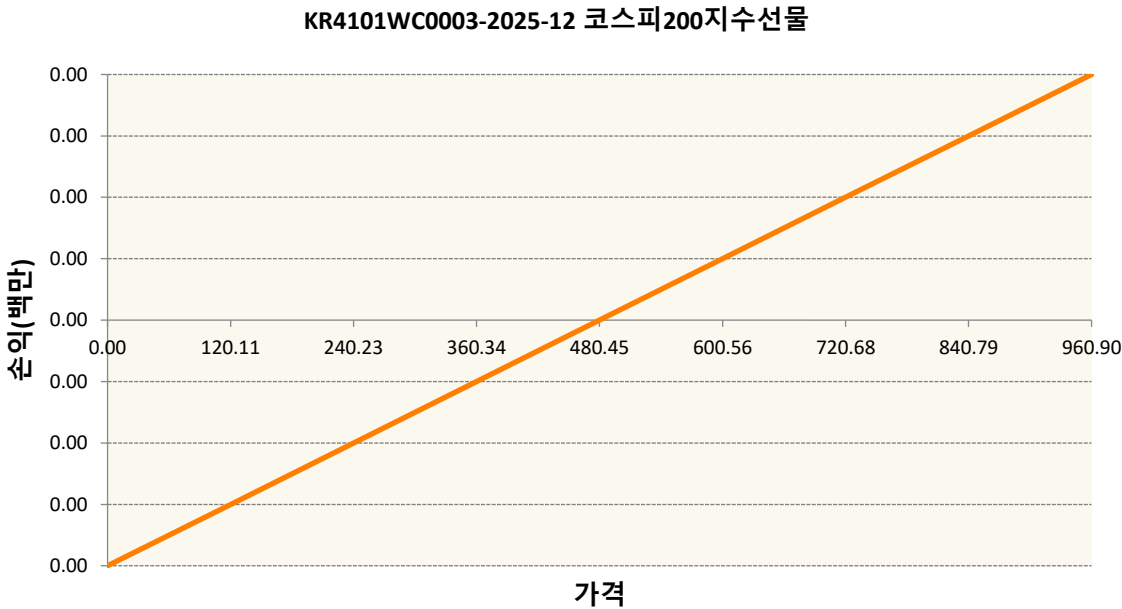
스마트인덱스모

1. 계약금액

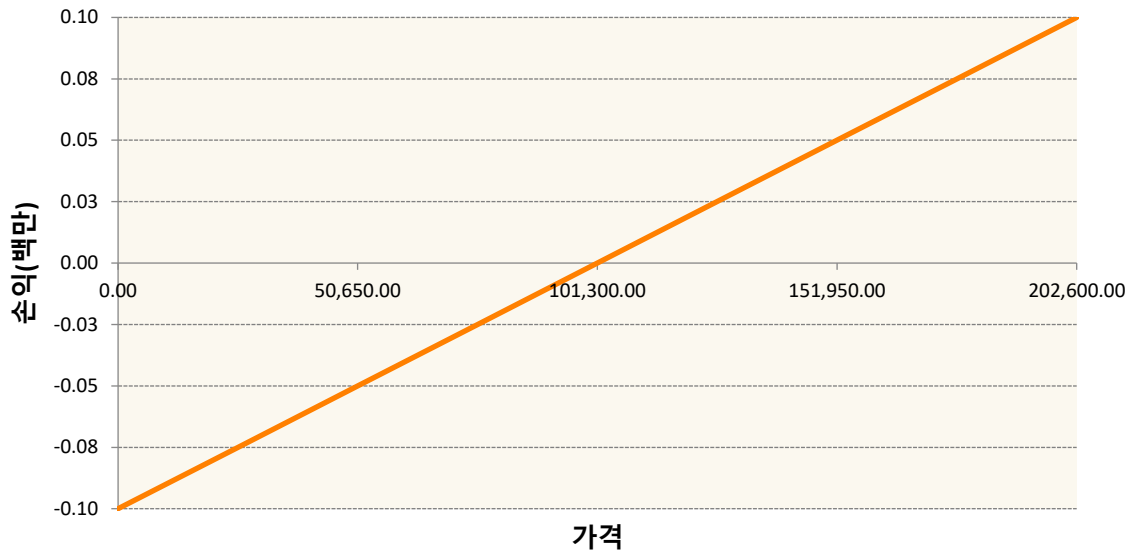
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	144	0	144	장내
누계	유가증권	선물	1,424	0	1,424	장내

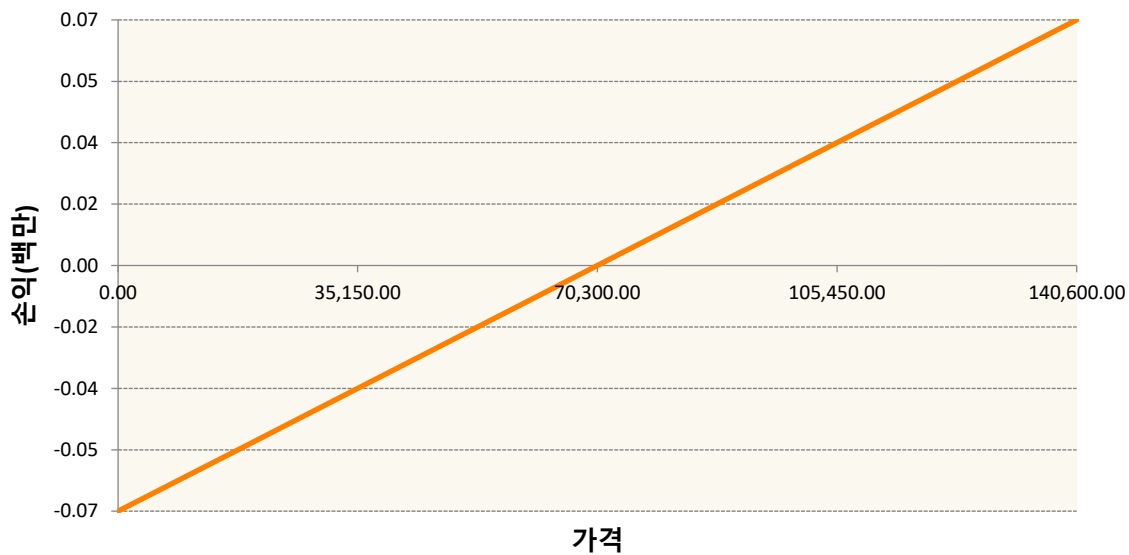
2. 만기시점의 손익구조



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물	106
KR41E8WA01 2025-10 포스코퓨처엠개별선물	4
KR41EJWB00 2025-11 SKC개별선물	2
KR41FMWB00 2025-11 엘앤에프개별선물	2

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

(단위:백만원)

12

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

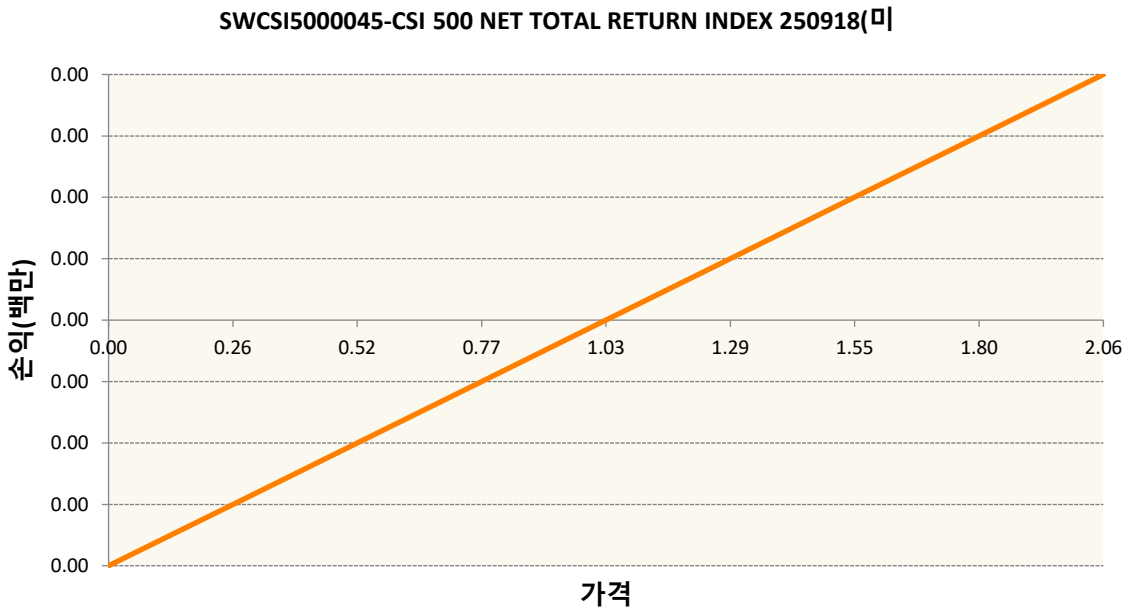
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,841	0	4,841	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미	388
--	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

615

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

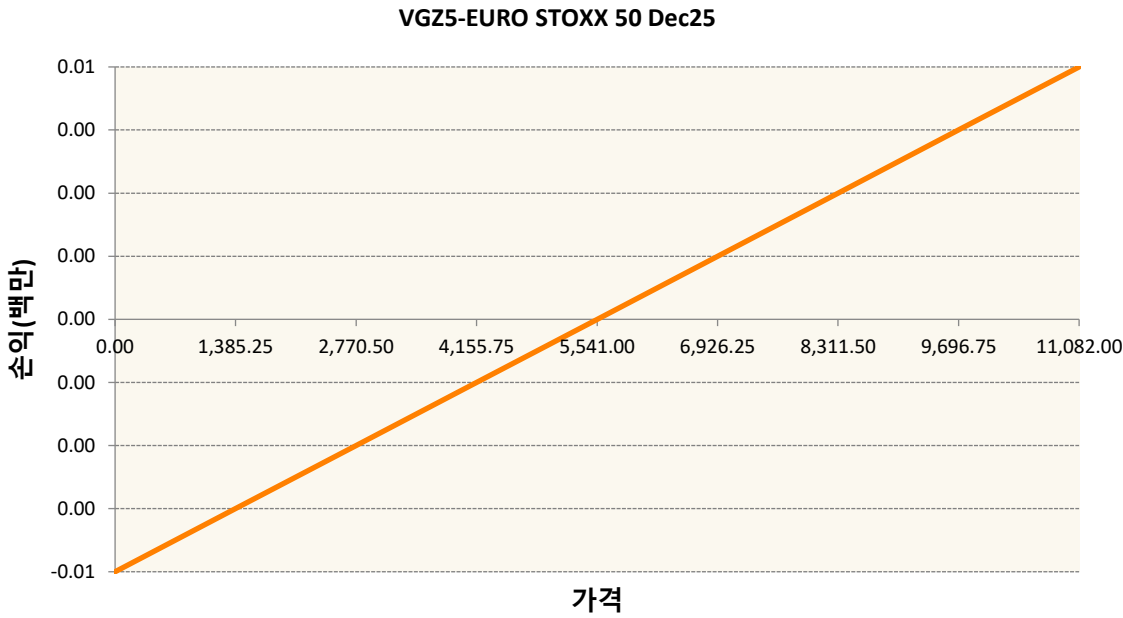
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	726	0	726	

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	2025-10-02
기준일	2025-10-01

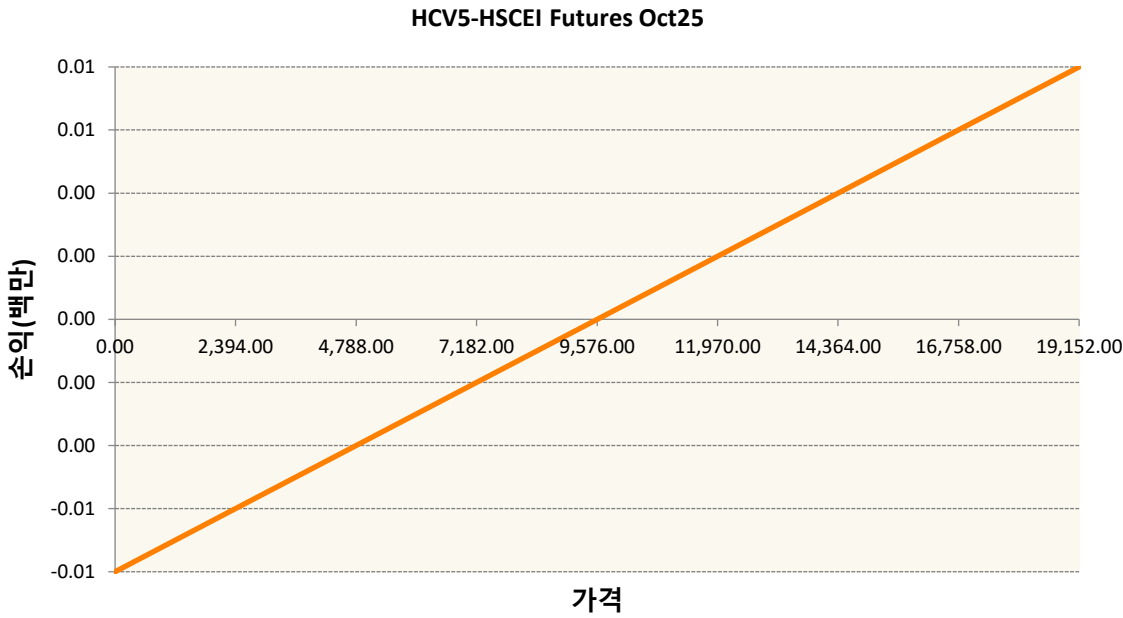
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,173	0	2,173	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV5	HSCEI Futures Oct25	174
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

