

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2025-10-31
기준일	2025-10-30

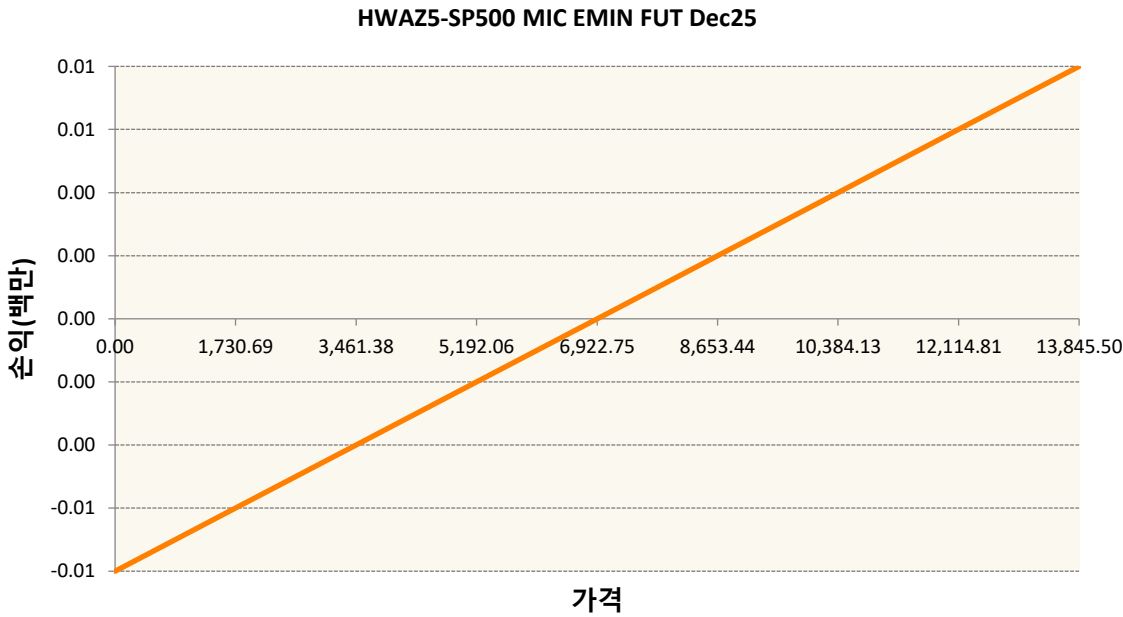
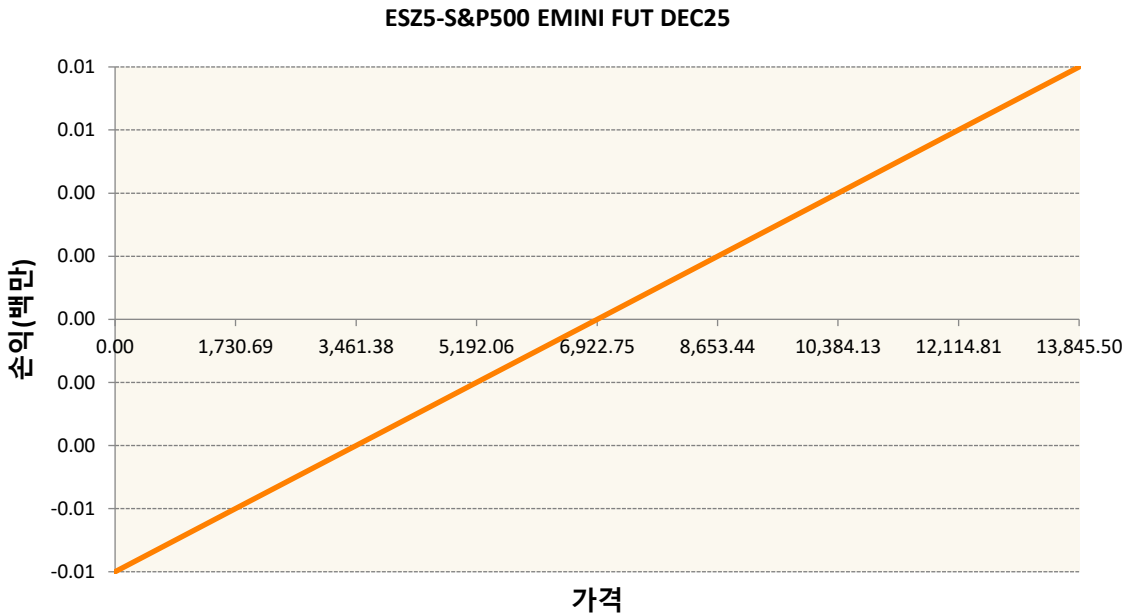
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	481	0	481	
누계	유가증권	선물	192	0	192	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)
	69

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

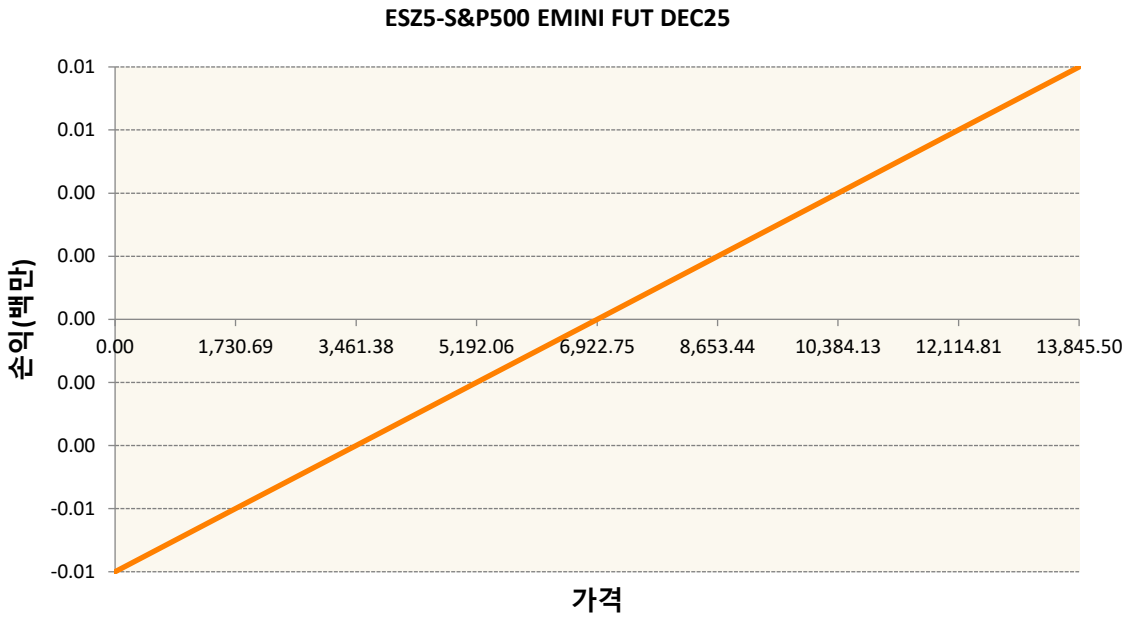
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,443	0	1,443	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	115
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

168

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

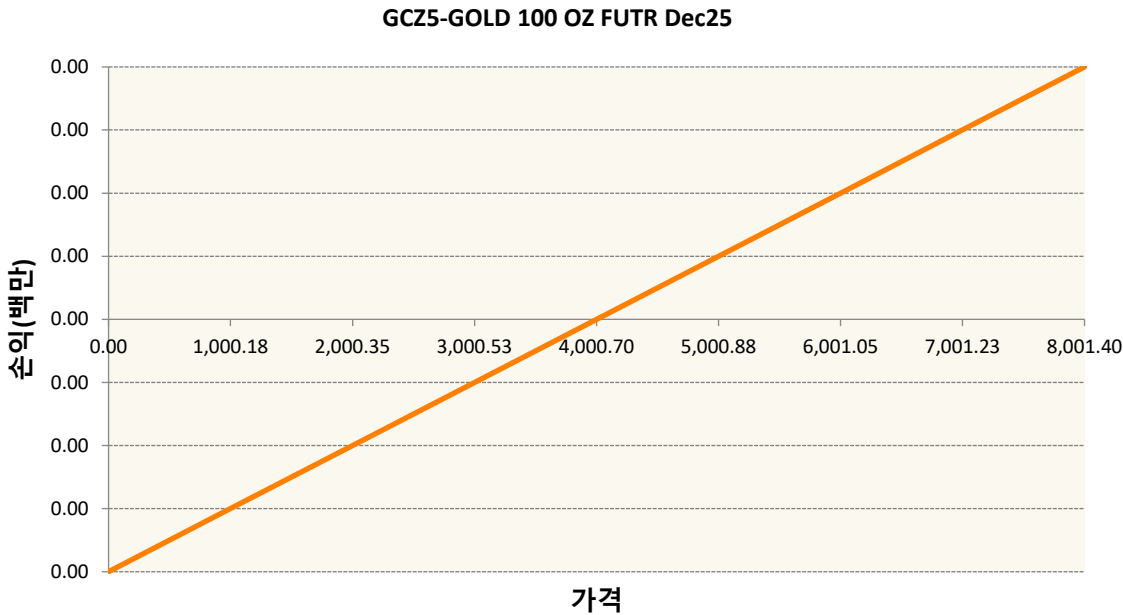
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
누계	실물자산	선물	3,367	0	3,367	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

GCZ5	GOLD 100 OZ FUTR Dec25	269
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

252

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

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)

AOPLTRUC1\$PLTR US 10/31/25 C187.5 EQUITY	108
AOPLTRUP1\$PLTR US 10/31/25 P187.5 EQUITY	60

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

(단위:백만원)

672

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

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)

AOTLTUSCC!TLT US 10/31/25 C92.5 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

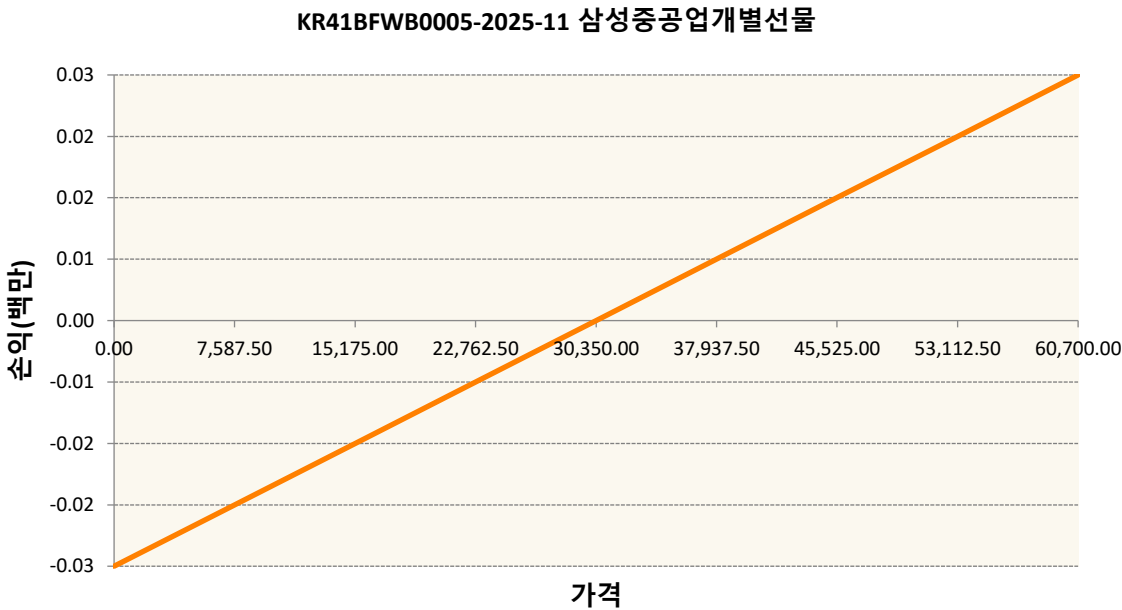
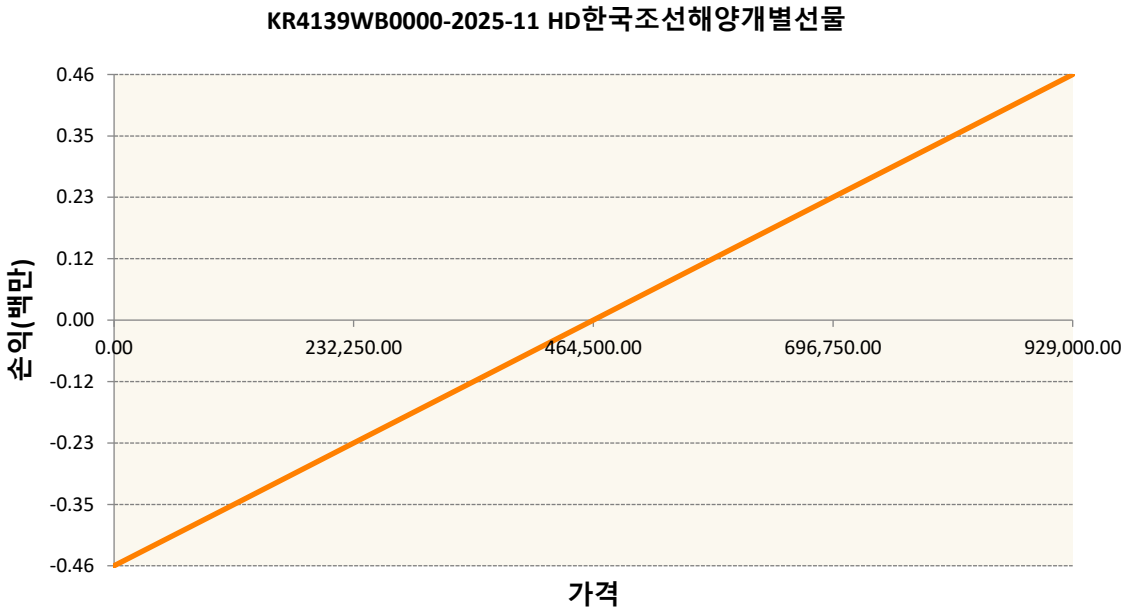
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

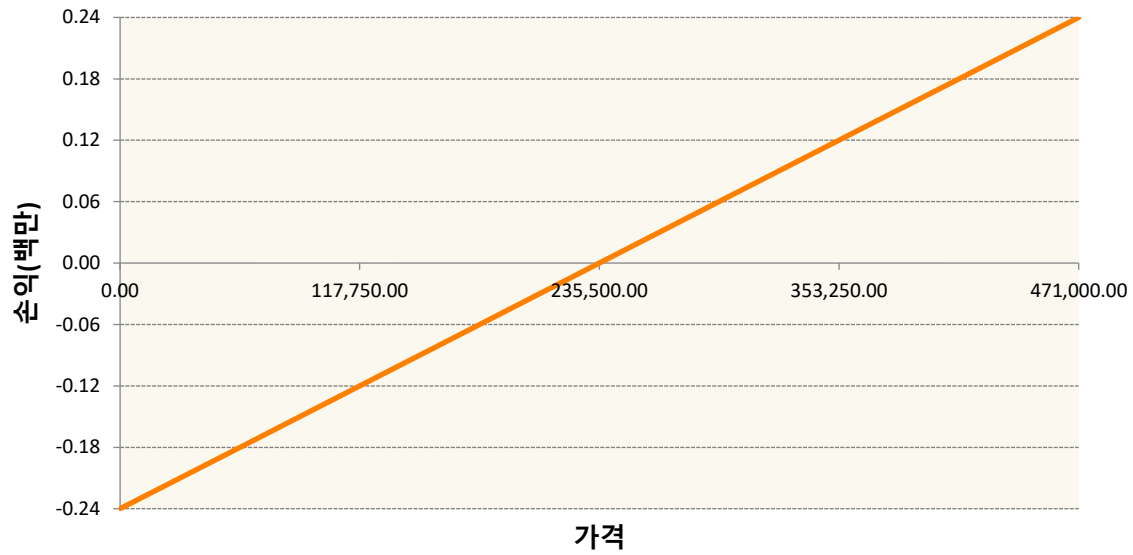
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	79	0	79	장내
누계	유가증권	선물	92,964	0	92,964	장내

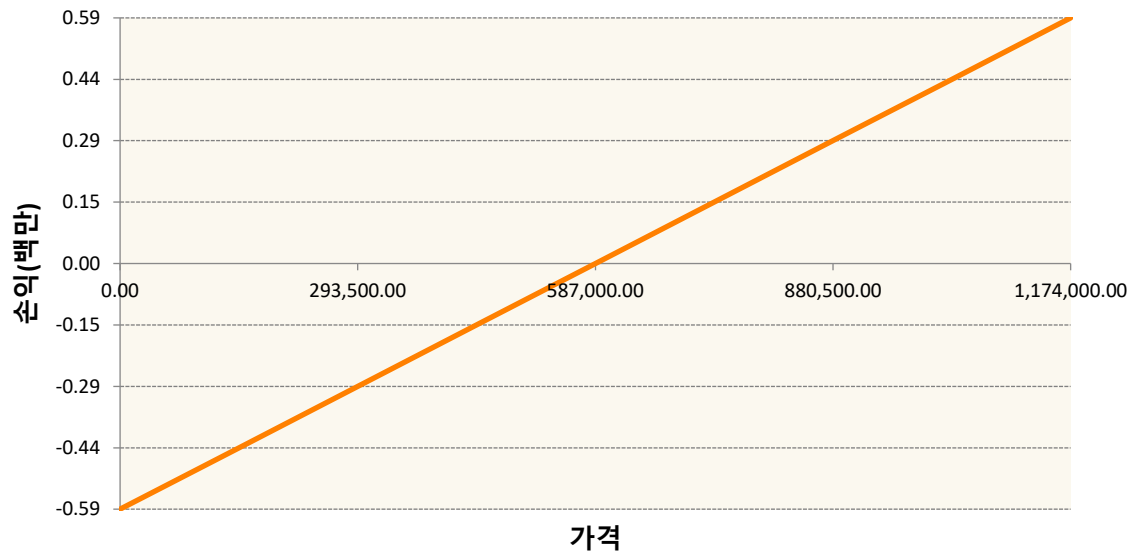
2. 만기시점의 손익구조



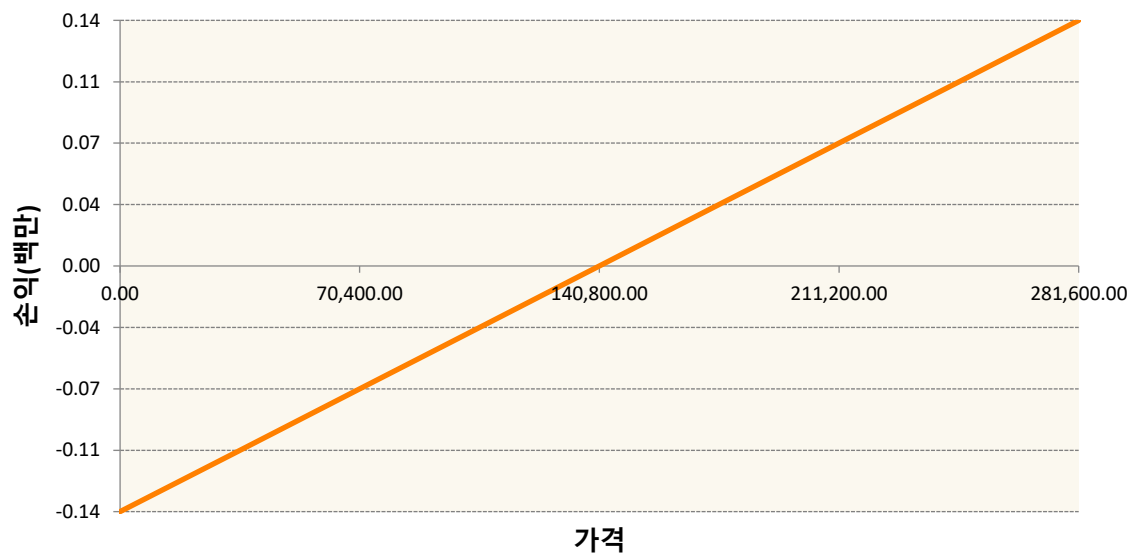
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



