

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

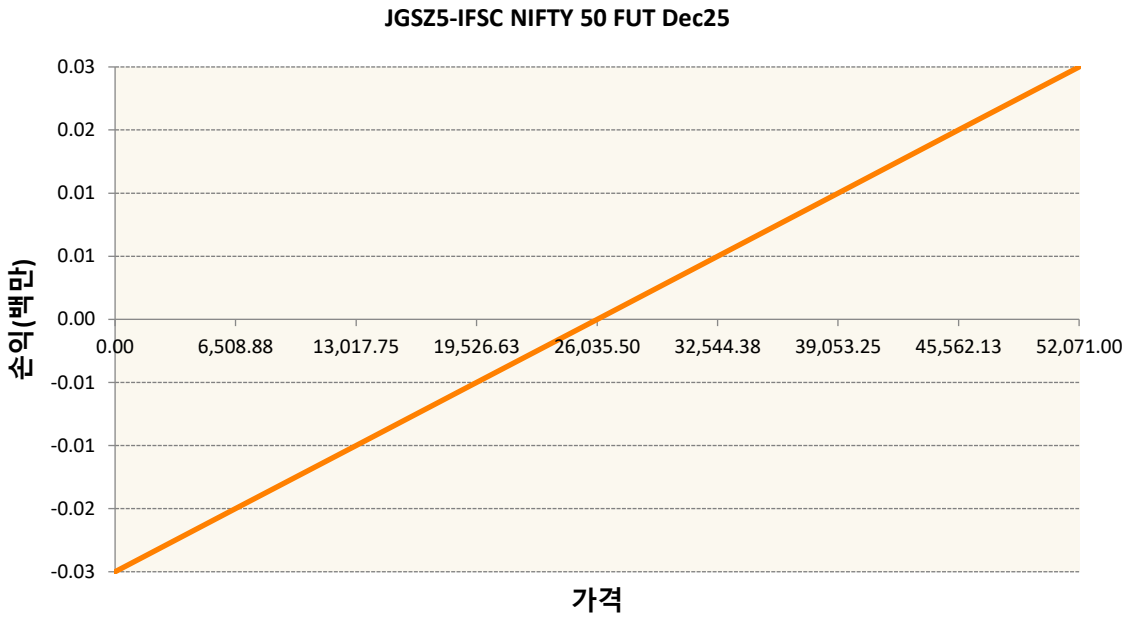
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	692	0	692	

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	2025-12-23
기준일	2025-12-22

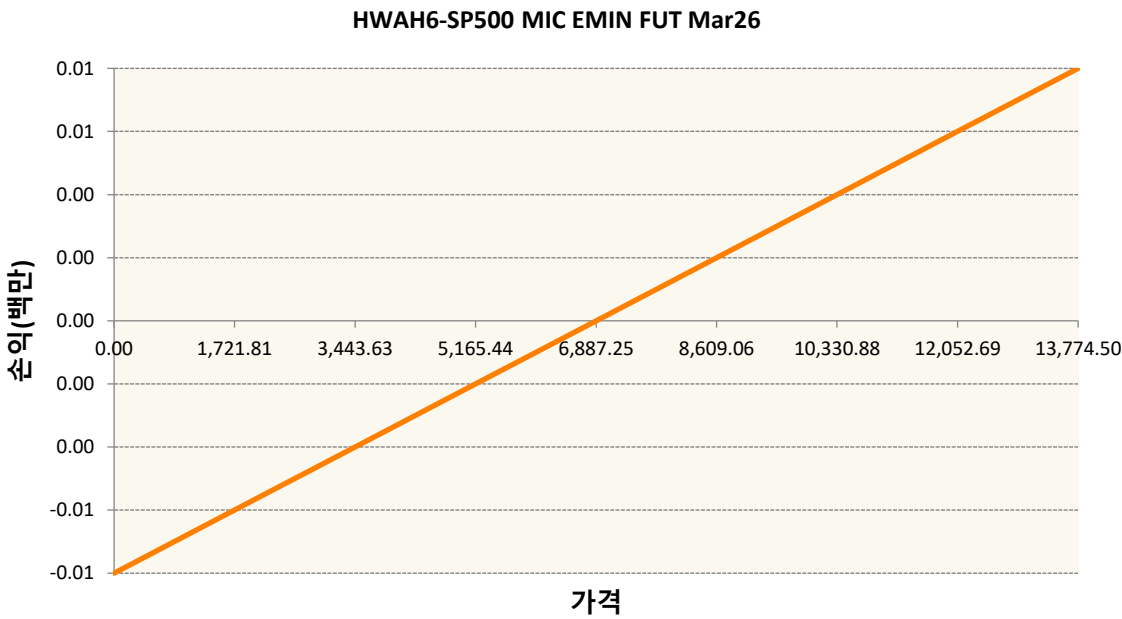
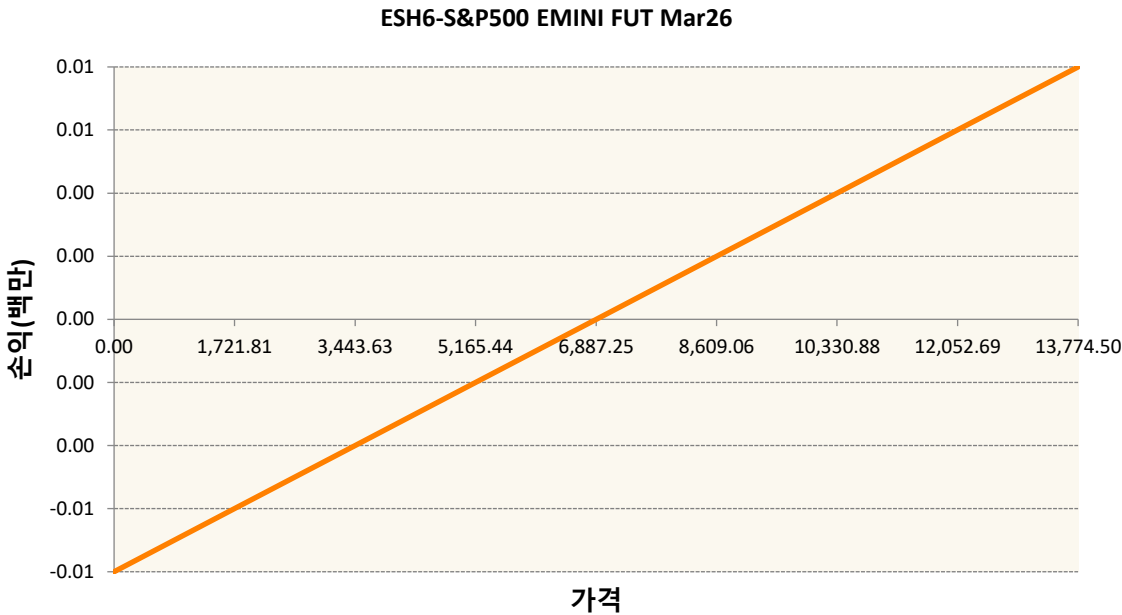
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	255	0	255	장내
누계	지수	선물	509	0	509	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	41
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	20

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	54

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

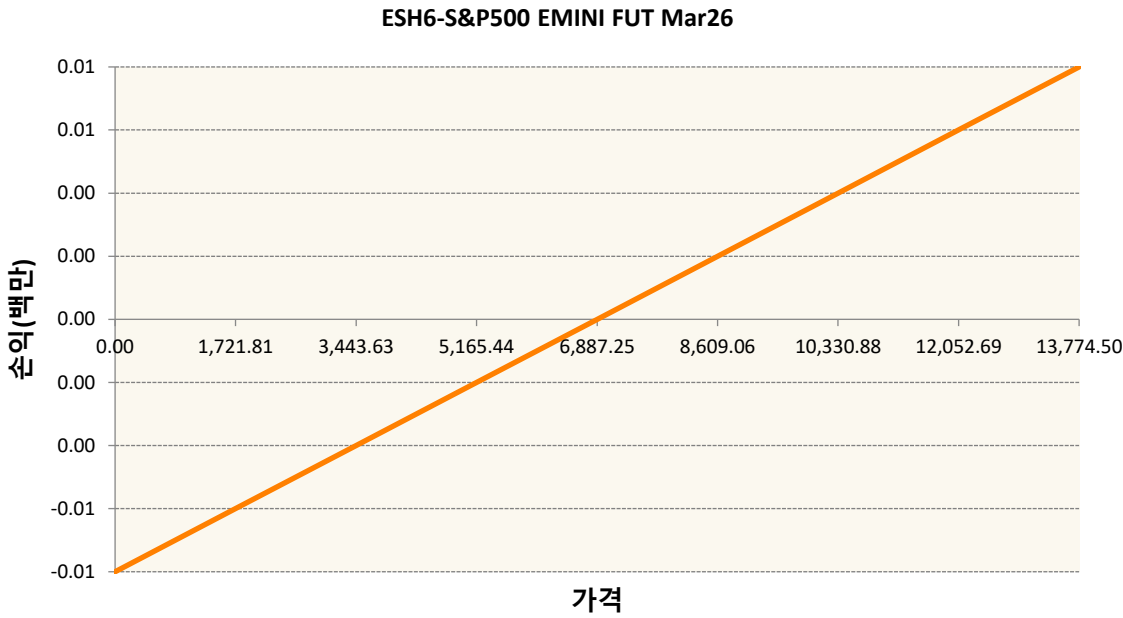
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,527	0	1,527	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	122
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

108

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

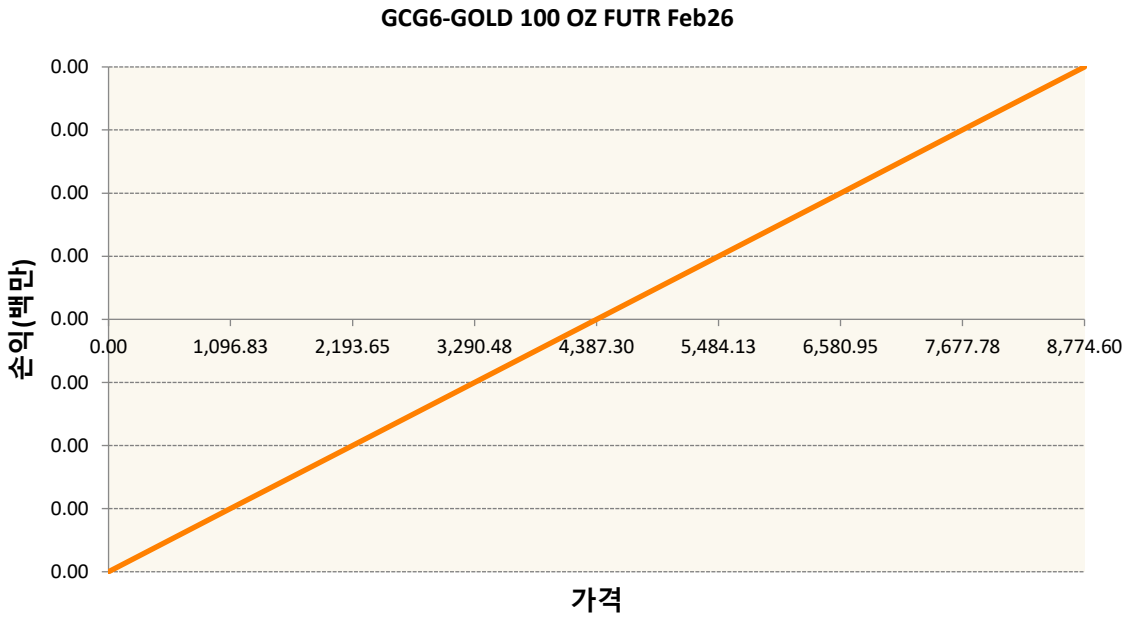
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	3,231	0	3,231	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 12/26/25 C405 EQUITY	1
GCG6 GOLD 100 OZ FUTR Feb26	258

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

(단위:백만원)

331

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

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)

AOPLTRUAP' PLTR US 12/26/25 P195 EQUITY	30
AOPLTRUCP' PLTR US 12/26/25 C195 EQUITY	90

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

(단위:백만원)

459

공시일 2025-12-23

기준일 2025-12-22

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

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	2025-12-23
기준일	2025-12-22

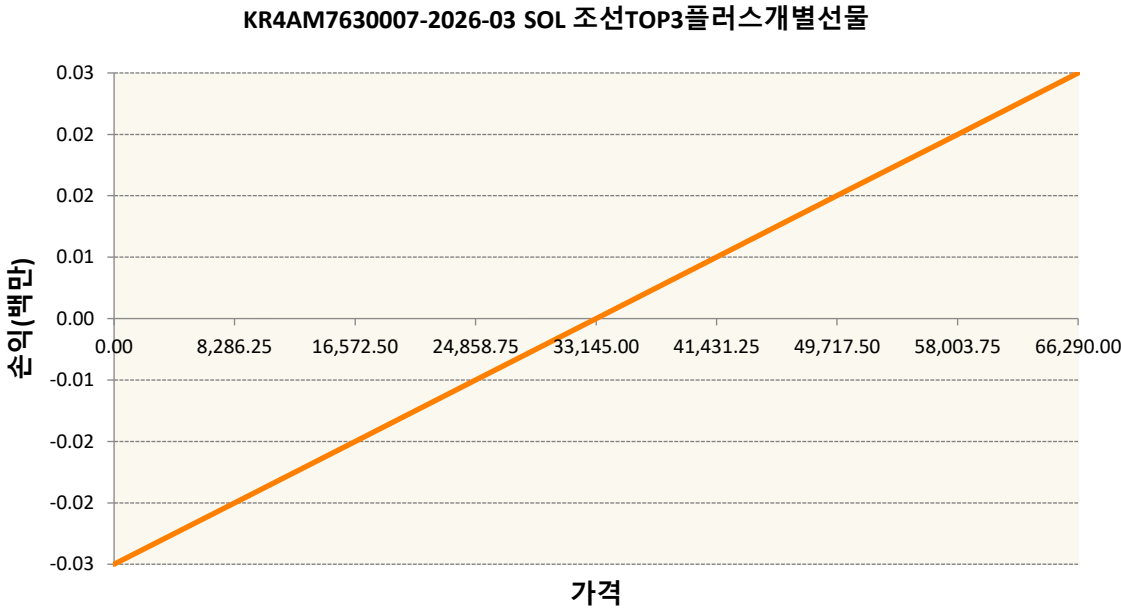
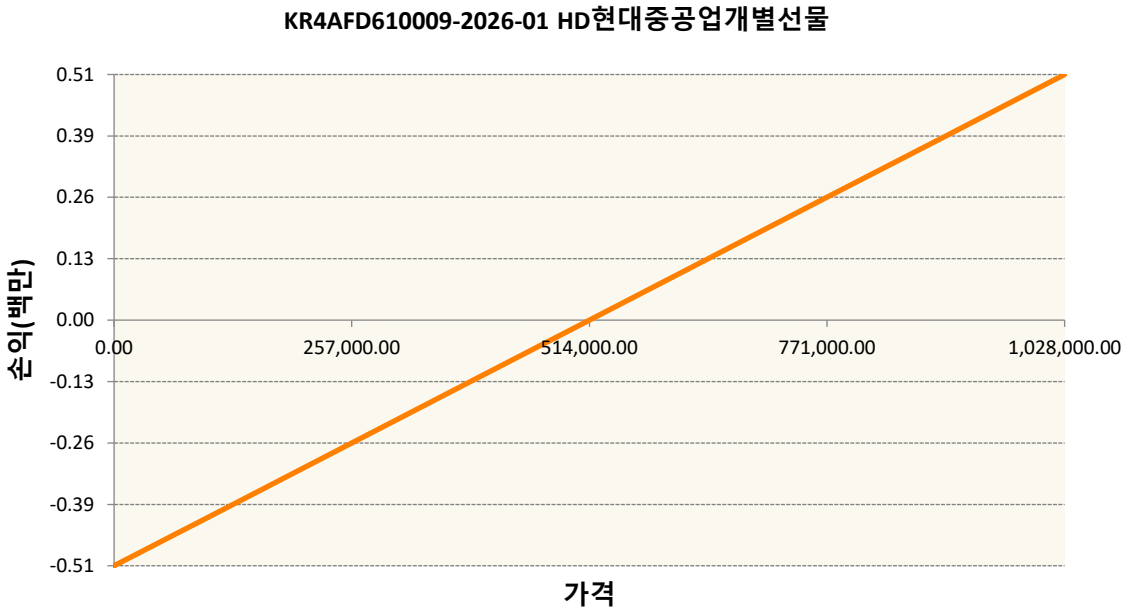
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	20,552	0	20,552	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD610009		2026-01 HD현대중공업개별선물					824
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-824	-824	-824	-824	-824	-824	-824
-5.33%	-549	-549	-549	-549	-549	-549	-549
-2.67%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	275	275	275	275	275	275	275
5.33%	549	549	549	549	549	549	549
8.00%	824	824	824	824	824	824	824
KR4AM7630007		2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물					806
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-806	-806	-806	-806	-806	-806	-806
-5.33%	-537	-537	-537	-537	-537	-537	-537
-2.67%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	269	269	269	269	269	269	269
5.33%	537	537	537	537	537	537	537
8.00%	806	806	806	806	806	806	806

