

공시일 2025-11-03

기준일 2025-10-31

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	2025-11-03
기준일	2025-10-31

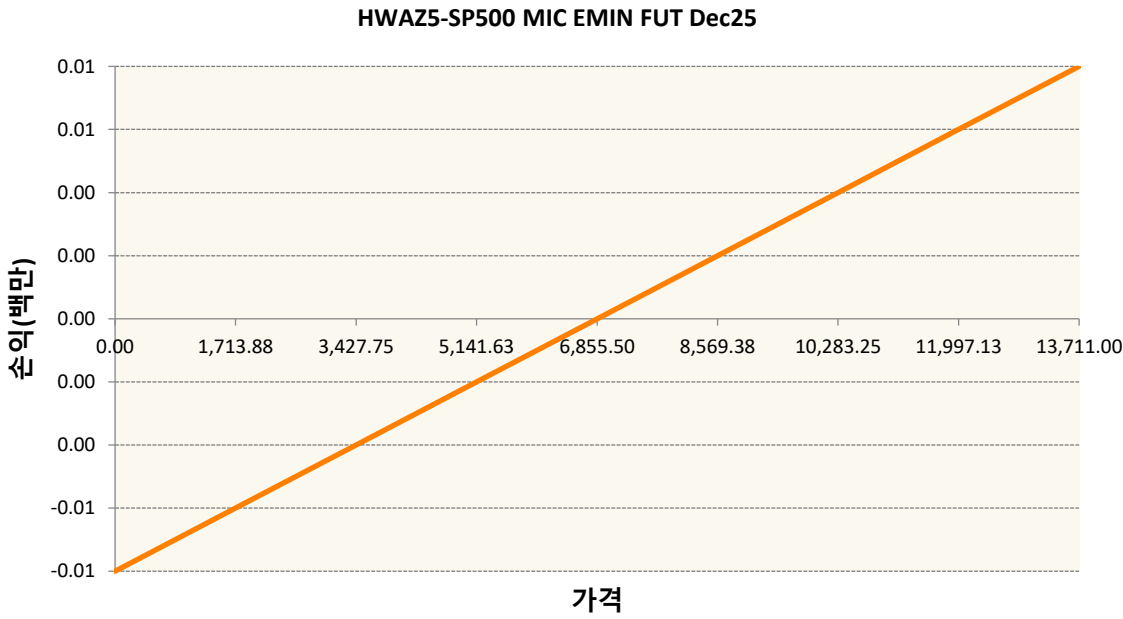
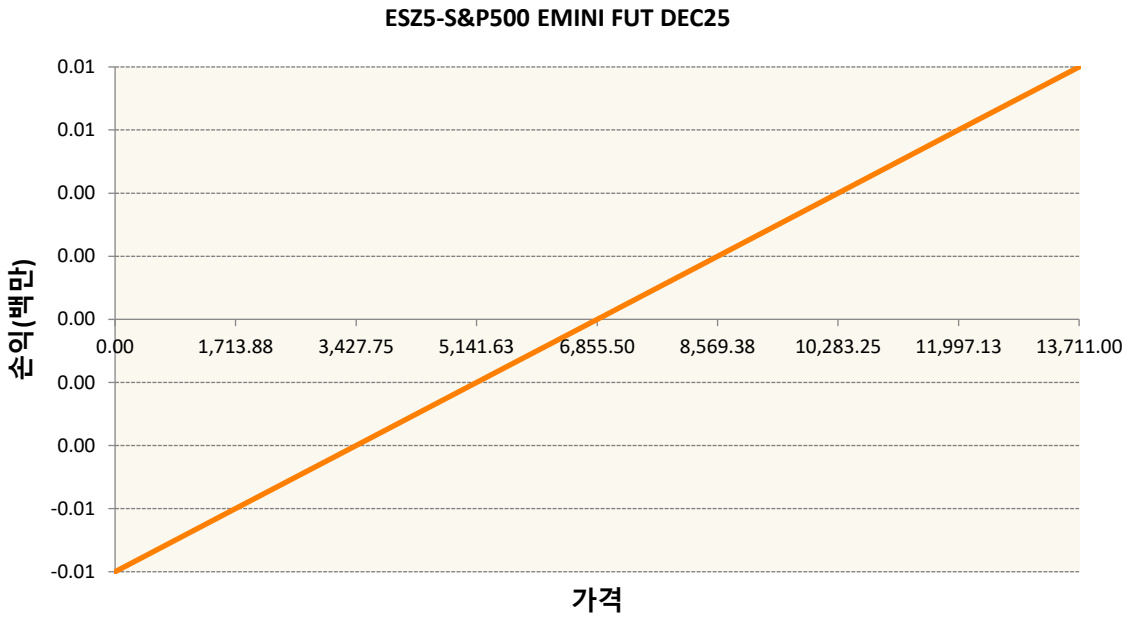
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	476	0	476	
누계	유가증권	선물	190	0	190	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	2025-11-03
기준일	2025-10-31

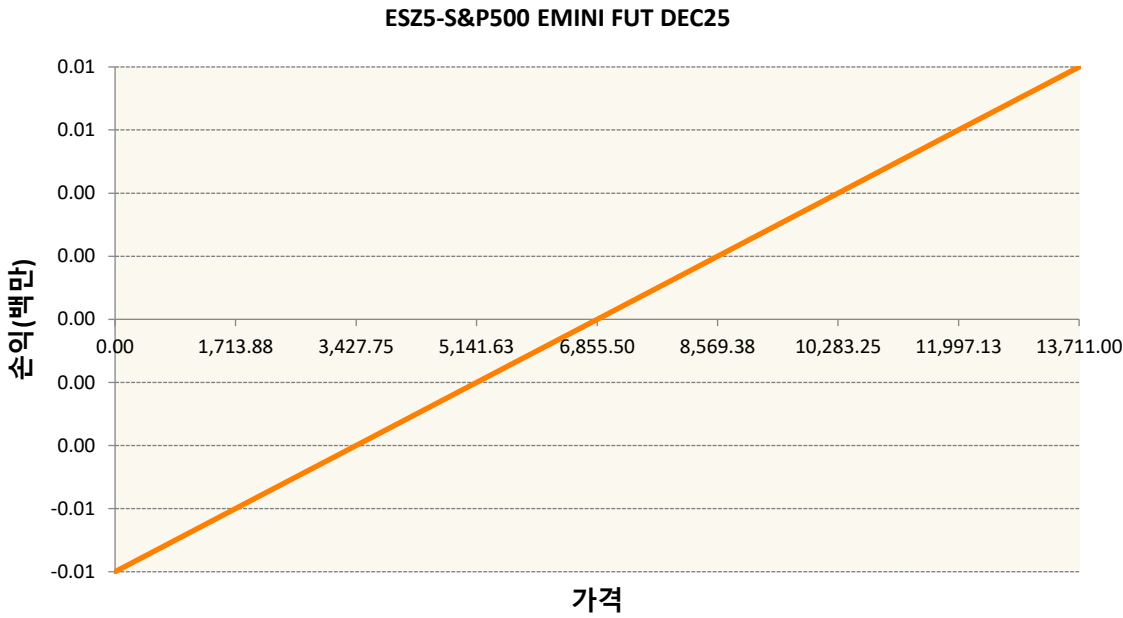
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,428	0	1,428	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	114
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

166

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

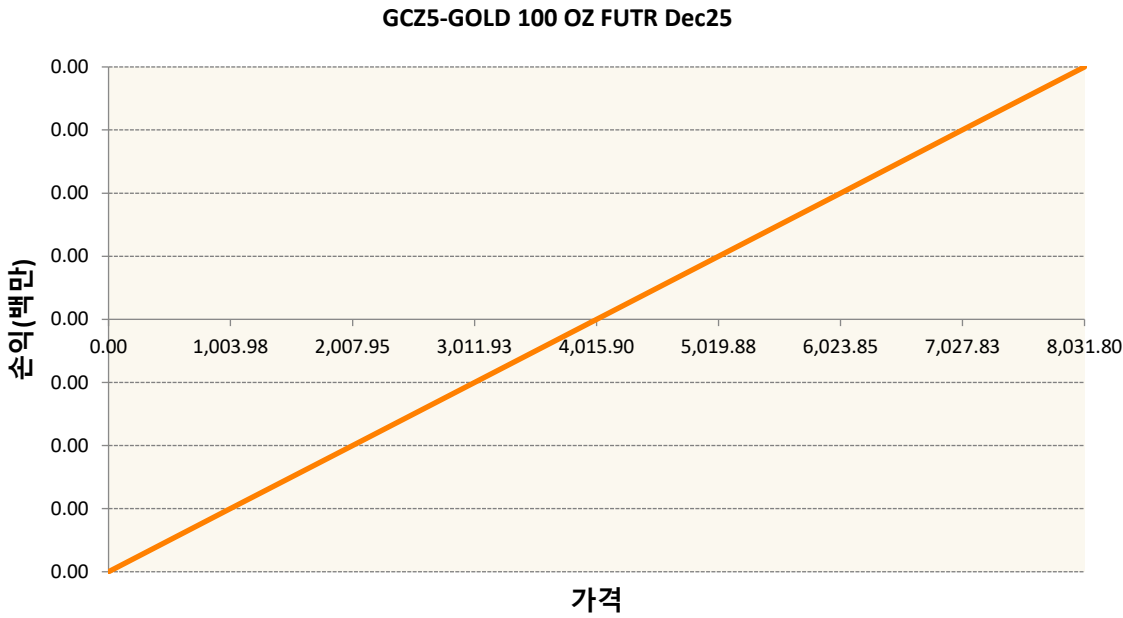
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	2,819	0	2,819	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 10/31/25 C390 EQUITY	2
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	226

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

(단위:백만원)

213

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

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	8
AOPLTRUP1\$PLTR US 10/31/25 P187.5 EQUITY	62

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

(단위:백만원)

280

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

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	2025-11-03
기준일	2025-10-31

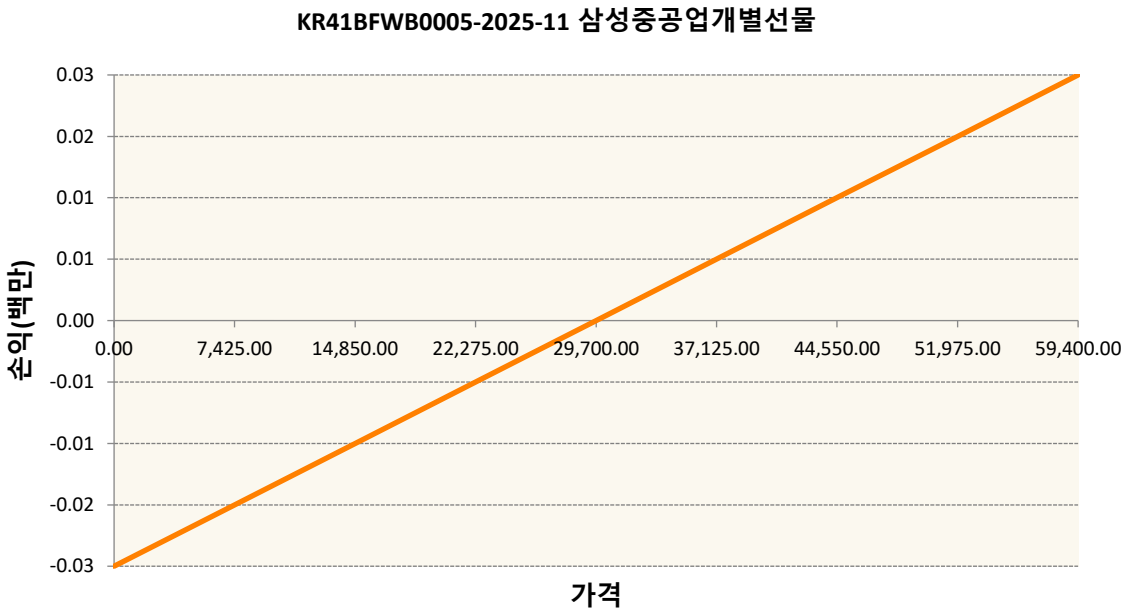
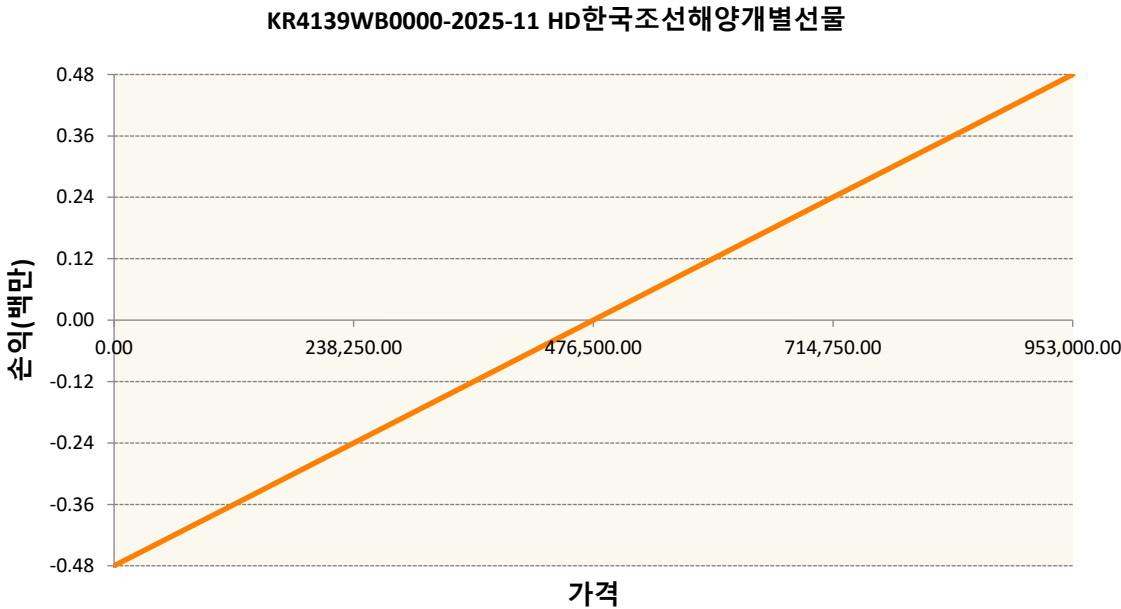
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

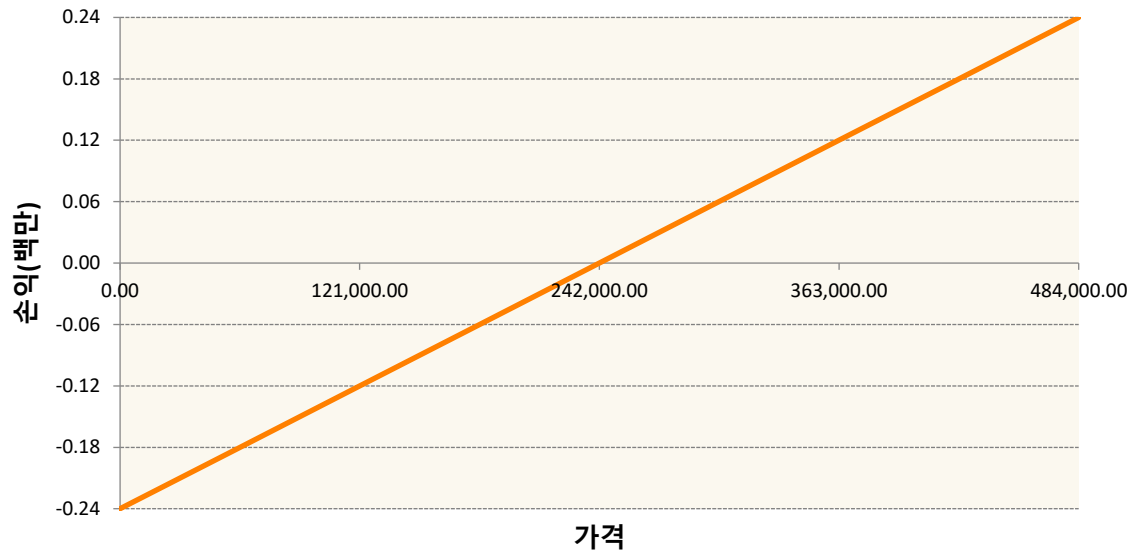
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	68,084	0	68,084	장내

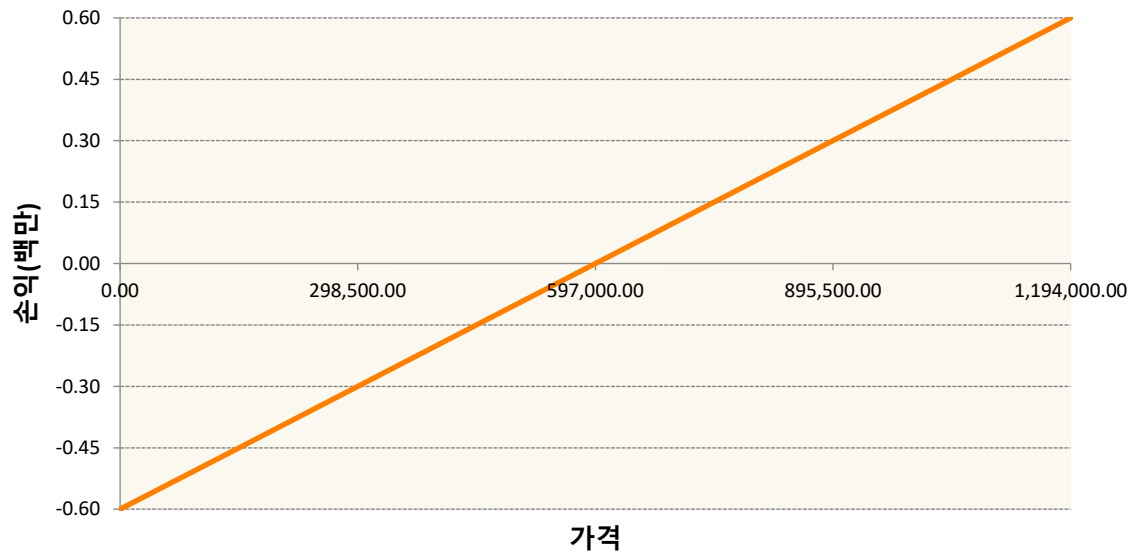
2. 만기시점의 손익구조



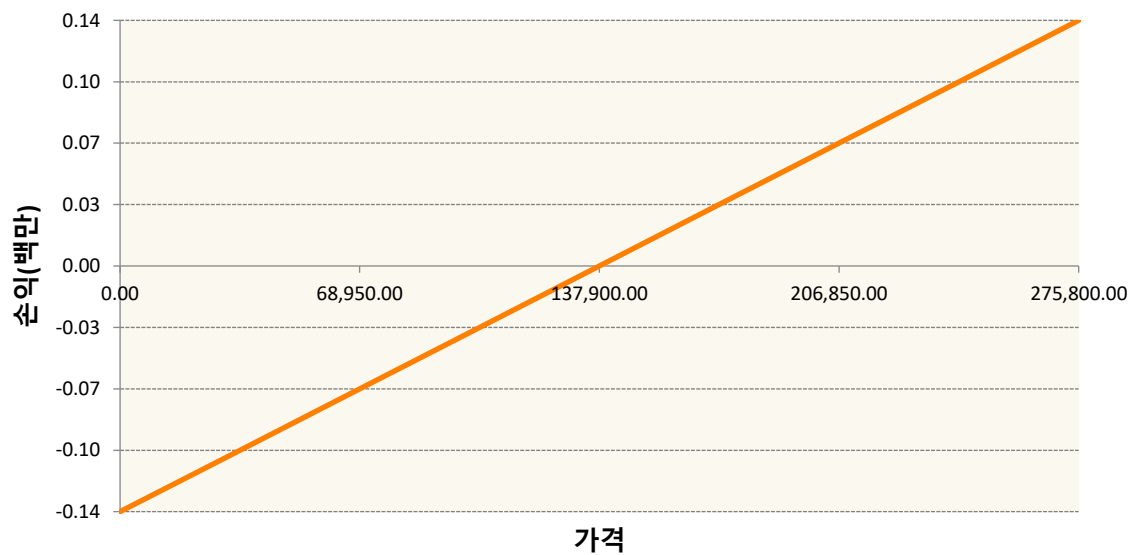
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



