

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

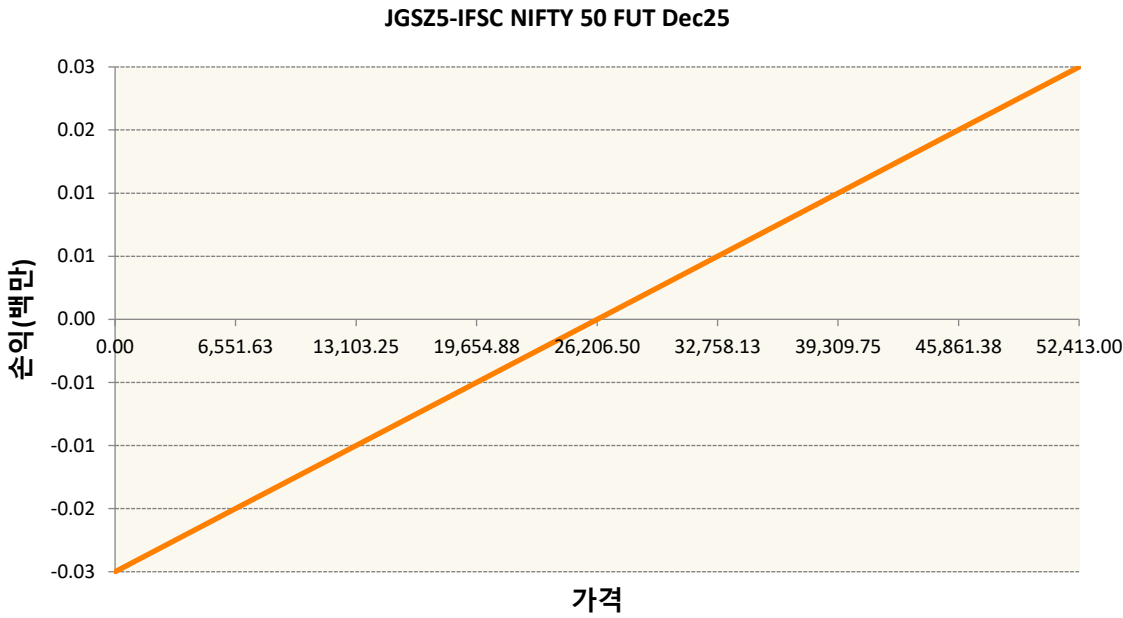
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	696	0	696	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

INE423A200` Adani Enterprises Ltd	0.04
JGSZ5 IFSC NIFTY 50 FUT Dec25	56

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

(단위:백만원)

35

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

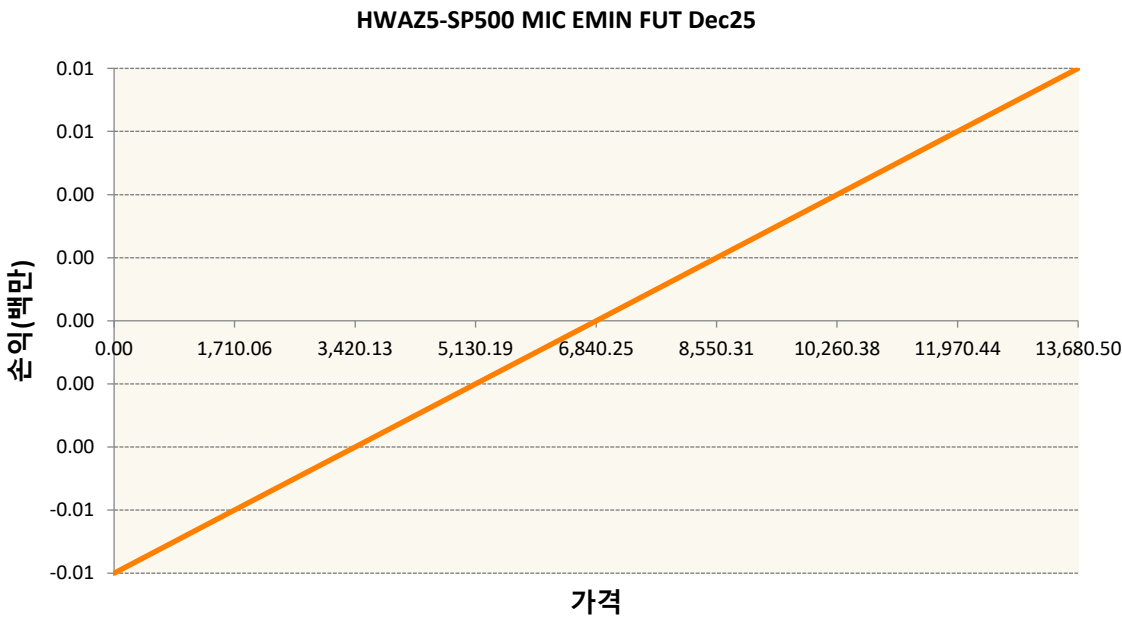
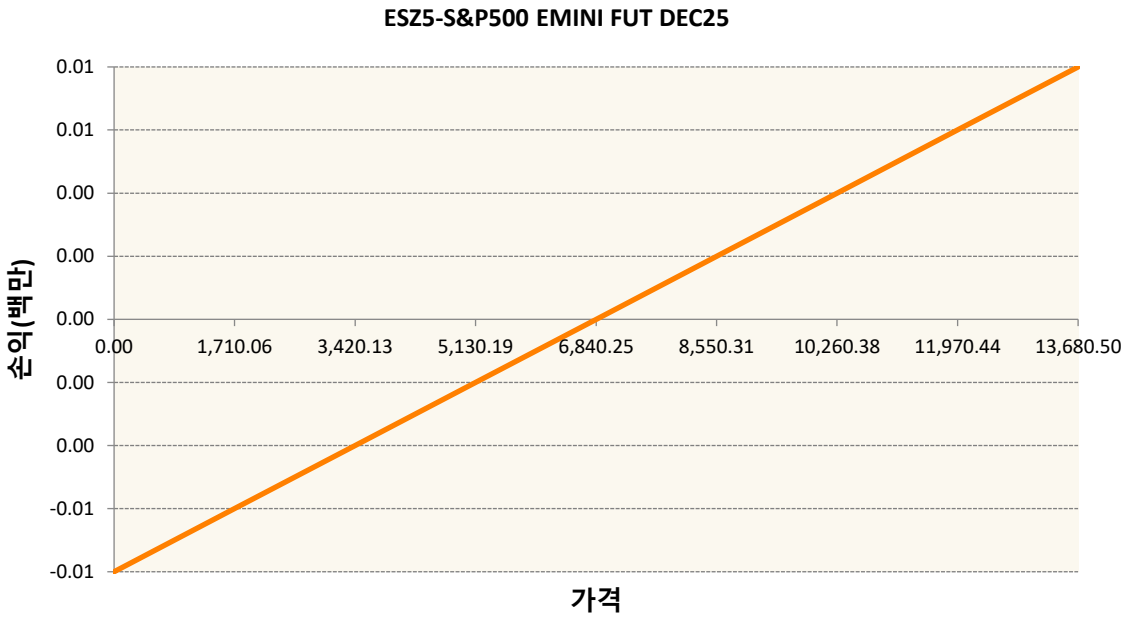
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	475	0	475	
누계	유가증권	선물	143	0	143	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)
	66

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

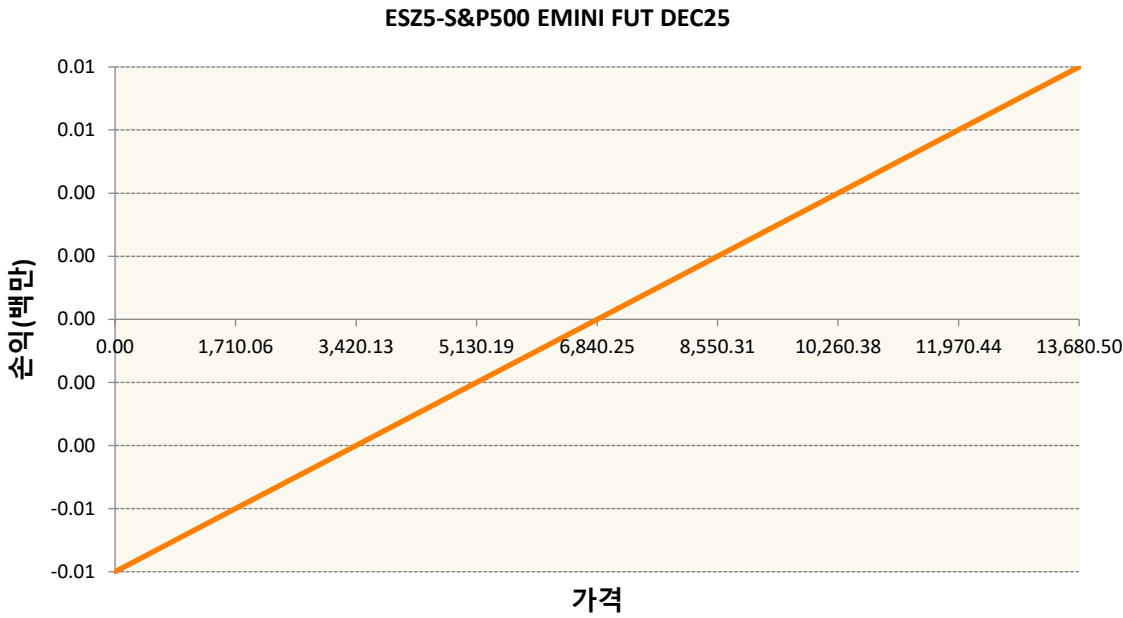
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,426	0	1,426	

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)

166

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

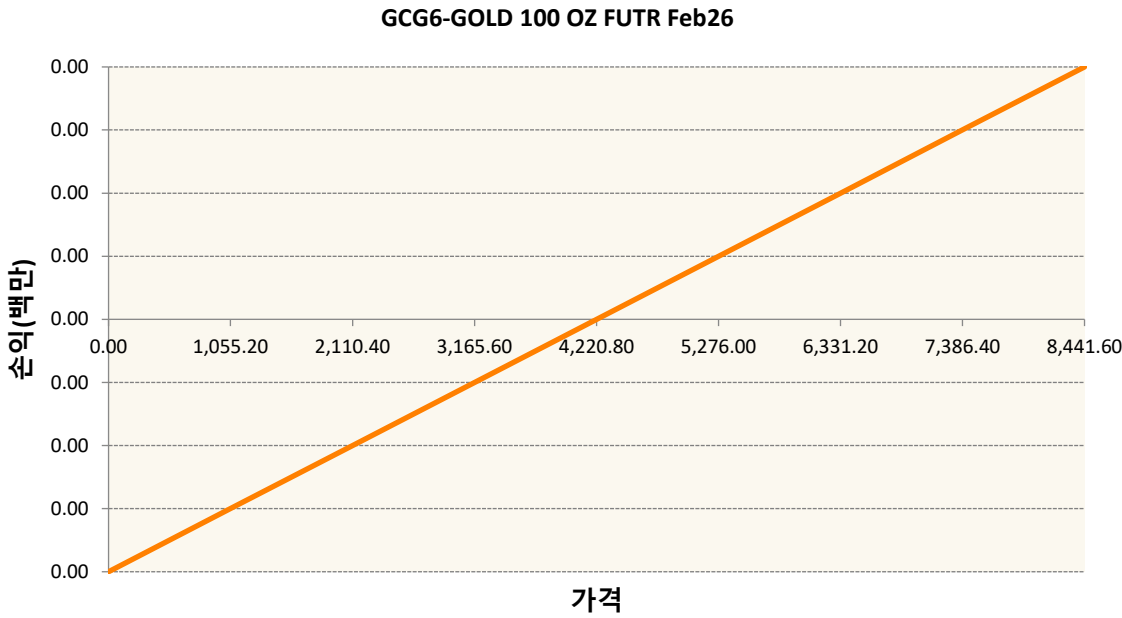
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	3,107	0	3,107	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 12/05/25 C393 EQUITY	5
GCG6 GOLD 100 OZ FUTR Feb26	249

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

(단위:백만원)

237

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

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)

AOPLTRUCC PLTR US 12/05/25 C175 EQUITY	36
AOPLTRUCP PLTR US 12/05/25 P175 EQUITY	88

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

(단위:백만원)

477

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

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)

AOTLTUSC0(TLT US 12/05/25 C91 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

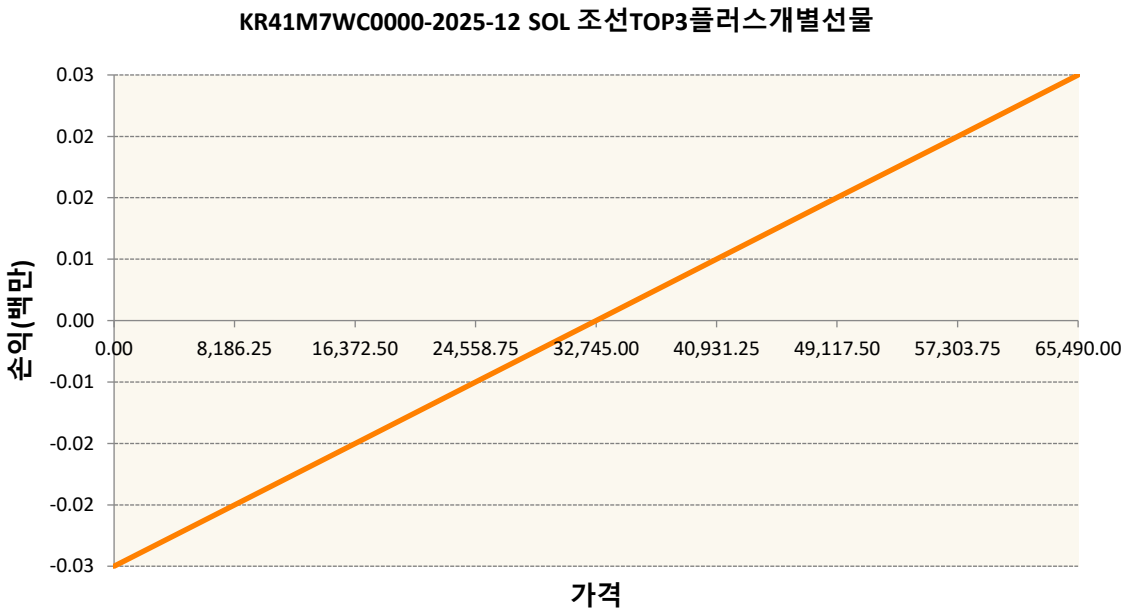
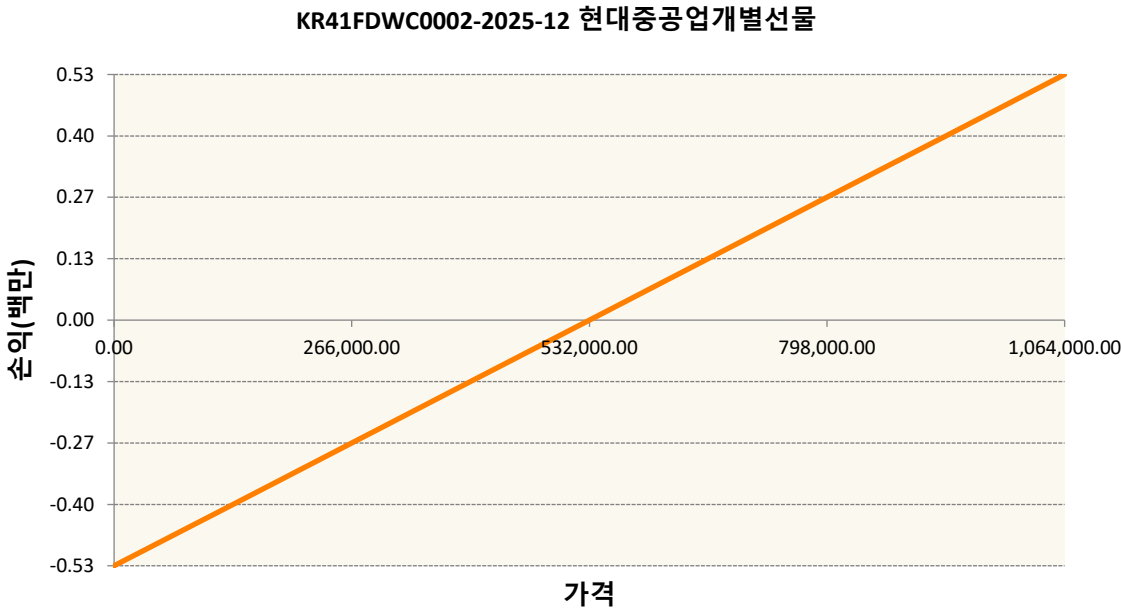
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	492	0	492	장내
누계	유가증권	선물	19,010	0	19,010	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR41FDWC0002		2025-12 현대중공업개별선물					856
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-856	-856	-856	-856	-856	-856	-856
-5.33%	-571	-571	-571	-571	-571	-571	-571
-2.67%	-285	-285	-285	-285	-285	-285	-285
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	285	285	285	285	285	285	285
5.33%	571	571	571	571	571	571	571
8.00%	856	856	856	856	856	856	856
KR41M7WC0000		2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물					6,670
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6,670	-6,670	-6,670	-6,670	-6,670	-6,670	-6,670
-5.33%	-4,447	-4,447	-4,447	-4,447	-4,447	-4,447	-4,447
-2.67%	-2,223	-2,223	-2,223	-2,223	-2,223	-2,223	-2,223
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2,223	2,223	2,223	2,223	2,223	2,223	2,223
5.33%	4,447	4,447	4,447	4,447	4,447	4,447	4,447
8.00%	6,670	6,670	6,670	6,670	6,670	6,670	6,670

