

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

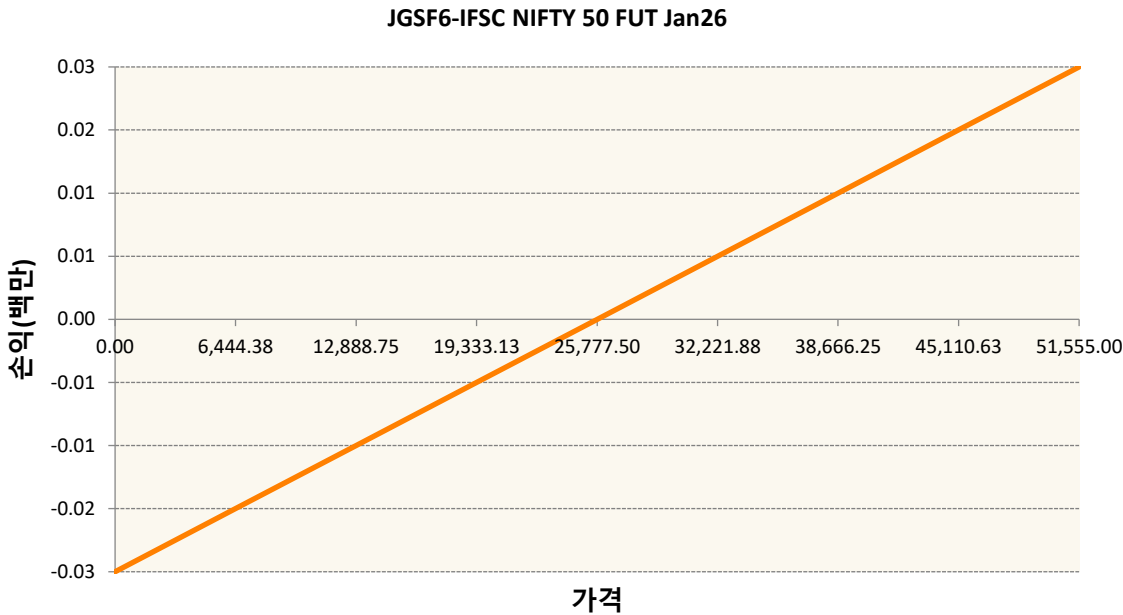
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 663   | 0     | 663       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |    |
|-------|-------------------------|----|
| JGSF6 | IFSC NIFTY 50 FUT Jan26 | 53 |
|-------|-------------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 33 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

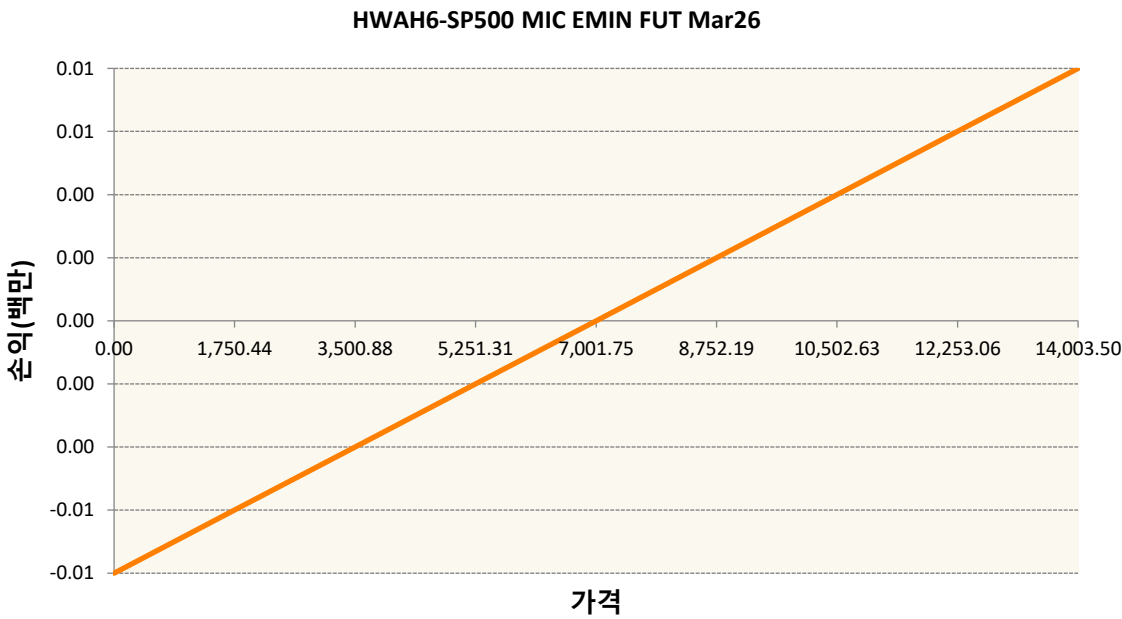
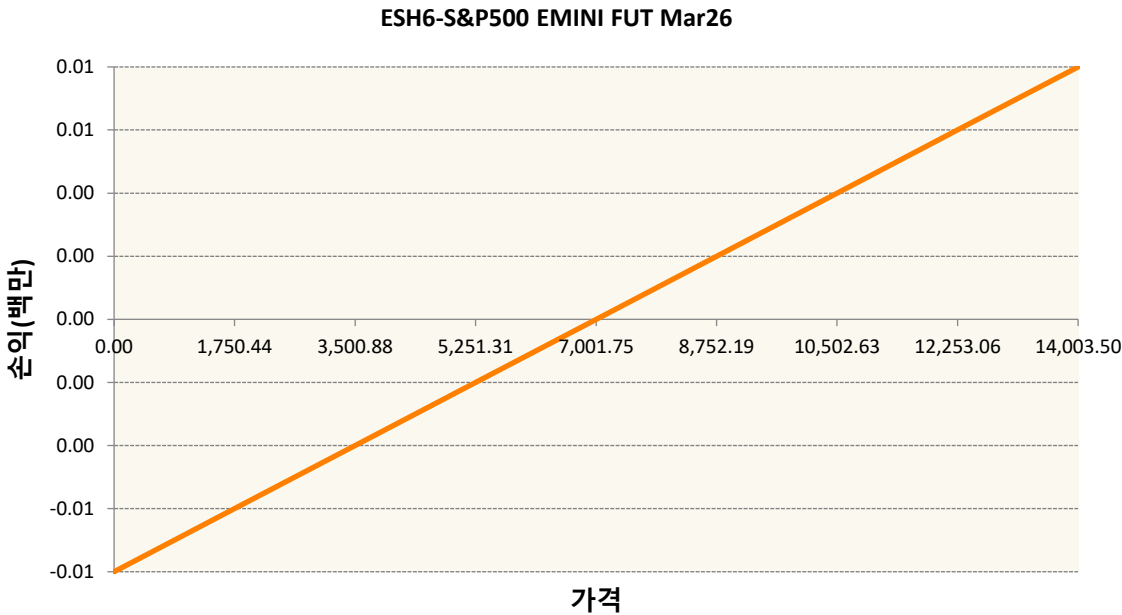
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 259   | 0     | 259       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 518   | 0     | 518       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 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) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 55       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

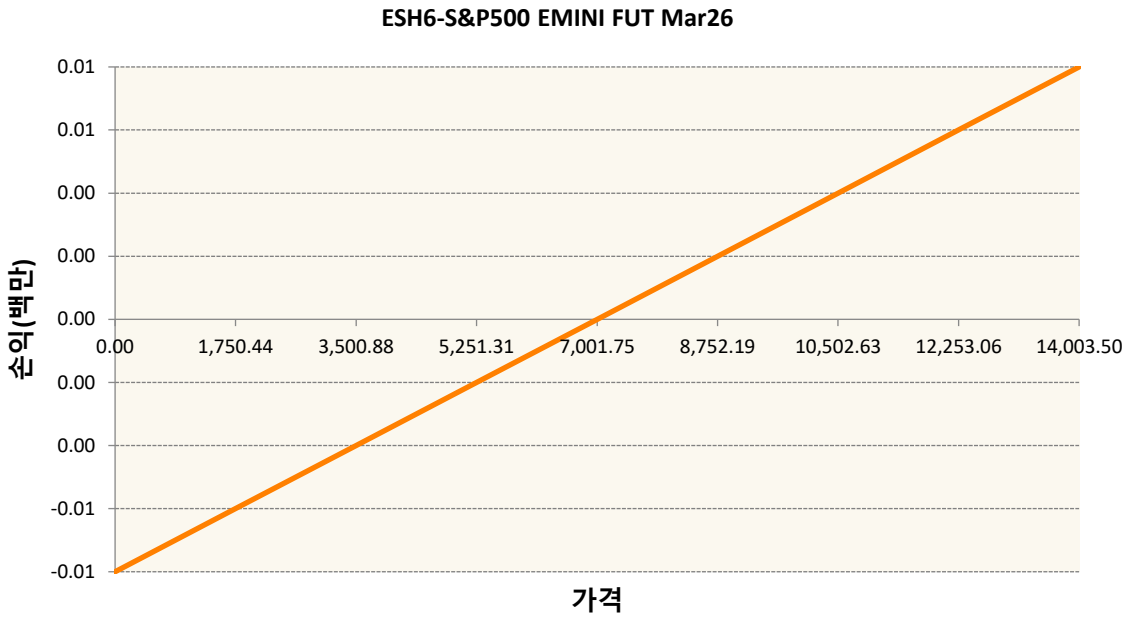
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,553 | 0     | 1,553     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| ESH6 | S&P500 EMINI FUT Mar26 | 124 |
|------|------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 109 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

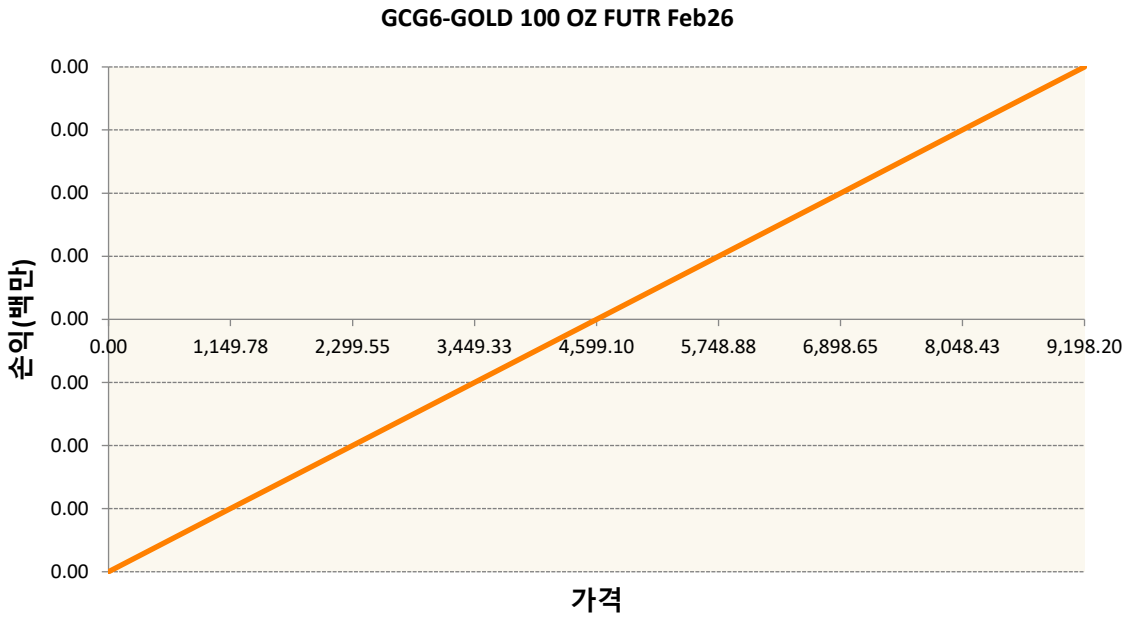
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 3,387 | 0     | 3,387     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| AOGLDUSC0 GLD US 01/16/26 C416 EQUITY | 1   |
| GCG6 GOLD 100 OZ FUTR Feb26           | 271 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 345 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

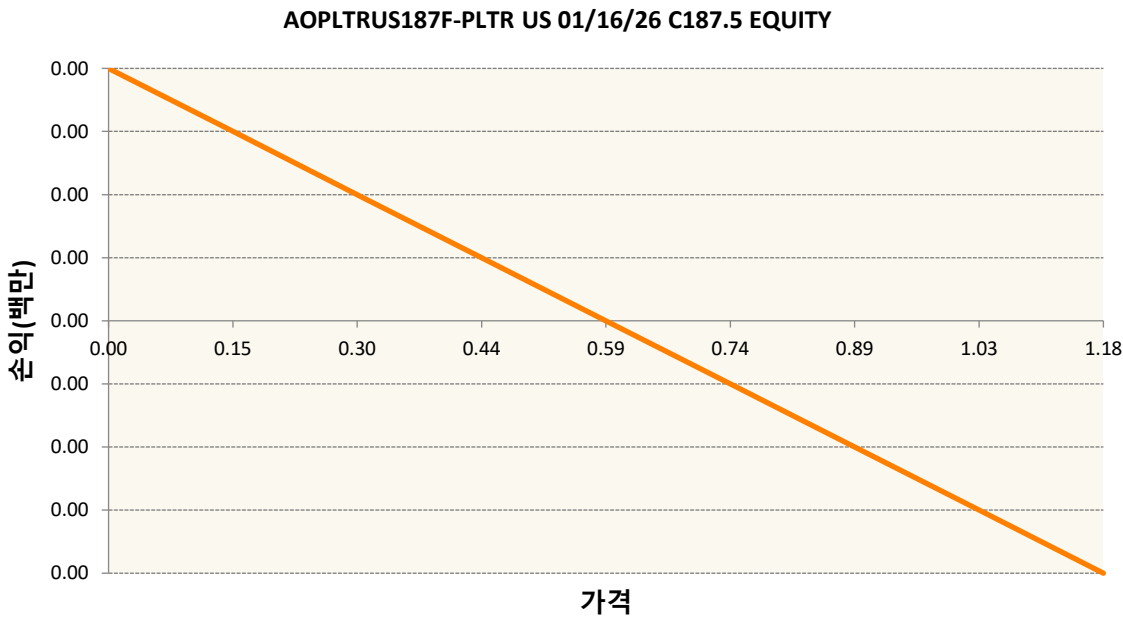
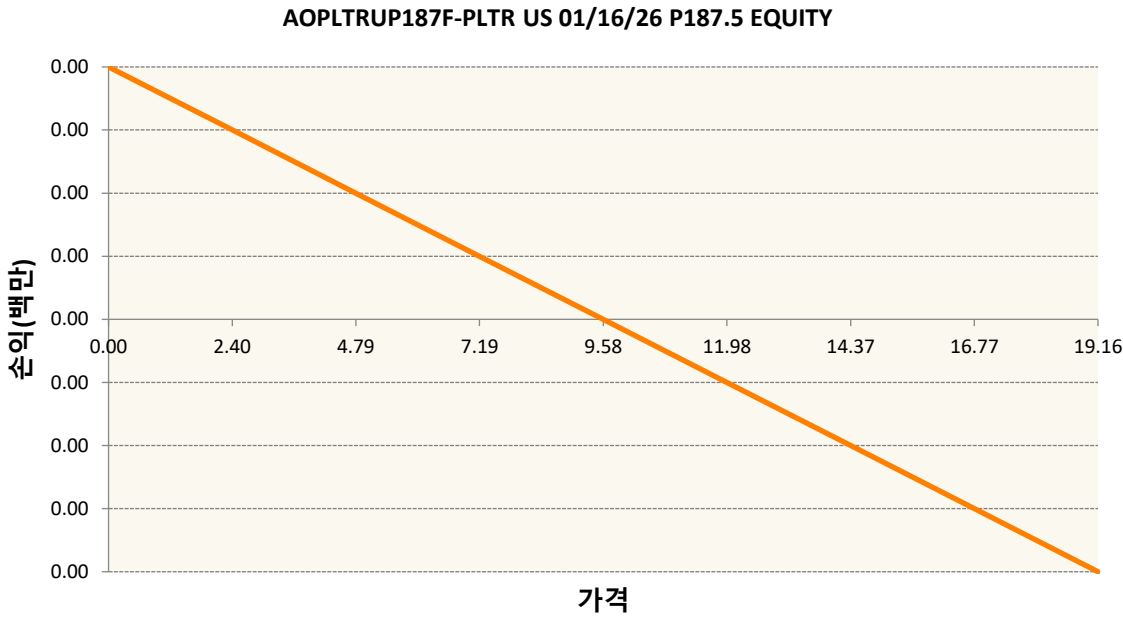
## SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 637   | -637      |    |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 631   | -631      |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                |  | (단위:백만원) |
|------------------------------------------|--|----------|
| AOPLTRUP1{PLTR US 01/16/26 P187.5 EQUITY |  | 51       |
| AOPLTRUPP{PLTR US 01/16/26 P185 EQUITY   |  | 2        |
| AOPLTRUS1{PLTR US 01/16/26 C187.5 EQUITY |  | 50       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 266      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

## 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)

AOTLTUSC8\TLT US 01/16/26 C88 EQUITY

10

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

(단위:백만원)

