

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

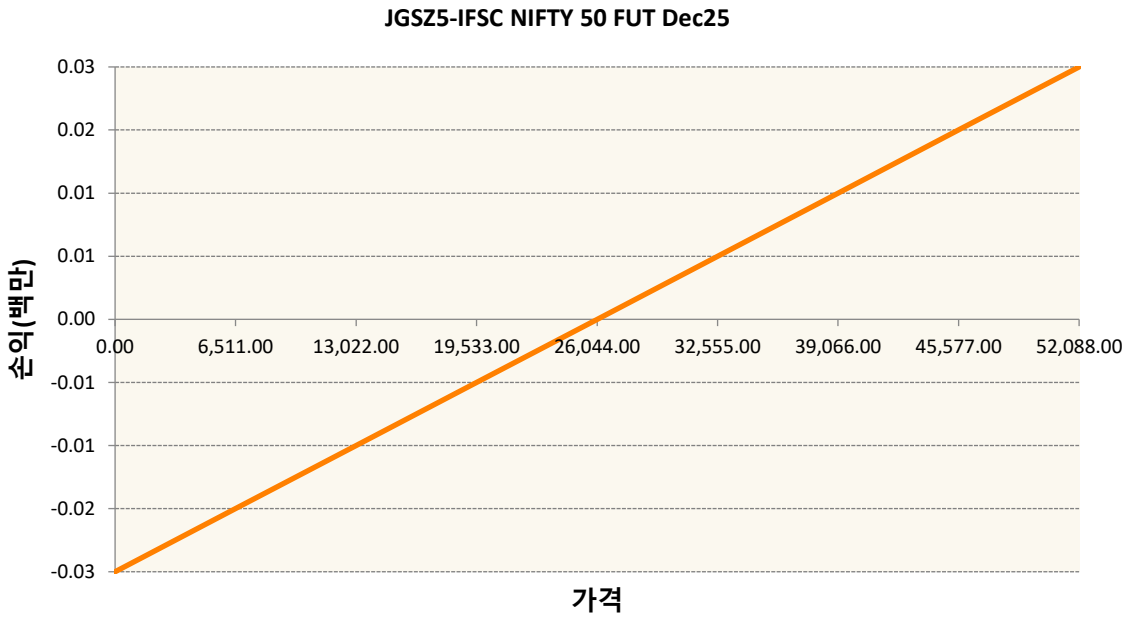
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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   | 615   | 0     | 615       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                   |      |
|-----------------------------------|------|
| INE423A200` Adani Enterprises Ltd | 0.05 |
| JGSZ5 IFSC NIFTY 50 FUT Dec25     | 49   |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 31 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

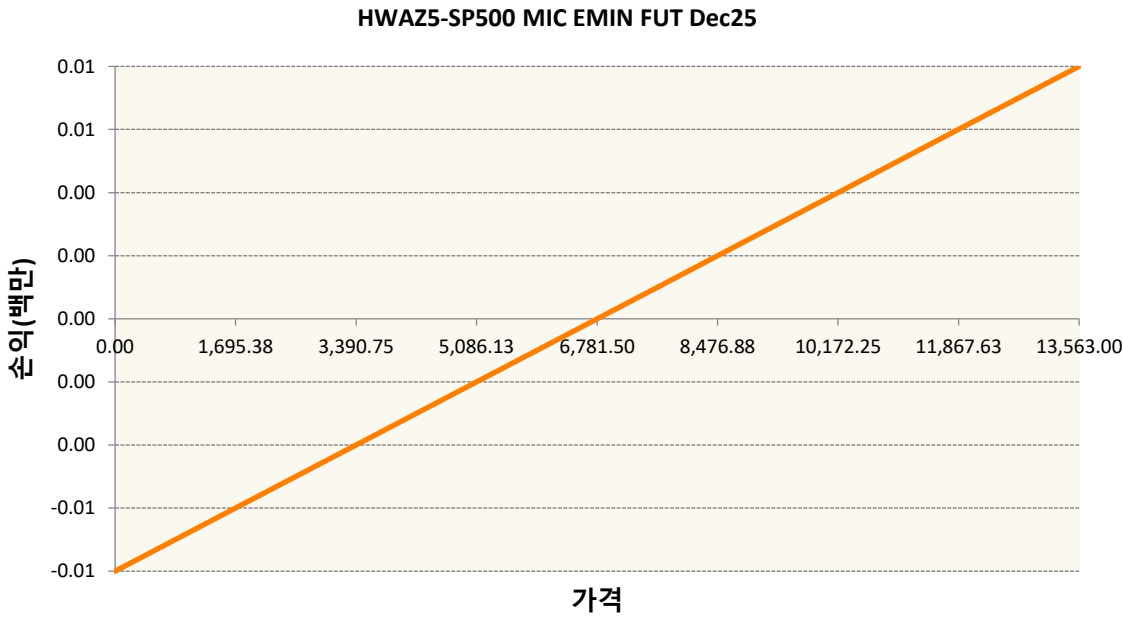
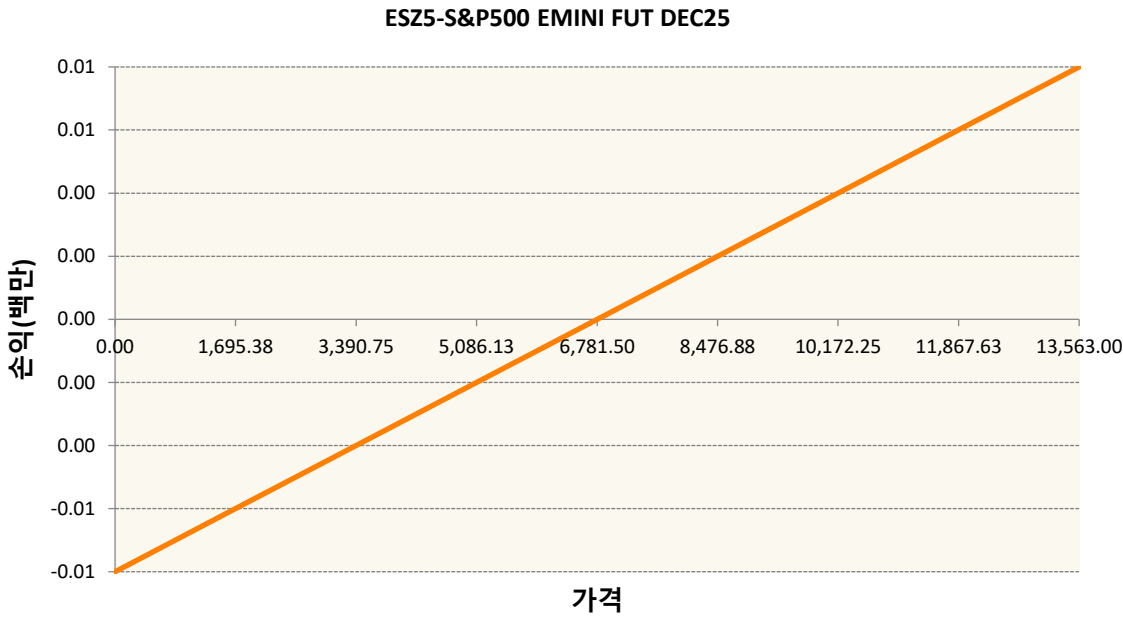
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 471   | 0     | 471       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 141   | 0     | 141       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ5                      | S&P500 EMINI FUT DEC25   | 38       |
| HWAZ5                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec25 | 11       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 65       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

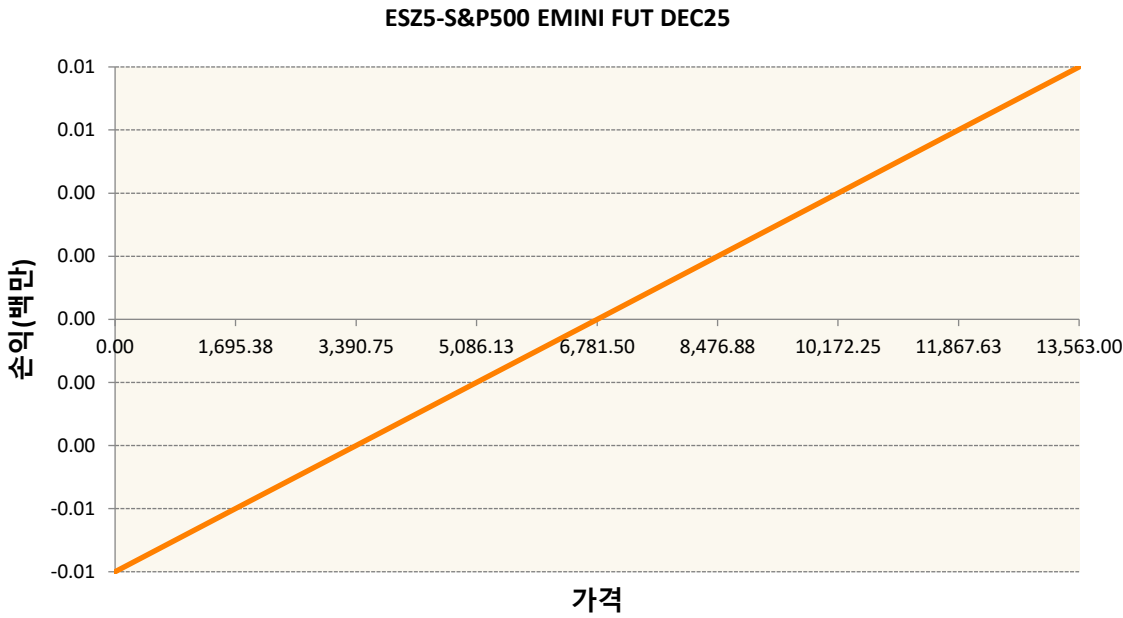
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,413 | 0     | 1,413     |    |

### 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)

|     |
|-----|
| 164 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

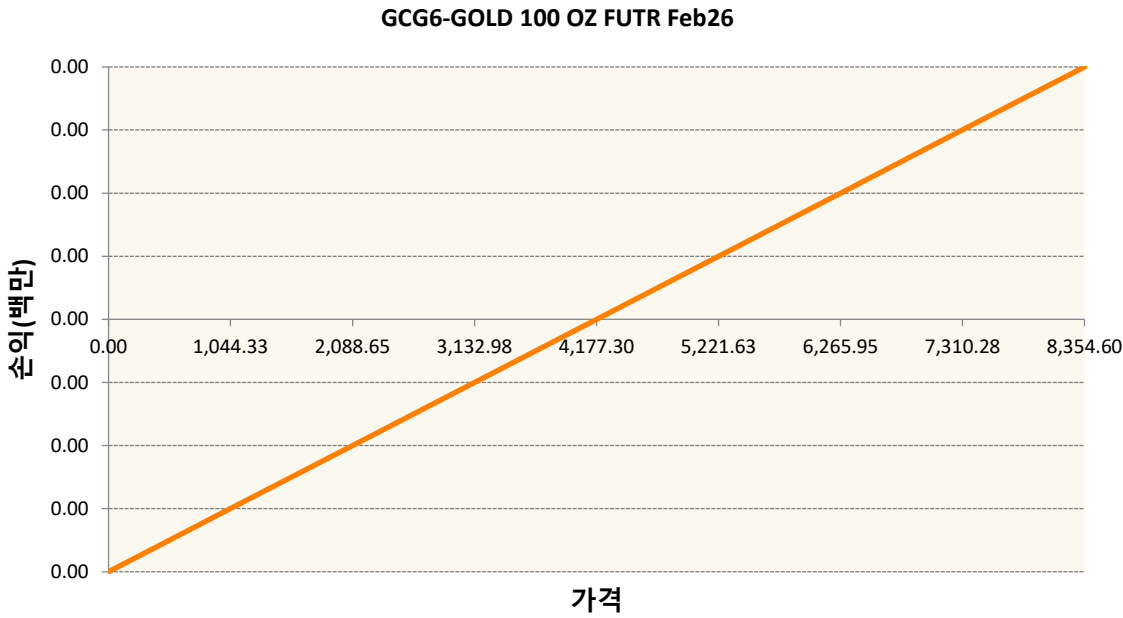
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 3,075 | 0     | 3,075     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| AOGLDUSC3 GLD US 11/28/25 C385 EQUITY | 1   |
| GCG6 GOLD 100 OZ FUTR Feb26           | 246 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 231 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

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 | 54  |
| AOPLTRUP0' PLTR US 11/28/25 P165 EQUITY | 130 |

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

(단위:백만원)

714

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

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

0.18

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

(단위:백만원)

0



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

(단위:백만원)

5,696

공시일 2025-11-27

기준일 2025-11-26

## 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 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

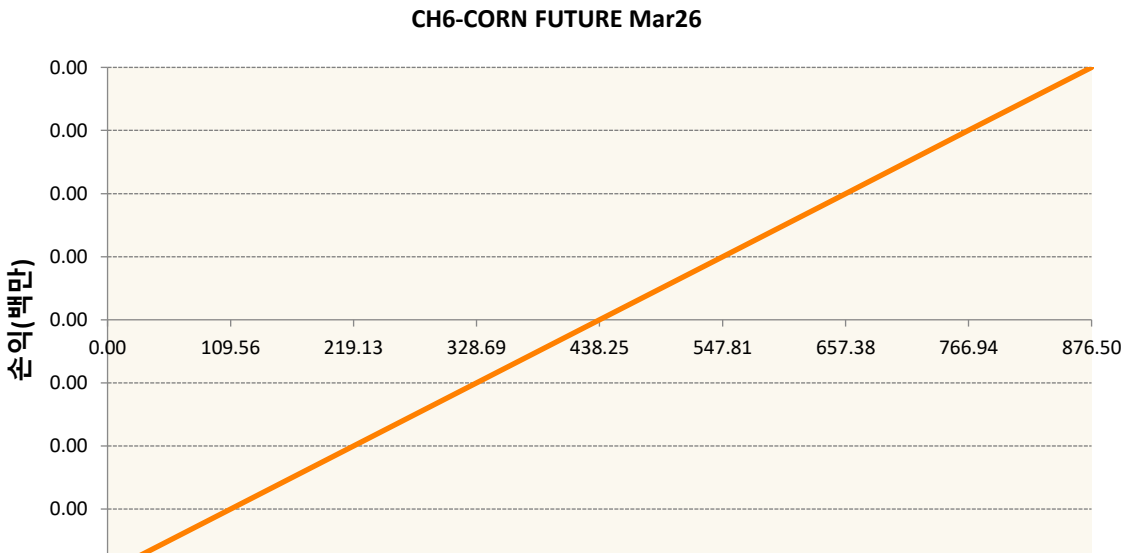
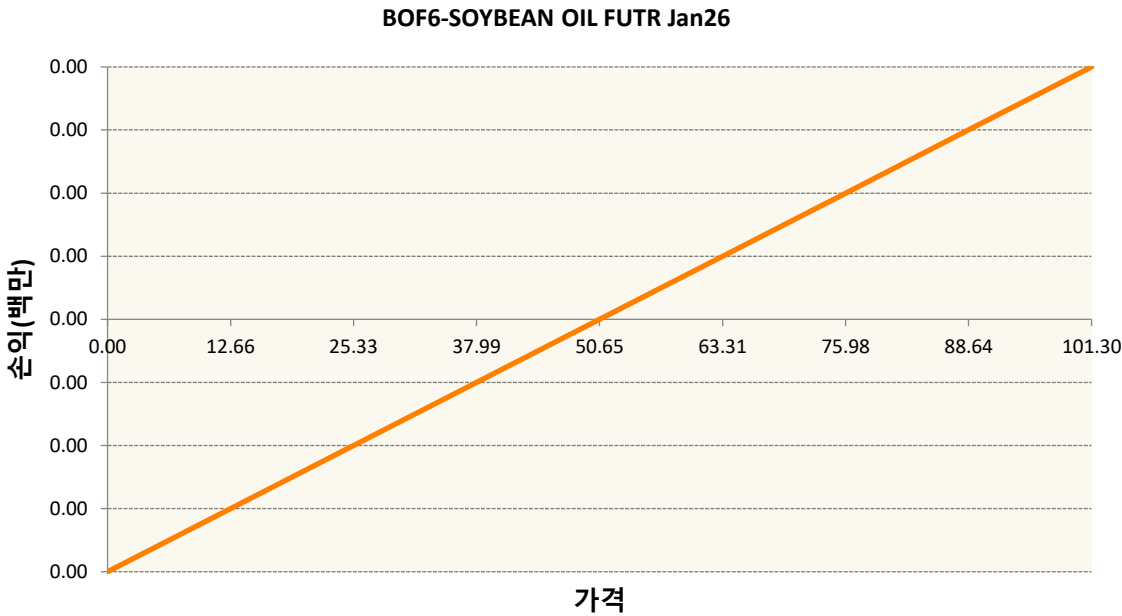
## 포커스농산물모(채권-파생형)

