

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

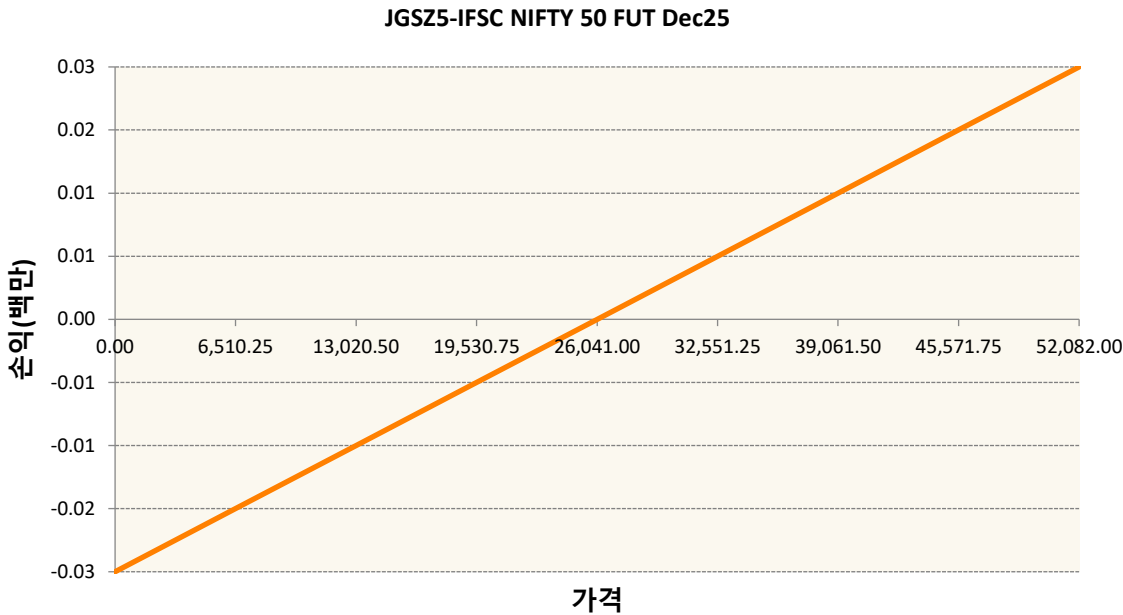
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 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)

|    |
|----|
| 35 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

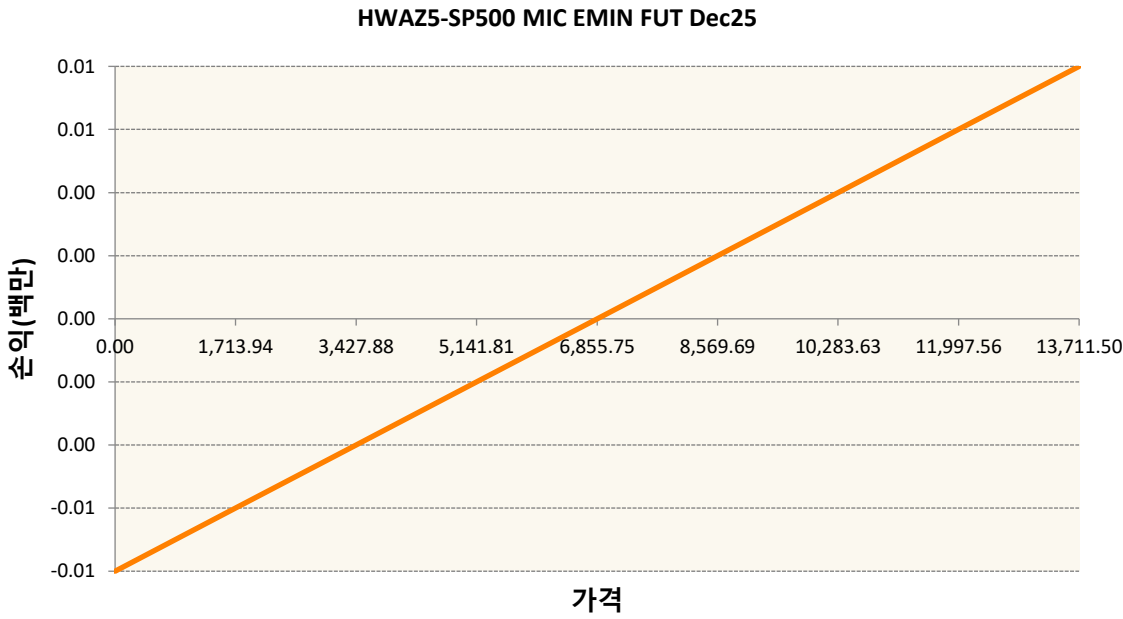
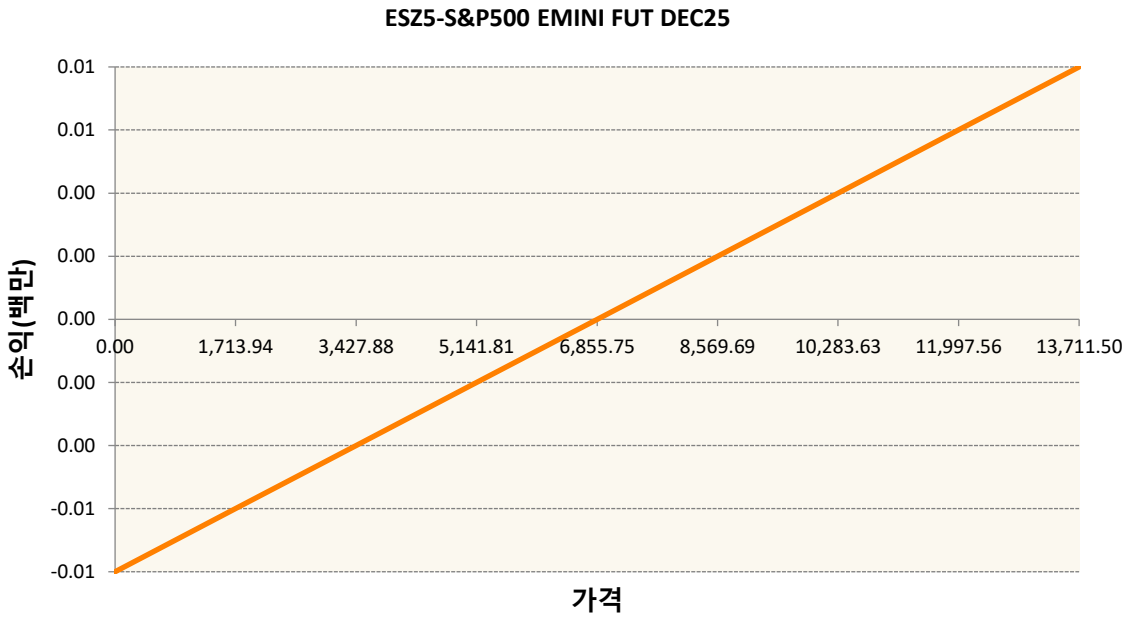
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 477   | 0     | 477       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 143   | 0     | 143       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ5                      | S&P500 EMINI FUT DEC25   | 38       |
| HWAZ5                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec25 | 11       |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

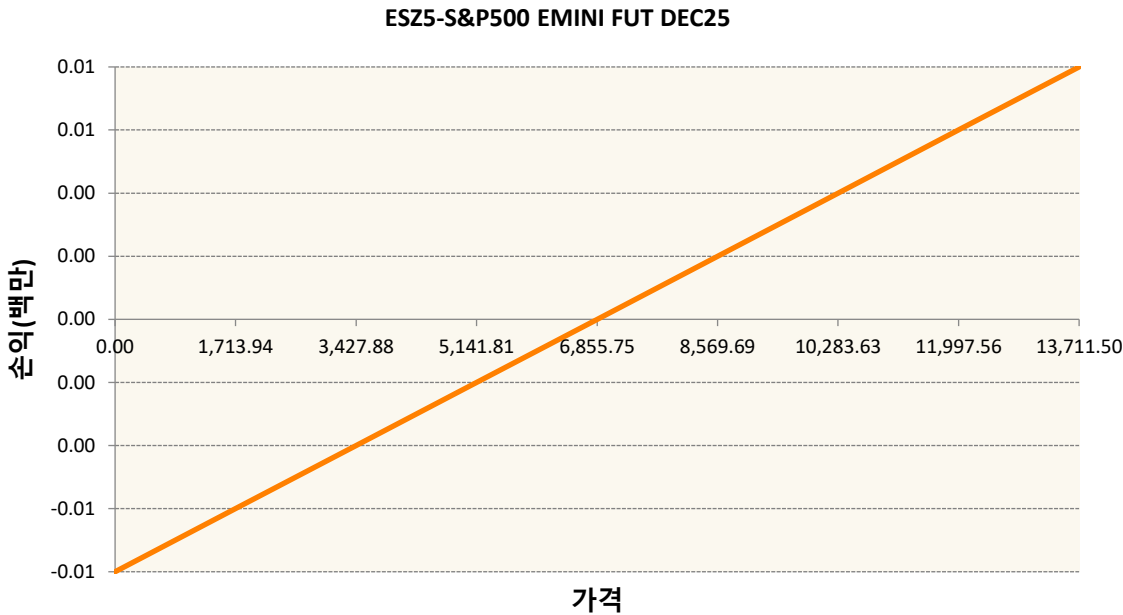
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,430 | 0     | 1,430     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| ESZ5 | S&P500 EMINI FUT DEC25 | 114 |
|------|------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

166

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

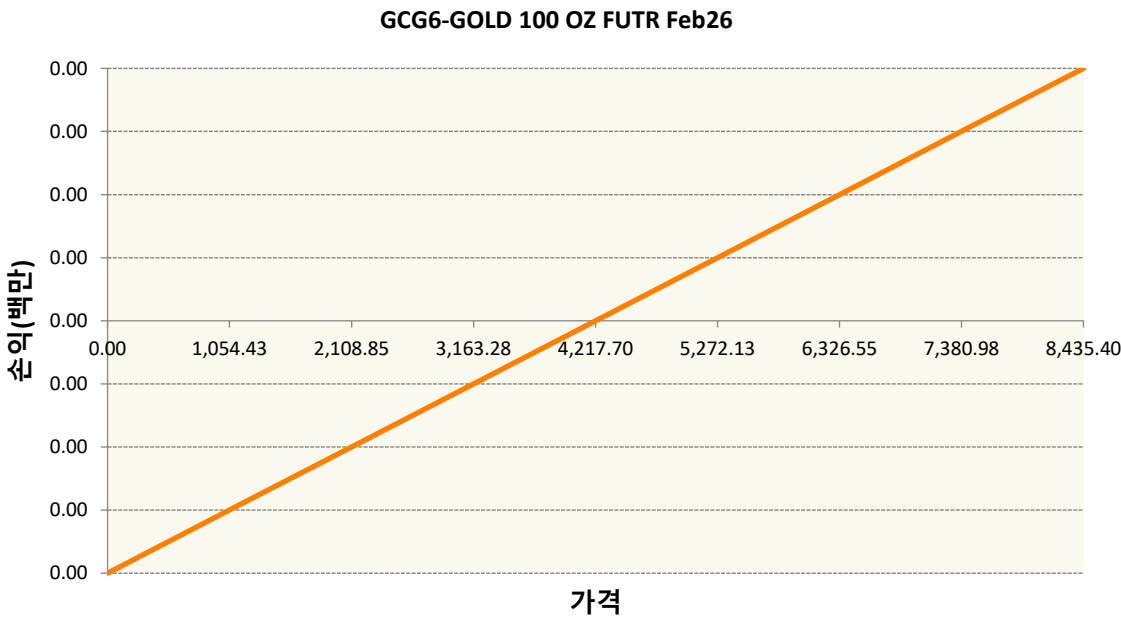
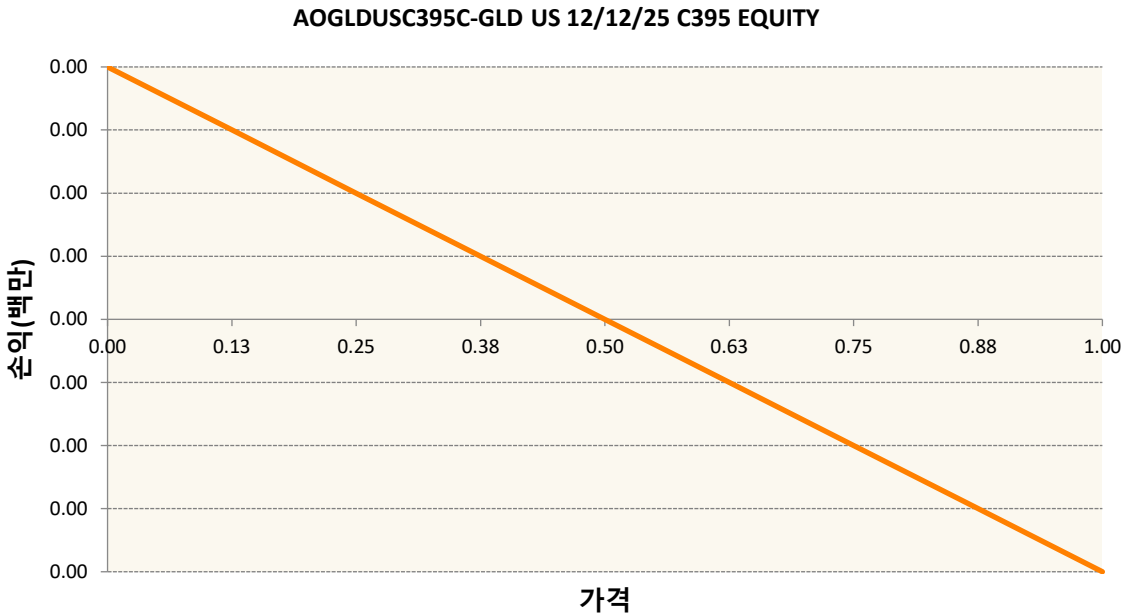
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 3,105 | 0     | 3,105     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 17    | -17       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)             |                        | (단위:백만원) |
|---------------------------------------|------------------------|----------|
| AOGLDUSC3 GLD US 12/12/25 C395 EQUITY |                        | 1        |
| GCG6                                  | GOLD 100 OZ FUTR Feb26 | 248      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 233      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                        |     |
|----------------------------------------|-----|
| AOPLTRUAC PLTR US 12/12/25 C185 EQUITY | 100 |
| AOPLTRUAP PLTR US 12/12/25 P185 EQUITY | 43  |

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

(단위:백만원)

549

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

## SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

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

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSCC!TLT US 12/12/25 C90 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

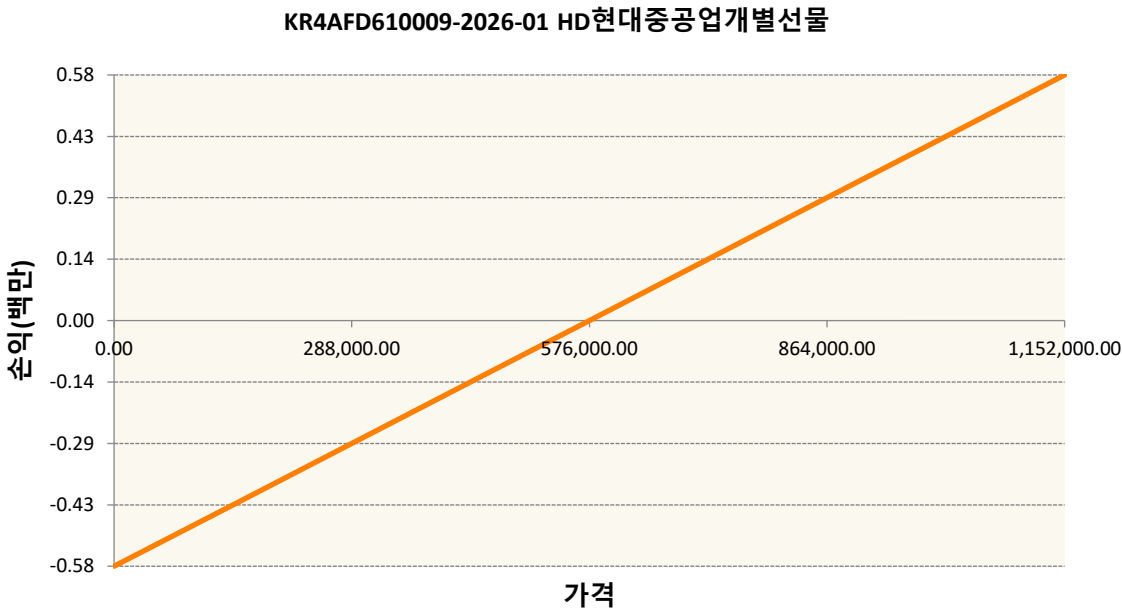
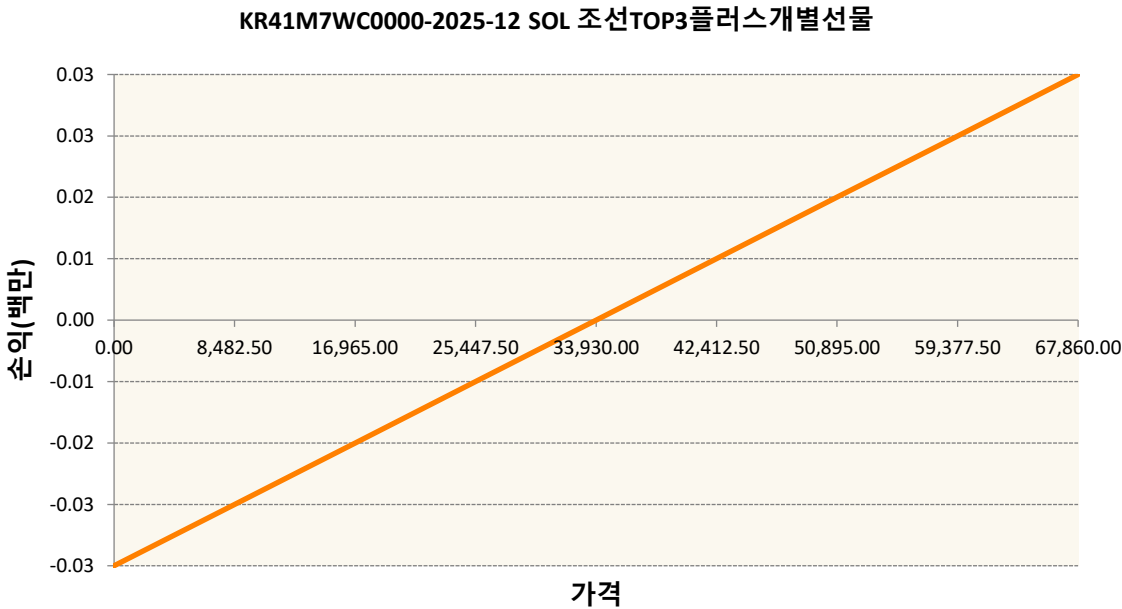
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 1. 계약금액