246

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

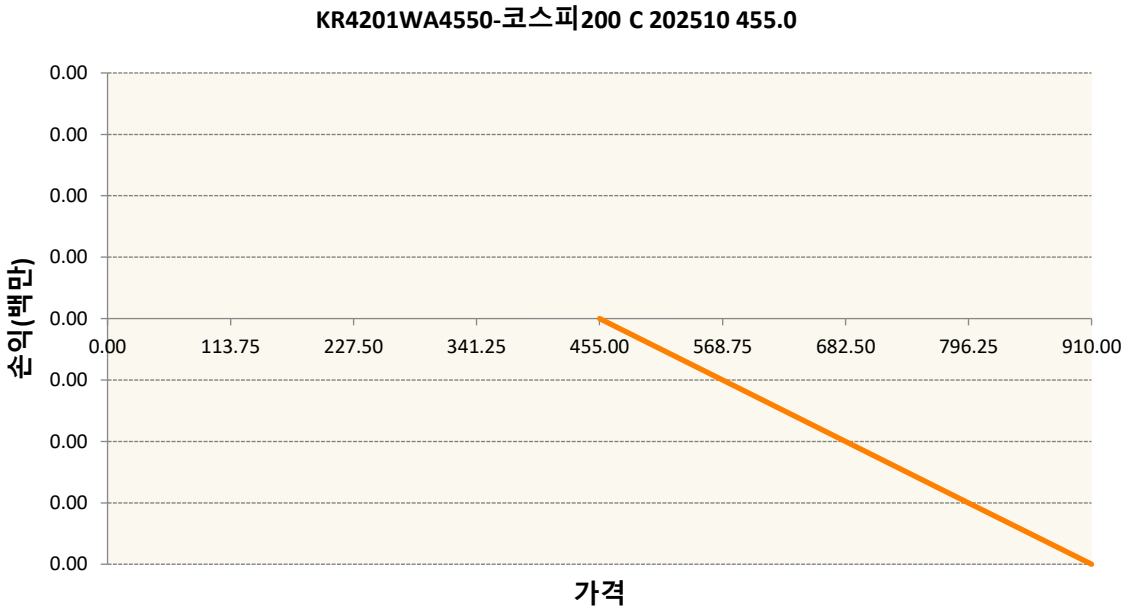
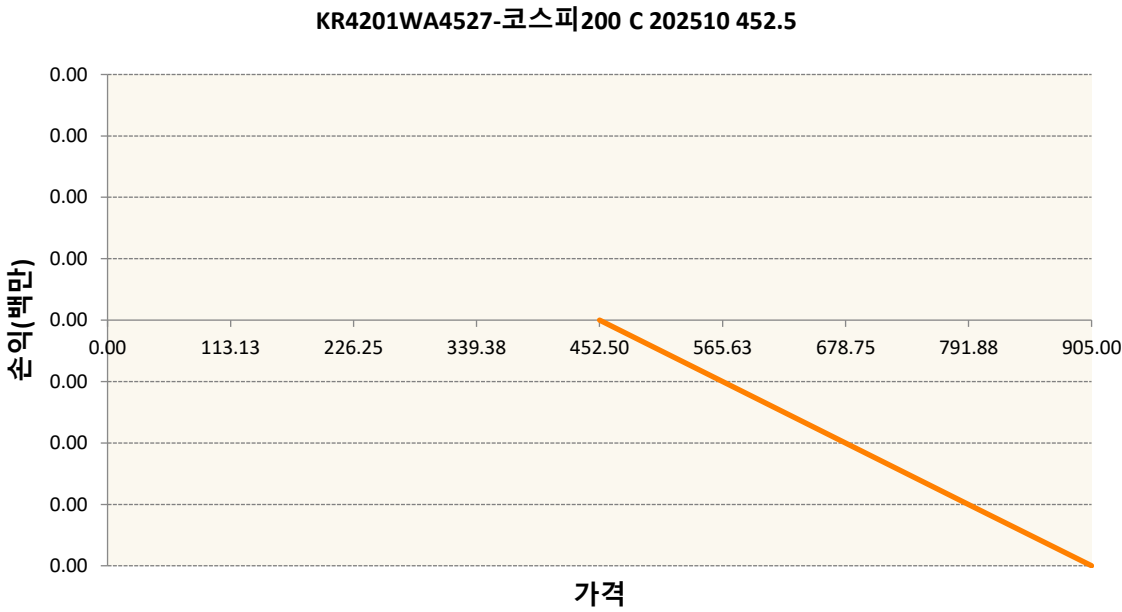
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

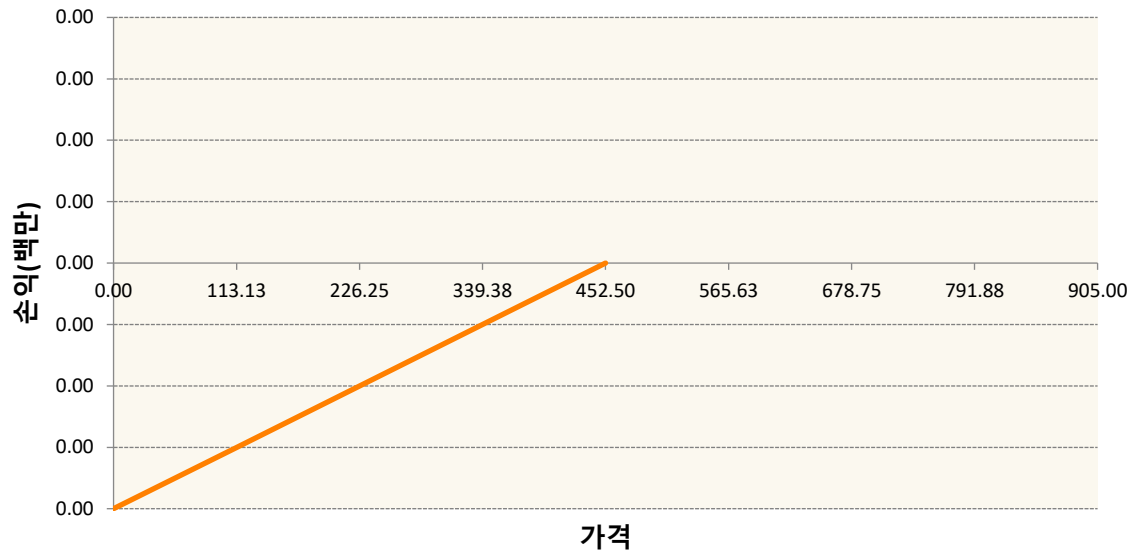
(단위:백만원)

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

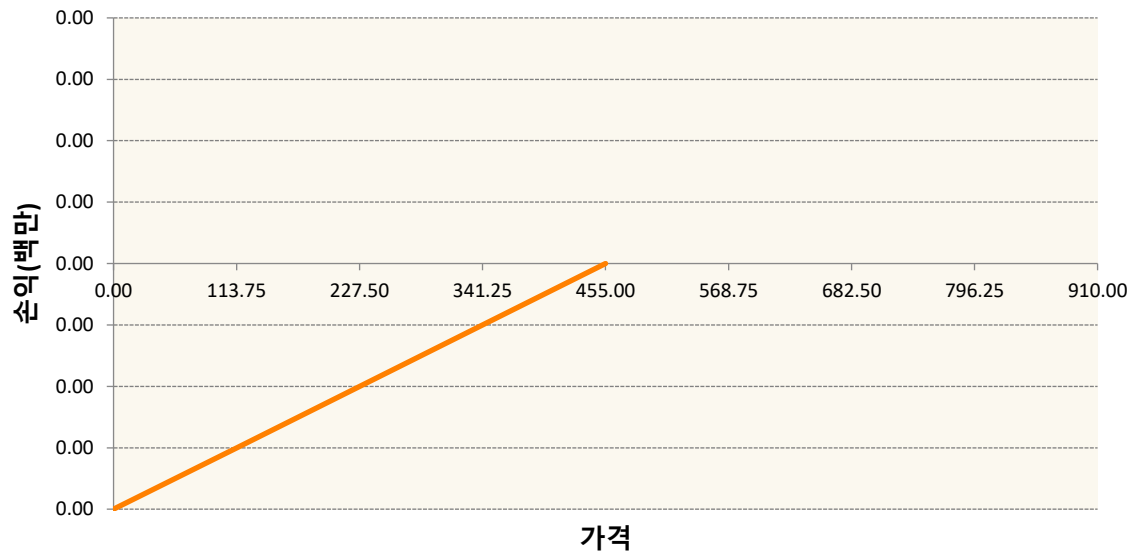
2. 만기시점의 손익구조



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 2025-10-02

기준일 2025-10-01

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	2025-10-02
기준일	2025-10-01

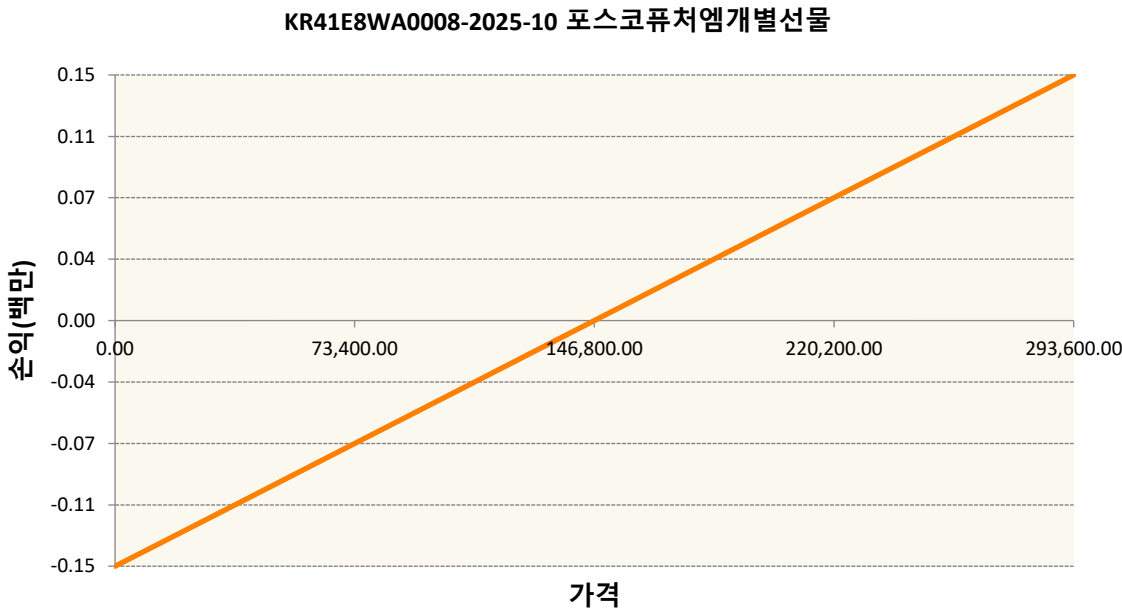
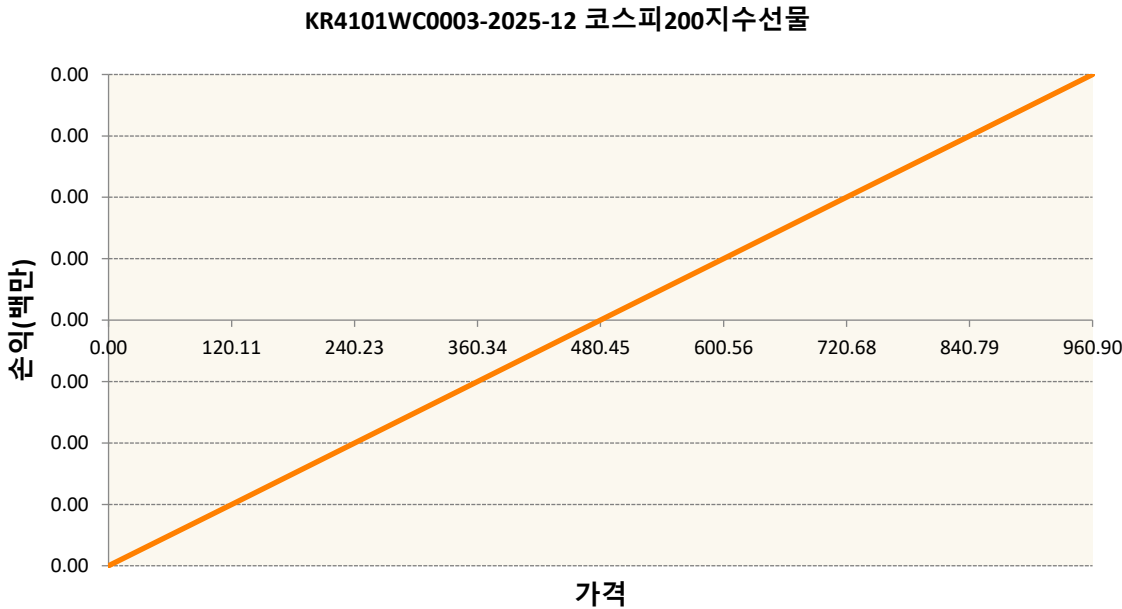
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

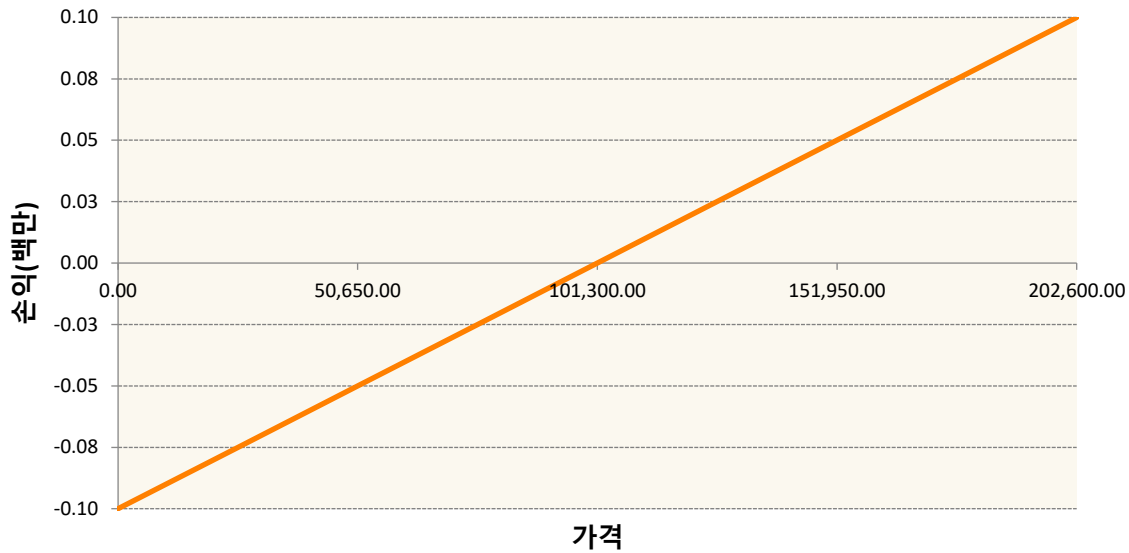
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10	0	10	장내
누계	유가증권	선물	405	0	405	장내

