

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

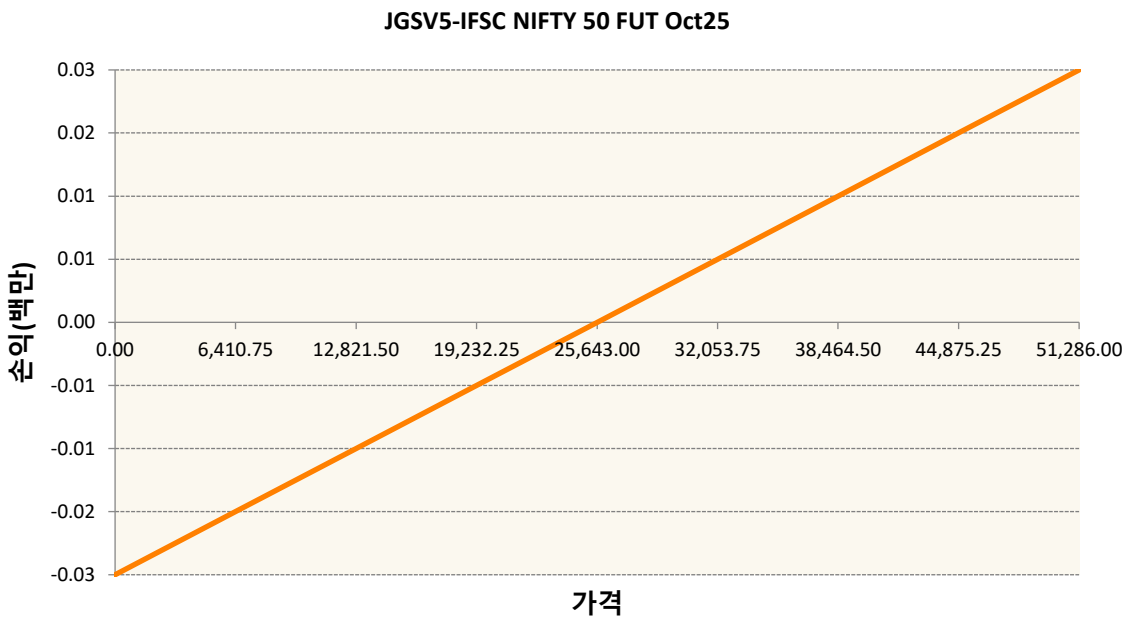
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	574	0	574	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSV5	IFSC NIFTY 50 FUT Oct25	46
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

32

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

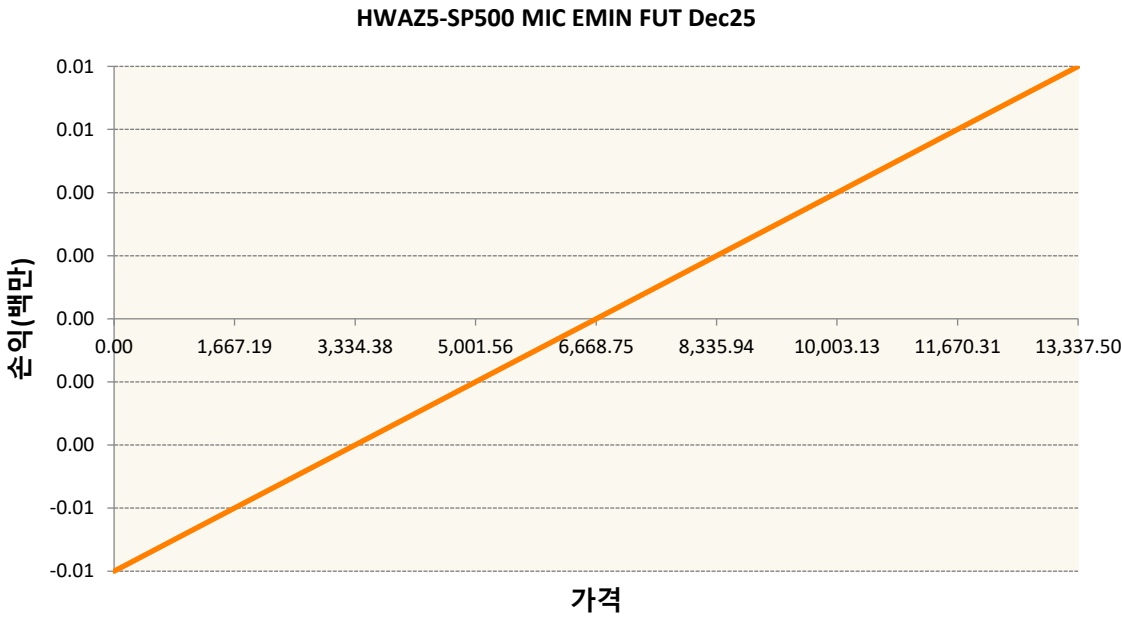
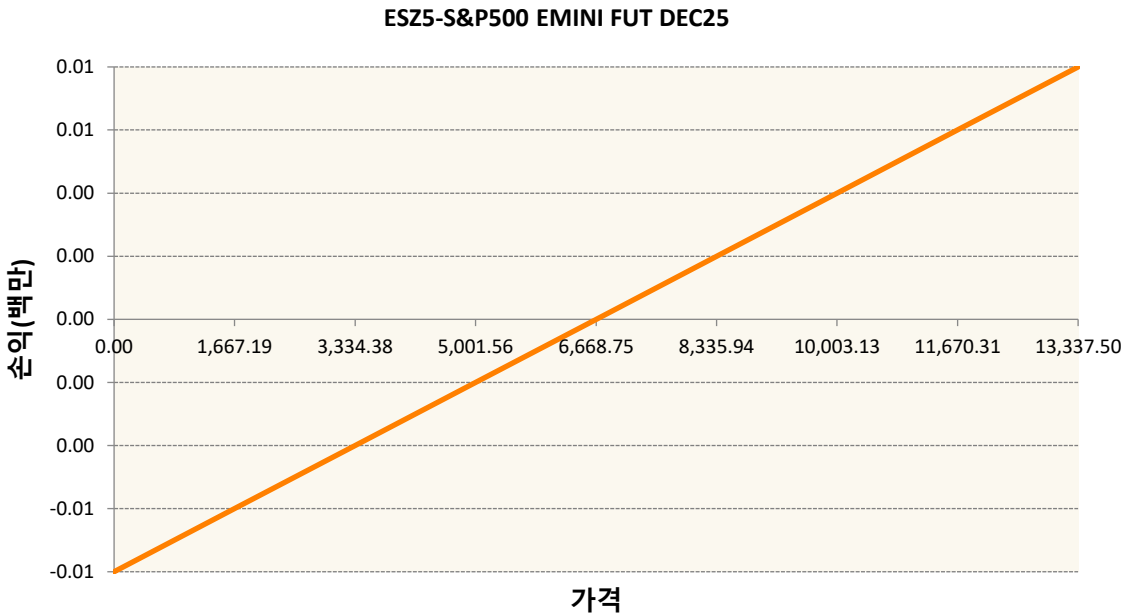
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	463	0	463	
누계	유가증권	선물	185	0	185	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

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

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

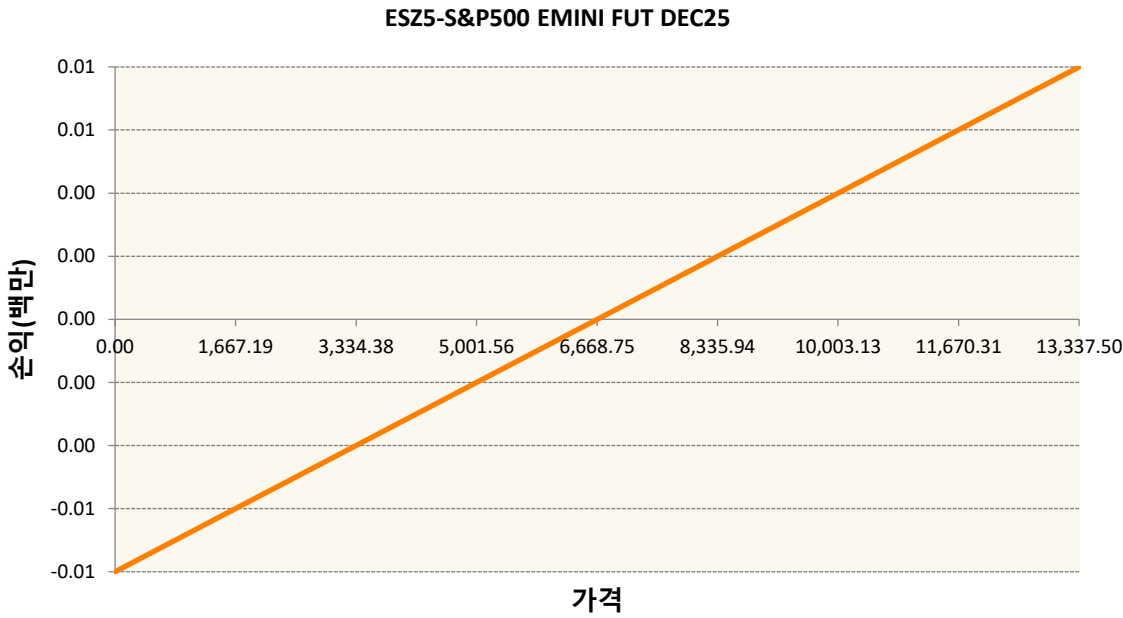
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,388	0	1,388	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	111
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

161

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

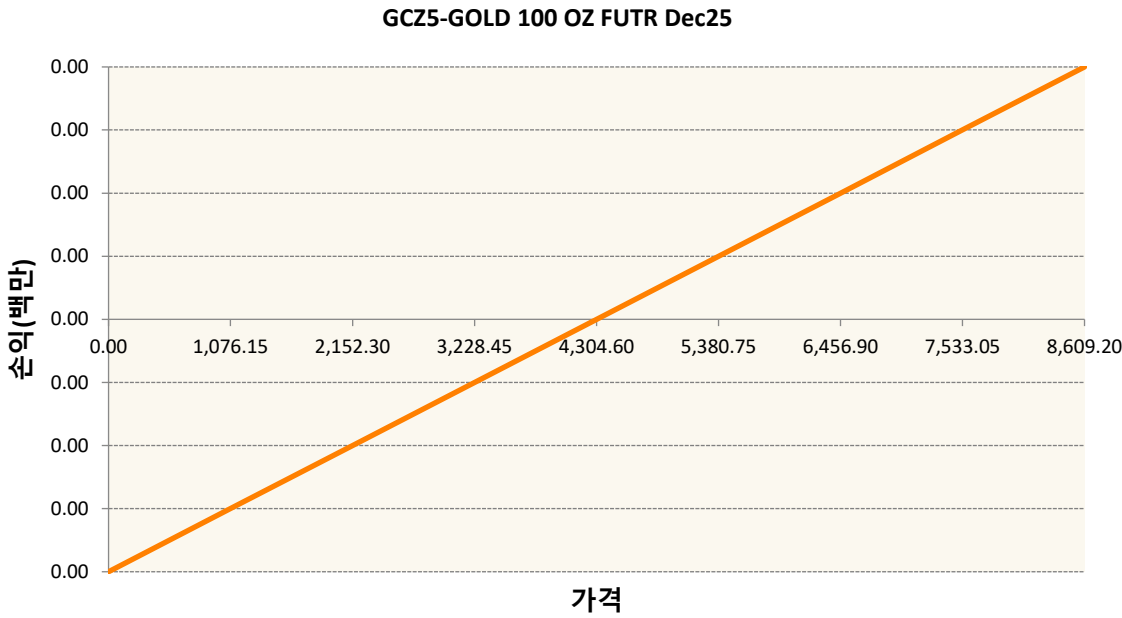
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	3,626	0	3,626	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 10/17/25 C370 EQUITY	14
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	290

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

(단위:백만원)

268

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

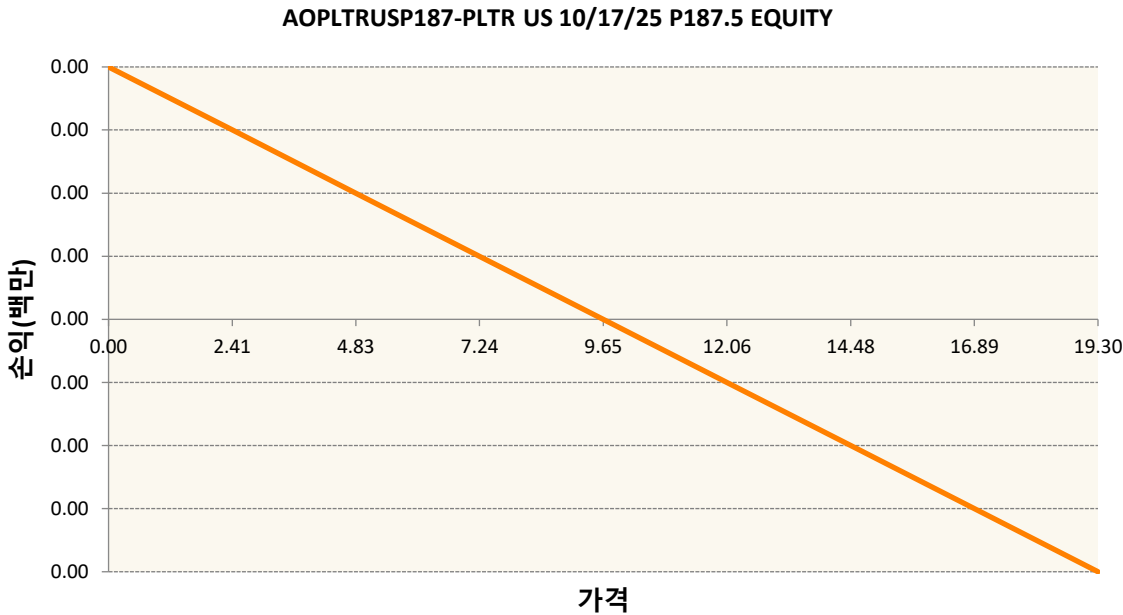
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	929	-929	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC PLTR US 10/17/25 C187.5 EQUITY	163
AOPLTRUSP PLTR US 10/17/25 P187.5 EQUITY	74

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

(단위:백만원)

952

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

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)

AOTLTUSC0(TLT US 10/17/25 C90 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

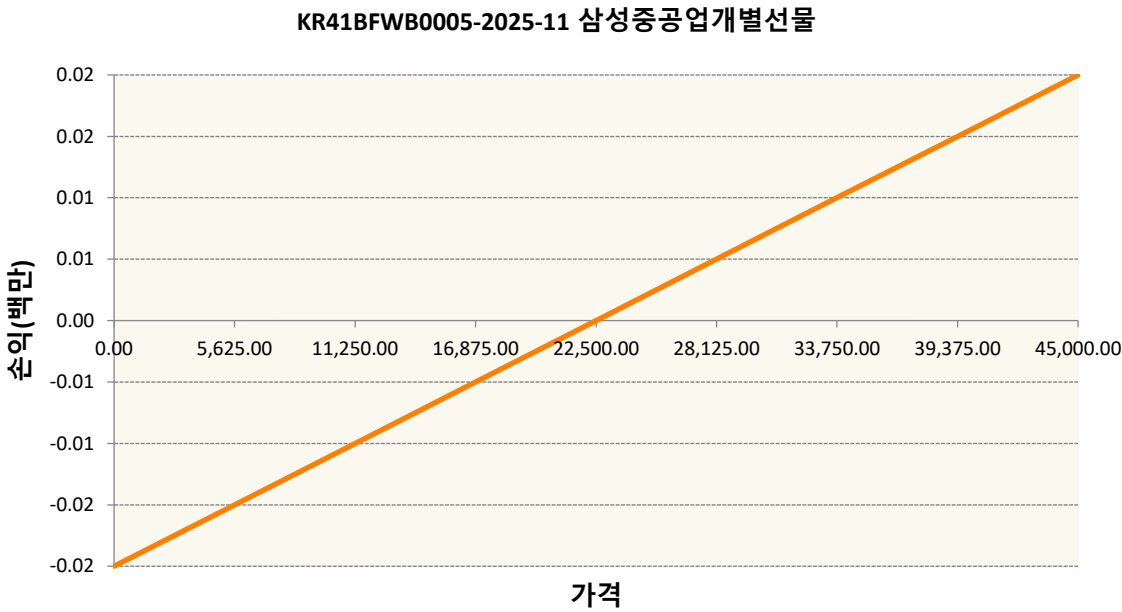
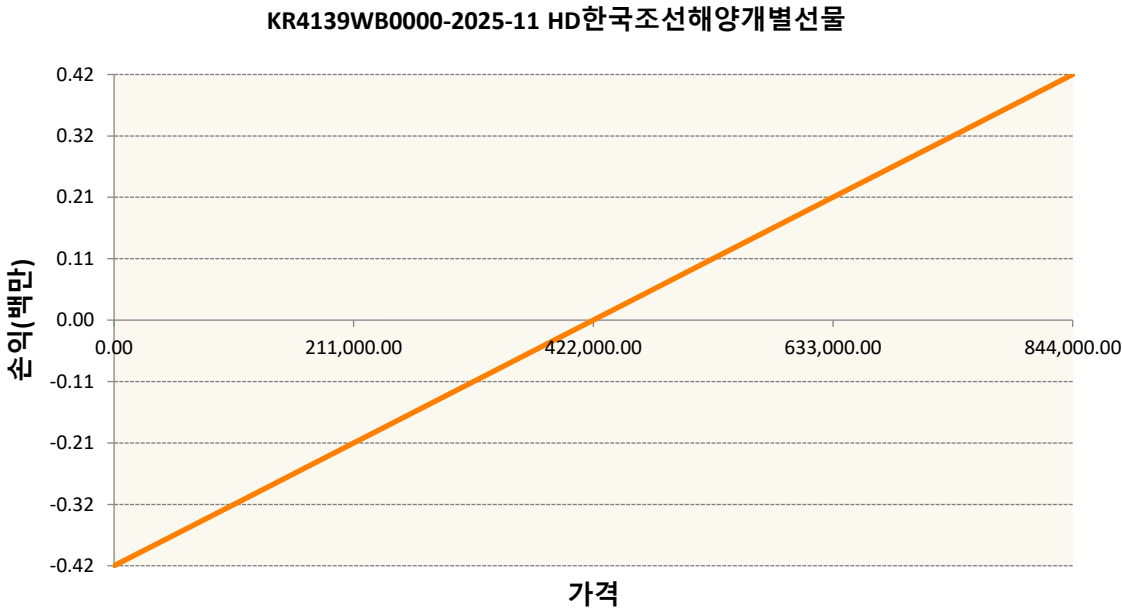
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

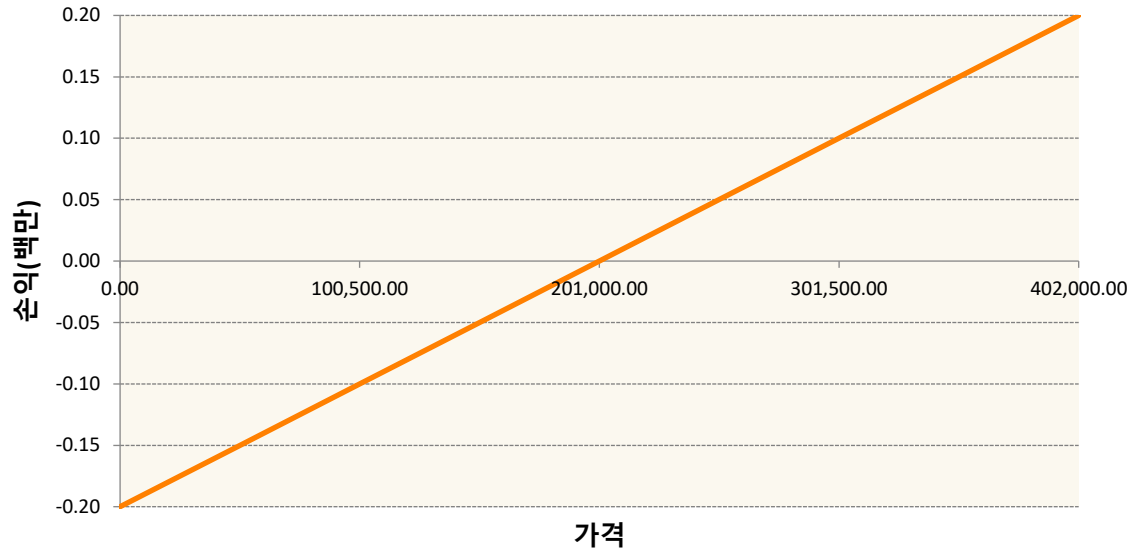
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	53,215	0	53,215	장내

