

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

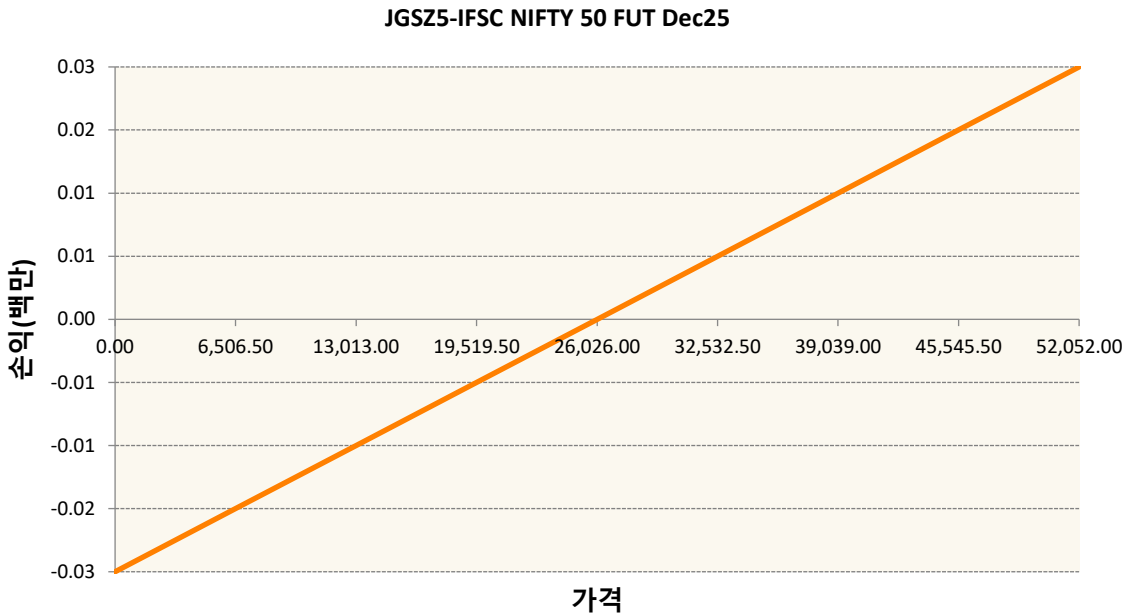
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	691	0	691	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSZ5	IFSC NIFTY 50 FUT Dec25	55
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

35

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

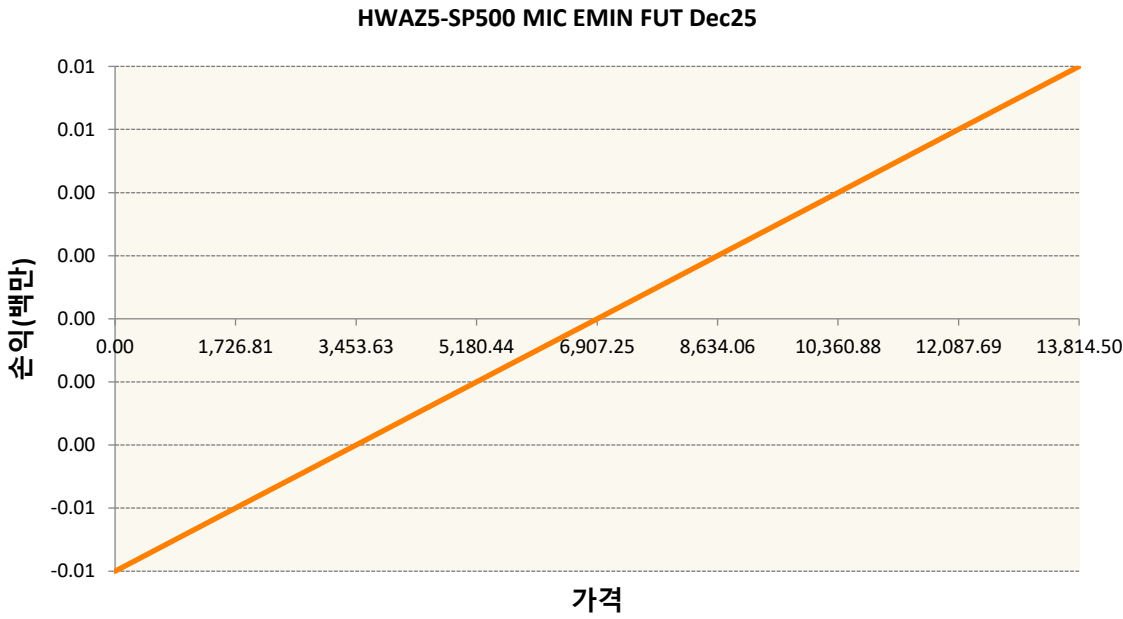
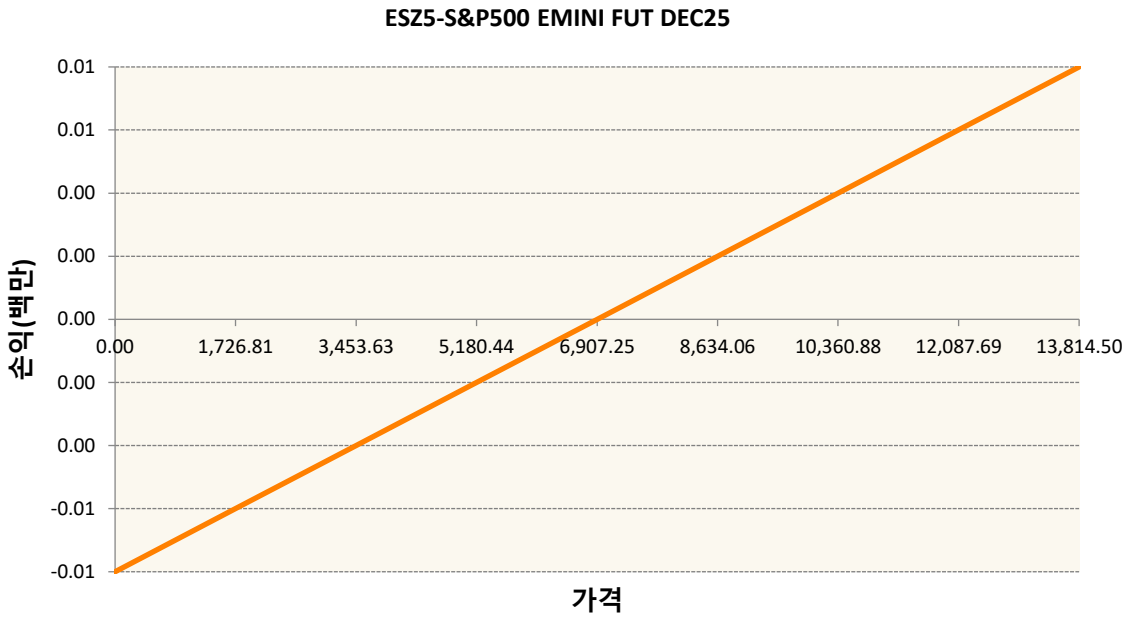
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	480	0	480	
누계	유가증권	선물	144	0	144	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	38
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	12

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

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

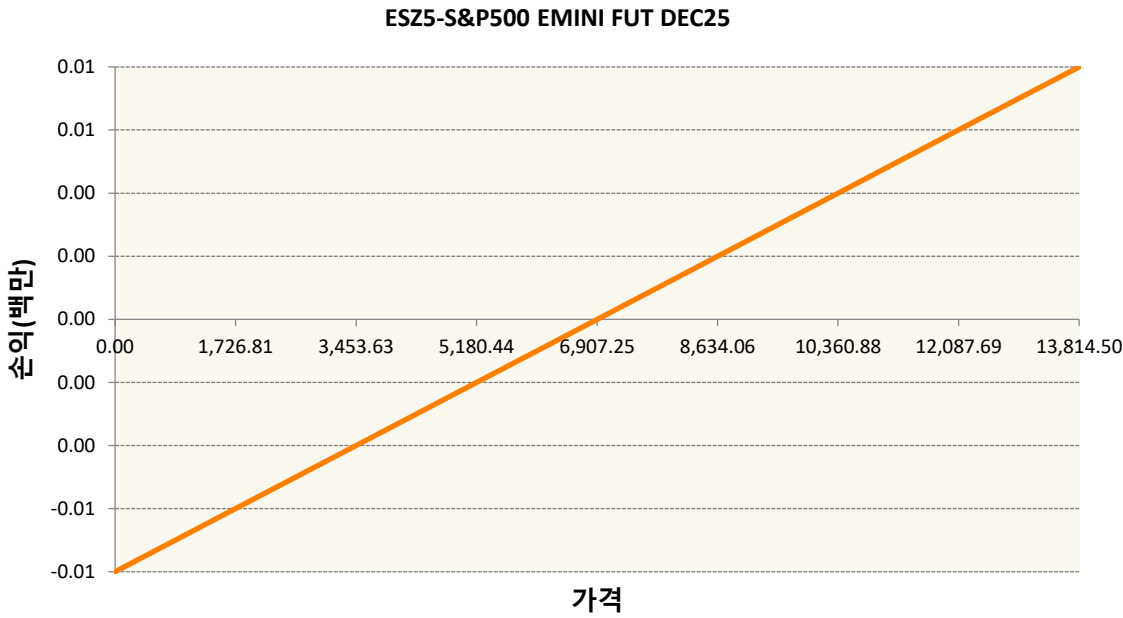
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,441	0	1,441	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	115
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

168

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

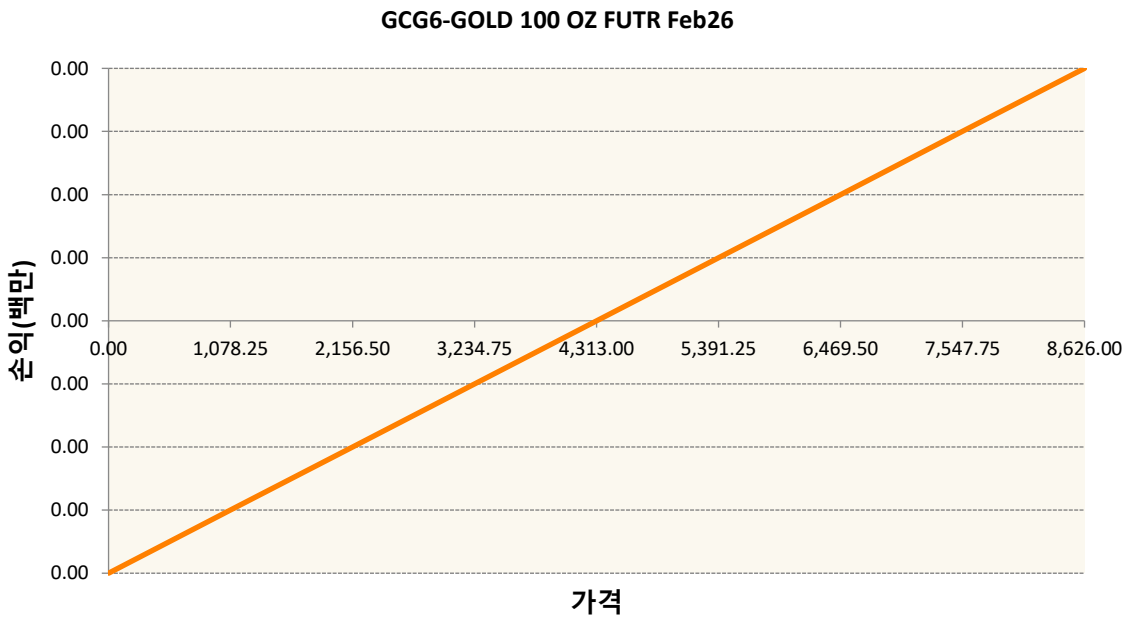
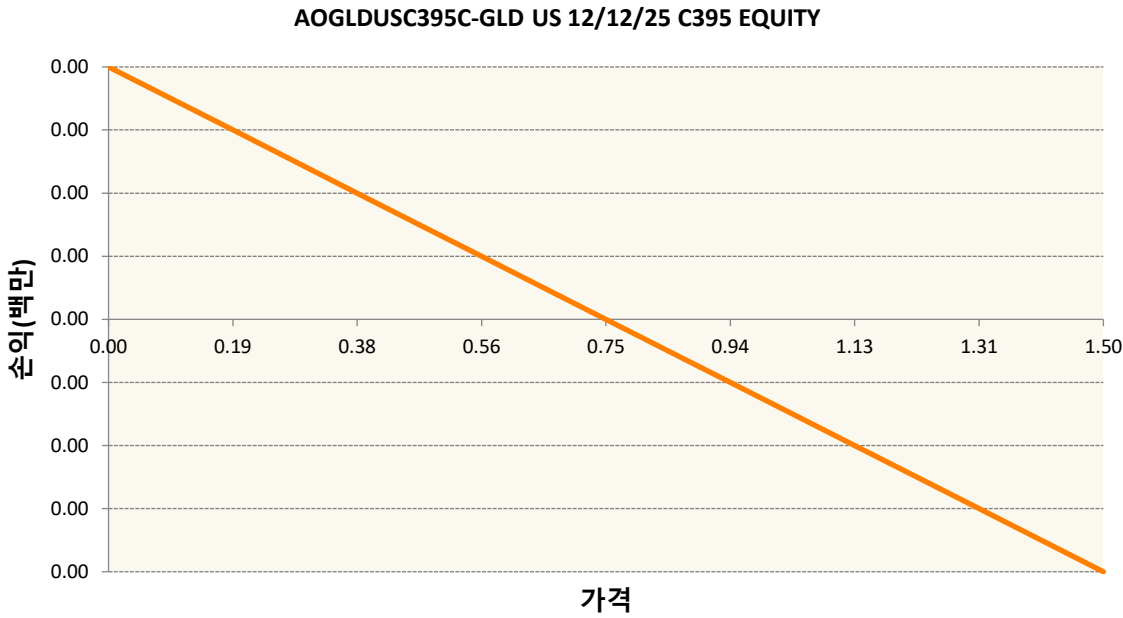
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	3,175	0	3,175	
누계	실물자산	옵션	0	14	-14	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSC3 GLD US 12/12/25 C395 EQUITY		1
GCG6	GOLD 100 OZ FUTR Feb26	254

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	238

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

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)

AOPLTRUAC PLTR US 12/12/25 C185 EQUITY	71
AOPLTRUAP PLTR US 12/12/25 P185 EQUITY	78

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

(단위:백만원)

572

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

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)

AOTLTUSCC!TLT US 12/12/25 C90 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