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

1,697

공시일 2025-12-23

기준일 2025-12-22

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	2025-12-23
기준일	2025-12-22

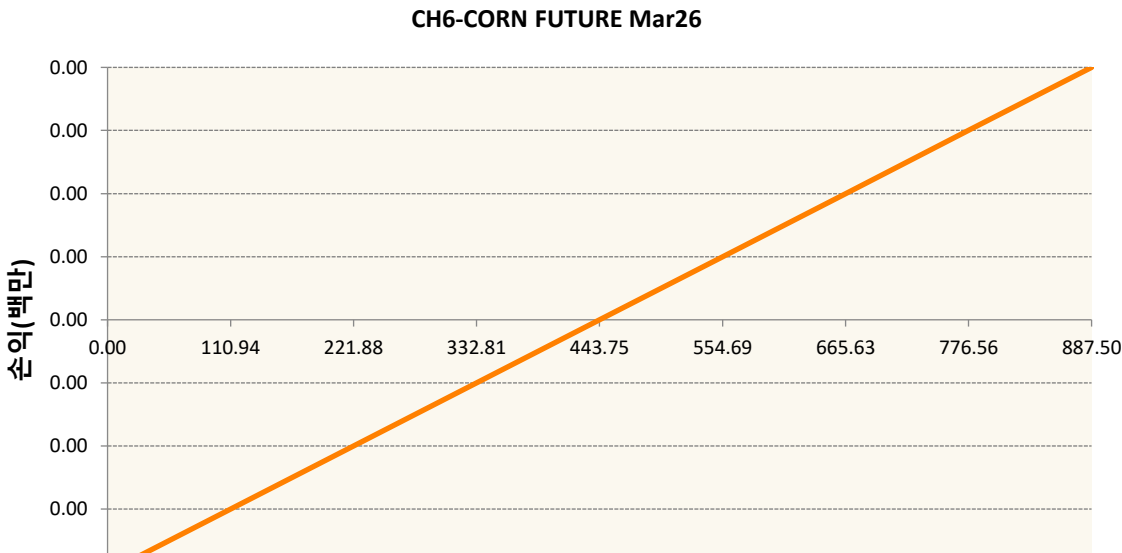
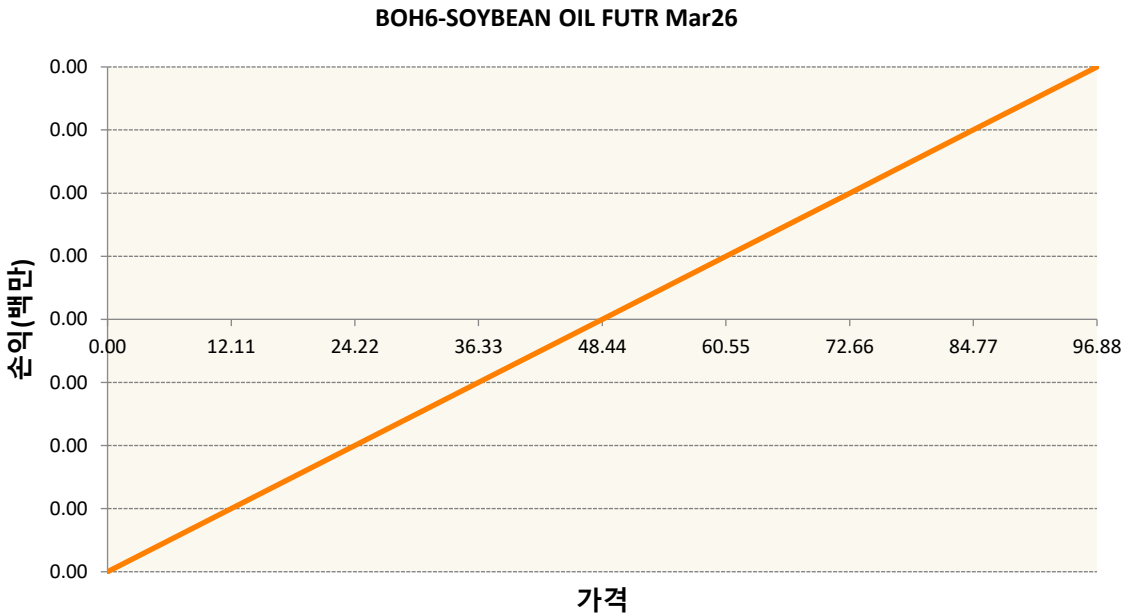
포커스농산물모(채권-파생형)

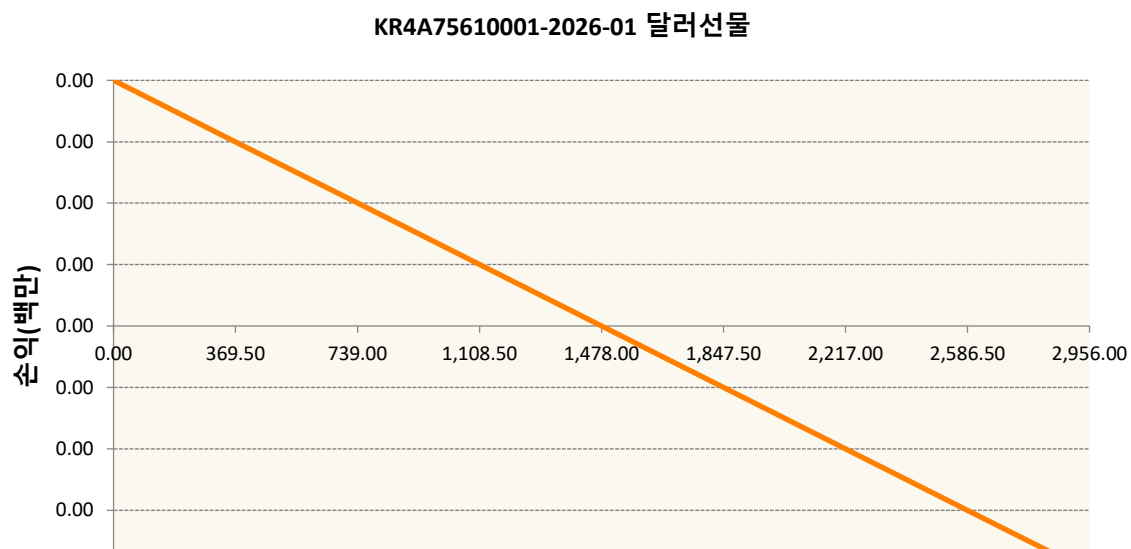
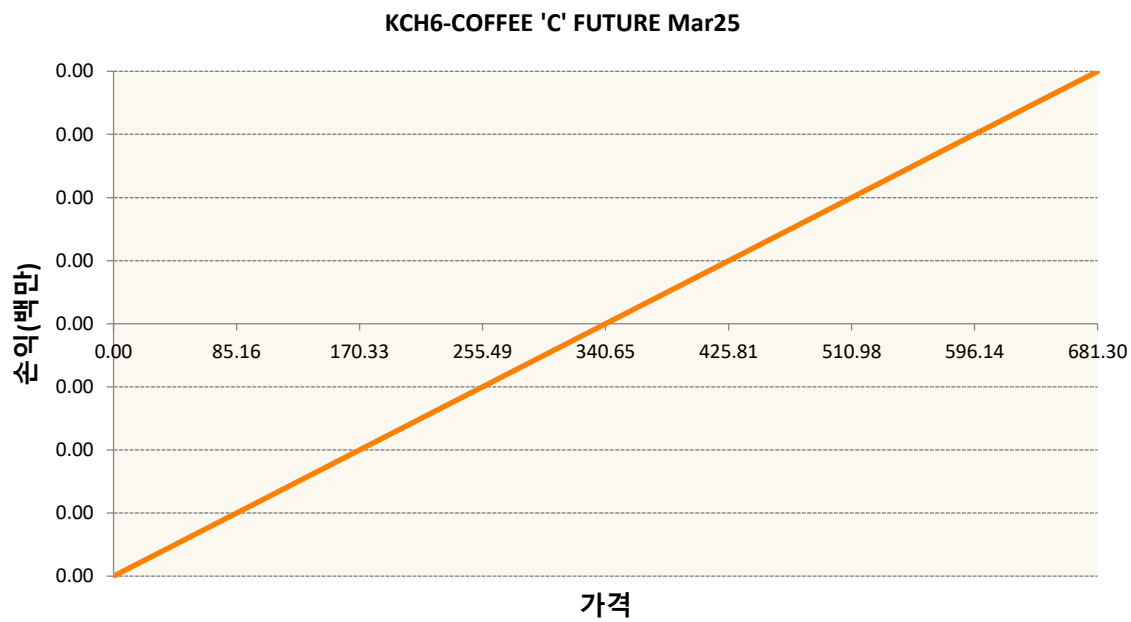
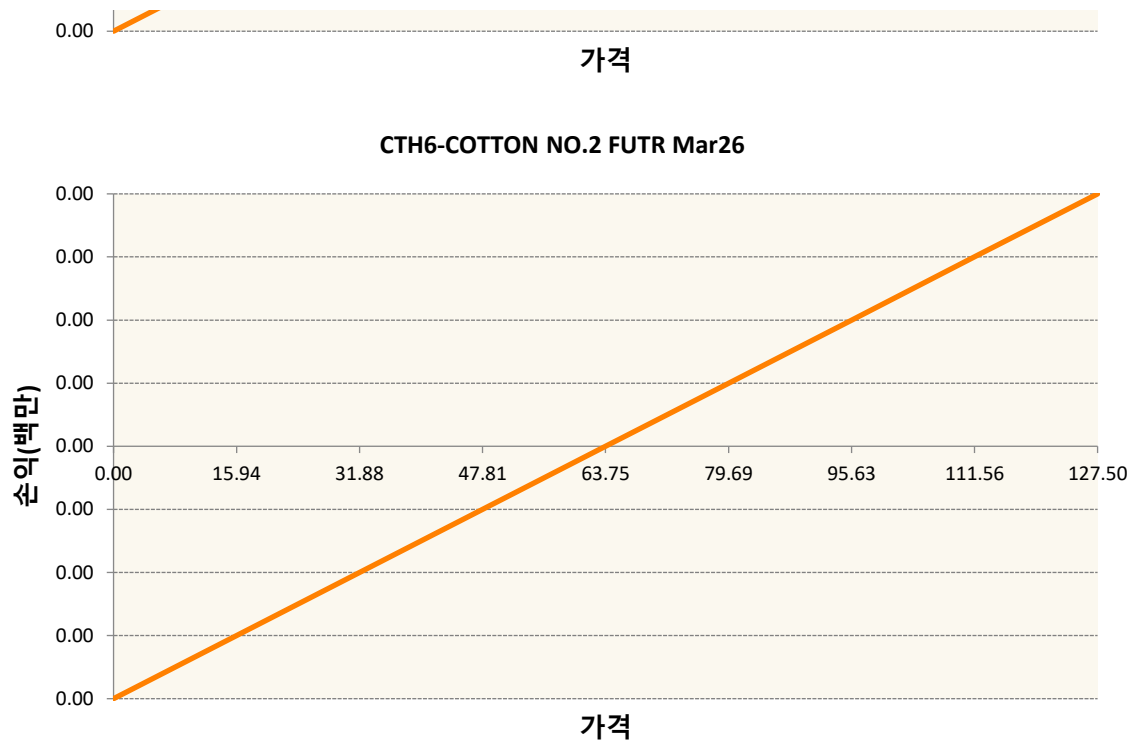
1. 계약금액

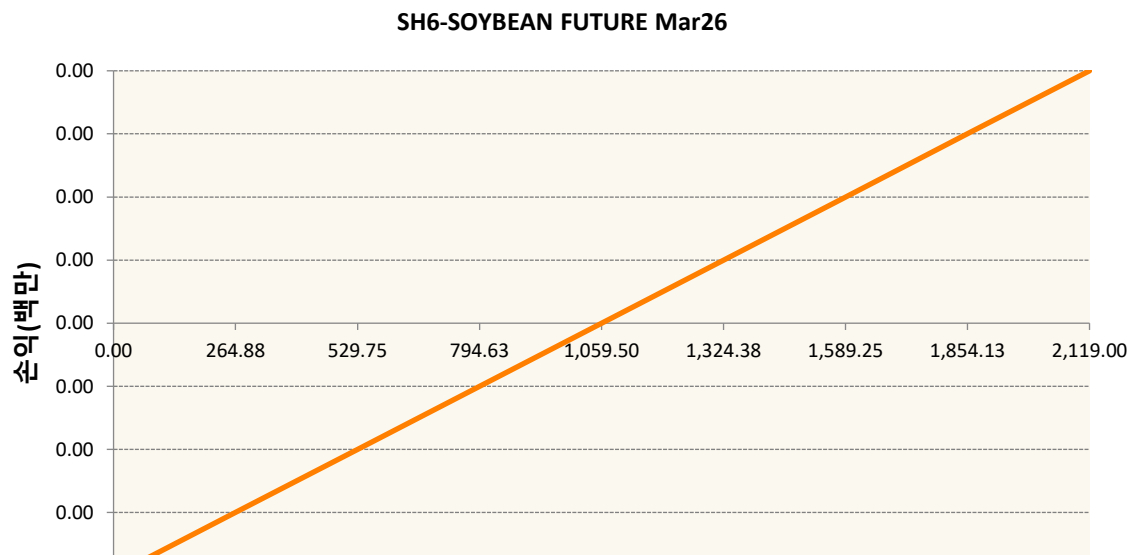
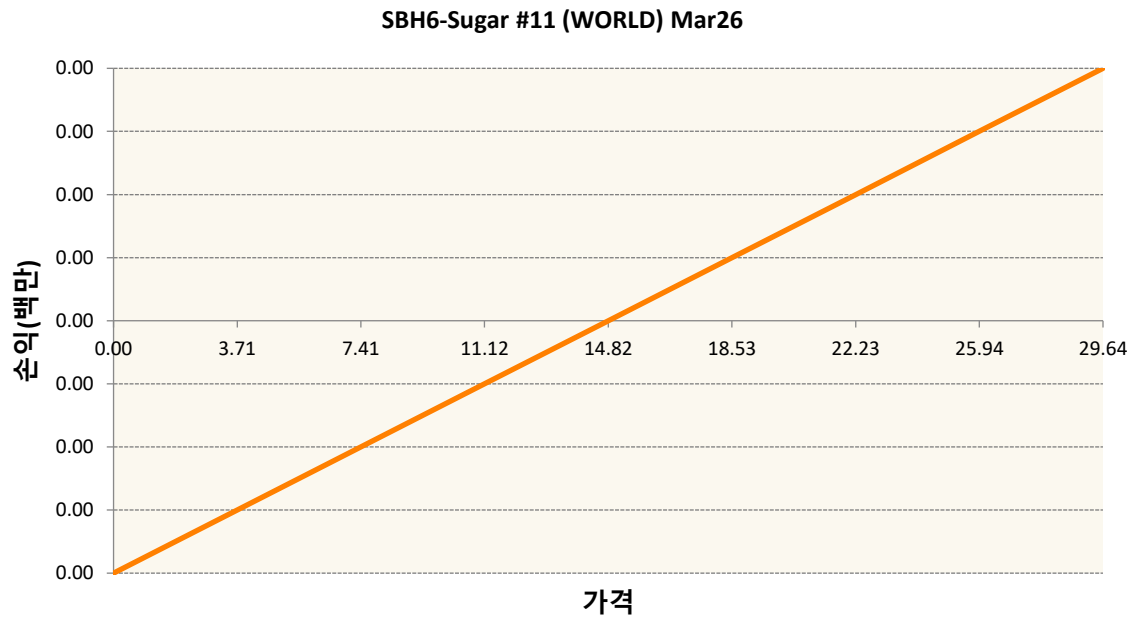
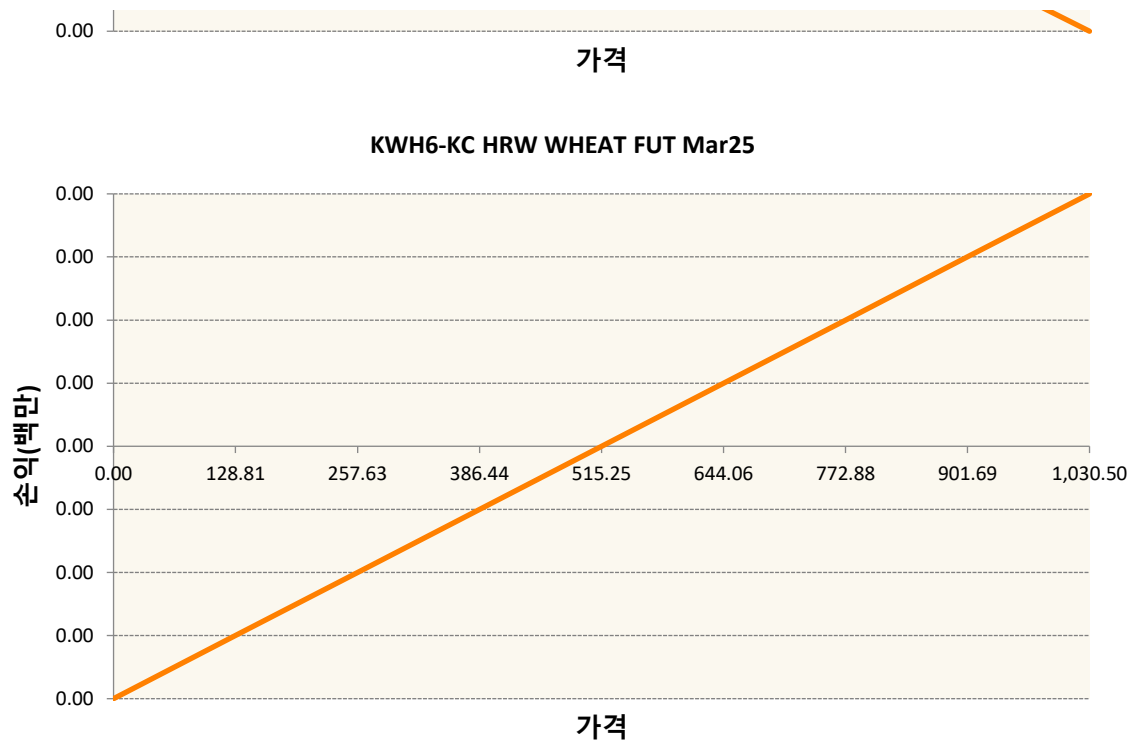
(단위:USD 백만)

