

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

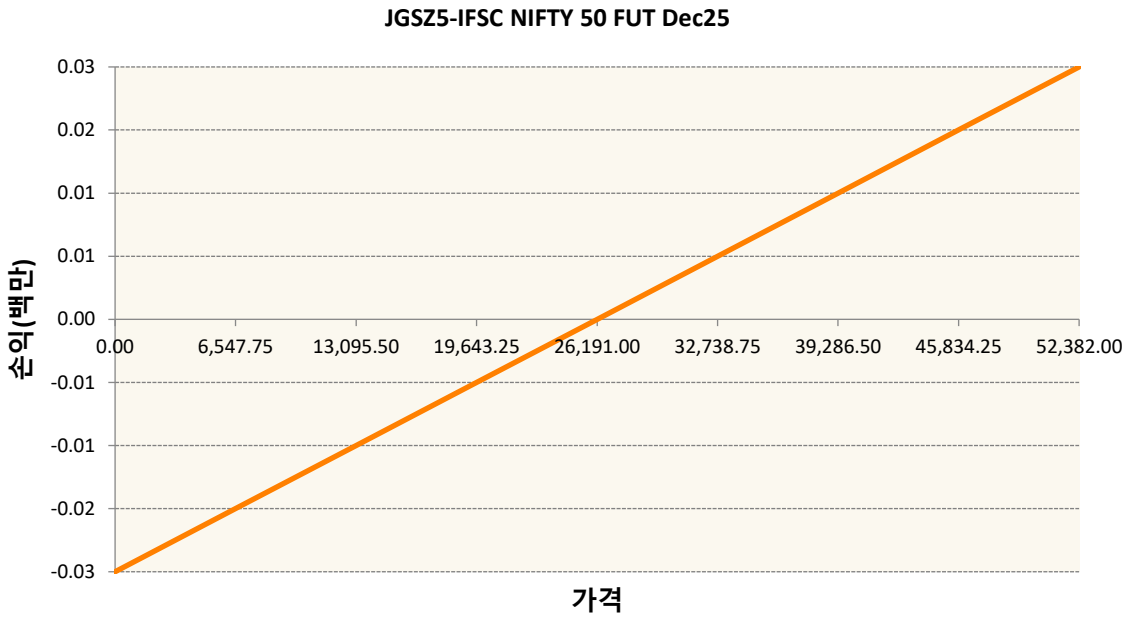
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	지수	선물	619	0	619	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

INE423A200` Adani Enterprises Ltd	0
JGSZ5 IFSC NIFTY 50 FUT Dec25	50

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

(단위:백만원)

31

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

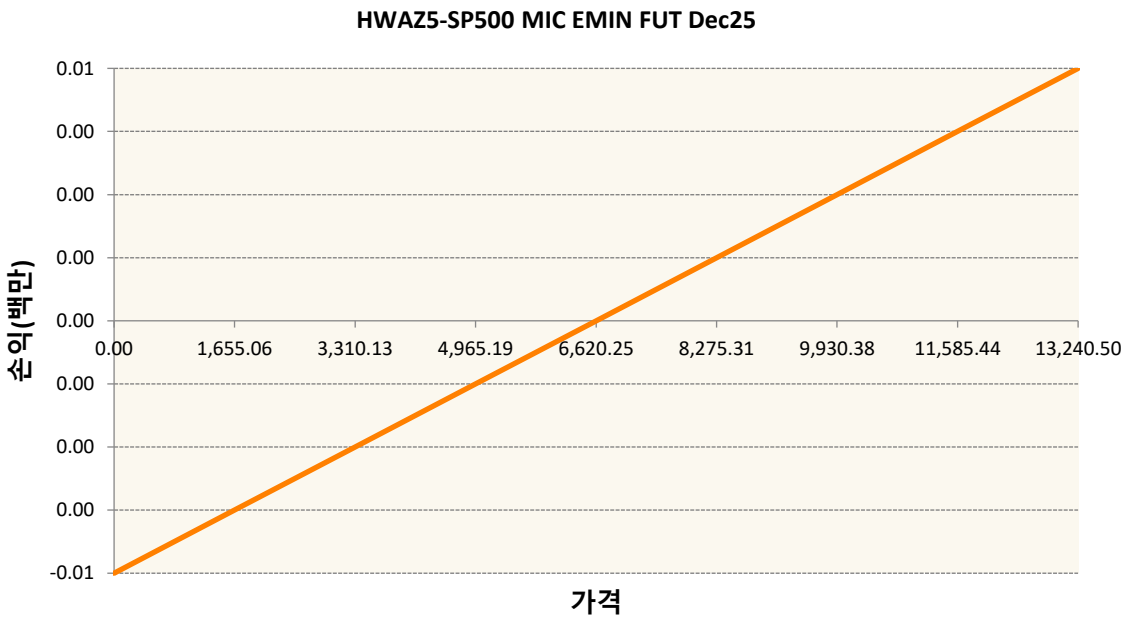
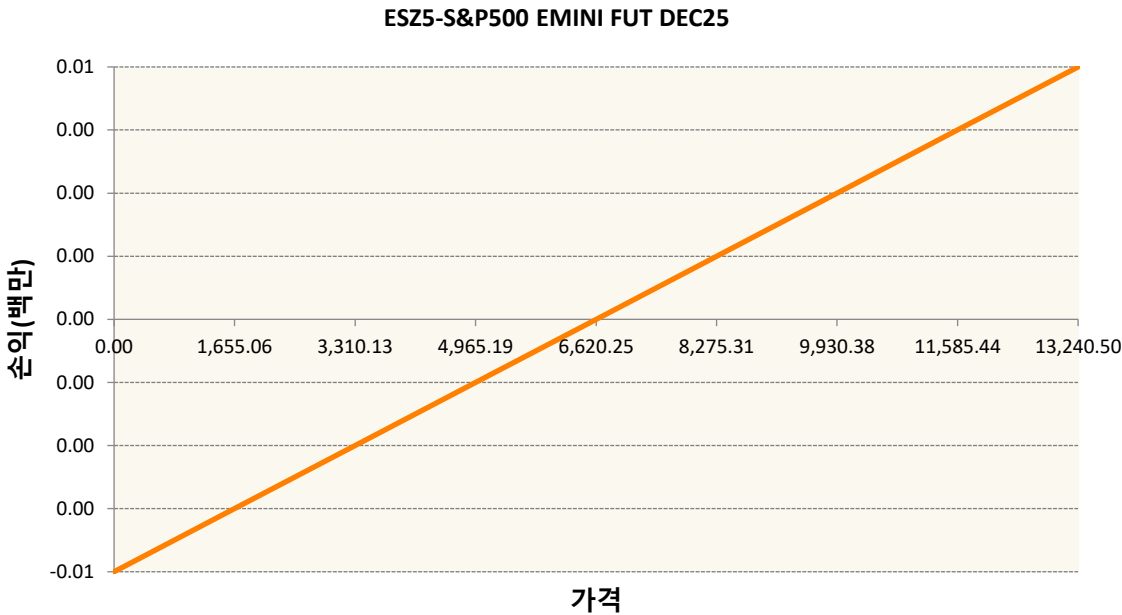
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	459	0	459	
누계	유가증권	선물	184	0	184	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	37
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	15

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	66

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

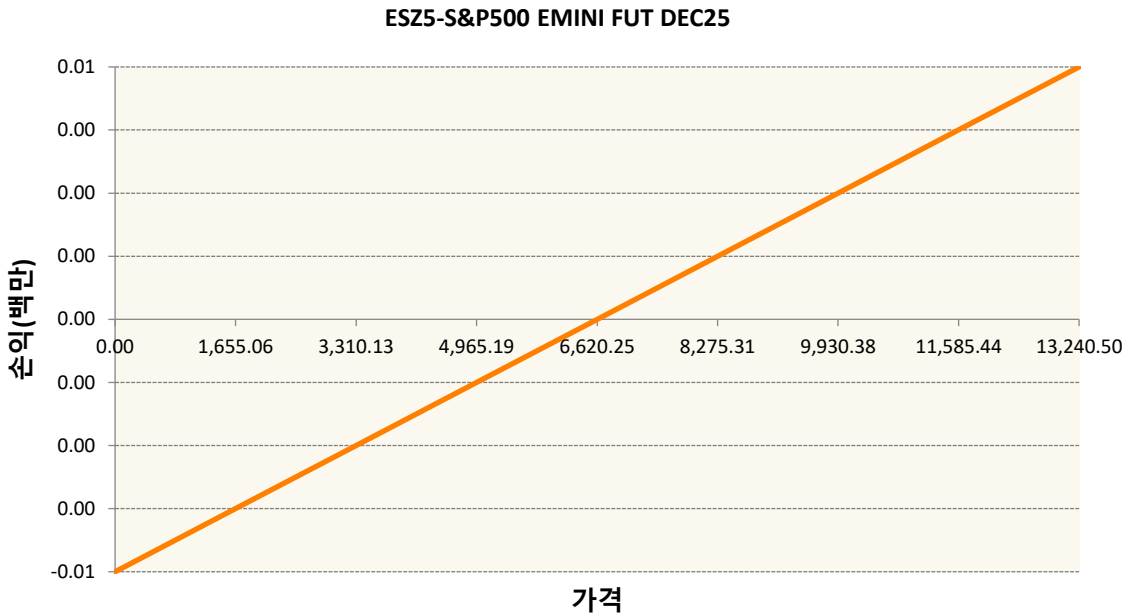
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,377	0	1,377	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	110
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

160

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

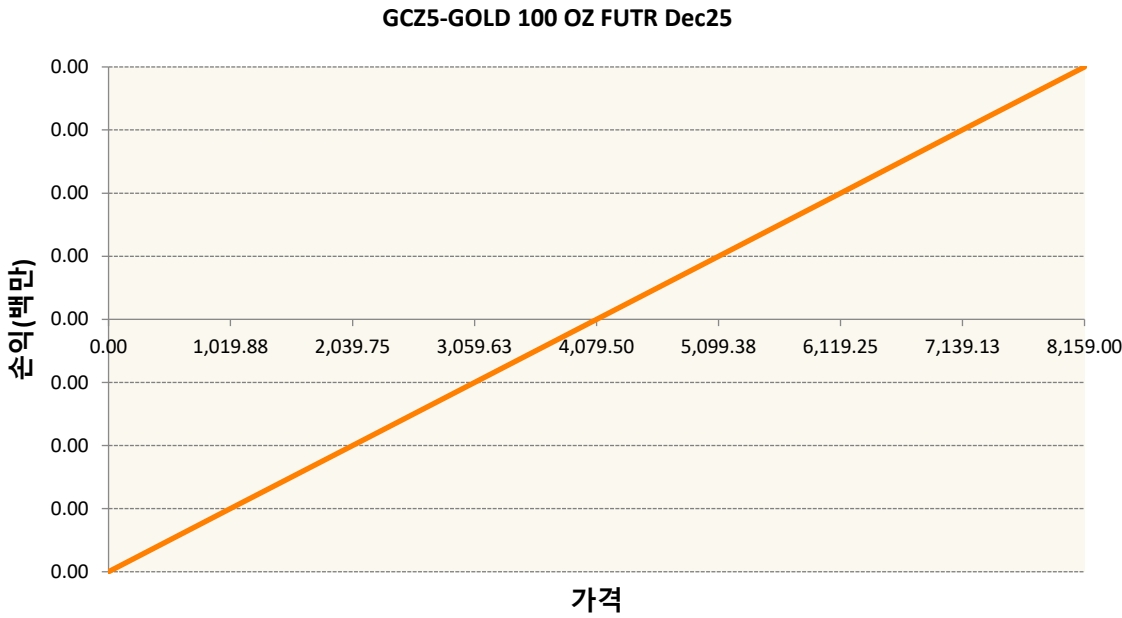
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	2,872	0	2,872	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 11/28/25 C385 EQUITY	1
GCZ5 GOLD 100 OZ FUTR Dec25	230

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

(단위:백만원)

216

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

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 11/28/25 C165 EQUITY	69
AOPLTRUP0' PLTR US 11/28/25 P165 EQUITY	69

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

(단위:백만원)

541

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

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 11/28/25 C90 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

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

(단위:백만원)

5,369

공시일 2025-11-25

기준일 2025-11-24

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	2025-11-25
기준일	2025-11-24

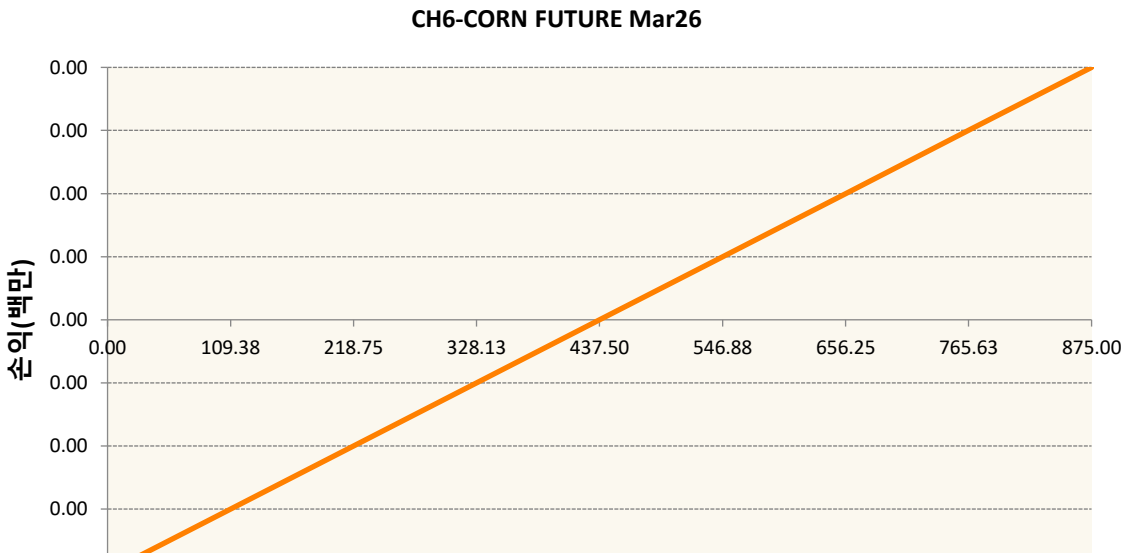
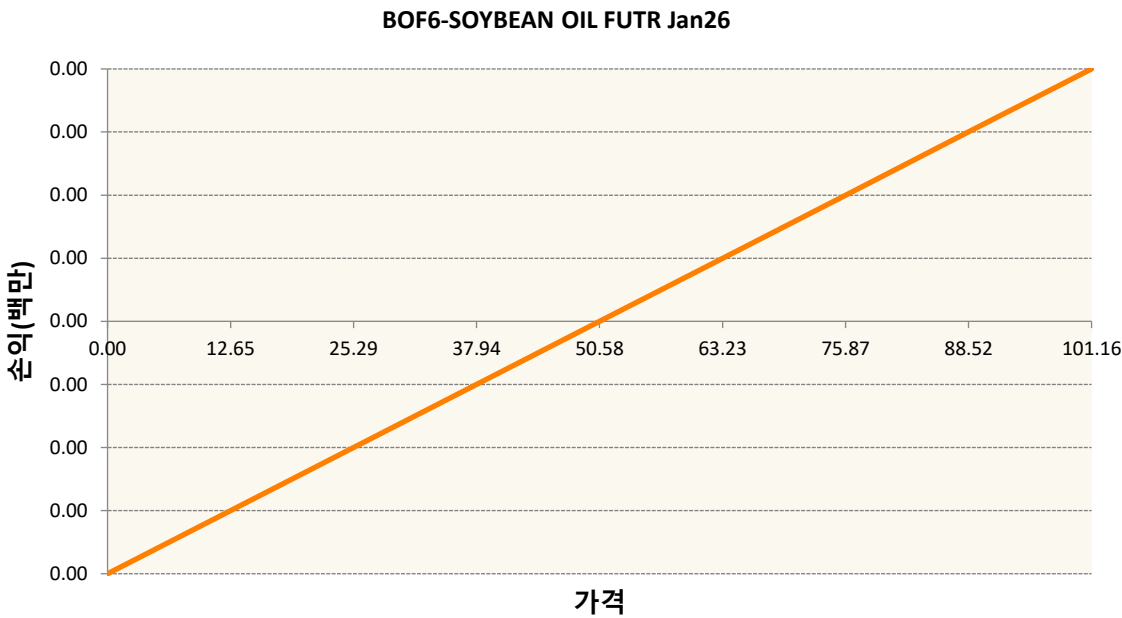
포커스농산물모(채권-파생형)

