

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

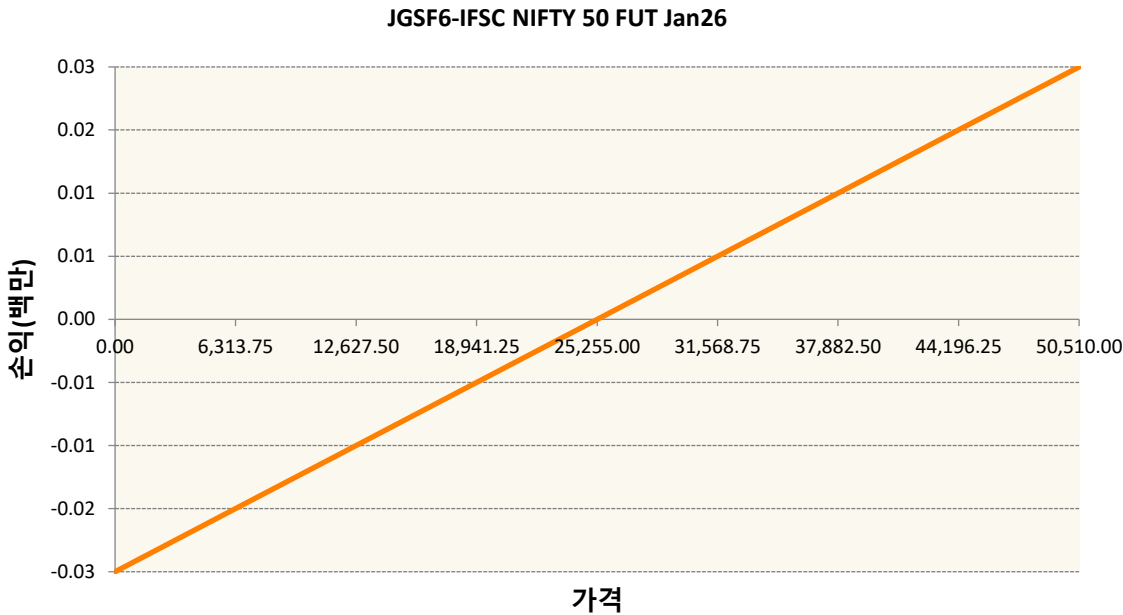
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 649   | 0     | 649       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |    |
|-------|-------------------------|----|
| JGSF6 | IFSC NIFTY 50 FUT Jan26 | 52 |
|-------|-------------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 32 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

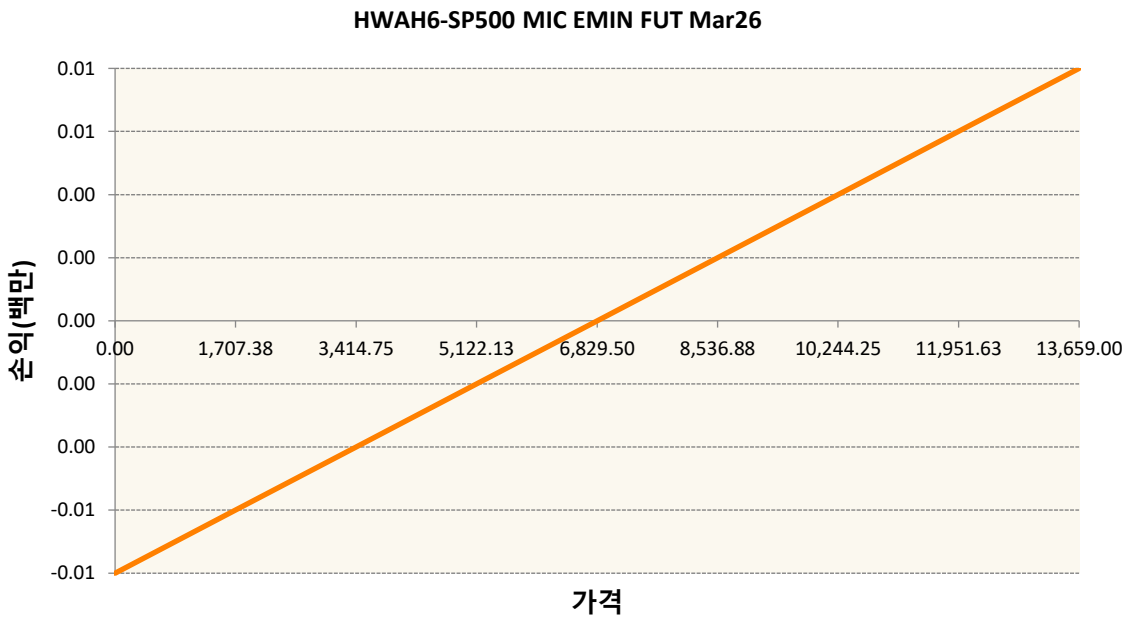
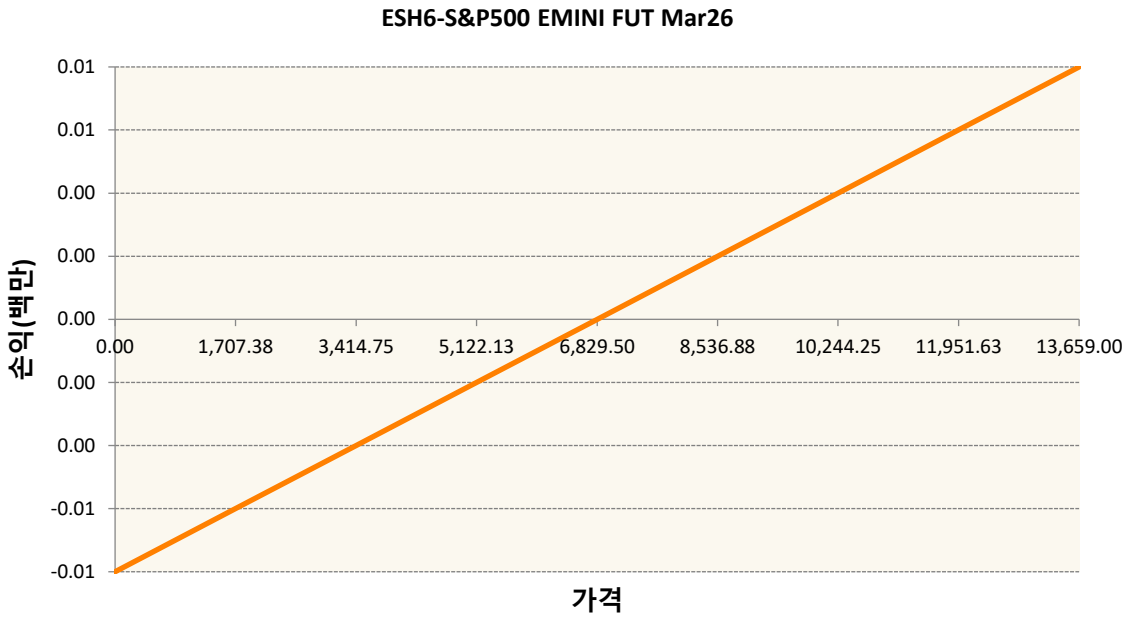
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 252   | 0     | 252       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 505   | 0     | 505       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|----------|
| ESH6                      | S&P500 EMINI FUT Mar26   | 40       |
| HWAH6                     | SP500 MIC EMIN FUT Mar26 | 20       |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 52       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

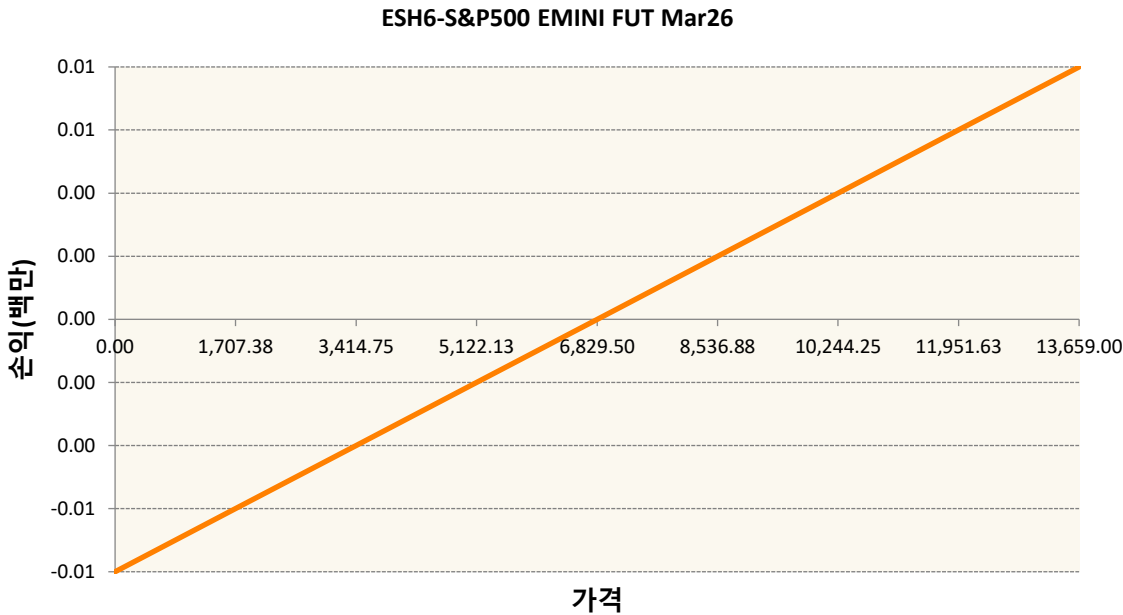
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,514 | 0     | 1,514     |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                        |     |
|------|------------------------|-----|
| ESH6 | S&P500 EMINI FUT Mar26 | 121 |
|------|------------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 104 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

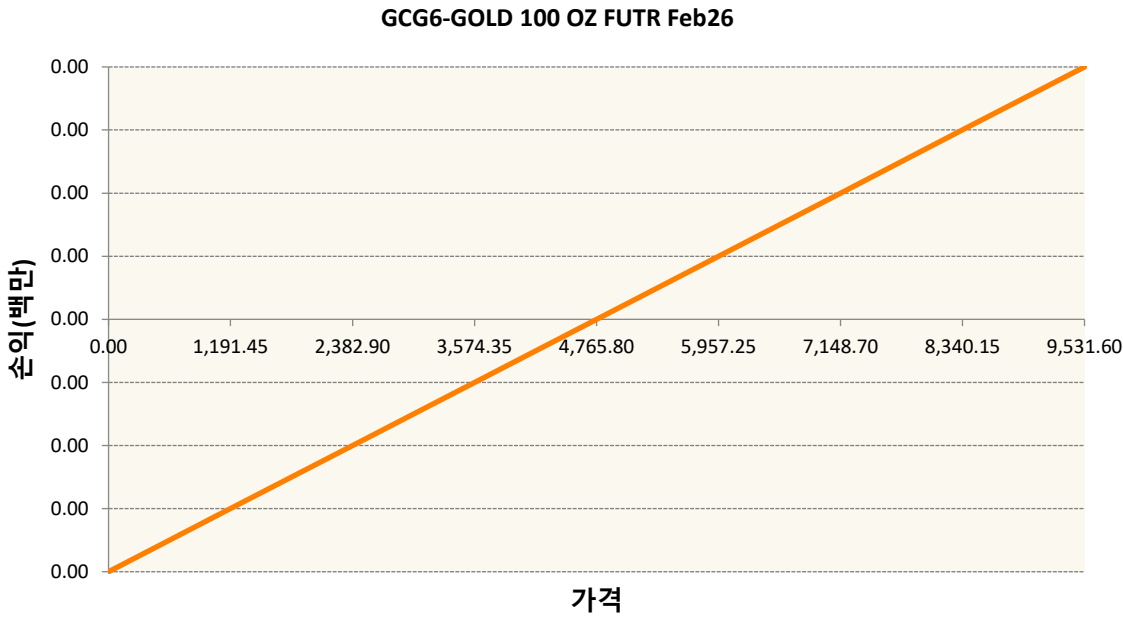
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 3,508 | 0     | 3,508     |    |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| AOGLDUSC0 GLD US 01/23/26 C428 EQUITY | 7   |
| GCG6 GOLD 100 OZ FUTR Feb26           | 281 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 276 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

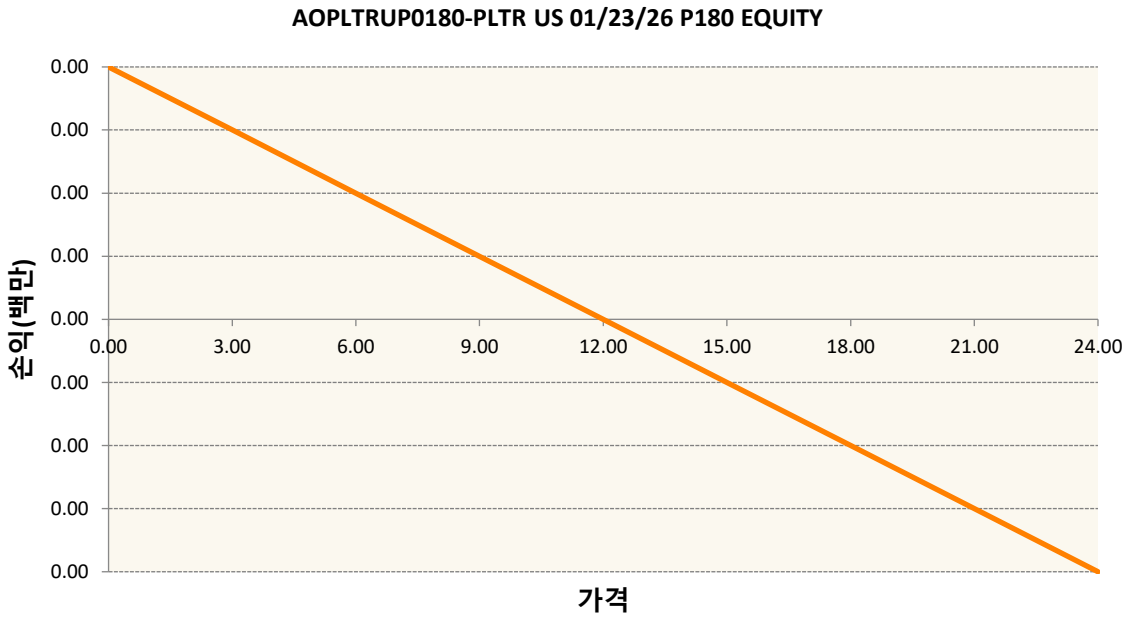
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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     | 85    | -85       |    |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| AOPLTRUA1{PLTR US 01/23/26 C187.5 EQUITY | 20 |
| AOPLTRUB1{PLTR US 01/23/26 P187.5 EQUITY | 78 |
| AOPLTRUC0`PLTR US 01/23/26 C180 EQUITY   | 1  |
| AOPLTRUP0`PLTR US 01/23/26 P180 EQUITY   | 7  |

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

(단위:백만원)

375

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

## 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

2

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

(단위:백만원)

1

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

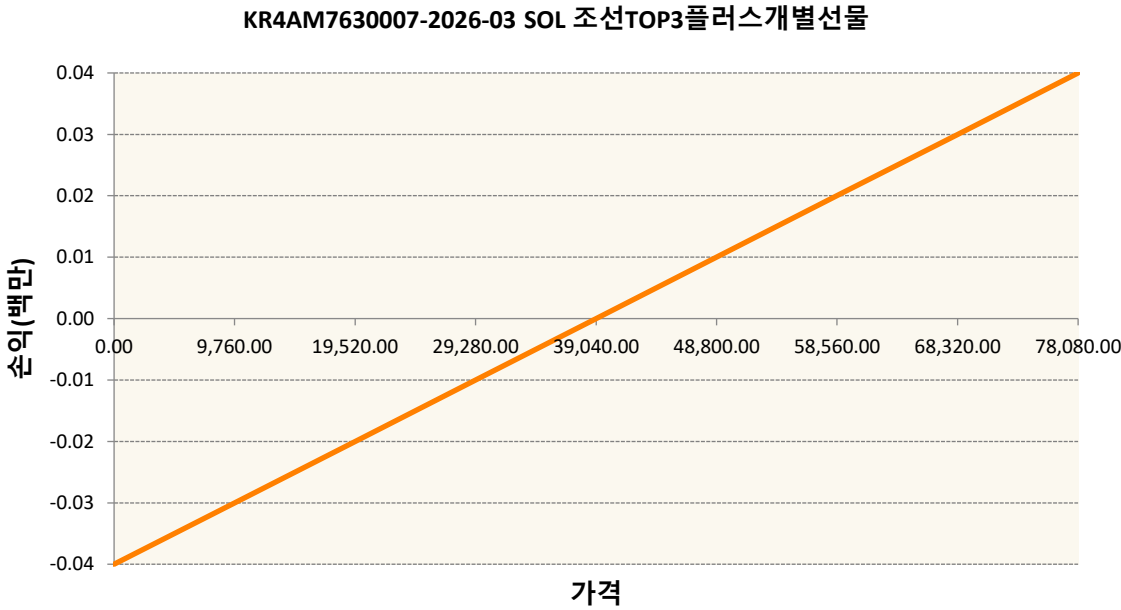
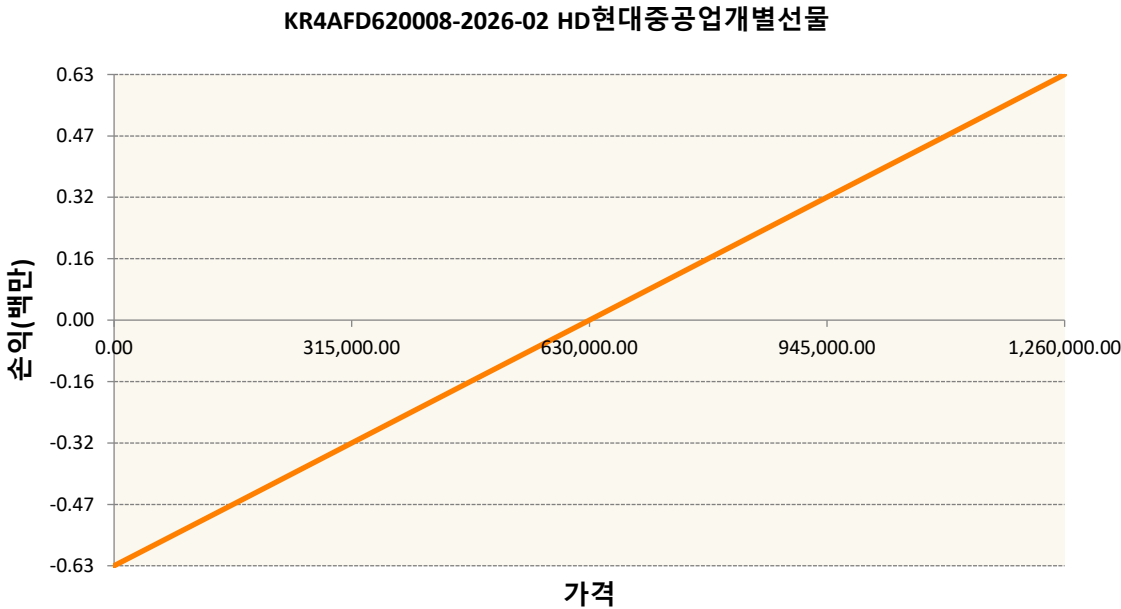
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 223   | -223      | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 25,996 | 0     | 25,996    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