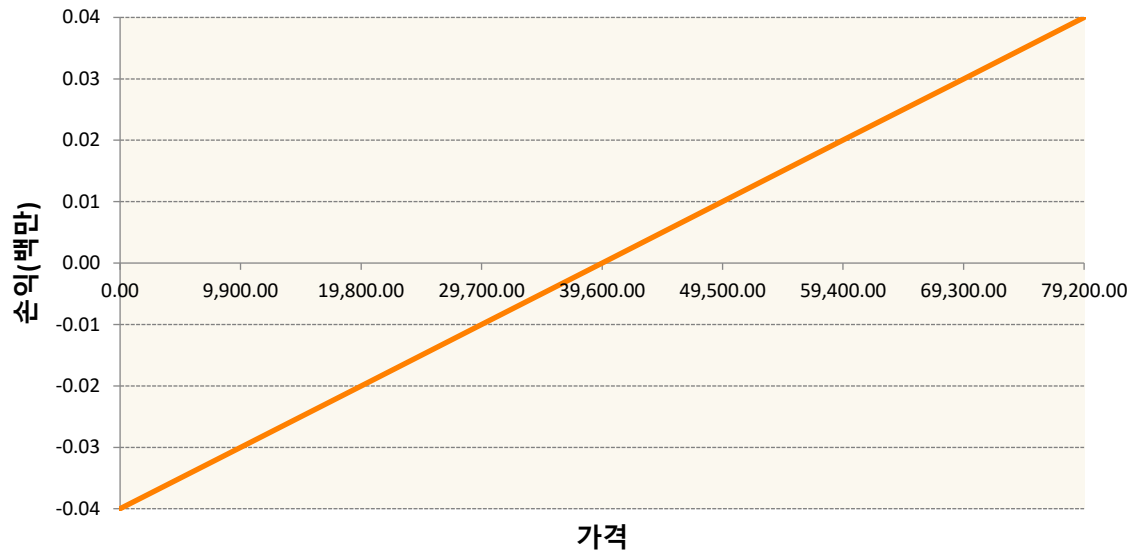
KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



KR41M7WC0000-2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4139WB0000 2025-11 HD한국조선해양개별선물								1,369
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,369	-1,369	-1,369	-1,369	-1,369	-1,369	-1,369	-1,369
-5.33%	-912	-912	-912	-912	-912	-912	-912	-912
-2.67%	-456	-456	-456	-456	-456	-456	-456	-456
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	456	456	456	456	456	456	456	456
5.33%	912	912	912	912	912	912	912	912
8.00%	1,369	1,369	1,369	1,369	1,369	1,369	1,369	1,369
KR41BFWB0005 2025-11 삼성중공업개별선물								1,464
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464	-1,464
-5.33%	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976	-976
-2.67%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	488	488	488	488	488	488	488	488
5.33%	976	976	976	976	976	976	976	976
8.00%	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464	1,464
KR41CDWB0006 2025-11 HD현대미포개별선물								546
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
-5.33%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
-2.67%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	182	182	182	182	182	182	182
5.33%	364	364	364	364	364	364	364
8.00%	546	546	546	546	546	546	546
KR41FDWB0003 2025-11 HD현대중공업개별선물							711
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-711	-711	-711	-711	-711	-711	-711
-5.33%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474
-2.67%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	237	237	237	237	237	237	237
5.33%	474	474	474	474	474	474	474
8.00%	711	711	711	711	711	711	711
KR41FVWB0001 2025-11 한화오션개별선물							1,121
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,121	-1,121	-1,121	-1,121	-1,121	-1,121	-1,121
-5.33%	-747	-747	-747	-747	-747	-747	-747
-2.67%	-374	-374	-374	-374	-374	-374	-374
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	374	374	374	374	374	374	374
5.33%	747	747	747	747	747	747	747
8.00%	1,121	1,121	1,121	1,121	1,121	1,121	1,121
KR41M7WC0000 2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물							2,206
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206	-2,206
-5.33%	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471	-1,471
-2.67%	-735	-735	-735	-735	-735	-735	-735
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	735	735	735	735	735	735	735
5.33%	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471	1,471
8.00%	2,206	2,206	2,206	2,206	2,206	2,206	2,206

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

(단위:백만원)

6,974

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

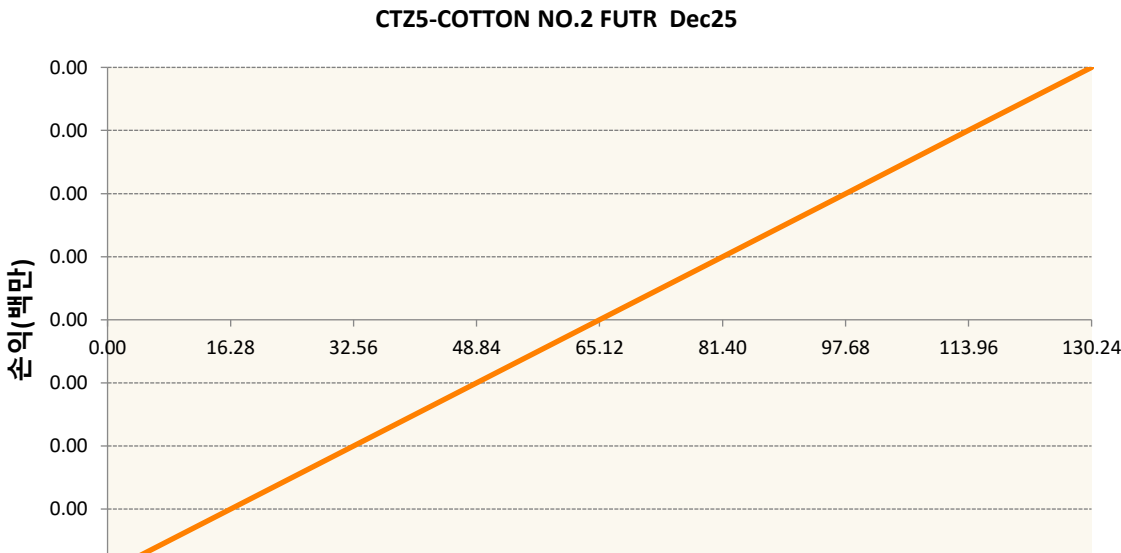
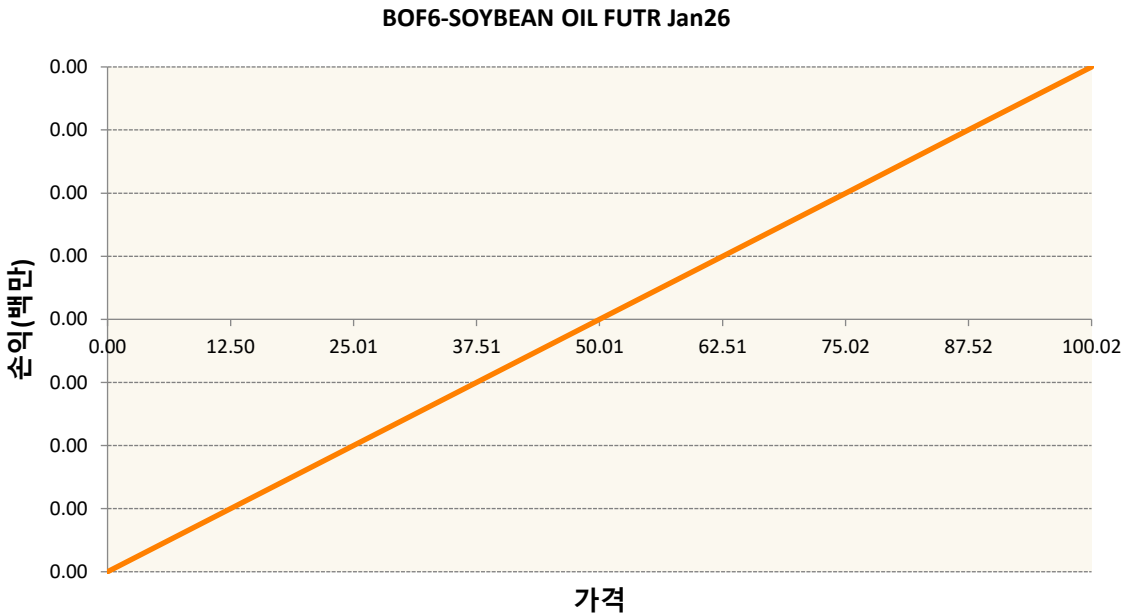
포커스농산물모(채권-파생형)

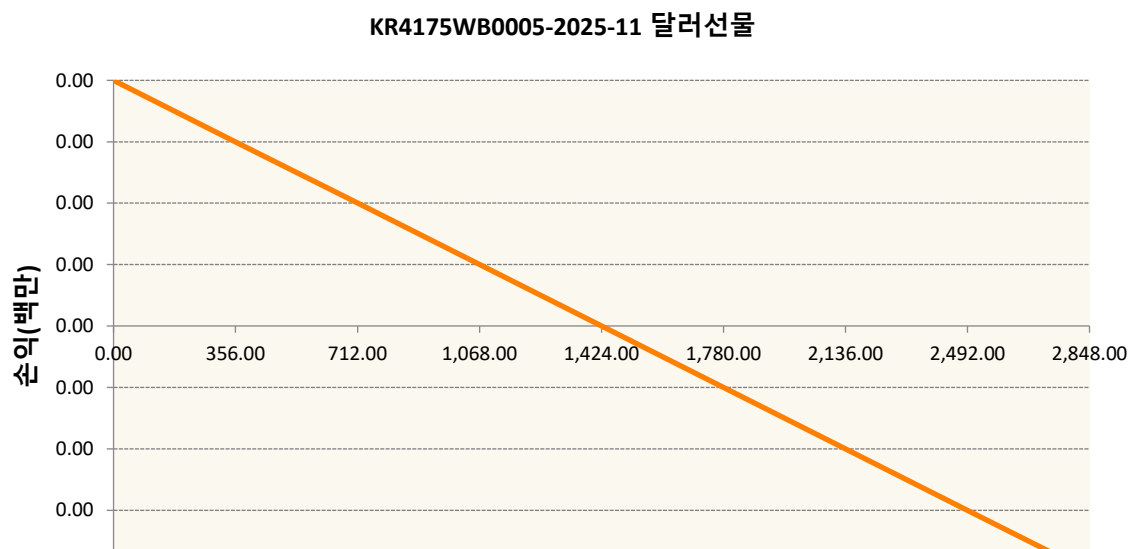
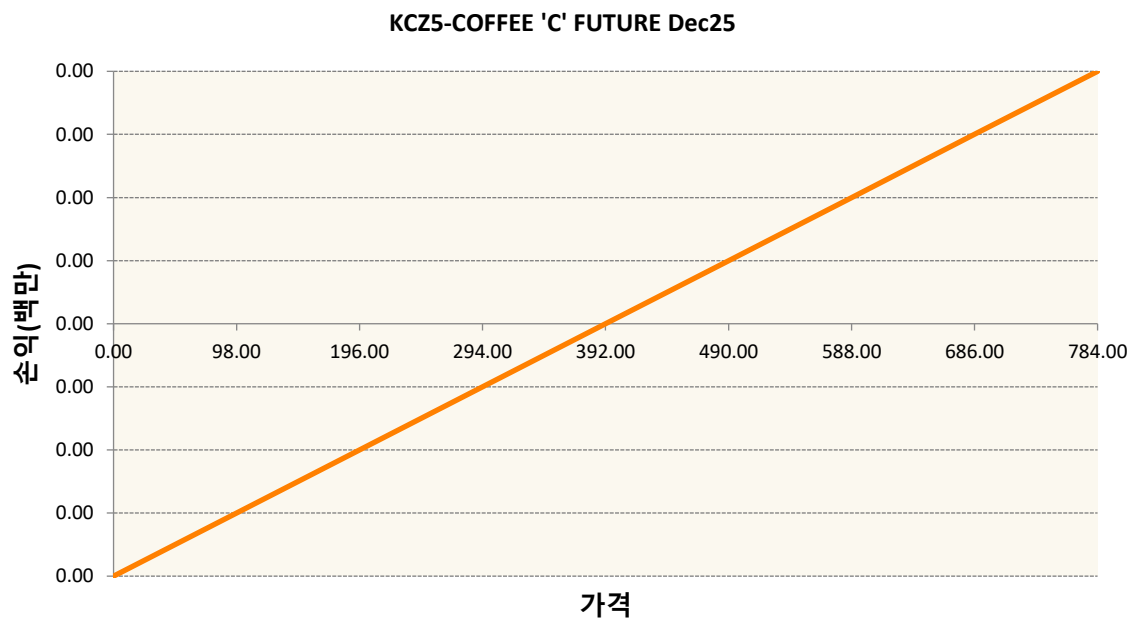
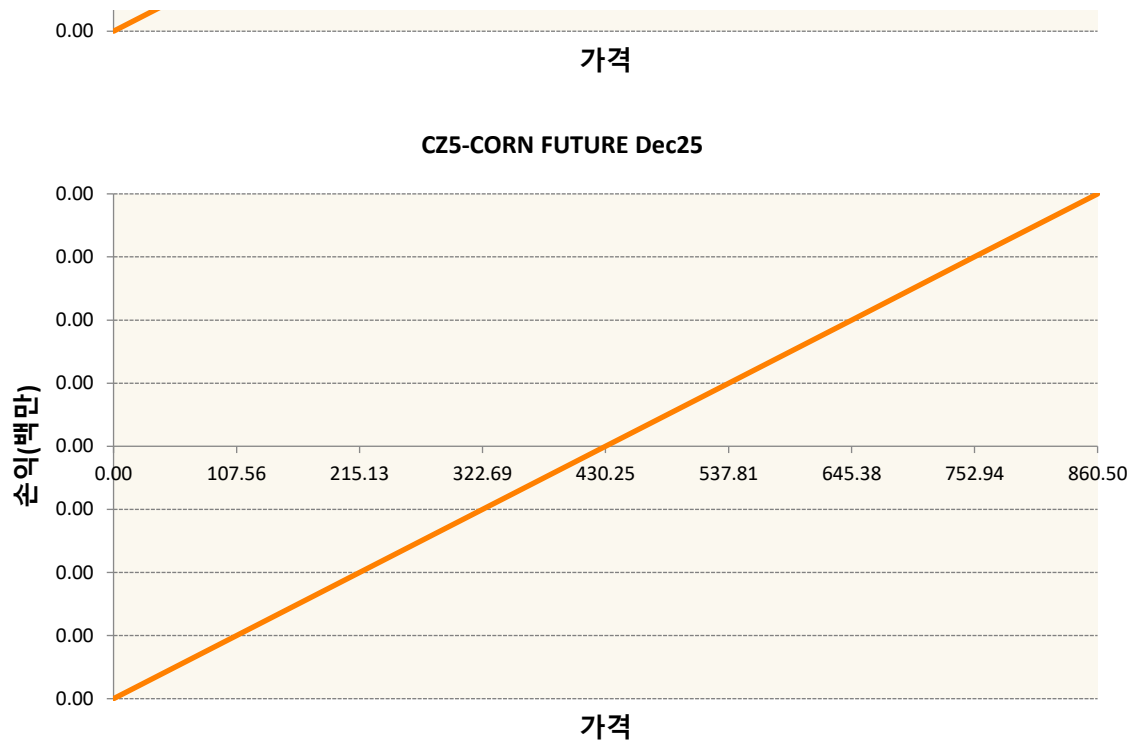
1. 계약금액

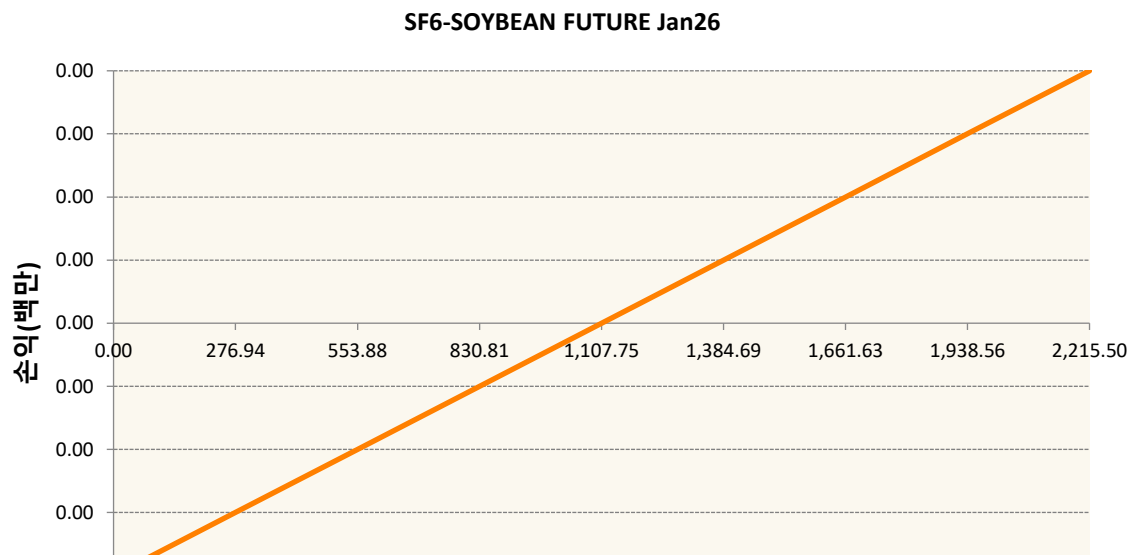
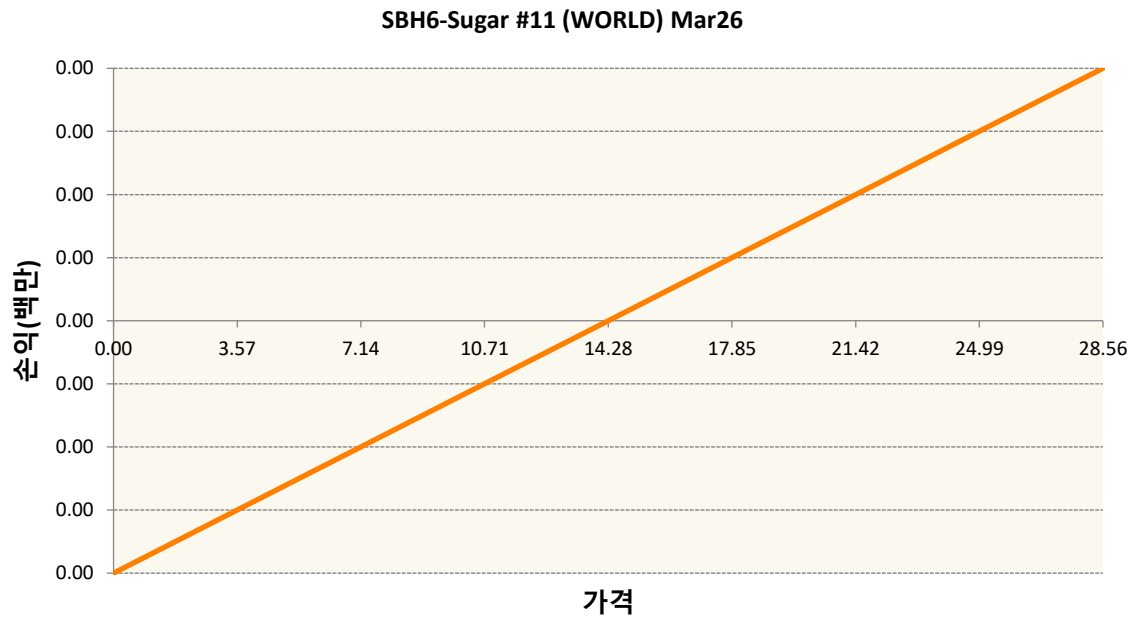
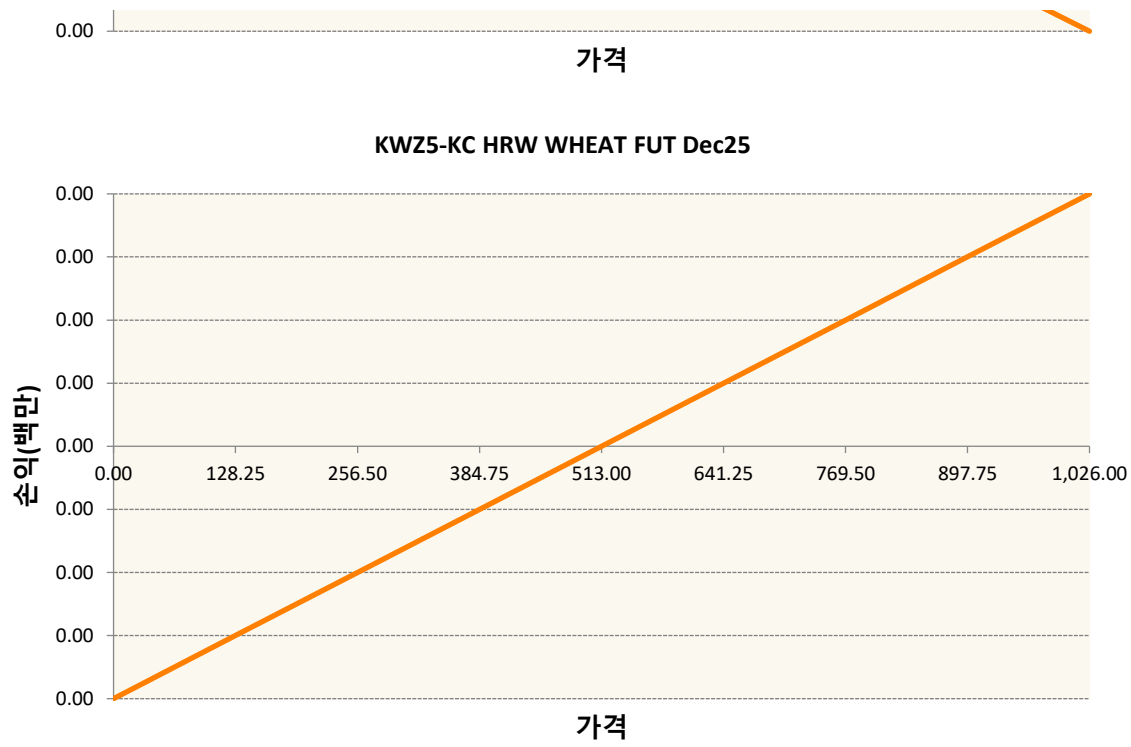
(단위:USD 백만)