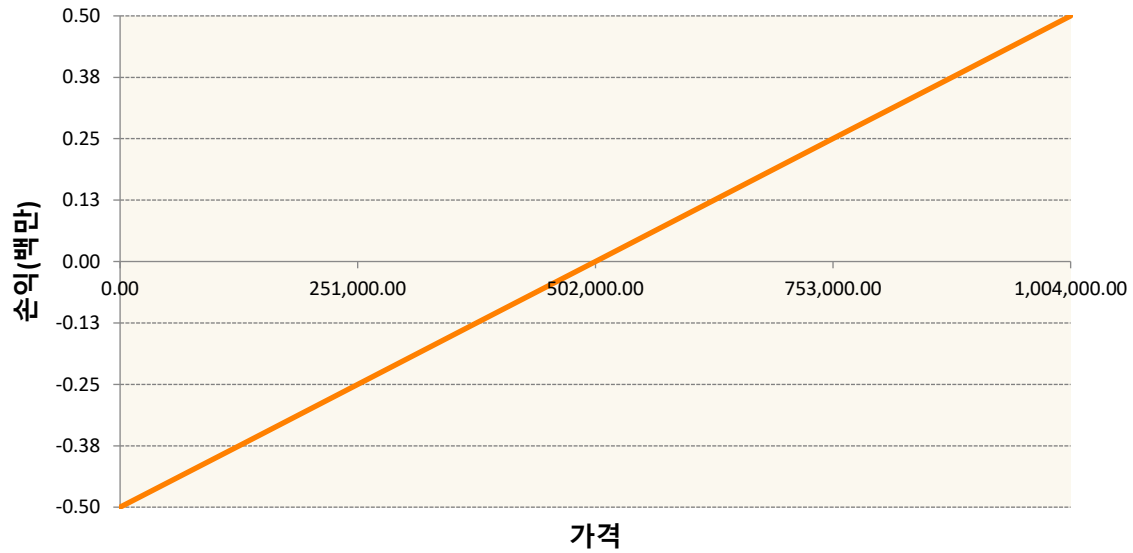
2. 만기시점의 손익구조



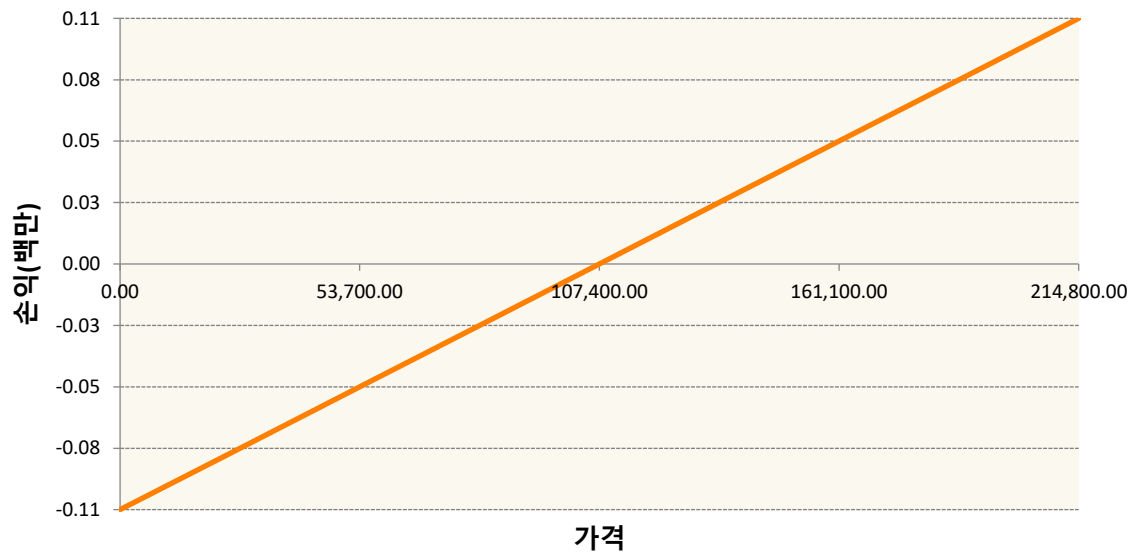
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139WB0000							2025-11 HD한국조선해양개별선물		1,214	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214			
-5.33%	-809	-809	-809	-809	-809	-809	-809			
-2.67%	-405	-405	-405	-405	-405	-405	-405			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	405	405	405	405	405	405	405			
5.33%	809	809	809	809	809	809	809			
8.00%	1,214	1,214	1,214	1,214	1,214	1,214	1,214			
KR41BFWB0005							2025-11 삼성중공업개별선물		1,117	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-1,117	-1,117	-1,117	-1,117	-1,117	-1,117	-1,117			
-5.33%	-745	-745	-745	-745	-745	-745	-745			
-2.67%	-372	-372	-372	-372	-372	-372	-372			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	372	372	372	372	372	372	372			
5.33%	745	745	745	745	745	745	745			
8.00%	1,117	1,117	1,117	1,117	1,117	1,117	1,117			
KR41CDWB0006							2025-11 HD현대미포개별선물		455	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-455	-455	-455	-455	-455	-455	-455			
-5.33%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303			
-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%	303	303	303	303	303	303	303			
8.00%	455	455	455	455	455	455	455			
KR41FDWB0003							2025-11 HD현대중공업개별선물		603	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603			
-5.33%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402			
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	201	201	201	201	201	201	201			
5.33%	402	402	402	402	402	402	402			
8.00%	603	603	603	603	603	603	603			
KR41FVWB0001							2025-11 한화오션개별선물		873	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-873	-873	-873	-873	-873	-873	-873
-5.33%	-582	-582	-582	-582	-582	-582	-582
-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%	582	582	582	582	582	582	582
8.00%	873	873	873	873	873	873	873

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

(단위:백만원)

2,172

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

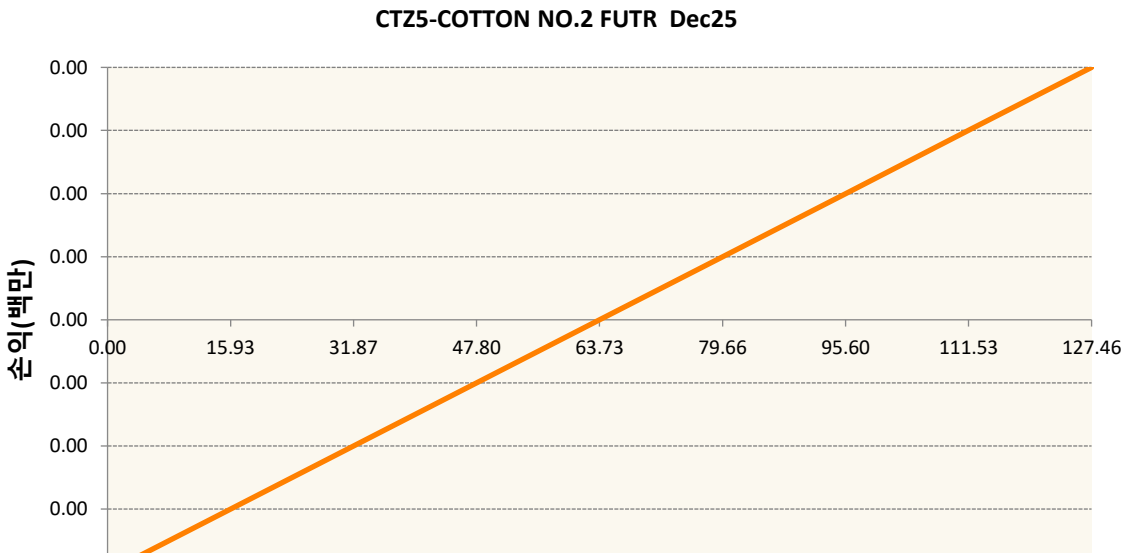
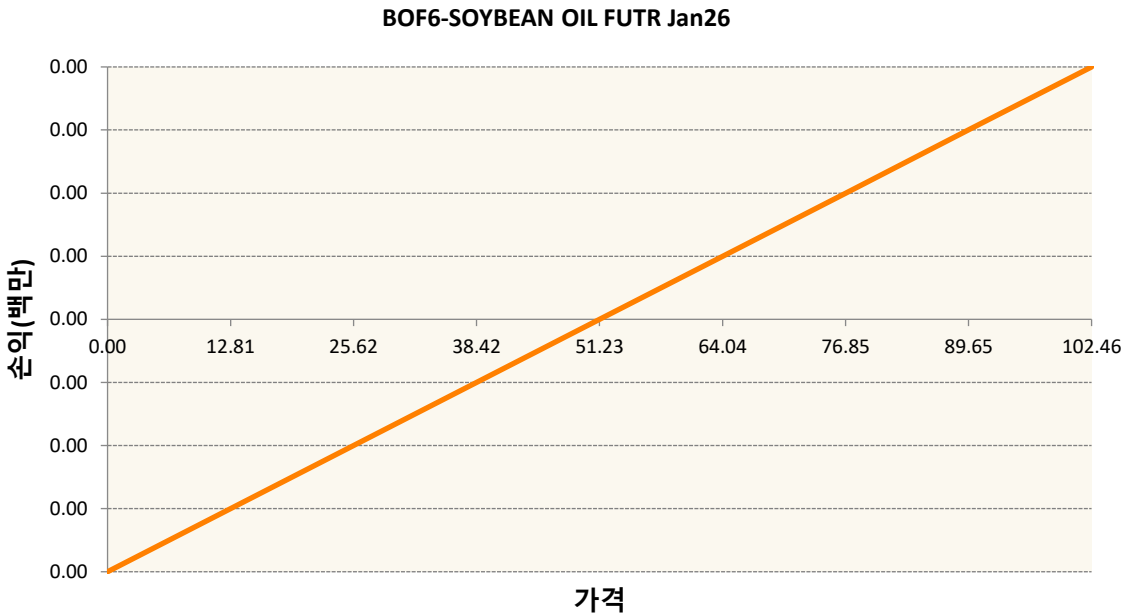
포커스농산물모(채권-파생형)

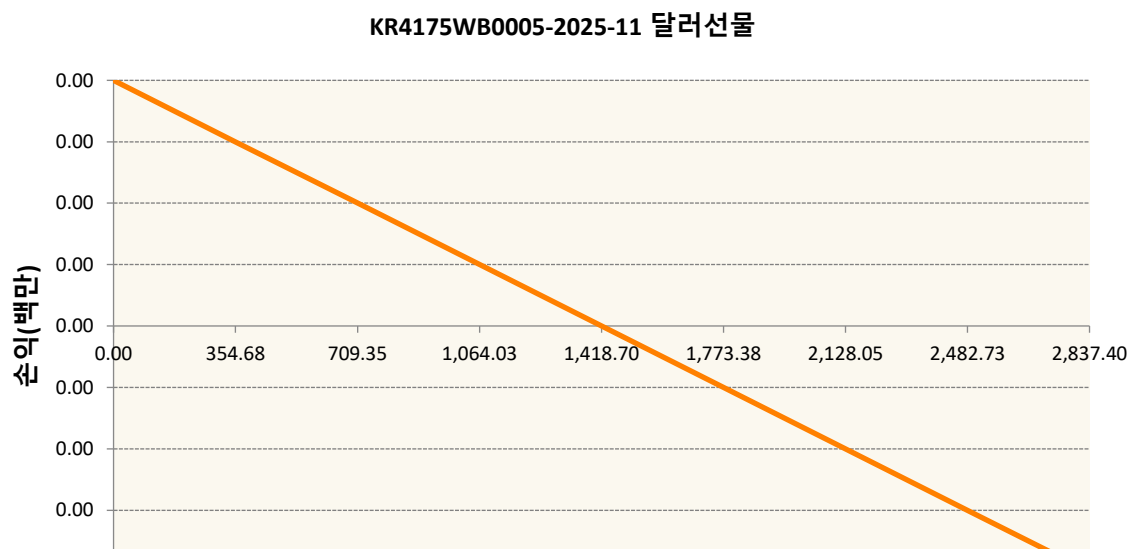
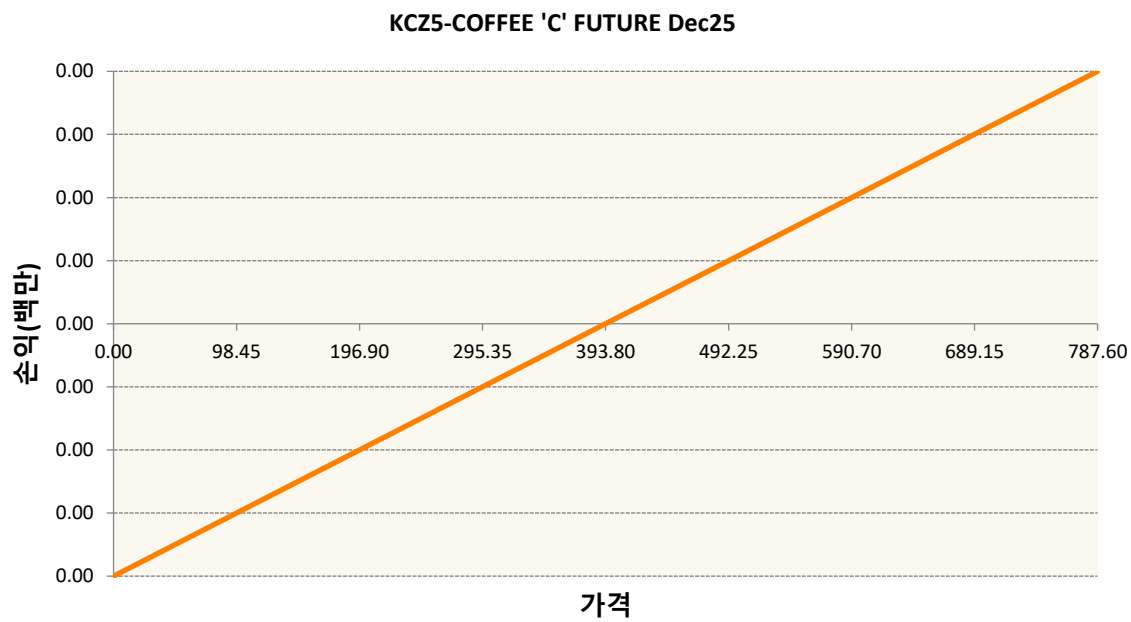
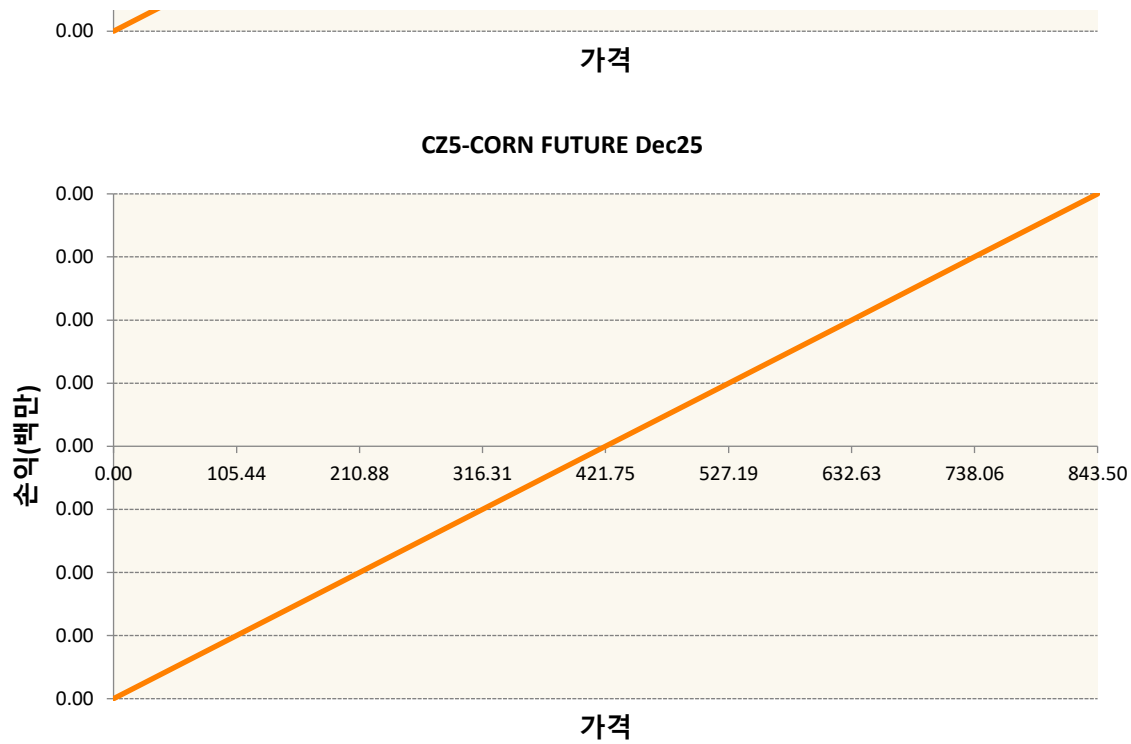
1. 계약금액

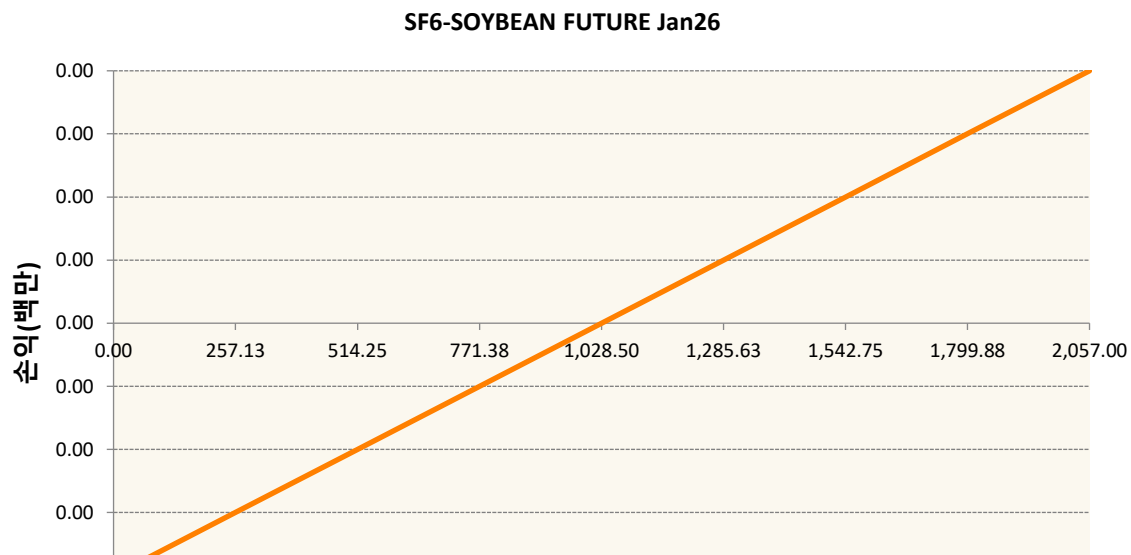
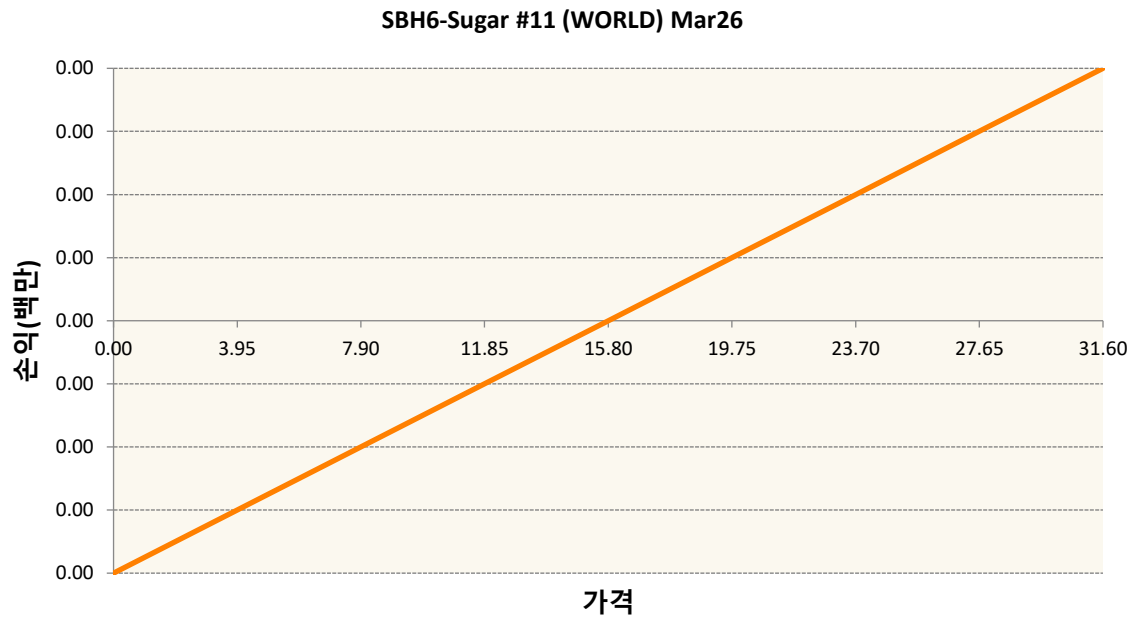
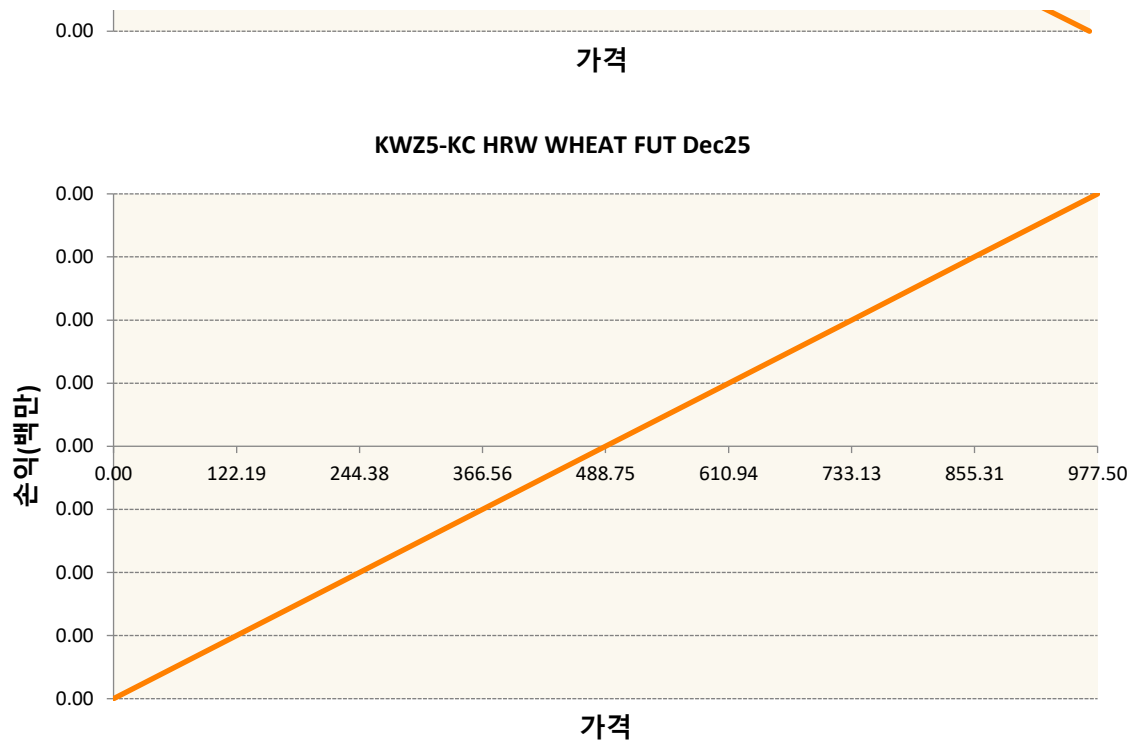
(단위:USD 백만)