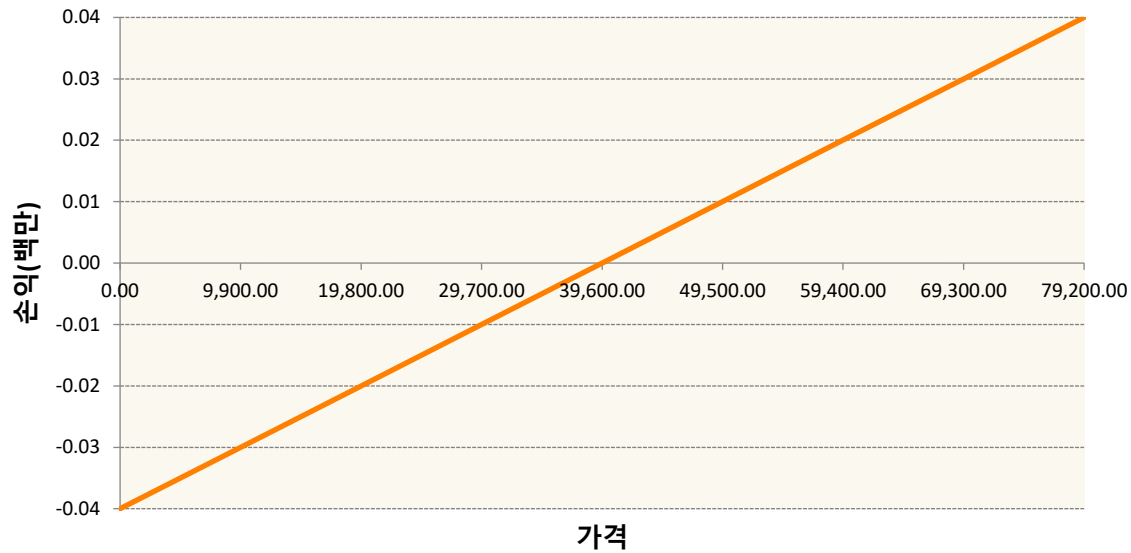
KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



KR41M7WC0000-2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4139WB0000 2025-11 HD한국조선해양개별선물 1,332							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332	-1,332
-5.33%	-888	-888	-888	-888	-888	-888	-888
-2.67%	-444	-444	-444	-444	-444	-444	-444
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	444	444	444	444	444	444	444
5.33%	888	888	888	888	888	888	888
8.00%	1,332	1,332	1,332	1,332	1,332	1,332	1,332
KR41BFWB0005 2025-11 삼성중공업개별선물 1,501							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501	-1,501
-5.33%	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001	-1,001
-2.67%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	500	500	500	500	500	500	500
5.33%	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001	1,001
8.00%	1,501	1,501	1,501	1,501	1,501	1,501	1,501
KR41CDWB0006 2025-11 HD현대미포개별선물 538							
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-538	-538	-538	-538	-538	-538	-538
-5.33%	-359	-359	-359	-359	-359	-359	-359
-2.67%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	179	179	179	179	179	179	179
5.33%	359	359	359	359	359	359	359
8.00%	538	538	538	538	538	538	538
KR41FDWB0003 2025-11 HD현대중공업개별선물							704
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-704	-704	-704	-704	-704	-704	-704
-5.33%	-469	-469	-469	-469	-469	-469	-469
-2.67%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	235	235	235	235	235	235	235
5.33%	469	469	469	469	469	469	469
8.00%	704	704	704	704	704	704	704
KR41FVWB0001 2025-11 한화오션개별선물							1,149
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149
-5.33%	-766	-766	-766	-766	-766	-766	-766
-2.67%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	383	383	383	383	383	383	383
5.33%	766	766	766	766	766	766	766
8.00%	1,149	1,149	1,149	1,149	1,149	1,149	1,149

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

(단위:백만원)

5,056

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

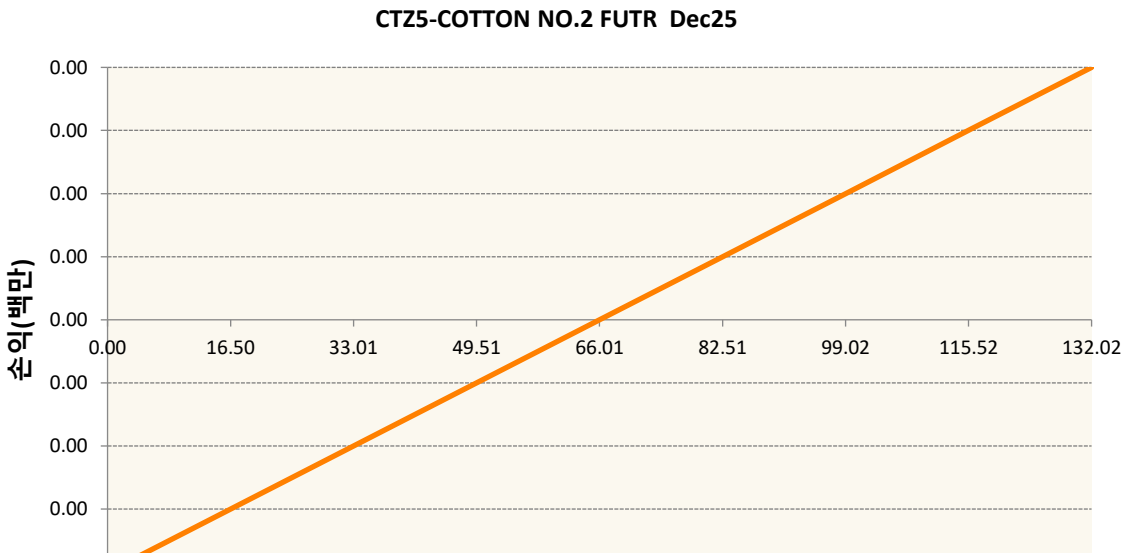
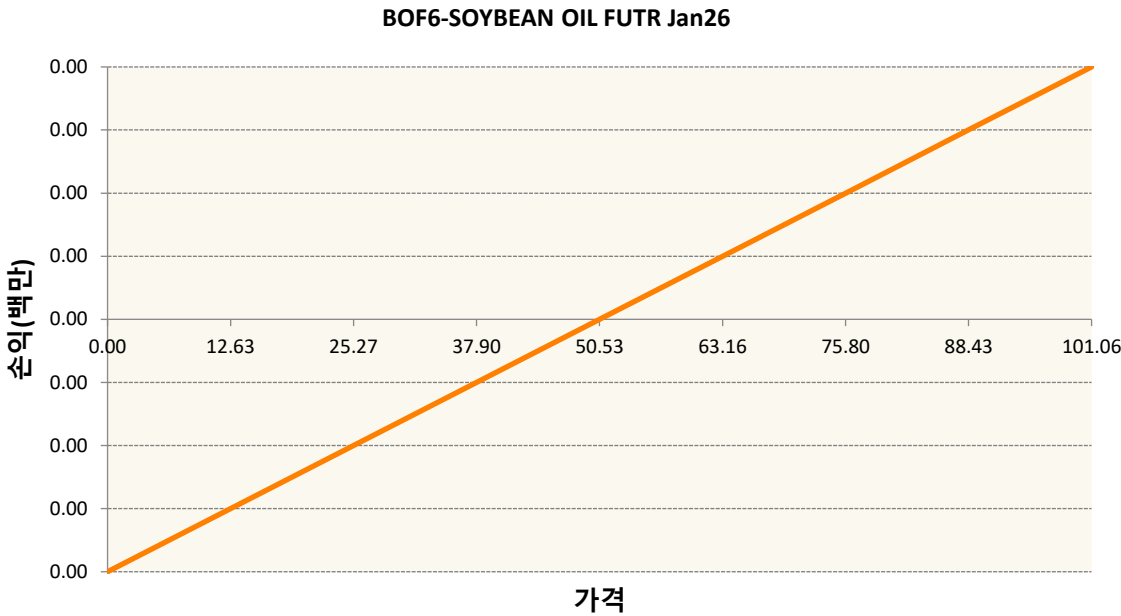
포커스농산물모(채권-파생형)

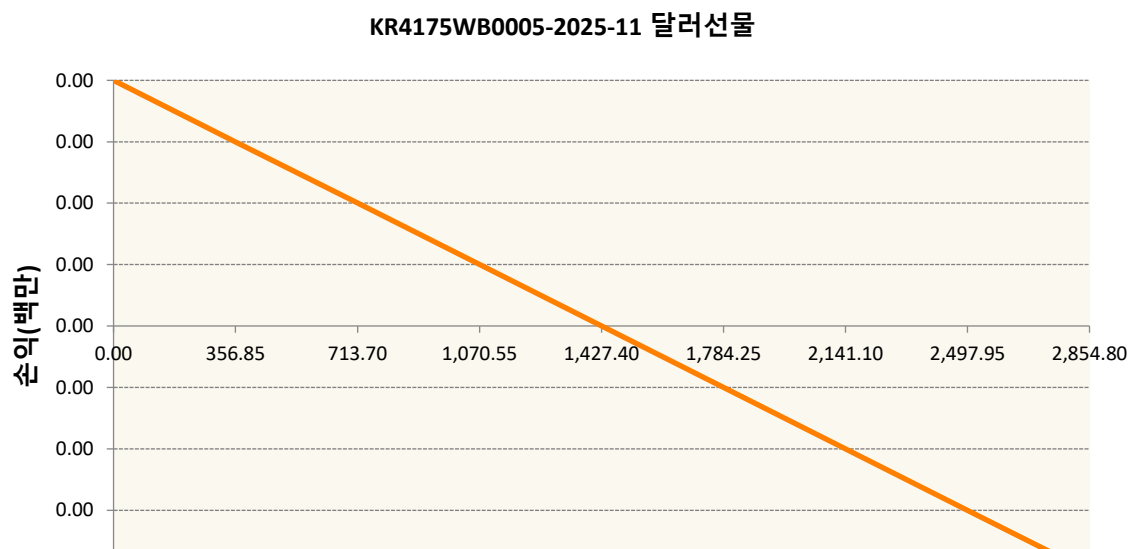
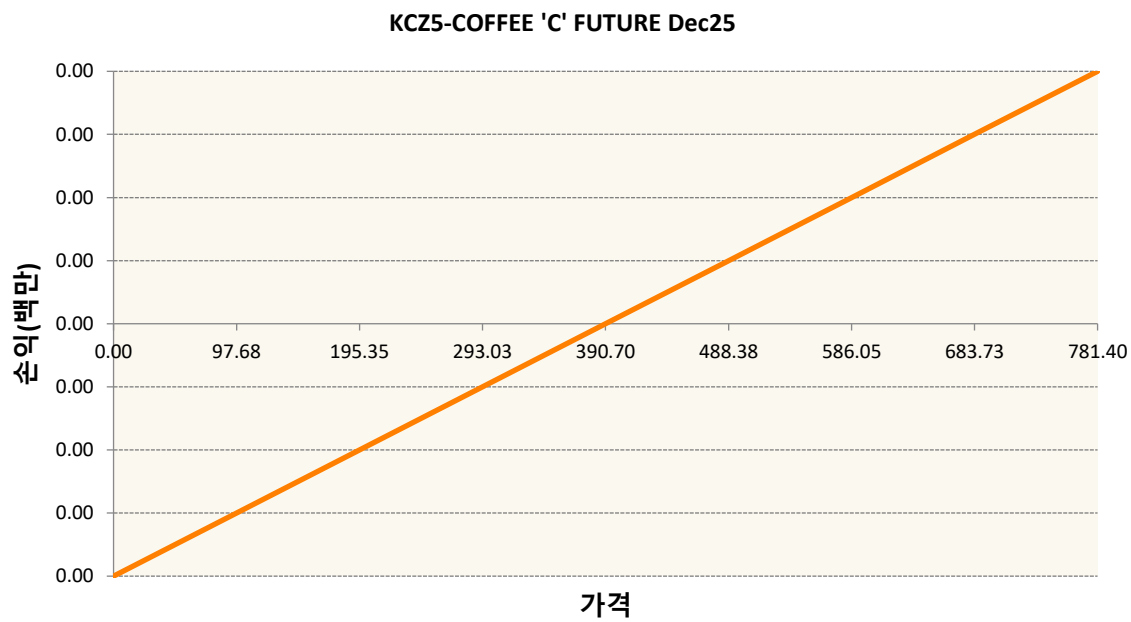
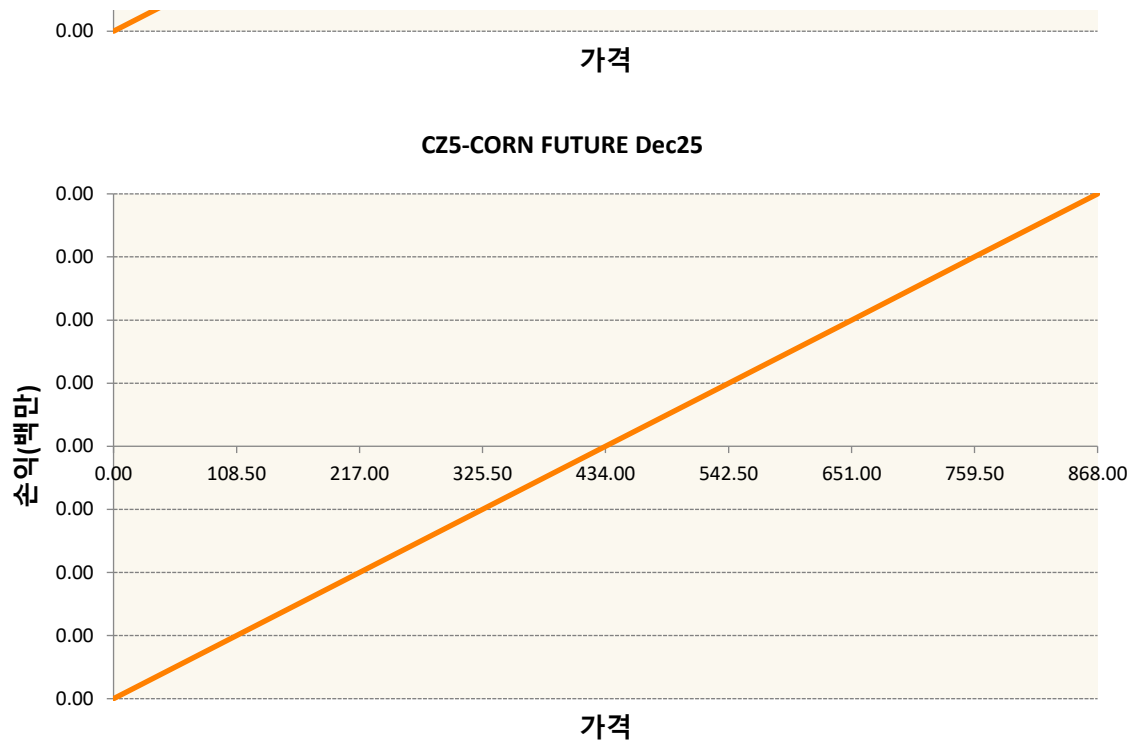
1. 계약금액

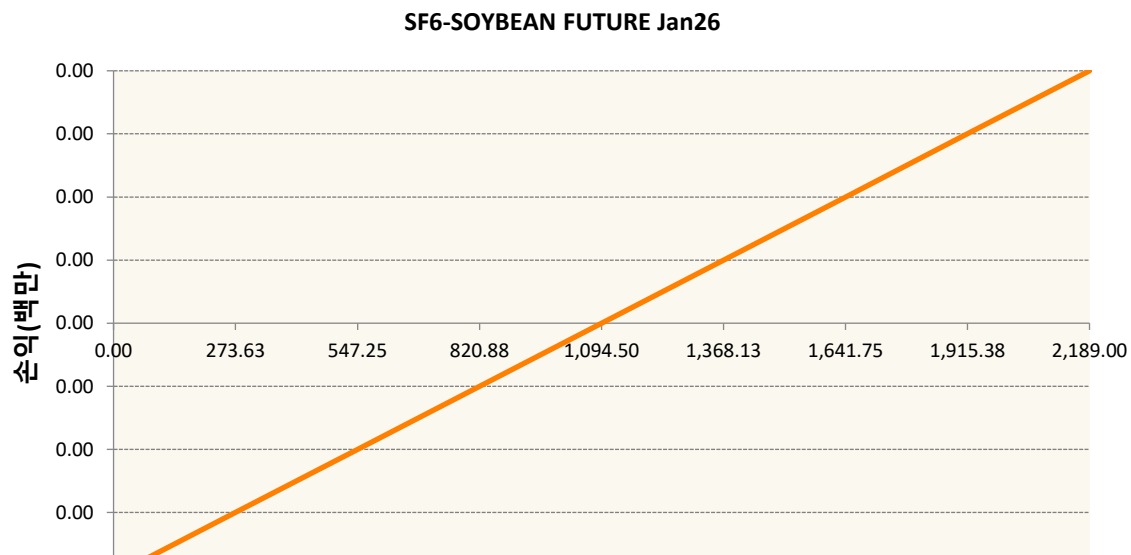
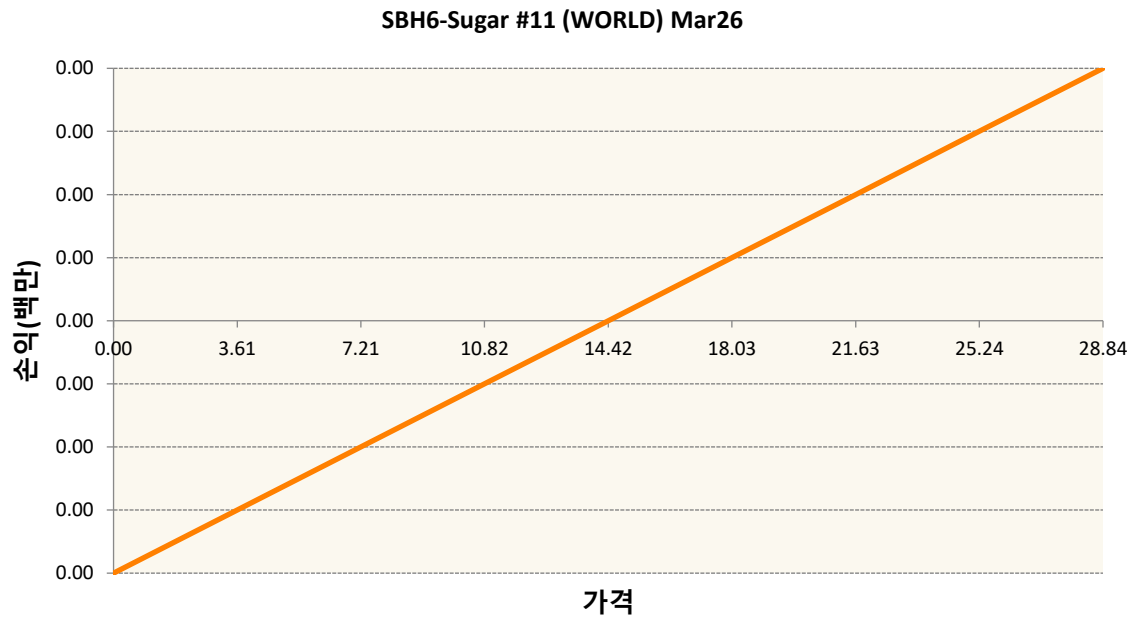
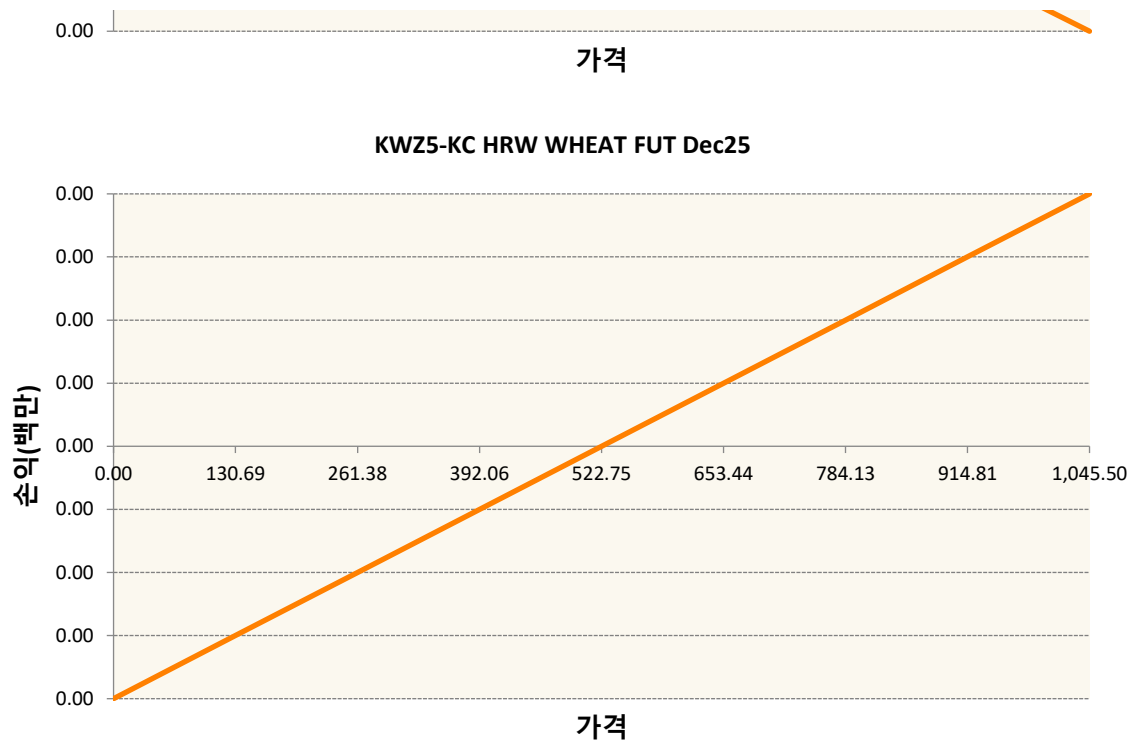
(단위:USD 백만)

