

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

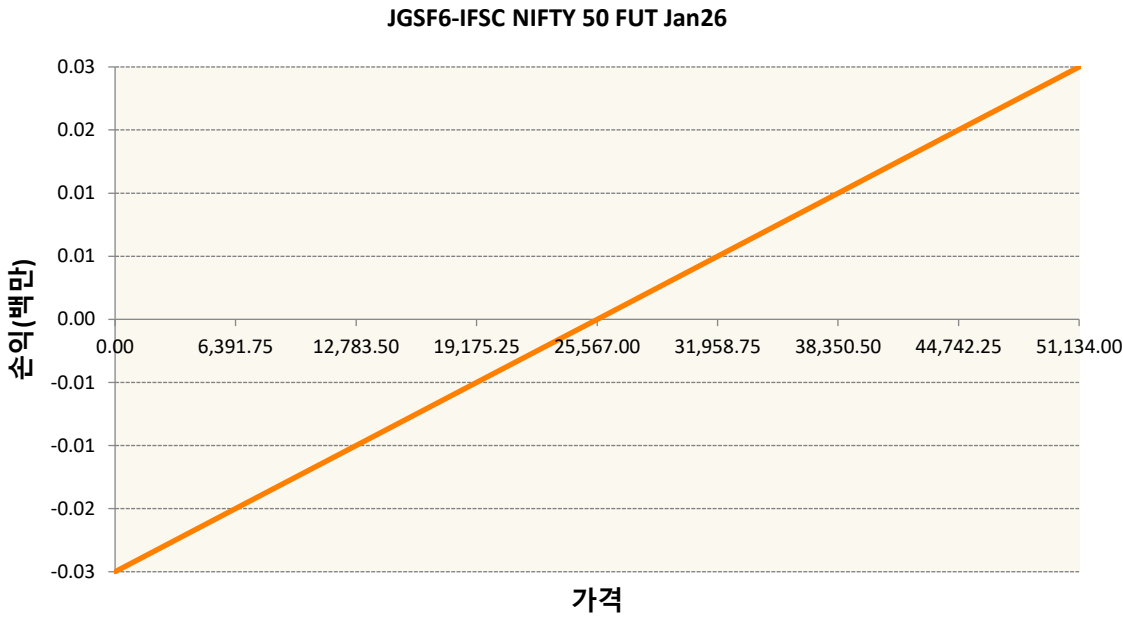
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	657	0	657	

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)

32

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

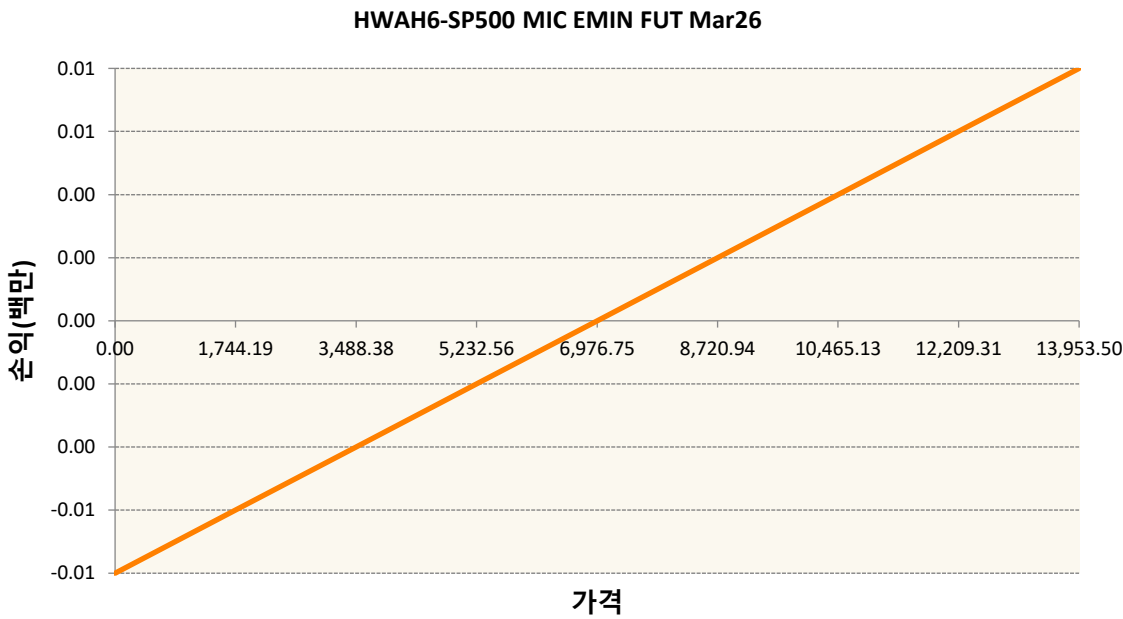
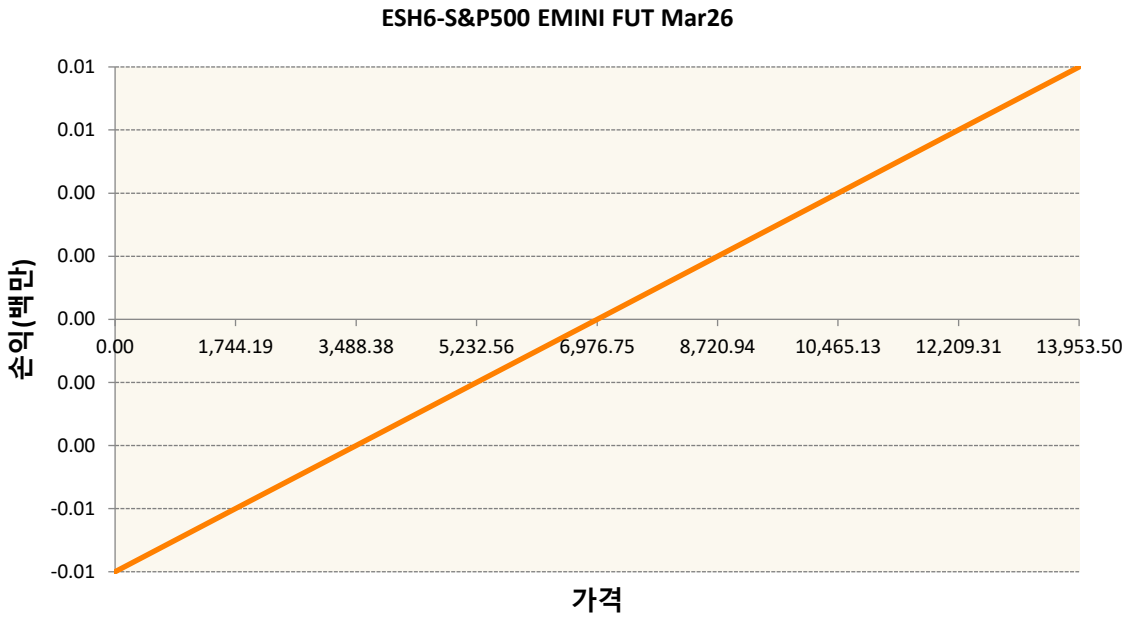
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	258	0	258	장내
누계	지수	선물	516	0	516	

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)
	53

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

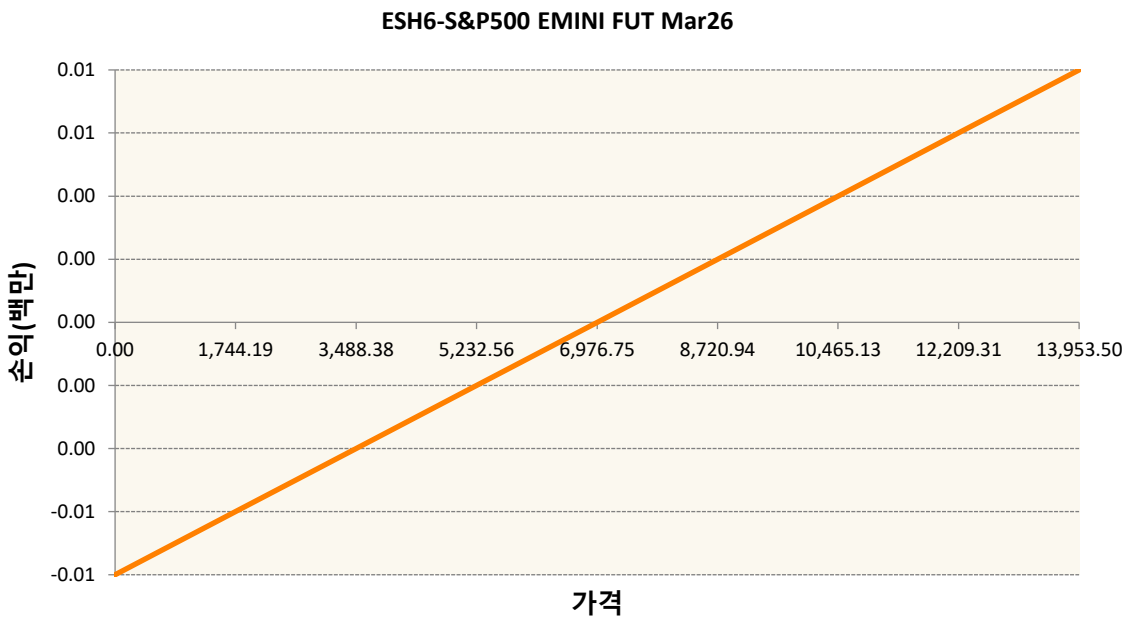
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,547	0	1,547	

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)

106

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

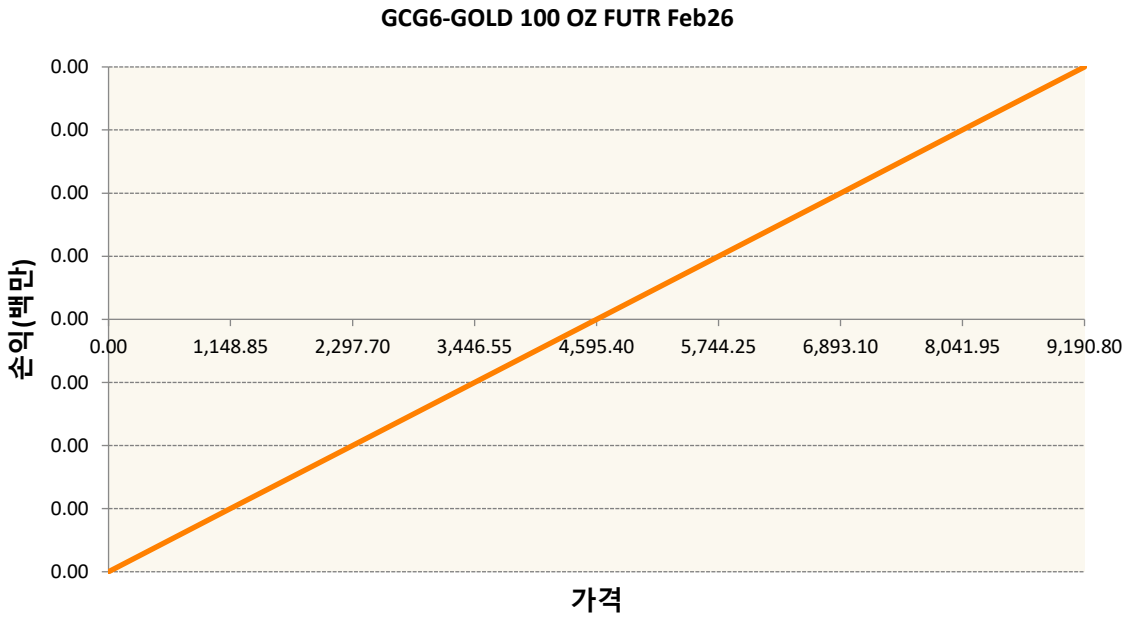
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	3,384	0	3,384	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 01/23/26 C428 EQUITY	2
GCG6 GOLD 100 OZ FUTR Feb26	271

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

(단위:백만원)

334

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

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)

AOPLTRUA1\$PLTR US 01/23/26 C187.5 EQUITY	10
AOPLTRUB1\$PLTR US 01/23/26 P187.5 EQUITY	88

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

(단위:백만원)

370

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

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)

AOTLTUS0C(TLT US 01/23/26 C89 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

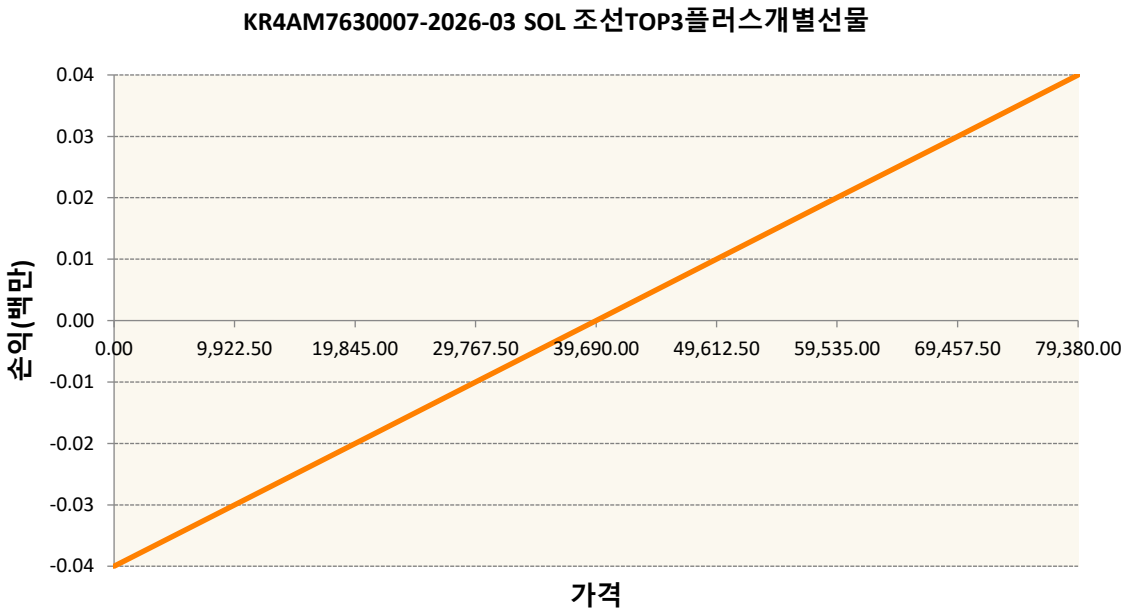
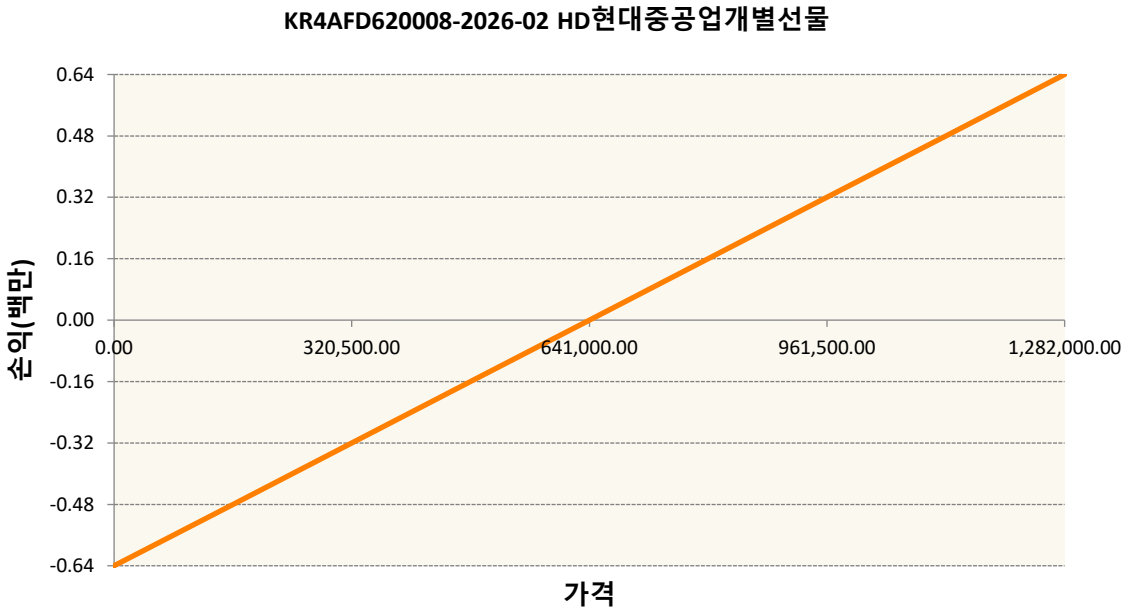
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	26,666	0	26,666	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD620008			2026-02 HD현대중공업개별선물				1,028
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028	-1,028
-5.33%	-685	-685	-685	-685	-685	-685	-685
-2.67%	-343	-343	-343	-343	-343	-343	-343
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	343	343	343	343	343	343	343
5.33%	685	685	685	685	685	685	685
8.00%	1,028	1,028	1,028	1,028	1,028	1,028	1,028
KR4AM7630007			2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물				1,109
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109	-1,109
-5.33%	-740	-740	-740	-740	-740	-740	-740
-2.67%	-370	-370	-370	-370	-370	-370	-370
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	370	370	370	370	370	370	370
5.33%	740	740	740	740	740	740	740
8.00%	1,109	1,109	1,109	1,109	1,109	1,109	1,109