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

7,123

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

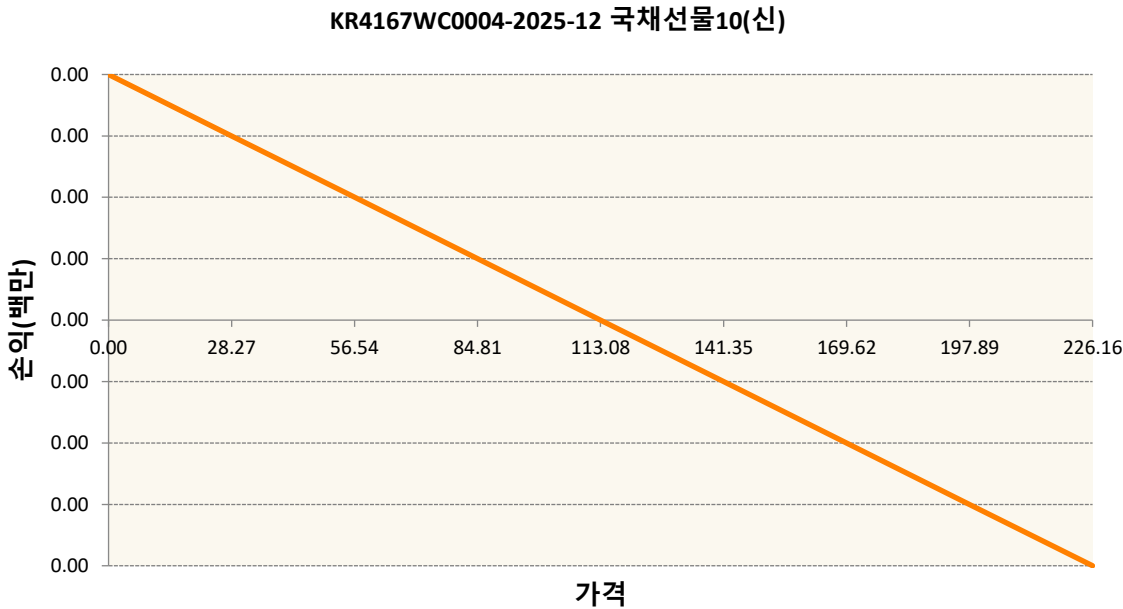
포커스채권(채권-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	금리	선물	0	0	0	장내
누계	금리	선물	0	22,051	-22,051	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4167WC0004			2025-12 국채선물10(신)				596
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-596	-596	-596	-596	-596	-596	-596
-5.33%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397
-2.67%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	199	199	199	199	199	199	199
5.33%	397	397	397	397	397	397	397
8.00%	596	596	596	596	596	596	596

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

(단위:백만원)

251

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

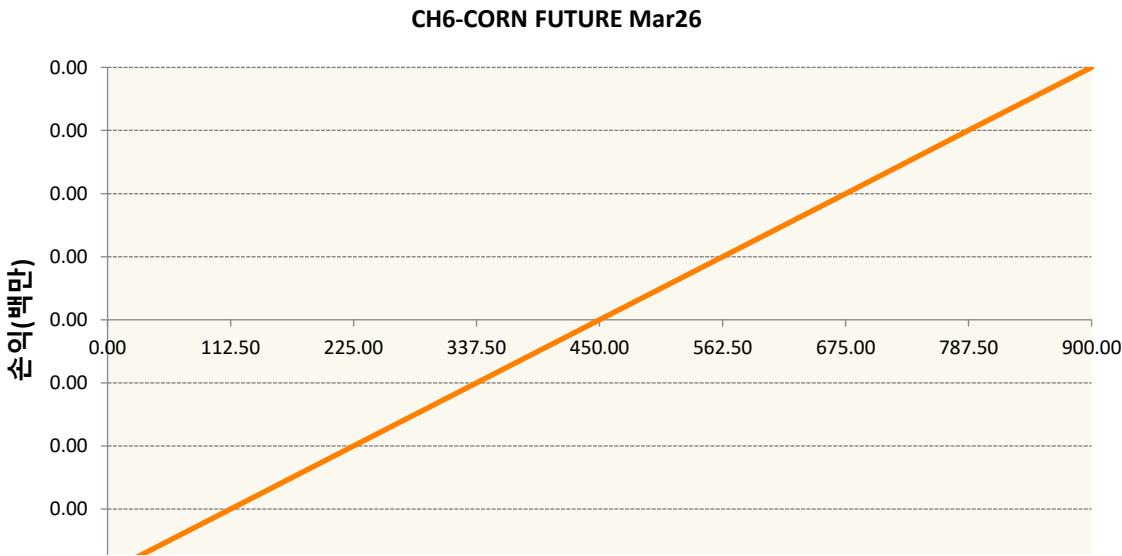
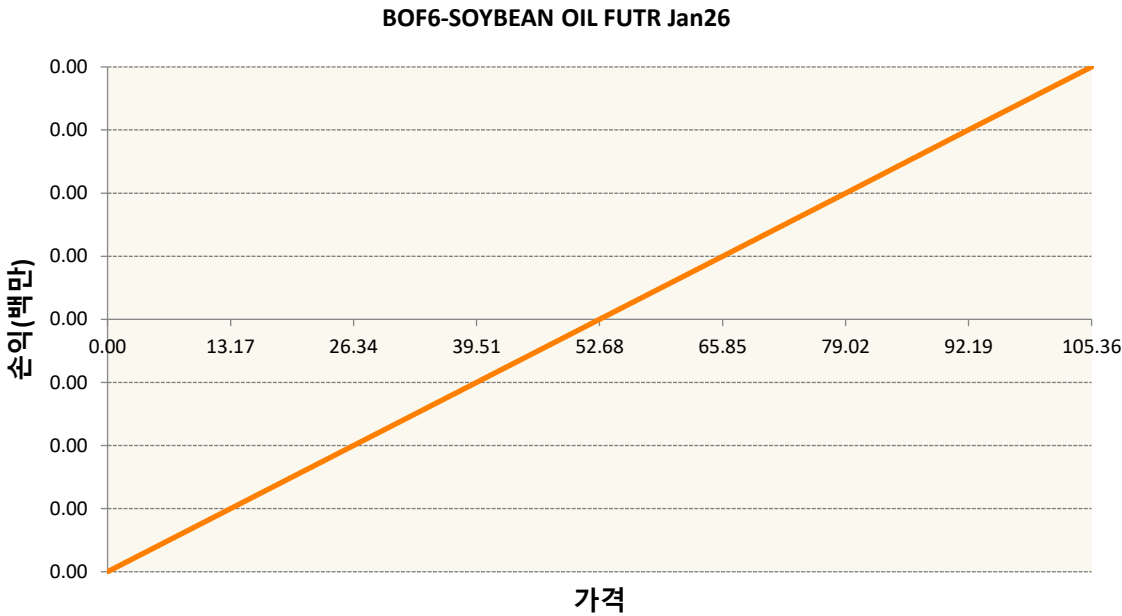
포커스농산물모(채권-파생형)

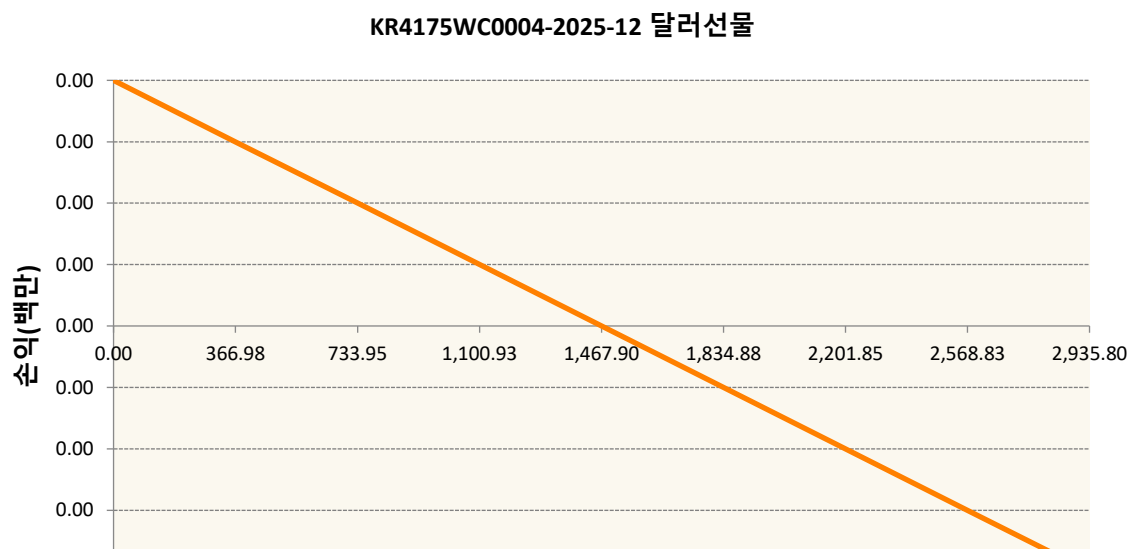
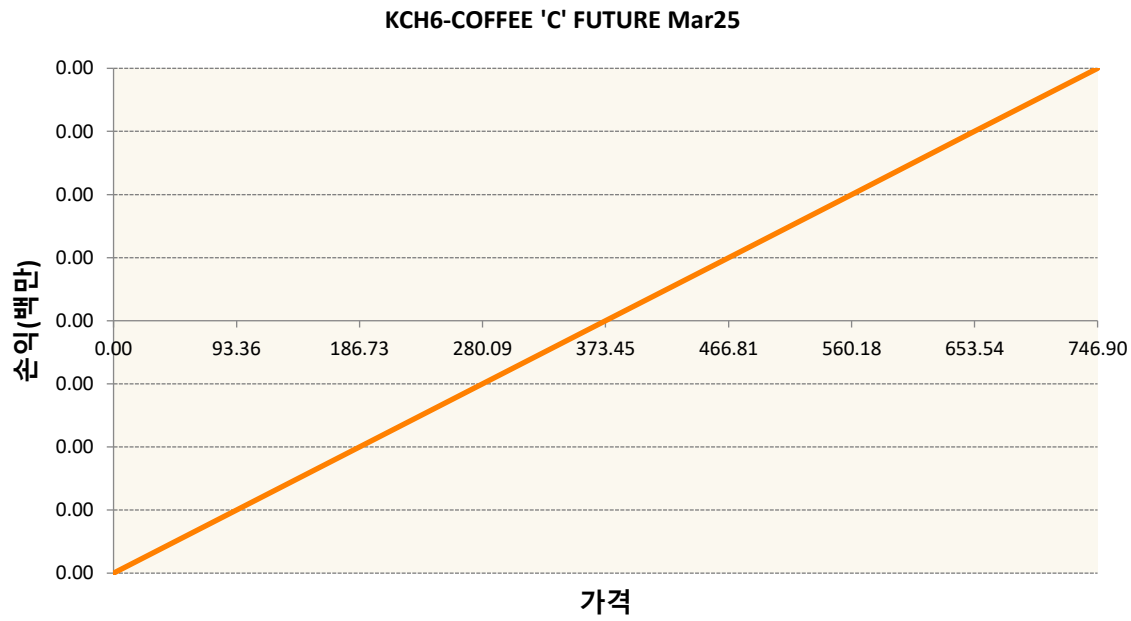
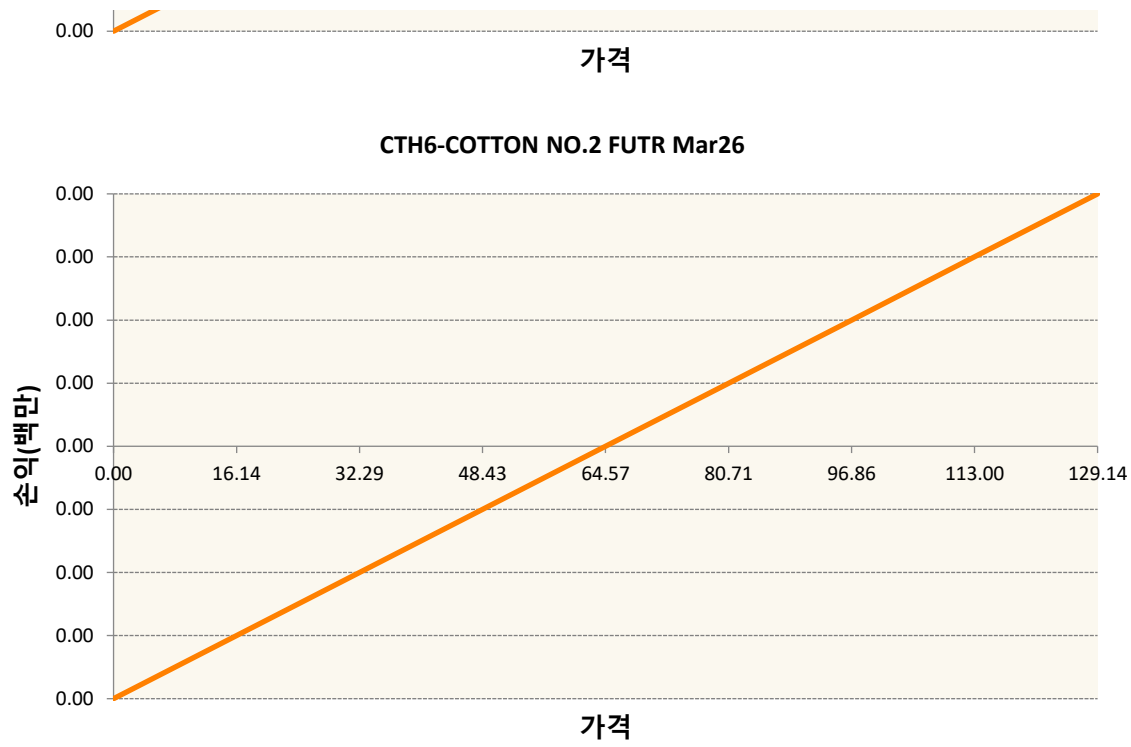
1. 계약금액

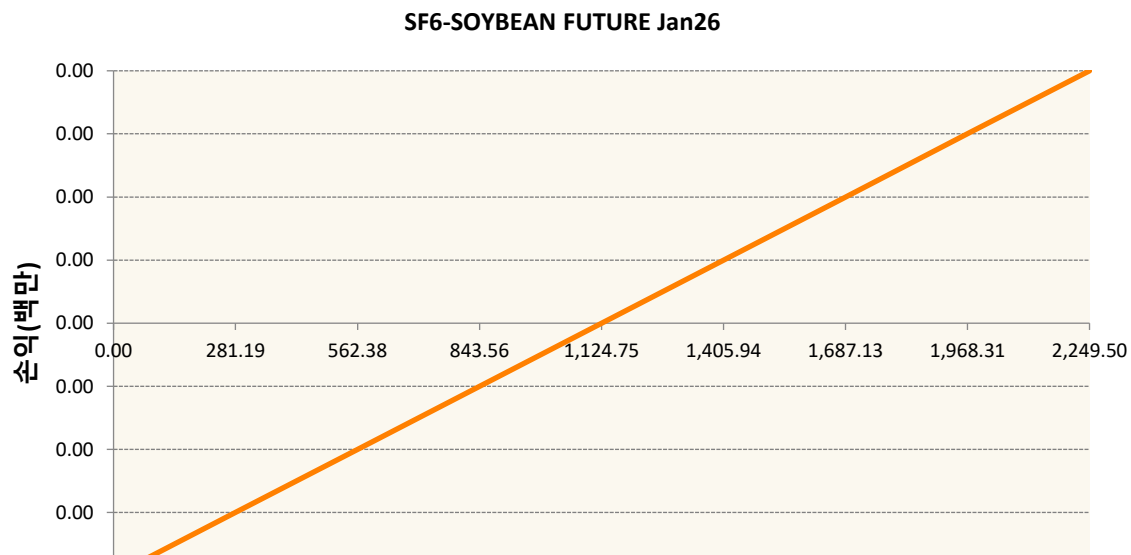
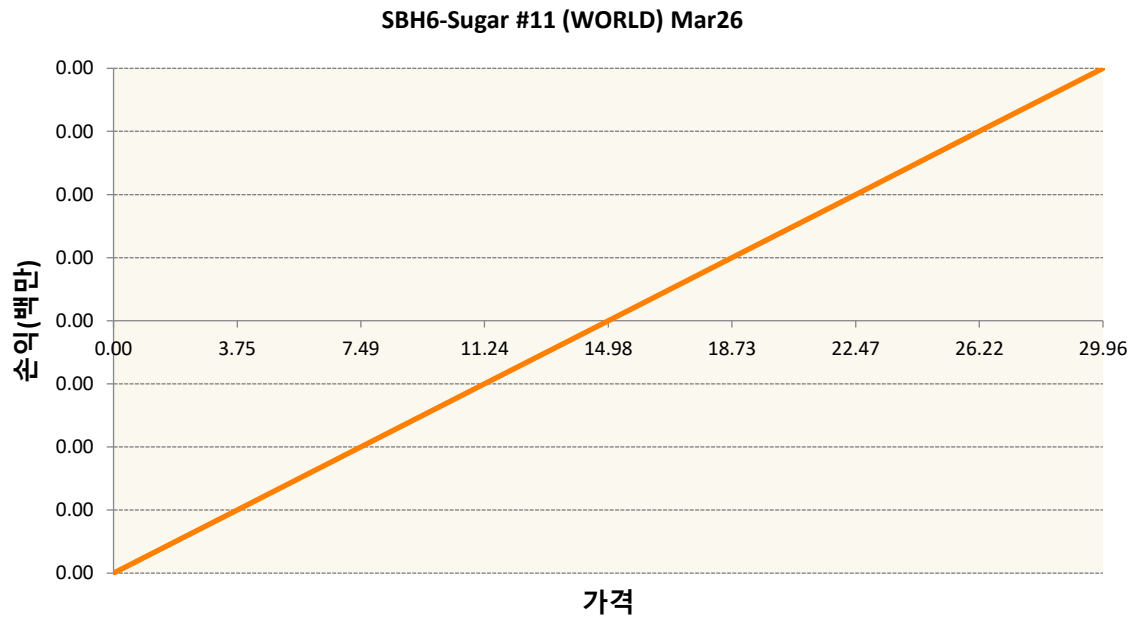
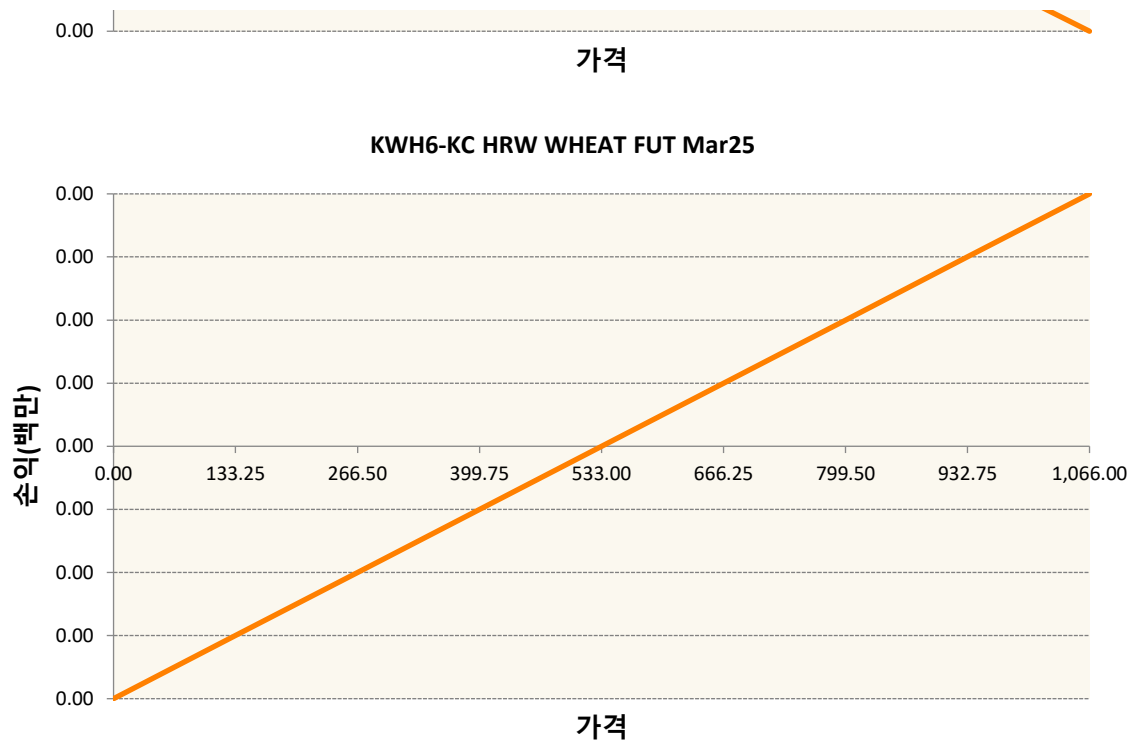
(단위:USD 백만)

