

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

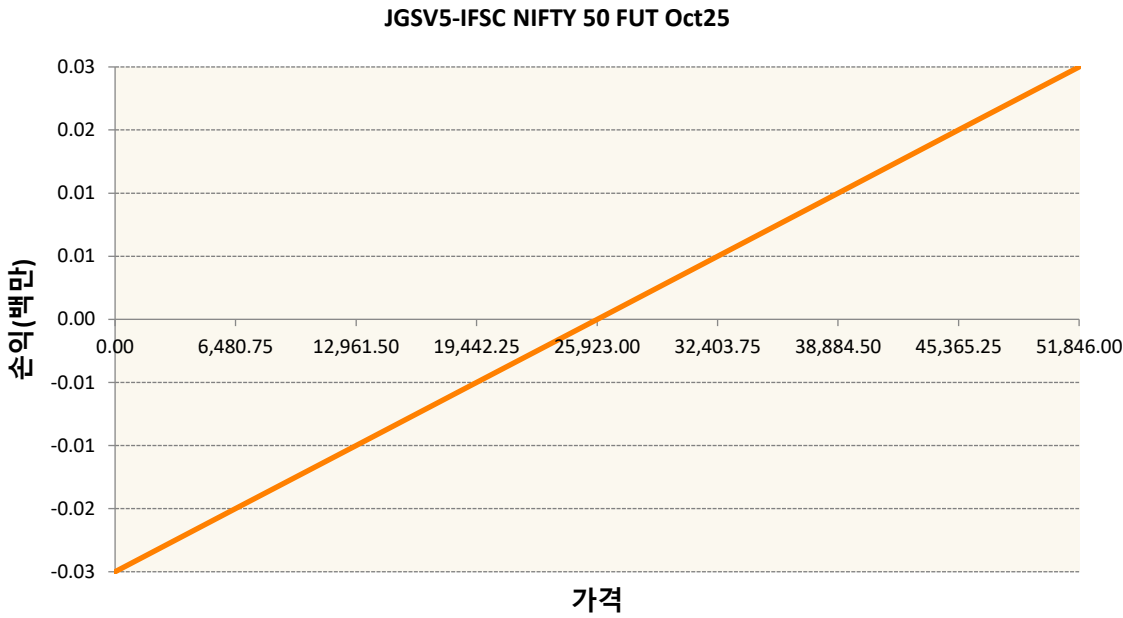
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 581   | 0     | 581       |    |

### 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 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

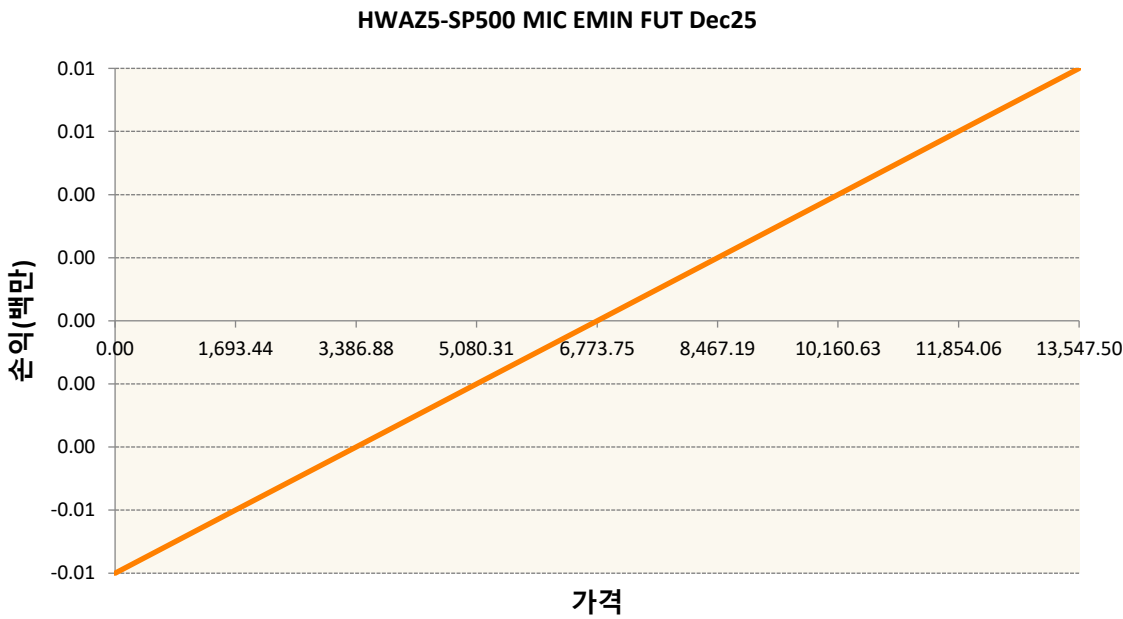
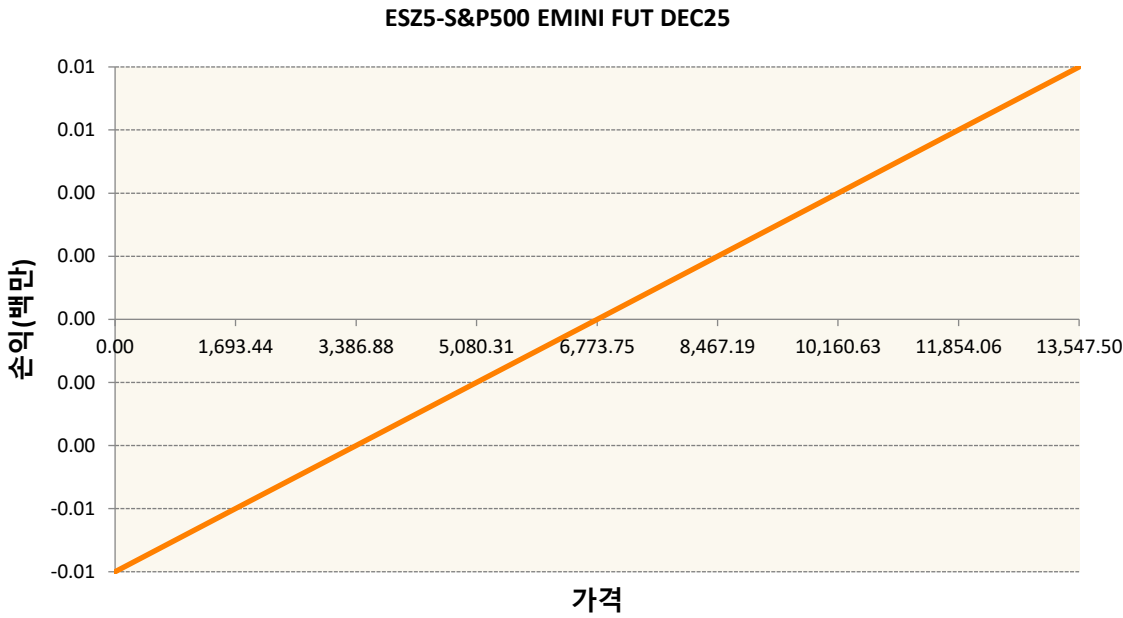
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 470   | 0     | 470       |    |
| 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) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 68       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

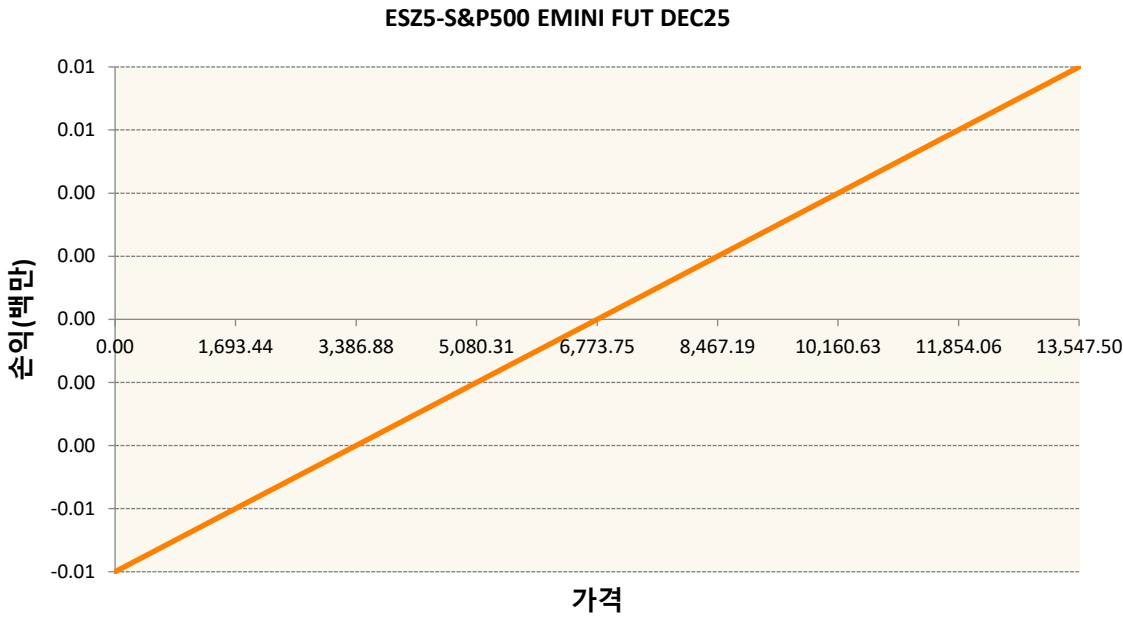
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,411 | 0     | 1,411     |    |

### 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)

163

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

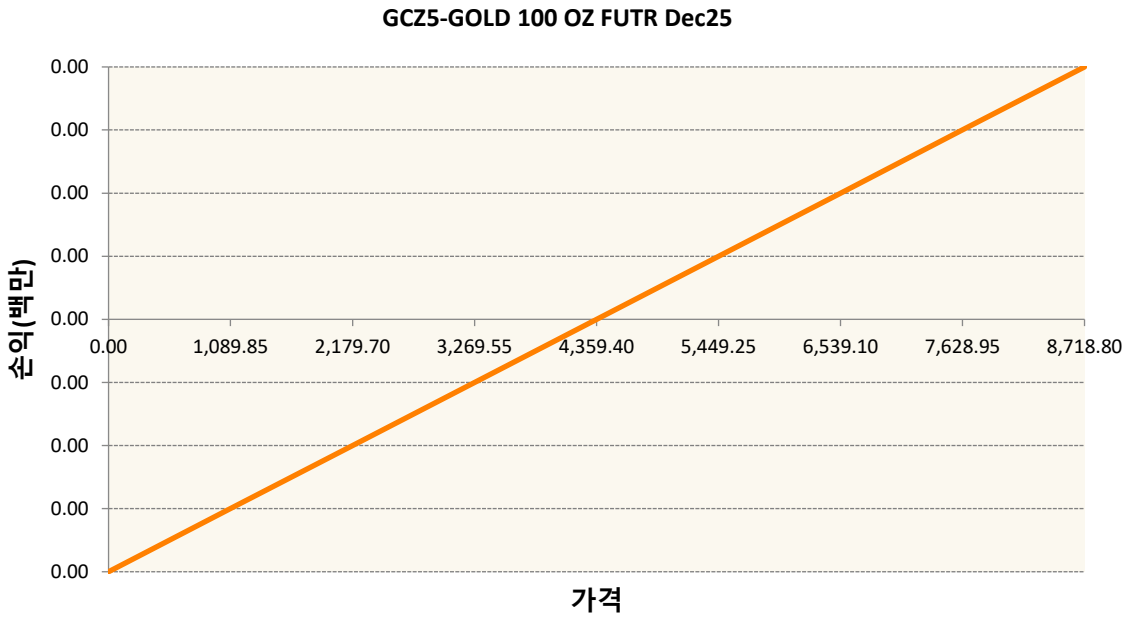
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 3,675 | 0     | 3,675     |    |
| 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 | 294 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 264 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

## 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 | 50 |
| AOPLTRUCP PLTR US 10/24/25 P185 EQUITY | 56 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 421 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

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 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

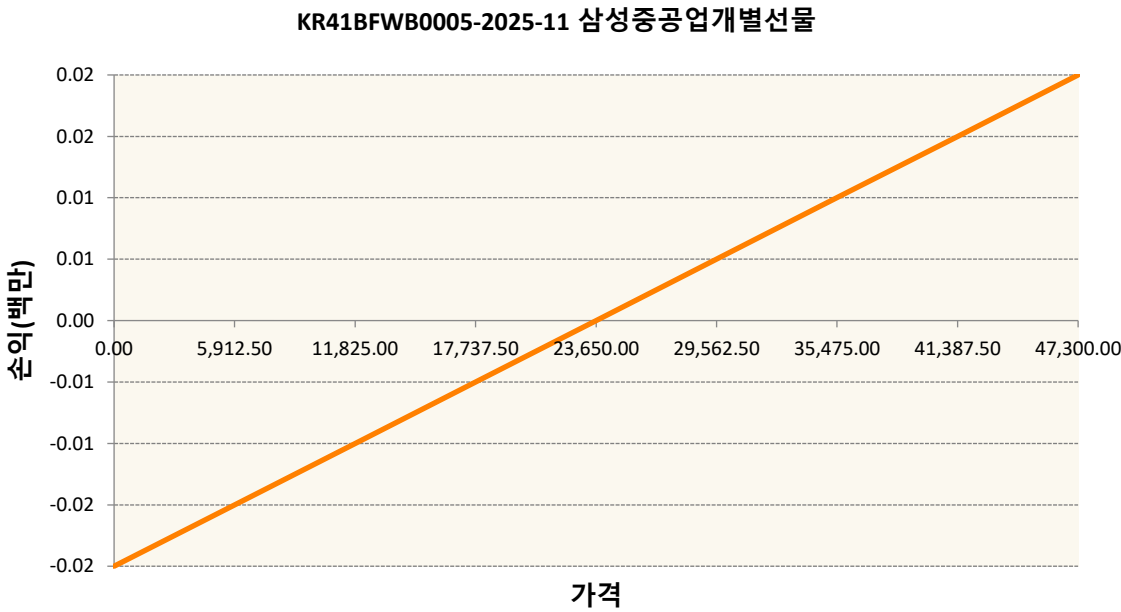
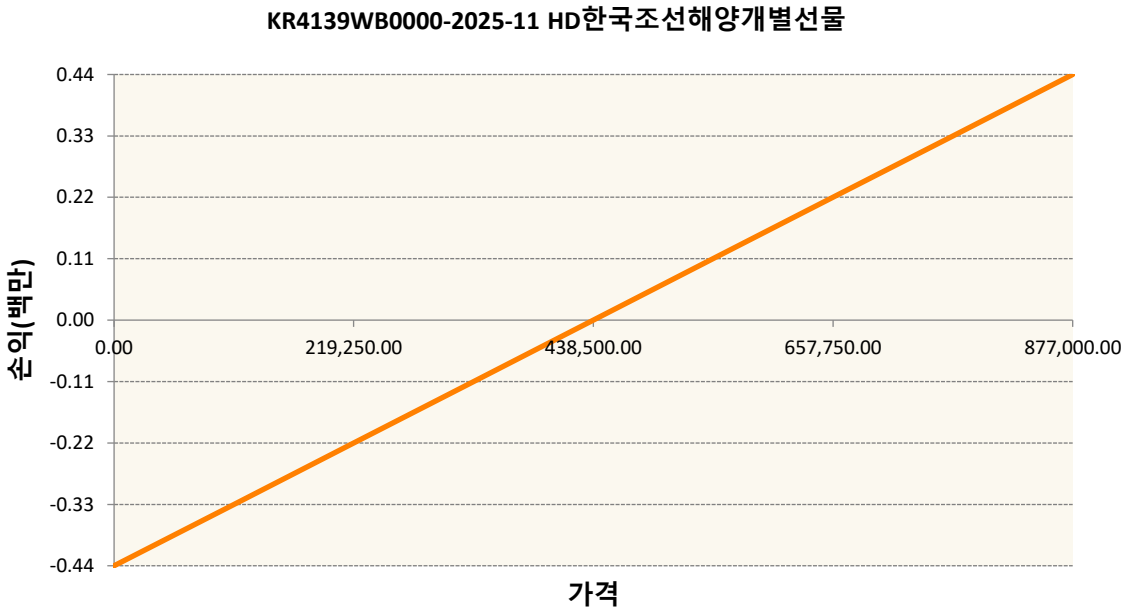
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 1. 계약금액

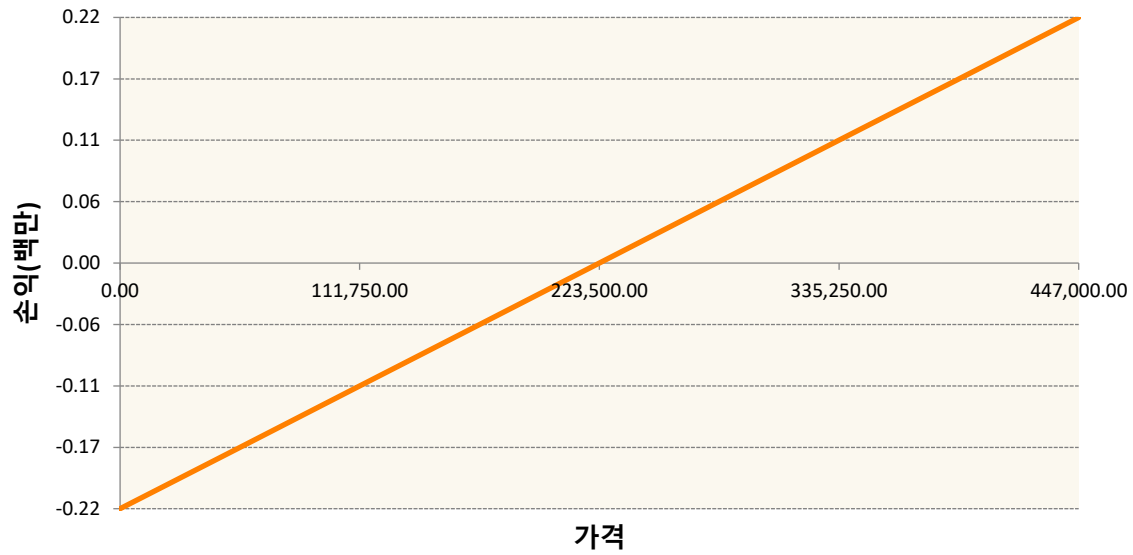
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 57,391 | 0     | 57,391    | 장내 |

