

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

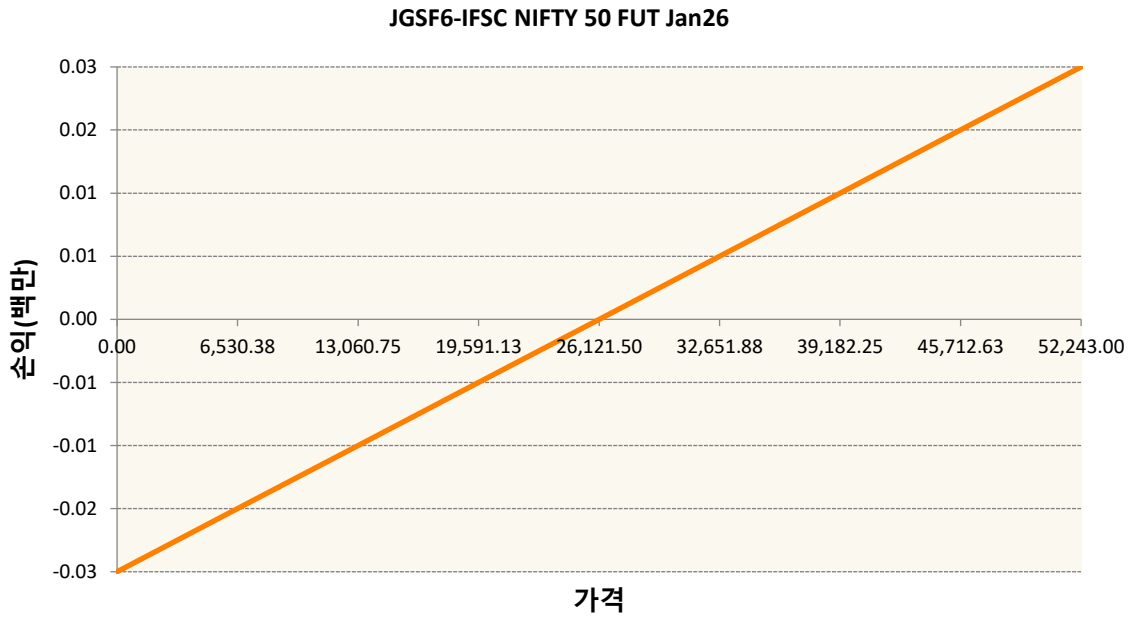
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	672	0	672	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSF6	IFSC NIFTY 50 FUT Jan26	54
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

<b>33</b>
-----------

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

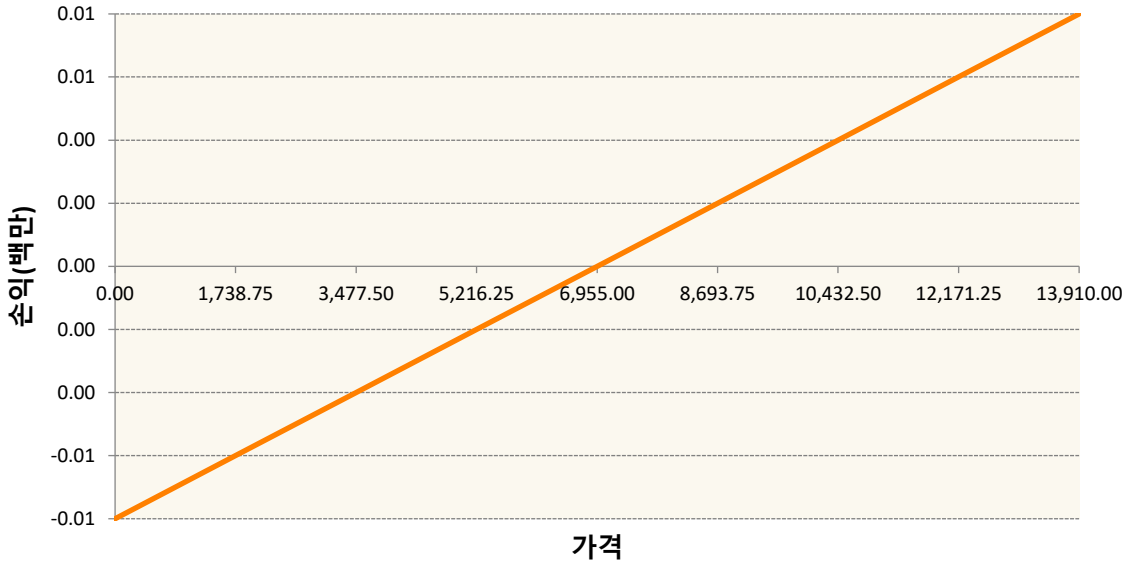
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

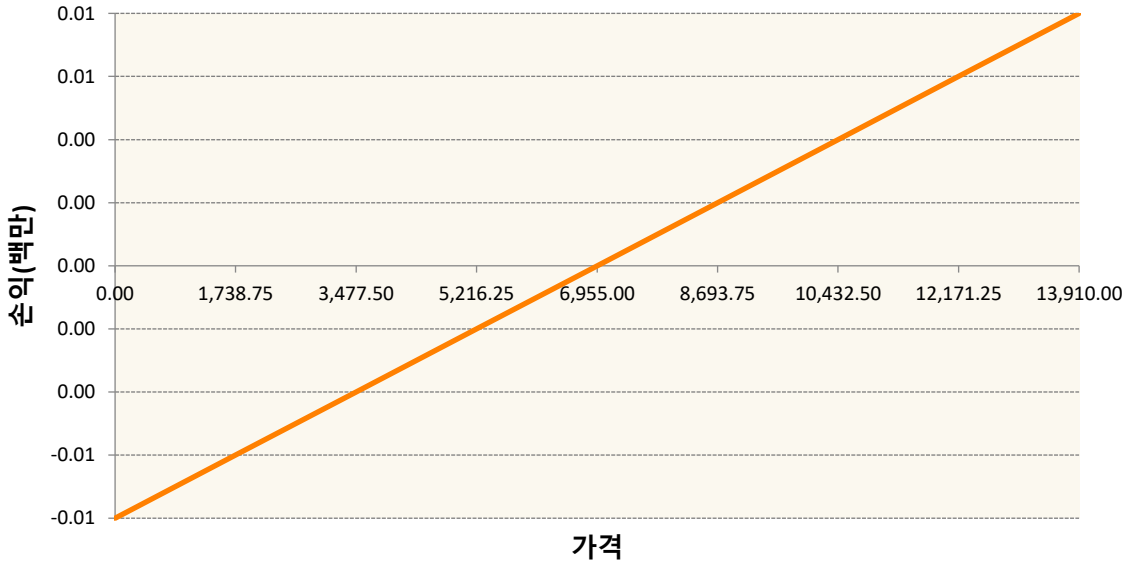
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	257	0	257	장내
누계	지수	선물	514	0	514	

### 2. 만기시점의 손익구조

ESH6-S&P500 EMINI FUT Mar26



HWAH6-SP500 MIC EMIN FUT Mar26



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	41
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	21

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

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

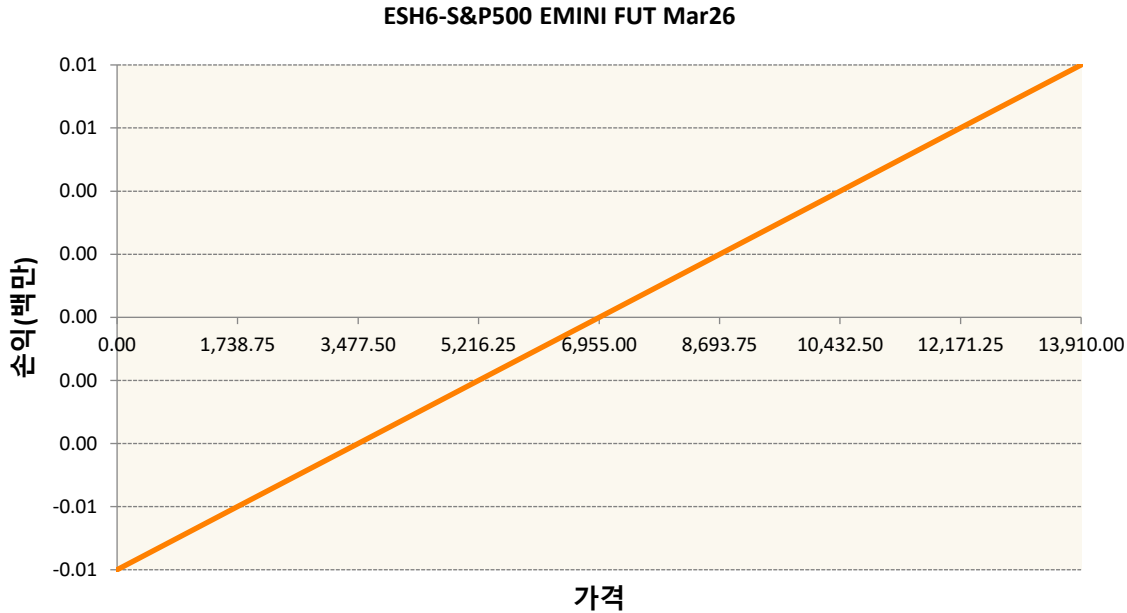
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,542	0	1,542	

### 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	2025-12-31
기준일	2025-12-30

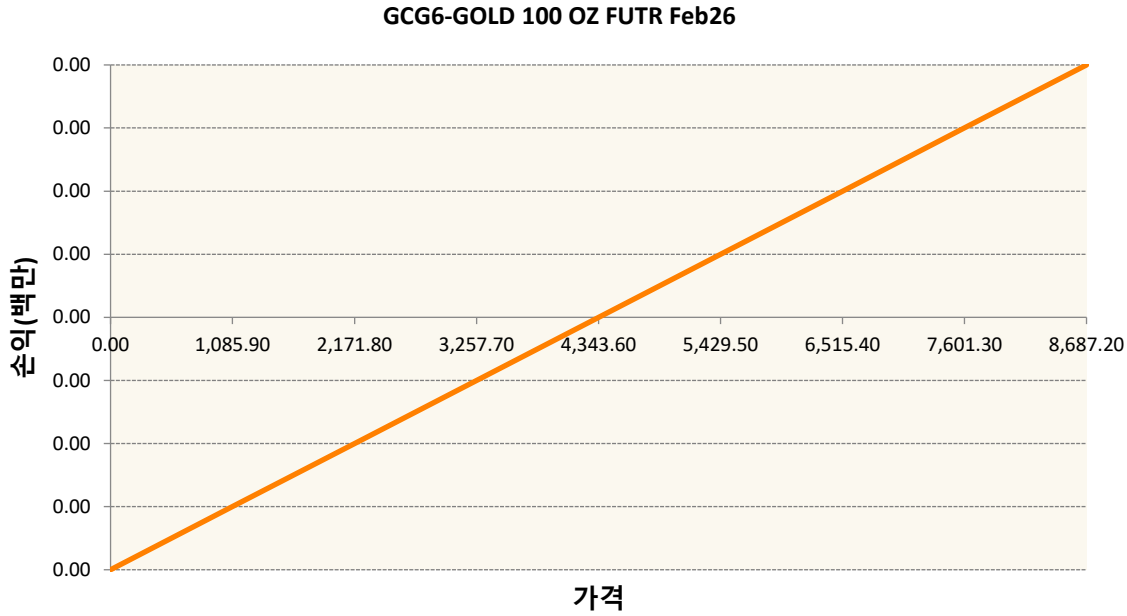
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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	3,194	0	3,194	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 01/02/26 C430 EQUITY  
GCG6 GOLD 100 OZ FUTR Feb26

2
256

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

(단위:백만원)

242
-----

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

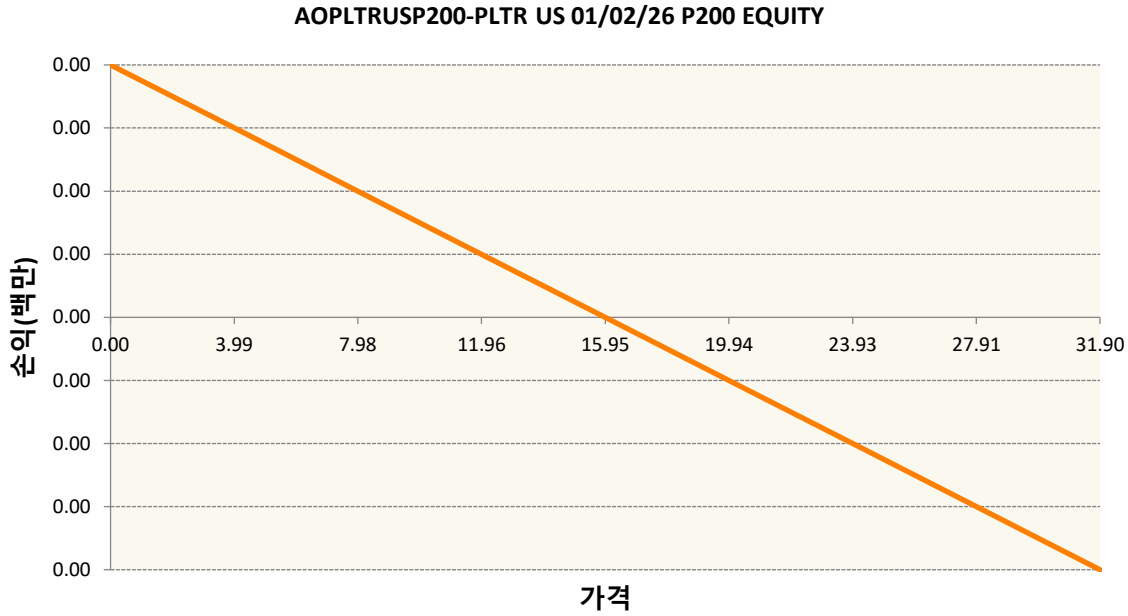
## SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

### 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	706	-706	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC; PLTR US 01/02/26 C200 EQUITY	20
AOPLTRUSP; PLTR US 01/02/26 P200 EQUITY	56

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

(단위:백만원)

292

공시일 2025-12-31

기준일 2025-12-30

## SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSC0(TLT US 01/02/26 C89 EQUITY)

0.35

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-12-31

기준일 2025-12-30

## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

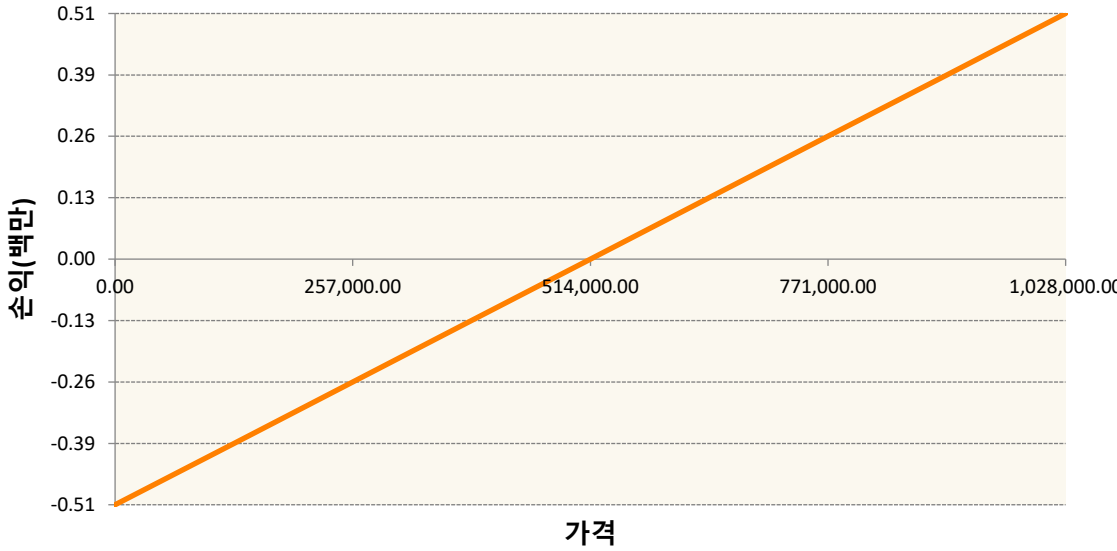
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