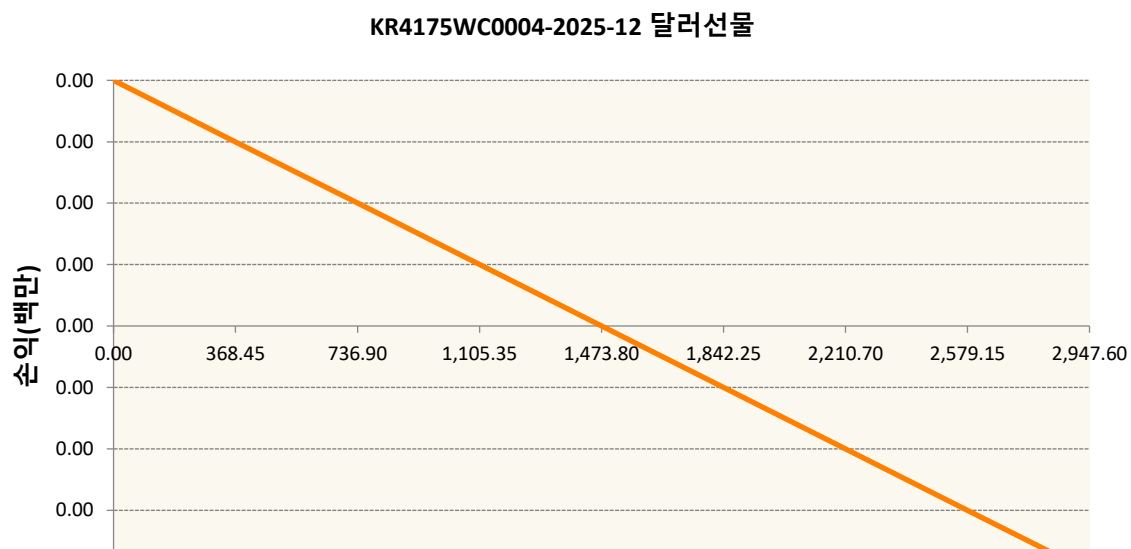
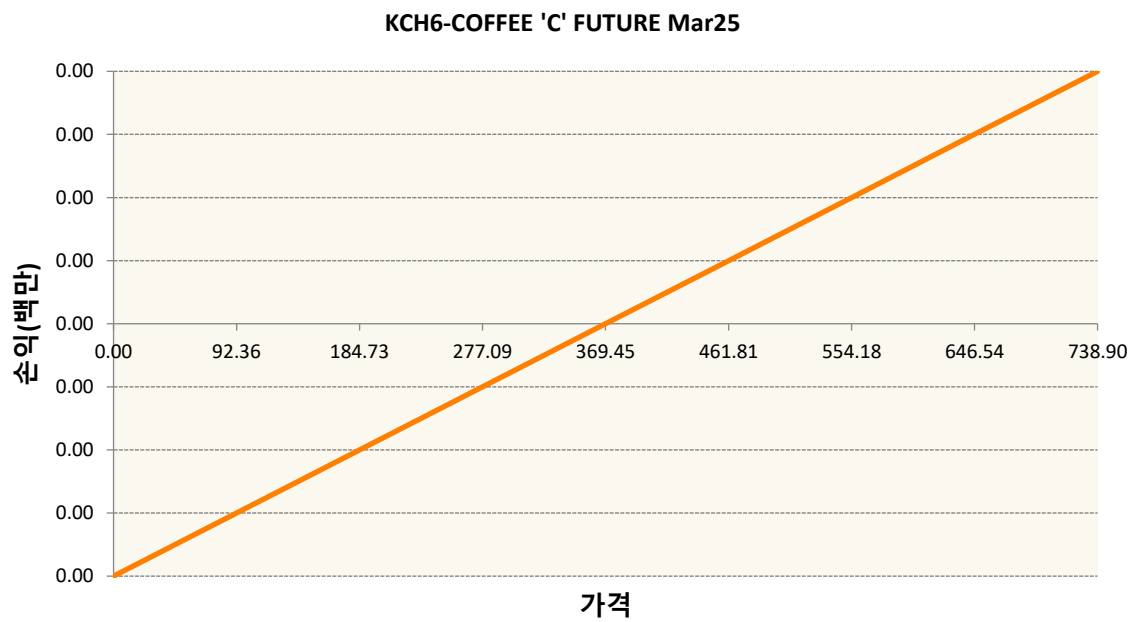
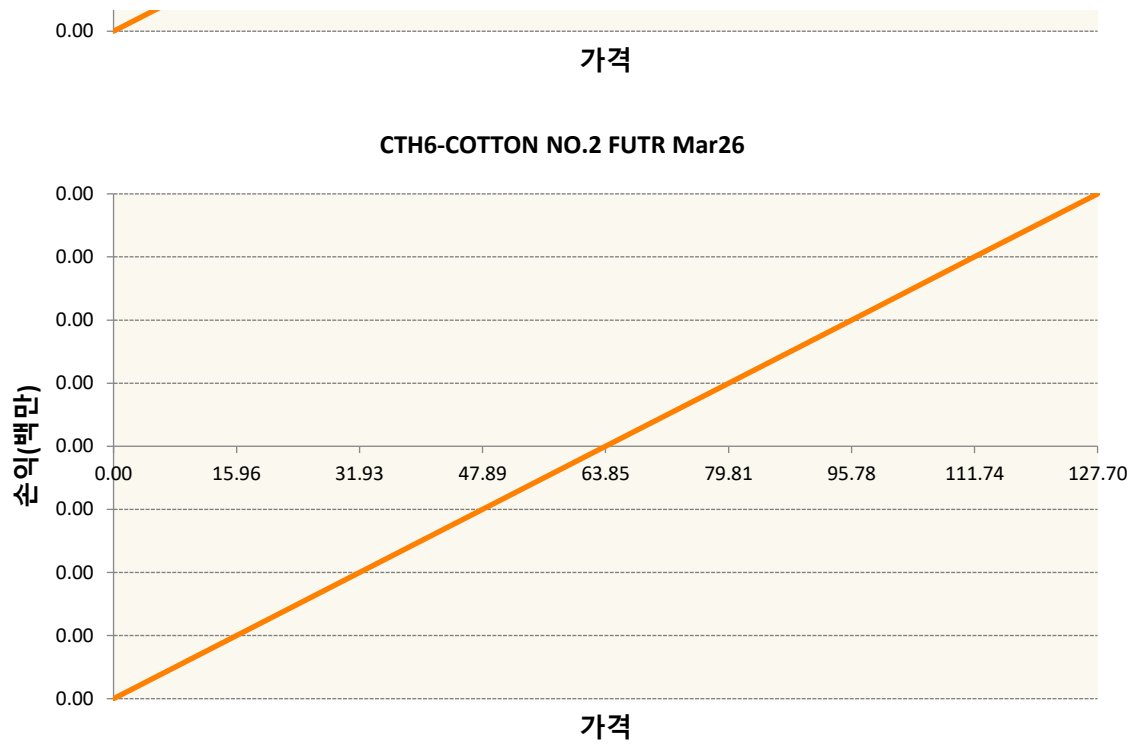
1. 계약금액

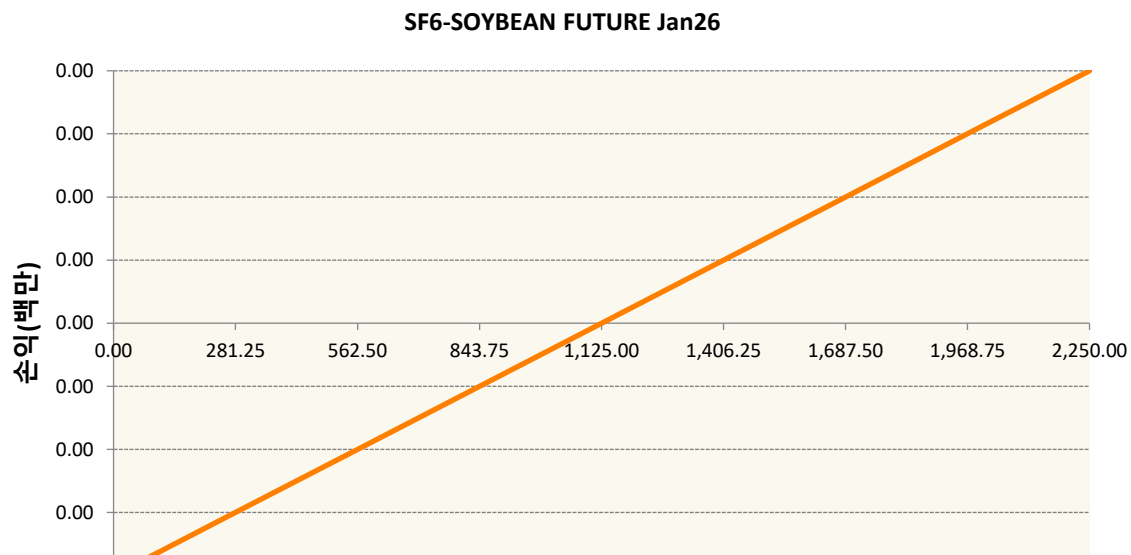
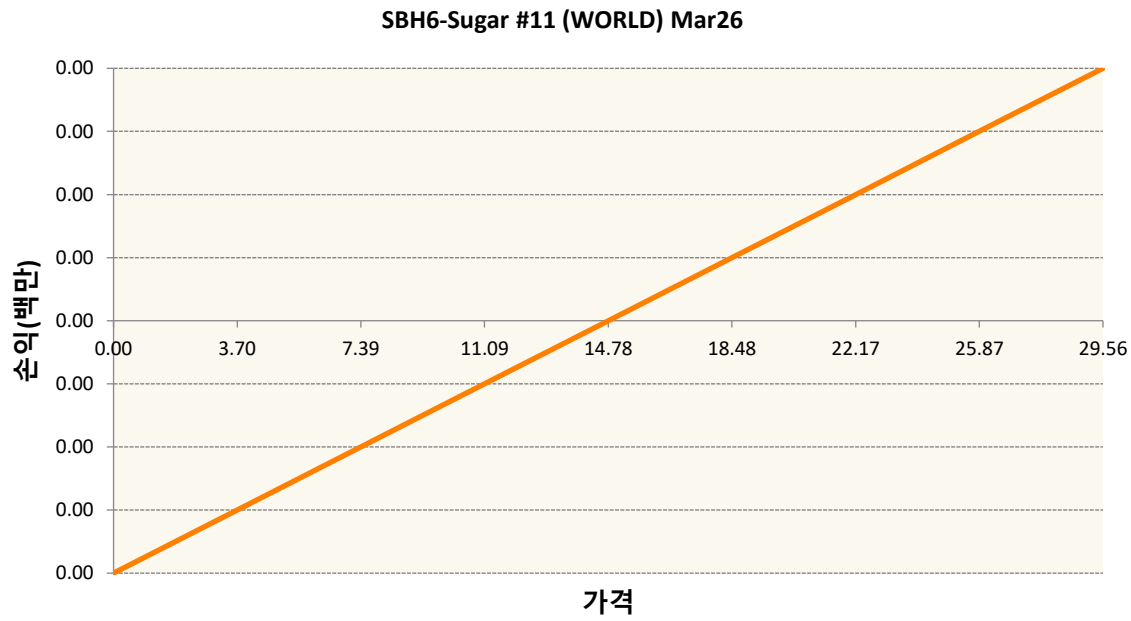
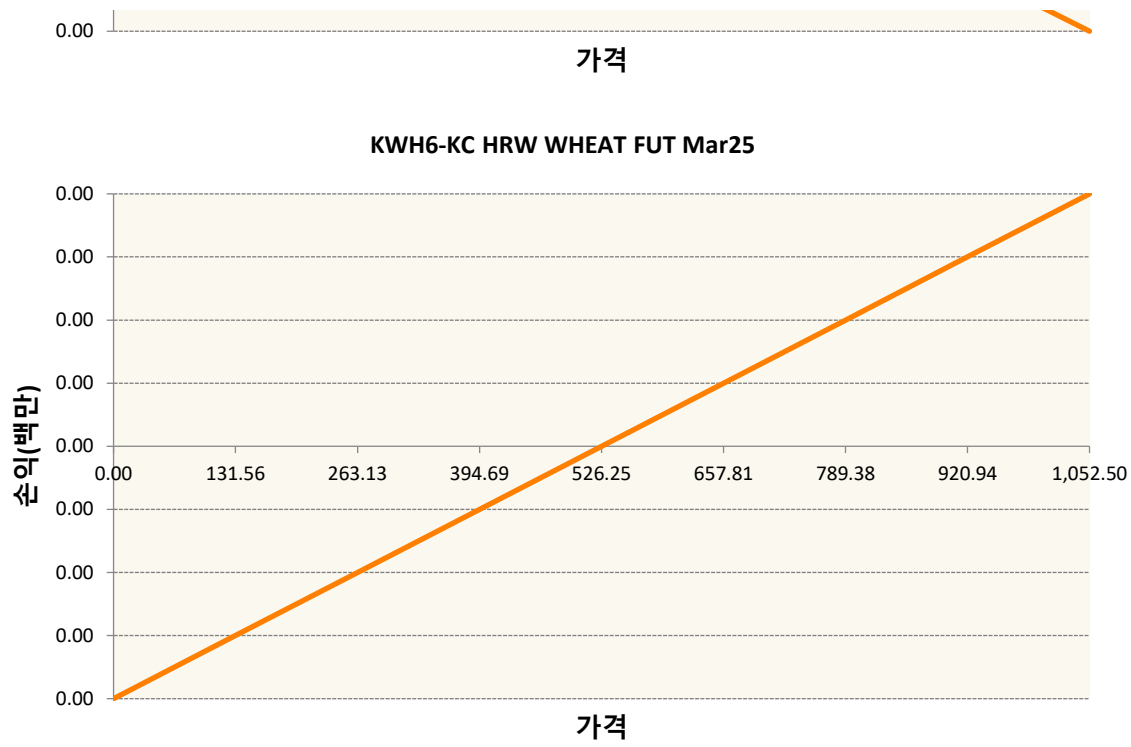
(단위:USD 백만)