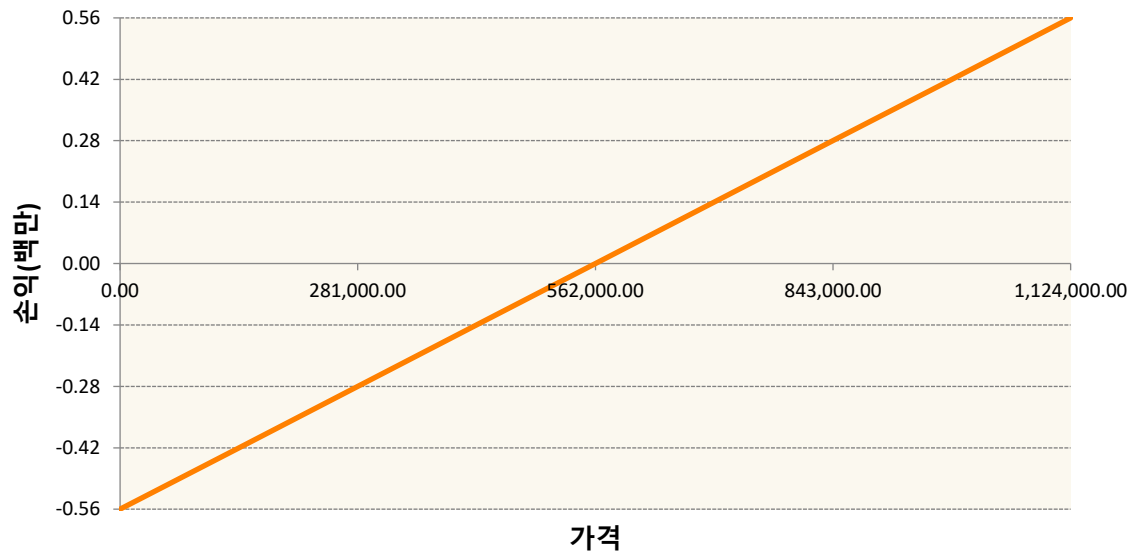
### 2. 만기시점의 손익구조



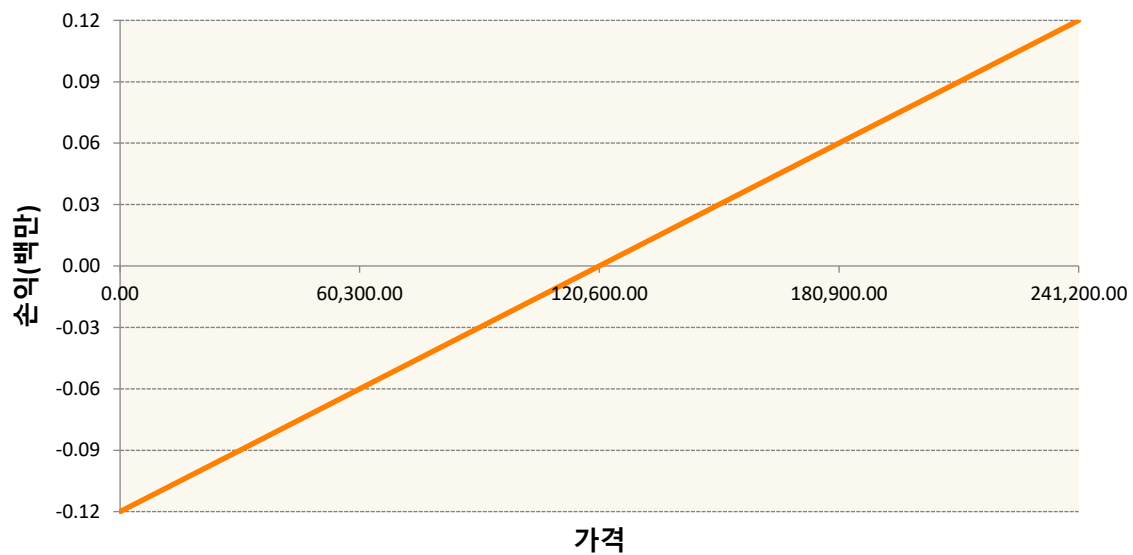
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |                      |        |        |        |        |
|--------------|-----------|---------|----------------------|--------|--------|--------|--------|
| KR4139WB0000 |           |         | 2025-11 HD한국조선해양개별선물 |        |        |        | 1,266  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                      |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%               | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -1,266    | -1,266  | -1,266               | -1,266 | -1,266 | -1,266 | -1,266 |
| -5.33%       | -844      | -844    | -844                 | -844   | -844   | -844   | -844   |
| -2.67%       | -422      | -422    | -422                 | -422   | -422   | -422   | -422   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                    | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%        | 422       | 422     | 422                  | 422    | 422    | 422    | 422    |
| 5.33%        | 844       | 844     | 844                  | 844    | 844    | 844    | 844    |
| 8.00%        | 1,266     | 1,266   | 1,266                | 1,266  | 1,266  | 1,266  | 1,266  |
| KR41BFWB0005 |           |         | 2025-11 삼성중공업개별선물    |        |        |        | 1,174  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                      |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%               | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -1,174    | -1,174  | -1,174               | -1,174 | -1,174 | -1,174 | -1,174 |
| -5.33%       | -783      | -783    | -783                 | -783   | -783   | -783   | -783   |
| -2.67%       | -391      | -391    | -391                 | -391   | -391   | -391   | -391   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                    | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%        | 391       | 391     | 391                  | 391    | 391    | 391    | 391    |
| 5.33%        | 783       | 783     | 783                  | 783    | 783    | 783    | 783    |
| 8.00%        | 1,174     | 1,174   | 1,174                | 1,174  | 1,174  | 1,174  | 1,174  |
| KR41CDWB0006 |           |         | 2025-11 HD현대미포개별선물   |        |        |        | 507    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                      |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%               | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -507      | -507    | -507                 | -507   | -507   | -507   | -507   |
| -5.33%       | -338      | -338    | -338                 | -338   | -338   | -338   | -338   |
| -2.67%       | -169      | -169    | -169                 | -169   | -169   | -169   | -169   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                    | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%        | 169       | 169     | 169                  | 169    | 169    | 169    | 169    |
| 5.33%        | 338       | 338     | 338                  | 338    | 338    | 338    | 338    |
| 8.00%        | 507       | 507     | 507                  | 507    | 507    | 507    | 507    |
| KR41FDWB0003 |           |         | 2025-11 HD현대중공업개별선물  |        |        |        | 667    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                      |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%               | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -667      | -667    | -667                 | -667   | -667   | -667   | -667   |
| -5.33%       | -445      | -445    | -445                 | -445   | -445   | -445   | -445   |
| -2.67%       | -222      | -222    | -222                 | -222   | -222   | -222   | -222   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                    | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%        | 222       | 222     | 222                  | 222    | 222    | 222    | 222    |
| 5.33%        | 445       | 445     | 445                  | 445    | 445    | 445    | 445    |
| 8.00%        | 667       | 667     | 667                  | 667    | 667    | 667    | 667    |
| KR41FVWB0001 |           |         | 2025-11 한화오션개별선물     |        |        |        | 983    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                      |        |        |        |        |

|        |         |         |        |      |       |        |        |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -983    | -983    | -983   | -983 | -983  | -983   | -983   |
| -5.33% | -655    | -655    | -655   | -655 | -655  | -655   | -655   |
| -2.67% | -328    | -328    | -328   | -328 | -328  | -328   | -328   |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 328     | 328     | 328    | 328  | 328   | 328    | 328    |
| 5.33%  | 655     | 655     | 655    | 655  | 655   | 655    | 655    |
| 8.00%  | 983     | 983     | 983    | 983  | 983   | 983    | 983    |

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

(단위:백만원)

2,376

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

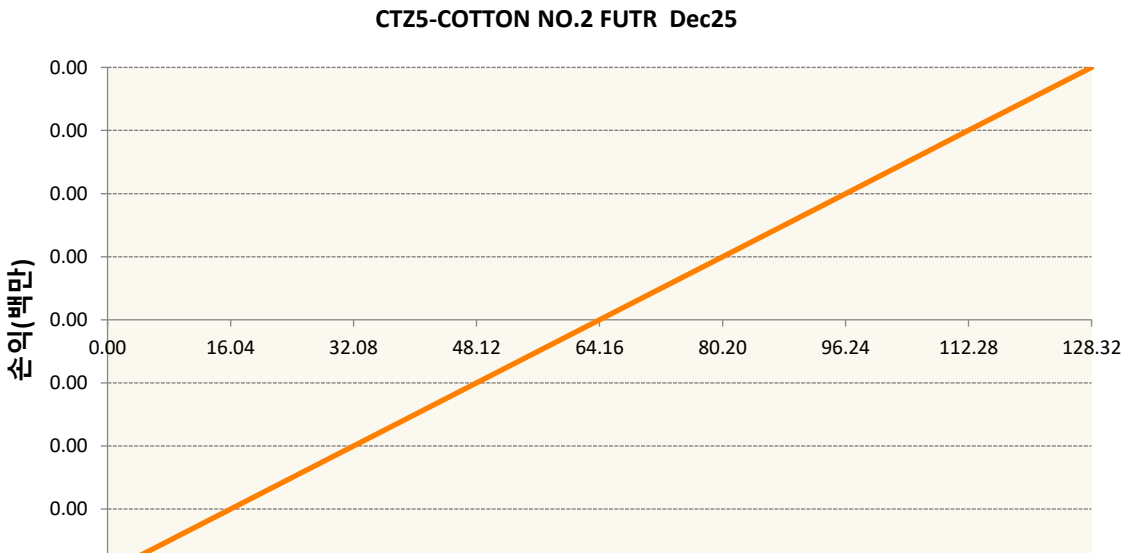
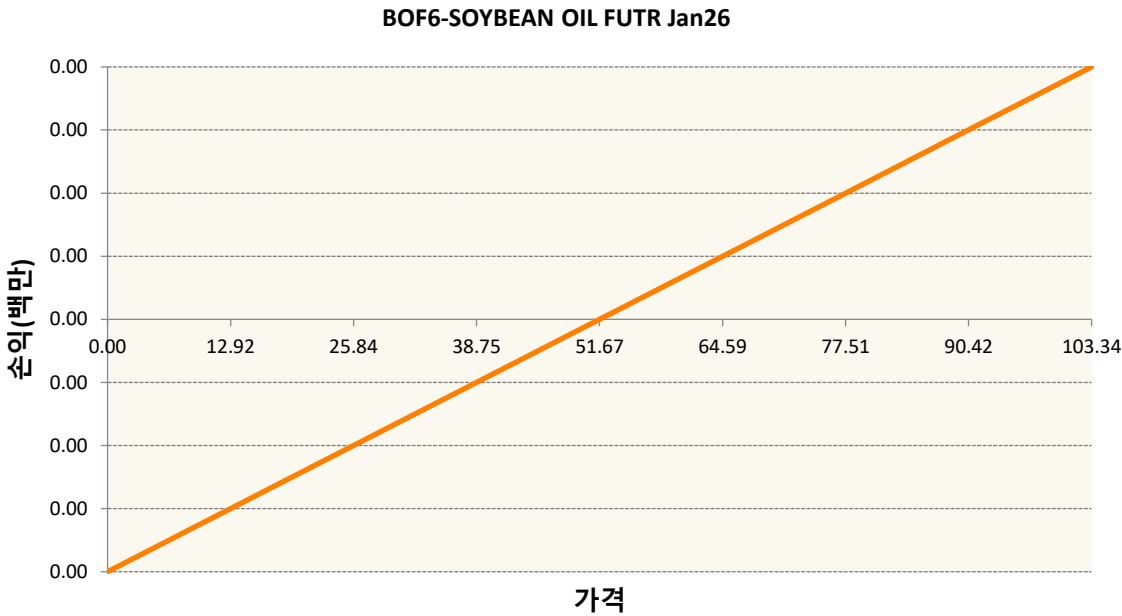
## 포커스농산물모(채권-파생형)

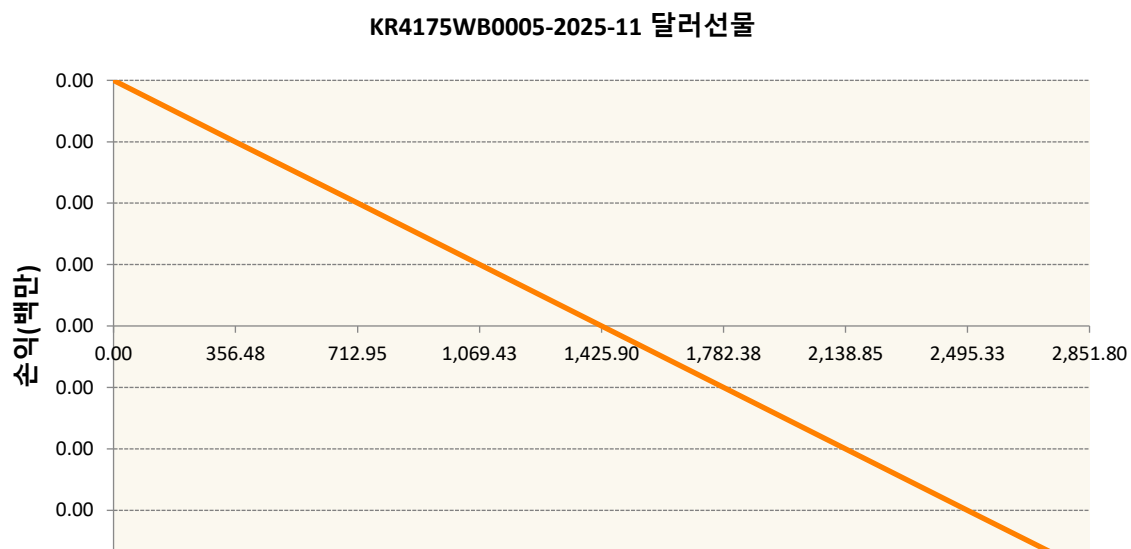
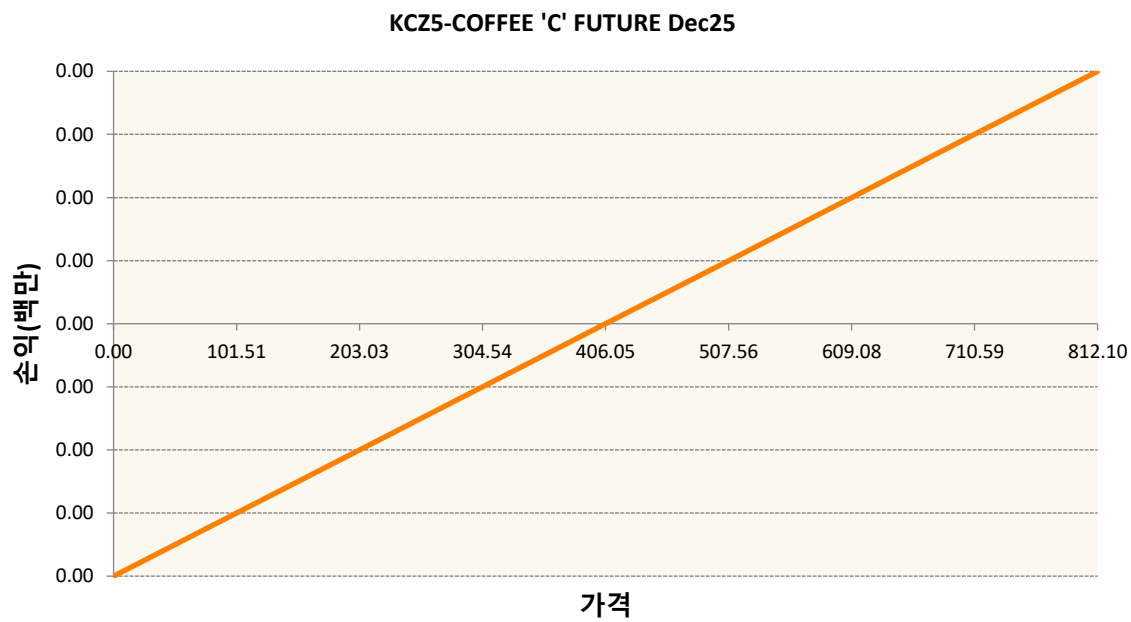
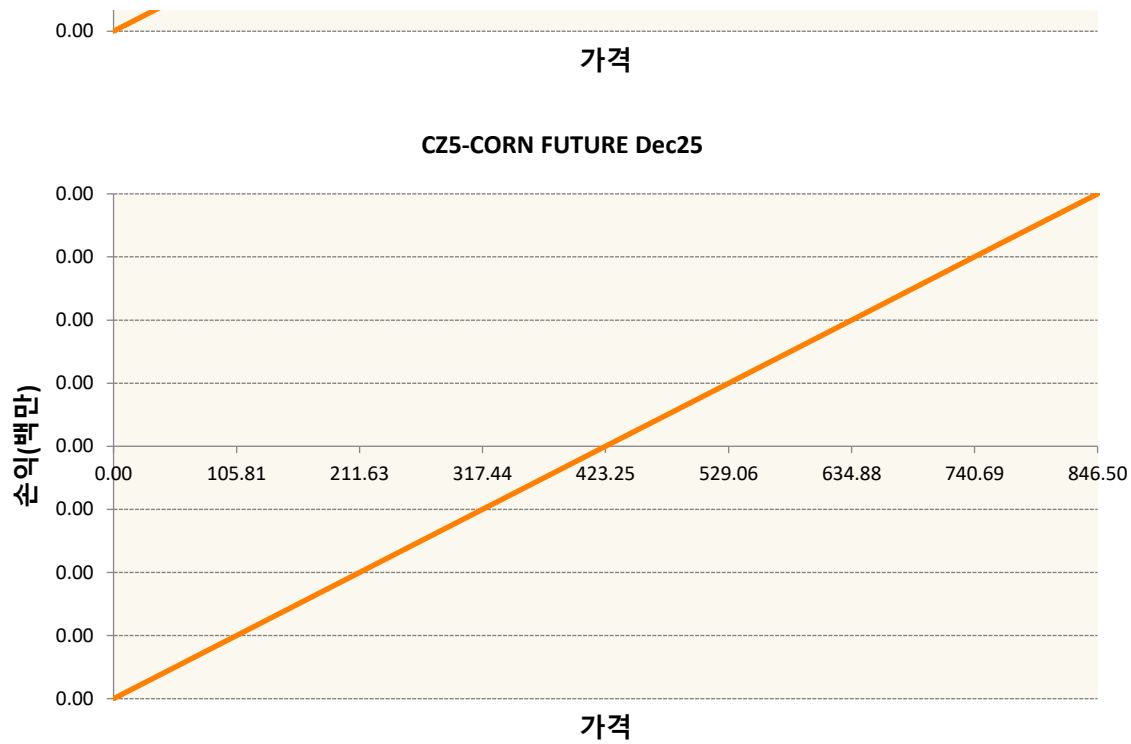
### 1. 계약금액

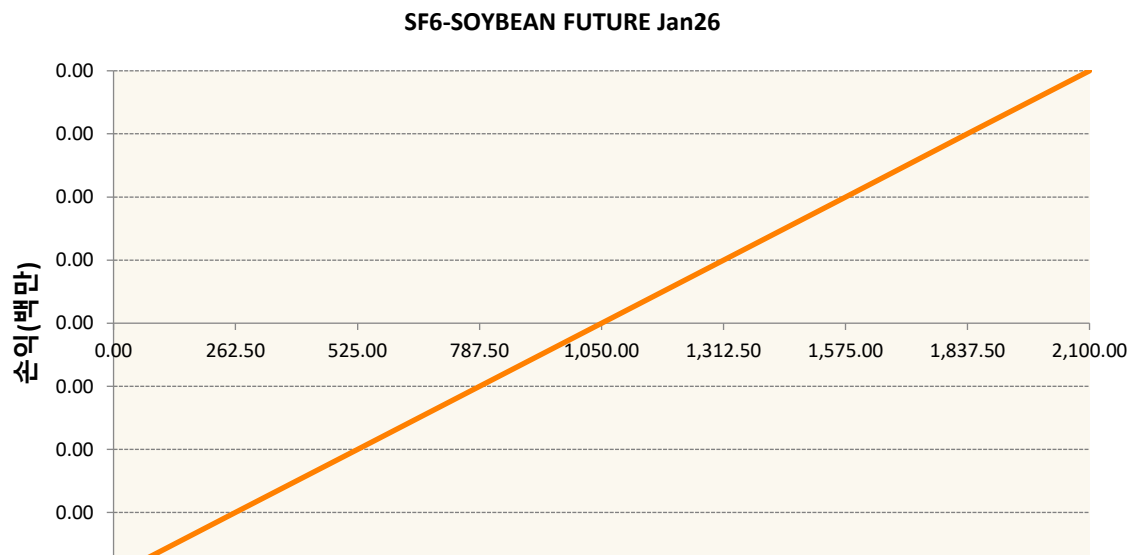
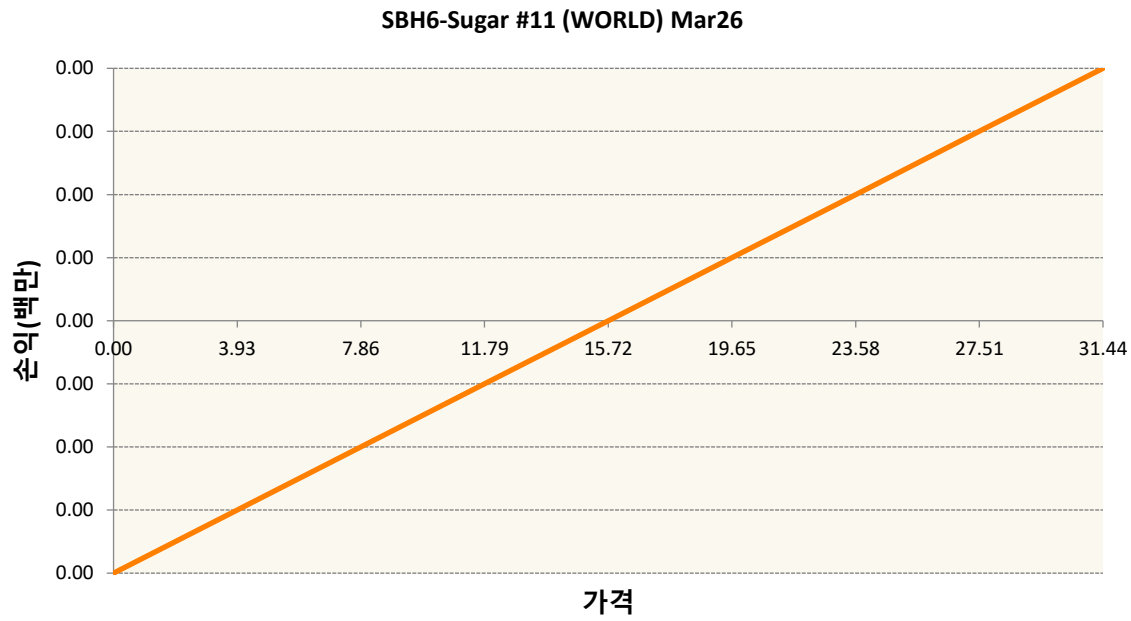
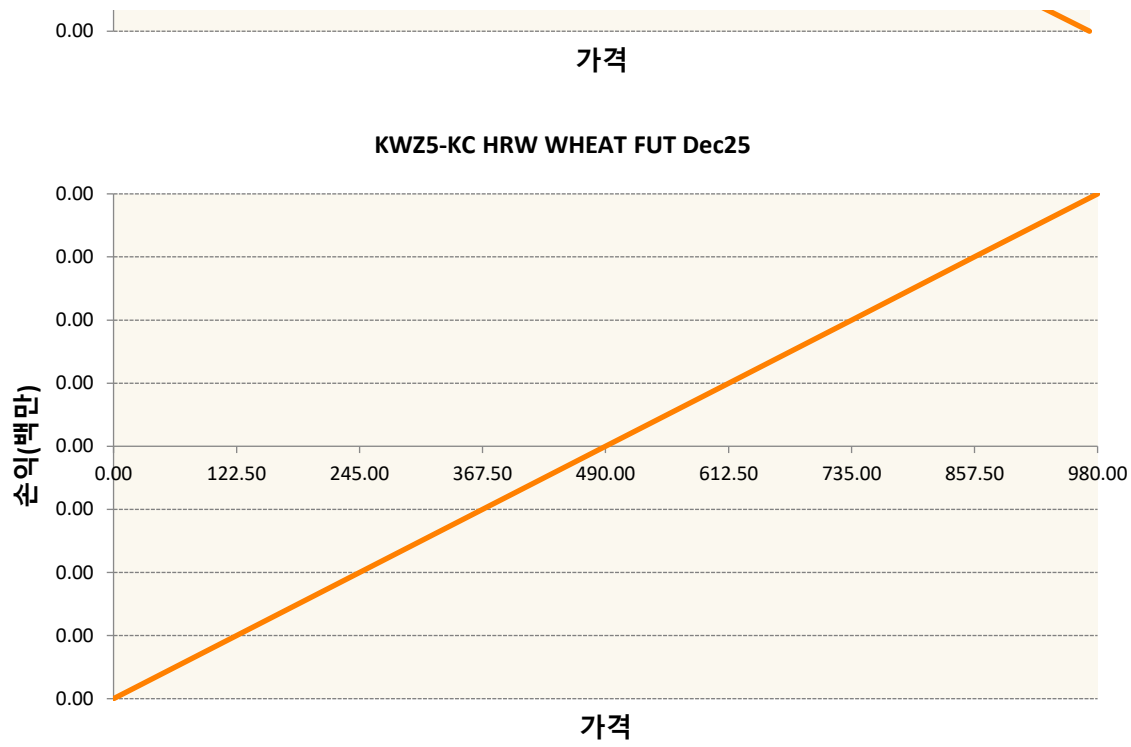
(단위:USD 백만)