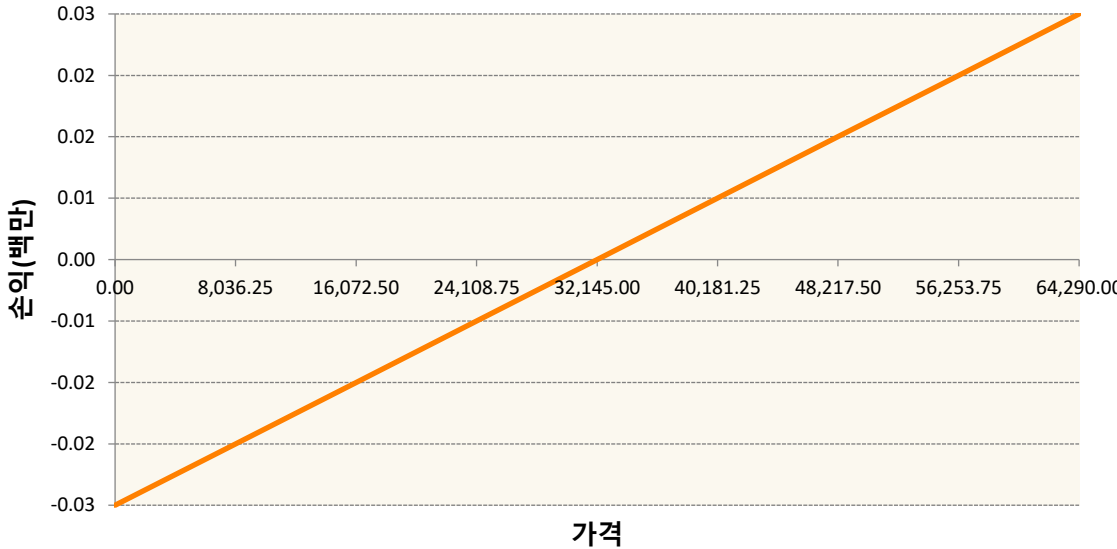
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	20,402	0	20,402	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4AFD610009-2026-01 HD현대중공업개별선물



KR4AM7630007-2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4AFD610009		2026-01 HD현대중공업개별선물						816
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-816	-816	-816	-816	-816	-816	-816	
-5.33%	-544	-544	-544	-544	-544	-544	-544	
-2.67%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	272	272	272	272	272	272	272	
5.33%	544	544	544	544	544	544	544	
8.00%	816	816	816	816	816	816	816	
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%	-543	-543	-543	-543	-543	-543	-543	
-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%	543	543	543	543	543	543	543	
8.00%	814	814	814	814	814	814	814	

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

**1,730**





공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## 포커스농산물모(채권-파생형)

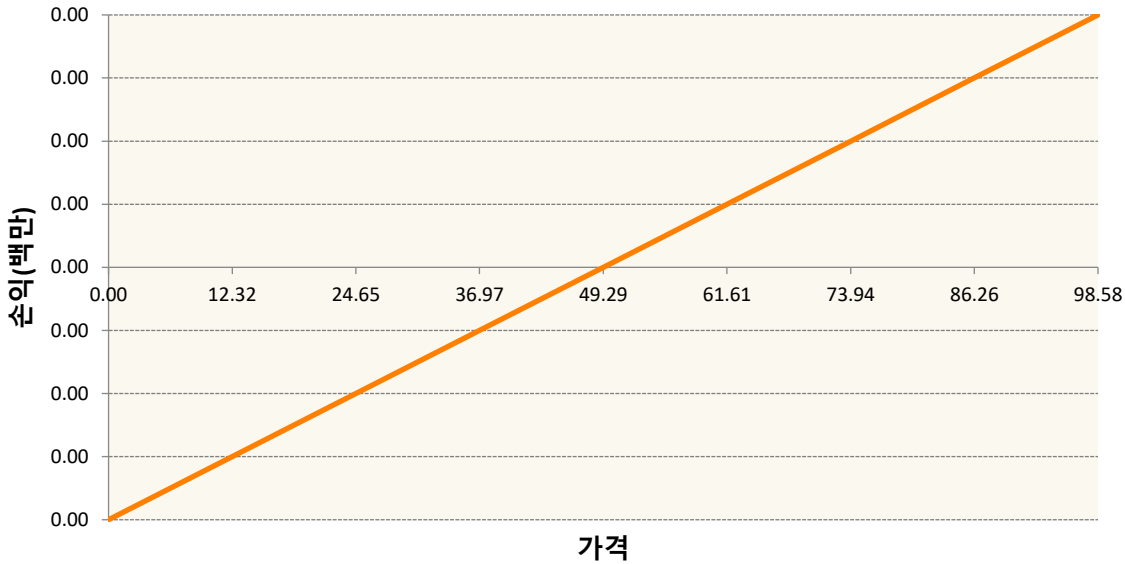
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

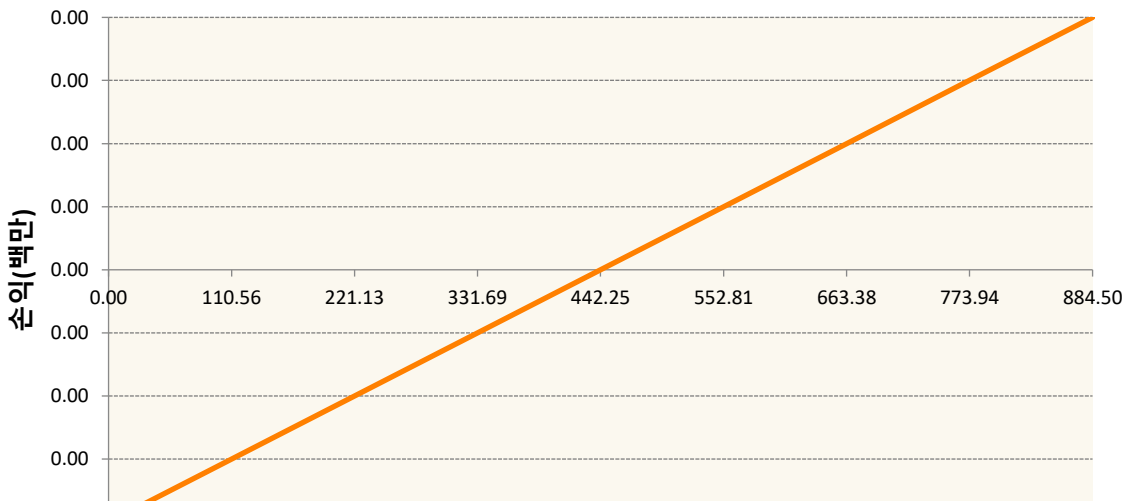
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	392	0	392	
누계	유가증권	선물	2,774	0	2,774	
누계	통화	선물	0	331	-331	장내

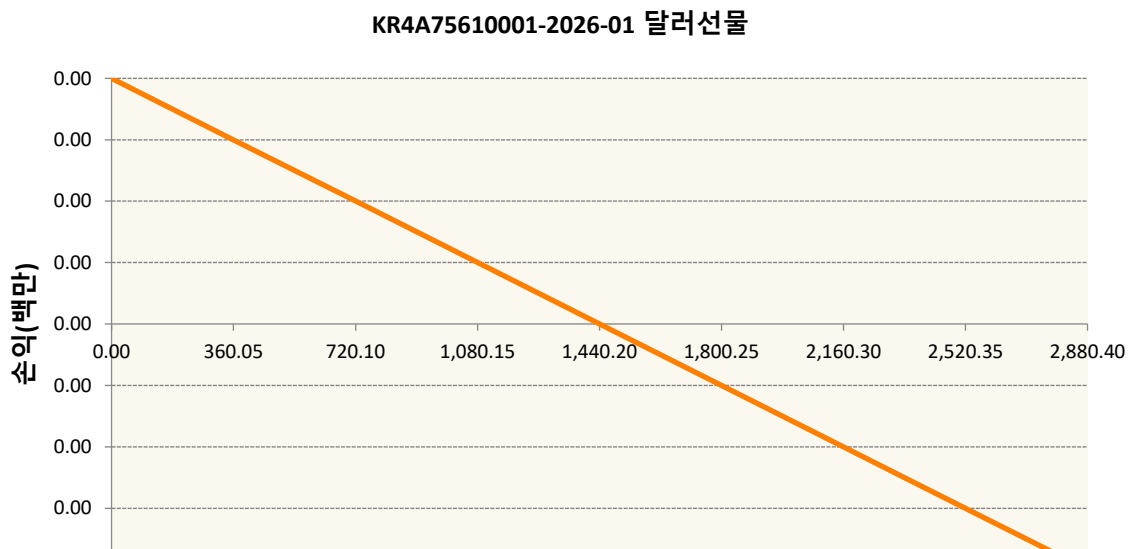
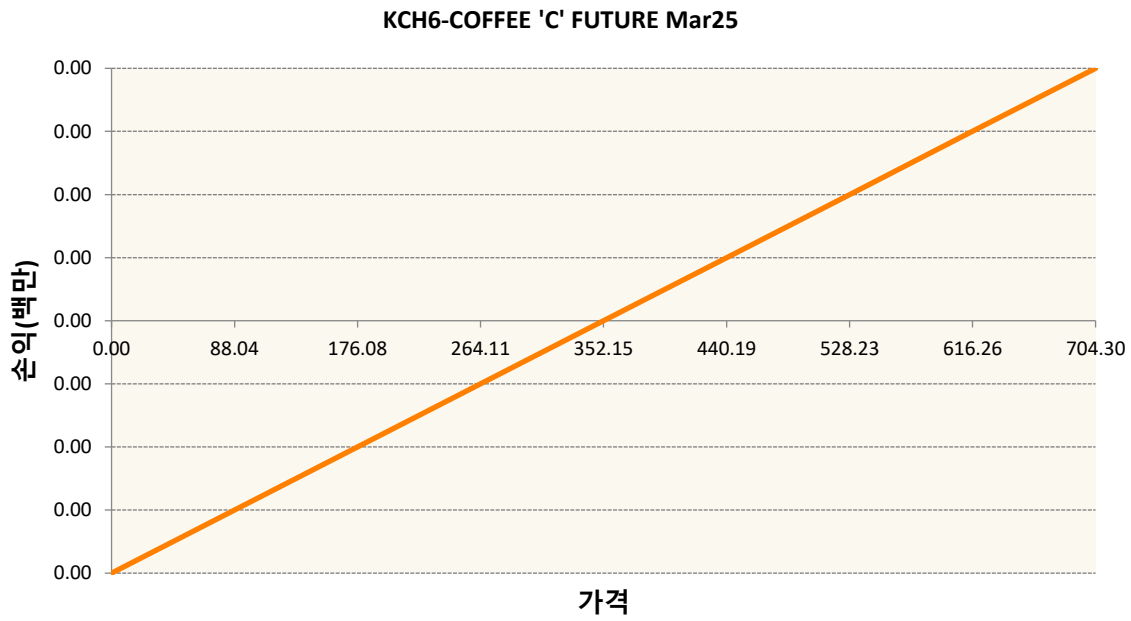
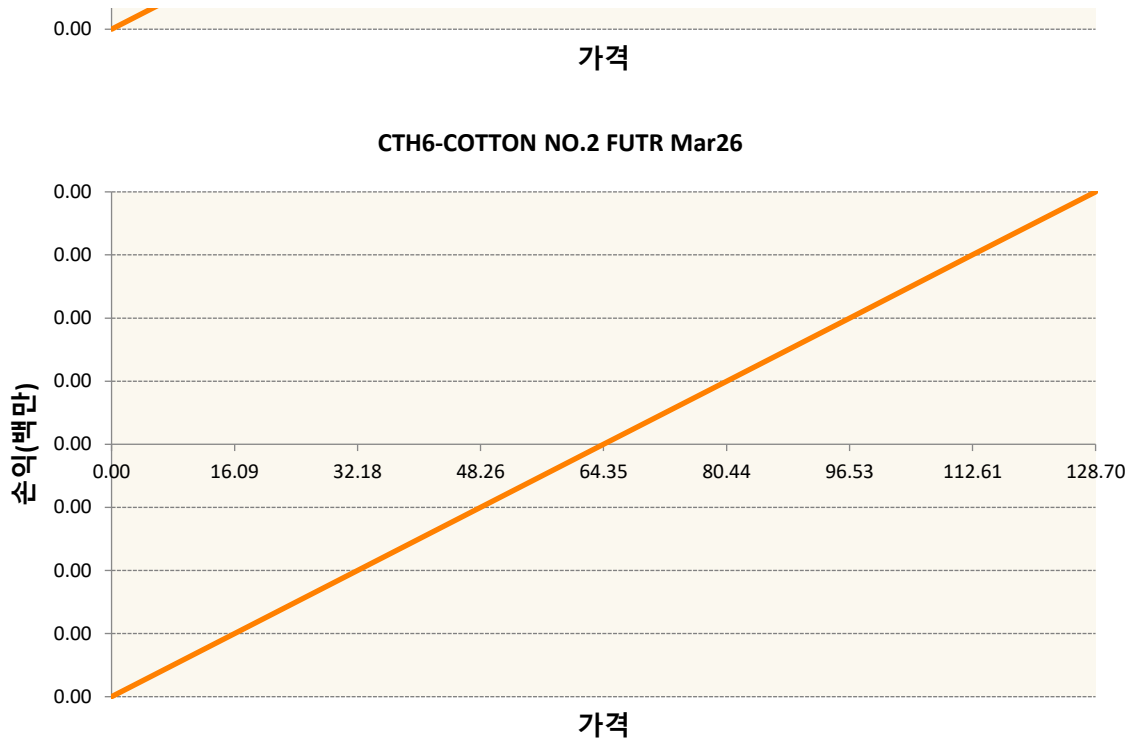
### 2. 만기시점의 손익구조

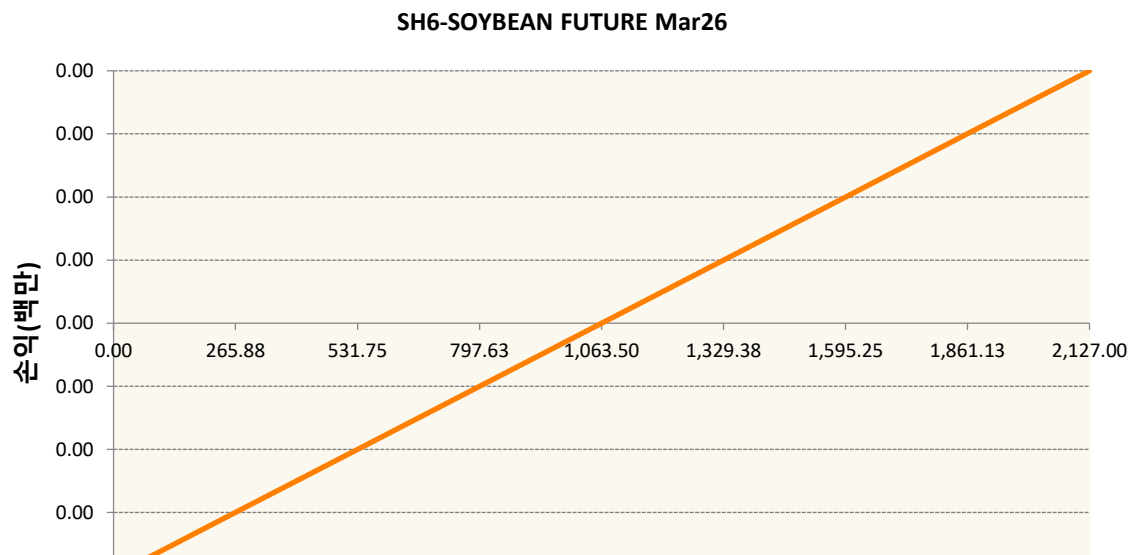
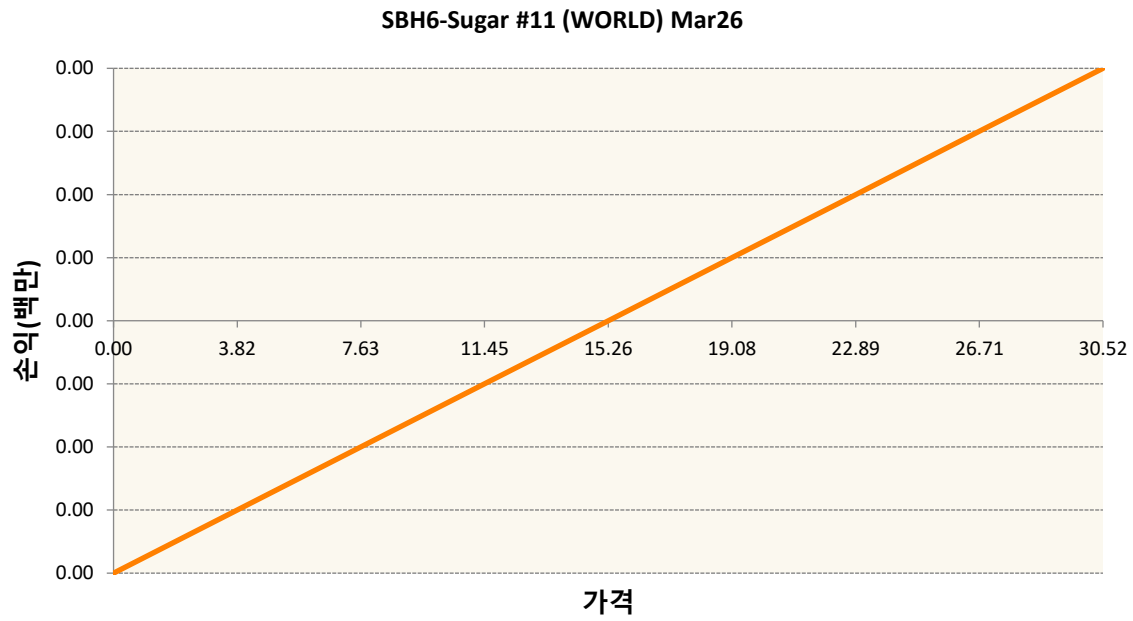
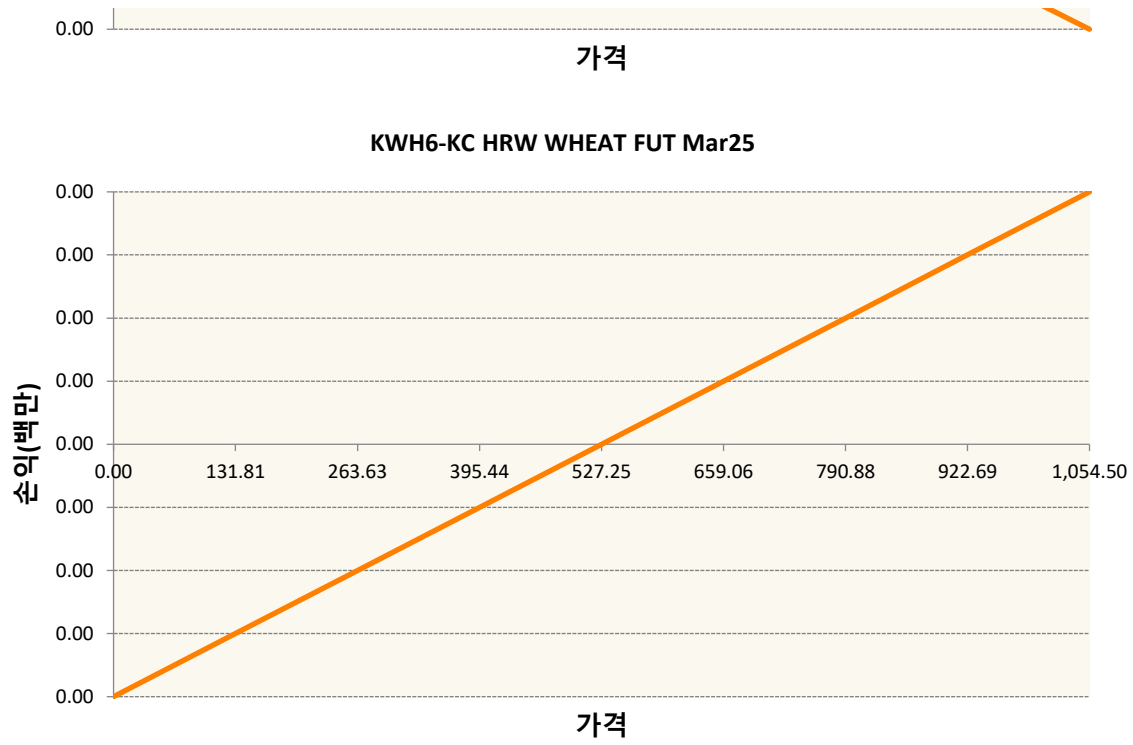
BOH6-SOYBEAN OIL FUTR Mar26