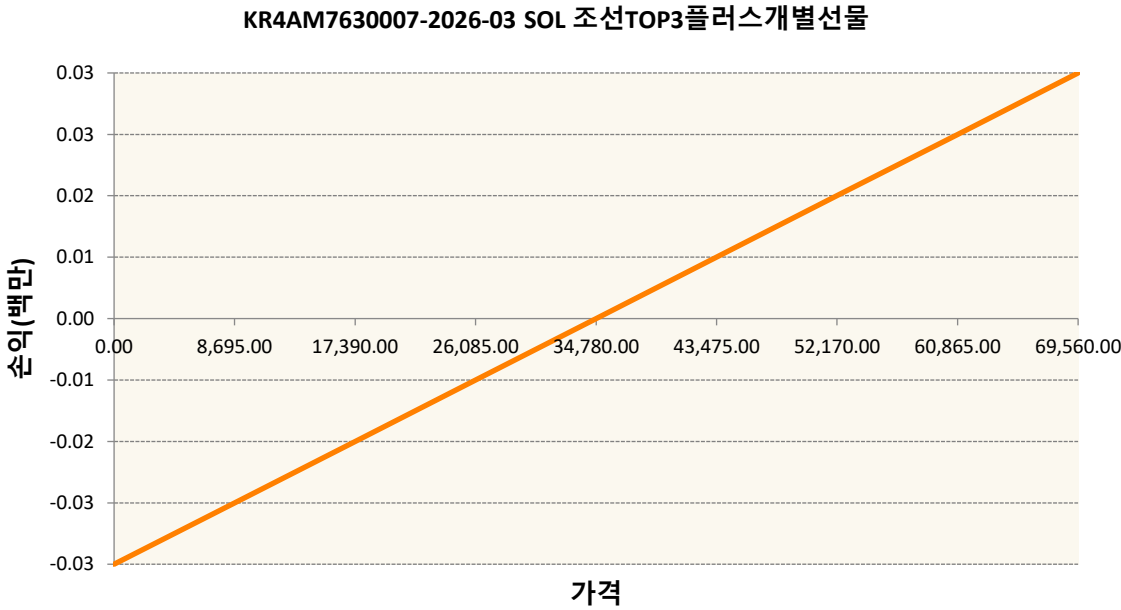
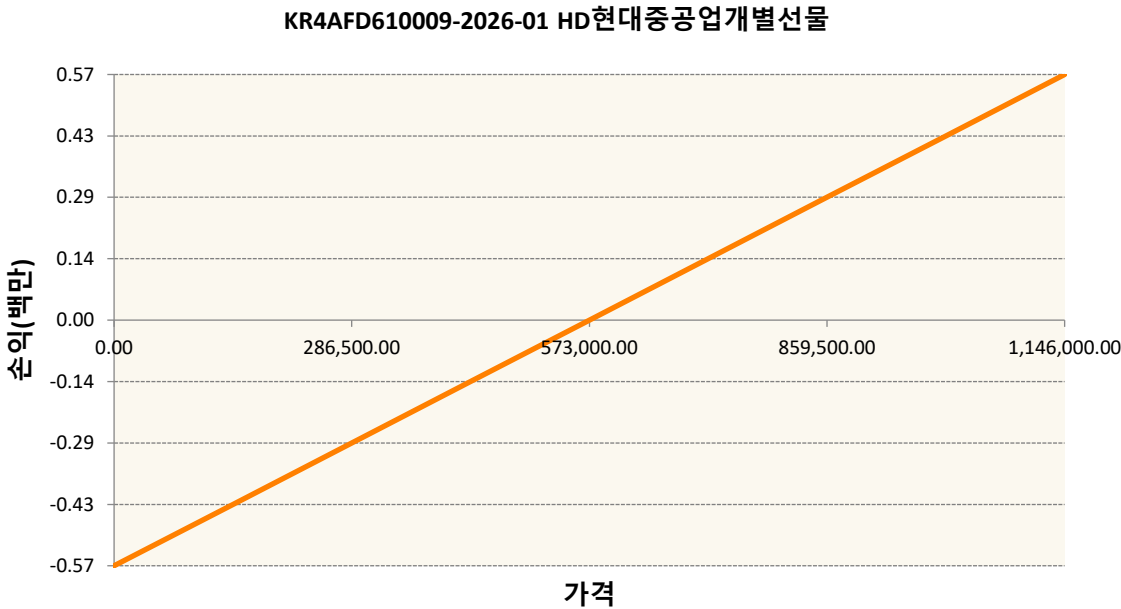
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	176	0	176	장내
누계	유가증권	선물	21,728	0	21,728	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD610009		2026-01 HD현대중공업개별선물					919
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-919	-919	-919	-919	-919	-919	-919
-5.33%	-612	-612	-612	-612	-612	-612	-612
-2.67%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	306	306	306	306	306	306	306
5.33%	612	612	612	612	612	612	612
8.00%	919	919	919	919	919	919	919
KR4AM7630007		2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물					819
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-819	-819	-819	-819	-819	-819	-819
-5.33%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
-2.67%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	273	273	273	273	273	273	273
5.33%	546	546	546	546	546	546	546
8.00%	819	819	819	819	819	819	819

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

1,786

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

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	2025-12-15
기준일	2025-12-12

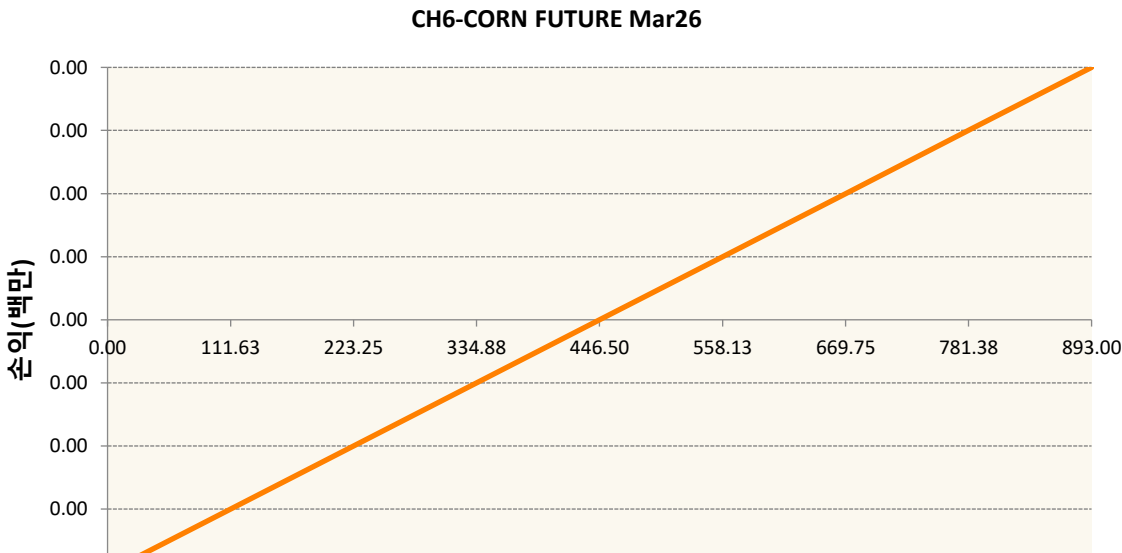
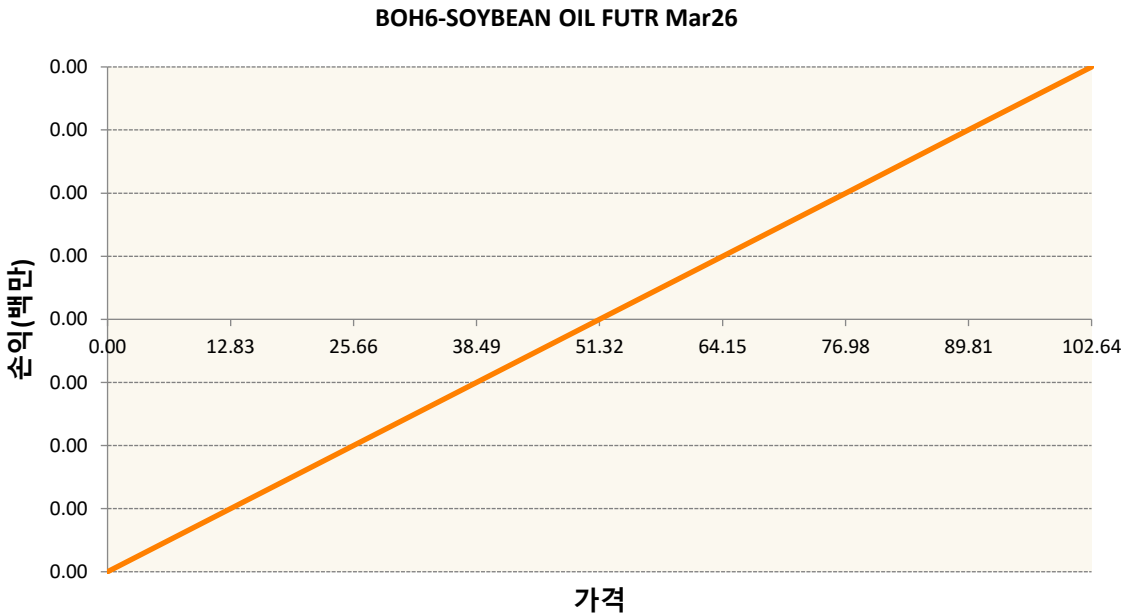
포커스농산물모(채권-파생형)

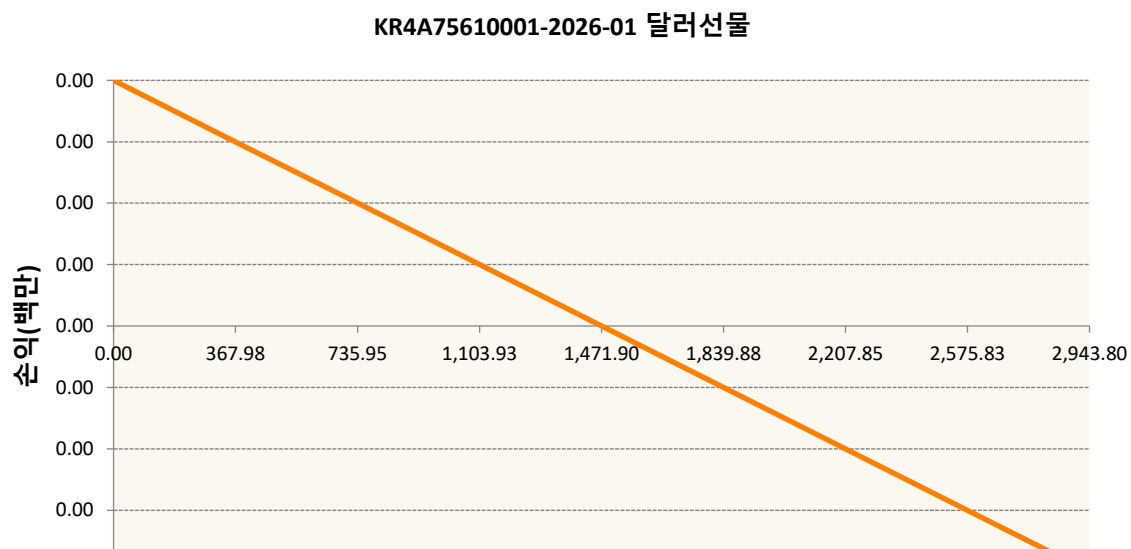
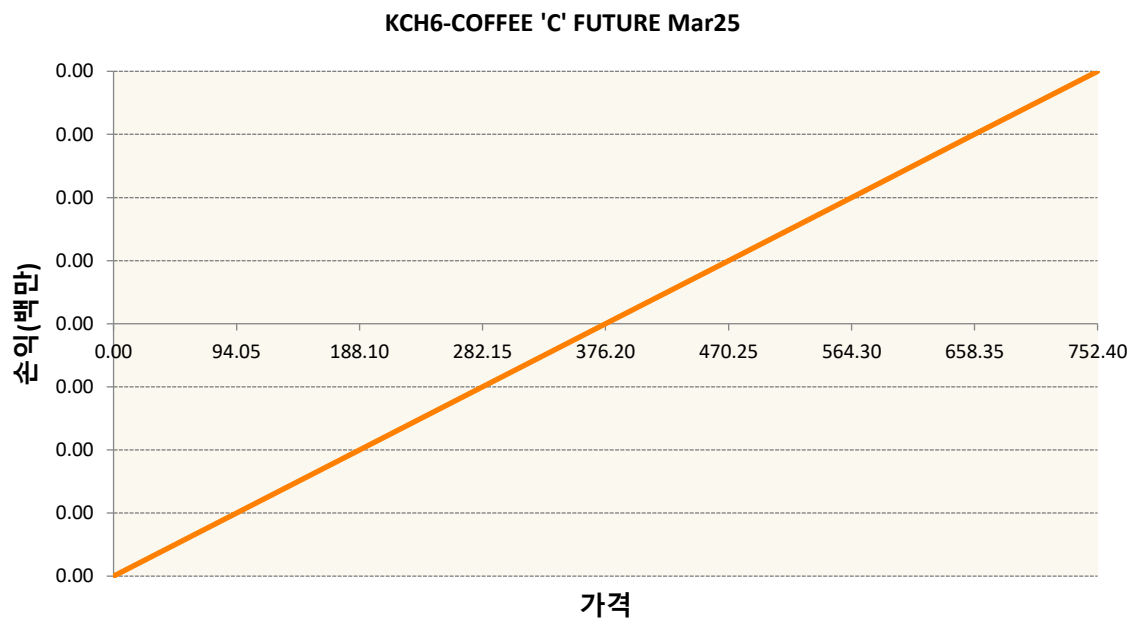
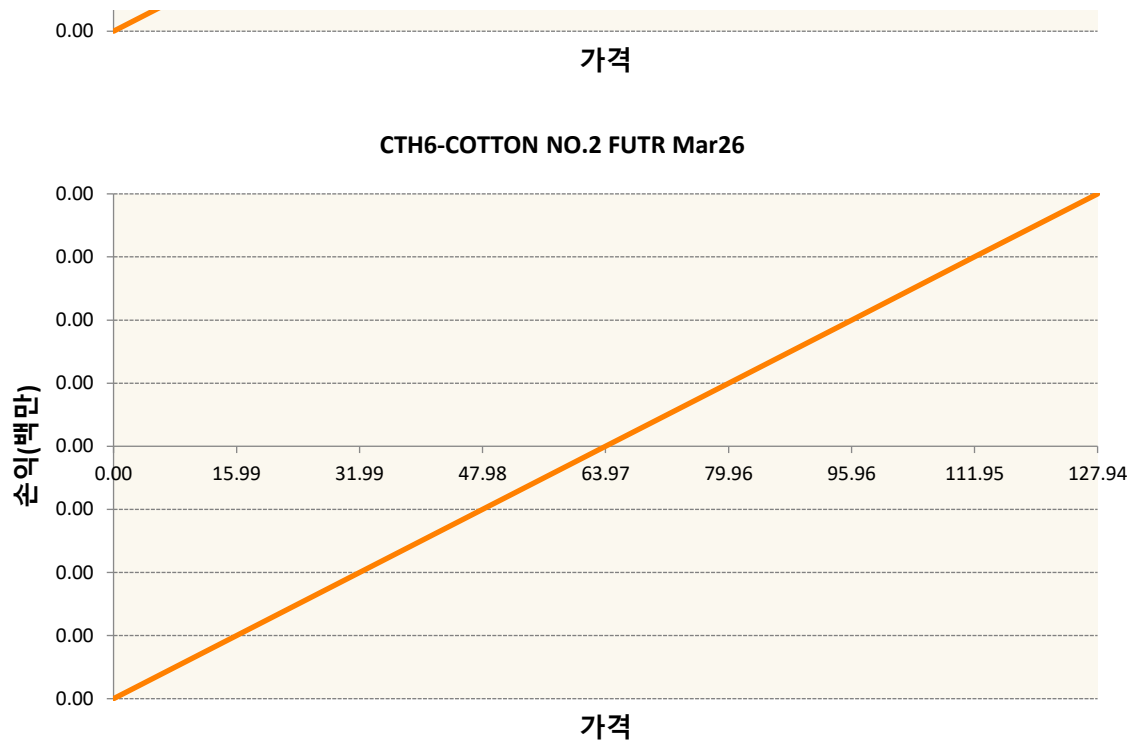
1. 계약금액