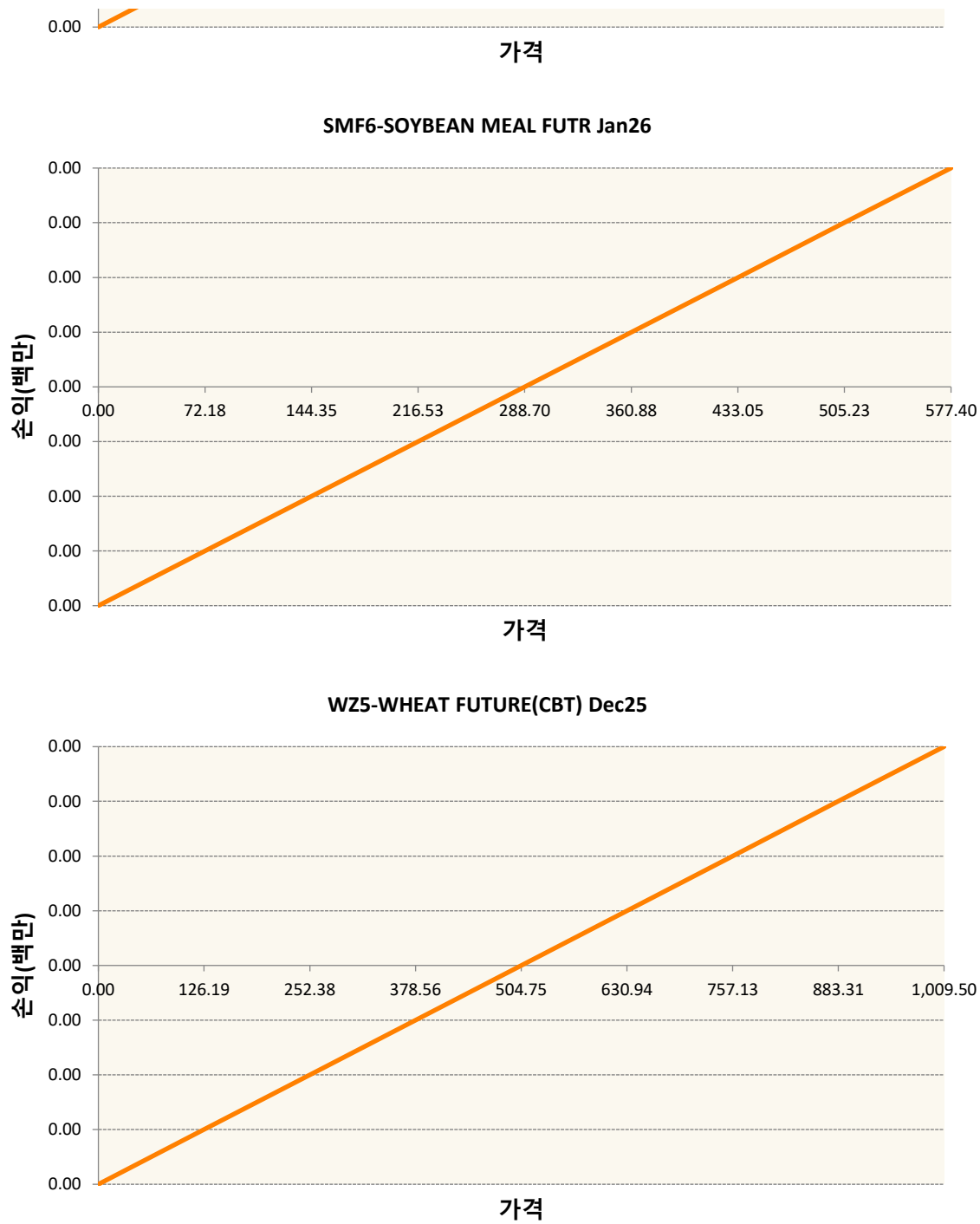
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 71    | -71       | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,112 | 0     | 1,112     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,187 | 0     | 2,187     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 356   | -356      | 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 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

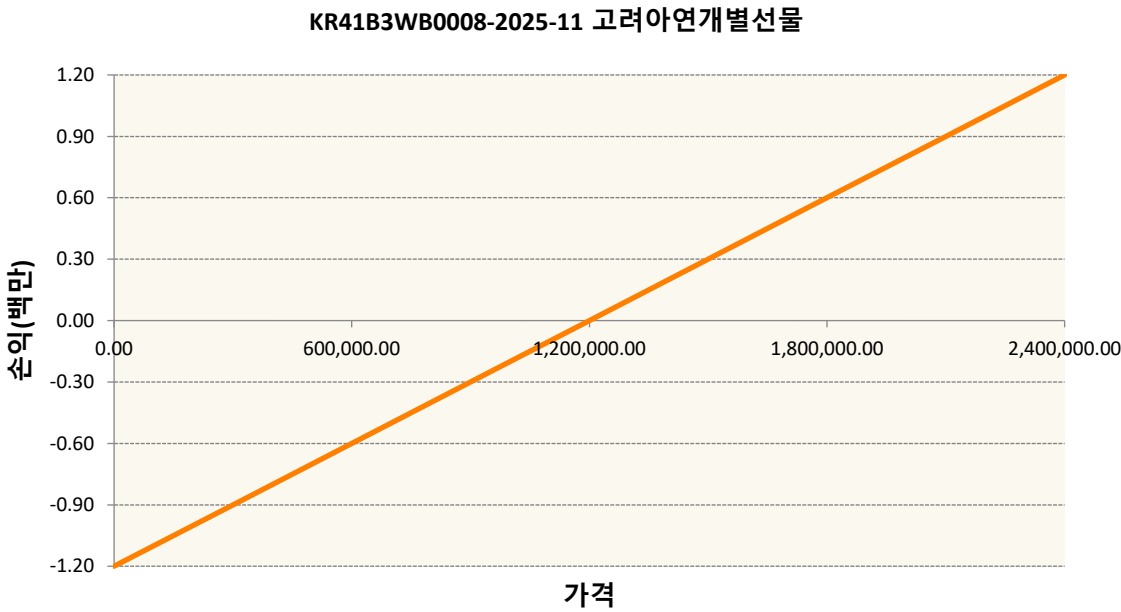
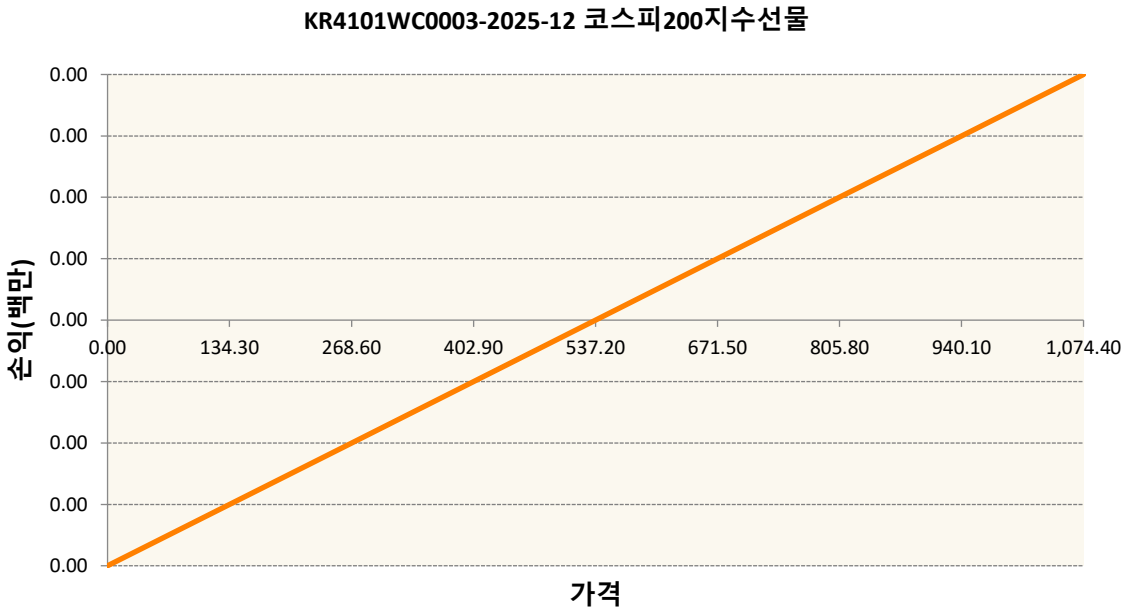
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

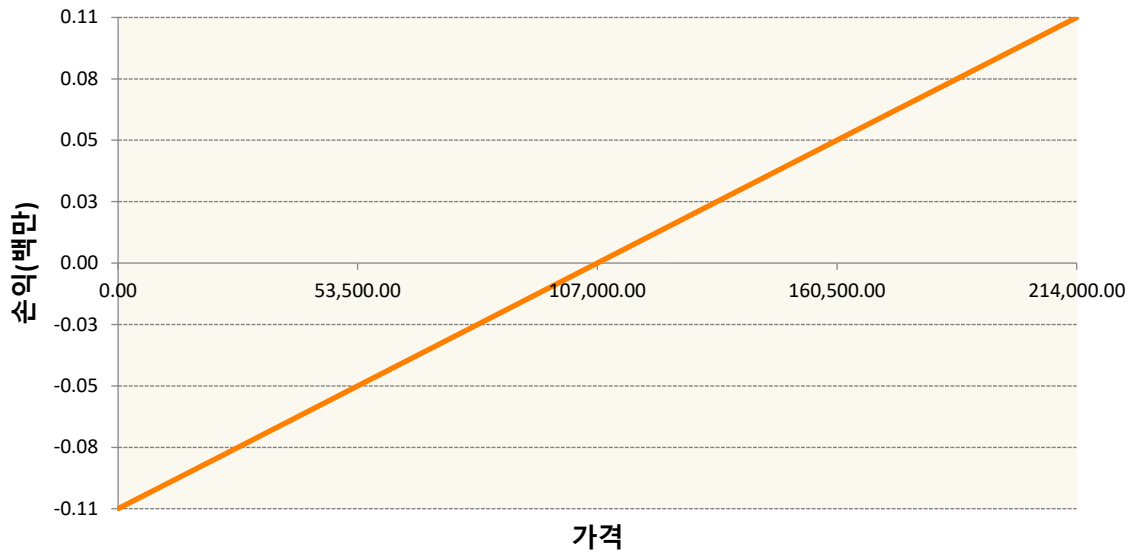
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 134   | -134      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,354 | 0     | 1,354     | 장내 |

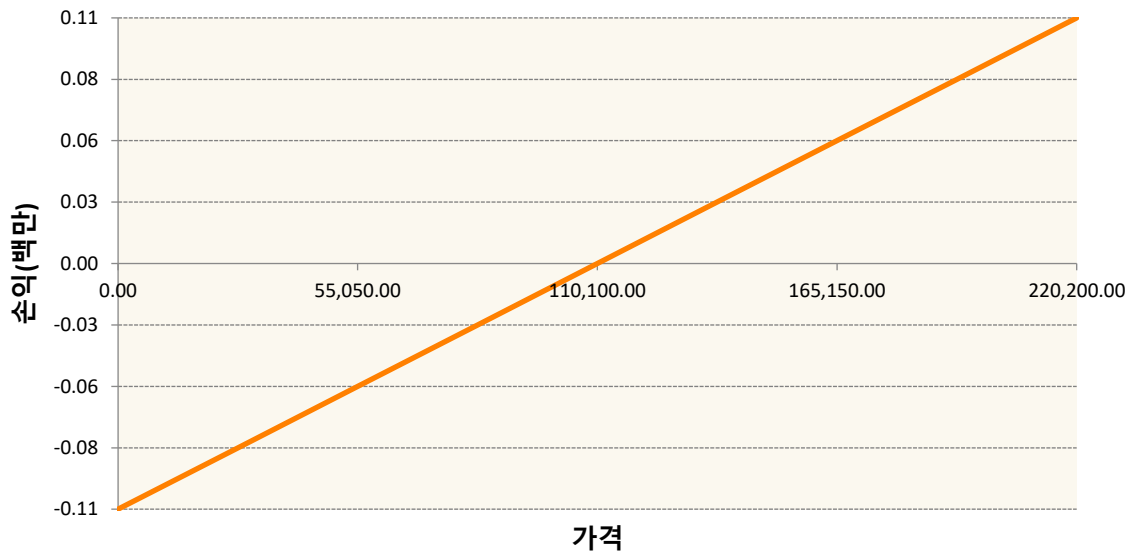
### 2. 만기시점의 손익구조



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |    |
|-------------------------------|----|
| KR4101WC0( 2025-12 코스피200지수선물 | 97 |
| KR41B3WB0( 2025-11 고려아연개별선물   | 7  |
| KR41EJWB0( 2025-11 SKC개별선물    | 2  |
| KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물    | 3  |

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

(단위:백만원)

43

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

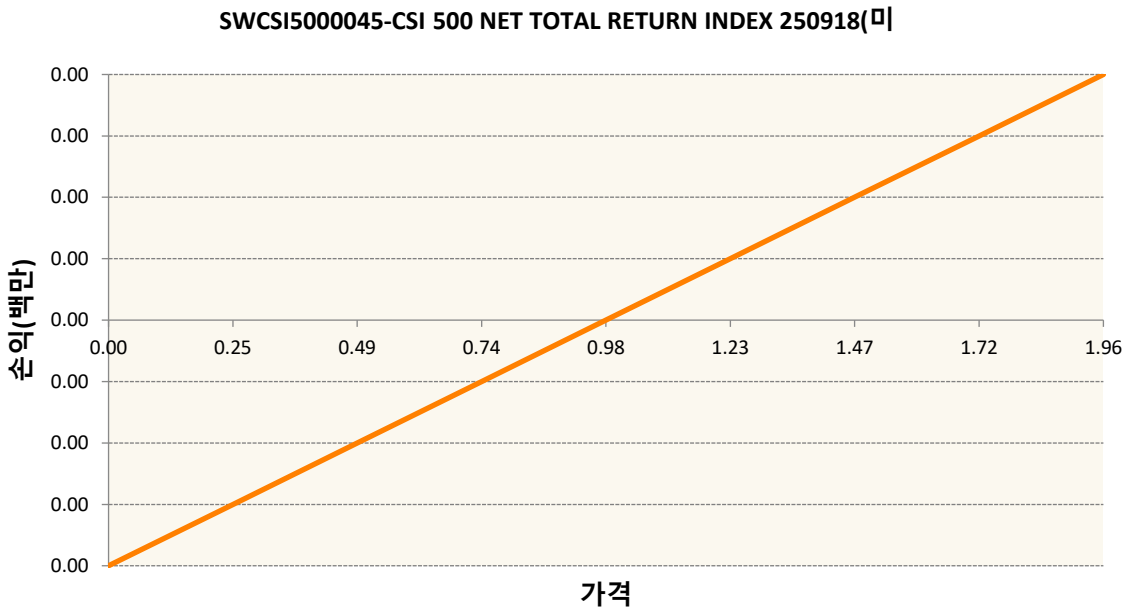
## SOL차이나강소기업CSI500상장

### 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   | 4,606 | 0     | 4,606     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

370

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

490

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

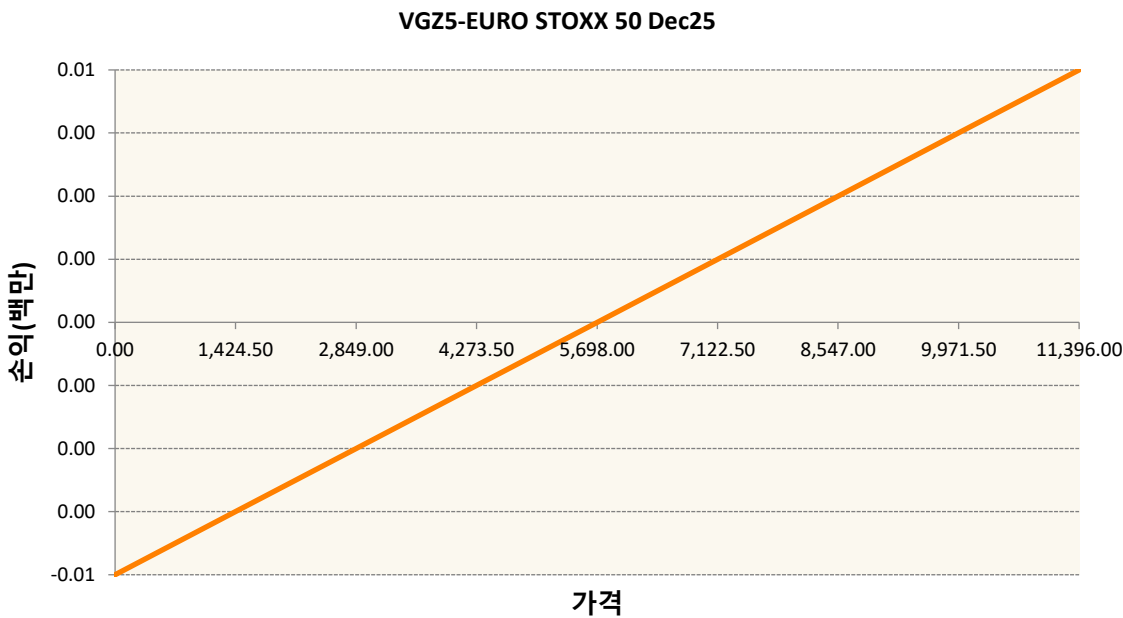
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 747   | 0     | 747       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGZ5 | EURO STOXX 50 Dec25 | 60 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 51 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

