

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

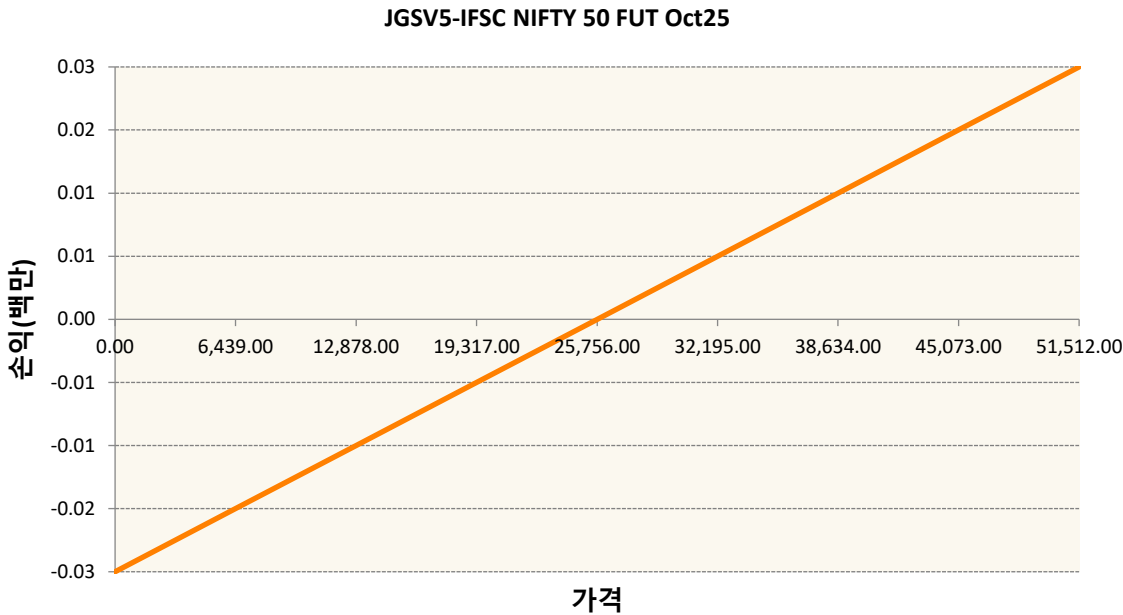
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	577	0	577	

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)

33

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

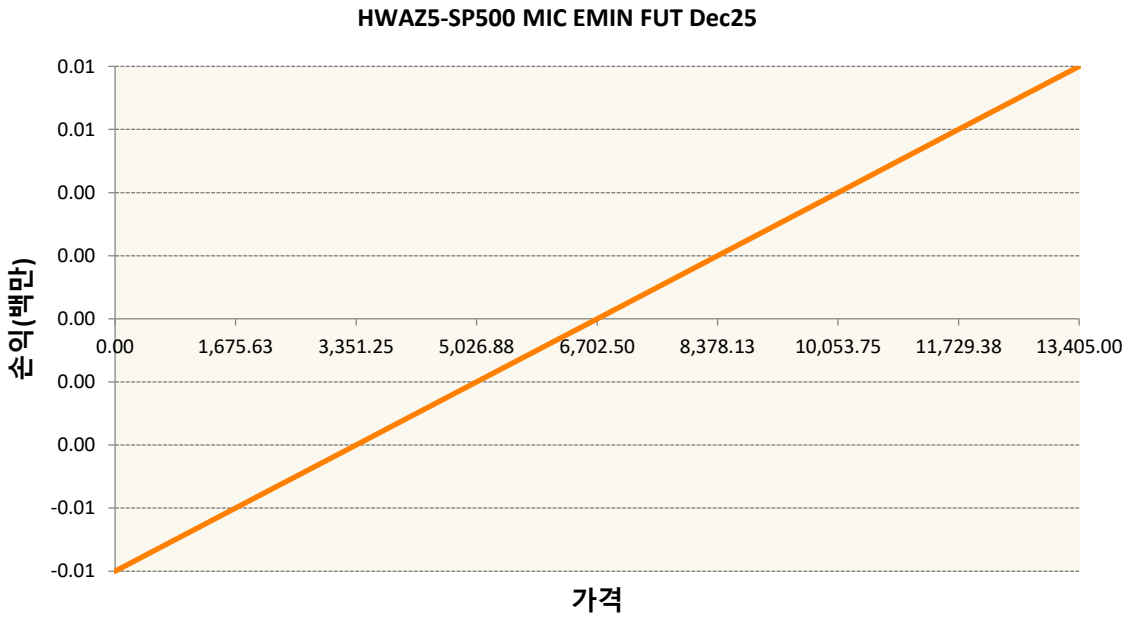
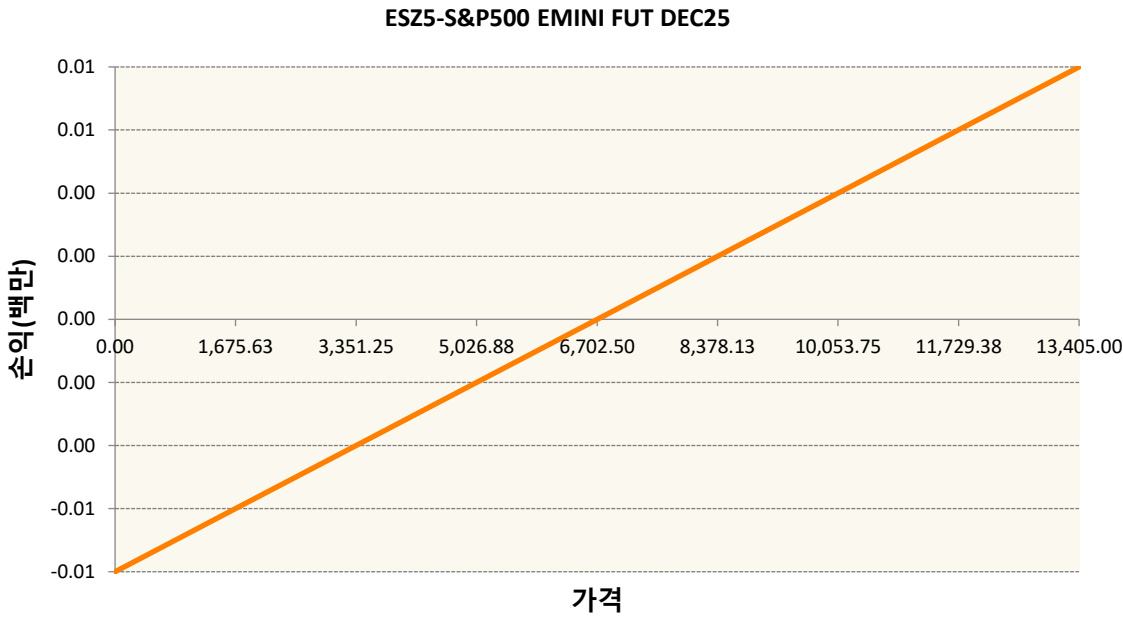
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	465	0	465	
누계	유가증권	선물	186	0	186	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

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

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

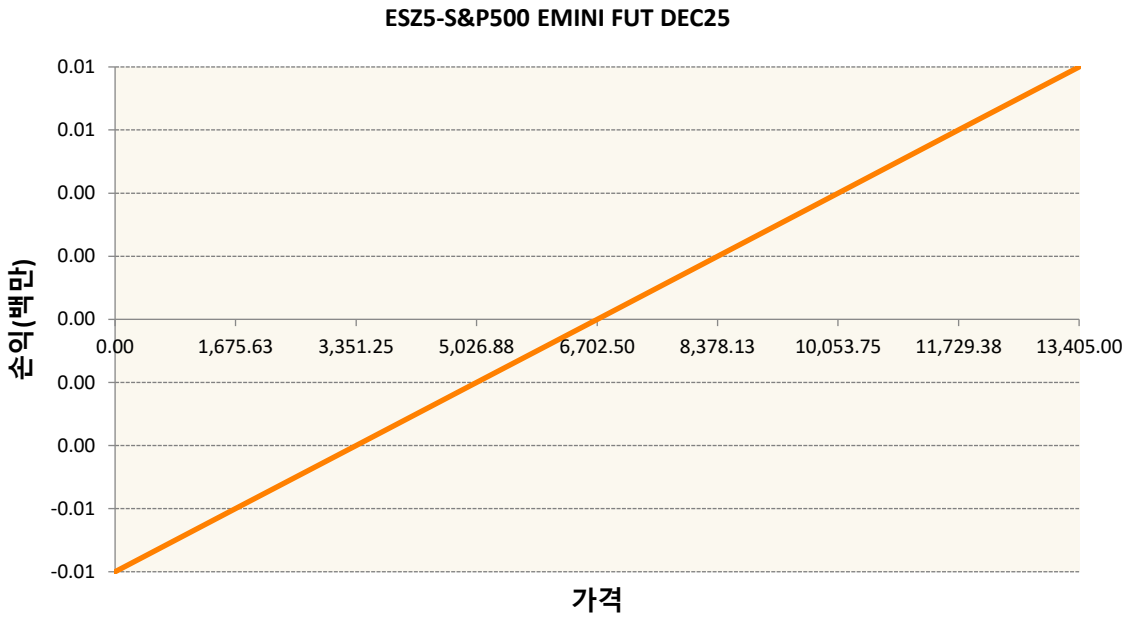
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,395	0	1,395	

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	2025-10-21
기준일	2025-10-20

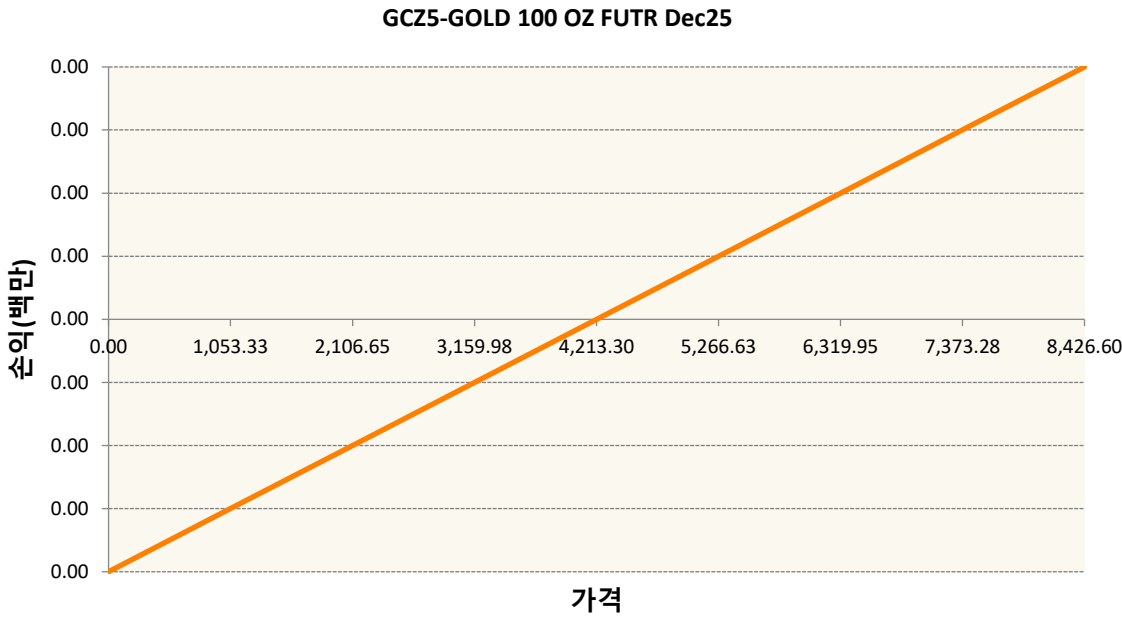
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	3,547	0	3,547	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 10/24/25 C410 EQUITY	1
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	284

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

(단위:백만원)

252

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

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	0	0	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUCC PLTR US 10/24/25 C185 EQUITY	49
AOPLTRUCP PLTR US 10/24/25 P185 EQUITY	40

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

(단위:백만원)

354

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

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 10/24/25 C92.5 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

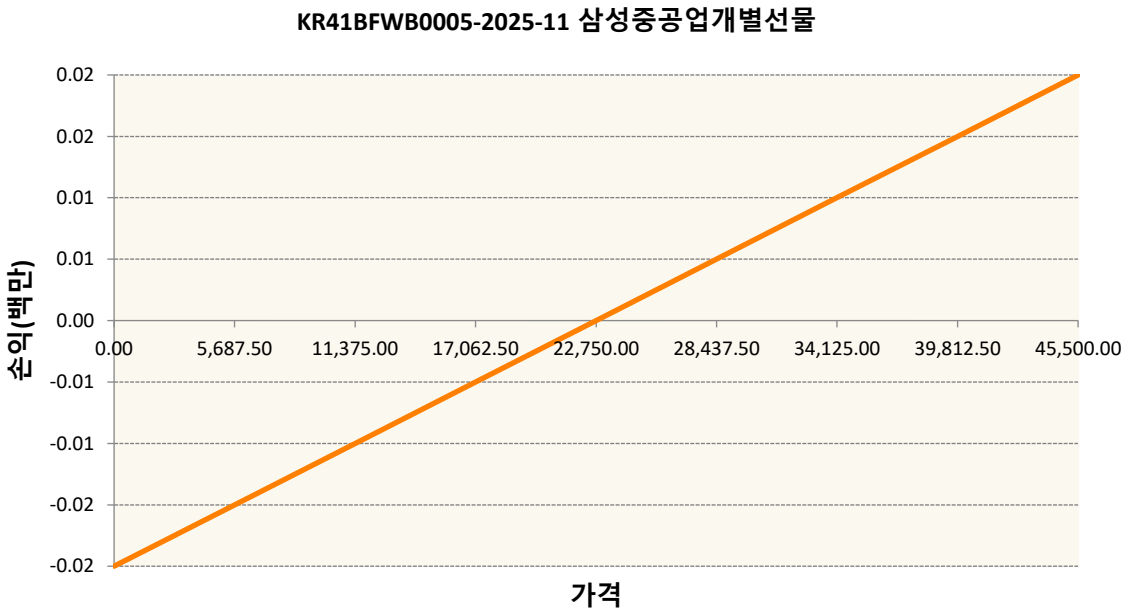
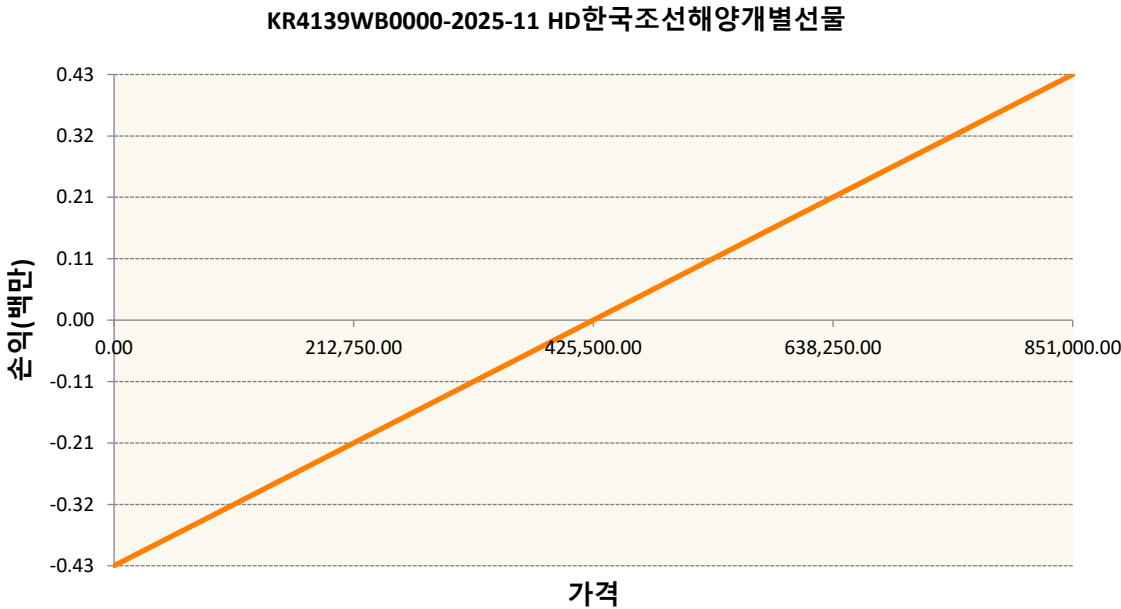
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

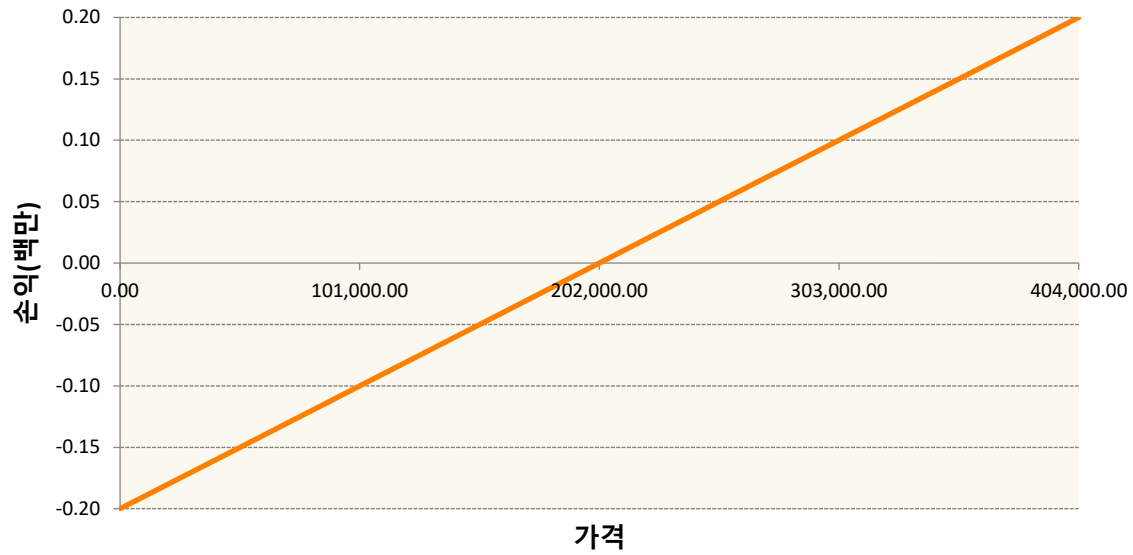
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	54,271	0	54,271	장내

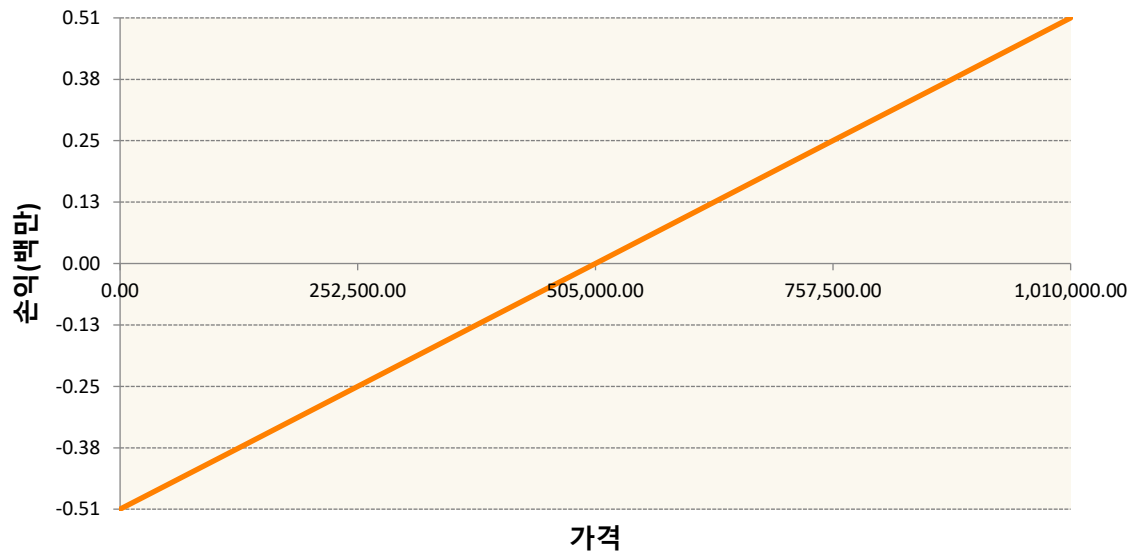
2. 만기시점의 손익구조



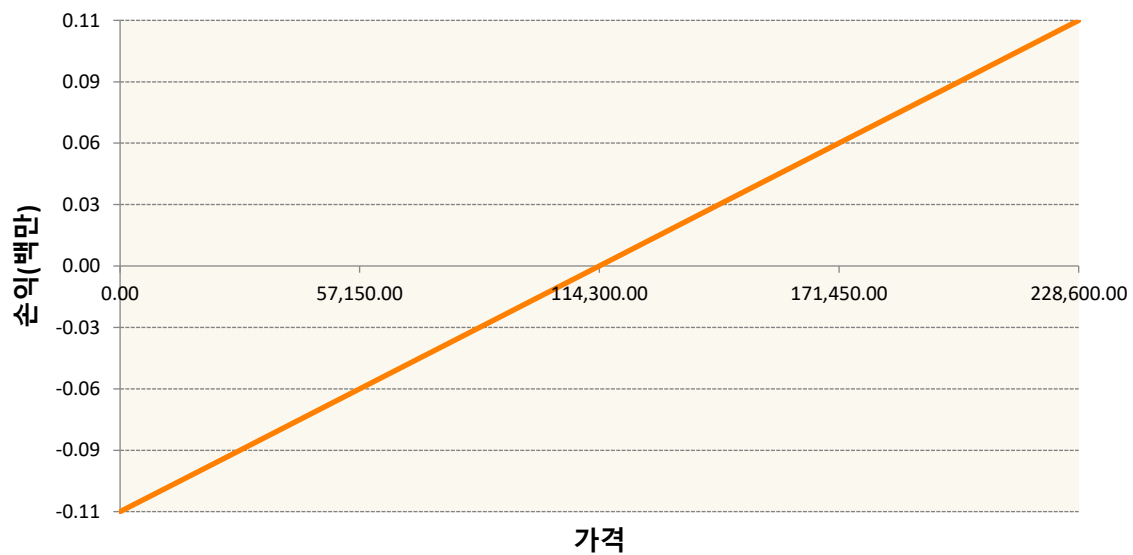
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



