

공시일 2025-11-07

기준일 2025-11-06

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	2025-11-07
기준일	2025-11-06

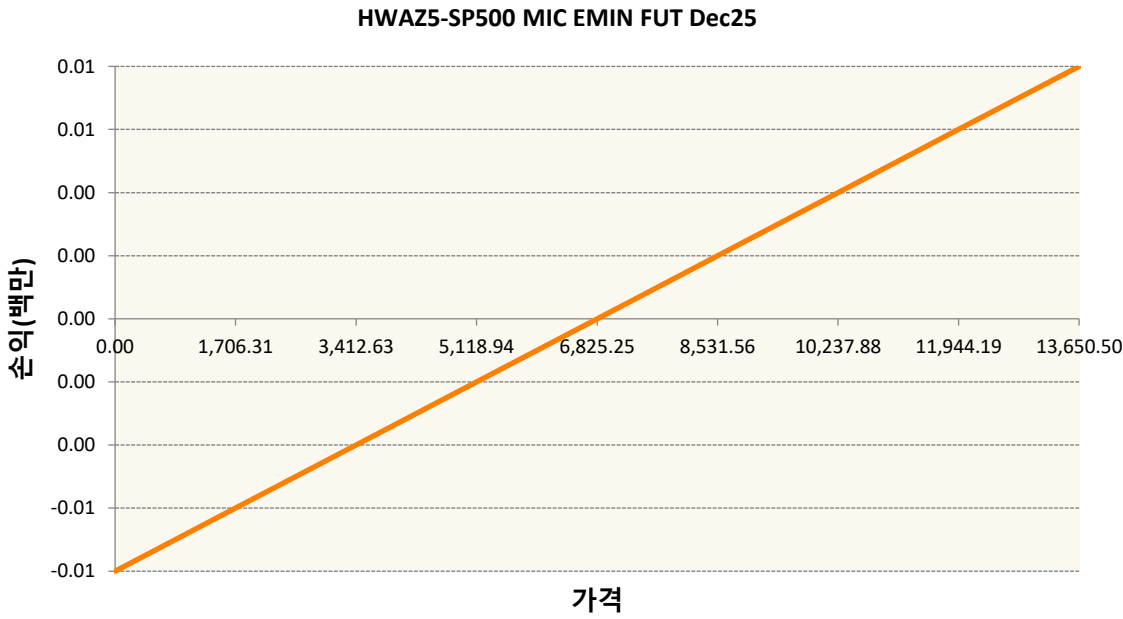
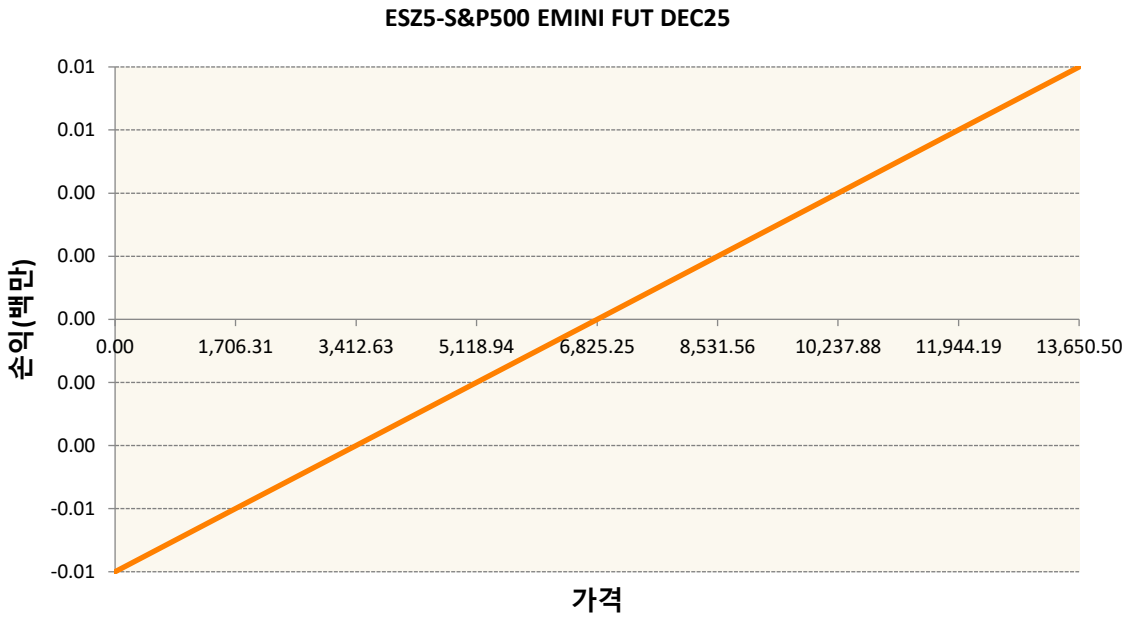
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	474	0	474	
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)
	68

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

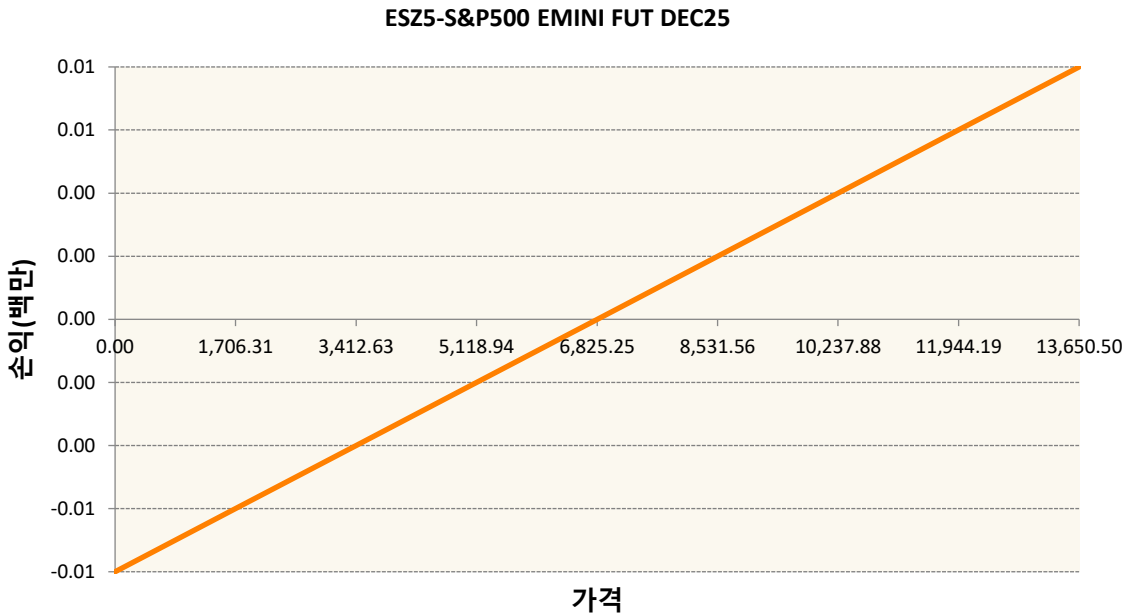
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,422	0	1,422	

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)

164

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

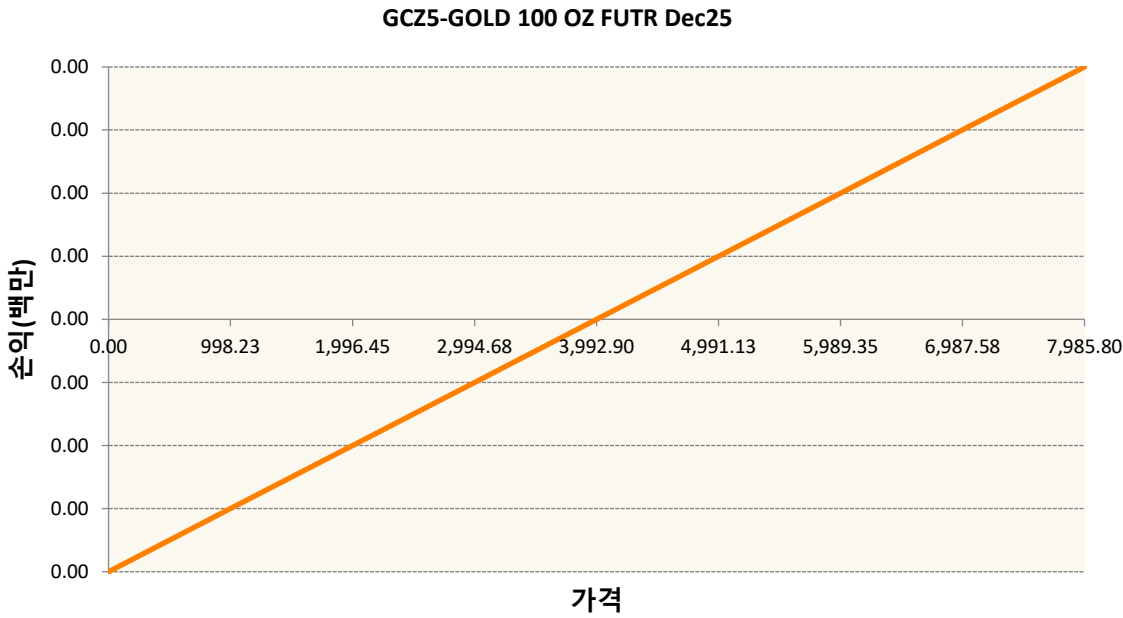
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,805	0	2,805	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 11/07/25 C390 EQUITY	0.27
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	224

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

(단위:백만원)

210

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

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	423
AOPLTRUP2(PLTR US 11/07/25 P202.5 EQUITY	41

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

(단위:백만원)

1,883

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

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

1

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

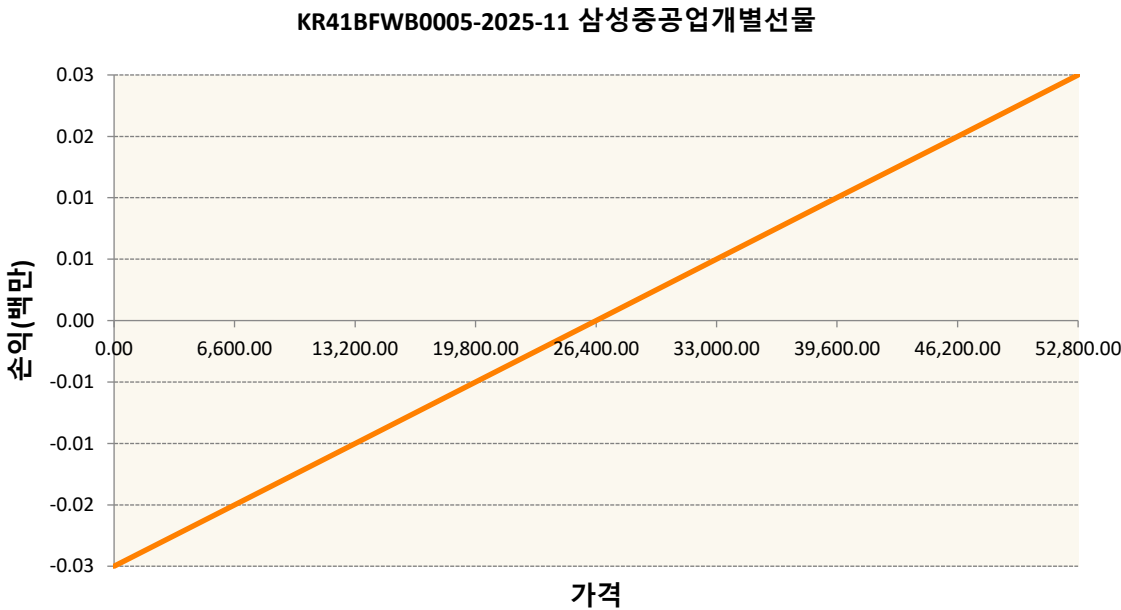
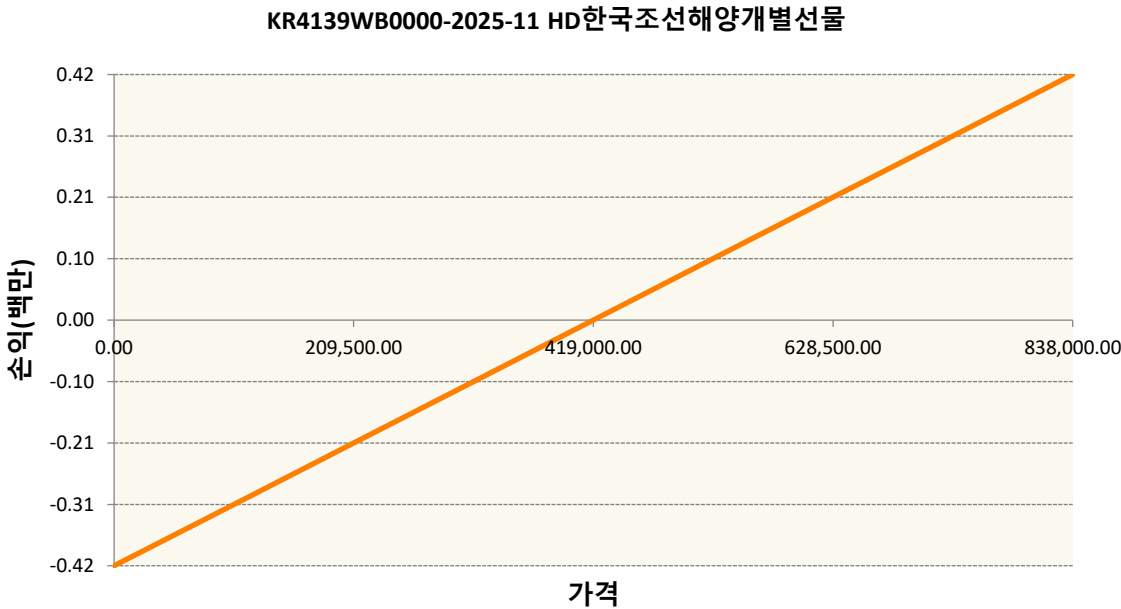
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

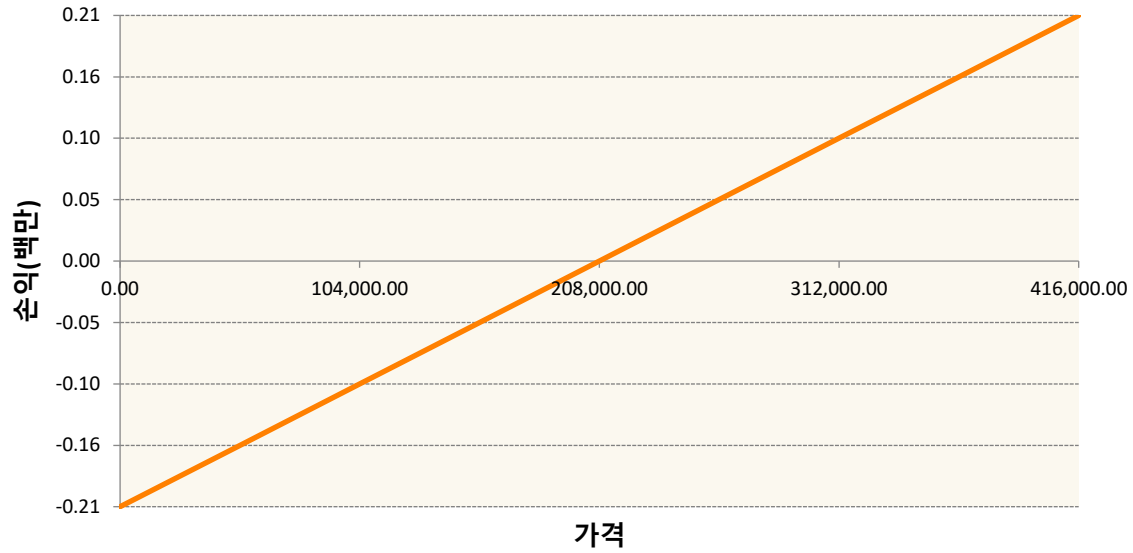
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	60,384	0	60,384	장내

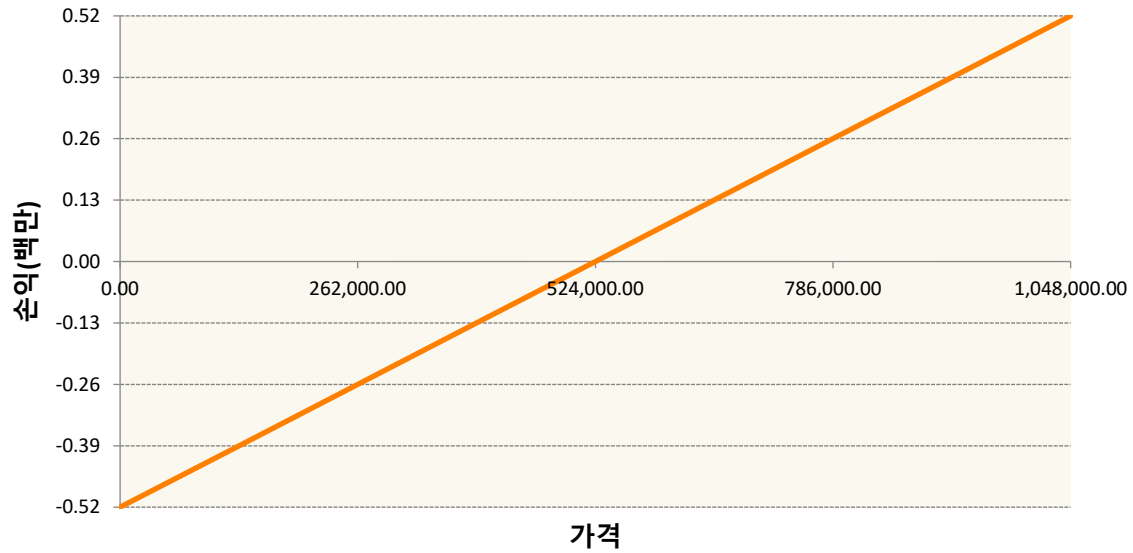
2. 만기시점의 손익구조



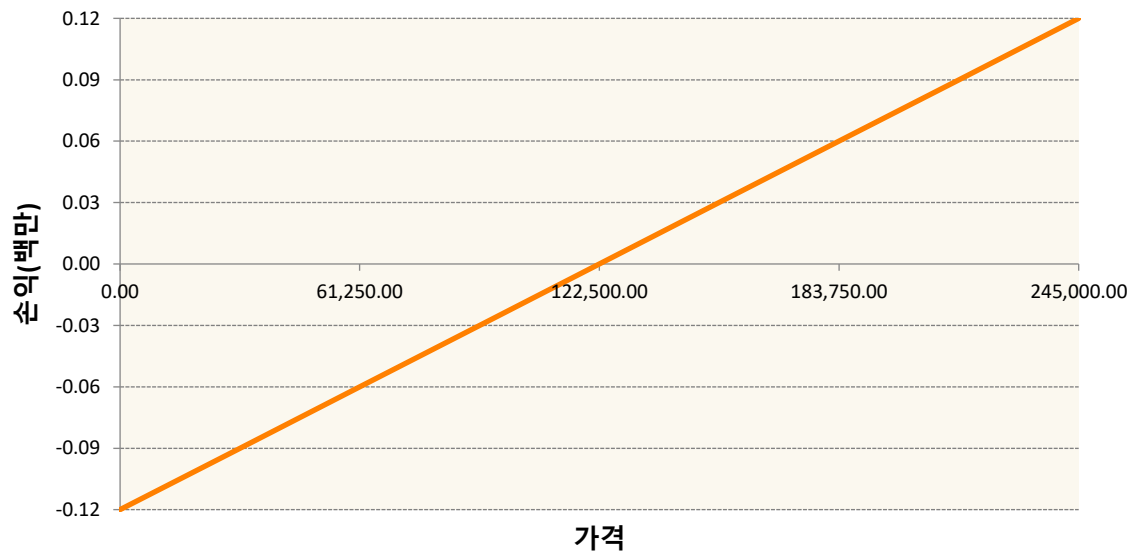
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



