

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

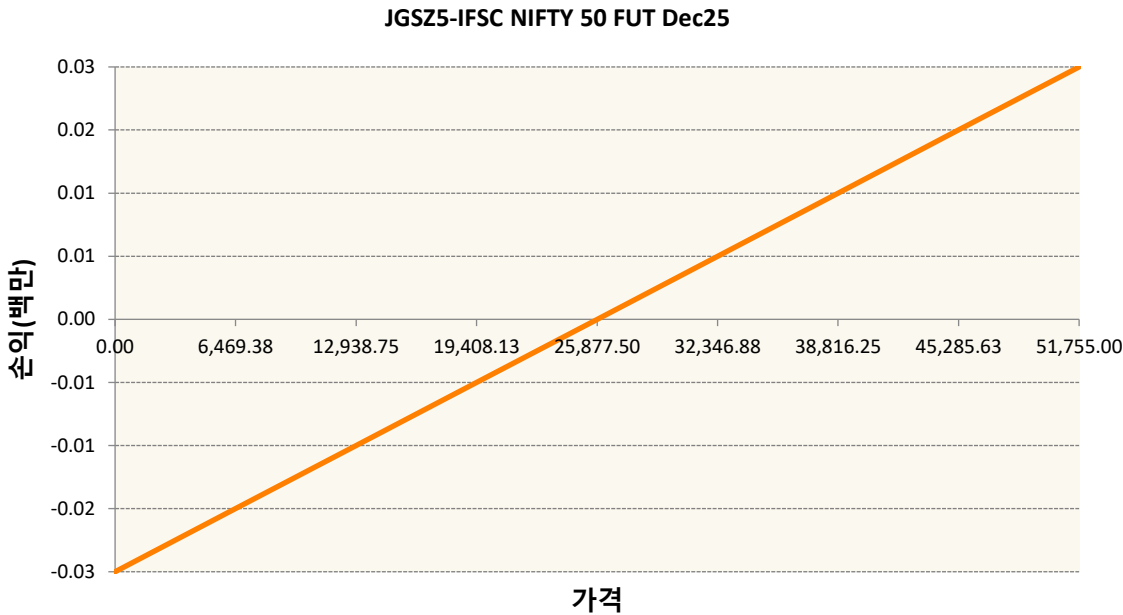
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	688	0	688	

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)

34

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

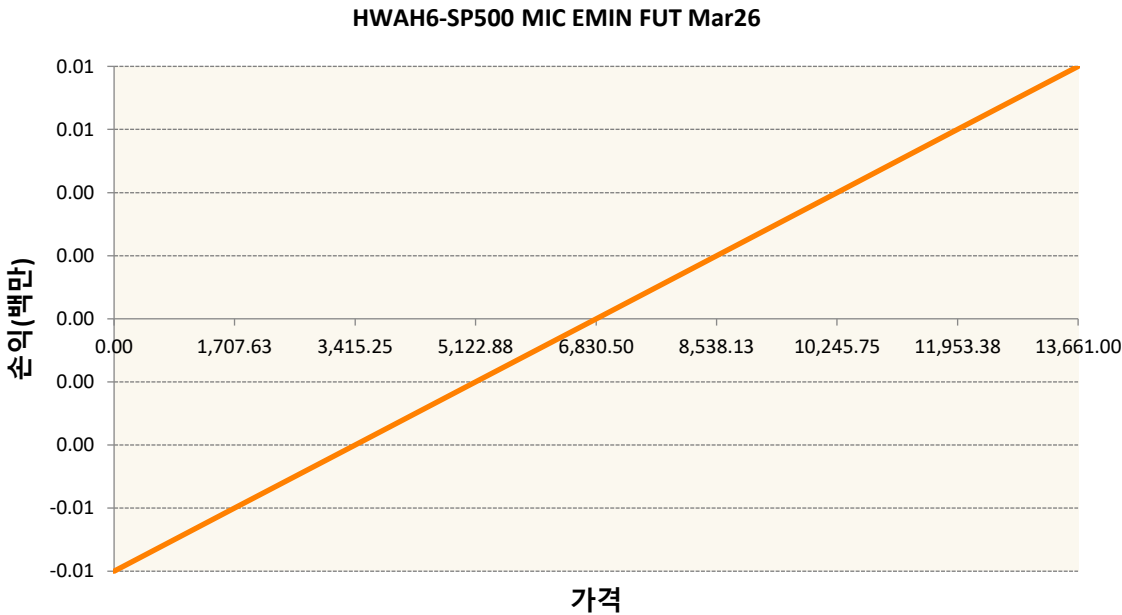
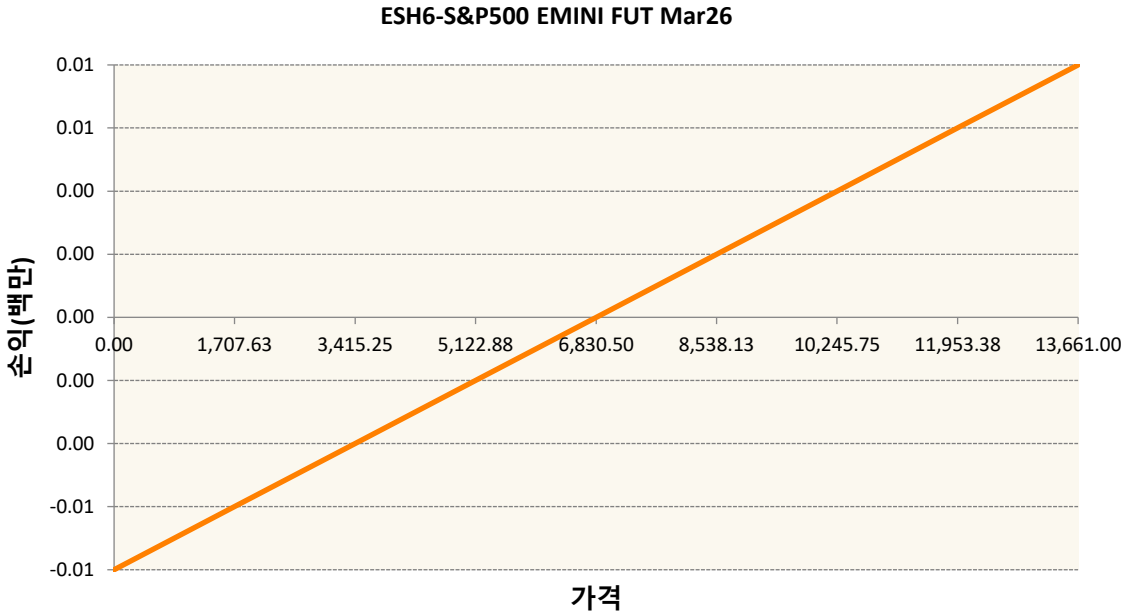
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	303	0	303	장내
누계	지수	선물	505	0	505	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	40
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	24

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	57

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

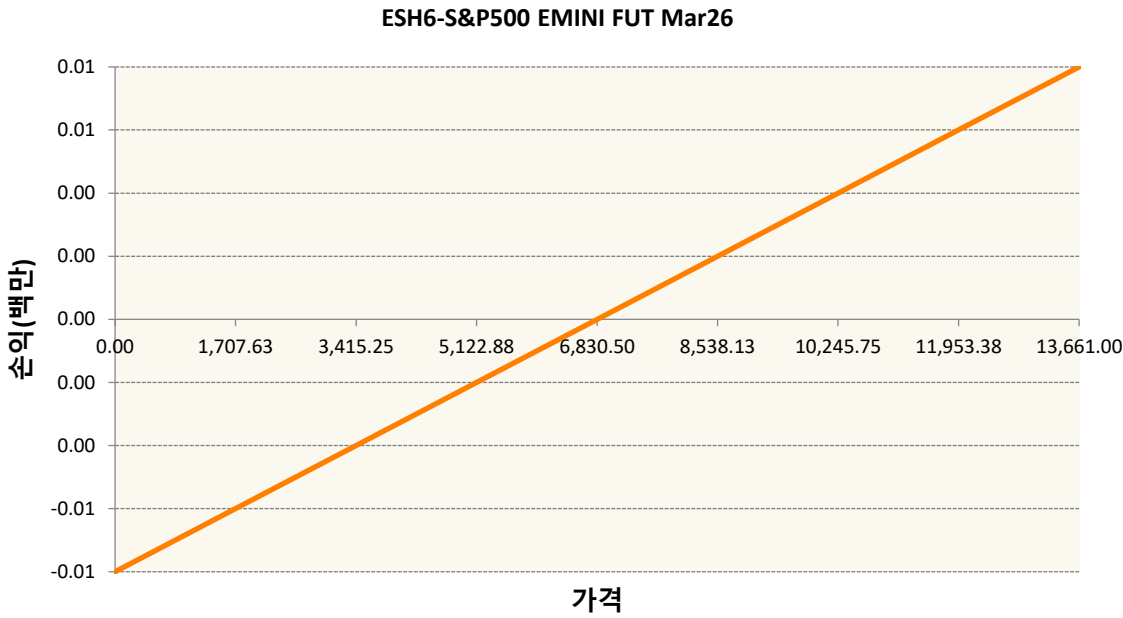
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,515	0	1,515	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	121
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

107

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

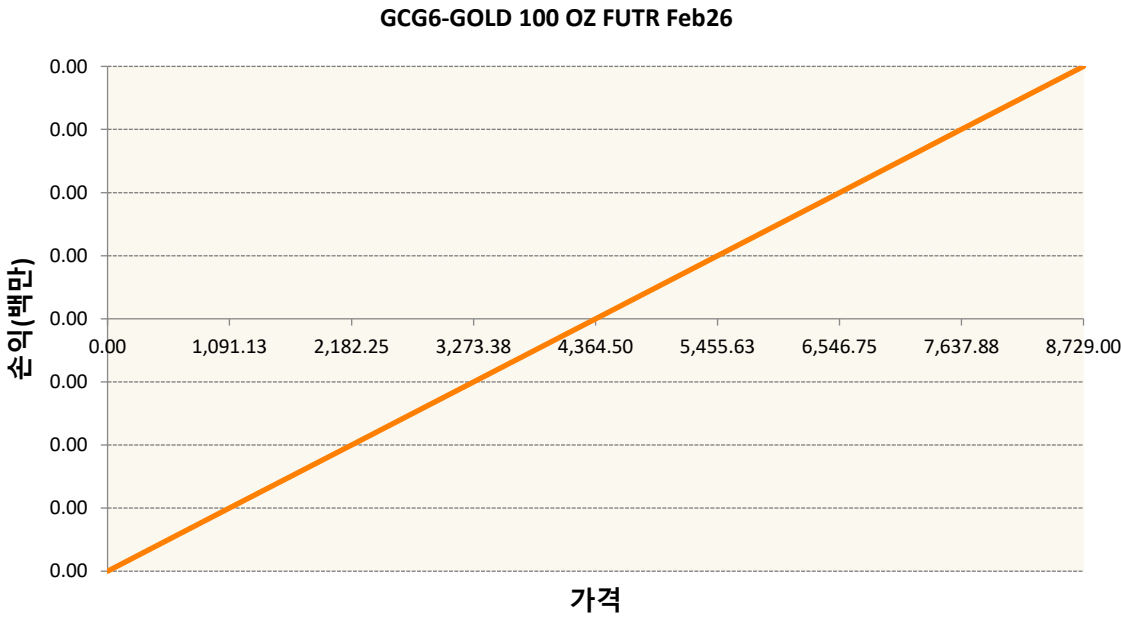
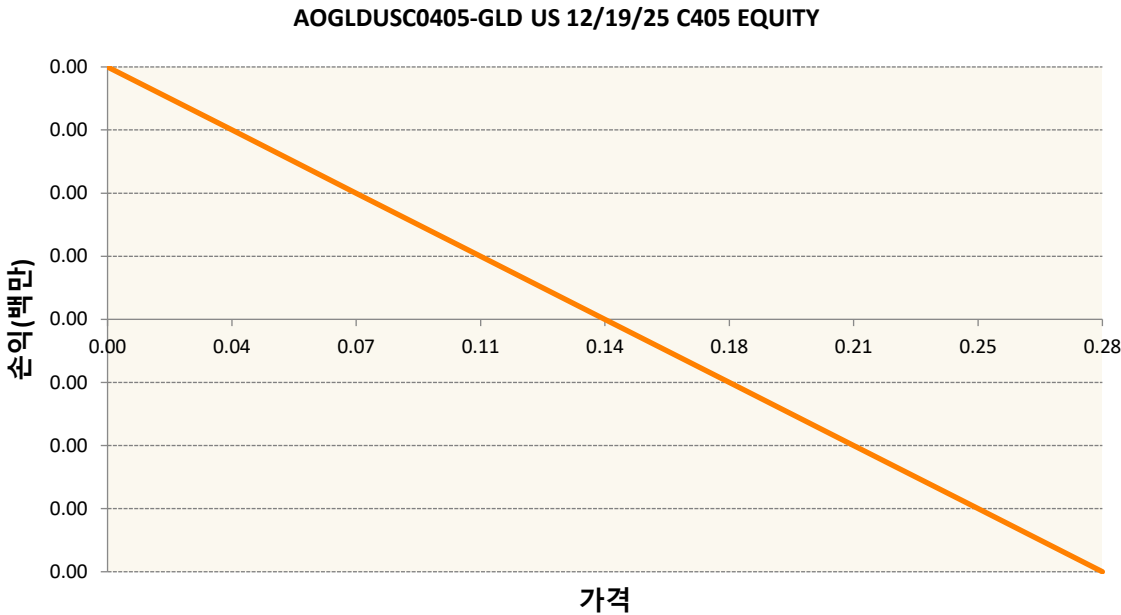
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	3,214	0	3,214	
누계	실물자산	옵션	0	30	-30	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSC0GLD US 12/19/25 C405 EQUITY		2
GCG6	GOLD 100 OZ FUTR Feb26	257

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	241

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

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 12/19/25 C190 EQUITY	0.26
AOPLTRUSC`PLTR US 12/19/25 C192.5 EQUITY	3
AOPLTRUSC`PLTR US 12/19/25 C195 EQUITY	40
AOPLTRUSP1`PLTR US 12/19/25 P195 EQUITY	98

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

(단위:백만원)

540

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

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)

AOTLTUCC0\TLT US 12/19/25 C89.5 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

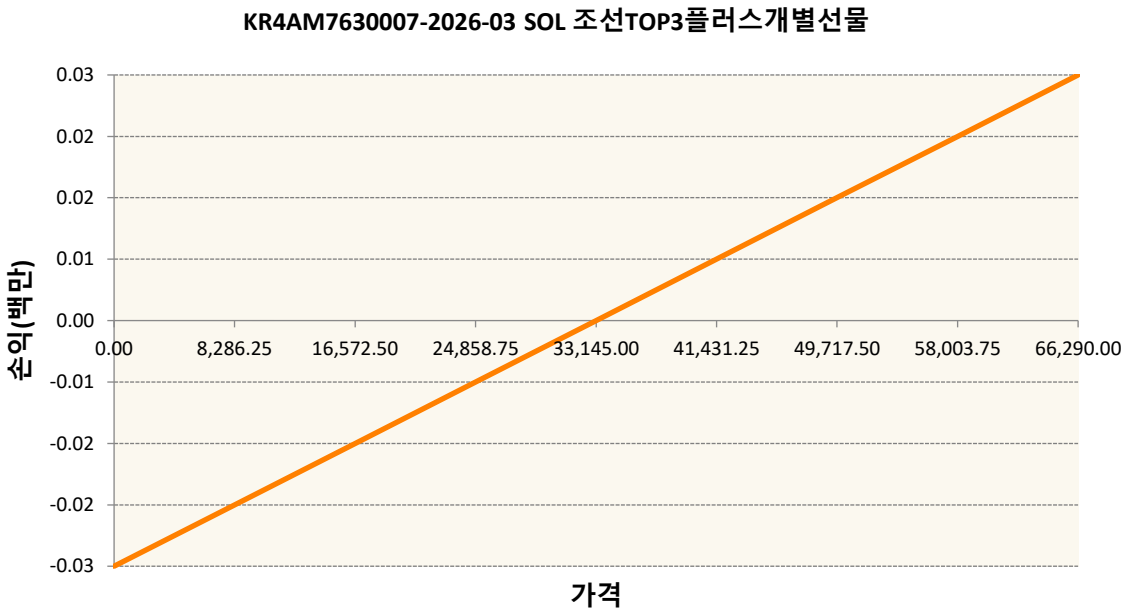
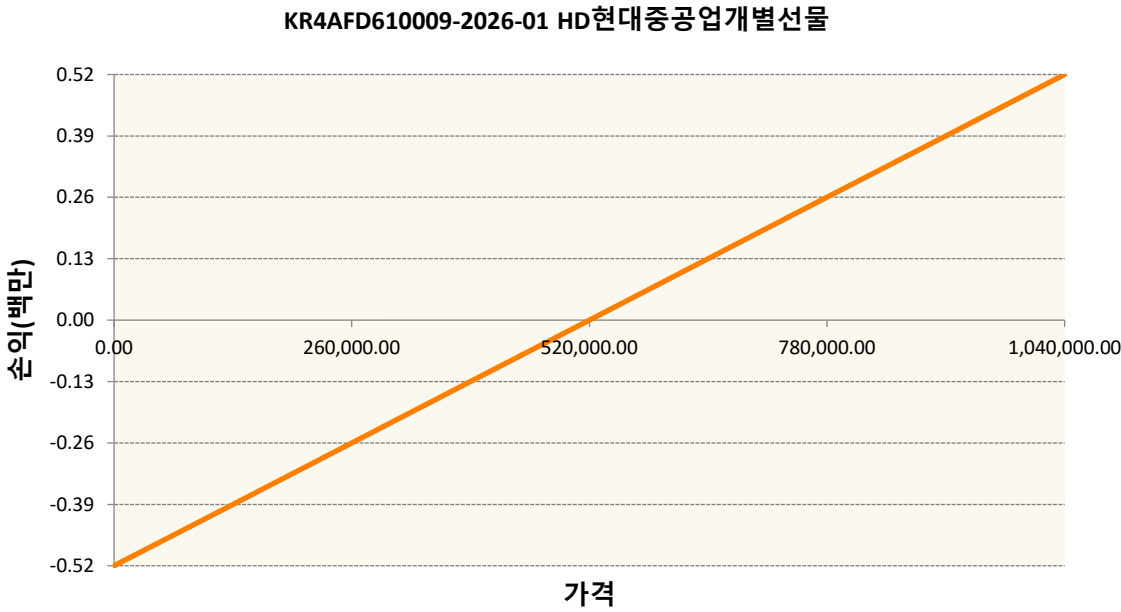
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	488	0	488	장내
누계	유가증권	선물	20,672	0	20,672	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD610009		2026-01 HD현대중공업개별선물					835
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-835	-835	-835	-835	-835	-835	-835
-5.33%	-557	-557	-557	-557	-557	-557	-557
-2.67%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	278	278	278	278	278	278	278
5.33%	557	557	557	557	557	557	557
8.00%	835	835	835	835	835	835	835
KR4AM7630007		2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물					814
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-814	-814	-814	-814	-814	-814	-814
-5.33%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
-2.67%	-271	-271	-271	-271	-271	-271	-271
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	271	271	271	271	271	271	271
5.33%	542	542	542	542	542	542	542
8.00%	814	814	814	814	814	814	814