(단위:백만원)

KR4139WB0000		2025-11 HD한국조선해양개별선물					1,223
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,223	-1,223	-1,223	-1,223	-1,223	-1,223	-1,223
-5.33%	-815	-815	-815	-815	-815	-815	-815
-2.67%	-408	-408	-408	-408	-408	-408	-408
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	408	408	408	408	408	408	408
5.33%	815	815	815	815	815	815	815
8.00%	1,223	1,223	1,223	1,223	1,223	1,223	1,223
KR41BFWB0005		2025-11 삼성중공업개별선물					1,120
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120	-1,120
-5.33%	-746	-746	-746	-746	-746	-746	-746
-2.67%	-373	-373	-373	-373	-373	-373	-373
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	373	373	373	373	373	373	373
5.33%	746	746	746	746	746	746	746
8.00%	1,120	1,120	1,120	1,120	1,120	1,120	1,120
KR41CDWB0006		2025-11 HD현대미포개별선물					457
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-457	-457	-457	-457	-457	-457	-457
-5.33%	-305	-305	-305	-305	-305	-305	-305
-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%	305	305	305	305	305	305	305
8.00%	457	457	457	457	457	457	457
KR41FDWB0003		2025-11 HD현대중공업개별선물					607
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-607	-607	-607	-607	-607	-607	-607
-5.33%	-404	-404	-404	-404	-404	-404	-404
-2.67%	-202	-202	-202	-202	-202	-202	-202
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	202	202	202	202	202	202	202
5.33%	404	404	404	404	404	404	404
8.00%	607	607	607	607	607	607	607
KR41FVWB0001		2025-11 한화오션개별선물					926
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-926	-926	-926	-926	-926	-926	-926
-5.33%	-617	-617	-617	-617	-617	-617	-617
-2.67%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	309	309	309	309	309	309	309
5.33%	617	617	617	617	617	617	617
8.00%	926	926	926	926	926	926	926

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

(단위:백만원)

2,231

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

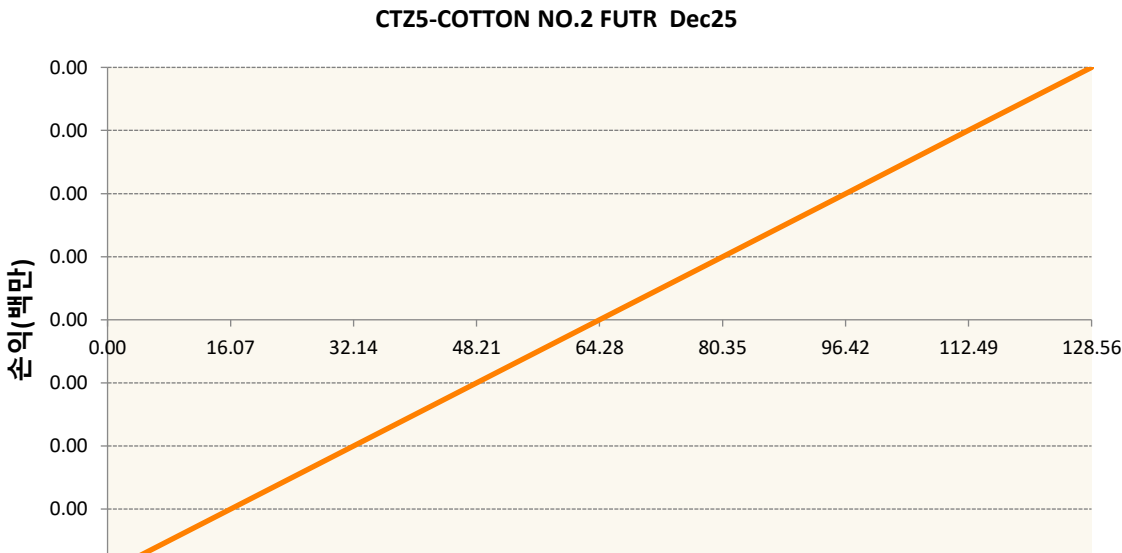
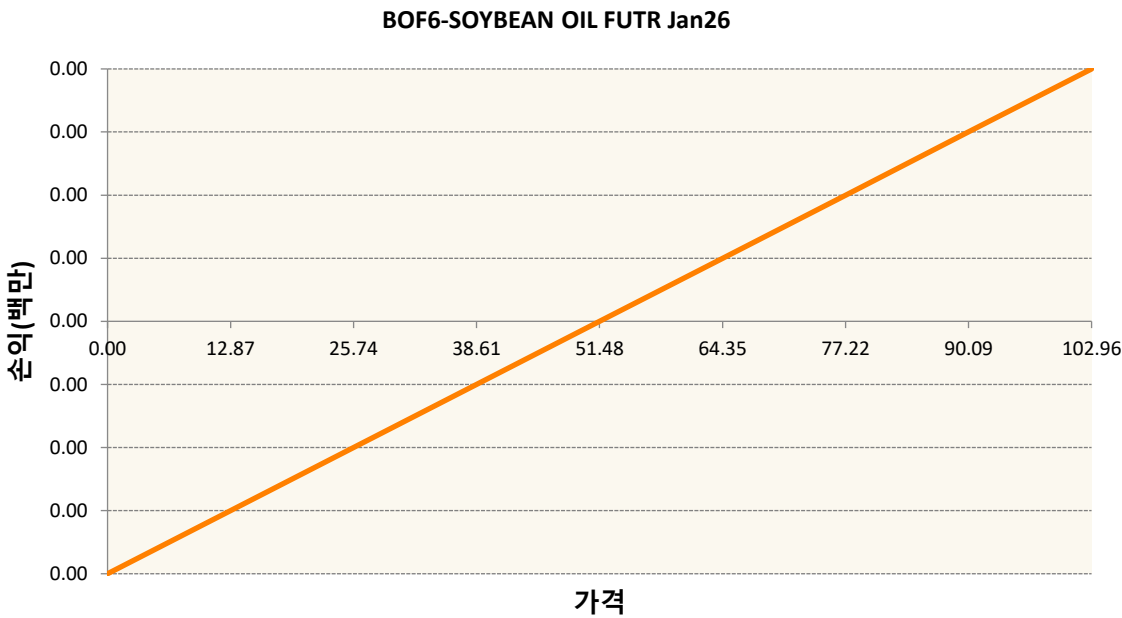
포커스농산물모(채권-파생형)

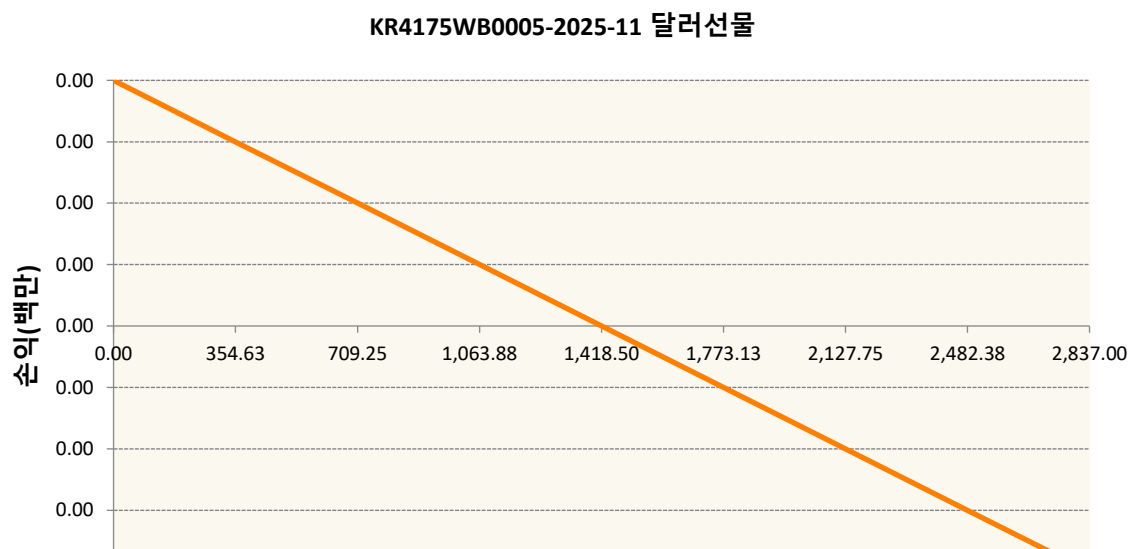
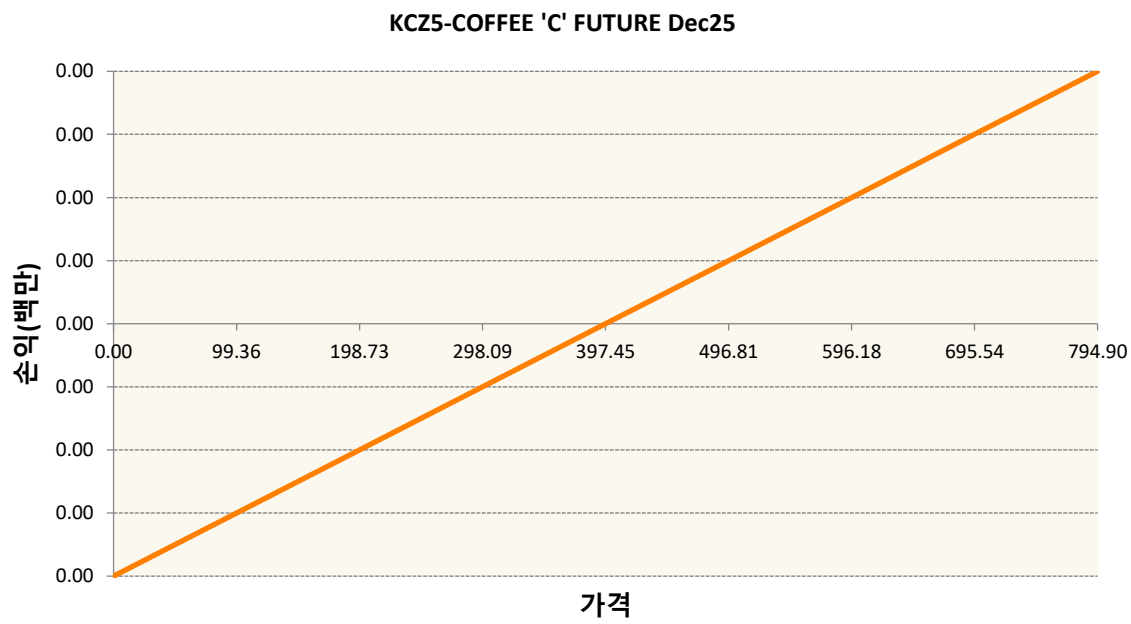
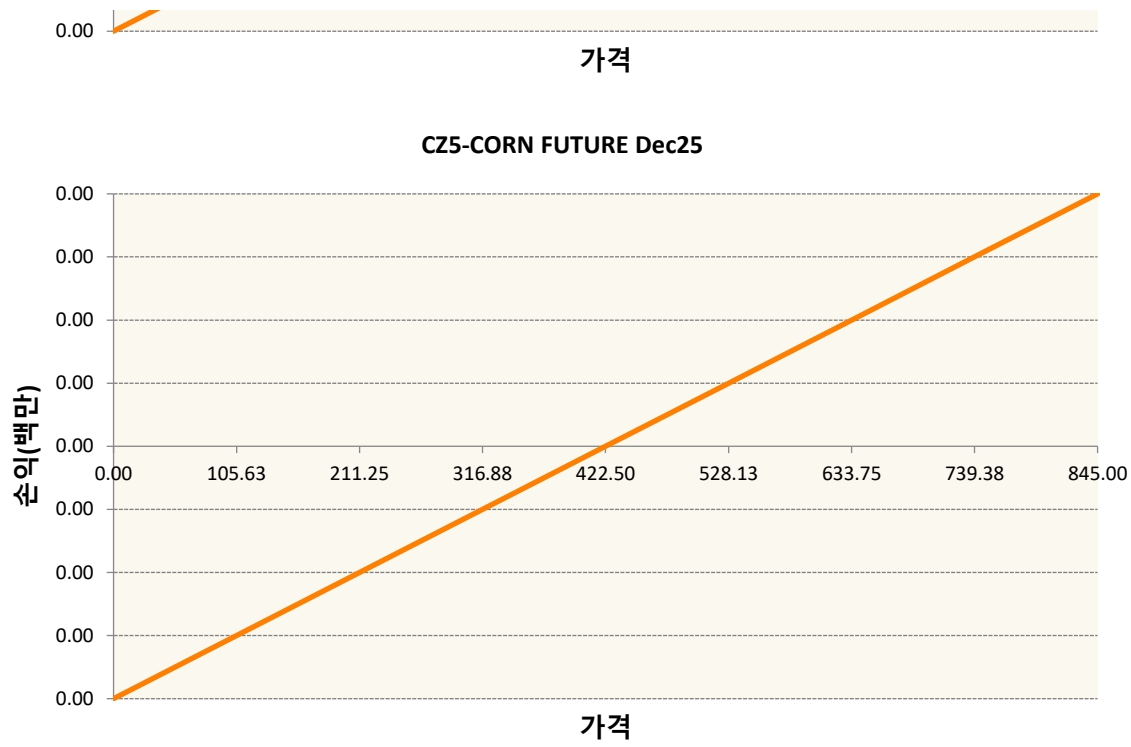
1. 계약금액

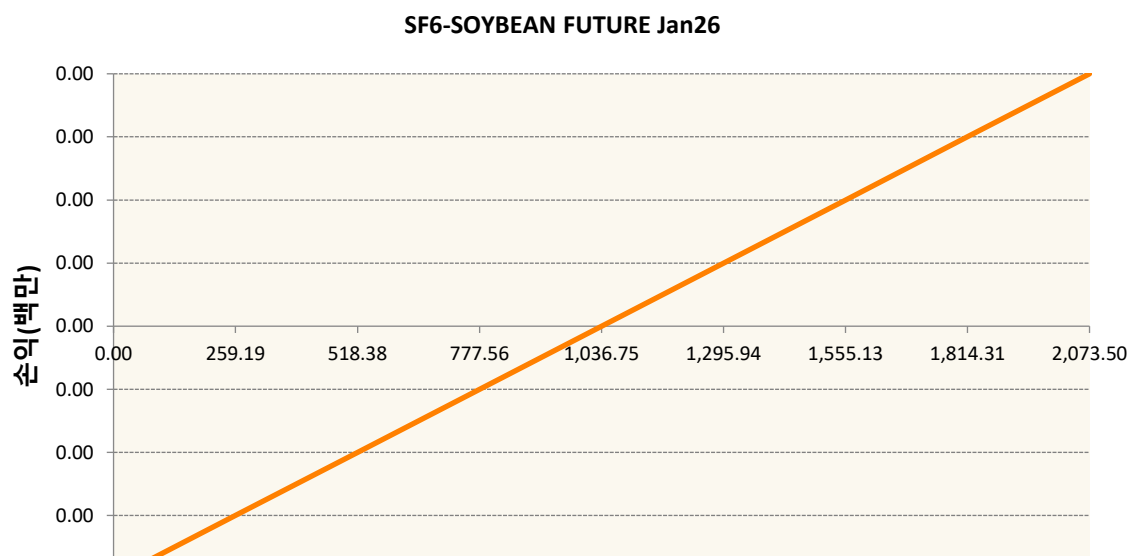
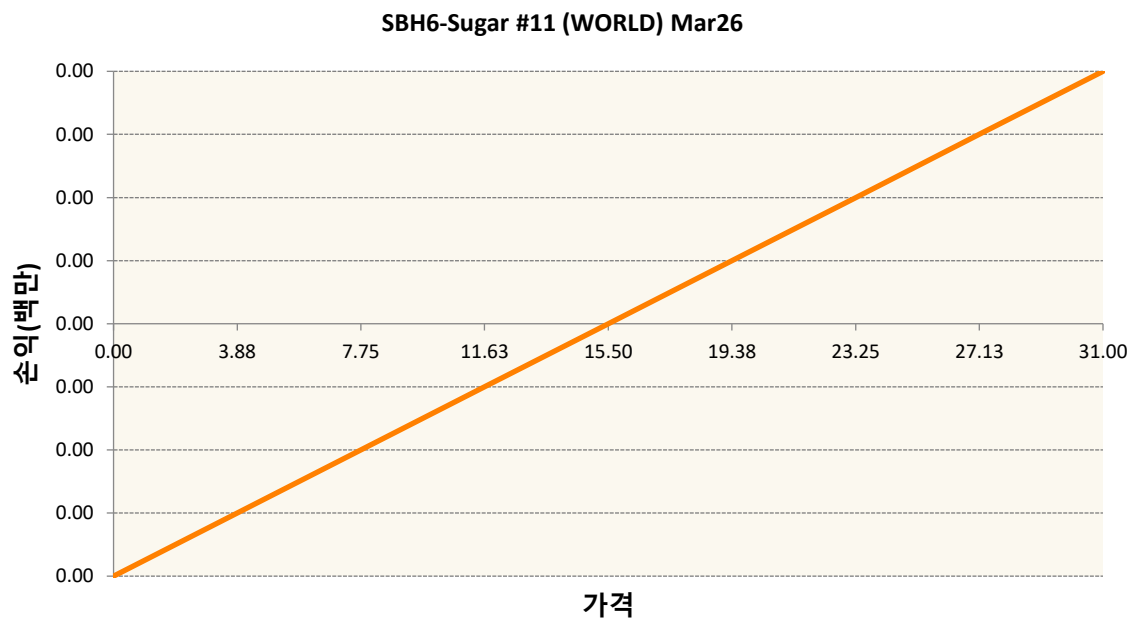
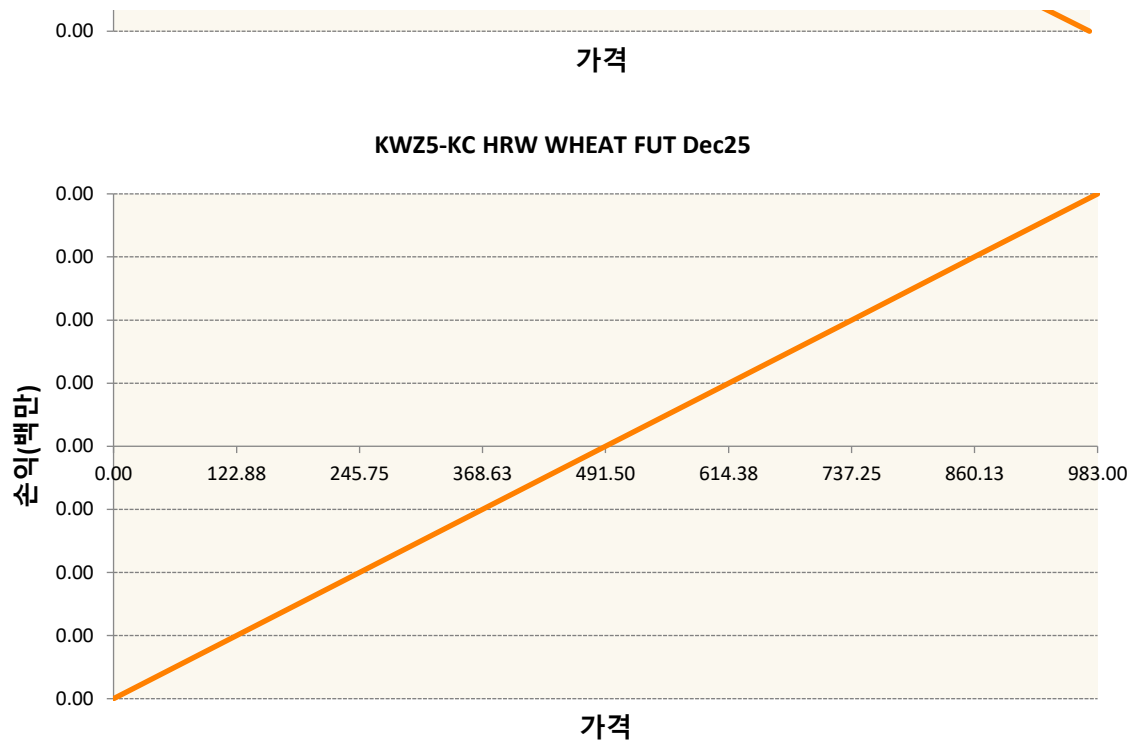
(단위:USD 백만)

