

공시일 2025-11-12

기준일 2025-11-11

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	2025-11-12
기준일	2025-11-11

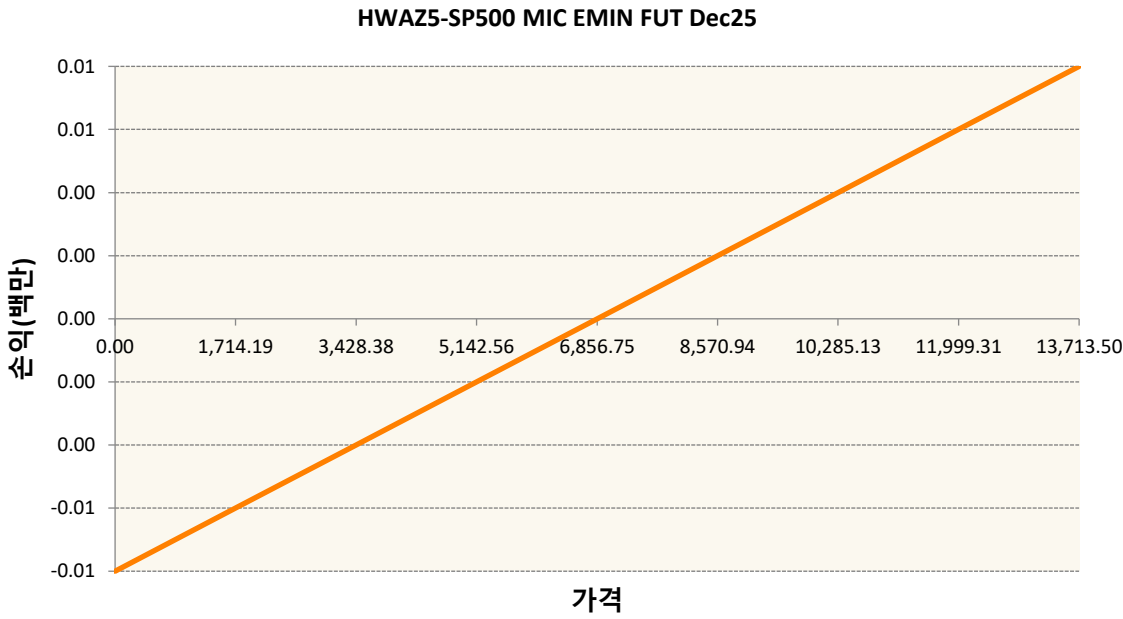
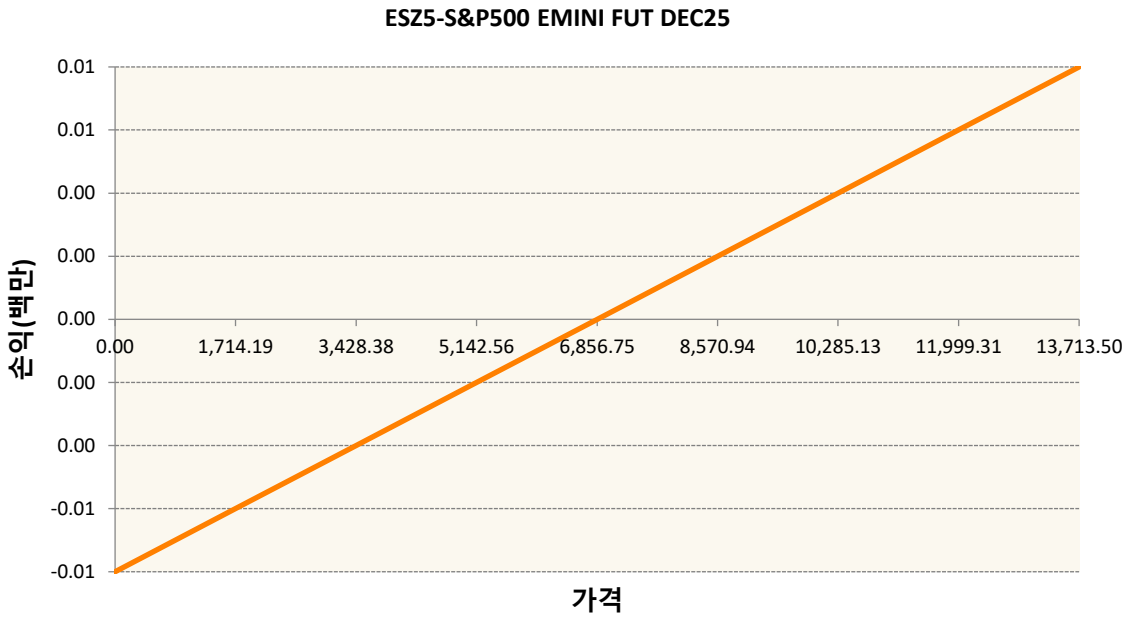
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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)
	68

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

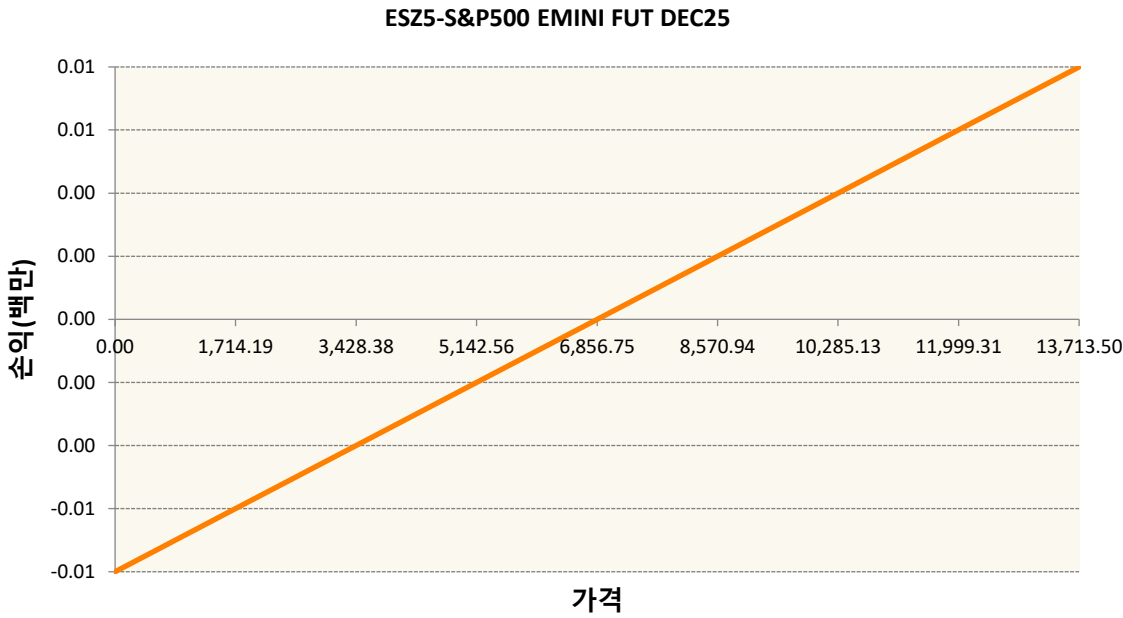
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

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)

165

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

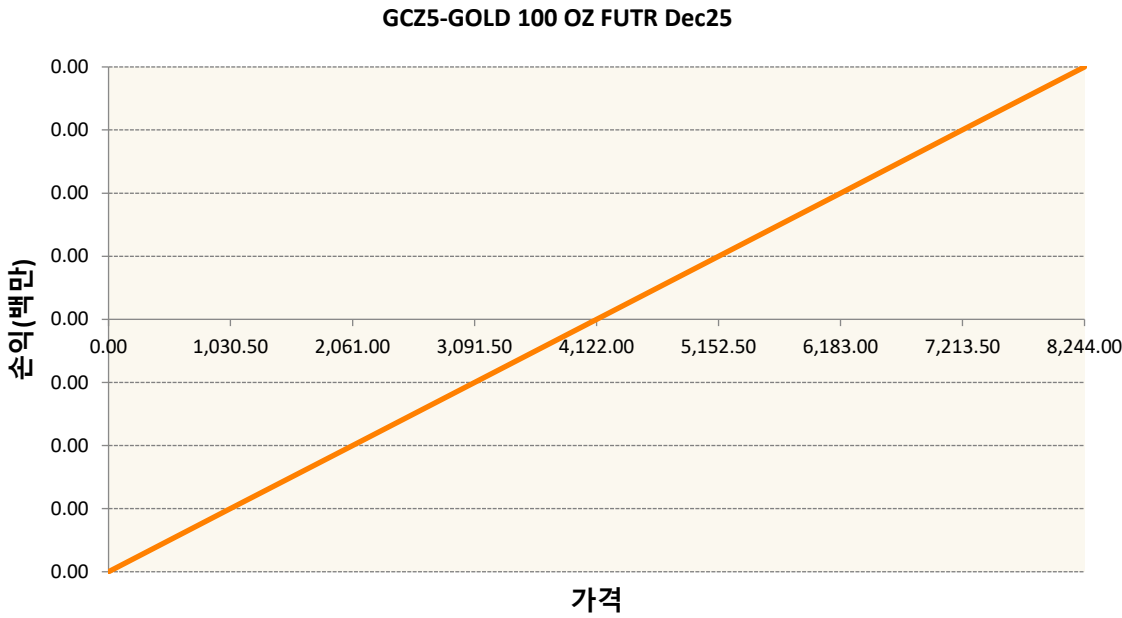
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,901	0	2,901	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 11/14/25 C385 EQUITY	1
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	232

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

(단위:백만원)

219

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

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)

AOPLTRUC0' PLTR US 11/14/25 C185 EQUITY	125
AOPLTRUP0' PLTR US 11/14/25 P185 EQUITY	106

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

(단위:백만원)

946

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

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)

AOTLTUC009TLT US 11/14/25 C91.5 EQUITY

0.33

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

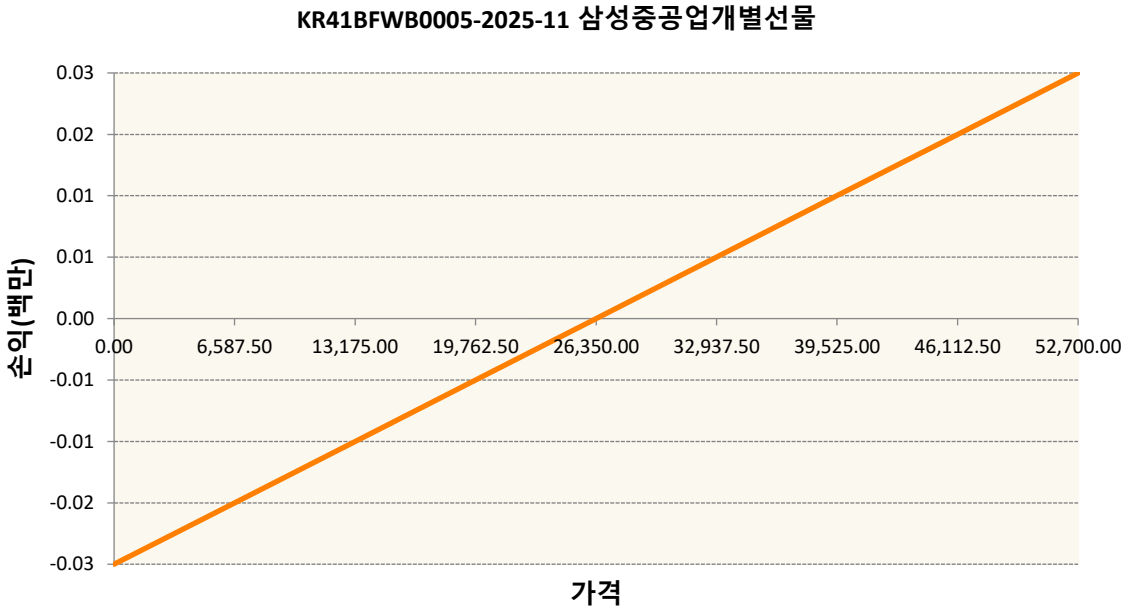
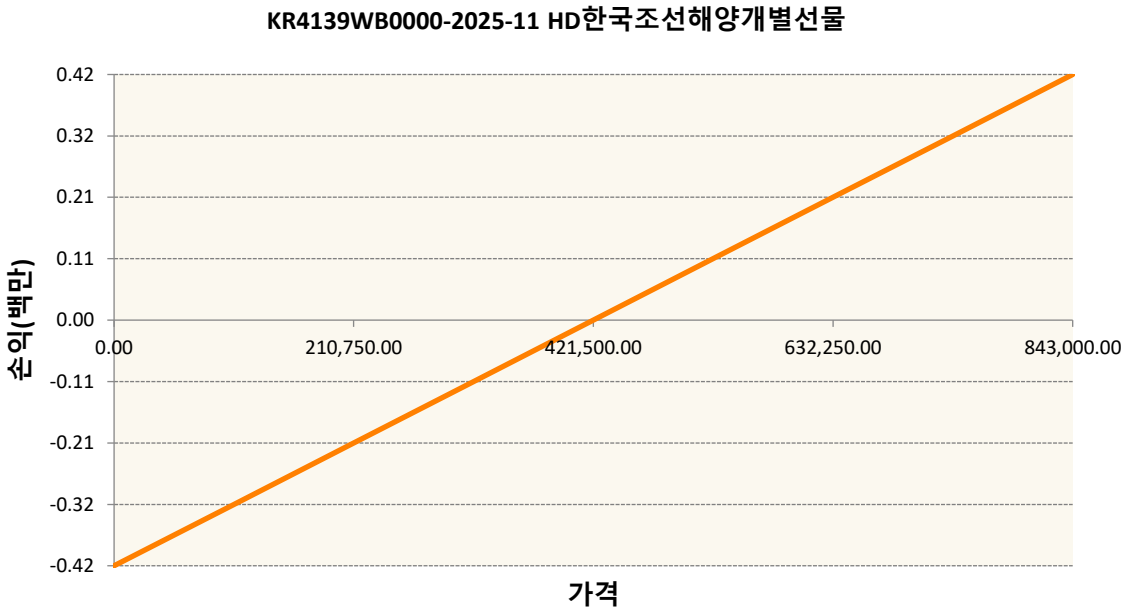
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

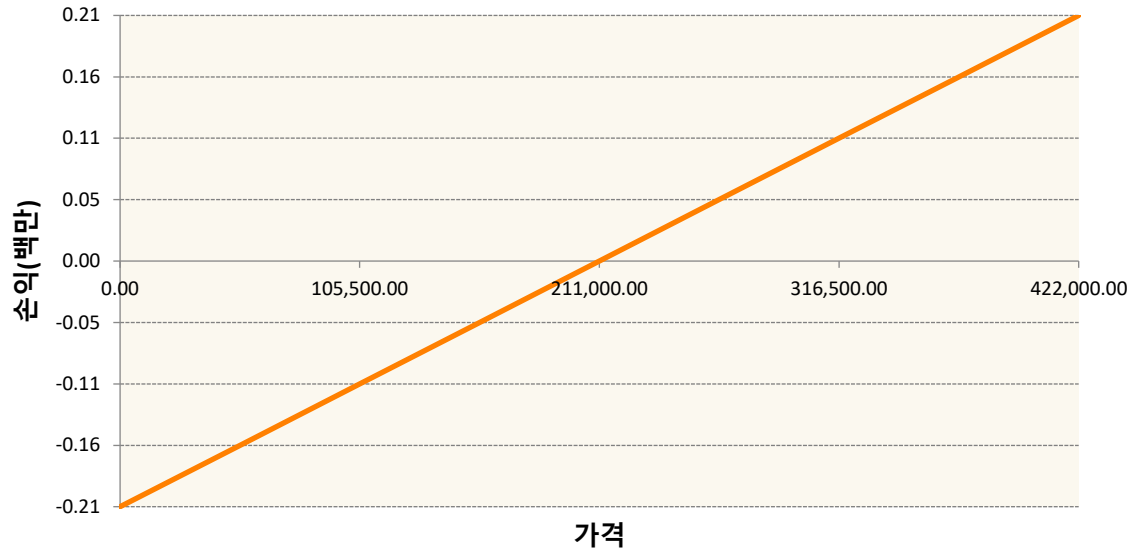
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	668	-668	장내
누계	유가증권	선물	60,966	0	60,966	장내