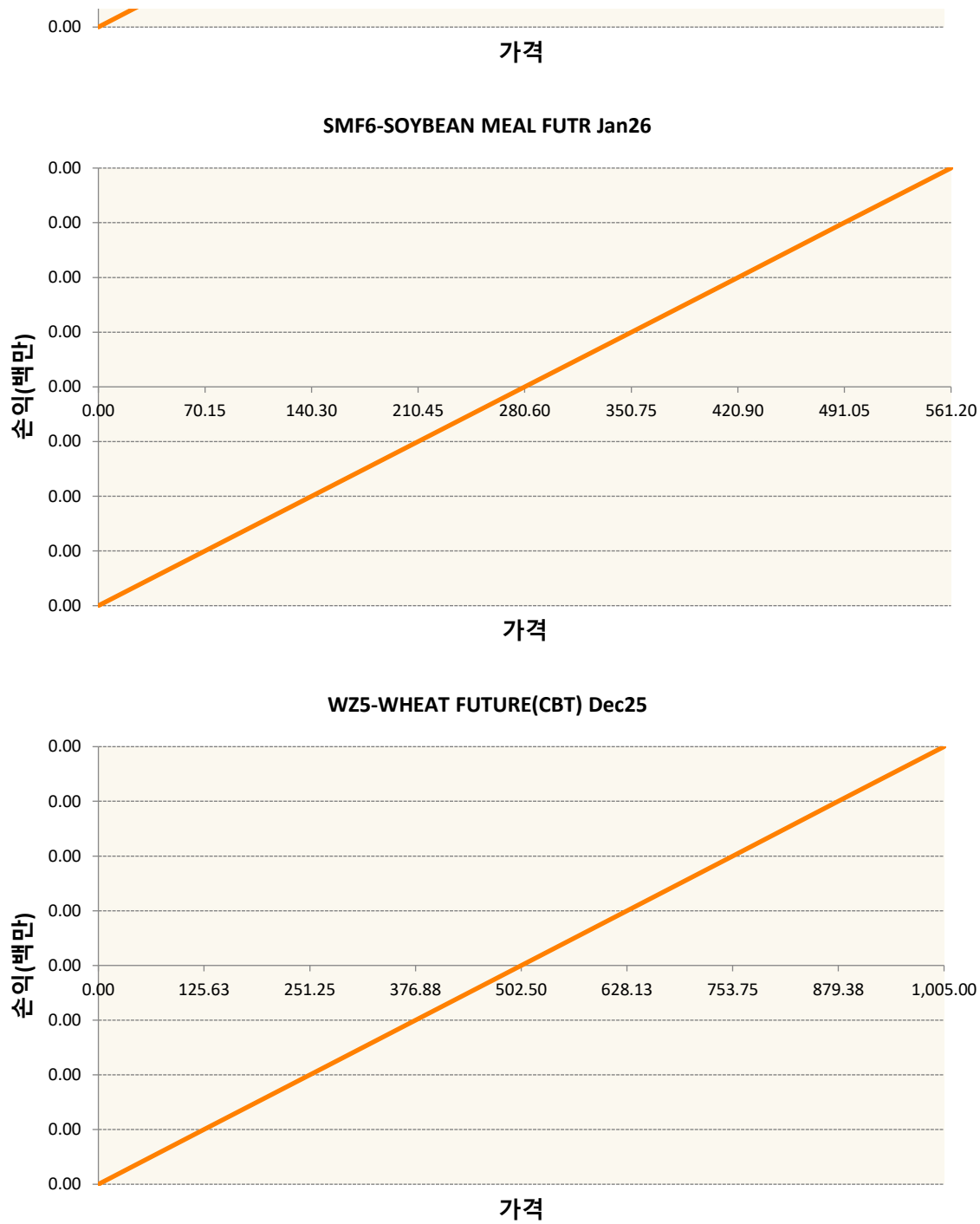
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,095	0	1,095	
누계	유가증권	선물	2,159	0	2,159	
누계	통화	선물	0	284	-284	장내

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	2025-10-20
기준일	2025-10-17

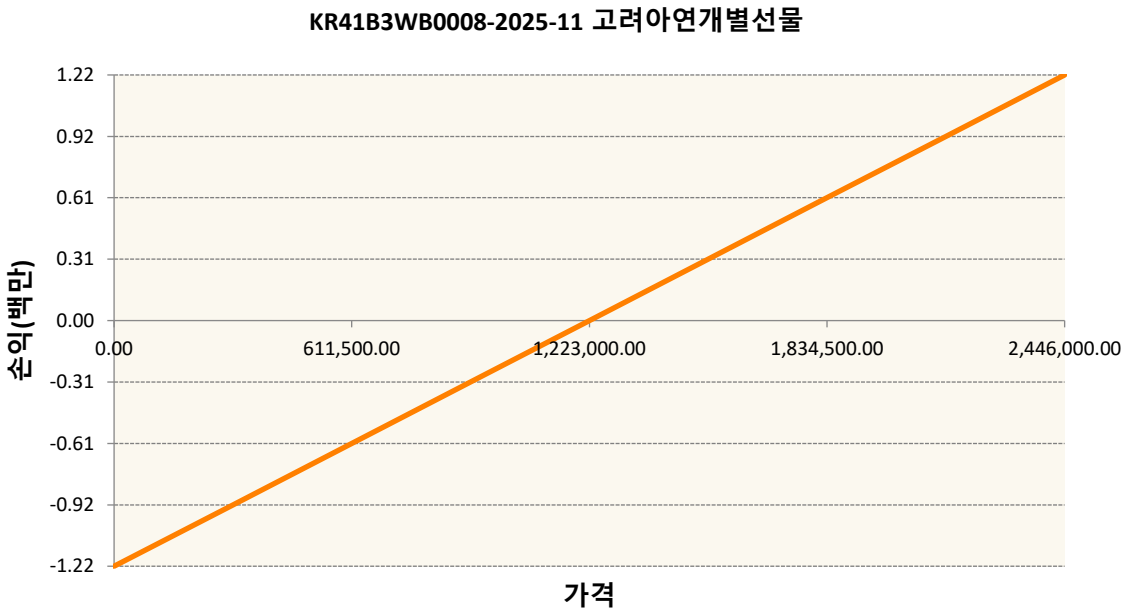
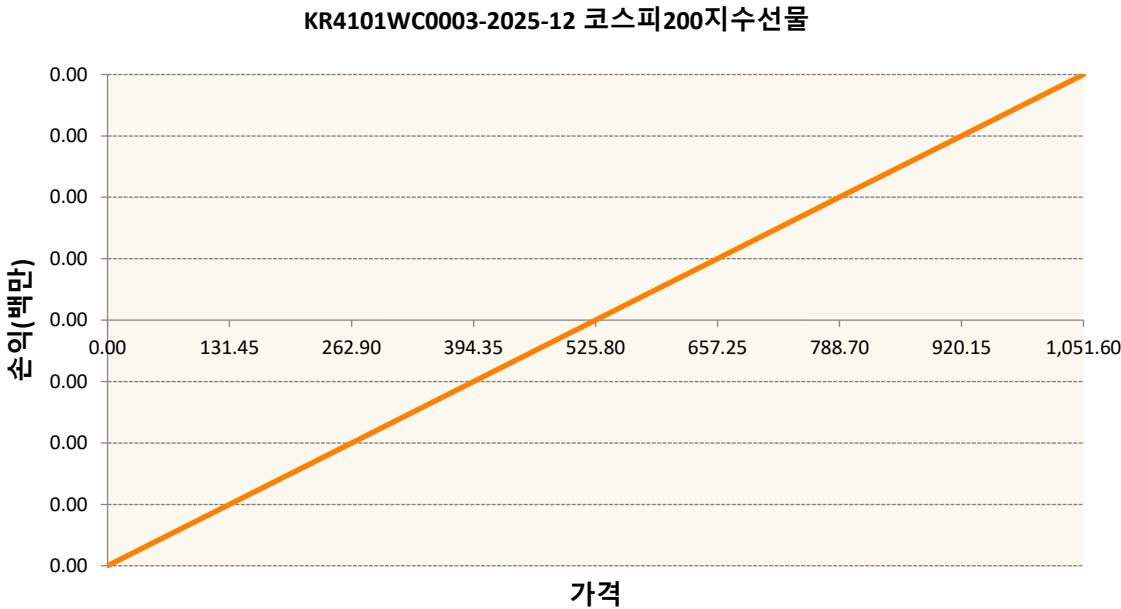
스마트인덱스모

1. 계약금액

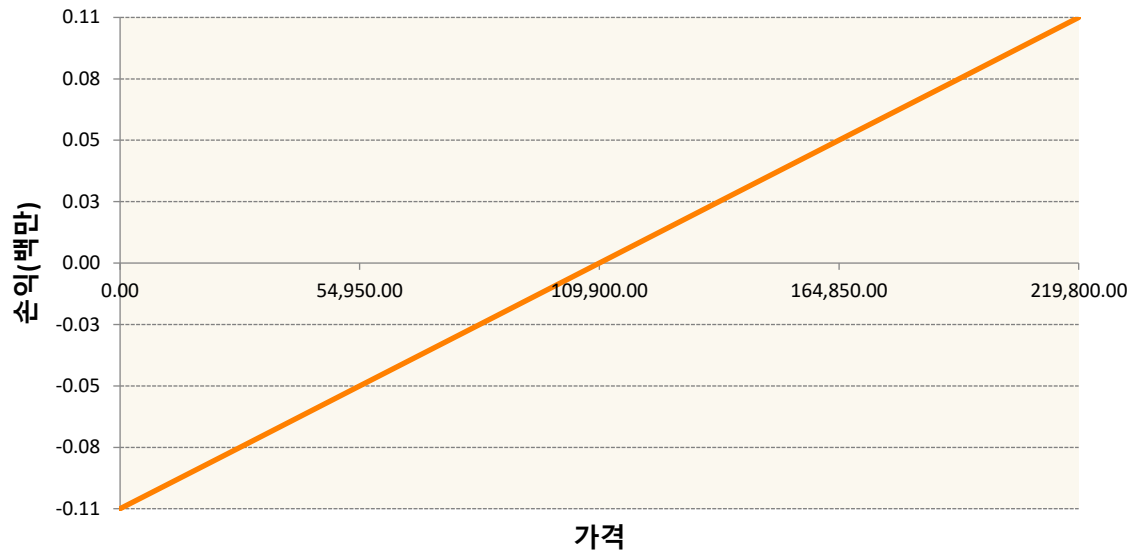
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,461	0	1,461	장내

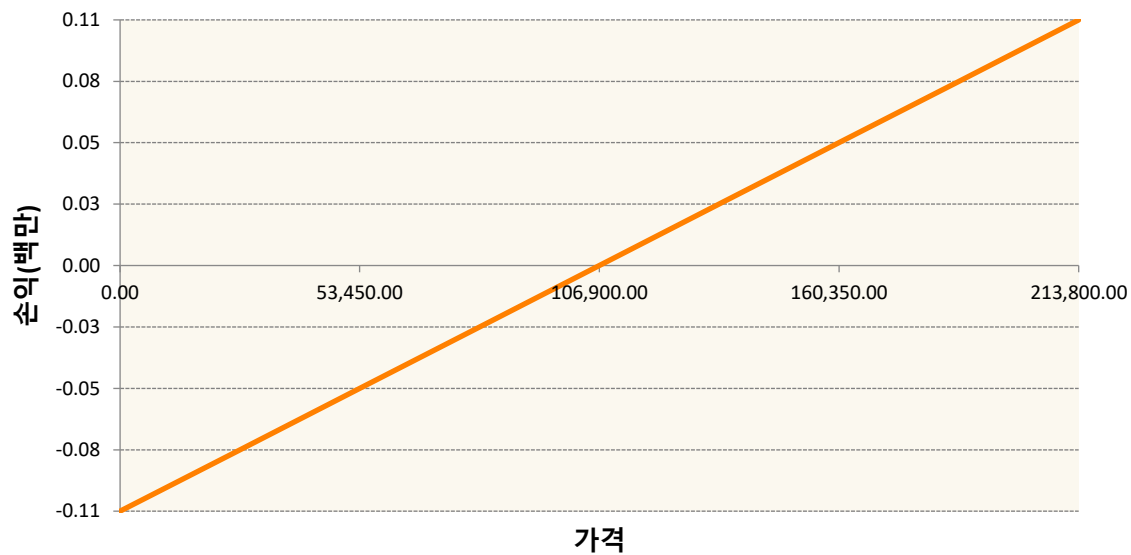
2. 만기시점의 손익구조



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	105
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물	7
KR41EJWB0(2025-11 SKC개별선물	2
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물	3

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

(단위:백만원)

44

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

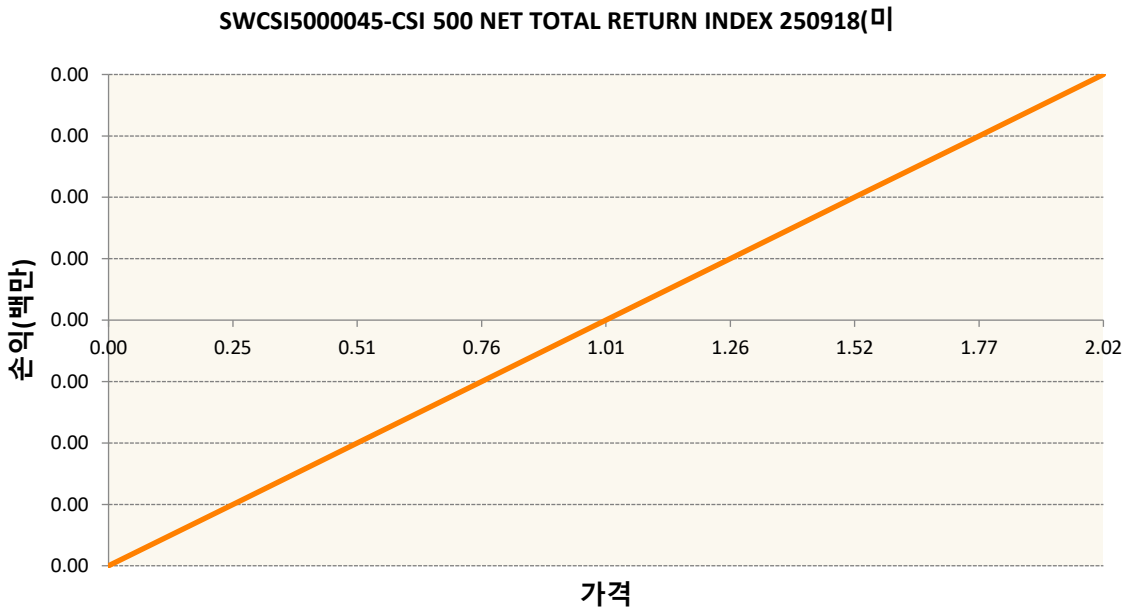
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,747	0	4,747	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 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

545

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

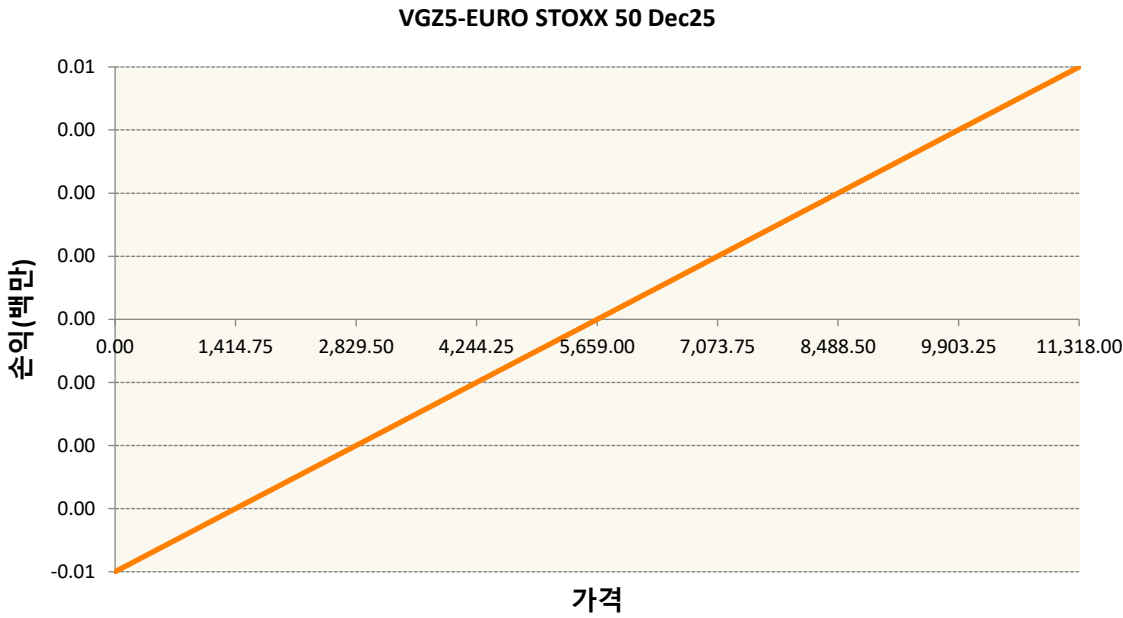
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	742	0	742	

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	2025-10-20
기준일	2025-10-17

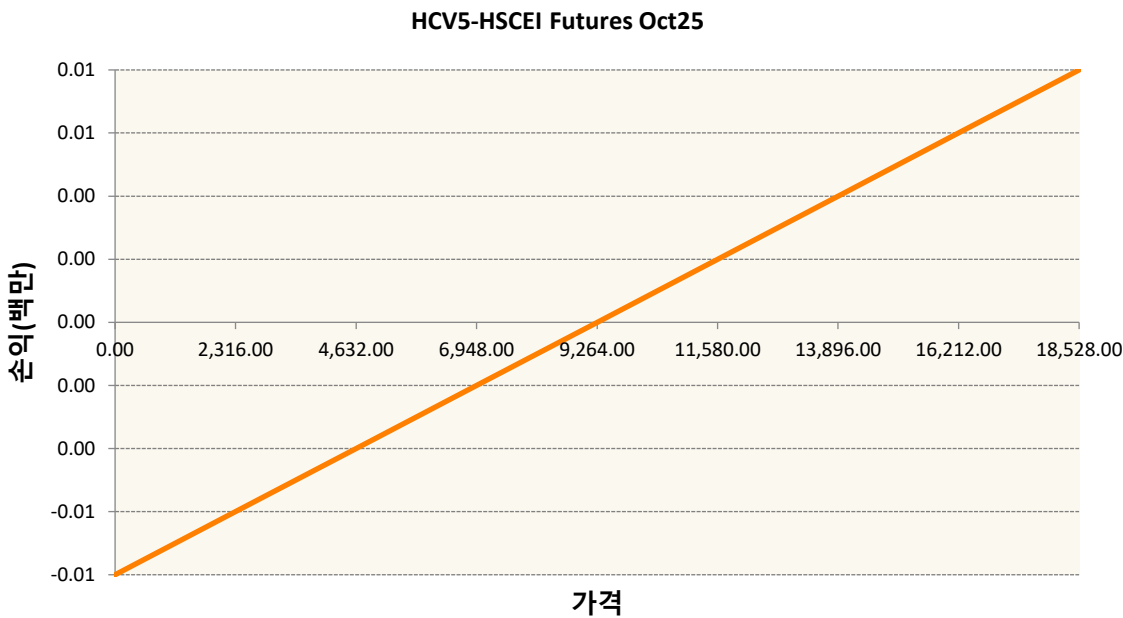
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,102	0	2,102	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV5	HSCEI Futures Oct25	168
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