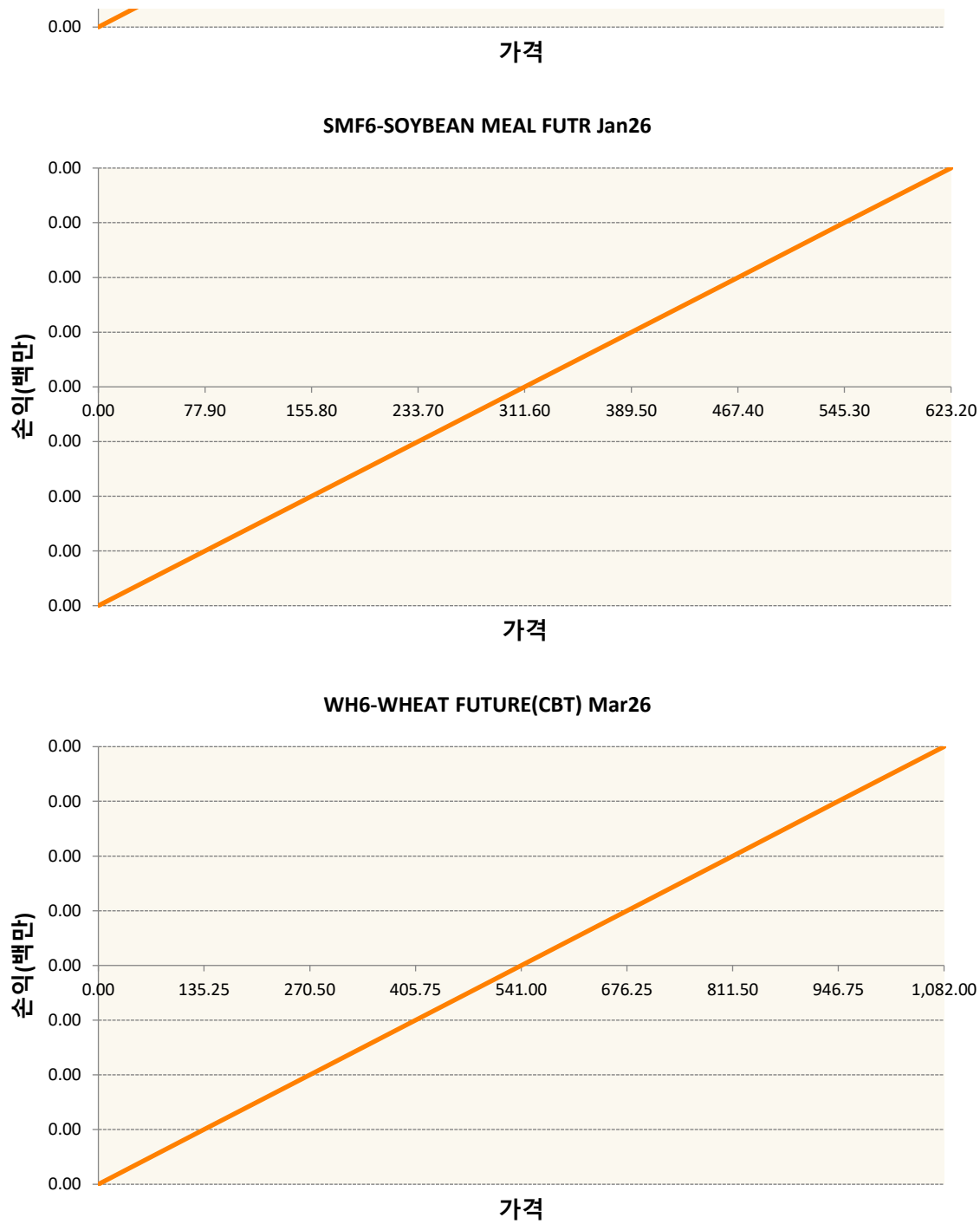
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,171	0	1,171	
누계	유가증권	선물	2,158	0	2,158	
누계	통화	선물	0	440	-440	장내

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	2025-12-04
기준일	2025-12-03

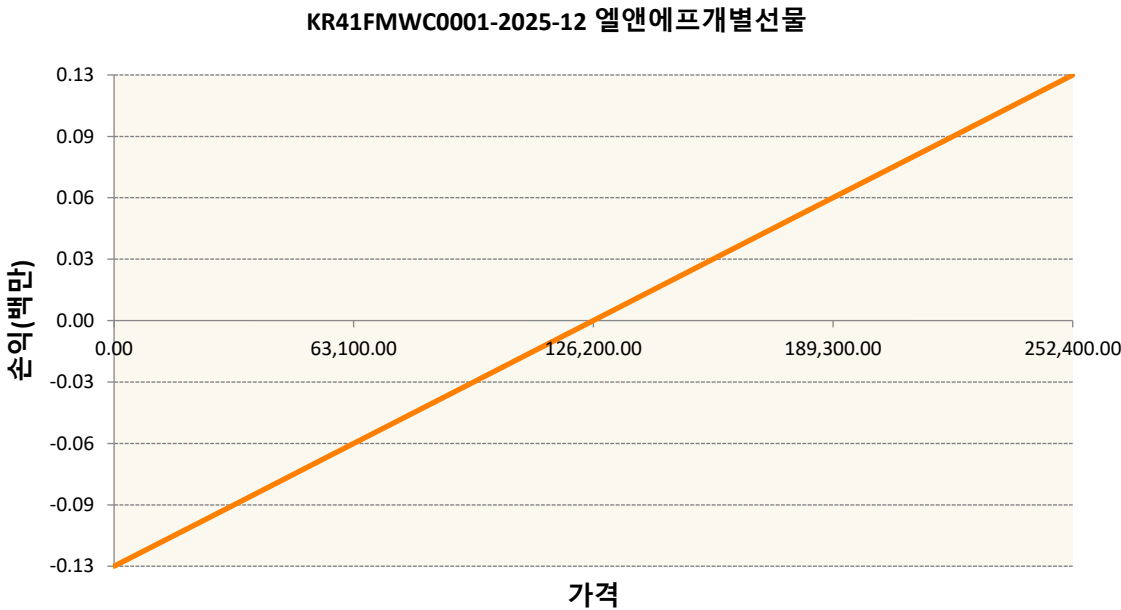
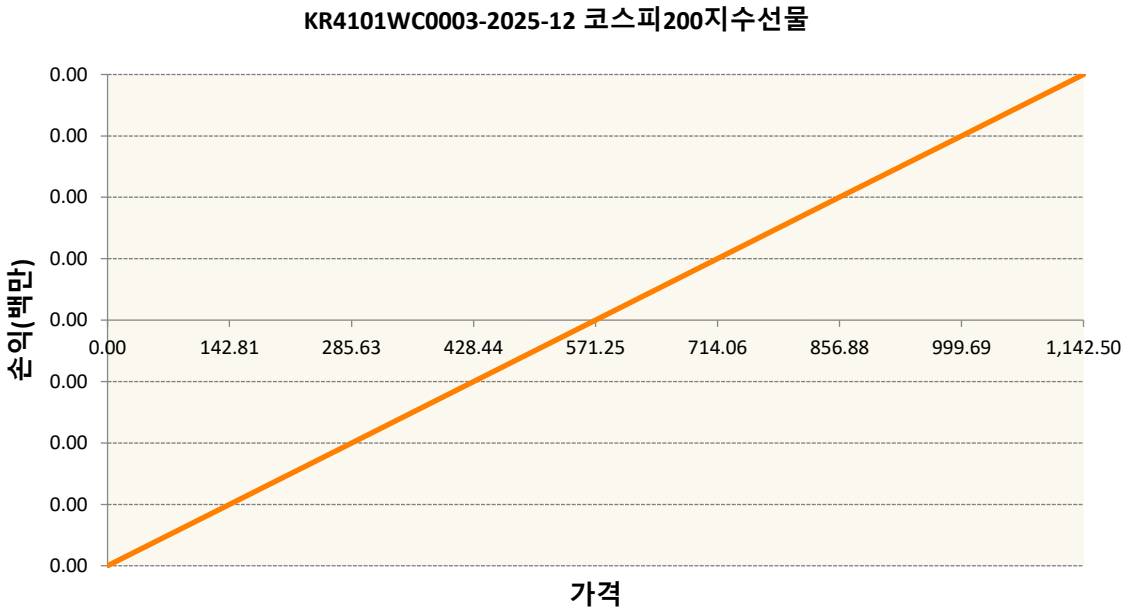
스마트인덱스모

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	1,469	0	1,469	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물		114
KR41FMWCC 2025-12 엘애펜개별선물		3

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

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

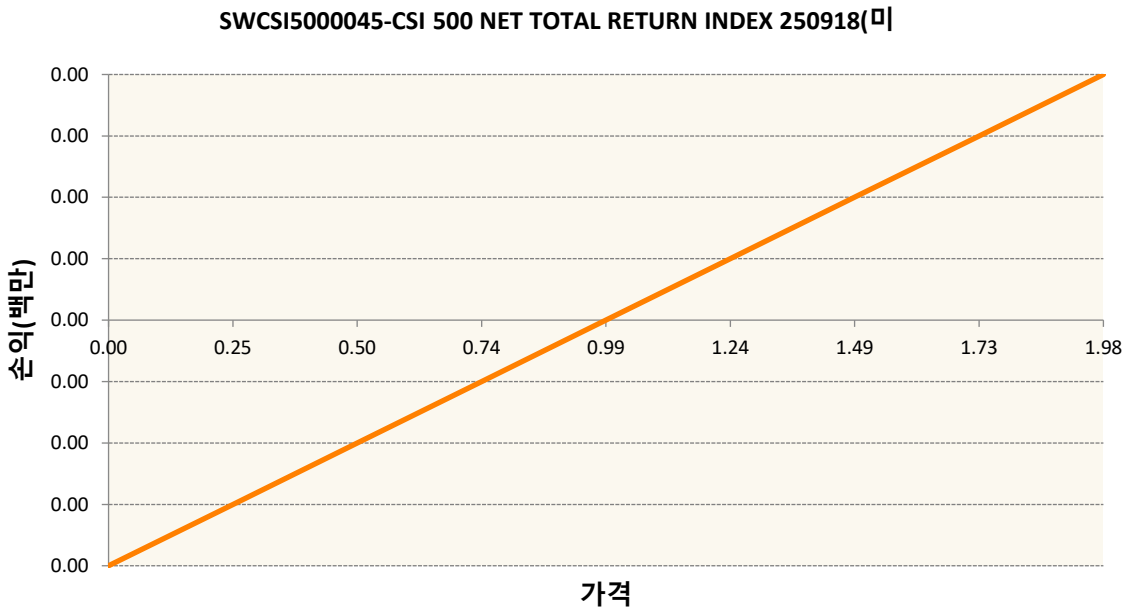
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,653	0	4,653	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

371

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

457

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

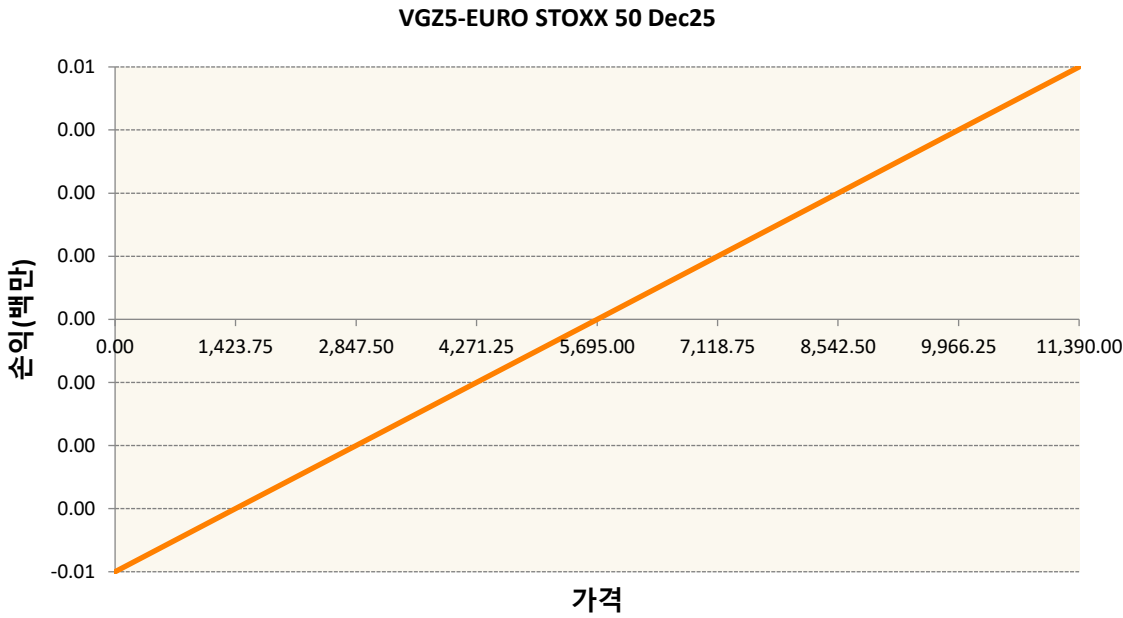
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	748	0	748	

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	2025-12-04
기준일	2025-12-03

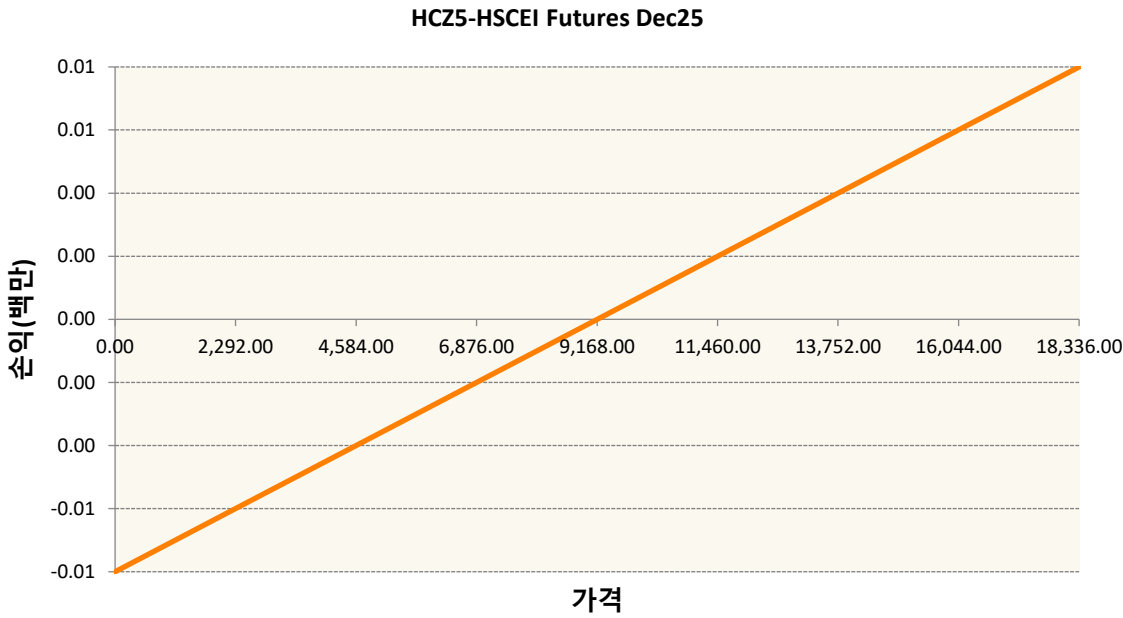
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,910	0	1,910	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ5	HSCEI Futures Dec25	153
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

