

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

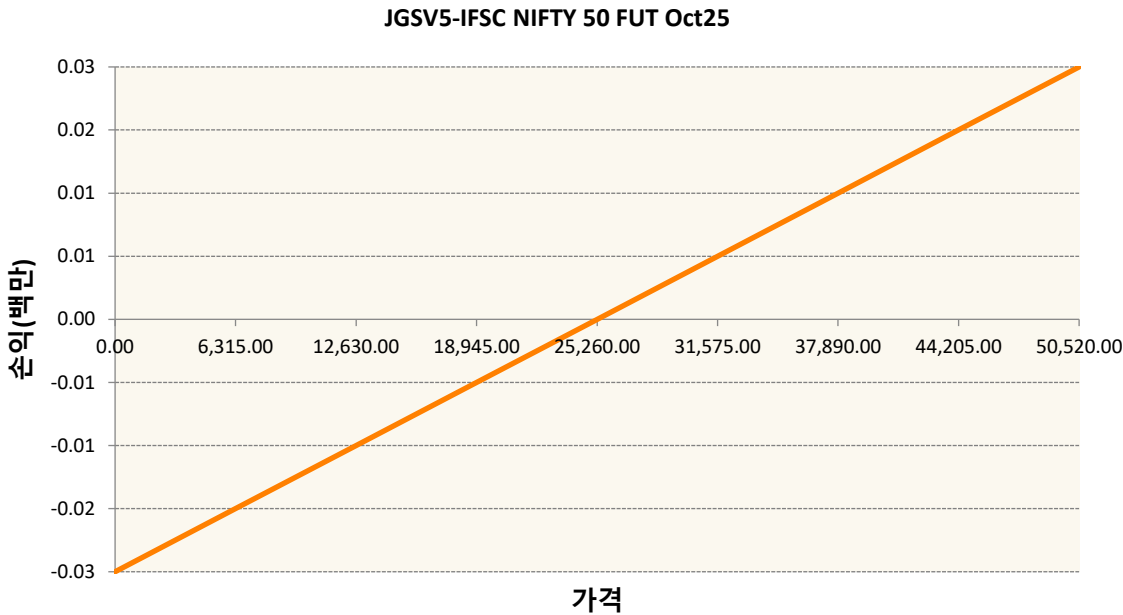
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 565   | 0     | 565       |    |

### 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 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

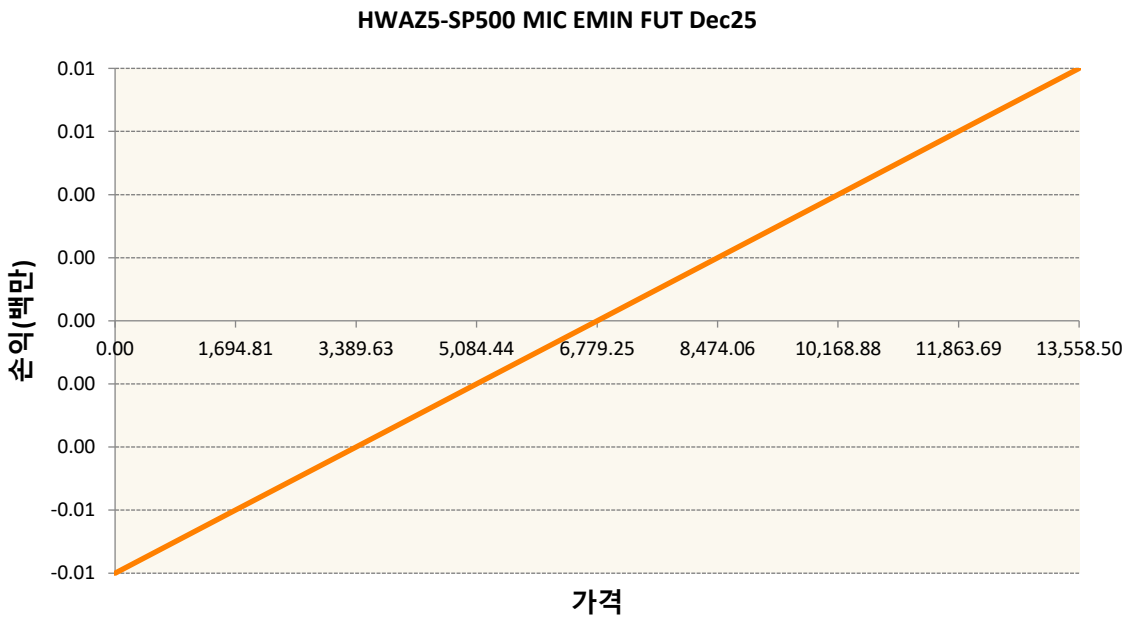
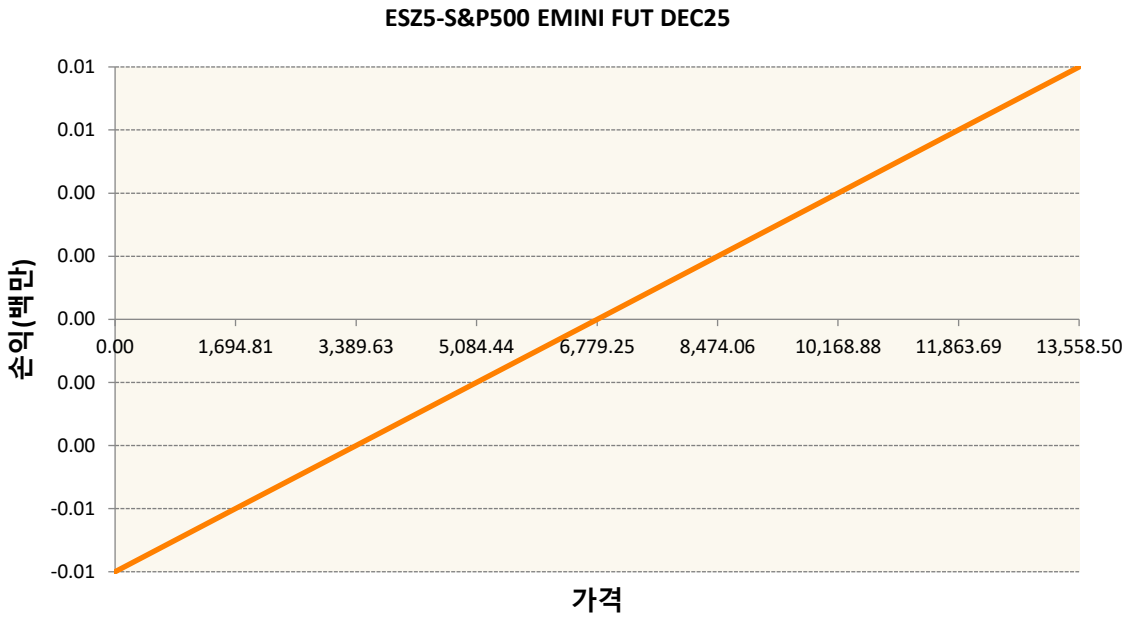
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 471   | 0     | 471       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 188   | 0     | 188       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ5                      | S&P500 EMINI FUT DEC25   | 38       |
| HWAZ5                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec25 | 15       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 67       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

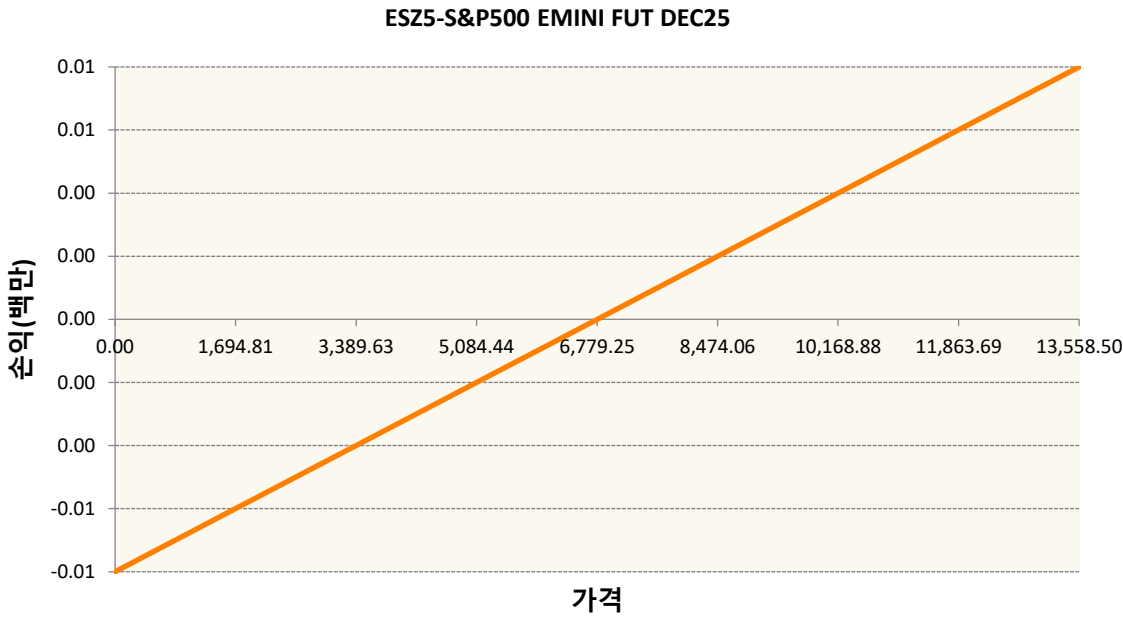
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,412 | 0     | 1,412     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| ESZ5 | S&P500 EMINI FUT DEC25 | 113 |
|------|------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 162 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

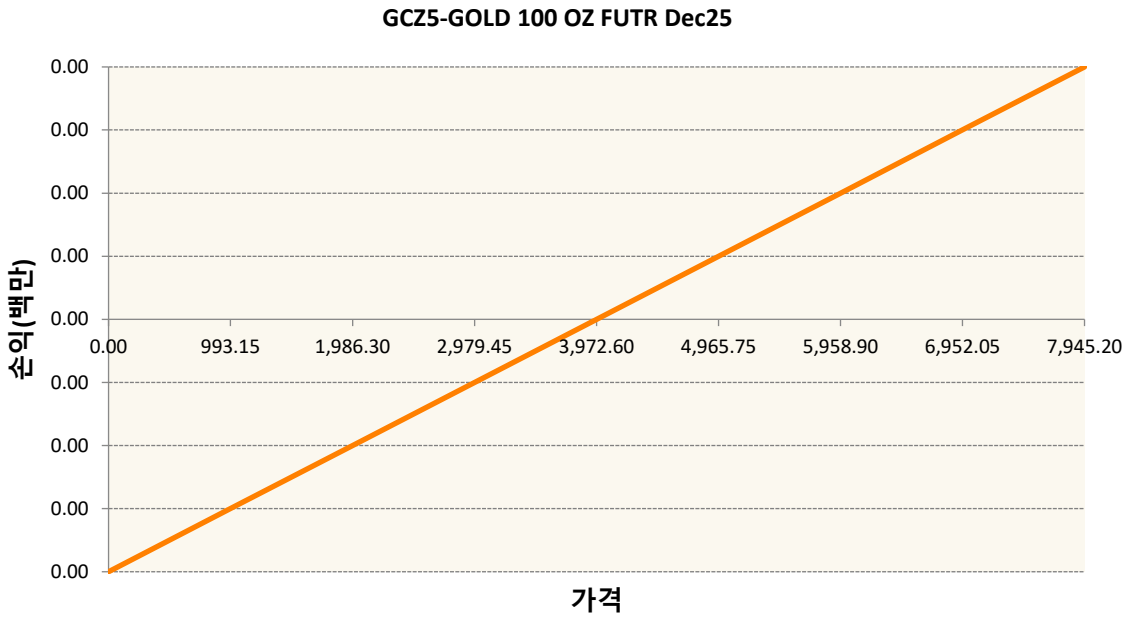
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 2,213 | 0     | 2,213     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| AOGLDUSC0 GLD US 10/10/25 C350 EQUITY | 7   |
| GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25           | 177 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 160 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

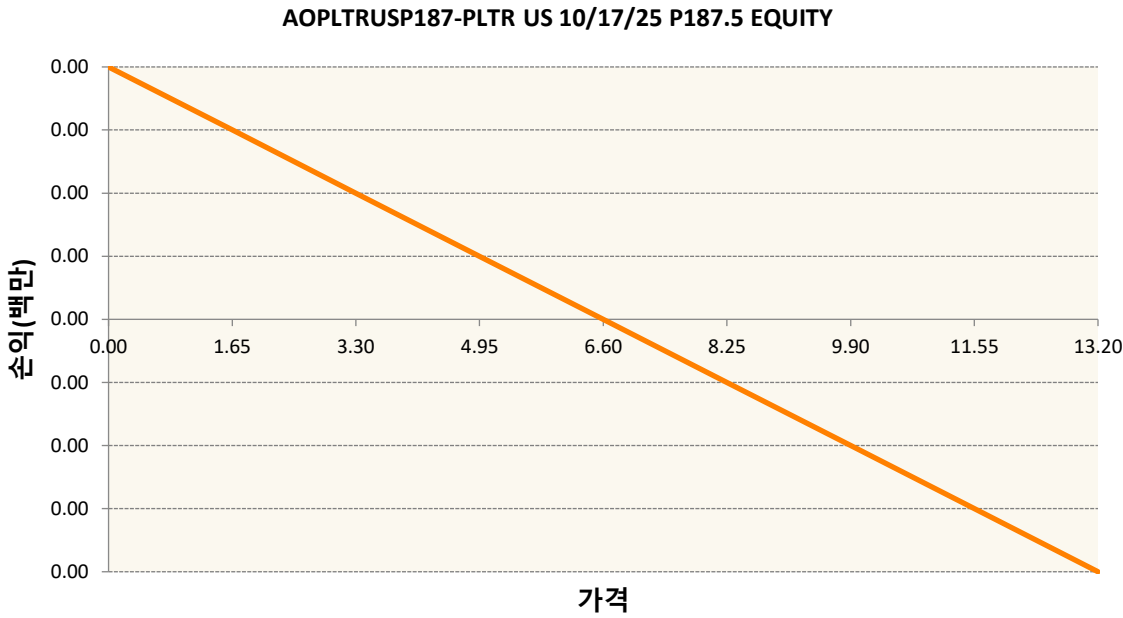
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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     | 1,190 | -1,190    |    |

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 | 95 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 700 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

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

2

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

(단위:백만원)

1

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

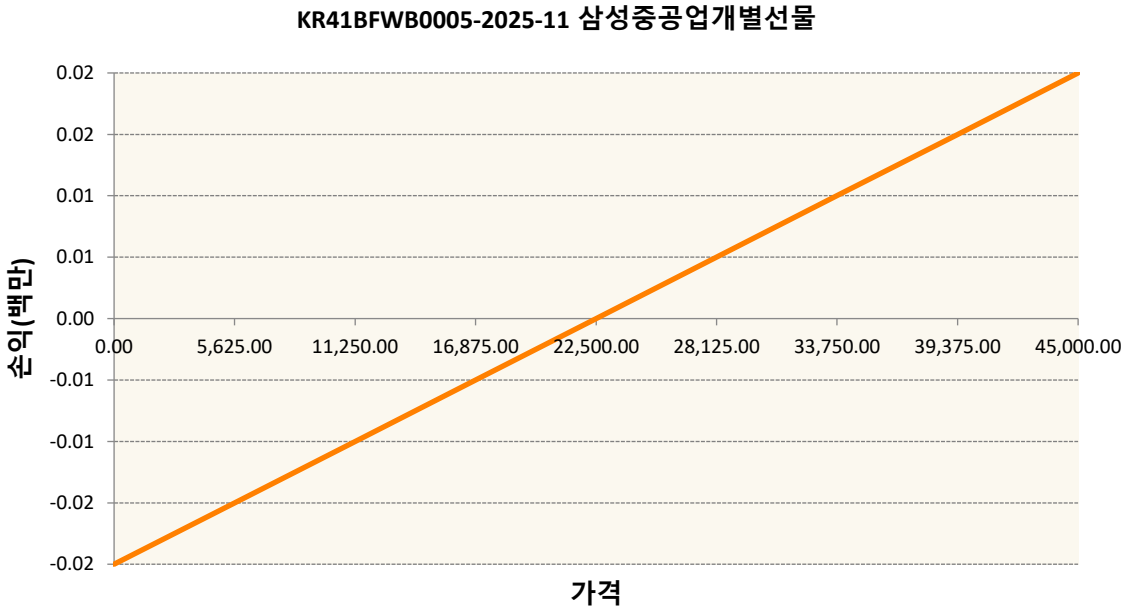
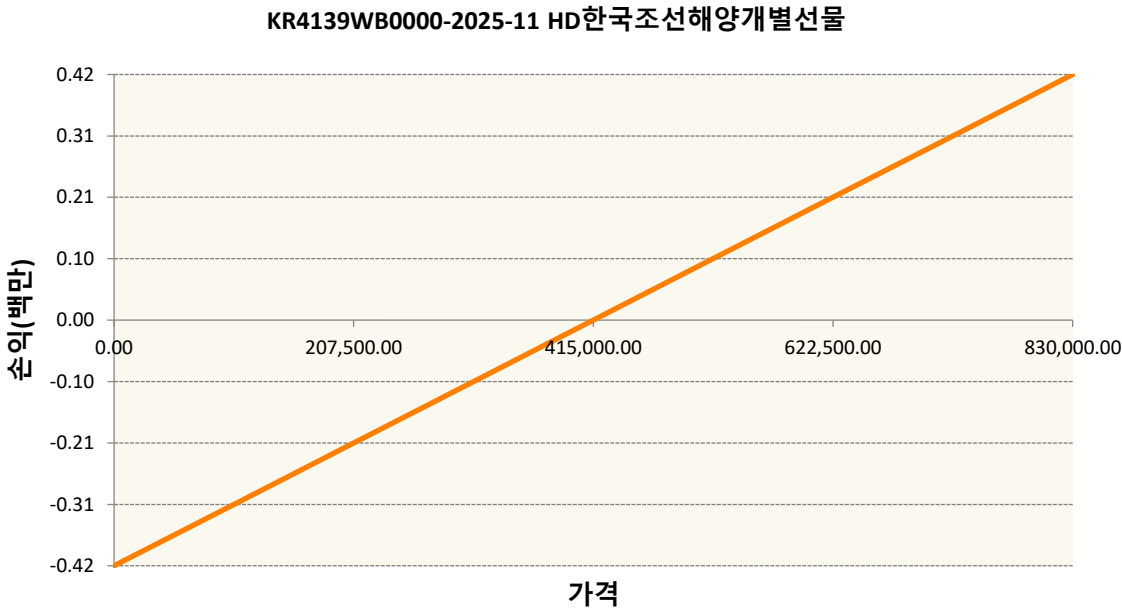
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 1. 계약금액