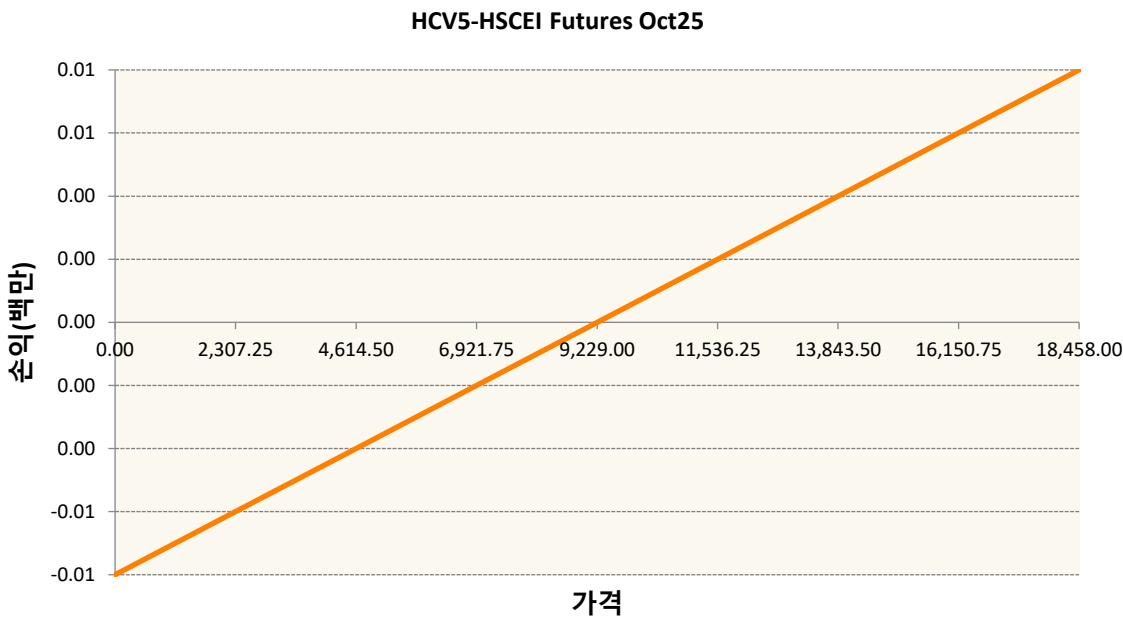
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 2,094 | 0     | 2,094     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCV5 | HSCEI Futures Oct25 | 167 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 237 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

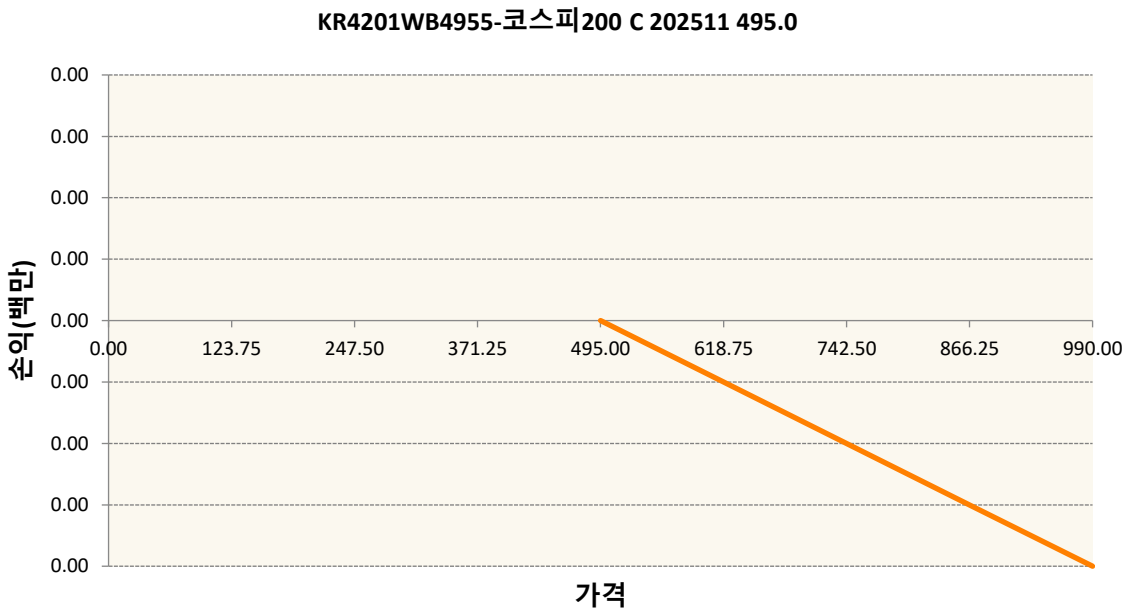
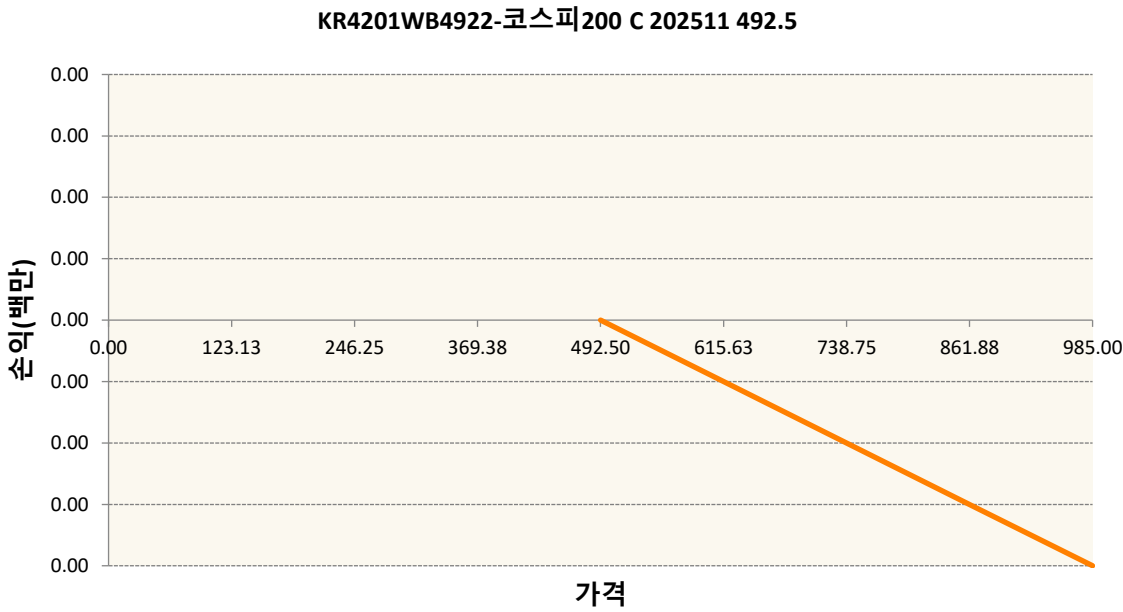
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

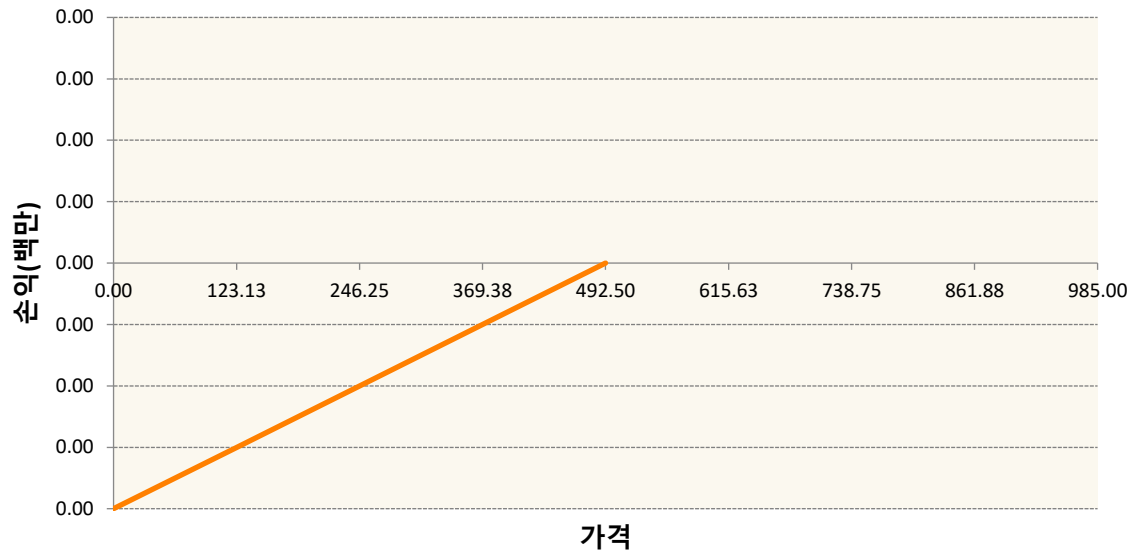
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 777   | 0      | 777       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 32,610 | -32,610   | 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

1,663

KR4301WB49 코스피200 P 202511 492.5

493

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-10-22

기준일 2025-10-21

## 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 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

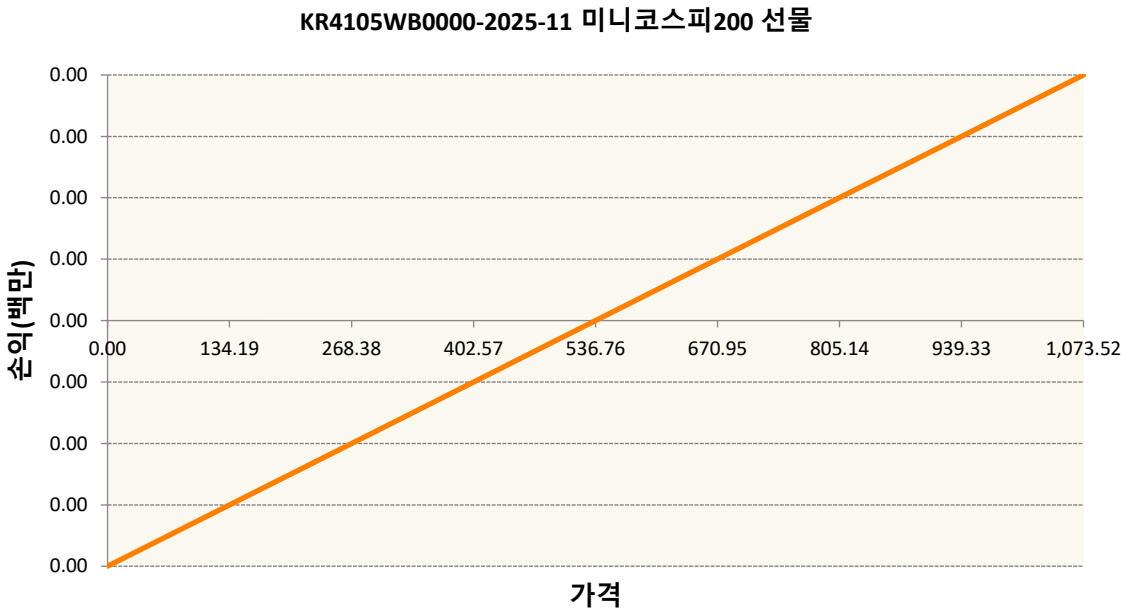
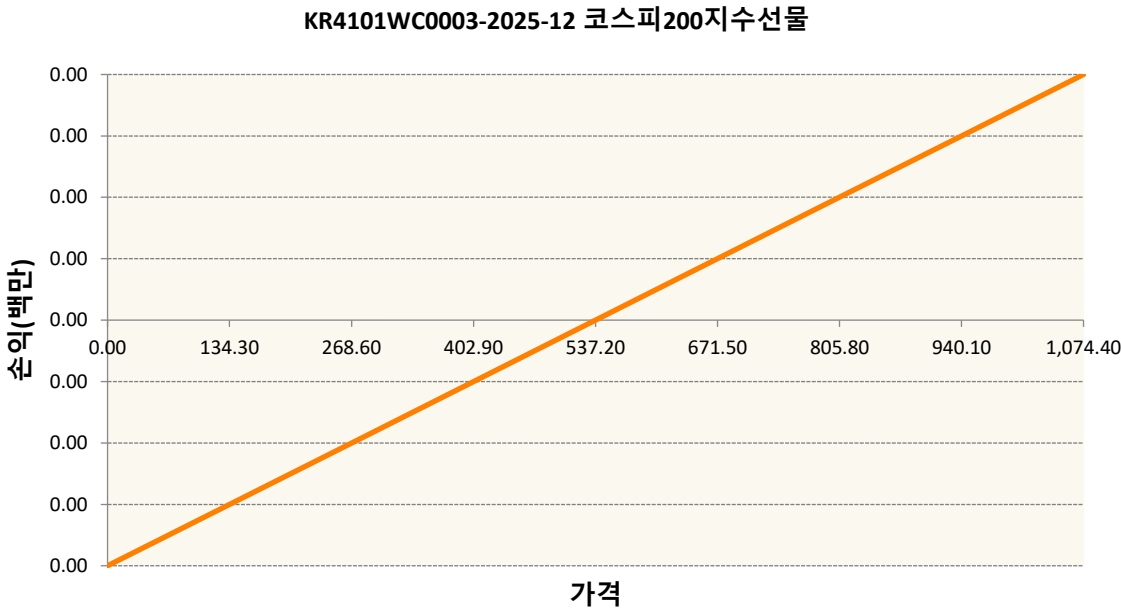
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

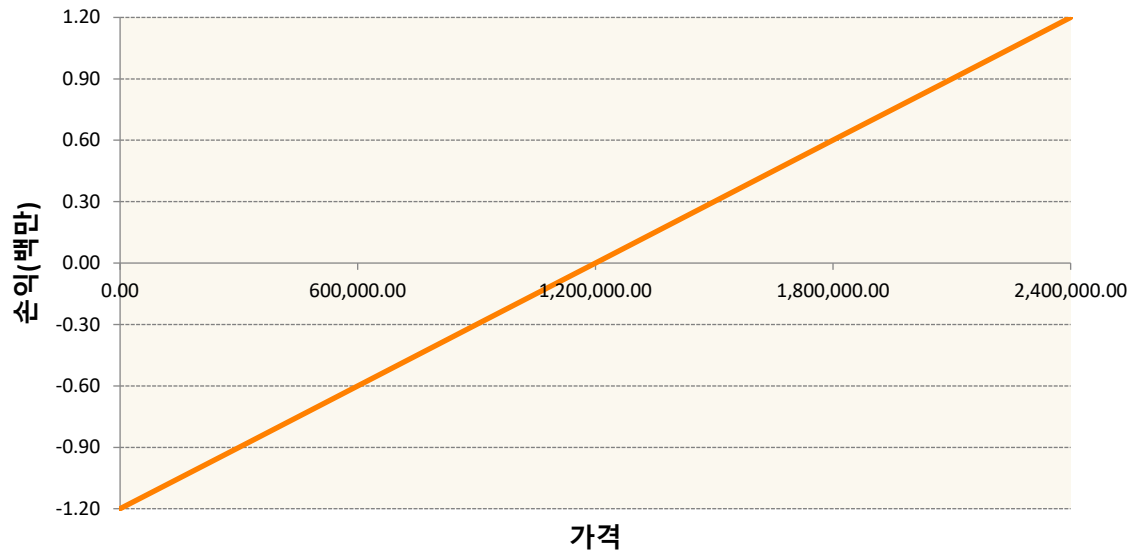
(단위:백만원)

| 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 |

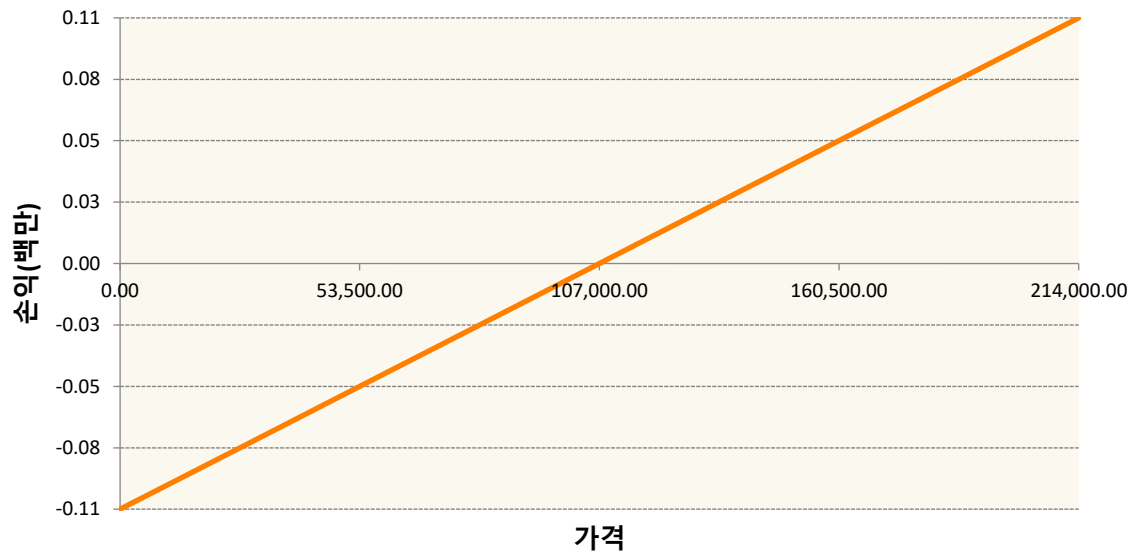
### 2. 만기시점의 손익구조



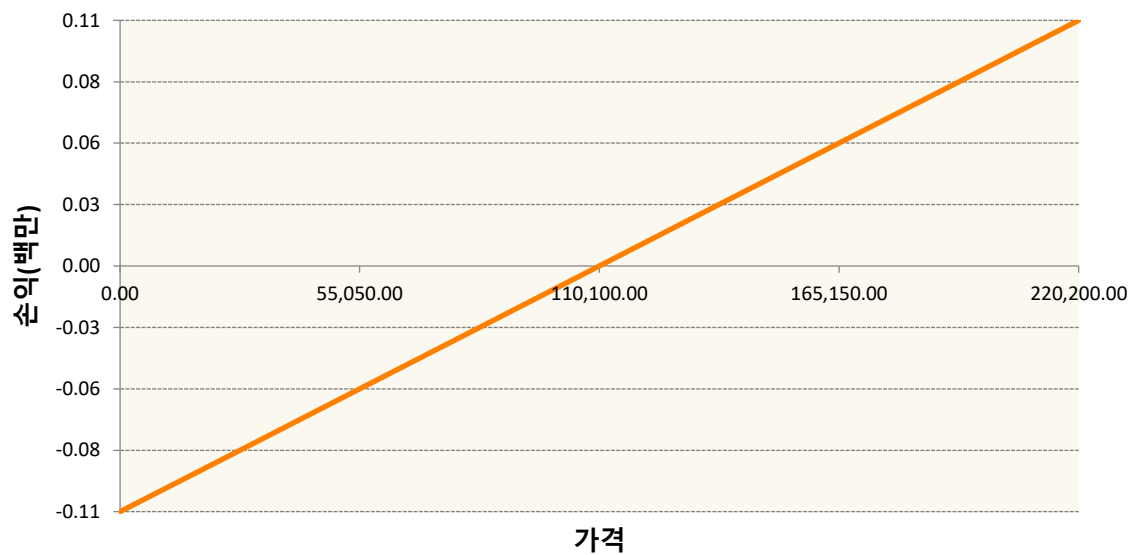
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 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 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