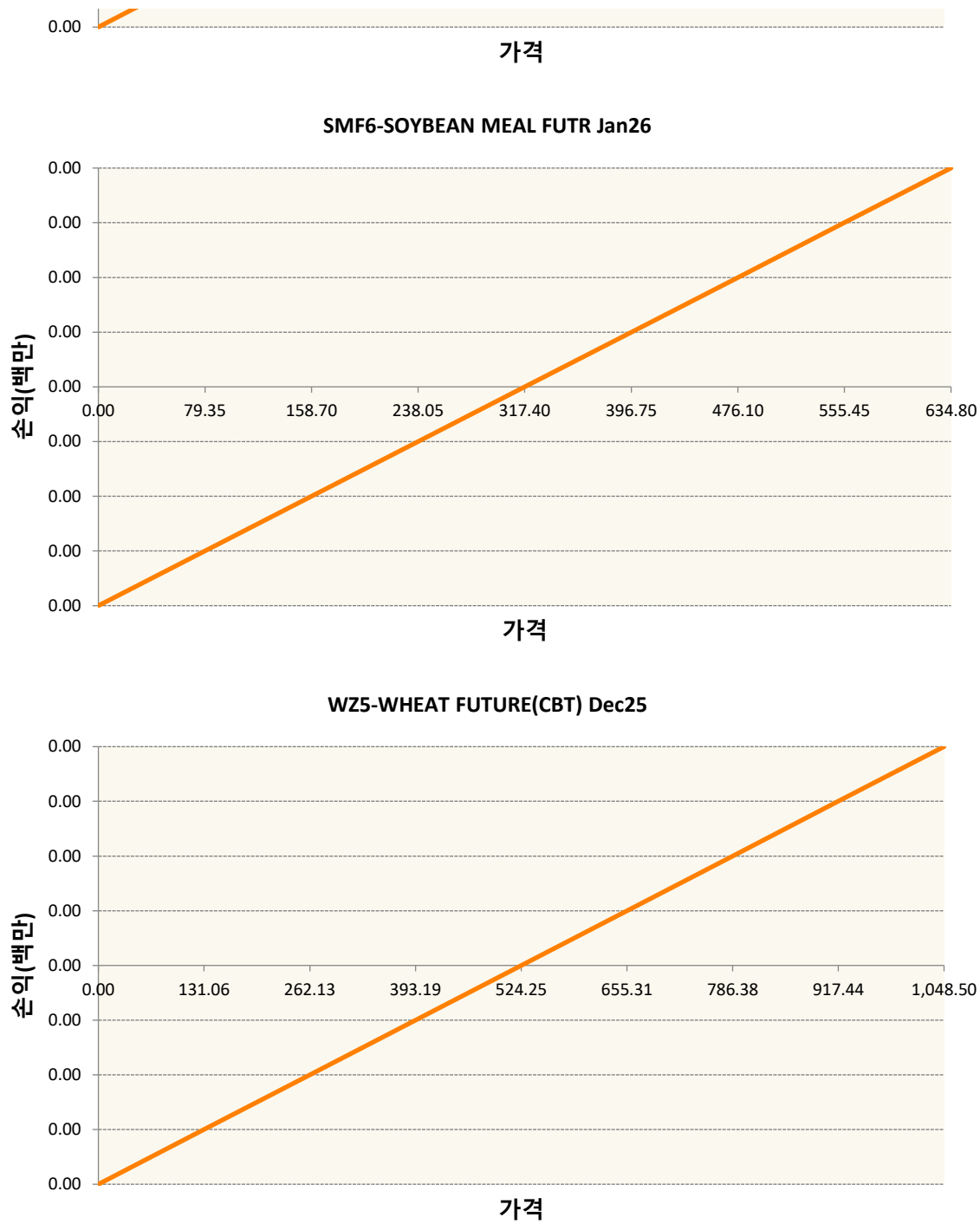
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,135	0	1,135	
누계	유가증권	선물	2,144	0	2,144	
누계	통화	선물	0	356	-356	장내

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	2025-11-03
기준일	2025-10-31

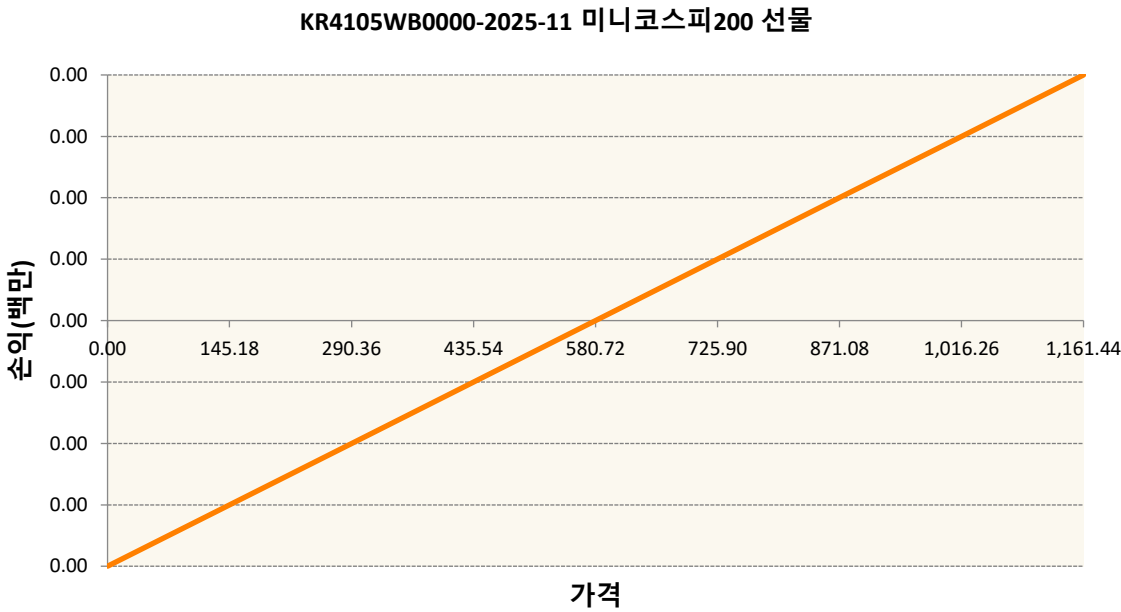
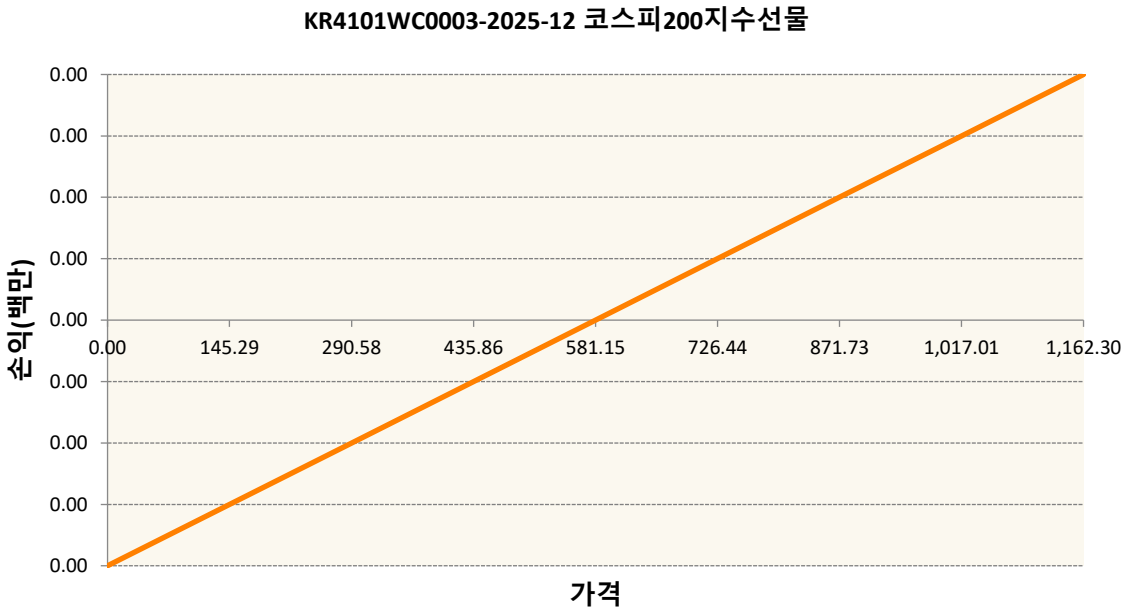
스마트인덱스모

1. 계약금액

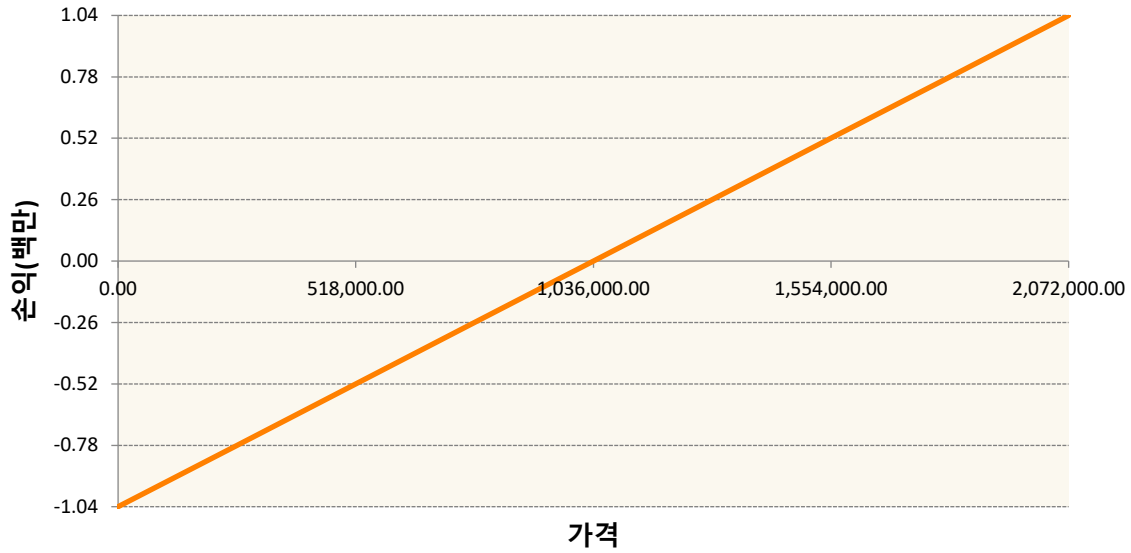
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	581	0	581	장내
누계	유가증권	선물	1,885	0	1,885	장내

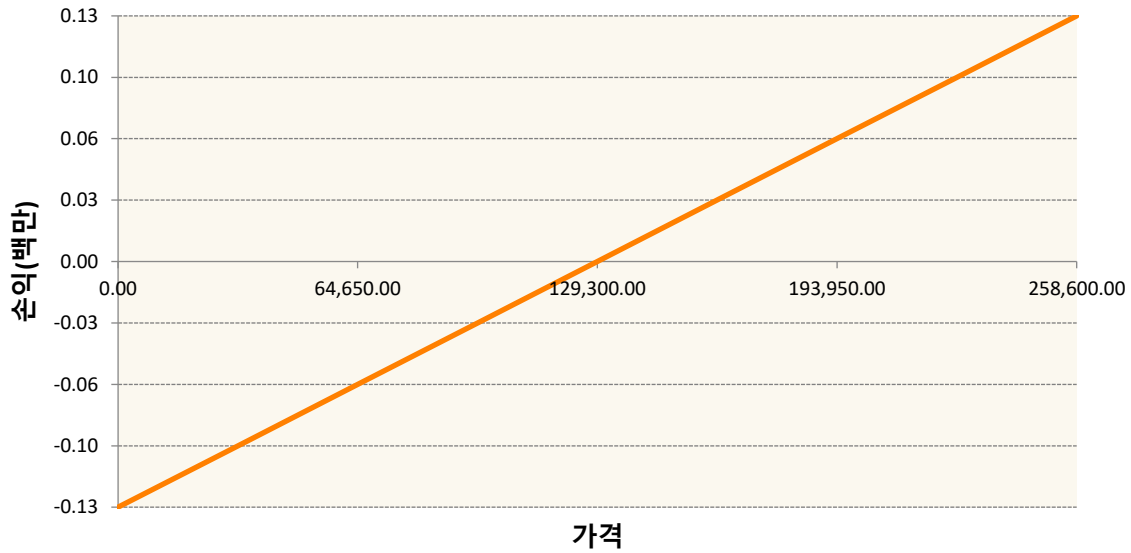
2. 만기시점의 손익구조



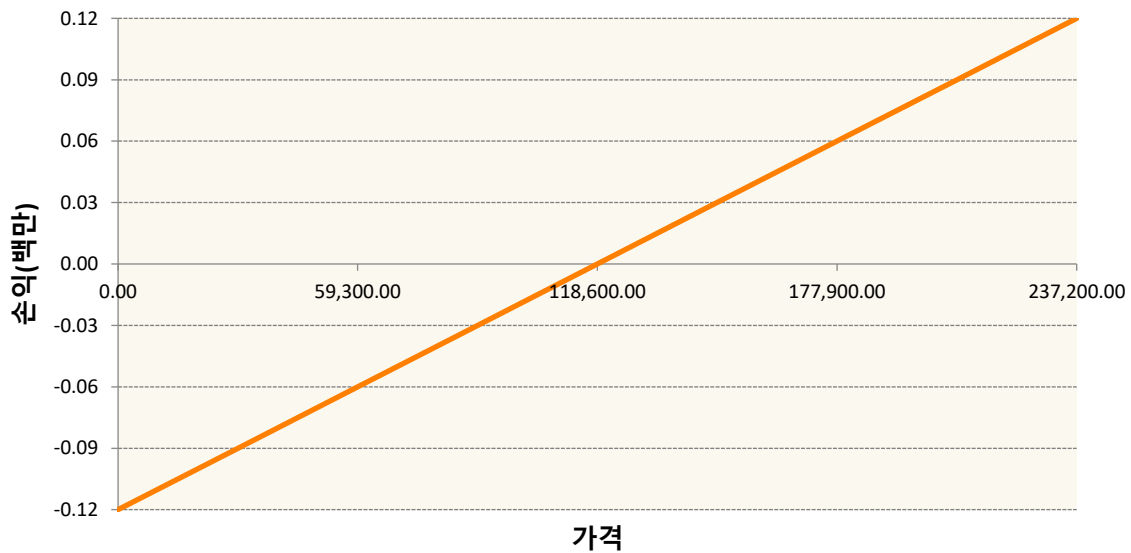
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물		105
KR4105WB0(2025-11 미니코스피200 선물		7
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물		6
KR41EJWB0(2025-11 SKC개별선물		2
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물		3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	42

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

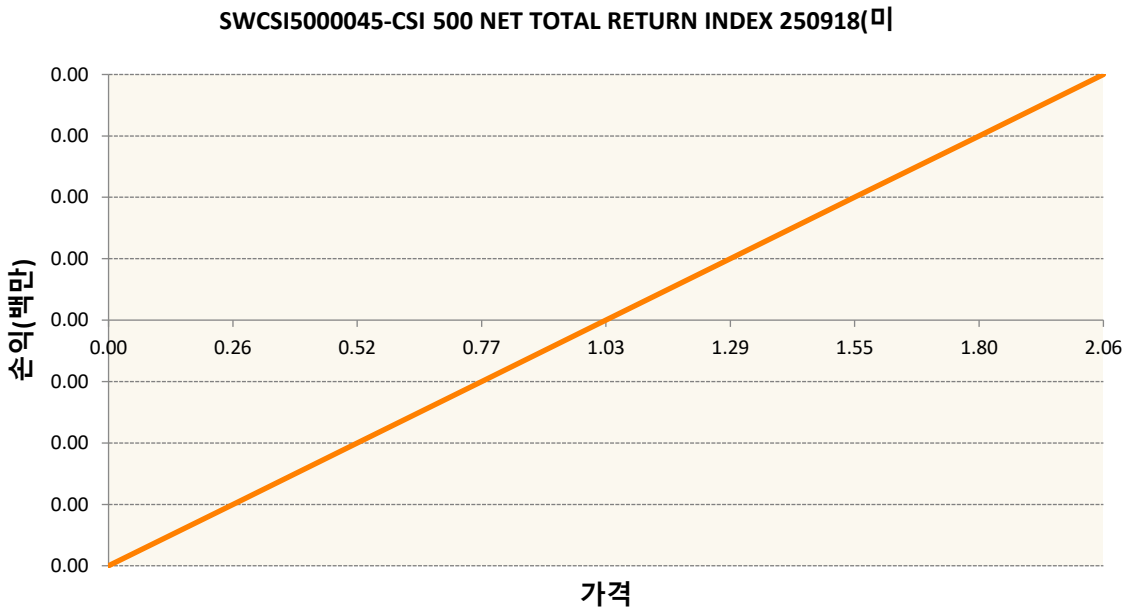
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,841	0	4,841	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미	388
--	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

496

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

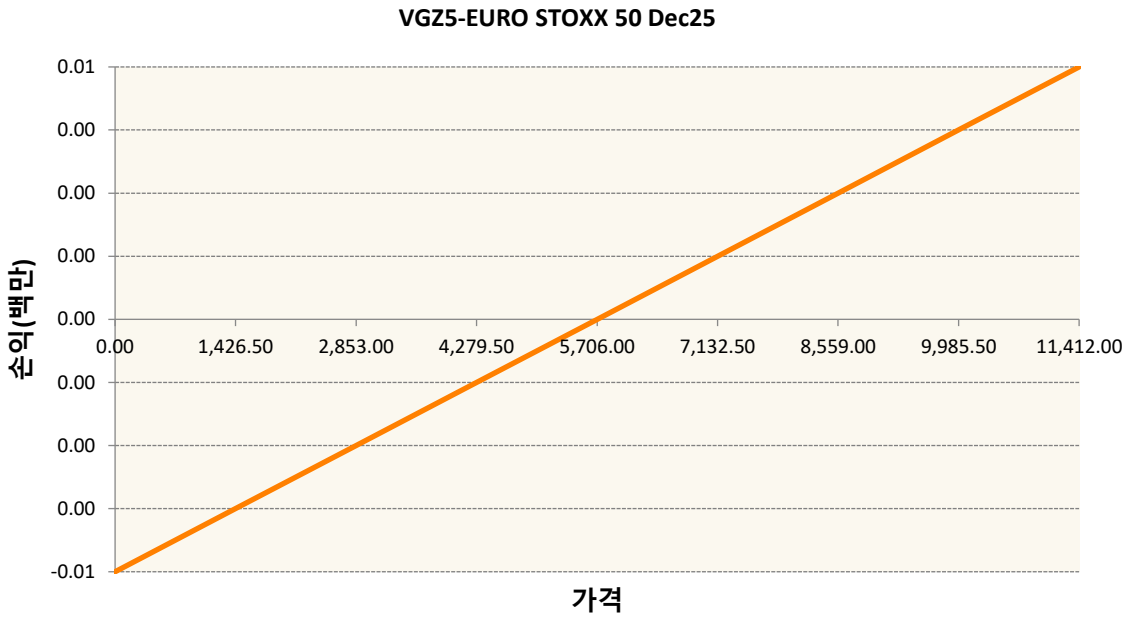
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