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

2,000

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

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	2026-01-21
기준일	2026-01-20

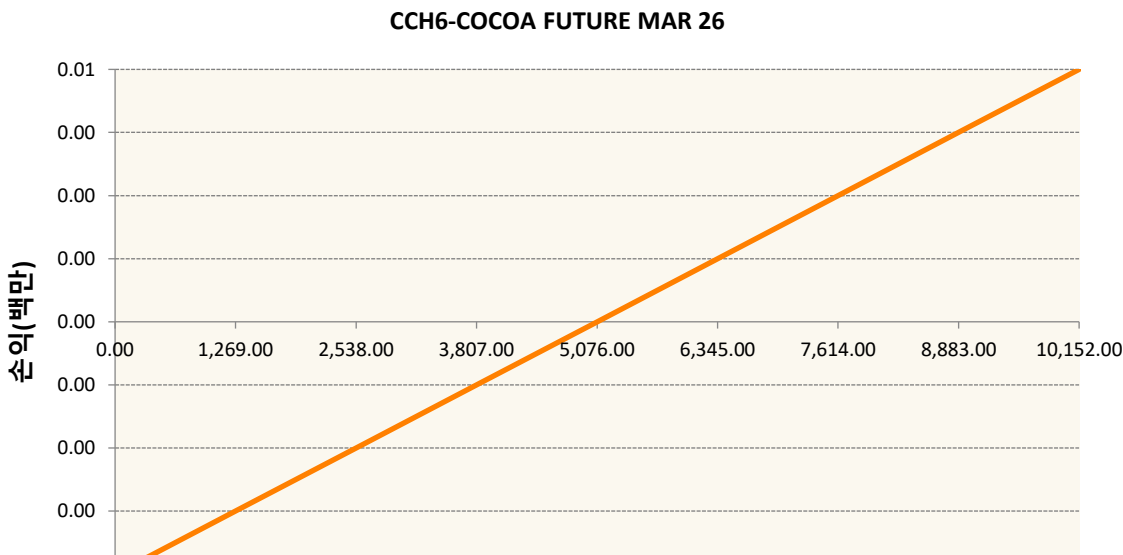
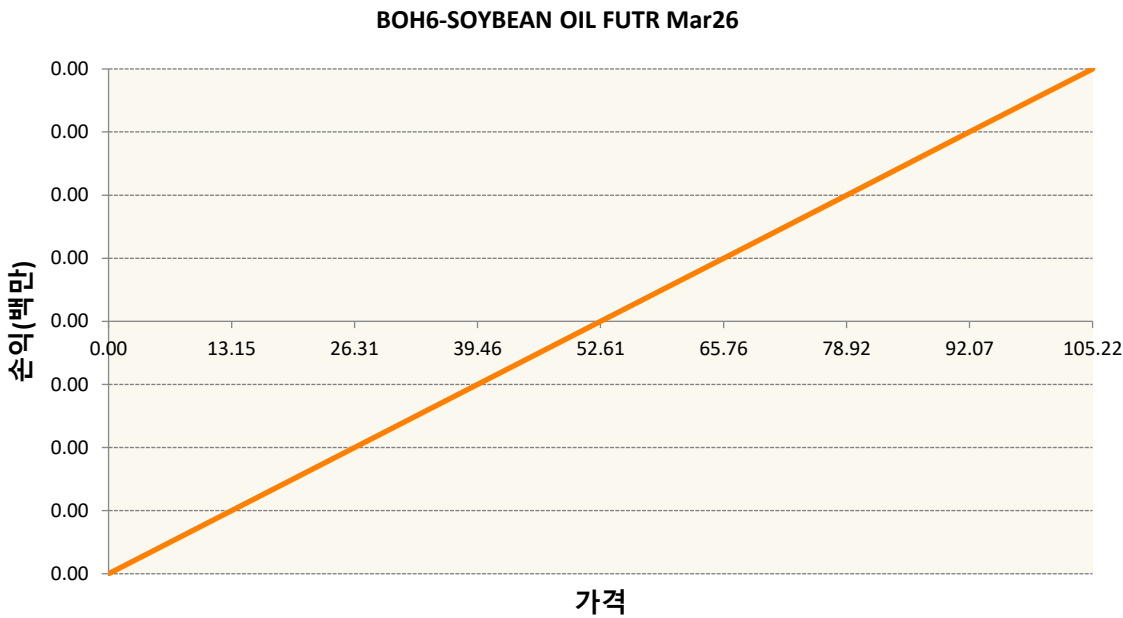
포커스농산물모(채권-파생형)

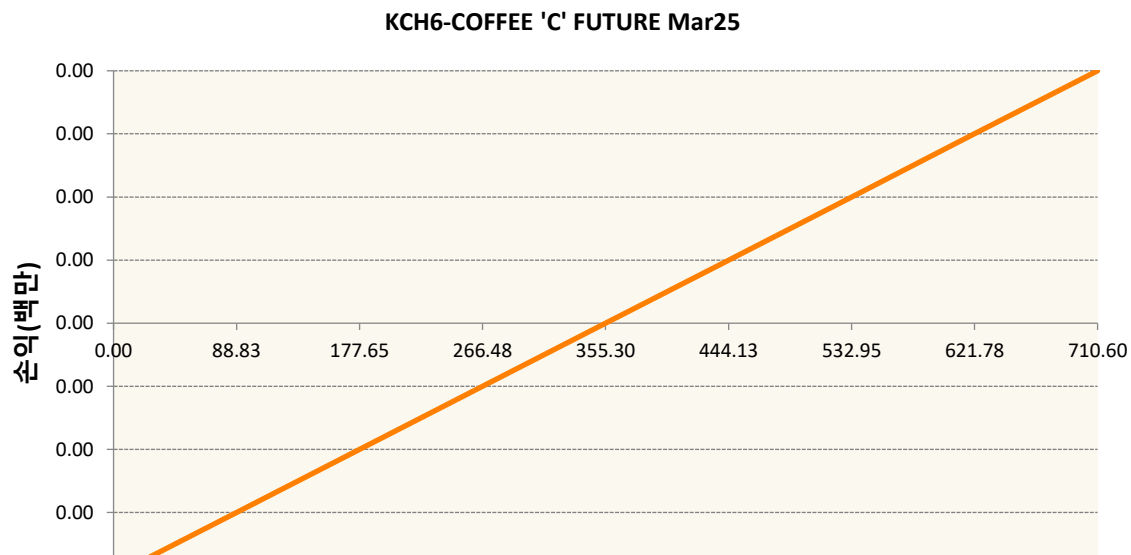
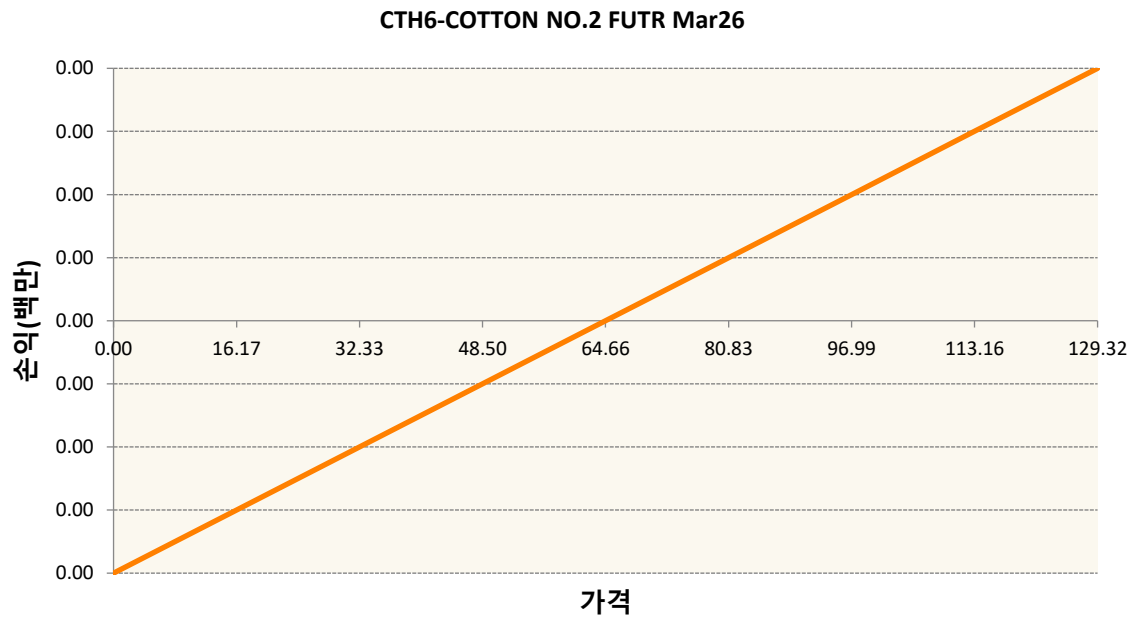
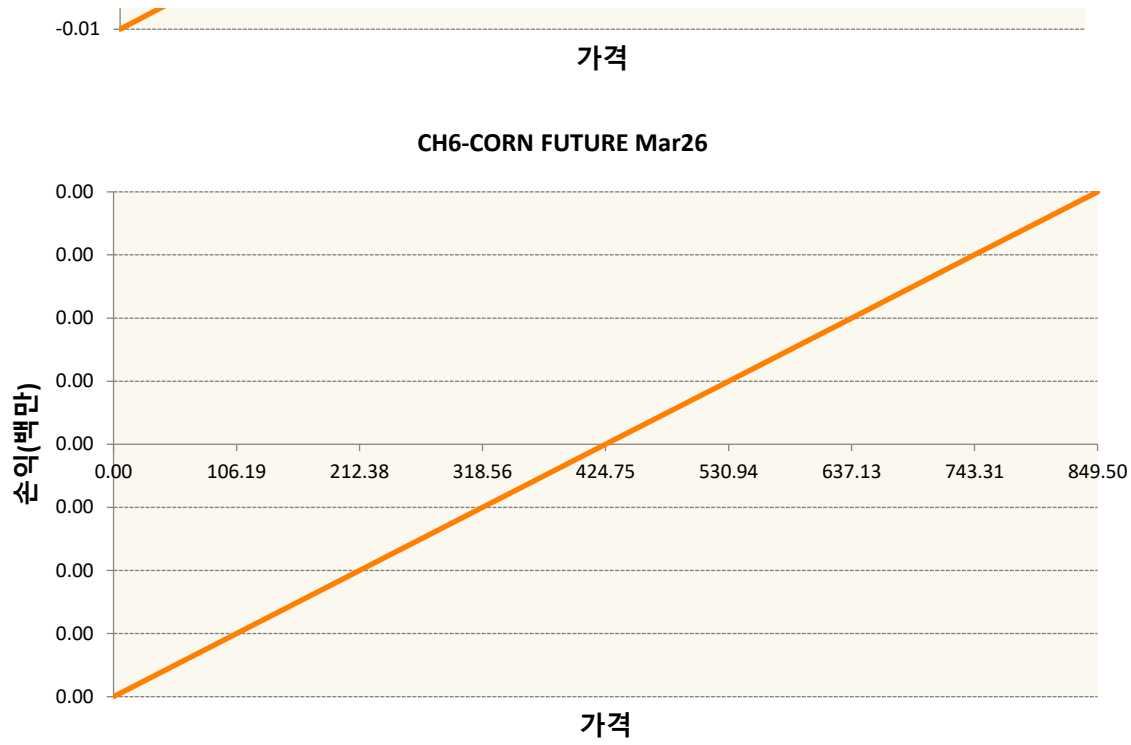
1. 계약금액

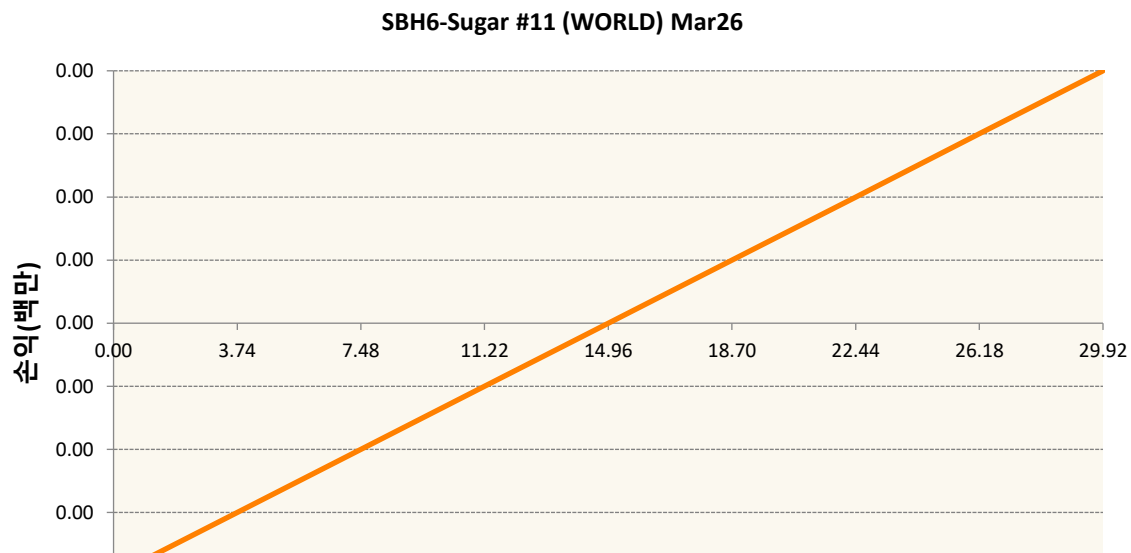
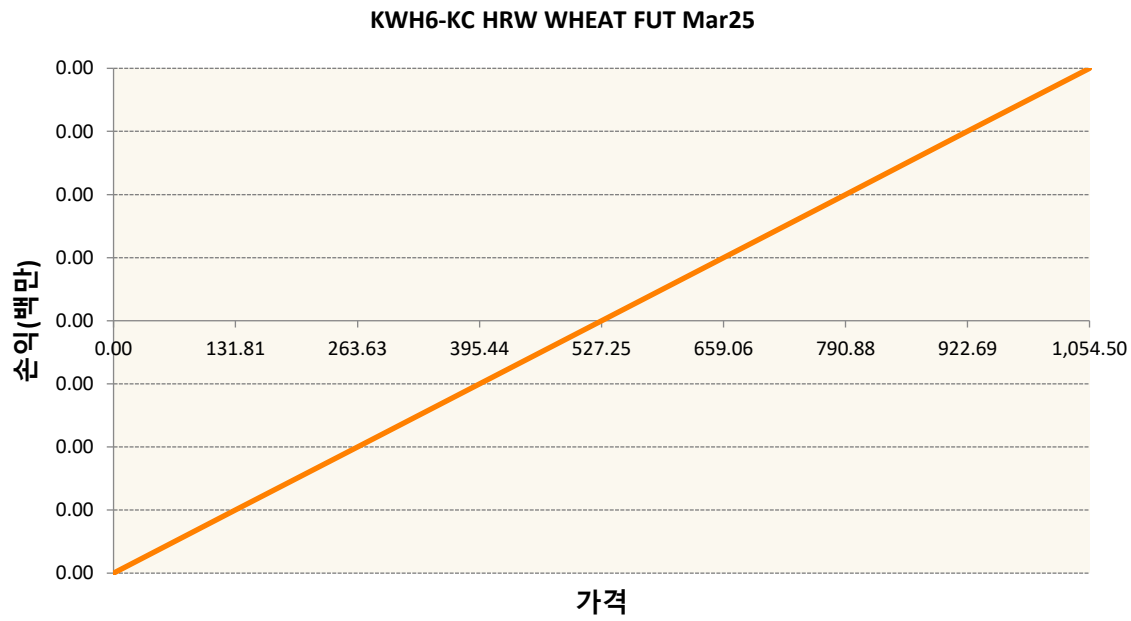
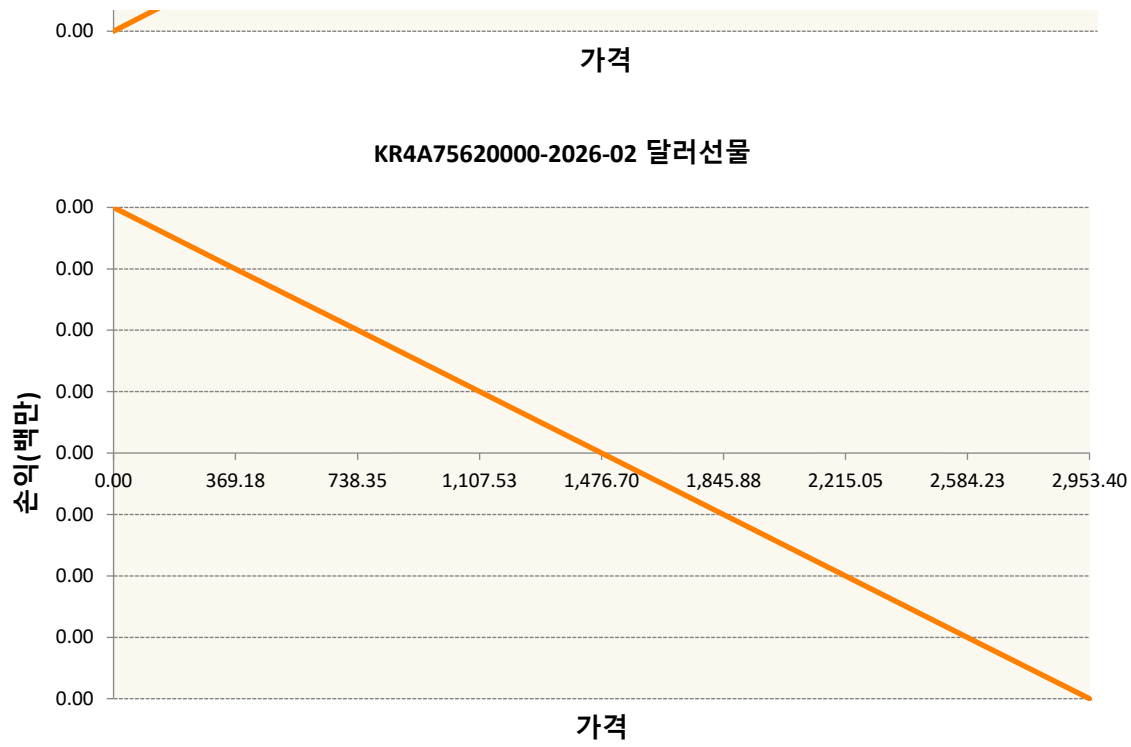
(단위:USD 백만)