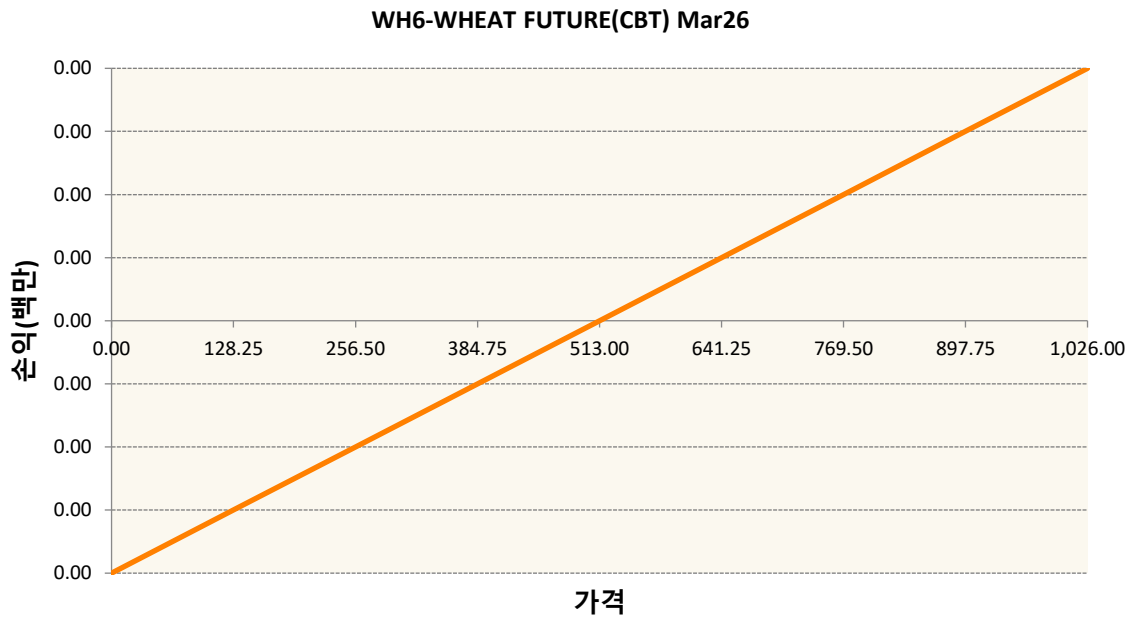
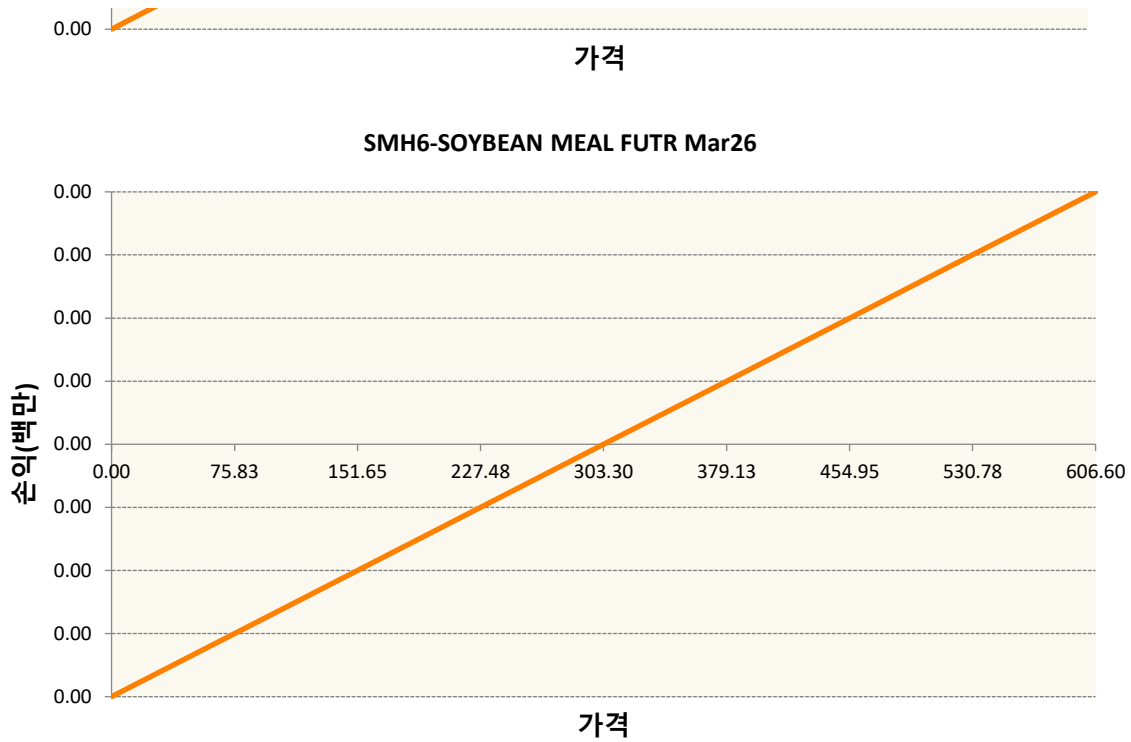


CH6-CORN FUTURE Mar26









### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## 스마트인덱스모

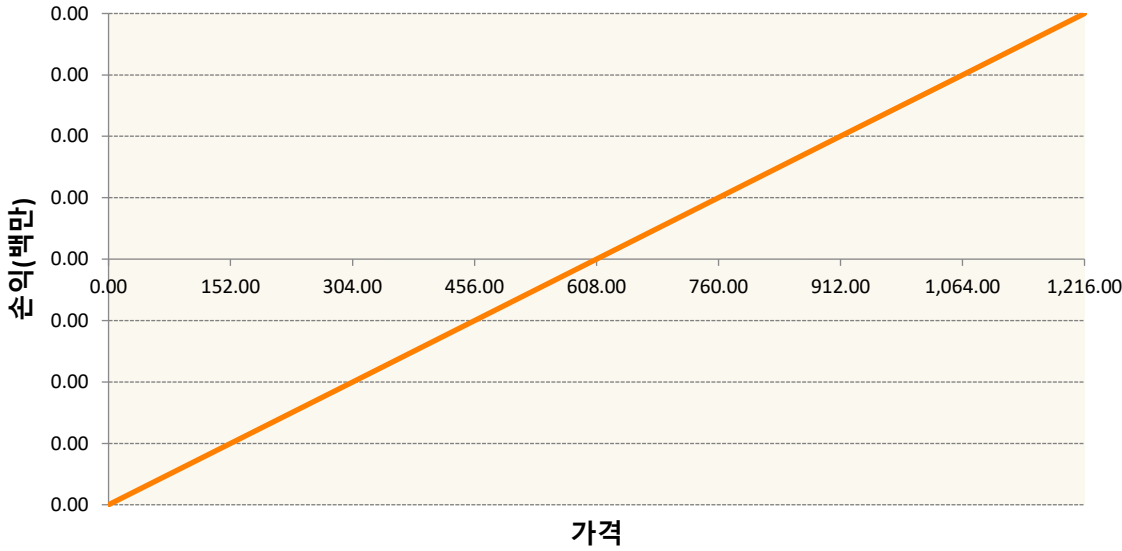
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,368	0	1,368	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4A01630008-2026-03 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물

109

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

(단위:백만원)

0

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## SOL차이나강소기업CSI500상장

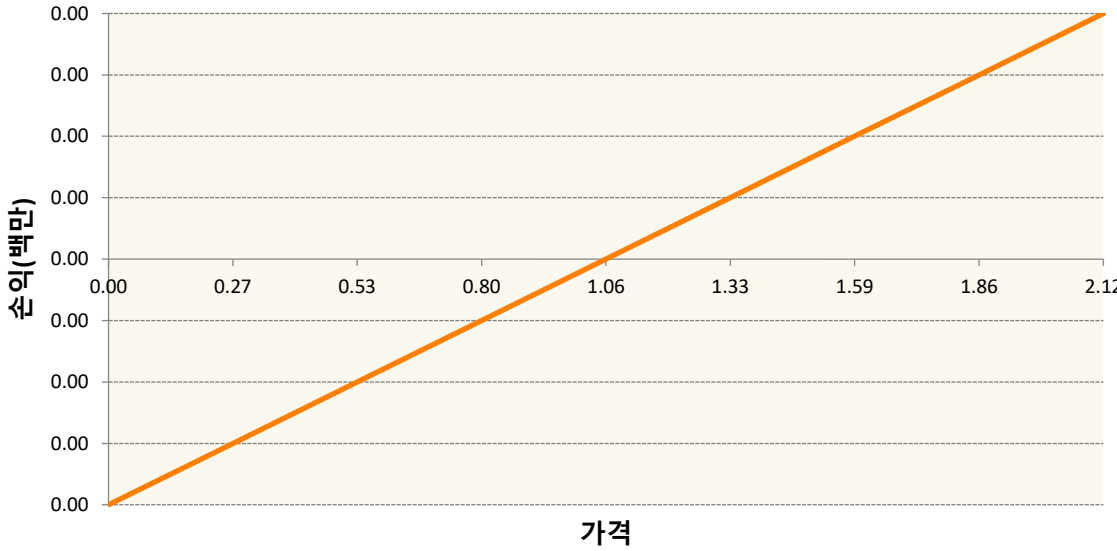
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,896	0	4,896	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

SWCSI5000046-CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미)



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미)

394

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

482

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

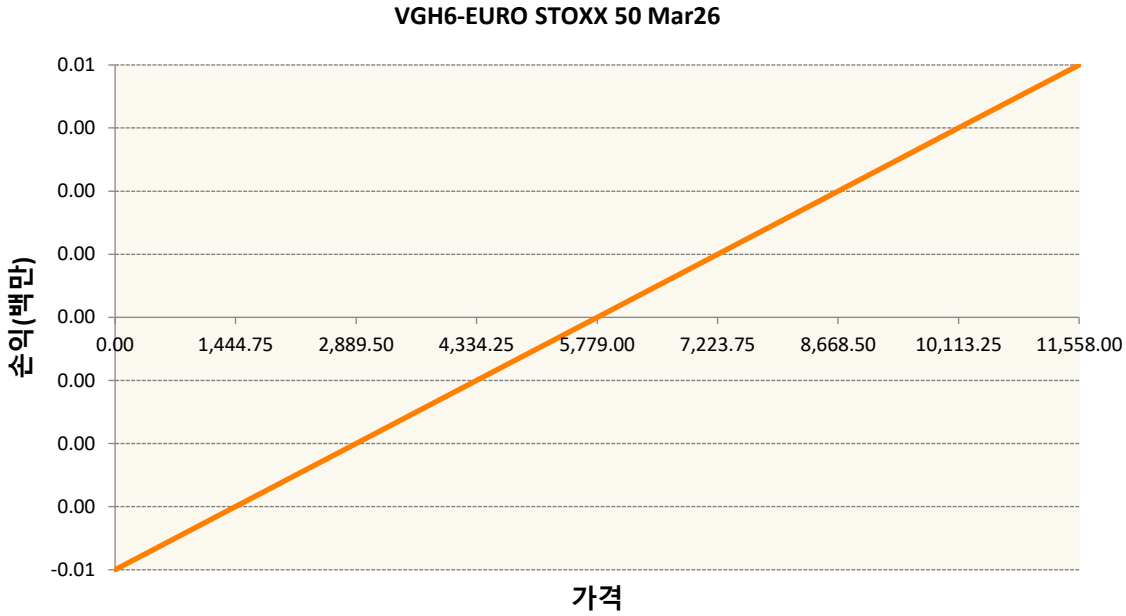
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	901	0	901	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EURO STOXX 50 Mar26	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

59
----

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

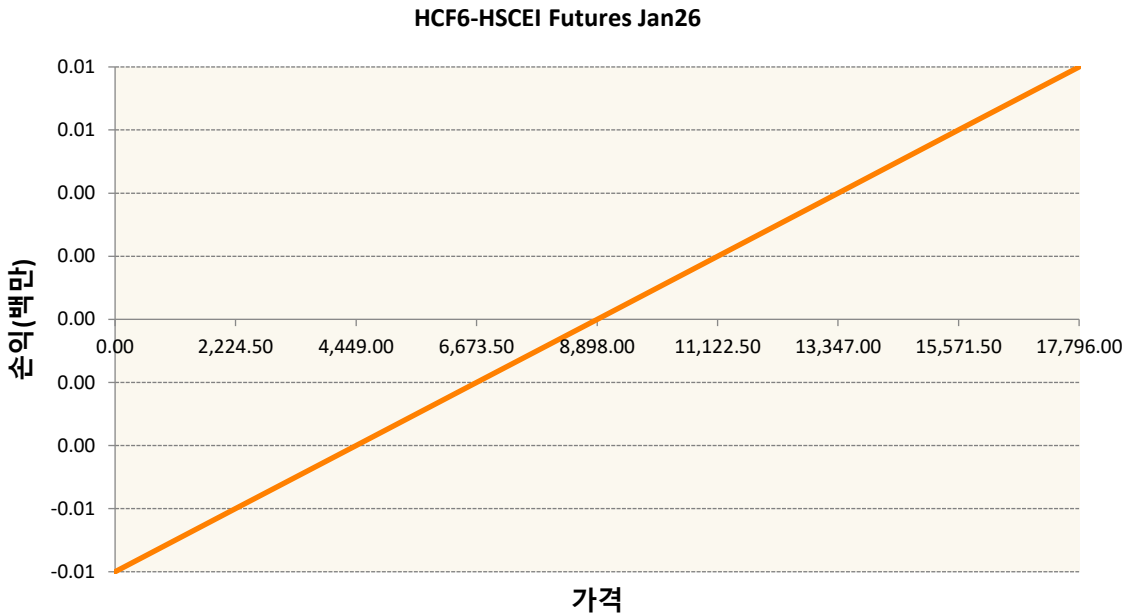
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,990	0	1,990	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF6	HSCEI Futures Jan26	159
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