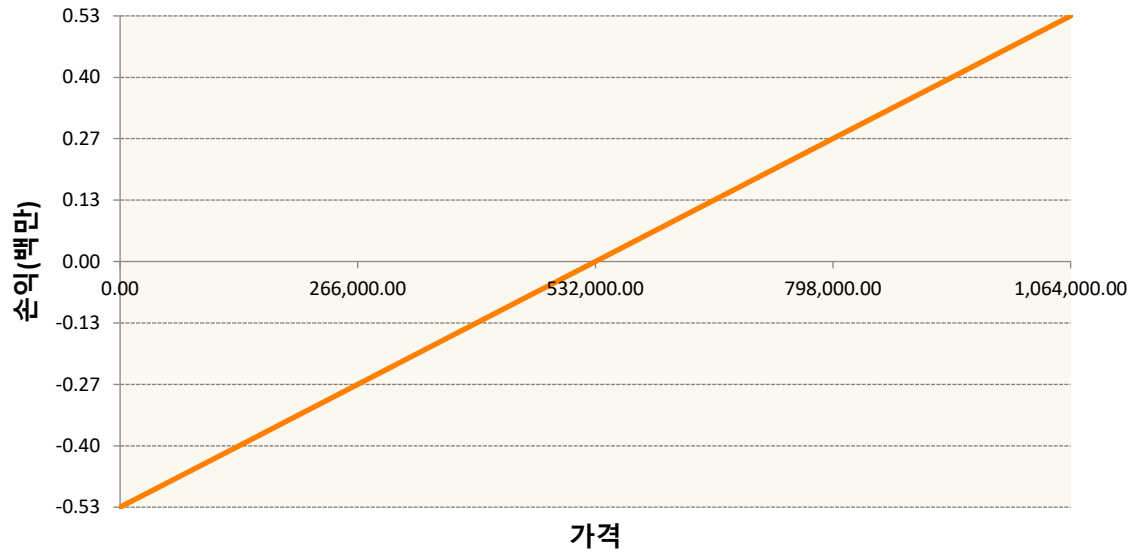
2. 만기시점의 손익구조



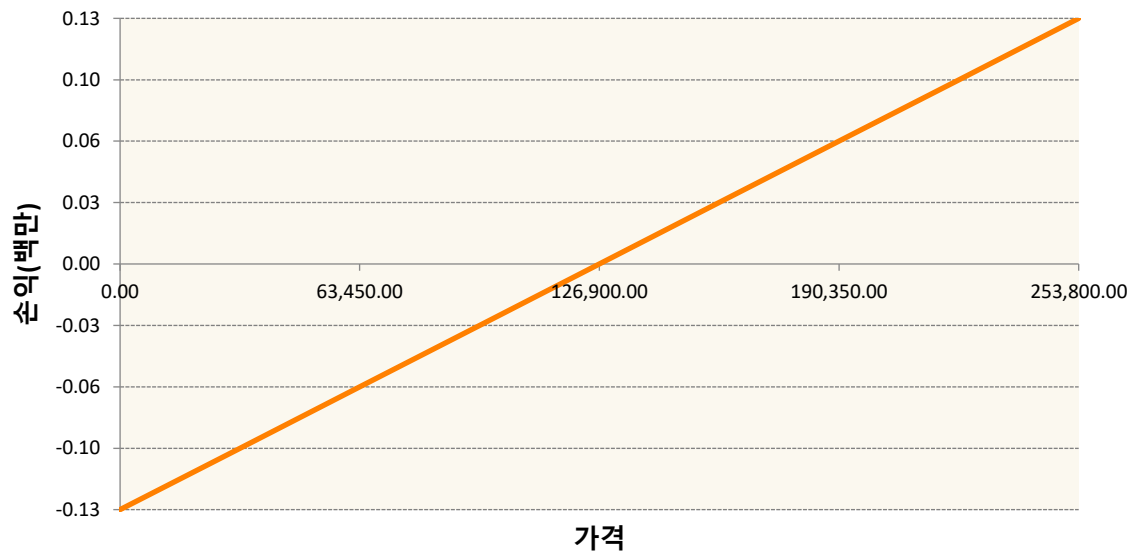
KR41CDWB0006-2025-11 HD현대미포개별선물



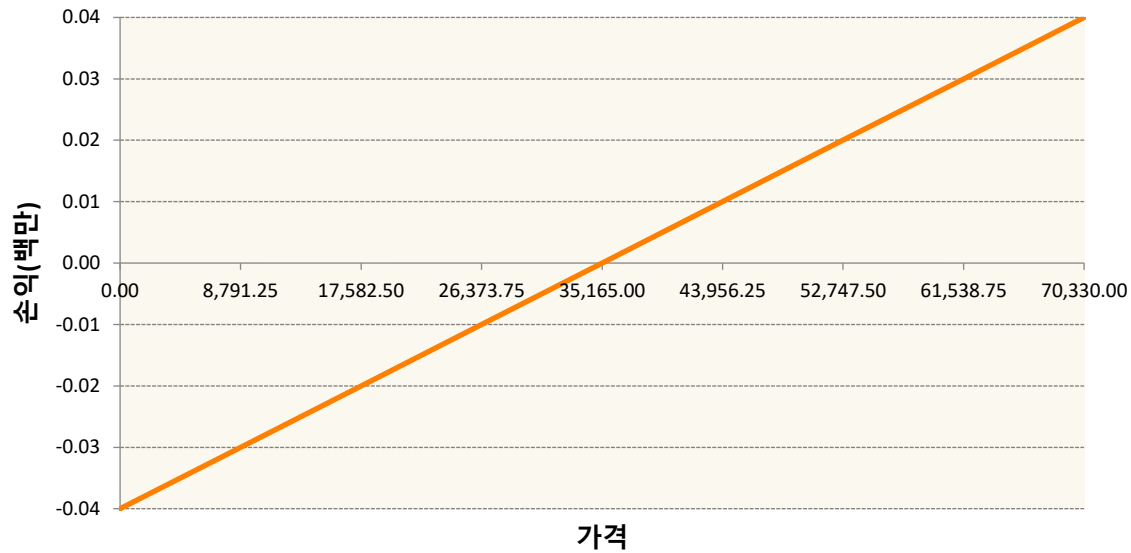
KR41FDWB0003-2025-11 HD현대중공업개별선물



KR41FVWB0001-2025-11 한화오션개별선물



KR41M7WC0000-2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4139WB0000 2025-11 HD한국조선해양개별선물								1,207
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,207	-1,207	-1,207	-1,207	-1,207	-1,207	-1,207	-1,207
-5.33%	-805	-805	-805	-805	-805	-805	-805	-805
-2.67%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	402	402	402	402	402	402	402	402
5.33%	805	805	805	805	805	805	805	805
8.00%	1,207	1,207	1,207	1,207	1,207	1,207	1,207	1,207
KR41BFWB0005 2025-11 삼성중공업개별선물								1,308
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,308	-1,308	-1,308	-1,308	-1,308	-1,308	-1,308	-1,308
-5.33%	-872	-872	-872	-872	-872	-872	-872	-872
-2.67%	-436	-436	-436	-436	-436	-436	-436	-436
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	436	436	436	436	436	436	436	436
5.33%	872	872	872	872	872	872	872	872
8.00%	1,308	1,308	1,308	1,308	1,308	1,308	1,308	1,308
KR41CDWB0006 2025-11 HD현대미포개별선물								475
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
-5.33%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-2.67%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	158	158	158	158	158	158	158
5.33%	317	317	317	317	317	317	317
8.00%	475	475	475	475	475	475	475
KR41FDWB0003 2025-11 HD현대중공업개별선물							633
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-633	-633	-633	-633	-633	-633	-633
-5.33%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	422	422	422	422	422	422	422
8.00%	633	633	633	633	633	633	633
KR41FVWB0001 2025-11 한화오션개별선물							1,031
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031	-1,031
-5.33%	-687	-687	-687	-687	-687	-687	-687
-2.67%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	344	344	344	344	344	344	344
5.33%	687	687	687	687	687	687	687
8.00%	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031	1,031
KR41M7WC0000 2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물							2,133
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,133	-2,133	-2,133	-2,133	-2,133	-2,133	-2,133
-5.33%	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422	-1,422
-2.67%	-711	-711	-711	-711	-711	-711	-711
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	711	711	711	711	711	711	711
5.33%	1,422	1,422	1,422	1,422	1,422	1,422	1,422
8.00%	2,133	2,133	2,133	2,133	2,133	2,133	2,133

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

(단위:백만원)

6,709

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

포커스채권(채권-파생형)(종)

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	2025-11-12
기준일	2025-11-11

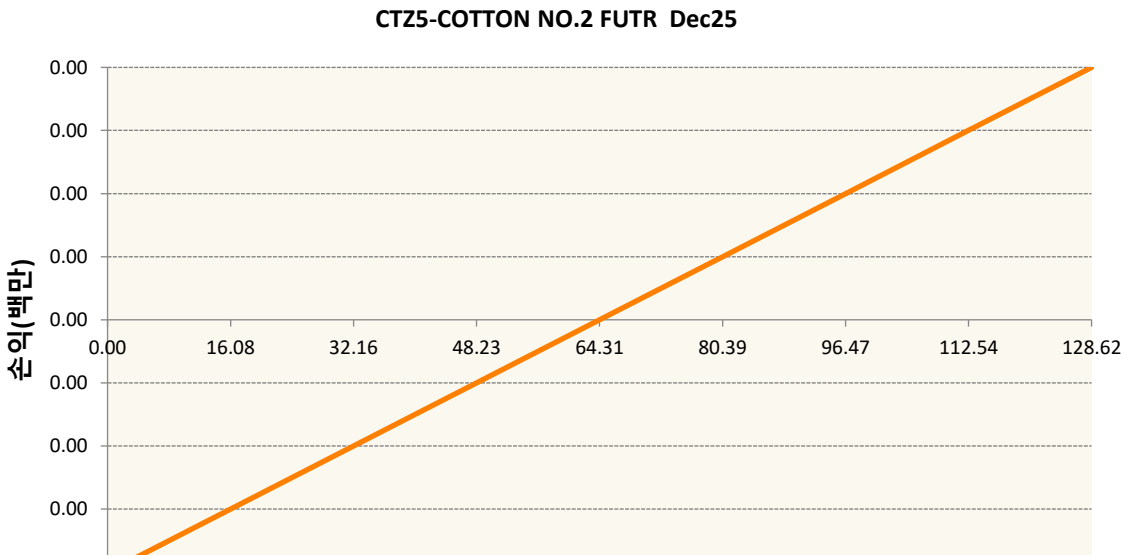
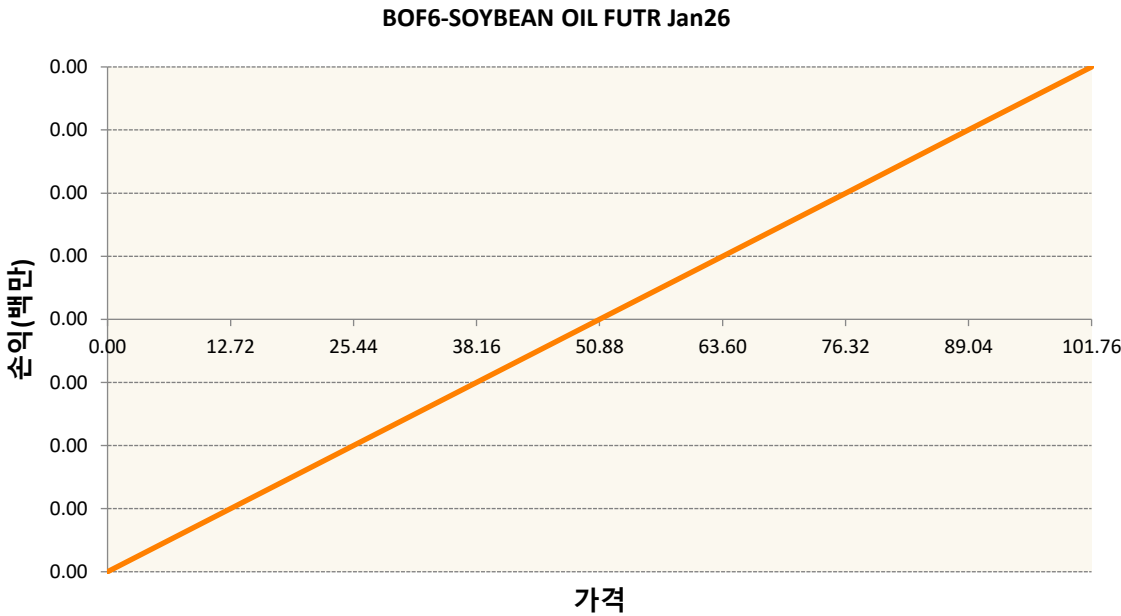
포커스농산물모(채권-파생형)

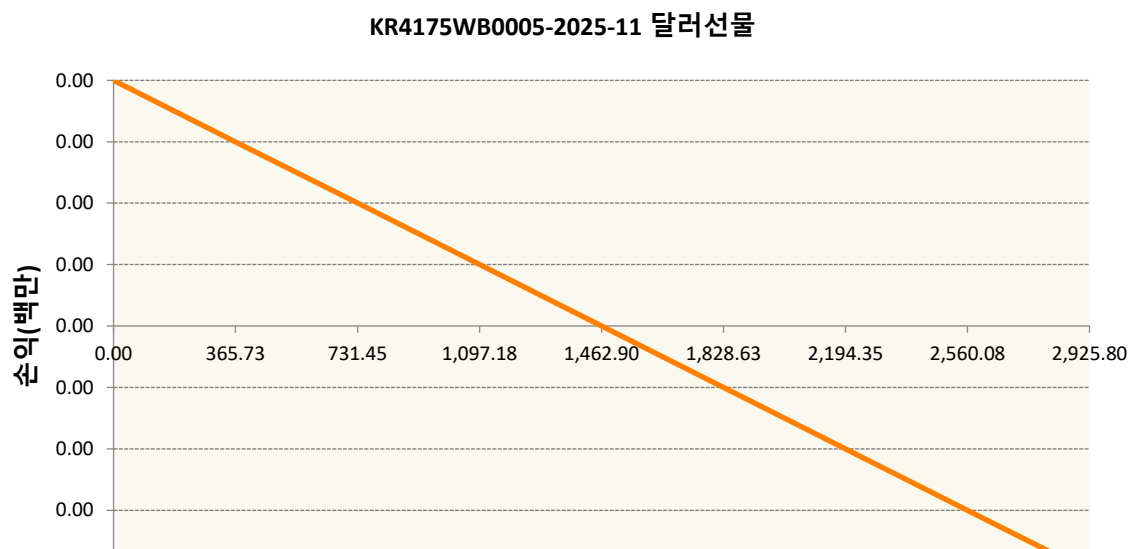
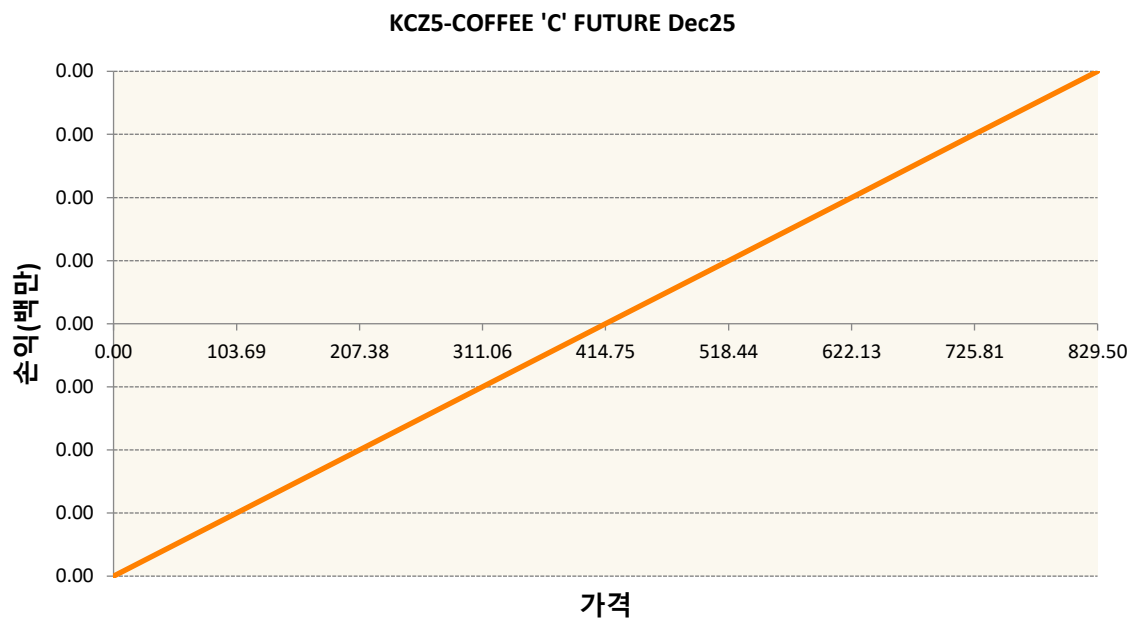
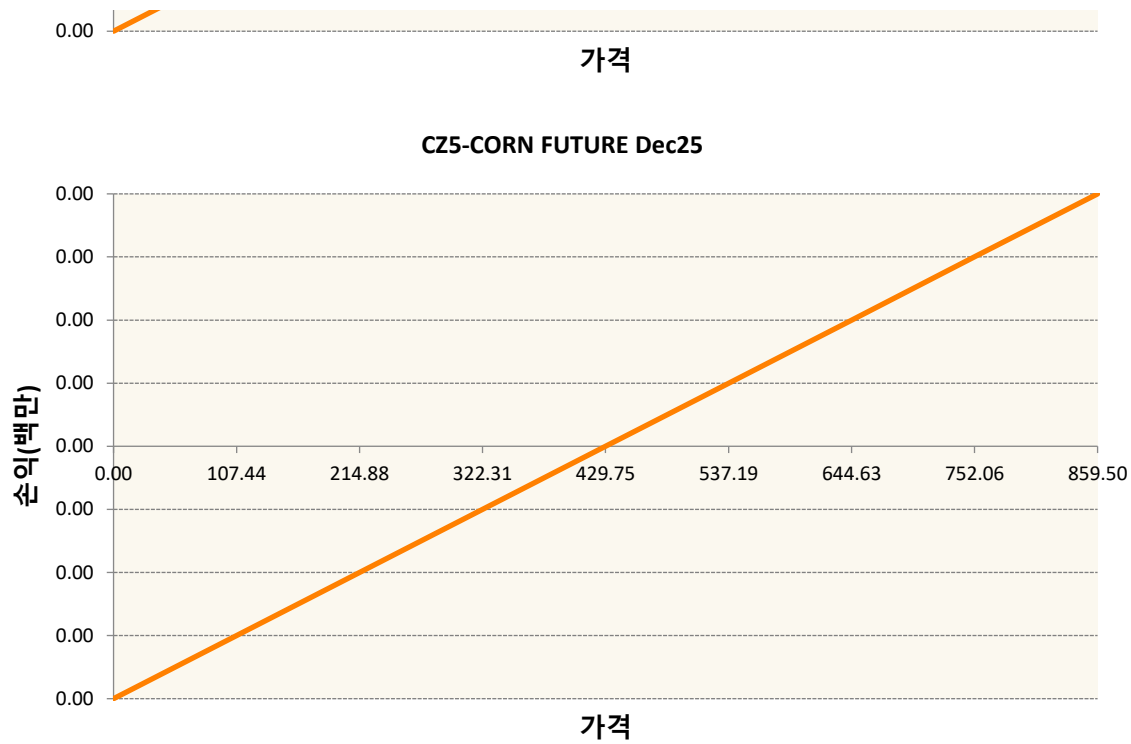
1. 계약금액

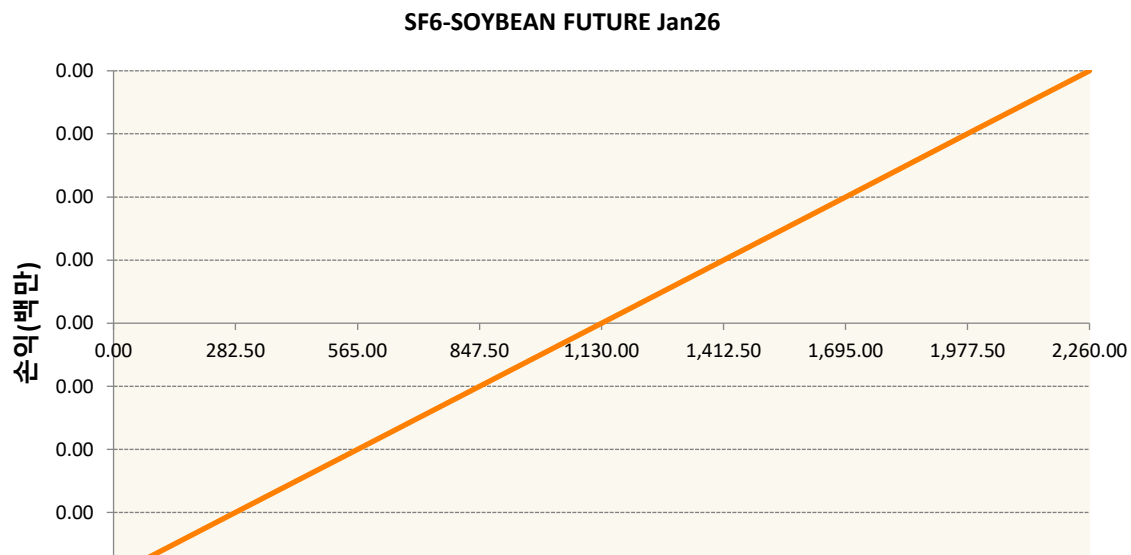
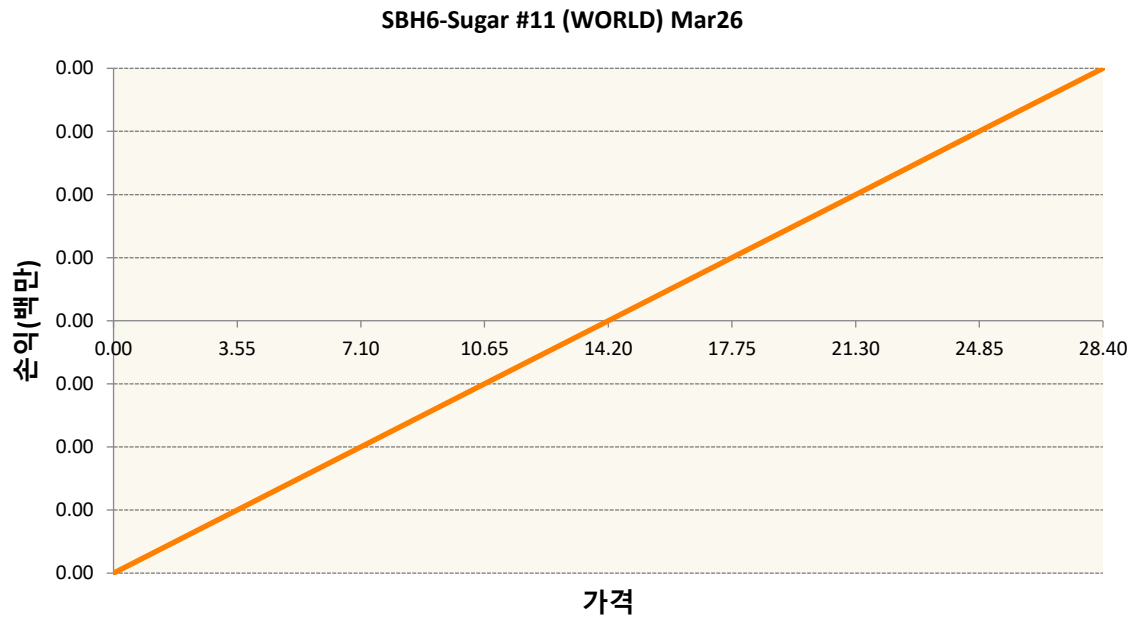
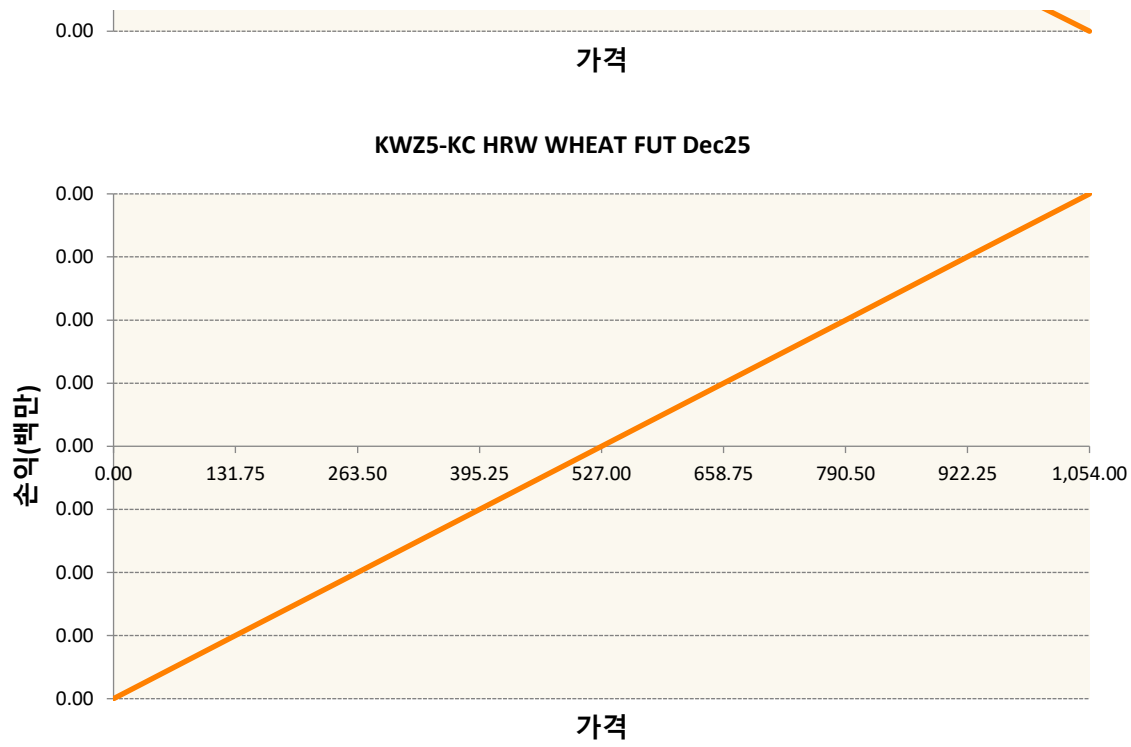
(단위:USD 백만)

