

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

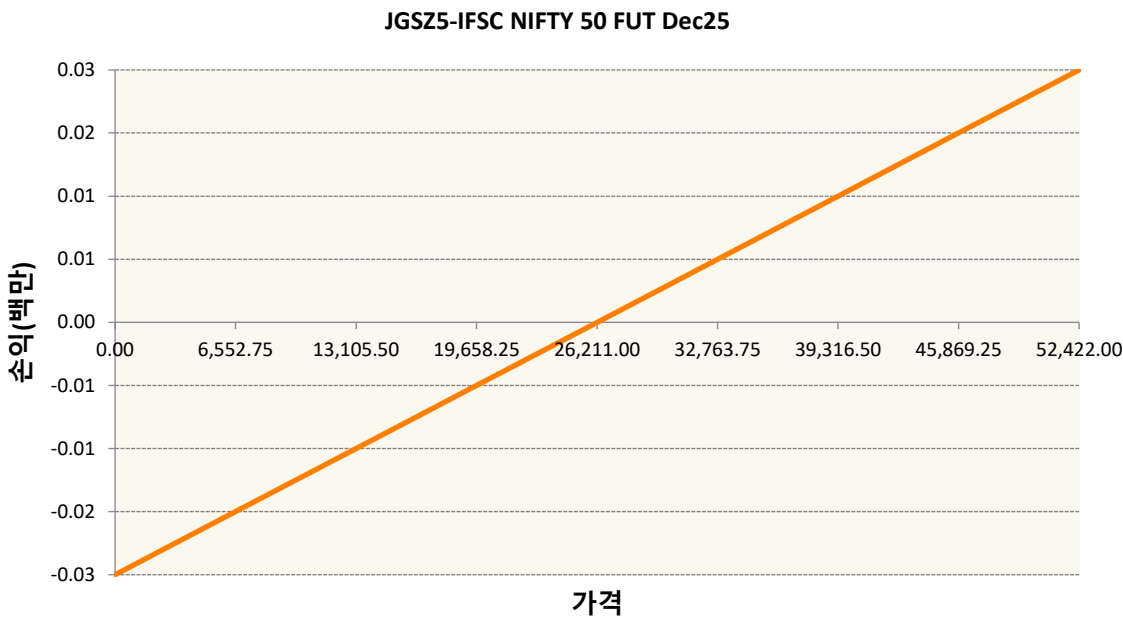
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	696	0	696	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSZ5	IFSC NIFTY 50 FUT Dec25	56
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

35

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

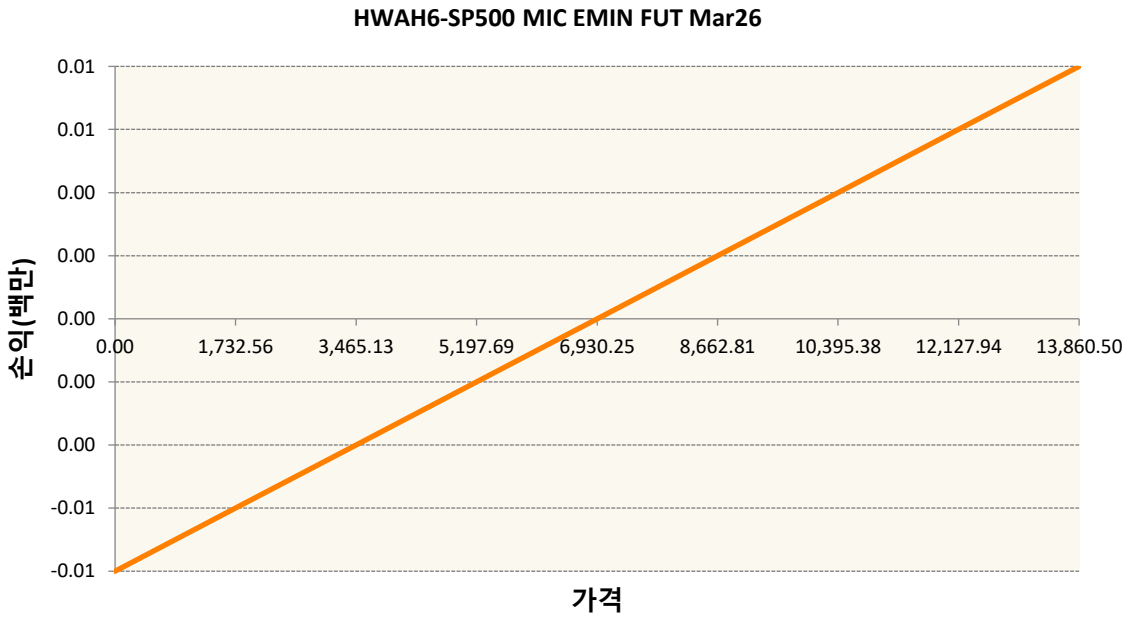
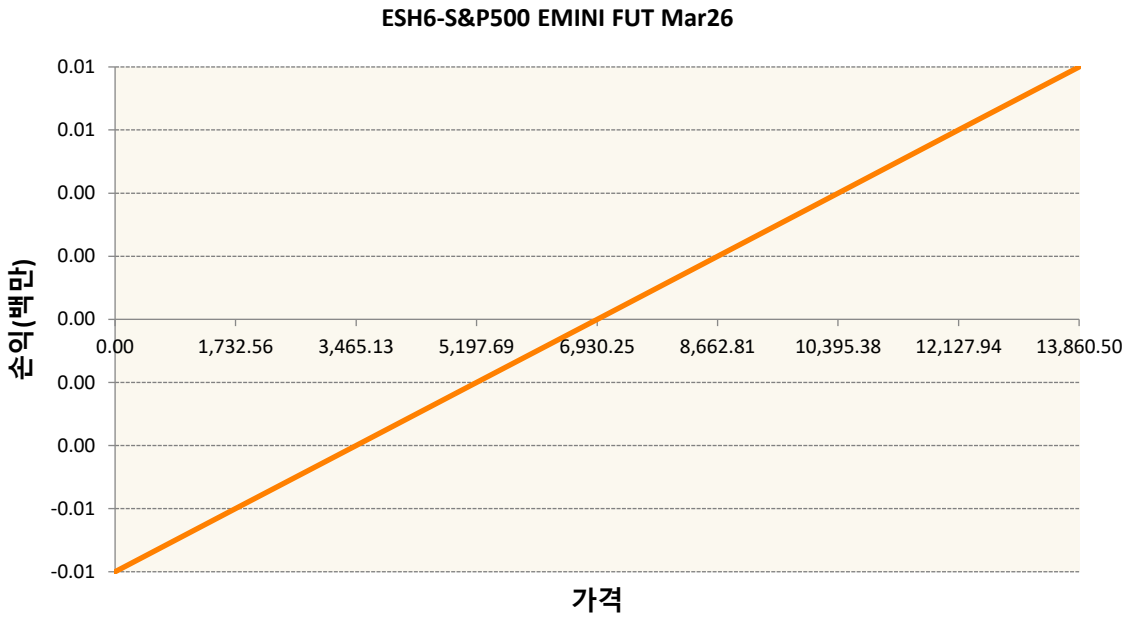
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	256	0	256	장내
누계	지수	선물	512	0	512	

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)
	55

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

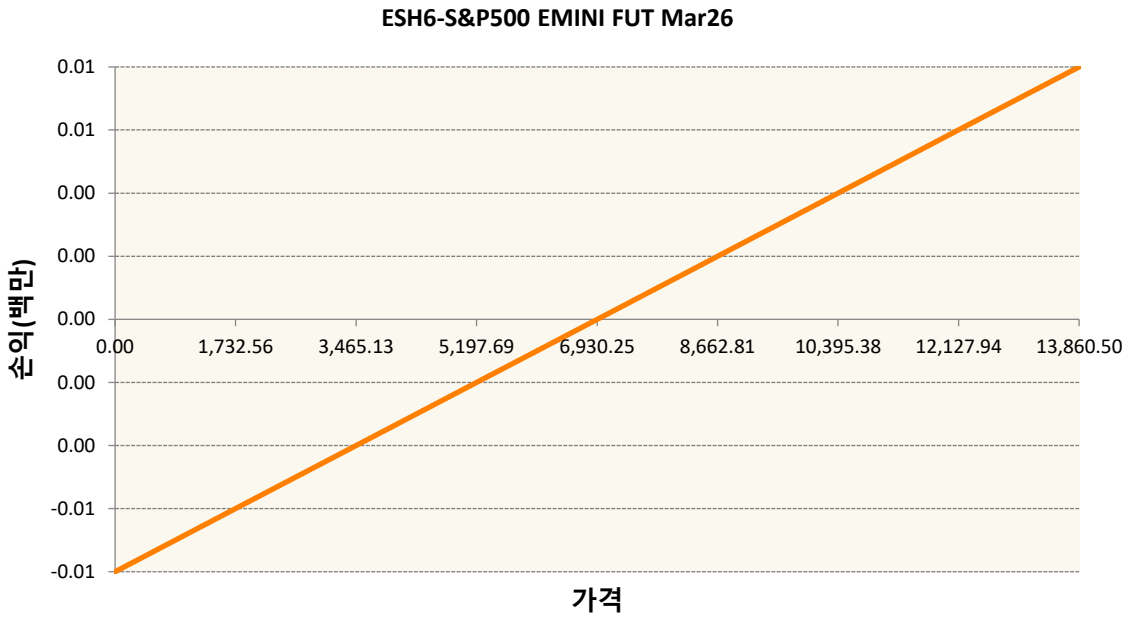
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,537	0	1,537	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	123
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

109

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

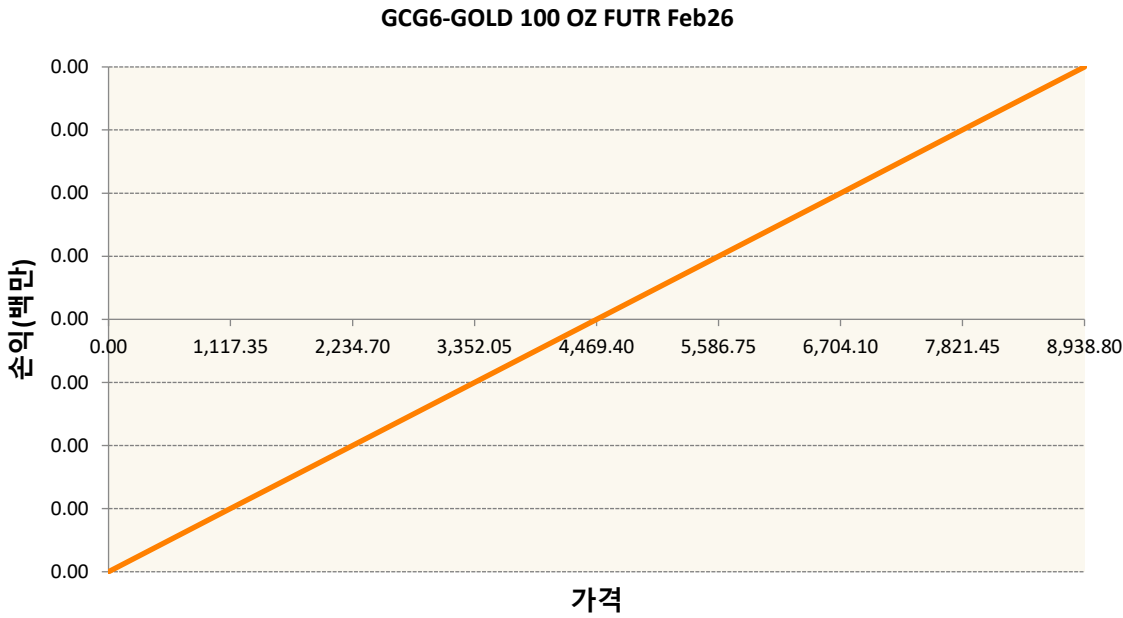
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	3,292	0	3,292	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 12/26/25 C405 EQUITY	3
GCG6 GOLD 100 OZ FUTR Feb26	263

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

(단위:백만원)

246

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

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	39
AOPLTRUCP' PLTR US 12/26/25 C195 EQUITY	113

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

(단위:백만원)

583

공시일 2025-12-24

기준일 2025-12-23

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	2025-12-24
기준일	2025-12-23

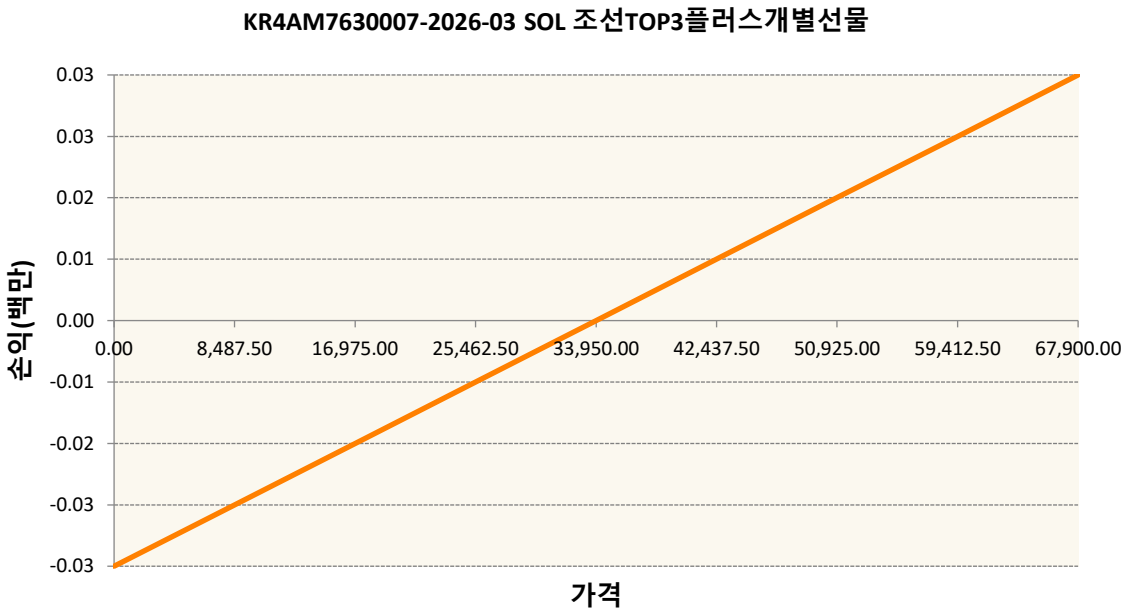
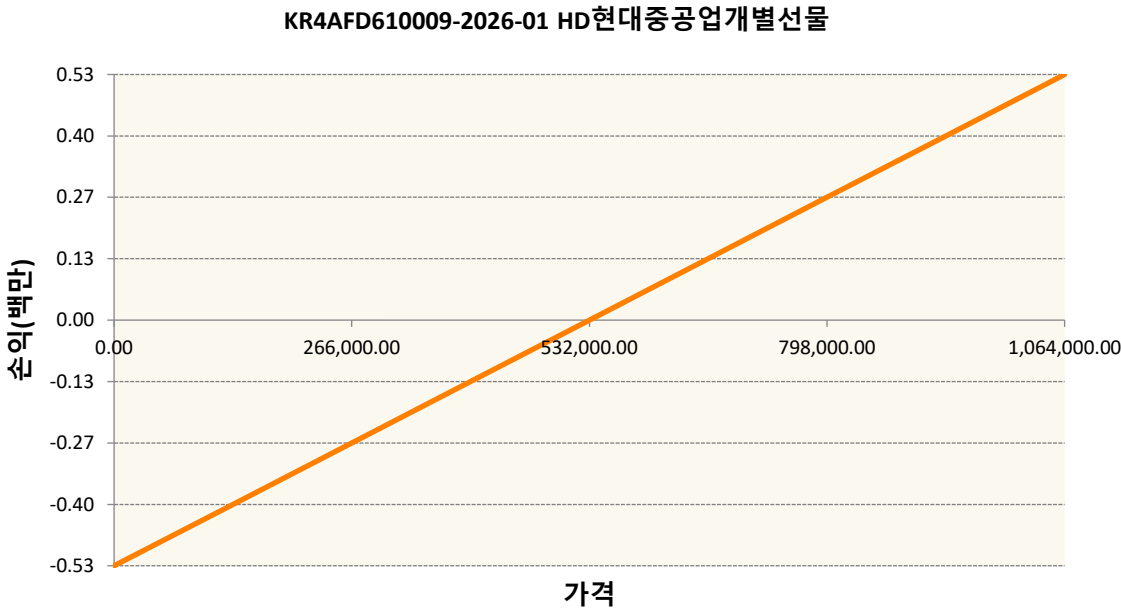
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	21,161	0	21,161	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD610009			2026-01 HD현대중공업개별선물				855
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-855	-855	-855	-855	-855	-855	-855
-5.33%	-570	-570	-570	-570	-570	-570	-570
-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%	570	570	570	570	570	570	570
8.00%	855	855	855	855	855	855	855
KR4AM7630007			2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물				844
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-844	-844	-844	-844	-844	-844	-844
-5.33%	-562	-562	-562	-562	-562	-562	-562
-2.67%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	281	281	281	281	281	281	281
5.33%	562	562	562	562	562	562	562
8.00%	844	844	844	844	844	844	844