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

1,709

공시일 2025-12-22

기준일 2025-12-19

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	2025-12-22
기준일	2025-12-19

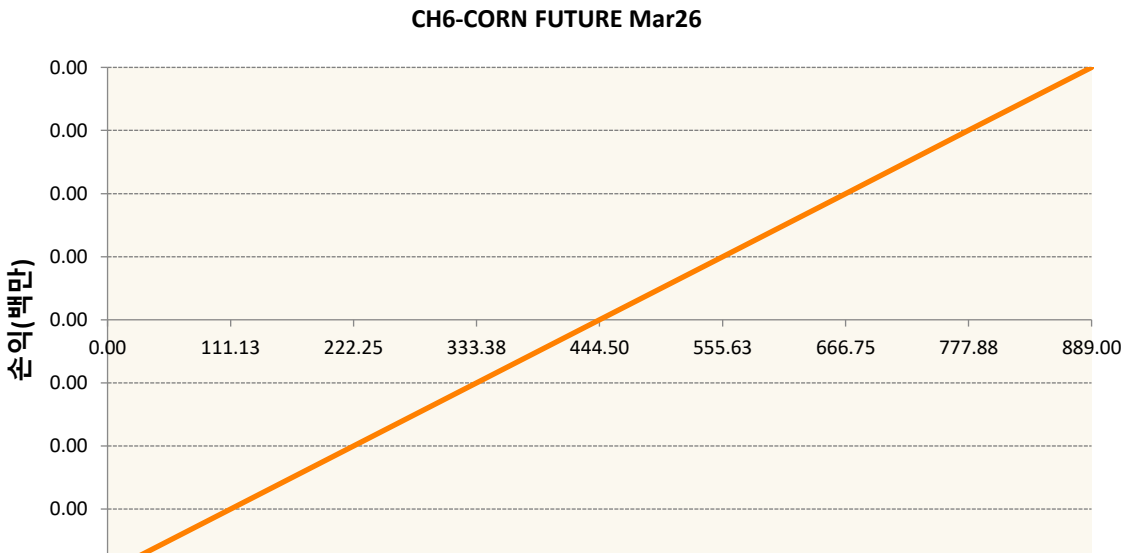
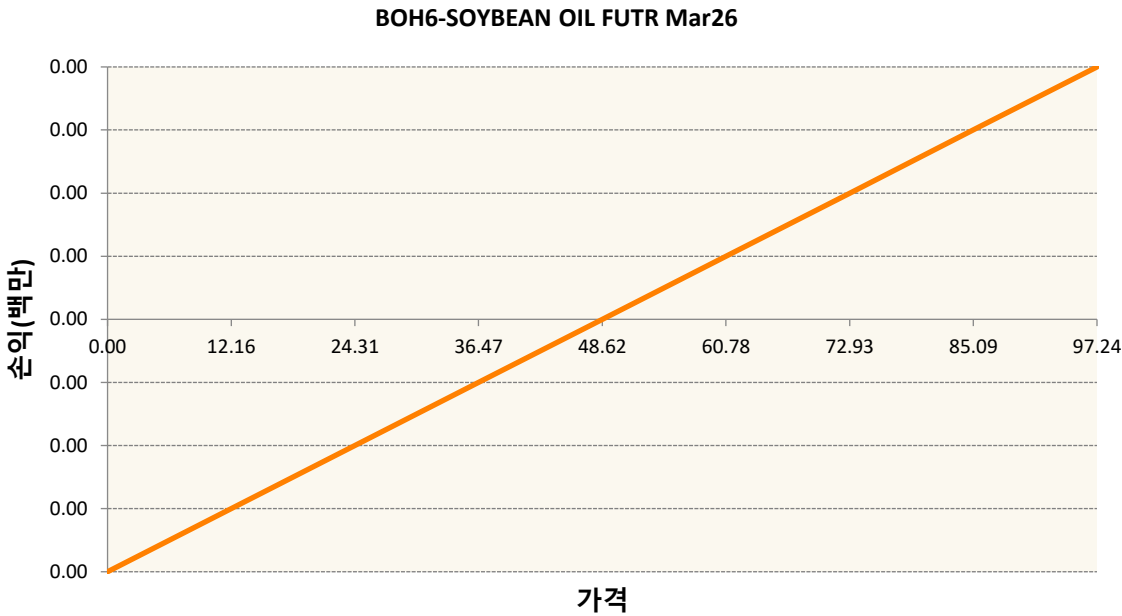
포커스농산물모(채권-파생형)

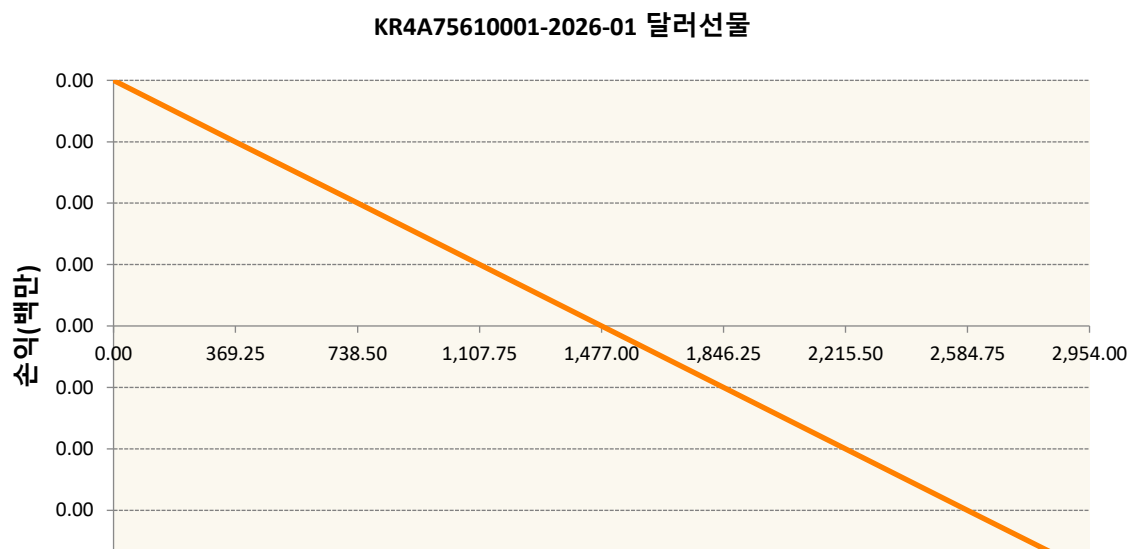
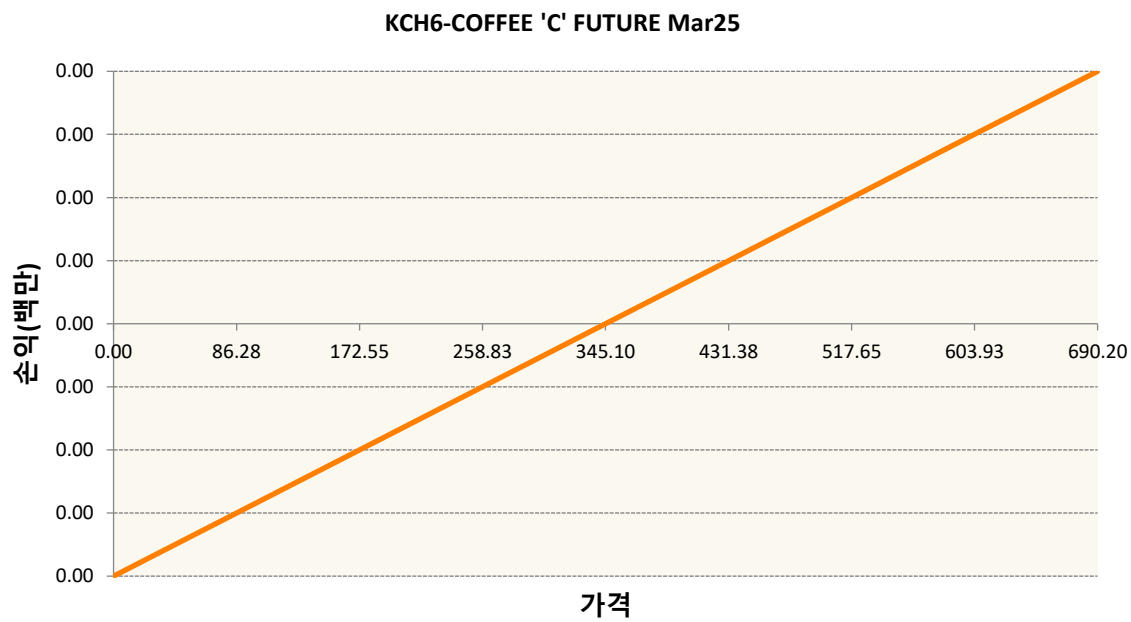
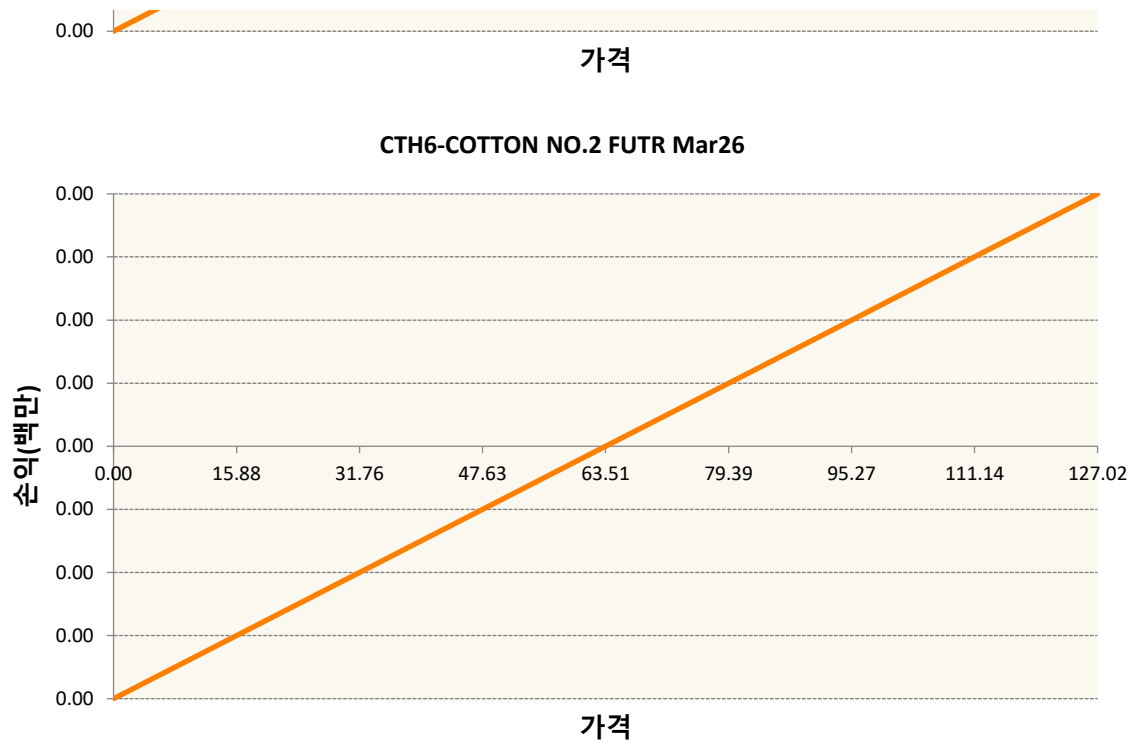
1. 계약금액

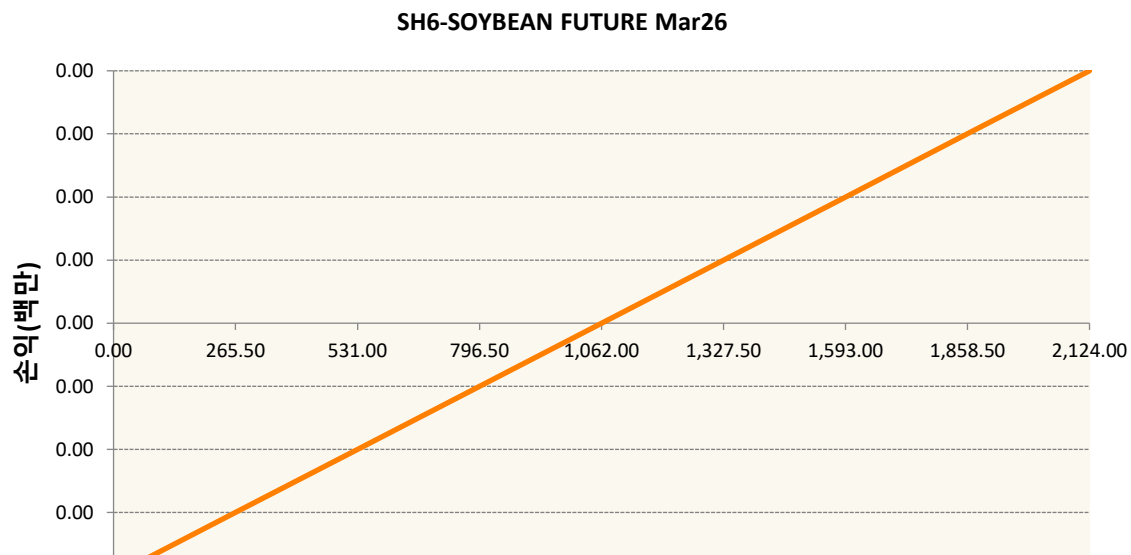
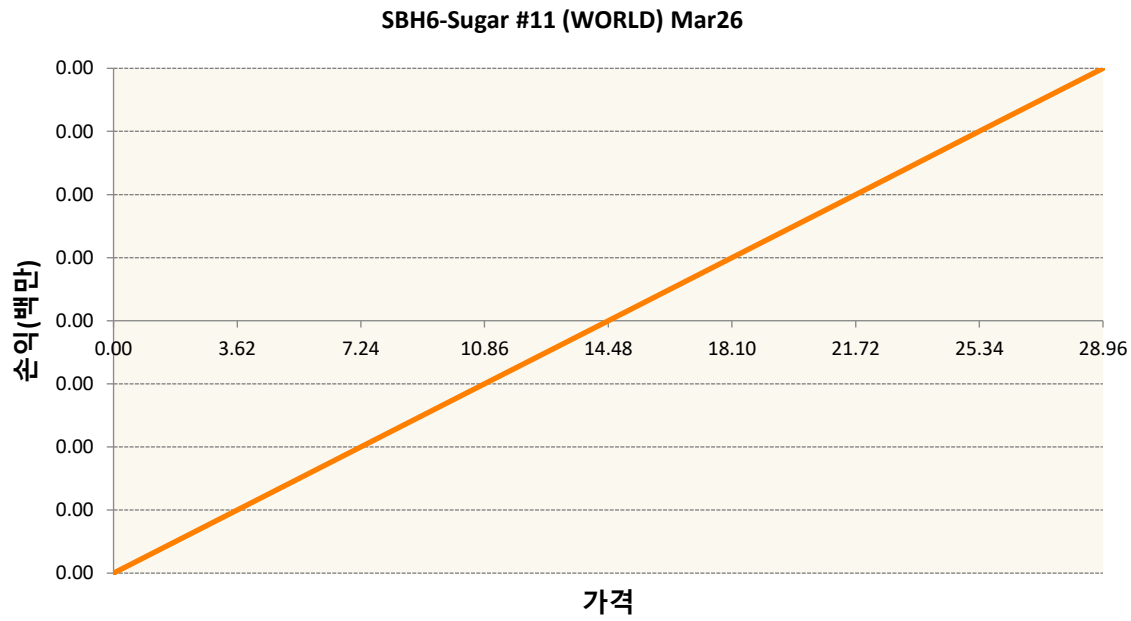
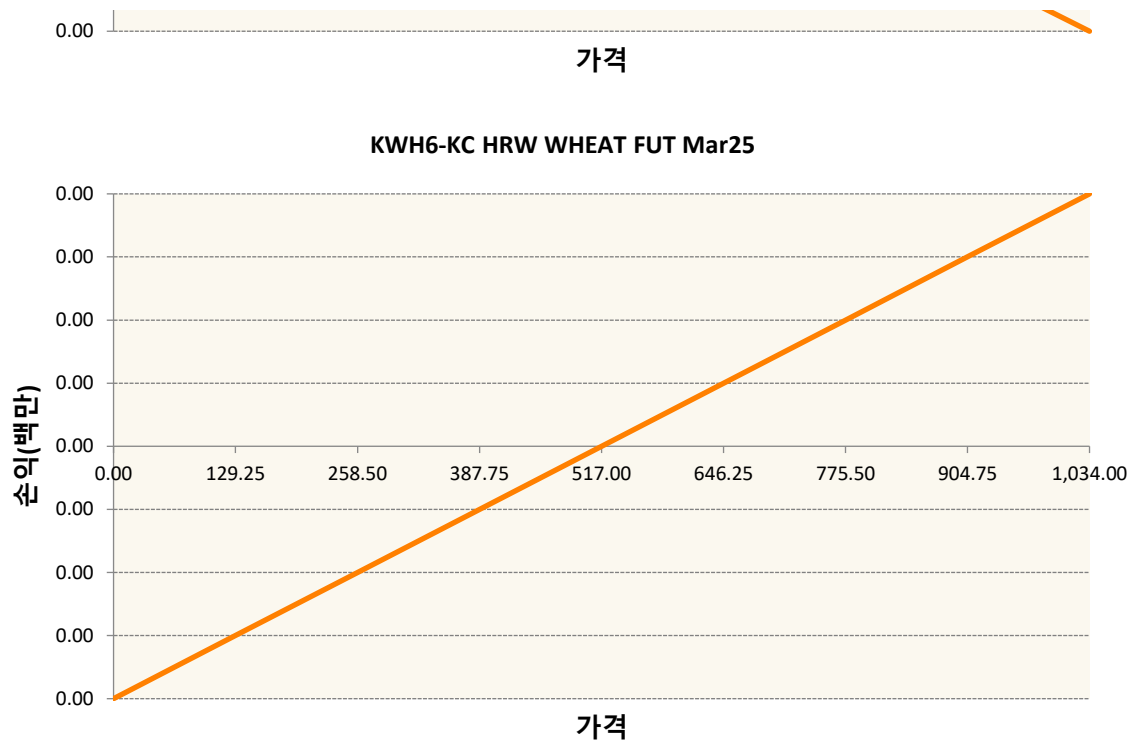
(단위:USD 백만)