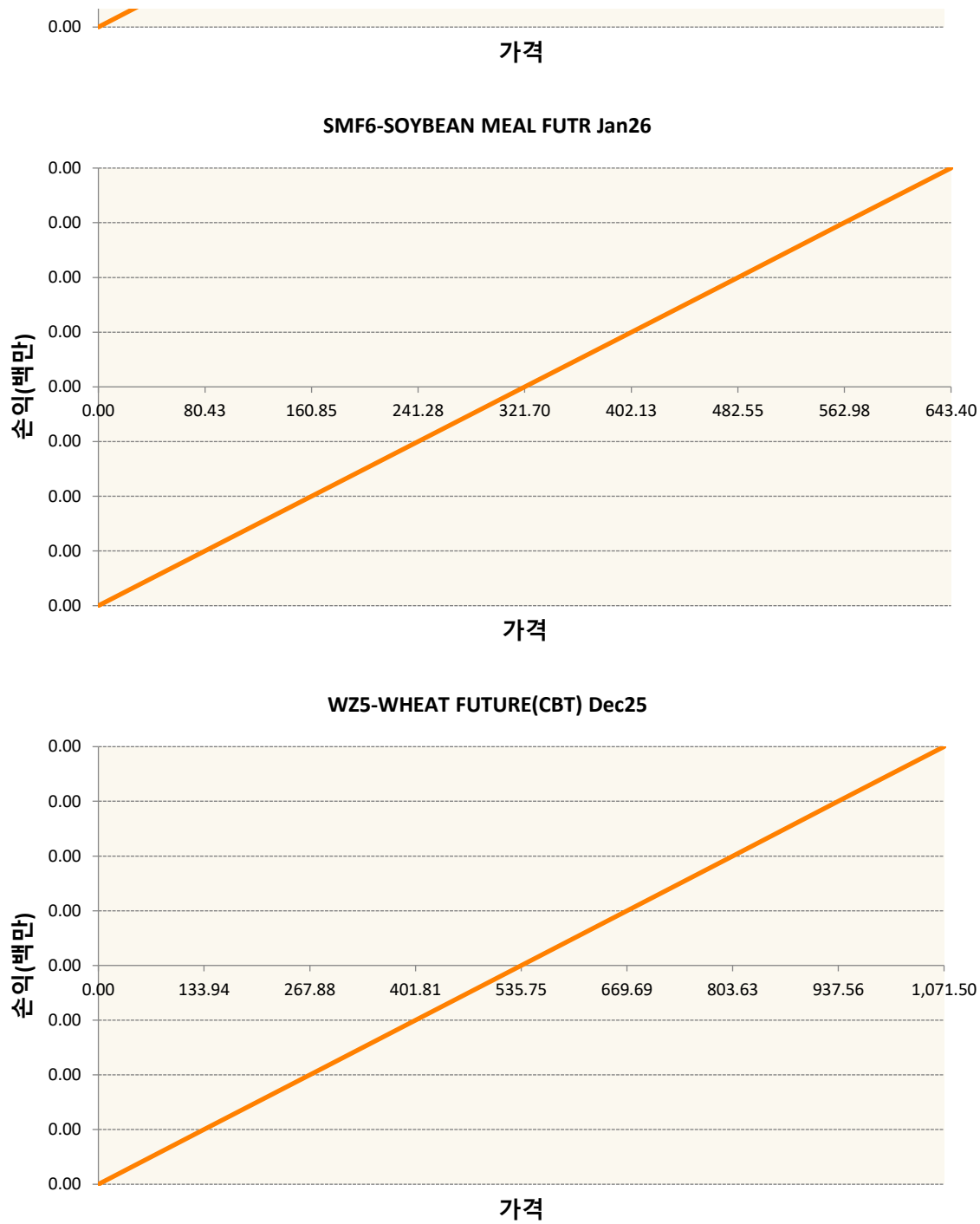
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,159	0	1,159	
누계	유가증권	선물	2,117	0	2,117	
누계	통화	선물	0	439	-439	장내

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	2025-11-12
기준일	2025-11-11

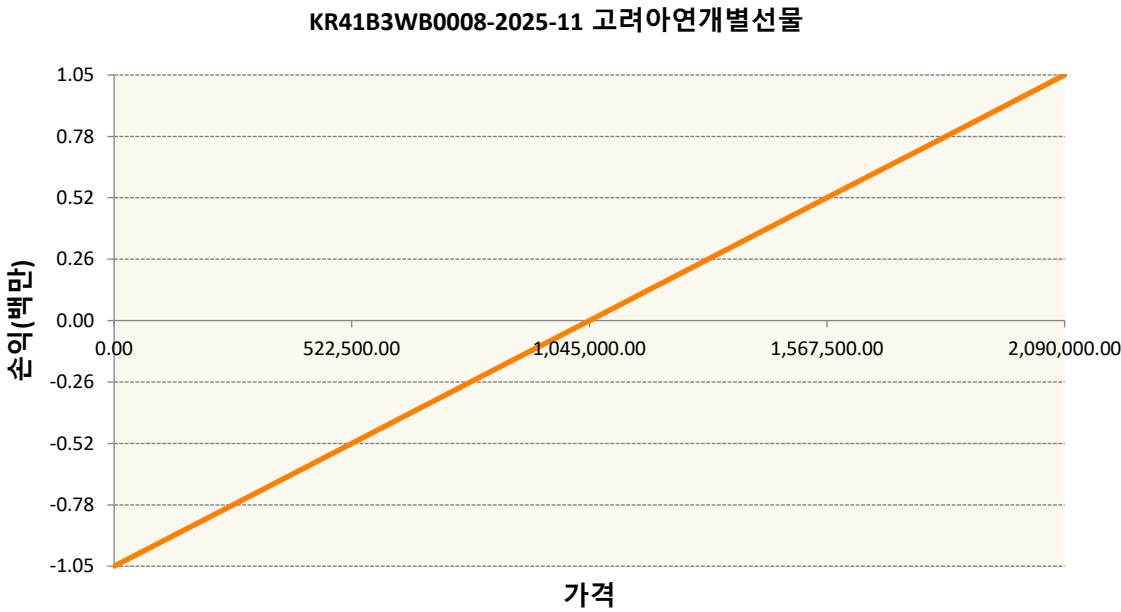
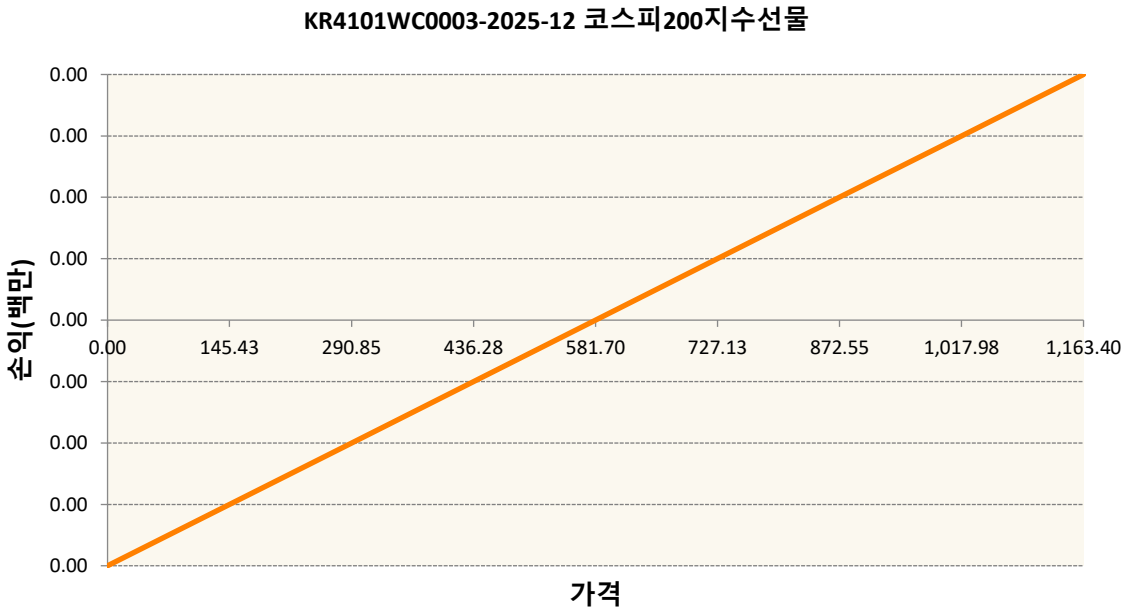
스마트인덱스모

1. 계약금액

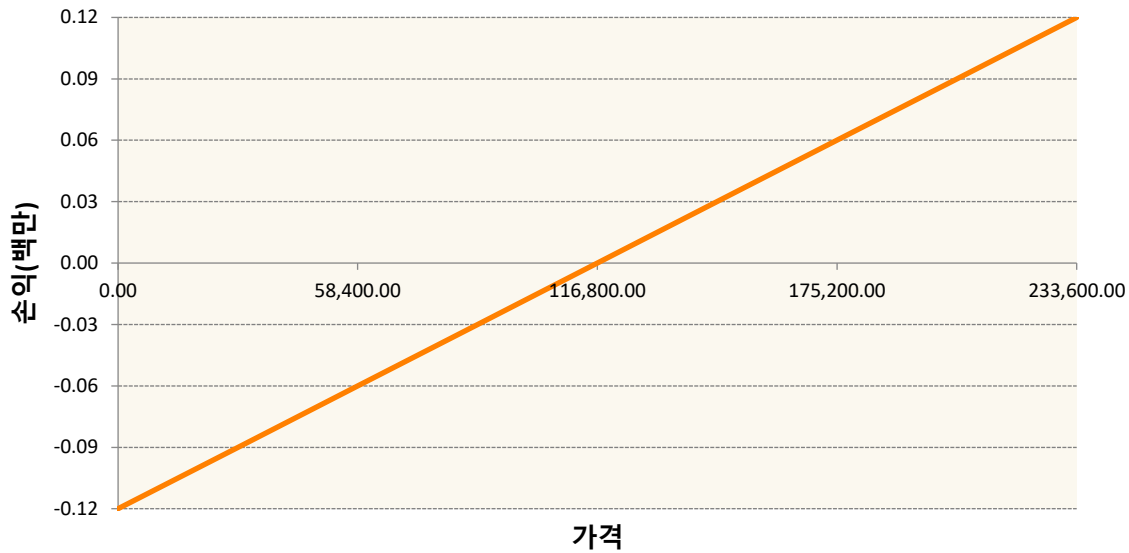
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	295	0	295	장내
누계	유가증권	선물	1,451	0	1,451	장내

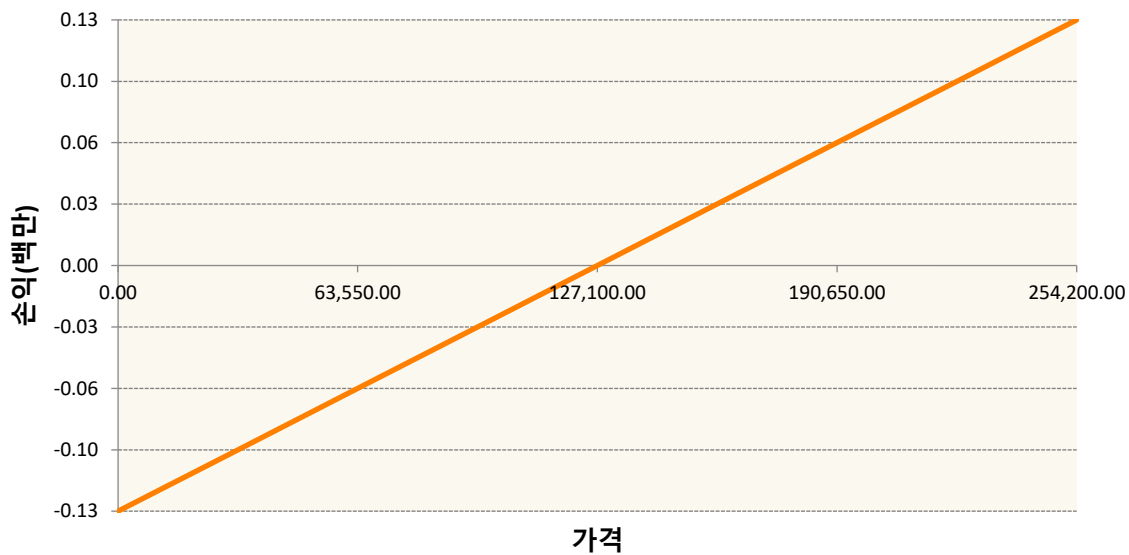
2. 만기시점의 손익구조



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	105
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물	6
KR41EJWB0(2025-11 SKC개별선물	2
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물	3

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

(단위:백만원)

43

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

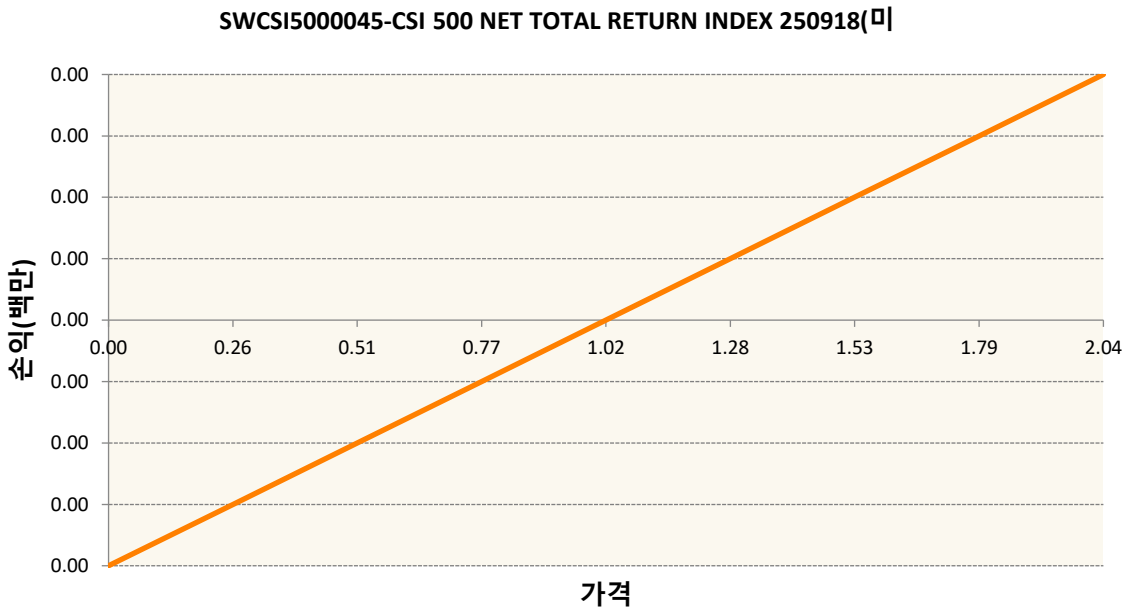
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

385

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

493

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

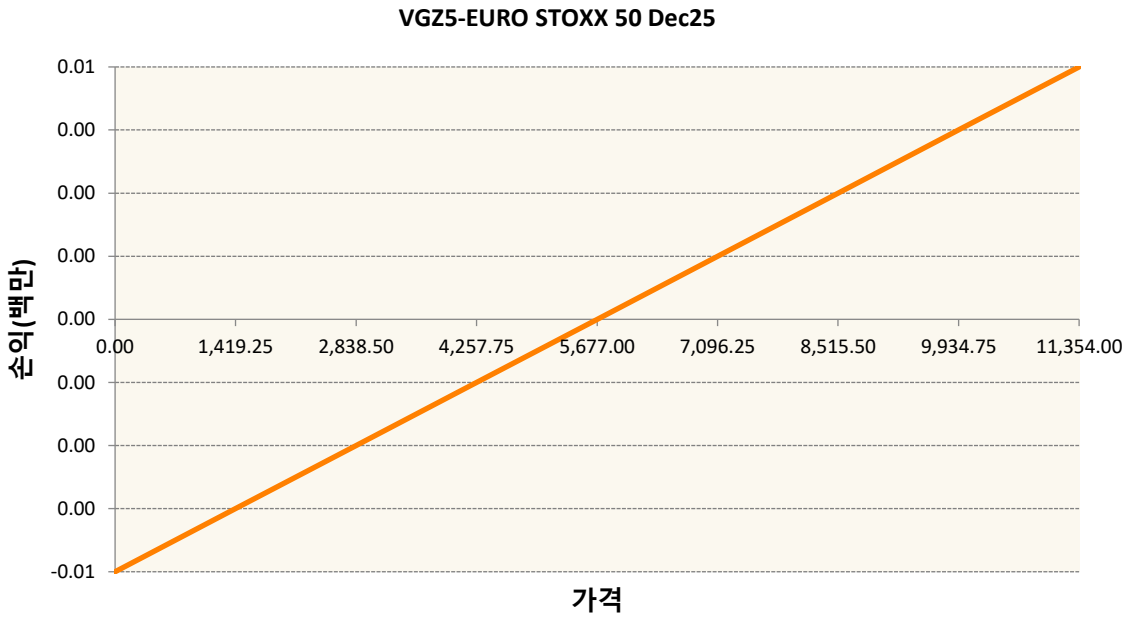
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2025-11-12
기준일	2025-11-11

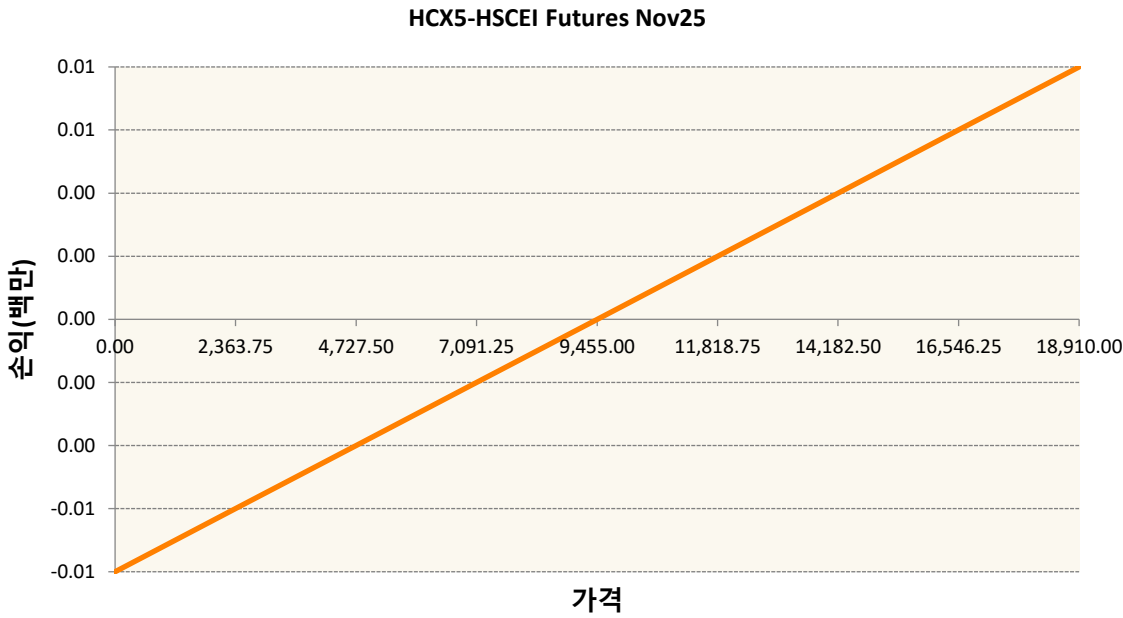
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,091	0	2,091	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX5	HSCEI Futures Nov25	167
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