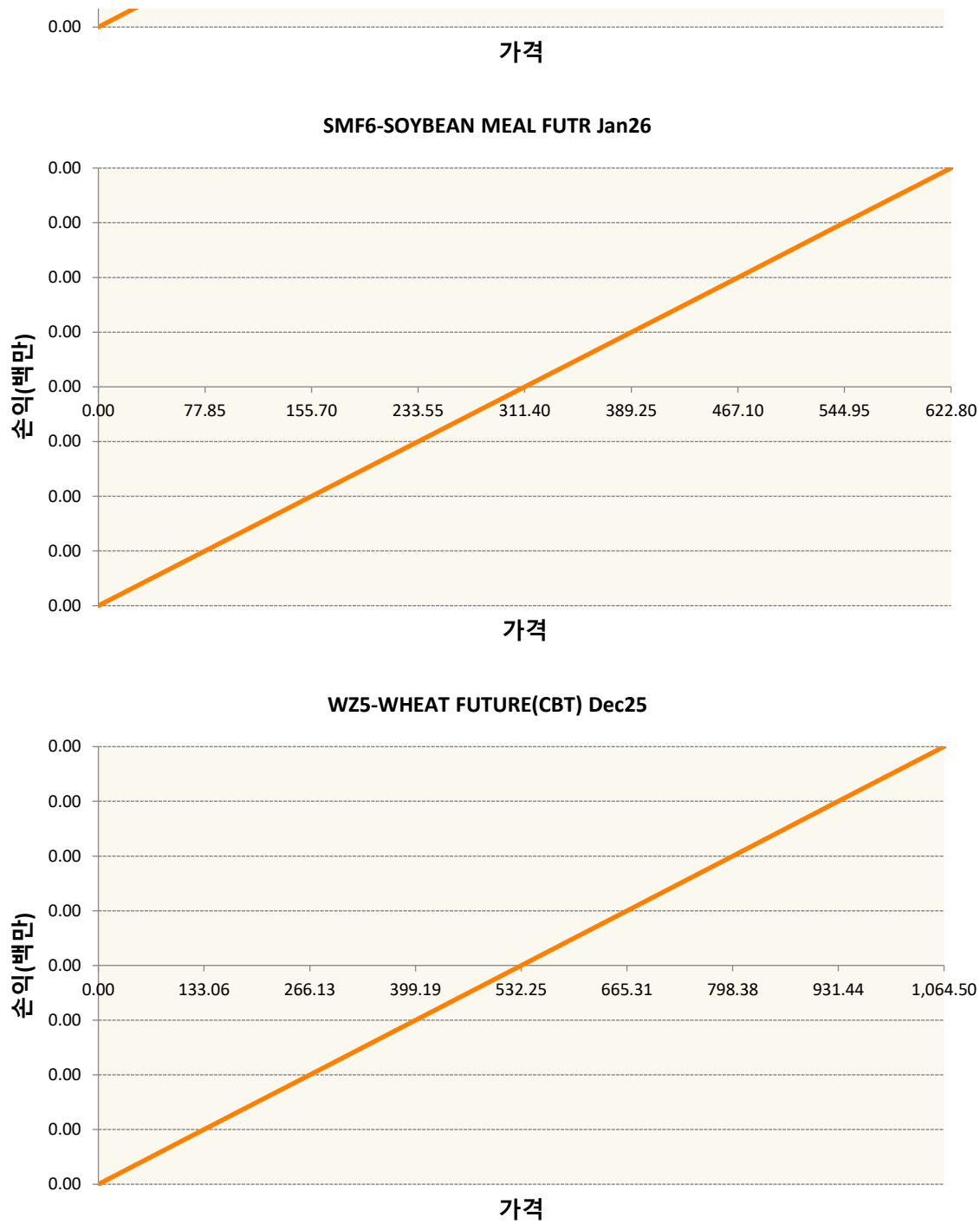
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,131	0	1,131	
누계	유가증권	선물	2,152	0	2,152	
누계	통화	선물	0	357	-357	장내

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	2025-10-31
기준일	2025-10-30

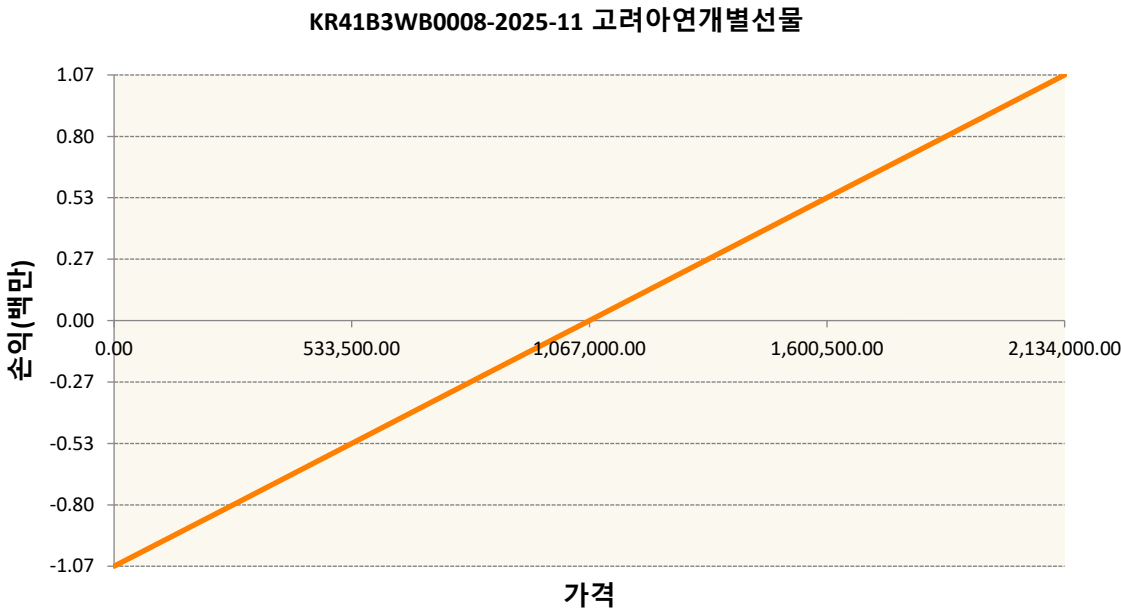
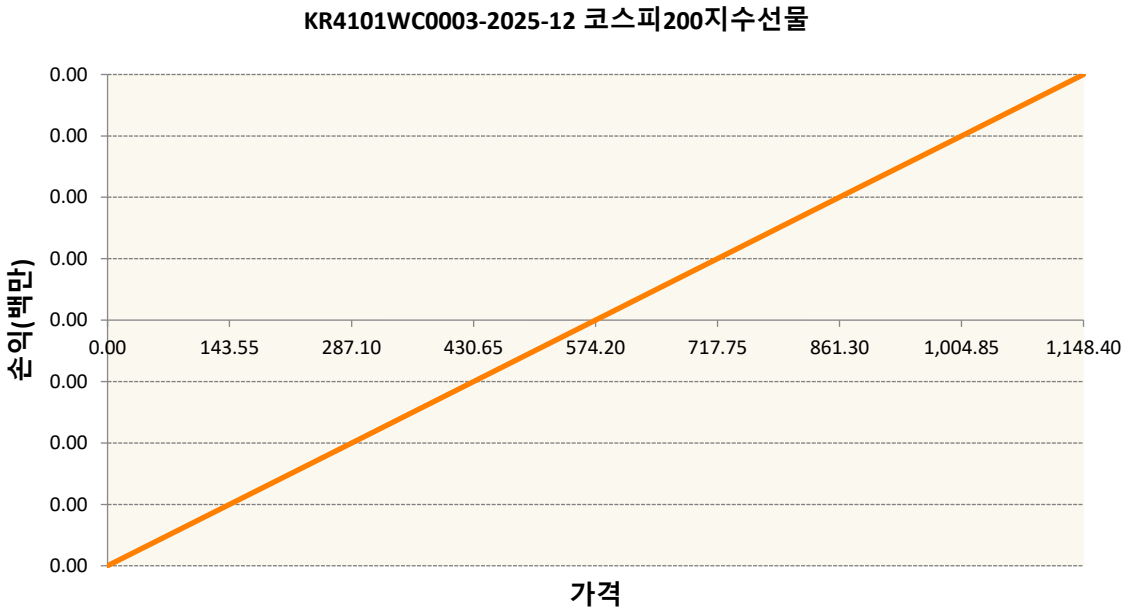
스마트인덱스모

1. 계약금액

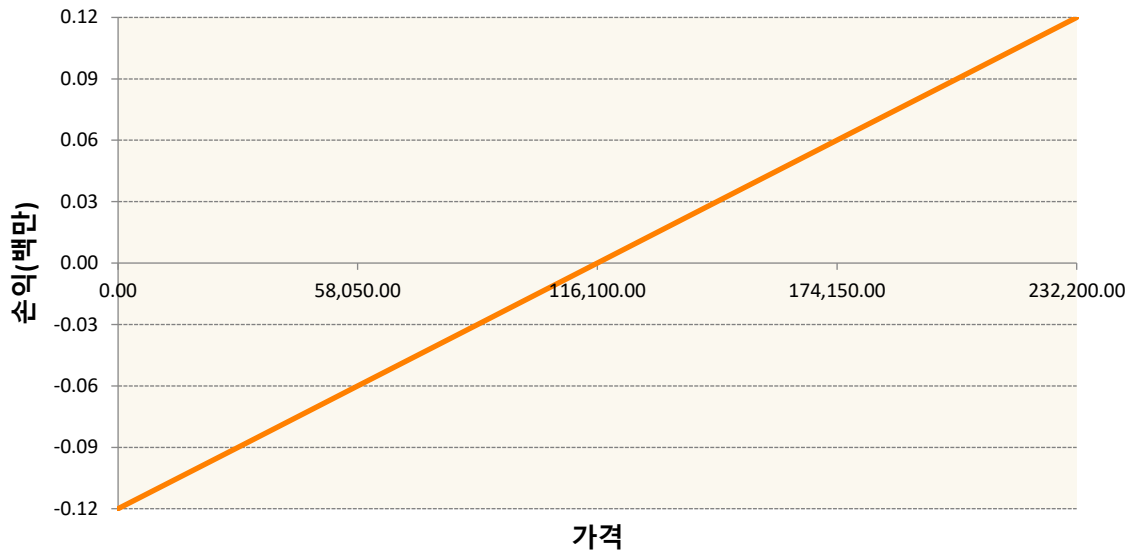
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,289	0	1,289	장내

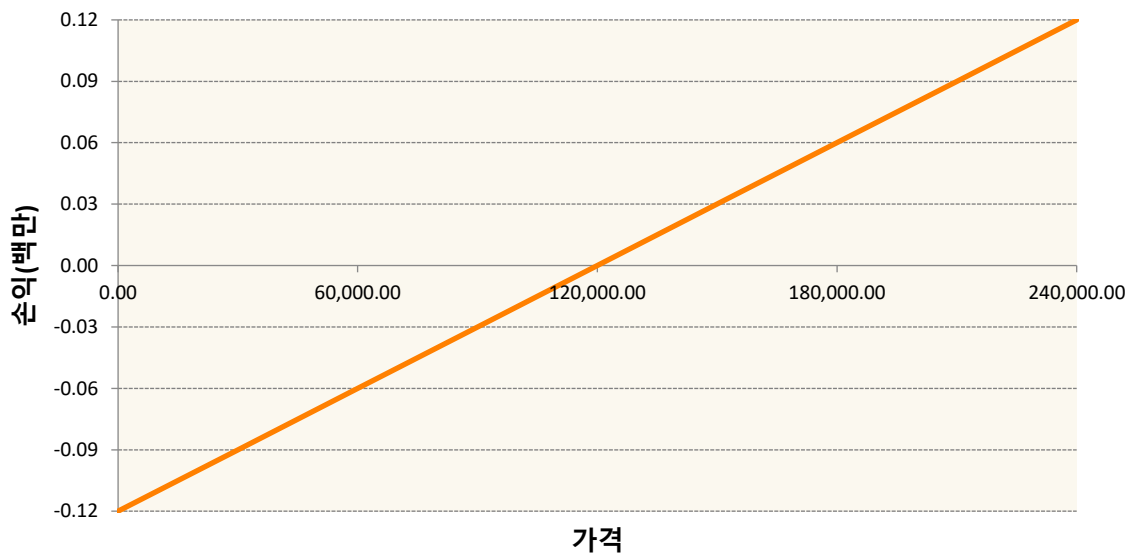
2. 만기시점의 손익구조



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물
 KR41B3WB01 2025-11 고려아연개별선물
 KR41EJWB00 2025-11 SKC개별선물
 KR41FMWB00 2025-11 엘앤에프개별선물

92
6
2
3

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

(단위:백만원)

42

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

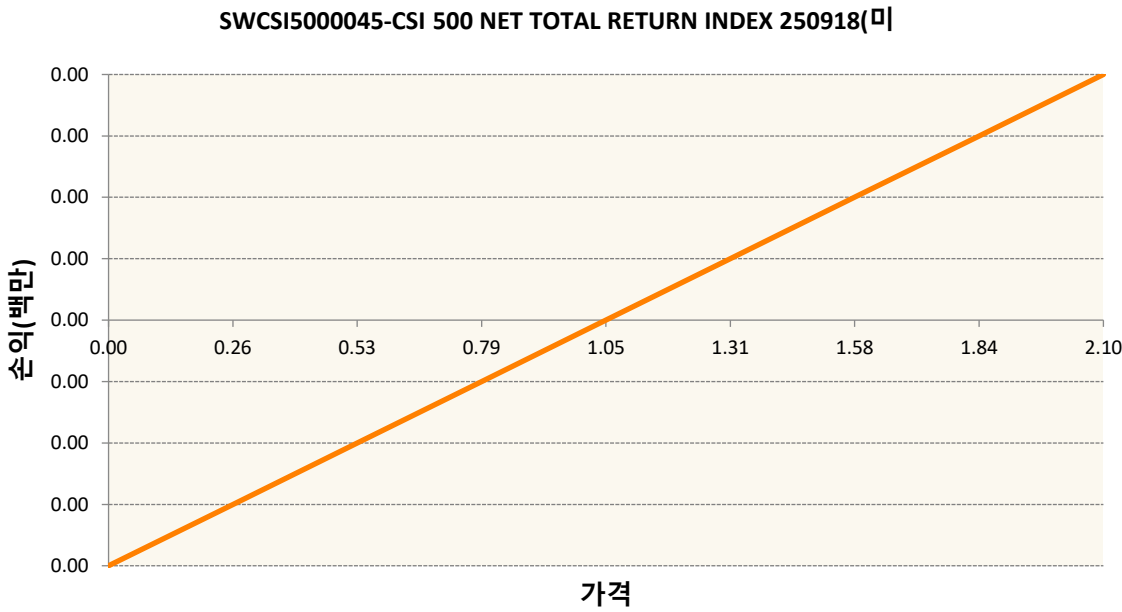
SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,935	0	4,935	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

393

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

502

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

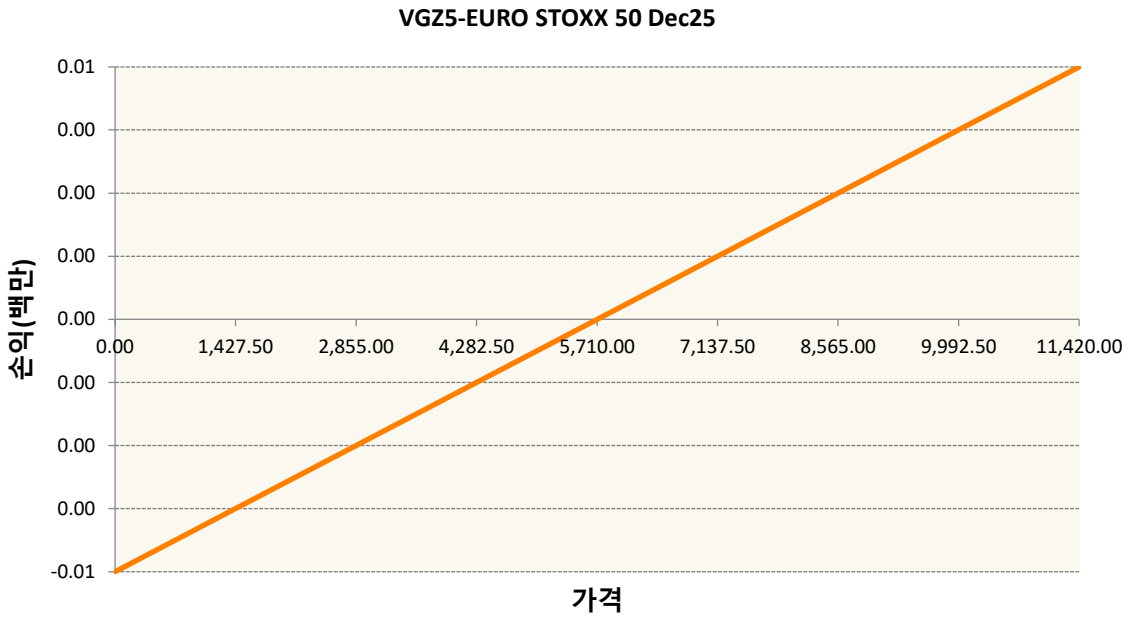
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	748	0	748	

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	2025-10-31
기준일	2025-10-30

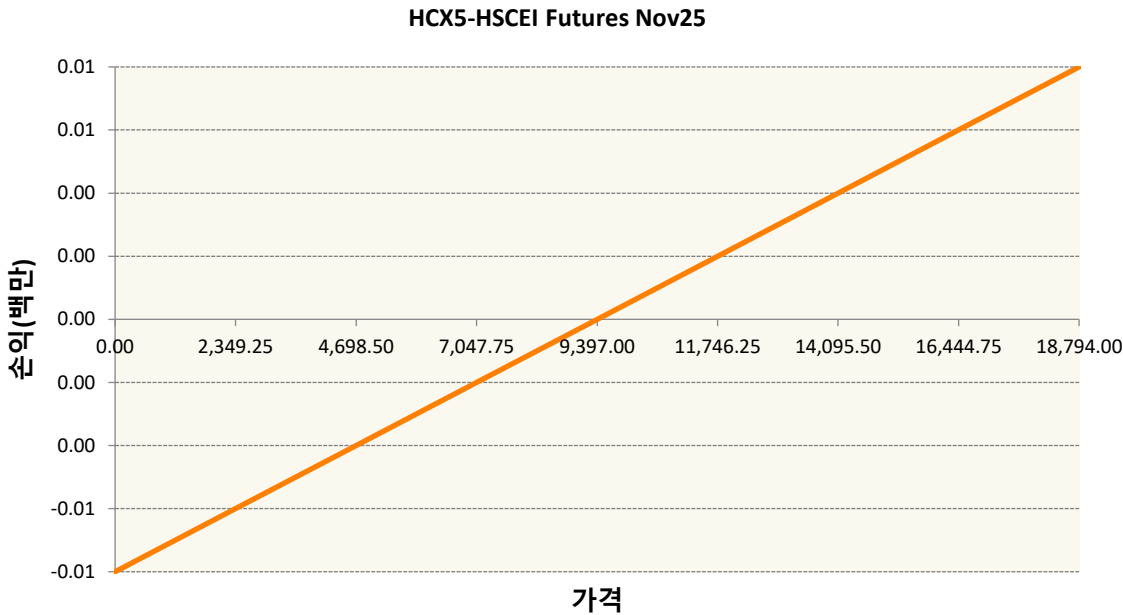
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,078	0	2,078	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX5	HSCEI Futures Nov25	166
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