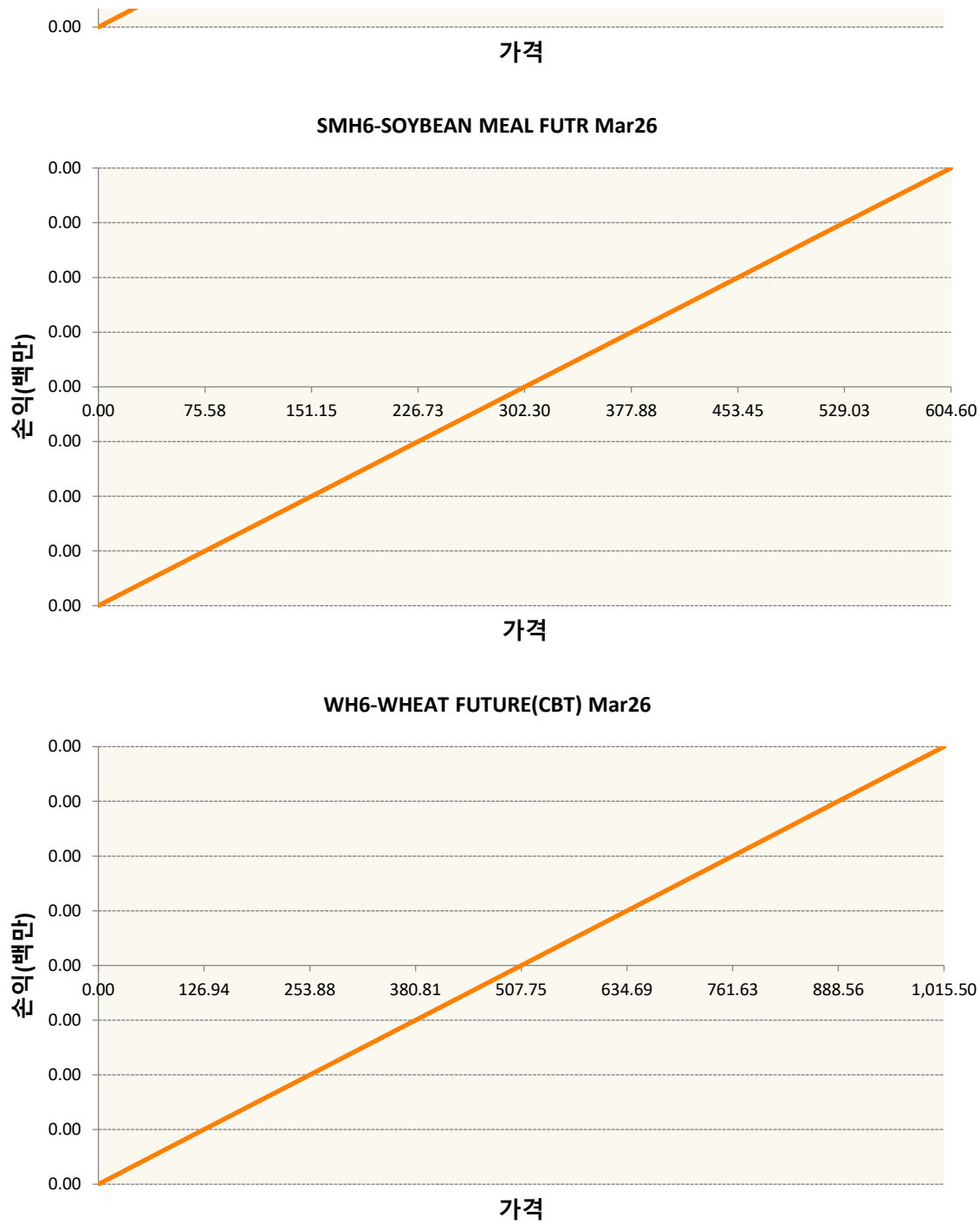
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	429	0	429	
누계	유가증권	선물	2,701	0	2,701	
누계	통화	선물	0	295	-295	장내

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	2025-12-22
기준일	2025-12-19

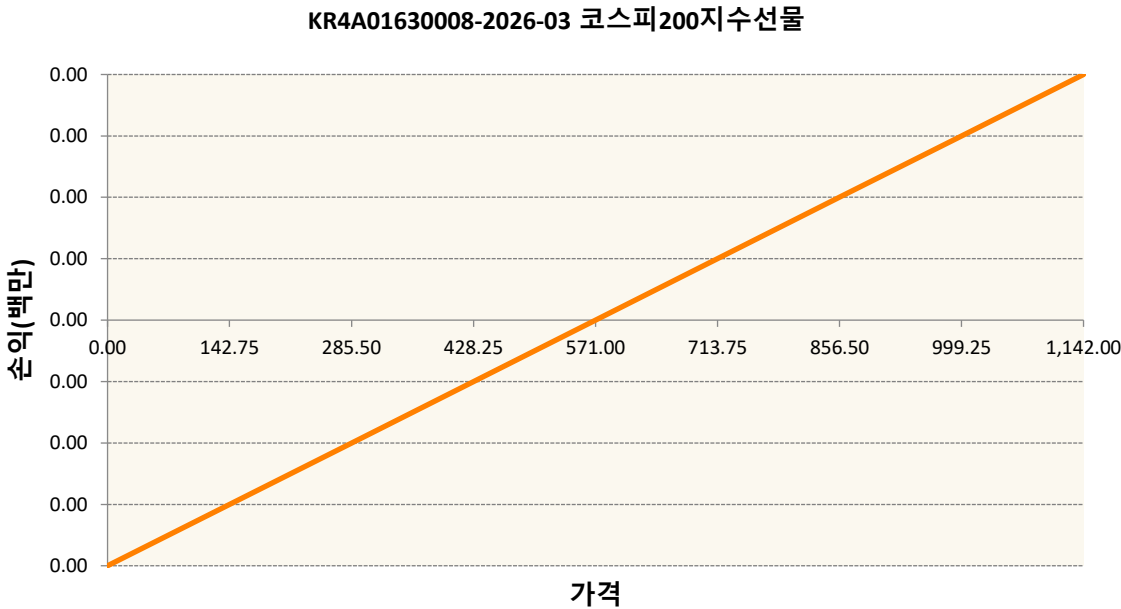
스마트인덱스모

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	1,285	0	1,285	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물

103

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

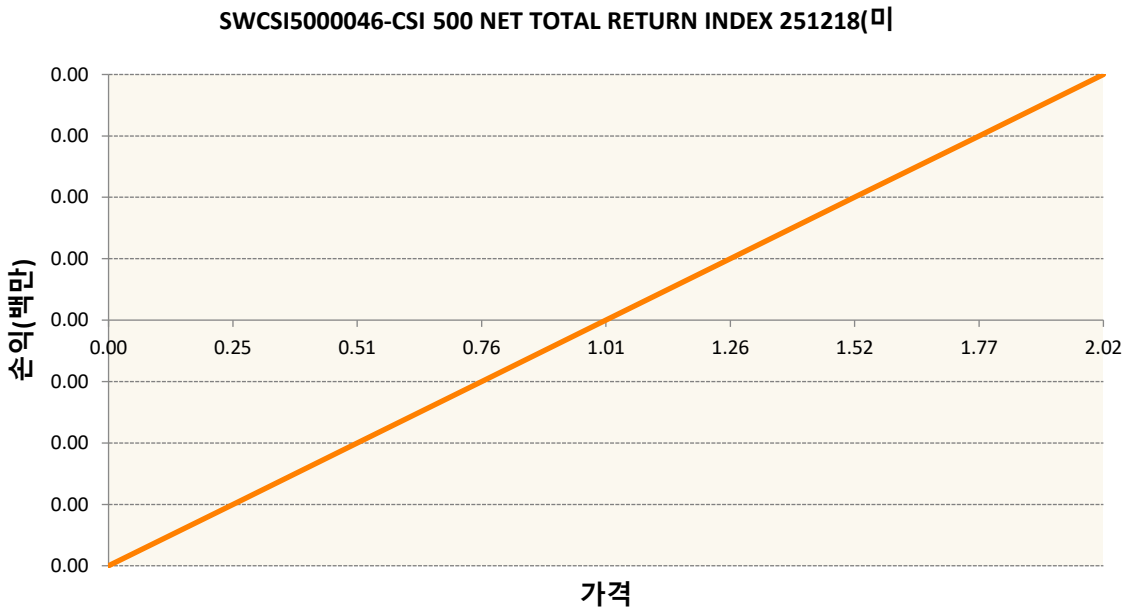
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,665	0	4,665	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

375

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

461

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

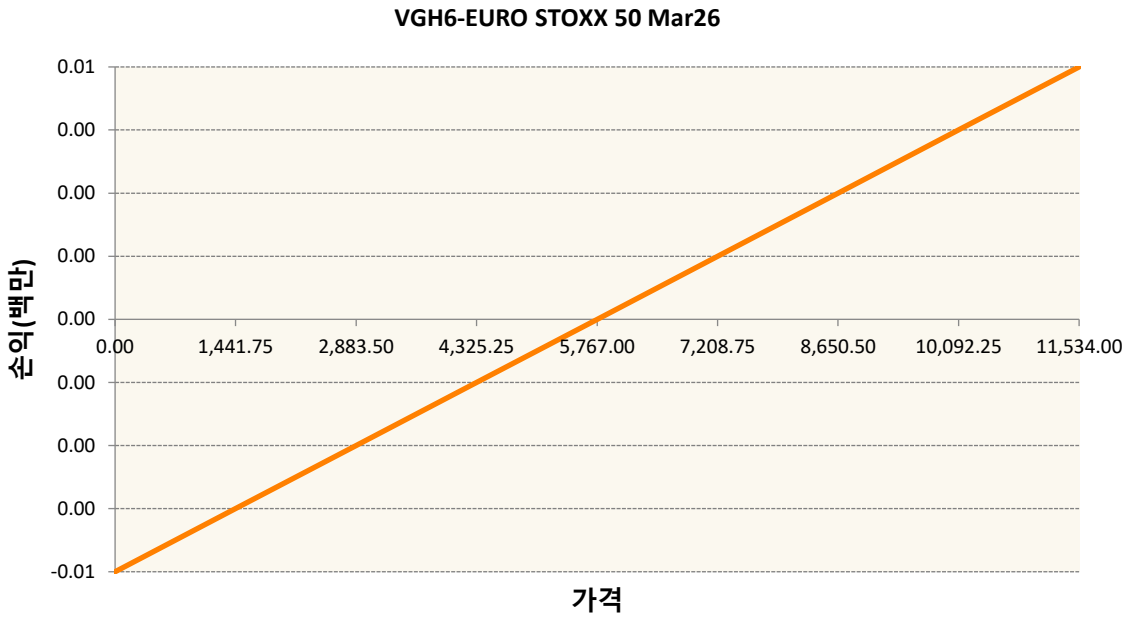
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	801	0	801	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EURO STOXX 50 Mar26	64
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

53

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

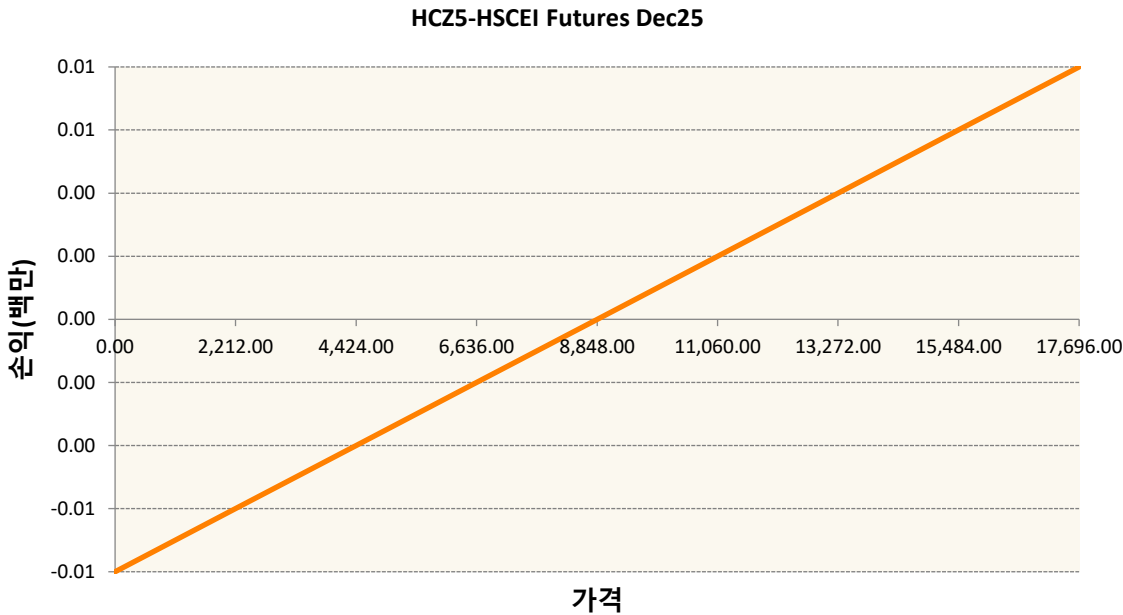
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,843	0	1,843	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCZ5	HSCEI Futures Dec25	147
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