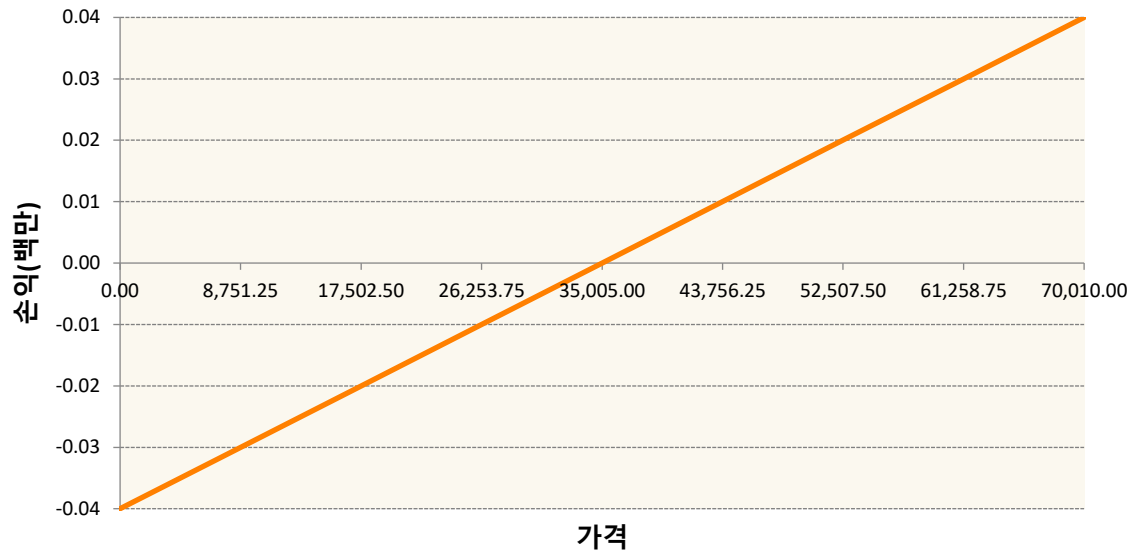
KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



KR41M7WC0000-2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4139WB0000 2025-11 HD한국조선해양개별선물 1,208

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,208	-1,208	-1,208	-1,208	-1,208	-1,208	-1,208
-5.33%	-806	-806	-806	-806	-806	-806	-806
-2.67%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	403	403	403	403	403	403	403
5.33%	806	806	806	806	806	806	806
8.00%	1,208	1,208	1,208	1,208	1,208	1,208	1,208

KR41BFWB0005 2025-11 삼성중공업개별선물 1,295

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,295	-1,295	-1,295	-1,295	-1,295	-1,295	-1,295
-5.33%	-864	-864	-864	-864	-864	-864	-864
-2.67%	-432	-432	-432	-432	-432	-432	-432
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	432	432	432	432	432	432	432
5.33%	864	864	864	864	864	864	864
8.00%	1,295	1,295	1,295	1,295	1,295	1,295	1,295

KR41CDWB0006 2025-11 HD현대미포개별선물 470

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-470	-470	-470	-470	-470	-470	-470
-5.33%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	470	470	470	470	470	470	470
KR41FDWB0003 2025-11 HD현대중공업개별선물							622
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-622	-622	-622	-622	-622	-622	-622
-5.33%	-415	-415	-415	-415	-415	-415	-415
-2.67%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	207	207	207	207	207	207	207
5.33%	415	415	415	415	415	415	415
8.00%	622	622	622	622	622	622	622
KR41FVWB0001 2025-11 한화오션개별선물							1,002
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002	-1,002
-5.33%	-668	-668	-668	-668	-668	-668	-668
-2.67%	-334	-334	-334	-334	-334	-334	-334
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	334	334	334	334	334	334	334
5.33%	668	668	668	668	668	668	668
8.00%	1,002	1,002	1,002	1,002	1,002	1,002	1,002
KR41M7WC0000 2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물							2,239
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,239	-2,239	-2,239	-2,239	-2,239	-2,239	-2,239
-5.33%	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493
-2.67%	-746	-746	-746	-746	-746	-746	-746
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	746	746	746	746	746	746	746
5.33%	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493
8.00%	2,239	2,239	2,239	2,239	2,239	2,239	2,239

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

(단위:백만원)

6,802

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

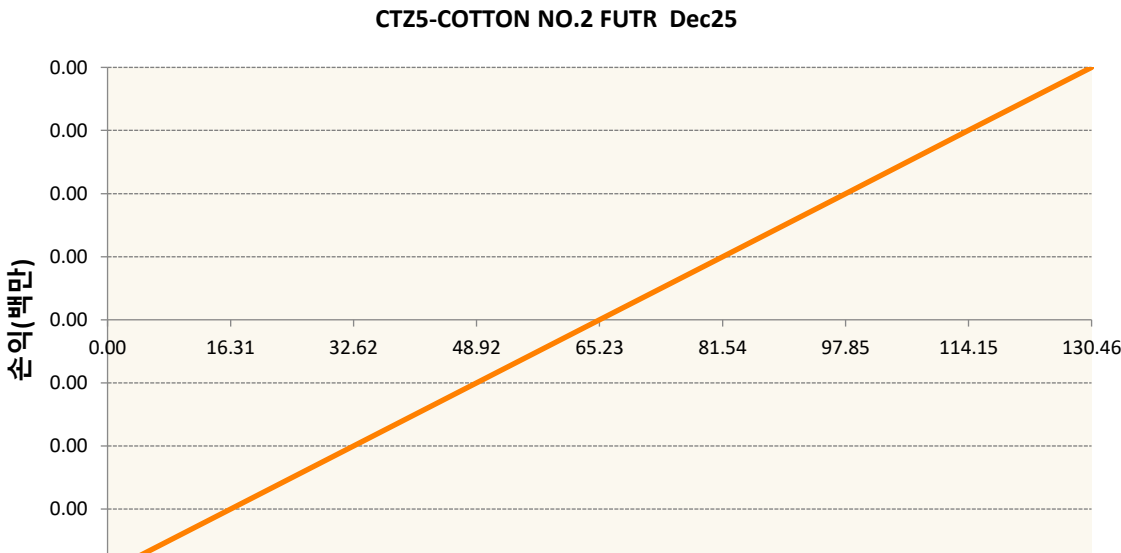
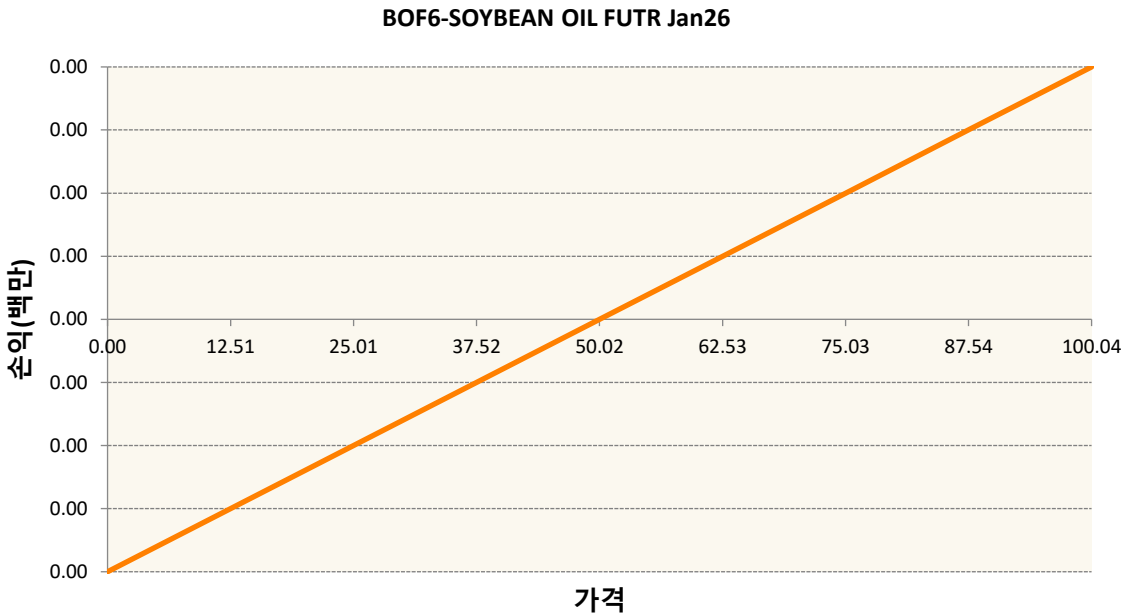
포커스농산물모(채권-파생형)

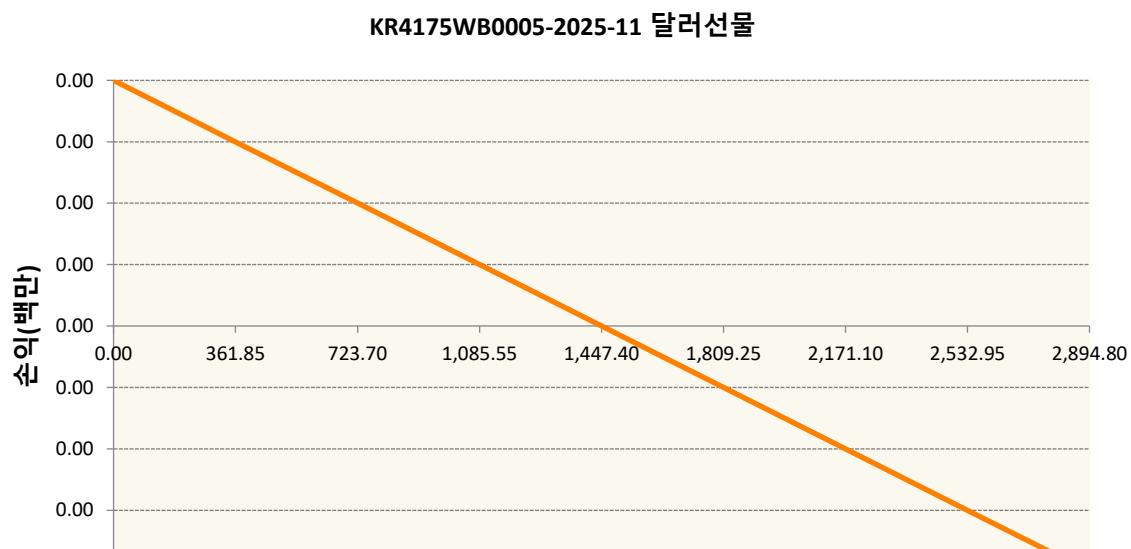
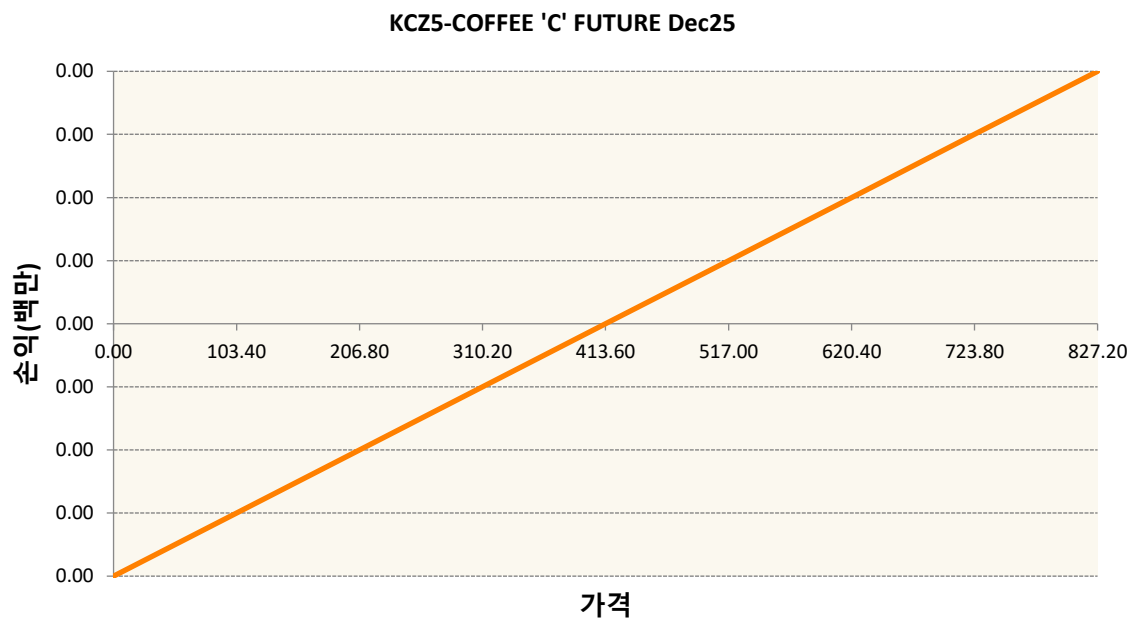
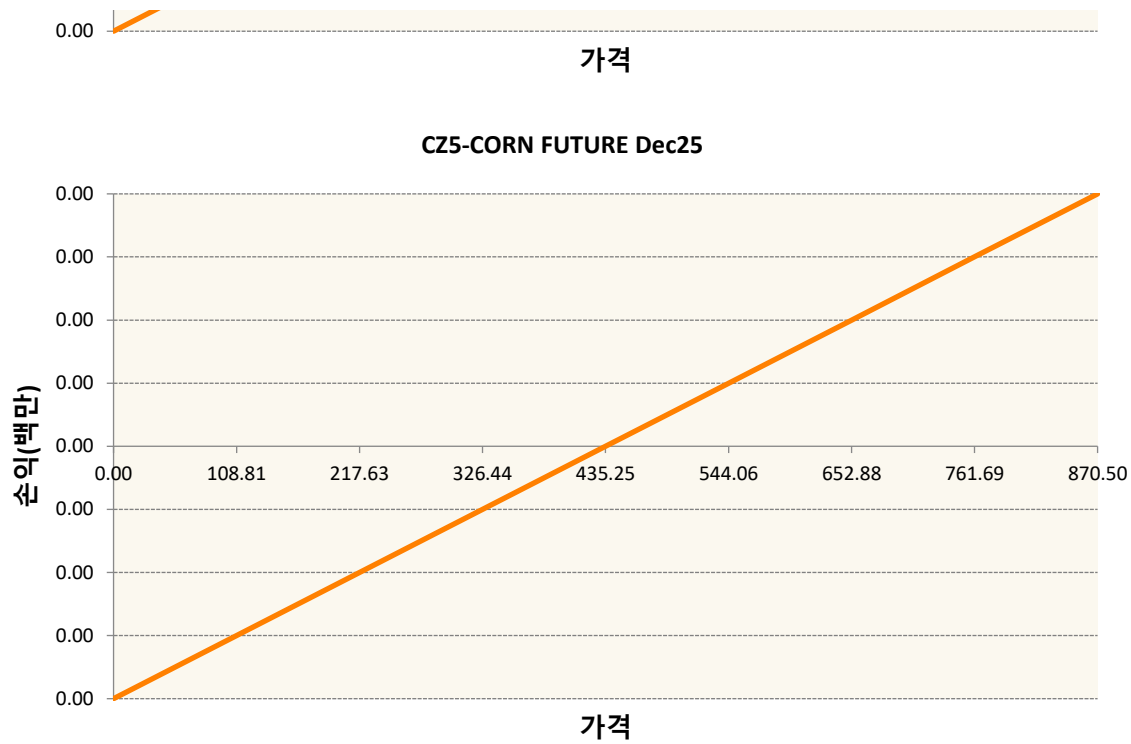
1. 계약금액

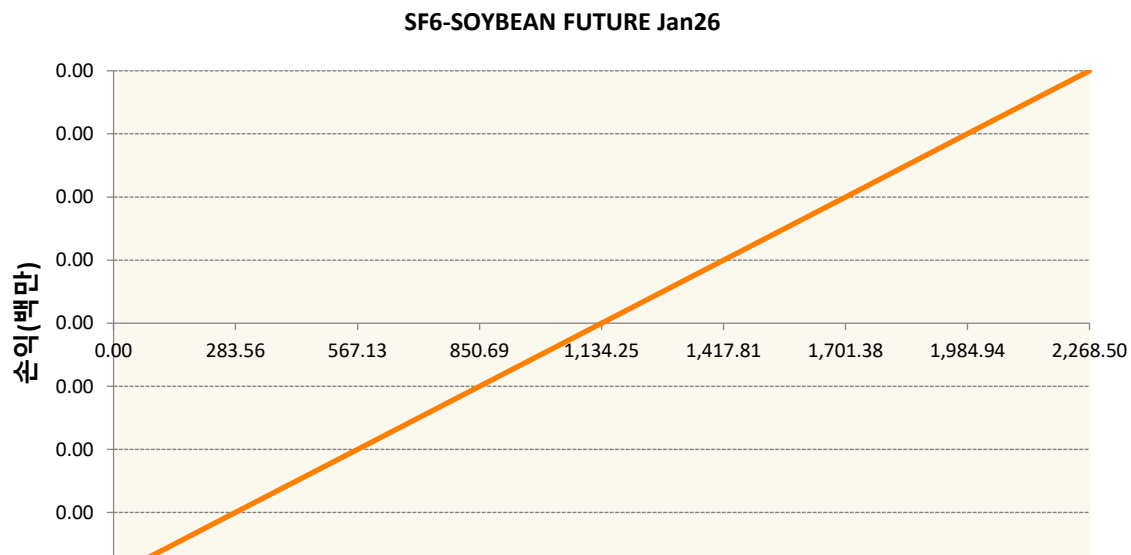
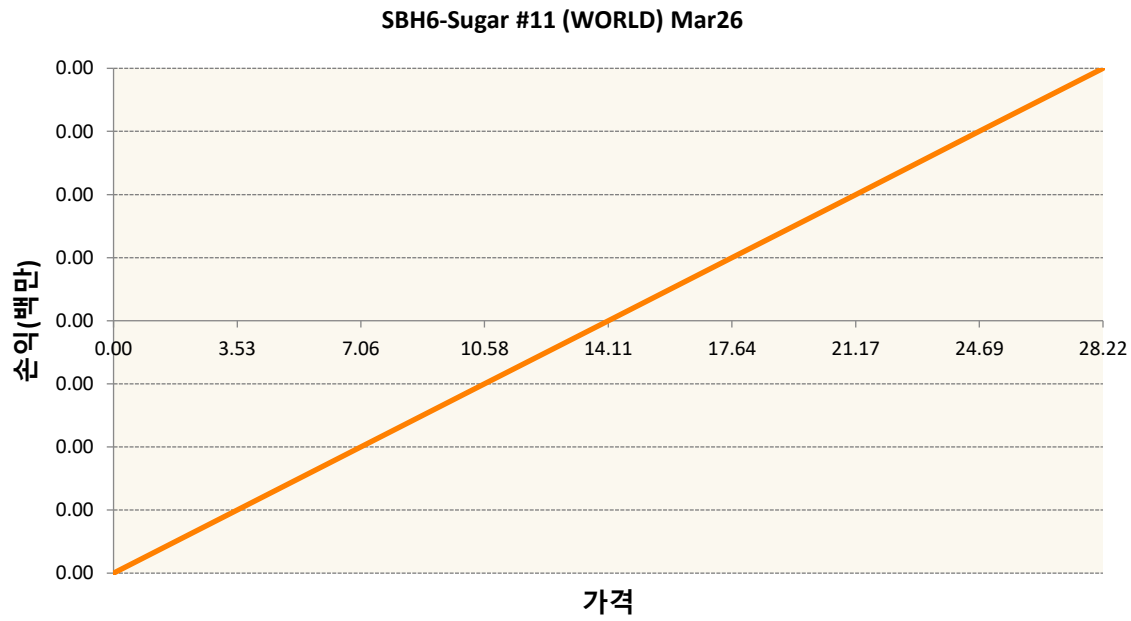
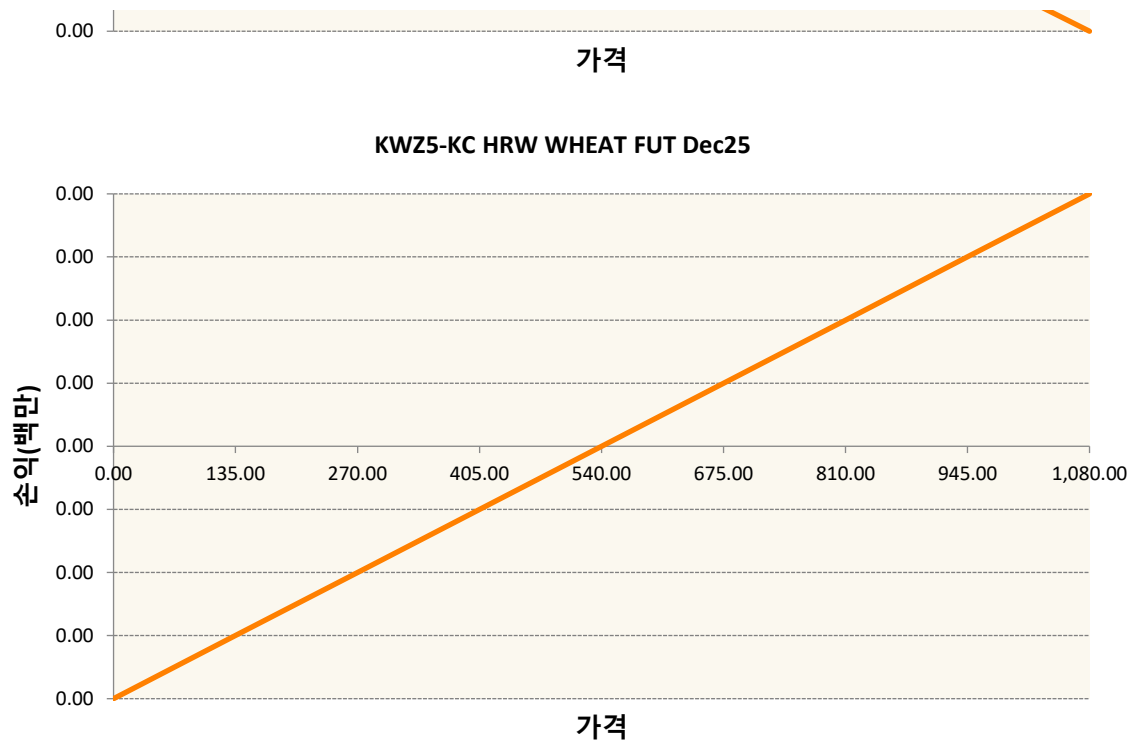
(단위:USD 백만)