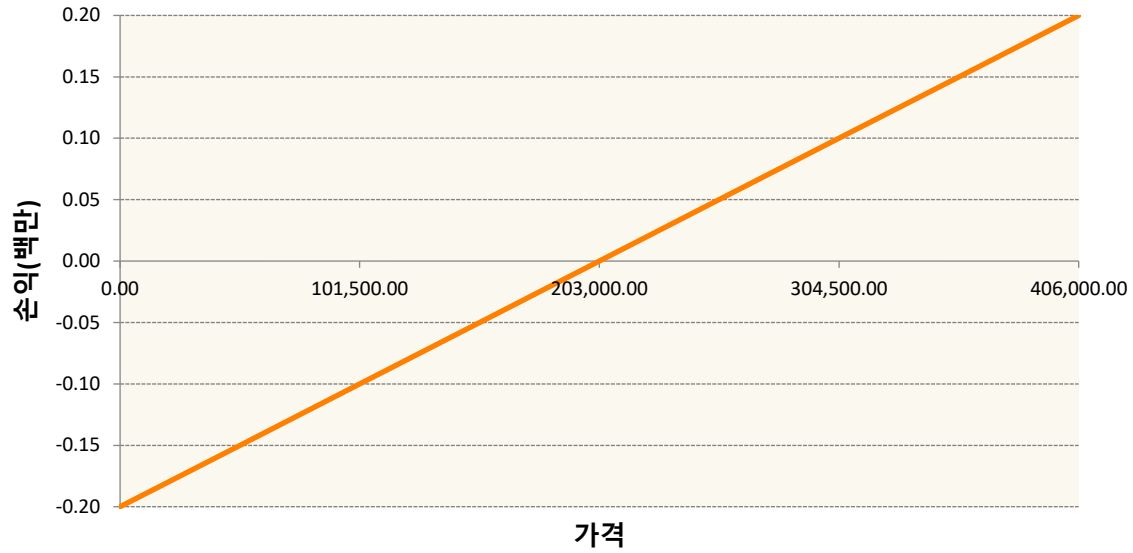
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 53,370 | 0     | 53,370    | 장내 |

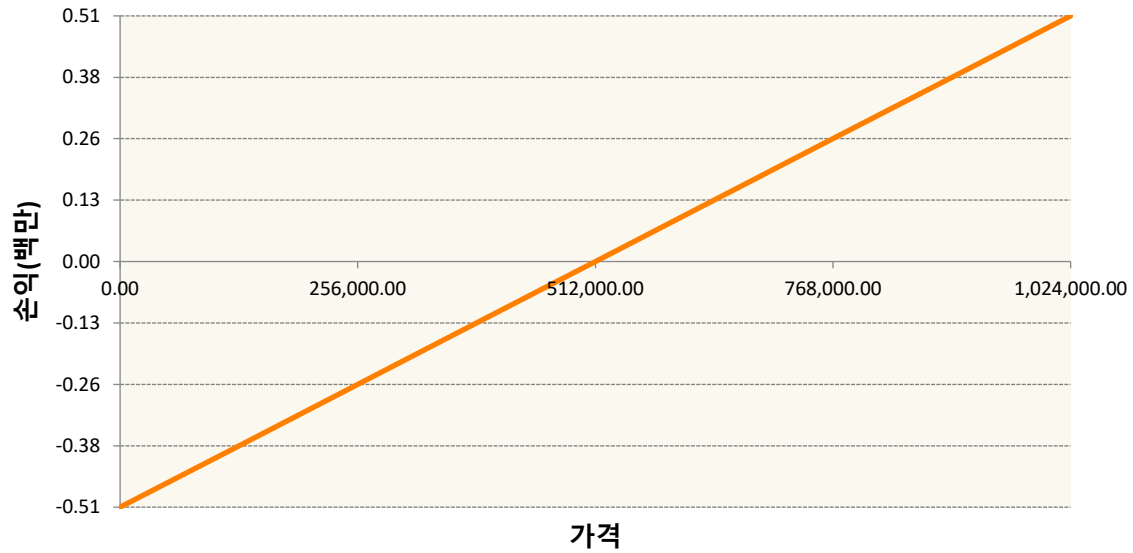
### 2. 만기시점의 손익구조



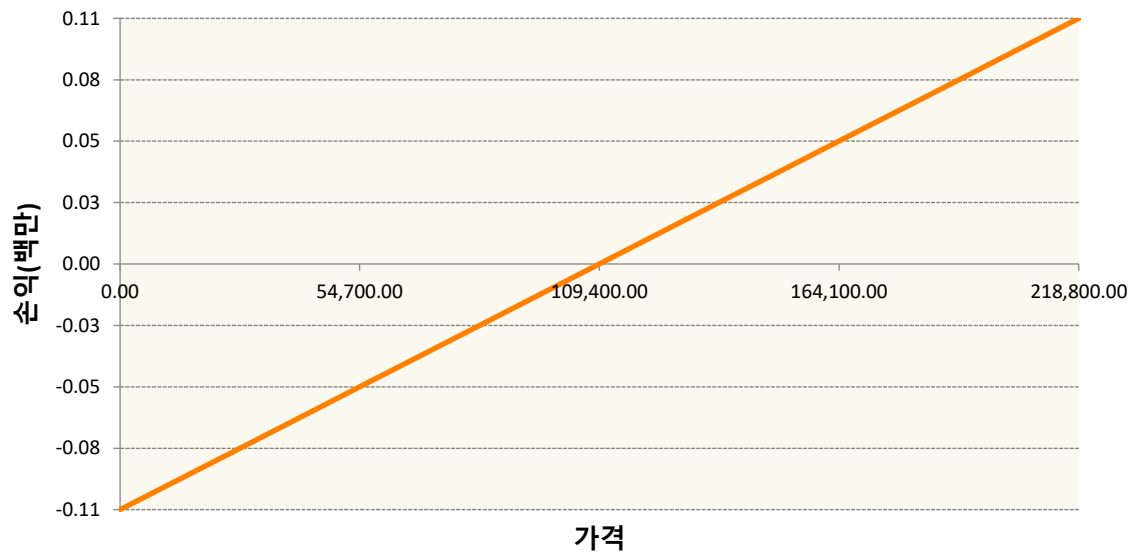
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |                      |        |        |        |        |
|--------------|-----------|---------|----------------------|--------|--------|--------|--------|
| KR4139WB0000 |           |         | 2025-11 HD한국조선해양개별선물 |        |        |        | 1,198  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                      |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%               | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -1,198    | -1,198  | -1,198               | -1,198 | -1,198 | -1,198 | -1,198 |
| -5.33%       | -799      | -799    | -799                 | -799   | -799   | -799   | -799   |
| -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%        | 799       | 799     | 799                  | 799    | 799    | 799    | 799    |
| 8.00%        | 1,198     | 1,198   | 1,198                | 1,198  | 1,198  | 1,198  | 1,198  |
| KR41BFWB0005 |           |         | 2025-11 삼성중공업개별선물    |        |        |        | 1,110  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                      |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%               | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -1,110    | -1,110  | -1,110               | -1,110 | -1,110 | -1,110 | -1,110 |
| -5.33%       | -740      | -740    | -740                 | -740   | -740   | -740   | -740   |
| -2.67%       | -370      | -370    | -370                 | -370   | -370   | -370   | -370   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                    | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%        | 370       | 370     | 370                  | 370    | 370    | 370    | 370    |
| 5.33%        | 740       | 740     | 740                  | 740    | 740    | 740    | 740    |
| 8.00%        | 1,110     | 1,110   | 1,110                | 1,110  | 1,110  | 1,110  | 1,110  |
| KR41CDWB0006 |           |         | 2025-11 HD현대미포개별선물   |        |        |        | 456    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                      |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%               | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -456      | -456    | -456                 | -456   | -456   | -456   | -456   |
| -5.33%       | -304      | -304    | -304                 | -304   | -304   | -304   | -304   |
| -2.67%       | -152      | -152    | -152                 | -152   | -152   | -152   | -152   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                    | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%        | 152       | 152     | 152                  | 152    | 152    | 152    | 152    |
| 5.33%        | 304       | 304     | 304                  | 304    | 304    | 304    | 304    |
| 8.00%        | 456       | 456     | 456                  | 456    | 456    | 456    | 456    |
| 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     |        |        |        | 890    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                      |        |        |        |        |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | -890    | -890    | -890   | -890 | -890  | -890   | -890   |
| -5.33% | -594    | -594    | -594   | -594 | -594  | -594   | -594   |
| -2.67% | -297    | -297    | -297   | -297 | -297  | -297   | -297   |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 297     | 297     | 297    | 297  | 297   | 297    | 297    |
| 5.33%  | 594     | 594     | 594    | 594  | 594   | 594    | 594    |
| 8.00%  | 890     | 890     | 890    | 890  | 890   | 890    | 890    |

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

(단위:백만원)

**2,191**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

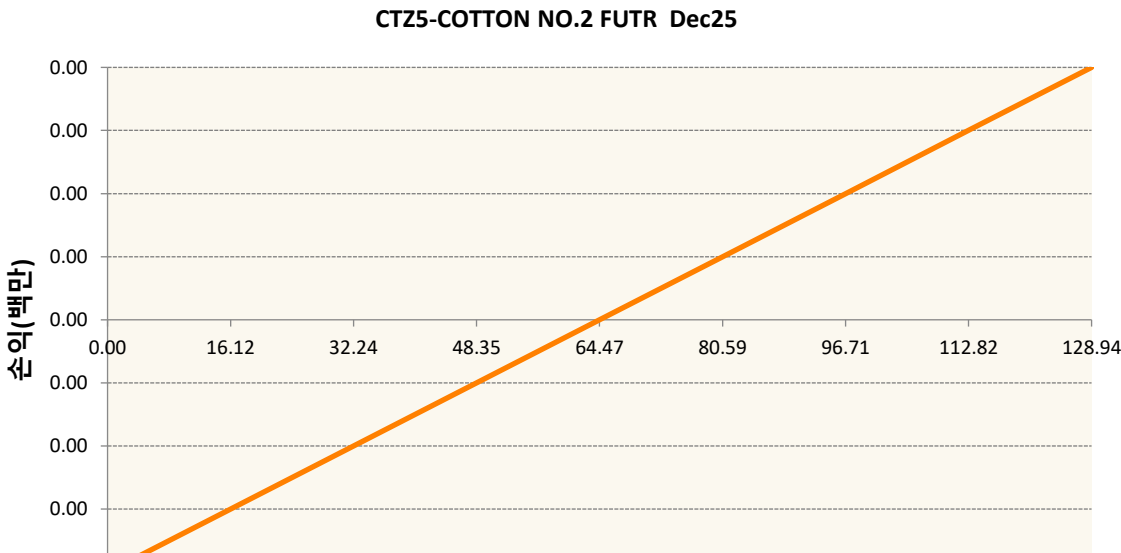
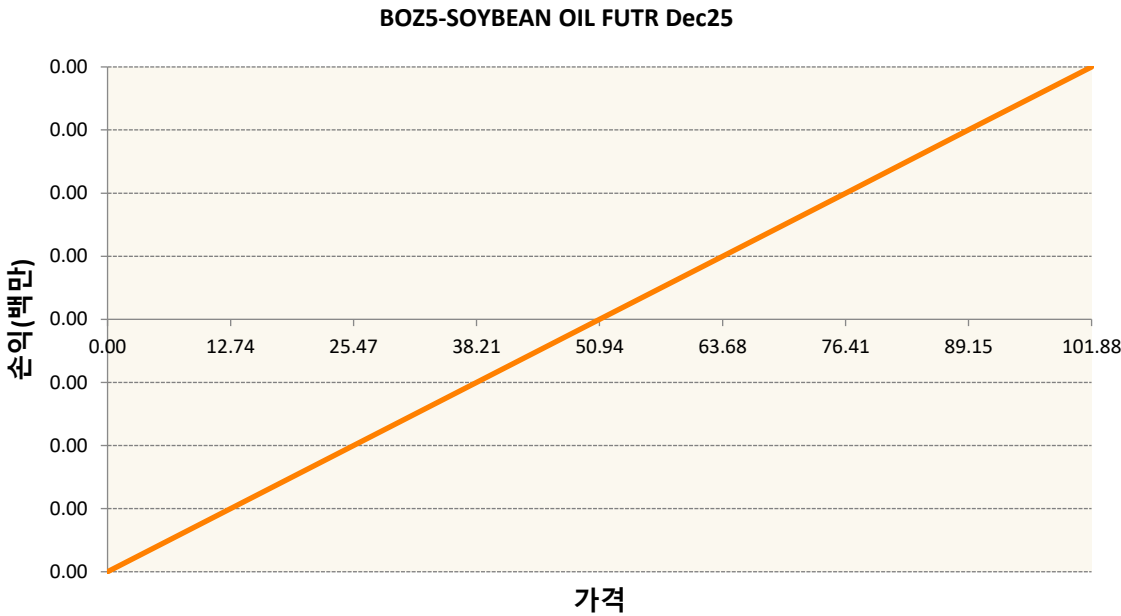
## 포커스농산물모(채권-파생형)

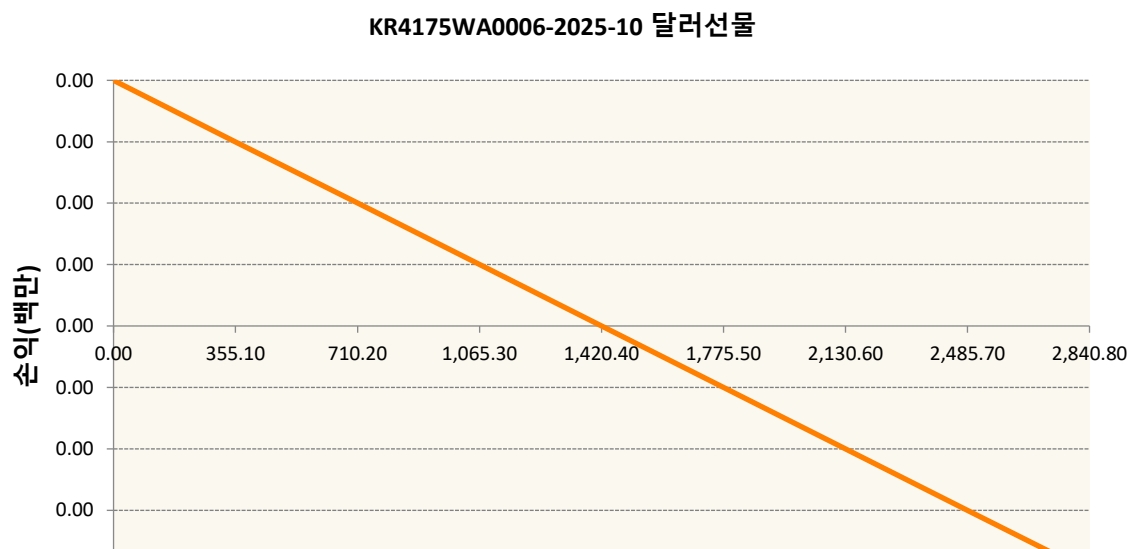
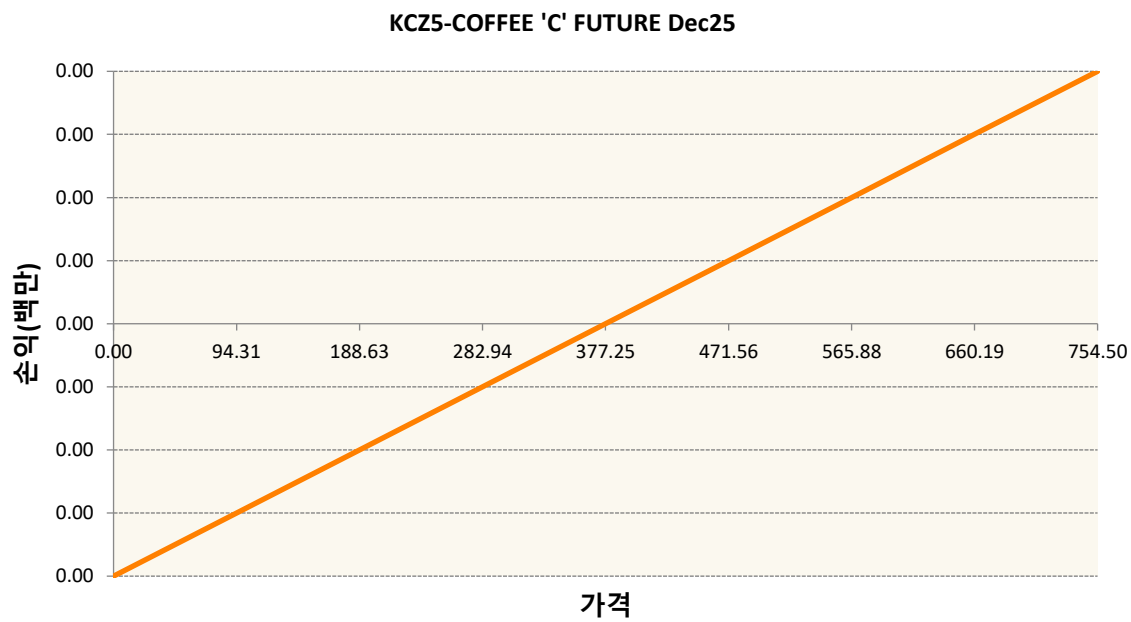
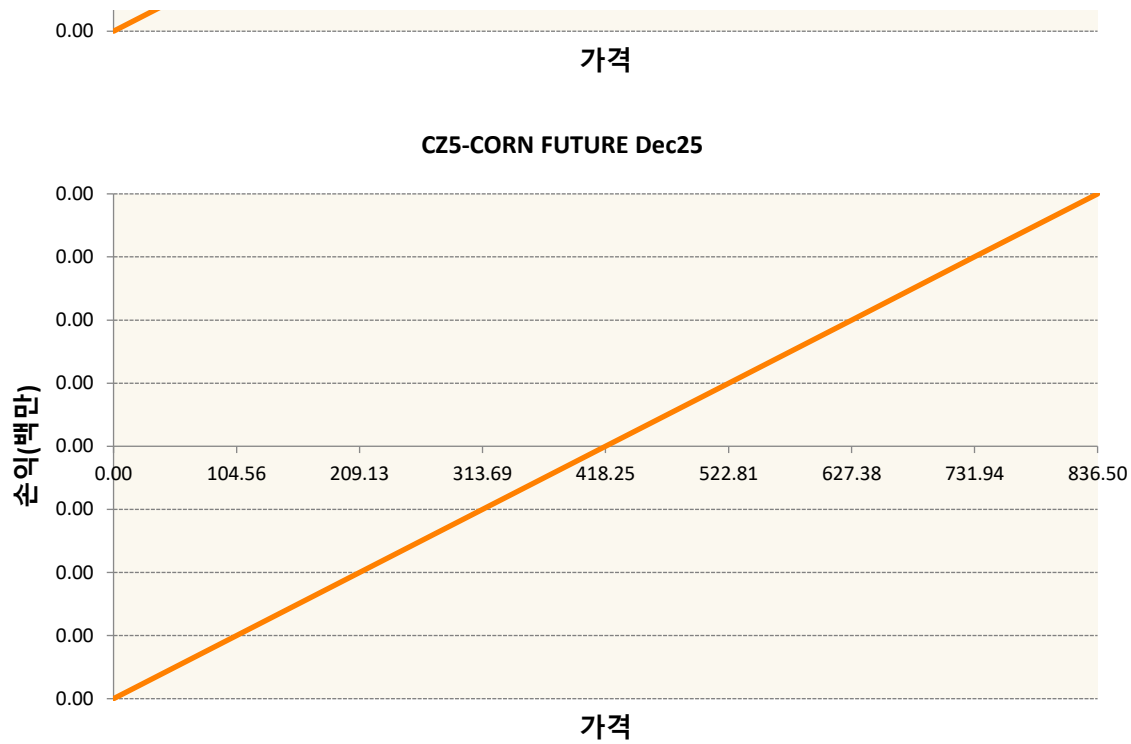
### 1. 계약금액