237

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

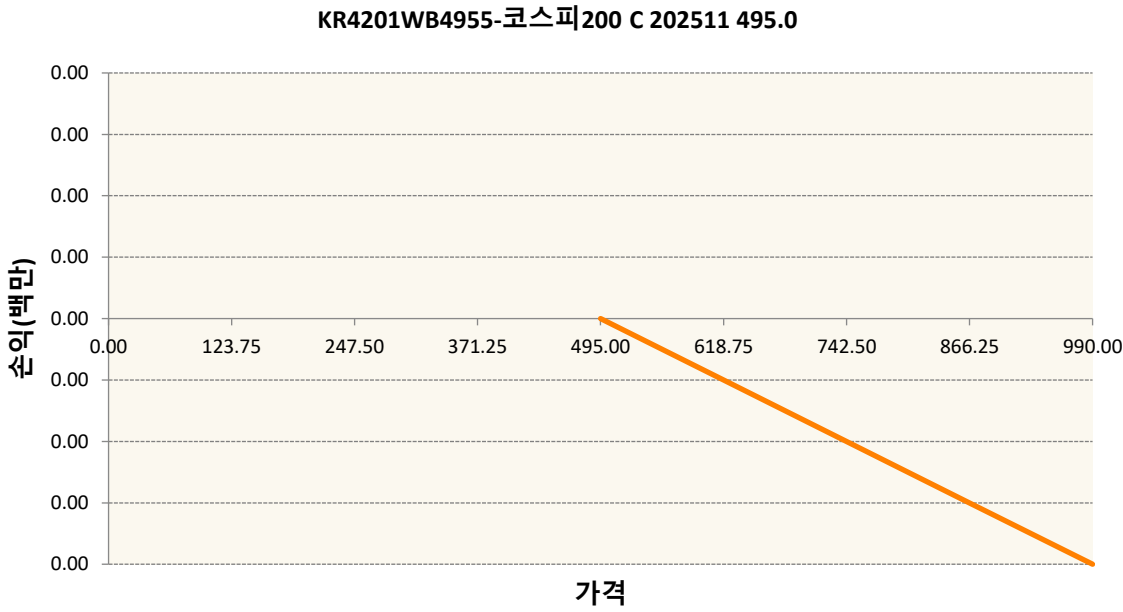
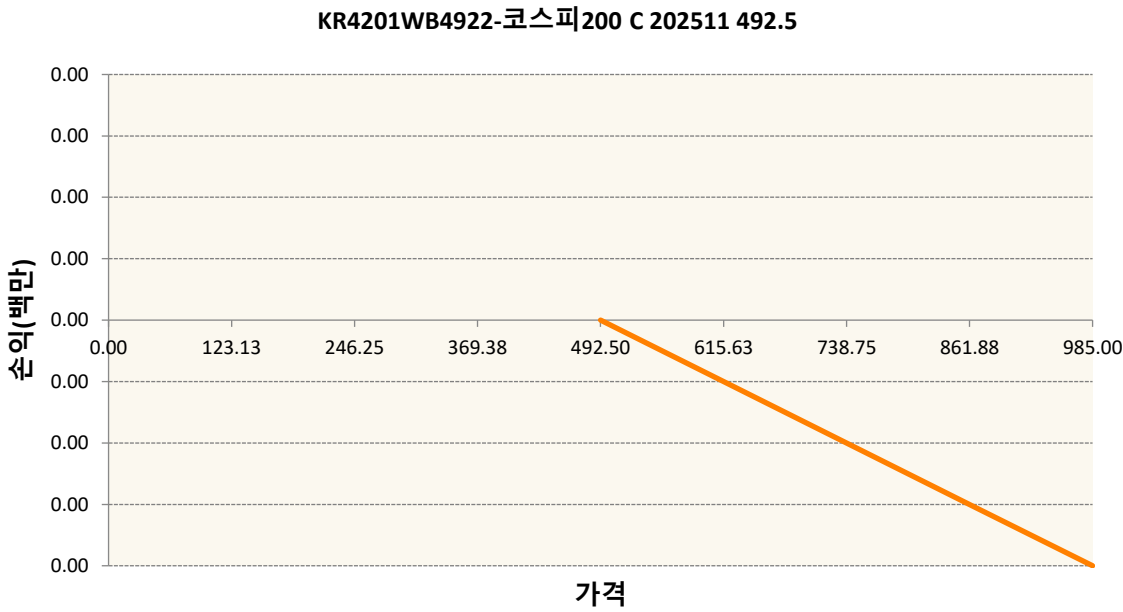
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

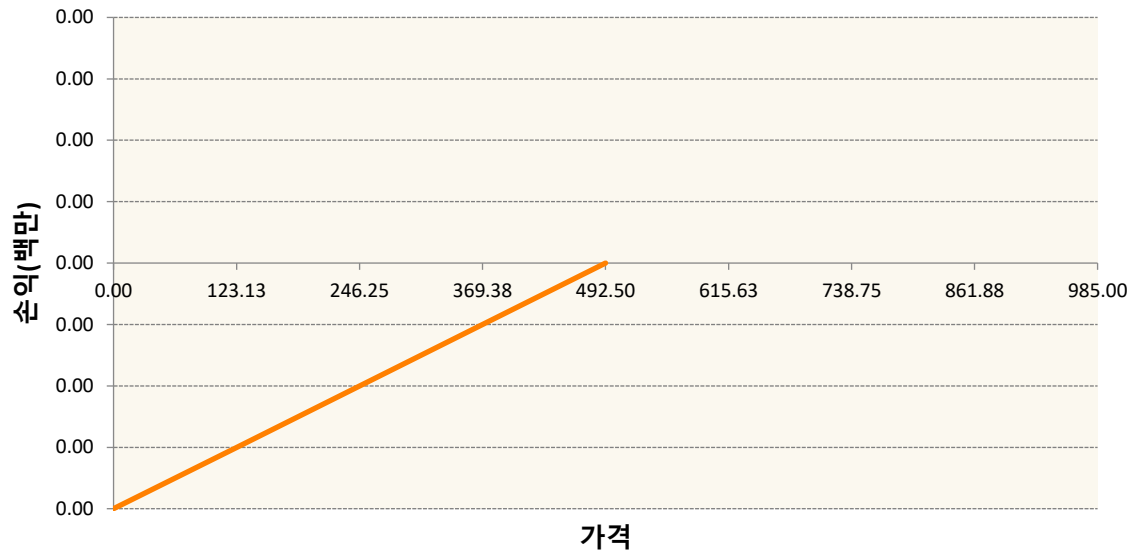
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	33,476	-33,476	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301WB4921-코스피200 P 202511 492.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WB49코스피200 C 202511 492.5

453

KR4201WB49코스피200 C 202511 495.0

1,733

KR4301WB49코스피200 P 202511 492.5

493

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-10-20

기준일 2025-10-17

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	2025-10-20
기준일	2025-10-17

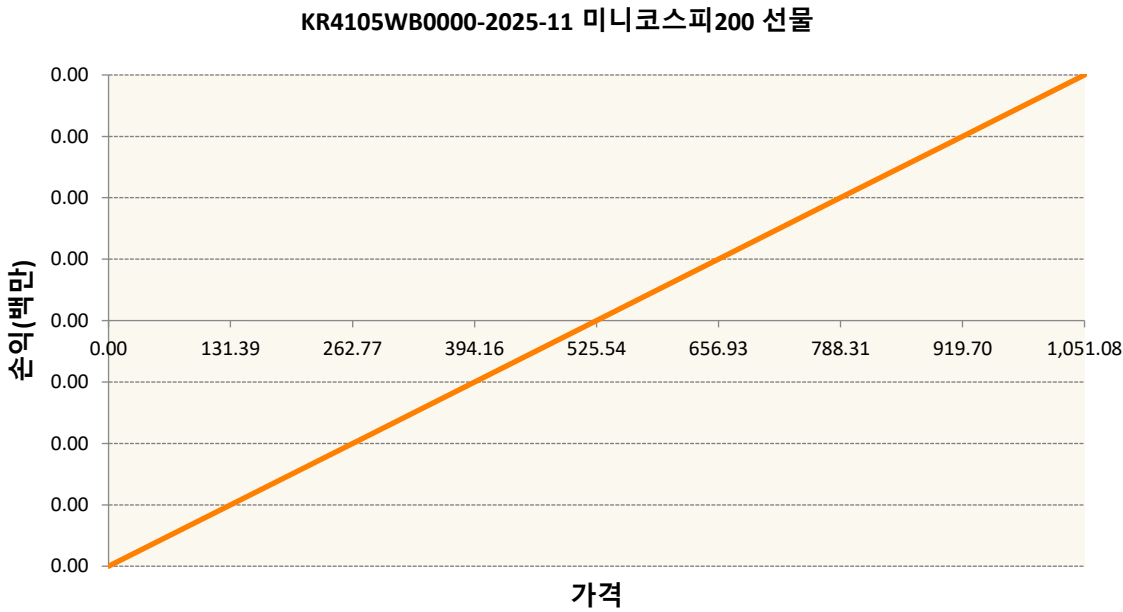
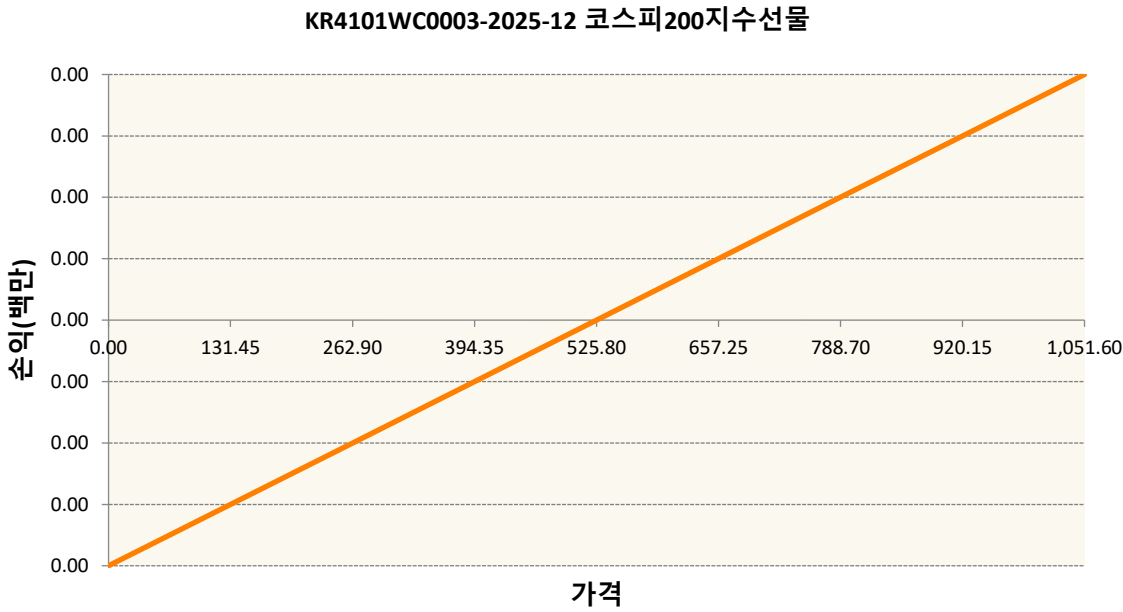
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

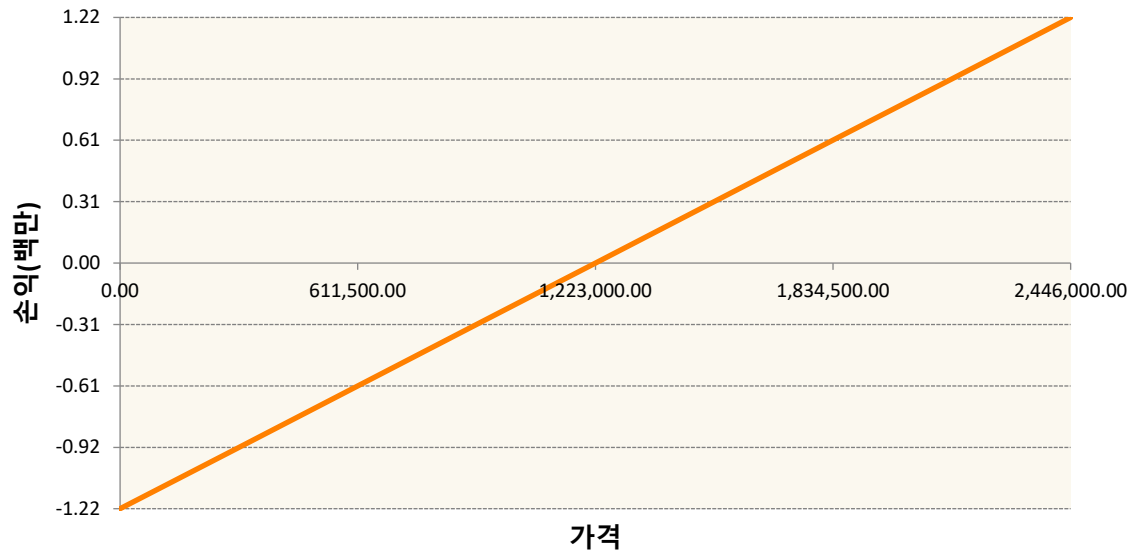
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	588	0	588	장내

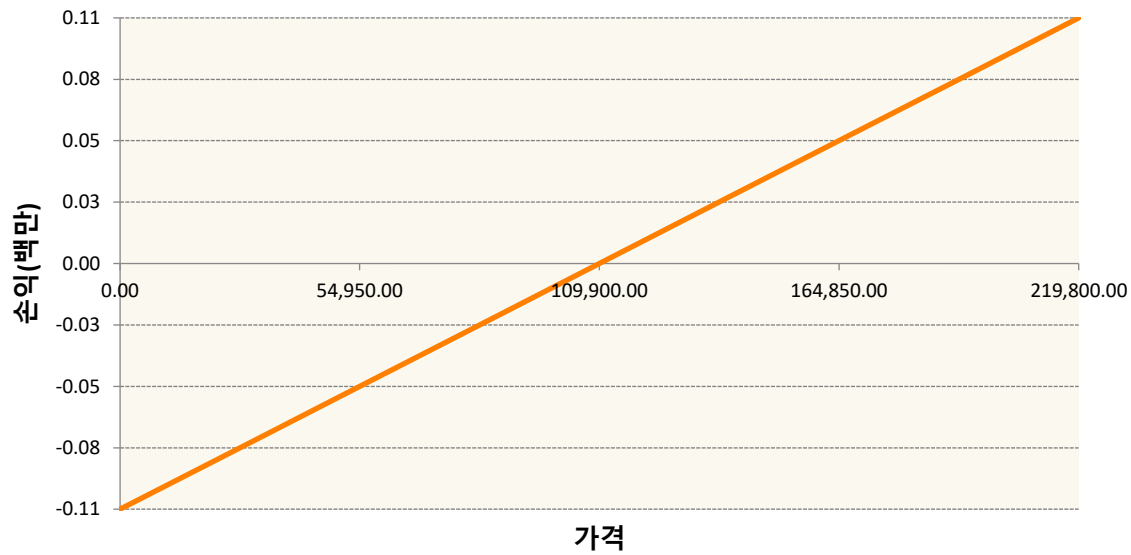
2. 만기시점의 손익구조



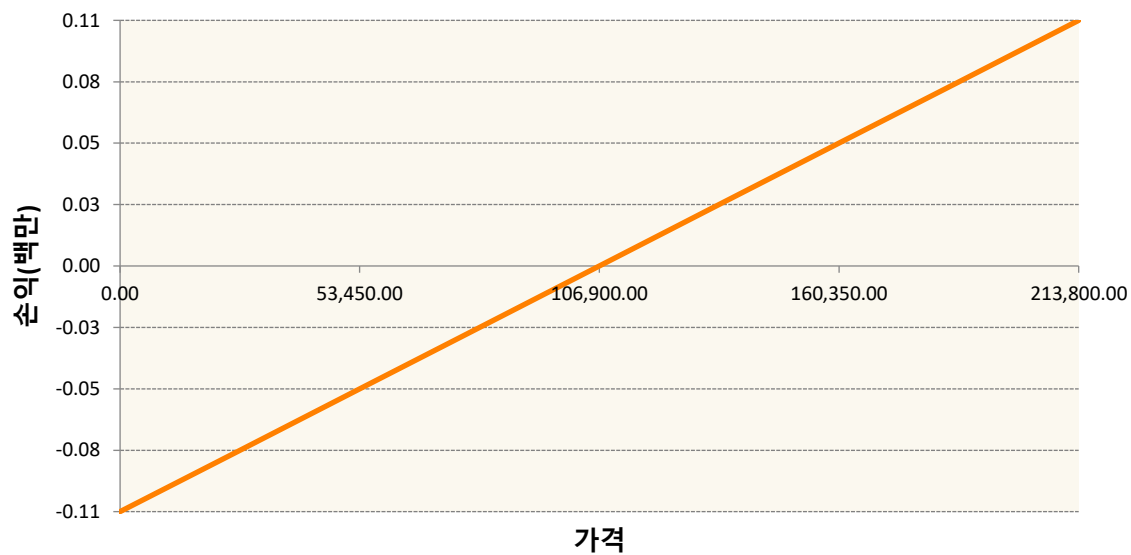
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물		32
KR4105WB0(2025-11 미니코스피200 선물		2
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물		3
KR41EJWB0(2025-11 SKC개별선물		1
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		19

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

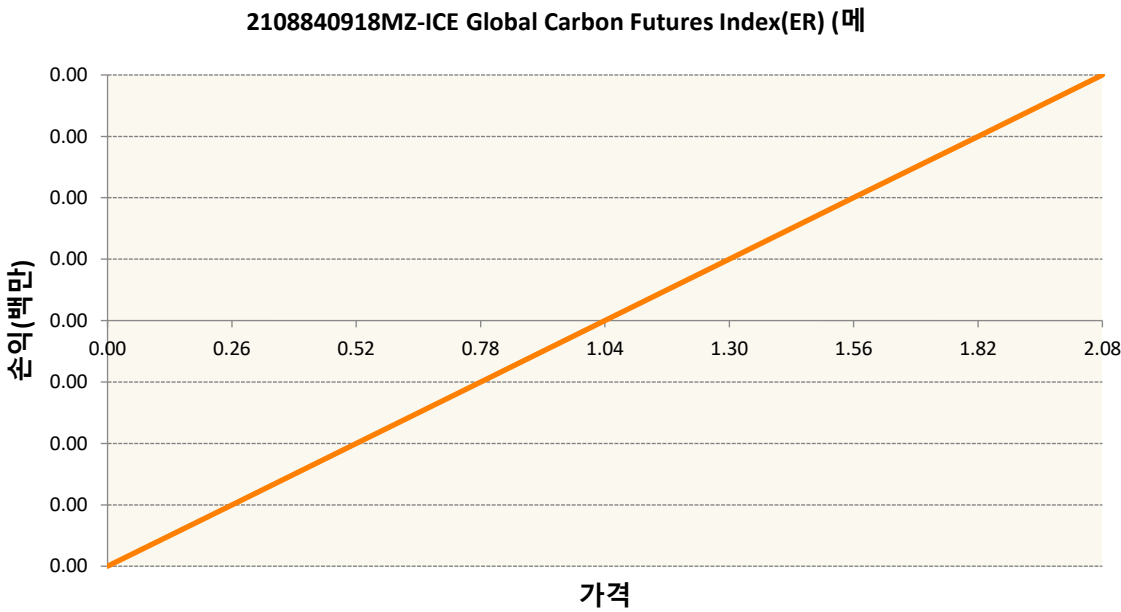
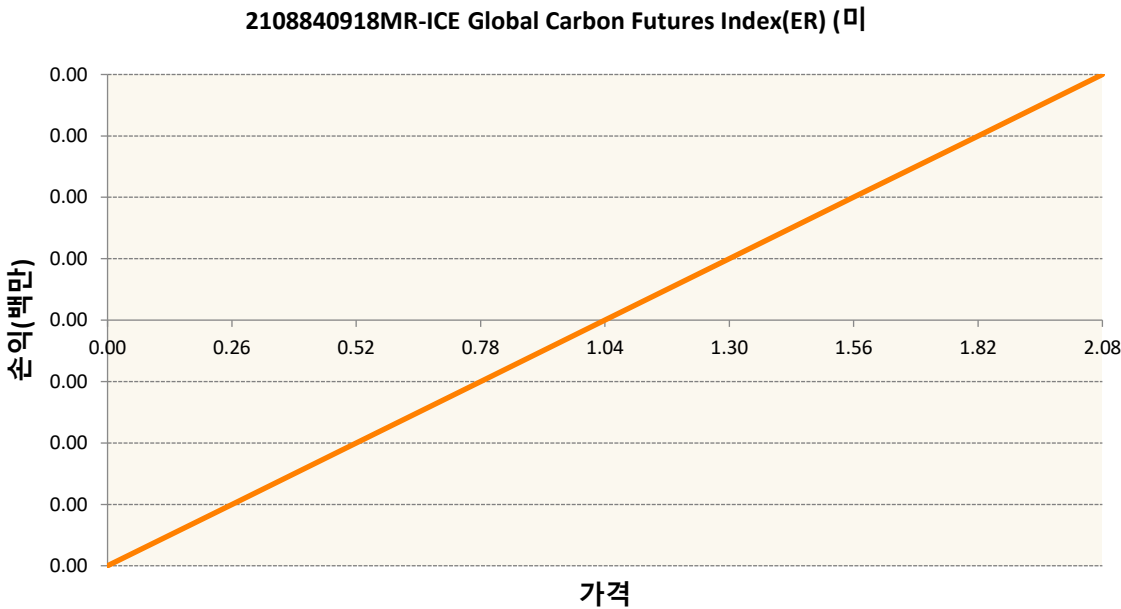
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	9,880	0	9,880	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		675
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		113