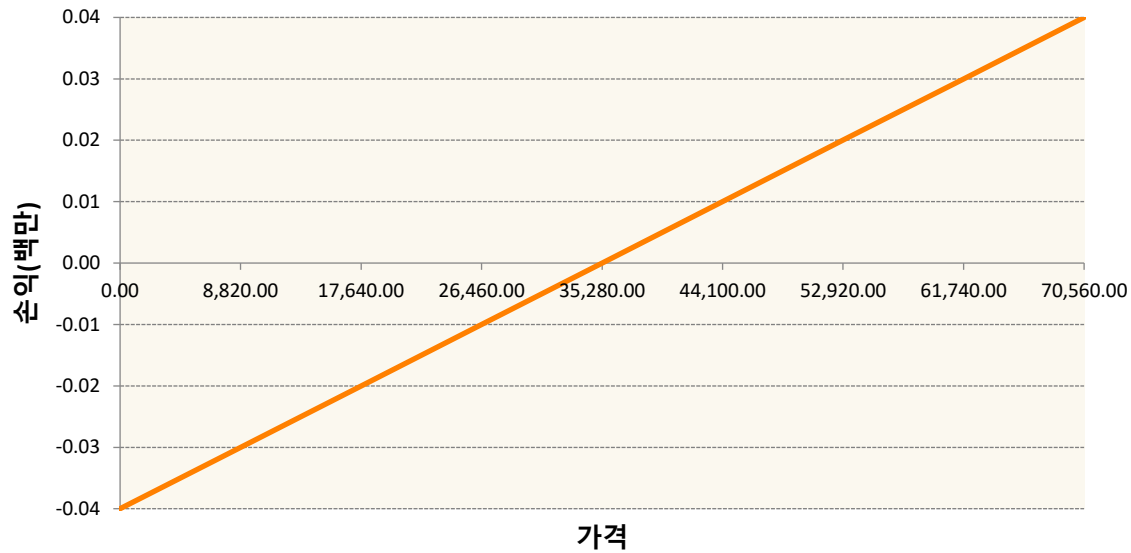
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 9,921  | 9,314 | 607       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 21,773 | 0     | 21,773    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



# KR4AM7630007-2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR41M7WC0000 2025-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물 |         |         |        |      |       |        |        |
|----------------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
|                                        |         |         |        |      |       |        | 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     |
| KR4AFD610009 2026-01 HD현대중공업개별선물       |         |         |        |      |       |        |        |
|                                        |         |         |        |      |       |        | 925    |
| 기초자산의 변동성                              |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                                     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                                 | -925    | -925    | -925   | -925 | -925  | -925   | -925   |
| -5.33%                                 | -617    | -617    | -617   | -617 | -617  | -617   | -617   |
| -2.67%                                 | -308    | -308    | -308   | -308 | -308  | -308   | -308   |
| 0%                                     | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                                  | 308     | 308     | 308    | 308  | 308   | 308    | 308    |
| 5.33%                                  | 617     | 617     | 617    | 617  | 617   | 617    | 617    |
| 8.00%                                  | 925     | 925     | 925    | 925  | 925   | 925    | 925    |
| 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)

1,781

공시일 2025-12-10

기준일 2025-12-09

## 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 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

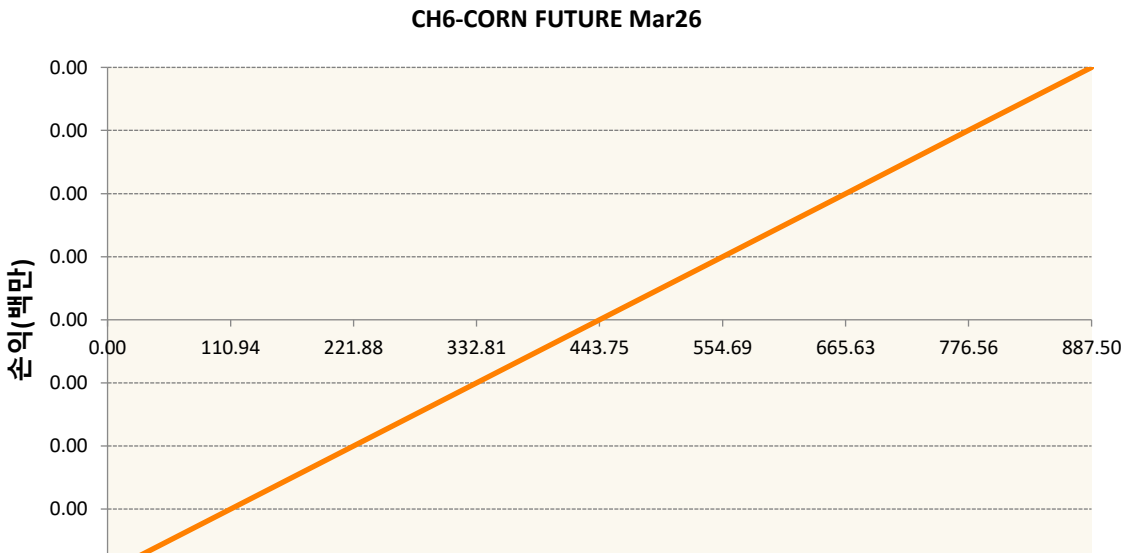
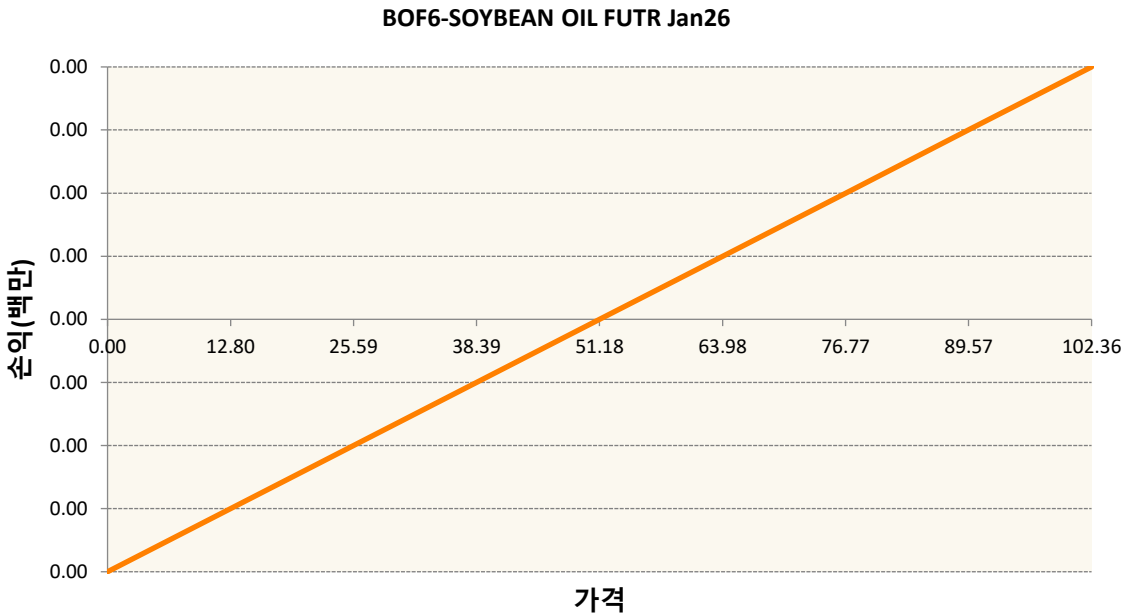
## 포커스농산물모(채권-파생형)

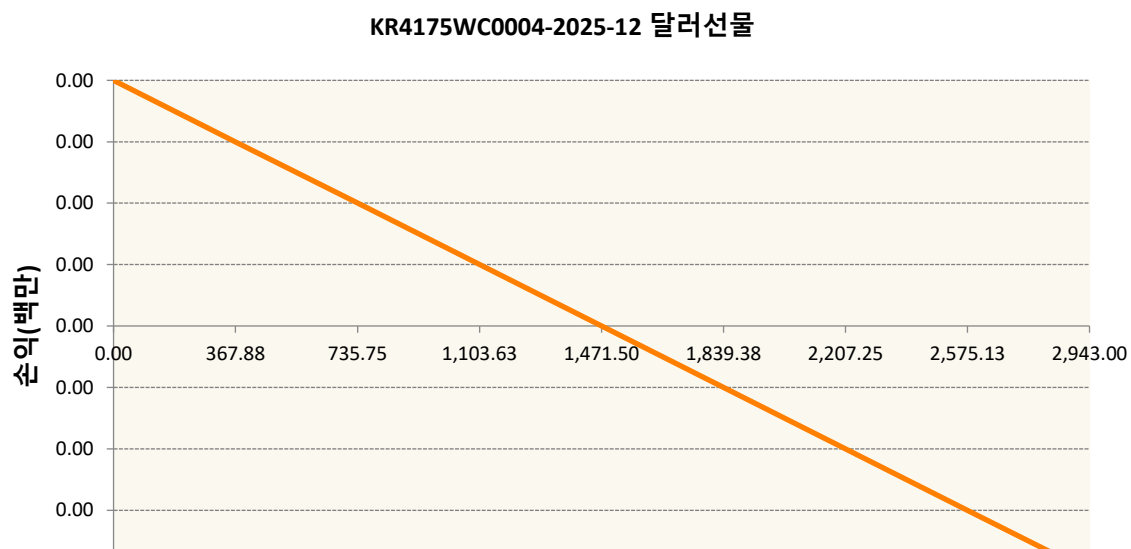
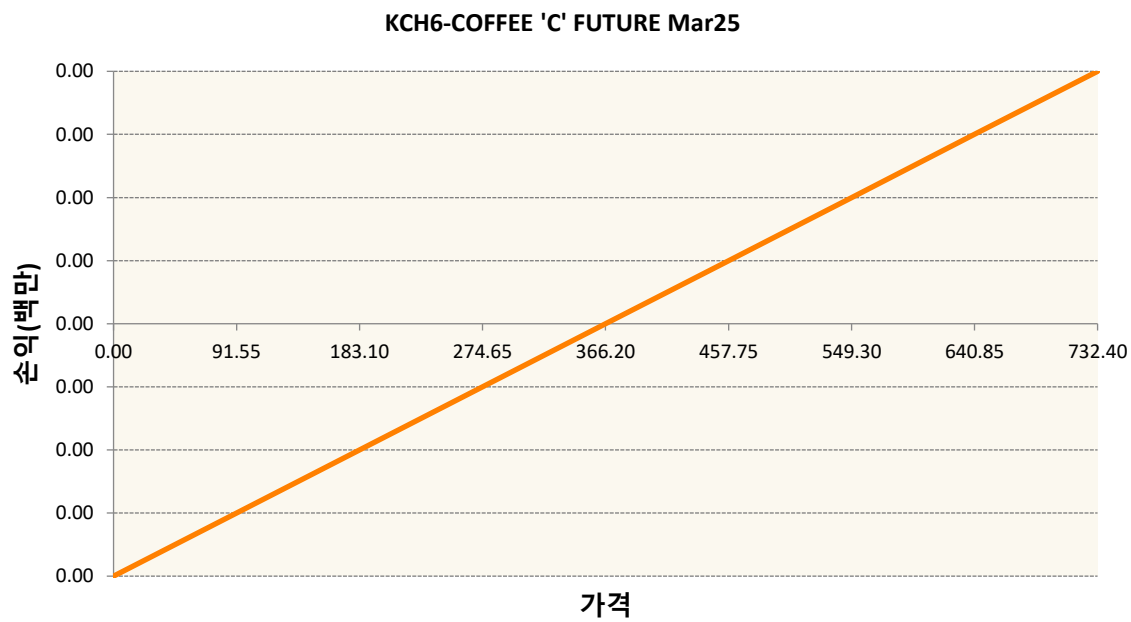
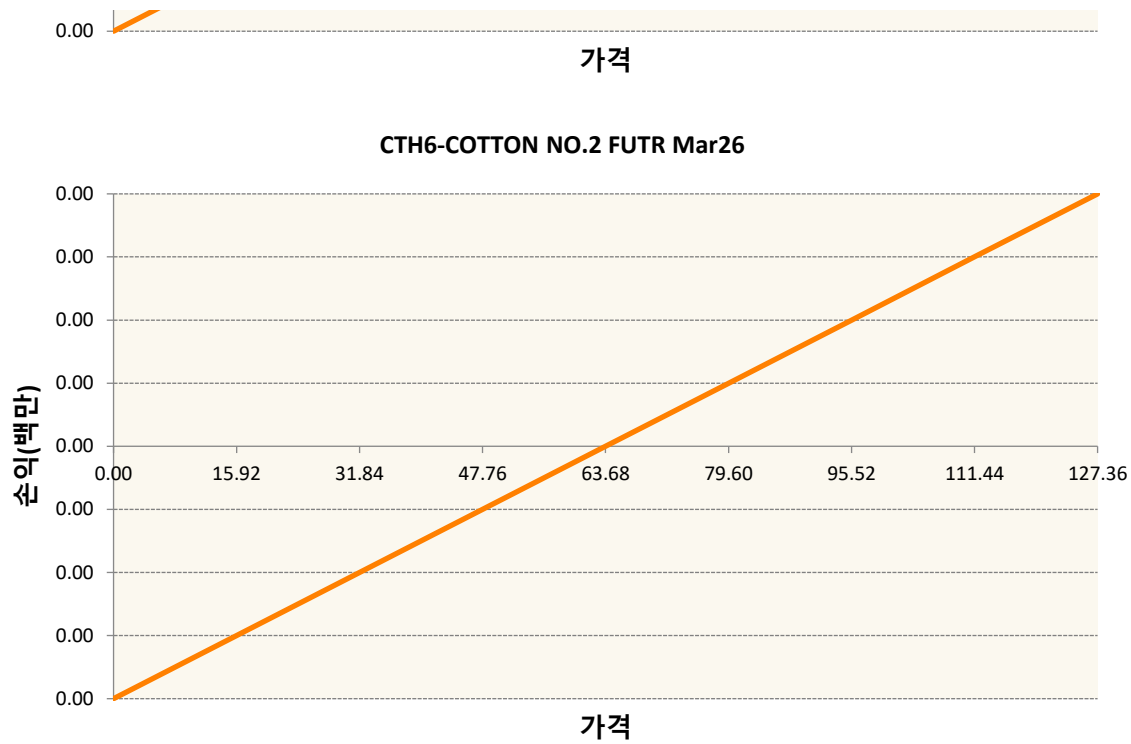
### 1. 계약금액