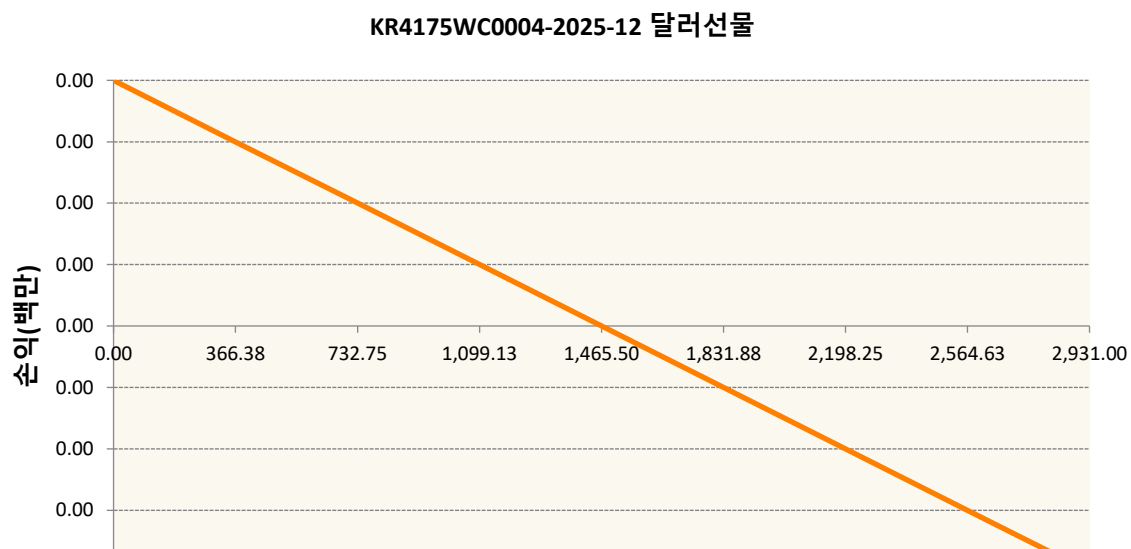
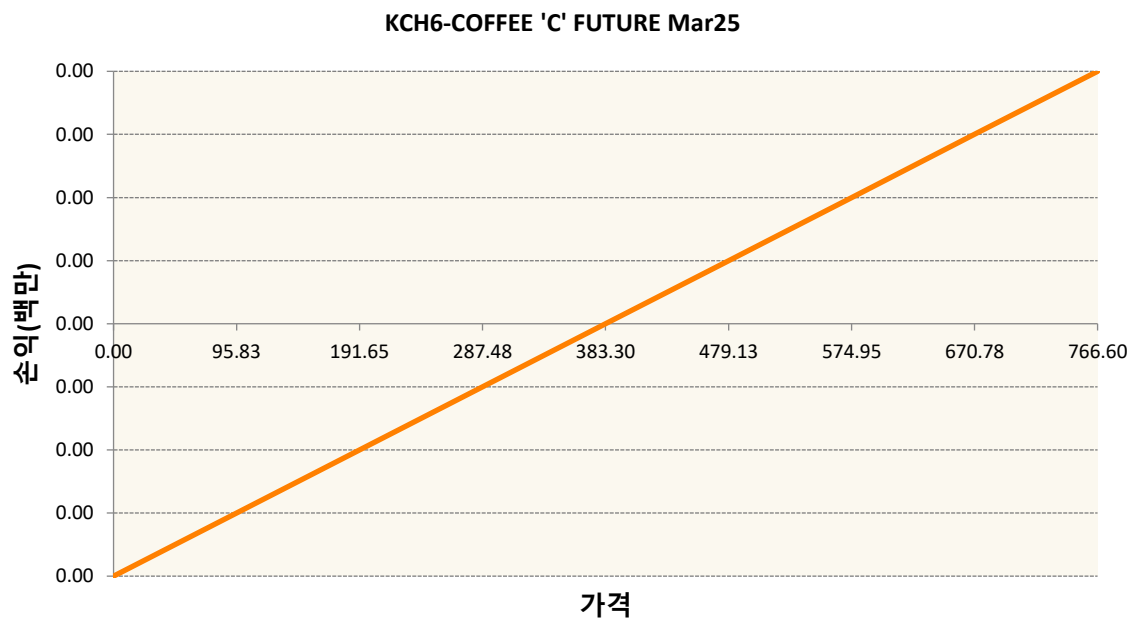
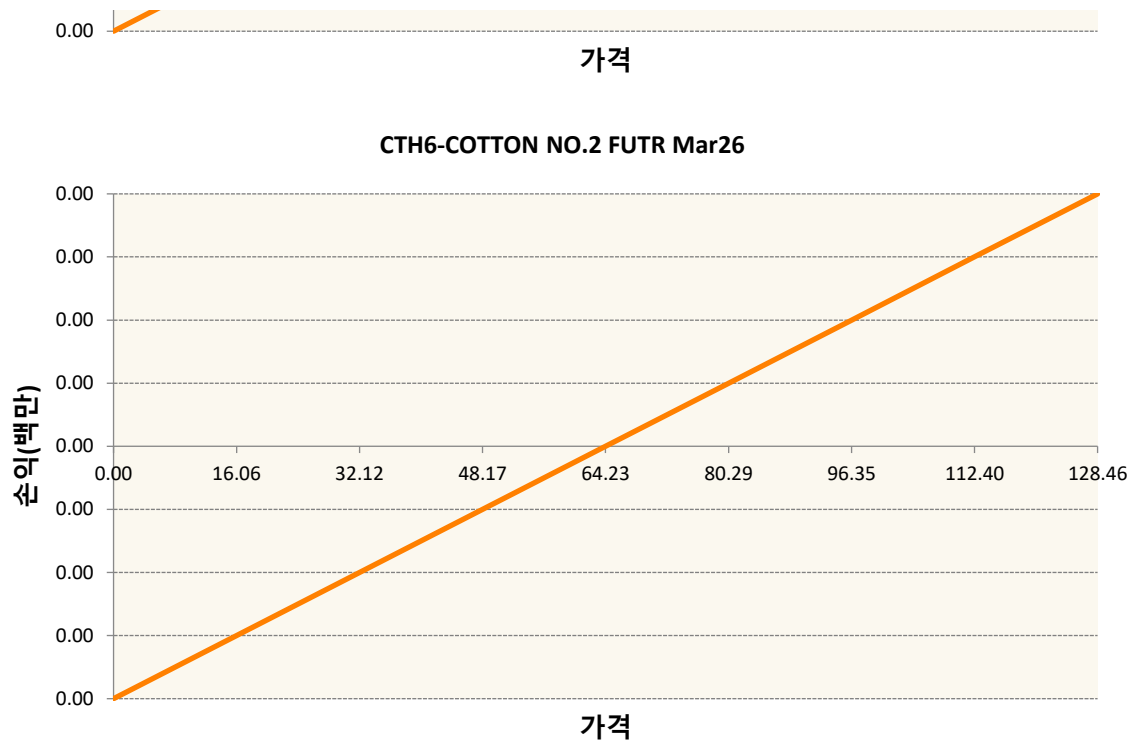
### 1. 계약금액

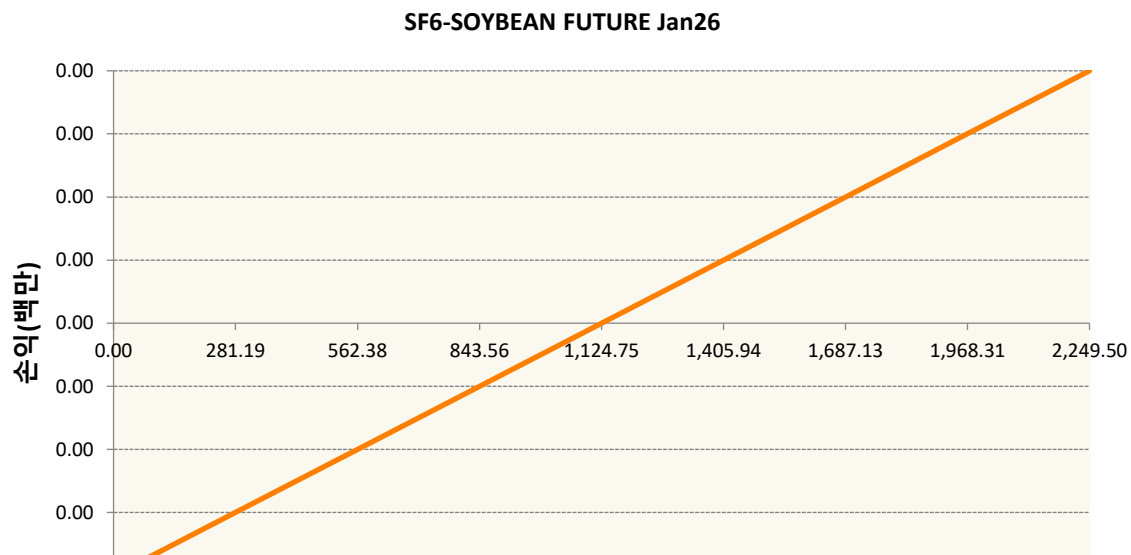
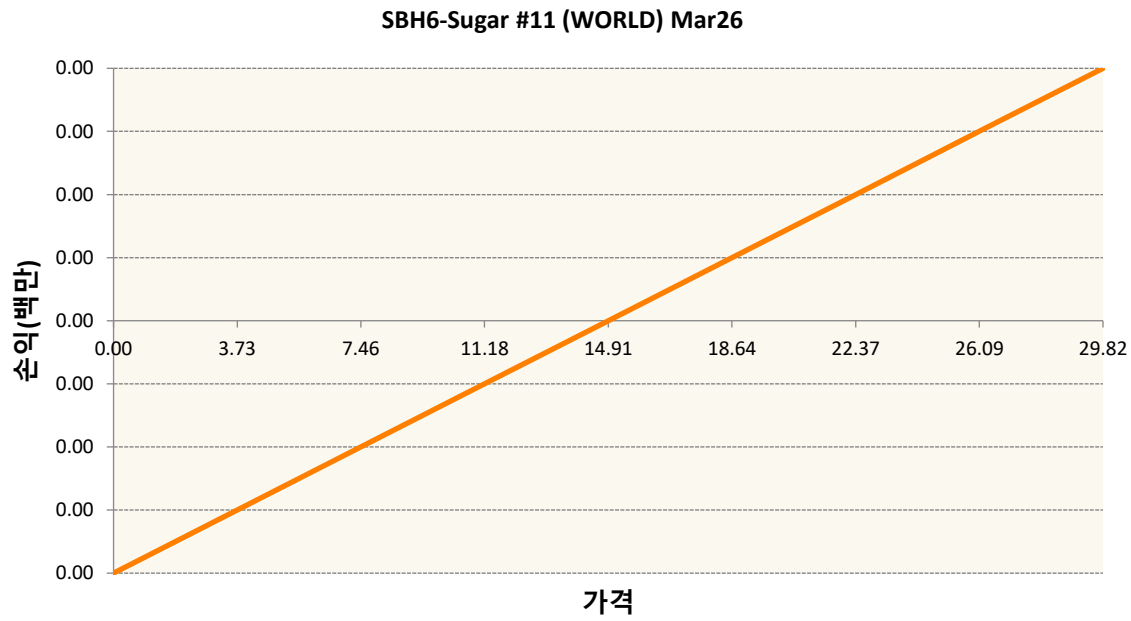
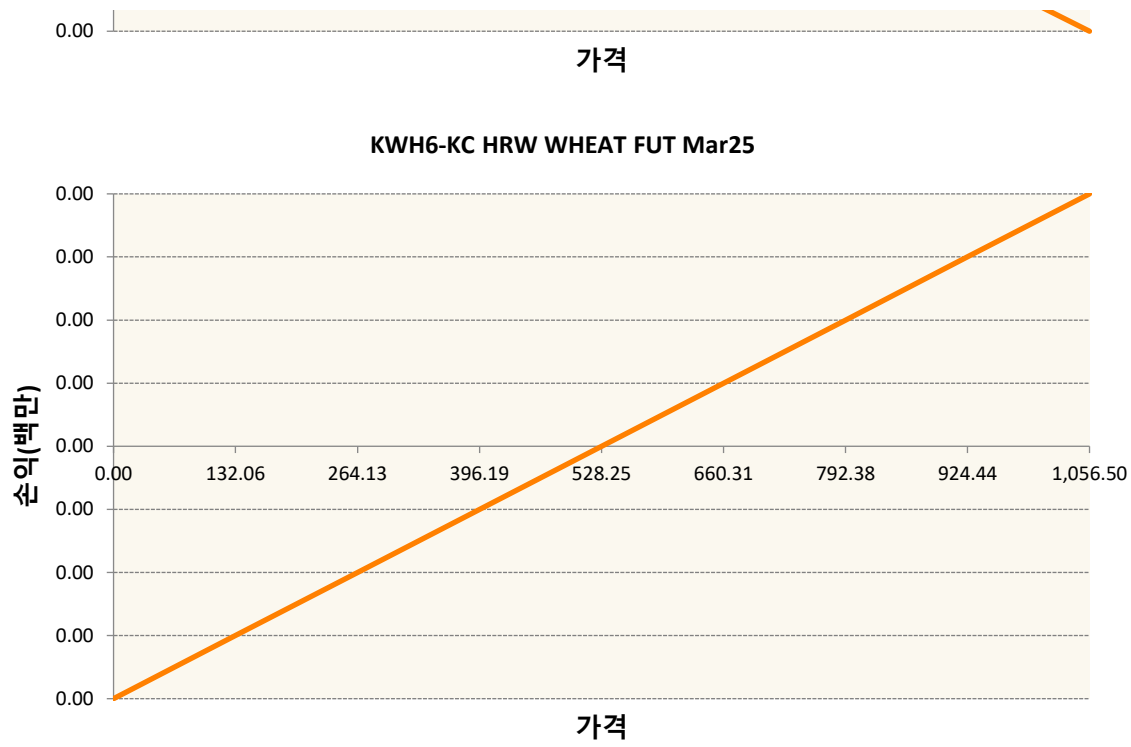
(단위:USD 백만)