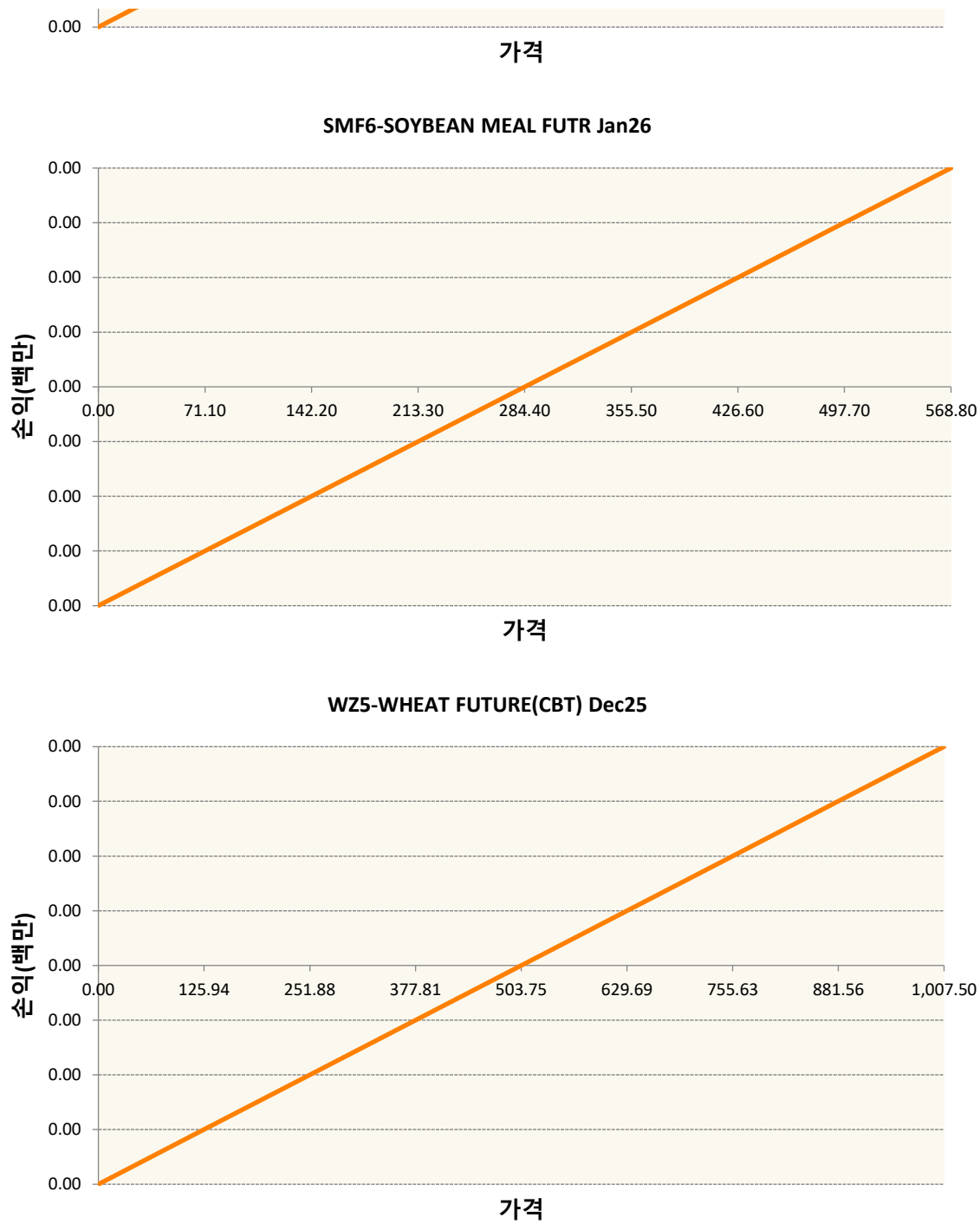
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,102	0	1,102	
누계	유가증권	선물	2,167	0	2,167	
누계	통화	선물	0	284	-284	장내

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	2025-10-21
기준일	2025-10-20

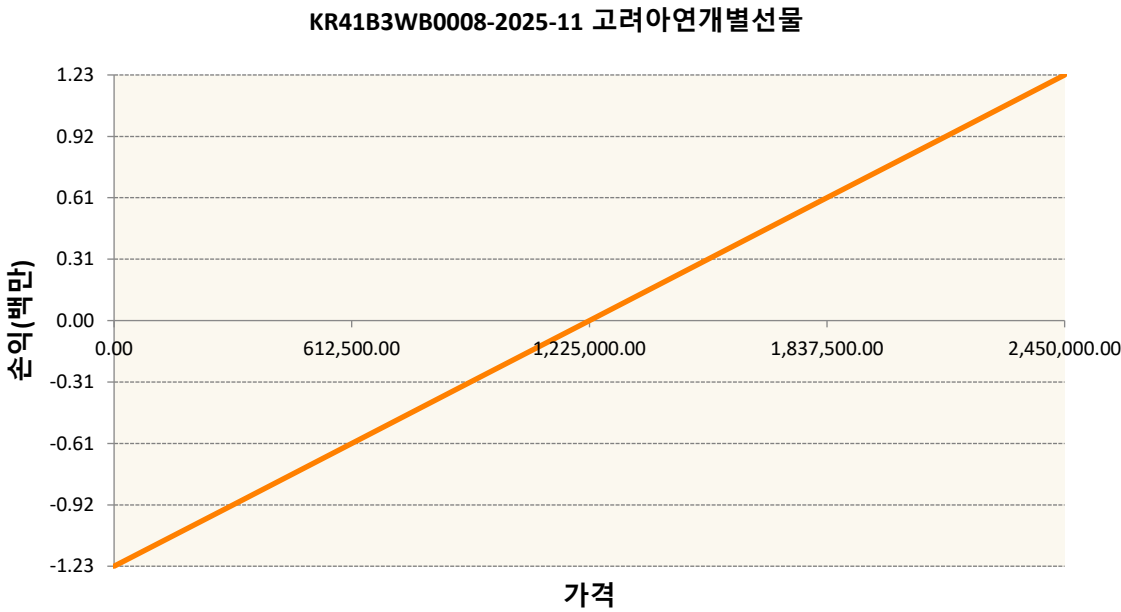
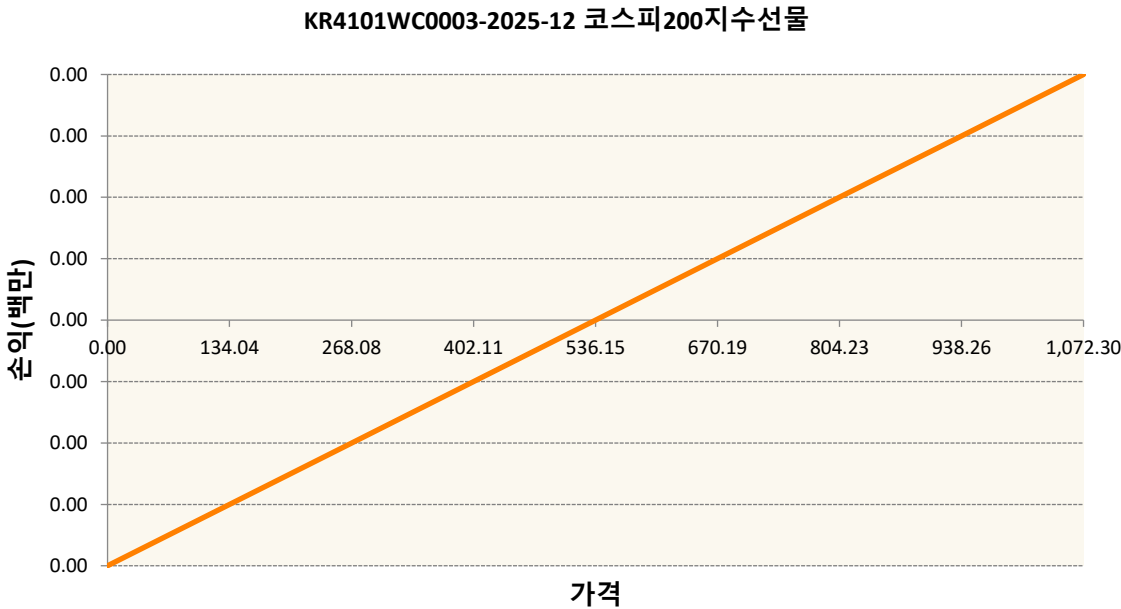
스마트인덱스모

1. 계약금액

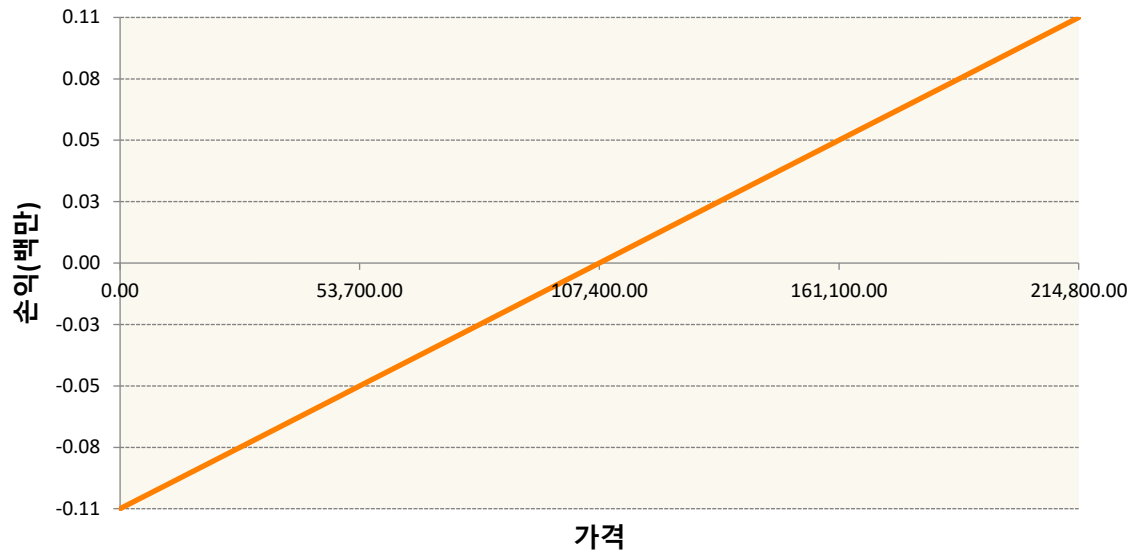
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,488	0	1,488	장내

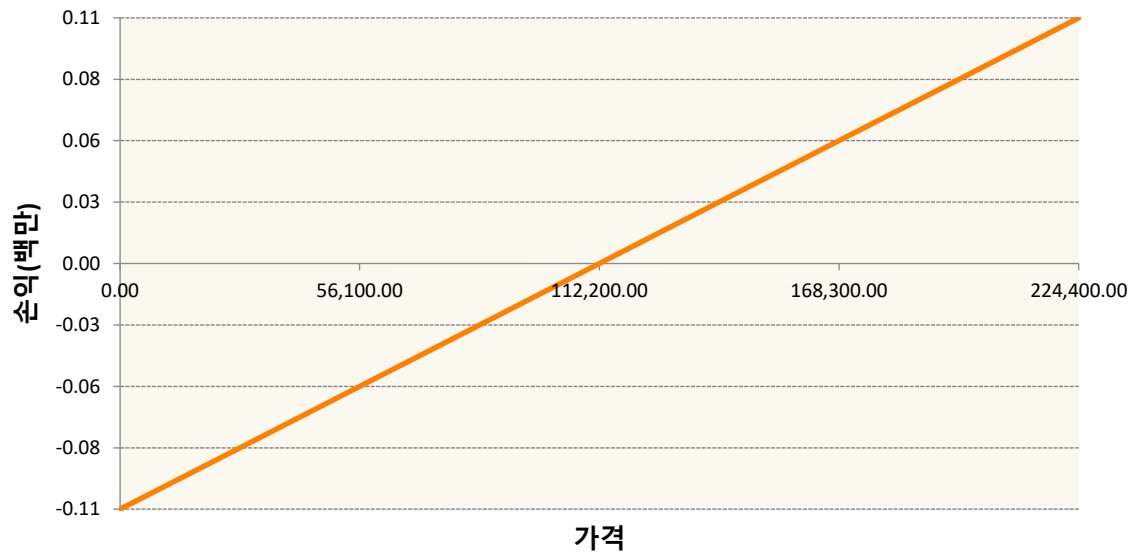
2. 만기시점의 손익구조



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	107
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	2025-10-21
기준일	2025-10-20

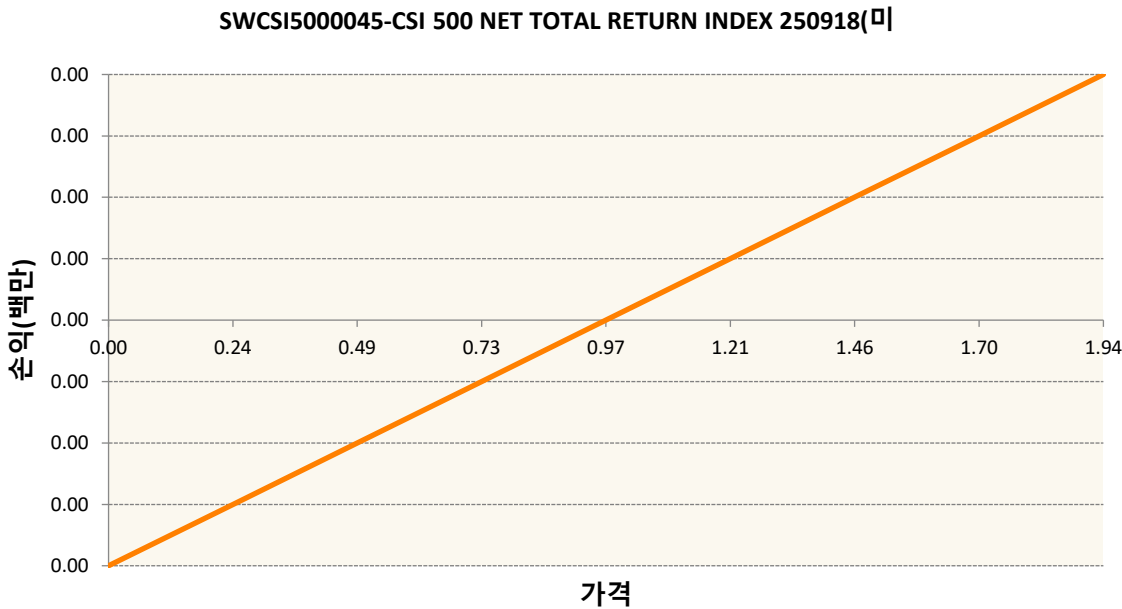
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,559	0	4,559	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

366

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

515

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

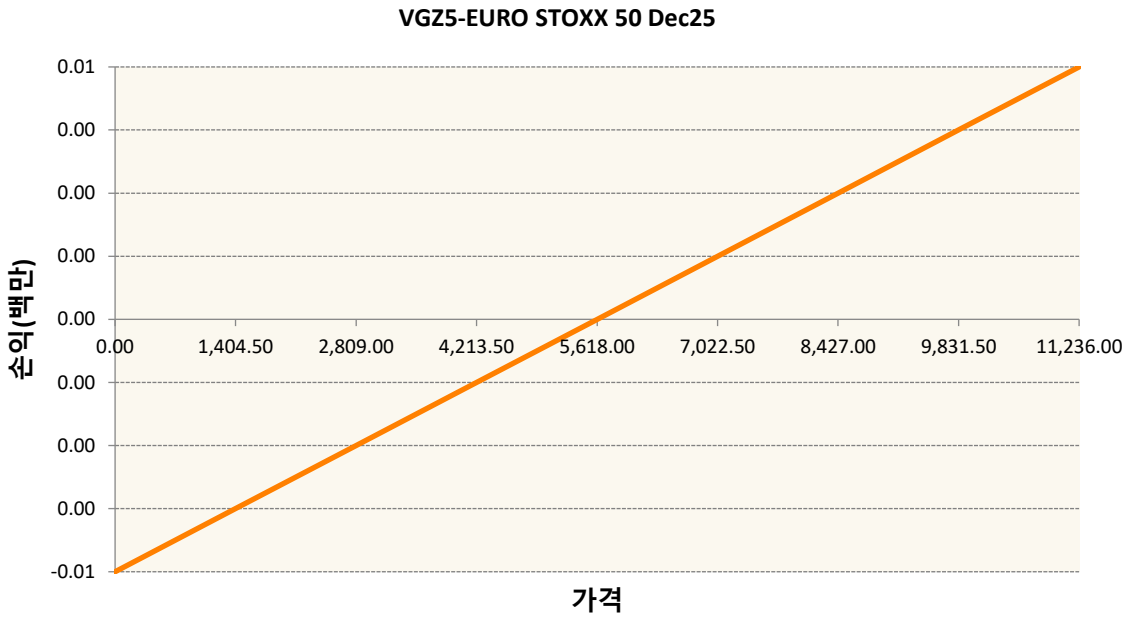
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	736	0	736	

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	2025-10-21
기준일	2025-10-20

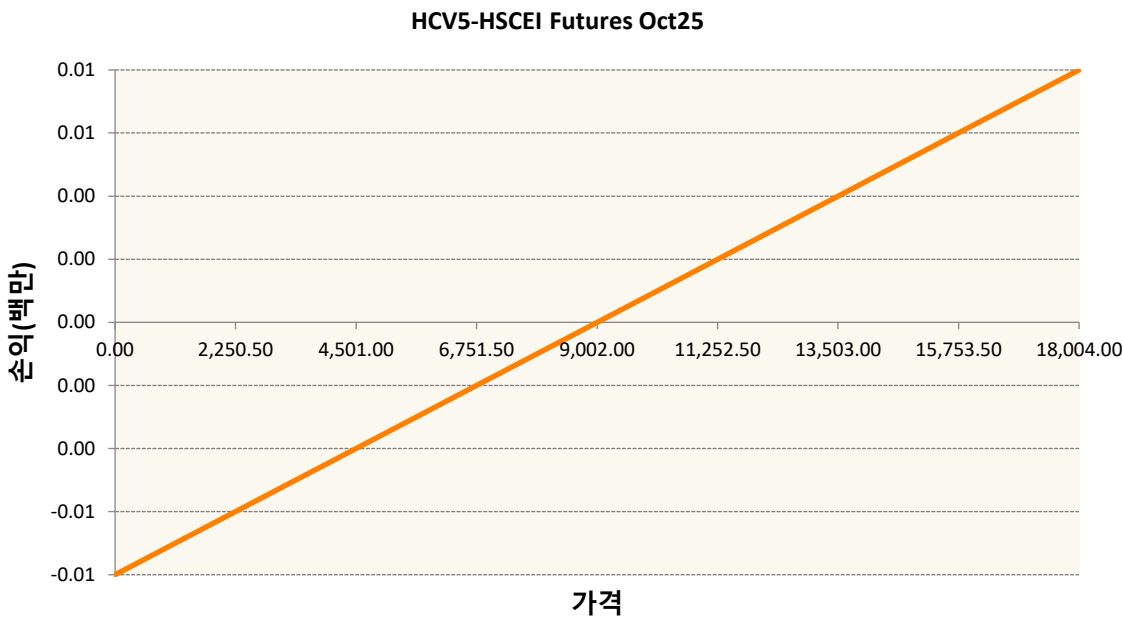
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,042	0	2,042	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV5	HSCEI Futures Oct25	163
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