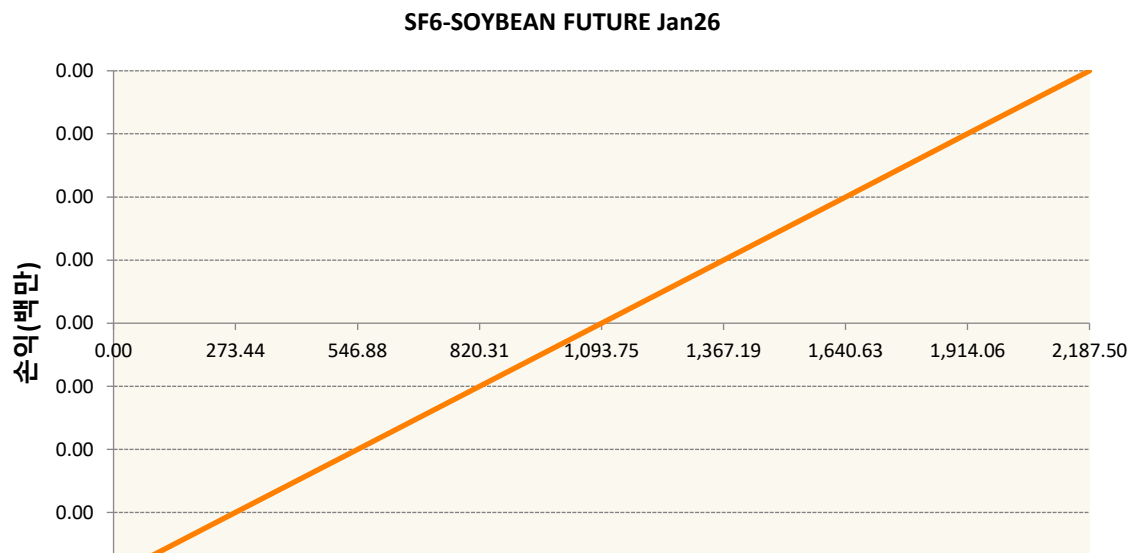
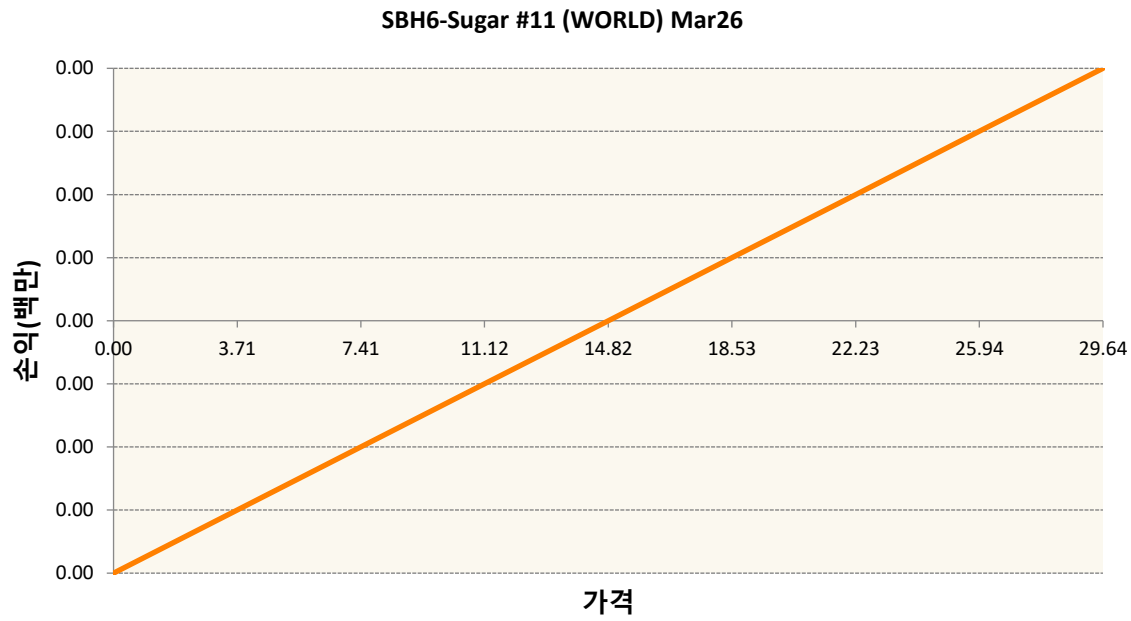
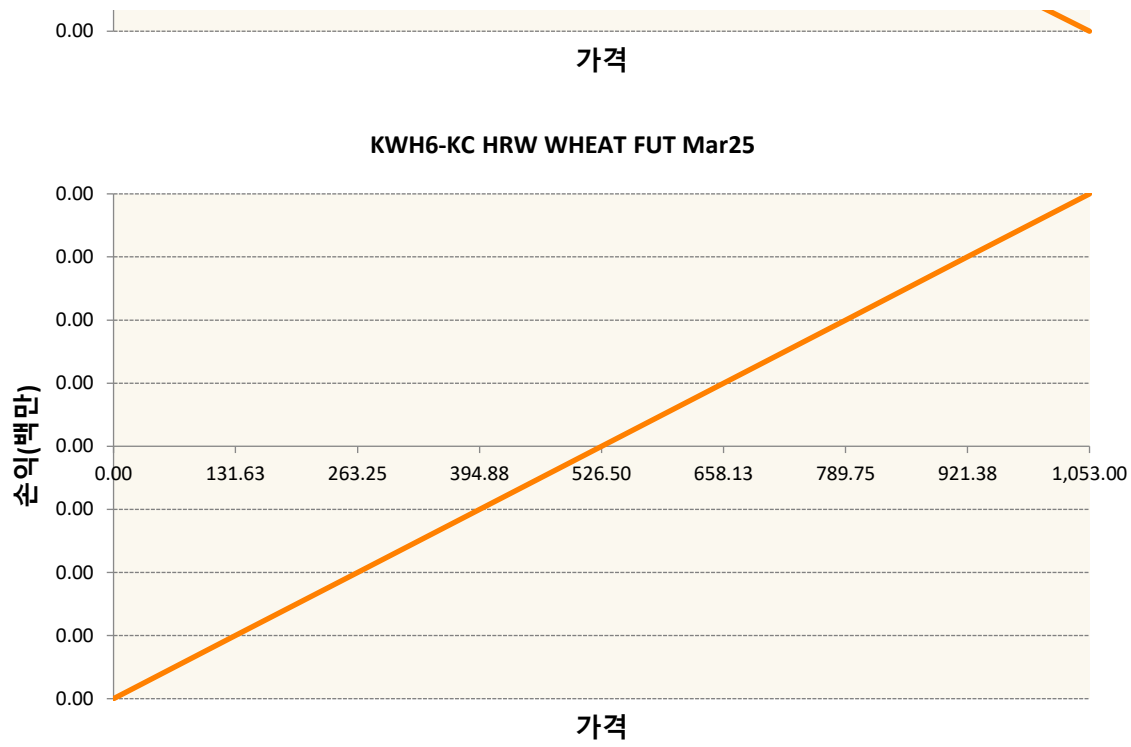
(단위:USD 백만)

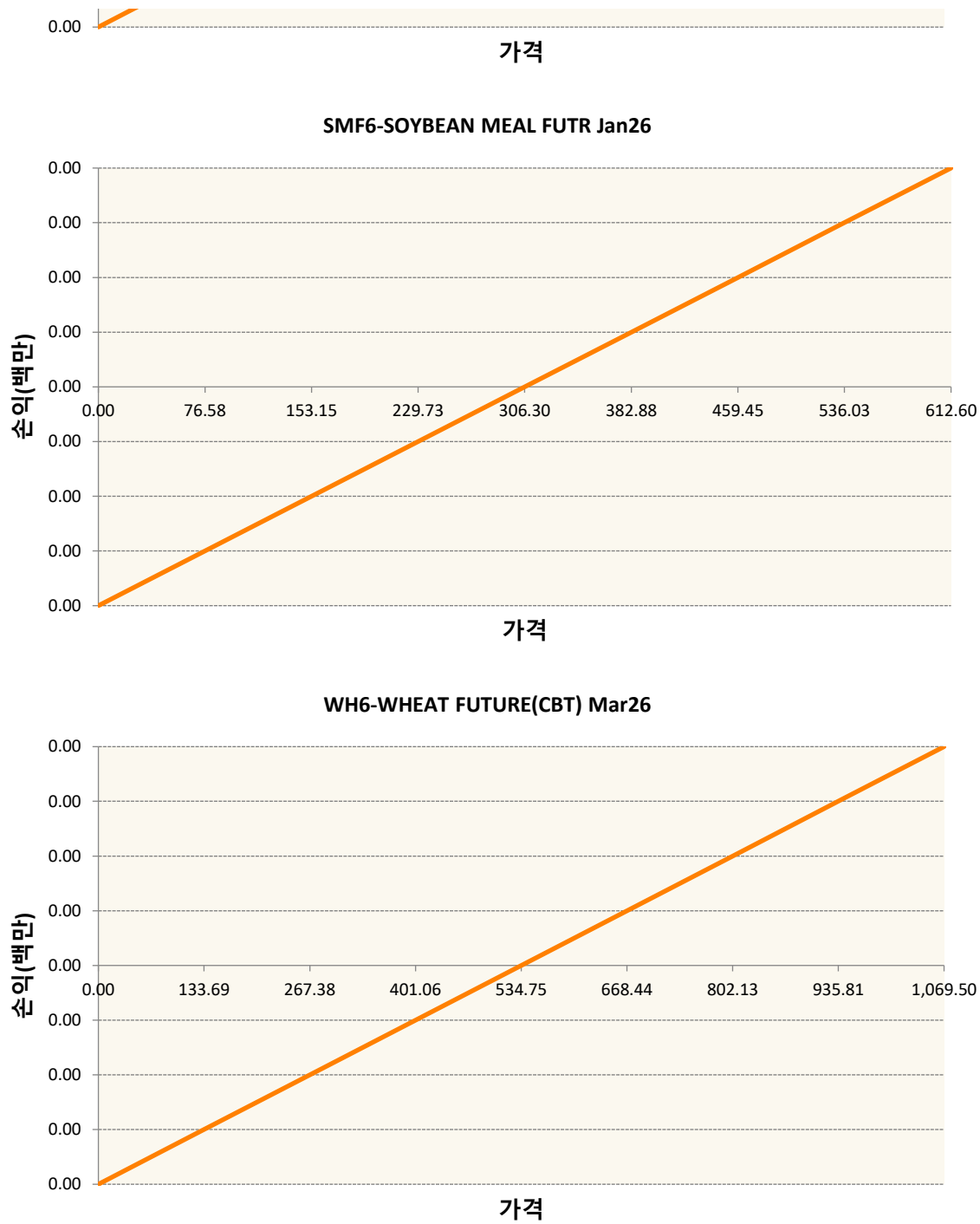
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 1,138 | 0     | 1,138     |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,082 | 0     | 2,082     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 441   | -441      | 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 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

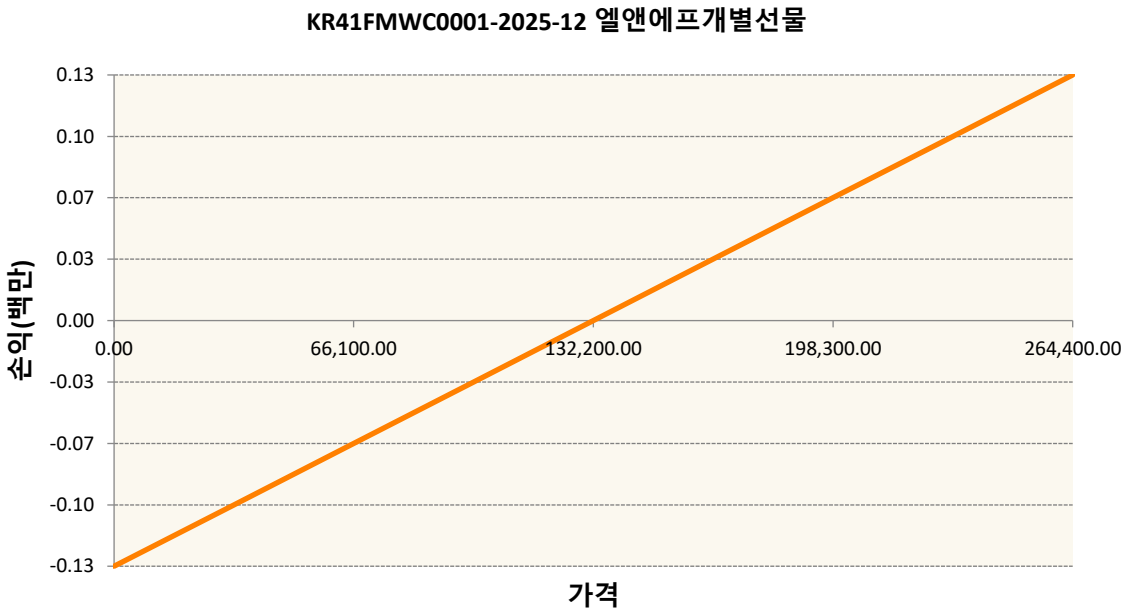
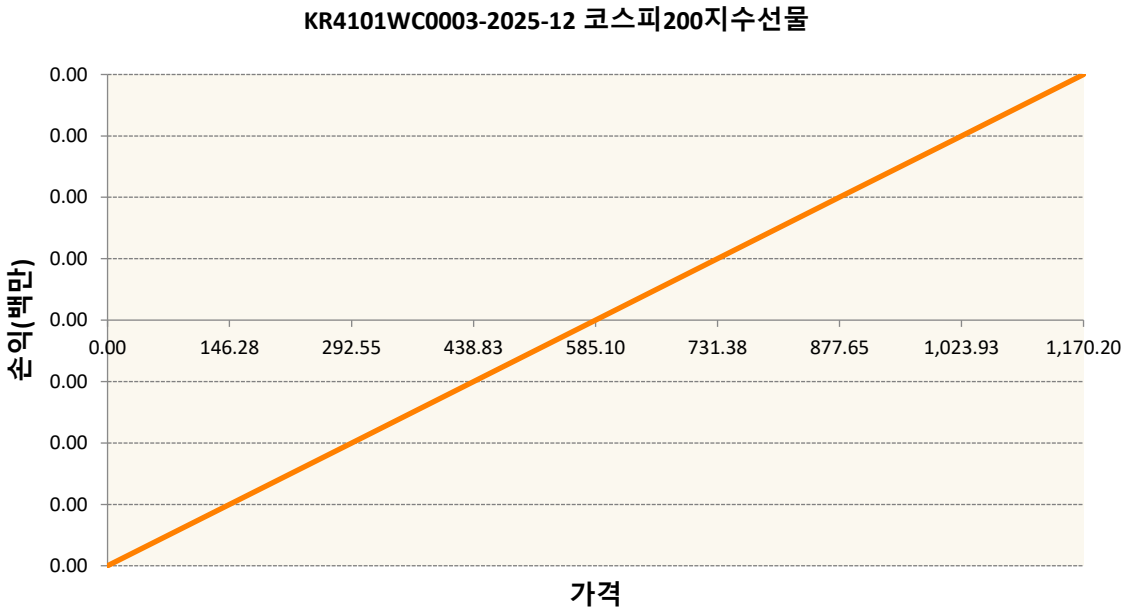
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 147   | -147      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,213 | 0     | 1,213     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)     |  | (단위:백만원) |
|-------------------------------|--|----------|
| KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물 |  | 94       |
| KR41FMWCC 2025-12 엘애프개별선물     |  | 3        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 12       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

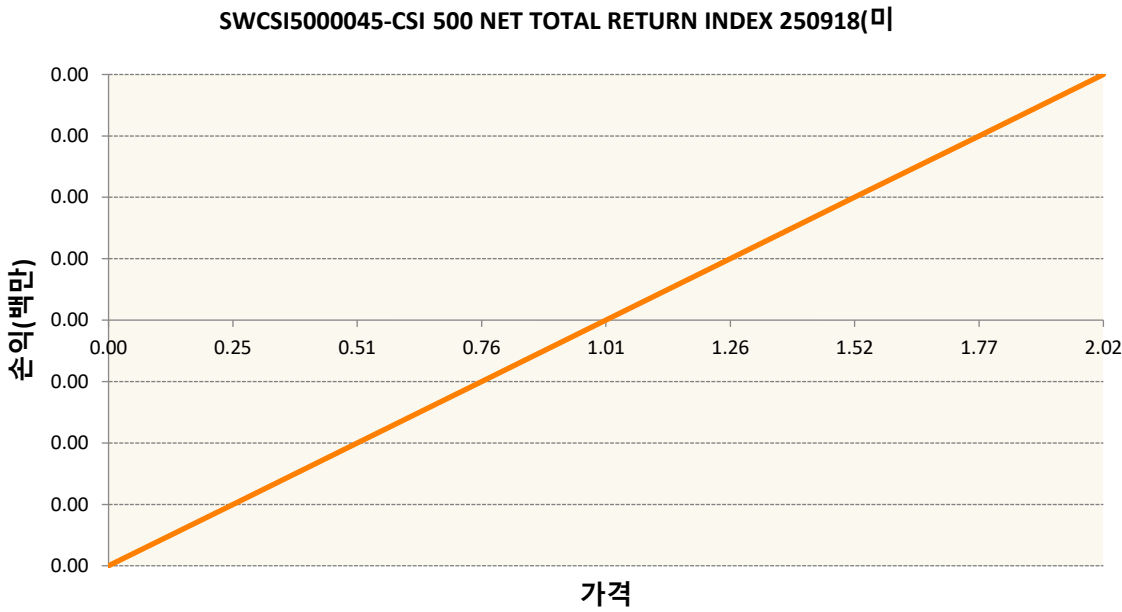
SOL차이나강소기업CSI500상장

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   | 4,747 | 0     | 4,747     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 250918(미

379

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

465

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

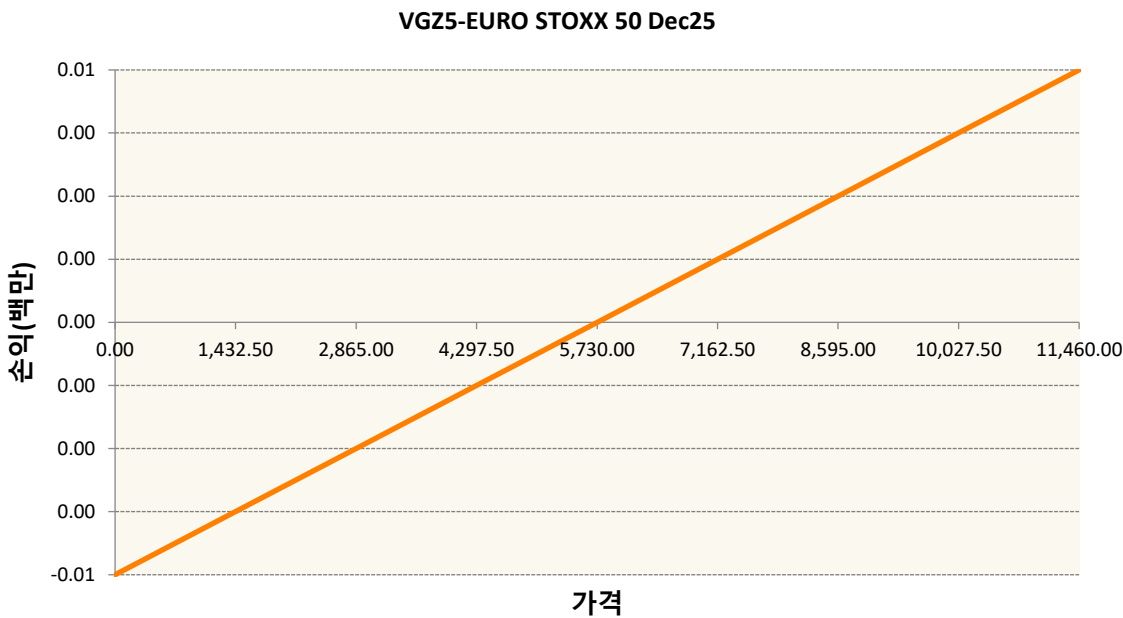
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 753   | 0     | 753       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGZ5 | EURO STOXX 50 Dec25 | 60 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 50 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