7

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

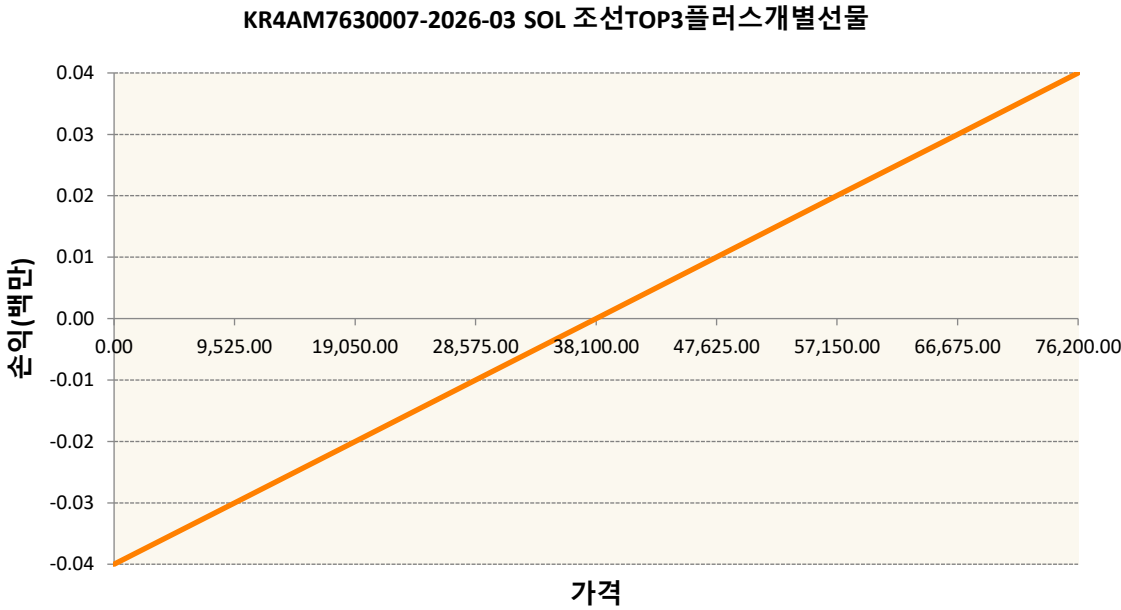
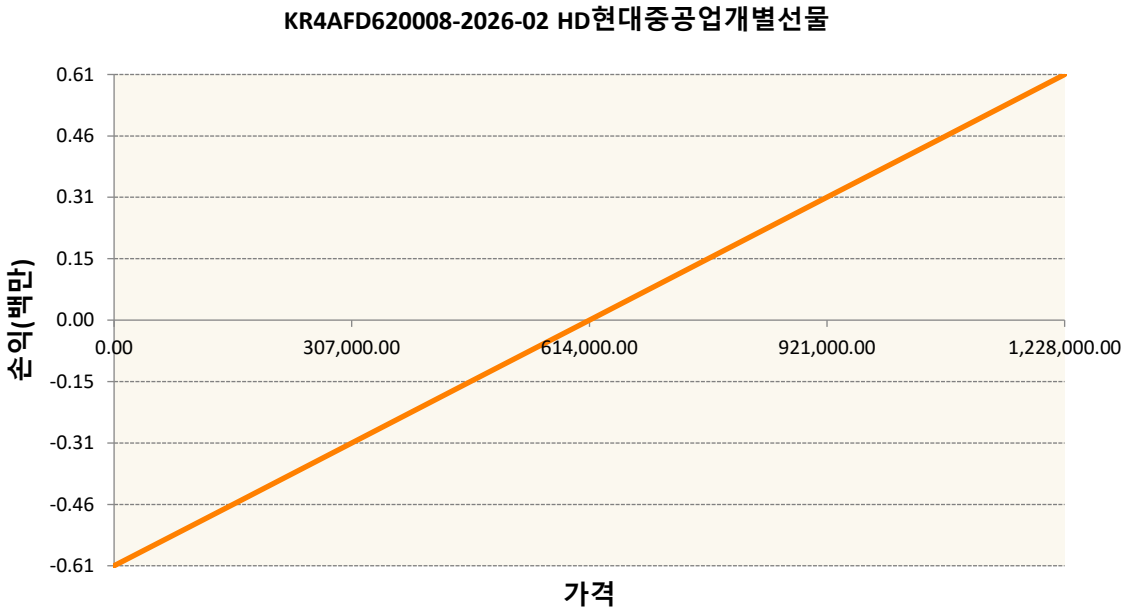
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 641   | -641      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 23,952 | 0     | 23,952    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



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

|              |           |         |                           |      |       |        |        |
|--------------|-----------|---------|---------------------------|------|-------|--------|--------|
| KR4AFD620008 |           |         | 2026-02 HD현대중공업개별선물       |      |       |        | 986    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                           |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%                    | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -986      | -986    | -986                      | -986 | -986  | -986   | -986   |
| -5.33%       | -657      | -657    | -657                      | -657 | -657  | -657   | -657   |
| -2.67%       | -329      | -329    | -329                      | -329 | -329  | -329   | -329   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                         | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 329       | 329     | 329                       | 329  | 329   | 329    | 329    |
| 5.33%        | 657       | 657     | 657                       | 657  | 657   | 657    | 657    |
| 8.00%        | 986       | 986     | 986                       | 986  | 986   | 986    | 986    |
| KR4AM7630007 |           |         | 2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물 |      |       |        | 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    |

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

1,759

공시일 2026-01-15

기준일 2026-01-14

## 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 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

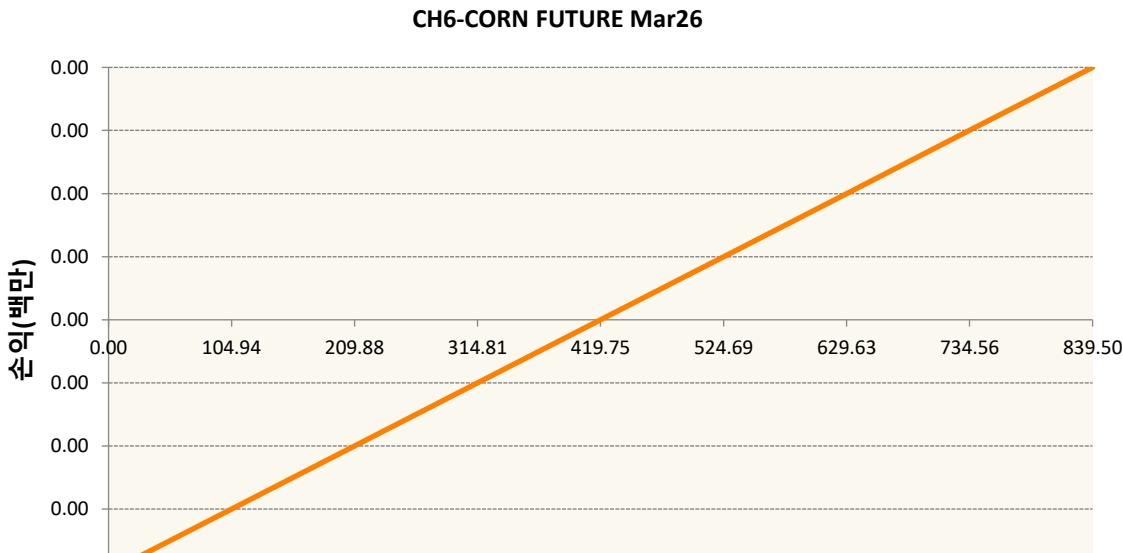
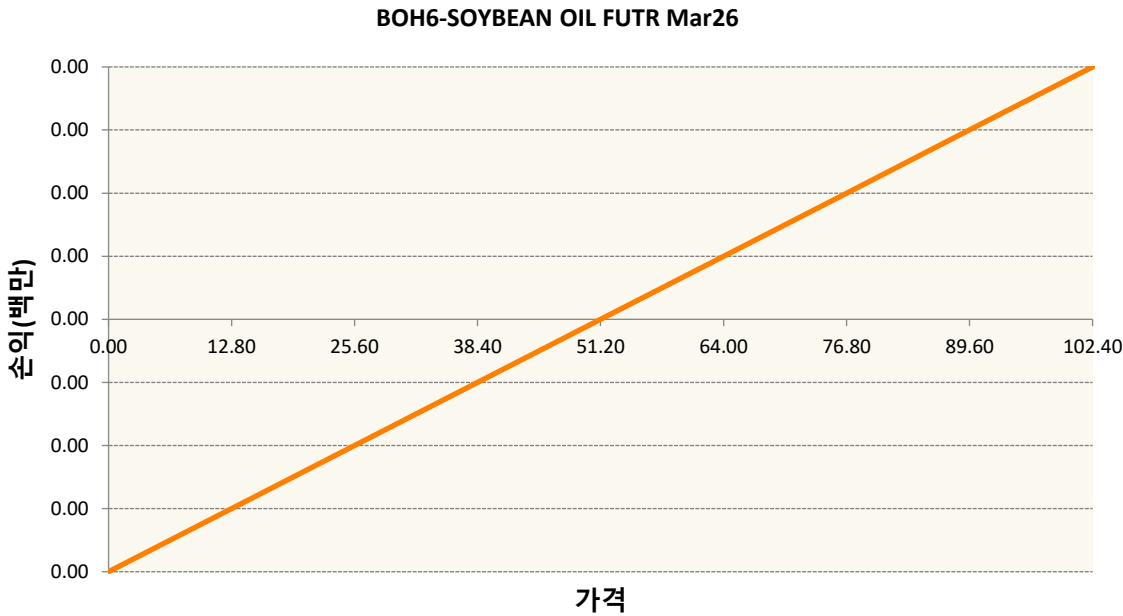
## 포커스농산물모(채권-파생형)

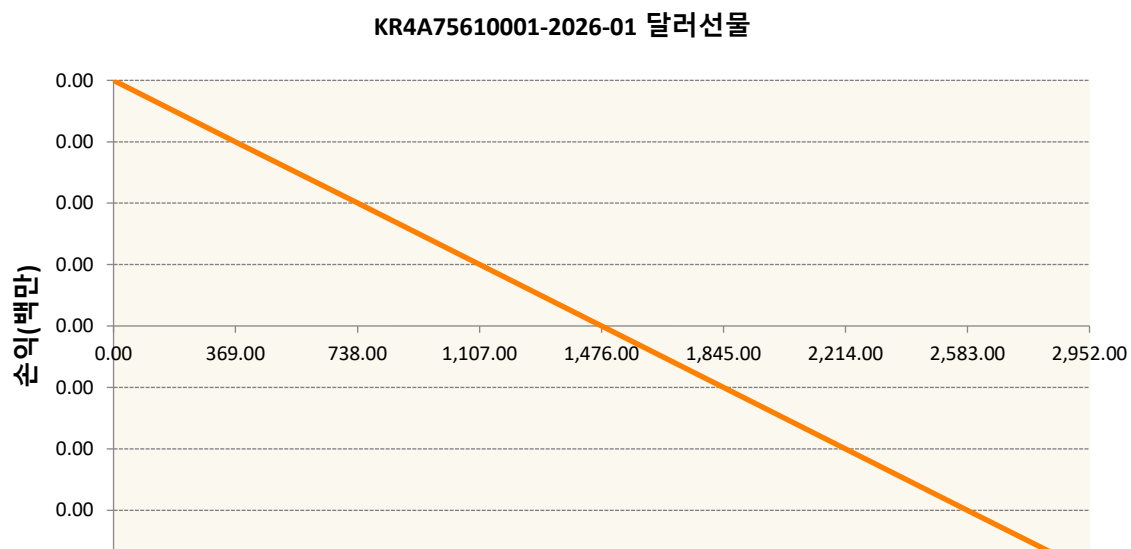
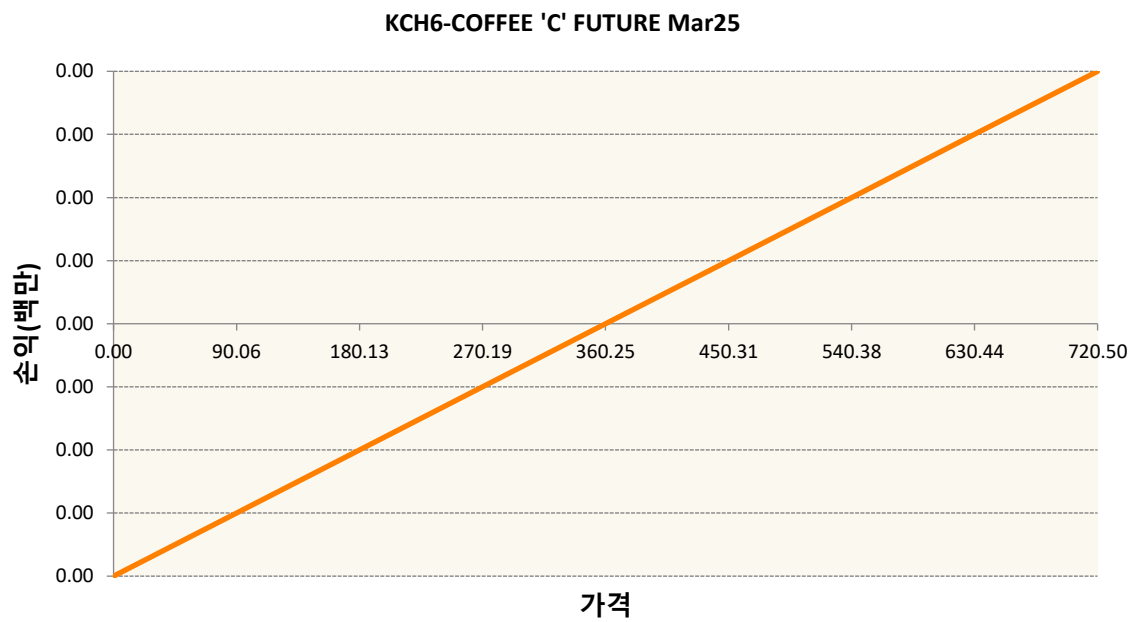
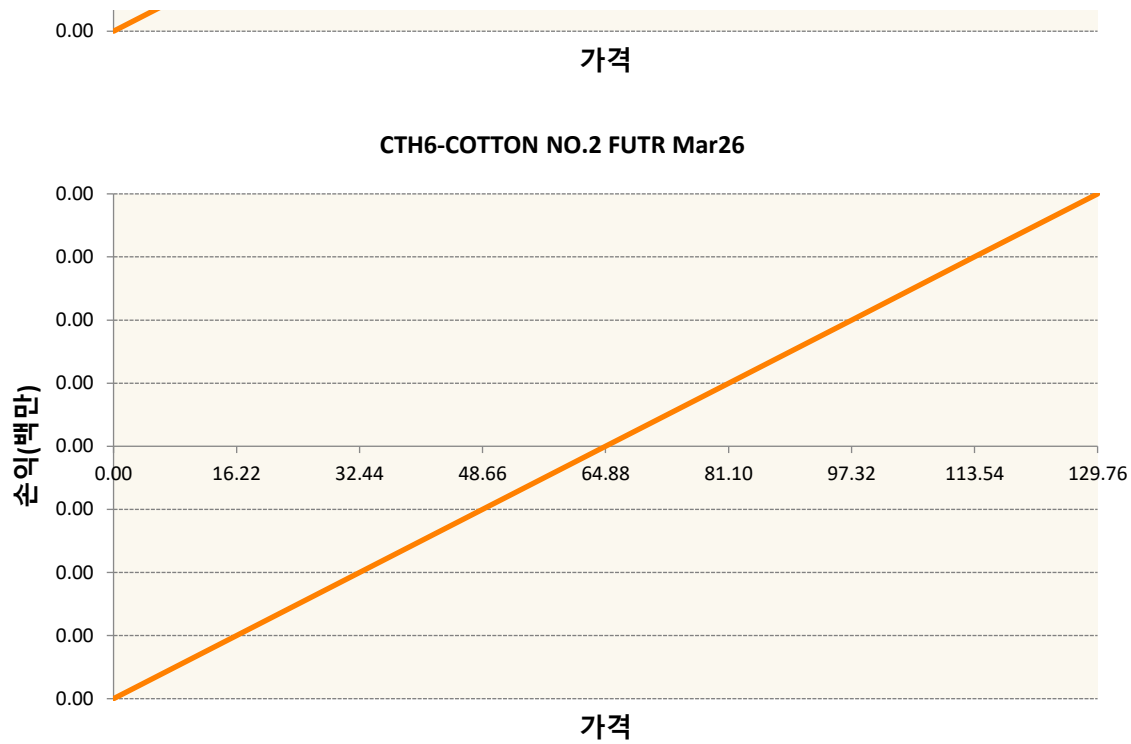
### 1. 계약금액