237

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

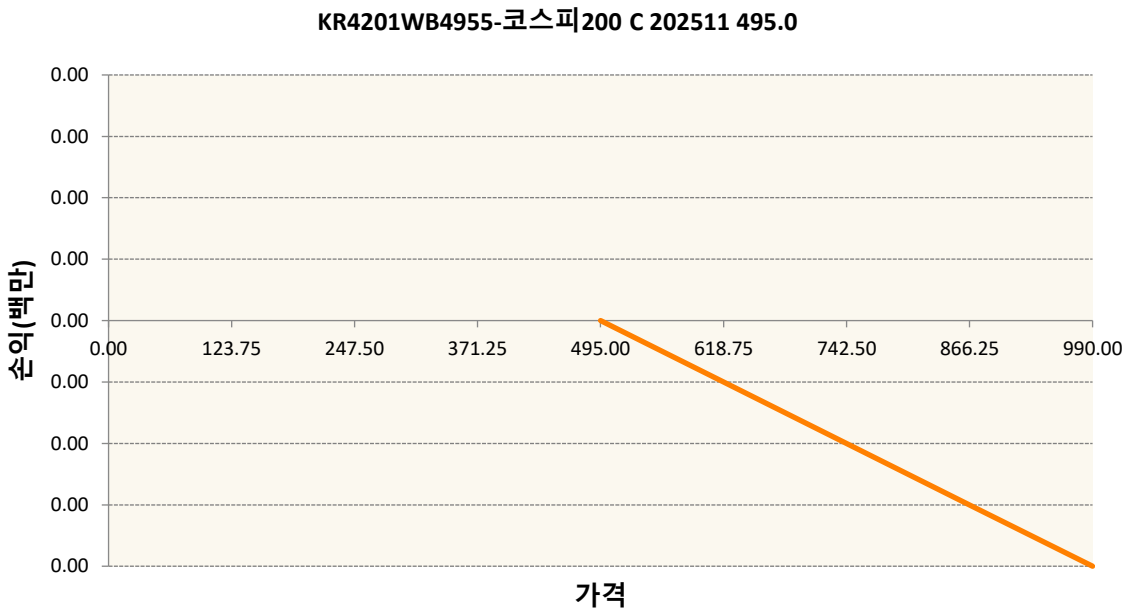
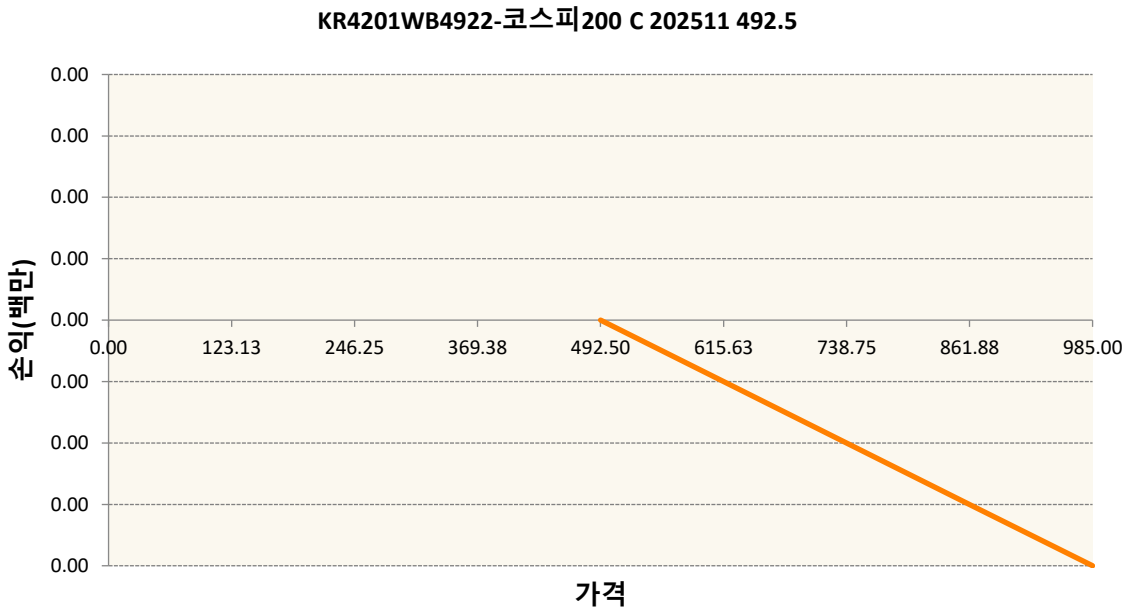
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

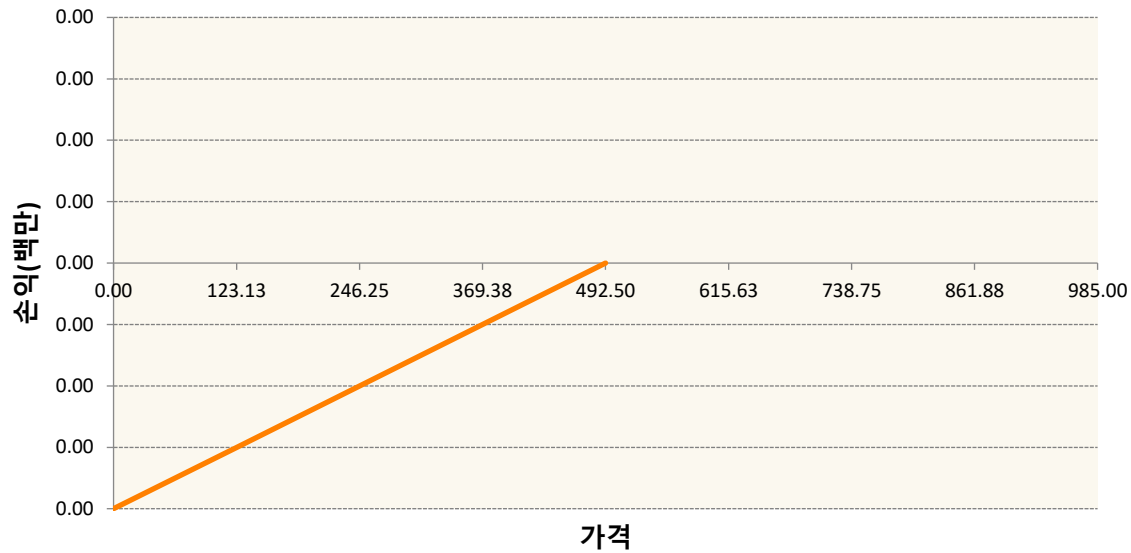
(단위:백만원)

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)

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 2025-11-12

기준일 2025-11-11

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	2025-11-12
기준일	2025-11-11

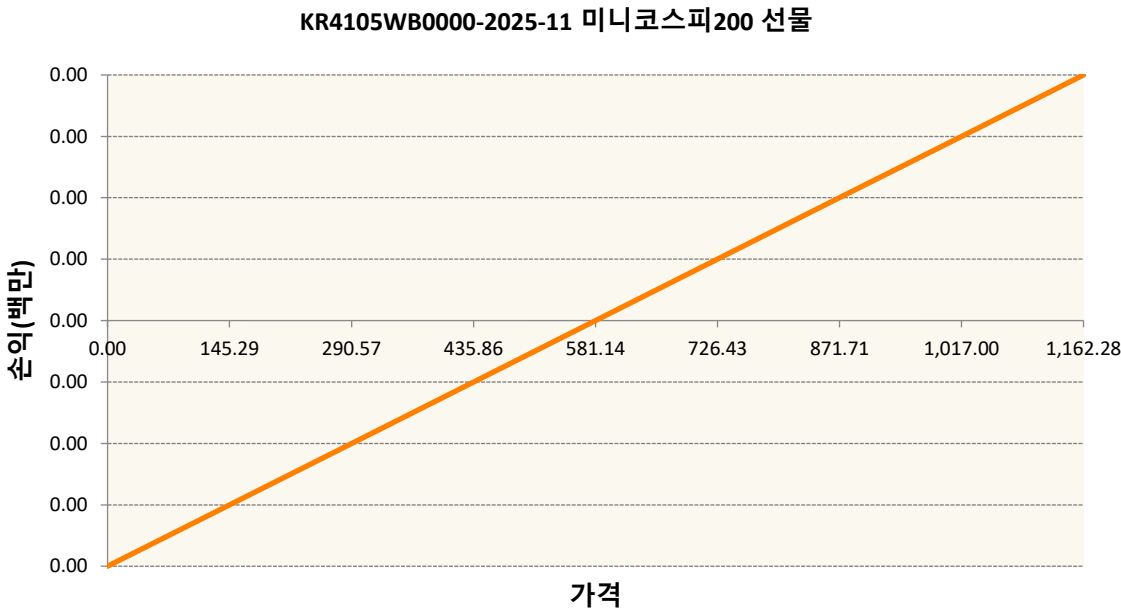
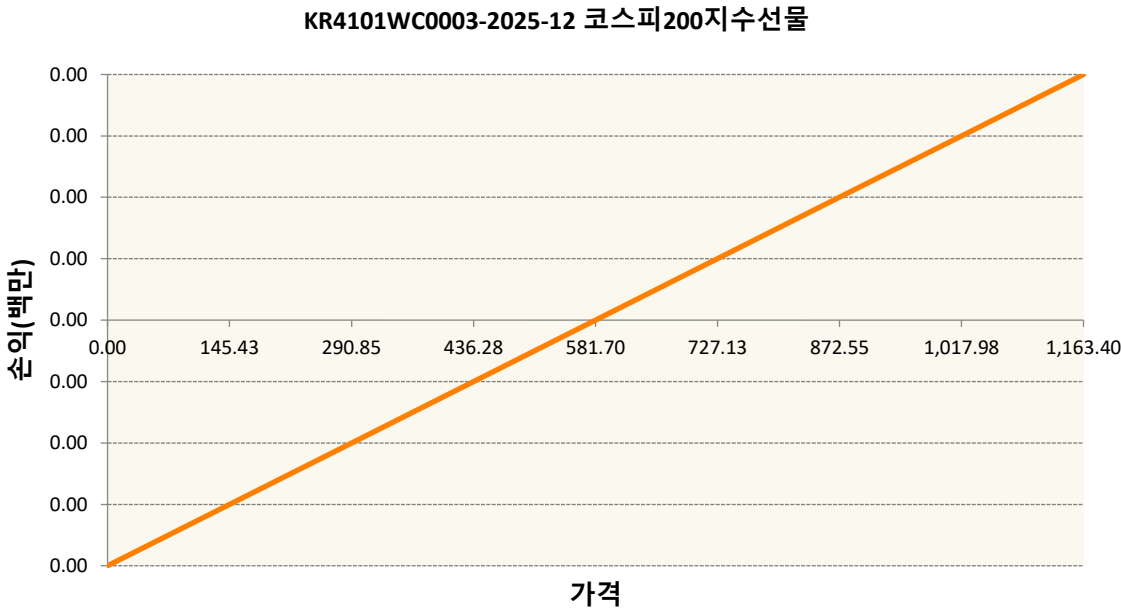
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

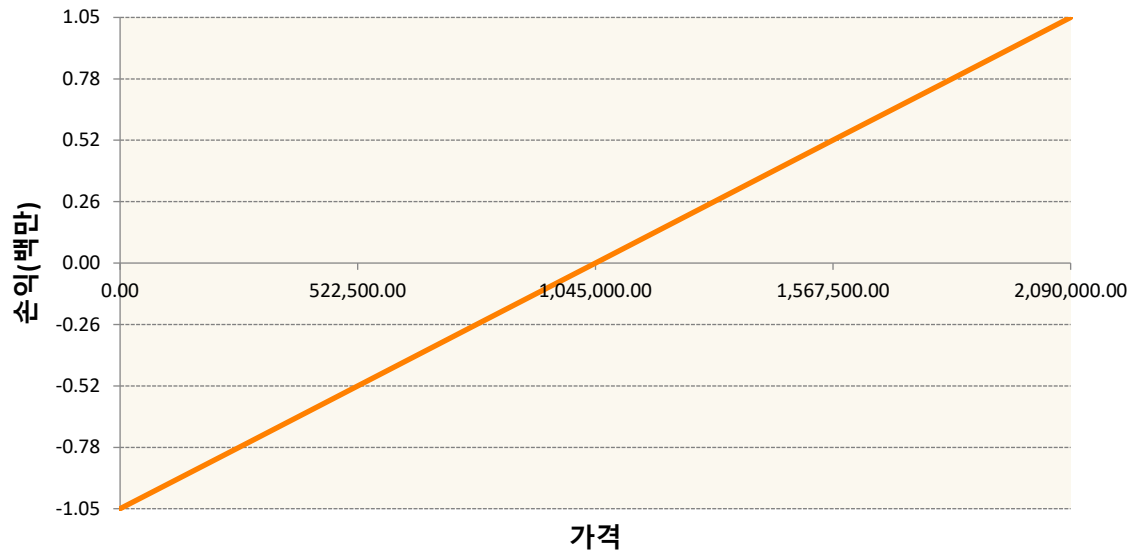
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	788	0	788	장내

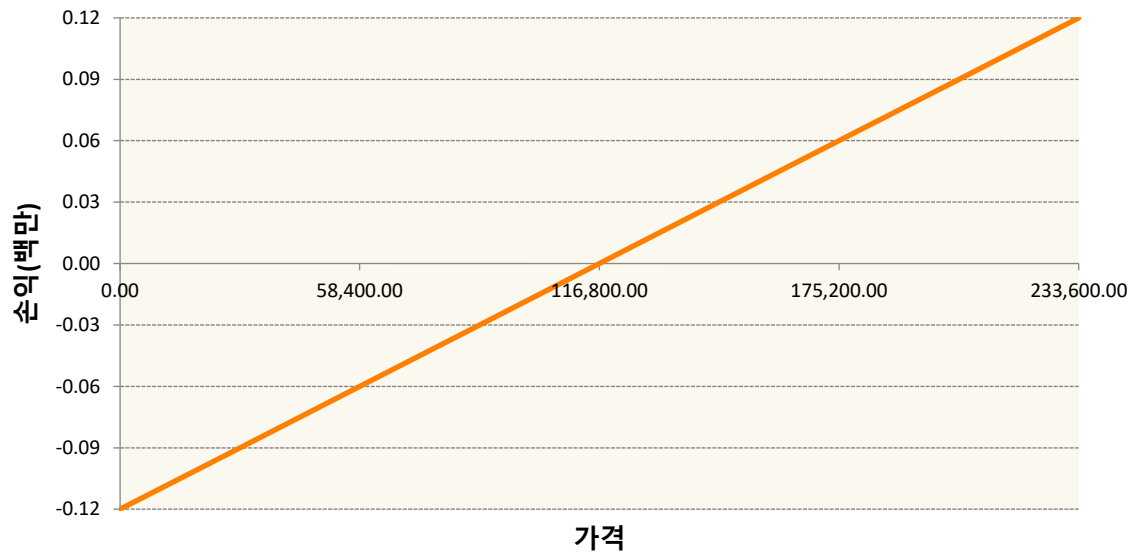
2. 만기시점의 손익구조



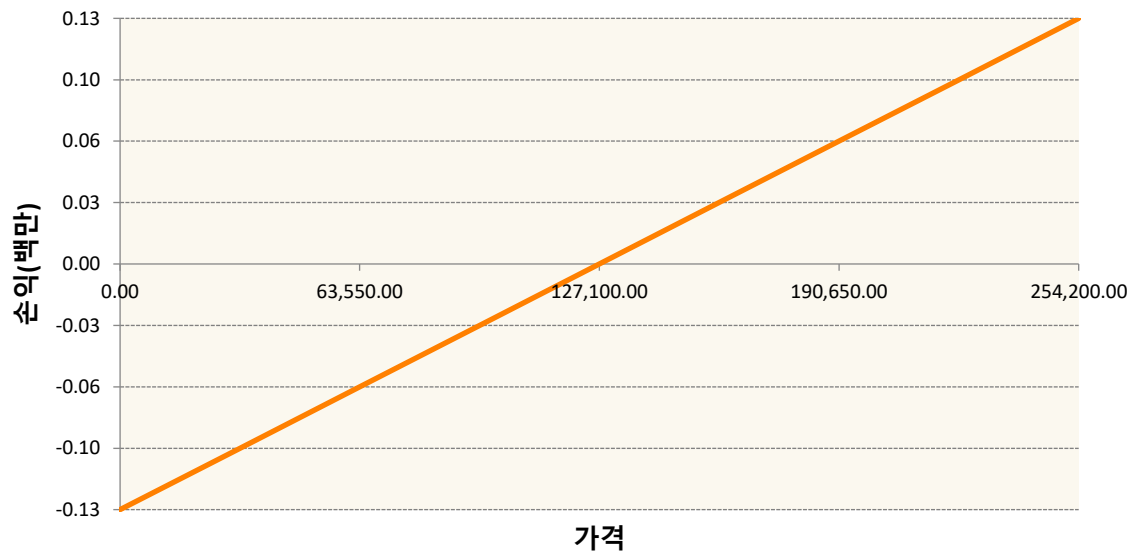
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물		35
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	2025-11-12
기준일	2025-11-11

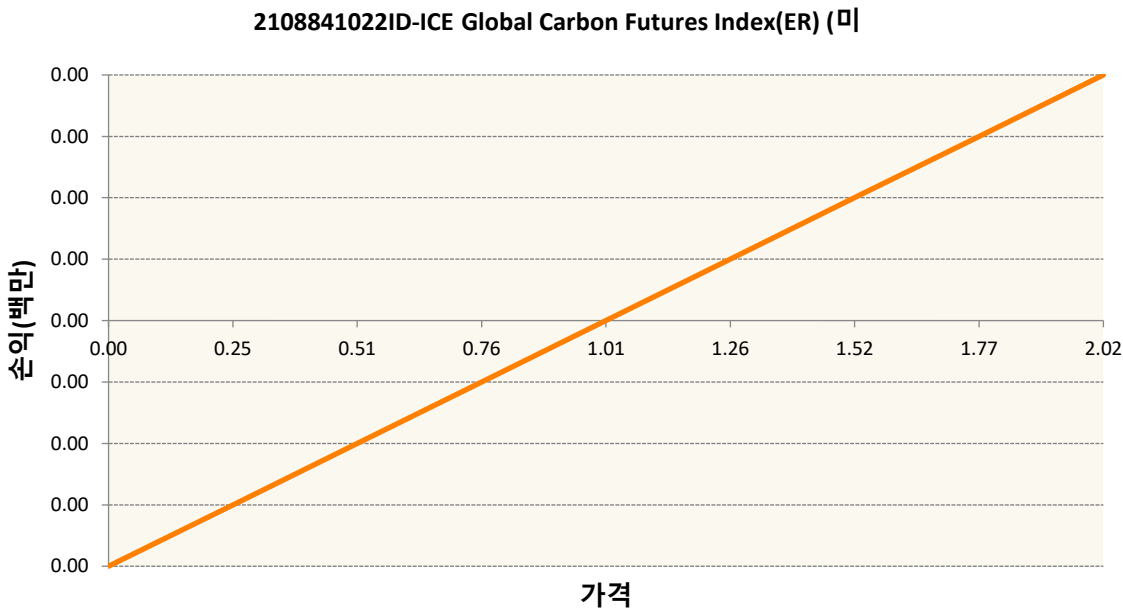
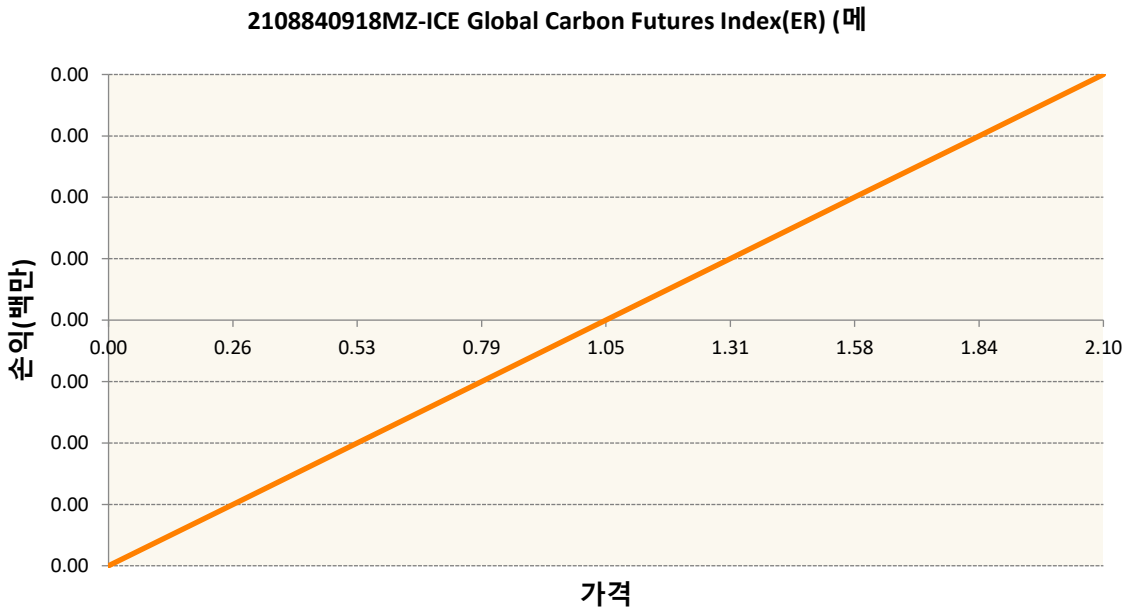
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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		115
2108841022IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		567