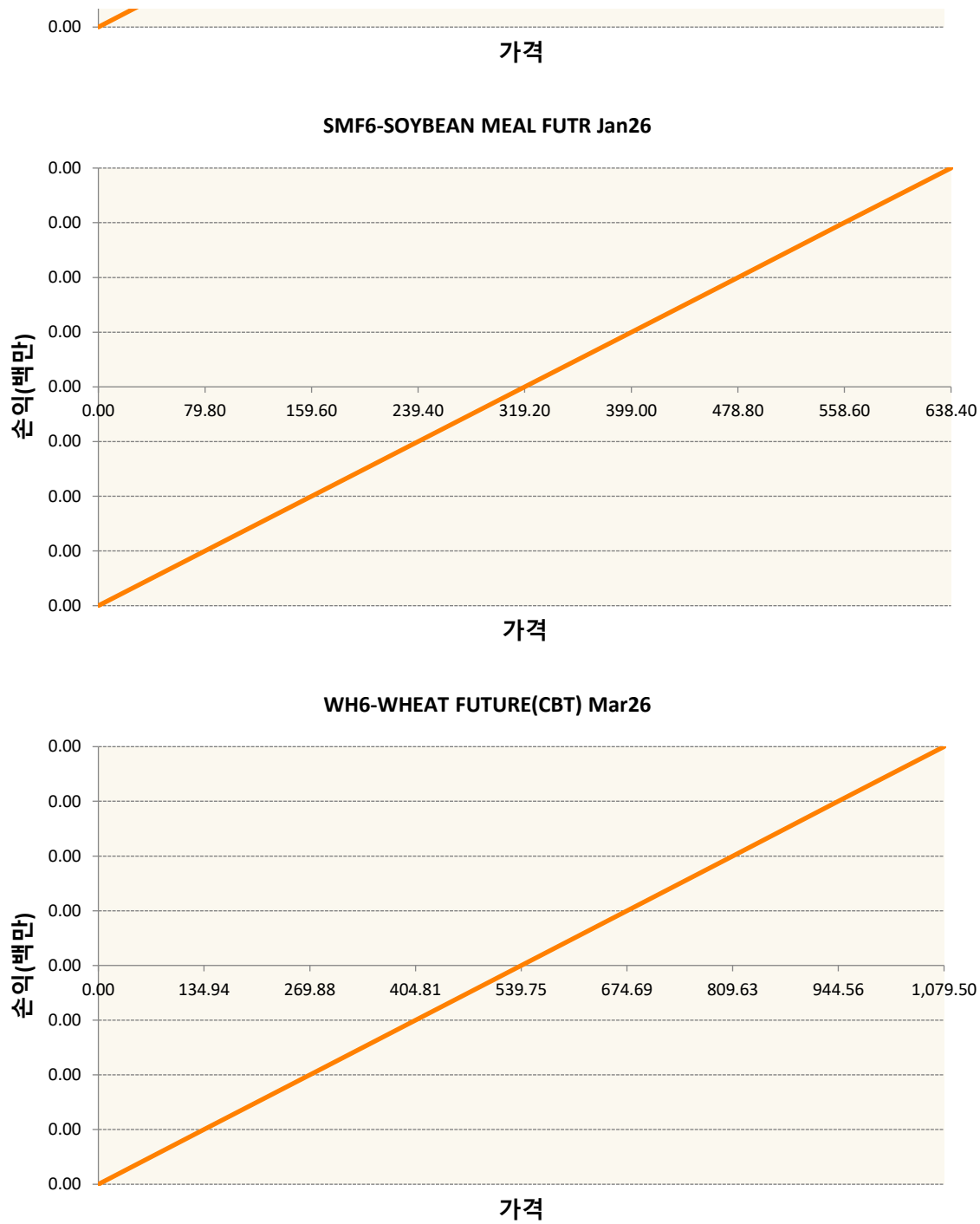
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,153	0	1,153	
누계	유가증권	선물	2,141	0	2,141	
누계	통화	선물	0	442	-442	장내

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	2025-11-25
기준일	2025-11-24

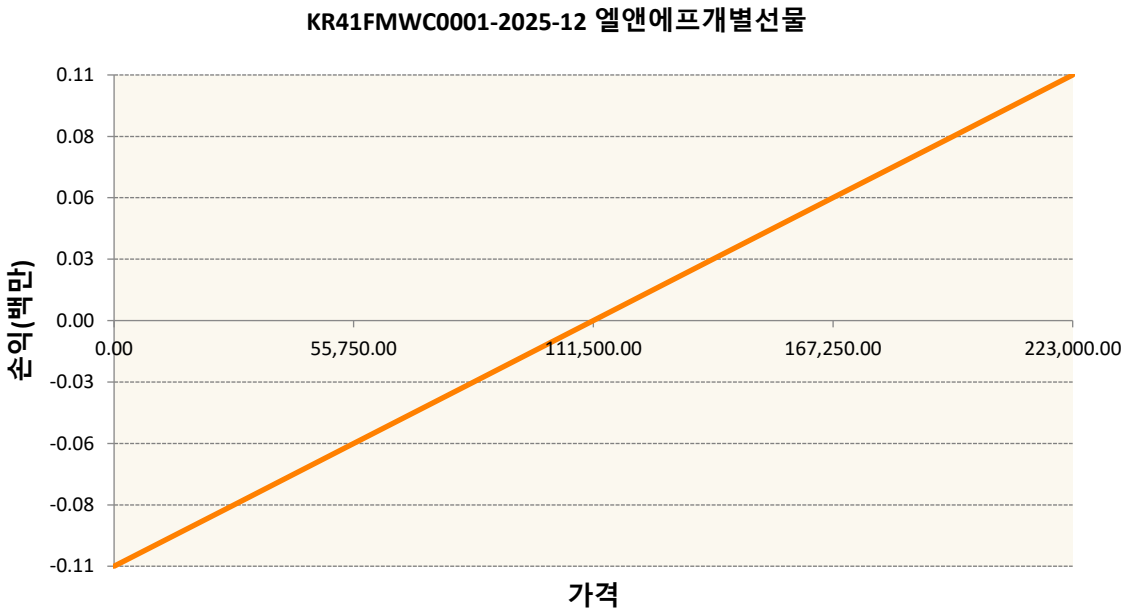
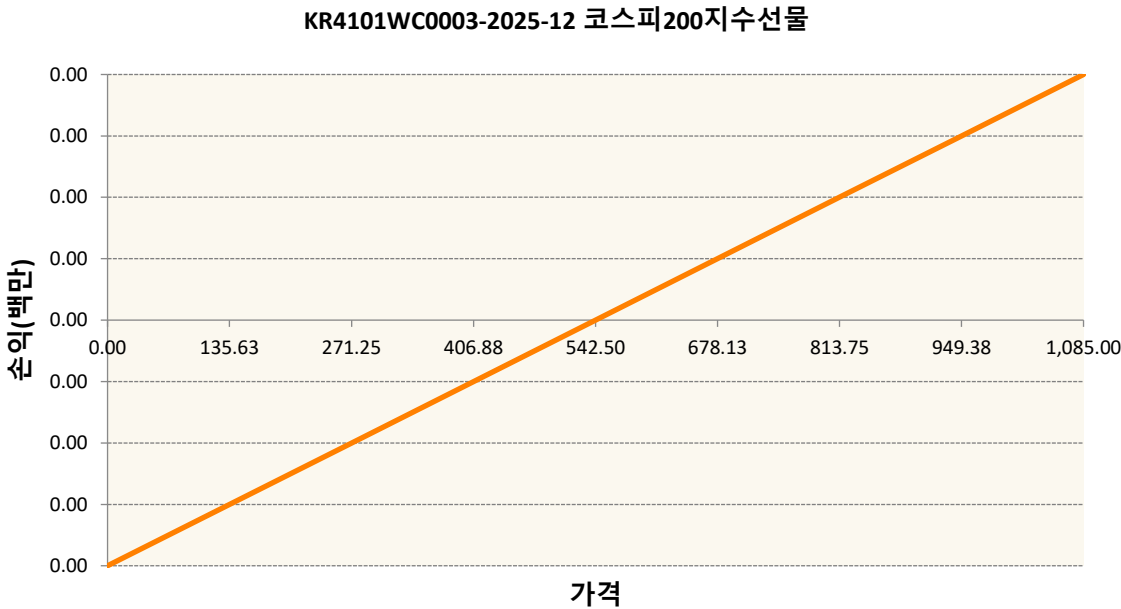
스마트인덱스모

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	1,256	0	1,256	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물		98
KR41FMWCC 2025-12 엘앤티에프개별선물		3

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

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

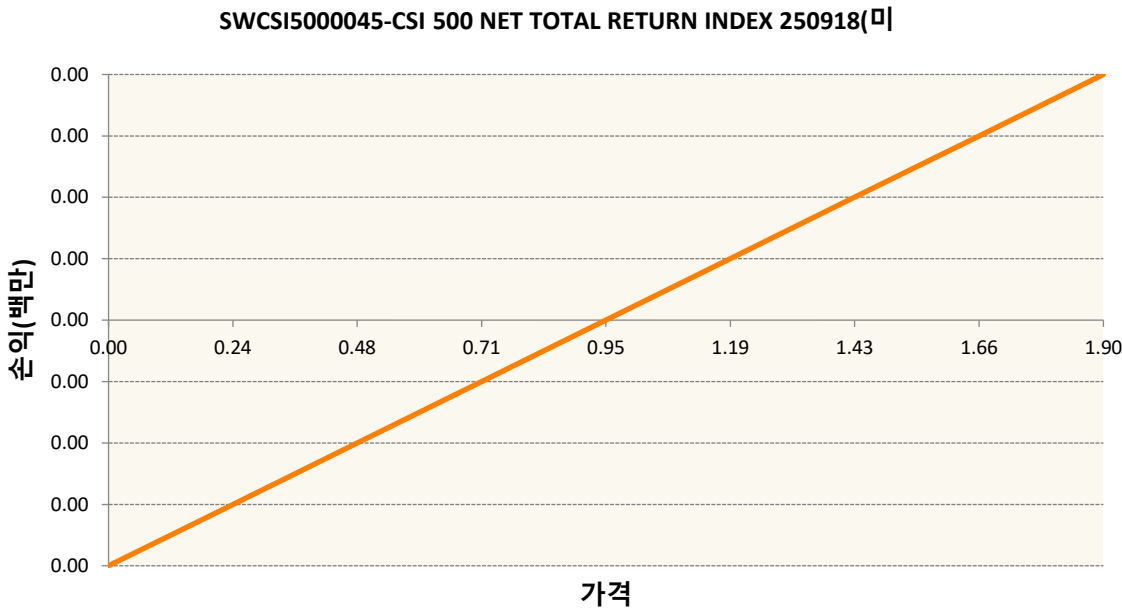
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,465	0	4,465	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

356

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

456

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

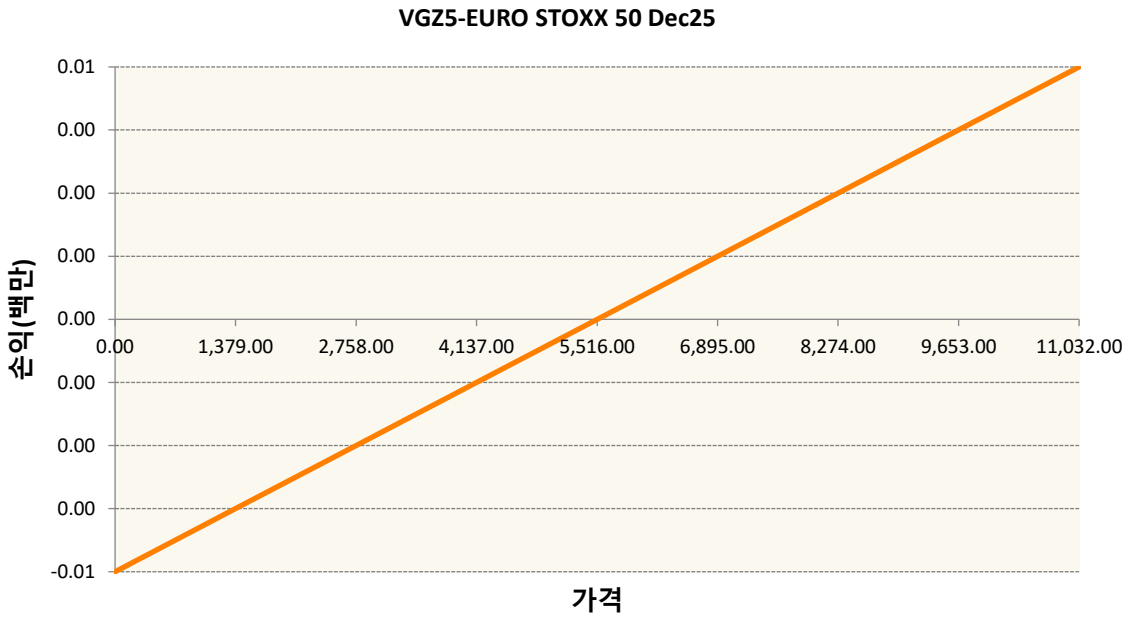
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	723	0	723	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ5	EURO STOXX 50 Dec25	58
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

49

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

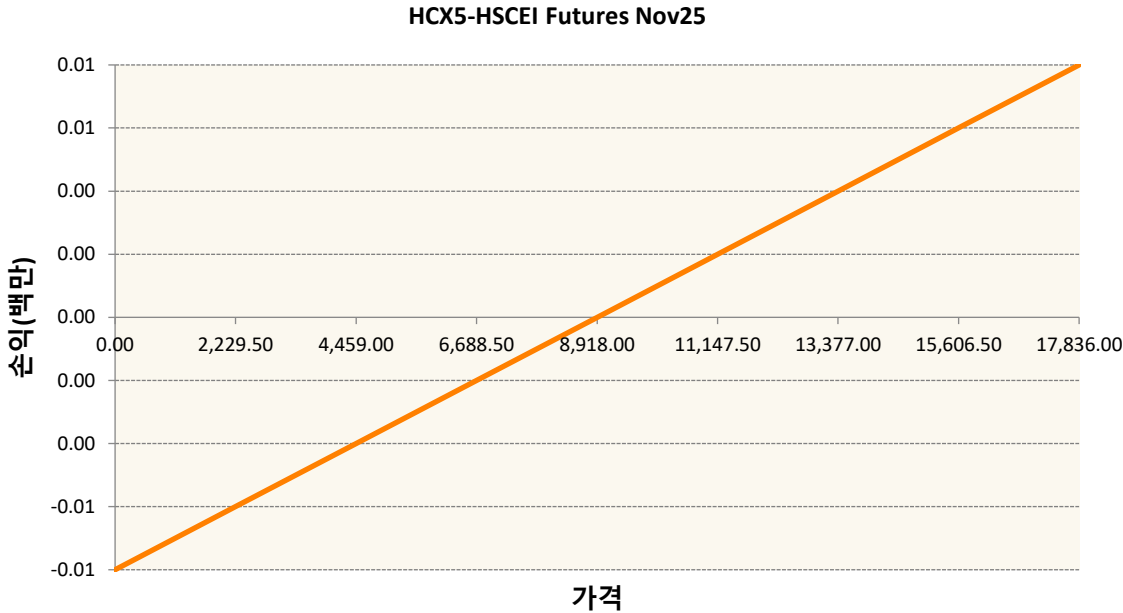
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,804	0	1,804	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HGX5	HSCEI Futures Nov25	144
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