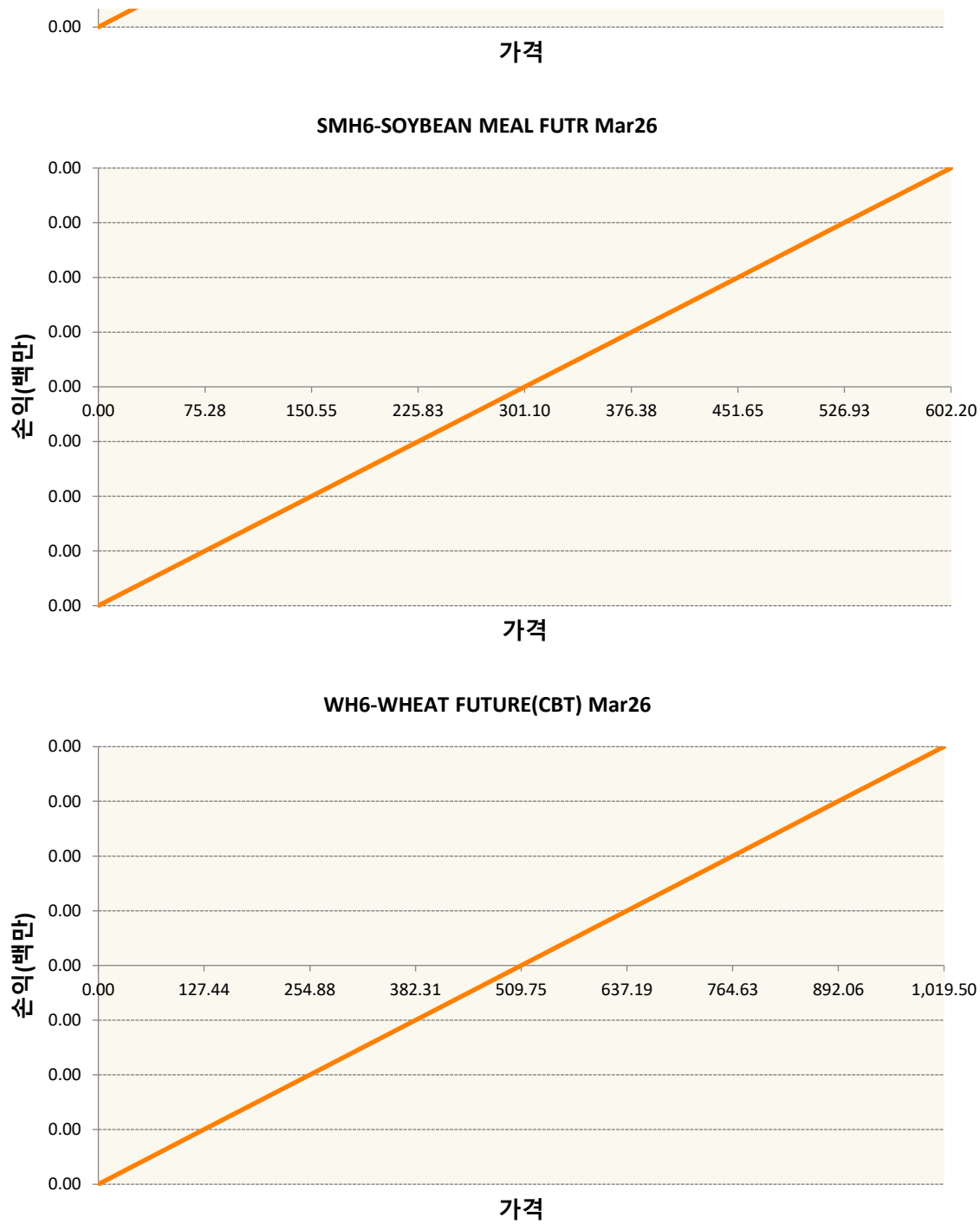
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	384	0	384	
누계	유가증권	선물	2,698	0	2,698	
누계	통화	선물	0	296	-296	장내

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	2025-12-23
기준일	2025-12-22

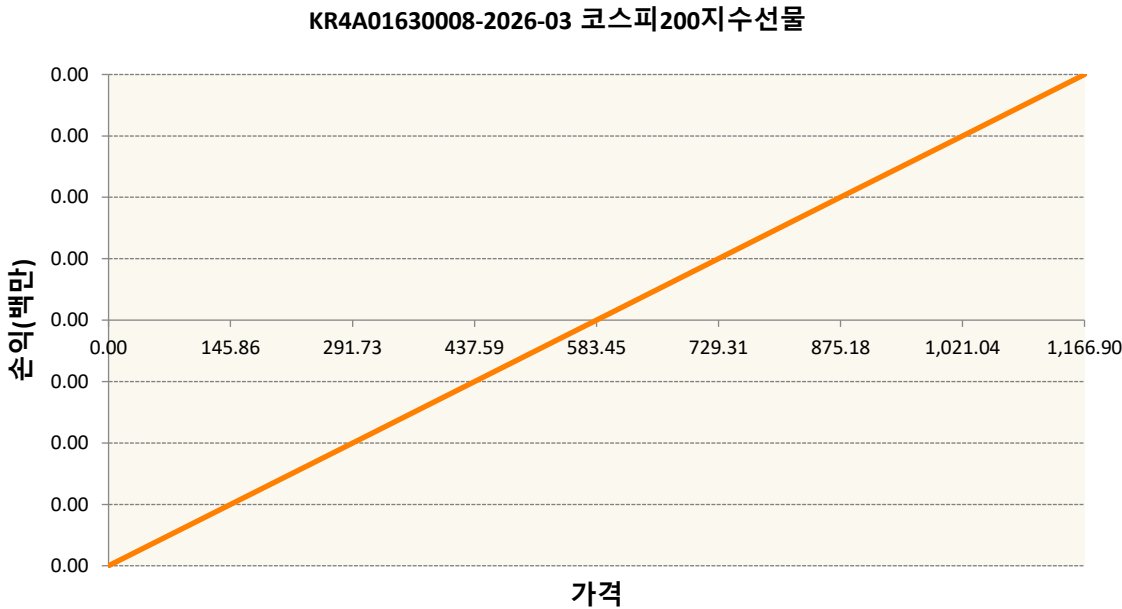
스마트인덱스모

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	1,313	0	1,313	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물

105

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

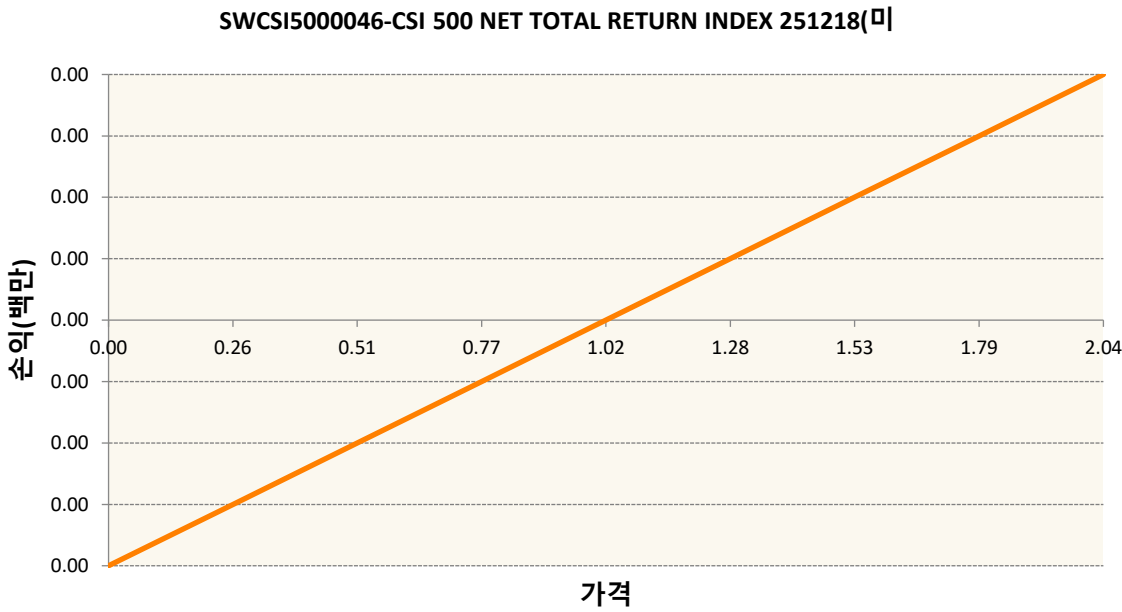
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,711	0	4,711	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

466

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

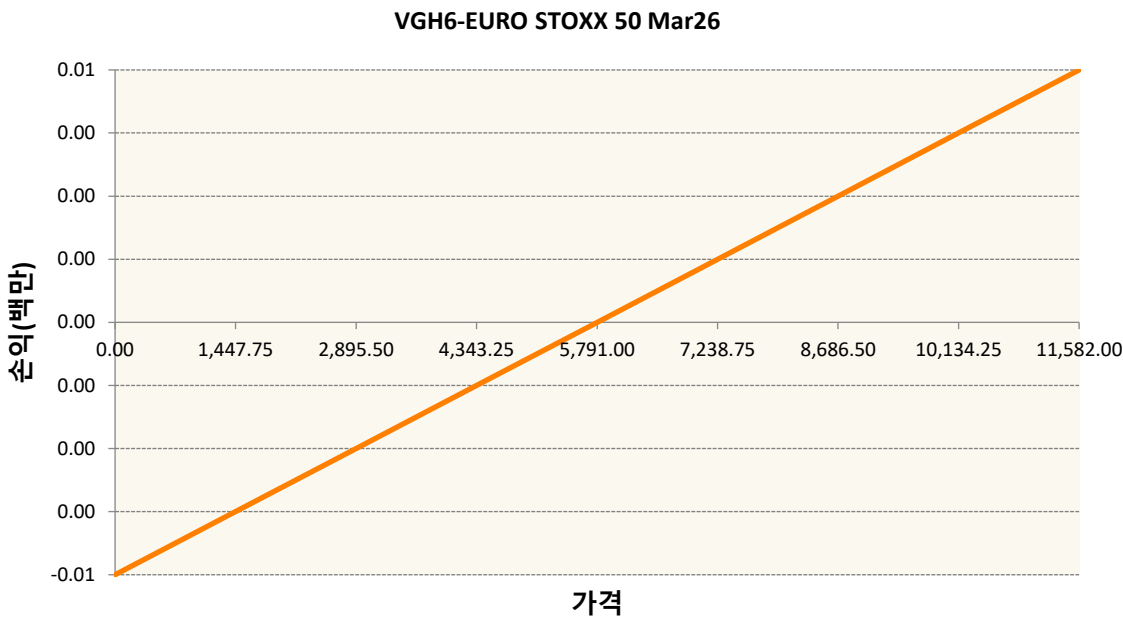
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	804	0	804	

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	2025-12-23
기준일	2025-12-22

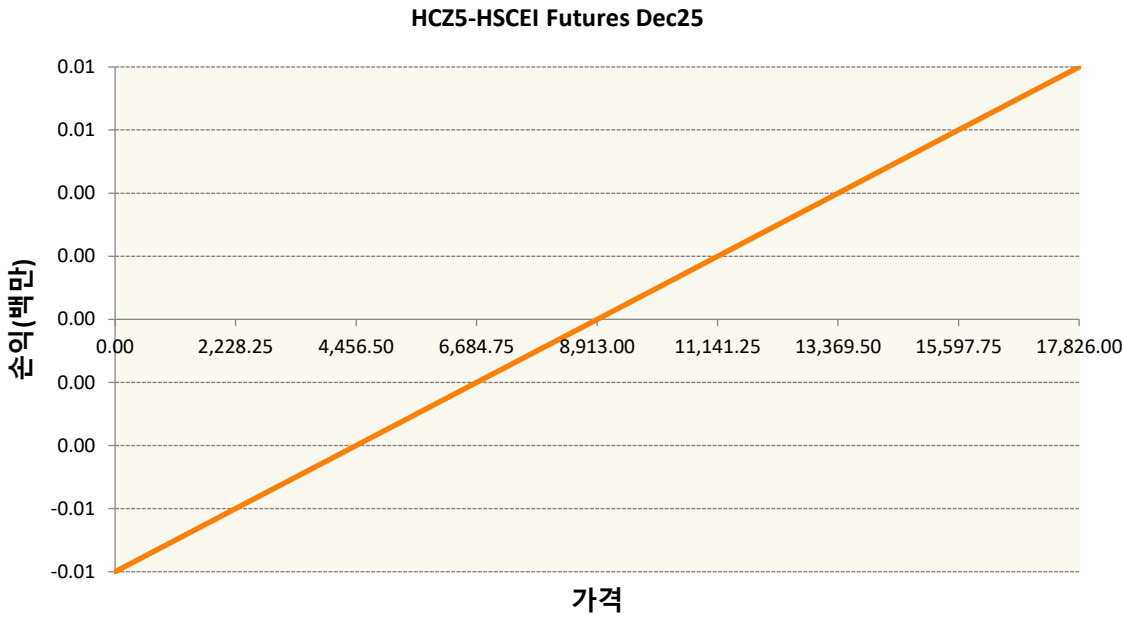
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,857	0	1,857	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