50

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

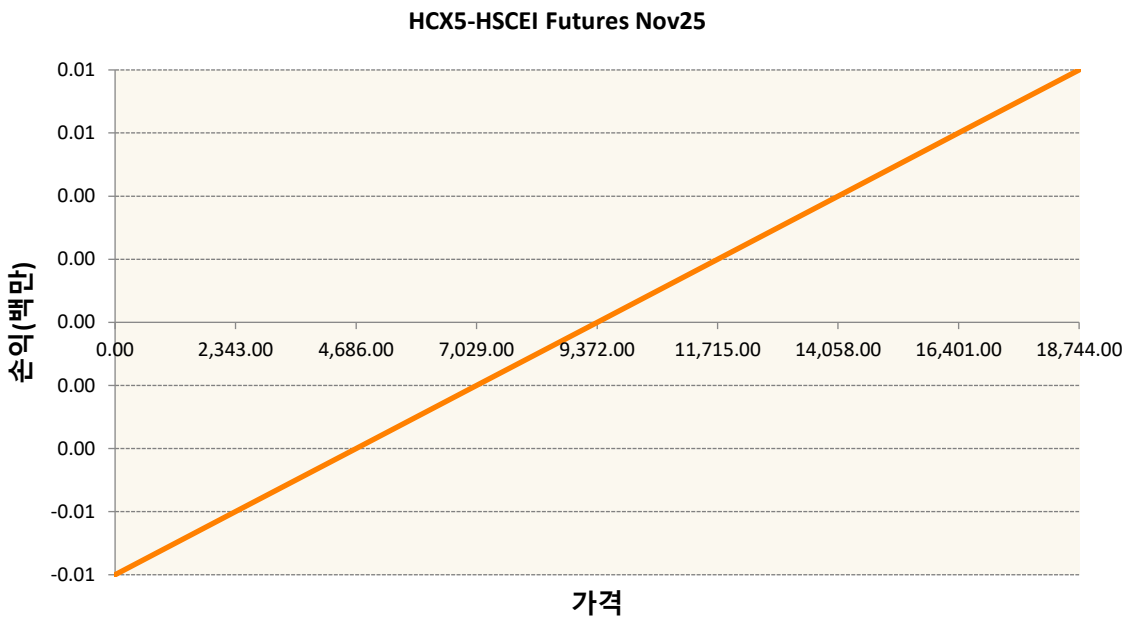
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,072	0	2,072	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX5	HSCEI Futures Nov25	166
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

234

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

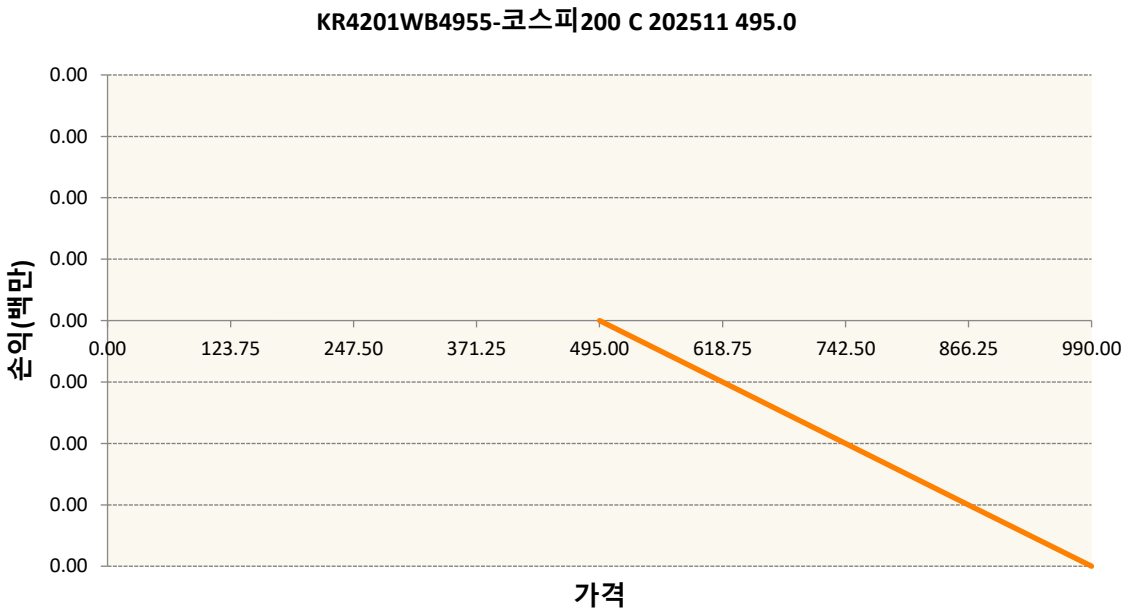
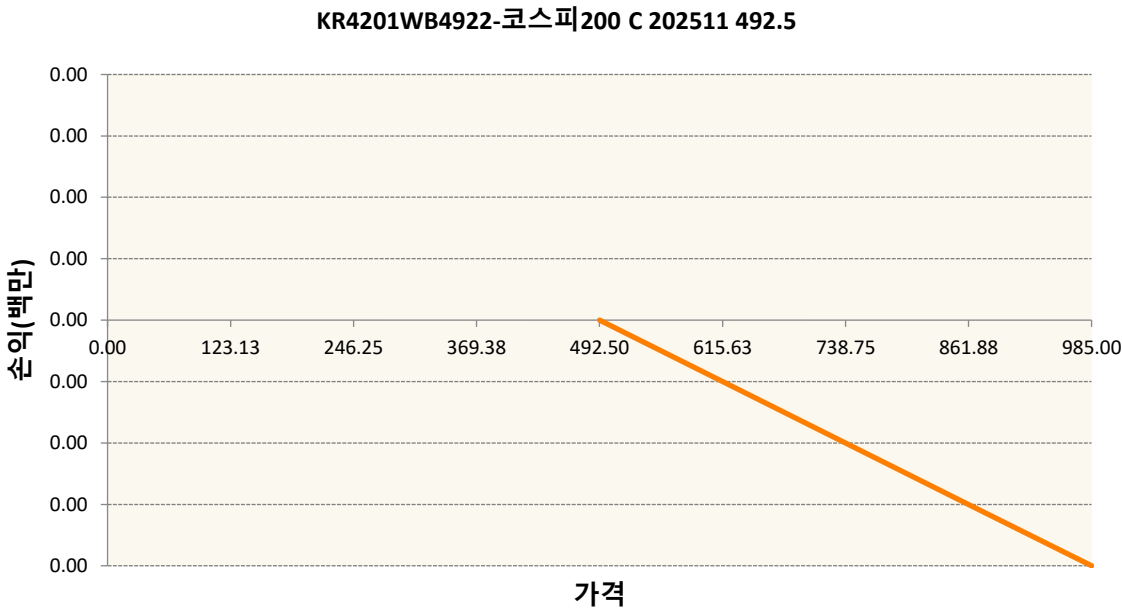
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

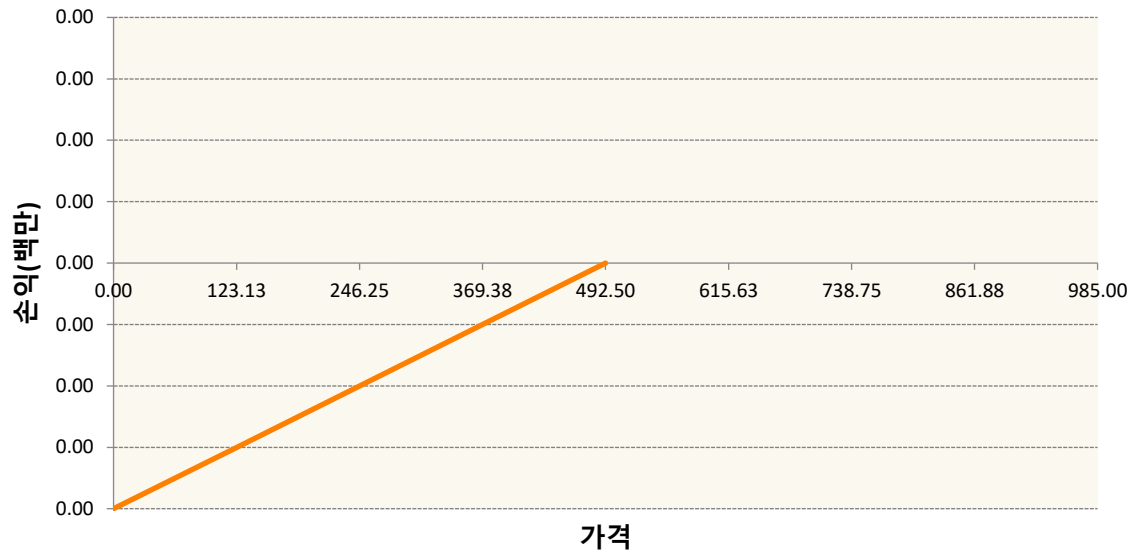
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	246	0	246	장내
누계	유가증권	옵션	0	30,756	-30,756	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4301WB4921-코스피200 P 202511 492.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WB4921-코스피200 C 202511 492.5

433

KR4201WB4921-코스피200 C 202511 495.0

1,554

KR4301WB4921-코스피200 P 202511 492.5

473

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-11-03

기준일 2025-10-31

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	2025-11-03
기준일	2025-10-31

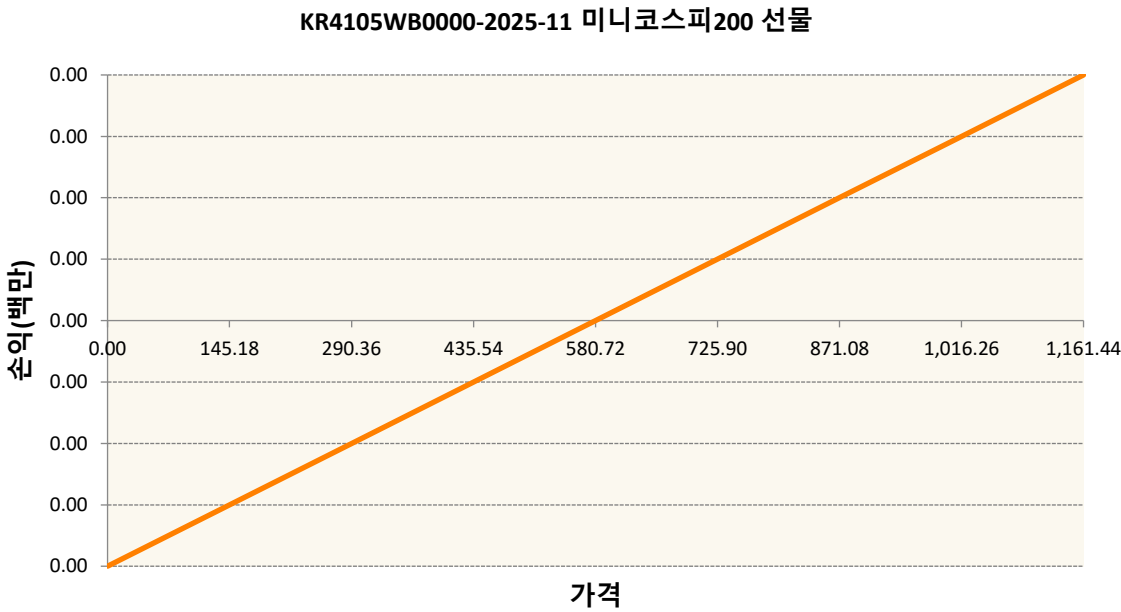
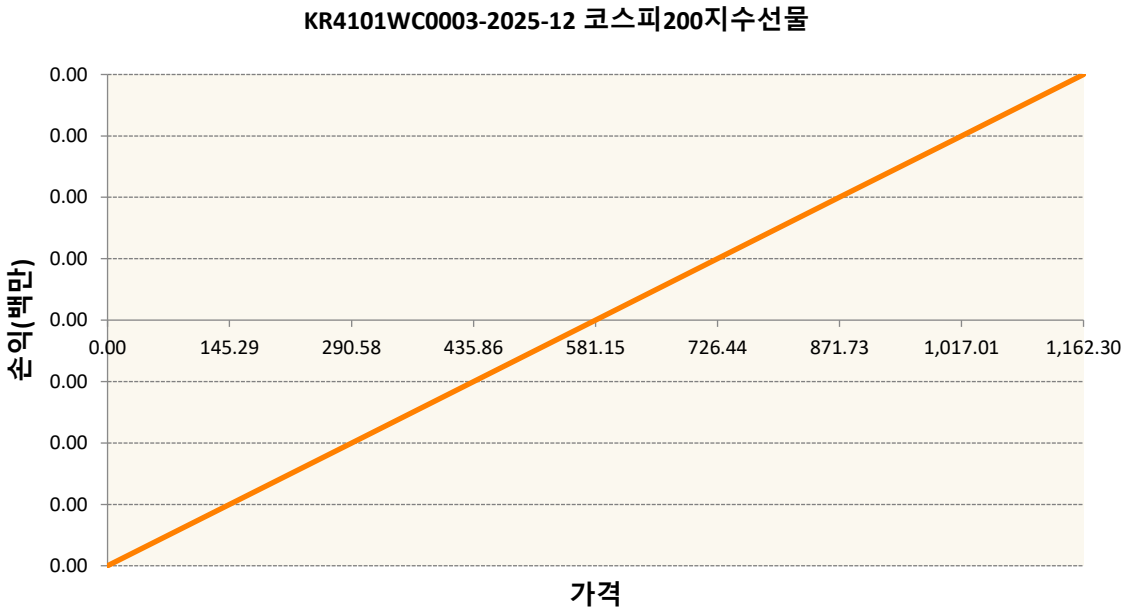
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

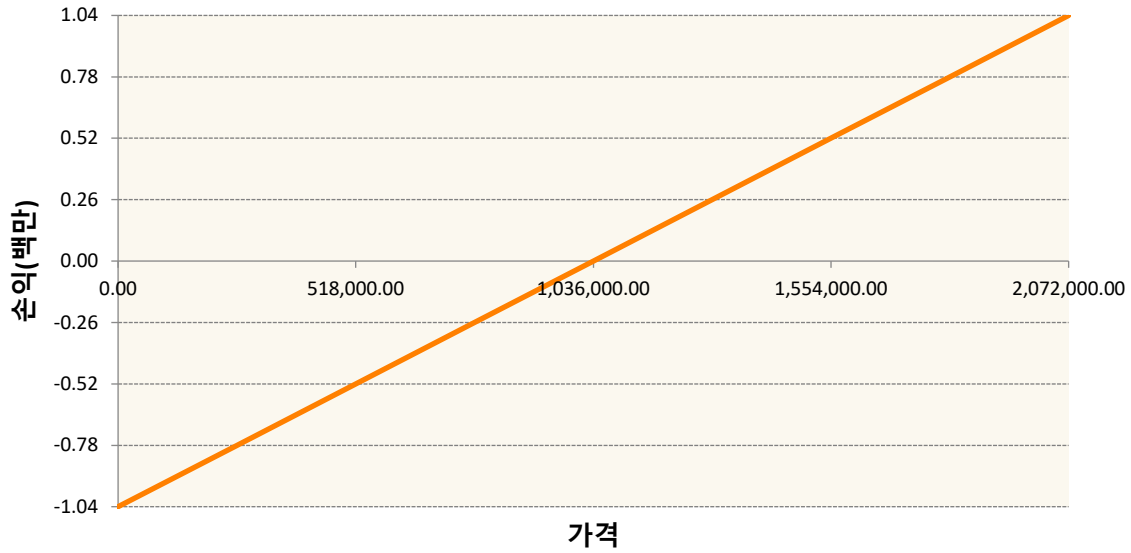
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	430	-430	장내
누계	유가증권	선물	787	0	787	장내

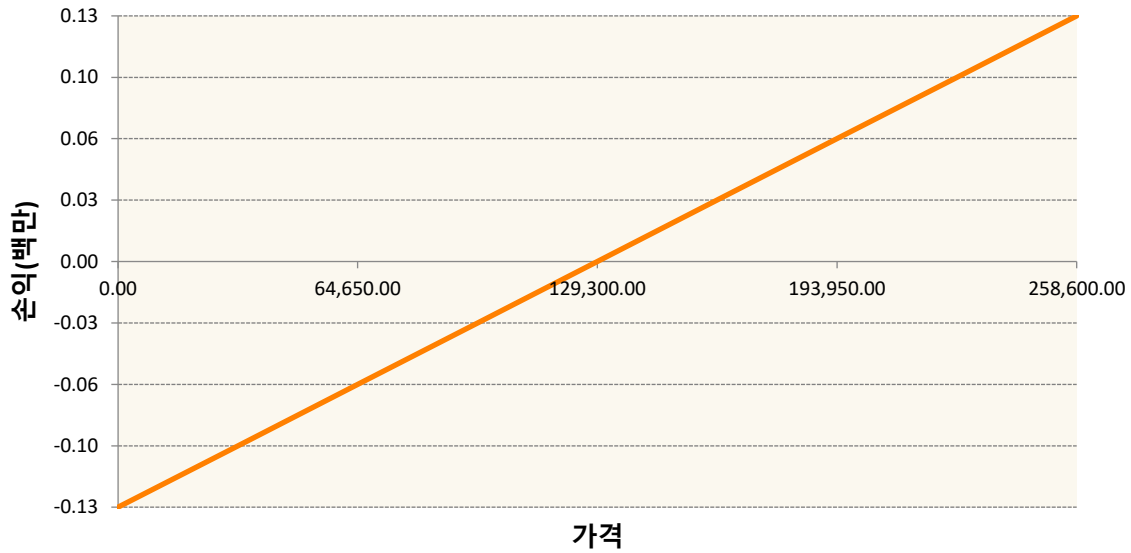
2. 만기시점의 손익구조



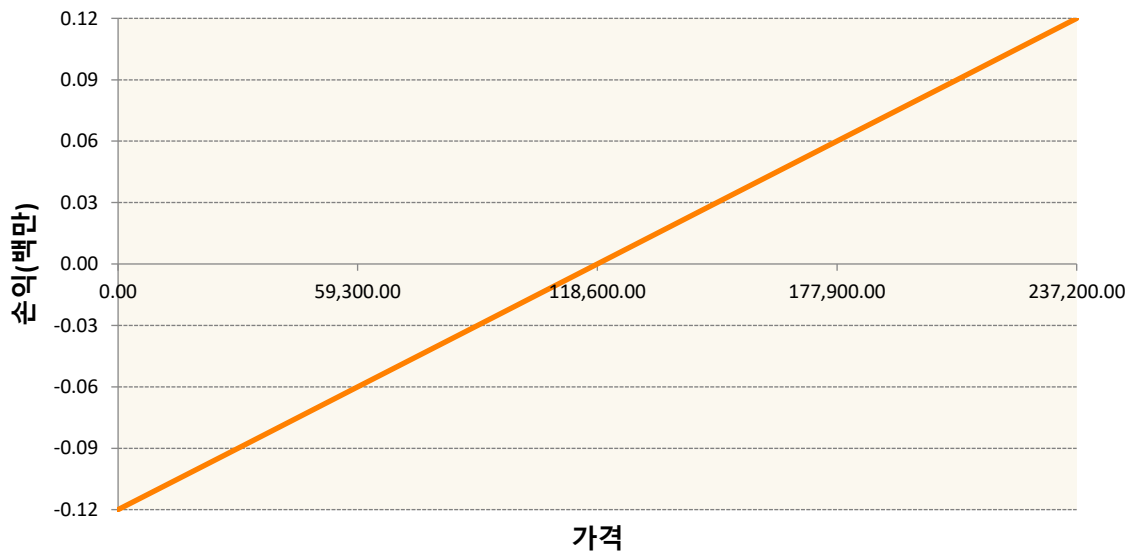
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물		46
KR4105WB0(2025-11 미니코스피200 선물		2
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물		2
KR41EJWB0(2025-11 SKC개별선물		1
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물		1