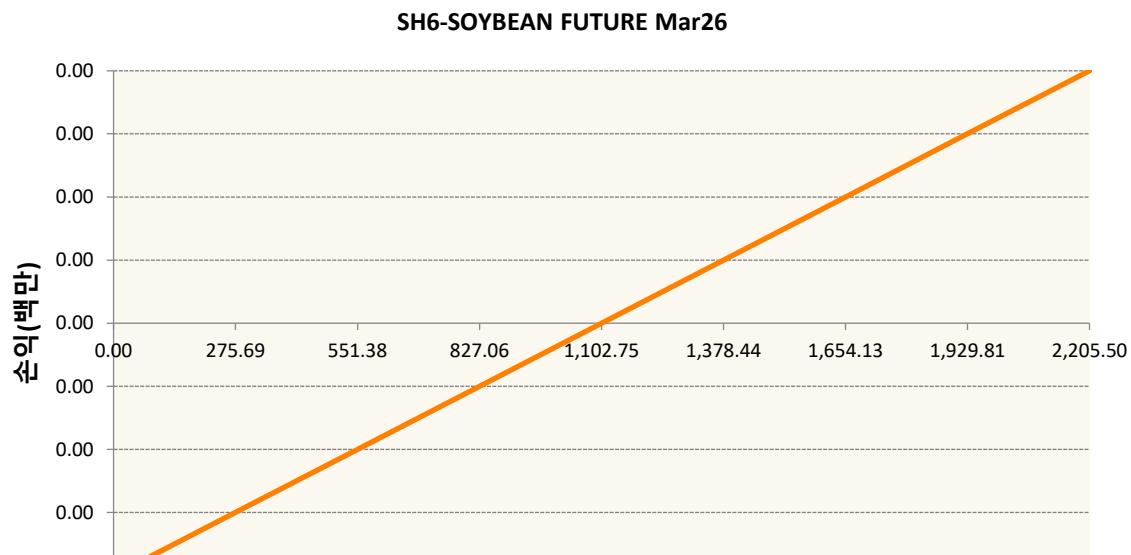
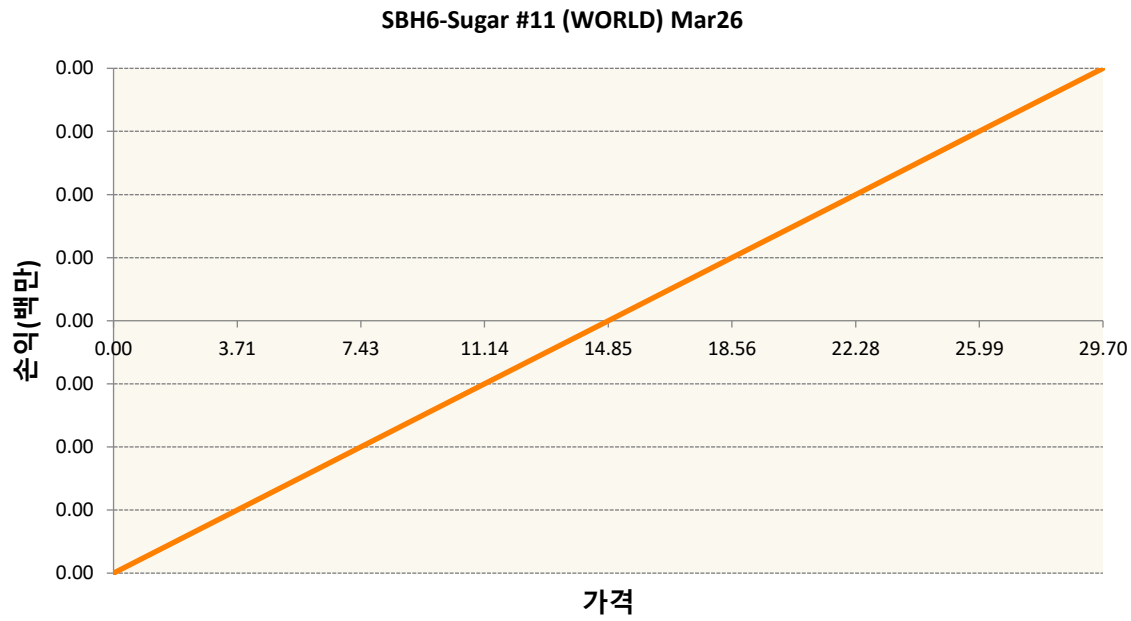
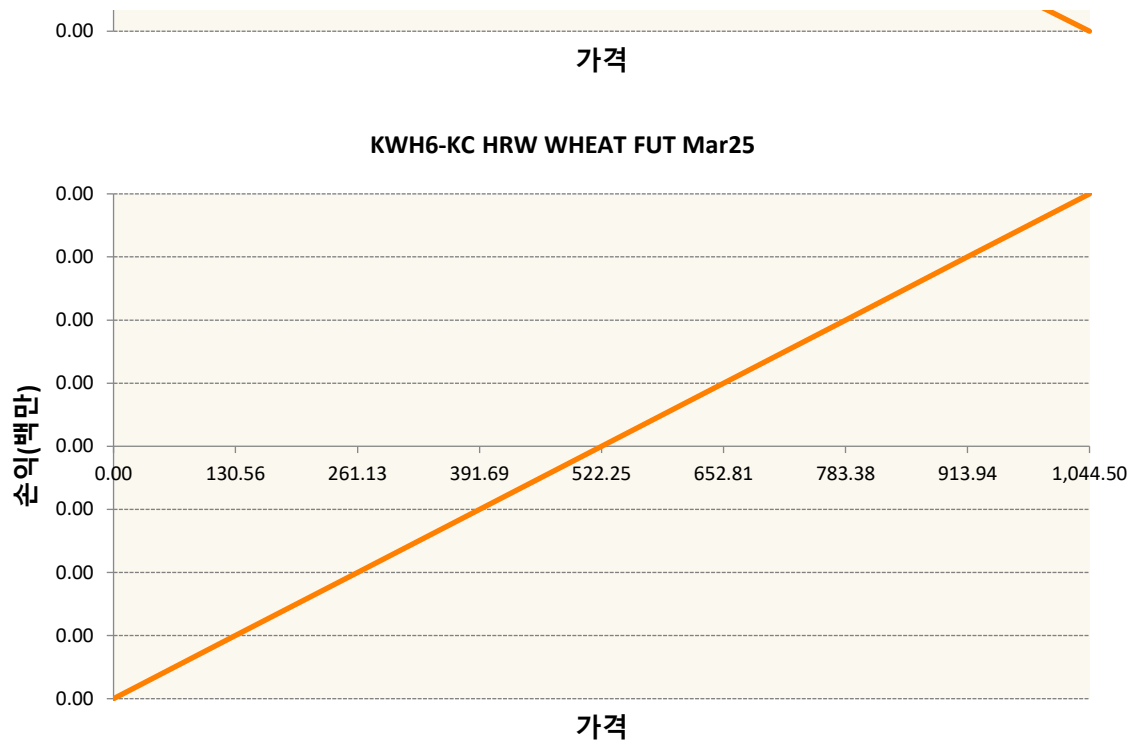
(단위:USD 백만)

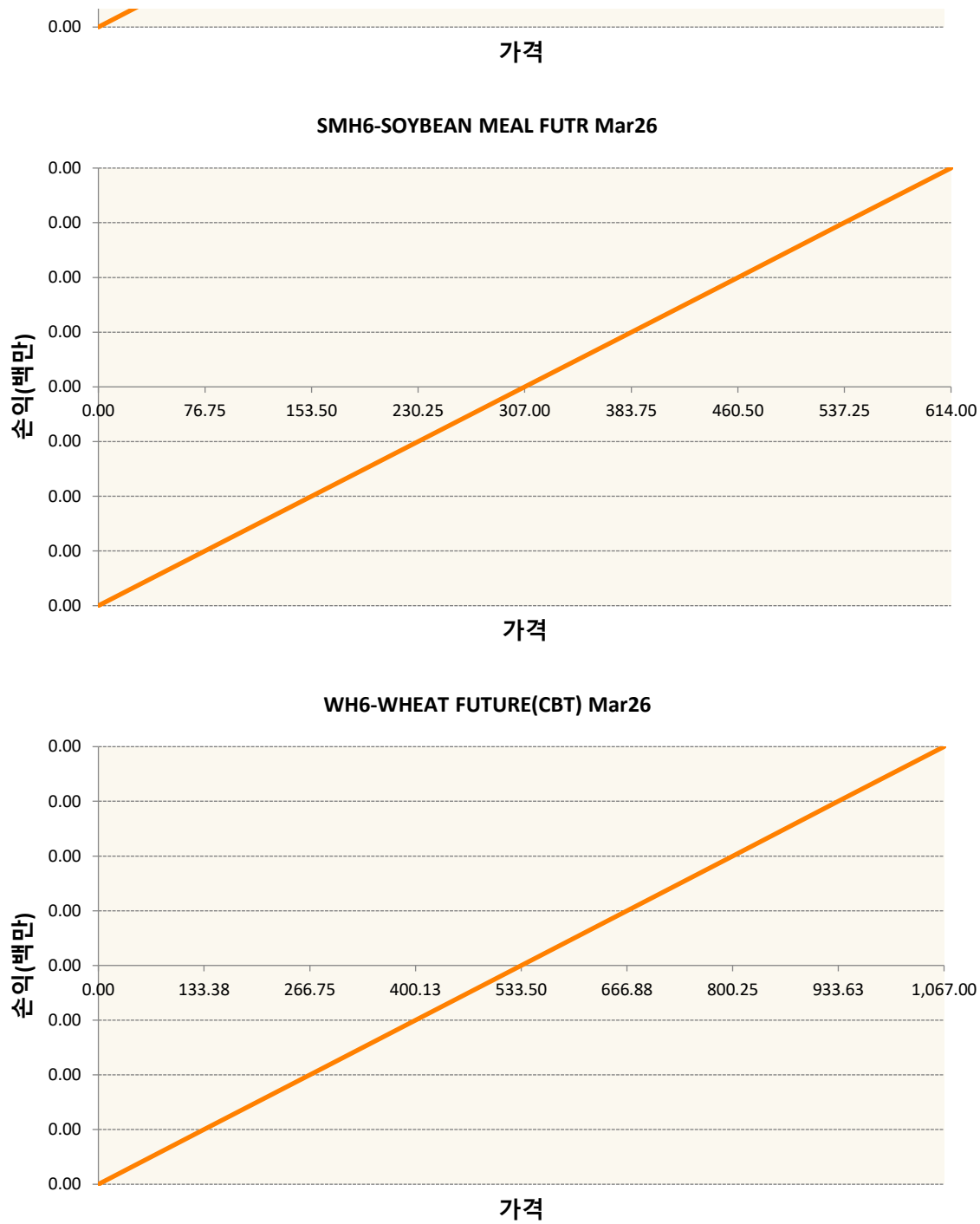
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	453	0	453	
누계	유가증권	선물	2,836	0	2,836	
누계	통화	선물	0	442	-442	장내

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	2025-12-15
기준일	2025-12-12

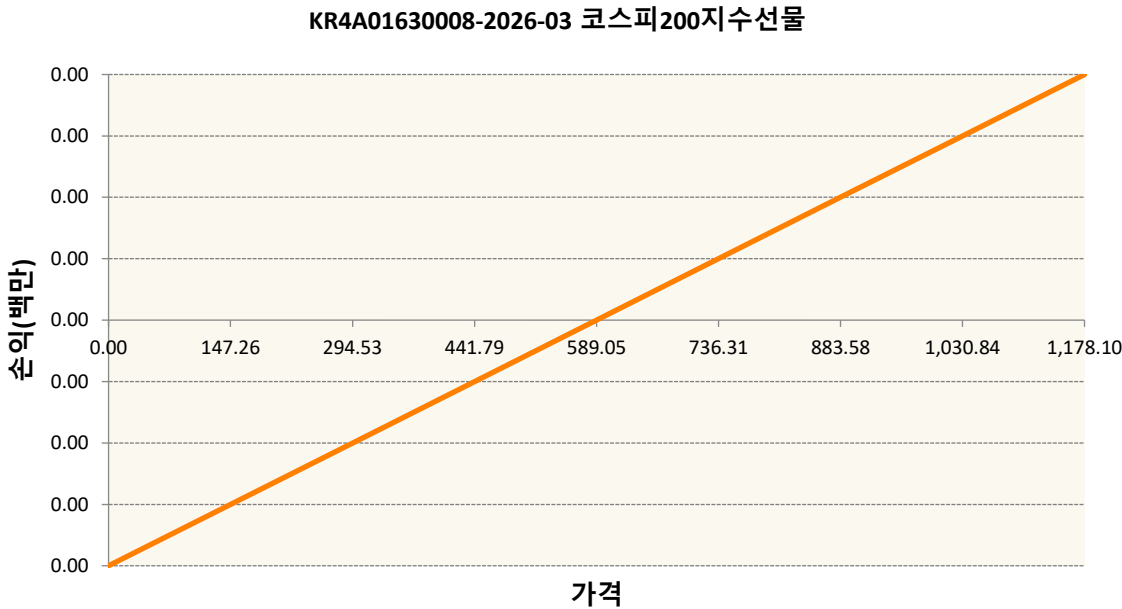
스마트인덱스모

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	1,473	0	1,473	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물	118
-------------------------------	-----