205

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

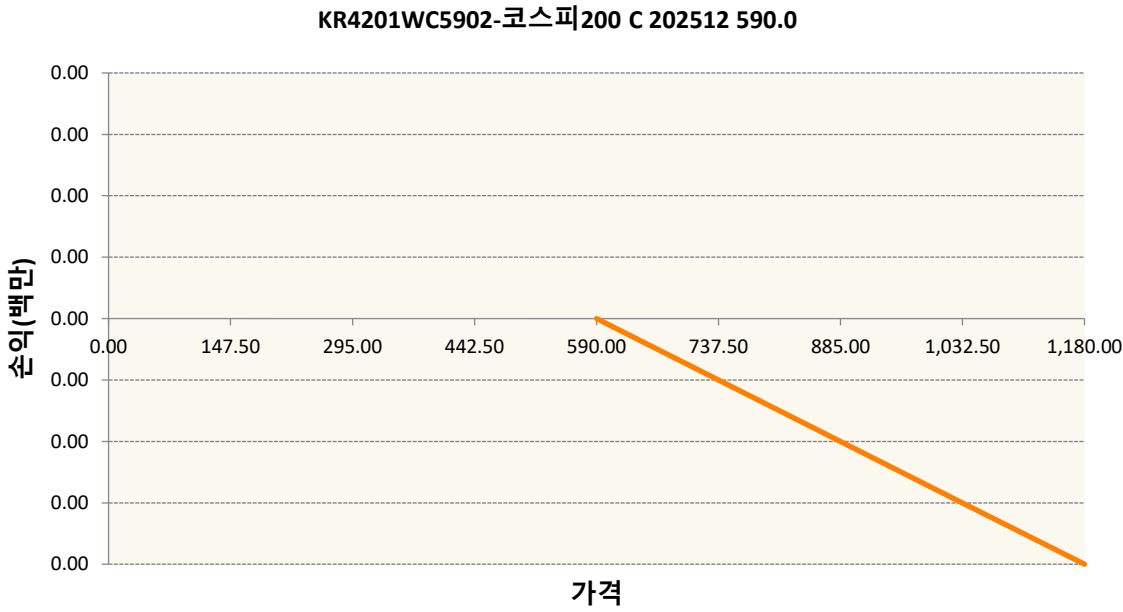
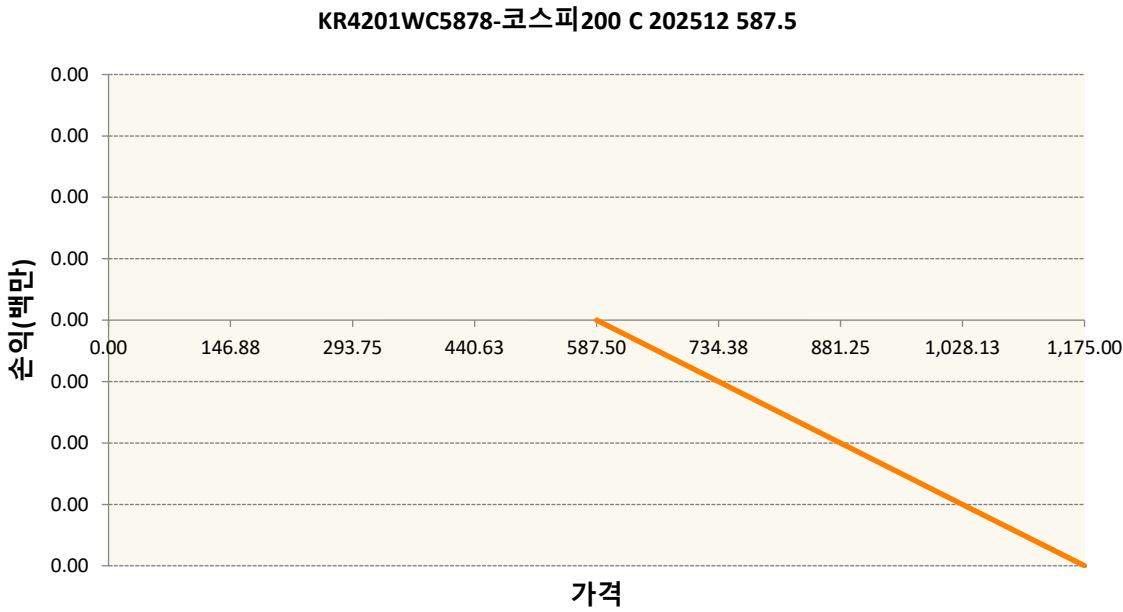
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

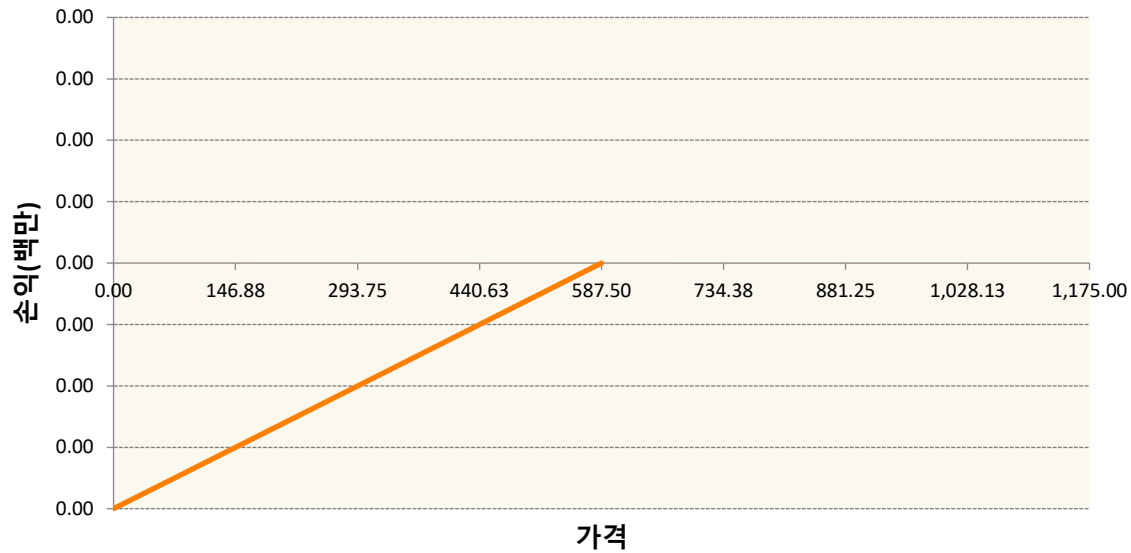
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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 2025-11-25

기준일 2025-11-24

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	2025-11-25
기준일	2025-11-24

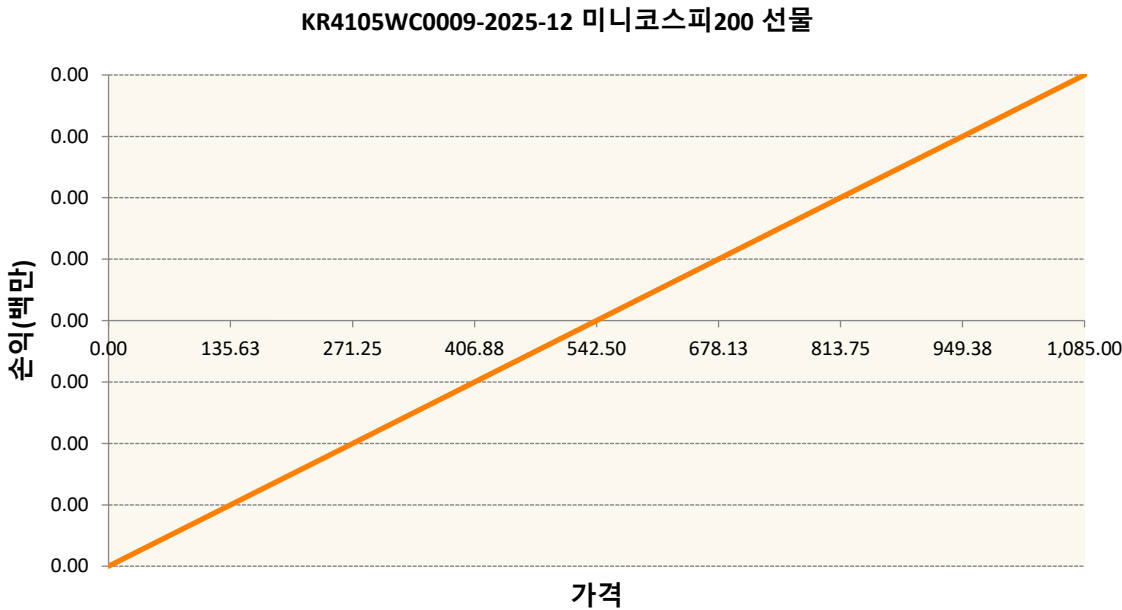
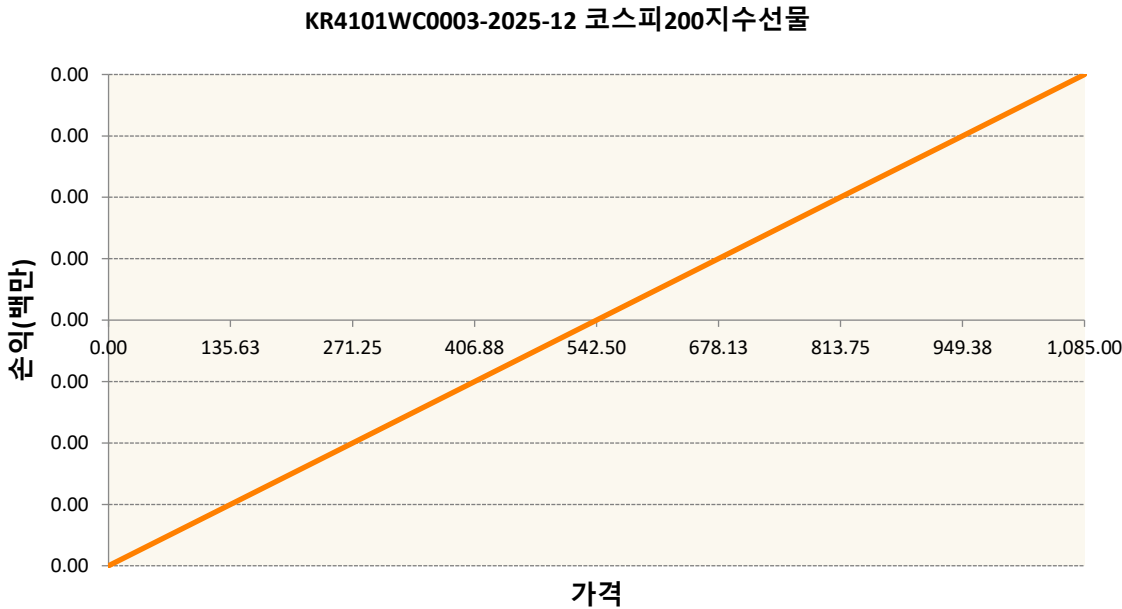
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

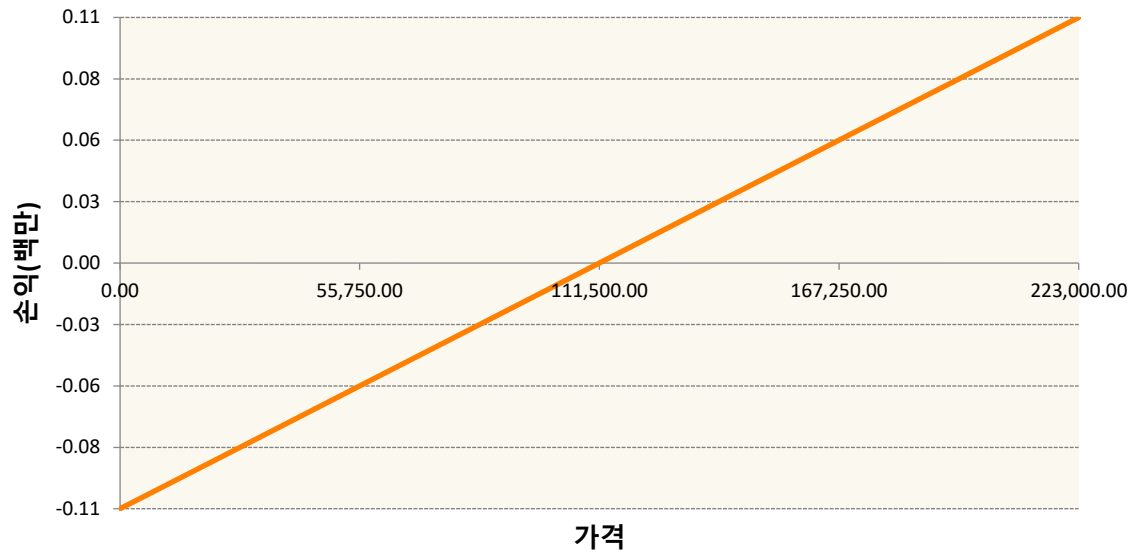
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	965	0	965	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR41FMWC0001-2025-12 엘애프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

33
 9
 1

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

(단위:백만원)

5

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

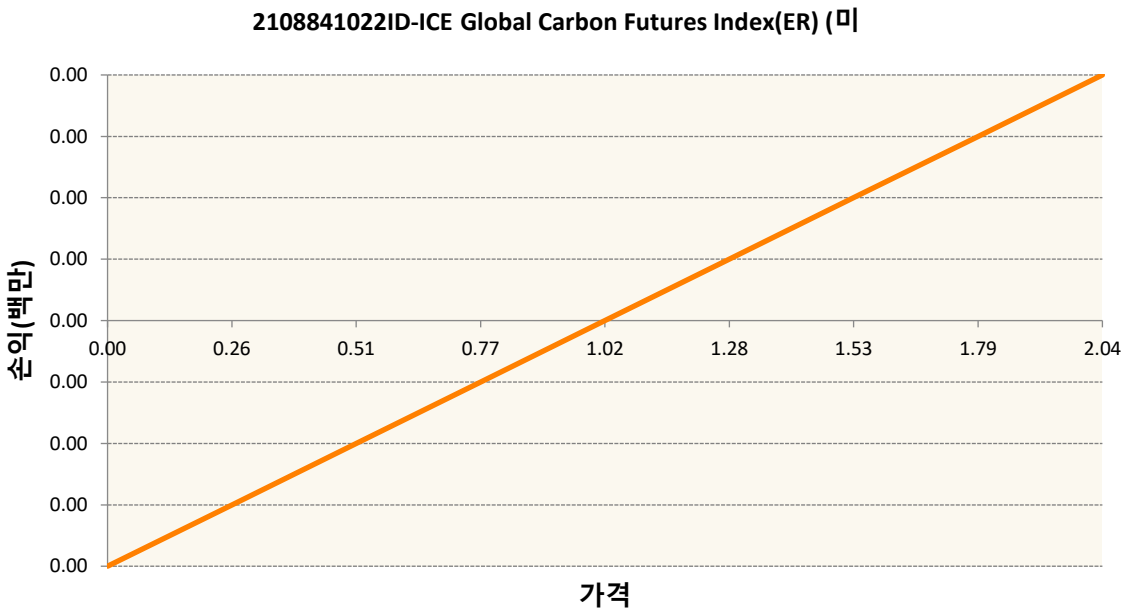
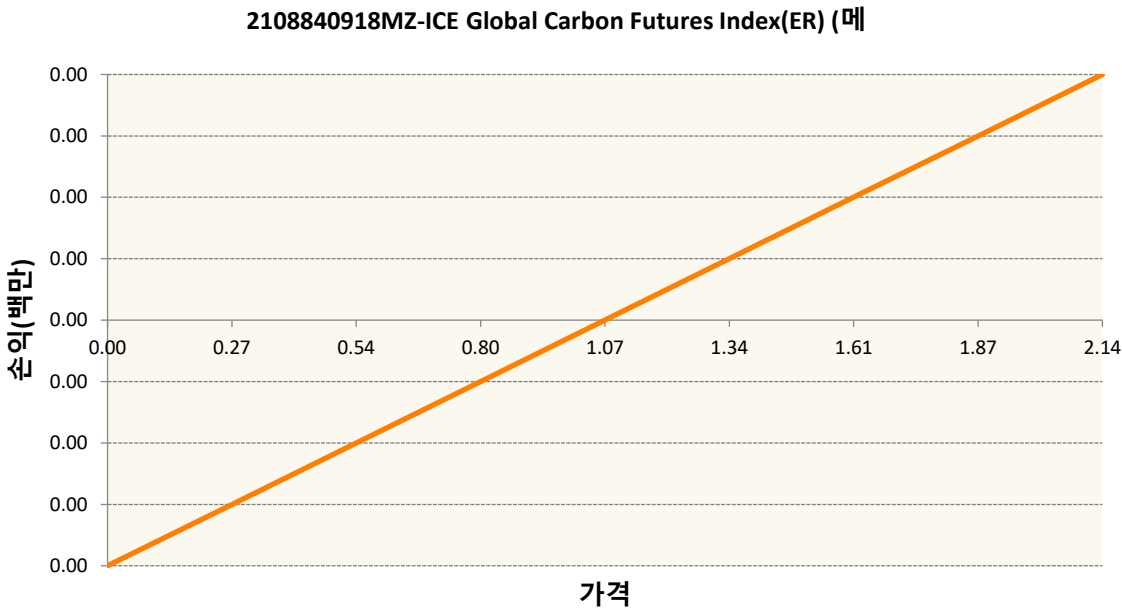
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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		575