191

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

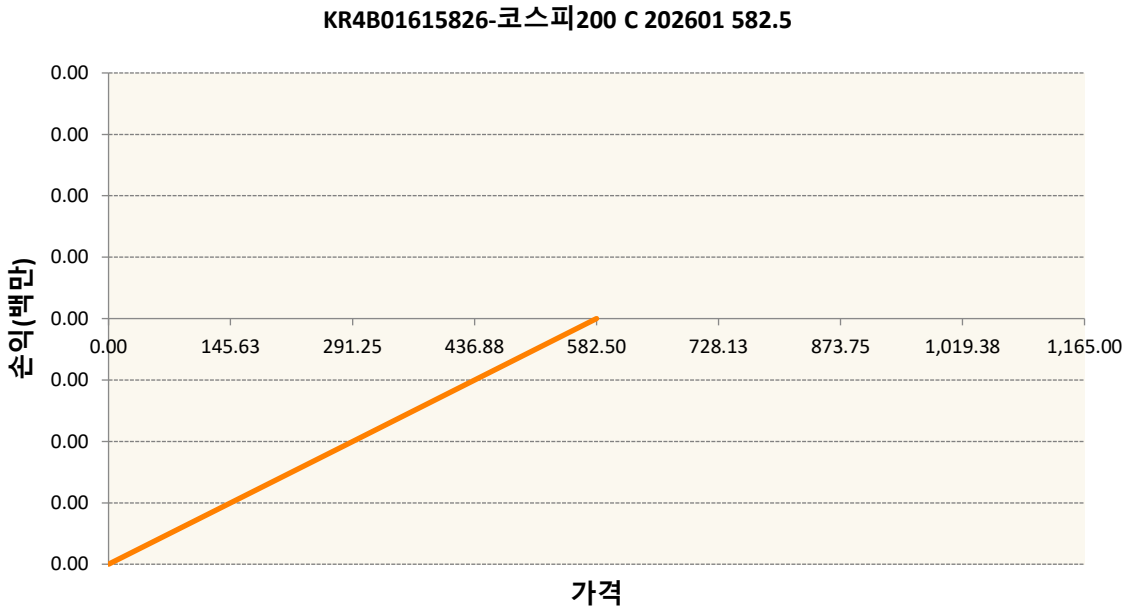
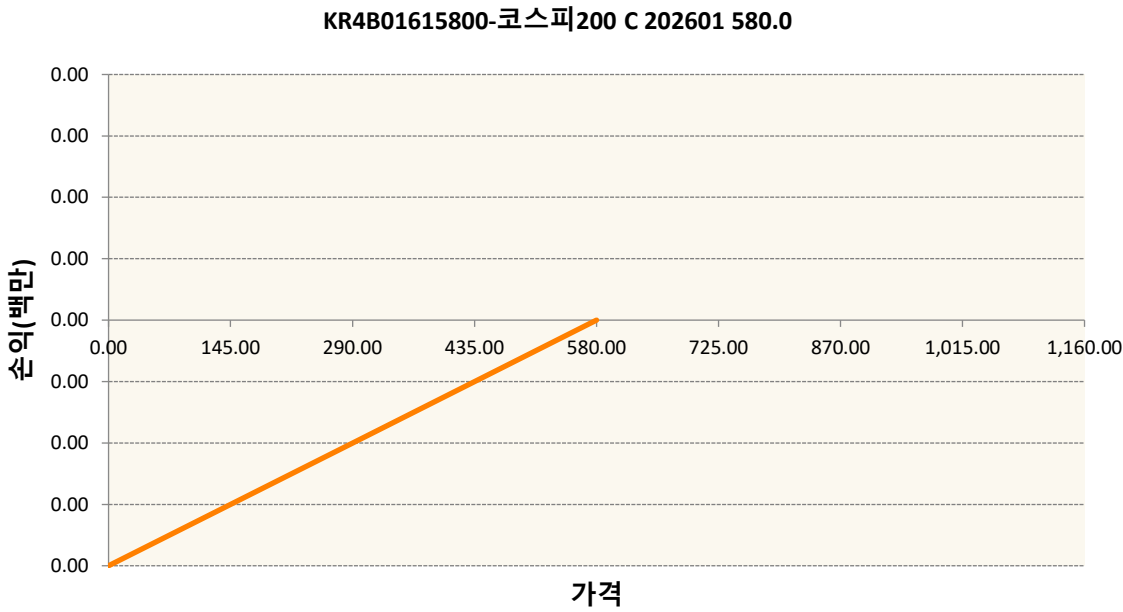
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

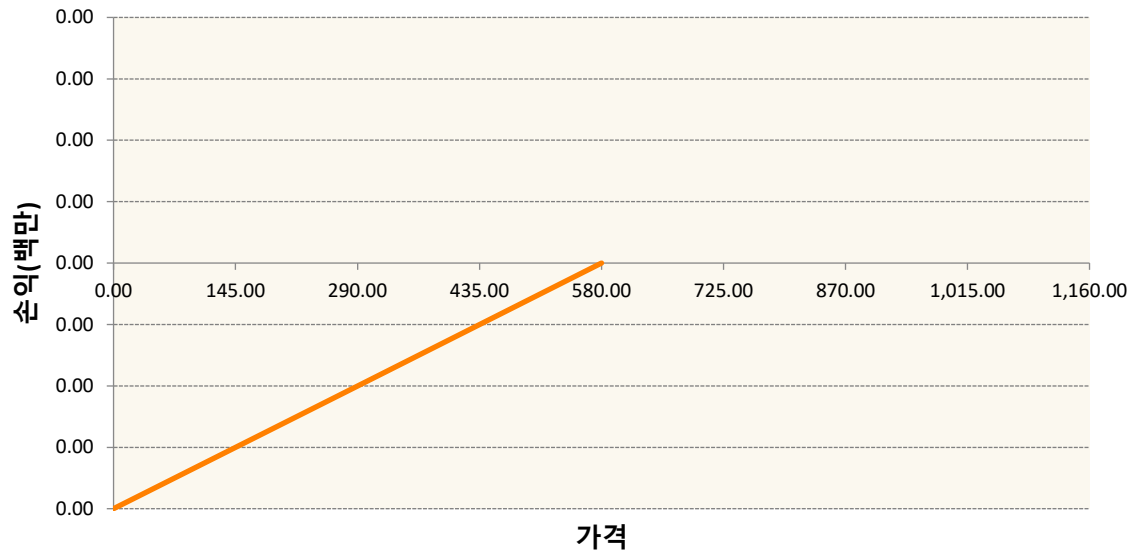
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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 2025-12-22

기준일 2025-12-19

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	2025-12-22
기준일	2025-12-19

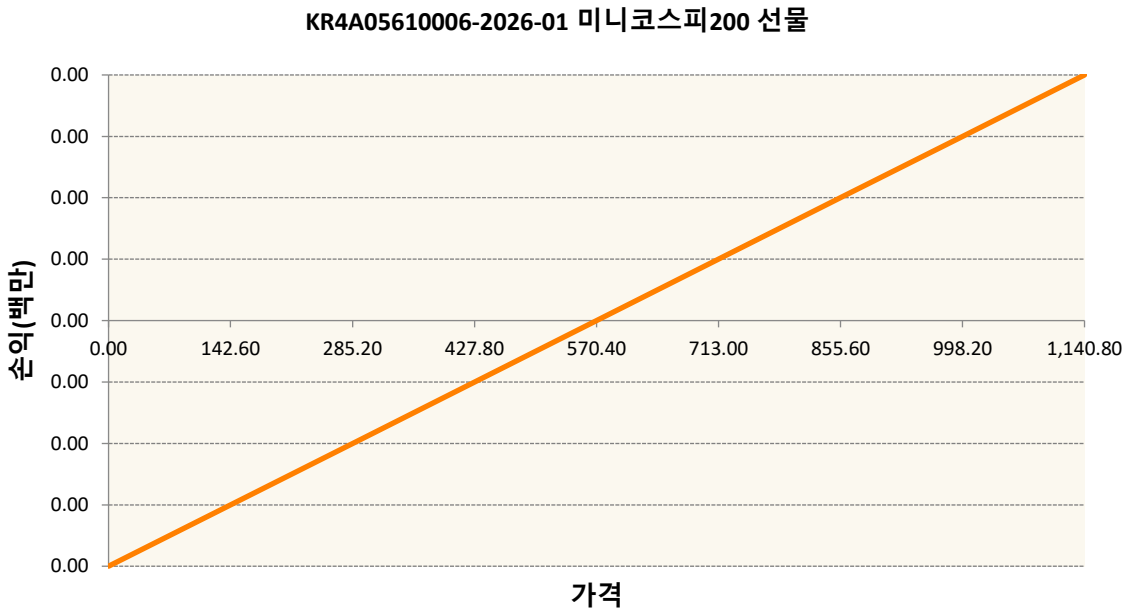
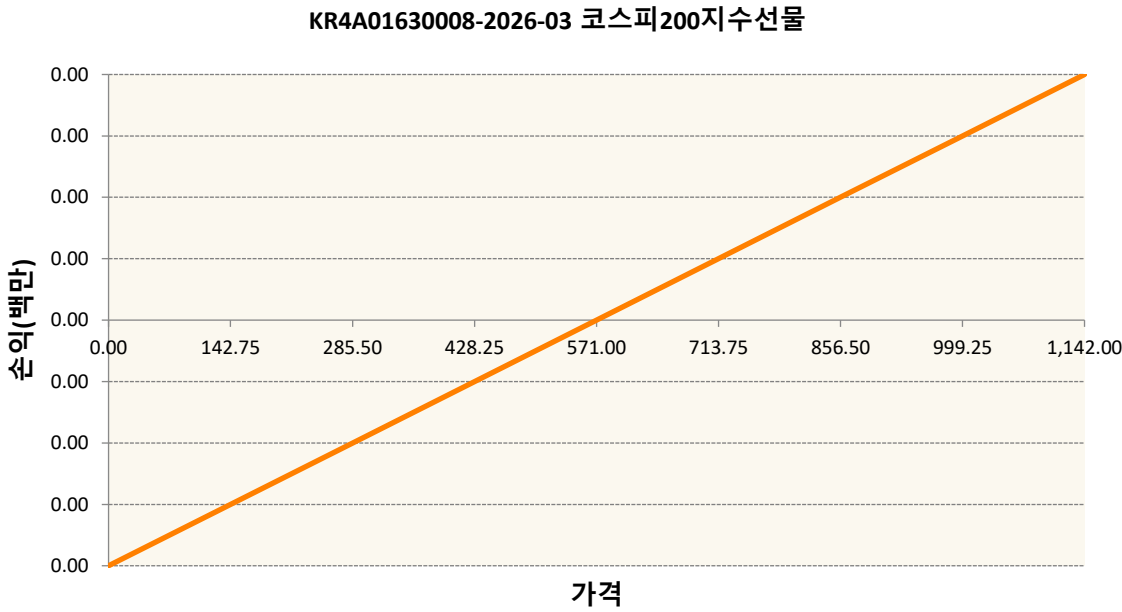
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,427	0	1,427	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		46
KR4A056100 2026-01 미니코스피200 선물		14

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

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

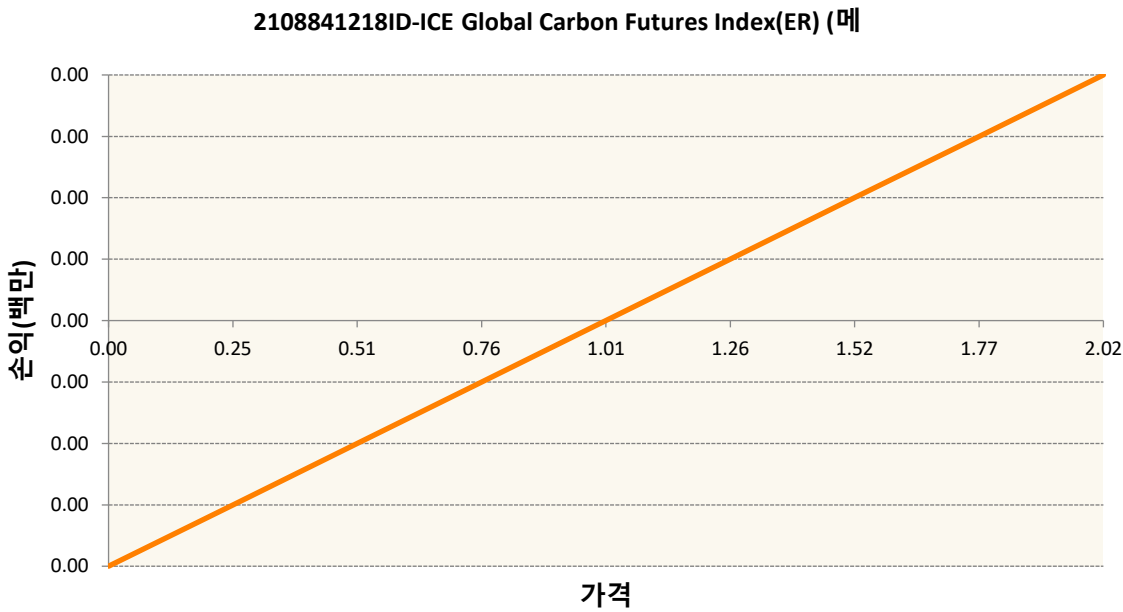
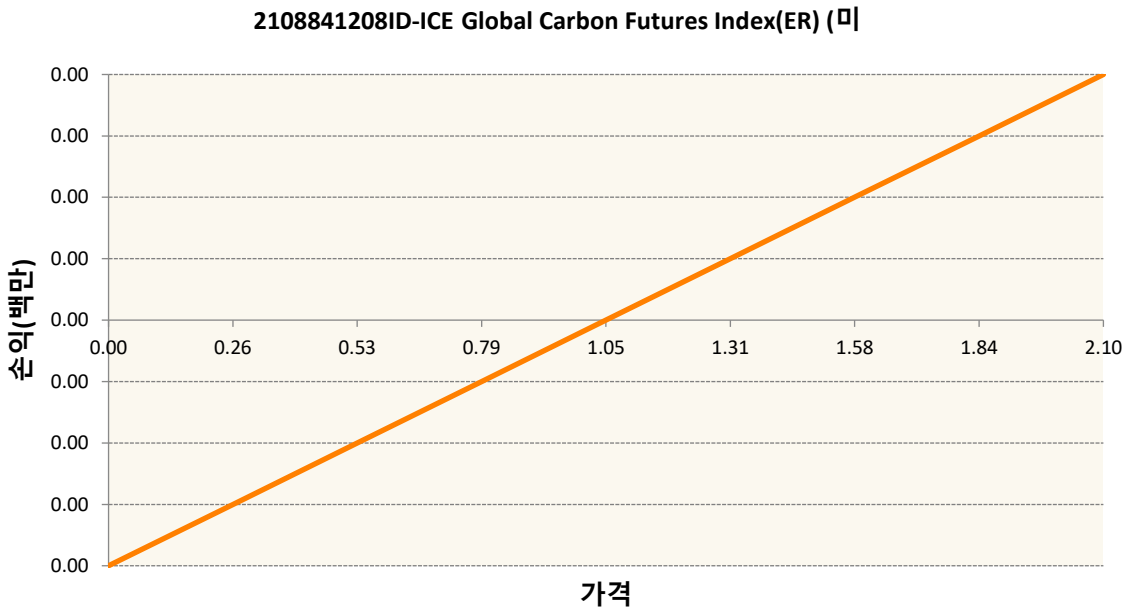
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,651	0	7,651	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		490
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		123

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	589

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

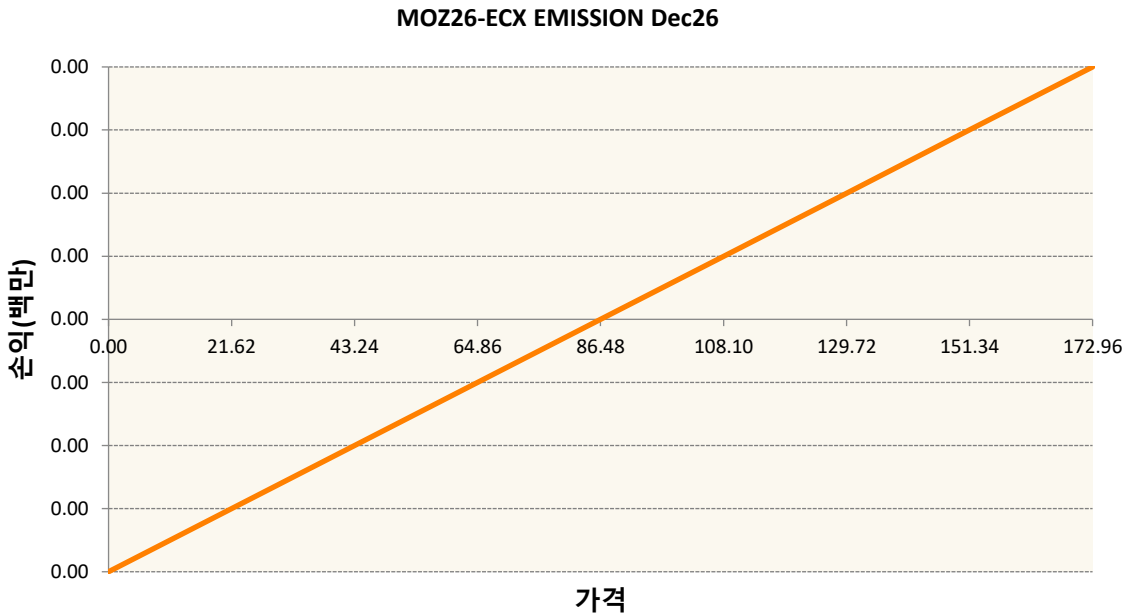
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,740	0	5,740	
누계	통화	선도	0	2,868	-2,868	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213FBTC KRW/EUR 23-12-25E	229
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	459