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

| KR4AFD620008 |           |         | 2026-02 HD현대중공업개별선물       |        |        |        | 1,012  |
|--------------|-----------|---------|---------------------------|--------|--------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                           |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%                    | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -1,012    | -1,012  | -1,012                    | -1,012 | -1,012 | -1,012 | -1,012 |
| -5.33%       | -674      | -674    | -674                      | -674   | -674   | -674   | -674   |
| -2.67%       | -337      | -337    | -337                      | -337   | -337   | -337   | -337   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                         | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%        | 337       | 337     | 337                       | 337    | 337    | 337    | 337    |
| 5.33%        | 674       | 674     | 674                       | 674    | 674    | 674    | 674    |
| 8.00%        | 1,012     | 1,012   | 1,012                     | 1,012  | 1,012  | 1,012  | 1,012  |
| KR4AM7630007 |           |         | 2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물 |        |        |        | 1,066  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                           |        |        |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%                    | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -1,066    | -1,066  | -1,066                    | -1,066 | -1,066 | -1,066 | -1,066 |
| -5.33%       | -711      | -711    | -711                      | -711   | -711   | -711   | -711   |
| -2.67%       | -355      | -355    | -355                      | -355   | -355   | -355   | -355   |
| 0%           | 0         | 0       | 0                         | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%        | 355       | 355     | 355                       | 355    | 355    | 355    | 355    |
| 5.33%        | 711       | 711     | 711                       | 711    | 711    | 711    | 711    |
| 8.00%        | 1,066     | 1,066   | 1,066                     | 1,066  | 1,066  | 1,066  | 1,066  |

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

1,926

공시일 2026-01-22

기준일 2026-01-21

## 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 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

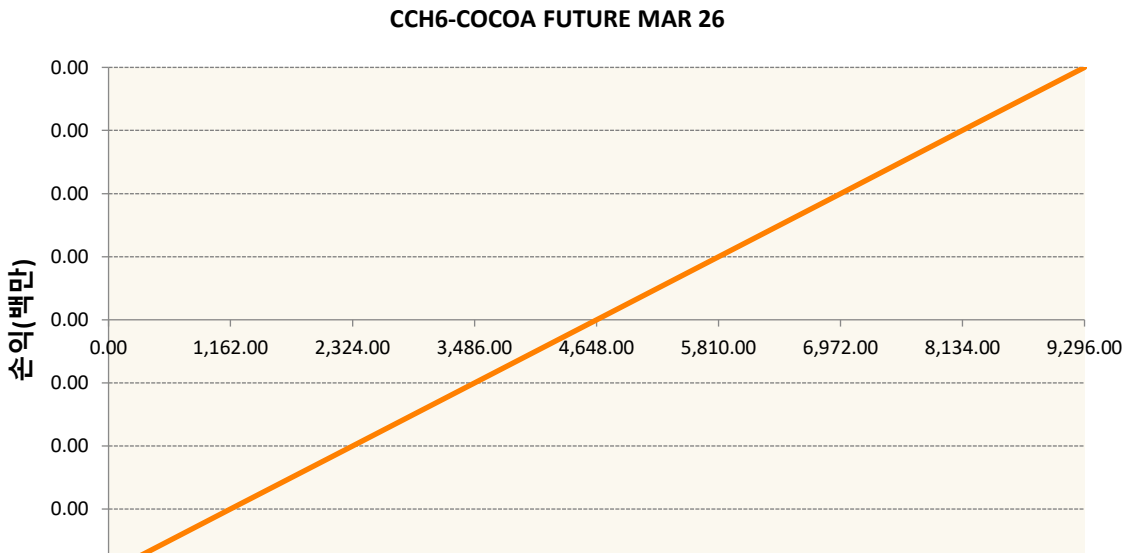
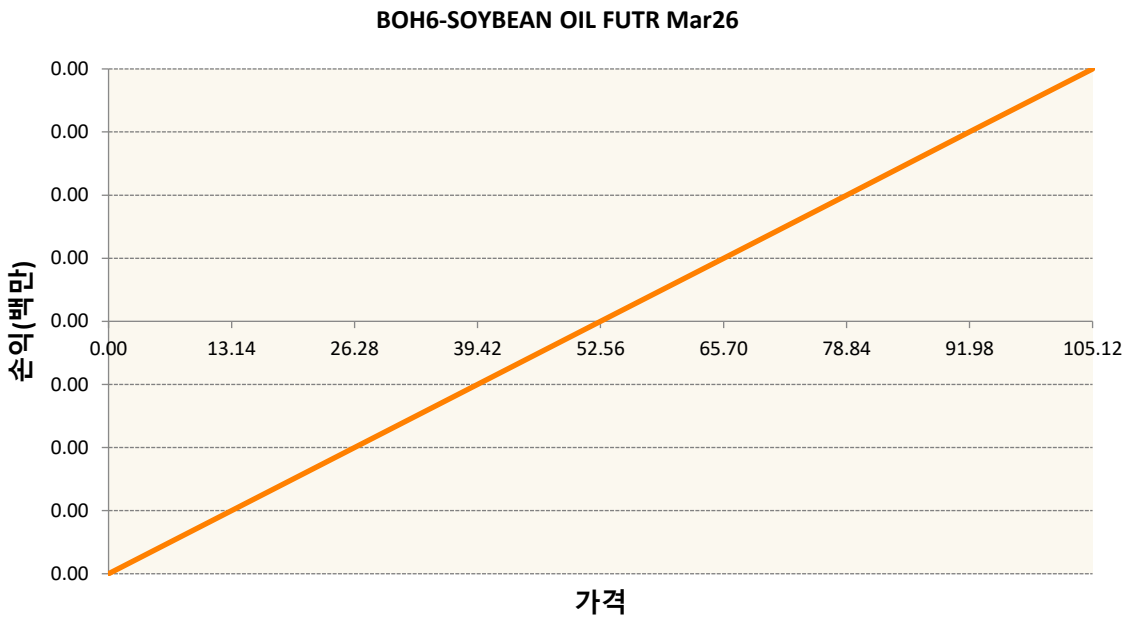
## 포커스농산물모(채권-파생형)

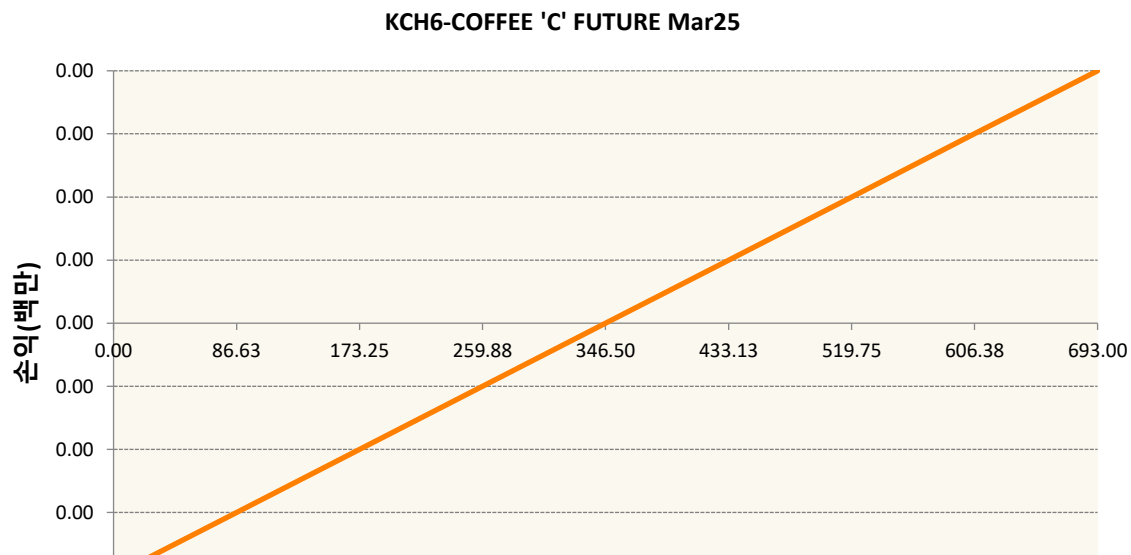
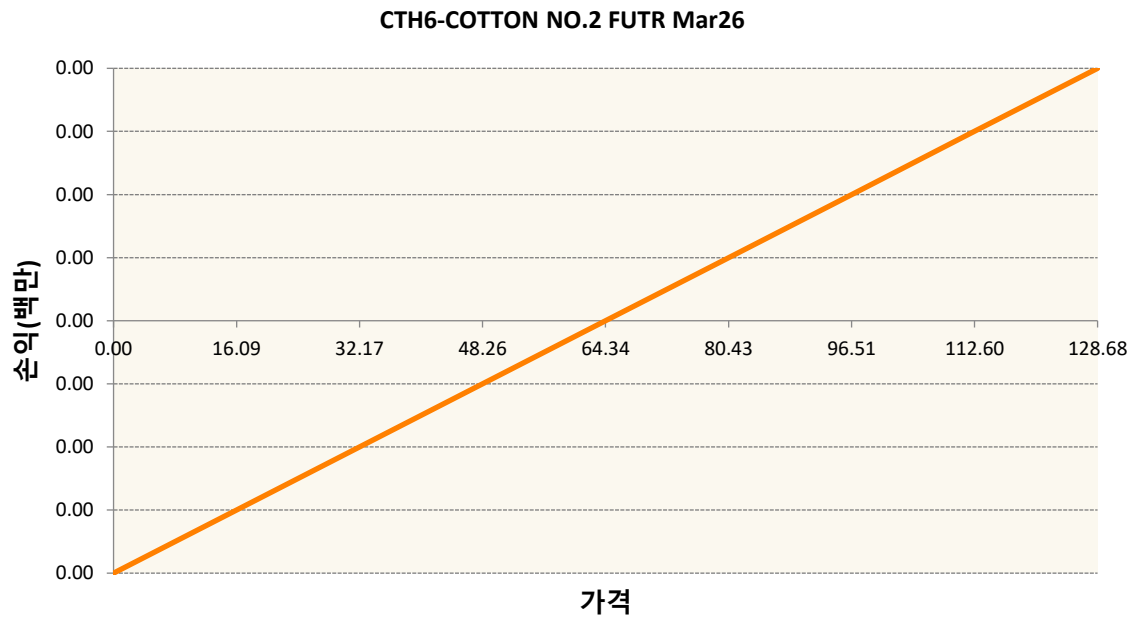
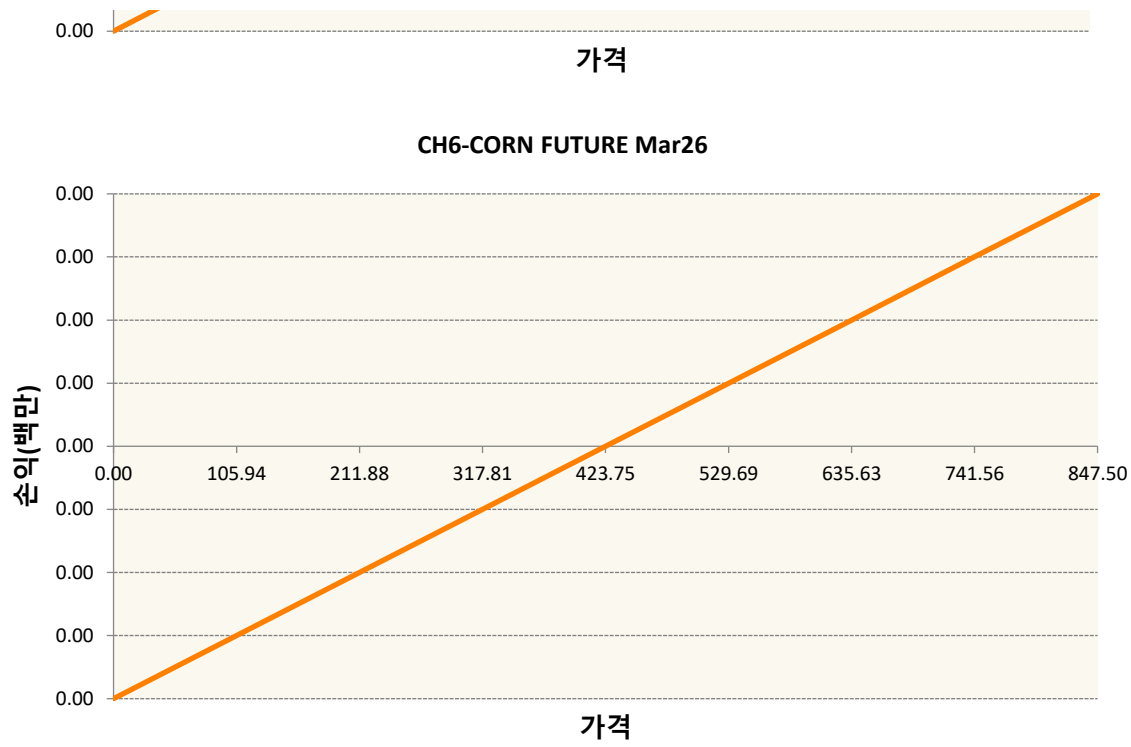
### 1. 계약금액

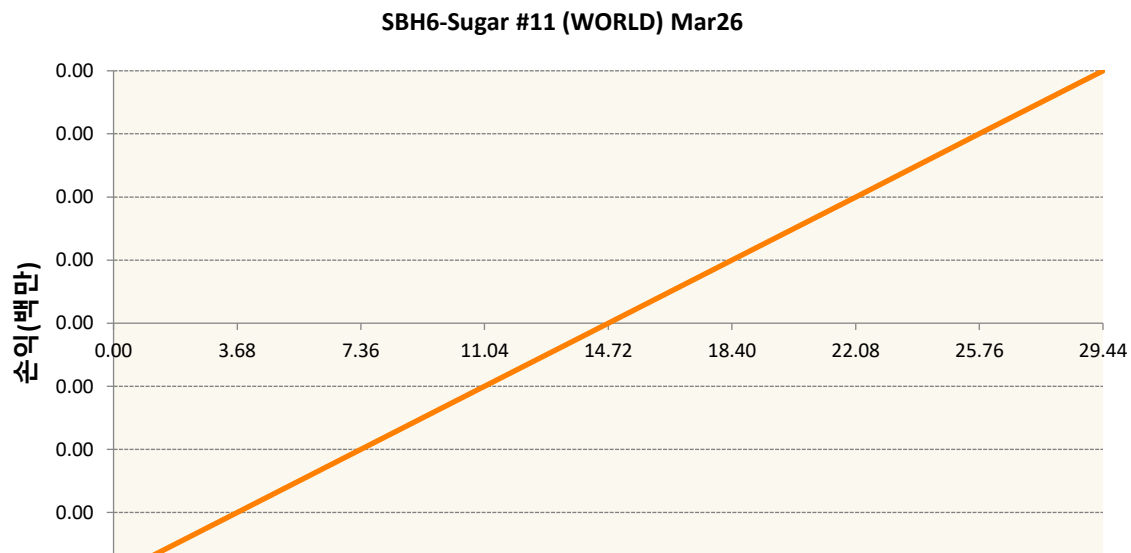
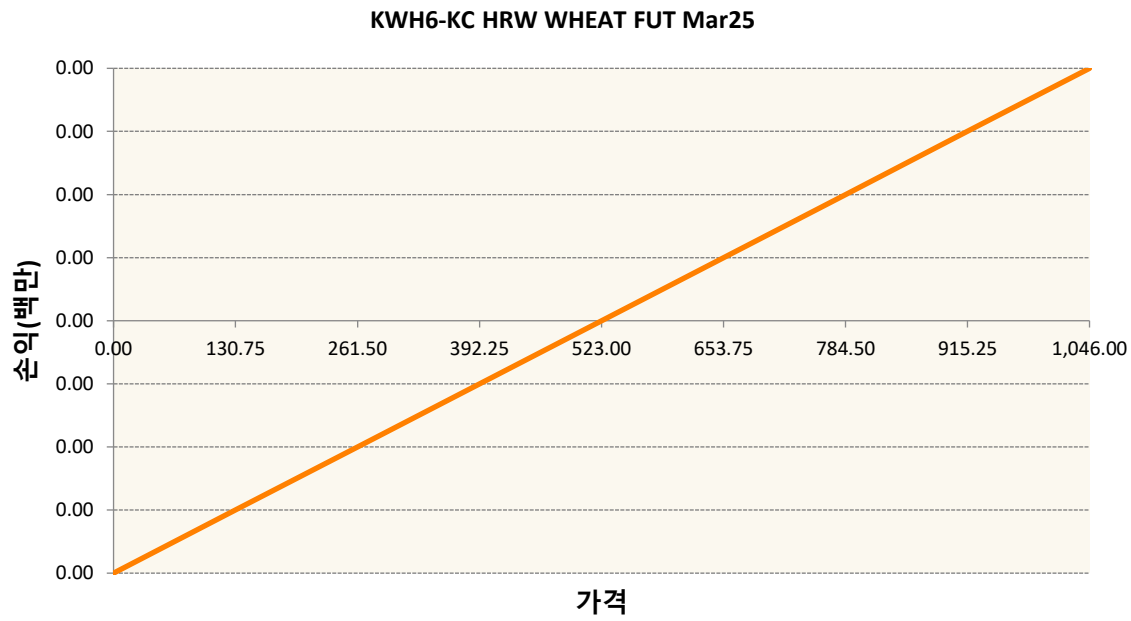
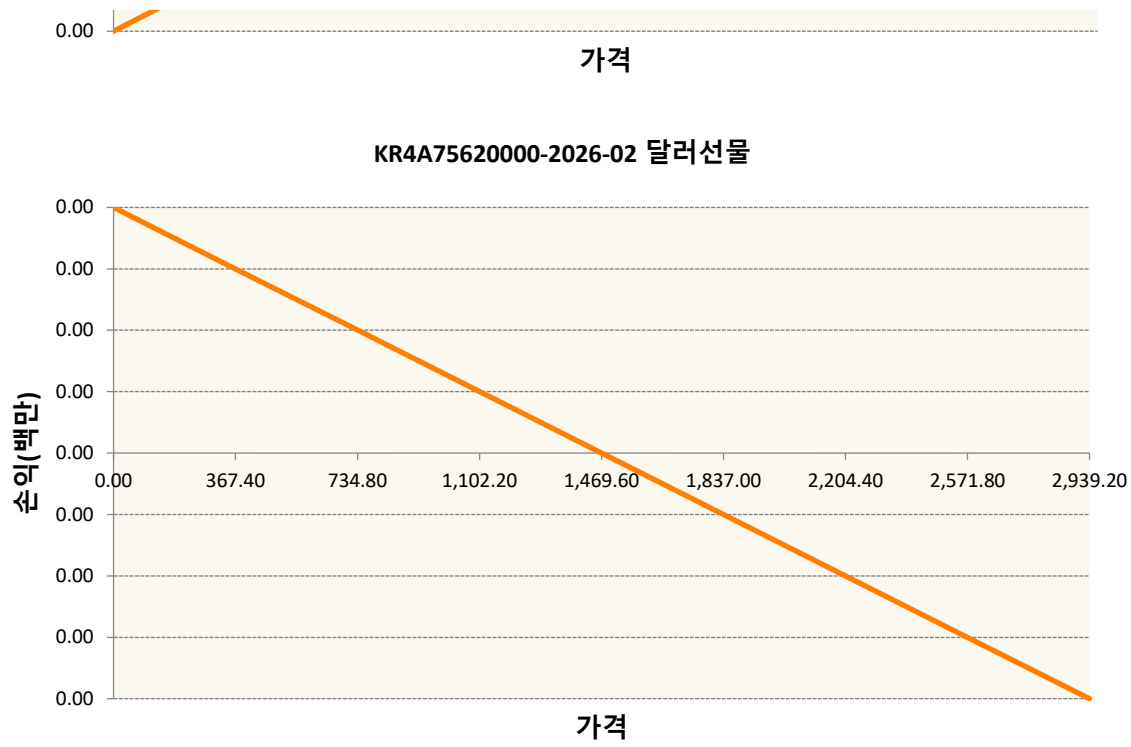
(단위:USD 백만)

