

공시일 2025-11-04

기준일 2025-11-03

## 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 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

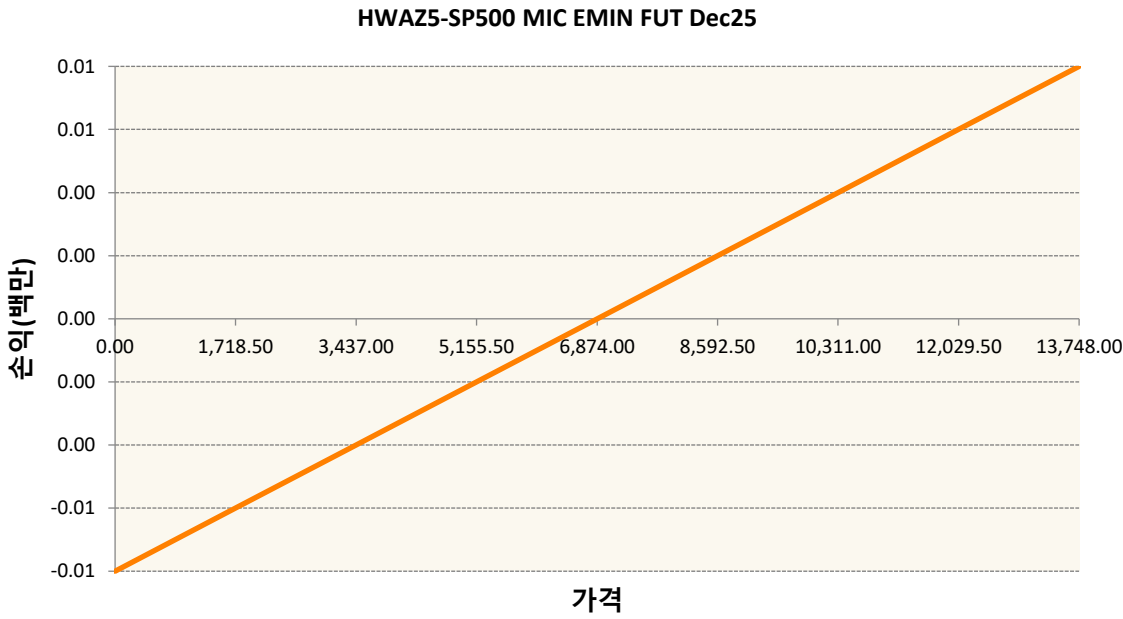
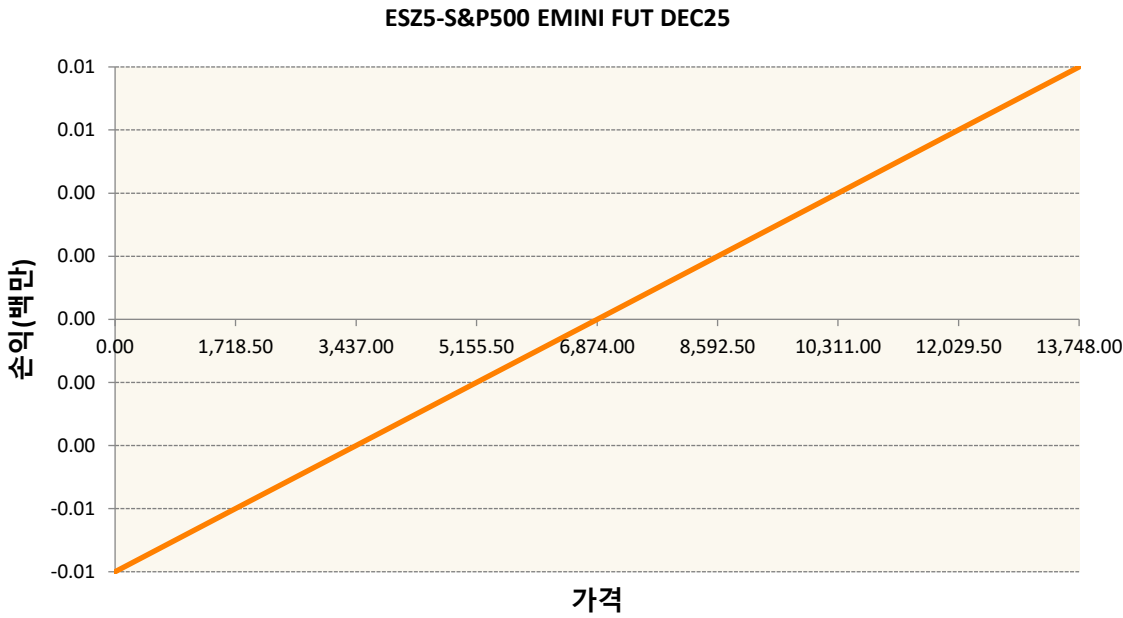
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 477   | 0     | 477       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 191   | 0     | 191       | 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 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

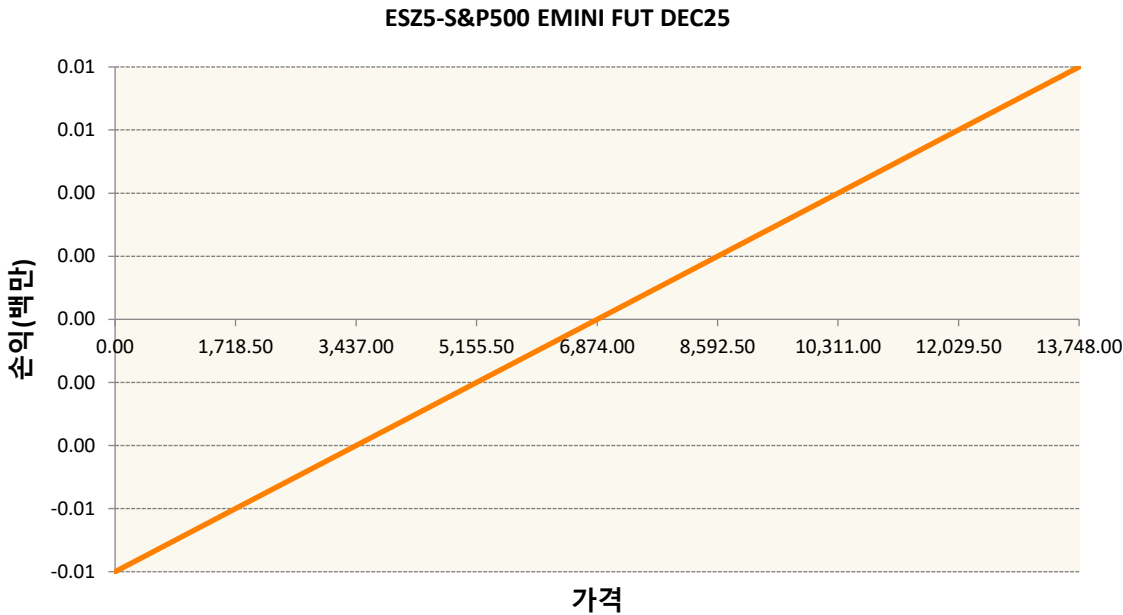
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,432 | 0     | 1,432     |    |

### 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)

|     |
|-----|
| 166 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

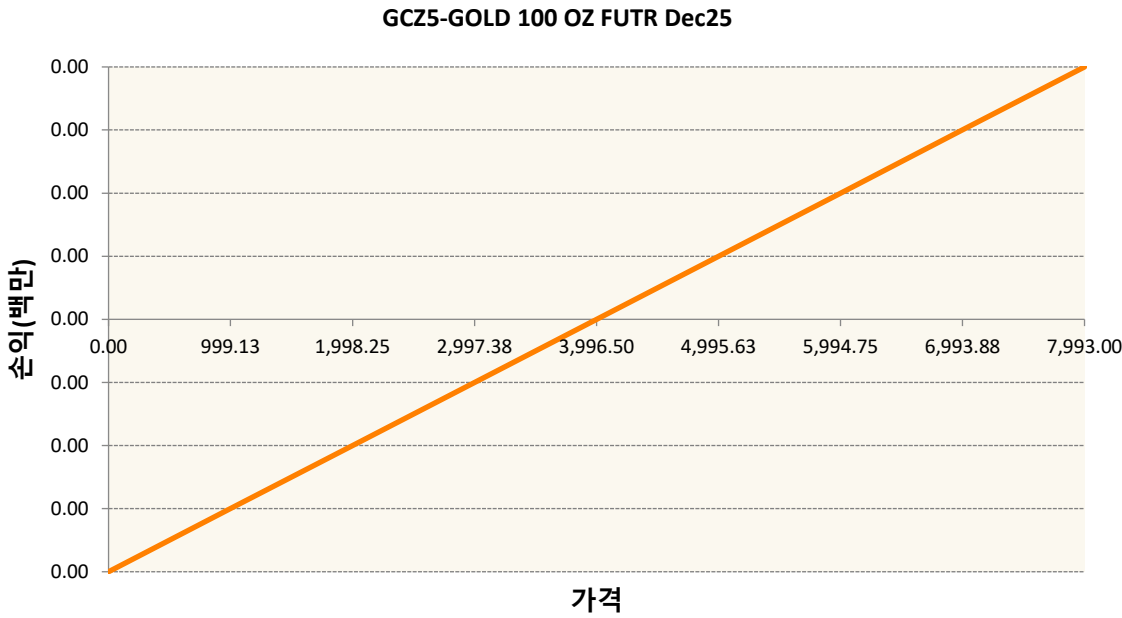
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 2,806 | 0     | 2,806     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                        |      |
|----------------------------------------|------|
| AOGLDUSC0 GLD US 11/07/25 C390 EQUITY  | 0.15 |
| GCZ5            GOLD 100 OZ FUTR Dec25 | 224  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 210 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

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)

|                                          |     |
|------------------------------------------|-----|
| AOPLTRUC2(PLTR US 11/07/25 C202.5 EQUITY | 225 |
| AOPLTRUP2(PLTR US 11/07/25 P202.5 EQUITY | 61  |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 1,148 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

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 11/07/25 C91.5 EQUITY

0.28

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

(단위:백만원)

0

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

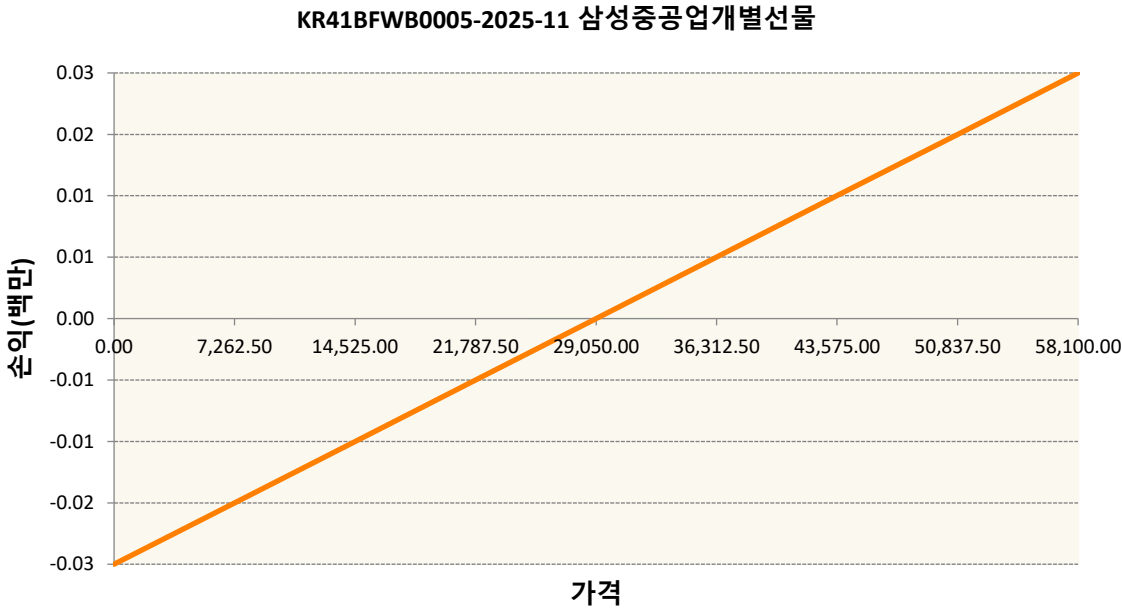
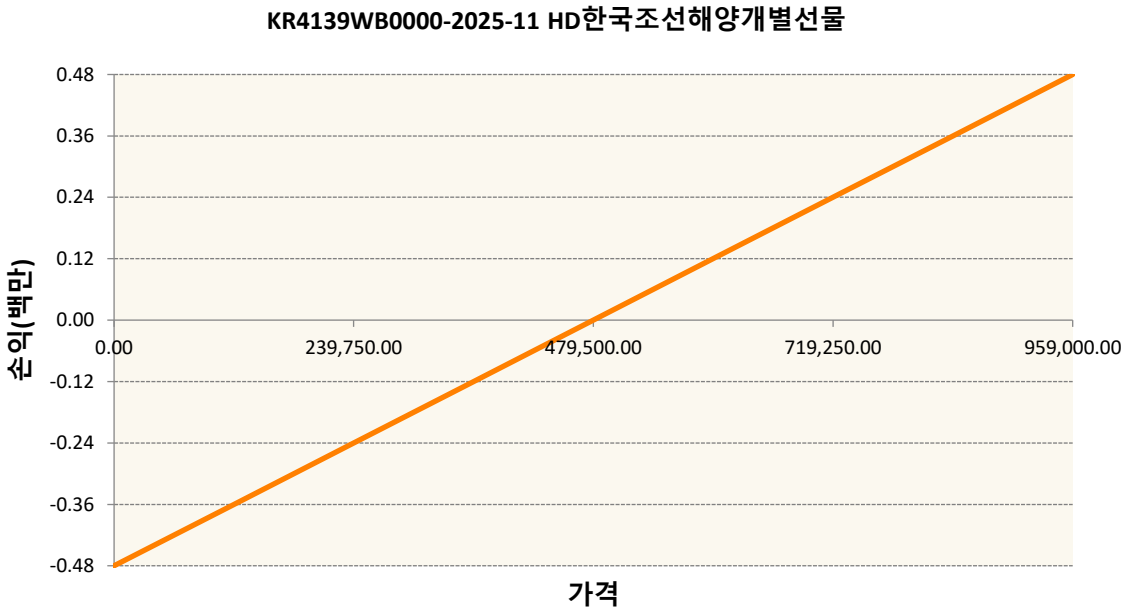
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 1. 계약금액

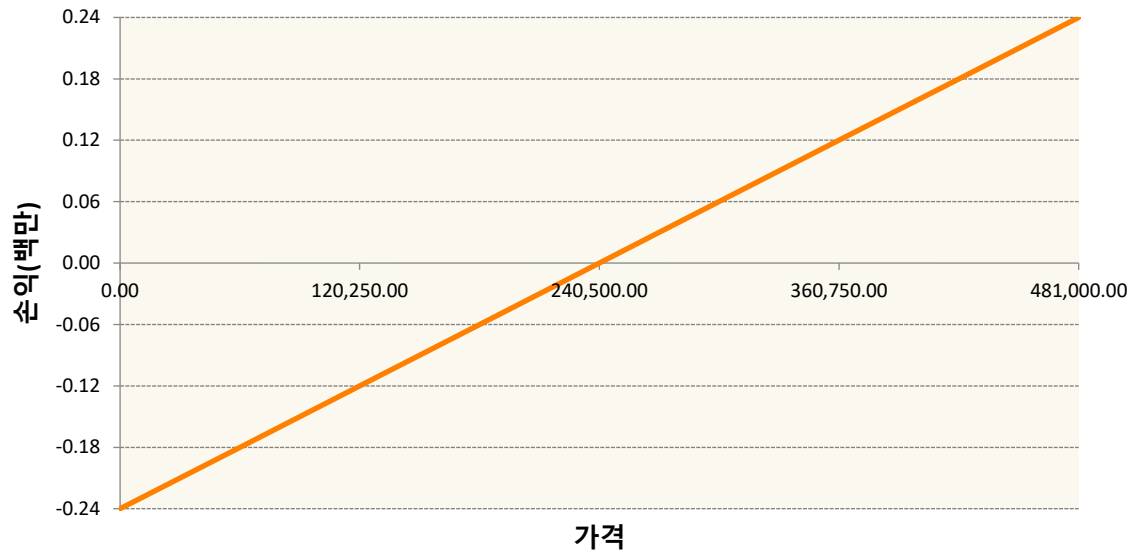
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 67,906 | 0     | 67,906    | 장내 |

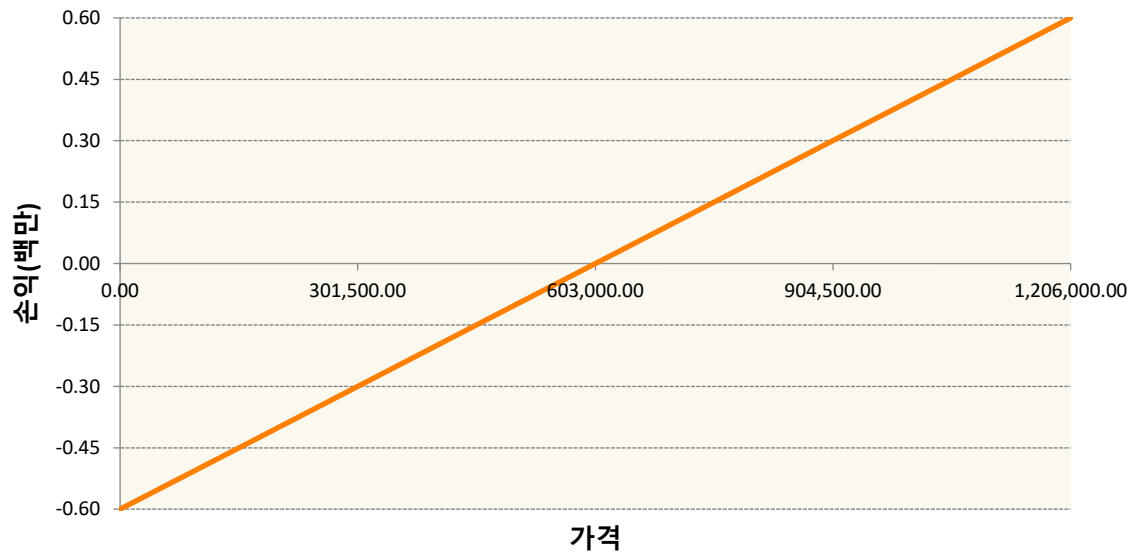
### 2. 만기시점의 손익구조



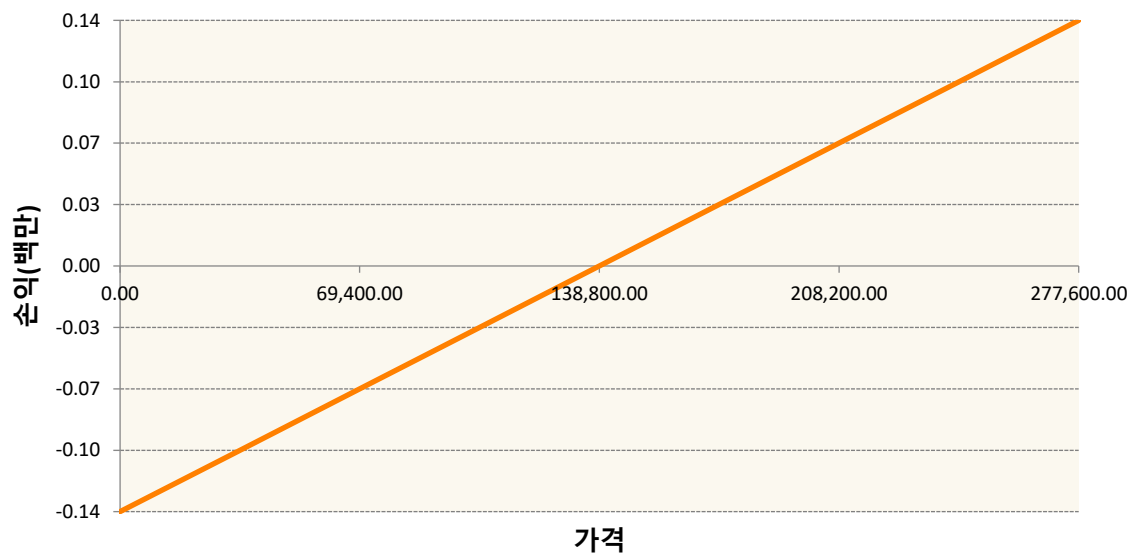
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