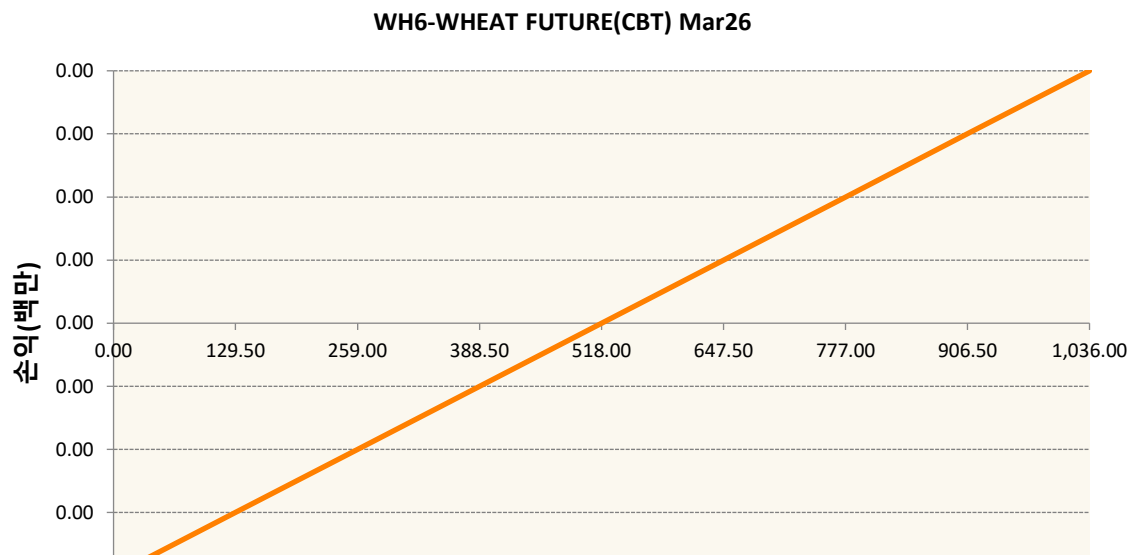
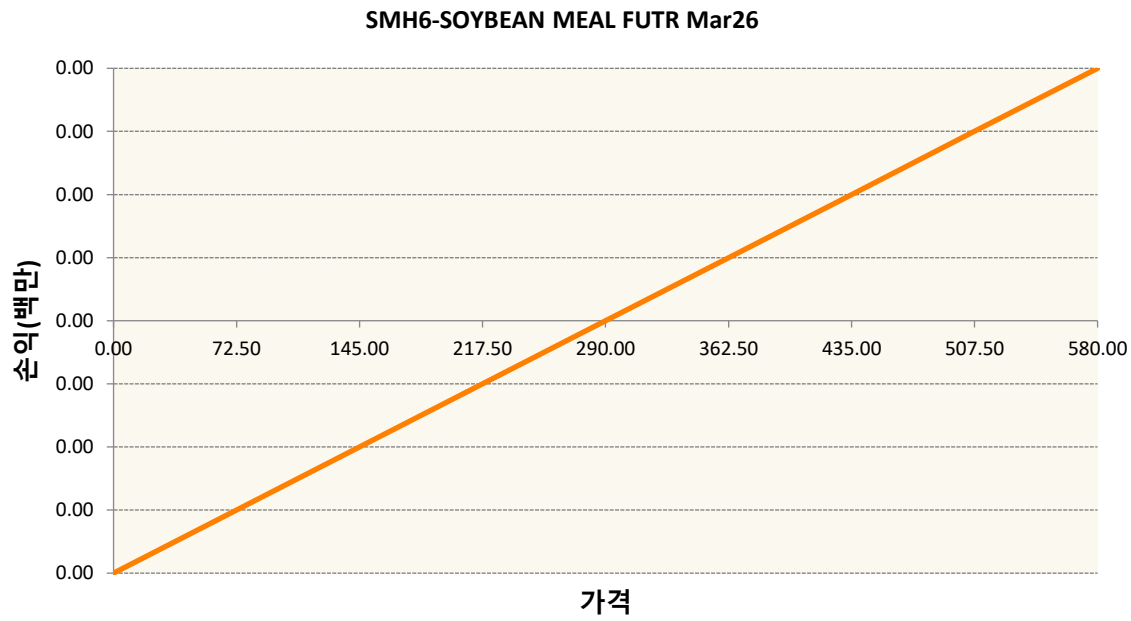
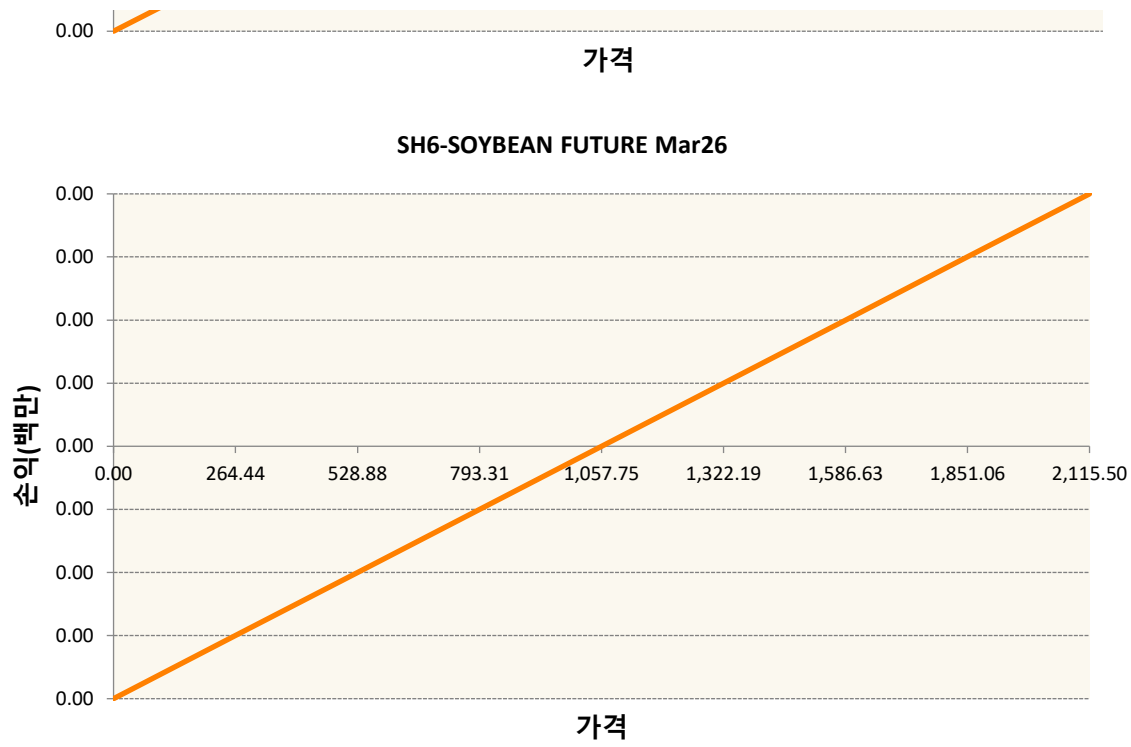
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	474	0	474	
누계	유가증권	선물	2,527	0	2,527	
누계	통화	선물	0	281	-281	장내

2. 만기시점의 손익구조









0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

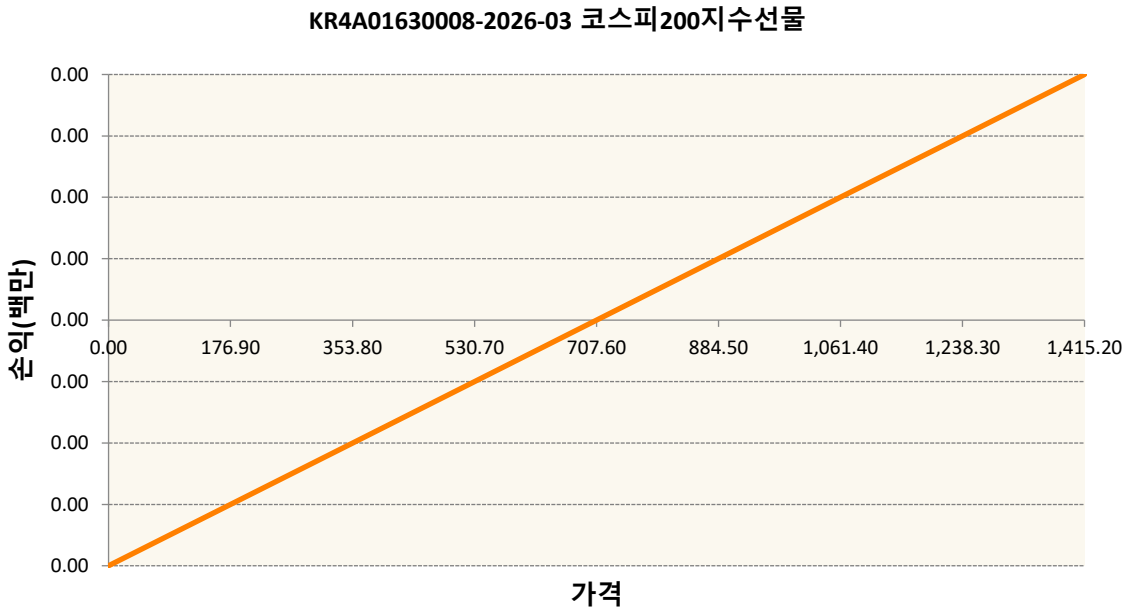
스마트인덱스모

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	2,300	0	2,300	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물	184
-------------------------------	-----

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

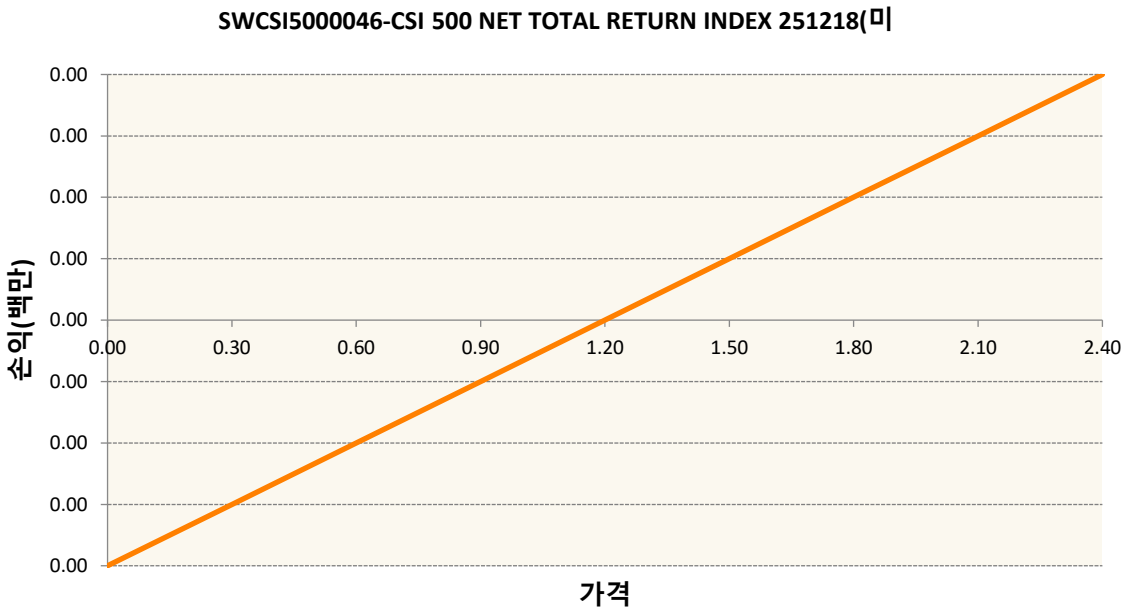
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,543	0	5,543	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

443

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

536

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

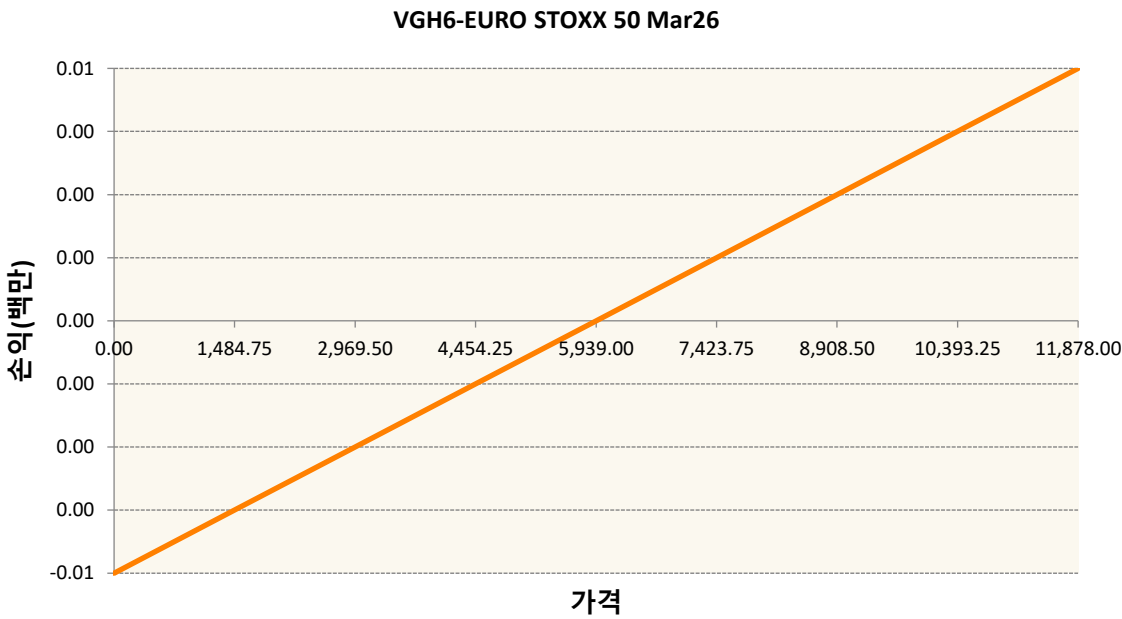
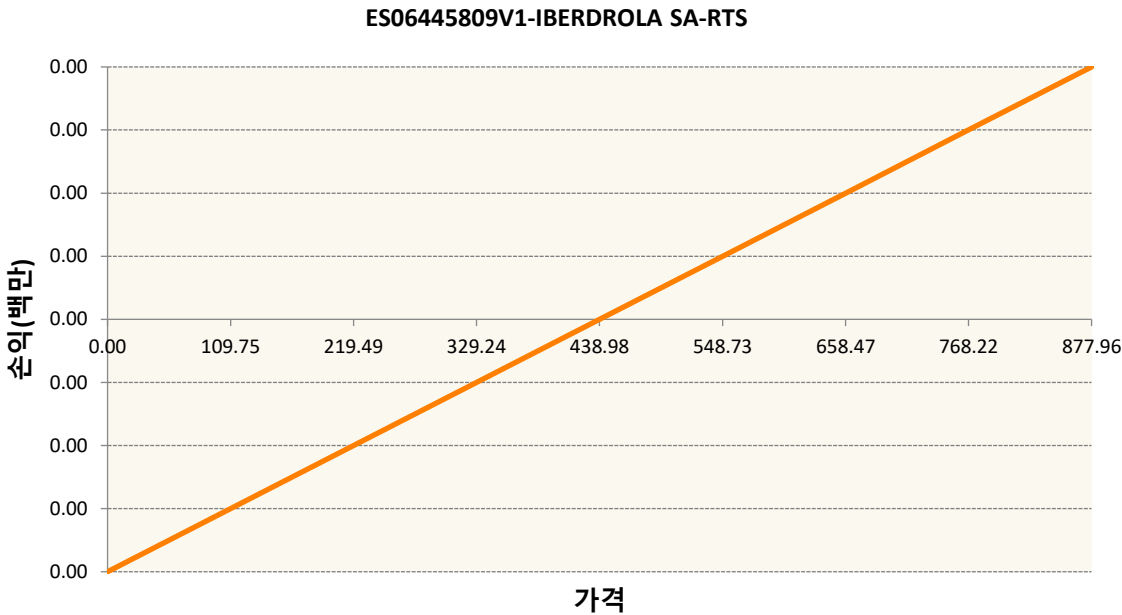
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	927	0	927	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ES06445809\IBERDROLA SA-RTS		0.12
VGH6	EURO STOXX 50 Mar26	74