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	666

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

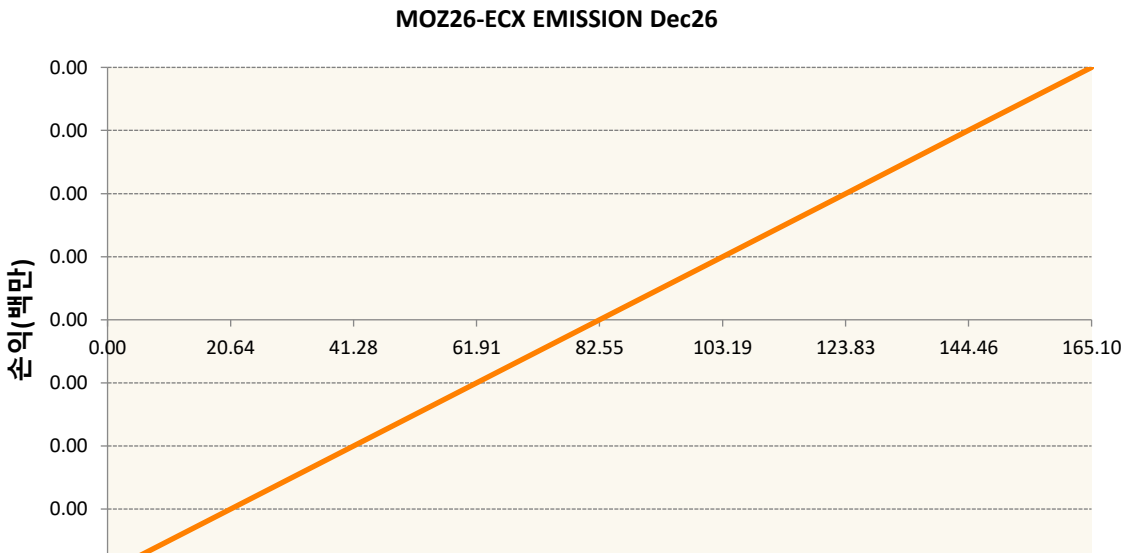
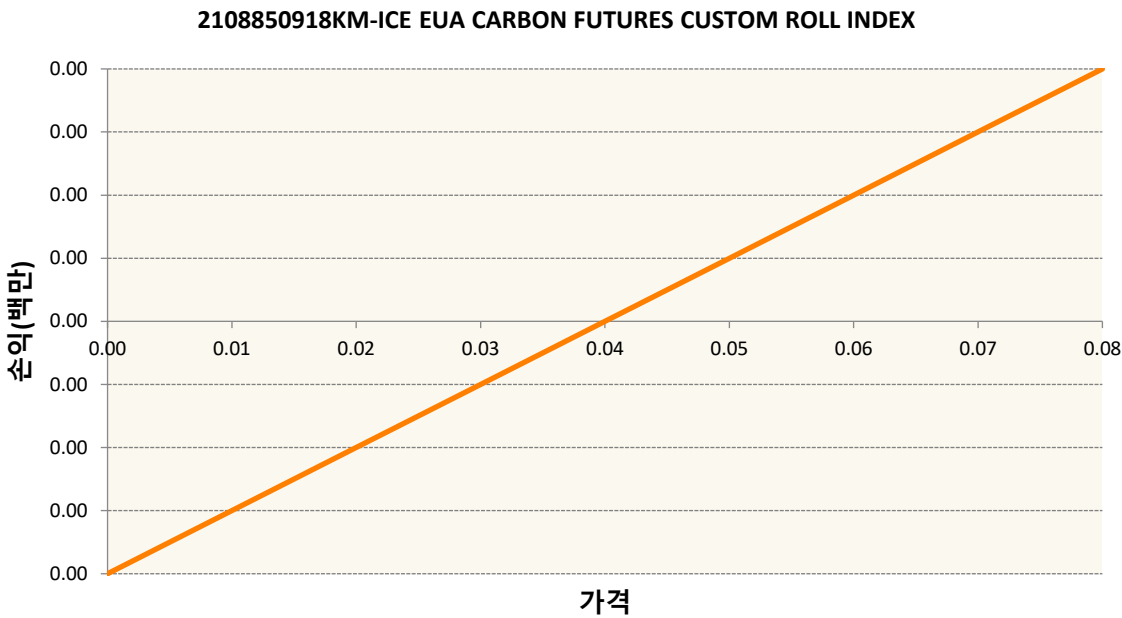
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,421	0	6,421	
누계	지수	스왑	16	0	16	장외
누계	통화	선도	0	2,553	-2,553	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E	204
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	514

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

(단위:백만원)

804

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

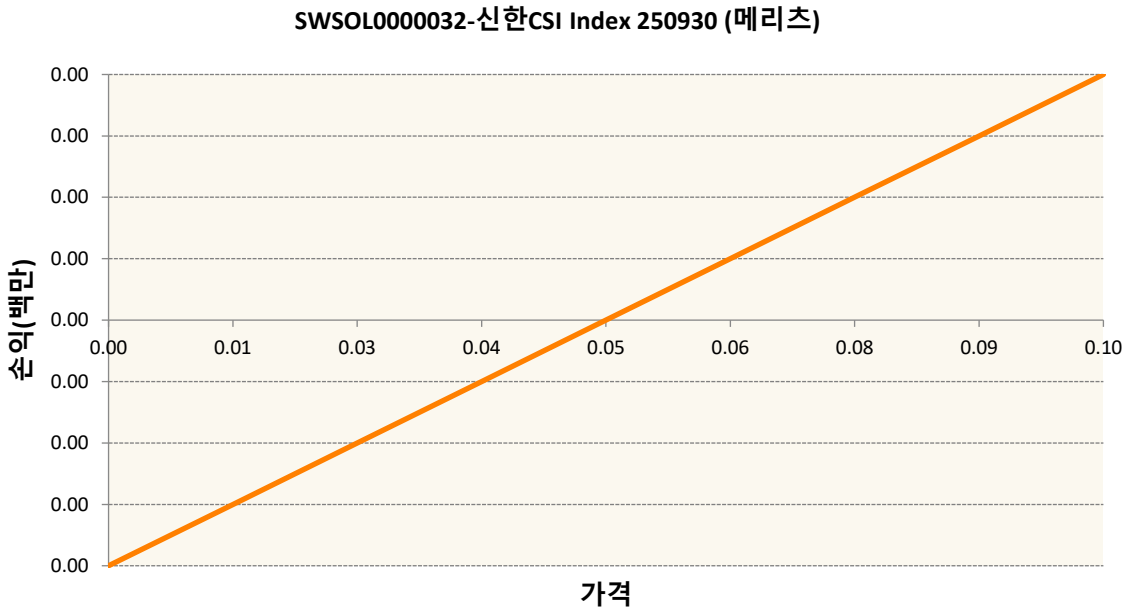
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,622	0	2,622	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	7
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	4
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	4
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	11

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

(단위:백만원)

47

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

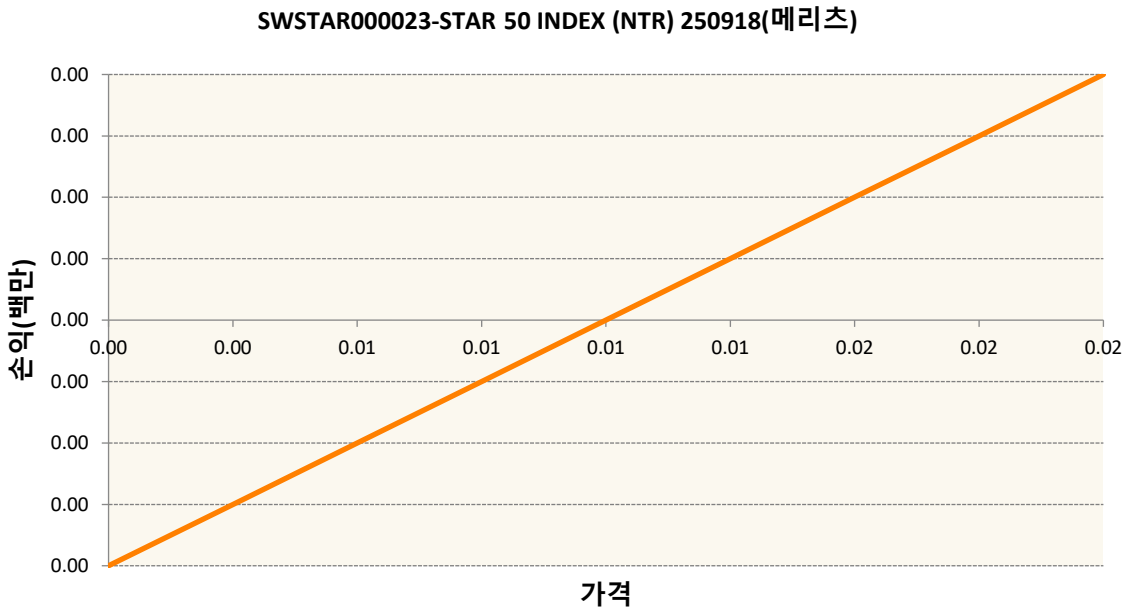
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	2,998	0	2,998	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	2
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	1
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)	7
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)	17
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠)	36

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

(단위:백만원)

113

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

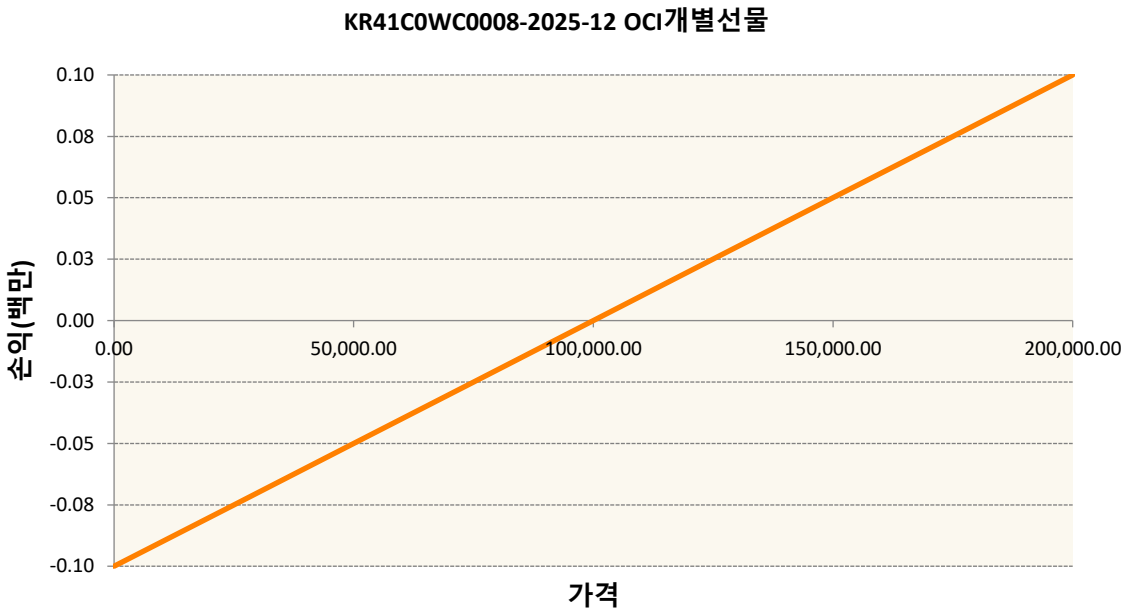
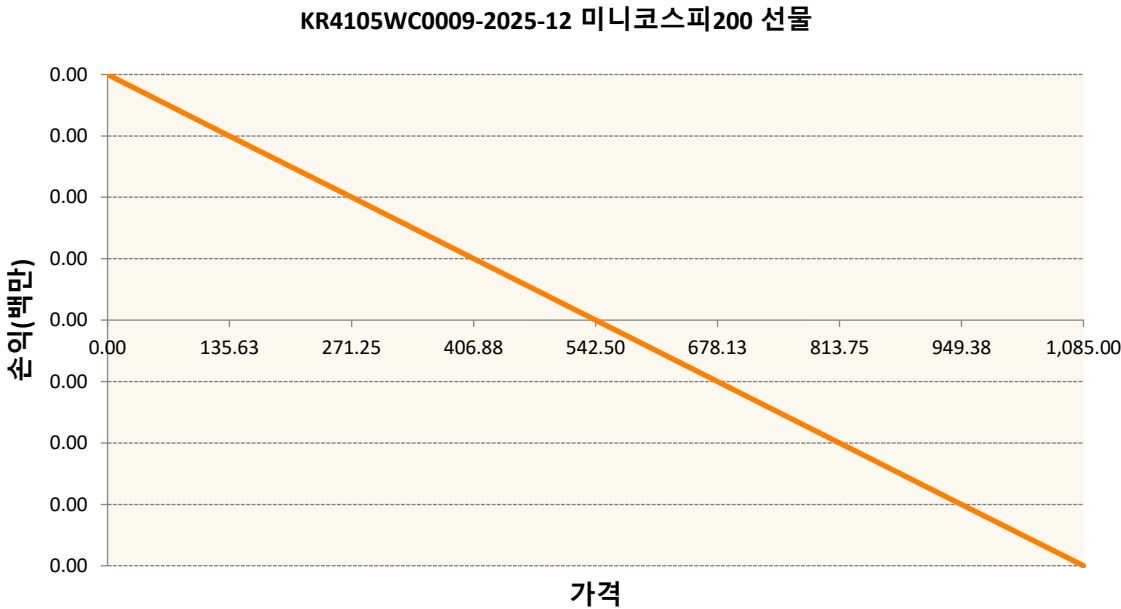
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

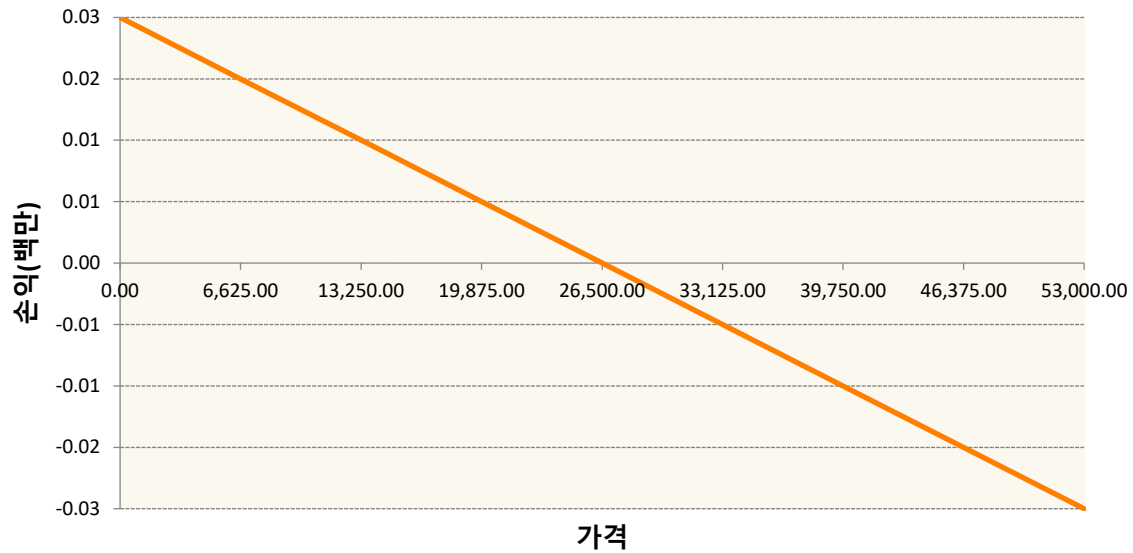
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	13	824	-811	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

13
 1
 1

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

(단위:백만원)