231

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

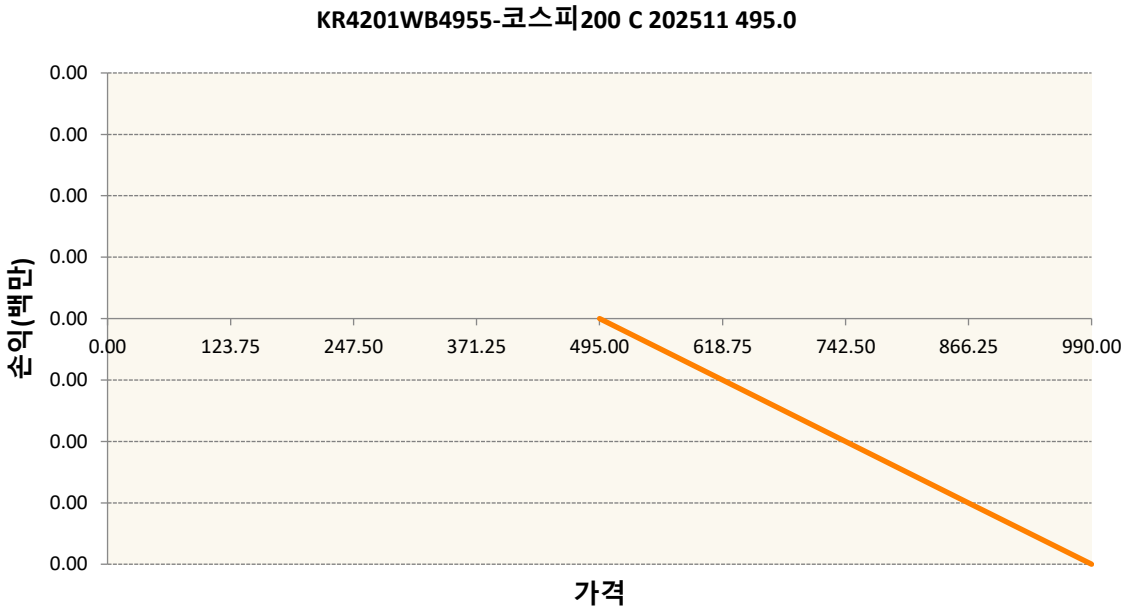
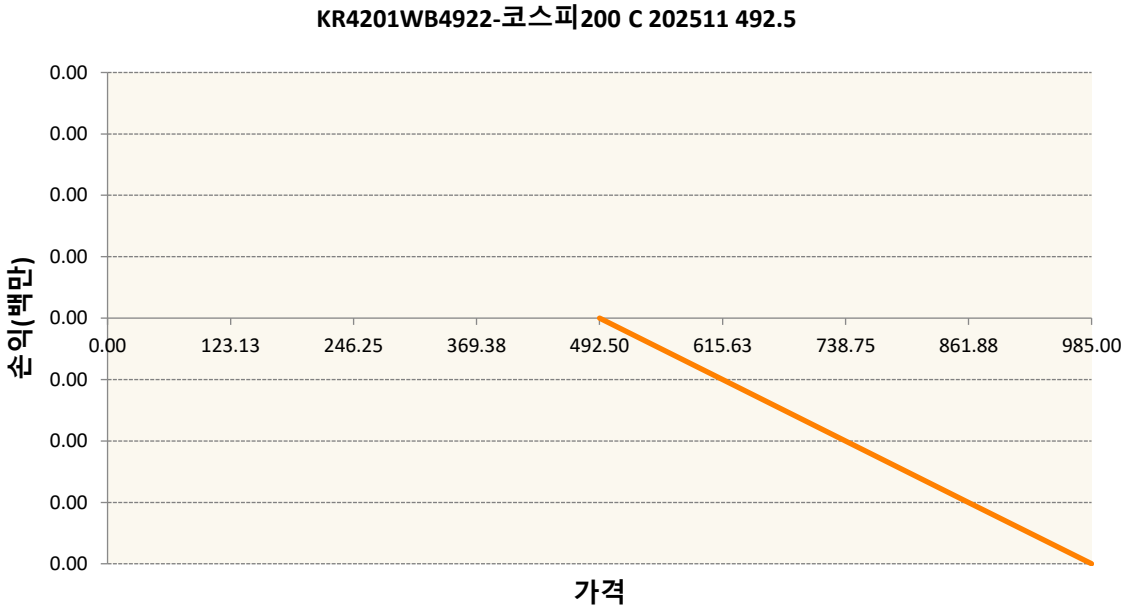
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

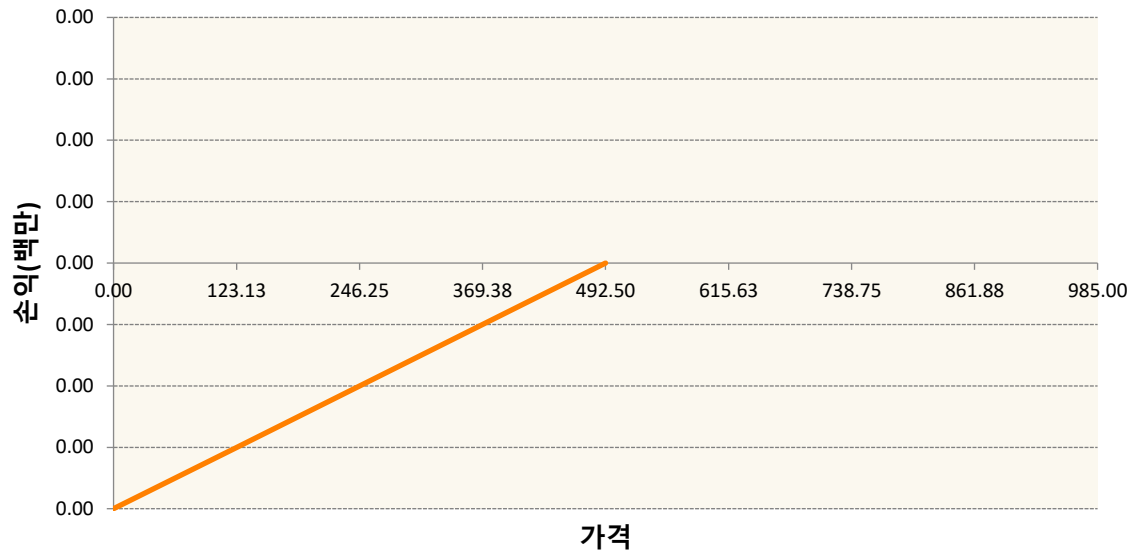
(단위:백만원)

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)

KR4201WB49 코스피200 C 202511 492.5

453

KR4201WB49 코스피200 C 202511 495.0

1,733

KR4301WB49 코스피200 P 202511 492.5

493

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-10-21

기준일 2025-10-20

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	2025-10-21
기준일	2025-10-20

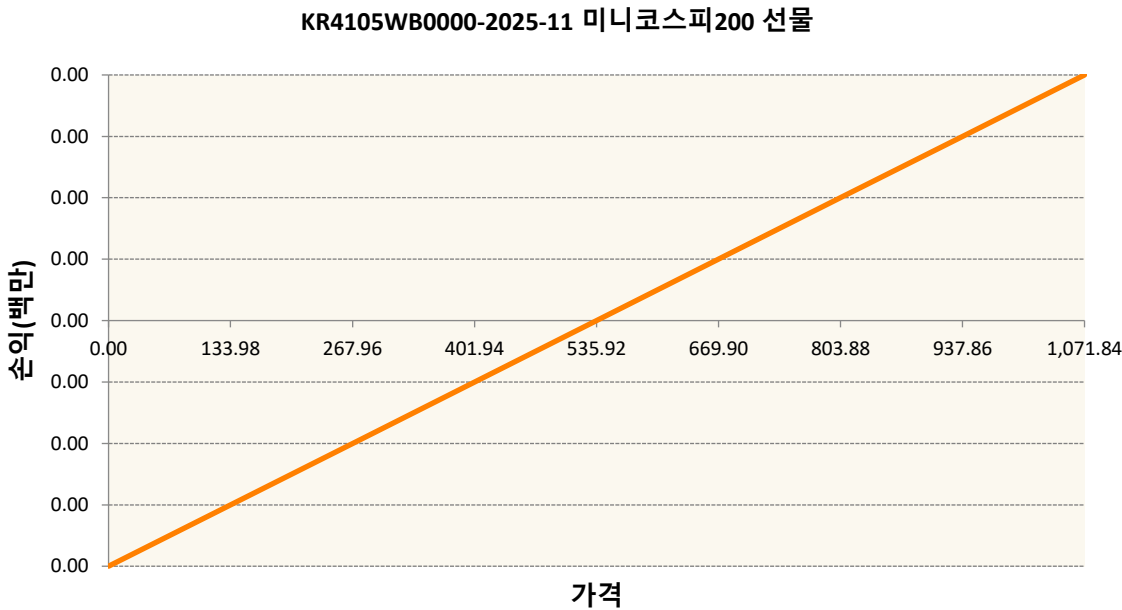
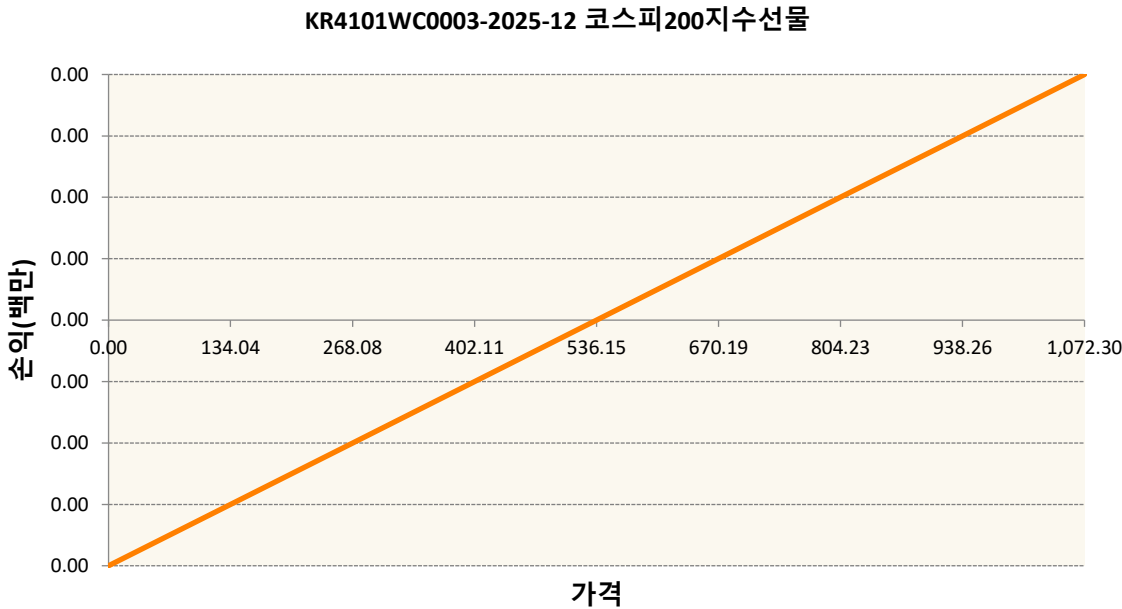
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

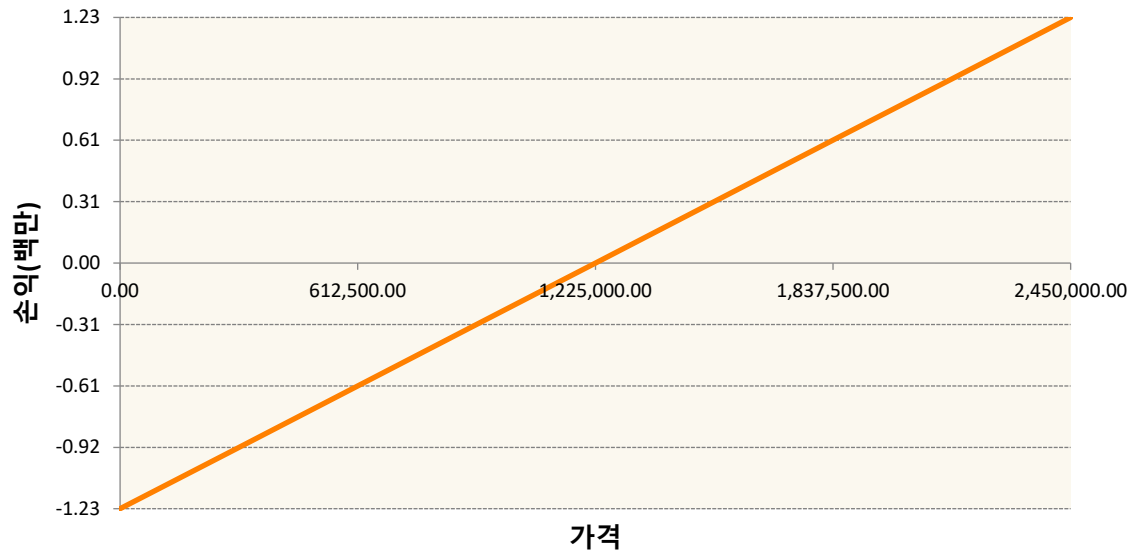
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	599	0	599	장내

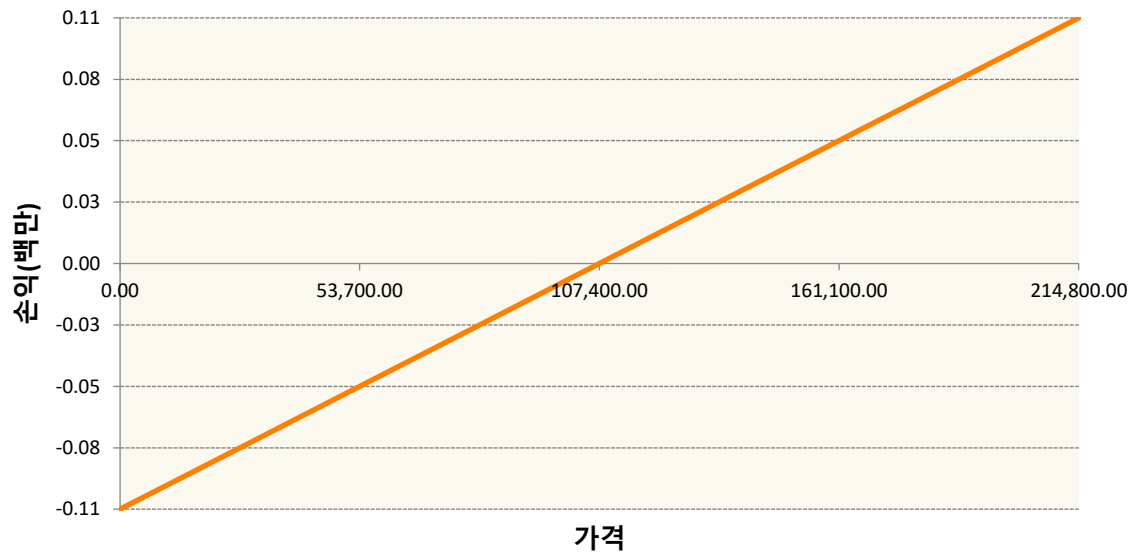
2. 만기시점의 손익구조



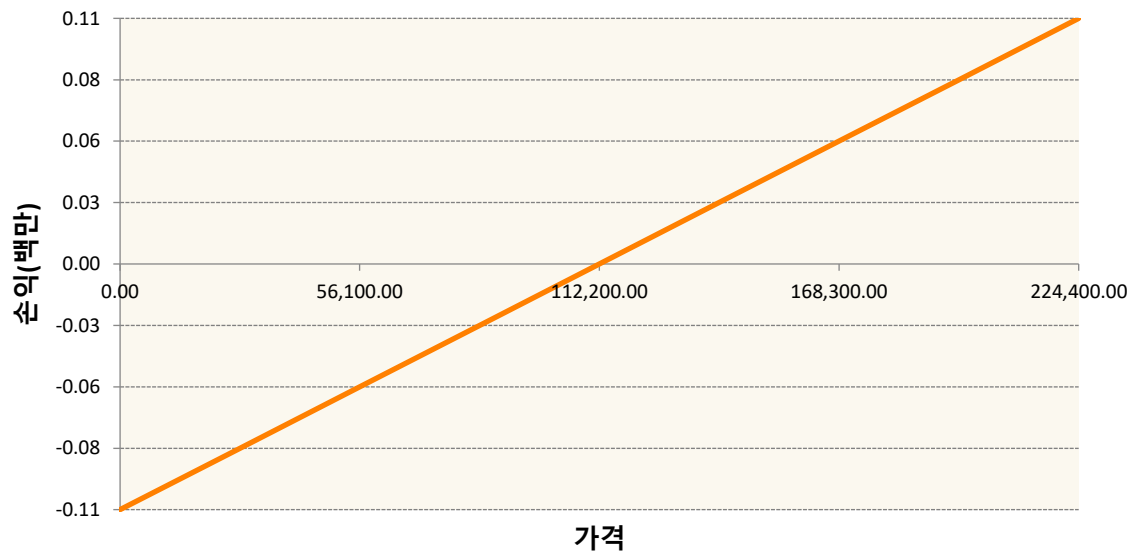
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘애프개별선물



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	2025-10-21
기준일	2025-10-20

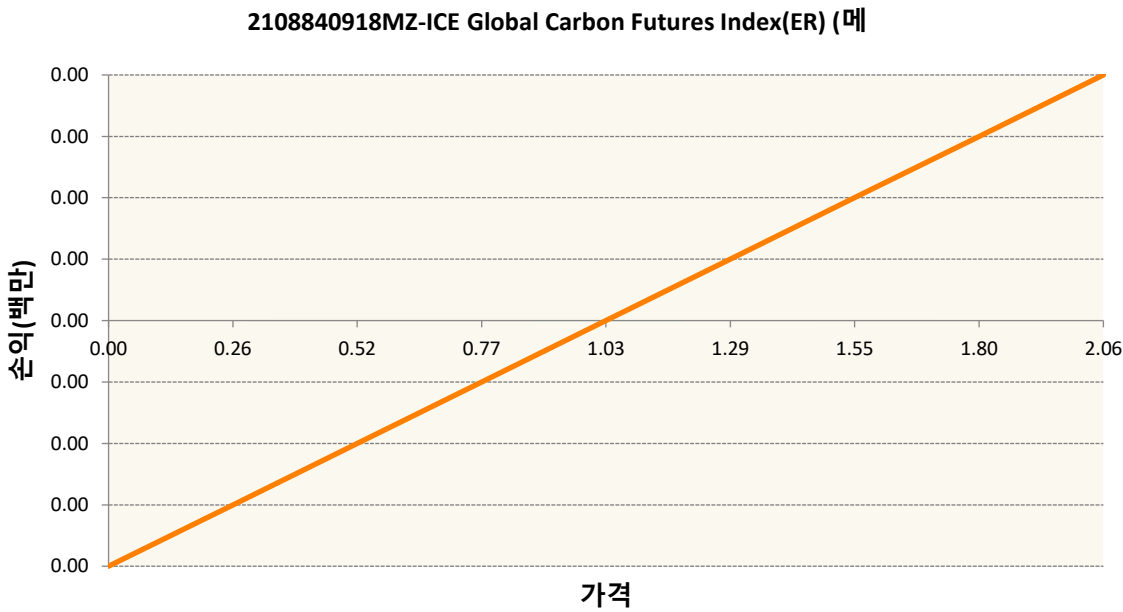
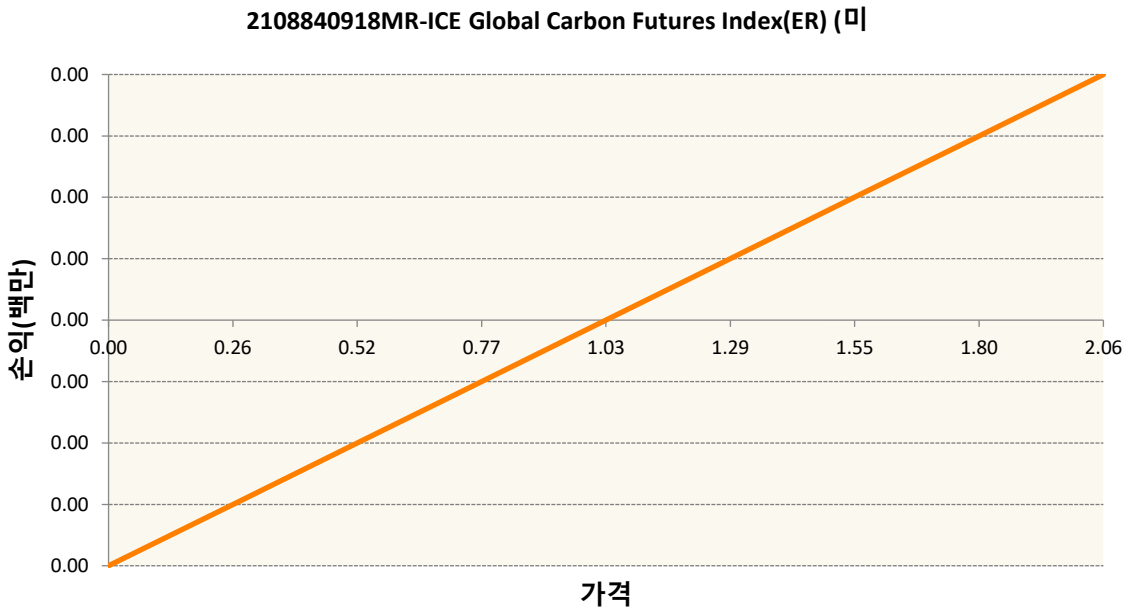
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	9,785	0	9,785	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		673
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		113