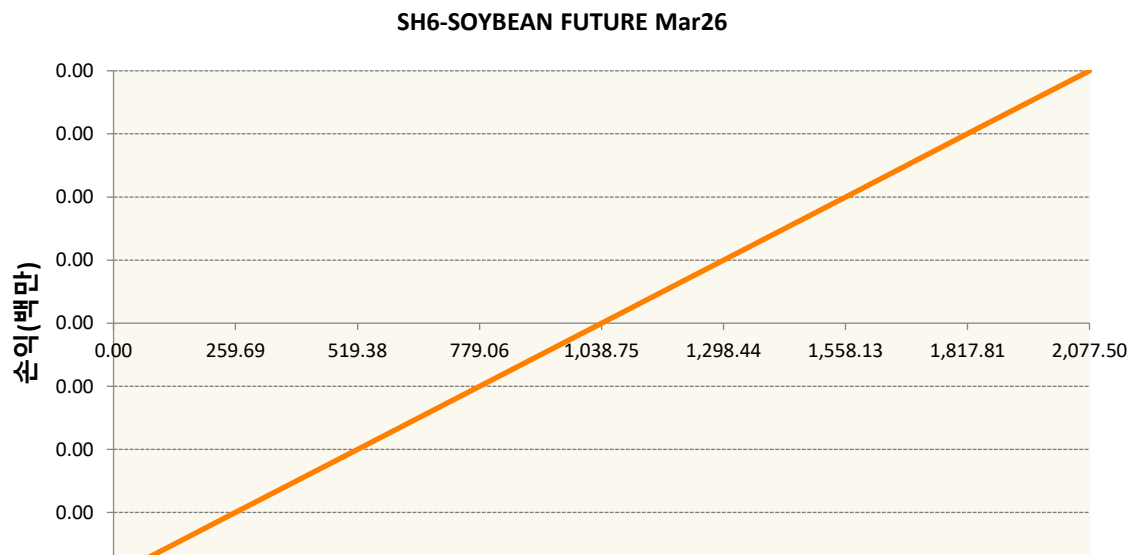
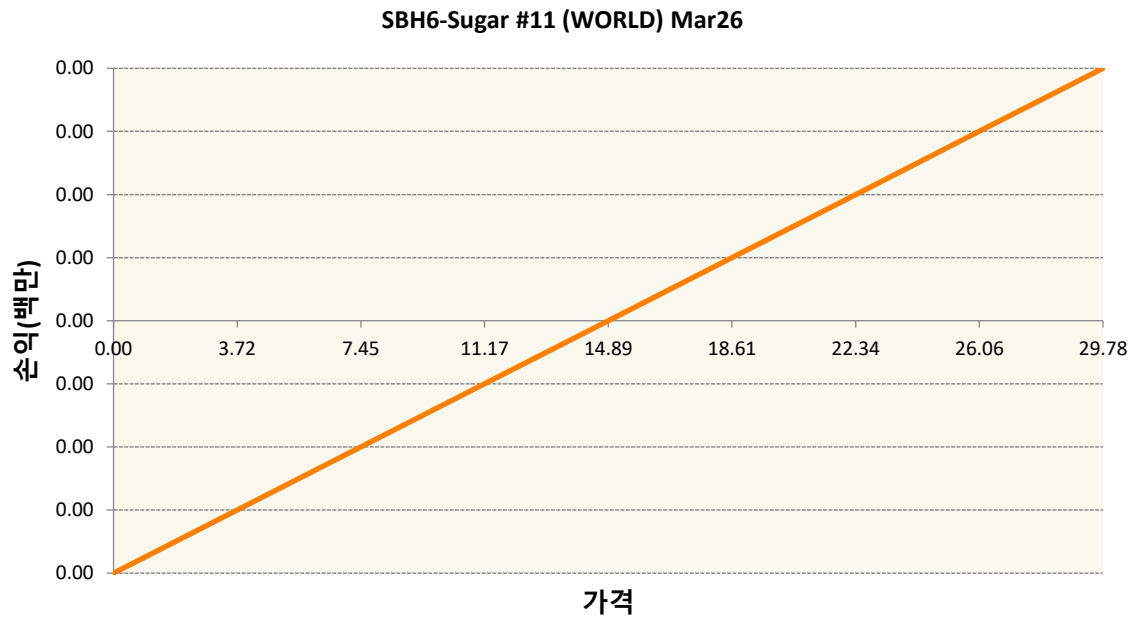
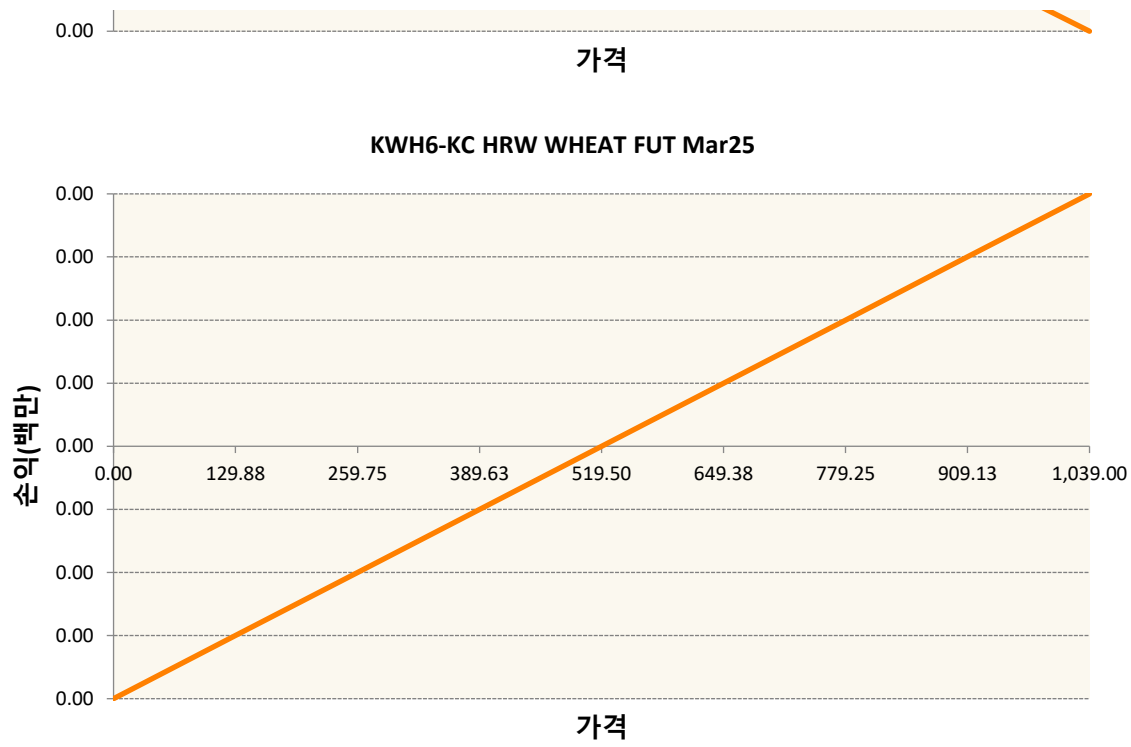
(단위:USD 백만)

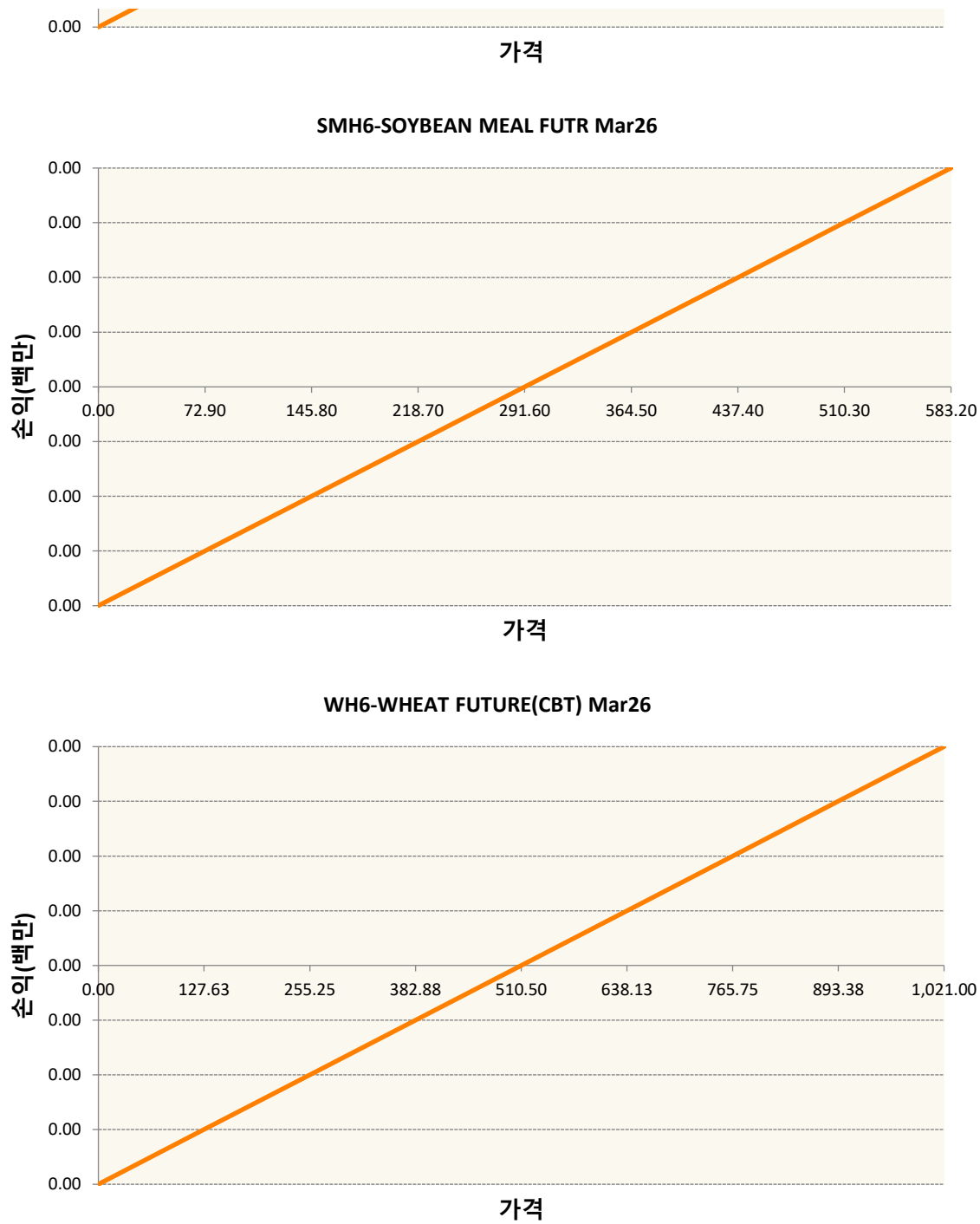
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 407   | 0     | 407       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,624 | 0     | 2,624     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 280   | -280      | 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 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

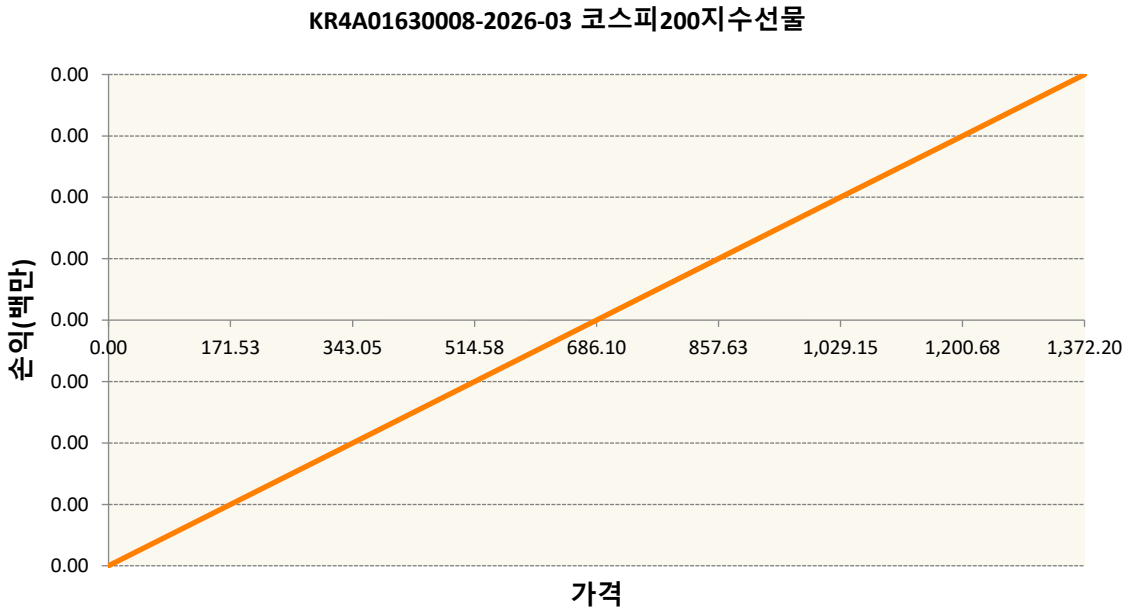
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 170   | 0     | 170       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,058 | 0     | 2,058     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물 | 165 |
|-------------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|   |
|---|
| 0 |
|---|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

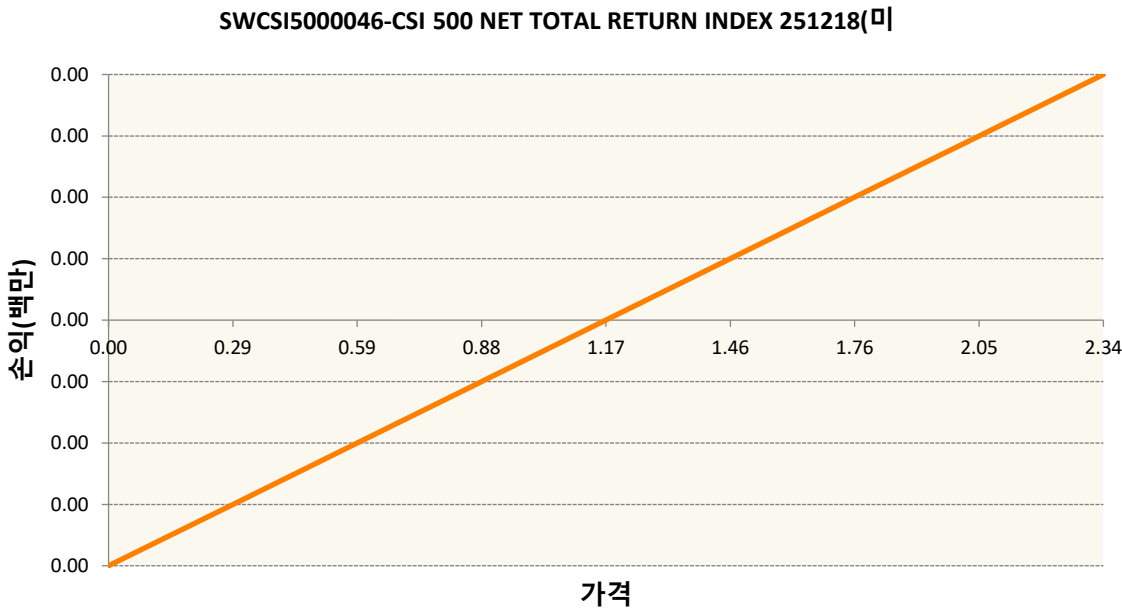
SOL차이나강소기업CSI500상장

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   | 5,404 | 0     | 5,404     | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

434

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

526

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

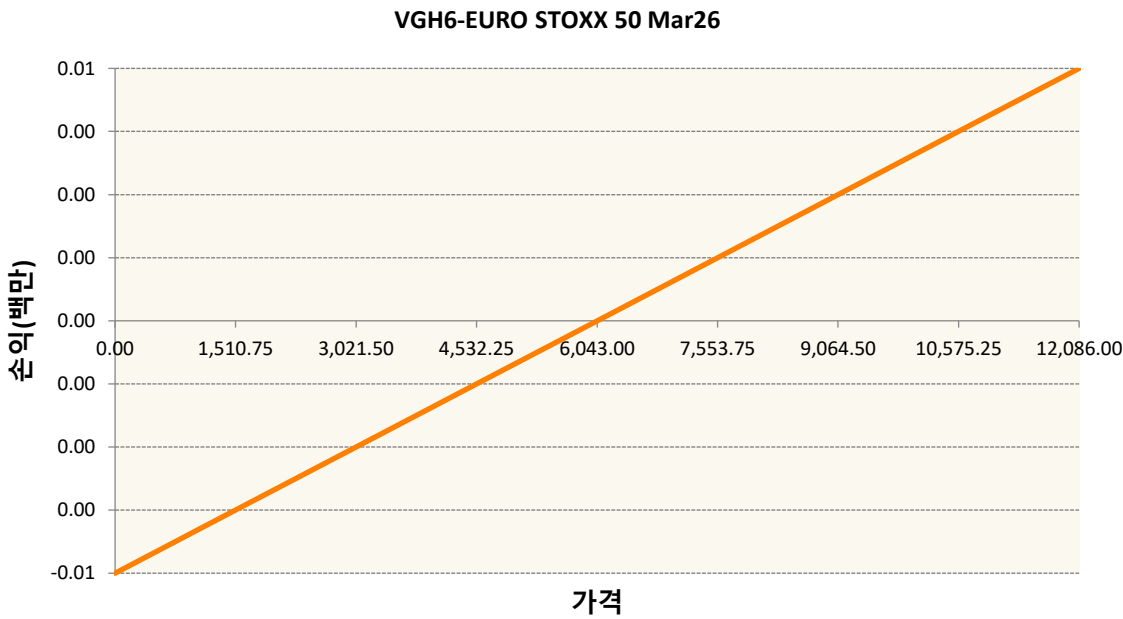
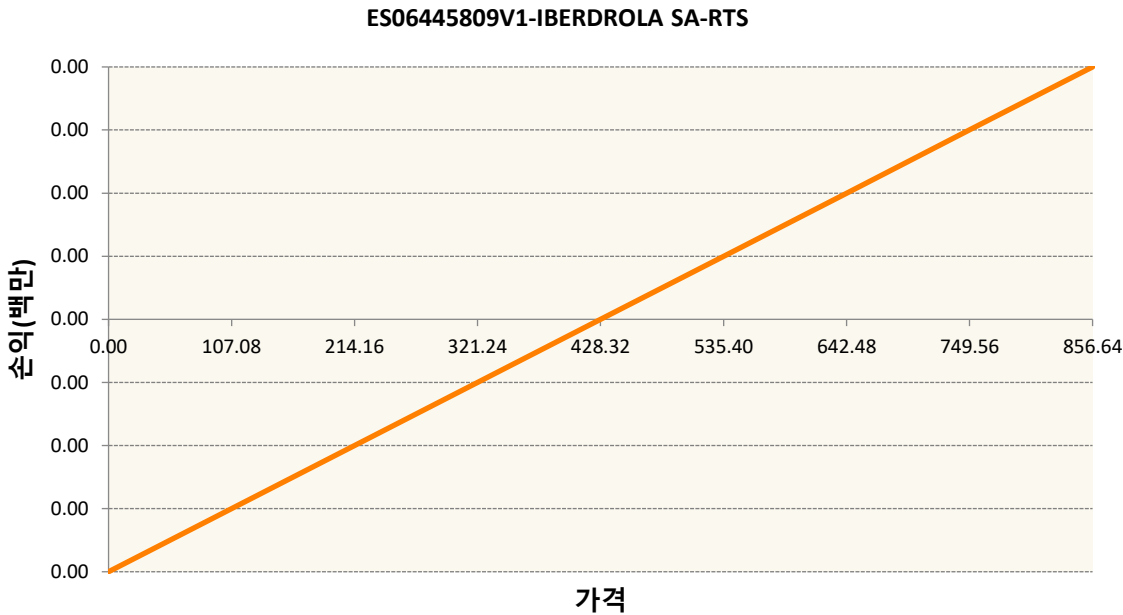
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 943   | 0     | 943       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)   |                     | (단위:백만원) |
|-----------------------------|---------------------|----------|
| ES06445809\IBERDROLA SA-RTS |                     | 0.12     |
| VGH6                        | EURO STOXX 50 Mar26 | 75       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 61       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