198

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

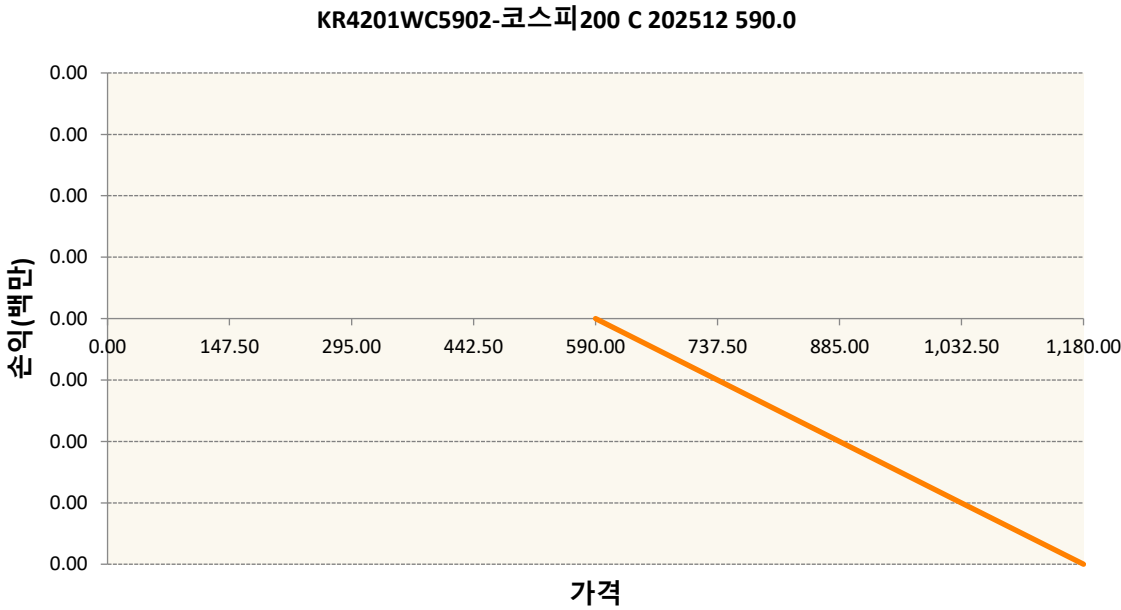
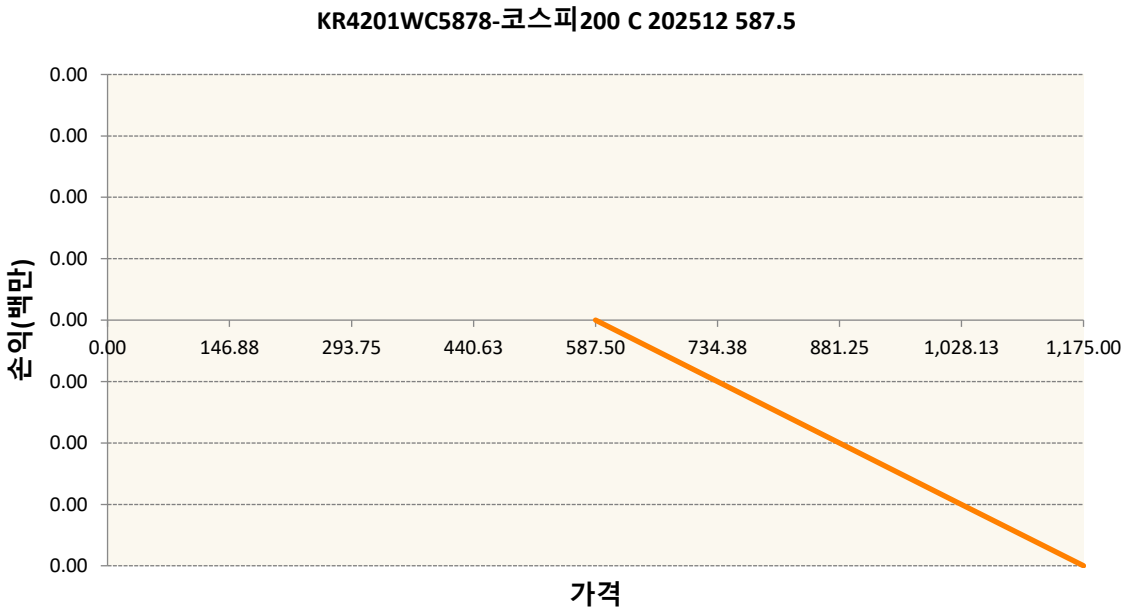
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

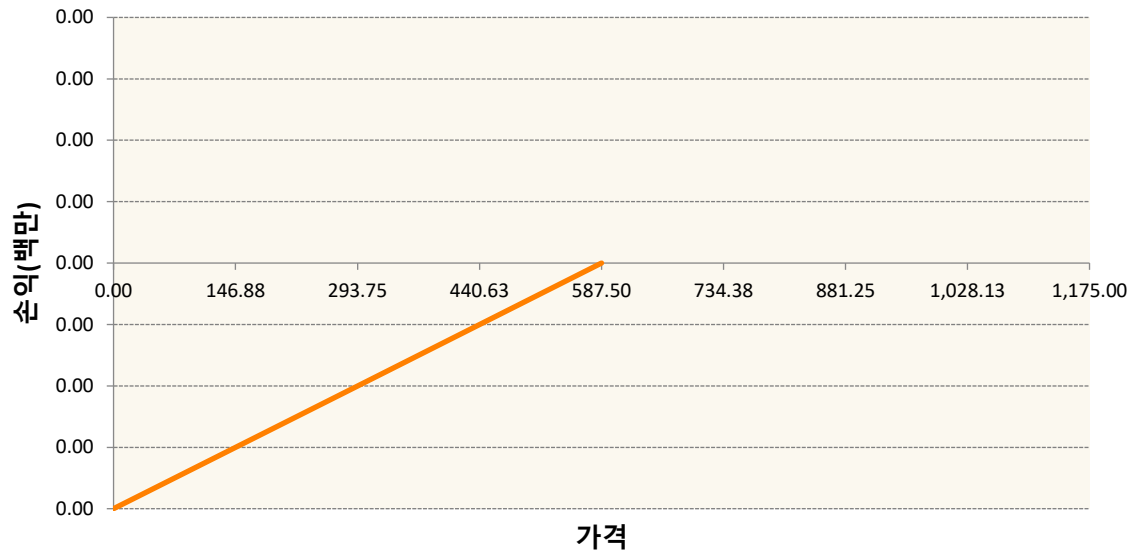
(단위:백만원)

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 2025-12-04

기준일 2025-12-03

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	2025-12-04
기준일	2025-12-03

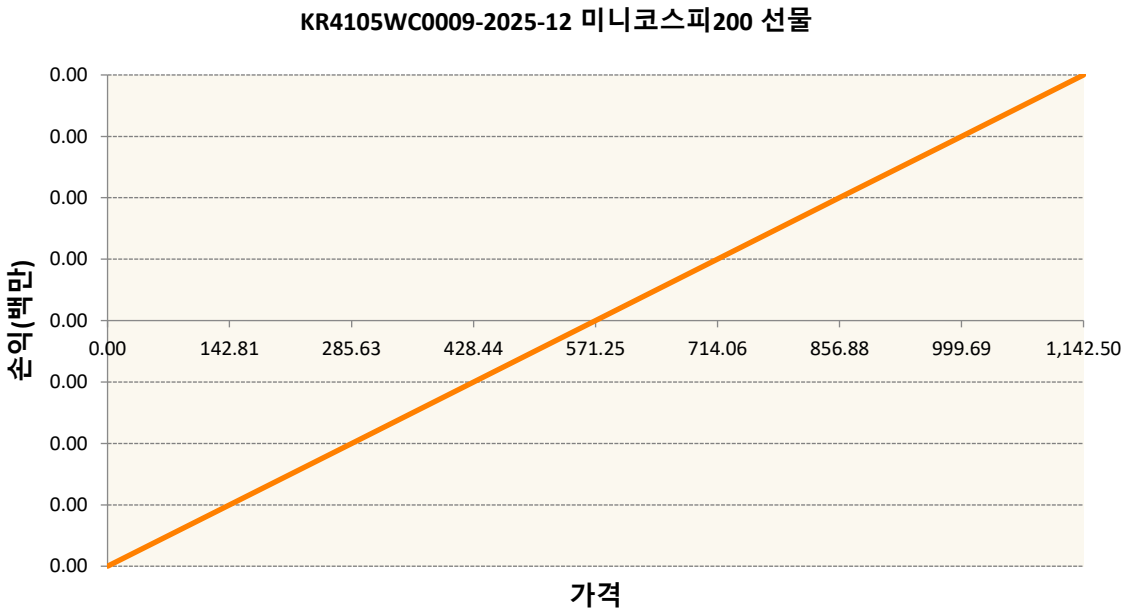
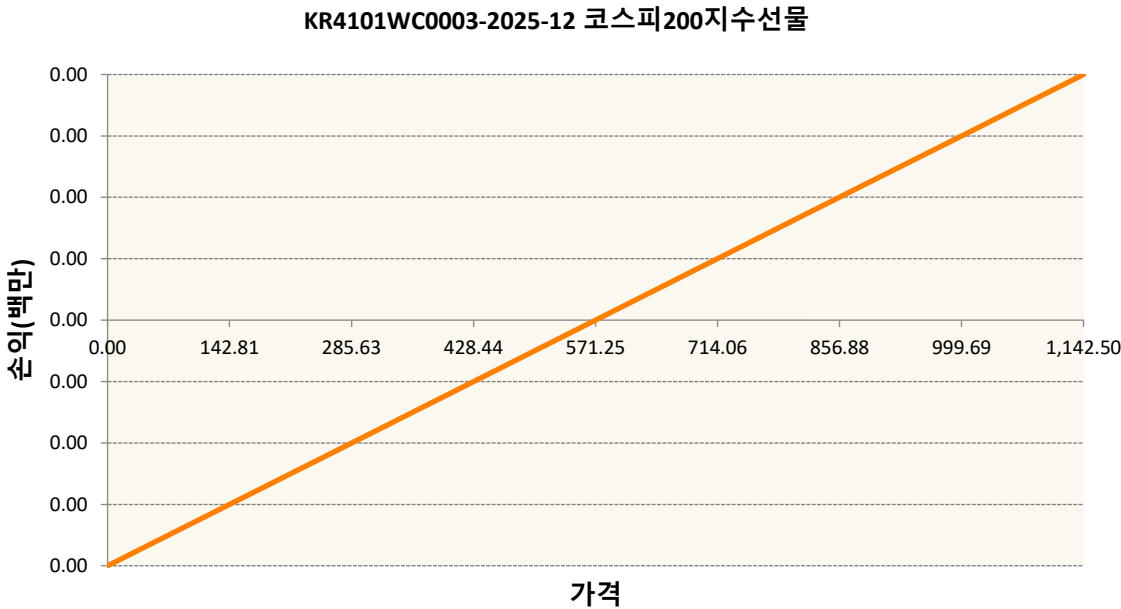
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

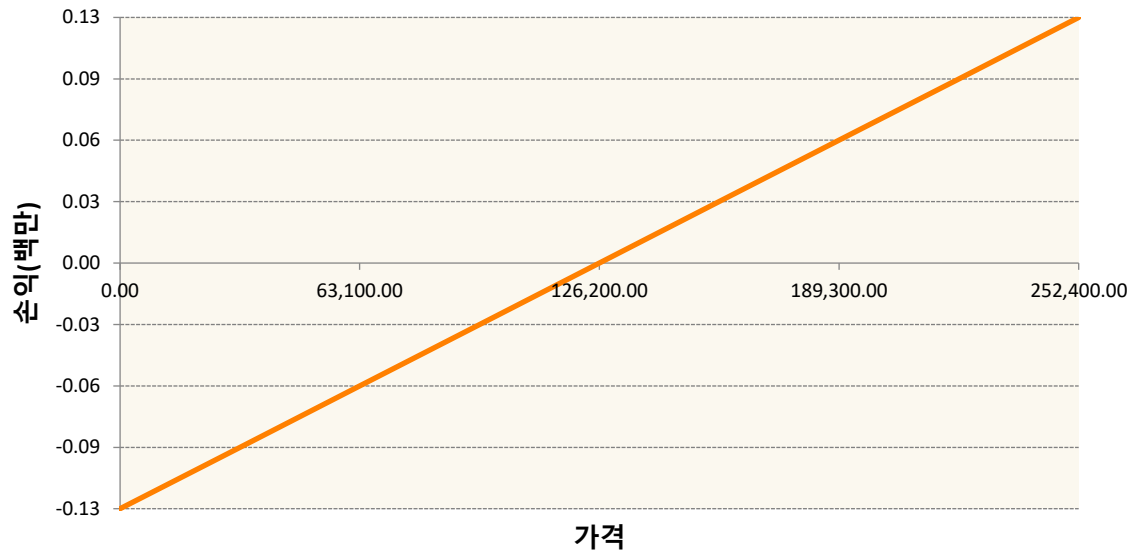
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,160	0	1,160	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

46
 9
 1

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

(단위:백만원)

5

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

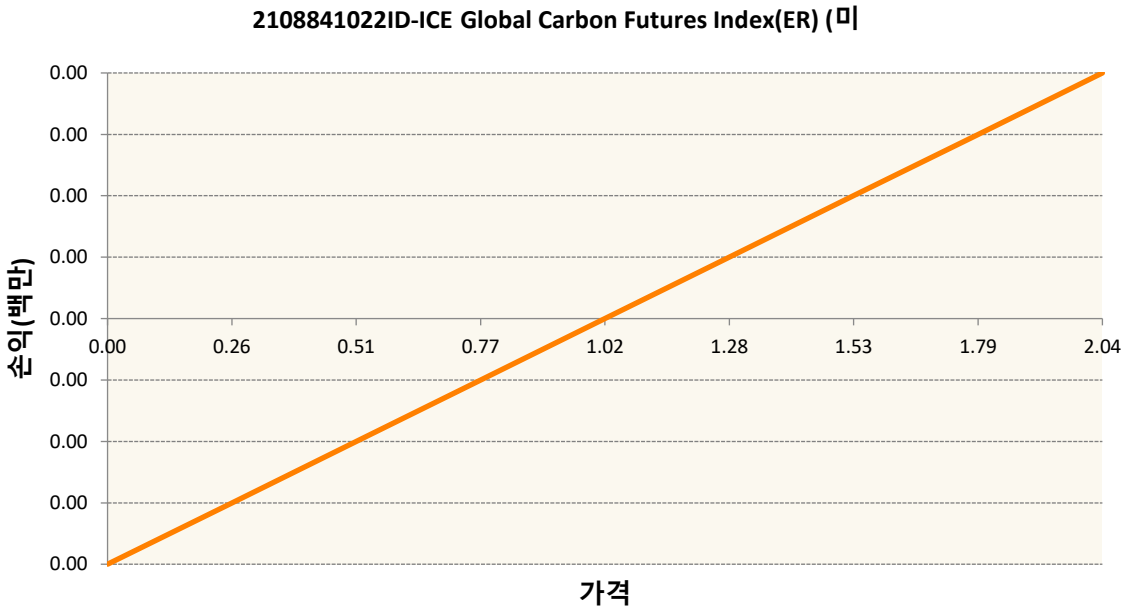
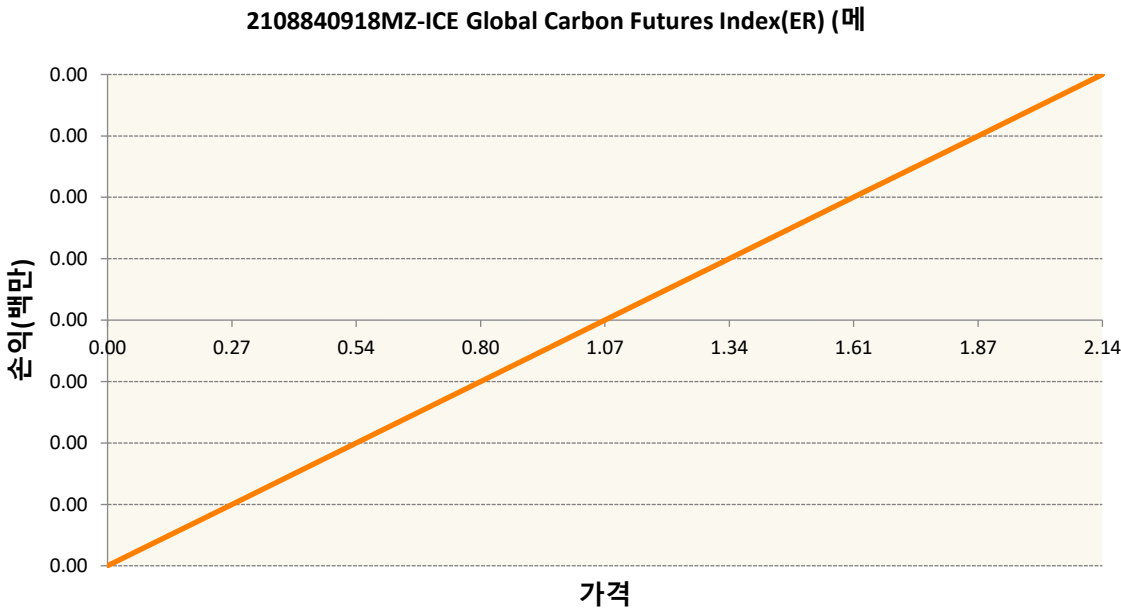
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)
	665