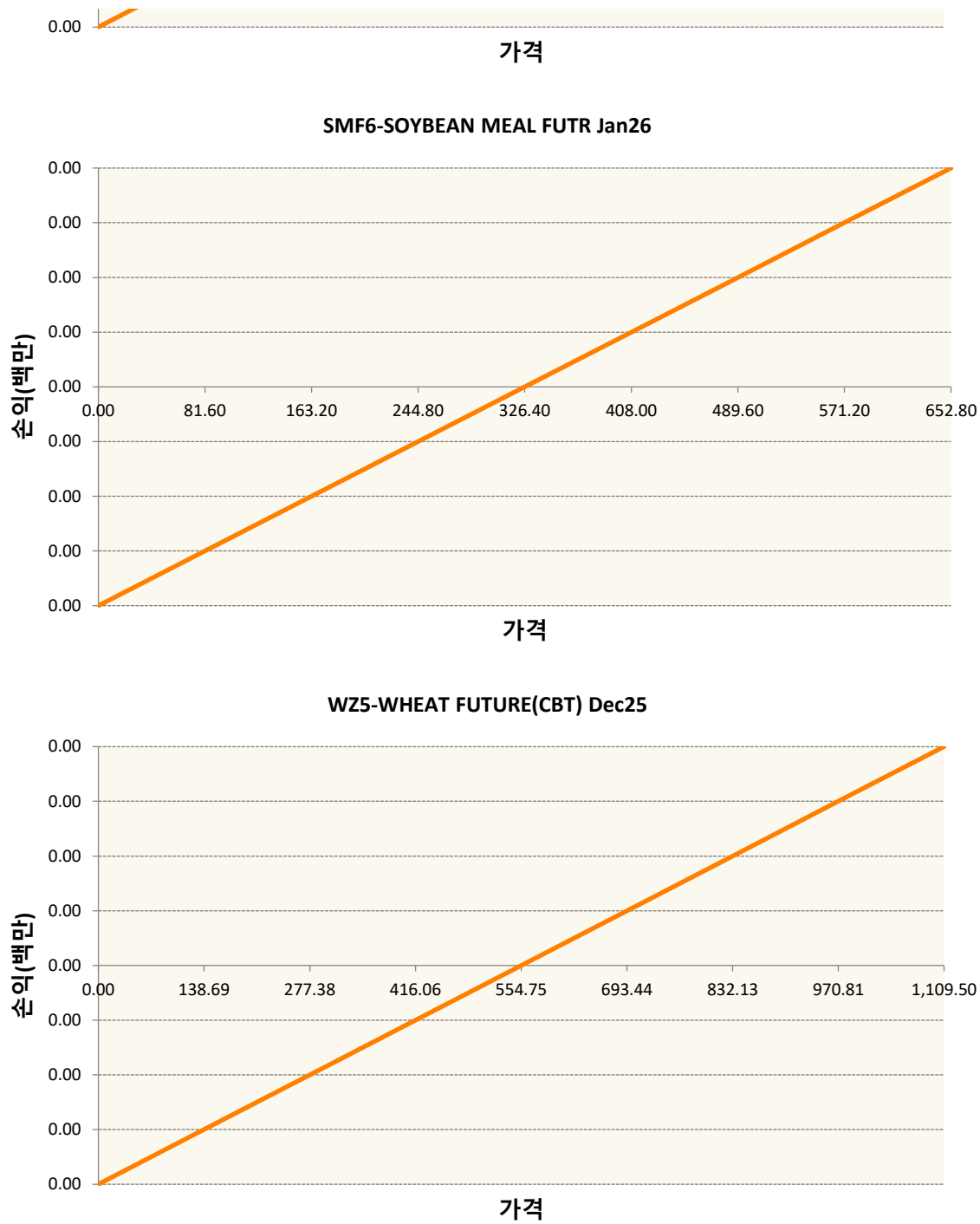
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,153	0	1,153	
누계	유가증권	선물	2,189	0	2,189	
누계	통화	선물	0	434	-434	장내

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	2025-11-07
기준일	2025-11-06

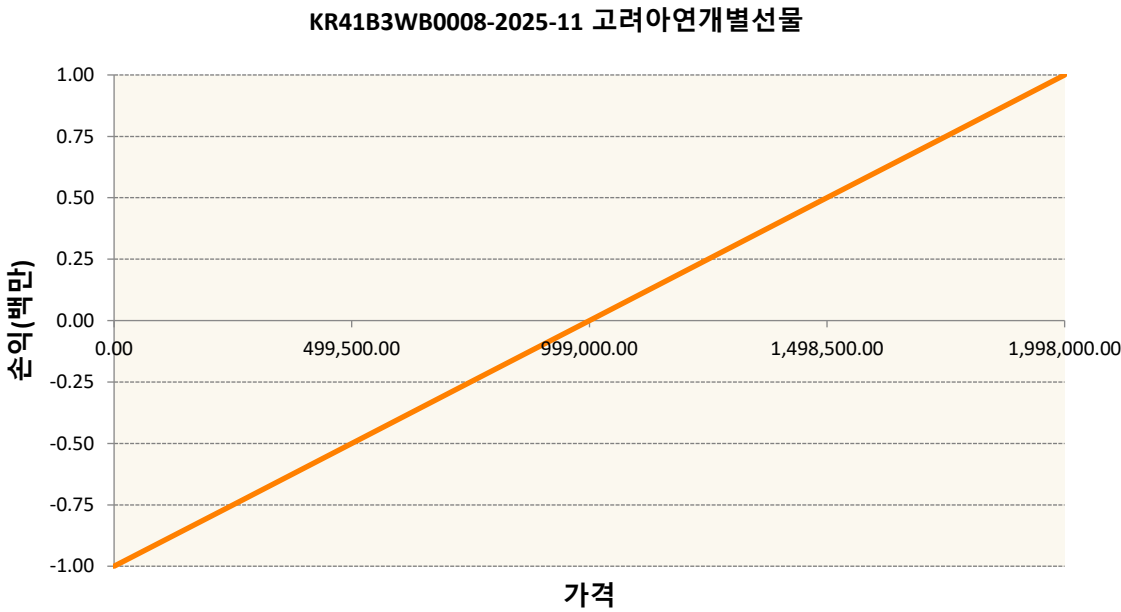
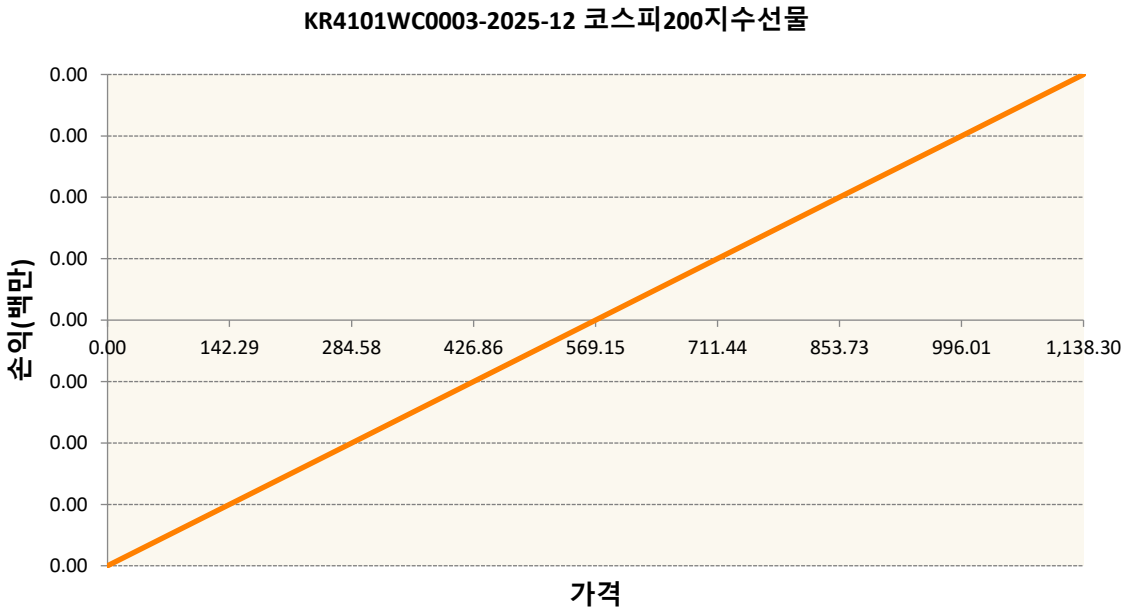
스마트인덱스모

1. 계약금액

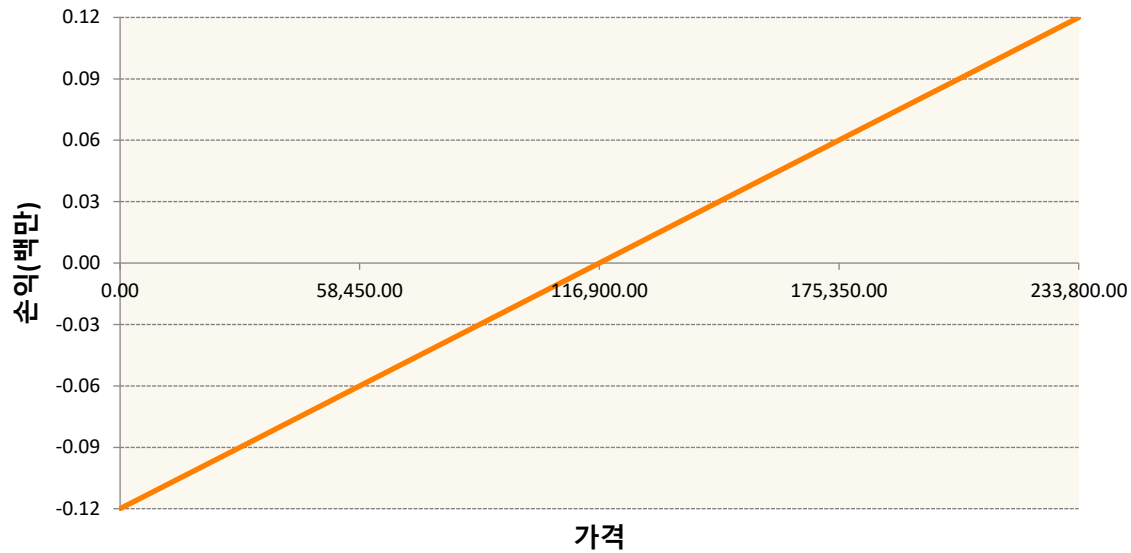
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	145	-145	장내
누계	유가증권	선물	1,419	0	1,419	장내

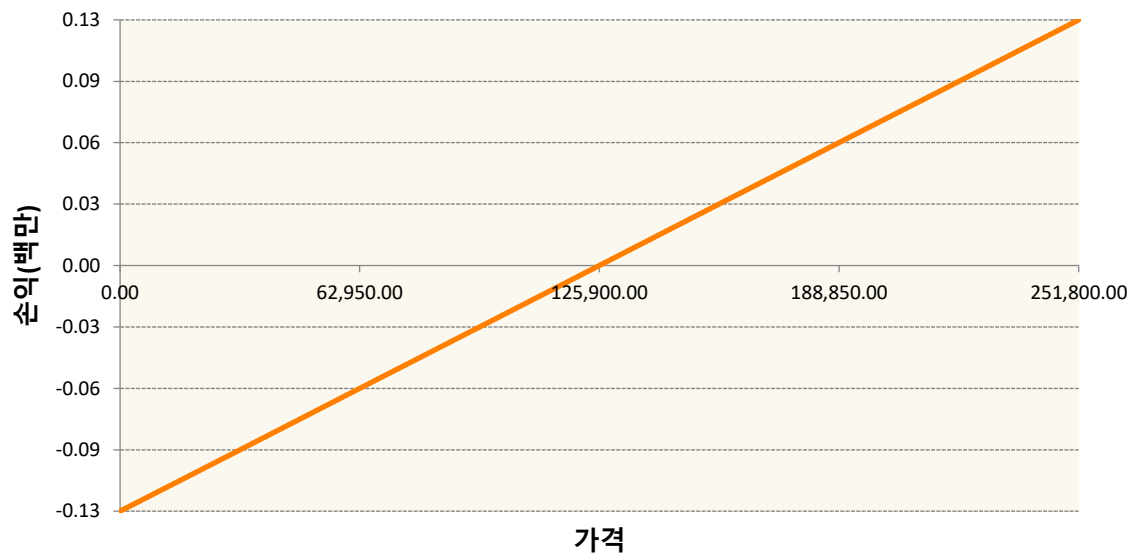
2. 만기시점의 손익구조



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	102
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	2025-11-07
기준일	2025-11-06

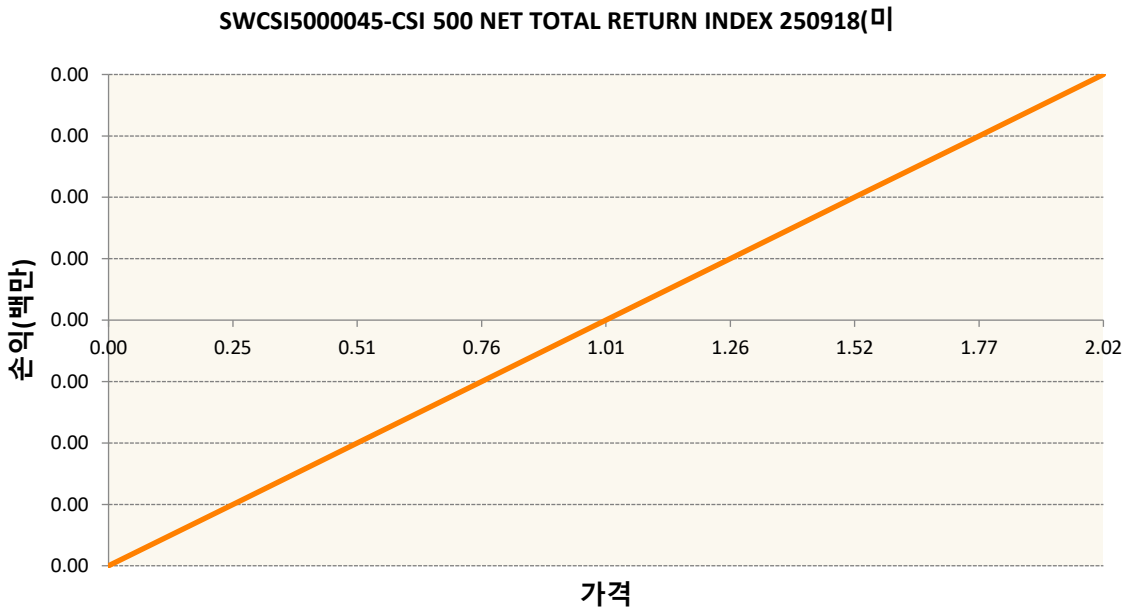
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,747	0	4,747	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

378

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

484

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

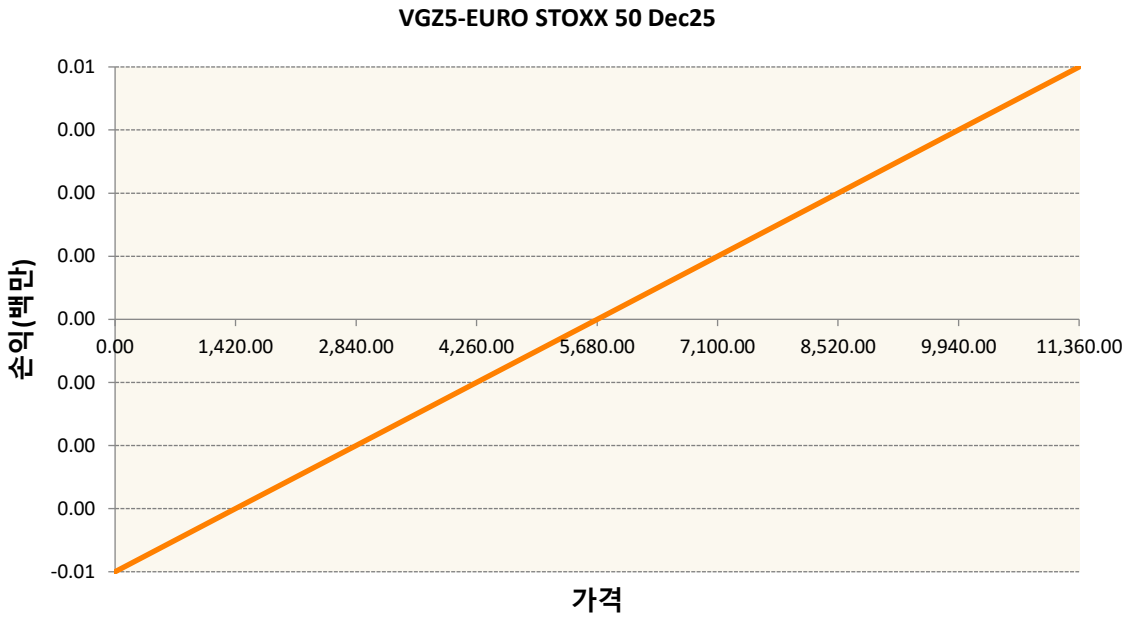
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	745	0	745	