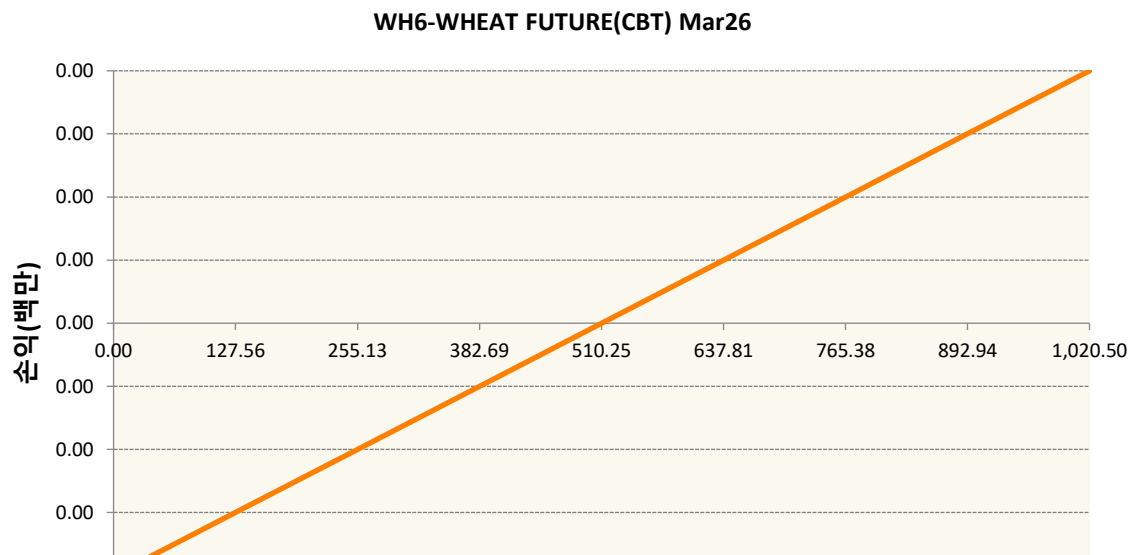
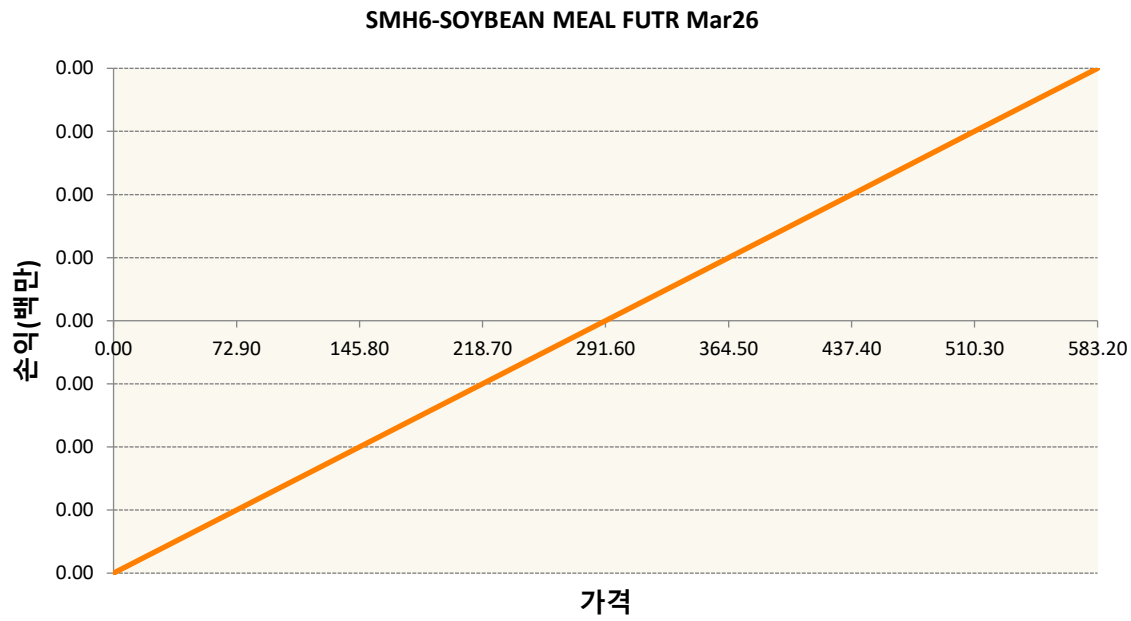
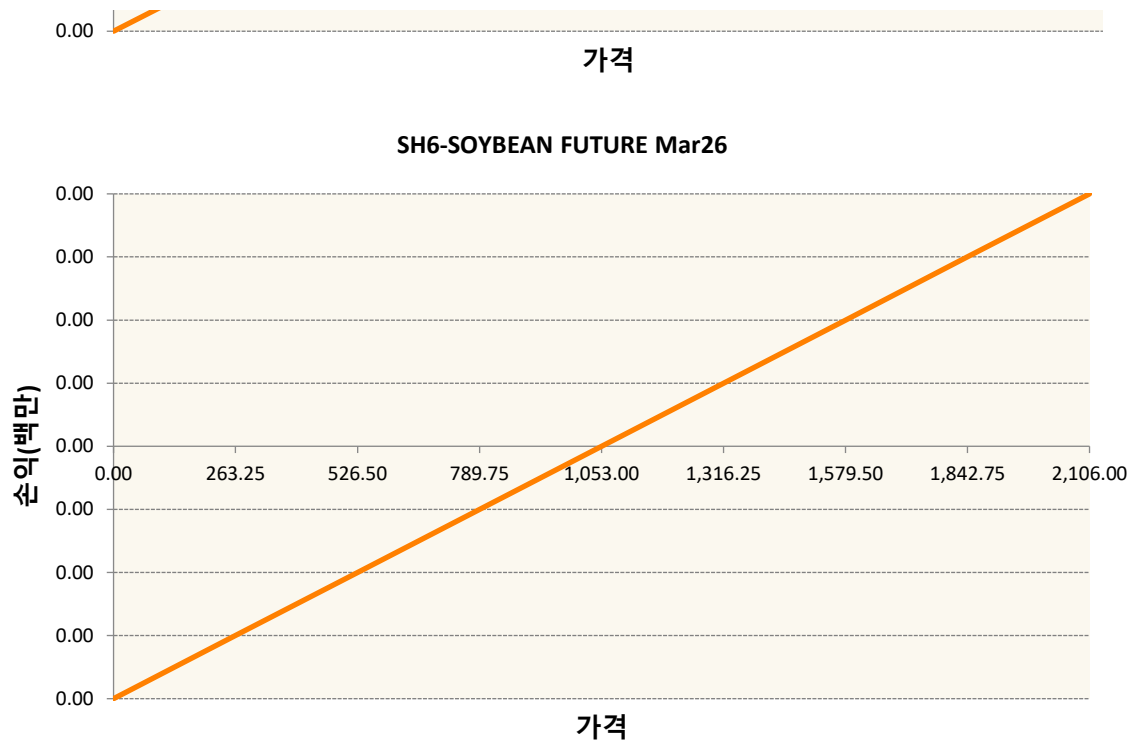
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 461   | 0     | 461       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,505 | 0     | 2,505     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 279   | -279      | 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 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

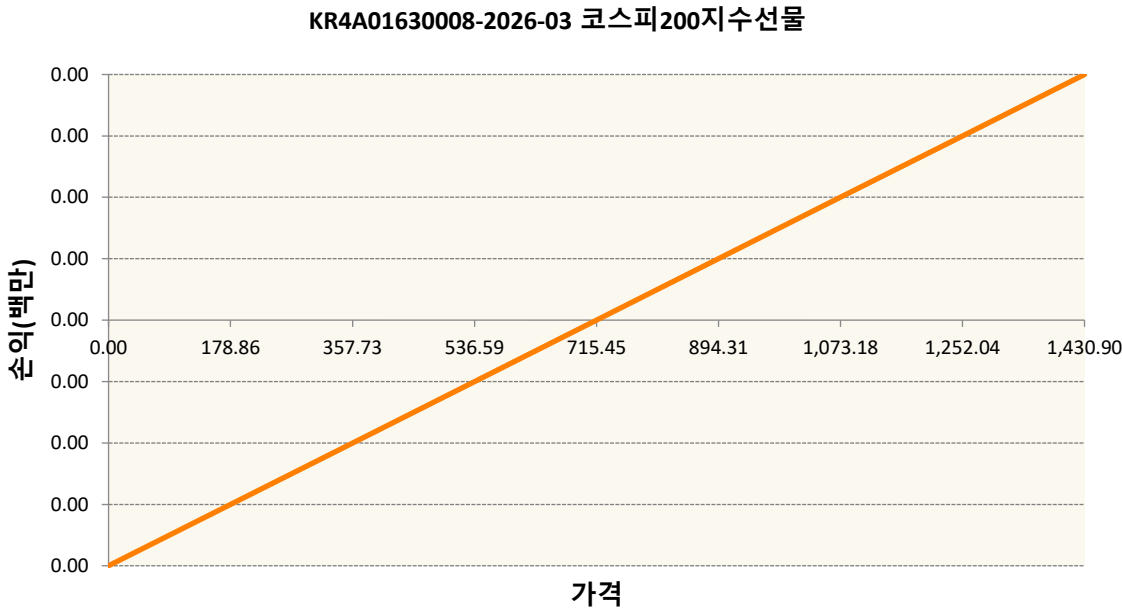
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 175   | 0     | 175       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,504 | 0     | 2,504     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물

200

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

(단위:백만원)

0

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

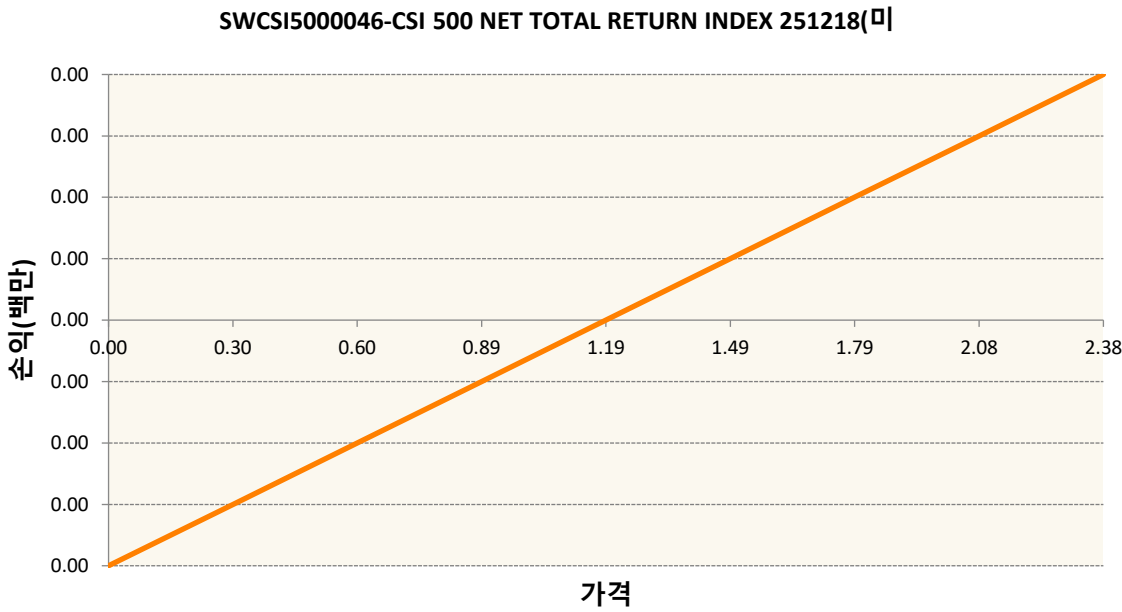
## SOL차이나강소기업CSI500상장

### 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   | 5,497 | 0     | 5,497     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

440

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

531

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

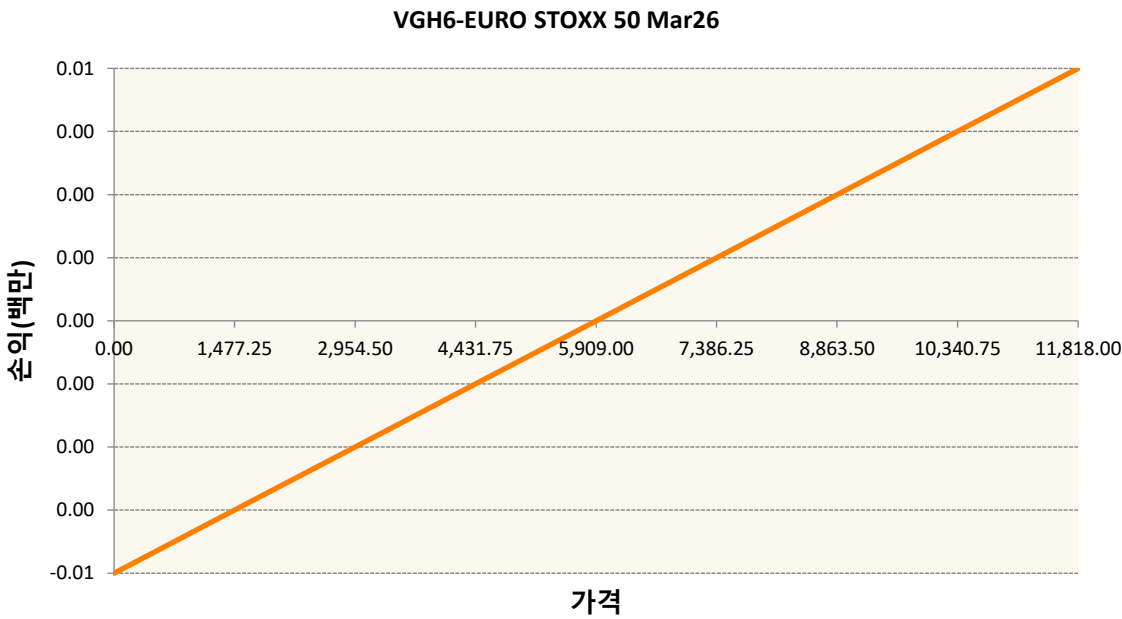
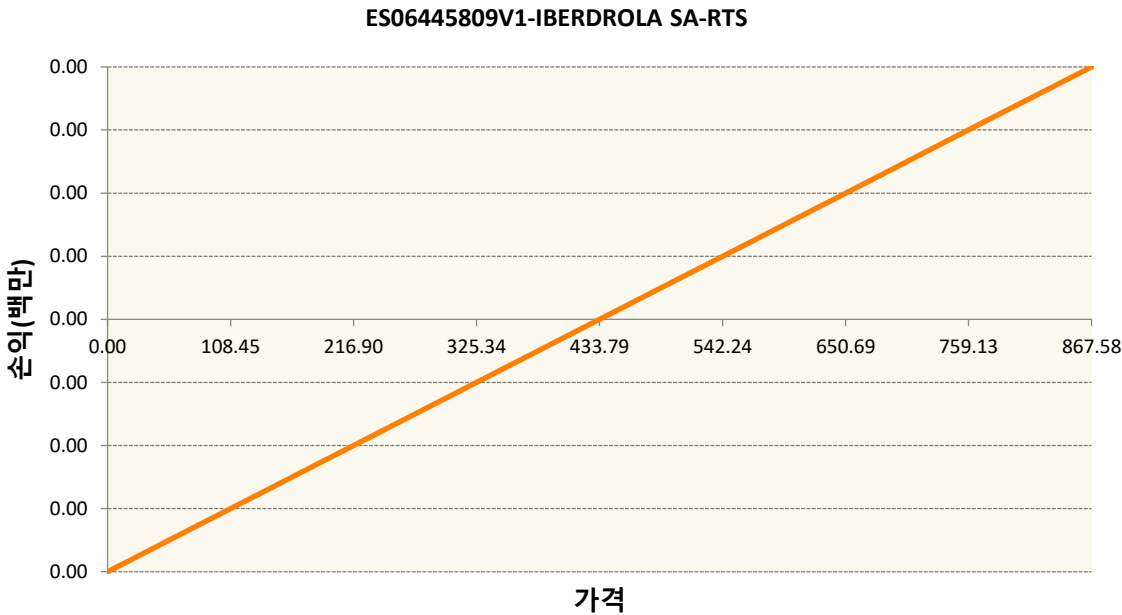
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 922   | 0     | 922       |    |

### 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 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

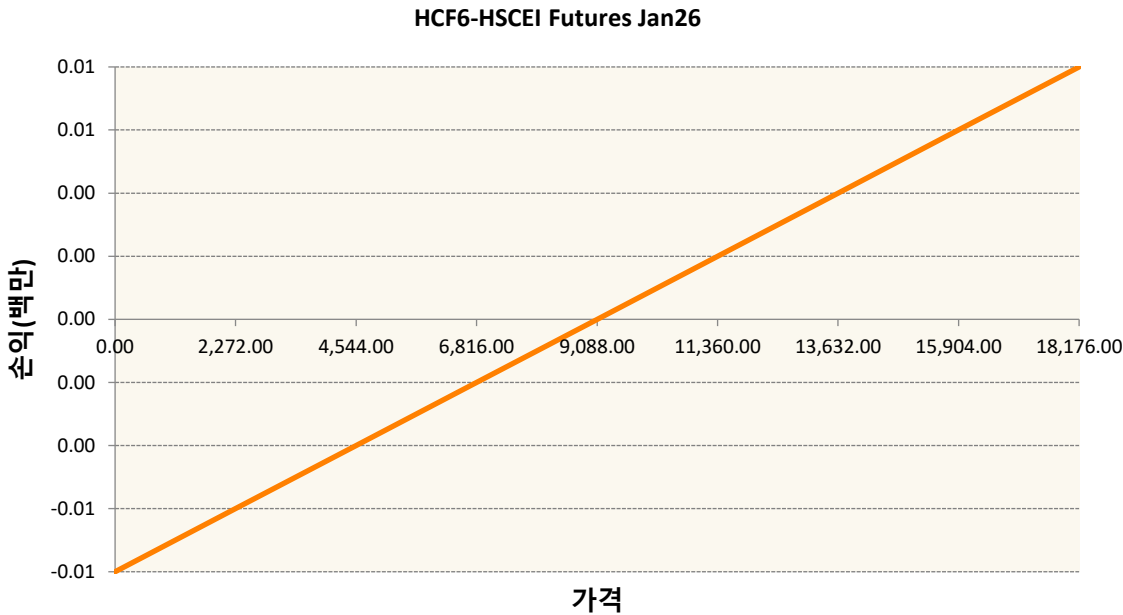
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 2,033 | 0     | 2,033     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCF6 | HSCEI Futures Jan26 | 163 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

228

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

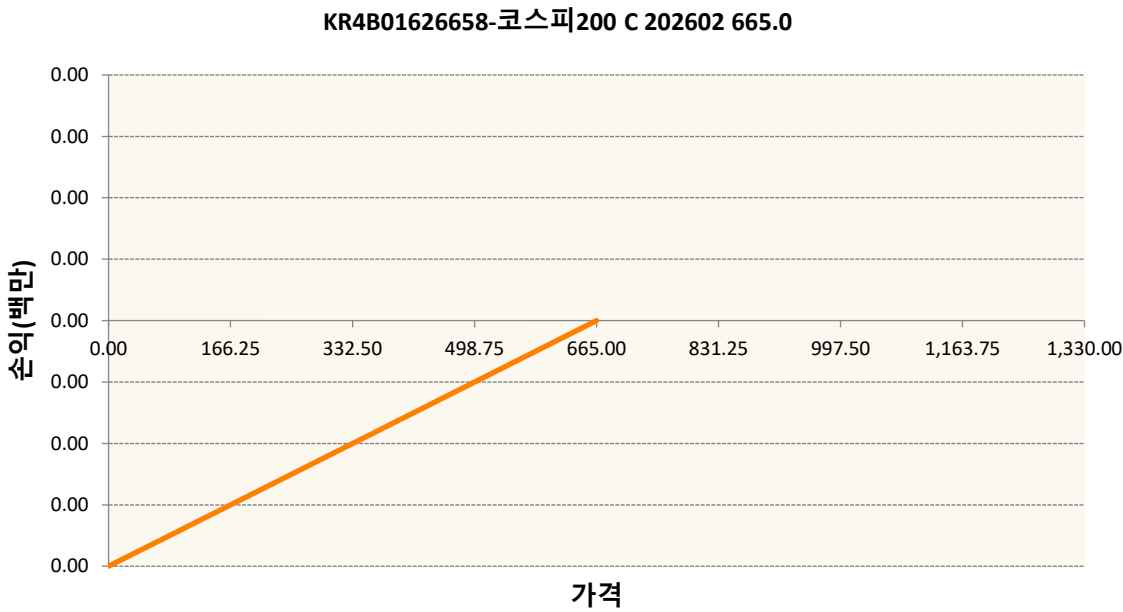
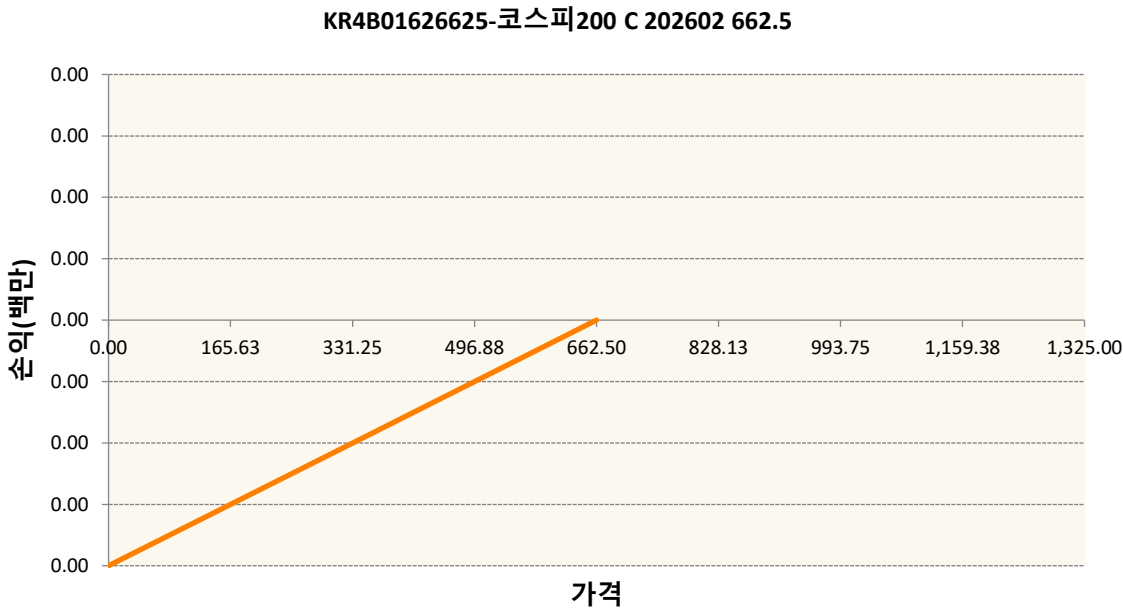
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