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

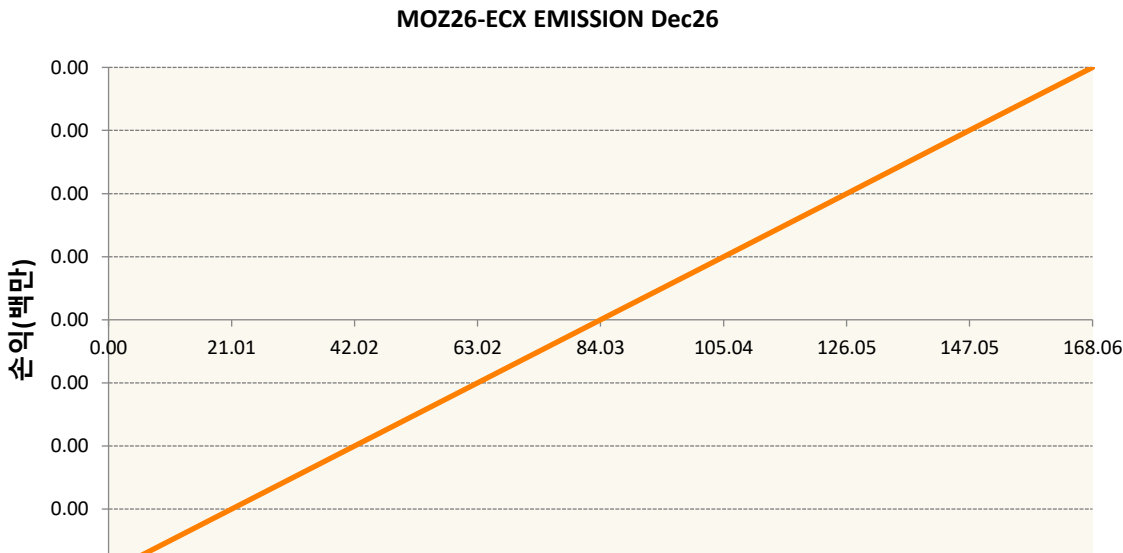
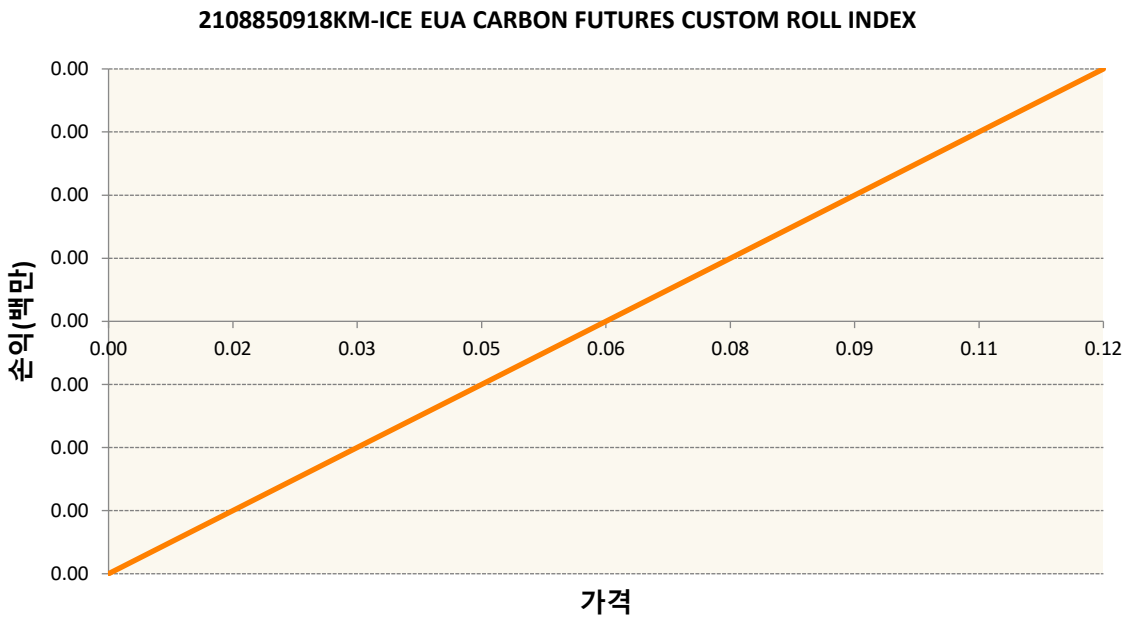
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,131	0	4,131	
누계	지수	스왑	25	0	25	장외
누계	통화	선도	0	2,834	-2,834	장외

2. 만기시점의 손익구조



0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2108850918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2
FXW213FBTC KRW/EUR 23-12-25E	227
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	330

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

(단위:백만원)

580

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

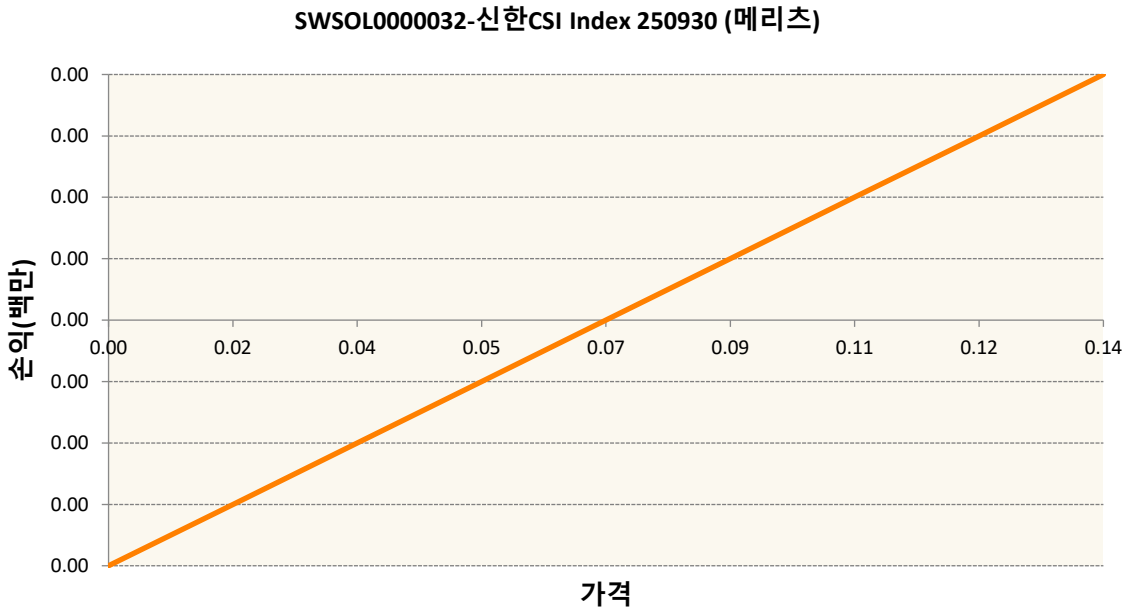
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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)	9
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	6
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	6
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	15

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

(단위:백만원)

63

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

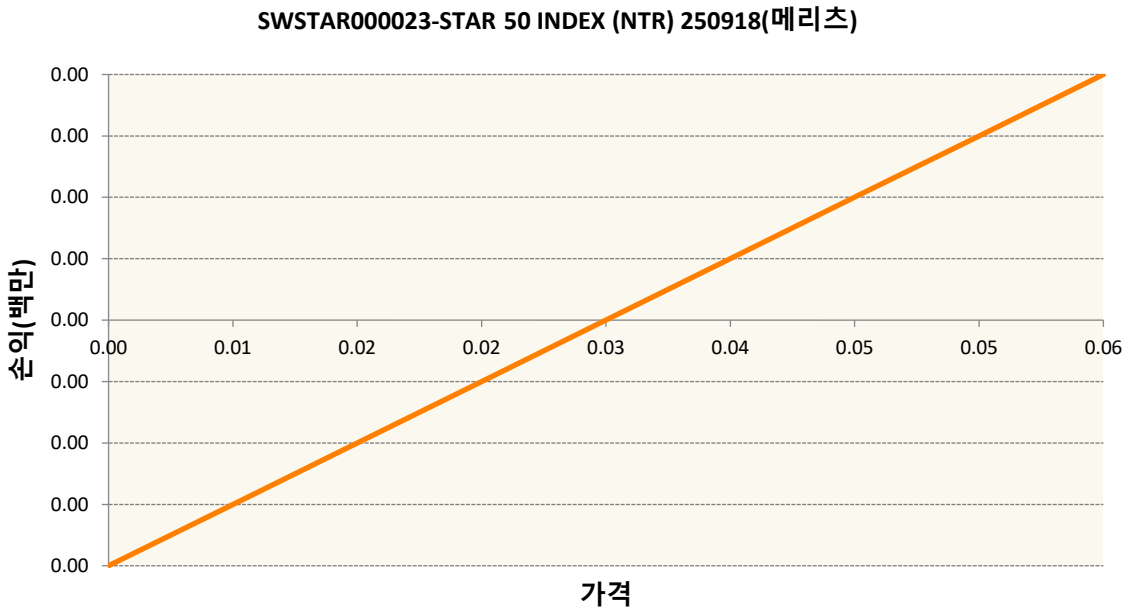
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	3,510	0	3,510	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)	8
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)	2
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)	28
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)	5
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠)	27

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

(단위:백만원)

129

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

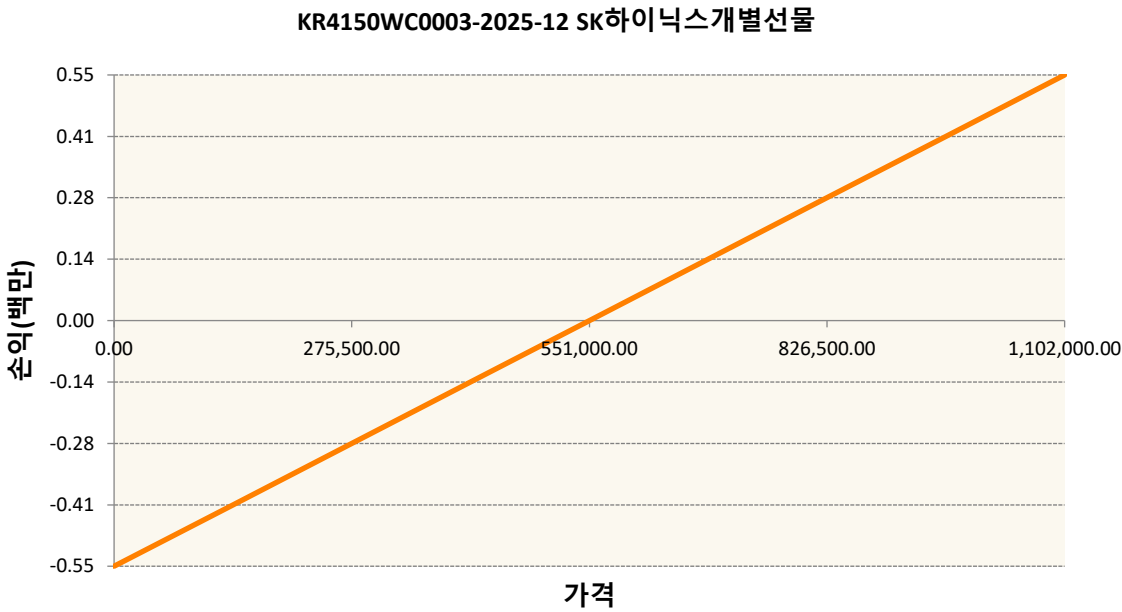
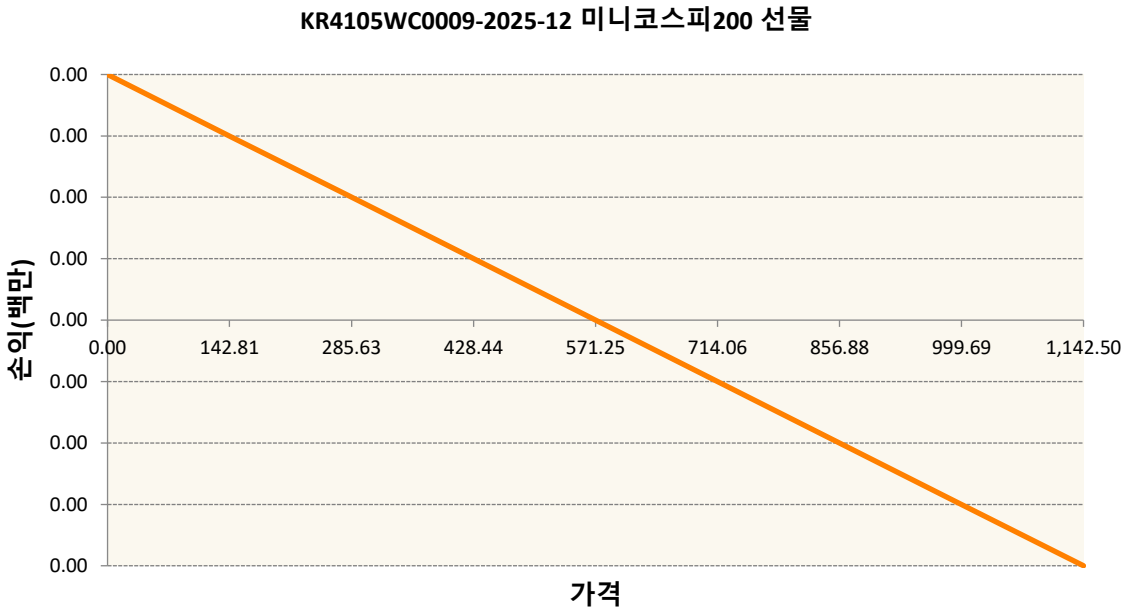
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

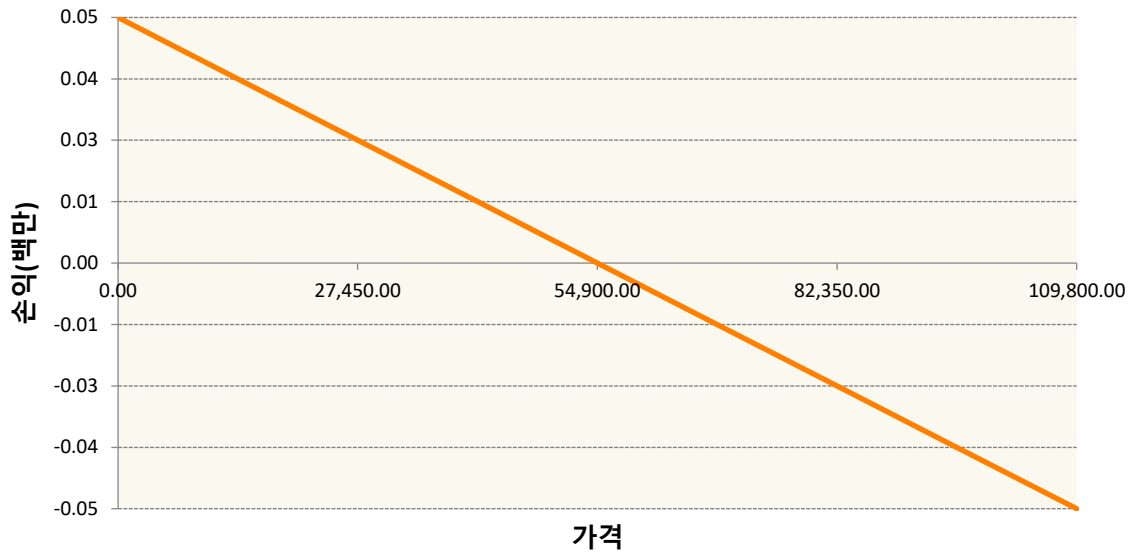
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6	0	6	장내
누계	유가증권	선물	30	885	-855	장내

