

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

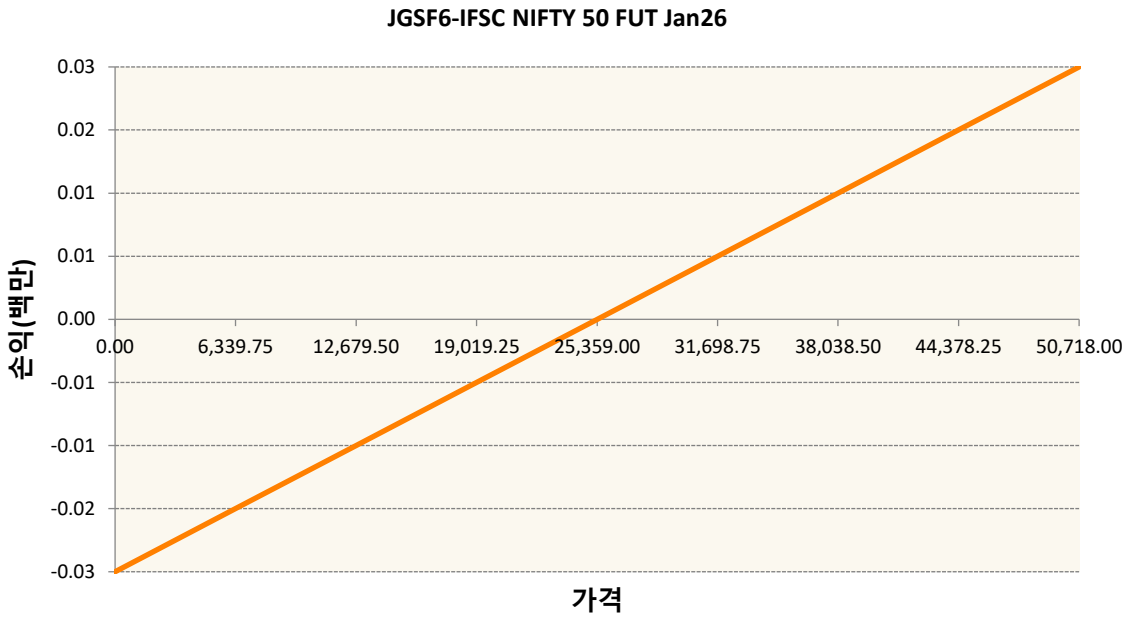
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	652	0	652	

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	2026-01-26
기준일	2026-01-23

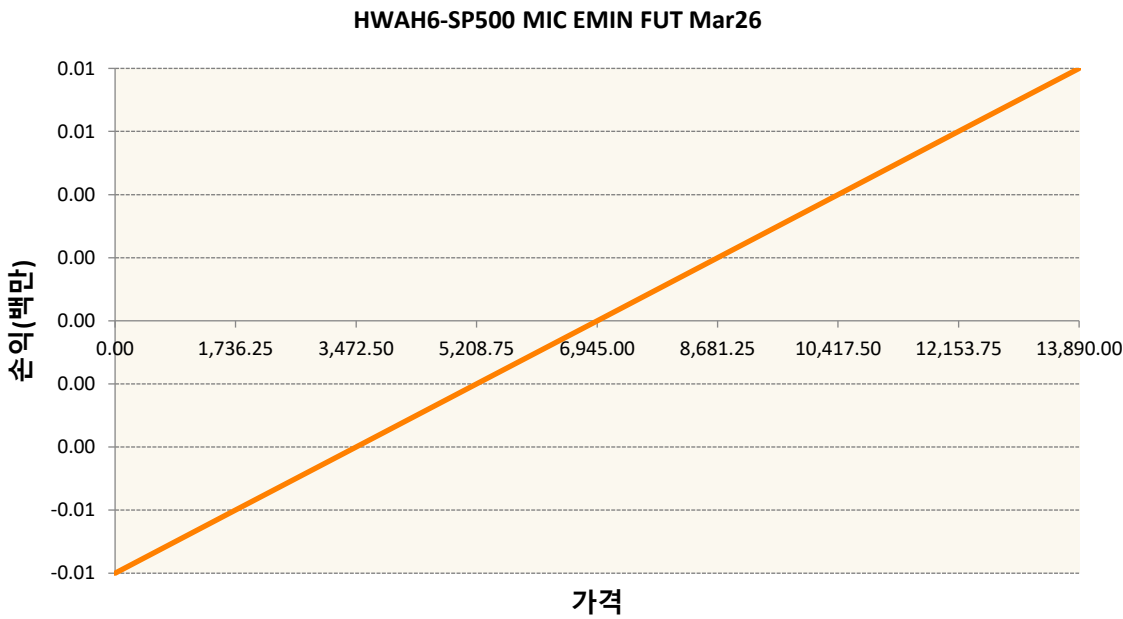
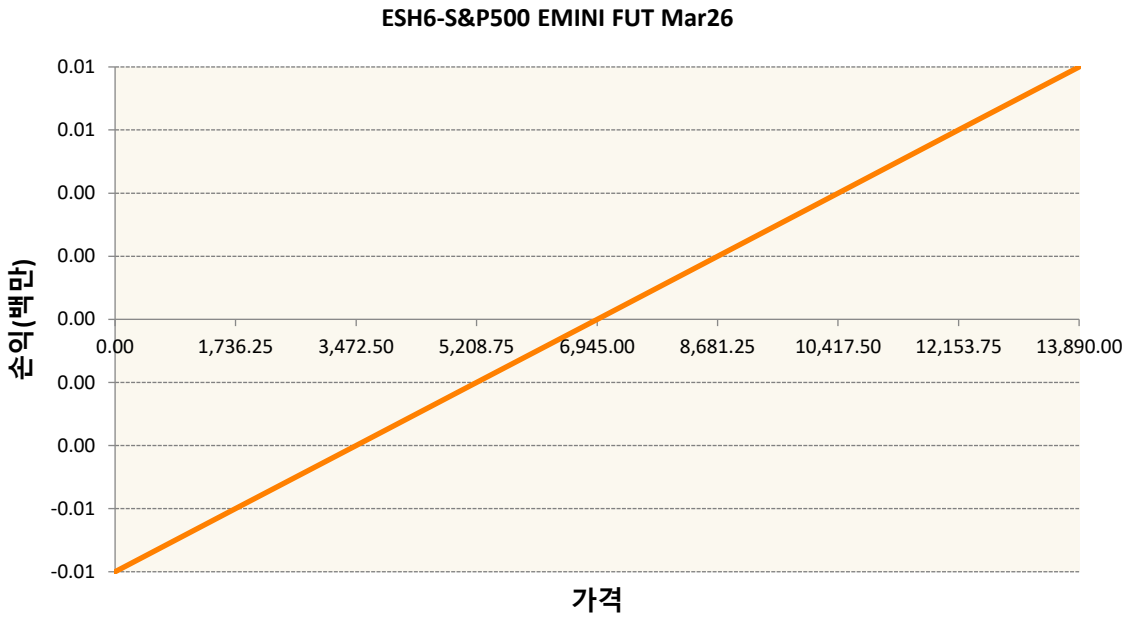
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	257	0	257	장내
누계	지수	선물	513	0	513	

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	2026-01-26
기준일	2026-01-23

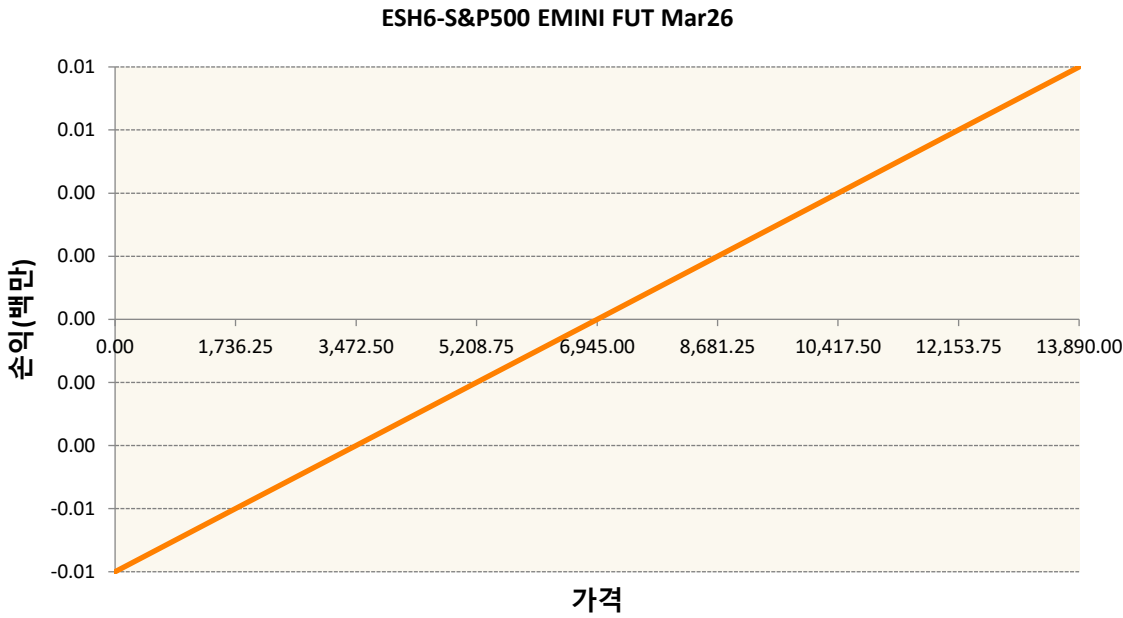
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,540	0	1,540	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	123
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

106

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

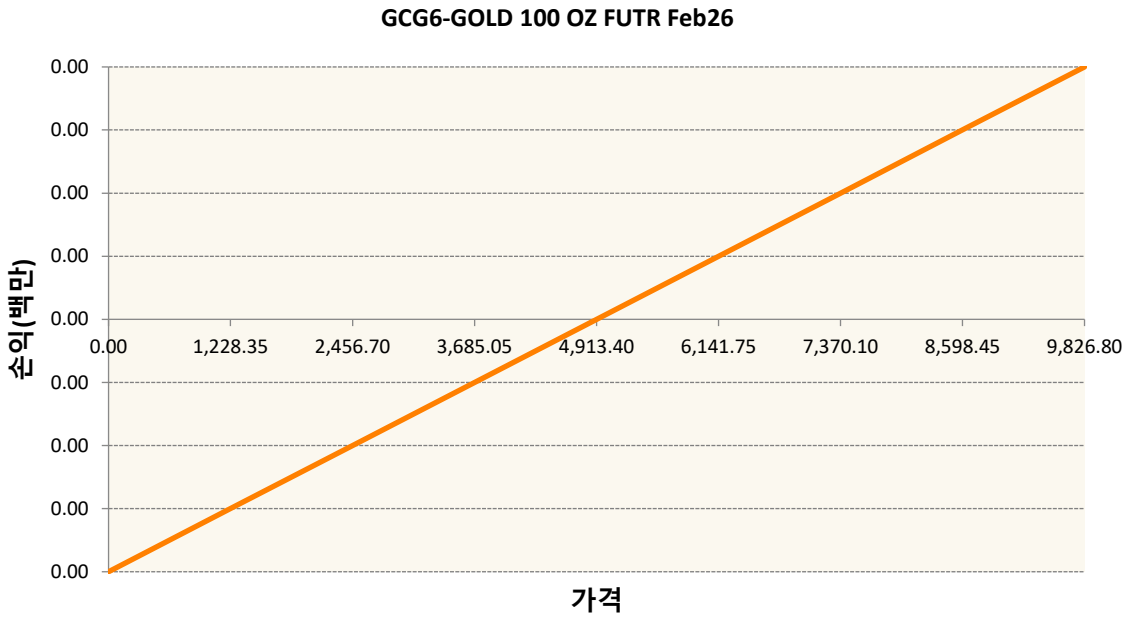
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,337	0	4,337	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 01/23/26 C428 EQUITY	22
GCG6 GOLD 100 OZ FUTR Feb26	347

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

(단위:백만원)

355

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

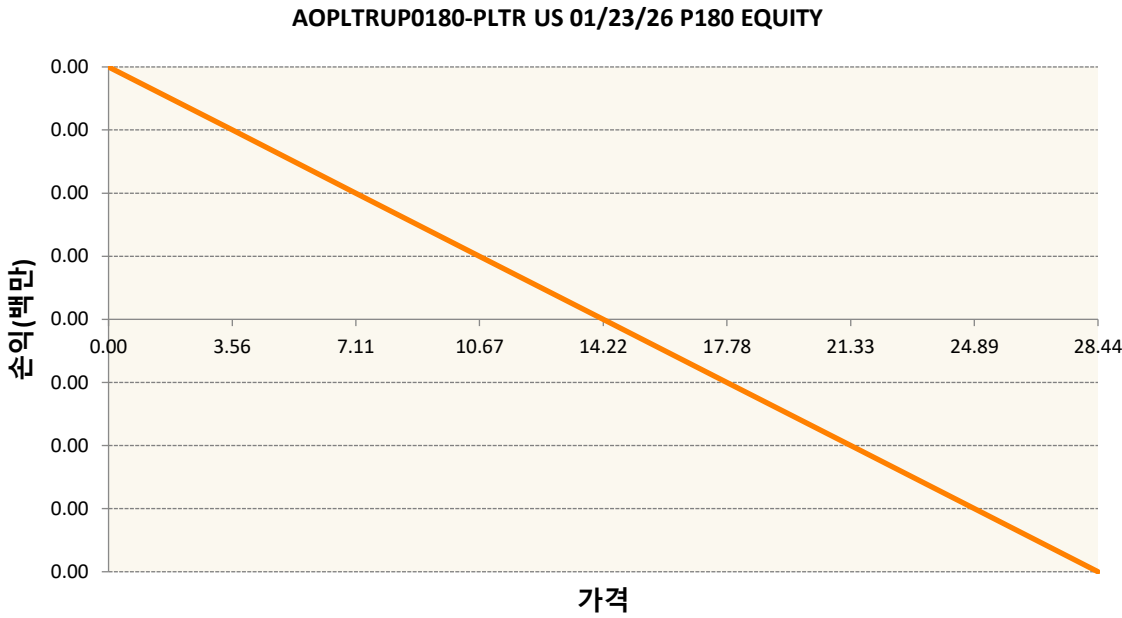
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	89	-89	
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUA1 PLTR US 01/23/26 C187.5 EQUITY	21
AOPLTRUC0 PLTR US 01/23/26 C180 EQUITY	1
AOPLTRUCS PLTR US 01/23/26 C175 EQUITY	0.1
AOPLTRUP0 PLTR US 01/23/26 P180 EQUITY	7
AOPLTRUPS1 PLTR US 01/23/26 P175 EQUITY	53

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

(단위:백만원)

292

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

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	2026-01-26
기준일	2026-01-23

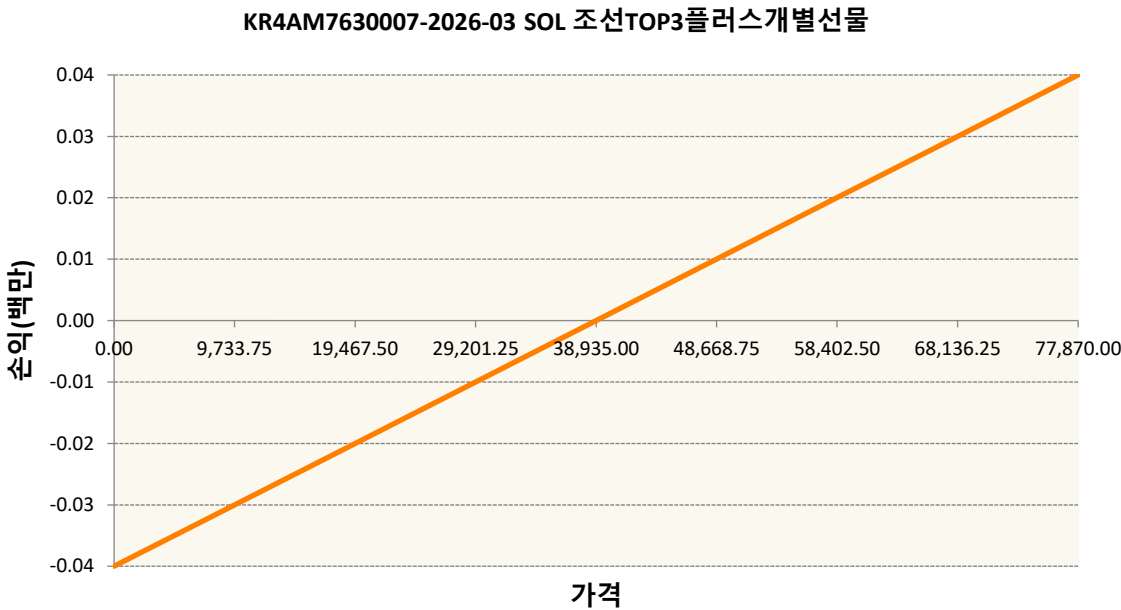
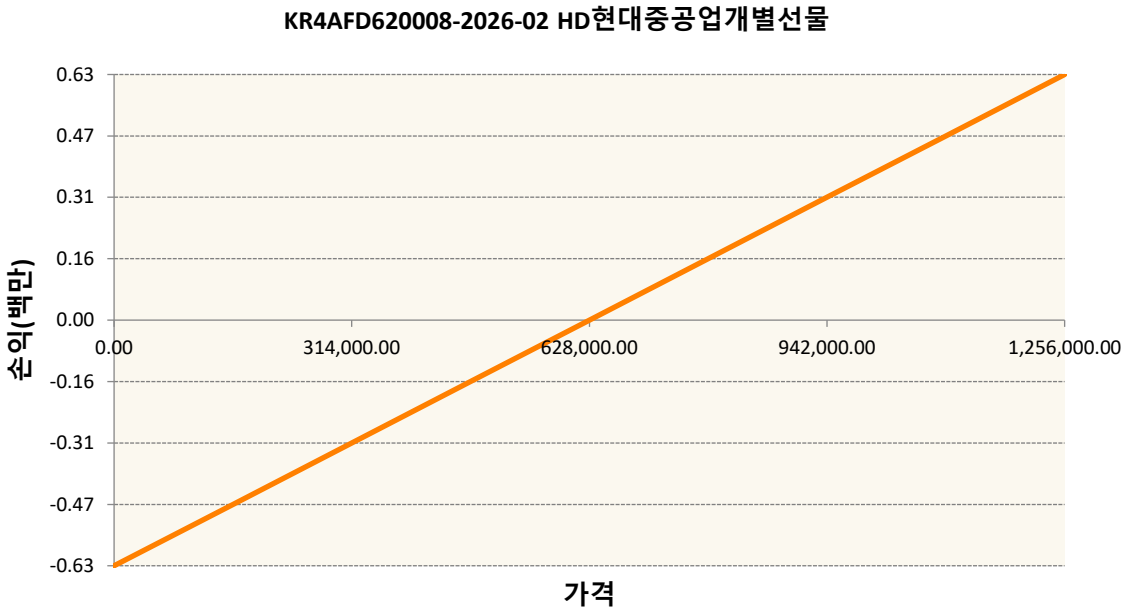
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	262	-262	장내
누계	유가증권	선물	25,440	0	25,440	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD620008		2026-02 HD현대중공업개별선물					1,005
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005	-1,005
-5.33%	-670	-670	-670	-670	-670	-670	-670
-2.67%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	335	335	335	335	335	335	335
5.33%	670	670	670	670	670	670	670
8.00%	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005	1,005
KR4AM7630007		2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물					1,023
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023
-5.33%	-682	-682	-682	-682	-682	-682	-682
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	341	341	341	341	341	341	341
5.33%	682	682	682	682	682	682	682
8.00%	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023