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

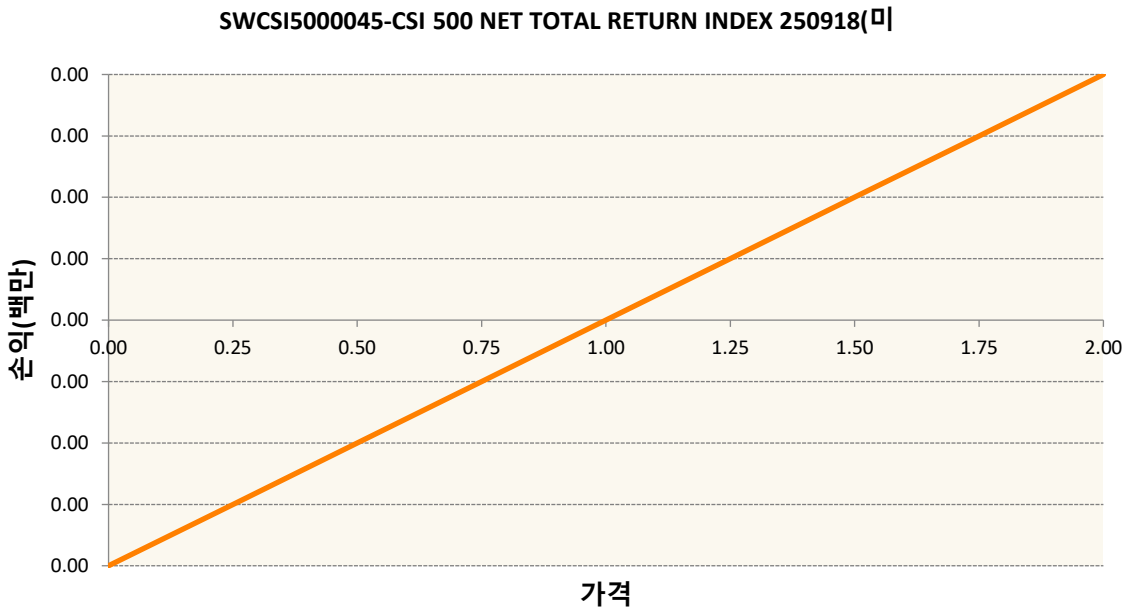
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,700	0	4,700	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

374

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

458

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

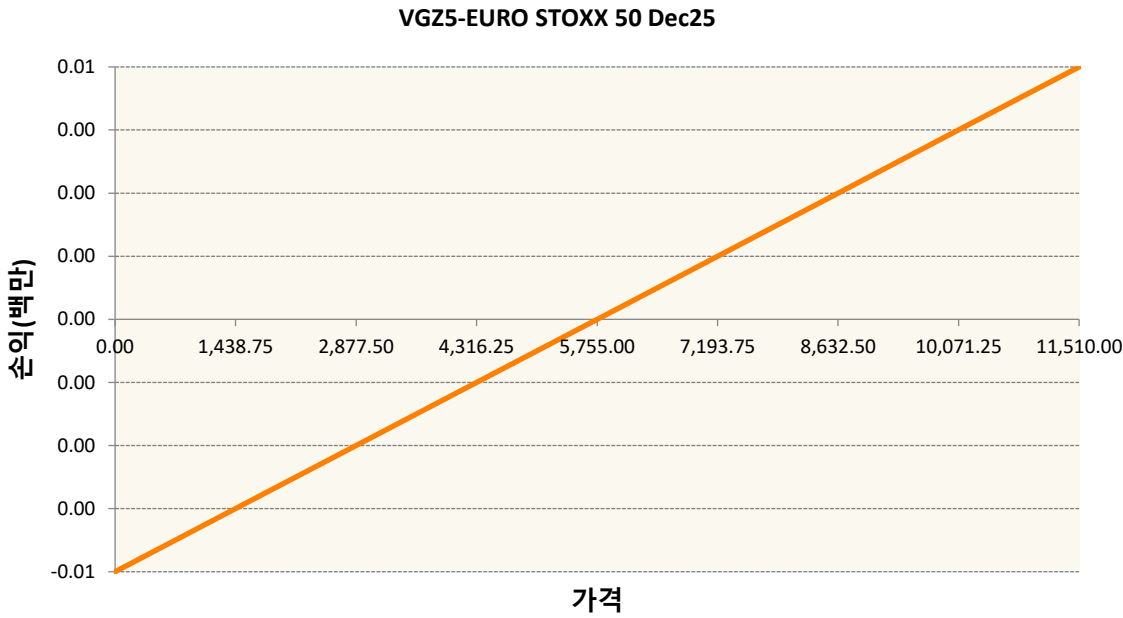
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	757	0	757	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ5	EURO STOXX 50 Dec25	61
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

50

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

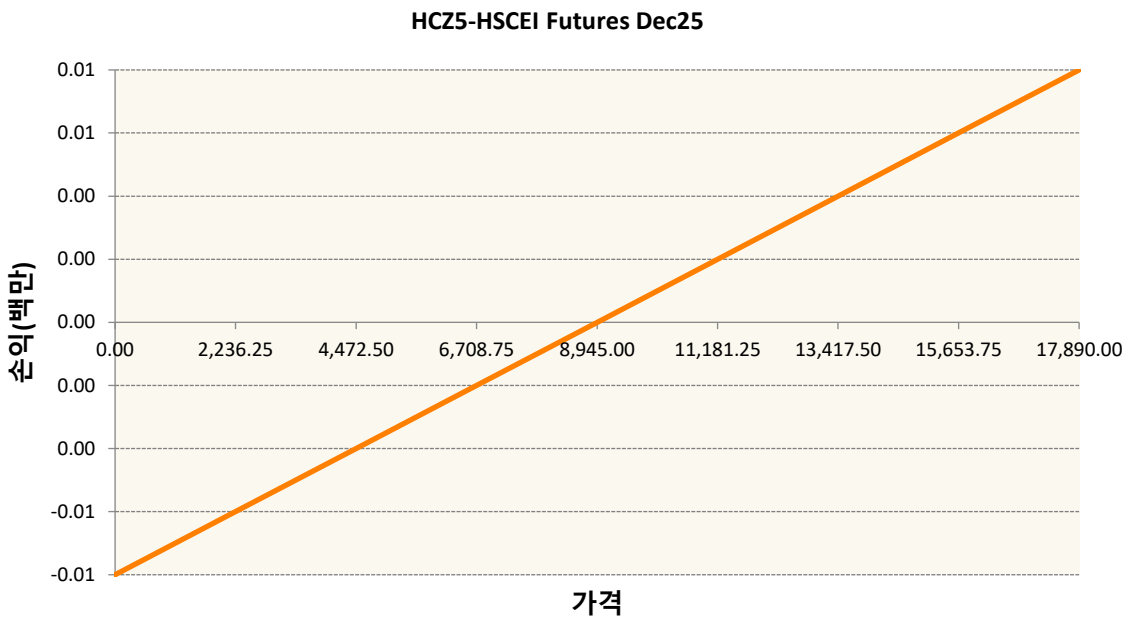
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,864	0	1,864	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ5	HSCEI Futures Dec25	149
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

193

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

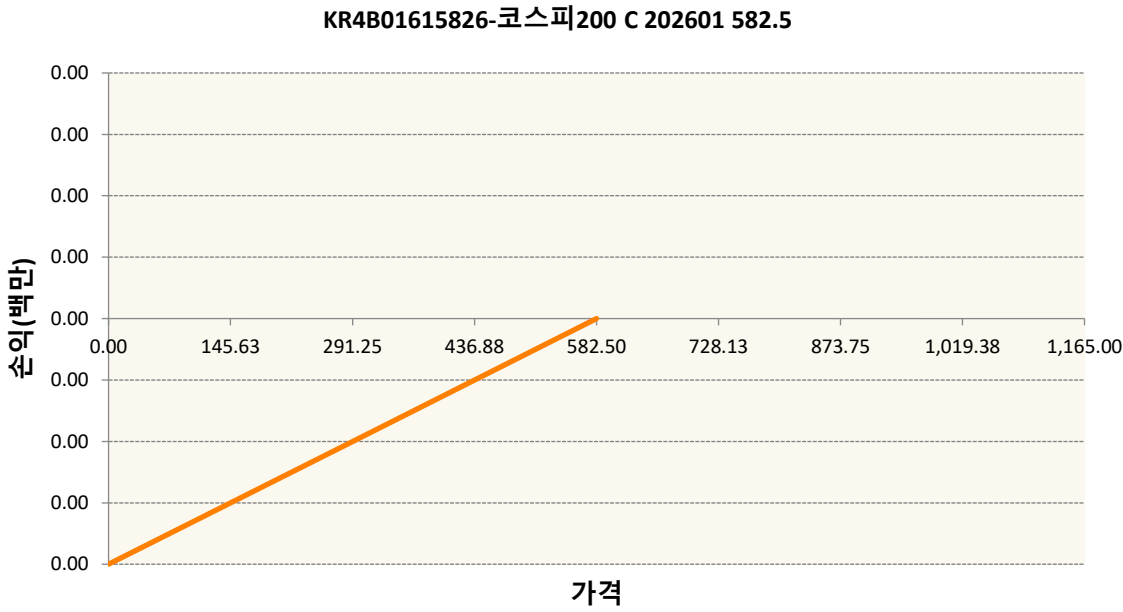
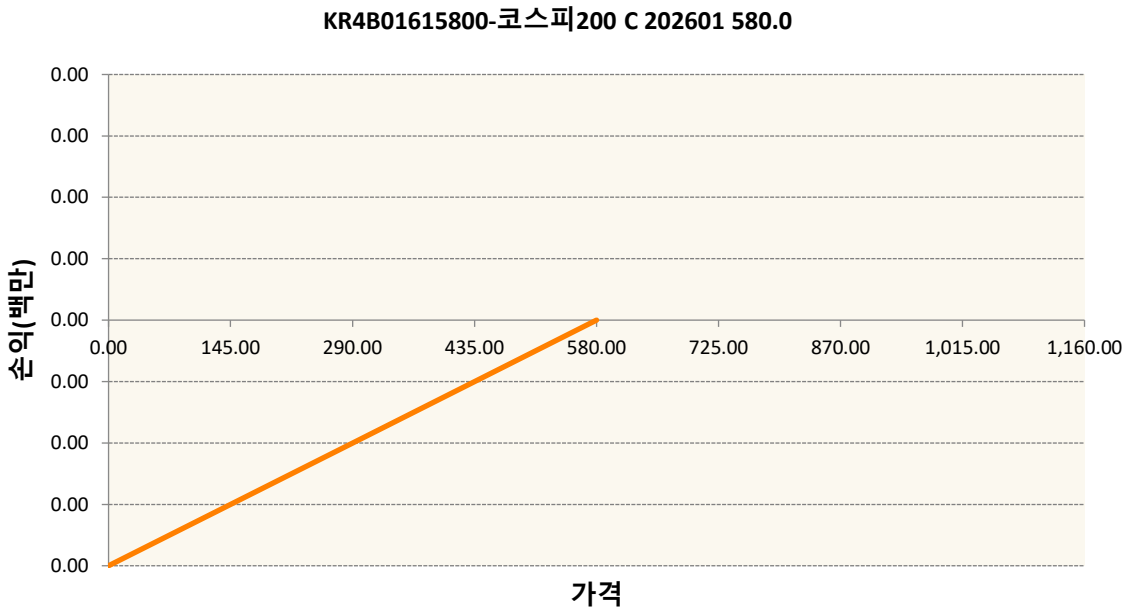
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

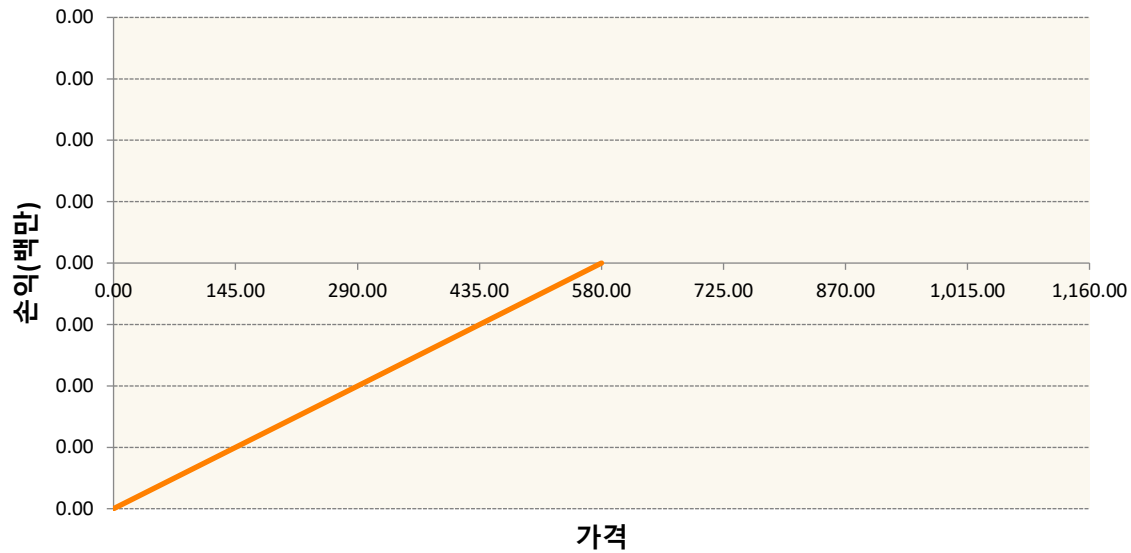
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	35,957	-35,957	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,954	-34,954	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01615809-코스피200 P 202601 580.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016158 코스피200 C 202601 580.0

2,100

KR4B016158 코스피200 C 202601 582.5

175

KR4C016158 코스피200 P 202601 580.0

522

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-12-15

기준일 2025-12-12

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	2025-12-15
기준일	2025-12-12

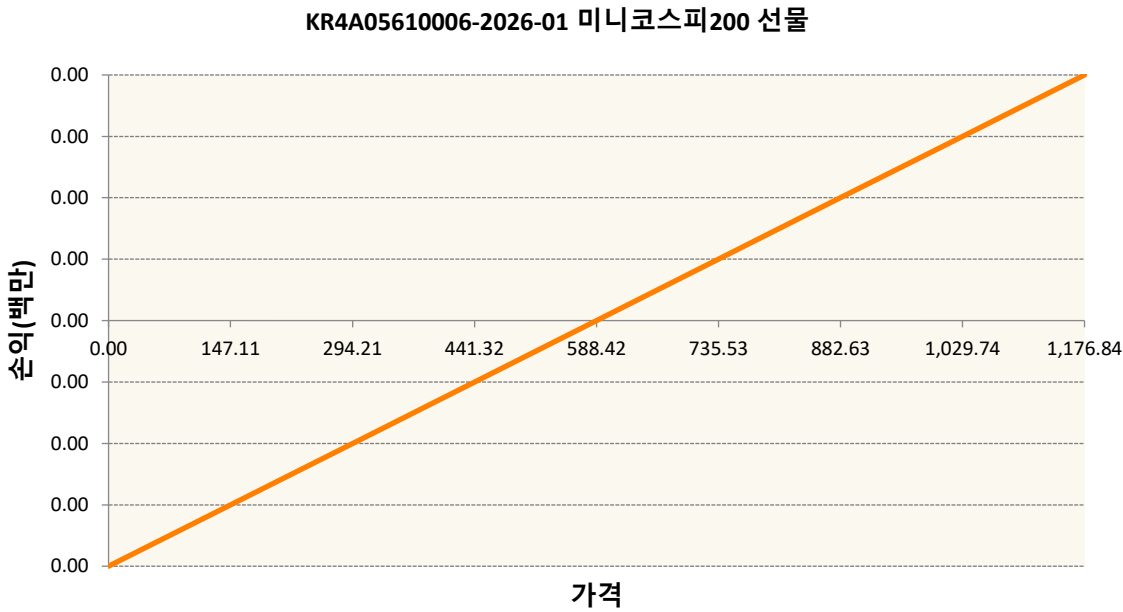
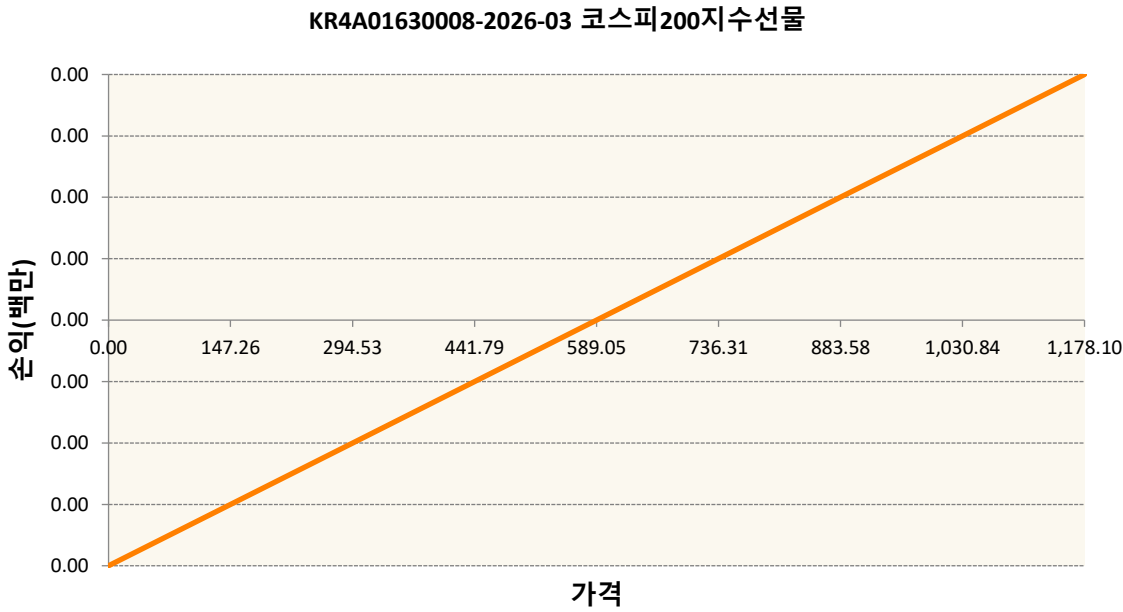
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,177	0	1,177	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		47
KR4A056100 2026-01 미니코스피200 선물		9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	0