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	2025-11-07
기준일	2025-11-06

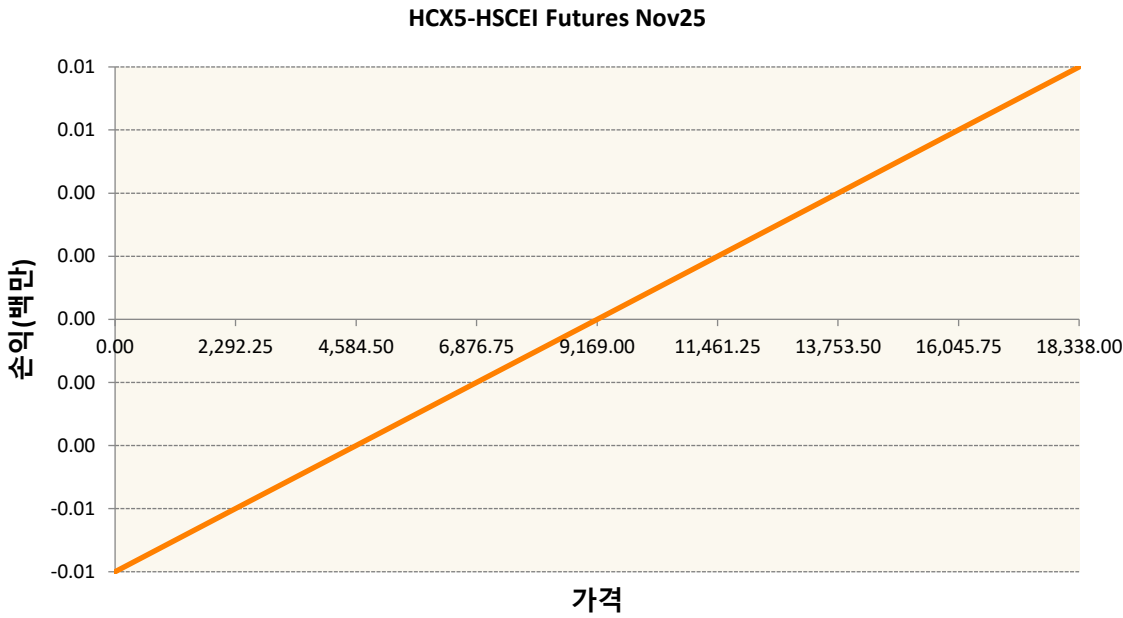
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,026	0	2,026	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCX5	HSCEI Futures Nov25	162
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

229

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

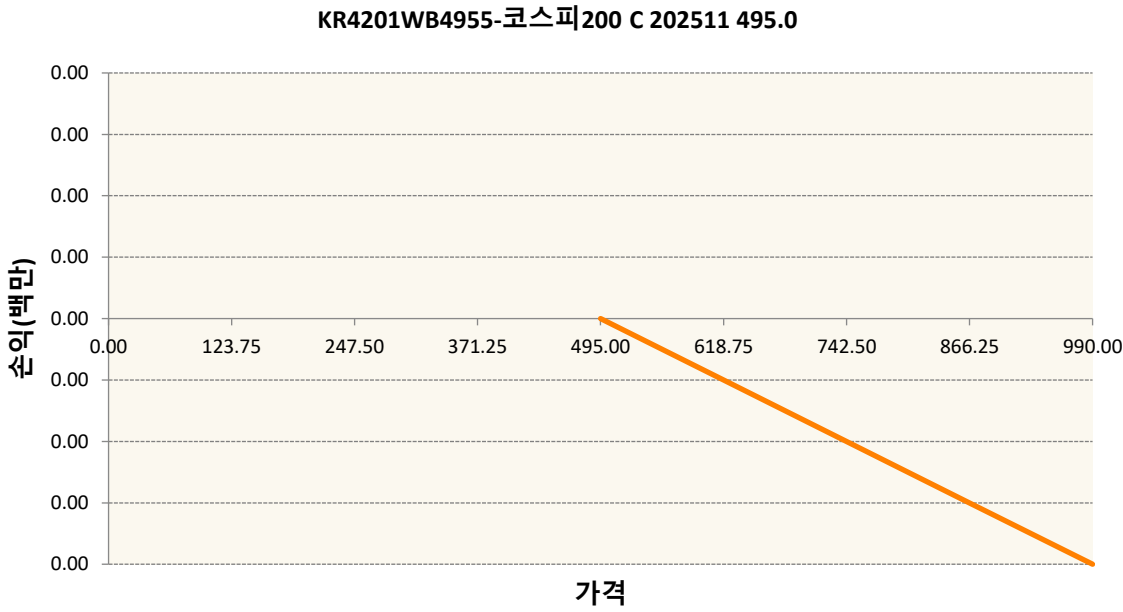
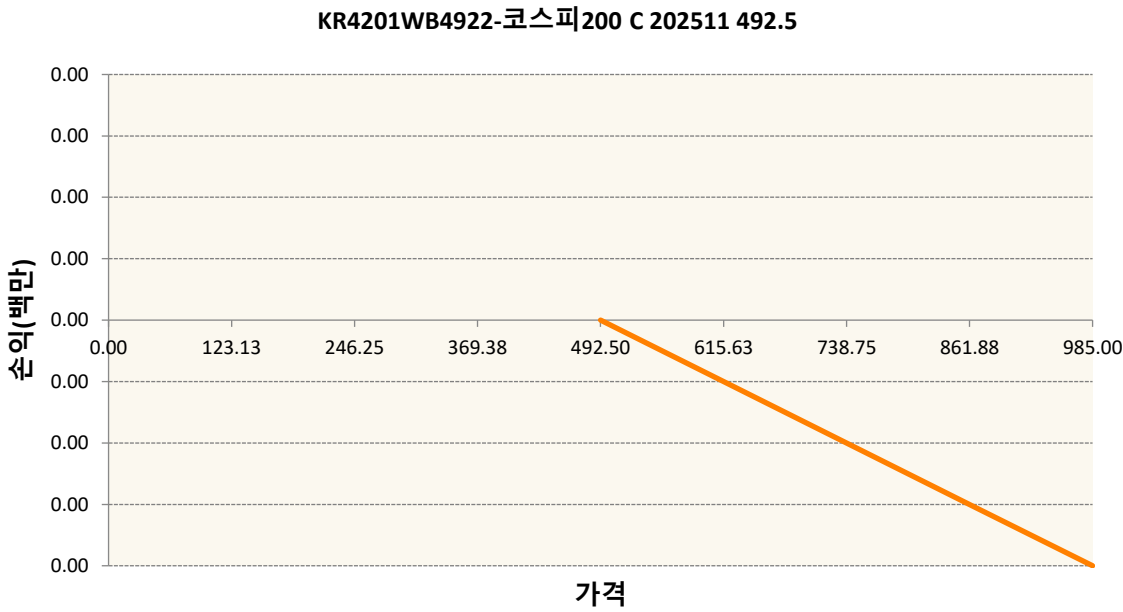
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

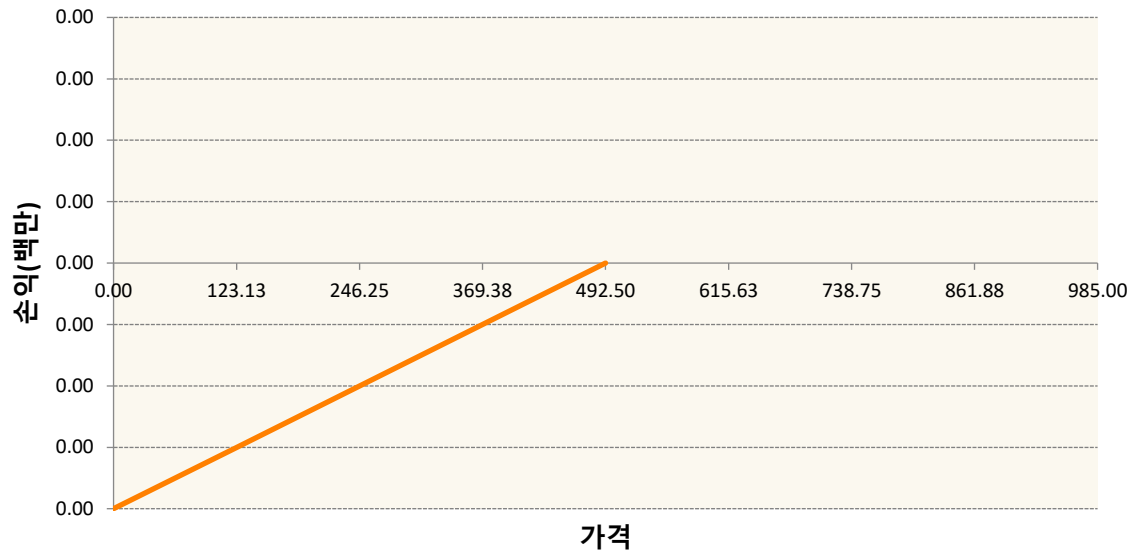
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4301WB4921-코스피200 P 202511 492.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WB4921-코스피200 C 202511 492.5

414

KR4201WB4951-코스피200 C 202511 495.0

1,505

KR4301WB4921-코스피200 P 202511 492.5

463

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-11-07

기준일 2025-11-06

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	2025-11-07
기준일	2025-11-06

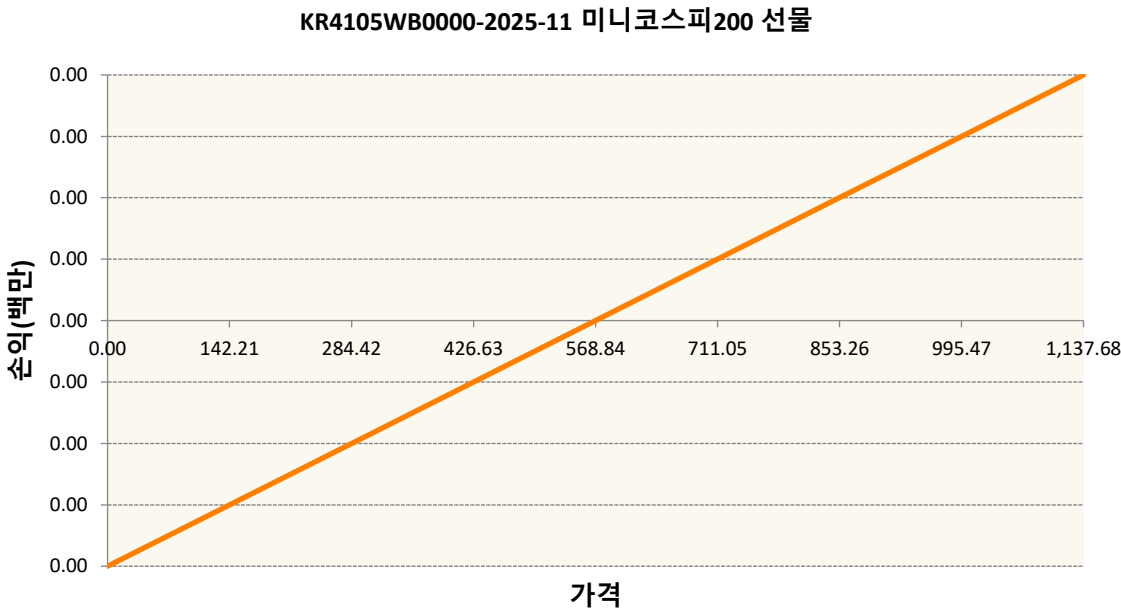
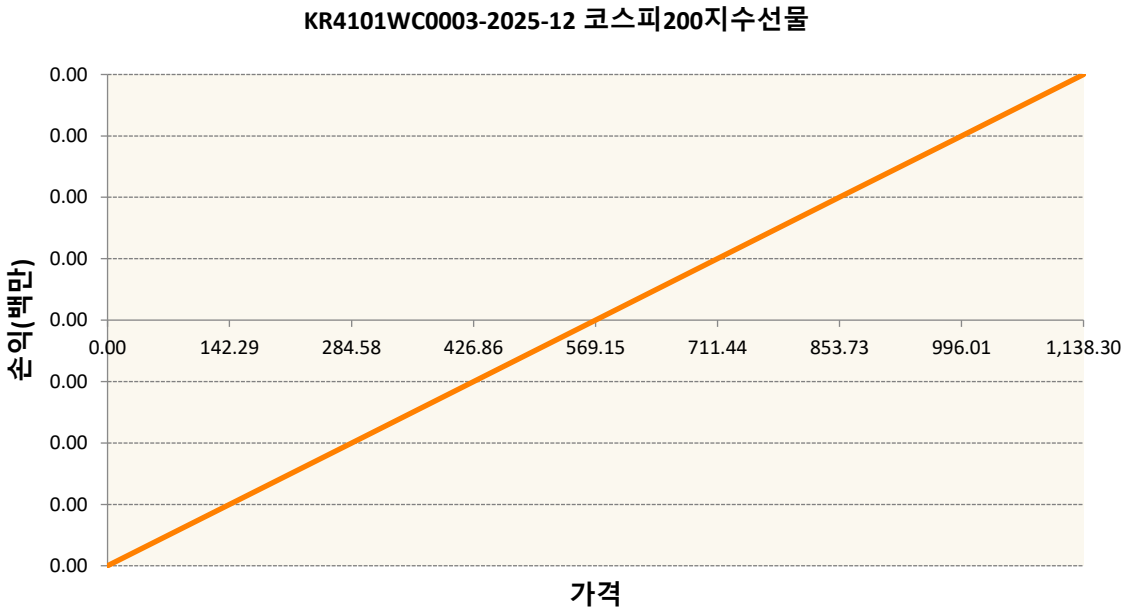
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

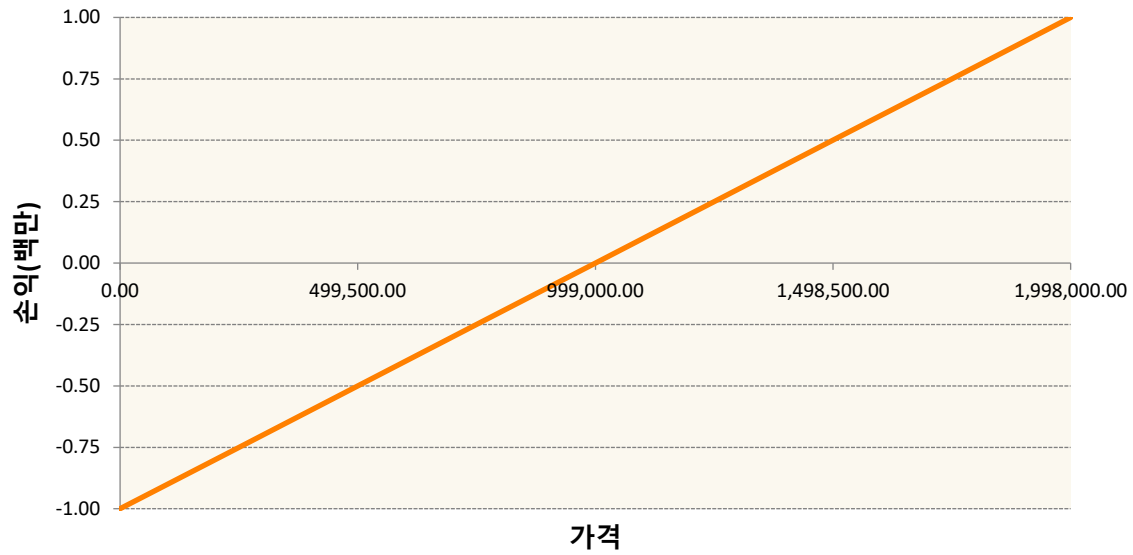
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	913	0	913	장내

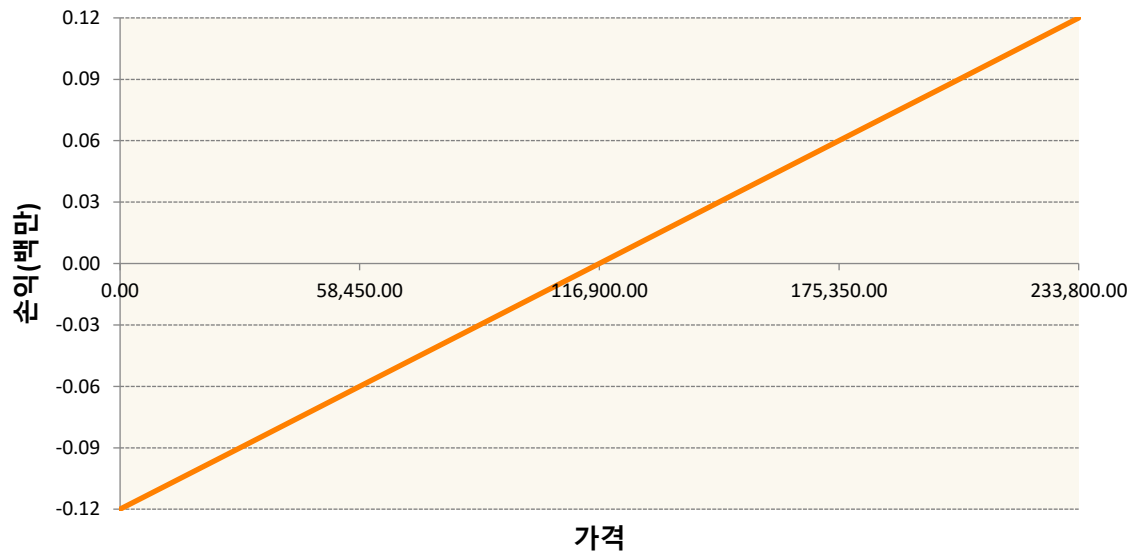
2. 만기시점의 손익구조



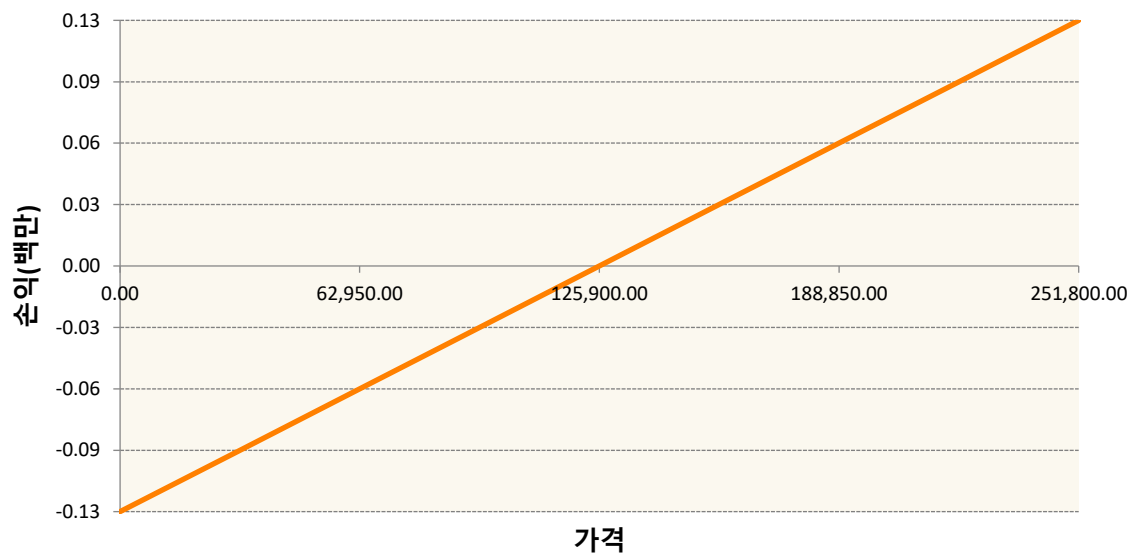
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물		46
KR4105WB0(2025-11 미니코스피200 선물		5
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	2025-11-07
기준일	2025-11-06