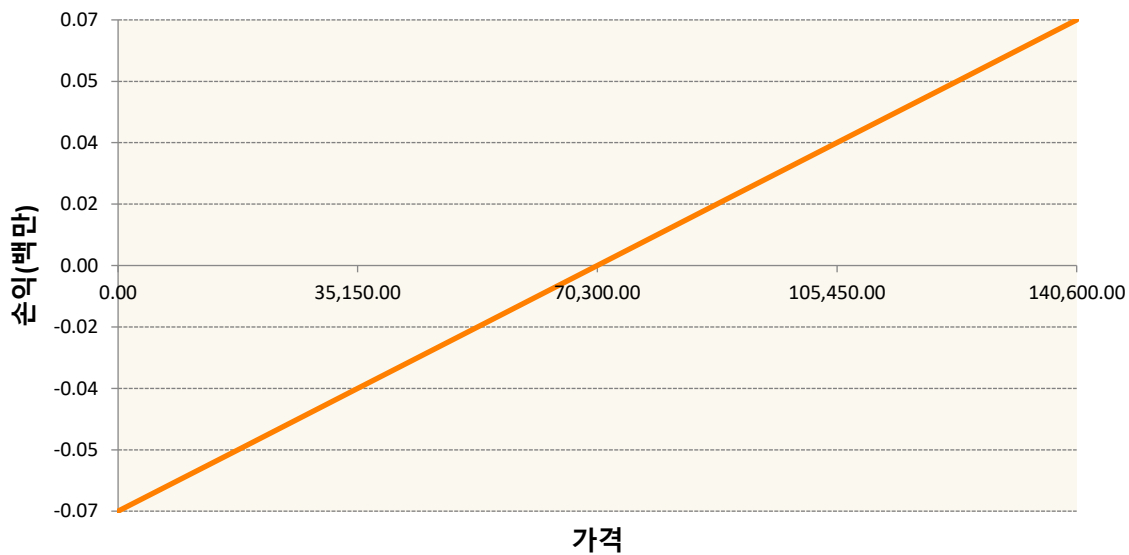
2. 만기시점의 손익구조



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물	29
KR41E8WA01 2025-10 포스코퓨처엠개별선물	2
KR41EJWB00 2025-11 SKC개별선물	1
KR41FMWB00 2025-11 엘앤에프개별선물	1

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

(단위:백만원)

5

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

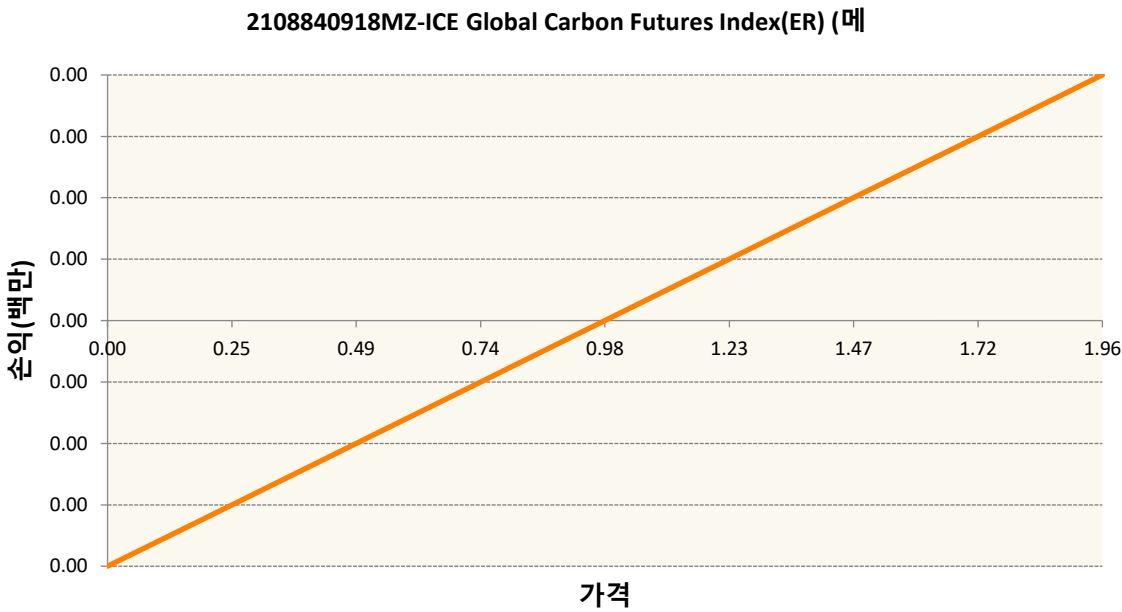
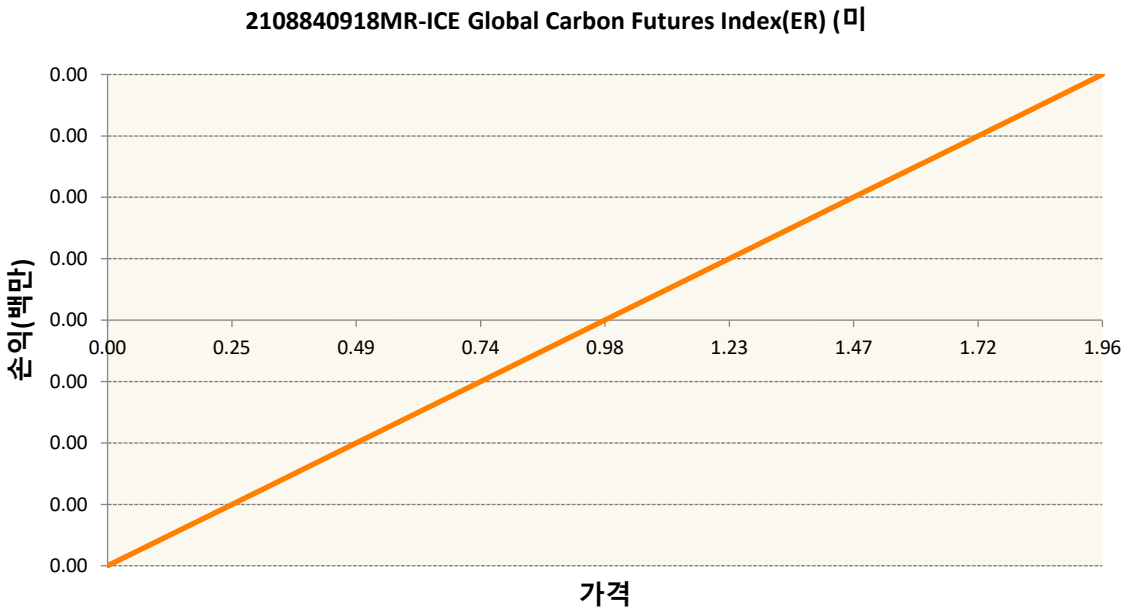
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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		637
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	749

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

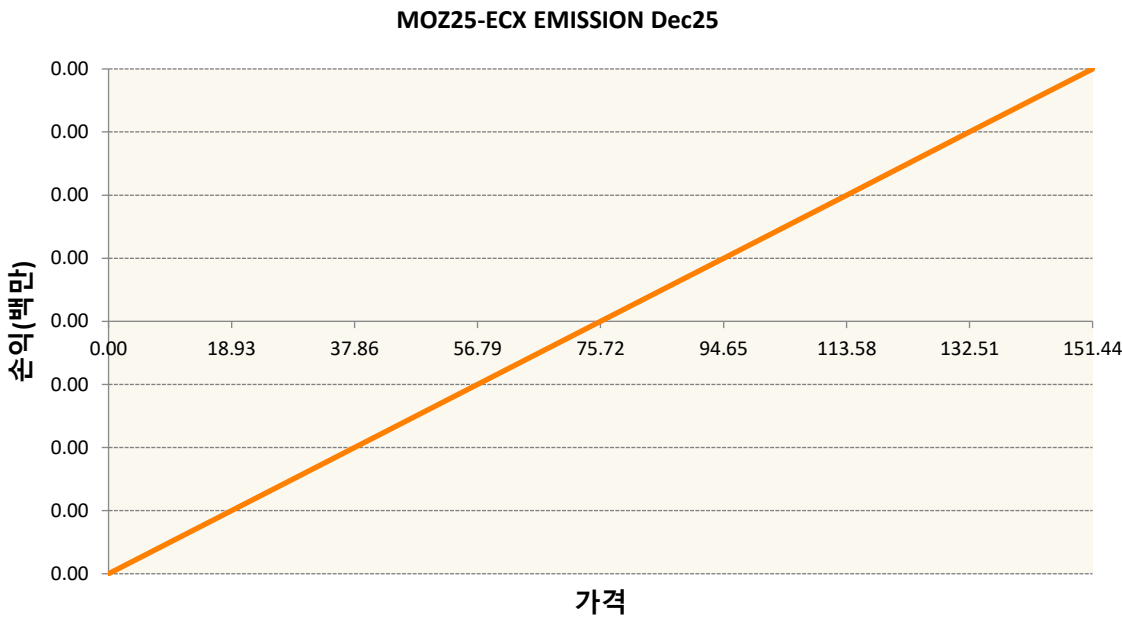
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,670	0	5,670	
누계	지수	스왑	-8	0	-8	장외
누계	통화	선도	0	2,279	-2,279	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

738

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

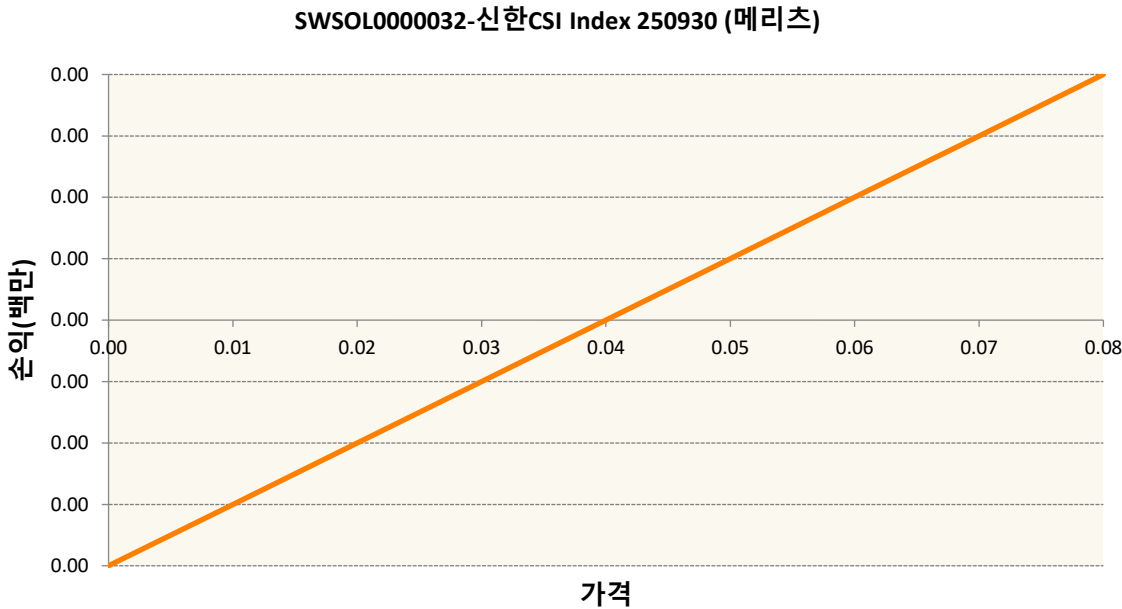
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	1,012	0	1,012	장외
누계	지수	스왑	2,596	0	2,596	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	4
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	3
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	3
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	7

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

(단위:백만원)

29

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

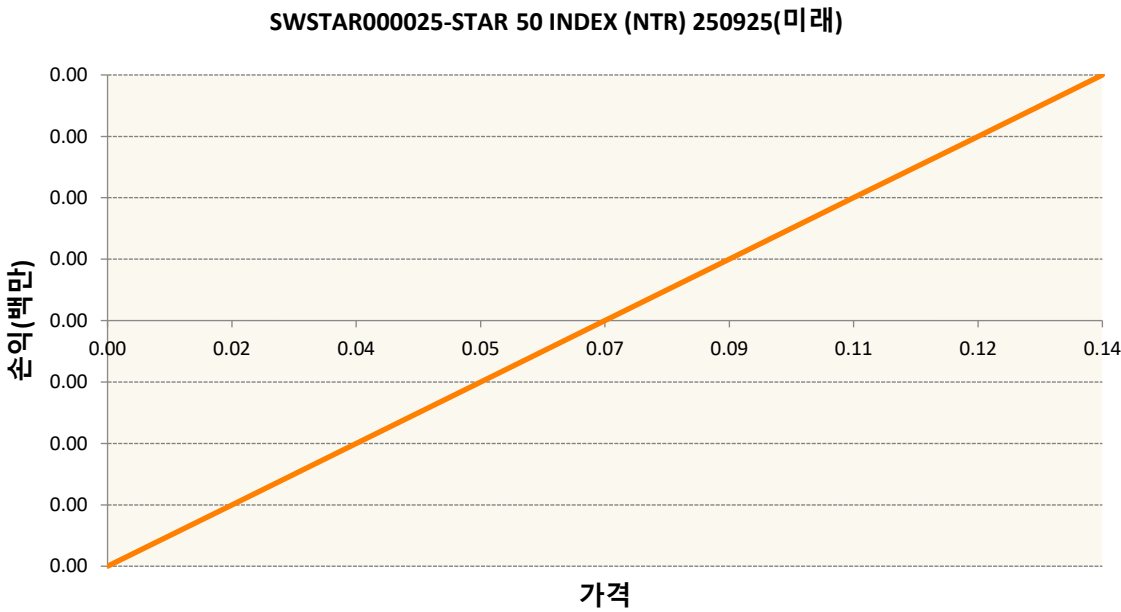
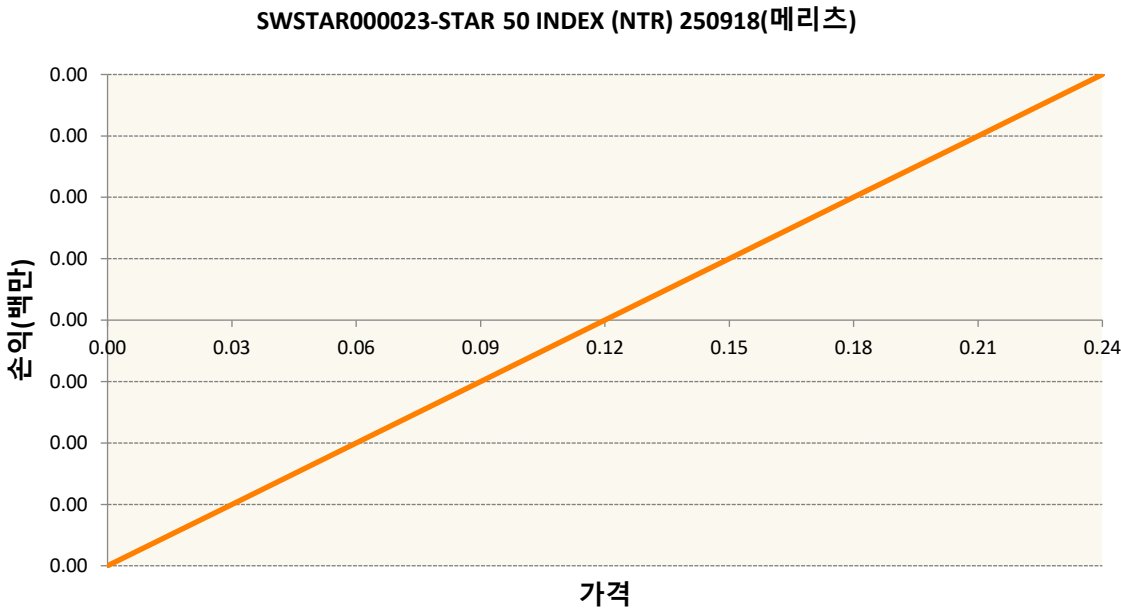
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	5,198	0	5,198	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		26
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		8
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		95
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		30