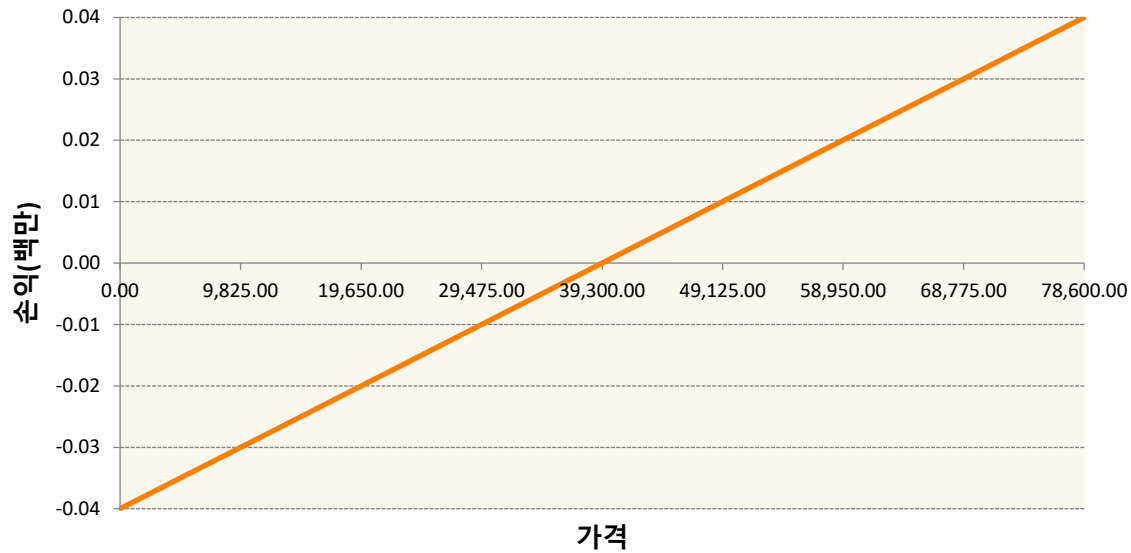
KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



KR41M7WC0000-2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4139WB0000 2025-11 HD한국조선해양개별선물 |         |         |        |        |        |        |        | 1,384  |
|-----------------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                         |         |         |        |        |        |        |        |        |
| 가격                                | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |        |
| -8.00%                            | -1,384  | -1,384  | -1,384 | -1,384 | -1,384 | -1,384 | -1,384 | -1,384 |
| -5.33%                            | -923    | -923    | -923   | -923   | -923   | -923   | -923   | -923   |
| -2.67%                            | -461    | -461    | -461   | -461   | -461   | -461   | -461   | -461   |
| 0%                                | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                             | 461     | 461     | 461    | 461    | 461    | 461    | 461    | 461    |
| 5.33%                             | 923     | 923     | 923    | 923    | 923    | 923    | 923    | 923    |
| 8.00%                             | 1,384   | 1,384   | 1,384  | 1,384  | 1,384  | 1,384  | 1,384  | 1,384  |
| KR41BFWB0005 2025-11 삼성중공업개별선물    |         |         |        |        |        |        |        | 1,434  |
| 기초자산의 변동성                         |         |         |        |        |        |        |        |        |
| 가격                                | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |        |
| -8.00%                            | -1,434  | -1,434  | -1,434 | -1,434 | -1,434 | -1,434 | -1,434 | -1,434 |
| -5.33%                            | -956    | -956    | -956   | -956   | -956   | -956   | -956   | -956   |
| -2.67%                            | -478    | -478    | -478   | -478   | -478   | -478   | -478   | -478   |
| 0%                                | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                             | 478     | 478     | 478    | 478    | 478    | 478    | 478    | 478    |
| 5.33%                             | 956     | 956     | 956    | 956    | 956    | 956    | 956    | 956    |
| 8.00%                             | 1,434   | 1,434   | 1,434  | 1,434  | 1,434  | 1,434  | 1,434  | 1,434  |
| KR41CDWB0006 2025-11 HD현대미포개별선물   |         |         |        |        |        |        |        | 543    |
| 기초자산의 변동성                         |         |         |        |        |        |        |        |        |
| 가격                                | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |        |
| -8.00%                            | -543    | -543    | -543   | -543   | -543   | -543   | -543   | -543   |
| -5.33%                            | -362    | -362    | -362   | -362   | -362   | -362   | -362   | -362   |
| -2.67%                            | -181    | -181    | -181   | -181   | -181   | -181   | -181   | -181   |
| 0%                                | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |

|                                        |         |         |        |        |        |        |        |
|----------------------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2.67%                                  | 181     | 181     | 181    | 181    | 181    | 181    | 181    |
| 5.33%                                  | 362     | 362     | 362    | 362    | 362    | 362    | 362    |
| 8.00%                                  | 543     | 543     | 543    | 543    | 543    | 543    | 543    |
| KR41FDWB0003 2025-11 HD현대중공업개별선물       |         |         |        |        |        |        | 719    |
| 기초자산의 변동성                              |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격                                     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                                 | -719    | -719    | -719   | -719   | -719   | -719   | -719   |
| -5.33%                                 | -479    | -479    | -479   | -479   | -479   | -479   | -479   |
| -2.67%                                 | -240    | -240    | -240   | -240   | -240   | -240   | -240   |
| 0%                                     | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                                  | 240     | 240     | 240    | 240    | 240    | 240    | 240    |
| 5.33%                                  | 479     | 479     | 479    | 479    | 479    | 479    | 479    |
| 8.00%                                  | 719     | 719     | 719    | 719    | 719    | 719    | 719    |
| KR41FVWB0001 2025-11 한화오션개별선물          |         |         |        |        |        |        | 1,131  |
| 기초자산의 변동성                              |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격                                     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                                 | -1,131  | -1,131  | -1,131 | -1,131 | -1,131 | -1,131 | -1,131 |
| -5.33%                                 | -754    | -754    | -754   | -754   | -754   | -754   | -754   |
| -2.67%                                 | -377    | -377    | -377   | -377   | -377   | -377   | -377   |
| 0%                                     | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                                  | 377     | 377     | 377    | 377    | 377    | 377    | 377    |
| 5.33%                                  | 754     | 754     | 754    | 754    | 754    | 754    | 754    |
| 8.00%                                  | 1,131   | 1,131   | 1,131  | 1,131  | 1,131  | 1,131  | 1,131  |
| KR41M7WC0000 2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물 |         |         |        |        |        |        | 2,200  |
| 기초자산의 변동성                              |         |         |        |        |        |        |        |
| 가격                                     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                                 | -2,200  | -2,200  | -2,200 | -2,200 | -2,200 | -2,200 | -2,200 |
| -5.33%                                 | -1,467  | -1,467  | -1,467 | -1,467 | -1,467 | -1,467 | -1,467 |
| -2.67%                                 | -733    | -733    | -733   | -733   | -733   | -733   | -733   |
| 0%                                     | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                                  | 733     | 733     | 733    | 733    | 733    | 733    | 733    |
| 5.33%                                  | 1,467   | 1,467   | 1,467  | 1,467  | 1,467  | 1,467  | 1,467  |
| 8.00%                                  | 2,200   | 2,200   | 2,200  | 2,200  | 2,200  | 2,200  | 2,200  |

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

(단위:백만원)

6,868

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

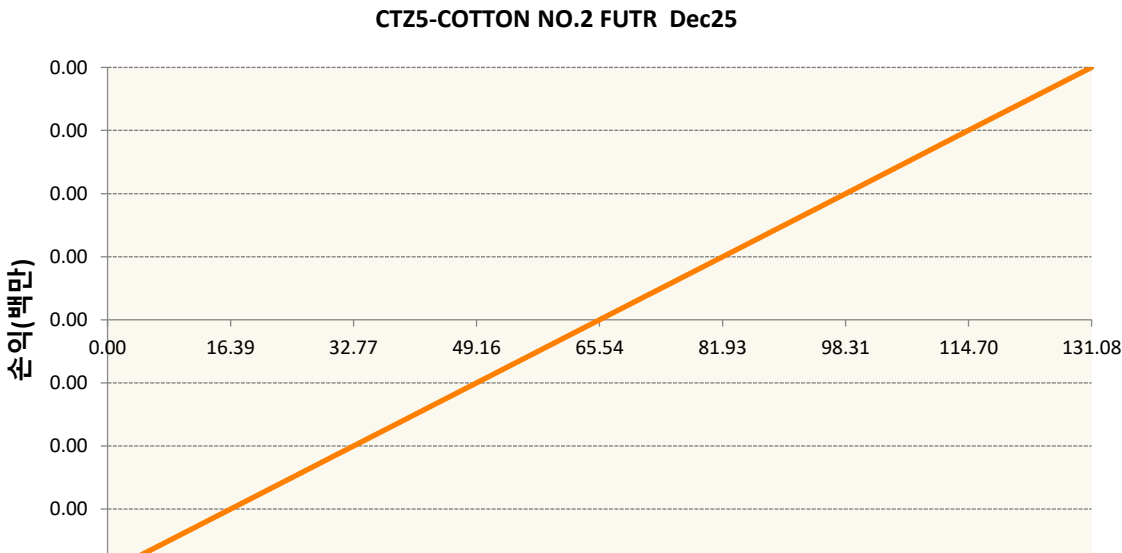
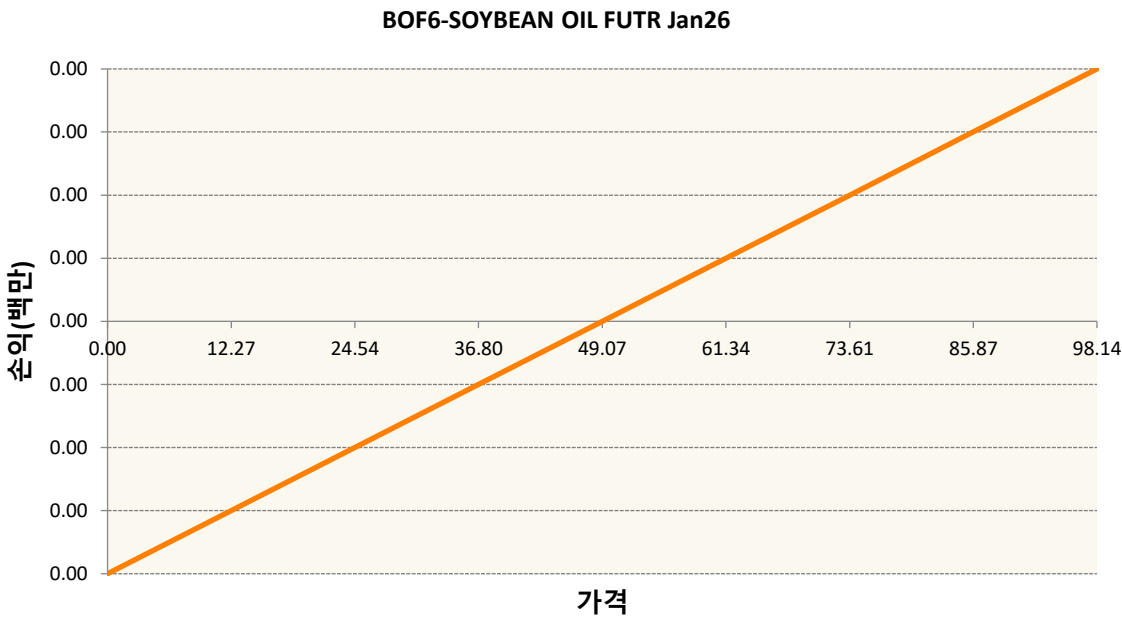
## 포커스농산물모(채권-파생형)

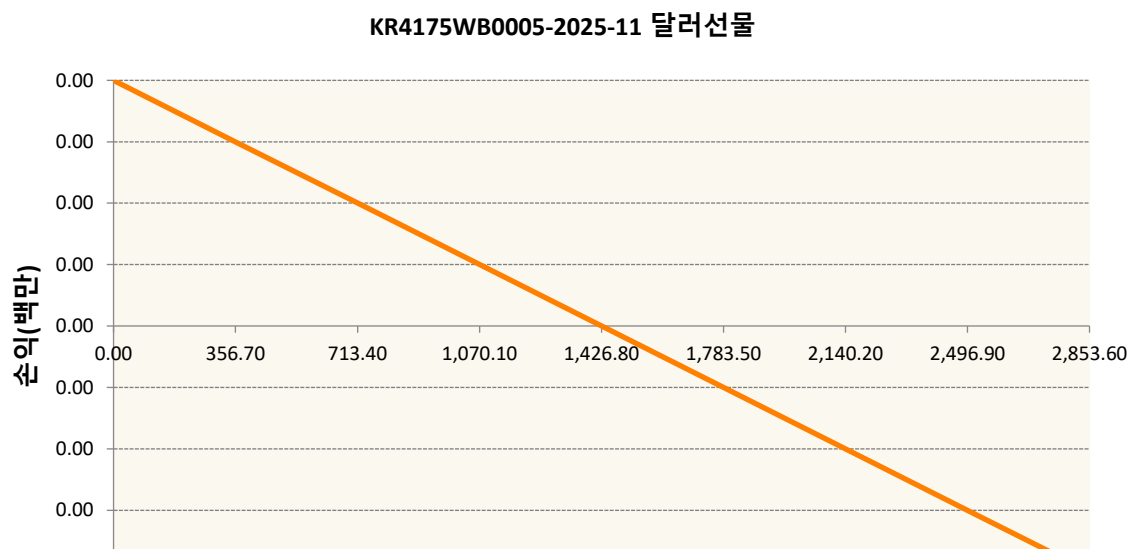
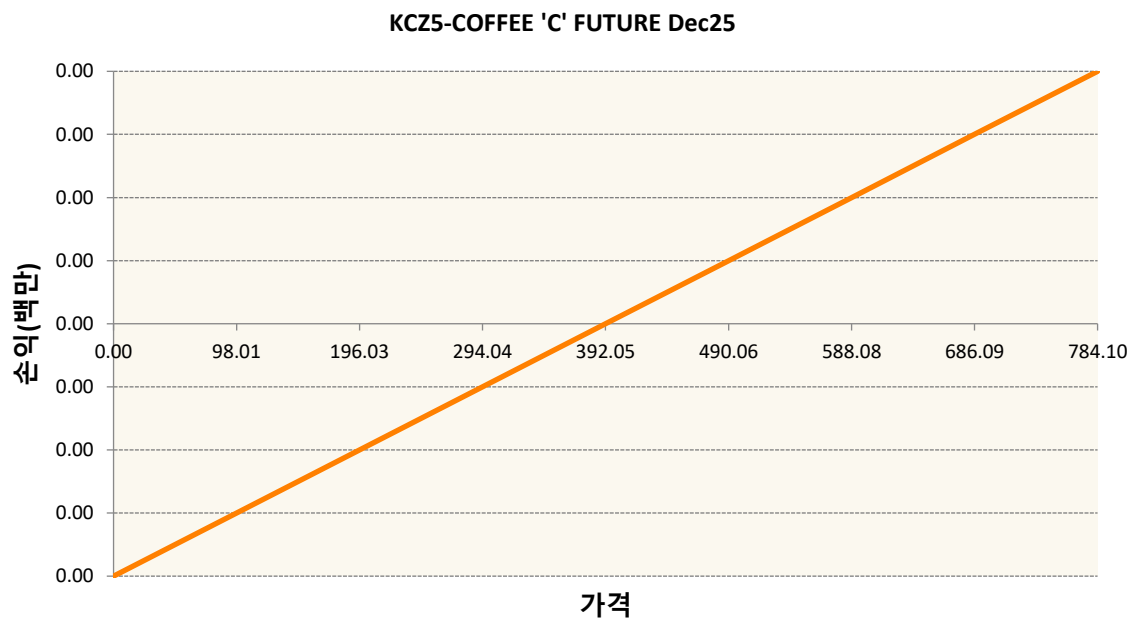
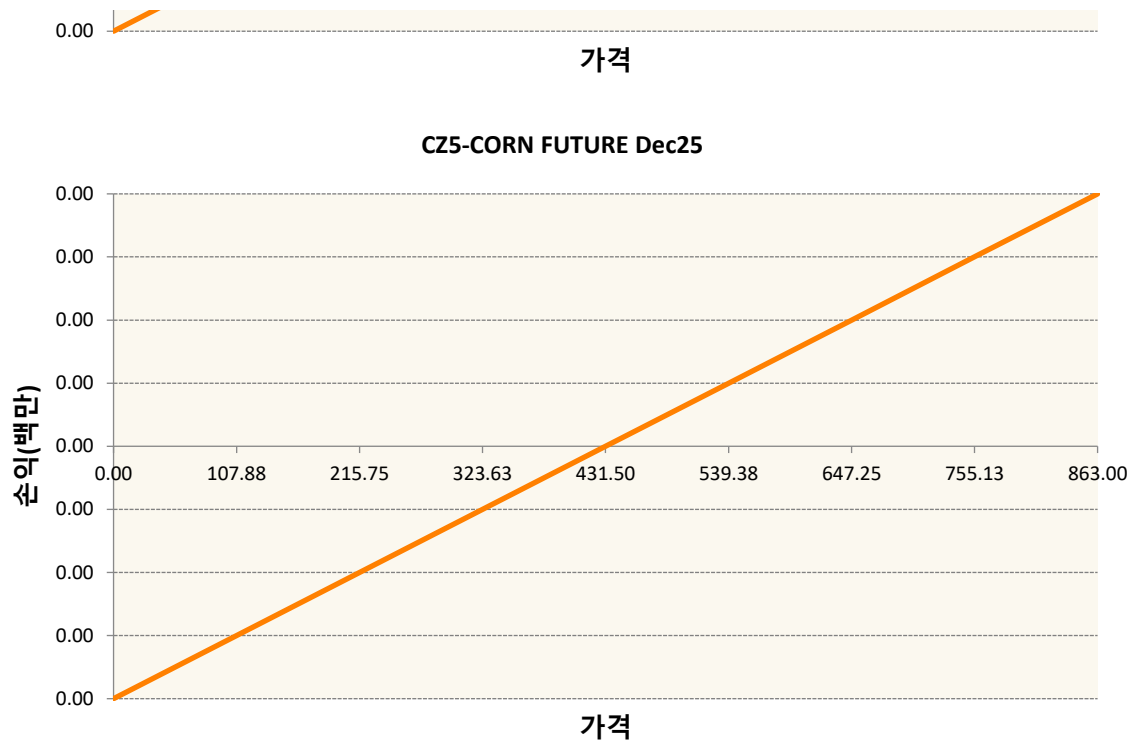
### 1. 계약금액

