

공시일 2025-11-17

기준일 2025-11-14

## 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 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

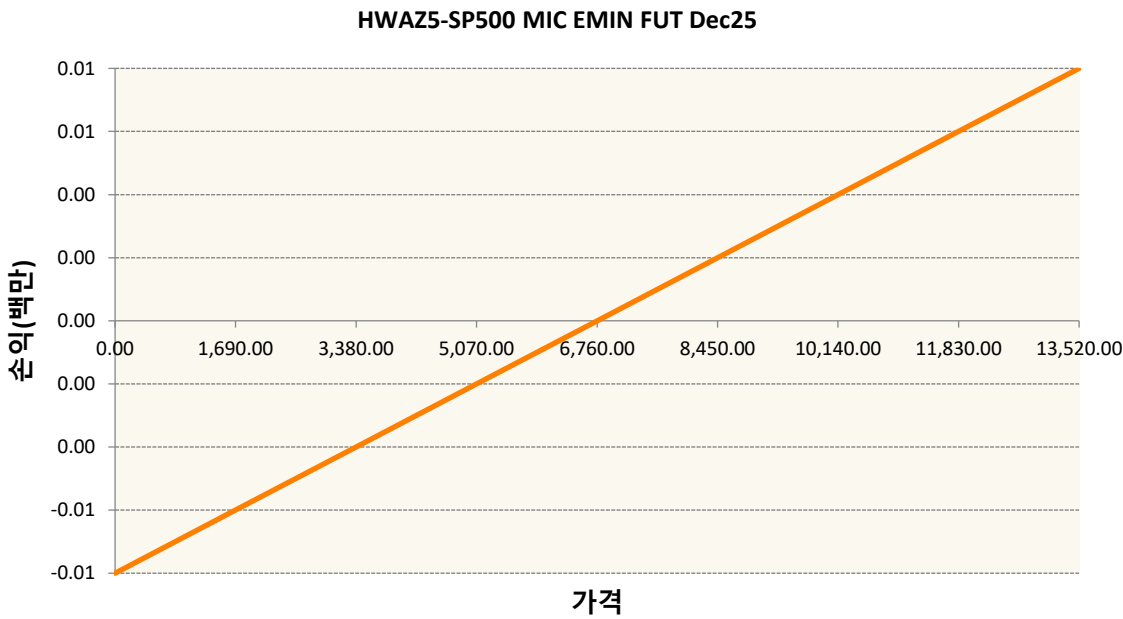
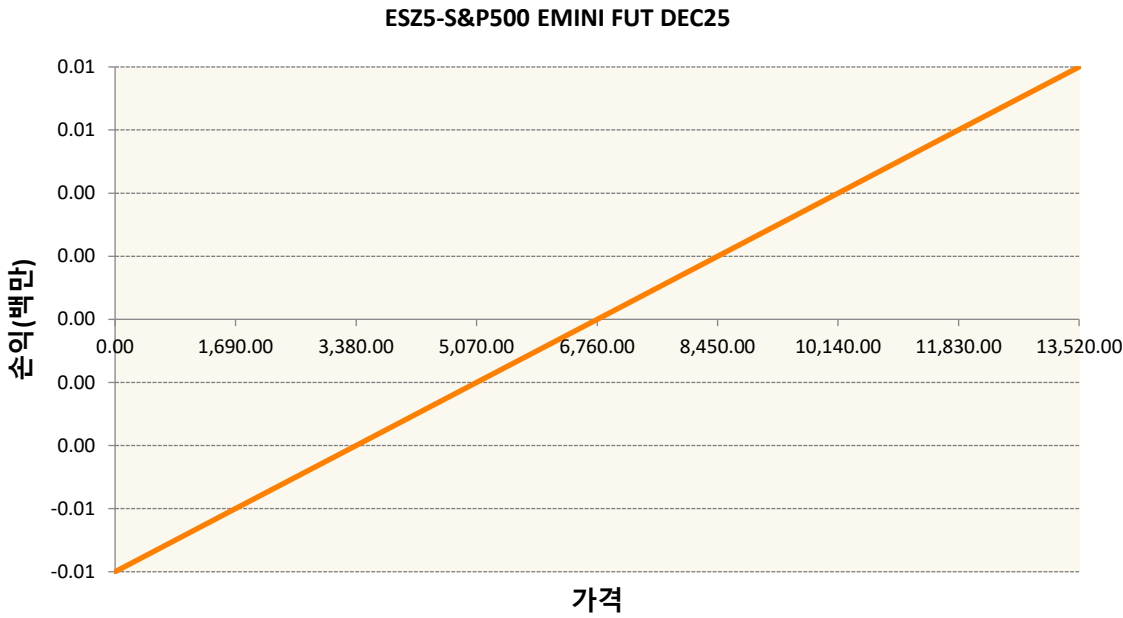
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 469   | 0     | 469       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 188   | 0     | 188       | 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 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

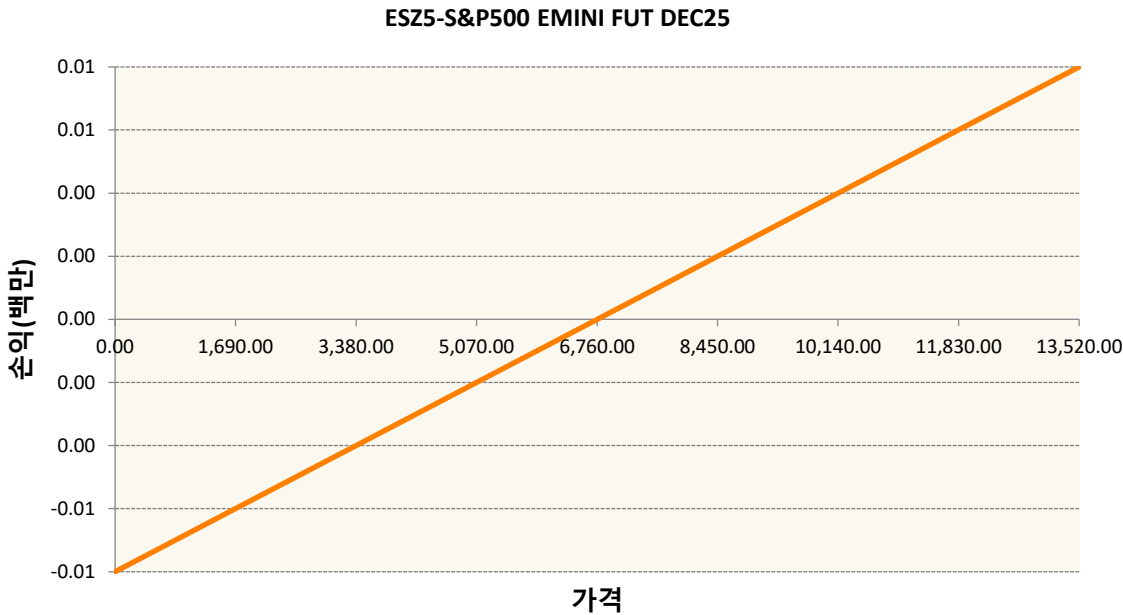
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,408 | 0     | 1,408     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| ESZ5 | S&P500 EMINI FUT DEC25 | 113 |
|------|------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

163

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

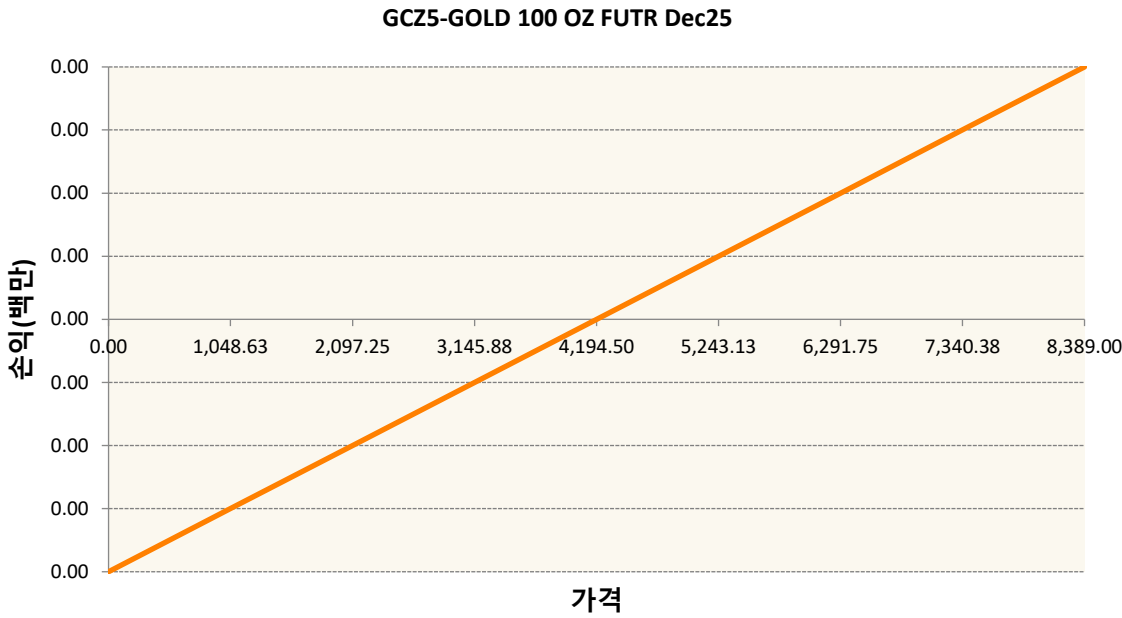
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 2,953 | 0     | 2,953     |    |
| 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 | 236 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 222 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

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 | 116 |
| AOPLTRUP0' PLTR US 11/14/25 P185 EQUITY | 39  |

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

(단위:백만원)

612

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

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

0.42

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

(단위:백만원)

0



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

(단위:백만원)

4,965

공시일 2025-11-17

기준일 2025-11-14

## 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 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

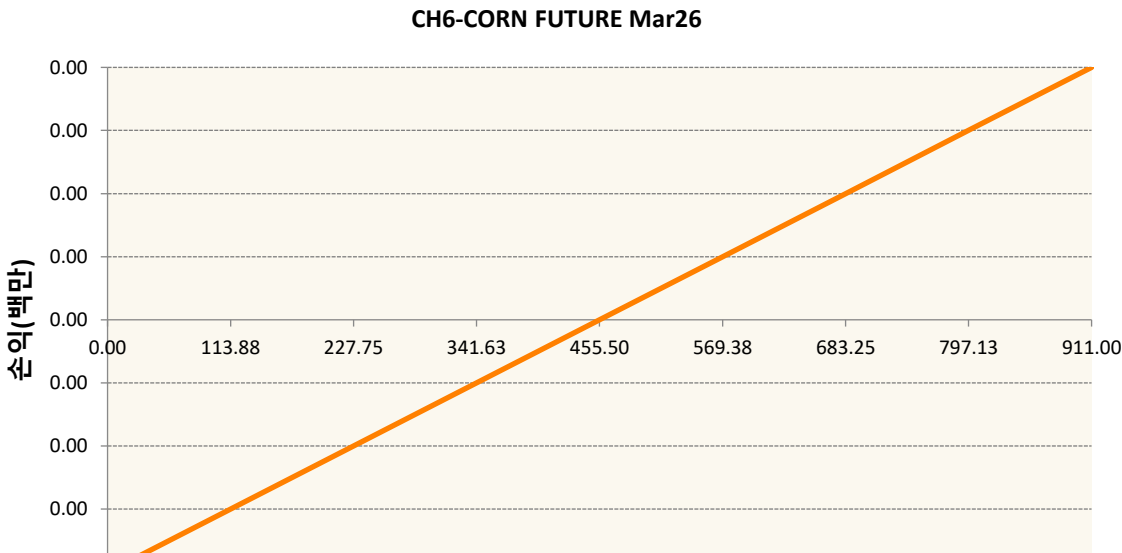
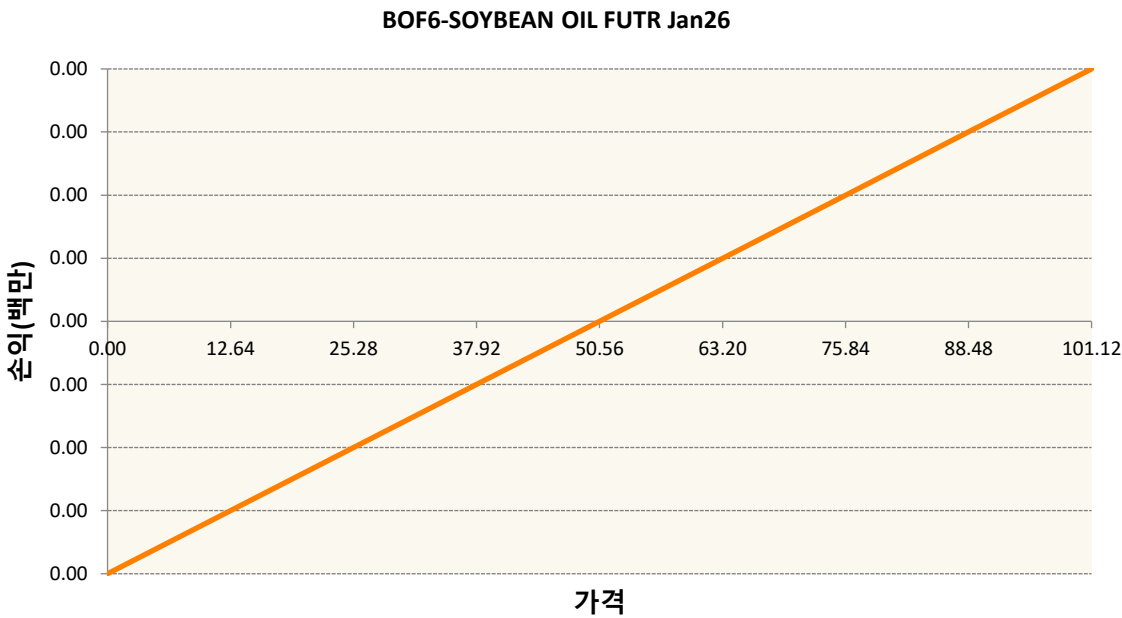
## 포커스농산물모(채권-파생형)