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

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

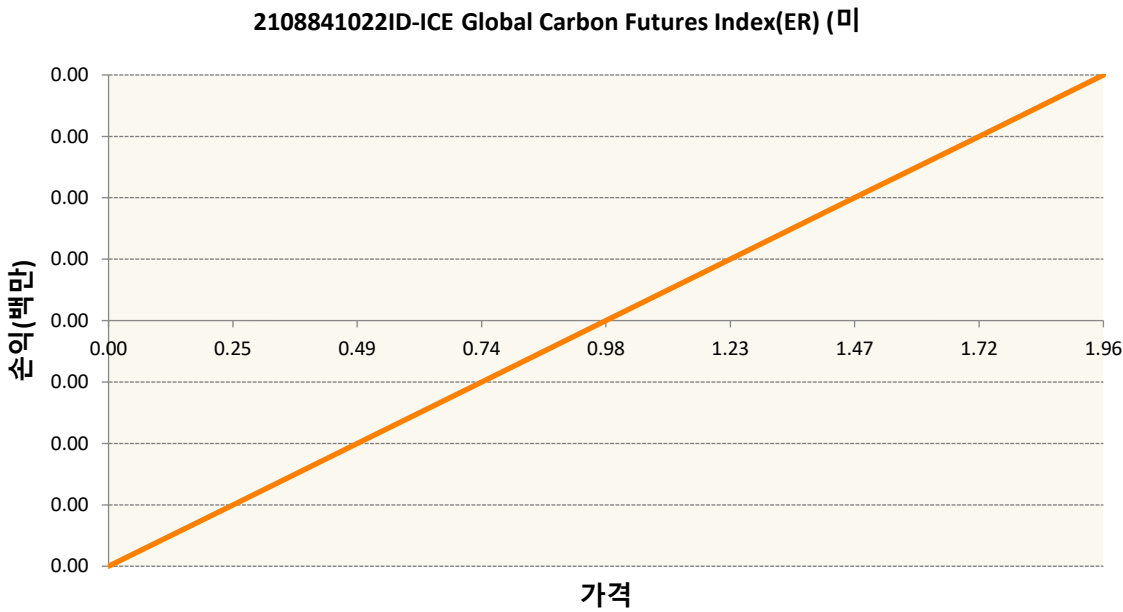
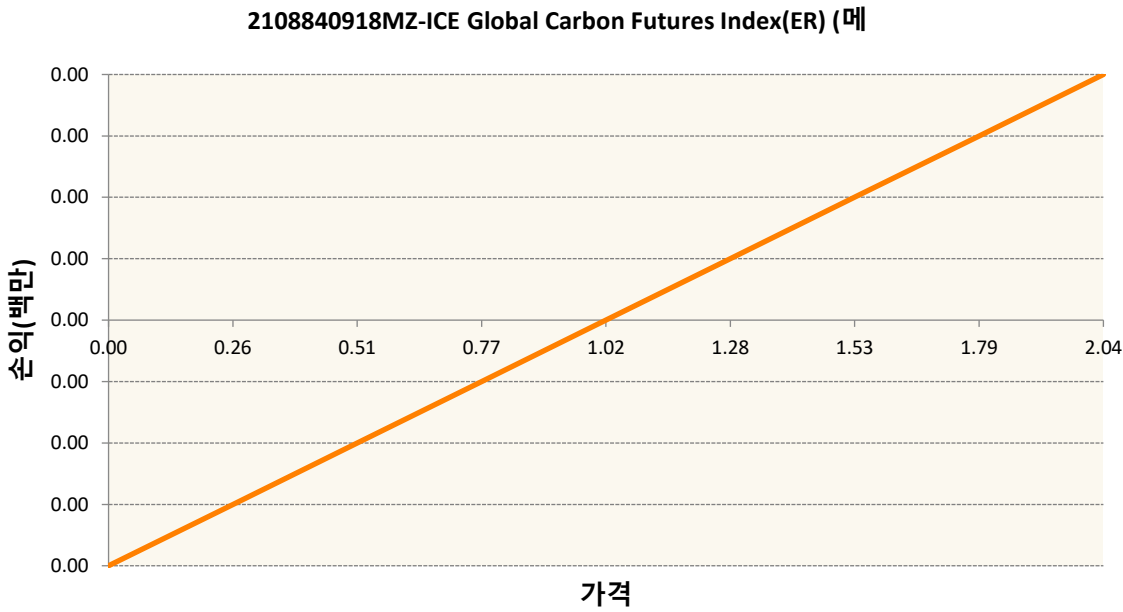
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	8,277	0	8,277	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		111
2108841022IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		551

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	653

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

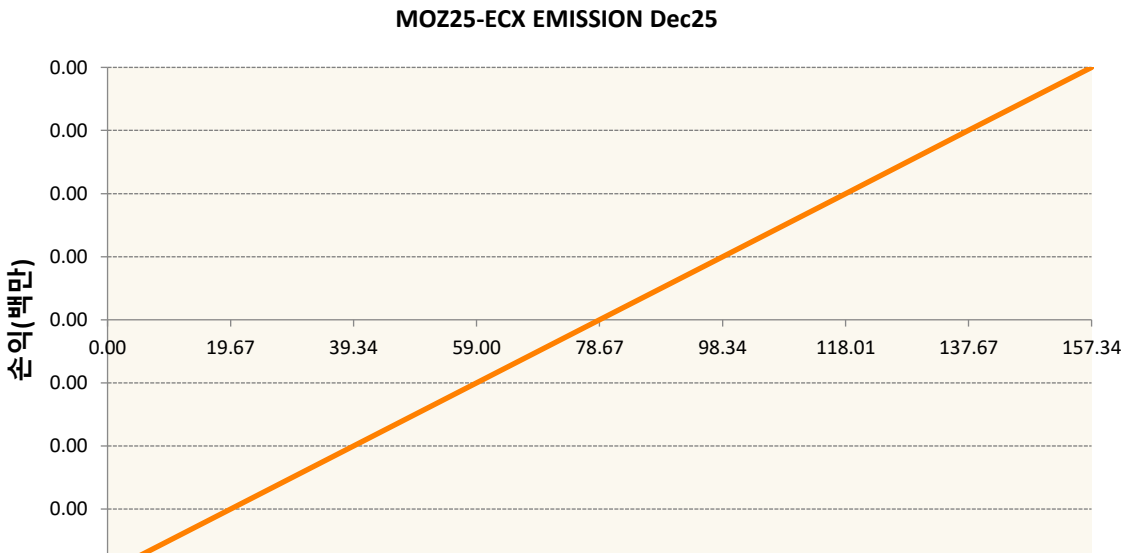
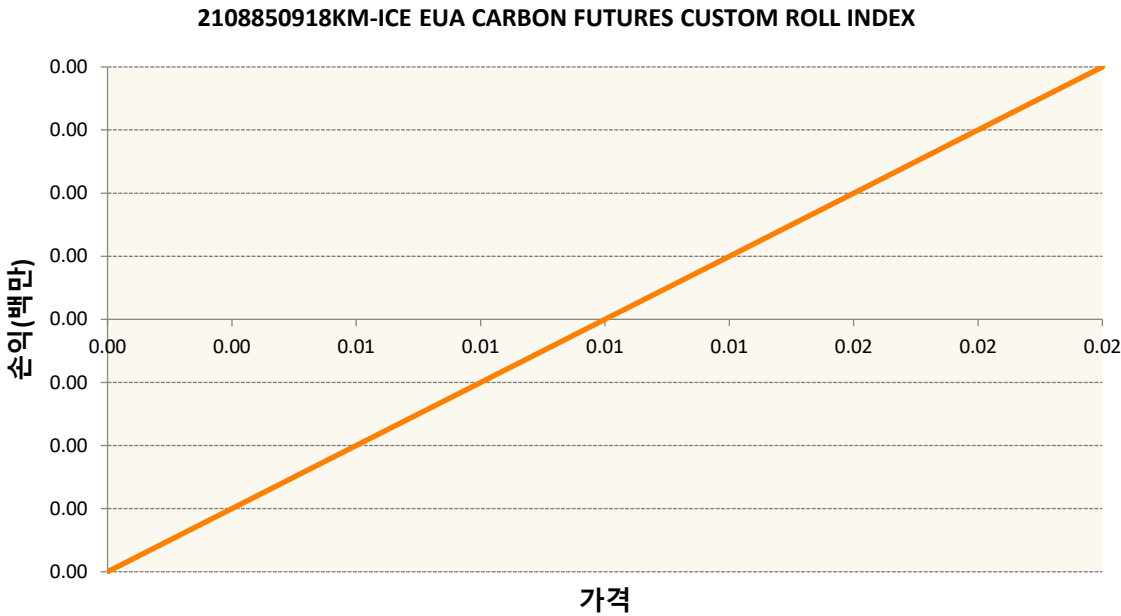
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	5,788	0	5,788	
누계	지수	스왑	4	0	4	장외
누계	통화	선도	0	2,472	-2,472	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	0.47
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E	198
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	463

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

(단위:백만원)

747

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

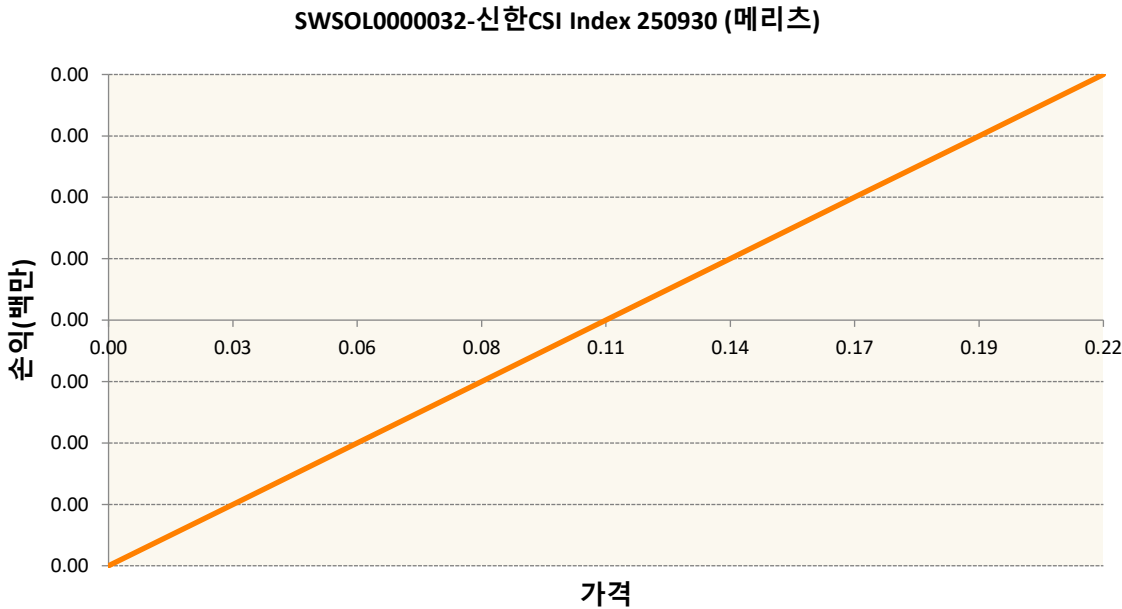
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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)

90

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

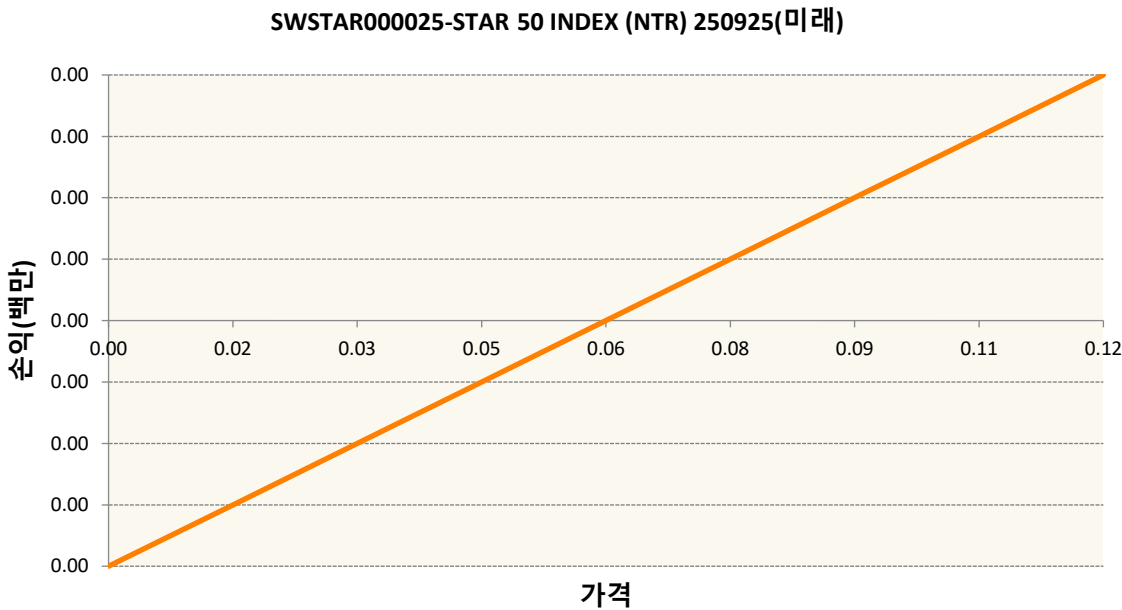
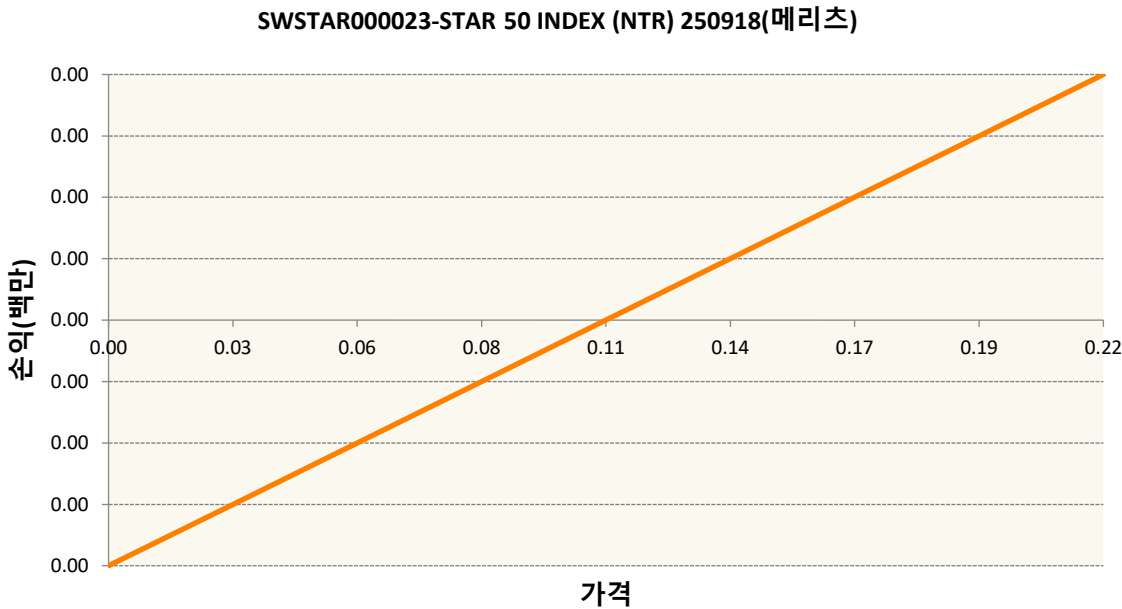
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	4,994	0	4,994	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		24
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		7
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		87
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		26
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠)		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		263

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

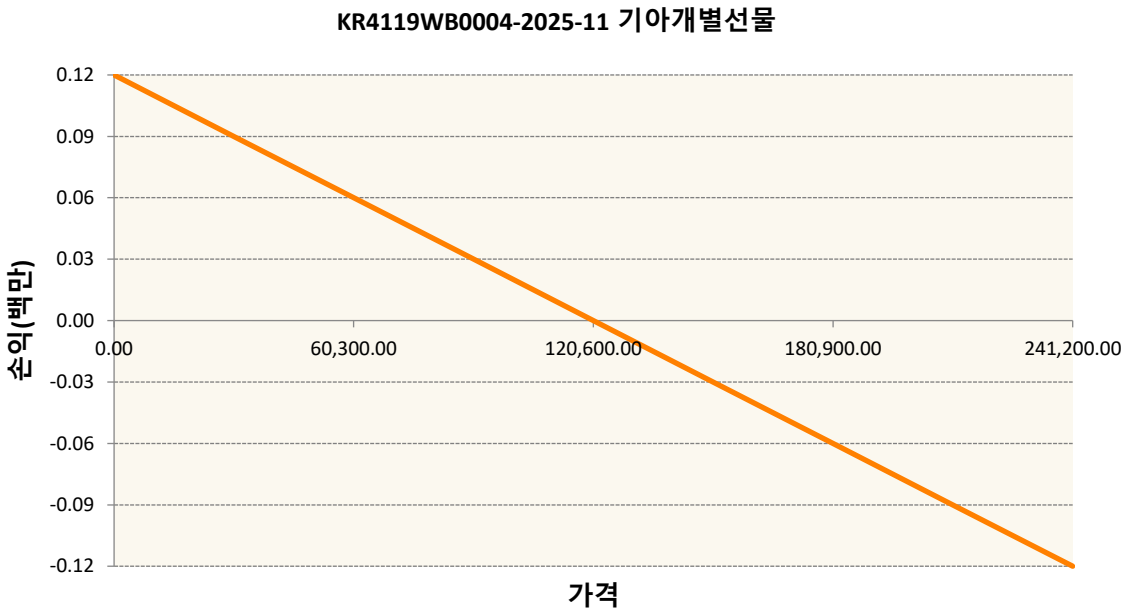
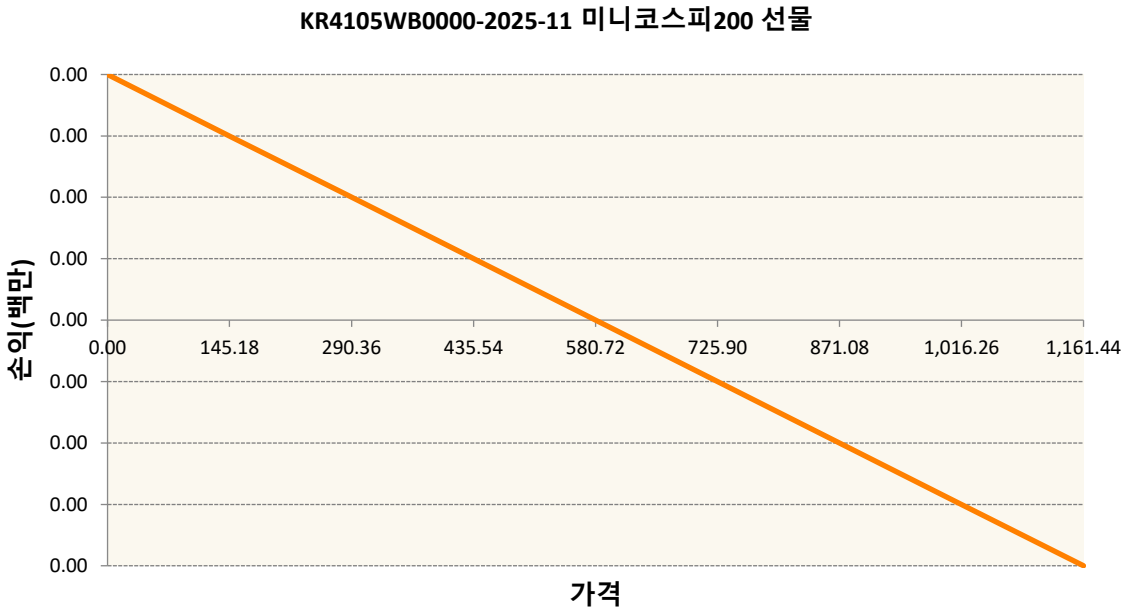
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

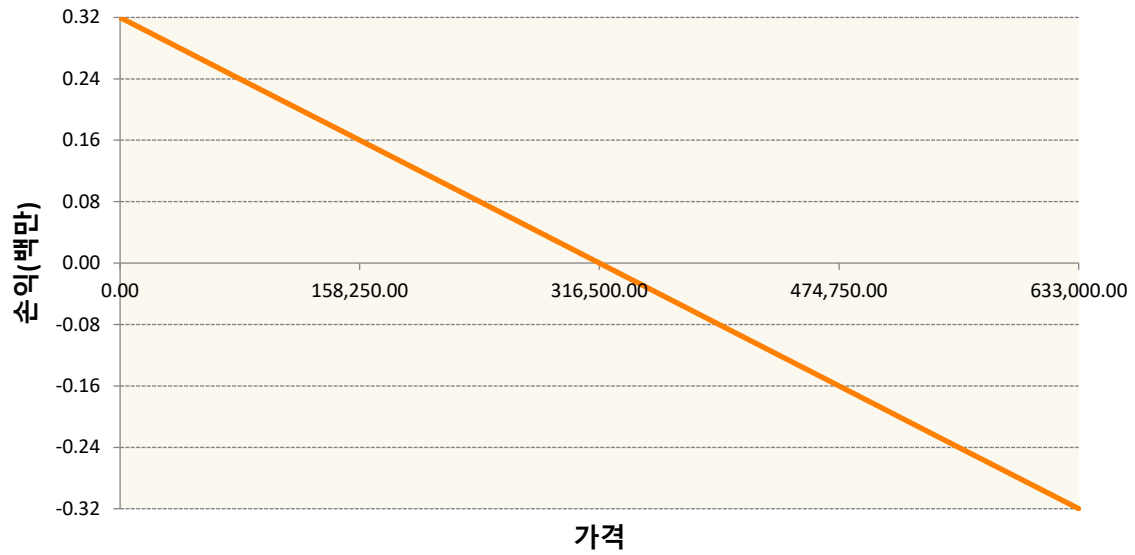
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	7	-7	장내
누계	유가증권	선물	0	909	-909	장내