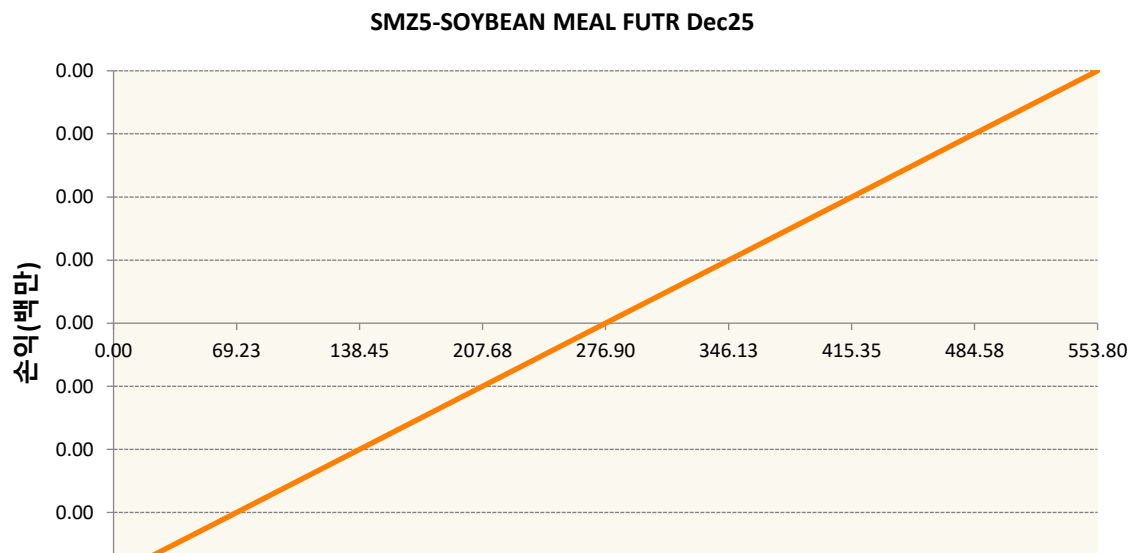
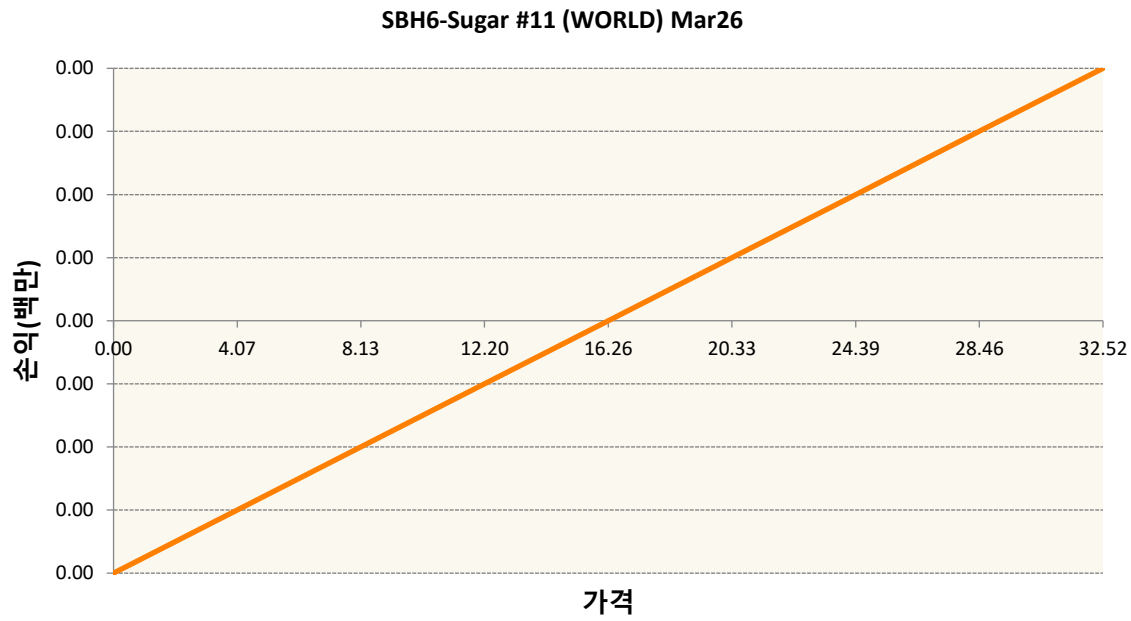
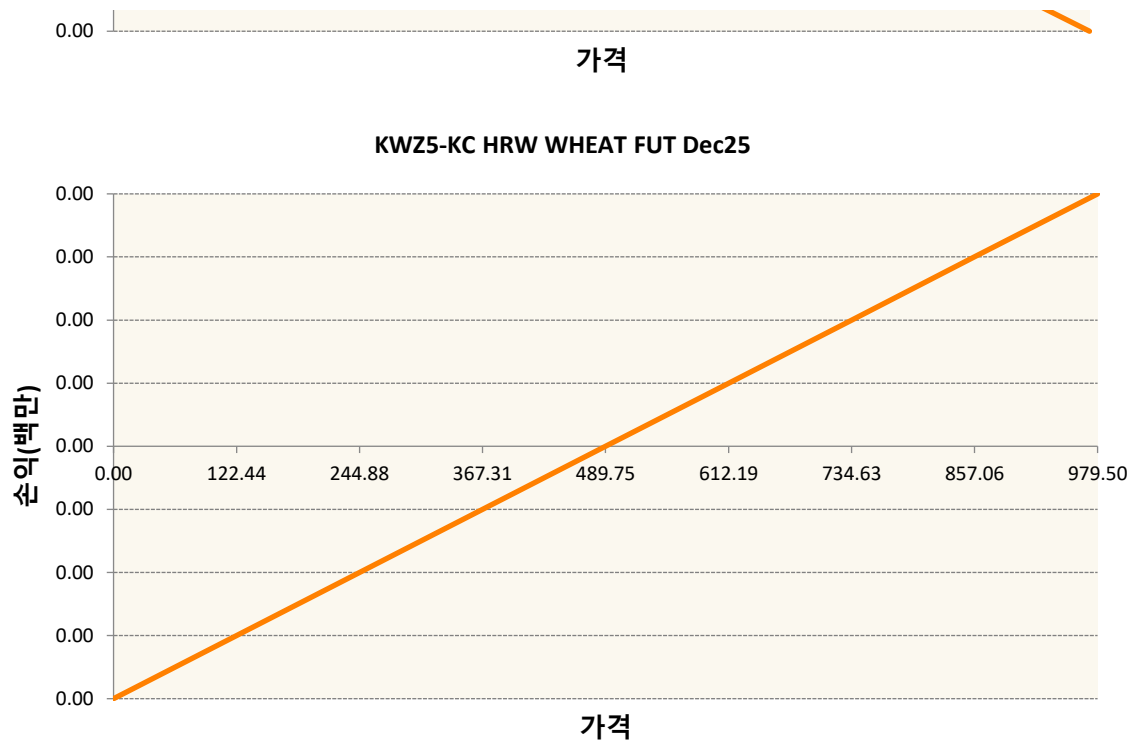
(단위:USD 백만)

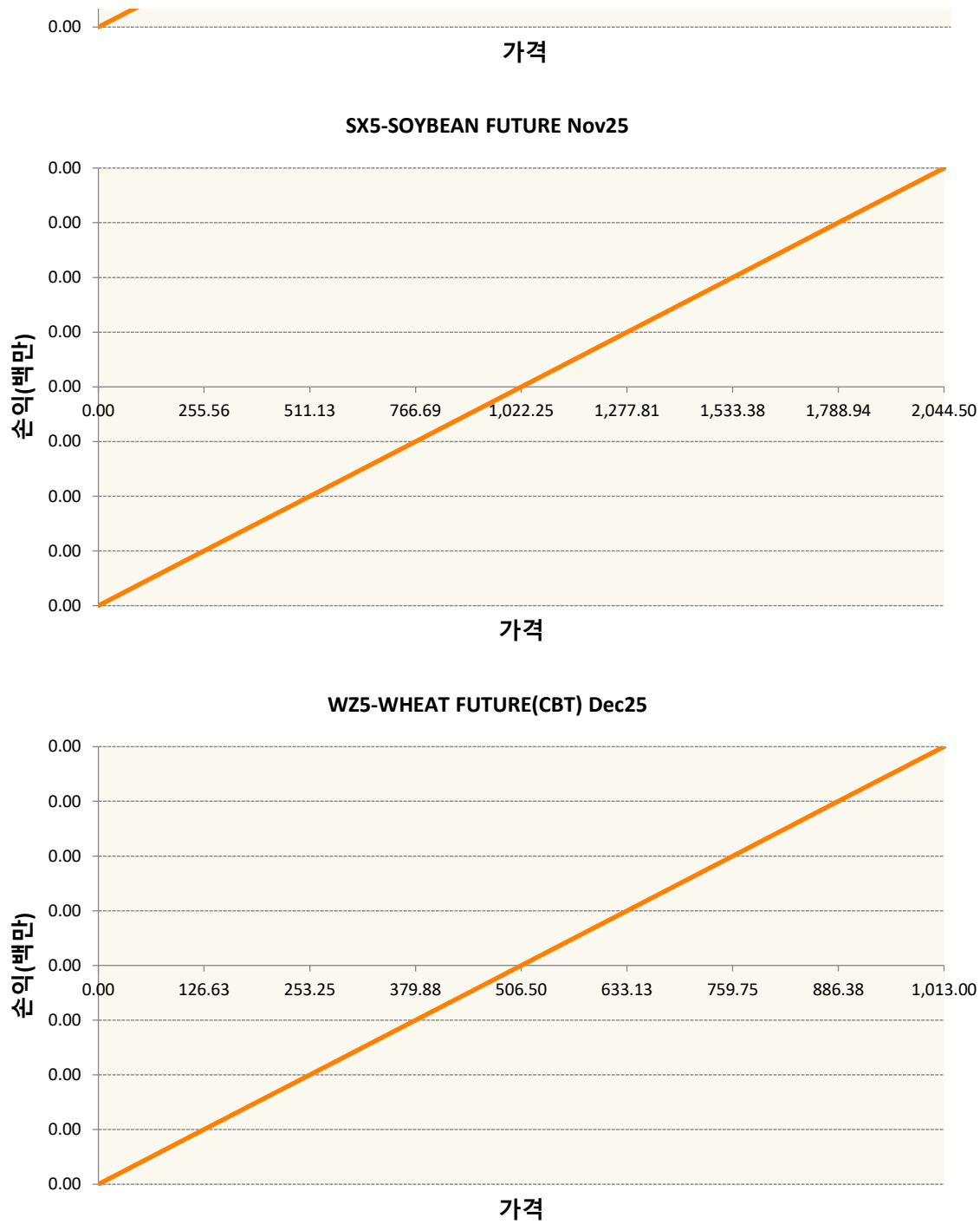
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,166 | 0     | 1,166     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,090 | 0     | 2,090     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 284   | -284      | 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 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

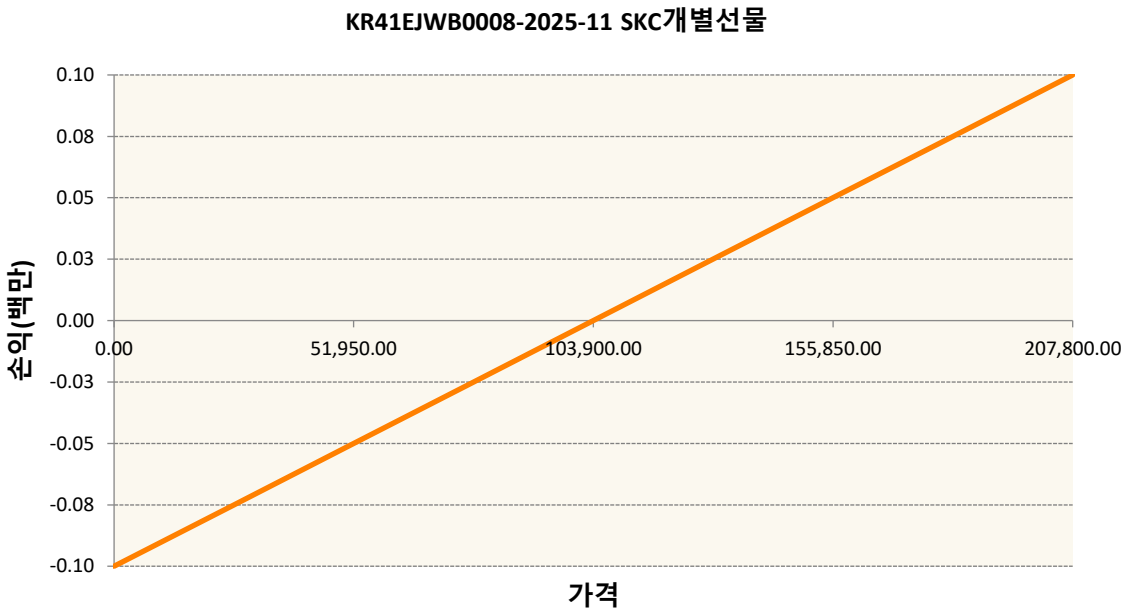
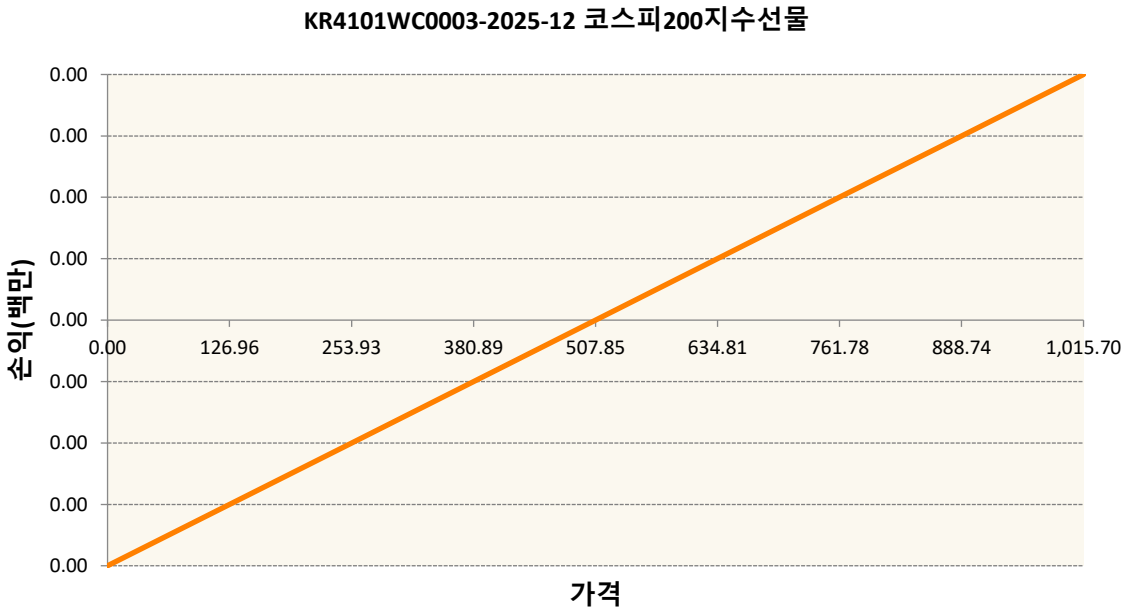
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

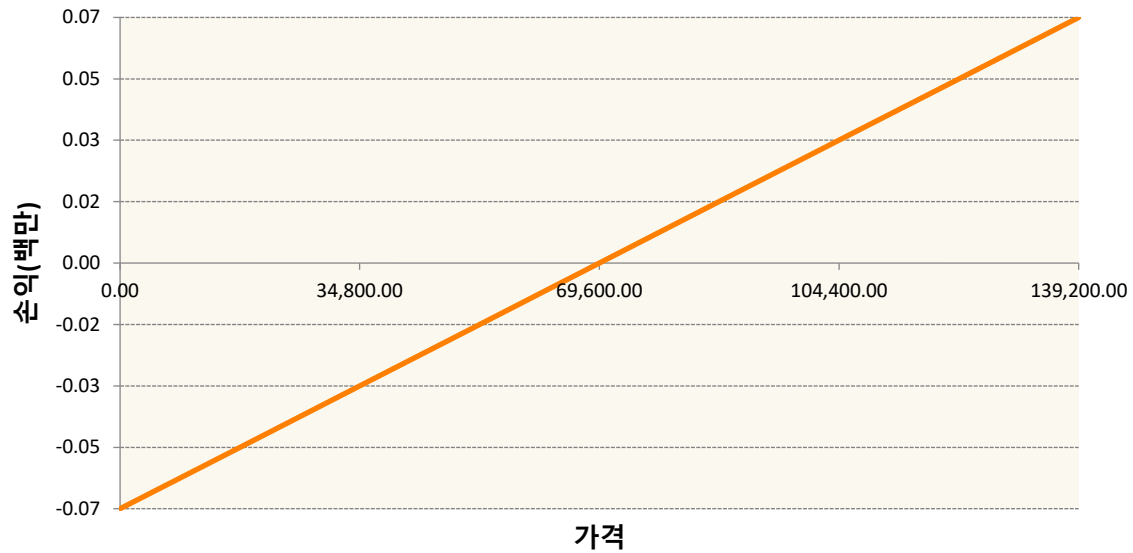
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 127   | -127      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,190 | 0     | 1,190     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물  
 KR41EJWB00 2025-11 SKC개별선물  
 KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물

|    |
|----|
| 91 |
| 2  |
| 2  |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 12 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