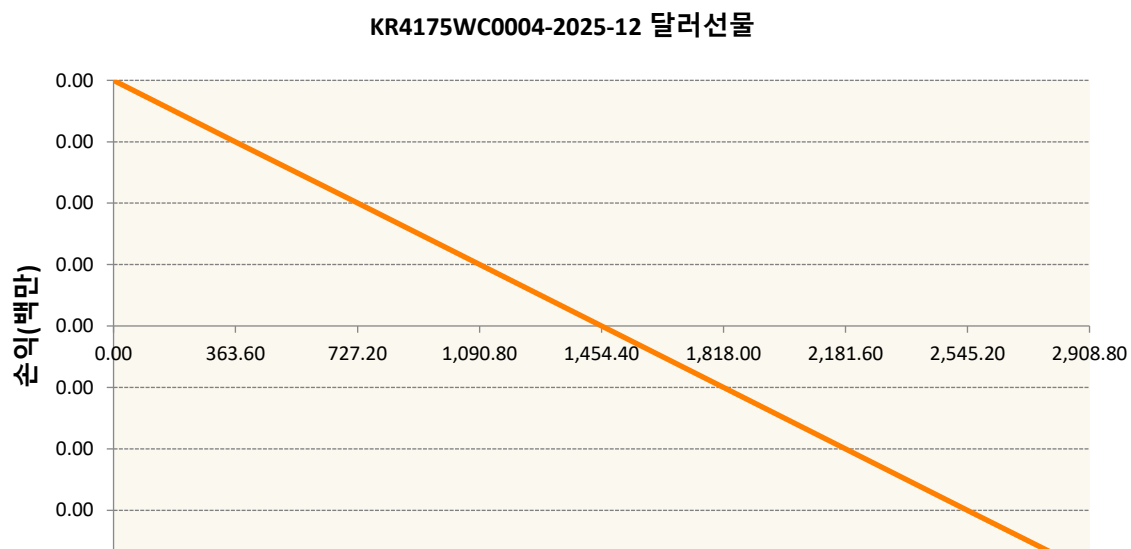
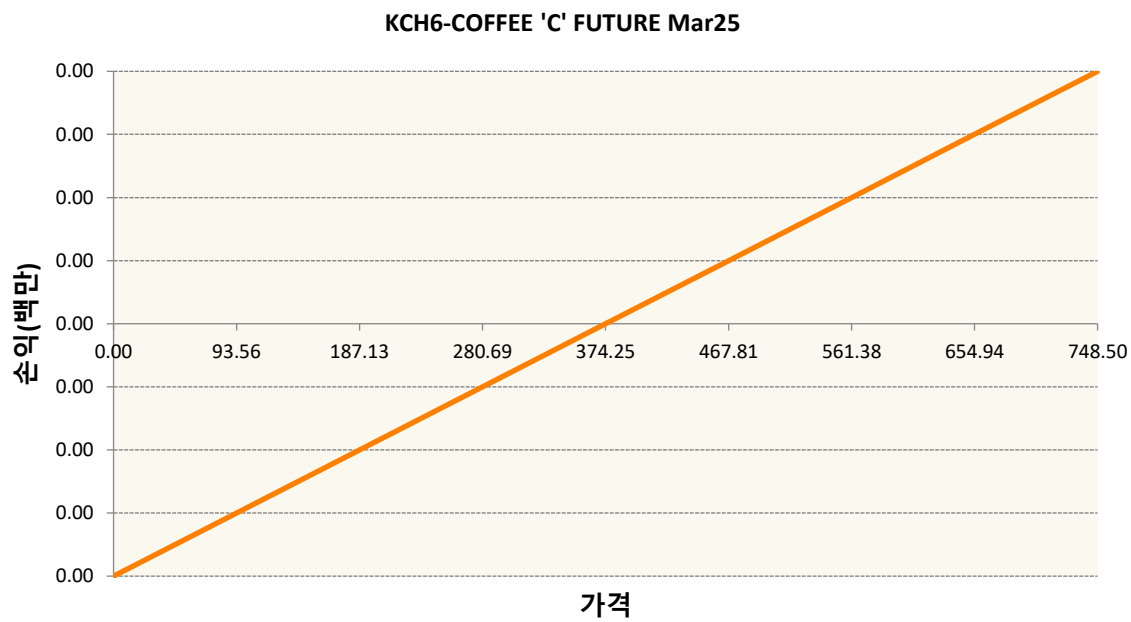
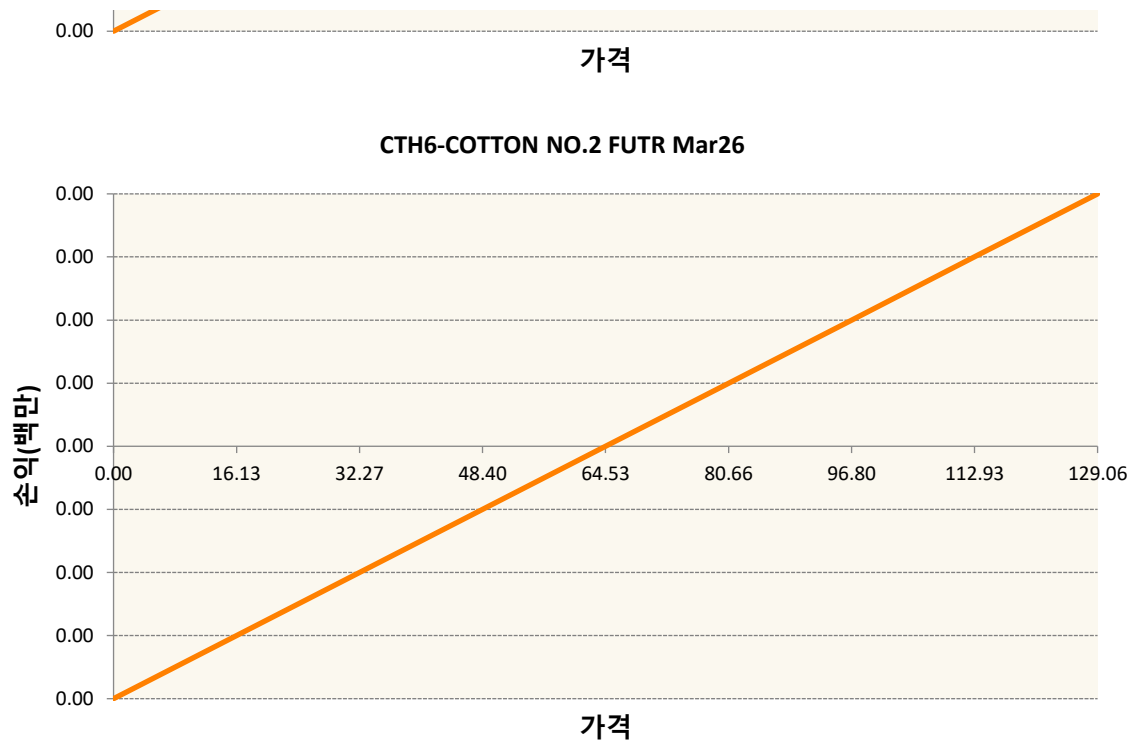
### 1. 계약금액

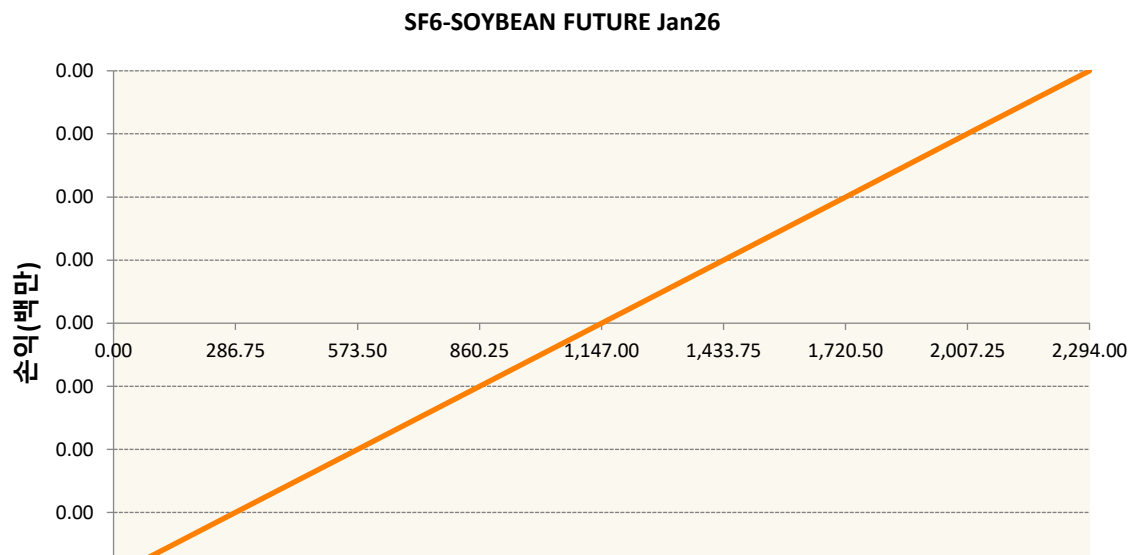
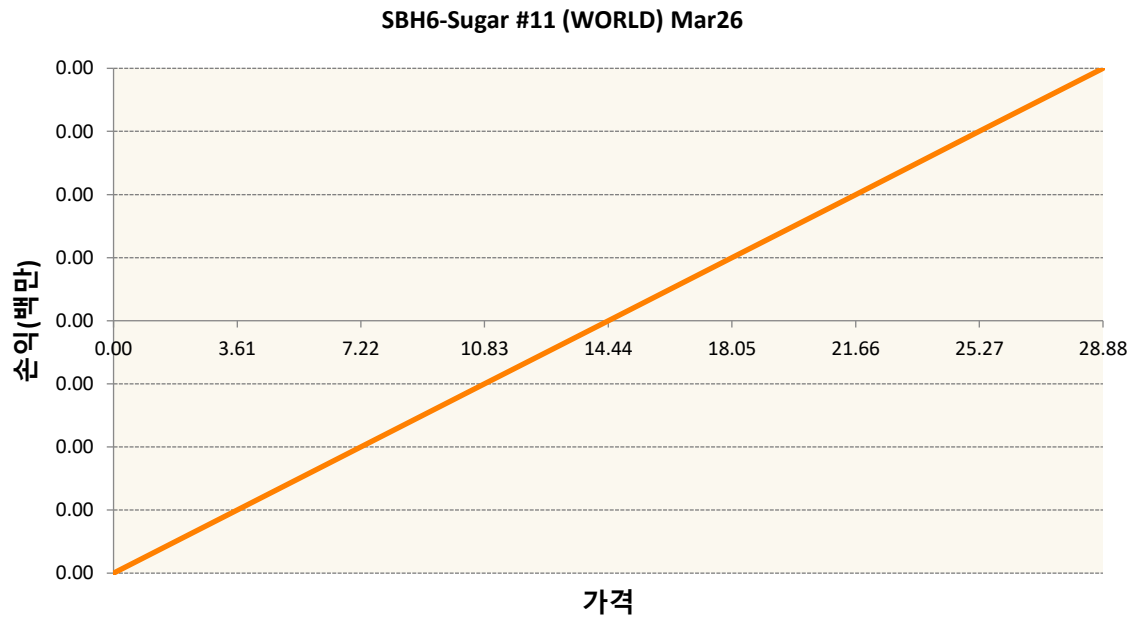
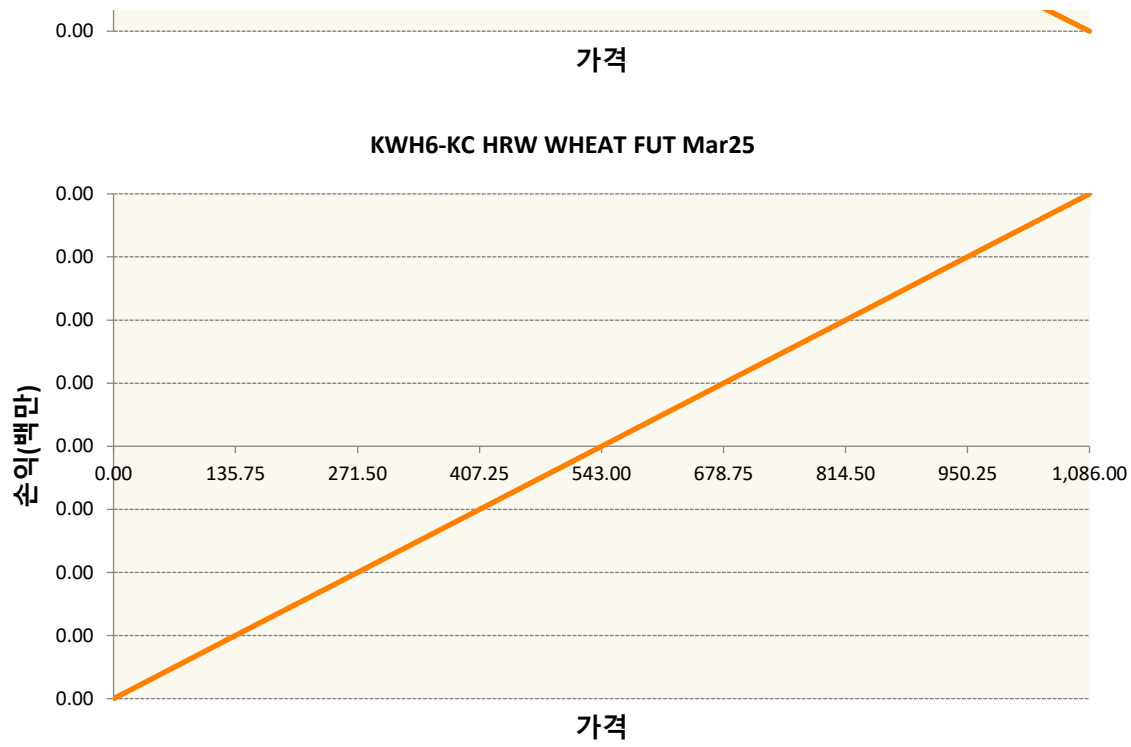
(단위:USD 백만)

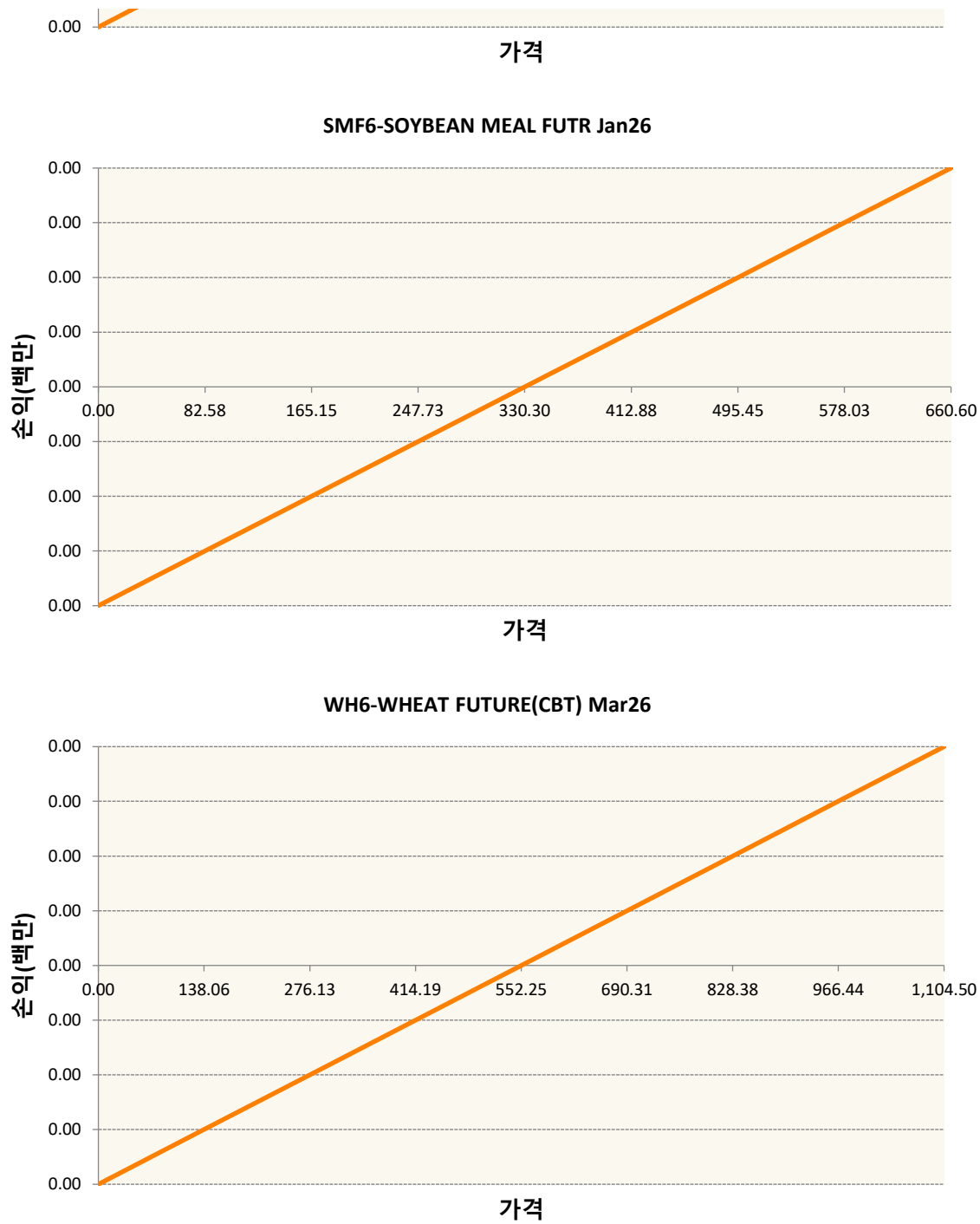
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,167 | 0     | 1,167     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,190 | 0     | 2,190     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 436   | -436      | 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 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