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	60

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

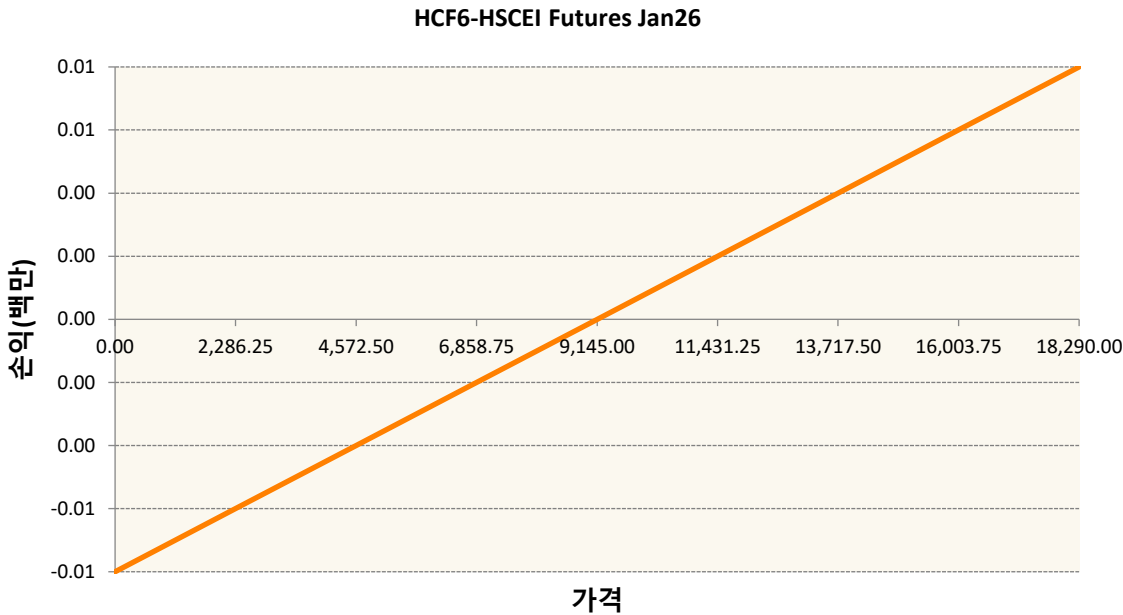
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,046	0	2,046	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF6	HSCEI Futures Jan26	164
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

230

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

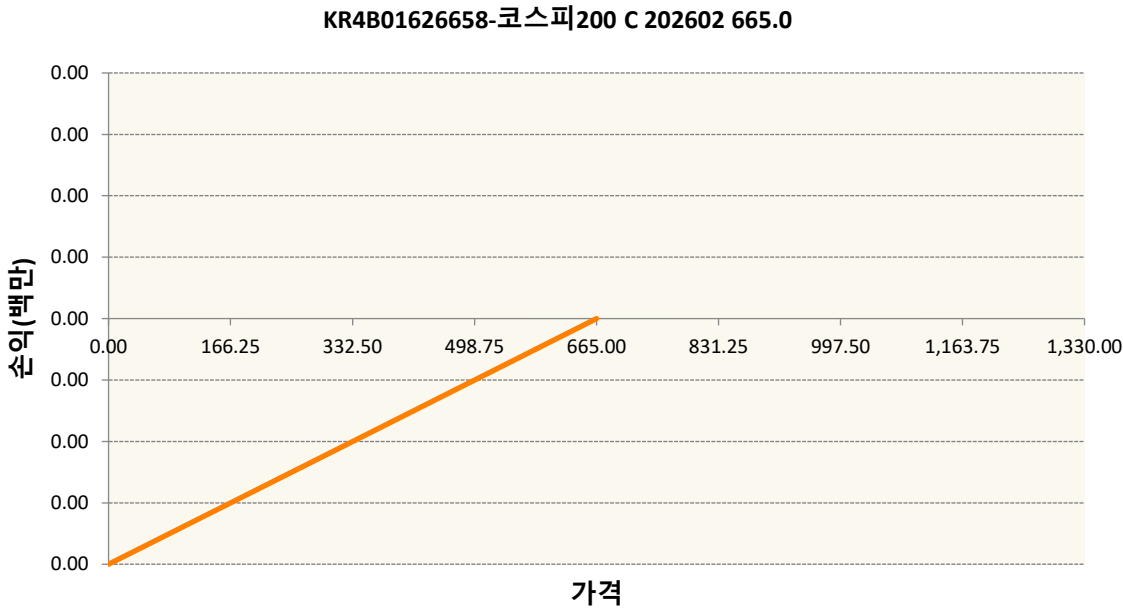
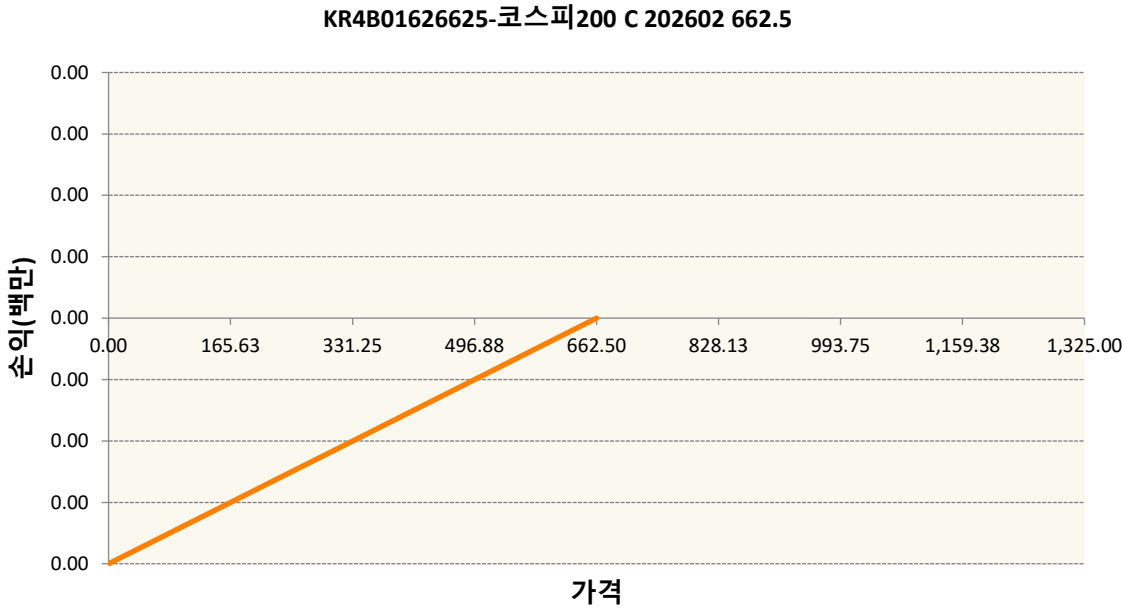
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

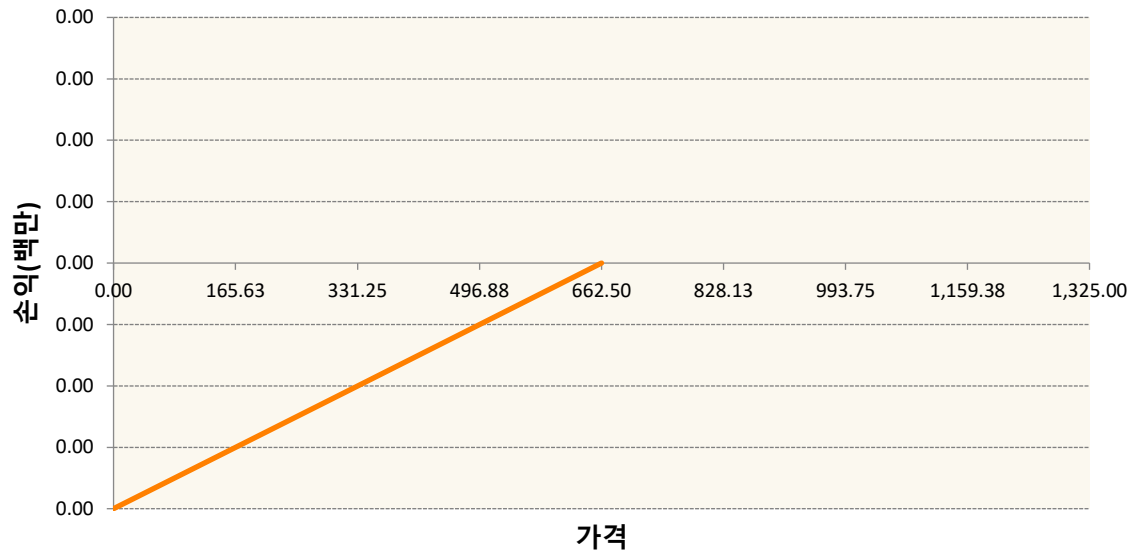
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,371	-34,371	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

1,835

KR4C016266 코스피200 P 202602 662.5

530

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-01-21

기준일 2026-01-20

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	2026-01-21
기준일	2026-01-20

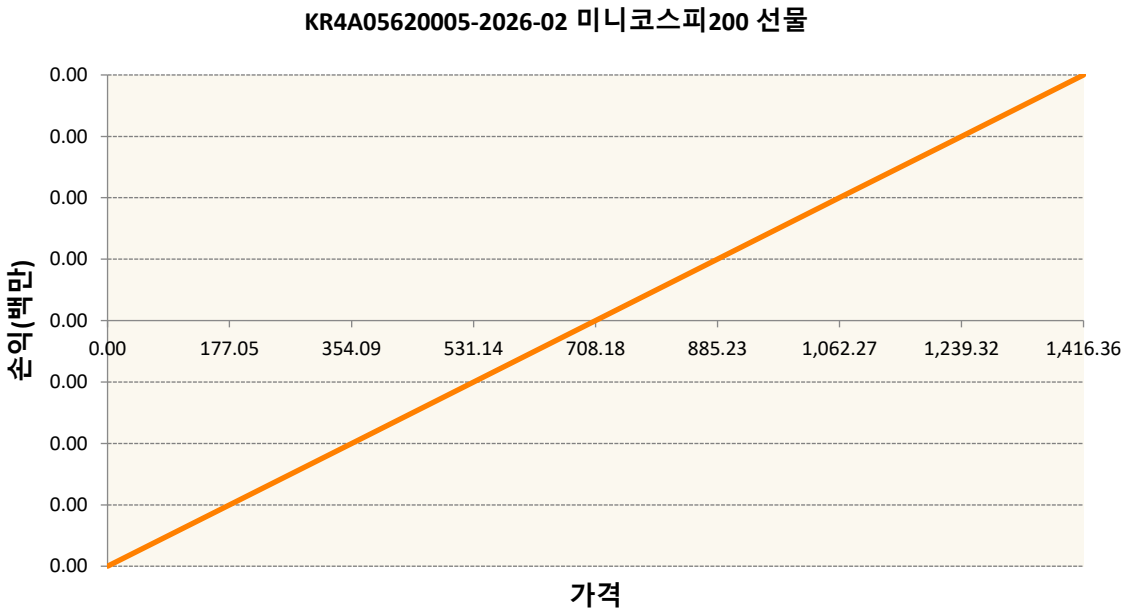
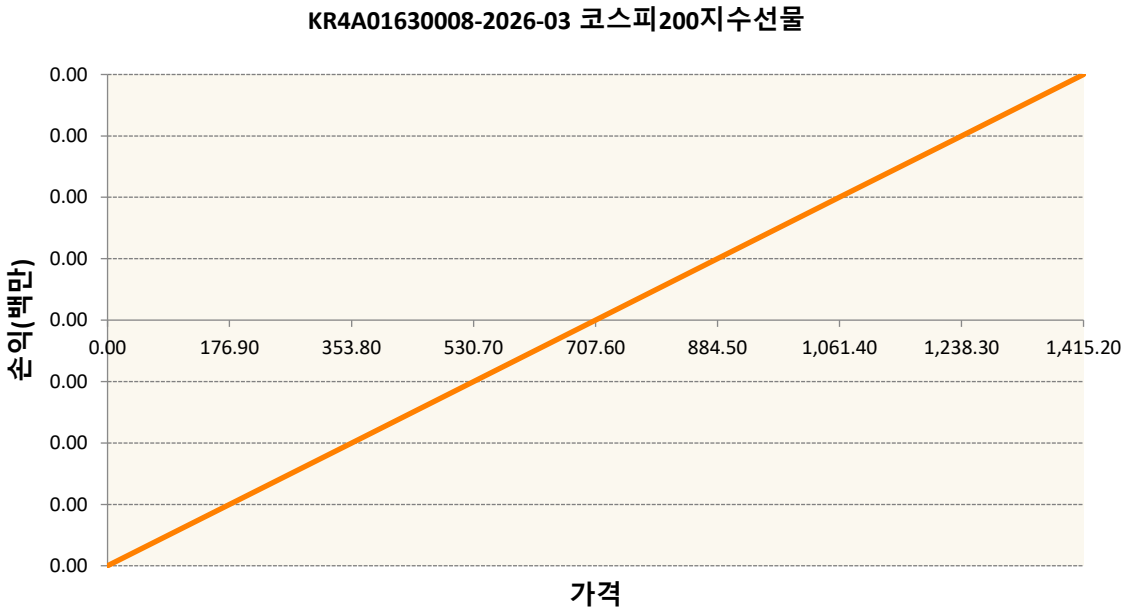
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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	1,947	0	1,947	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		71
KR4A056200 2026-02 미니코스피200 선물		17

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

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

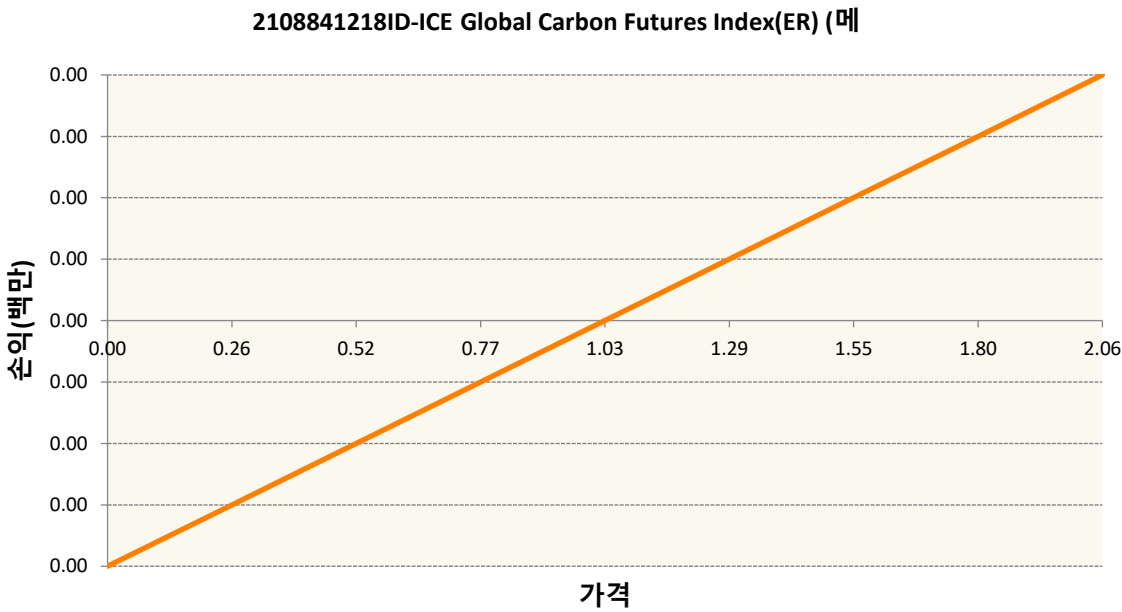
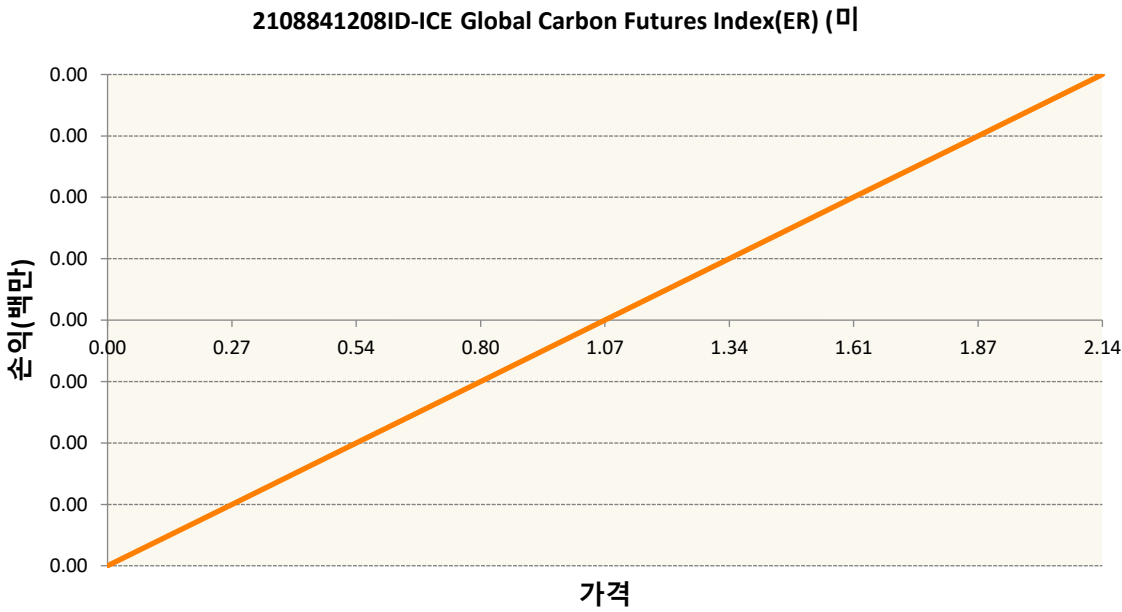
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,798	0	7,798	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		500
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		125