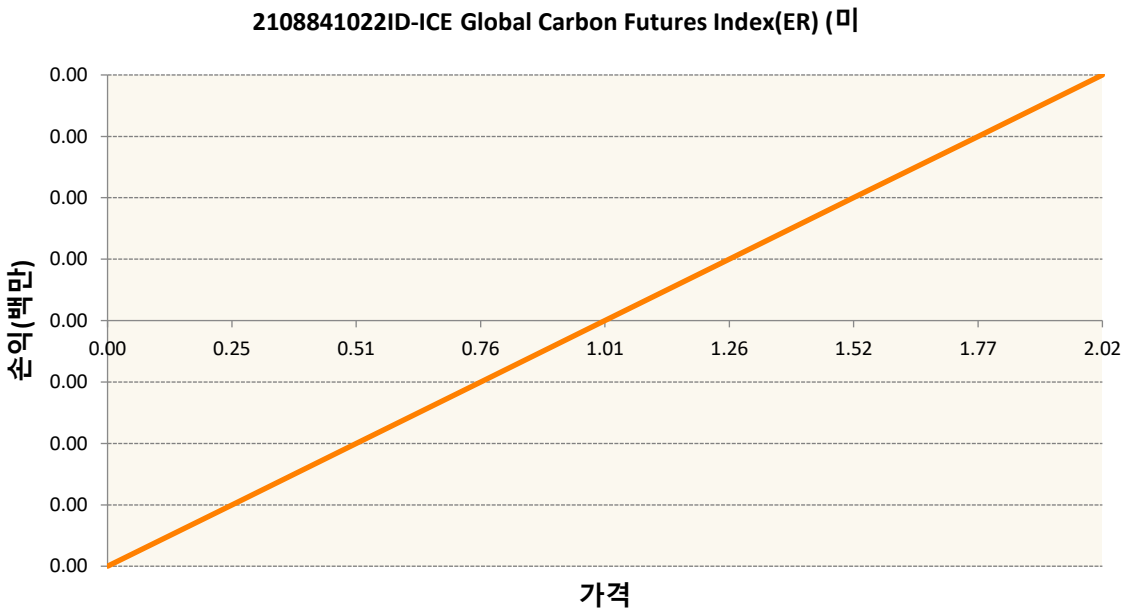
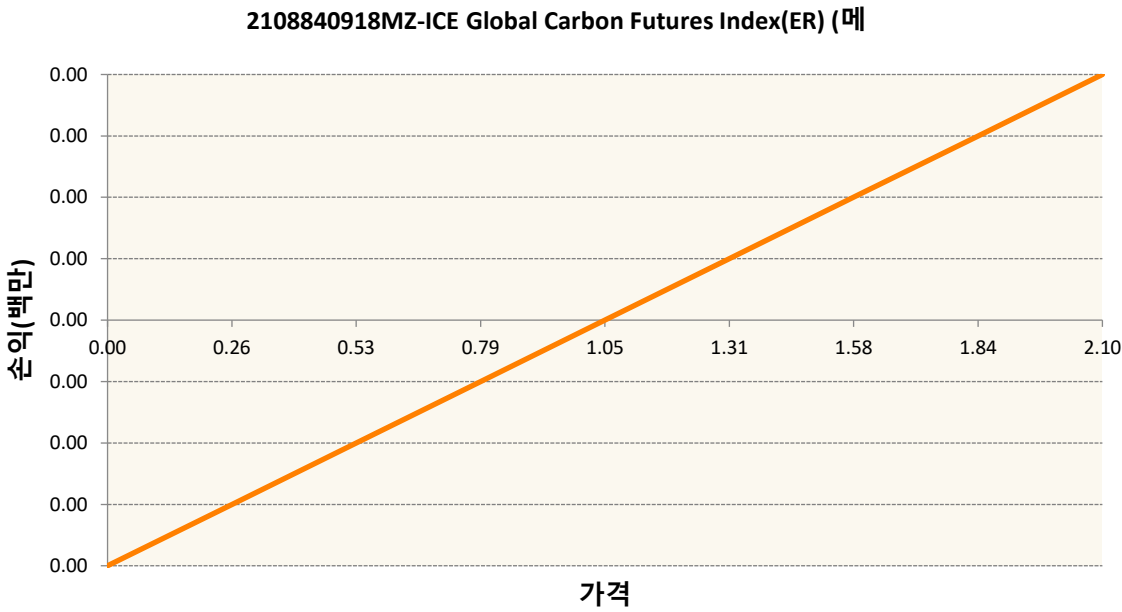
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	8,529	0	8,529	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		114
2108841022IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		566

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	667

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

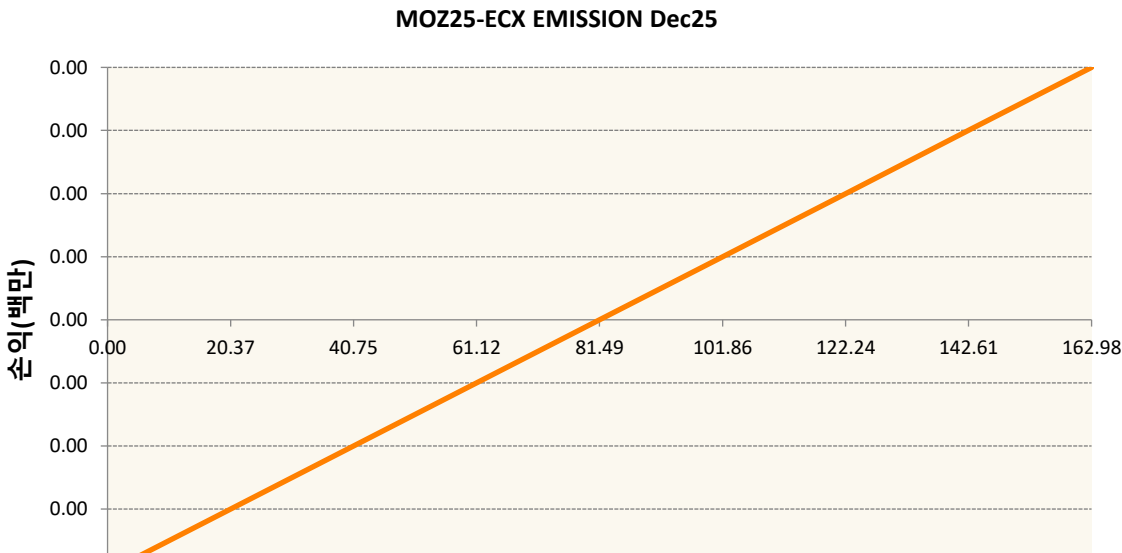
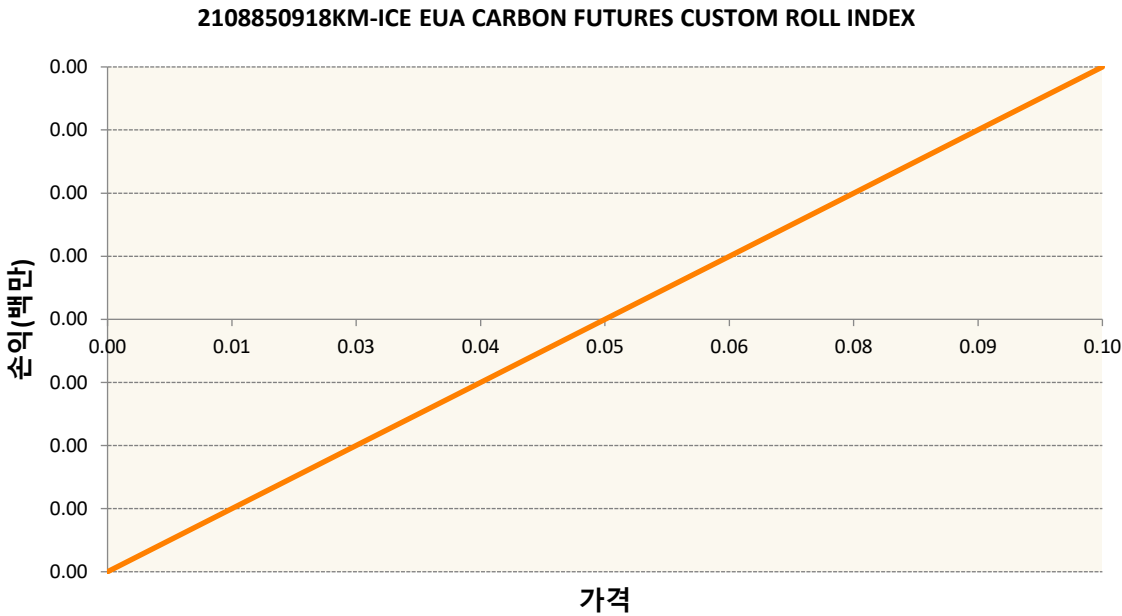
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,023	0	6,023	
누계	지수	스왑	20	0	20	장외
누계	통화	선도	0	2,499	-2,499	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E	200
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	482

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

(단위:백만원)

775

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

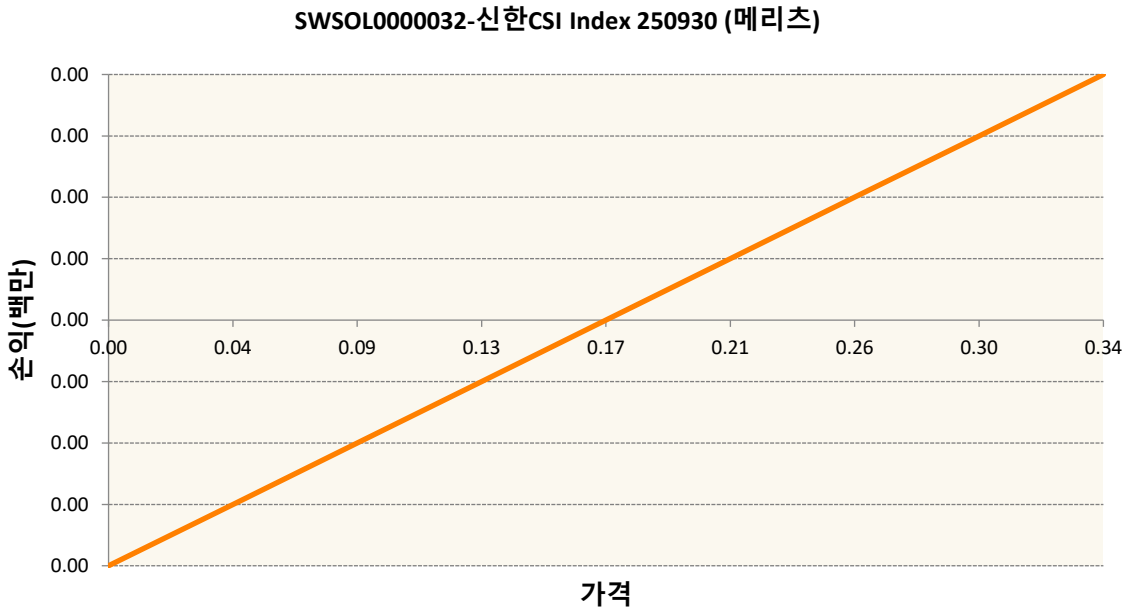
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,922	0	2,922	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	13
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	13
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	33

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

(단위:백만원)

140

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

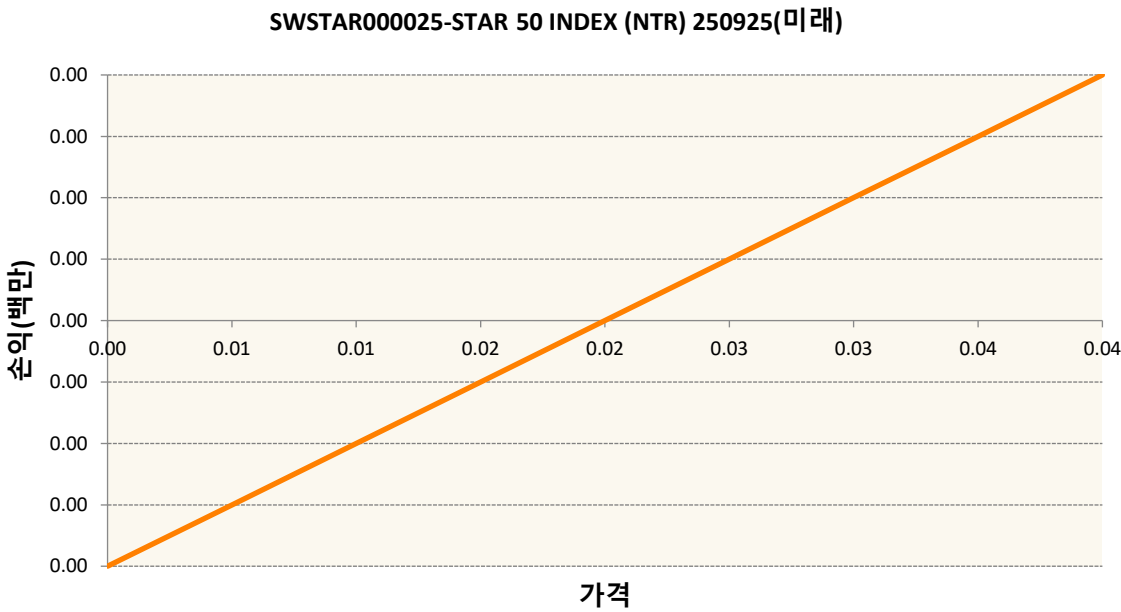
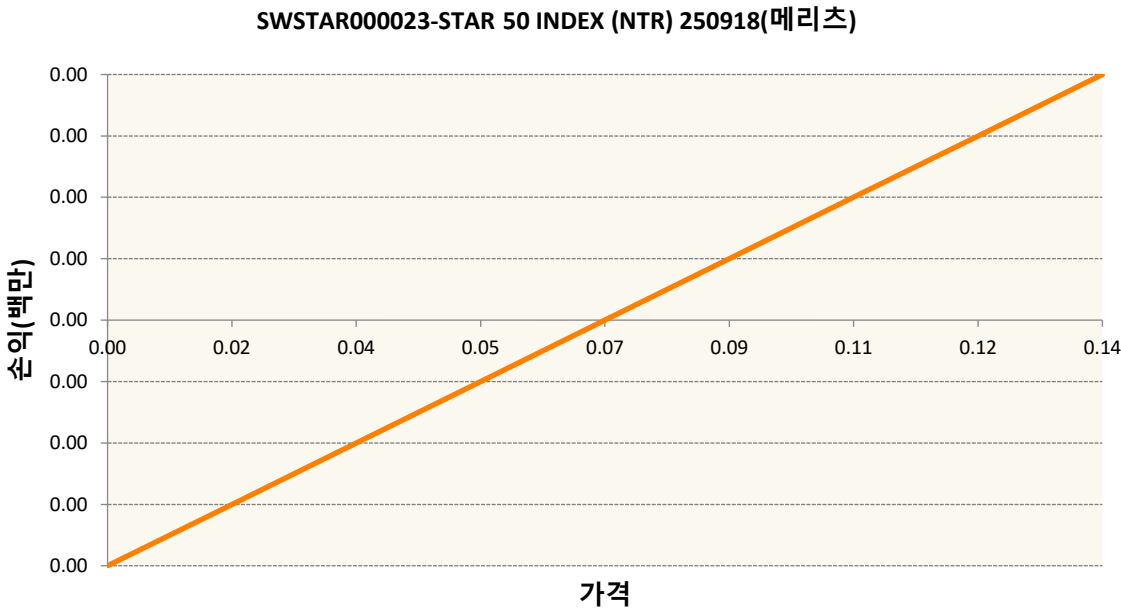
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	4,224	0	4,224	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		15
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		4
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		55
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		9
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠)		16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	179

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

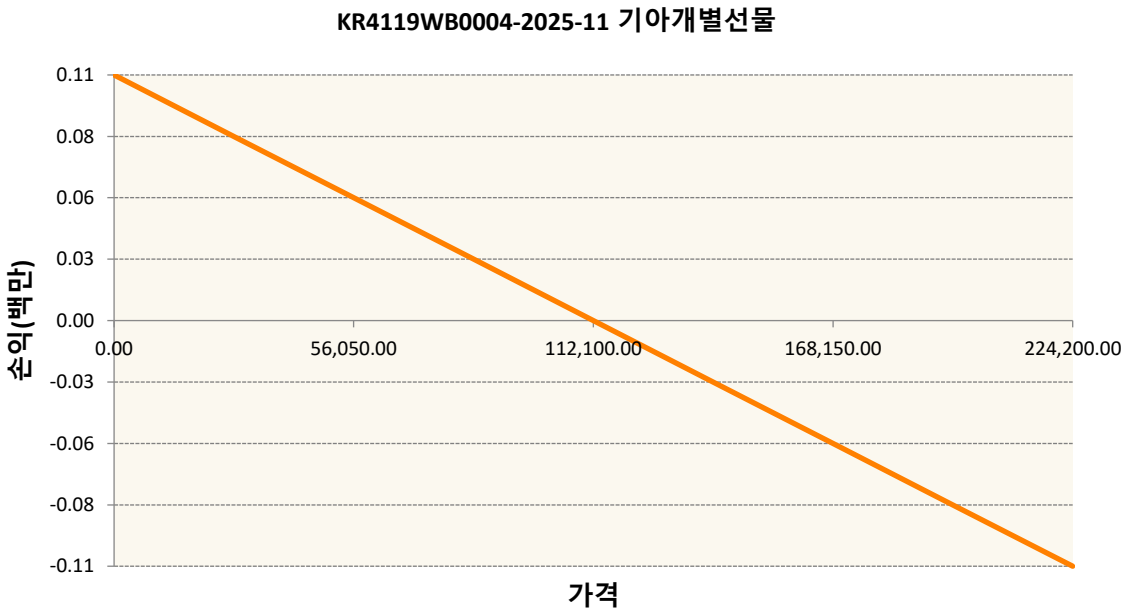
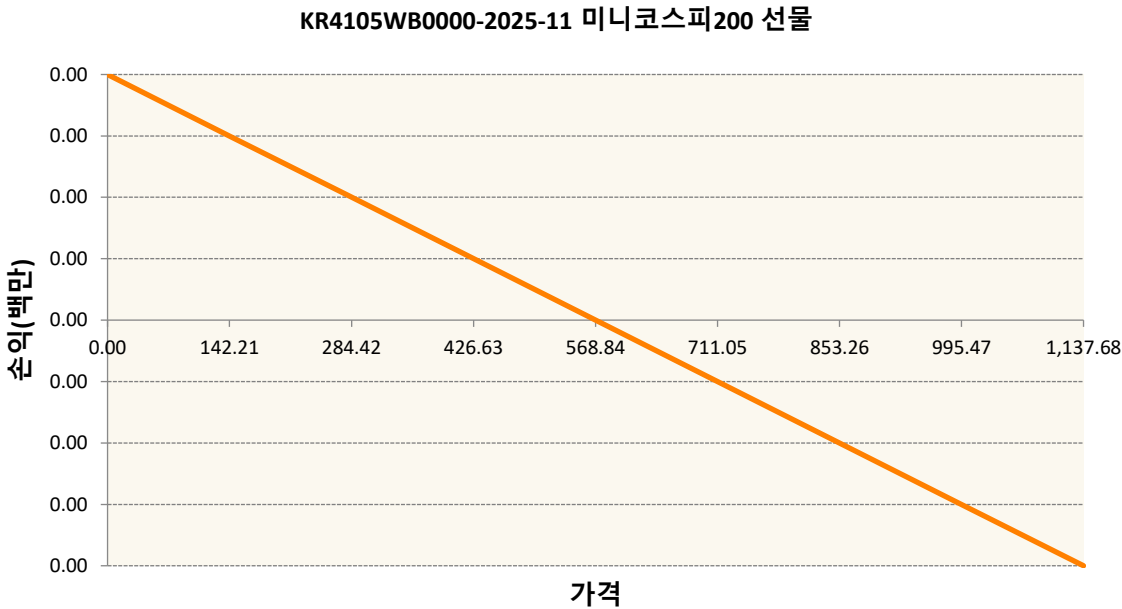
에퀴티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