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

1,862

공시일 2026-01-26

기준일 2026-01-23

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	2026-01-26
기준일	2026-01-23

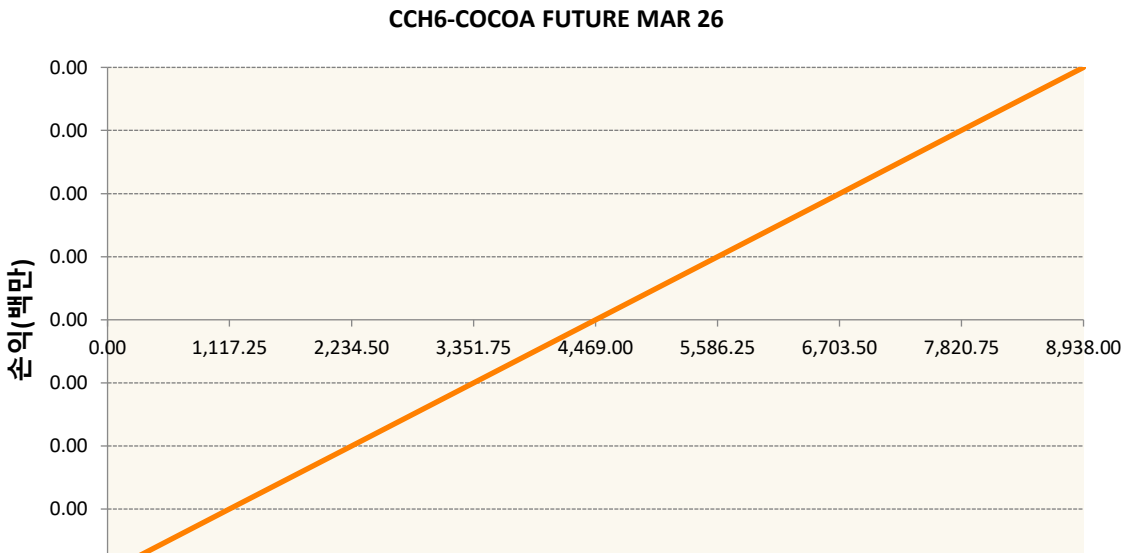
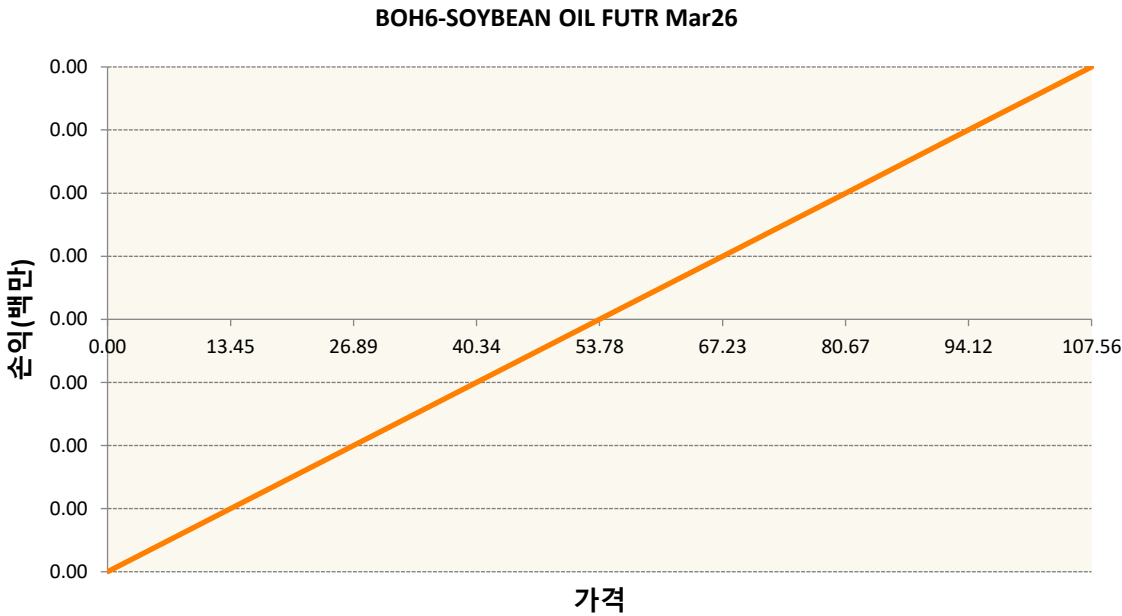
포커스농산물모(채권-파생형)

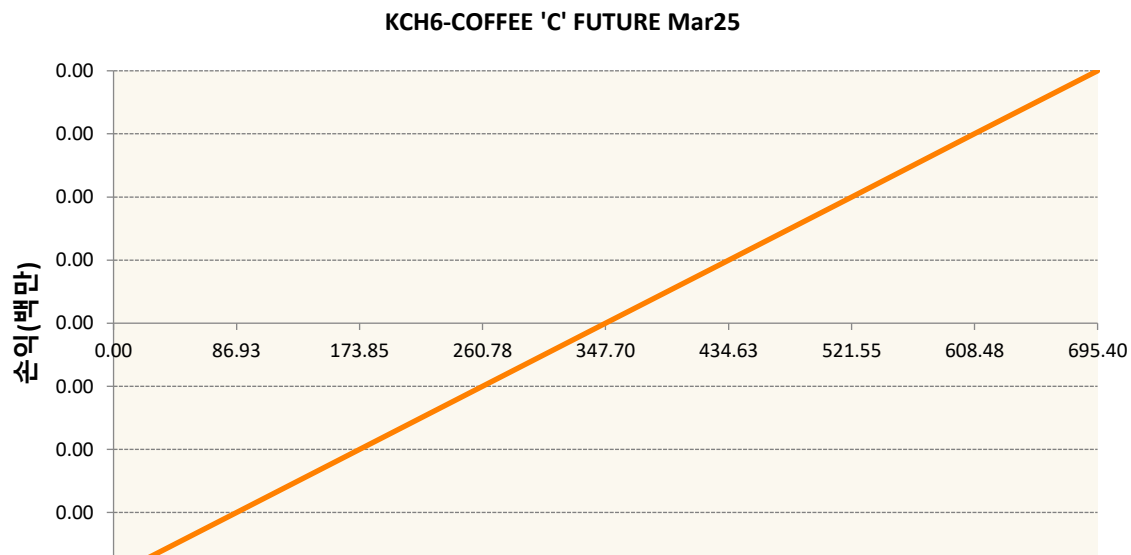
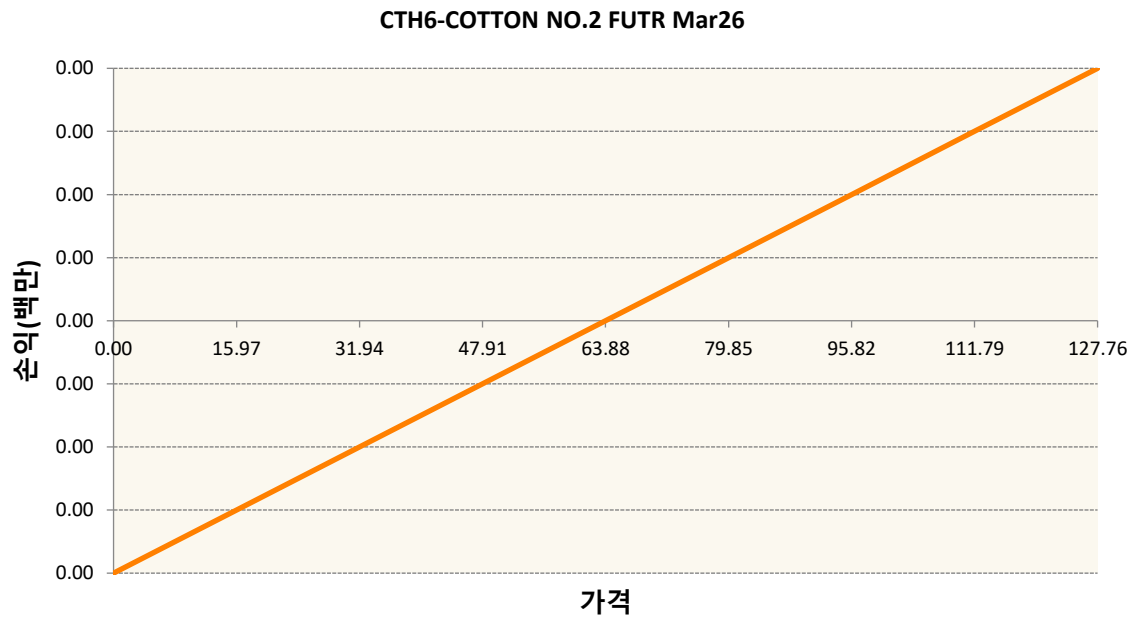
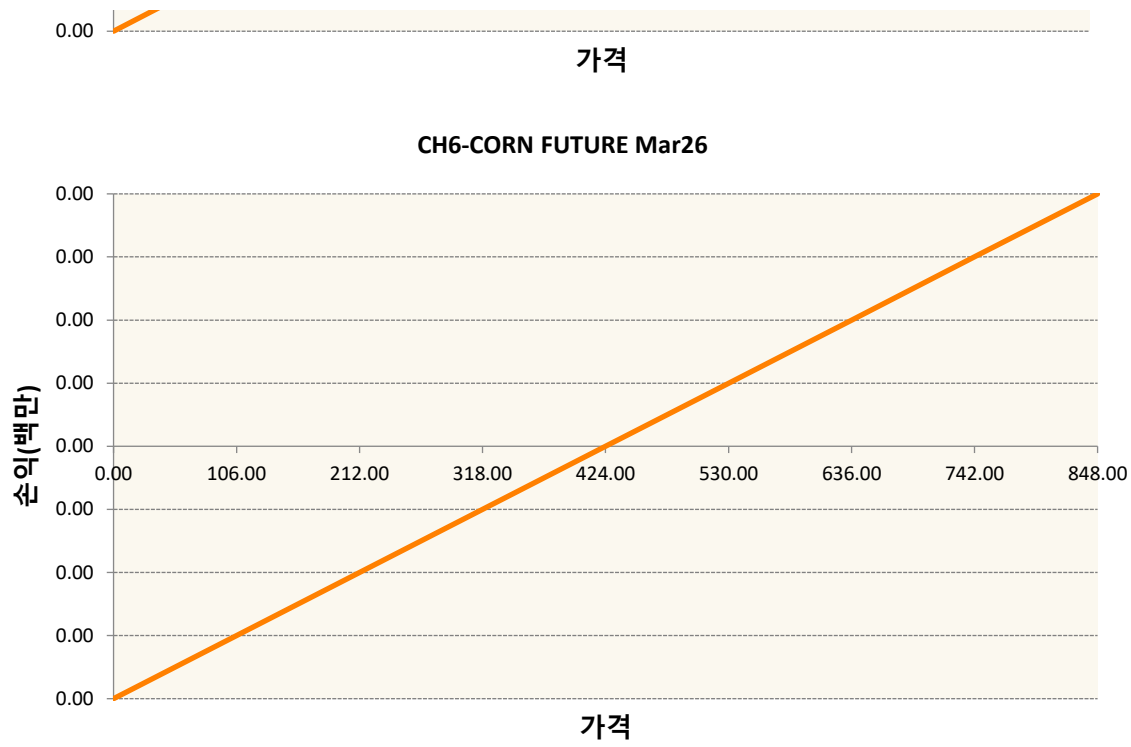
1. 계약금액

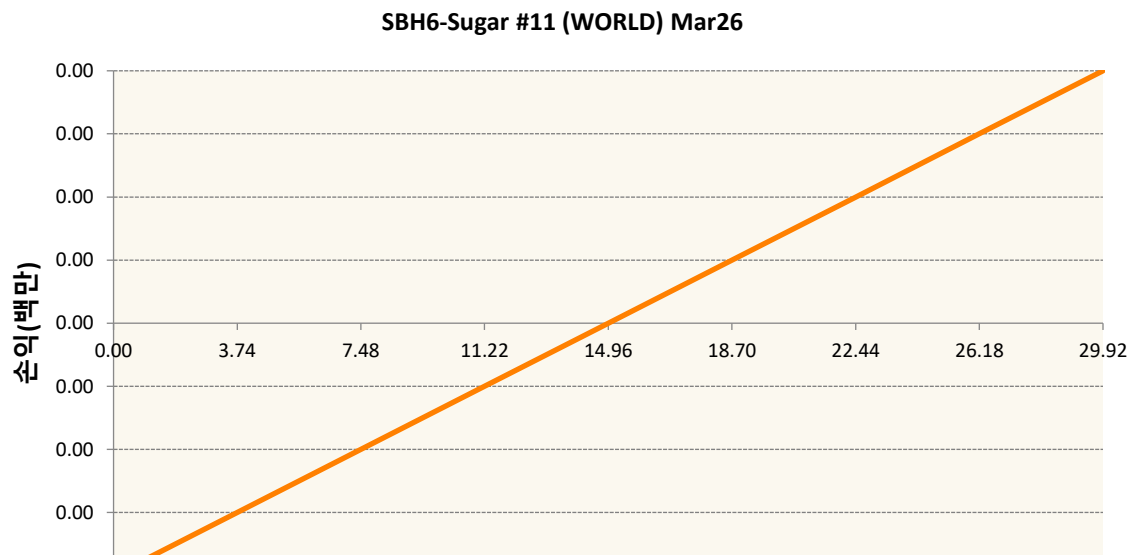
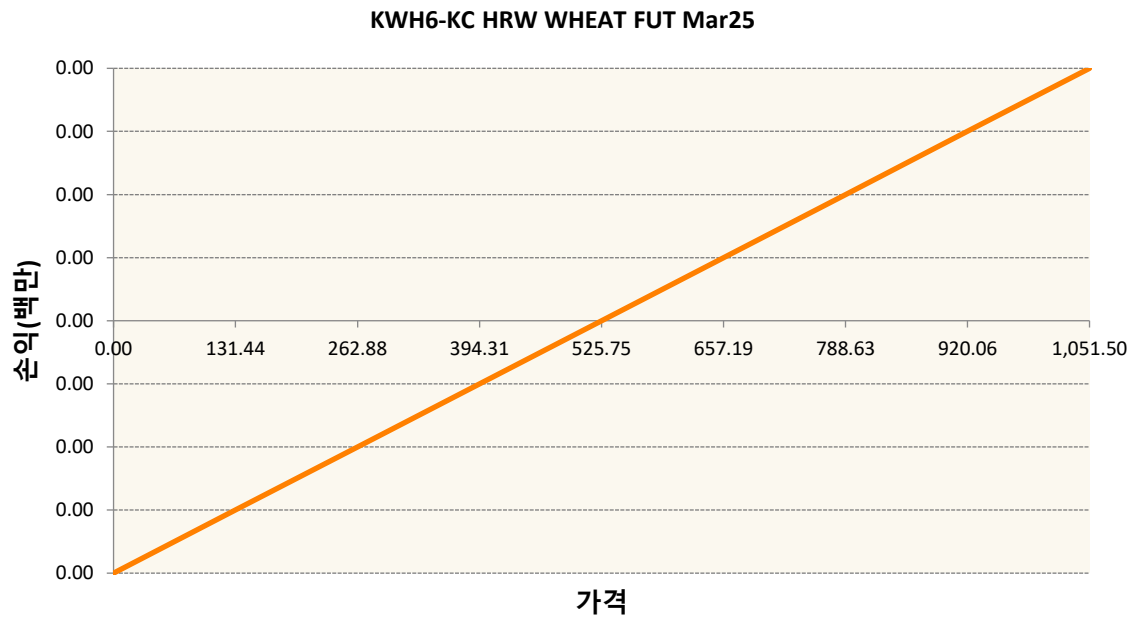
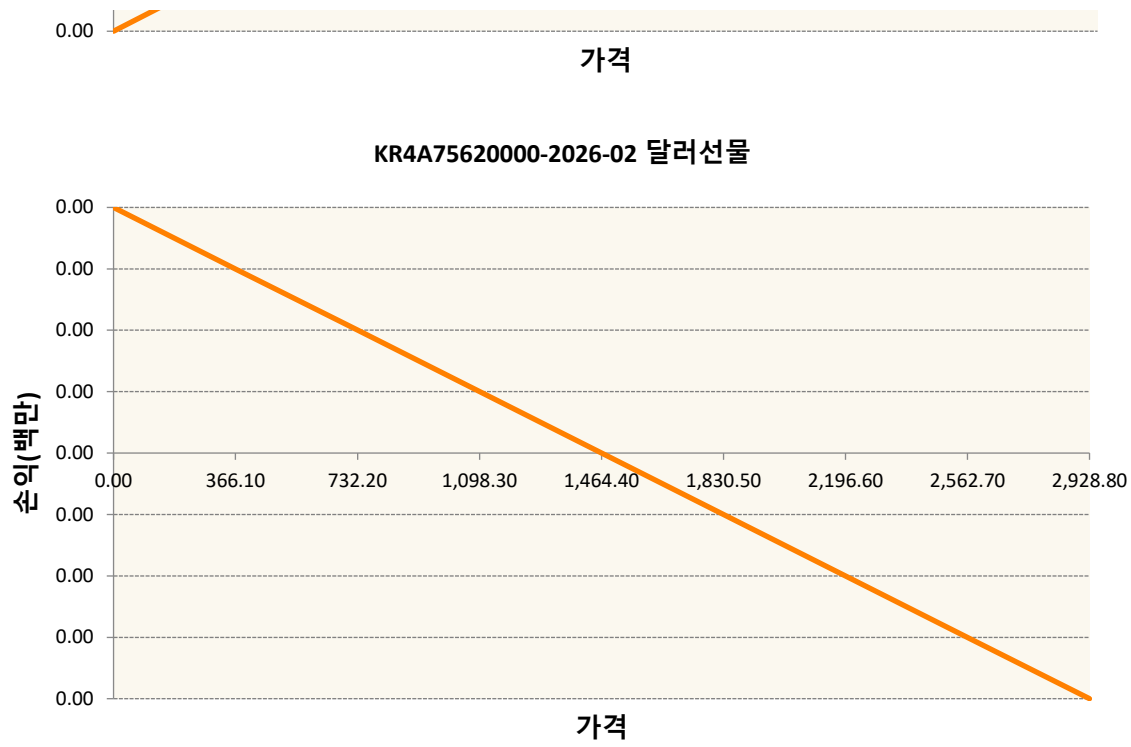
(단위:USD 백만)