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

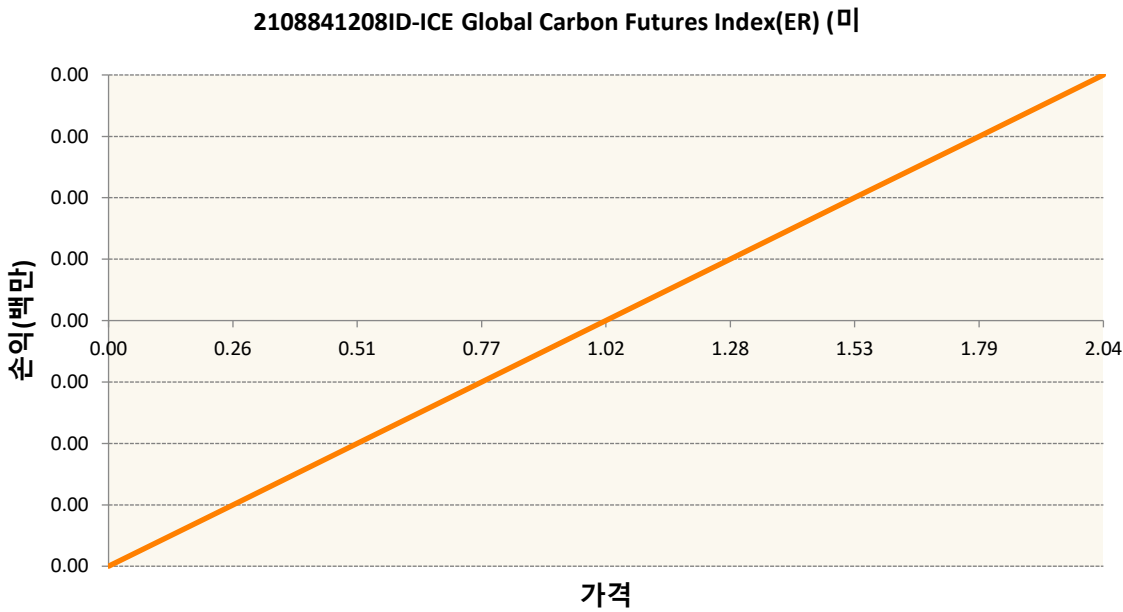
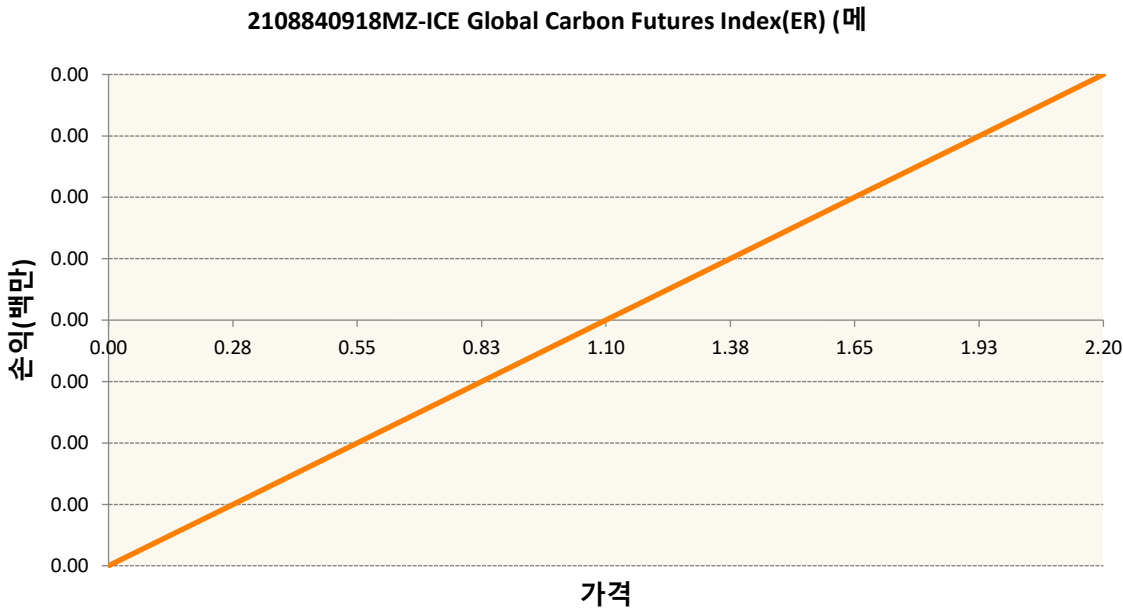
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,440	0	7,440	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		120
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		478

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		574

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

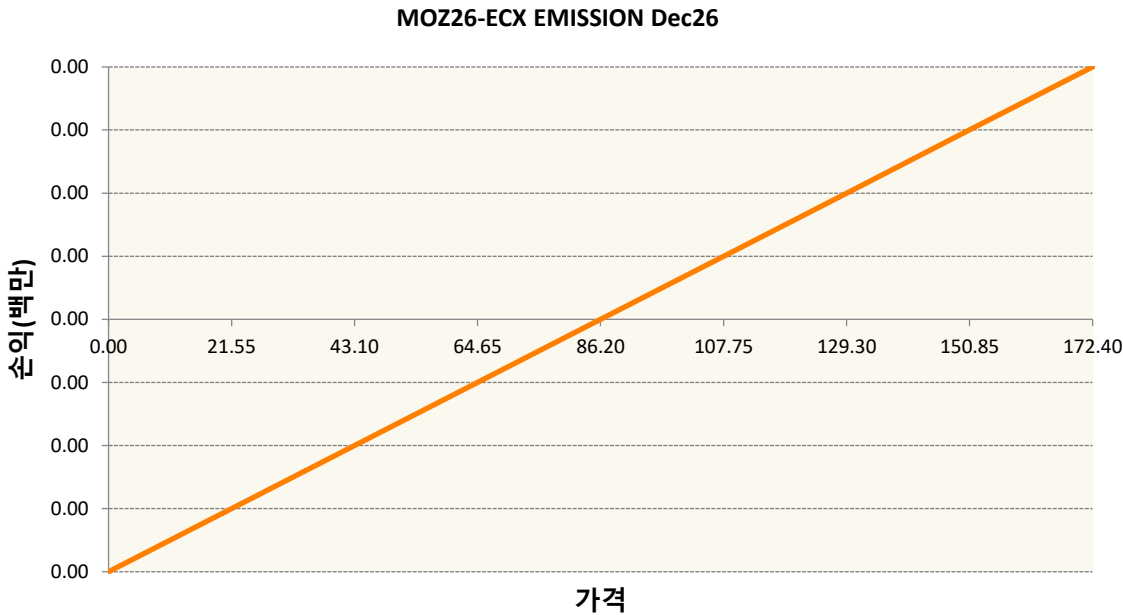
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			5,721	0	5,721	
누계	통화	선도	0	2,867	-2,867	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213FBTC KRW/EUR 23-12-25E	229
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	458

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

(단위:백만원)

741

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

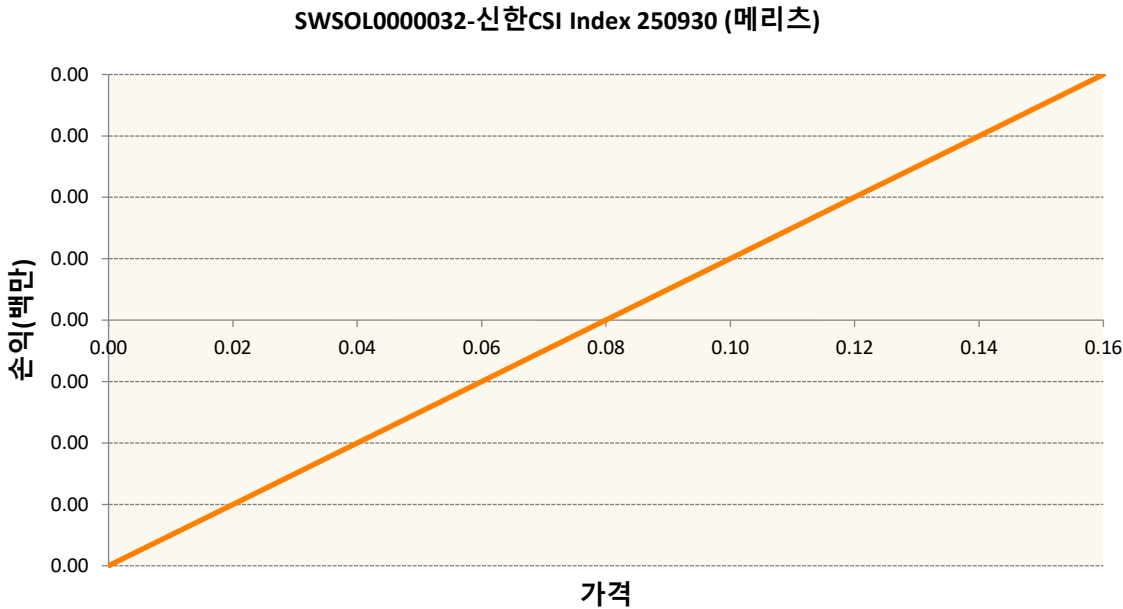
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,697	0	2,697	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	10
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	6
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	7
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	16

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

(단위:백만원)

69

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

SOL차이나육성산업엑티브상장지

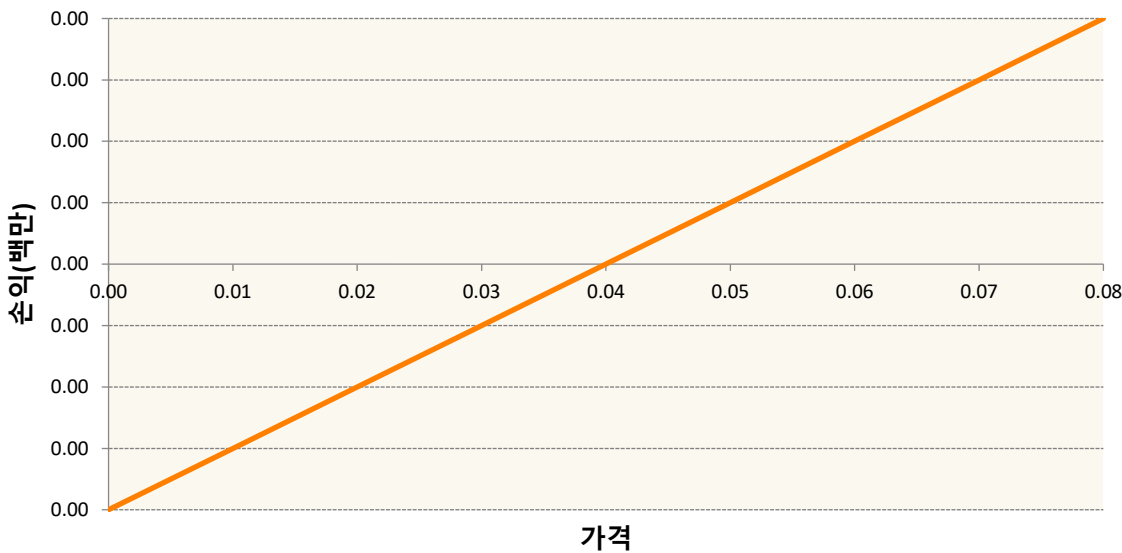
1. 계약금액

(단위:백만원)

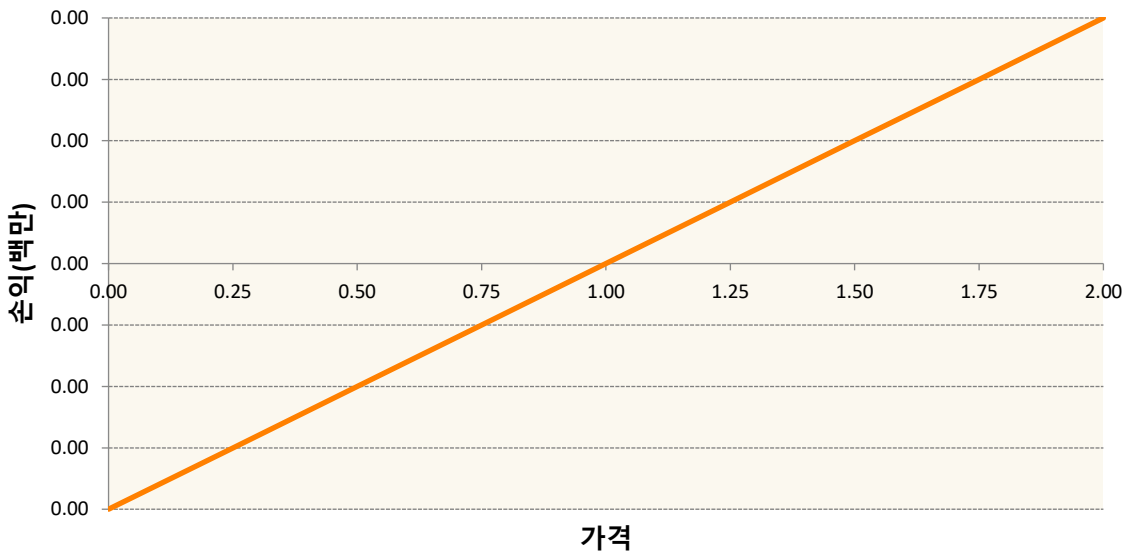
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,714	0	3,714	장외