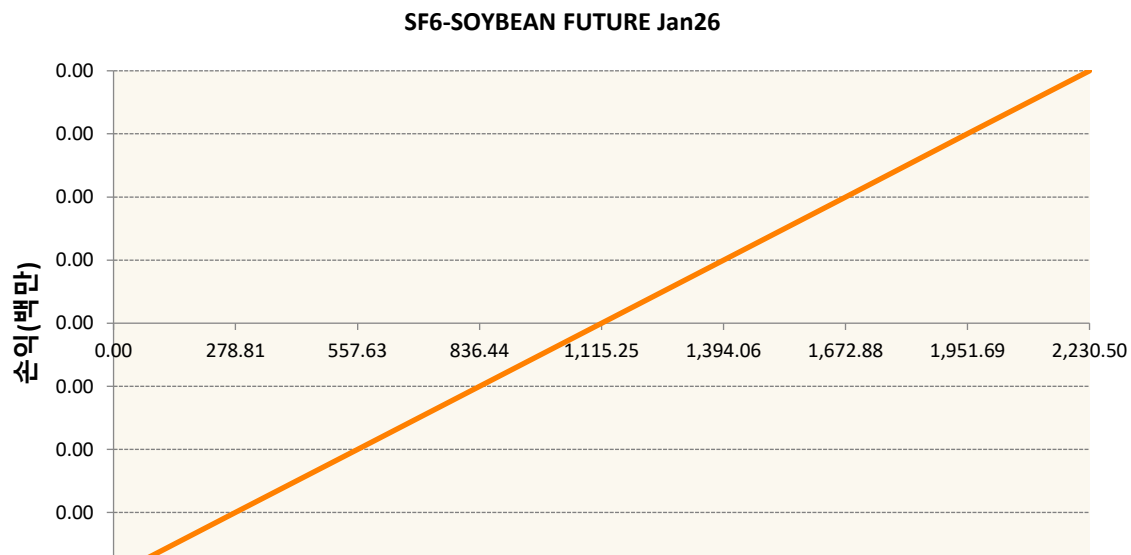
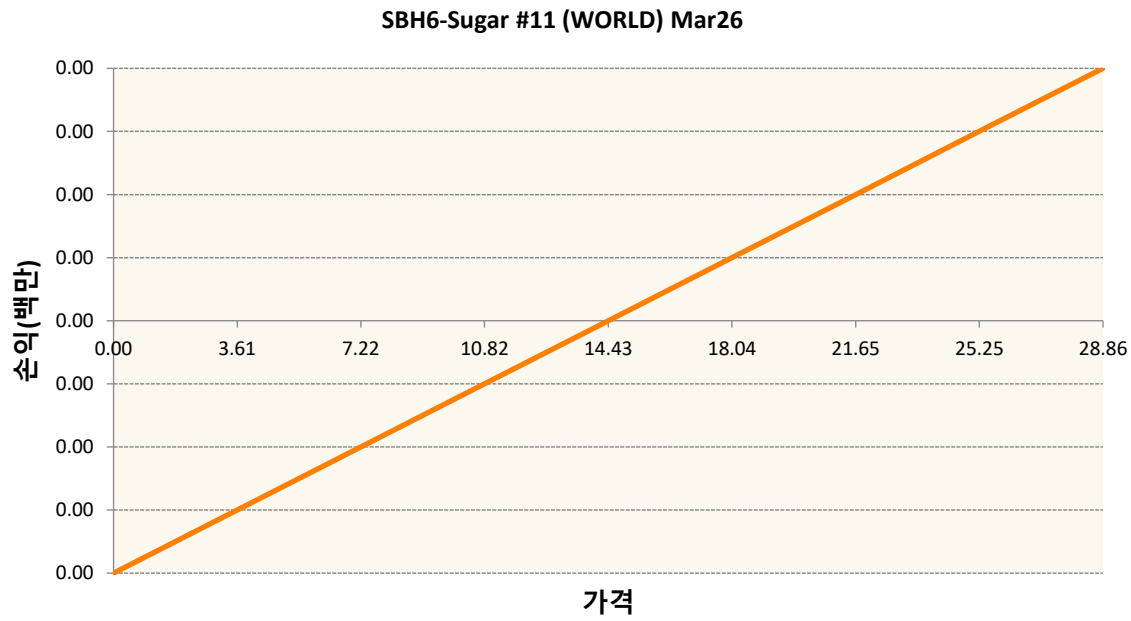
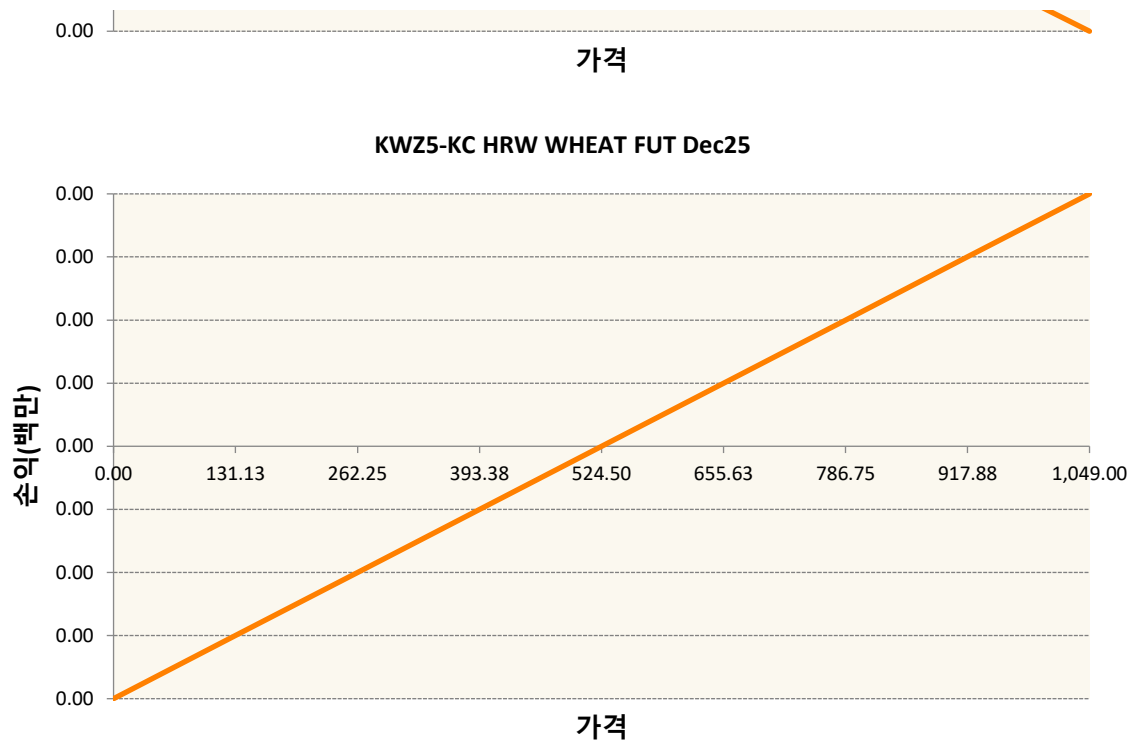
(단위:USD 백만)

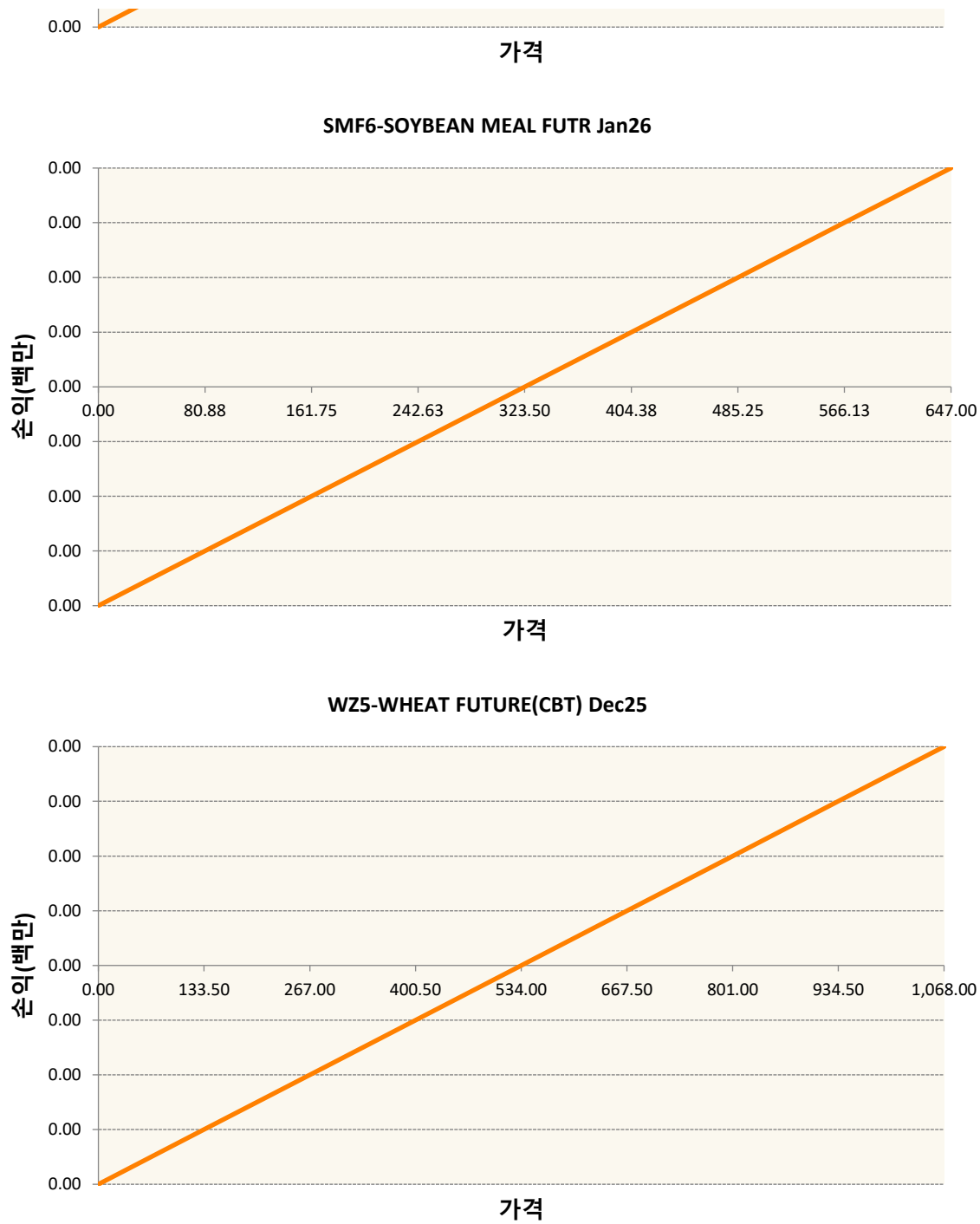
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,132 | 0     | 1,132     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,166 | 0     | 2,166     |    |
| 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 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

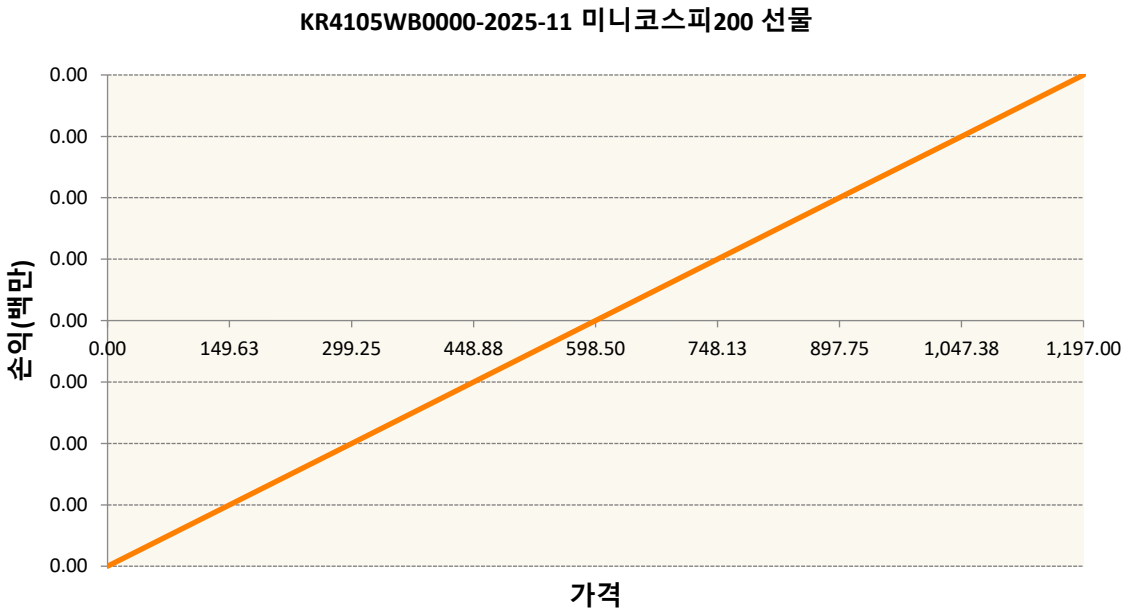
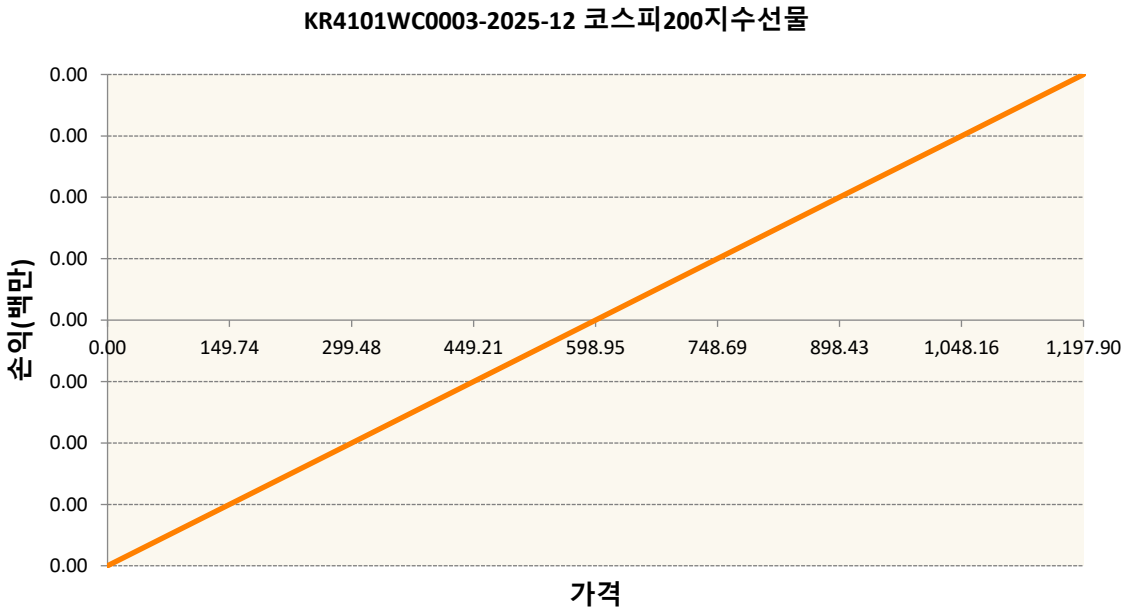
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

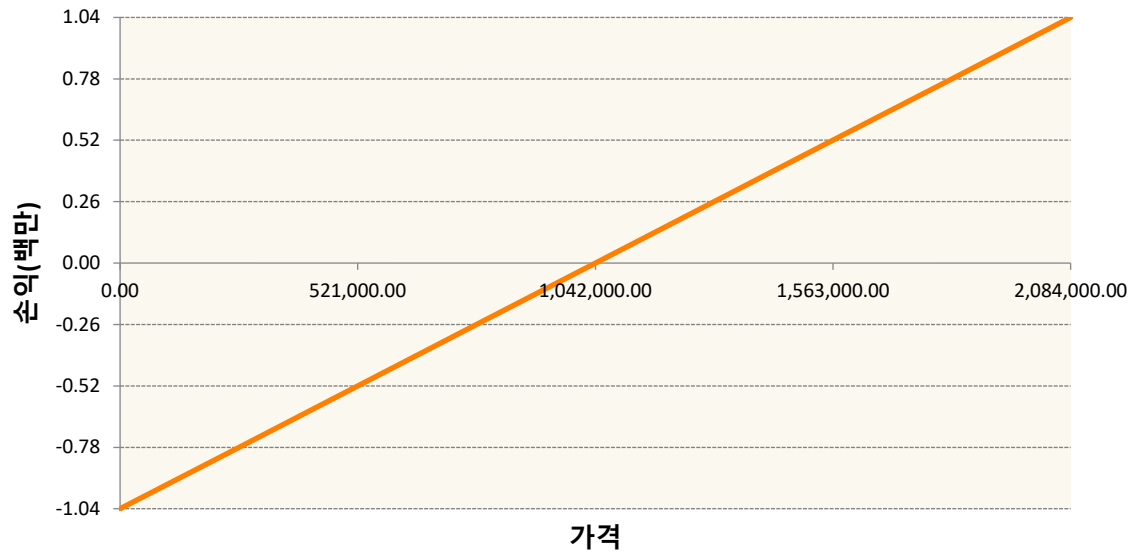
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 145   | 0     | 145       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,089 | 0     | 2,089     | 장내 |

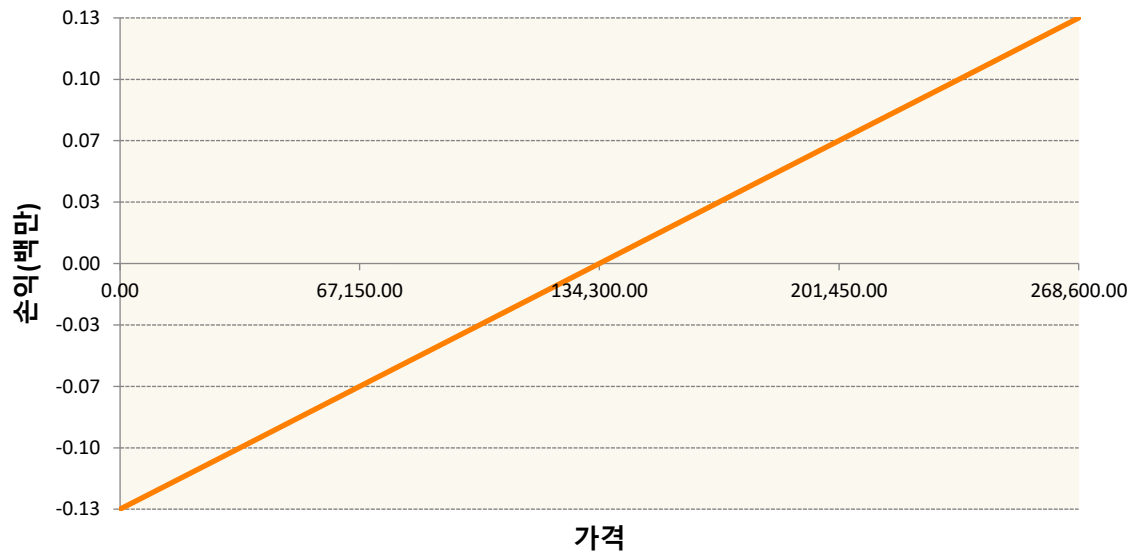
### 2. 만기시점의 손익구조



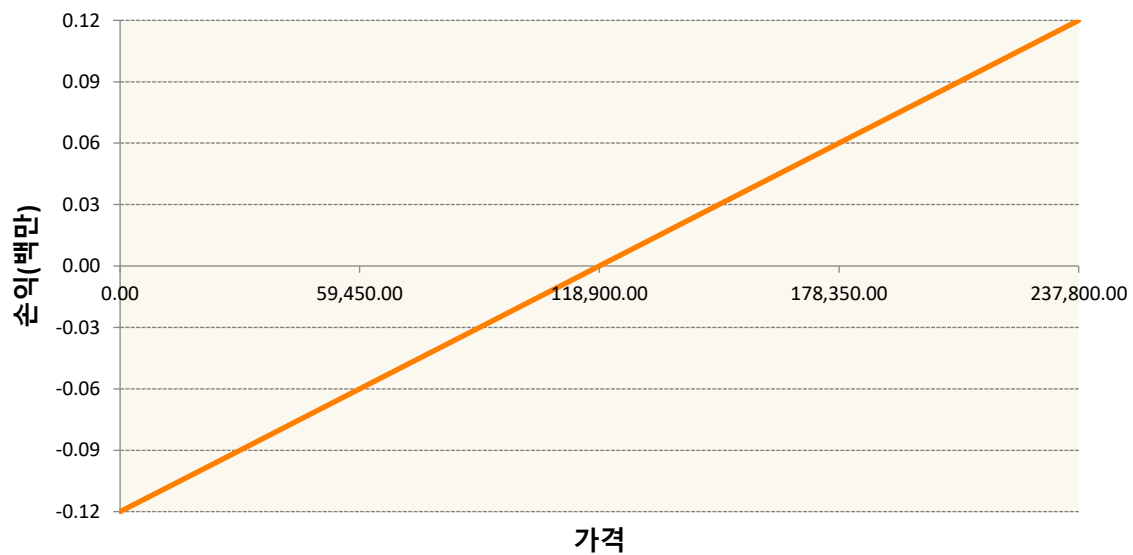
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)      |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------|--|----------|
| KR4101WC0( 2025-12 코스피200지수선물  |  | 120      |
| KR4105WB0( 2025-11 미니코스피200 선물 |  | 7        |
| KR41B3WB0( 2025-11 고려아연개별선물    |  | 6        |
| KR41EJWB0( 2025-11 SKC개별선물     |  | 3        |
| KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물     |  | 3        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 43       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

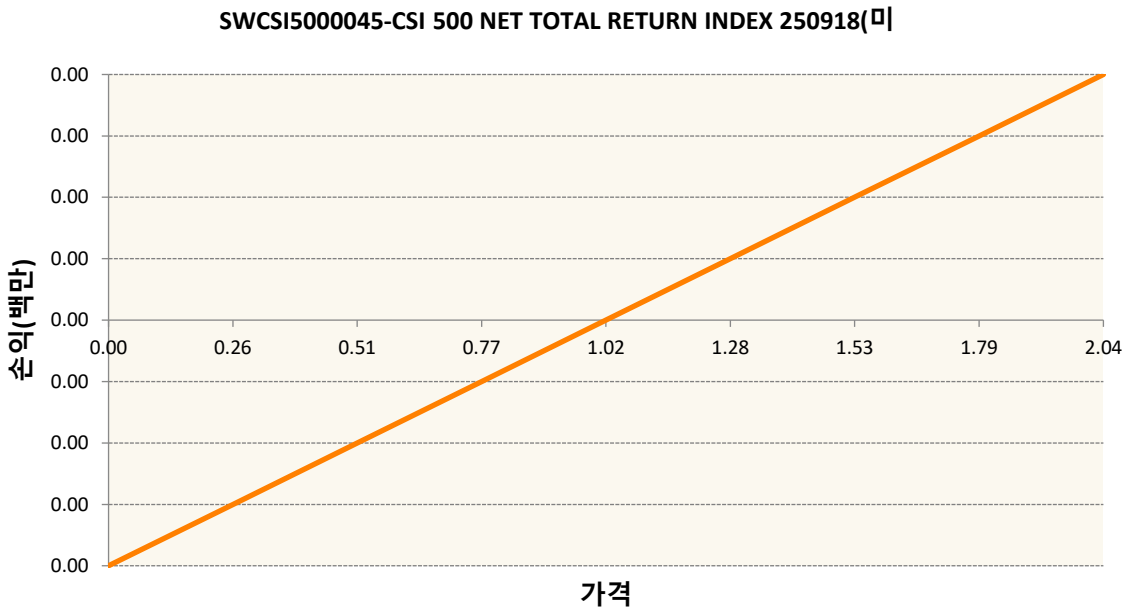
SOL차이나강소기업CSI500상장

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   | 4,794 | 0     | 4,794     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