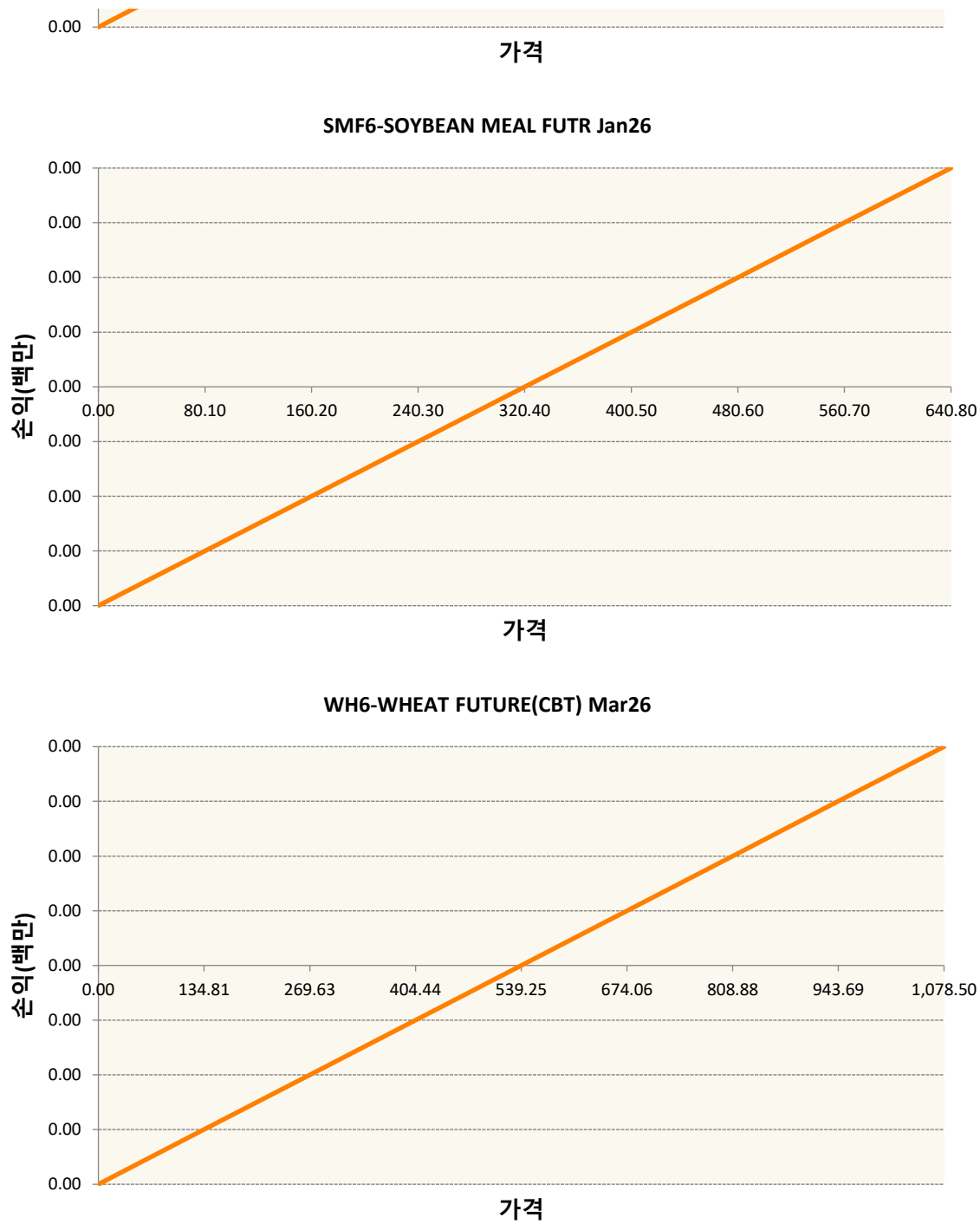
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,153 | 0     | 1,153     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,162 | 0     | 2,162     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 440   | -440      | 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 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

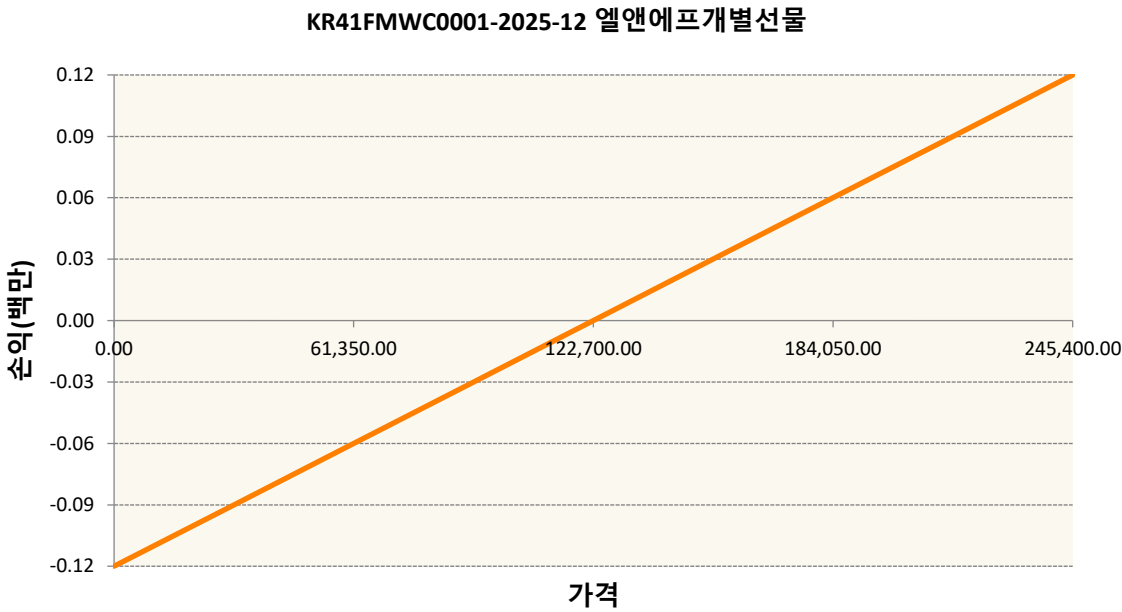
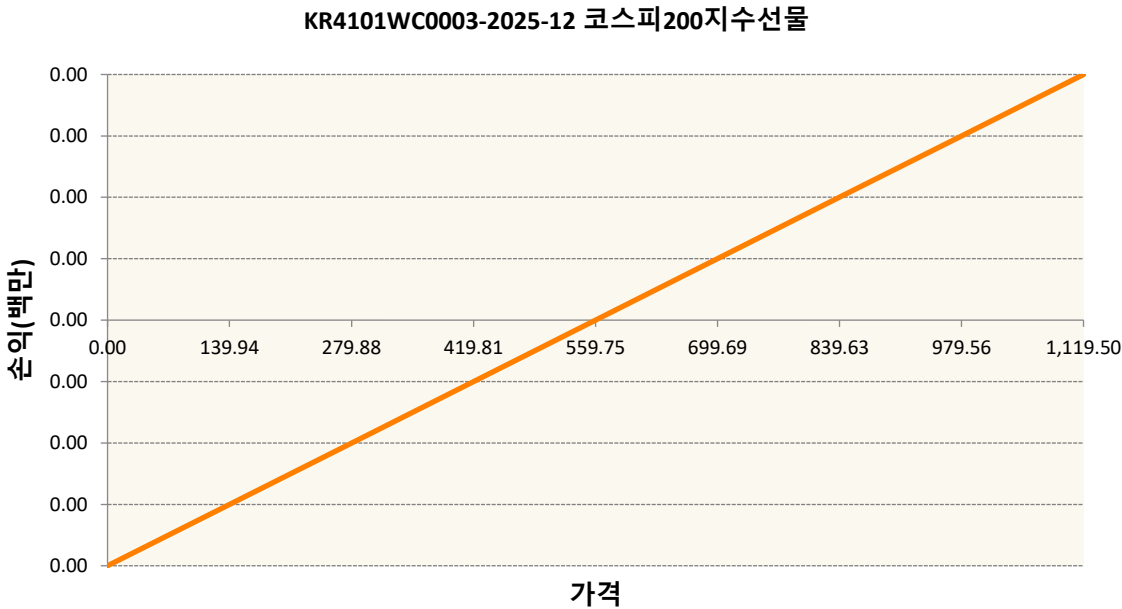
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 138   | 0     | 138       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,439 | 0     | 1,439     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)     |  | (단위:백만원) |
|-------------------------------|--|----------|
| KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물 |  | 112      |
| KR41FMWCC 2025-12 엘앤티에프개별선물   |  | 3        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 11       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

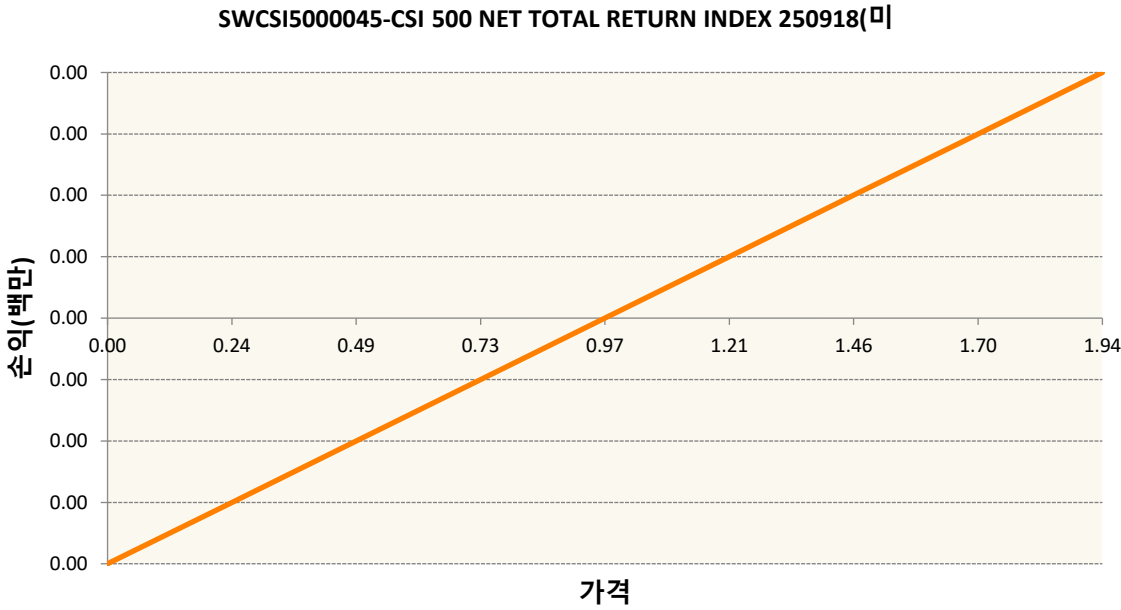
SOL차이나강소기업CSI500상장

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   | 4,559 | 0     | 4,559     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

365

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

460

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

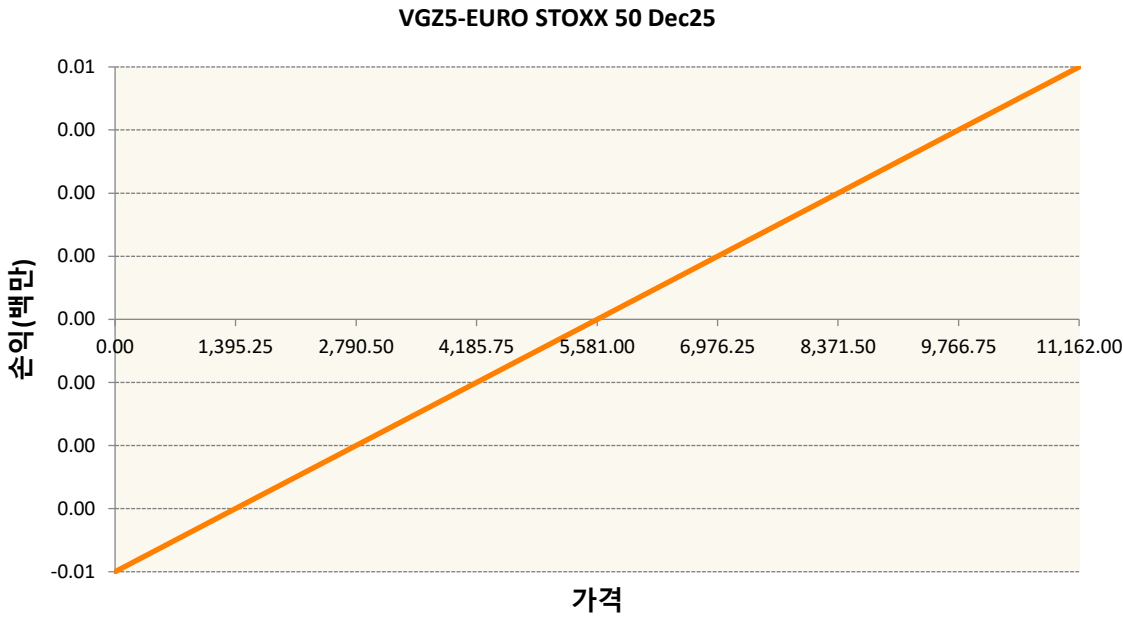
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 732   | 0     | 732       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGZ5 | EURO STOXX 50 Dec25 | 59 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 49 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

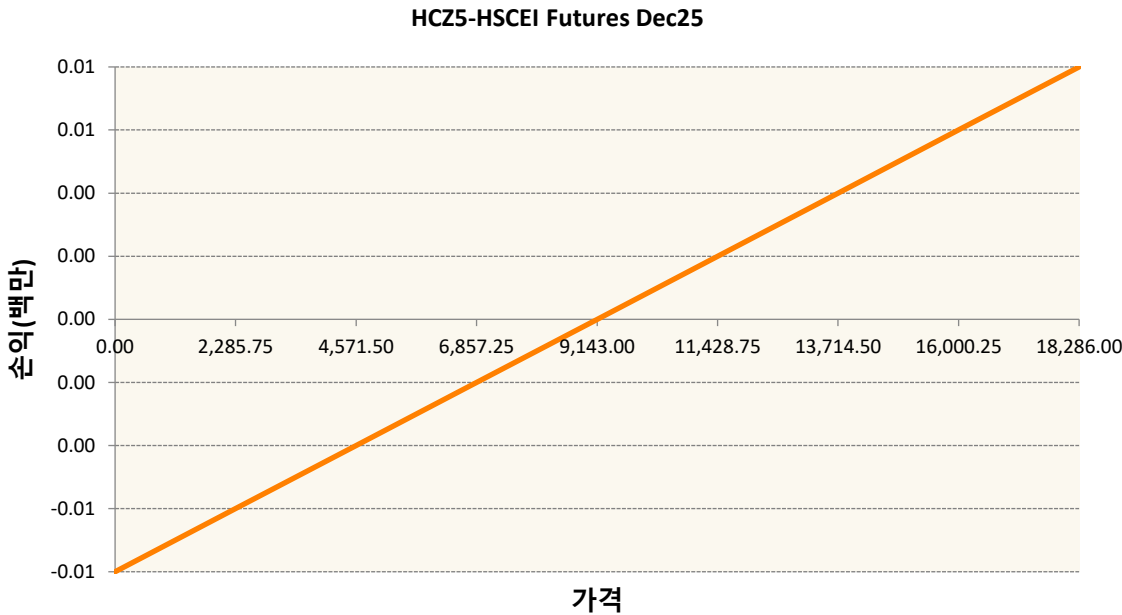
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,905 | 0     | 1,905     |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCZ5 | HSCEI Futures Dec25 | 152 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