223

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

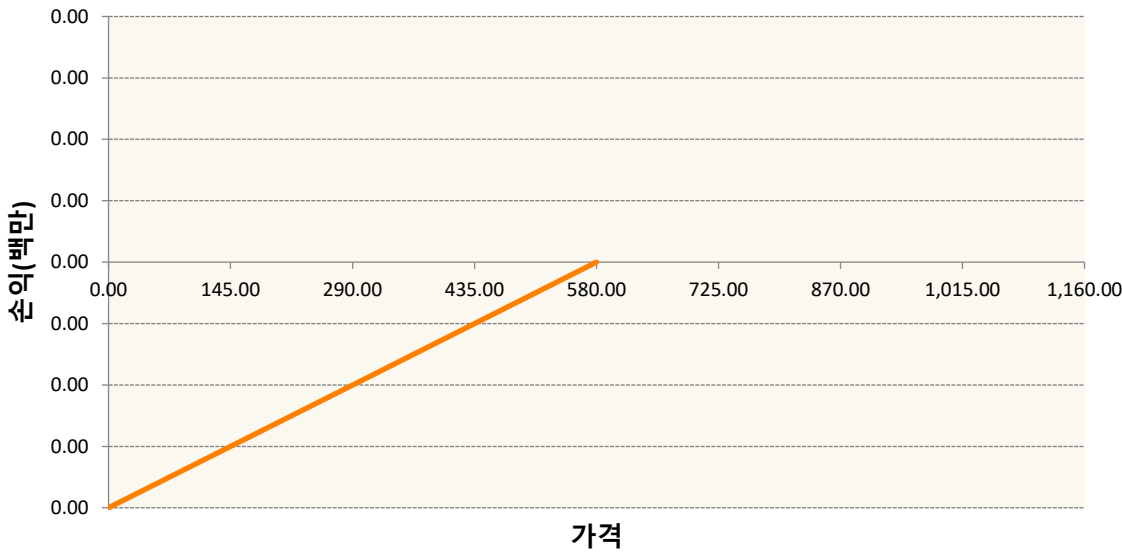
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

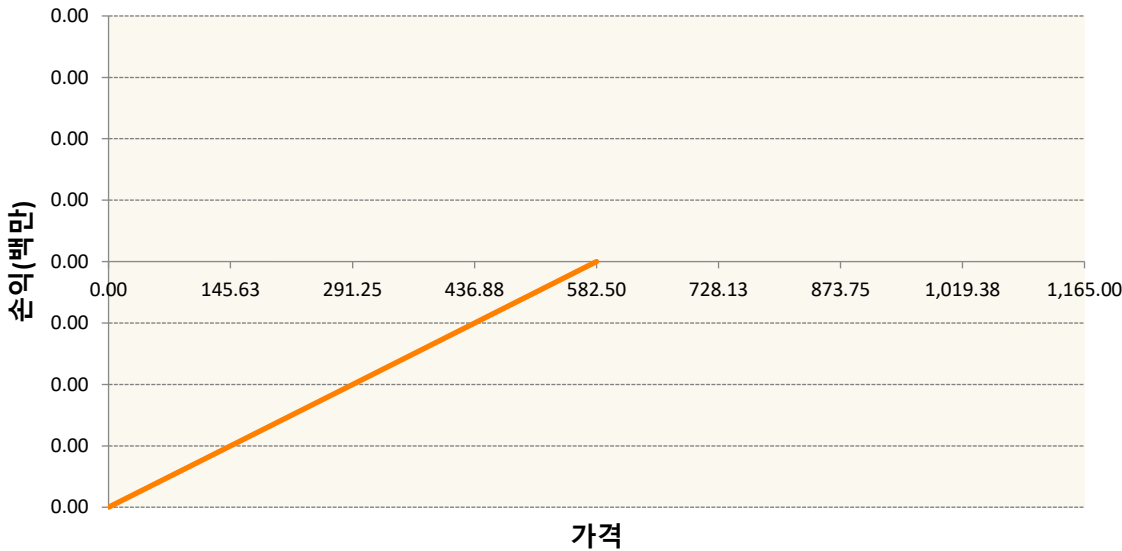
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	276	0	276	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,664	-34,664	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

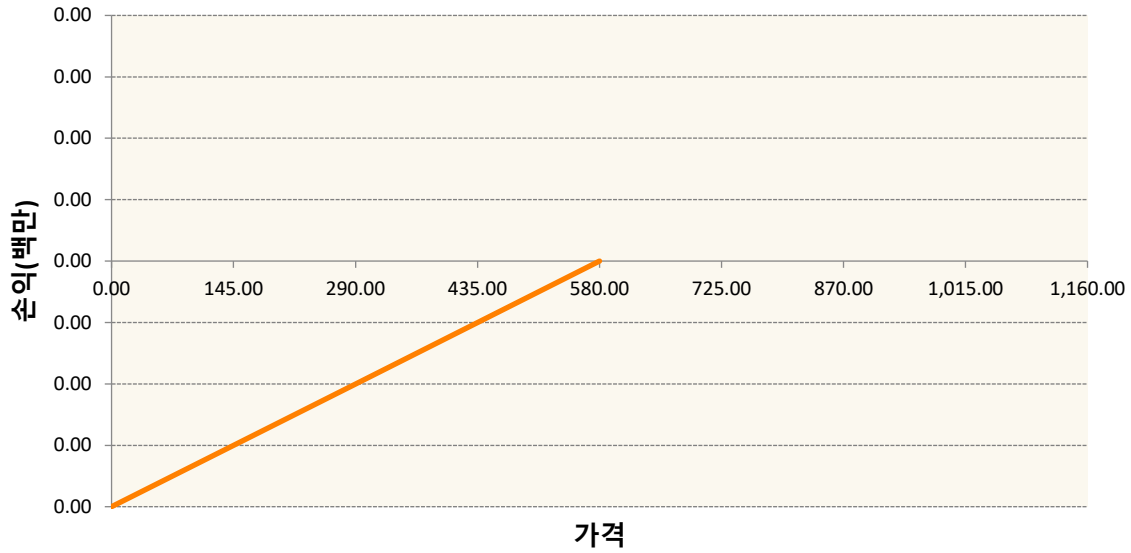
**KR4B01615800-코스피200 C 202601 580.0**



**KR4B01615826-코스피200 C 202601 582.5**



KR4C01615809-코스피200 P 202601 580.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016158 코스피200 C 202601 580.0  
 KR4B016158 코스피200 C 202601 582.5  
 KR4C016158 코스피200 P 202601 580.0

2,076
175
522

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

(단위:백만원)

0
---

공시일 2025-12-31

기준일 2025-12-30

## 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	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

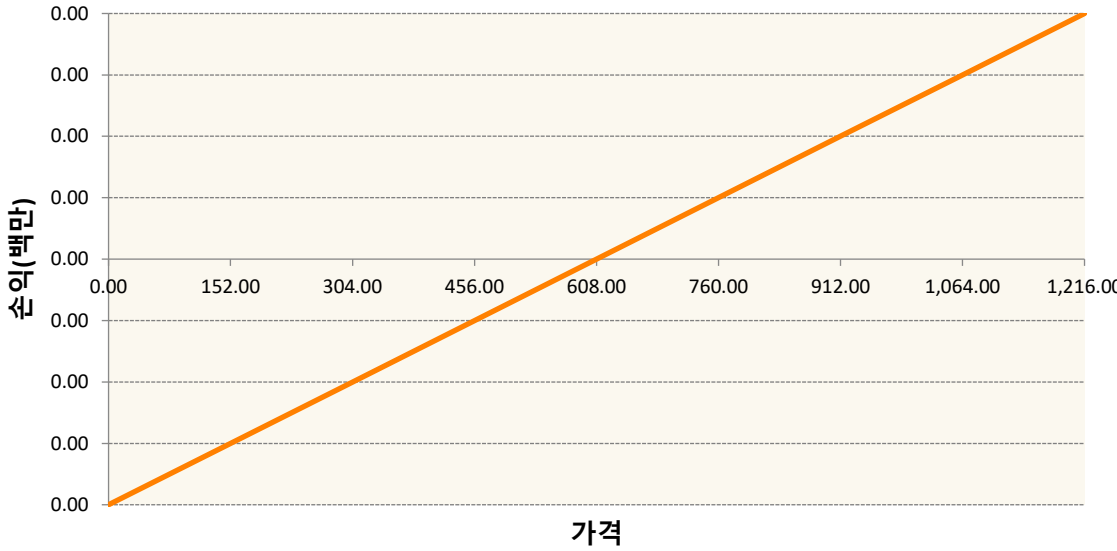
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

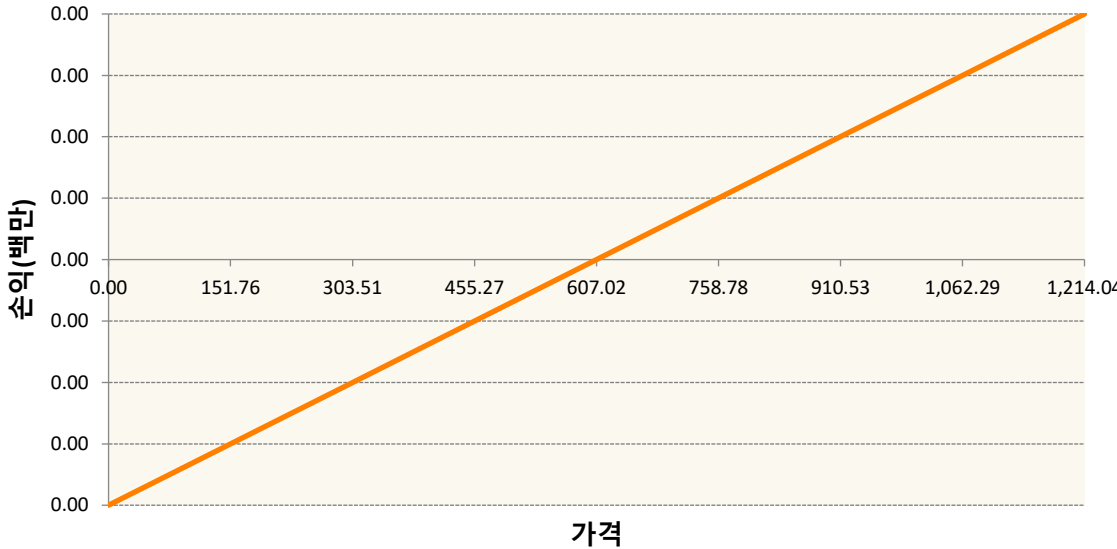
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,063	0	1,063	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4A01630008-2026-03 코스피200지수선물



KR4A05610006-2026-01 미니코스피200 선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		49
KR4A056100 2026-01 미니코스피200 선물		7

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

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

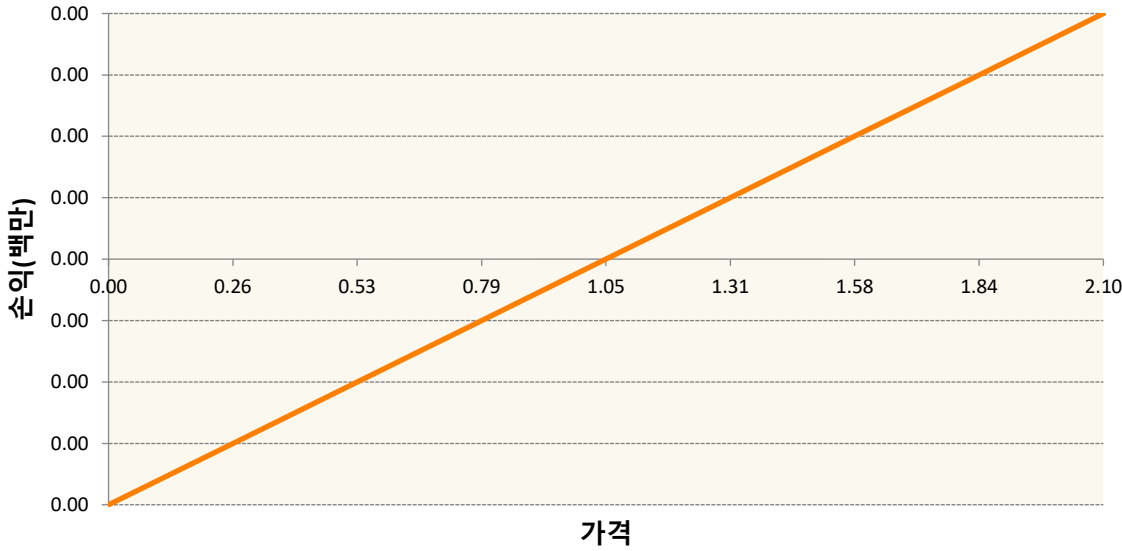
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

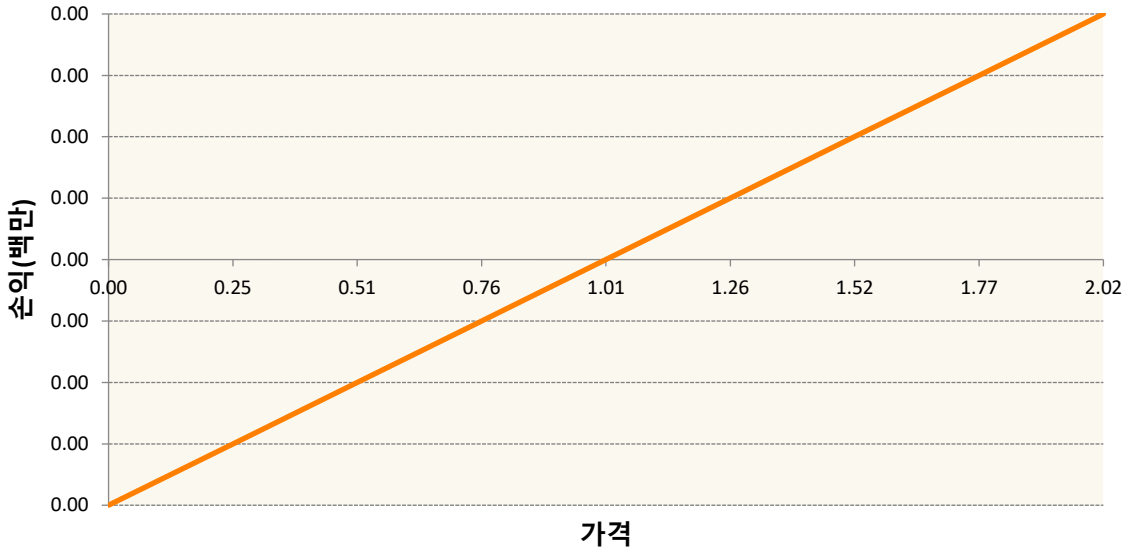
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,651	0	7,651	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

2108841208ID-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미)



2108841218ID-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미	488
2108841218	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	122

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		581

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

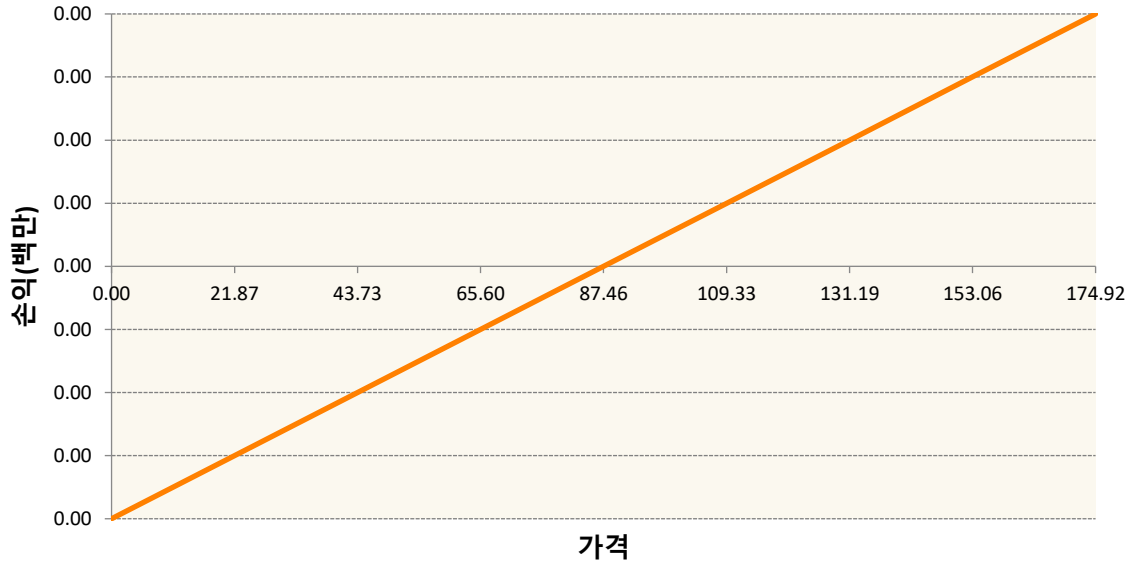
### 1. 계약금액

(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			5,800	0	5,800	
누계	통화	선도	0	2,810	-2,810	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

MOZ26-ECX EMISSION Dec26



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213FCP(KRW/EUR 30-01-26E)	225
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	464

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

(단위:백만원)