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

1,801

공시일 2025-12-24

기준일 2025-12-23

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	2025-12-24
기준일	2025-12-23

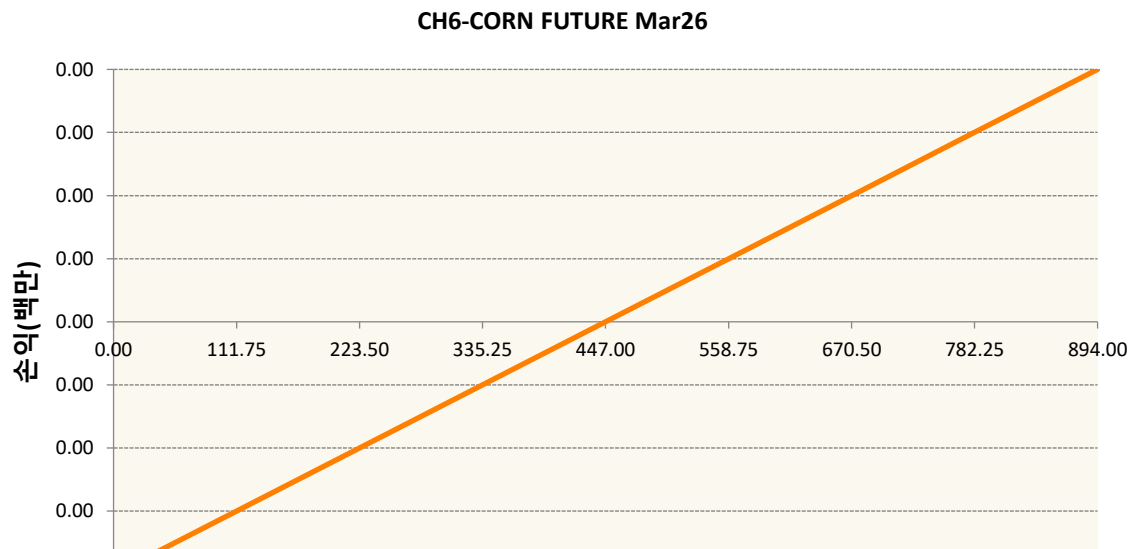
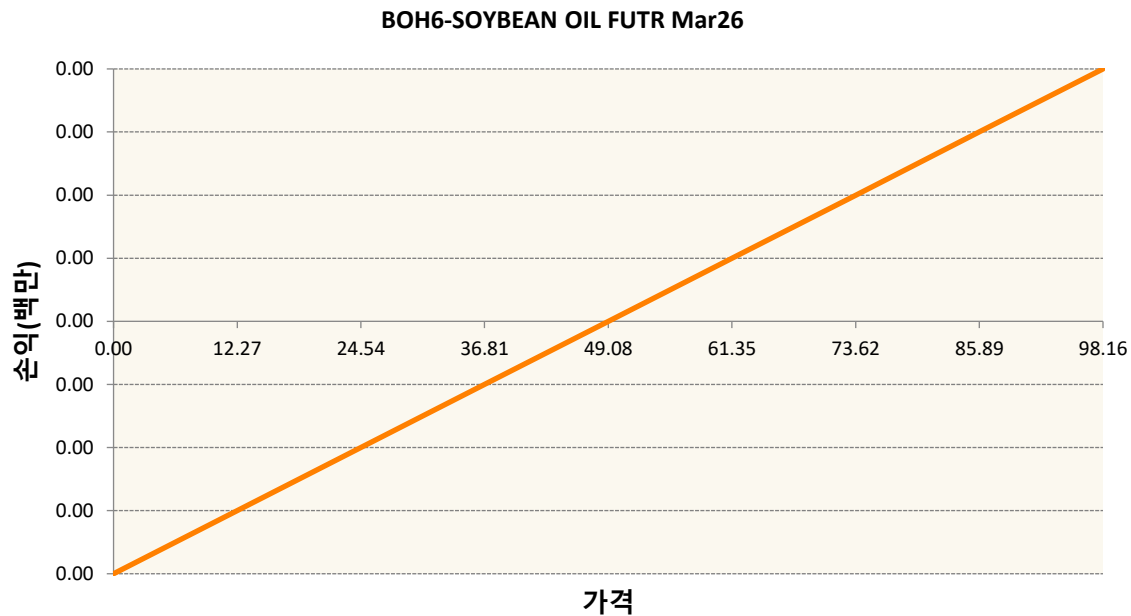
포커스농산물모(채권-파생형)

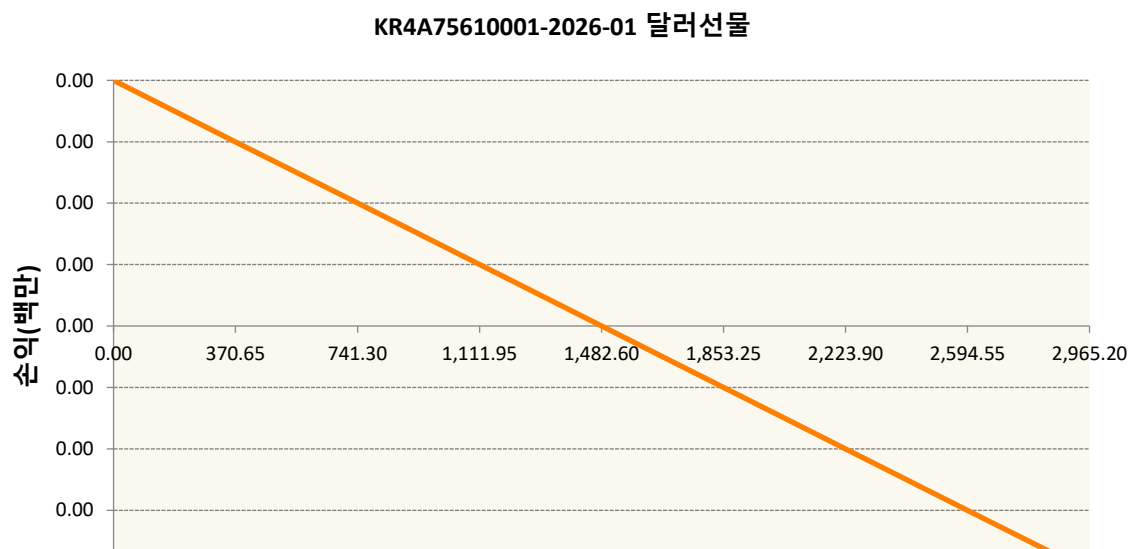
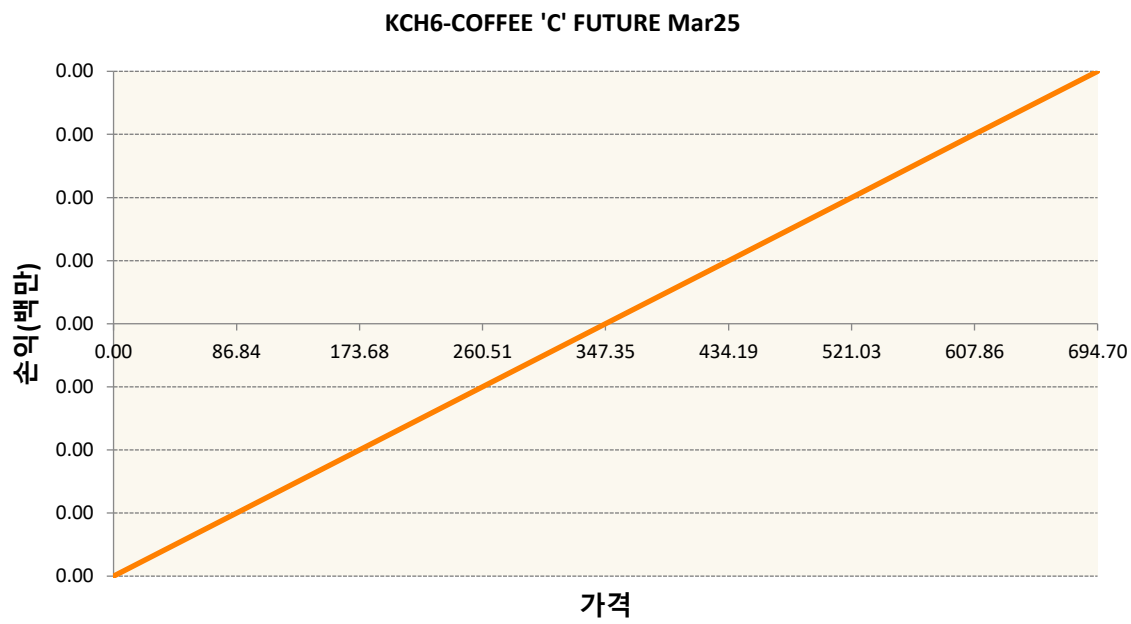
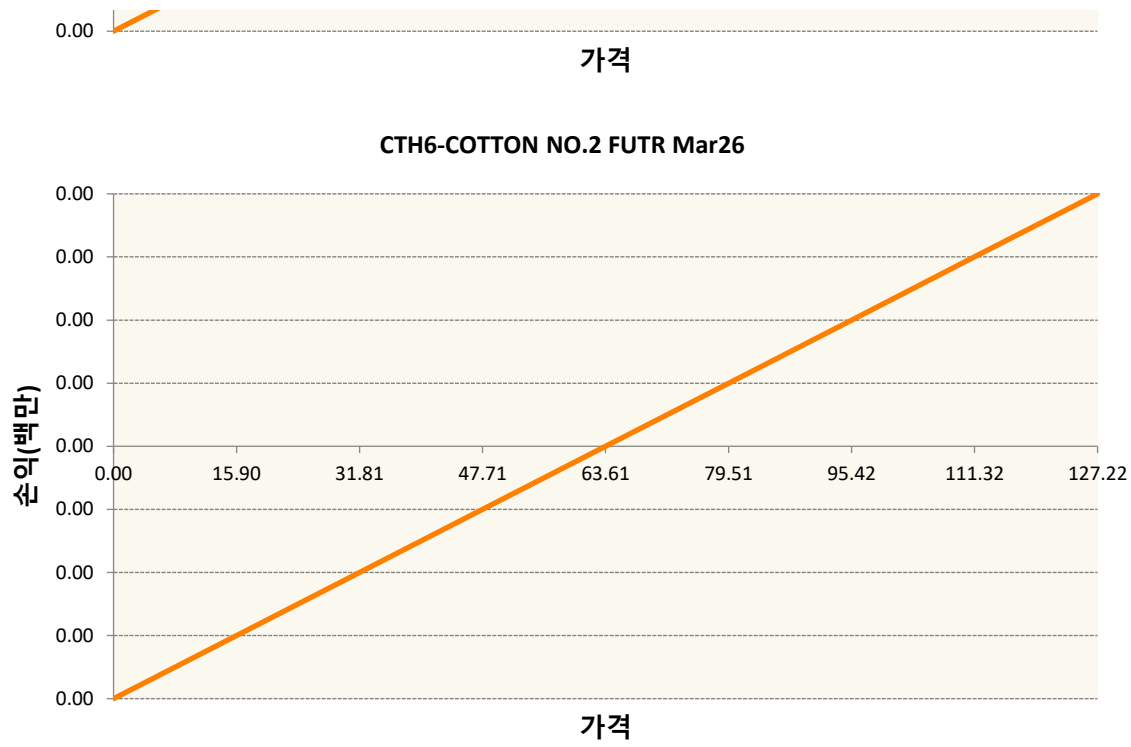
1. 계약금액

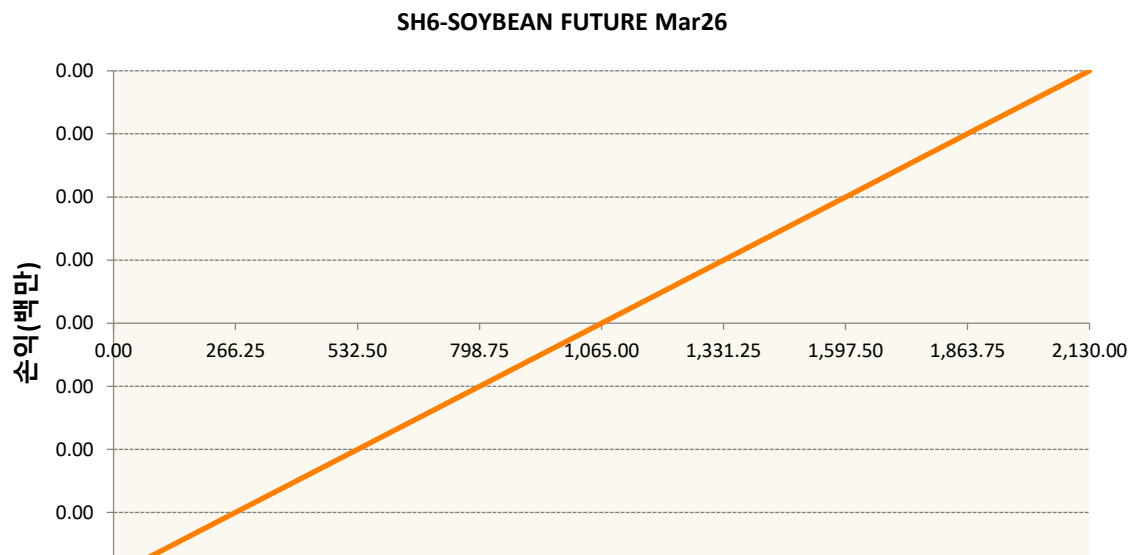
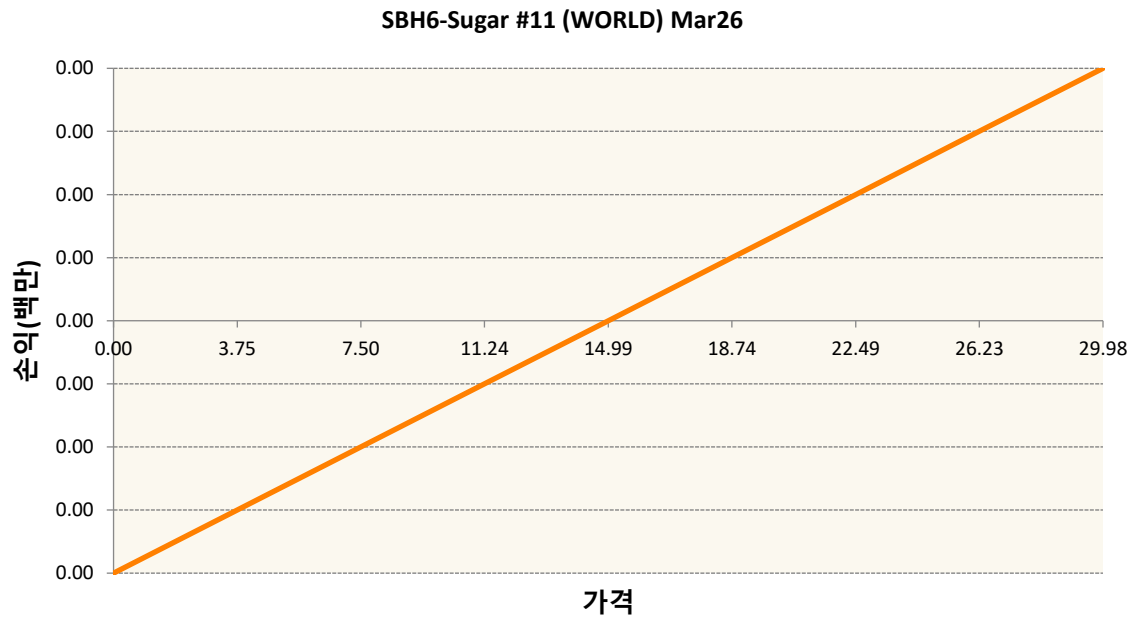
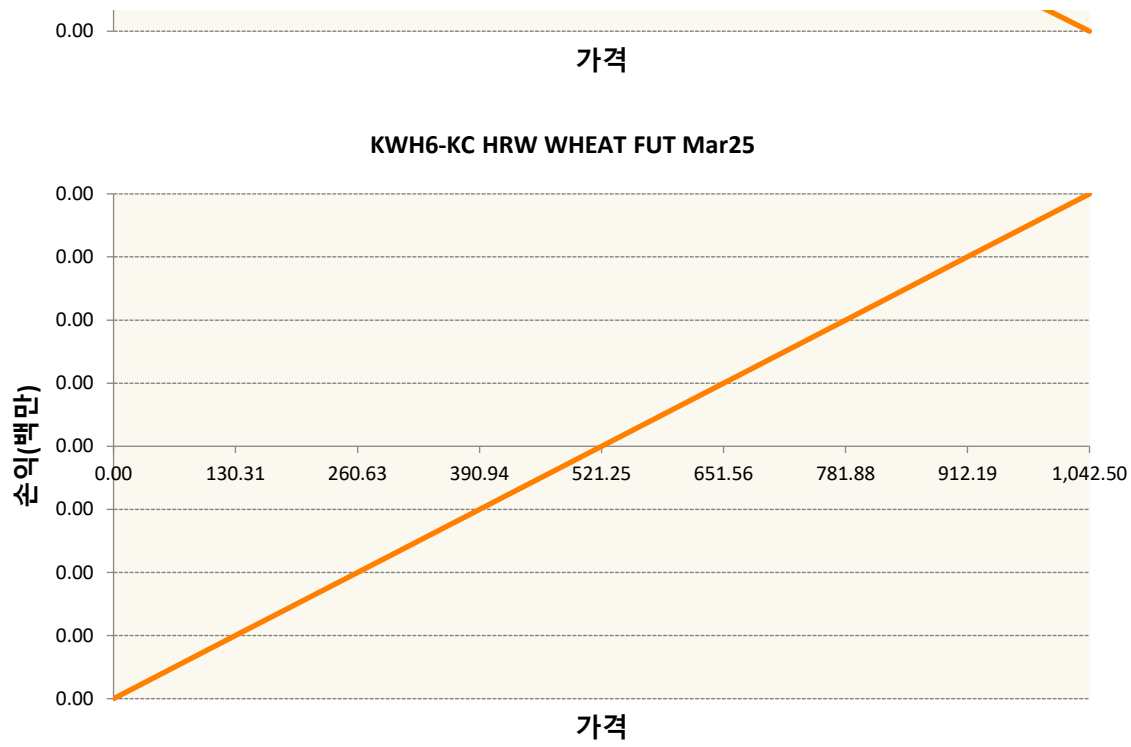
(단위:USD 백만)