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	786

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

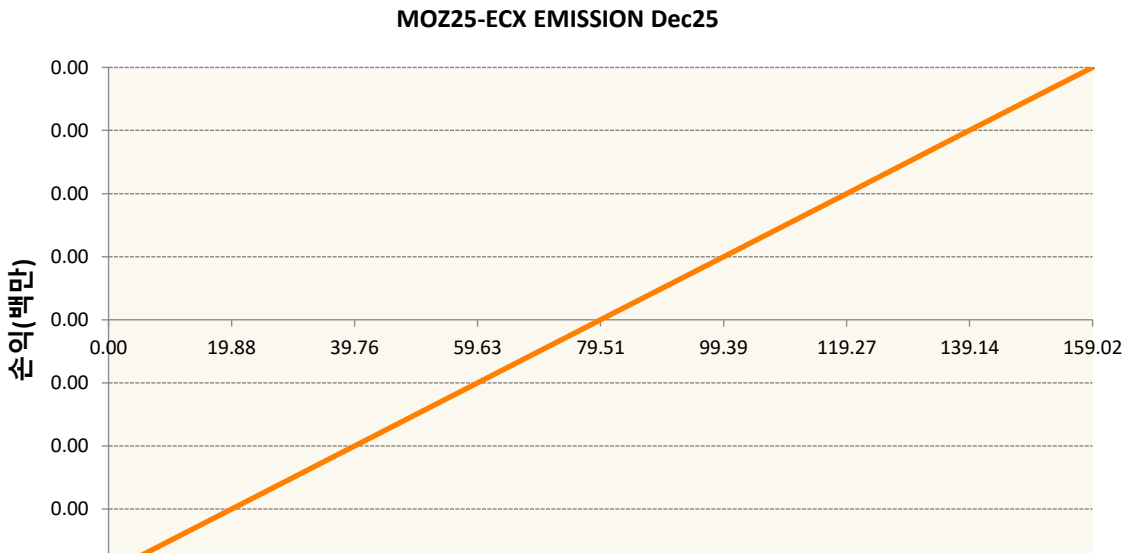
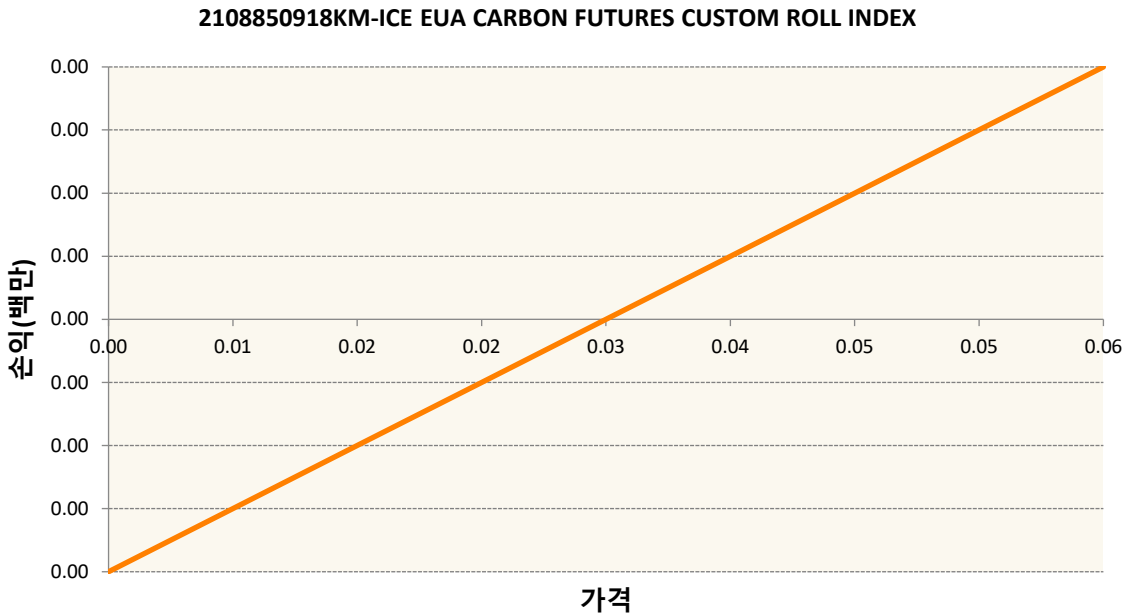
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,984	0	5,984	
누계	지수	스왑	12	0	12	장외
누계	통화	선도	0	2,297	-2,297	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	184
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	479

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

(단위:백만원)

765

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

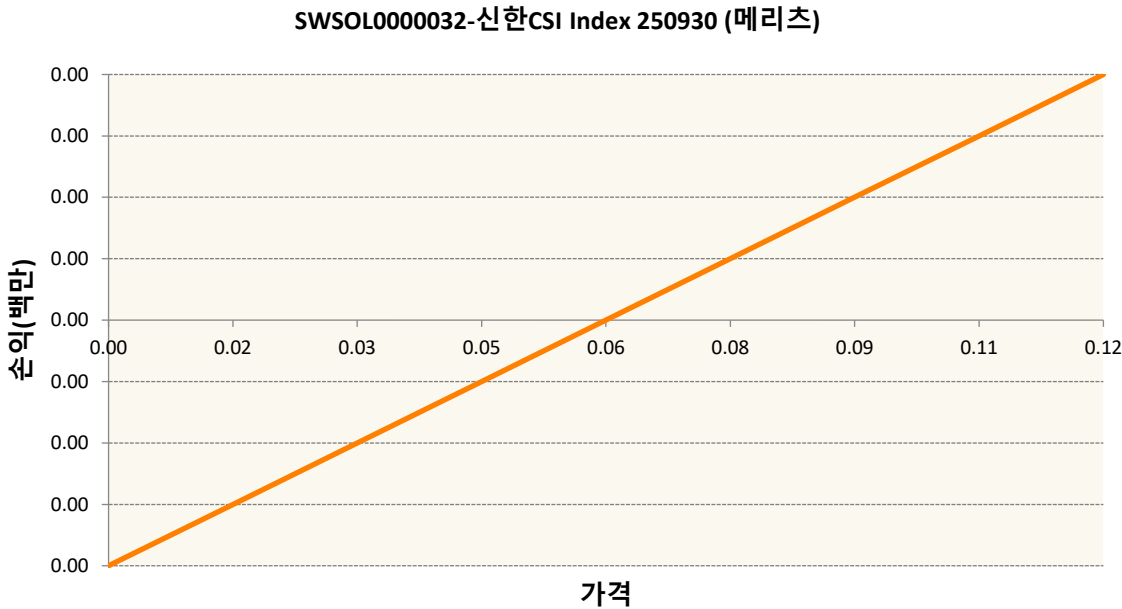
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,647	0	2,647	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	5
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	5
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	12

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

SOL차이나육성산업엑티브상장지

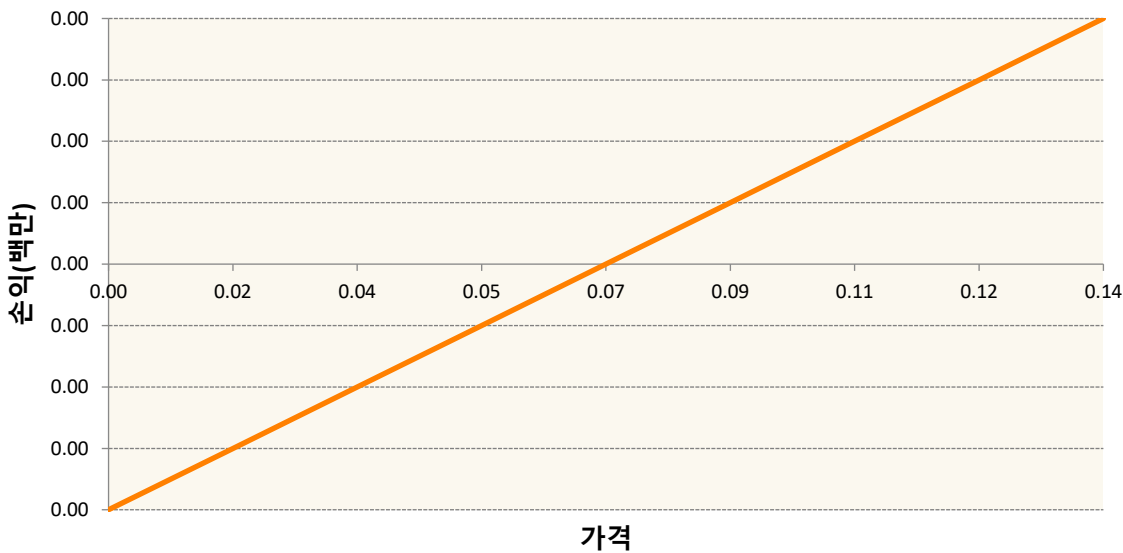
1. 계약금액

(단위:백만원)

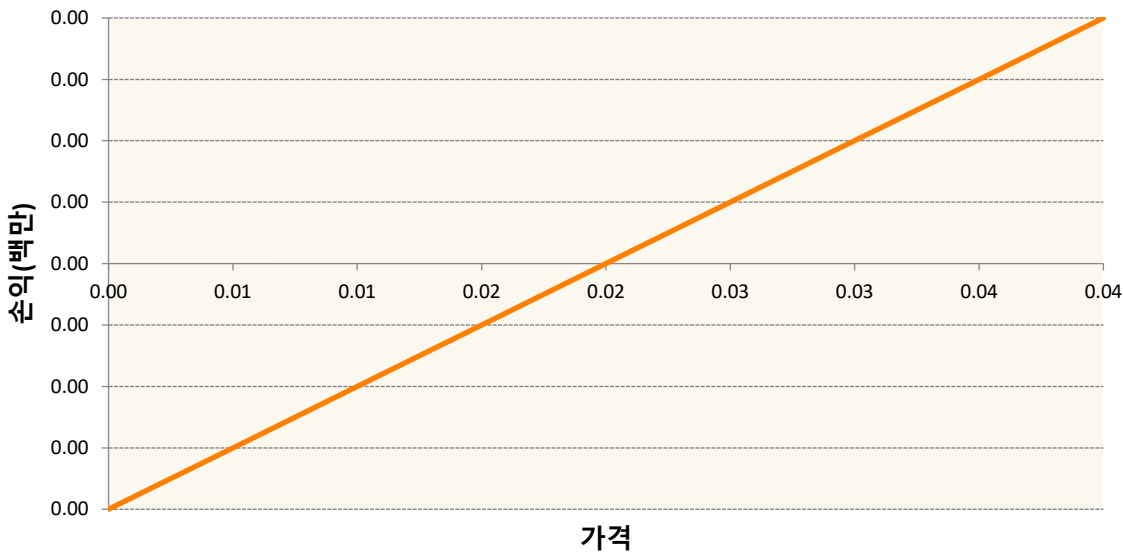
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,224	0	4,224	장외

2. 만기시점의 손익구조

SWSTAR000023-STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)



SWSTAR000025-STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		5
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		56
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		10
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠)		15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	182

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

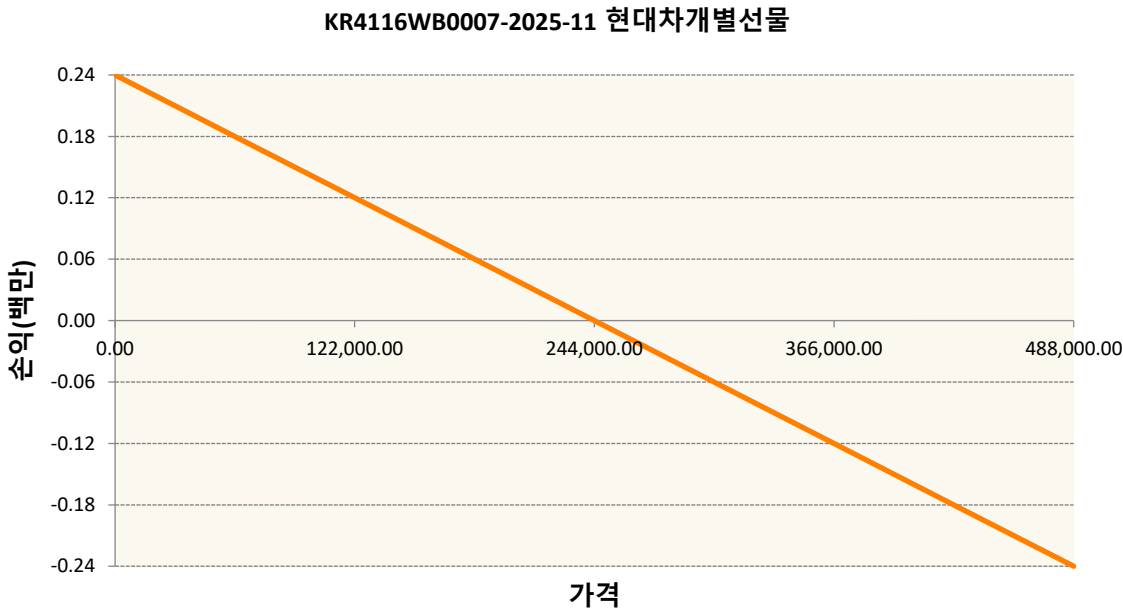
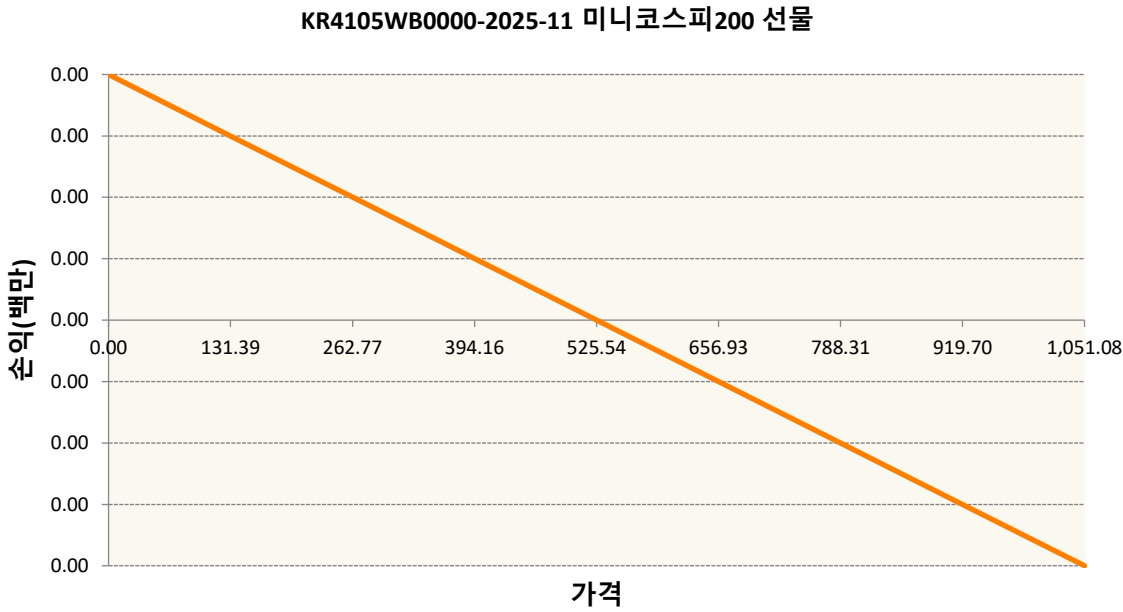
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

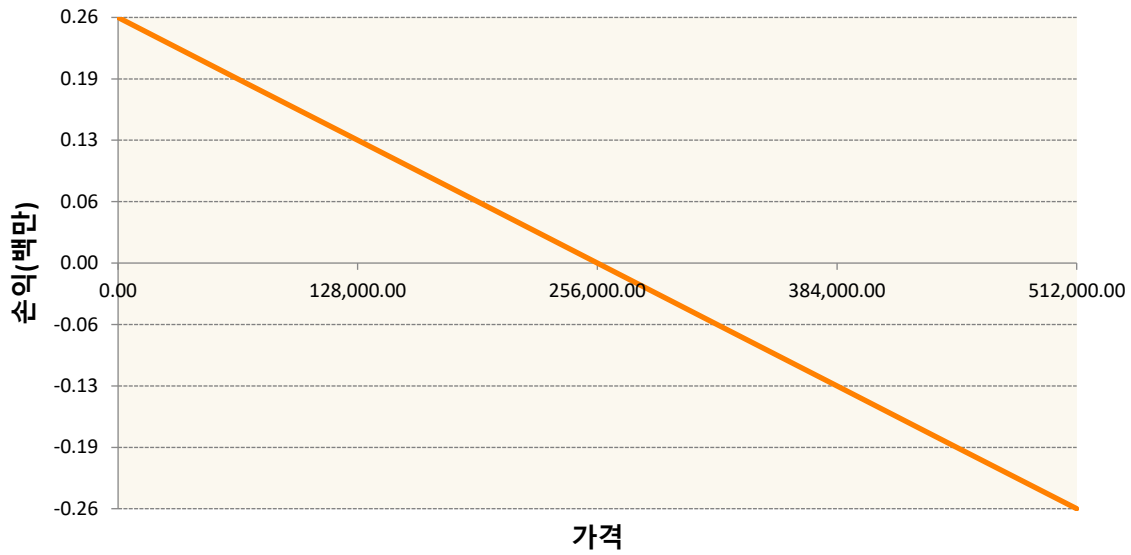
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	15	-15	장내
누계	유가증권	선물	26	847	-820	장내