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

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

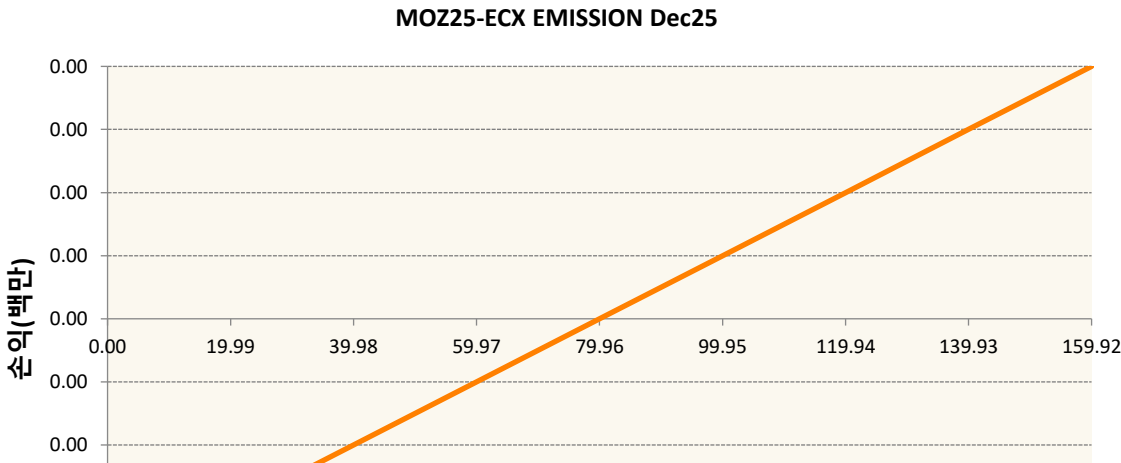
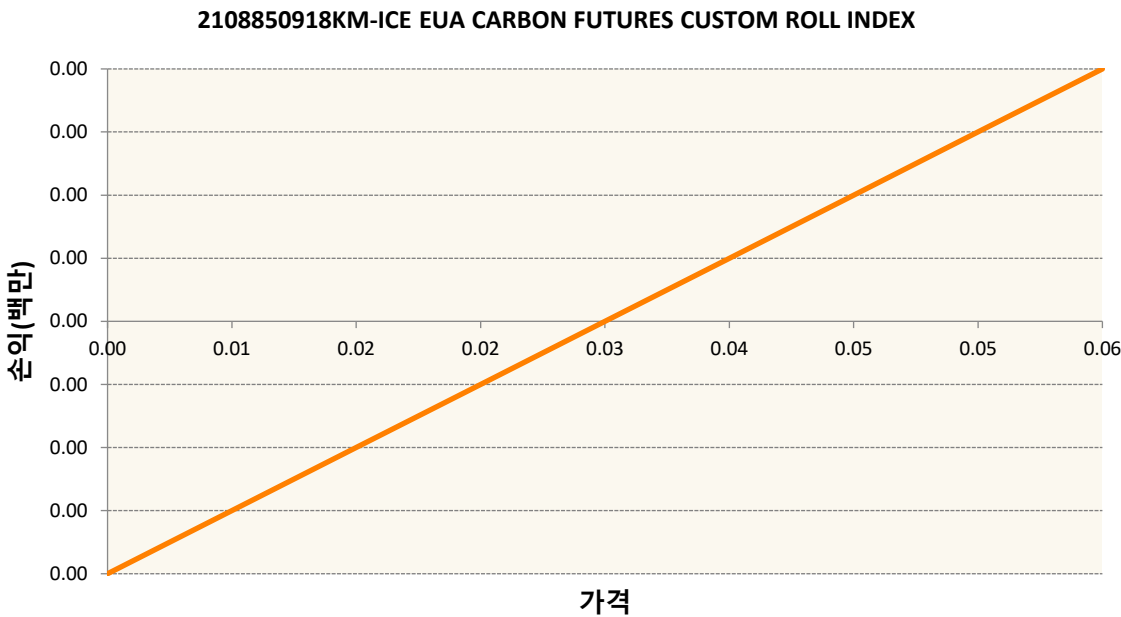
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

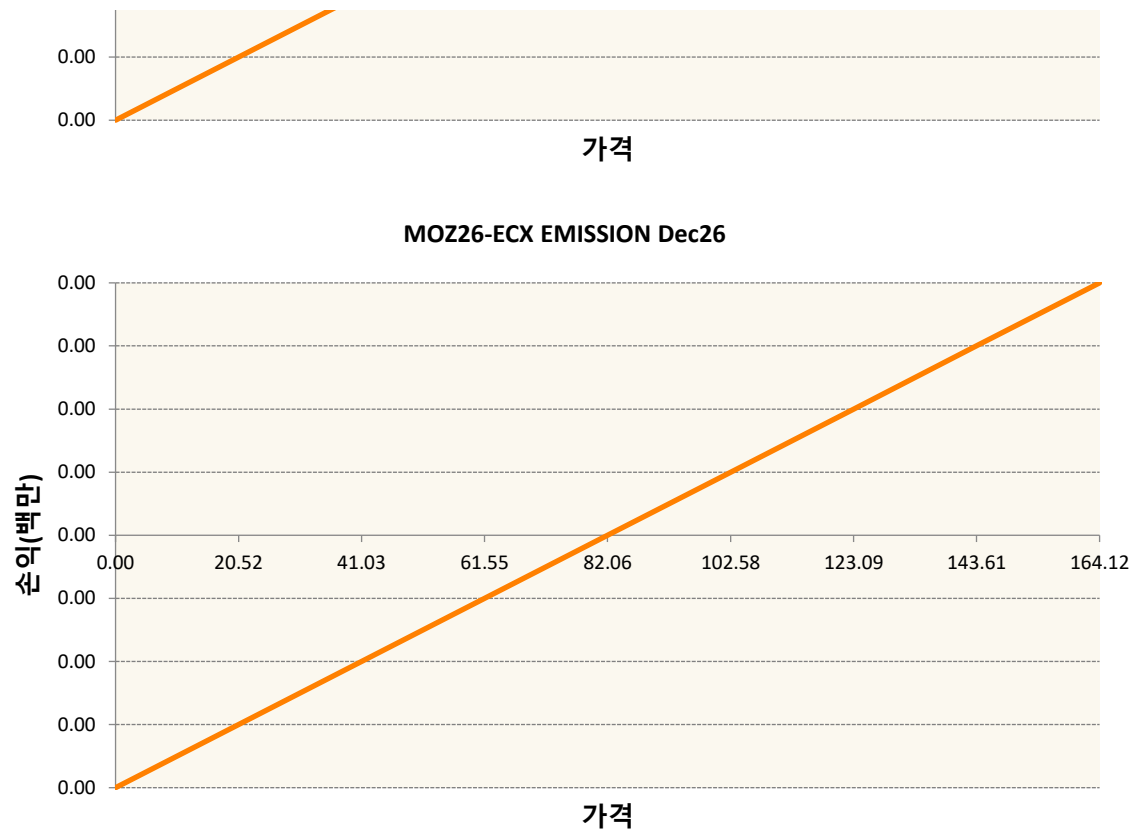
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			2,764	0	2,764	
누계	유가증권	선물	3,372	0	3,372	
누계	지수	스왑	12	0	12	장외
누계	통화	선도	0	2,536	-2,536	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		1
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E		203
MOZ25 ECX EMISSION Dec25		270
MOZ26 ECX EMISSION Dec26		221

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	783

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

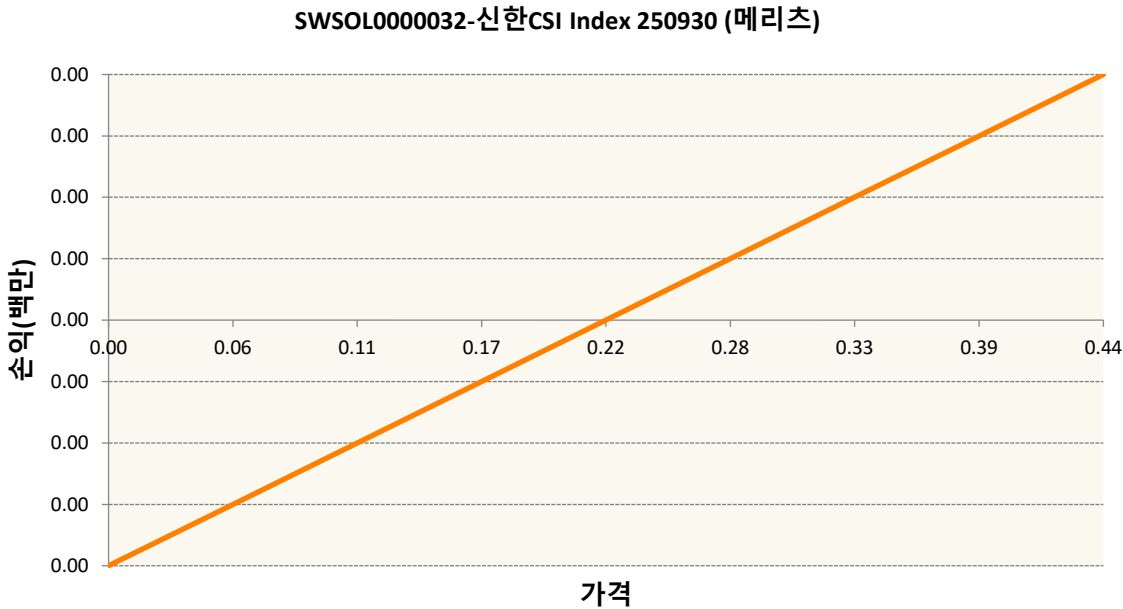
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,048	0	3,048	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	26
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	18
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	18
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	44

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

(단위:백만원)

186

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

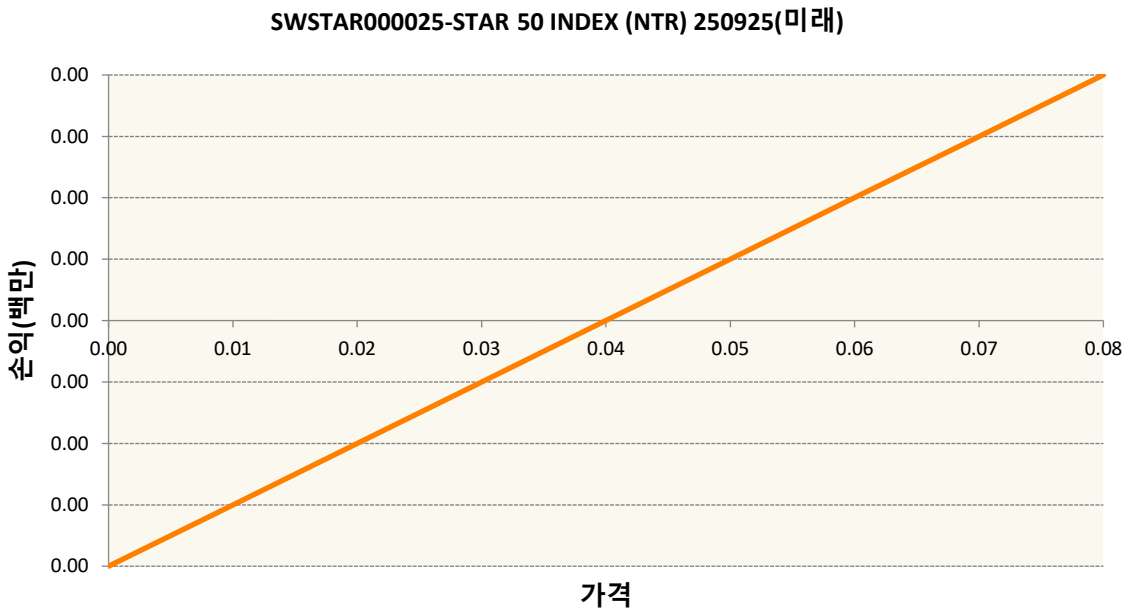
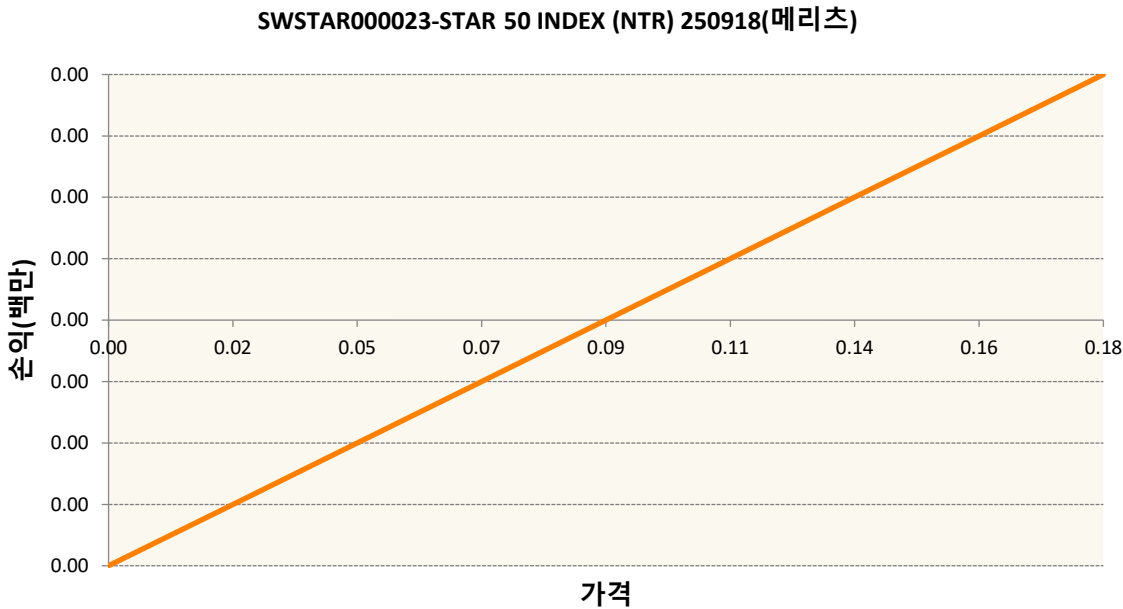
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	4,632	0	4,632	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		21
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		6
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		75
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		19
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠)		7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		234

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

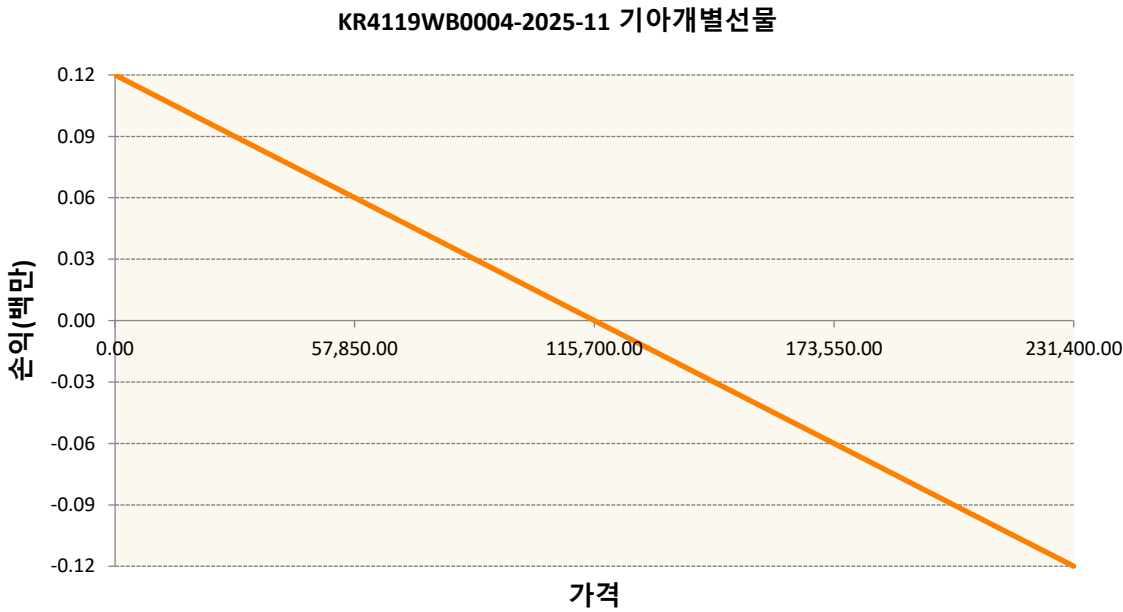
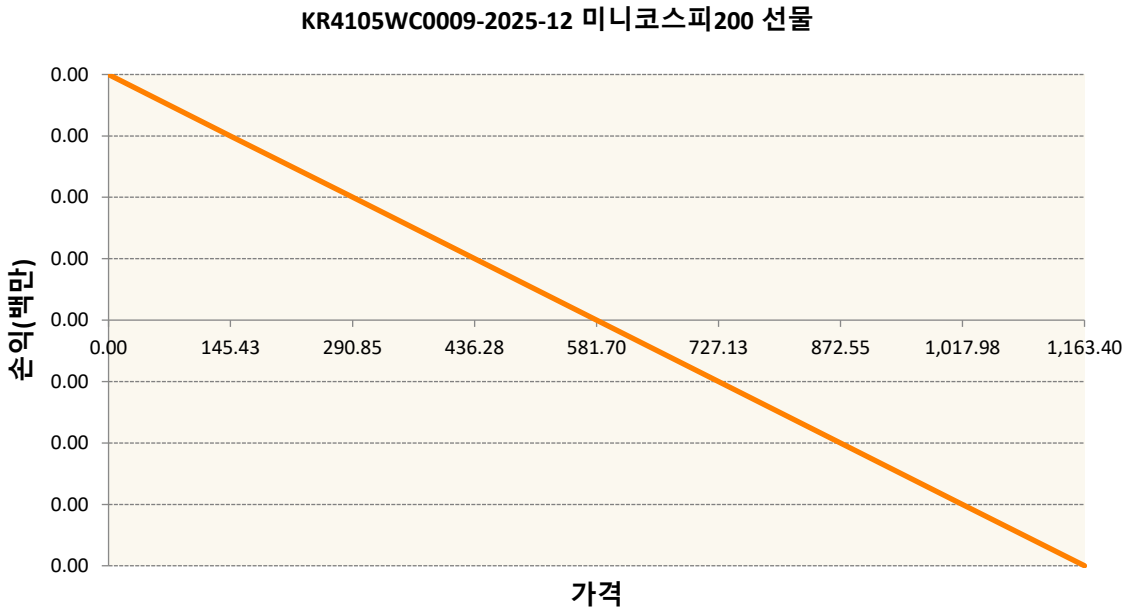
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