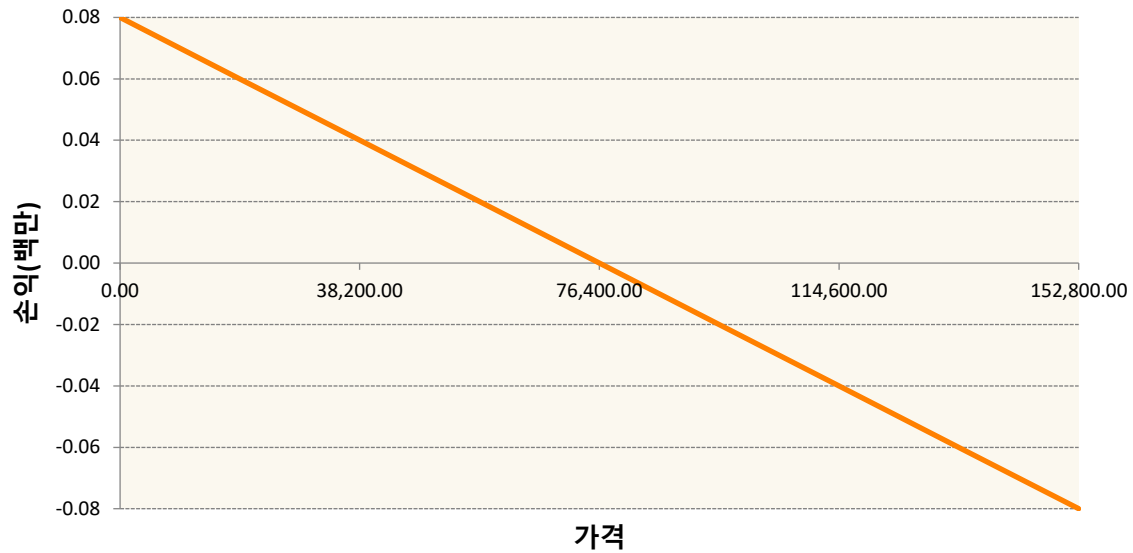
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	870	-870	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41B2WB0009-2025-11 S-Oil개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105WB0(2025-11 미니코스피200 선물
 KR4119WB0(2025-11 기아개별선물
 KR41B2WB0(2025-11 S-Oil개별선물

14
1
0.43

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

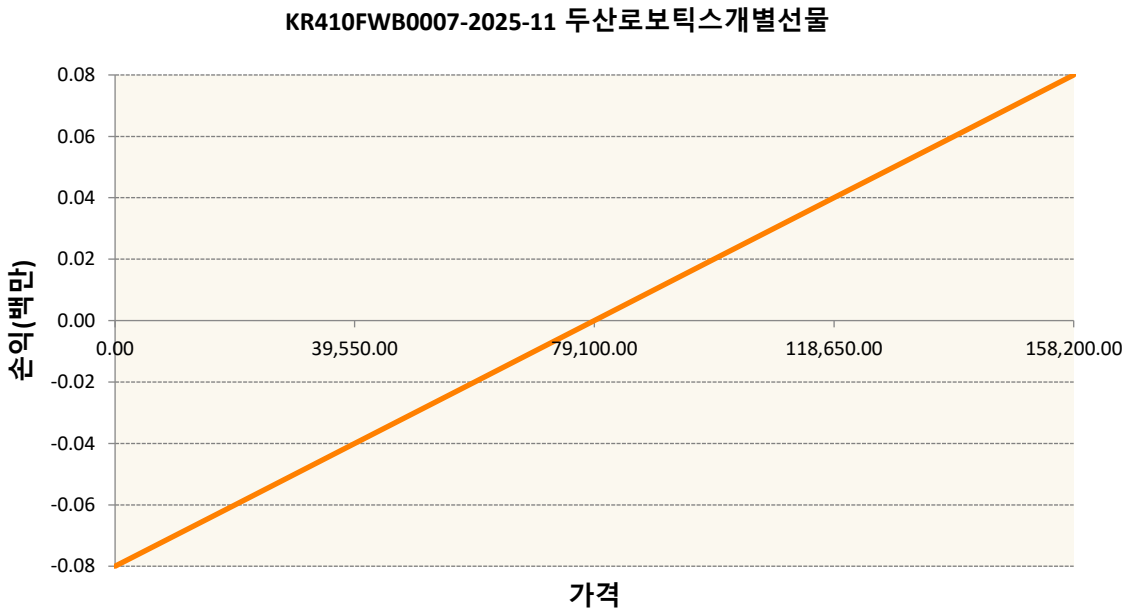
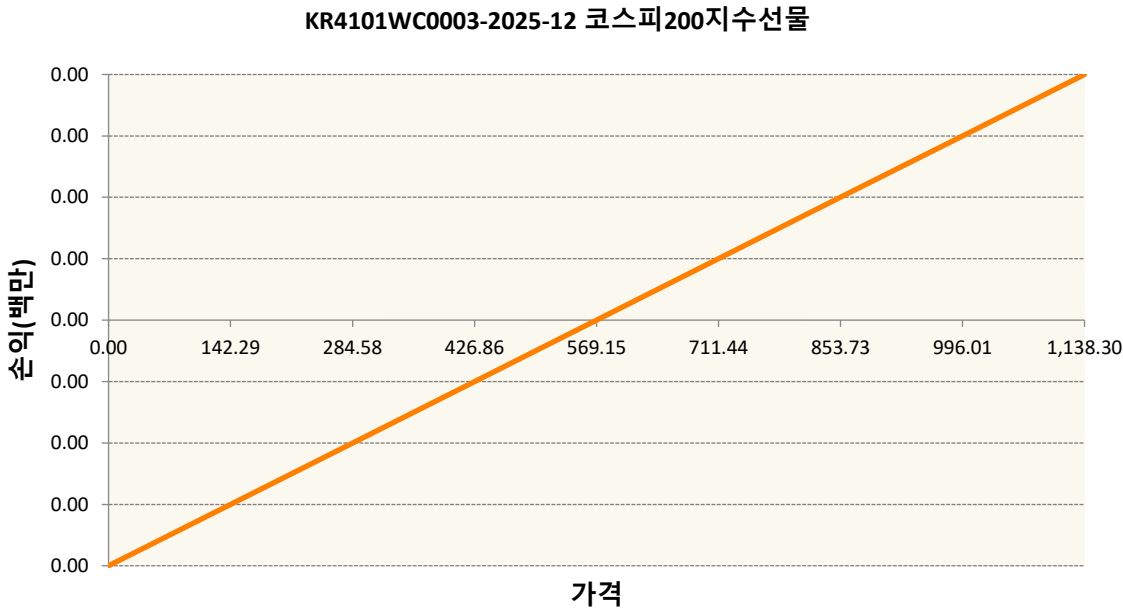
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

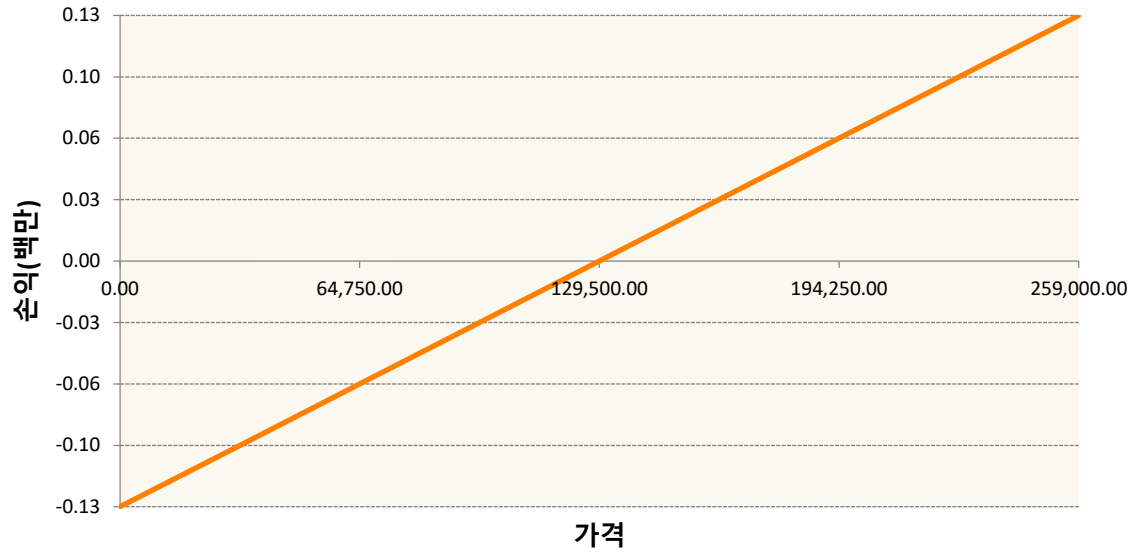
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,157	285	873	장내
누계	유가증권	선물	15,961	0	15,961	장내

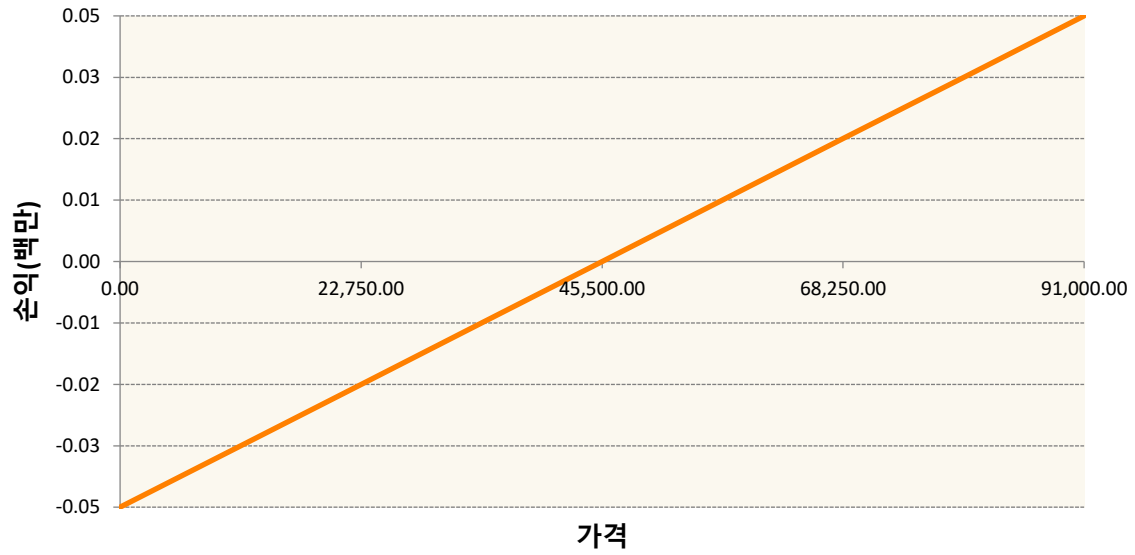
2. 만기시점의 손익구조



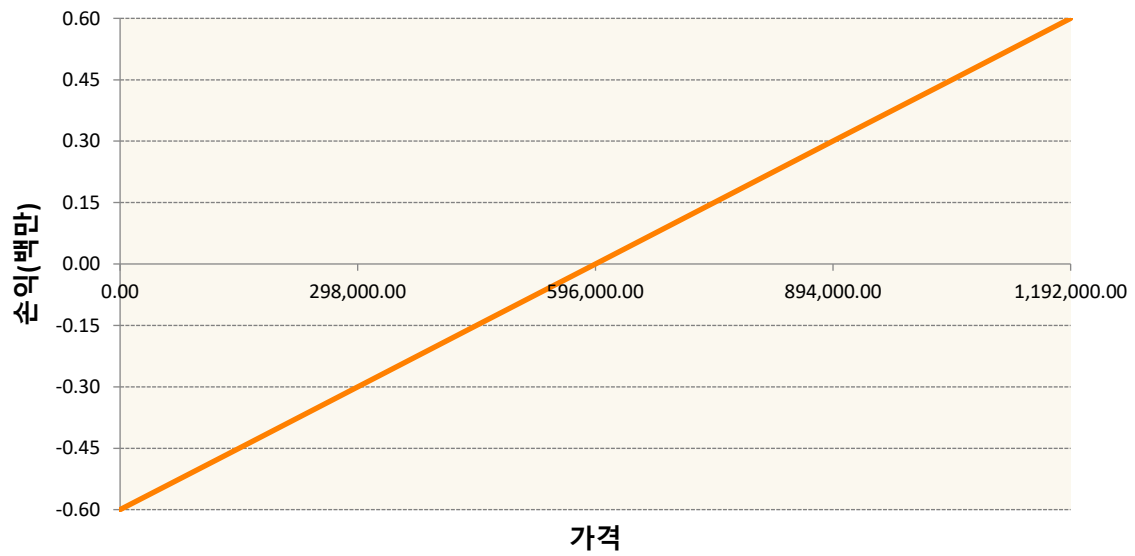
KR410ZWB0003-2025-11 한미반도체개별선물



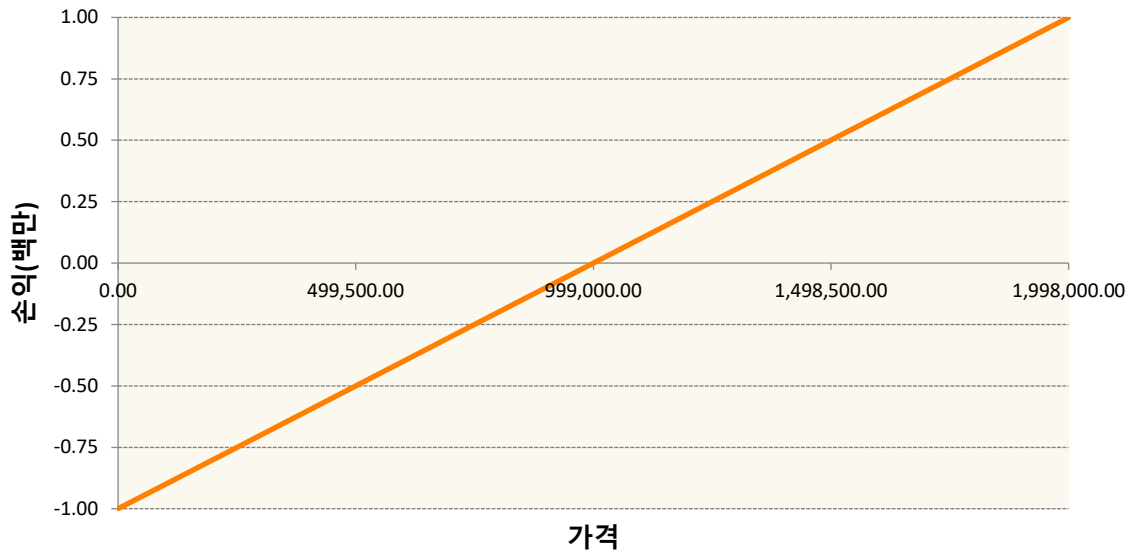
KR411RWB0002-2025-11 한화비전개별선물



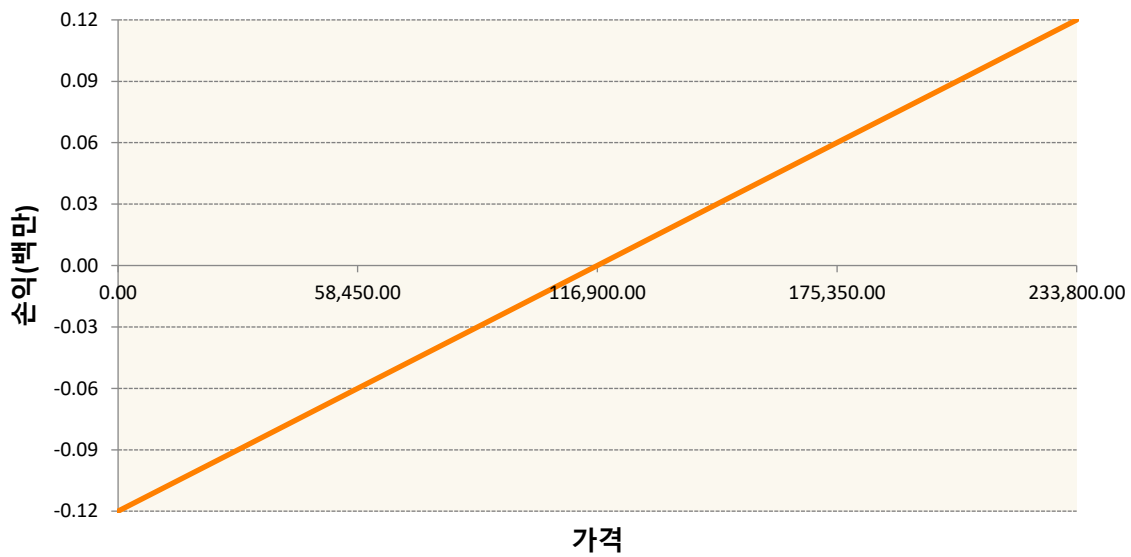
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



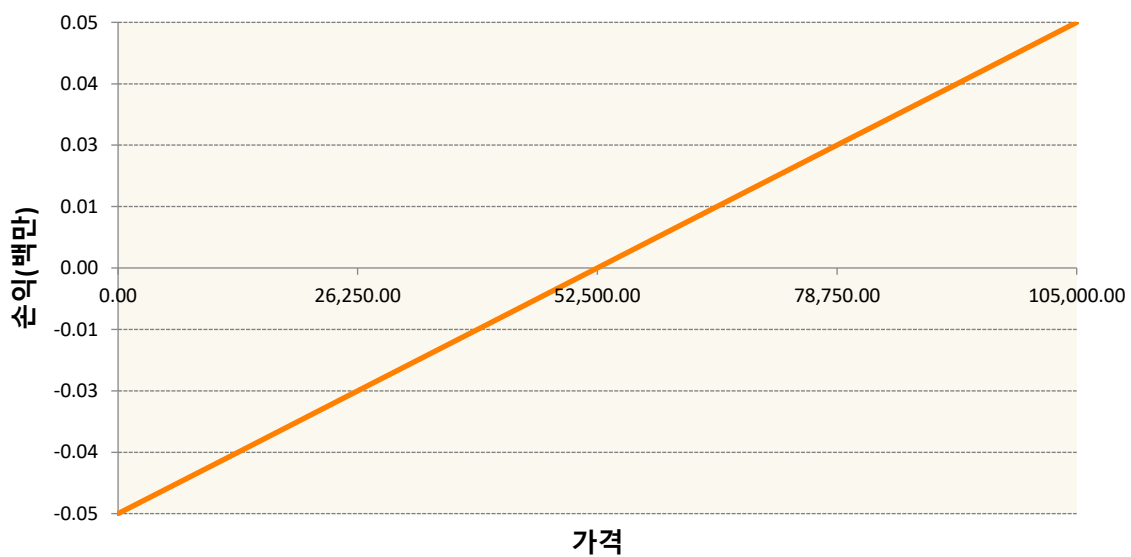
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