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		600

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

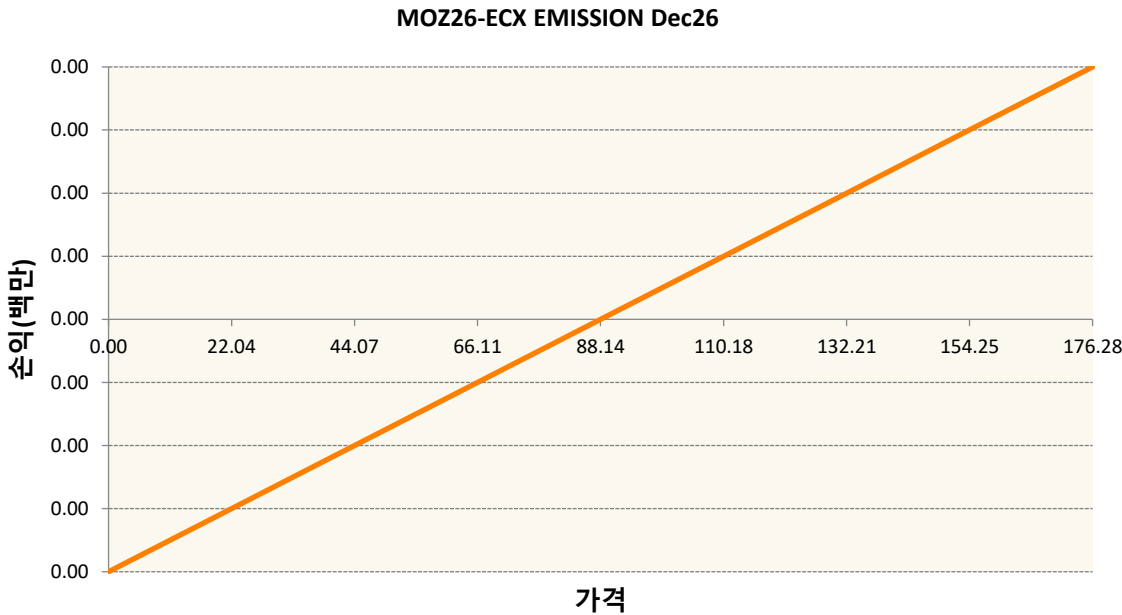
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,851	0	5,851	
누계	통화	선도	0	3,393	-3,393	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213FCP(KRW/EUR 30-01-26E	229
FXW213G1E(KRW/EUR 30-01-26E	43
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	468

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

(단위:백만원)

768

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

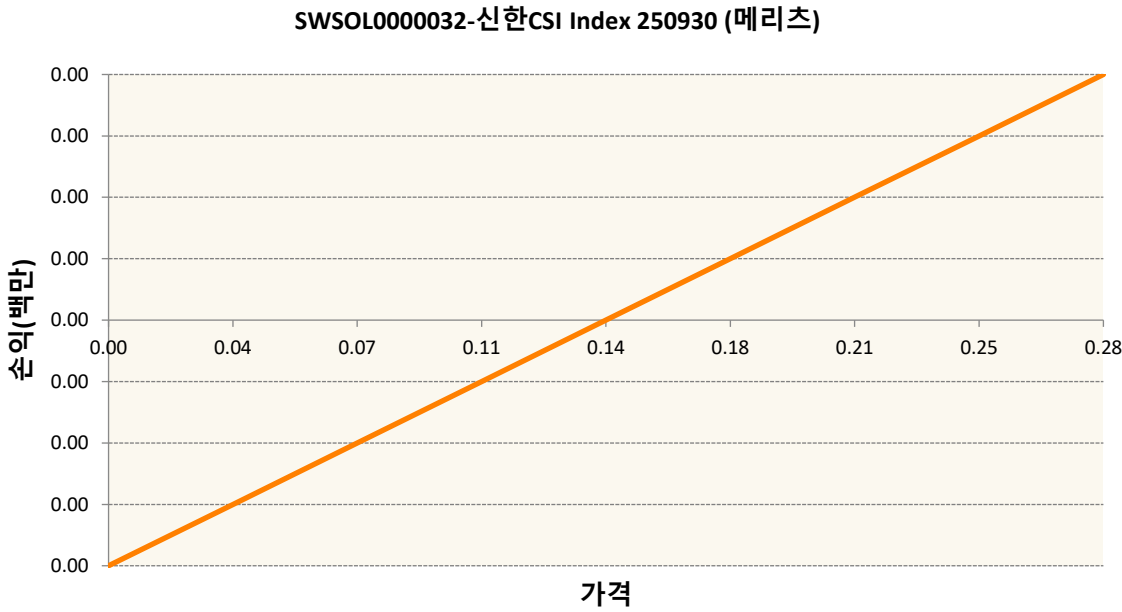
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,106	0	3,106	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	19
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	13
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	13
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	32

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

(단위:백만원)

133

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

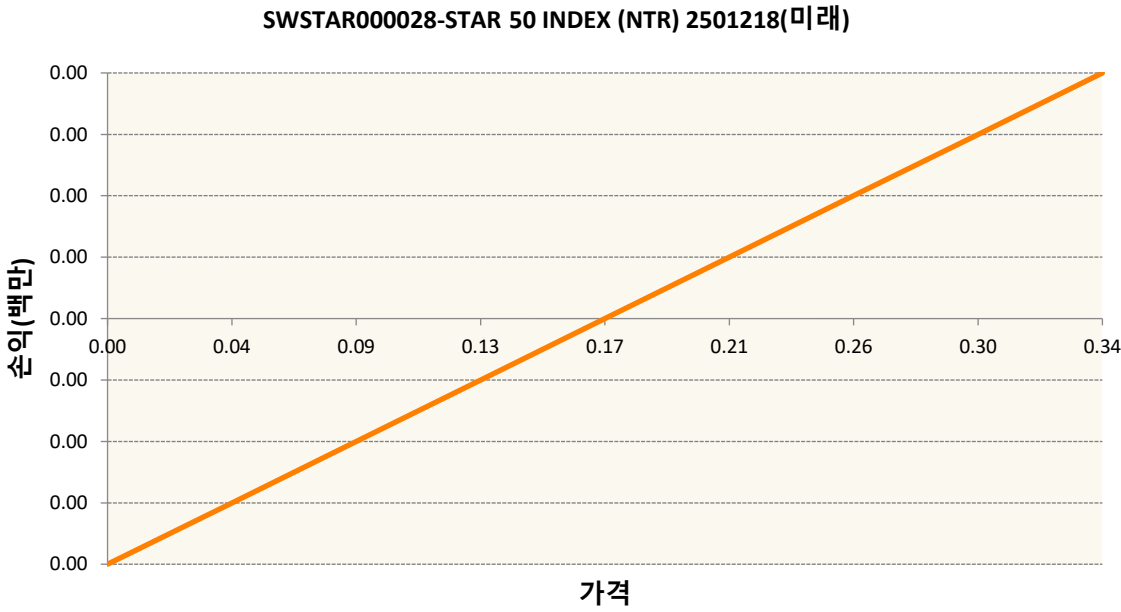
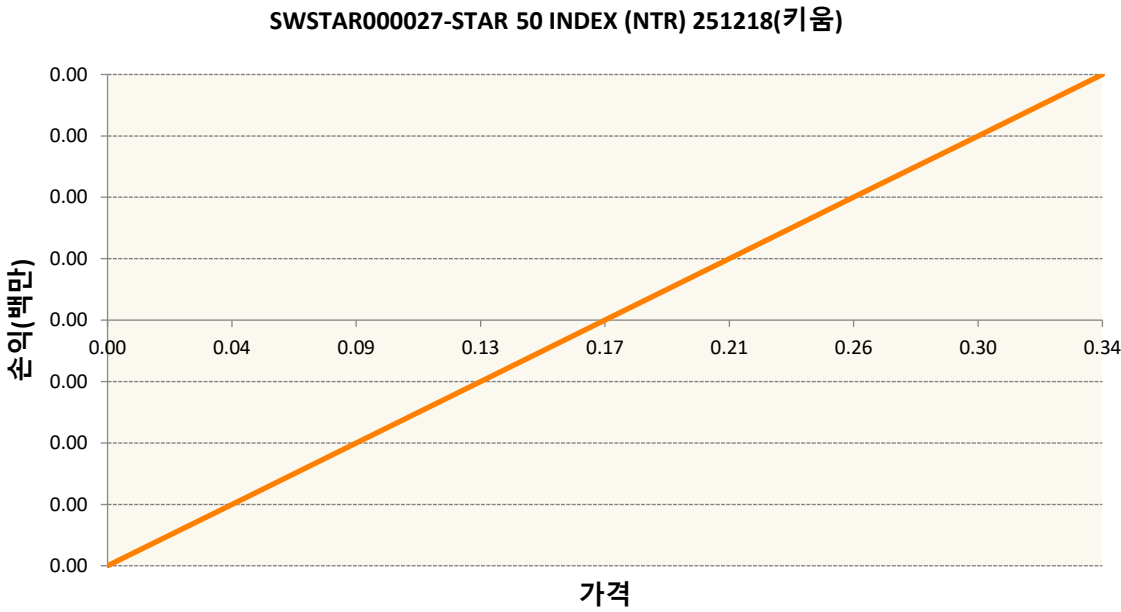
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

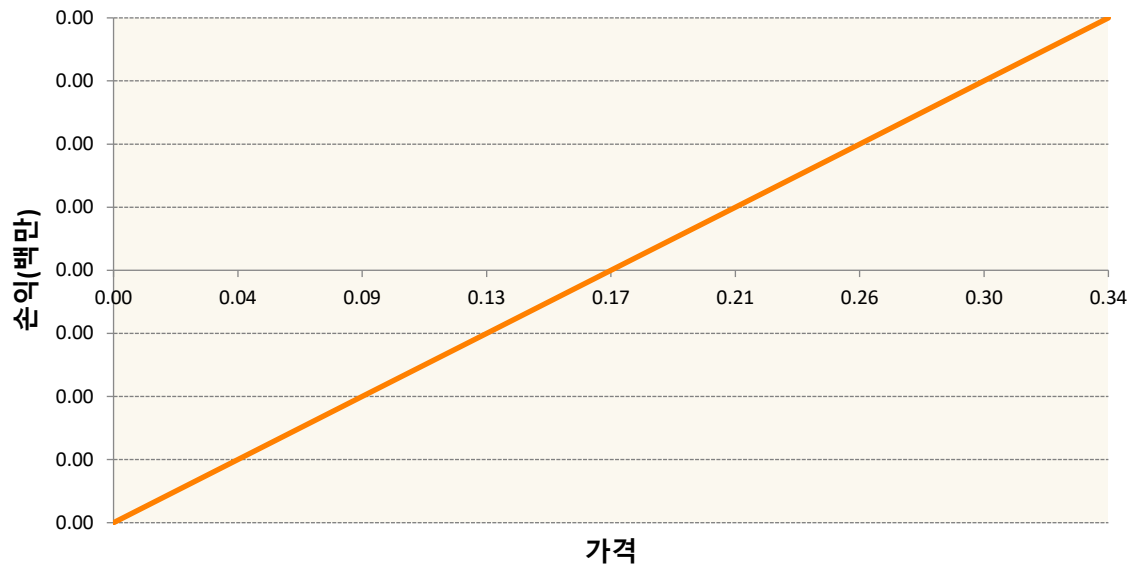
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,105	0	3,105	장외

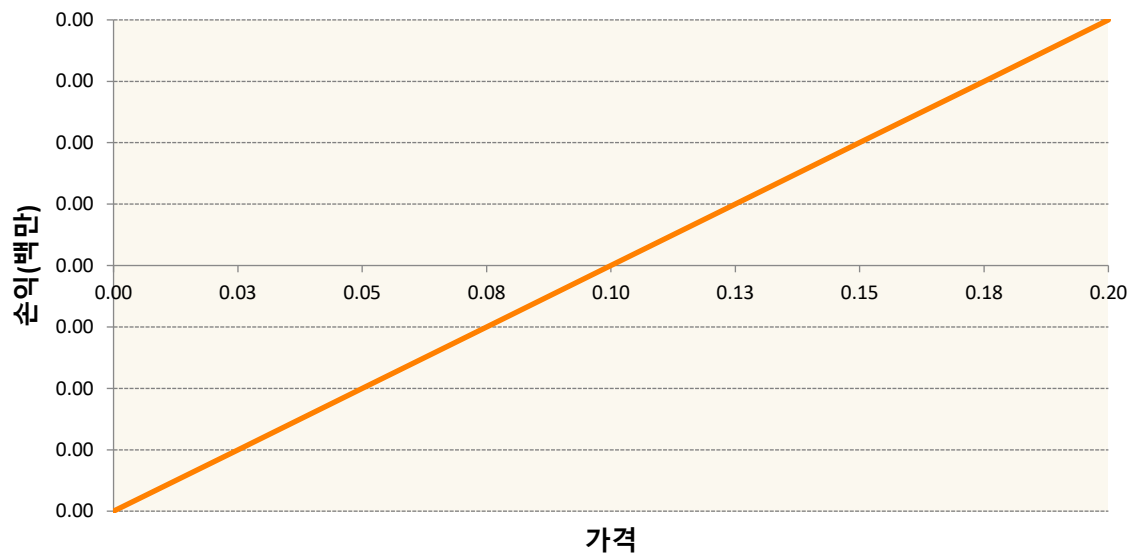
2. 만기시점의 손익구조



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))	12
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))	77
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))	40
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠))	124

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

(단위:백만원)

460

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

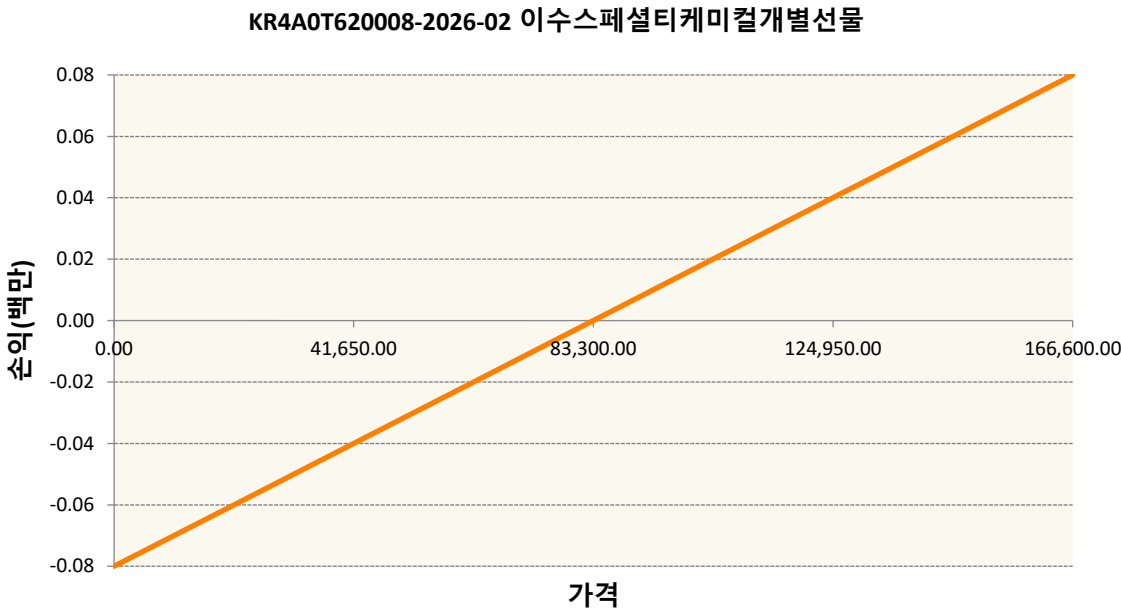
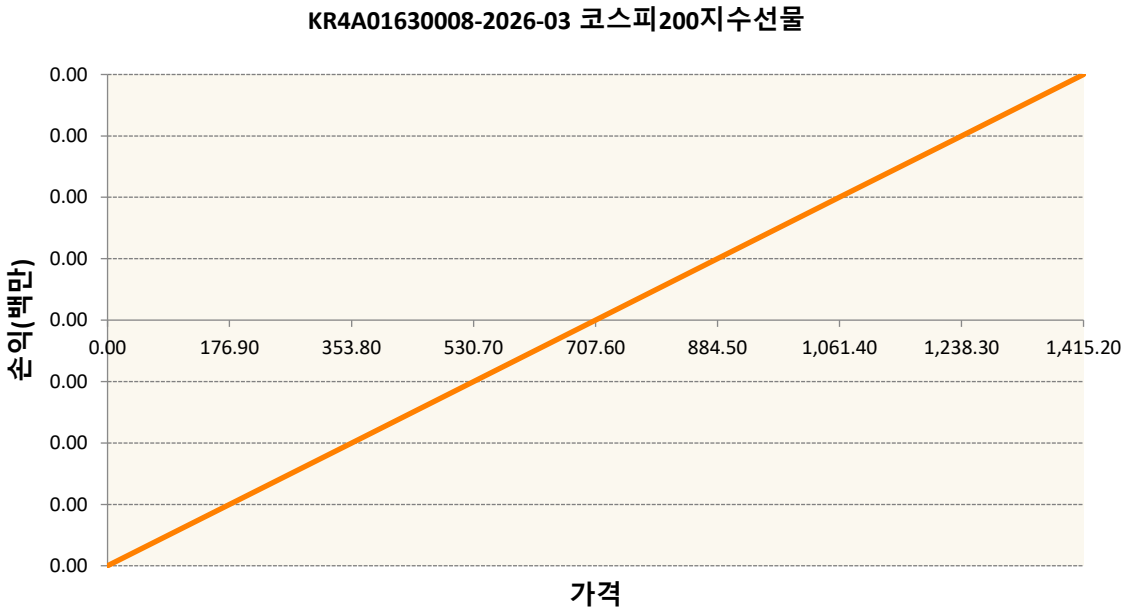
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