235

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

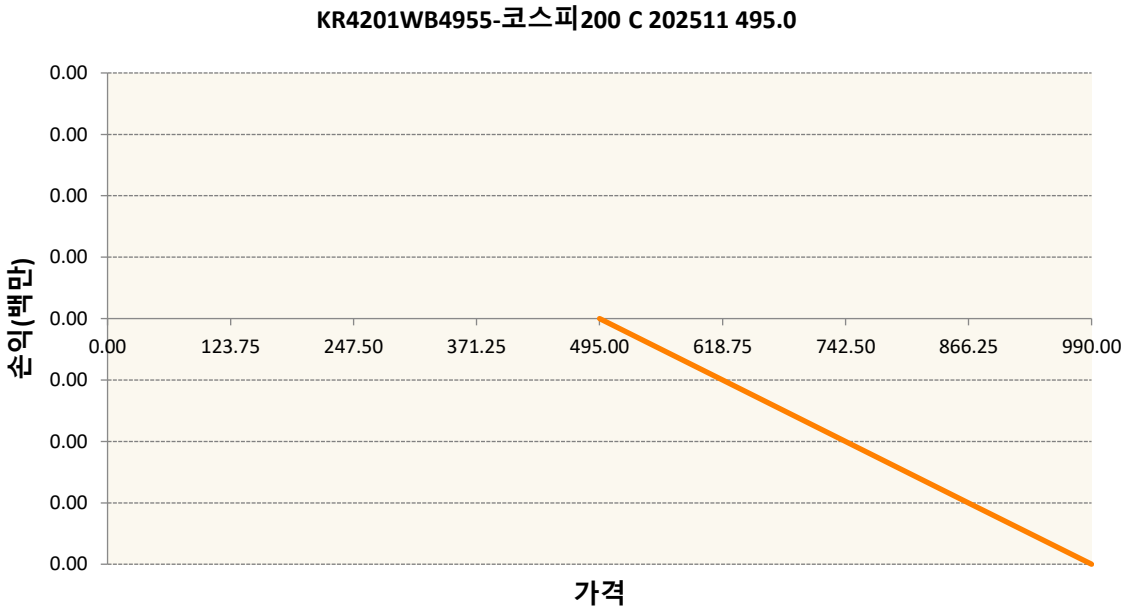
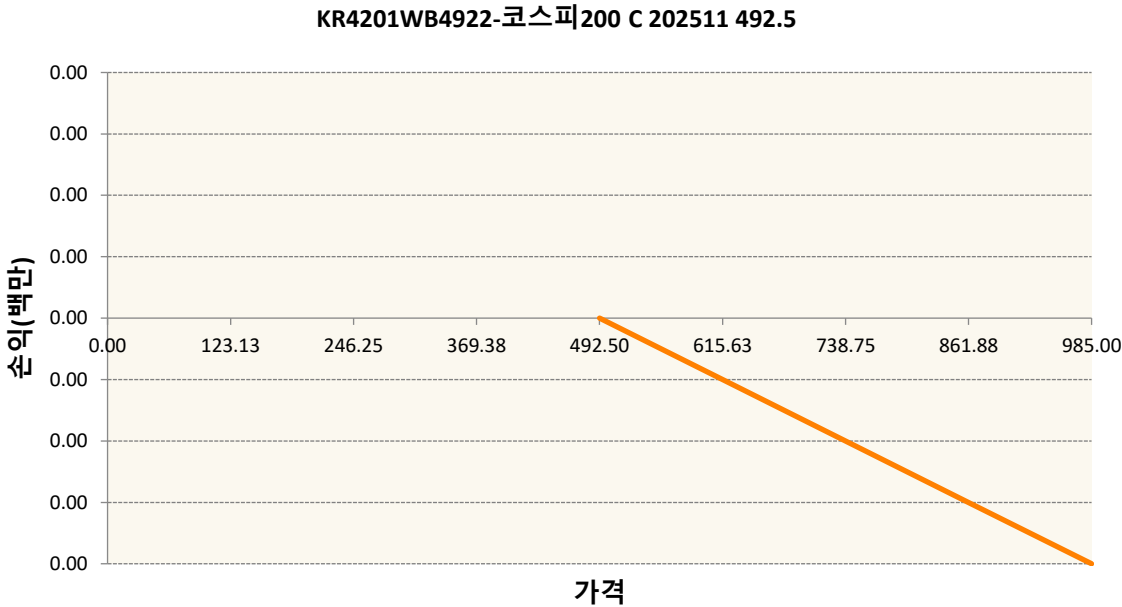
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

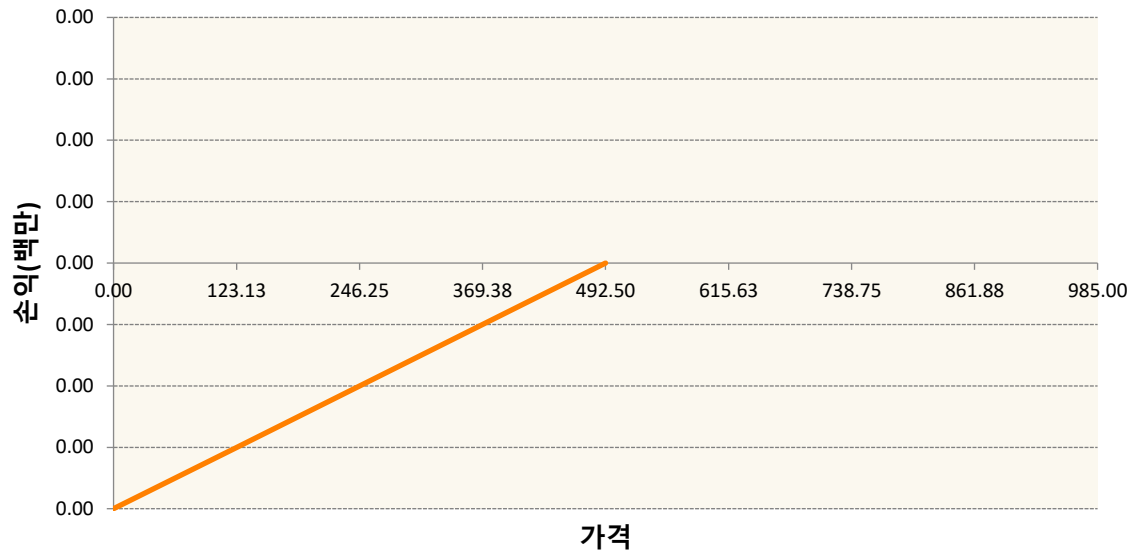
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	617	0	617	장내
누계	유가증권	옵션	0	31,003	-31,003	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301WB4921-코스피200 P 202511 492.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WB4921-코스피200 C 202511 492.5

433

KR4201WB4951-코스피200 C 202511 495.0

1,554

KR4301WB4921-코스피200 P 202511 492.5

493

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-10-31

기준일 2025-10-30

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	2025-10-31
기준일	2025-10-30

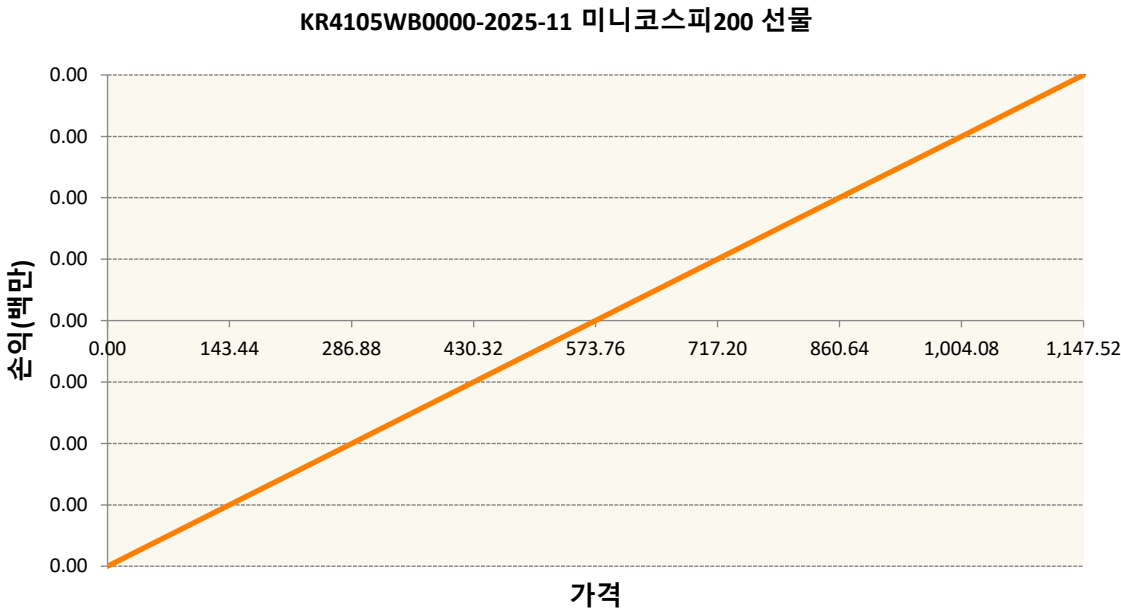
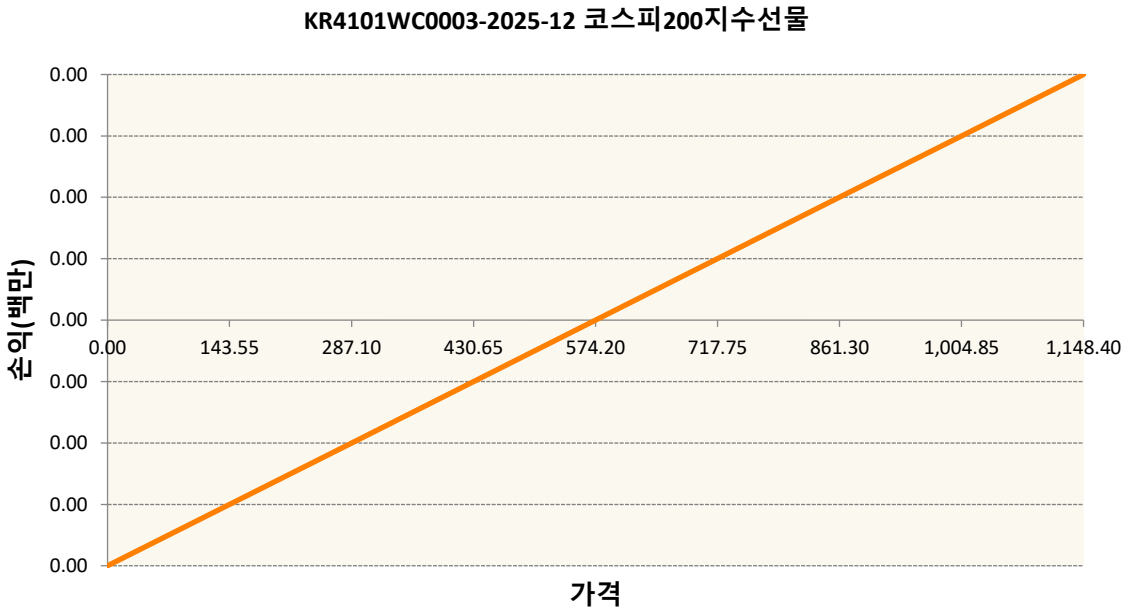
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

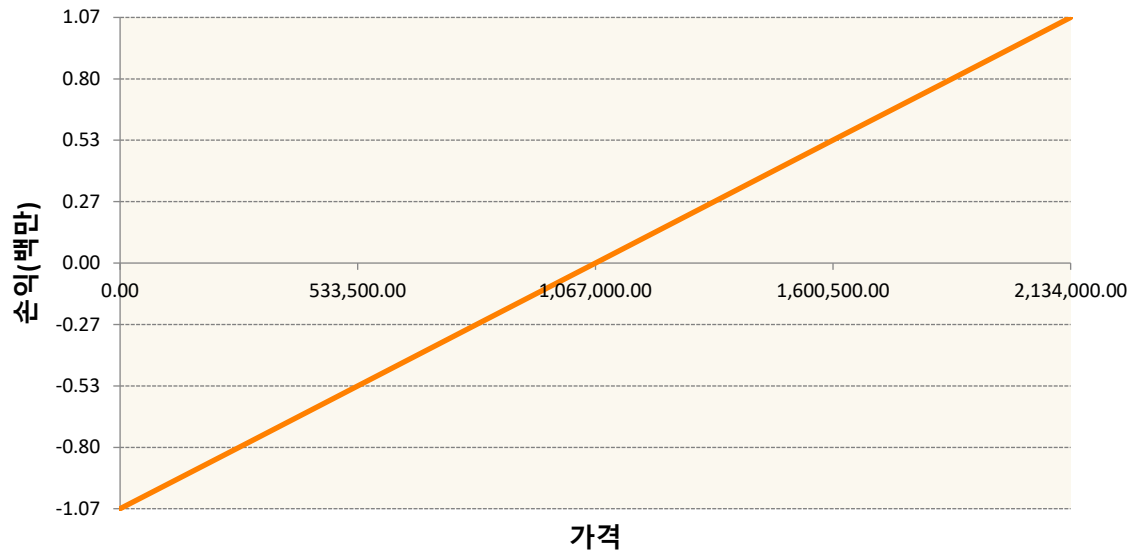
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,208	0	1,208	장내

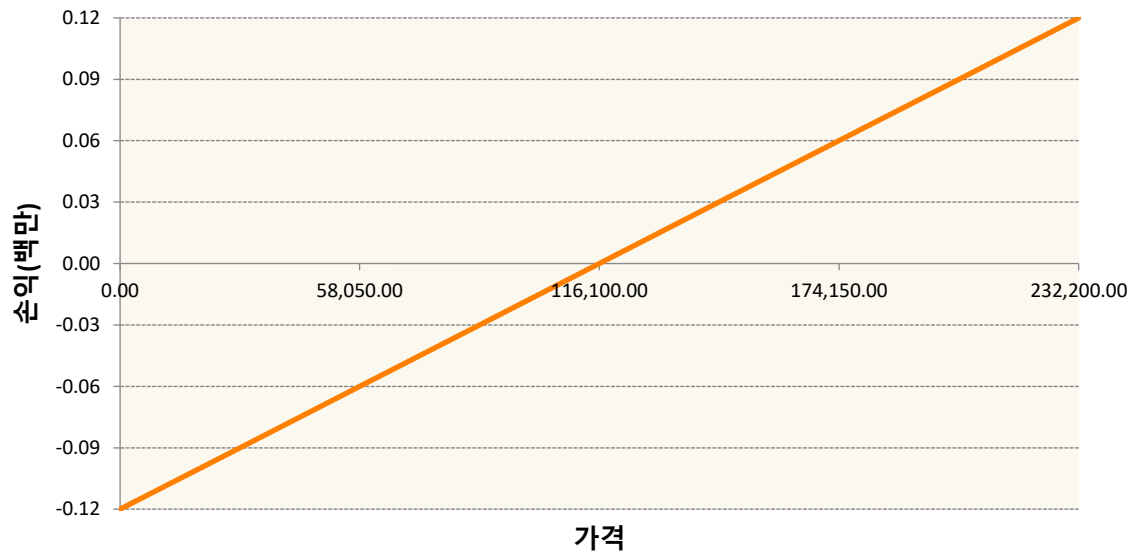
2. 만기시점의 손익구조



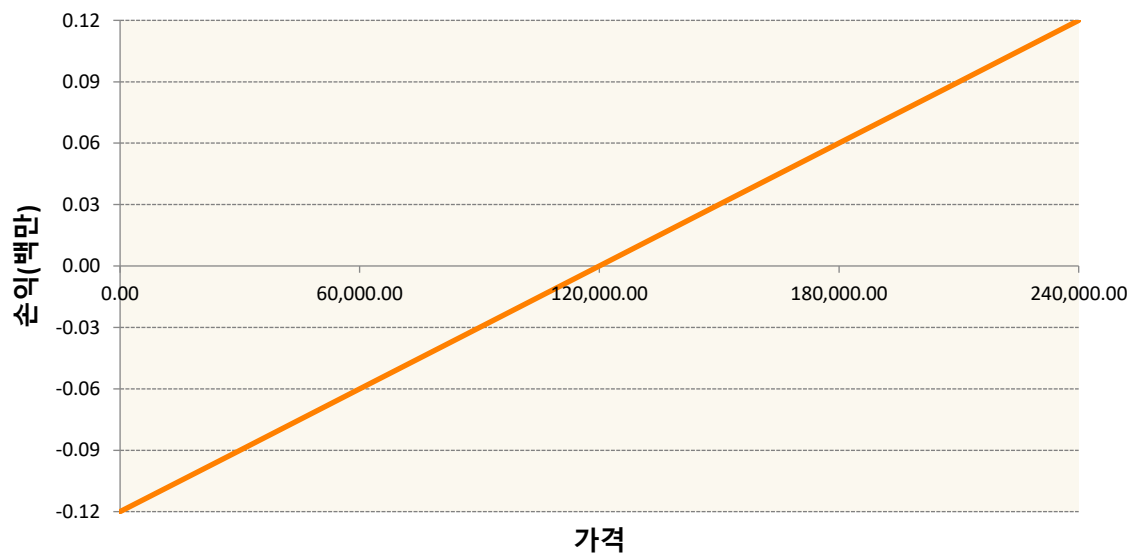
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물		46
KR4105WB0(2025-11 미니코스피200 선물		9
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물		3
KR41EJWB0(2025-11 SKC개별선물		1
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	18

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

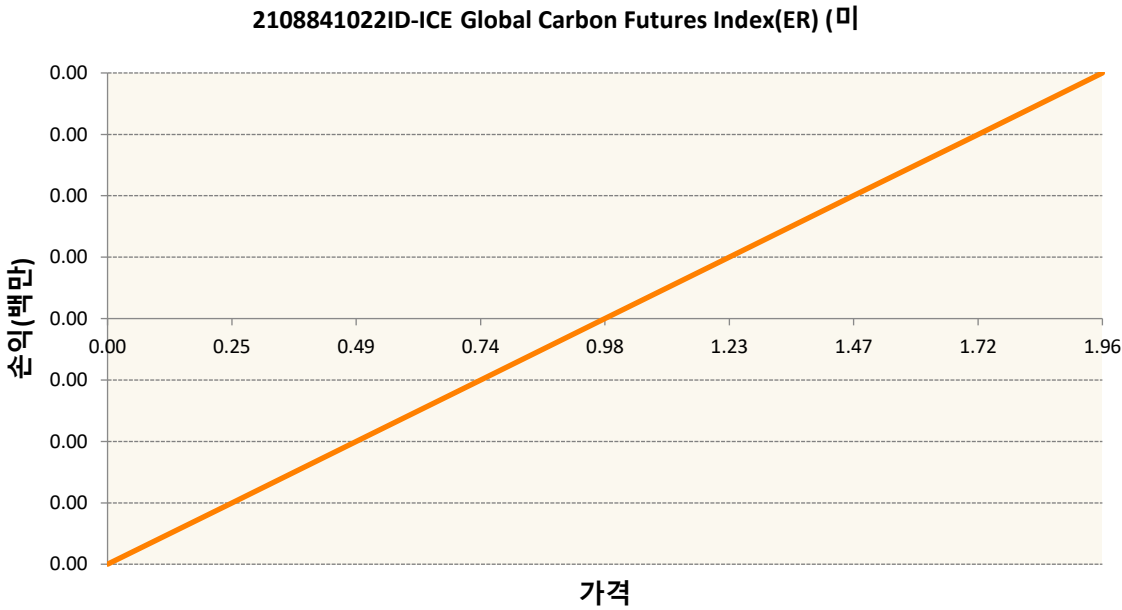
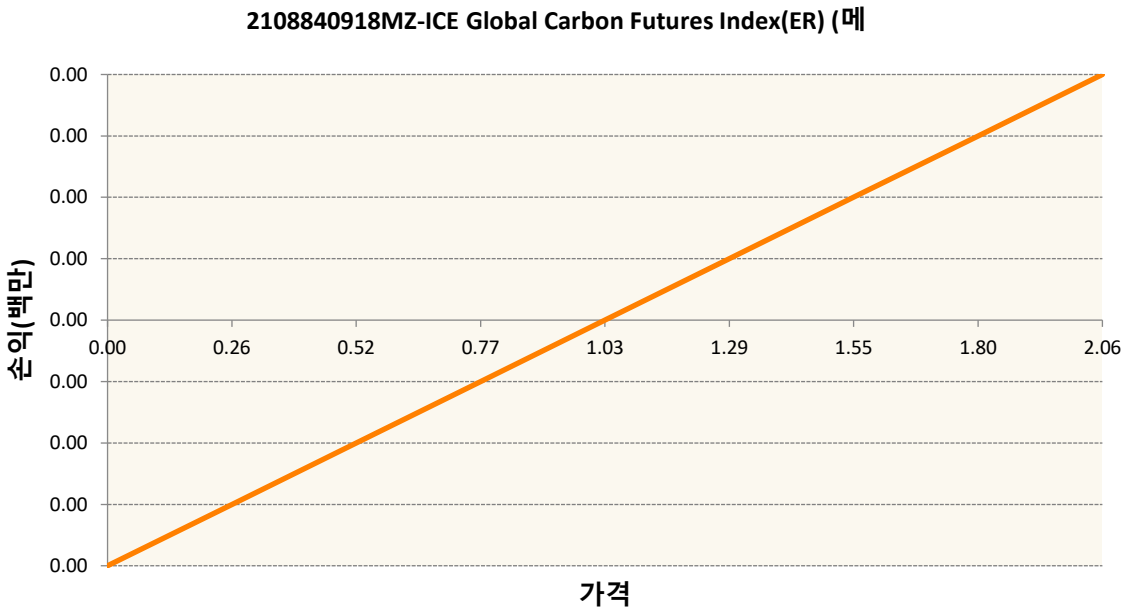
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	8,291	0	8,291	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		112
2108841022IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		554