384

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

492

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

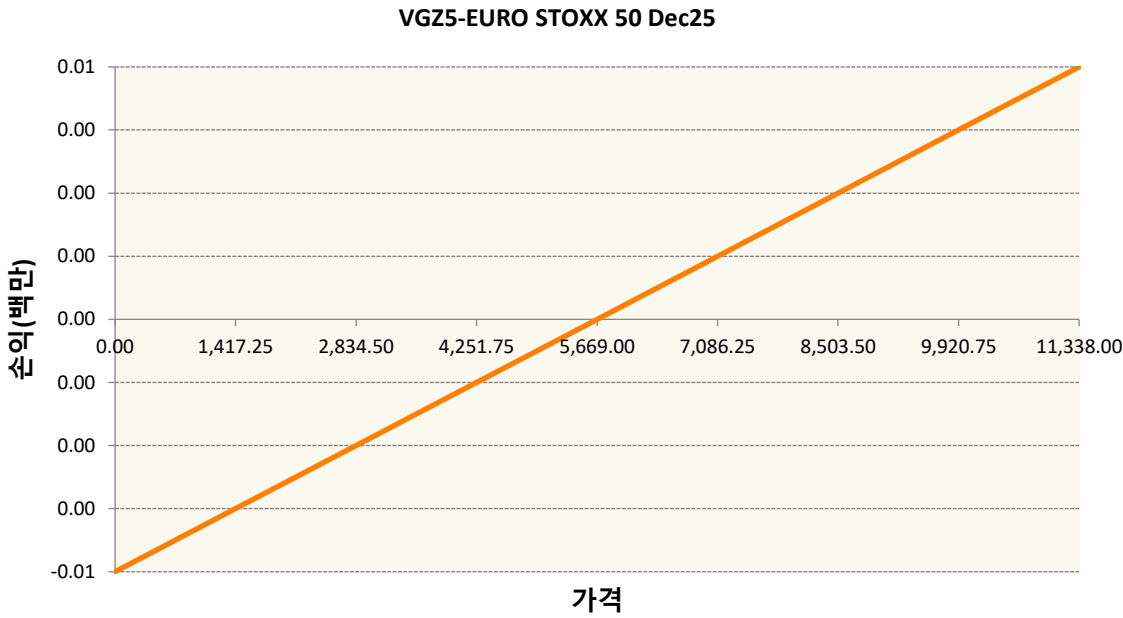
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 743   | 0     | 743       |    |

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 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

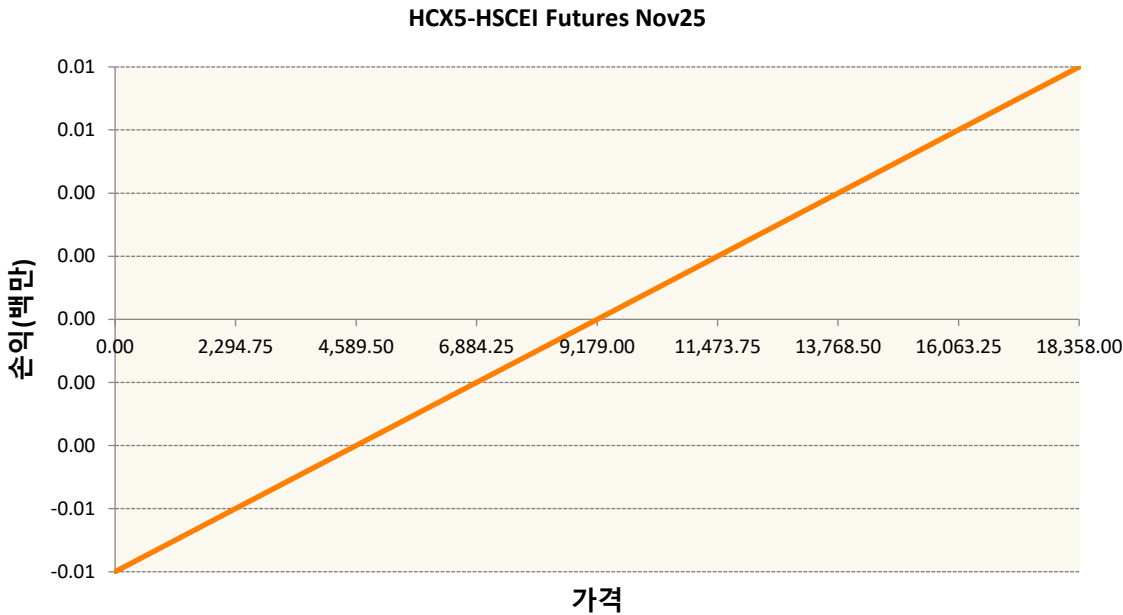
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 2,030 | 0     | 2,030     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HGX5 | HSCEI Futures Nov25 | 162 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

230

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

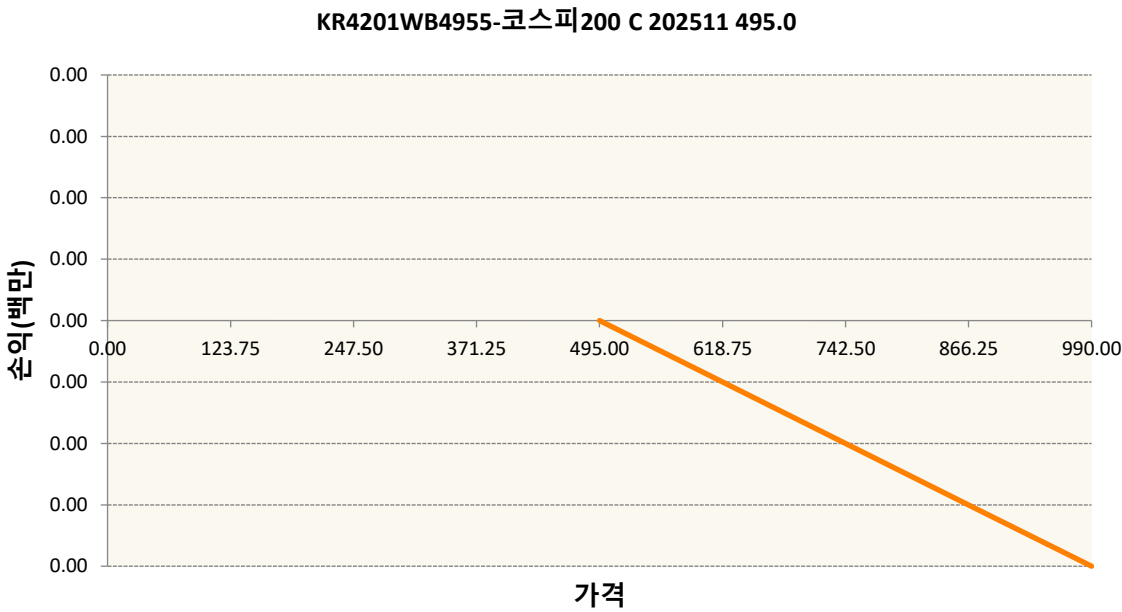
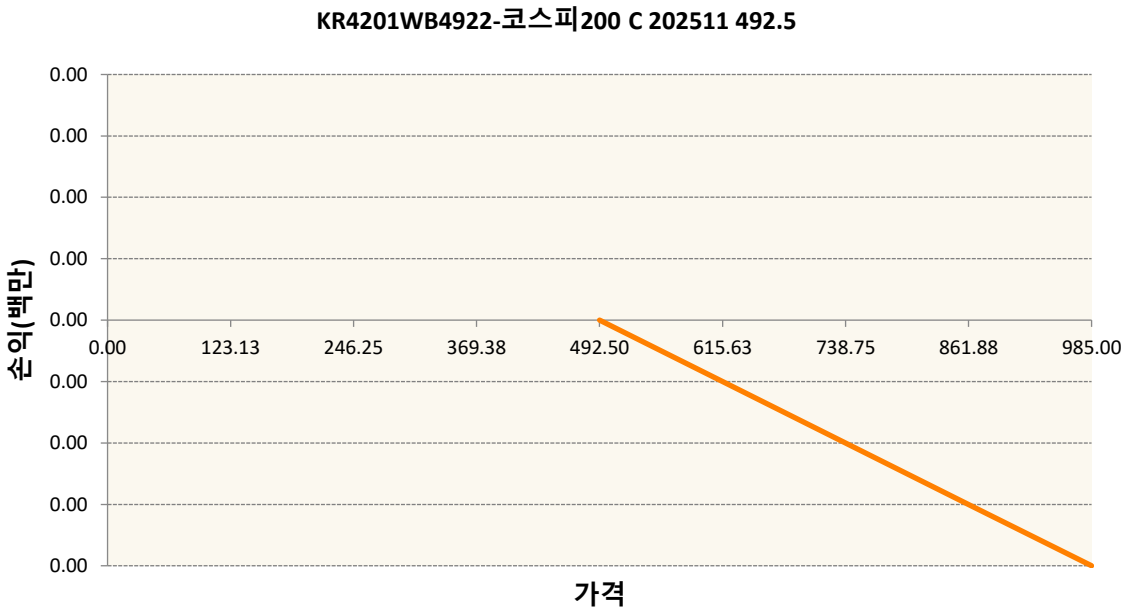
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

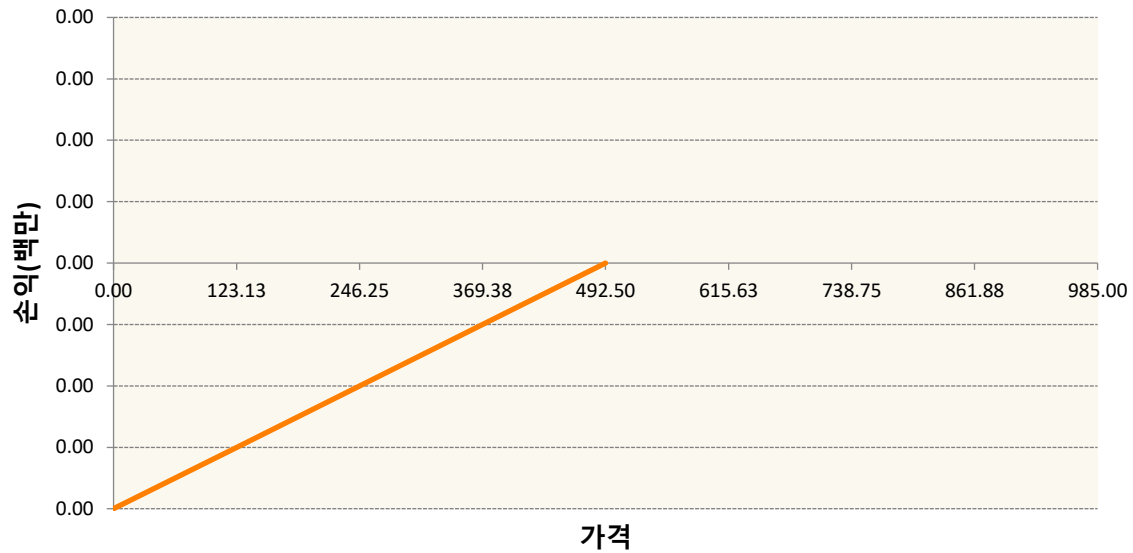
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 806   | 0      | 806       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 29,768 | -29,768   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301WB4921-코스피200 P 202511 492.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WB49코스피200 C 202511 492.5

414

KR4201WB49코스피200 C 202511 495.0

1,505

KR4301WB49코스피200 P 202511 492.5

463

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-11-04

기준일 2025-11-03

## 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 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

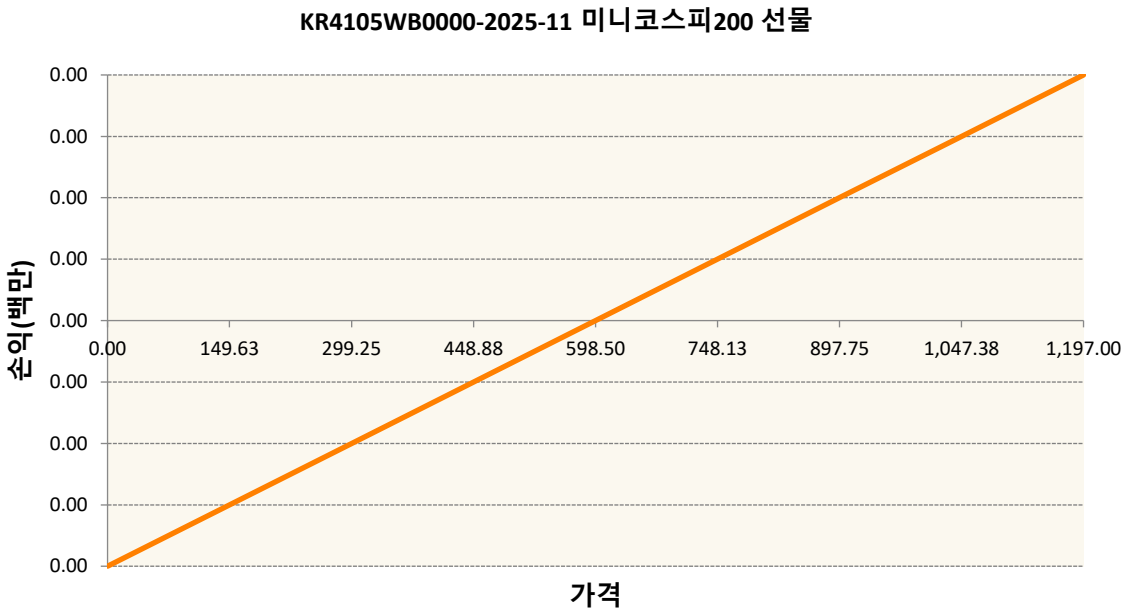
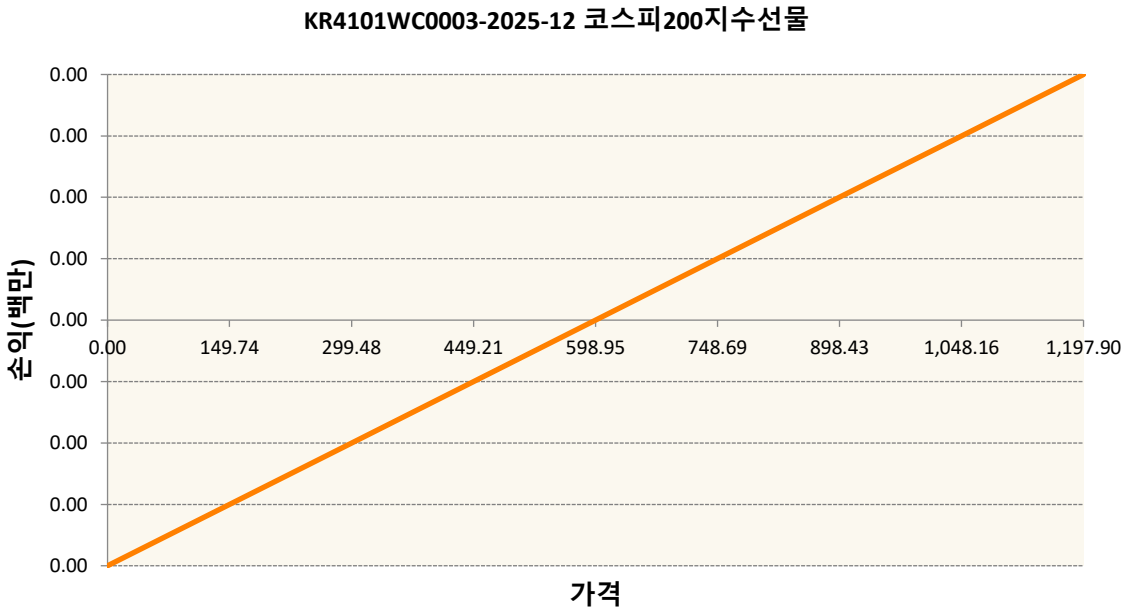
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

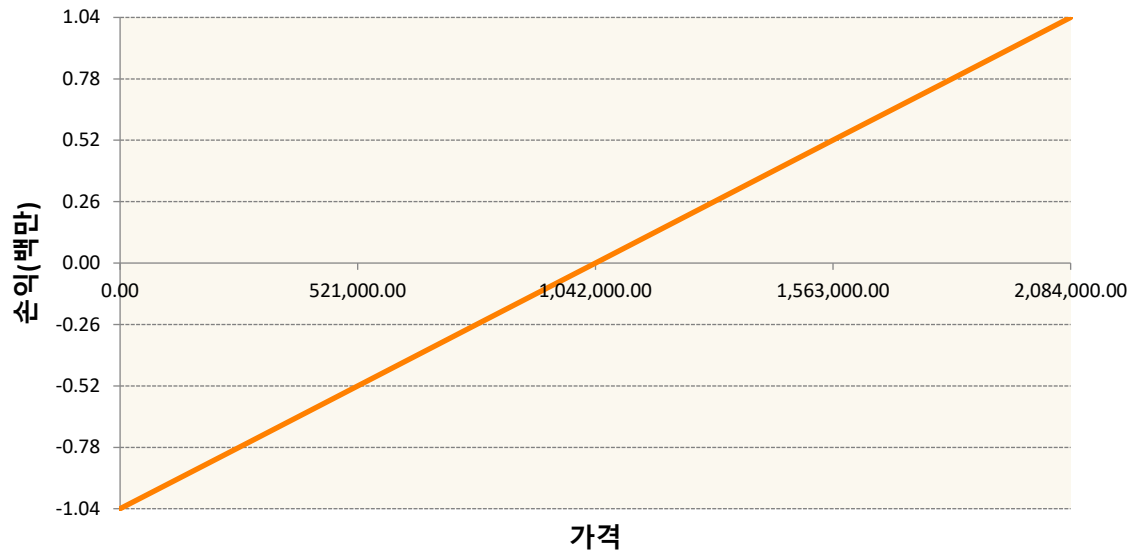
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 150   | 0     | 150       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 960   | 0     | 960       | 장내 |

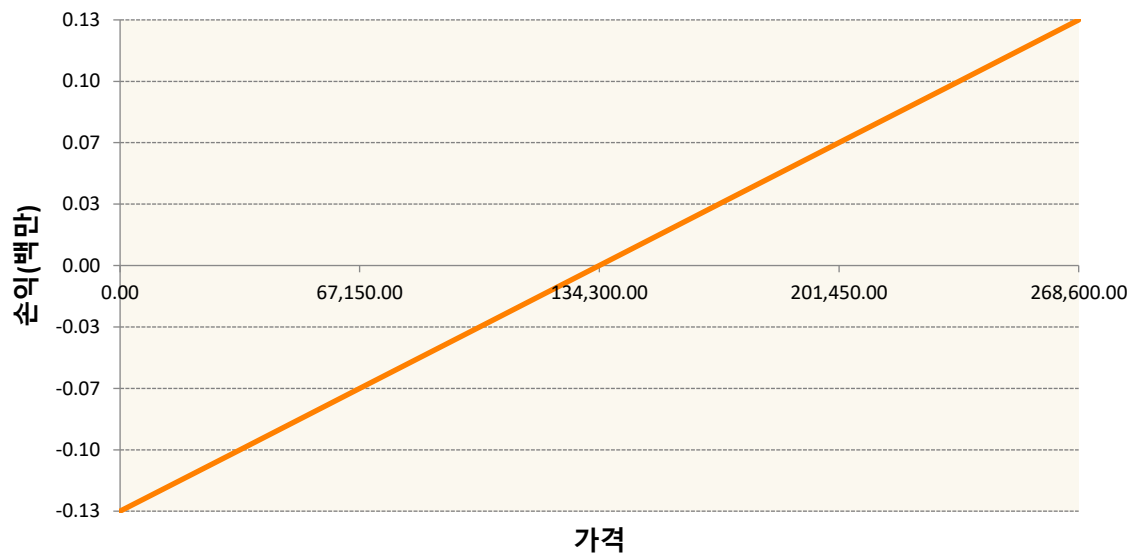
### 2. 만기시점의 손익구조



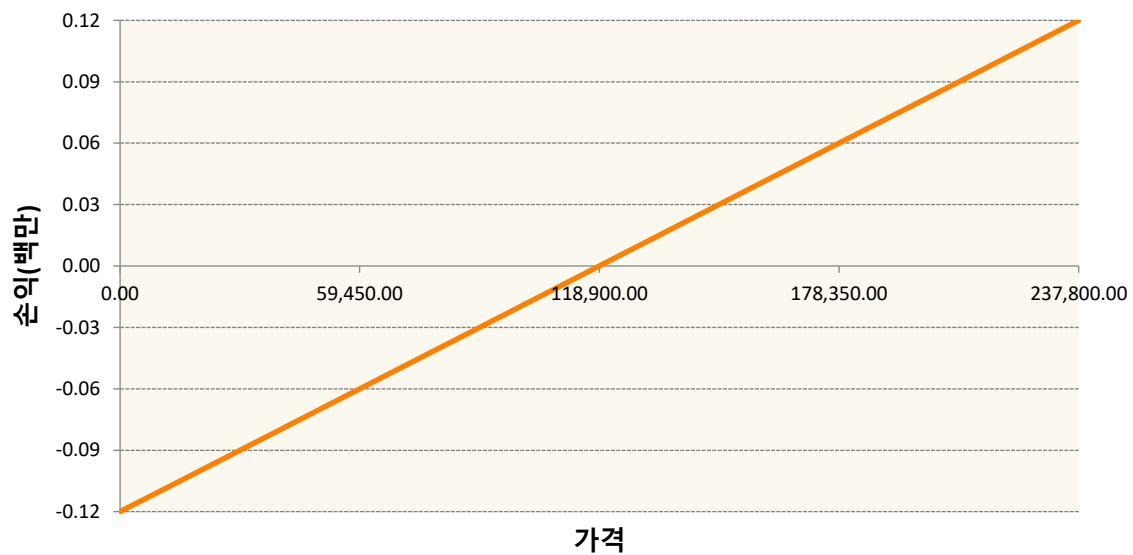
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)      |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------|--|----------|
| KR4101WC0( 2025-12 코스피200지수선물  |  | 48       |
| KR4105WB0( 2025-11 미니코스피200 선물 |  | 5        |
| 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 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