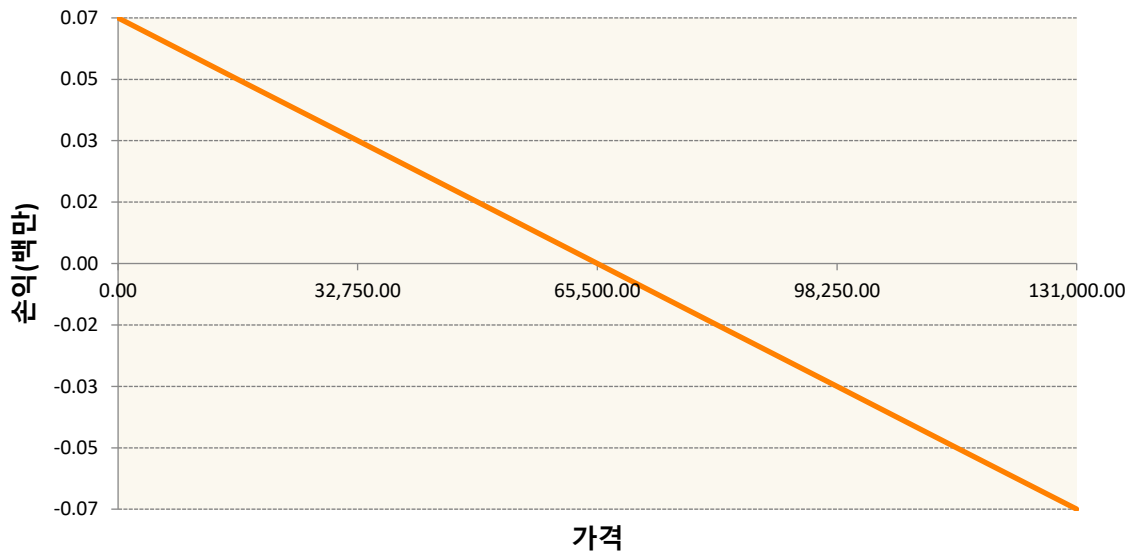
2. 만기시점의 손익구조



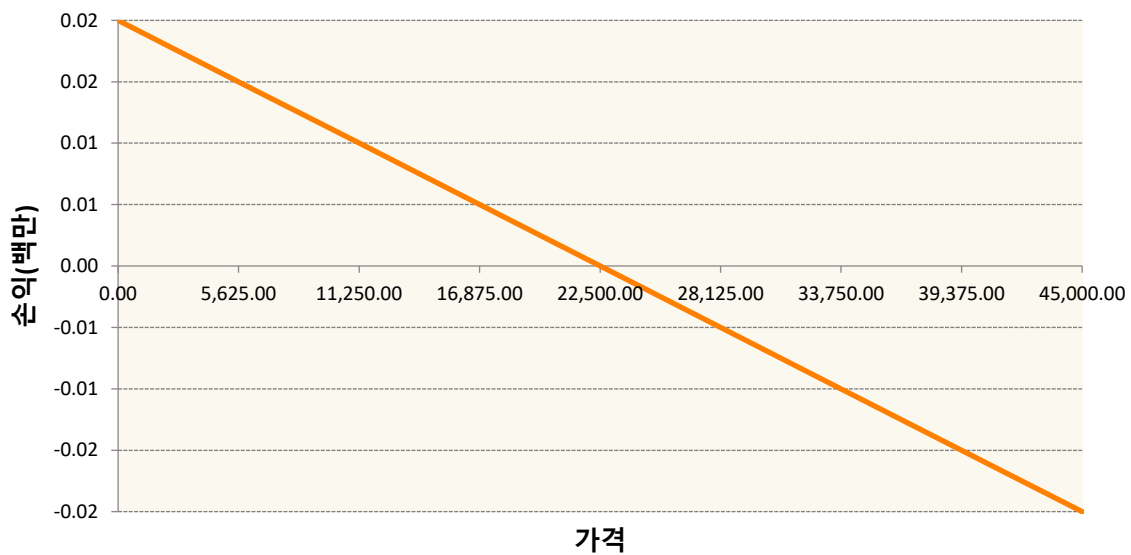
KR4122WB0009-2025-11 삼성SDI개별선물



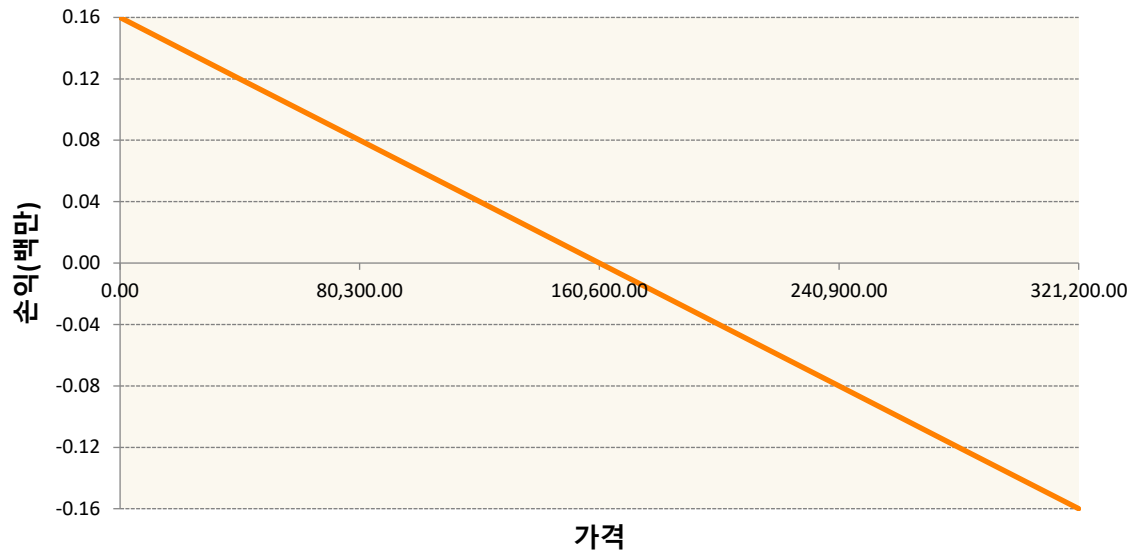
KR41B2WB0009-2025-11 S-Oil개별선물



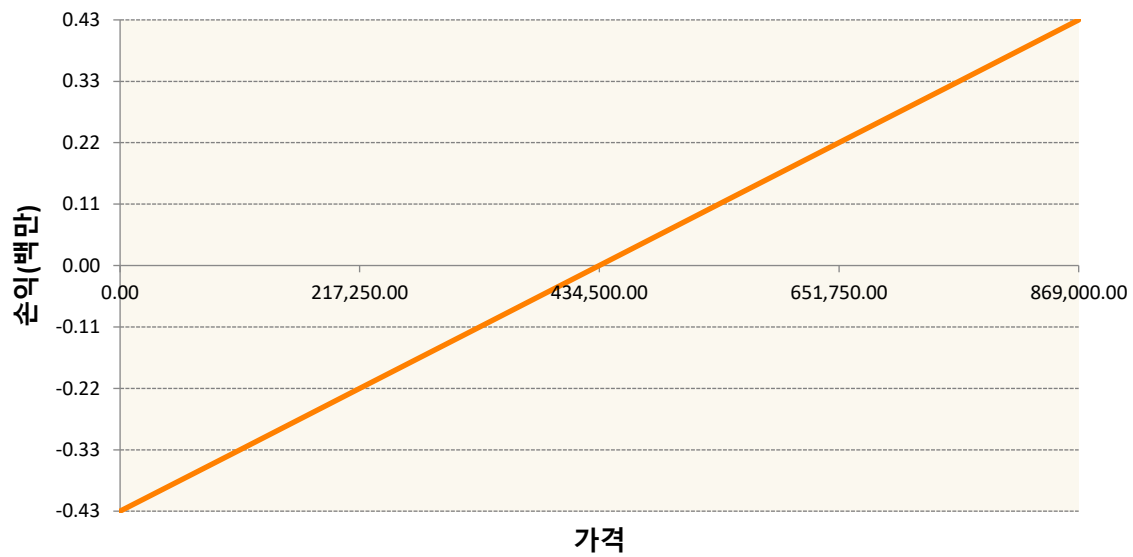
KR41BFWB0005-2025-11 삼성중공업개별선물



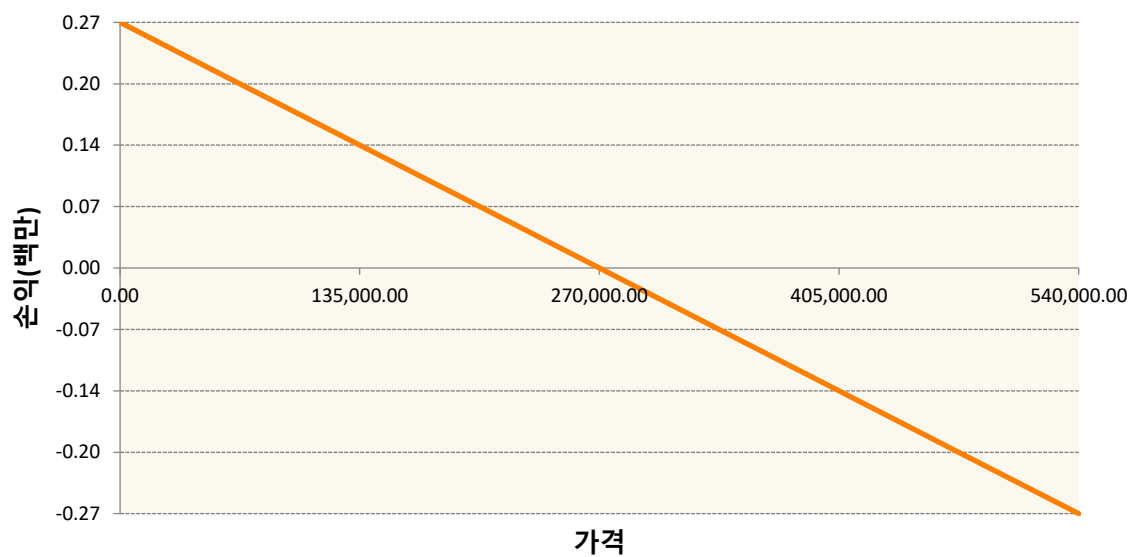
KR41EYWB0009-2025-11 에코프로비엠개별선물



KR41F5WB0007-2025-11 LG에너지솔루션개별선물



KR41FCWB0004-2025-11 하이브개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4105WB0(2025-11 미니코스피200 선물		13
KR4116WB0(2025-11 현대차개별선물		1
KR4122WB0(2025-11 삼성SDI개별선물		2
KR41B2WB0(2025-11 S-Oil개별선물		0.31
KR41BFWB0(2025-11 삼성중공업개별선물		1
KR41EYWB0(2025-11 에코프로비엠개별선물		0.26
KR41F5WB0(2025-11 LG에너지솔루션개별선물		2
KR41FCWB0(2025-11 하이브개별선물		0.43

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	8

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

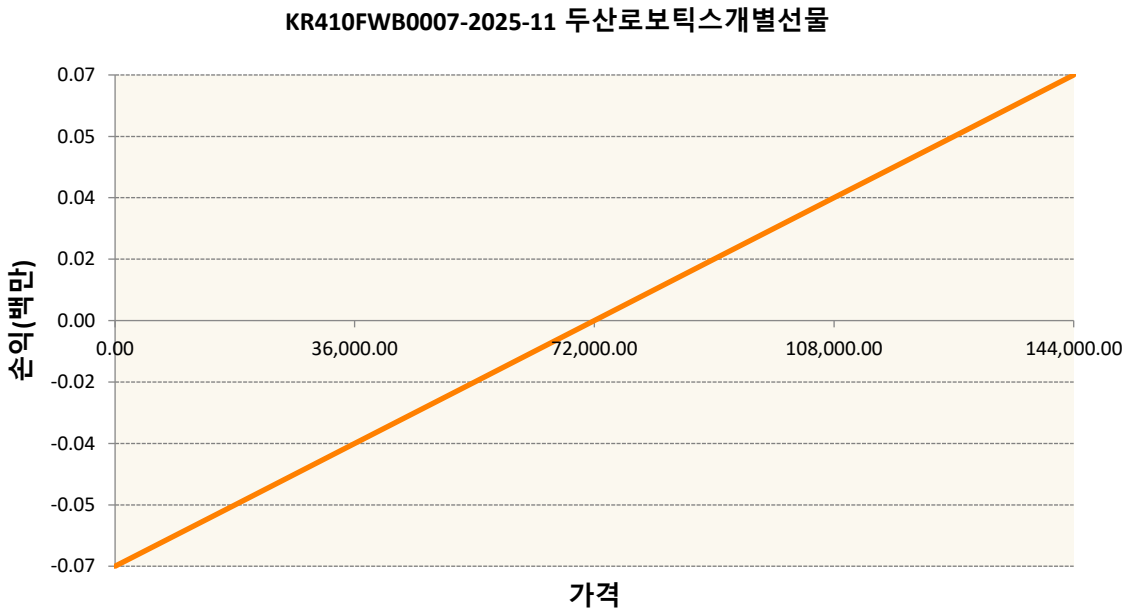
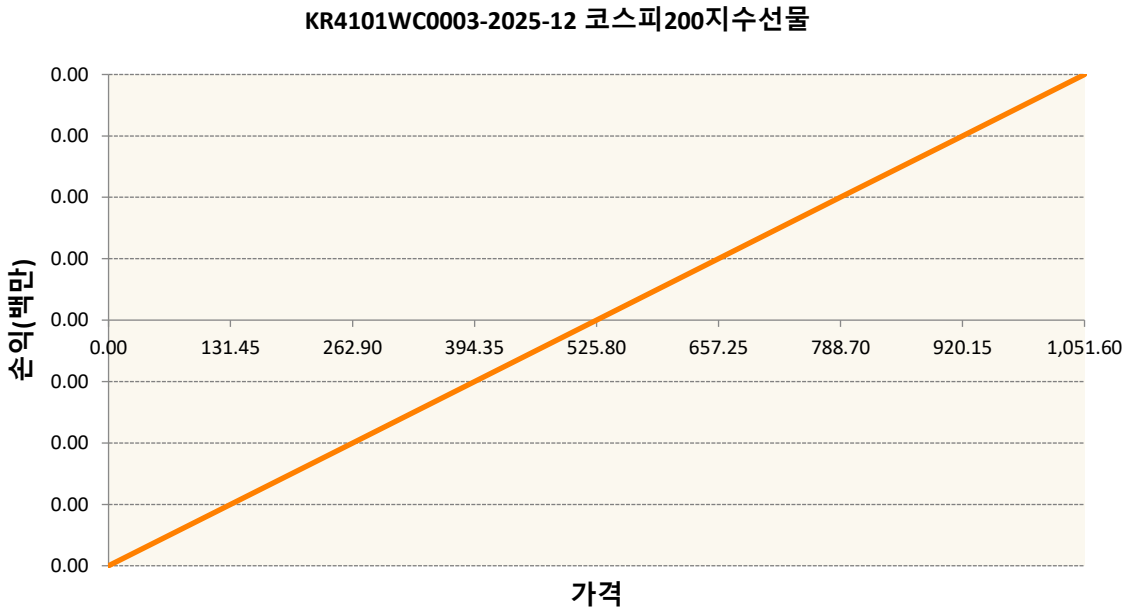
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

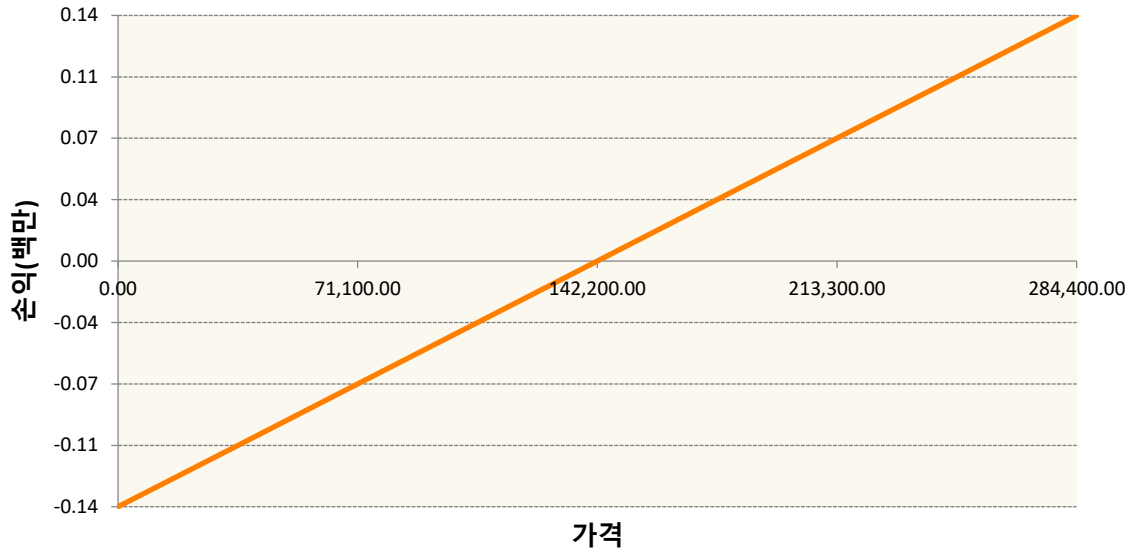
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	263	-263	장내
누계	유가증권	선물	6,861	0	6,861	장내

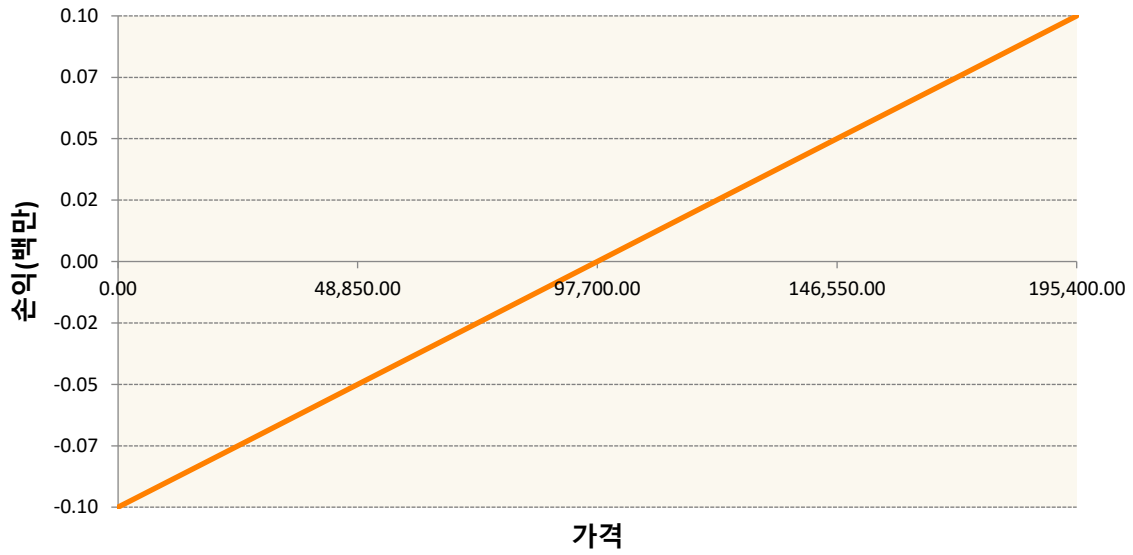
2. 만기시점의 손익구조



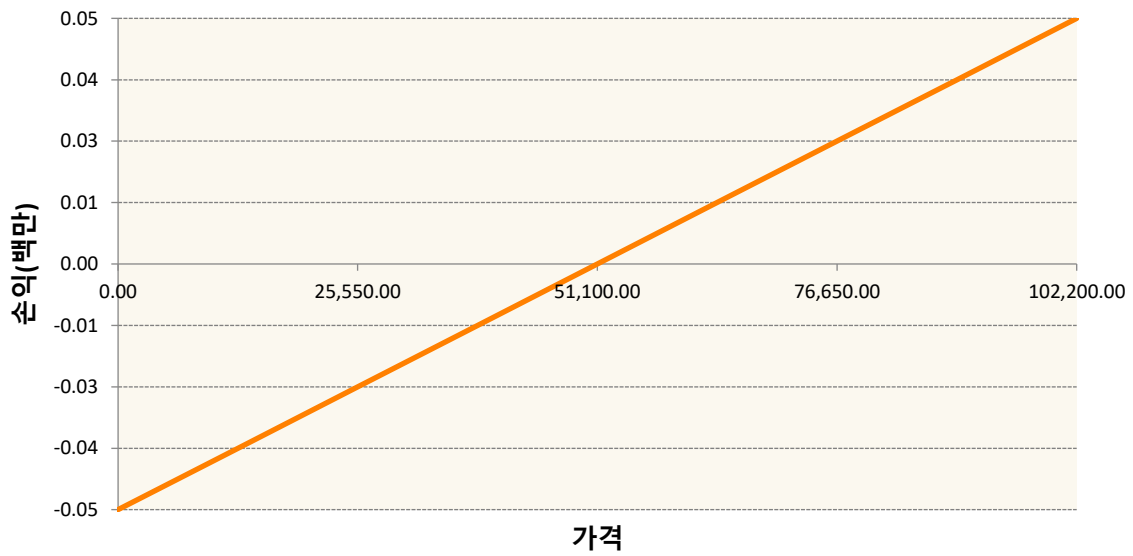
KR410ZWB0003-2025-11 한미반도체개별선물



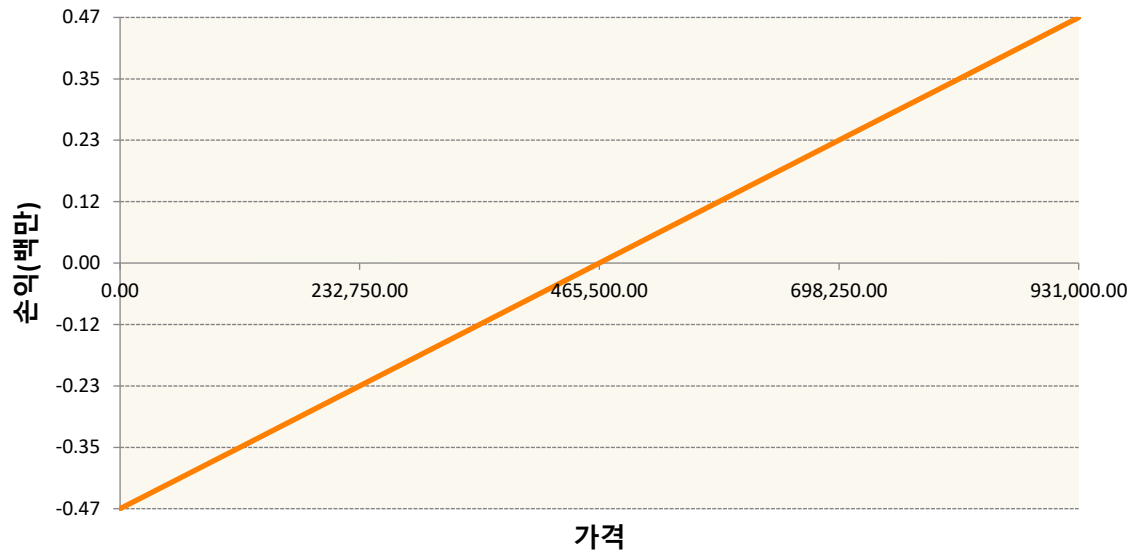
KR4111WB0002-2025-11 삼성전자개별선물



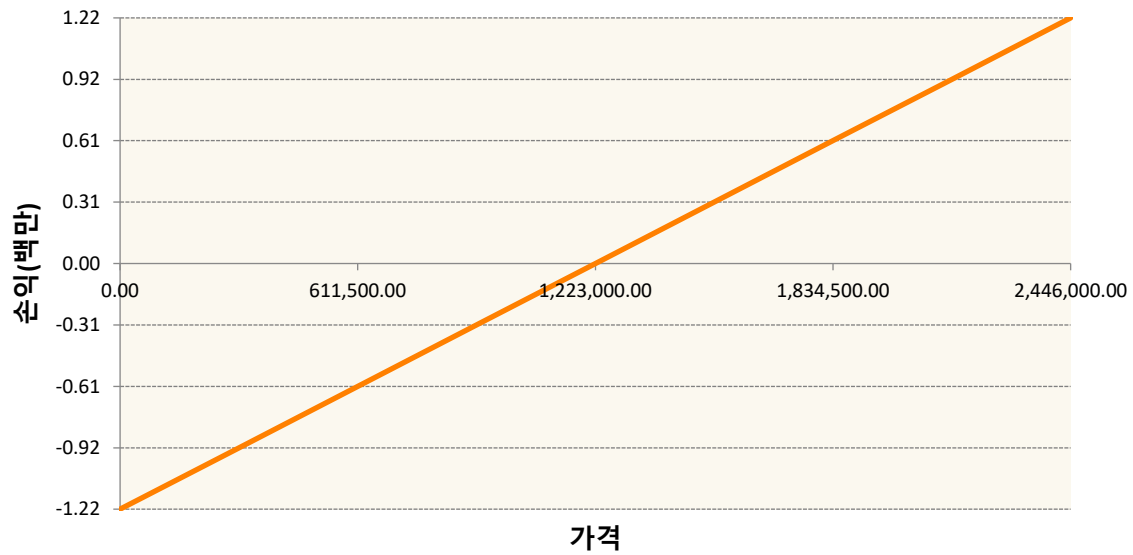
KR411RWB0002-2025-11 한화비전개별선물



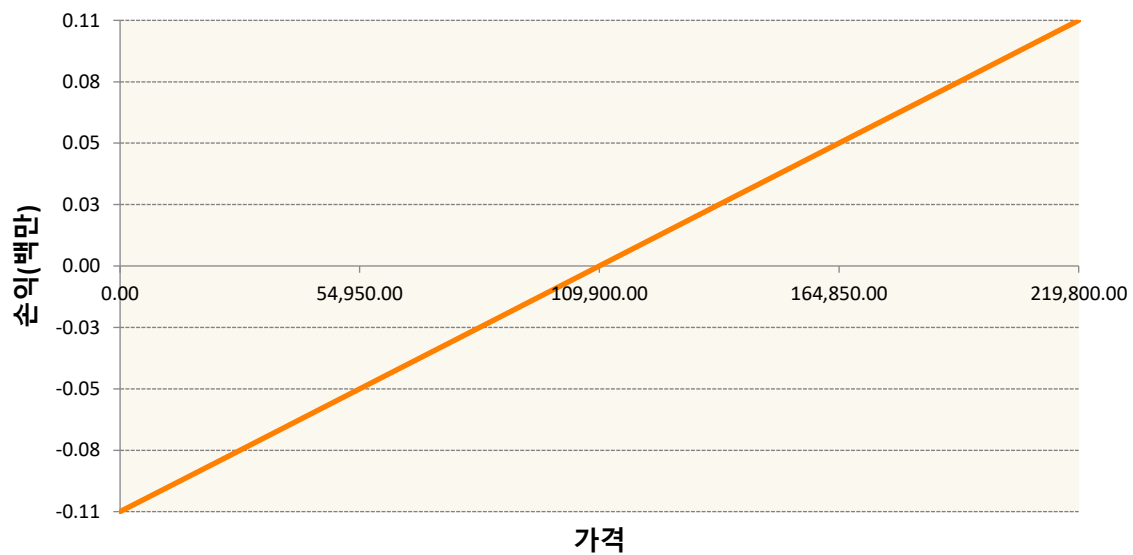
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