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	281

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

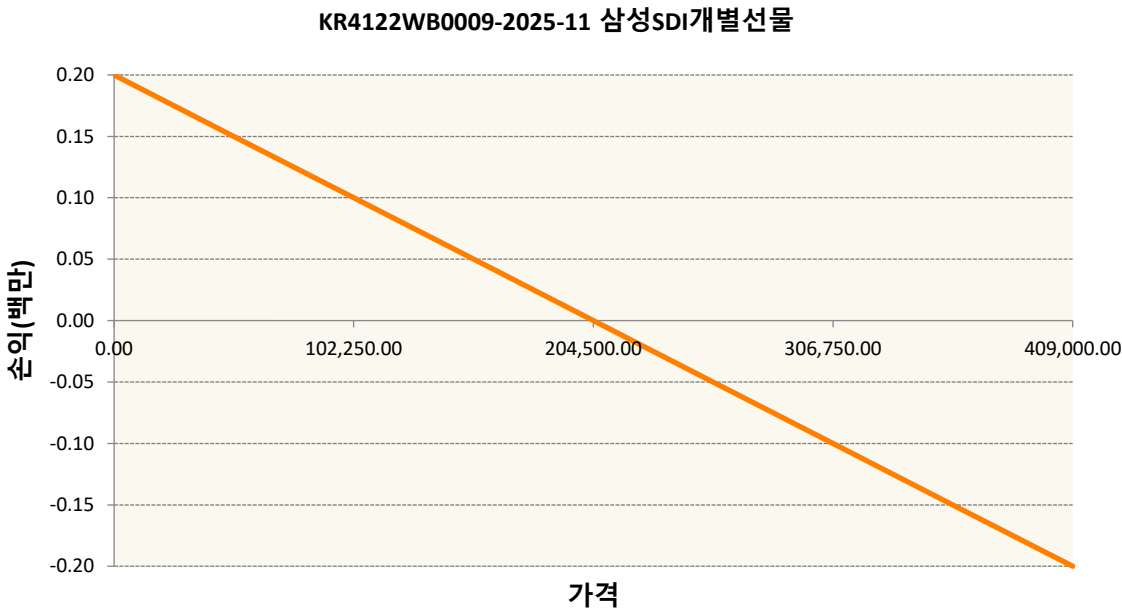
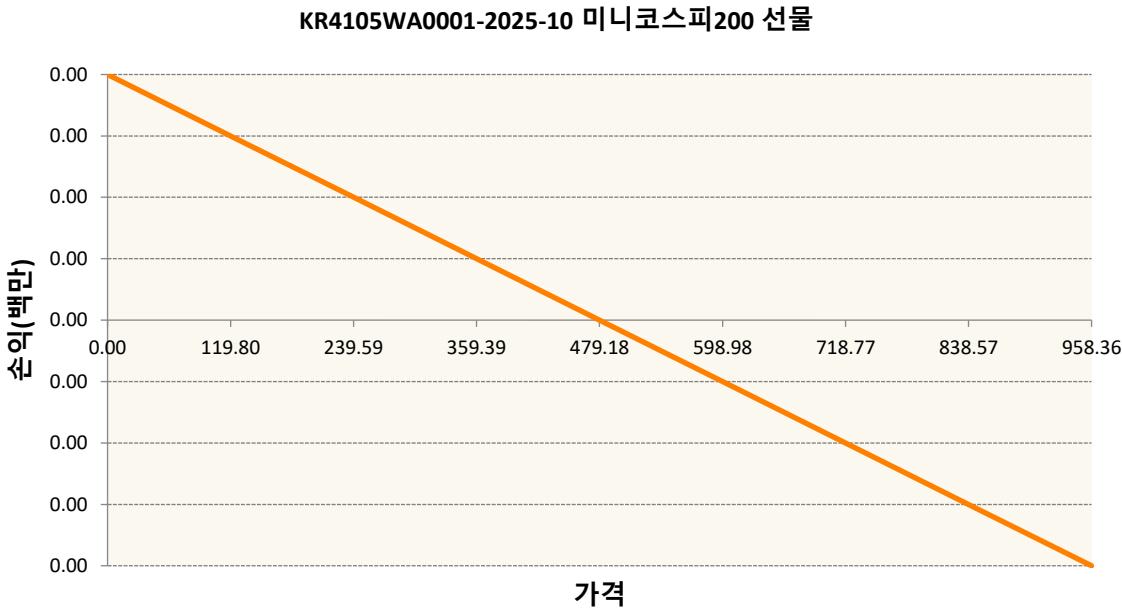
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

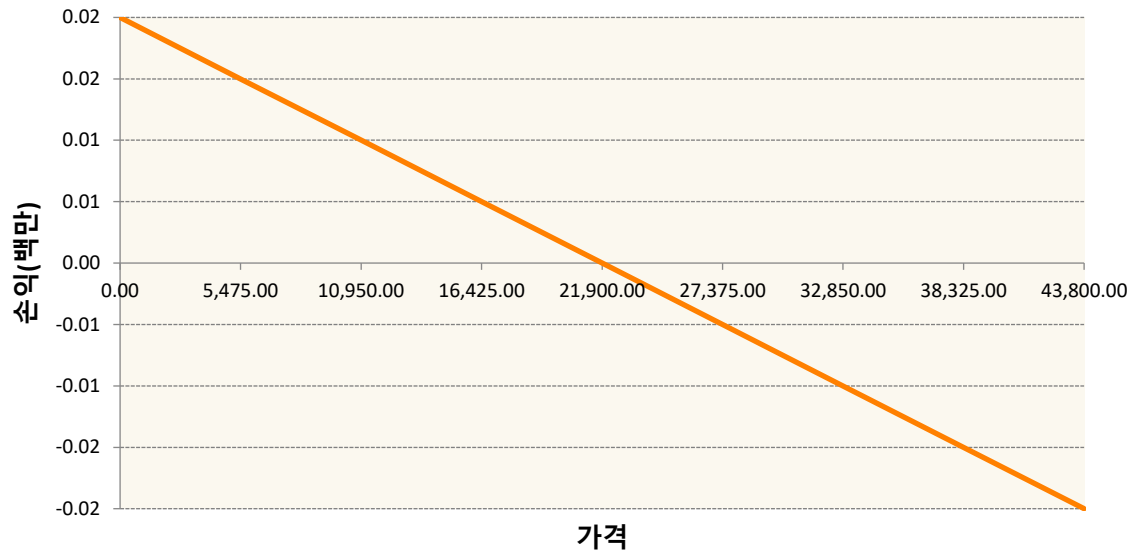
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	4	-4	장내
누계	유가증권	선물	21	983	-962	장내

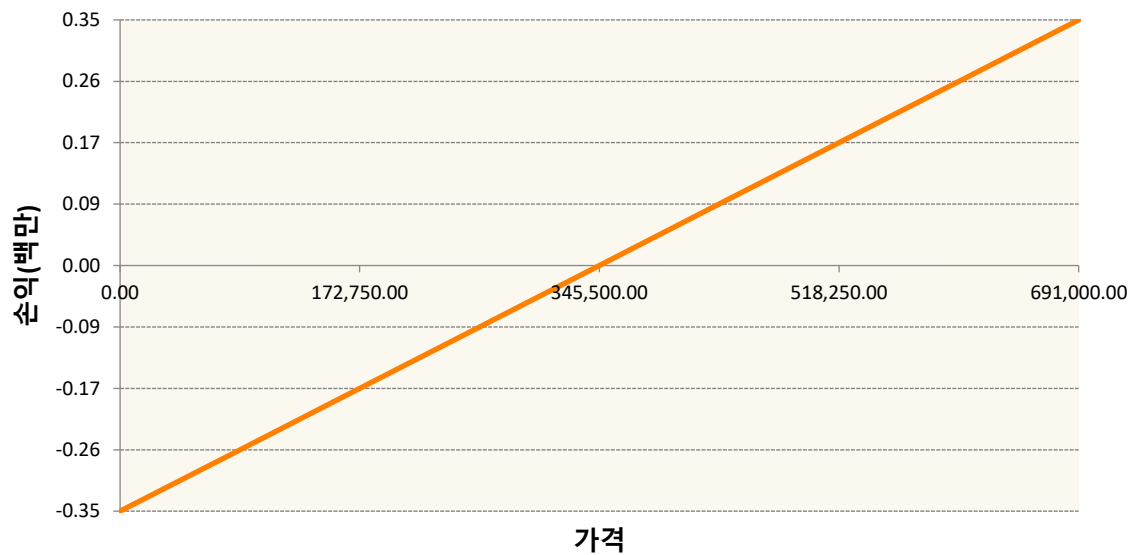
2. 만기시점의 손익구조



KR41BFWB0005-2025-11 삼성중공업개별선물



KR41F5WB0007-2025-11 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105WA0(2025-10 미니코스피200 선물	15
KR4122WB0(2025-11 삼성SDI개별선물	2
KR41BFWB0(2025-11 삼성중공업개별선물	0.35
KR41F5WB0(2025-11 LG에너지솔루션개별선물	2

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

(단위:백만원)

4

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

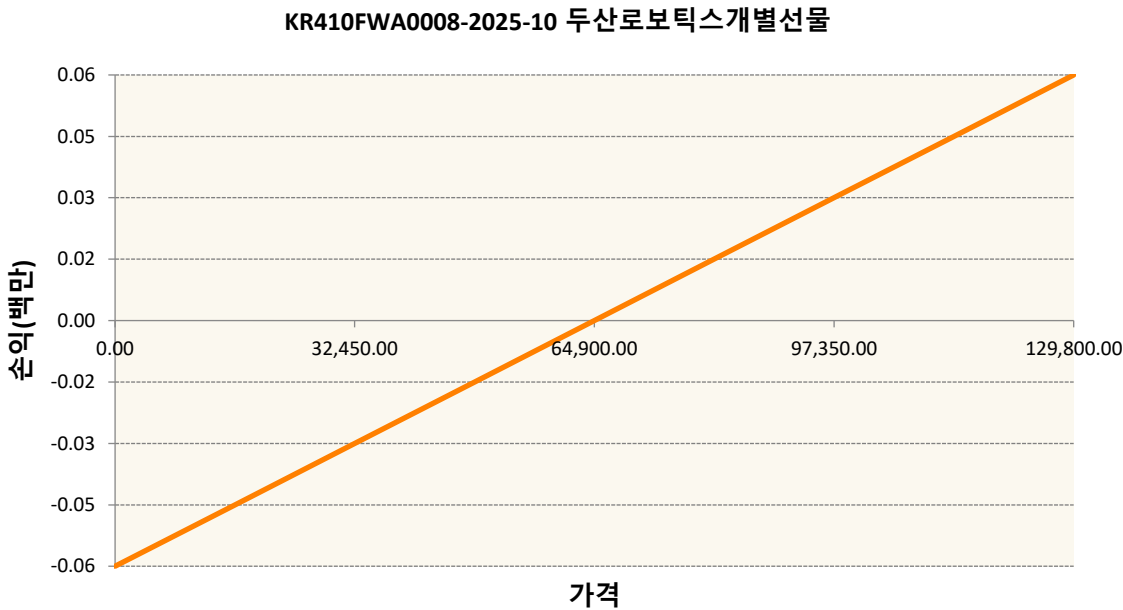
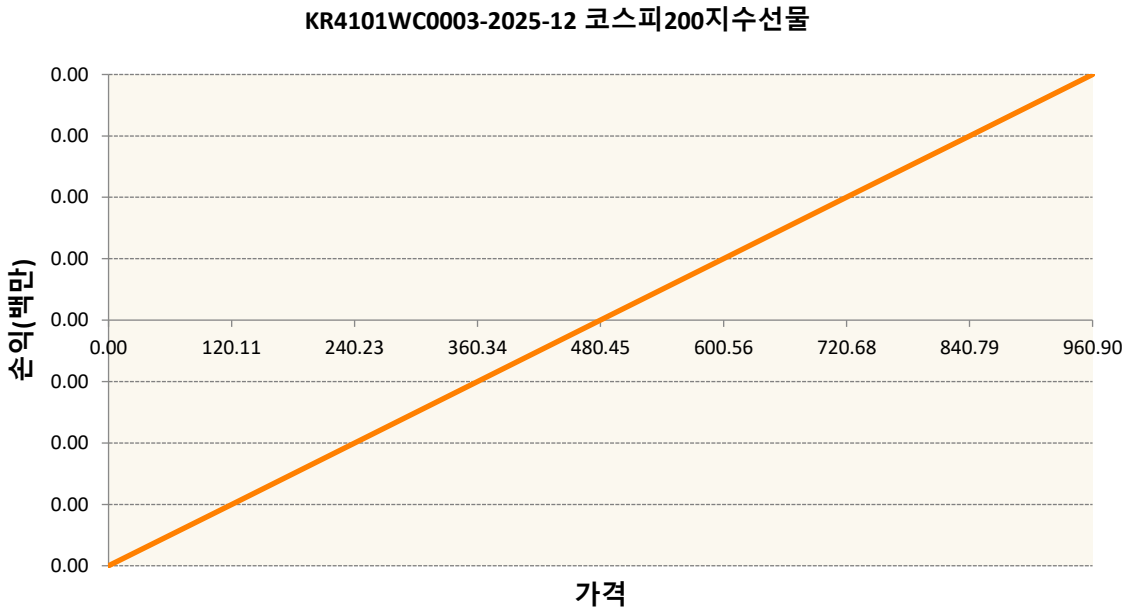
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