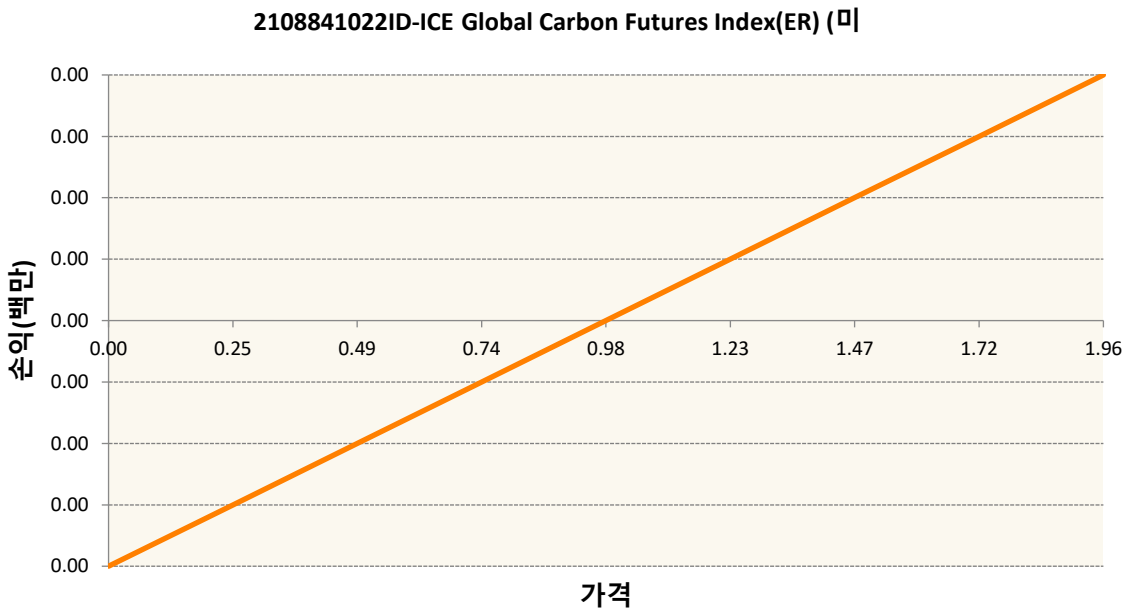
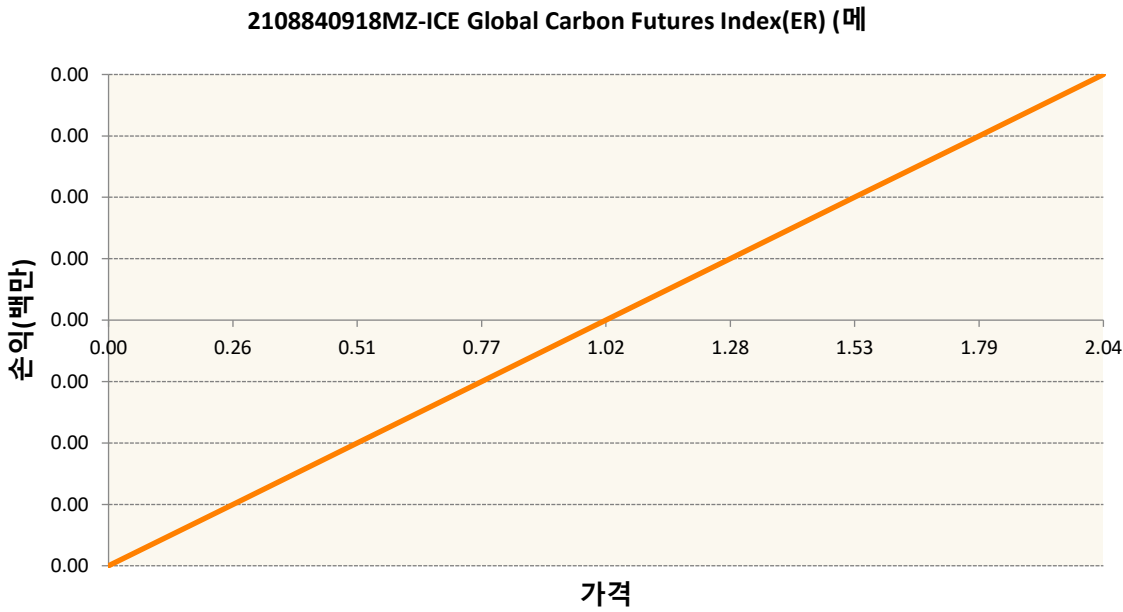
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 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 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

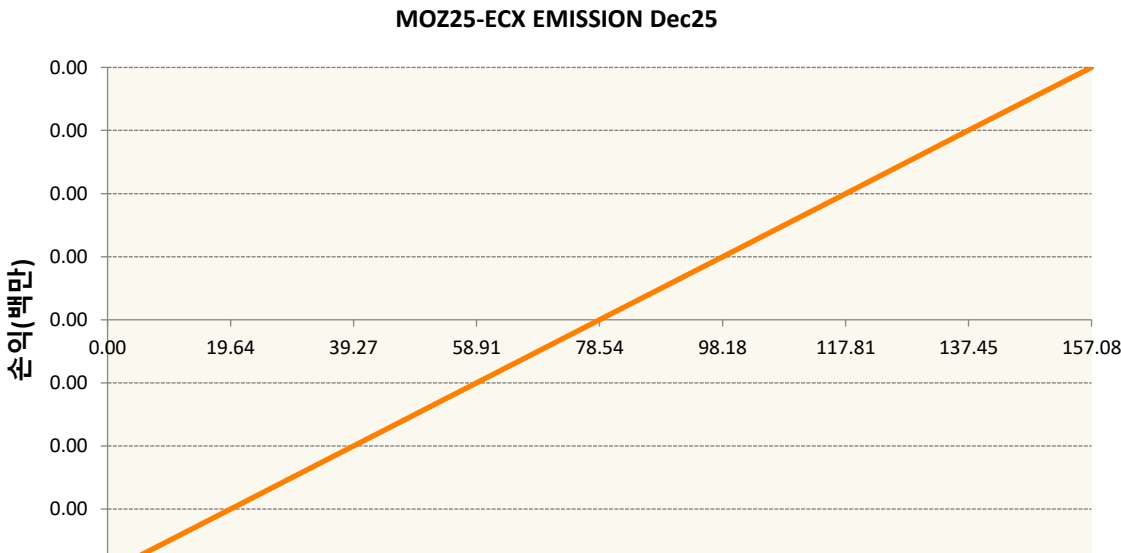
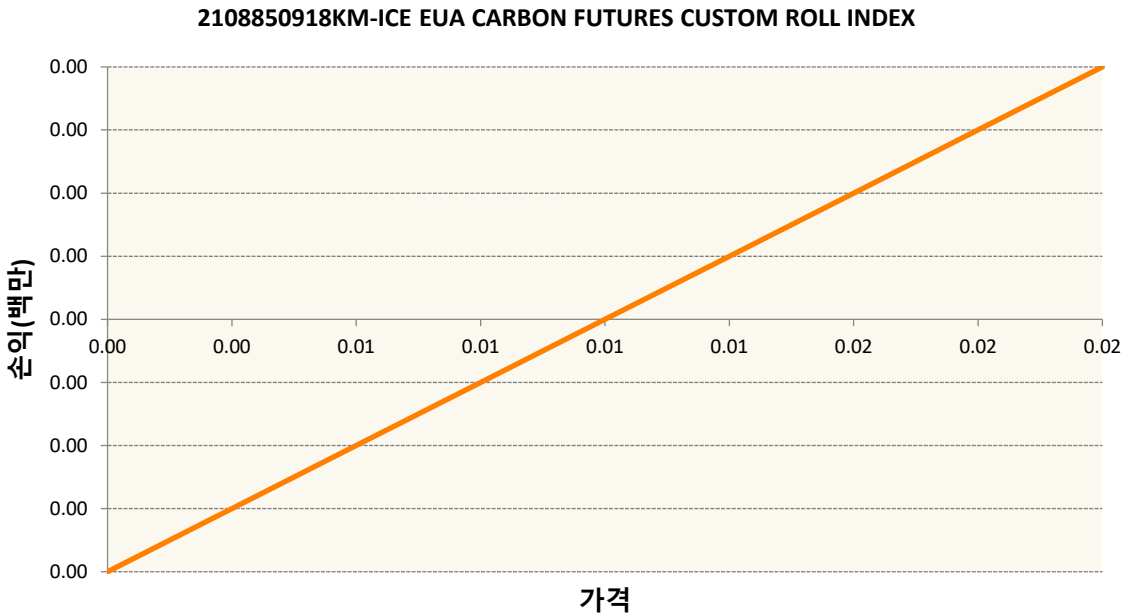
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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   | 5,778 | 0     | 5,778     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 4     | 0     | 4         | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,473 | -2,473    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



0.00



가격

**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX

0.41

FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E

198

MOZ25 ECX EMISSION Dec25

462

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

(단위:백만원)

**746**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

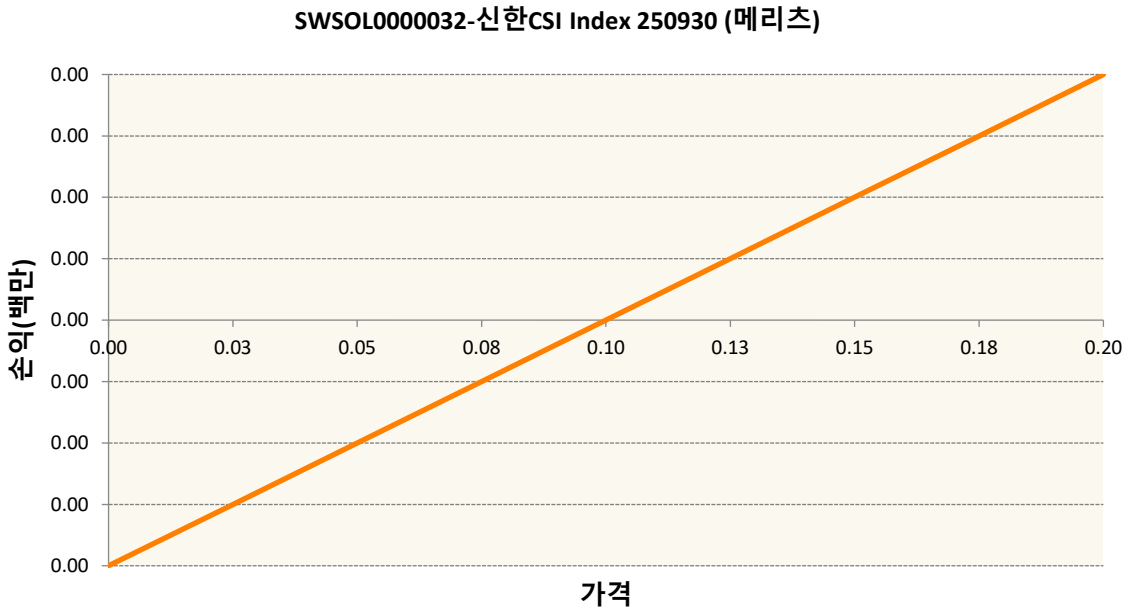
## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 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   | 2,747 | 0     | 2,747     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                |    |
|------------------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 11 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 8  |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 8  |
| SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)            | 19 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 80 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

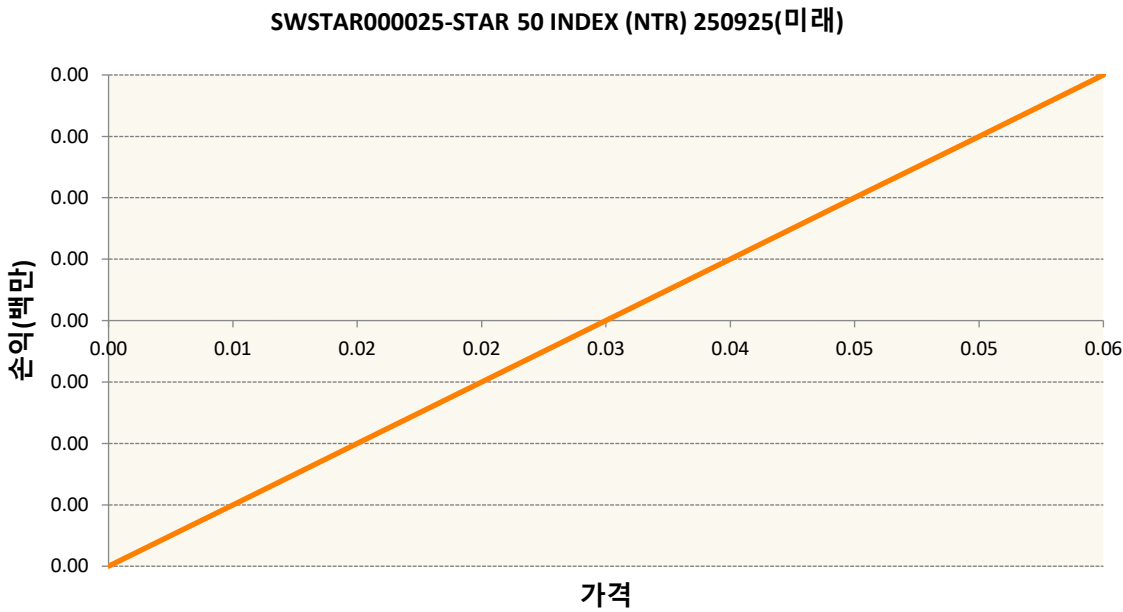
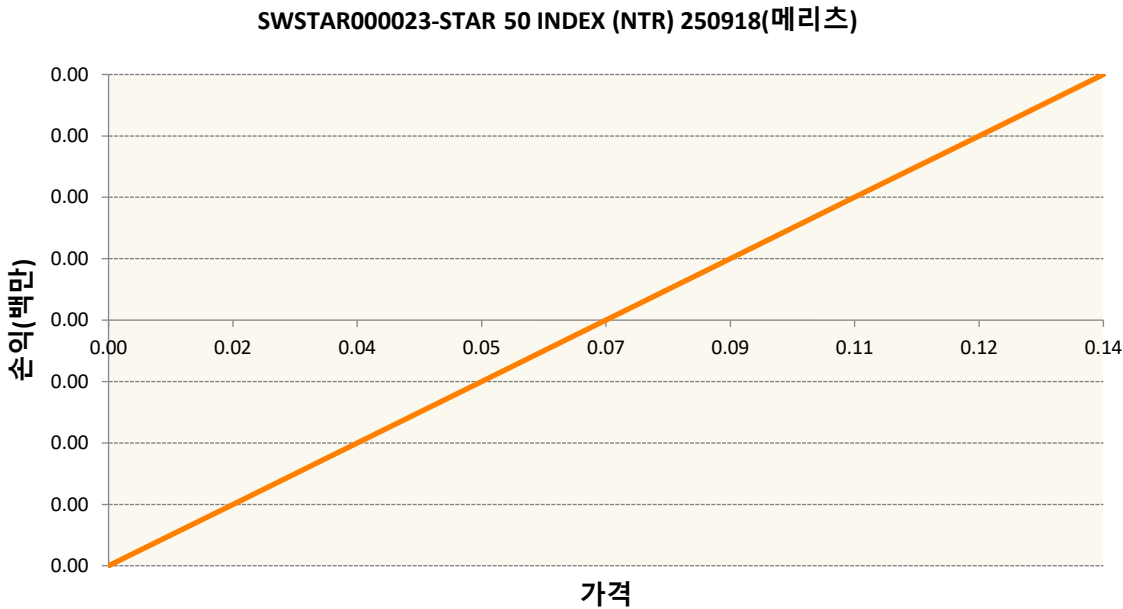
# SOL차이나육성산업엑티브상장지

## 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   | 4,280 | 0     | 4,280     | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                  |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------------------|--|----------|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)     |  | 17       |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)     |  | 5        |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠) |  | 61       |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)  |  | 12       |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠) |  | 13       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 194      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

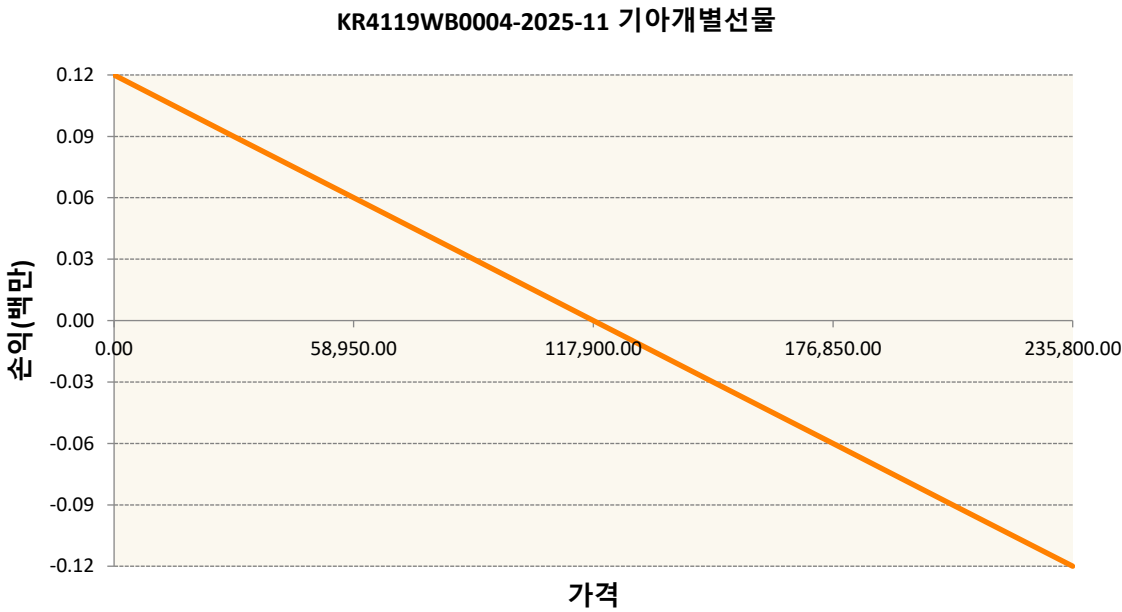
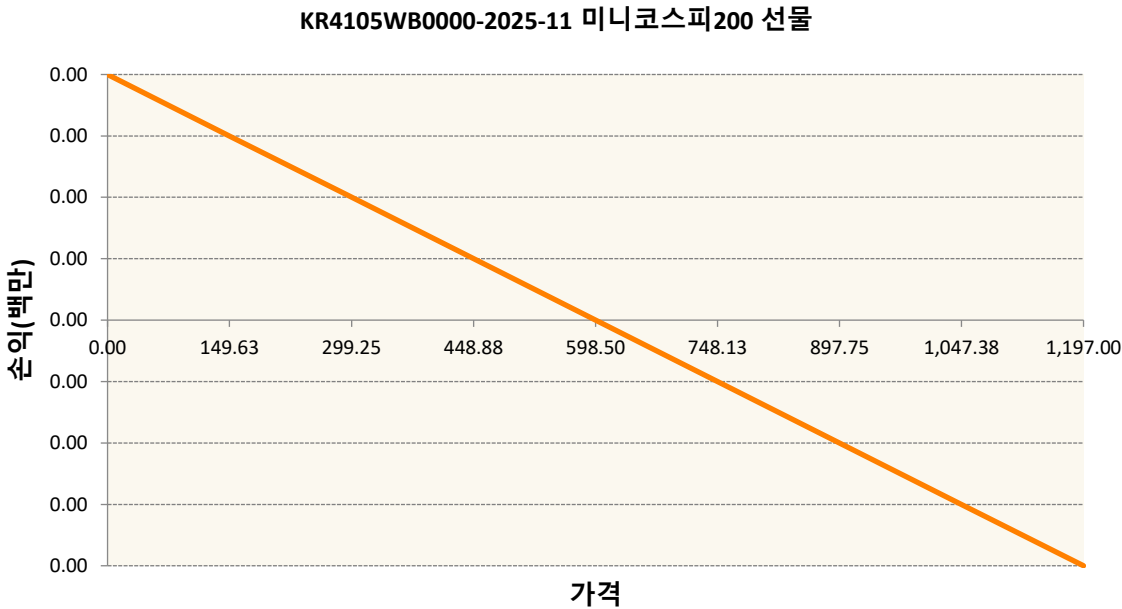
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