3

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

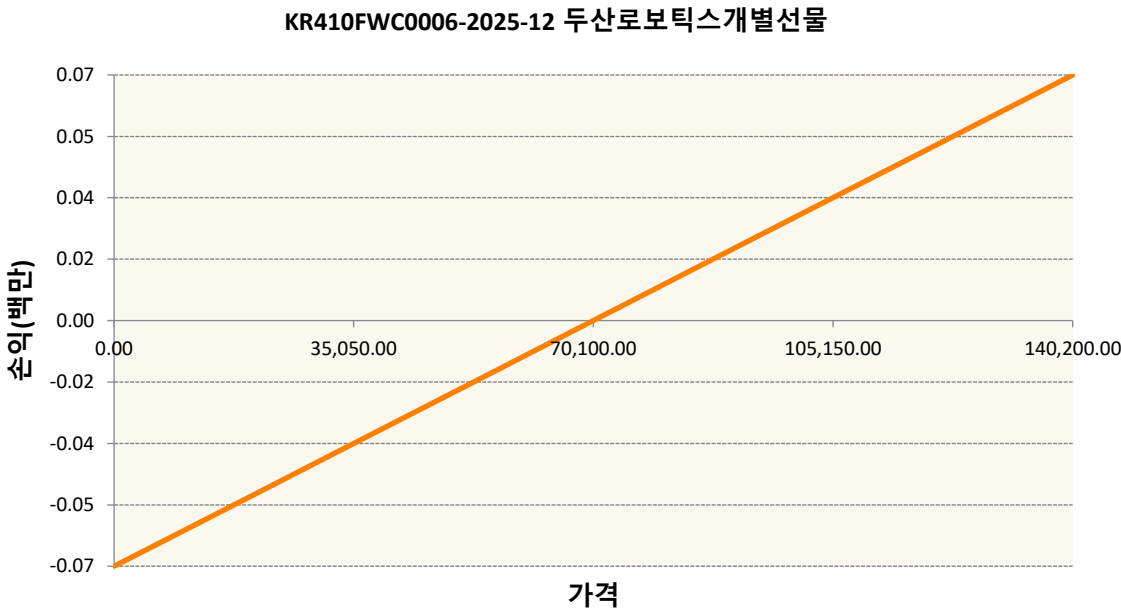
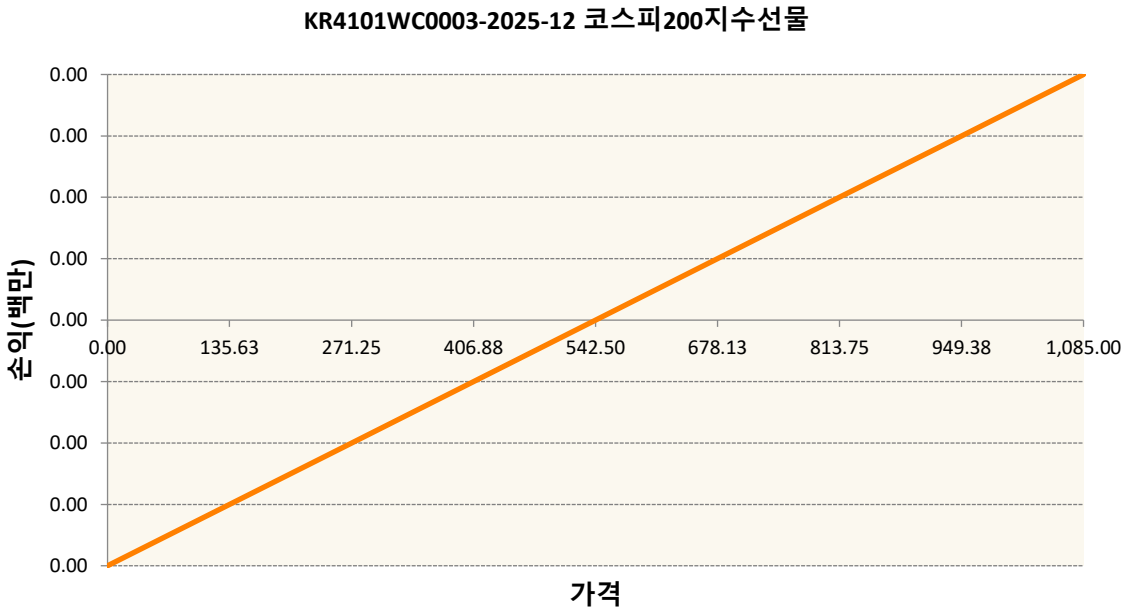
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

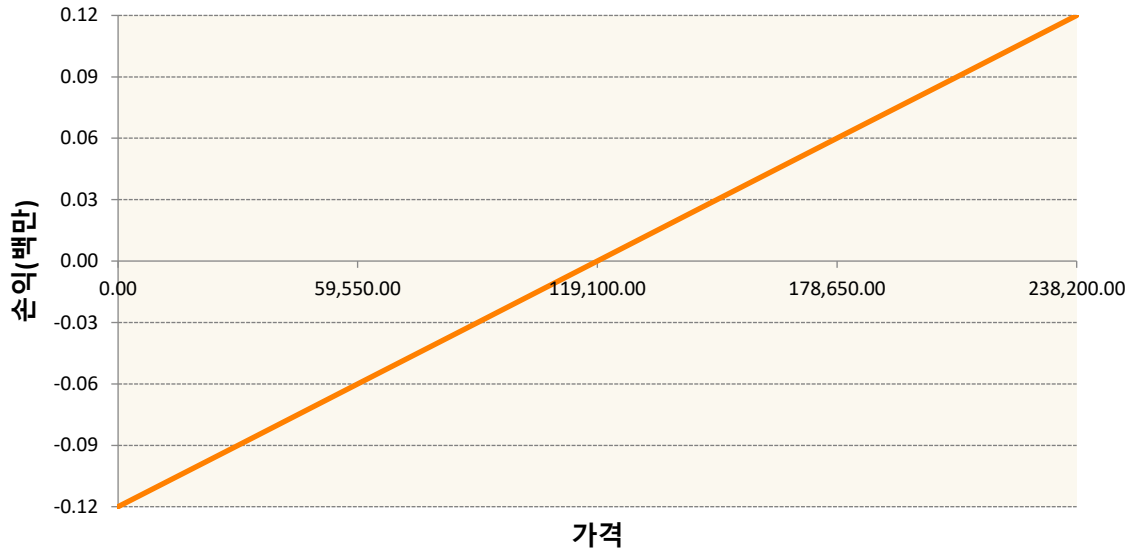
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	318	271	47	장내
누계	유가증권	선물	11,541	0	11,541	장내

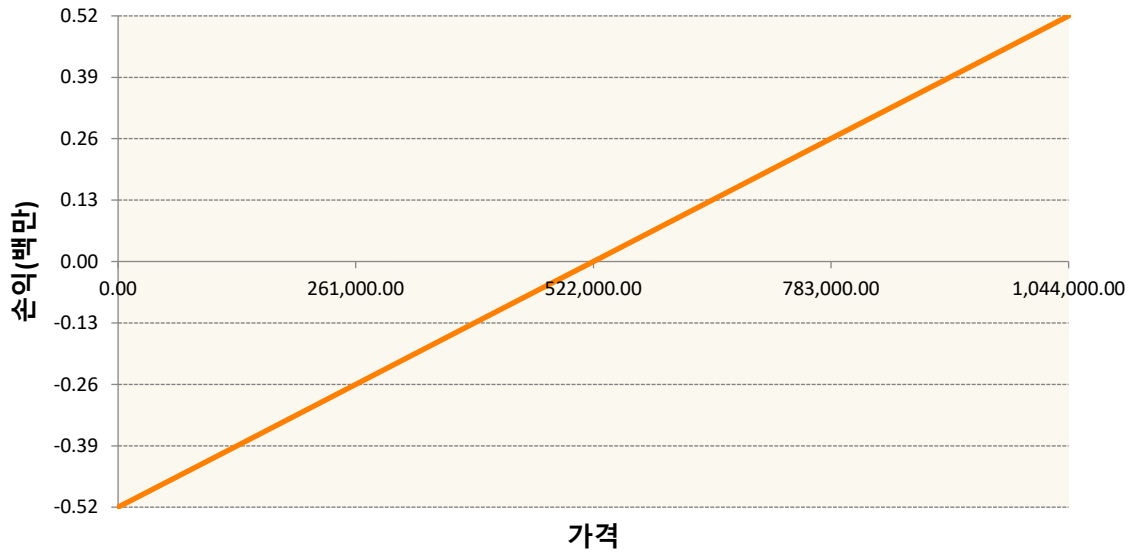
2. 만기시점의 손익구조



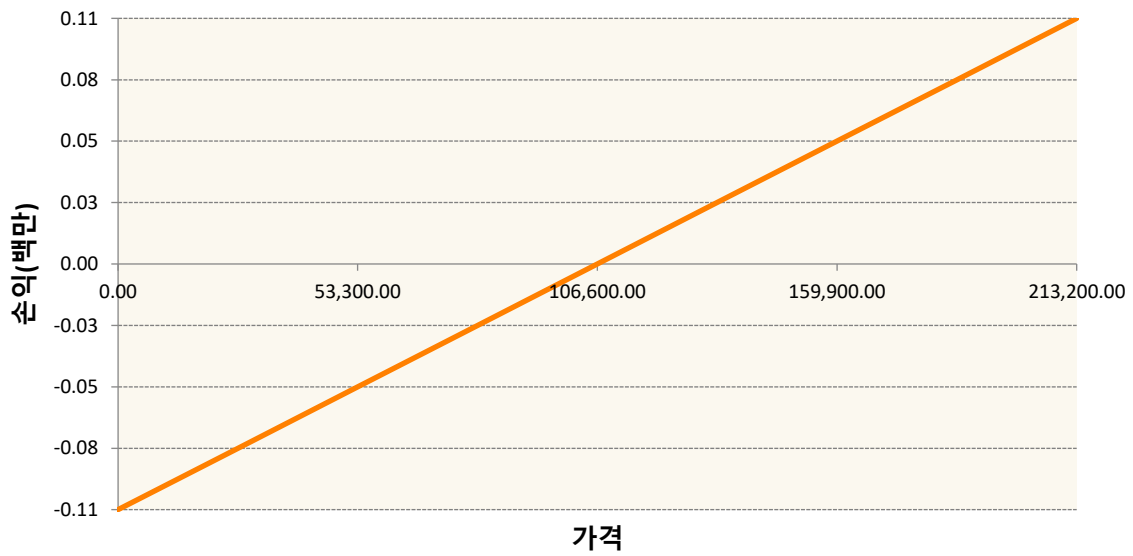
KR410ZWC0002-2025-12 한미반도체개별선물



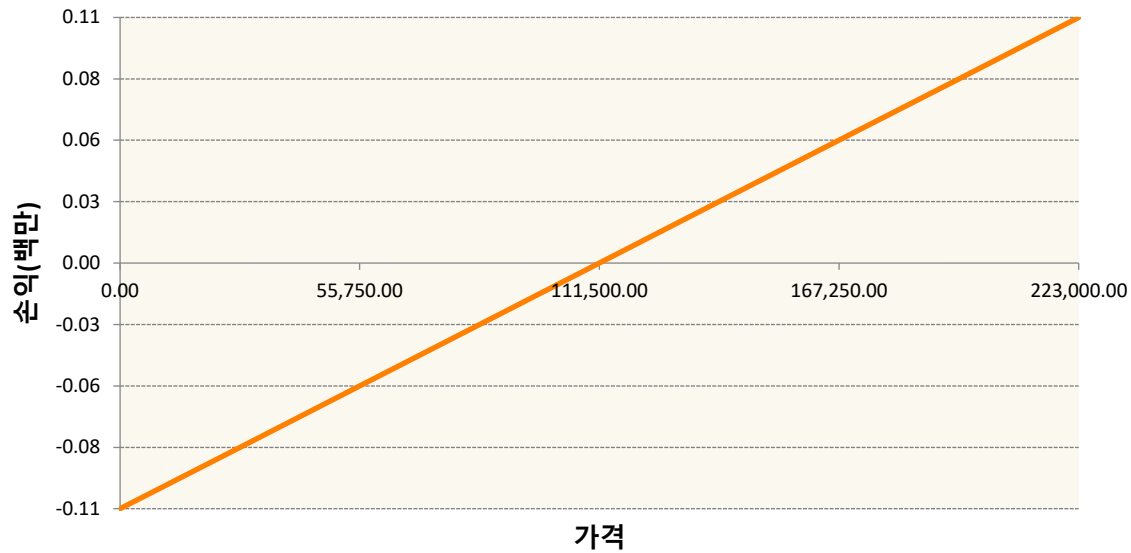
KR4150WC0003-2025-12 SK하이닉스개별선물



KR41EJWC0007-2025-12 SKC개별선물



KR41FMWC0001-2025-12 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0003 2025-12 코스피200지수선물								844
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-844	-844	-844	-844	-844	-844	-844	-844
-5.33%	-562	-562	-562	-562	-562	-562	-562	-562
-2.67%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	281	281	281	281	281	281	281	281
5.33%	562	562	562	562	562	562	562	562
8.00%	844	844	844	844	844	844	844	844
KR410ZWC0002 2025-12 한미반도체개별선물								6
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	6	6	6	6	6	6	6	6
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
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3
KR41EJWC0007 2025-12 SKC개별선물							22
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	22	22	22	22	22	22	22
KR41FMWC0001 2025-12 엘앤에프개별선물							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

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

(단위:백만원)

1,164

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

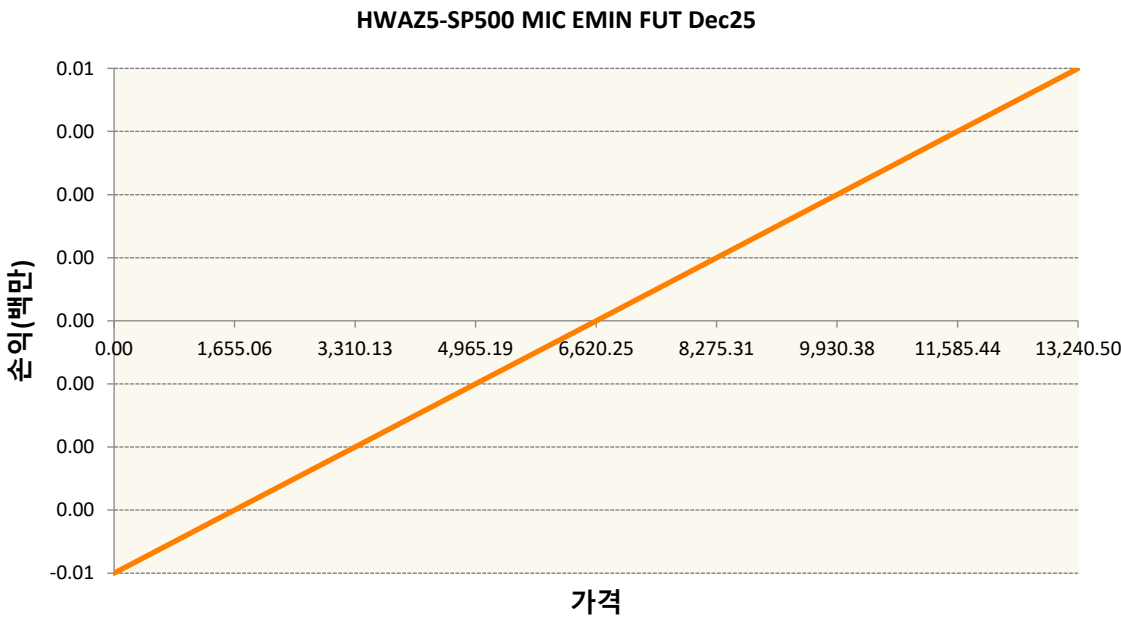
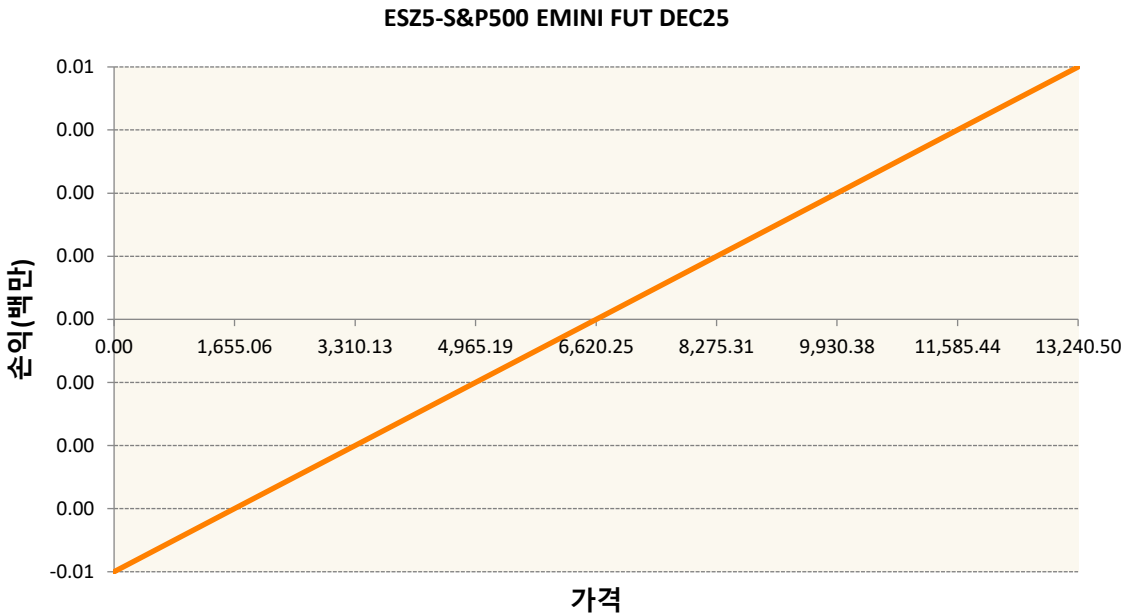
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	40,075	0	40,075	
누계	유가증권	선물	1,240	0	1,240	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,206
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,748