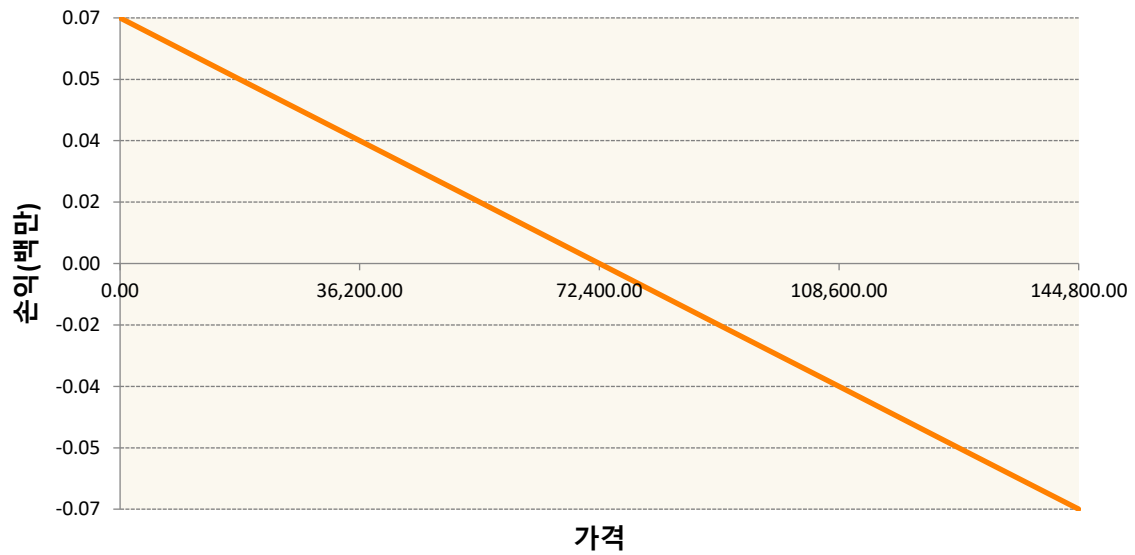
2. 만기시점의 손익구조



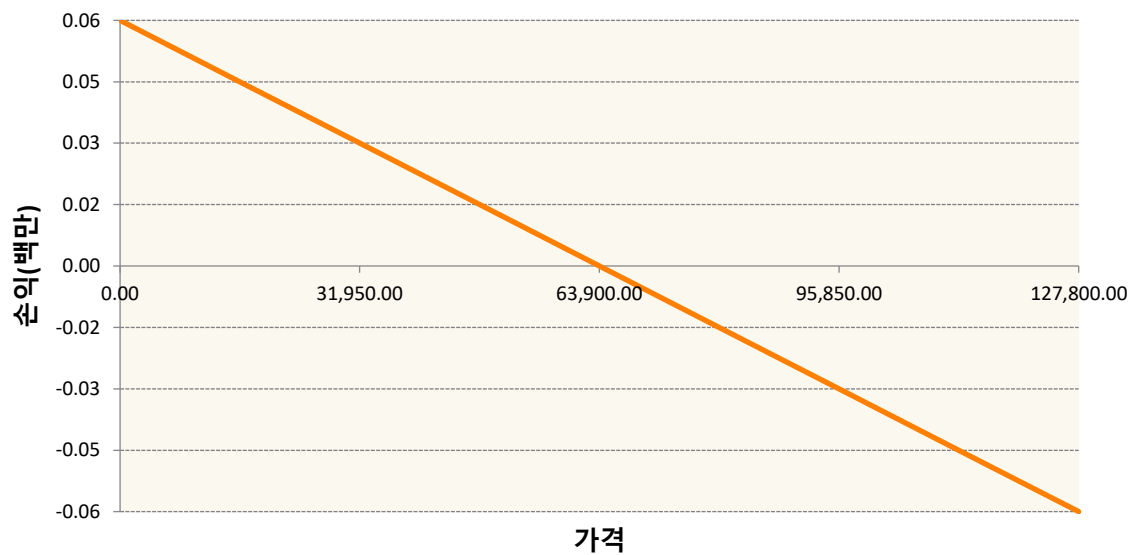
KR4120WB0001-2025-11 현대모비스개별선물



KR41B2WB0009-2025-11 S-Oil개별선물



KR41BAWB0000-2025-11 롯데쇼핑개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4105WB0(2025-11 미니코스피200 선물		14
KR4119WB0(2025-11 기아개별선물		1
KR4120WB0(2025-11 현대모비스개별선물		1
KR41B2WB0(2025-11 S-Oil개별선물		1
KR41BAWB0 2025-11 롯데쇼핑개별선물		0.26

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		2

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

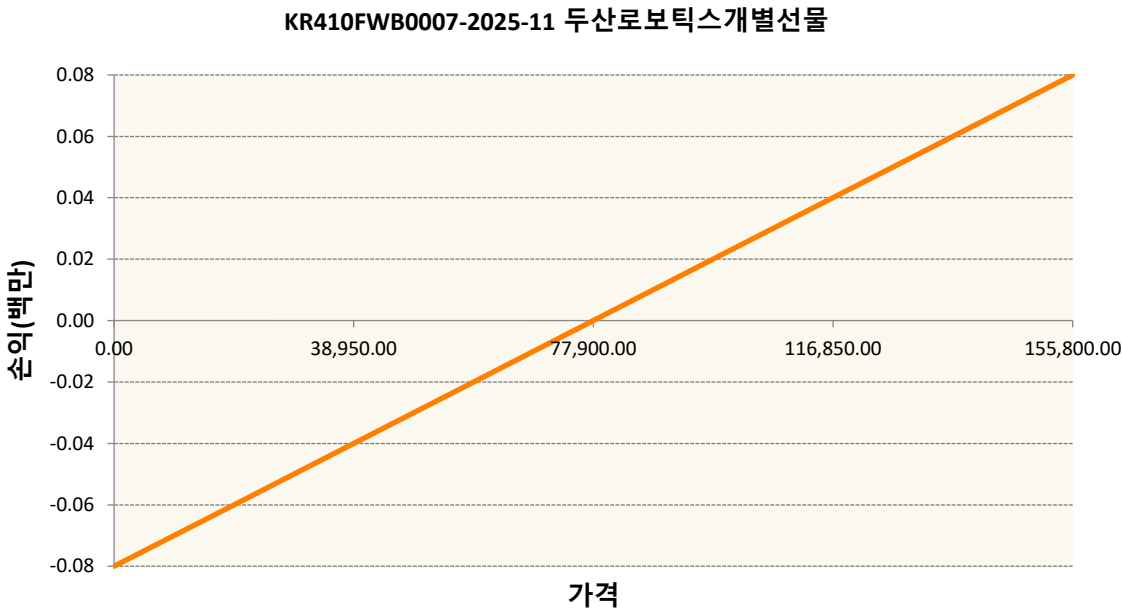
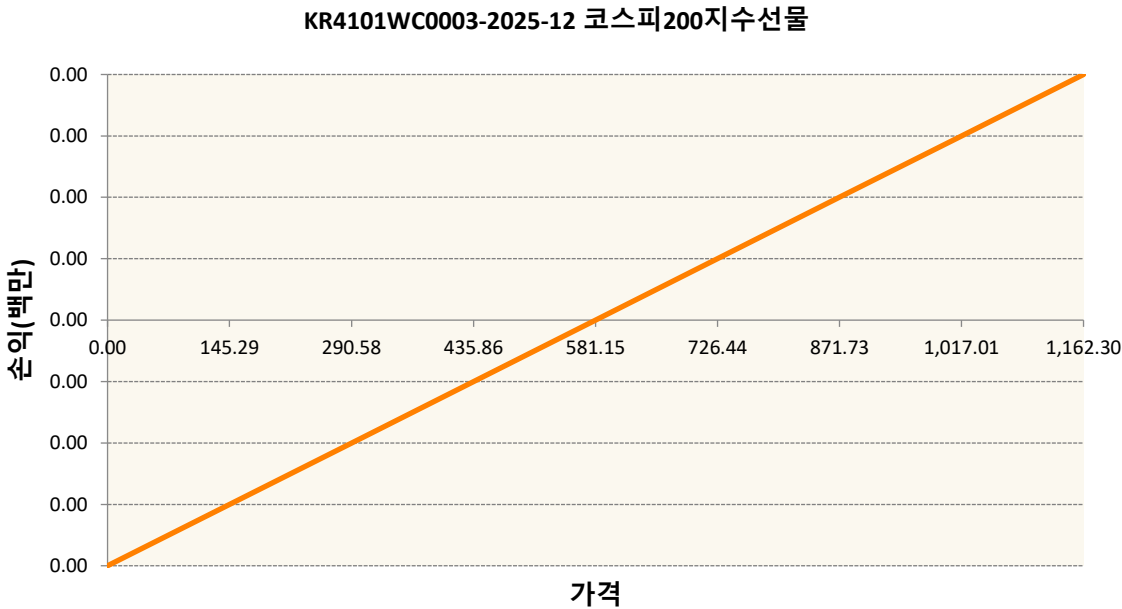
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

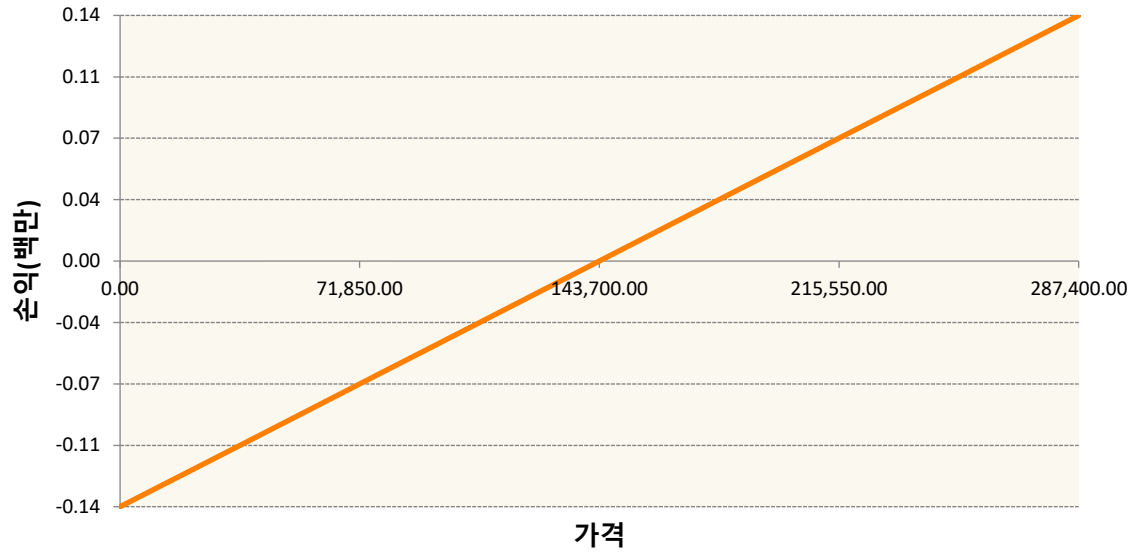
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,468	0	2,468	장내
누계	유가증권	선물	20,280	0	20,280	장내

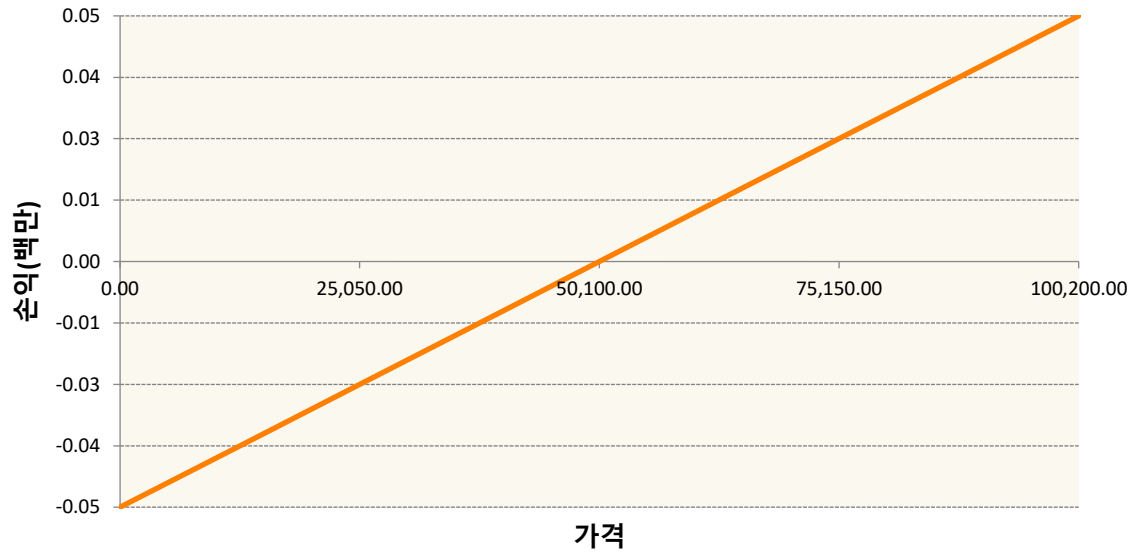
2. 만기시점의 손익구조



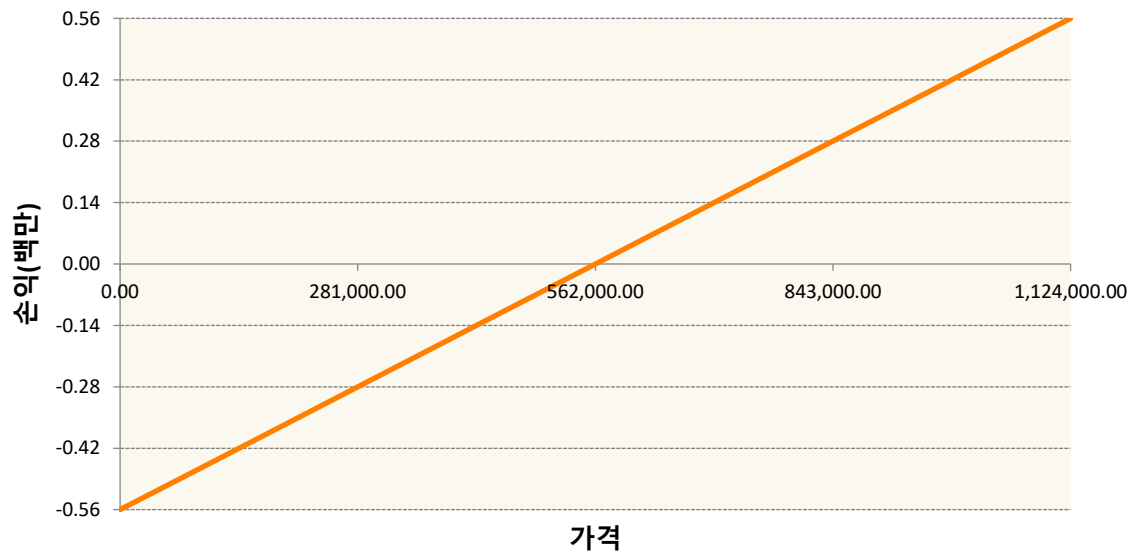
KR410ZWB0003-2025-11 한미반도체개별선물



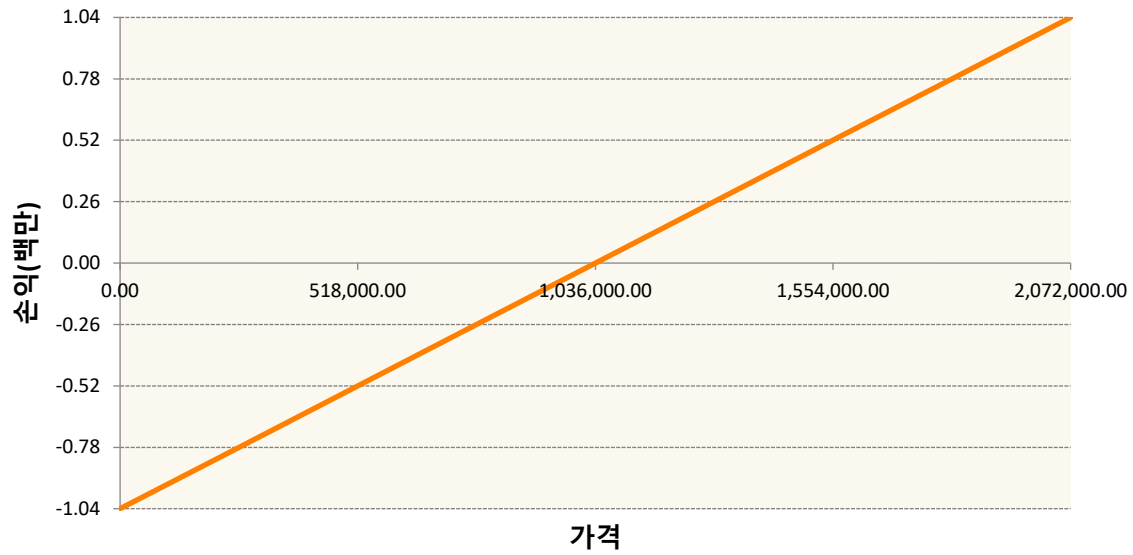
KR411RWB0002-2025-11 한화비전개별선물



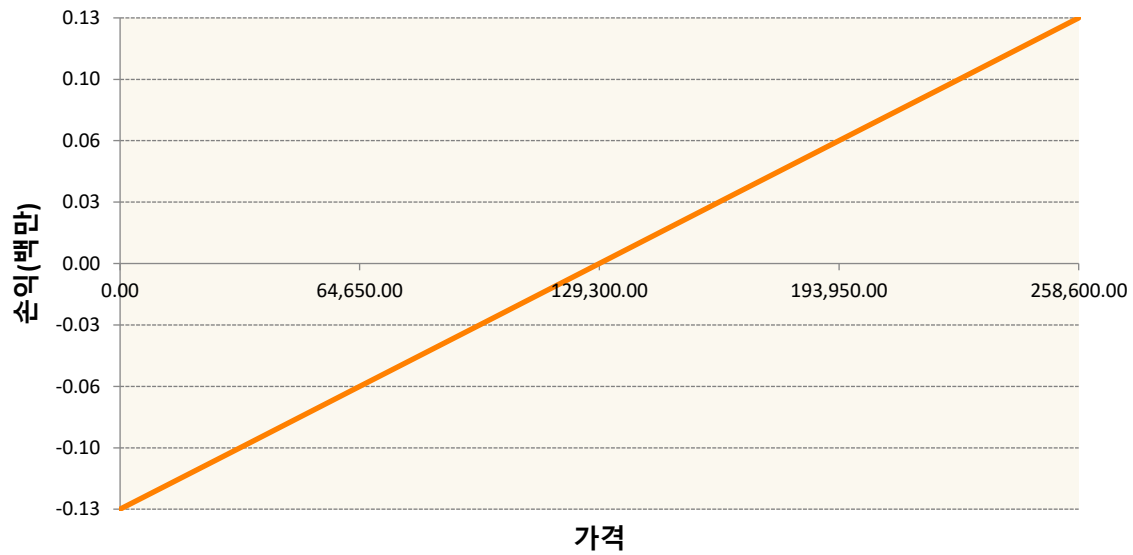
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