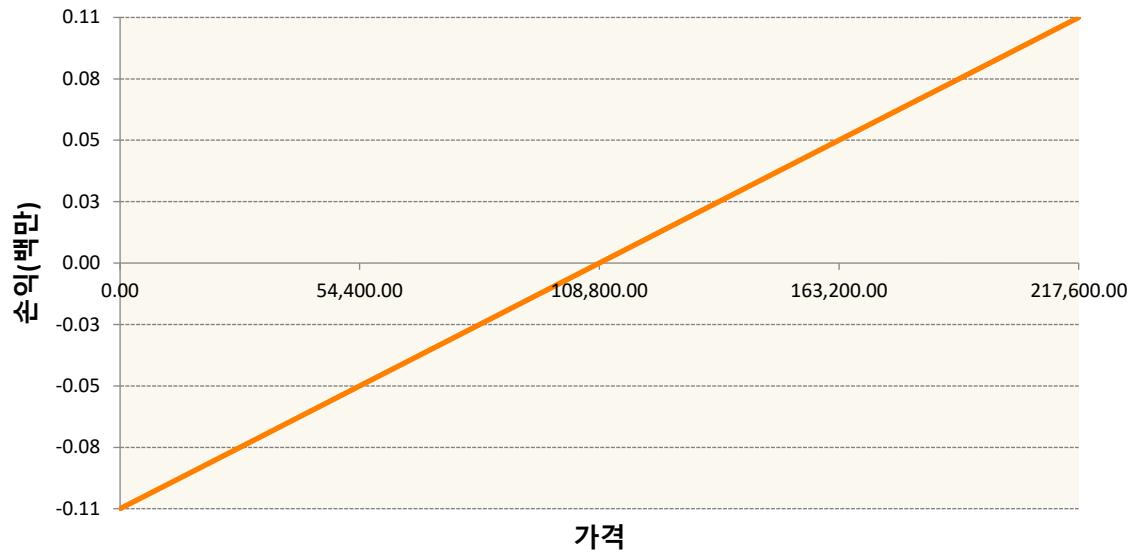
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	897	1,770	-873	장내
누계	유가증권	선물	10	886	-876	장내

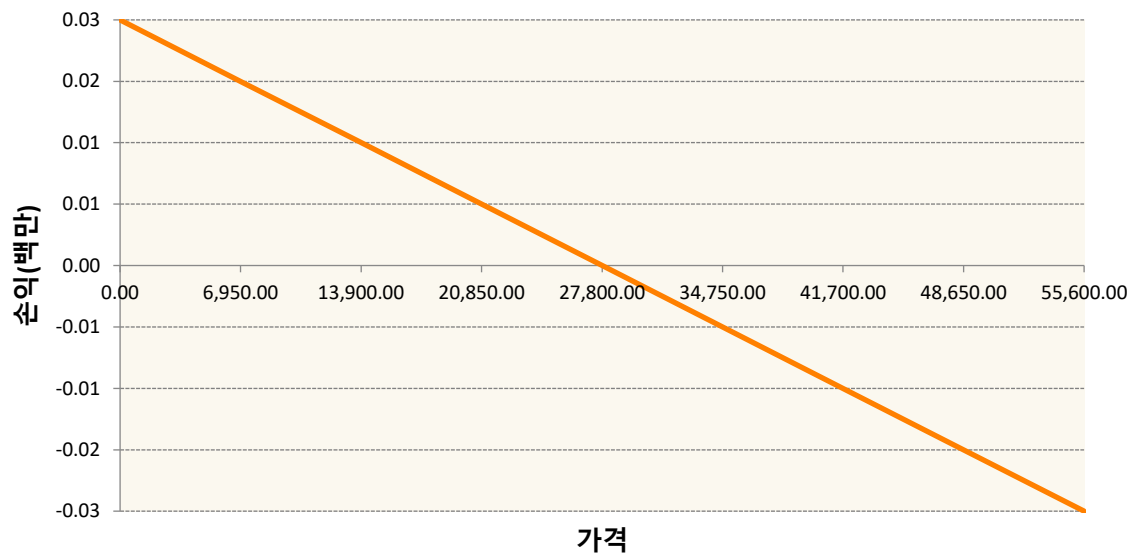
2. 만기시점의 손익구조



KR41C0WC0008-2025-12 OCI개별선물



KR41CBWC0007-2025-12 한화솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105WC0 2025-12 미니코스피200 선물	14
KR4119WB0 2025-11 기아개별선물	0.46
KR41C0WC0 2025-12 OCI개별선물	1
KR41CBWC0 2025-12 한화솔루션개별선물	1

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

(단위:백만원)

2

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

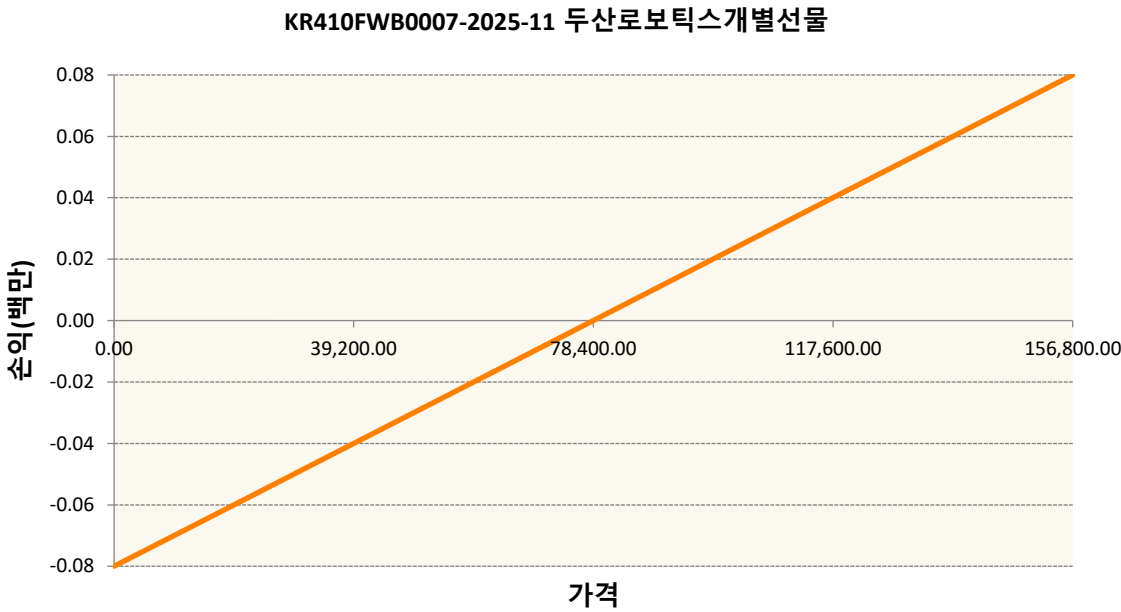
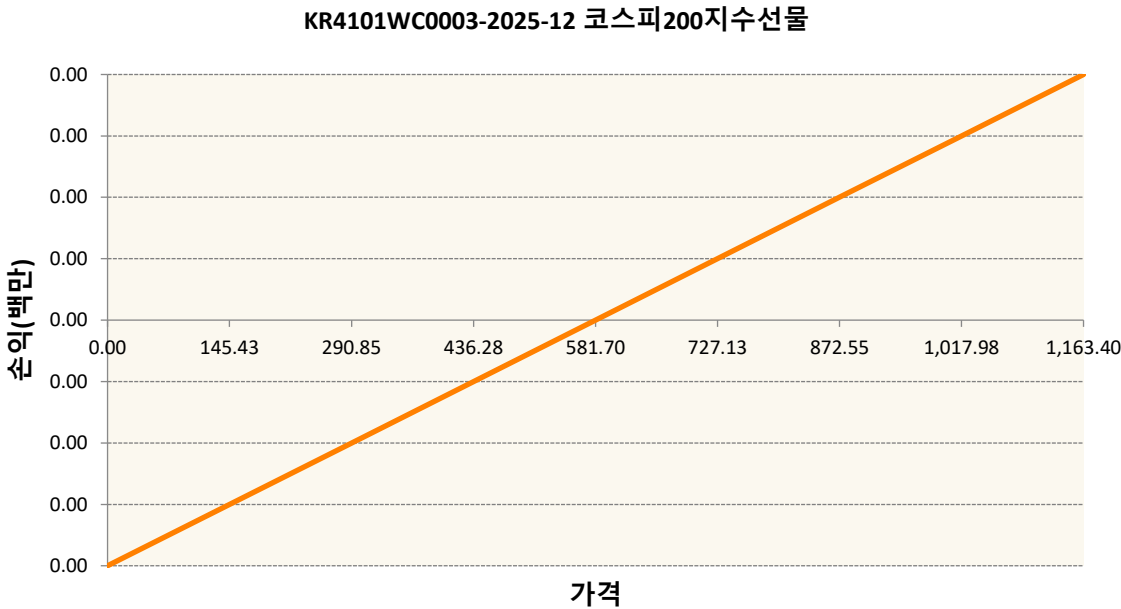
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

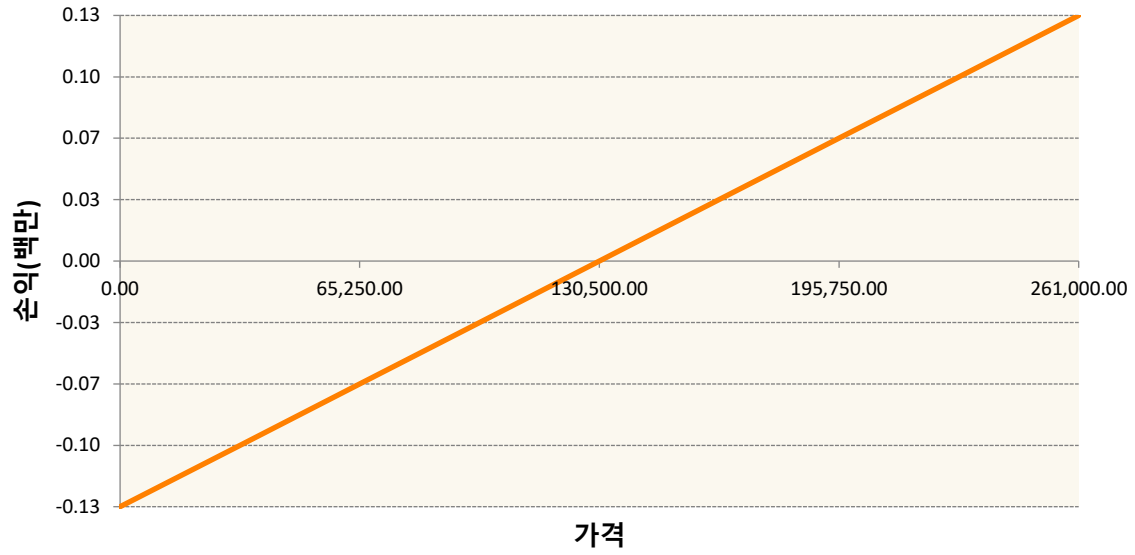
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,032	1,162	-130	장내
누계	유가증권	선물	16,447	0	16,447	장내