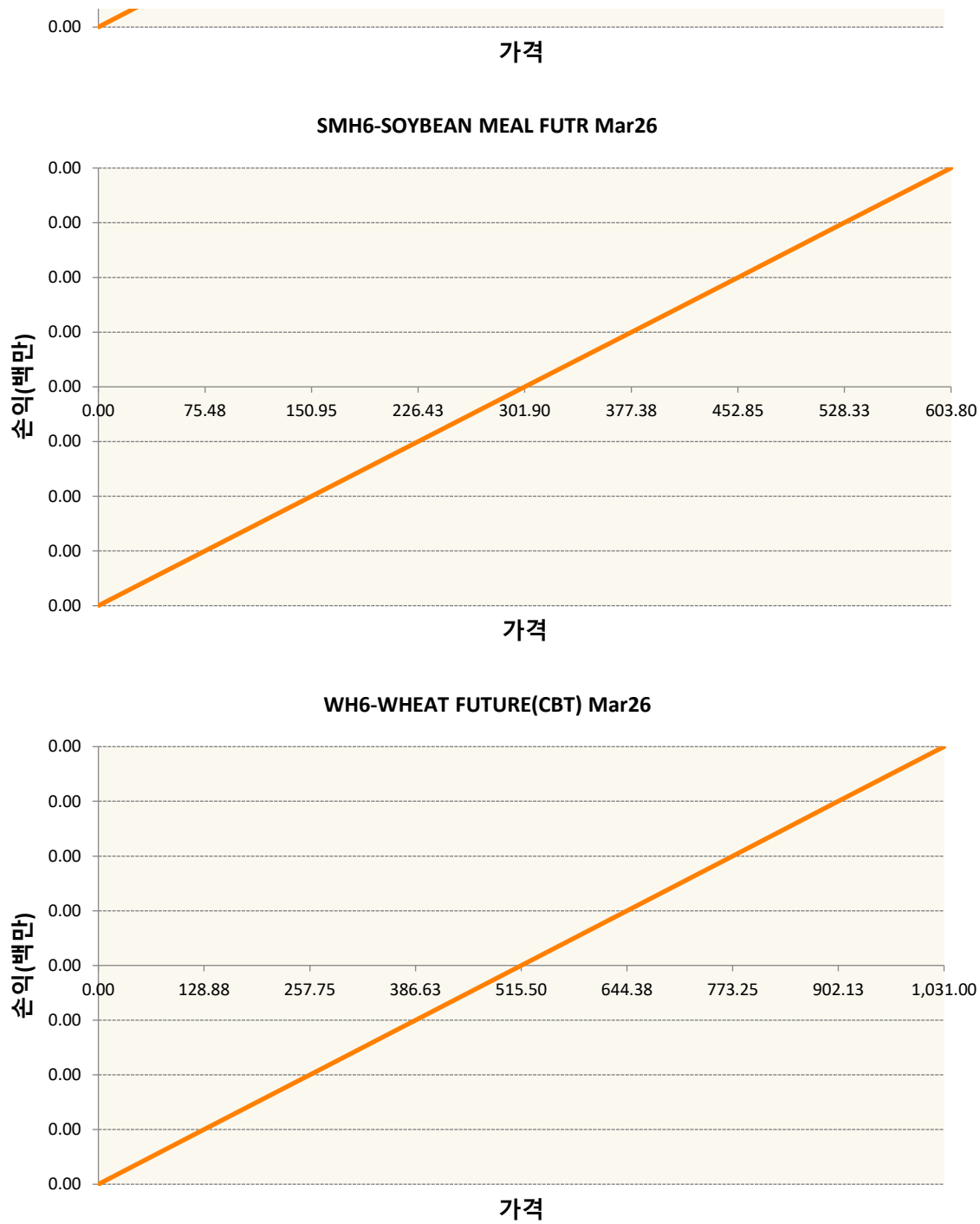
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	390	0	390	
누계	유가증권	선물	2,720	0	2,720	
누계	통화	선물	0	297	-297	장내

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	2025-12-24
기준일	2025-12-23

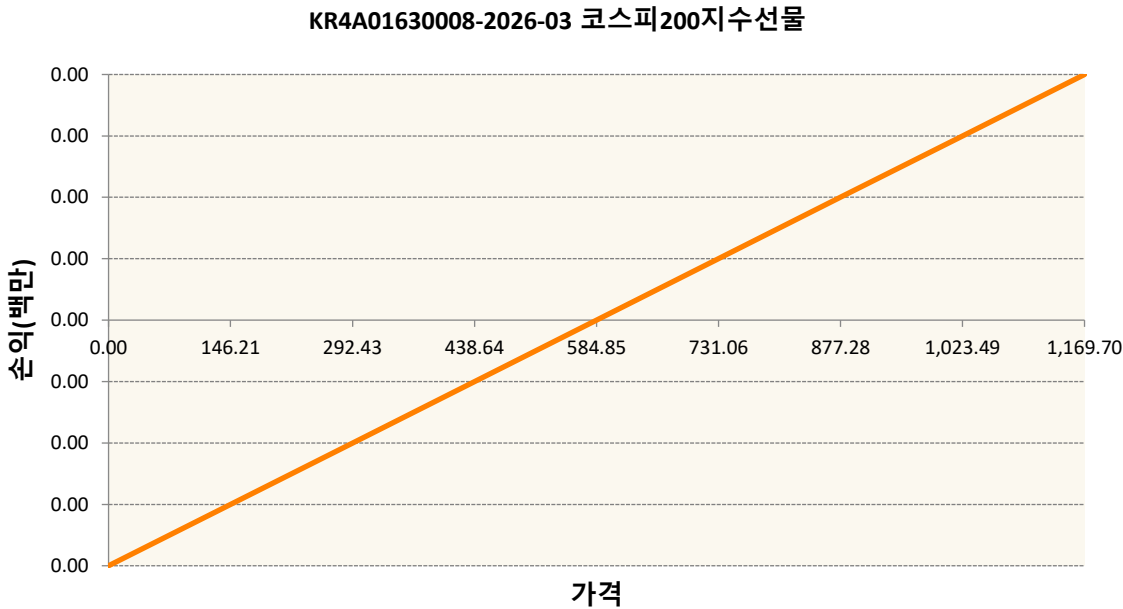
스마트인덱스모

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	1,316	0	1,316	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	2025-12-24
기준일	2025-12-23

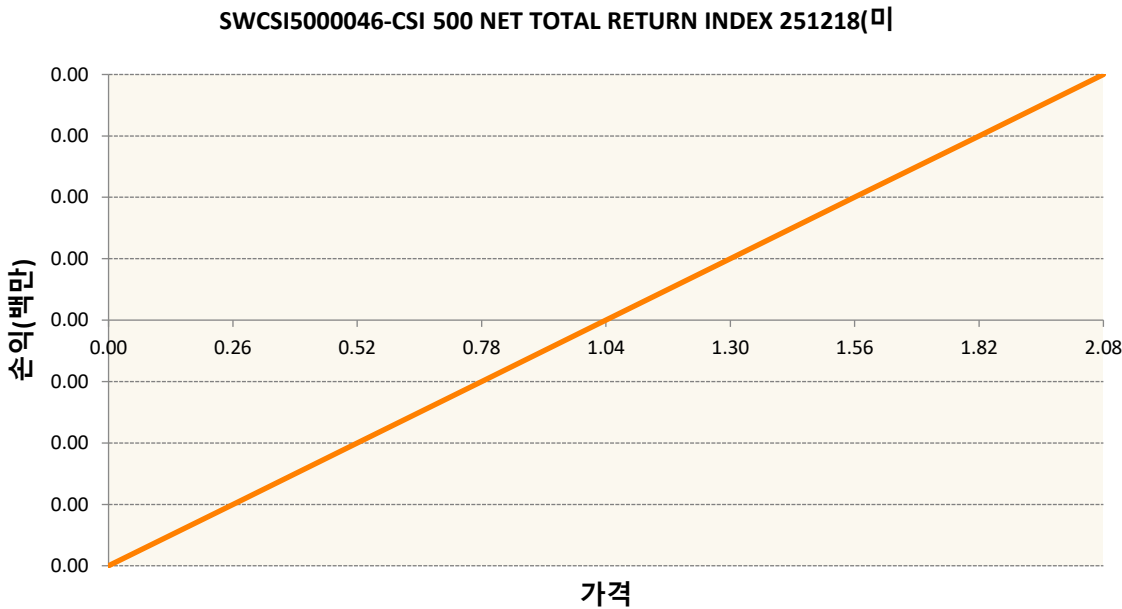
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,804	0	4,804	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

383

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

472

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

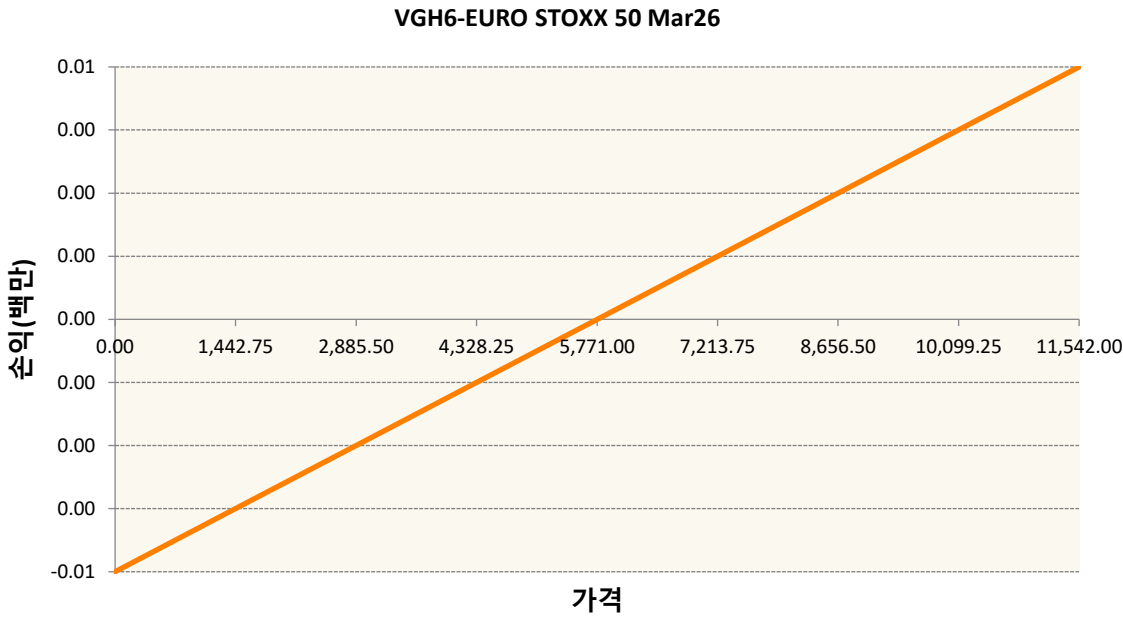
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	802	0	802	

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	2025-12-24
기준일	2025-12-23

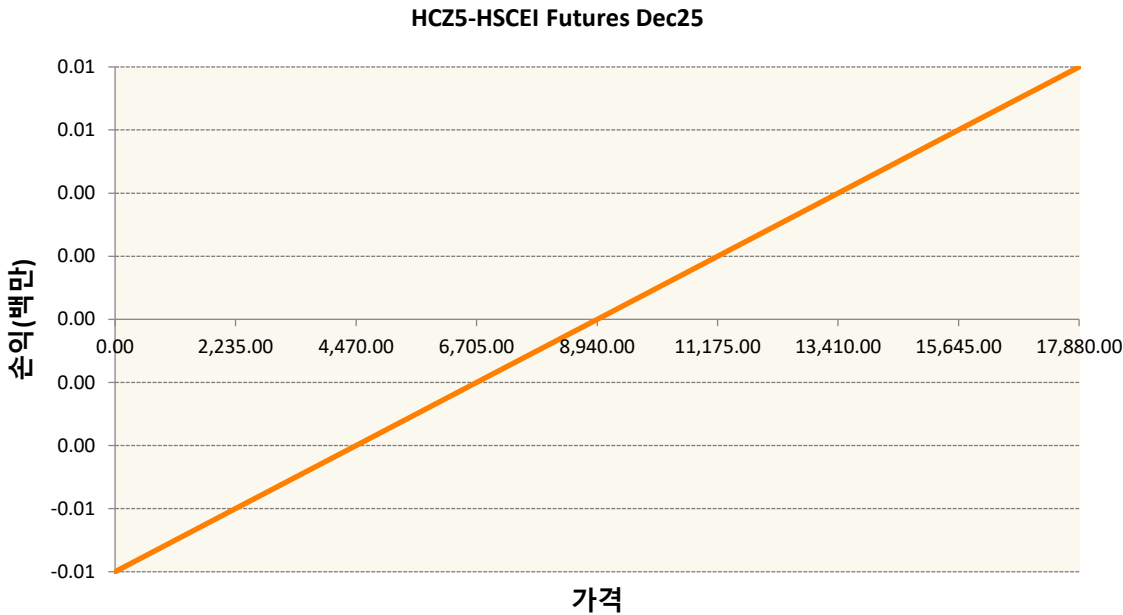
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,862	0	1,862	