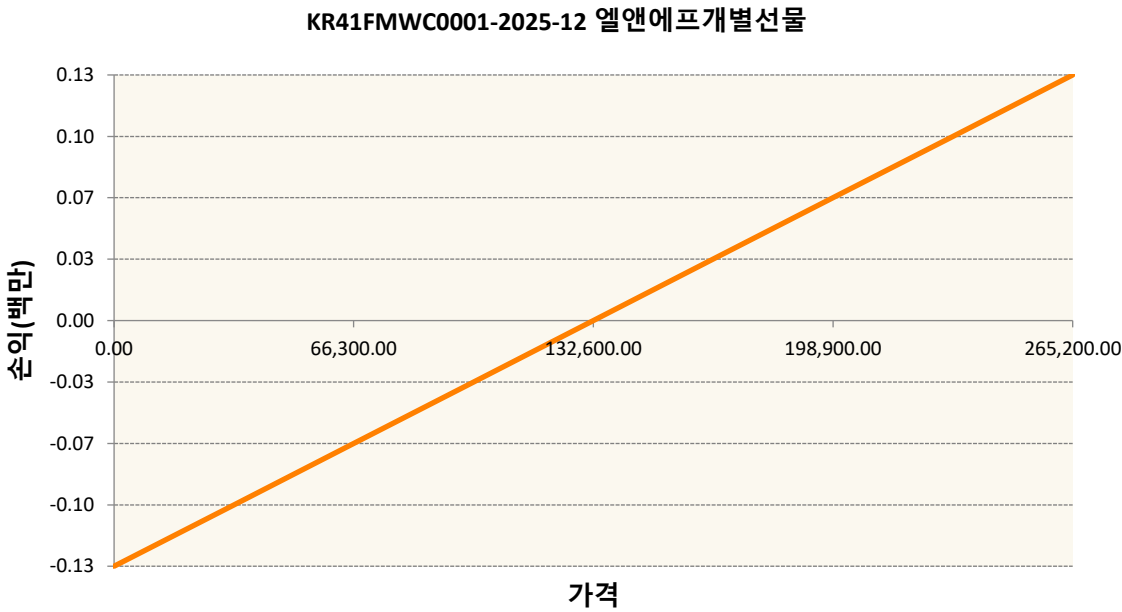
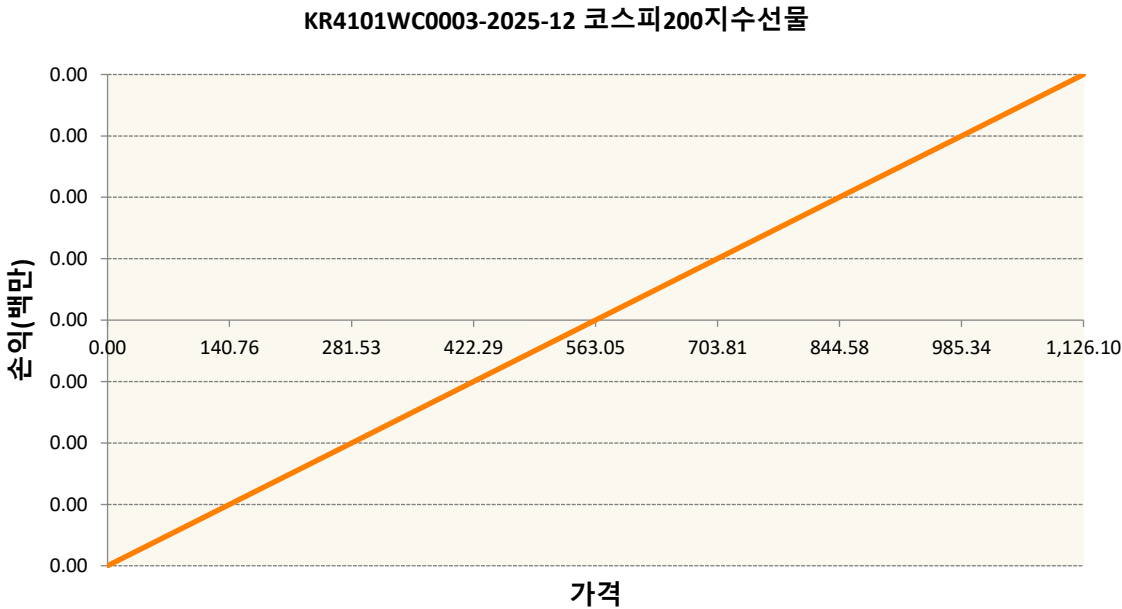
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,309 | 0     | 1,309     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)     |  | (단위:백만원) |
|-------------------------------|--|----------|
| KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물 |  | 101      |
| KR41FMWCC 2025-12 엘앤티에프개별선물   |  | 3        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 12       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

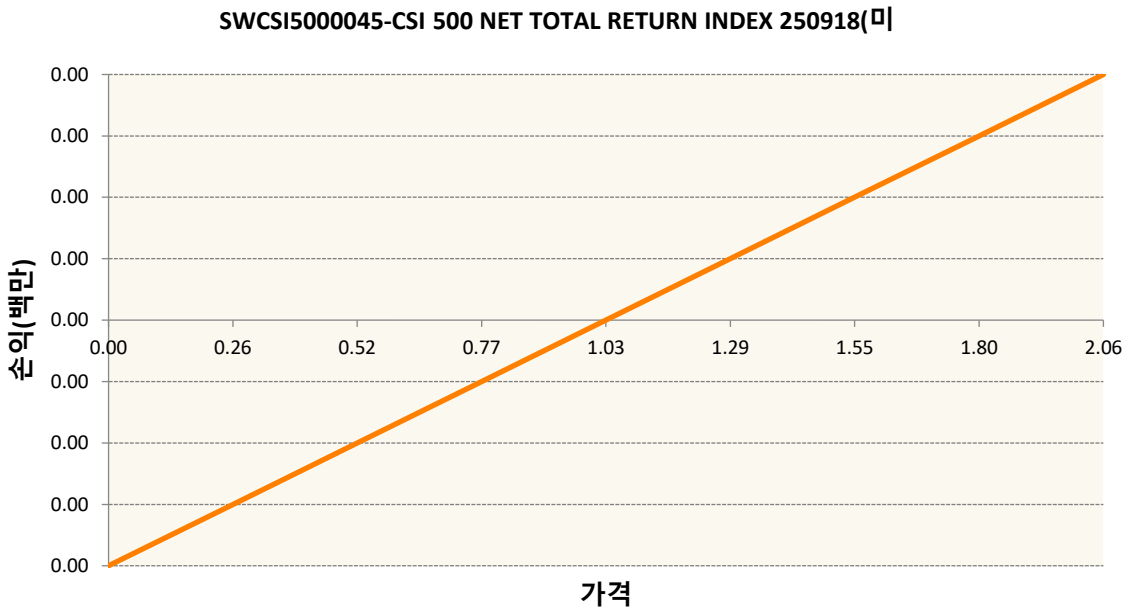
## SOL차이나강소기업CSI500상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 4,841 | 0     | 4,841     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

387

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

490

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

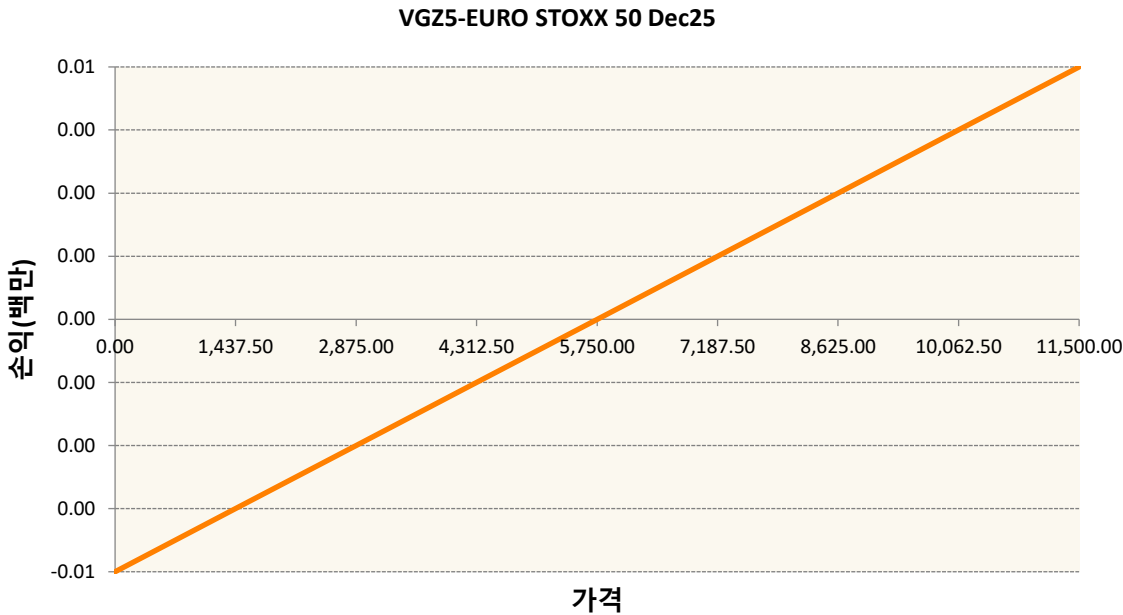
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 755   | 0     | 755       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGZ5 | EURO STOXX 50 Dec25 | 60 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 51 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

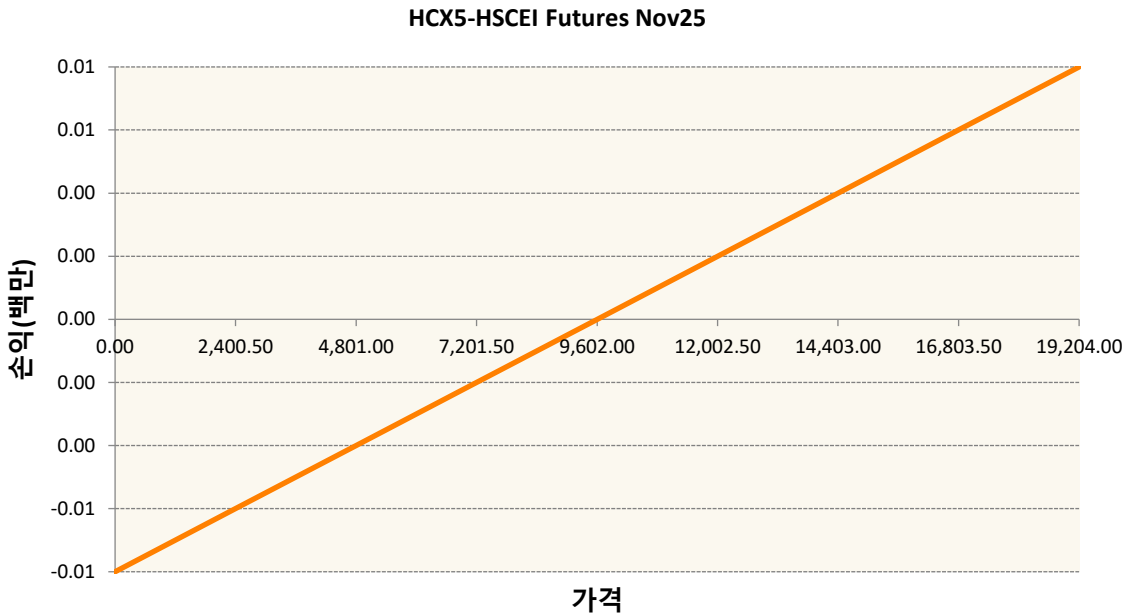
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 2,035 | 0     | 2,035     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HGX5 | HSCEI Futures Nov25 | 163 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

230

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

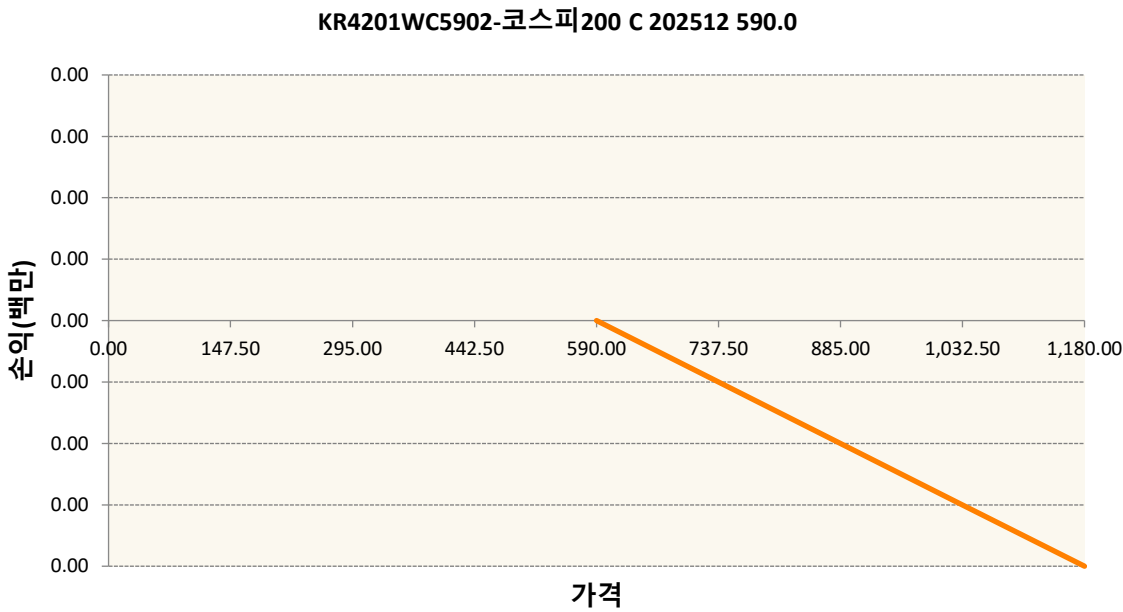
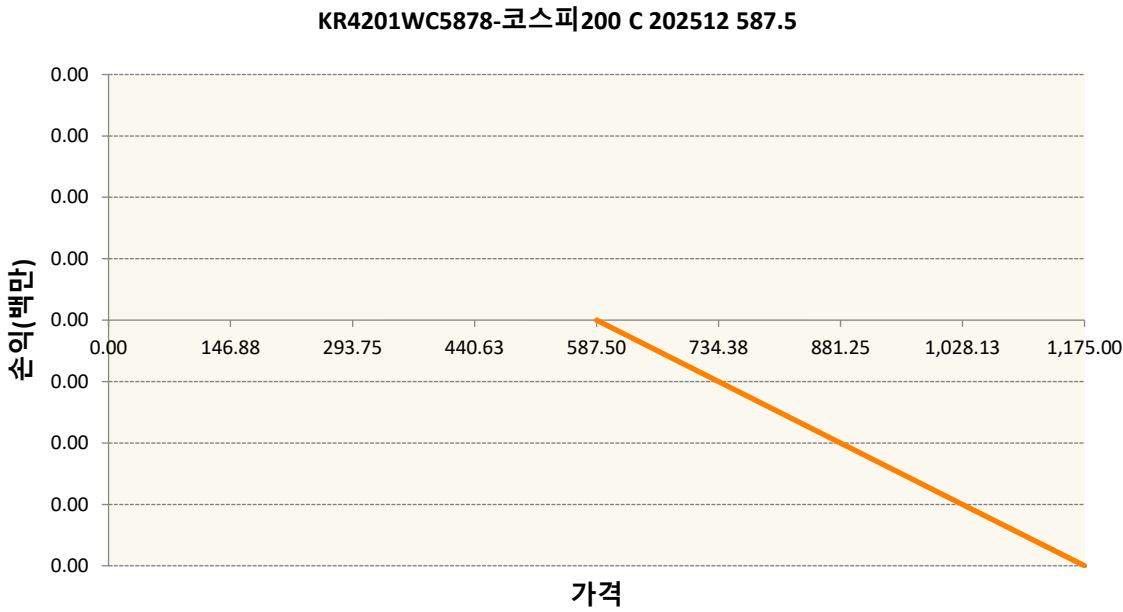
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

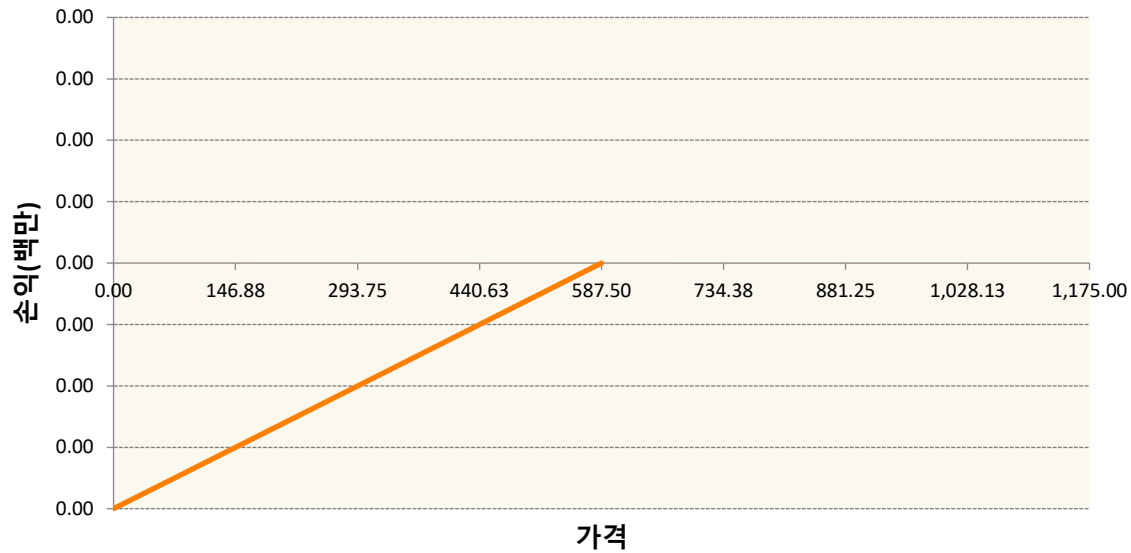
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 36,228 | -36,228   | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 35,319 | -35,319   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301WC5877-코스피200 P 202512 587.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WC5877-코스피200 C 202512 587.5