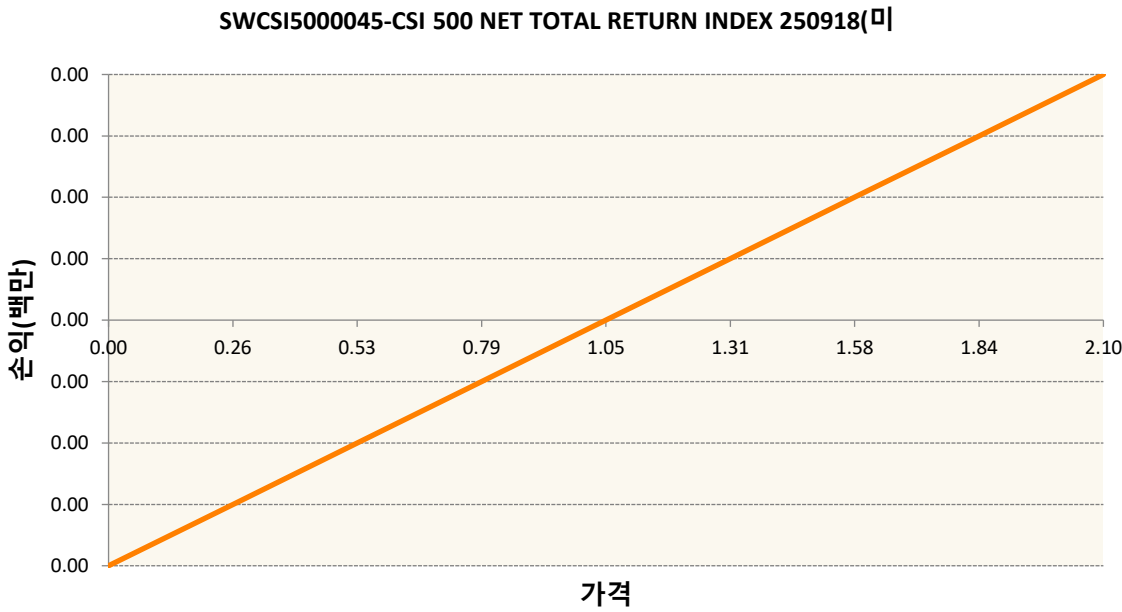
SOL차이나강소기업CSI500상장

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   | 4,935 | 0     | 4,935     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

395

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

618

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

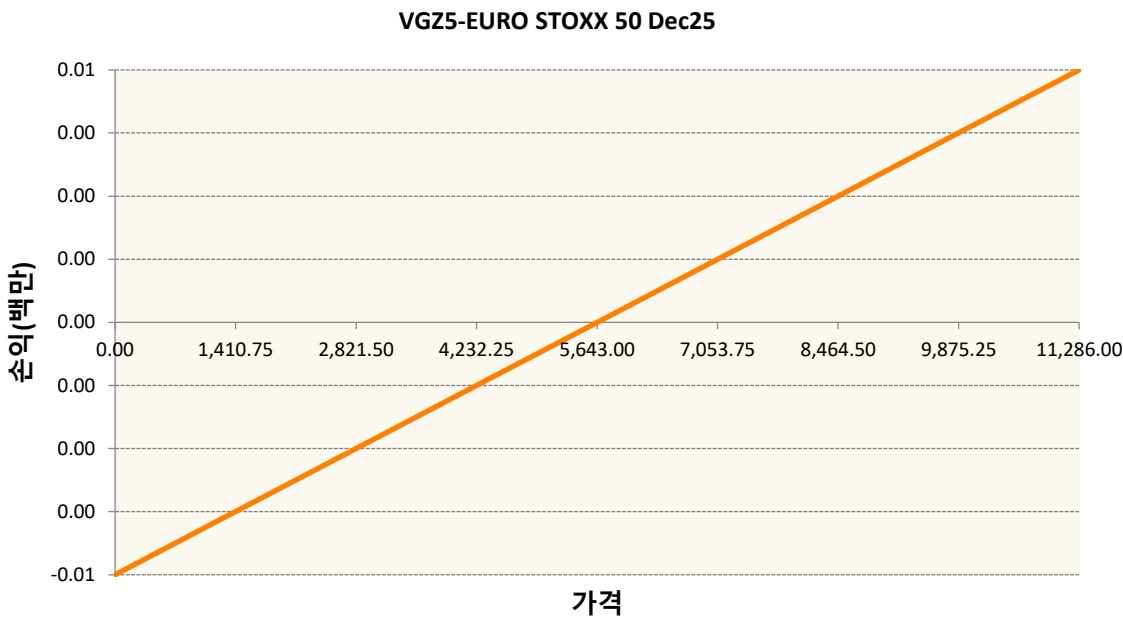
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 739   | 0     | 739       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGZ5 | EURO STOXX 50 Dec25 | 59 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 50 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

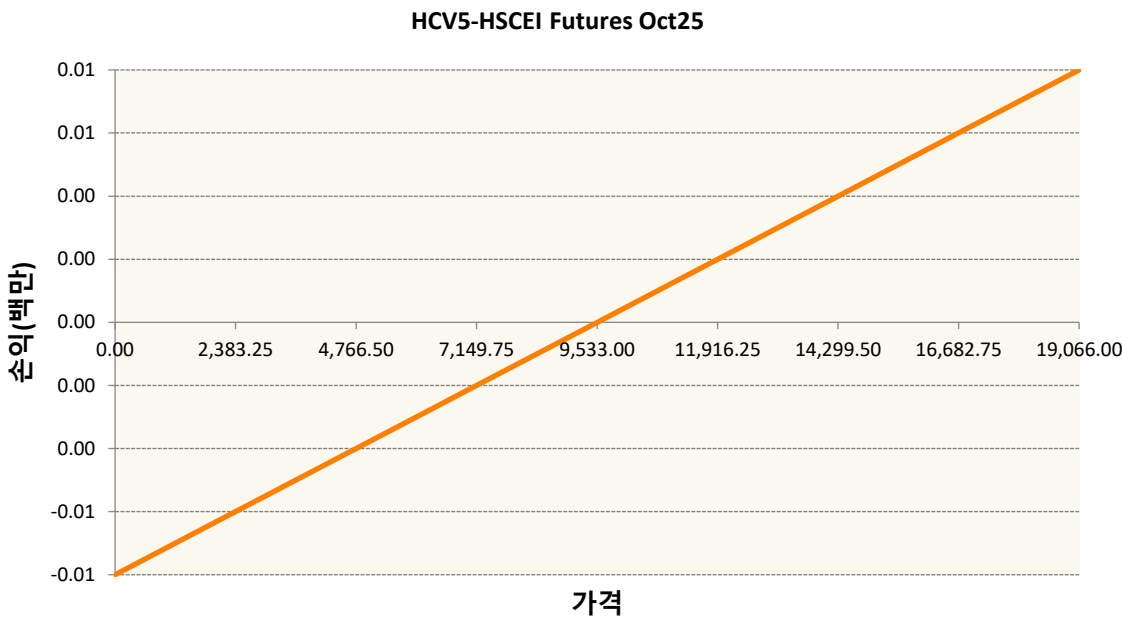
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 2,164 | 0     | 2,164     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCV5 | HSCEI Futures Oct25 | 173 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

244

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

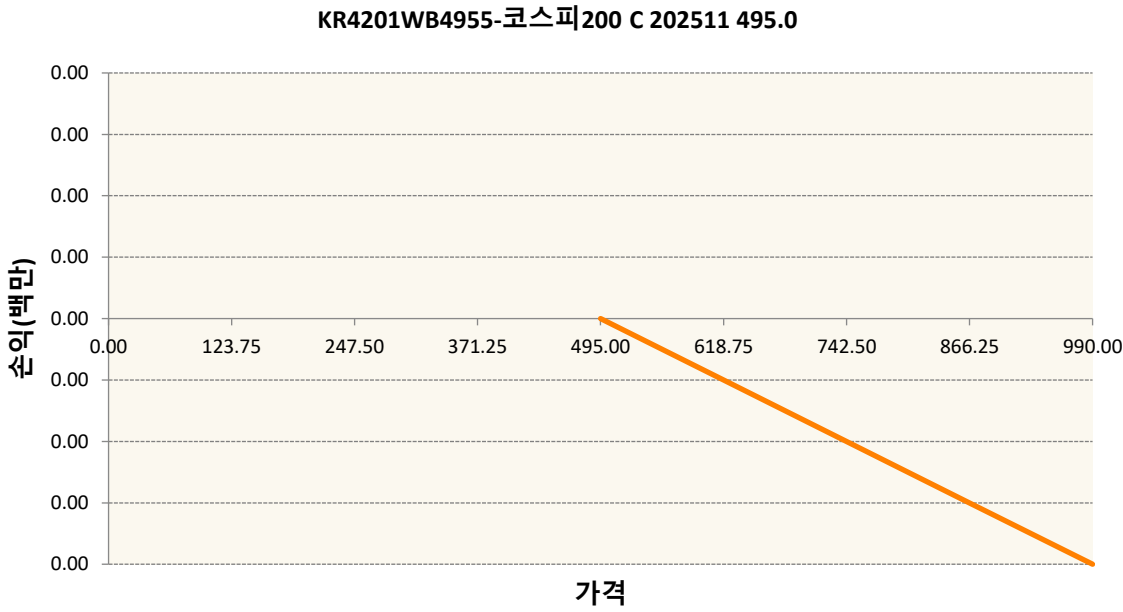
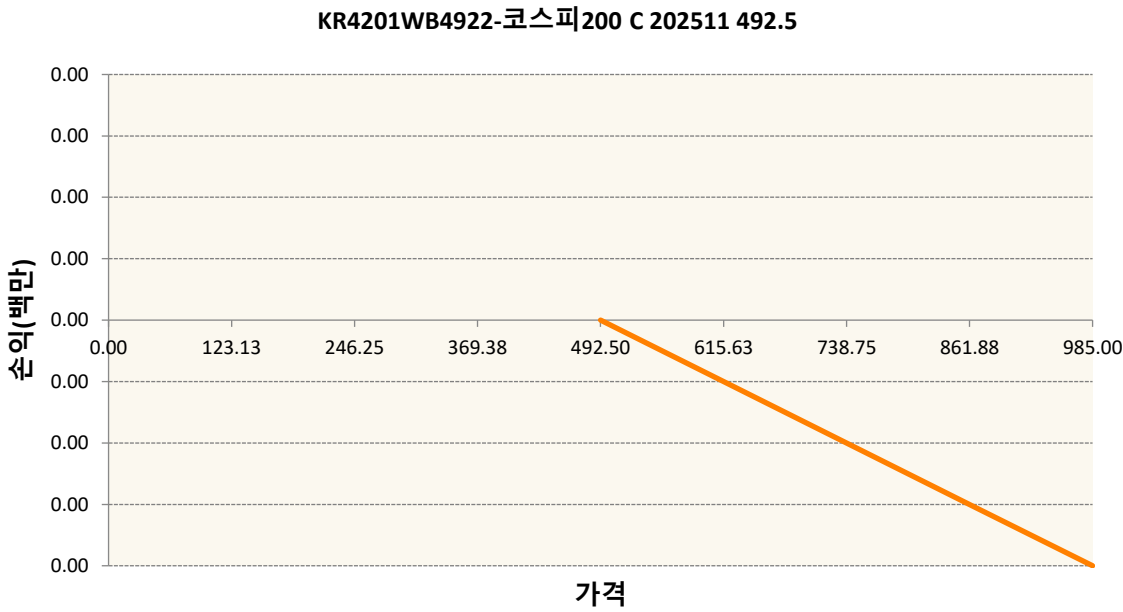
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

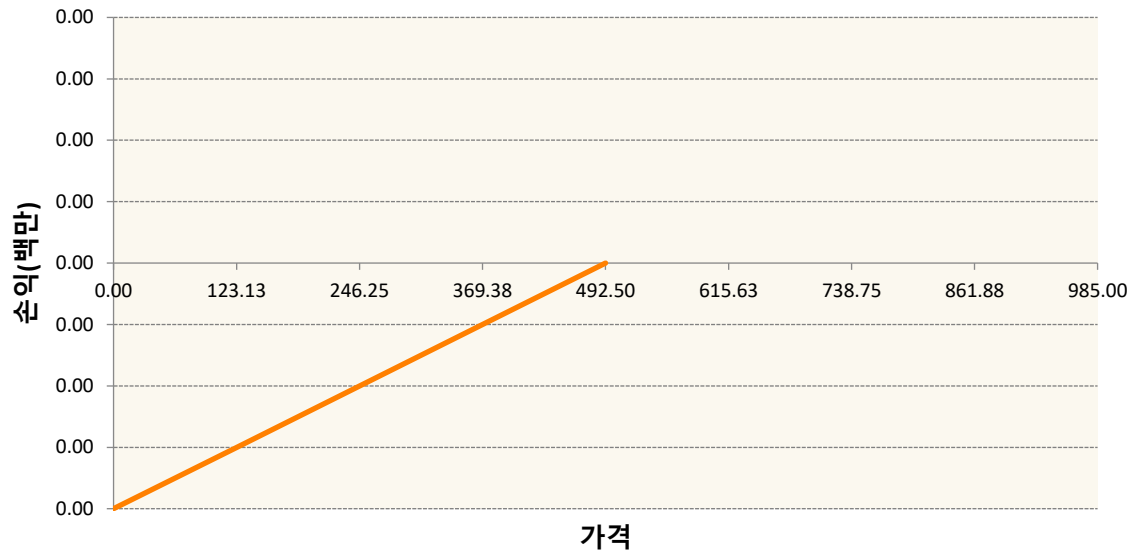
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 36,385 | -36,385   | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 35,083 | -35,083   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301WB4921-코스피200 P 202511 492.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WB49코스피200 C 202511 492.5

493

KR4201WB49코스피200 C 202511 495.0

1,822

KR4301WB49코스피200 P 202511 492.5

493

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-10-13

기준일 2025-10-10

## 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 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

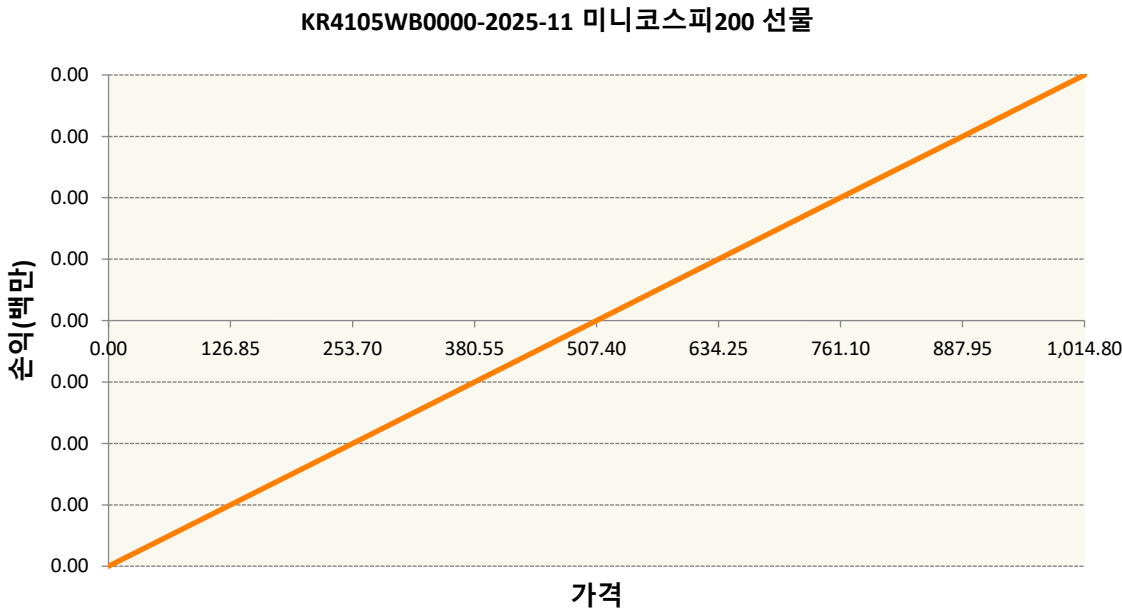
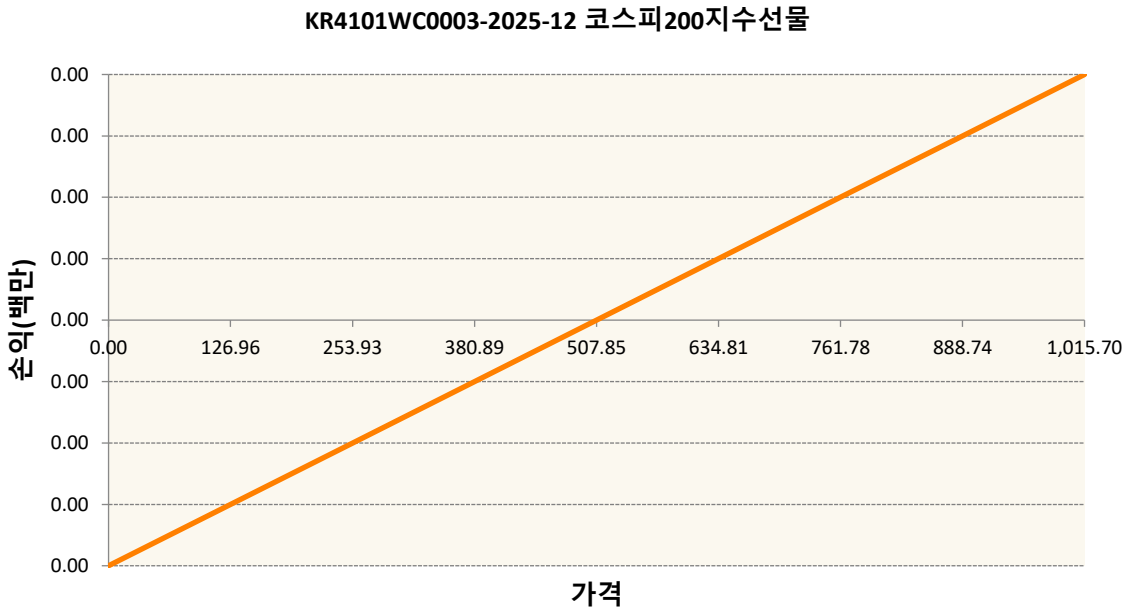
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

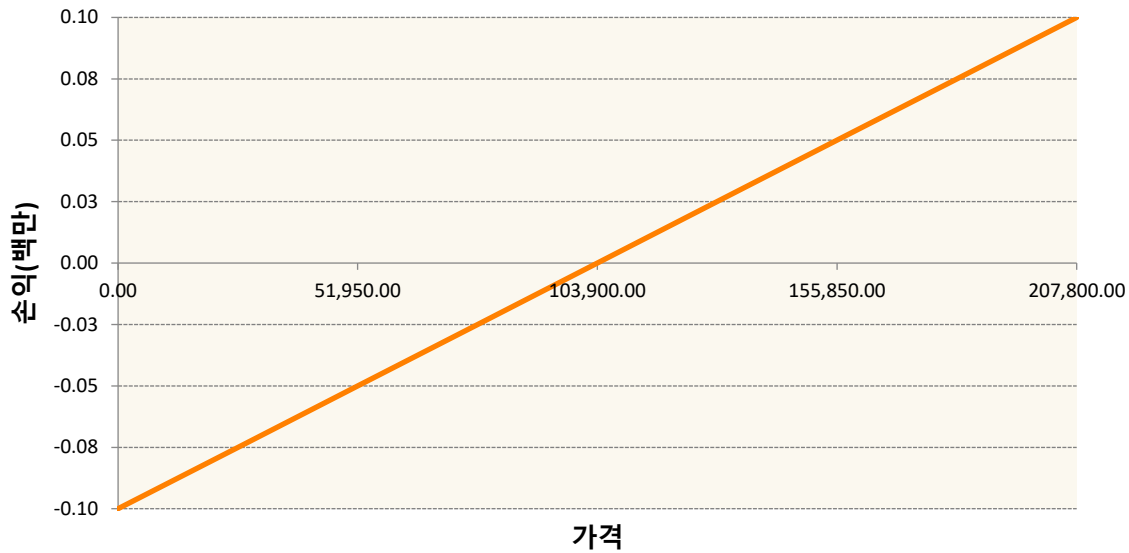
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 126   | 0     | 126       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 528   | 0     | 528       | 장내 |