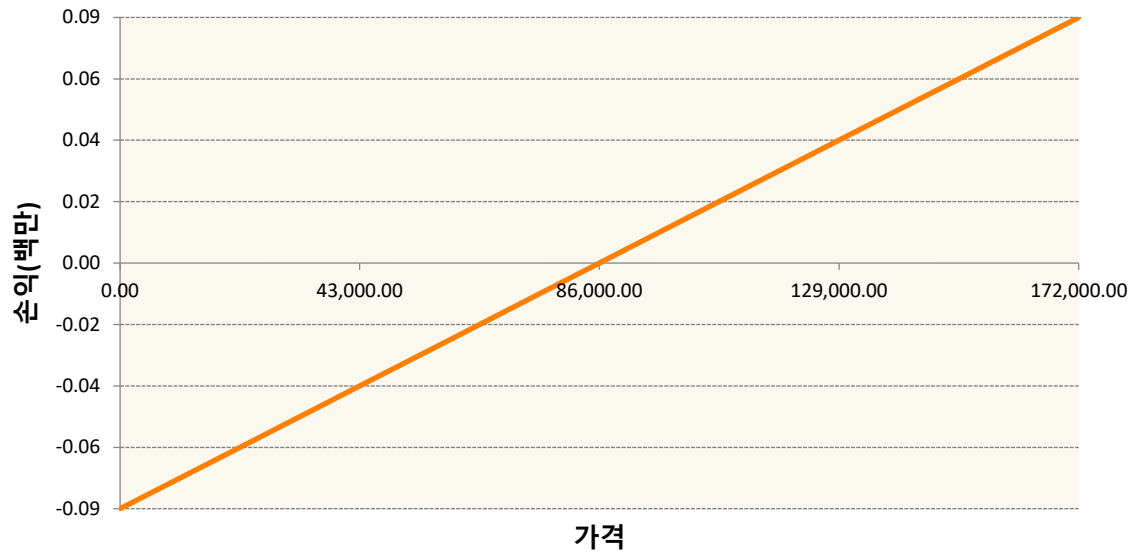
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	689	360	329	장내
누계	유가증권	선물	11,018	1,258	9,760	장내

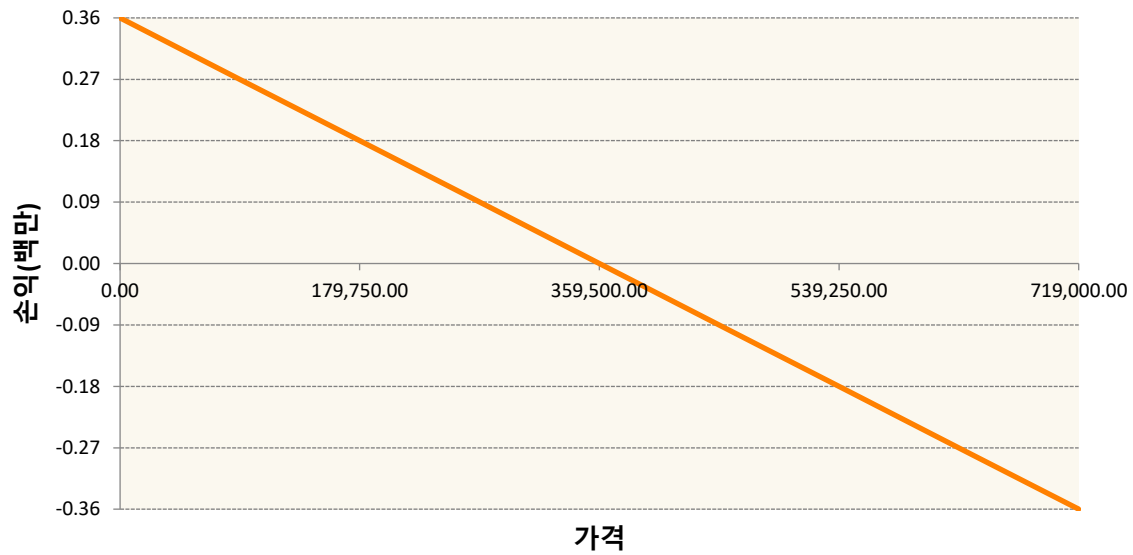
2. 만기시점의 손익구조



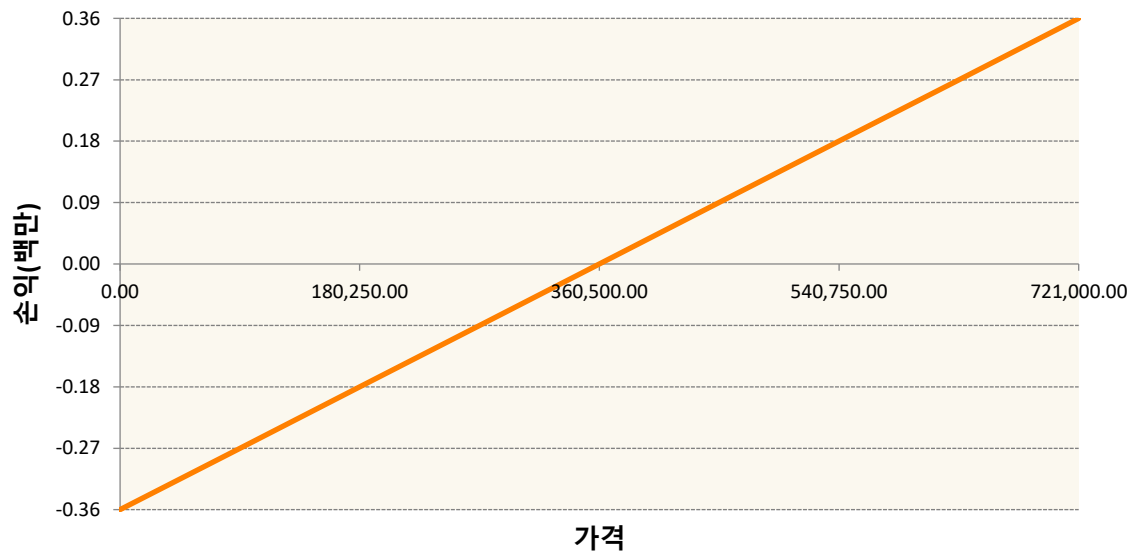
KR4111WA0003-2025-10 삼성전자개별선물



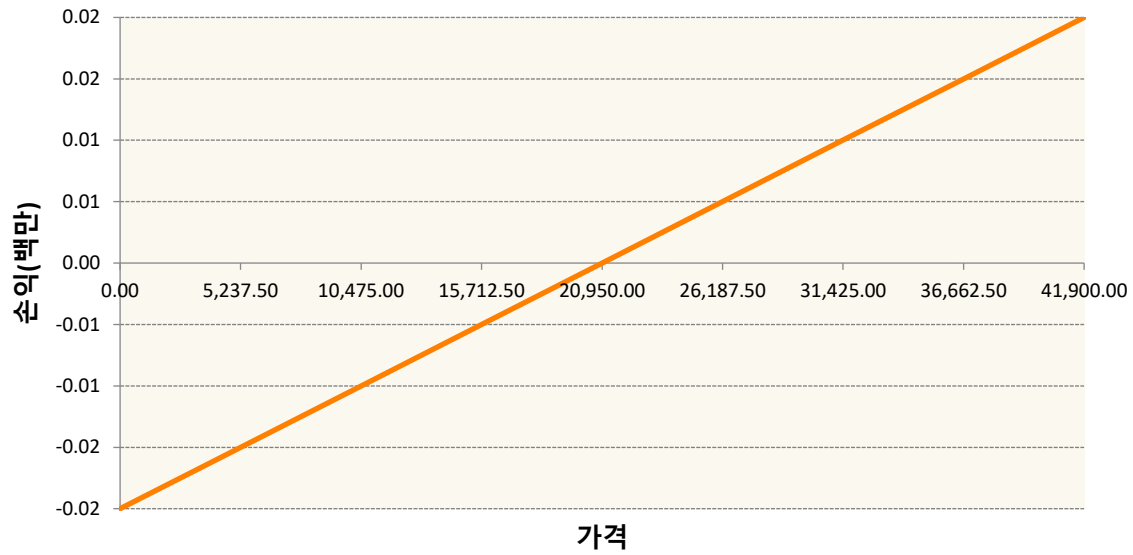
KR4150WA0005-2025-10 SK하이닉스개별선물



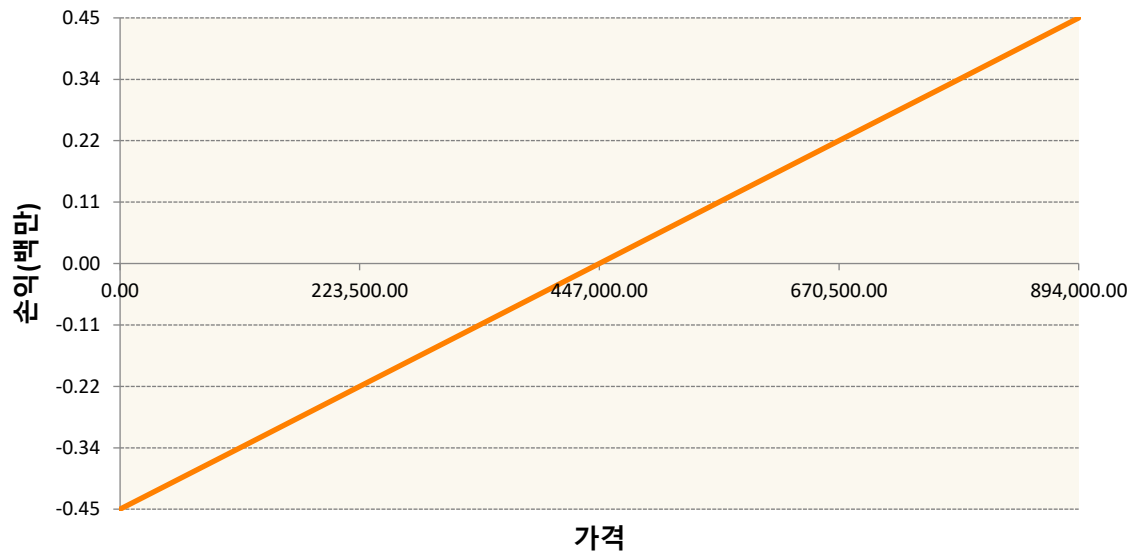
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