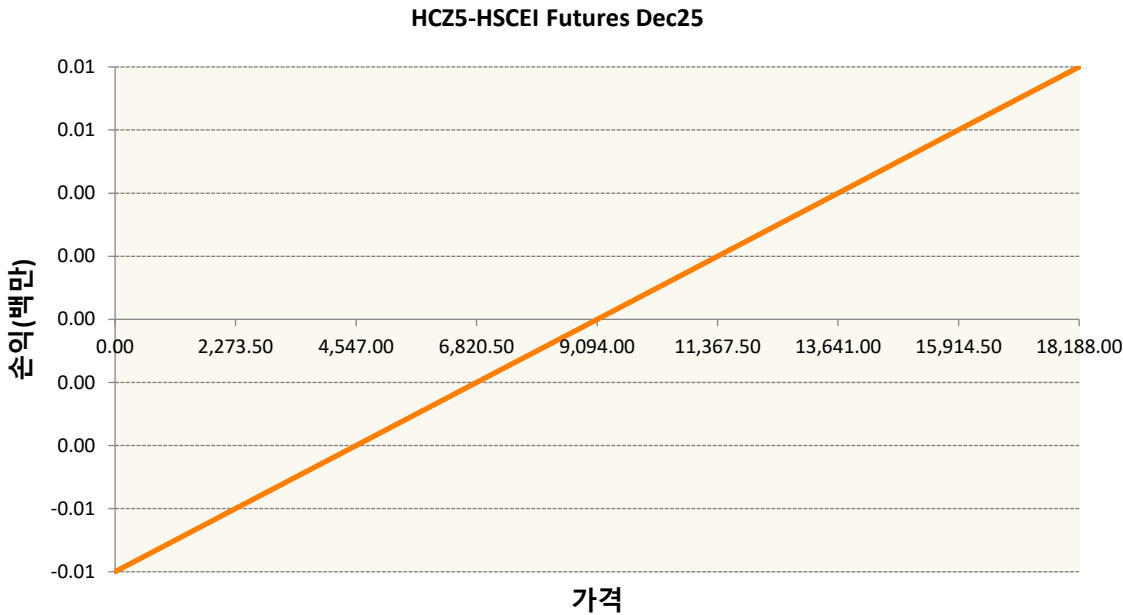
차이나인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,894 | 0     | 1,894     |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCZ5 | HSCEI Futures Dec25 | 152 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 196 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

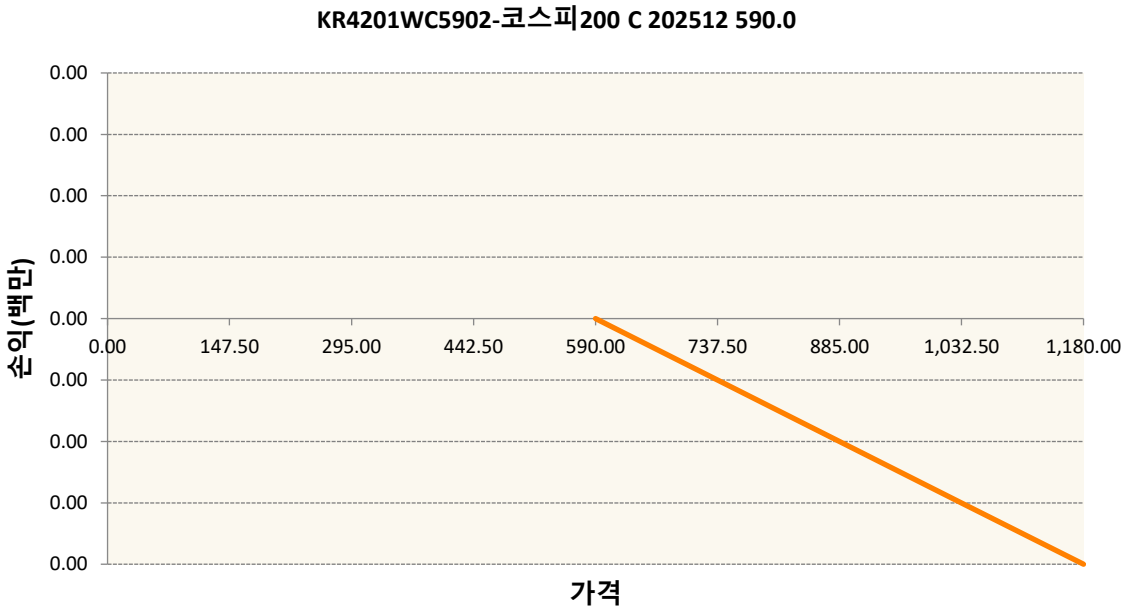
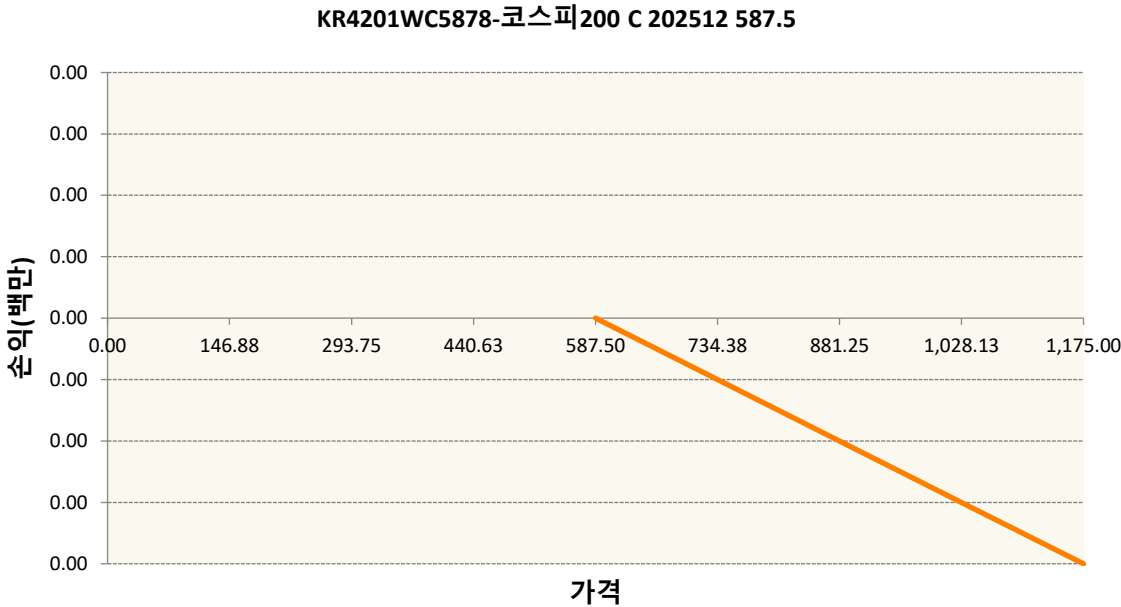
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

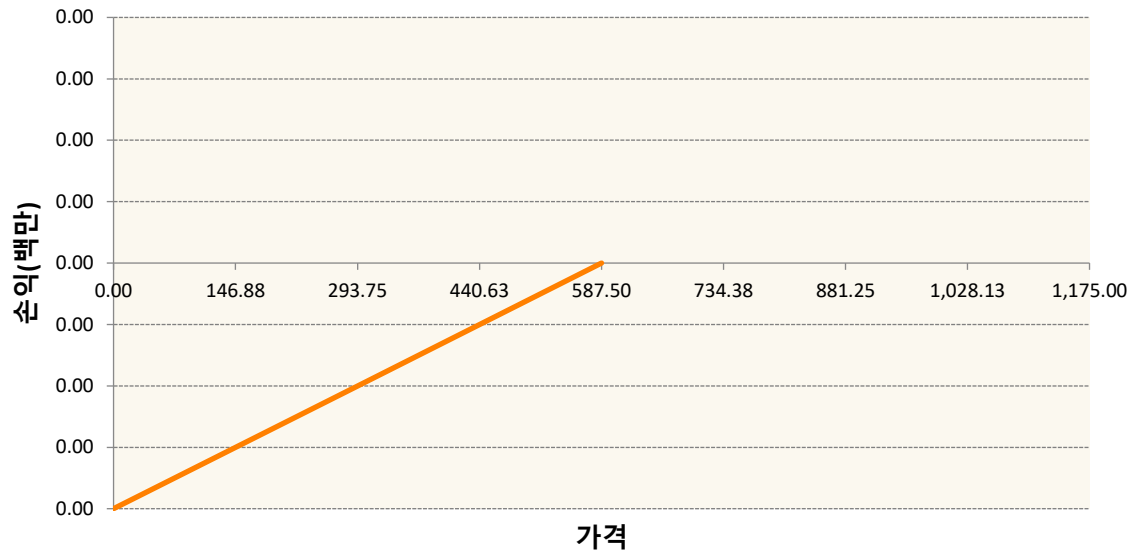
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 35,319 | -35,319   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4301WC5877-코스피200 P 202512 587.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201WC5877-코스피200 C 202512 587.5

999

KR4201WC5877-코스피200 C 202512 590.0

1,298

KR4301WC5877-코스피200 P 202512 587.5

529

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

(단위:백만원)

0

공시일 2025-12-10

기준일 2025-12-09

## 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 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

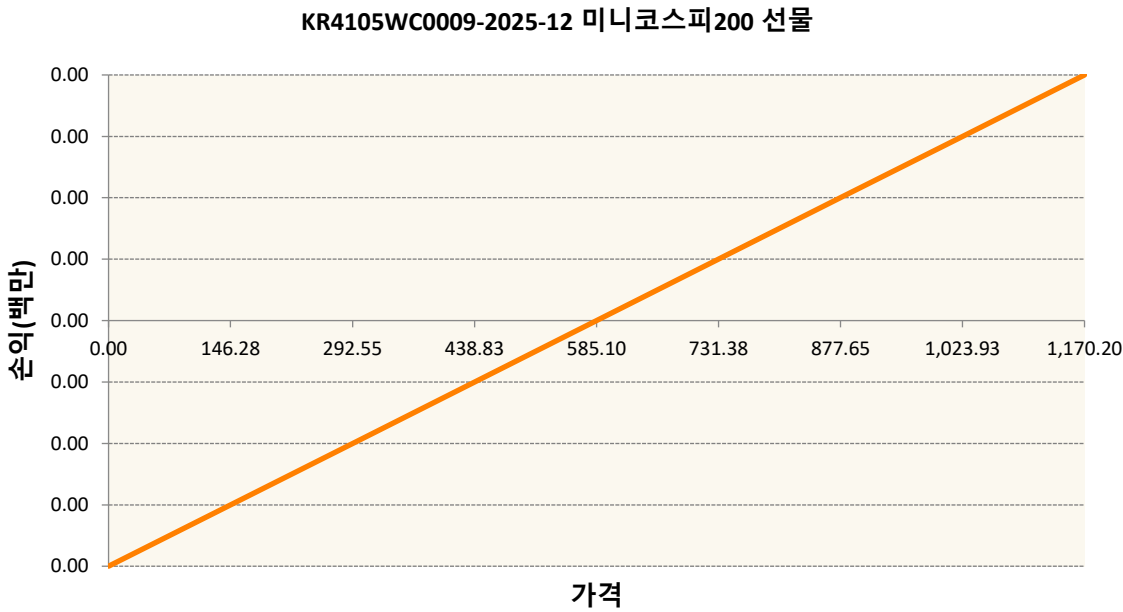
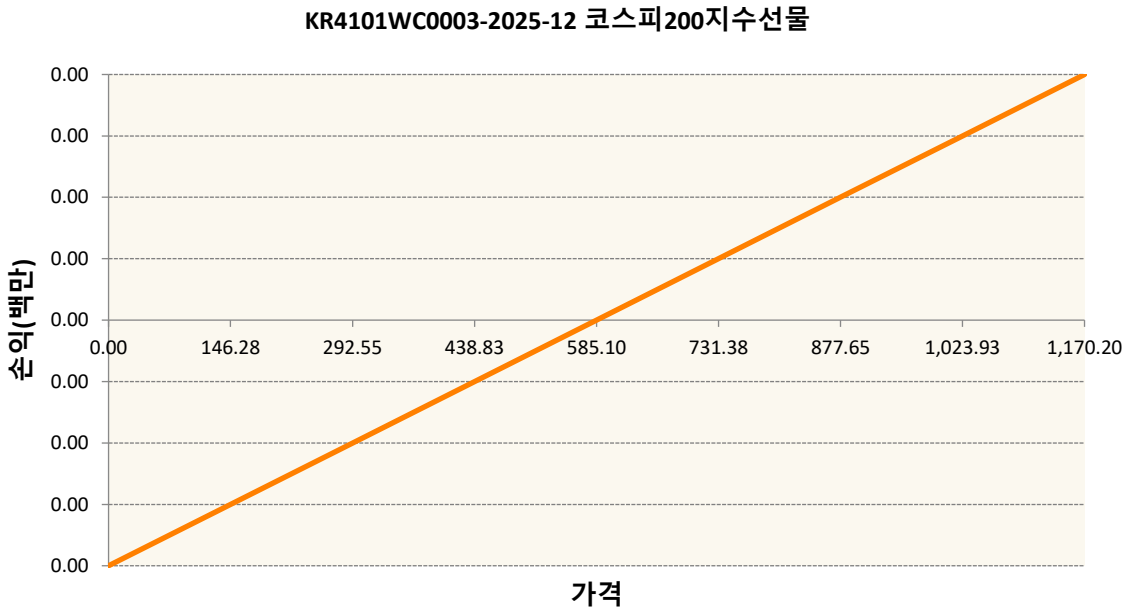
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

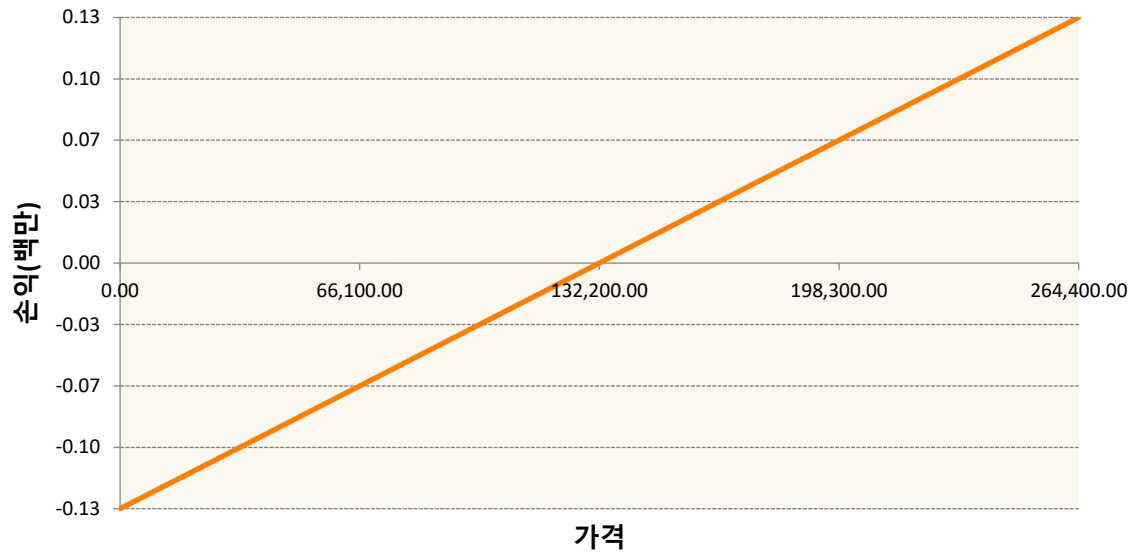
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,189 | 0     | 1,189     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



### KR41FMWC0001-2025-12 엘애프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101WC01 2025-12 코스피200지수선물  
 KR4105WC01 2025-12 미니코스피200 선물  
 KR41FMWCC 2025-12 엘애프개별선물

47  
 9  
 1

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

(단위:백만원)

5

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

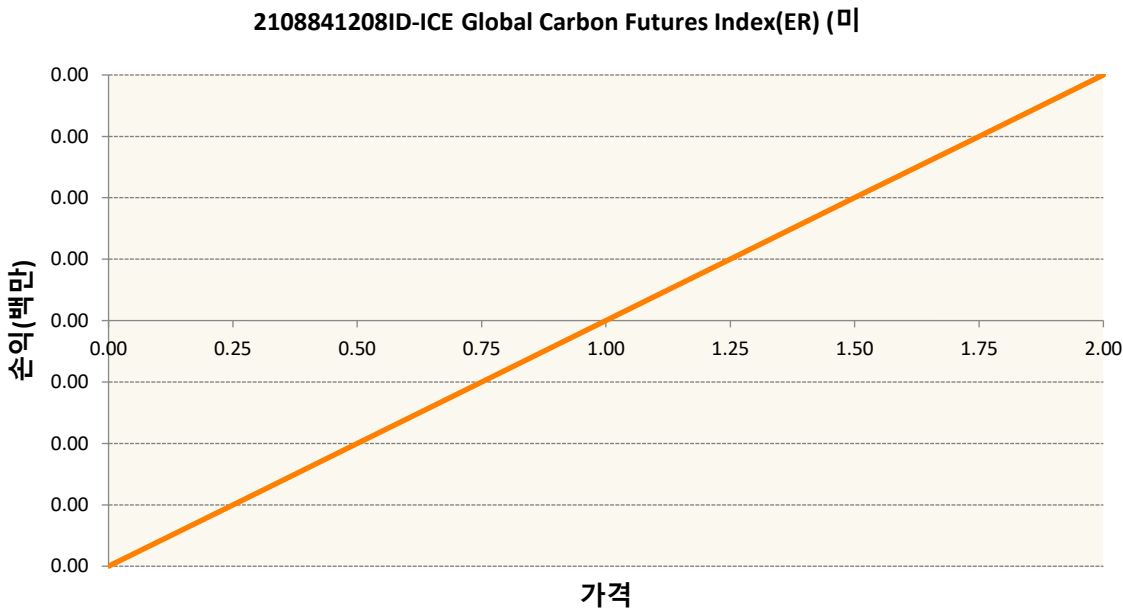
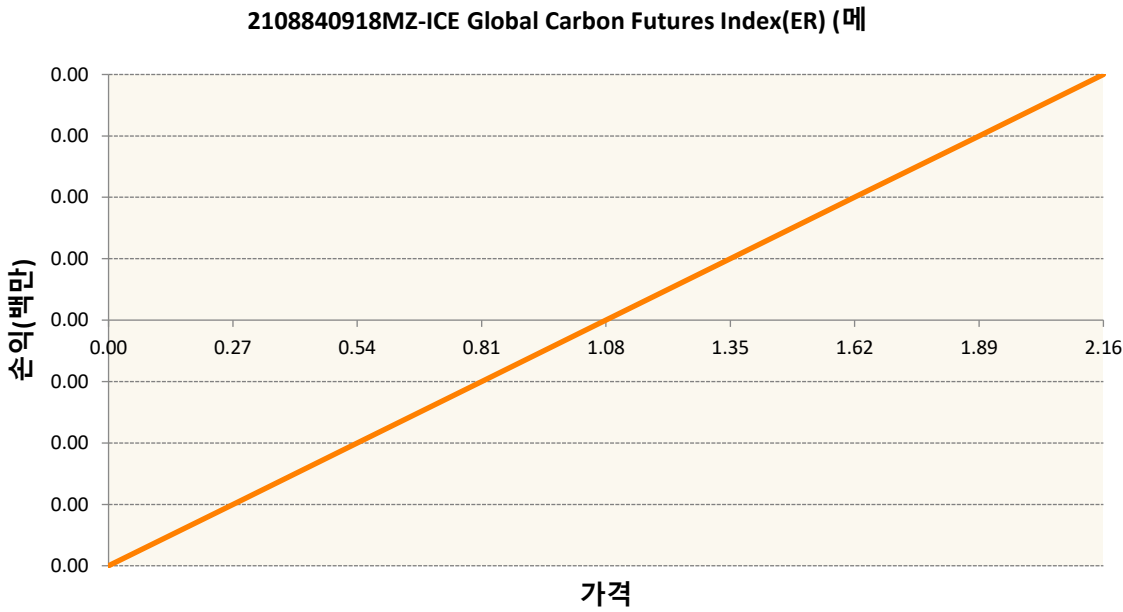
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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   | 7,296 | 0     | 7,296     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840918IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 117      |
| 2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 467      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 561      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