192

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

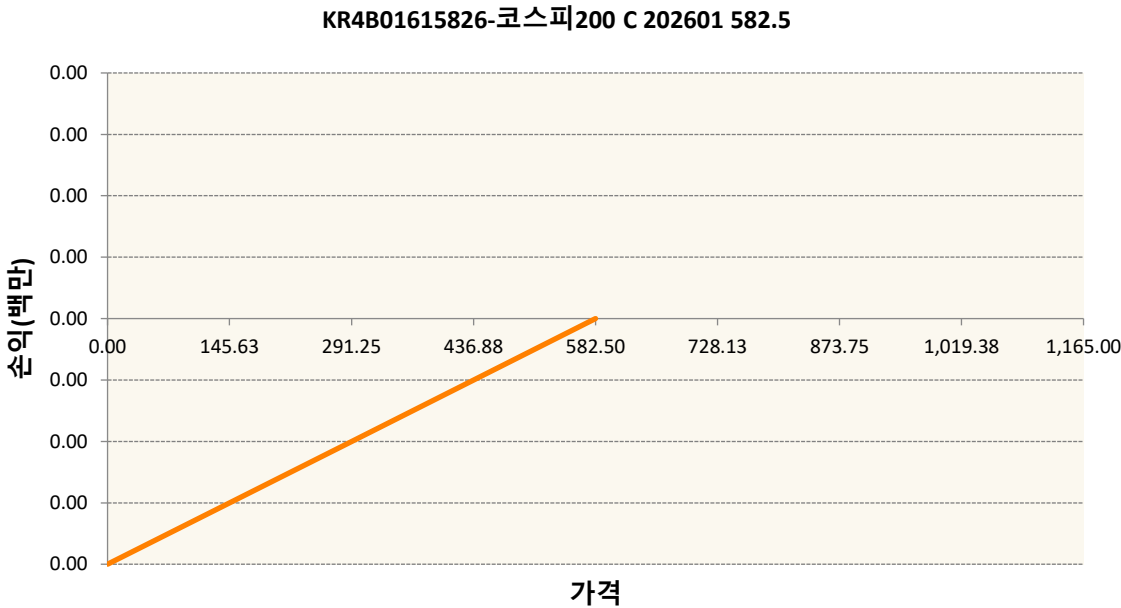
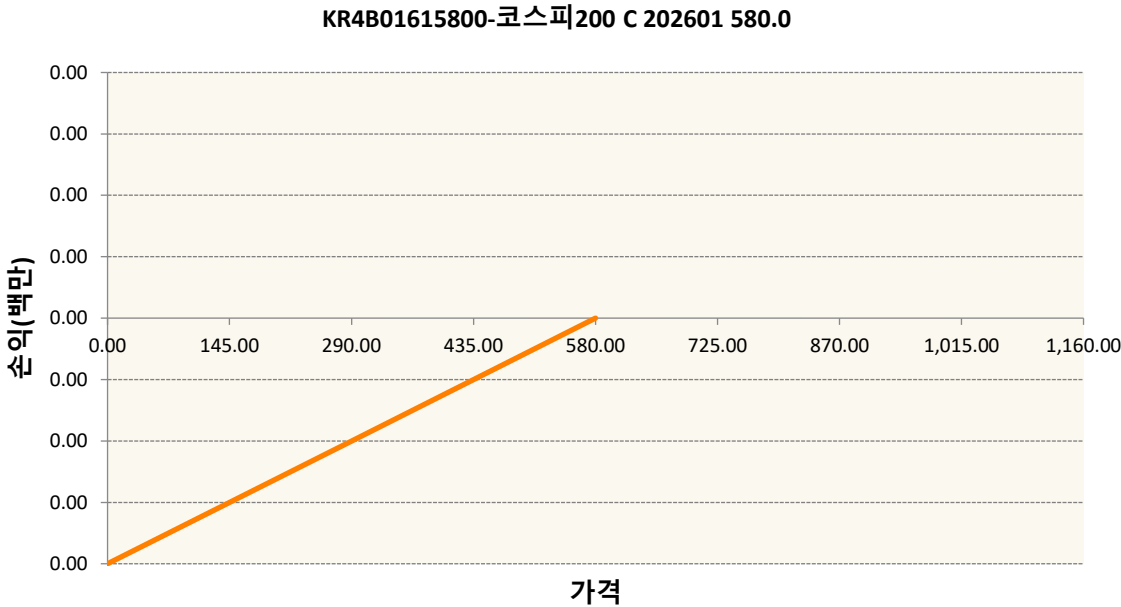
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

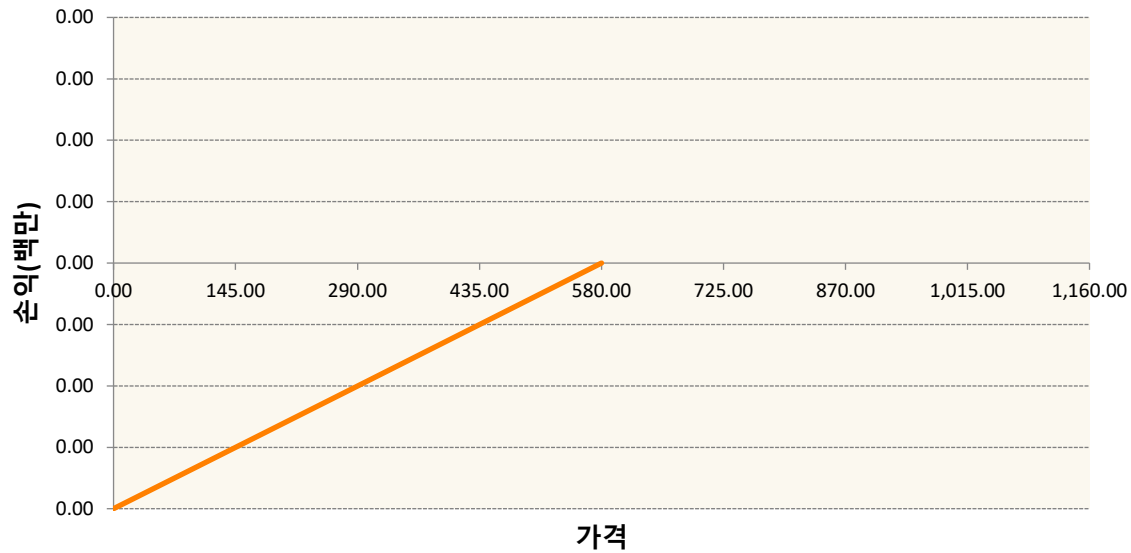
(단위:백만원)

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 2025-12-23

기준일 2025-12-22

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	2025-12-23
기준일	2025-12-22

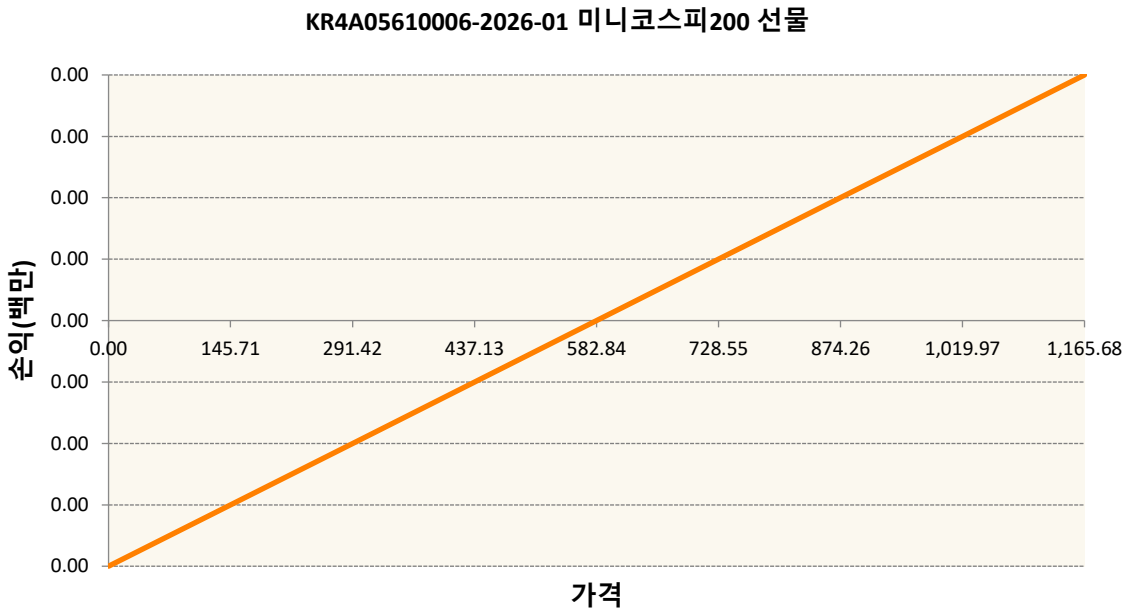
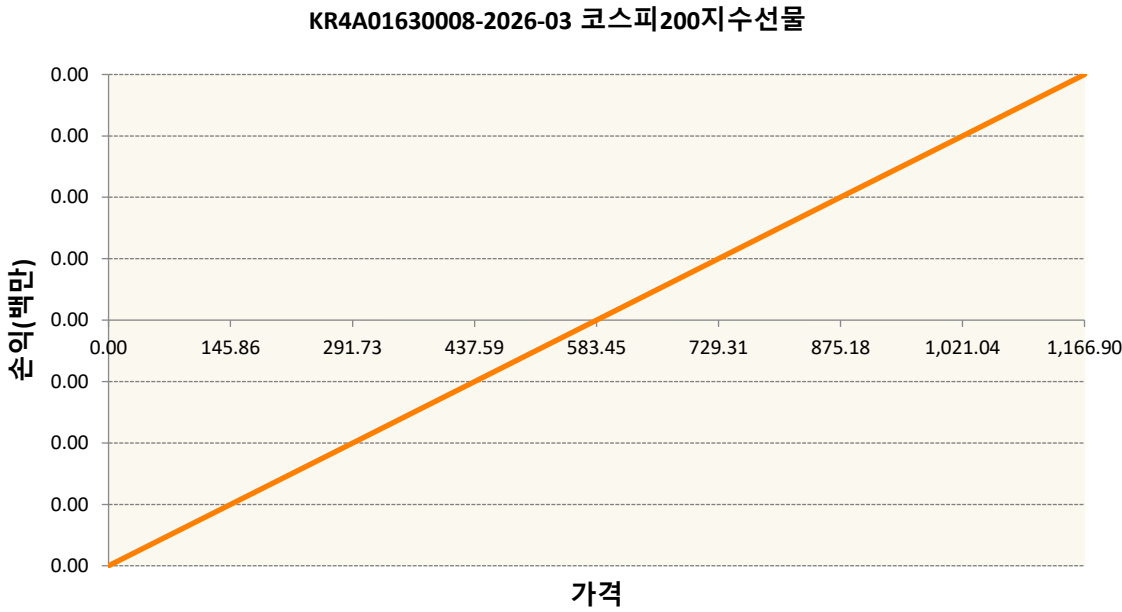
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,458	0	1,458	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		47
KR4A056100 2026-01 미니코스피200 선물		14

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

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

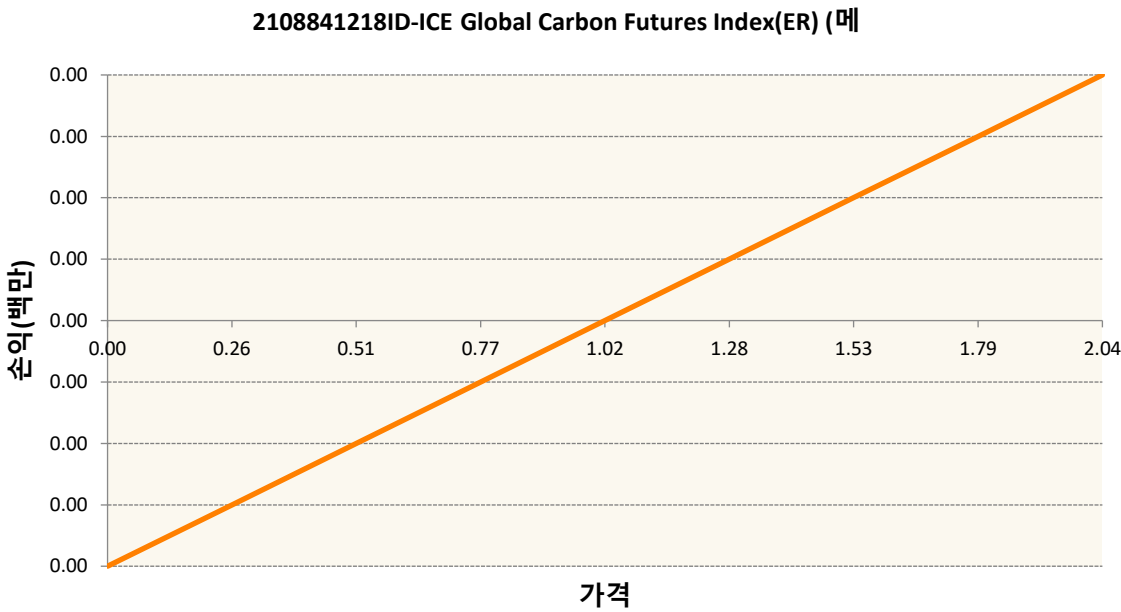
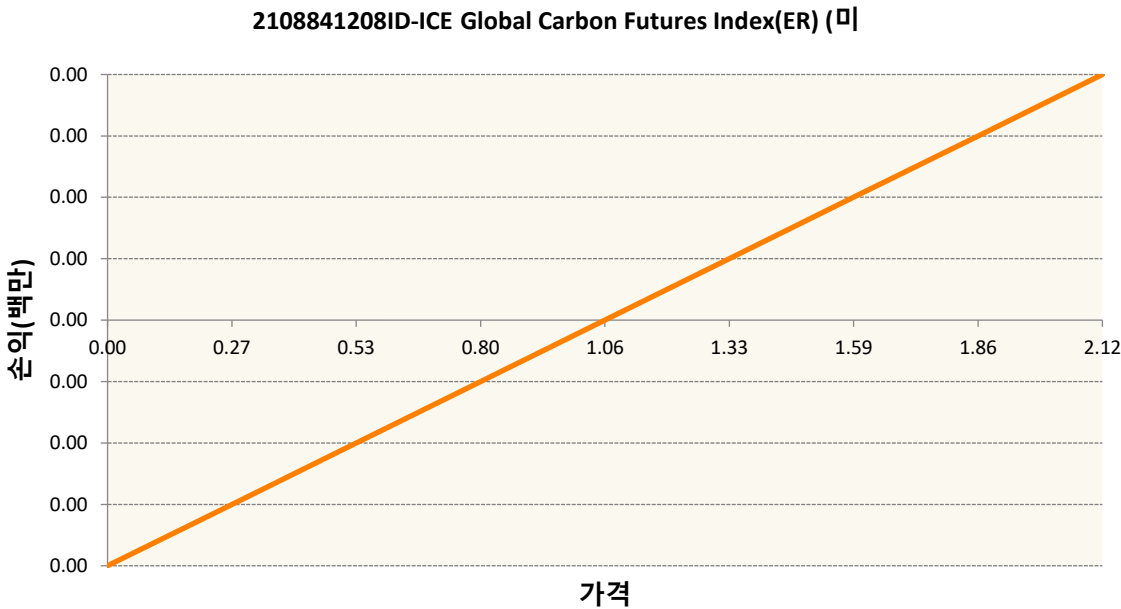
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,724	0	7,724	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		494
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		124