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

(단위:백만원)

736

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

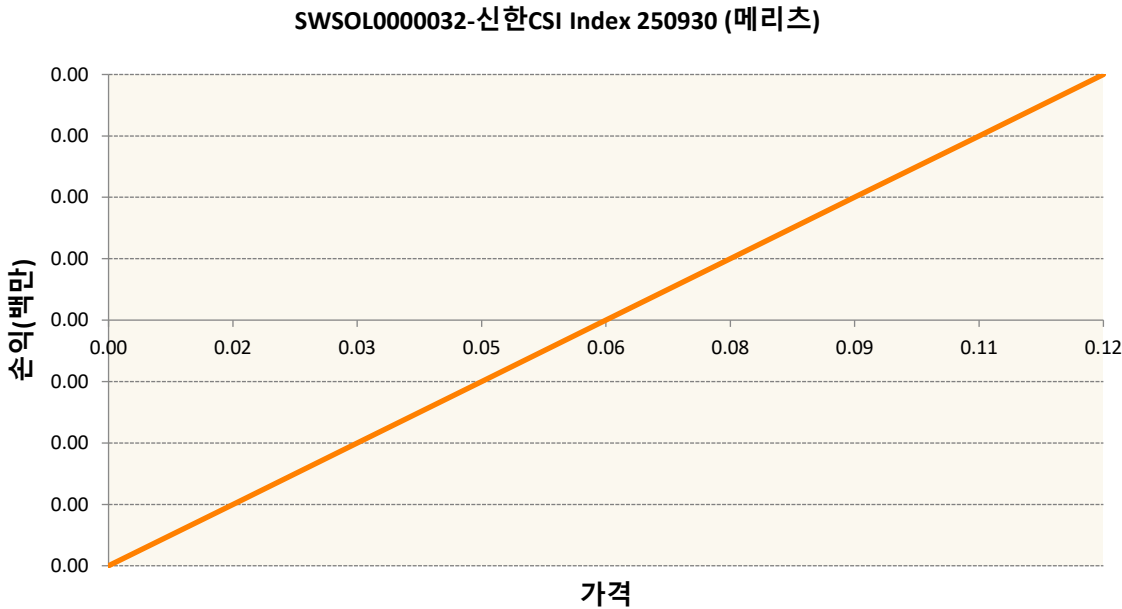
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,647	0	2,647	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	8
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	5
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	5
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	13

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

(단위:백만원)

54

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

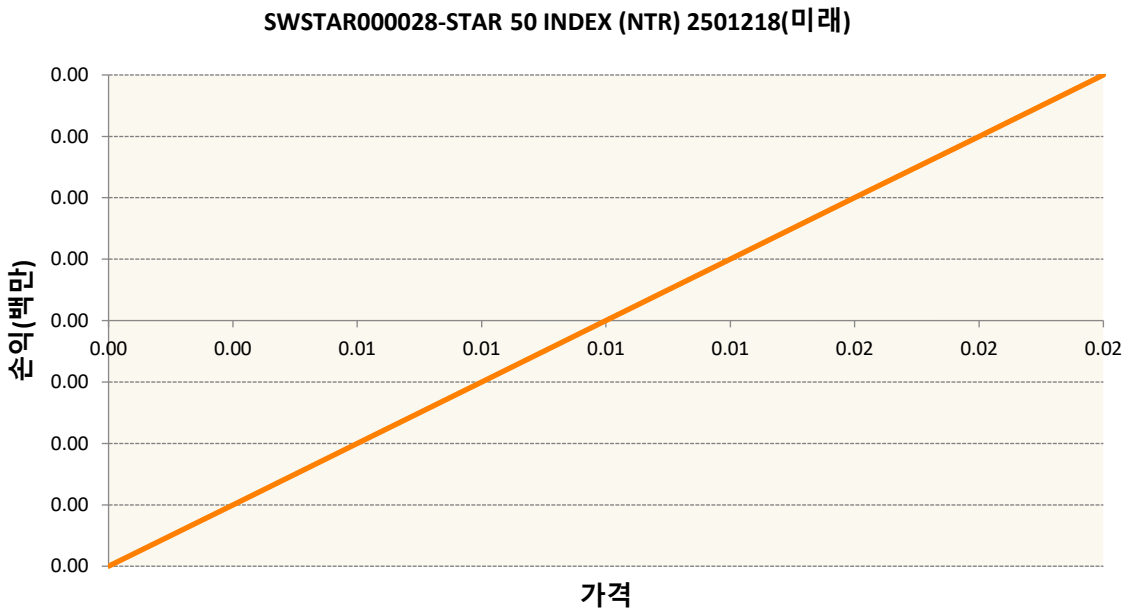
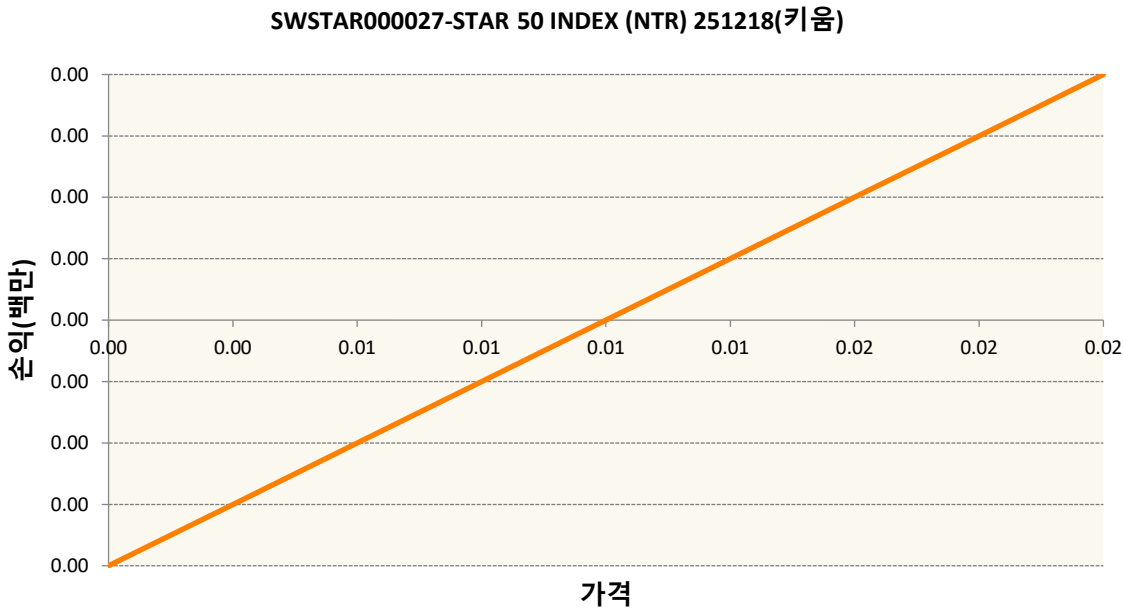
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

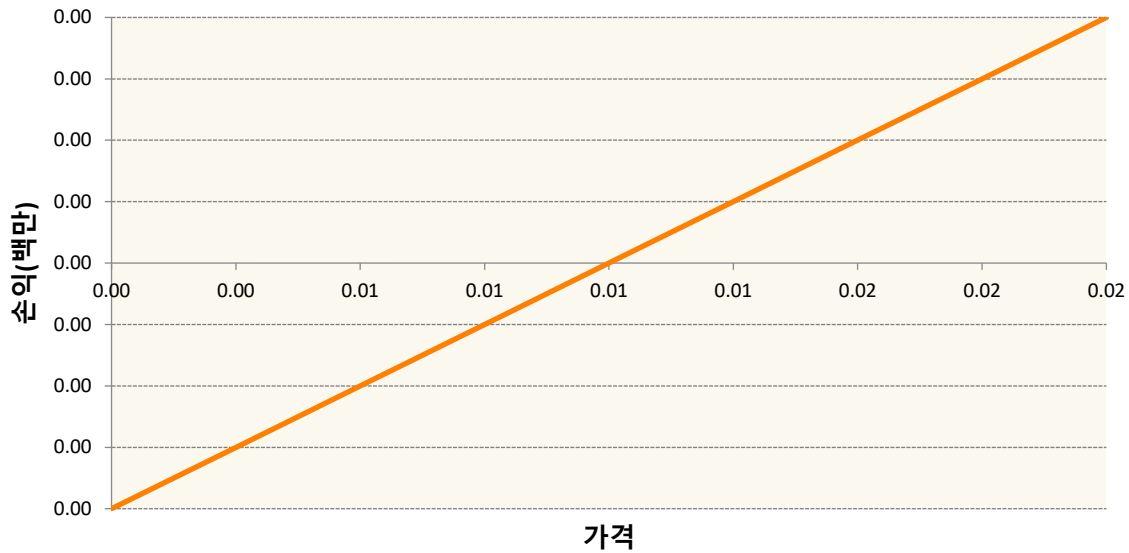
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	238	0	238	장외

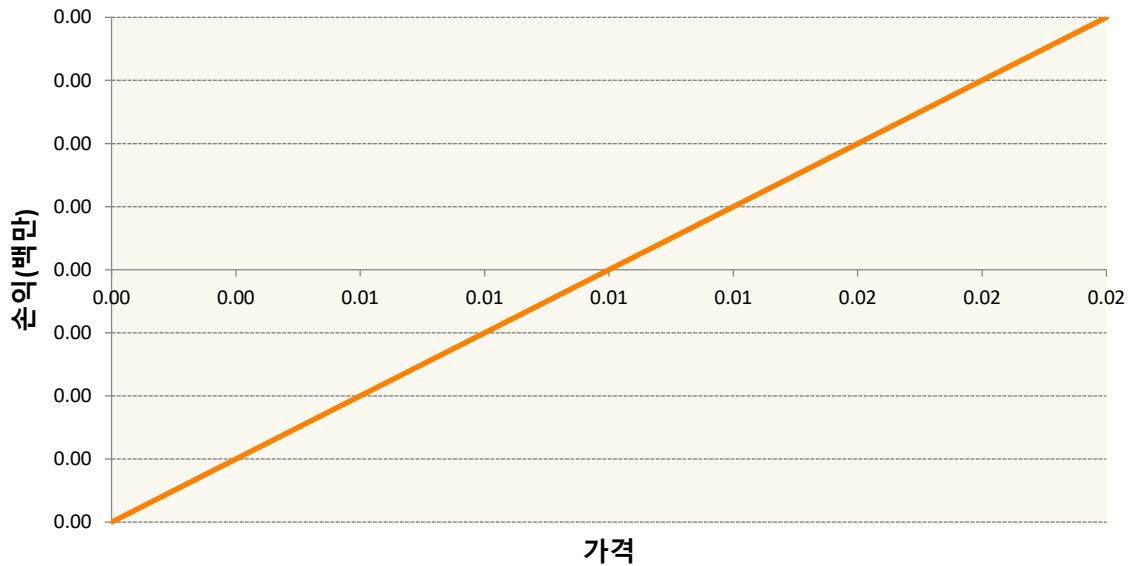
2. 만기시점의 손익구조



SWSTAR000029-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(메리츠)



SWSTAR000030-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움))
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(메리츠))
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))

1
 3
 9
 2

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

(단위:백만원)

27

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

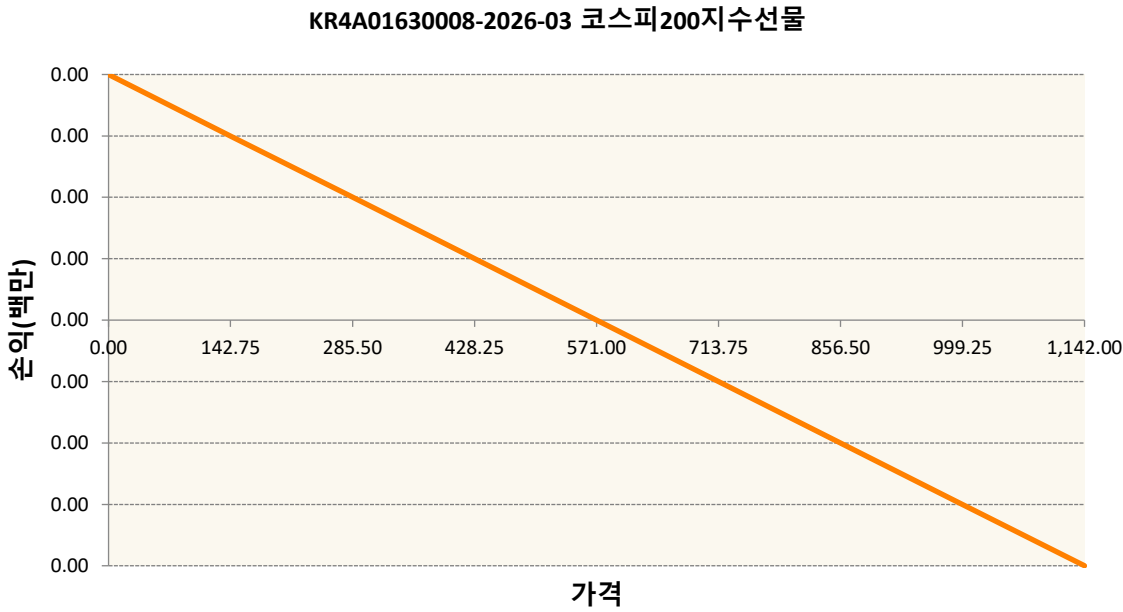
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	143	-143	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01630008			2026-03 코스피200지수선물				11
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	11	11	11	11	11	11	11
-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%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

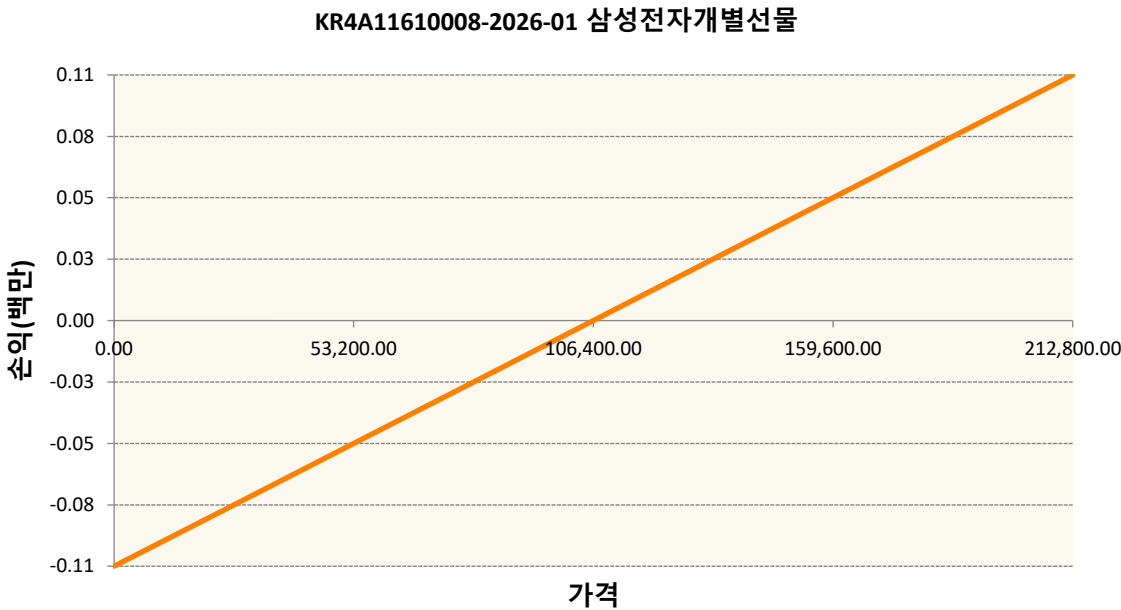
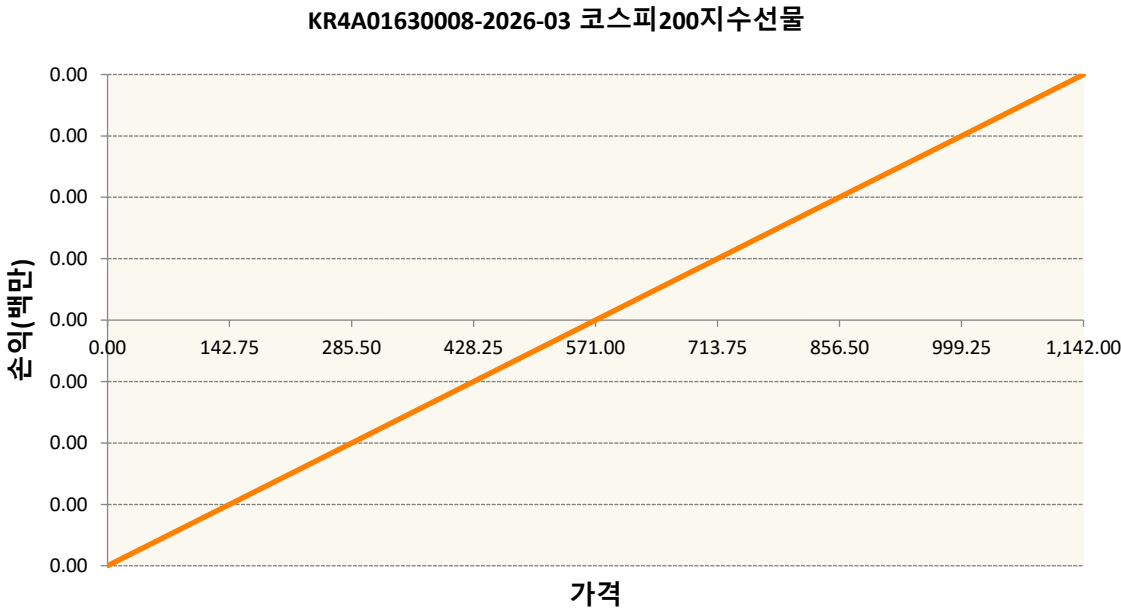
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