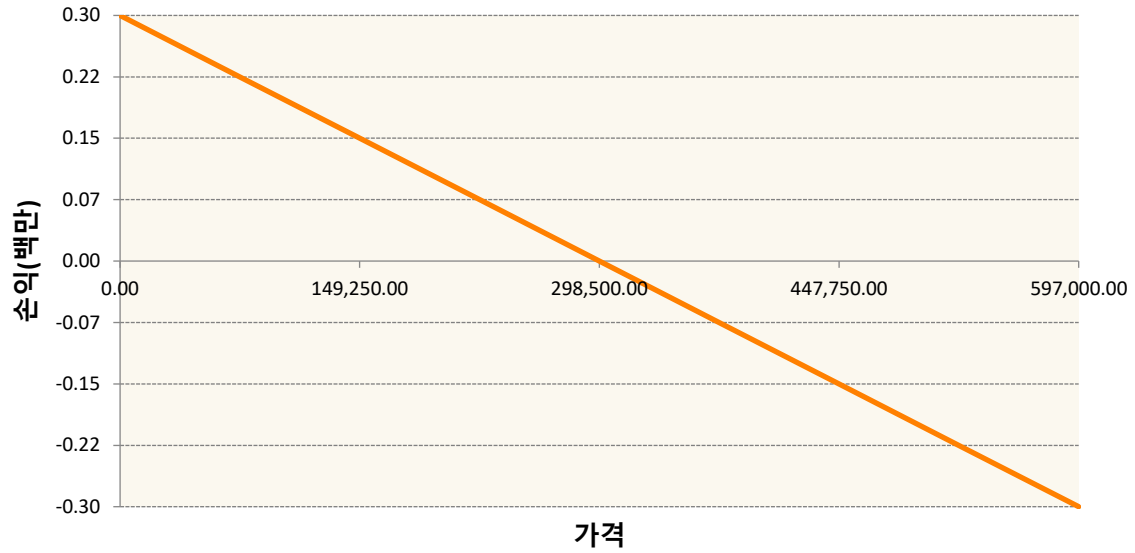
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 935   | -935      | 장내 |

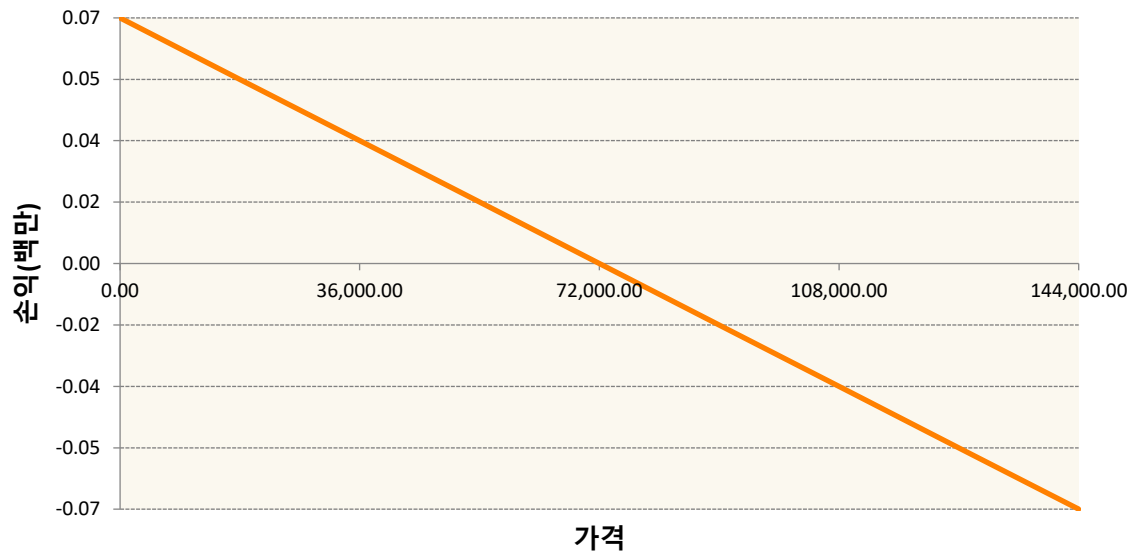
### 2. 만기시점의 손익구조



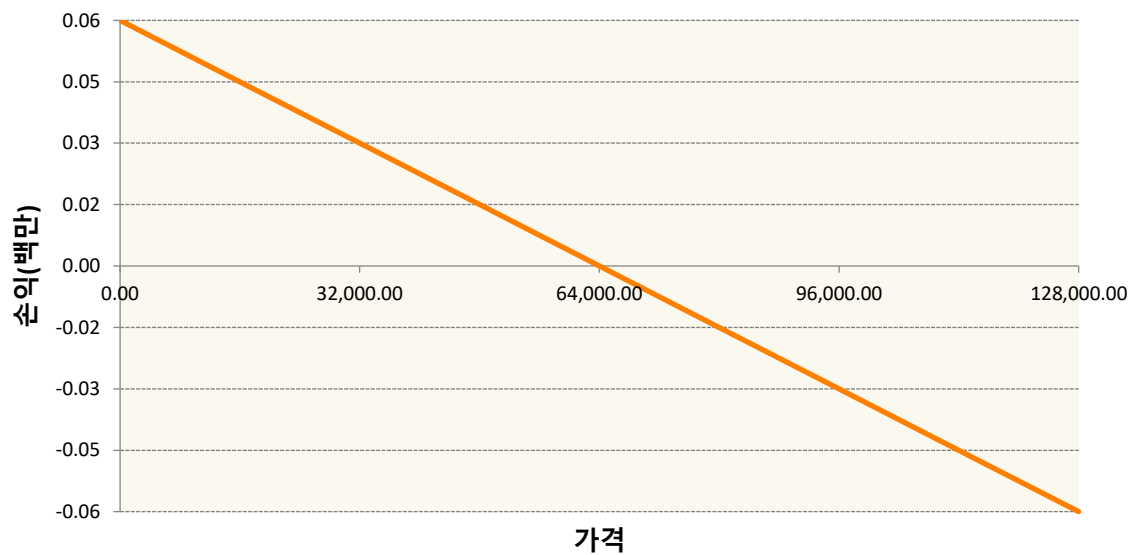
KR4120WB0001-2025-11 현대모비스개별선물



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 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

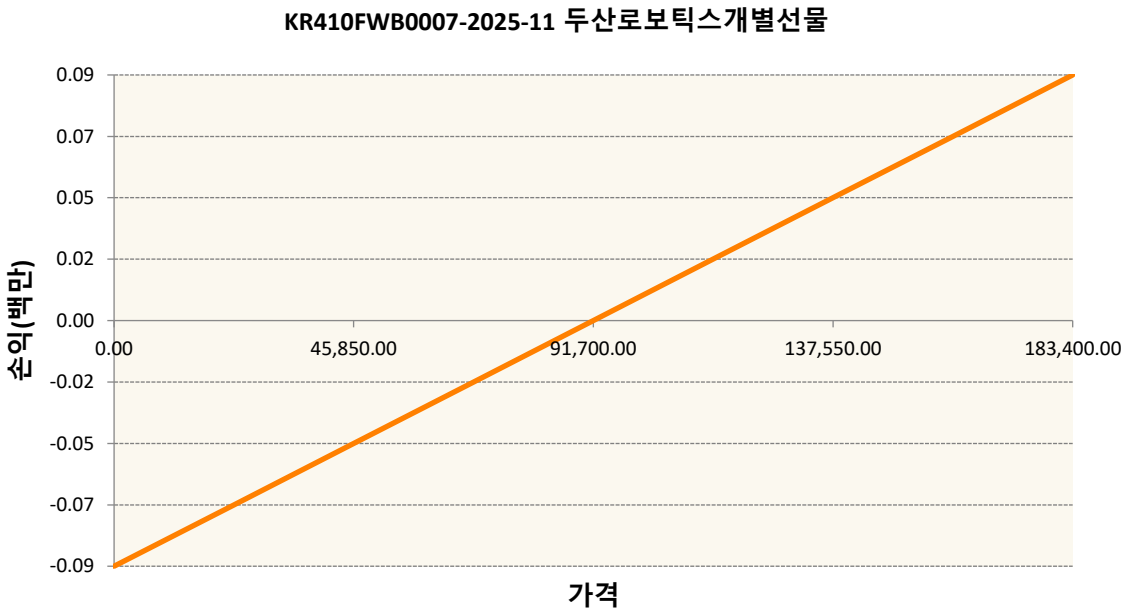
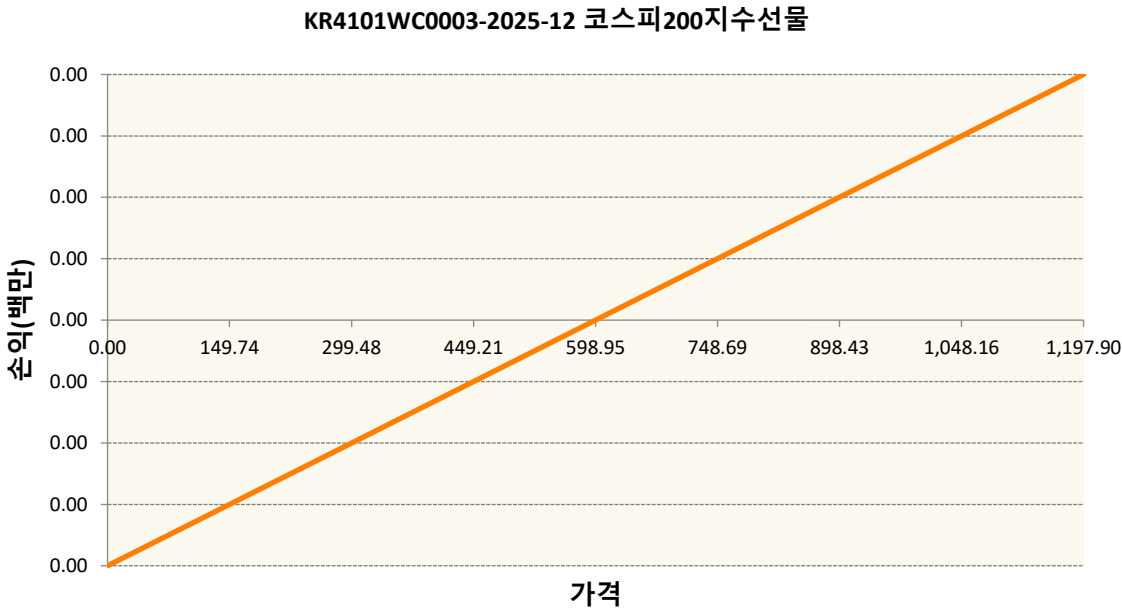
## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 1. 계약금액

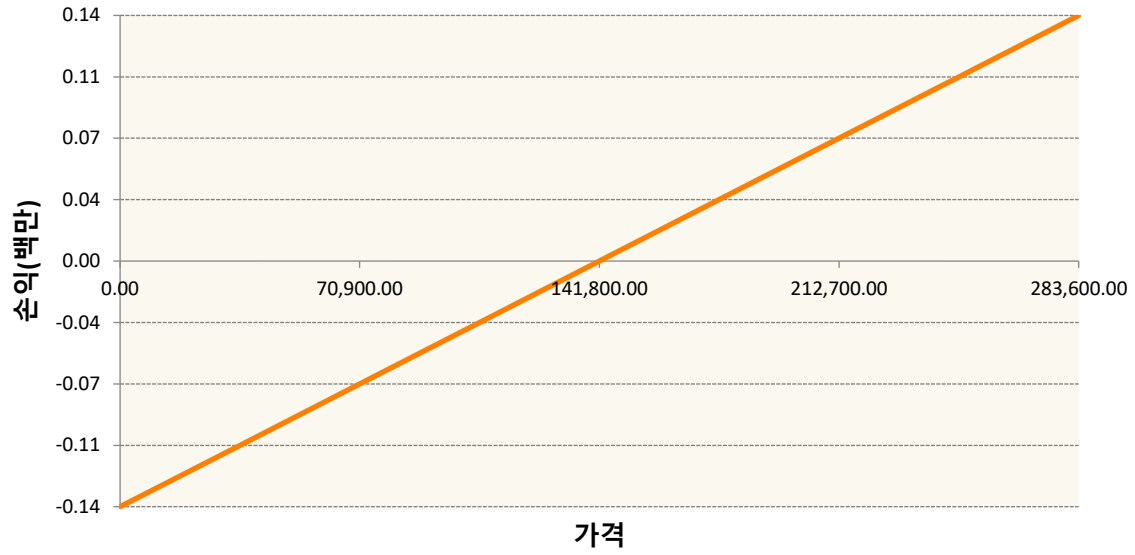
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 149    | 2,986 | -2,838    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 17,571 | 0     | 17,571    | 장내 |

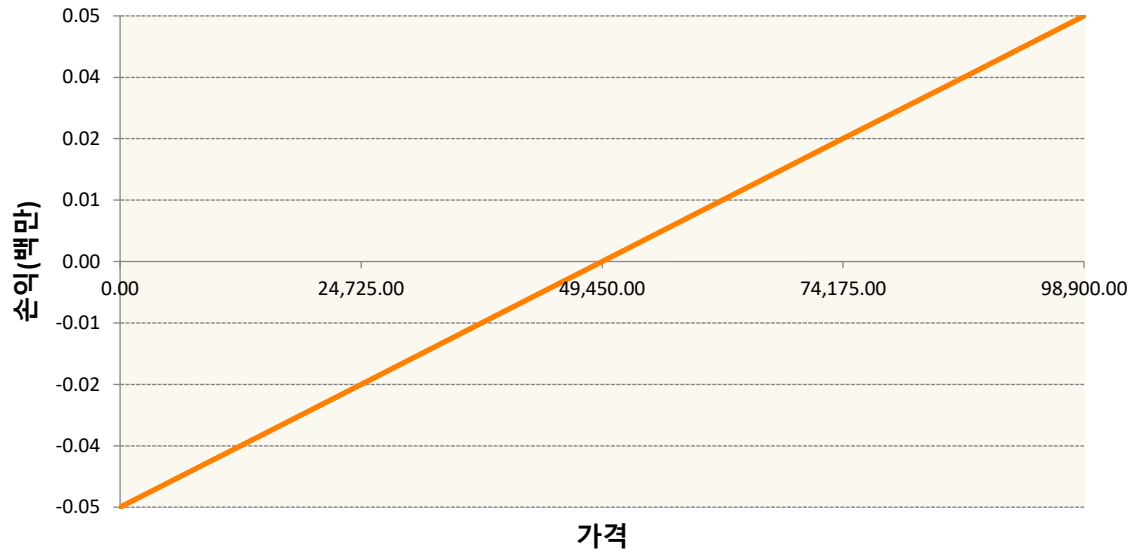
### 2. 만기시점의 손익구조



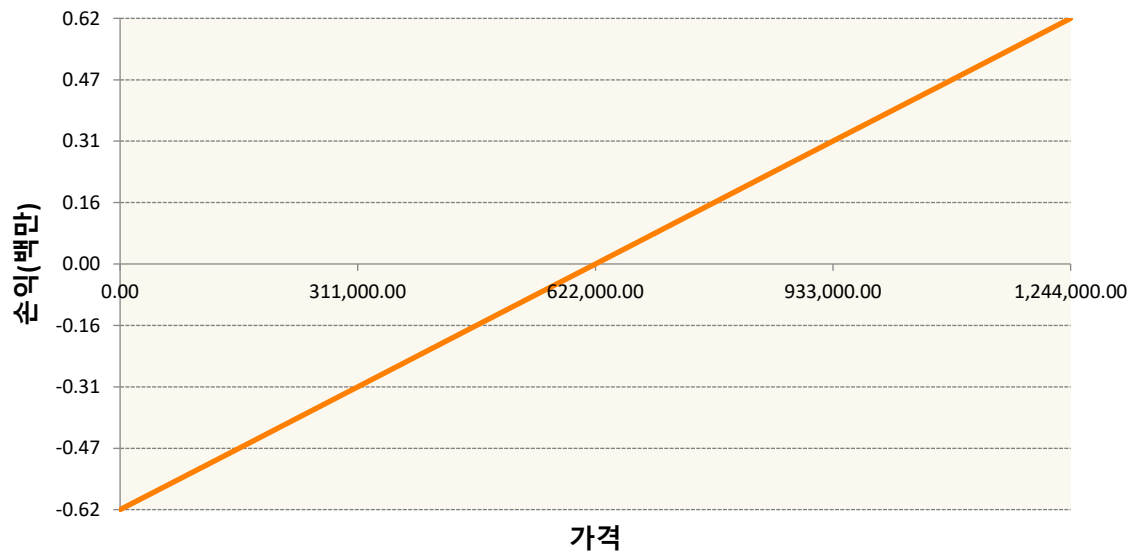
KR410ZWB0003-2025-11 한미반도체개별선물



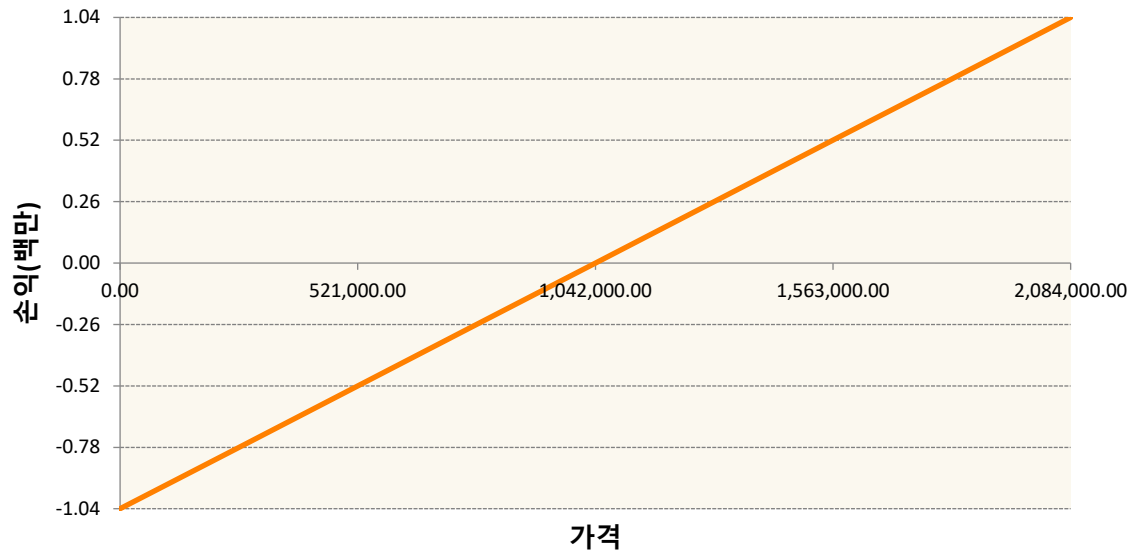
KR411RWB0002-2025-11 한화비전개별선물



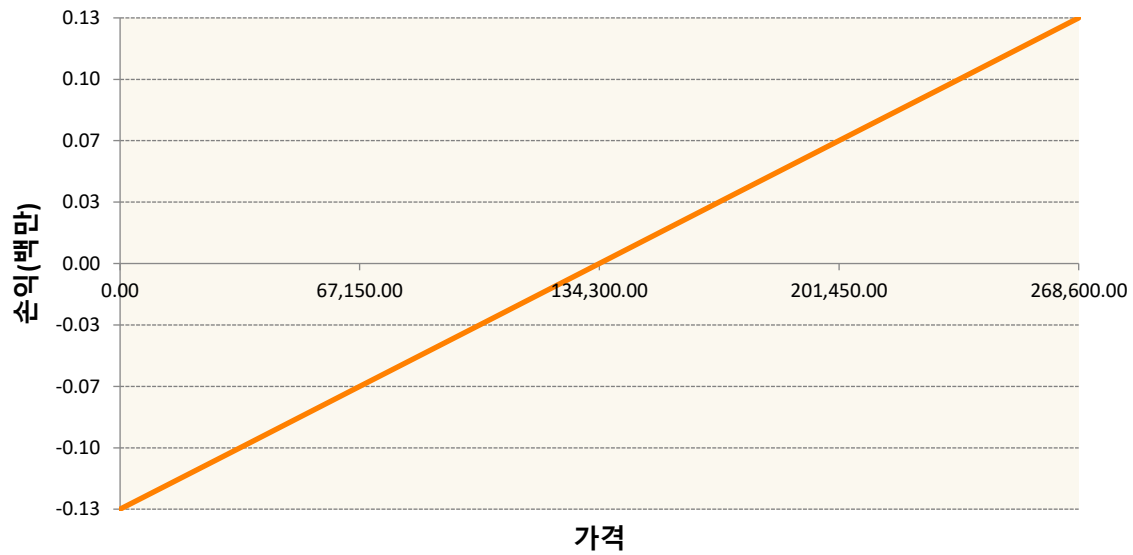
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