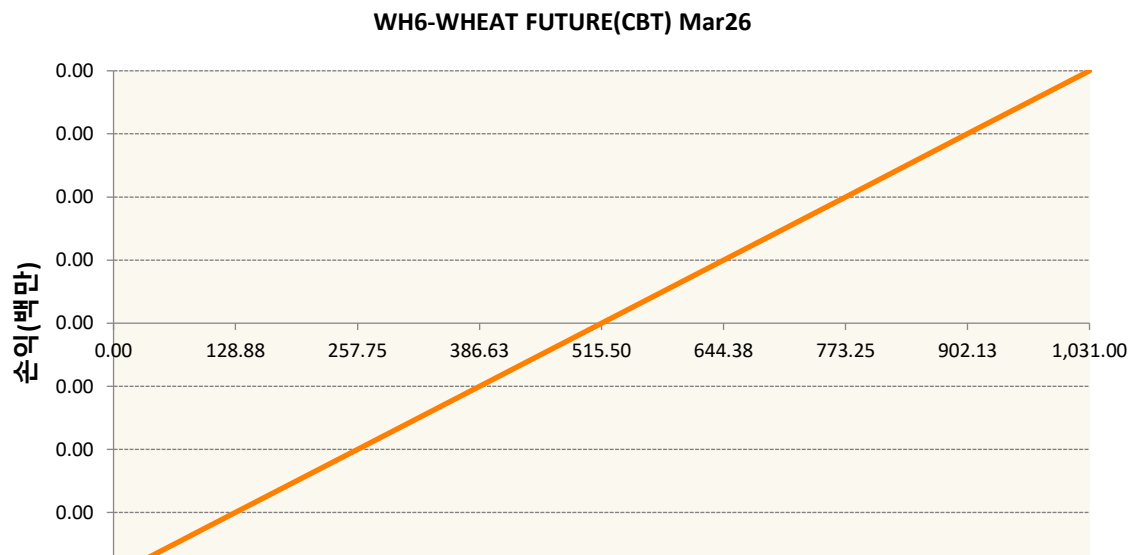
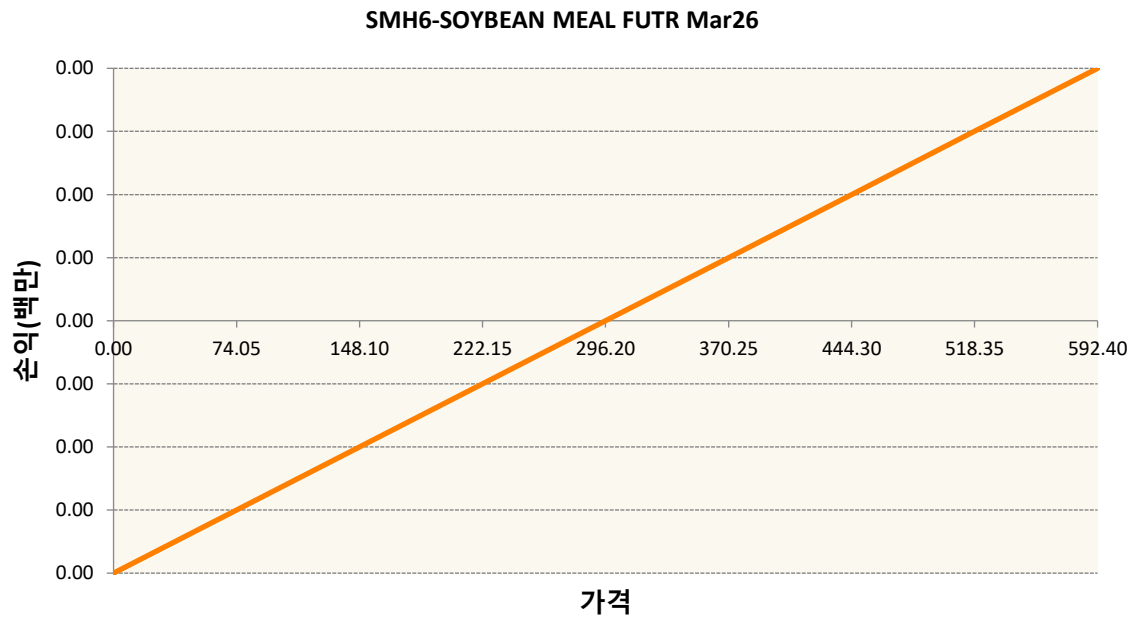
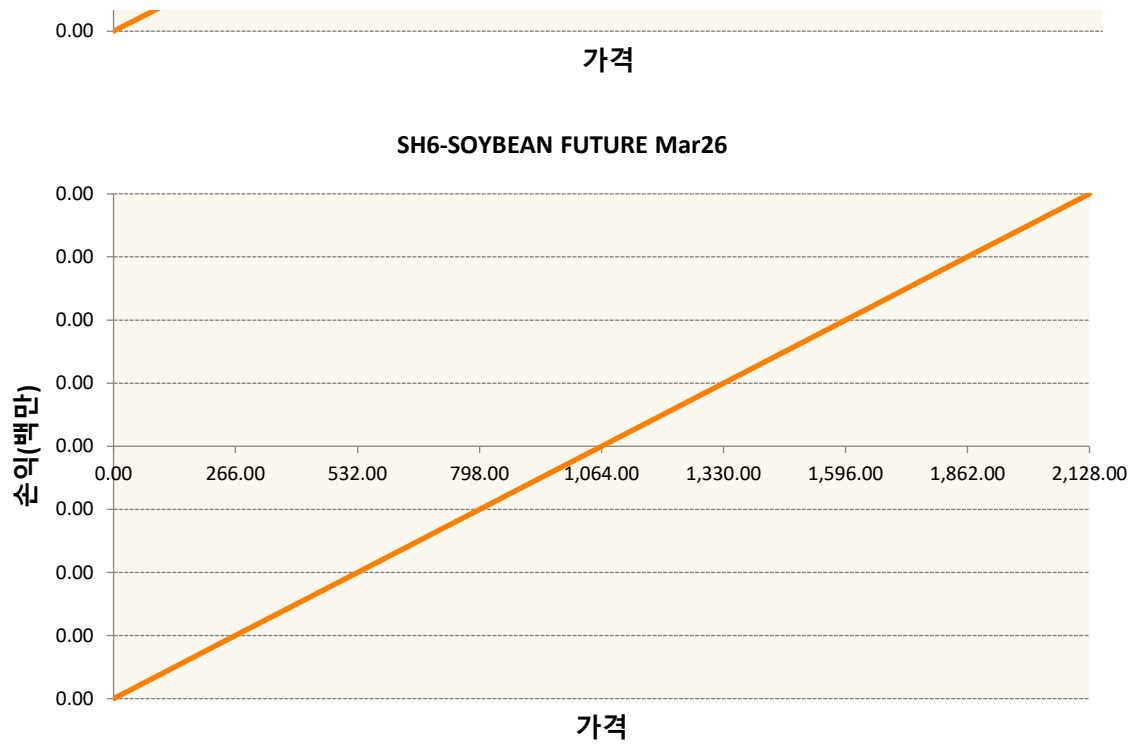
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	416	0	416	
누계	유가증권	선물	2,592	0	2,592	
누계	통화	선물	0	278	-278	장내

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	2026-01-26
기준일	2026-01-23

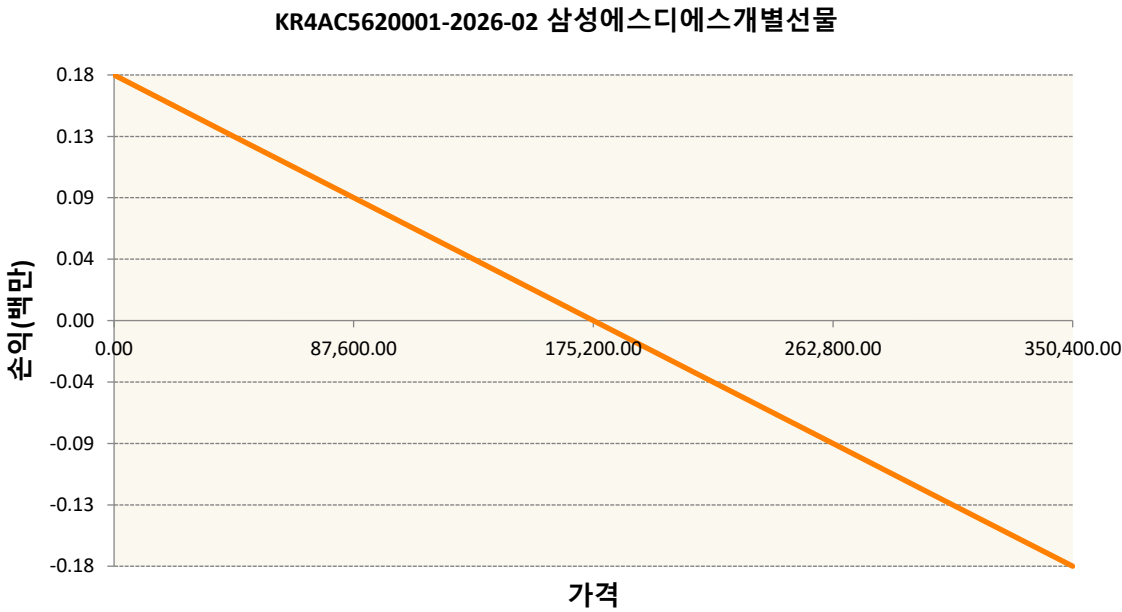
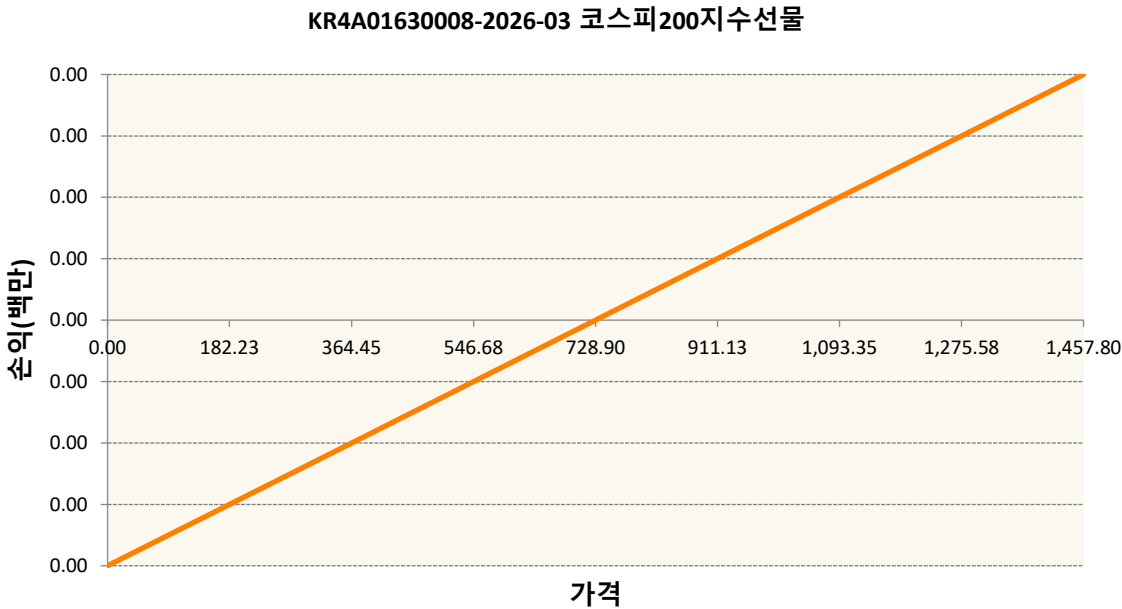
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	182	75	107	장내
누계	유가증권	선물	2,733	77	2,656	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		219
KR4AC56200 2026-02 삼성에스디에스개별선물		6

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

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

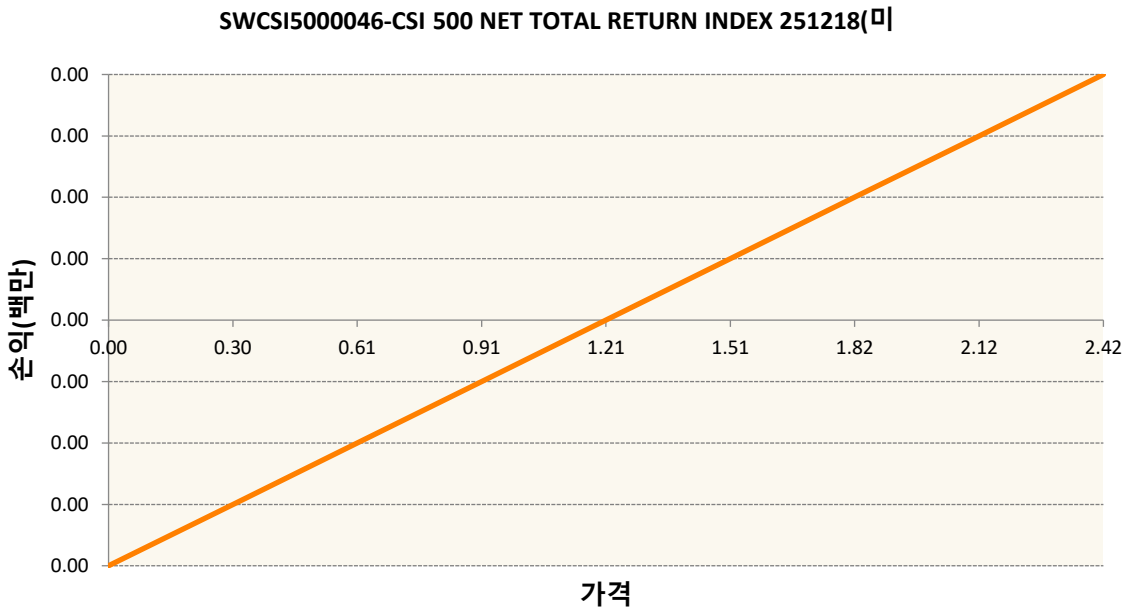
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,589	0	5,589	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

447

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

534

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

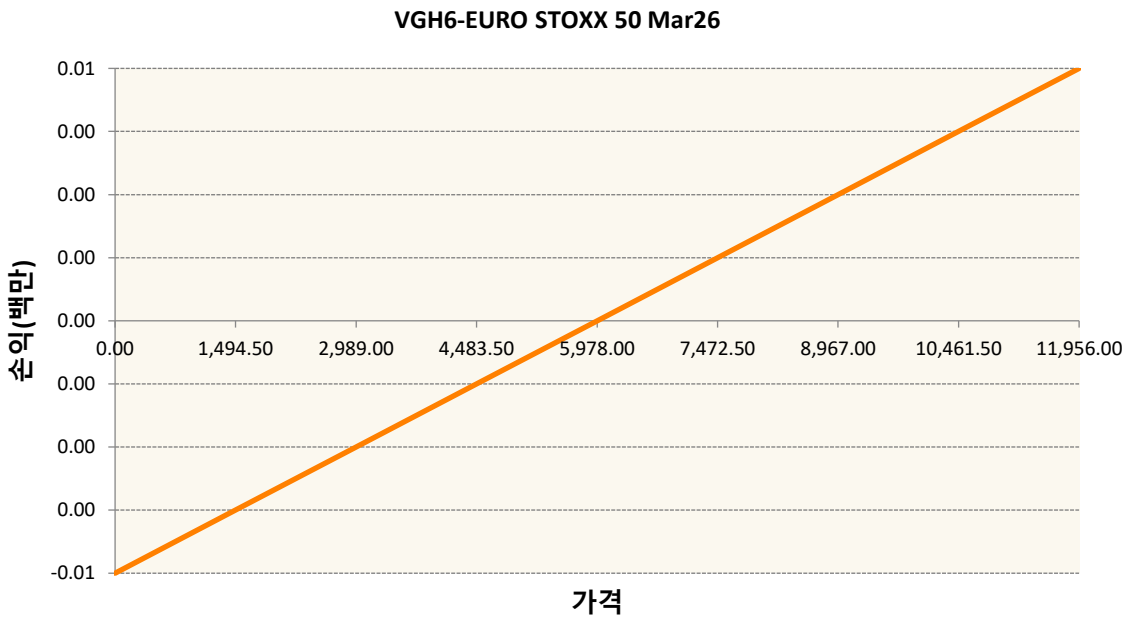
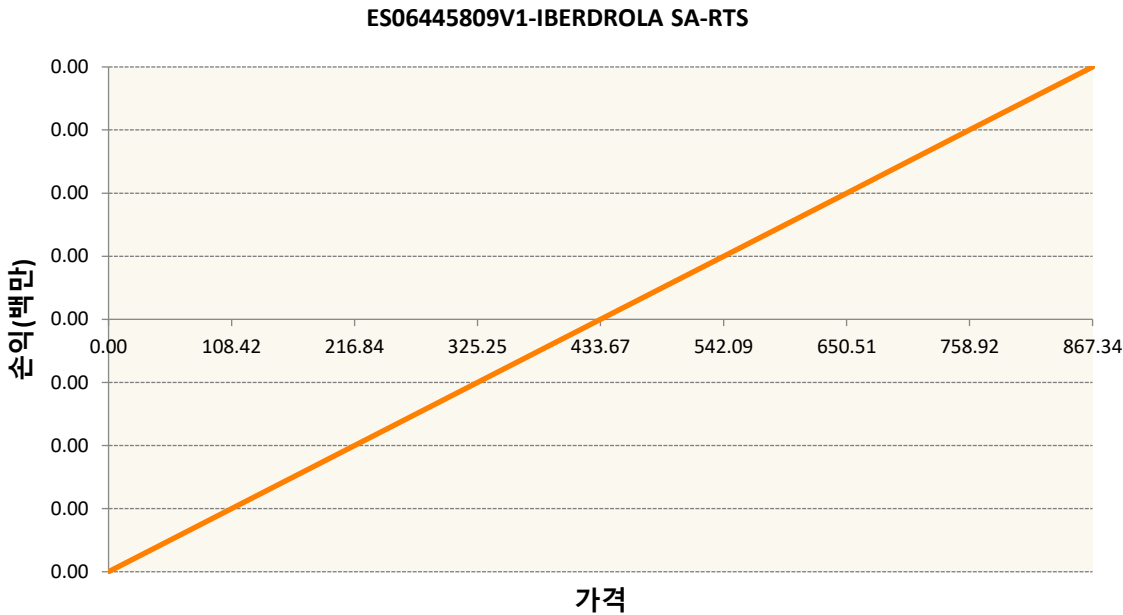
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	933	0	933	

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)
		60

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

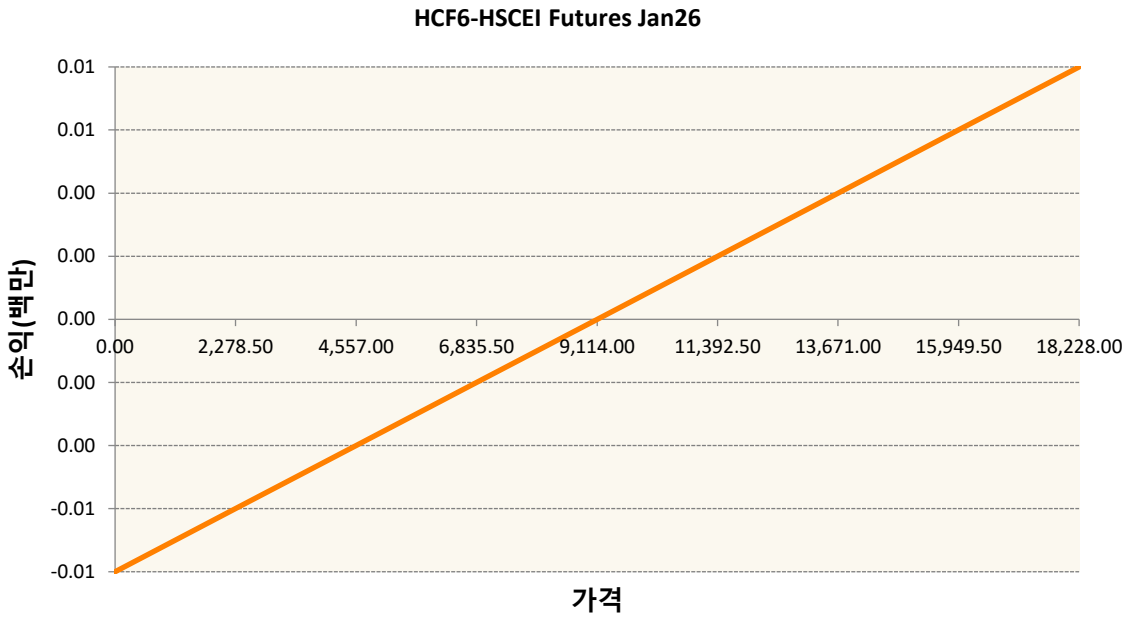
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,038	0	2,038	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