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	783

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

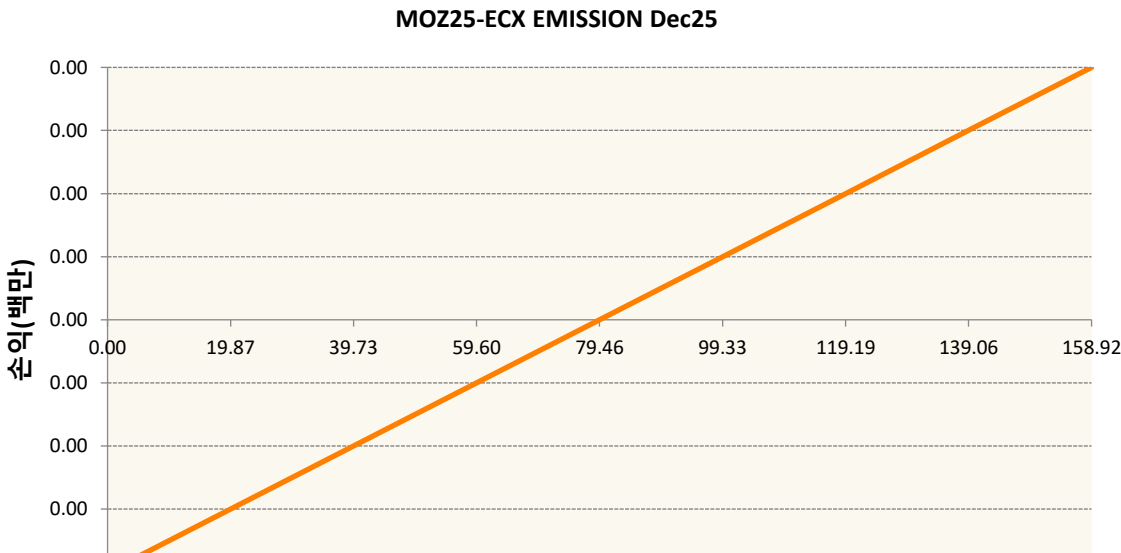
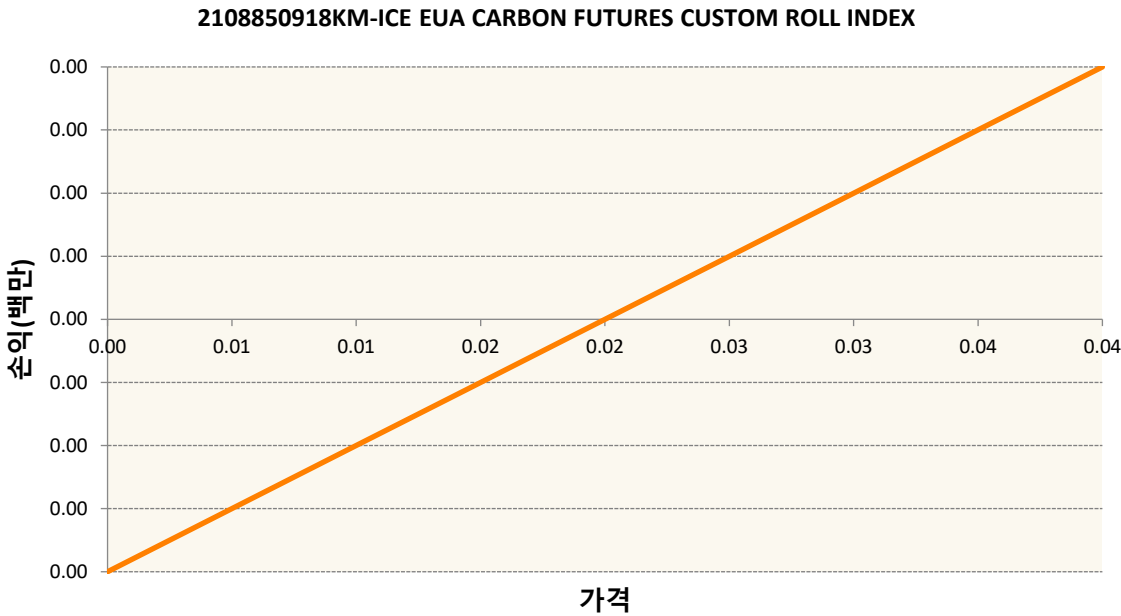
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,975	0	5,975	
누계	지수	스왑	8	0	8	장외
누계	통화	선도	0	2,285	-2,285	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	183
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	478

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

(단위:백만원)

762

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

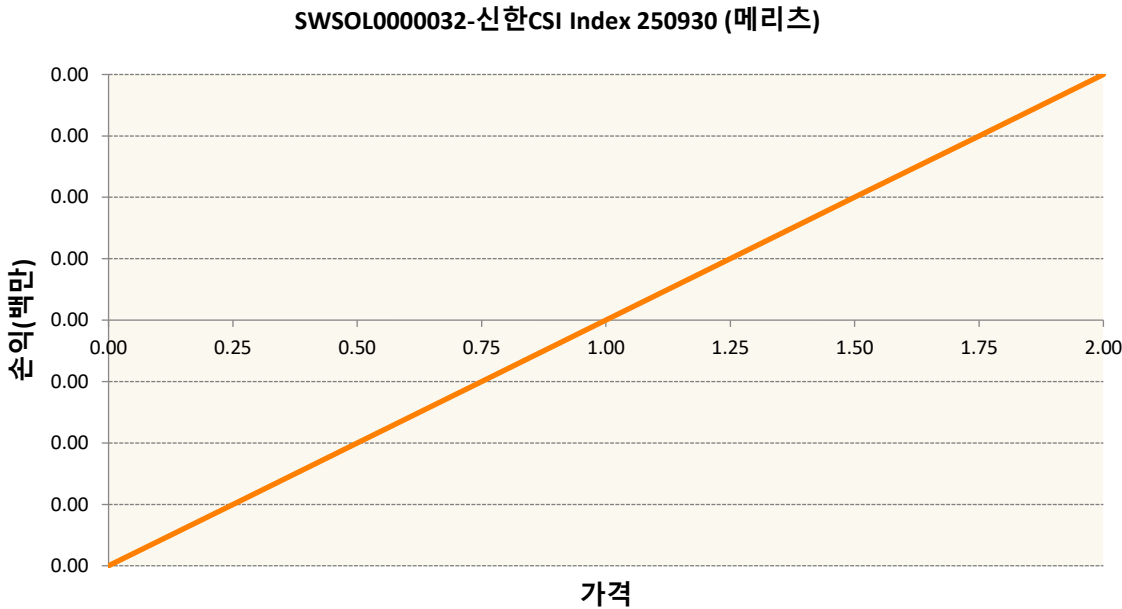
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,496	0	2,496	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	0.42
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	0.28
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	0.28
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	1

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

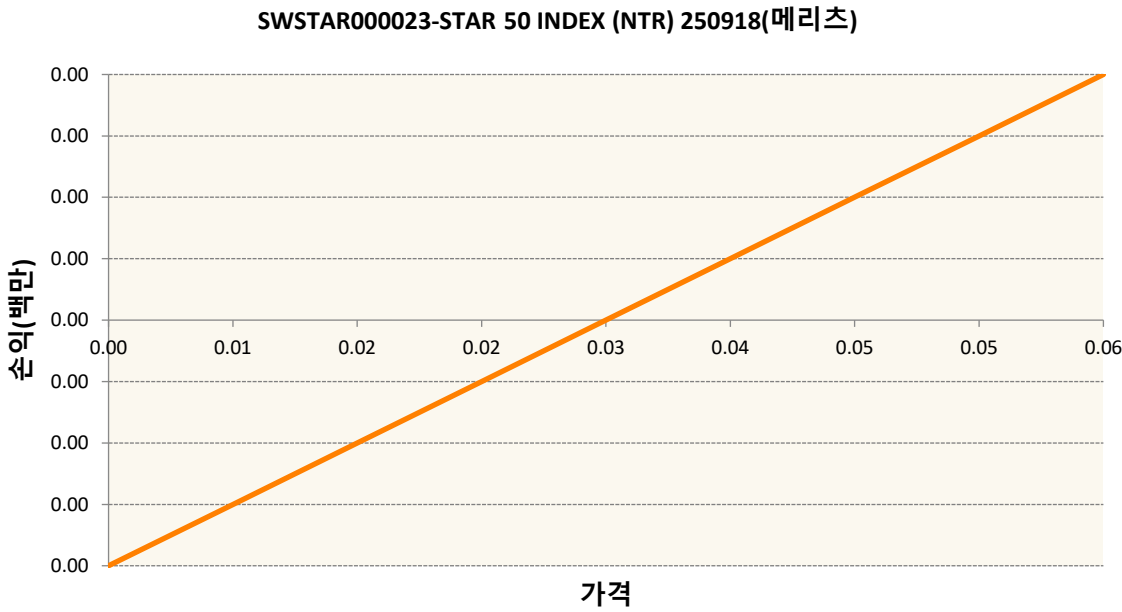
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	3,407	0	3,407	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	6
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)	22
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)	9
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠)	29

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

(단위:백만원)

123

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

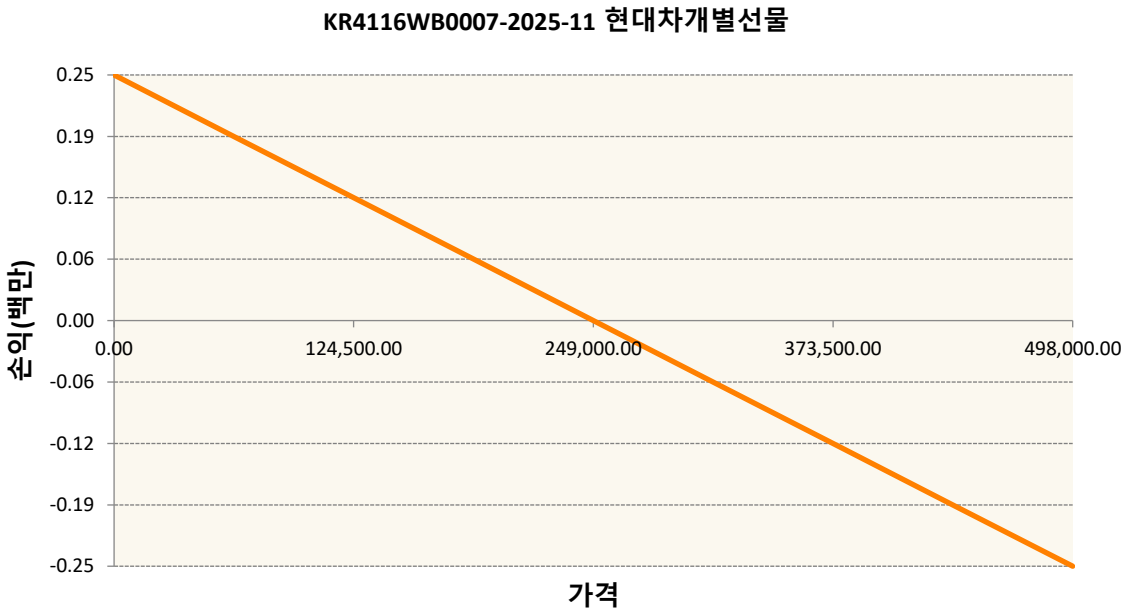
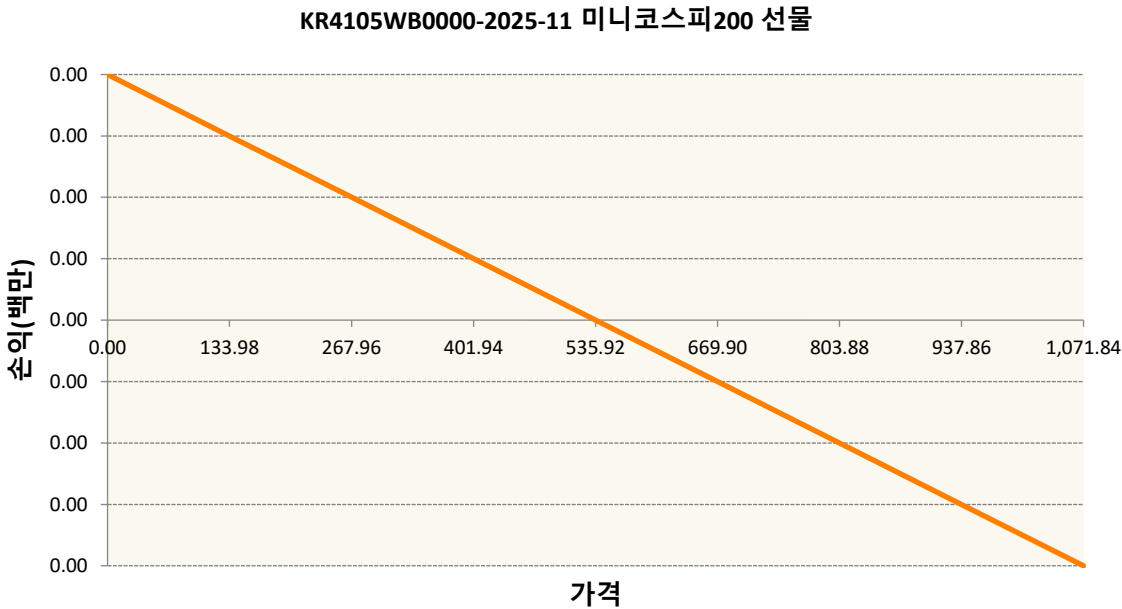
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

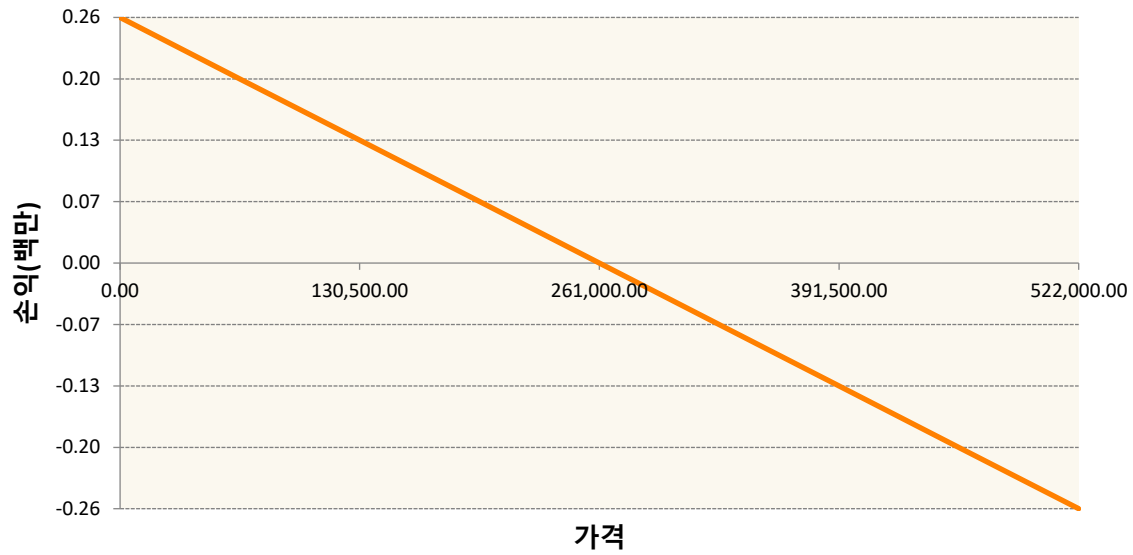
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	4	-4	장내
누계	유가증권	선물	26	864	-839	장내