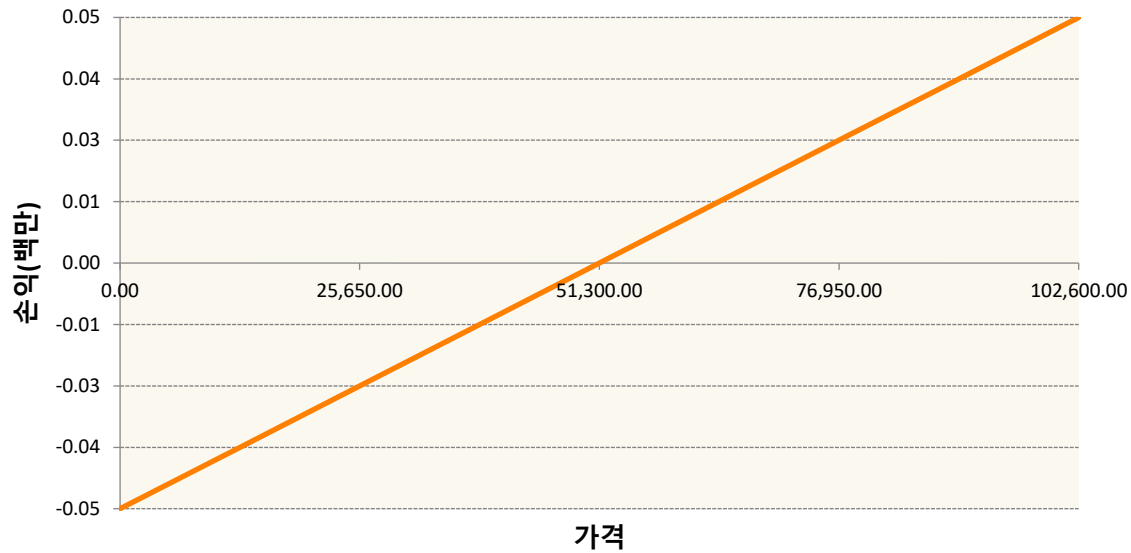
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



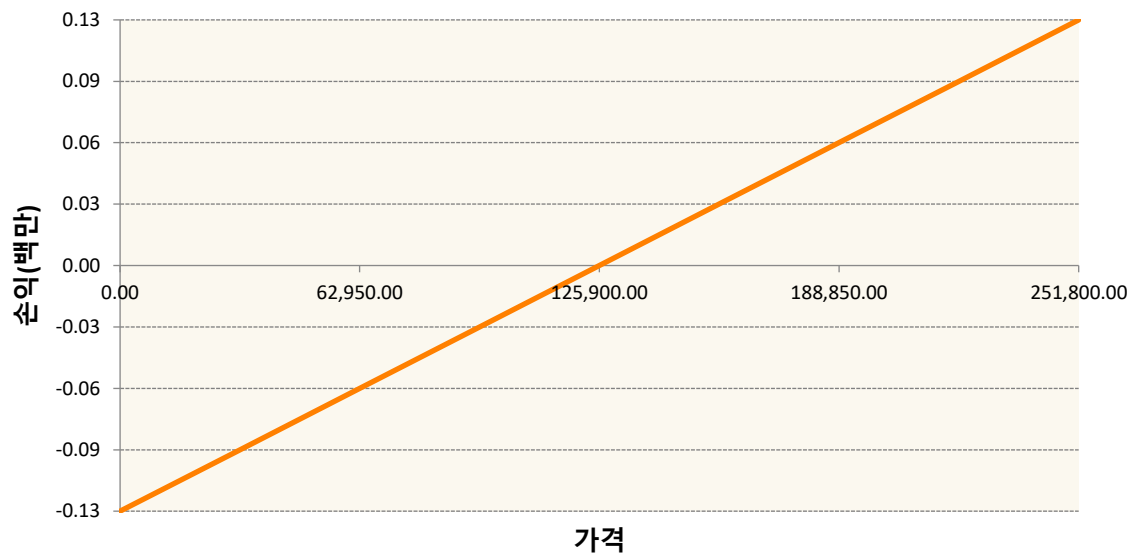
KR41EVWB0002-2025-11 한화시스템개별선물



KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	1,081
KR410FWB0(2025-11 두산로보틱스개별선물	17
KR410ZWB0(2025-11 한미반도체개별선물	40
KR411RWB0(2025-11 한화비전개별선물	3
KR4150WB0(2025-11 SK하이닉스개별선물	3
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물	46
KR41EJWB0C 2025-11 SKC개별선물	24
KR41EVWB0(2025-11 한화시스템개별선물	11
KR41F7WB0(2025-11 카카오페이개별선물	15
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물	36

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

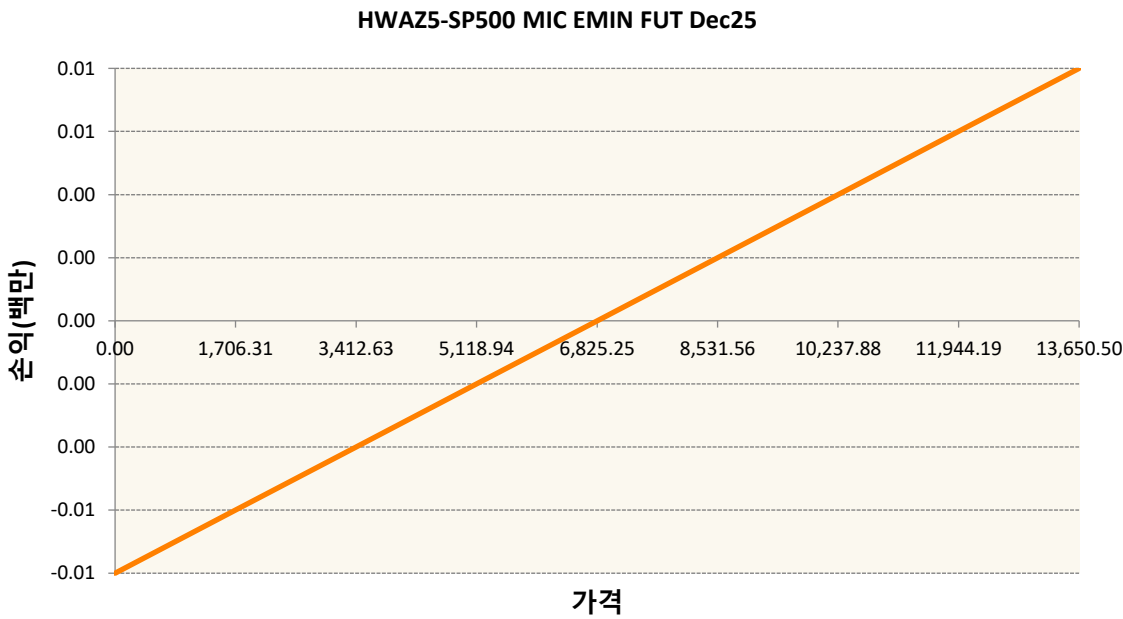
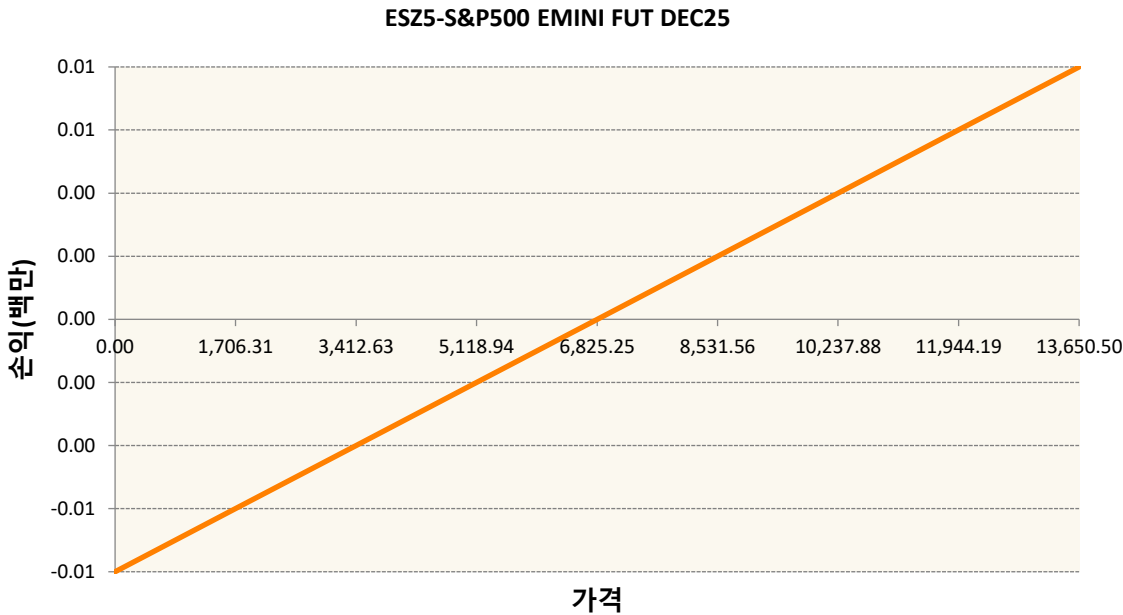
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	41,374	0	41,374	
누계	유가증권	선물	1,280	0	1,280	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,310
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	102

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,873

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

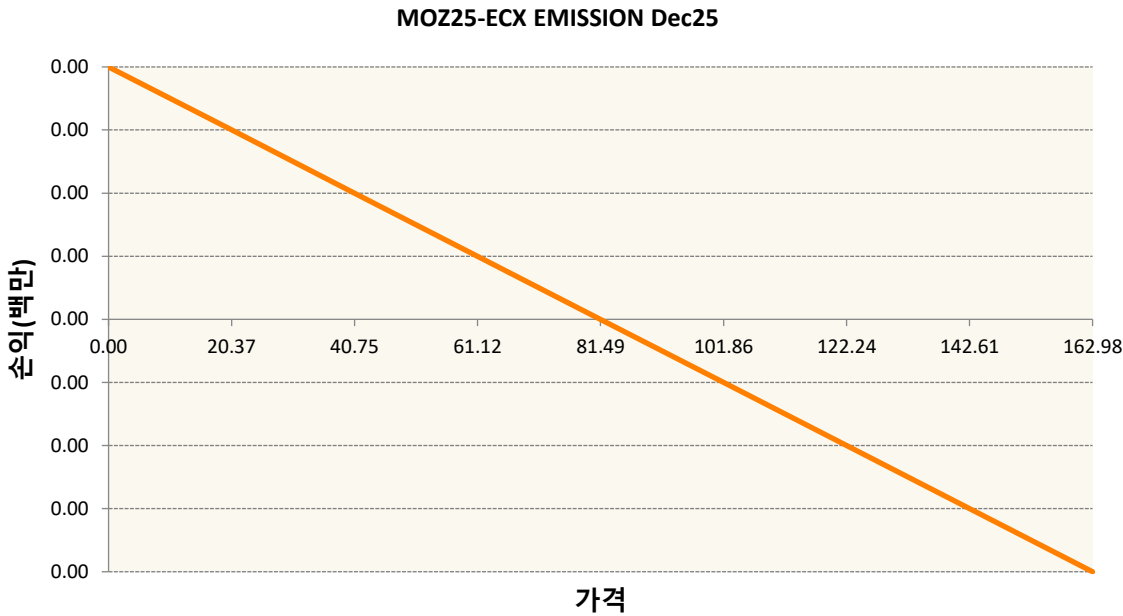
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	0	2,882	-2,882	
누계	지수	스왑	-20	0	-20	장외
누계	통화	선도	0	1,156	-1,156	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E	92
MOZ25 ECX EMISSION Dec25	231

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

(단위:백만원)

370

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

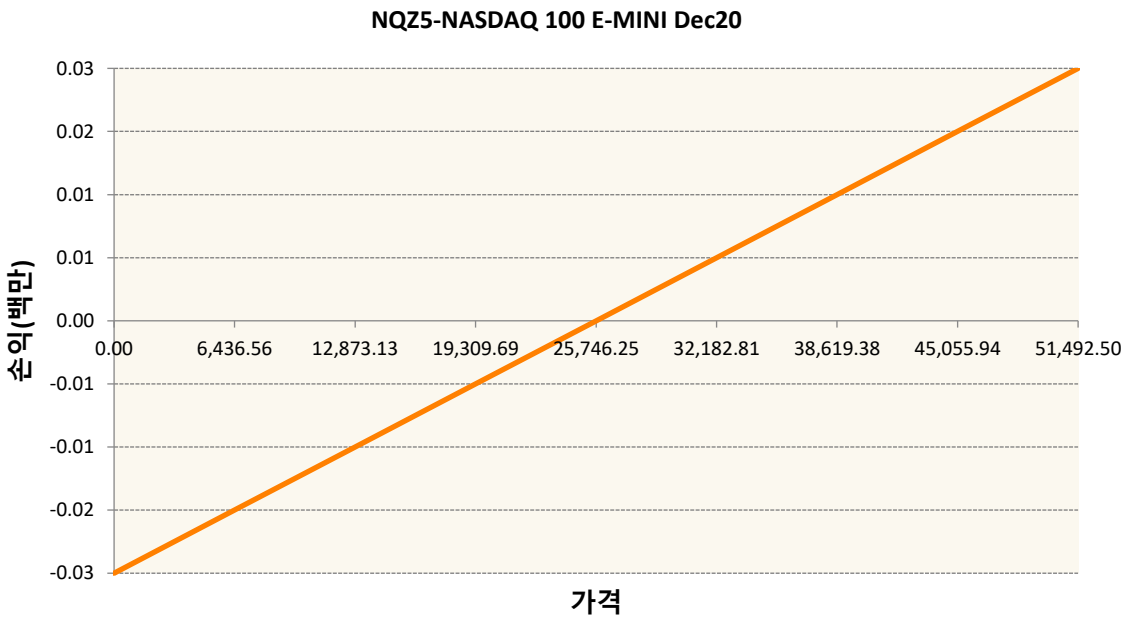
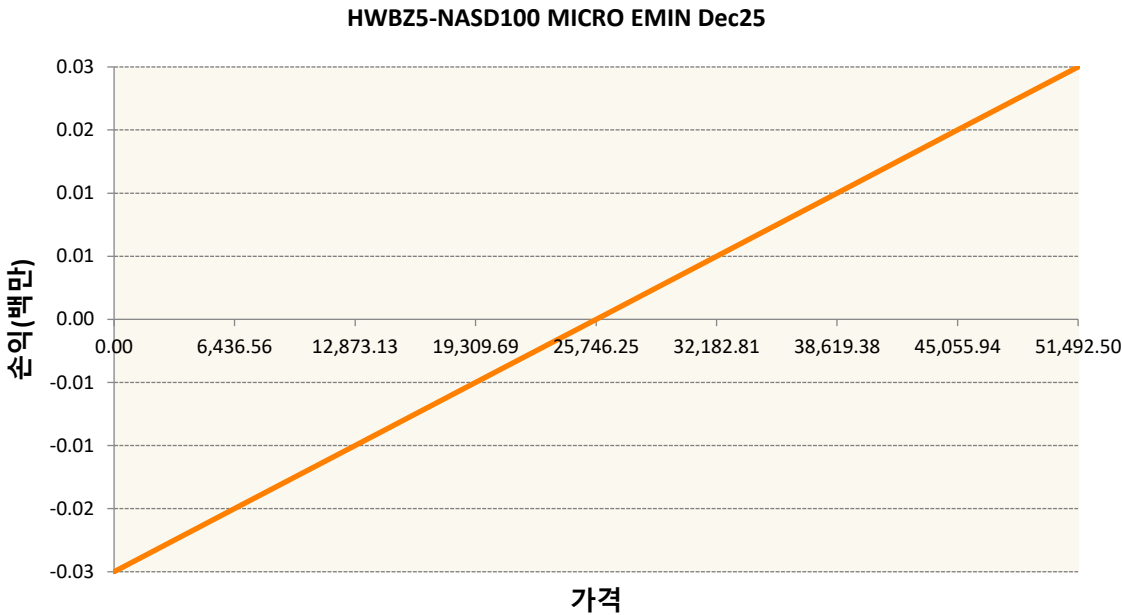
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	18,670	0	18,670	
누계	유가증권	선물	1,434	0	1,434	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25		115
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,494

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,793

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

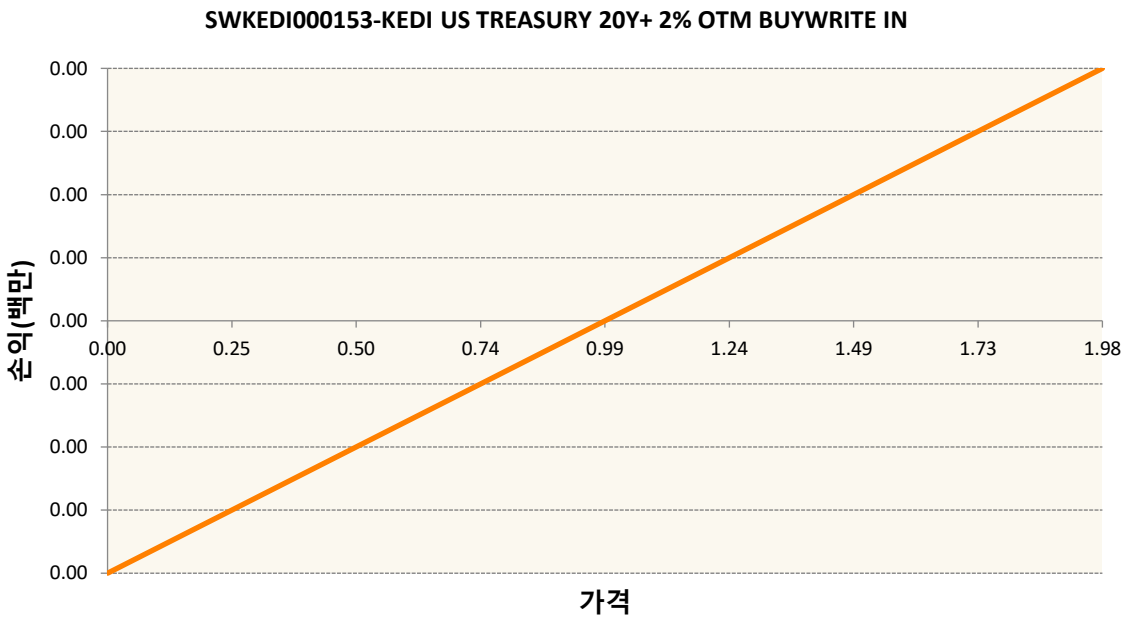
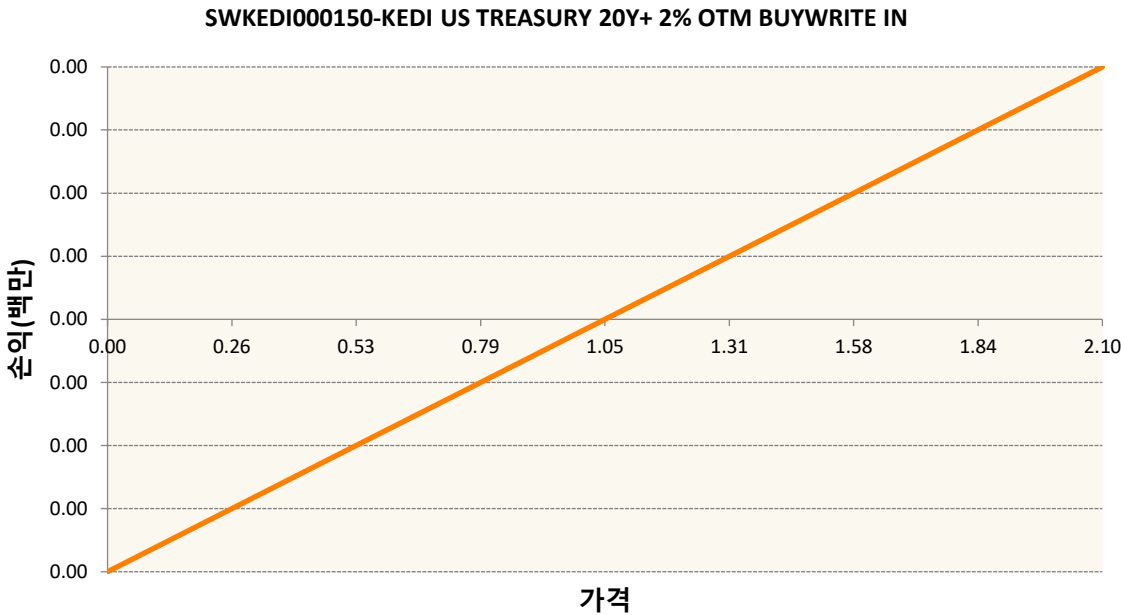
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