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	656

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

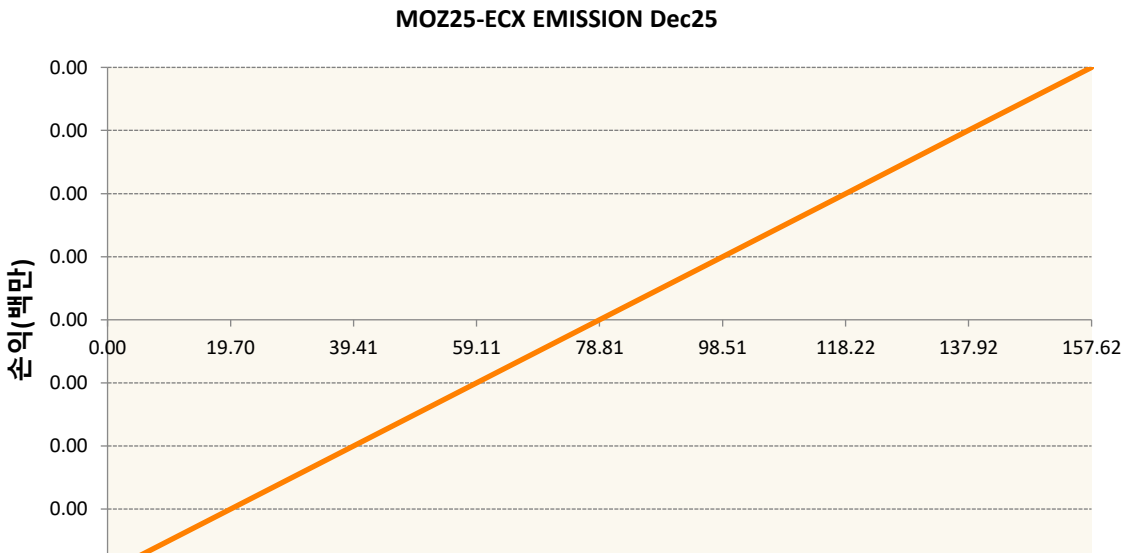
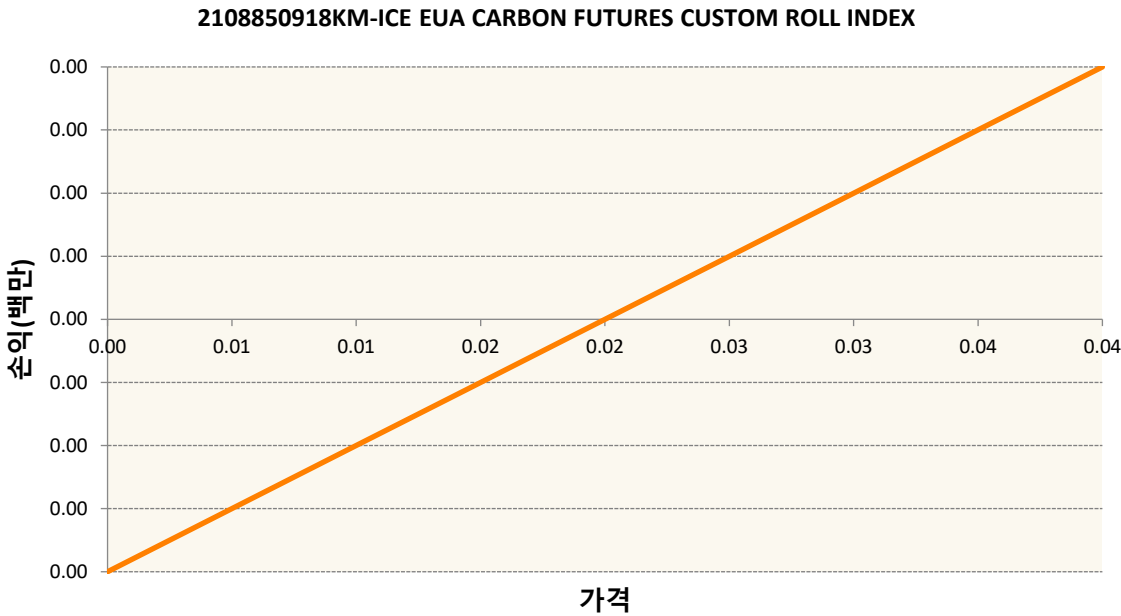
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,804	0	5,804	
누계	지수	스왑	8	0	8	장외
누계	통화	선도	0	4,774	-4,774	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
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E	199
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	464

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

(단위:백만원)

871

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

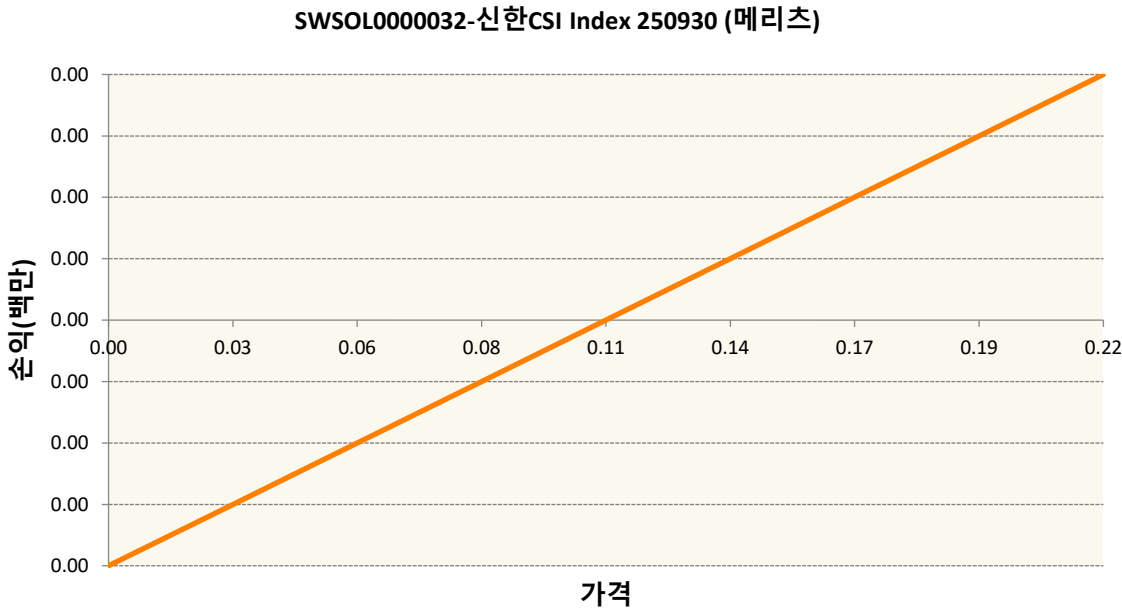
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,772	0	2,772	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	13
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	9
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	9
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	22

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

(단위:백만원)

94

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

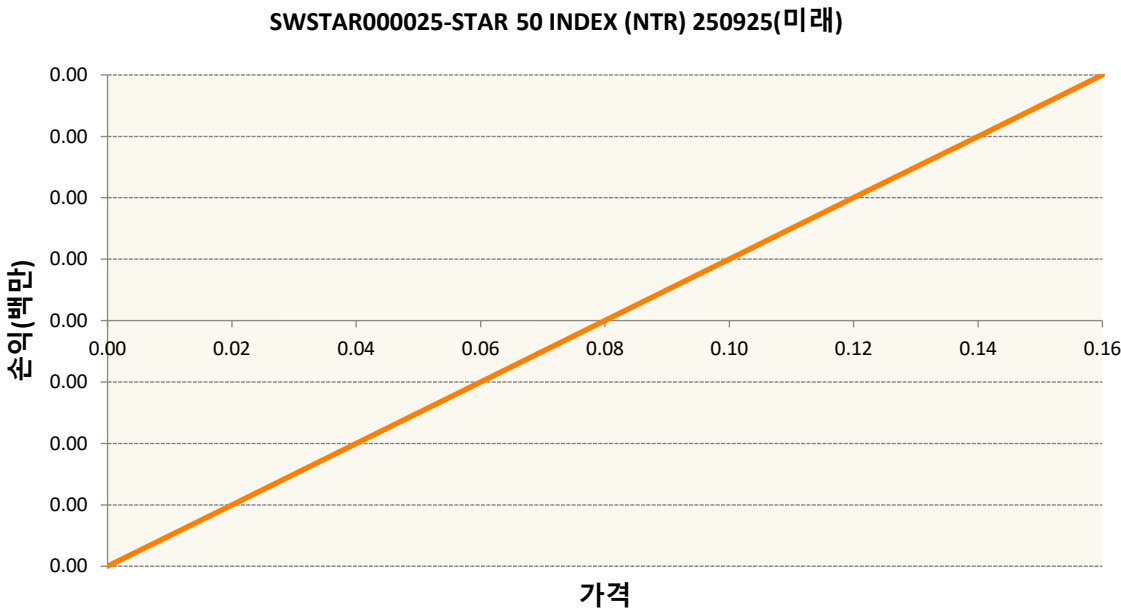
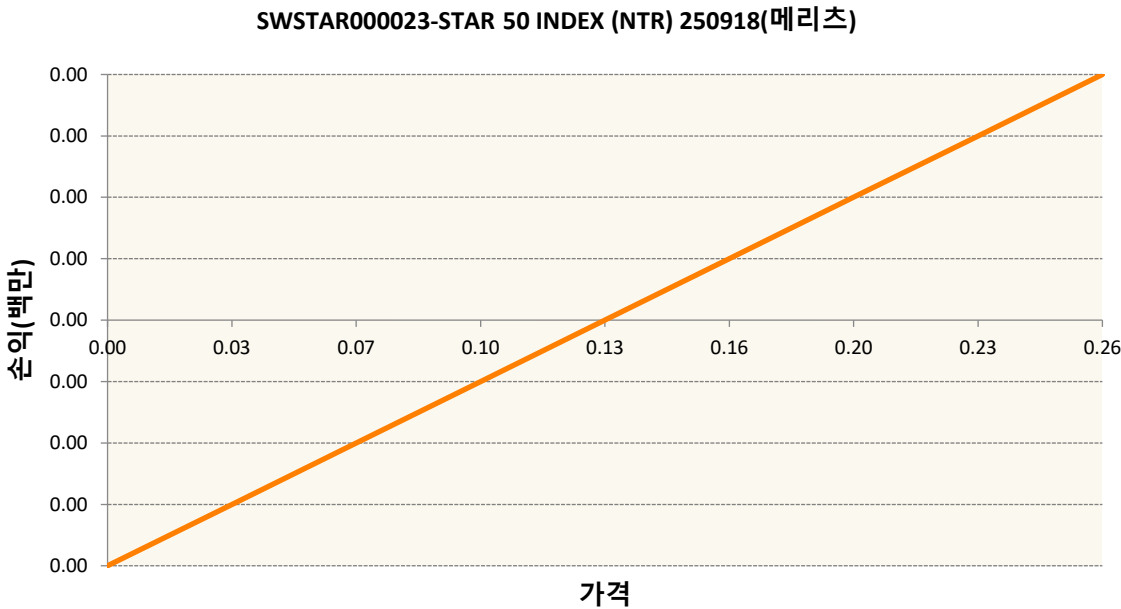
SOL차이나육성산업엑티브상장지

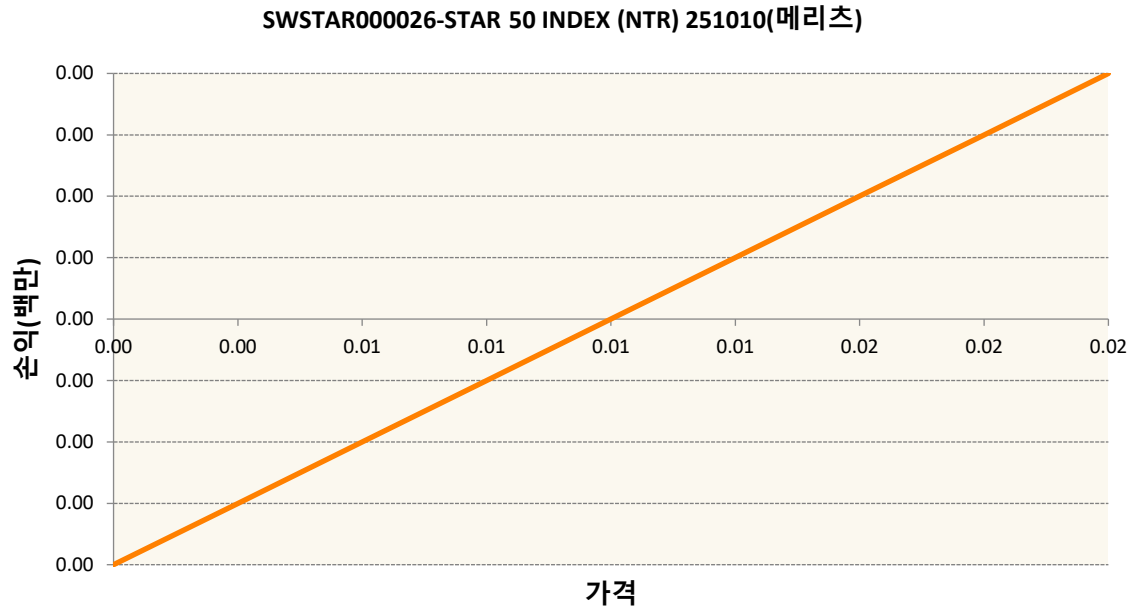
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,402	0	5,402	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		29
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		9
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		106
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		36
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠)		5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	334

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

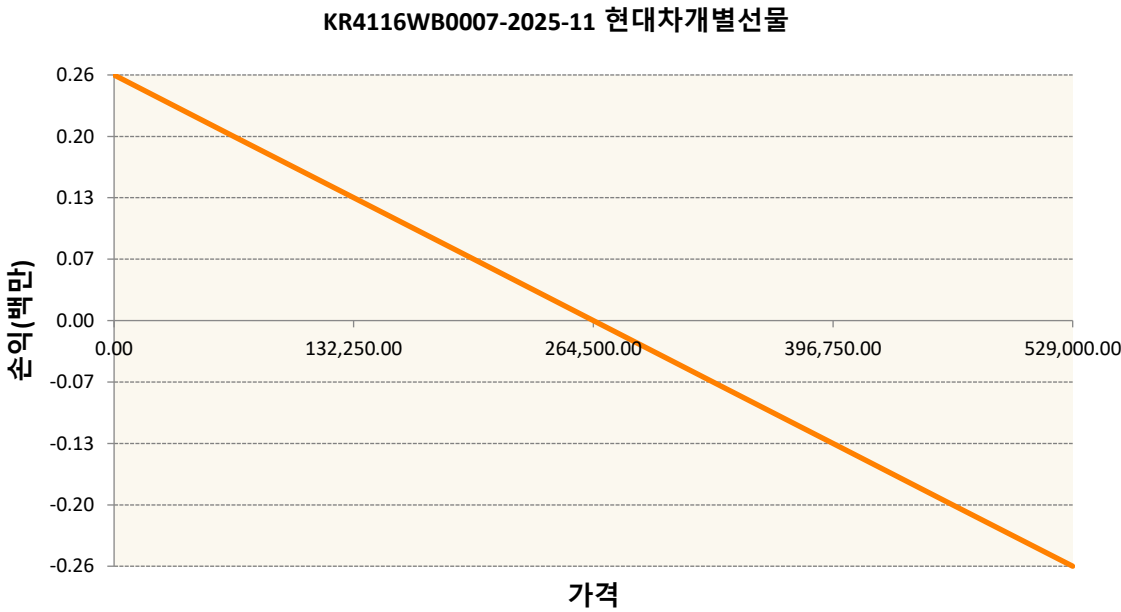
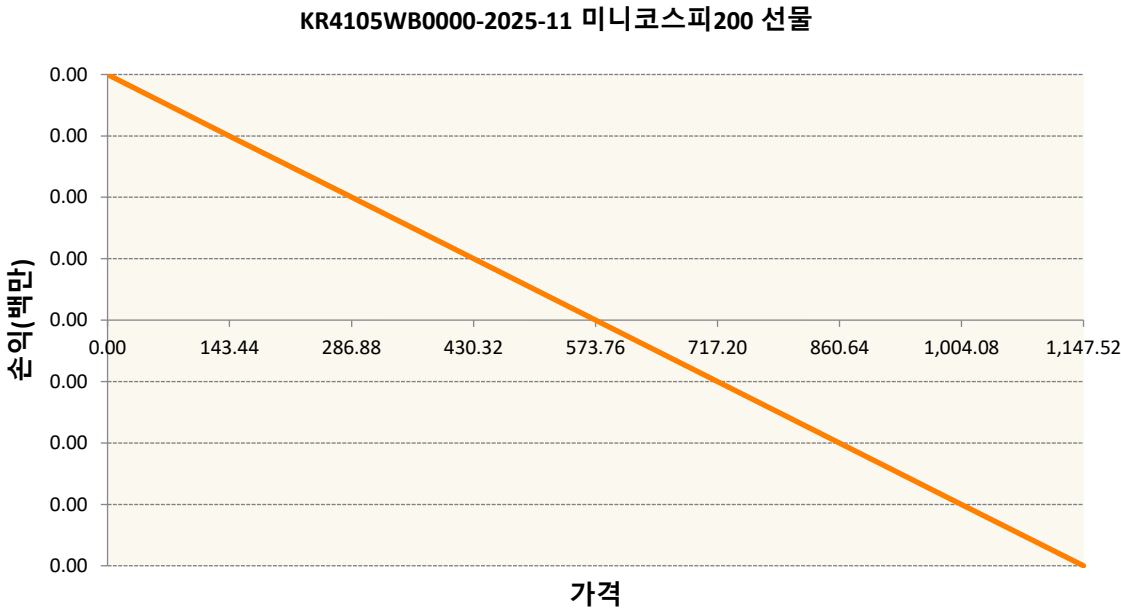
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

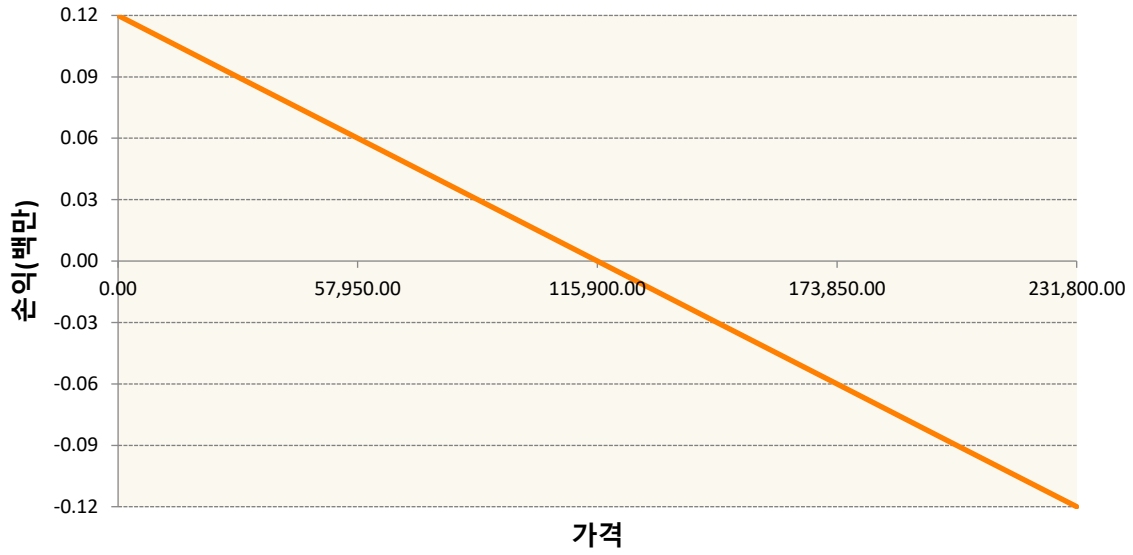
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	12	7	5	장내
누계	유가증권	선물	0	924	-924	장내