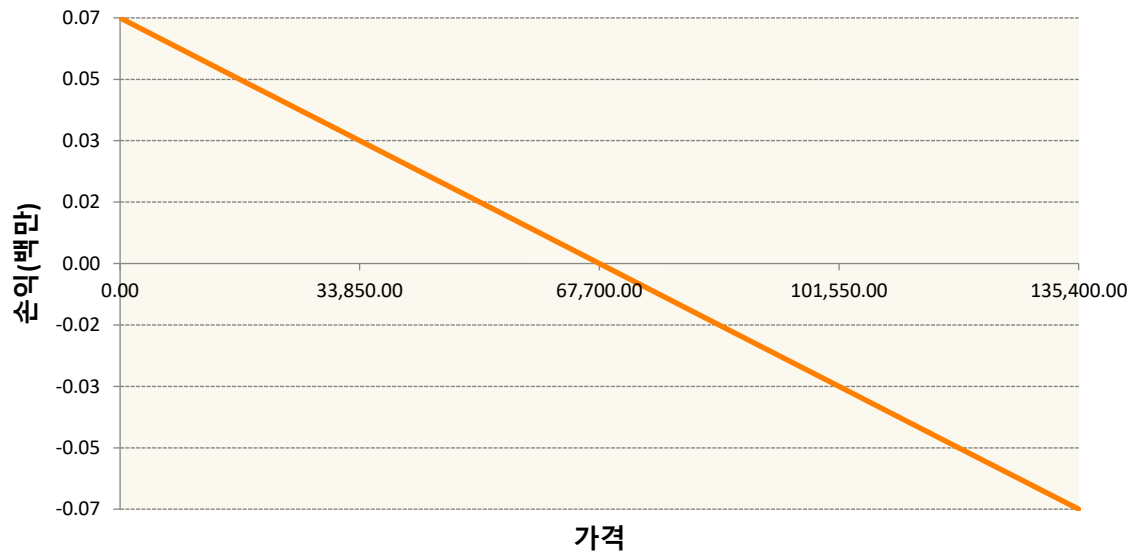
2. 만기시점의 손익구조



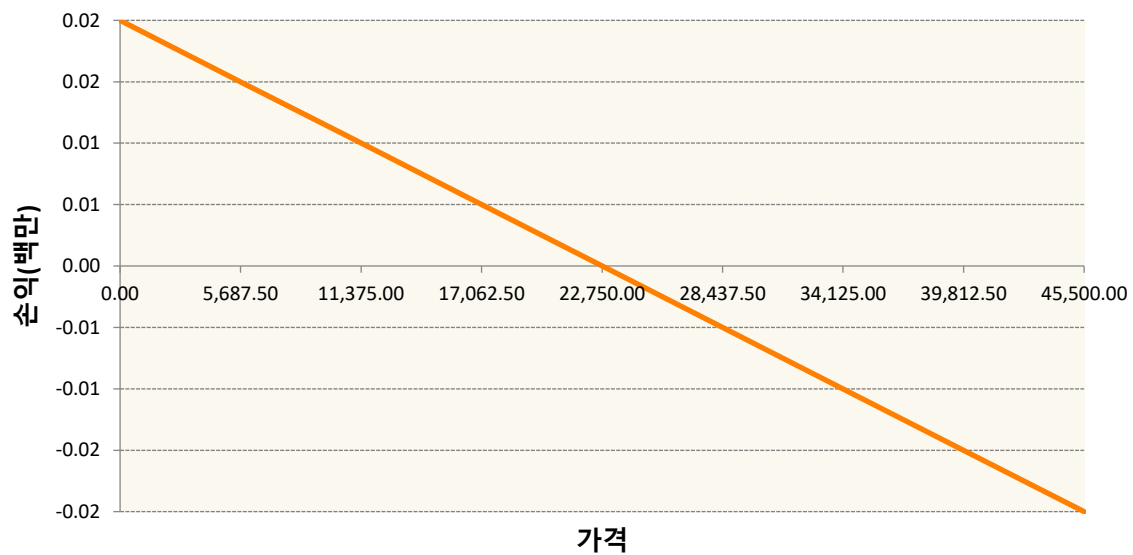
KR4122WB0009-2025-11 삼성SDI개별선물



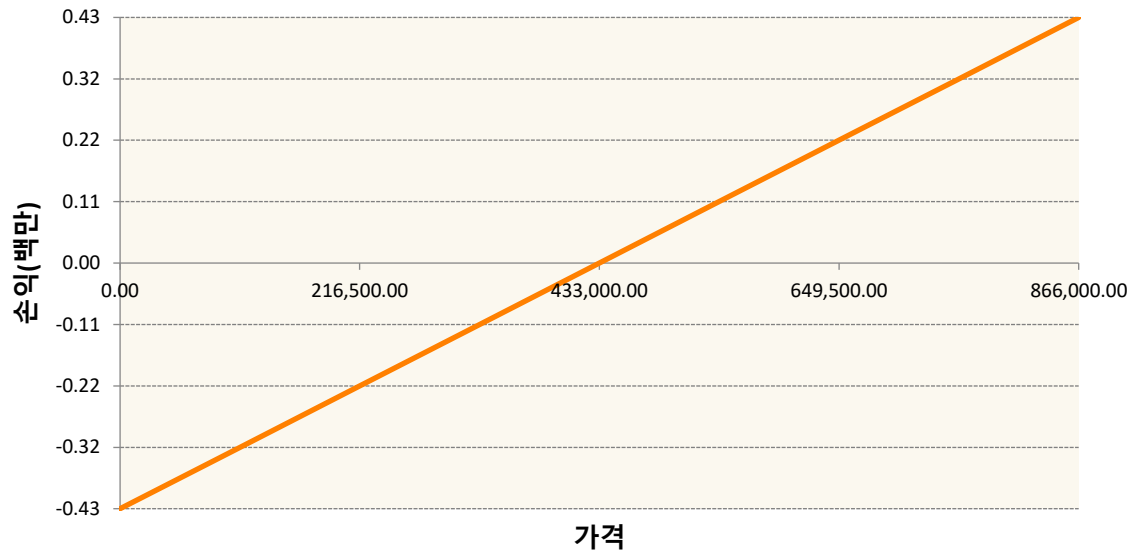
KR41B2WB0009-2025-11 S-Oil개별선물



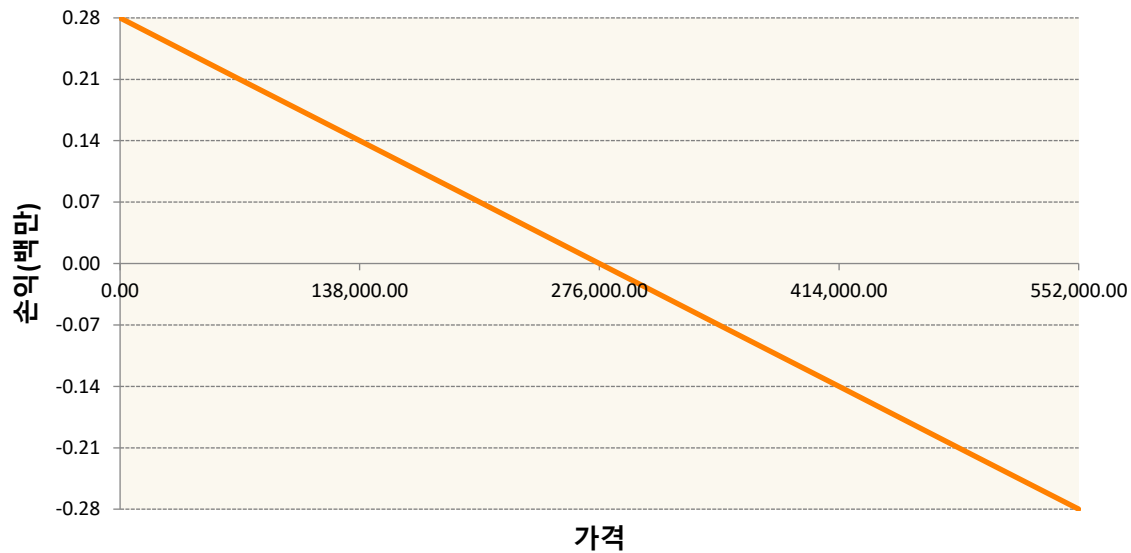
KR41BFWB0005-2025-11 삼성중공업개별선물



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	0.49
KR41BFWB0(2025-11 삼성중공업개별선물	1
KR41F5WB0(2025-11 LG에너지솔루션개별선물	2
KR41FCWB0(2025-11 하이브개별선물	0.44

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

(단위:백만원)

9

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

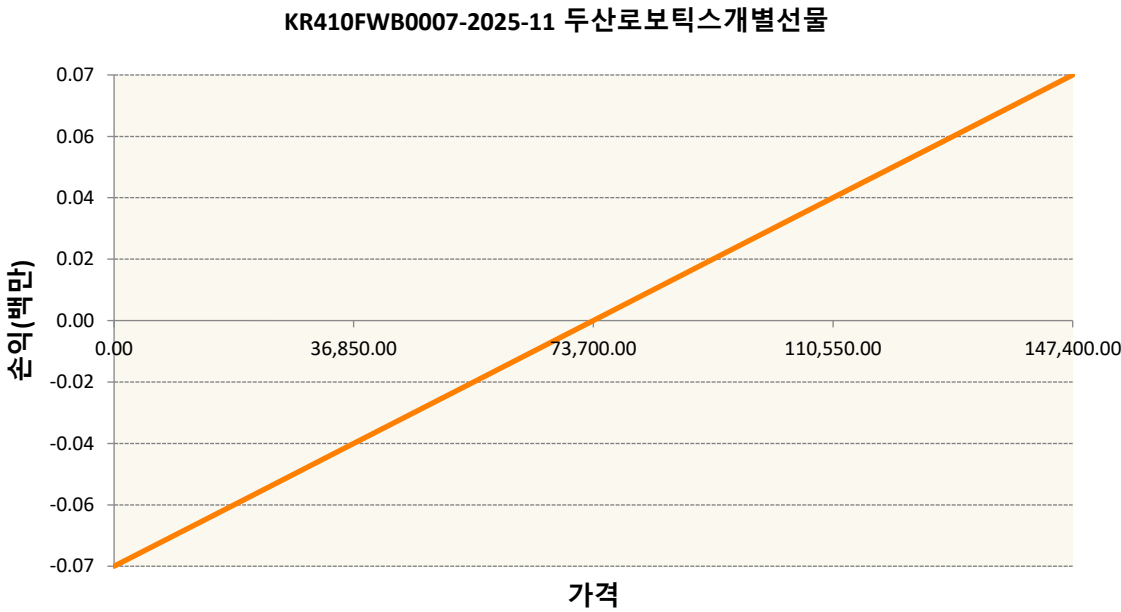
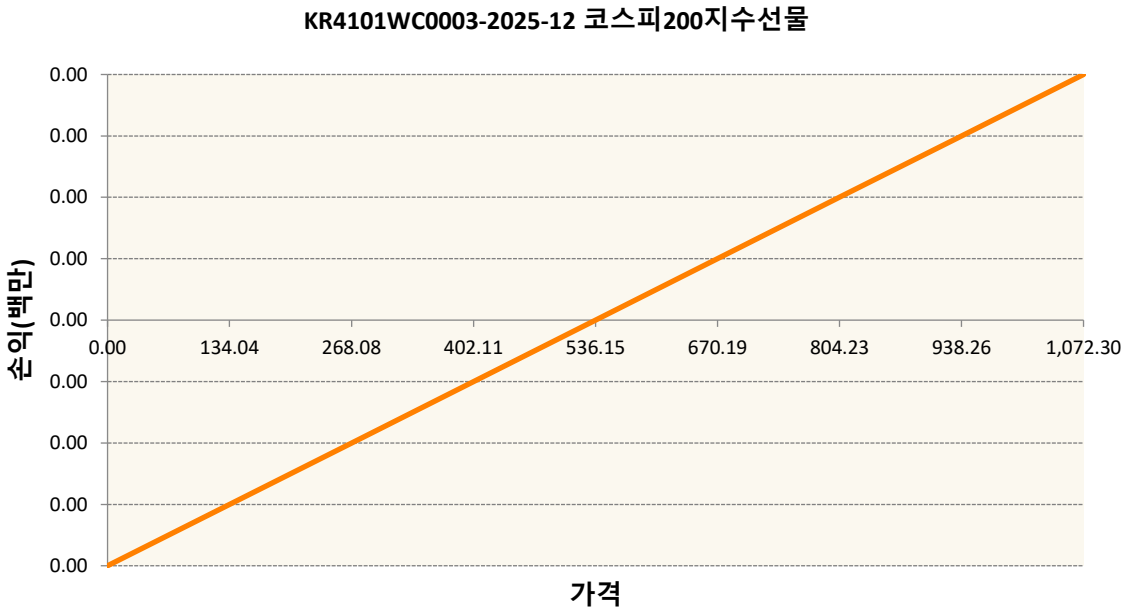
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

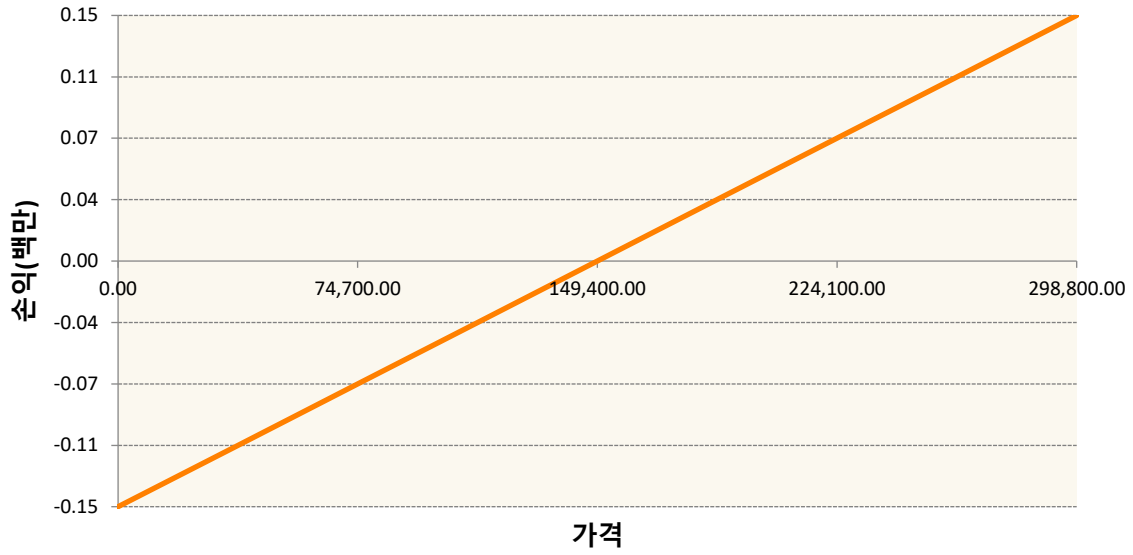
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	529	-529	장내
누계	유가증권	선물	6,486	0	6,486	장내

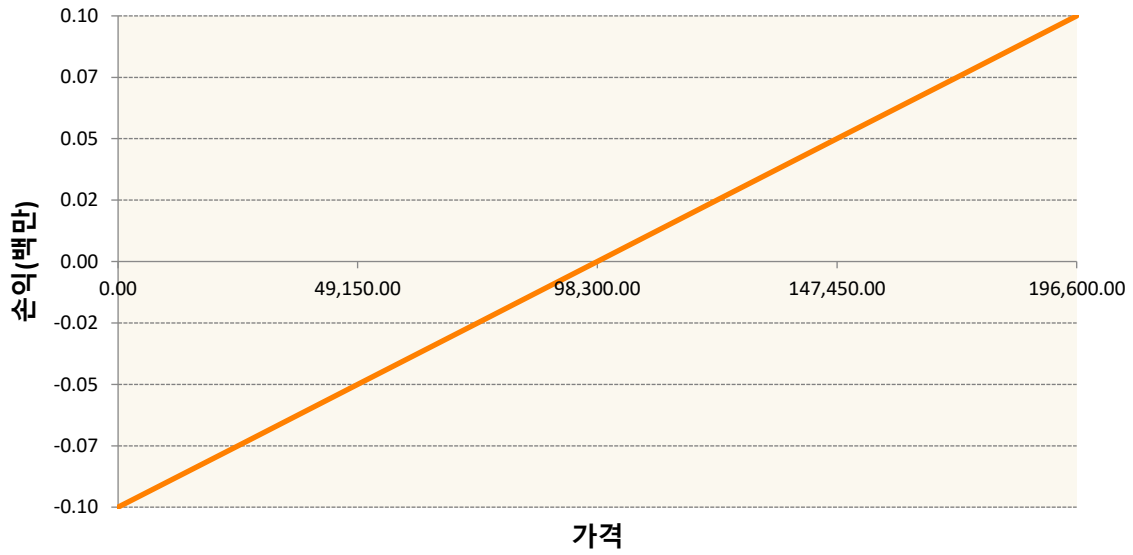
2. 만기시점의 손익구조



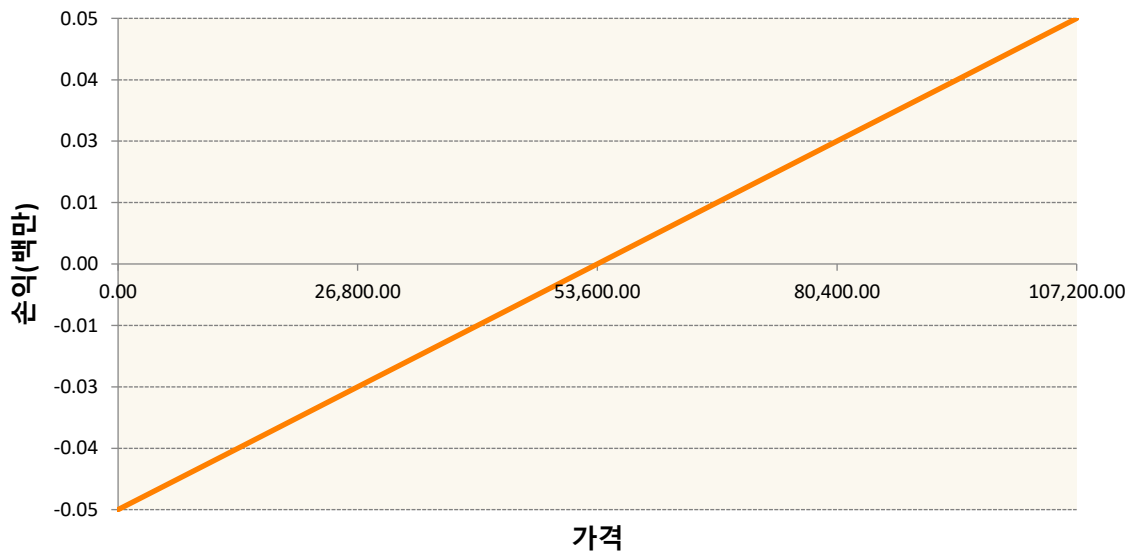
KR410ZWB0003-2025-11 한미반도체개별선물



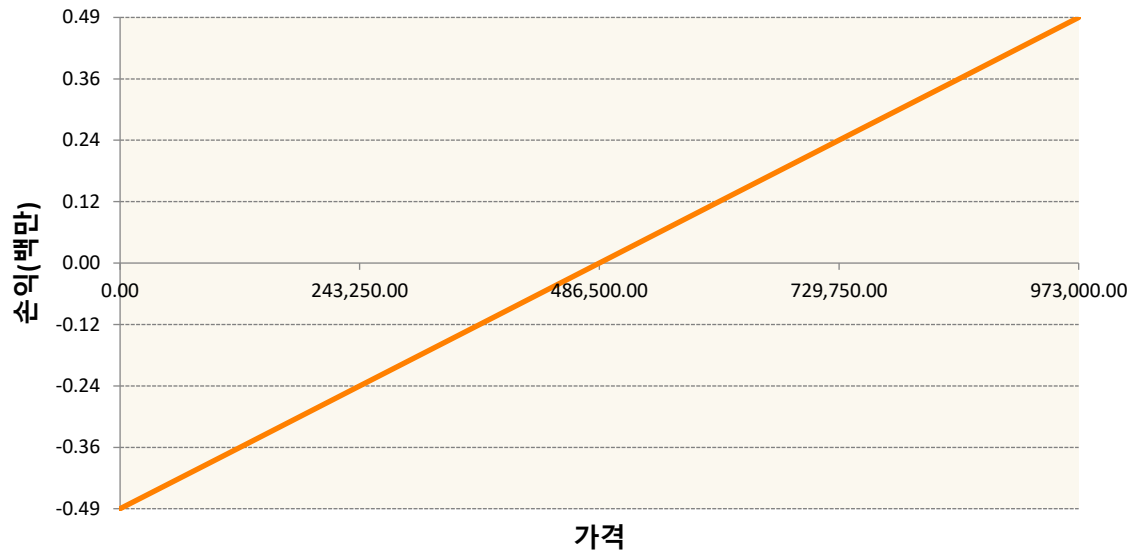
KR4111WB0002-2025-11 삼성전자개별선물



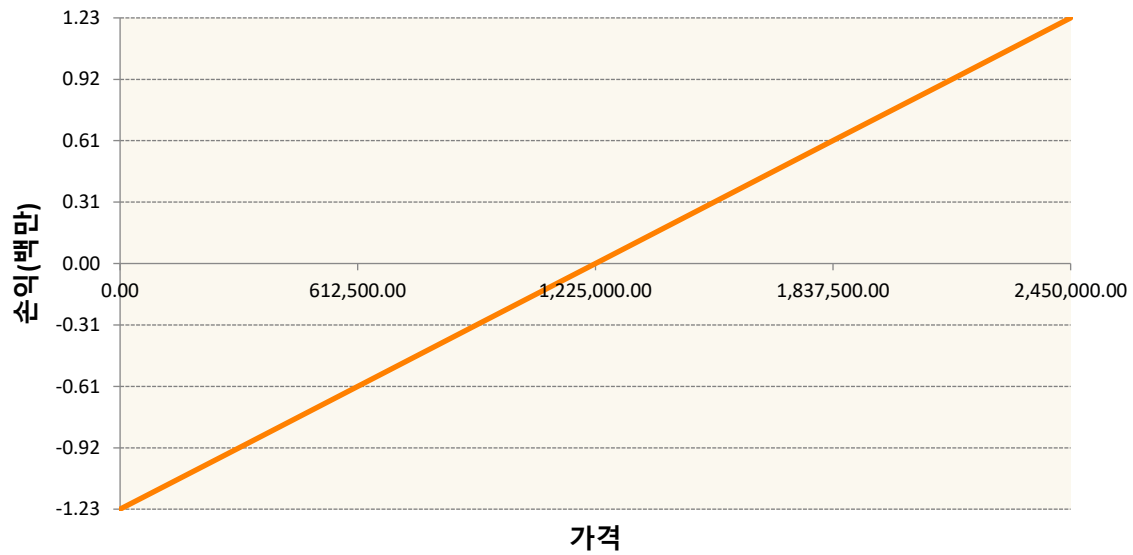
KR411RWB0002-2025-11 한화비전개별선물



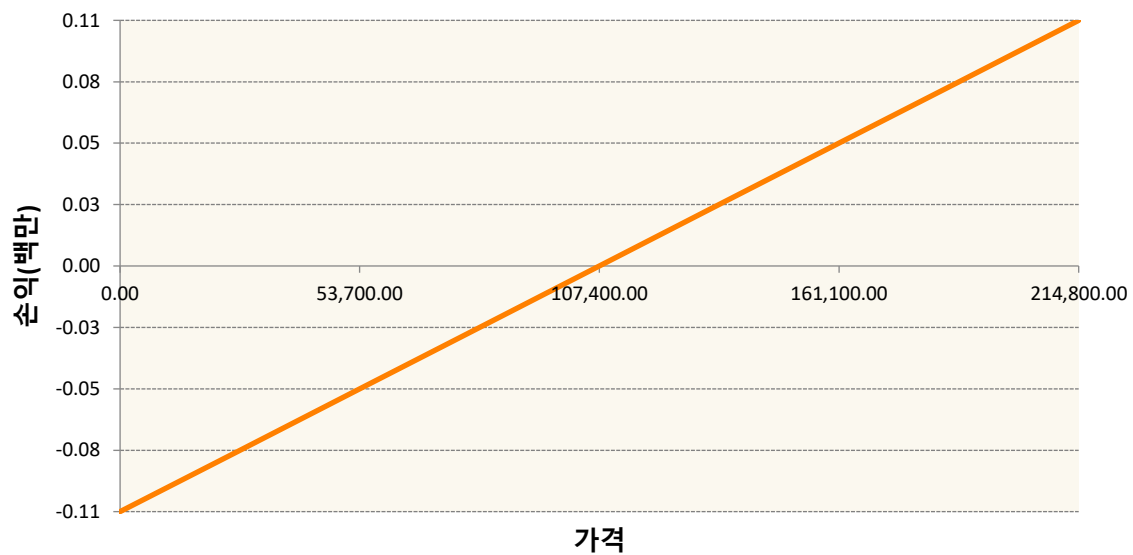
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