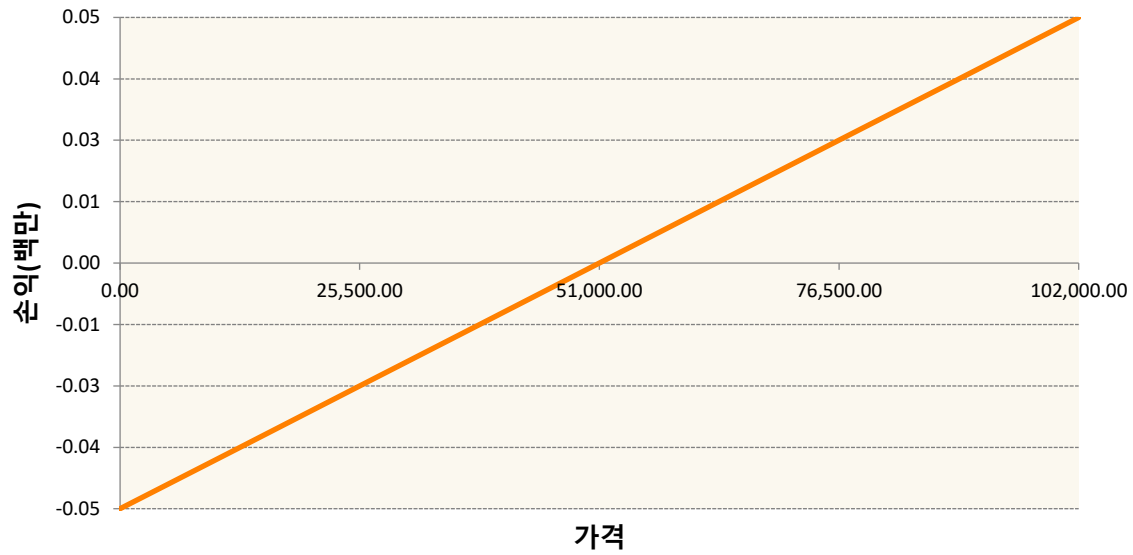
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



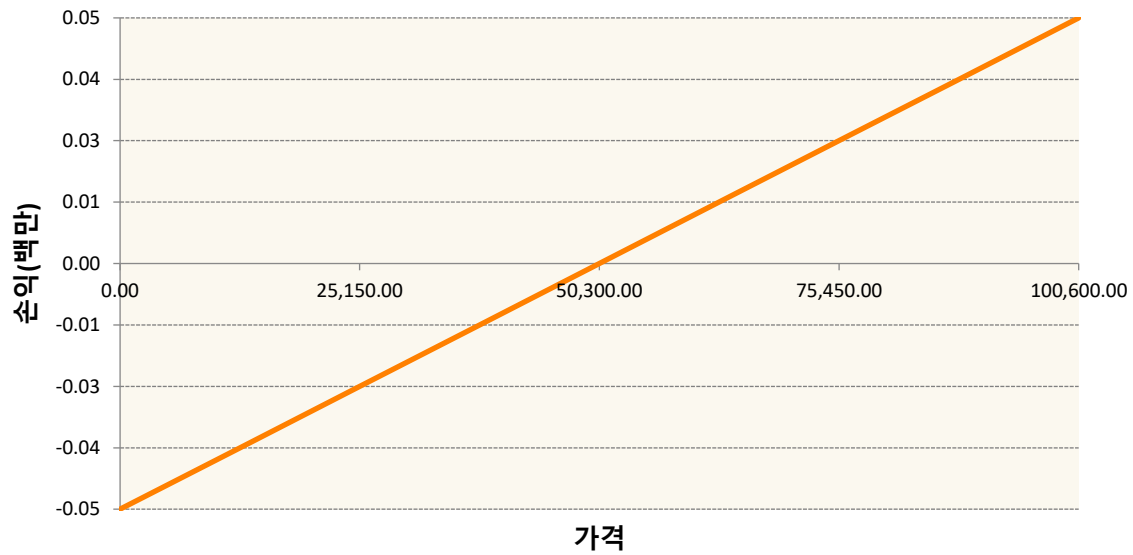
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



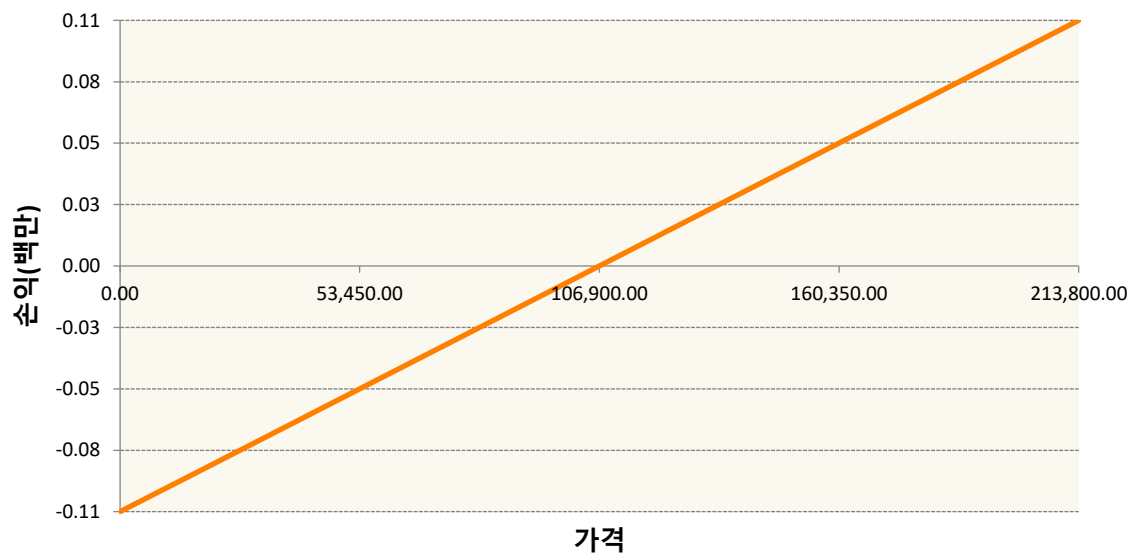
KR41EVWB0002-2025-11 한화시스템개별선물



KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	210
KR410FWB0(2025-11 두산로보틱스개별선물	16
KR410ZWB0(2025-11 한미반도체개별선물	68
KR4111WB0(2025-11 삼성전자개별선물	16
KR411RWB0(2025-11 한화비전개별선물	4
KR4150WB0(2025-11 SK하이닉스개별선물	44
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물	83
KR41EJWB0(2025-11 SKC개별선물	22
KR41EVWB0(2025-11 한화시스템개별선물	41
KR41F7WB0(2025-11 카카오페이개별선물	15
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물	30

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

1,136

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

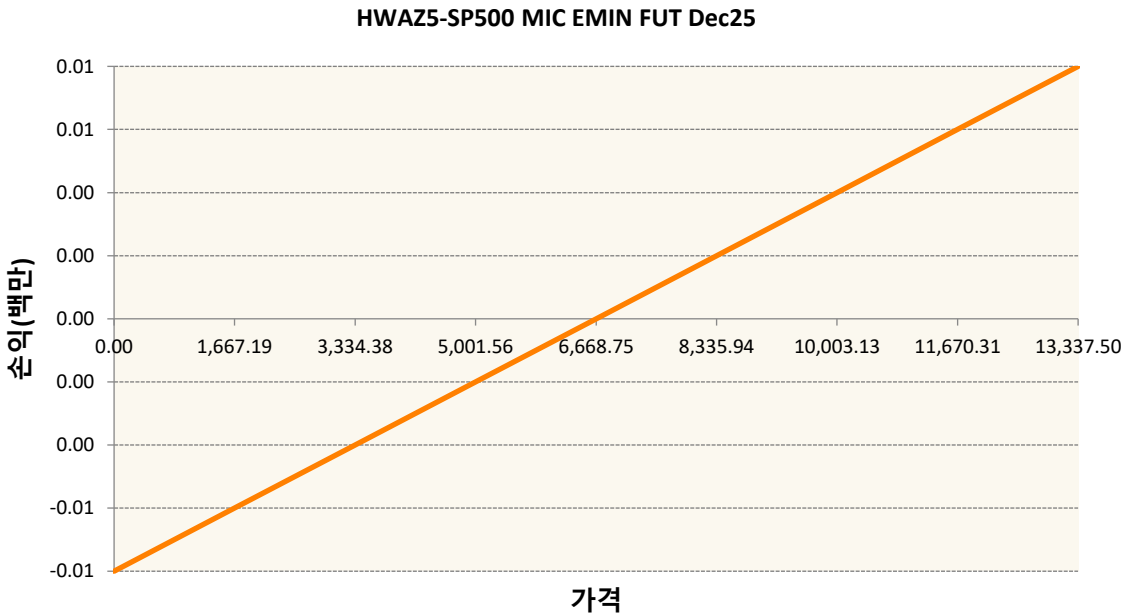
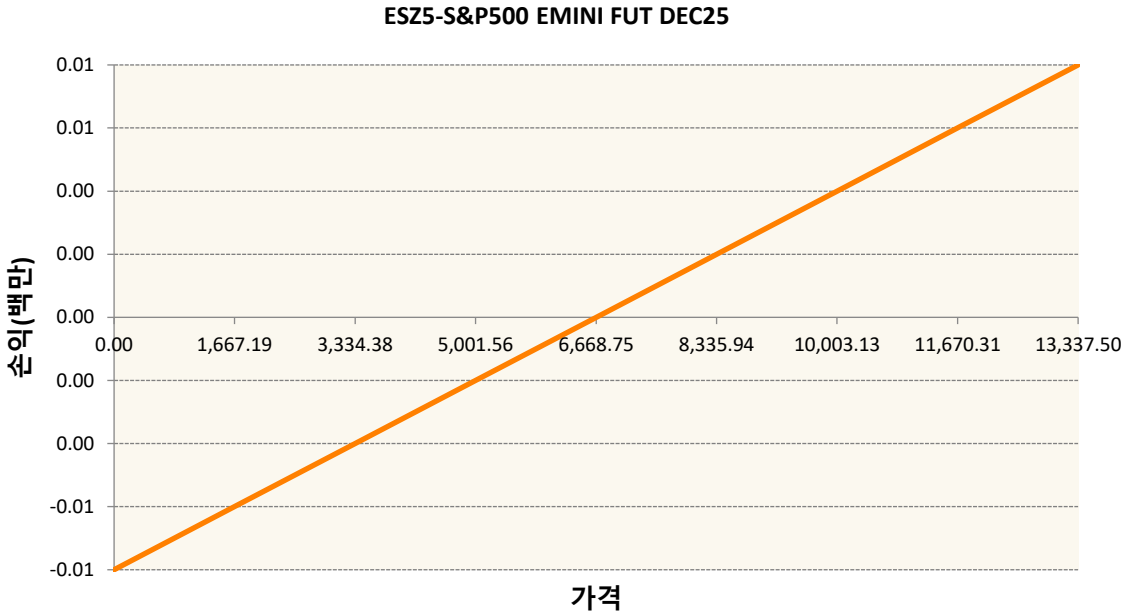
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	37,967	0	37,967	
누계	유가증권	선물	1,249	0	1,249	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,037
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,487

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

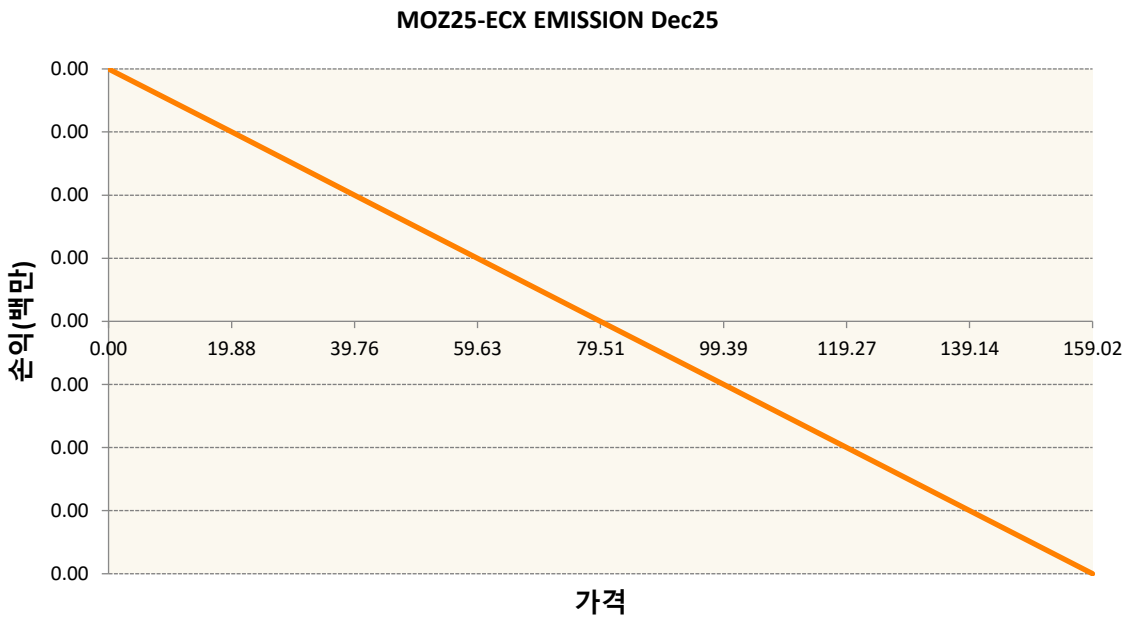
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	3,066	-3,066	
누계	지수	스왑	-12	0	-12	장외
누계	통화	선도	83	1,239	-1,155	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930918IIICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213F9SC KRW/EUR 31-10-25E	99
FXW213FAA(EUR/KRW 31-10-25E	7
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	245

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

(단위:백만원)

400

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

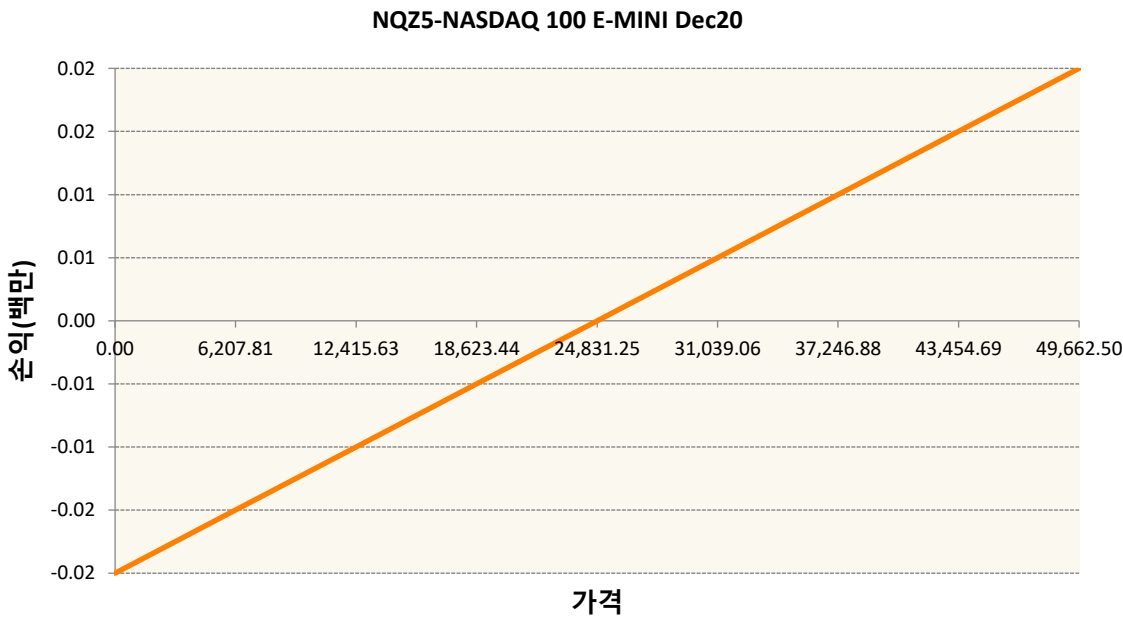
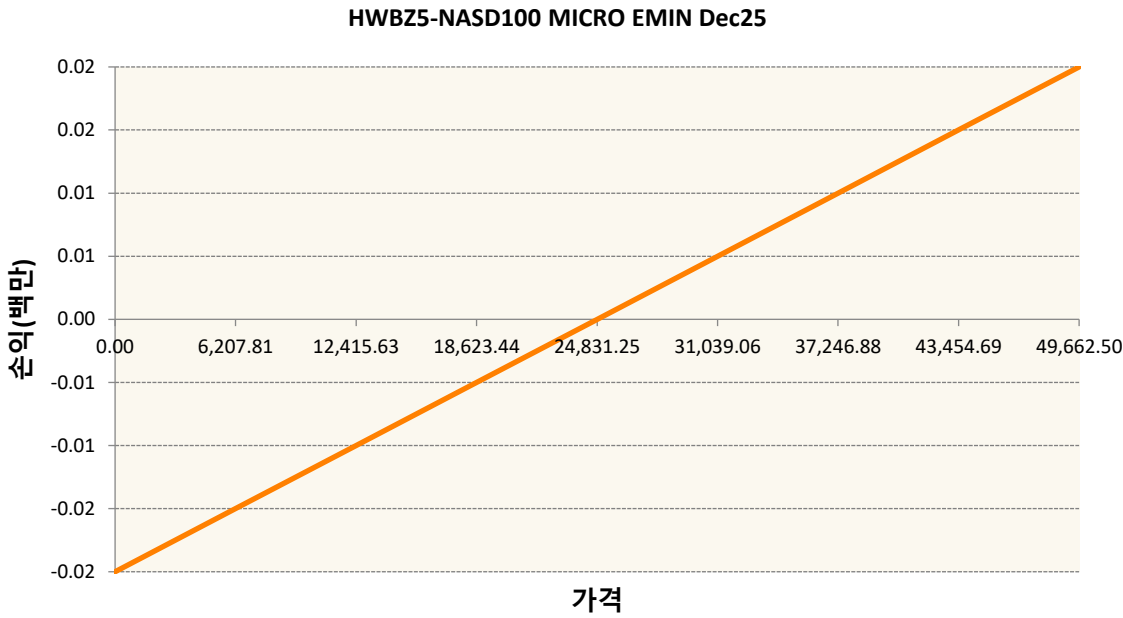
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	16,568	0	16,568	
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	1,325