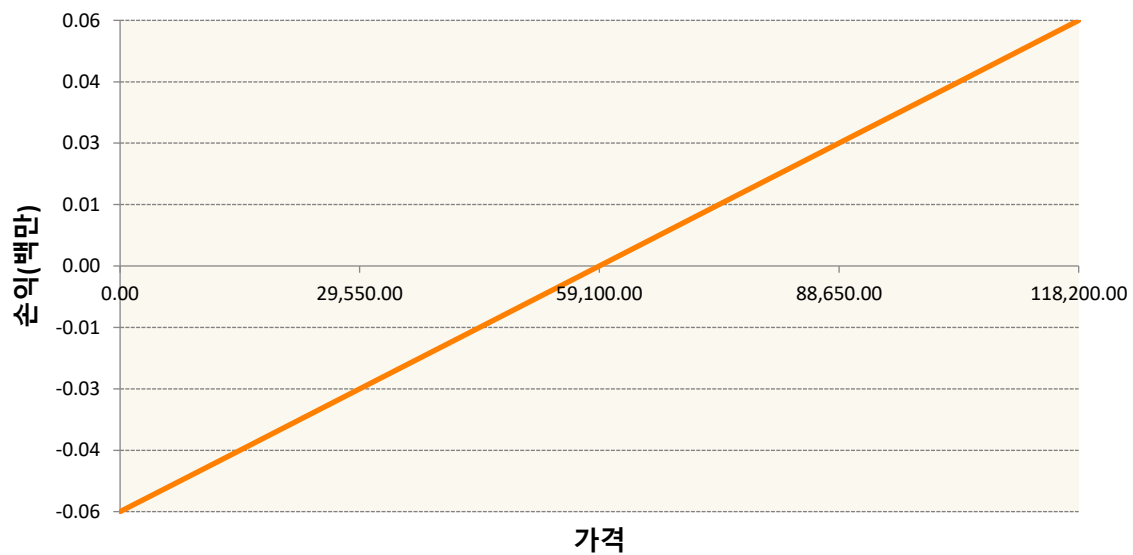
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



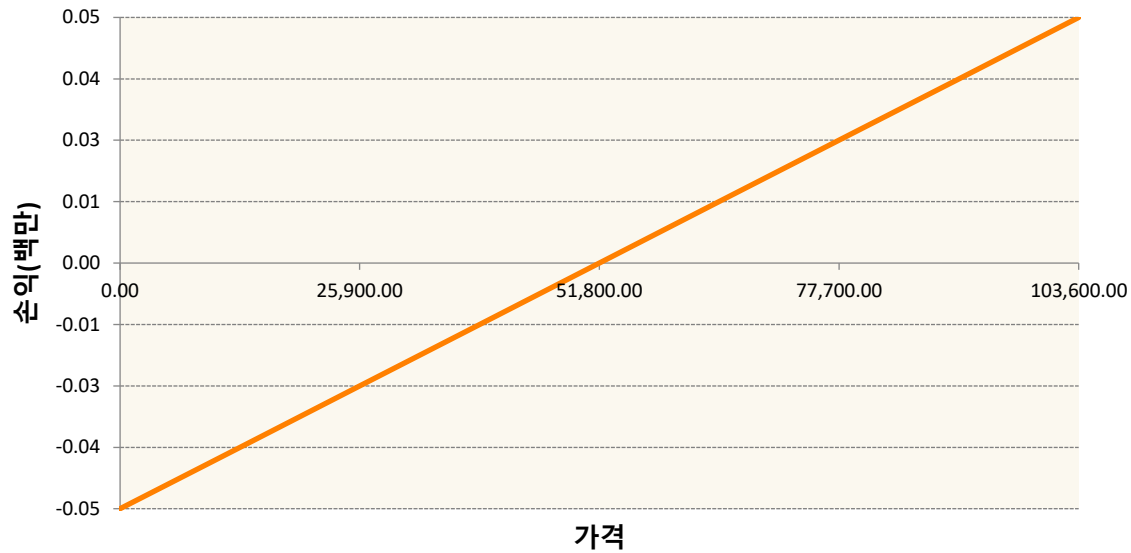
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



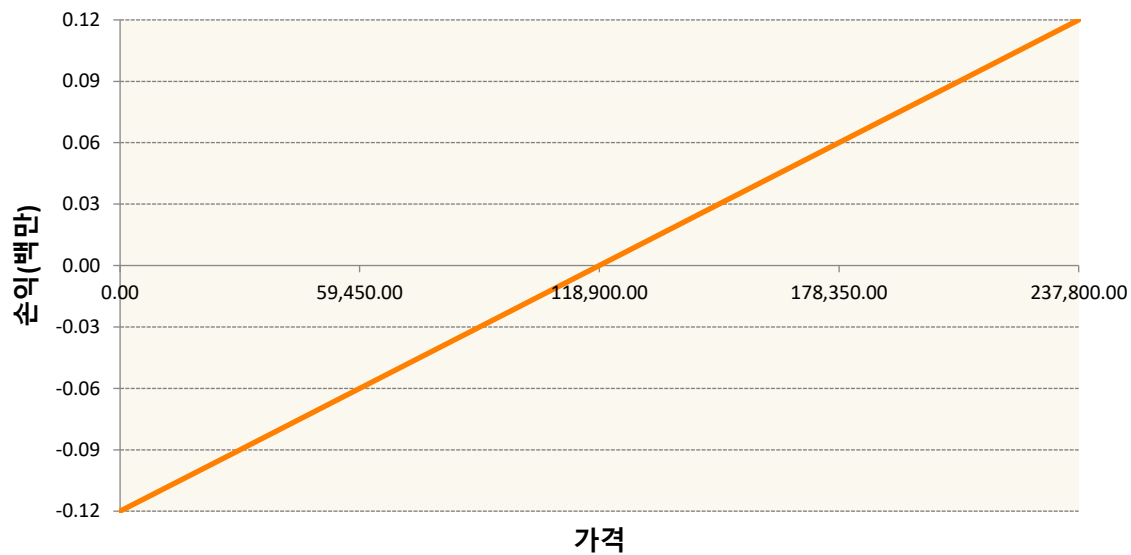
KR41EVWB0002-2025-11 한화시스템개별선물



KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |       |
|-------------------------------|-------|
| KR4101WC0( 2025-12 코스피200지수선물 | 1,174 |
| KR410FWB0( 2025-11 두산로보틱스개별선물 | 20    |
| KR410ZWB0( 2025-11 한미반도체개별선물  | 68    |
| KR411RWB0( 2025-11 한화비전개별선물   | 4     |
| KR4150WB0( 2025-11 SK하이닉스개별선물 | 3     |
| KR41B3WB0( 2025-11 고려아연개별선물   | 48    |
| KR41EJWB0( 2025-11 SKC개별선물    | 27    |
| KR41EVWB0( 2025-11 한화시스템개별선물  | 13    |
| KR41F7WB0( 2025-11 카카오페이개별선물  | 15    |
| KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물    | 34    |

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

(단위:백만원)

804

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

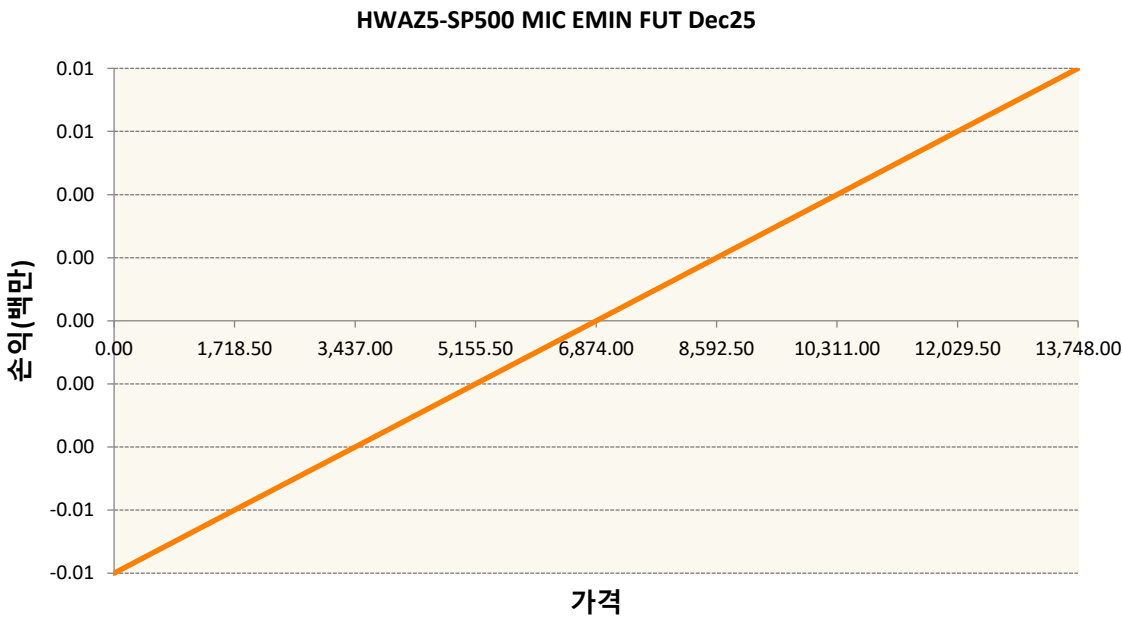
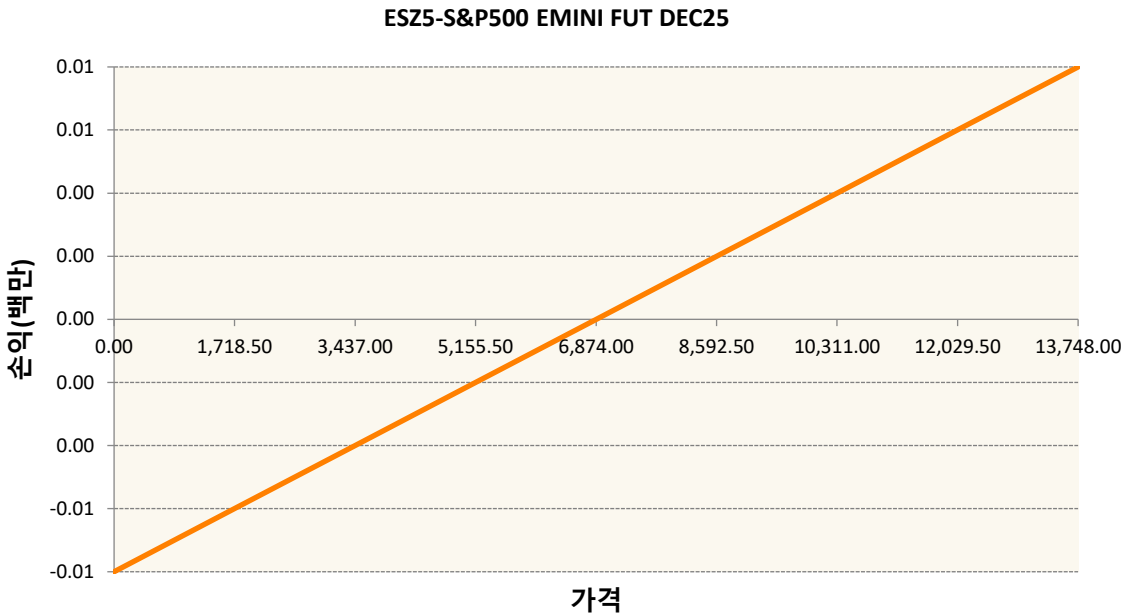
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 39,169 | 0     | 39,169    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,289  | 0     | 1,289     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ5                      | S&P500 EMINI FUT DEC25   | 3,134    |
| HWAZ5                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec25 | 103      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 4,641    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

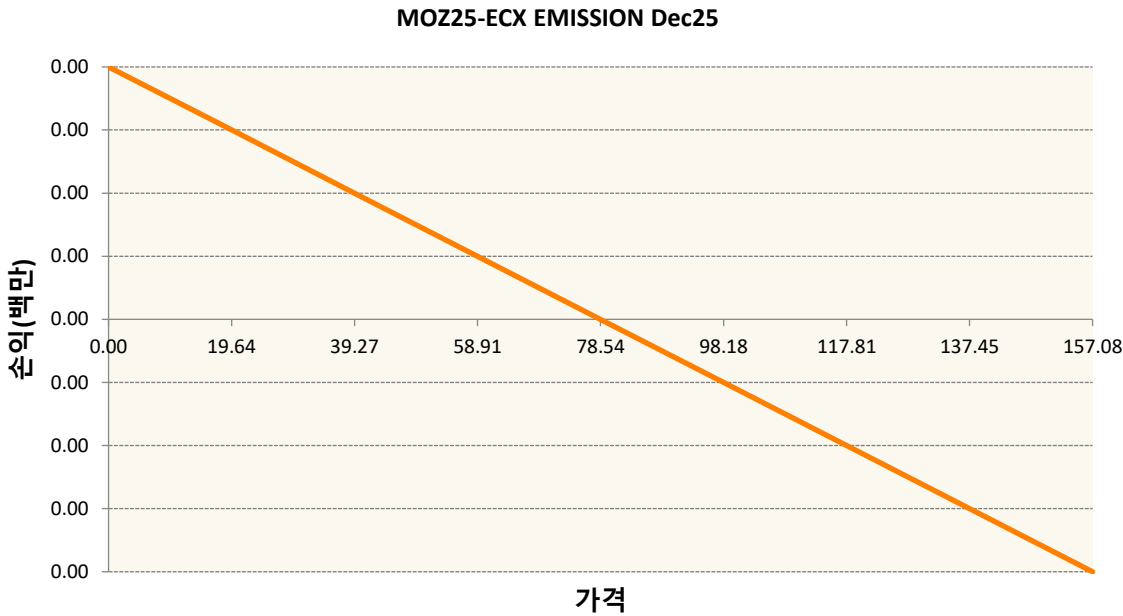
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 3,171 | -3,171    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | -4    | 0     | -4        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,144 | -1,144    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |                                          |      |
|--------------|------------------------------------------|------|
| 2109930918II | ICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 0.46 |
| FXW213FAW    | KRW/EUR 28-11-25E                        | 92   |
| MOZ25        | ECX EMISSION Dec25                       | 254  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 398 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

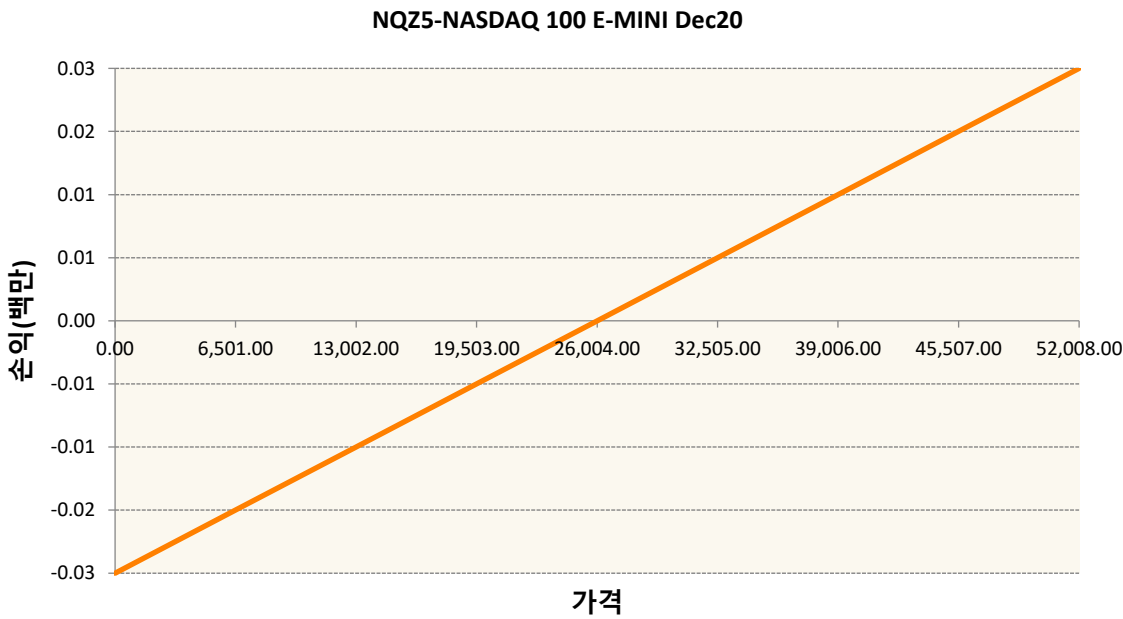
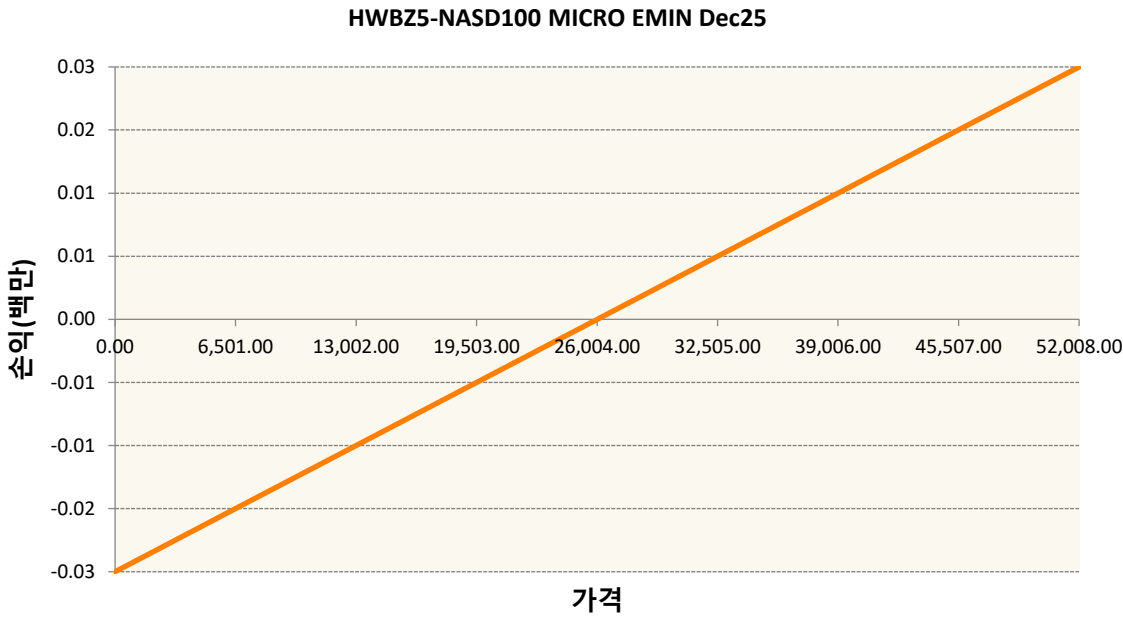
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 18,850 | 0     | 18,850    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,737  | 0     | 1,737     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBZ5                     | NASD100 MICRO EMIN Dec25 |  | 139      |
| NQZ5                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 1,508    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 1,826    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