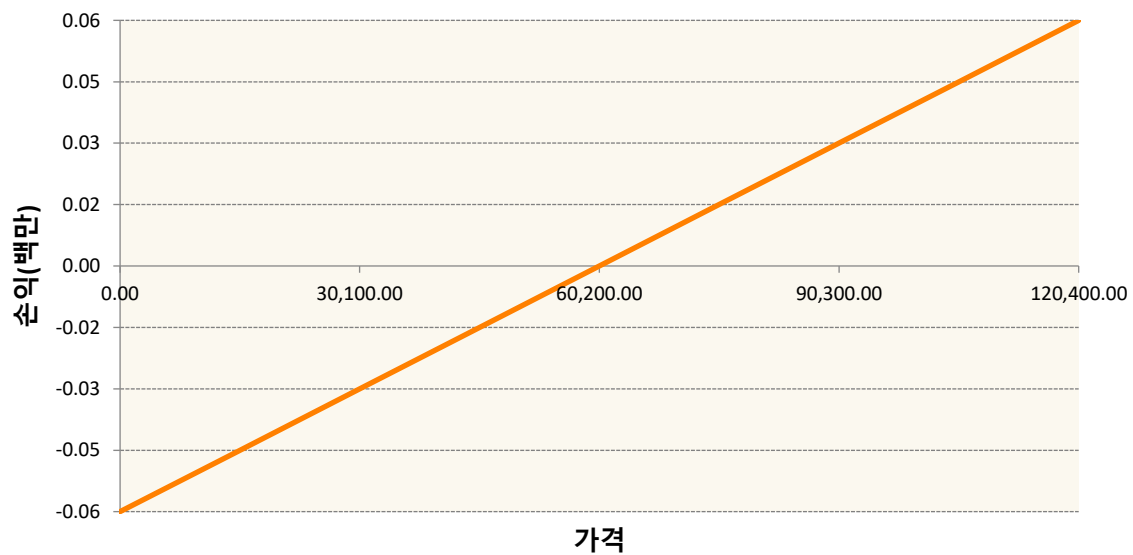
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



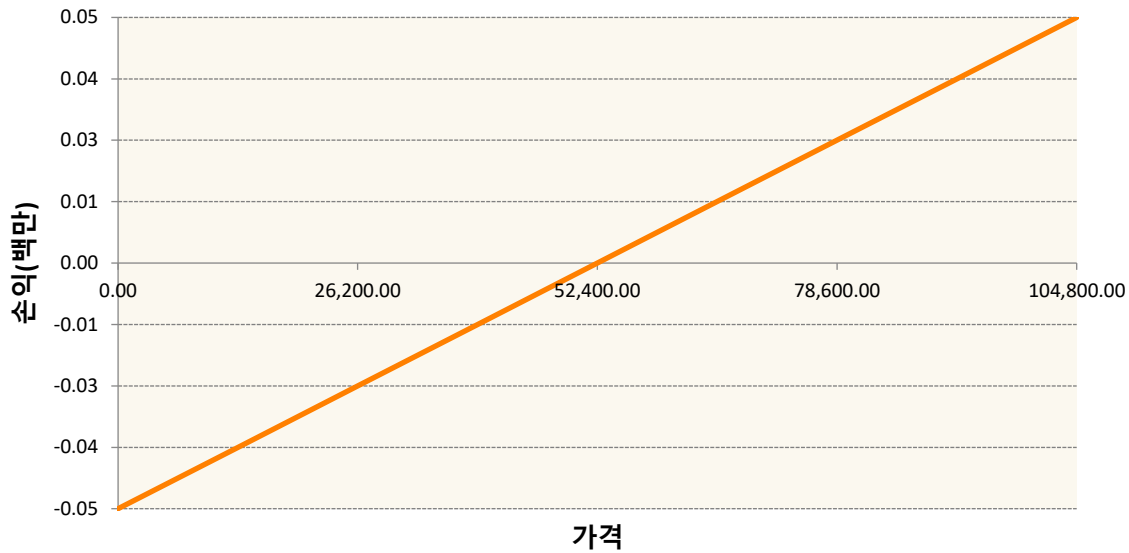
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



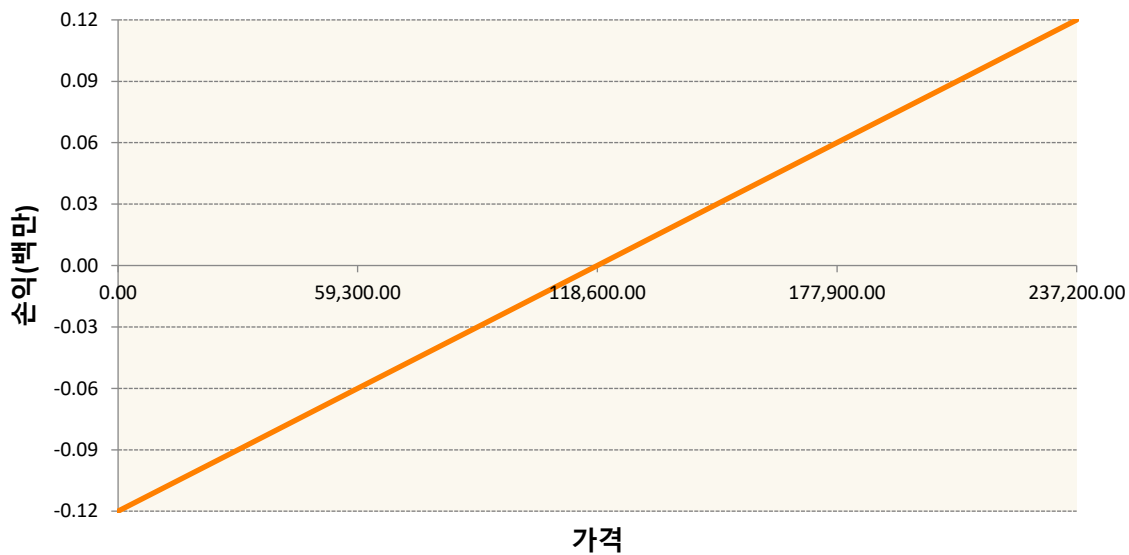
KR41EVWB0002-2025-11 한화시스템개별선물



KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	1,360
KR410FWB0(2025-11 두산로보틱스개별선물	17
KR410ZWB0(2025-11 한미반도체개별선물	69
KR411RWB0(2025-11 한화비전개별선물	4
KR4150WB0(2025-11 SK하이닉스개별선물	3
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물	48
KR41EJWB0C 2025-11 SKC개별선물	26
KR41EVWB0(2025-11 한화시스템개별선물	47
KR41F7WB0(2025-11 카카오페이개별선물	15
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물	33

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

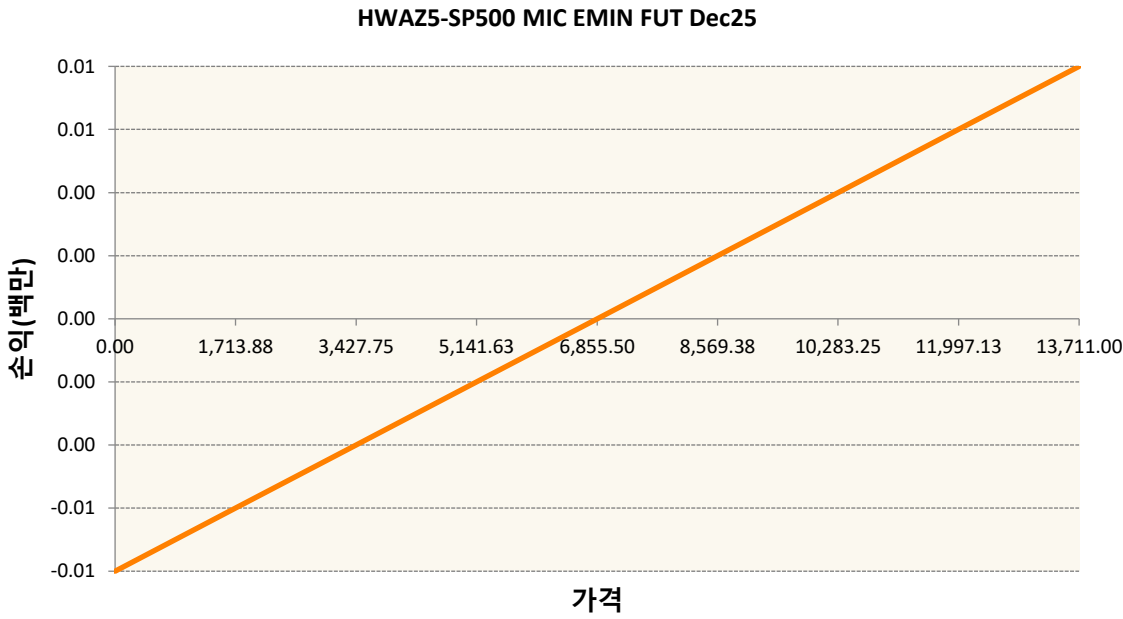
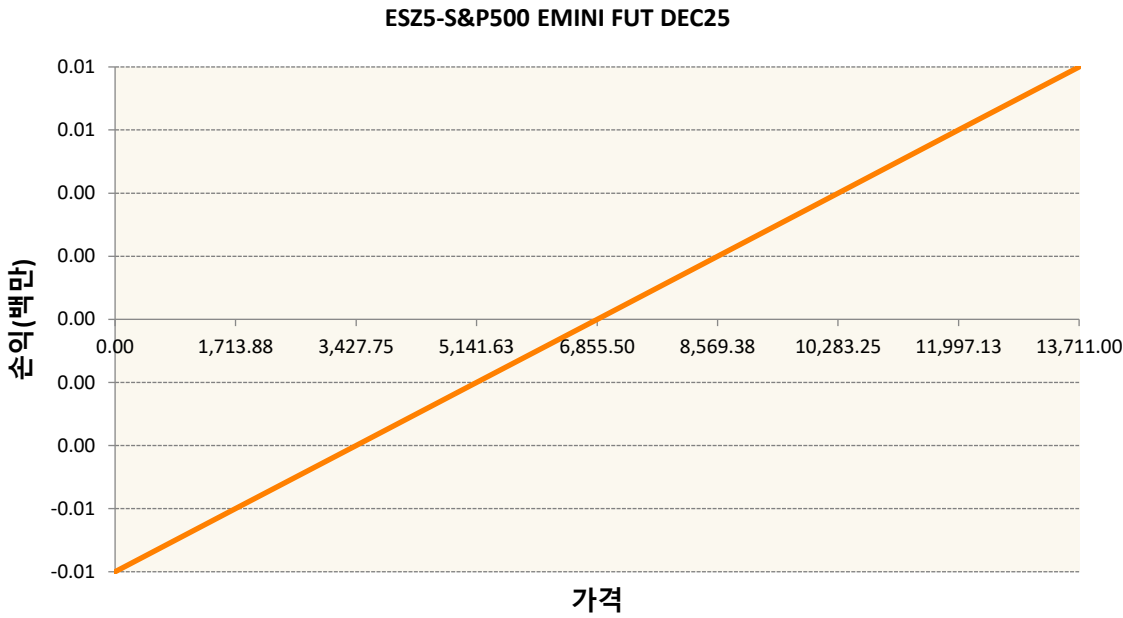
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	39,058	0	39,058	
누계	유가증권	선물	1,285	0	1,285	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,125
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,628

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

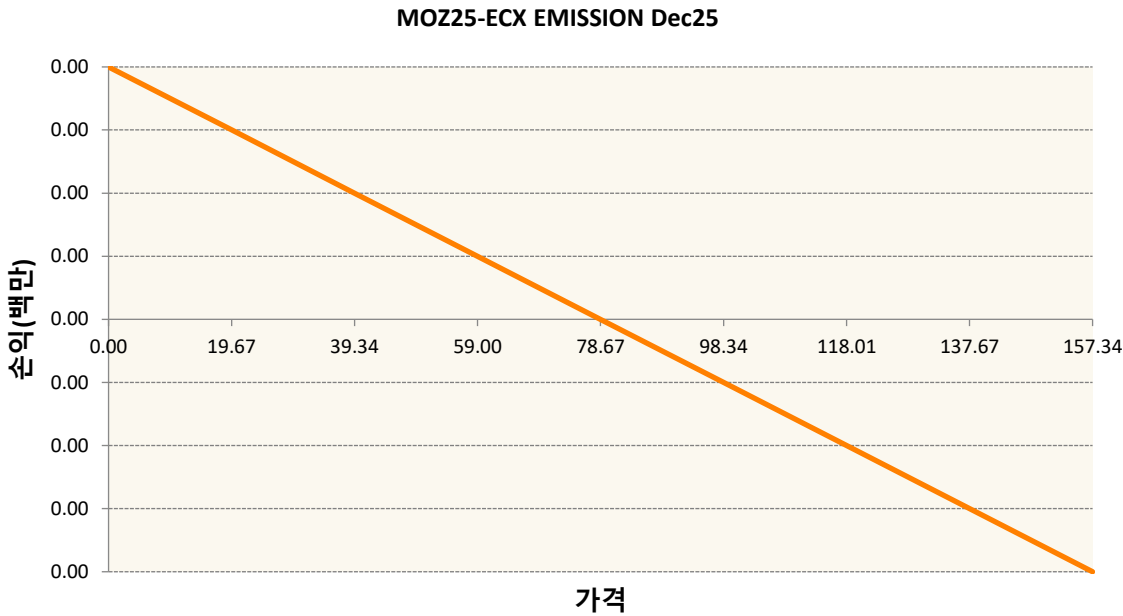
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	3,165	-3,165	
누계	지수	스왑	-8	0	-8	장외
누계	통화	선도	0	1,144	-1,144	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930918IIICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E	91
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	253

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

(단위:백만원)

398

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

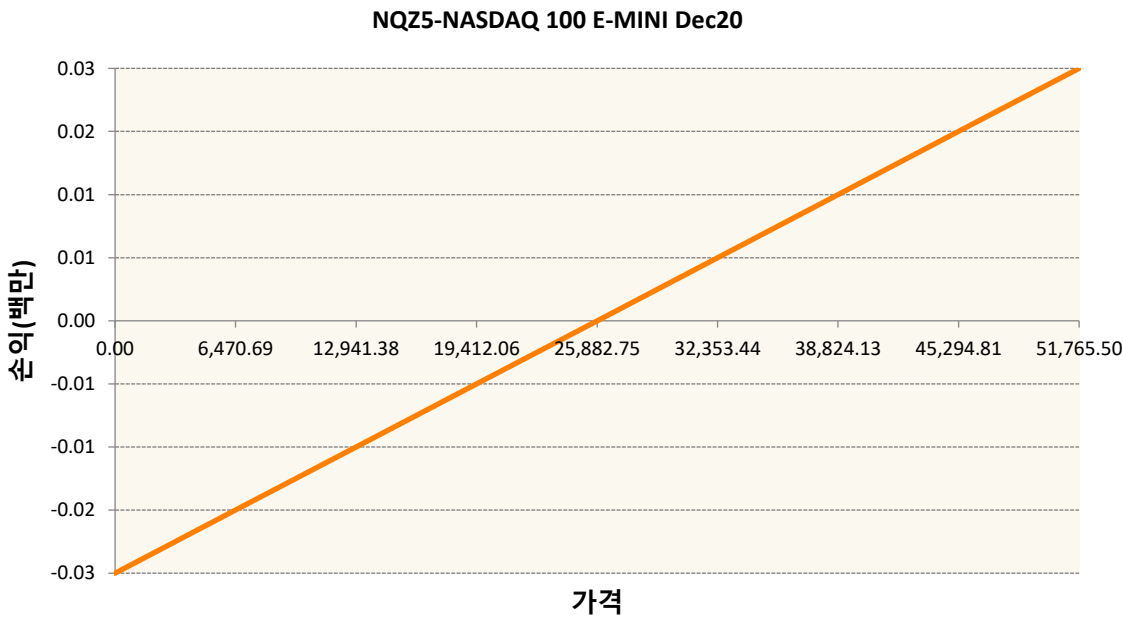
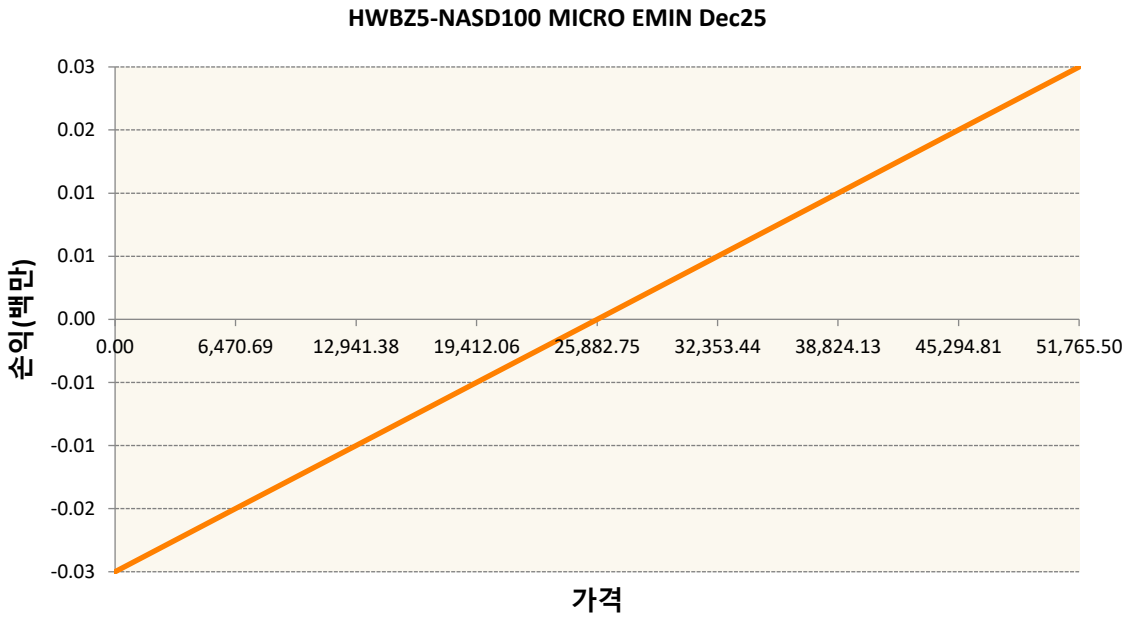
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	18,757	0	18,757	
누계	유가증권	선물	1,728	0	1,728	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25	138
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,501

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,817

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

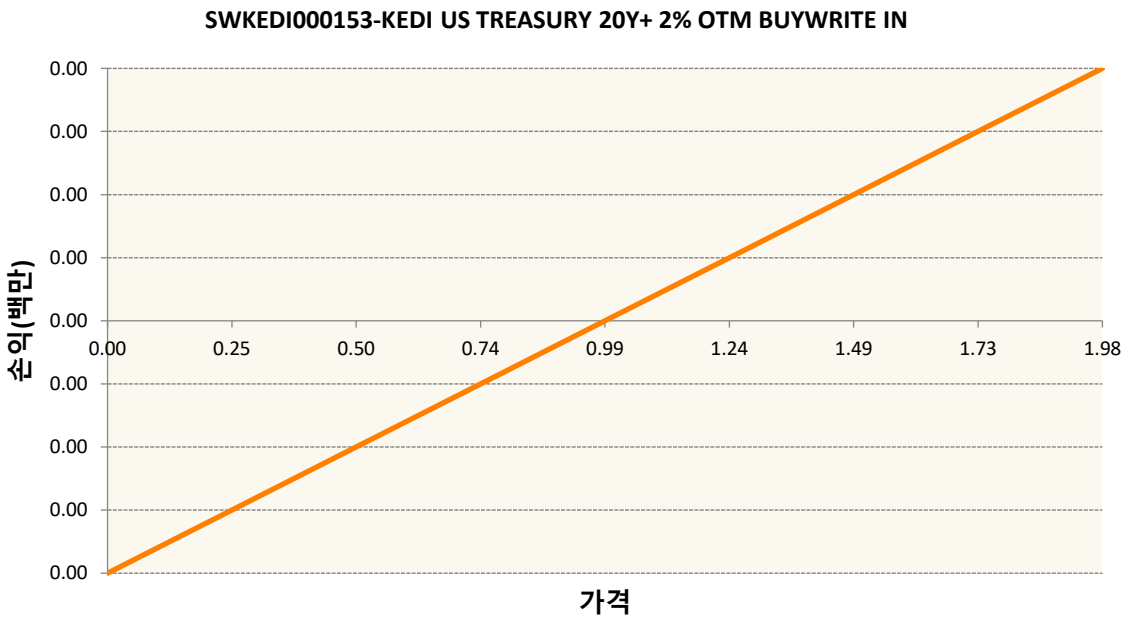
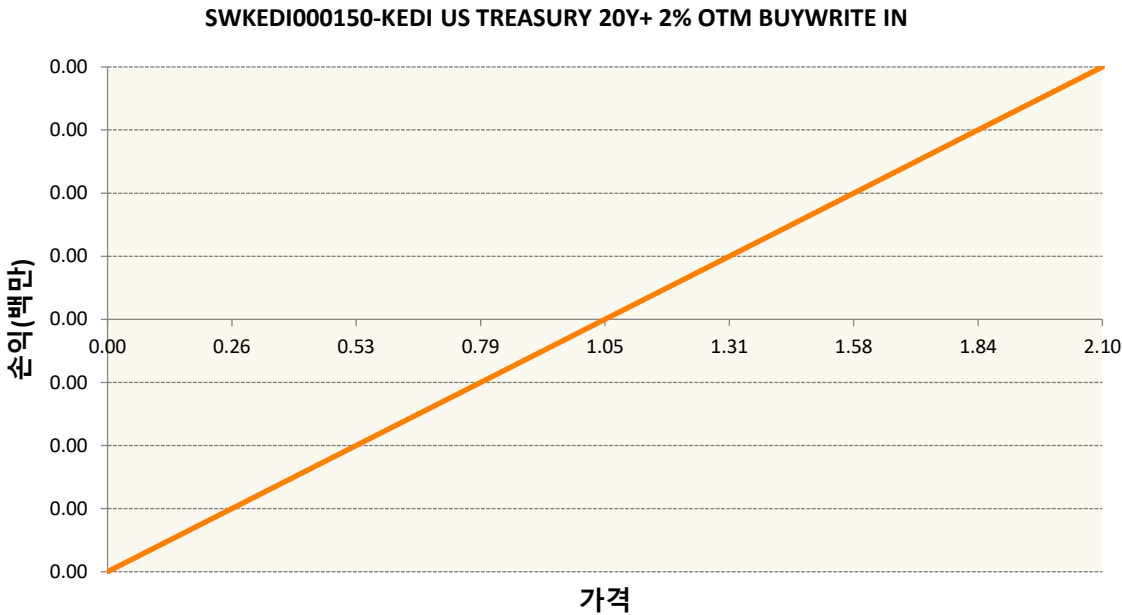
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