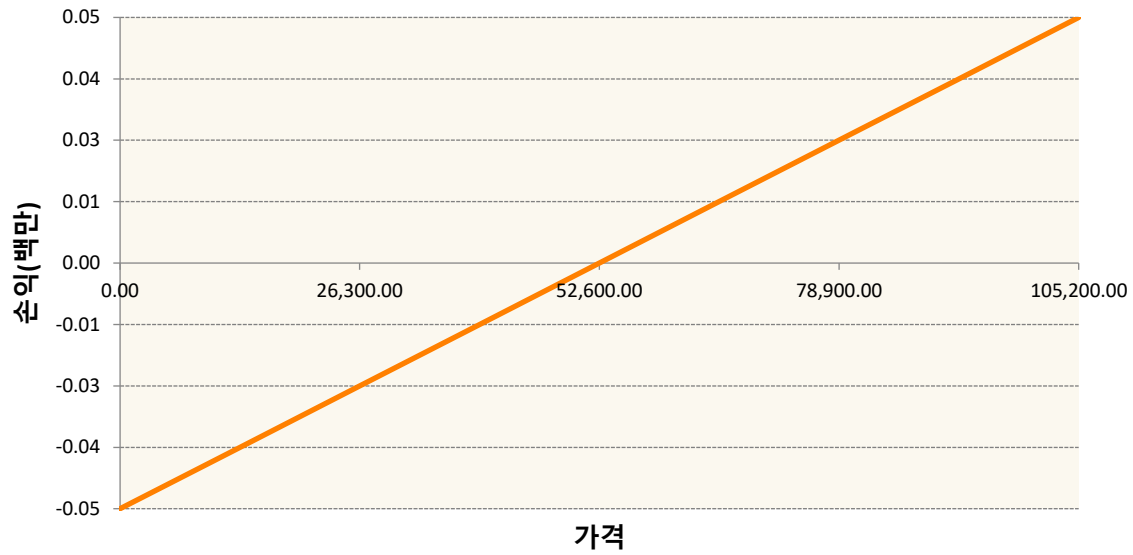
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



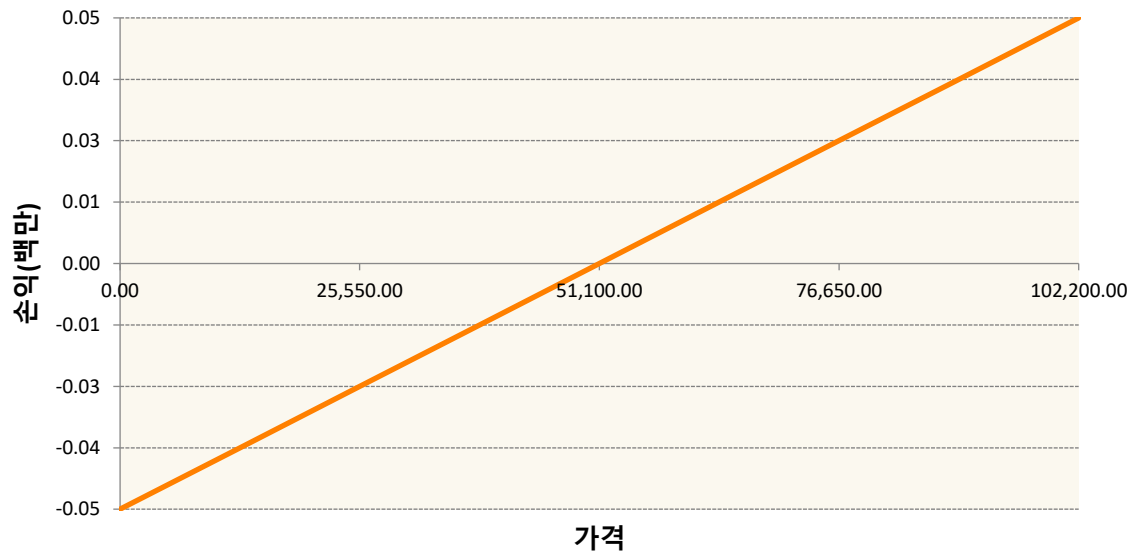
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



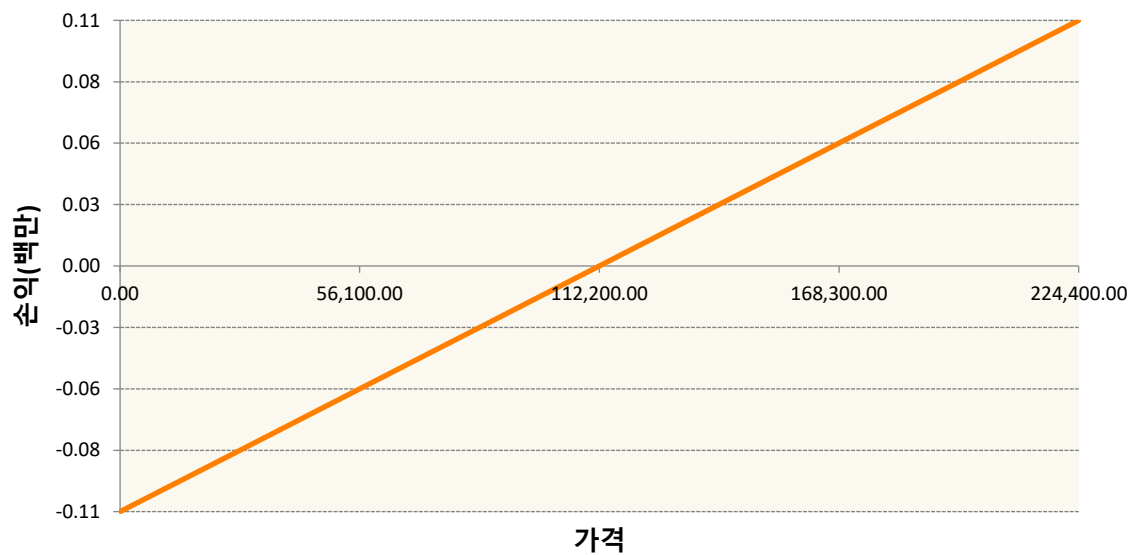
KR41EVWB0002-2025-11 한화시스템개별선물



KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물		172
KR410FWB0(2025-11 두산로보틱스개별선물		16
KR410ZWB0(2025-11 한미반도체개별선물		72
KR4111WB0(2025-11 삼성전자개별선물		16
KR411RWB0(2025-11 한화비전개별선물		4
KR4150WB0(2025-11 SK하이닉스개별선물		46
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물		83
KR41EJWB0(2025-11 SKC개별선물		22
KR41EVWB0(2025-11 한화시스템개별선물		42
KR41F7WB0(2025-11 카카오페이개별선물		15
KR41FMWB0(2025-11 엘앤에프개별선물		32

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,164

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

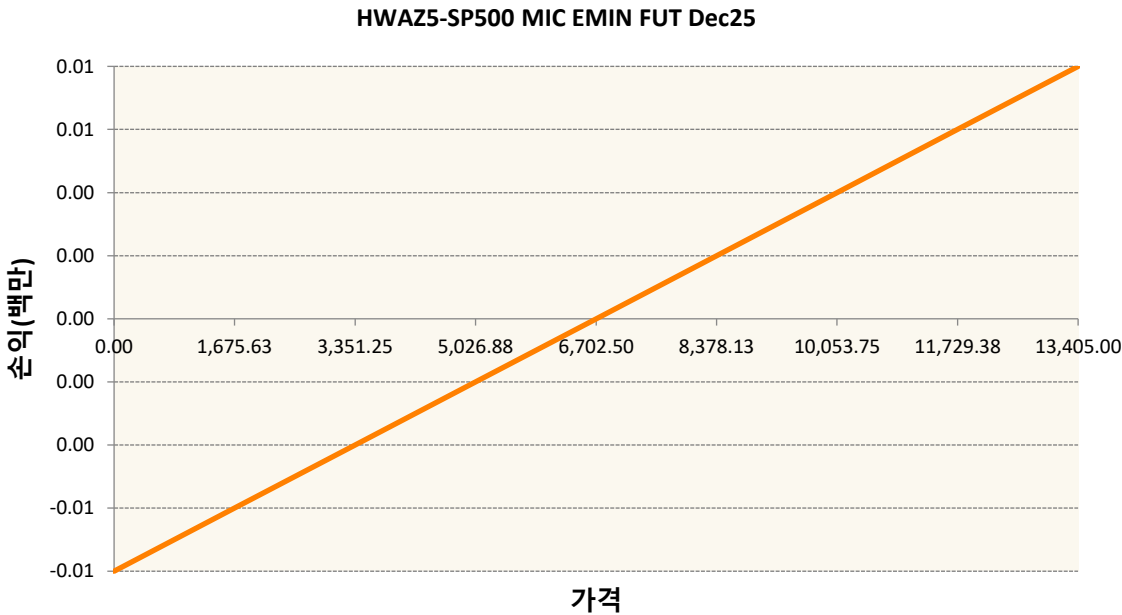
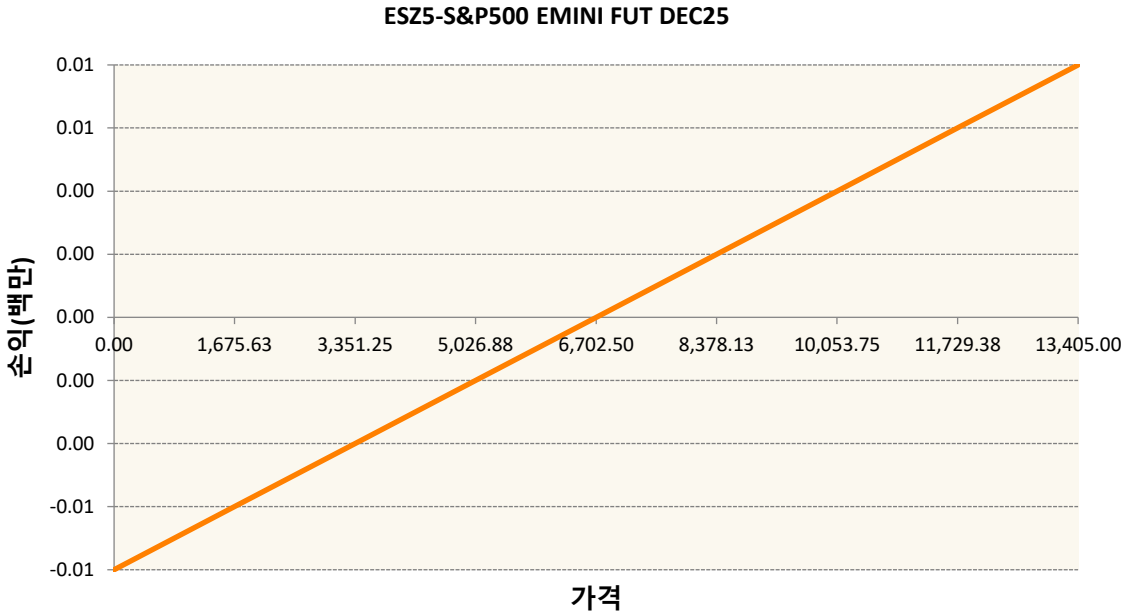
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	38,163	0	38,163	
누계	유가증권	선물	1,256	0	1,256	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,053
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	100

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,509

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

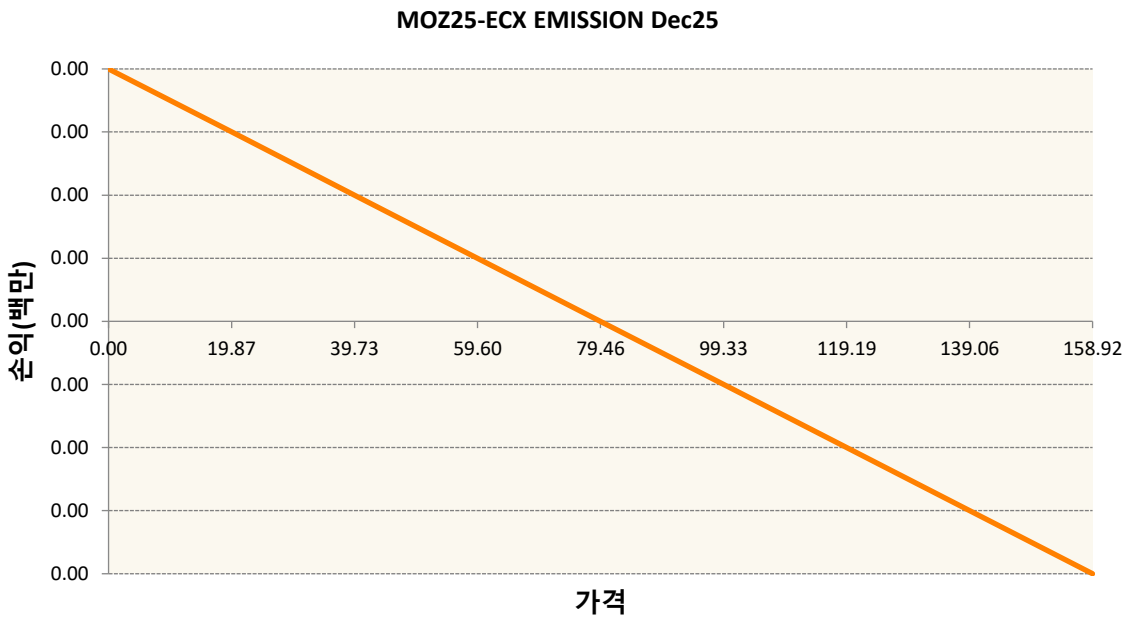
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	2,969	-2,969	
누계	지수	스왑	-12	0	-12	장외
누계	통화	선도	83	1,232	-1,149	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	238

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

(단위:백만원)

389

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

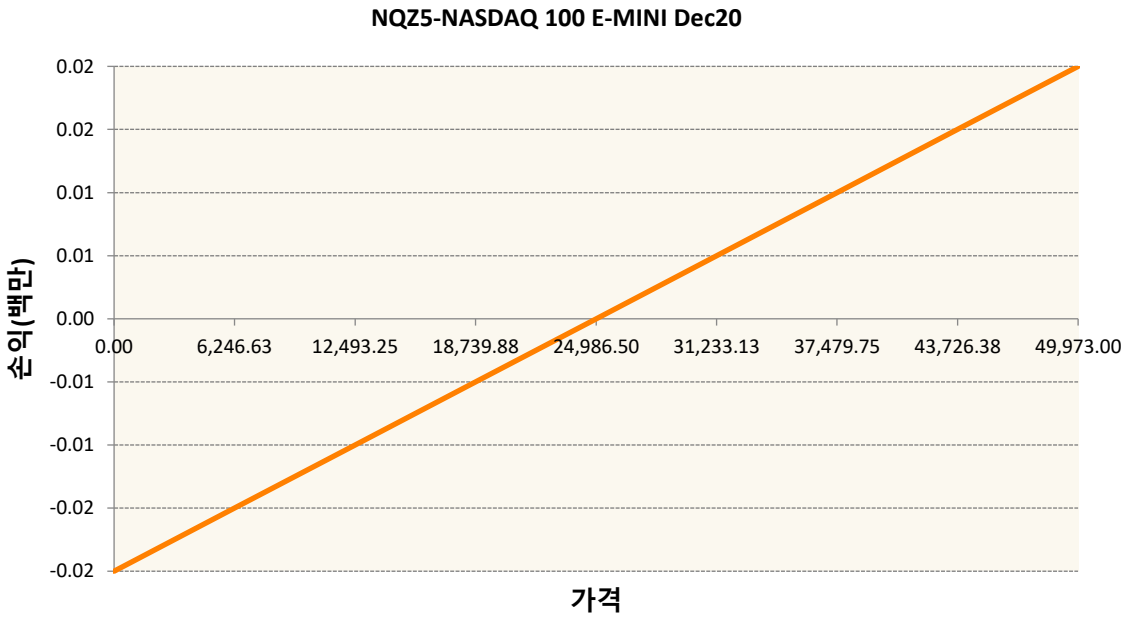
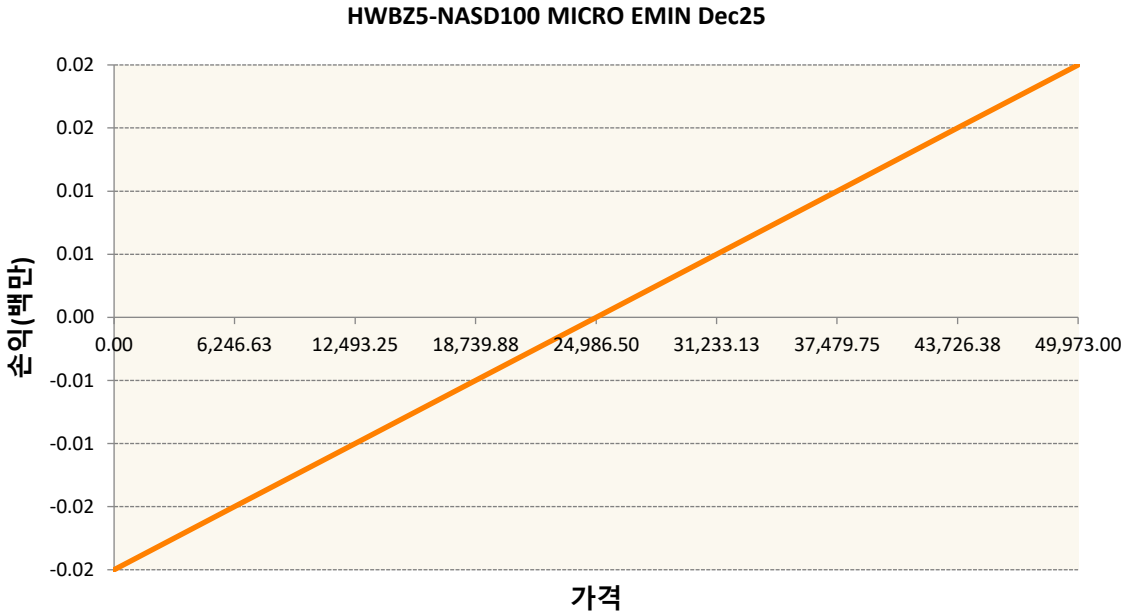
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	18,092	0	18,092	
누계	유가증권	선물	1,666	0	1,666	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25		133
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,447