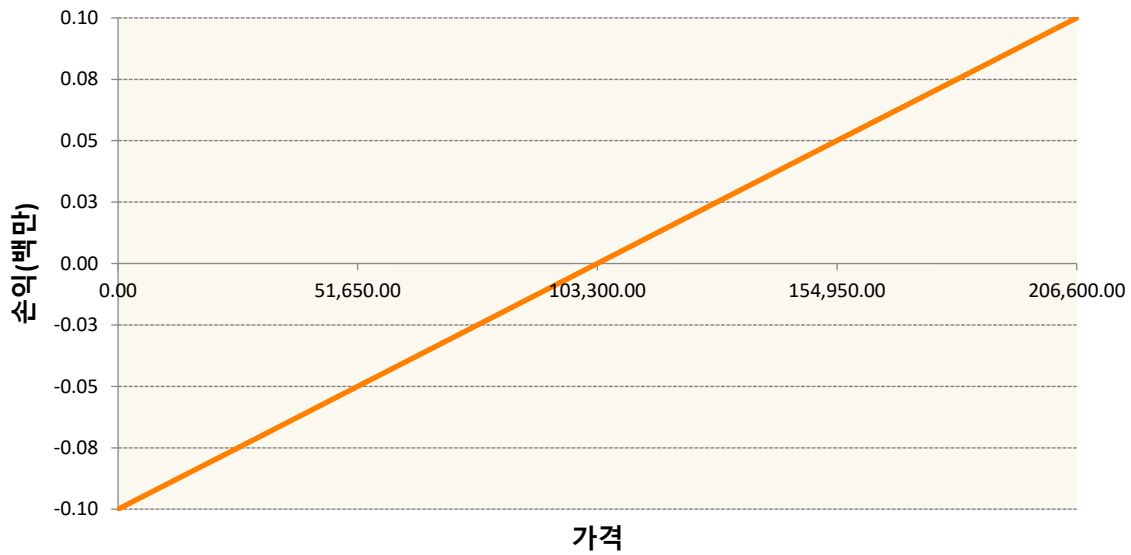
2. 만기시점의 손익구조



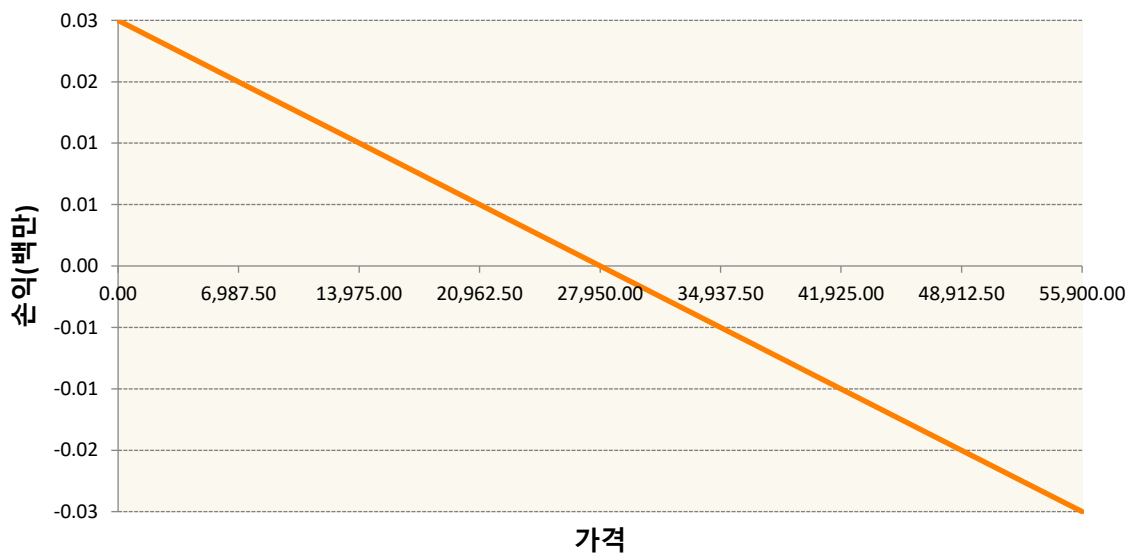
KR41BGWC0003-2025-12 삼성카드개별선물



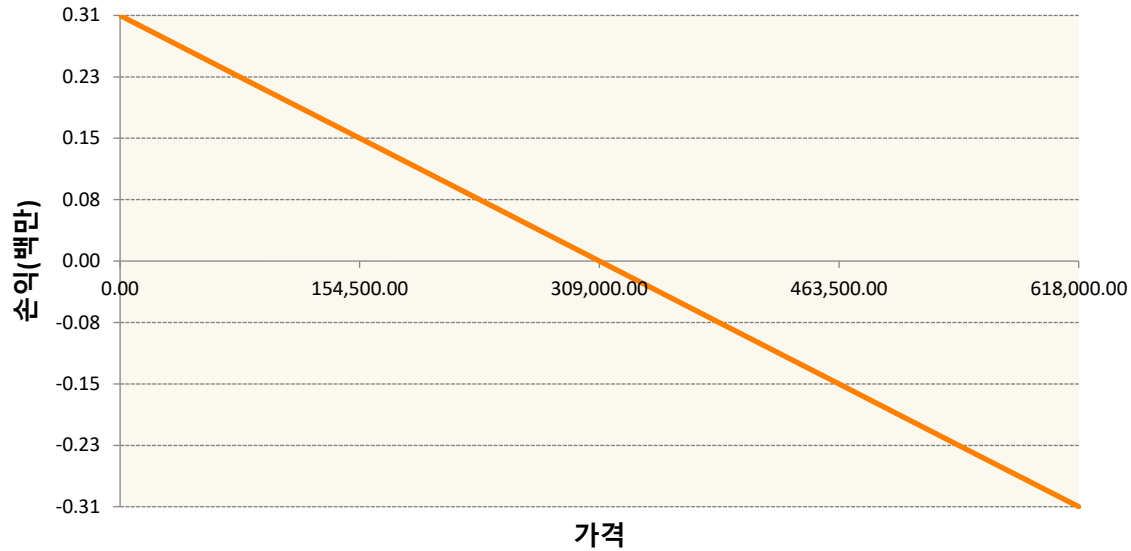
KR41C0WC0008-2025-12 OCI개별선물



KR41CBWC0007-2025-12 한화솔루션개별선물



KR41FEWC0001-2025-12 SK스퀘어개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4105WC0009 2025-12 미니코스피200 선물								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	14
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9	9
-2.67%	5	5	5	5	5	5	5	5
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
KR4150WC0003 2025-12 SK하이닉스개별선물								1
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1	1
KR41BGWC0003 2025-12 삼성카드개별선물								1
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

KR41C0WC0008 2025-12 OCI개별선물 1

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

KR41CBWC0007 2025-12 한화솔루션개별선물 1

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	1	1	1	1	1	1	1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

KR41FEWC0001 2025-12 SK스퀘어개별선물 1

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1	1	1	1	1	1	1
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1

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

(단위:백만원)

25

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

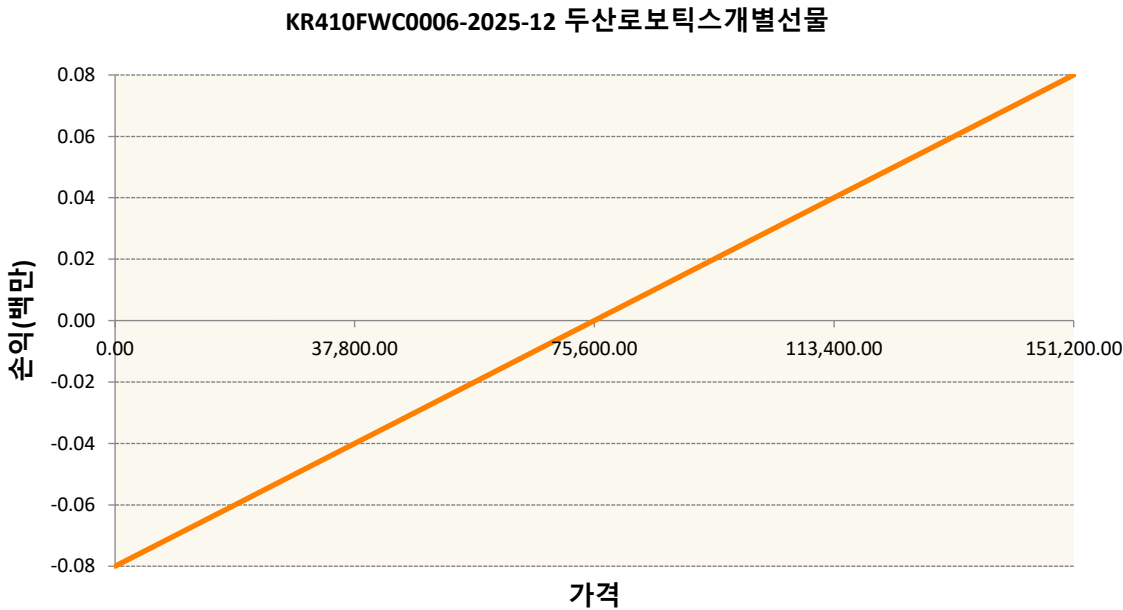
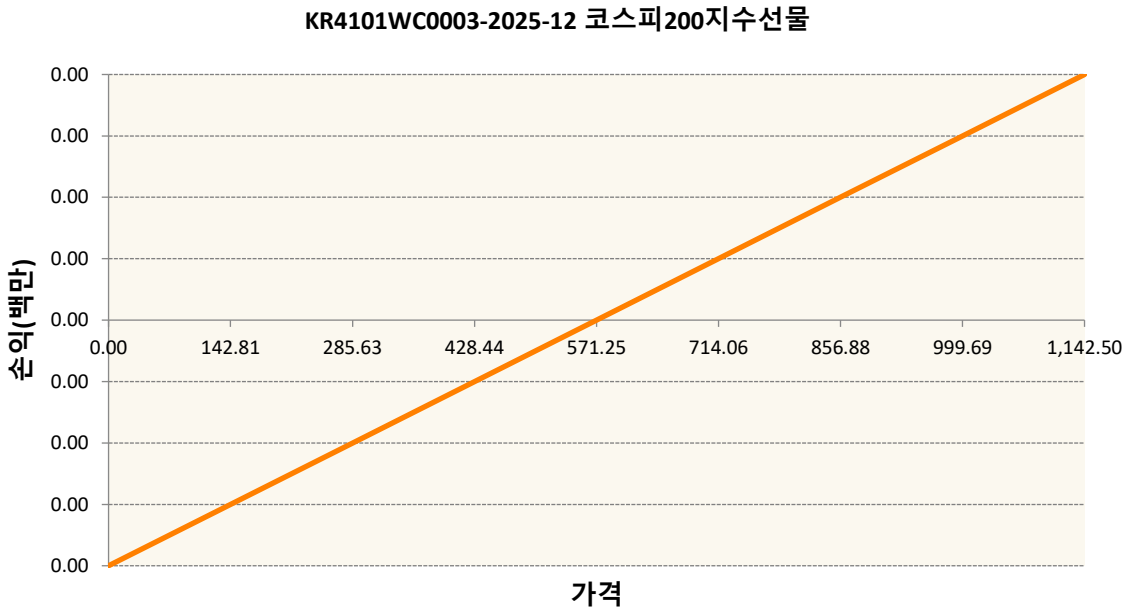
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

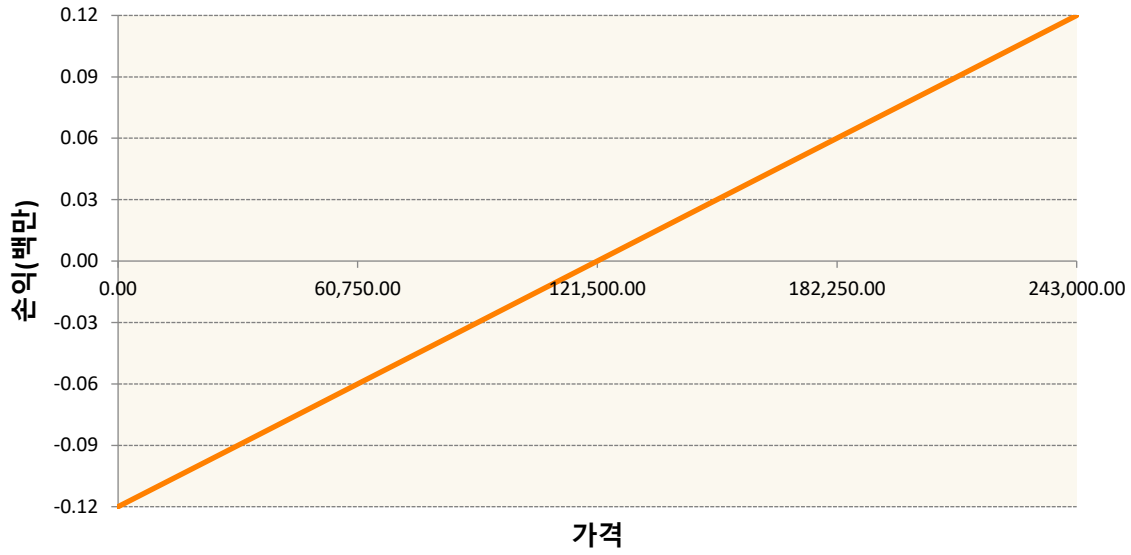
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,326	0	12,326	장내

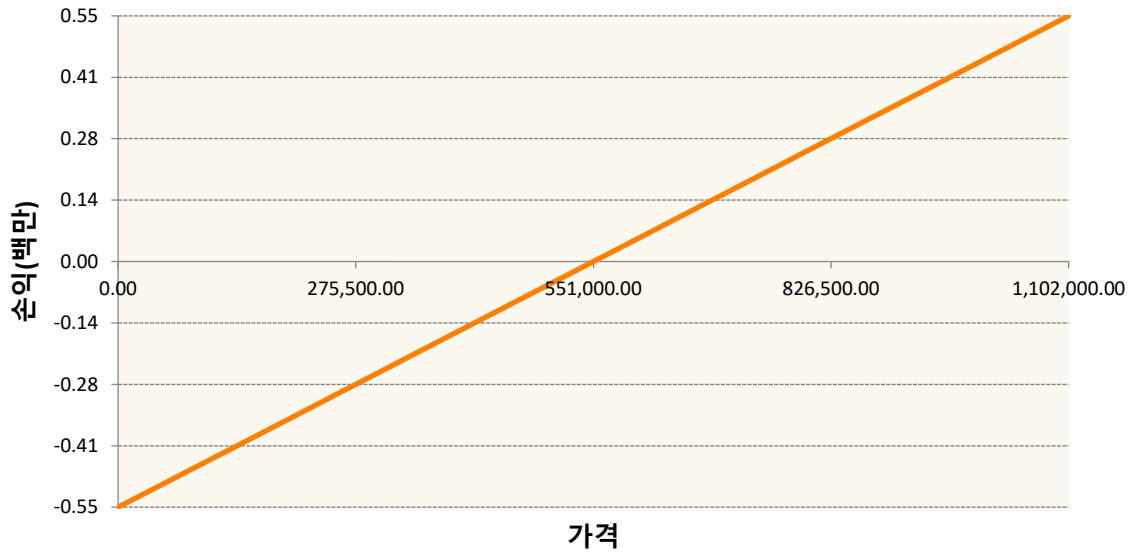
2. 만기시점의 손익구조



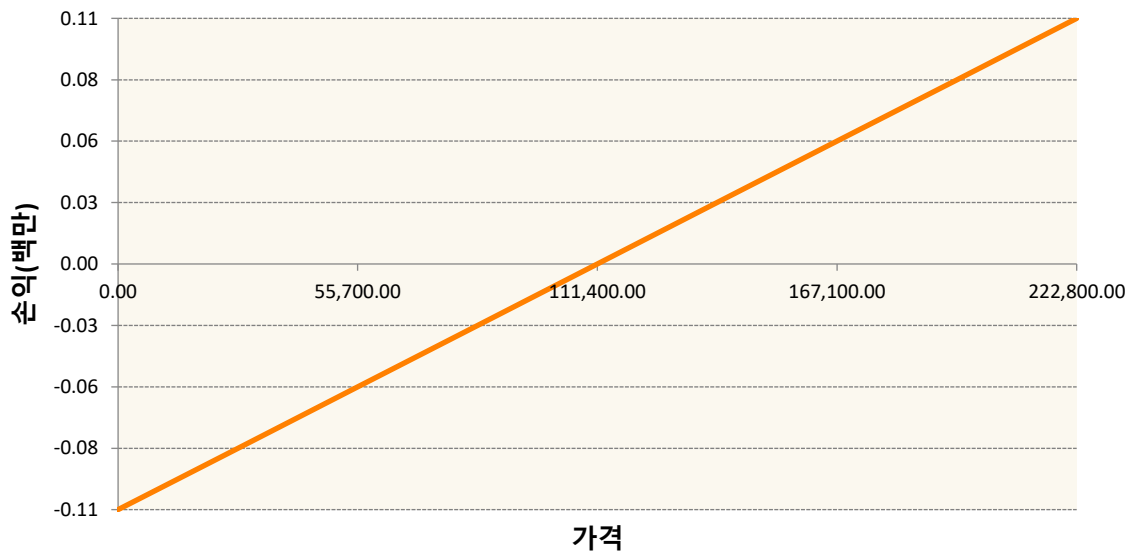
KR410ZWC0002-2025-12 한미반도체개별선물



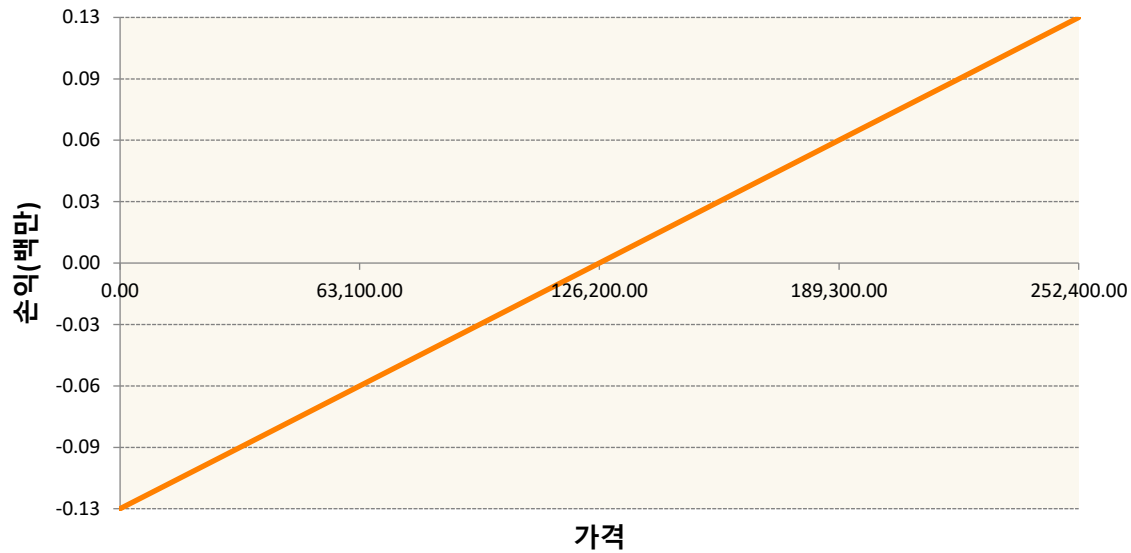
KR4150WC0003-2025-12 SK하이닉스개별선물



KR41EJWC0007-2025-12 SKC개별선물



KR41FMWC0001-2025-12 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC0003 2025-12 코스피200지수선물								902
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-902	-902	-902	-902	-902	-902	-902	-902
-5.33%	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601	-601
-2.67%	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301	-301
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	301	301	301	301	301	301	301	301
5.33%	601	601	601	601	601	601	601	601
8.00%	902	902	902	902	902	902	902	902
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							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%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-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%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	23	23	23	23	23	23	23
KR41FMWC0001 2025-12 엘앤에프개별선물							36
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-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%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	36	36	36	36	36	36	36