737

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

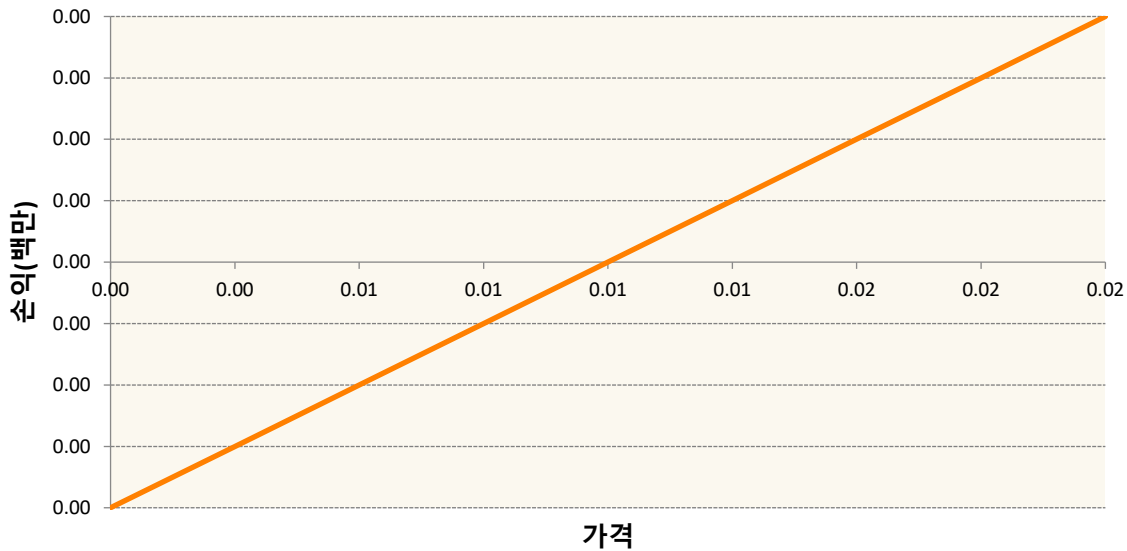
### 1. 계약금액

(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	1,104	0	1,104	장외
누계	지수	스왑	2,750	0	2,750	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

SWSOL0000032-신한CSI Index 250930 (메리츠)



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	2
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	1
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	1
SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)	3

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

(단위:백만원)

<b>11</b>
-----------

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## SOL차이나육성산업액티브상장지

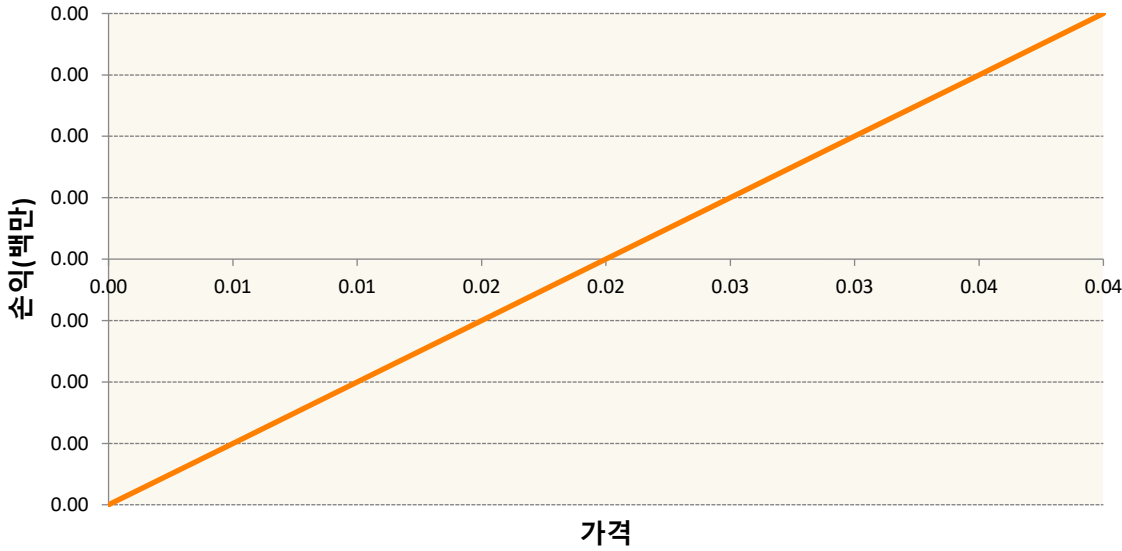
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

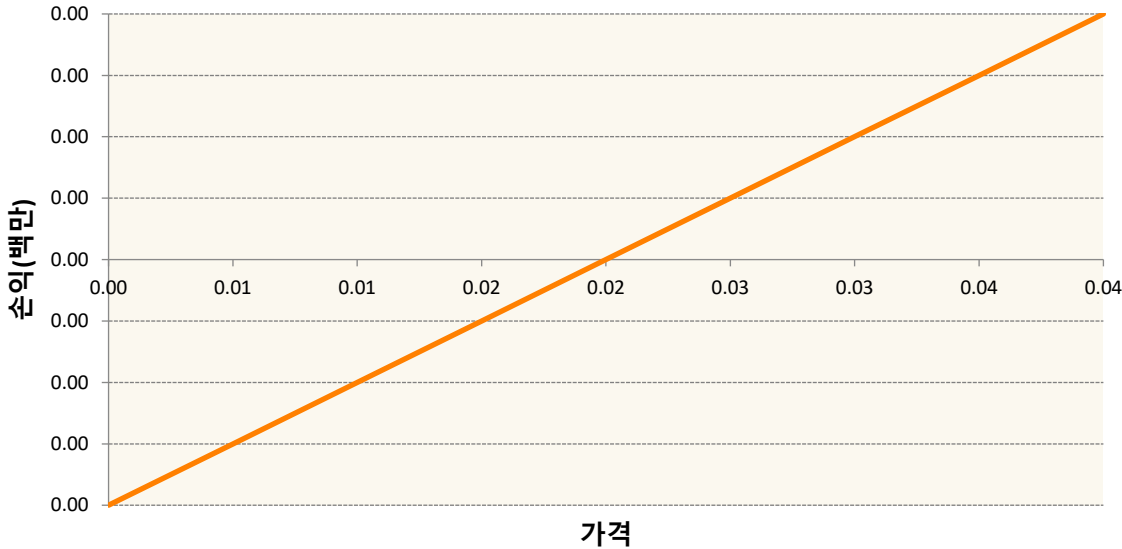
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	476	0	476	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

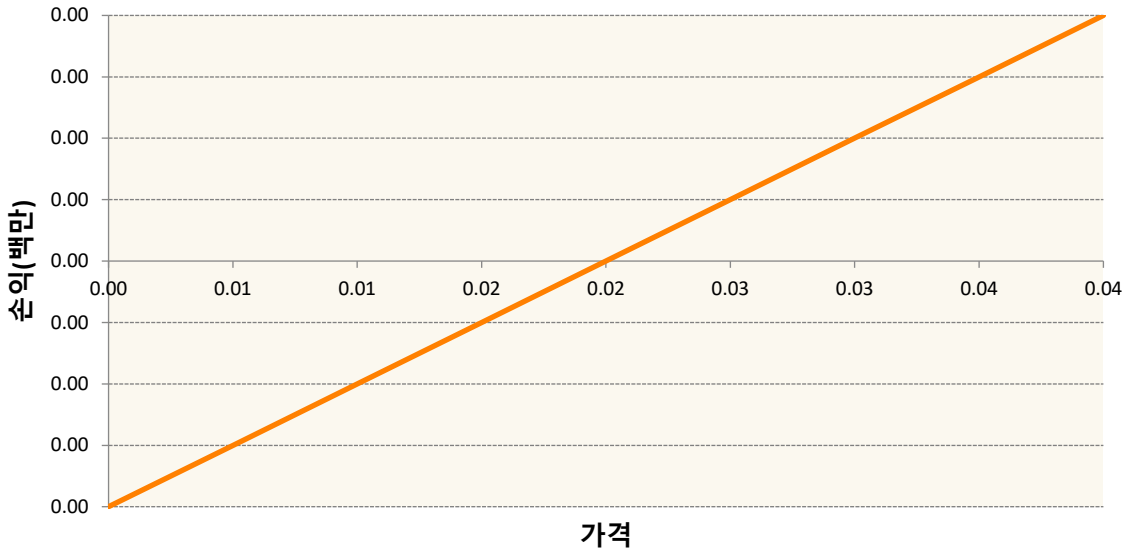
SWSTAR000027-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)



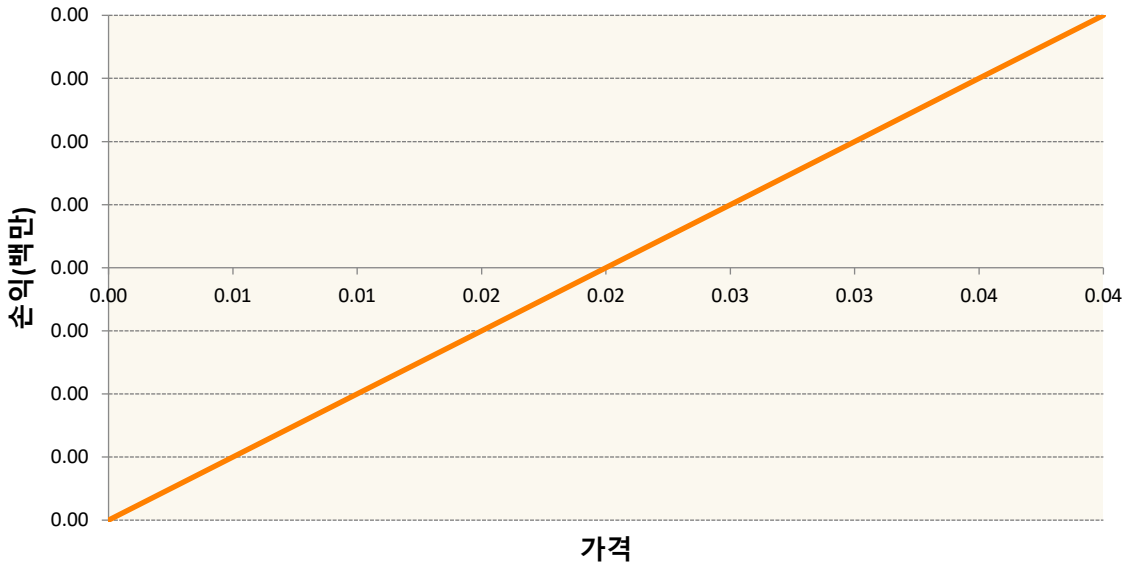
SWSTAR000028-STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래)



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)	1
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래)	8
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(메리츠)	22
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	4

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

(단위:백만원)

65
----

공시일 2025-12-31

기준일 2025-12-30

## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 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 2025-12-31

기준일 2025-12-30

## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

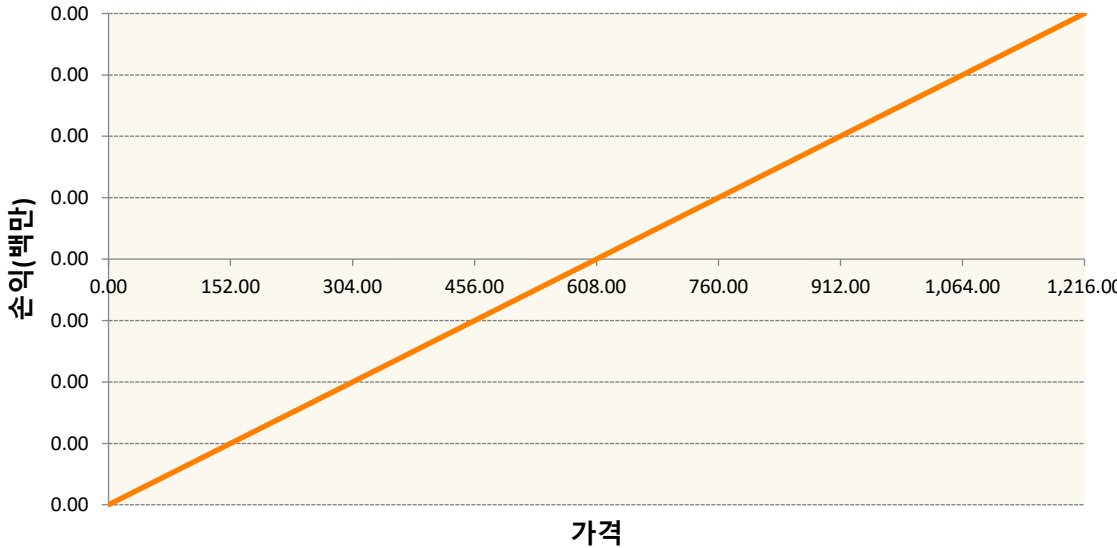
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

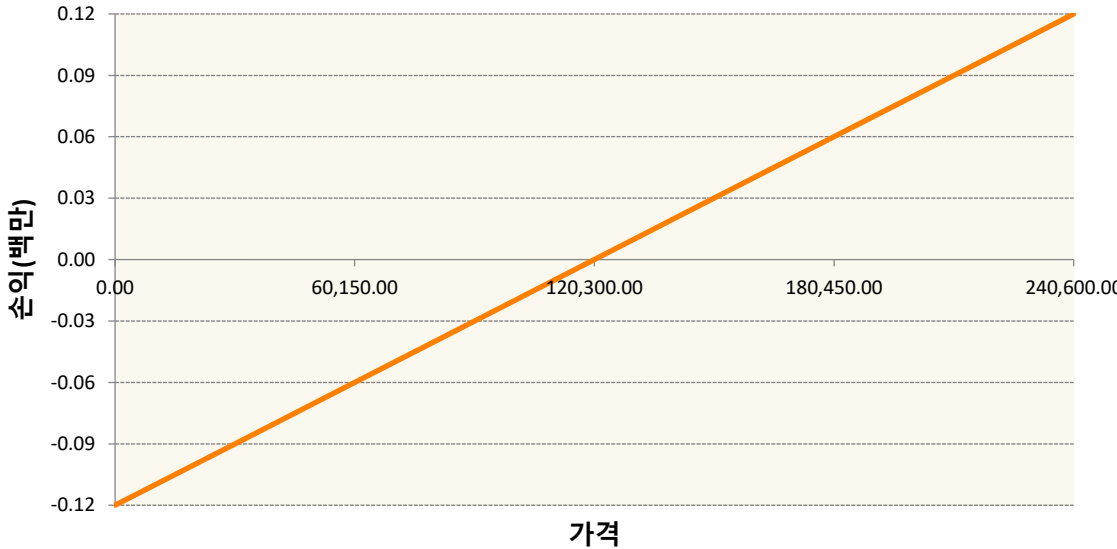
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	604	1,366	-762	장내
누계	유가증권	선물	13,700	3,503	10,197	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