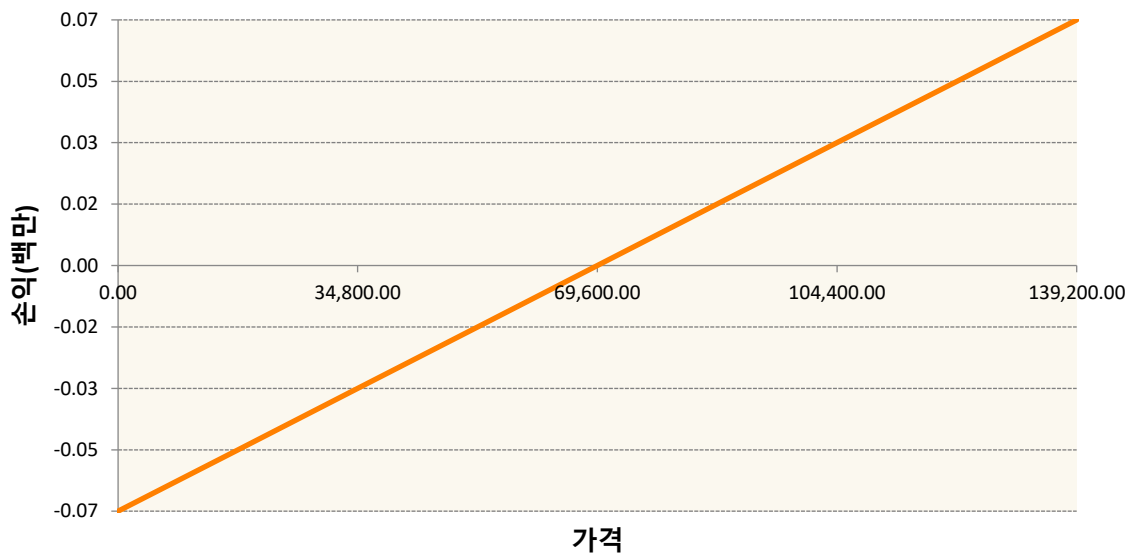
2. 만기시점의 손익구조



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                |    |
|--------------------------------|----|
| KR4101WC0( 2025-12 코스피200지수선물  | 30 |
| KR4105WB0( 2025-11 미니코스피200 선물 | 2  |
| KR41EJWB0( 2025-11 SKC개별선물     | 1  |
| KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물     | 1  |

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

(단위:백만원)

5

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

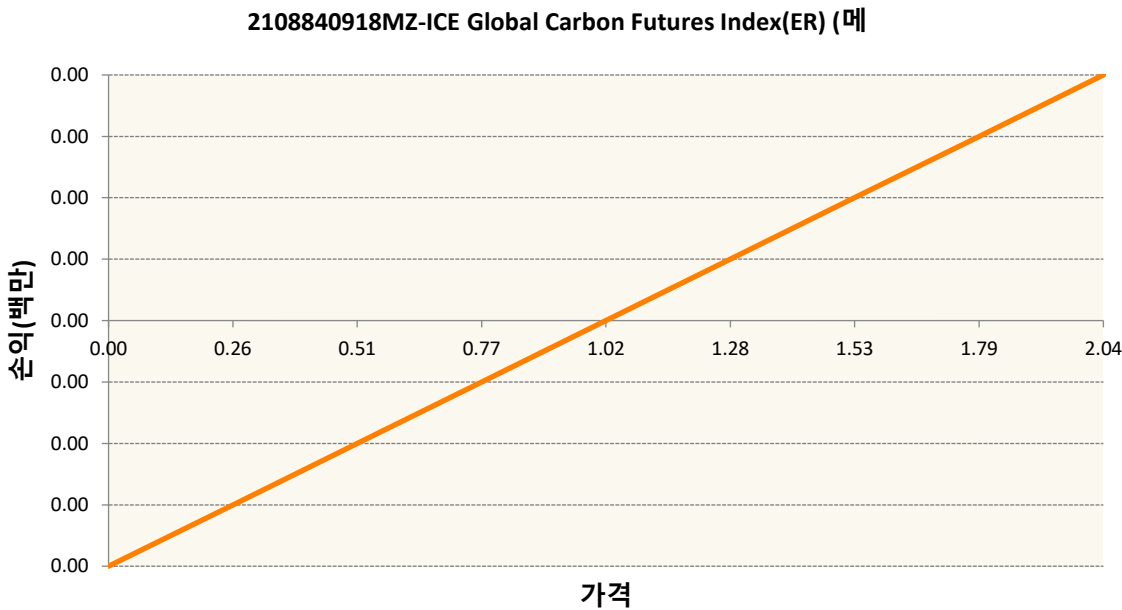
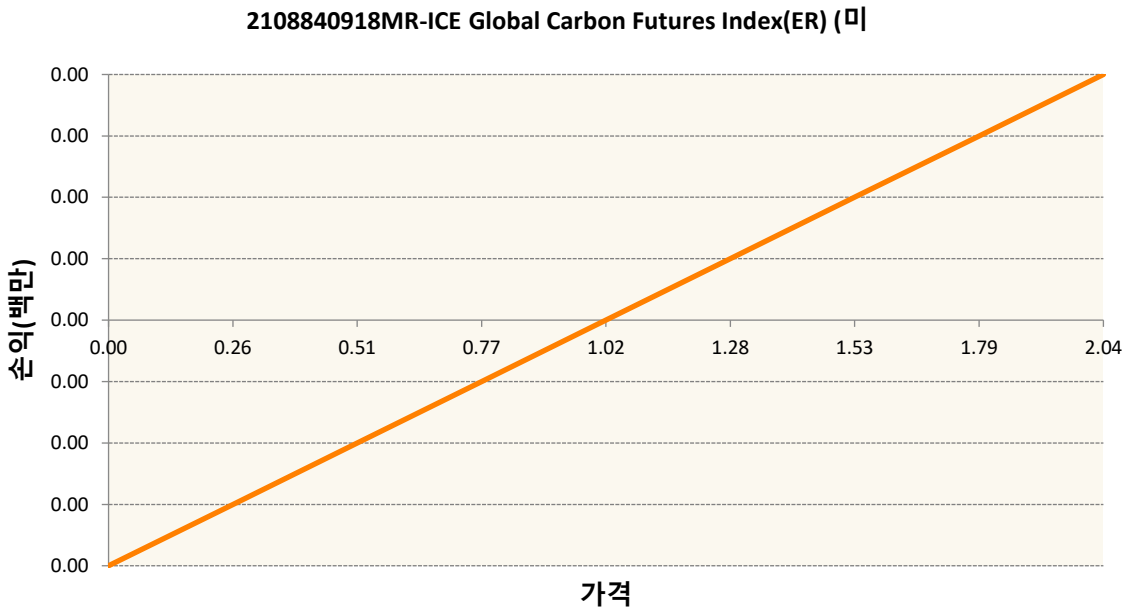
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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   | 9,690 | 0     | 9,690     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 663      |
| 2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 111      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 769      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

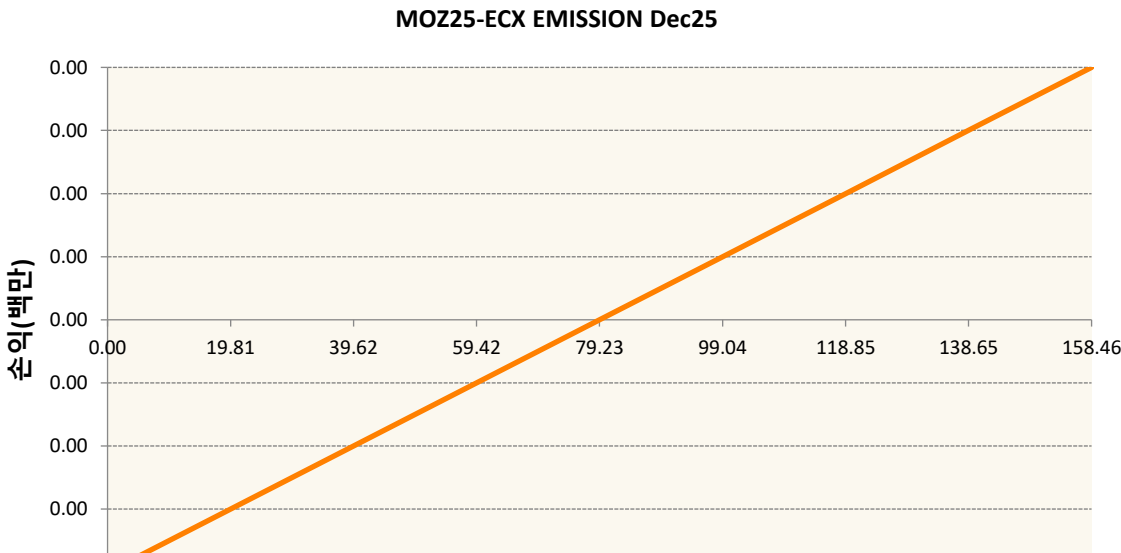
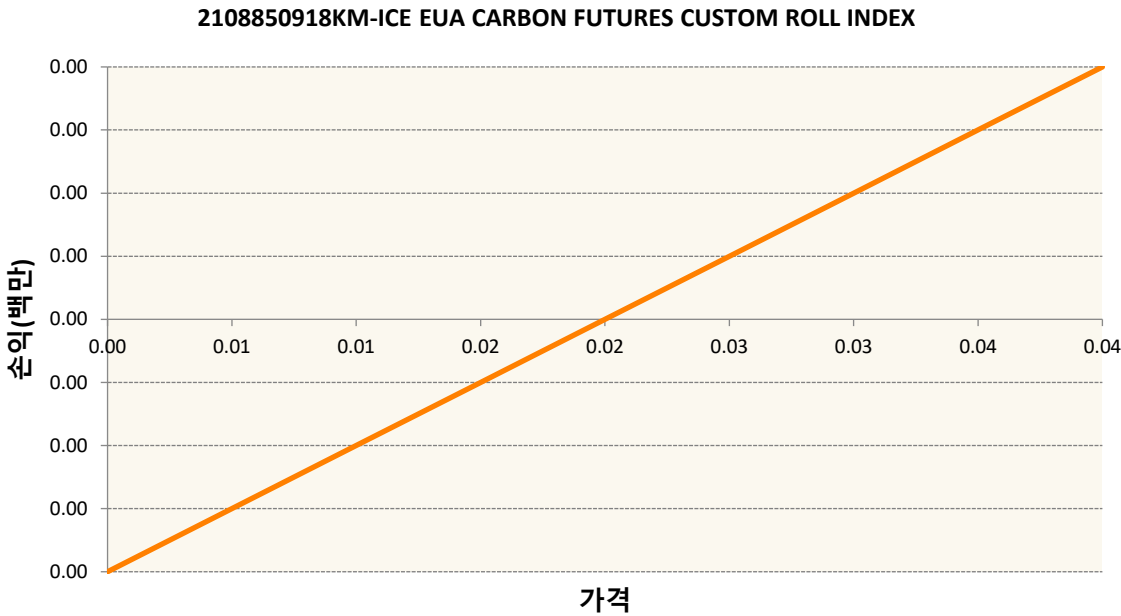
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 5,949 | 0     | 5,949     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 8     | 0     | 8         | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,268 | -2,268    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



0.00



가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

|                                                     |     |
|-----------------------------------------------------|-----|
| 2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 1   |
| FXW213F9SC KRW/EUR 31-10-25E                        | 181 |
| MOZ25      ECX EMISSION Dec25                       | 476 |

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

(단위:백만원)

**758**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

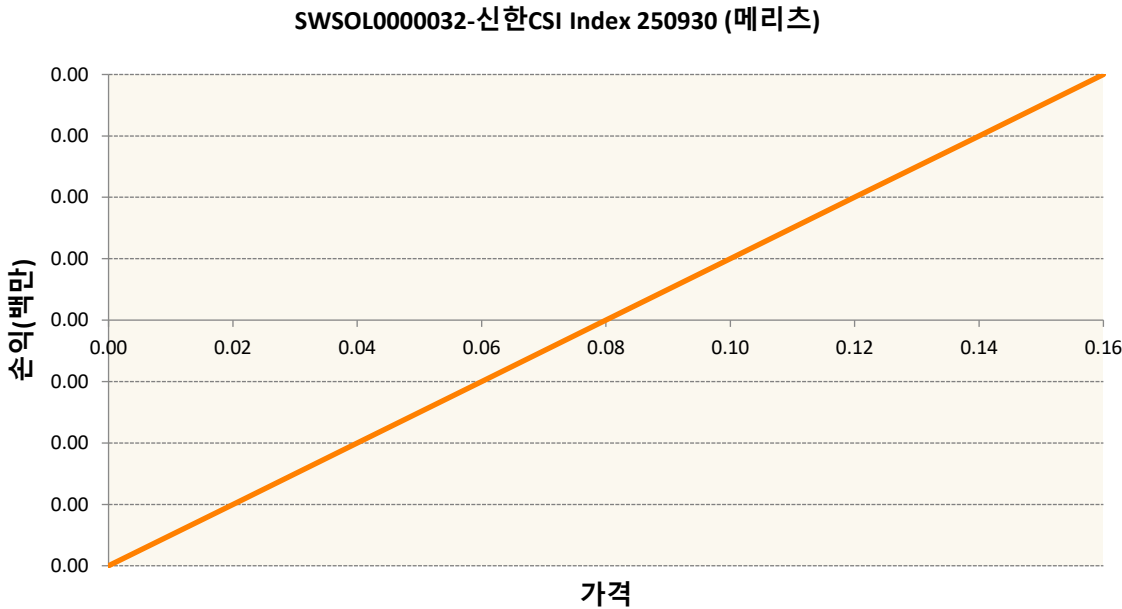
## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 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   | 2,697 | 0     | 2,697     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                |    |
|------------------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 9  |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 6  |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 6  |
| SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)            | 15 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 63 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

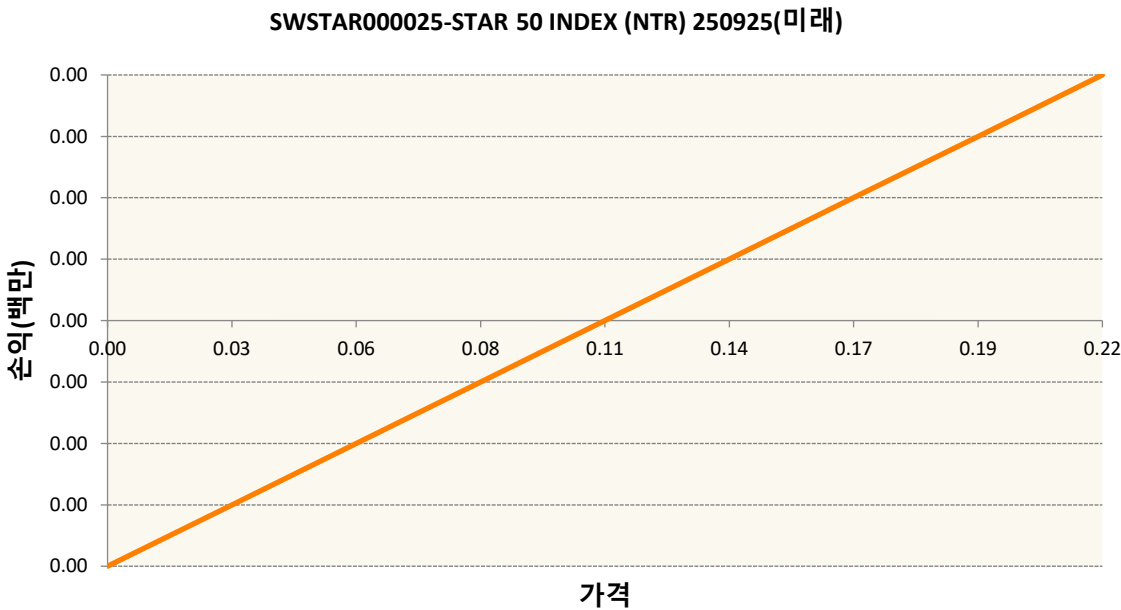
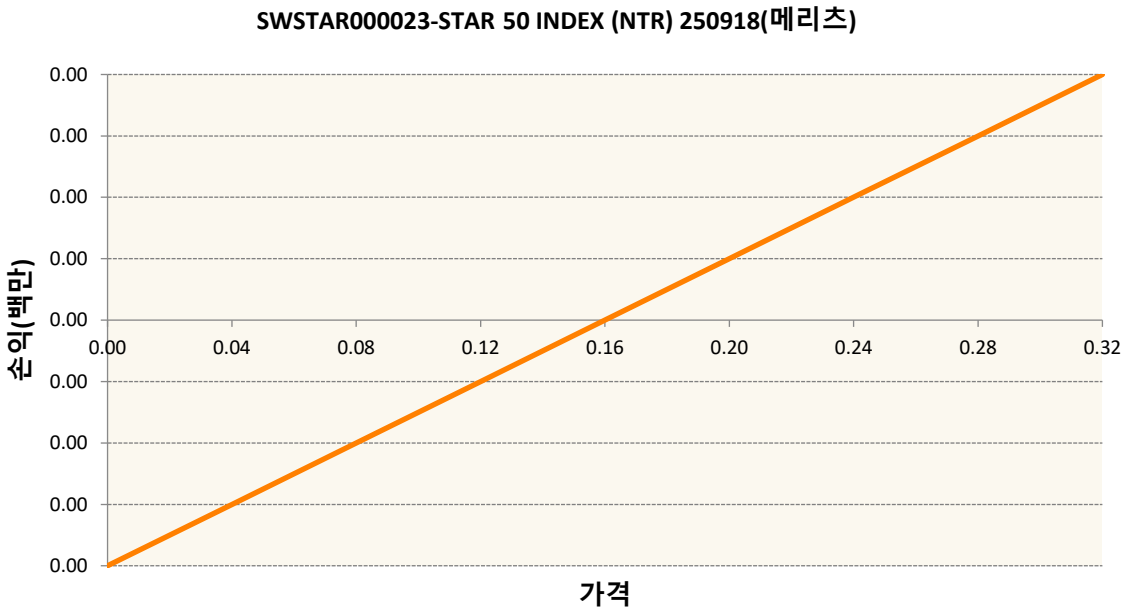
## SOL차이나육성산업엑티브상장지