229

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

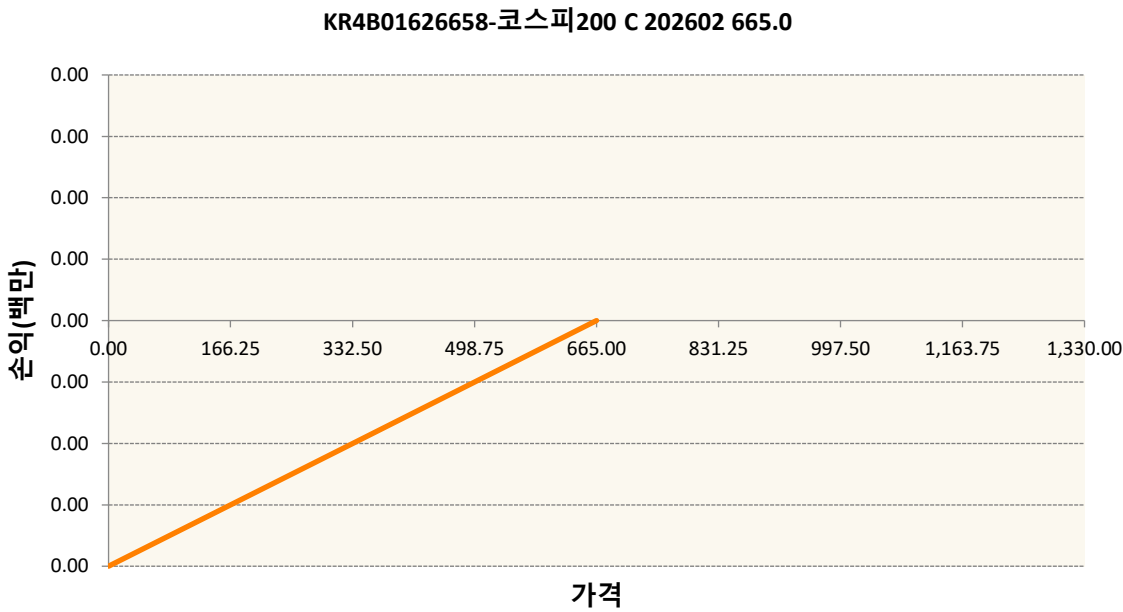
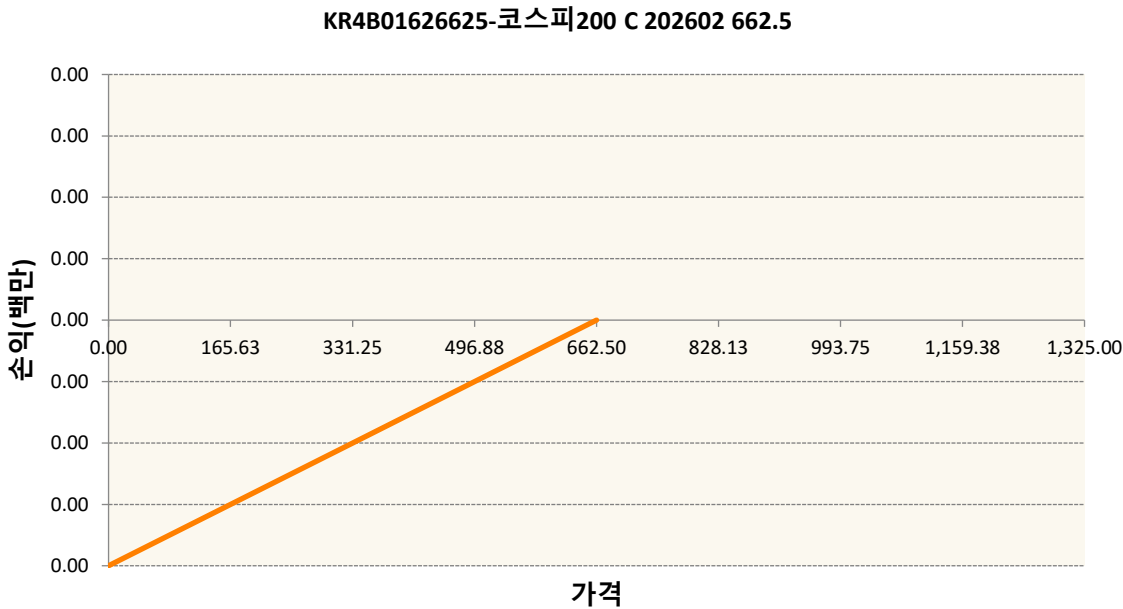
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

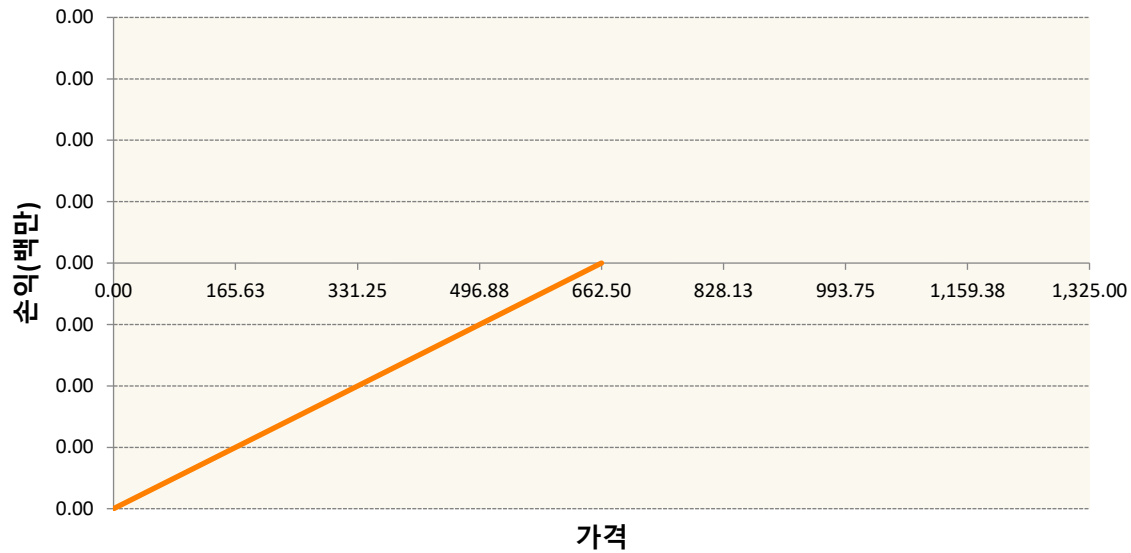
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	33,374	-33,374	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01626624-코스피200 P 202602 662.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016266 코스피200 C 202602 662.5

371

KR4B016266 코스피200 C 202602 665.0

1,769

KR4C016266 코스피200 P 202602 662.5

530

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-01-26

기준일 2026-01-23

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	2026-01-26
기준일	2026-01-23

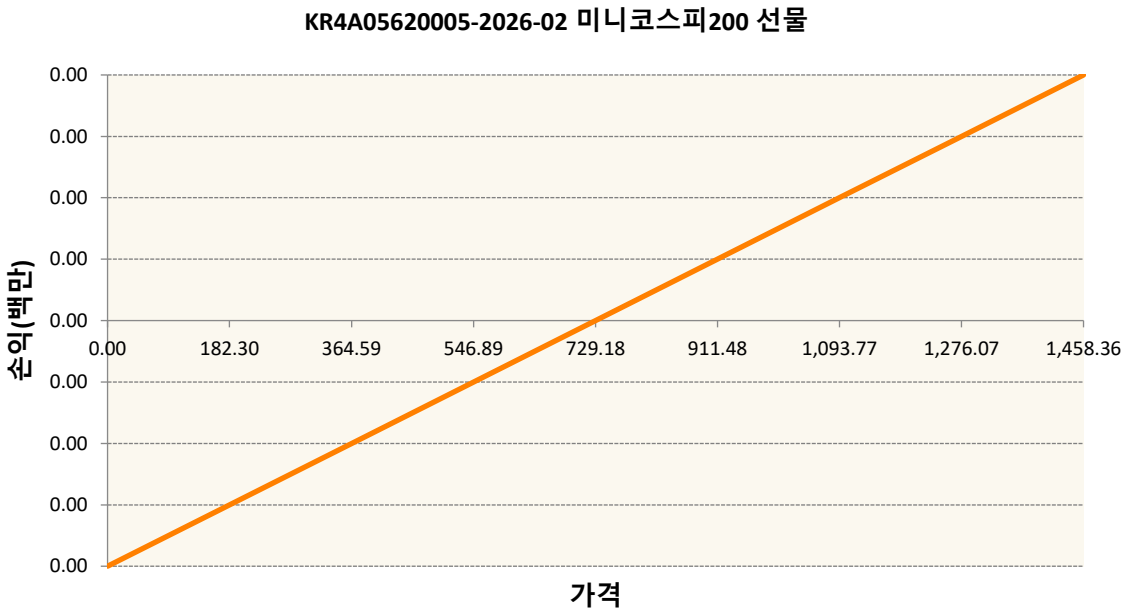
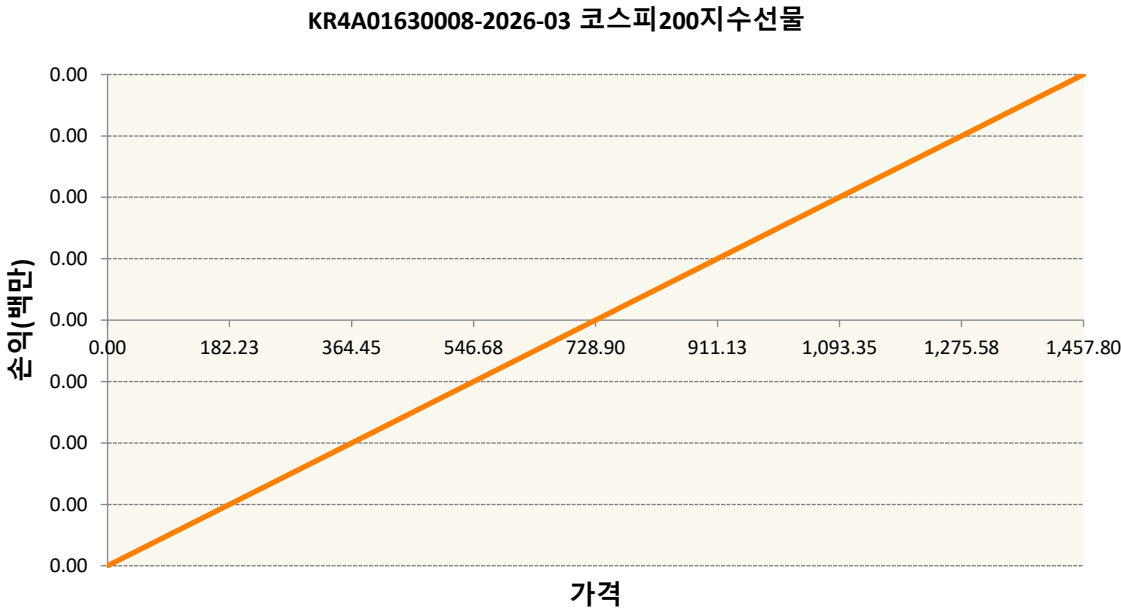
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	181	0	181	장내
누계	유가증권	선물	2,187	0	2,187	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		73
KR4A056200 2026-02 미니코스피200 선물		20

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

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

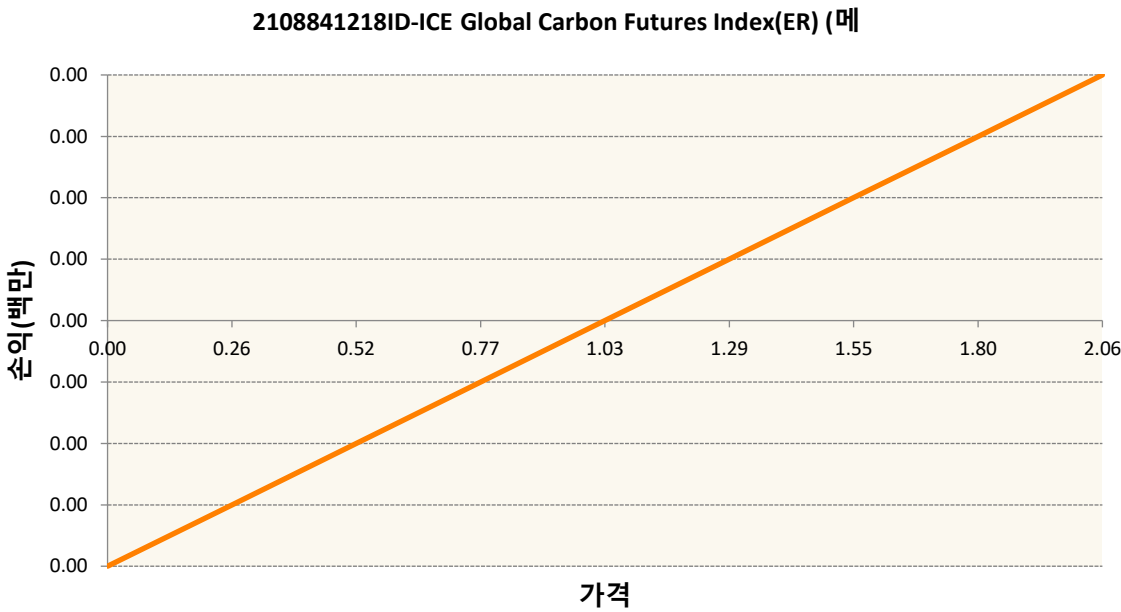
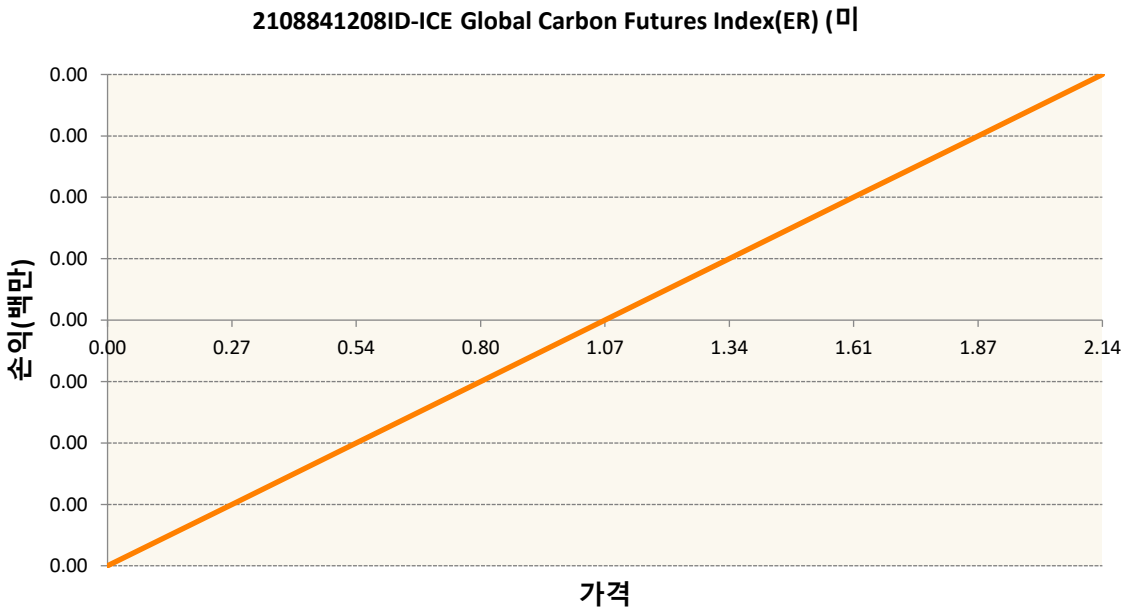
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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		499
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		125

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	607

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

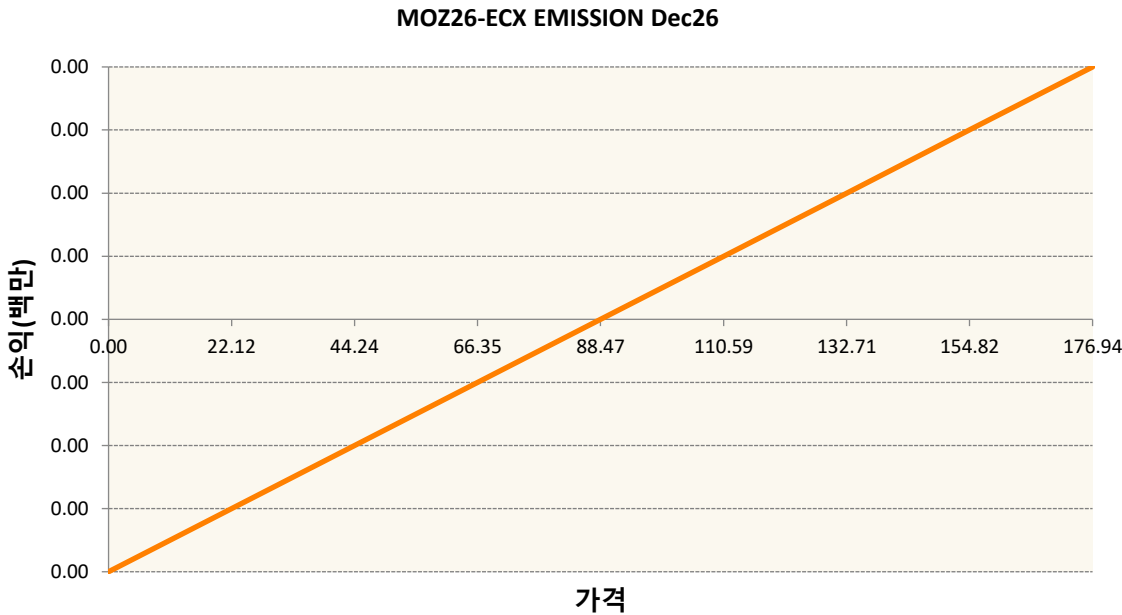
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,872	0	5,872	
누계	통화	선도	0	3,388	-3,388	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	470

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

(단위:백만원)

777

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

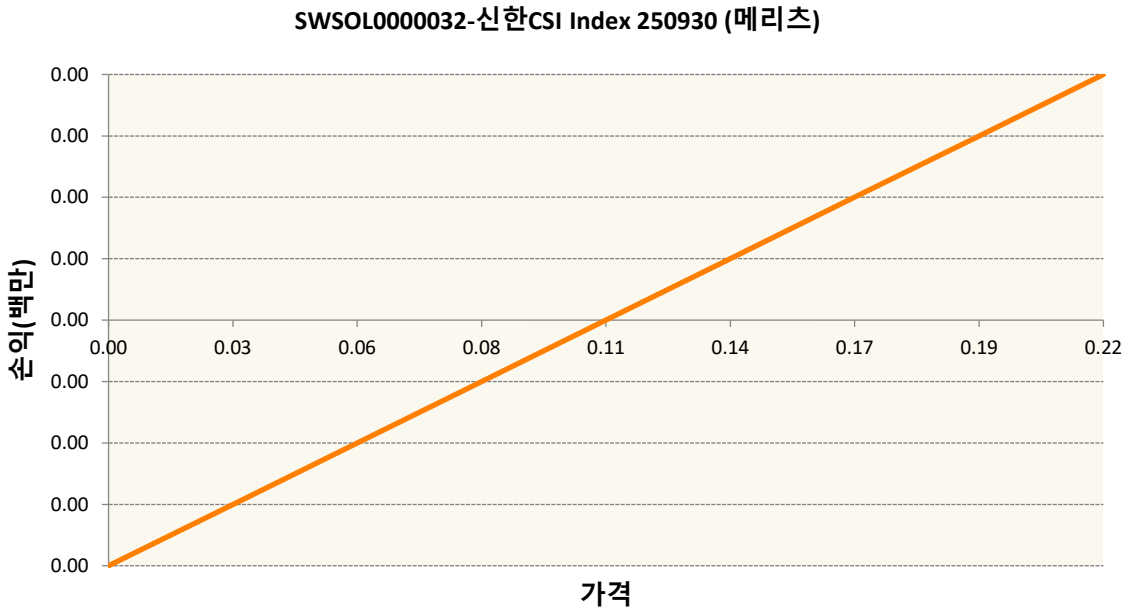
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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)	15
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	10
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	10
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	25

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

(단위:백만원)