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	594

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

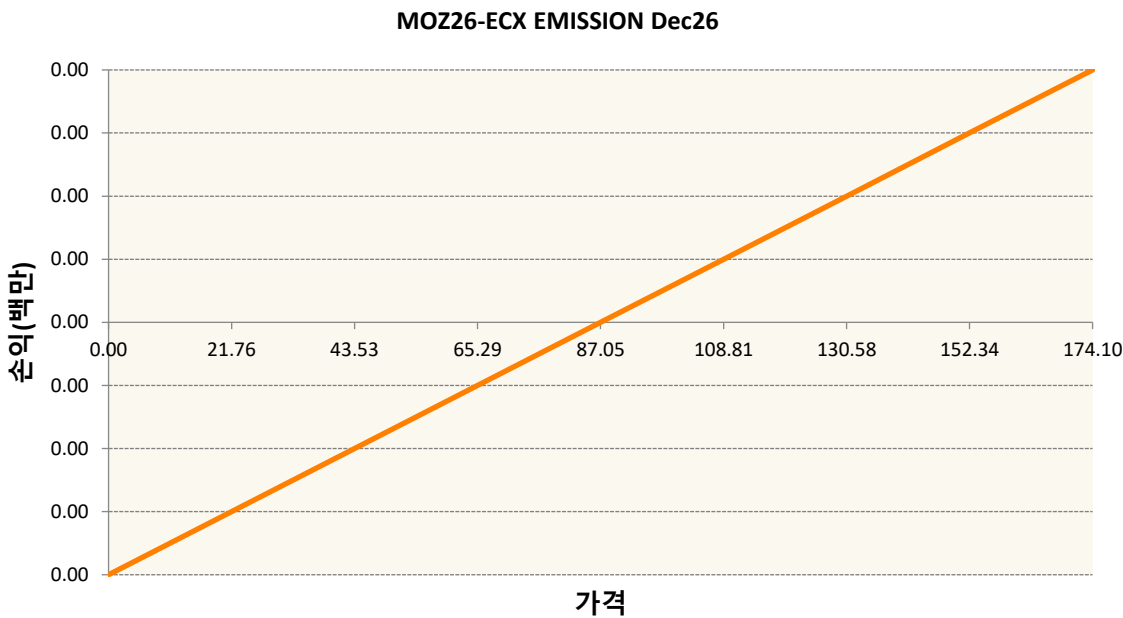
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,779	0	5,779	
누계	통화	선도	0	2,875	-2,875	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213FBTC KRW/EUR 23-12-25E	230
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	462

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

(단위:백만원)

740

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

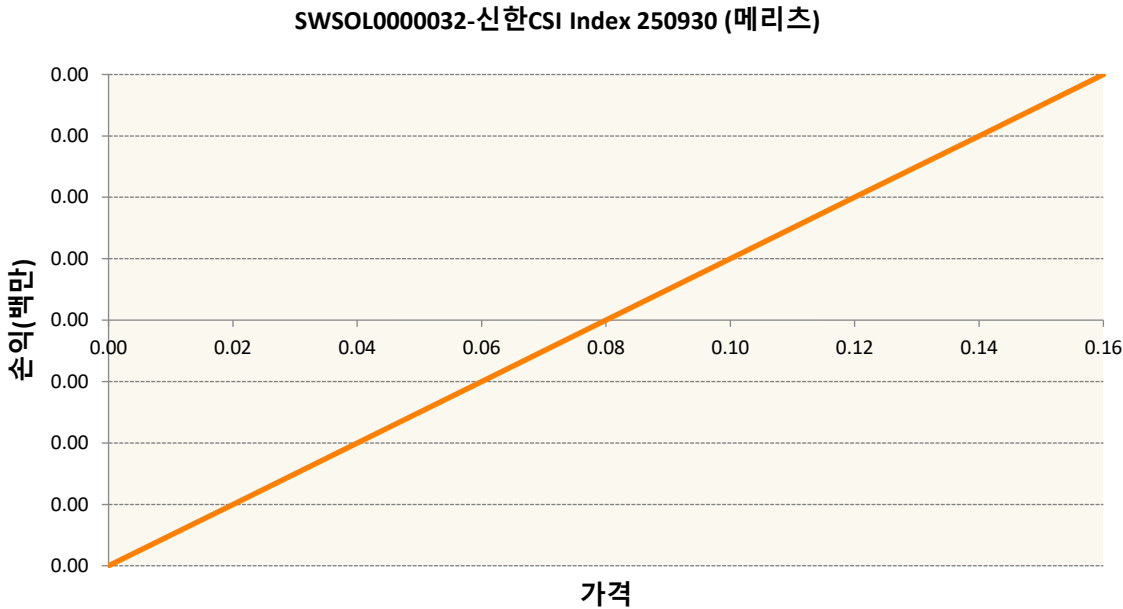
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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)	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)

65

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

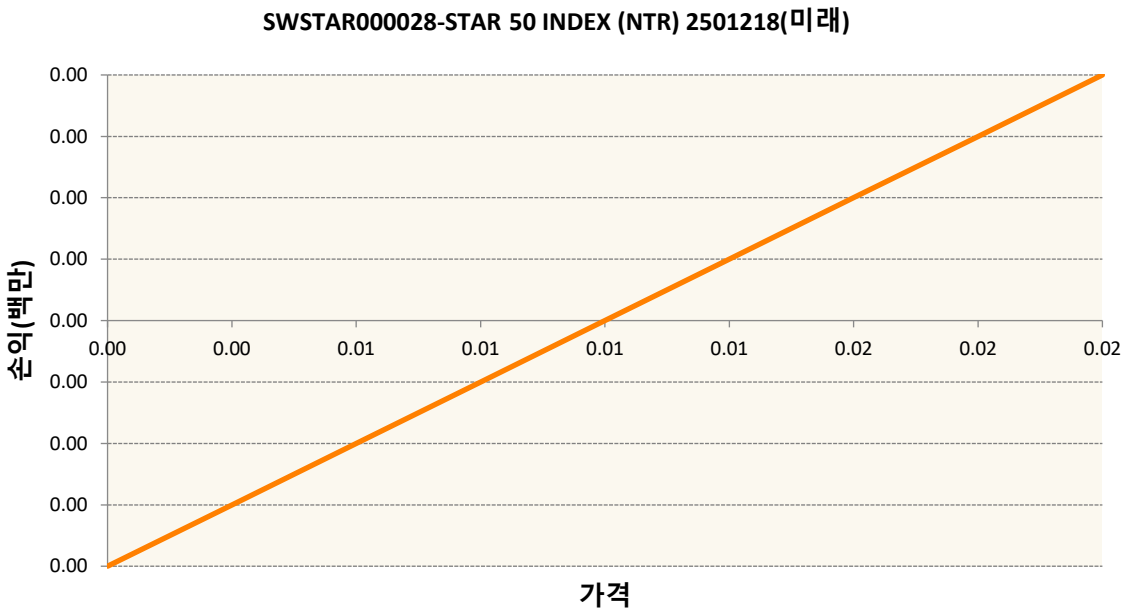
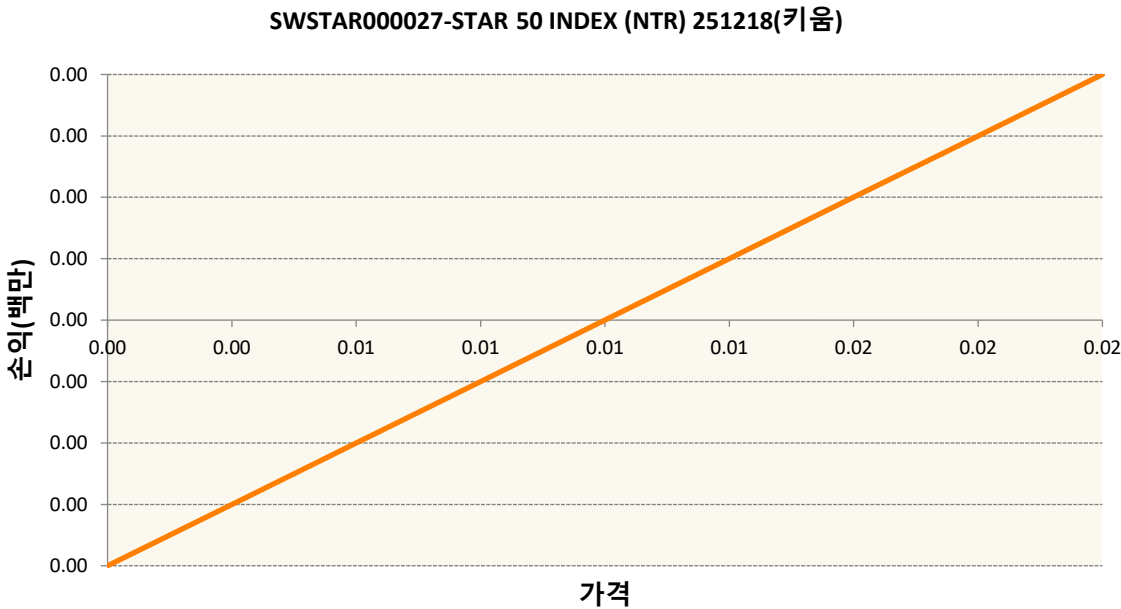
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

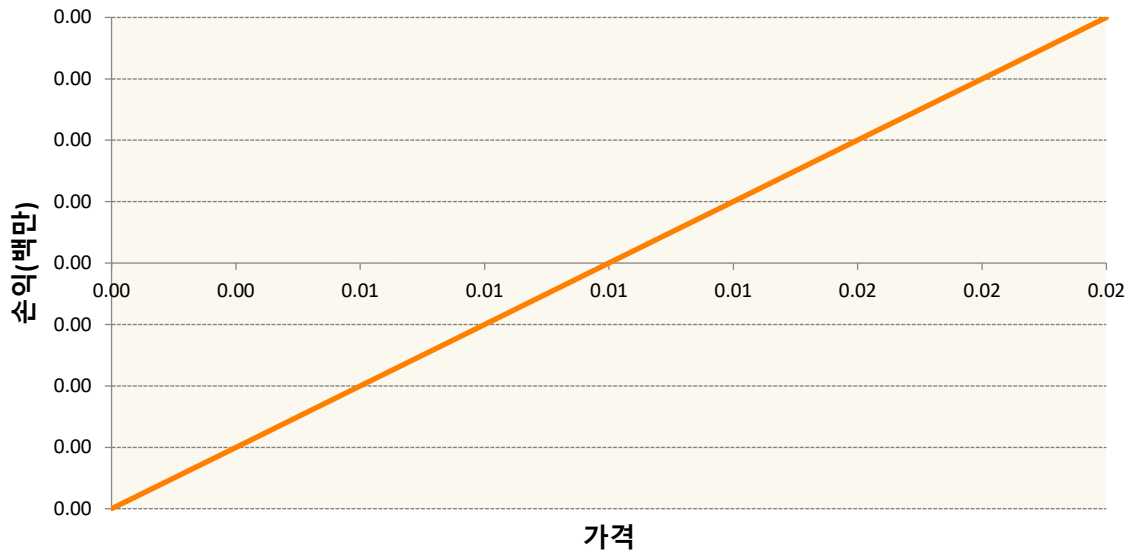
(단위:백만원)

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

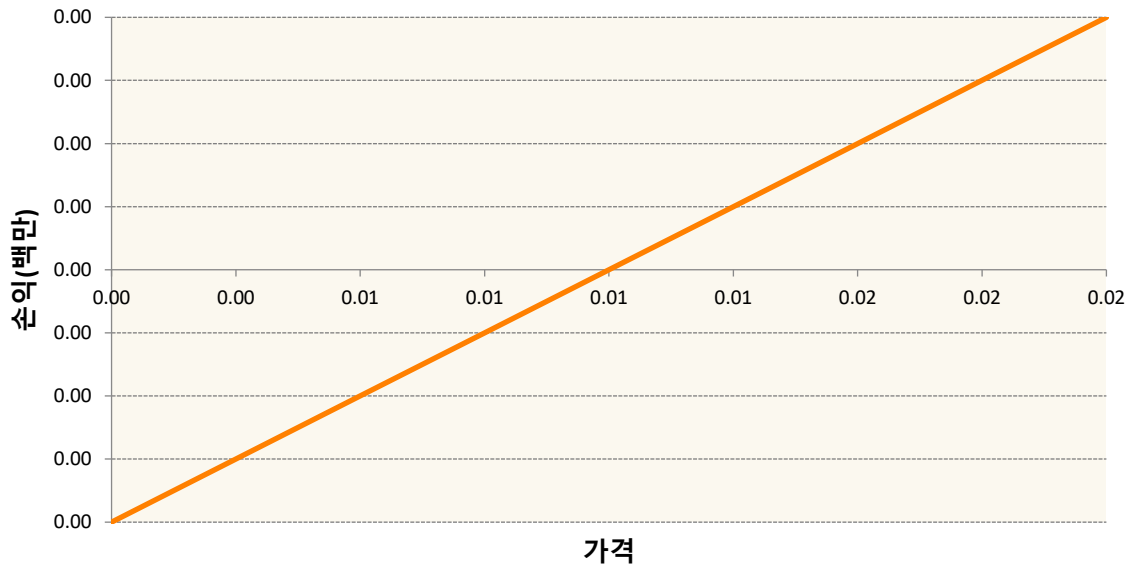
2. 만기시점의 손익구조



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
 5
 14
 3

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

(단위:백만원)

42

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

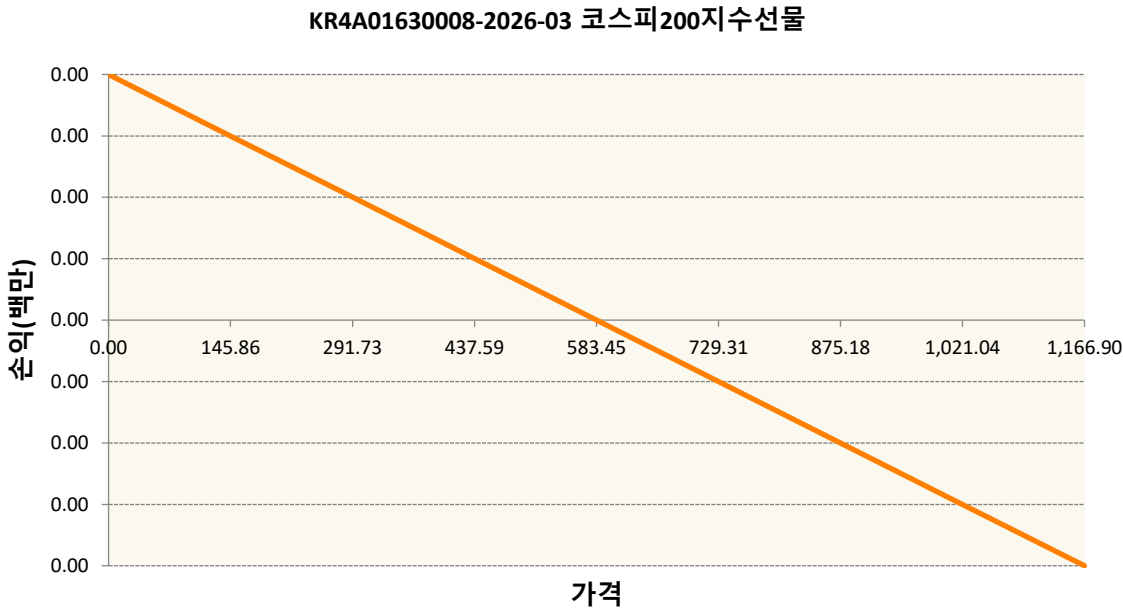
에쿼티알파일반사모혼합자산

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	146	-146	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	2025-12-23
기준일	2025-12-22