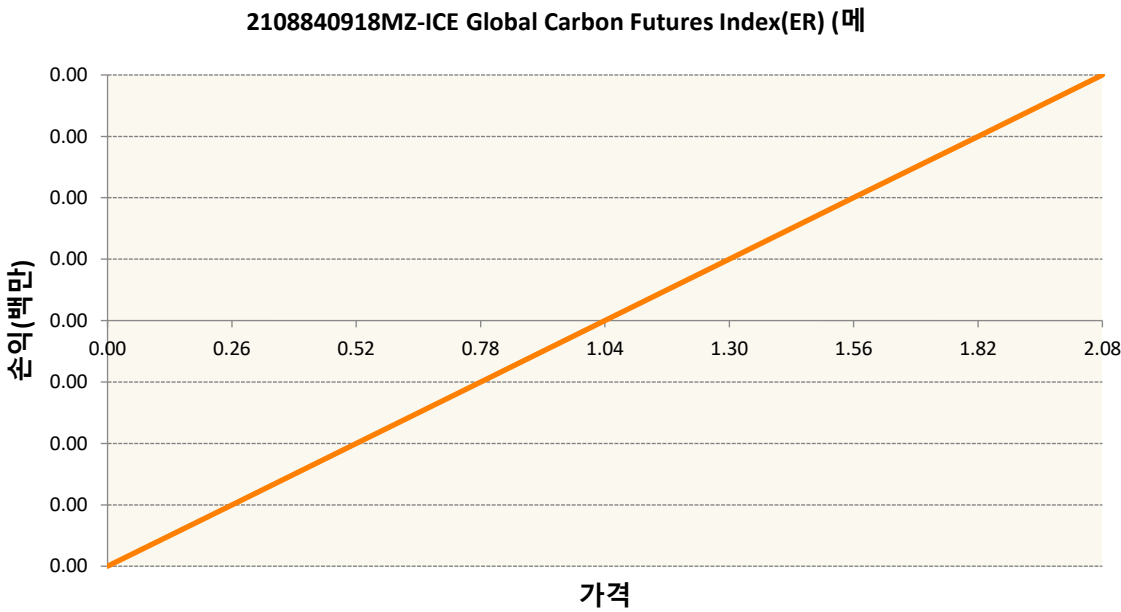
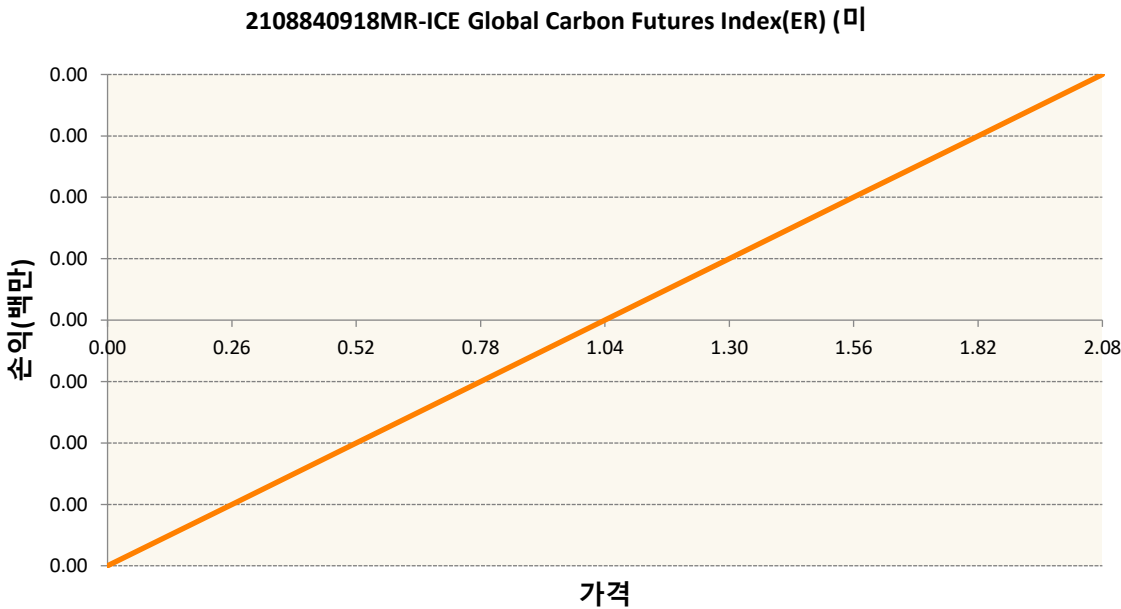
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 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 |  | 680      |
| 2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 114      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 790      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

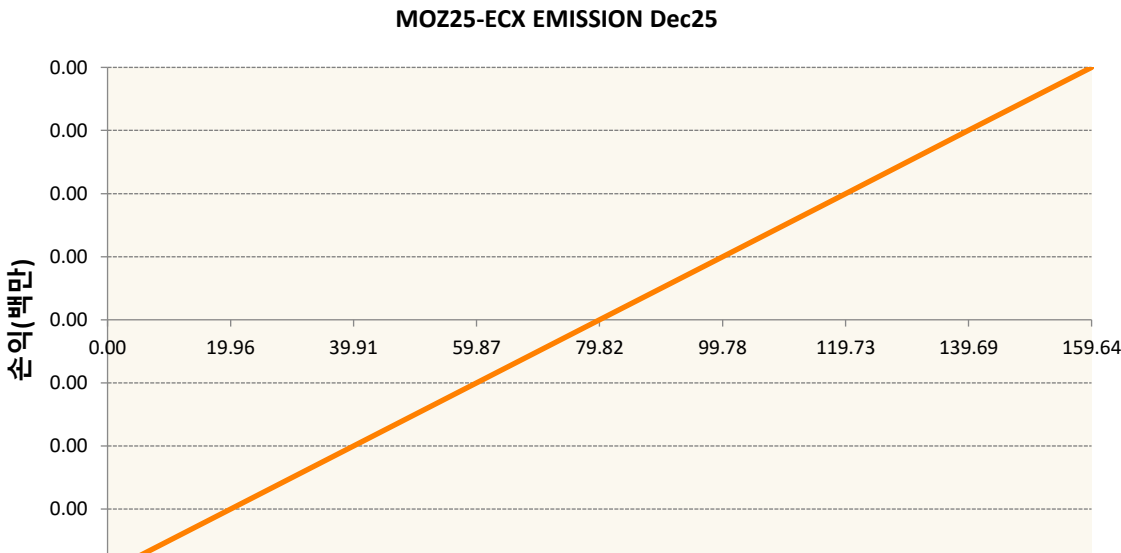
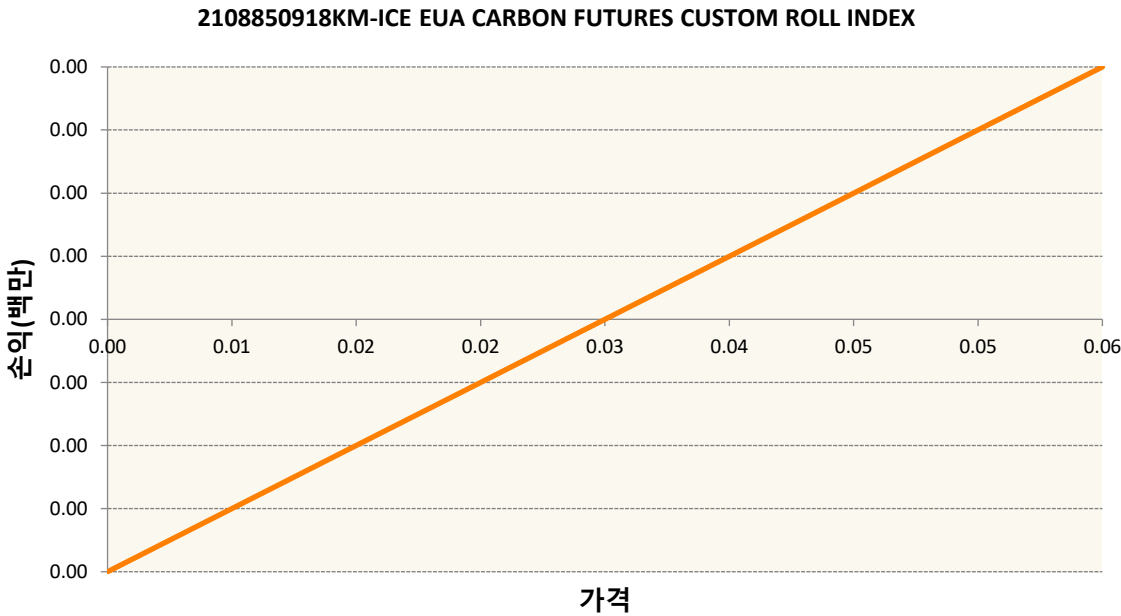
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 6,007 | 0     | 6,007     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 12    | 0     | 12        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,292 | -2,292    | 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                       | 481 |

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

(단위:백만원)

765

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

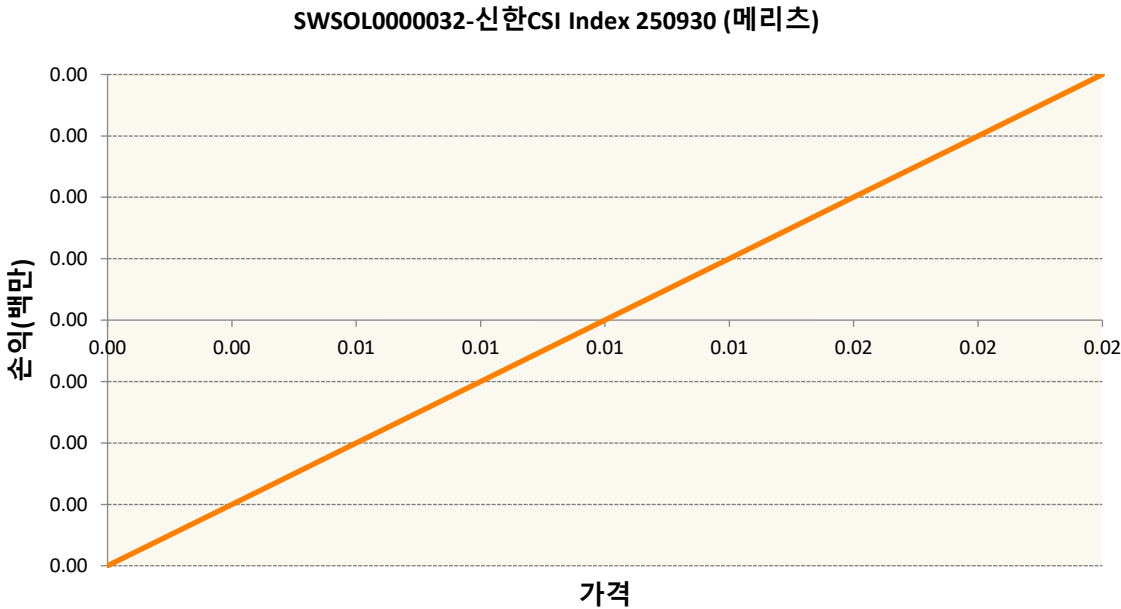
## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 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   | 2,521 | 0     | 2,521     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                |      |
|------------------------------------------------|------|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 1    |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 0.44 |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 0.44 |
| SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)            | 1    |

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

(단위:백만원)

|   |
|---|
| 5 |
|---|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

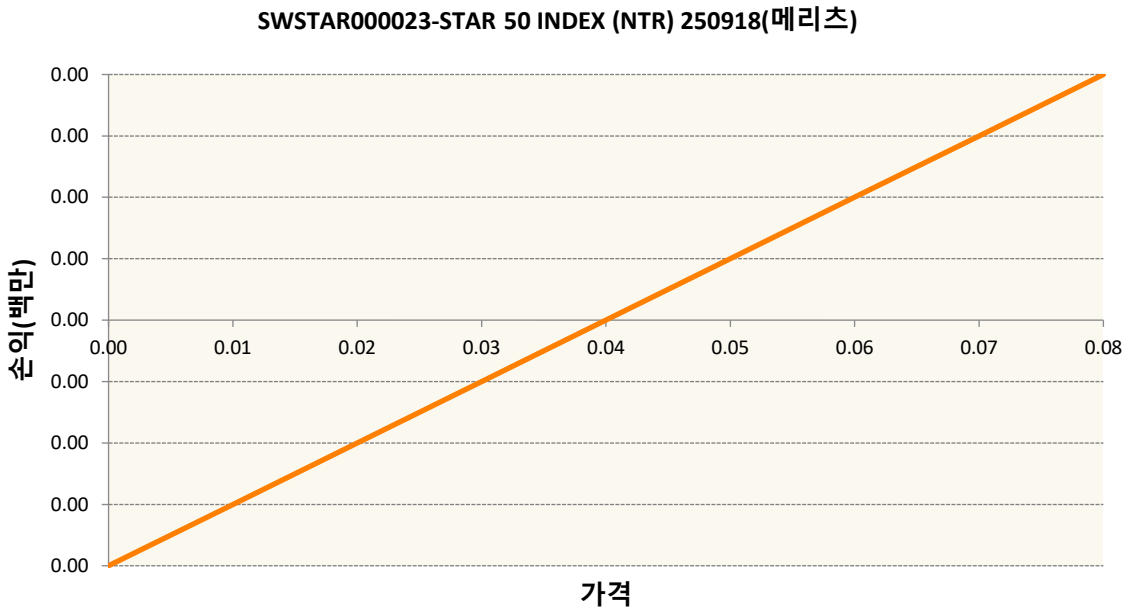
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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   | 3,611 | 0     | 3,611     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                            |    |
|--------------------------------------------|----|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)     | 8  |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)     | 2  |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠) | 31 |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)  | 4  |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠) | 26 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 129 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

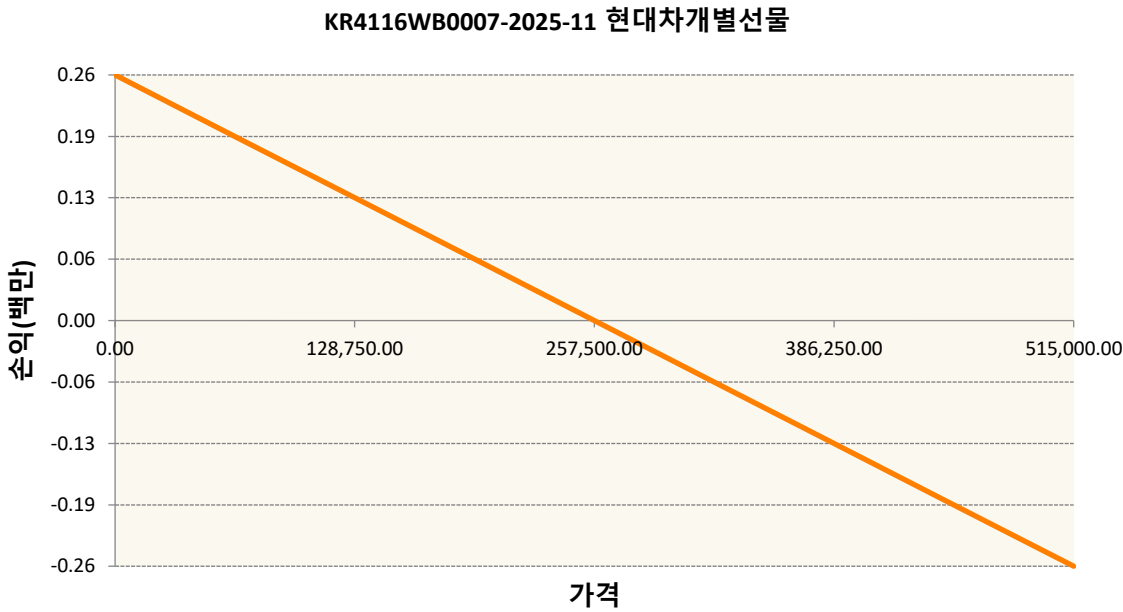
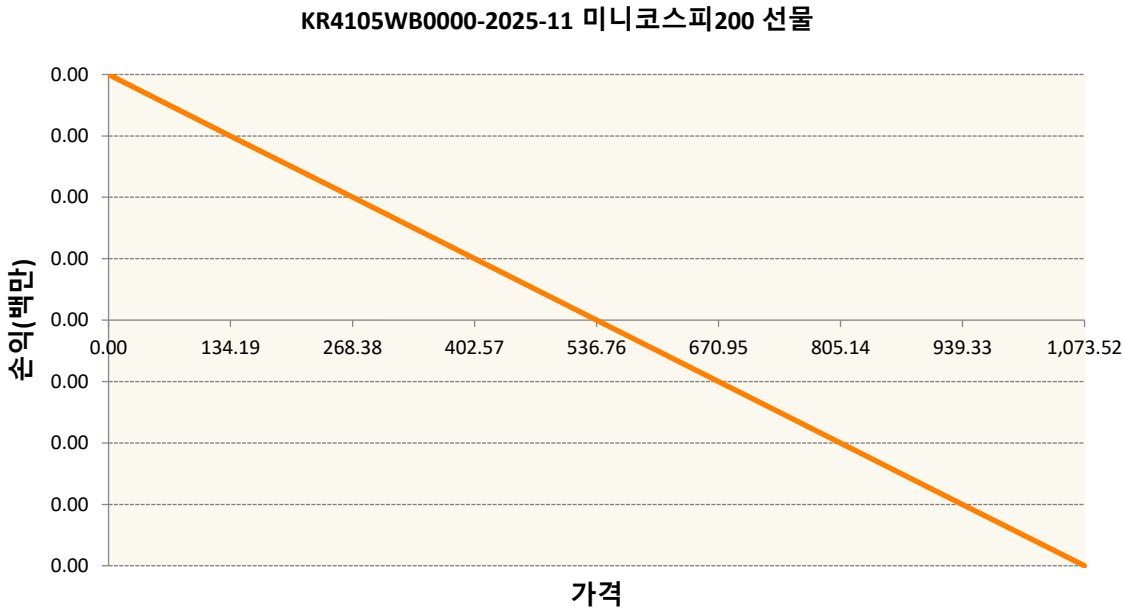
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

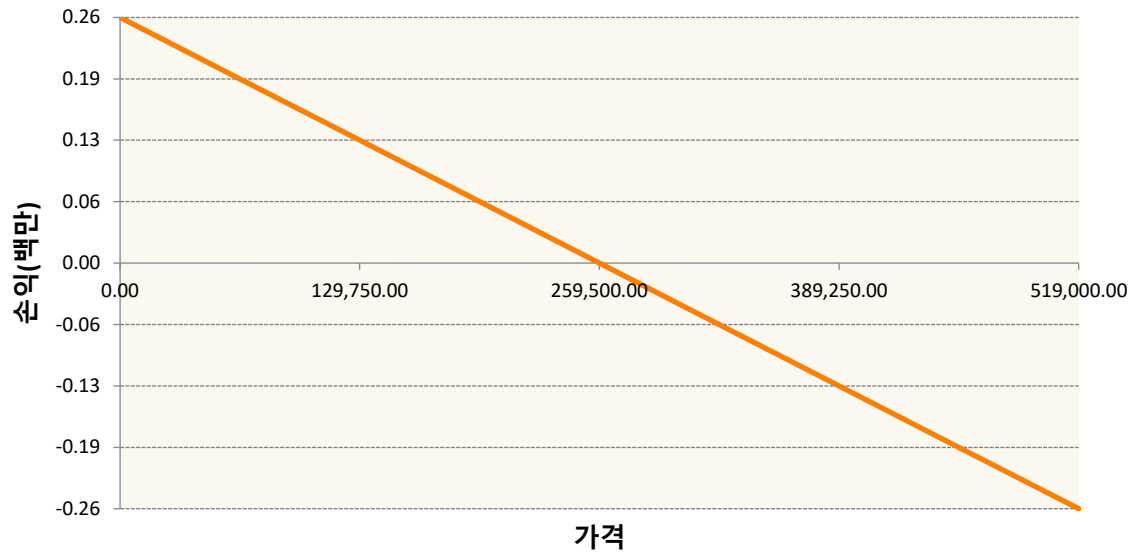
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 26    | 867   | -840      | 장내 |