199

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

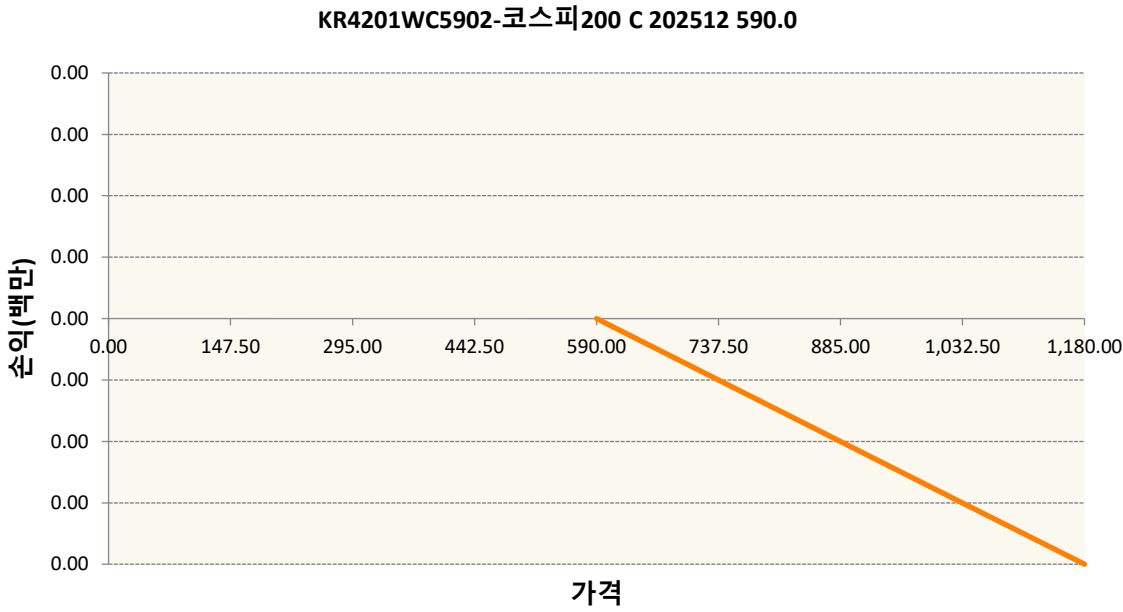
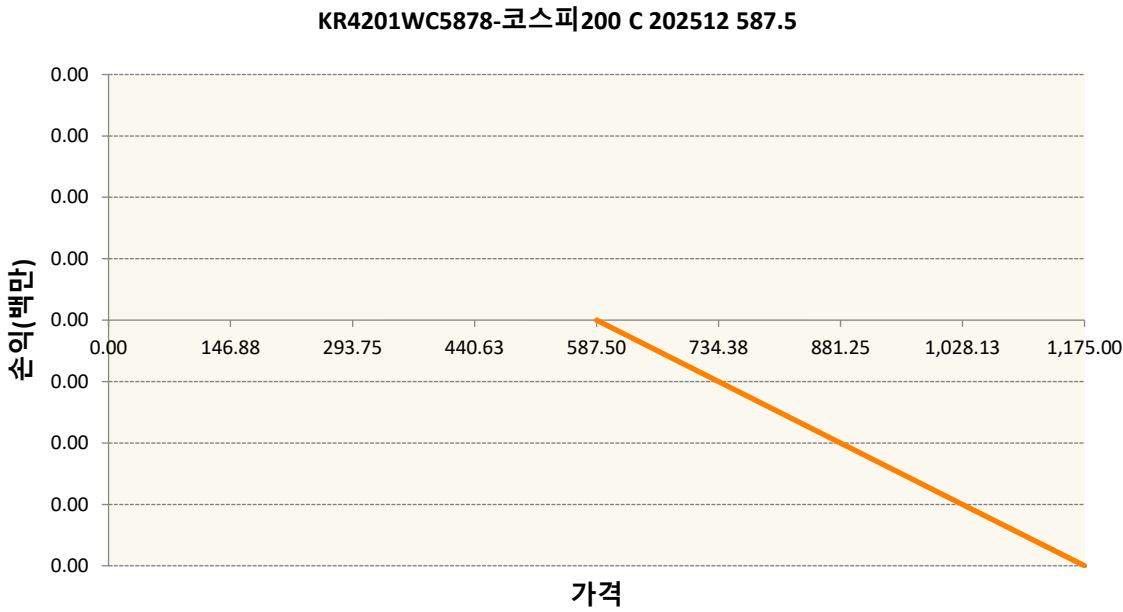
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

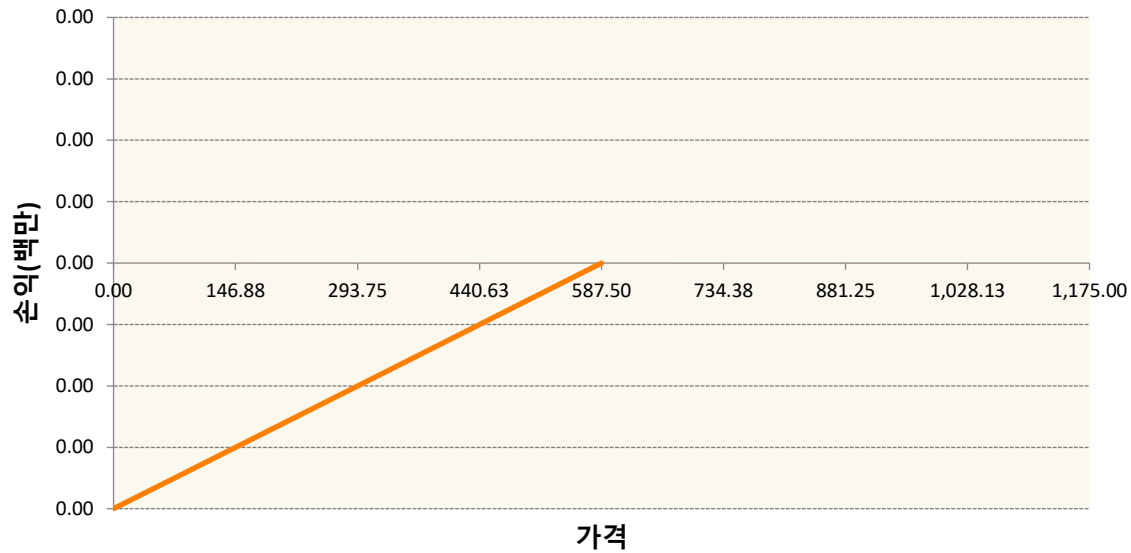
(단위:백만원)

| 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 2025-11-27

기준일 2025-11-26

## 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 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

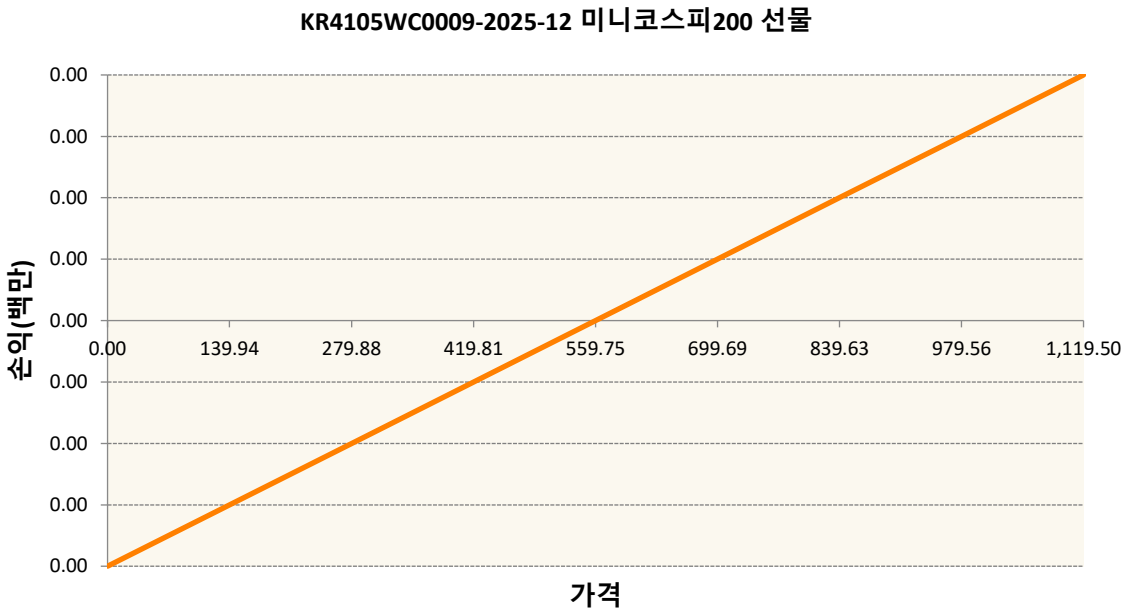
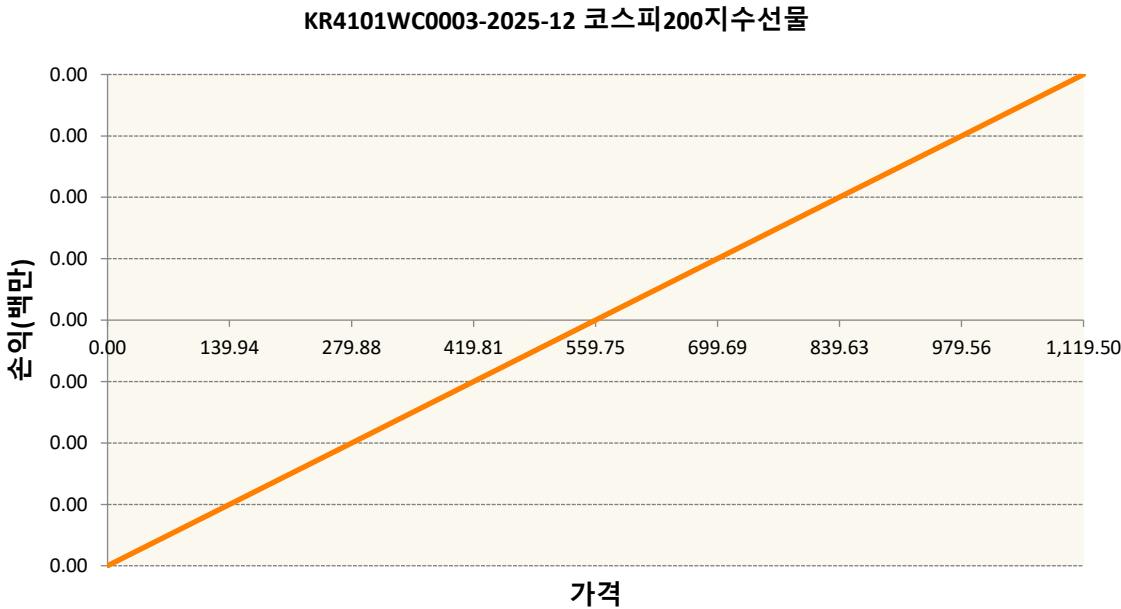
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

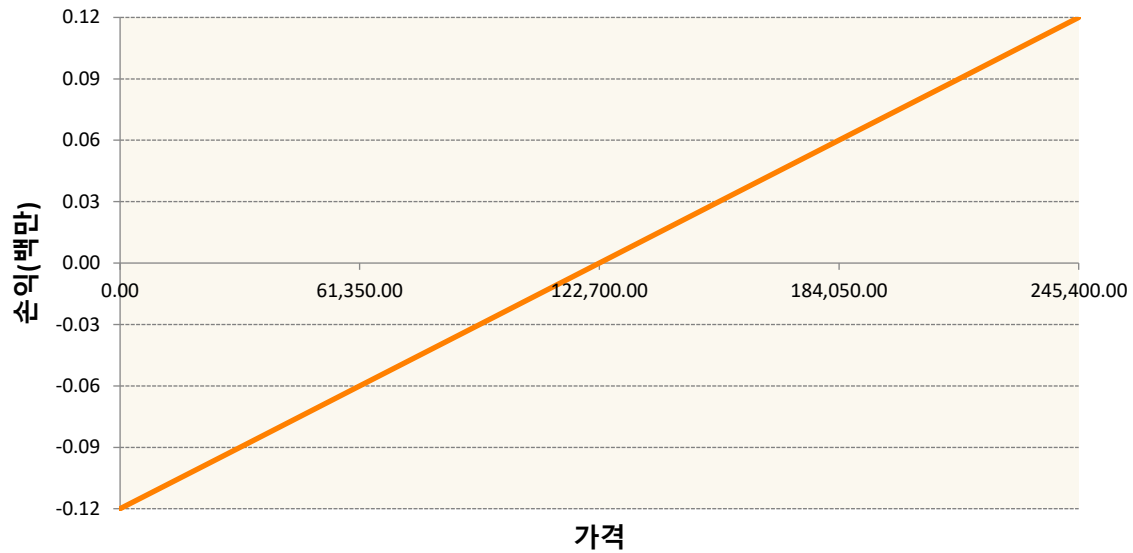
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 140   | 0     | 140       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,137 | 0     | 1,137     | 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  
 11  
 1

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

(단위:백만원)

5

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

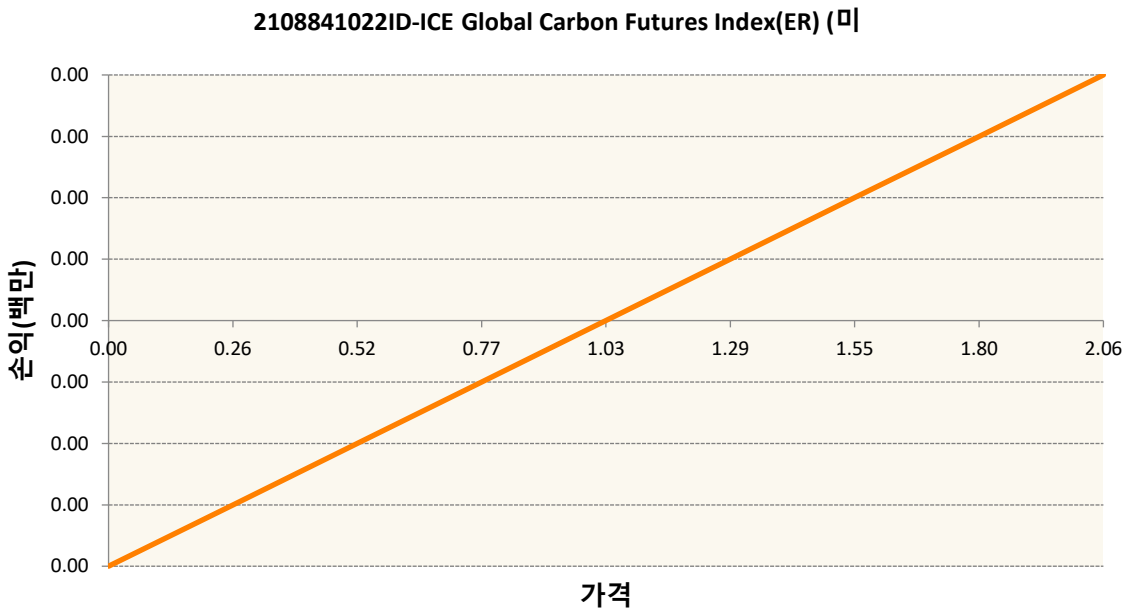
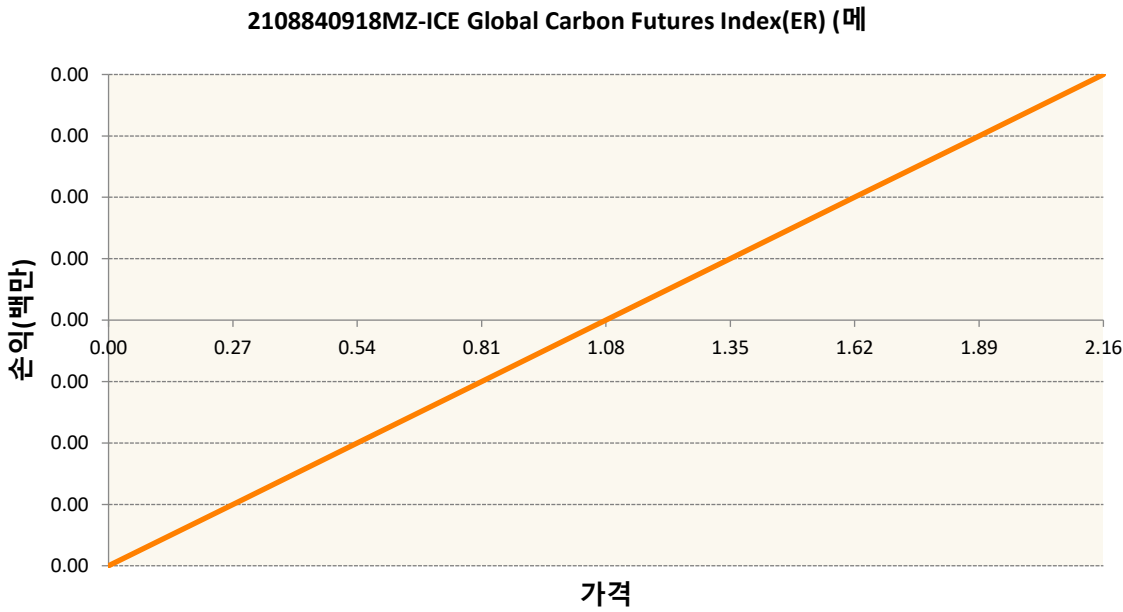
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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   | 8,710 | 0     | 8,710     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 117      |
| 2108841022IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 580      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 673      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