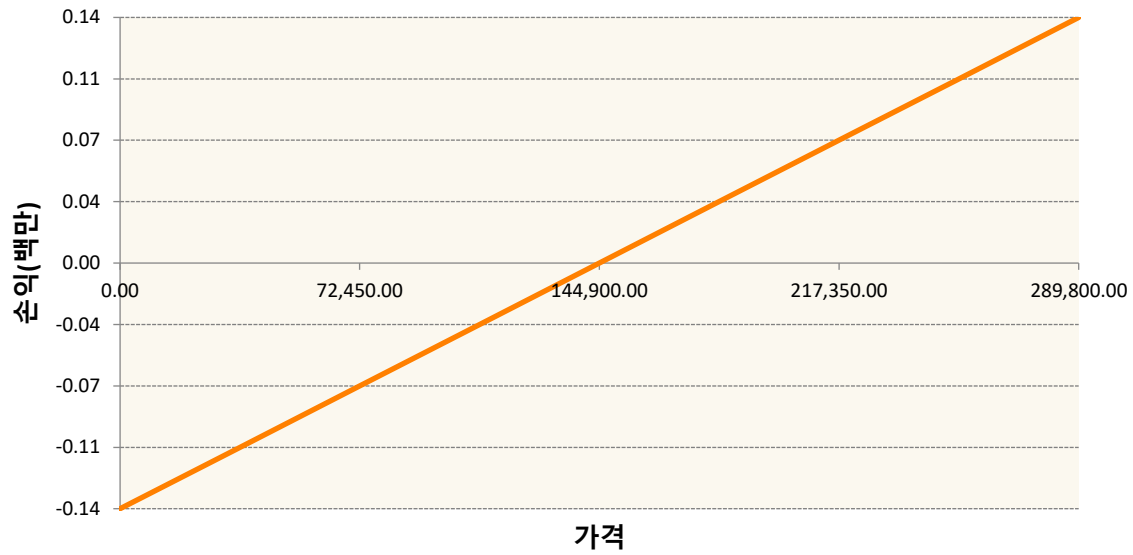
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	178	352	-174	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	9,553	3,588	5,965	장내
누계	유가증권	스왑	4	0	4	장외

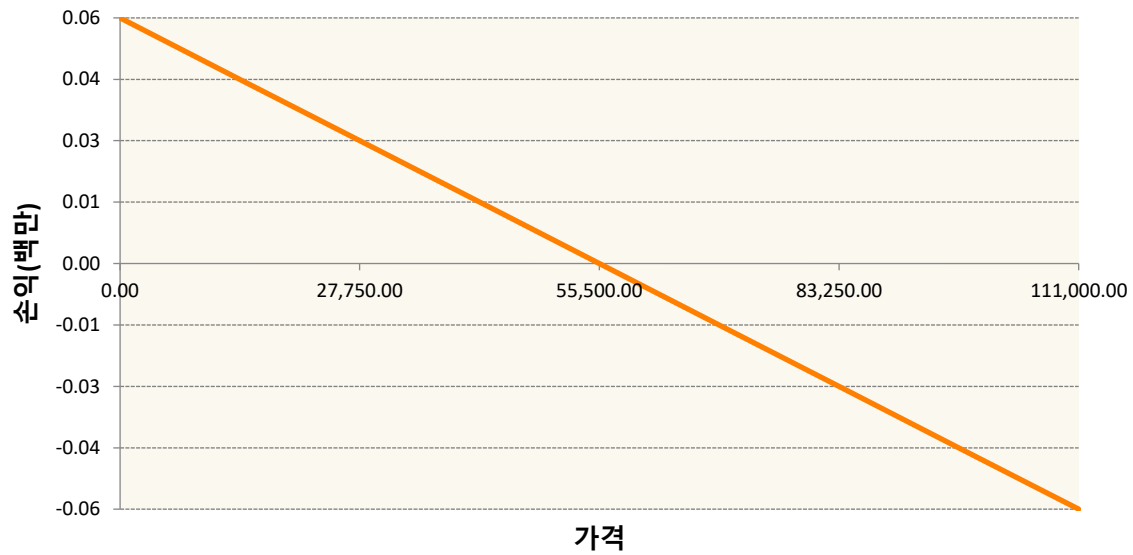
2. 만기시점의 손익구조



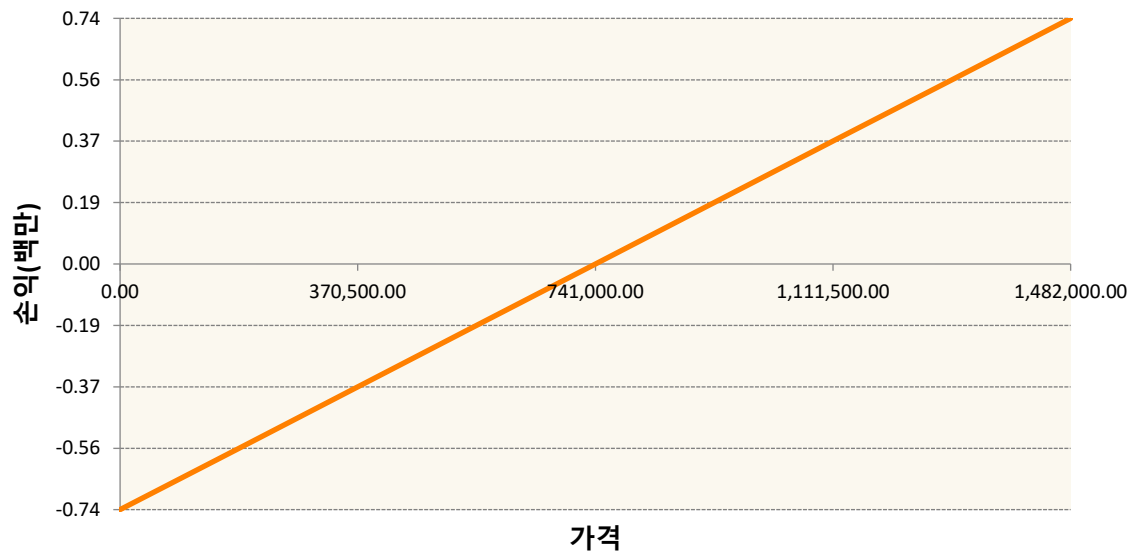
KR4A11620007-2026-02 삼성전자개별선물



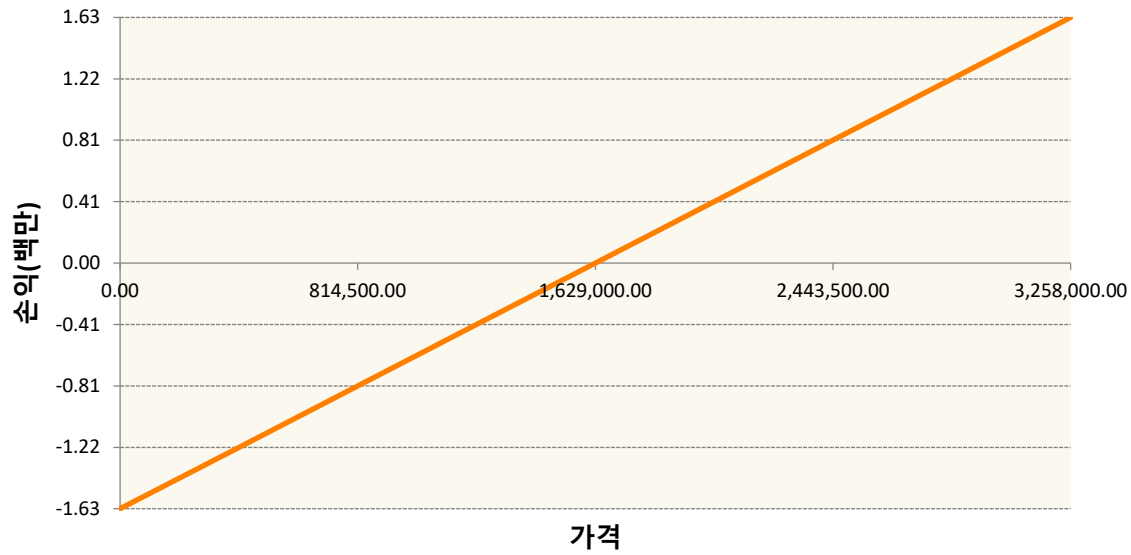
KR4A14620004-2026-02 KT개별선물



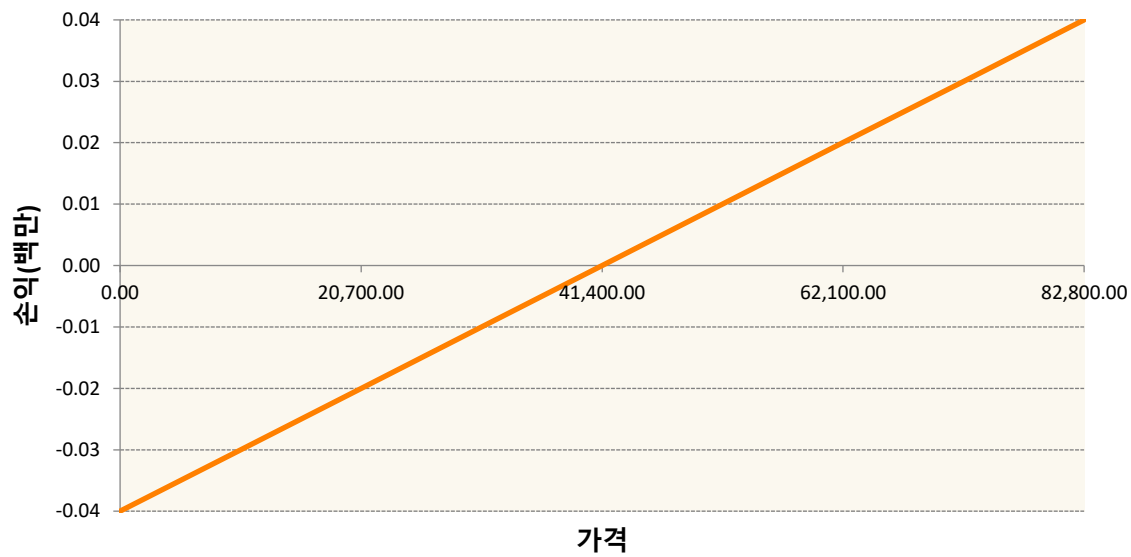
KR4A50620009-2026-02 SK하이닉스개별선물



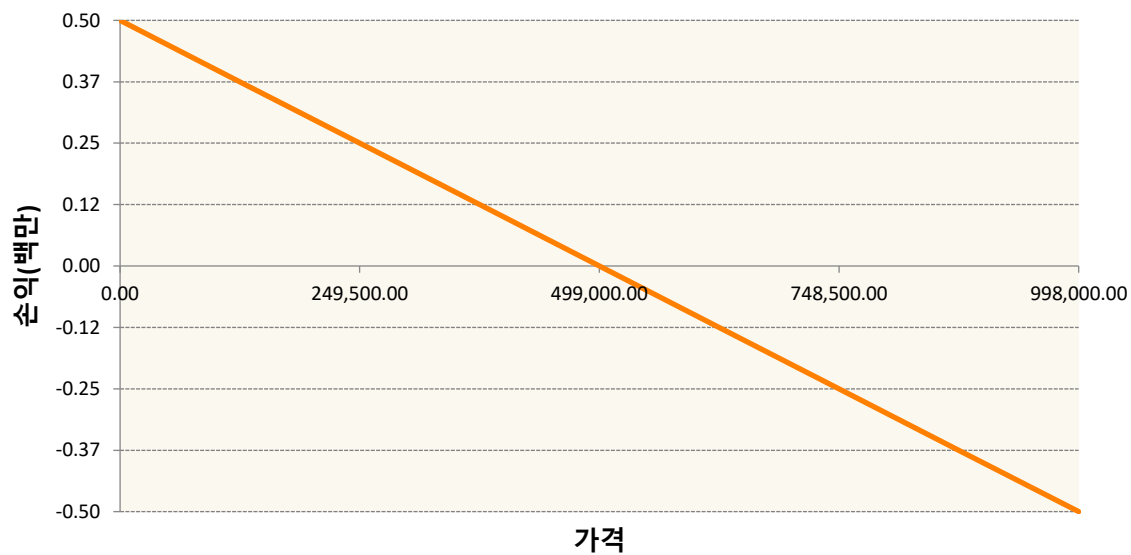
KR4AB3620005-2026-02 고려아연개별선물



KR4ACN620009-2026-02 포스코DX개별선물



KR4ACT620003-2026-02 삼성화재개별선물



The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 258,200.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -0.13 to 0.13. A solid orange line represents the profit function, starting at a profit of 0.13 when the price is 0.00 and decreasing linearly to a profit of -0.13 at a price of 258,200.00. The line intersects the x-axis at a price of 129,100.00, which is the break-even point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.13
64,550.00	0.06
129,100.00	0.00
193,650.00	-0.06
258,200.00	-0.13

가액	순익 (백만)
0.00	-0.05
26,850.00	-0.03
53,700.00	-0.01
80,550.00	0.01
107,400.00	0.05

(단위:백만원)

KR4A01630008		2026-03 코스피200지수선물					269
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269
-5.33%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179
-2.67%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	90	90	90	90	90	90	90
5.33%	179	179	179	179	179	179	179
8.00%	269	269	269	269	269	269	269
KR4A11620007		2026-02 삼성전자개별선물					181

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181
-5.33%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	120	120	120	120	120	120	120
8.00%	181	181	181	181	181	181	181

KR4A14620004 2026-02 KT개별선물 133

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	133	133	133	133	133	133	133
-5.33%	89	89	89	89	89	89	89
-2.67%	44	44	44	44	44	44	44
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
5.33%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
8.00%	-133	-133	-133	-133	-133	-133	-133

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
-5.33%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	119	119	119	119	119	119	119
8.00%	179	179	179	179	179	179	179

KR4AB3620005 2026-02 고려아연개별선물 113

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

KR4ACN620009 2026-02 포스코DX개별선물 22

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	22	22	22	22	22	22	22
KR4ACT620003 2026-02 삼성화재개별선물							92
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	92	92	92	92	92	92	92
-5.33%	61	61	61	61	61	61	61
-2.67%	31	31	31	31	31	31	31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
KR4AD0620004 2026-02 DB손해보험개별선물							62
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	62	62	62	62	62	62
-5.33%	41	41	41	41	41	41	41
-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%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
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)

1,226

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

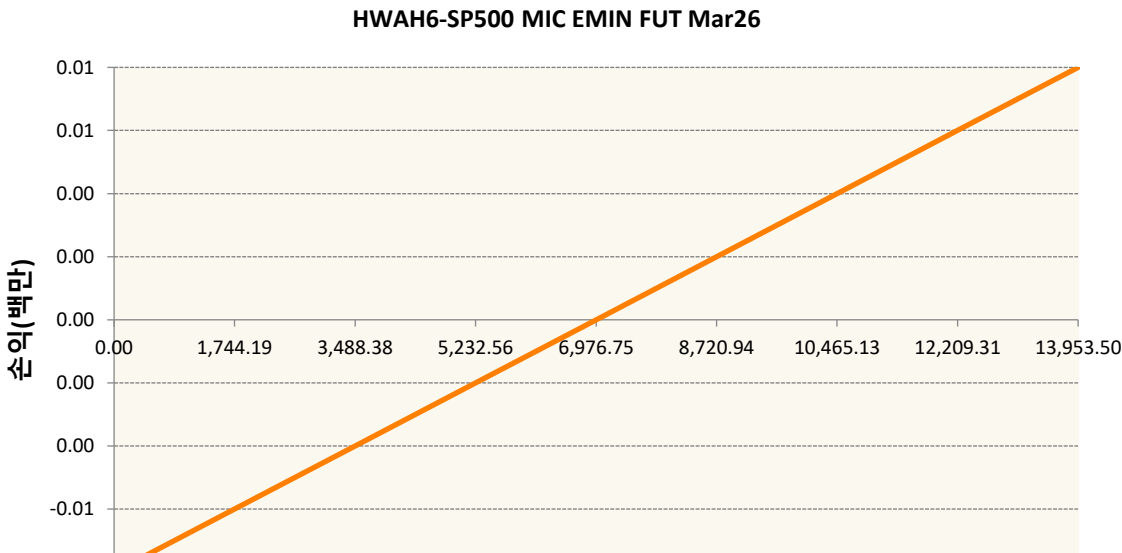
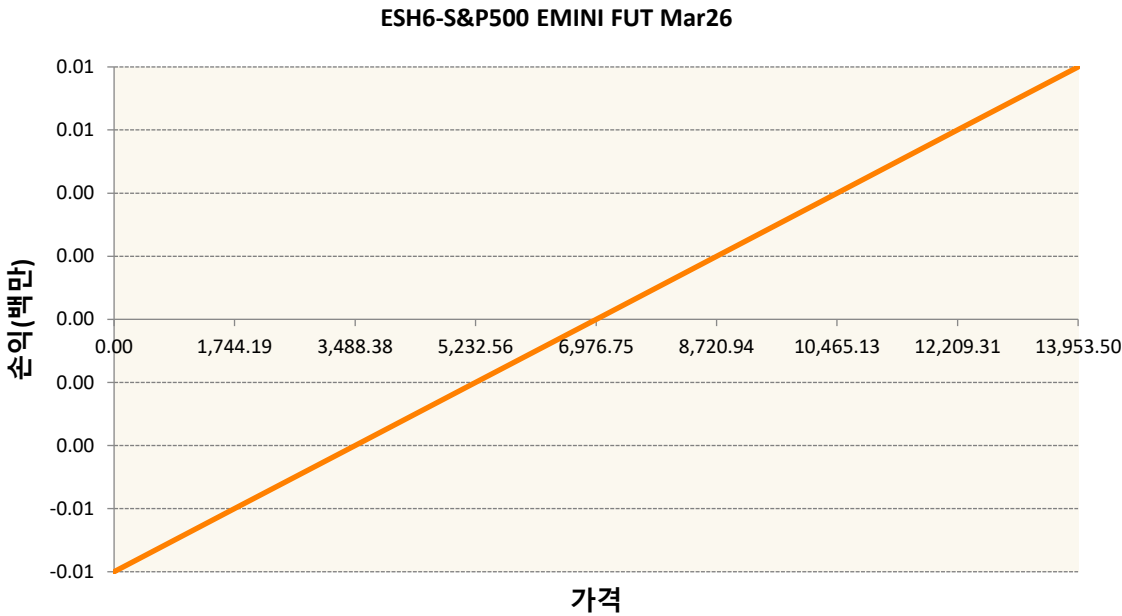
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