999

KR4201WC5877-코스피200 C 202512 590.0

1,298

KR4301WC5877-코스피200 P 202512 587.5

529

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-11-17

기준일 2025-11-14

## 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 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

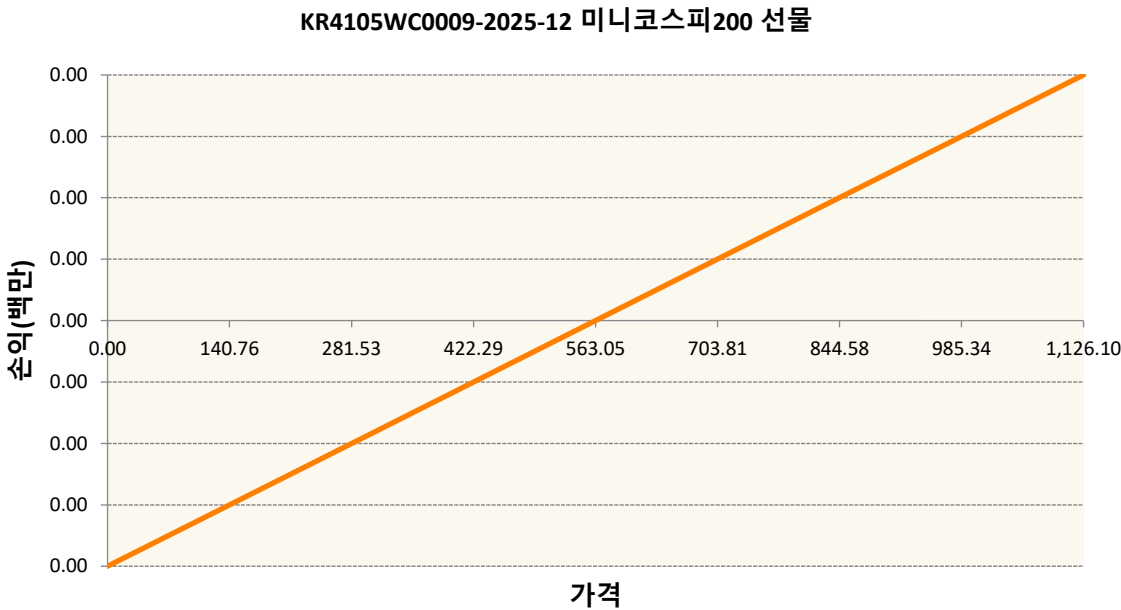
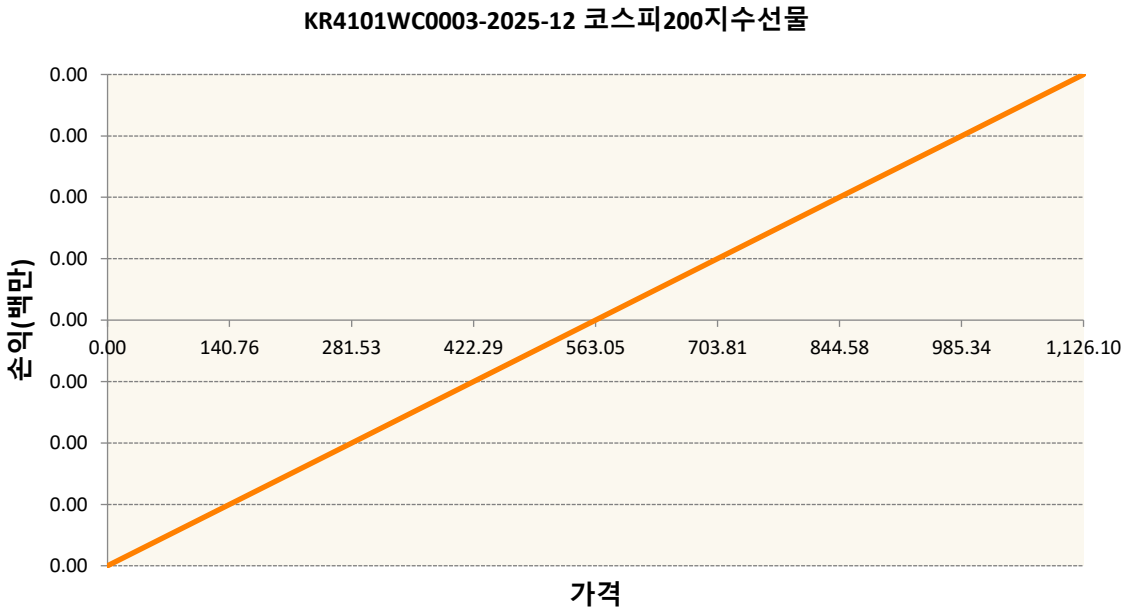
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

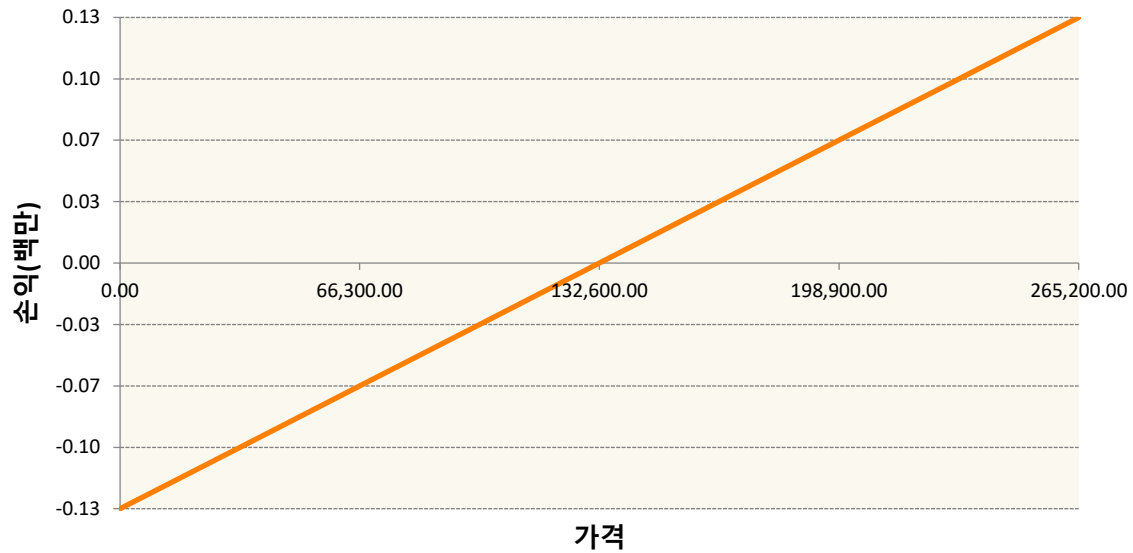
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,004 | 0     | 1,004     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### KR41FMWC0001-2025-12 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물  
 KR4105WC01 2025-12 미니코스피200 선물  
 KR41FMWCC 2025-12 엘앤에프개별선물

34  
 9  
 1

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

(단위:백만원)

5

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

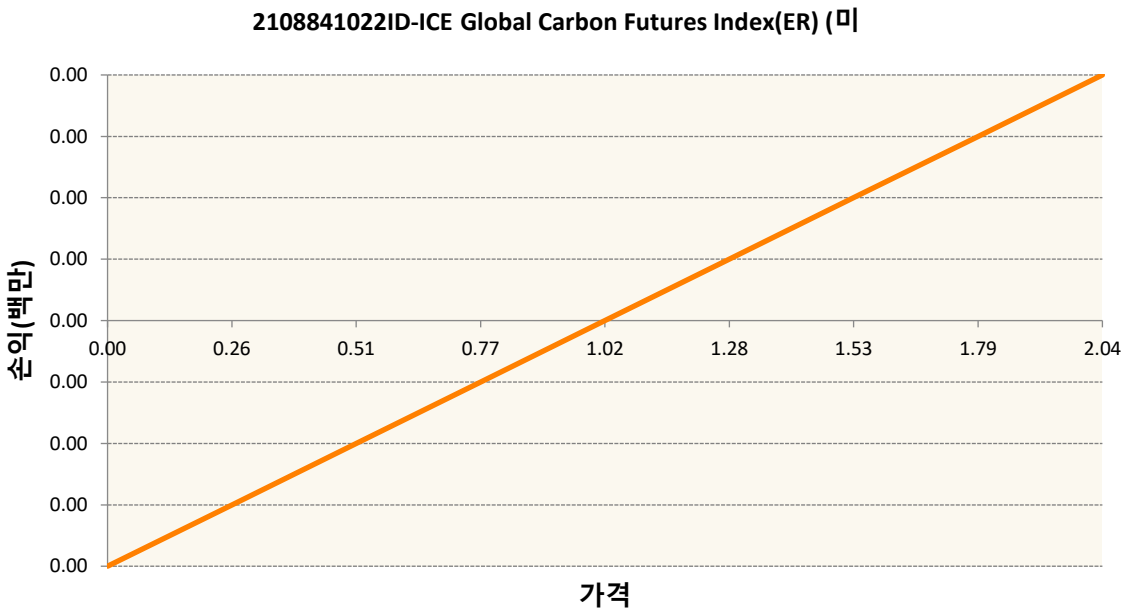
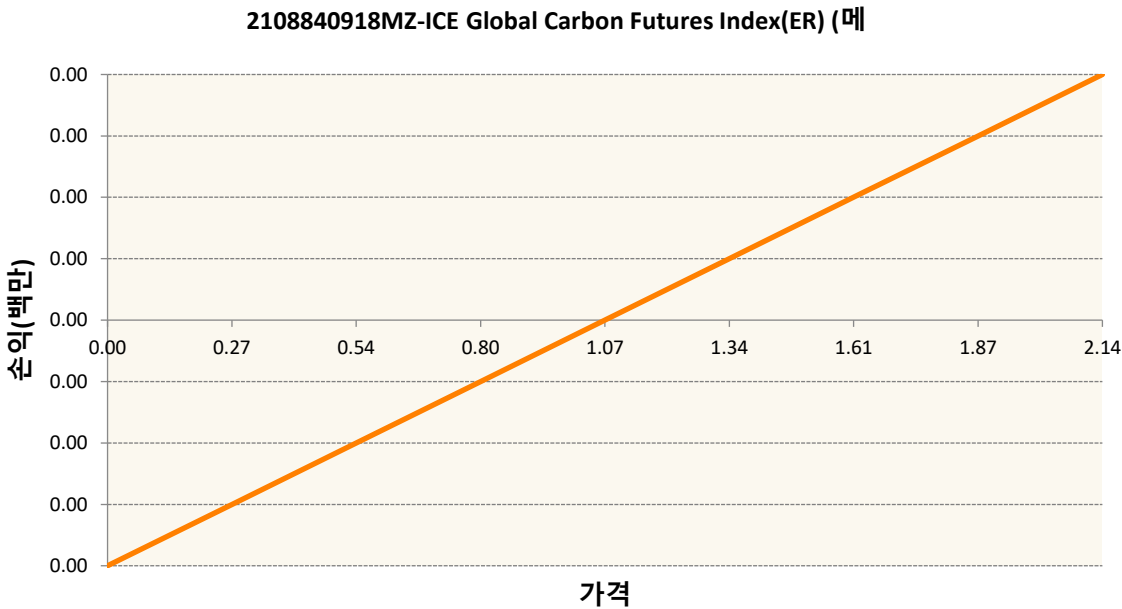
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 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   | 8,626 | 0     | 8,626     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 116      |
| 2108841022IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 576      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 670      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

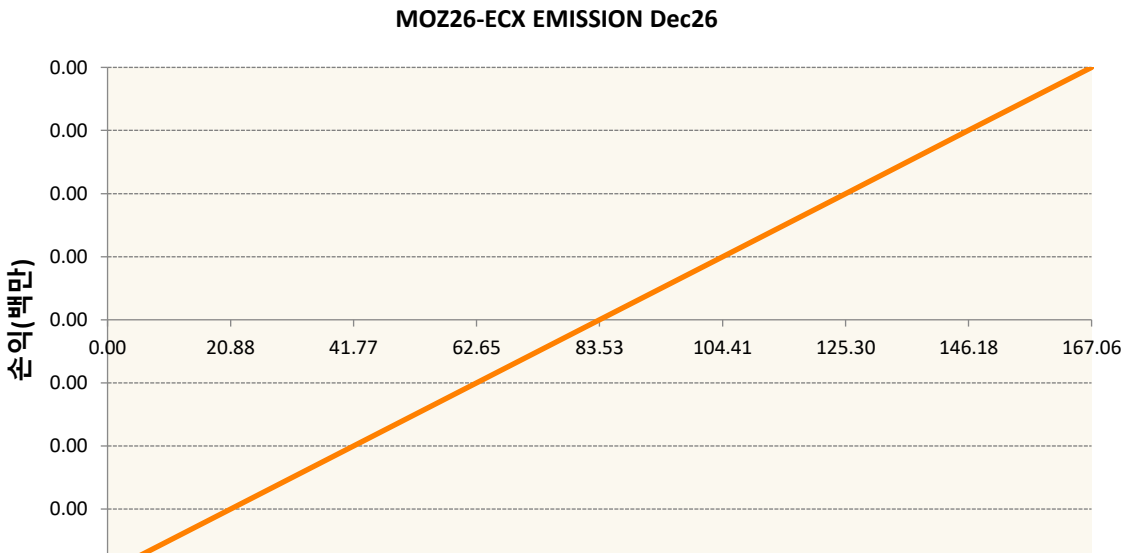
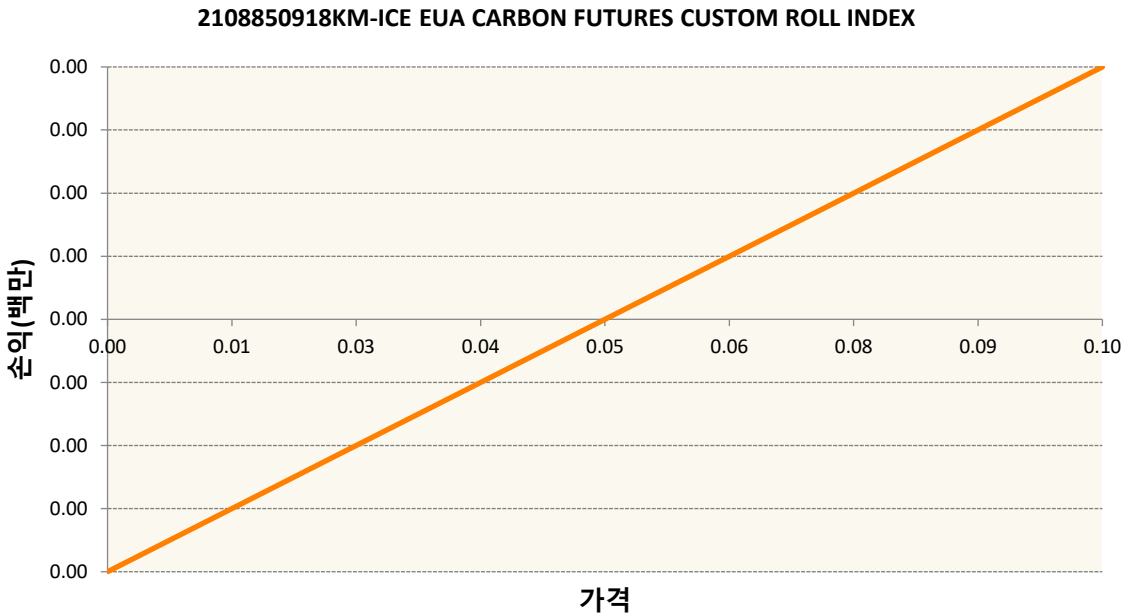
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 |      |      | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 |      |      | 6,497 | 0     | 6,497     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 20    | 0     | 20        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,543 | -2,543    | 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                         | 203 |
| MOZ26      ECX EMISSION Dec26                       | 520 |

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

(단위:백만원)