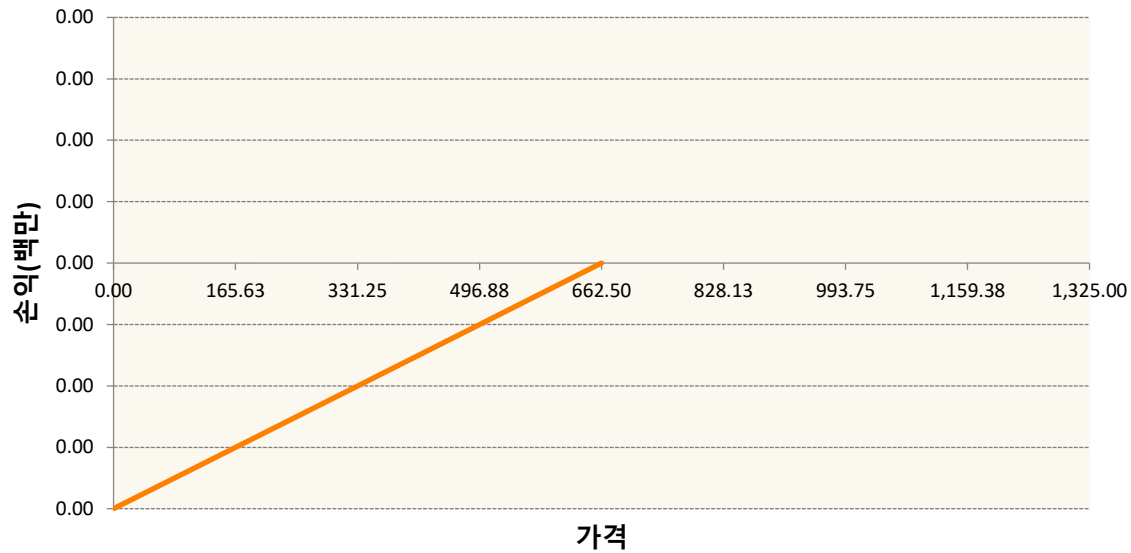
(단위:백만원)

| 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 2026-01-22

기준일 2026-01-21

## 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 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

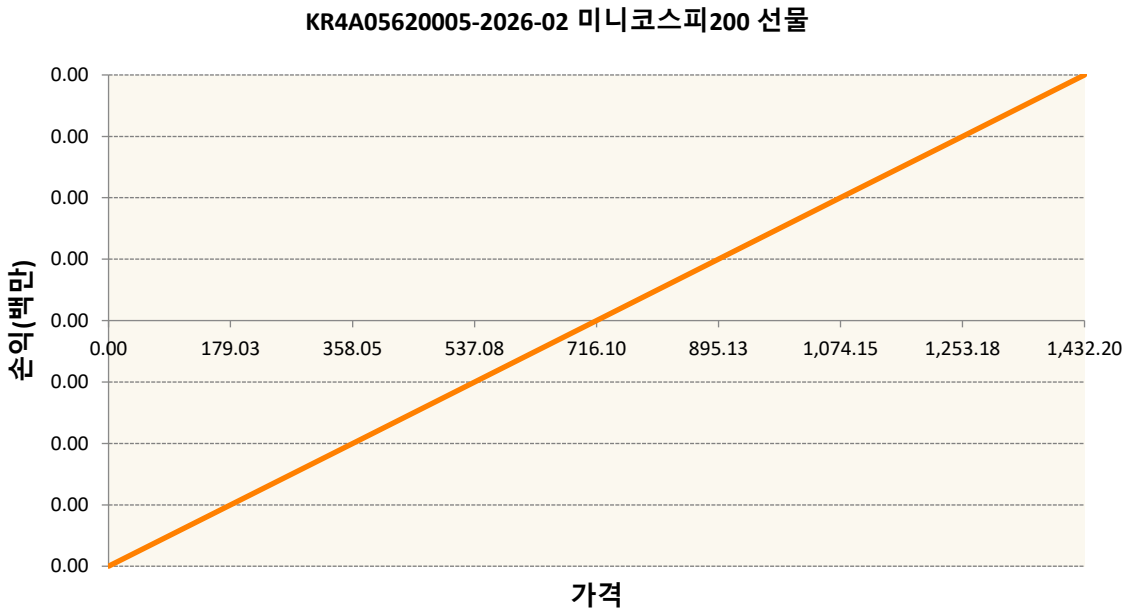
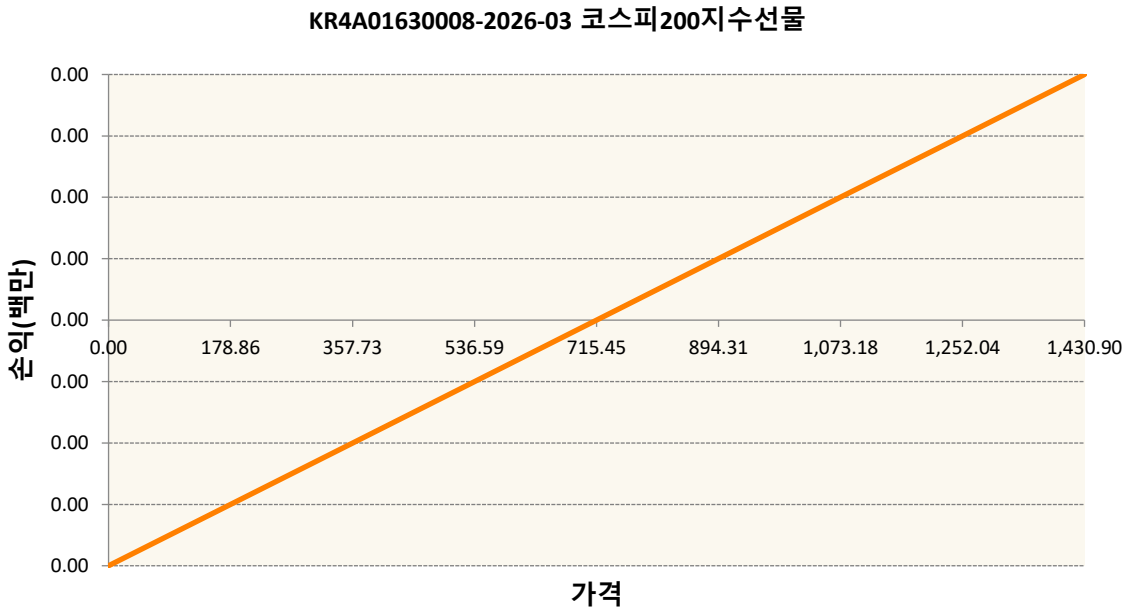
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,968 | 0     | 1,968     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)      |  | (단위:백만원) |
|--------------------------------|--|----------|
| KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물  |  | 72       |
| KR4A056200 2026-02 미니코스피200 선물 |  | 17       |

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

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

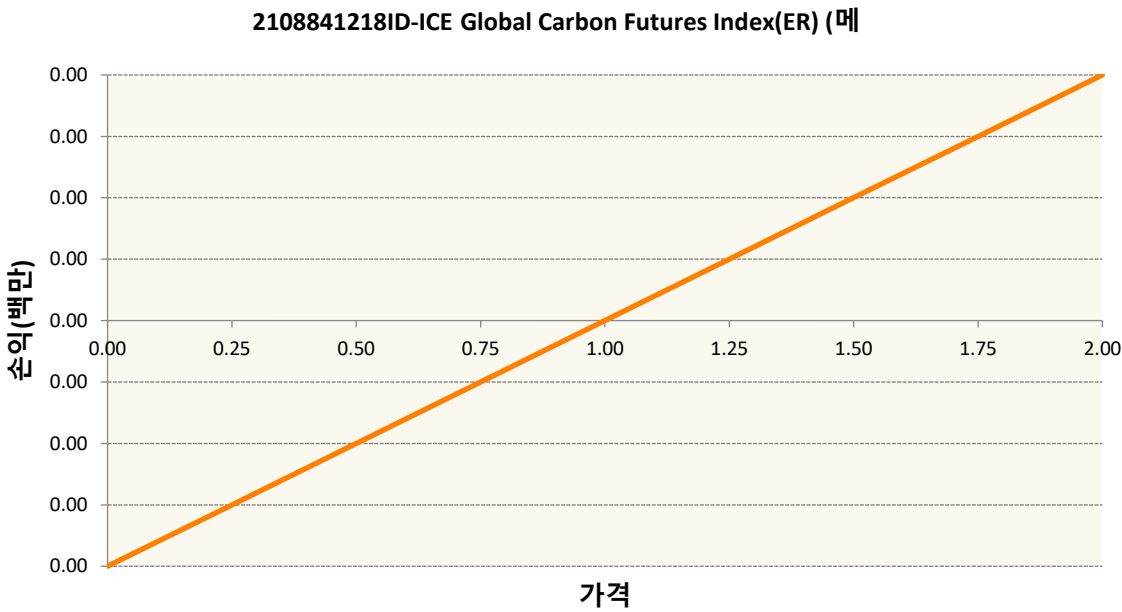
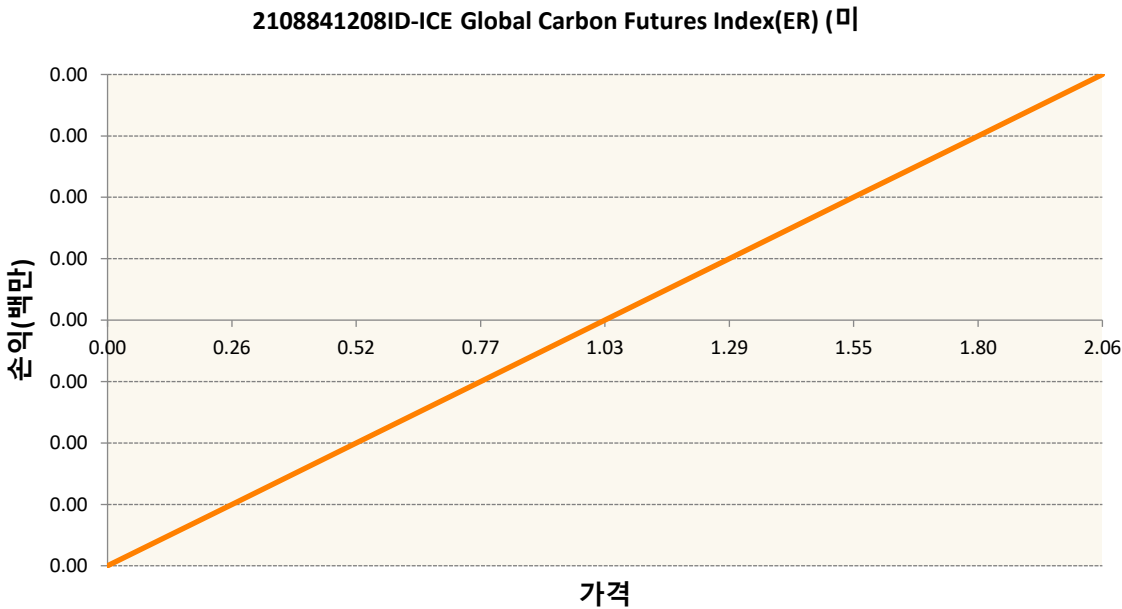
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 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   | 7,519 | 0     | 7,519     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                                        | (단위:백만원) |
|---------------------------|----------------------------------------|----------|
| 2108841208II              | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (미 | 482      |
| 2108841218II              | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 | 121      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 583      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

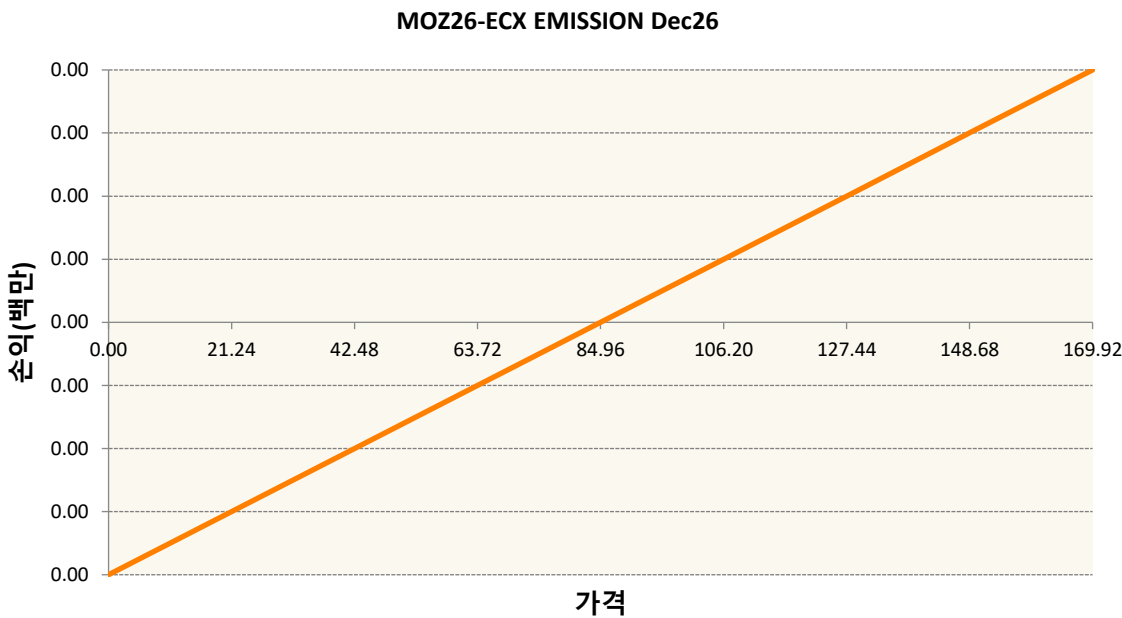
## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

### 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 |      |      | 5,637 | 0     | 5,637     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 3,394 | -3,394    | 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 | 451 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 751 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

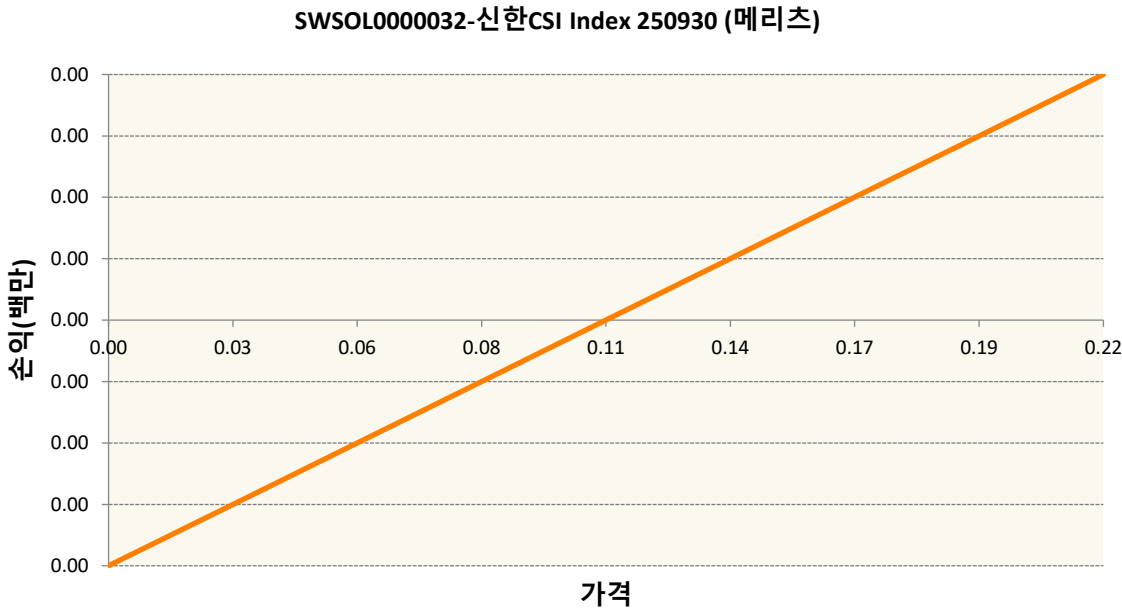
## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 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   | 3,024 | 0     | 3,024     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                                |    |
|------------------------------------------------|----|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)             | 14 |
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)             | 9  |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 9  |
| SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)            | 23 |

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 99 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