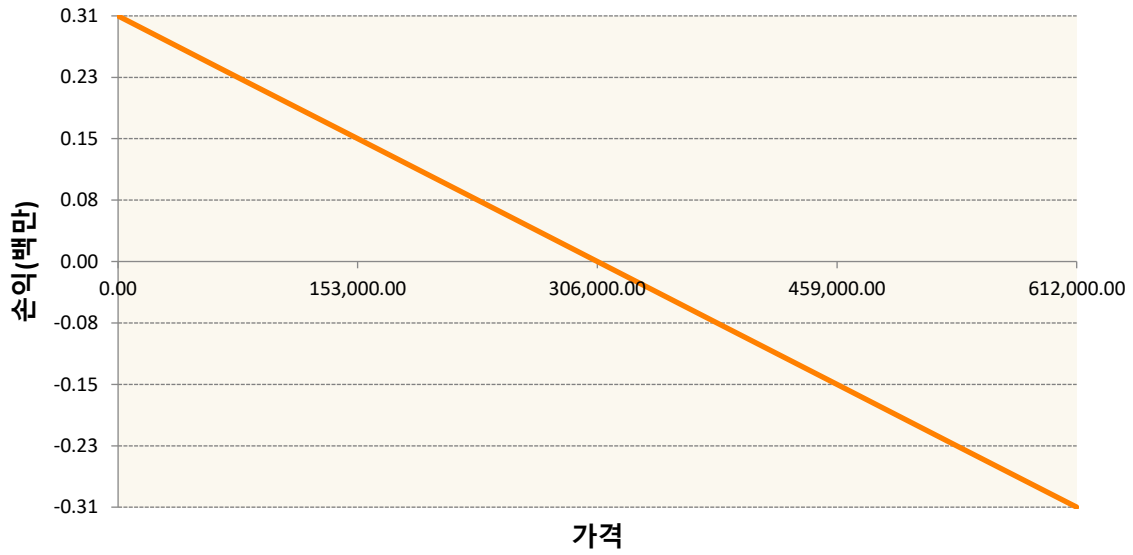
2. 만기시점의 손익구조



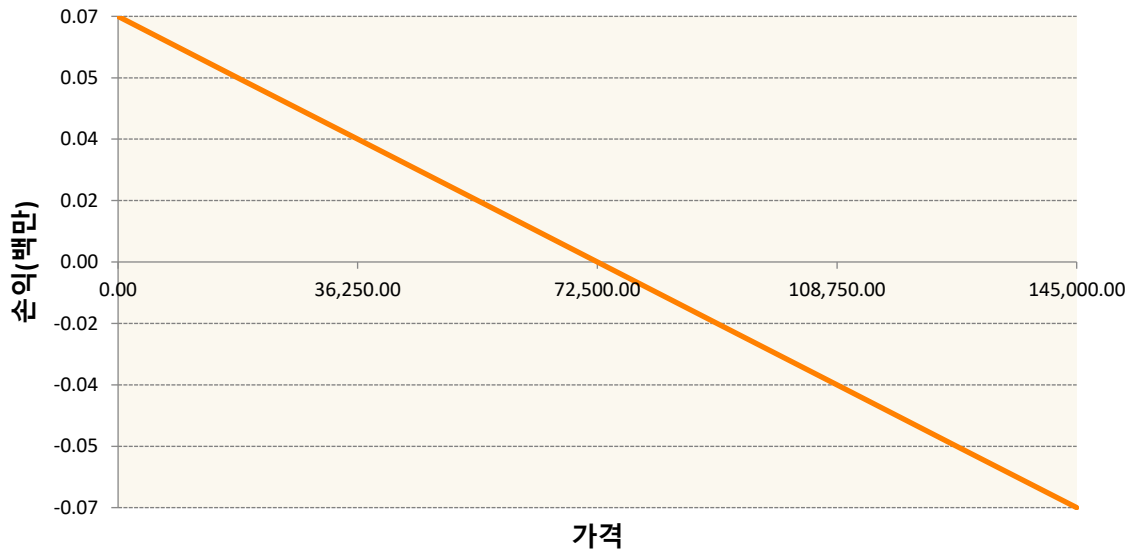
KR4119WB0004-2025-11 기아개별선물



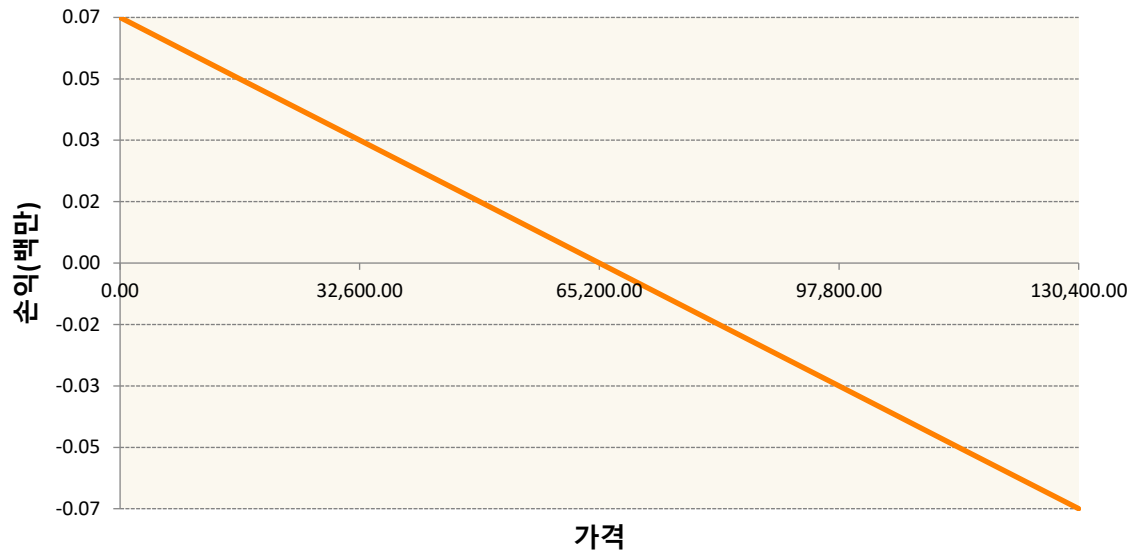
KR4120WB0001-2025-11 현대모비스개별선물



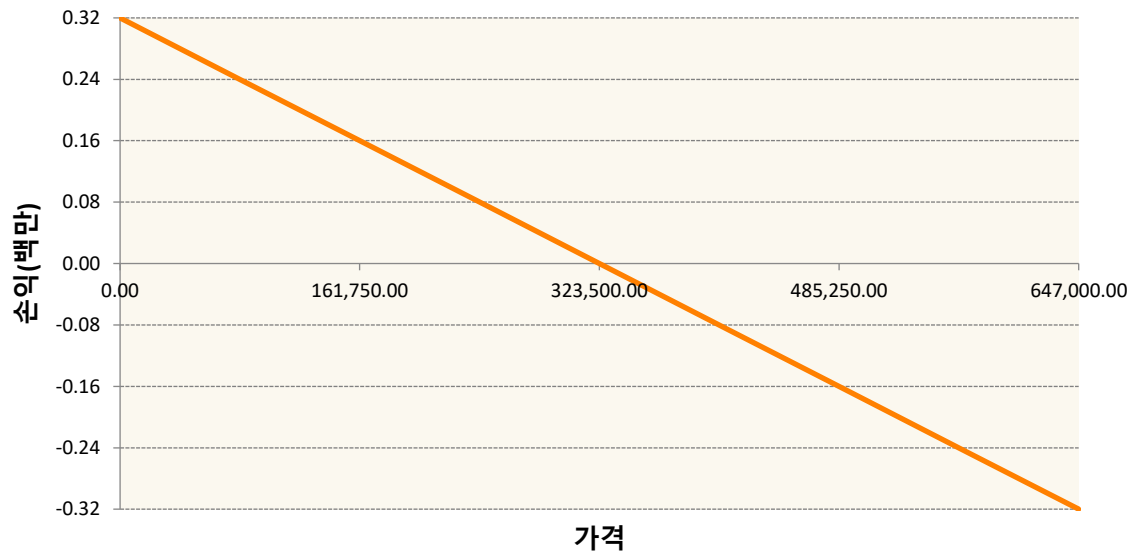
KR41B2WB0009-2025-11 S-Oil개별선물



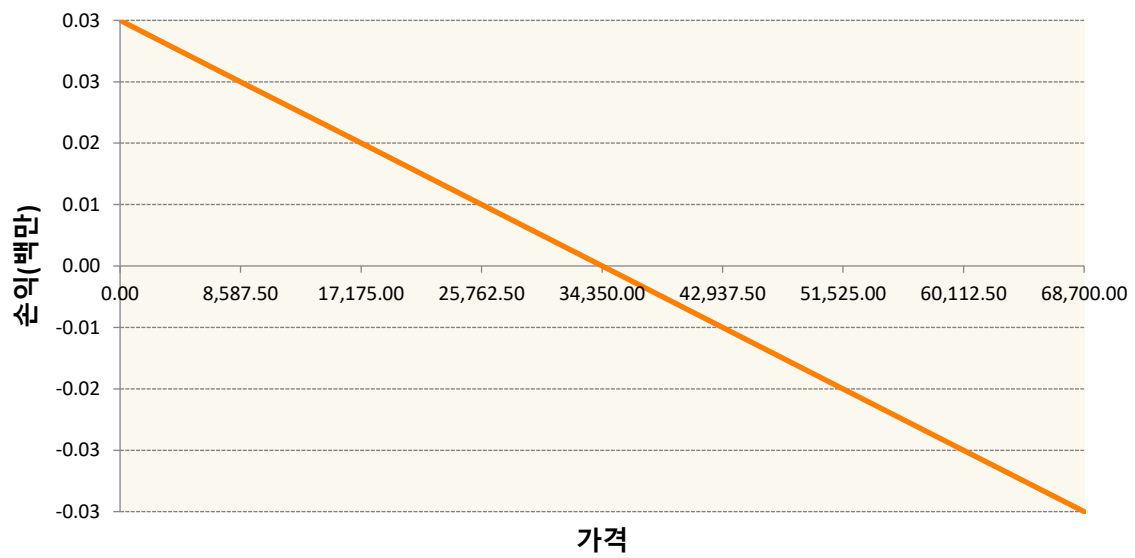
KR41BAWB0000-2025-11 롯데쇼핑개별선물



KR41FCWB0004-2025-11 하이브개별선물



KR41FLWB0003-2025-11 펄어비스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4105WB0(2025-11 미니코스피200 선물	14
KR4116WB0(2025-11 현대차개별선물	1
KR4119WB0(2025-11 기아개별선물	0.37
KR4120WB0(2025-11 현대모비스개별선물	1
KR41B2WB0(2025-11 S-Oil개별선물	1
KR41BAWB0 2025-11 롯데쇼핑개별선물	0.26
KR41FCWB0(2025-11 하이브개별선물	1
KR41FLWB0(2025-11 펄어비스개별선물	0.36

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

5

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

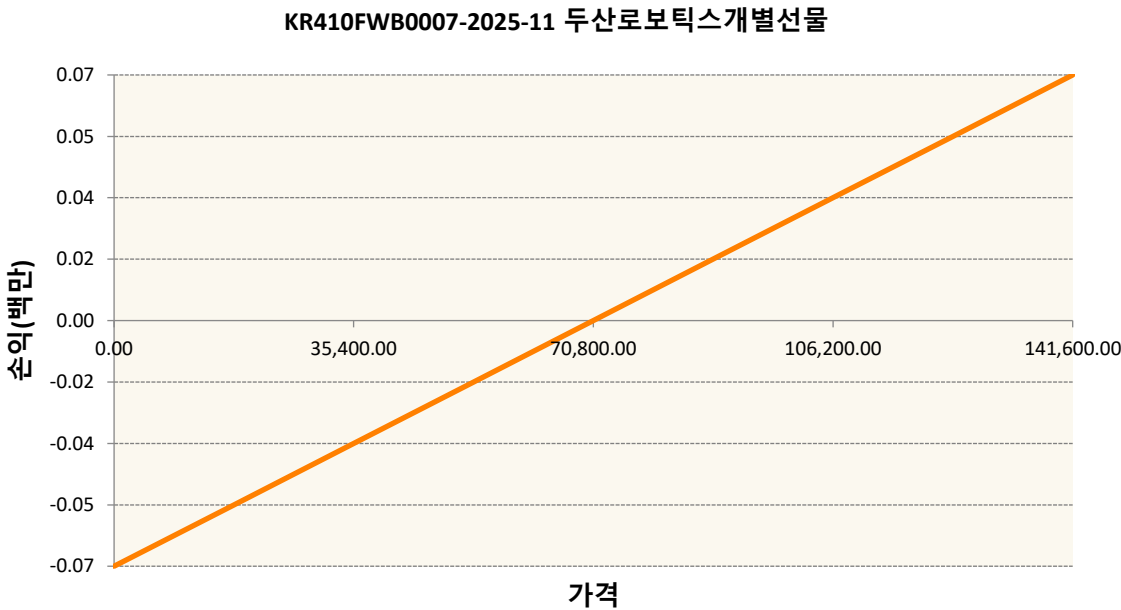
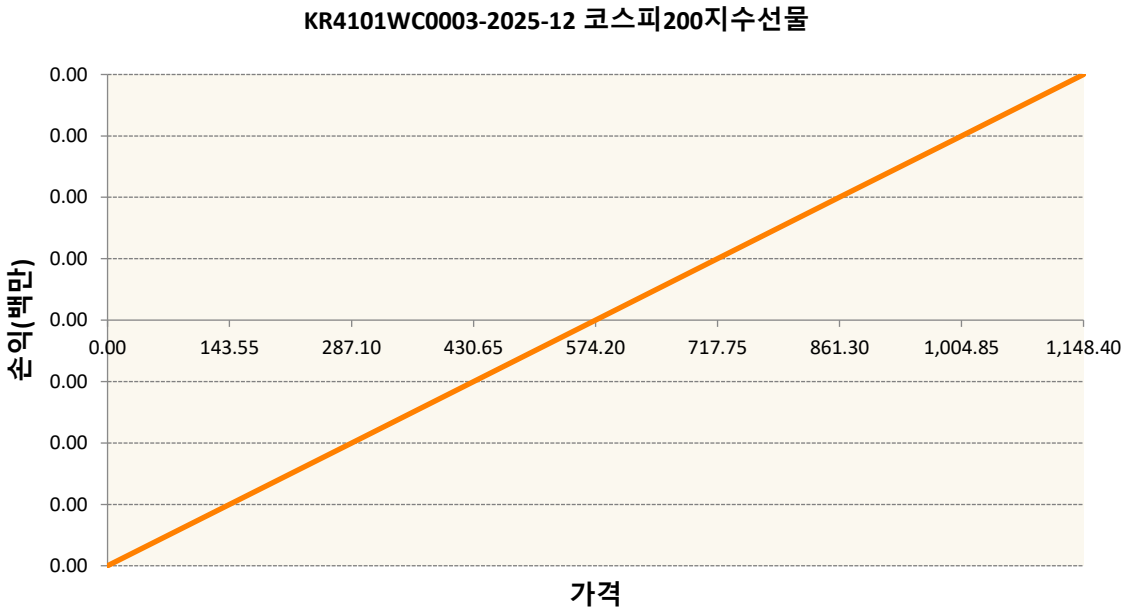
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

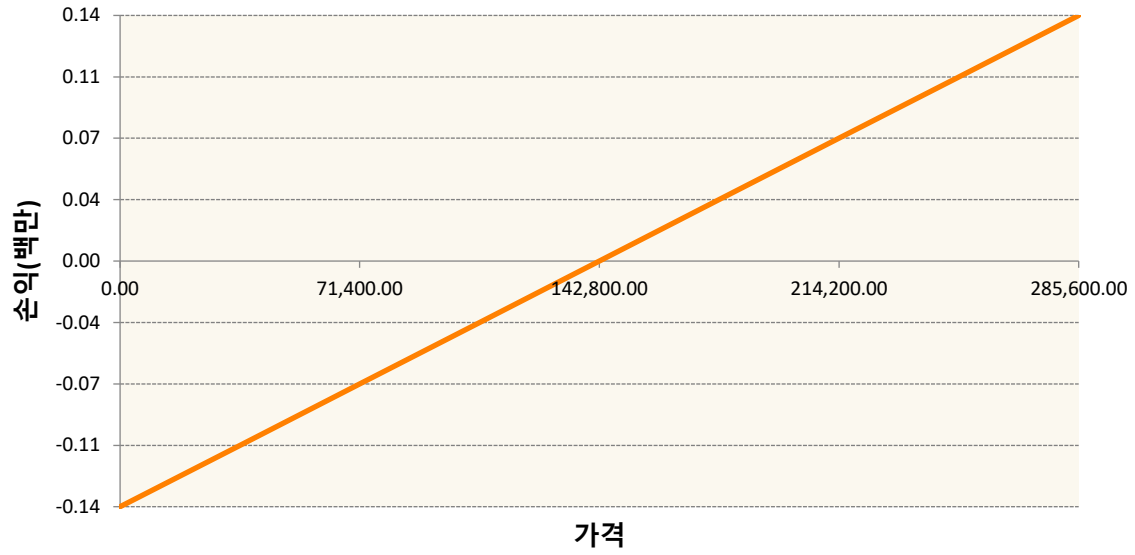
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,155	432	722	장내
누계	유가증권	선물	17,631	0	17,631	장내

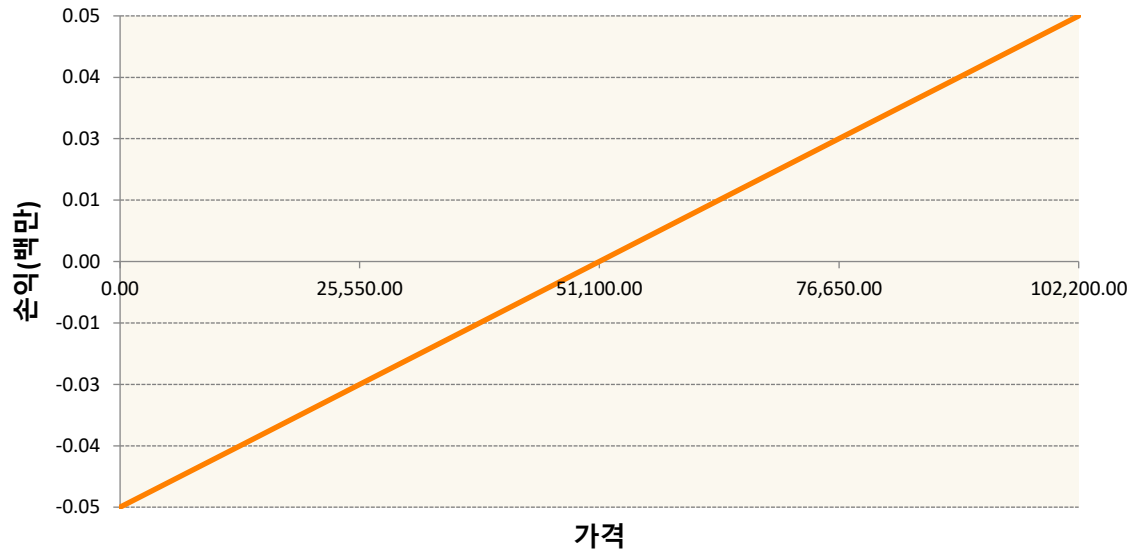
2. 만기시점의 손익구조



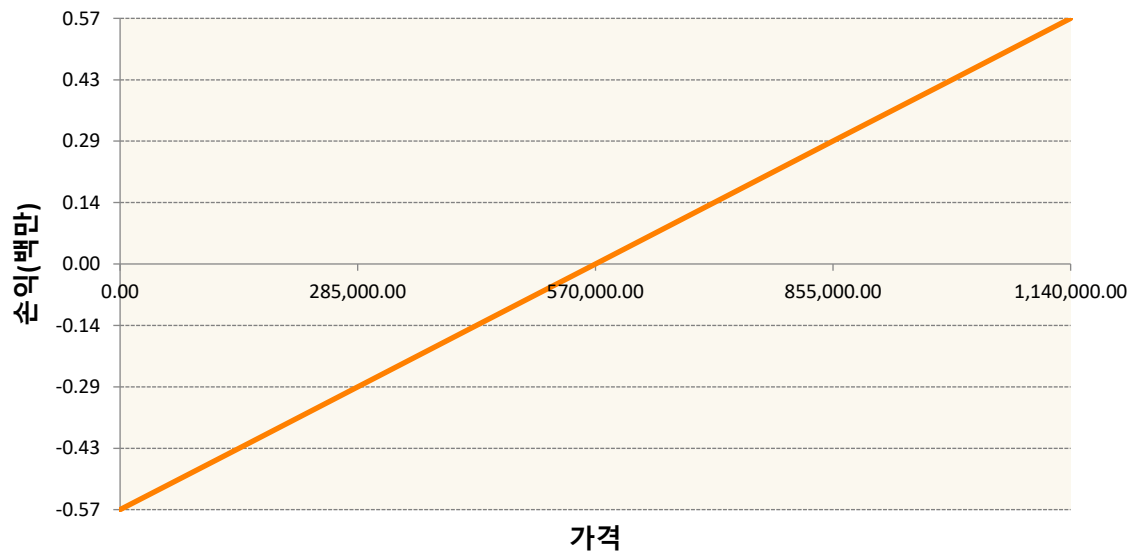
KR410ZWB0003-2025-11 한미반도체개별선물



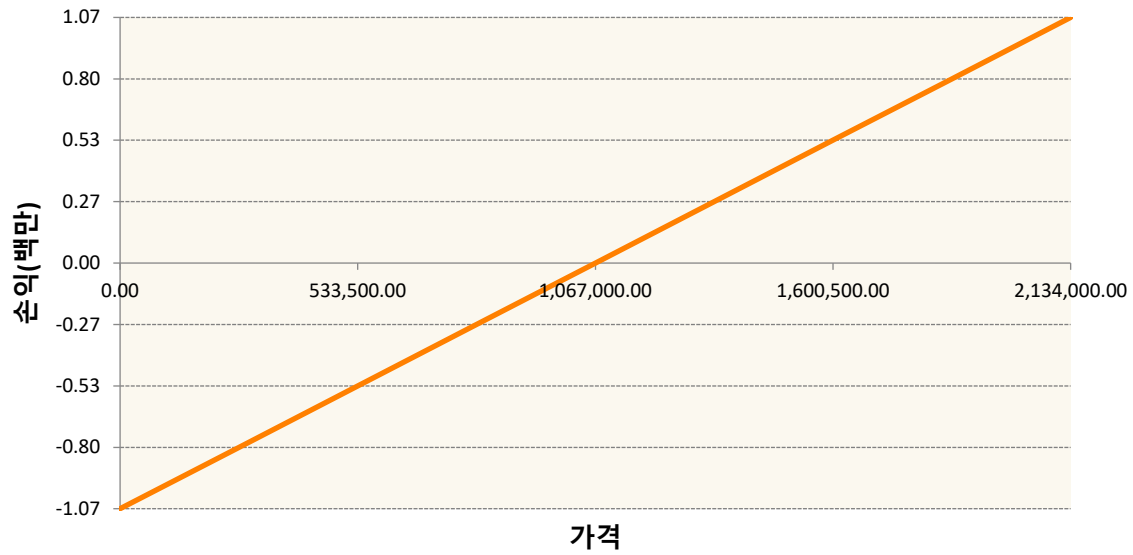
KR411RWB0002-2025-11 한화비전개별선물



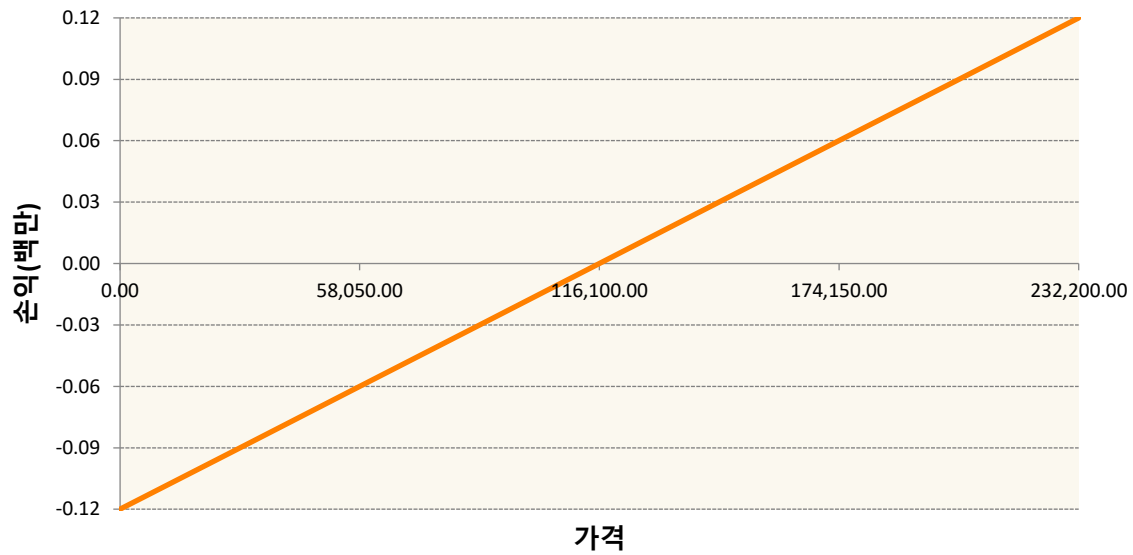
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