105

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

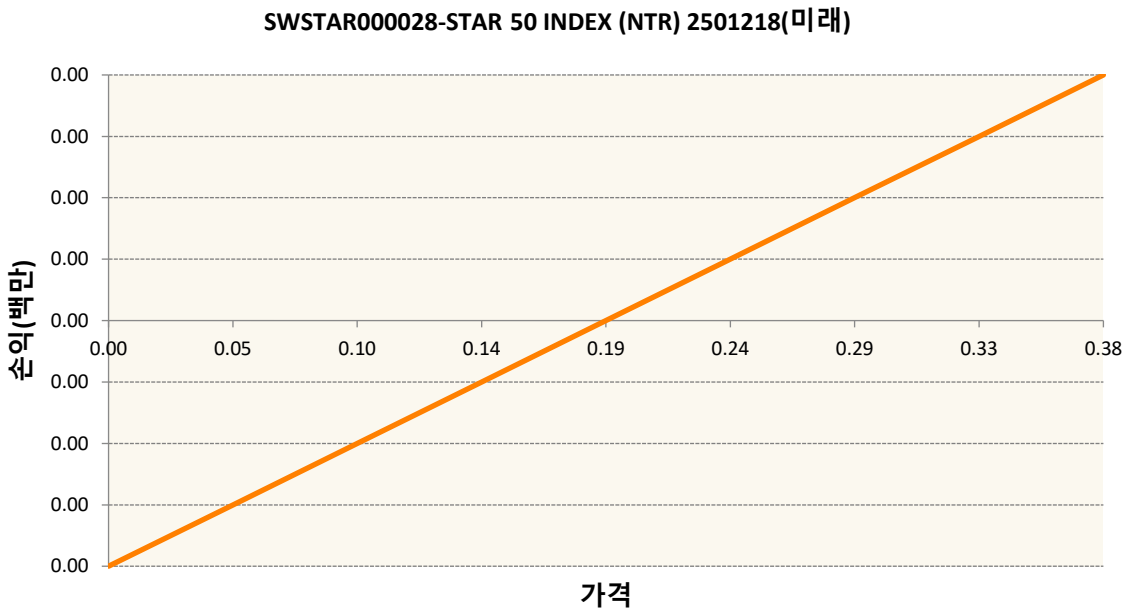
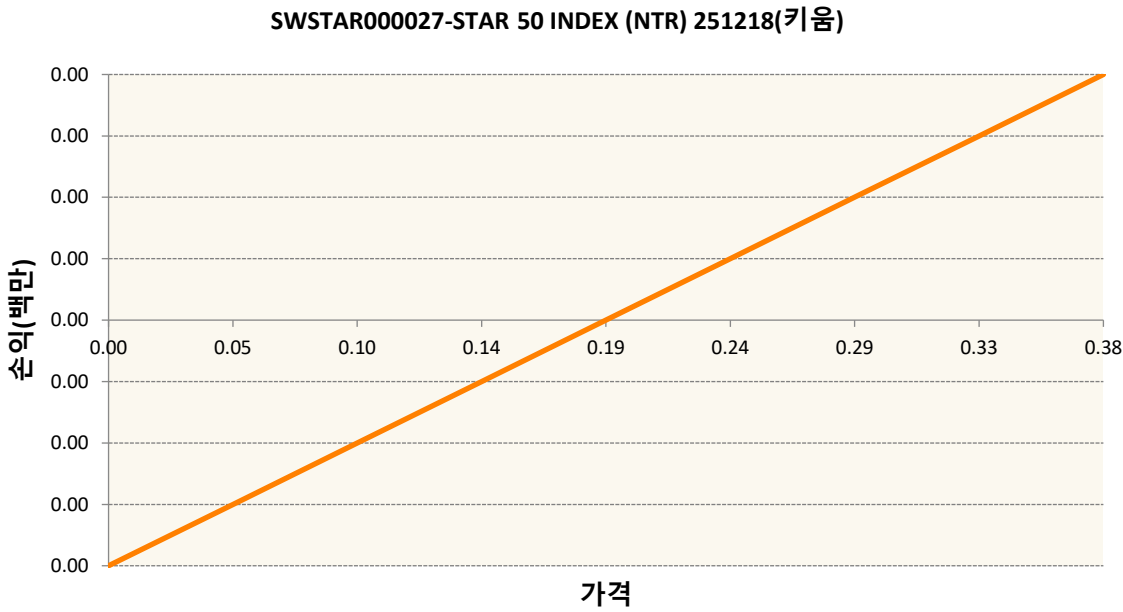
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

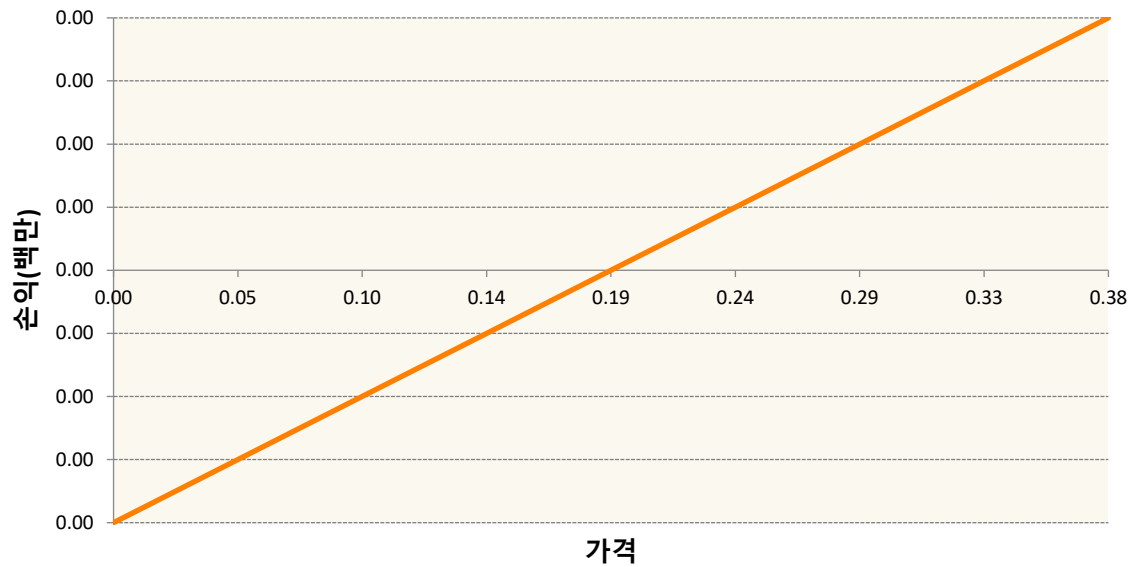
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,597	0	3,597	장외

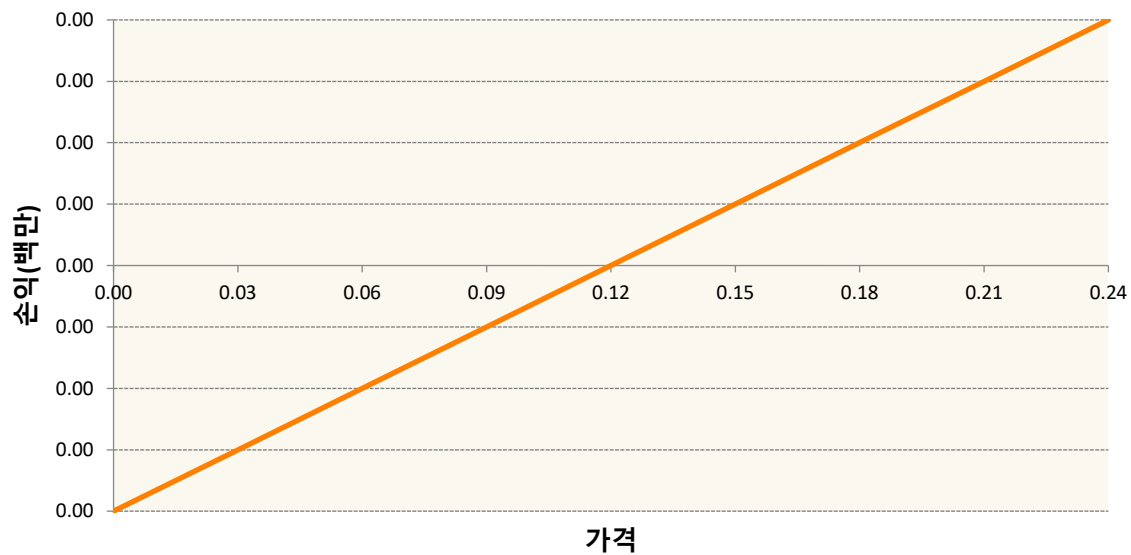
2. 만기시점의 손익구조



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))	13
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))	84
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))	43
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠))	143

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

(단위:백만원)

516

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

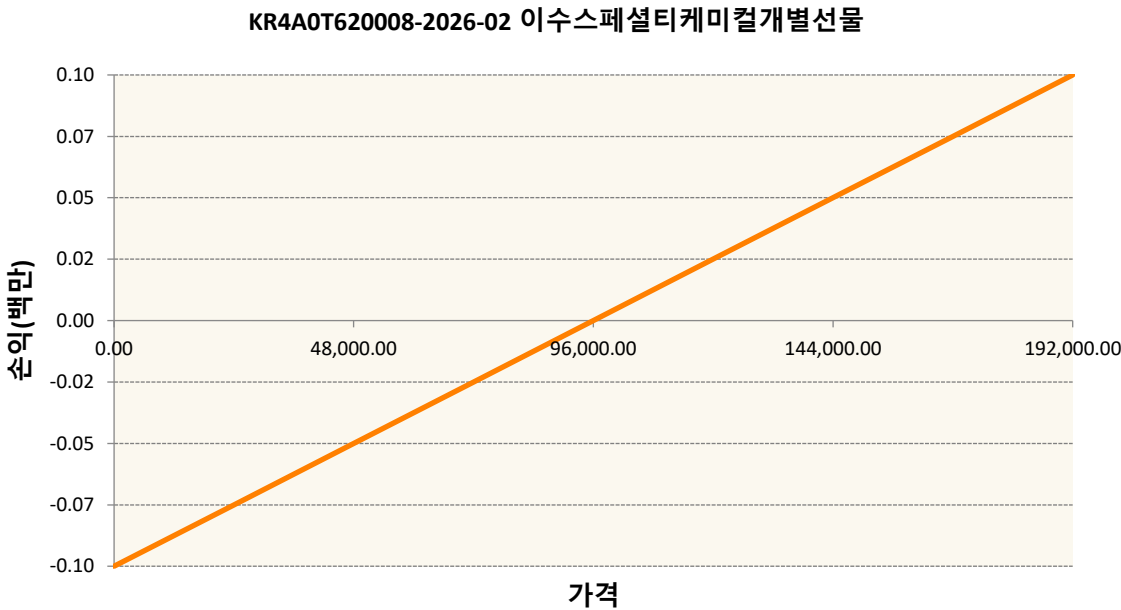
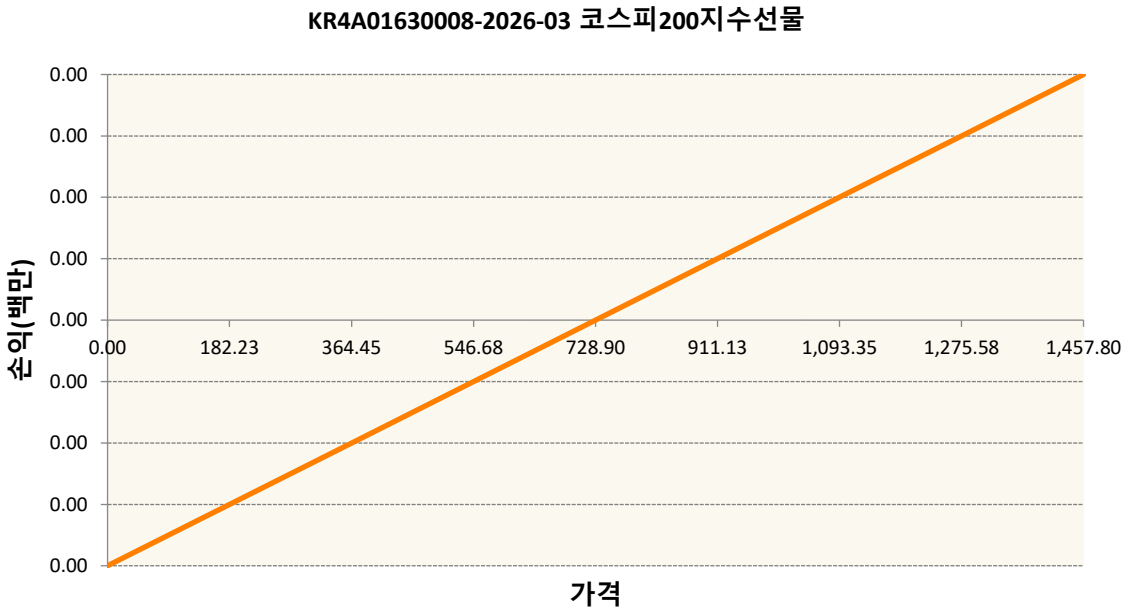
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

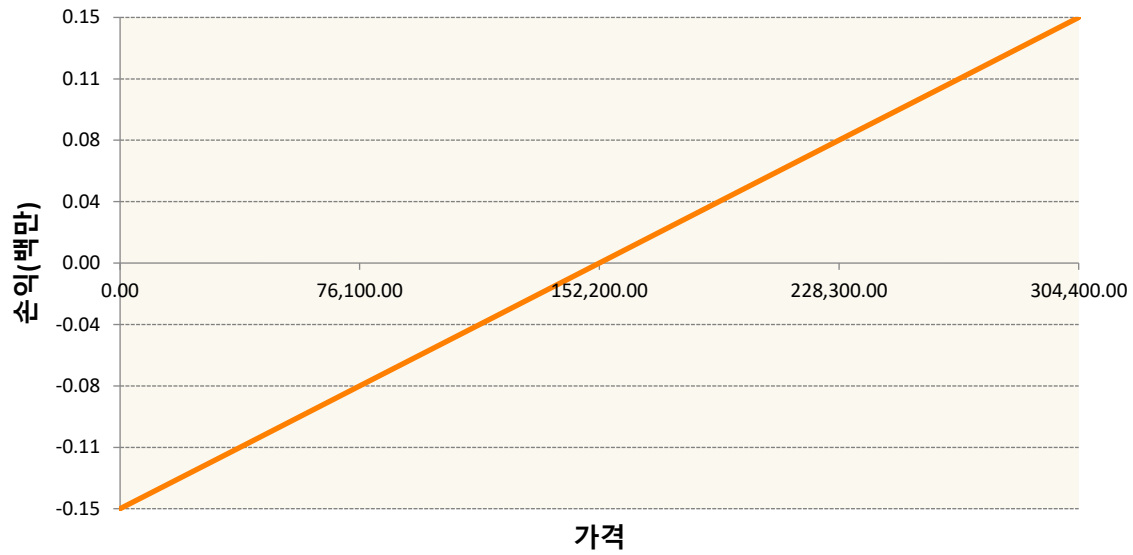
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	364	0	364	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	11,086	4,417	6,669	장내
누계	유가증권	스왑	5	0	5	장외