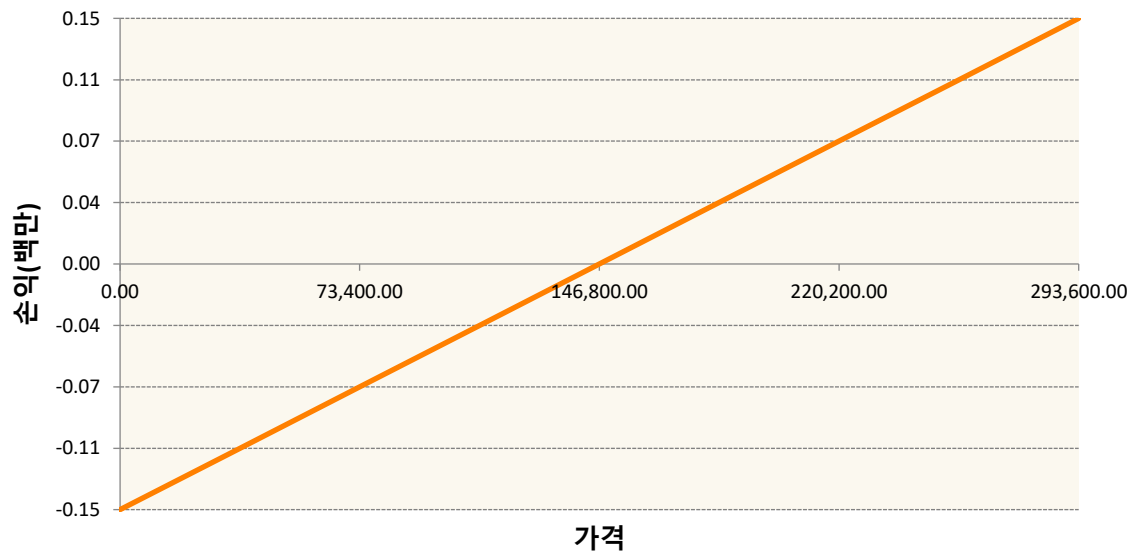
KR41CNWA0005-2025-10 포스코DX개별선물



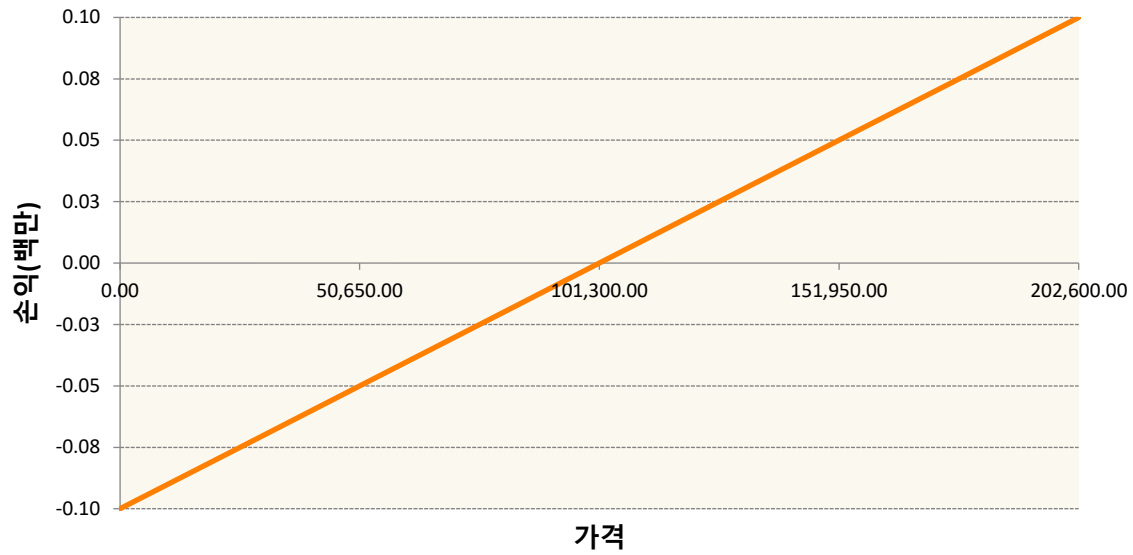
KR41DAWA0009-2025-10 농심개별선물



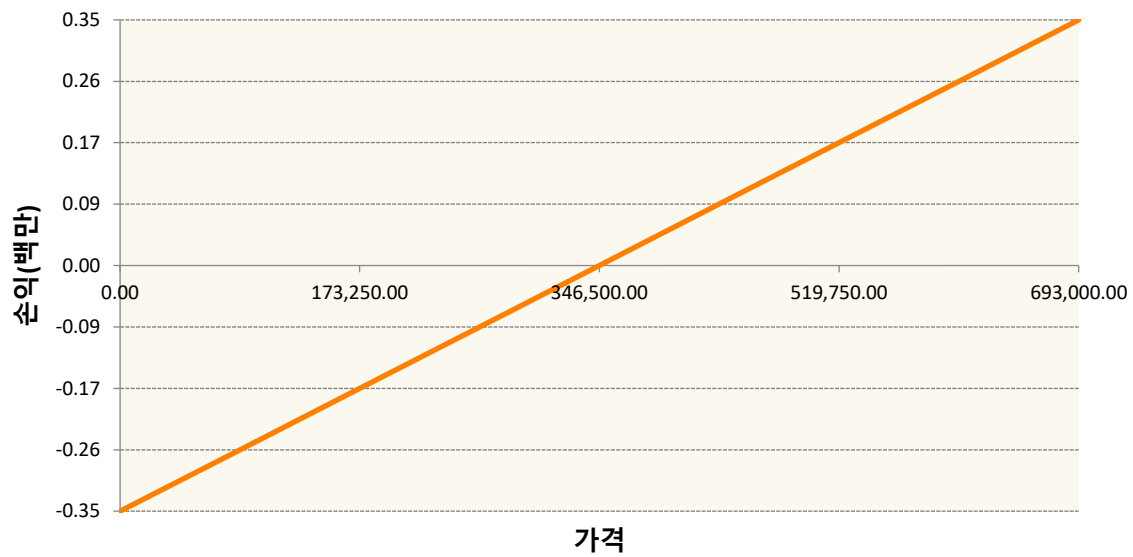
KR41E8WA0008-2025-10 포스코퓨처엠개별선물



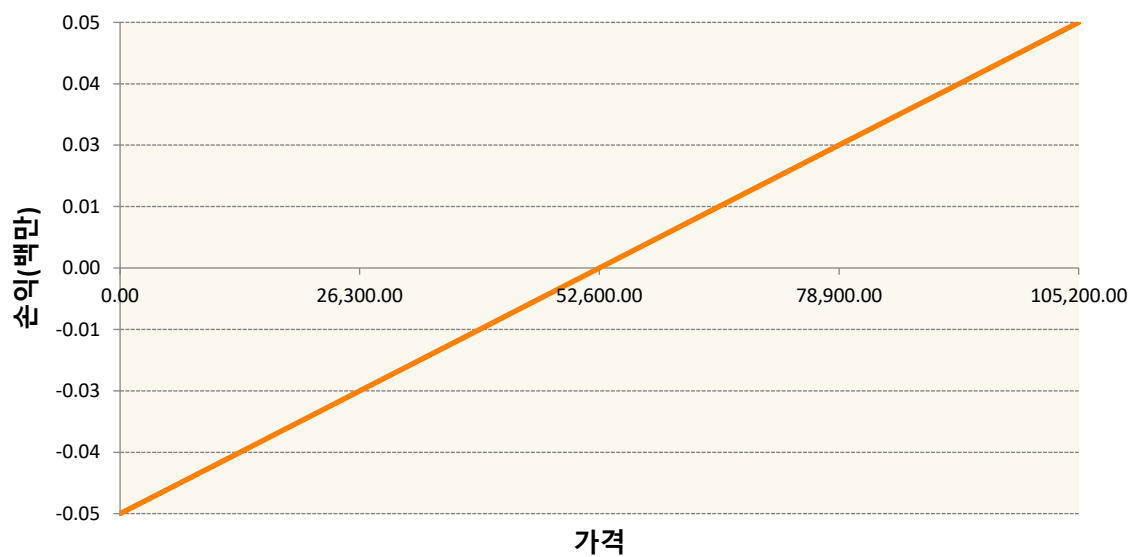
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



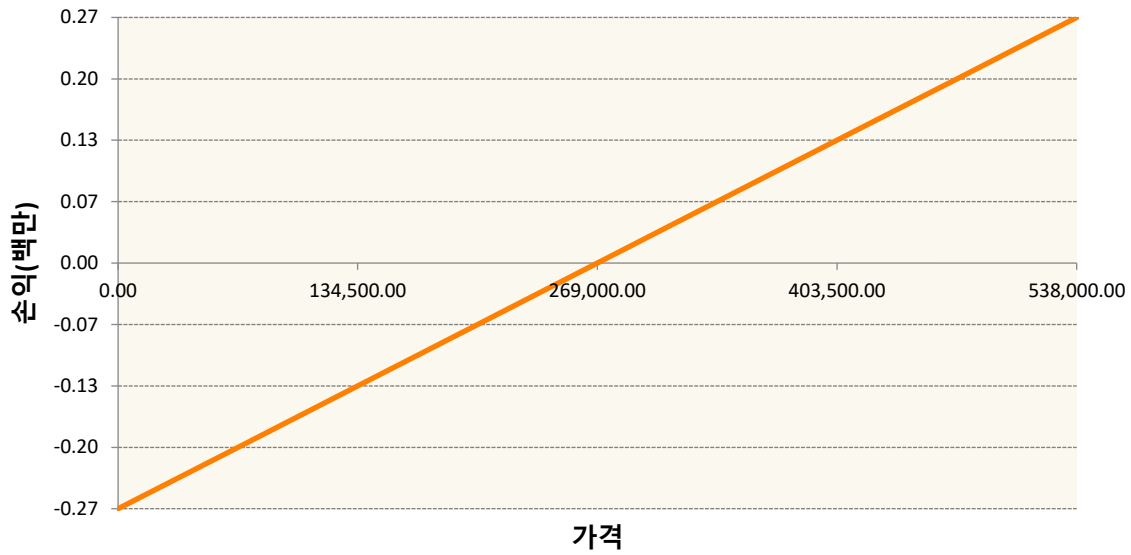
KR41F5WA0008-2025-10 LG에너지솔루션개별선물



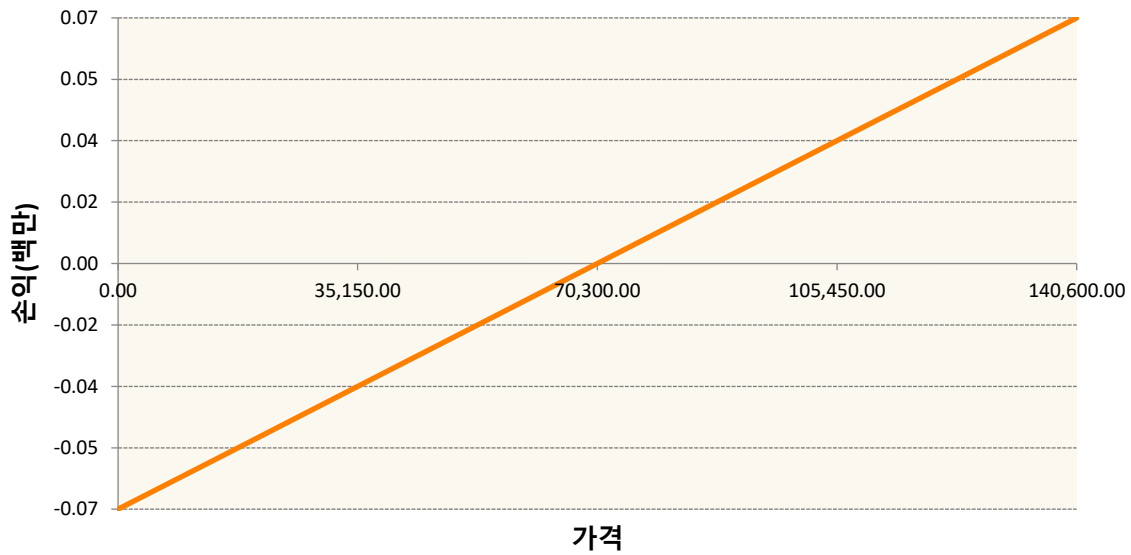
KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



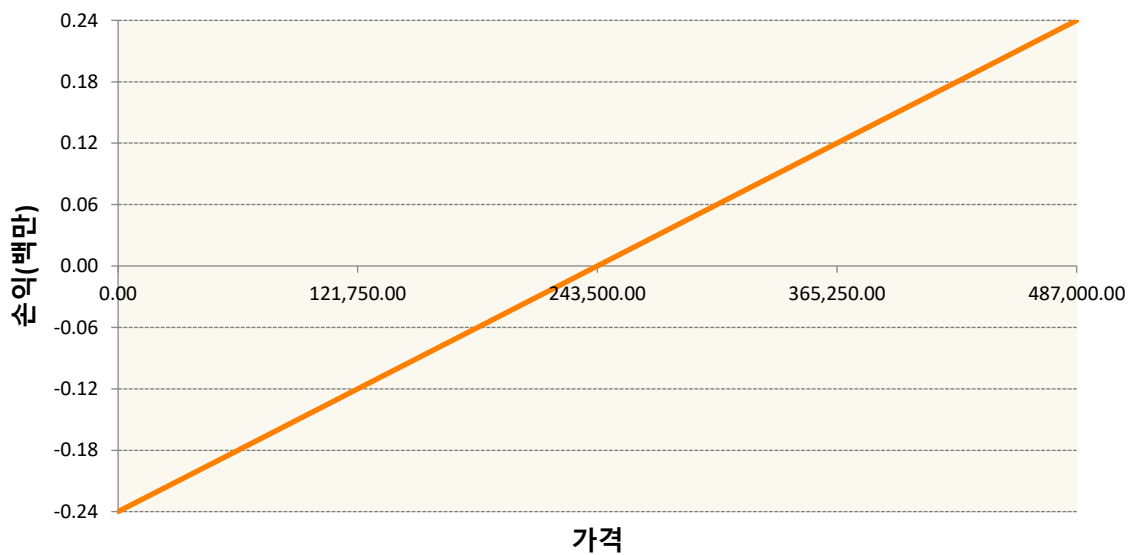
KR41FCWA0005-2025-10 하이브개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



KR41HEWA0001-2025-10 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물		519
KR410FWA0(2025-10 두산로보틱스개별선물		14
KR4111WA0(2025-10 삼성전자개별선물		103
KR4150WA0(2025-10 SK하이닉스개별선물		101
KR4150WB0(2025-11 SK하이닉스개별선물		34
KR41CNWAC 2025-10 포스코DX개별선물		10
KR41DAWAC 2025-10 농심개별선물		4
KR41E8WA0(2025-10 포스코퓨처엠개별선물		41
KR41EJWB0C 2025-11 SKC개별선물		21
KR41F5WA0(2025-10 LG에너지솔루션개별선물		1
KR41F7WB0(2025-11 카카오페이개별선물		15
KR41FCWA0(2025-10 하이브개별선물		62
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물		20
KR41HEWA0 2025-10 키움증권개별선물		37

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	501

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

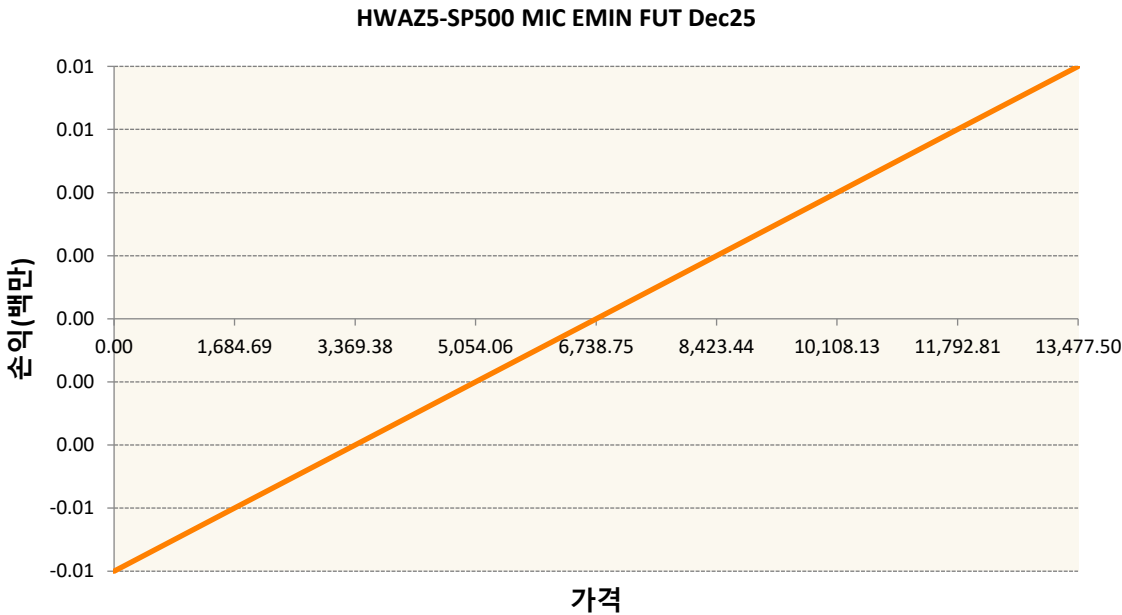
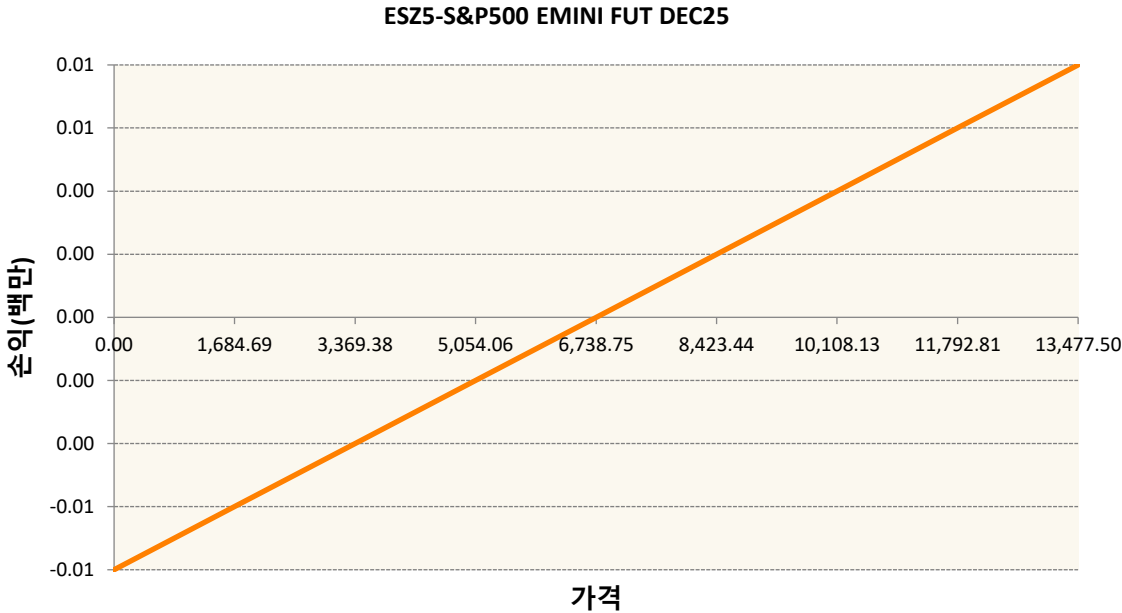
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	37,890	0	37,890	
누계	유가증권	선물	1,263	0	1,263	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,031
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,452