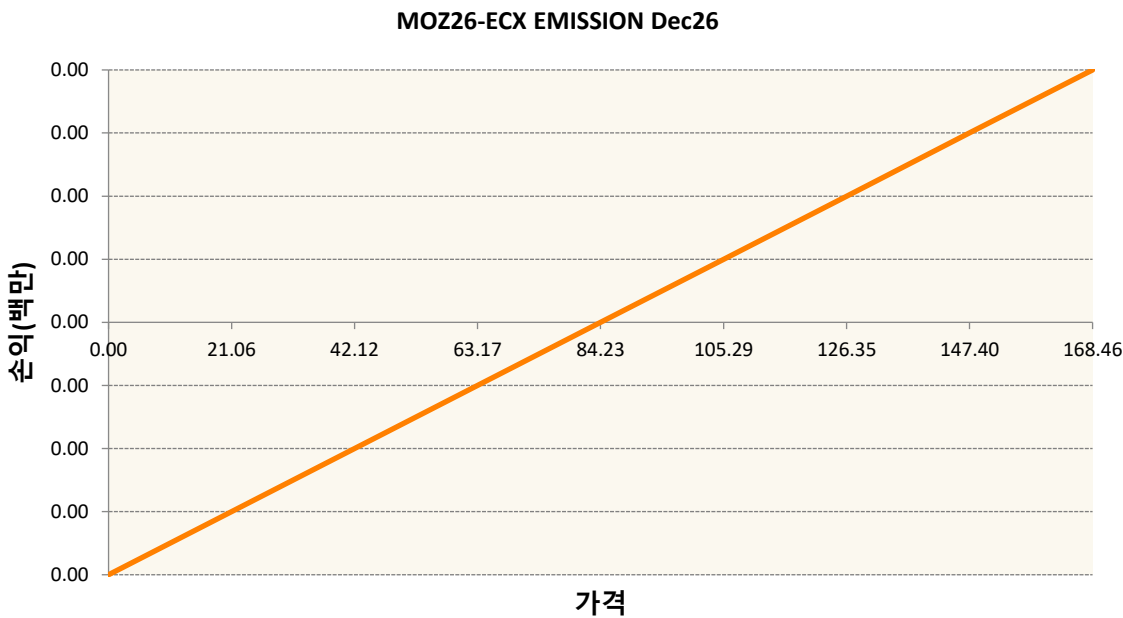
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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 |      |      | 5,587 | 0     | 5,587     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,843 | -2,843    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FXW213FBTC KRW/EUR 23-12-25E | 227 |
| MOZ26 ECX EMISSION Dec26     | 447 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 727 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

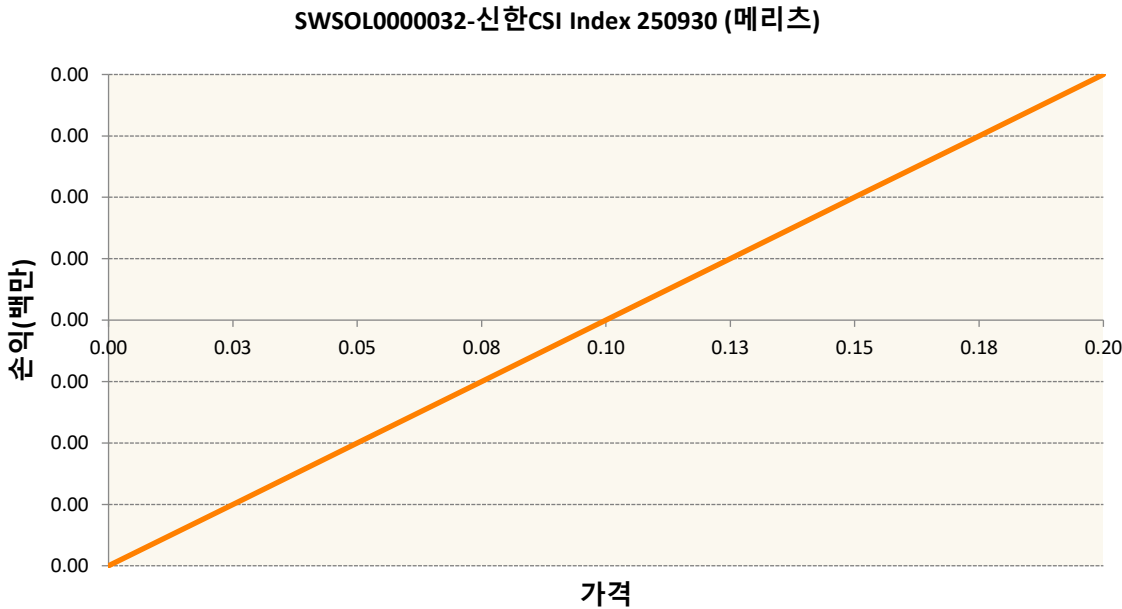
## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 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   | 2,747 | 0     | 2,747     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                |    |
|------------------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 12 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 8  |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 8  |
| SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)            | 20 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 84 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

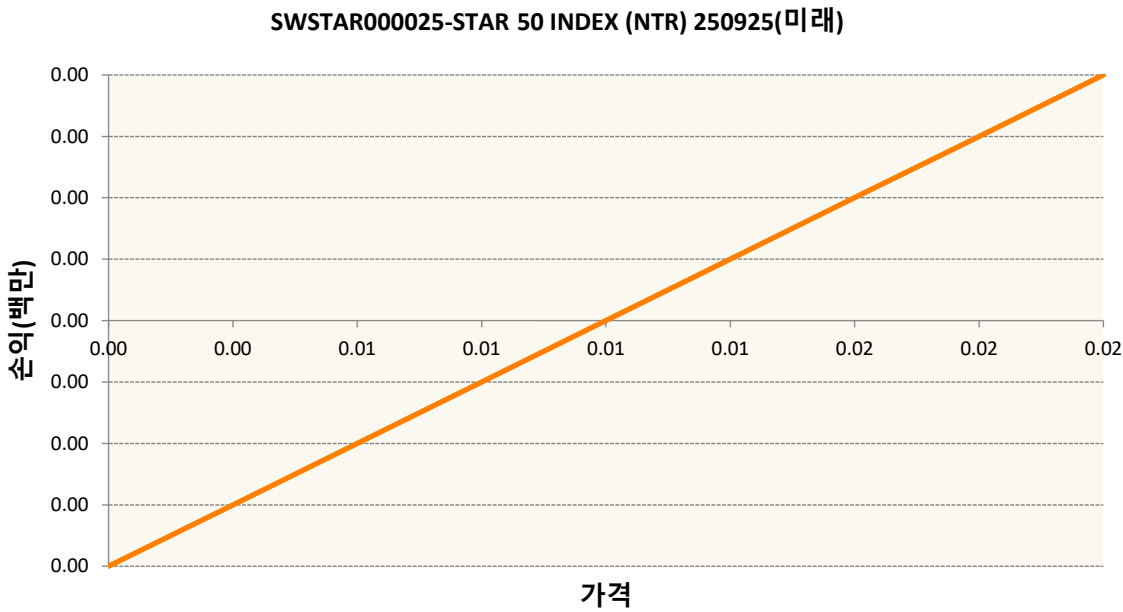
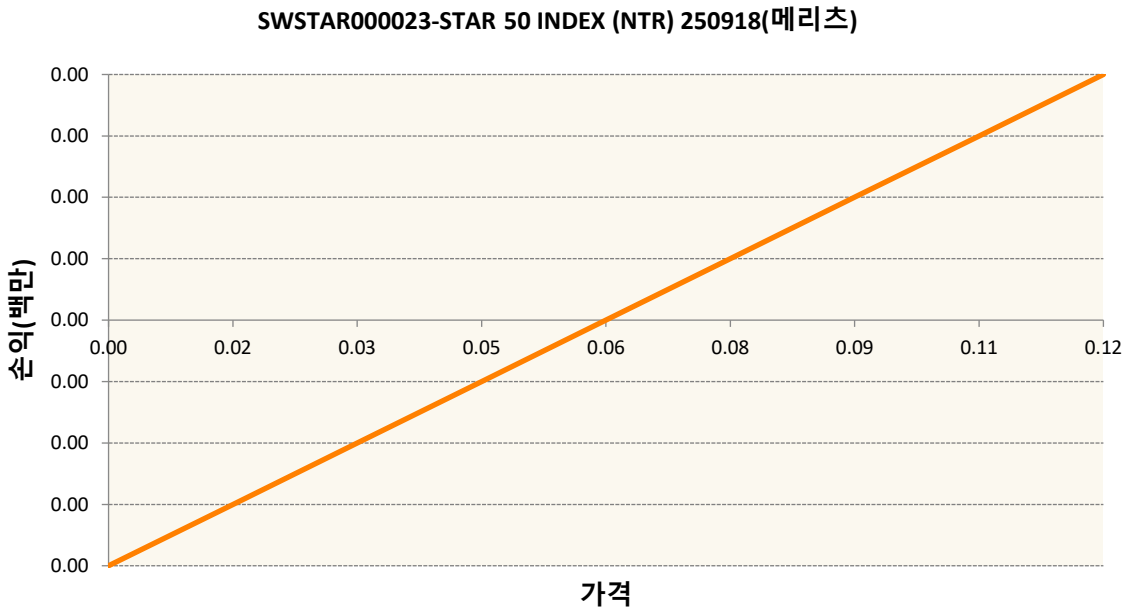
# SOL차이나육성산업엑티브상장지

## 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   | 4,019 | 0     | 4,019     | 장외 |

## 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                  |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------------------|--|----------|
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 241219(NH)     |  | 13       |
| SWSTAR000( 신한 STAR 50 Index 231226(키움)     |  | 4        |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250918(메리츠) |  | 49       |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 250925(미래)  |  | 5        |
| SWSTAR000( STAR 50 INDEX (NTR) 251010(메리츠) |  | 18       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 164      |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

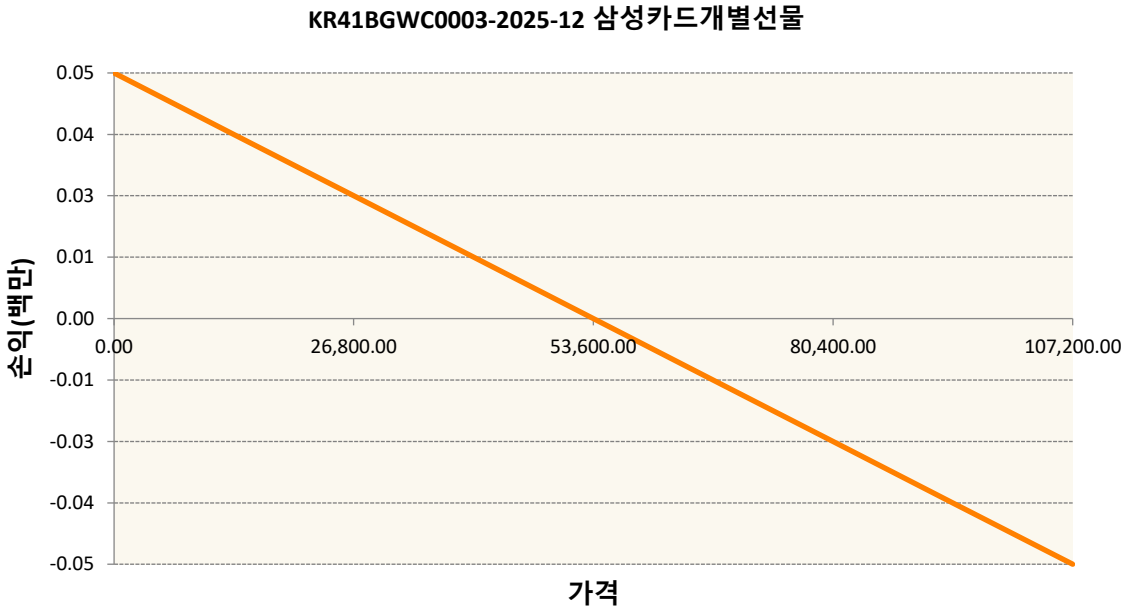
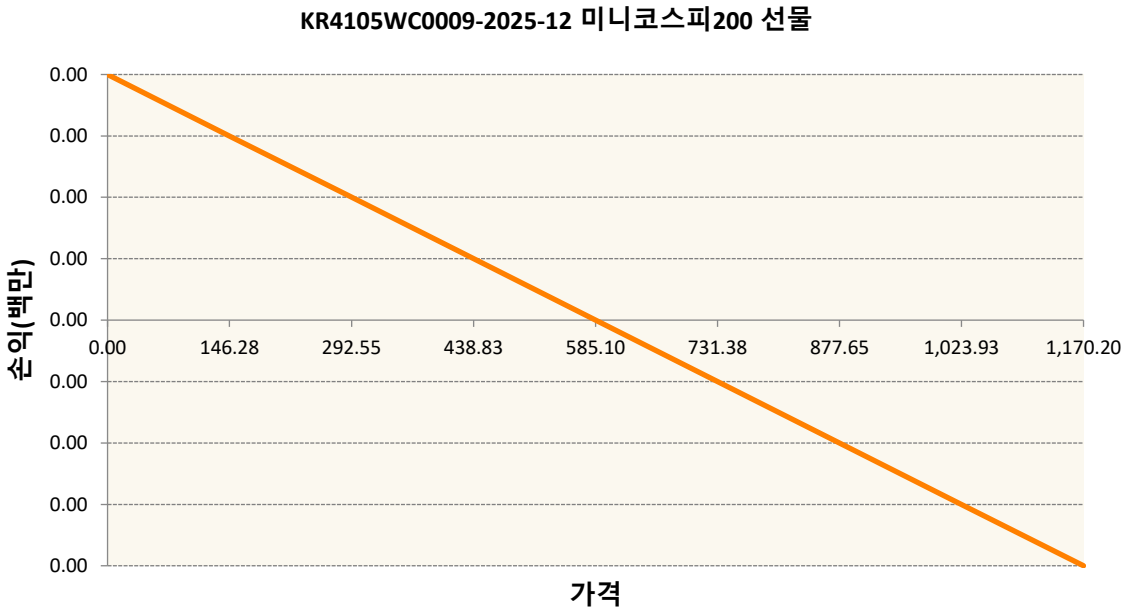
## 에쿼티알파일반사모혼합자산

### 1. 계약금액

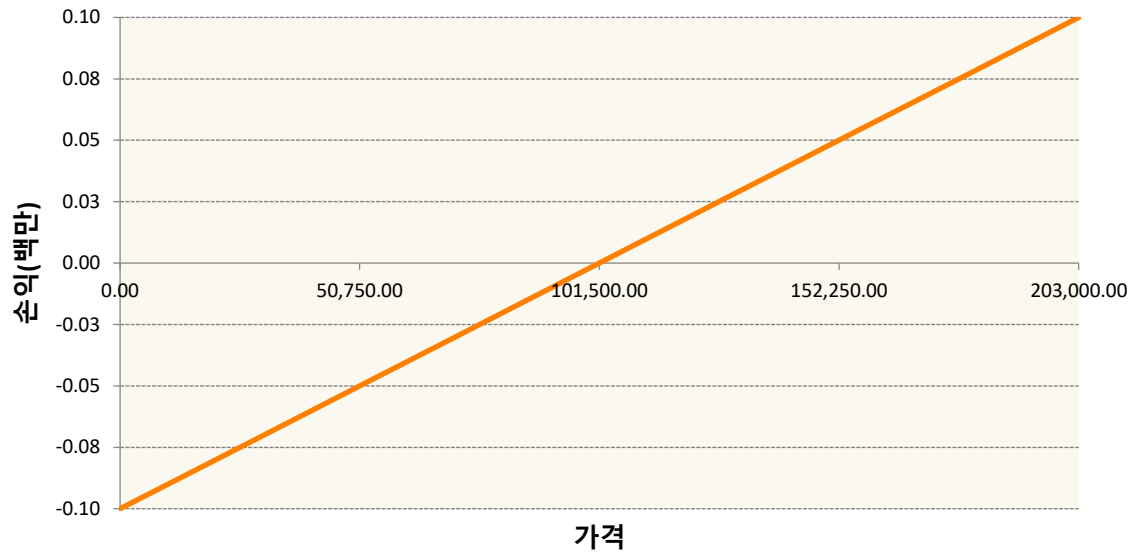
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 13    | 896   | -883      | 장내 |