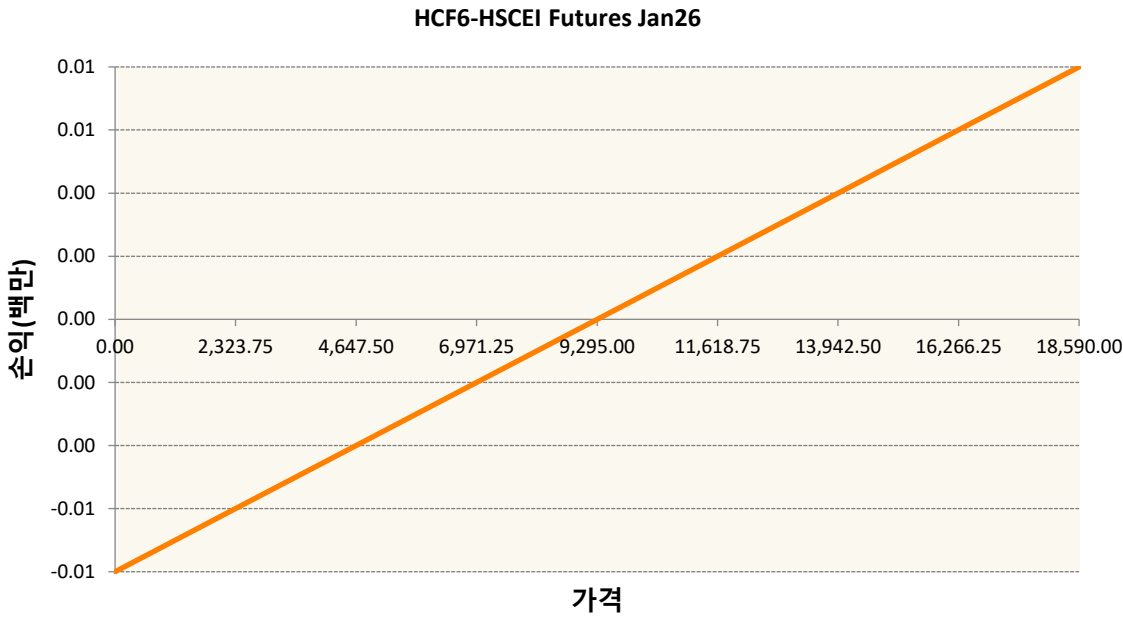
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 2,080 | 0     | 2,080     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCF6 | HSCEI Futures Jan26 | 166 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

234

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

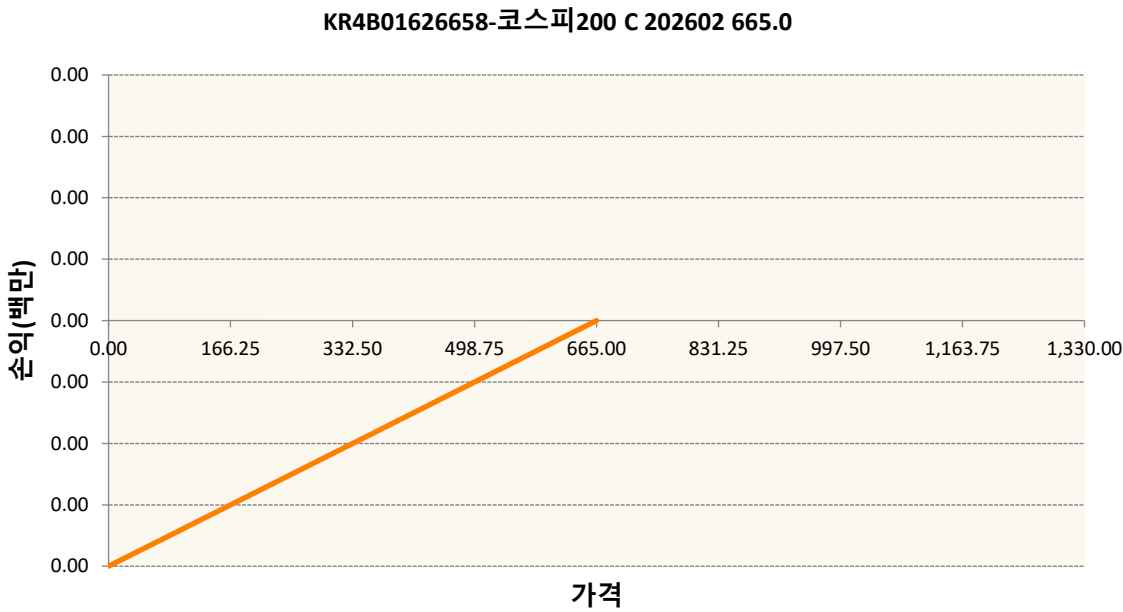
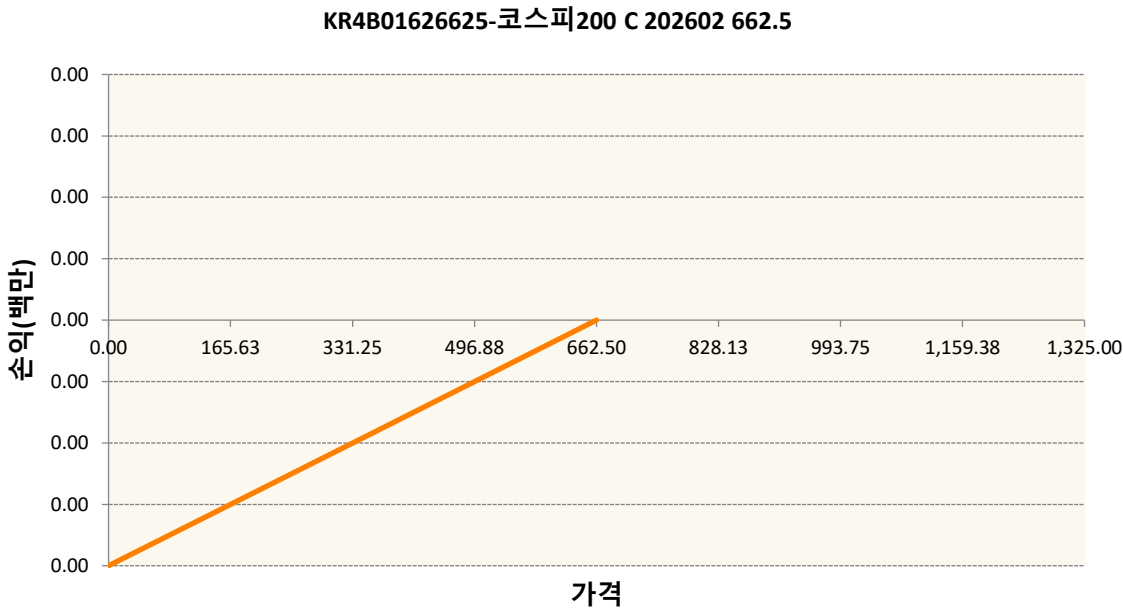
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

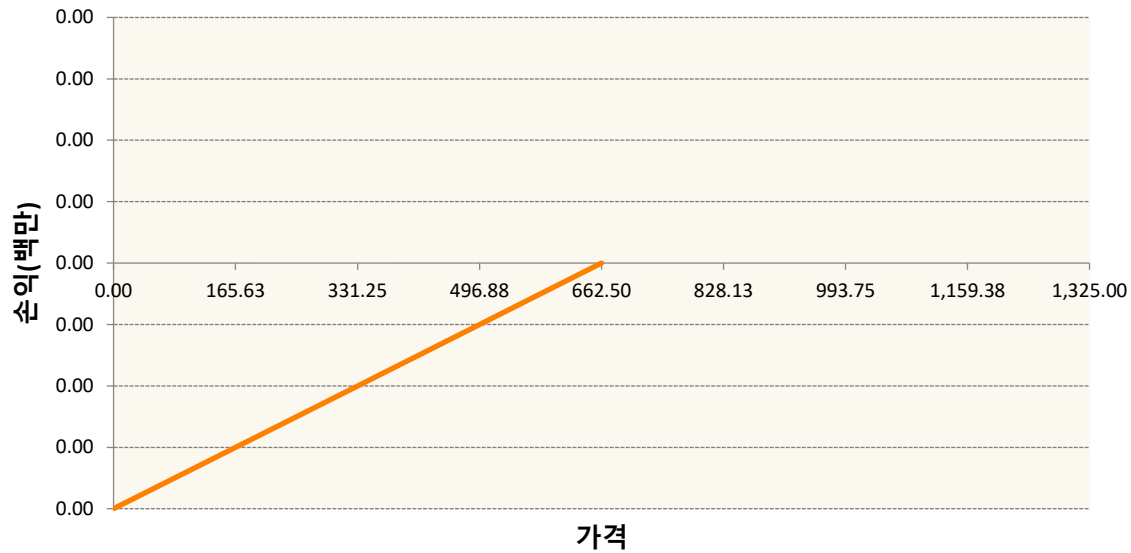
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 35,534 | -35,534   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4C01626624-코스피200 P 202602 662.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016266 코스피200 C 202602 662.5

384

KR4B016266 코스피200 C 202602 665.0

1,929

KR4C016266 코스피200 P 202602 662.5

530

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-01-15

기준일 2026-01-14

## 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 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

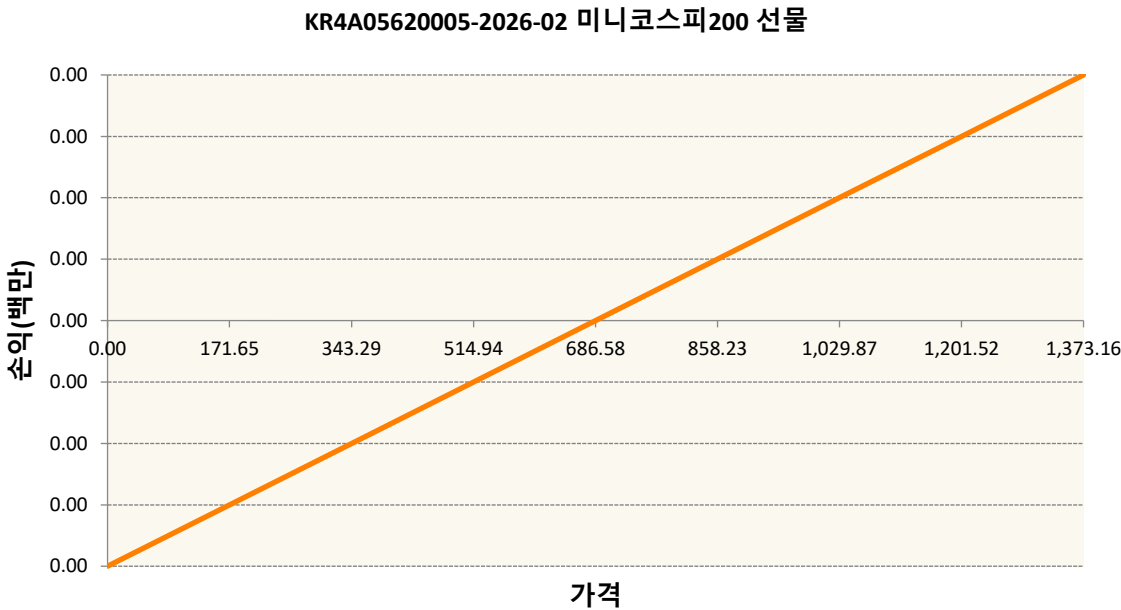
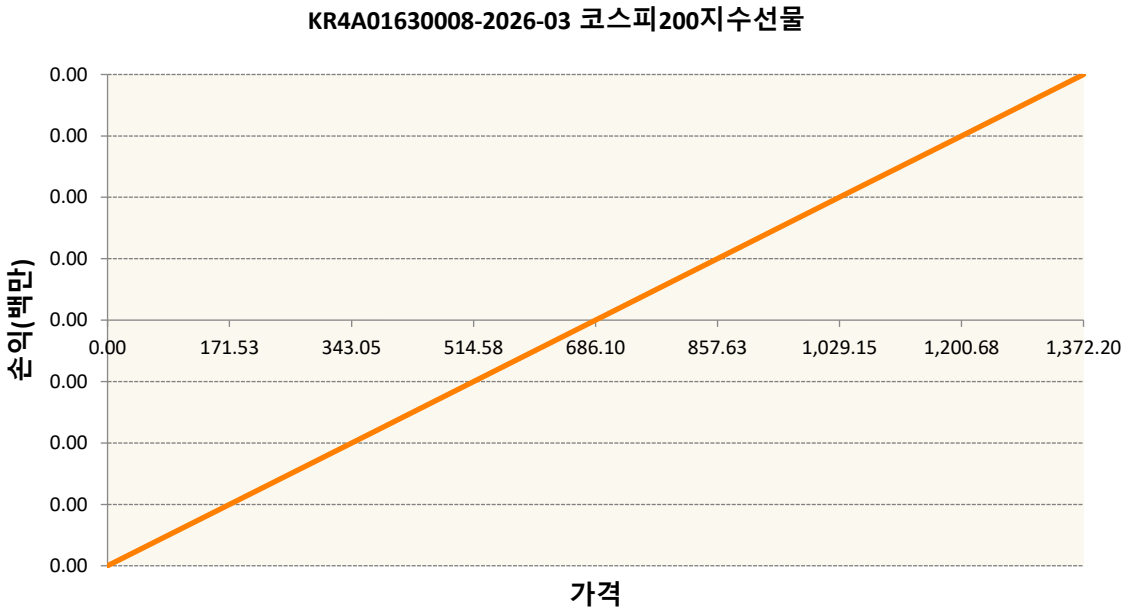
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,544 | 0     | 1,544     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)      |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------|--|----------|
| KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물  |  | 55       |
| KR4A056200 2026-02 미니코스피200 선물 |  | 14       |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

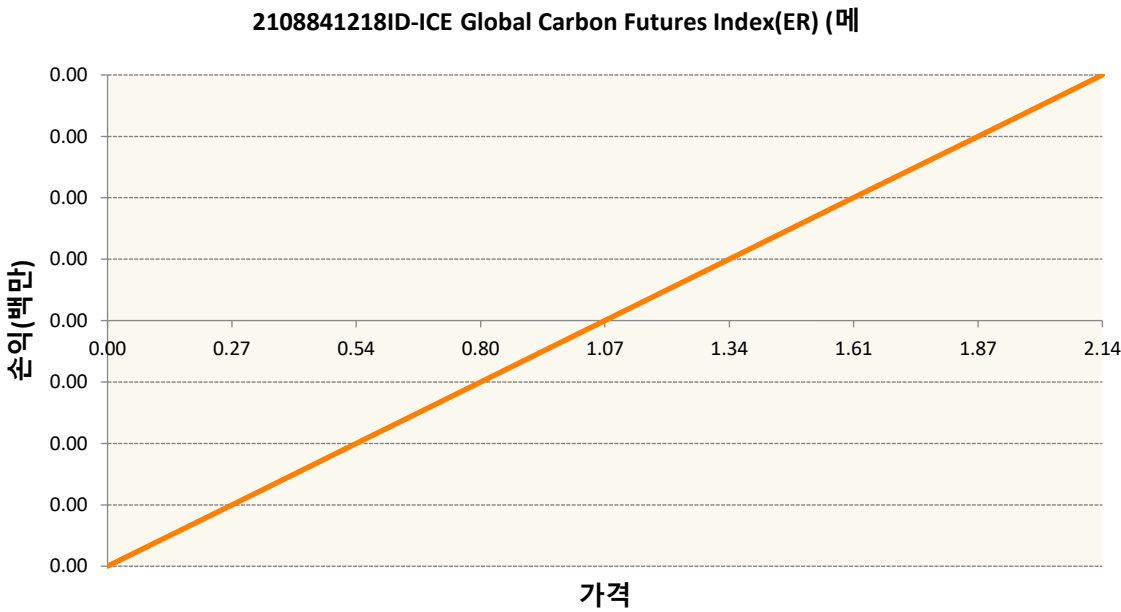
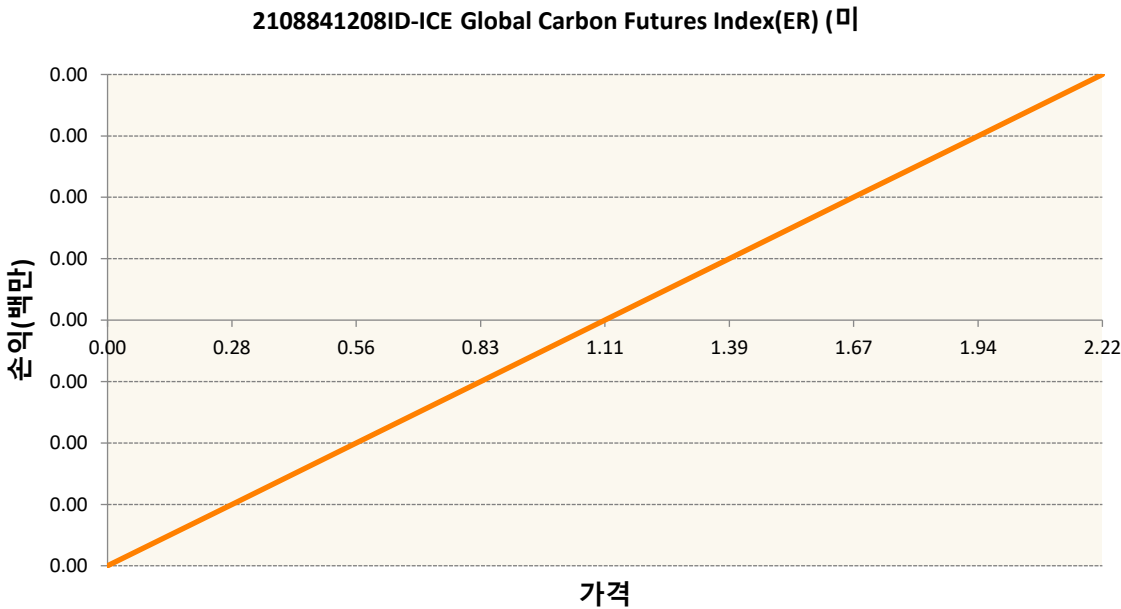
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 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   | 8,091 | 0     | 8,091     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------------------------------|--|----------|
| 2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 |  | 518      |
| 2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 |  | 130      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 617      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