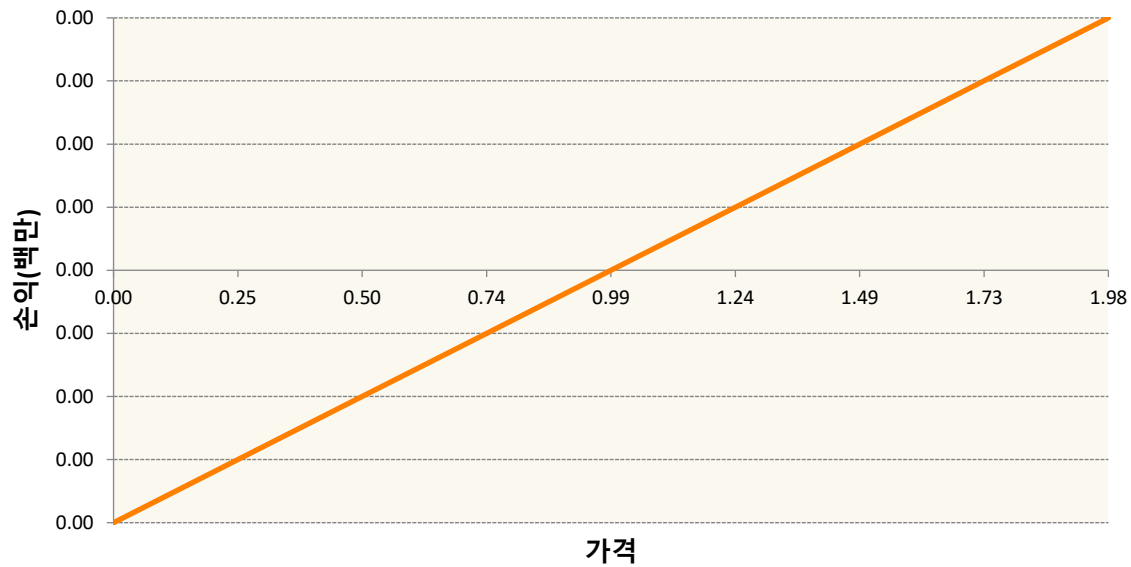
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	377,584	0	377,584	장외

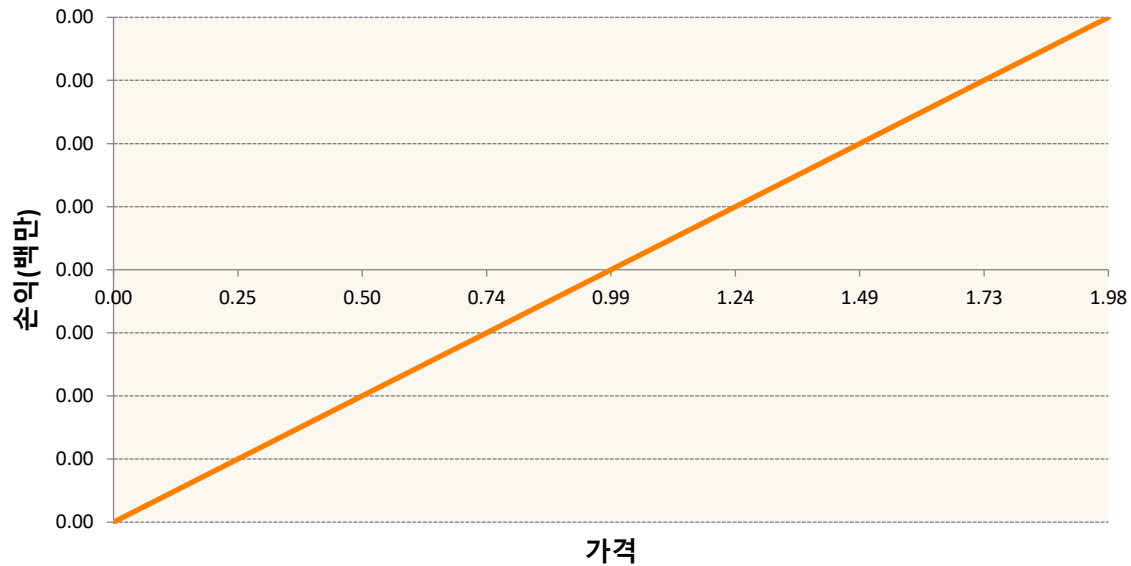
2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000154-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000155-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,065
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,712
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	10,045
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,442

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

(단위:백만원)

14,456

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

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	2,322	0	2,322	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	9

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-11-03
기준일	2025-10-31

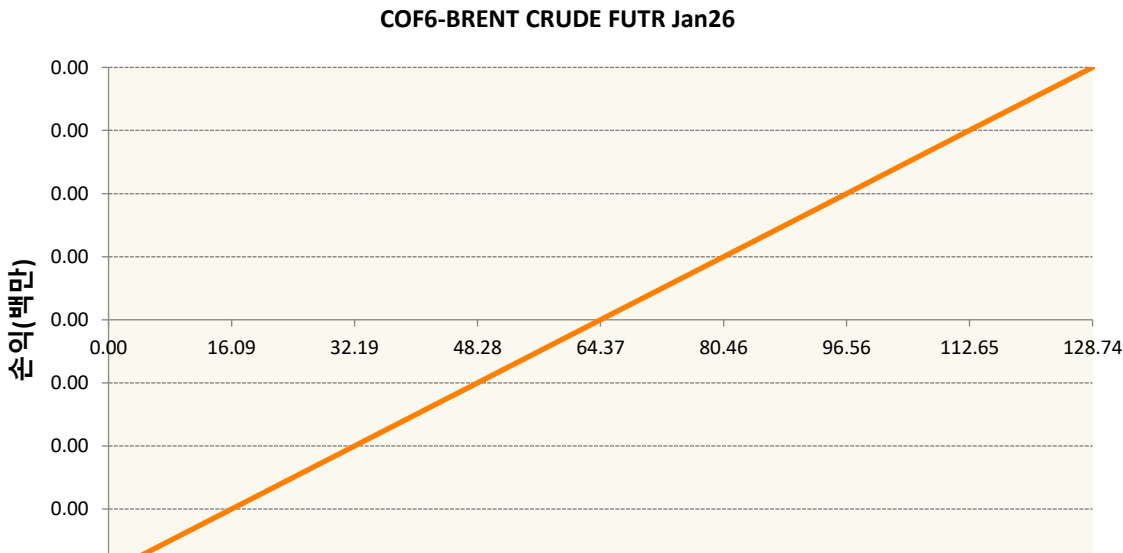
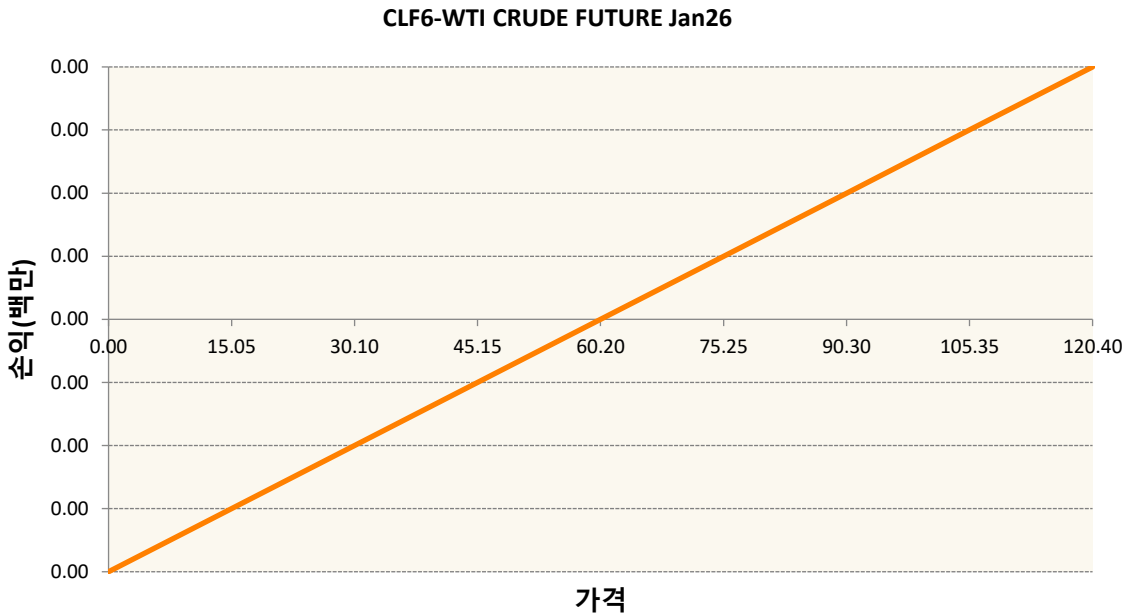
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

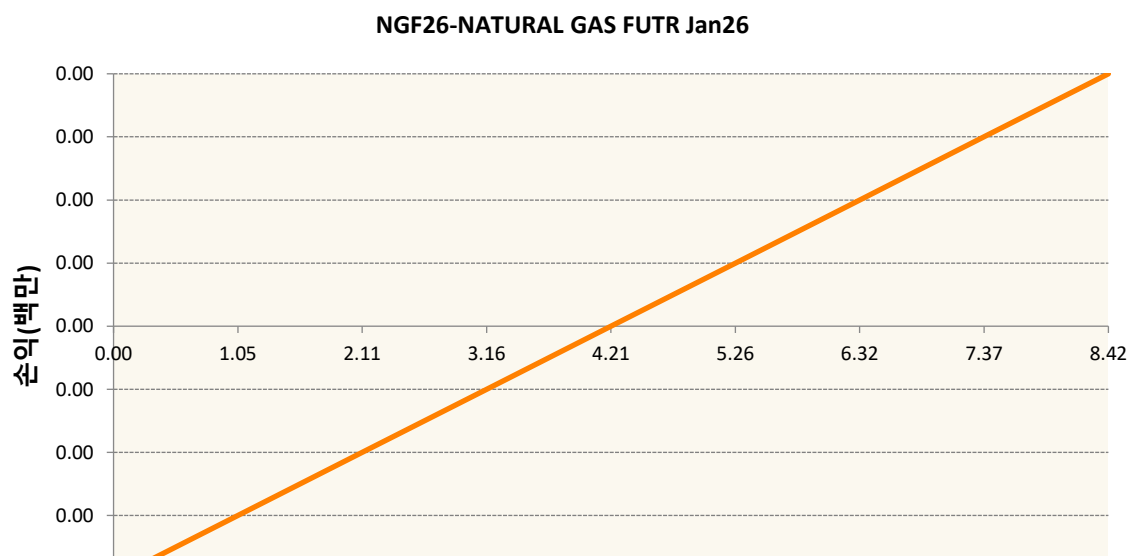
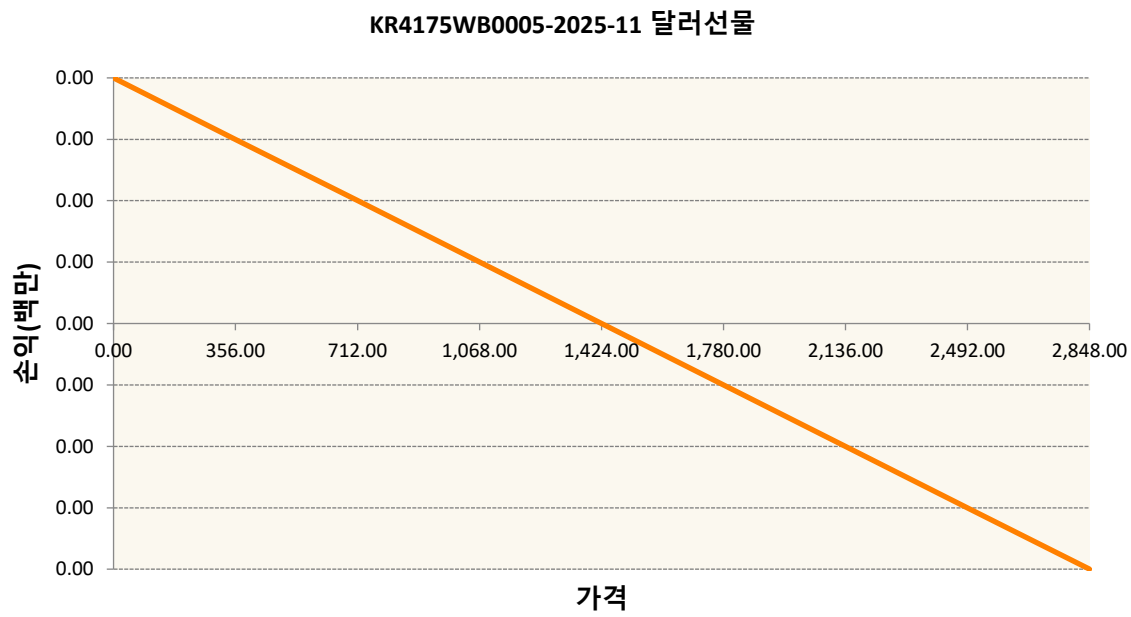
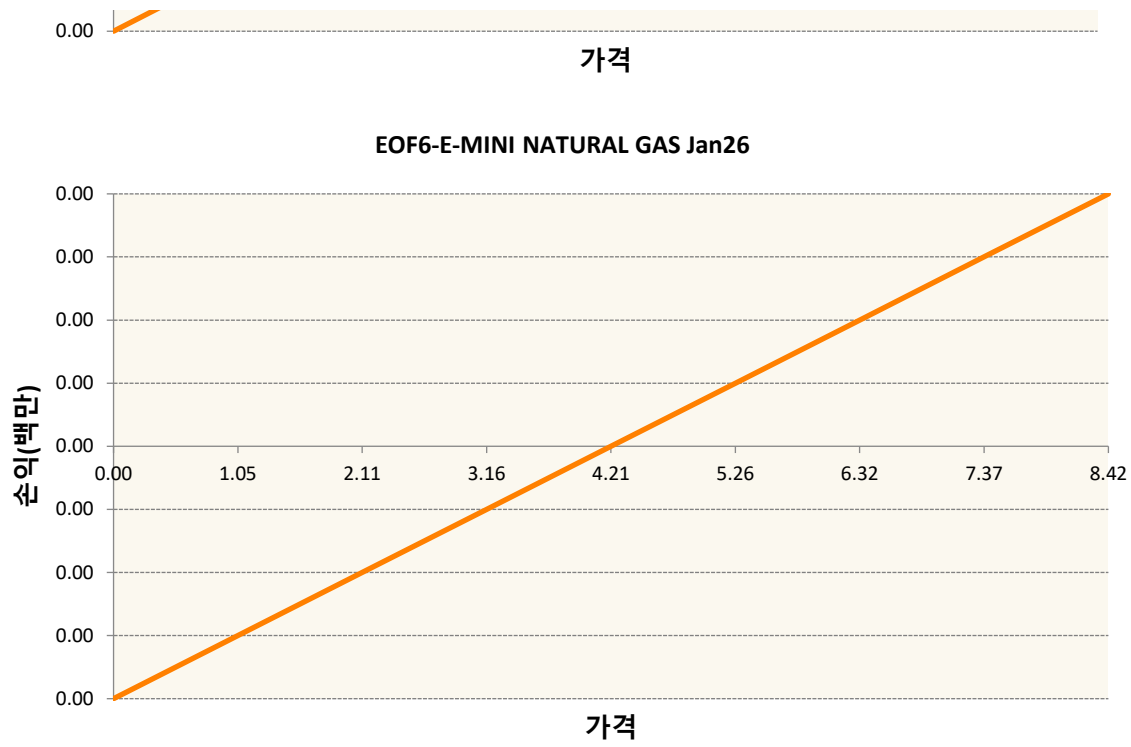
1. 계약금액

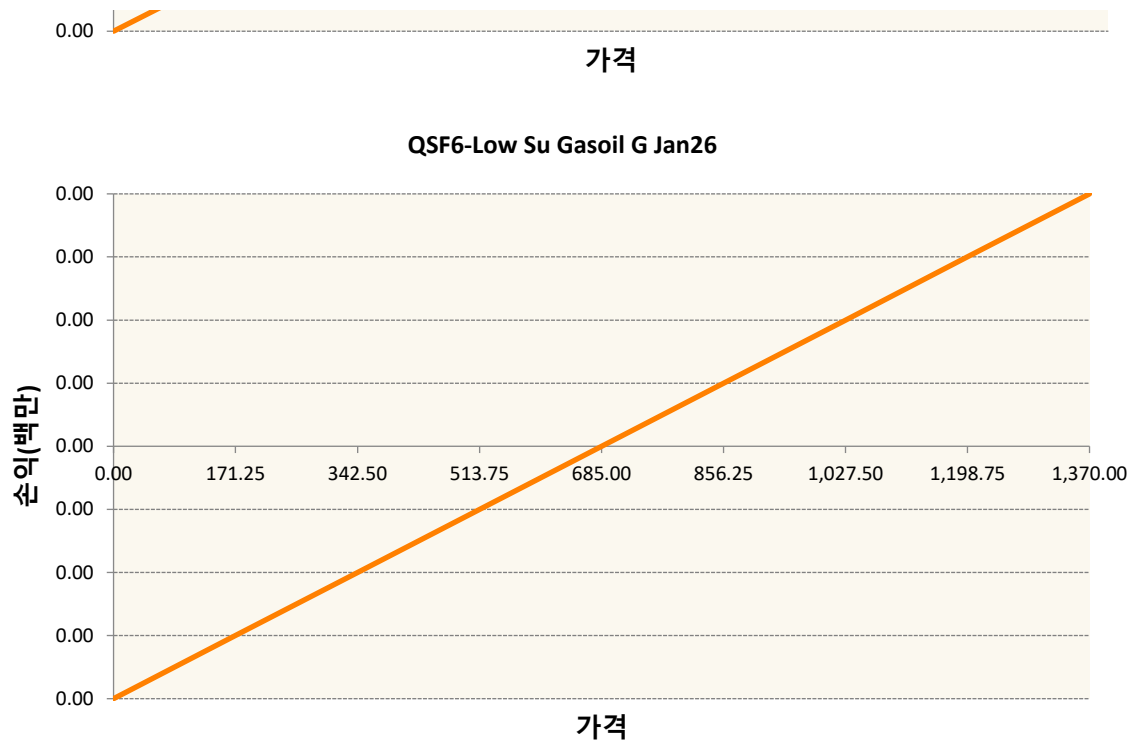
(단위:백만원)

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	347	0	347	
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	4
KR4175WB0(2025-11 달러선물		8
NGF26	NATURAL GAS FUTR Jan26	10
QSF6	Low Su Gasoil G Jan26	8

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

(단위:백만원)

92