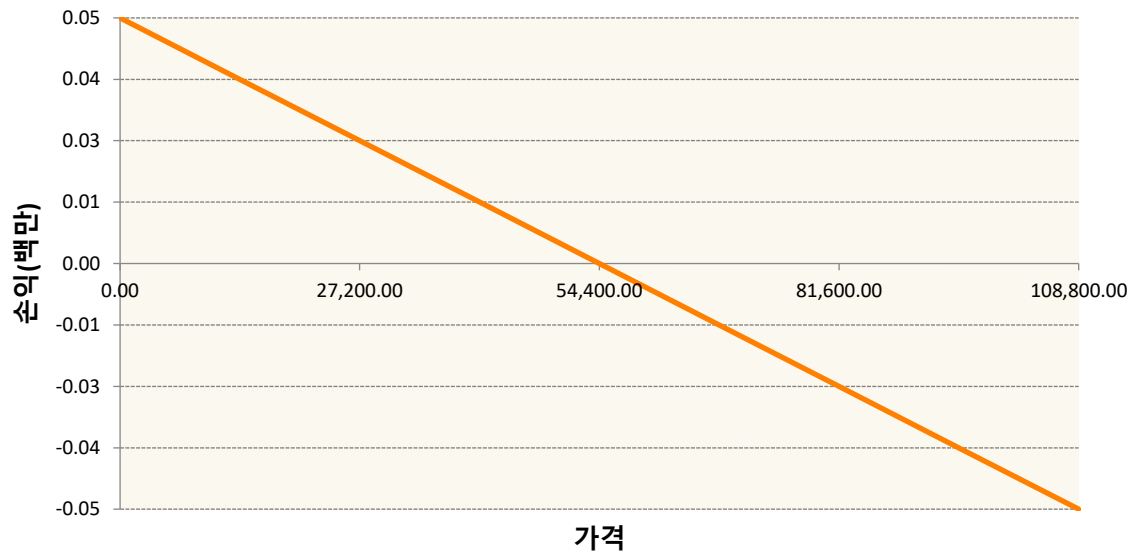
2. 만기시점의 손익구조



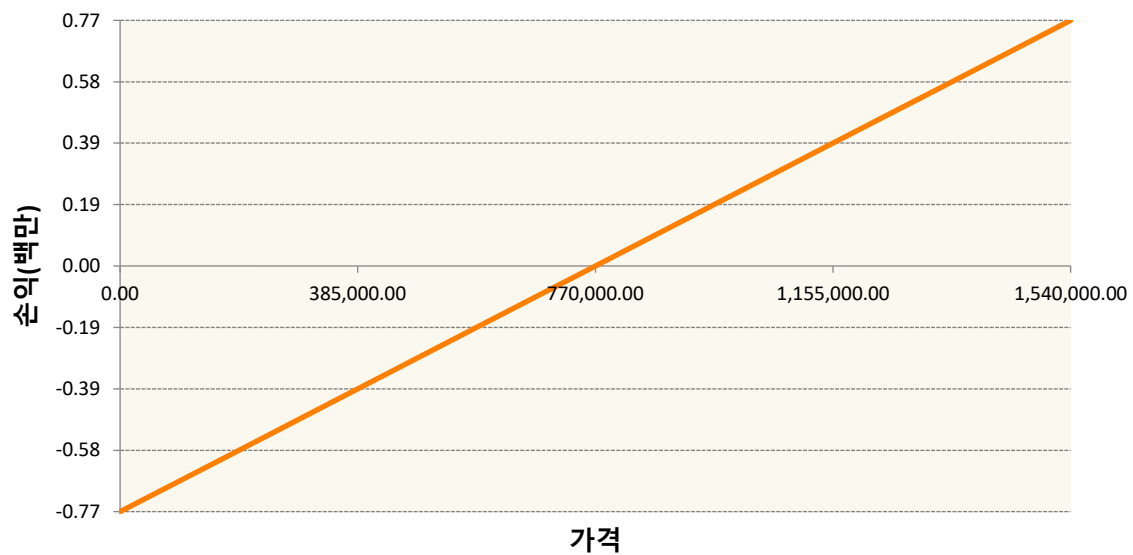
KR4A11620007-2026-02 삼성전자개별선물



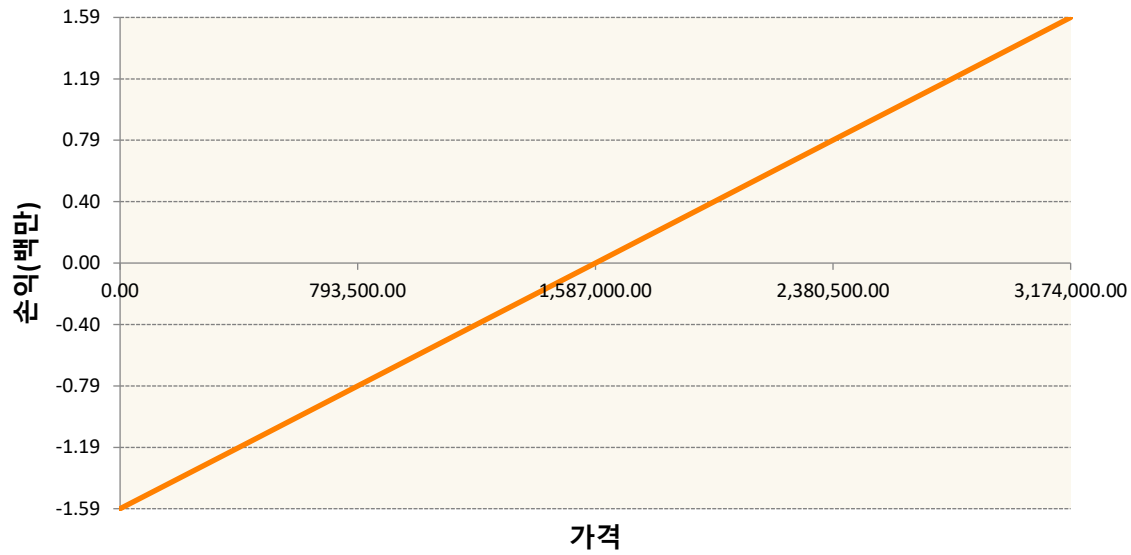
KR4A14620004-2026-02 KT개별선물



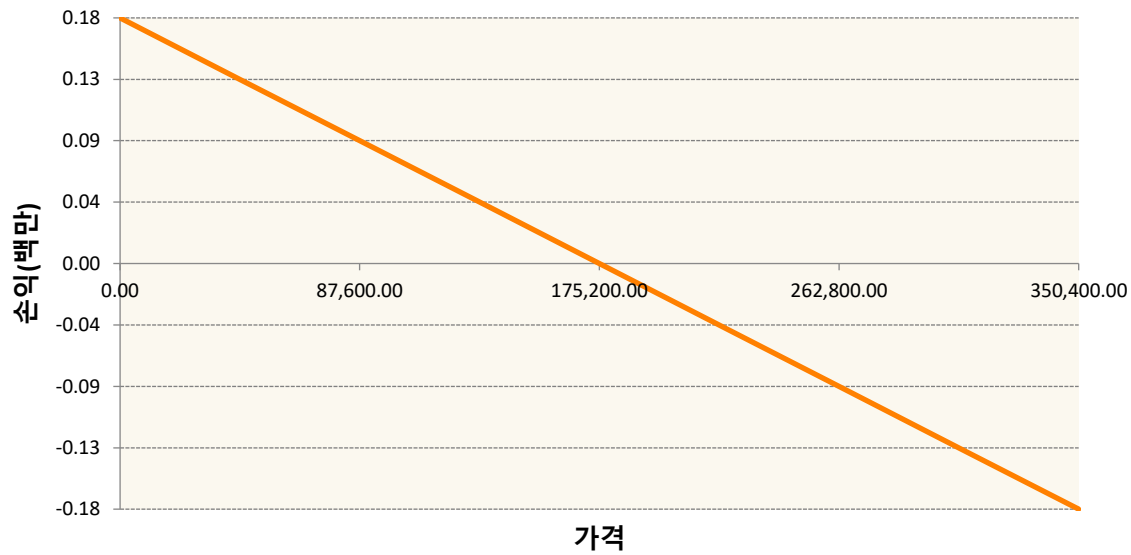
KR4A50620009-2026-02 SK하이닉스개별선물



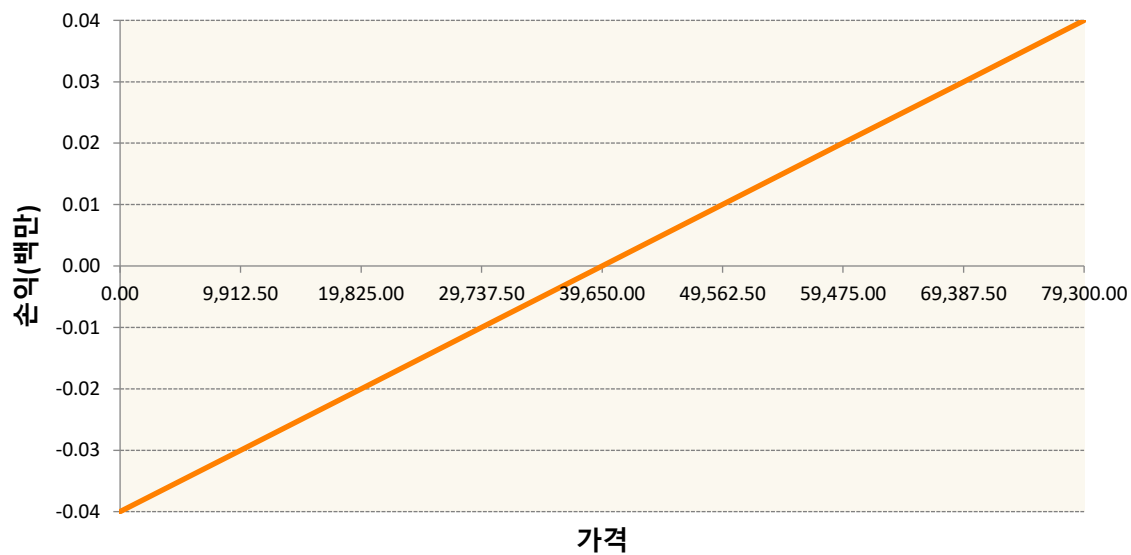
KR4AB3620005-2026-02 고려아연개별선물



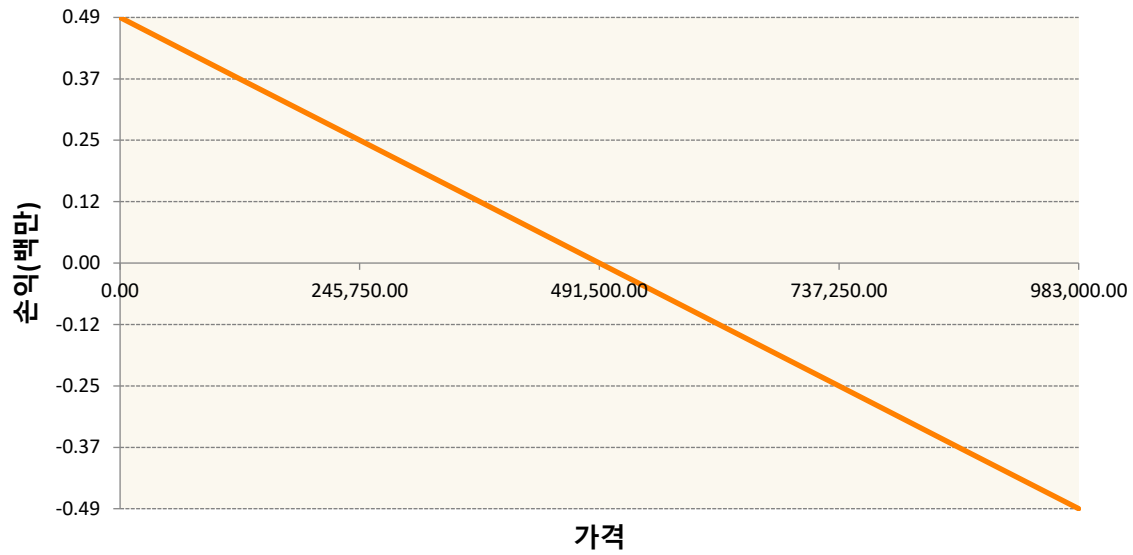
KR4AC5620001-2026-02 삼성에스디에스개별선물



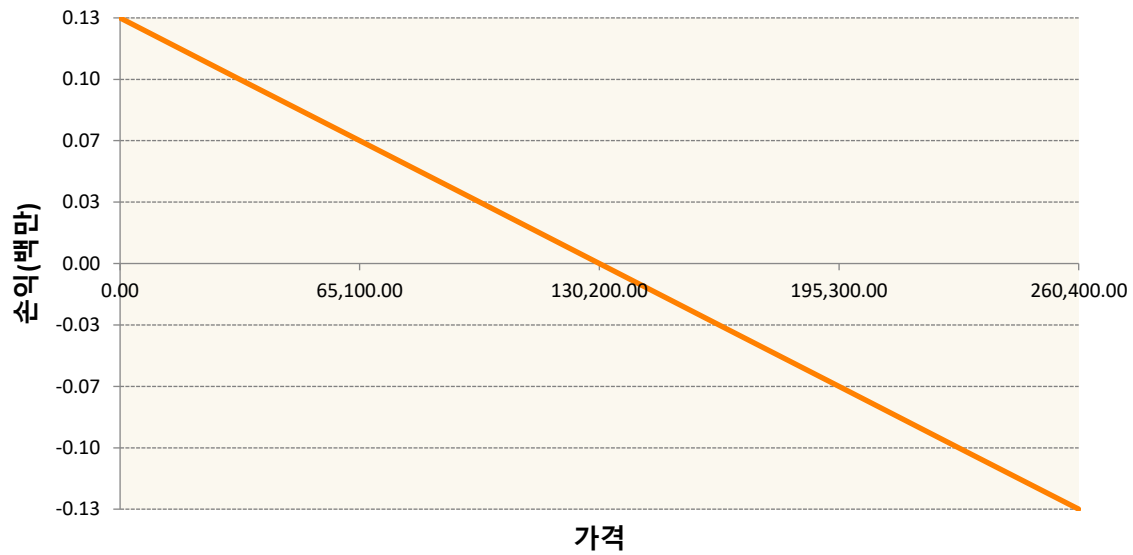
KR4ACN620009-2026-02 포스코DX개별선물



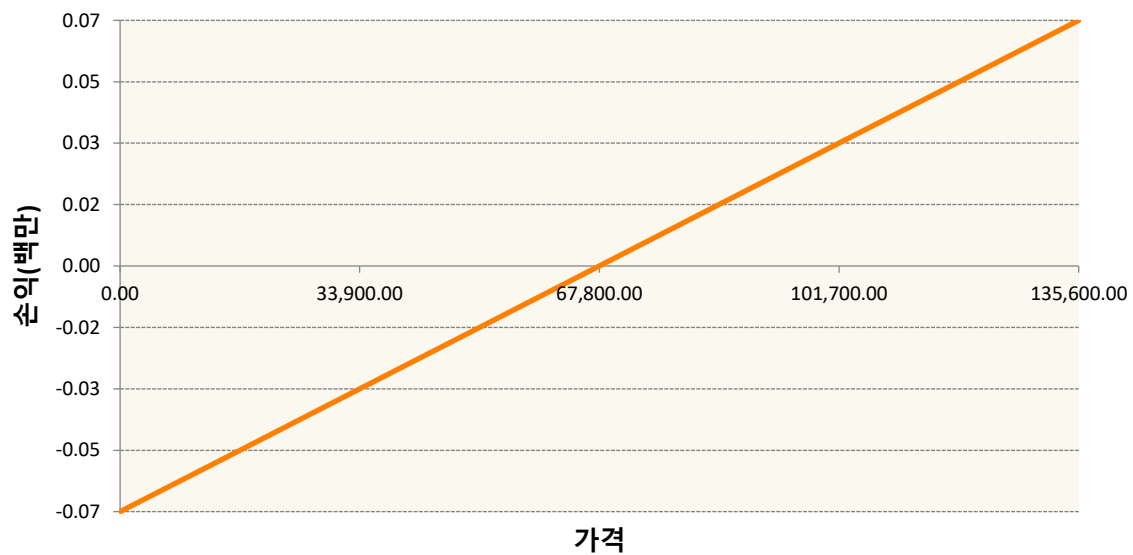
KR4ACT620003-2026-02 삼성화재개별선물



KR4AD0620004-2026-02 DB손해보험개별선물



KR4AF7620002-2026-02 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01630008							2026-03 코스피200지수선물		378	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378		
-5.33%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252		
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	126	126	126	126	126	126	126	126		
5.33%	252	252	252	252	252	252	252	252		
8.00%	378	378	378	378	378	378	378	378		
KR4A11620007								2026-02 삼성전자개별선물		189
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189		
-5.33%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126		
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	63	63	63	63	63	63	63	63		
5.33%	126	126	126	126	126	126	126	126		
8.00%	189	189	189	189	189	189	189	189		
KR4A14620004								2026-02 KT개별선물		131
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	131	131	131	131	131	131	131	131		
-5.33%	87	87	87	87	87	87	87	87		
-2.67%	44	44	44	44	44	44	44	44		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44		
5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87		
8.00%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131		
KR4A50620009								2026-02 SK하이닉스개별선물		185
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185		
-5.33%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123		
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	62	62	62	62	62	62	62	62		
5.33%	123	123	123	123	123	123	123	123		
8.00%	185	185	185	185	185	185	185	185		
KR4AB3620005								2026-02 고려아연개별선물		110

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-5.33%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	73	73	73	73	73	73	73
8.00%	110	110	110	110	110	110	110

KR4AC5620001 2026-02 삼성에스디에스개별선물 70

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	70	70	70	70	70	70	70
-5.33%	46	46	46	46	46	46	46
-2.67%	23	23	23	23	23	23	23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70

KR4ACN620009 2026-02 포스코DX개별선물 21

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	21	21	21	21	21	21	21

KR4ACT620003 2026-02 삼성화재개별선물 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

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)

1,457

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

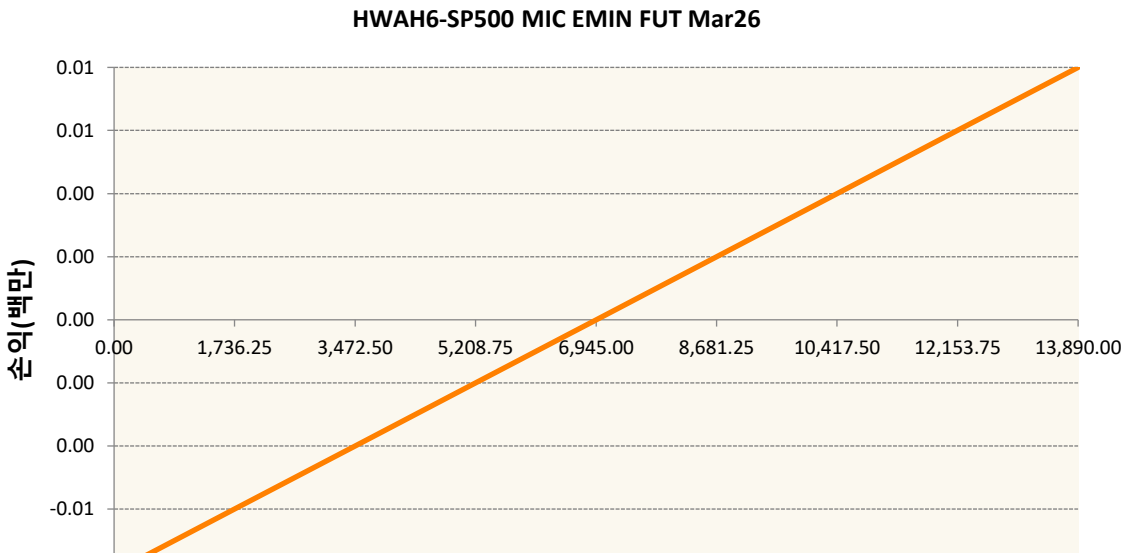
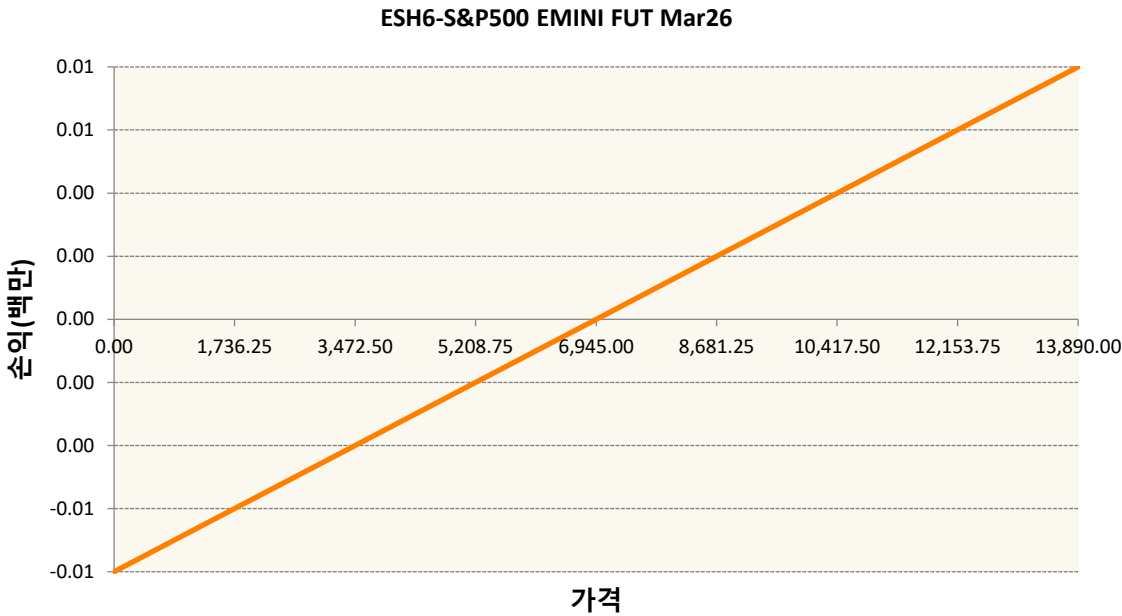
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

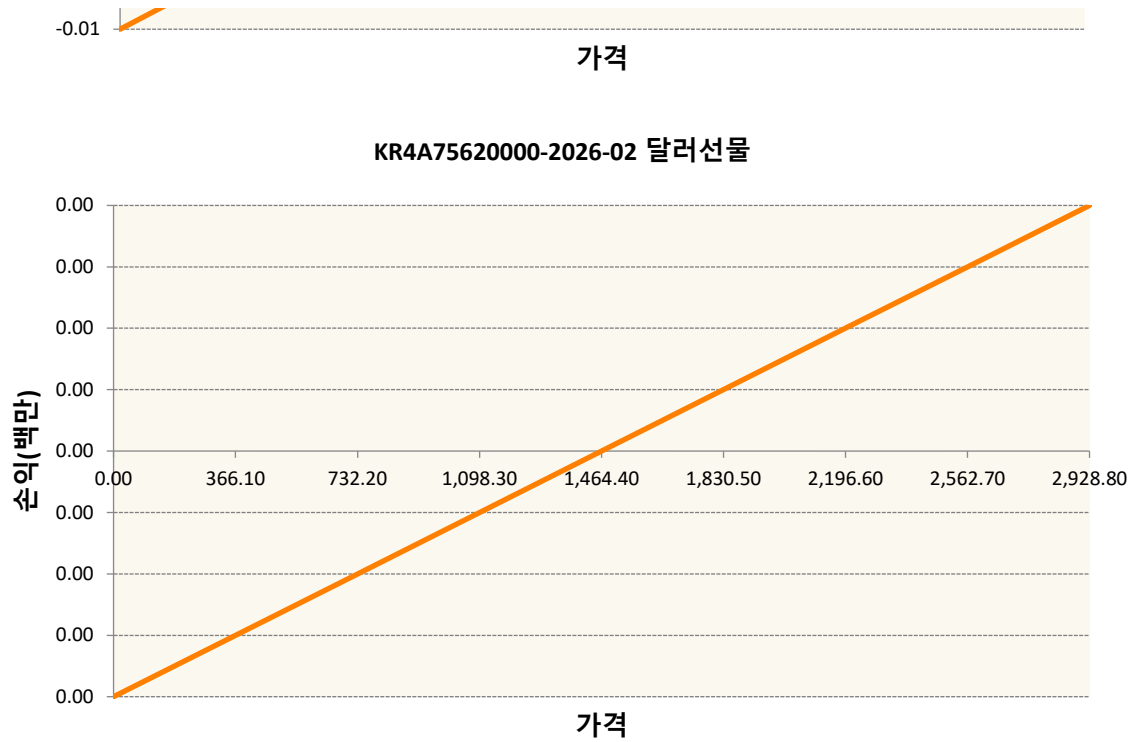
1. 계약금액

(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	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,129	0	1,129	장내
누계	지수	선물	55,293	0	55,293	
누계	통화	선물	3,954	0	3,954	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26		4,423
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26		90
	KR4A756200 2026-02 달러선물		316