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,746

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

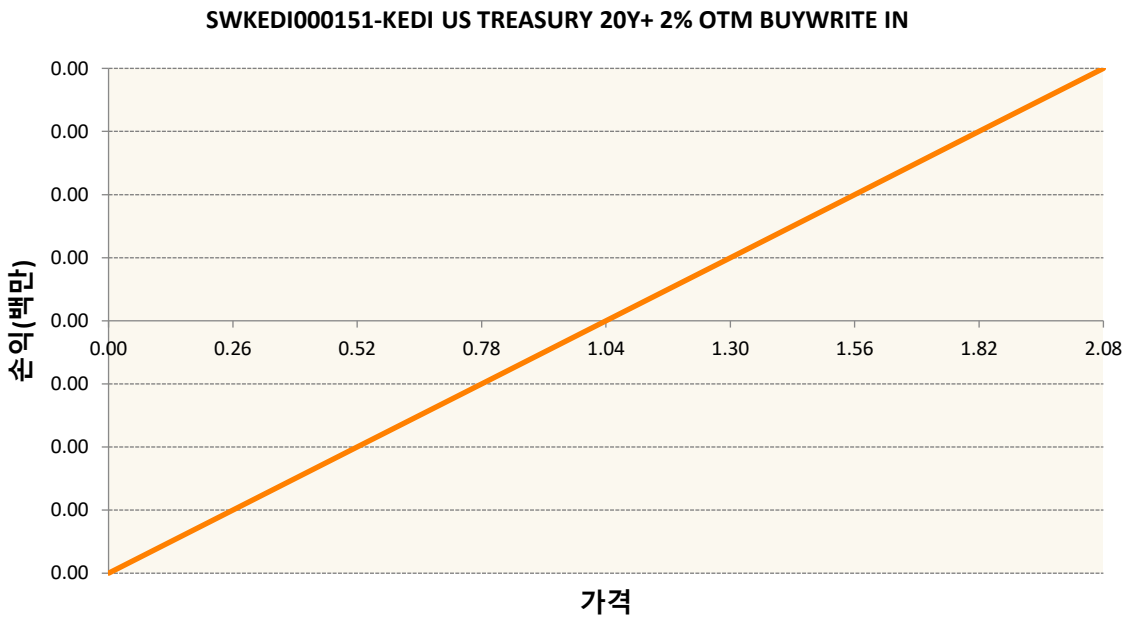
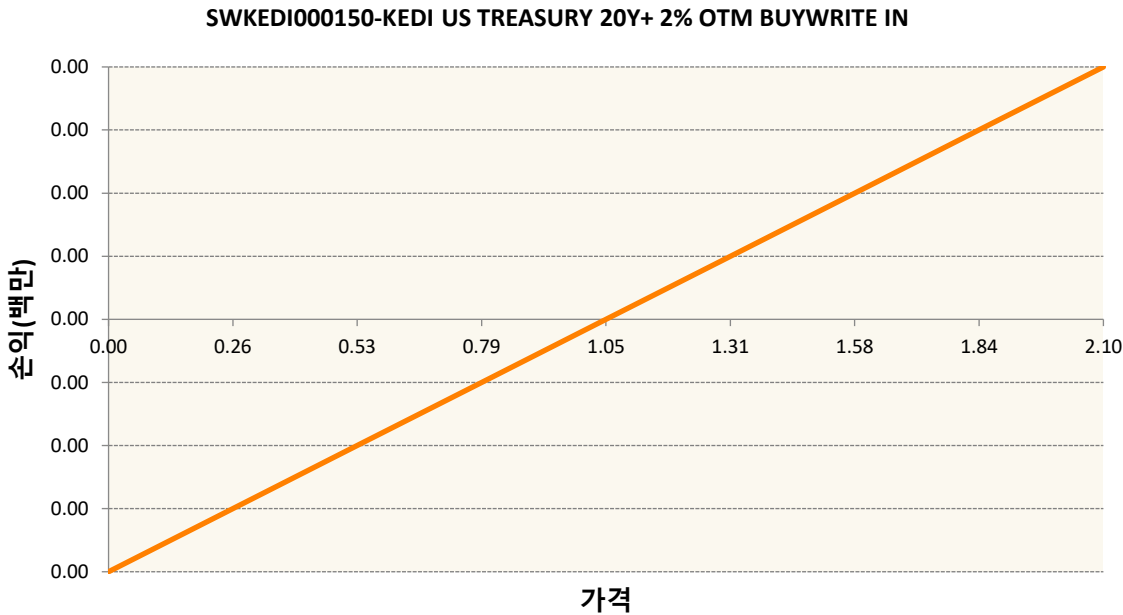
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

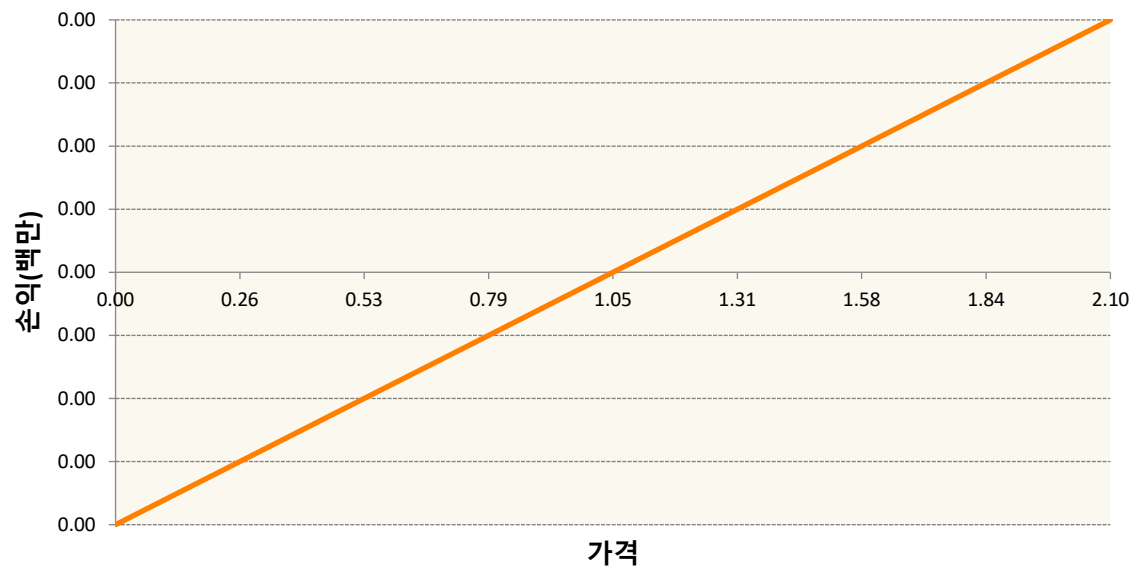
(단위:백만원)

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

8,482
8,046
3,734
10,082

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

(단위:백만원)

14,715

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

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	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	4

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

(단위:백만원)

19

공시일	2025-10-21
기준일	2025-10-20

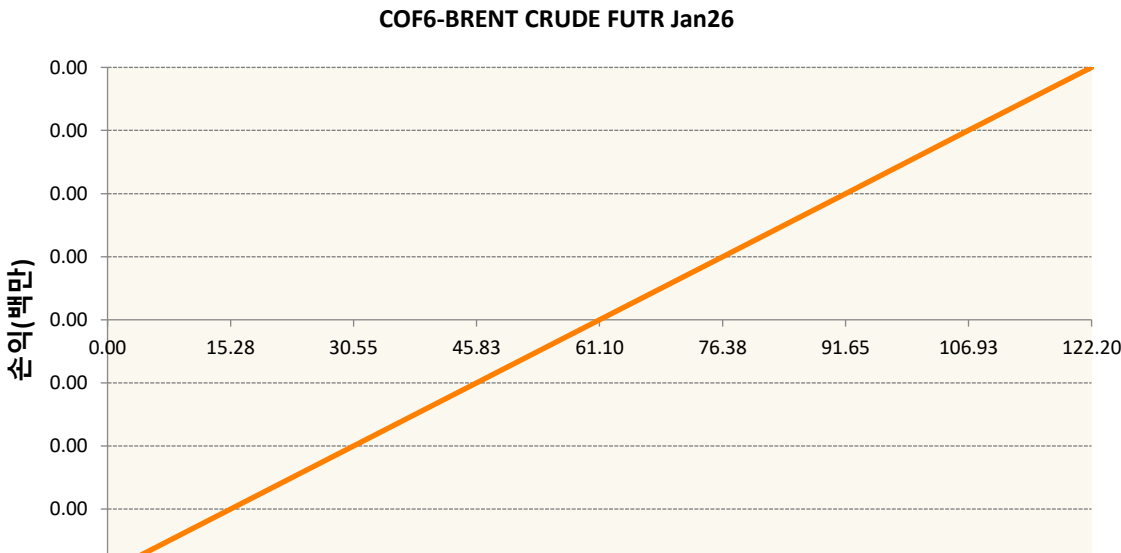
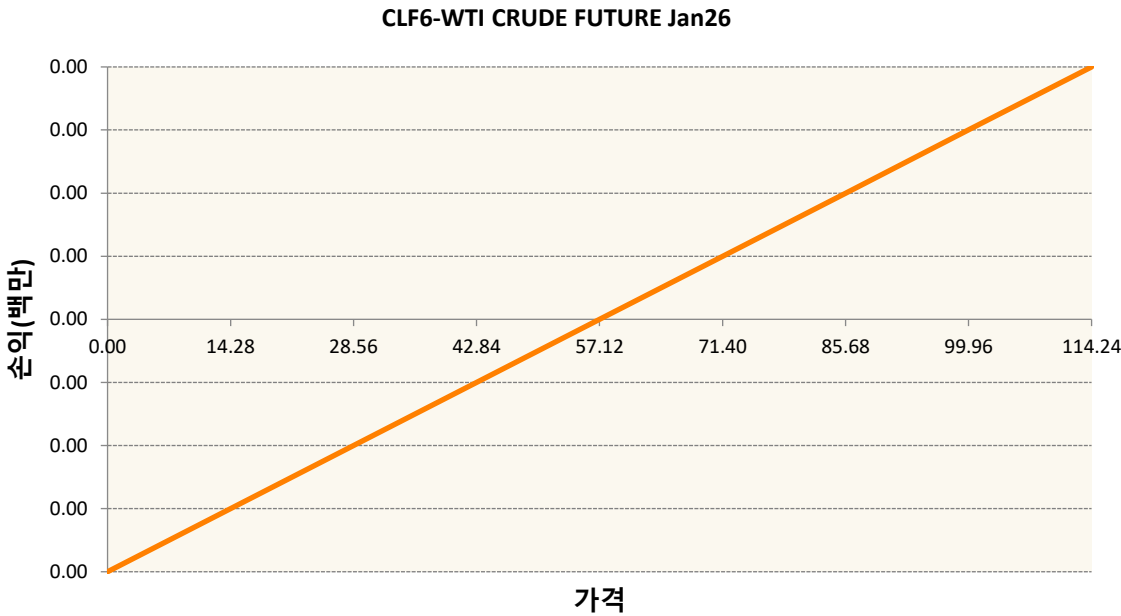
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

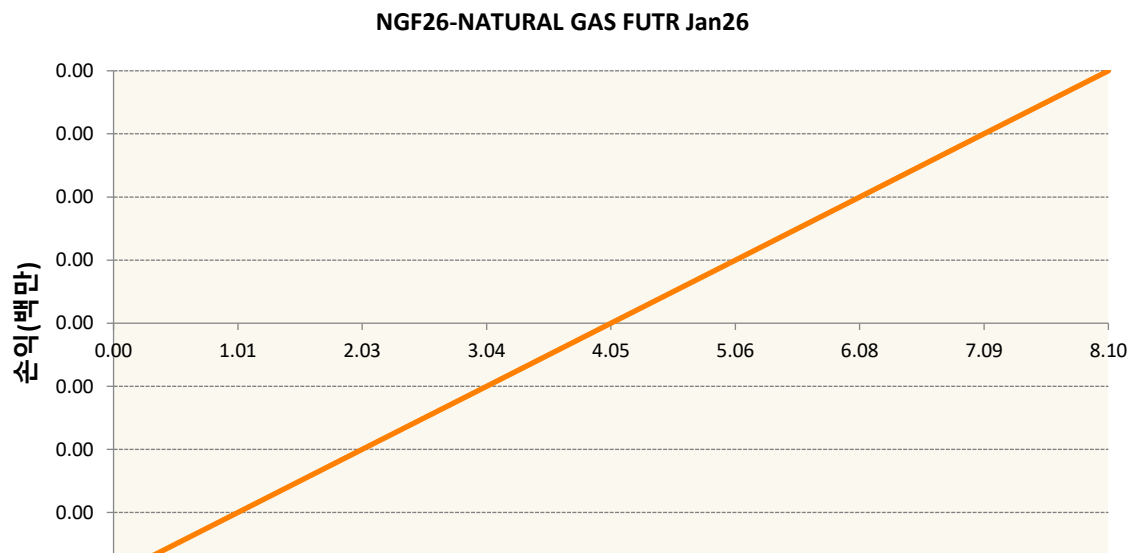
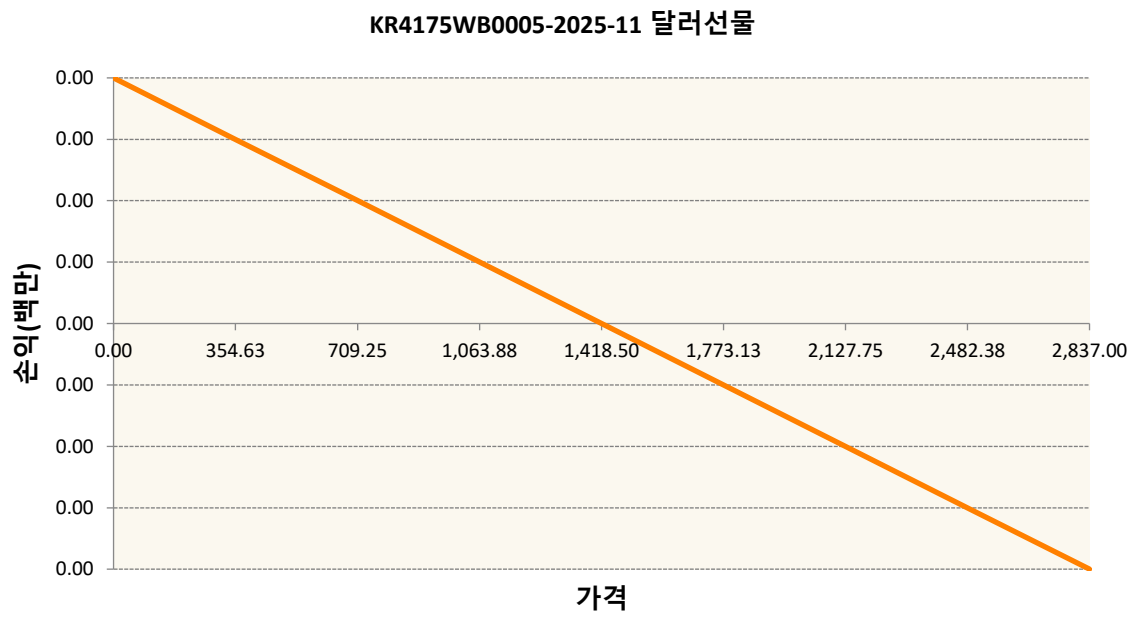
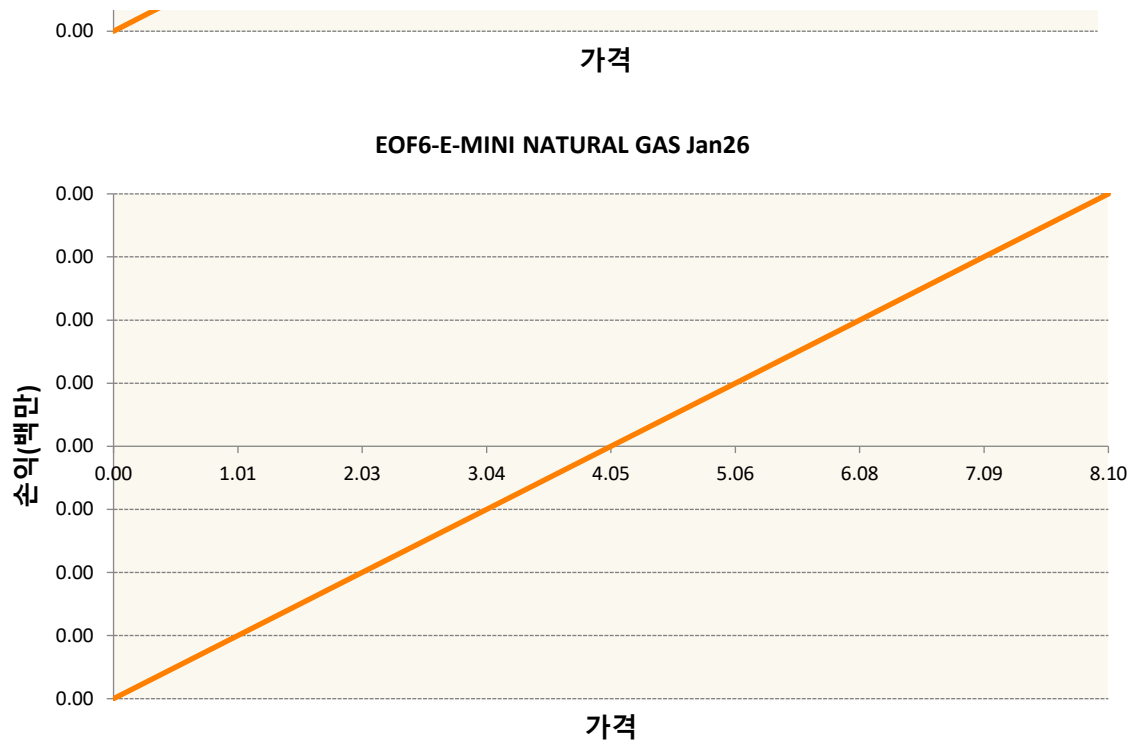
1. 계약금액

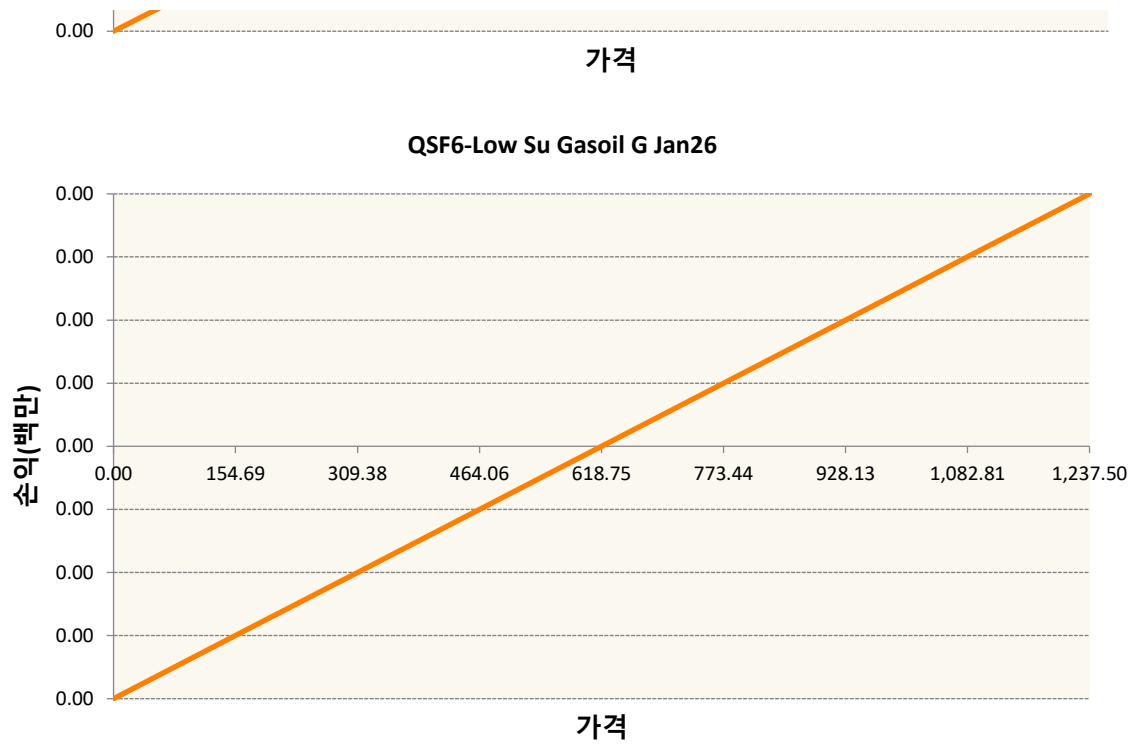
(단위:백만원)

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	328	0	328	
누계	유가증권	선물	170	0	170	
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)

87