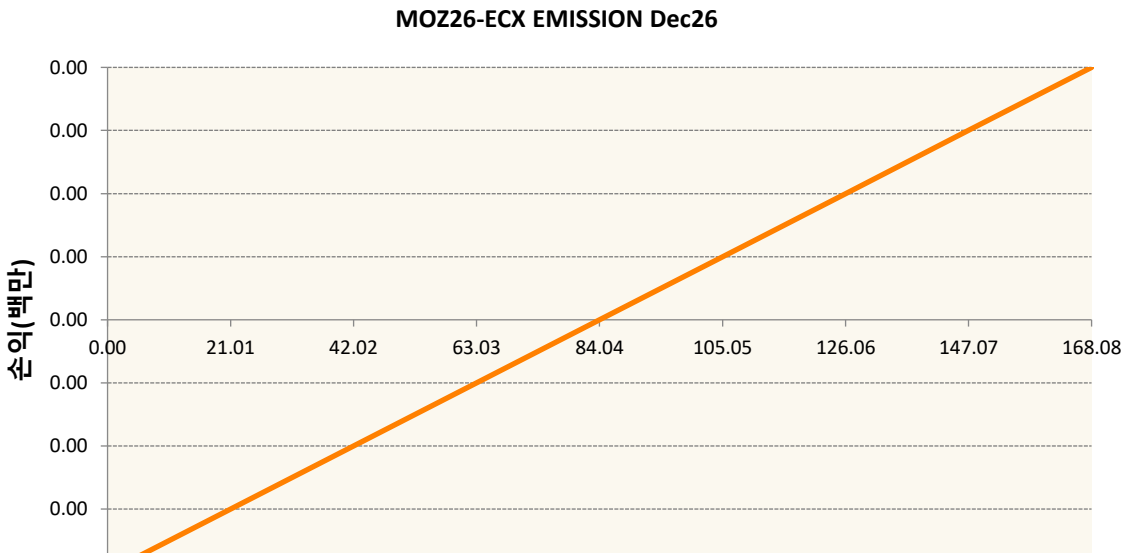
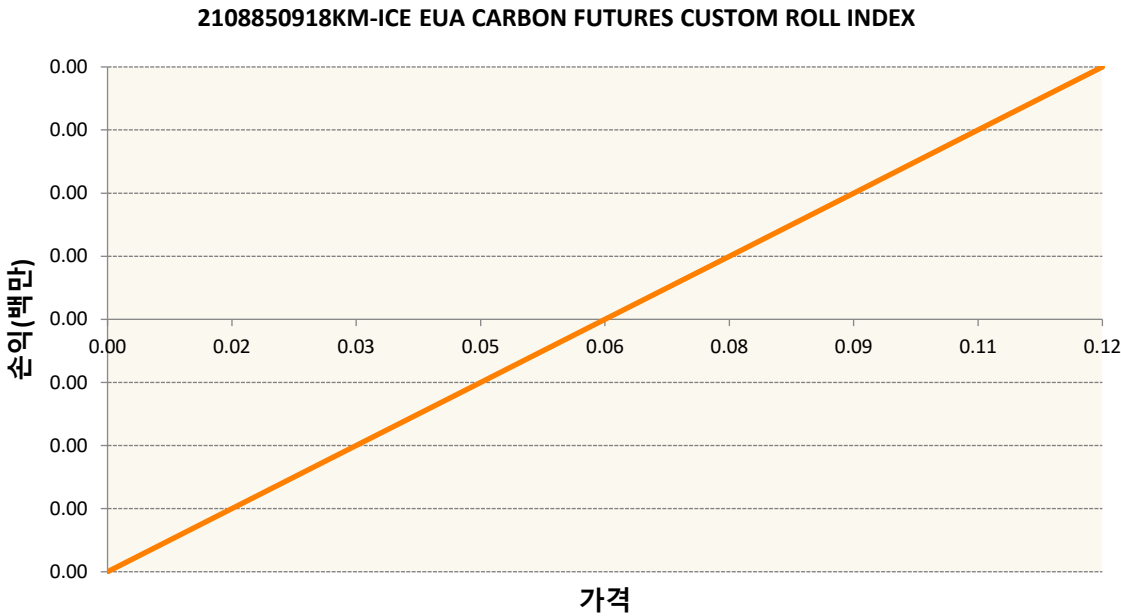
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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 |      |      | 6,537 | 0     | 6,537     |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 25    | 0     | 25        | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,548 | -2,548    | 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                         | 204 |
| MOZ26      ECX EMISSION Dec26                       | 523 |

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

(단위:백만원)

**817**

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

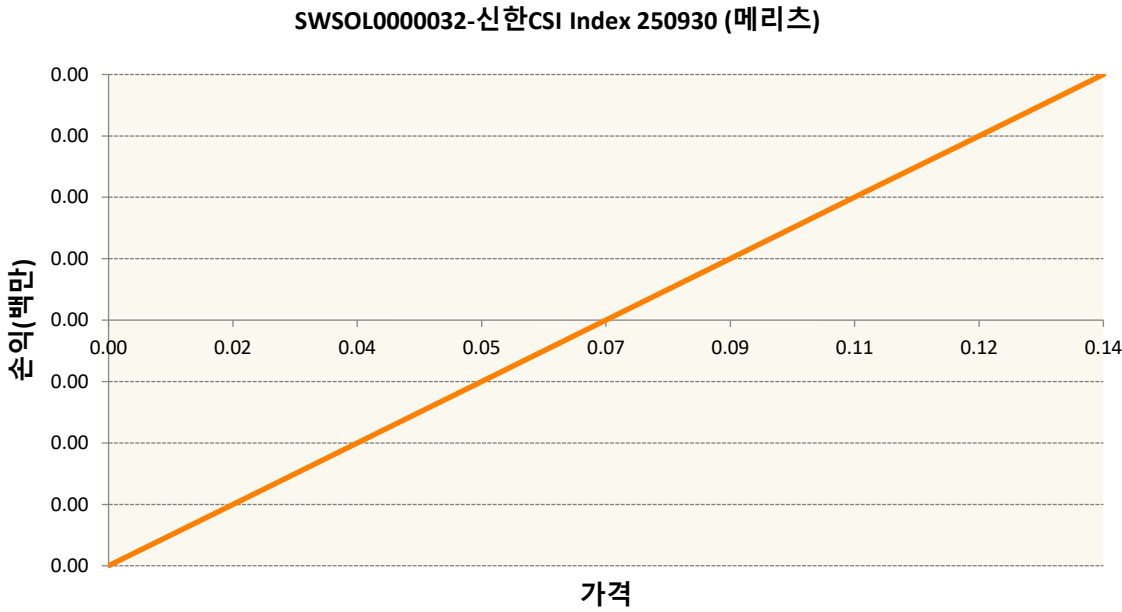
## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 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   | 2,672 | 0     | 2,672     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                |    |
|------------------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 8  |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 6  |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 6  |
| SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)            | 14 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 59 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

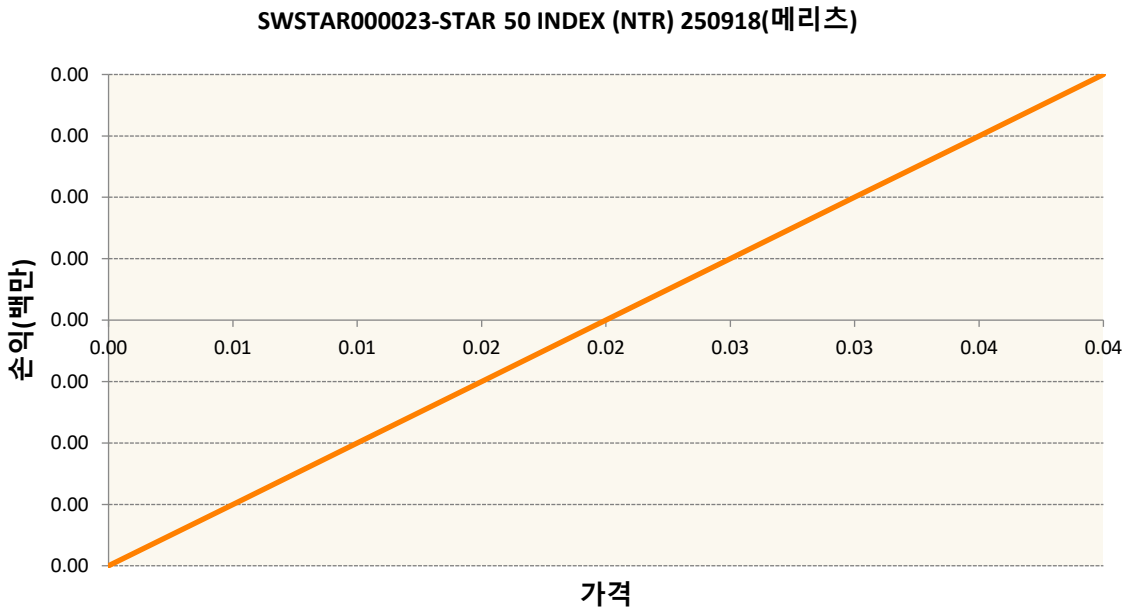
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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   | 3,203 | 0     | 3,203     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                            |    |
|--------------------------------------------|----|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)     | 4  |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)     | 1  |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠) | 13 |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)  | 13 |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠) | 33 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 118 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

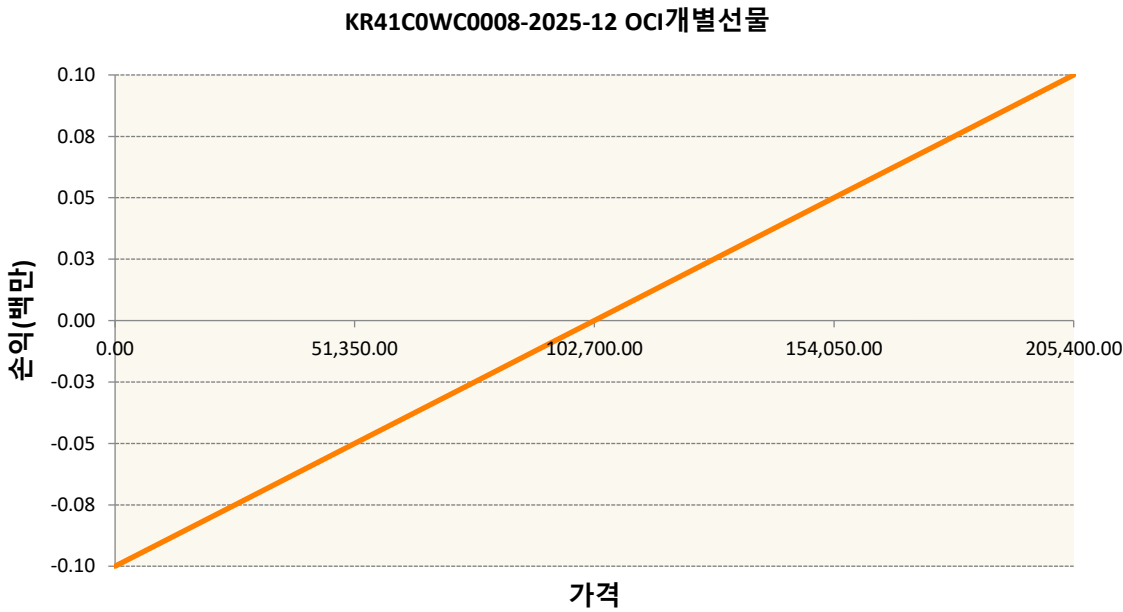
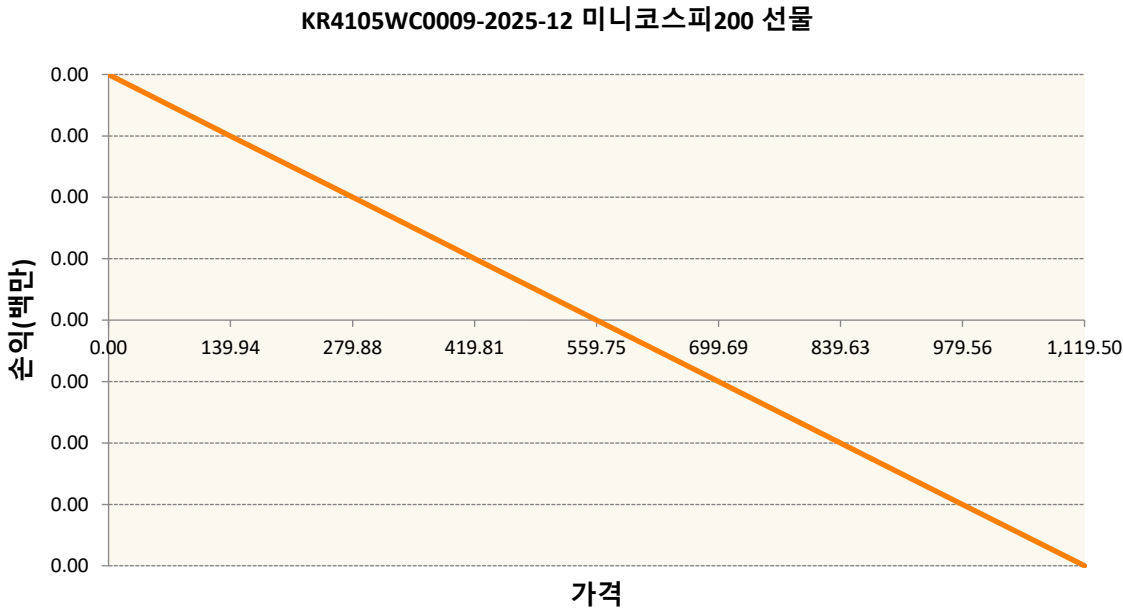
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

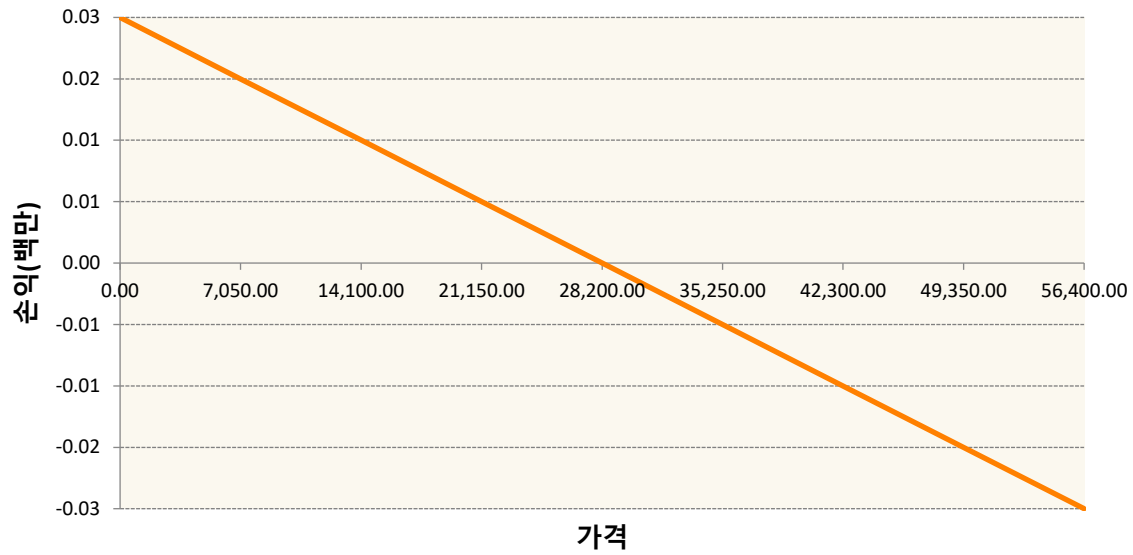
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 13    | 851   | -837      | 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 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