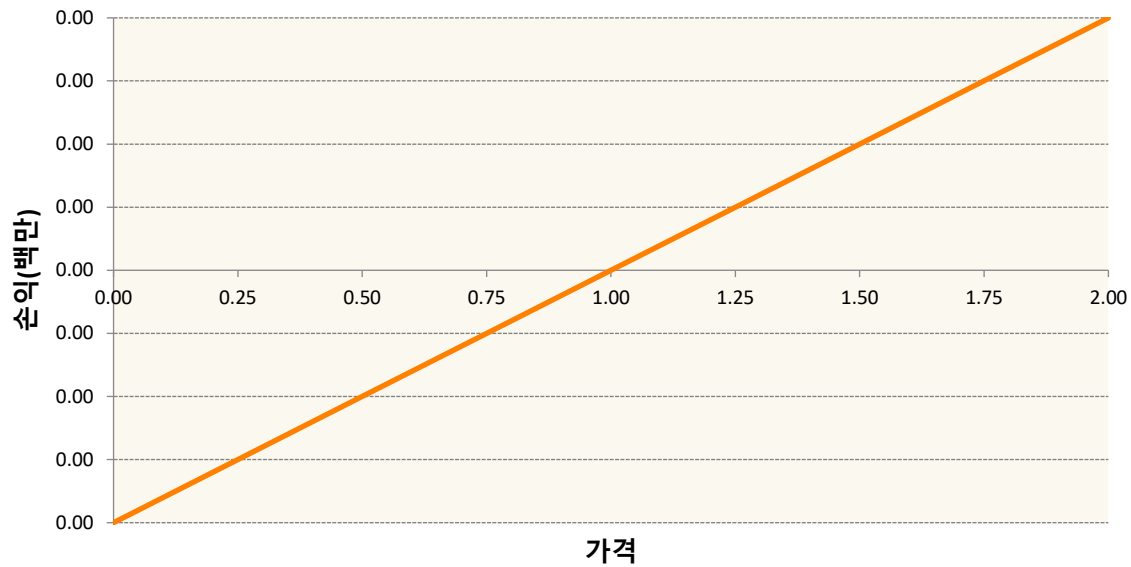
(단위:백만원)

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

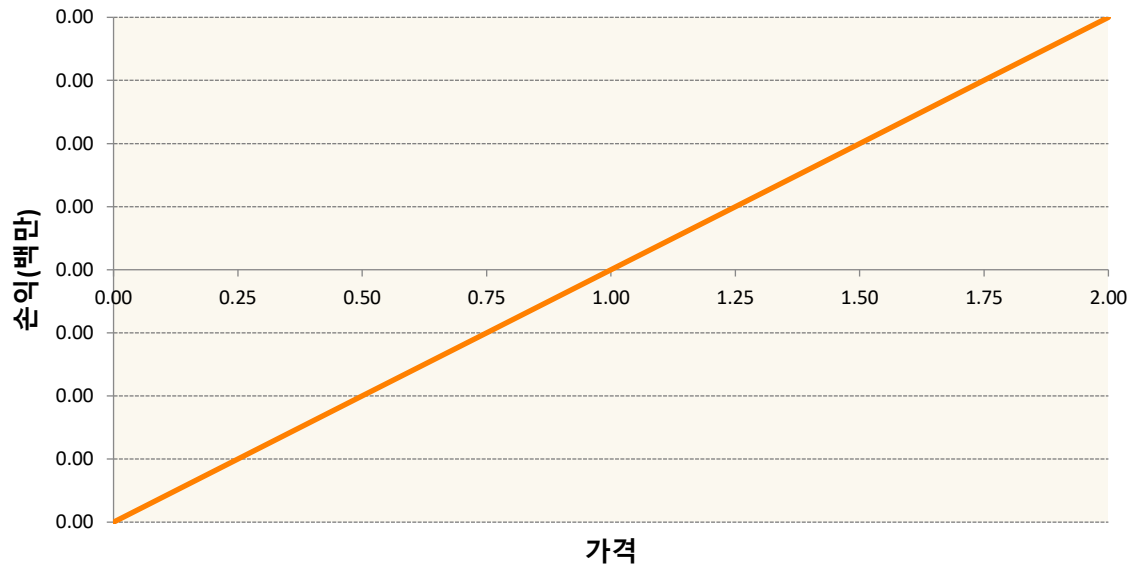
2. 만기시점의 손익구조



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	8,099
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,728
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	10,087
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,478

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

(단위:백만원)

14,560

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

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)

55

공시일	2025-11-07
기준일	2025-11-06

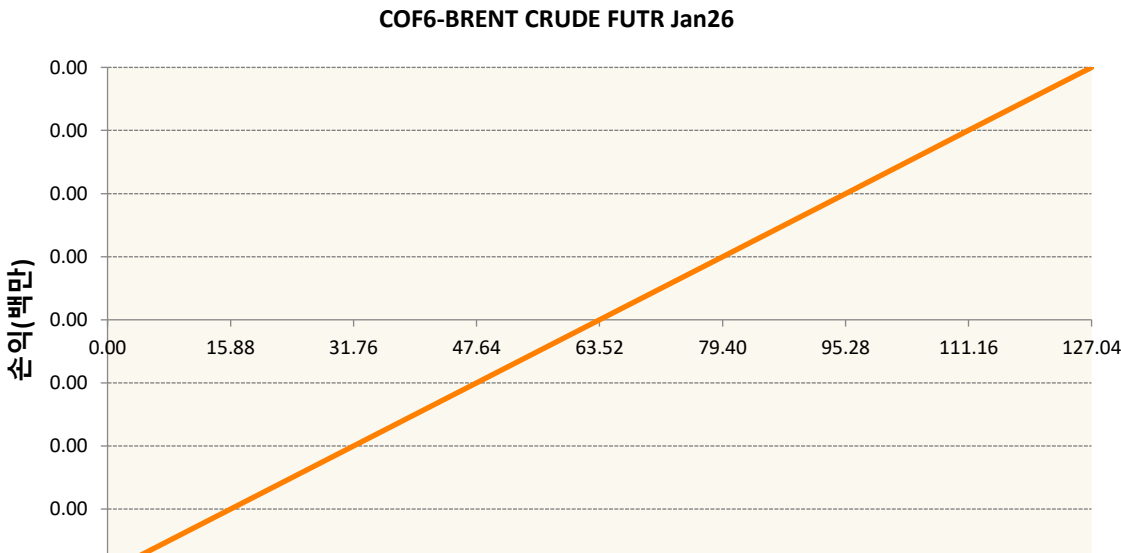
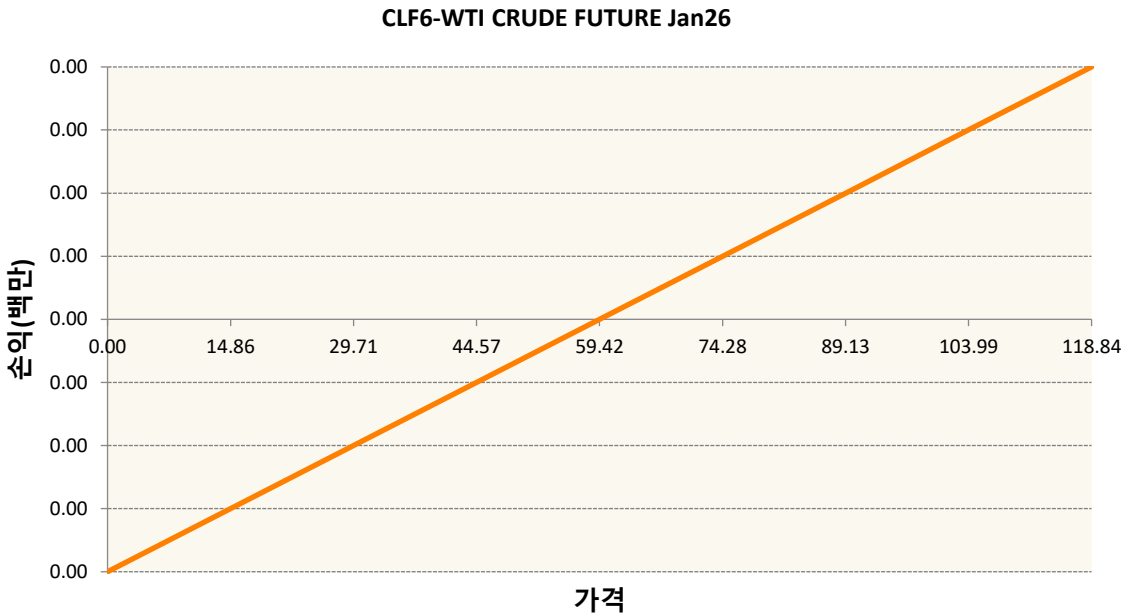
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

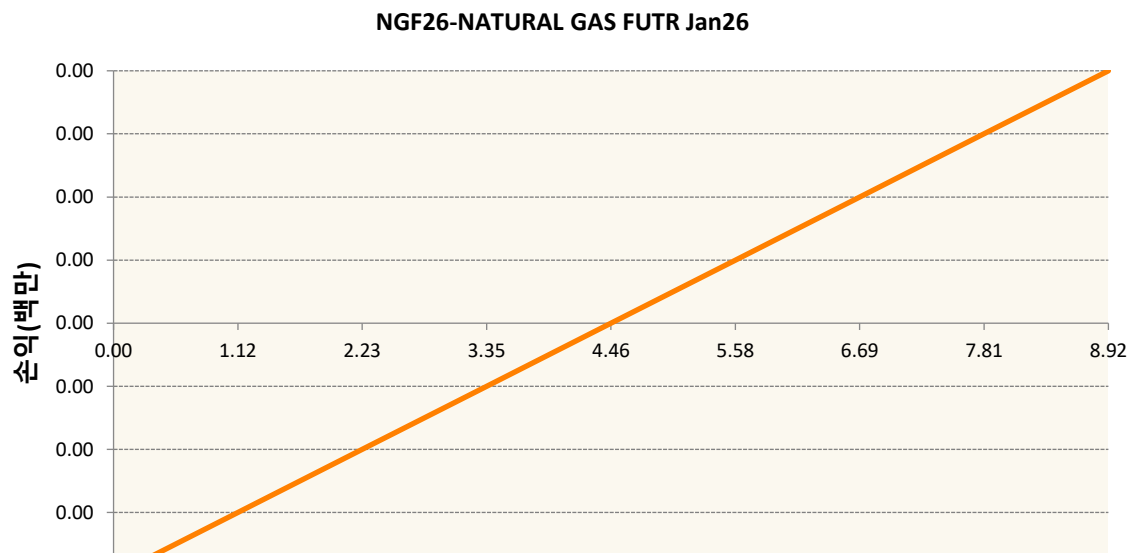
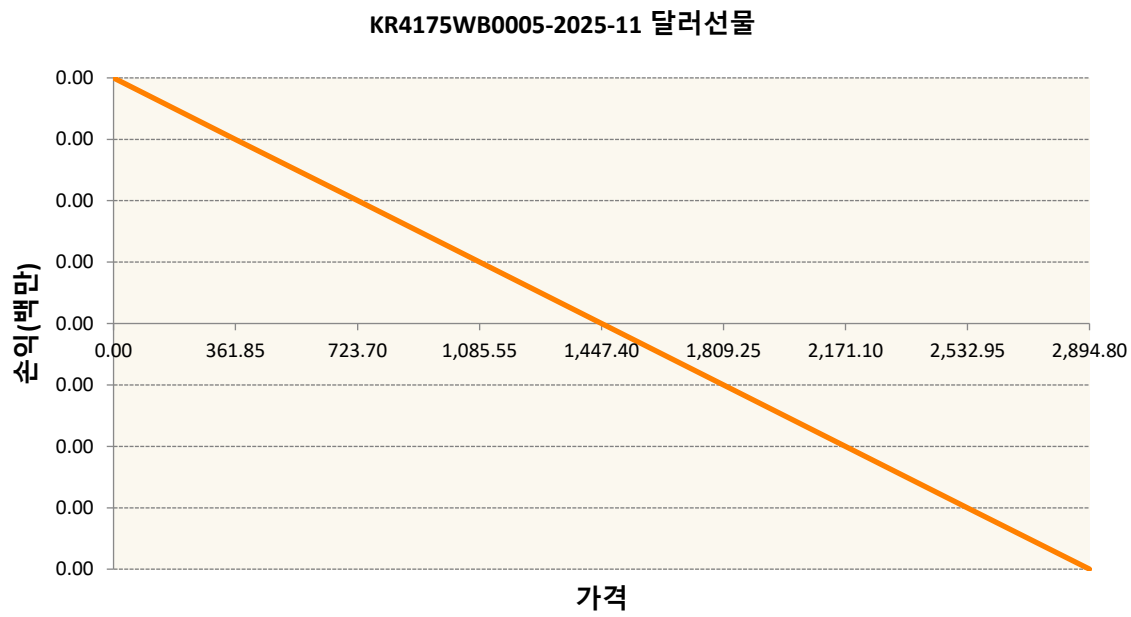
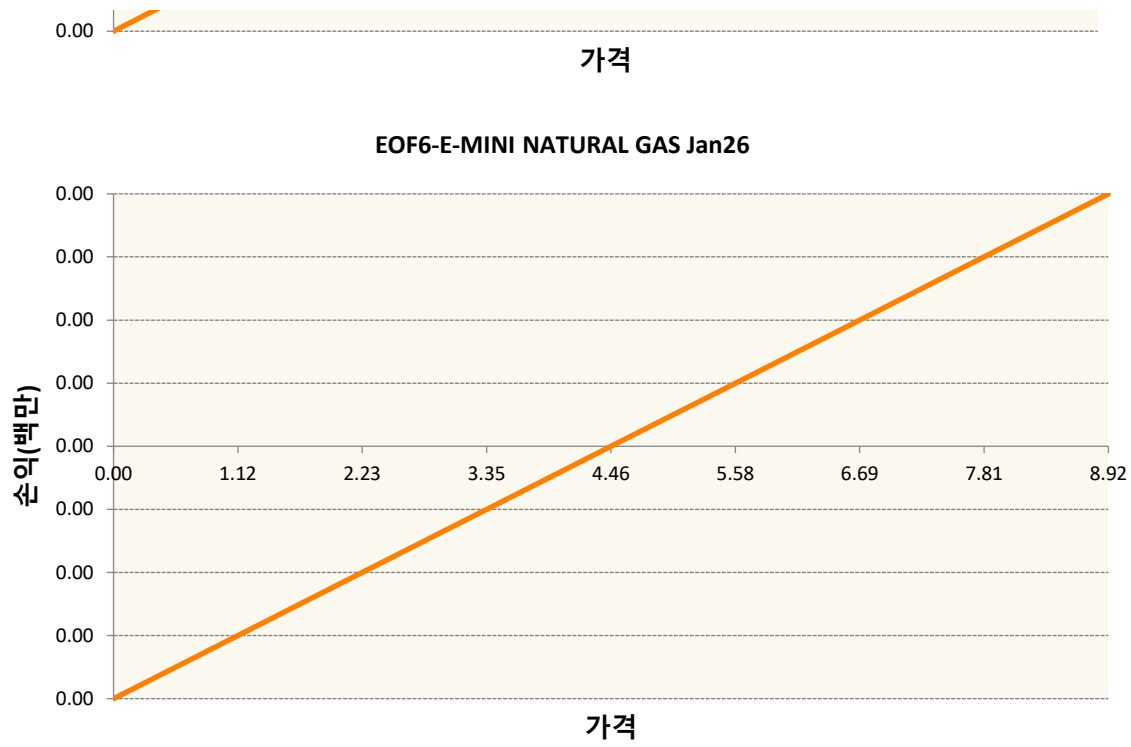
1. 계약금액

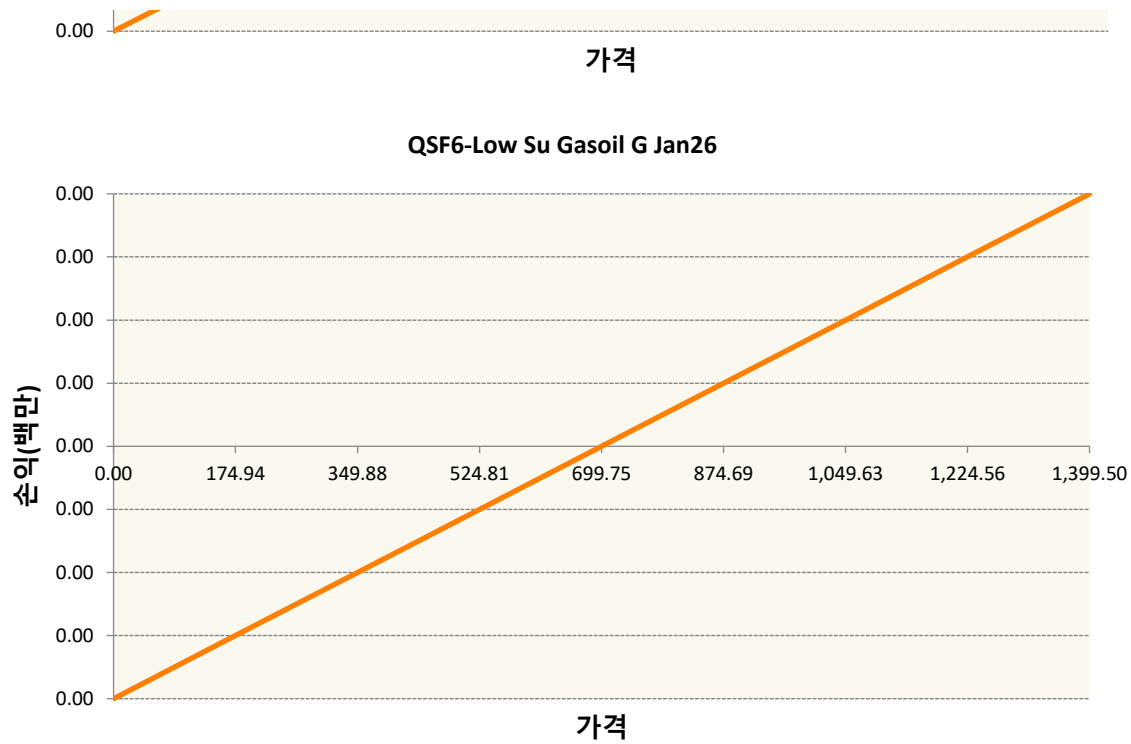
(단위:백만원)

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	359	0	359	
누계	유가증권	선물	176	0	176	
누계	통화	선물	0	116	-116	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		9
NGF26	NATURAL GAS FUTR Jan26	10
QSF6	Low Su Gasoil G Jan26	8

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

(단위:백만원)

93