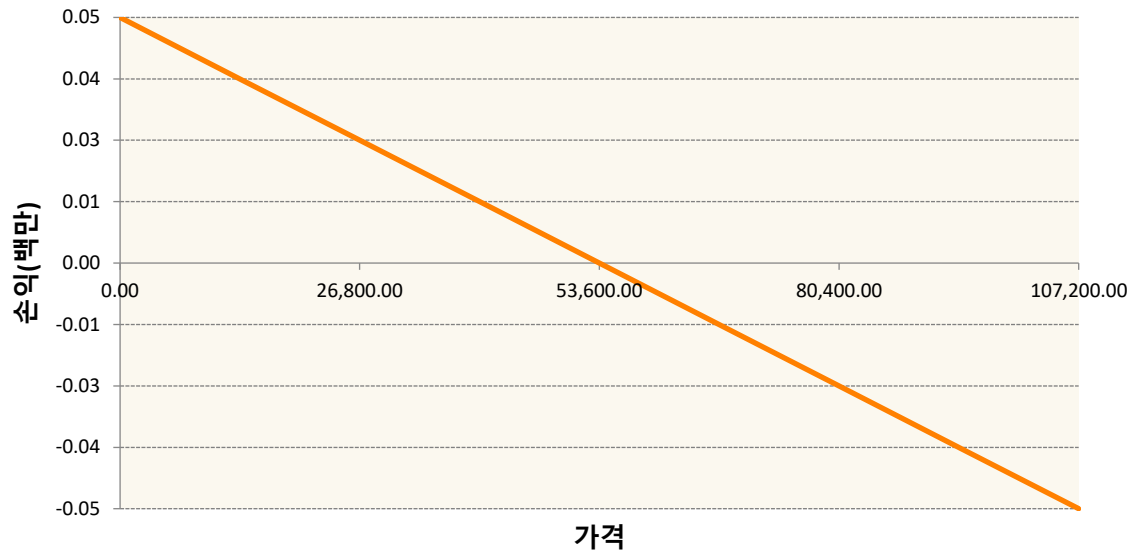
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,460	1,358	11,102	장내

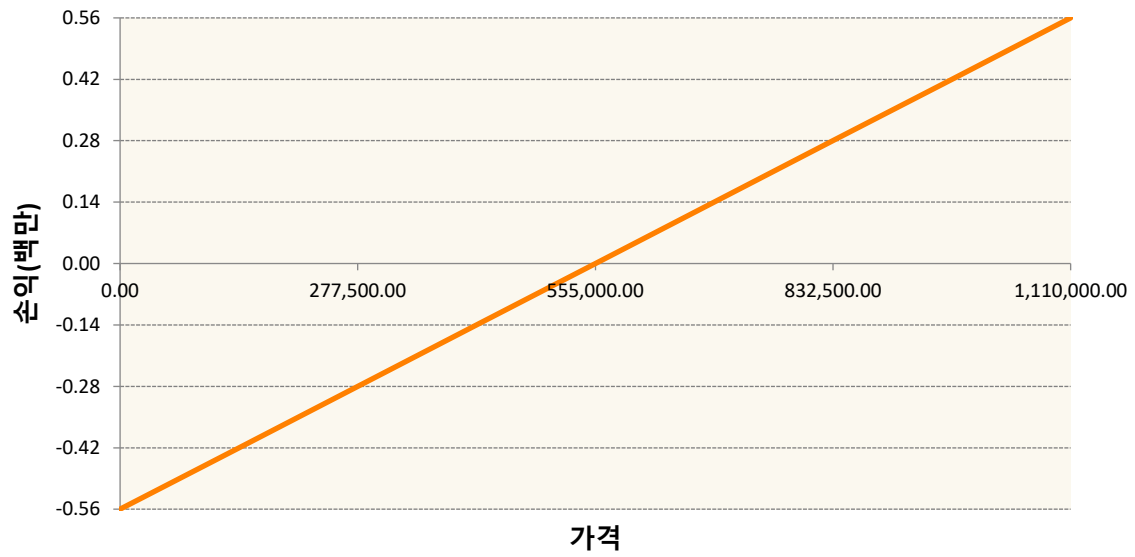
2. 만기시점의 손익구조



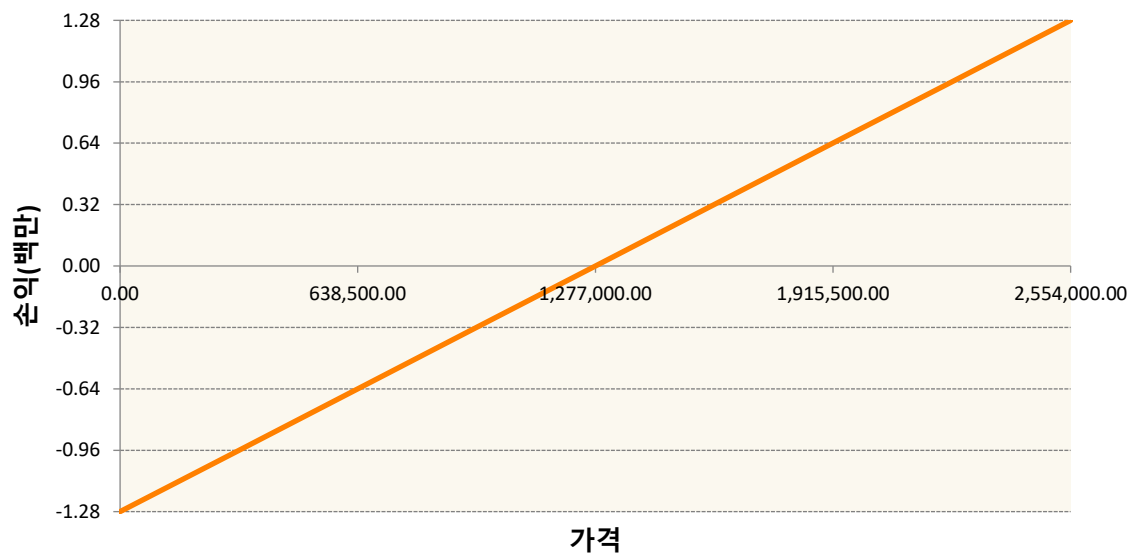
KR4A14610005-2026-01 KT개별선물



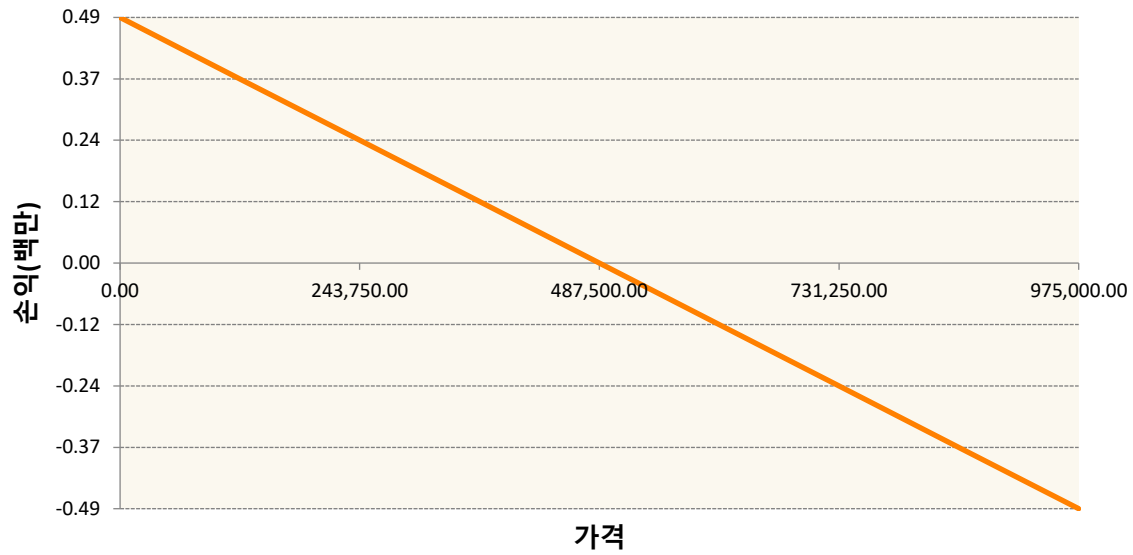
KR4A50610000-2026-01 SK하이닉스개별선물



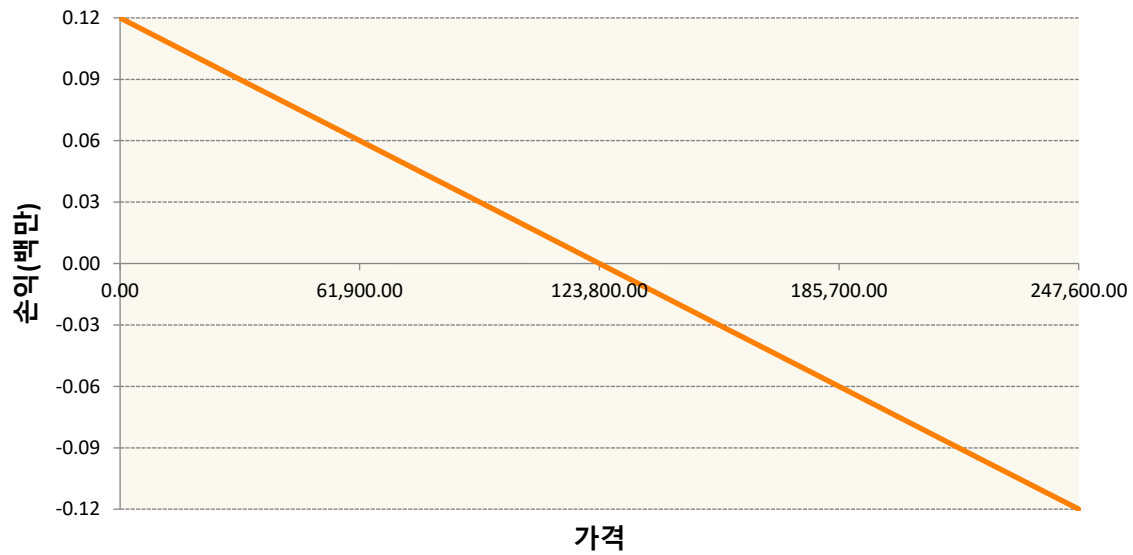
KR4AB3610006-2026-01 고려아연개별선물



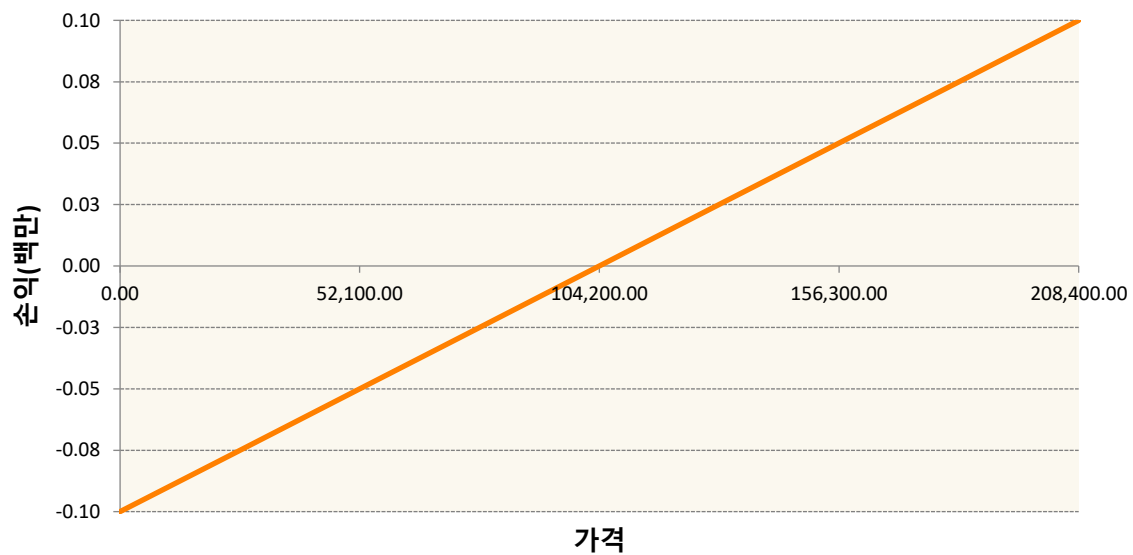
KR4ACT610004-2026-01 삼성화재개별선물



KR4AD0610005-2026-01 DB손해보험개별선물



KR4AEJ610004-2026-01 SKC개별선물



(단위:백만원)

KR4A01630008							2026-03 코스피200지수선물		762	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-762	-762	-762	-762	-762	-762	-762			
-5.33%	-508	-508	-508	-508	-508	-508	-508			
-2.67%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	254	254	254	254	254	254	254			
5.33%	508	508	508	508	508	508	508			
8.00%	762	762	762	762	762	762	762			
KR4A11610008							2026-01 삼성전자개별선물		55	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55			
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37			
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	18	18	18	18	18	18	18			
5.33%	37	37	37	37	37	37	37			
8.00%	55	55	55	55	55	55	55			
KR4A14610005							2026-01 KT개별선물		55	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55			
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37			
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18			
5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37			
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55			
KR4A50610000							2026-01 SK하이닉스개별선물		58	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58			
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39			
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	19	19	19	19	19	19	19			
5.33%	39	39	39	39	39	39	39			
8.00%	58	58	58	58	58	58	58			
KR4AB3610006							2026-01 고려아연개별선물		100	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	66	66	66	66	66	66	66
8.00%	100	100	100	100	100	100	100
KR4ACT610004 2026-01 삼성화재개별선물							27
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	27	27	27
-5.33%	18	18	18	18	18	18	18
-2.67%	9	9	9	9	9	9	9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
KR4AD0610005 2026-01 DB손해보험개별선물							27
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	27	27	27
-5.33%	18	18	18	18	18	18	18
-2.67%	9	9	9	9	9	9	9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
KR4AEJ610004 2026-01 SKC개별선물							21
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-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%	21	21	21	21	21	21	21

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

(단위:백만원)

1,325

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

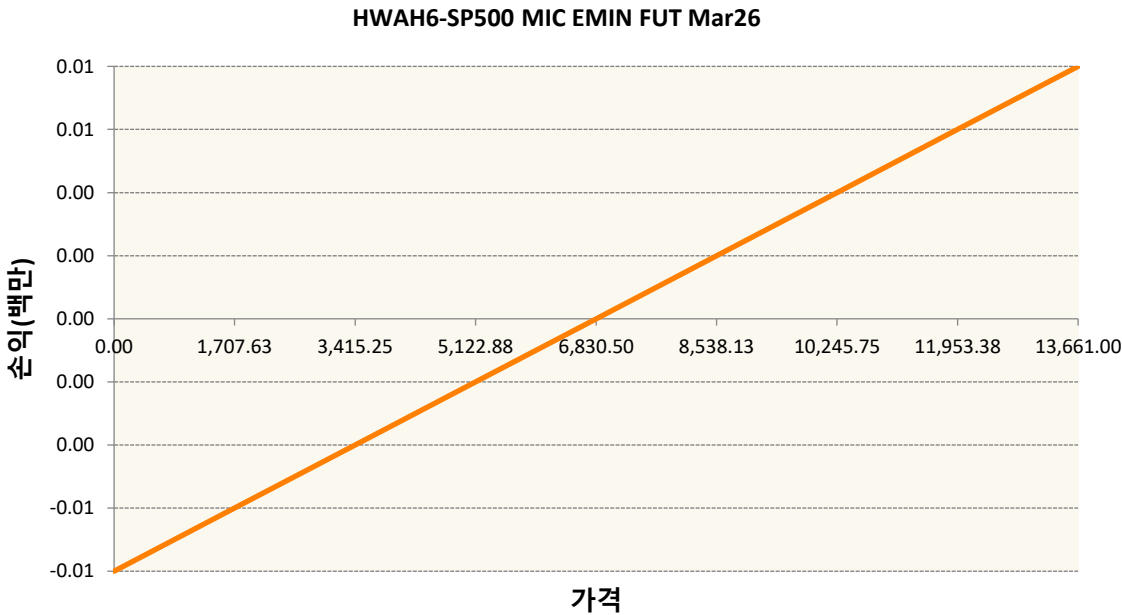
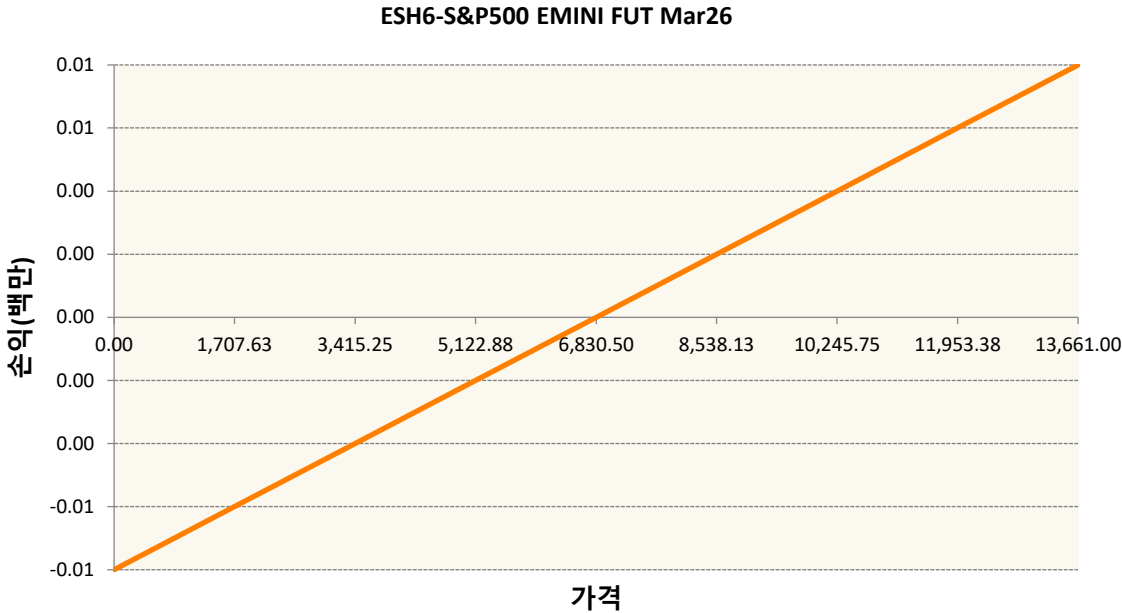
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,111	0	1,111	장내
누계	지수	선물	46,954	0	46,954	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	3,756
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	89