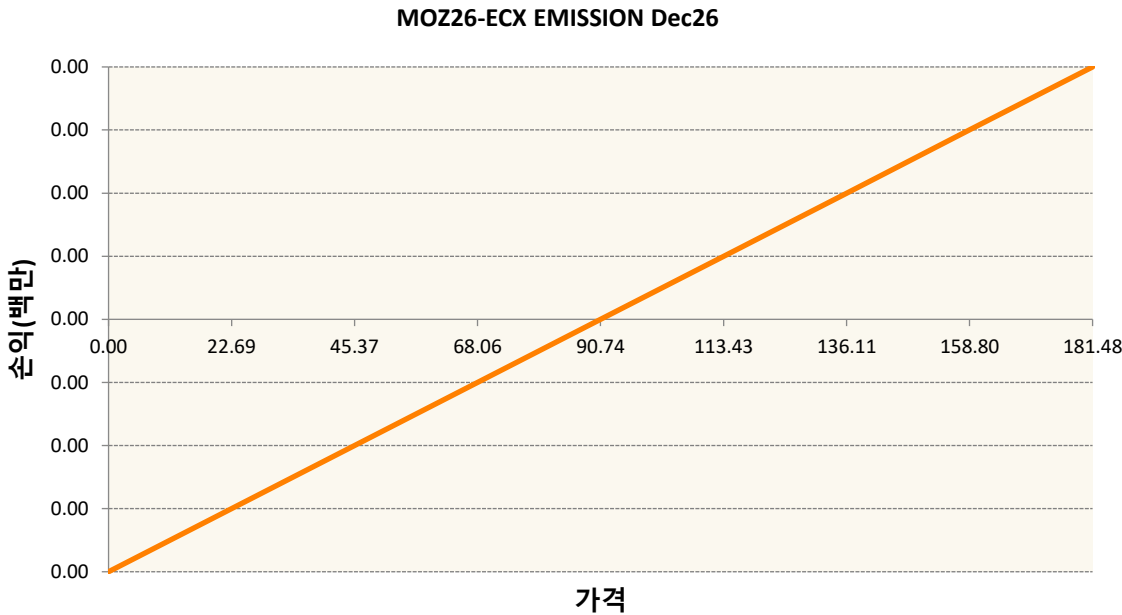
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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 |      |      | 6,025 | 0     | 6,025     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 3,387 | -3,387    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| FXW213FCP( KRW/EUR 30-01-26E  | 228 |
| FXW213G1E( KRW/EUR 30-01-26E  | 43  |
| MOZ26      ECX EMISSION Dec26 | 482 |

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

(단위:백만원)

782

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

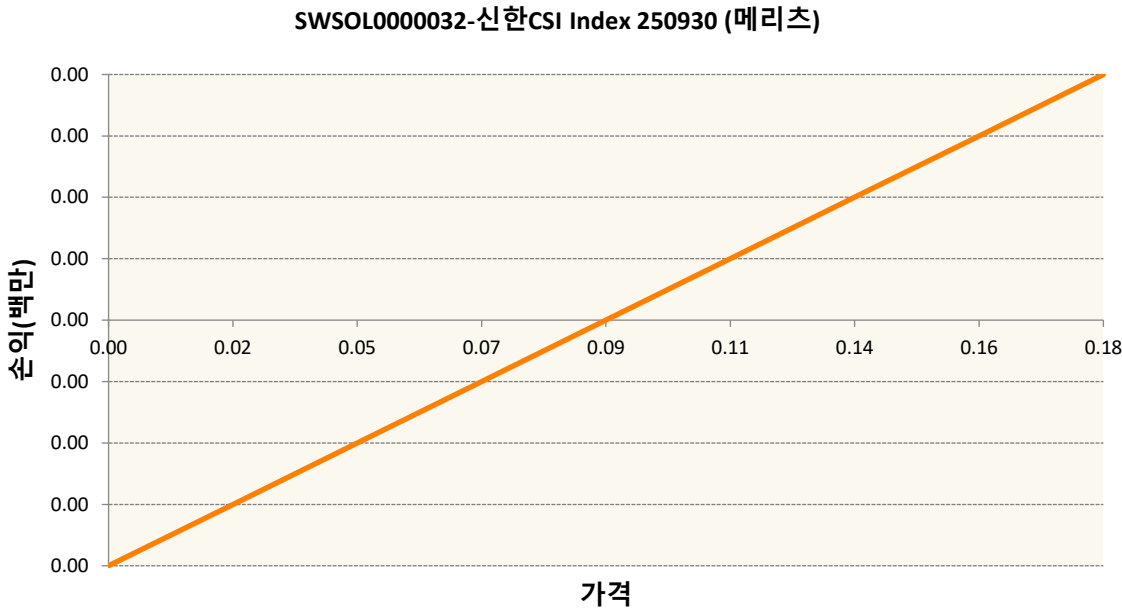
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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   | 2,969 | 0     | 2,969     | 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)

|    |
|----|
| 85 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

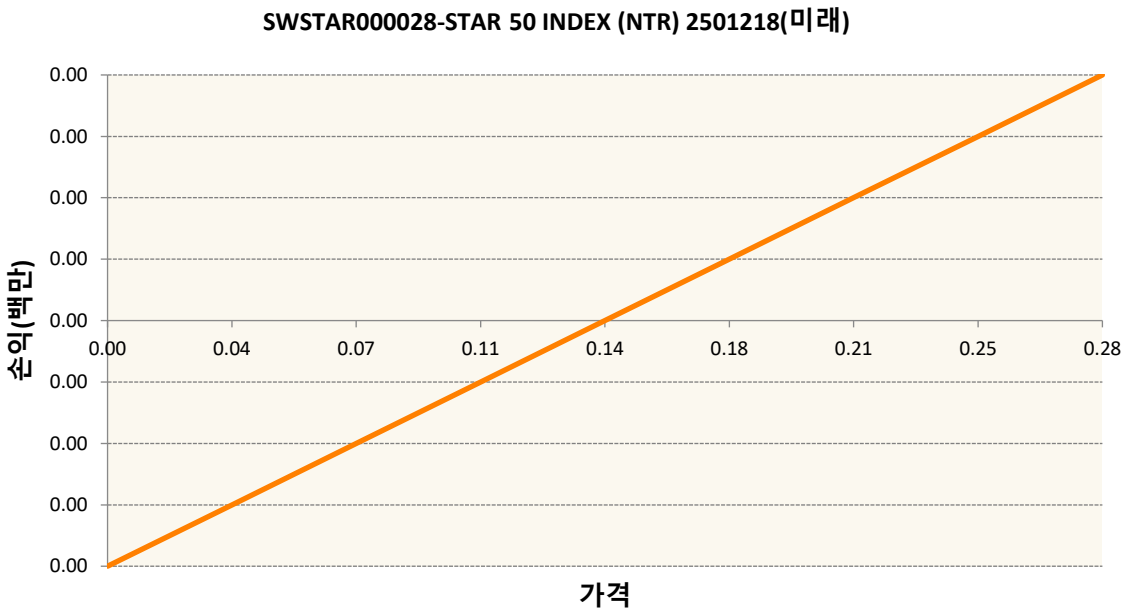
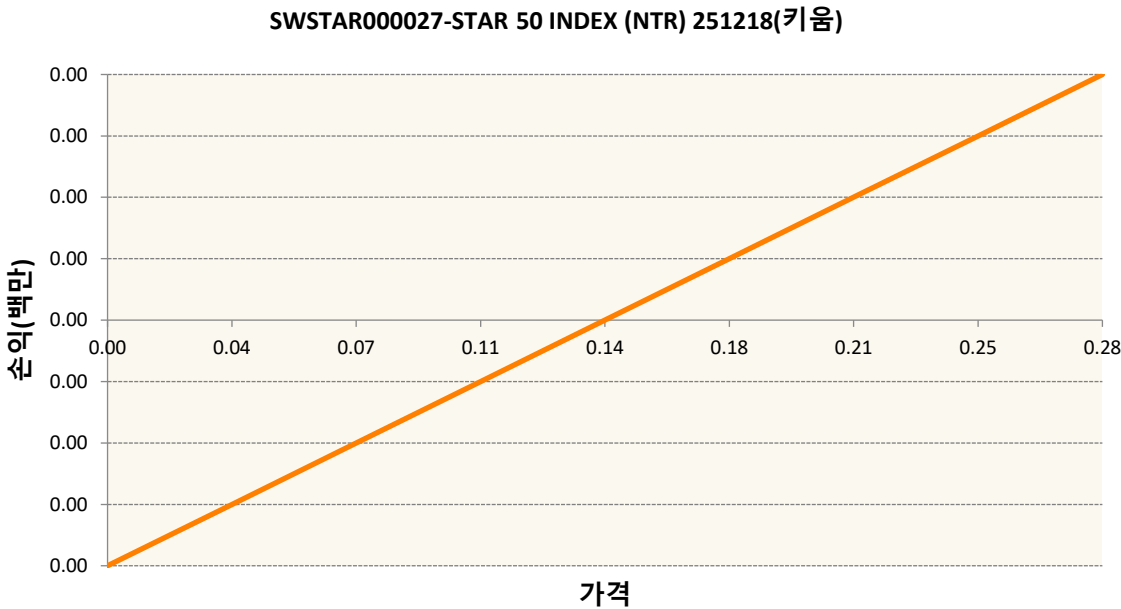
## SOL차이나육성산업엑티브상장지

### 1. 계약금액

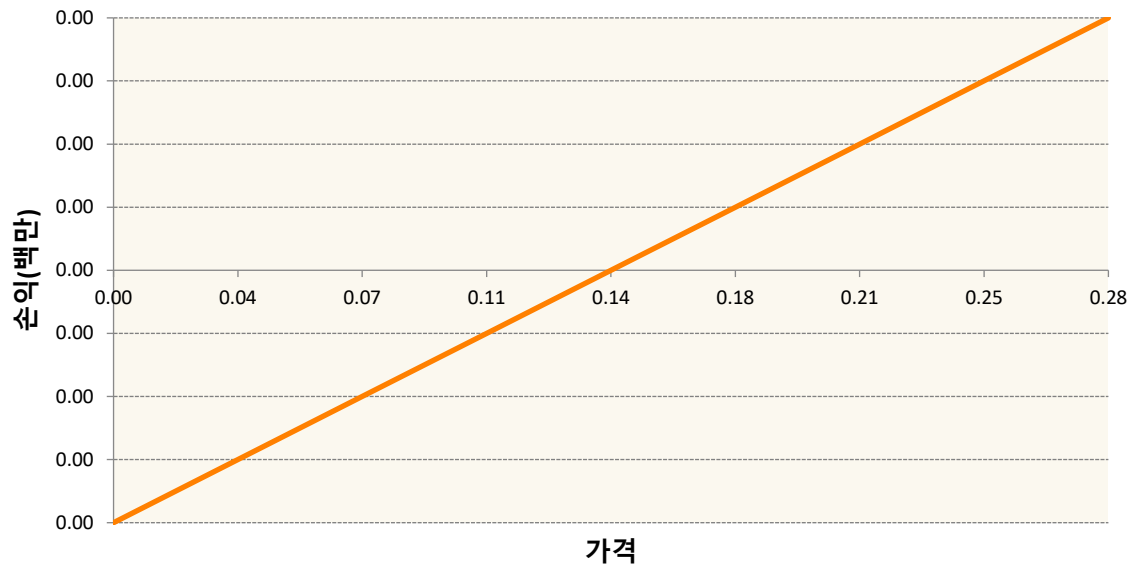
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 2,366 | 0     | 2,366     | 장외 |

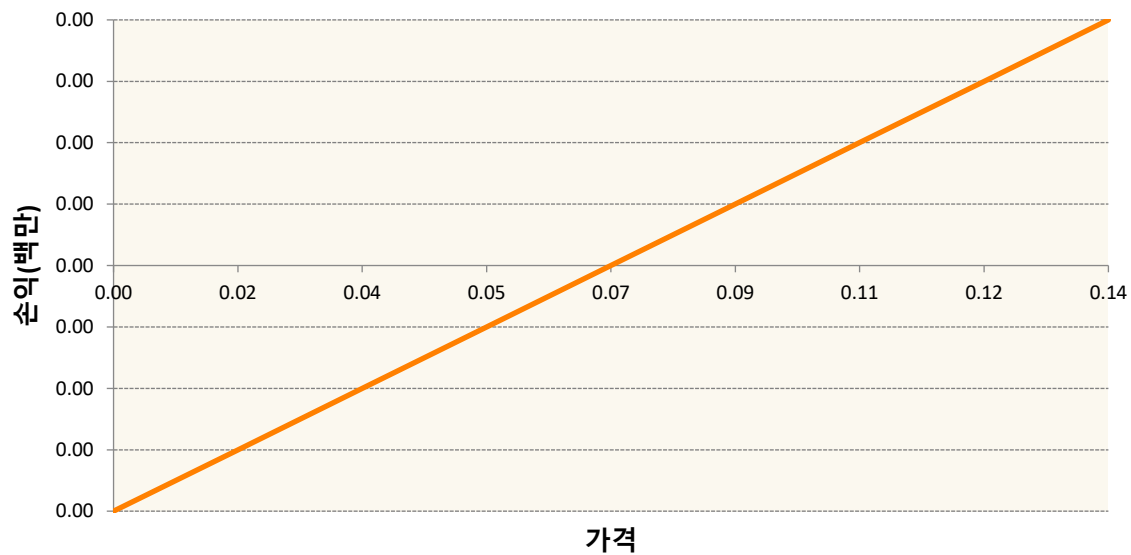
### 2. 만기시점의 손익구조



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



SWSTAR000031-STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                            |    |
|--------------------------------------------|----|
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움))  | 10 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래)) | 63 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))  | 32 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)) | 87 |

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

(단위:백만원)

350

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

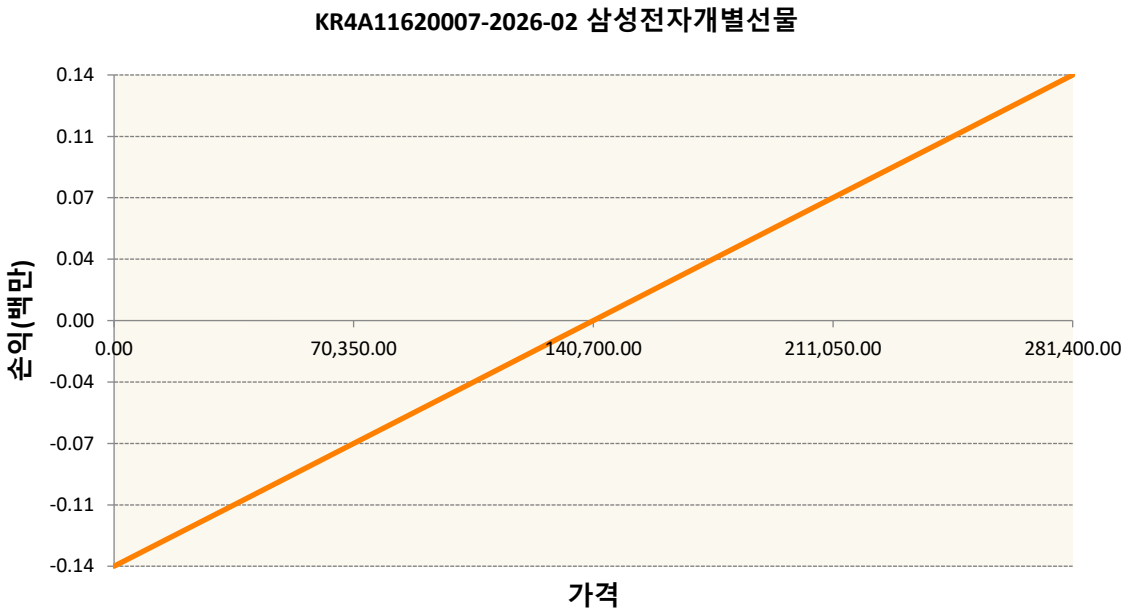
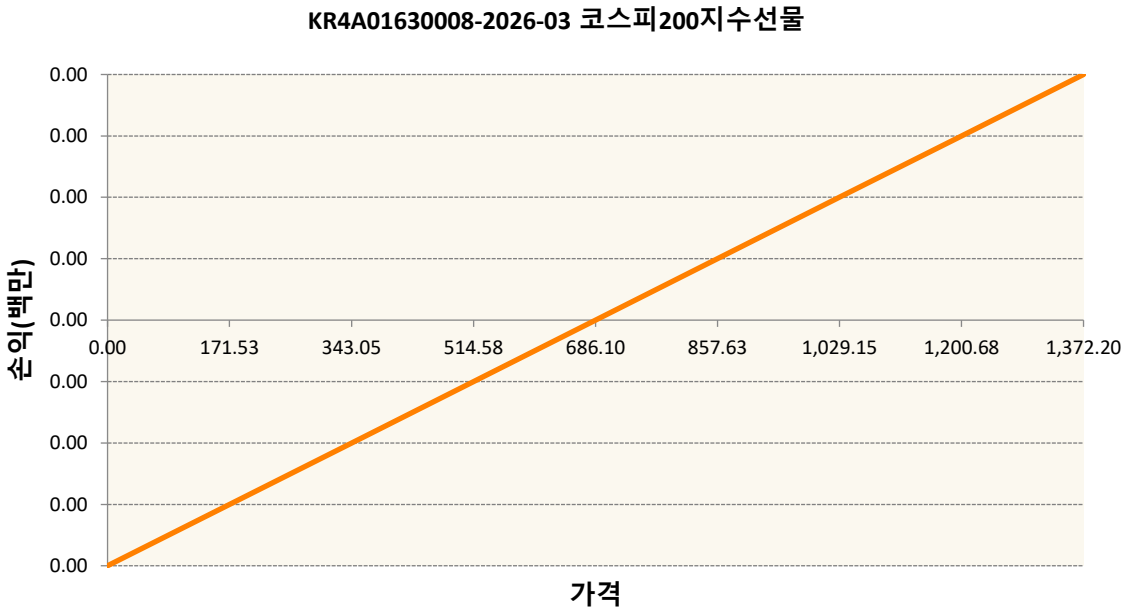
## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 1. 계약금액