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,632

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

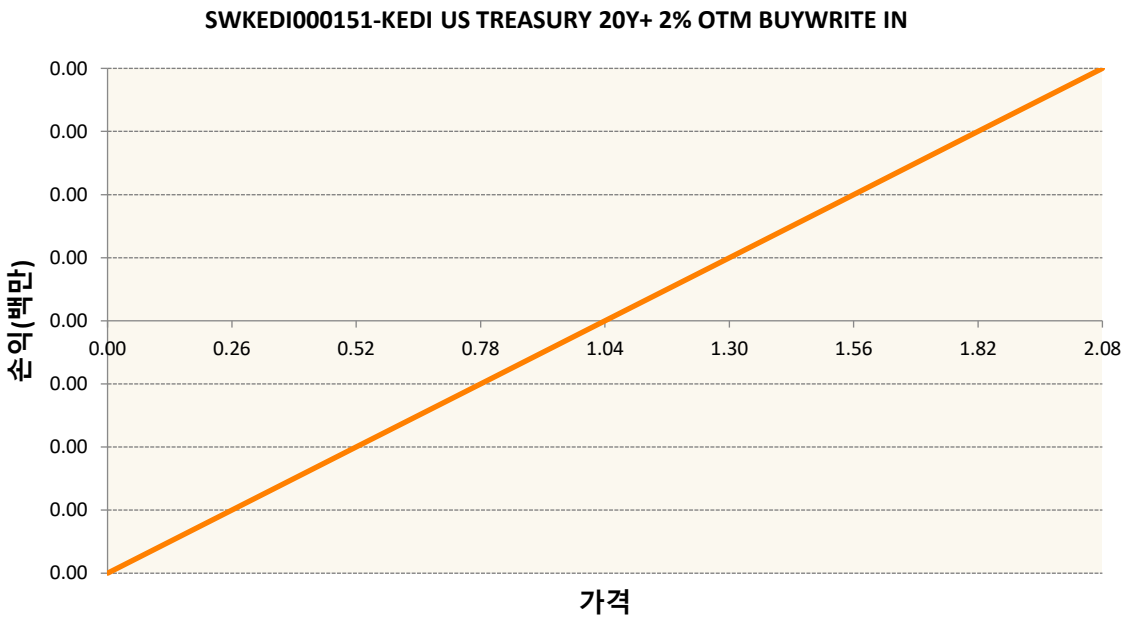
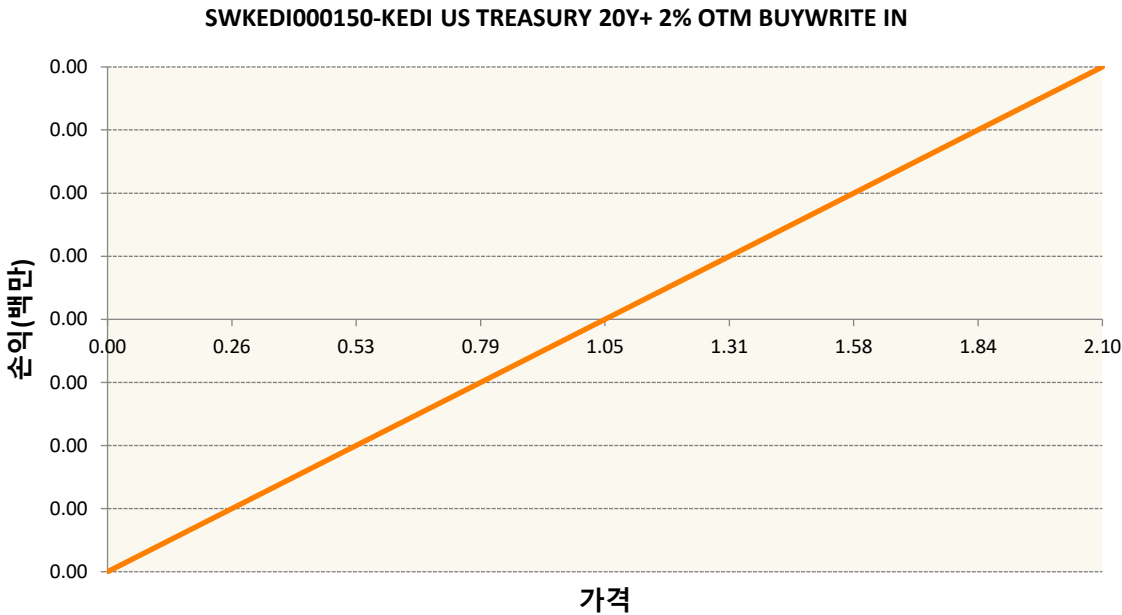
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

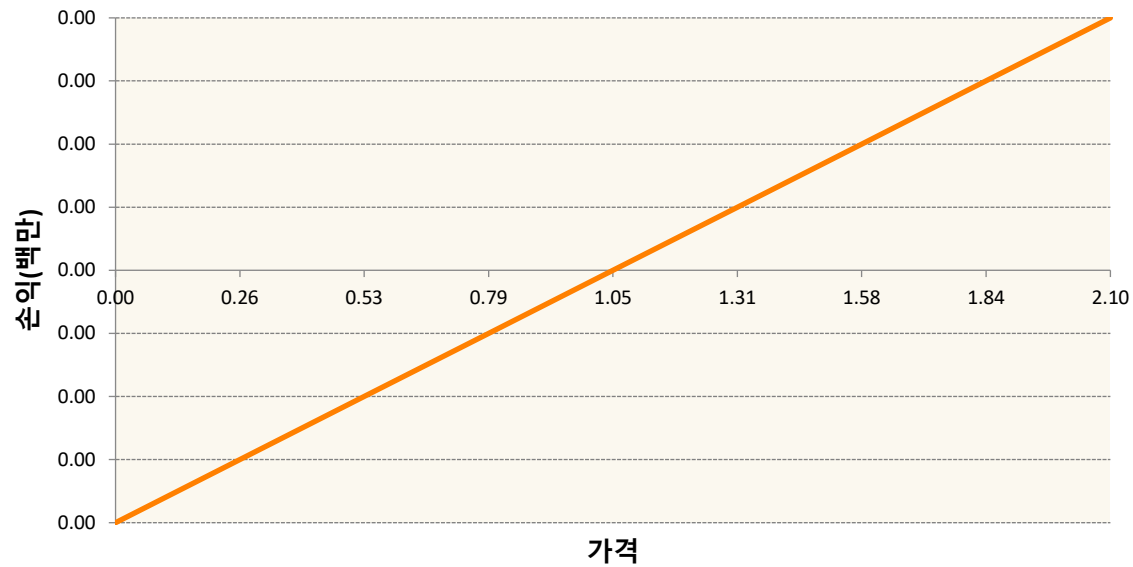
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	375,507	0	375,507	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

8,484
8,048
3,735
10,085

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

(단위:백만원)

14,777

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

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	2,475	0	2,475	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	3

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

(단위:백만원)

16

공시일	2025-10-20
기준일	2025-10-17

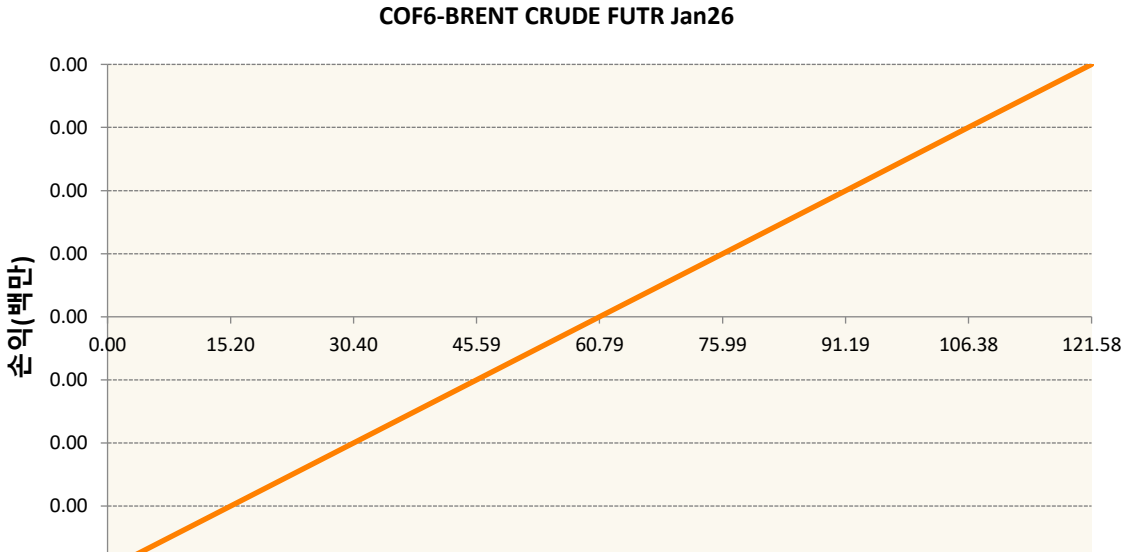
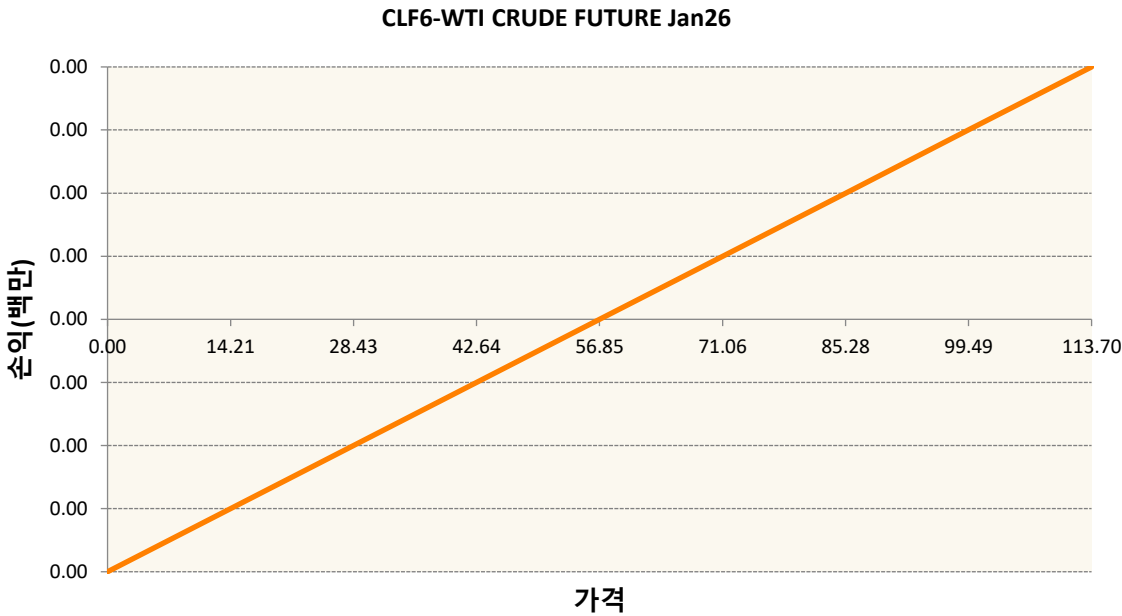
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

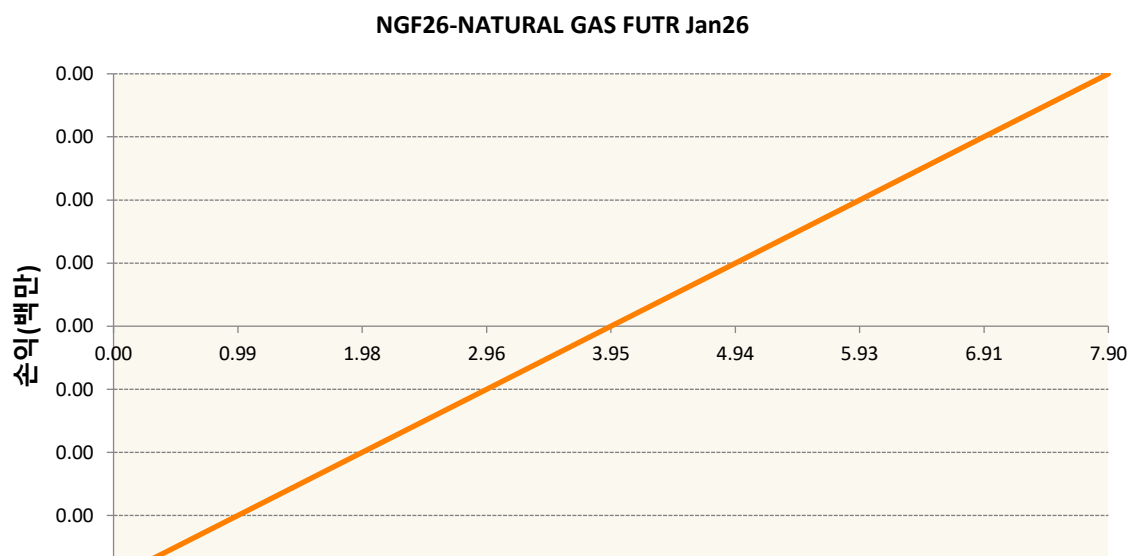
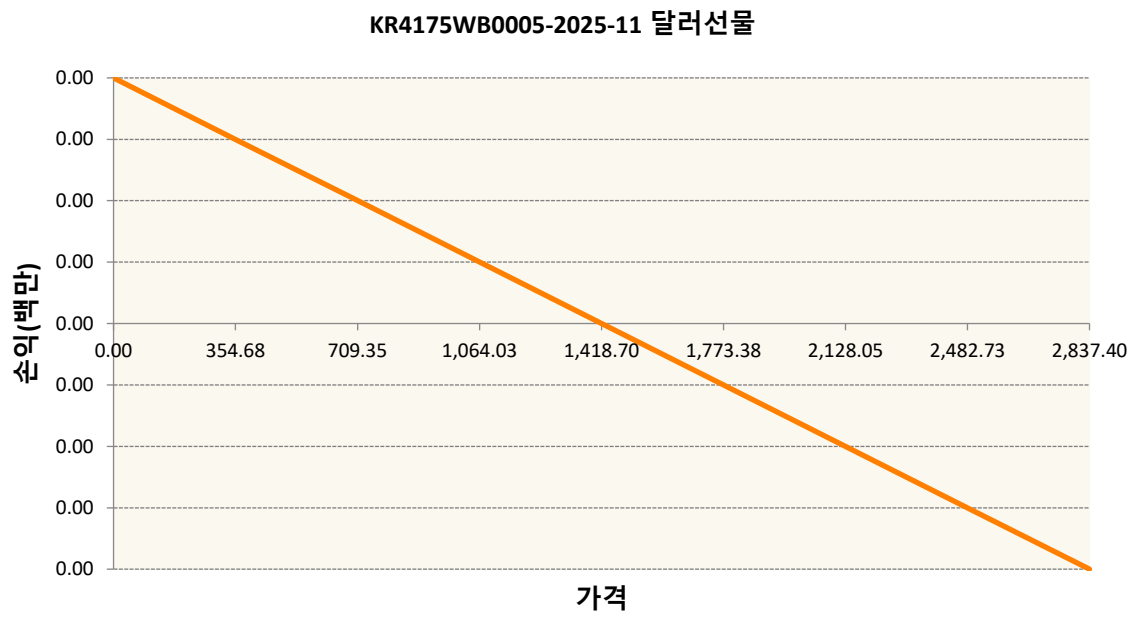
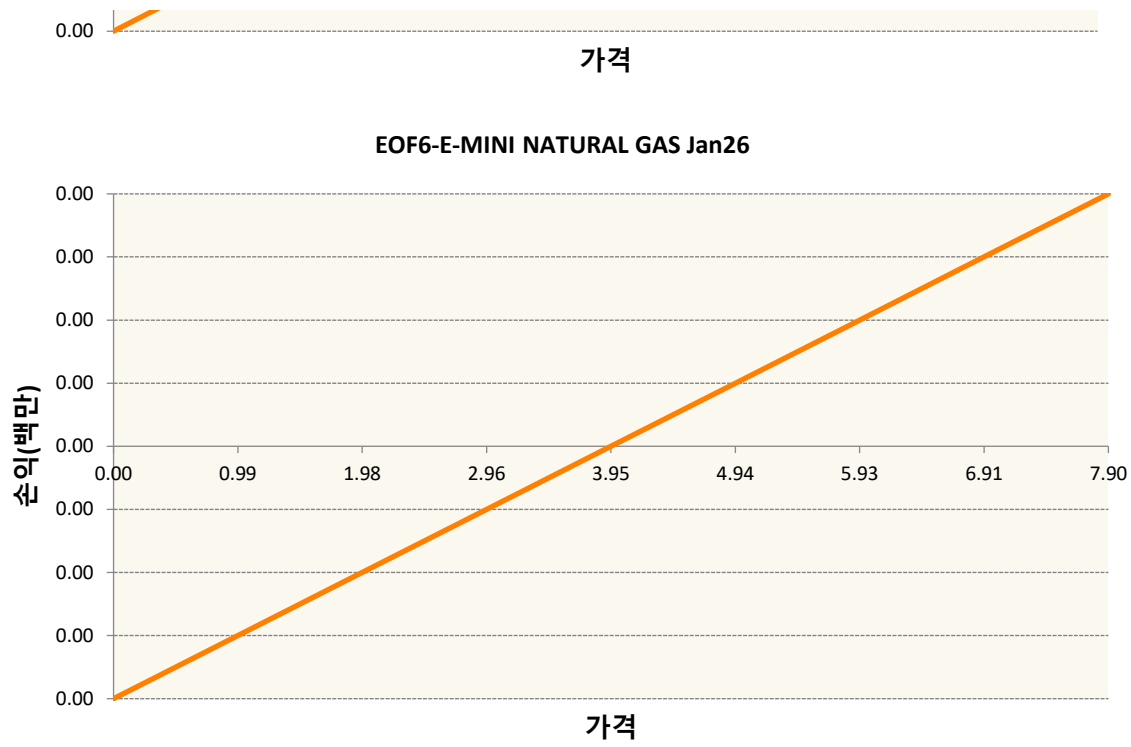
1. 계약금액

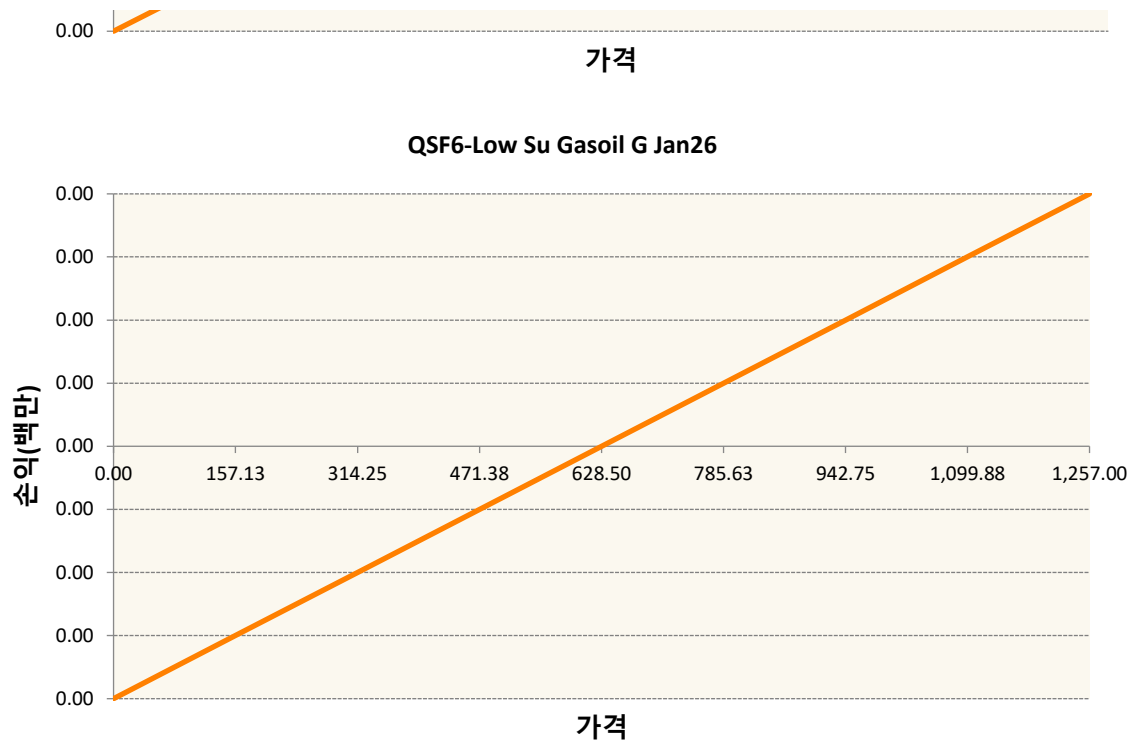
(단위:백만원)

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	324	0	324	
누계	유가증권	선물	169	0	169	
누계	통화	선물	0	71	-71	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF6	WTI CRUDE FUTURE Jan26	6
COF6	BRENT CRUDE FUTR Jan26	14
EOF6	E-MINI NATURAL GAS Jan26	3
KR4175WB0(2025-11 달러선물		6
NGF26	NATURAL GAS FUTR Jan26	9
QSF6	Low Su Gasoil G Jan26	7

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

(단위:백만원)

86