**818**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

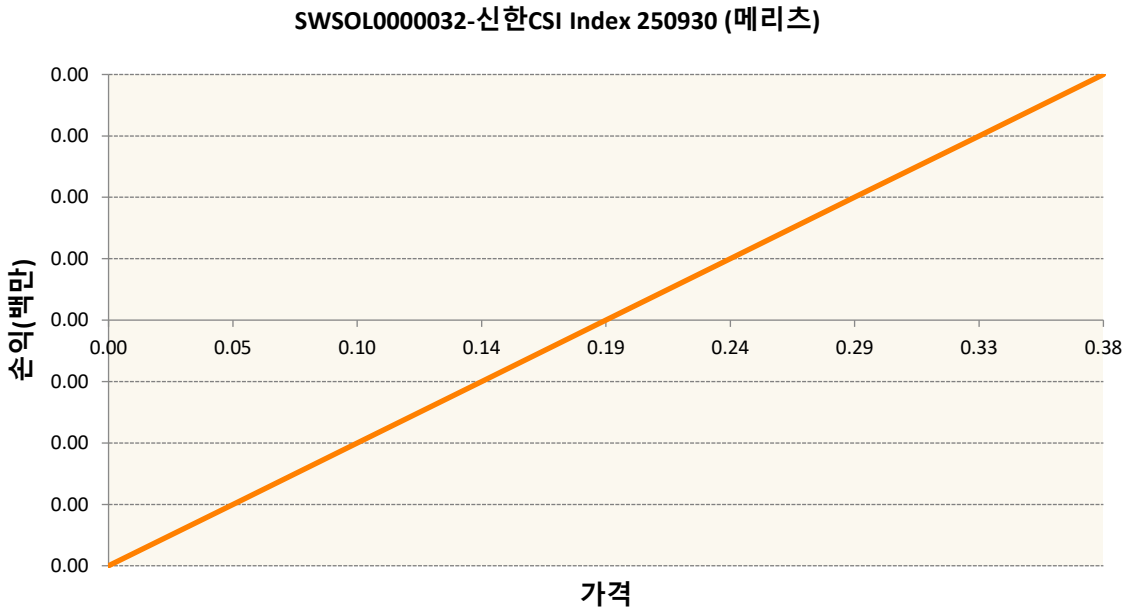
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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   | 2,973 | 0     | 2,973     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                |    |
|------------------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 23 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 15 |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 15 |
| SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)            | 38 |

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

(단위:백만원)

159

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

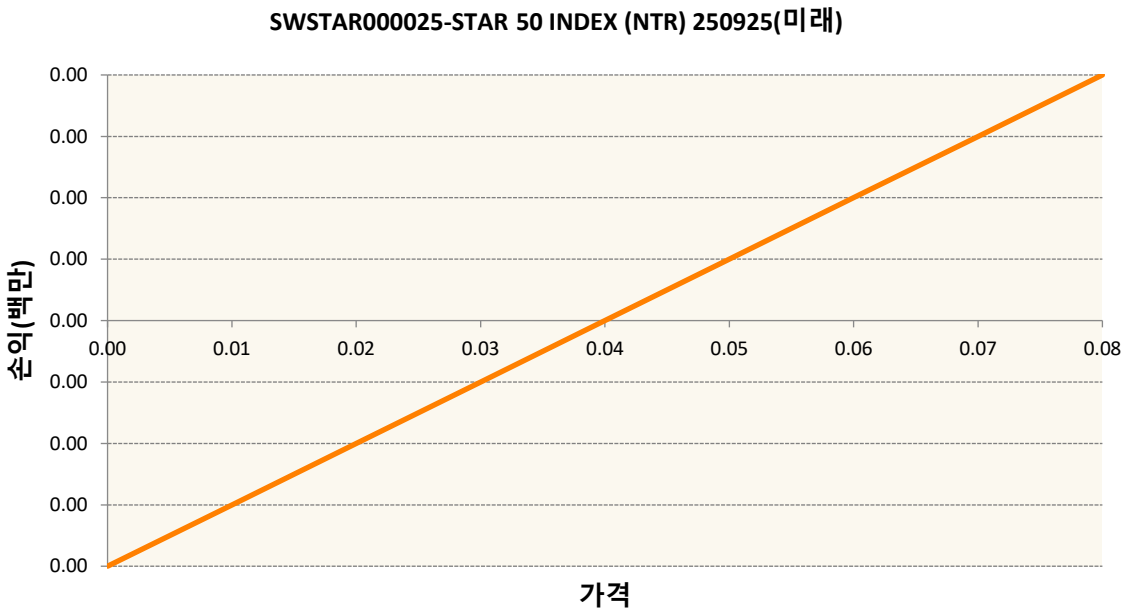
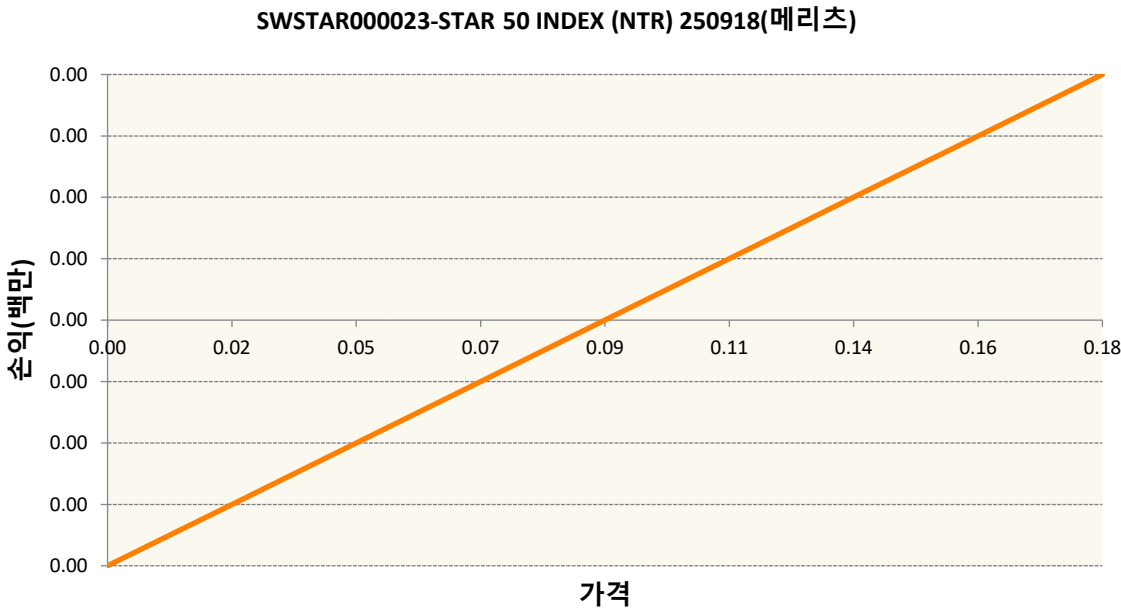
## SOL차이나육성산업엑티브상장지

### 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   | 4,585 | 0     | 4,585     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                  |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------------------|--|----------|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)     |  | 19       |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)     |  | 6        |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠) |  | 69       |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)  |  | 16       |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠) |  | 10       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 218      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

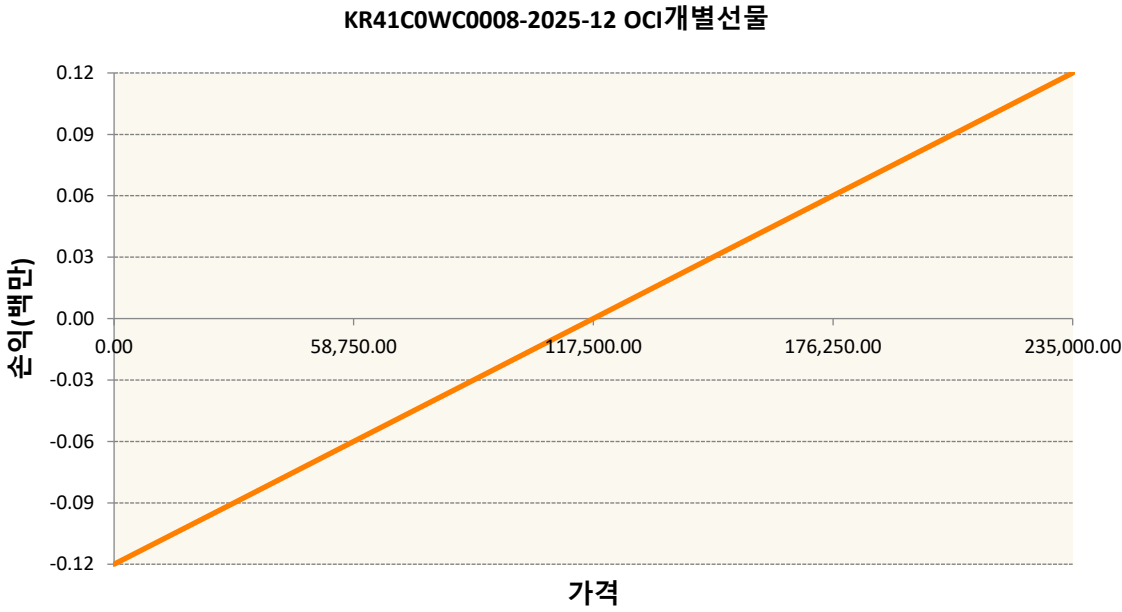
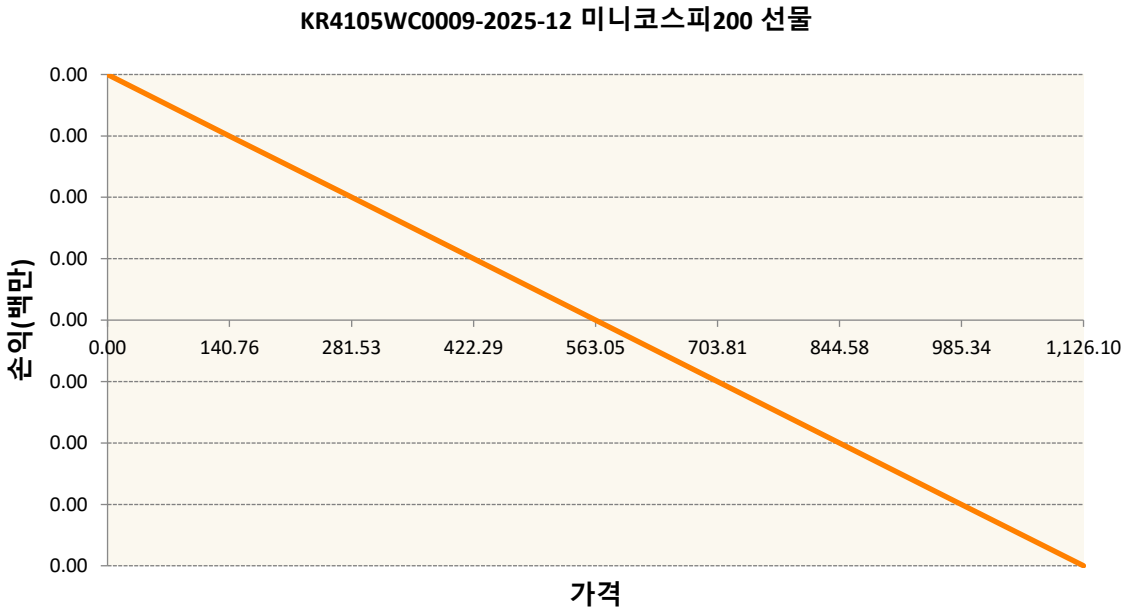
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

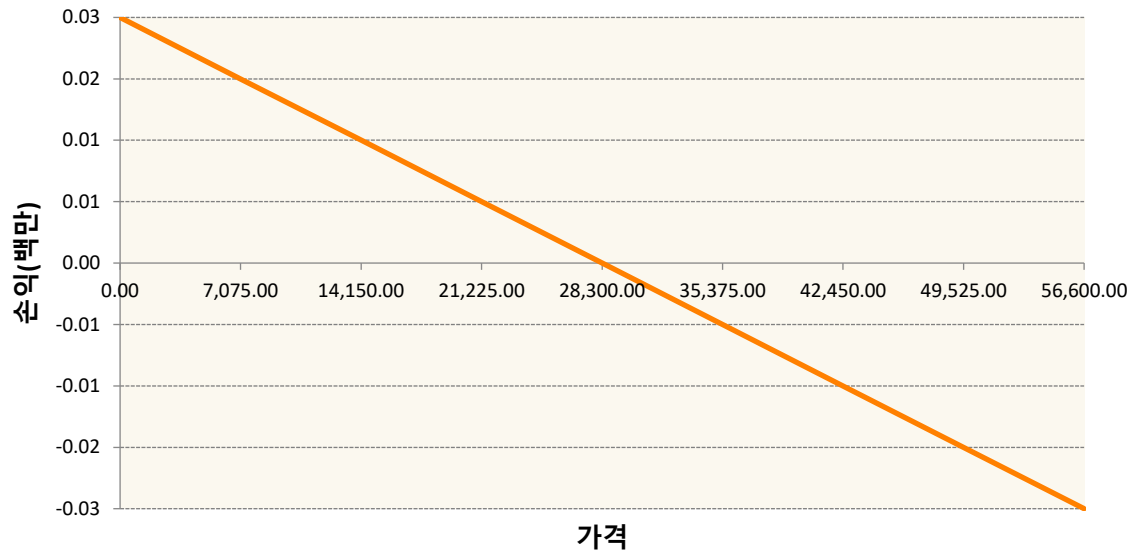
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 11    | 852   | -841      | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### KR41CBWC0007-2025-12 한화솔루션개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105WC0 2025-12 미니코스피200 선물  
 KR41C0WC0 2025-12 OCI개별선물  
 KR41CBWC0 2025-12 한화솔루션개별선물

|    |
|----|
| 14 |
| 1  |
| 1  |

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

(단위:백만원)

|   |
|---|
| 2 |
|---|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

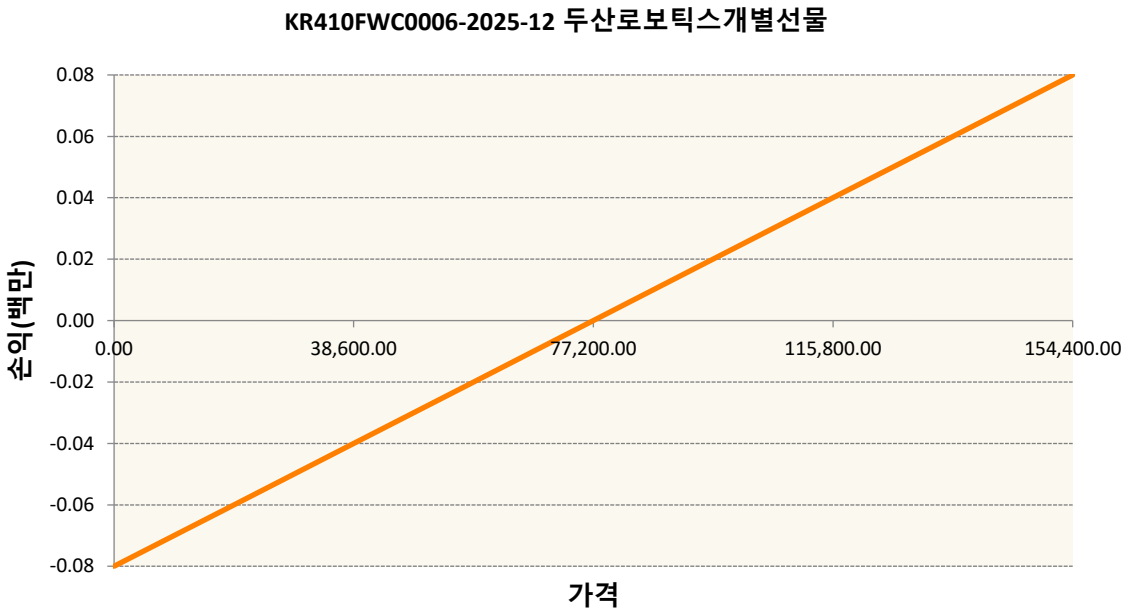
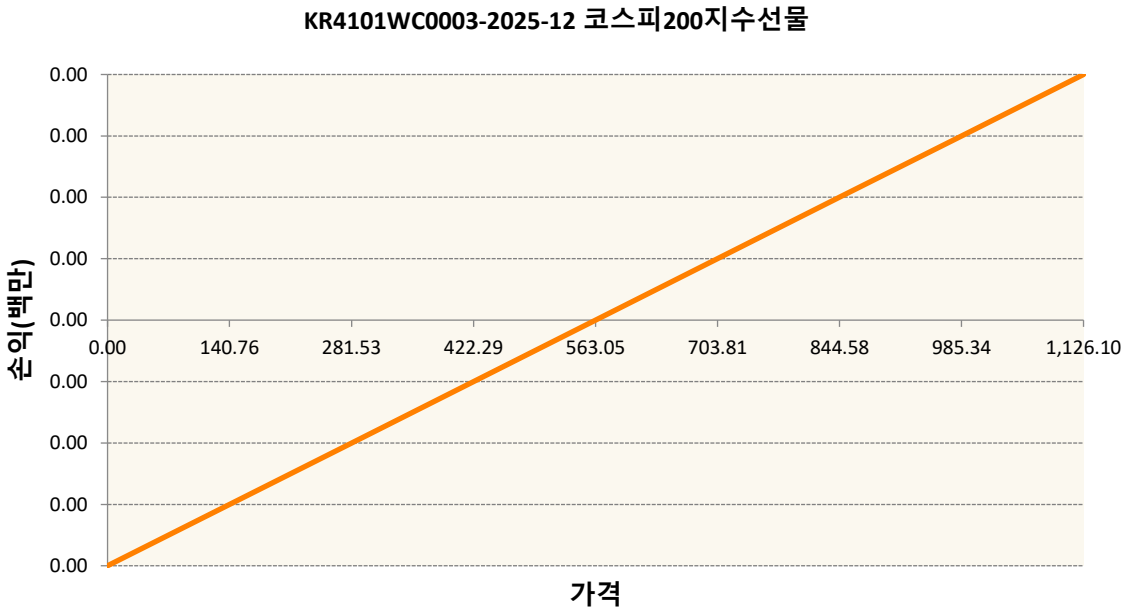
## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 1. 계약금액