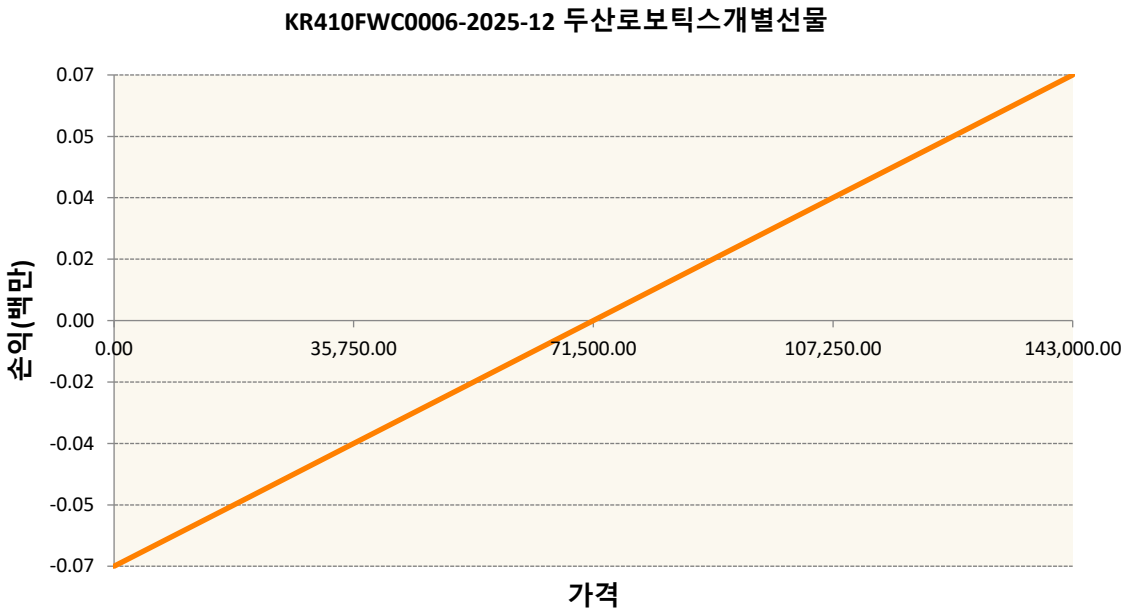
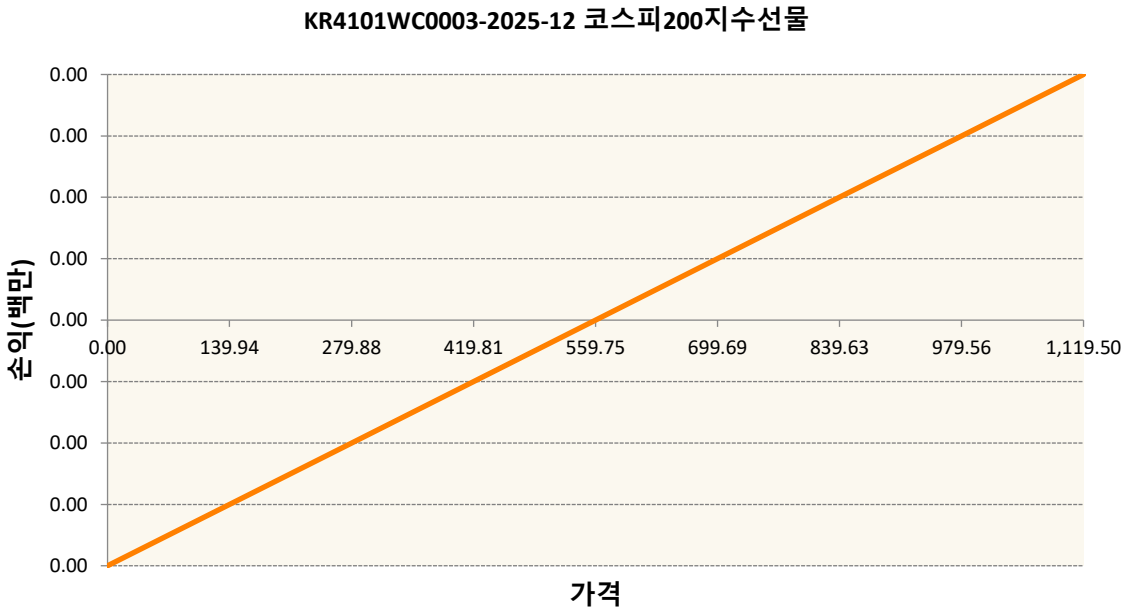
## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 1. 계약금액

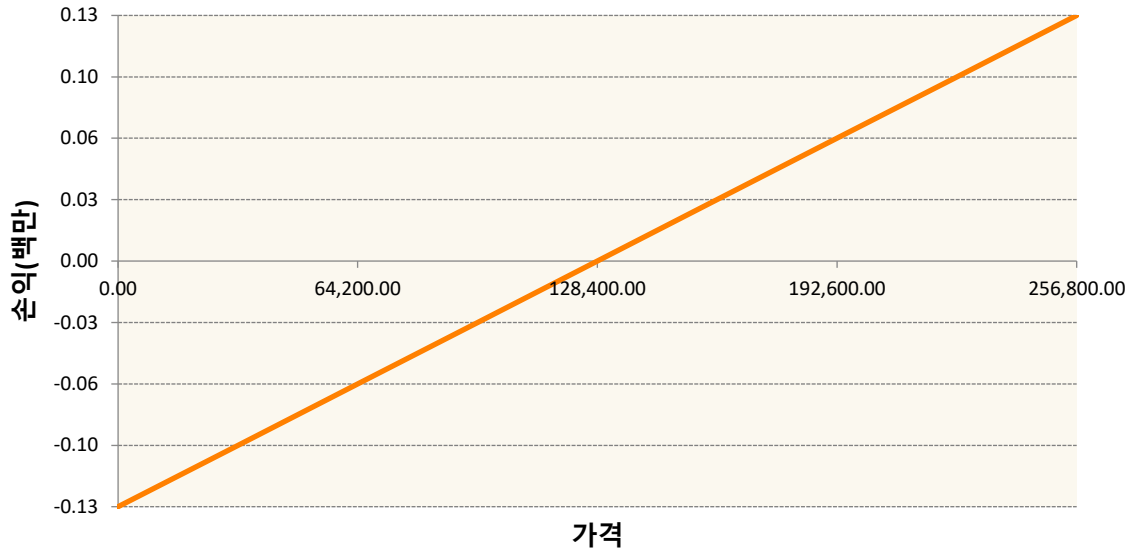
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 280    | 0     | 280       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 12,356 | 0     | 12,356    | 장내 |

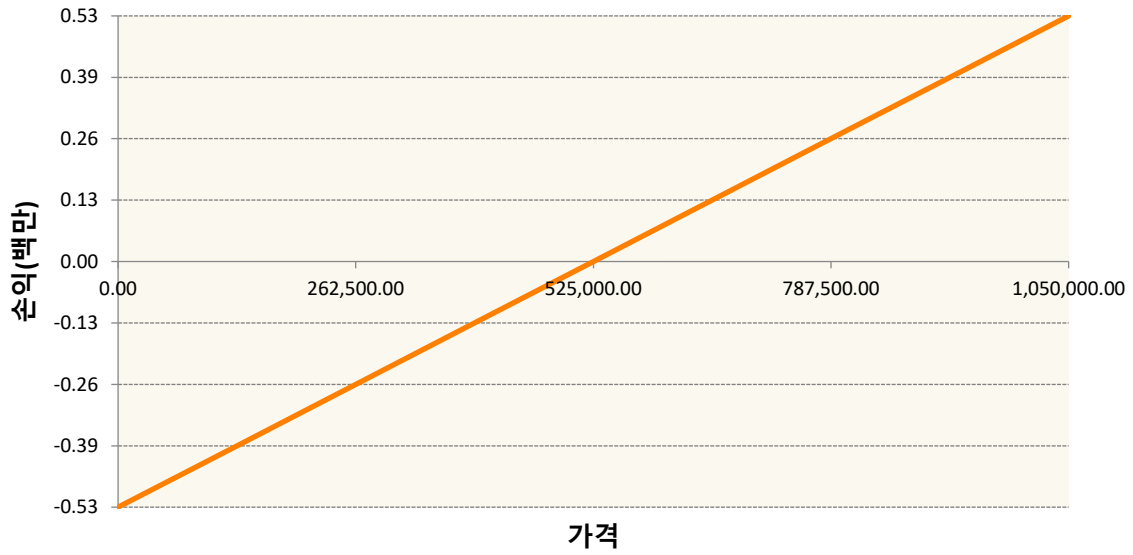
### 2. 만기시점의 손익구조



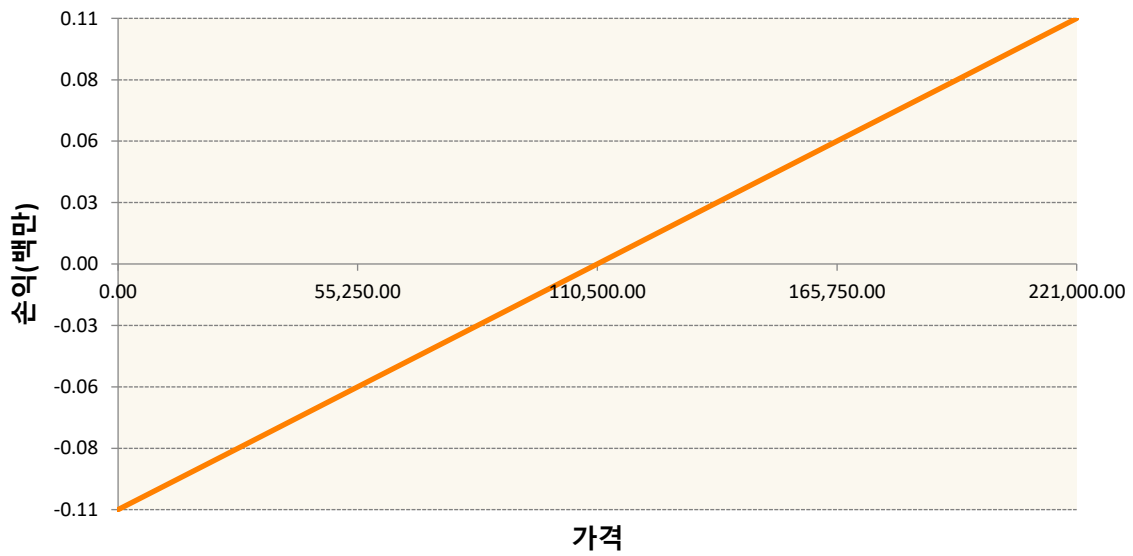
KR410ZWC0002-2025-12 한미반도체개별선물



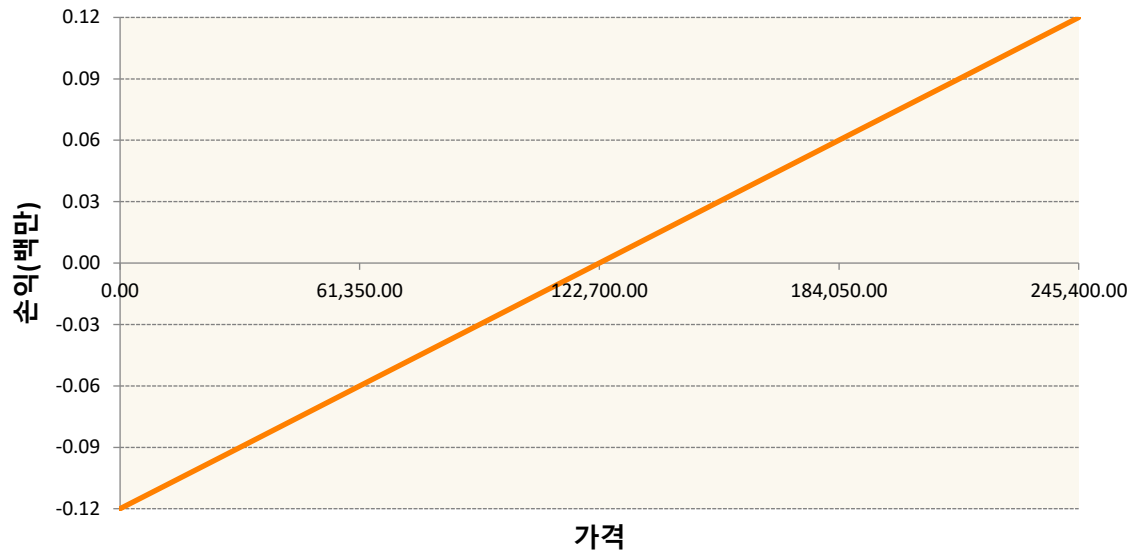
KR4150WC0003-2025-12 SK하이닉스개별선물



KR41EJWC0007-2025-12 SKC개별선물



### KR41FMWC0001-2025-12 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4101WC0003 2025-12 코스피200지수선물 |         |         |        |      |       |        |        | 906  |
|---------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|------|
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |      |       |        |        |      |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |      |
| -8.00%                          | -906    | -906    | -906   | -906 | -906  | -906   | -906   | -906 |
| -5.33%                          | -604    | -604    | -604   | -604 | -604  | -604   | -604   | -604 |
| -2.67%                          | -302    | -302    | -302   | -302 | -302  | -302   | -302   | -302 |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      | 0    |
| 2.67%                           | 302     | 302     | 302    | 302  | 302   | 302    | 302    | 302  |
| 5.33%                           | 604     | 604     | 604    | 604  | 604   | 604    | 604    | 604  |
| 8.00%                           | 906     | 906     | 906    | 906  | 906   | 906    | 906    | 906  |
| 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%                        | -15     | -15     | -15    | -15 | -15   | -15    | -15    |
| -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%                         | 15      | 15      | 15     | 15  | 15    | 15     | 15     |
| 8.00%                         | 22      | 22      | 22     | 22  | 22    | 22     | 22     |
| KR41FMWC0001 2025-12 엘앤에프개별선물 |         |         |        |     |       |        | 35     |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | -35     | -35     | -35    | -35 | -35   | -35    | -35    |
| -5.33%                        | -23     | -23     | -23    | -23 | -23   | -23    | -23    |
| -2.67%                        | -12     | -12     | -12    | -12 | -12   | -12    | -12    |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | 12      | 12      | 12     | 12  | 12    | 12     | 12     |
| 5.33%                         | 23      | 23      | 23     | 23  | 23    | 23     | 23     |
| 8.00%                         | 35      | 35      | 35     | 35  | 35    | 35     | 35     |

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

(단위:백만원)

1,255

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

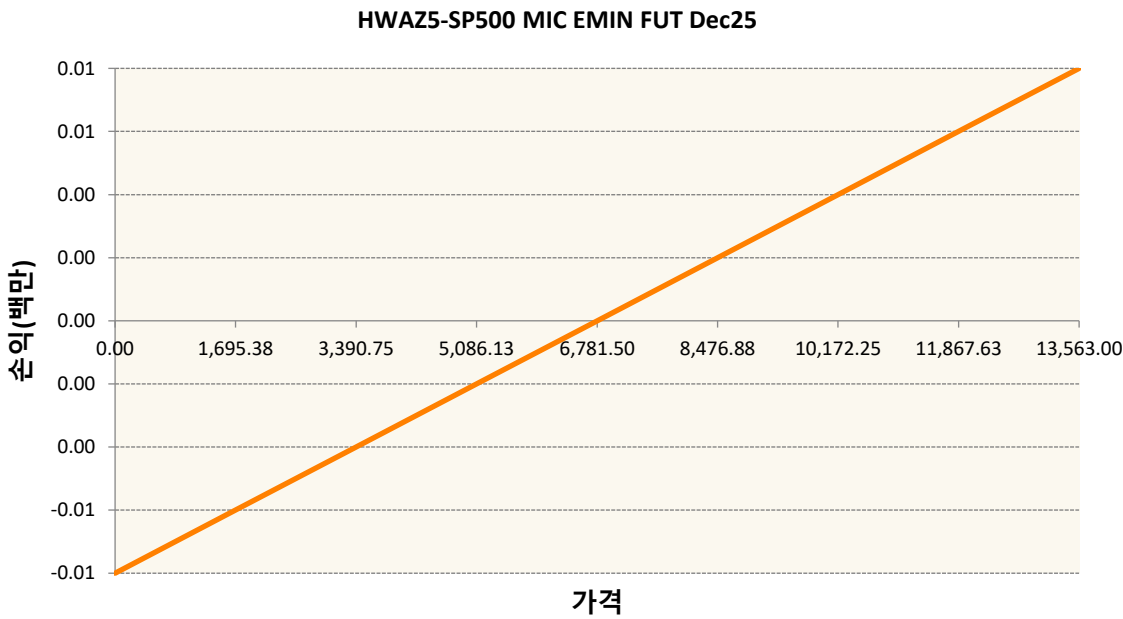
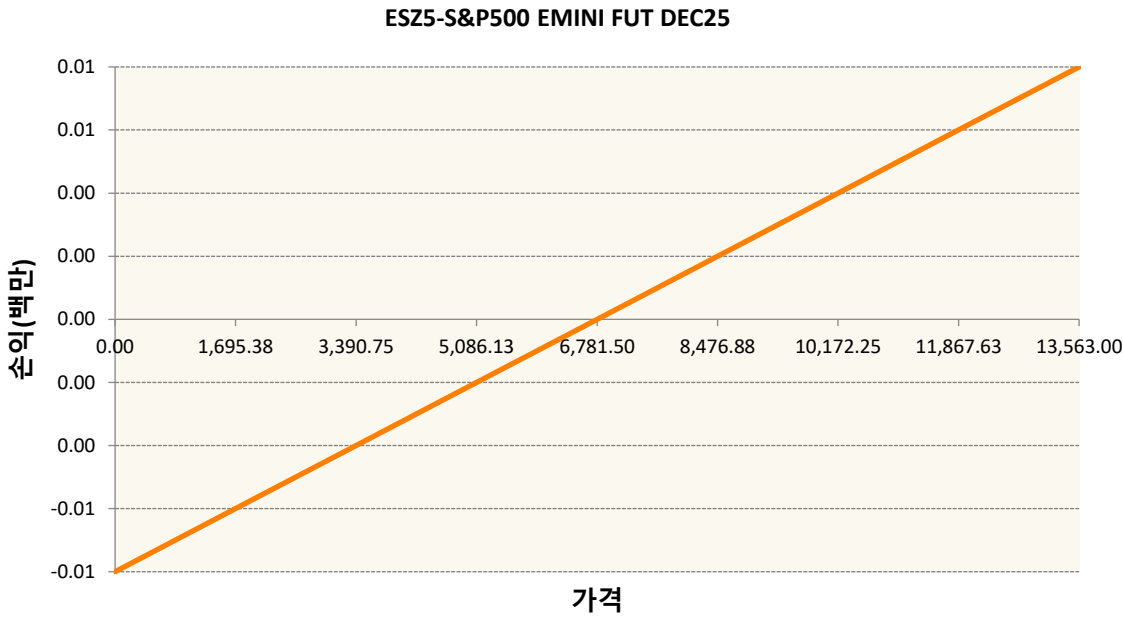
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 41,106 | 0     | 41,106    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,272  | 0     | 1,272     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ5                      | S&P500 EMINI FUT DEC25   | 3,289    |
| HWAZ5                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec25 | 102      |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