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

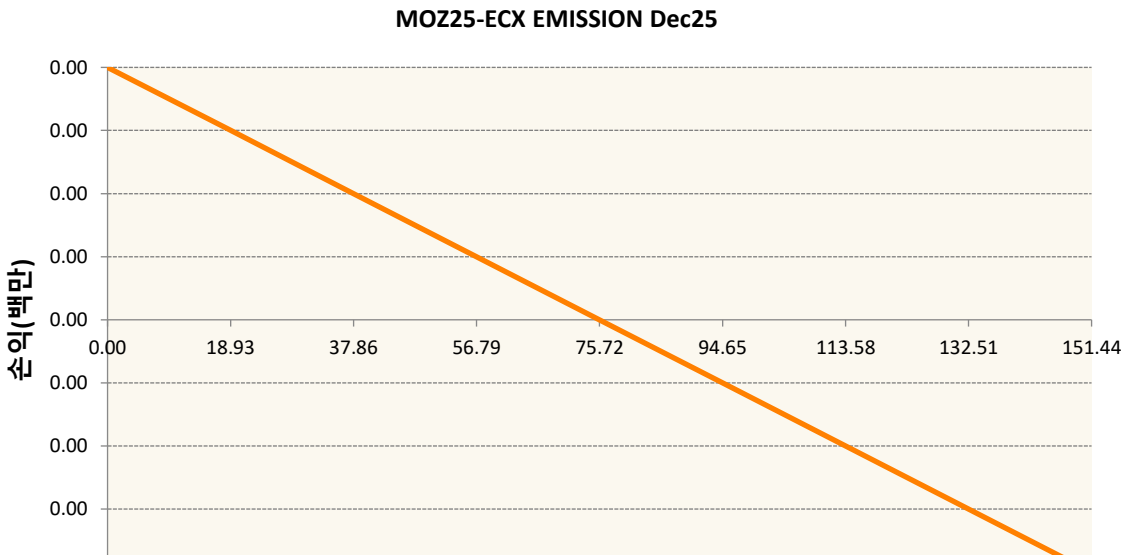
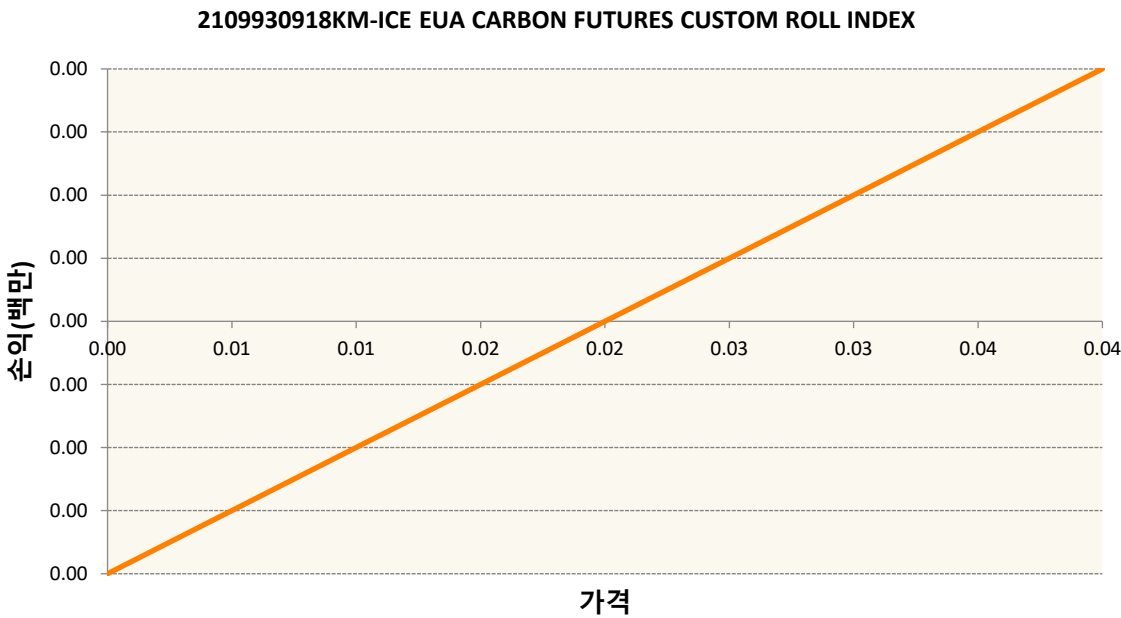
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	4,299	-4,299	
누계	지수	스왑	8	0	8	장외
누계	통화	선도	0	1,229	-1,229	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F9SC KRW/EUR 31-10-25E	98
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	344

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

(단위:백만원)

533

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

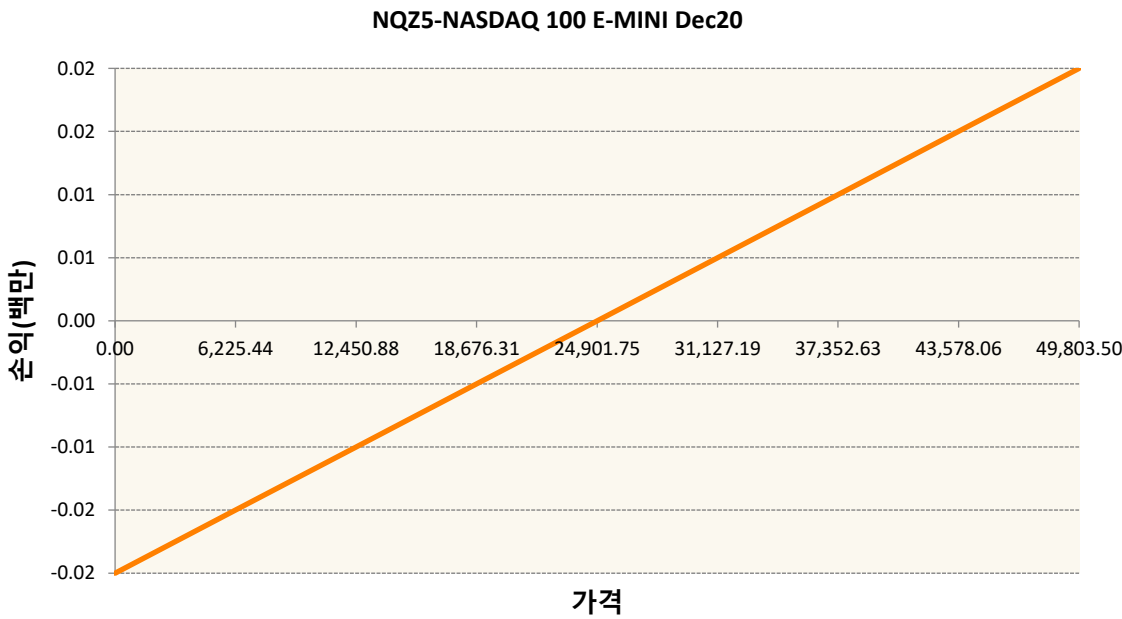
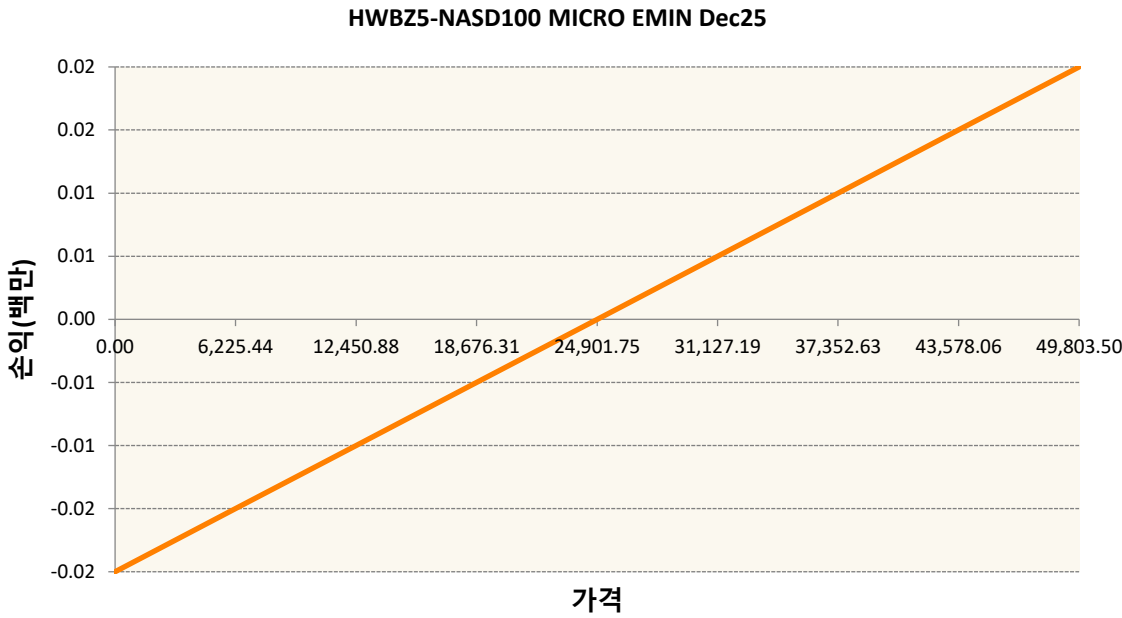
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	15,905	0	15,905	
누계	유가증권	선물	2,006	0	2,006	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25	160
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,272

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,563

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

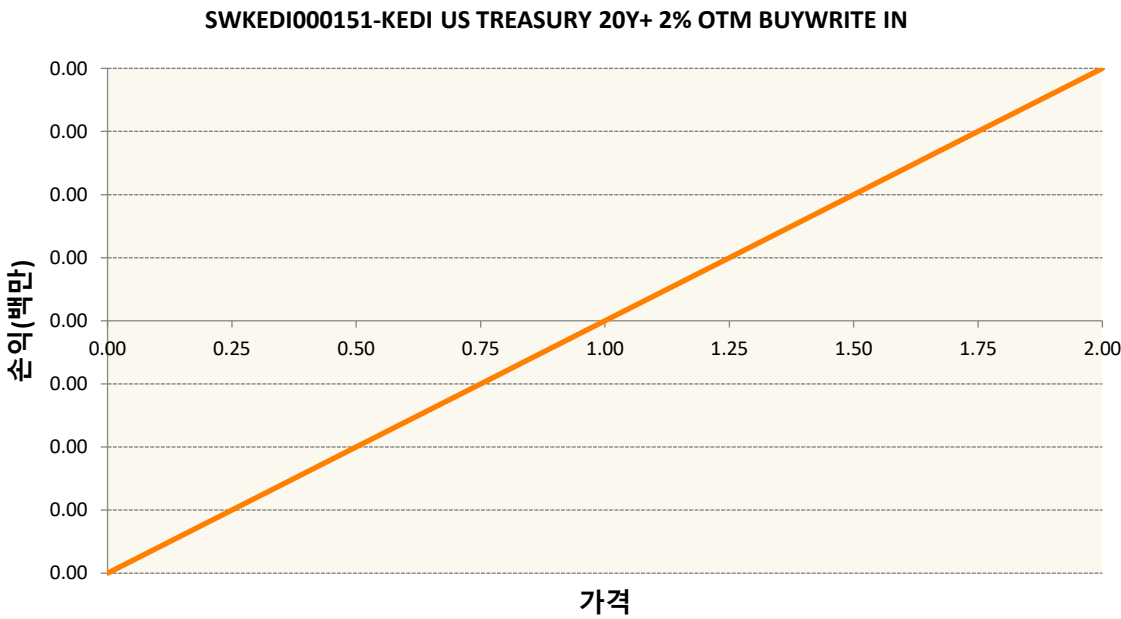
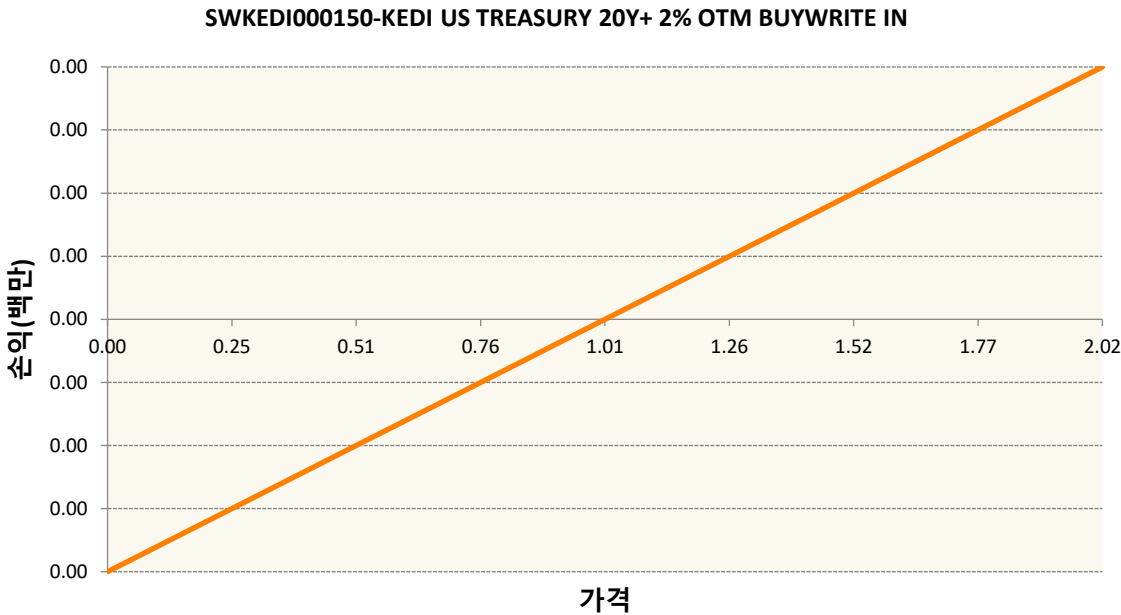
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