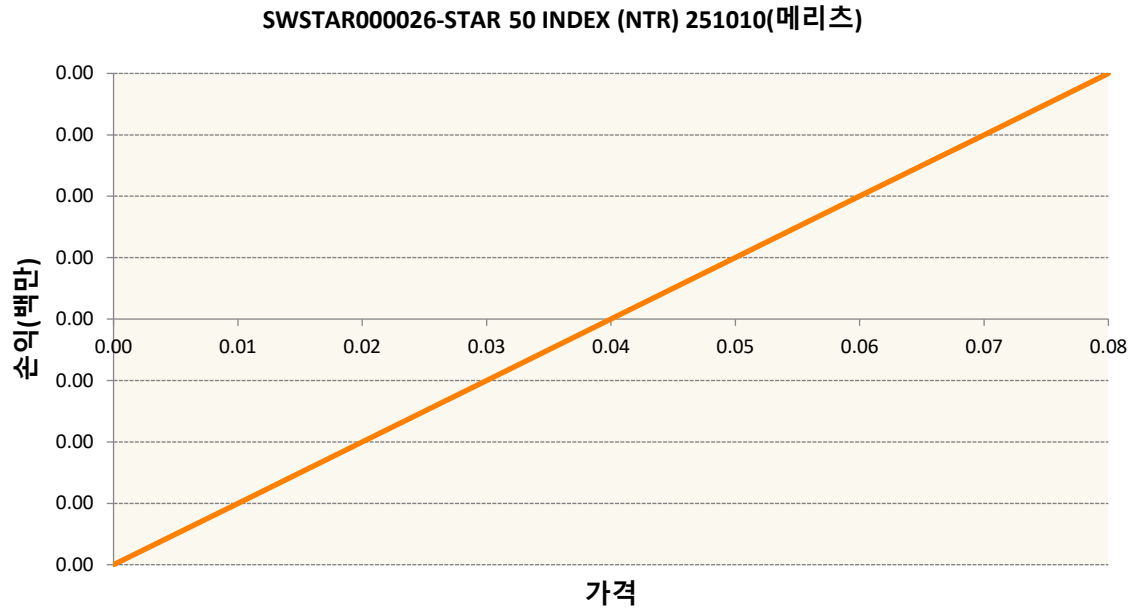
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 6,015 | 0     | 6,015     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                  |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------------------|--|----------|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)     |  | 36       |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)     |  | 11       |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠) |  | 132      |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)  |  | 49       |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠) |  | 16       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 435      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

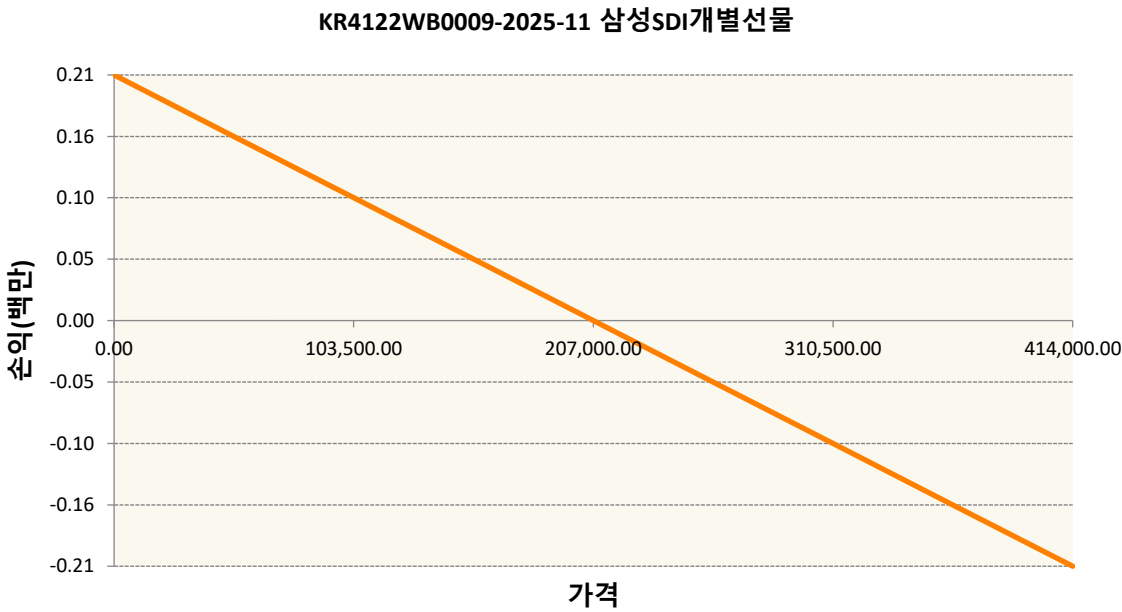
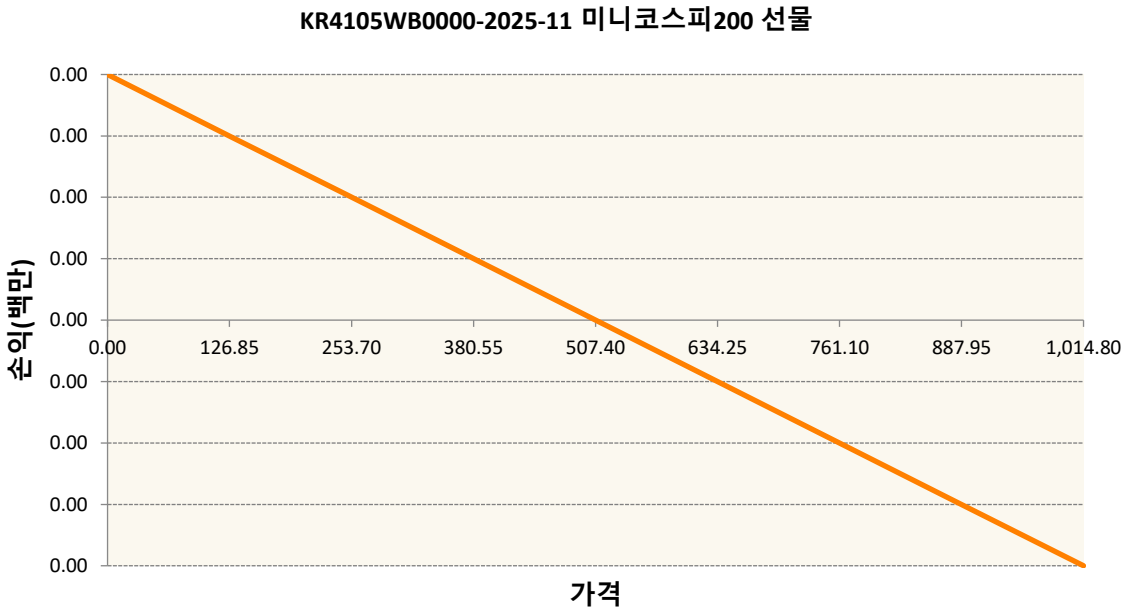
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

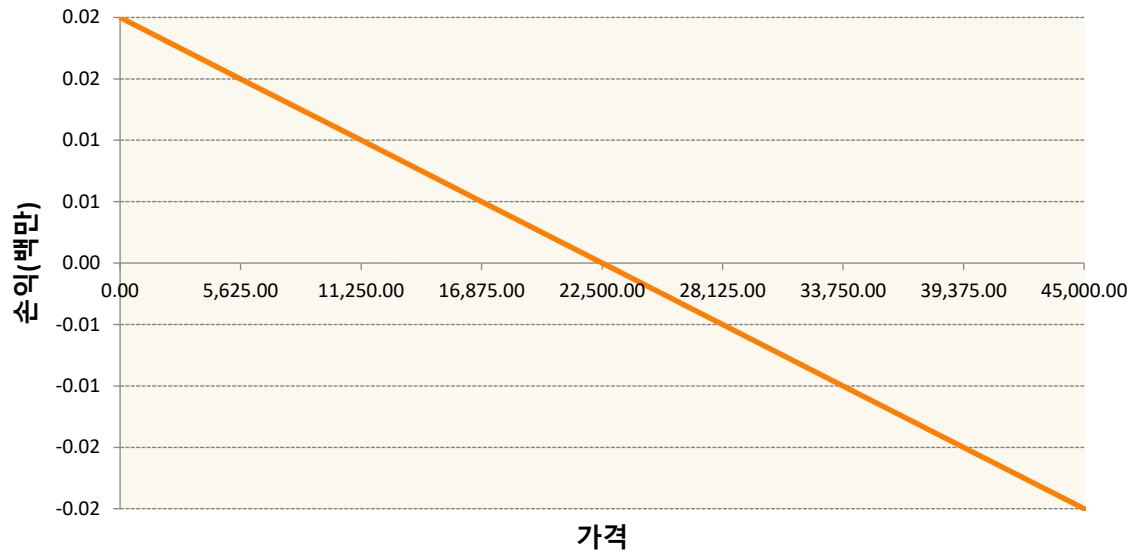
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 758   | -758      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 22    | 786   | -765      | 장내 |

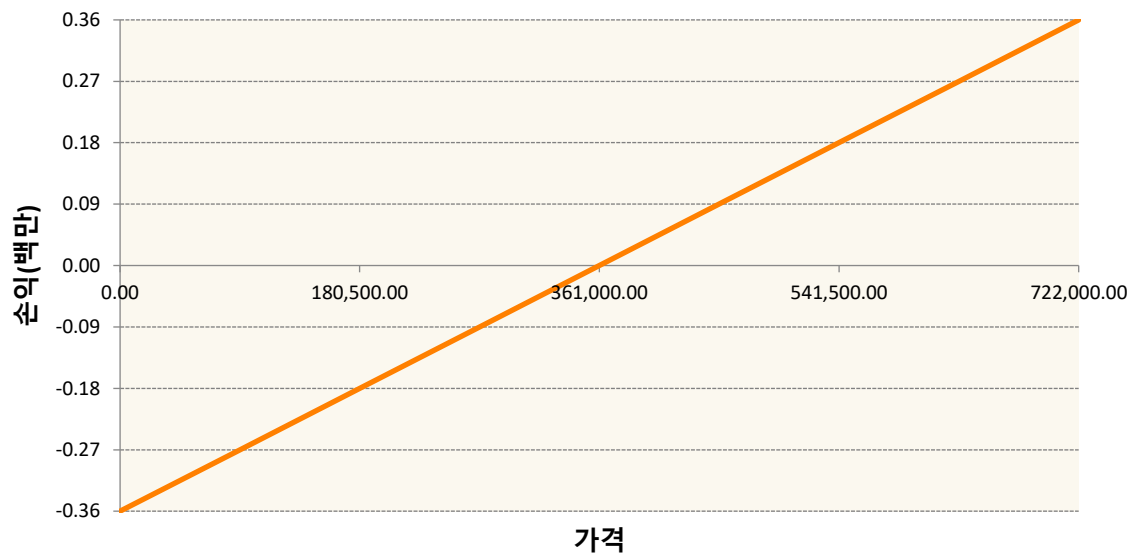
### 2. 만기시점의 손익구조



KR41BFWB0005-2025-11 삼성중공업개별선물



KR41F5WB0007-2025-11 LG에너지솔루션개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                 |      |
|---------------------------------|------|
| KR4105WB0( 2025-11 미니코스피200 선물  | 12   |
| KR4122WB0( 2025-11 삼성SDI개별선물    | 2    |
| KR41BFWB0( 2025-11 삼성중공업개별선물    | 0.36 |
| KR41F5WB0( 2025-11 LG에너지솔루션개별선물 | 2    |

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

(단위:백만원)

4

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

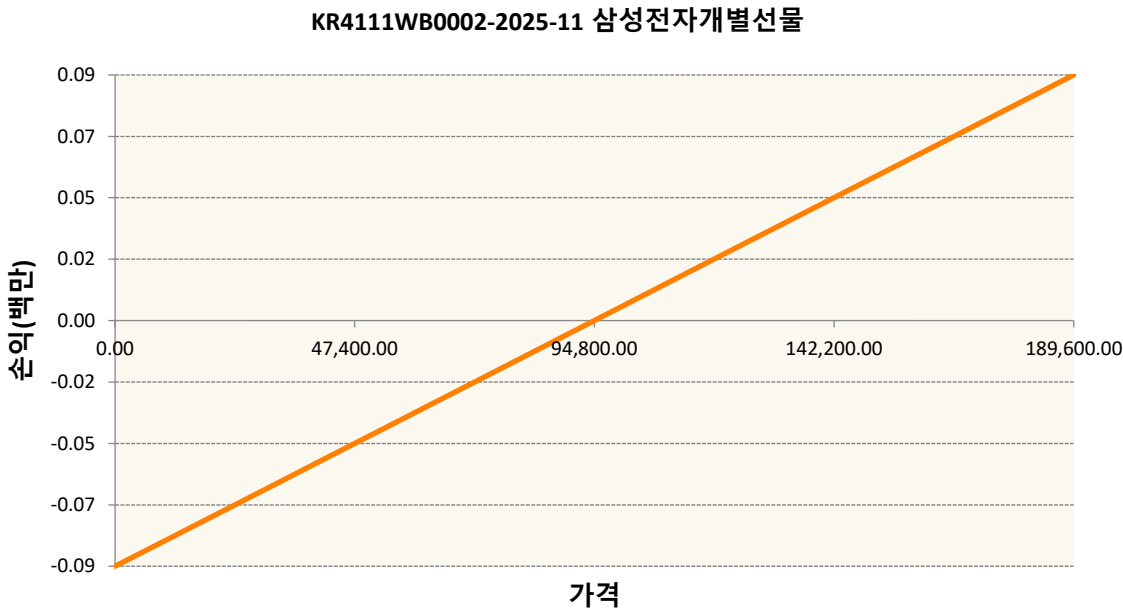
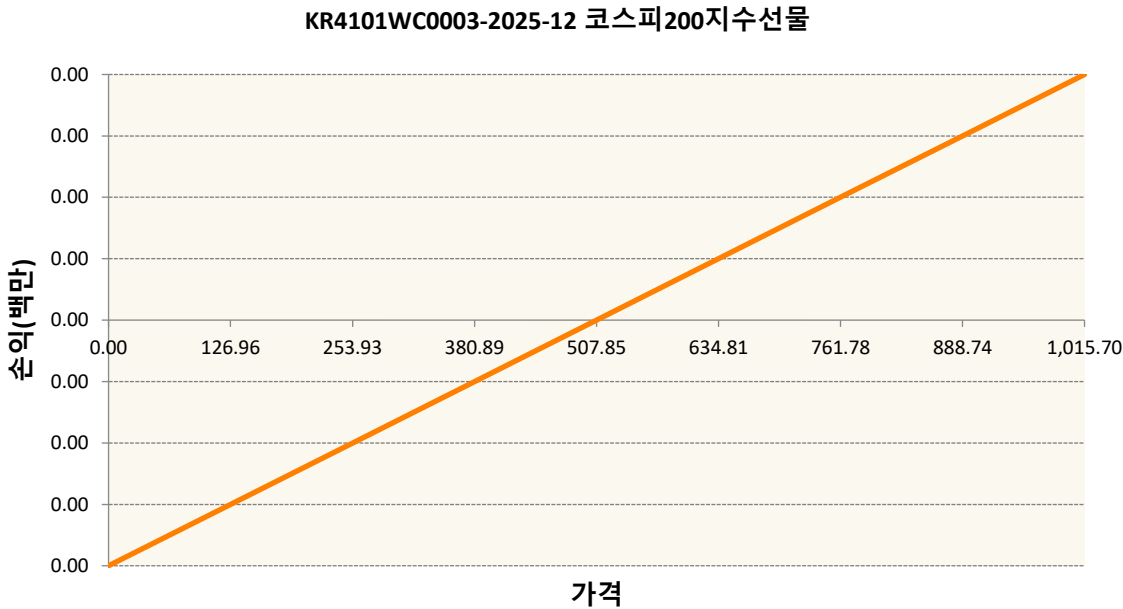
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

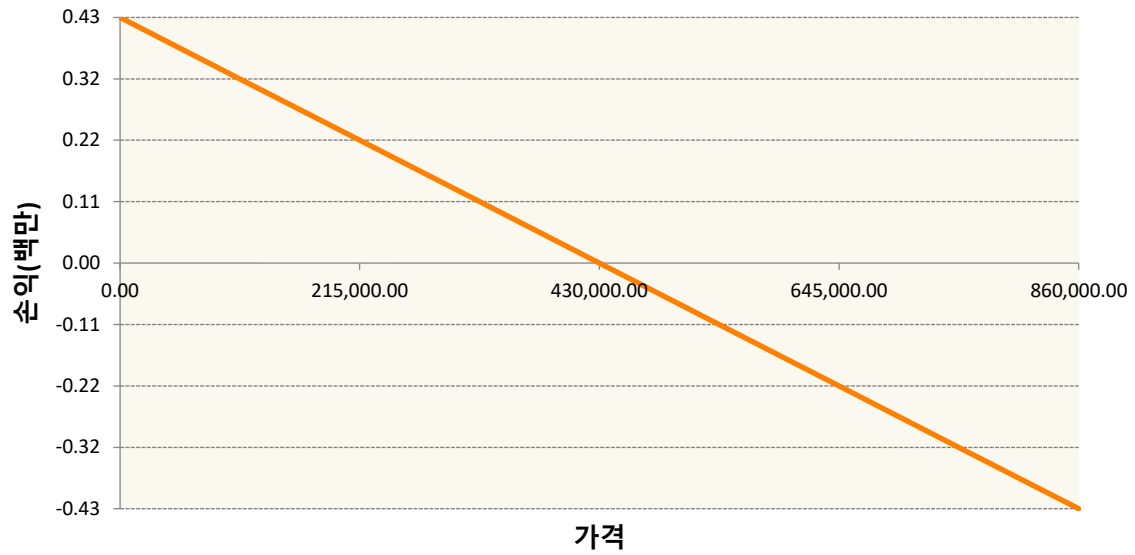
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 761   | -761      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 6,947 | 993   | 5,953     | 장내 |