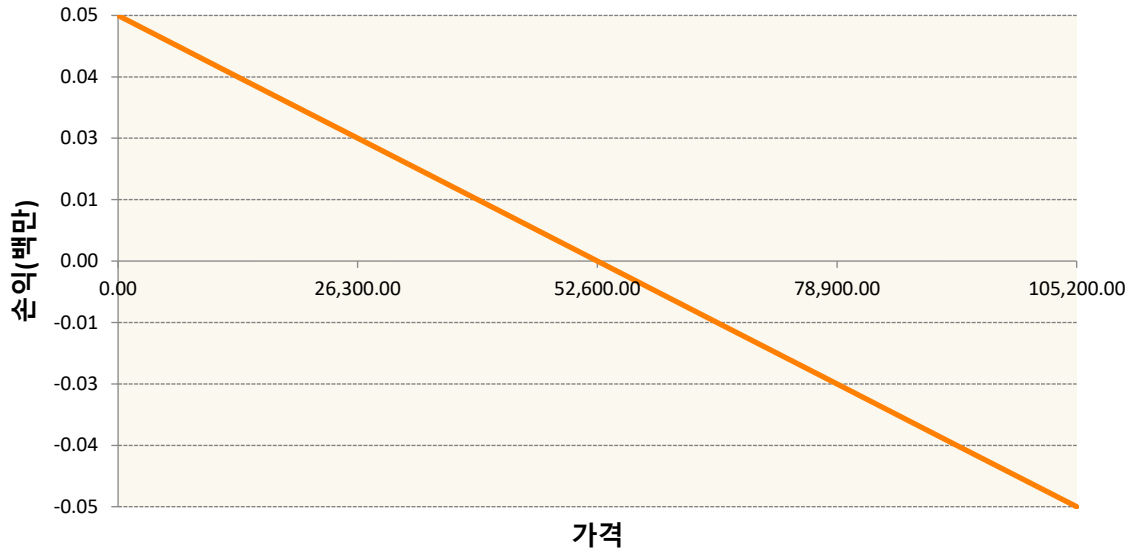
KR4A01630008-2026-03 코스피200지수선물



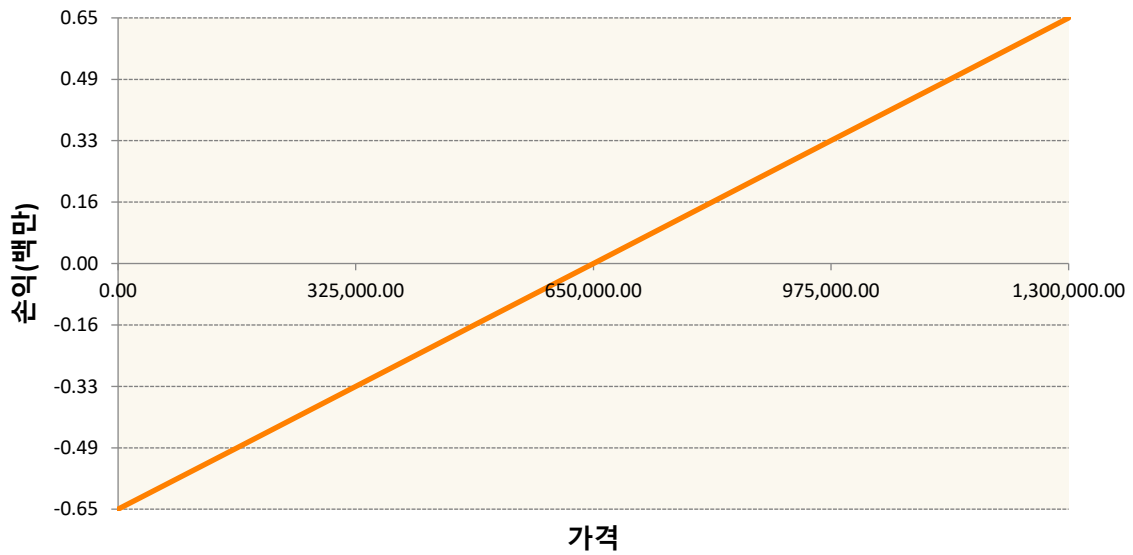
KR4A11610008-2026-01 삼성전자개별선물



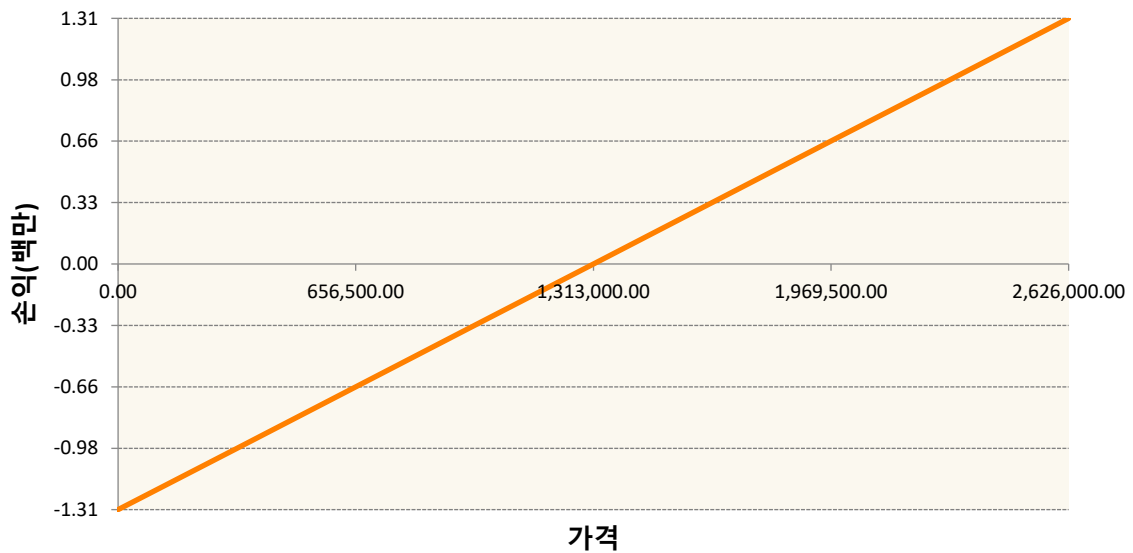
KR4A14610005-2026-01 KT개별선물



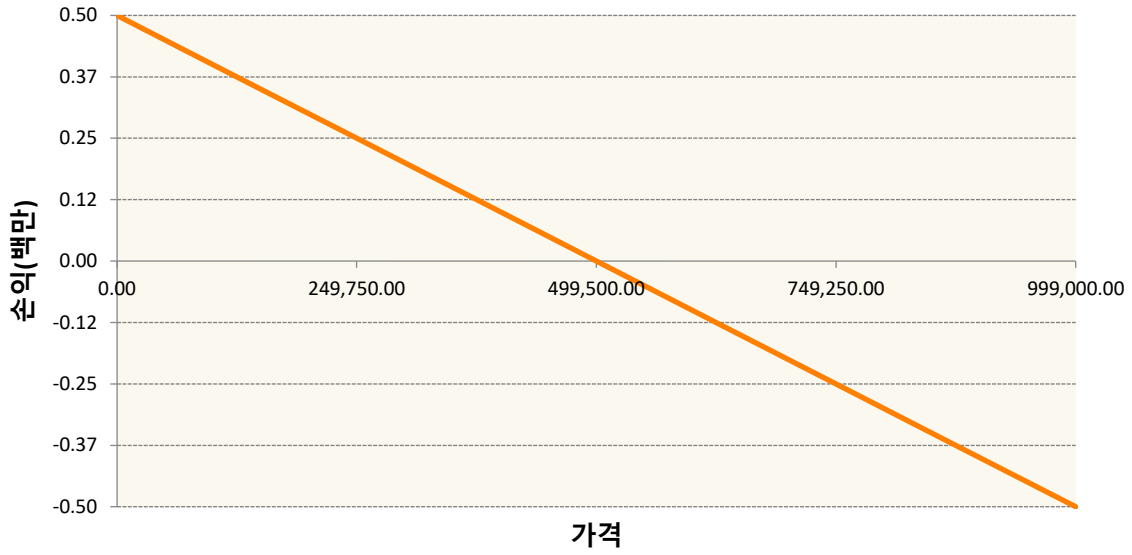
KR4A50610000-2026-01 SK하이닉스개별선물



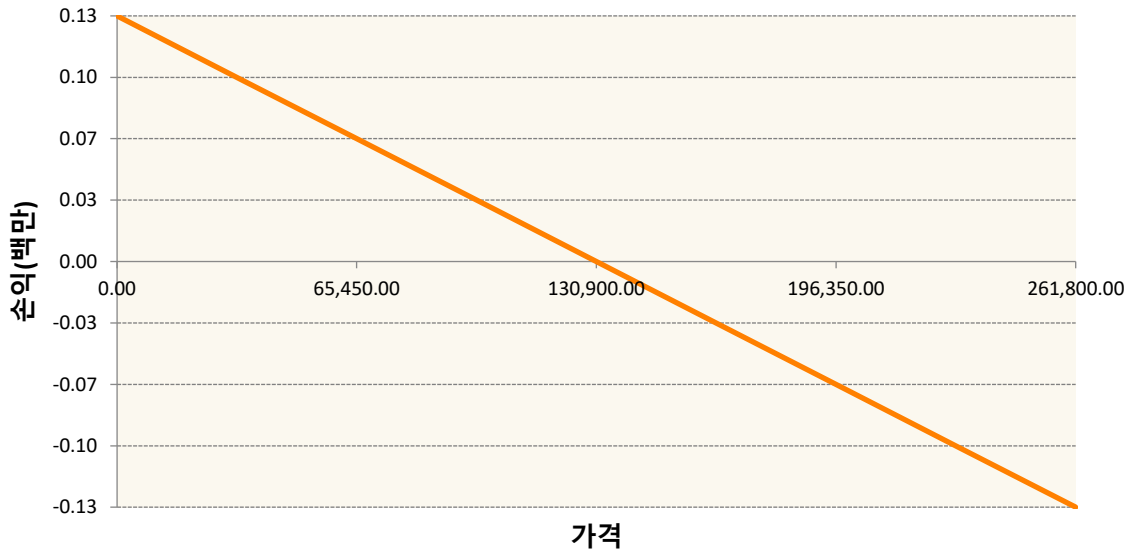
KR4AB3610006-2026-01 고려아연개별선물



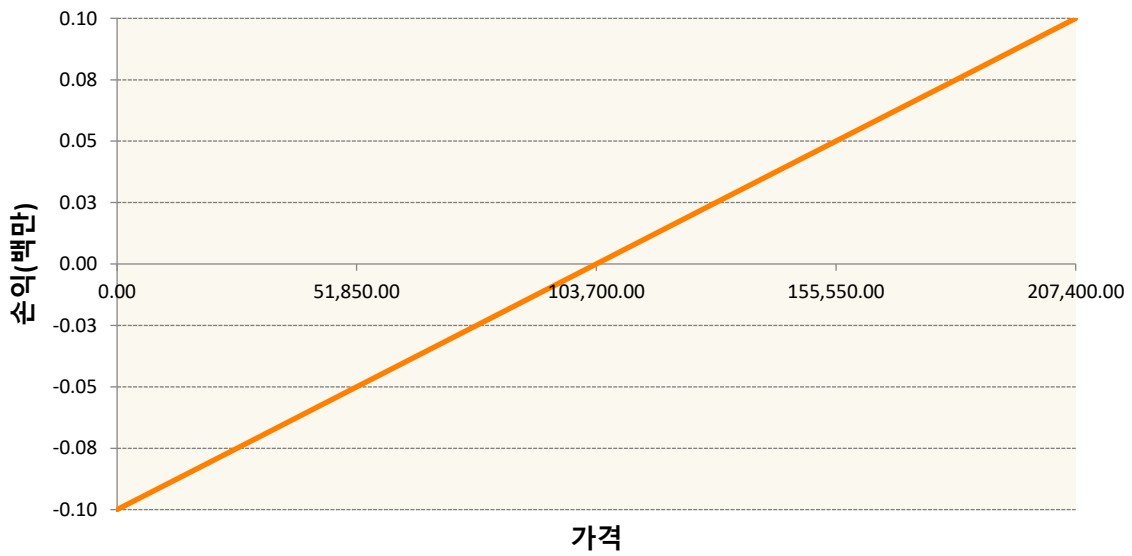
KR4ACT610004-2026-01 삼성화재개별선물



KR4AD0610005-2026-01 DB손해보험개별선물



KR4AEJ610004-2026-01 SKC개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01630008		2026-03 코스피200지수선물						691
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-691	-691	-691	-691	-691	-691	-691	
-5.33%	-461	-461	-461	-461	-461	-461	-461	
-2.67%	-230	-230	-230	-230	-230	-230	-230	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	230	230	230	230	230	230	230	
5.33%	461	461	461	461	461	461	461	
8.00%	691	691	691	691	691	691	691	
KR4A11610008		2026-01 삼성전자개별선물						149
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149	
-5.33%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	
-2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	50	50	50	50	50	50	50	
5.33%	100	100	100	100	100	100	100	
8.00%	149	149	149	149	149	149	149	
KR4A14610005		2026-01 KT개별선물						140
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	140	140	140	140	140	140	140	
-5.33%	93	93	93	93	93	93	93	
-2.67%	47	47	47	47	47	47	47	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
5.33%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
8.00%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140	
KR4A50610000		2026-01 SK하이닉스개별선물						157
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157	
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105	
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	52	52	52	52	52	52	52	
5.33%	105	105	105	105	105	105	105	
8.00%	157	157	157	157	157	157	157	
KR4AB3610006		2026-01 고려아연개별선물						76
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	76	76	76	76	76	76	76

KR4ACT610004 2026-01 삼성화재개별선물 77

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	77	77	77	77	77
-5.33%	51	51	51	51	51	51	51
-2.67%	26	26	26	26	26	26	26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77

KR4AD0610005 2026-01 DB손해보험개별선물 63

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	63	63	63	63
-5.33%	42	42	42	42	42	42	42
-2.67%	21	21	21	21	21	21	21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63

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)

1,676

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

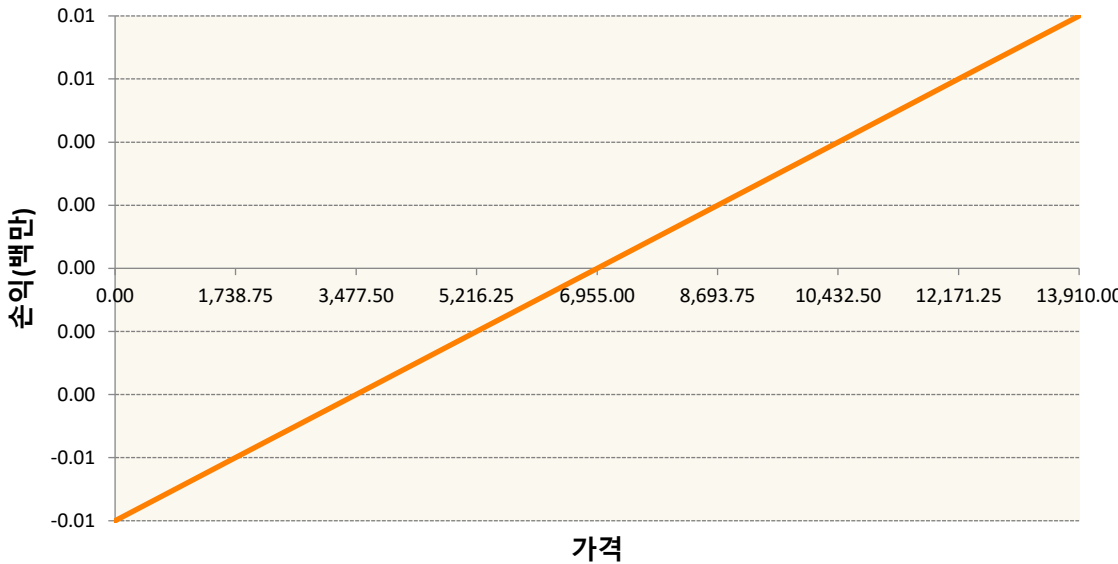
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

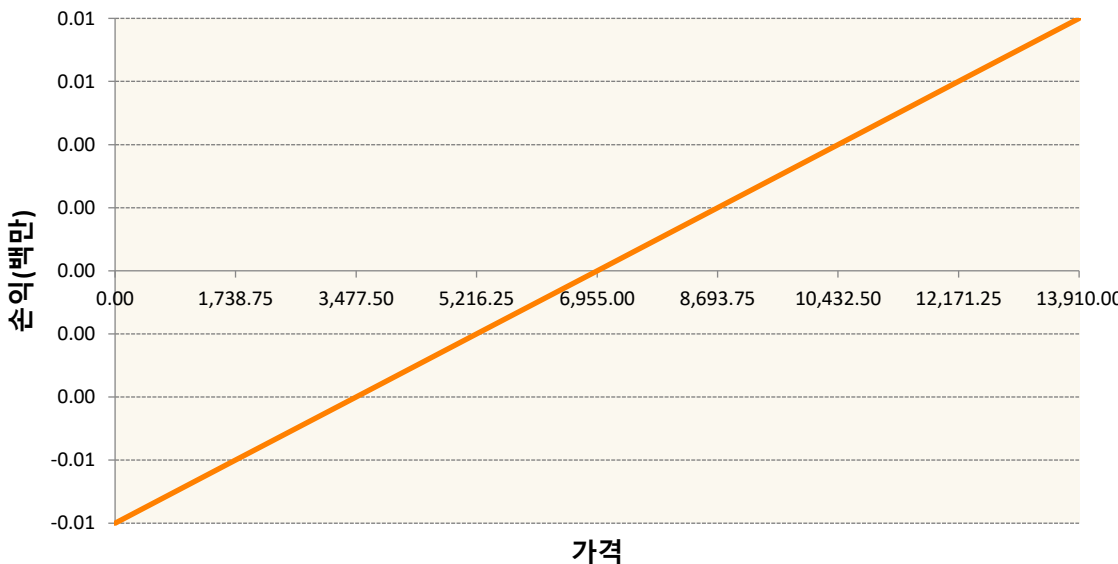
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,130	0	1,130	장내
누계	지수	선물	52,788	0	52,788	

### 2. 만기시점의 손익구조

ESH6-S&P500 EMINI FUT Mar26



HWAH6-SP500 MIC EMIN FUT Mar26



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	4,223
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	90

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,800

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

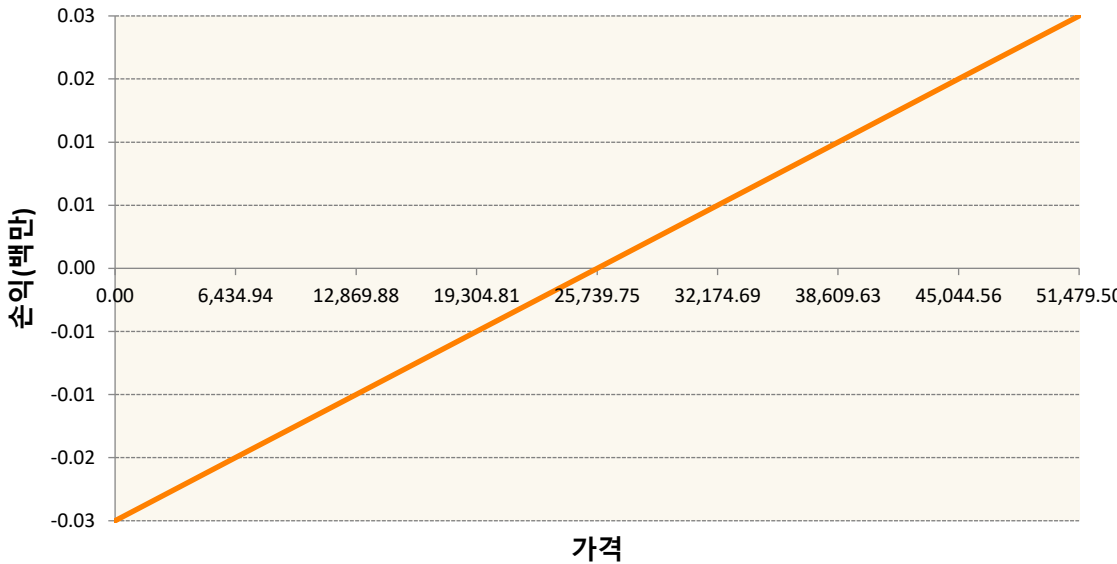
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