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	2025-12-24
기준일	2025-12-23

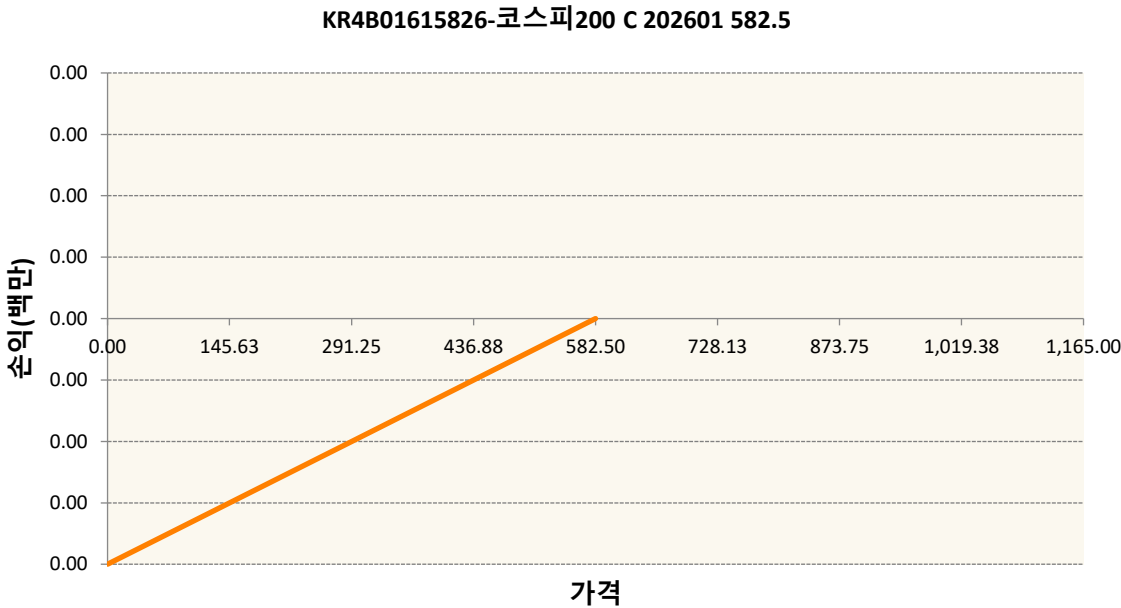
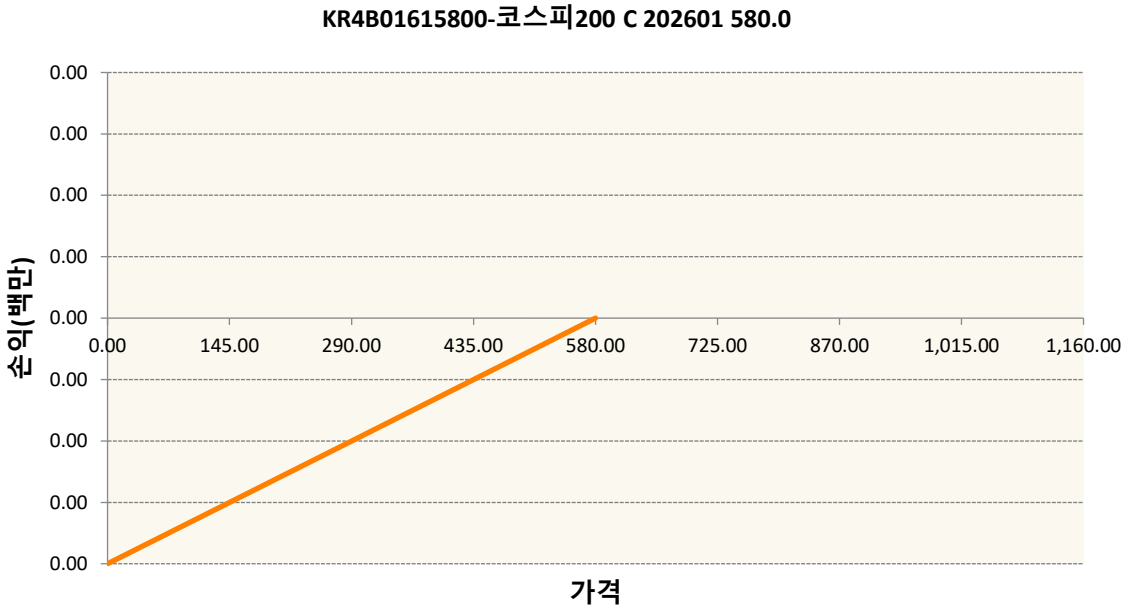
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

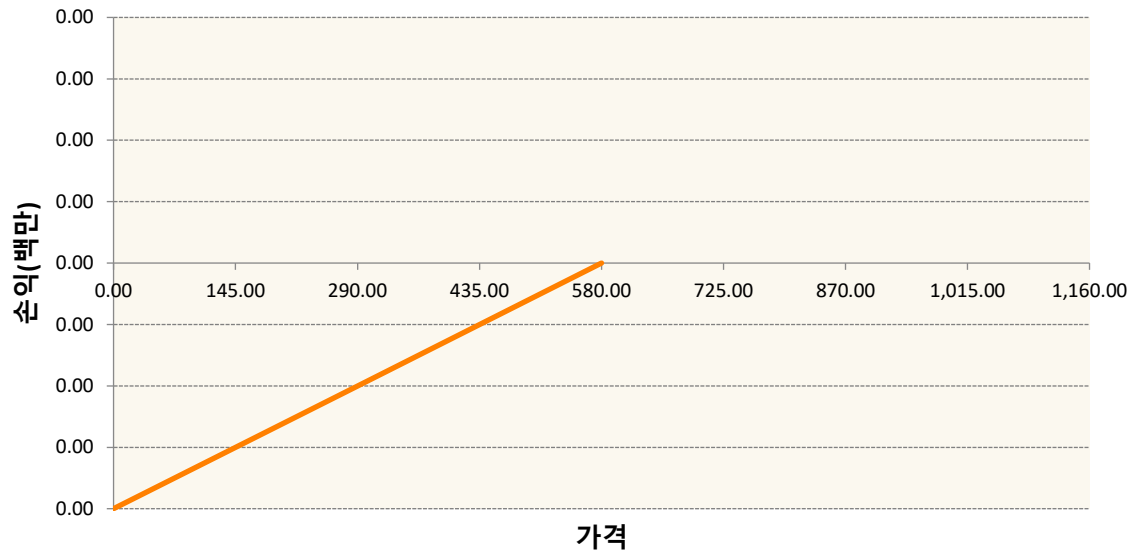
(단위:백만원)

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 2025-12-24

기준일 2025-12-23

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	2025-12-24
기준일	2025-12-23

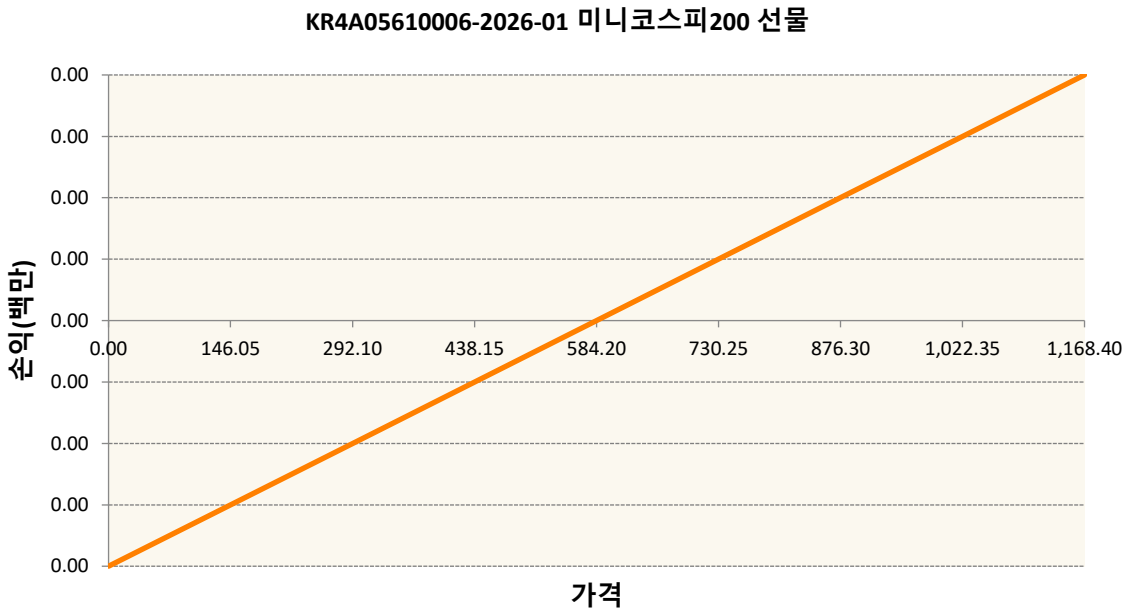
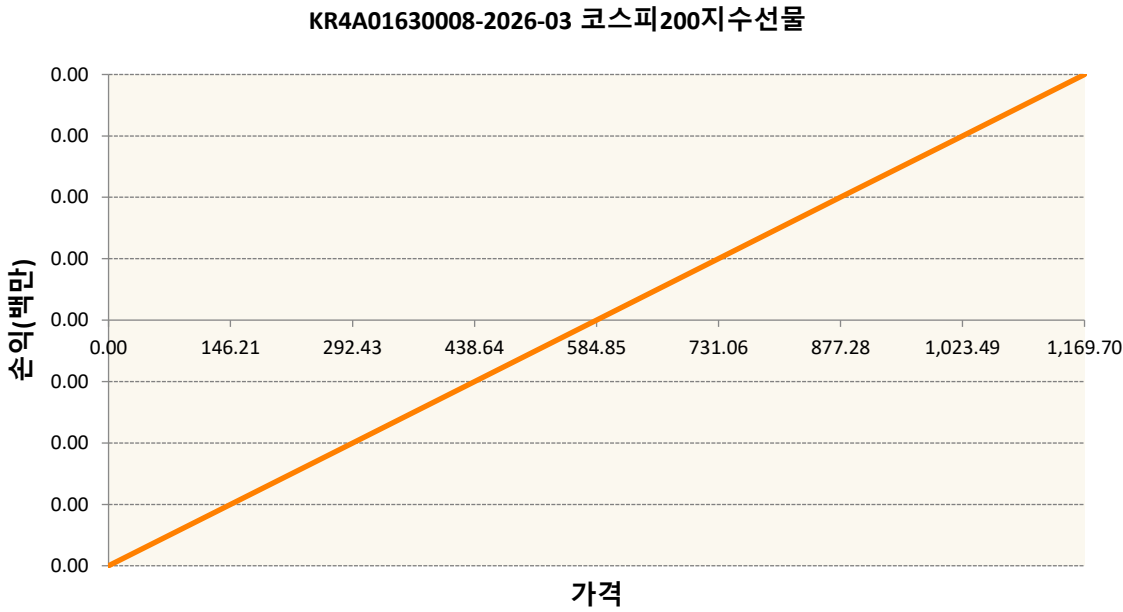
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,461	0	1,461	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	2025-12-24
기준일	2025-12-23

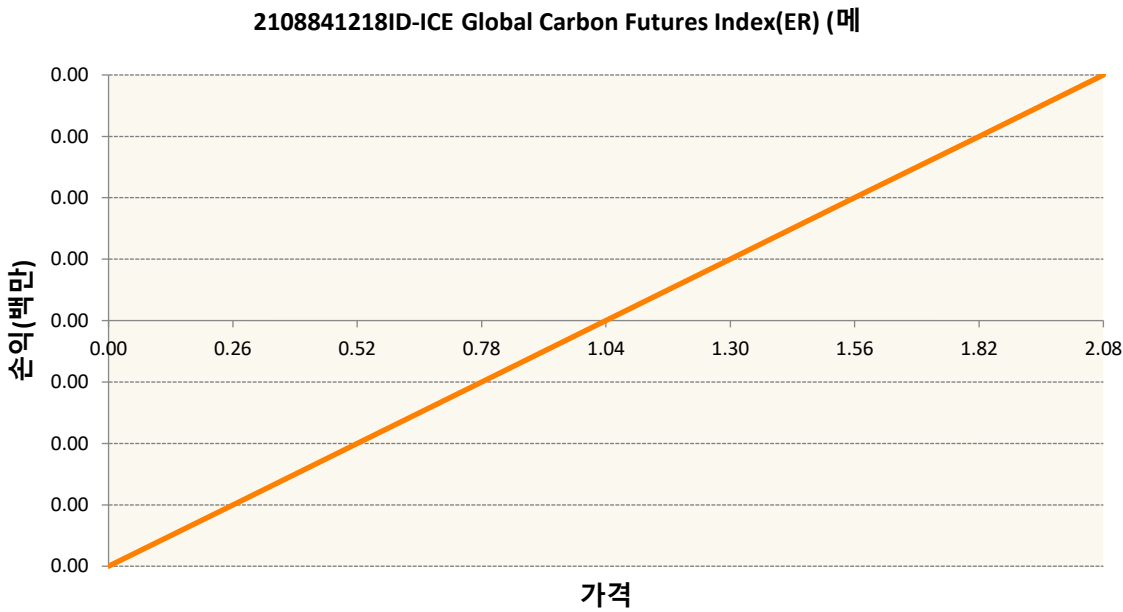
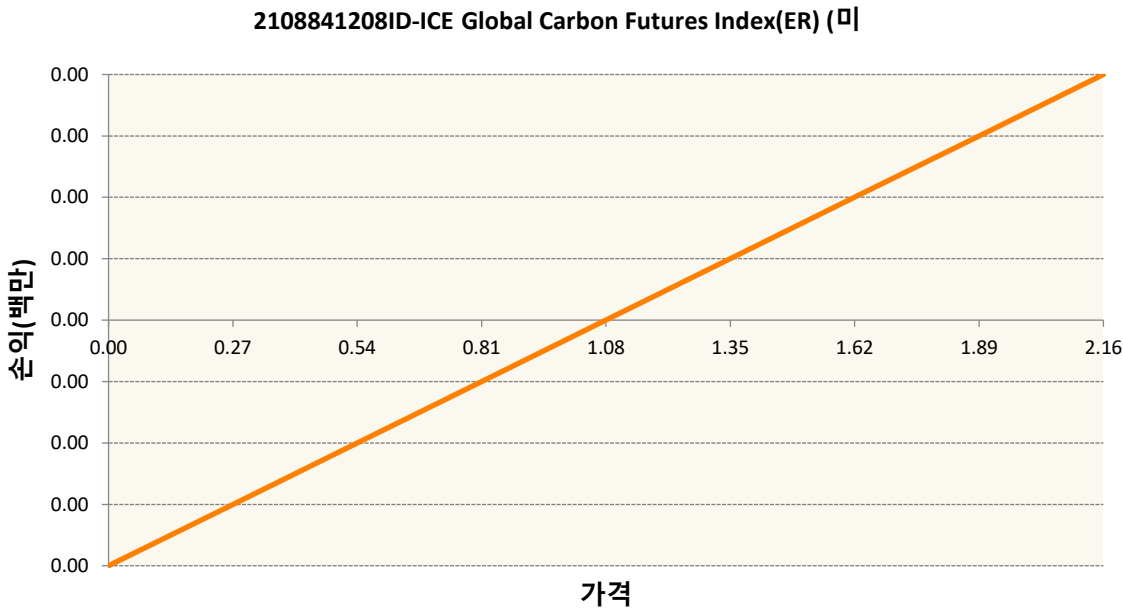
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,871	0	7,871	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		501
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		126

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	602

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

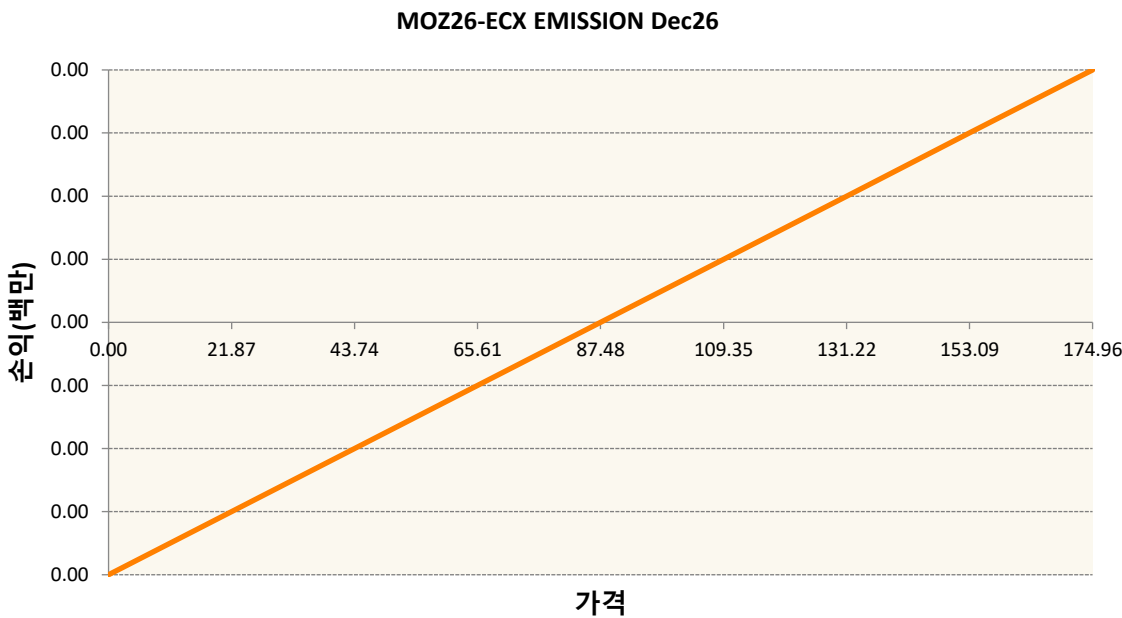
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,810	0	5,810	
누계	통화	선도	0	2,896	-2,896	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213FCP(KRW/EUR 30-01-26E	232
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	465