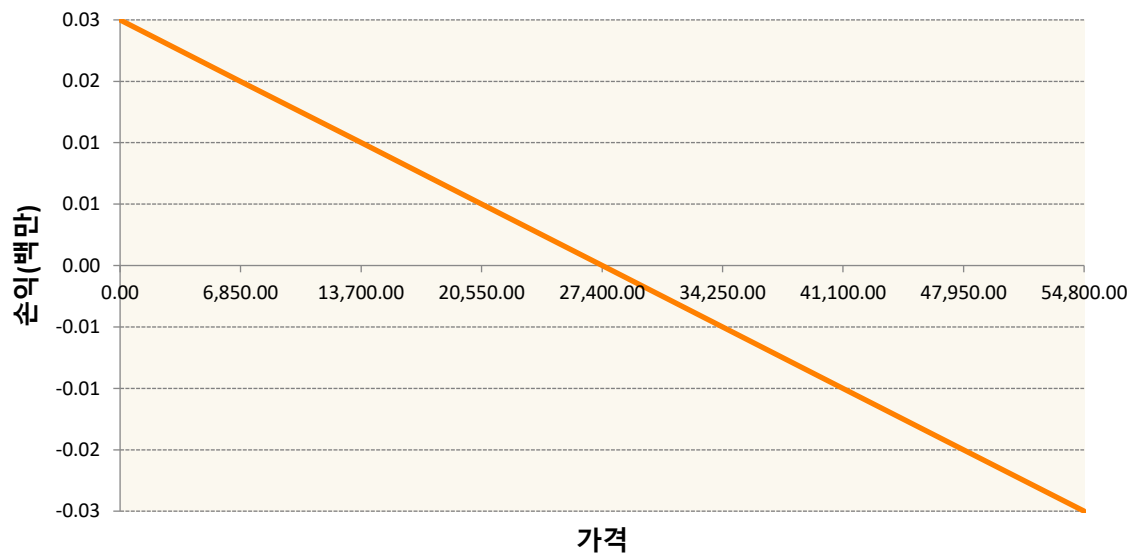
### 2. 만기시점의 손익구조



KR41C0WC0008-2025-12 OCI개별선물



KR41CBWC0007-2025-12 한화솔루션개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |                     |        |     |       |        |        |
|--------------|-----------|---------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
| KR4105WC0009 |           | 2025-12 미니코스피200 선물 |        |     |       |        | 14     |
|              | 기초자산의 변동성 |                     |        |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67%             | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | 14        | 14                  | 14     | 14  | 14    | 14     | 14     |
| -5.33%       | 9         | 9                   | 9      | 9   | 9     | 9      | 9      |
| -2.67%       | 5         | 5                   | 5      | 5   | 5     | 5      | 5      |
| 0%           | 0         | 0                   | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | -5        | -5                  | -5     | -5  | -5    | -5     | -5     |
| 5.33%        | -9        | -9                  | -9     | -9  | -9    | -9     | -9     |
| 8.00%        | -14       | -14                 | -14    | -14 | -14   | -14    | -14    |
| KR41BGWC0003 |           | 2025-12 삼성카드개별선물    |        |     |       |        | 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     |
| KR41C0WC0008 2025-12 OCI개별선물 |         |         |        |    |       |        | 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%    | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| -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%     | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |
| 8.00%     | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |

|                                |  |  |  |  |  |  |   |
|--------------------------------|--|--|--|--|--|--|---|
| KR41CBWC0007 2025-12 한화솔루션개별선물 |  |  |  |  |  |  | 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%    | 1       | 1       | 1      | 1  | 1     | 1      | 1      |
| -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%     | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |
| 8.00%     | -1      | -1      | -1     | -1 | -1    | -1     | -1     |

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

(단위:백만원)

20

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

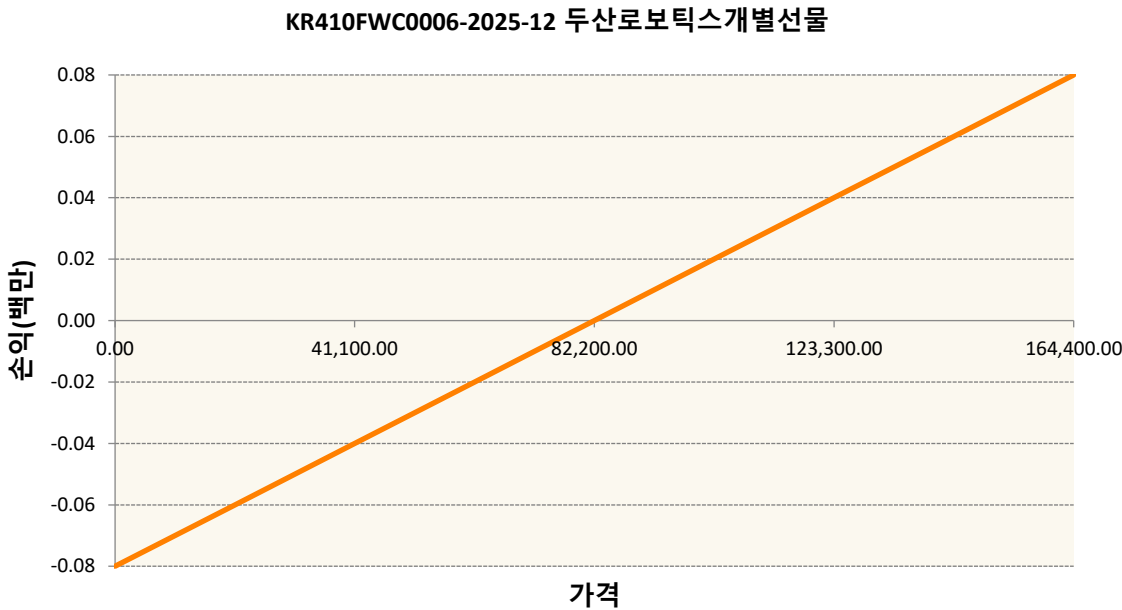
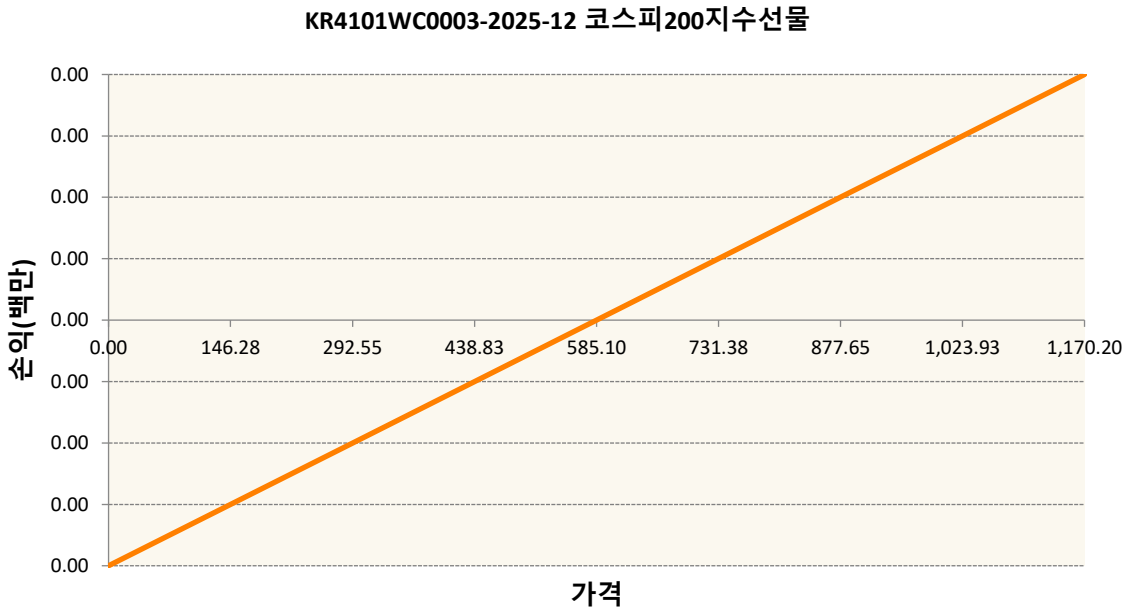
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

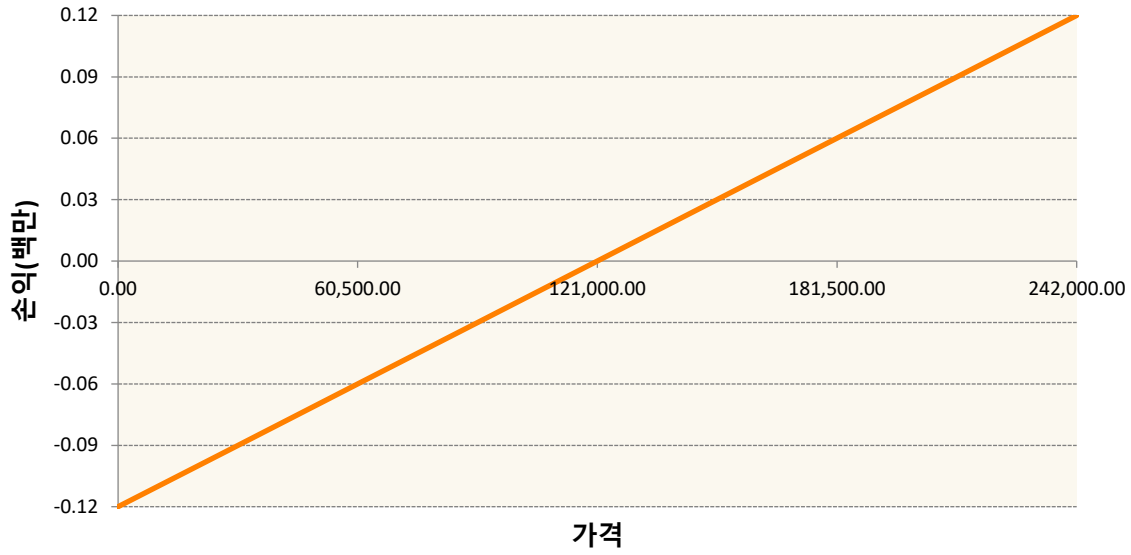
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 286    | 0     | 286       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 11,621 | 0     | 11,621    | 장내 |

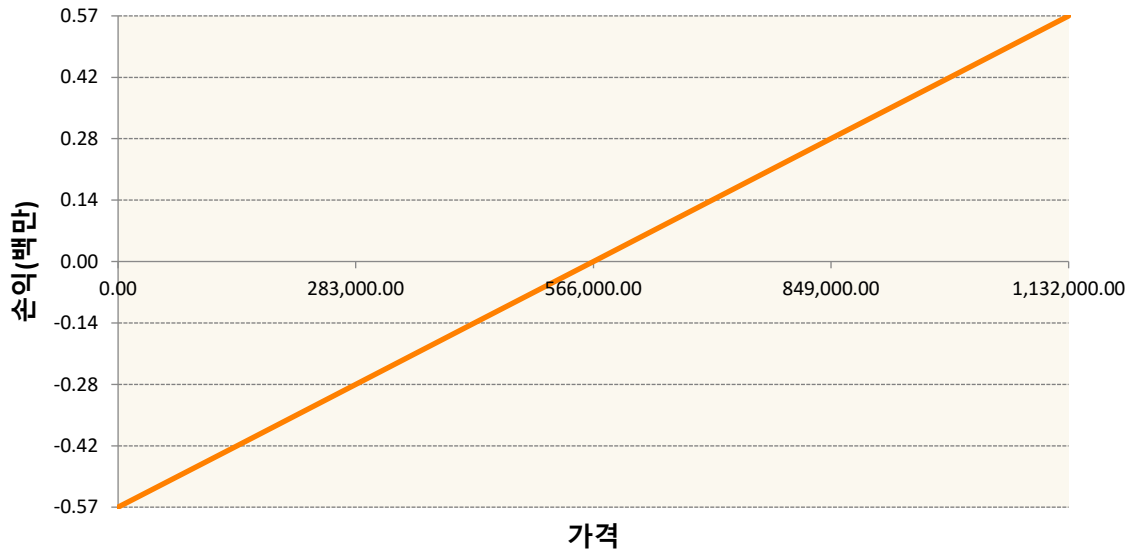
2. 만기시점의 손익구조



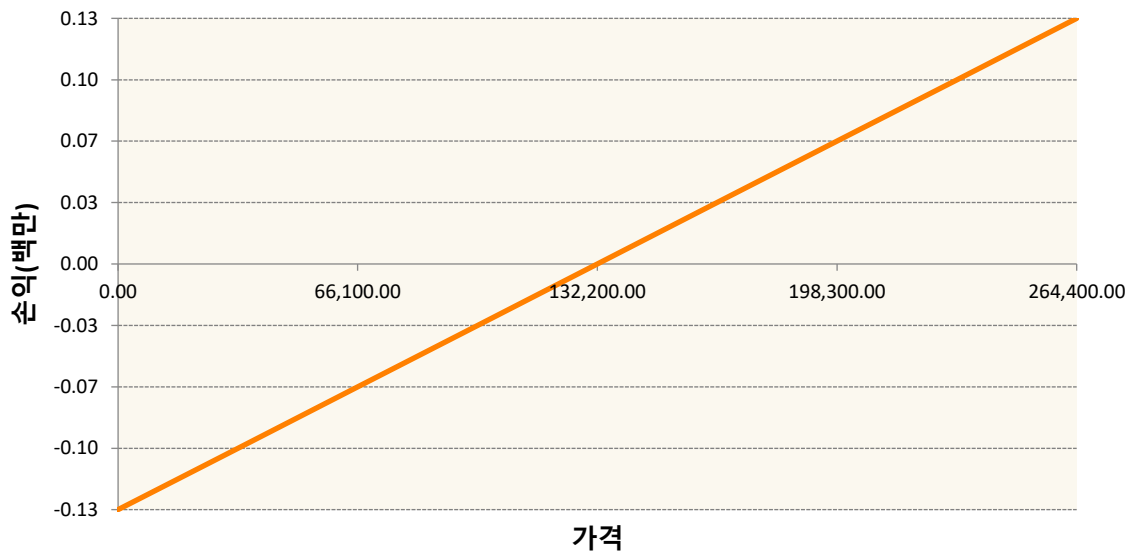
KR410ZWC0002-2025-12 한미반도체개별선물



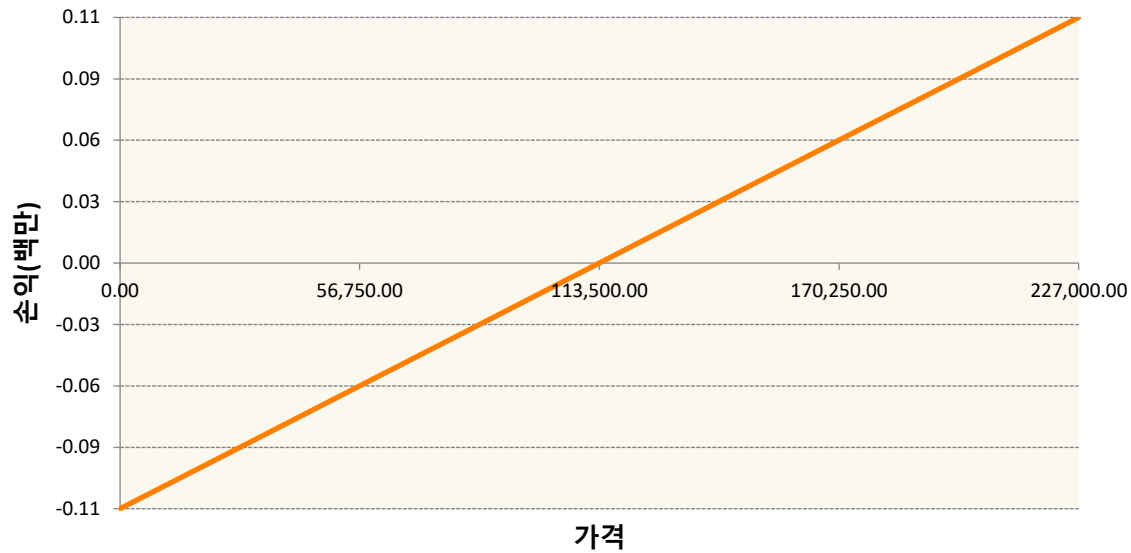
KR4150WC0003-2025-12 SK하이닉스개별선물



KR41FMWC0001-2025-12 엘앤에프개별선물



# KR4AEJ610004-2026-01 SKC개별선물



## 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4101WC0003 2025-12 코스피200지수선물 |         |         |        |      |       |        |        | 843  |
|---------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|------|
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |      |       |        |        |      |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |      |
| -8.00%                          | -843    | -843    | -843   | -843 | -843  | -843   | -843   | -843 |
| -5.33%                          | -562    | -562    | -562   | -562 | -562  | -562   | -562   | -562 |
| -2.67%                          | -281    | -281    | -281   | -281 | -281  | -281   | -281   | -281 |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      | 0    |
| 2.67%                           | 281     | 281     | 281    | 281  | 281   | 281    | 281    | 281  |
| 5.33%                           | 562     | 562     | 562    | 562  | 562   | 562    | 562    | 562  |
| 8.00%                           | 843     | 843     | 843    | 843  | 843   | 843    | 843    | 843  |
| KR410ZWC0002 2025-12 한미반도체개별선물  |         |         |        |      |       |        |        | 6    |
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |      |       |        |        |      |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |      |
| -8.00%                          | -6      | -6      | -6     | -6   | -6    | -6     | -6     | -6   |
| -5.33%                          | -4      | -4      | -4     | -4   | -4    | -4     | -4     | -4   |
| -2.67%                          | -2      | -2      | -2     | -2   | -2    | -2     | -2     | -2   |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      | 0    |
| 2.67%                           | 2       | 2       | 2      | 2    | 2     | 2      | 2      | 2    |
| 5.33%                           | 4       | 4       | 4      | 4    | 4     | 4      | 4      | 4    |
| 8.00%                           | 6       | 6       | 6      | 6    | 6     | 6      | 6      | 6    |
| KR4150WC0003 2025-12 SK하이닉스개별선물 |         |         |        |      |       |        |        | 3    |
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |      |       |        |        |      |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |      |
| -8.00%                          | -3      | -3      | -3     | -3   | -3    | -3     | -3     | -3   |
| -5.33%                          | -2      | -2      | -2     | -2   | -2    | -2     | -2     | -2   |
| -2.67%                          | -1      | -1      | -1     | -1   | -1    | -1     | -1     | -1   |

|                               |         |         |        |     |       |        |        |
|-------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | 1       | 1       | 1      | 1   | 1     | 1      | 1      |
| 5.33%                         | 2       | 2       | 2      | 2   | 2     | 2      | 2      |
| 8.00%                         | 3       | 3       | 3      | 3   | 3     | 3      | 3      |
| KR41FMWC0001 2025-12 엘앤에프개별선물 |         |         |        |     |       |        | 37     |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | -37     | -37     | -37    | -37 | -37   | -37    | -37    |
| -5.33%                        | -25     | -25     | -25    | -25 | -25   | -25    | -25    |
| -2.67%                        | -12     | -12     | -12    | -12 | -12   | -12    | -12    |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | 12      | 12      | 12     | 12  | 12    | 12     | 12     |
| 5.33%                         | 25      | 25      | 25     | 25  | 25    | 25     | 25     |
| 8.00%                         | 37      | 37      | 37     | 37  | 37    | 37     | 37     |
| KR4AEJ610004 2026-01 SKC개별선물  |         |         |        |     |       |        | 23     |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | -23     | -23     | -23    | -23 | -23   | -23    | -23    |
| -5.33%                        | -15     | -15     | -15    | -15 | -15   | -15    | -15    |
| -2.67%                        | -8      | -8      | -8     | -8  | -8    | -8     | -8     |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | 8       | 8       | 8      | 8   | 8     | 8      | 8      |
| 5.33%                         | 15      | 15      | 15     | 15  | 15    | 15     | 15     |
| 8.00%                         | 23      | 23      | 23     | 23  | 23    | 23     | 23     |