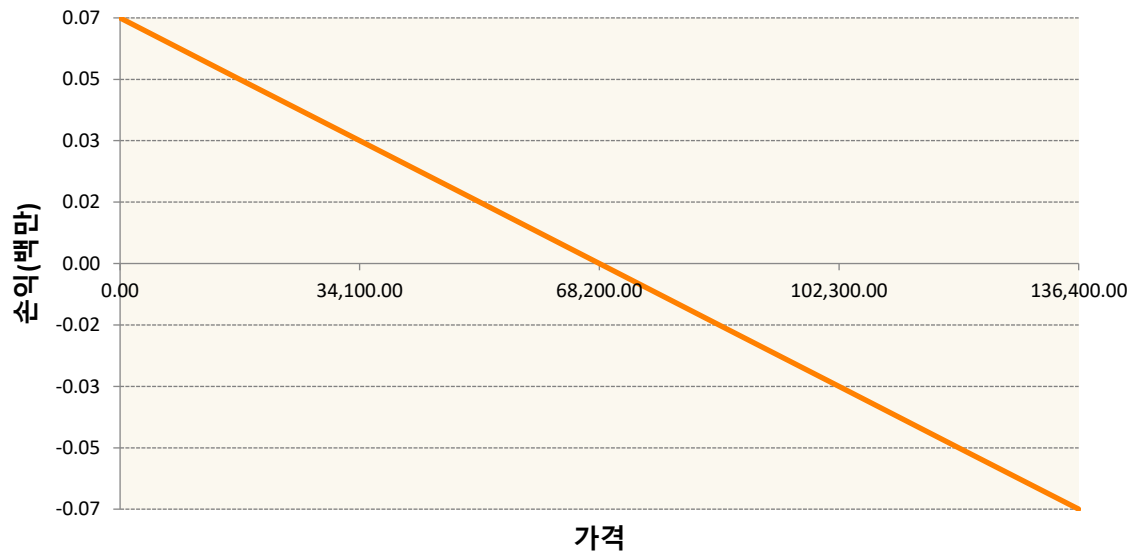
### 2. 만기시점의 손익구조



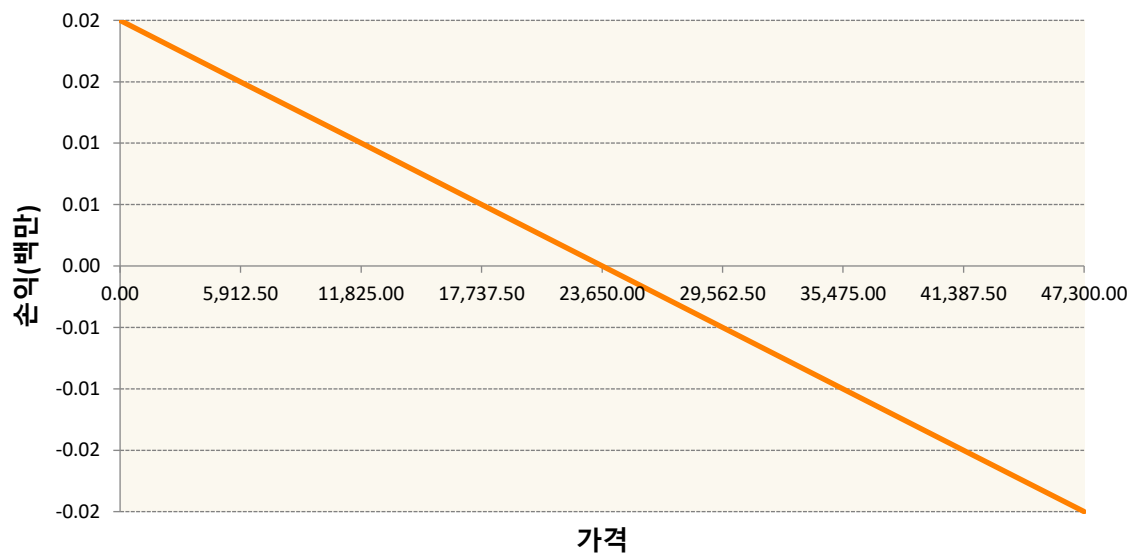
KR4122WB0009-2025-11 삼성SDI개별선물



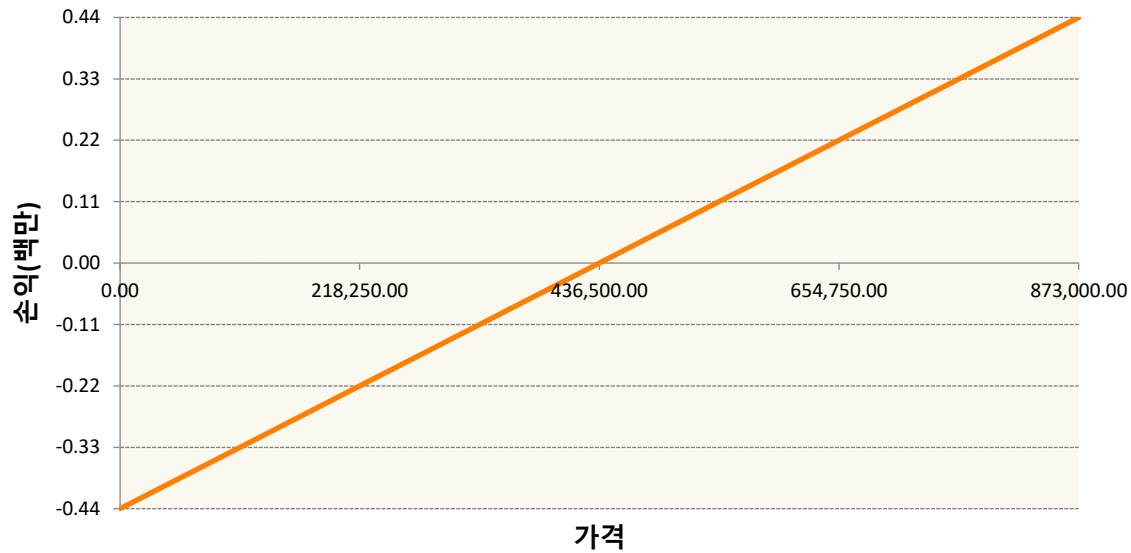
KR41B2WB0009-2025-11 S-Oil개별선물



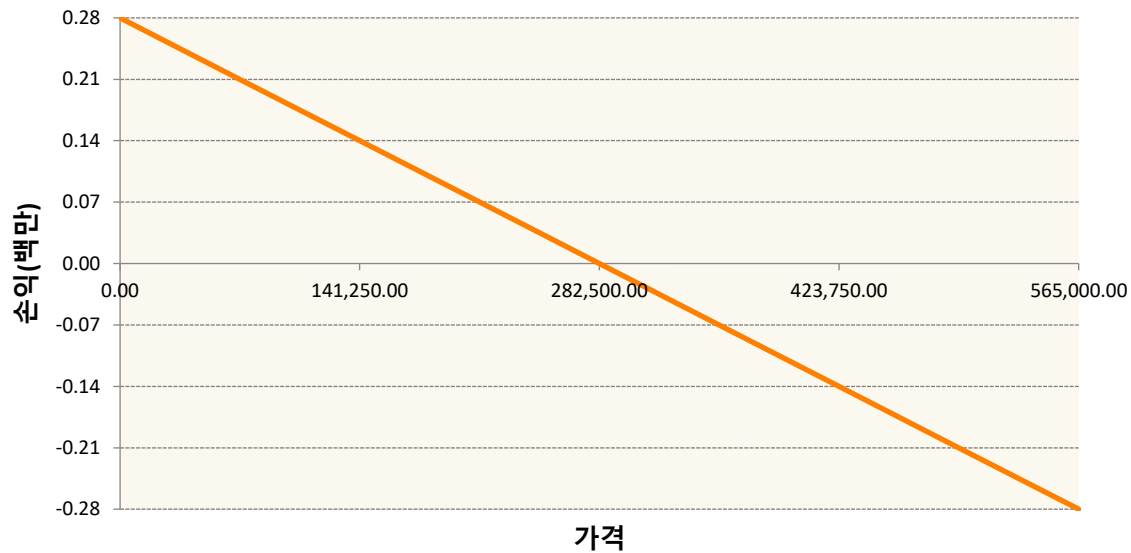
KR41BFWB0005-2025-11 삼성중공업개별선물



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      | 0.45 |

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

(단위:백만원)

9

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

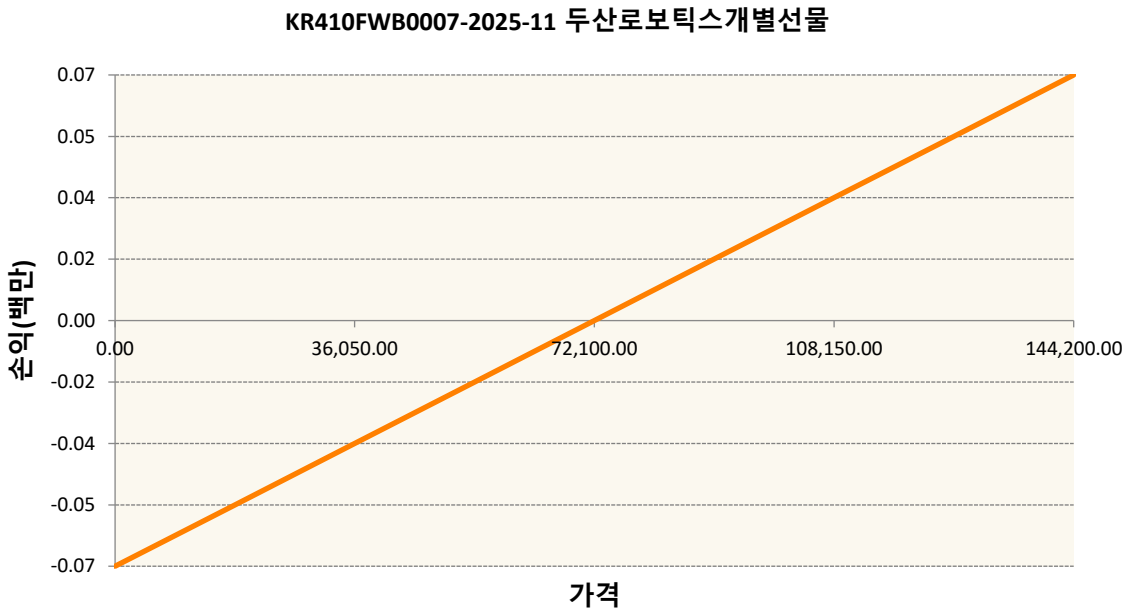
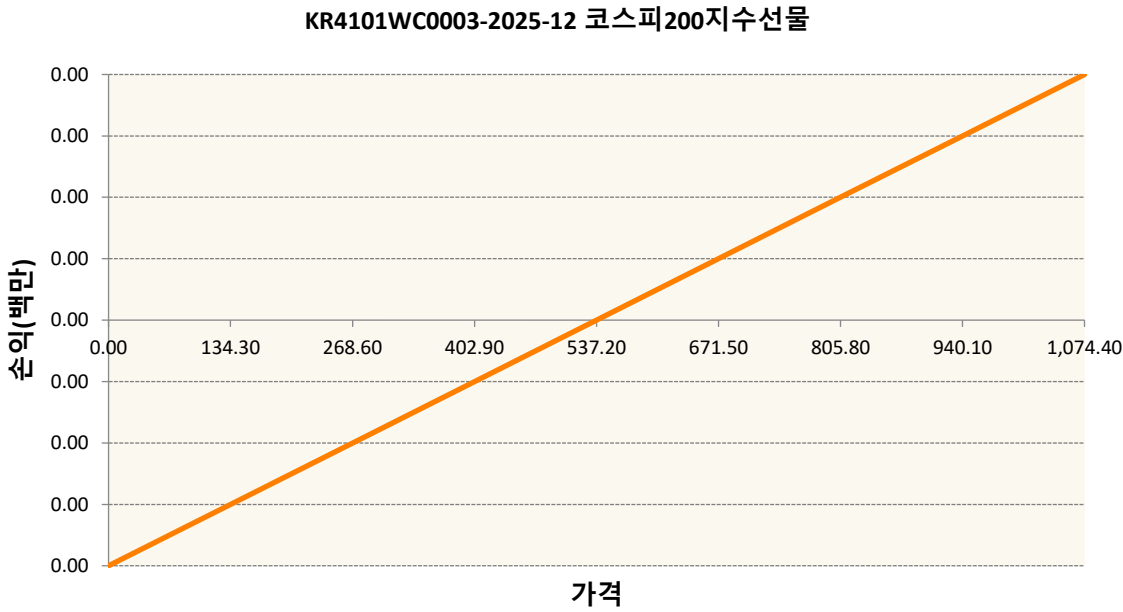
## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 1. 계약금액

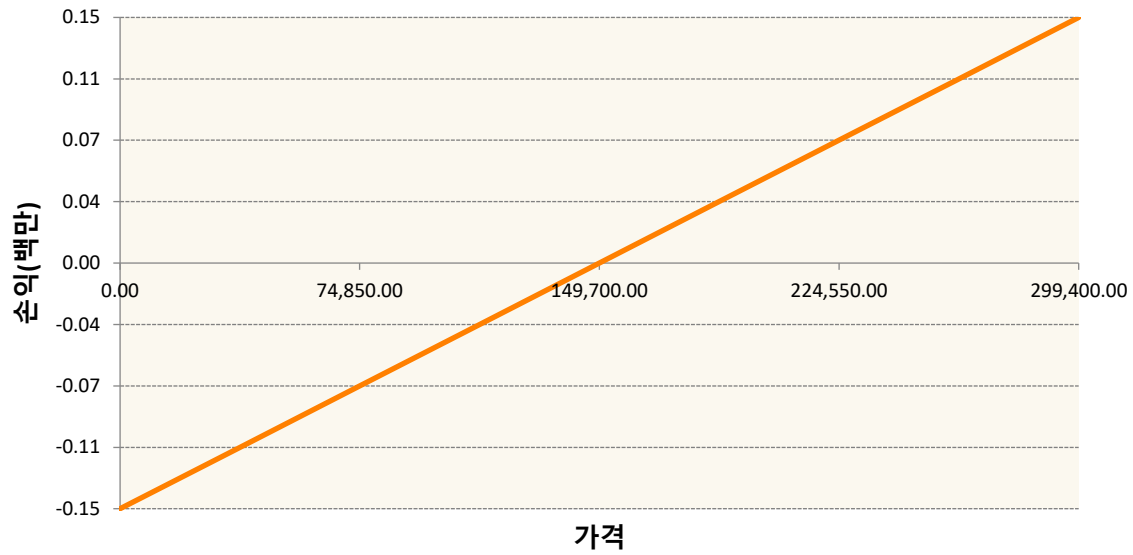
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 1,481 | 406   | 1,075     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 7,020 | 0     | 7,020     | 장내 |

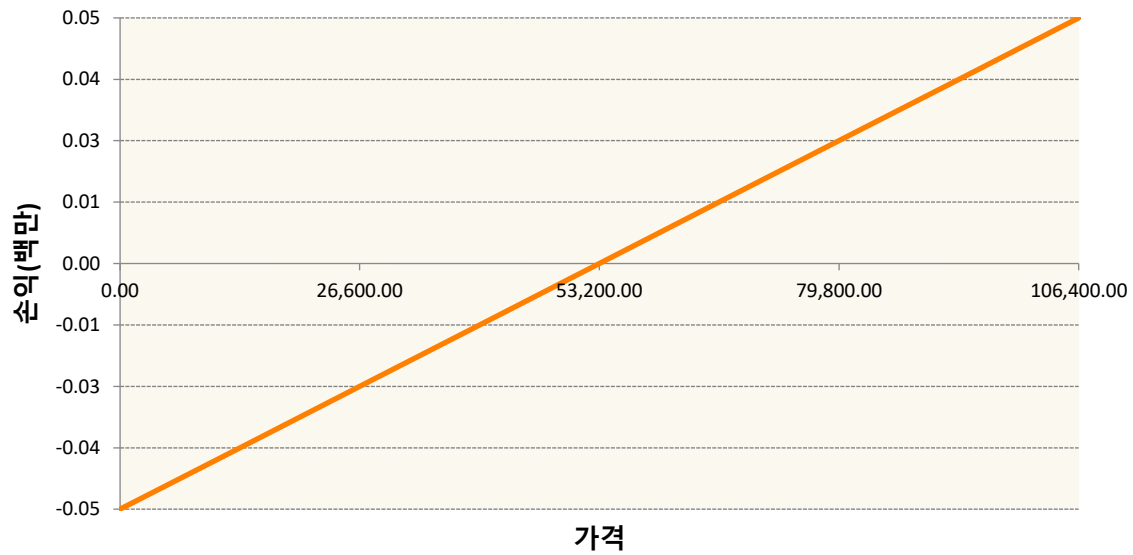
### 2. 만기시점의 손익구조



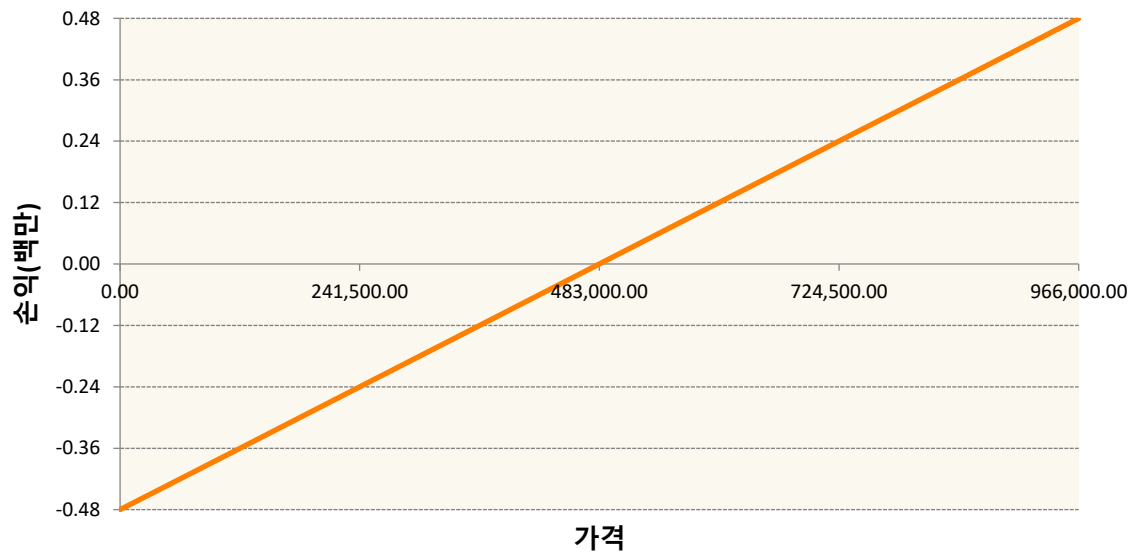
KR410ZWB0003-2025-11 한미반도체개별선물



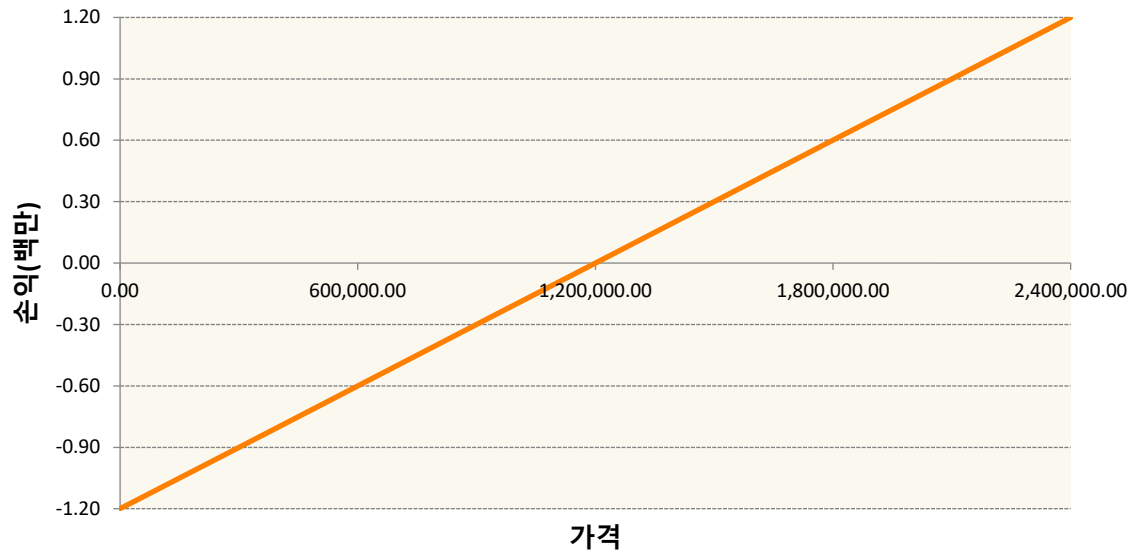
KR411RWB0002-2025-11 한화비전개별선물



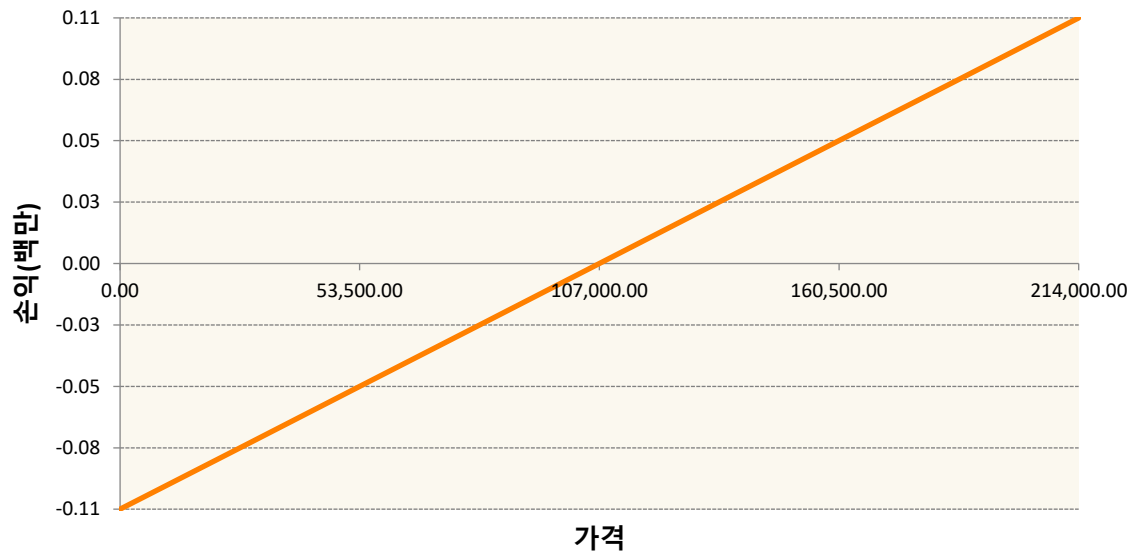
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