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

(단위:백만원)

743

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

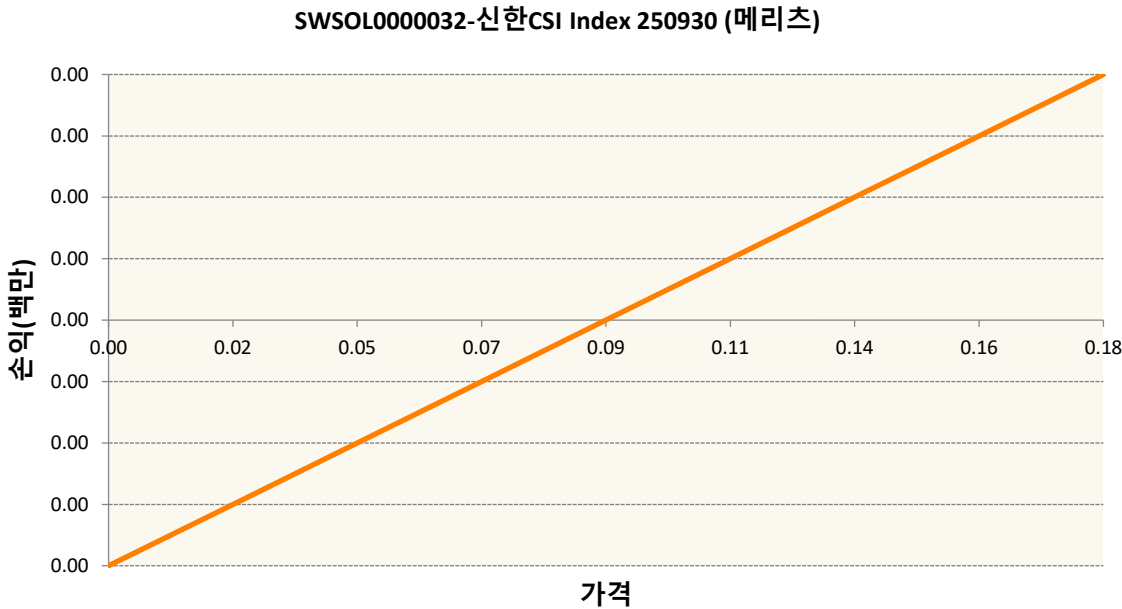
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,722	0	2,722	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	11
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	7
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	7
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	77

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

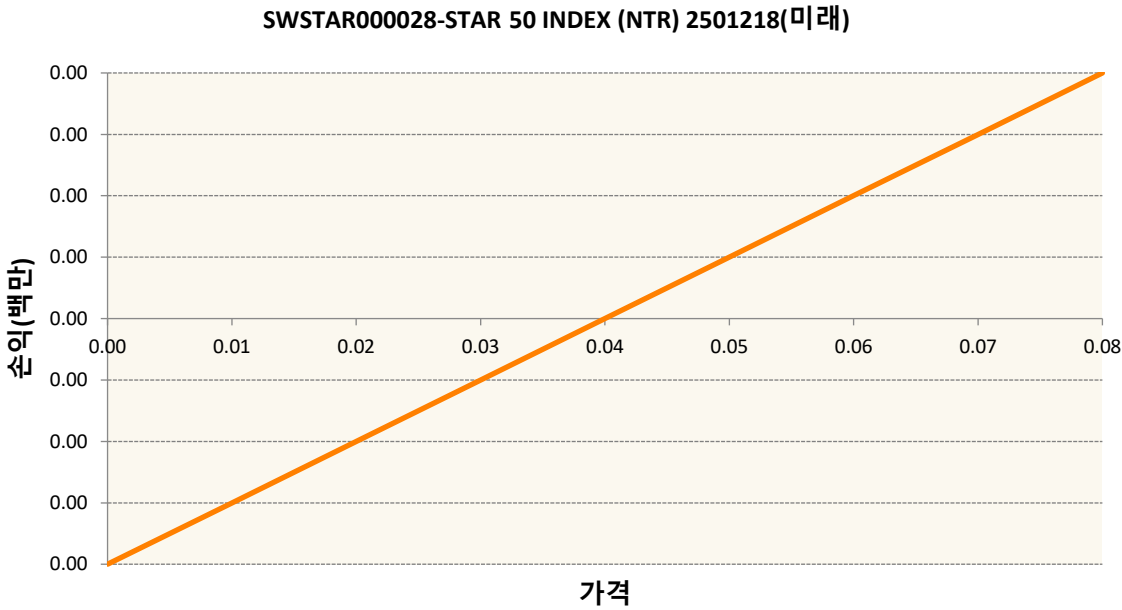
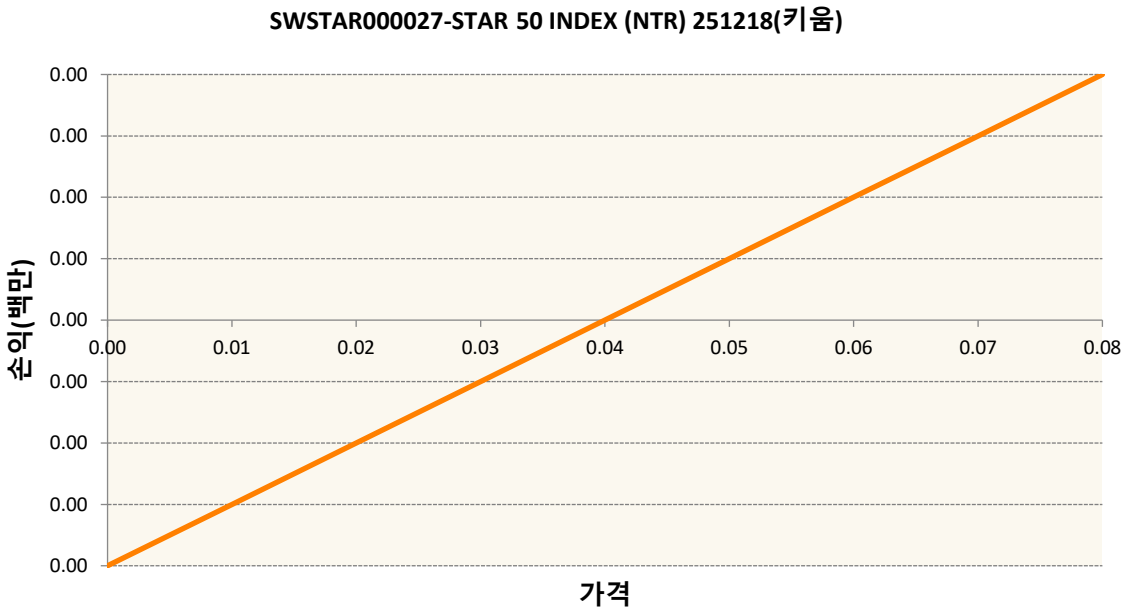
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

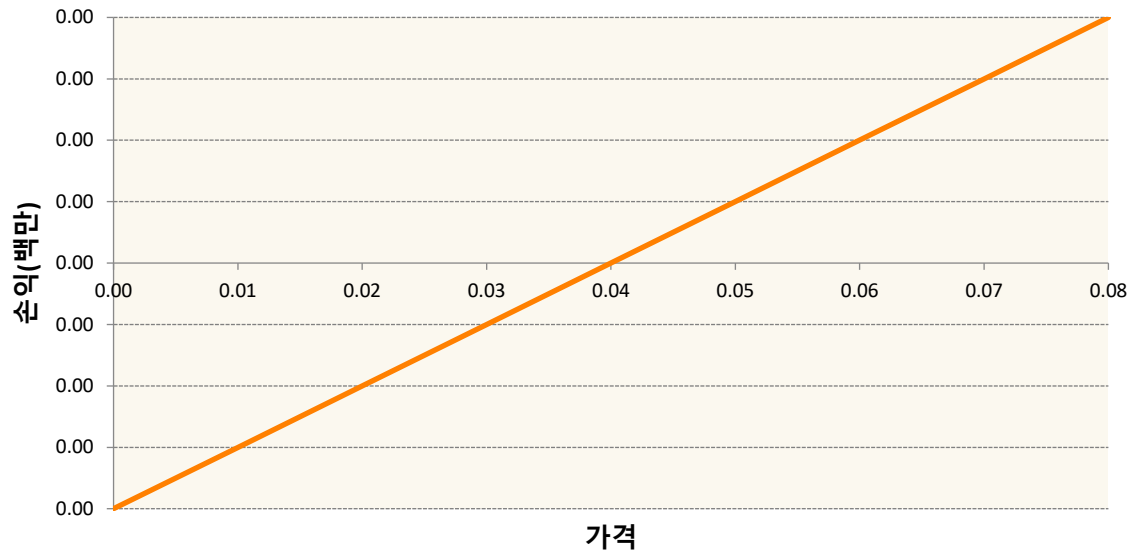
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	953	0	953	장외

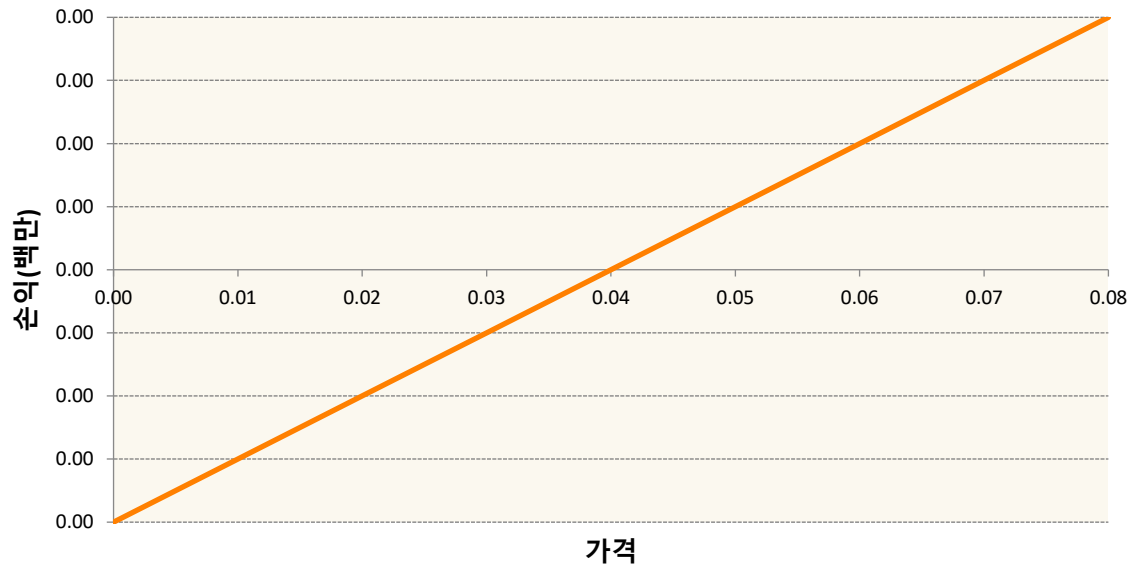
2. 만기시점의 손익구조



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))	2
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))	16
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(메리츠))	43
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))	8

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

(단위:백만원)

128

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

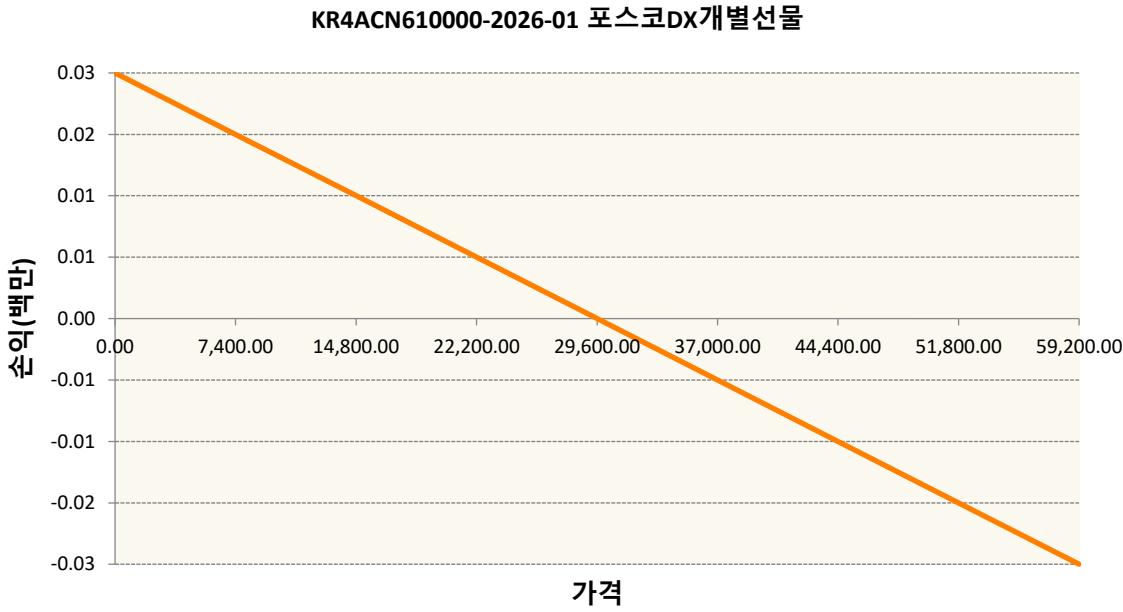
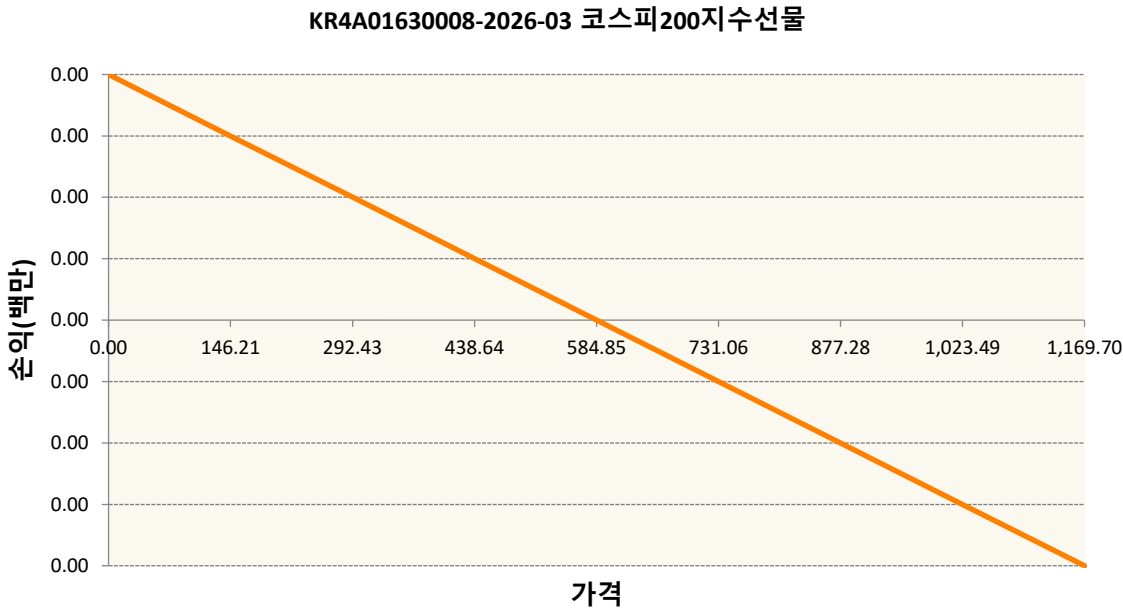
에쿼티알파일반사모혼합자산

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	8	-8	장내
누계	유가증권	선물	0	154	-154	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
KR4ACN610000		2026-01 포스코DX개별선물					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)