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

(단위:백만원)

1,252

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

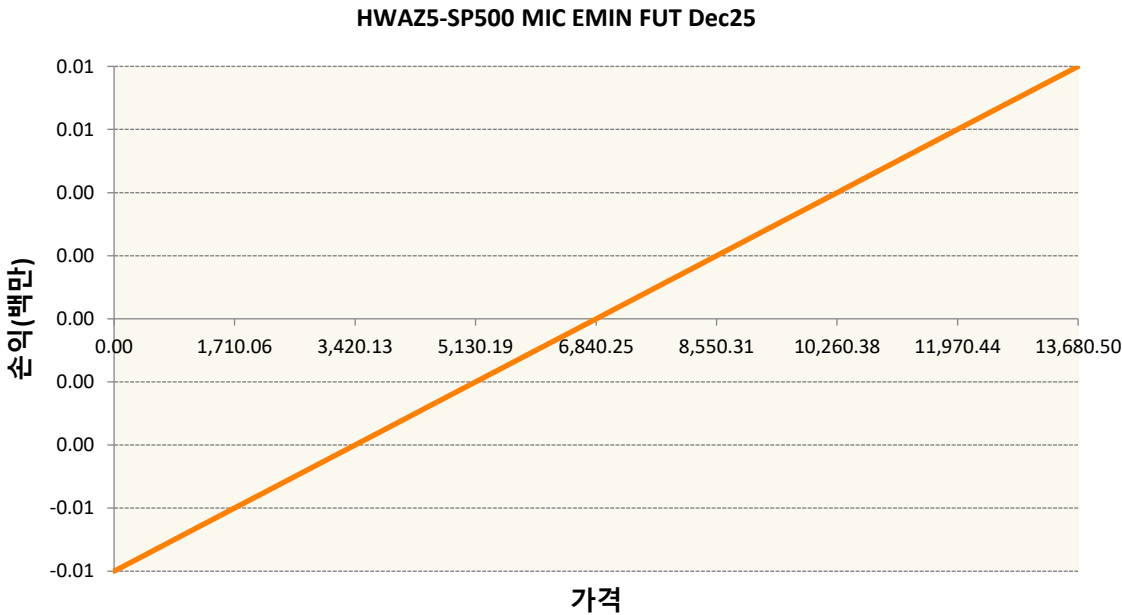
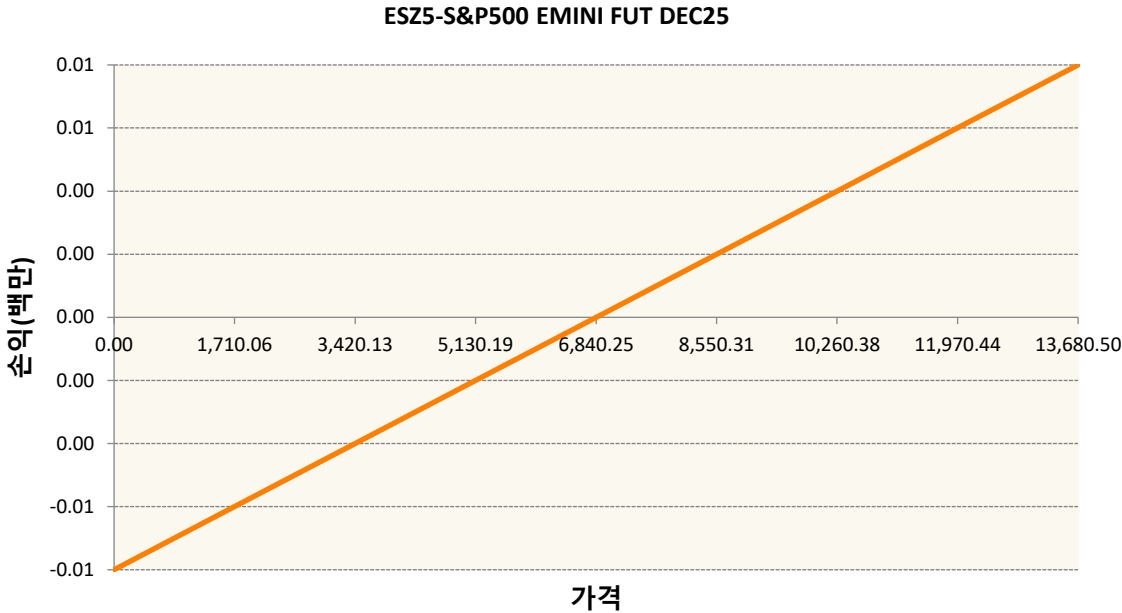
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	44,501	0	44,501	
누계	유가증권	선물	1,046	0	1,046	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,560
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	84

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,260

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

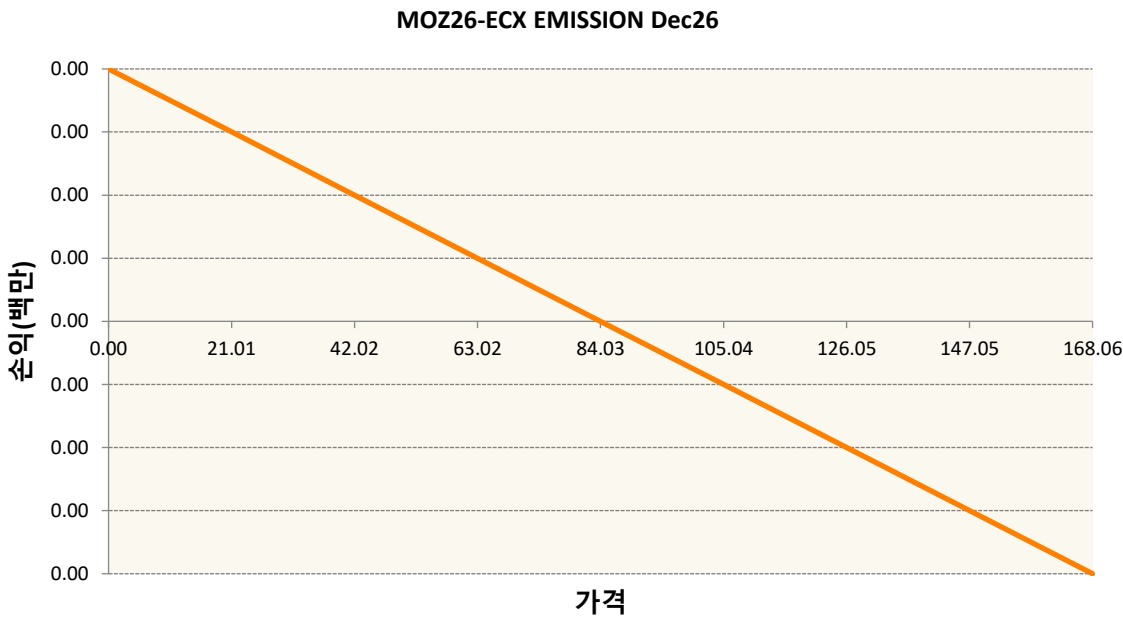
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	3,305	-3,305	
누계	지수	스왑	-25	0	-25	장외
누계	통화	선도	0	1,066	-1,066	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2109930918IICE EUA CARBON FUTURES CUSTOM ROLL INDEX	2
FXW213FBTC KRW/EUR 23-12-25E	85
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	264

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

(단위:백만원)

402

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

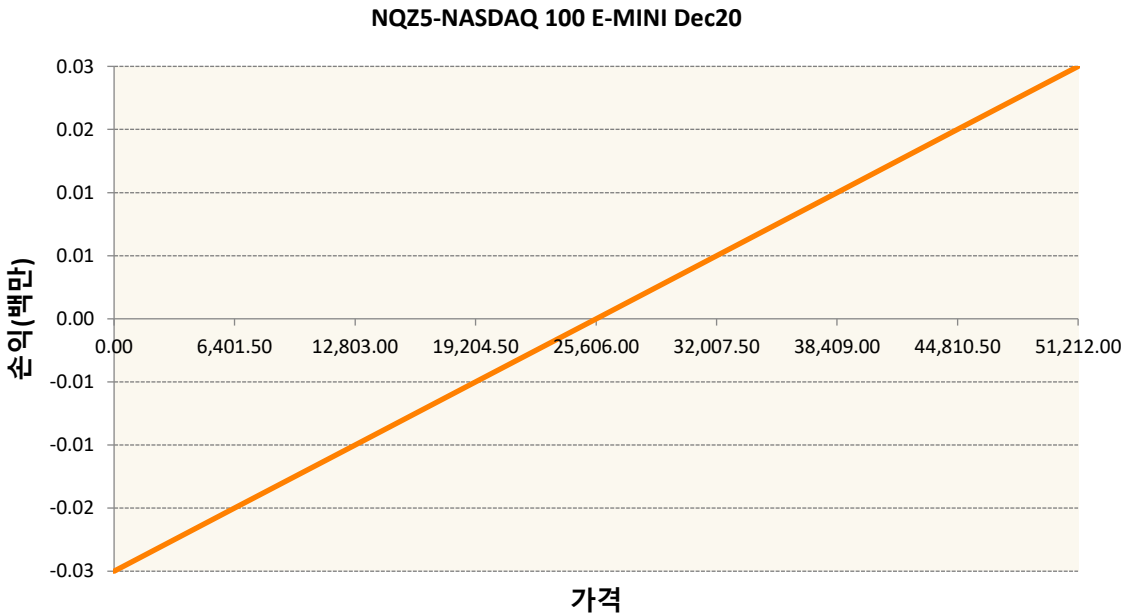
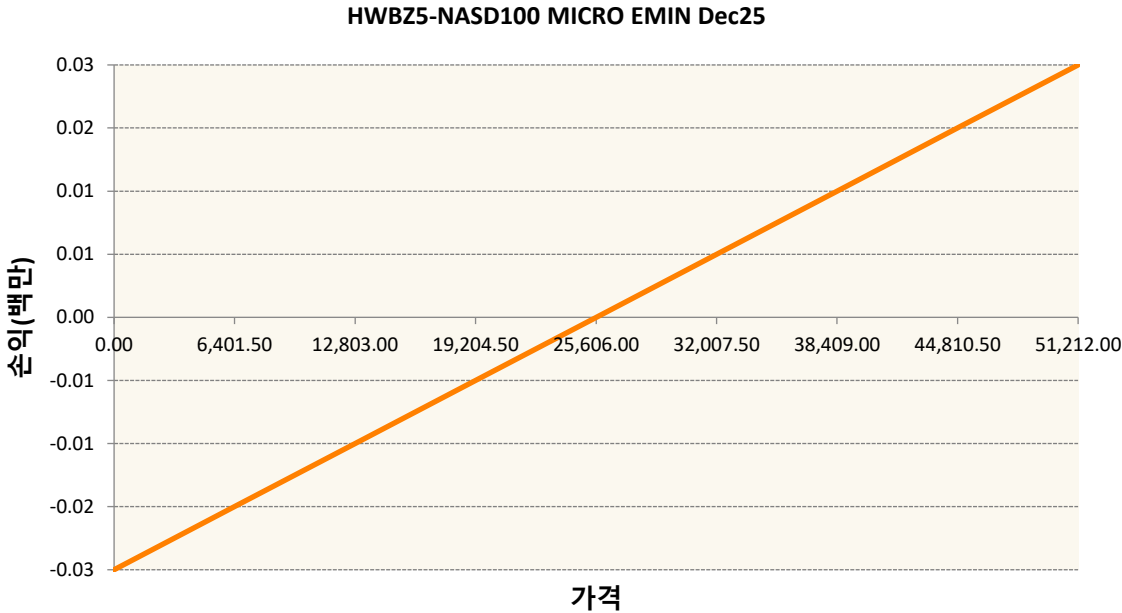
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	19,329	0	19,329	
누계	유가증권	선물	1,284	0	1,284	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25	103
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,546

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,868

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

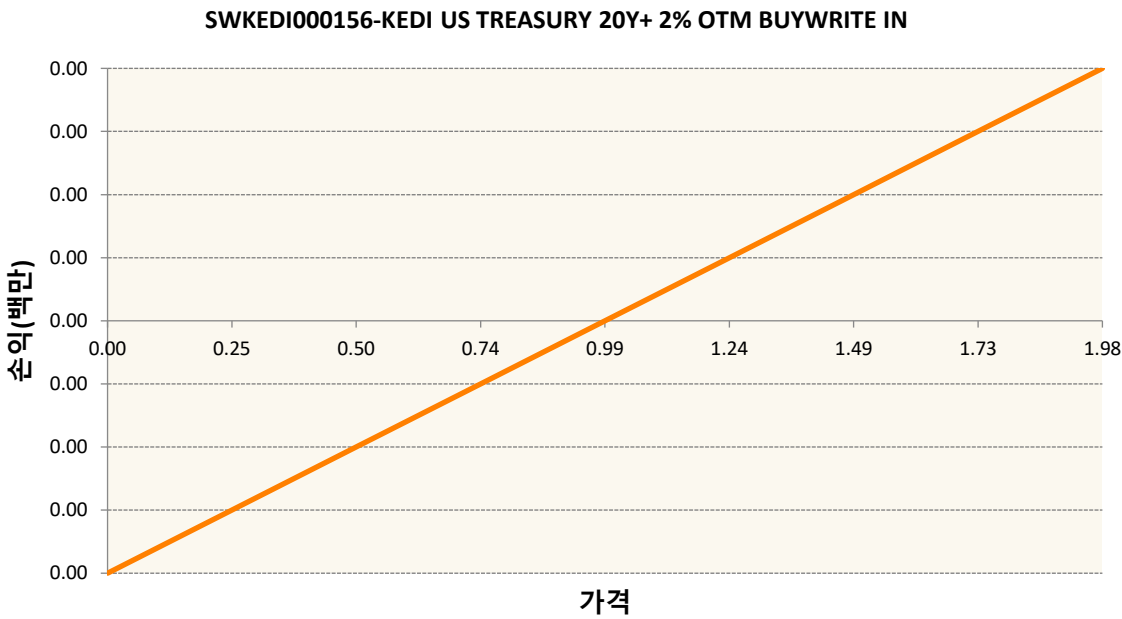
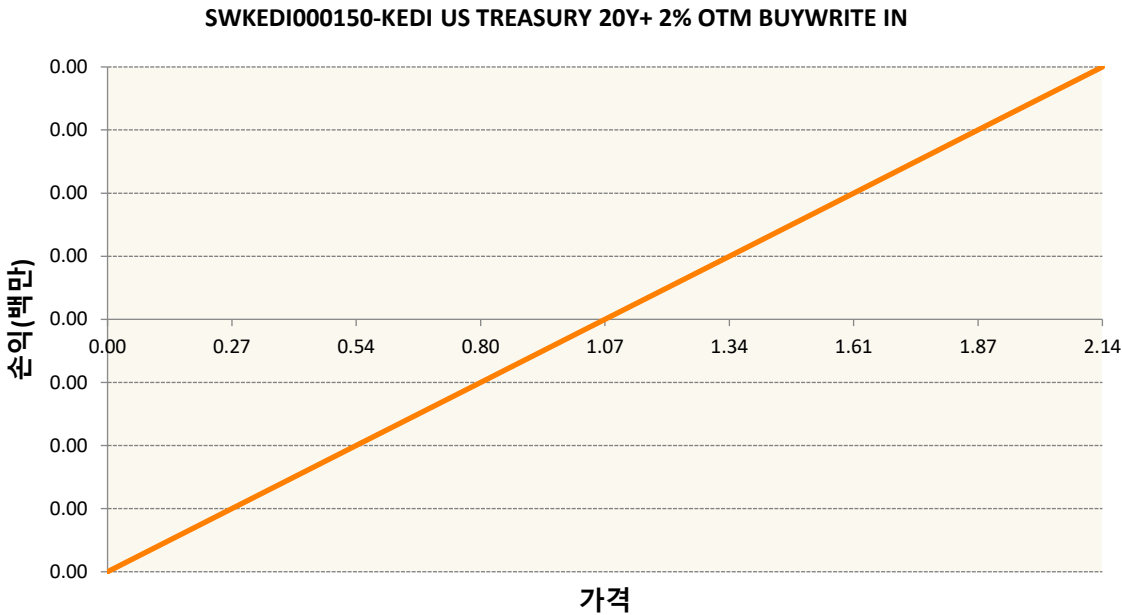
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