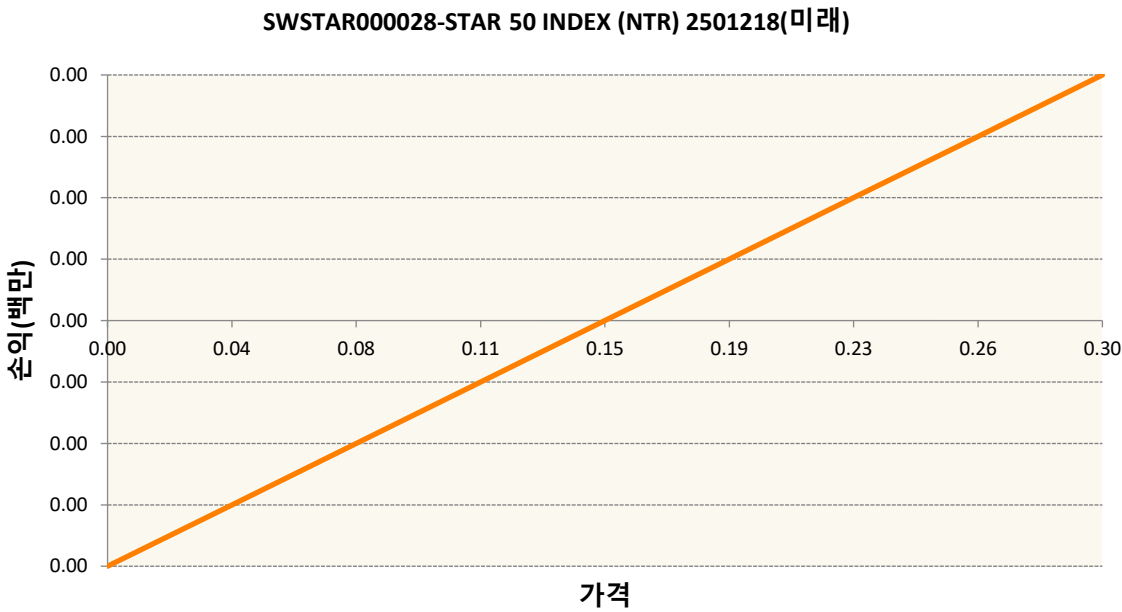
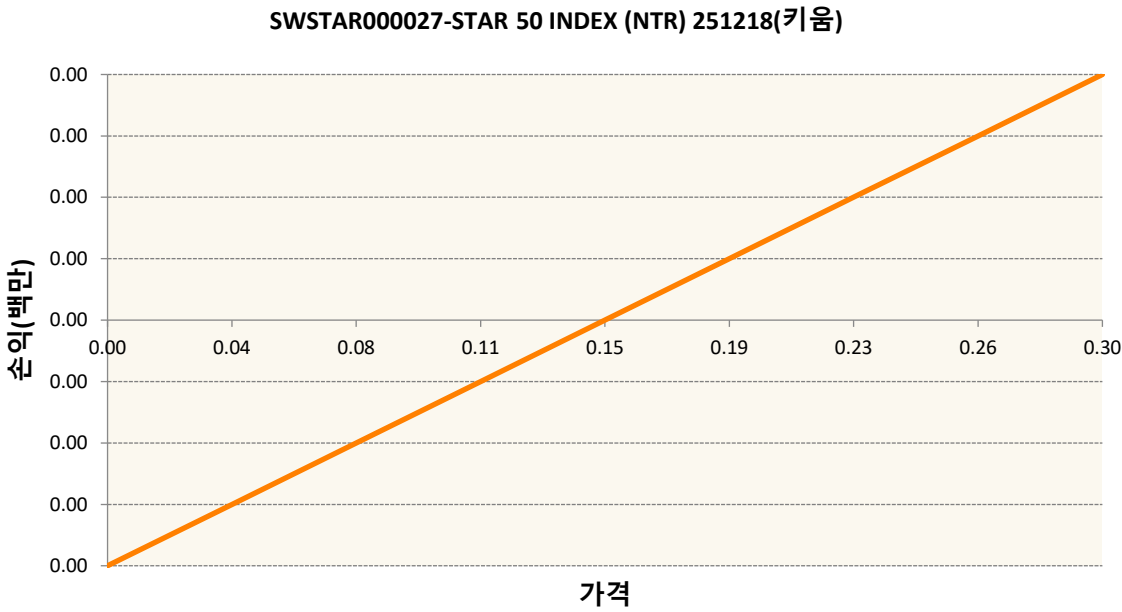
## SOL차이나육성산업엑티브상장지

### 1. 계약금액

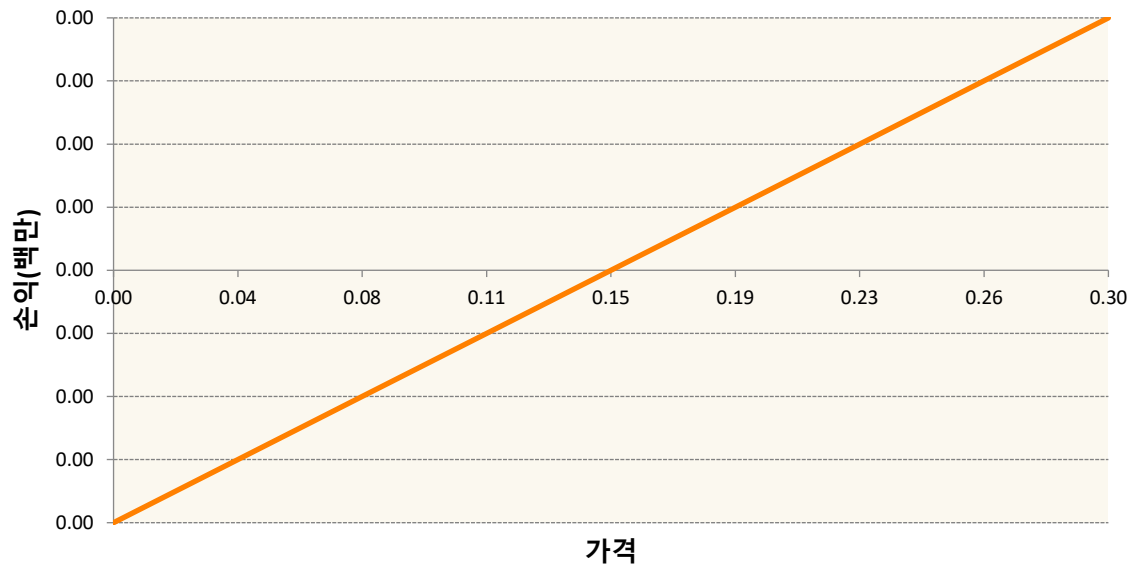
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 2,612 | 0     | 2,612     | 장외 |

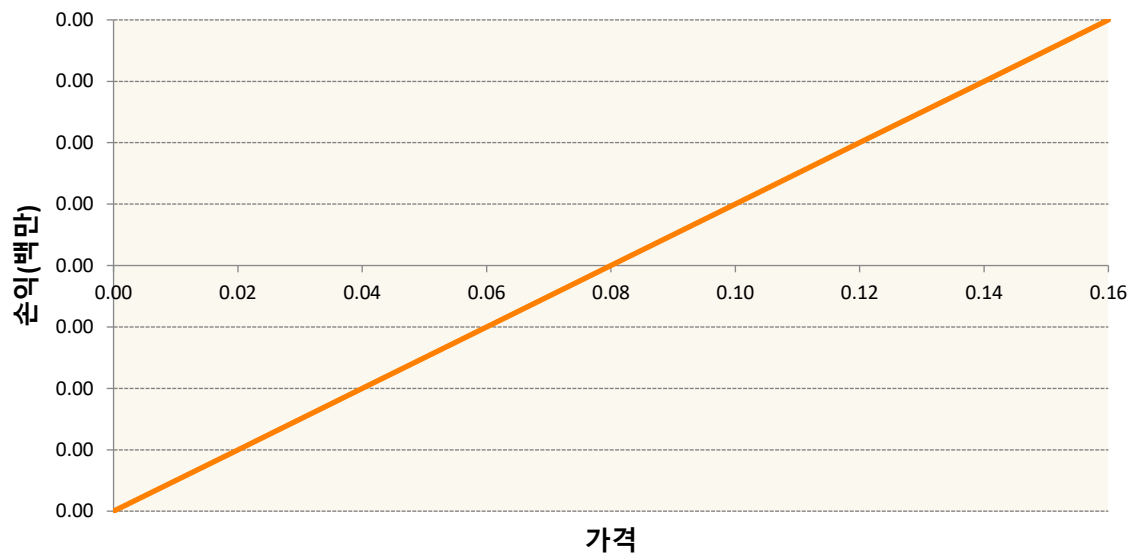
### 2. 만기시점의 손익구조



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)) | 66 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))  | 34 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)) | 95 |

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

(단위:백만원)

375

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

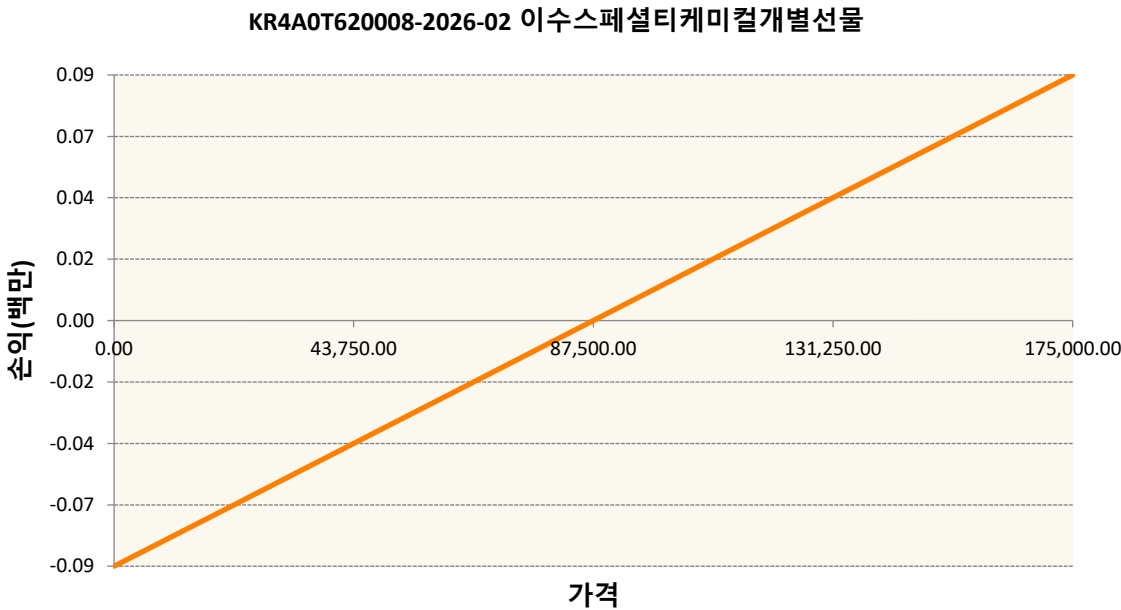
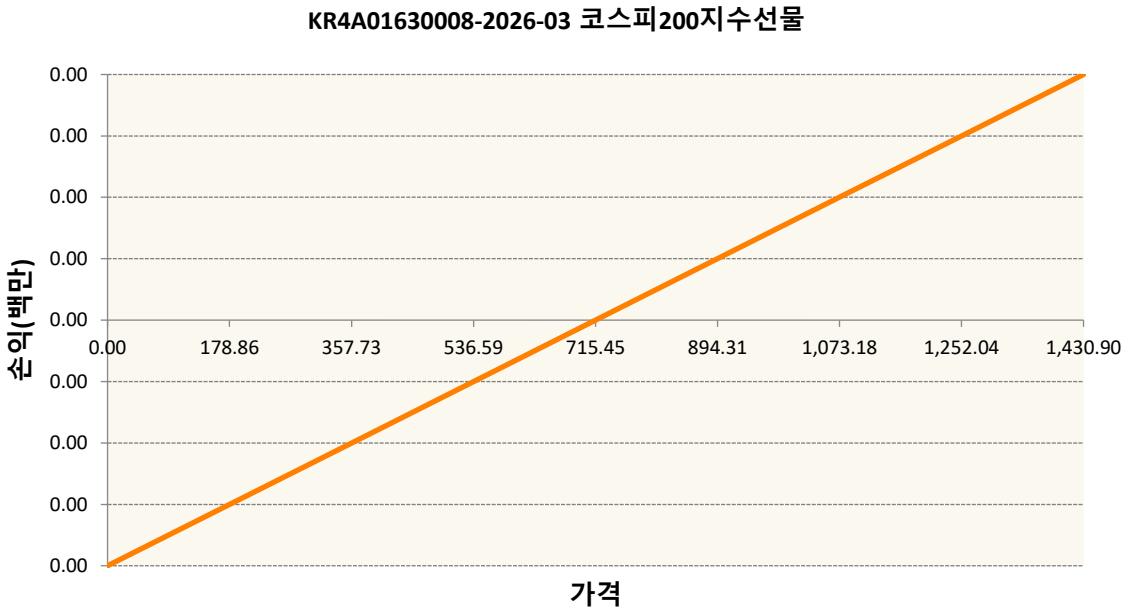
## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

### 1. 계약금액

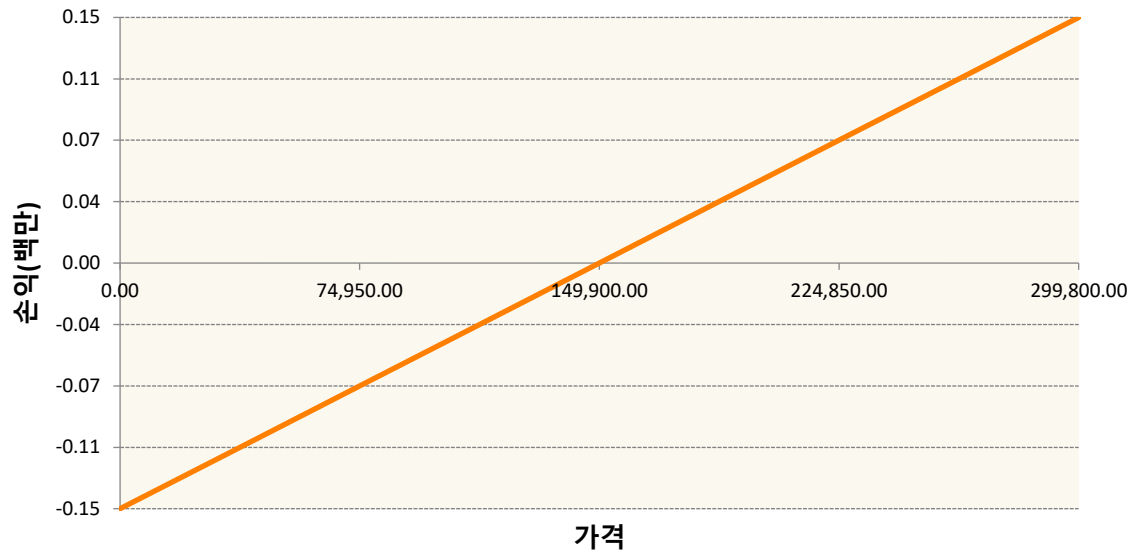
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 9,710 | 3,588 | 6,122     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 4     | 0     | 4         | 장외 |