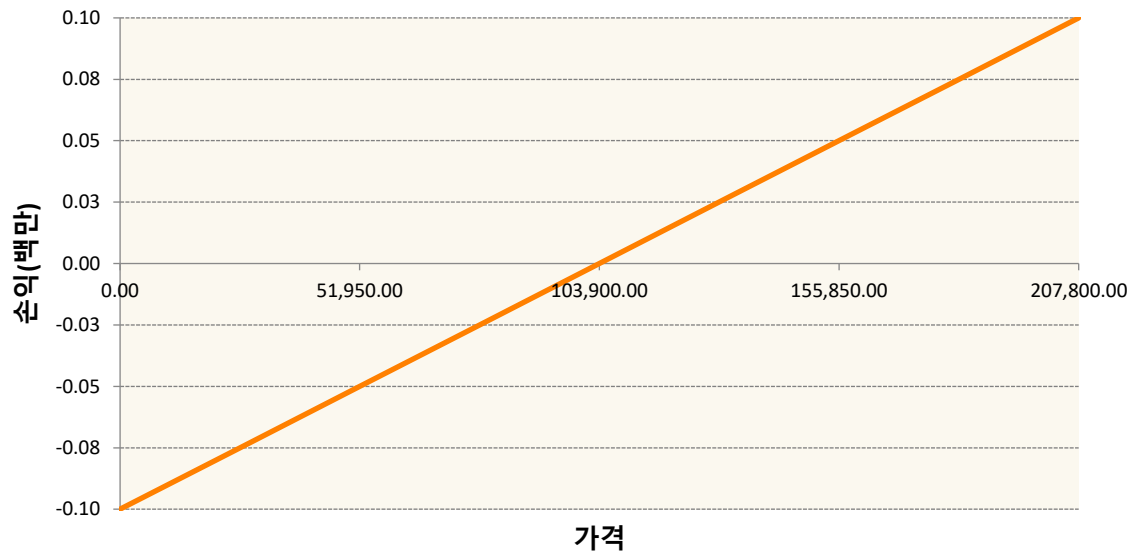
2. 만기시점의 손익구조



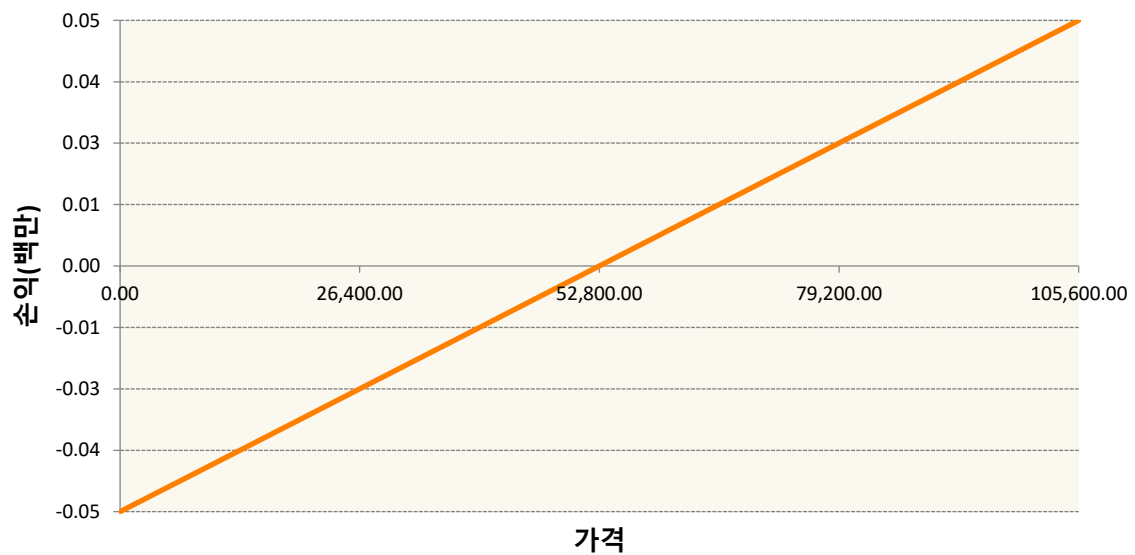
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



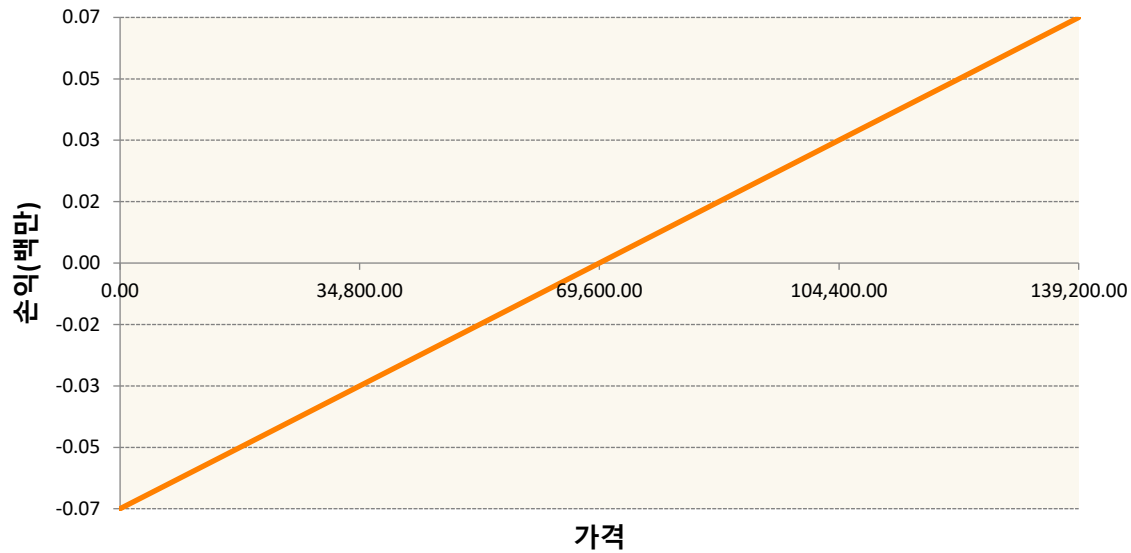
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



### KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| KR4101WC0( 2025-12 코스피200지수선물 | 386 |
| KR4111WB0( 2025-11 삼성전자개별선물   | 114 |
| KR4150WB0( 2025-11 SK하이닉스개별선물 | 79  |
| KR41EJWB0C 2025-11 SKC개별선물    | 21  |
| KR41F7WB0( 2025-11 카카오페이개별선물  | 15  |
| KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물    | 20  |

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

(단위:백만원)

367

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

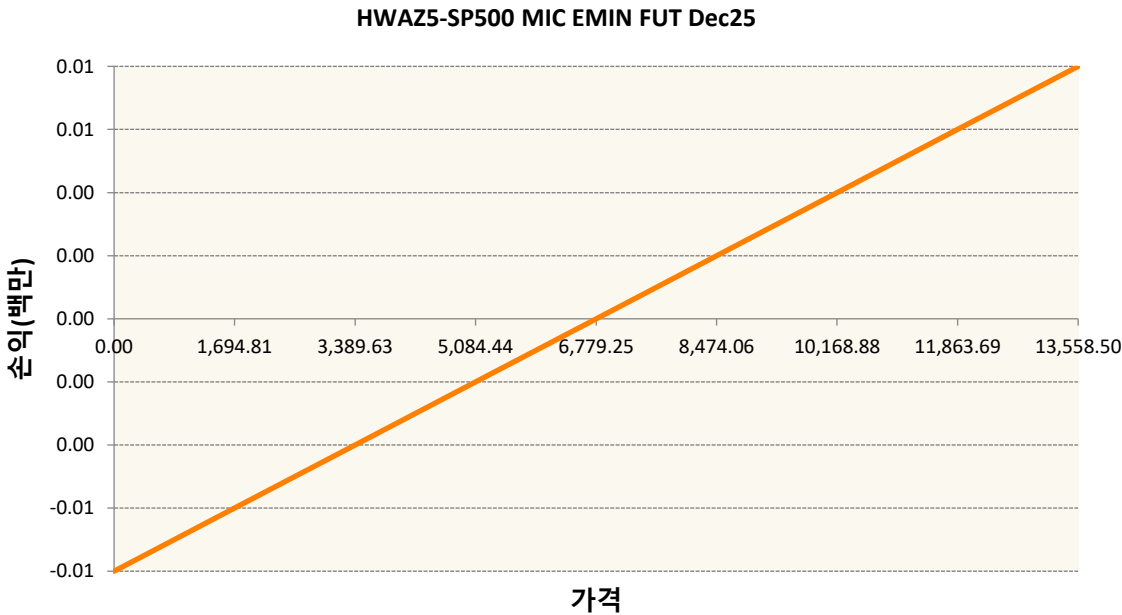
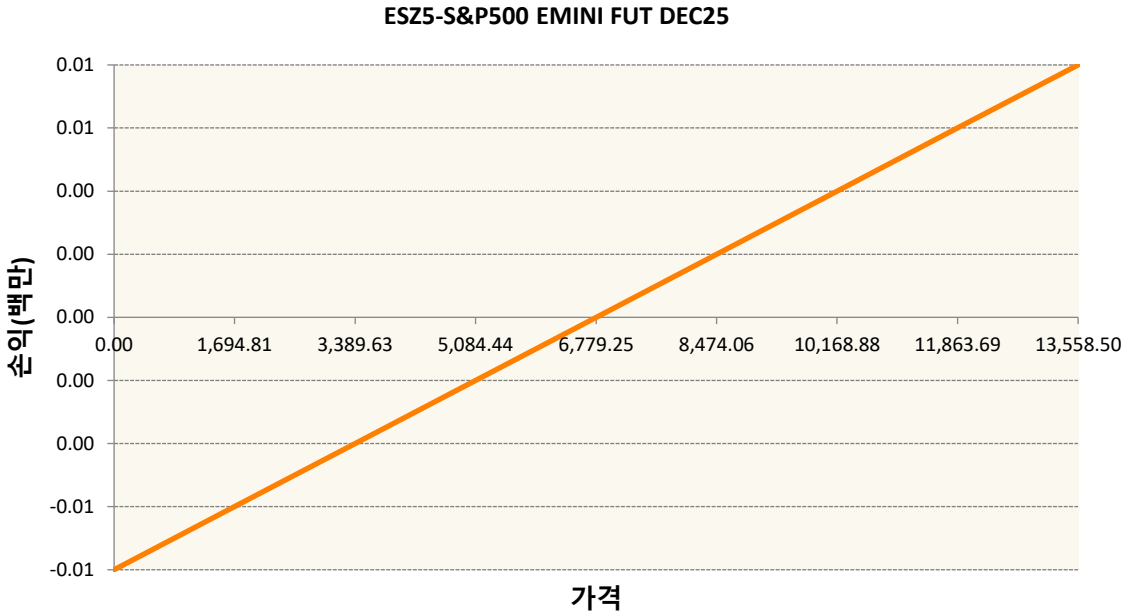
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 38,129 | 0     | 38,129    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,271  | 0     | 1,271     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ5                      | S&P500 EMINI FUT DEC25   | 3,050    |
| HWAZ5                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec25 | 102      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 4,470    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

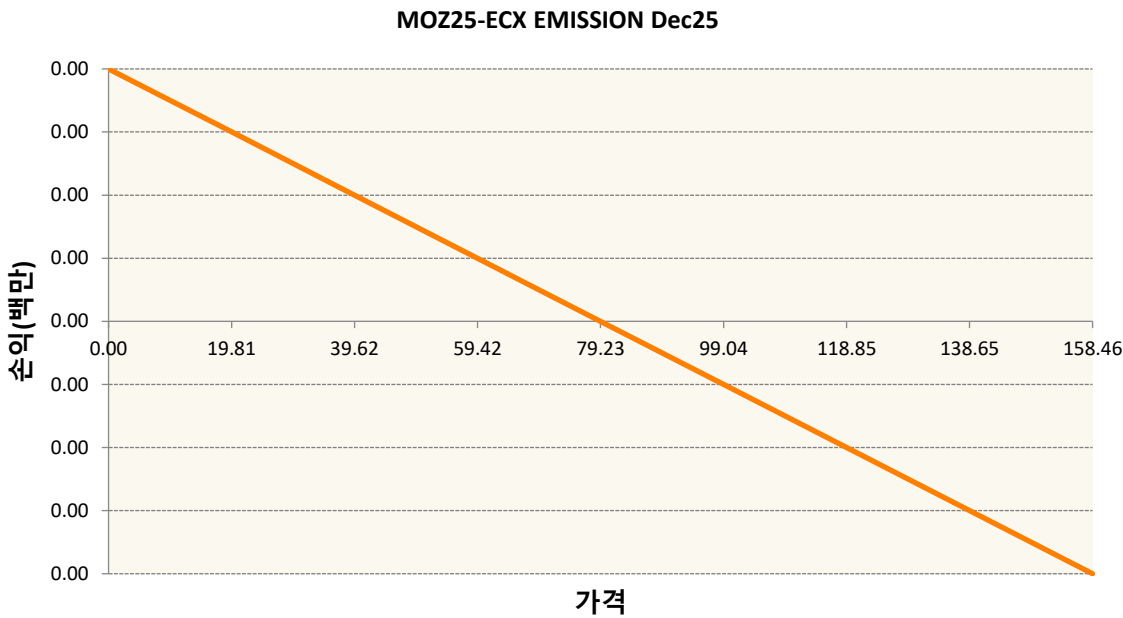
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 2,862 | -2,862    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | -8    | 0     | -8        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 82    | 1,223 | -1,141    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                      |     |
|------------------------------------------------------|-----|
| 2109930918IIICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 1   |
| FXW213F9SC KRW/EUR 31-10-25E                         | 98  |
| FXW213FAA( EUR/KRW 31-10-25E                         | 7   |
| MOZ25      ECX EMISSION Dec25                        | 229 |

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

(단위:백만원)

377

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

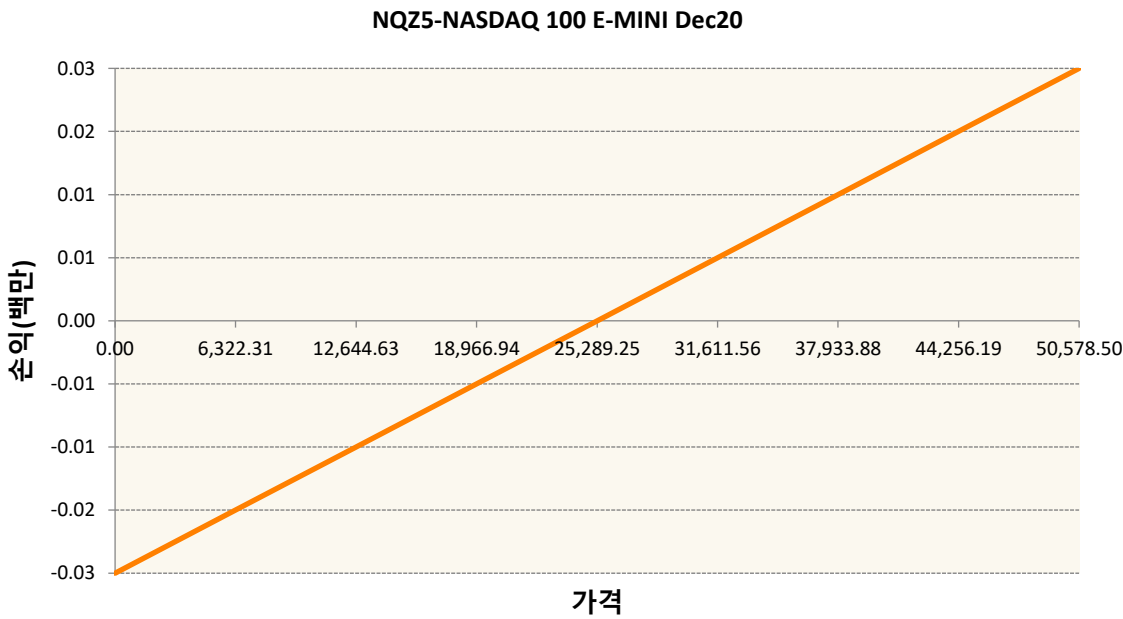
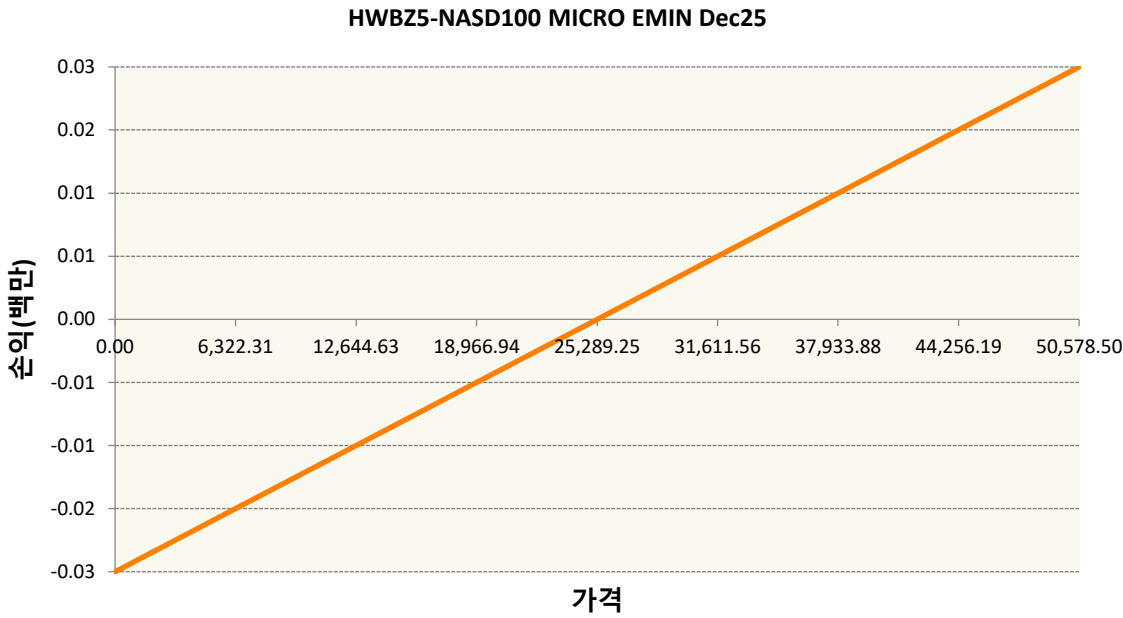
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 16,161 | 0     | 16,161    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,039  | 0     | 2,039     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| HWBZ5                     | NASD100 MICRO EMIN Dec25 | 163      |
| NQZ5                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  | 1,293    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,578    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