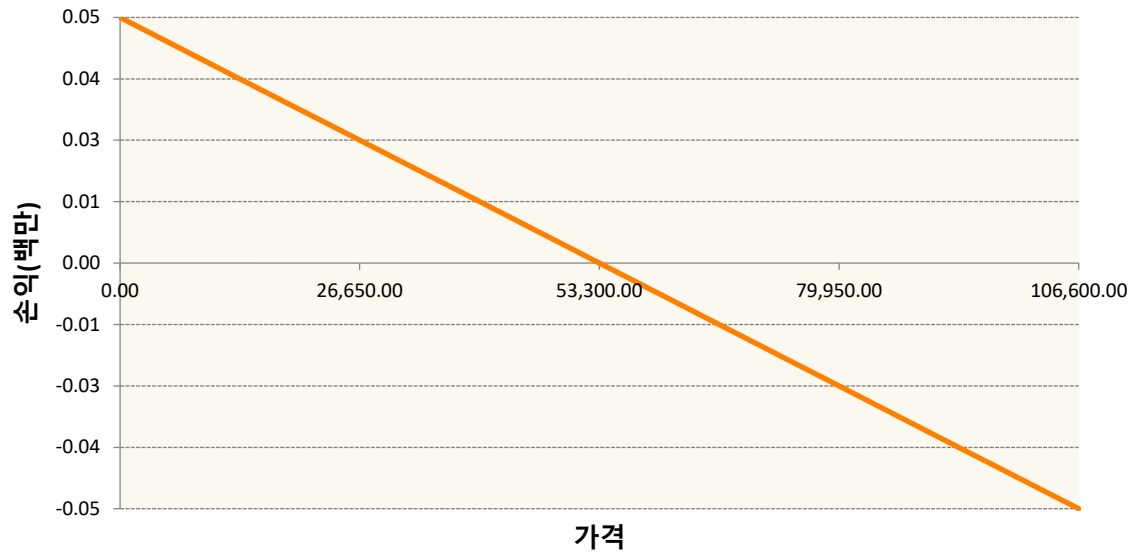
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 171   | 0     | 171       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 9,861 | 3,439 | 6,423     | 장내 |

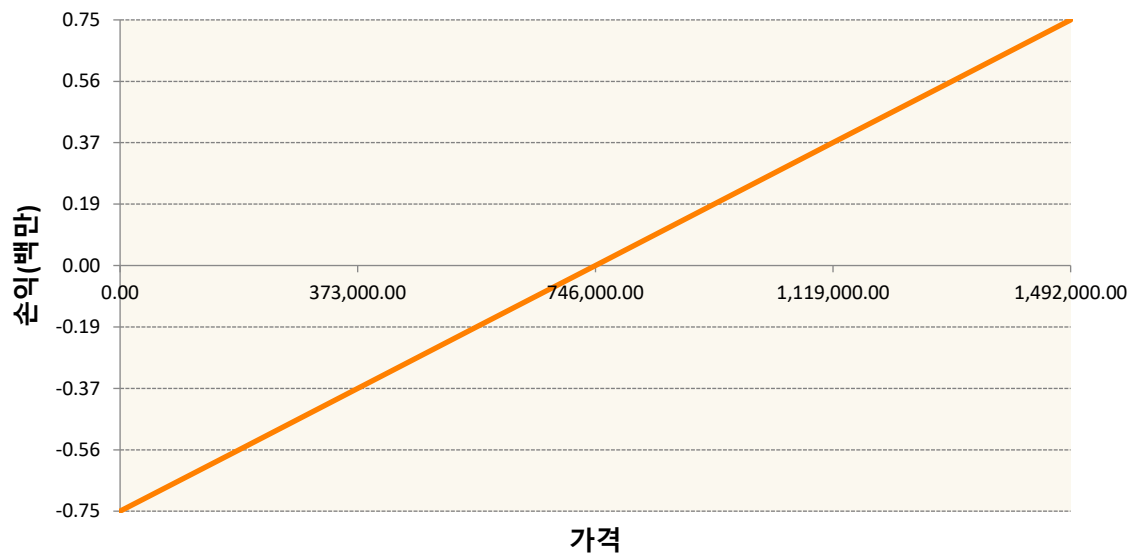
### 2. 만기시점의 손익구조



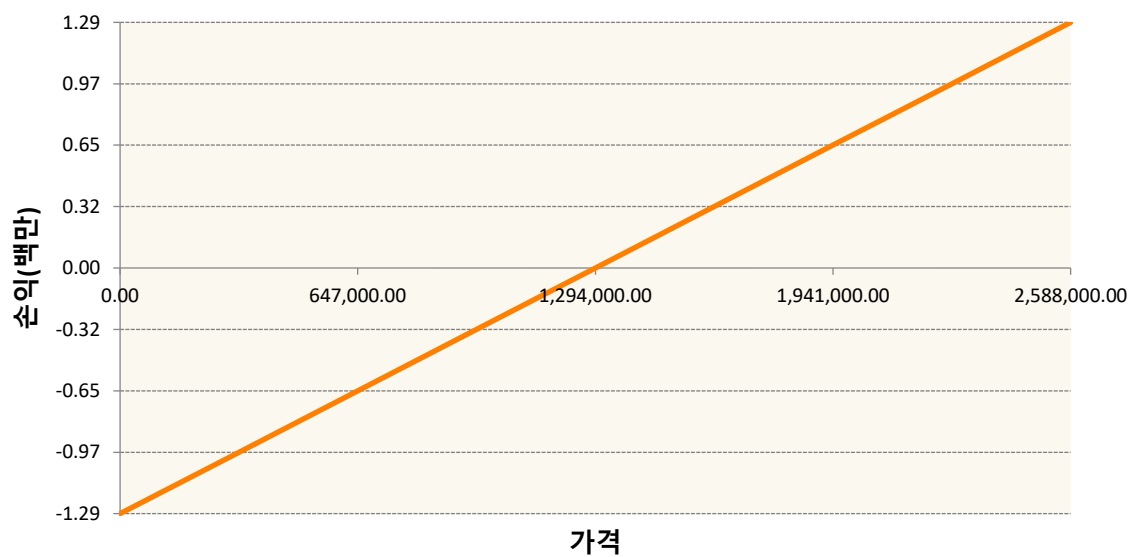
KR4A14620004-2026-02 KT개별선물



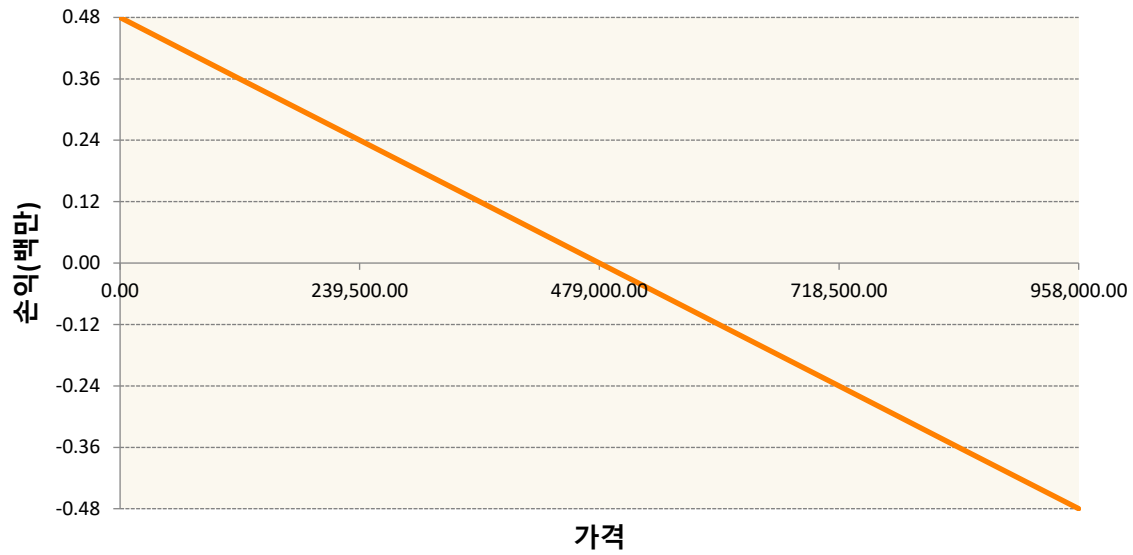
KR4A50620009-2026-02 SK하이닉스개별선물



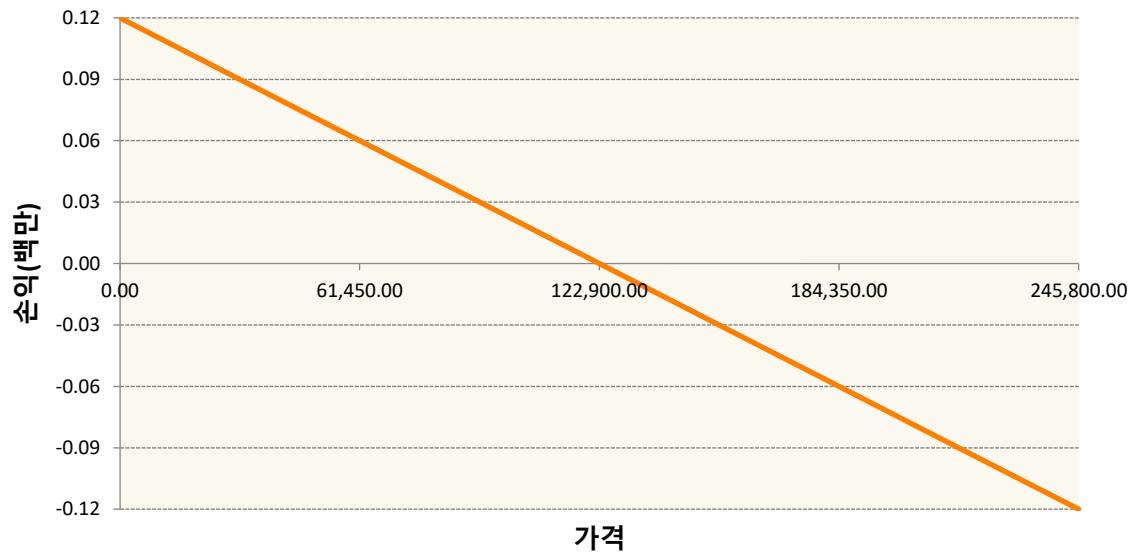
KR4AB3620005-2026-02 고려아연개별선물



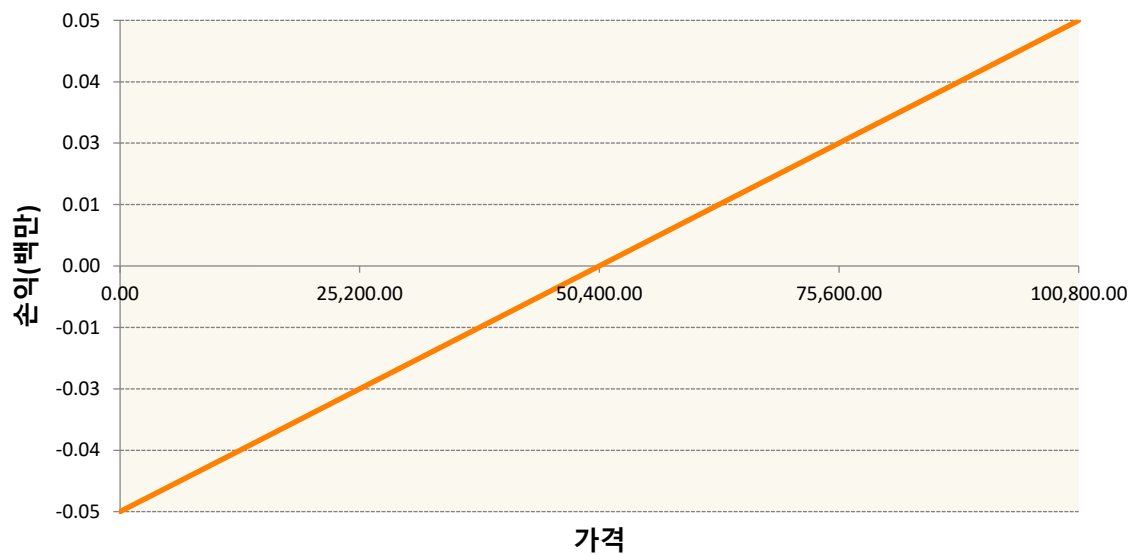
KR4ACT620003-2026-02 삼성화재개별선물



KR4AD0620004-2026-02 DB손해보험개별선물



KR4AF7620002-2026-02 카카오페이개별선물



(단위:백만원)

|              |           |         |        |      |       |        |                    |      |     |
|--------------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------------------|------|-----|
| KR4A01630008 |           |         |        |      |       |        | 2026-03 코스피200지수선물 |      | 343 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                    |      |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |      |     |
| -8.00%       | -343      | -343    | -343   | -343 | -343  | -343   | -343               | -343 |     |
| -5.33%       | -229      | -229    | -229   | -229 | -229  | -229   | -229               | -229 |     |
| -2.67%       | -114      | -114    | -114   | -114 | -114  | -114   | -114               | -114 |     |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                  | 0    |     |
| 2.67%        | 114       | 114     | 114    | 114  | 114   | 114    | 114                | 114  |     |
| 5.33%        | 229       | 229     | 229    | 229  | 229   | 229    | 229                | 229  |     |
| 8.00%        | 343       | 343     | 343    | 343  | 343   | 343    | 343                | 343  |     |
| KR4A11620007 |           |         |        |      |       |        | 2026-02 삼성전자개별선물   |      | 175 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                    |      |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |      |     |
| -8.00%       | -175      | -175    | -175   | -175 | -175  | -175   | -175               | -175 |     |
| -5.33%       | -116      | -116    | -116   | -116 | -116  | -116   | -116               | -116 |     |
| -2.67%       | -58       | -58     | -58    | -58  | -58   | -58    | -58                | -58  |     |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                  | 0    |     |
| 2.67%        | 58        | 58      | 58     | 58   | 58    | 58     | 58                 | 58   |     |
| 5.33%        | 116       | 116     | 116    | 116  | 116   | 116    | 116                | 116  |     |
| 8.00%        | 175       | 175     | 175    | 175  | 175   | 175    | 175                | 175  |     |
| KR4A14620004 |           |         |        |      |       |        | 2026-02 KT개별선물     |      | 128 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                    |      |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |      |     |
| -8.00%       | 128       | 128     | 128    | 128  | 128   | 128    | 128                | 128  |     |
| -5.33%       | 85        | 85      | 85     | 85   | 85    | 85     | 85                 | 85   |     |
| -2.67%       | 43        | 43      | 43     | 43   | 43    | 43     | 43                 | 43   |     |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                  | 0    |     |
| 2.67%        | -43       | -43     | -43    | -43  | -43   | -43    | -43                | -43  |     |
| 5.33%        | -85       | -85     | -85    | -85  | -85   | -85    | -85                | -85  |     |
| 8.00%        | -128      | -128    | -128   | -128 | -128  | -128   | -128               | -128 |     |
| KR4A50620009 |           |         |        |      |       |        | 2026-02 SK하이닉스개별선물 |      | 179 |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                    |      |     |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |      |     |
| -8.00%       | -179      | -179    | -179   | -179 | -179  | -179   | -179               | -179 |     |
| -5.33%       | -119      | -119    | -119   | -119 | -119  | -119   | -119               | -119 |     |
| -2.67%       | -60       | -60     | -60    | -60  | -60   | -60    | -60                | -60  |     |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                  | 0    |     |
| 2.67%        | 60        | 60      | 60     | 60   | 60    | 60     | 60                 | 60   |     |
| 5.33%        | 119       | 119     | 119    | 119  | 119   | 119    | 119                | 119  |     |
| 8.00%        | 179       | 179     | 179    | 179  | 179   | 179    | 179                | 179  |     |
| KR4AB3620005 |           |         |        |      |       |        | 2026-02 고려아연개별선물   |      | 90  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |                    |      |     |

|                                 |         |         |        |     |       |        |        |
|---------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                          | -90     | -90     | -90    | -90 | -90   | -90    | -90    |
| -5.33%                          | -60     | -60     | -60    | -60 | -60   | -60    | -60    |
| -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%                           | 60      | 60      | 60     | 60  | 60    | 60     | 60     |
| 8.00%                           | 90      | 90      | 90     | 90  | 90    | 90     | 90     |
| KR4ACT620003 2026-02 삼성화재개별선물   |         |         |        |     |       |        | 88     |
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                          | 88      | 88      | 88     | 88  | 88    | 88     | 88     |
| -5.33%                          | 59      | 59      | 59     | 59  | 59    | 59     | 59     |
| -2.67%                          | 29      | 29      | 29     | 29  | 29    | 29     | 29     |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                           | -29     | -29     | -29    | -29 | -29   | -29    | -29    |
| 5.33%                           | -59     | -59     | -59    | -59 | -59   | -59    | -59    |
| 8.00%                           | -88     | -88     | -88    | -88 | -88   | -88    | -88    |
| KR4AD0620004 2026-02 DB손해보험개별선물 |         |         |        |     |       |        | 58     |
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                          | 58      | 58      | 58     | 58  | 58    | 58     | 58     |
| -5.33%                          | 39      | 39      | 39     | 39  | 39    | 39     | 39     |
| -2.67%                          | 19      | 19      | 19     | 19  | 19    | 19     | 19     |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                           | -19     | -19     | -19    | -19 | -19   | -19    | -19    |
| 5.33%                           | -39     | -39     | -39    | -39 | -39   | -39    | -39    |
| 8.00%                           | -58     | -58     | -58    | -58 | -58   | -58    | -58    |
| KR4AF7620002 2026-02 카카오페이개별선물  |         |         |        |     |       |        | 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)