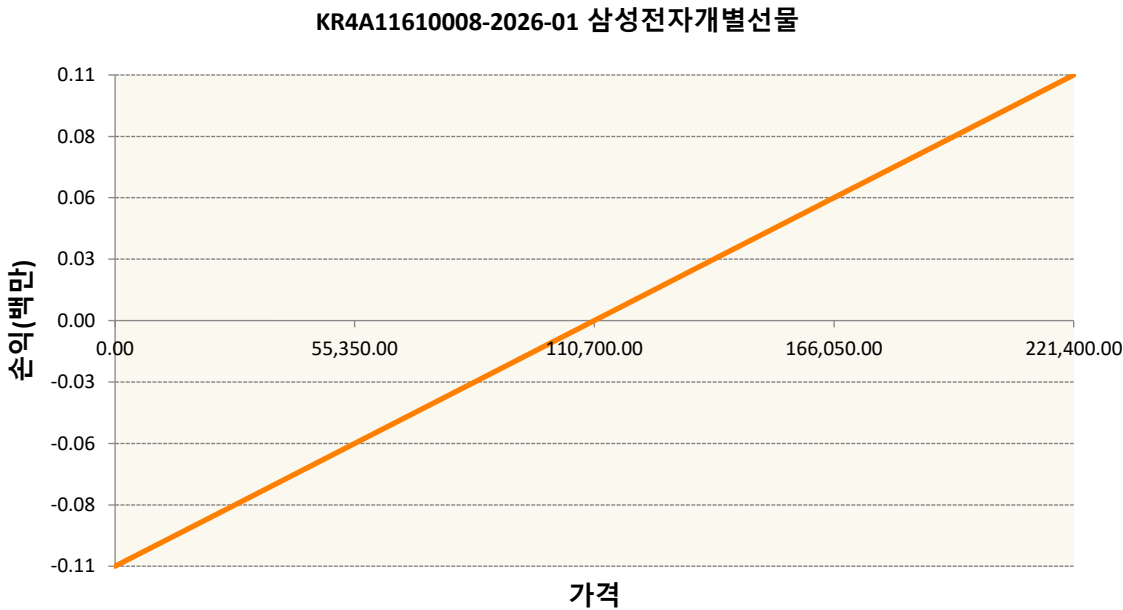
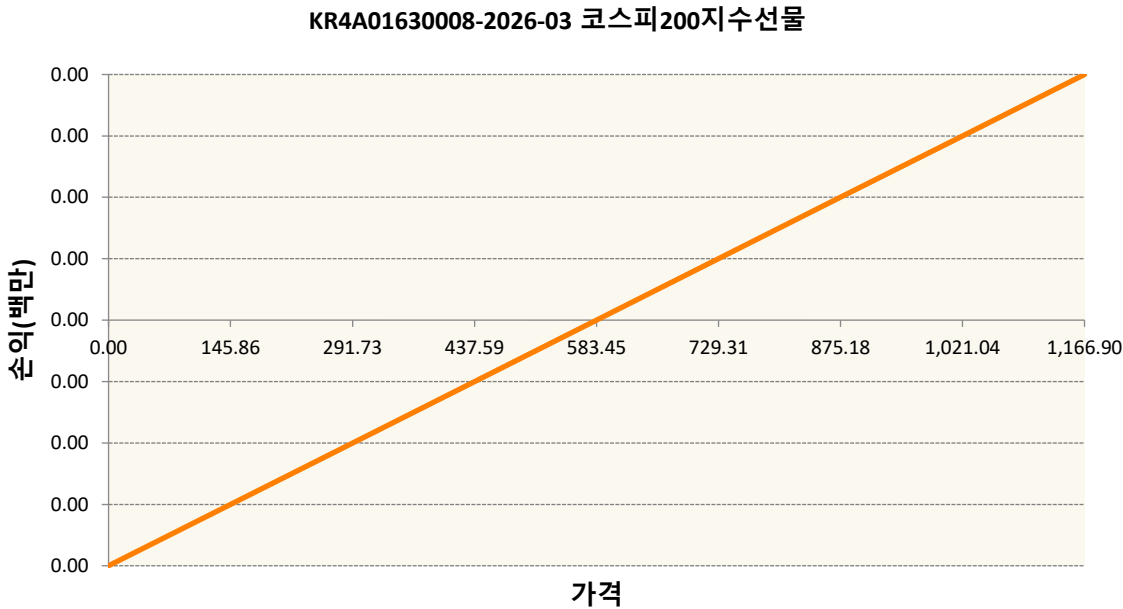
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

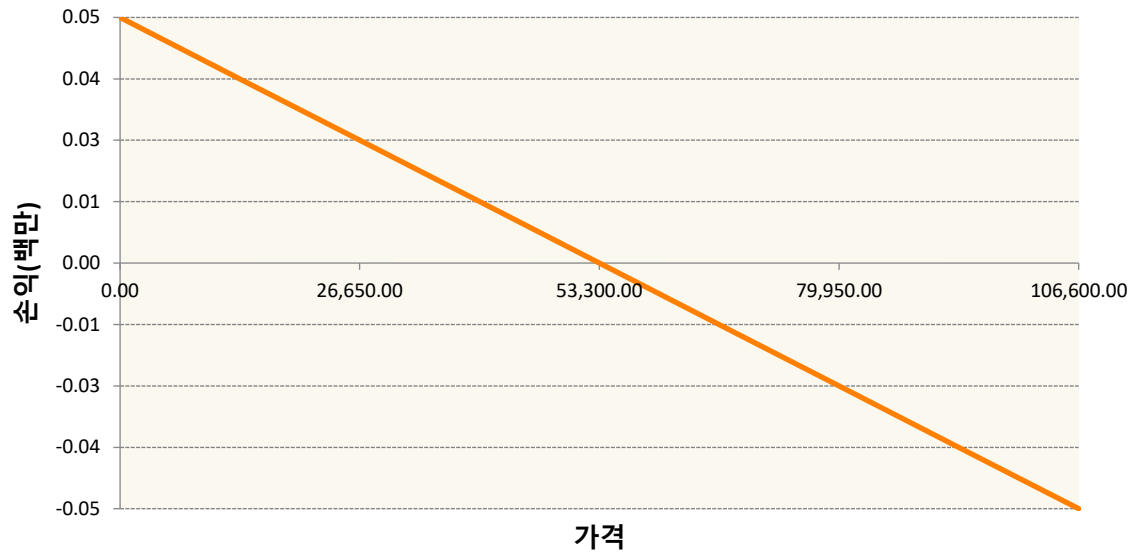
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,833	1,369	11,464	장내

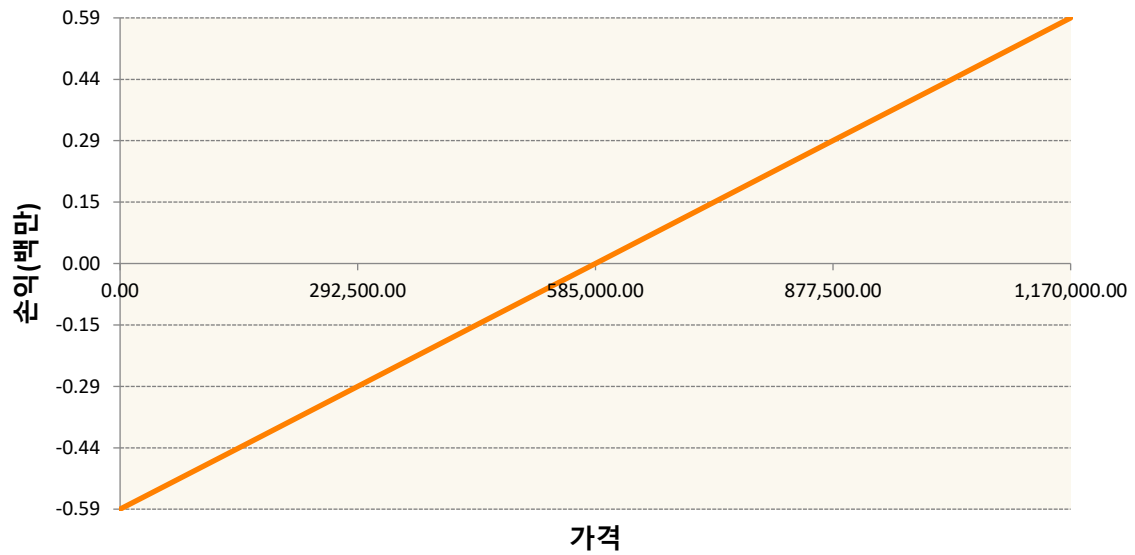
2. 만기시점의 손익구조



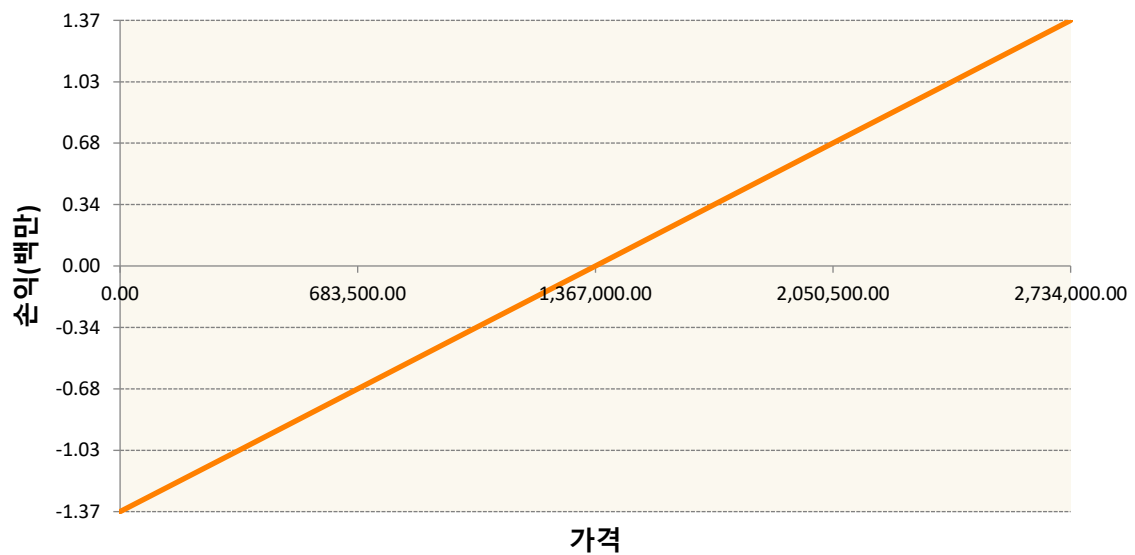
KR4A14610005-2026-01 KT개별선물



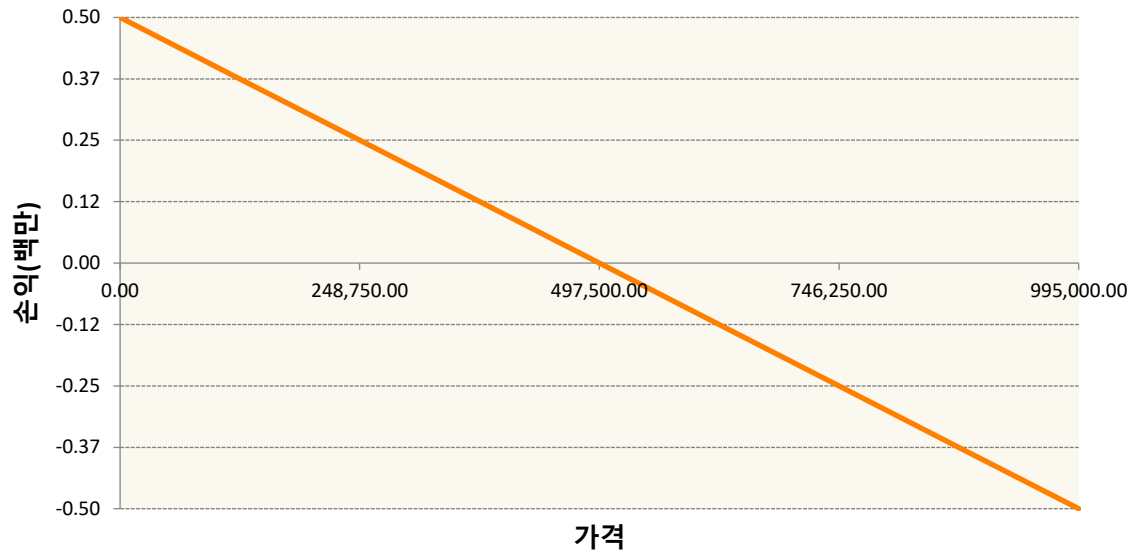
KR4A50610000-2026-01 SK하이닉스개별선물



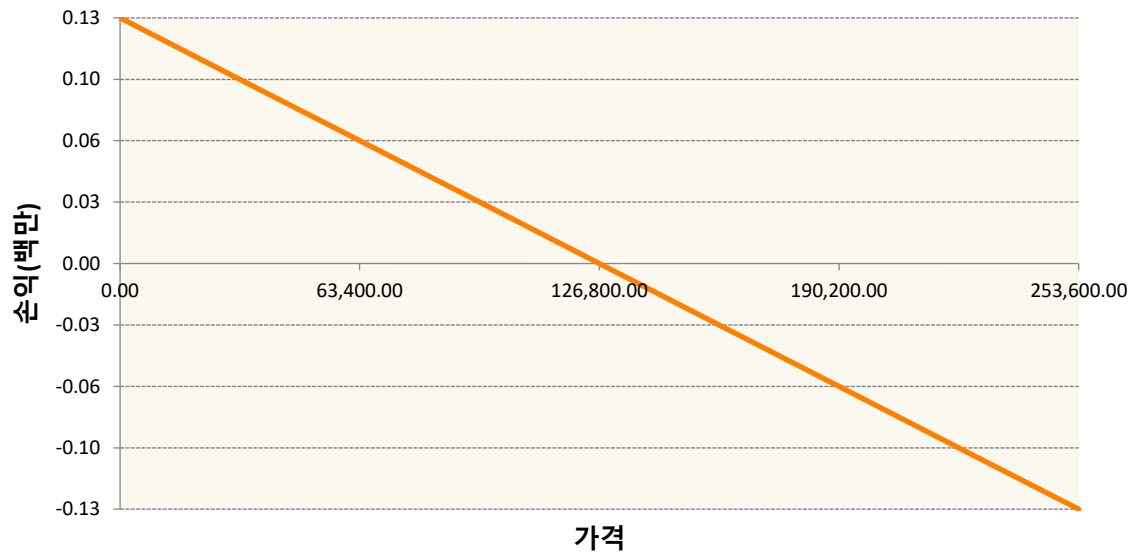
KR4AB3610006-2026-01 고려아연개별선물



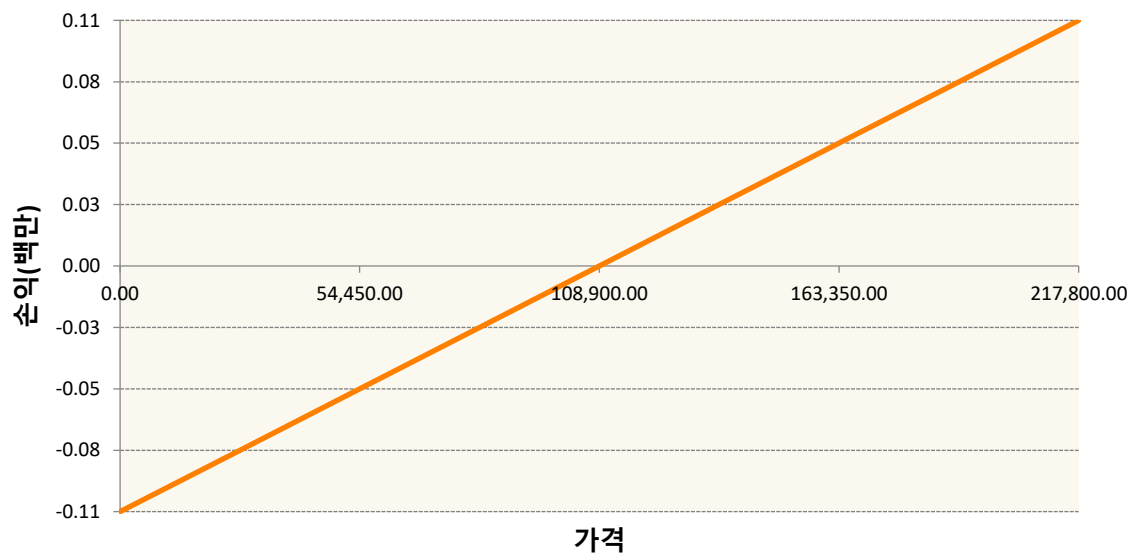
KR4ACT610004-2026-01 삼성화재개별선물



KR4AD0610005-2026-01 DB손해보험개별선물



KR4AEJ610004-2026-01 SKC개별선물



(단위:백만원)

KR4A01630008							2026-03 코스피200지수선물		781	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-781	-781	-781	-781	-781	-781	-781			
-5.33%	-521	-521	-521	-521	-521	-521	-521			
-2.67%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	260	260	260	260	260	260	260			
5.33%	521	521	521	521	521	521	521			
8.00%	781	781	781	781	781	781	781			
KR4A11610008							2026-01 삼성전자개별선물		57	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57			
-5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38			
-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%	38	38	38	38	38	38	38			
8.00%	57	57	57	57	57	57	57			
KR4A14610005							2026-01 KT개별선물		54	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	54	54	54	54	54	54	54			
-5.33%	36	36	36	36	36	36	36			
-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%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36			
8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54			
KR4A50610000							2026-01 SK하이닉스개별선물		61	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61			
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41			
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	20	20	20	20	20	20	20			
5.33%	41	41	41	41	41	41	41			
8.00%	61	61	61	61	61	61	61			
KR4AB3610006							2026-01 고려아연개별선물		105	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	105	105	105	105	105	105	105
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							28
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	28	28	28	28
-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%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
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
-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