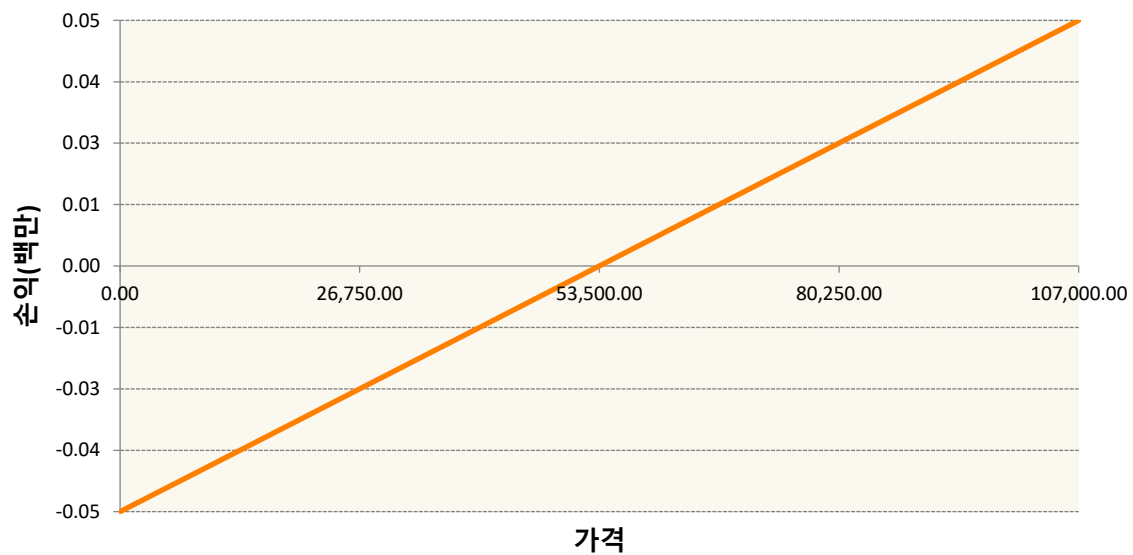
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



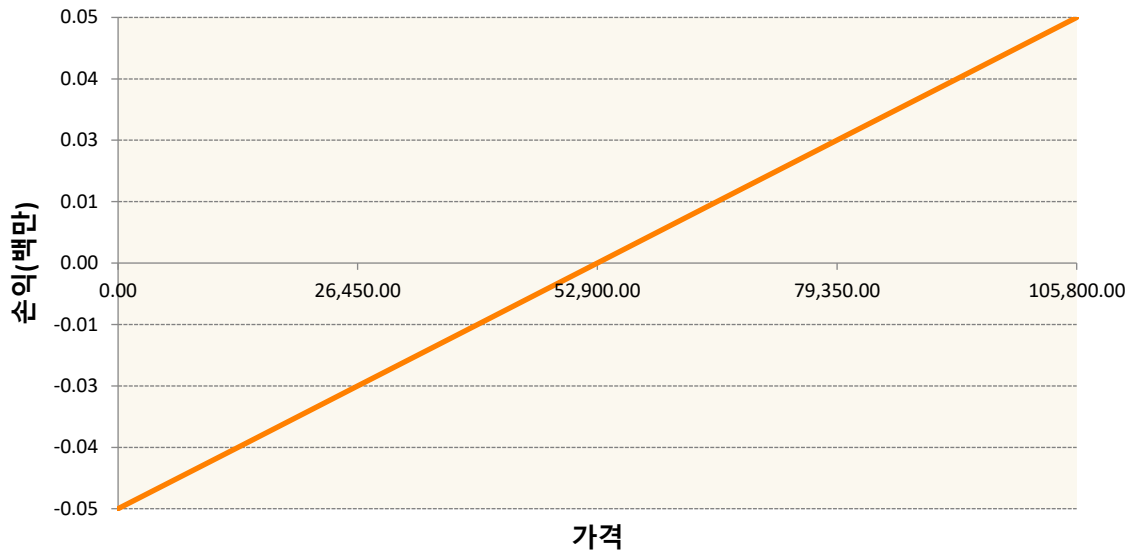
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



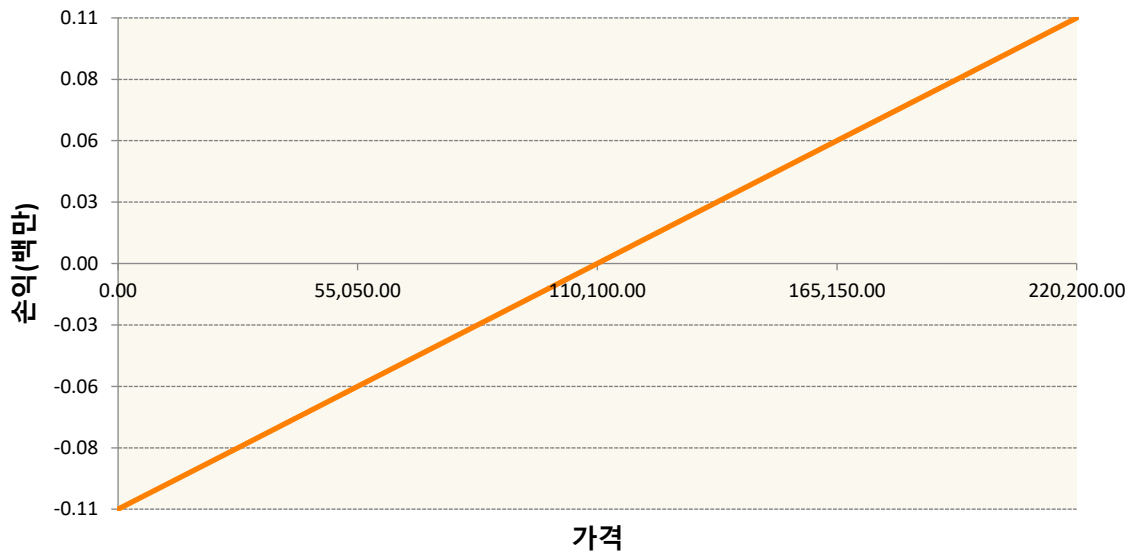
KR41EVWB0002-2025-11 한화시스템개별선물



KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| KR4101WC0( 2025-12 코스피200지수선물 | 258 |
| KR410FWB0( 2025-11 두산로보틱스개별선물 | 16  |
| KR410ZWB0( 2025-11 한미반도체개별선물  | 72  |
| KR411RWB0( 2025-11 한화비전개별선물   | 4   |
| KR4150WB0( 2025-11 SK하이닉스개별선물 | 21  |
| KR41B3WB0( 2025-11 고려아연개별선물   | 81  |
| KR41EJWB0( 2025-11 SKC개별선물    | 22  |
| KR41EVWB0( 2025-11 한화시스템개별선물  | 42  |
| KR41F7WB0( 2025-11 카카오페이개별선물  | 15  |
| KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물    | 31  |

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

(단위:백만원)

1,056

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

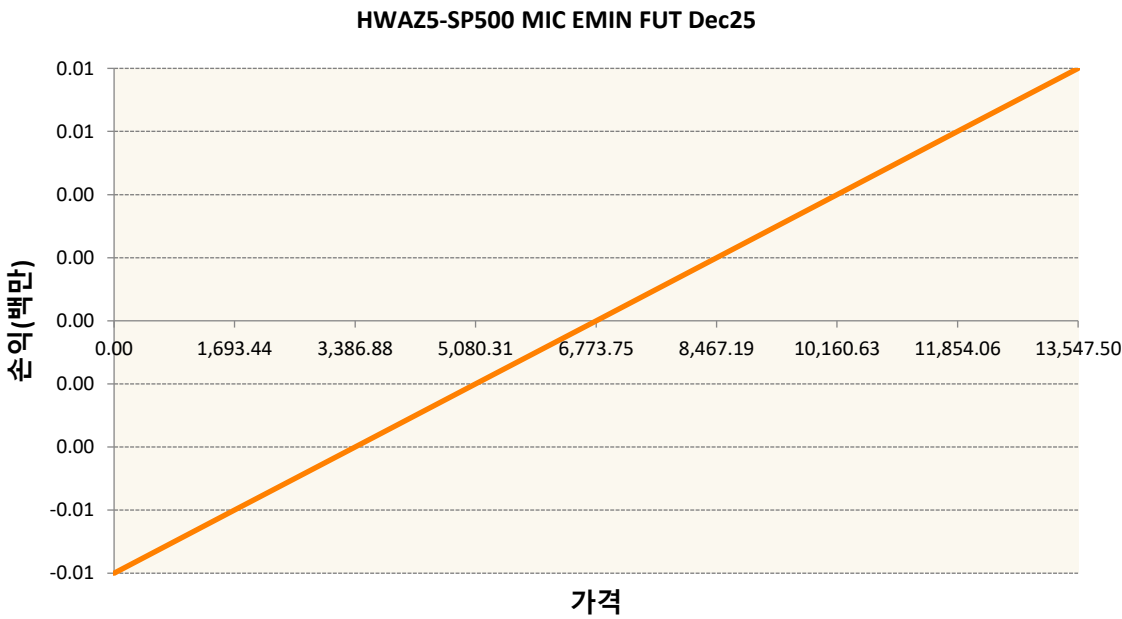
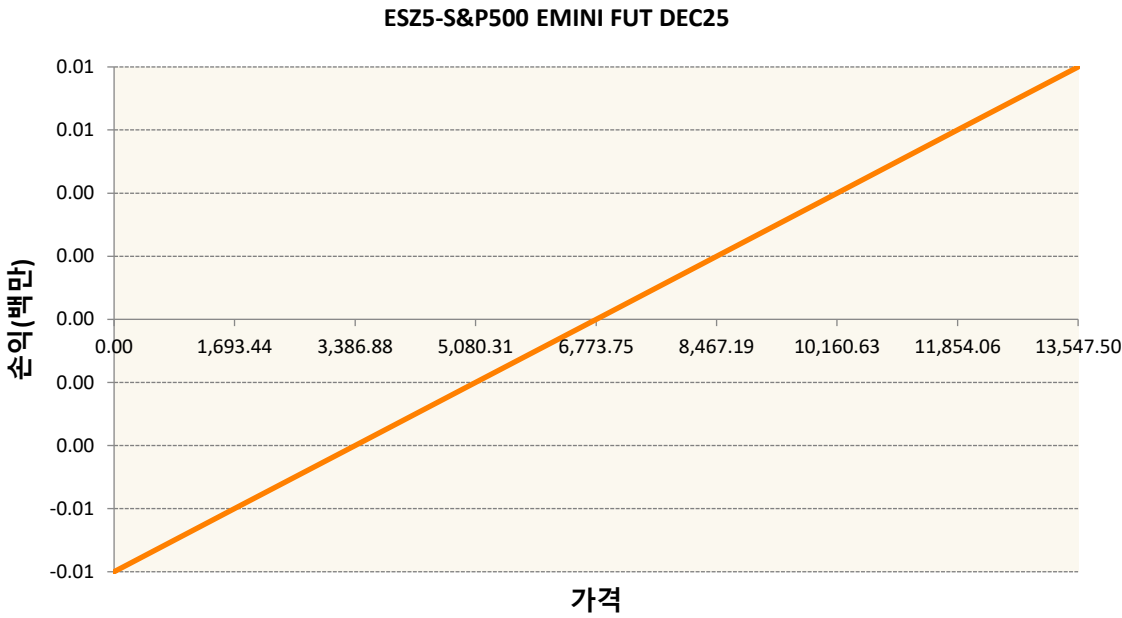
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 38,581 | 0     | 38,581    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,270  | 0     | 1,270     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ5                      | S&P500 EMINI FUT DEC25   | 3,087    |
| HWAZ5                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec25 | 102      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 4,557    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

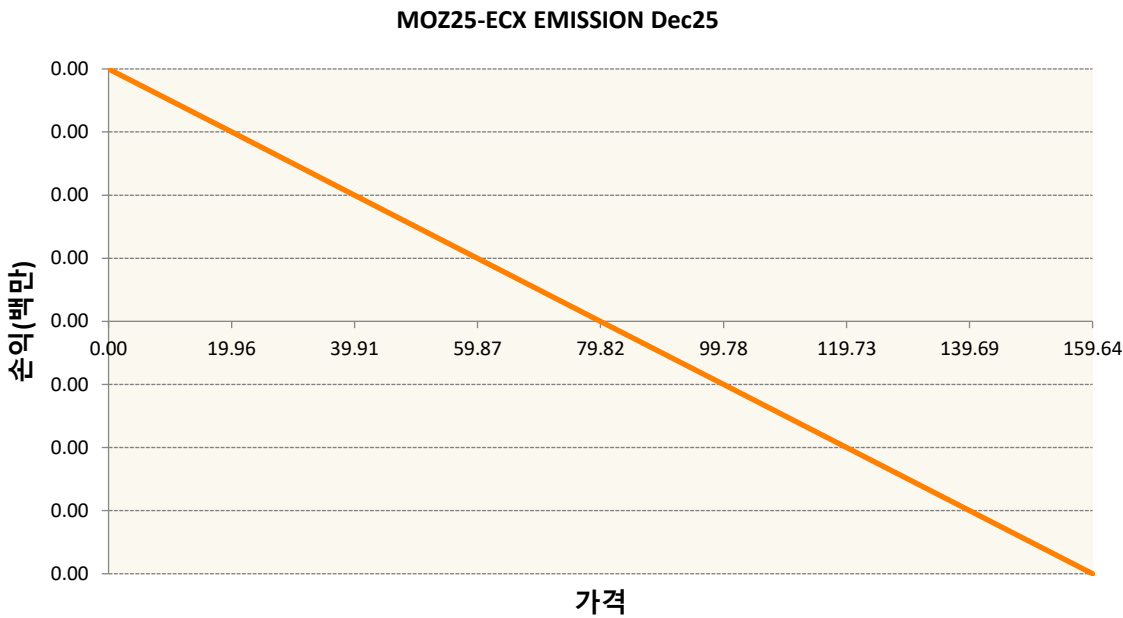
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 2,952 | -2,952    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | -12   | 0     | -12       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 83    | 1,235 | -1,152    | 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                        | 236 |

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

(단위:백만원)

387

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

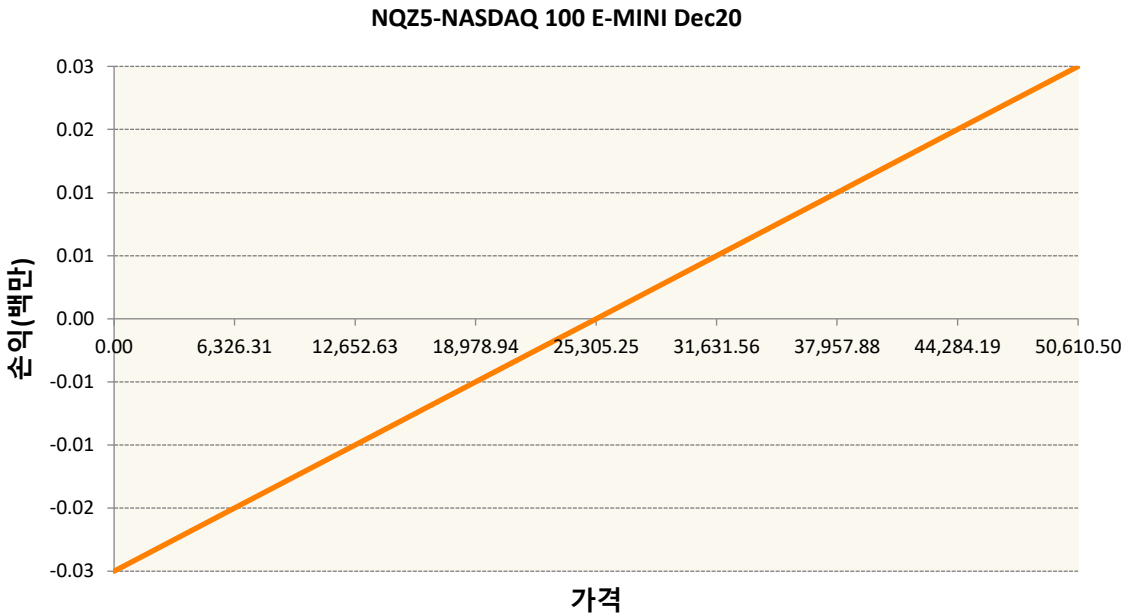
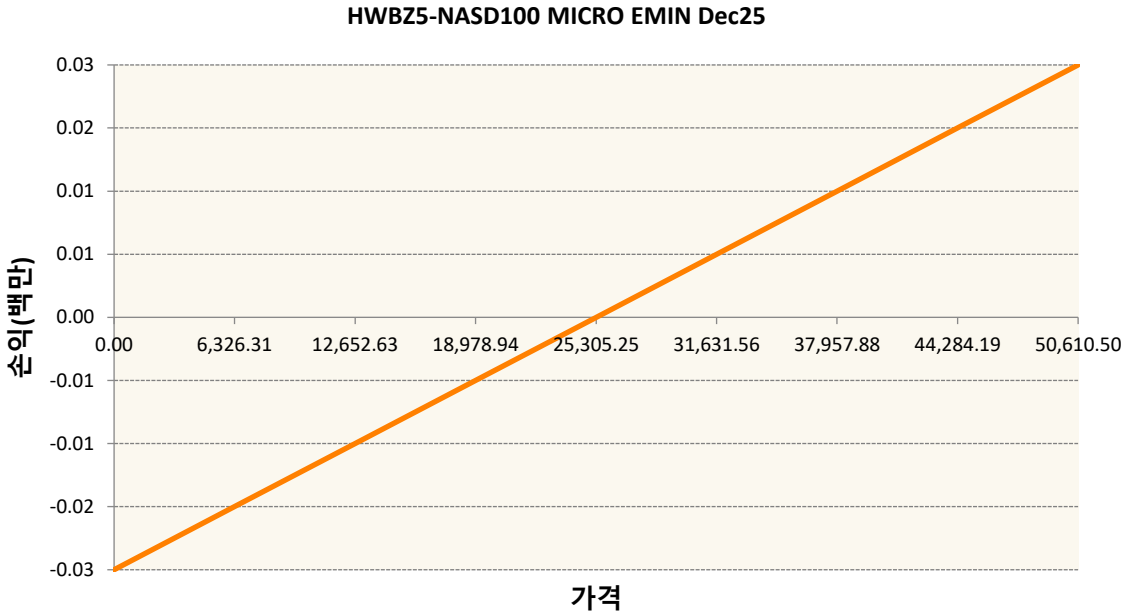
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 18,331 | 0     | 18,331    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,689  | 0     | 1,689     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| HWBZ5                     | NASD100 MICRO EMIN Dec25 | 135      |
| NQZ5                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  | 1,466    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,768    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