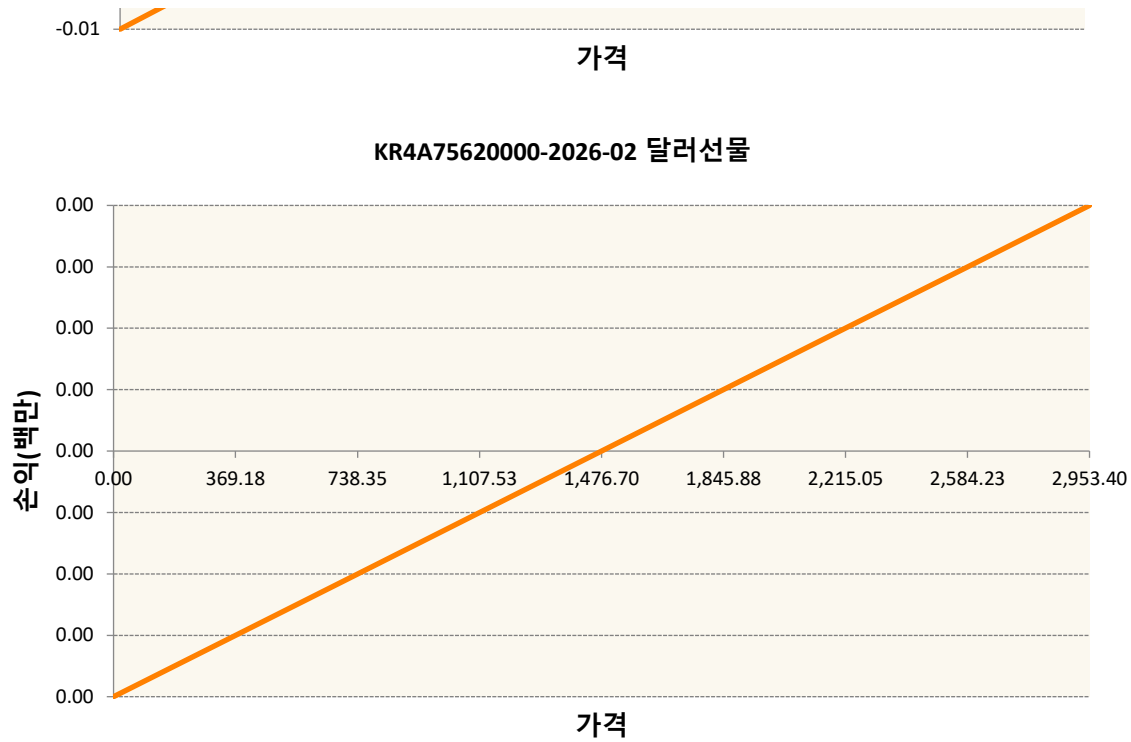
1. 계약금액

(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	
신규	통화	선물	2,657	0	2,657	장내
누계	유가증권	선물	1,134	0	1,134	장내
누계	지수	선물	55,553	0	55,553	
누계	통화	선물	2,658	0	2,658	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26		4,444
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26		91
	KR4A756200 2026-02 달러선물		213

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,881

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

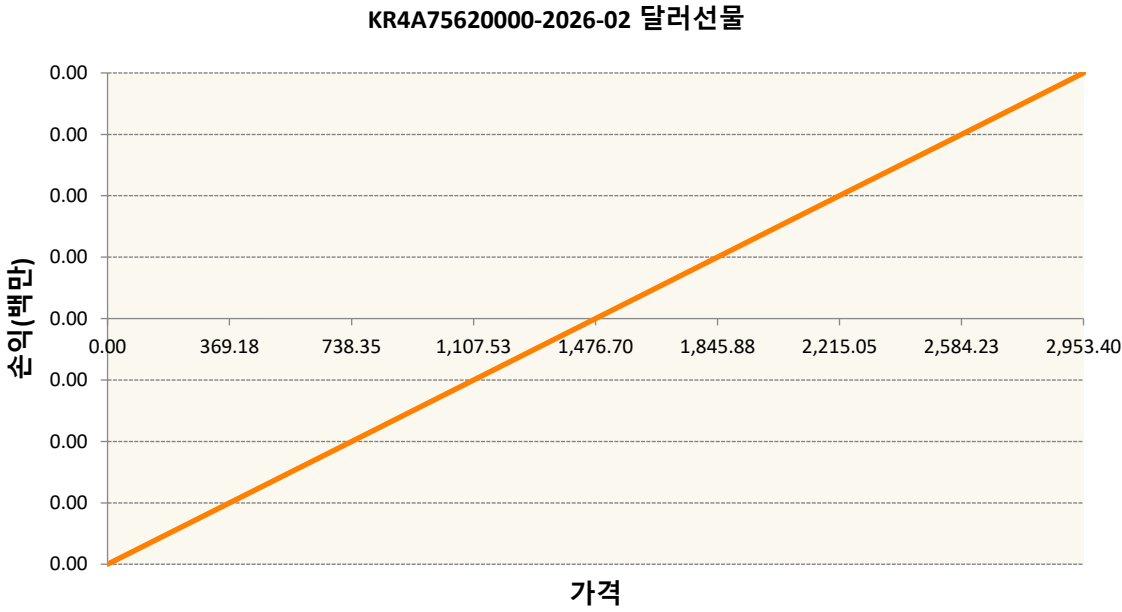
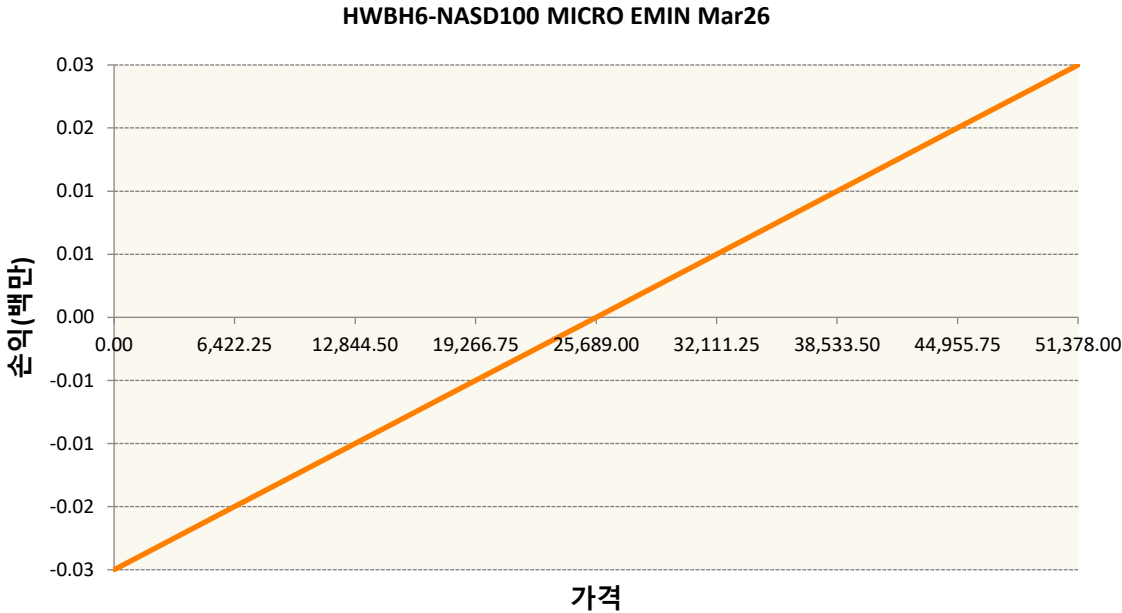
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

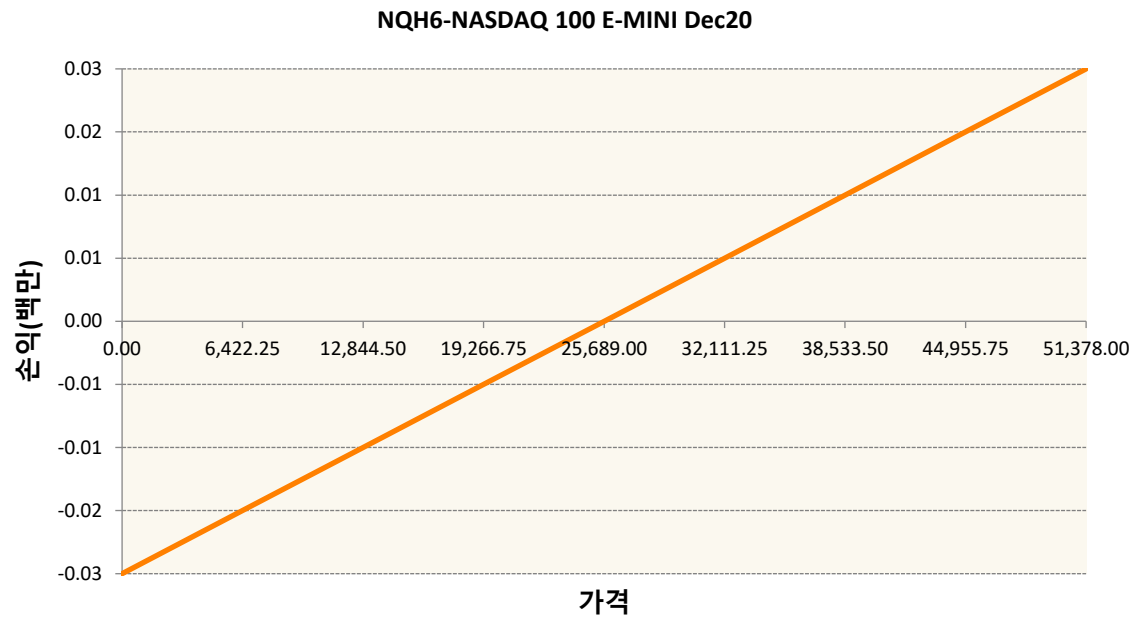
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	886	0	886	장내
누계	지수	선물	25,175	0	25,175	장내
누계	통화	선물	886	0	886	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN Mar26		73
KR4A756200	2026-02 달러선물		71
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,941

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,193

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

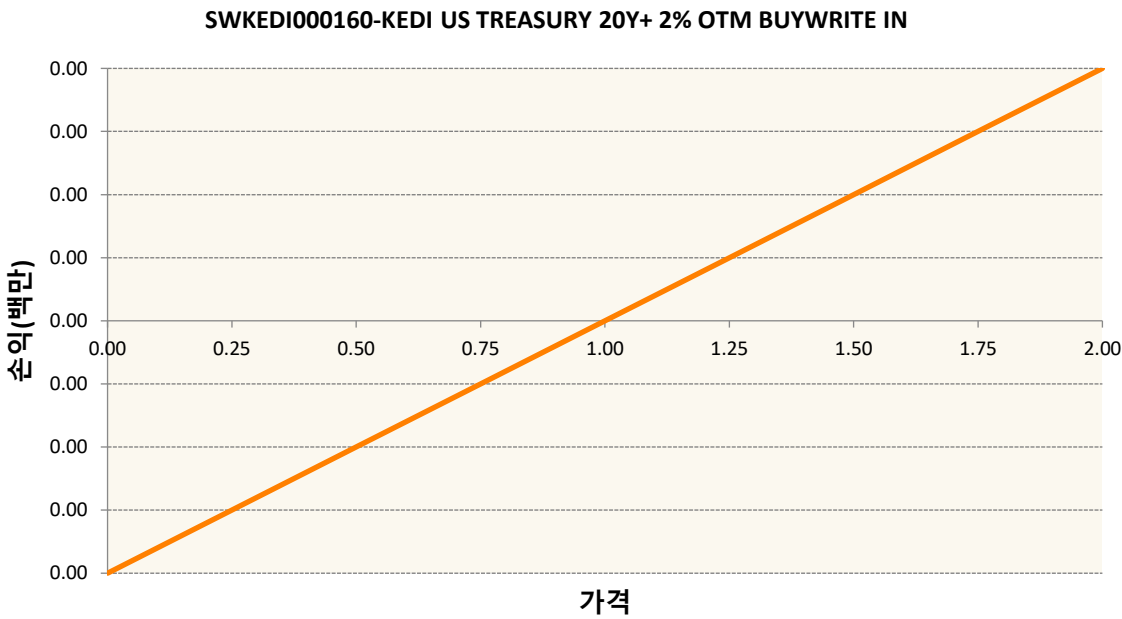
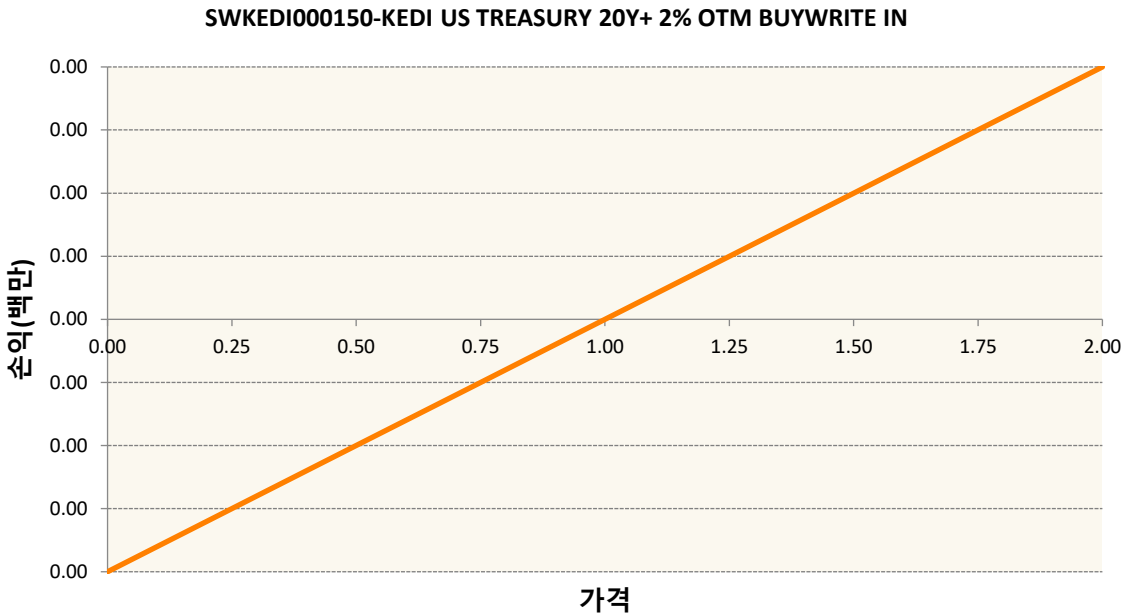
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

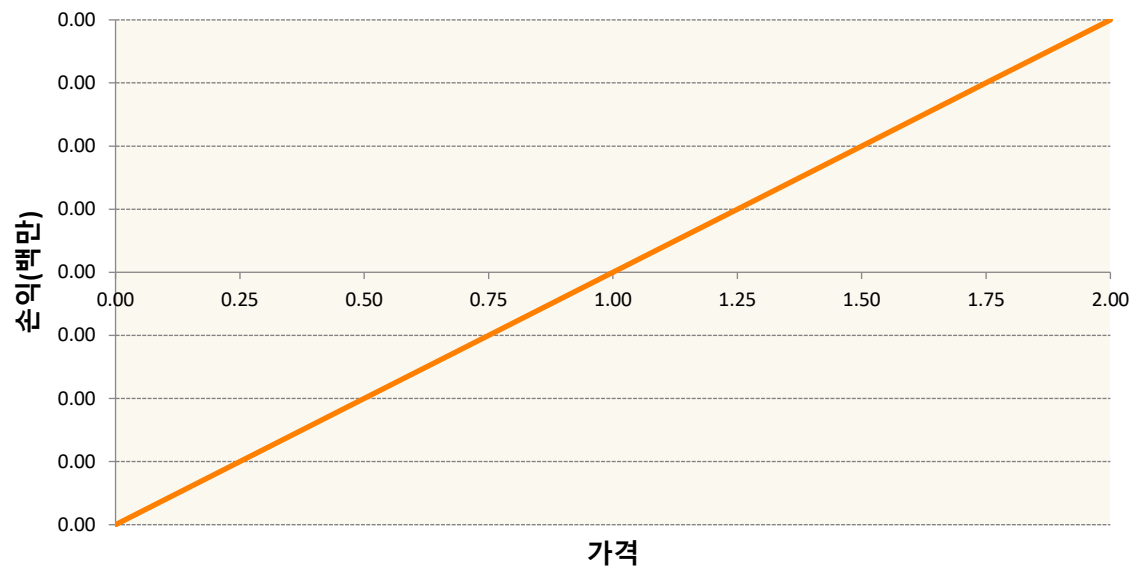
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	382,529	0	382,529	장외