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

(단위:백만원)

1,371

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

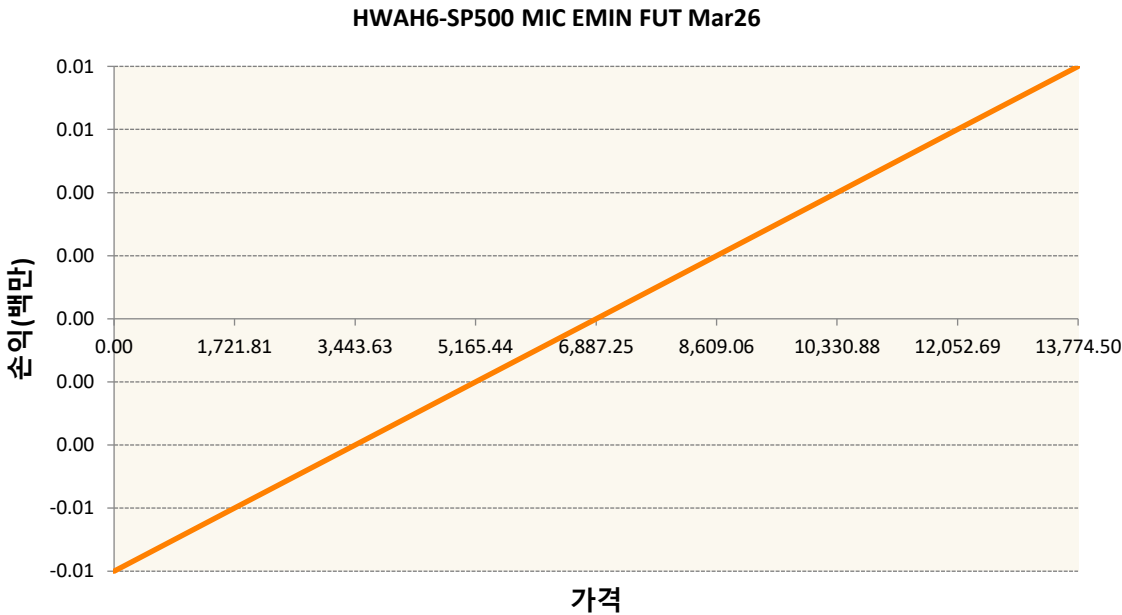
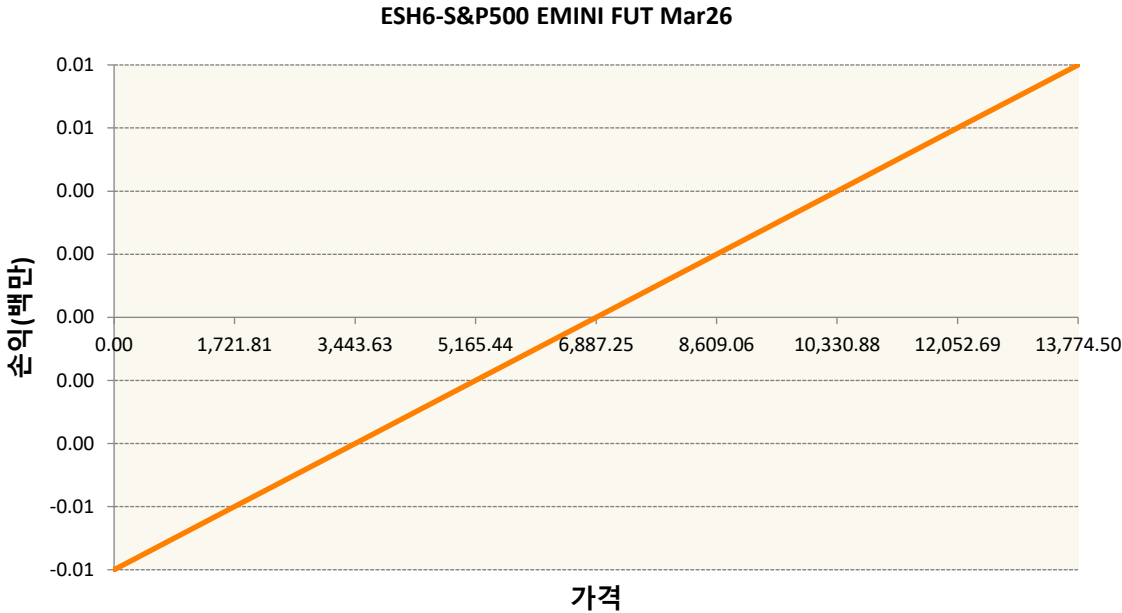
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,120	0	1,120	장내
누계	지수	선물	47,344	0	47,344	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	3,788
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	90

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,433

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

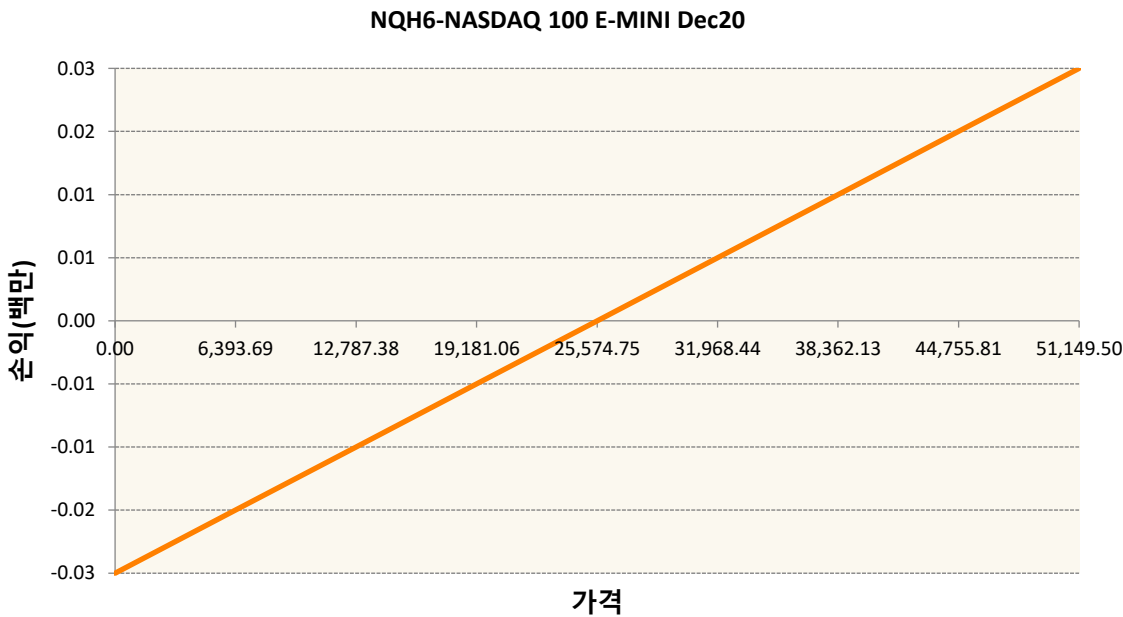
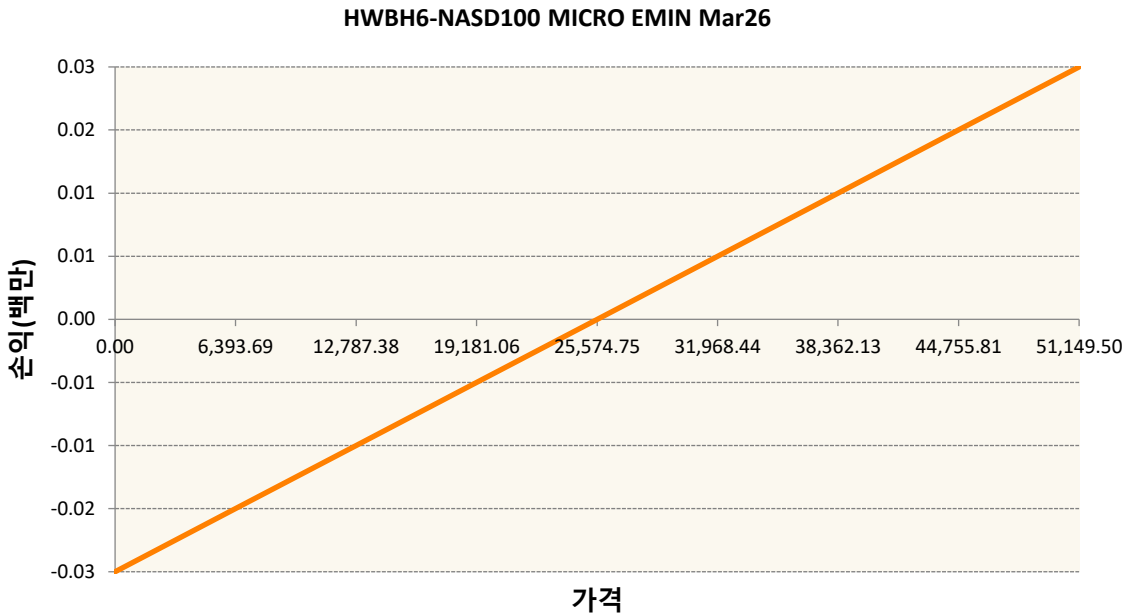
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	22,610	0	22,610	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN Mar26	54
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,754

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,054

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

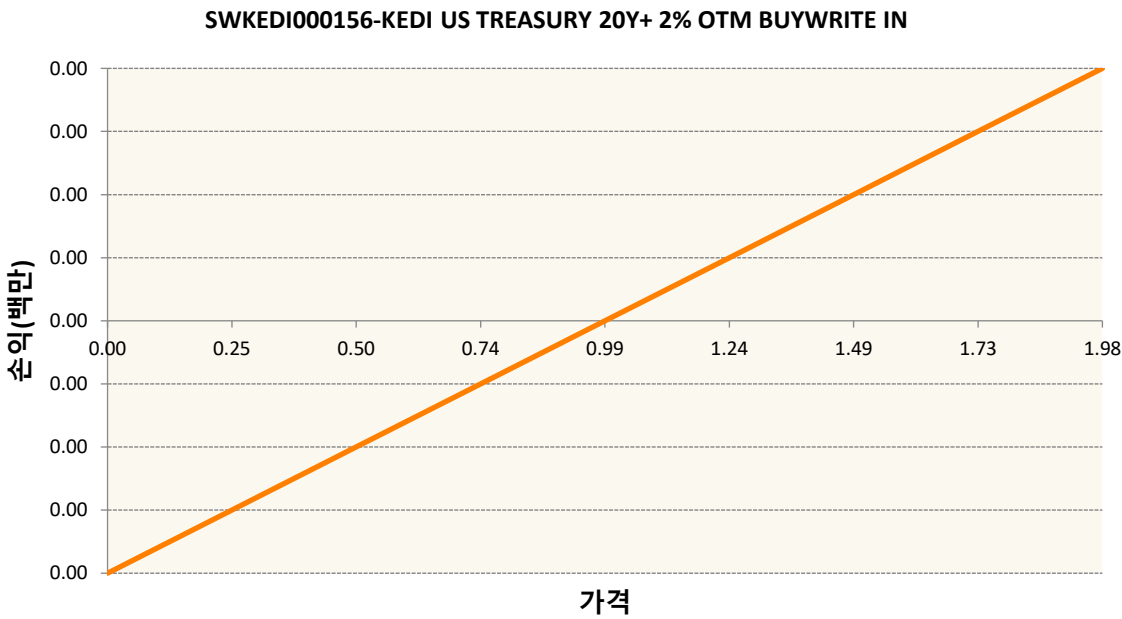
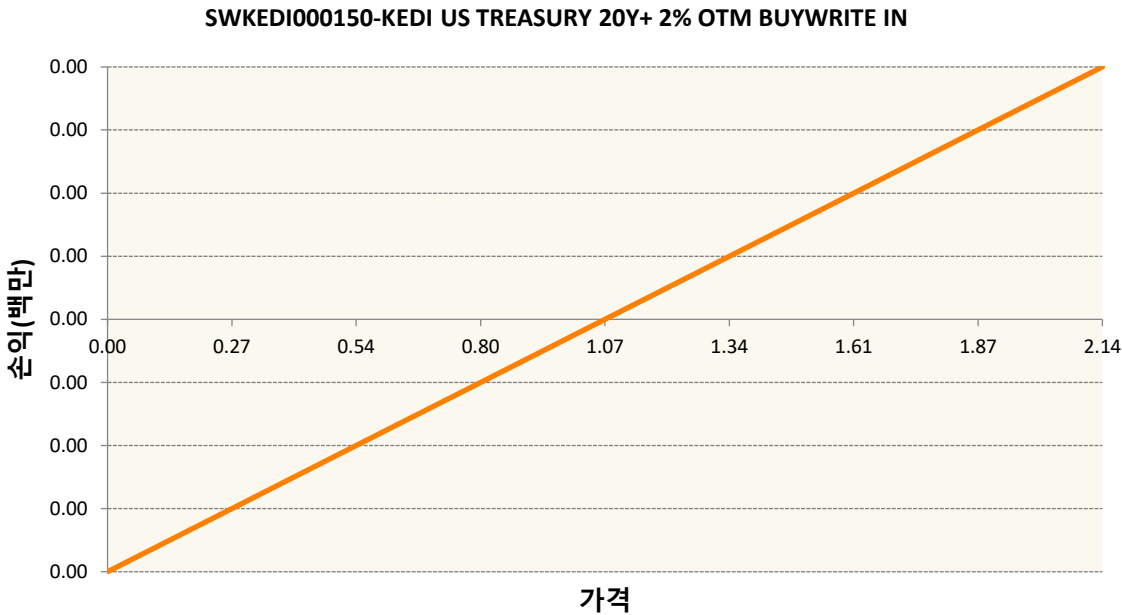
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

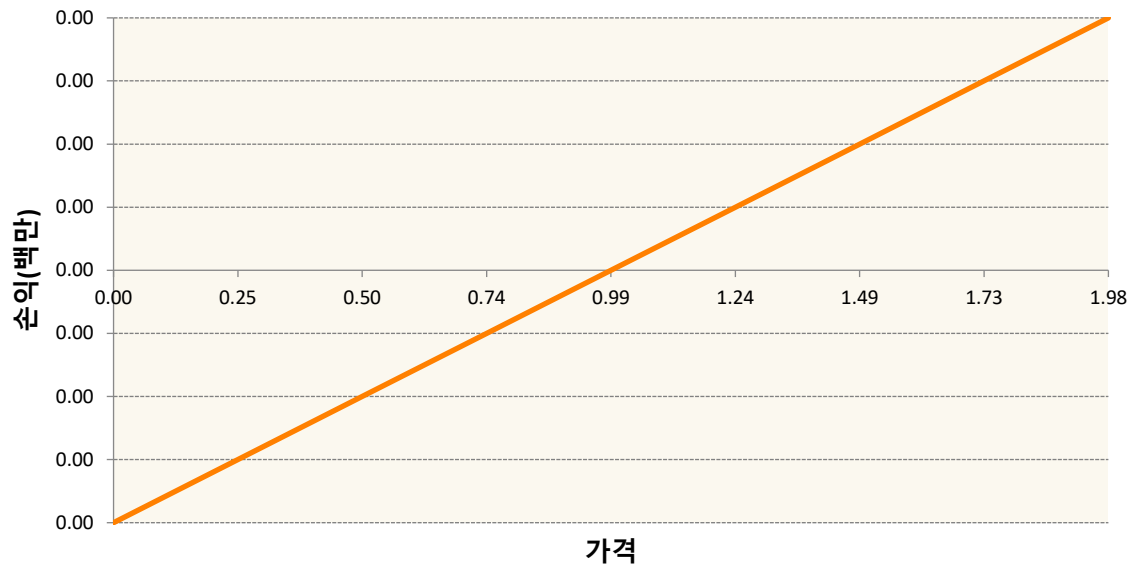
(단위:백만원)