1,279

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

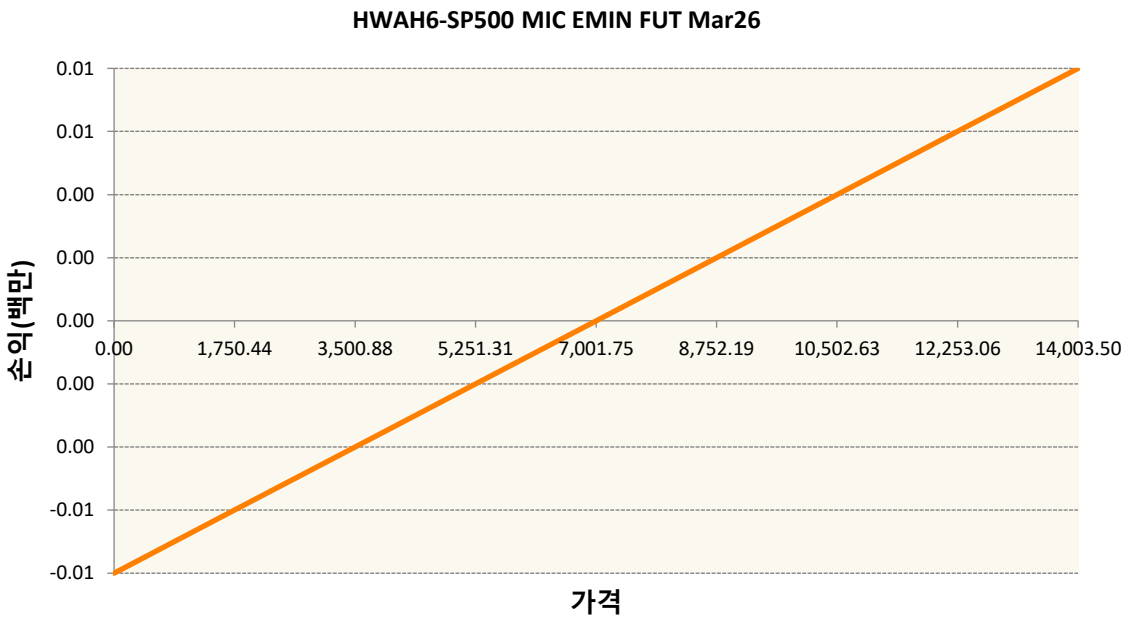
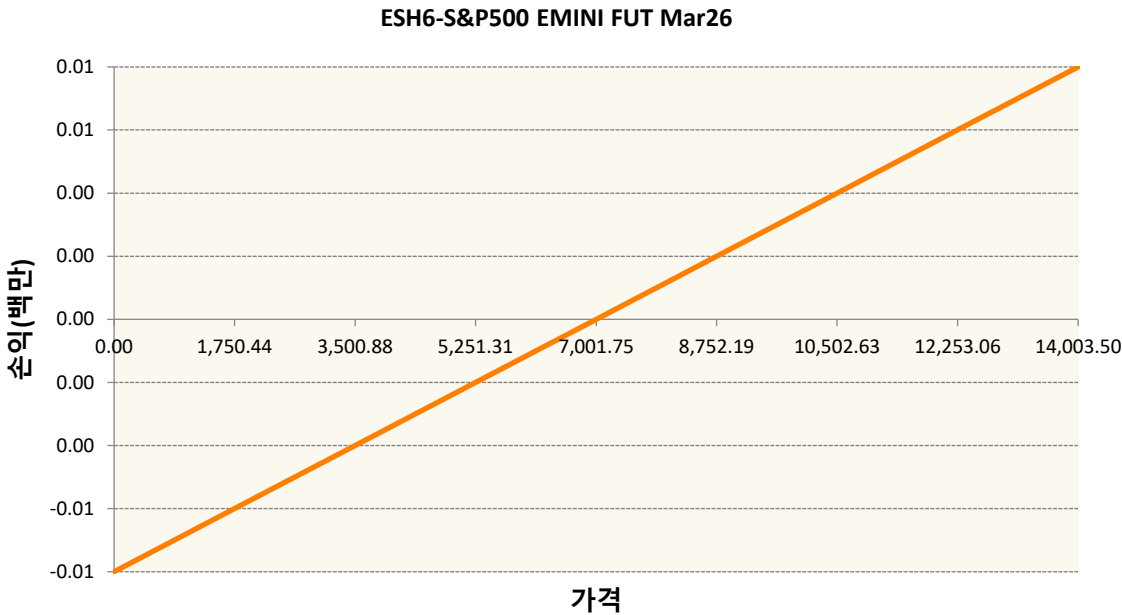
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

### 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   | 1,138  | 0     | 1,138     | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 53,683 | 0     | 53,683    |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESH6                      | S&P500 EMINI FUT Mar26   | 4,295    |
| HWAH6                     | SP500 MIC EMIN FUT Mar26 | 91       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 3,862    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

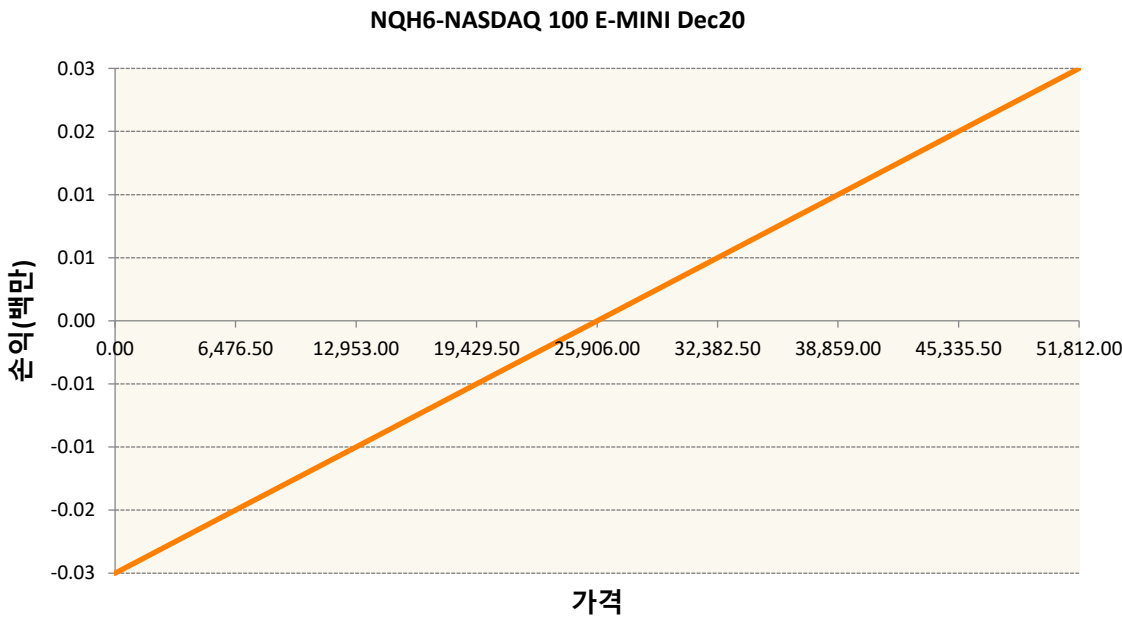
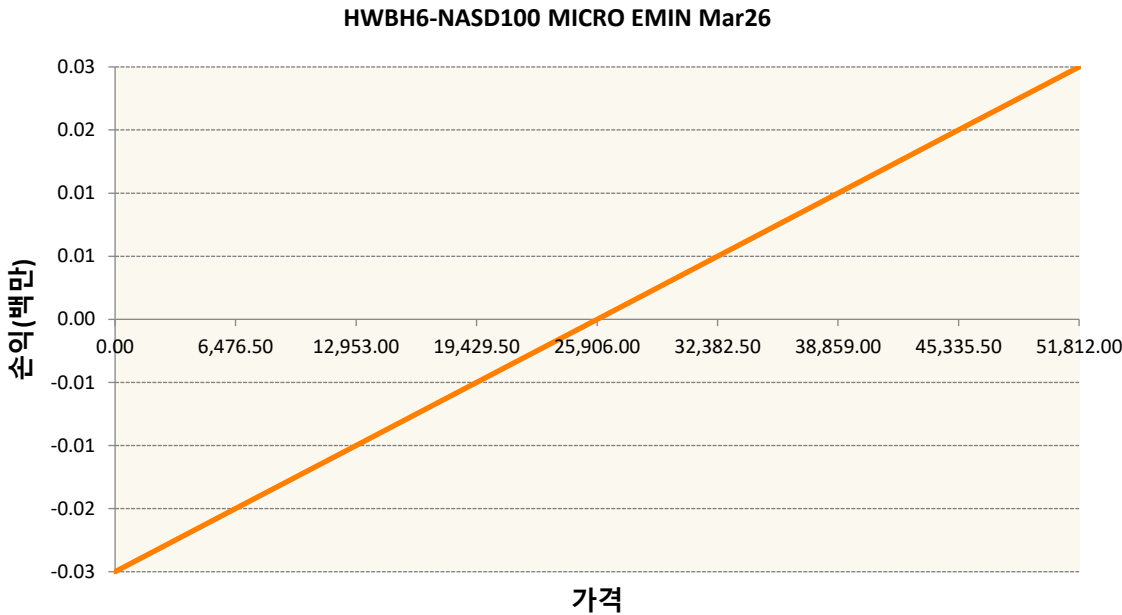
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

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   | 24,392 | 0     | 24,392    | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBH6                     | NASD100 MICRO EMIN Mar26 |  | 55       |
| NQH6                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 1,896    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|--|----------|
|                                        |  |  | 2,194    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

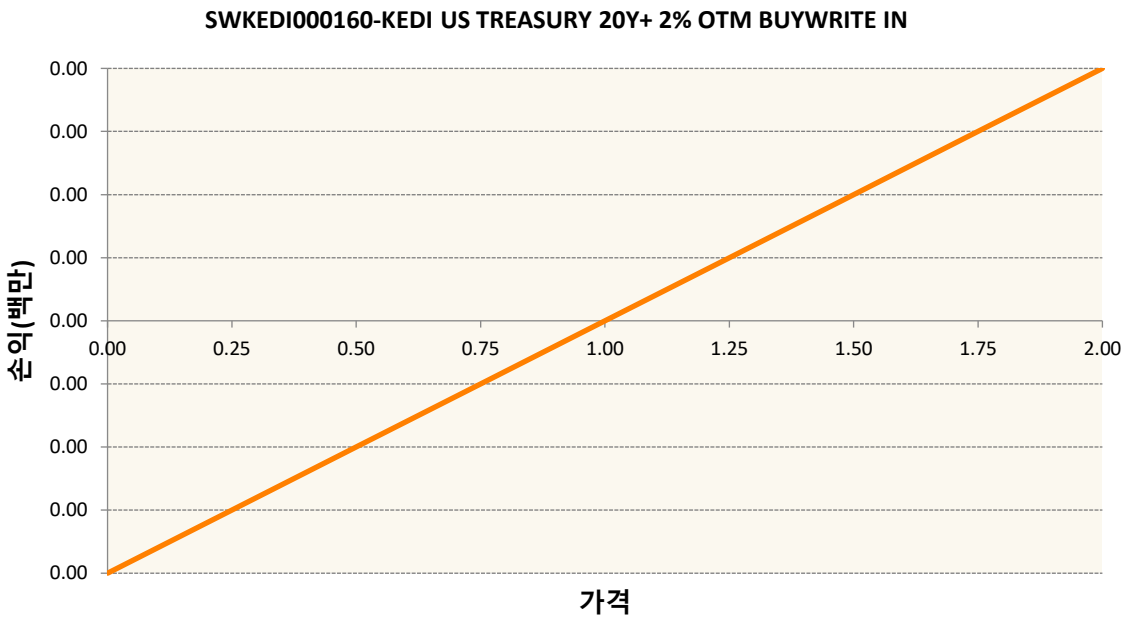
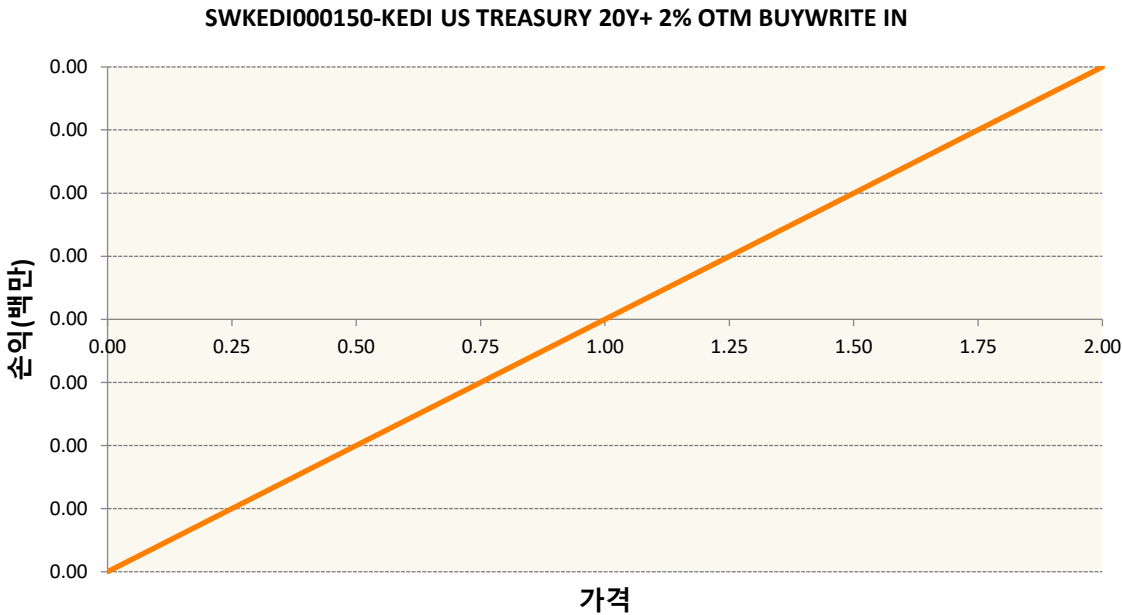
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

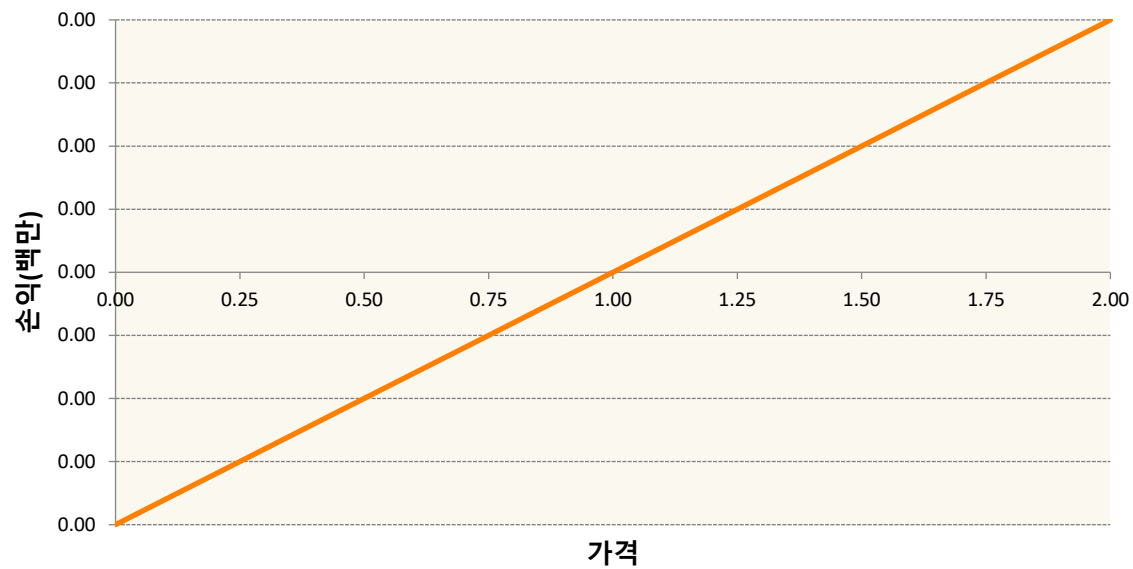
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 381,258 | 0     | 381,258   | 장외 |