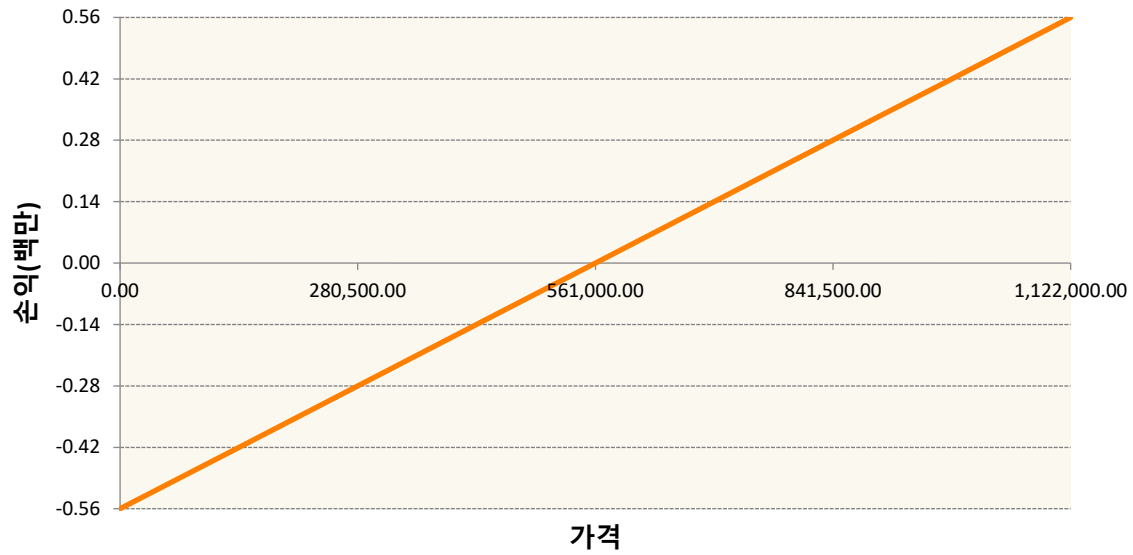
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 707    | 742   | -36       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 10,849 | 742   | 10,107    | 장내 |

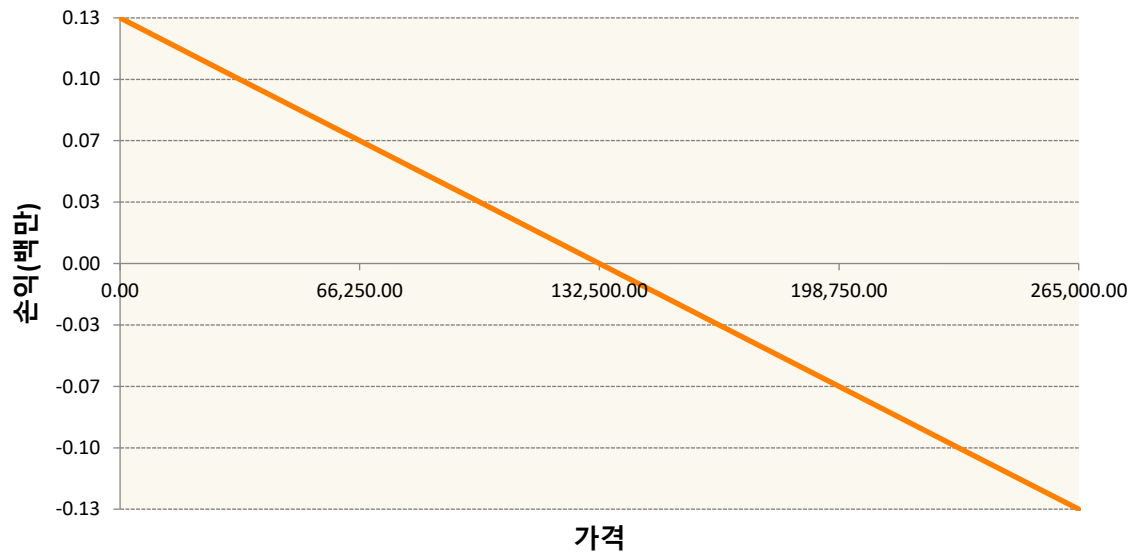
### 2. 만기시점의 손익구조



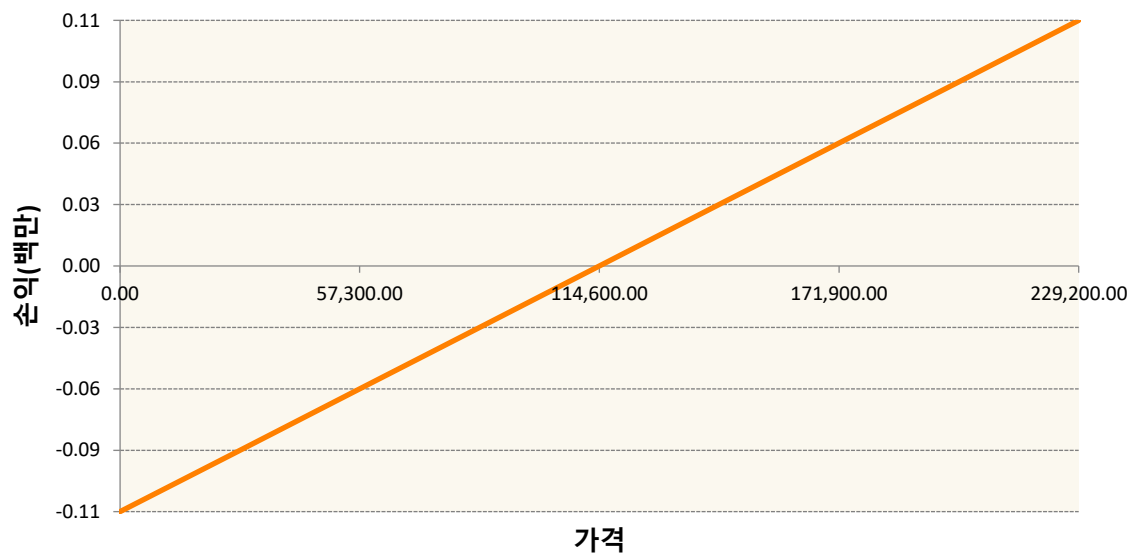
KR4150WC0003-2025-12 SK하이닉스개별선물



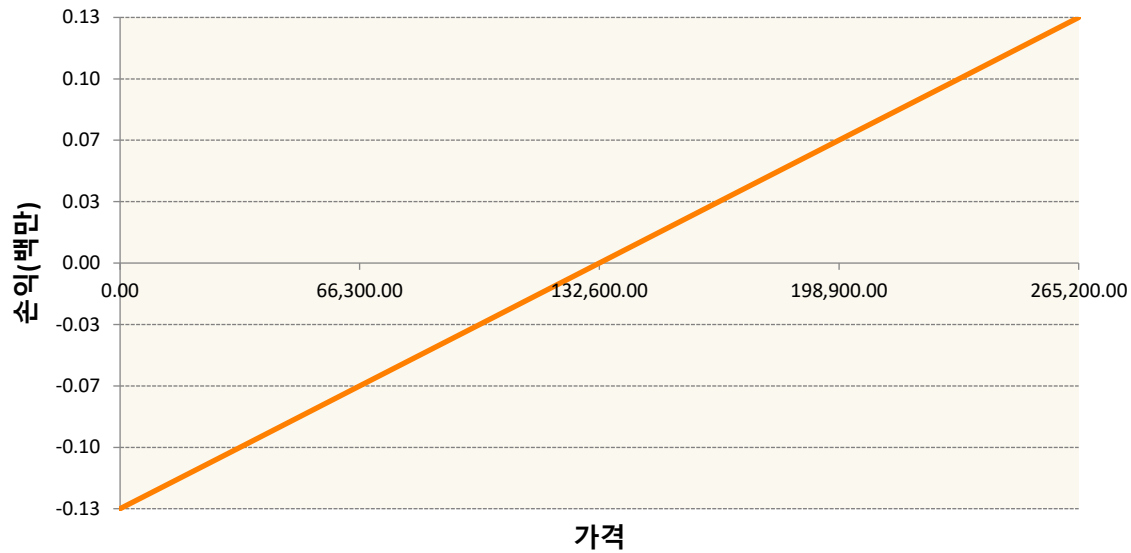
KR41D0WC0006-2025-12 DB손해보험개별선물



KR41EJWC0007-2025-12 SKC개별선물



### KR41FMWC0001-2025-12 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101WC0003 |           | 2025-12 코스피200지수선물 |        |      |       |        |        | 811  |
|--------------|-----------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|------|
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |      |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |      |
| -8.00%       | -811      | -811               | -811   | -811 | -811  | -811   | -811   | -811 |
| -5.33%       | -541      | -541               | -541   | -541 | -541  | -541   | -541   | -541 |
| -2.67%       | -270      | -270               | -270   | -270 | -270  | -270   | -270   | -270 |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      | 0    |
| 2.67%        | 270       | 270                | 270    | 270  | 270   | 270    | 270    | 270  |
| 5.33%        | 541       | 541                | 541    | 541  | 541   | 541    | 541    | 541  |
| 8.00%        | 811       | 811                | 811    | 811  | 811   | 811    | 811    | 811  |
|              |           |                    |        |      |       |        |        |      |
| KR4150WC0003 |           | 2025-12 SK하이닉스개별선물 |        |      |       |        |        | 3    |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |      |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |      |
| -8.00%       | -3        | -3                 | -3     | -3   | -3    | -3     | -3     | -3   |
| -5.33%       | -2        | -2                 | -2     | -2   | -2    | -2     | -2     | -2   |
| -2.67%       | -1        | -1                 | -1     | -1   | -1    | -1     | -1     | -1   |
| 0%           | 0         | 0                  | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      | 0    |
| 2.67%        | 1         | 1                  | 1      | 1    | 1     | 1      | 1      | 1    |
| 5.33%        | 2         | 2                  | 2      | 2    | 2     | 2      | 2      | 2    |
| 8.00%        | 3         | 3                  | 3      | 3    | 3     | 3      | 3      | 3    |
|              |           |                    |        |      |       |        |        |      |
| KR41D0WC0006 |           | 2025-12 DB손해보험개별선물 |        |      |       |        |        | 59   |
|              | 기초자산의 변동성 |                    |        |      |       |        |        |      |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%            | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |      |
| -8.00%       | 59        | 59                 | 59     | 59   | 59    | 59     | 59     | 59   |
| -5.33%       | 40        | 40                 | 40     | 40   | 40    | 40     | 40     | 40   |
| -2.67%       | 20        | 20                 | 20     | 20   | 20    | 20     | 20     | 20   |

|                               |         |         |        |     |       |        |        |
|-------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | -20     | -20     | -20    | -20 | -20   | -20    | -20    |
| 5.33%                         | -40     | -40     | -40    | -40 | -40   | -40    | -40    |
| 8.00%                         | -59     | -59     | -59    | -59 | -59   | -59    | -59    |
| KR41EJWC0007 2025-12 SKC개별선물  |         |         |        |     |       |        | 23     |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | -23     | -23     | -23    | -23 | -23   | -23    | -23    |
| -5.33%                        | -16     | -16     | -16    | -16 | -16   | -16    | -16    |
| -2.67%                        | -8      | -8      | -8     | -8  | -8    | -8     | -8     |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | 8       | 8       | 8      | 8   | 8     | 8      | 8      |
| 5.33%                         | 16      | 16      | 16     | 16  | 16    | 16     | 16     |
| 8.00%                         | 23      | 23      | 23     | 23  | 23    | 23     | 23     |
| KR41FMWC0001 2025-12 엘앤에프개별선물 |         |         |        |     |       |        | 14     |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | -14     | -14     | -14    | -14 | -14   | -14    | -14    |
| -5.33%                        | -9      | -9      | -9     | -9  | -9    | -9     | -9     |
| -2.67%                        | -5      | -5      | -5     | -5  | -5    | -5     | -5     |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | 5       | 5       | 5      | 5   | 5     | 5      | 5      |
| 5.33%                         | 9       | 9       | 9      | 9   | 9     | 9      | 9      |
| 8.00%                         | 14      | 14      | 14     | 14  | 14    | 14     | 14     |

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

(단위:백만원)

1,097

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

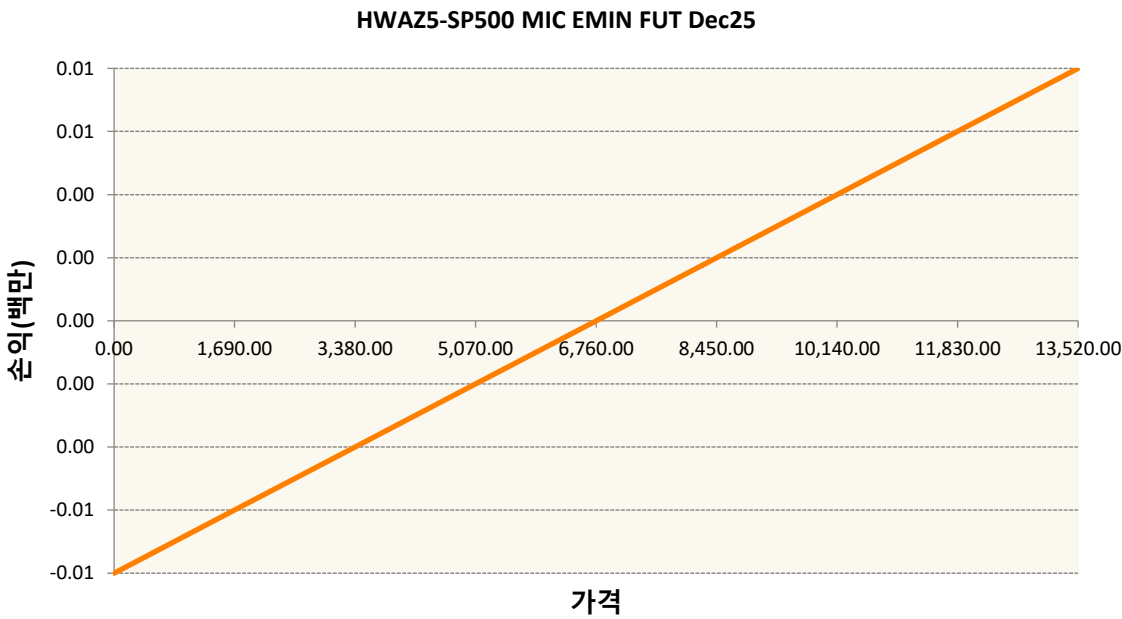
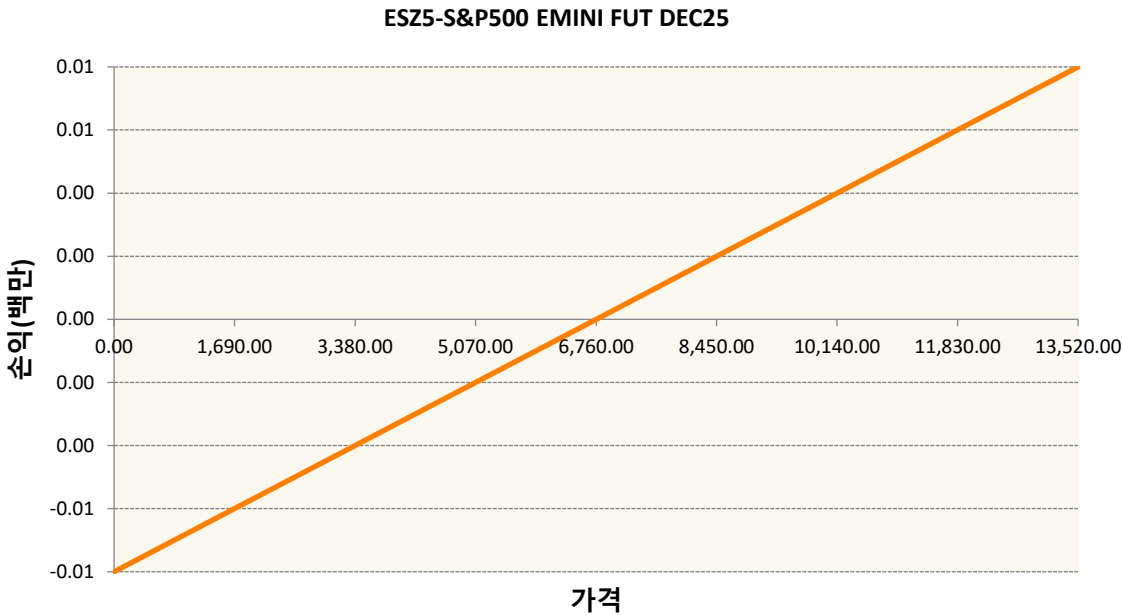
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 40,967 | 0     | 40,967    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,267  | 0     | 1,267     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ5                      | S&P500 EMINI FUT DEC25   | 3,277    |
| HWAZ5                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec25 | 101      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 4,837    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