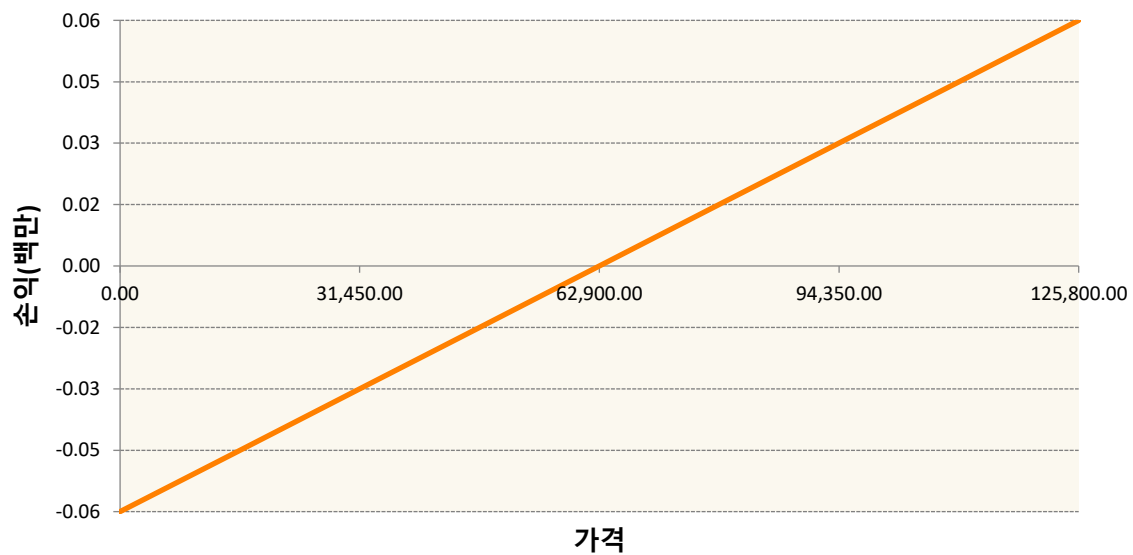
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



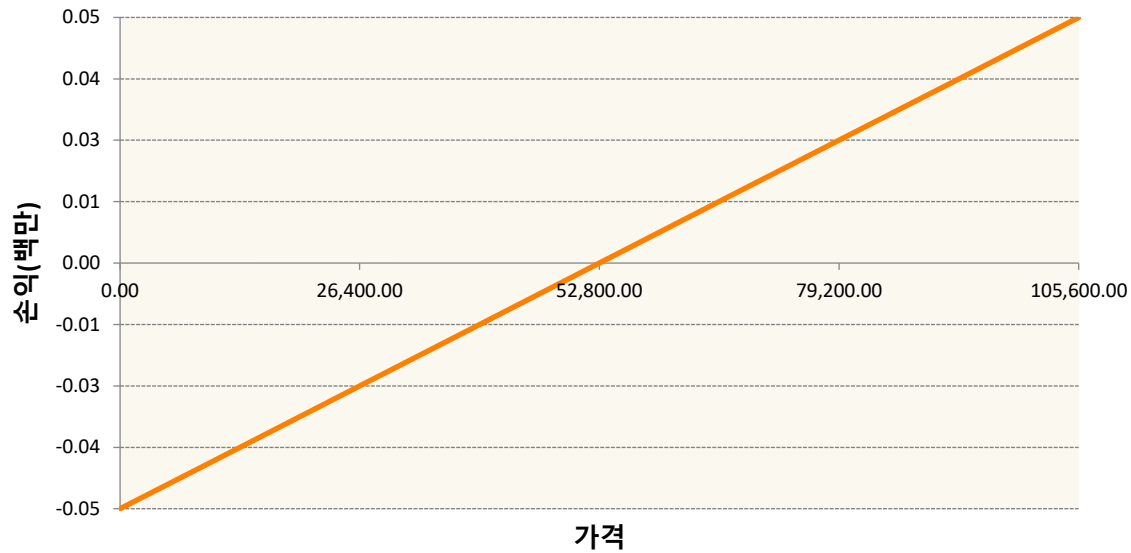
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



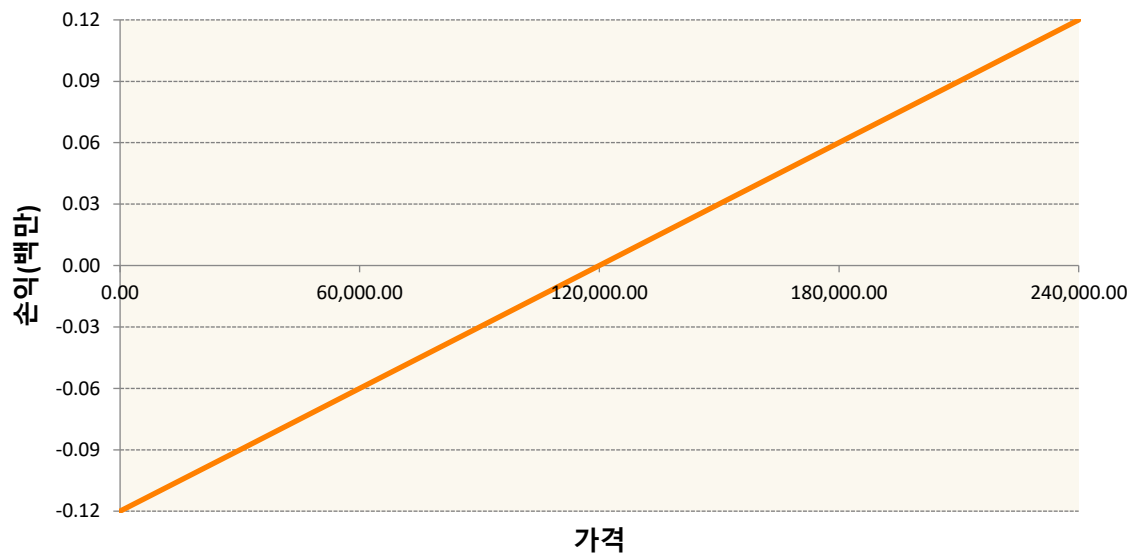
KR41EVWB0002-2025-11 한화시스템개별선물



KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	1,148
KR410FWB0(2025-11 두산로보틱스개별선물	15
KR410ZWB0(2025-11 한미반도체개별선물	68
KR411RWB0(2025-11 한화비전개별선물	4
KR4150WB0(2025-11 SK하이닉스개별선물	3
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물	50
KR41EJWB0C 2025-11 SKC개별선물	23
KR41EVWB0(2025-11 한화시스템개별선물	49
KR41F7WB0(2025-11 카카오페이개별선물	15
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물	34

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

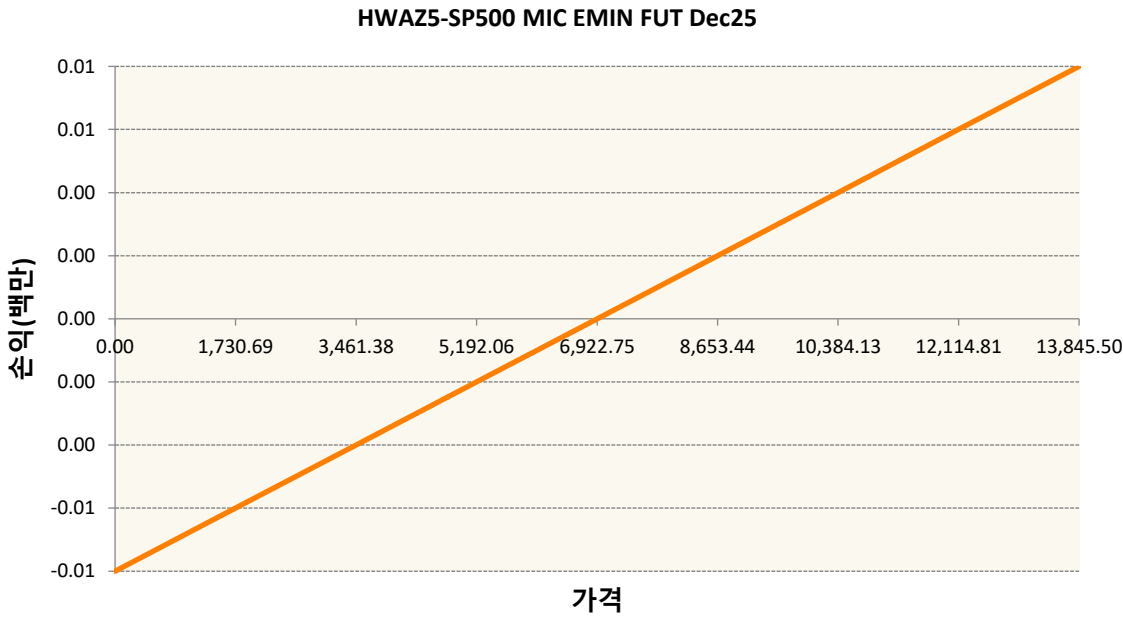
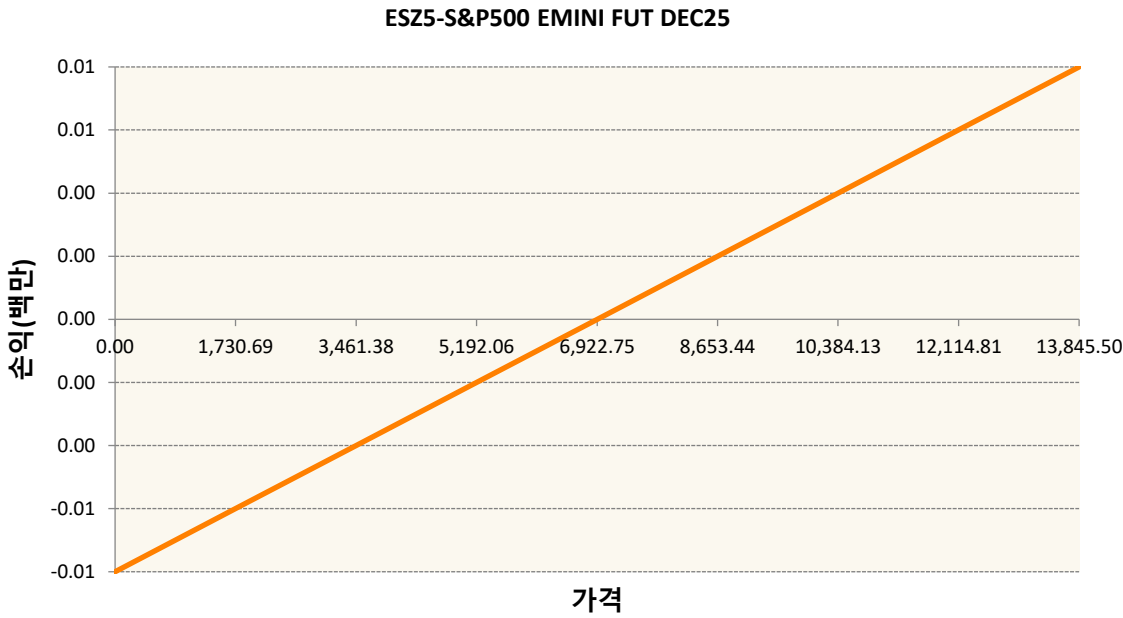
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	39,453	0	39,453	
누계	유가증권	선물	1,298	0	1,298	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,156
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,689

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

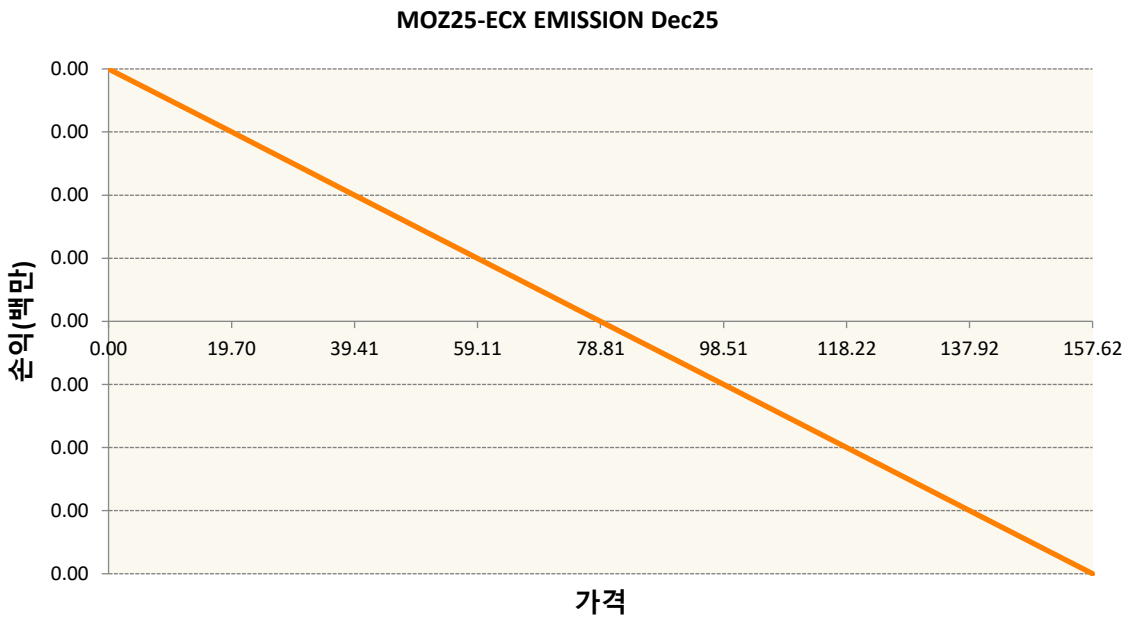
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	3,157	-3,157	
누계	지수	스왑	-8	0	-8	장외
누계	통화	선도	83	2,384	-2,301	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
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E	92
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	253

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

(단위:백만원)

467

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

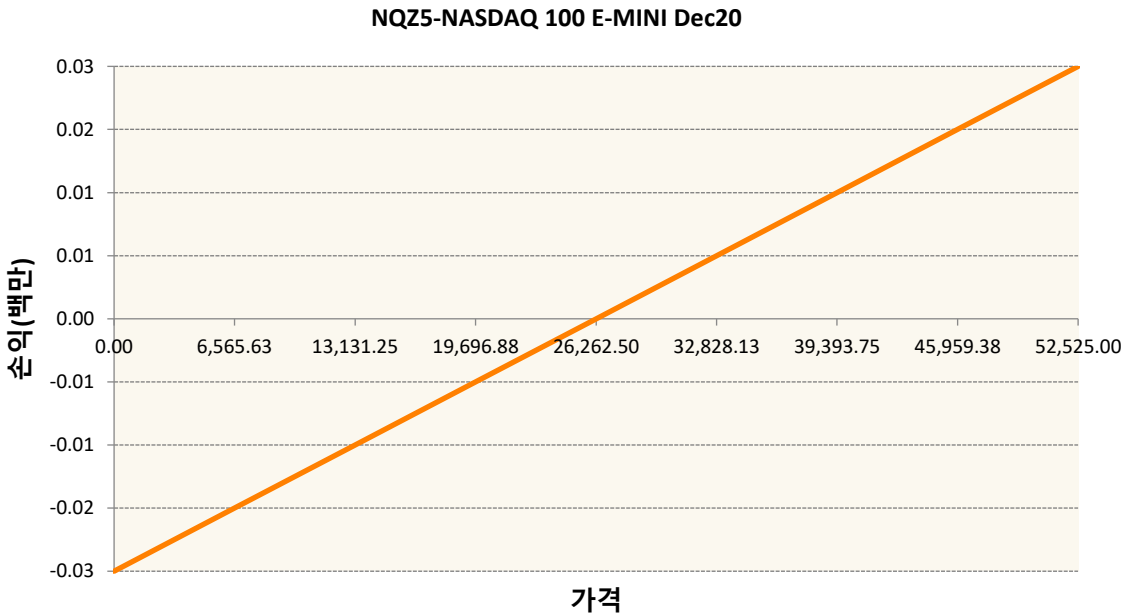
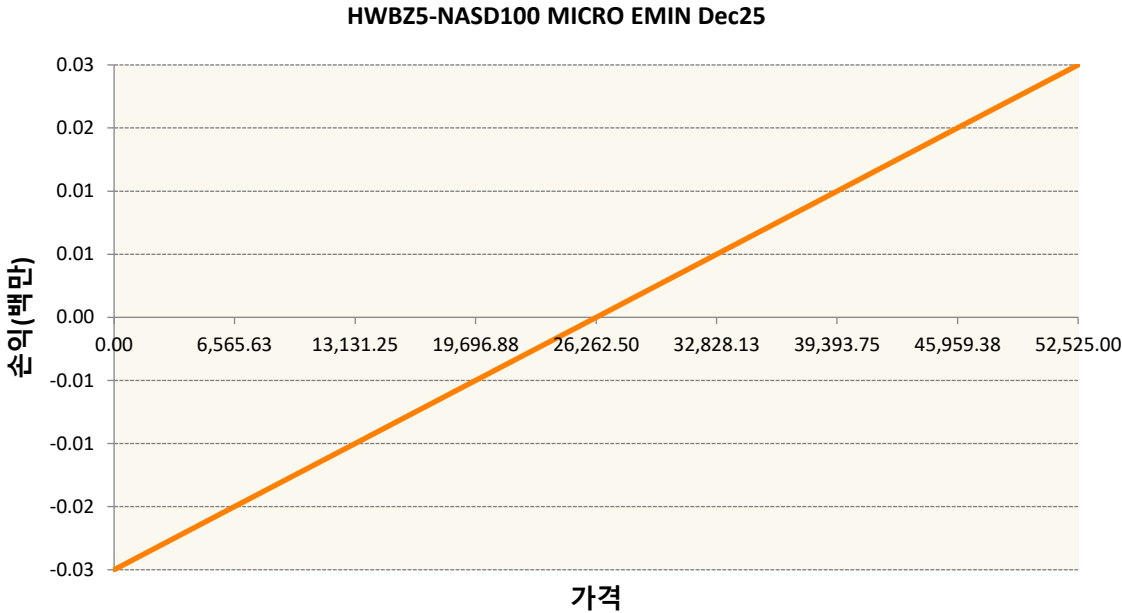
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	19,040	0	19,040	
누계	유가증권	선물	1,754	0	1,754	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25	140
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,523