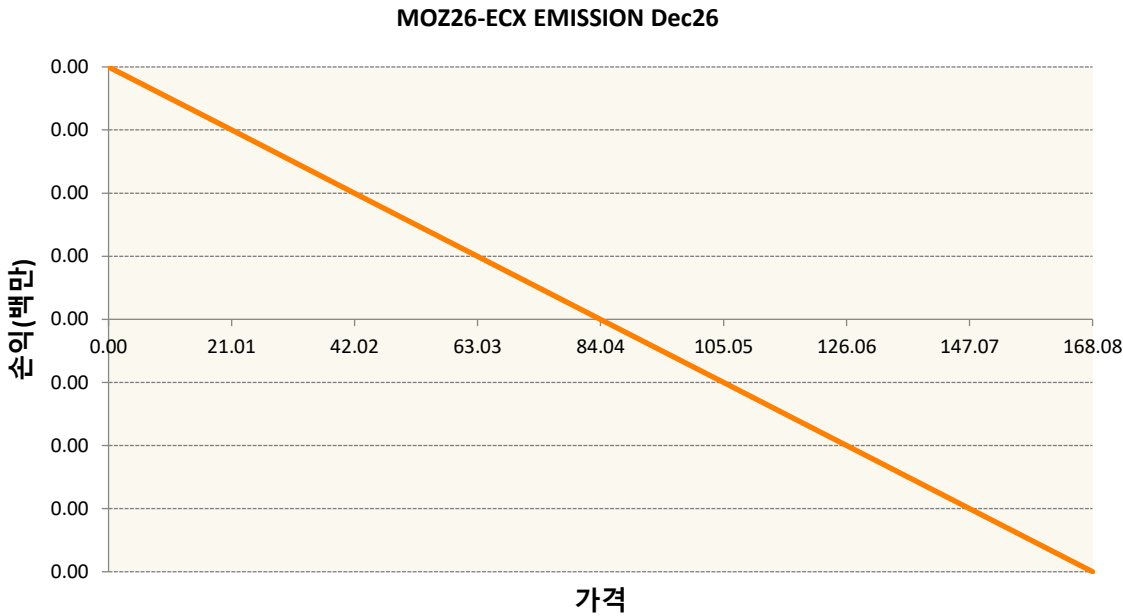
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 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     | 3,437 | -3,437    |    |
| 누계 | 지수   | 스왑   | -25   | 0     | -25       | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,179 | -1,179    | 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                            | 275 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 422 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

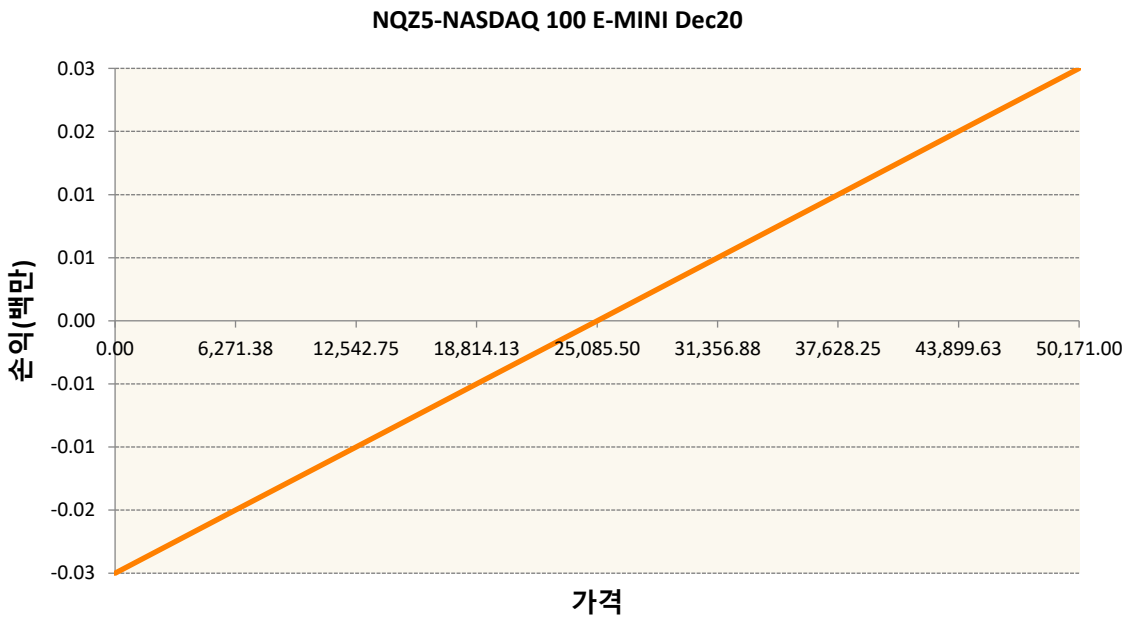
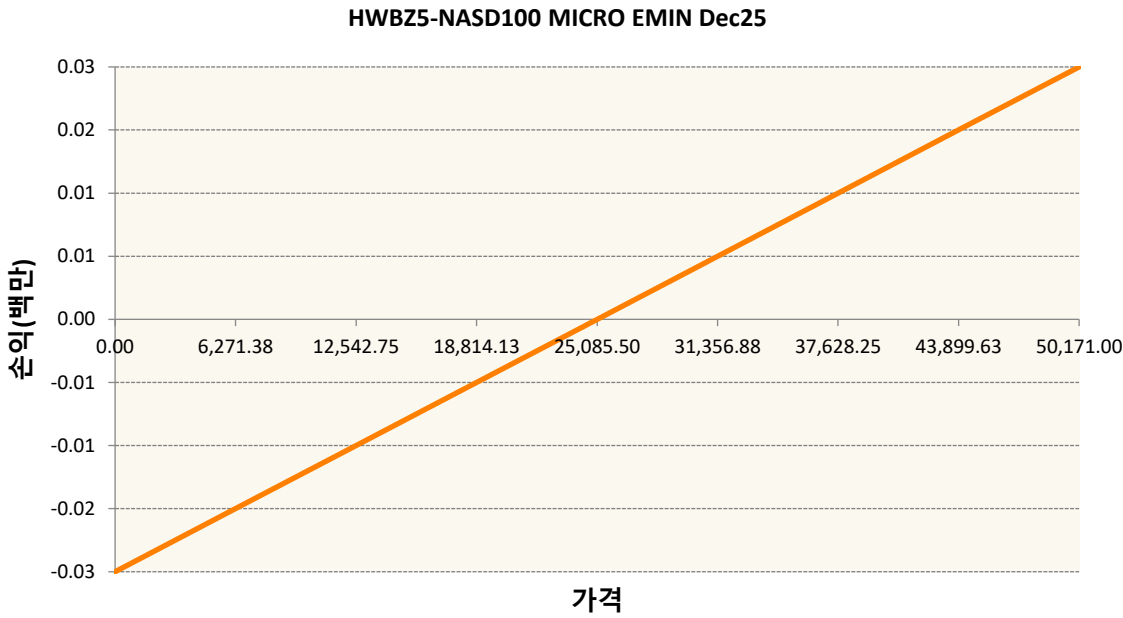
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 18,178 | 0     | 18,178    |    |
| 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  | 1,454    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 1,769    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

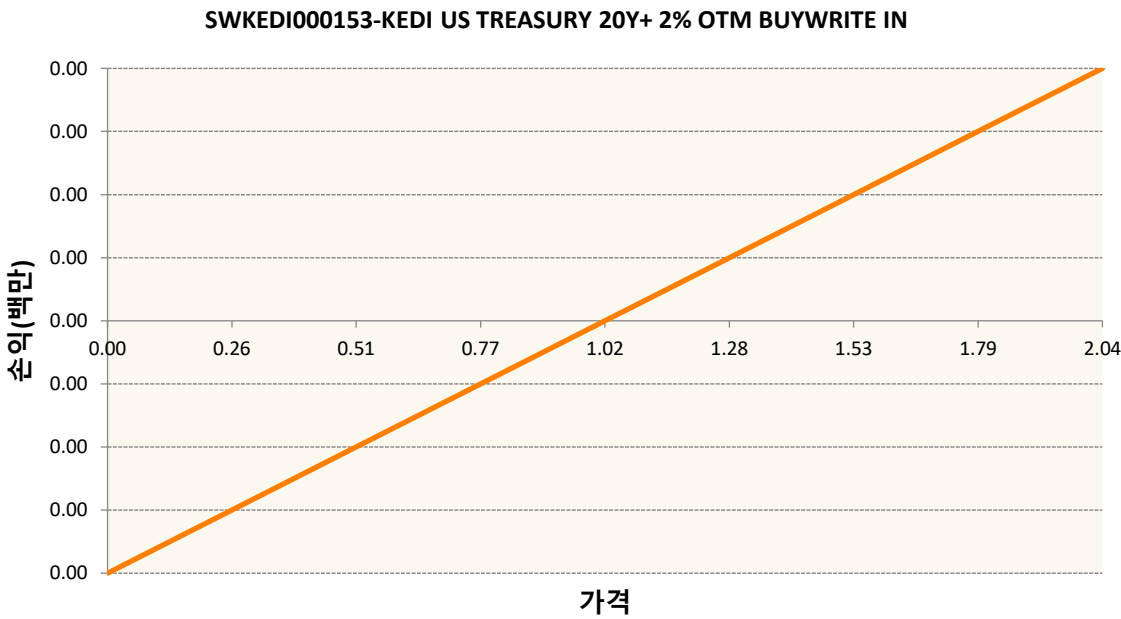
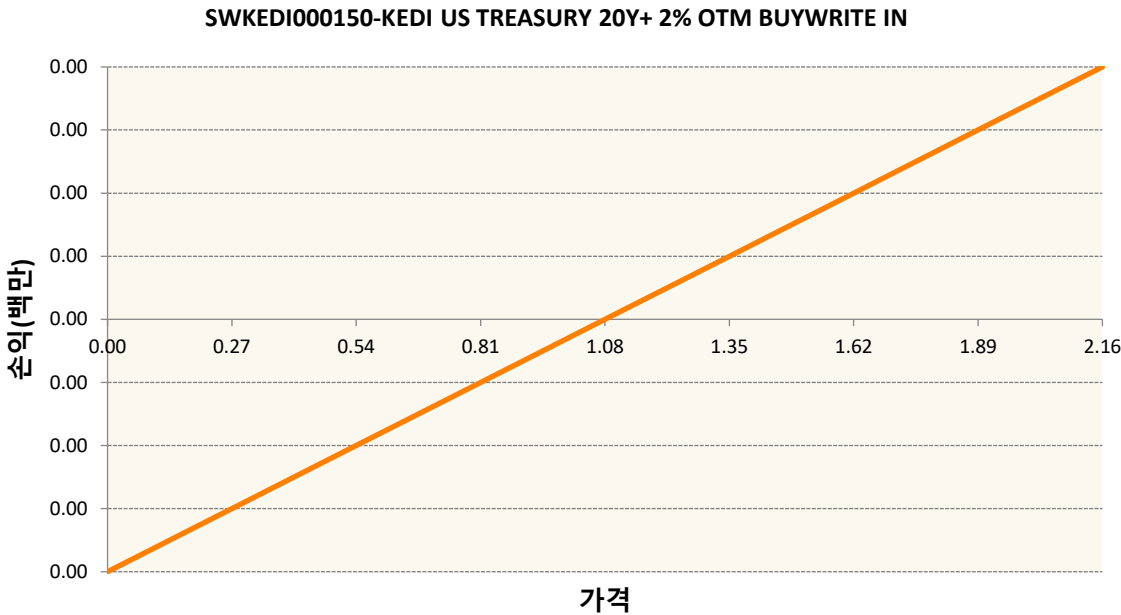
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

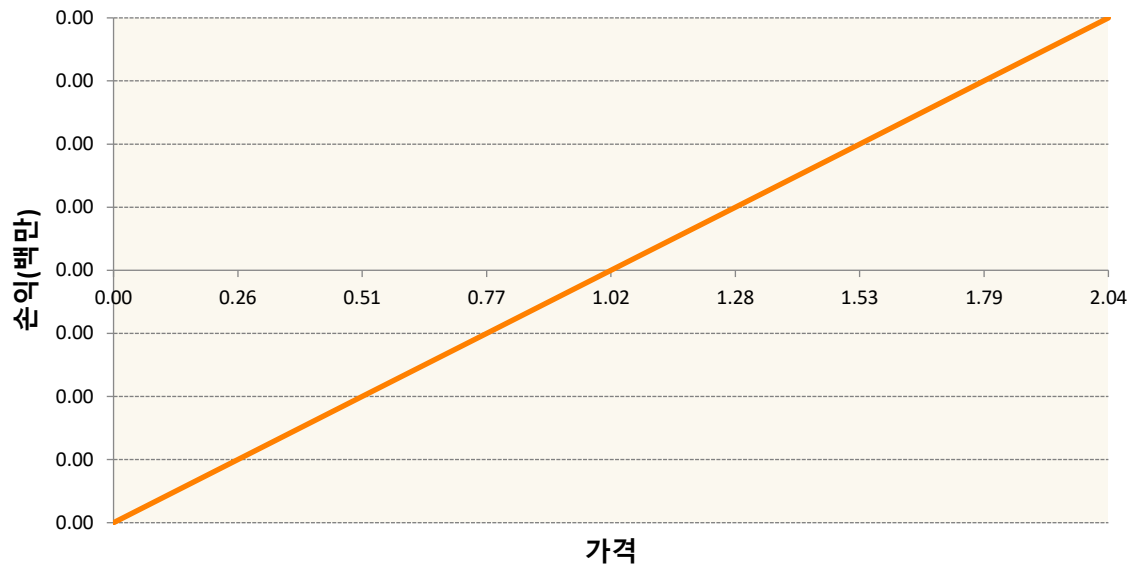
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 388,851 | 0     | 388,851   | 장외 |