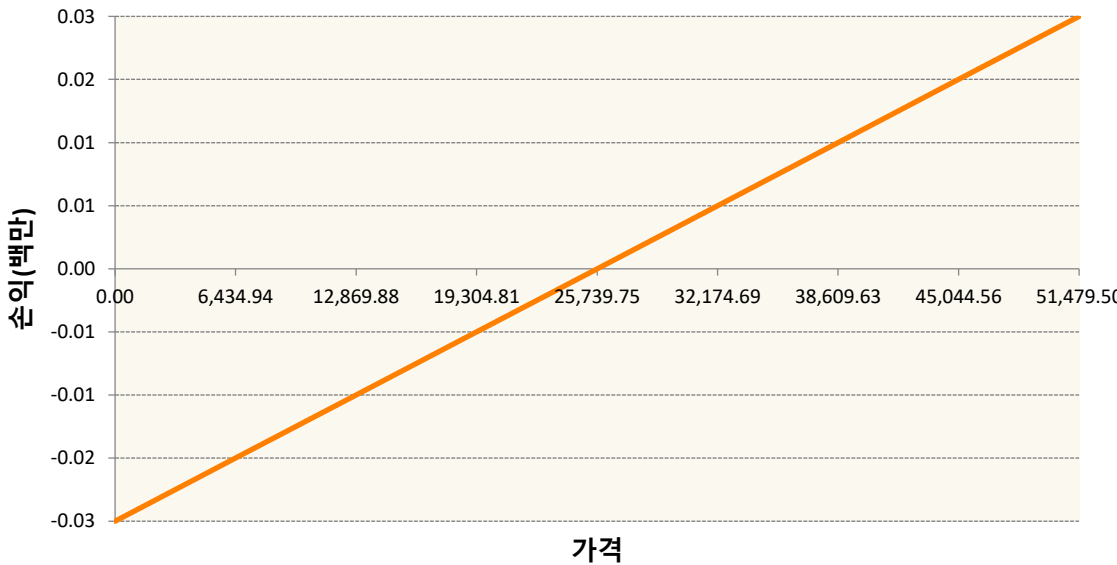
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	24,221	0	24,221	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

HWB6-NASD100 MICRO EMIN Mar26



NQH6-NASDAQ 100 E-MINI Dec20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN Mar26	55
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,883

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,181

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

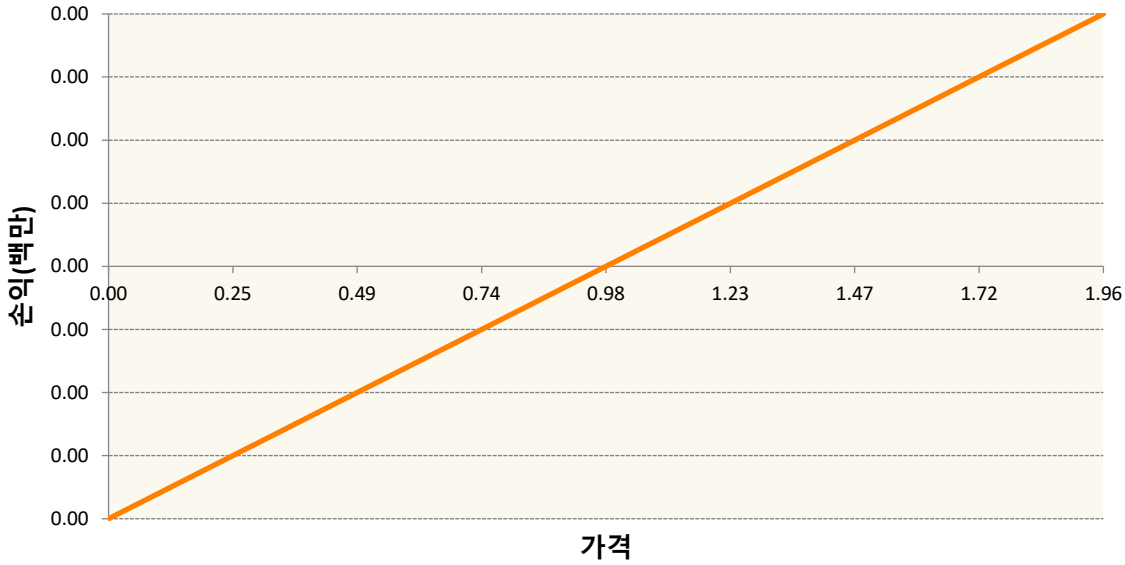
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

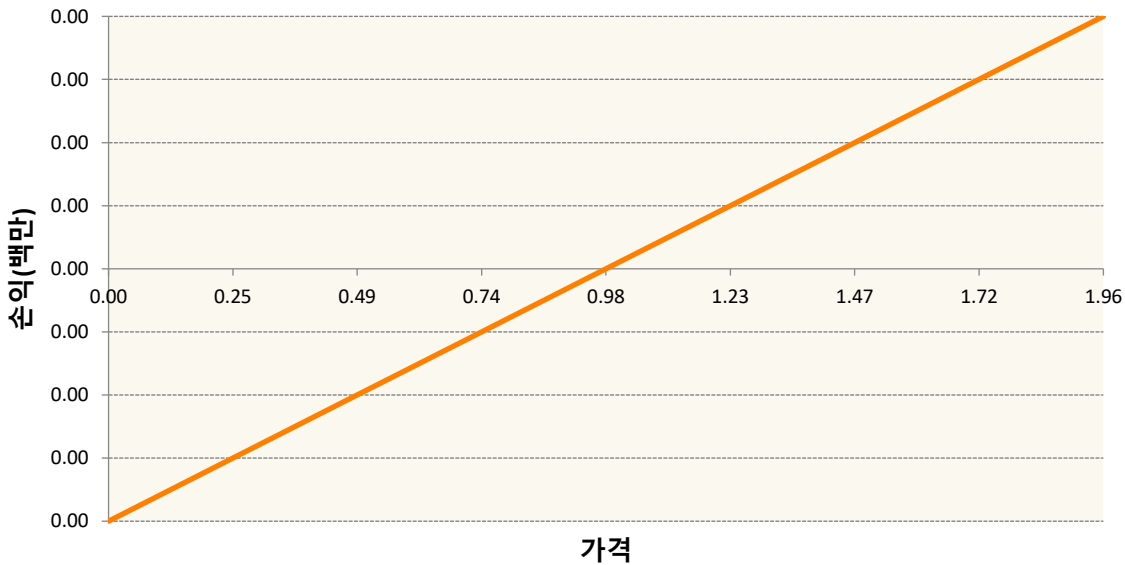
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	367,502	0	367,502	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

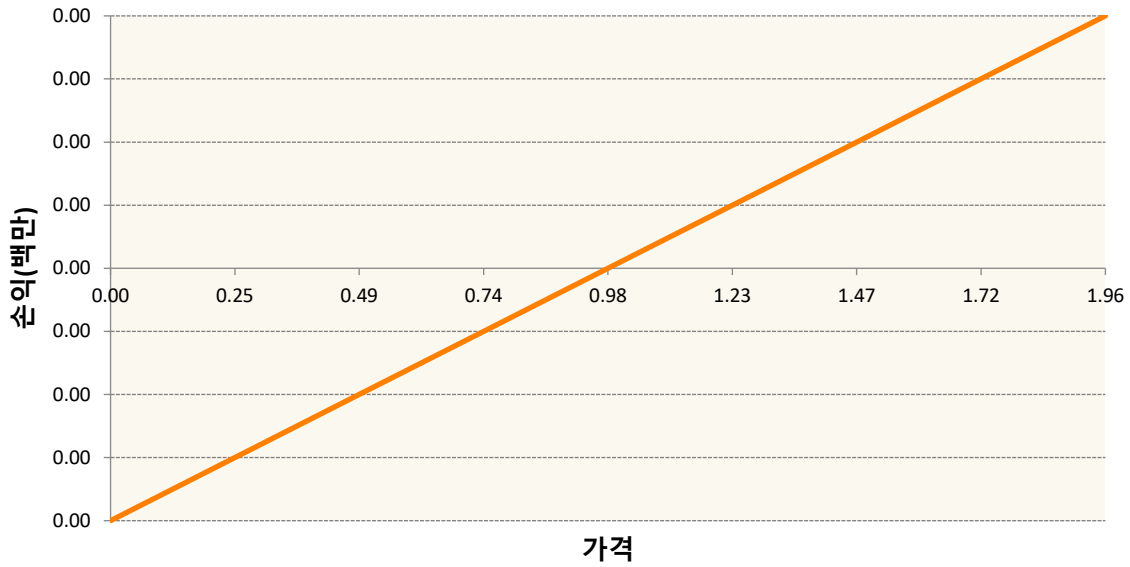
SWKEDI000150-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



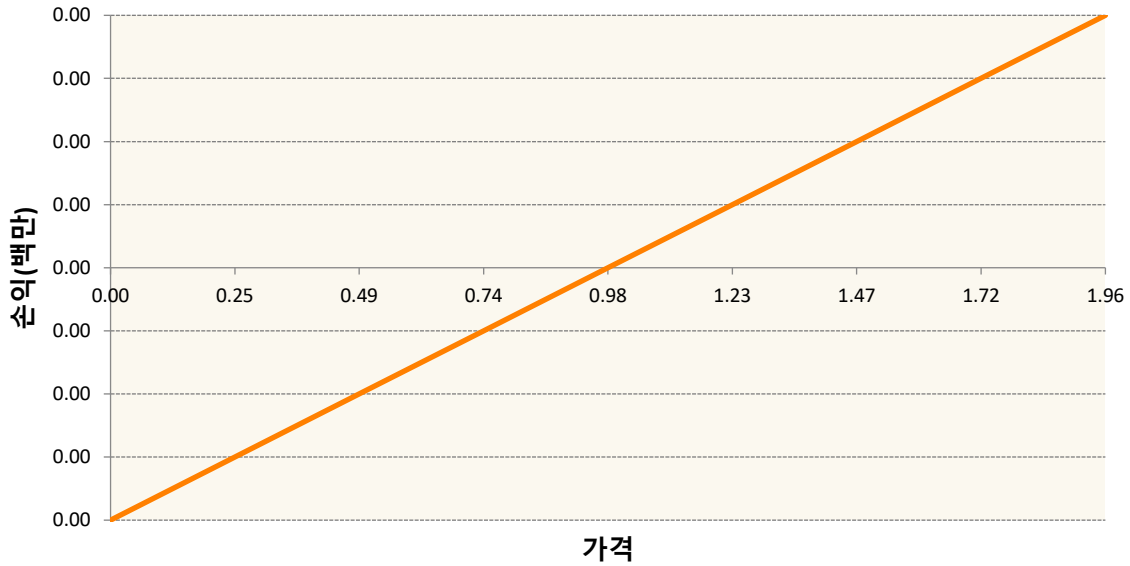
SWKEDI000159-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000160-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,056
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	9,464
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,197
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,608

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

(단위:백만원)

13,324
--------

공시일 2025-12-31

기준일 2025-12-30

## SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

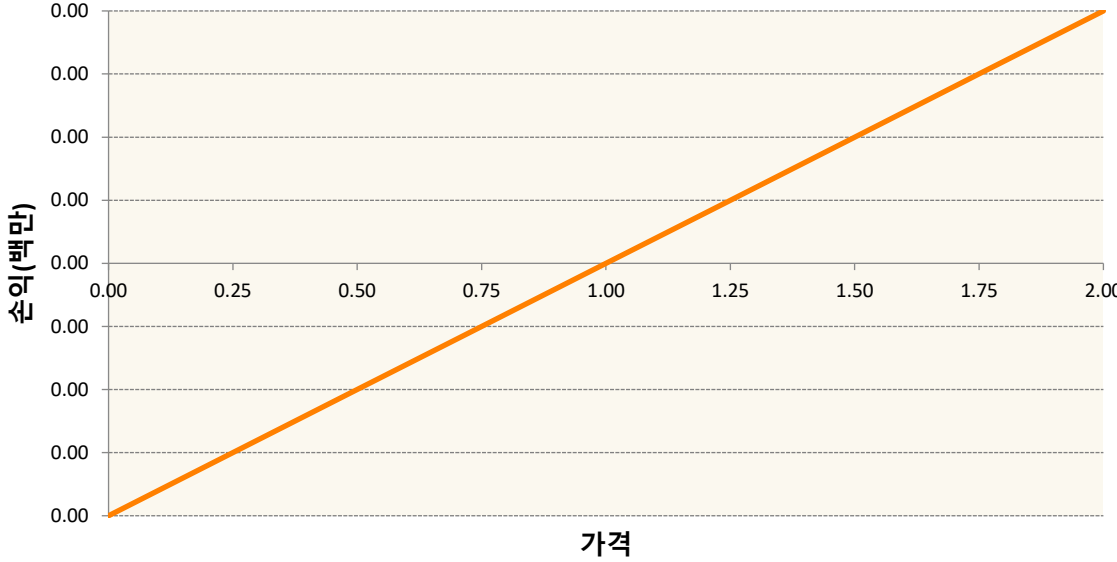
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

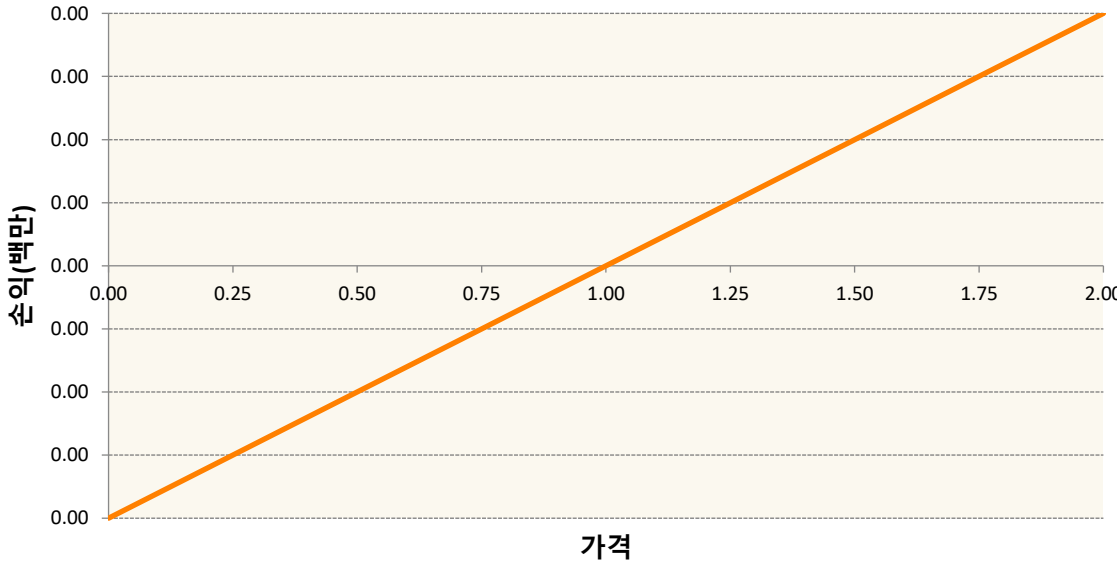
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	0	0	0	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

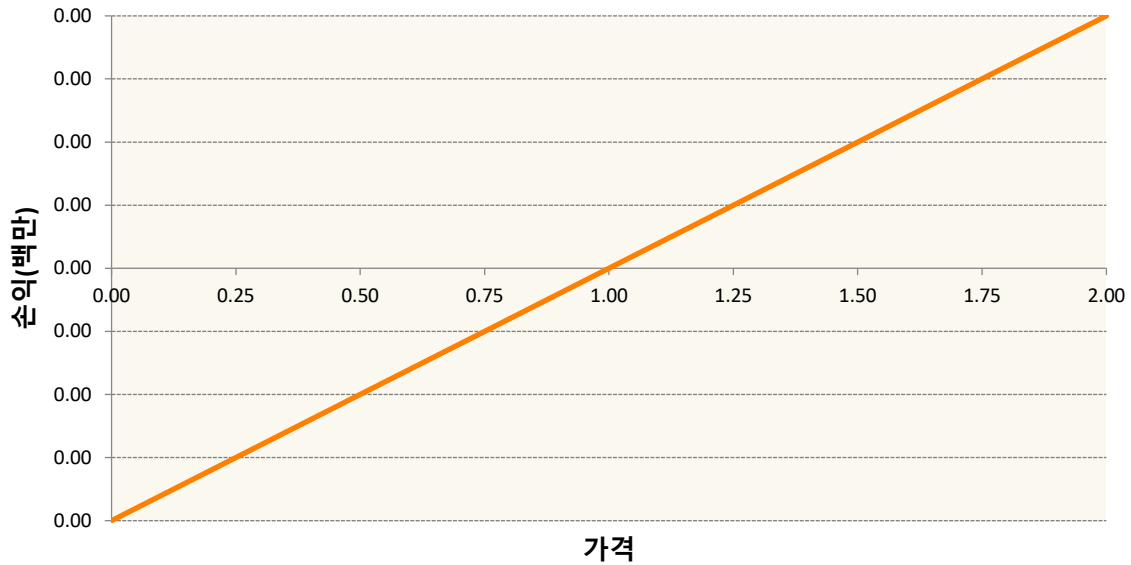
SWSOL0000035-SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P)