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

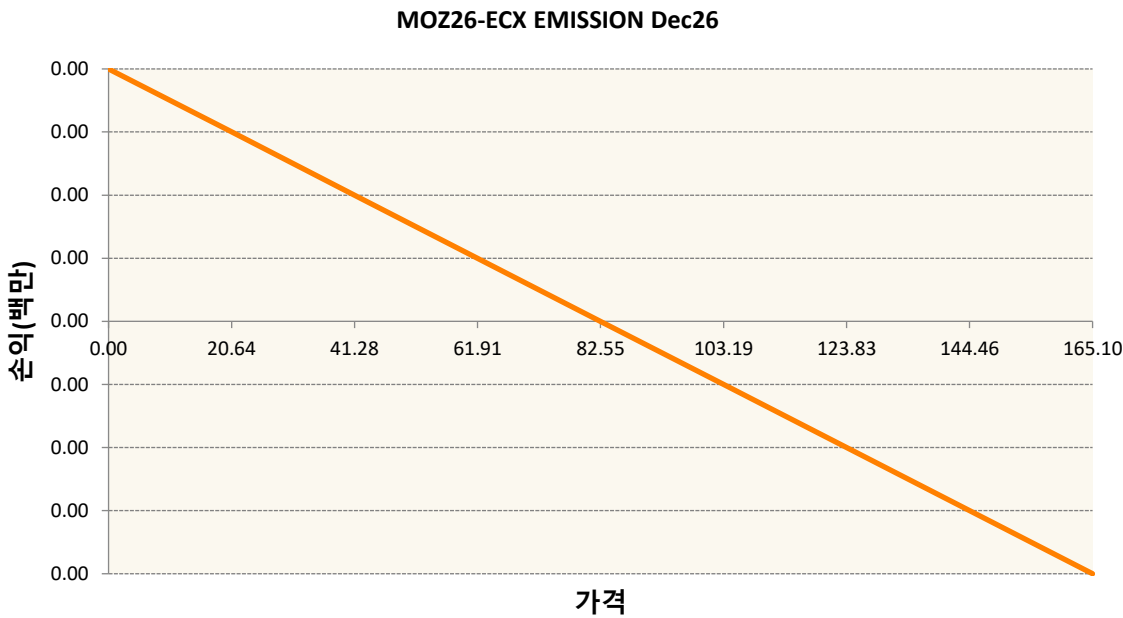
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	3,501	-3,501	
누계	지수	스왑	-16	0	-16	장외
누계	통화	선도	0	1,181	-1,181	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	1
FXW213FAW KRW/EUR 28-11-25E	95
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	280

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

(단위:백만원)

428

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

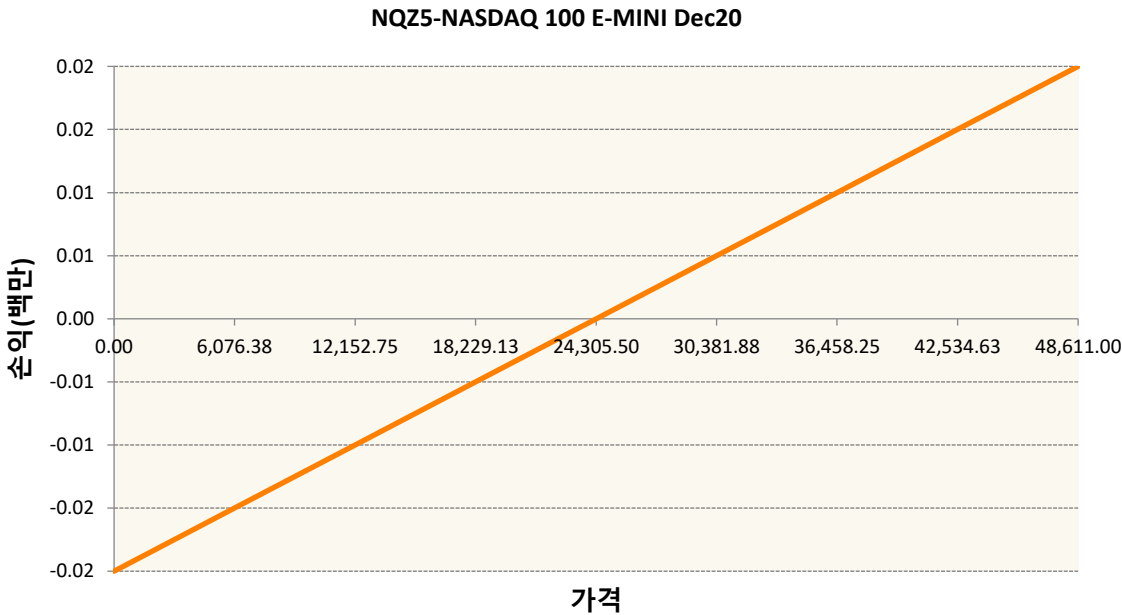
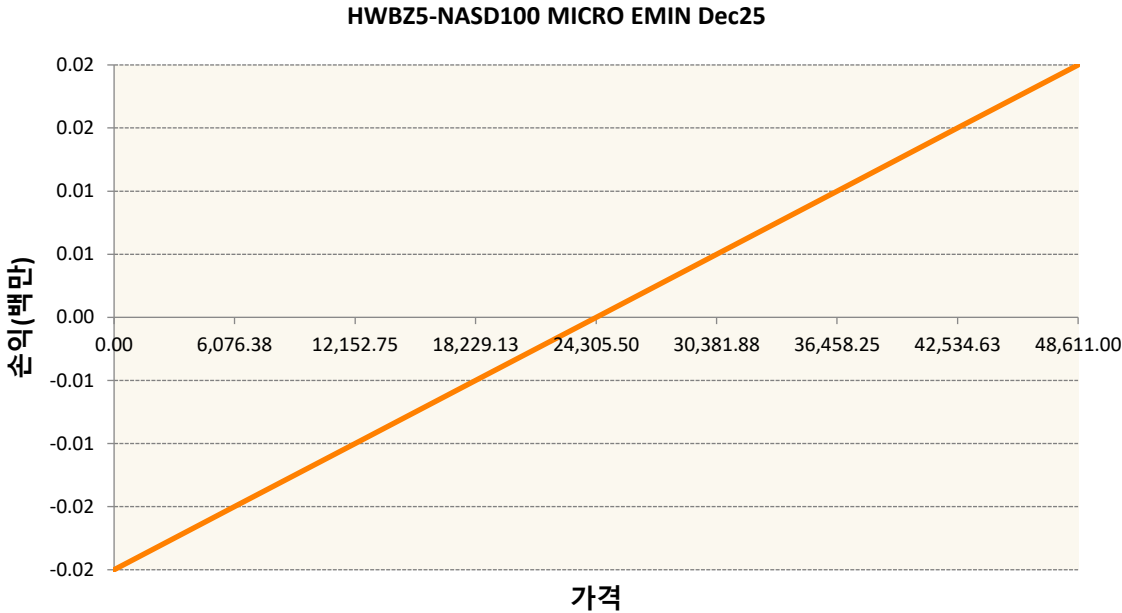
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	17,583	0	17,583	
누계	유가증권	선물	1,350	0	1,350	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25		108
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,407

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			1,704

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

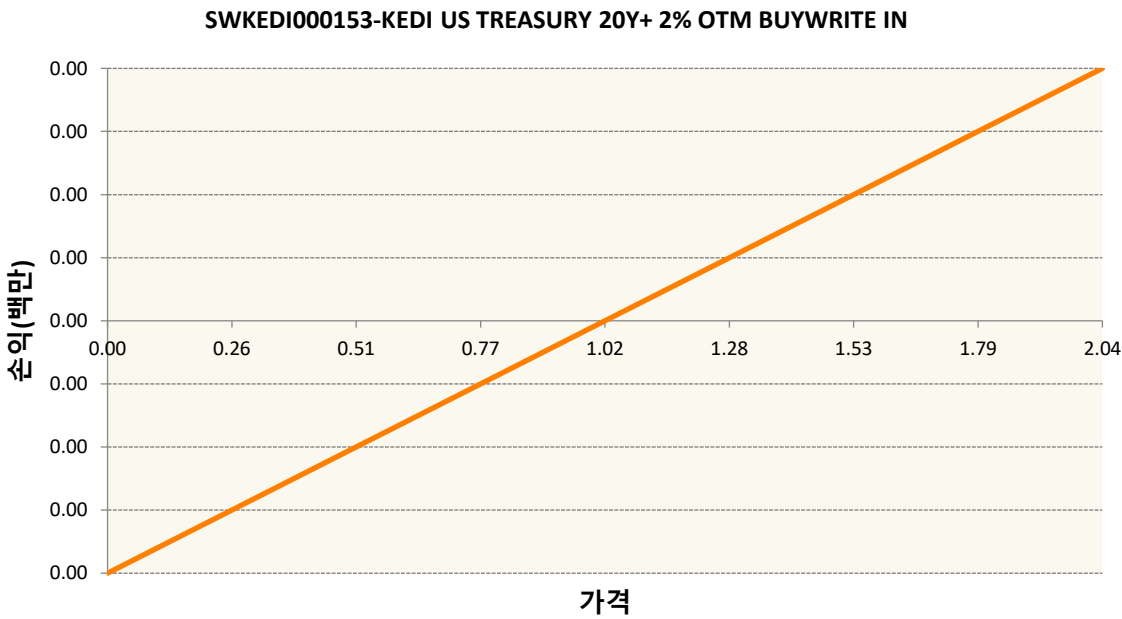
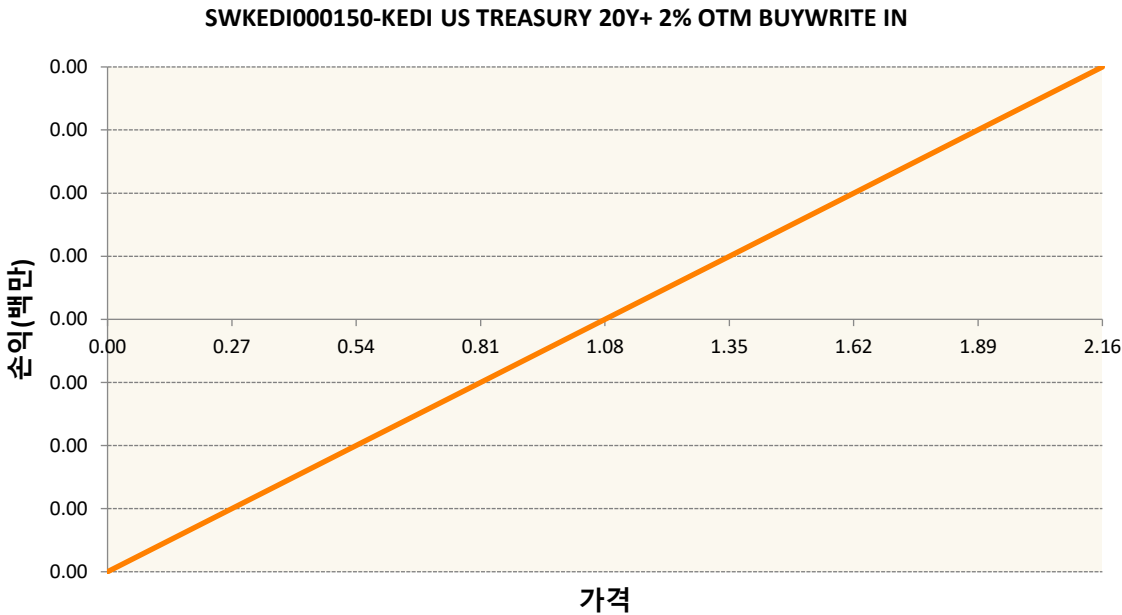
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

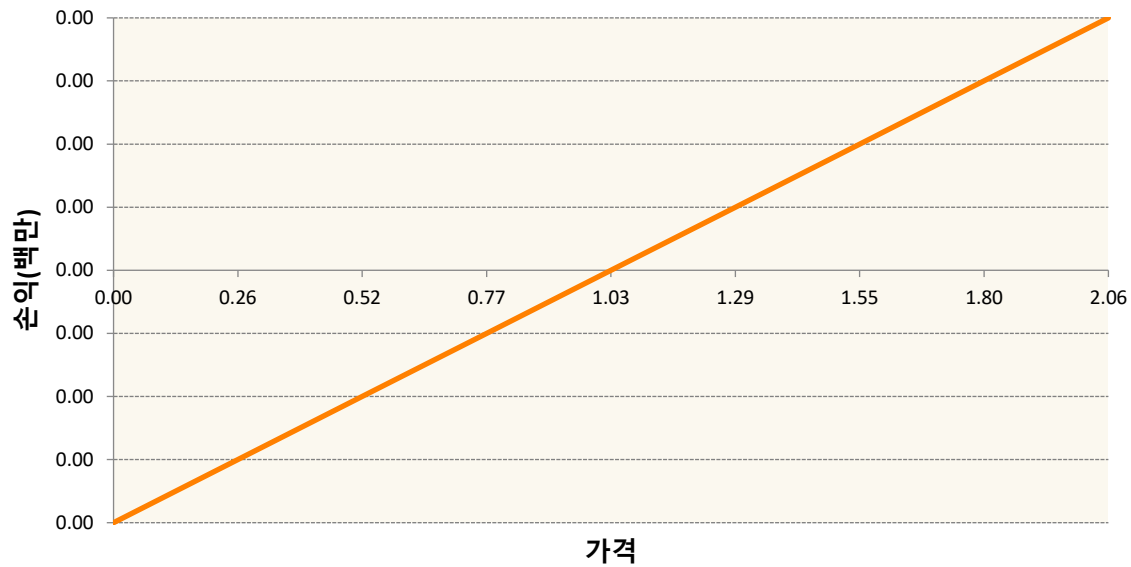
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	391,175	0	391,175	장외