17

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

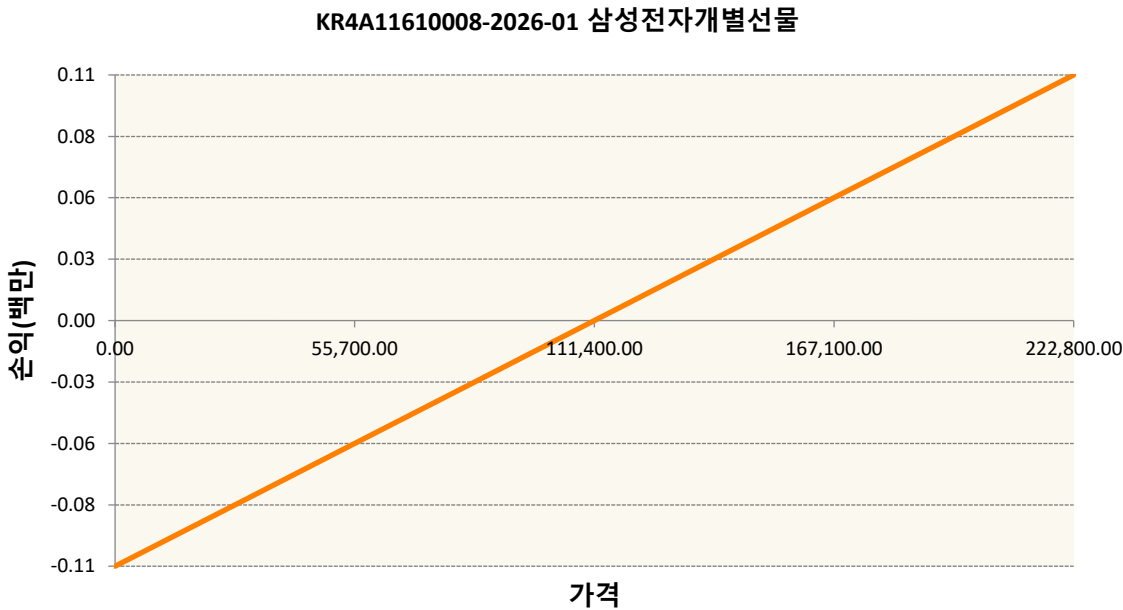
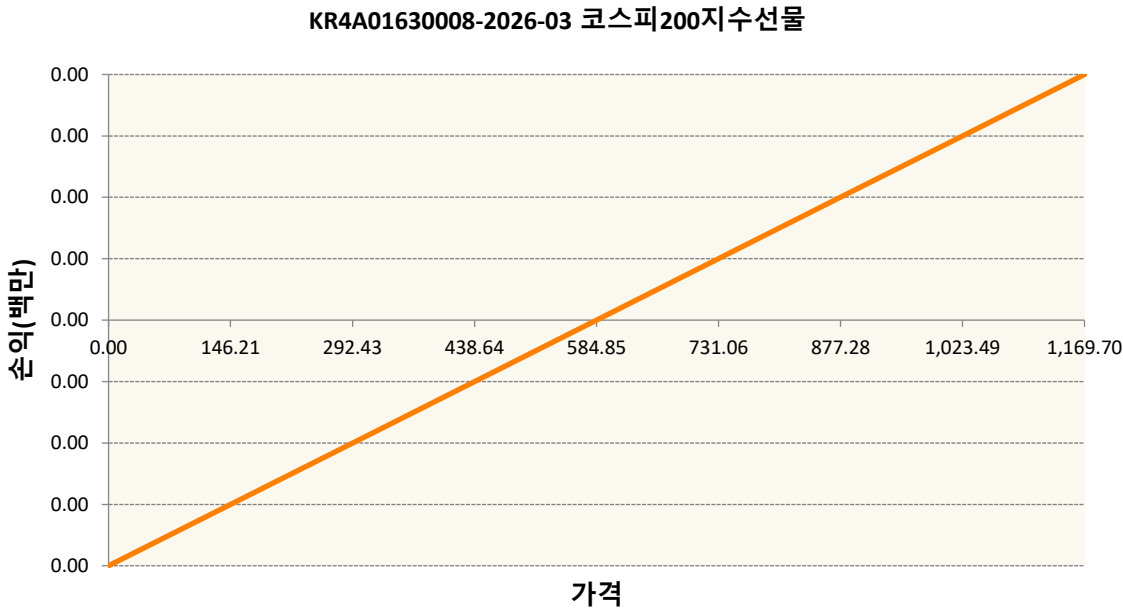
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

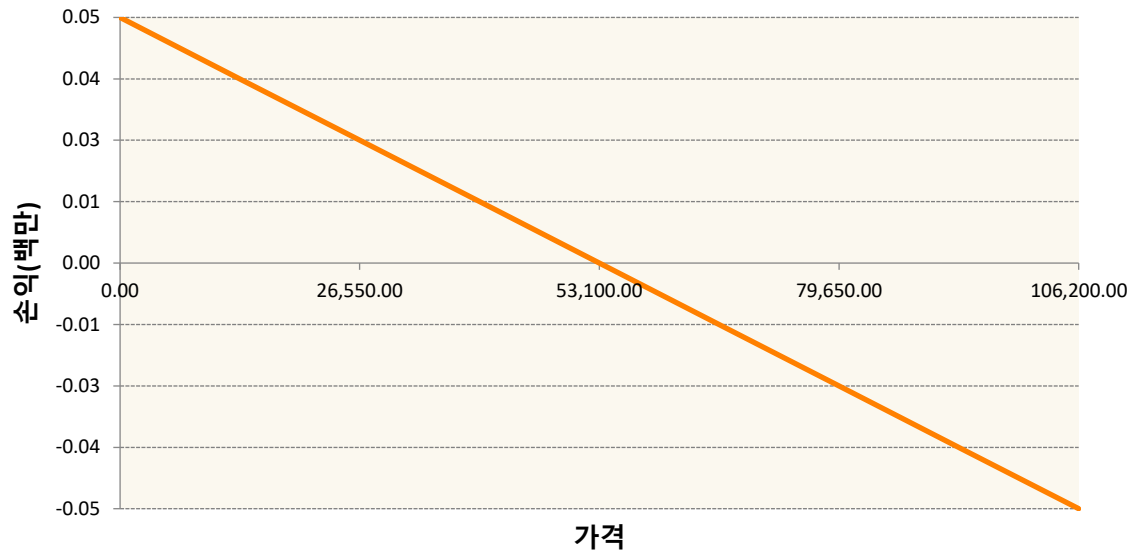
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	841	696	145	장내
누계	유가증권	선물	13,667	2,070	11,597	장내

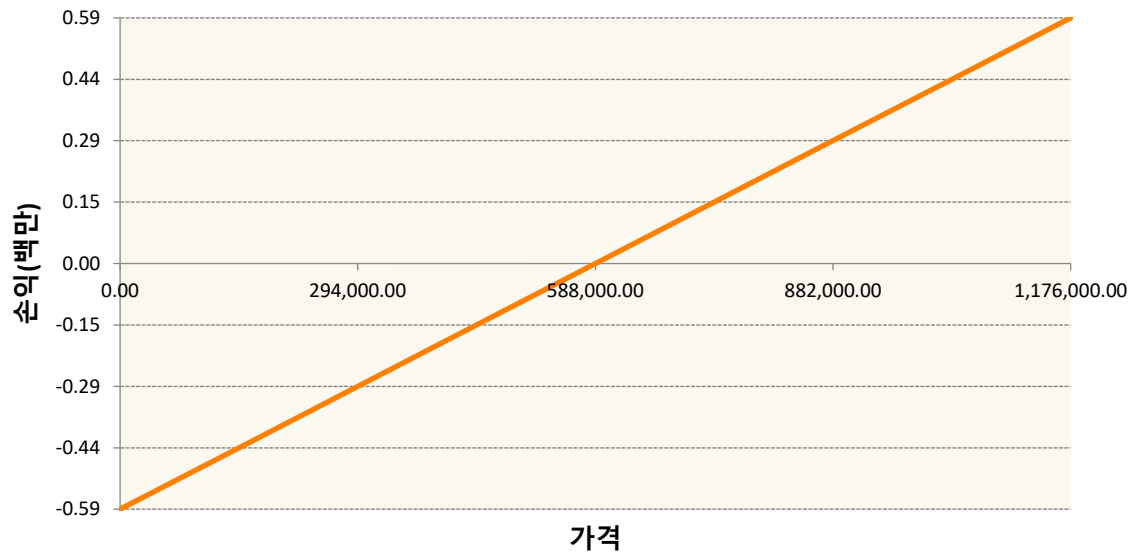
2. 만기시점의 손익구조



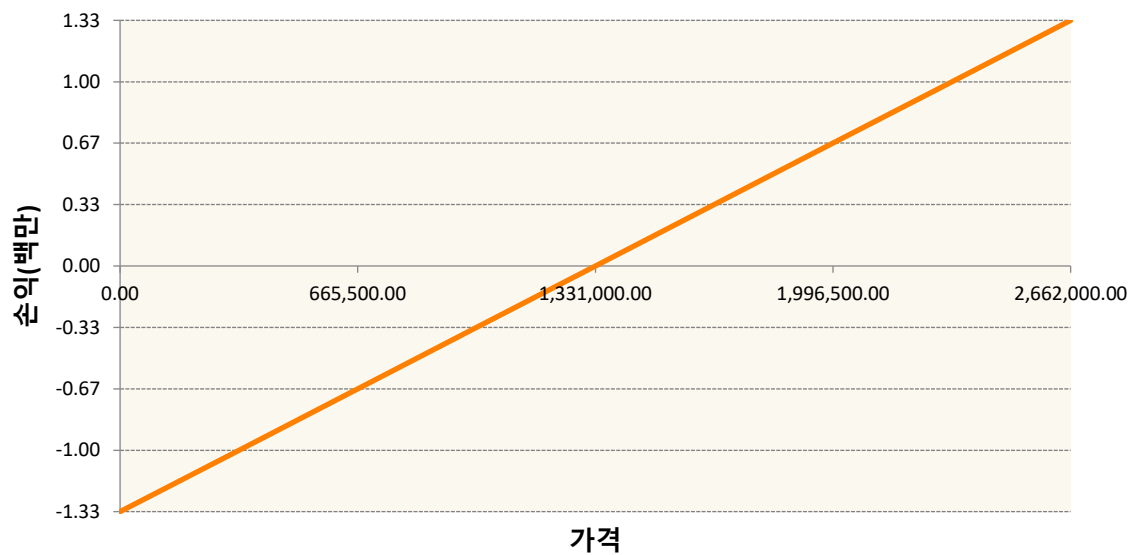
KR4A14610005-2026-01 KT개별선물



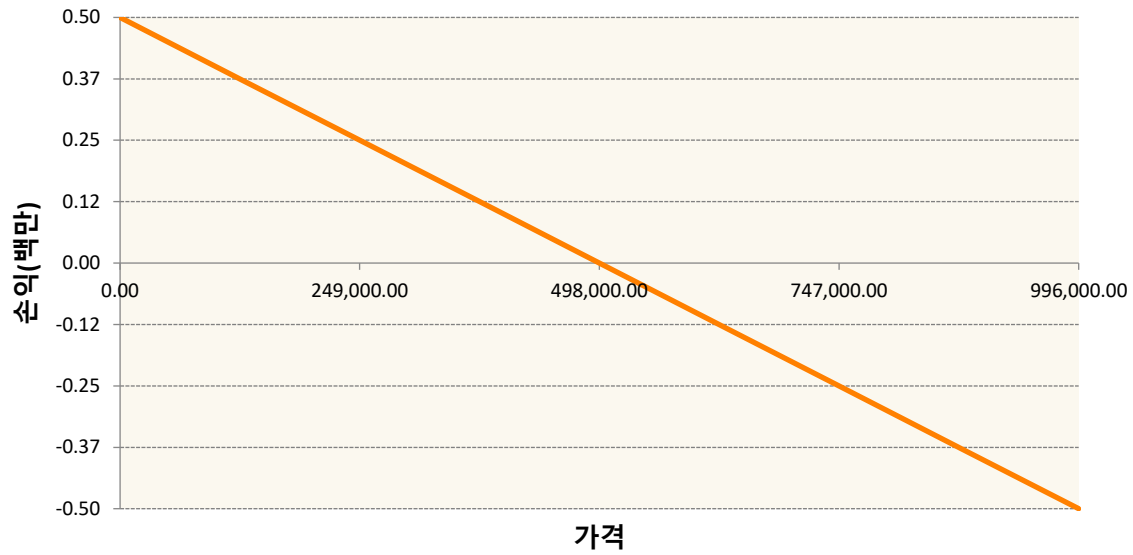
KR4A50610000-2026-01 SK하이닉스개별선물



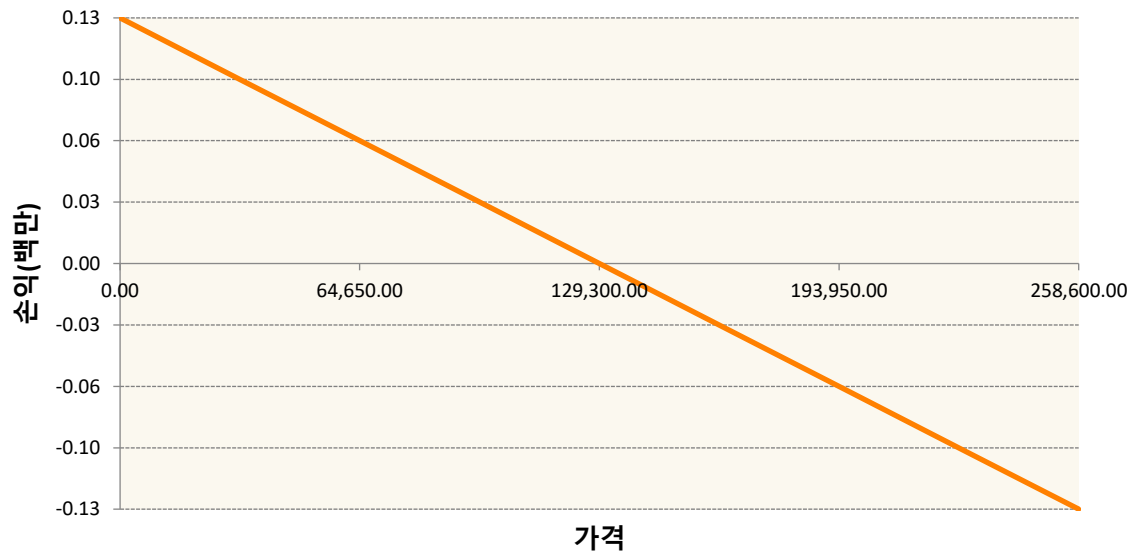
KR4AB3610006-2026-01 고려아연개별선물



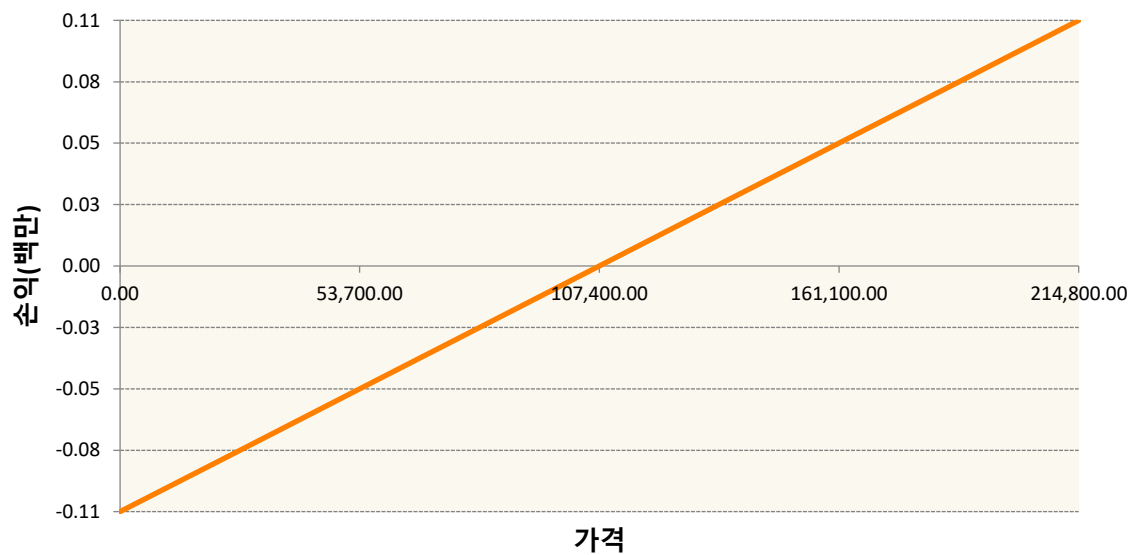
KR4ACT610004-2026-01 삼성화재개별선물



KR4AD0610005-2026-01 DB손해보험개별선물



KR4AEJ610004-2026-01 SKC개별선물



(단위:백만원)