2. 만기시점의 손익구조

SWSTAR000023-STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)



SWSTAR000025-STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 241219(NH)		10
SWSTAR000(신한 STAR 50 Index 231226(키움)		3
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠)		35
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)		2
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠)		24

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		134

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

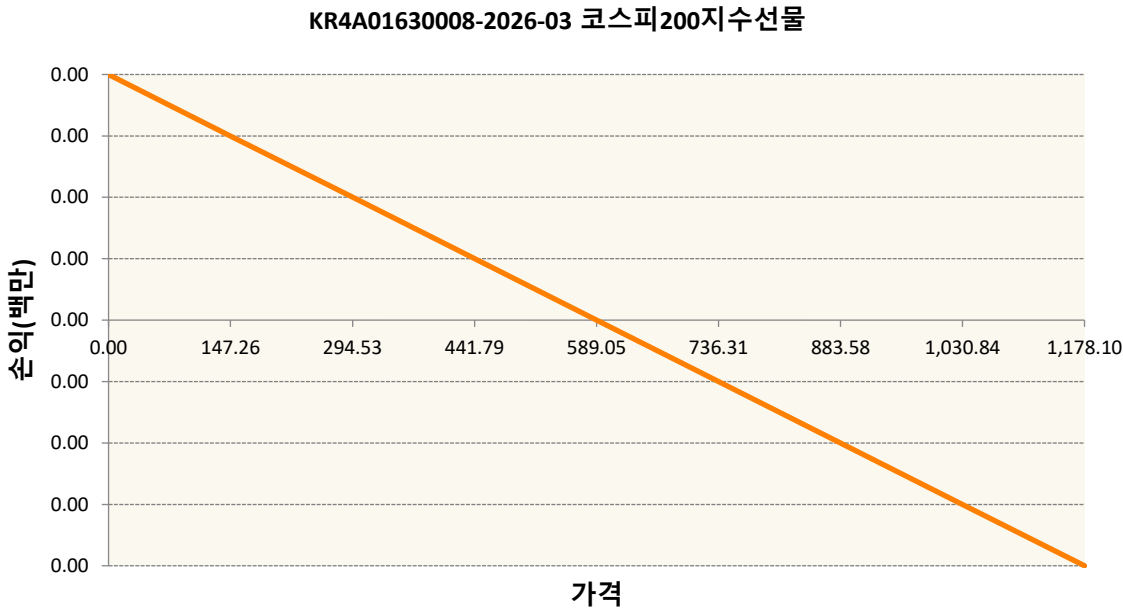
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	0	147	-147	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01630008			2026-03 코스피200지수선물				12
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	4	4	4	4	4	4	4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

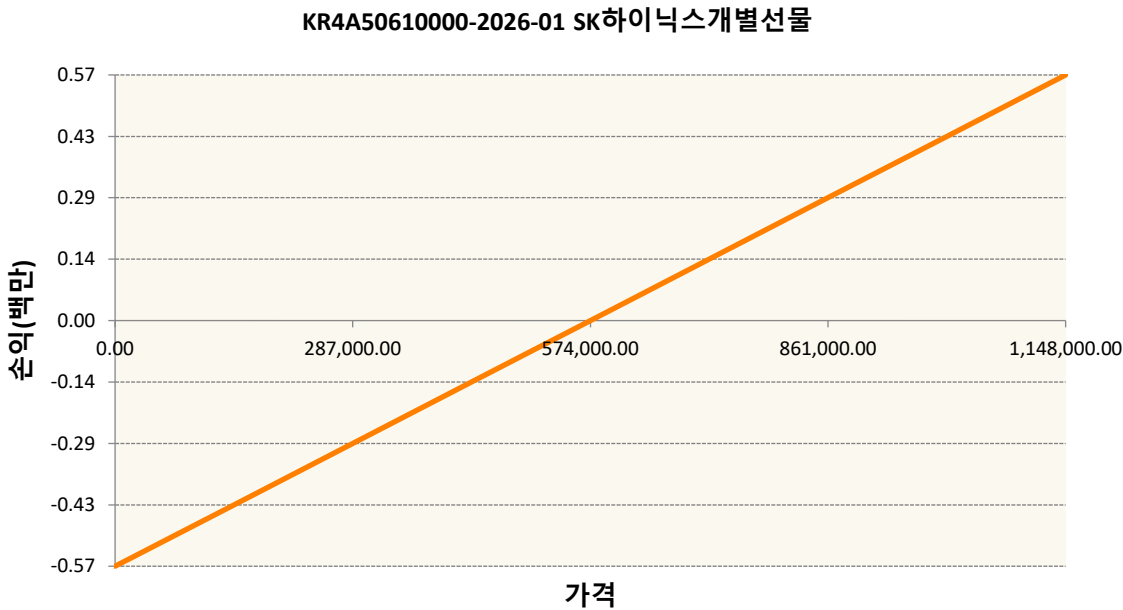
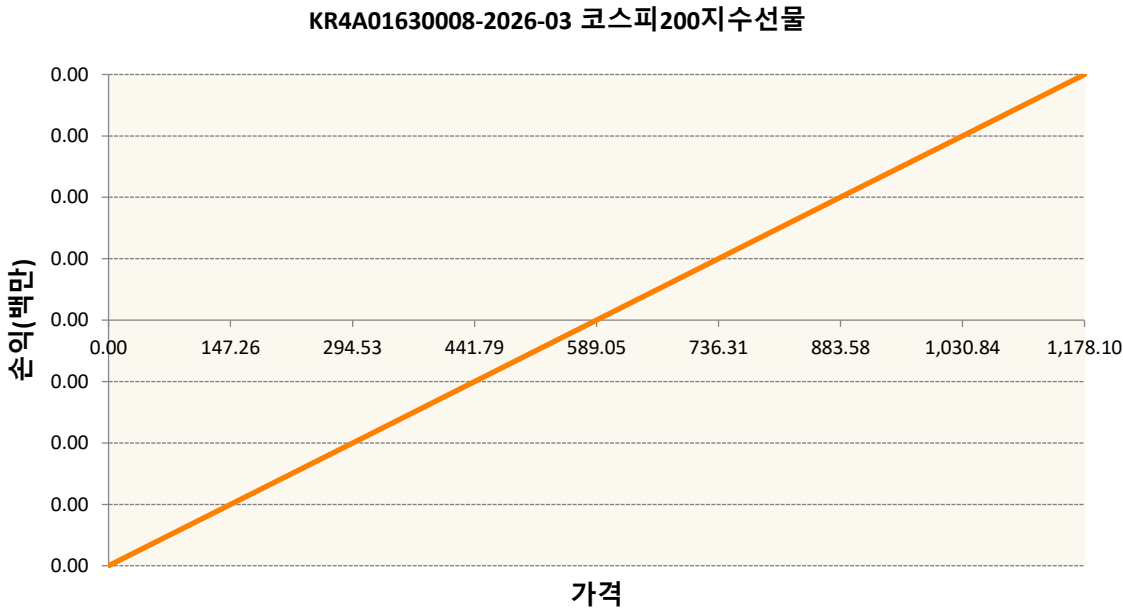
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

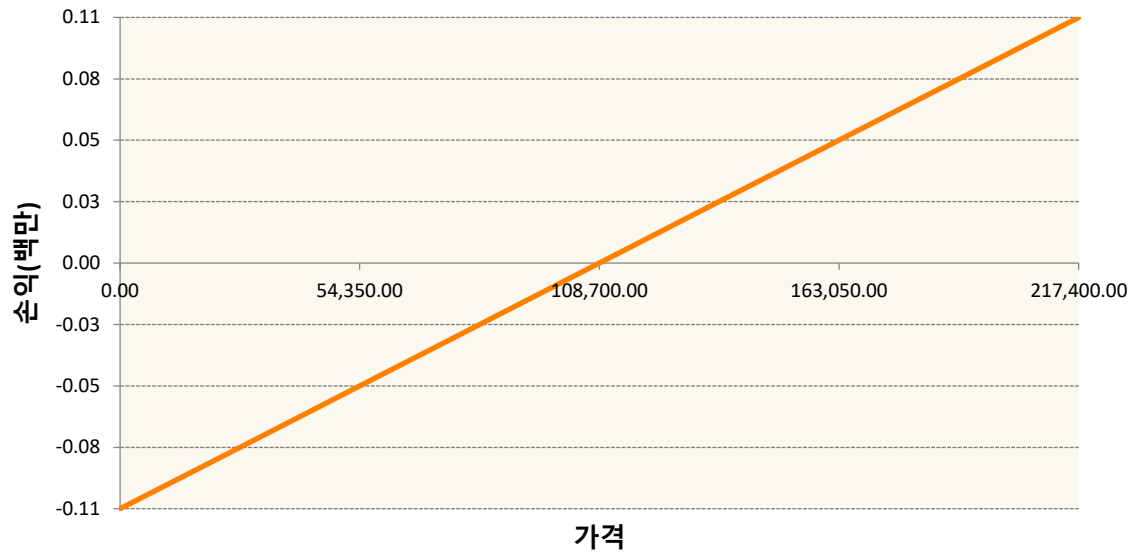
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,031	-1,031	장내
누계	유가증권	선물	9,298	0	9,298	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4AEJ610004-2026-01 SKC개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01630008 2026-03 코스피200지수선물								717
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-717	-717	-717	-717	-717	-717	-717	-717
-5.33%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
-2.67%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	239	239	239	239	239	239	239	239
5.33%	478	478	478	478	478	478	478	478
8.00%	717	717	717	717	717	717	717	717
KR4A50610000 2026-01 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
KR4AEJ610004 2026-01 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	-22
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	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

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)						(단위:백만원)
						976

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

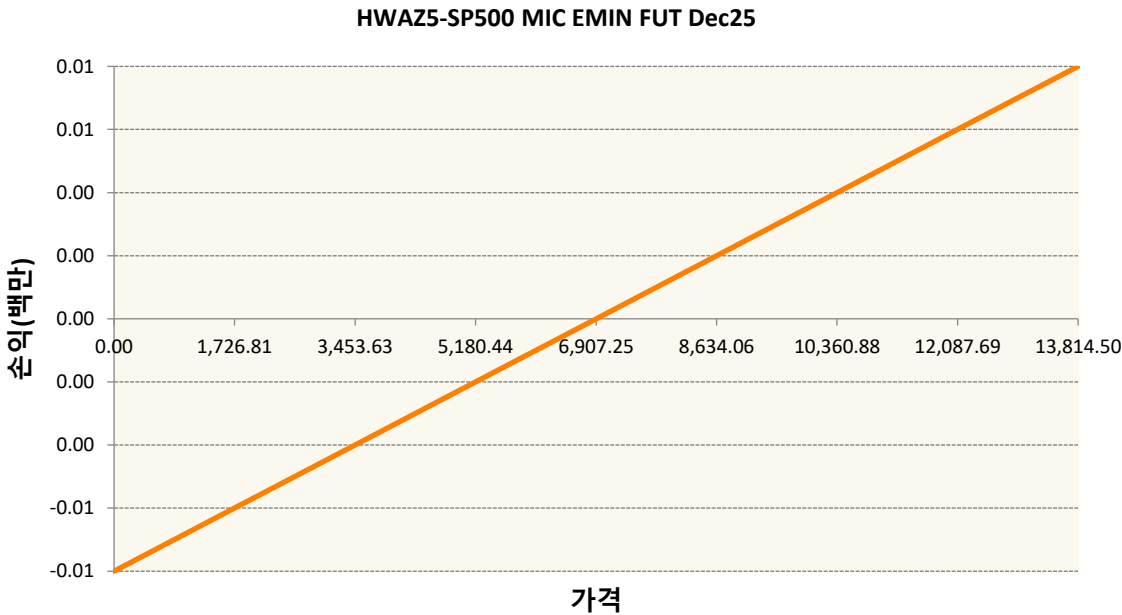
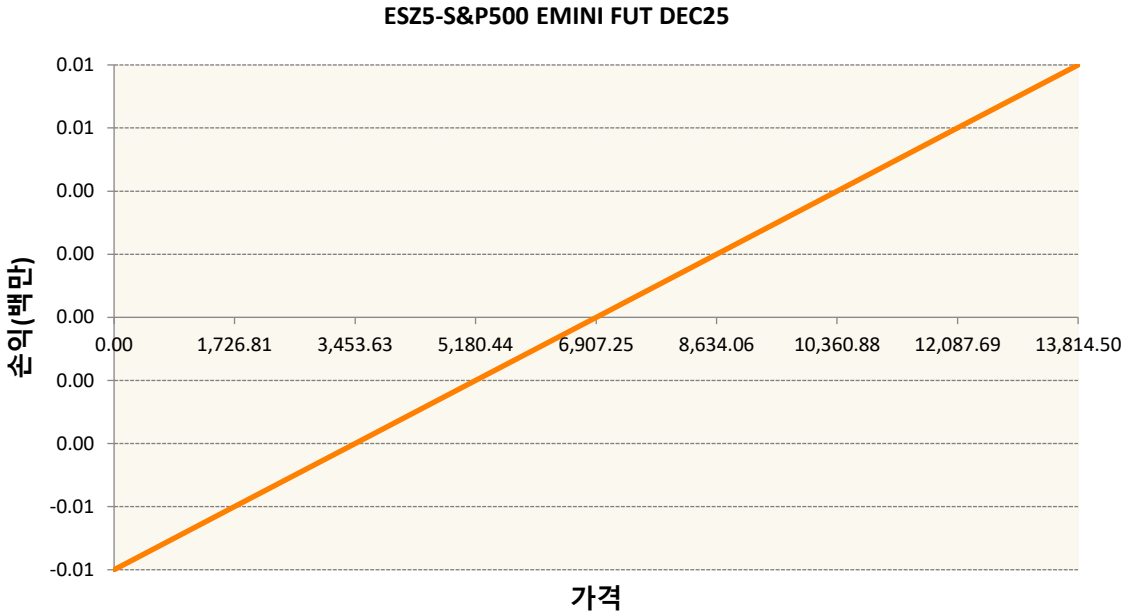
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	44,964	0	44,964	
누계	유가증권	선물	1,057	0	1,057	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ5	S&P500 EMINI FUT DEC25	3,597
HWAZ5	SP500 MIC EMIN FUT Dec25	85