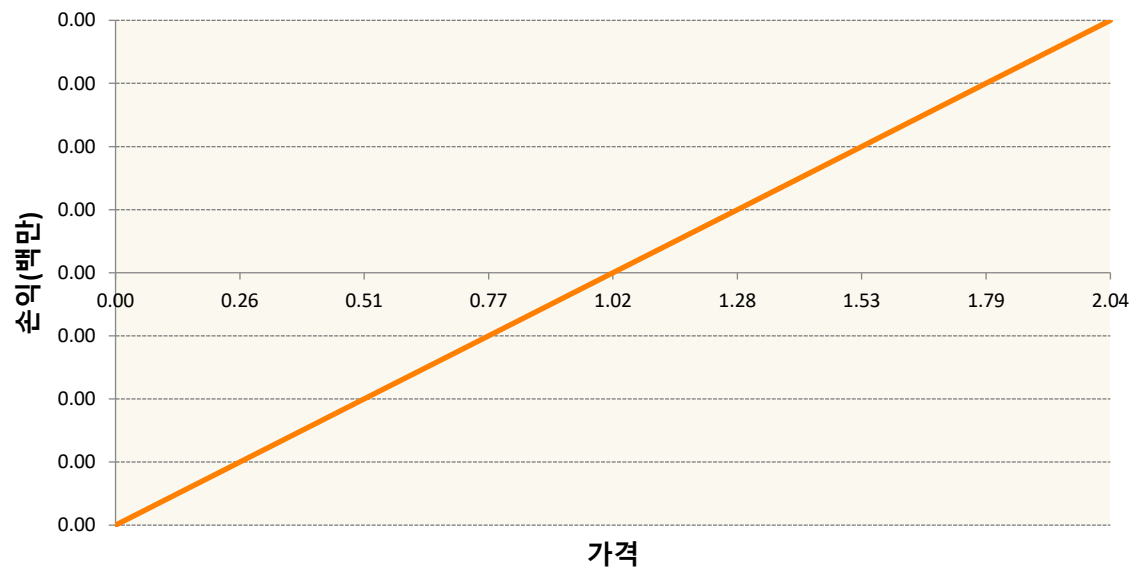
### 2. 만기시점의 손익구조



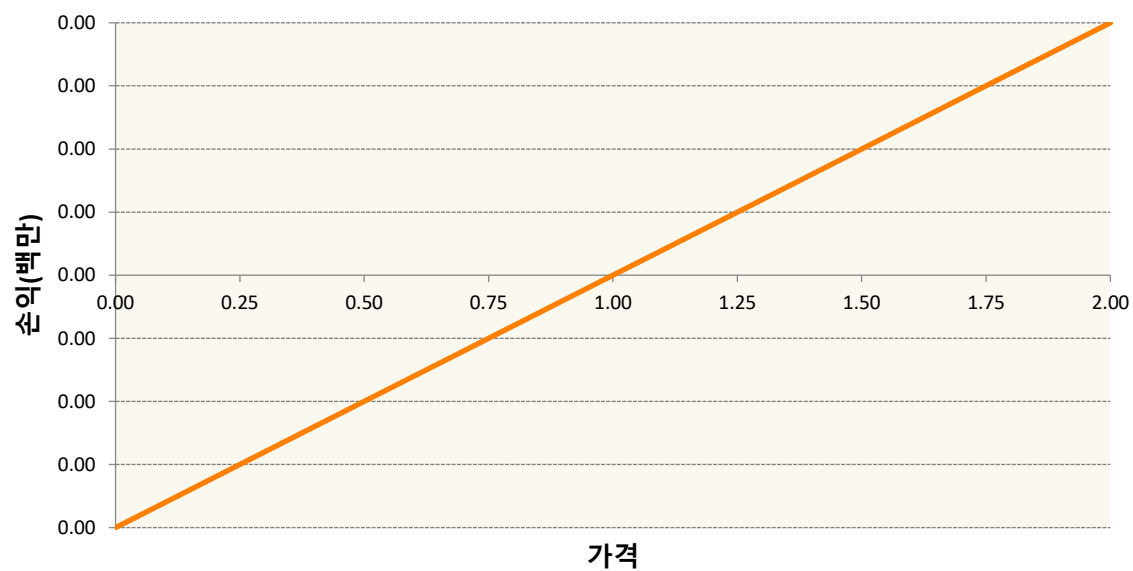
SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000164-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000165-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                           |  | (단위:백만원) |
|-----------------------------------------------------|--|----------|
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 8,254    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 8,399    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 3,697    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 150      |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 10,073   |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 13,905   |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

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 | 2026-01-15 |
| 기준일 | 2026-01-14 |

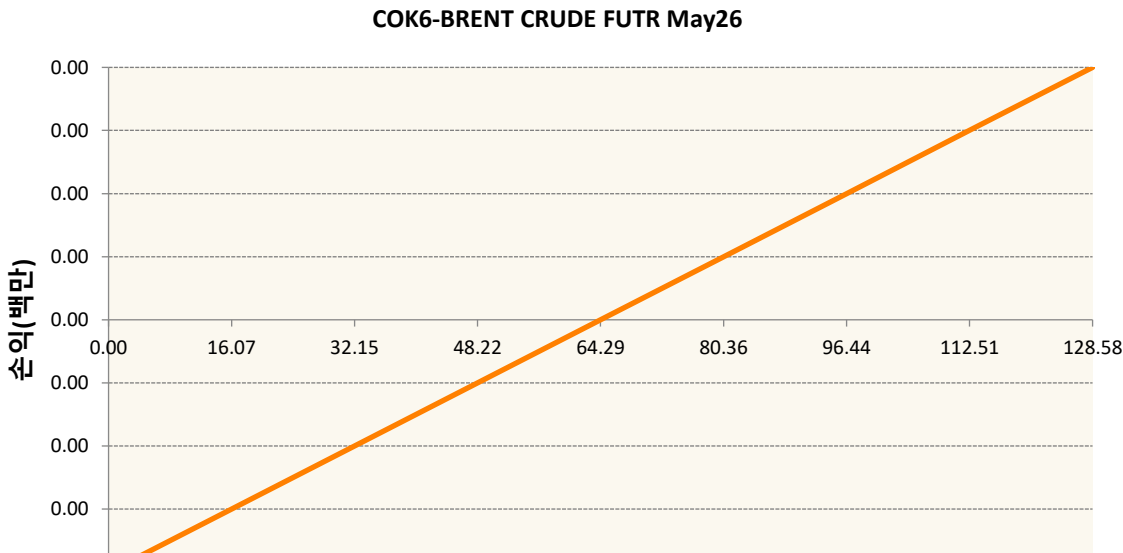
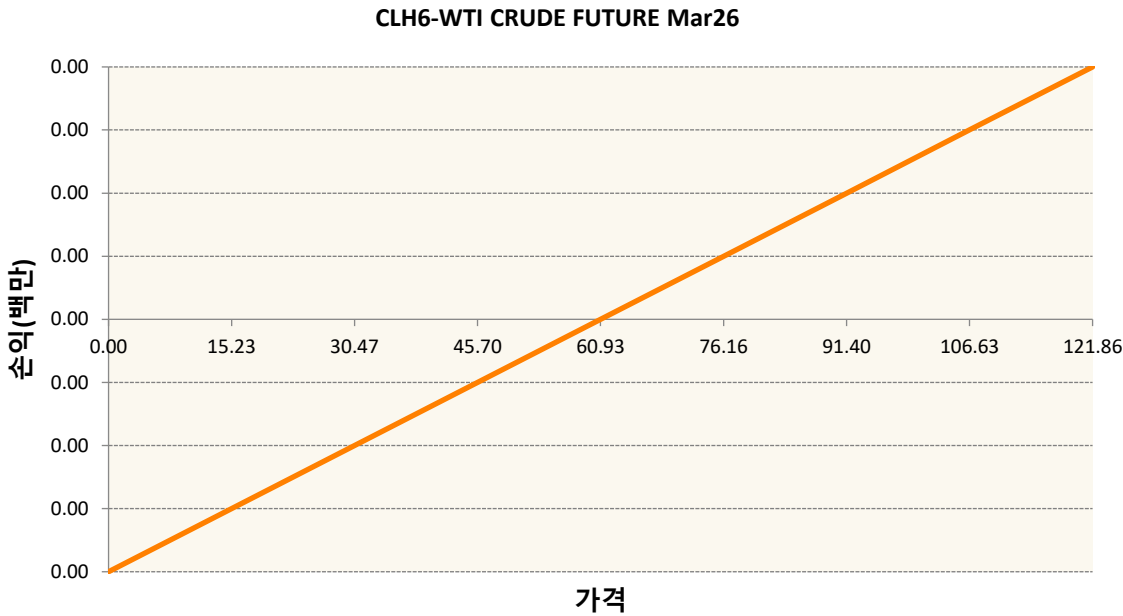
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

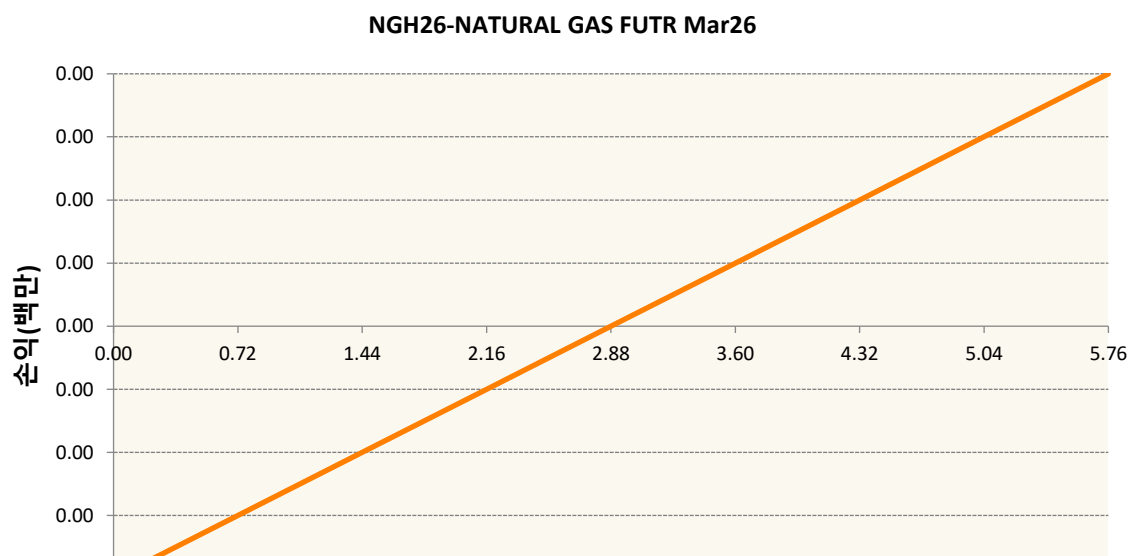
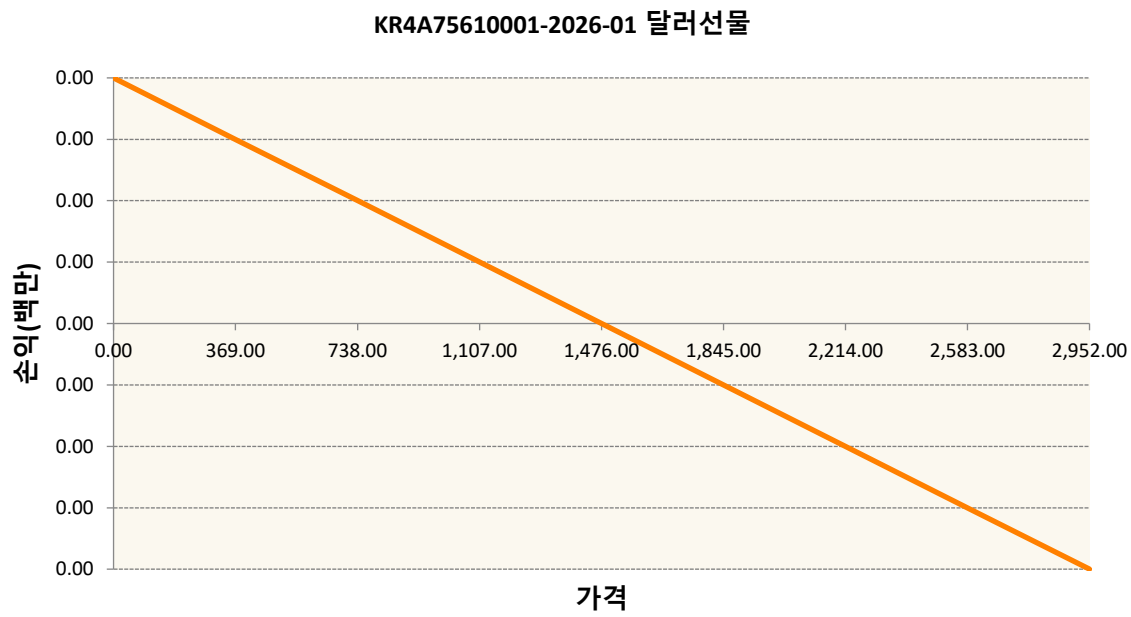
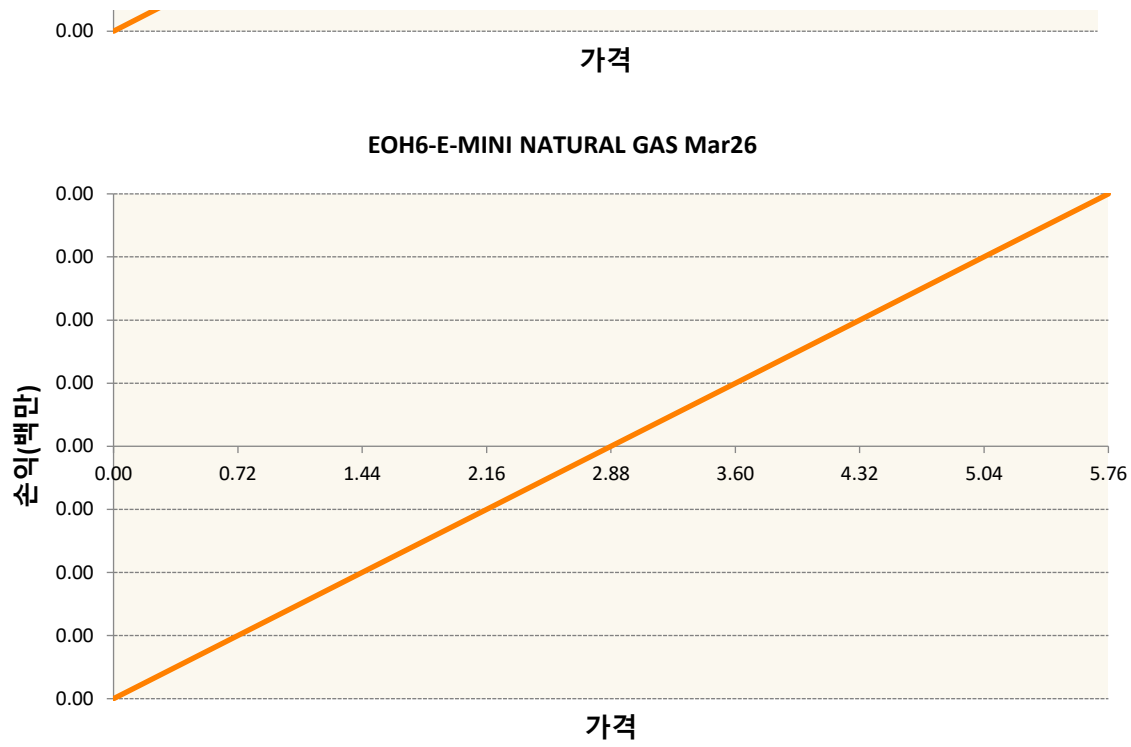
### 1. 계약금액

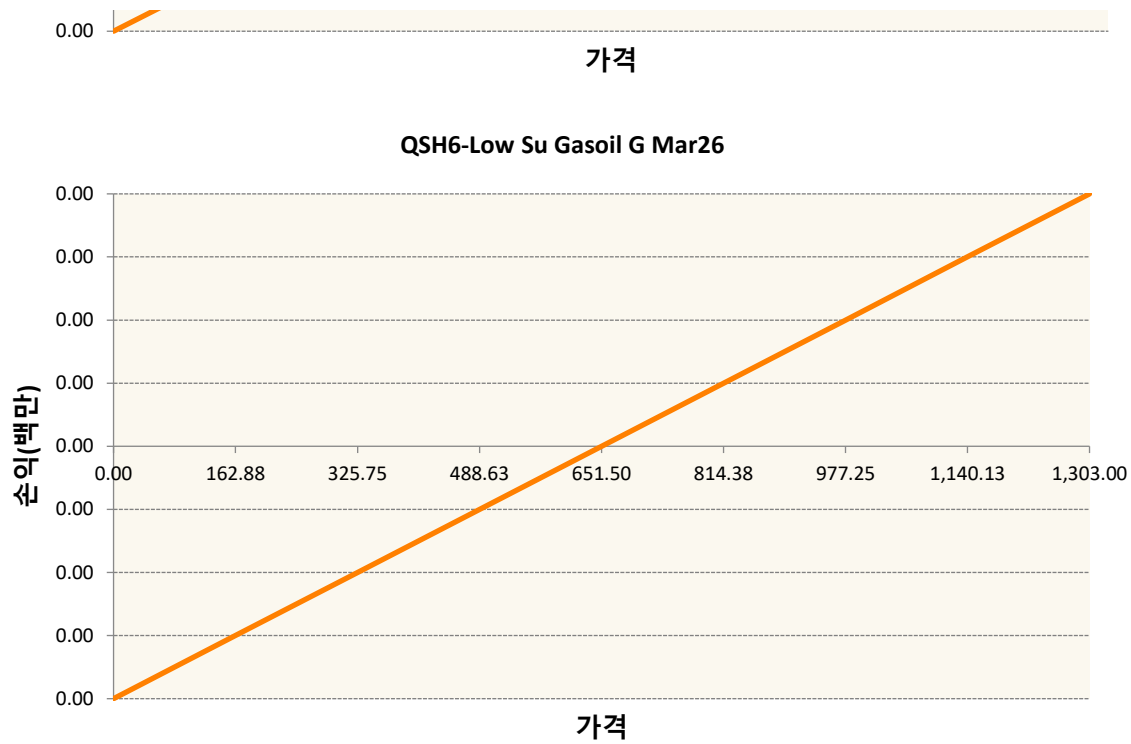
(단위:백만원)

| 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   | 116   | 0     | 116       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 375   | 0     | 375       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 74    | -74       | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조







### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                    |                          |    |
|--------------------|--------------------------|----|
| CLH6               | WTI CRUDE FUTURE Mar26   | 7  |
| COK6               | BRENT CRUDE FUTR May26   | 15 |
| EOH6               | E-MINI NATURAL GAS Mar26 | 3  |
| KR4A756100 2026-01 | 달러선물                     | 6  |
| NGH26              | NATURAL GAS FUTR Mar26   | 7  |
| QSH6               | Low Su Gasoil G Mar26    | 8  |

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

(단위:백만원)

84