KR4A01630008							2026-03 코스피200지수선물		795	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-795	-795	-795	-795	-795	-795	-795			
-5.33%	-530	-530	-530	-530	-530	-530	-530			
-2.67%	-265	-265	-265	-265	-265	-265	-265			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	265	265	265	265	265	265	265			
5.33%	530	530	530	530	530	530	530			
8.00%	795	795	795	795	795	795	795			
KR4A11610008							2026-01 삼성전자개별선물		85	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85			
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57			
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	28	28	28	28	28	28	28			
5.33%	57	57	57	57	57	57	57			
8.00%	85	85	85	85	85	85	85			
KR4A14610005							2026-01 KT개별선물		82	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	82	82	82	82	82	82	82			
-5.33%	55	55	55	55	55	55	55			
-2.67%	27	27	27	27	27	27	27			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27			
5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55			
8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82			
KR4A50610000							2026-01 SK하이닉스개별선물		89	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89			
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59			
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	30	30	30	30	30	30	30			
5.33%	59	59	59	59	59	59	59			
8.00%	89	89	89	89	89	89	89			
KR4AB3610006							2026-01 고려아연개별선물		103	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
-5.33%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	34	34	34	34	34	34	34
5.33%	69	69	69	69	69	69	69
8.00%	103	103	103	103	103	103	103
KR4ACT610004 2026-01 삼성화재개별선물							41
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	41	41	41	41	41	41
-5.33%	28	28	28	28	28	28	28
-2.67%	14	14	14	14	14	14	14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
KR4AD0610005 2026-01 DB손해보험개별선물							42
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	42	42	42	42	42	42	42
-5.33%	28	28	28	28	28	28	28
-2.67%	14	14	14	14	14	14	14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
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%	-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%	22	22	22	22	22	22	22

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

(단위:백만원)

1,519

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

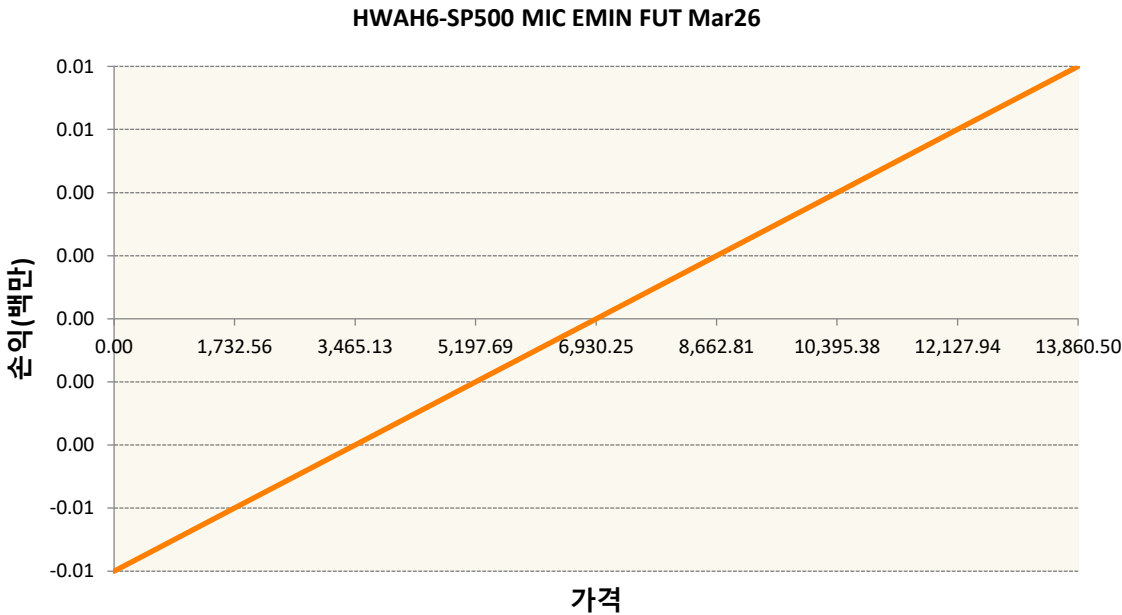
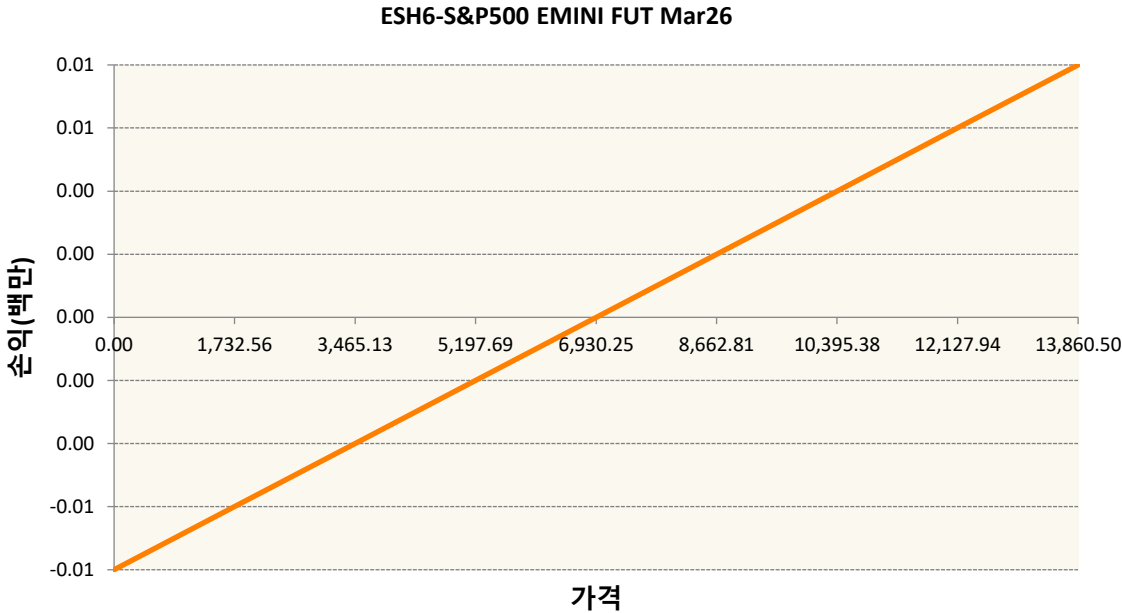
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

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	1,127	0	1,127	장내
누계	지수	선물	47,642	0	47,642	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	3,811
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	90

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,462

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

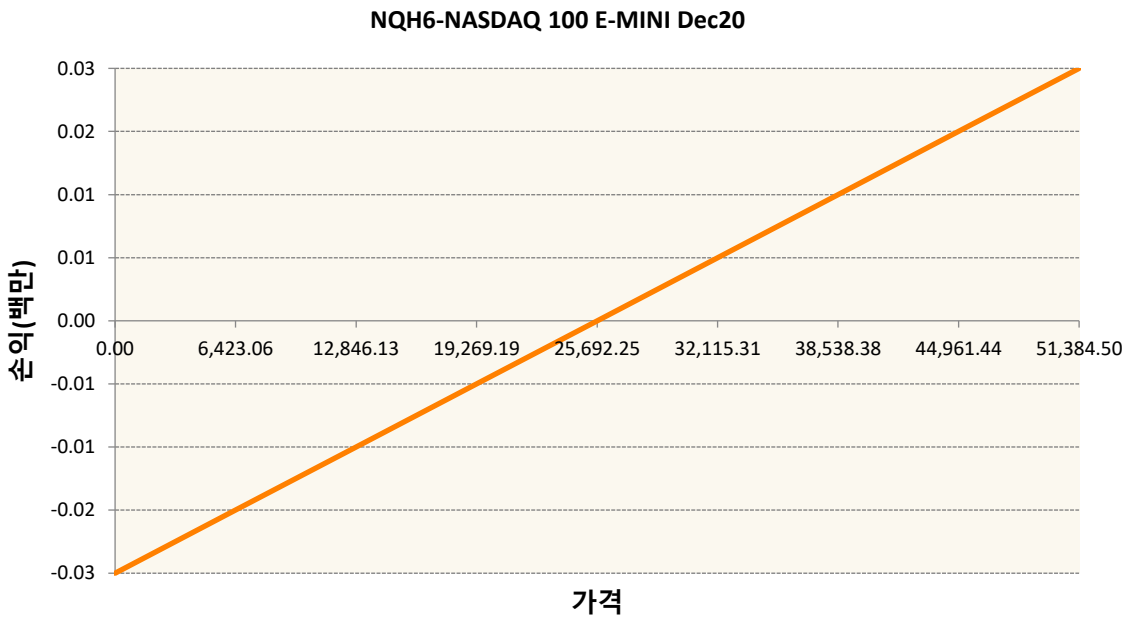
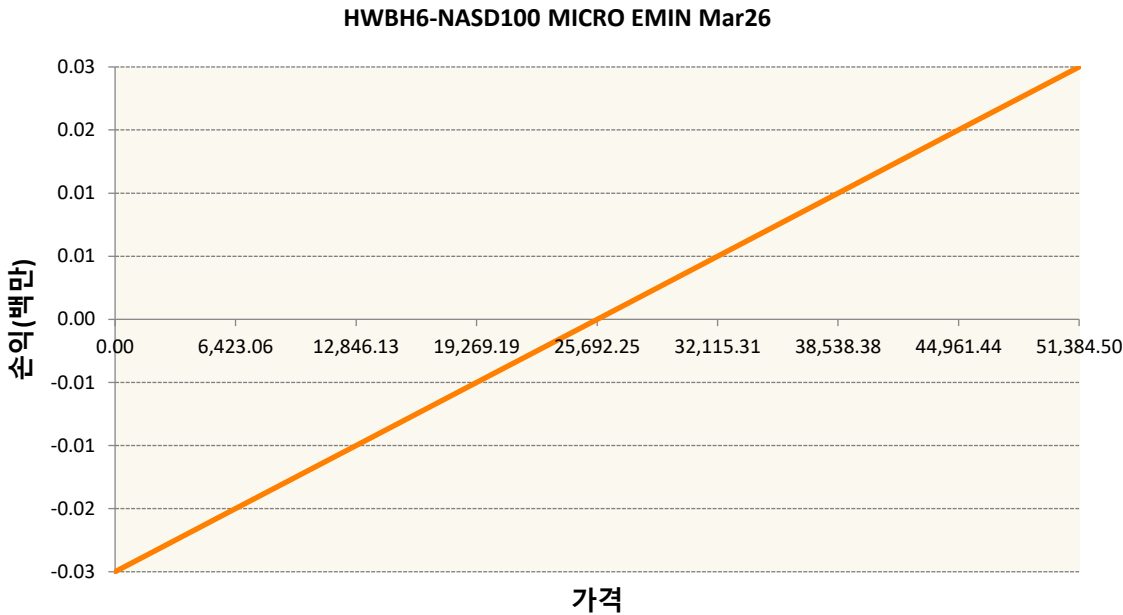
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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	22,715	0	22,715	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN Mar26		55
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,762

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)			(단위:백만원)
			2,068

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

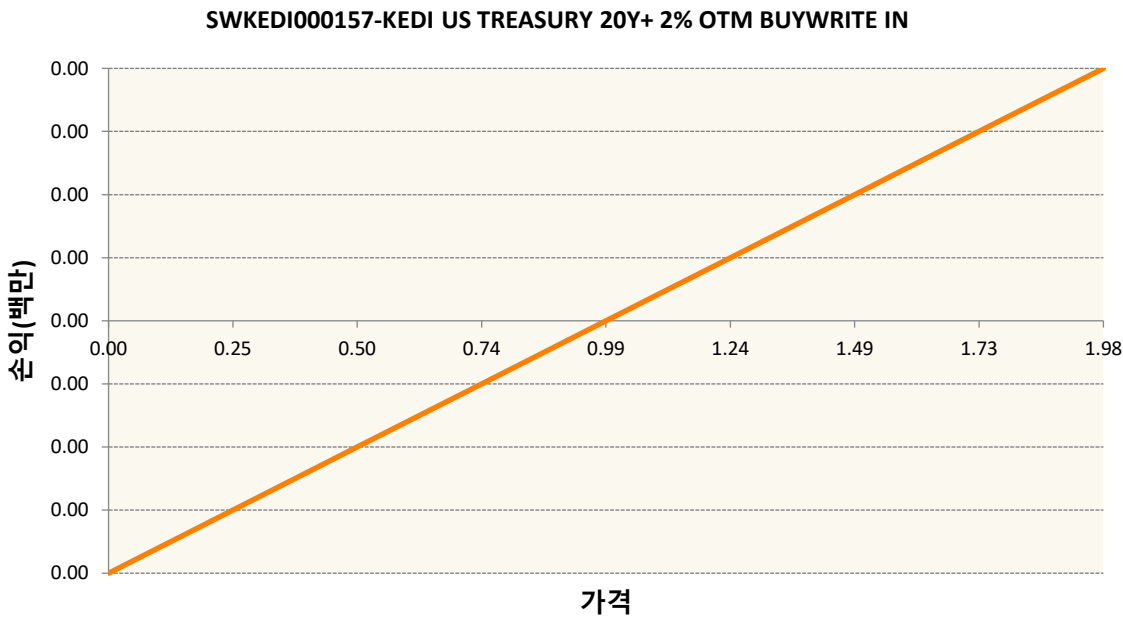
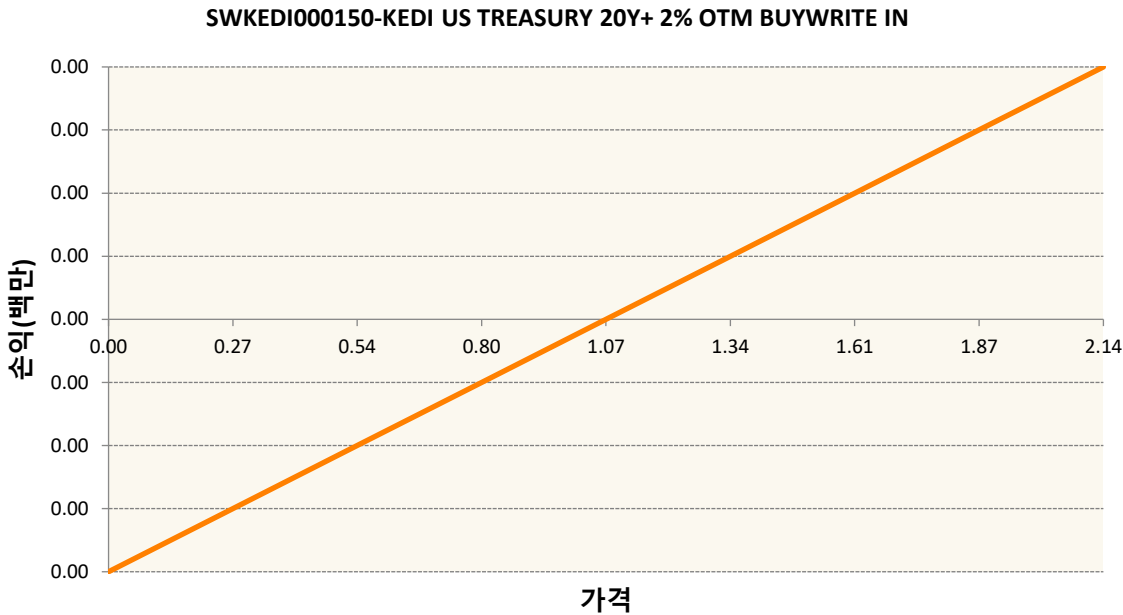
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

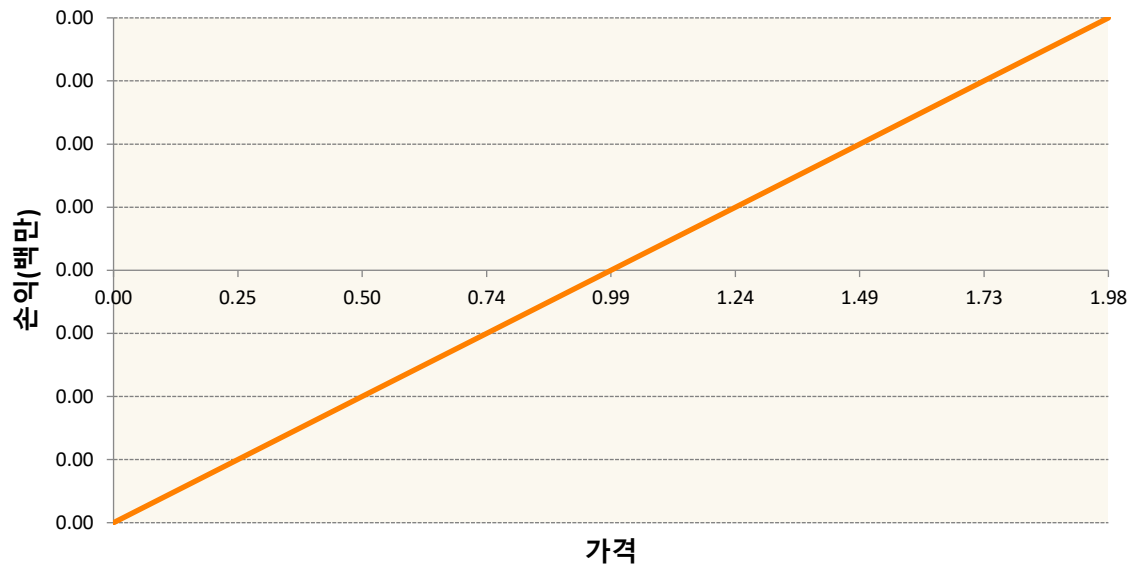
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	376,513	0	376,513	장외