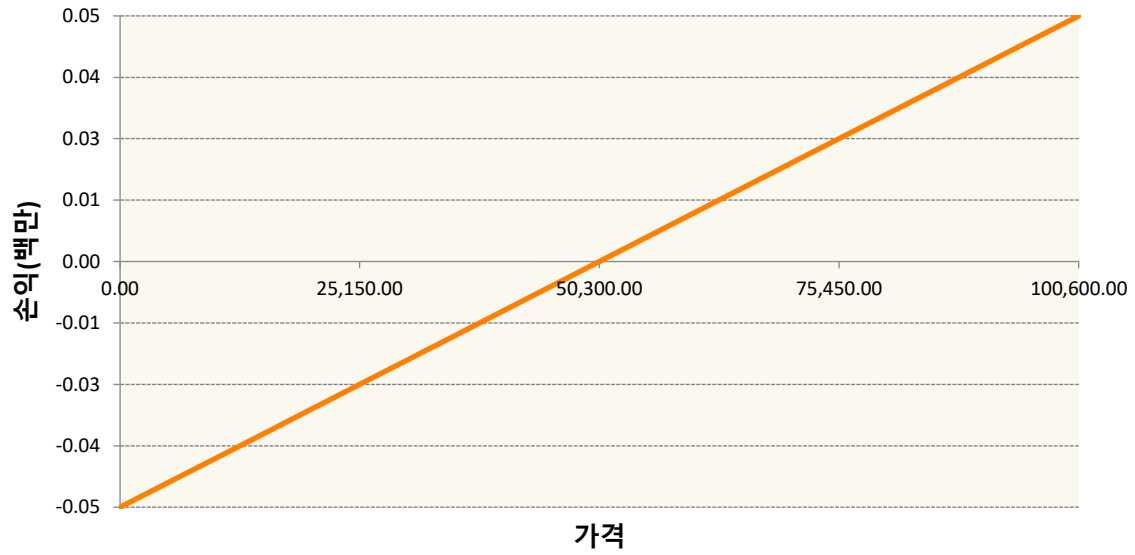
2. 만기시점의 손익구조



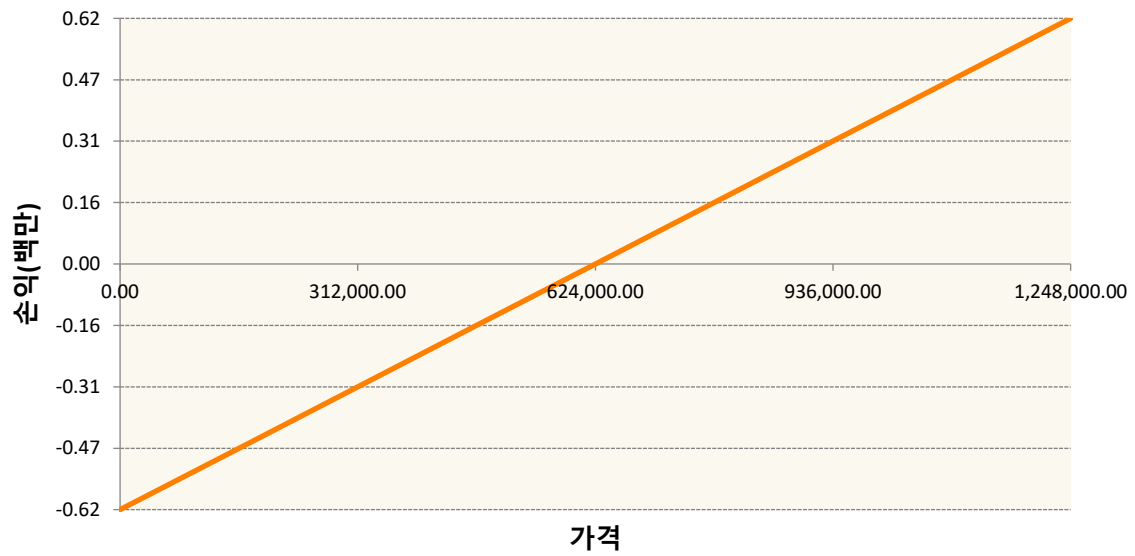
KR410ZWB0003-2025-11 한미반도체개별선물



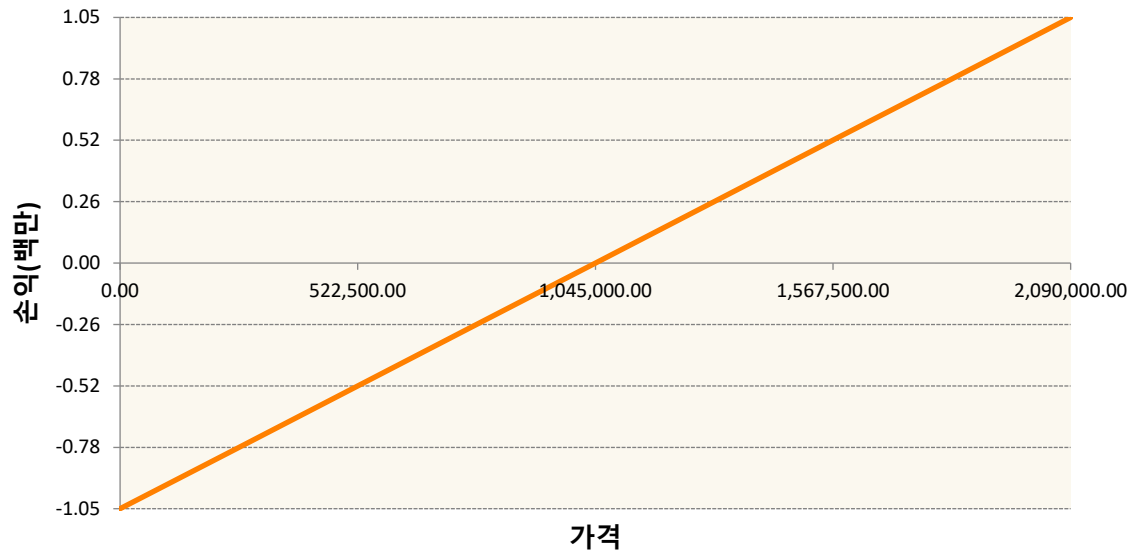
KR411RWB0002-2025-11 한화비전개별선물



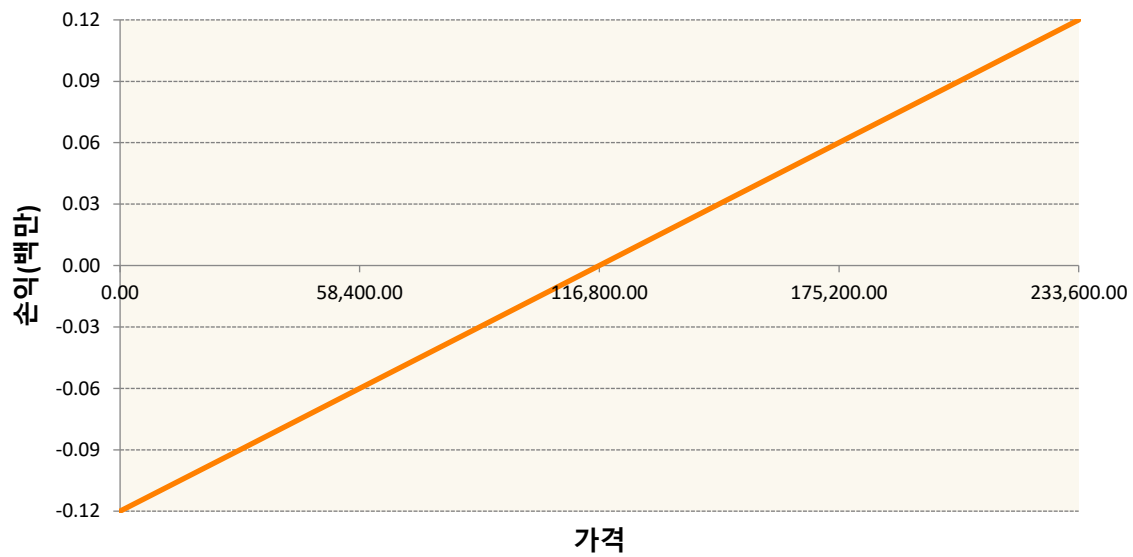
KR4150WB0004-2025-11 SK하이닉스개별선물



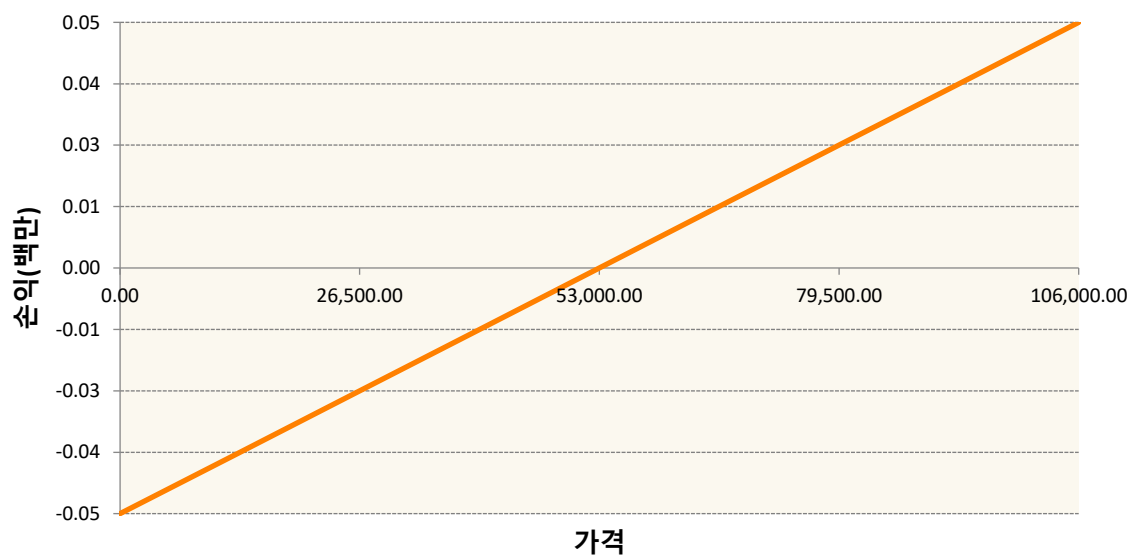
KR41B3WB0008-2025-11 고려아연개별선물



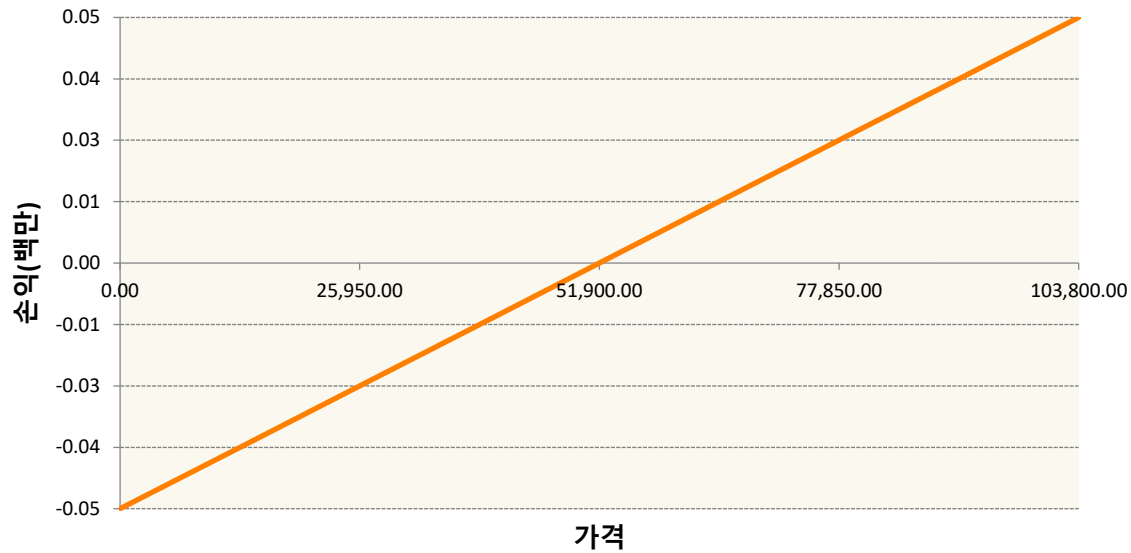
KR41EJWB0008-2025-11 SKC개별선물



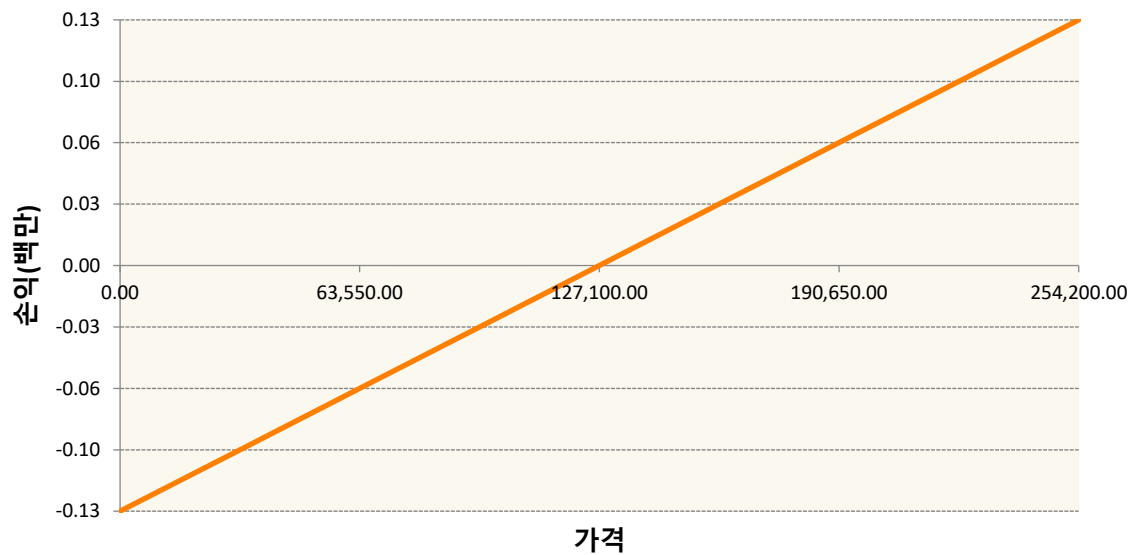
KR41EVWB0002-2025-11 한화시스템개별선물



KR41F7WB0005-2025-11 카카오페이개별선물



KR41FMWB0002-2025-11 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0(2025-12 코스피200지수선물	1,117
KR410FWB0(2025-11 두산로보틱스개별선물	17
KR410ZWB0(2025-11 한미반도체개별선물	40
KR411RWB0(2025-11 한화비전개별선물	4
KR4150WB0(2025-11 SK하이닉스개별선물	3
KR41B3WB0(2025-11 고려아연개별선물	48
KR41EJWB0C 2025-11 SKC개별선물	24
KR41EVWB0(2025-11 한화시스템개별선물	12
KR41F7WB0(2025-11 카카오페이개별선물	15
KR41FMWB0 2025-11 엘앤에프개별선물	36

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

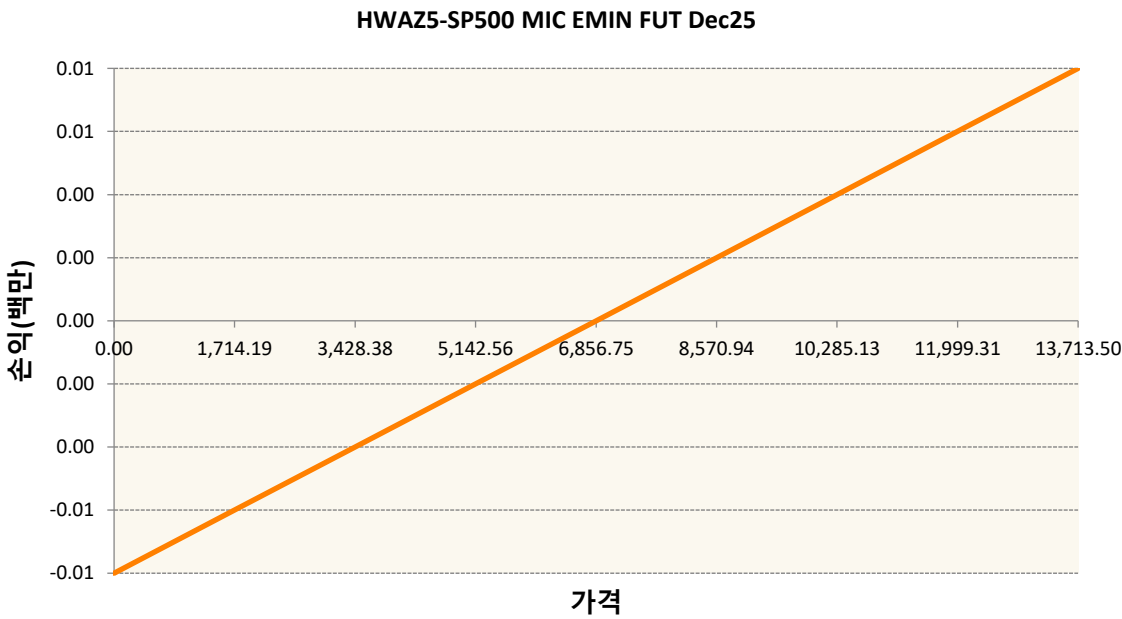
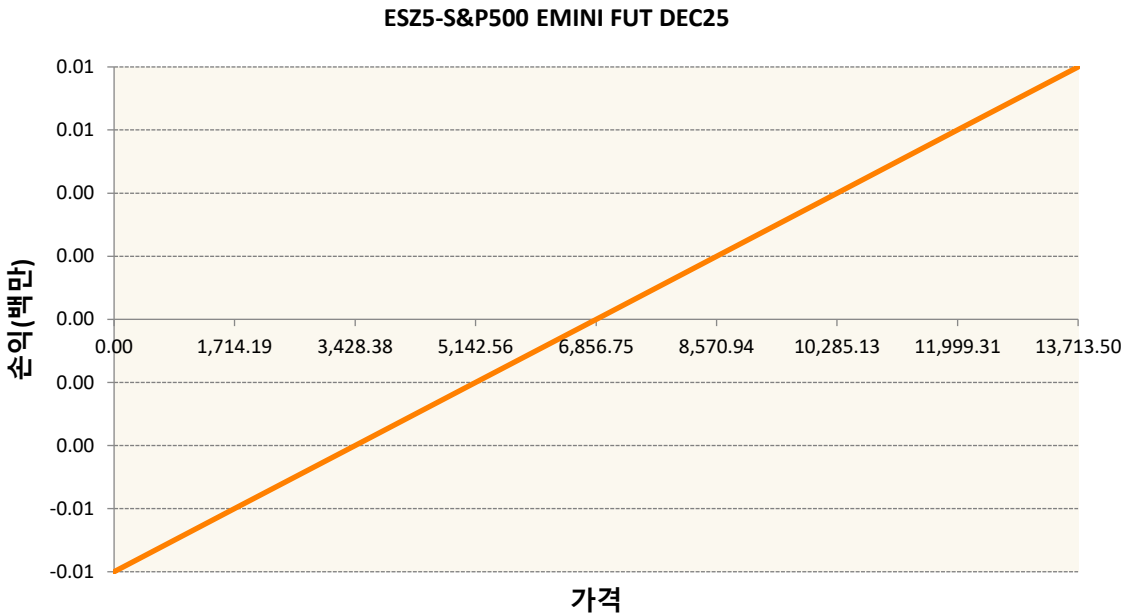
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	41,585	0	41,585	
누계	유가증권	선물	1,286	0	1,286	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,327
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	103

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,887

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

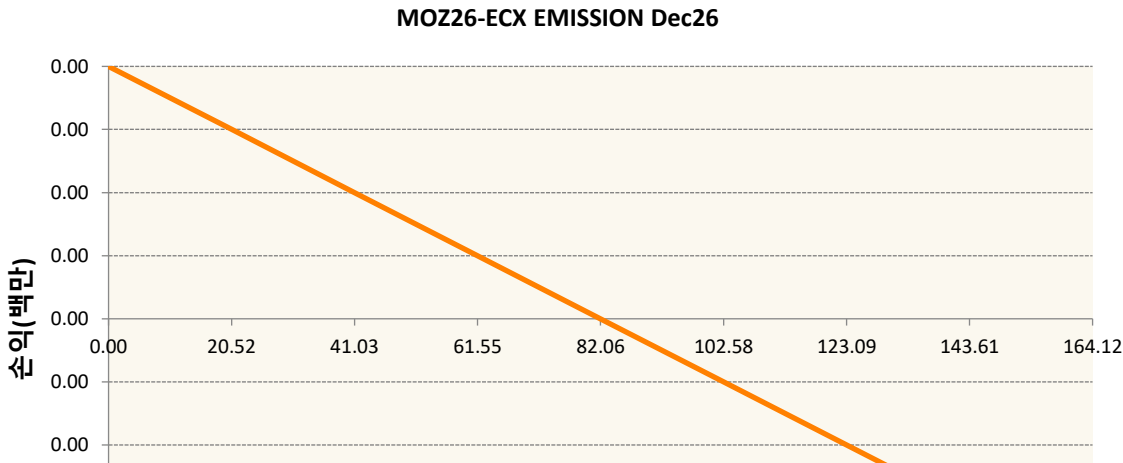
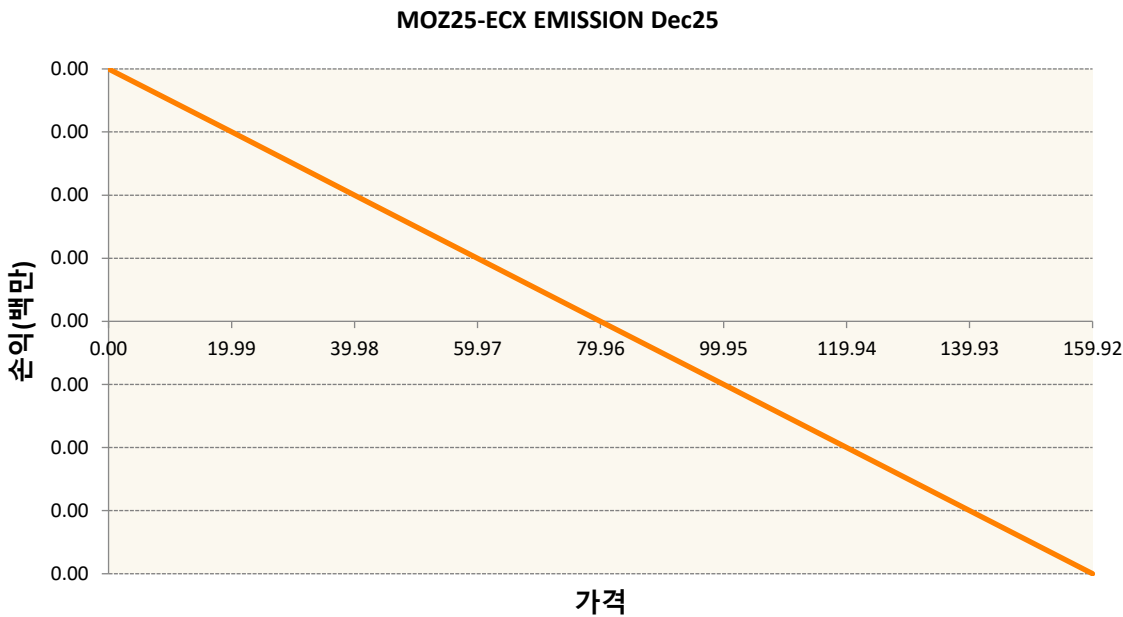
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

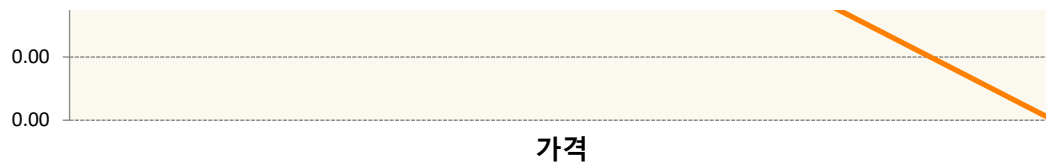
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			0	1,512	-1,512	
누계	유가증권	선물	0	1,841	-1,841	
누계	지수	스왑	-12	0	-12	장외
누계	통화	선도	0	1,173	-1,173	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2109930918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX		1
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E		94
MOZ25	ECX EMISSION Dec25	147
MOZ26	ECX EMISSION Dec26	121

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

417

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

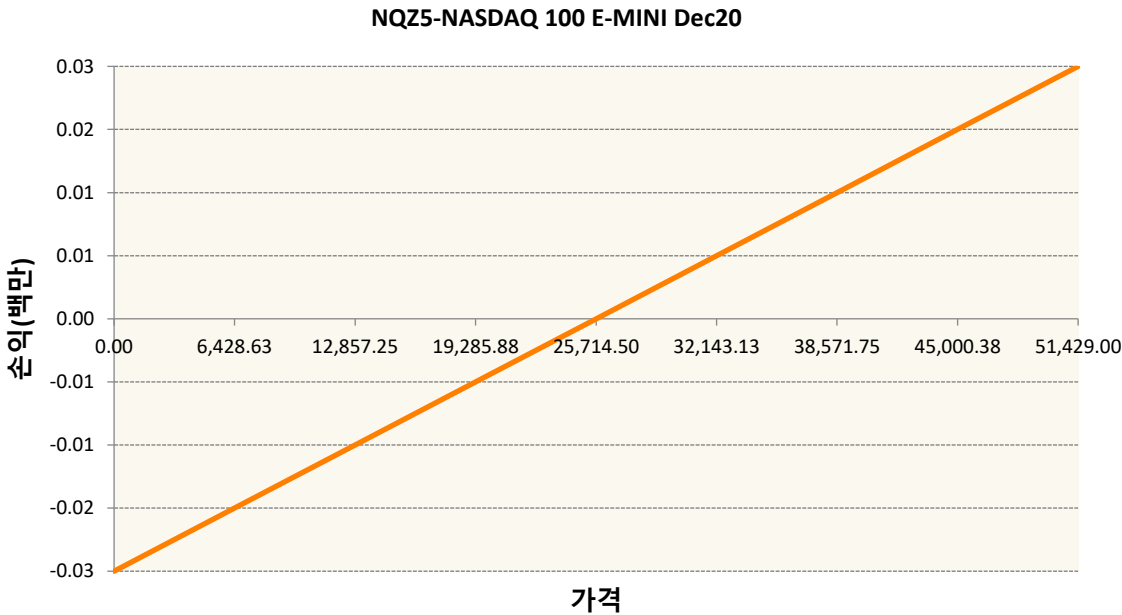
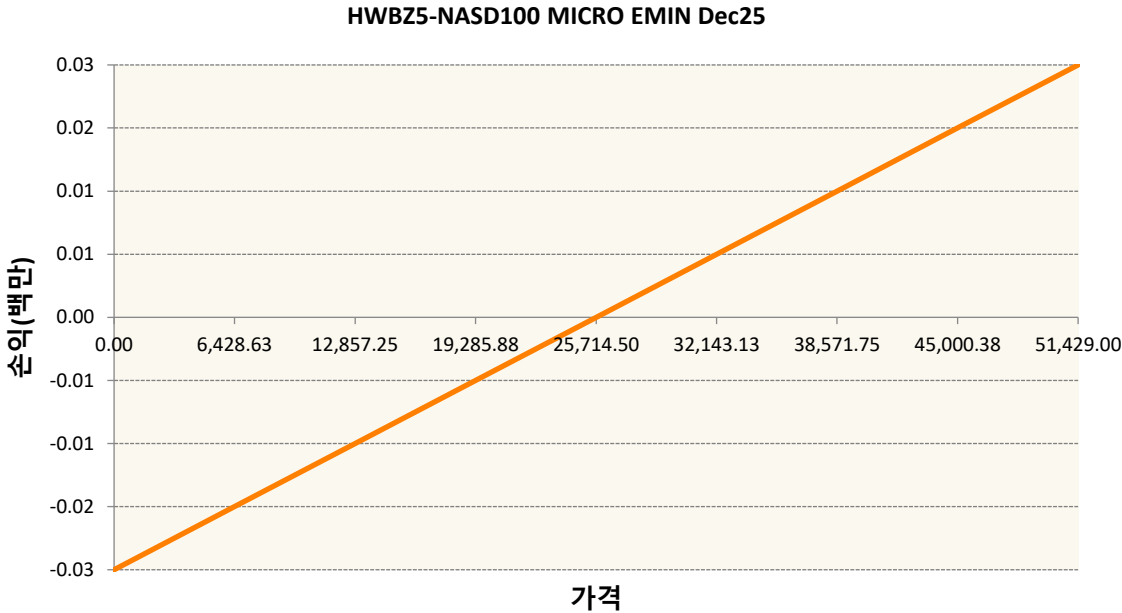
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	18,656	0	18,656	
누계	유가증권	선물	1,433	0	1,433	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25	115
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,492