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,404

공시일 2025-12-22

기준일 2025-12-19

SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

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	2025-12-22
기준일	2025-12-19

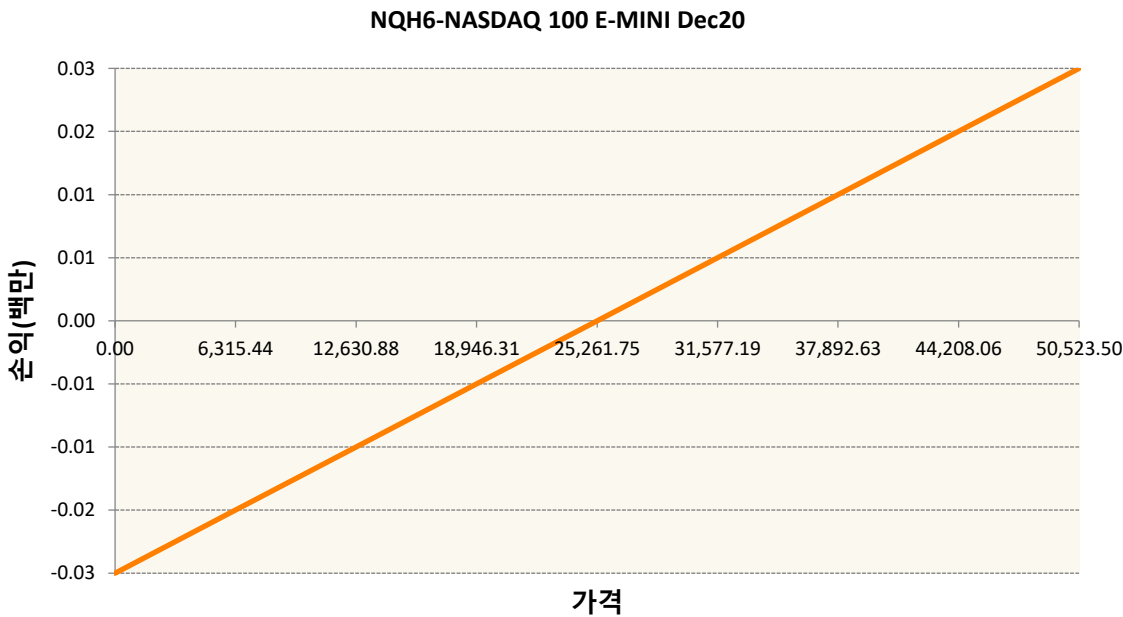
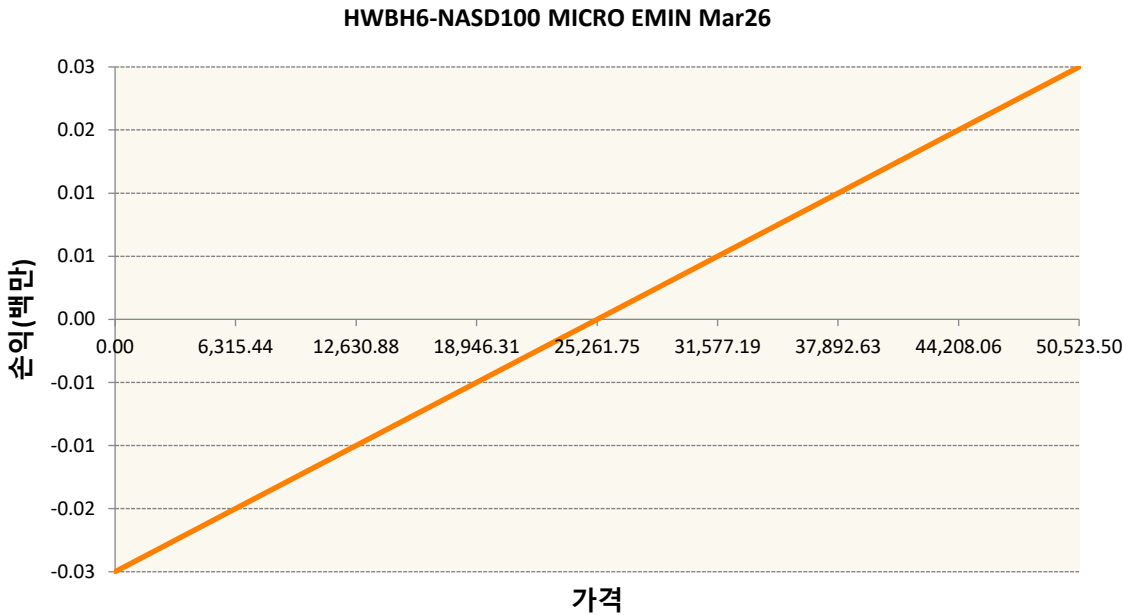
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	22,332	0	22,332	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN Mar26	54
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,733

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,028

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

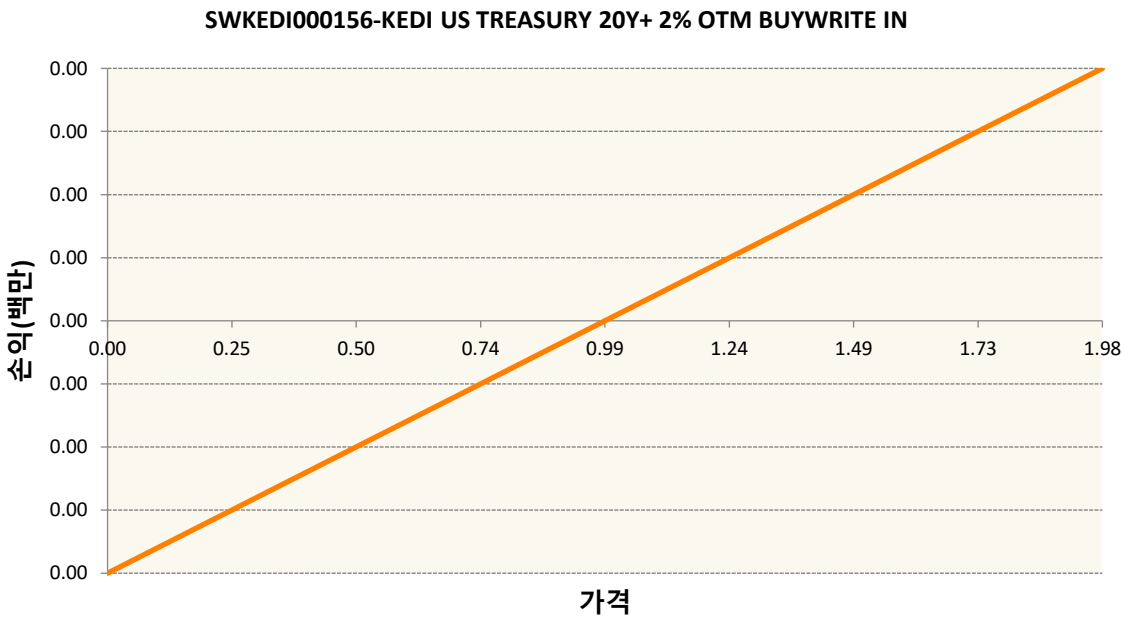
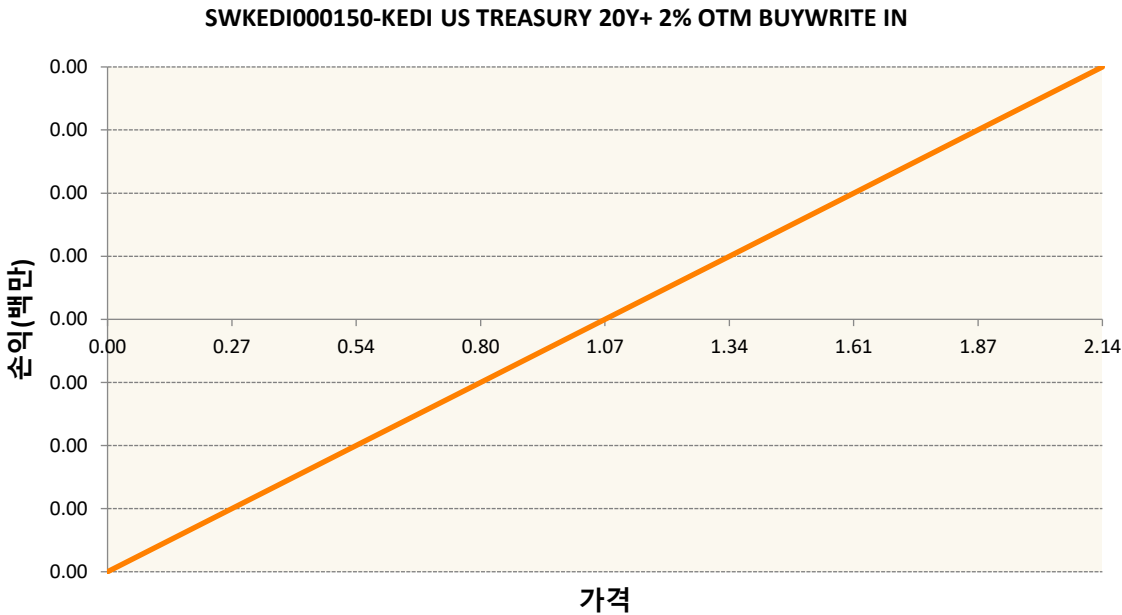
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

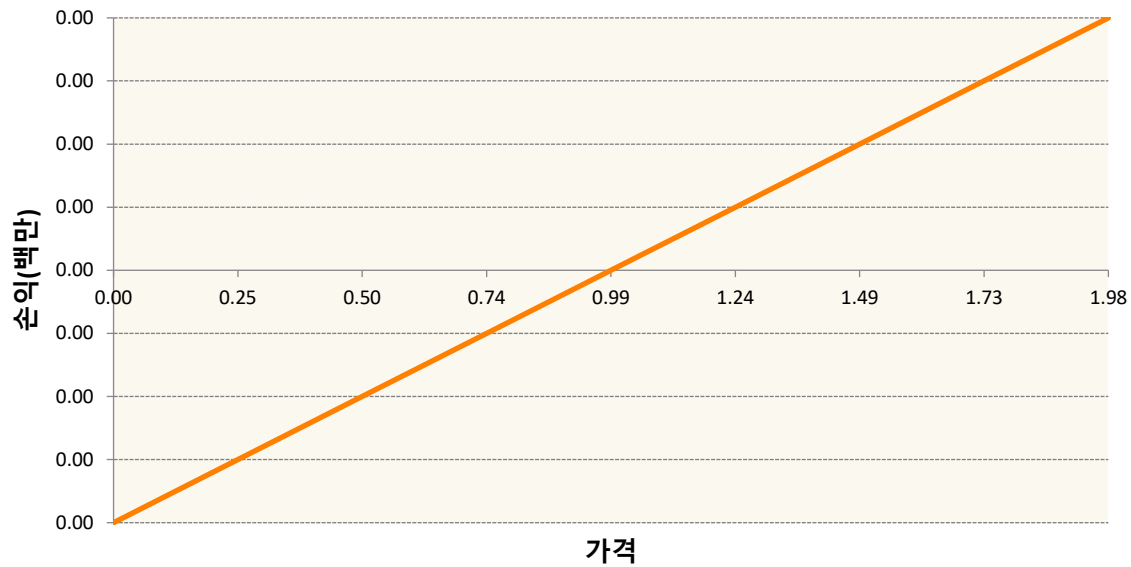
(단위:백만원)

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

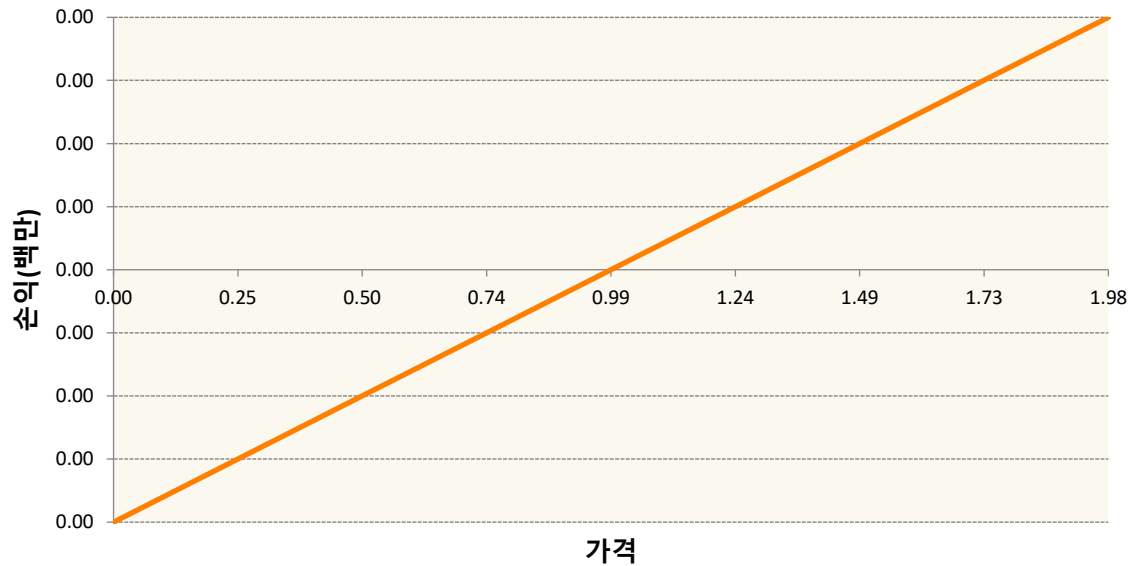
2. 만기시점의 손익구조



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	8,247
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	10,167
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,511
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,746

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

(단위:백만원)