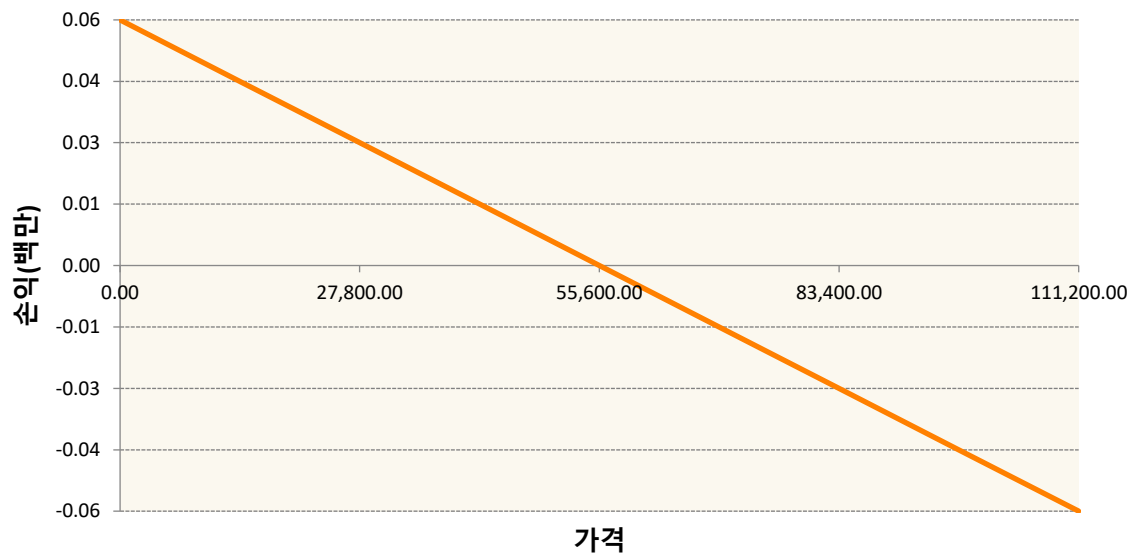
### 2. 만기시점의 손익구조



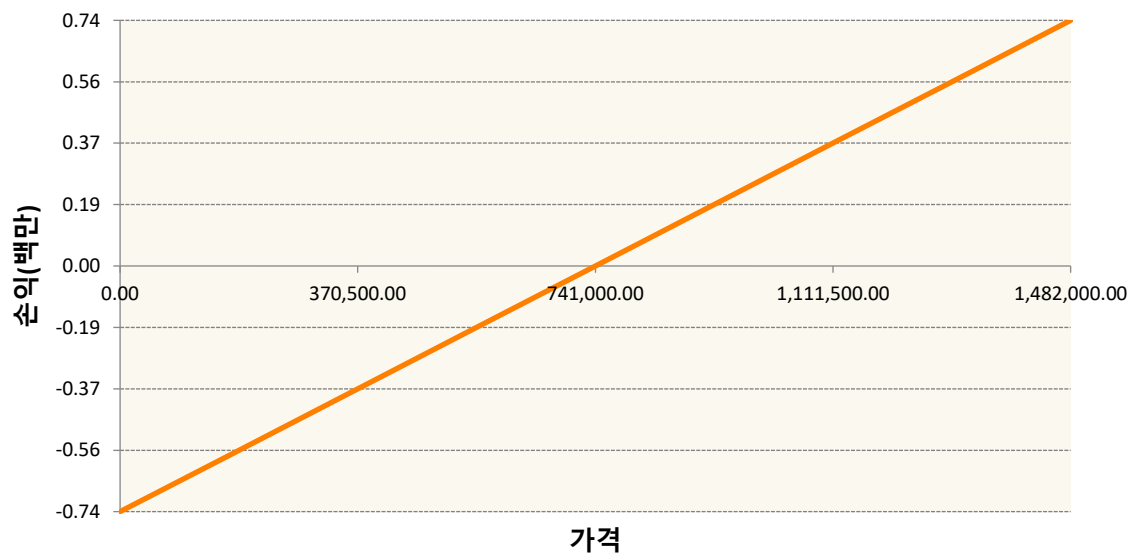
KR4A11620007-2026-02 삼성전자개별선물



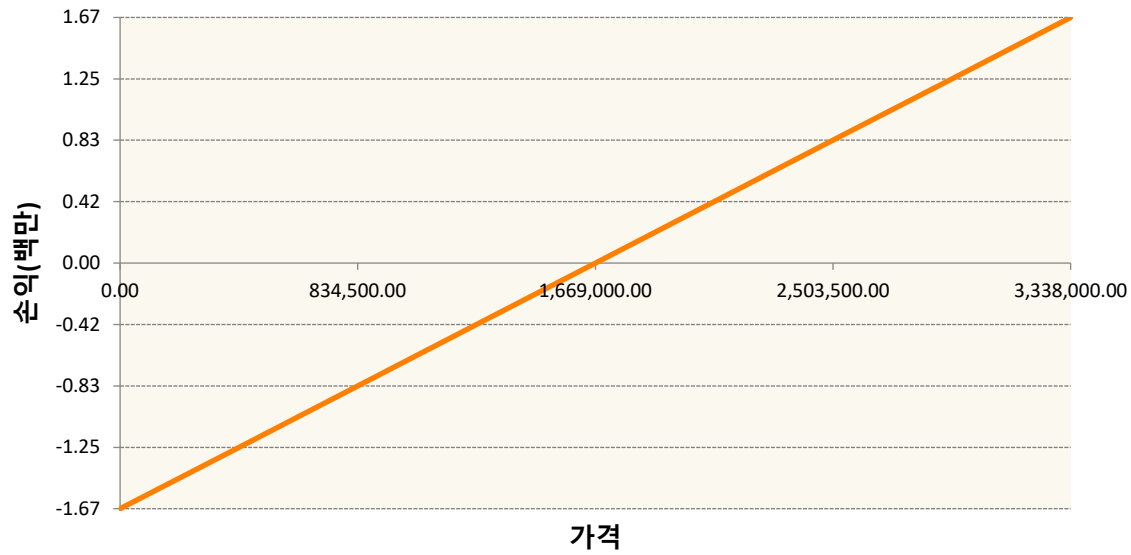
KR4A14620004-2026-02 KT개별선물



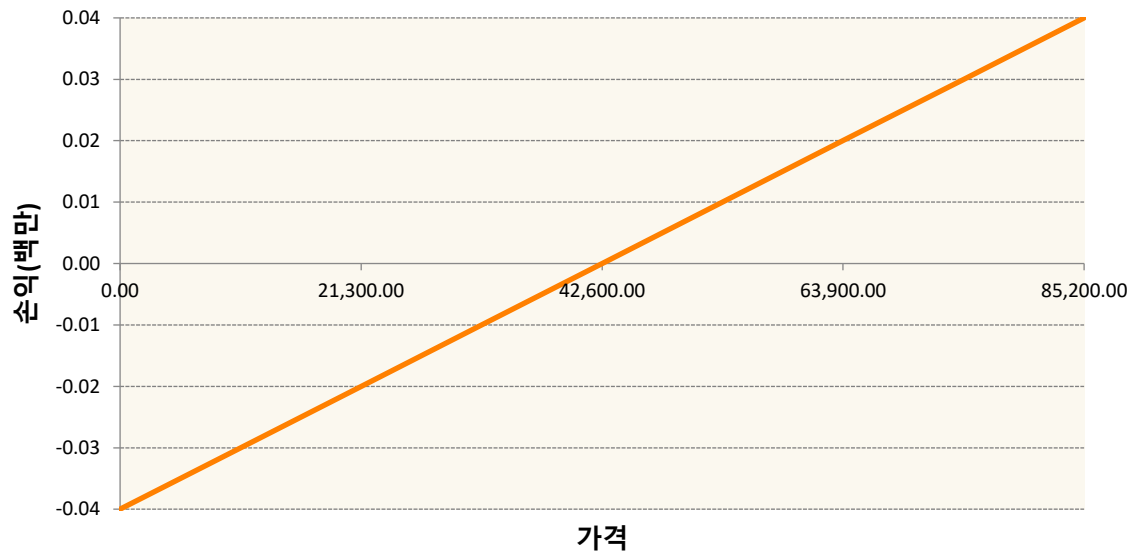
KR4A50620009-2026-02 SK하이닉스개별선물



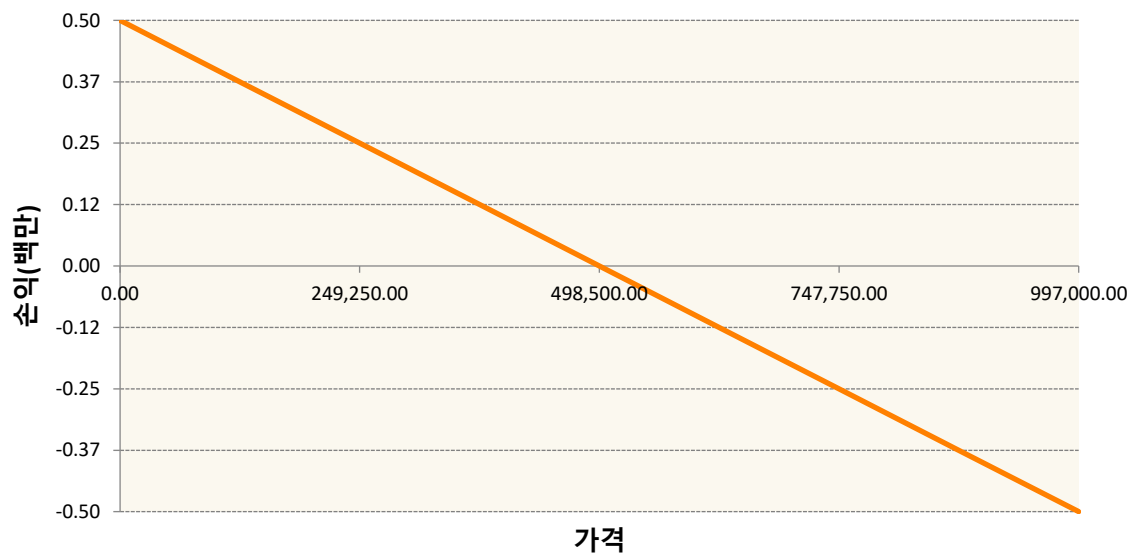
KR4AB3620005-2026-02 고려아연개별선물



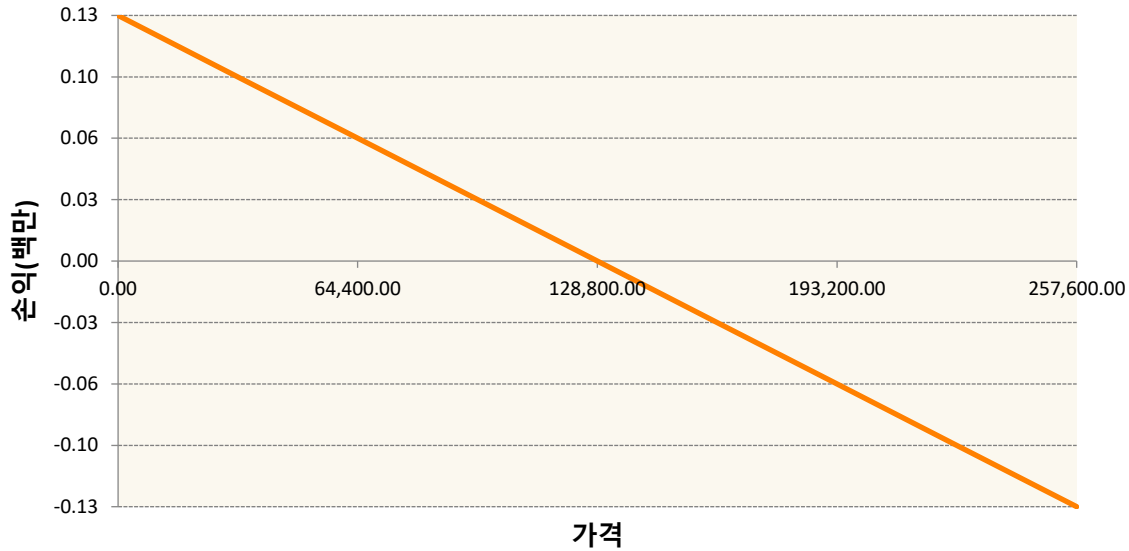
KR4ACN620009-2026-02 포스코DX개별선물



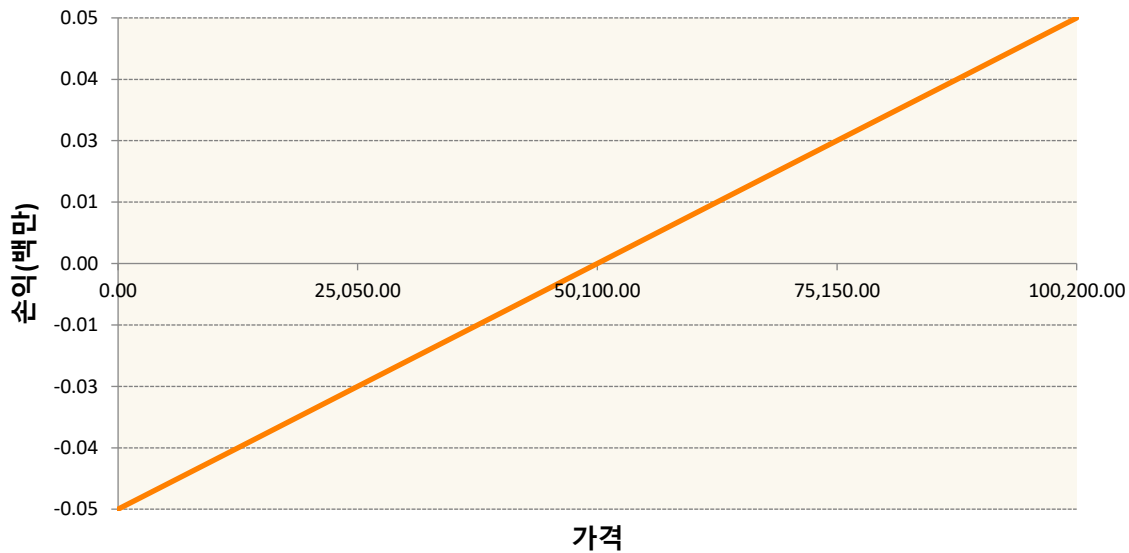
KR4ACT620003-2026-02 삼성화재개별선물



KR4AD0620004-2026-02 DB손해보험개별선물



KR4AF7620002-2026-02 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |         |                    |      |       |        |        |      |
|--------------|-----------|---------|--------------------|------|-------|--------|--------|------|
| KR4A01630008 |           |         | 2026-03 코스피200지수선물 |      |       |        |        | 272  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                    |      |       |        |        |      |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%             | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |      |
| -8.00%       | -272      | -272    | -272               | -272 | -272  | -272   | -272   | -272 |
| -5.33%       | -181      | -181    | -181               | -181 | -181  | -181   | -181   | -181 |
| -2.67%       | -91       | -91     | -91                | -91  | -91   | -91    | -91    | -91  |
| 0%           | 0         | 0       | 0                  | 0    | 0     | 0      | 0      | 0    |
| 2.67%        | 91        | 91      | 91                 | 91   | 91    | 91     | 91     | 91   |
| 5.33%        | 181       | 181     | 181                | 181  | 181   | 181    | 181    | 181  |
| 8.00%        | 272       | 272     | 272                | 272  | 272   | 272    | 272    | 272  |
|              |           |         |                    |      |       |        |        |      |
| KR4A11620007 |           |         | 2026-02 삼성전자개별선물   |      |       |        |        | 186  |

|        | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |        |
|--------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -186      | -186    | -186   | -186 | -186  | -186   | -186   |
| -5.33% | -124      | -124    | -124   | -124 | -124  | -124   | -124   |
| -2.67% | -62       | -62     | -62    | -62  | -62   | -62    | -62    |
| 0%     | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 62        | 62      | 62     | 62   | 62    | 62     | 62     |
| 5.33%  | 124       | 124     | 124    | 124  | 124   | 124    | 124    |
| 8.00%  | 186       | 186     | 186    | 186  | 186   | 186    | 186    |

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      178

|        | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |        |
|--------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -178      | -178    | -178   | -178 | -178  | -178   | -178   |
| -5.33% | -119      | -119    | -119   | -119 | -119  | -119   | -119   |
| -2.67% | -59       | -59     | -59    | -59  | -59   | -59    | -59    |
| 0%     | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 59        | 59      | 59     | 59   | 59    | 59     | 59     |
| 5.33%  | 119       | 119     | 119    | 119  | 119   | 119    | 119    |
| 8.00%  | 178       | 178     | 178    | 178  | 178   | 178    | 178    |

KR4AB3620005      2026-02 고려아연개별선물      115

|        | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |        |
|--------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -115      | -115    | -115   | -115 | -115  | -115   | -115   |
| -5.33% | -77       | -77     | -77    | -77  | -77   | -77    | -77    |
| -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%  | 77        | 77      | 77     | 77   | 77    | 77     | 77     |
| 8.00%  | 115       | 115     | 115    | 115  | 115   | 115    | 115    |

KR4ACN620009      2026-02 포스코DX개별선물      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     |
| KR4ACT620003 2026-02 삼성화재개별선물   |         |         |        |     |       |        | 91     |
| 기초자산의 변동성                       |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                          | 91      | 91      | 91     | 91  | 91    | 91     | 91     |
| -5.33%                          | 61      | 61      | 61     | 61  | 61    | 61     | 61     |
| -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%                           | -61     | -61     | -61    | -61 | -61   | -61    | -61    |
| 8.00%                           | -91     | -91     | -91    | -91 | -91   | -91    | -91    |
| 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)

1,237

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

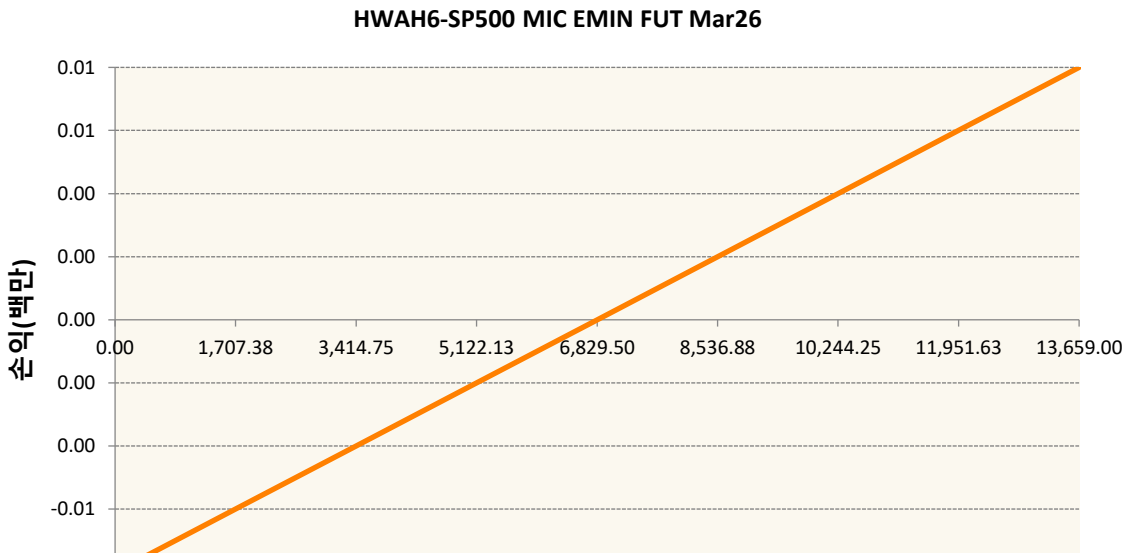
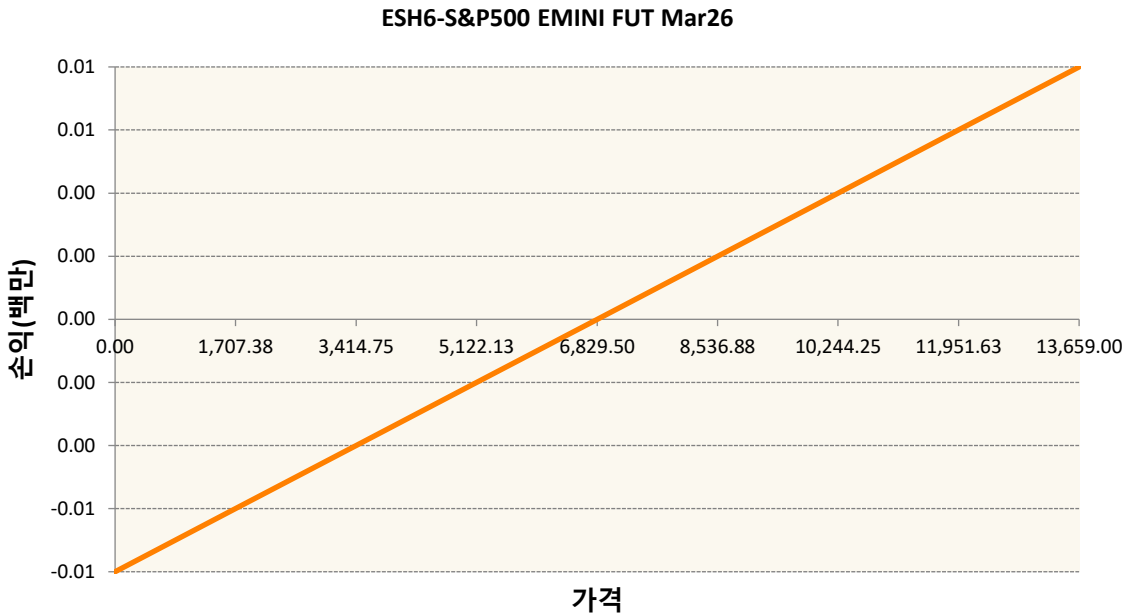
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

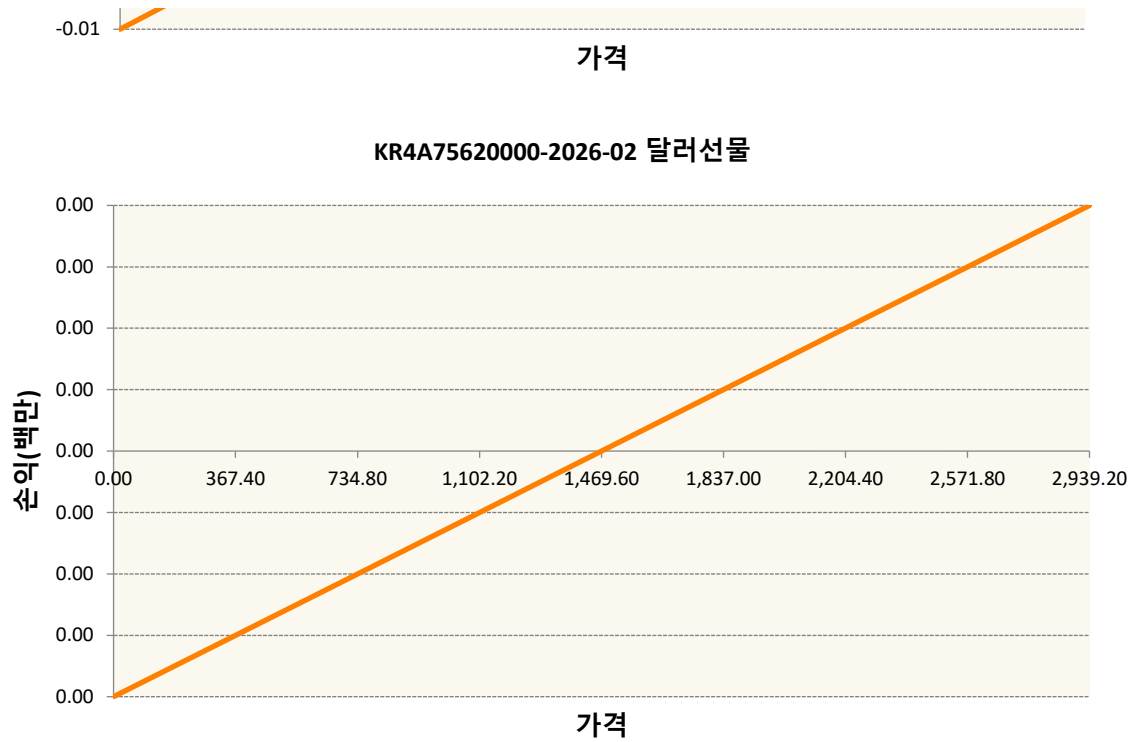
### 1. 계약금액

(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   | 1,469  | 0     | 1,469     | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,111  | 0     | 1,111     | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 54,379 | 0     | 54,379    |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 4,115  | 0     | 4,115     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                          |       |
|------------|--------------------------|-------|
| ESH6       | S&P500 EMINI FUT Mar26   | 4,350 |
| HWAH6      | SP500 MIC EMIN FUT Mar26 | 89    |
| KR4A756200 | 2026-02 달러선물             | 329   |

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

(단위:백만원)