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,796

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

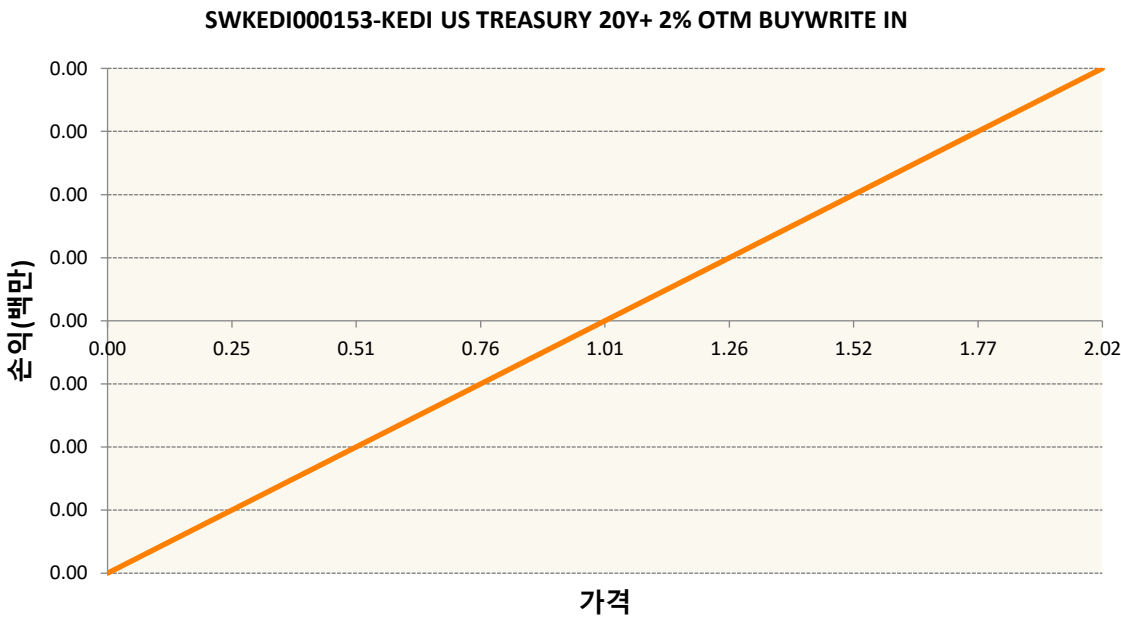
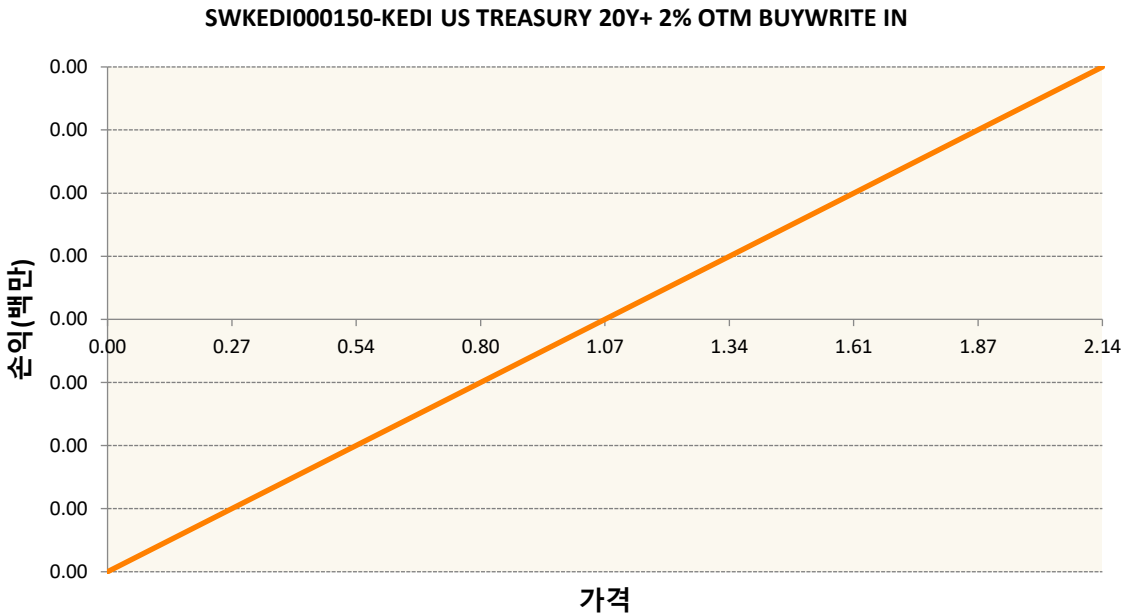
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

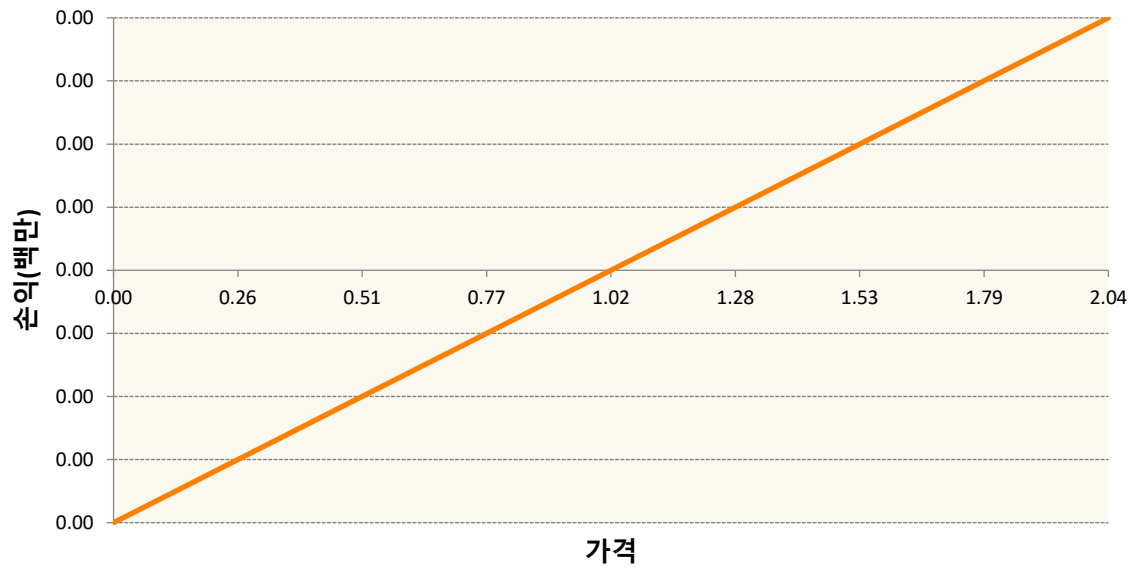
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	387,419	0	387,419	장외

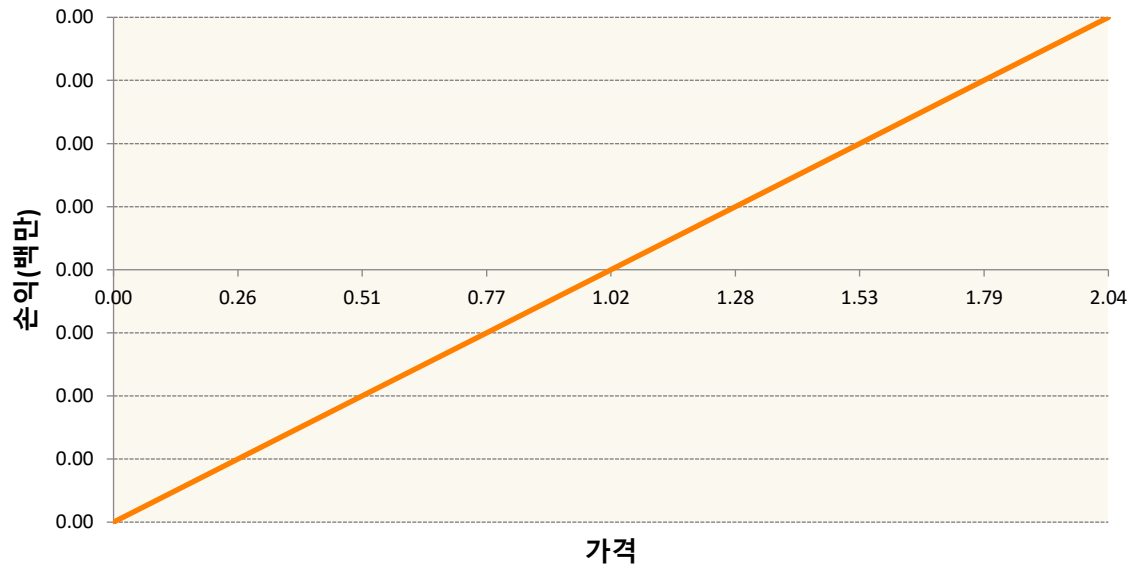
2. 만기시점의 손익구조



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	8,240
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,793
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	10,262
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,625

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

(단위:백만원)

14,844

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,271	0	2,271	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	12

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

(단위:백만원)

63

공시일	2025-11-12
기준일	2025-11-11

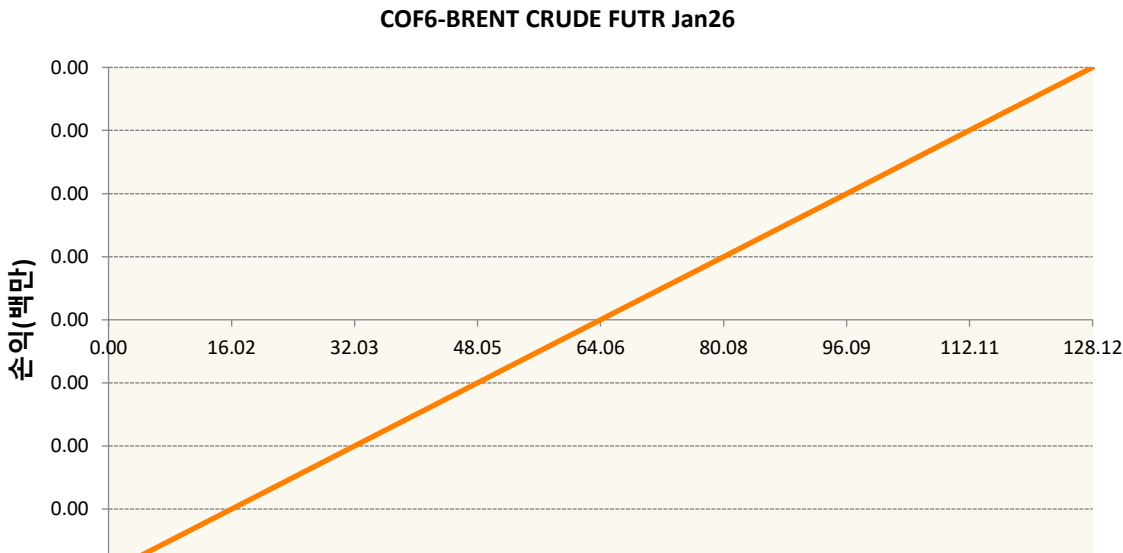
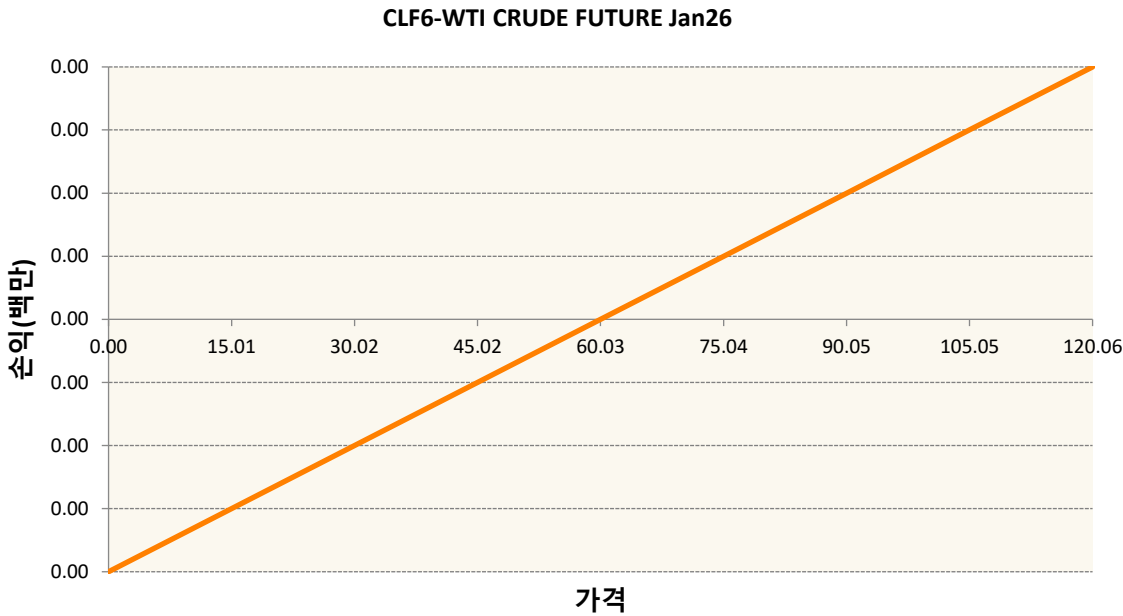
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

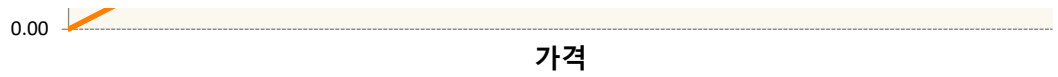
1. 계약금액

(단위:백만원)

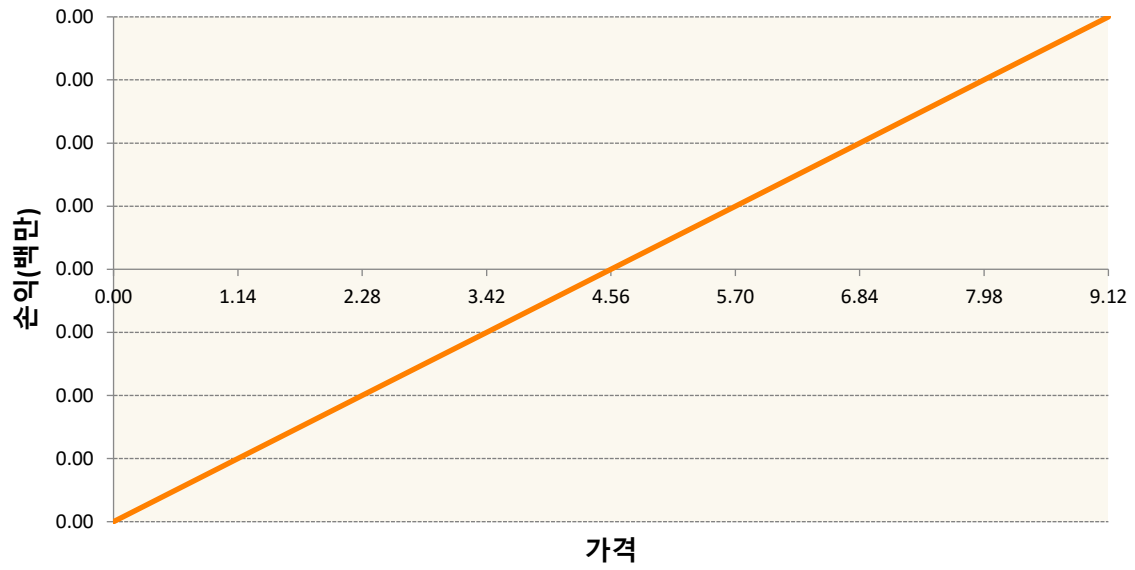
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	364	0	364	
누계	유가증권	선물	178	0	178	
누계	통화	선물	0	117	-117	장내

2. 만기시점의 손익구조

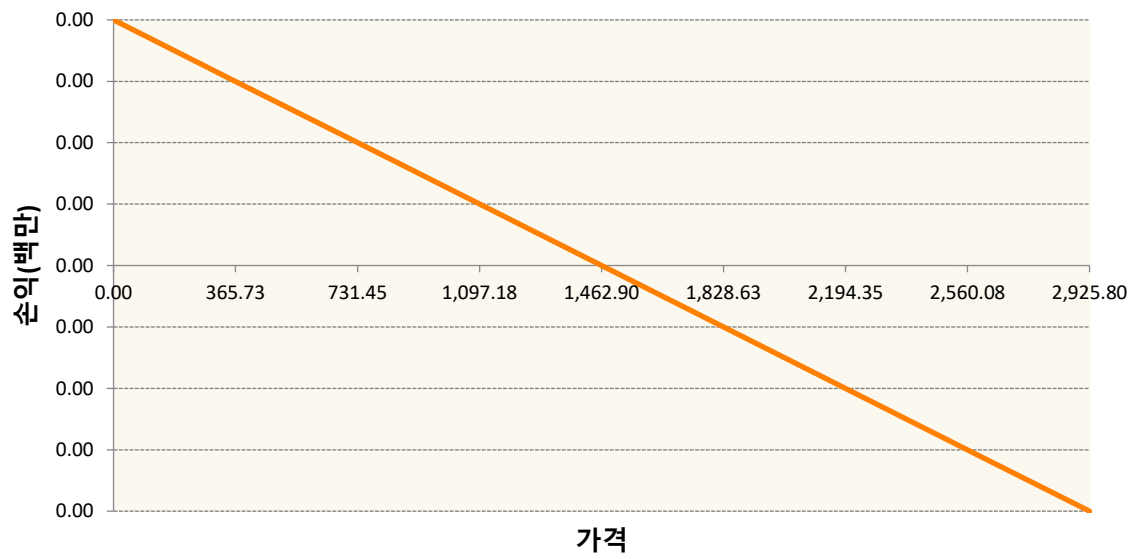




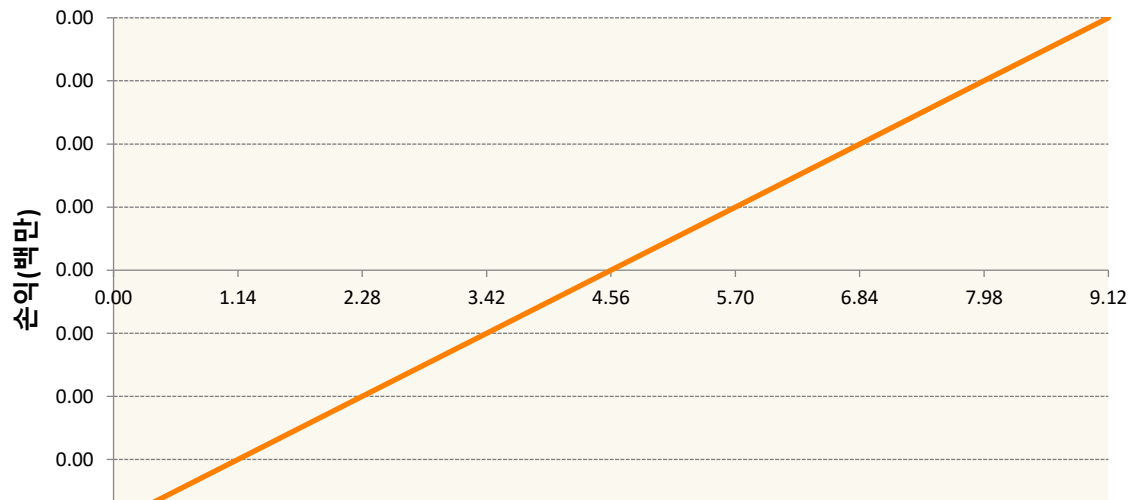
EOF6-E-MINI NATURAL GAS Jan26

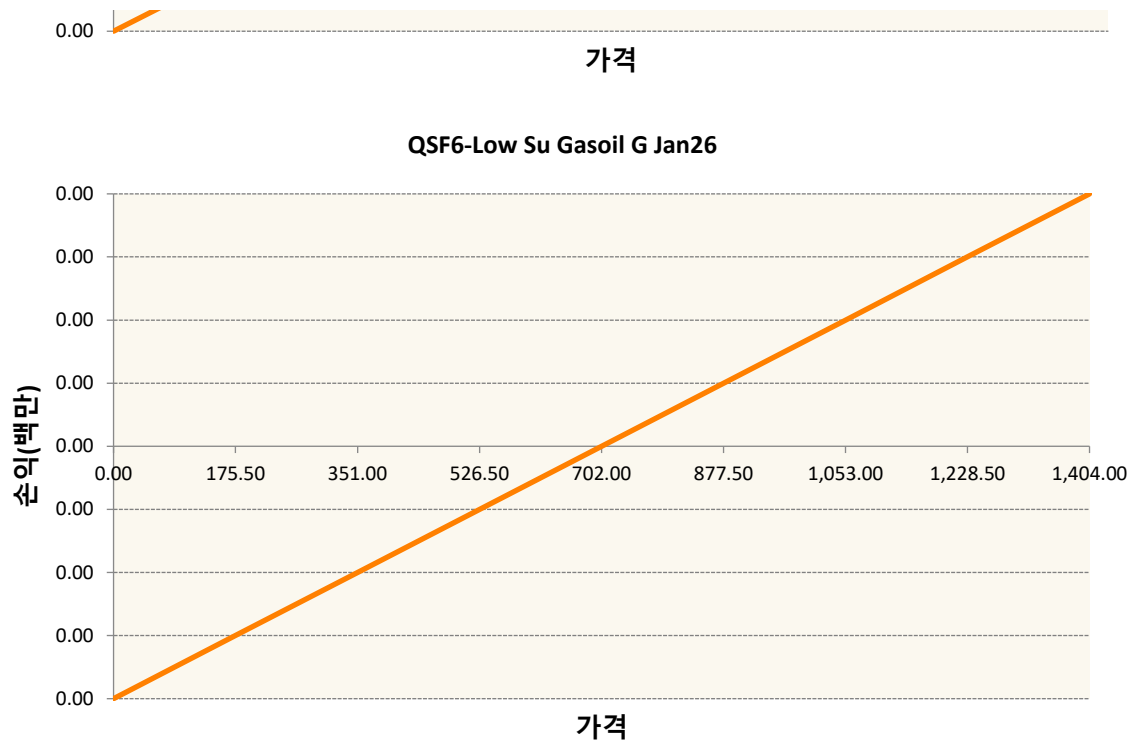


KR4175WB0005-2025-11 달러선물



NGF26-NATURAL GAS FUTR Jan26





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF6	WTI CRUDE FUTURE Jan26	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)

94