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,842

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

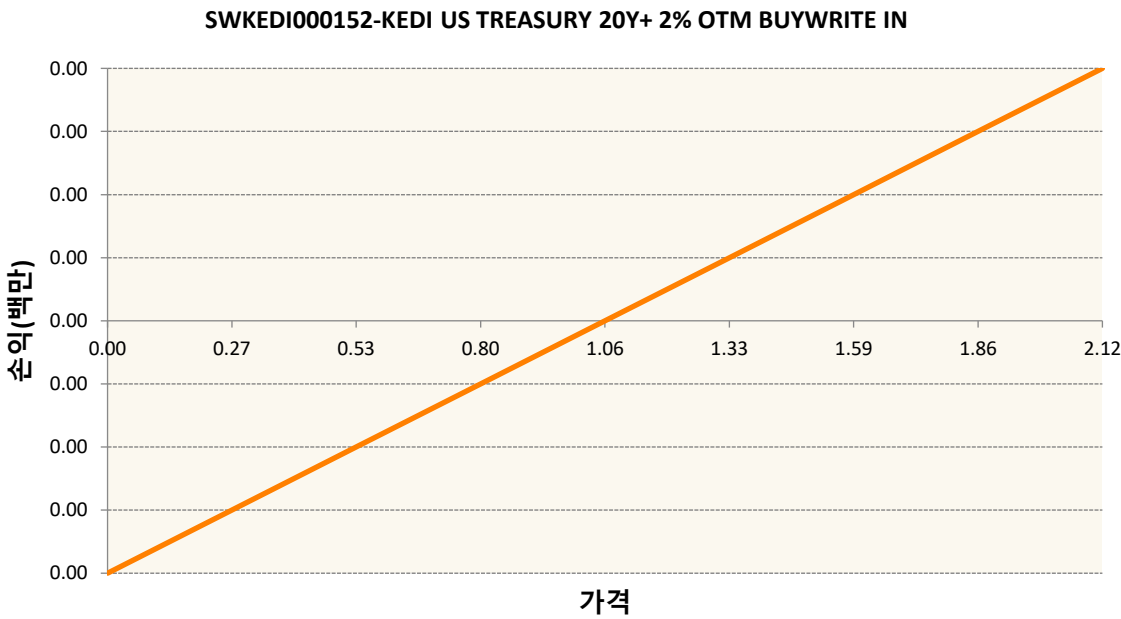
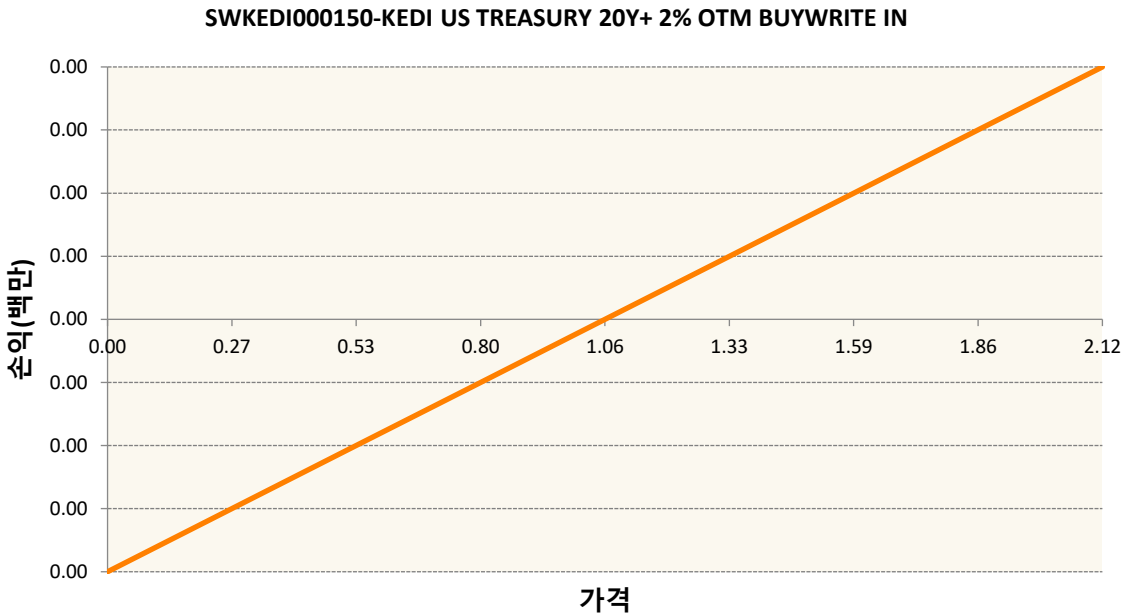
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

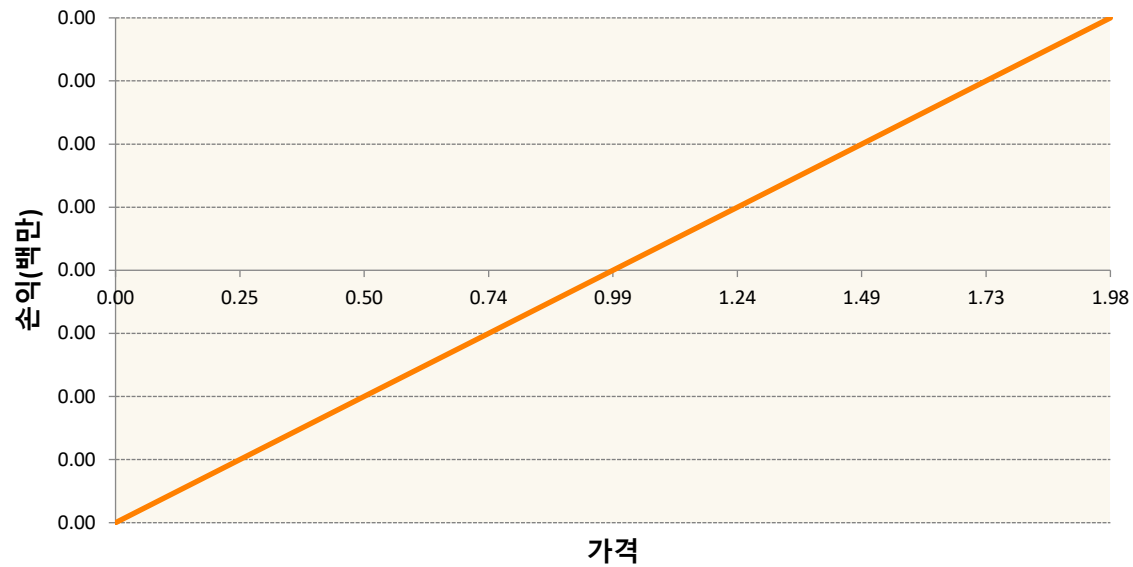
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	377,387	0	377,387	장외

2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000153-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

8,551
8,111
10,164
3,734

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

(단위:백만원)

14,597

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

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	2,271	0	2,271	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	11

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

(단위:백만원)

61

공시일	2025-10-31
기준일	2025-10-30

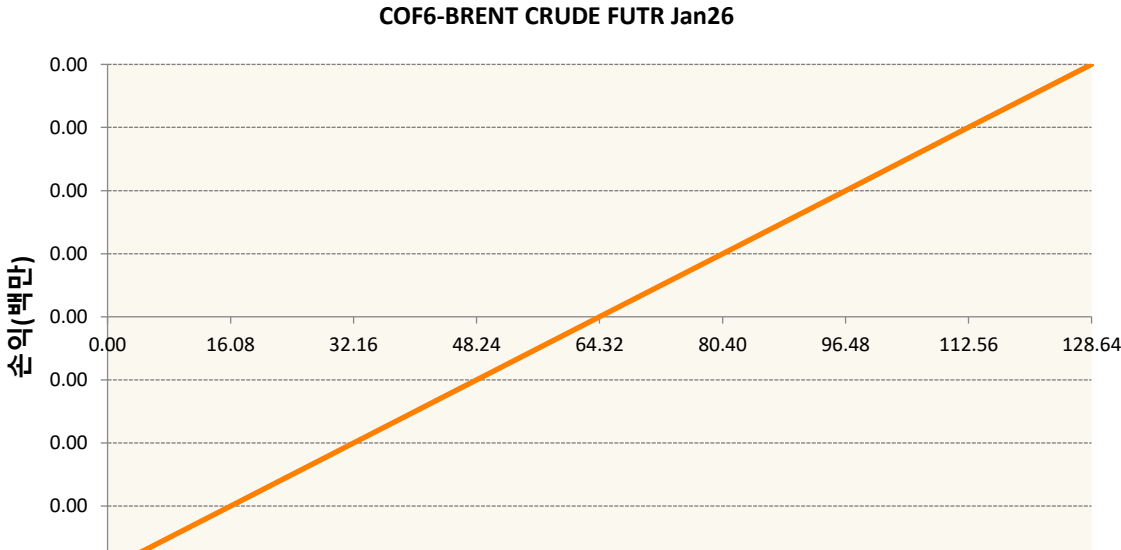
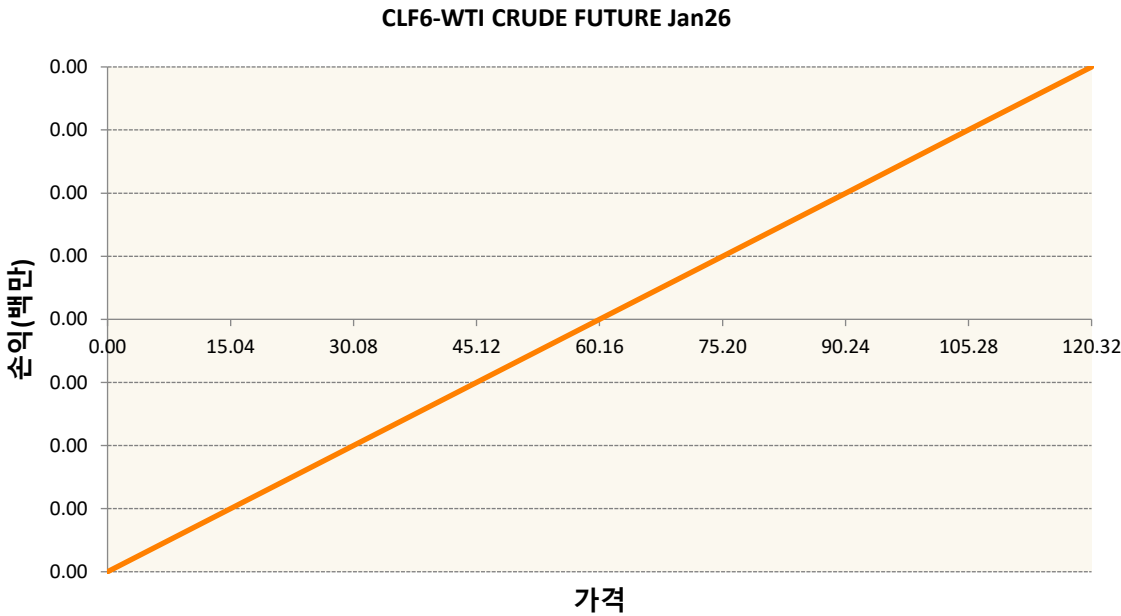
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

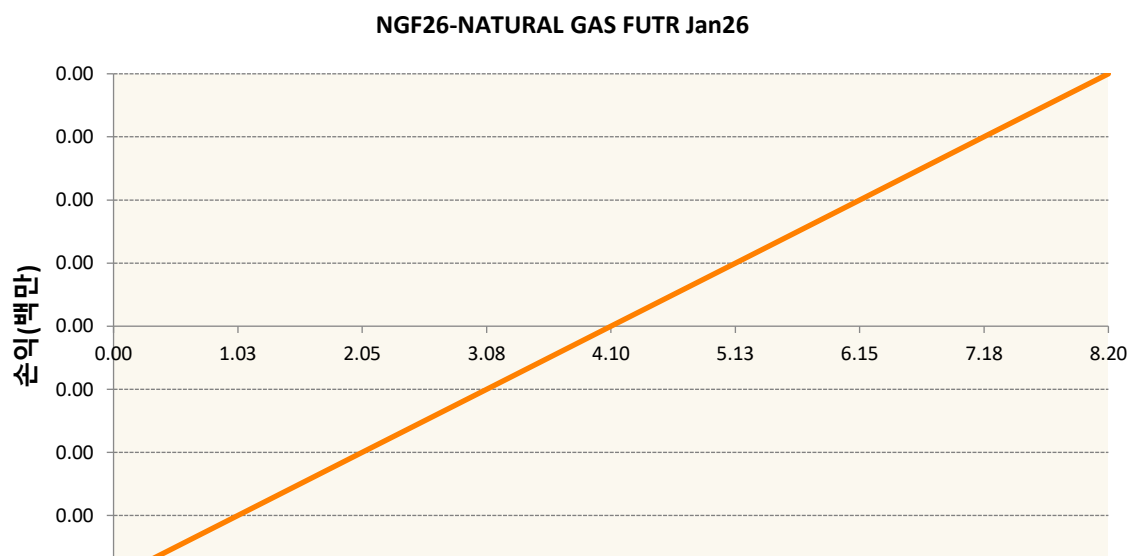
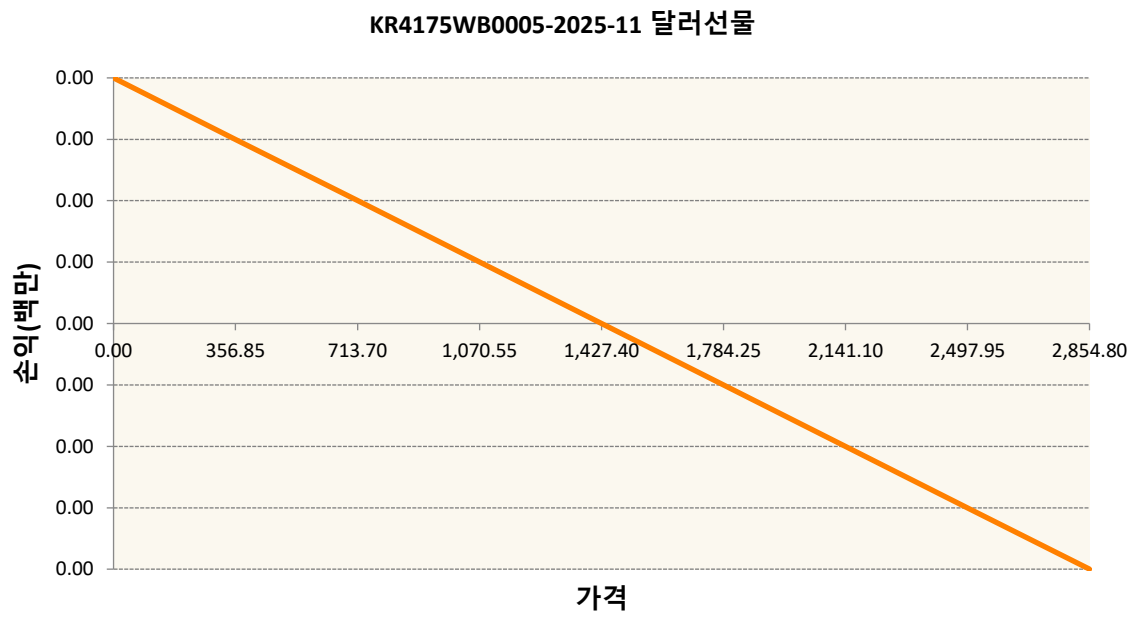
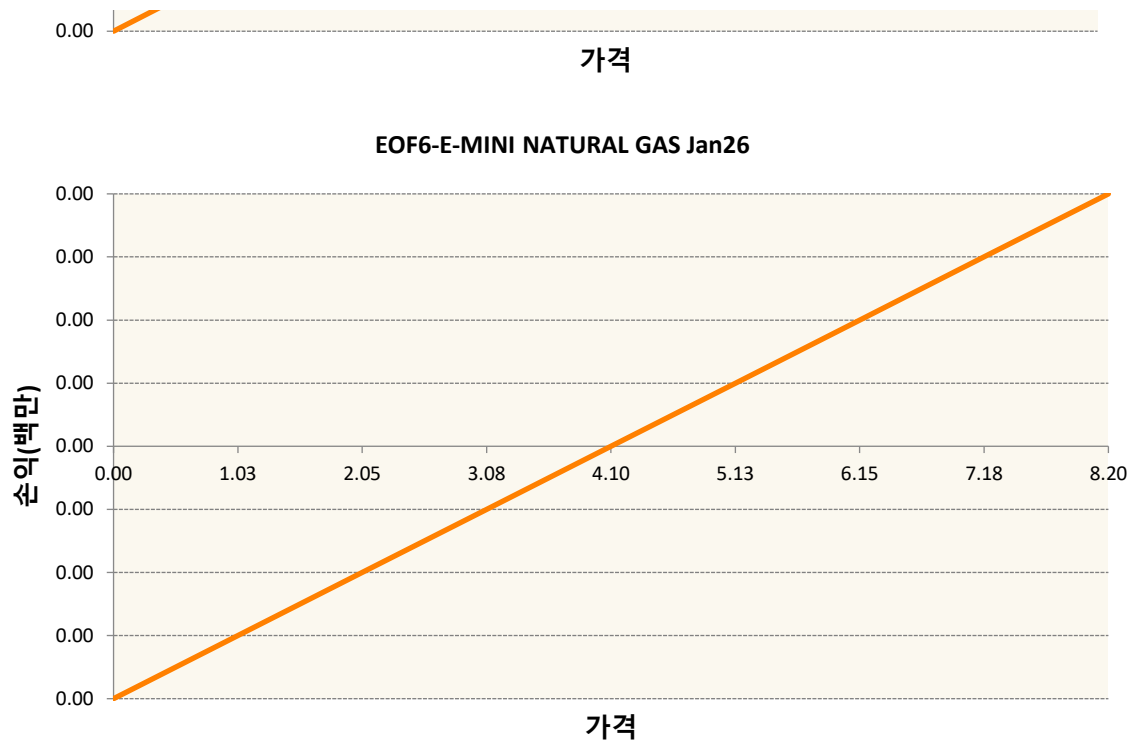
1. 계약금액

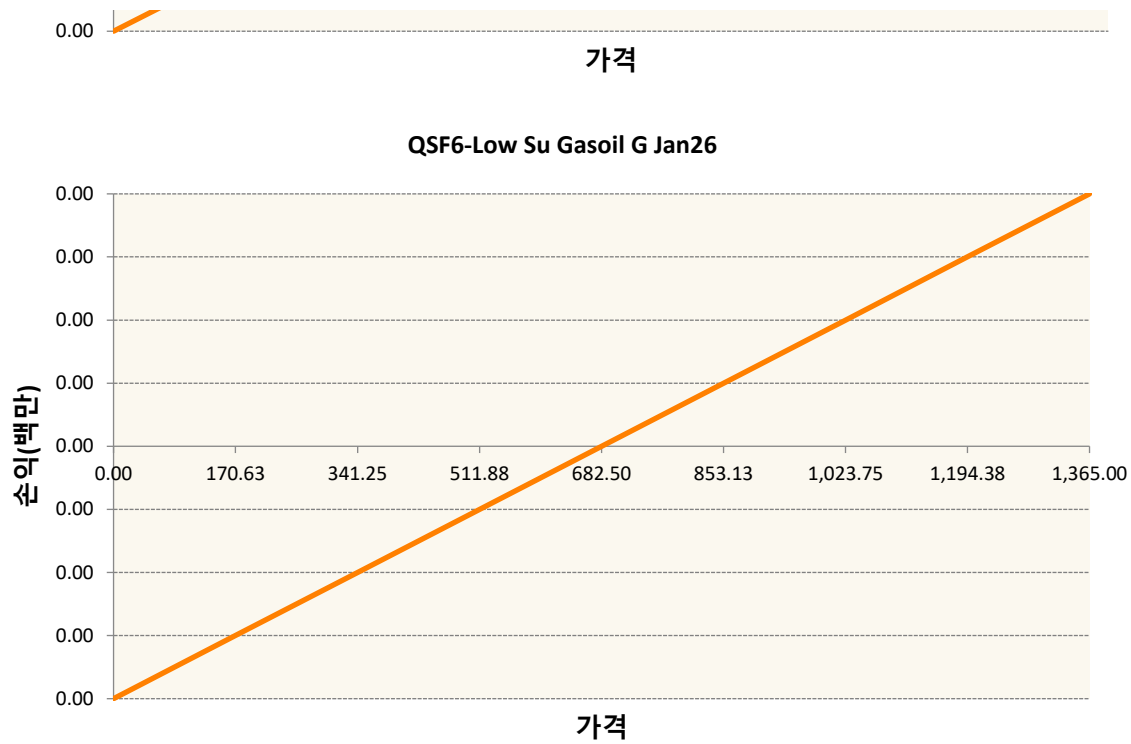
(단위:백만원)

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	343	0	343	
누계	유가증권	선물	179	0	179	
누계	통화	선물	0	100	-100	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF6	WTI CRUDE FUTURE Jan26	7
COF6	BRENT CRUDE FUTR Jan26	14
EOF6	E-MINI NATURAL GAS Jan26	3
KR4175WB0(2025-11	달러선물	8
NGF26	NATURAL GAS FUTR Jan26	9
QSF6	Low Su Gasoil G Jan26	8

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

(단위:백만원)

90