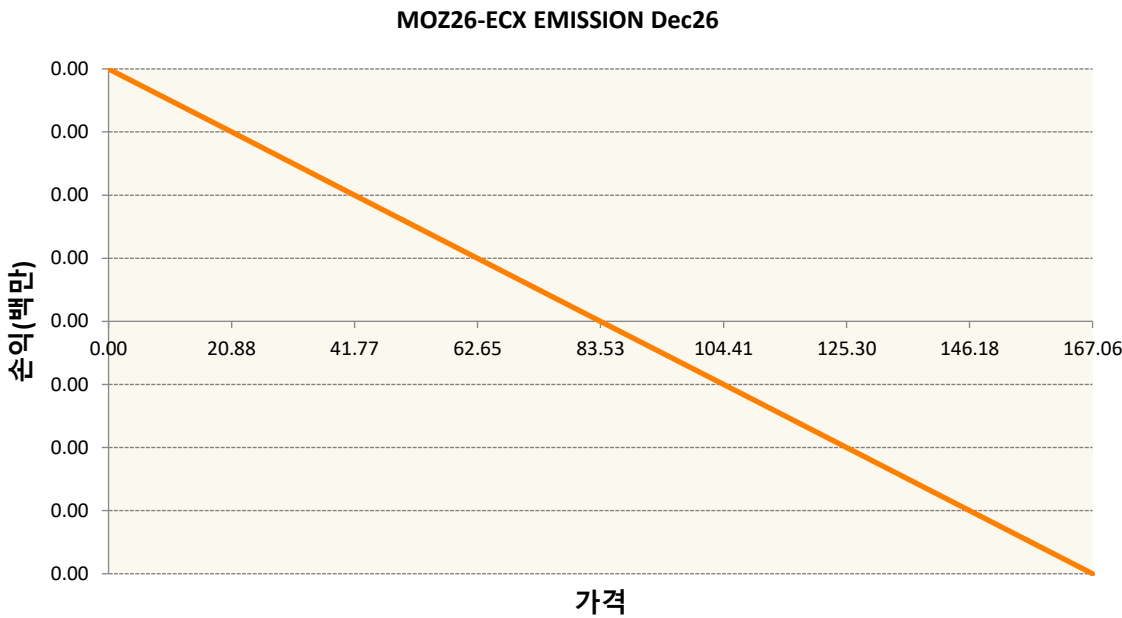
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 |      |      | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 |      |      | 0     | 3,459 | -3,459    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | -20   | 0     | -20       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,177 | -1,177    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                     |     |
|-----------------------------------------------------|-----|
| 2109930918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX | 2   |
| FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E                         | 94  |
| MOZ26 ECX EMISSION Dec26                            | 277 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 427 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

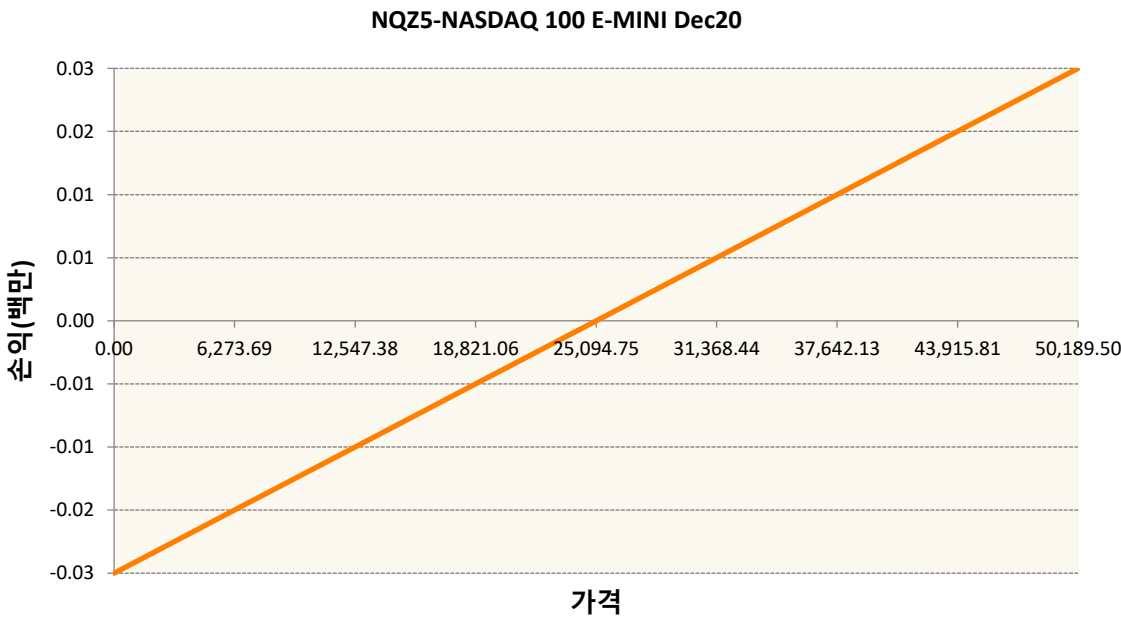
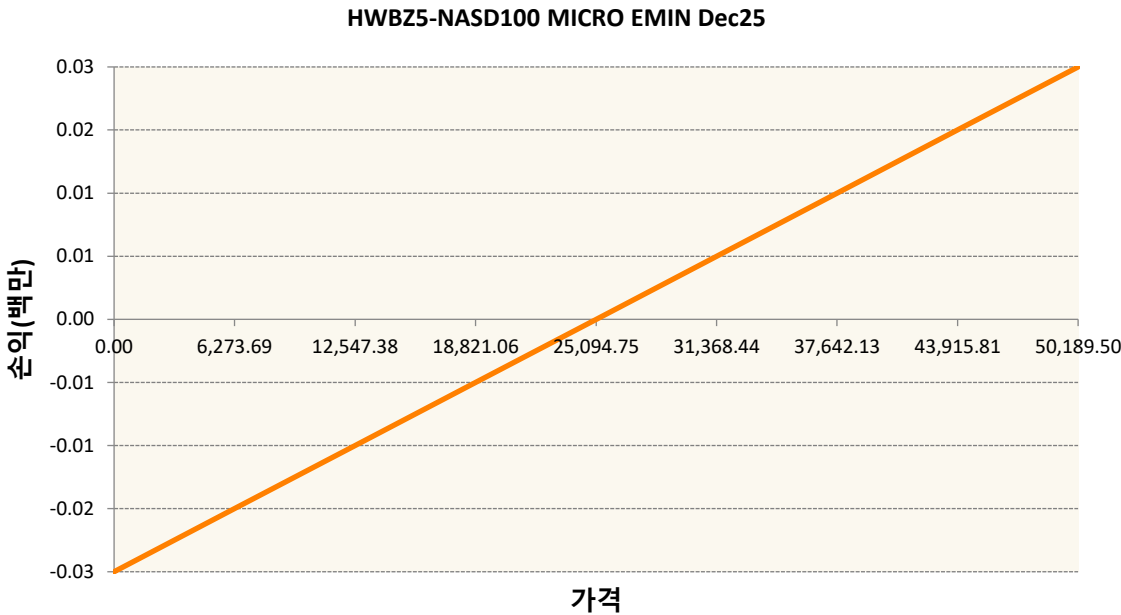
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 18,183 | 0     | 18,183    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,396  | 0     | 1,396     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| HWBZ5                     | NASD100 MICRO EMIN Dec25 | 112      |
| NQZ5                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  | 1,455    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,756    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

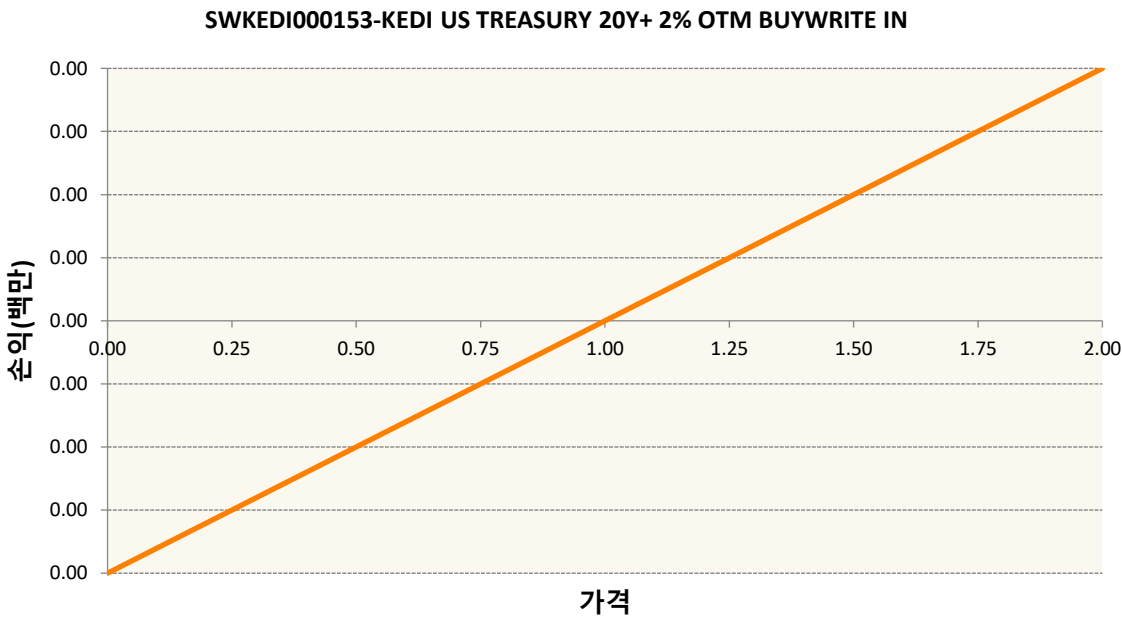
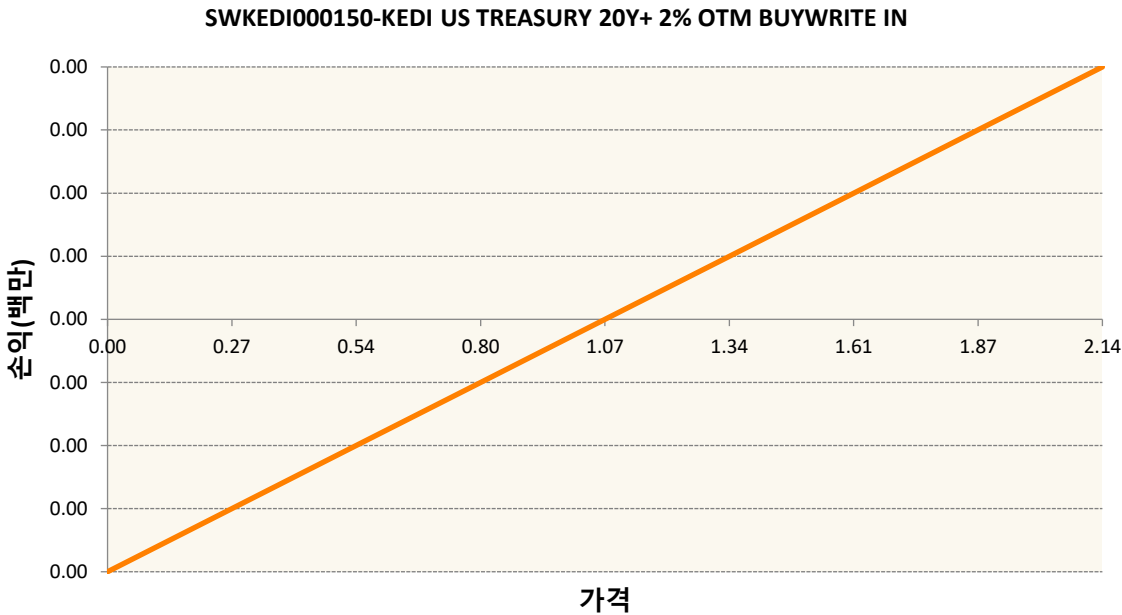
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

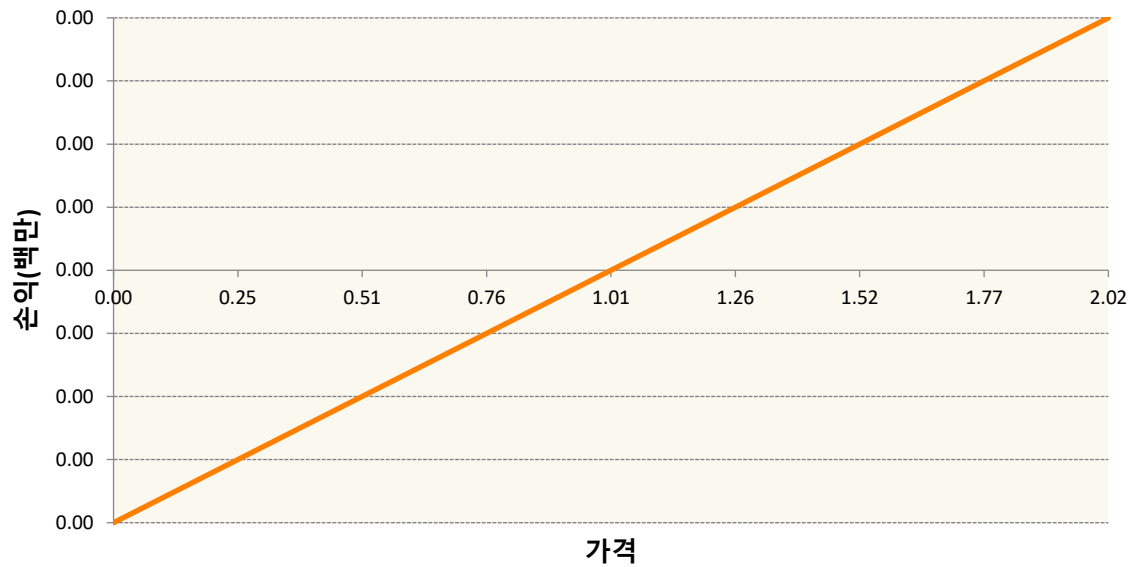
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 384,624 | 0     | 384,624   | 장외 |