3,821

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

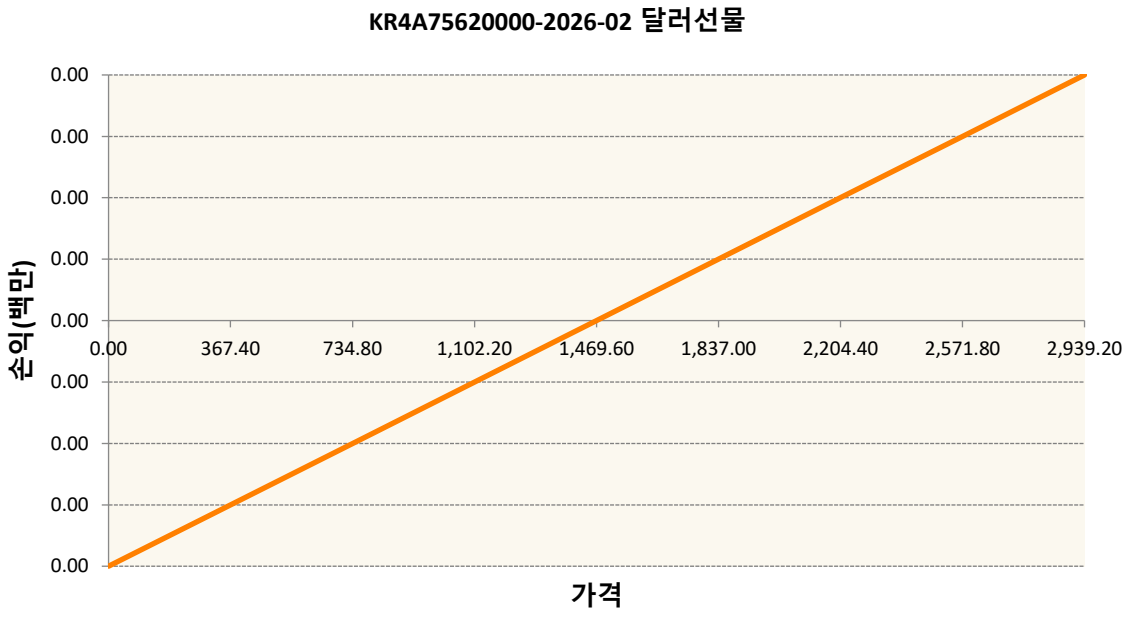
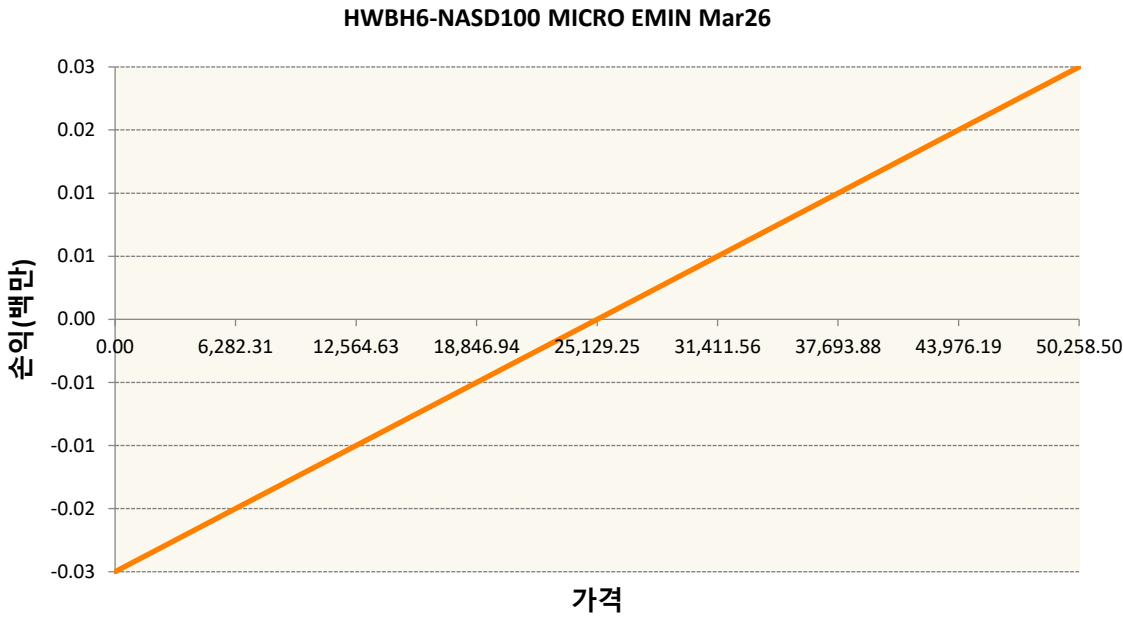
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

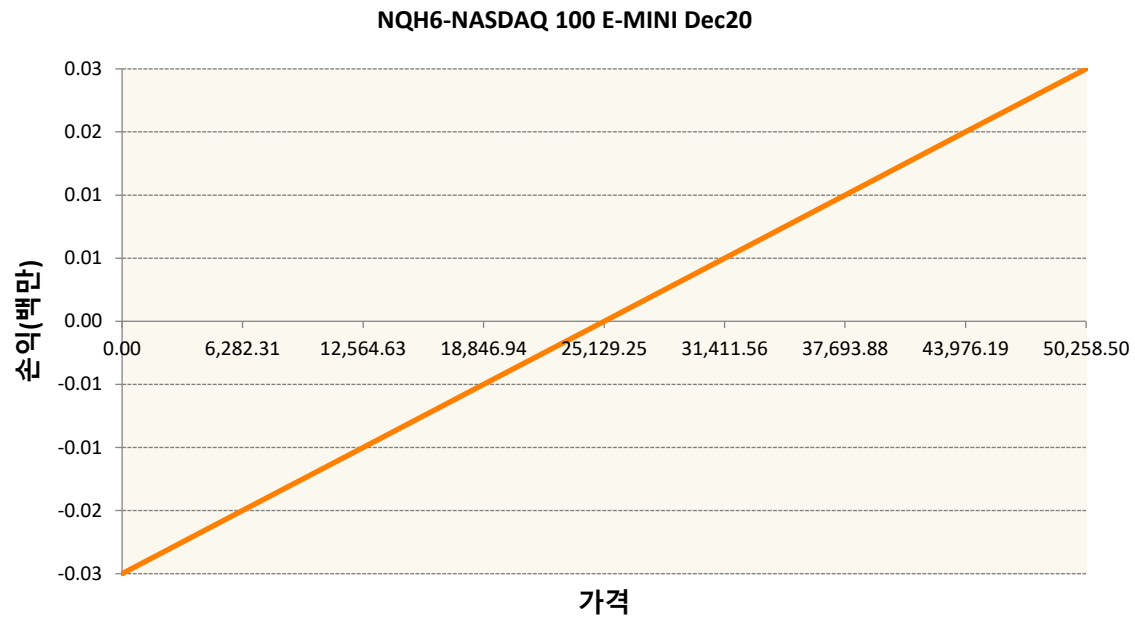
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선물   | 543    | 0     | 543       | 장내 |
| 누계 | 지수   | 선물   | 24,626 | 0     | 24,626    | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선물   | 1,426  | 0     | 1,426     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                          |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|--------------------------|--|----------|
| HWBH6                     | NASD100 MICRO EMIN Mar26 |  | 71       |
| KR4A756200                | 2026-02 달러선물             |  | 114      |
| NQH6                      | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  |  | 1,899    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 2,154    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

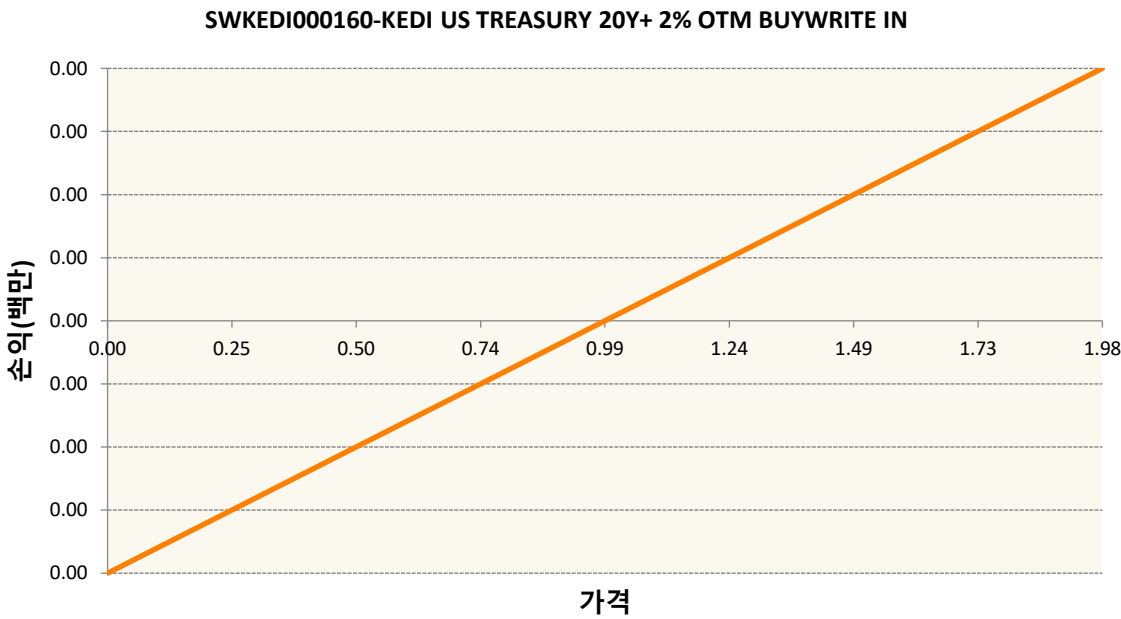
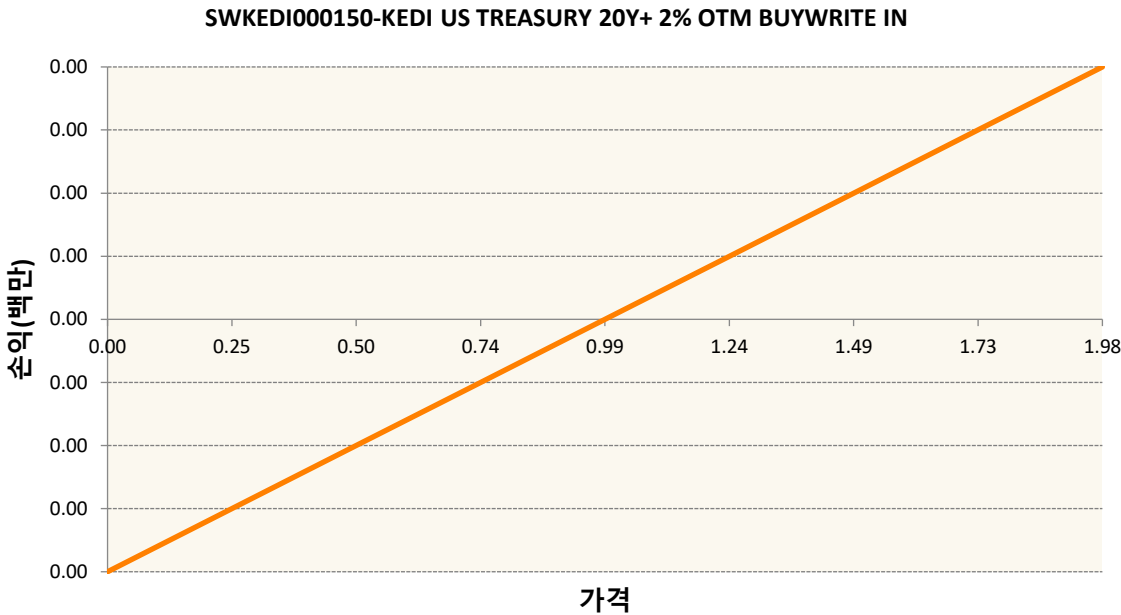
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

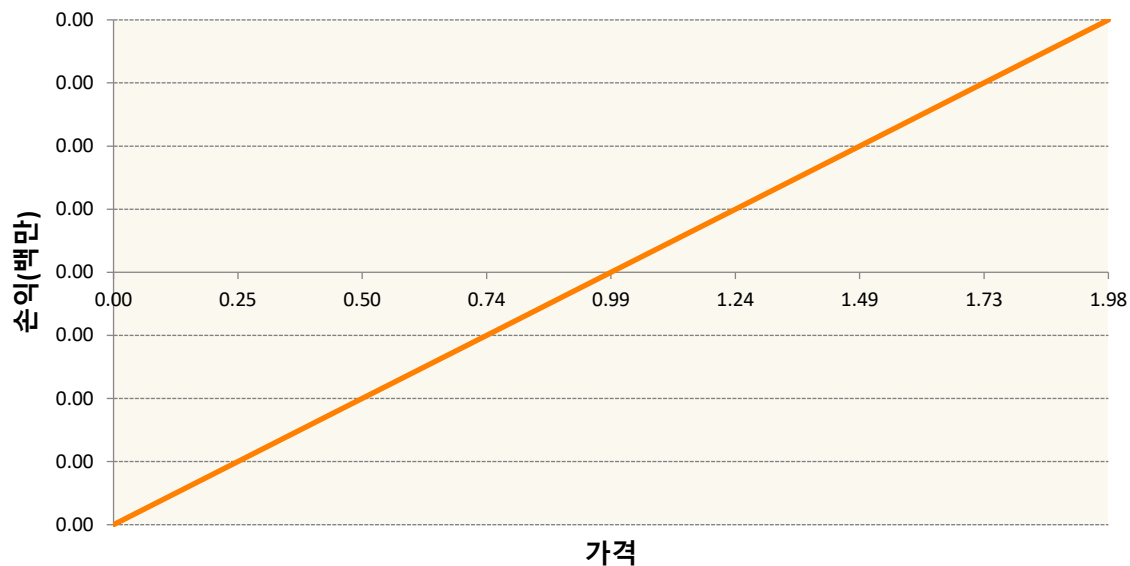
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 377,445 | 0     | 377,445   | 장외 |

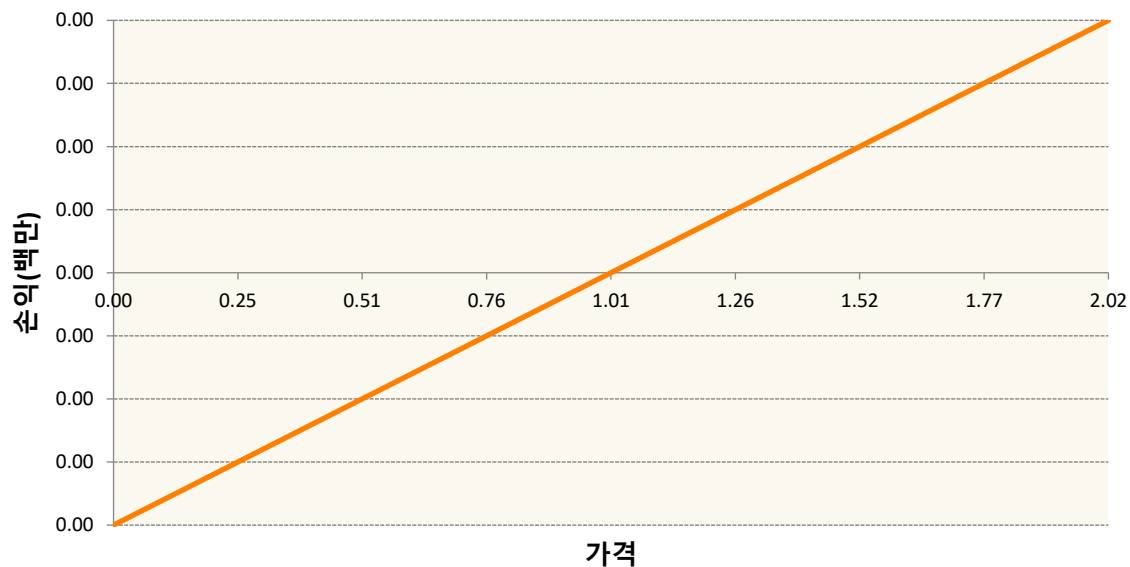
### 2. 만기시점의 손익구조



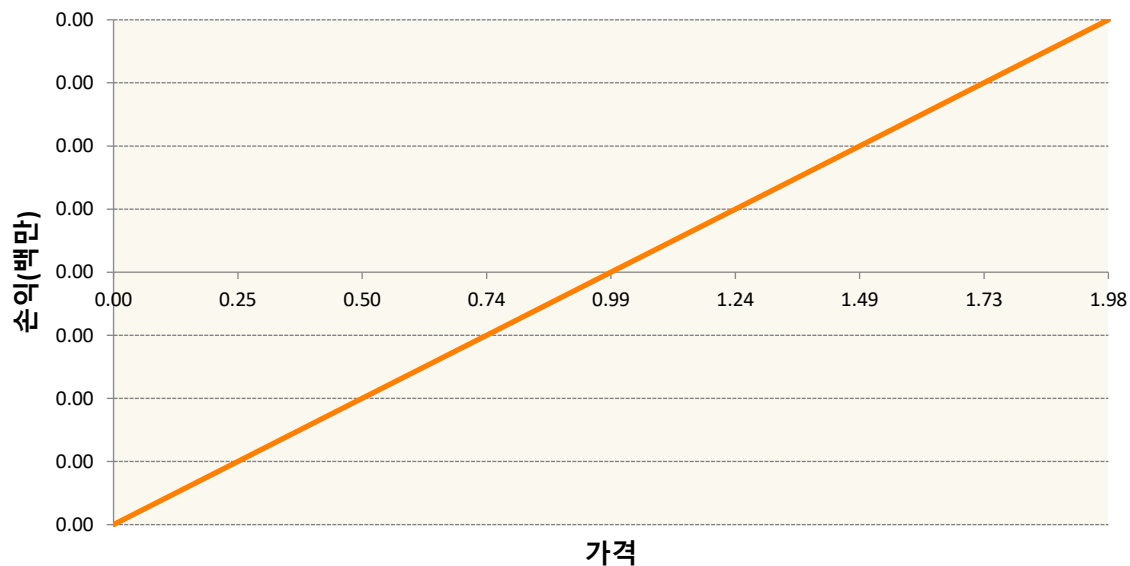
SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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 |  | 8,128    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 8,271    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 3,641    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 147      |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 9,920    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 13,649   |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

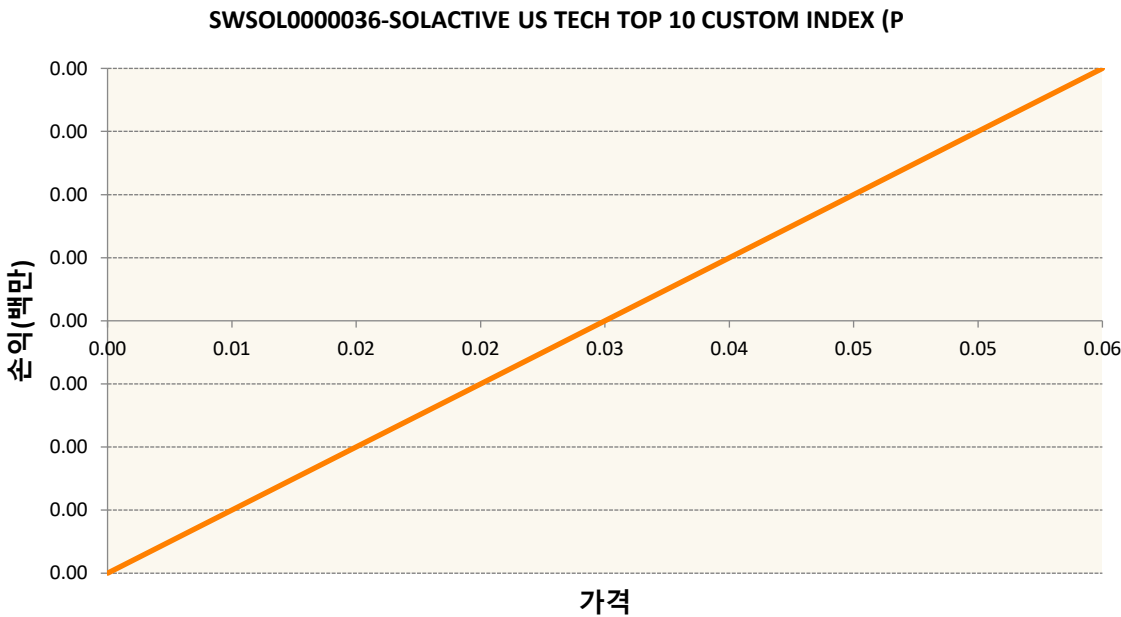
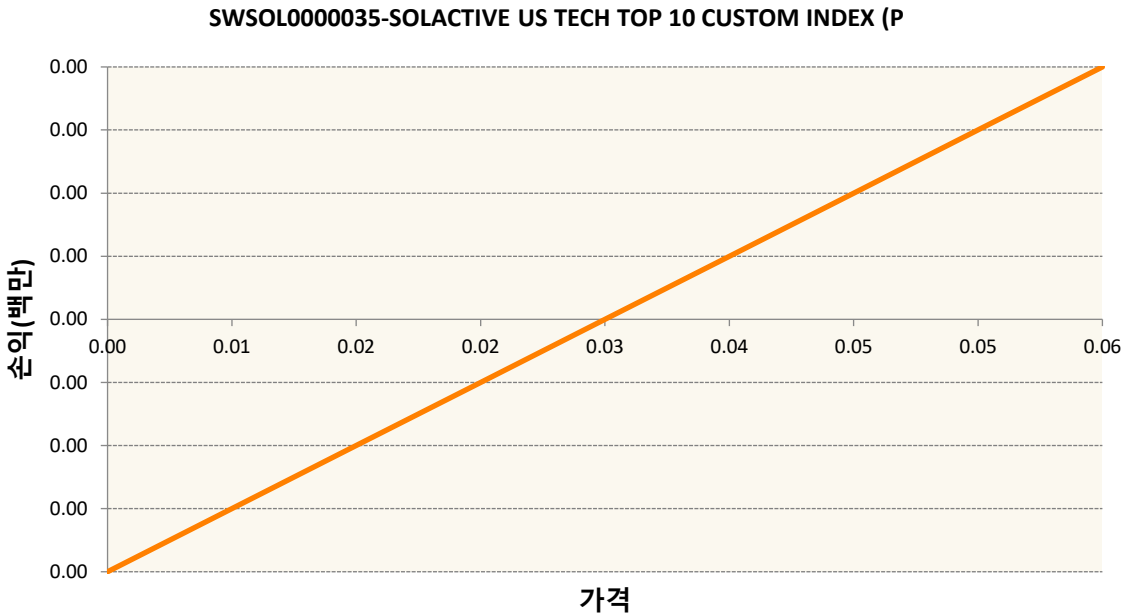
SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