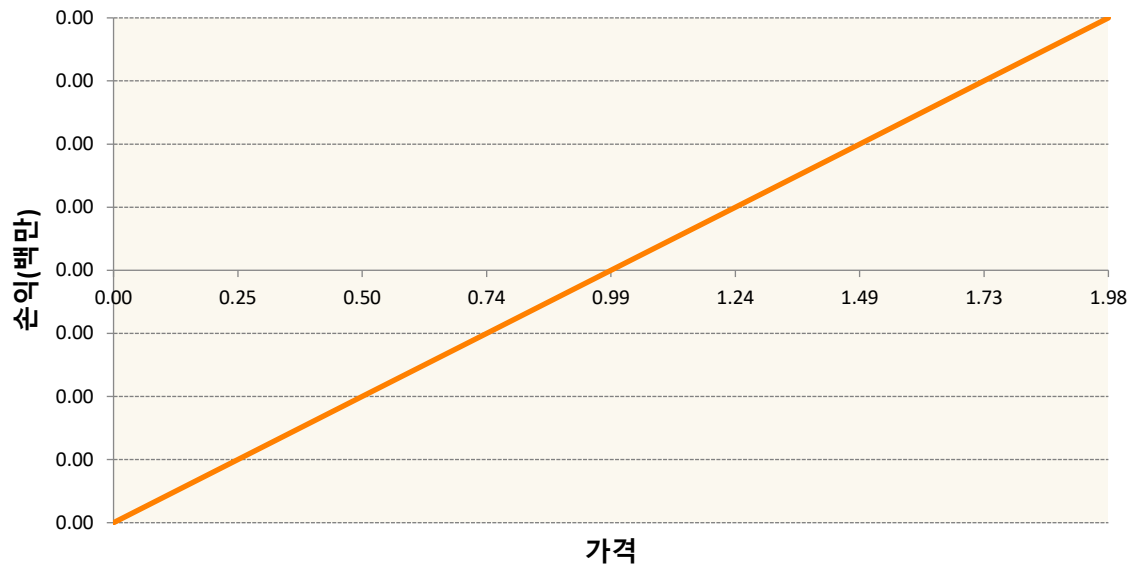
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	382,310	0	382,310	장외

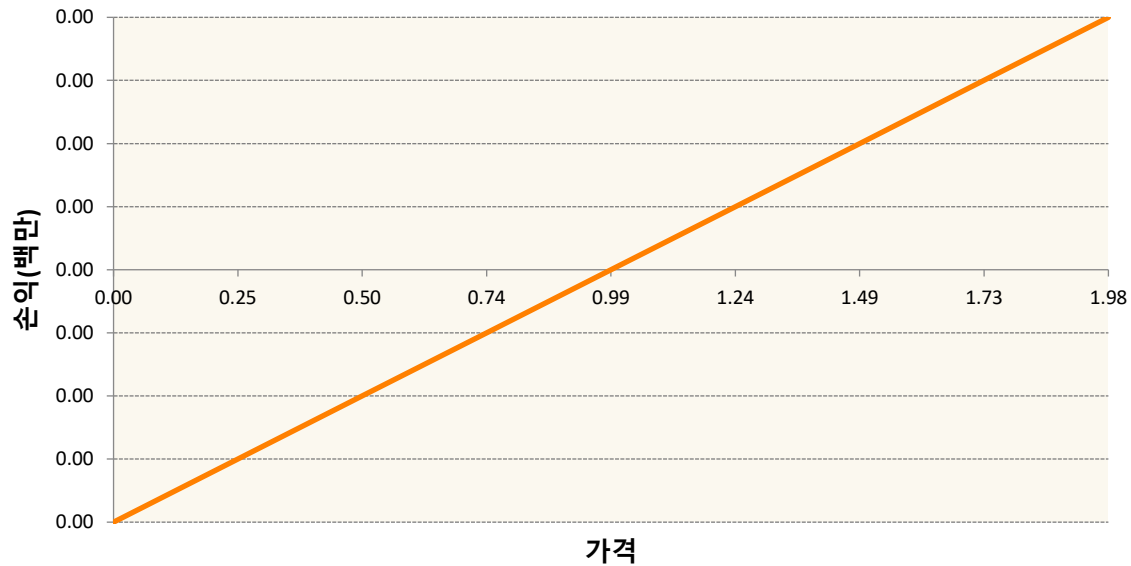
2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000157-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000158-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,249
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	10,170
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,513
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,747

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

(단위:백만원)

14,148

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

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	2,246	0	2,246	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)

65

공시일	2025-12-04
기준일	2025-12-03

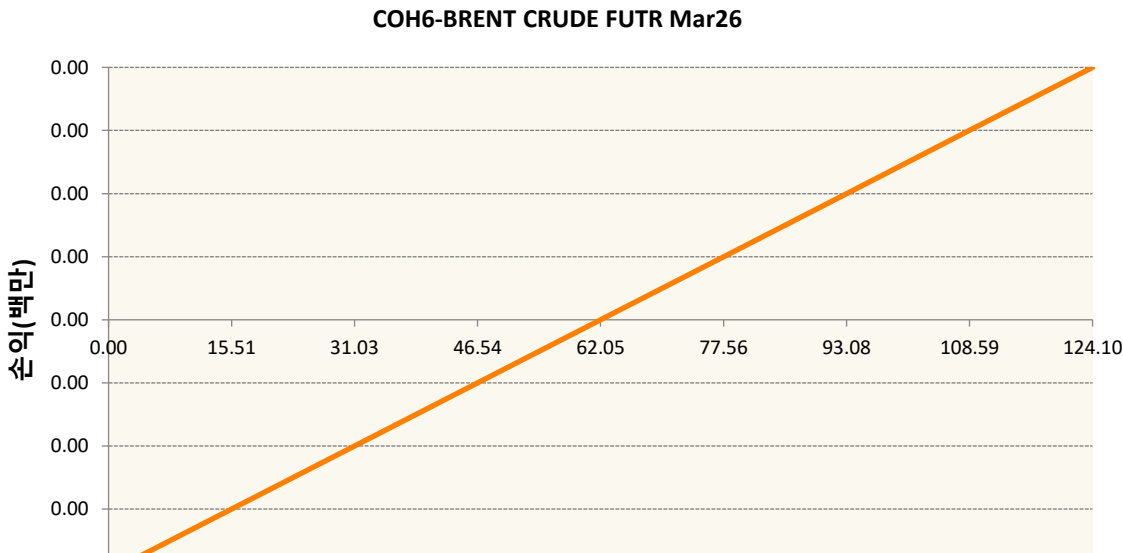
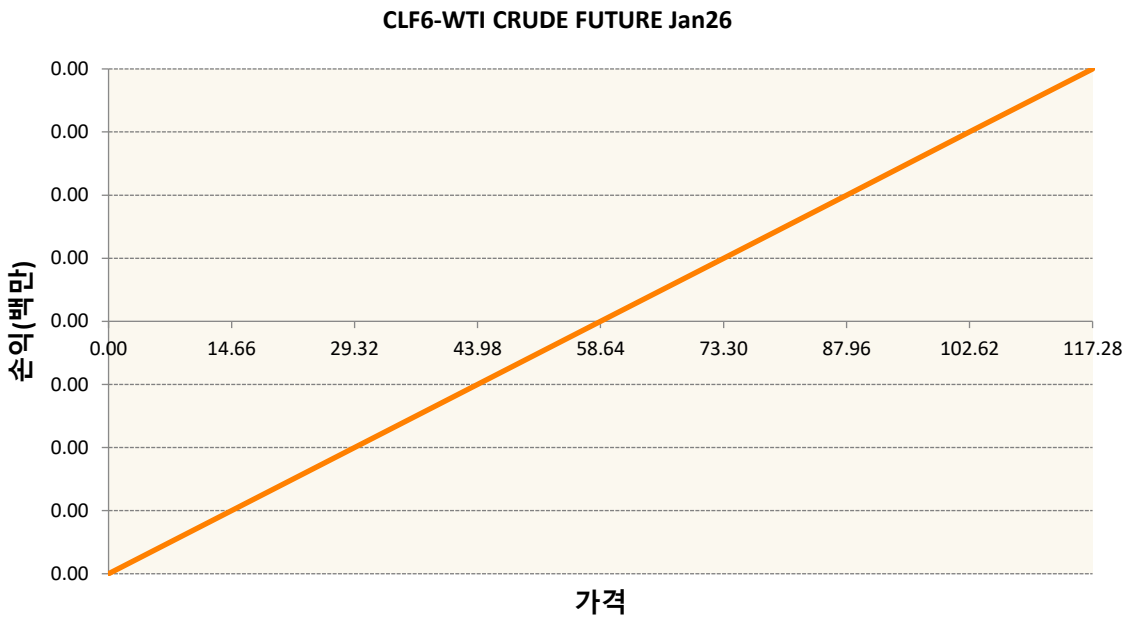
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

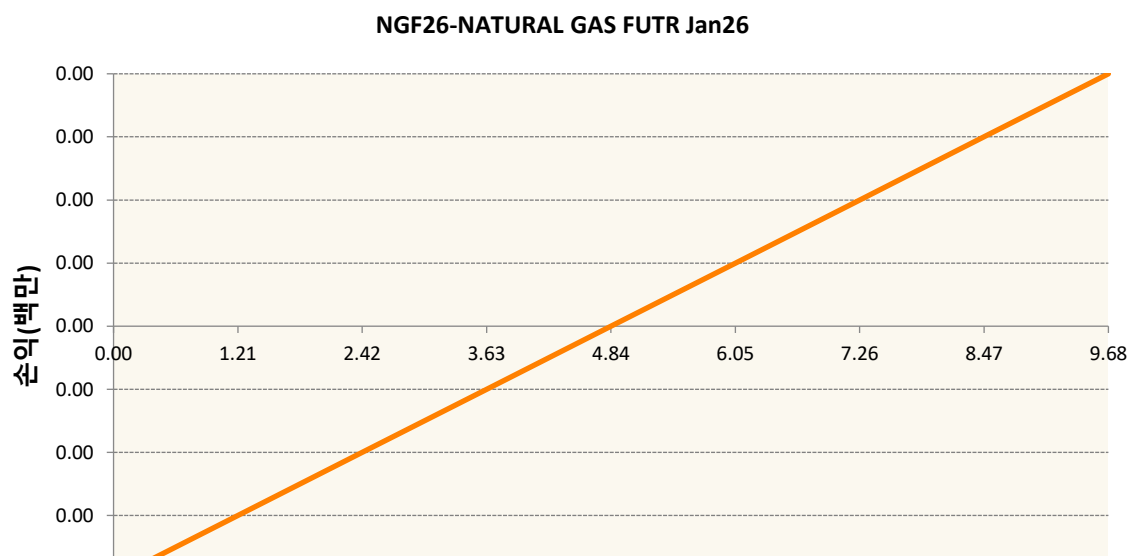
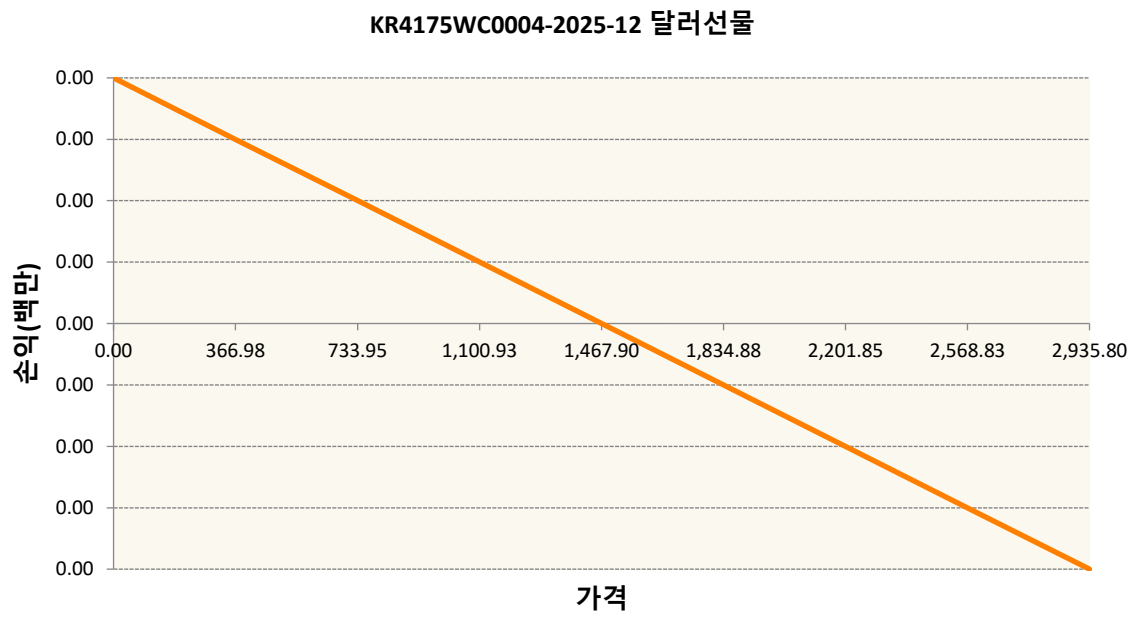
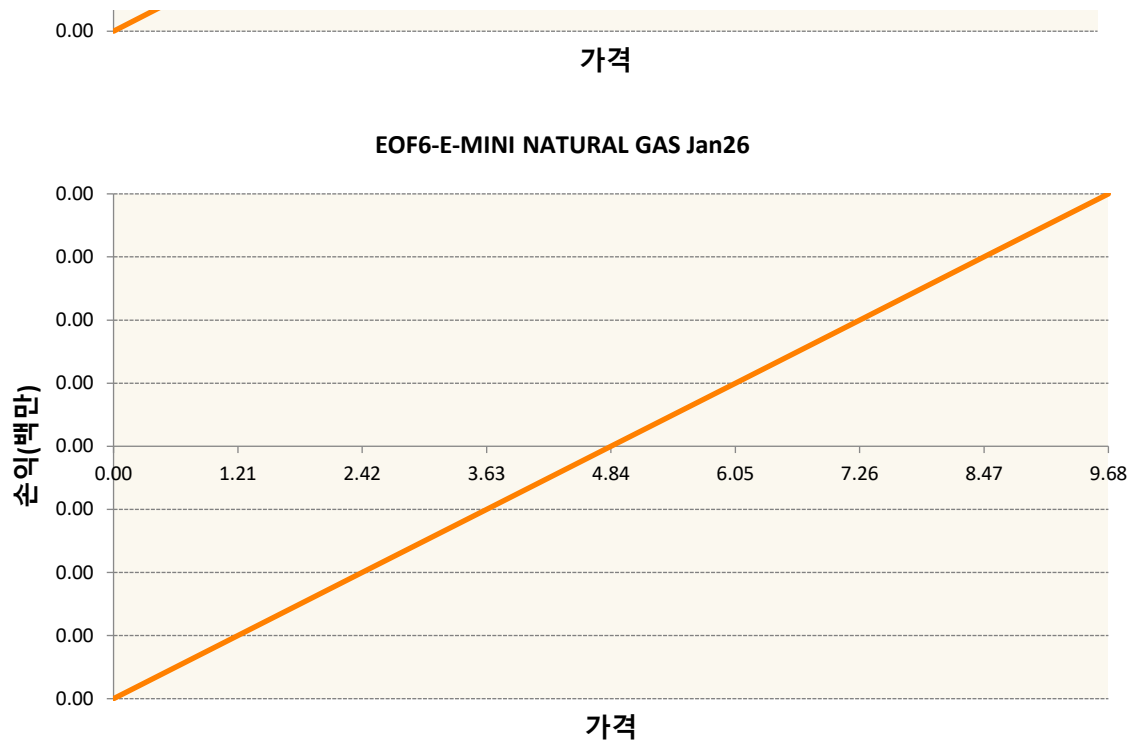
1. 계약금액

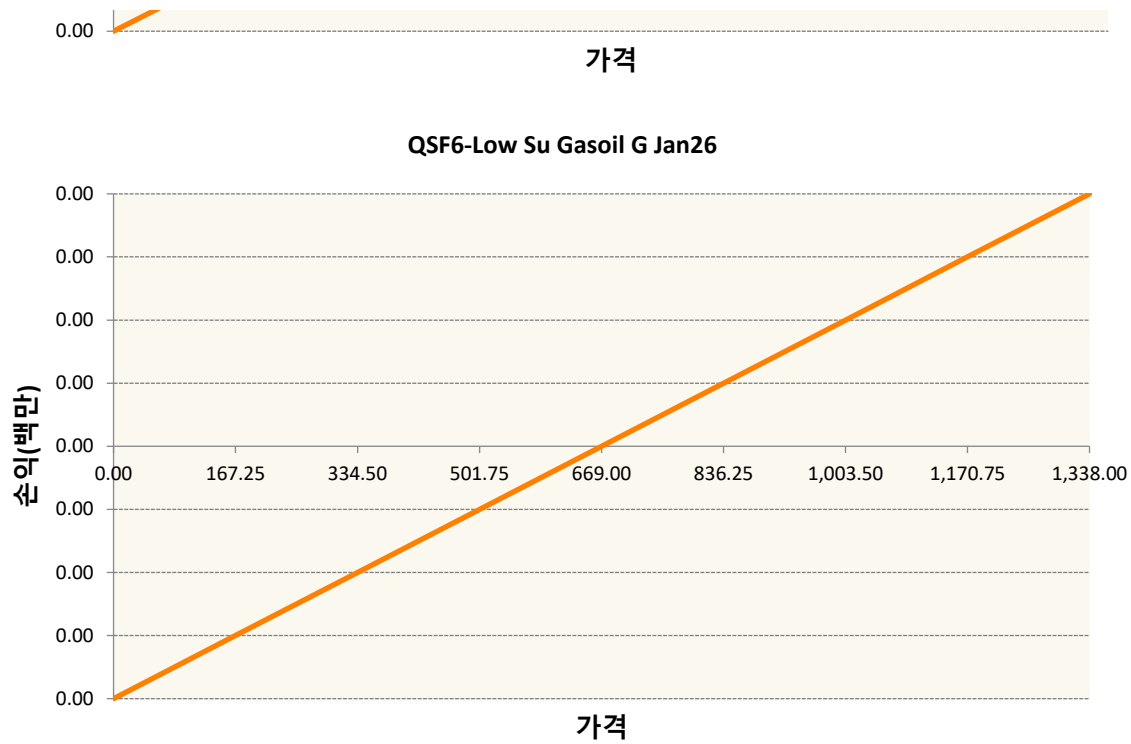
(단위:백만원)

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	369	0	369	
누계	유가증권	선물	182	0	182	
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	15
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)

97