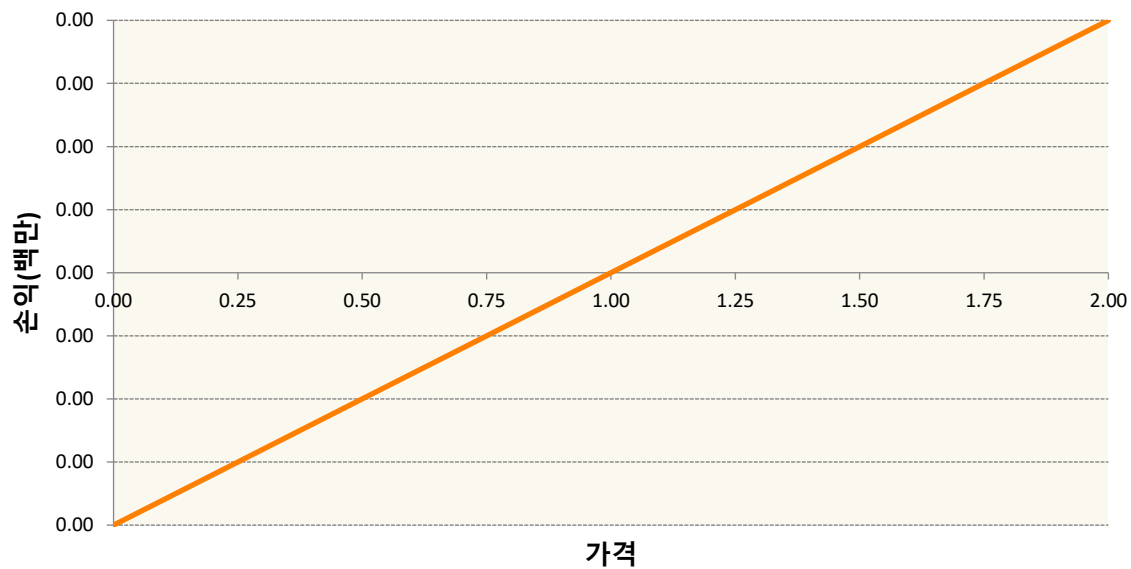
2. 만기시점의 손익구조



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



SWKEDI000159-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,245
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,508
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,745
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	9,686

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

(단위:백만원)

13,743

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

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)

5

공시일	2025-12-24
기준일	2025-12-23

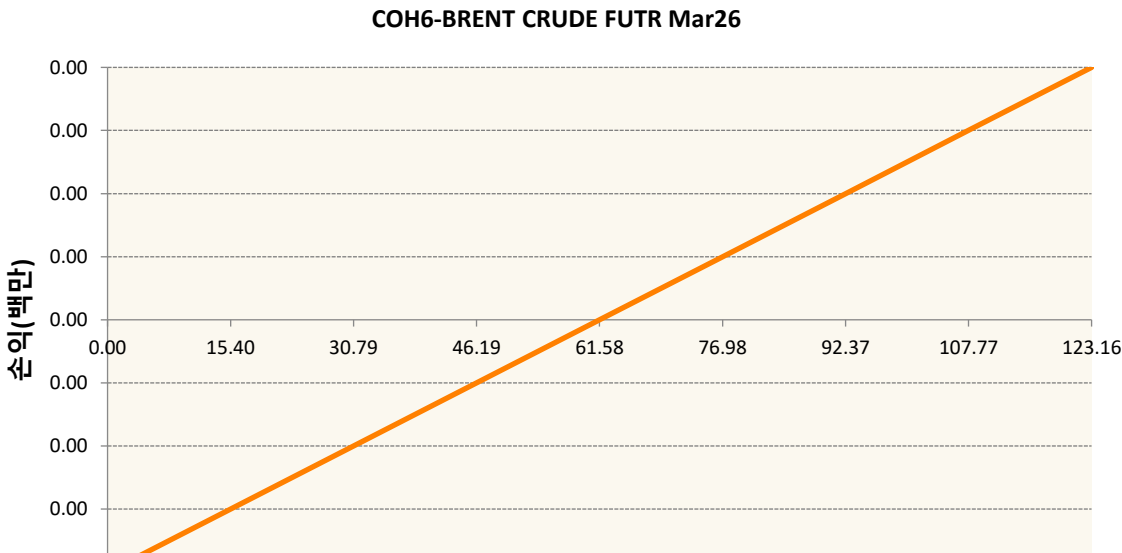
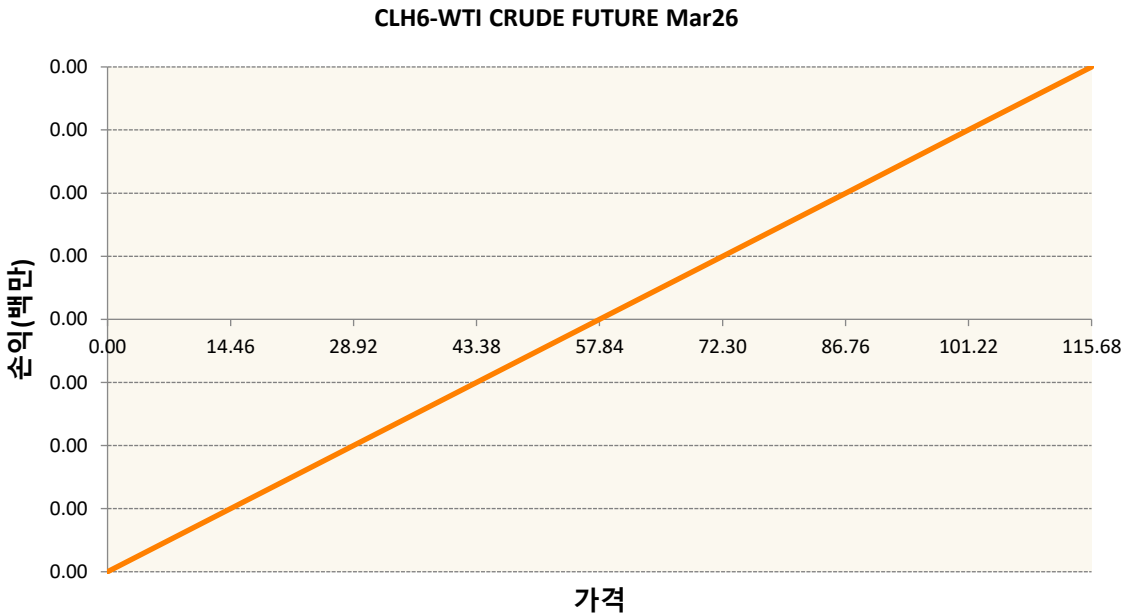
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

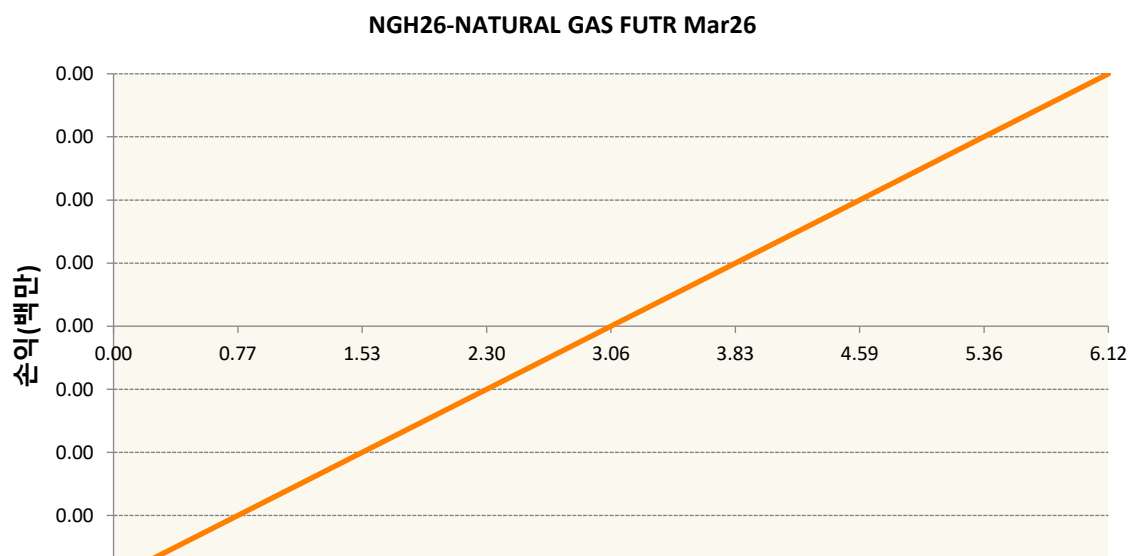
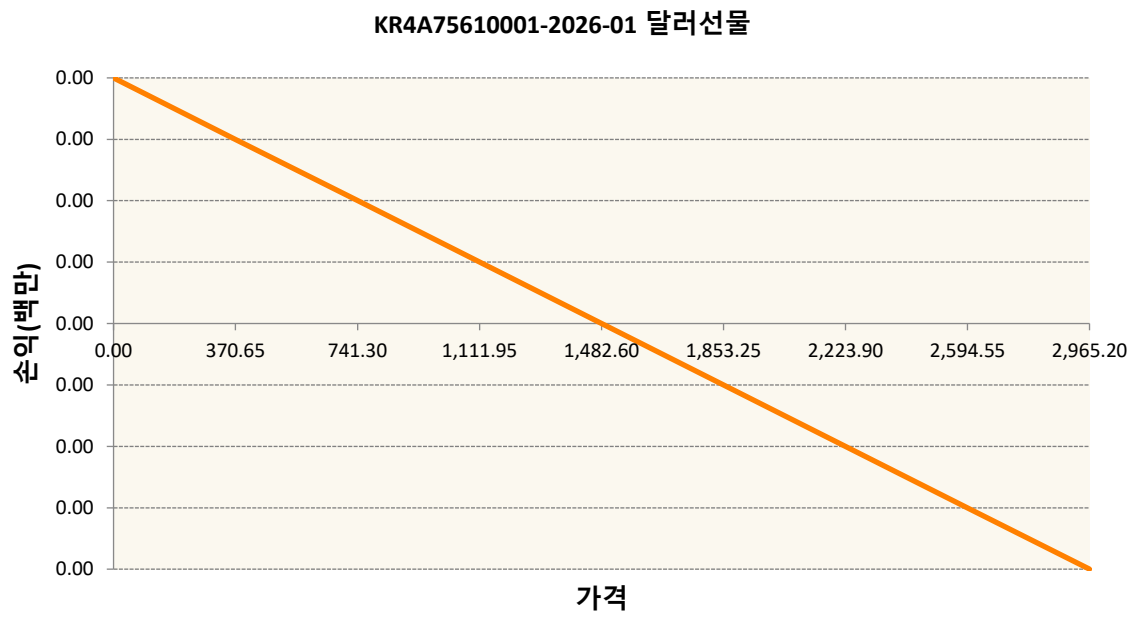
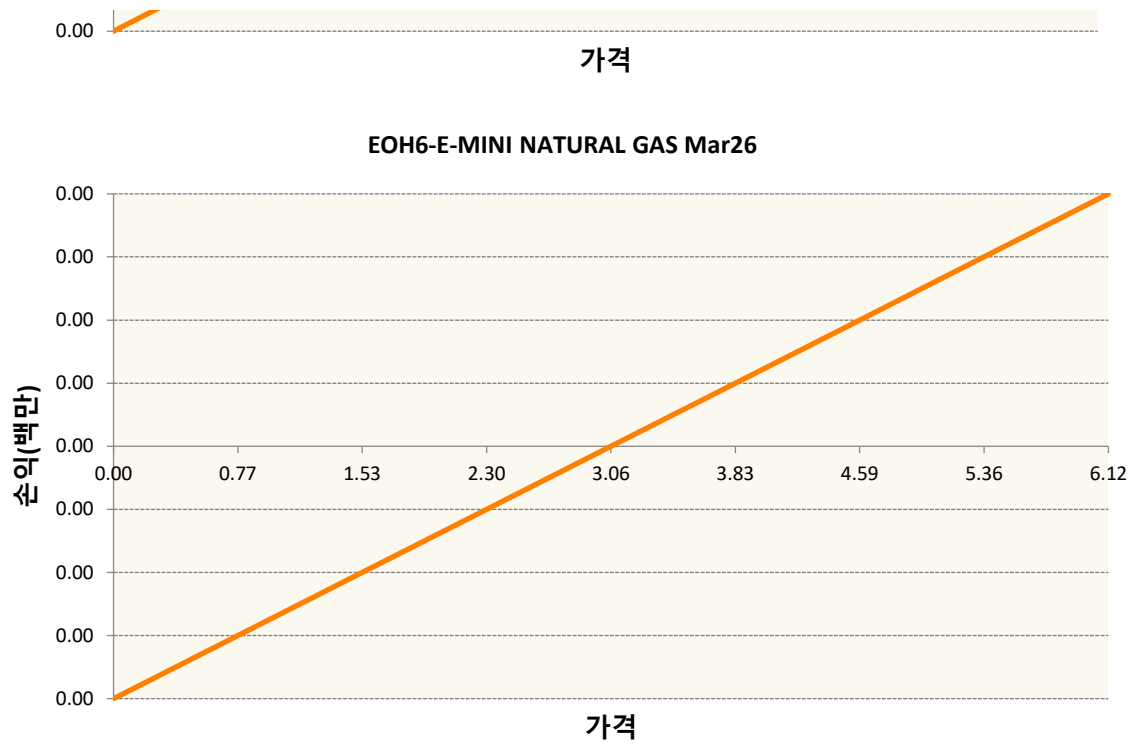
1. 계약금액

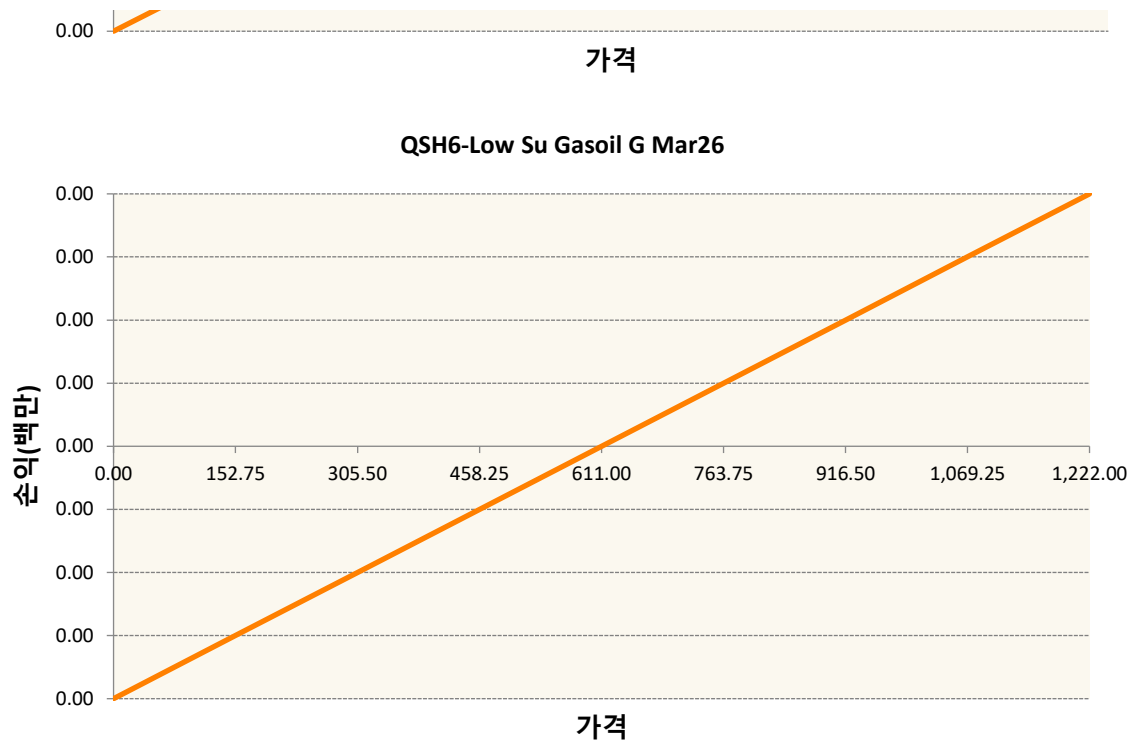
(단위:백만원)

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	135	0	135	
누계	유가증권	선물	355	0	355	
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)

82