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

(단위:백만원)

1,177

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

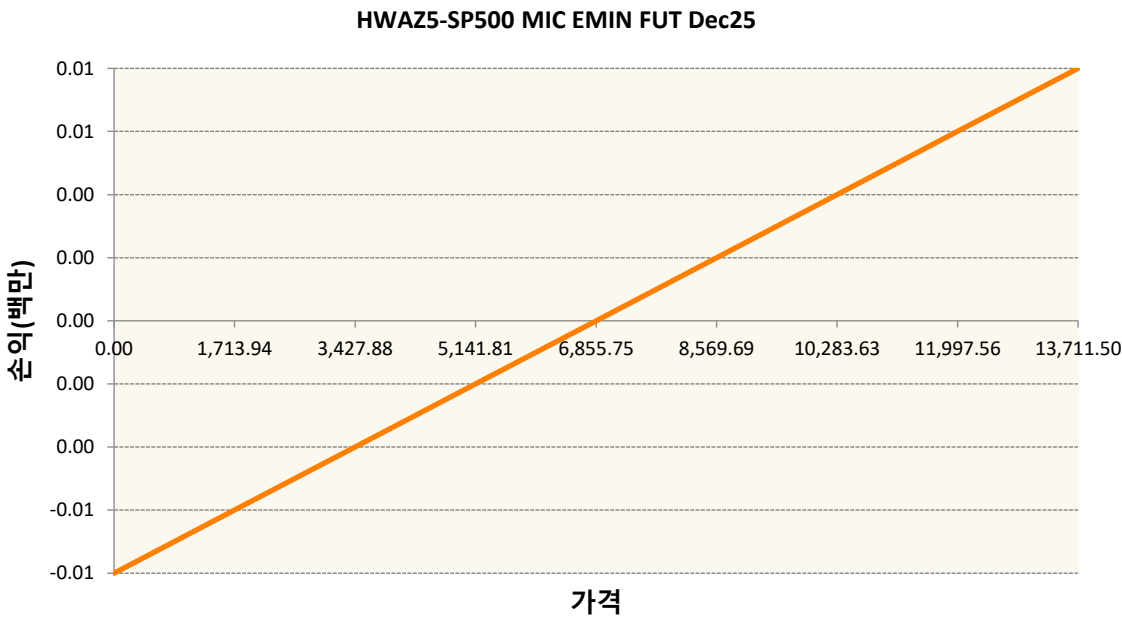
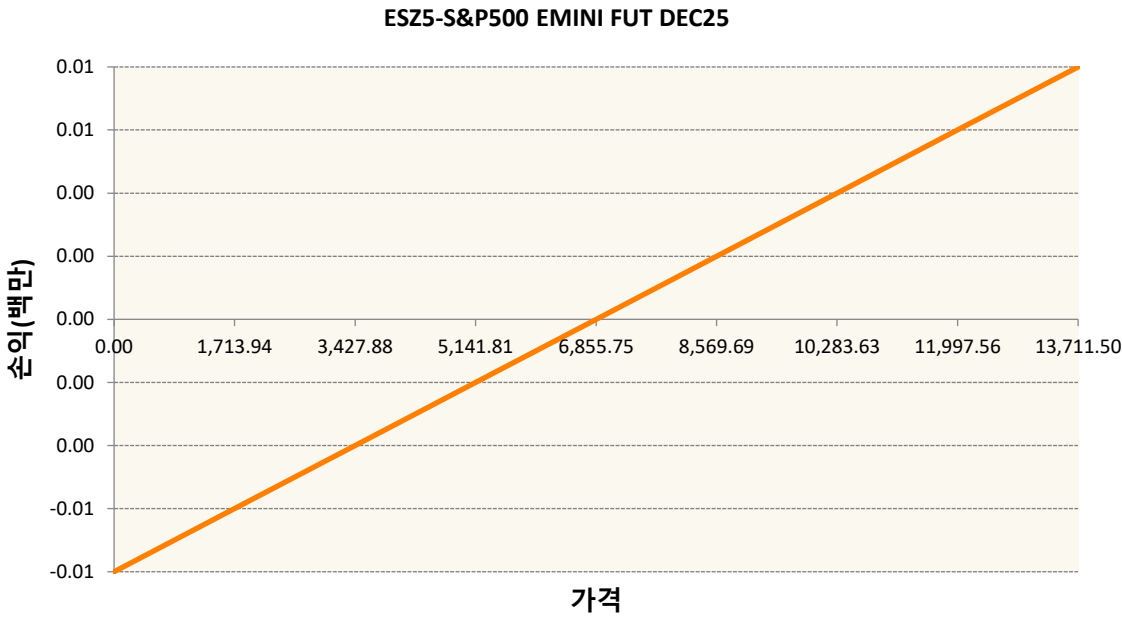
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 44,610 | 0     | 44,610    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,048  | 0     | 1,048     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESZ5                      | S&P500 EMINI FUT DEC25   | 3,569    |
| HWAZ5                     | SP500 MIC EMIN FUT Dec25 | 84       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 5,270    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

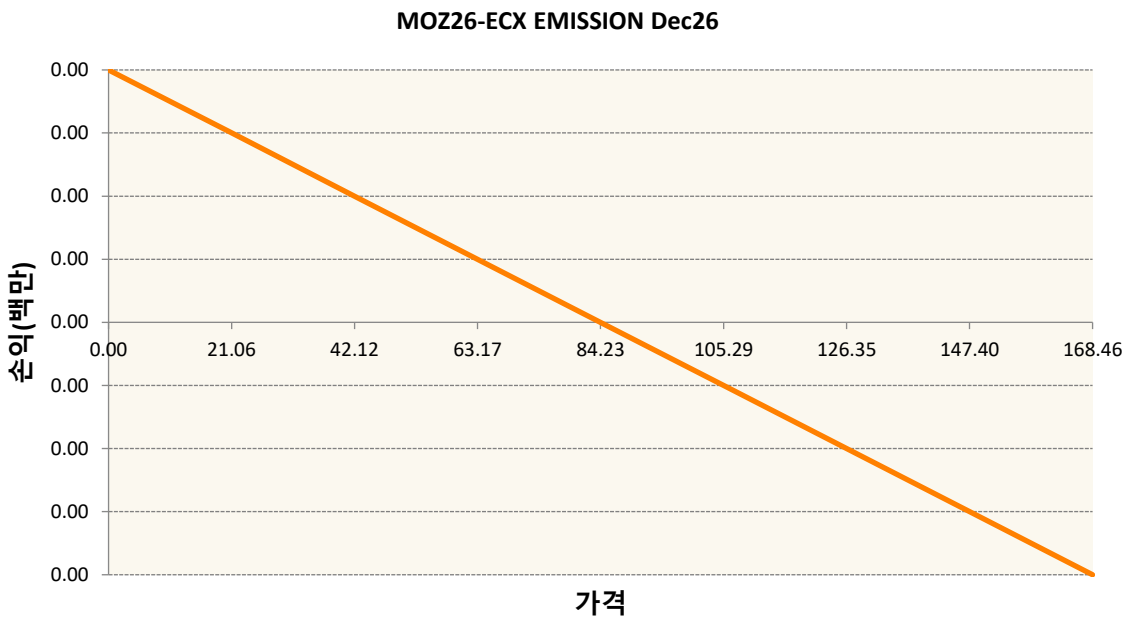
## SOL유럽탄소배출권선물인버스ICE특별자산상

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 |      |      | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 |      |      | 0     | 1,819 | -1,819    |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 1,070 | -1,070    | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                              |     |
|------------------------------|-----|
| FXW213FBTC KRW/EUR 23-12-25E | 86  |
| MOZ26 ECX EMISSION Dec26     | 146 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 244 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

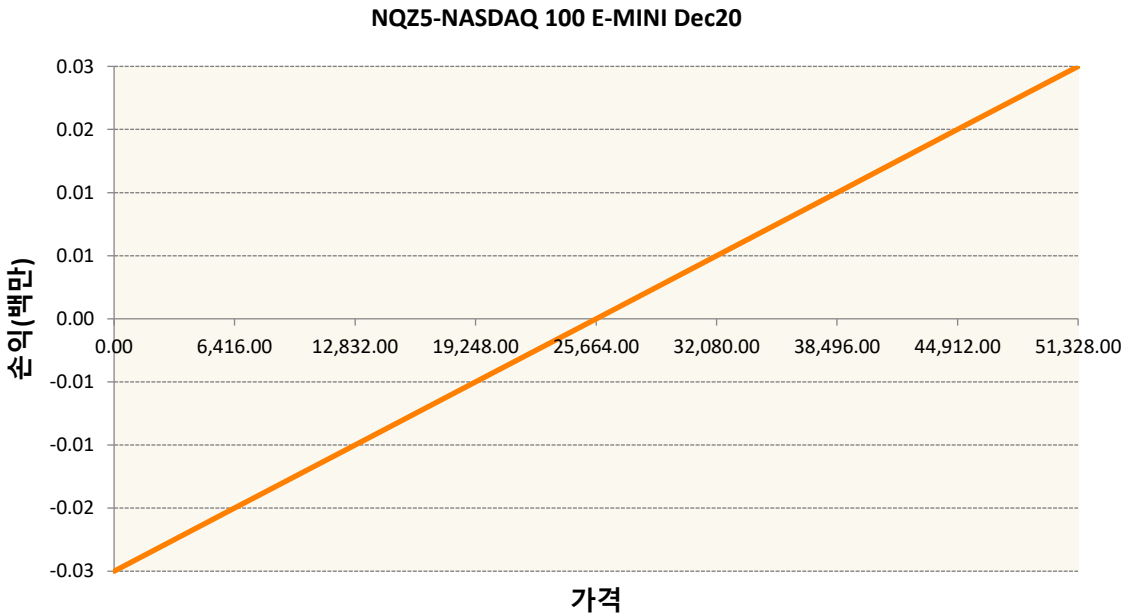
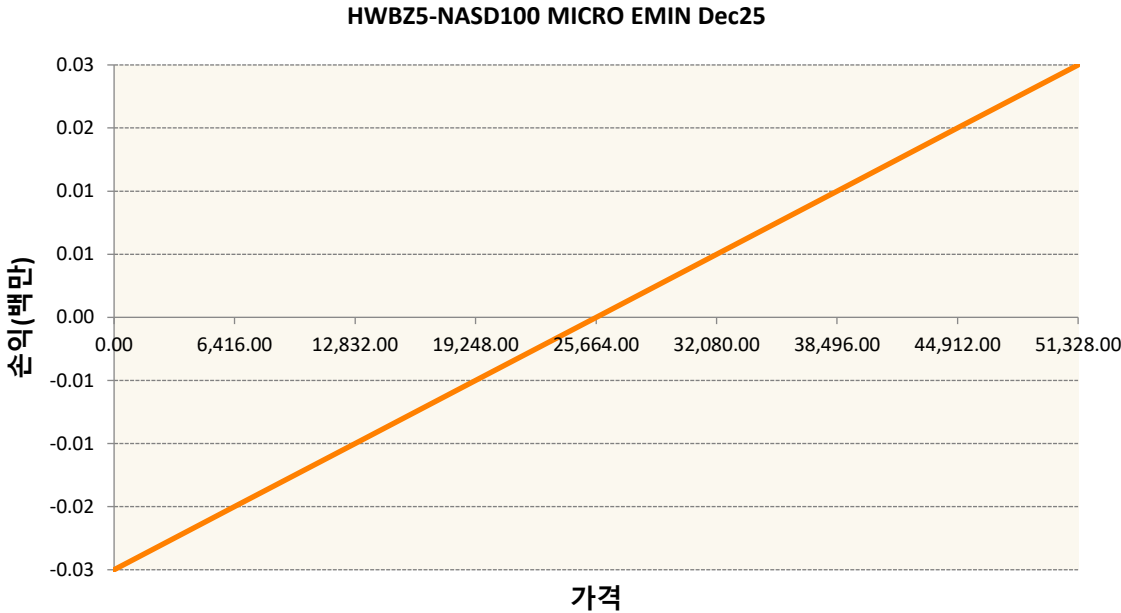
## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 20,884 | 0     | 20,884    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 787    | 0     | 787       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBZ5                     | NASD100 MICRO EMIN Dec25 |  | 63       |
| NQZ5                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 1,671    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 1,972    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

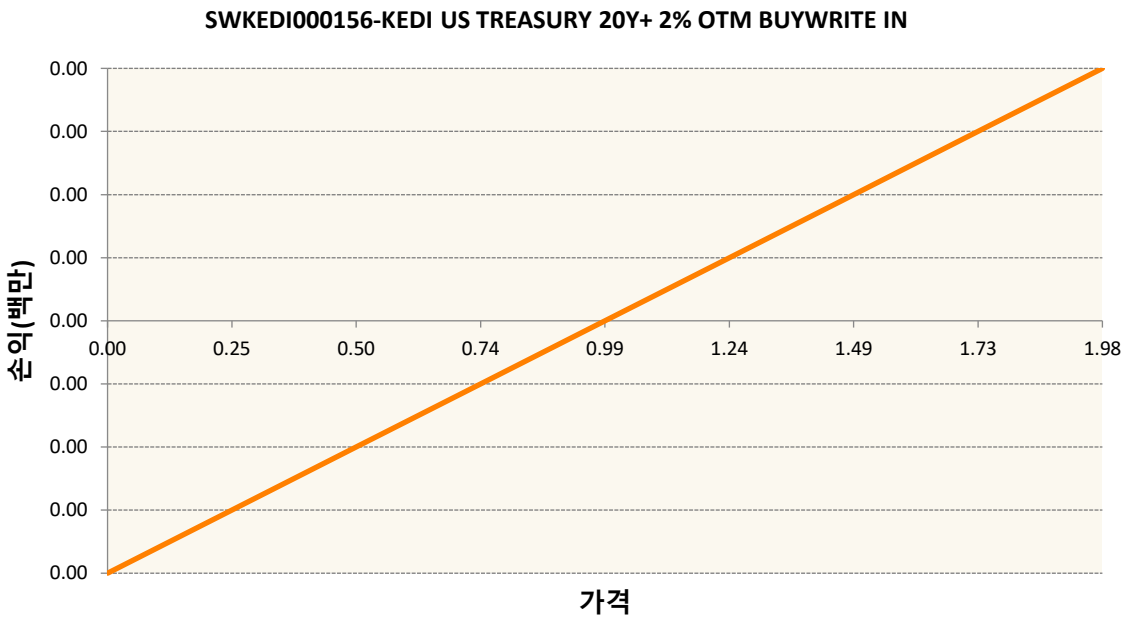
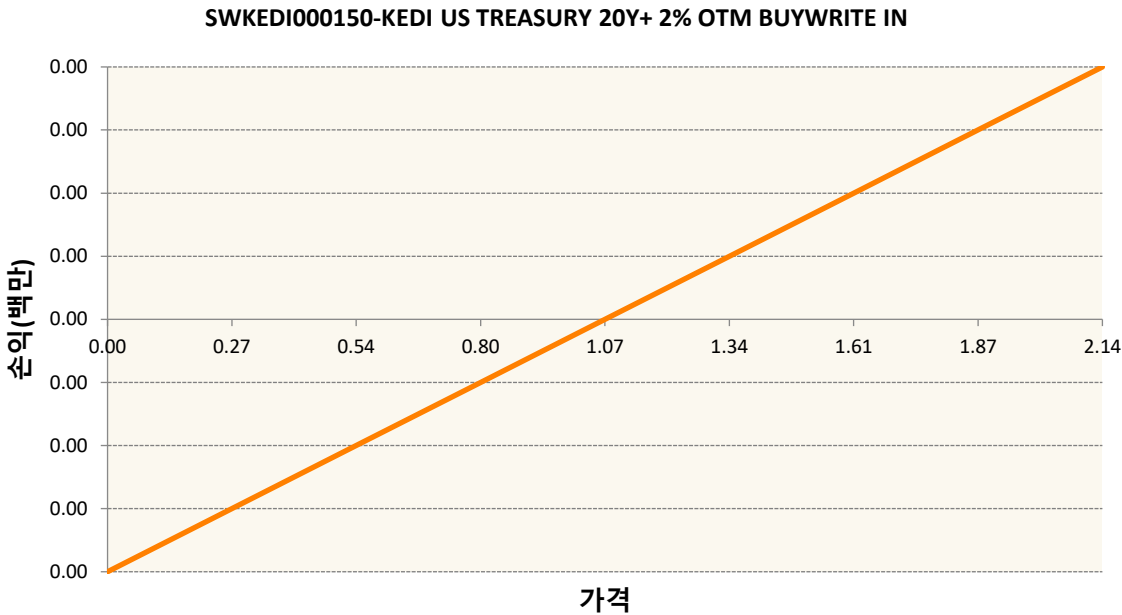
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