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

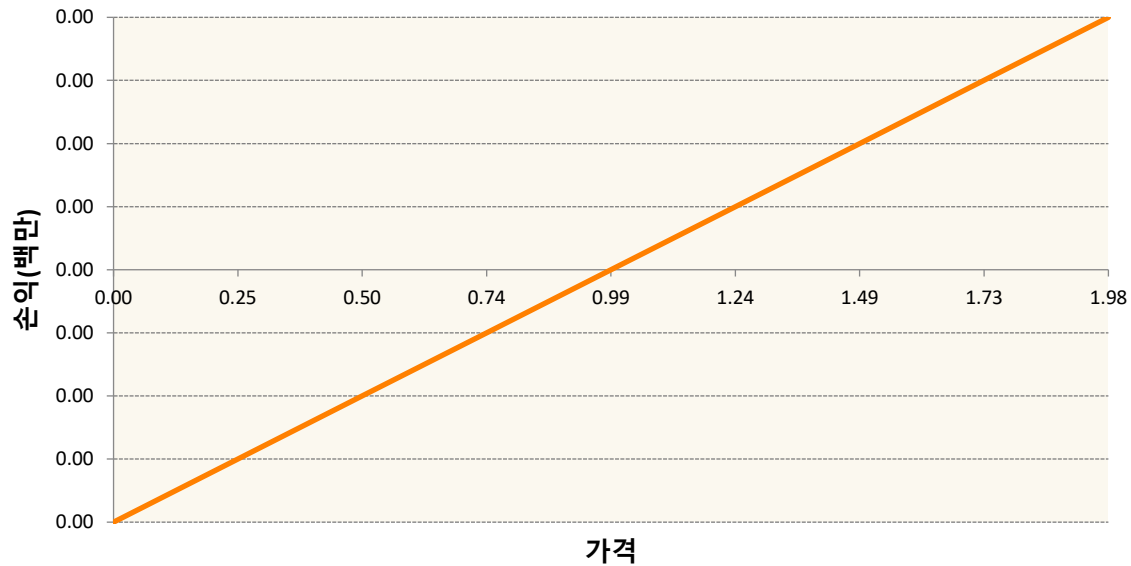
2. 만기시점의 손익구조



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	8,234
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	10,151
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,497
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,740

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

(단위:백만원)

13,943

공시일	2025-12-23
기준일	2025-12-22

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	-46	0	-46	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	2025-12-23
기준일	2025-12-22

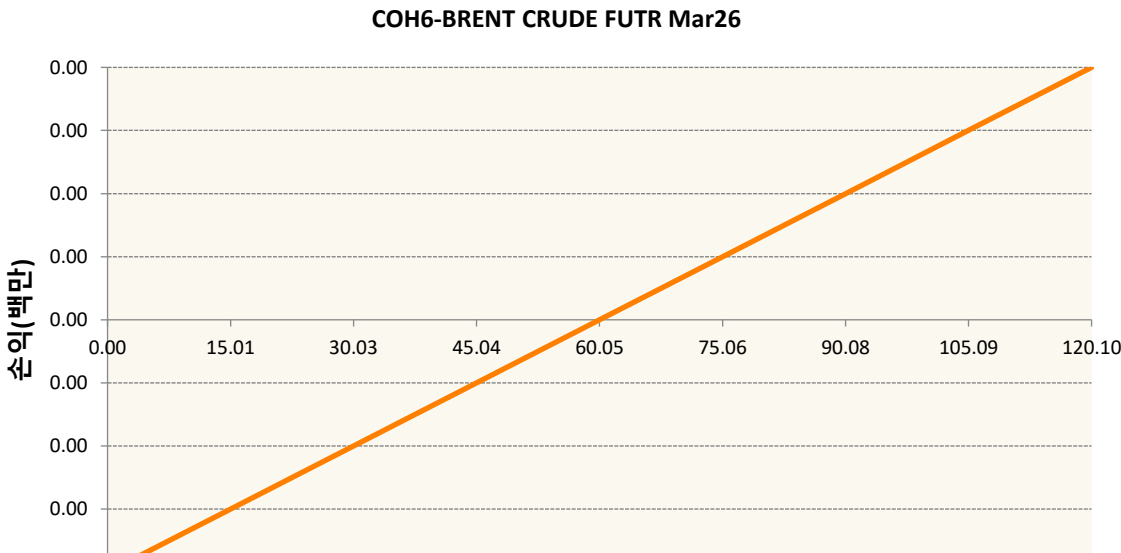
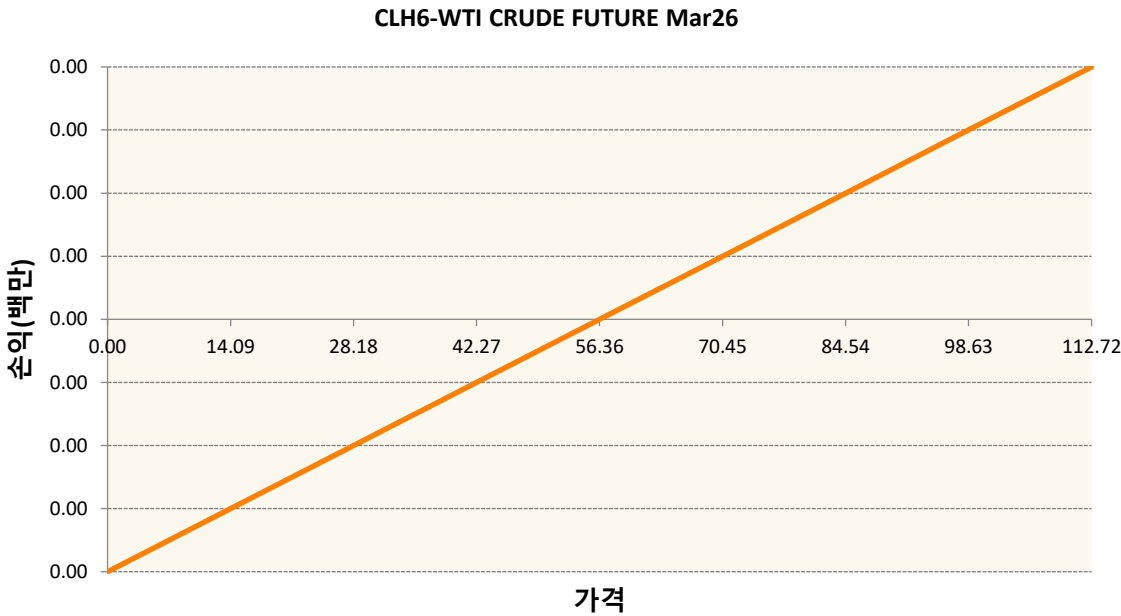
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

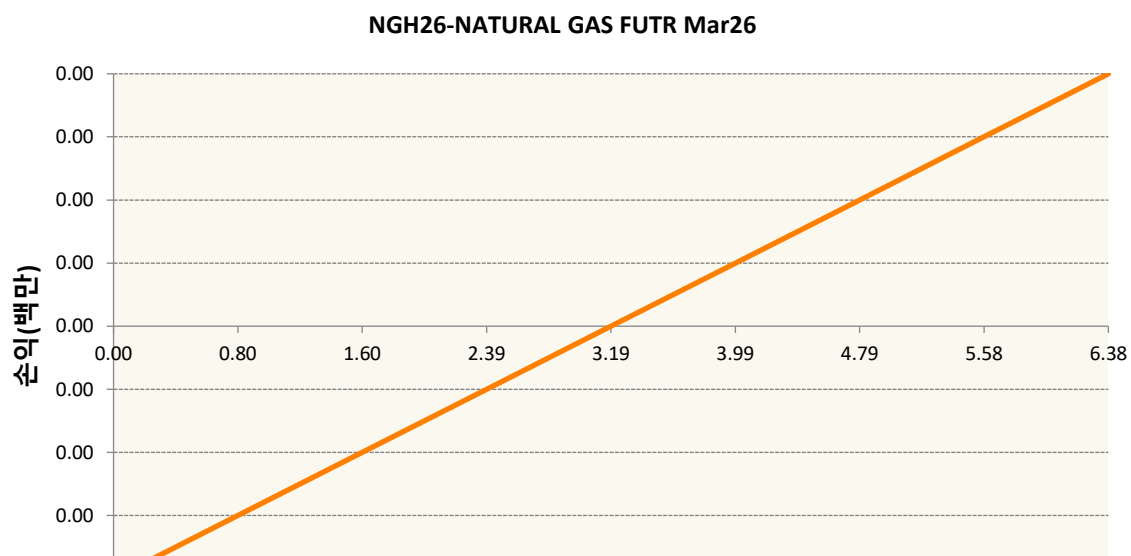
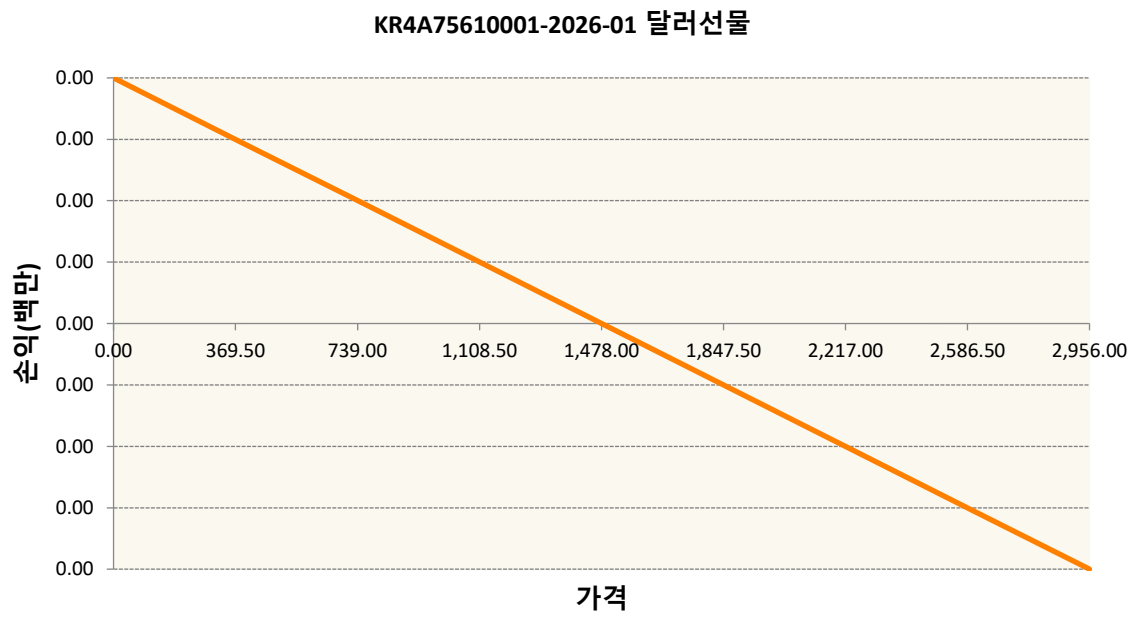
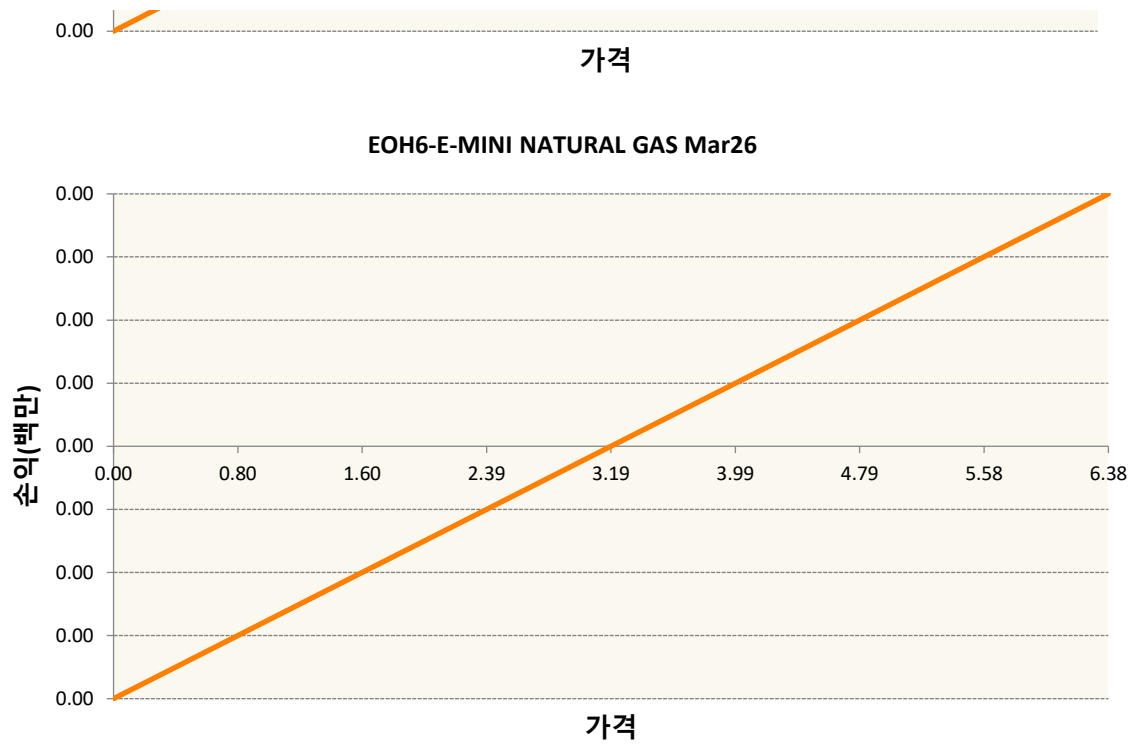
1. 계약금액

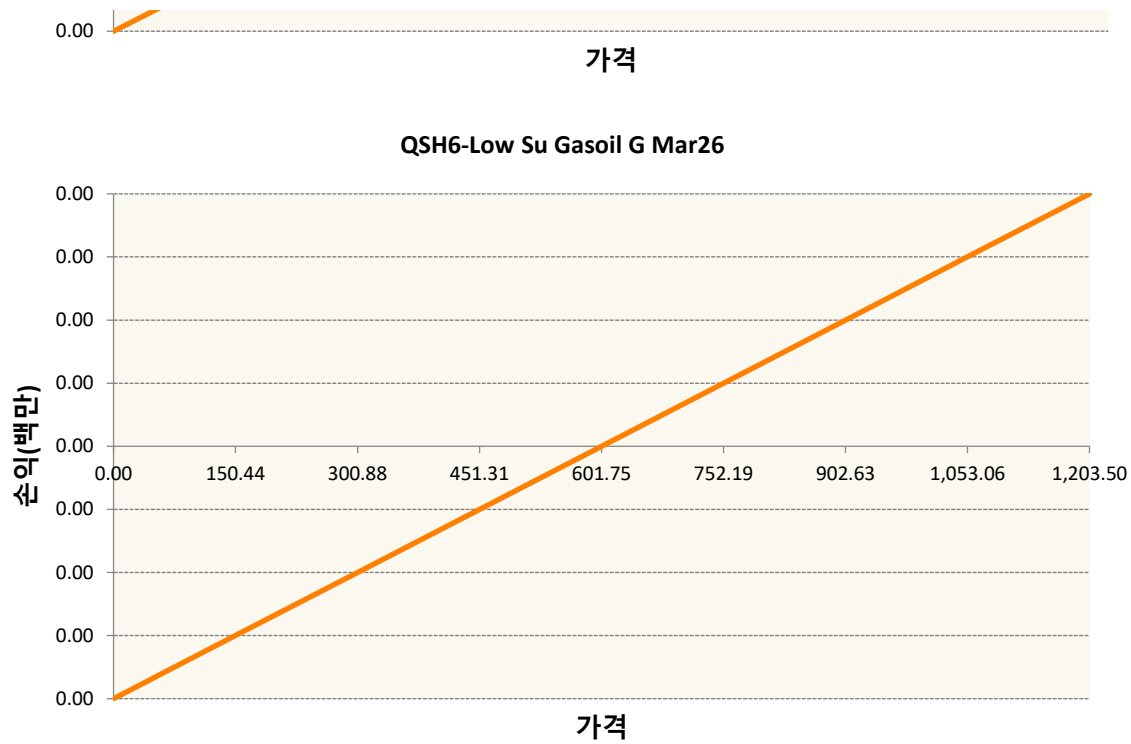
(단위:백만원)

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	347	0	347	
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	7
QSH6	Low Su Gasoil G Mar26	7

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

(단위:백만원)

85