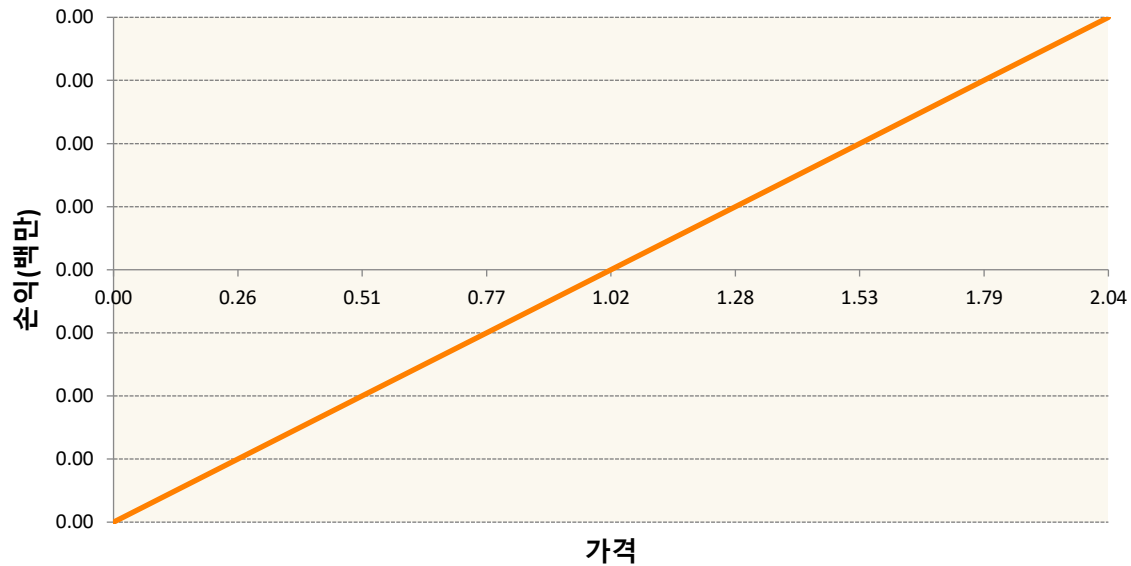
### 2. 만기시점의 손익구조



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 | 8,305  |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 3,823  |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 10,344 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 8,693  |

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

(단위:백만원)

14,523

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

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 | 11       |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 11       |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 11       |
| SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P | 11       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 58       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-11-27 |
| 기준일 | 2025-11-26 |

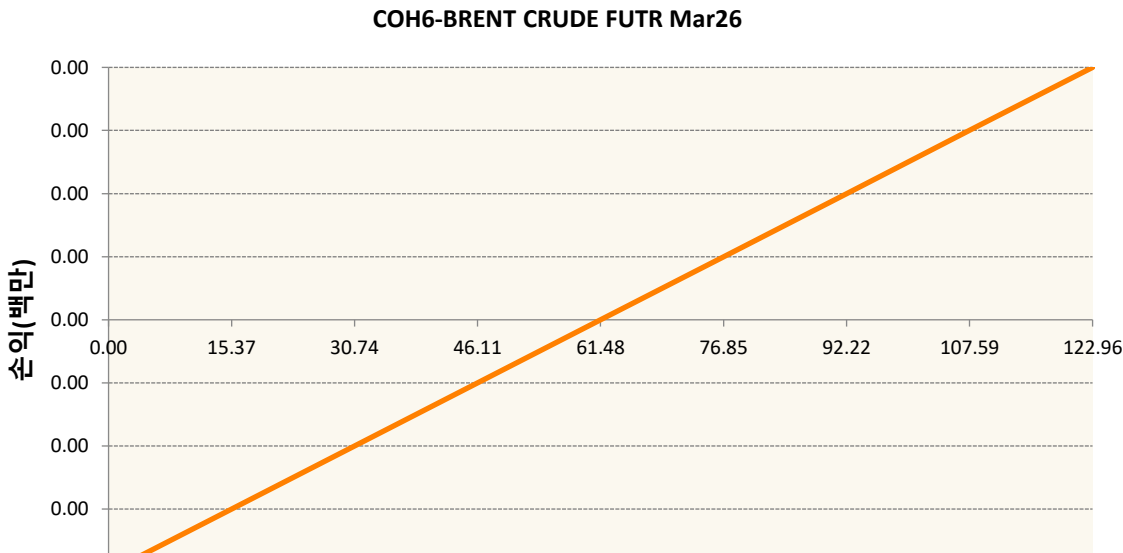
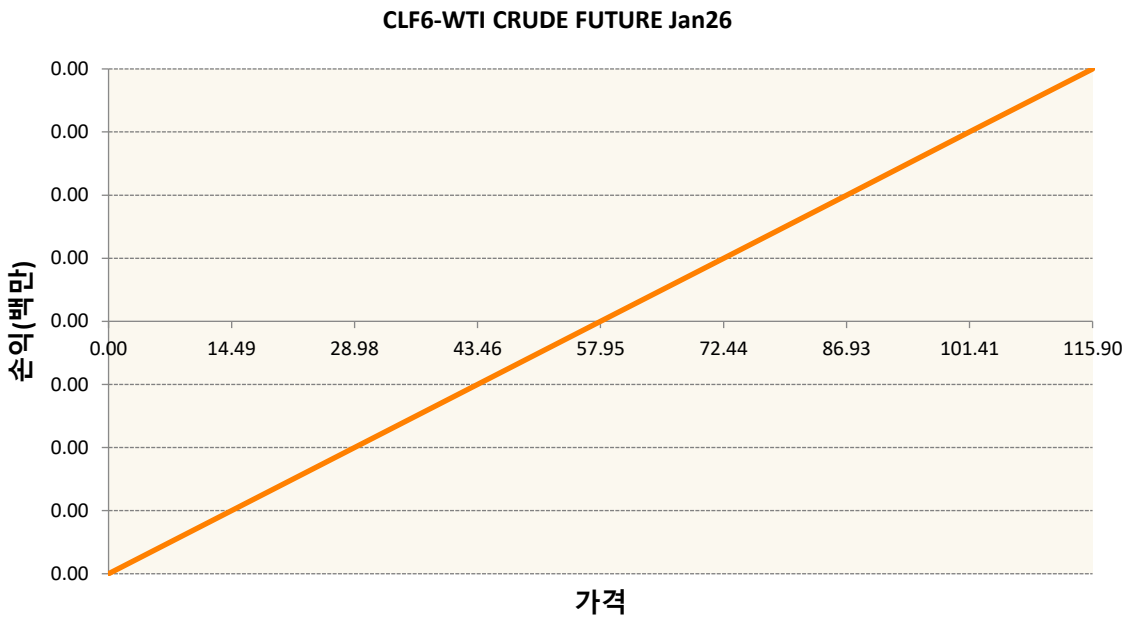
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

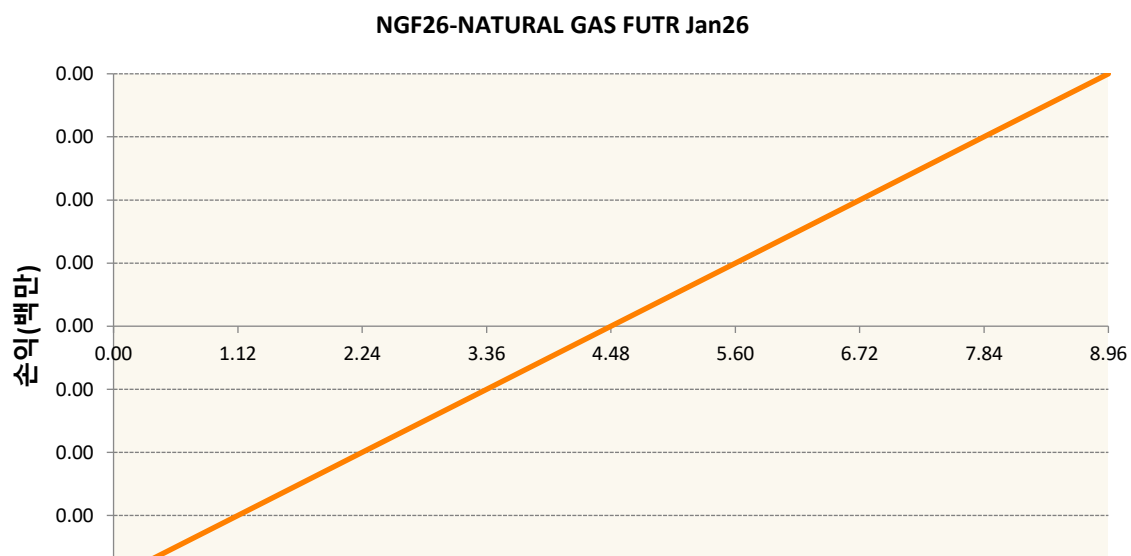
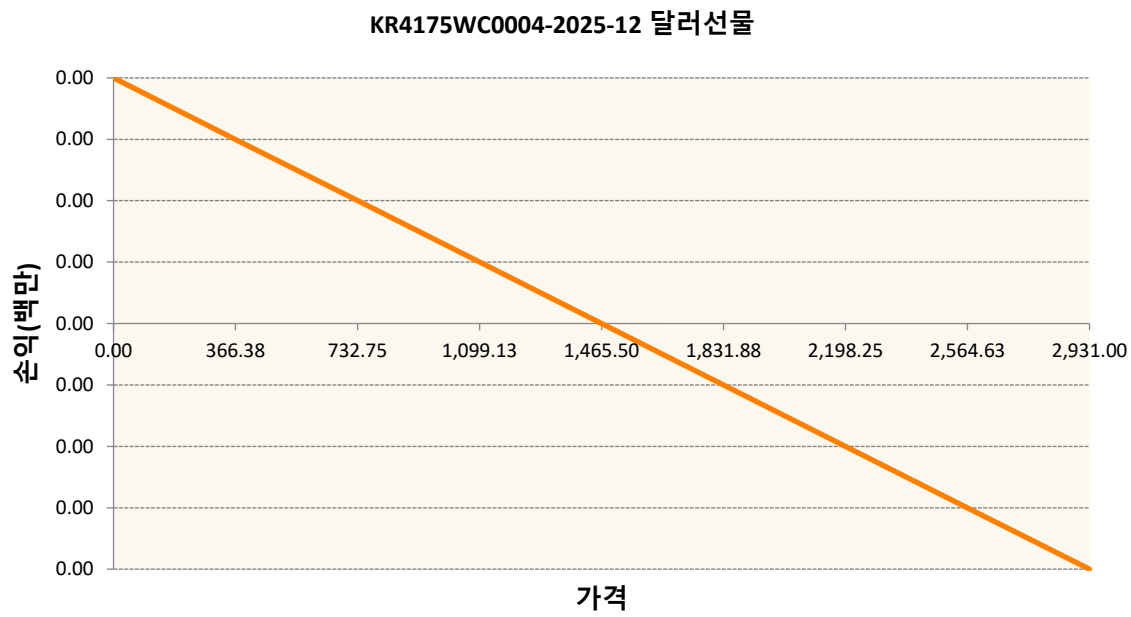
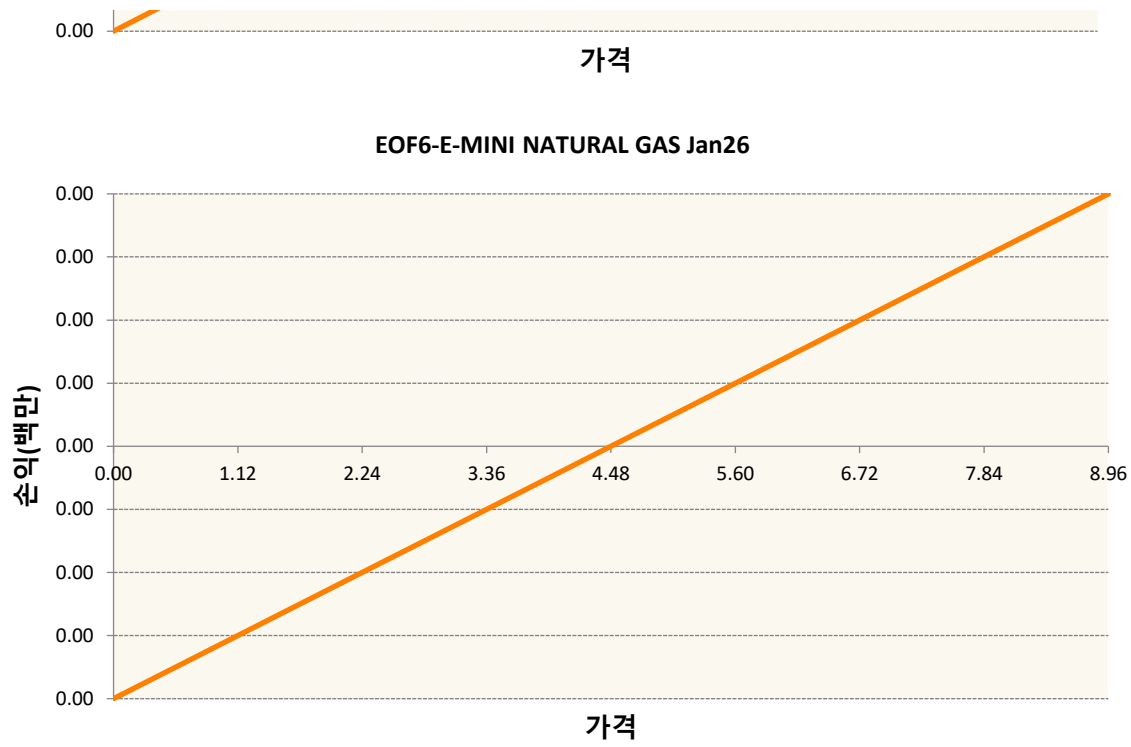
### 1. 계약금액

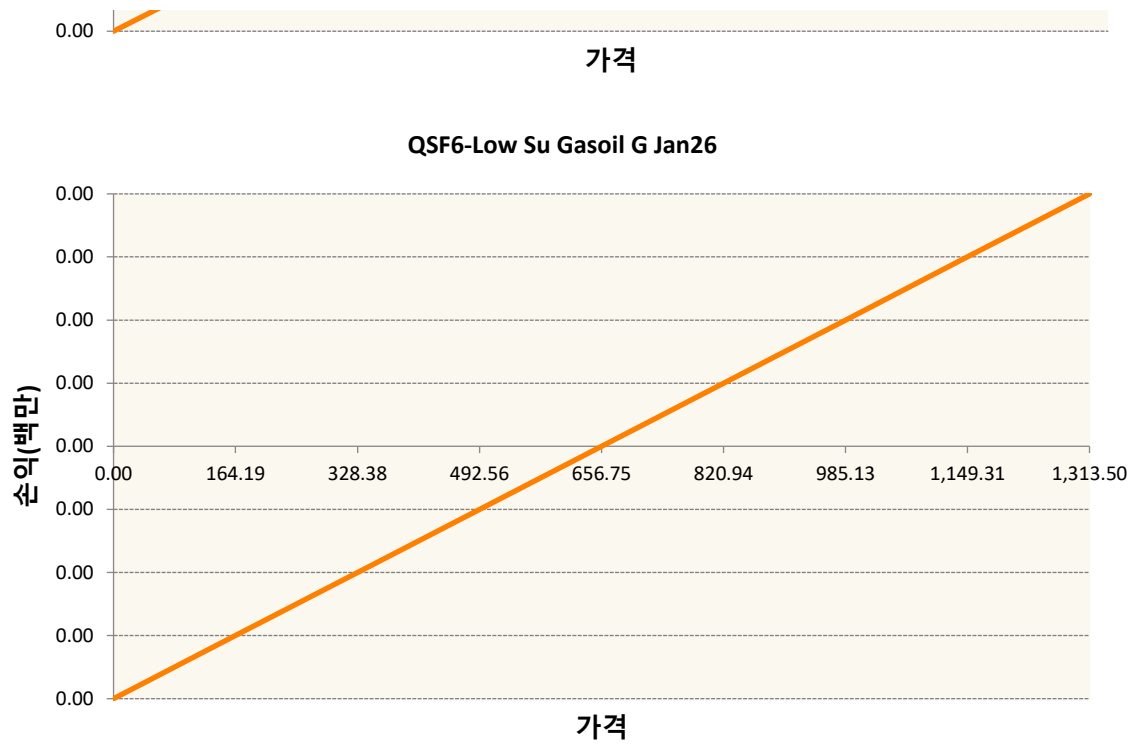
(단위:백만원)

| 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   | 352   | 0     | 352       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 180   | 0     | 180       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 117   | -117      | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조







### 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   | 10 |
| QSF6       | Low Su Gasoil G Jan26    | 7  |

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

(단위:백만원)

93