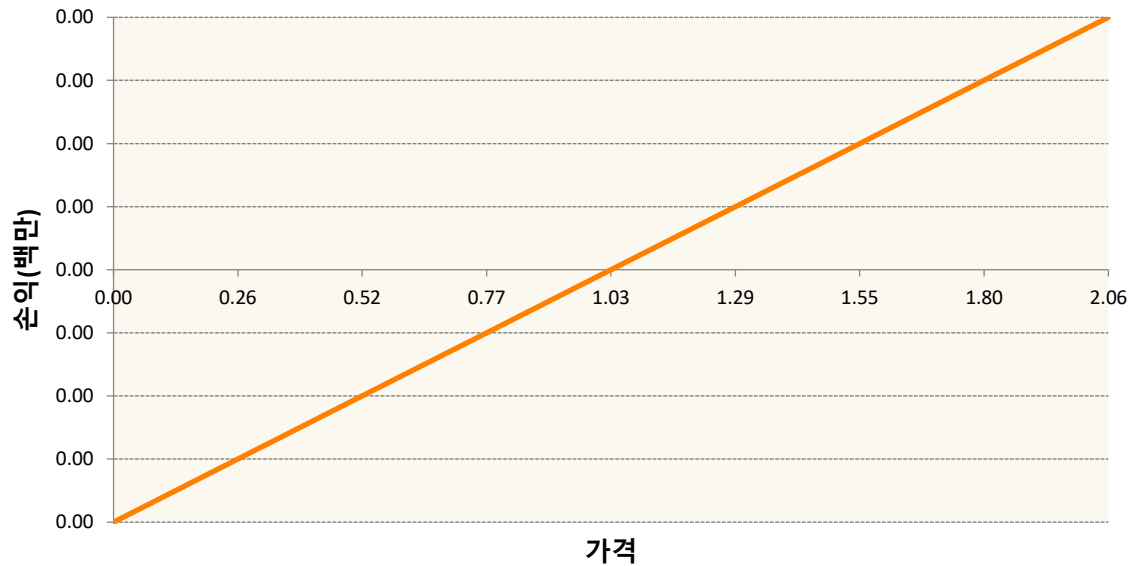
2. 만기시점의 손익구조



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	8,315
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,827
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	10,355
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,703

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

(단위:백만원)

14,540

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

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	2,373	0	2,373	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)

42

공시일	2025-11-25
기준일	2025-11-24

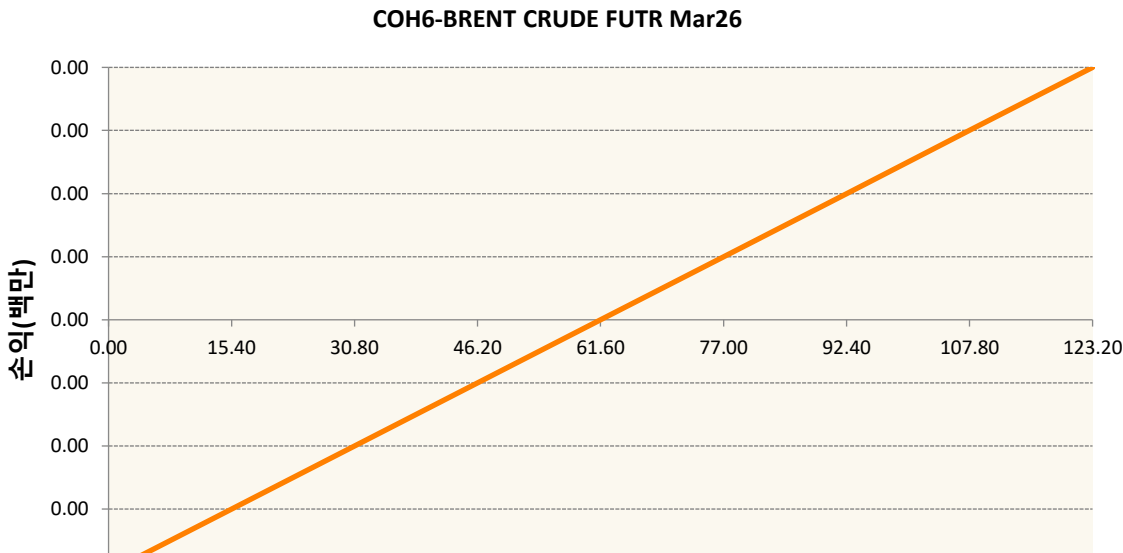
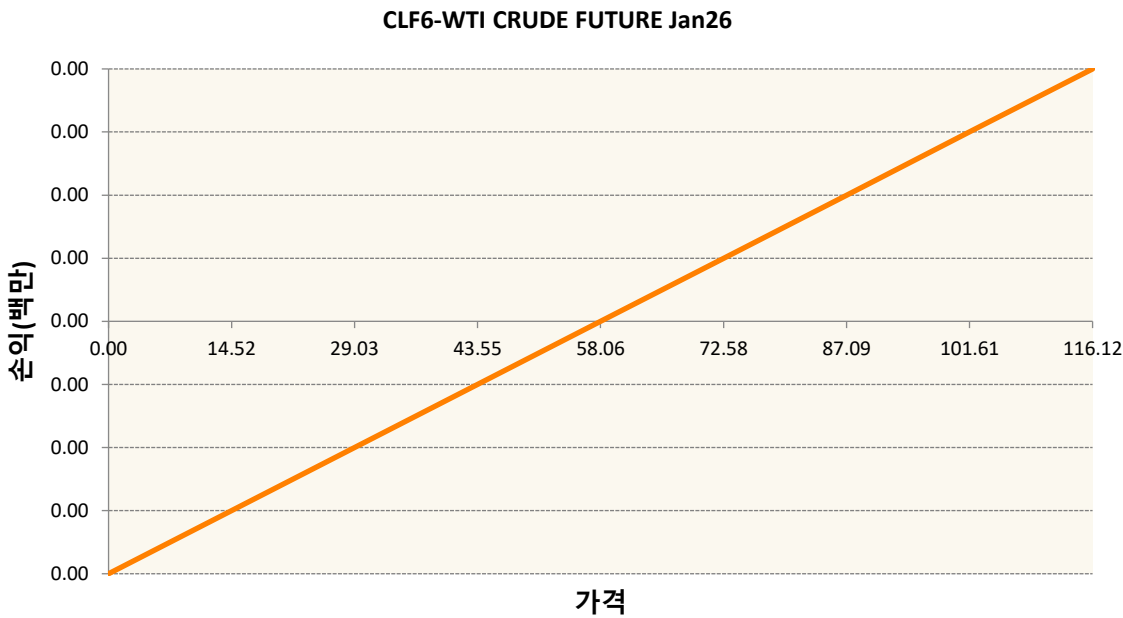
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

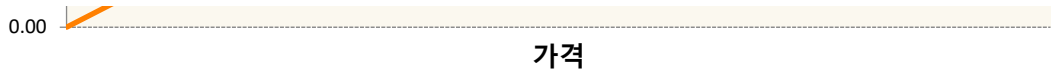
1. 계약금액

(단위:백만원)

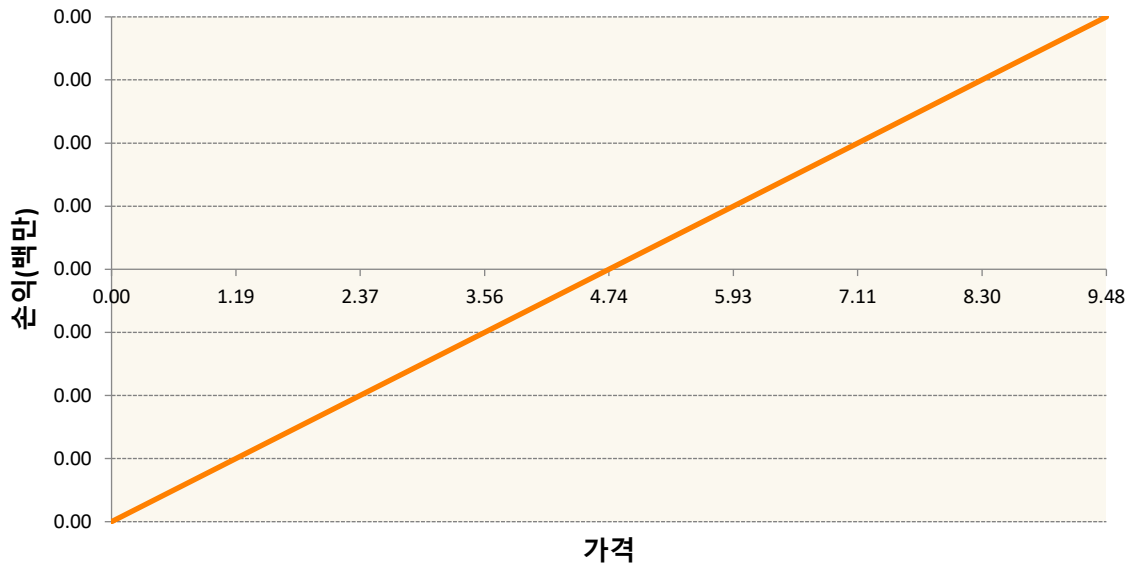
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	366	0	366	
누계	유가증권	선물	181	0	181	
누계	통화	선물	0	118	-118	장내

2. 만기시점의 손익구조

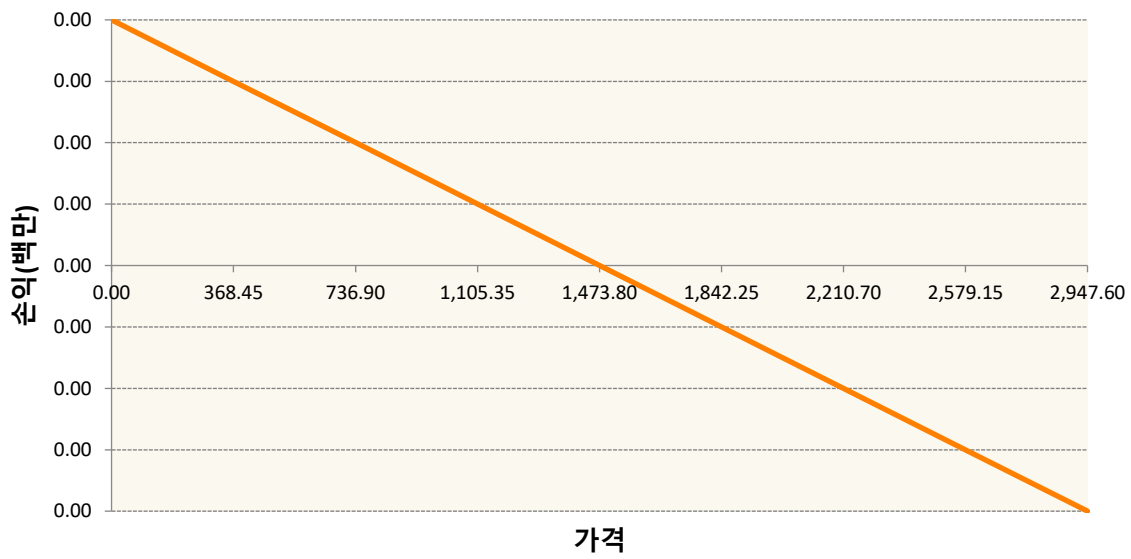




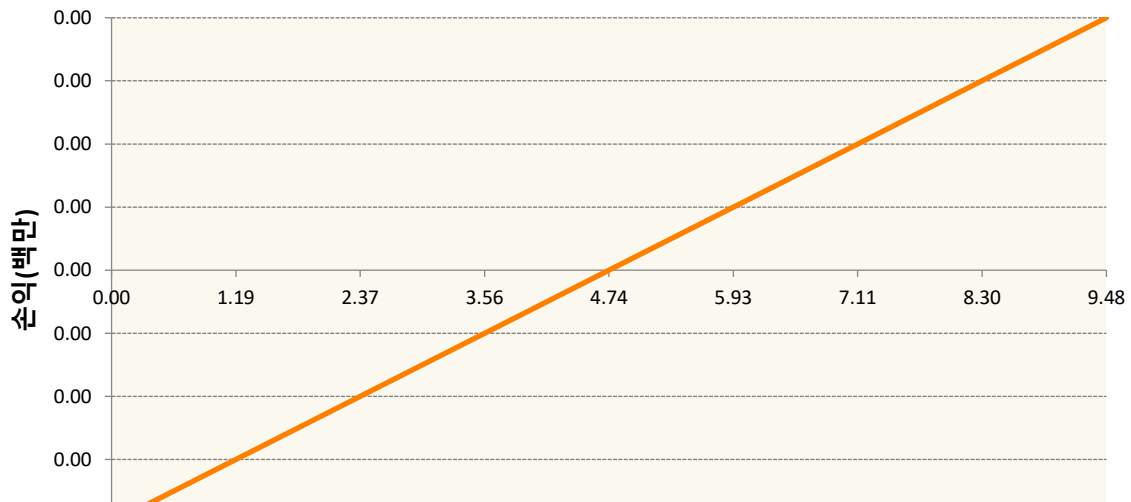
EOF6-E-MINI NATURAL GAS Jan26

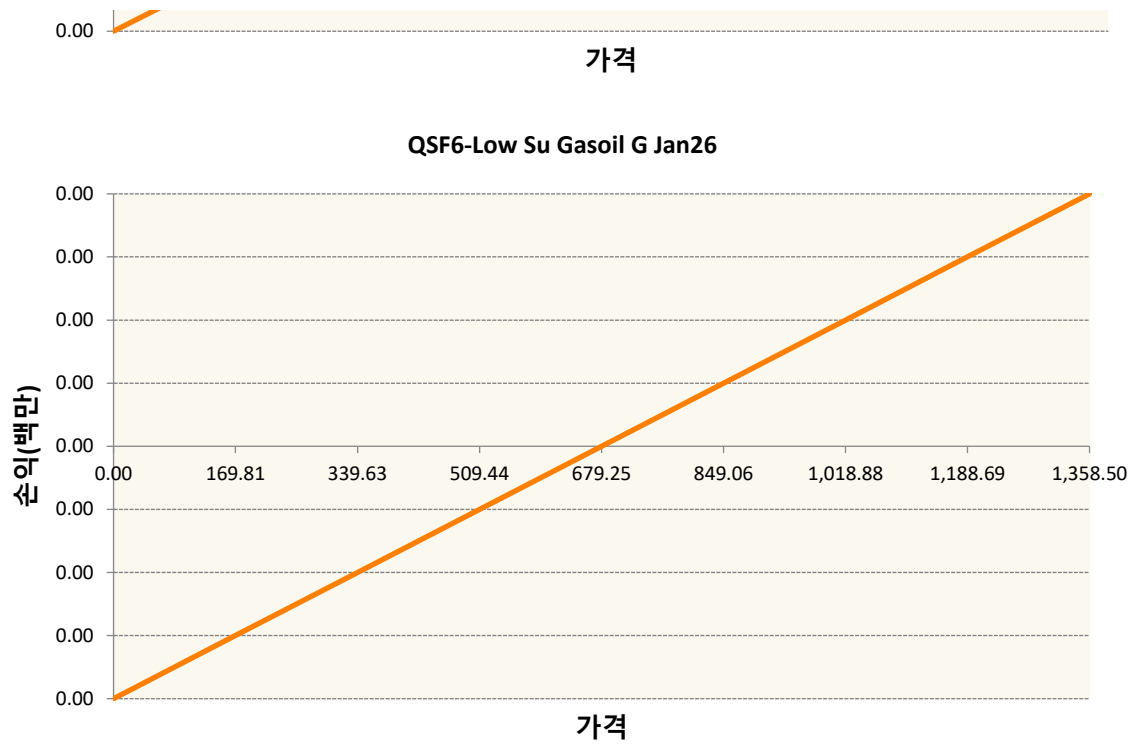


KR4175WC0004-2025-12 달러선물



NGF26-NATURAL GAS FUTR Jan26





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLF6	WTI CRUDE FUTURE Jan26	7
COH6	BRENT CRUDE FUTR Mar26	14
EOF6	E-MINI NATURAL GAS Jan26	4
KR4175WC01	2025-12 달러선물	9
NGF26	NATURAL GAS FUTR Jan26	11
QSF6	Low Su Gasoil G Jan26	8

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

(단위:백만원)

96