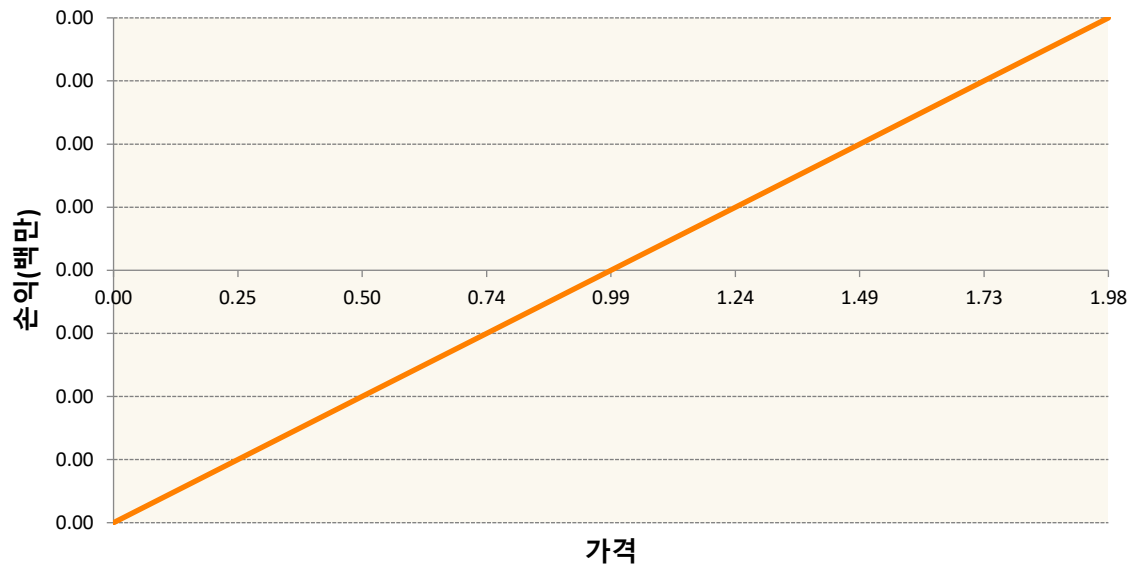
(단위:백만원)

| 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 |

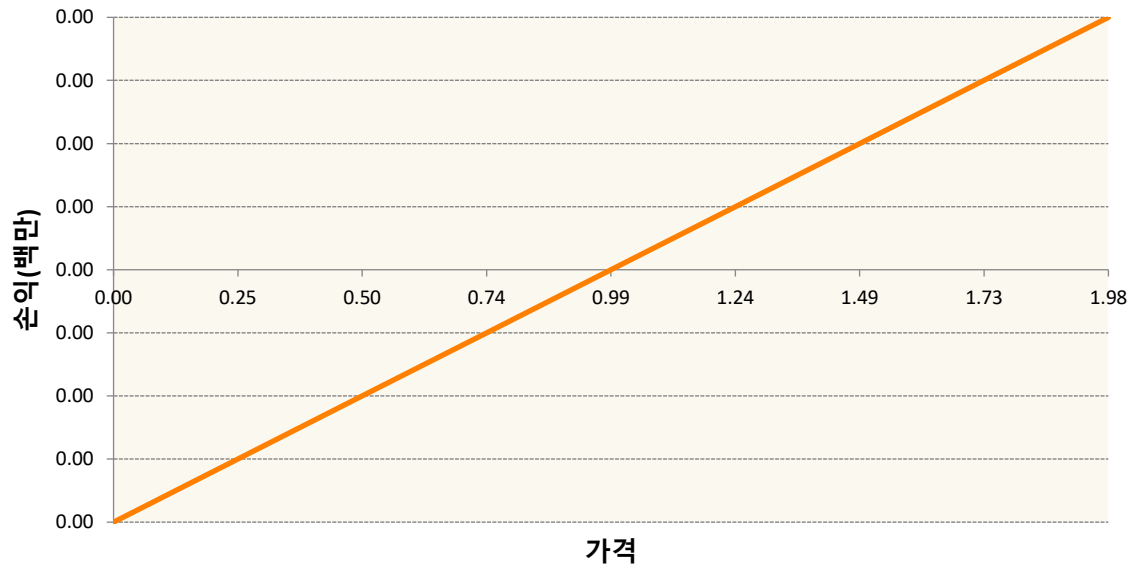
### 2. 만기시점의 손익구조



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 | 8,198  |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 10,107 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 8,460  |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | 3,724  |

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

(단위:백만원)

14,045

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

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   | 2,246 | 0     | 2,246     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 66 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2025-12-10 |
| 기준일 | 2025-12-09 |

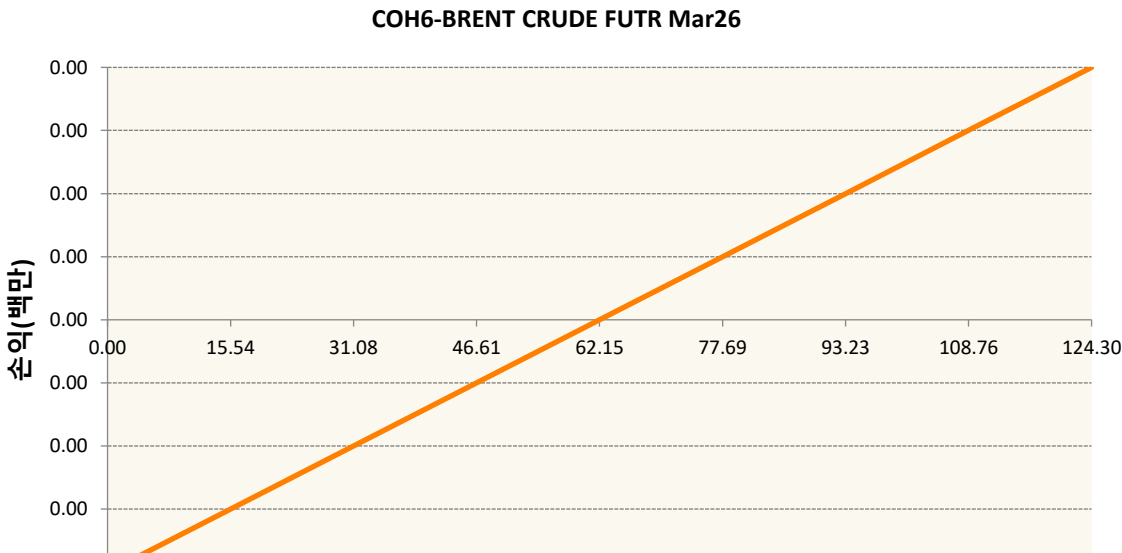
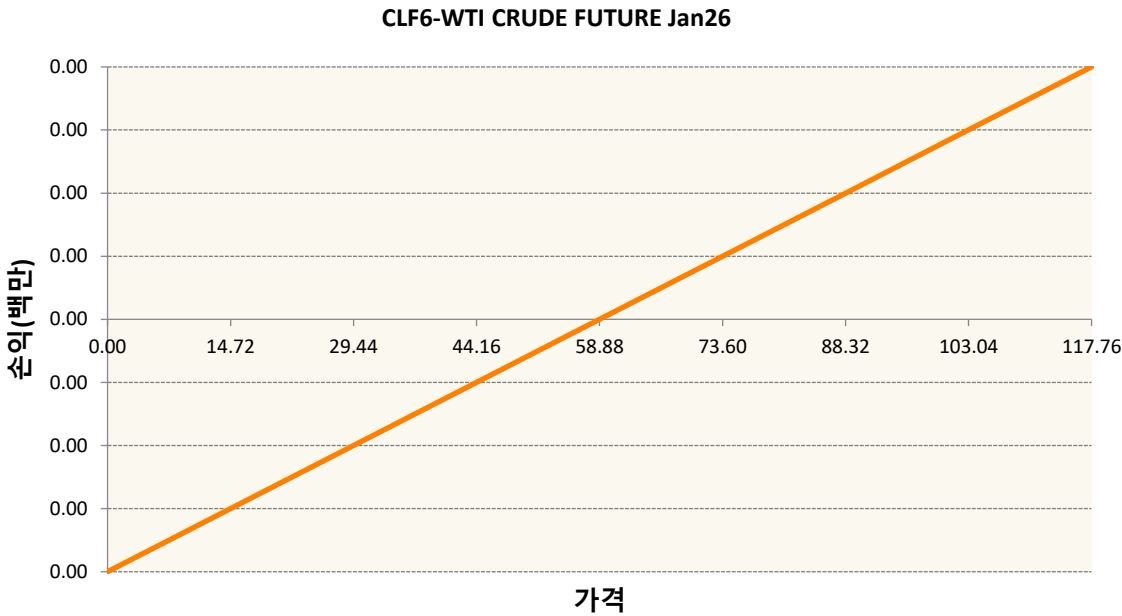
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

### 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   | 15    | 0     | 15        | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 353   | 0     | 353       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 182   | 0     | 182       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 132   | -132      | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

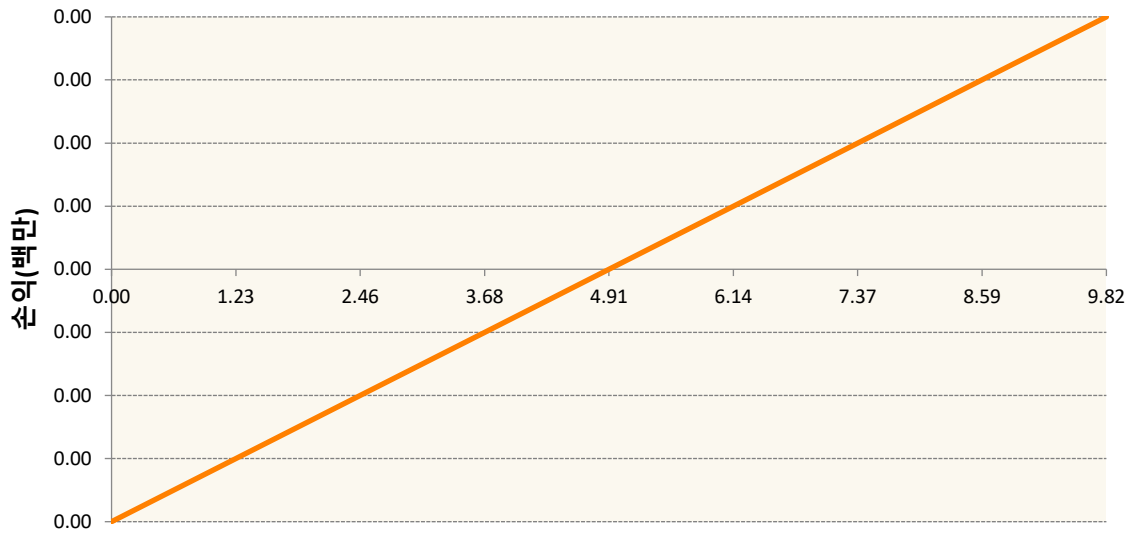






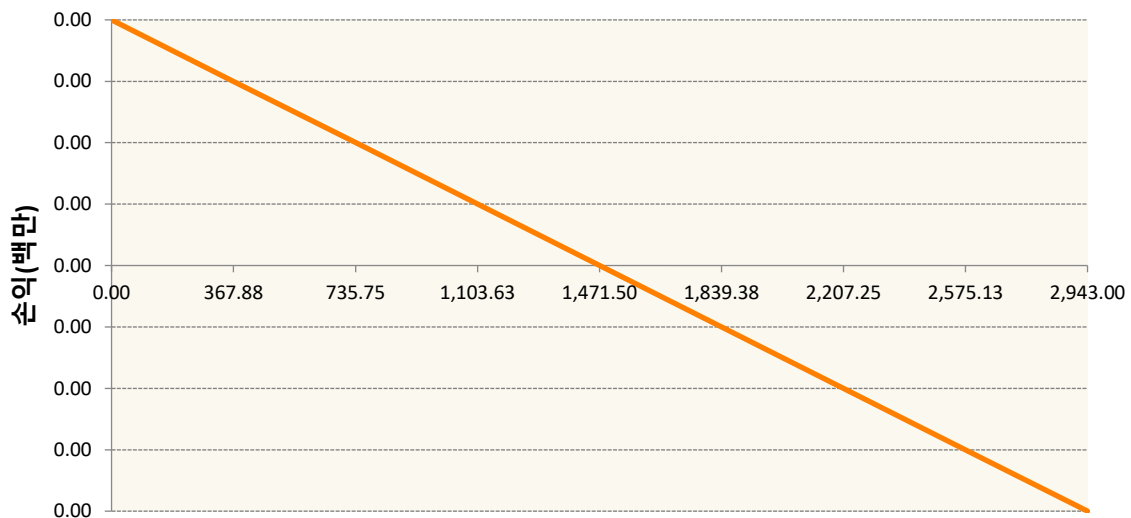
가격

EOF6-E-MINI NATURAL GAS Jan26



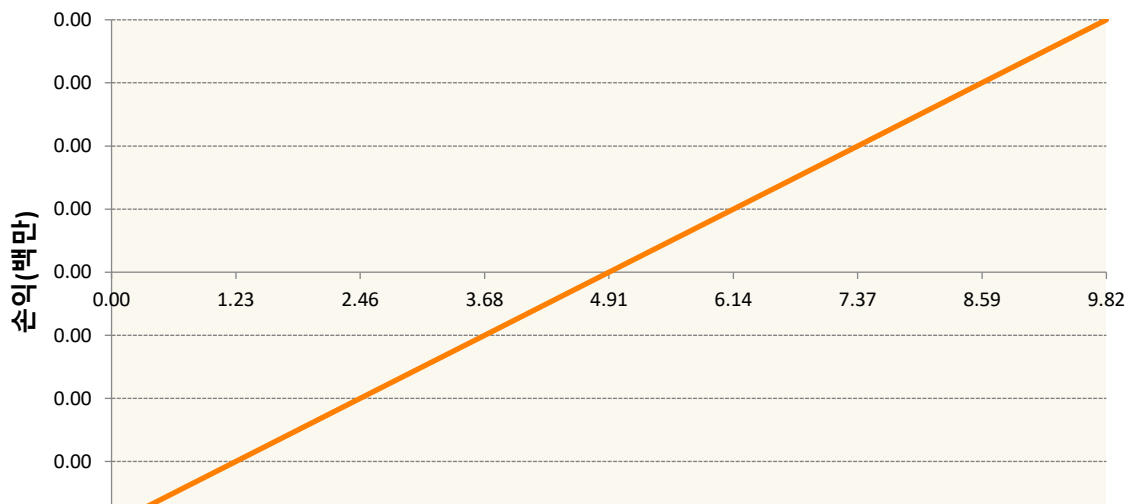
가격

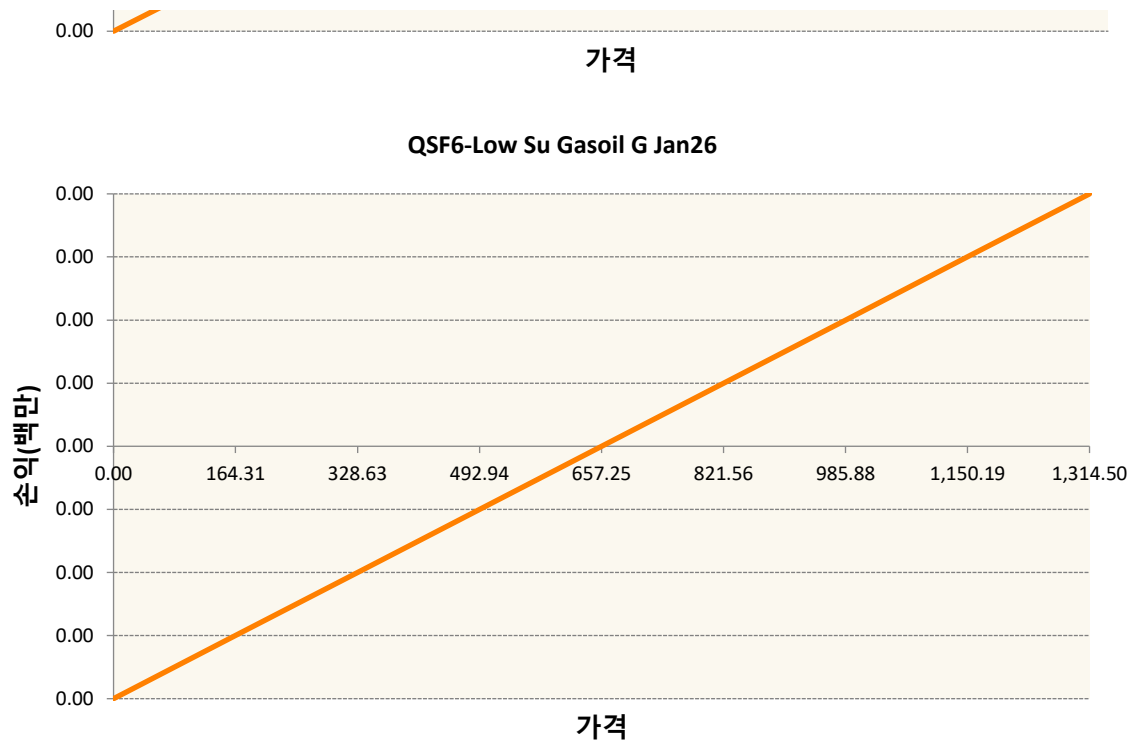
KR4175WC0004-2025-12 달러선물



가격

NGF26-NATURAL GAS FUTR Jan26





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                          |    |
|------------|--------------------------|----|
| CLF6       | WTI CRUDE FUTURE Jan26   | 7  |
| COH6       | BRENT CRUDE FUTR Mar26   | 15 |
| EOF6       | E-MINI NATURAL GAS Jan26 | 3  |
| KR4175WC01 | 2025-12 달러선물             | 11 |
| NGF26      | NATURAL GAS FUTR Jan26   | 11 |
| QSF6       | Low Su Gasoil G Jan26    | 7  |

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

(단위:백만원)

94