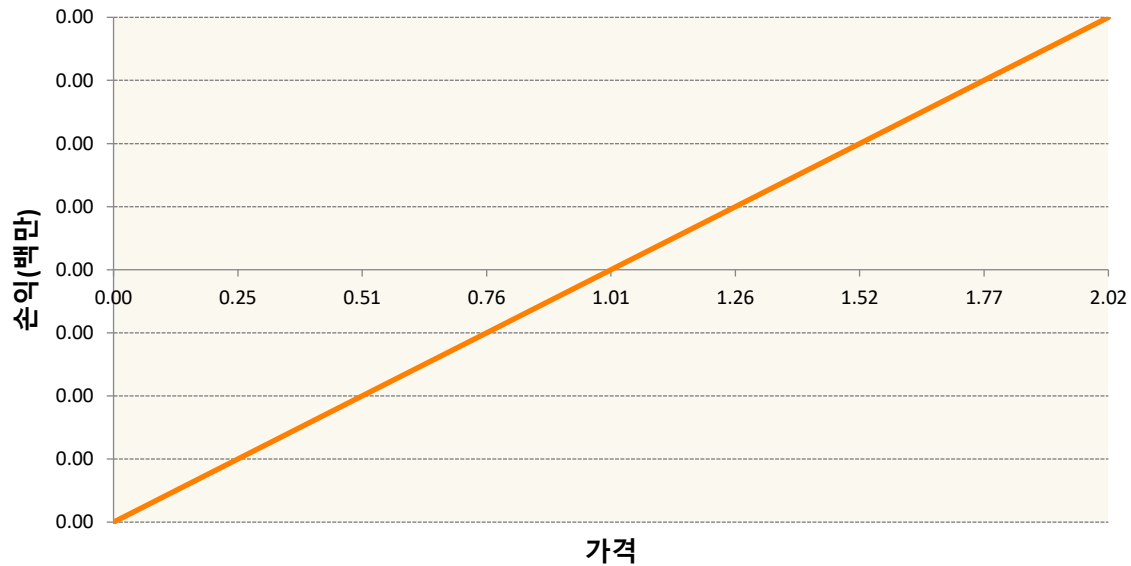
### 2. 만기시점의 손익구조



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 | 8,193  |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 3,771  |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 10,204 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 8,576  |

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

(단위:백만원)

14,610

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

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   | 2,348 | 0     | 2,348     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                    |   |
|----------------------------------------------------|---|
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 8 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 8 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 8 |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 8 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 45 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-17 |
| 기준일 | 2025-11-14 |

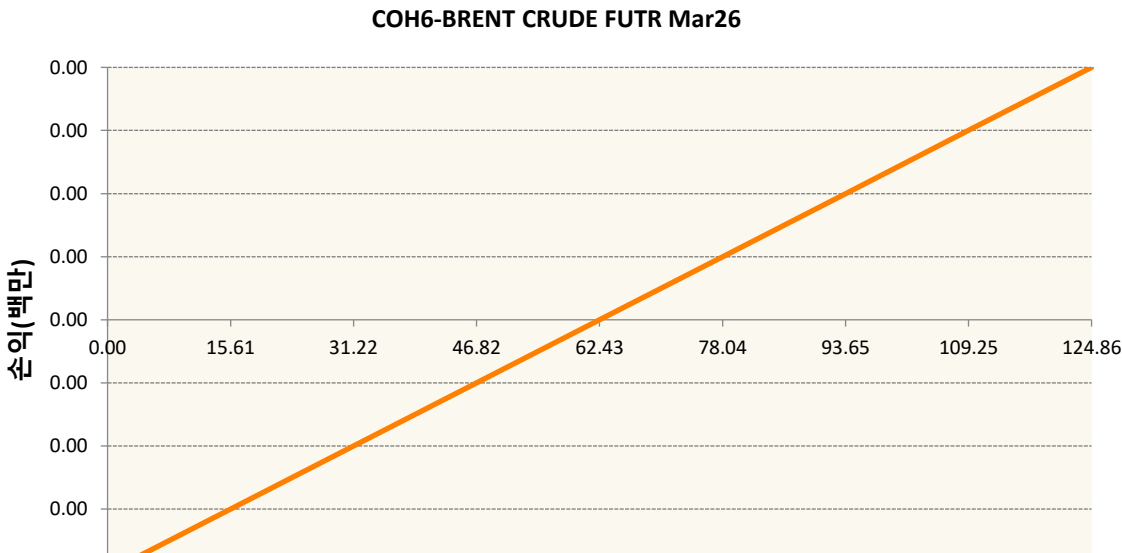
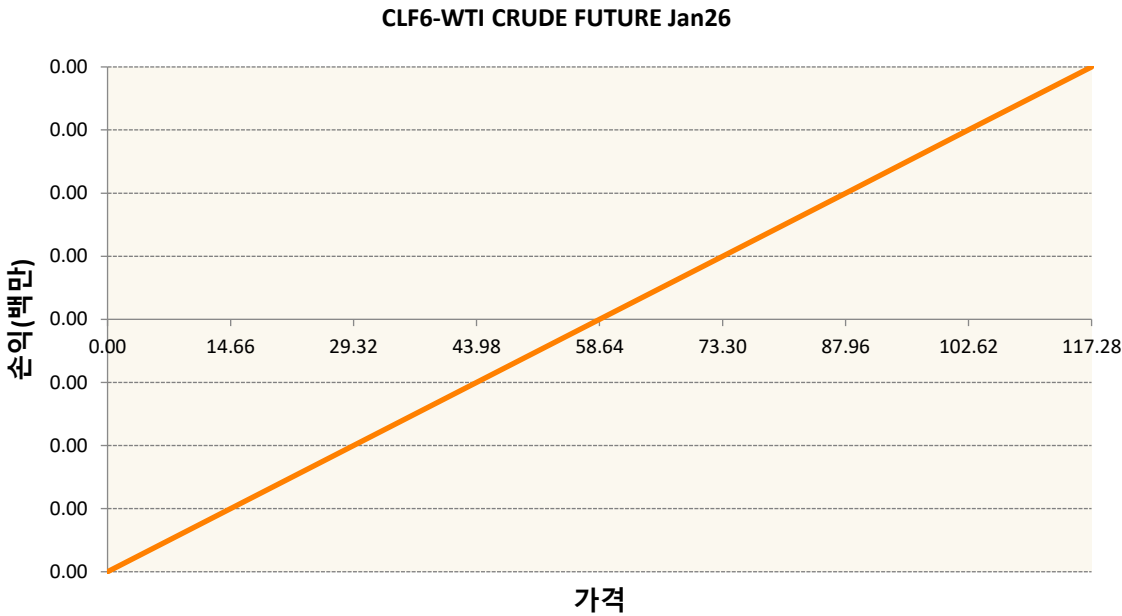
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

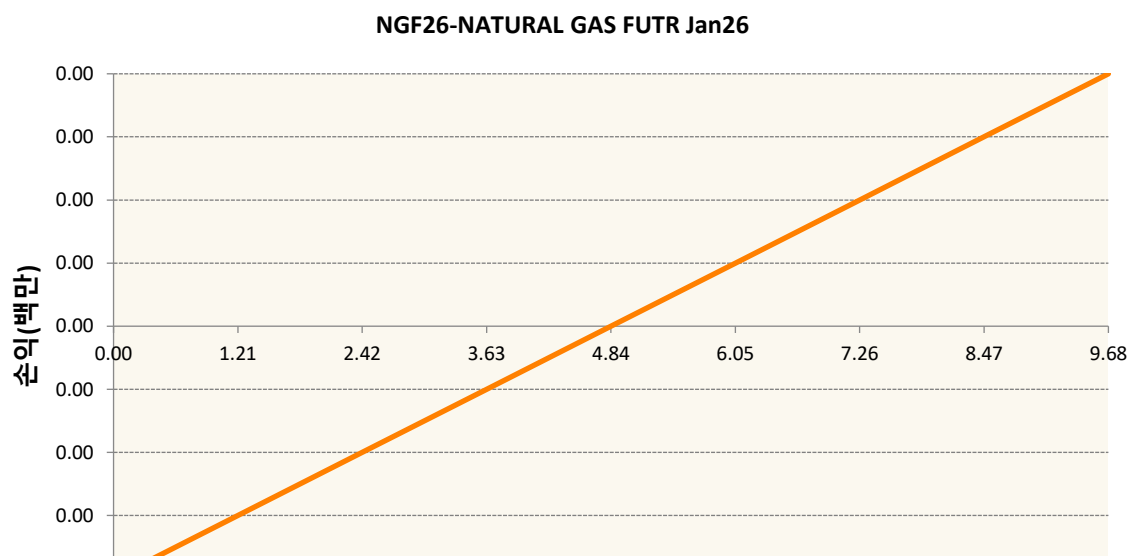
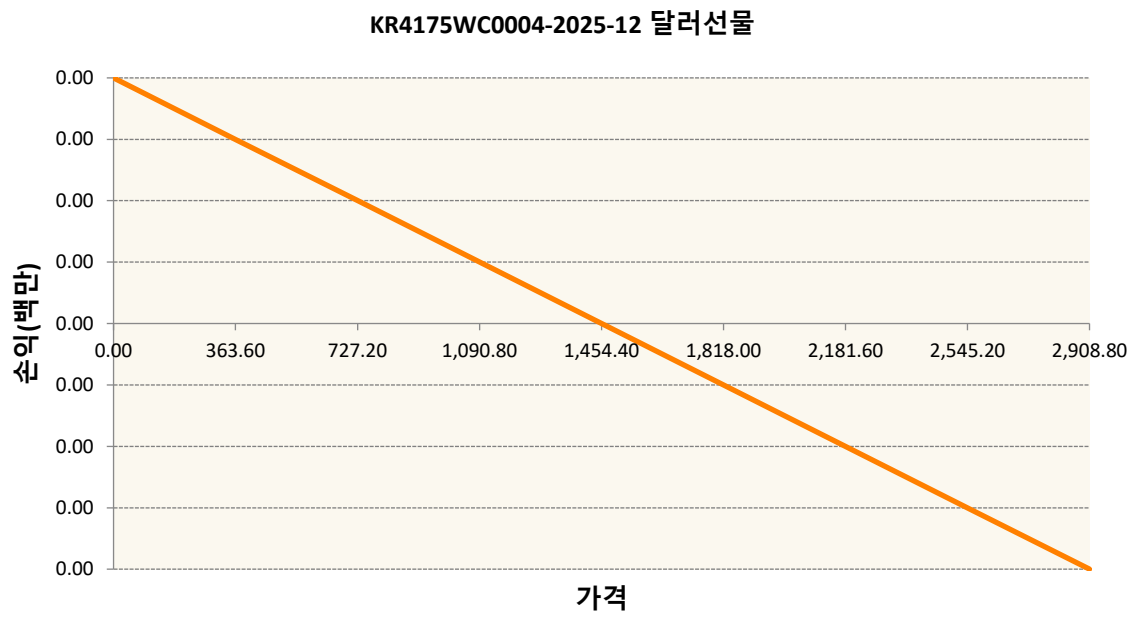
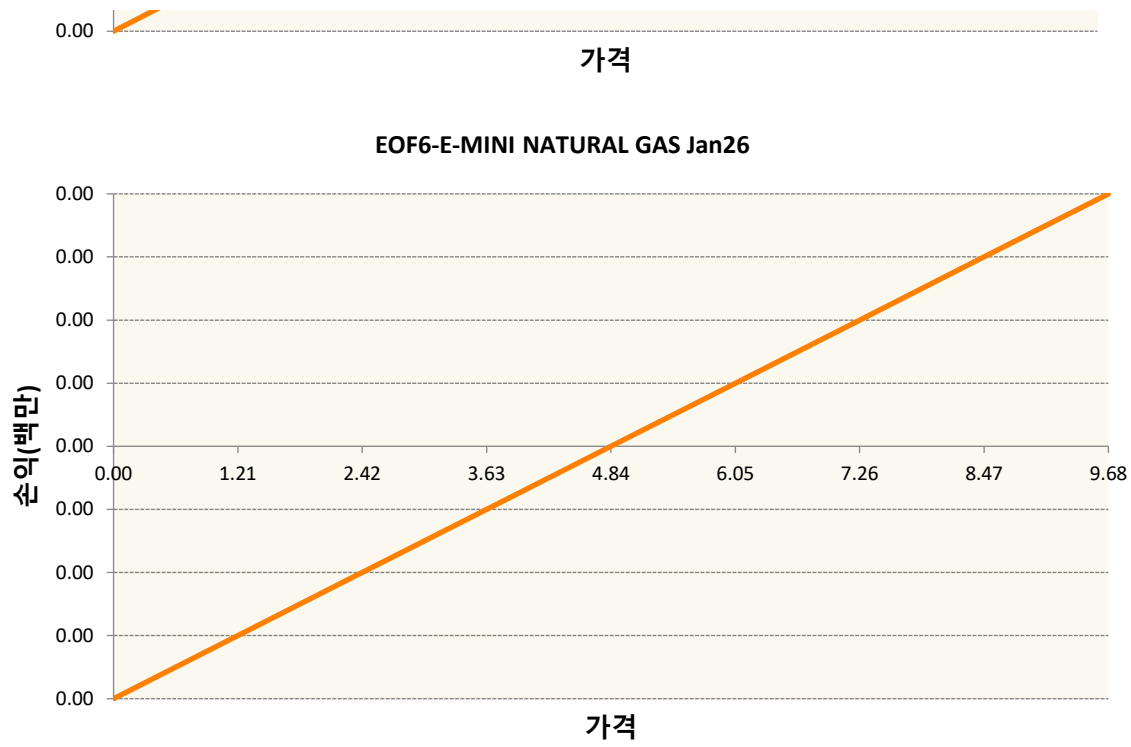
### 1. 계약금액

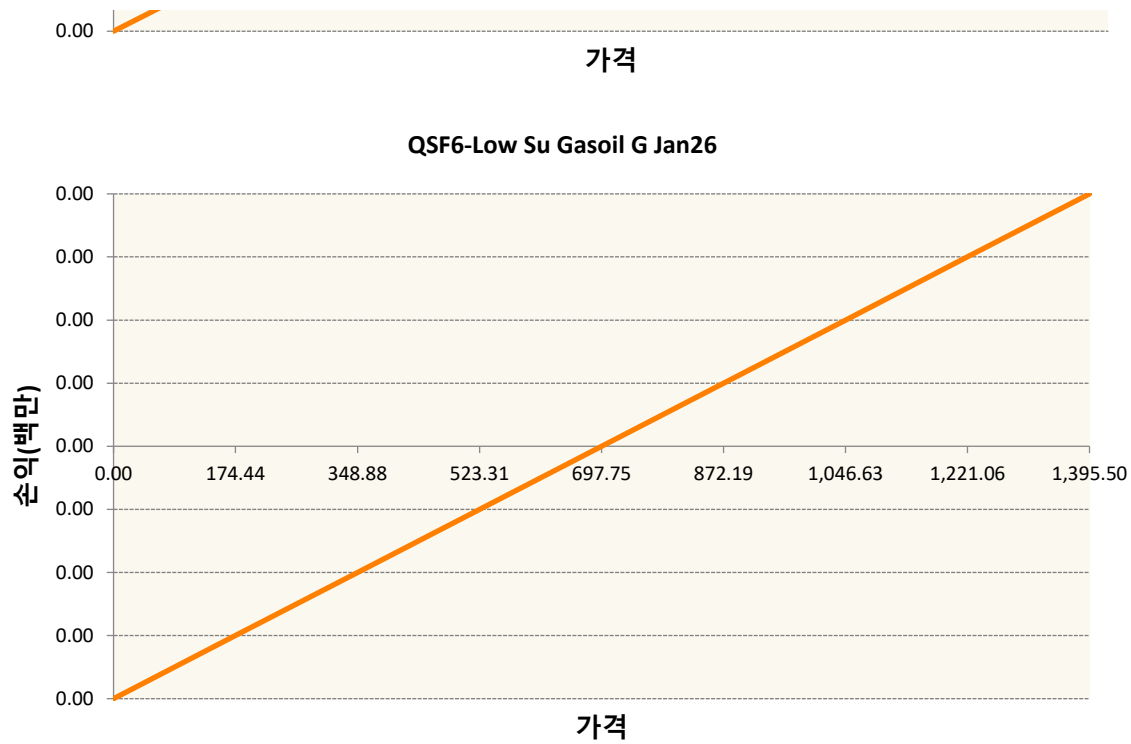
(단위:백만원)

| 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     | 29    | -29       | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 373   | 0     | 373       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 183   | 0     | 183       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 131   | -131      | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조







### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                          |    |
|------------|--------------------------|----|
| CLF6       | WTI CRUDE FUTURE Jan26   | 7  |
| COH6       | BRENT CRUDE FUTR Mar26   | 15 |
| EOF6       | E-MINI NATURAL GAS Jan26 | 4  |
| KR4175WC01 | 2025-12 달러선물             | 10 |
| NGF26      | NATURAL GAS FUTR Jan26   | 11 |
| QSF6       | Low Su Gasoil G Jan26    | 8  |

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

(단위:백만원)

98