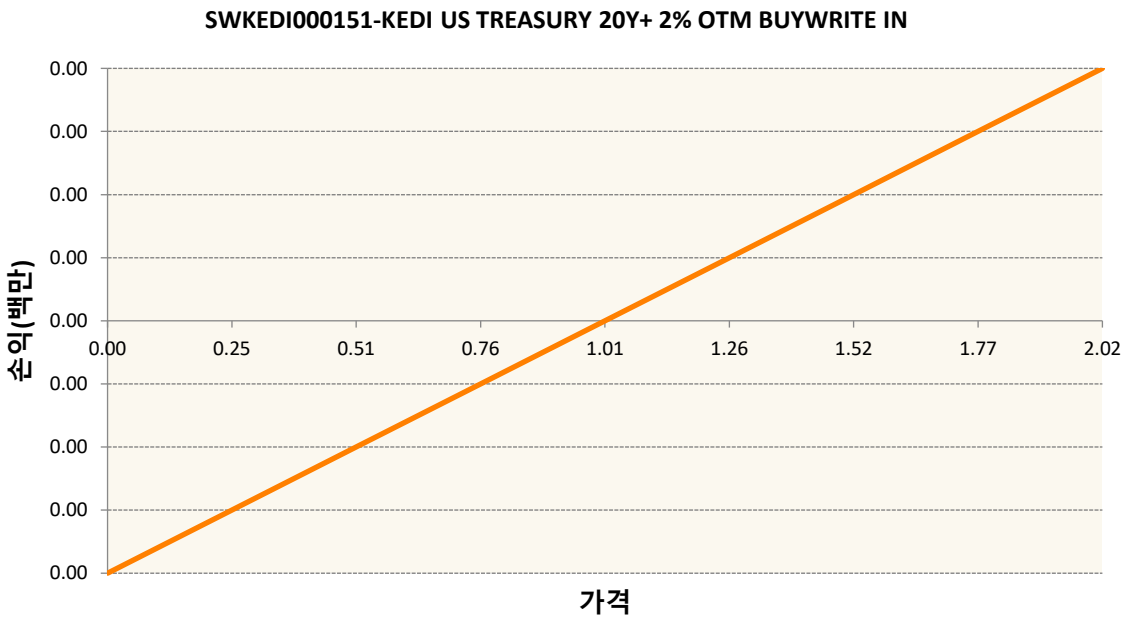
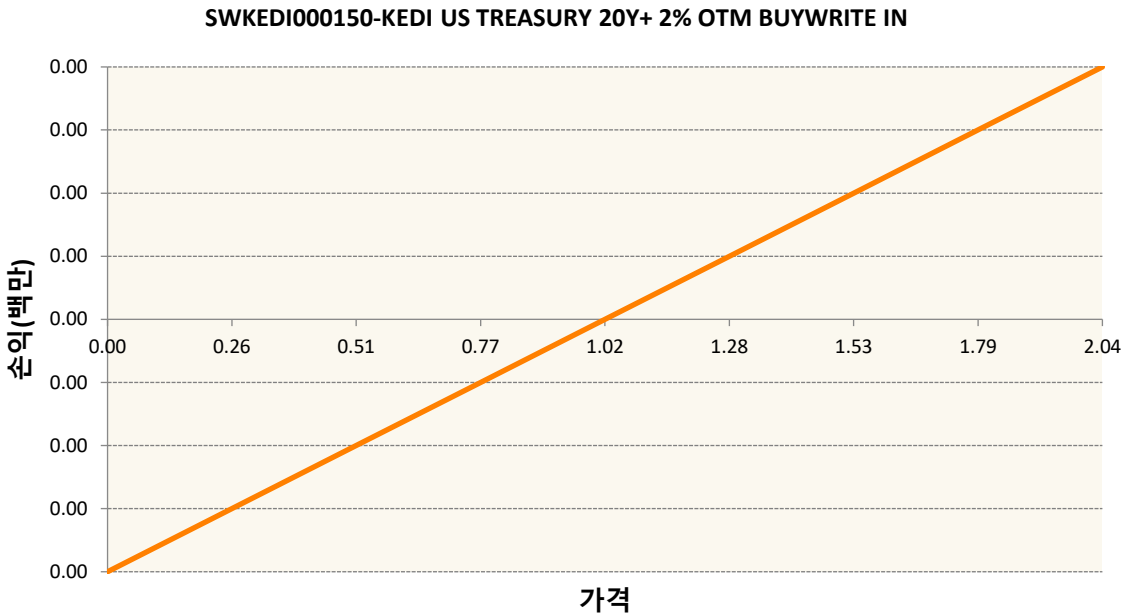
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

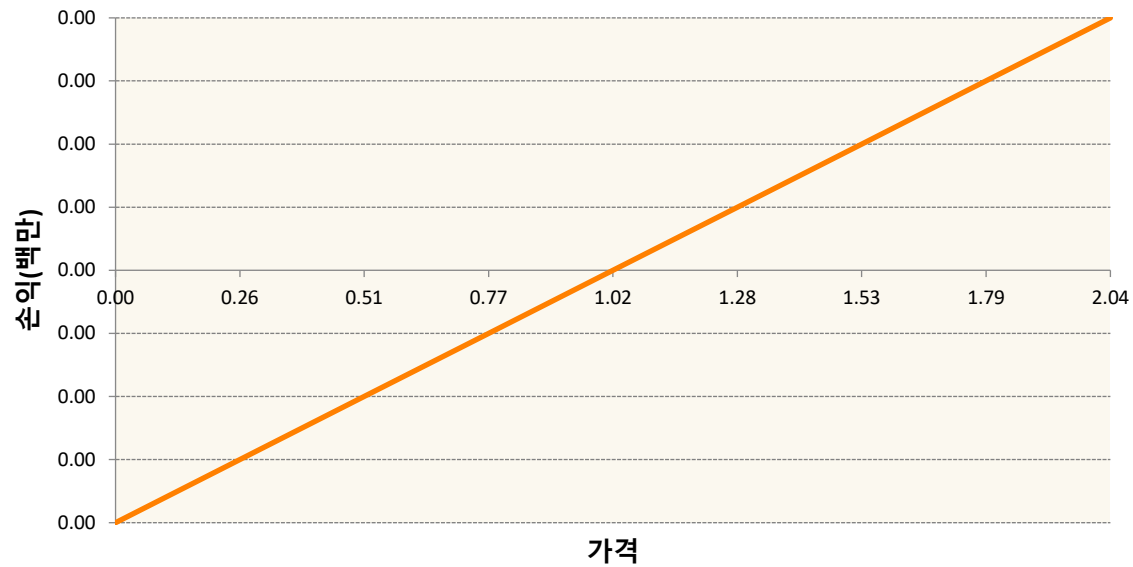
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 367,660 | 0     | 367,660   | 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

|       |
|-------|
| 8,292 |
| 7,866 |
| 3,650 |
| 9,856 |

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

(단위:백만원)

|        |
|--------|
| 14,558 |
|--------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

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   | 2,424 | 0     | 2,424     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |   |
|----------------------------------------------------|---|
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 5 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 5 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 5 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 5 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 26 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-13 |
| 기준일 | 2025-10-10 |

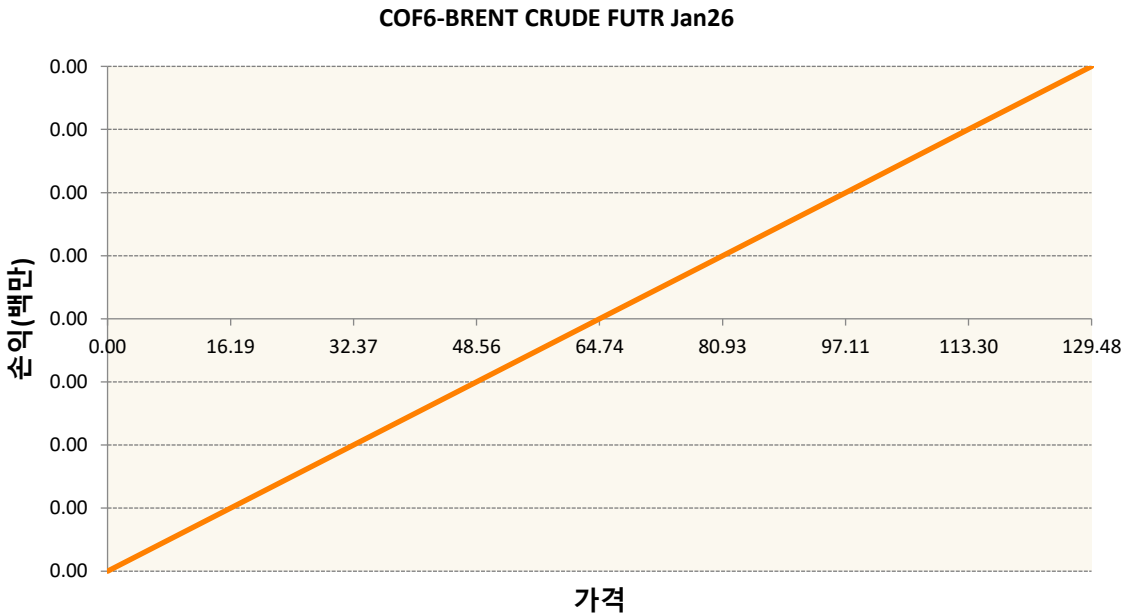
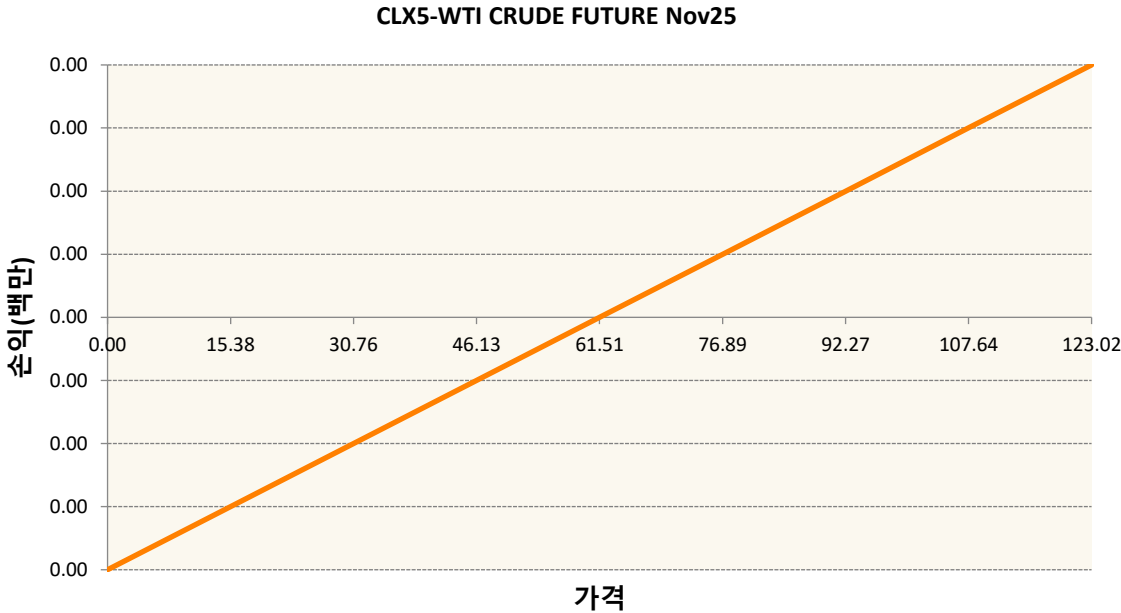
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 1. 계약금액

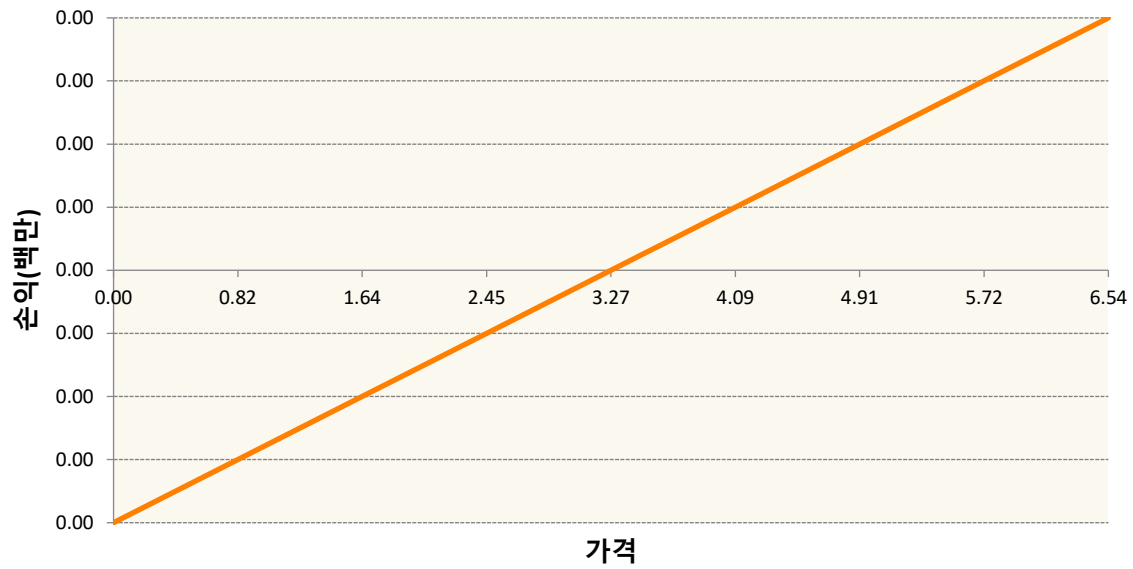
(단위:백만원)

| 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   | 530   | 0     | 530       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 71    | -71       | 장내 |

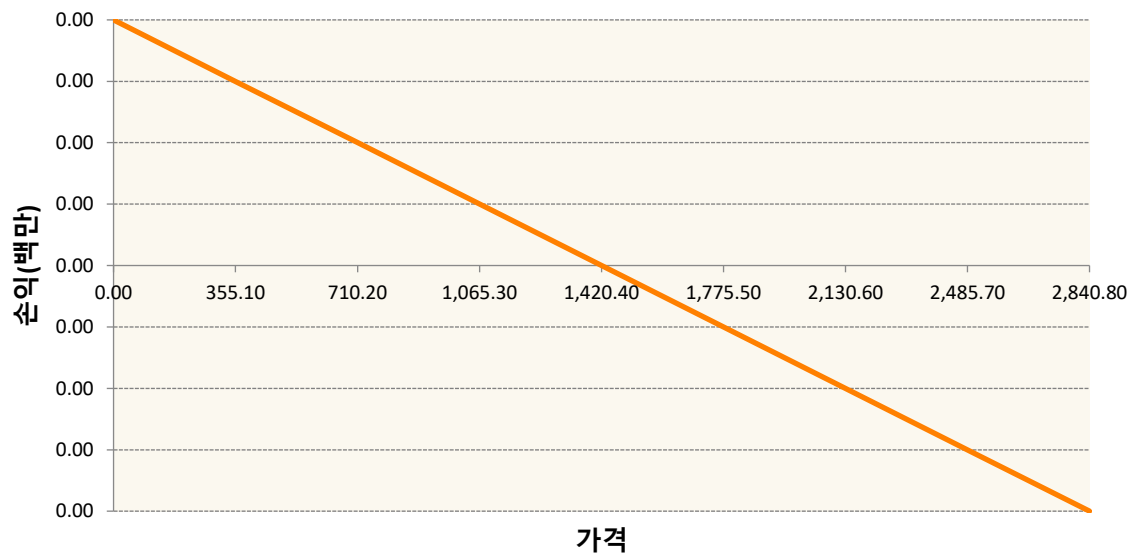
### 2. 만기시점의 손익구조



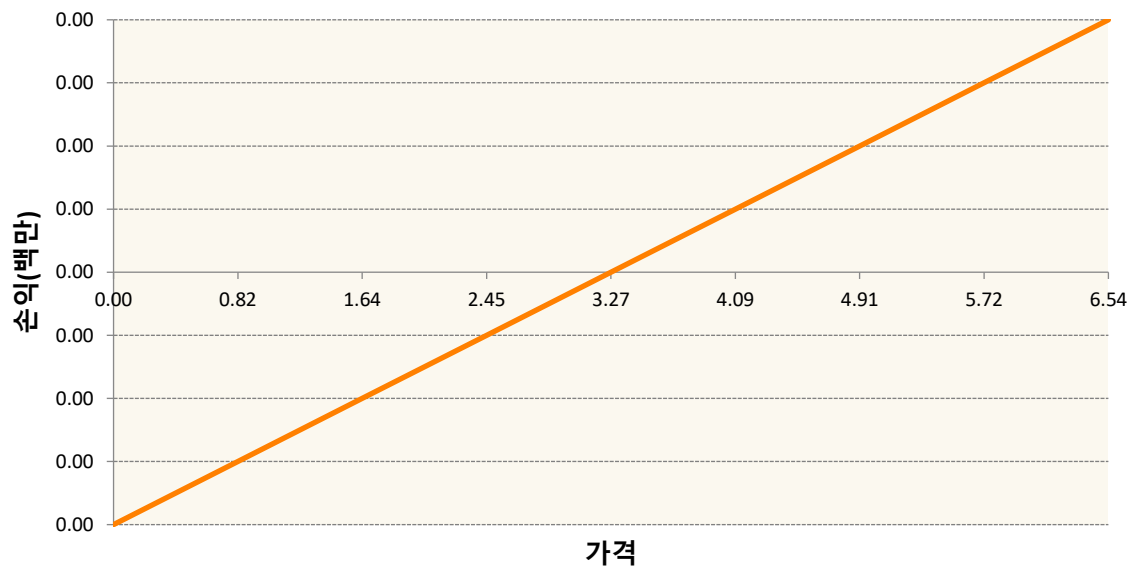
EOX5-E-MINI NATURAL GA Nov25

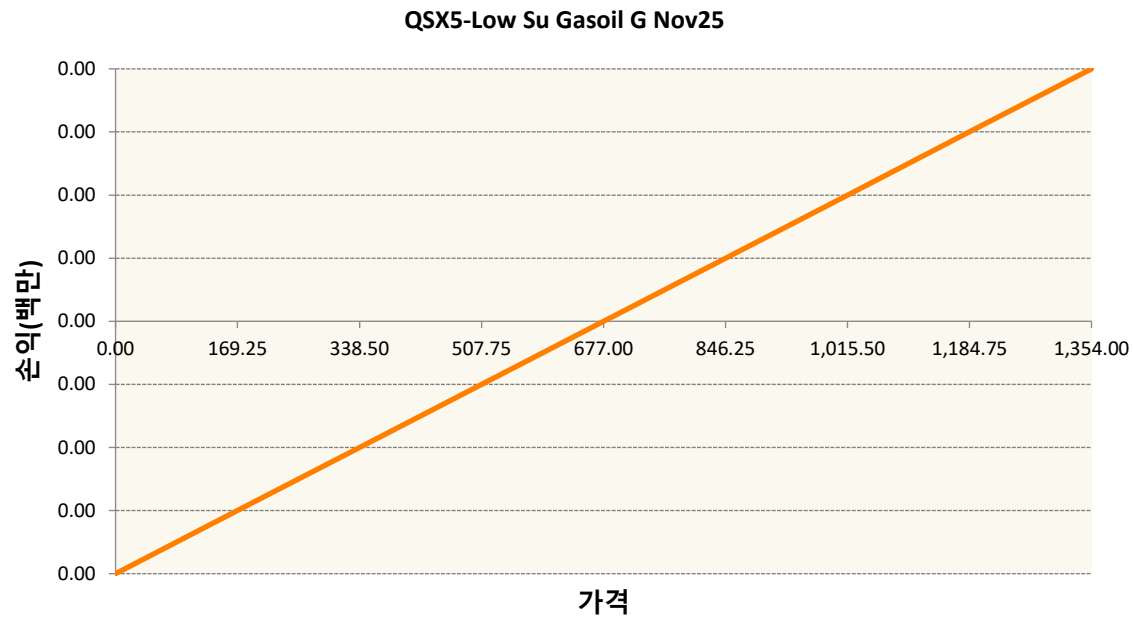


KR4175WA0006-2025-10 달러선물



NGX25-NATURAL GAS FUTR Nov25





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| CLX5                      | WTI CRUDE FUTURE Nov25  |  | 7        |
| COF6                      | BRENT CRUDE FUTR Jan26  |  | 14       |
| 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) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 94       |