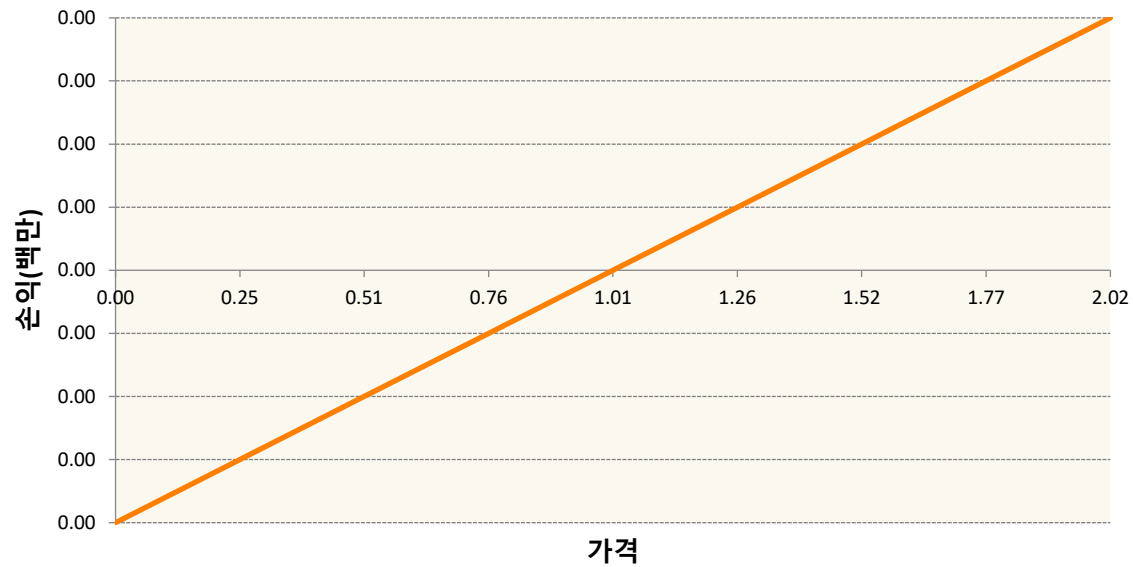
(단위:백만원)

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

8,174
7,754
3,598
9,716

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

(단위:백만원)

14,336

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

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)

13

공시일	2025-10-02
기준일	2025-10-01

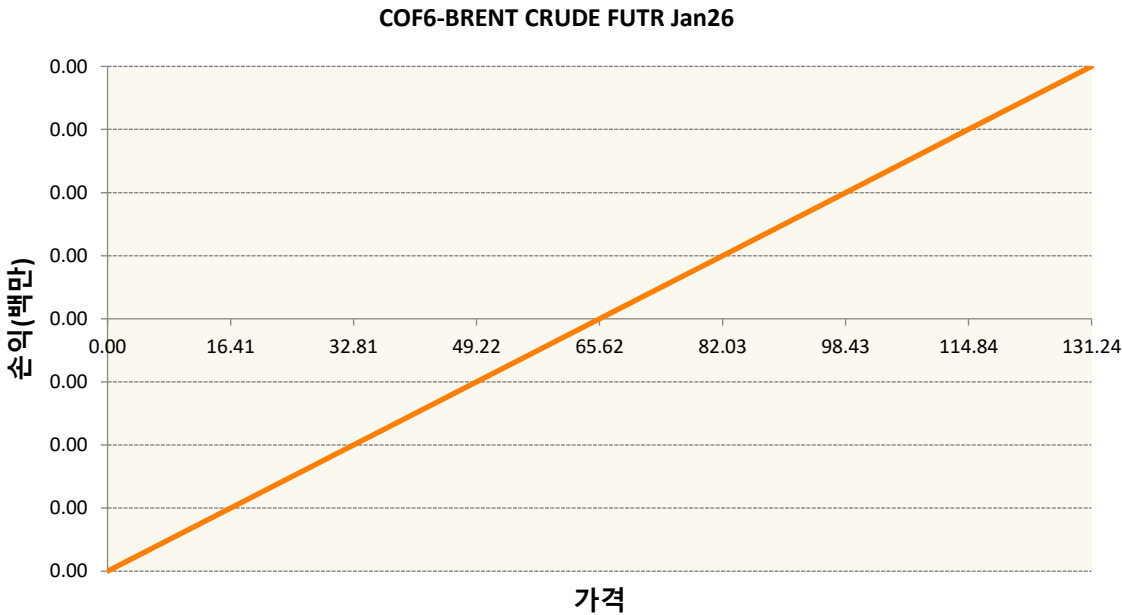
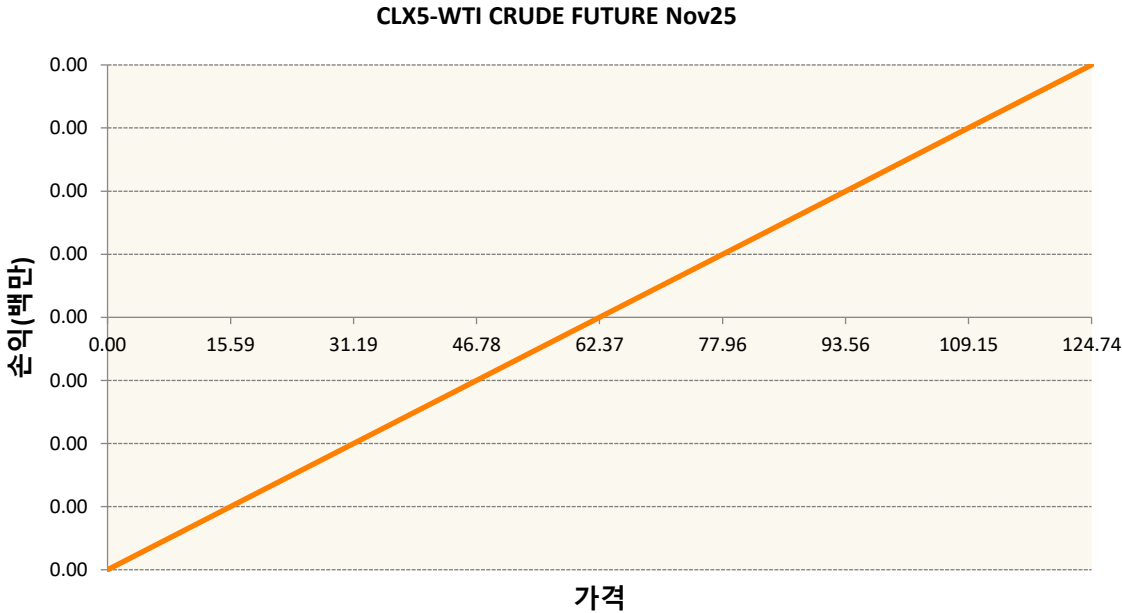
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

1. 계약금액

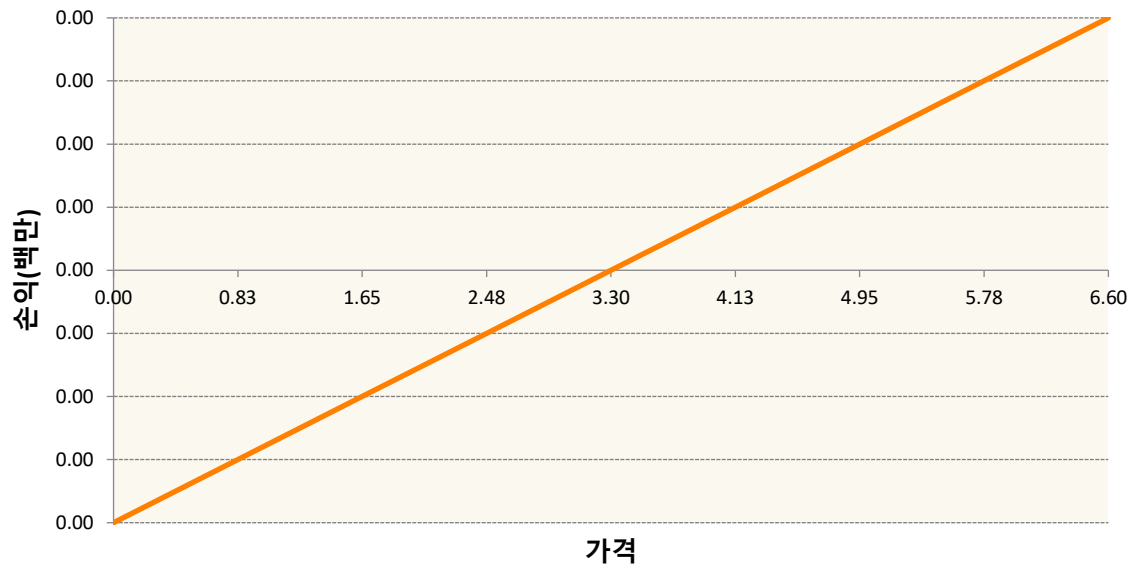
(단위:백만원)

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	537	0	537	
누계	통화	선물	0	70	-70	장내

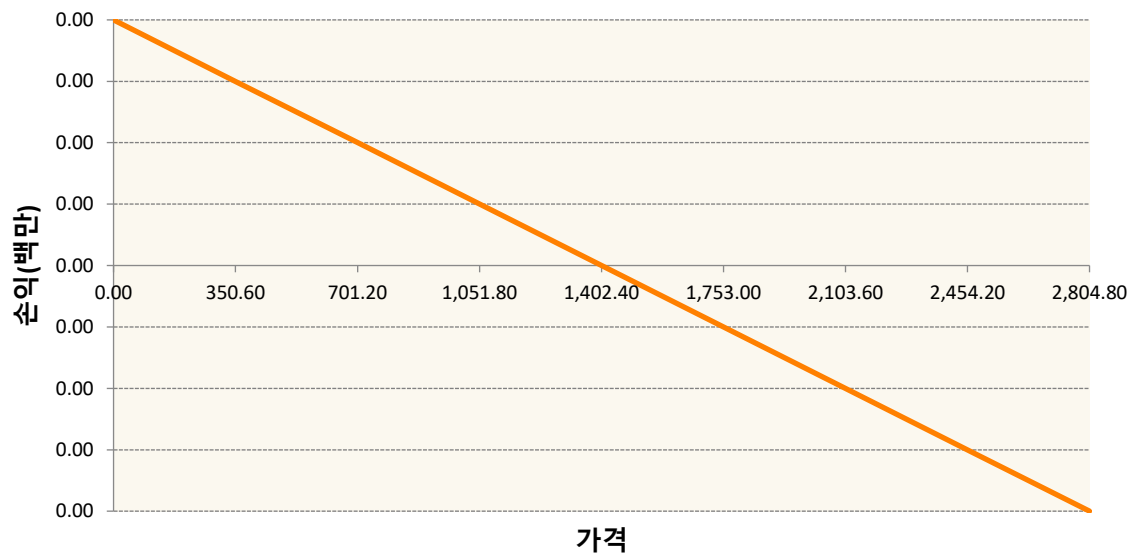
2. 만기시점의 손익구조



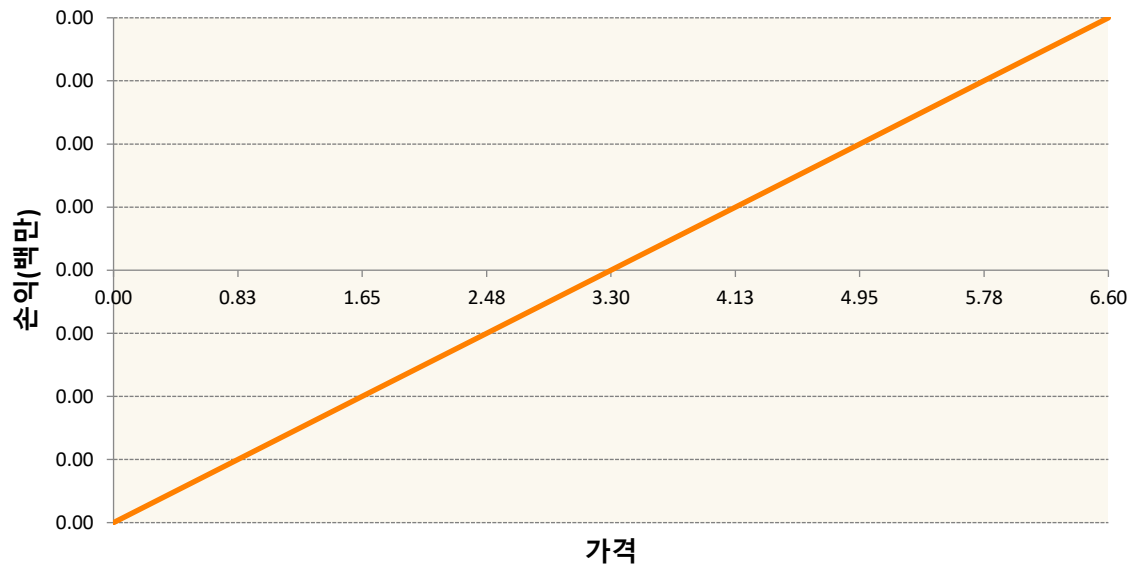
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

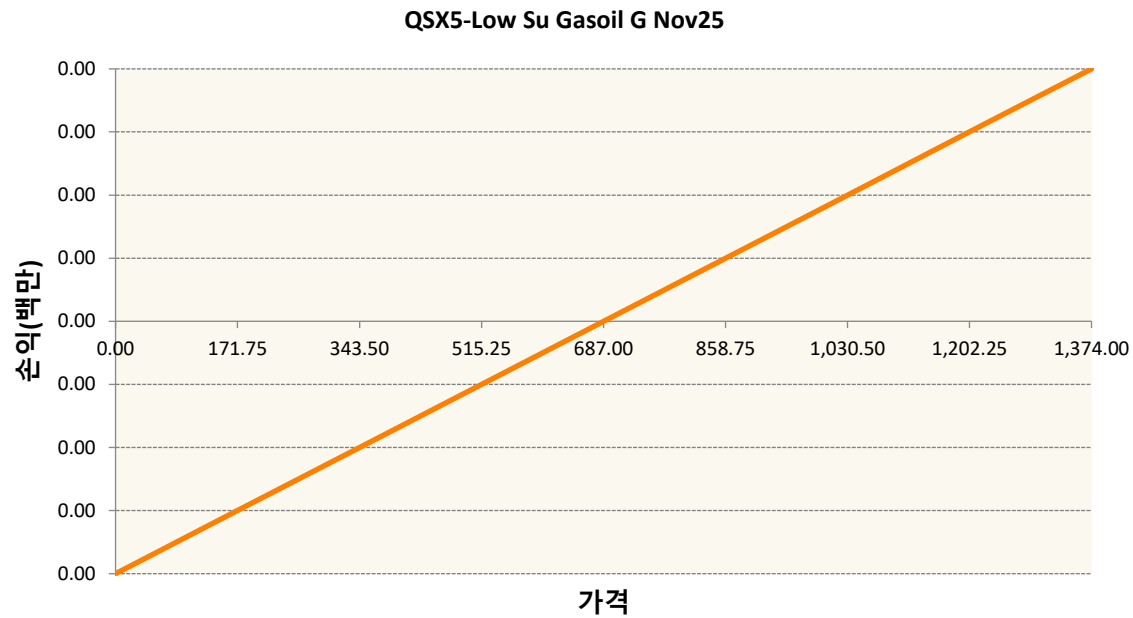


KR4175WA0006-2025-10 달러선물



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