13,965

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

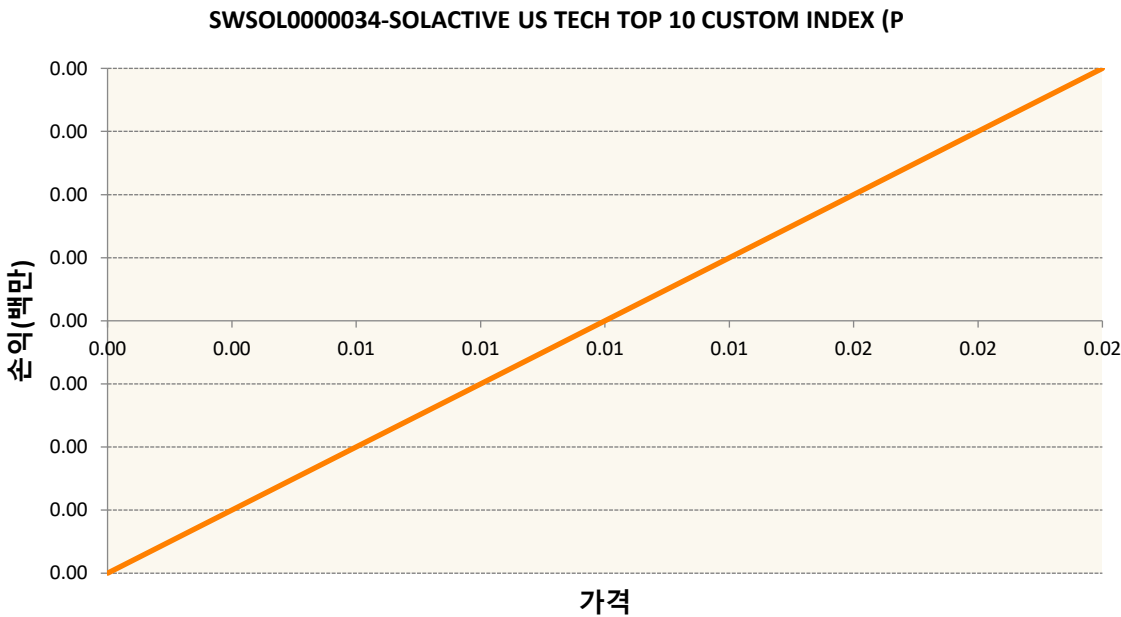
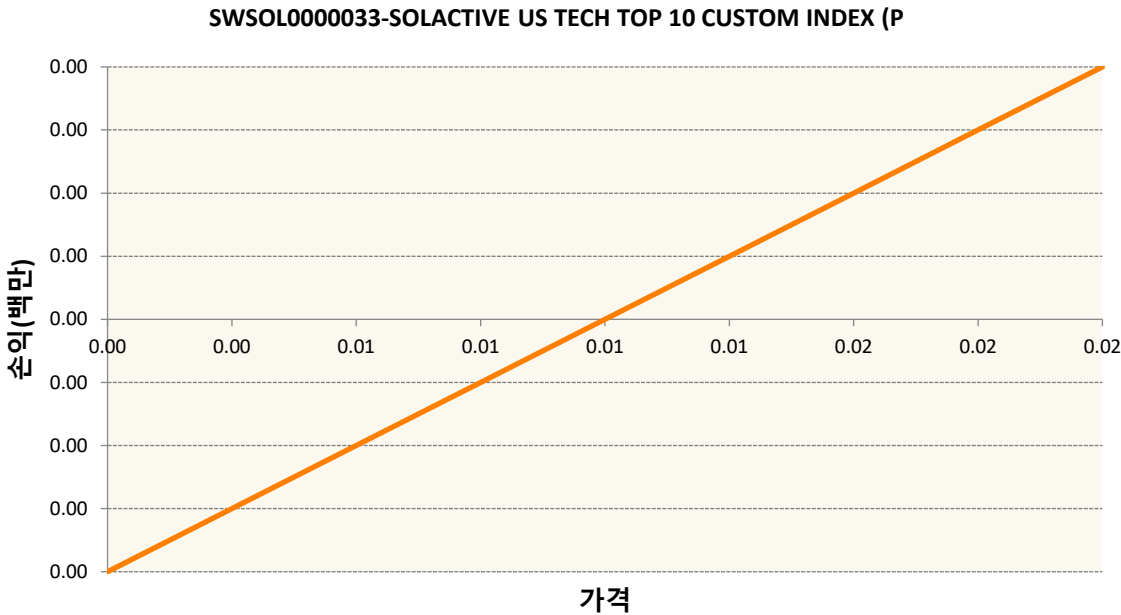
SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

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	2,323	0	2,323	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	1

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

4

공시일	2025-12-22
기준일	2025-12-19

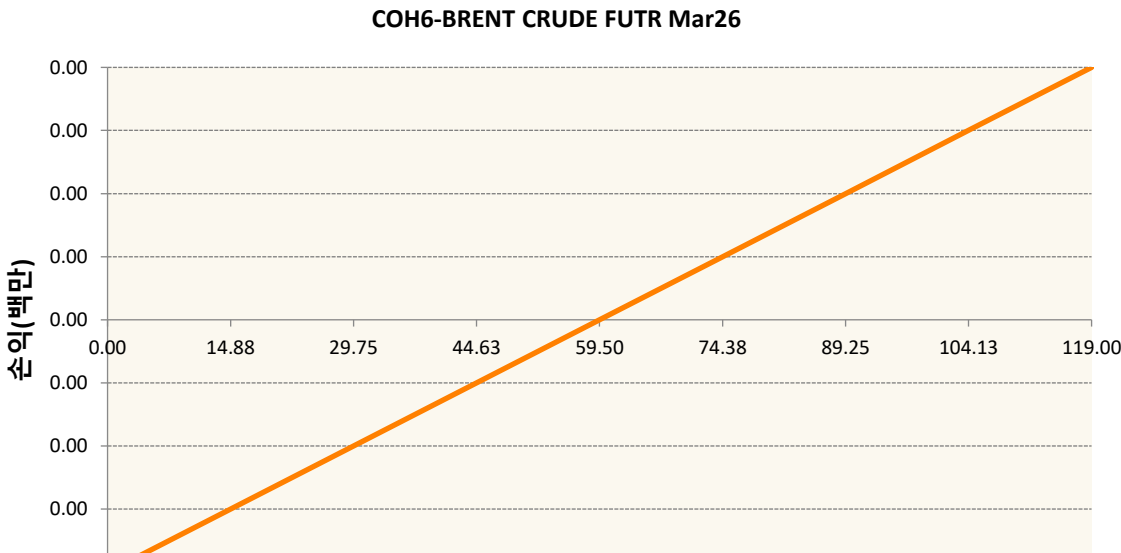
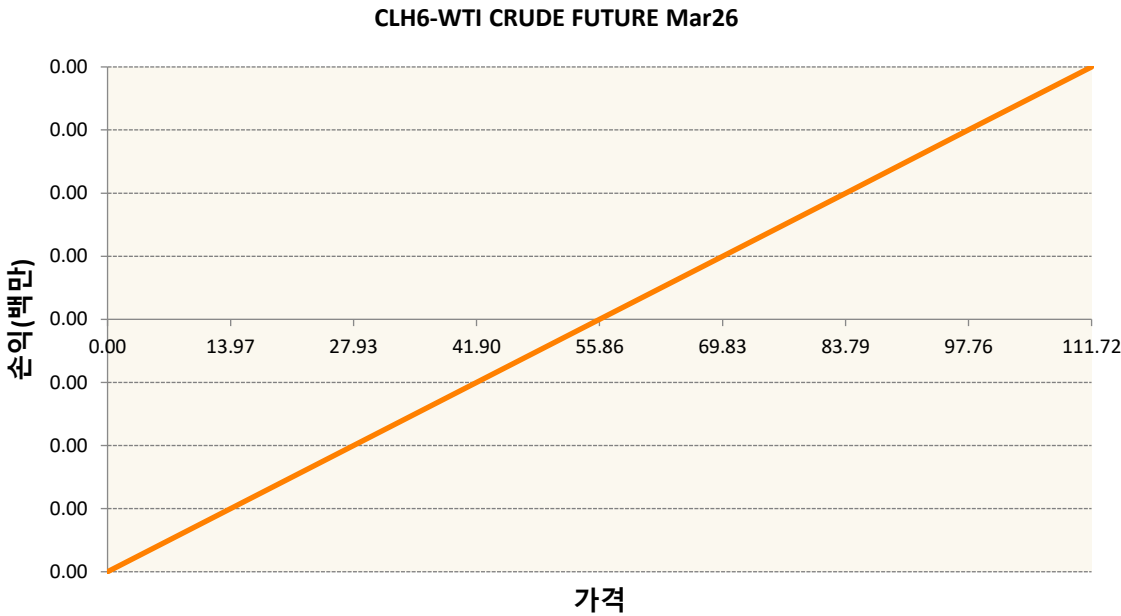
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

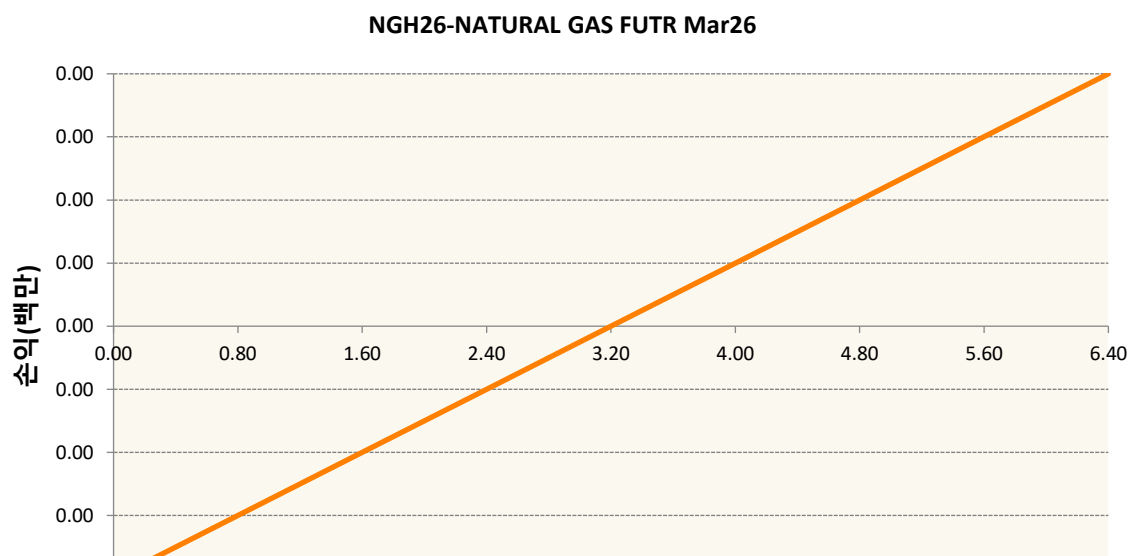
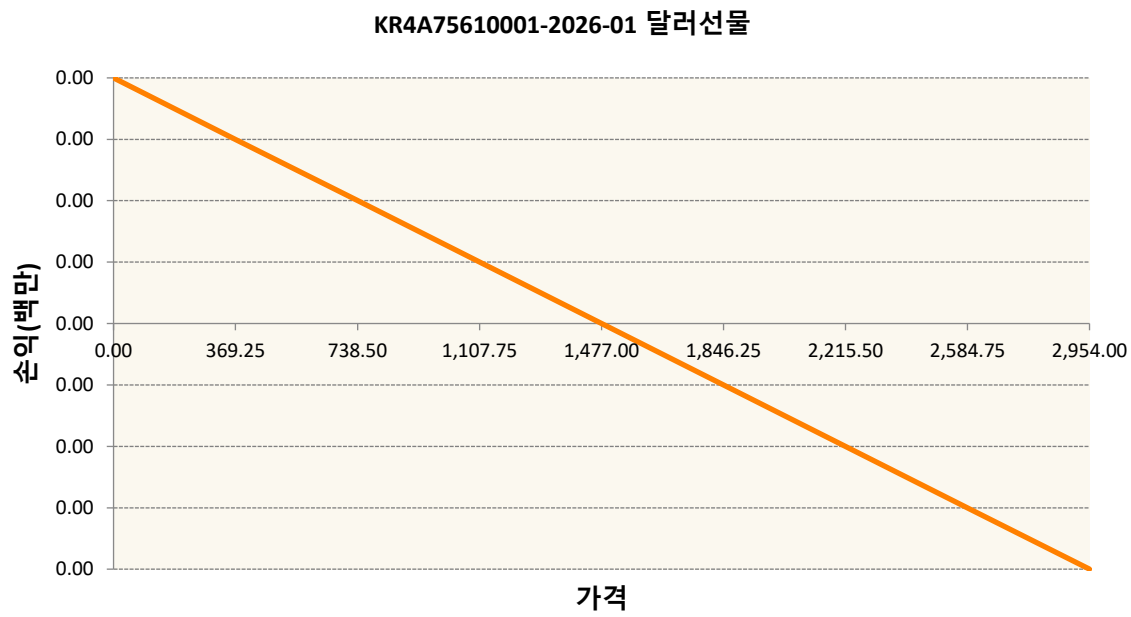
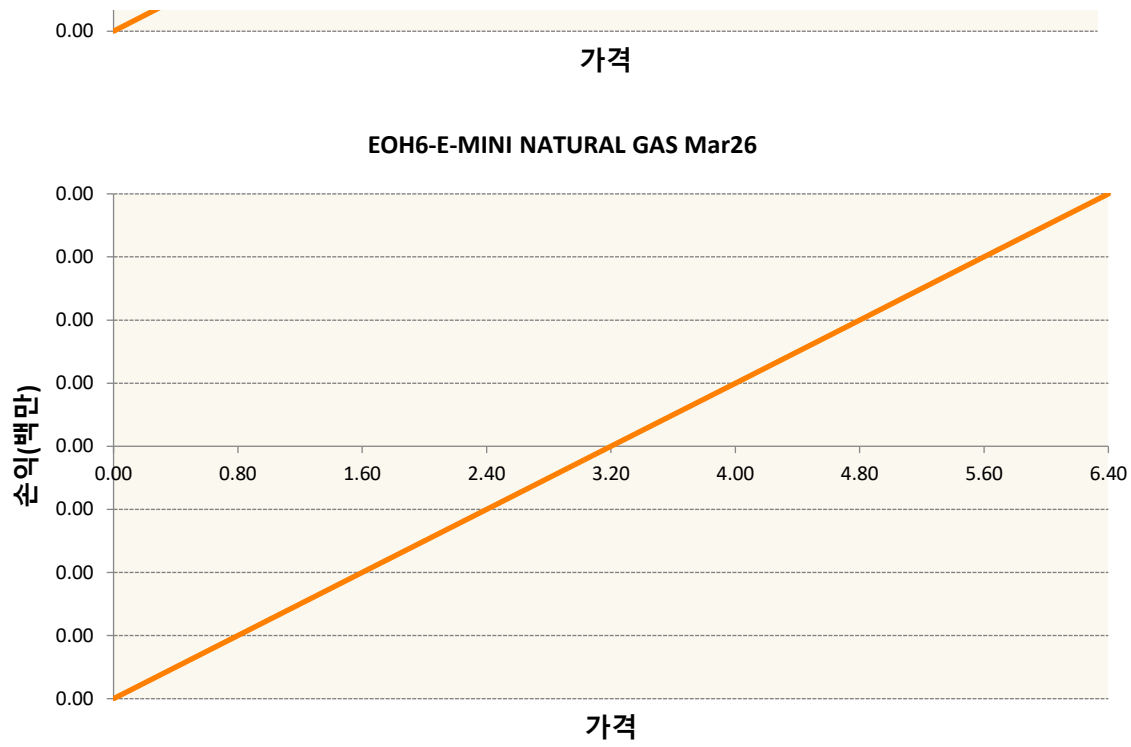
1. 계약금액

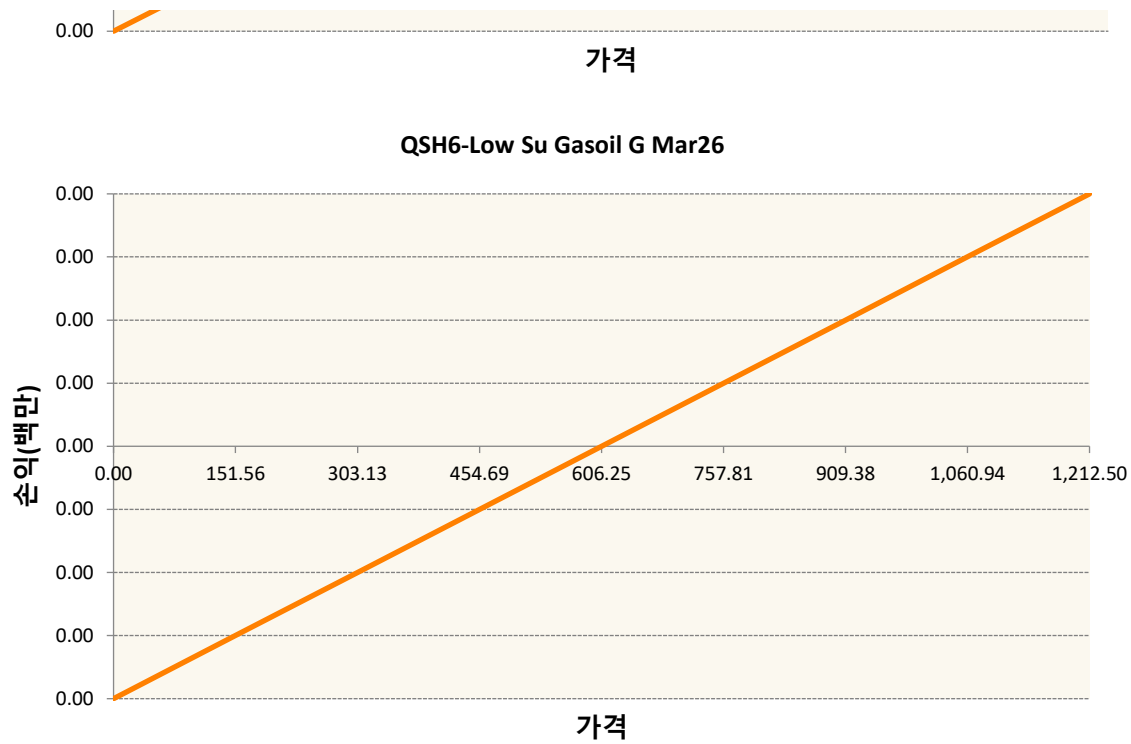
(단위:백만원)

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	141	0	141	
누계	유가증권	선물	346	0	346	
누계	통화	선물	0	74	-74	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		4
KR4A756100 2026-01 달러선물			6
NGH26	NATURAL GAS FUTR Mar26		8
QSH6	Low Su Gasoil G Mar26		7

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		82