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,880

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

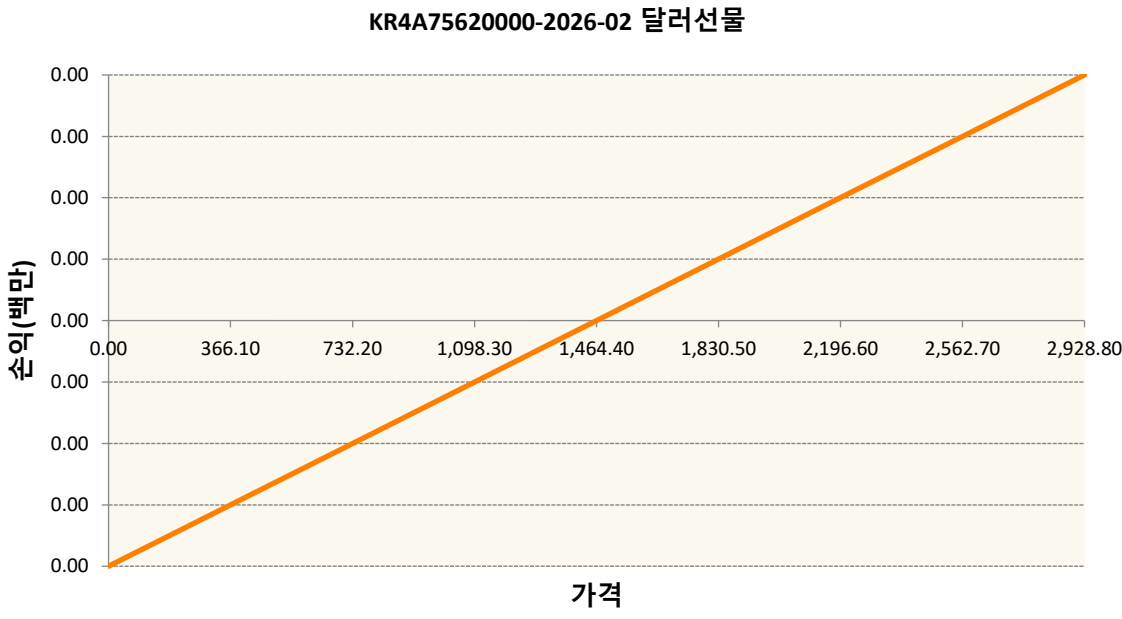
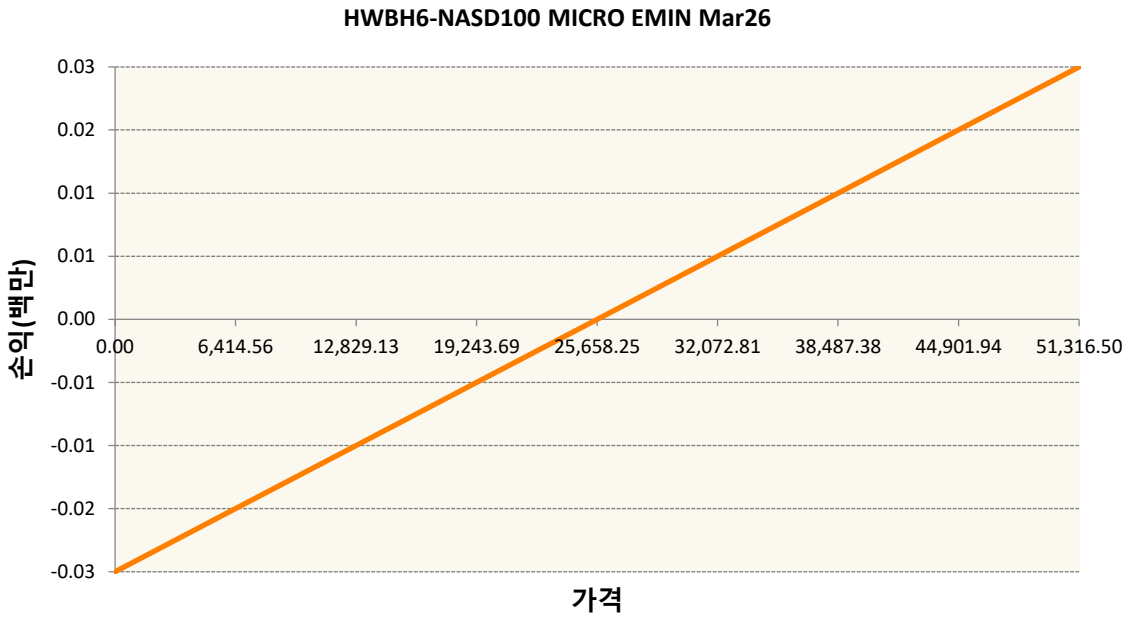
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

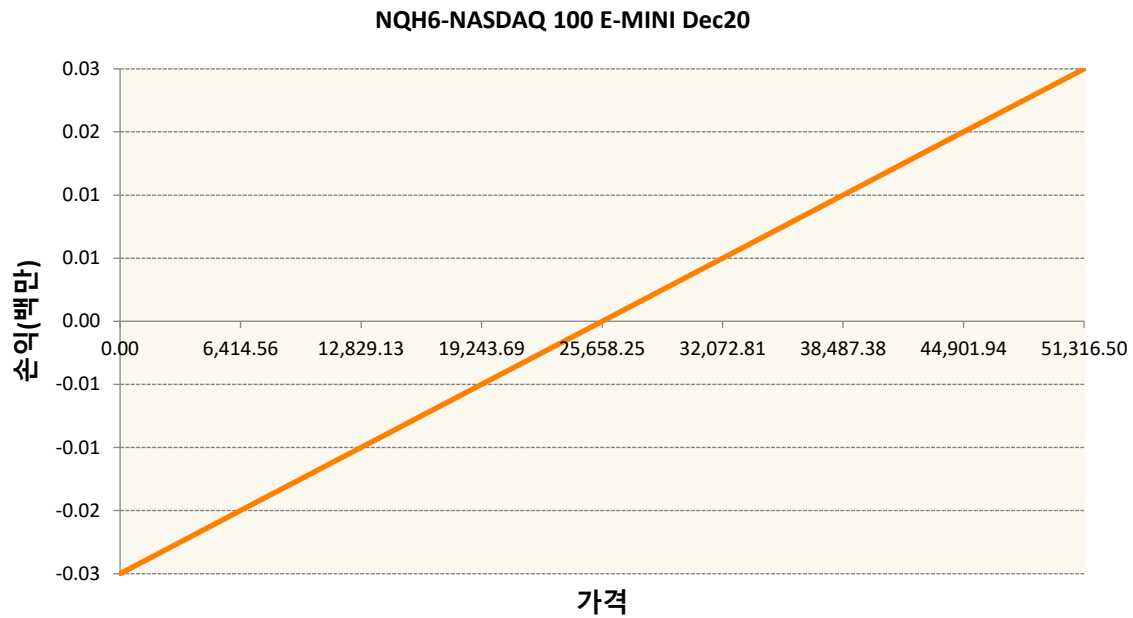
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	25,140	0	25,140	장내
누계	통화	선물	1,318	0	1,318	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN	Mar26	73
KR4A756200	2026-02	달러선물	105
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI	Dec20	1,938

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

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

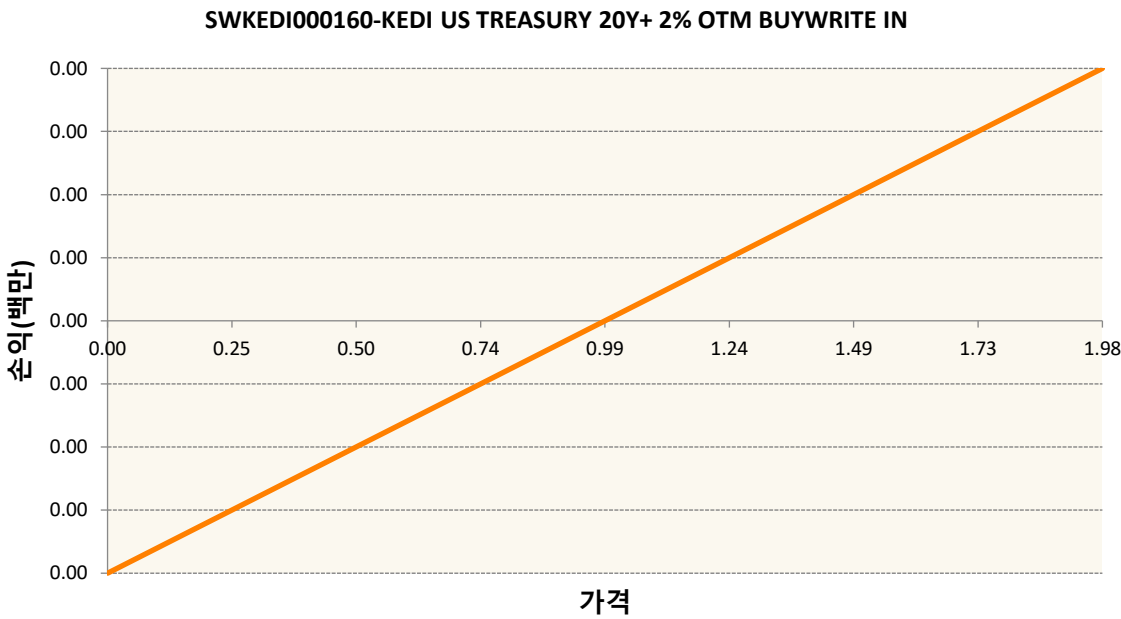
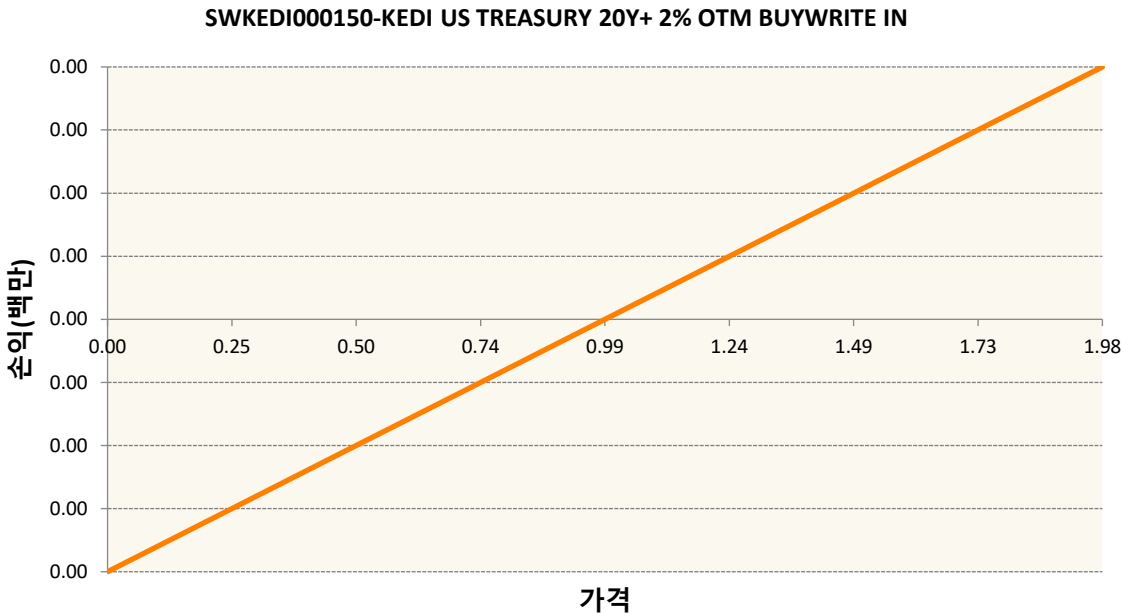
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

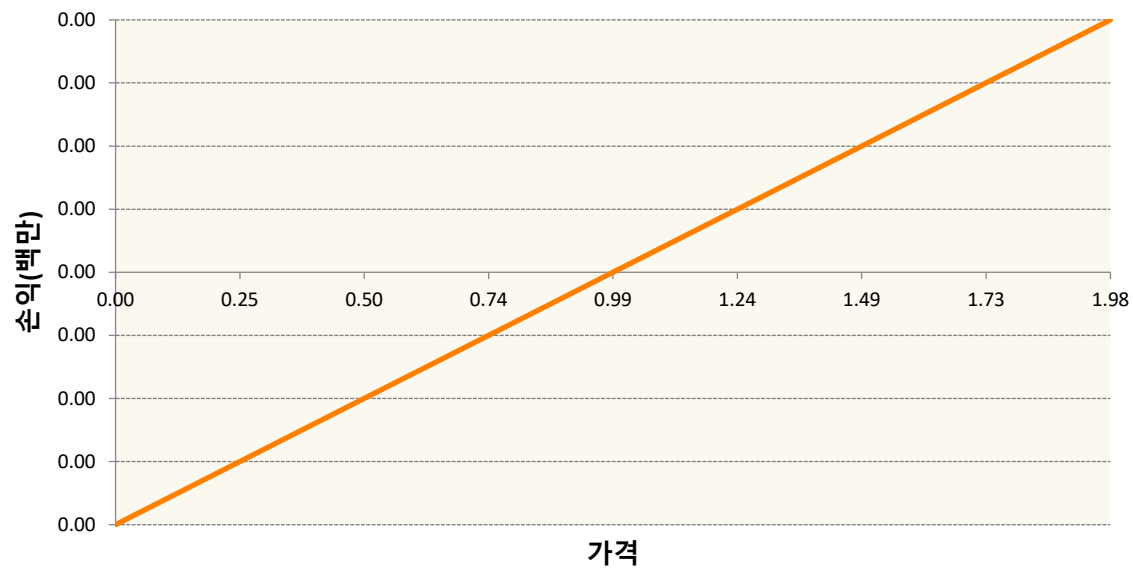
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	378,717	0	378,717	장외

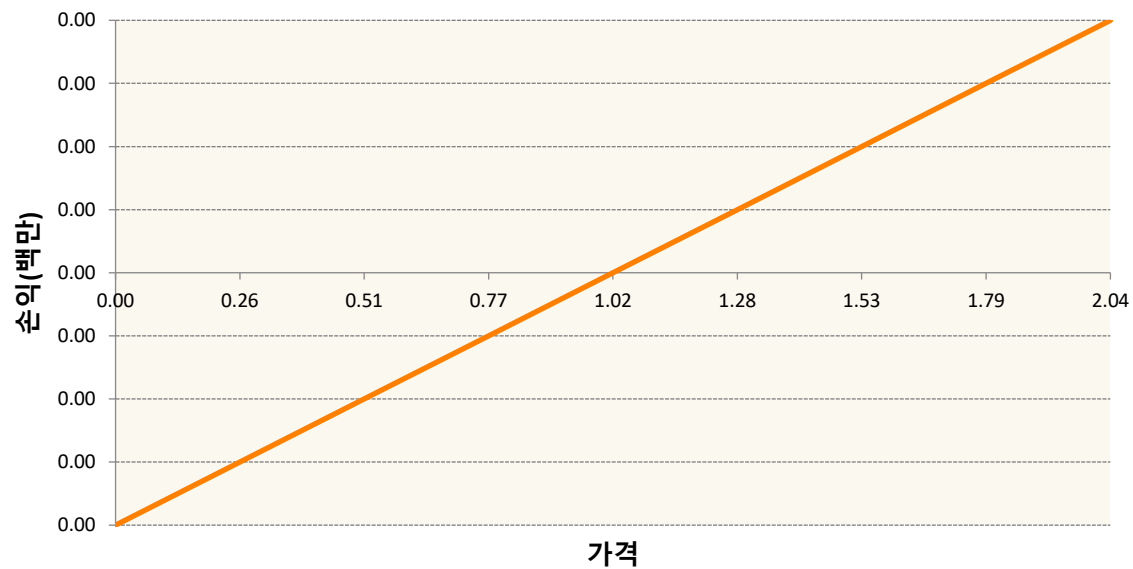
2. 만기시점의 손익구조



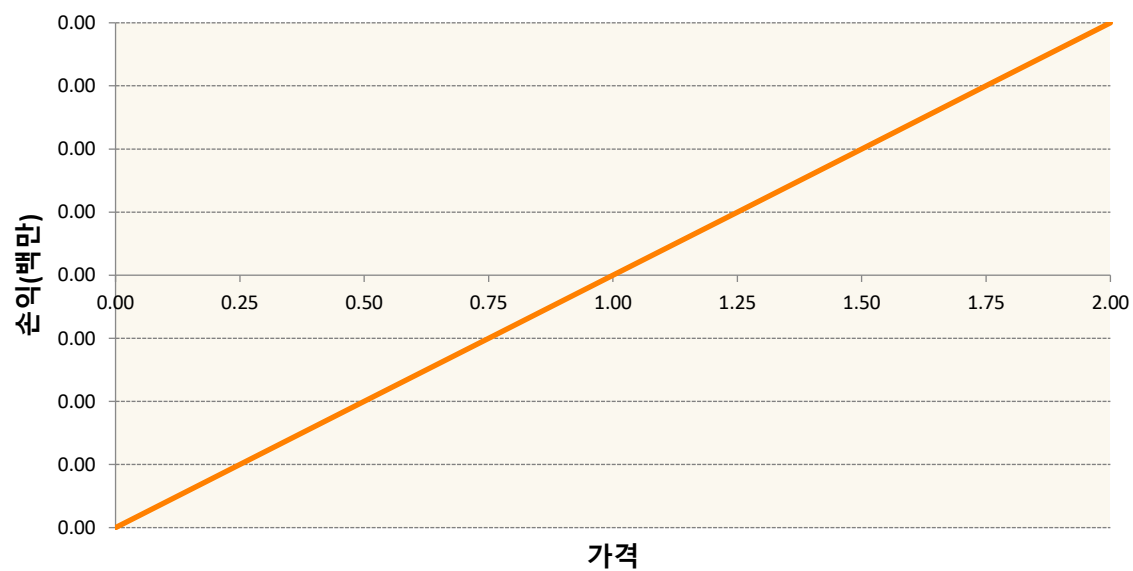
SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,192
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,335
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,669
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		148
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,997

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,801

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

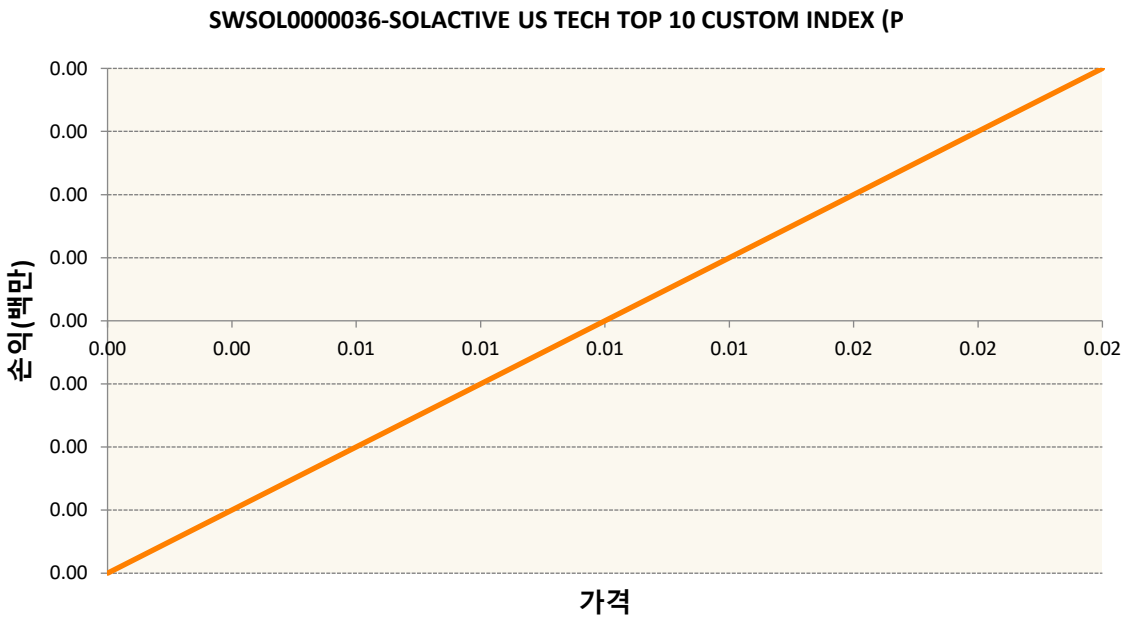
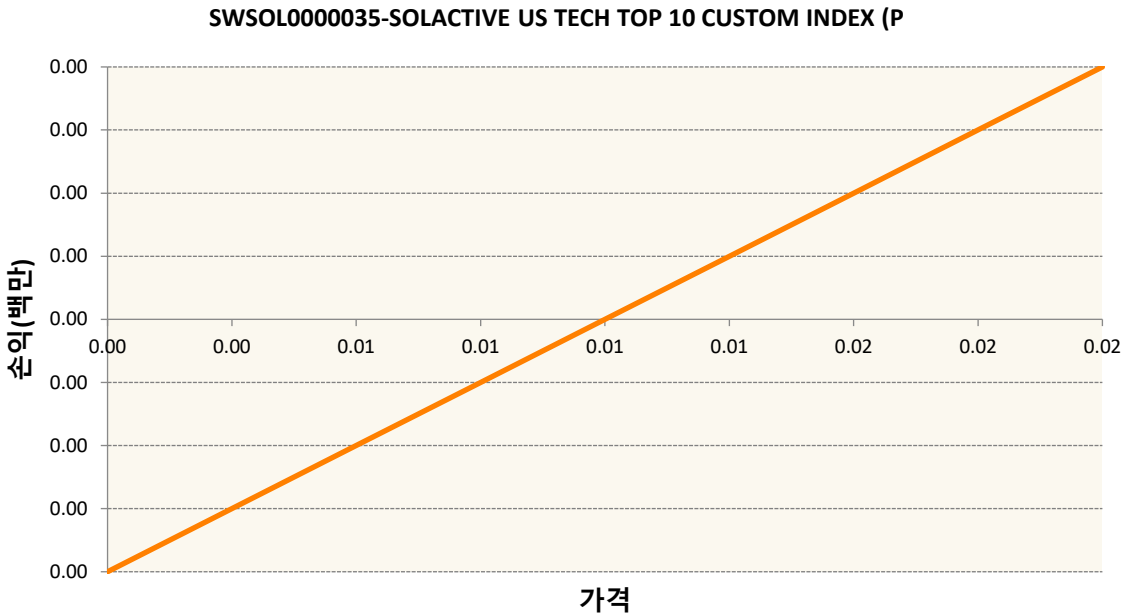
SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