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,312

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

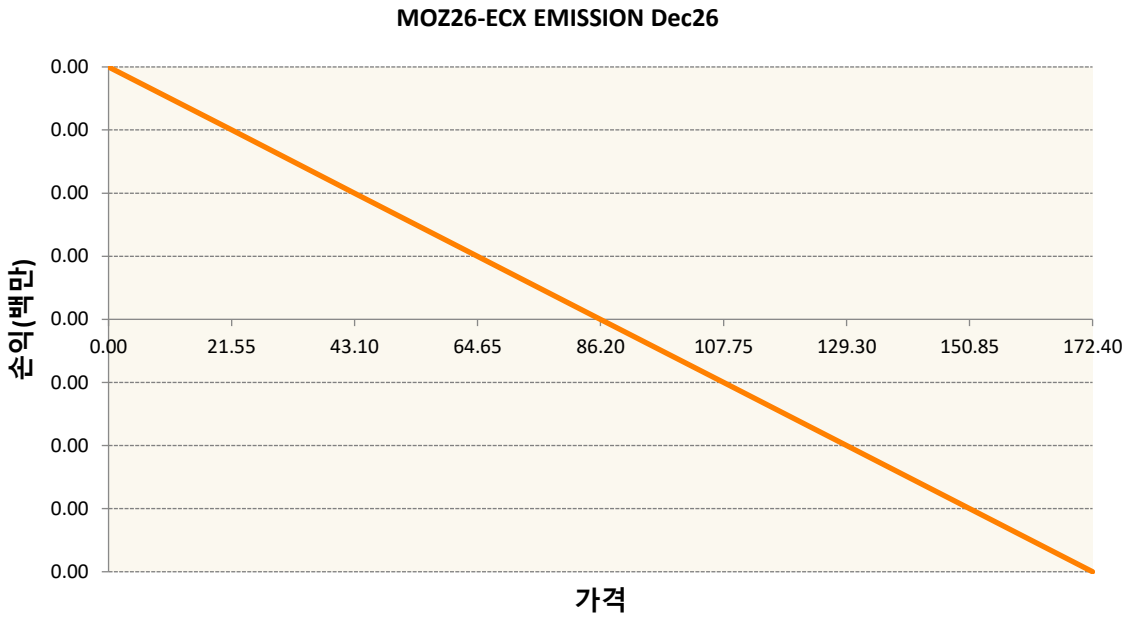
SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			0	1,775	-1,775	
누계	통화	선도	0	1,079	-1,079	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213FBTC KRW/EUR 23-12-25E	86
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	142

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

(단위:백만원)

240

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

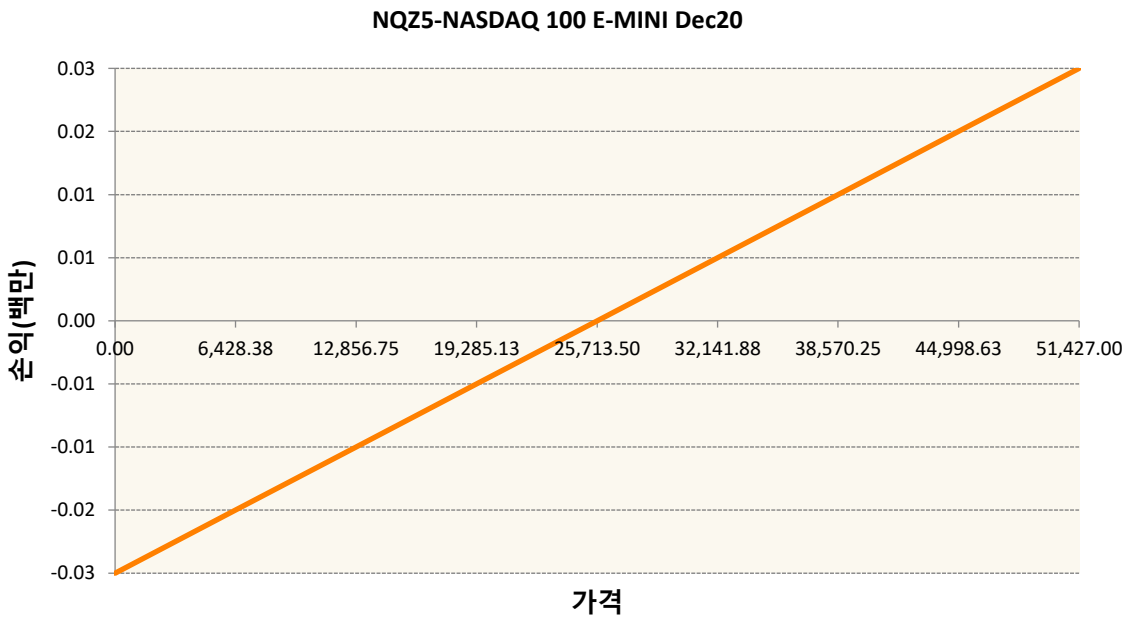
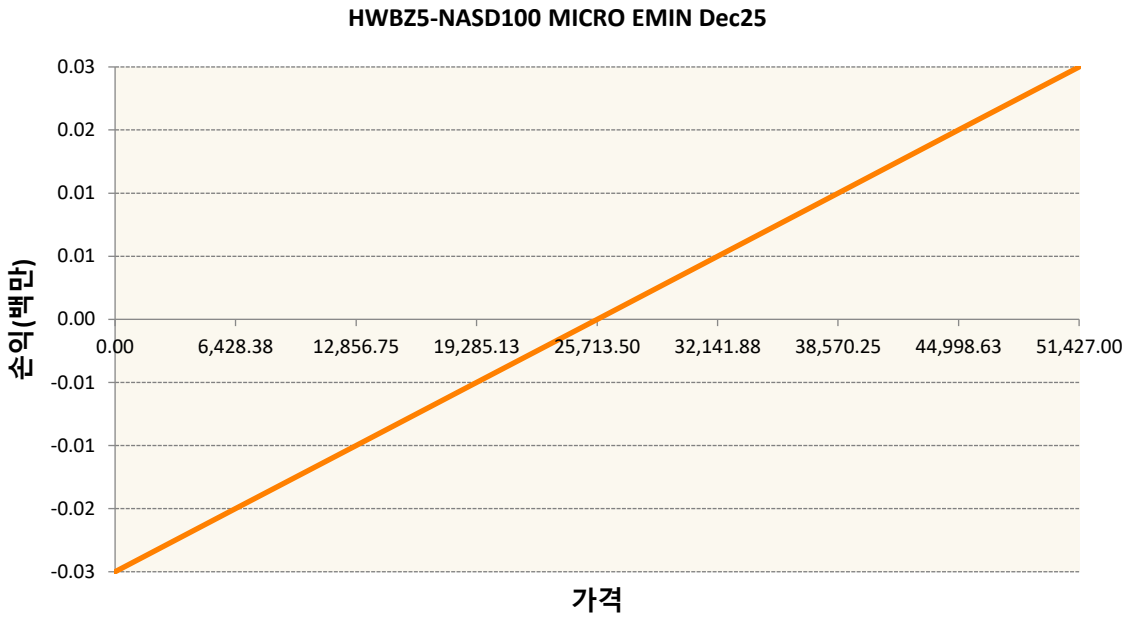
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	20,927	0	20,927	
누계	유가증권	선물	645	0	645	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ5	NASD100 MICRO EMIN Dec25	52
NQZ5	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,674

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,965

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

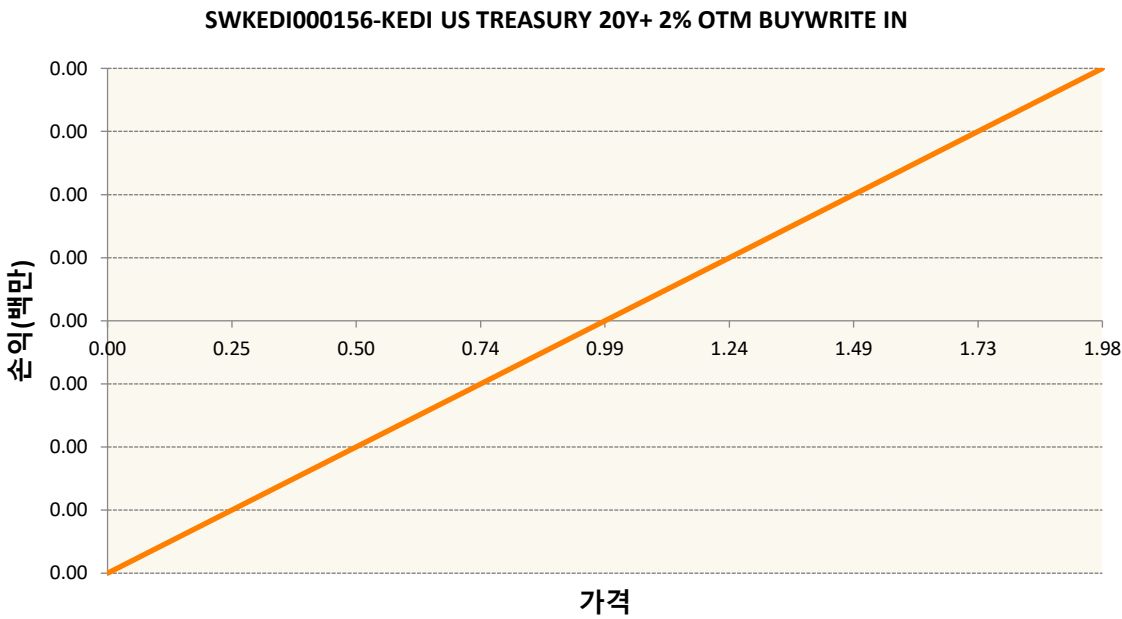
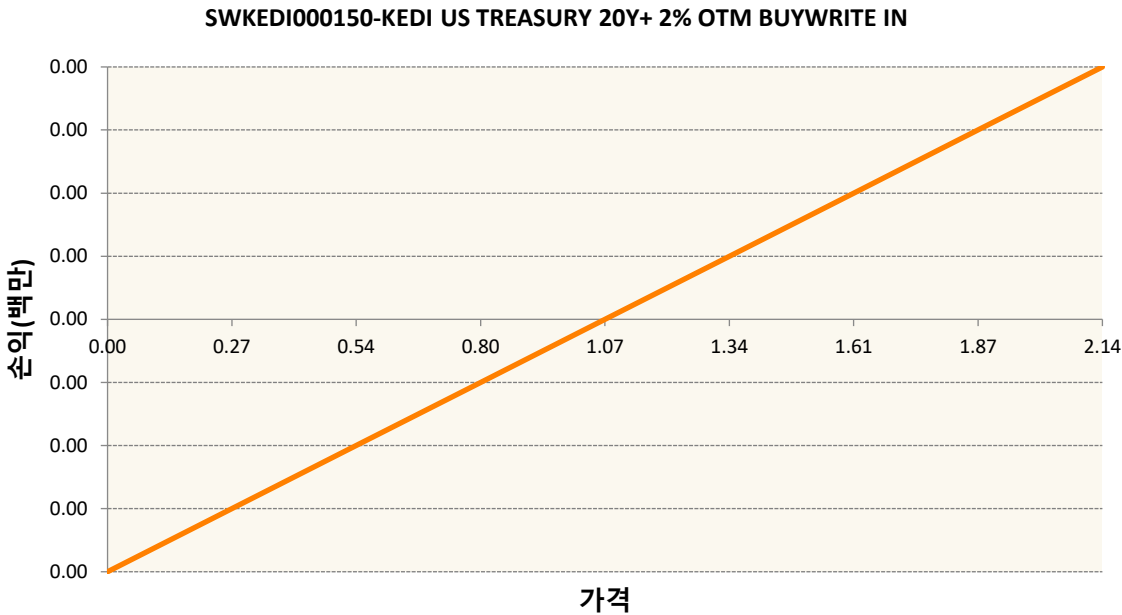
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

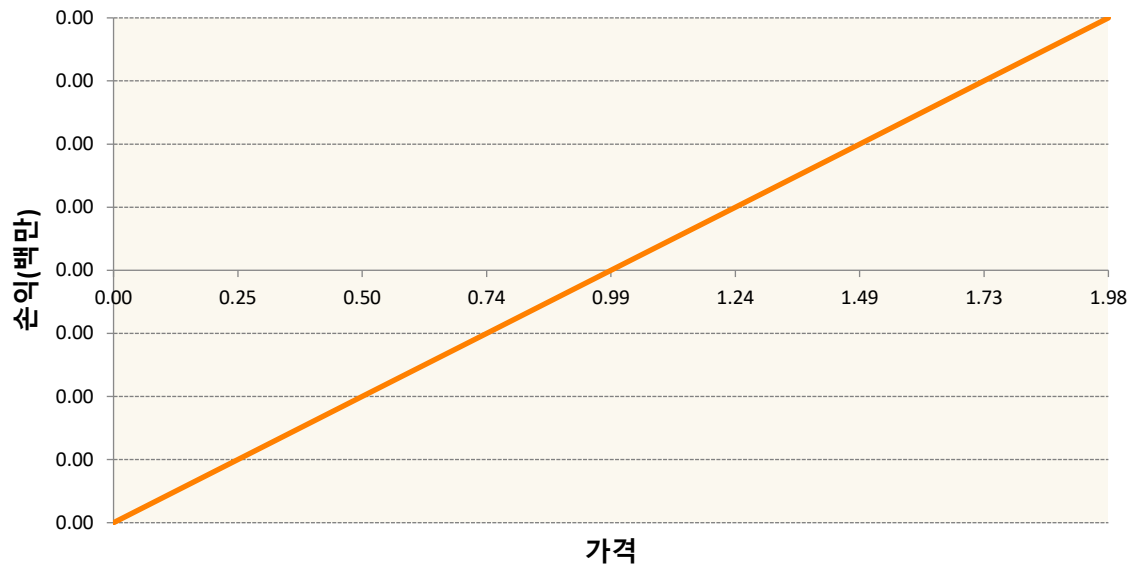
(단위:백만원)

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

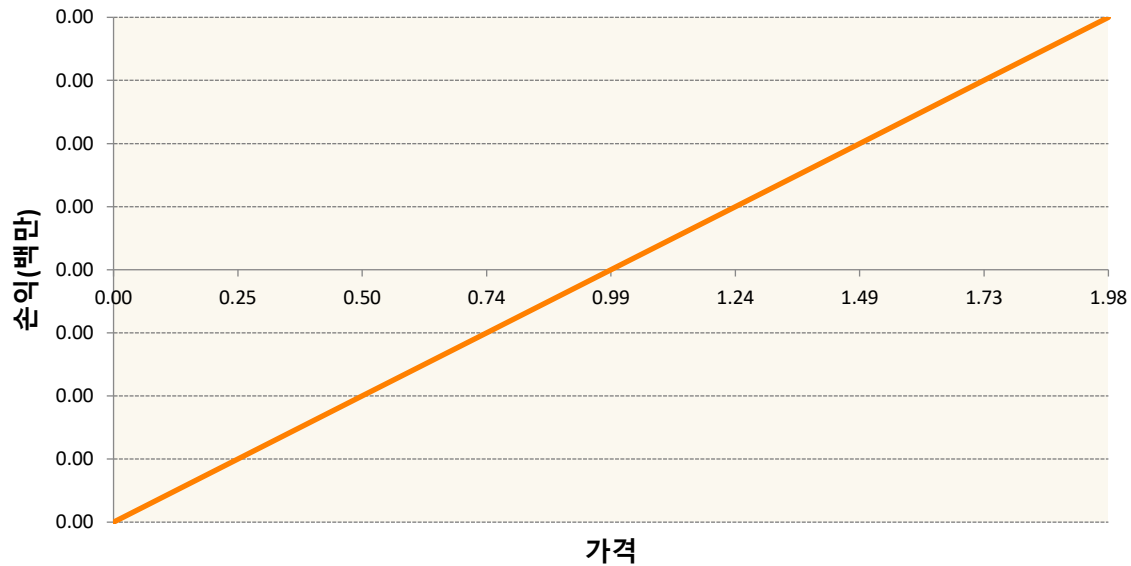
2. 만기시점의 손익구조



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	8,236
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	10,154
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,499
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,741