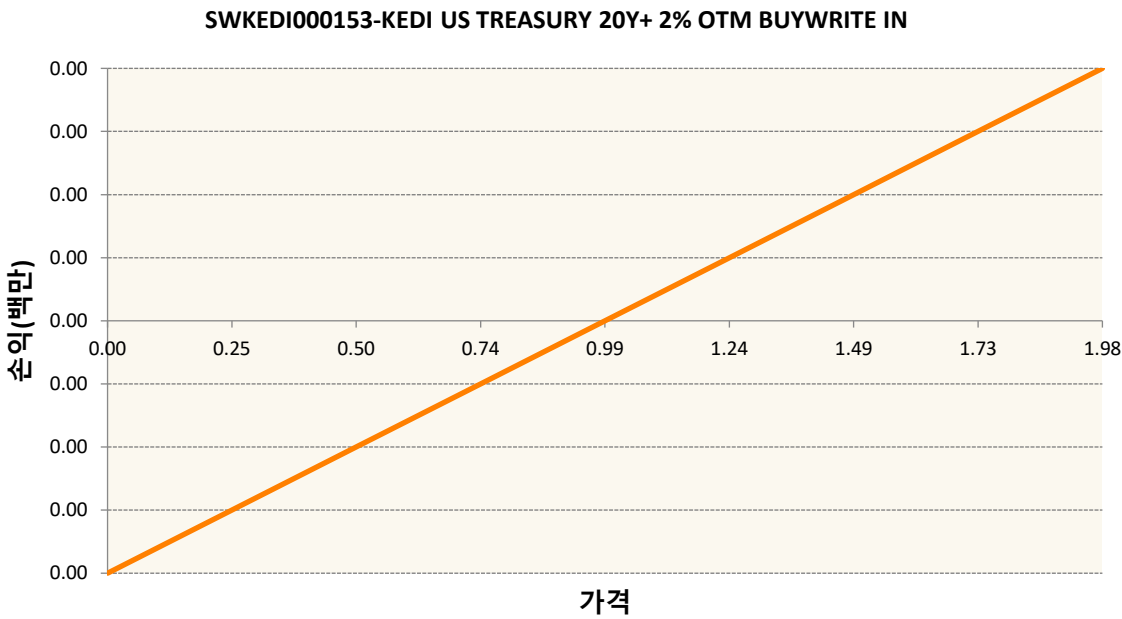
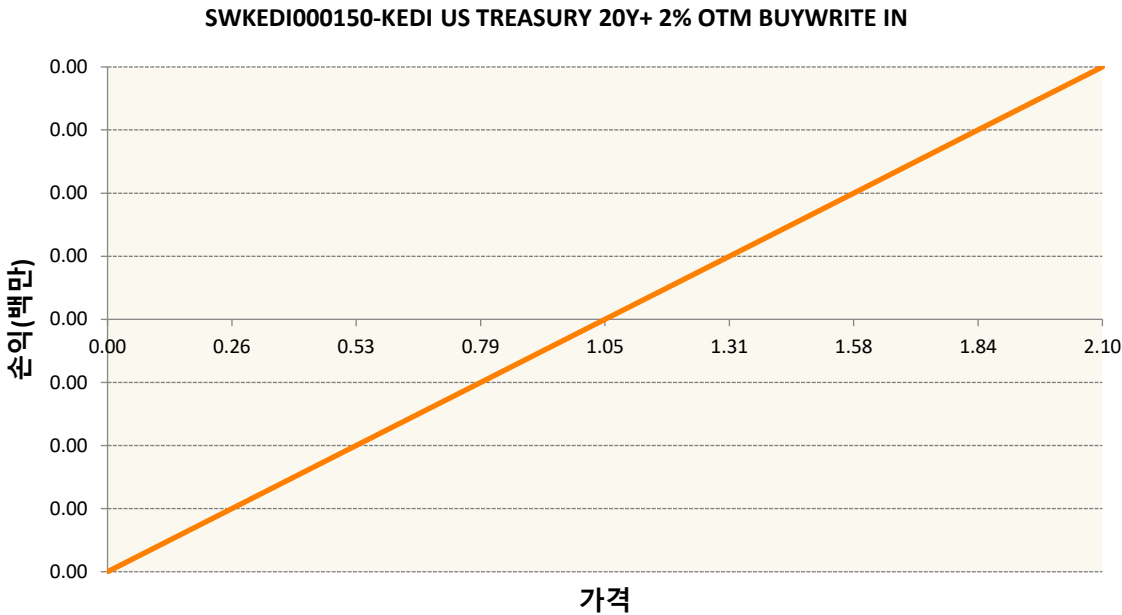
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

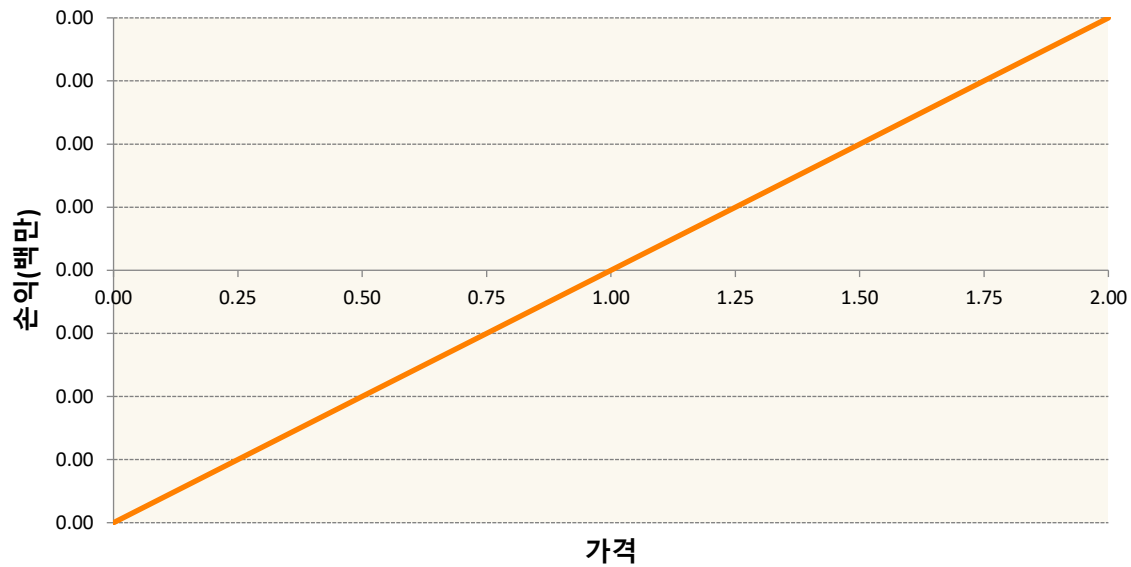
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 379,908 | 0     | 379,908   | 장외 |

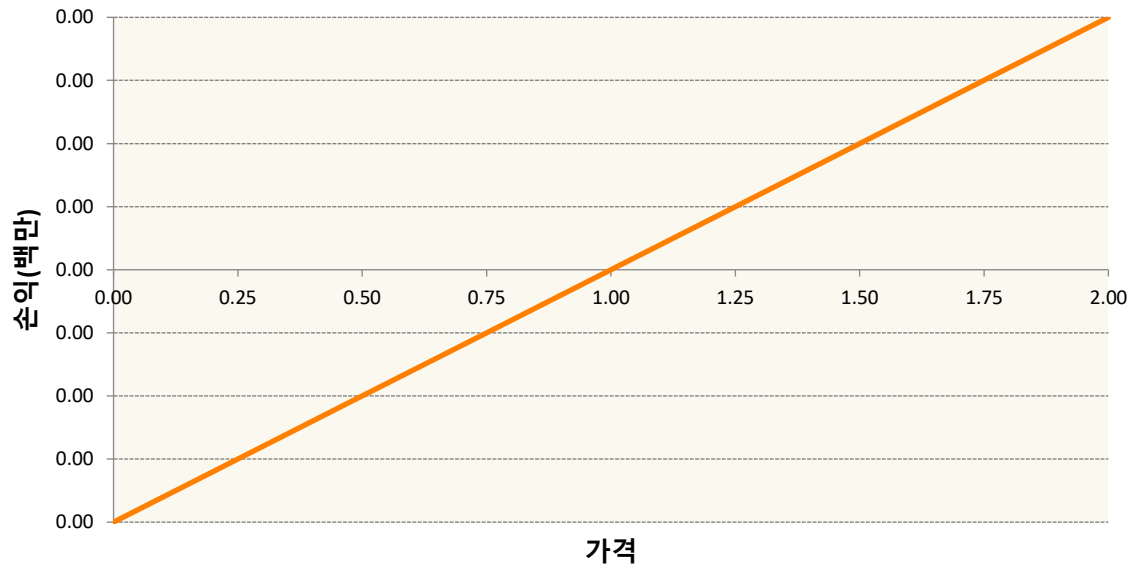
### 2. 만기시점의 손익구조



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 | 8,076  |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 3,717  |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 10,058 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 8,454  |

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

(단위:백만원)

14,475

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

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   | 2,297 | 0     | 2,297     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |    |
|----------------------------------------------------|----|
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 10 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 10 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 10 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 10 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 53 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-04 |
| 기준일 | 2025-11-03 |

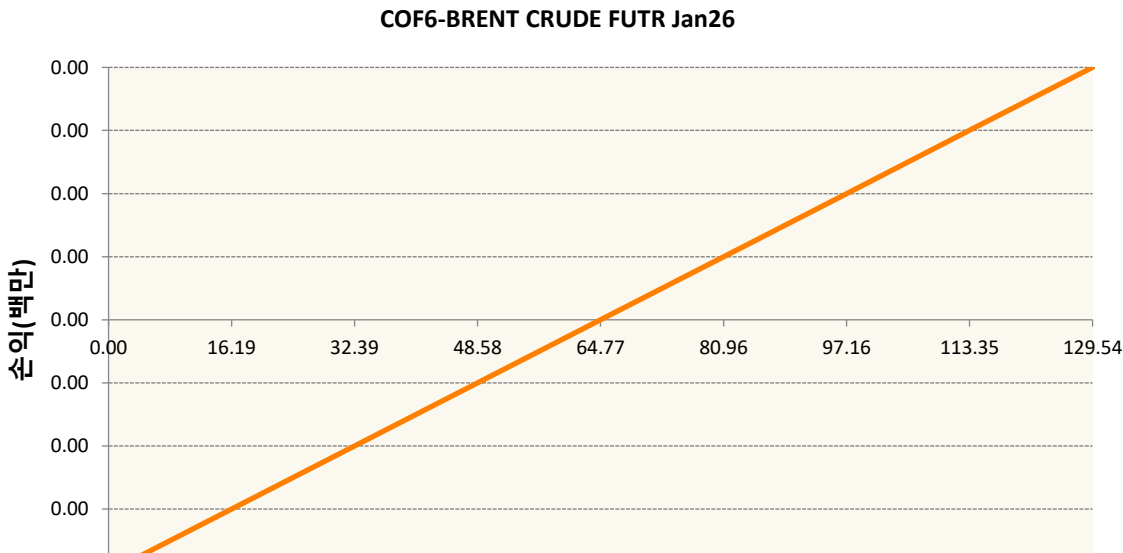
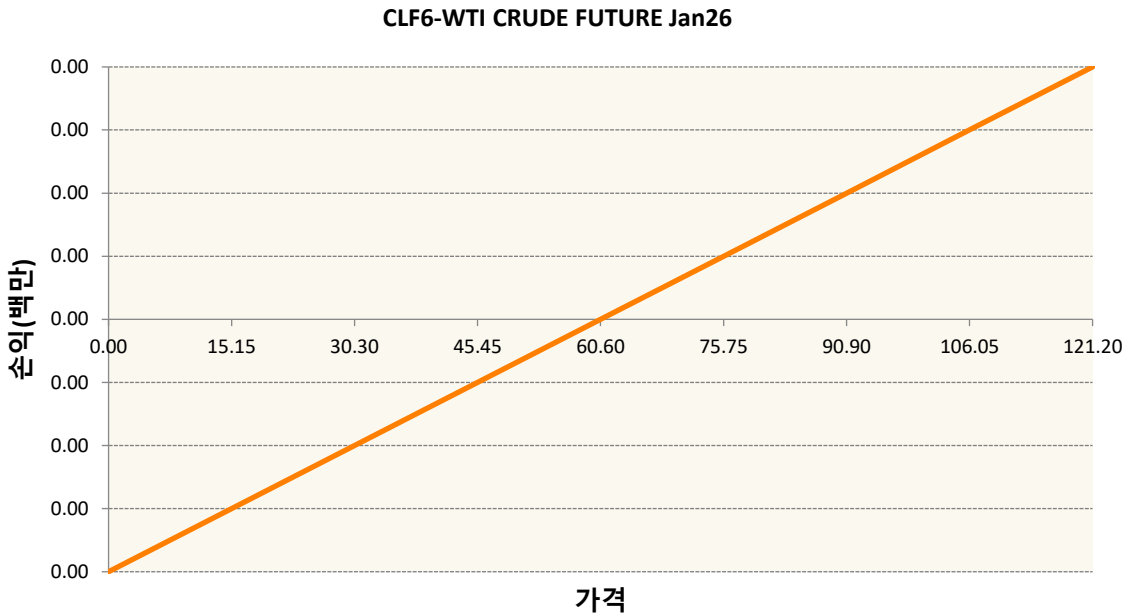
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

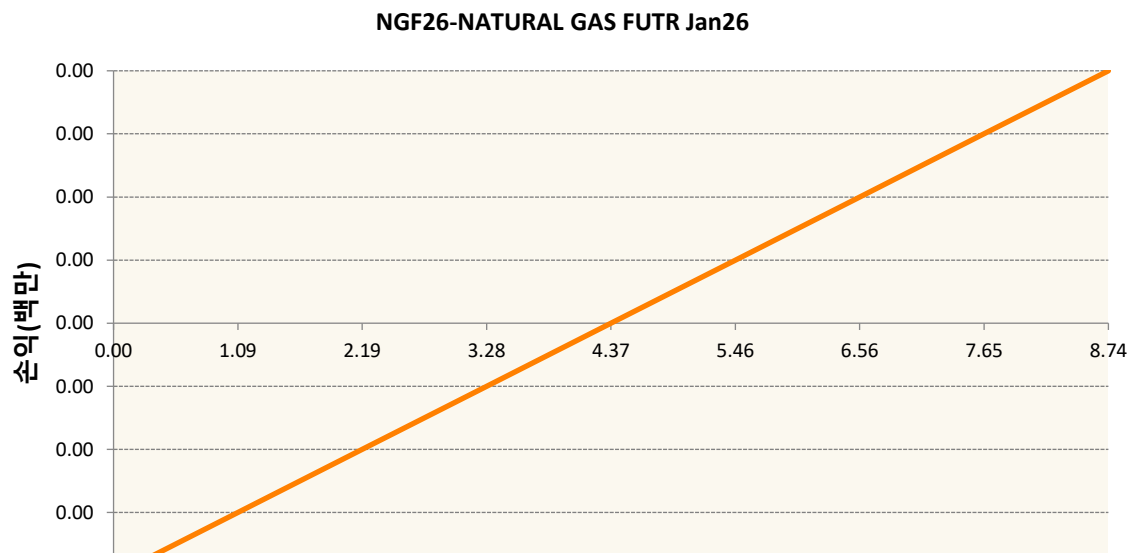
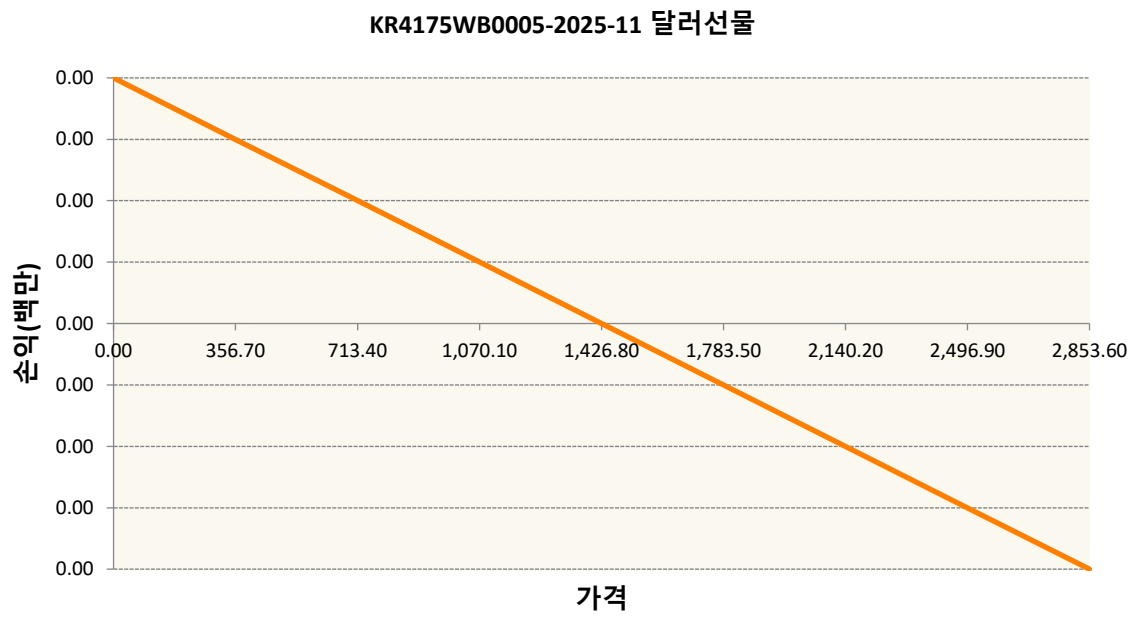
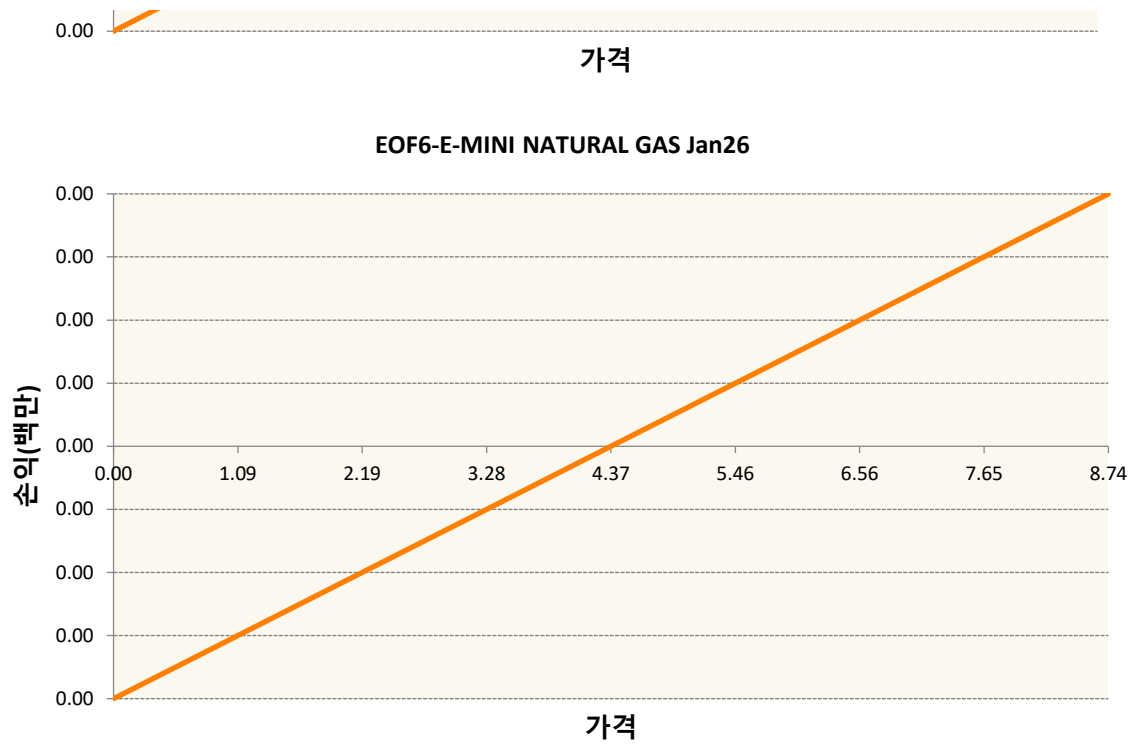
### 1. 계약금액

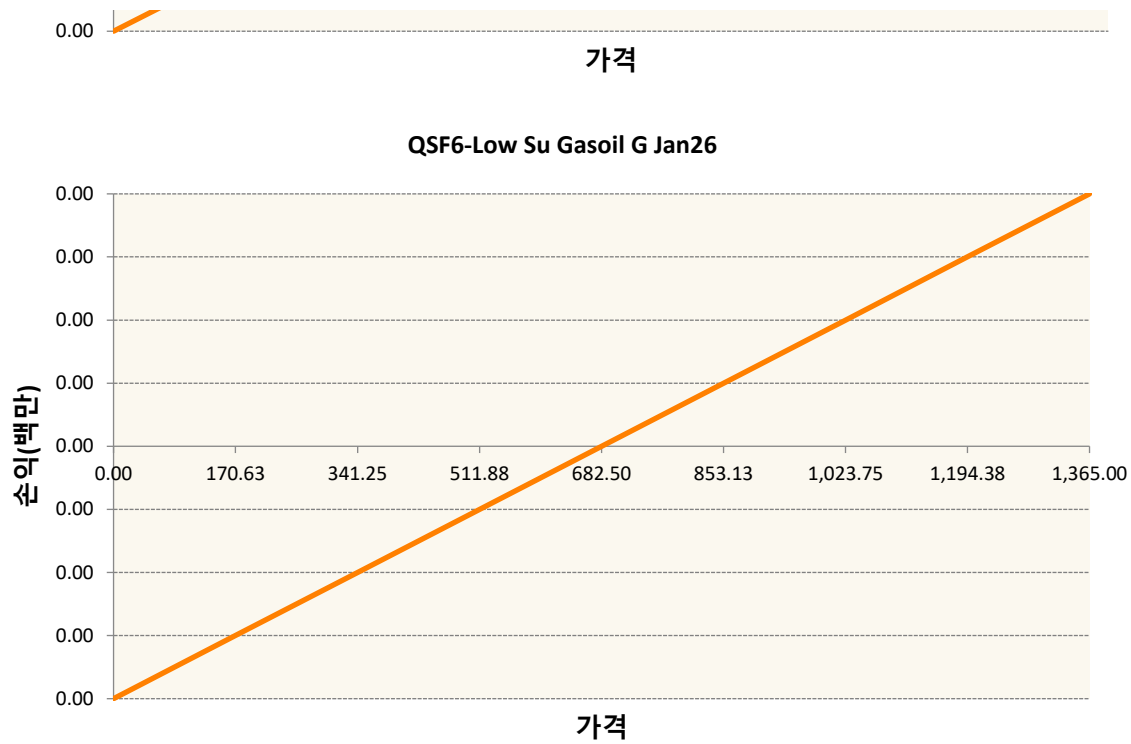
(단위:백만원)

| 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   | 354   | 0     | 354       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 180   | 0     | 180       |    |
| 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)

94