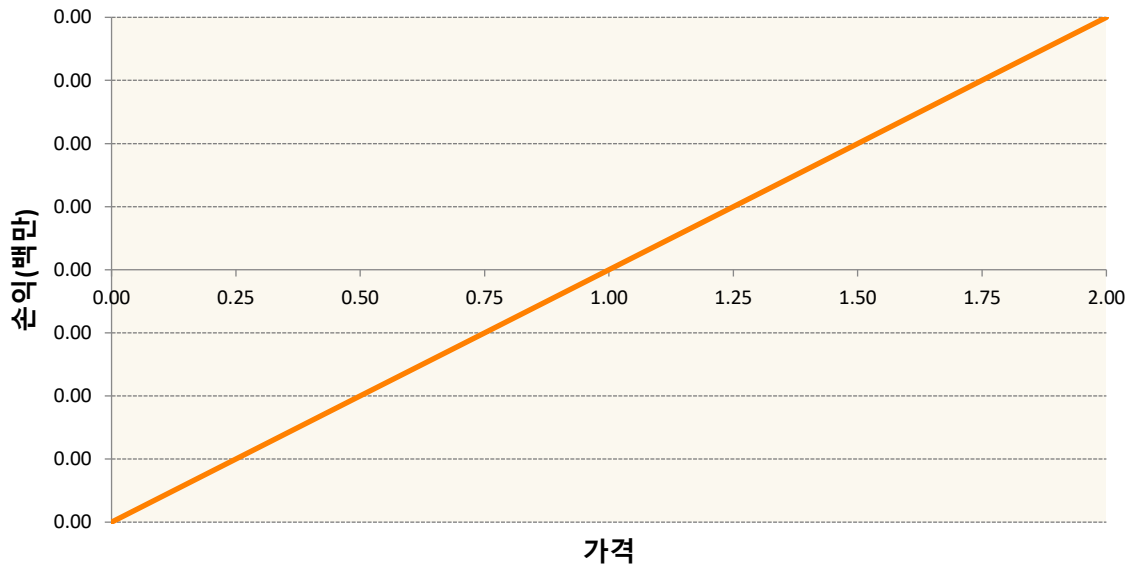
SWSOL0000036-SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P)



SWSOL0000037-SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P



SWSOL0000038-SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P		0.05
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P		0.05
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P		0.05
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P		0.05

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

공시일	2025-12-31
기준일	2025-12-30

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

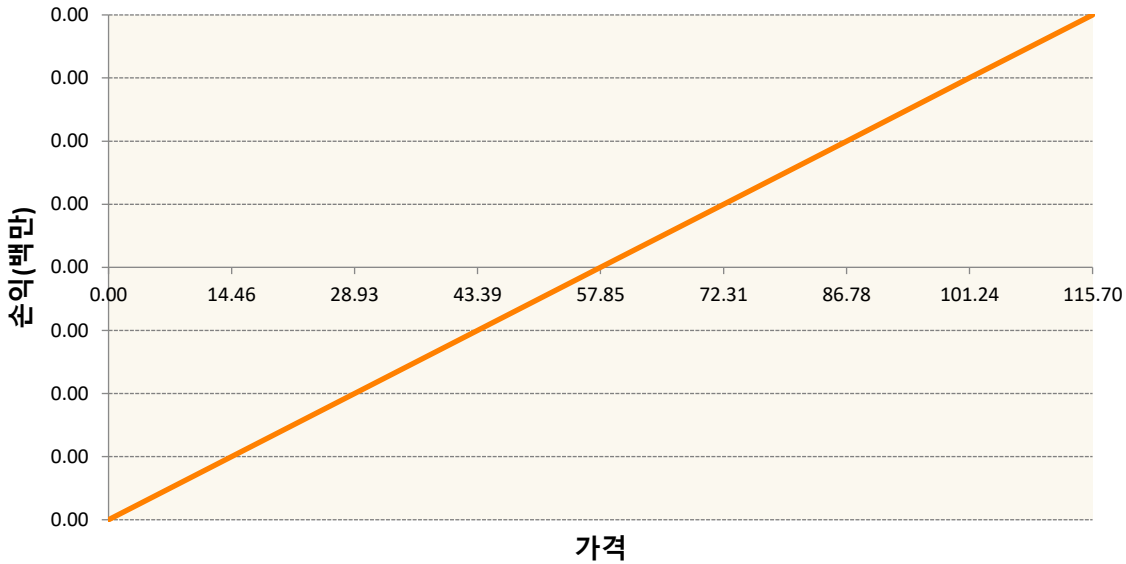
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

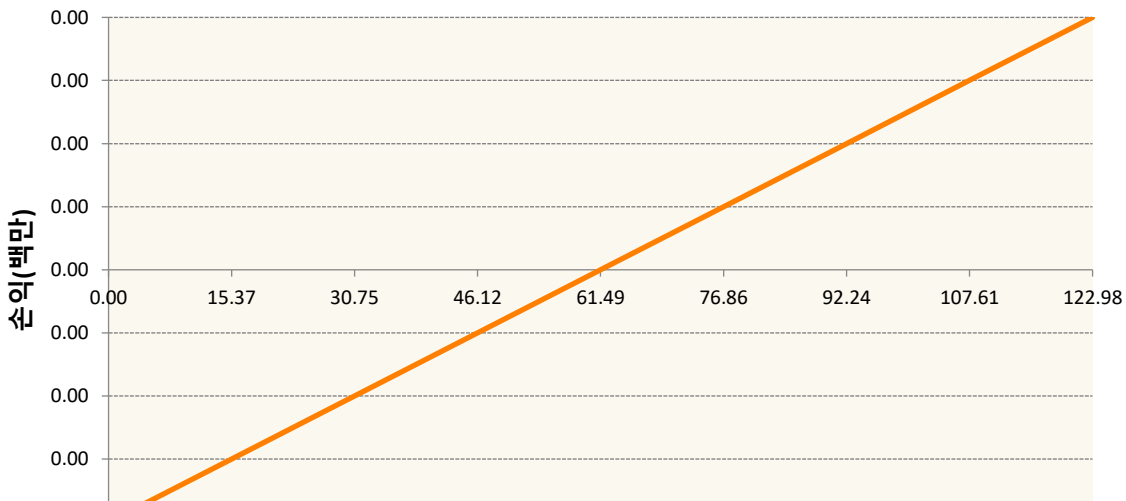
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	149	0	149	
누계	유가증권	선물	356	0	356	
누계	통화	선물	0	86	-86	장내

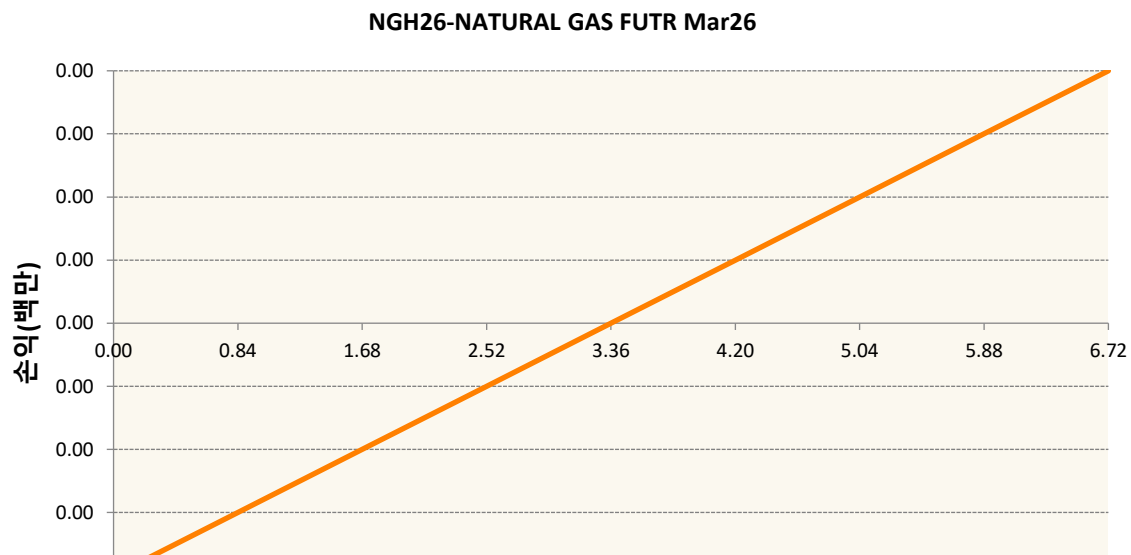
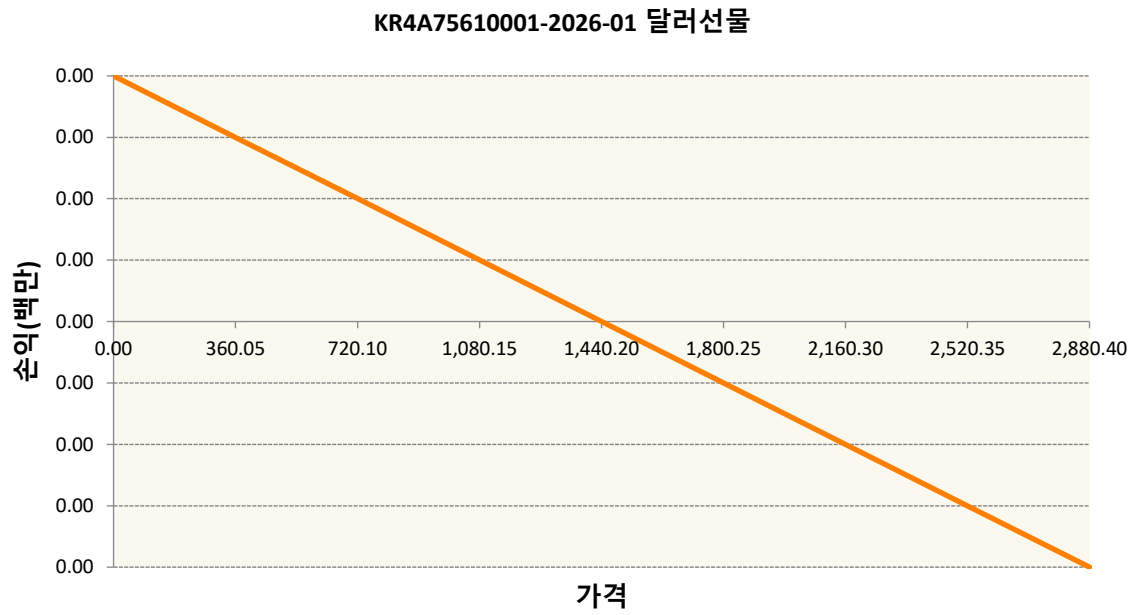
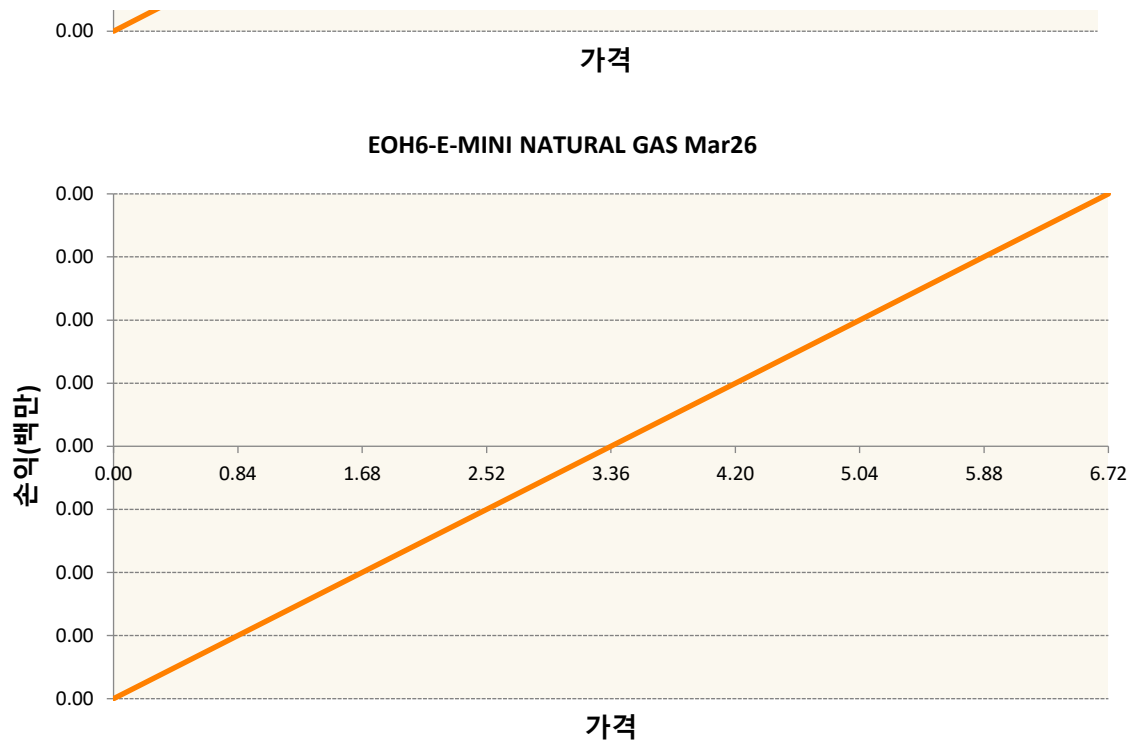
### 2. 만기시점의 손익구조

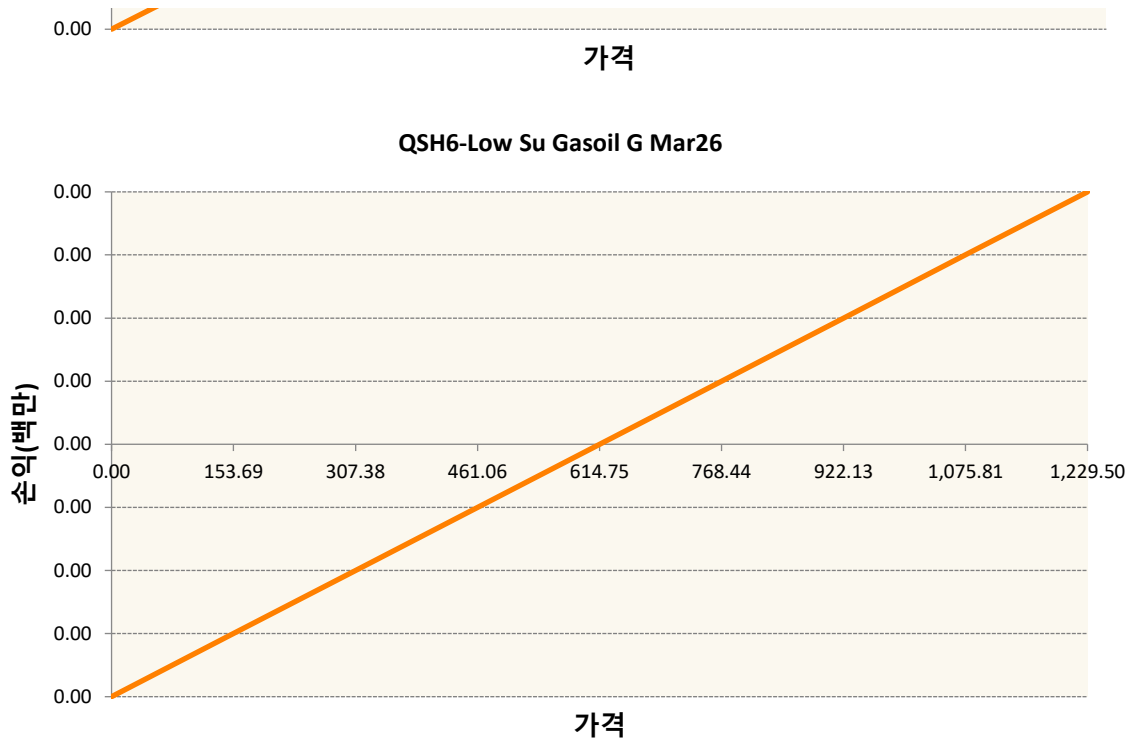
CLH6-WTI CRUDE FUTURE Mar26



COH6-BRENT CRUDE FUTR Mar26







### 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	7
NGH26	NATURAL GAS FUTR Mar26	8
QSH6	Low Su Gasoil G Mar26	7

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

(단위:백만원)

86