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

(단위:백만원)

14,006

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

62

공시일	2025-12-15
기준일	2025-12-12

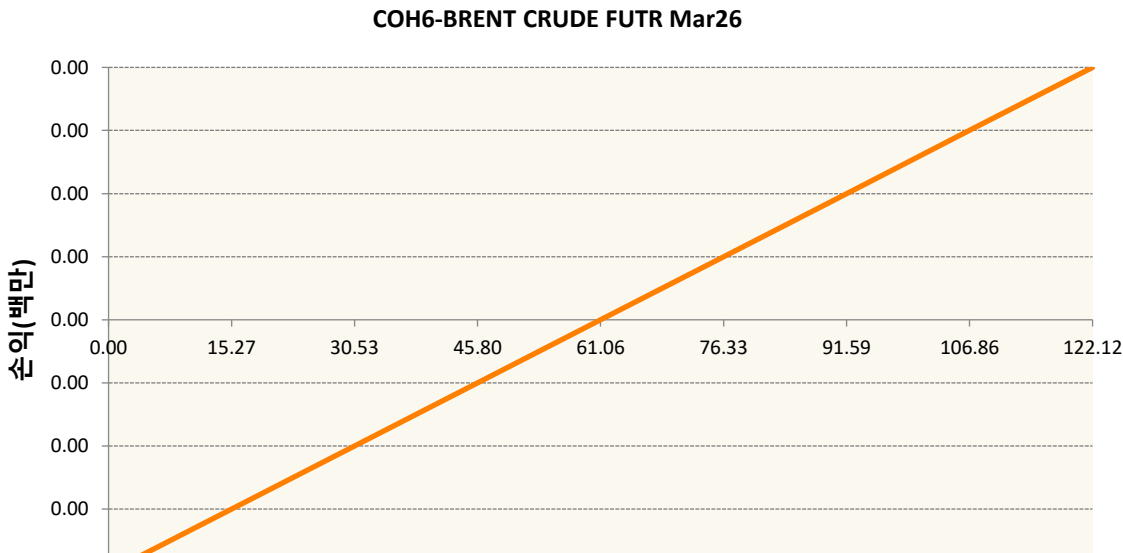
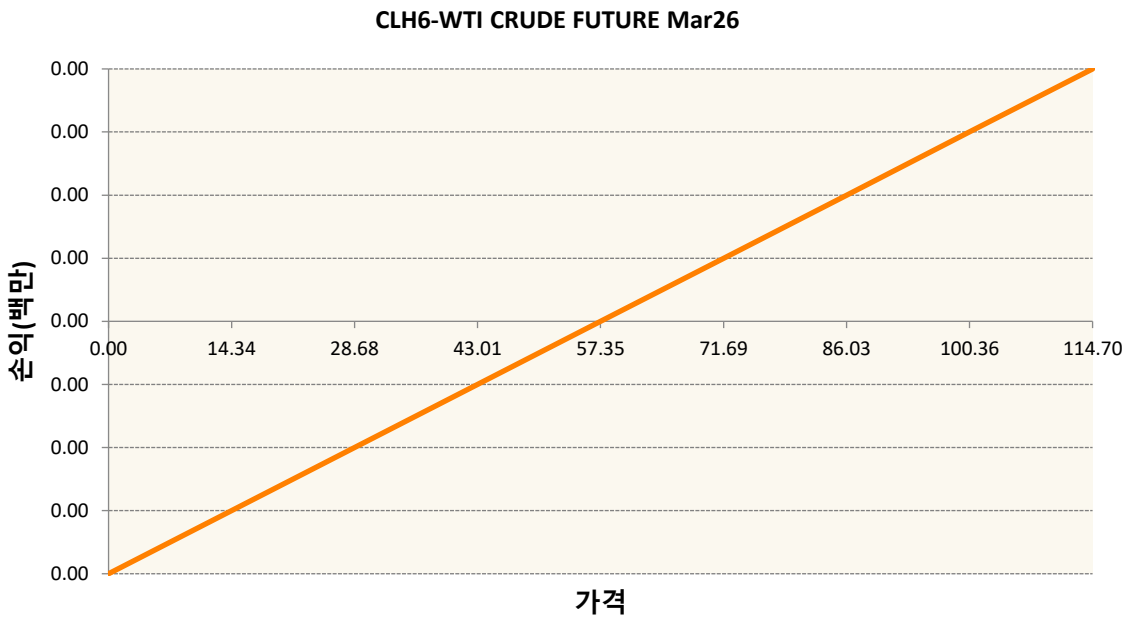
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

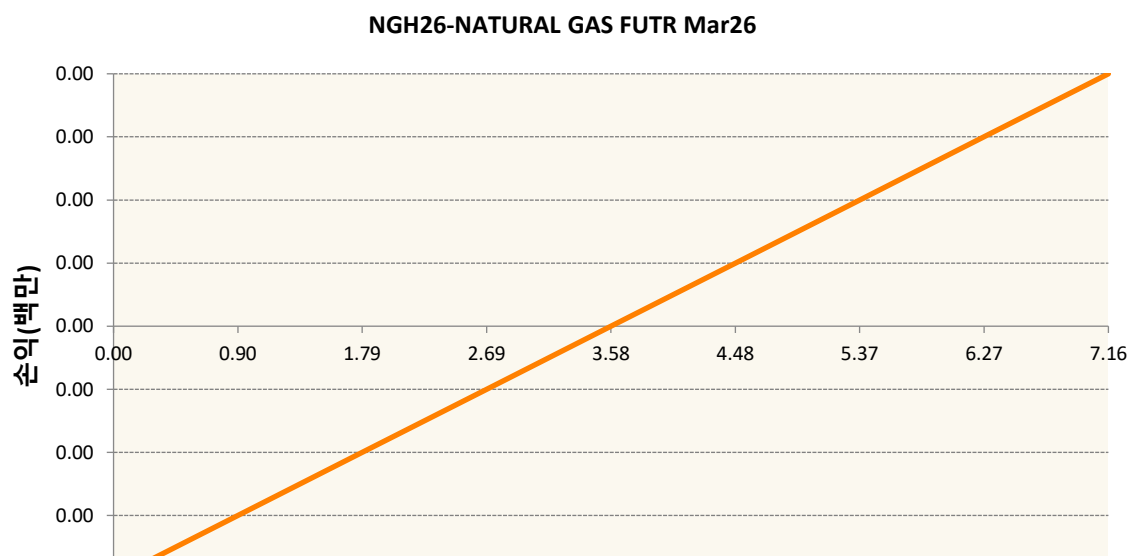
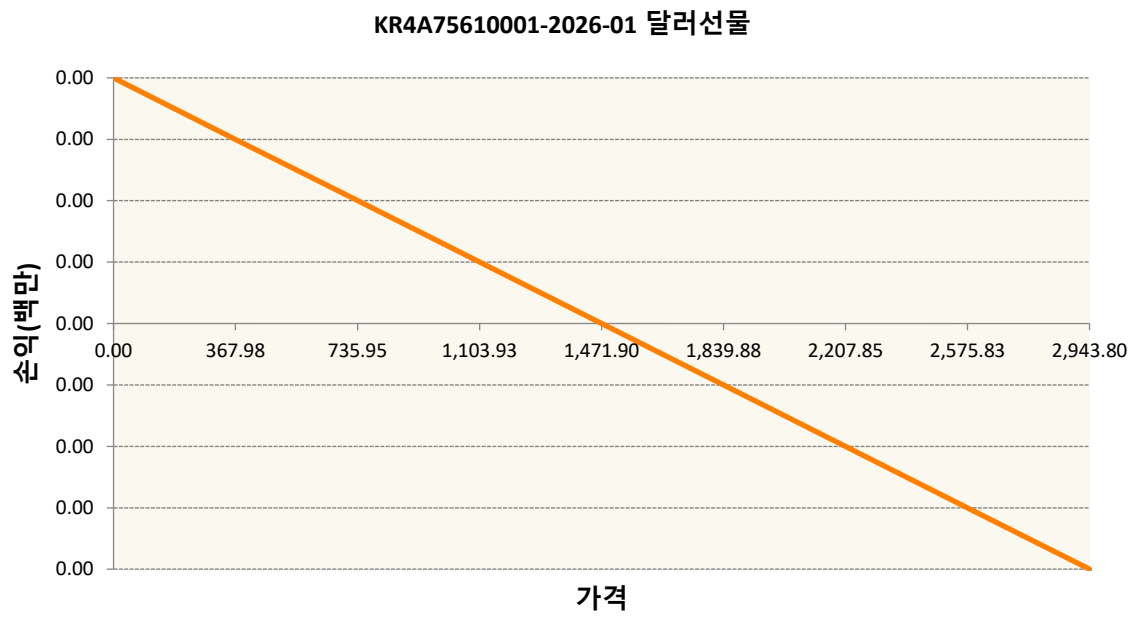
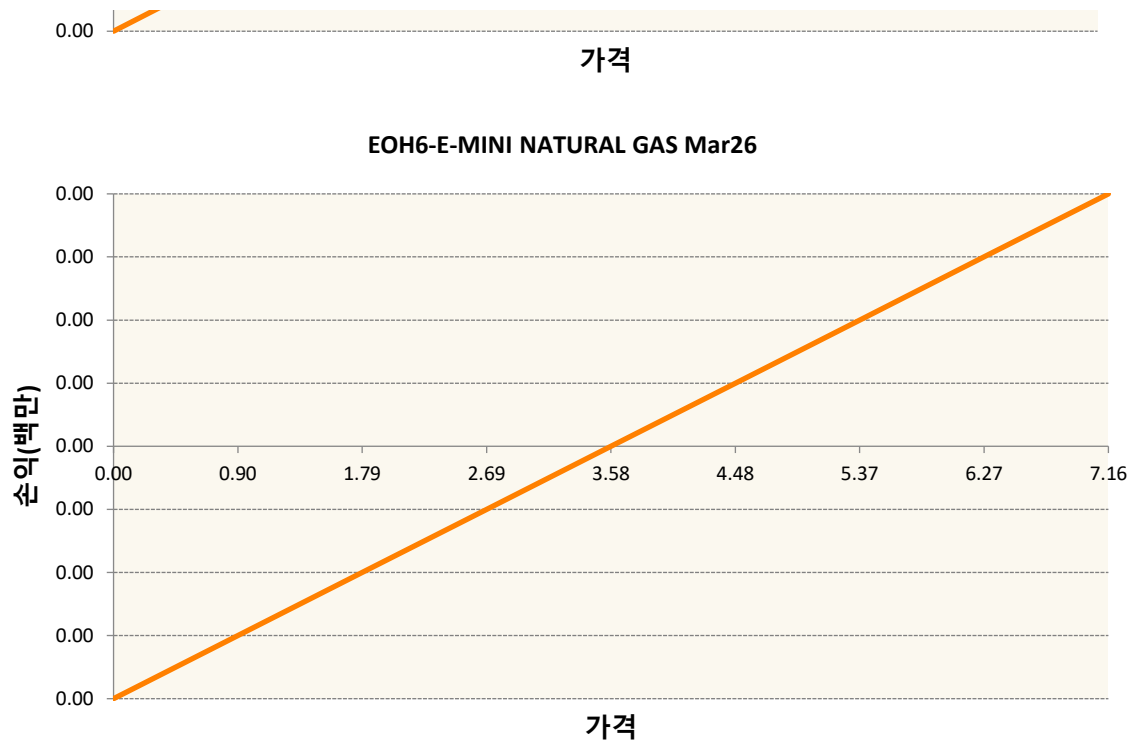
1. 계약금액

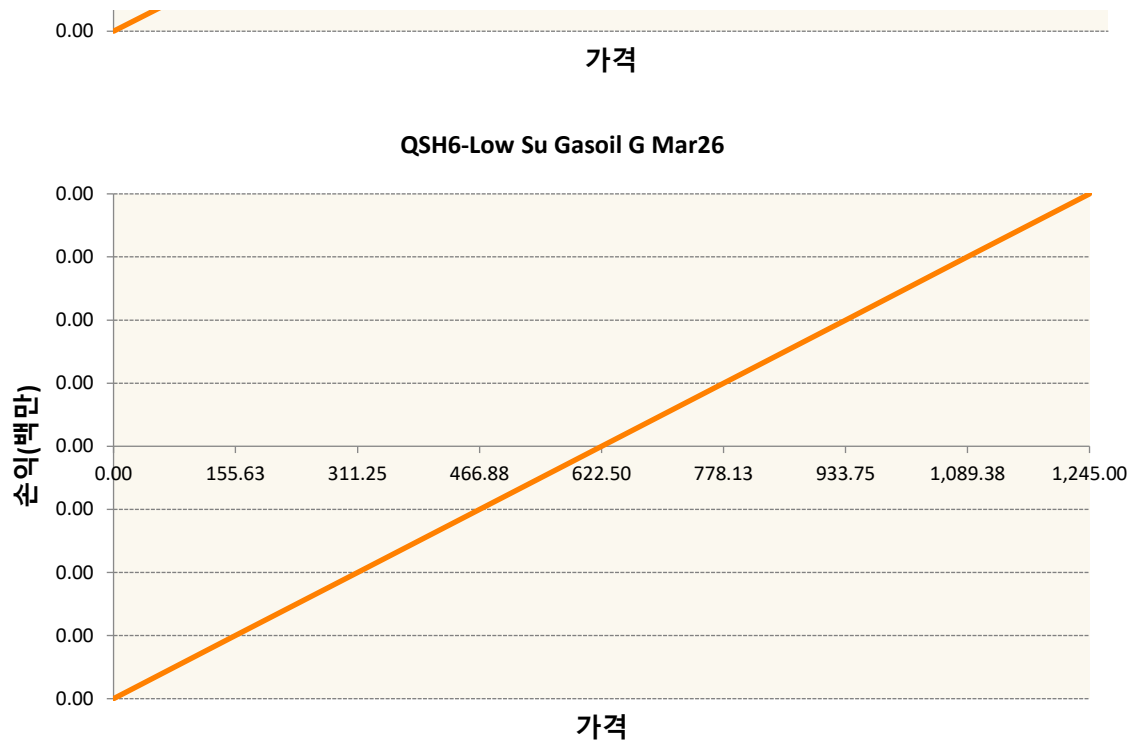
(단위:백만원)

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	171	0	171	
누계	유가증권	선물	355	0	355	
누계	통화	선물	0	103	-103	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH6	WTI CRUDE FUTURE Mar26	7
COH6	BRENT CRUDE FUTR Mar26	14
EOH6	E-MINI NATURAL GAS Mar26	5
KR4A756100 2026-01	달러선물	8
NGH26	NATURAL GAS FUTR Mar26	8
QSH6	Low Su Gasoil G Mar26	7

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

(단위:백만원)

91