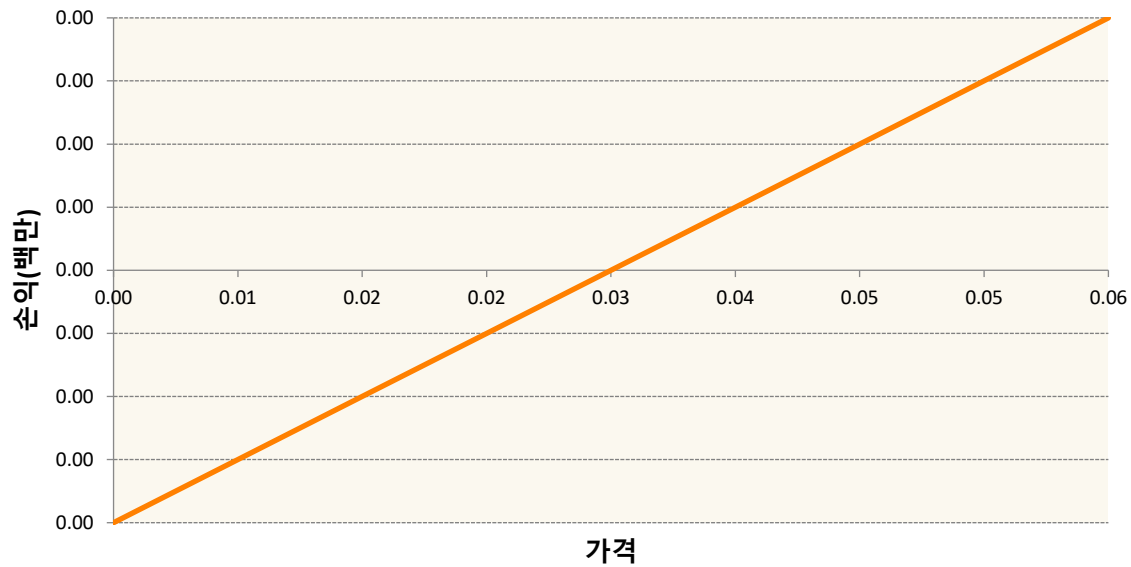
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 70    | 0     | 70        | 장외 |

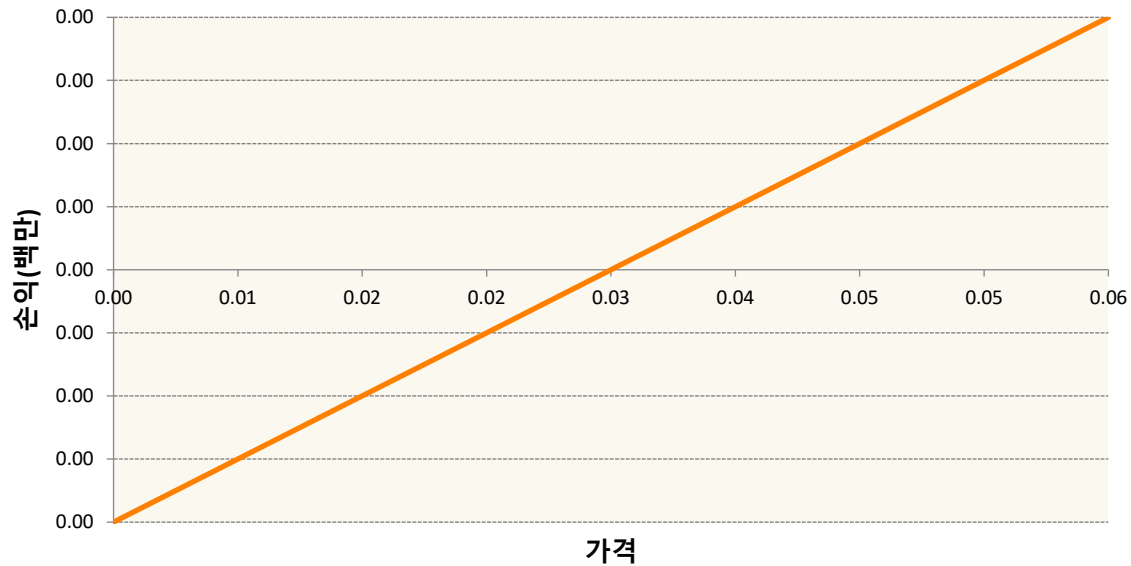
2. 만기시점의 손익구조



SWSOL0000037-SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P



SWSOL0000038-SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P  
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P  
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P  
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P

|   |
|---|
| 1 |
| 1 |
| 1 |
| 1 |

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

(단위:백만원)

|   |
|---|
| 7 |
|---|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-01-22 |
| 기준일 | 2026-01-21 |

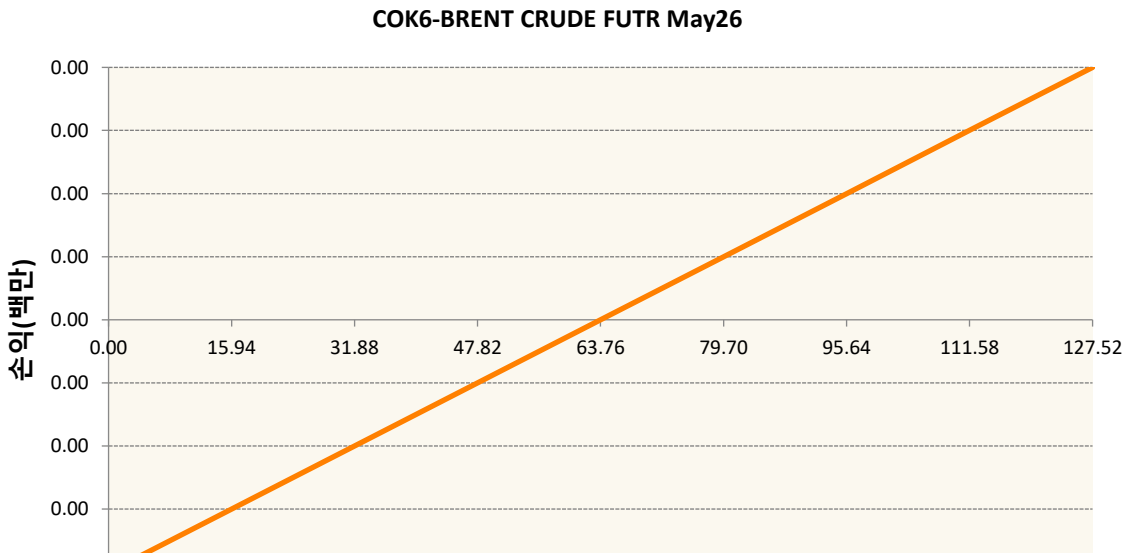
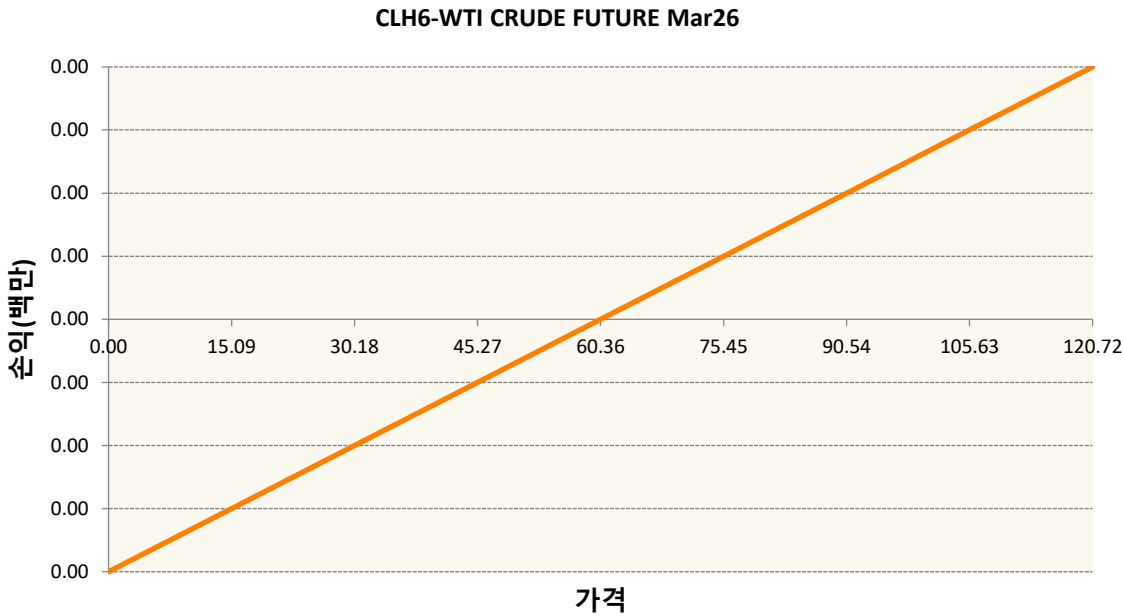
## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

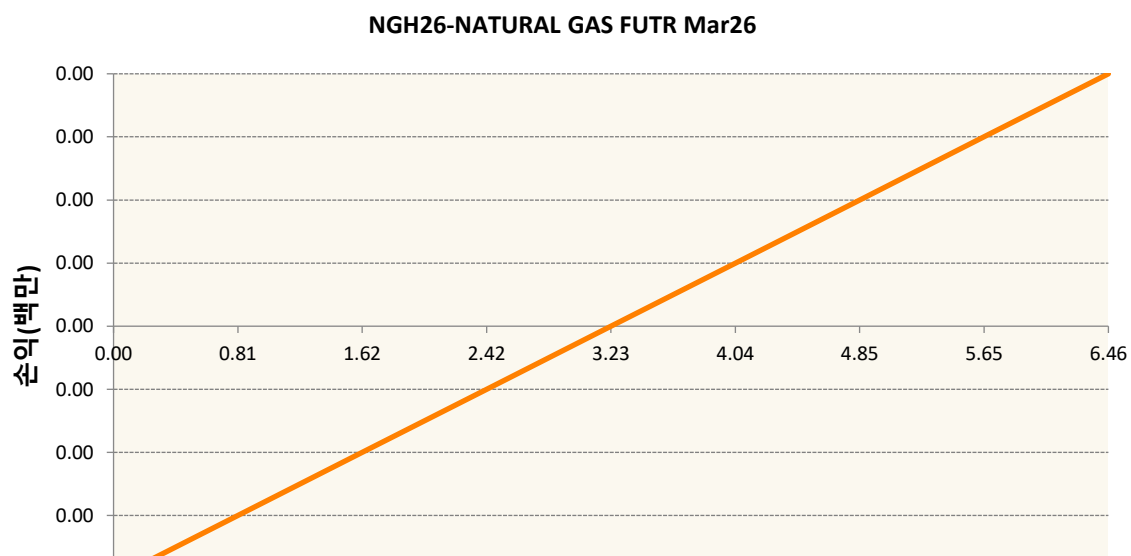
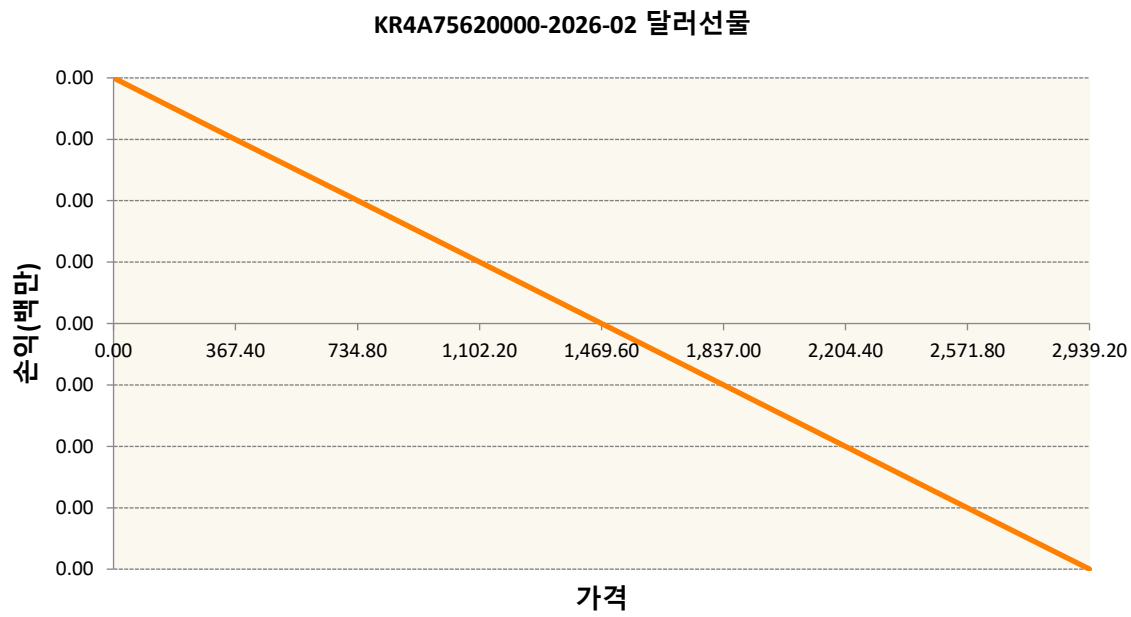
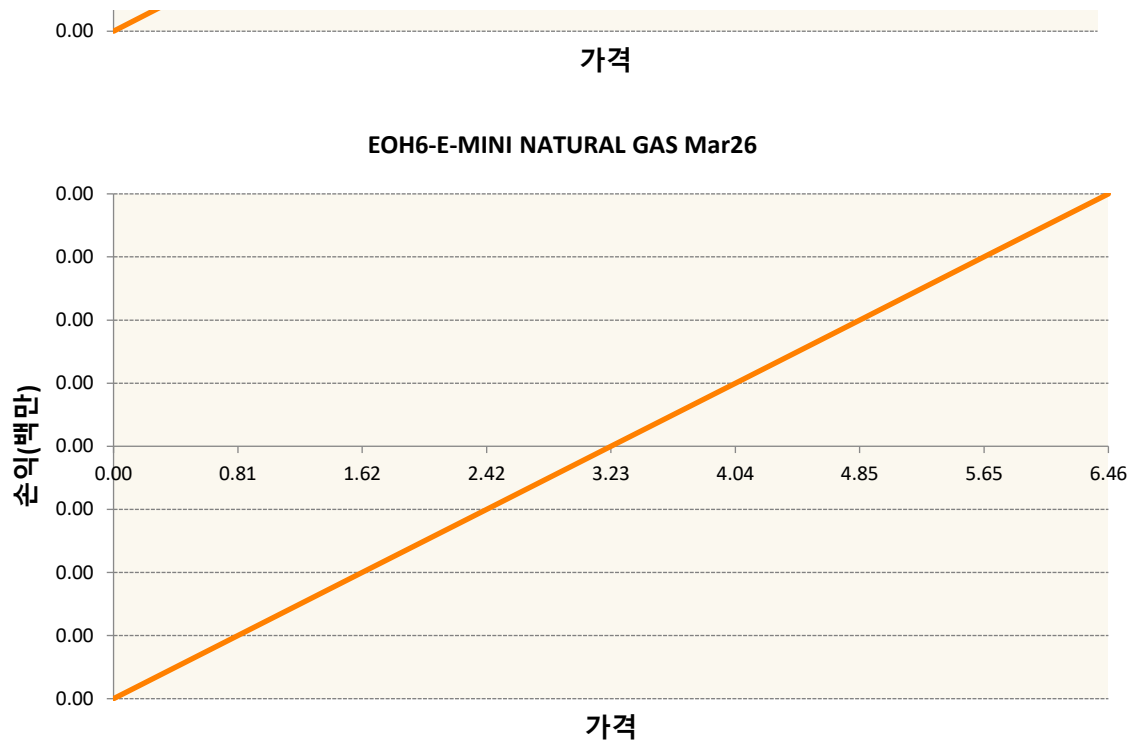
### 1. 계약금액

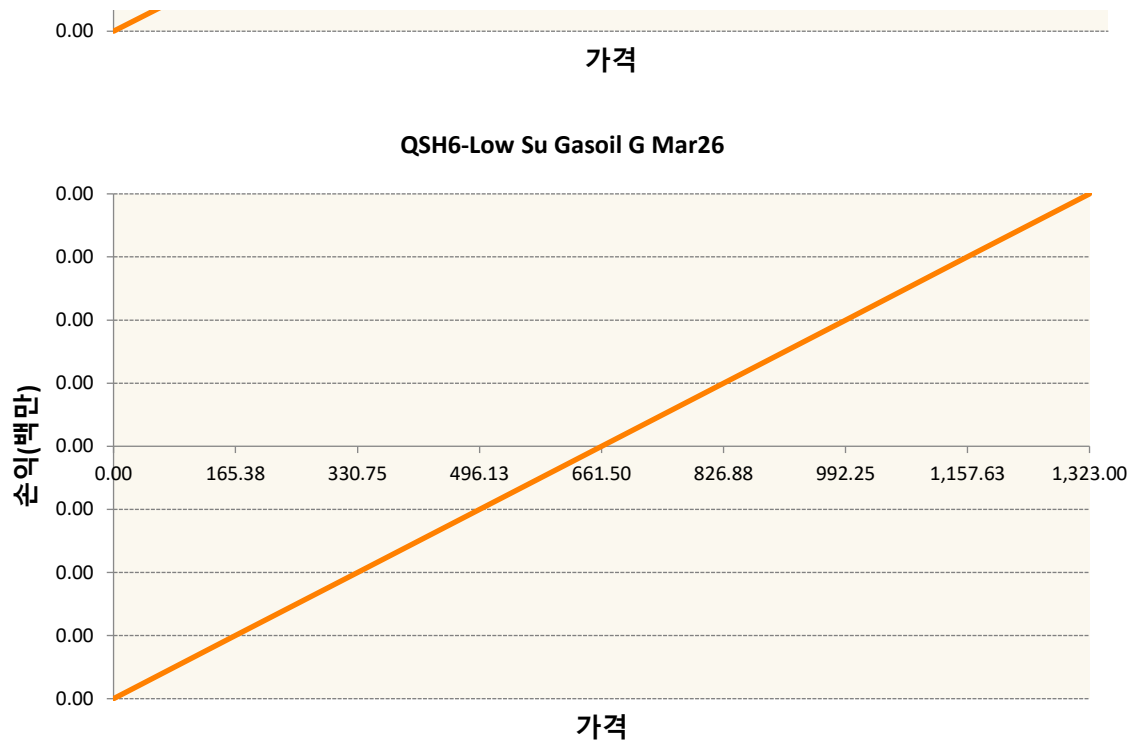
(단위:백만원)

| 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   | 119   | 0     | 119       |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 374   | 0     | 374       |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 73    | -73       | 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   | 8  |
| QSH6       | Low Su Gasoil G Mar26    | 8  |

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

(단위:백만원)

84