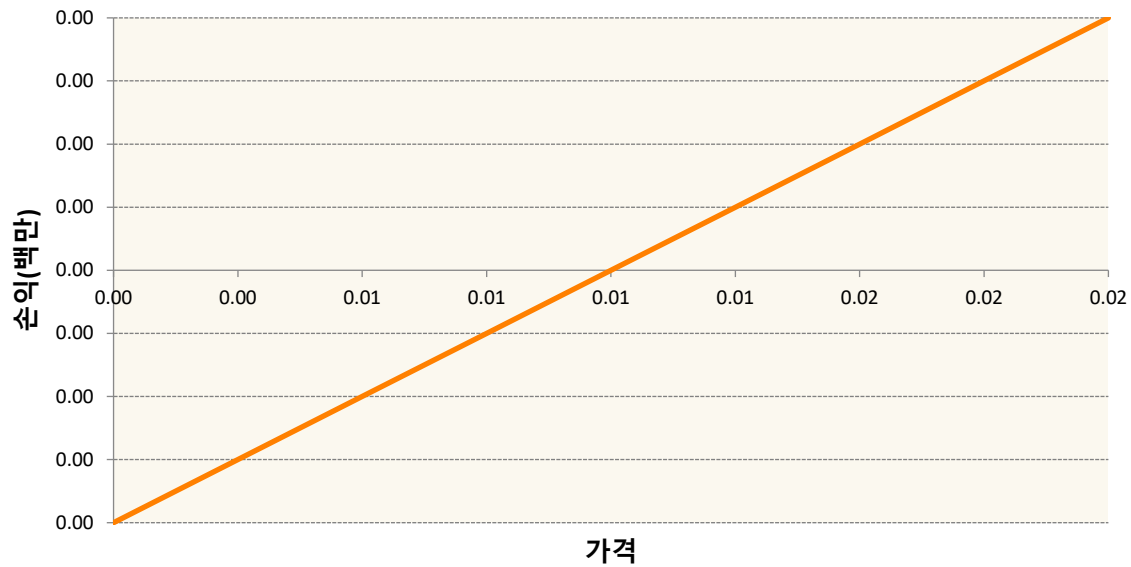
(단위:백만원)

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

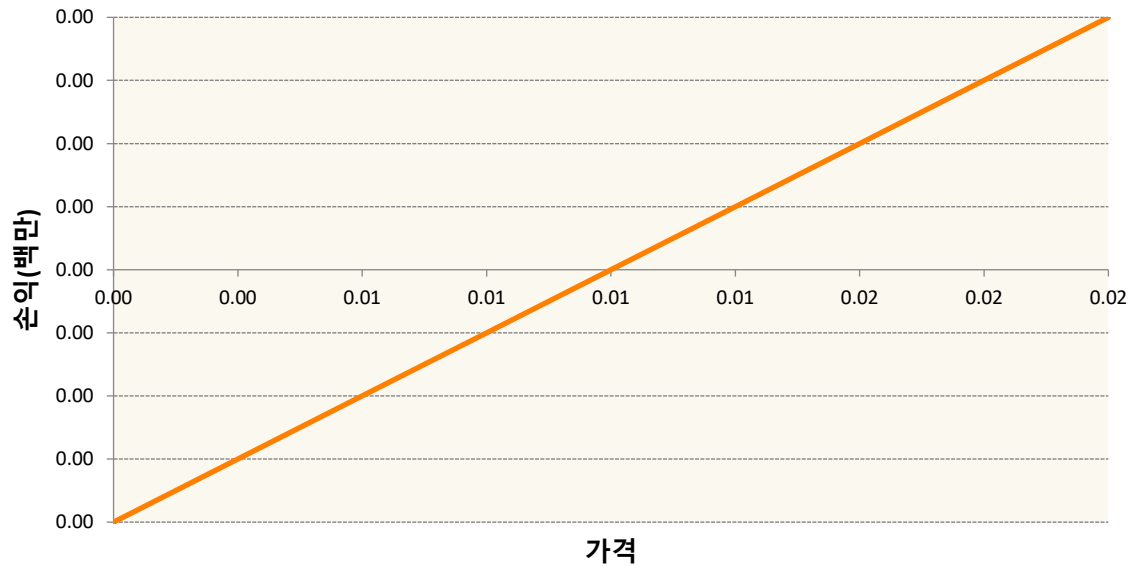
2. 만기시점의 손익구조



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)

3

공시일	2026-01-26
기준일	2026-01-23

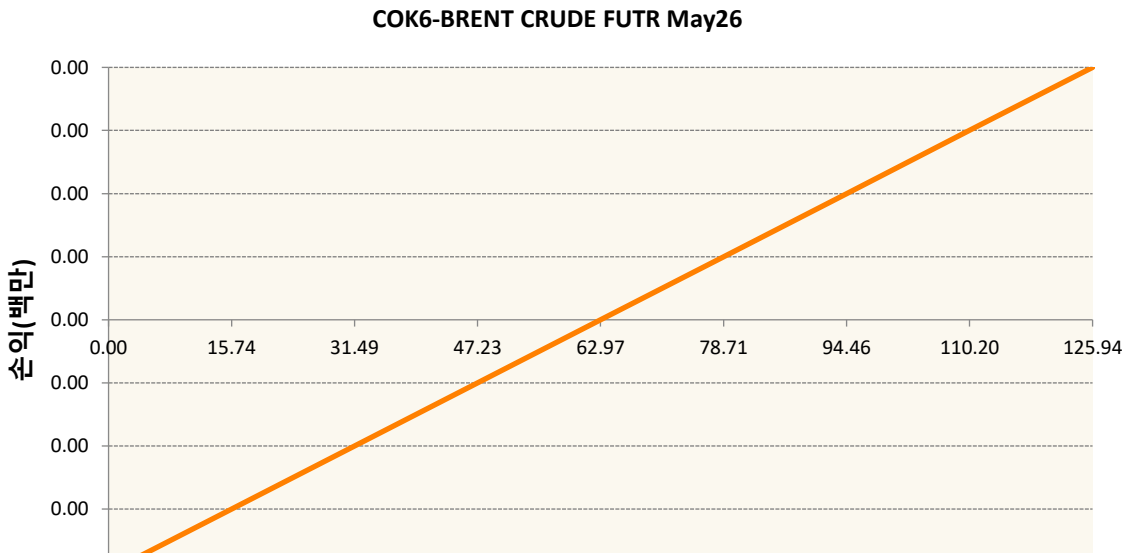
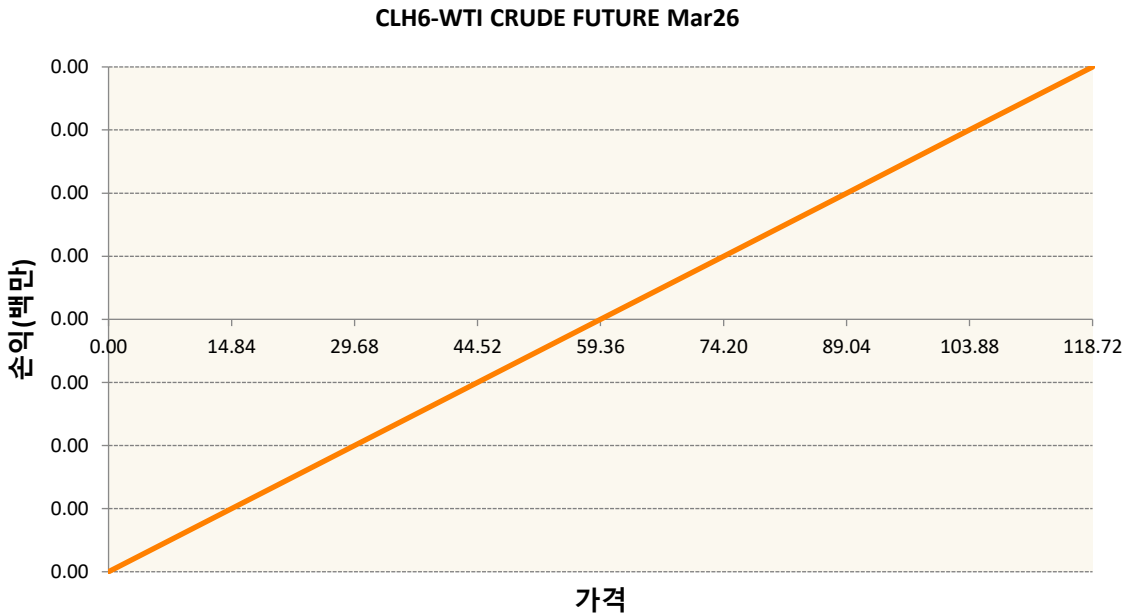
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

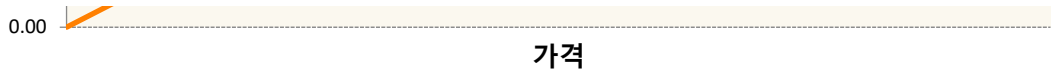
1. 계약금액

(단위:백만원)

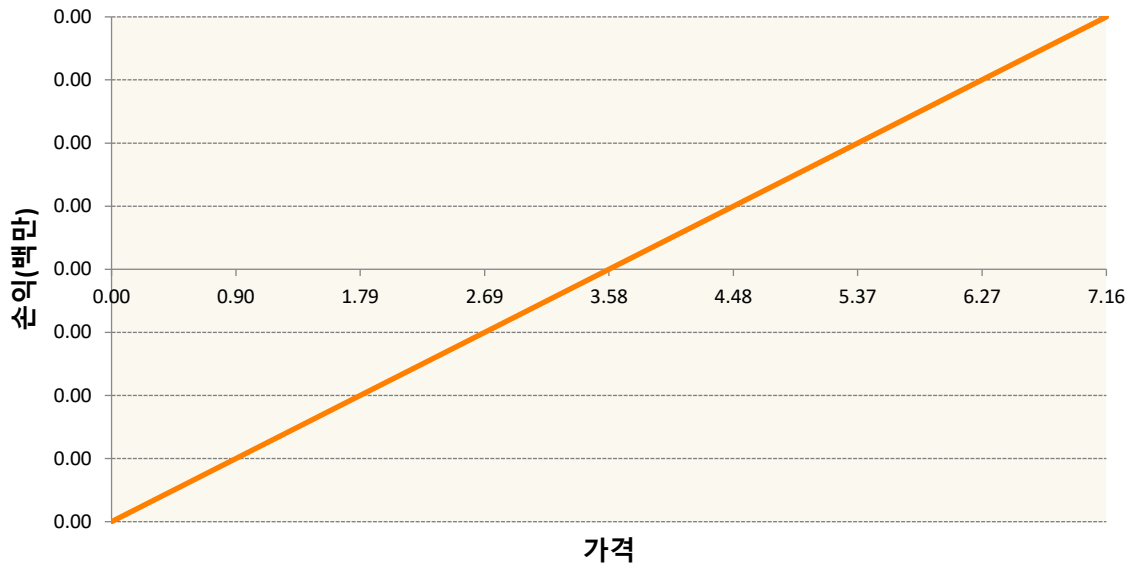
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	132	0	132	
누계	유가증권	선물	370	0	370	
누계	통화	선물	0	103	-103	장내

2. 만기시점의 손익구조

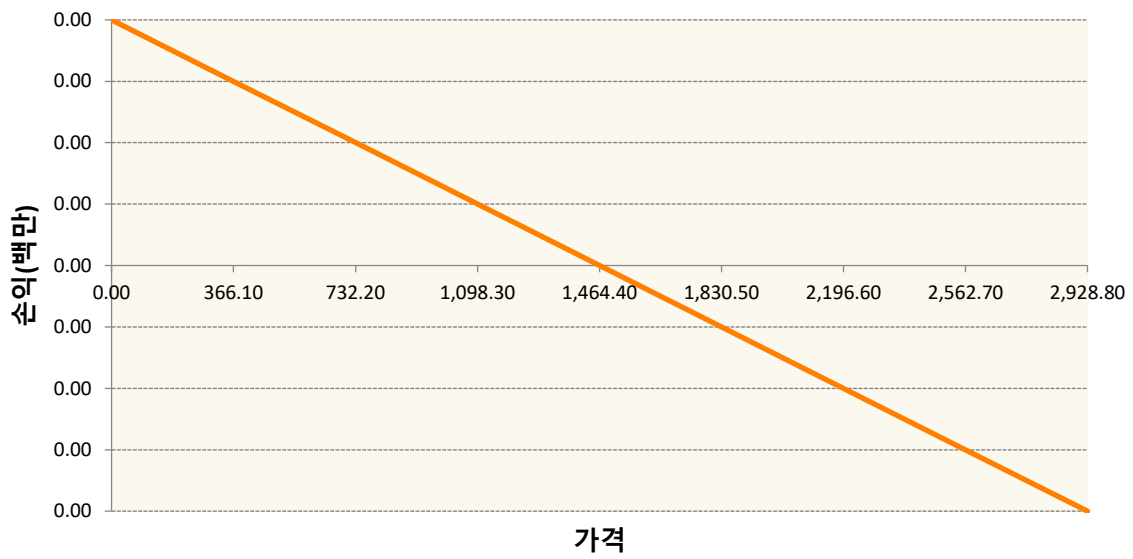




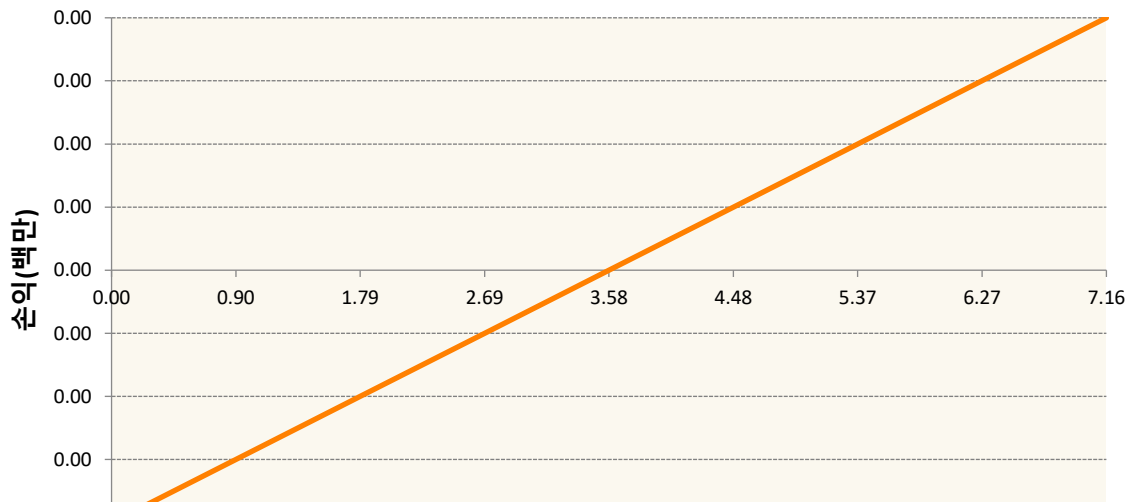
EOH6-E-MINI NATURAL GAS Mar26

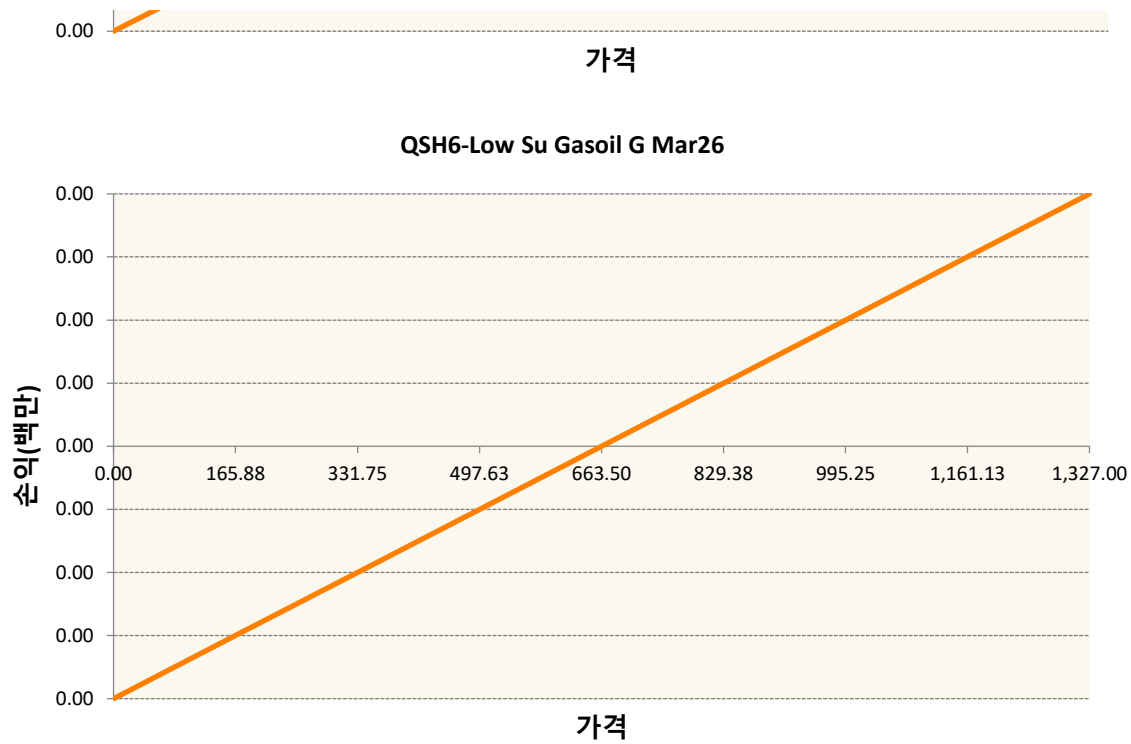


KR4A75620000-2026-02 달러선물



NGH26-NATURAL GAS FUTR Mar26





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

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

(단위:백만원)

88