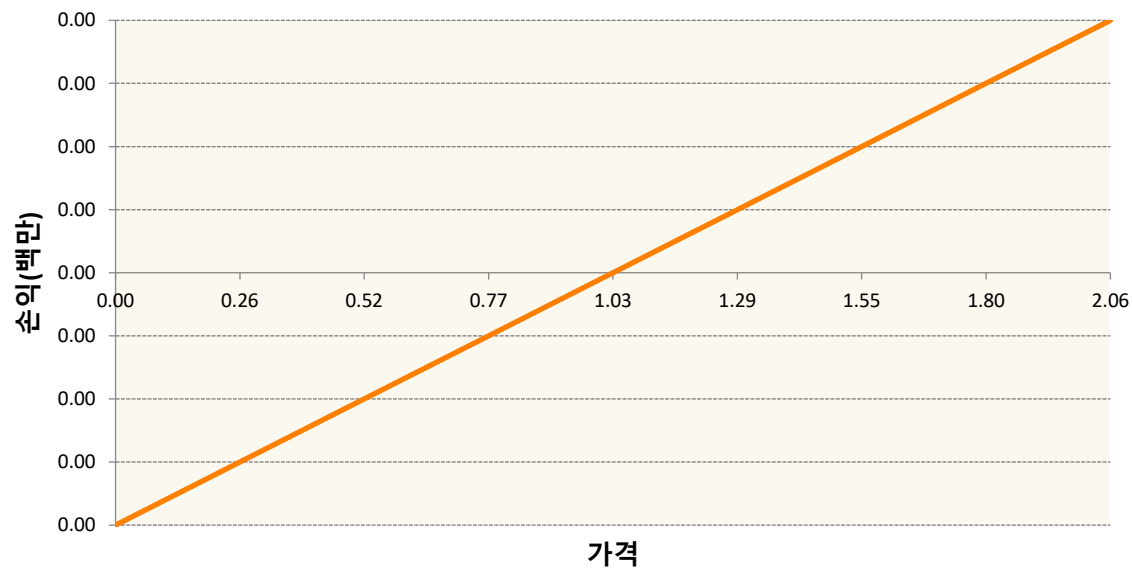
2. 만기시점의 손익구조



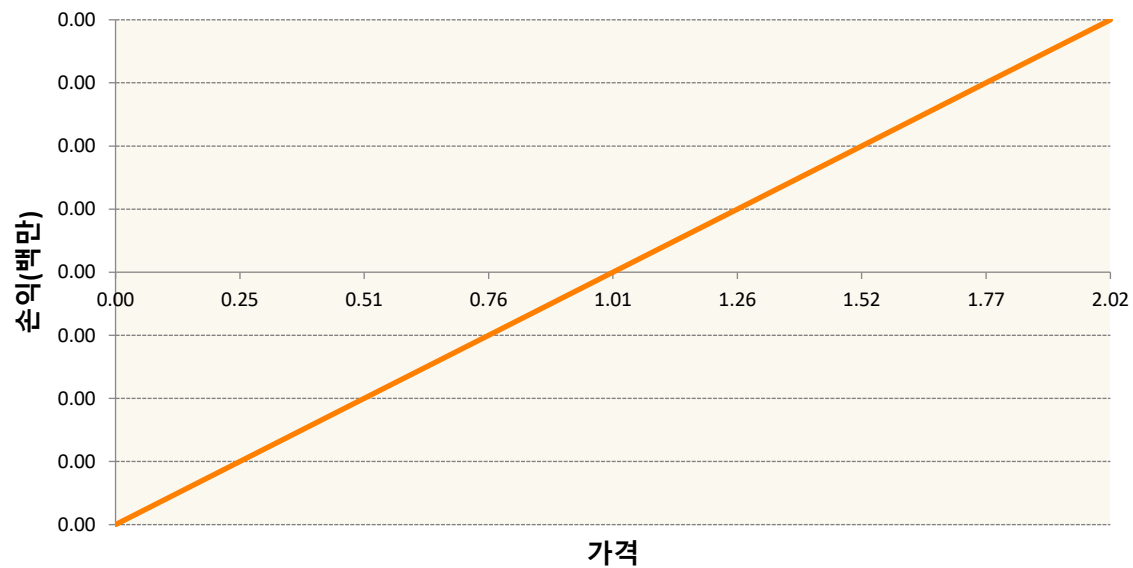
SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,265
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,410
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,702
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		150
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		10,086

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,834

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

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	-23	0	-23	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.31
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.31
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.31
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.31

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

공시일	2026-01-21
기준일	2026-01-20

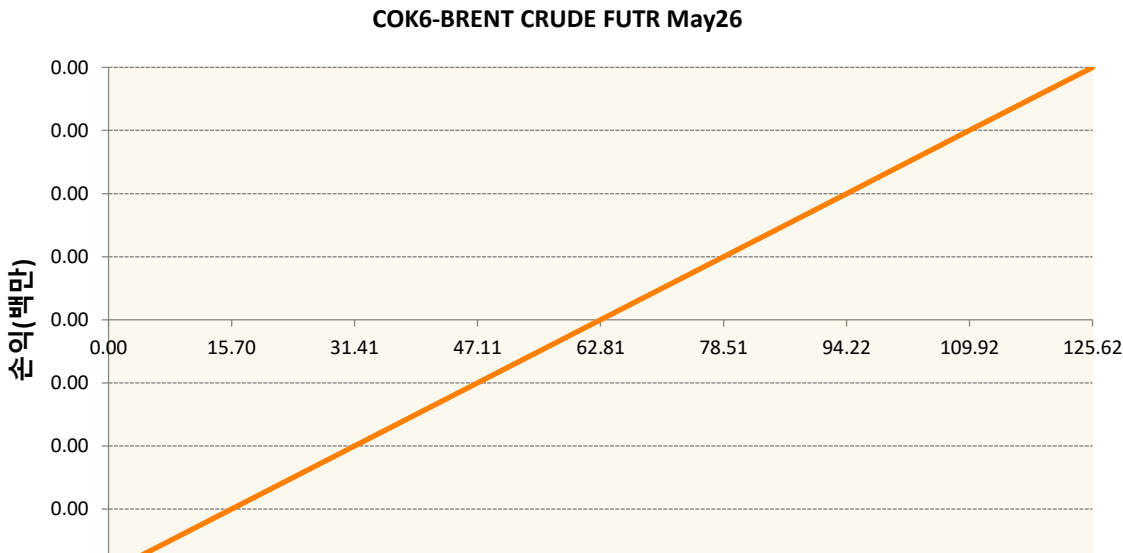
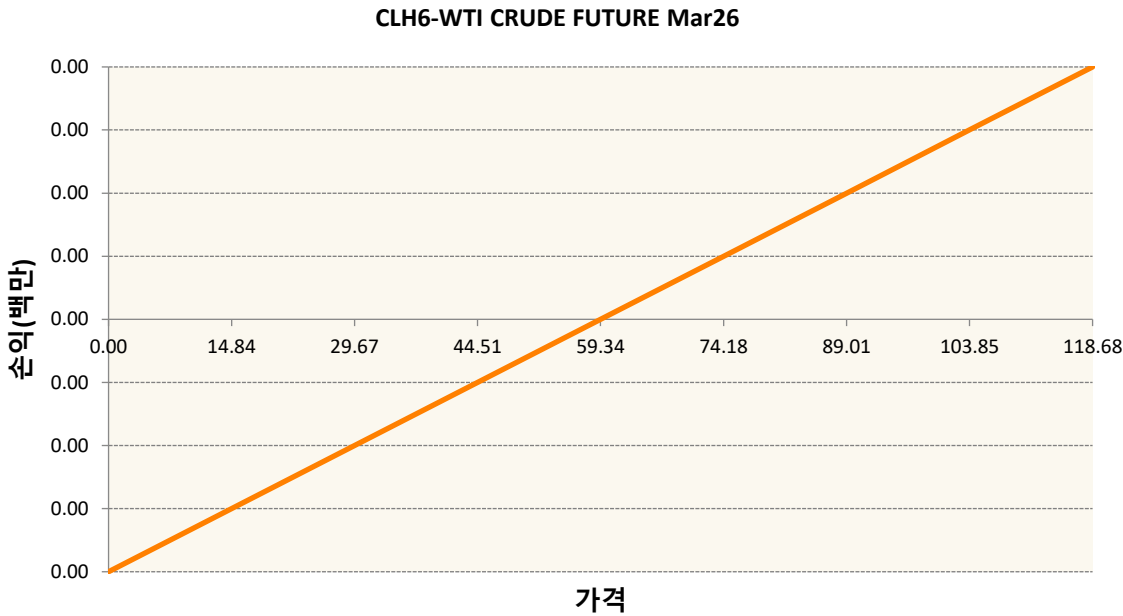
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

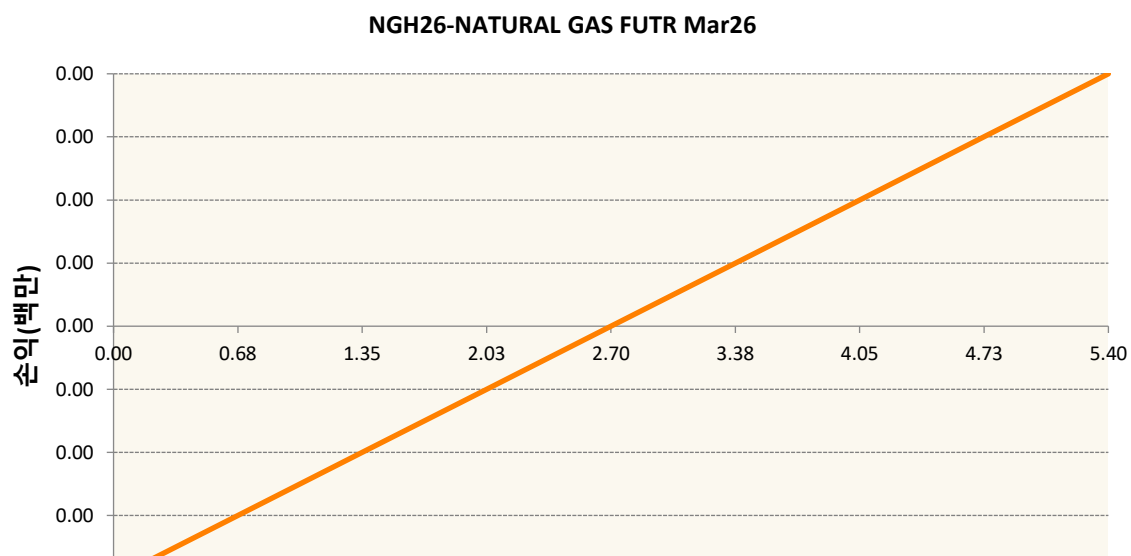
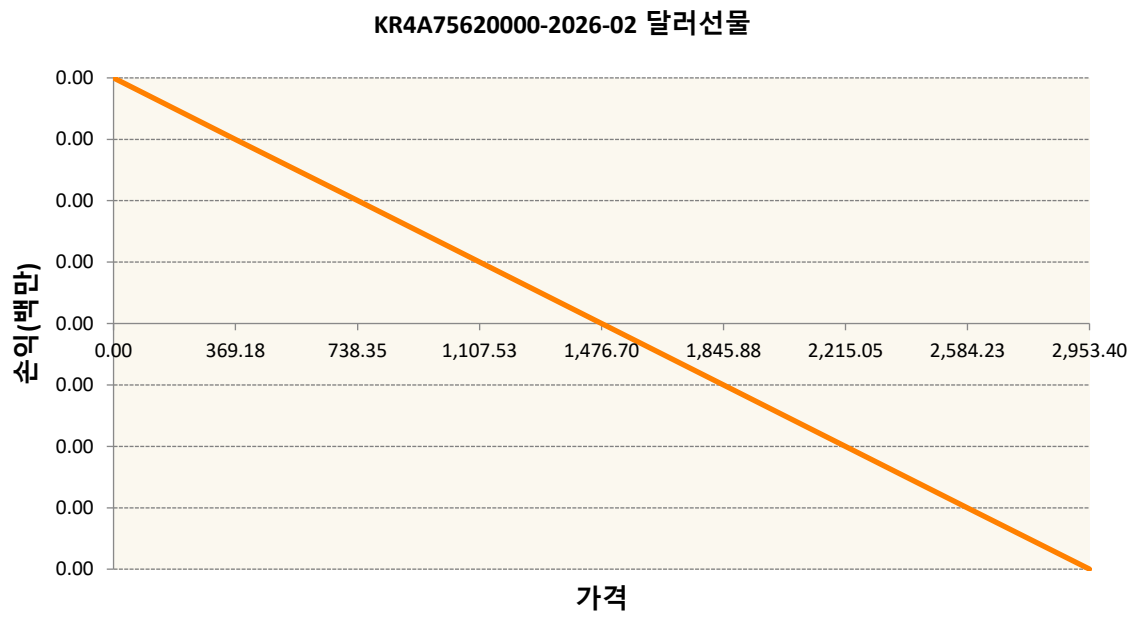
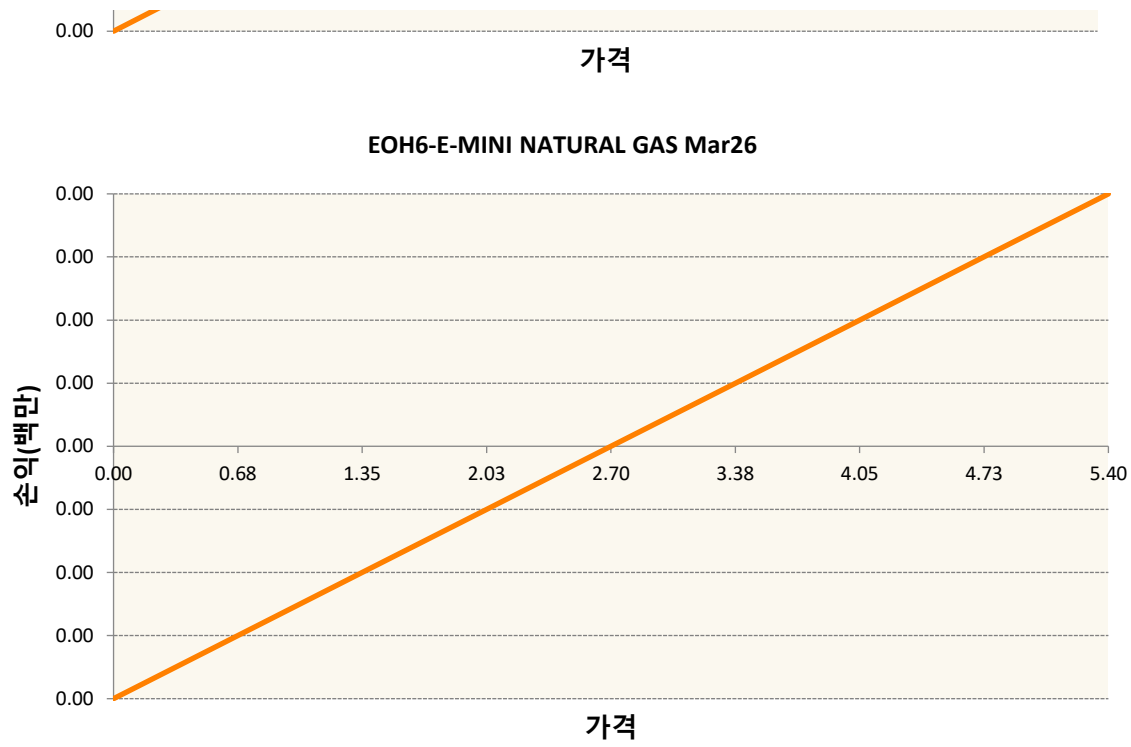
1. 계약금액

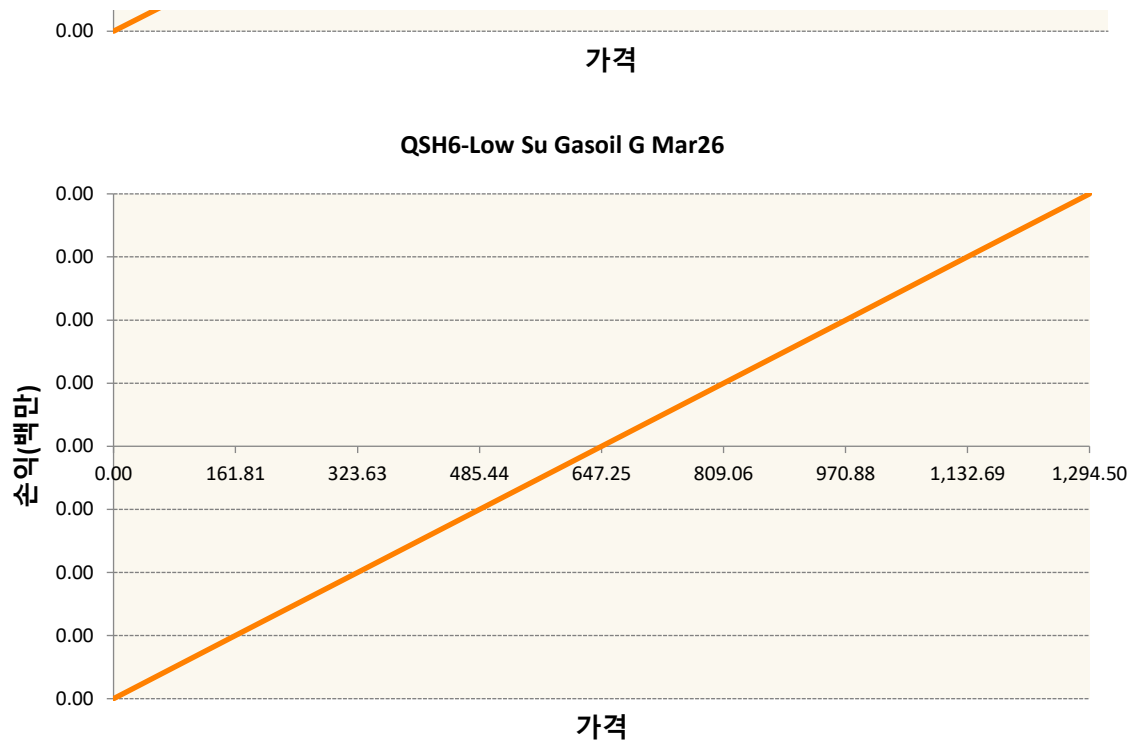
(단위:백만원)

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	109	0	109	
누계	유가증권	선물	368	0	368	
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		2
KR4A756200	2026-02 달러선물		6
NGH26	NATURAL GAS FUTR Mar26		6
QSH6	Low Su Gasoil G Mar26		8

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		82