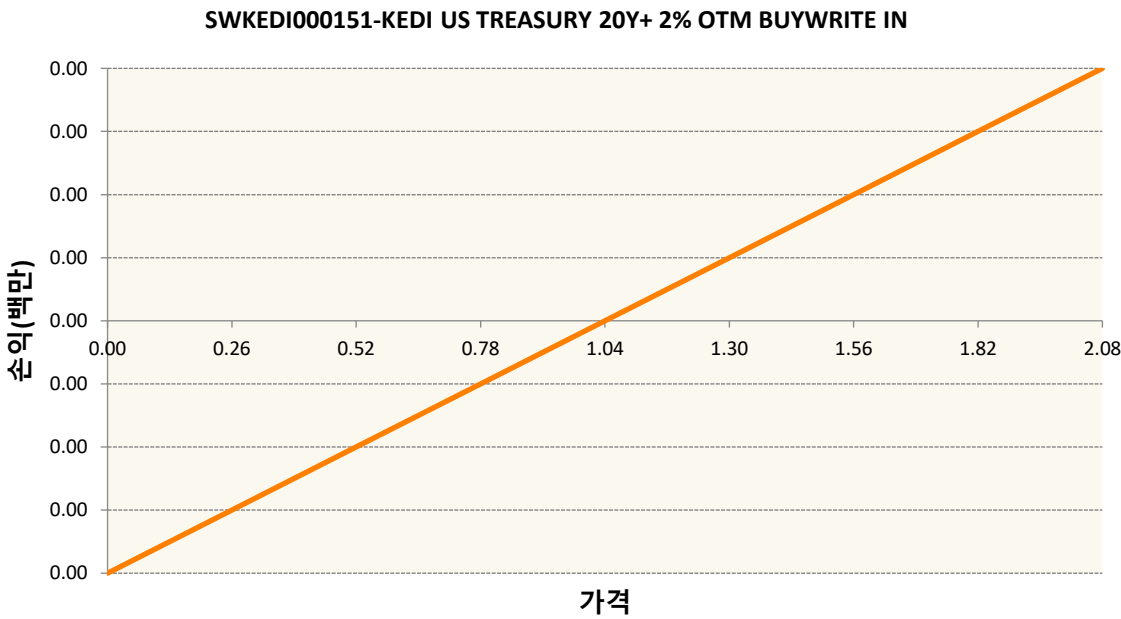
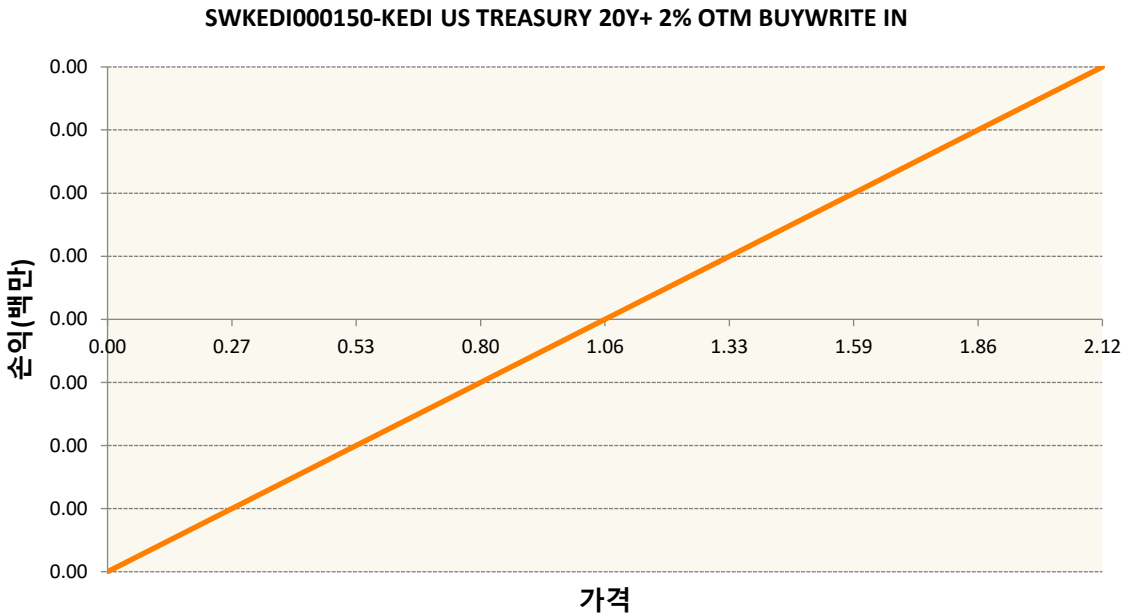
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

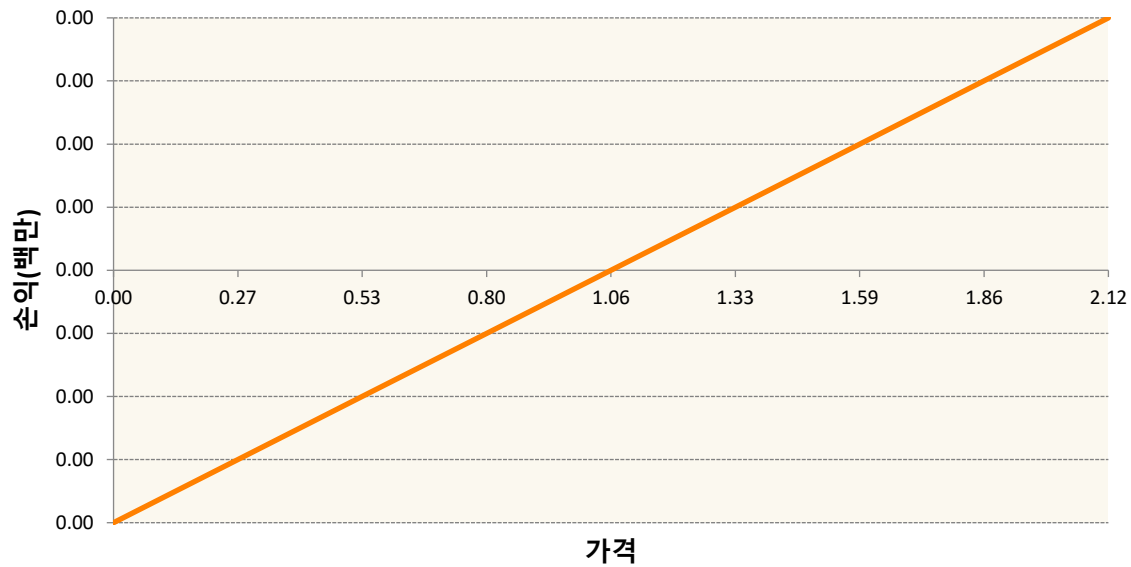
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 377,672 | 0     | 377,672   | 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

|        |
|--------|
| 8,552  |
| 8,113  |
| 3,765  |
| 10,165 |

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

(단위:백만원)

|        |
|--------|
| 14,807 |
|--------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

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)

|    |
|----|
| 30 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-10-22 |
| 기준일 | 2025-10-21 |

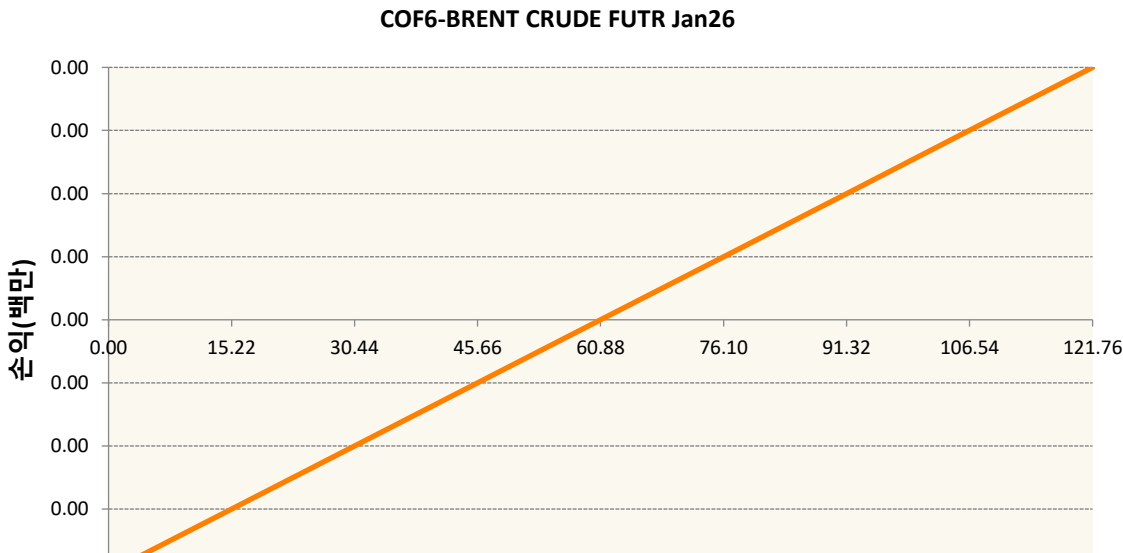
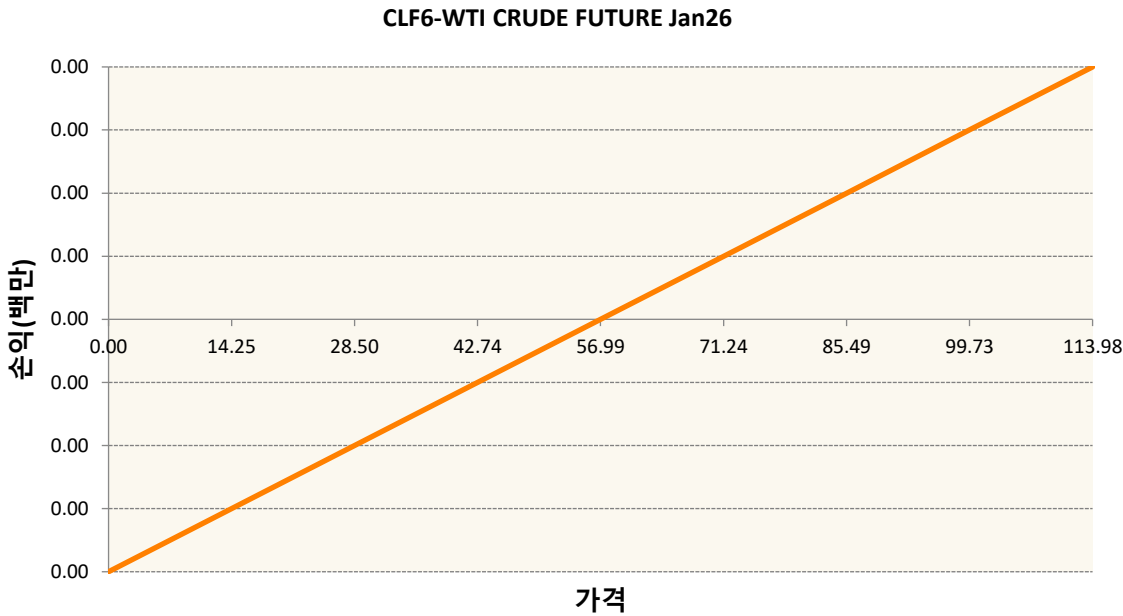
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

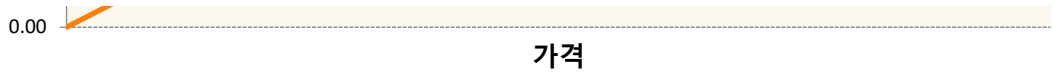
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

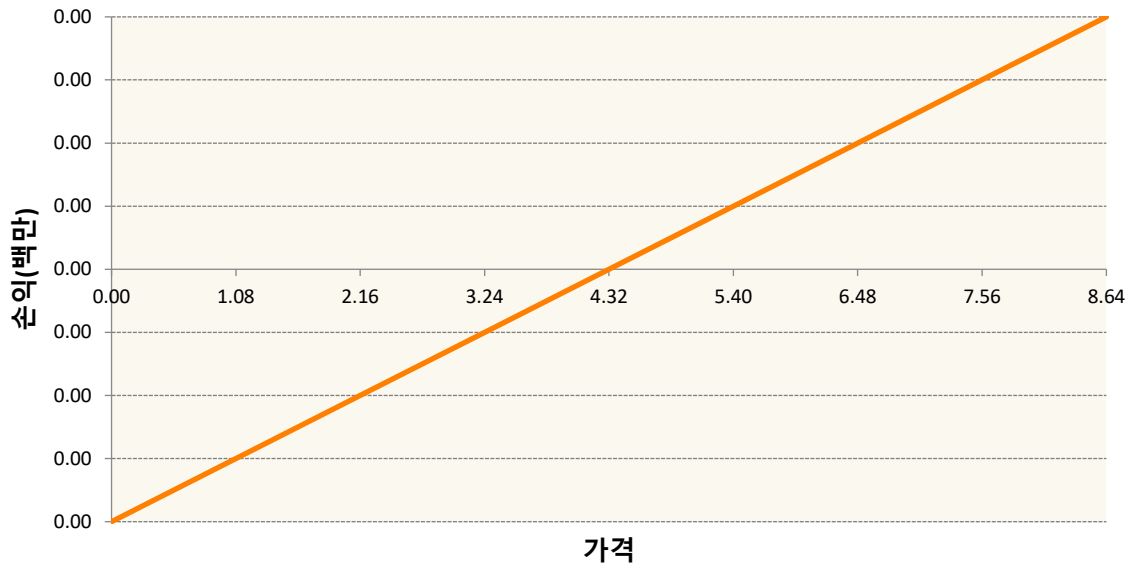
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 14    | -14       | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 338   | 0     | 338       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 169   | 0     | 169       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 86    | -86       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

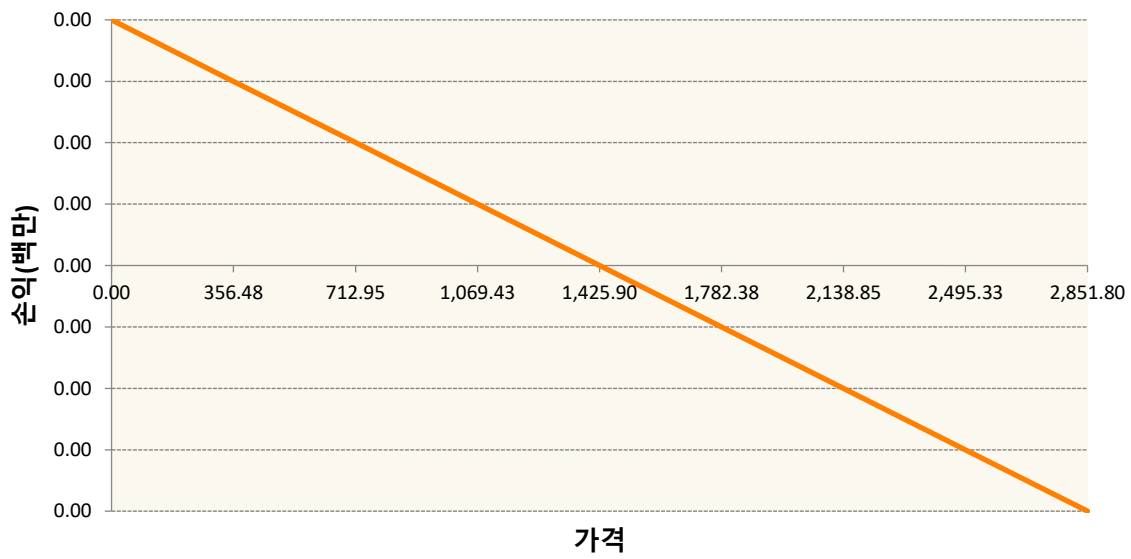




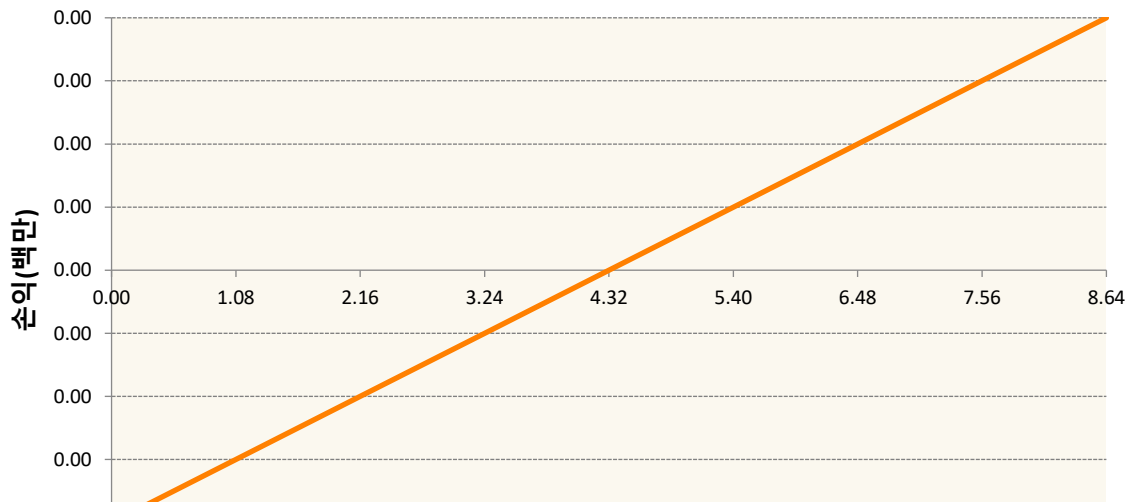
EOF6-E-MINI NATURAL GAS Jan26

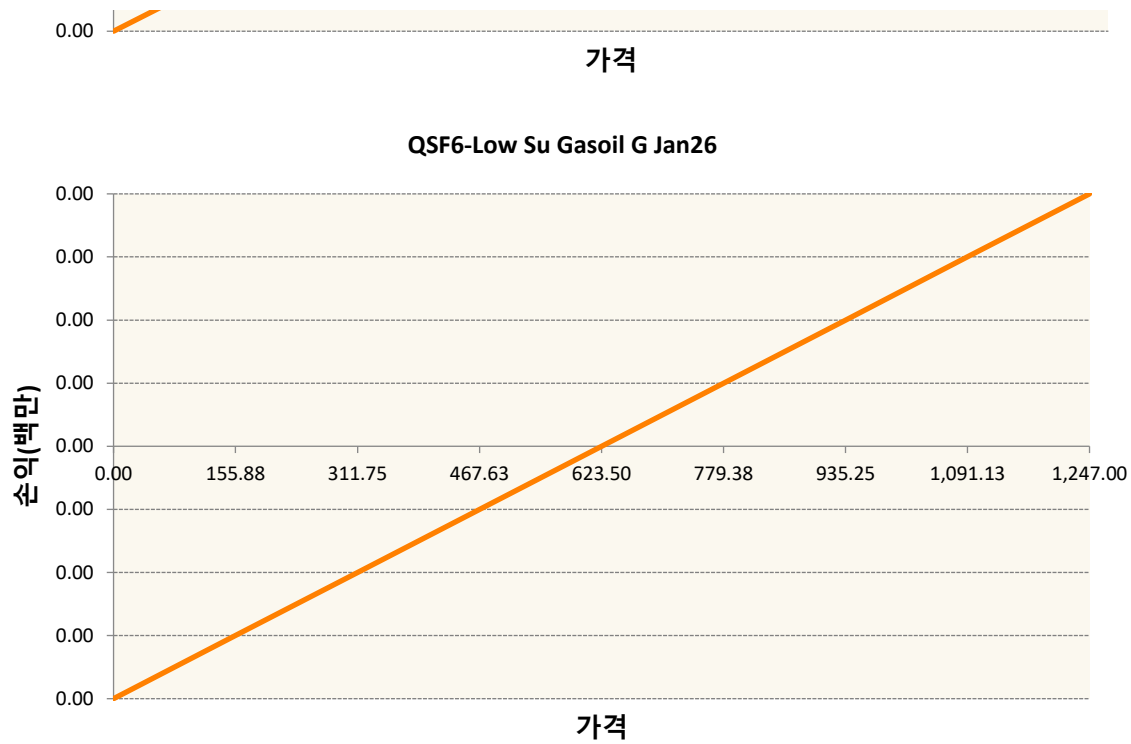


KR4175WB0005-2025-11 달러선물



NGF26-NATURAL GAS FUTR Jan26





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                        |                          |    |
|------------------------|--------------------------|----|
| CLF6                   | WTI CRUDE FUTURE Jan26   | 6  |
| COF6                   | BRENT CRUDE FUTR Jan26   | 14 |
| EOF6                   | E-MINI NATURAL GAS Jan26 | 4  |
| KR4175WB0(2025-11 달러선물 |                          | 7  |
| NGF26                  | NATURAL GAS FUTR Jan26   | 10 |
| QSF6                   | Low Su Gasoil G Jan26    | 7  |

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

(단위:백만원)

90