

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

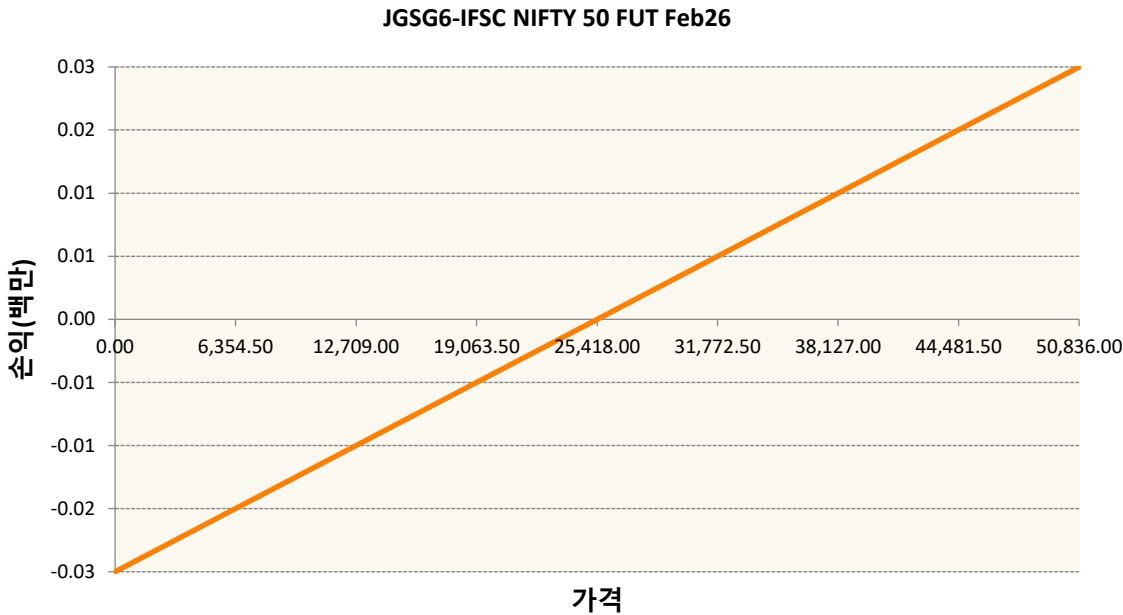
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	659	0	659	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSG6	IFSC NIFTY 50 FUT Feb26	53
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

33

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

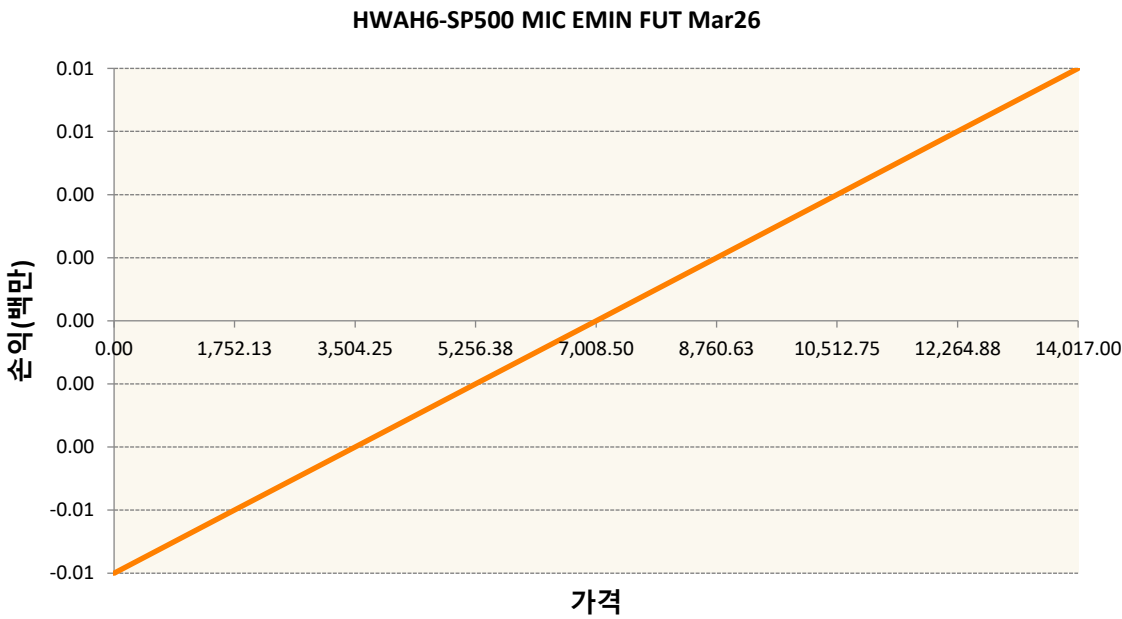
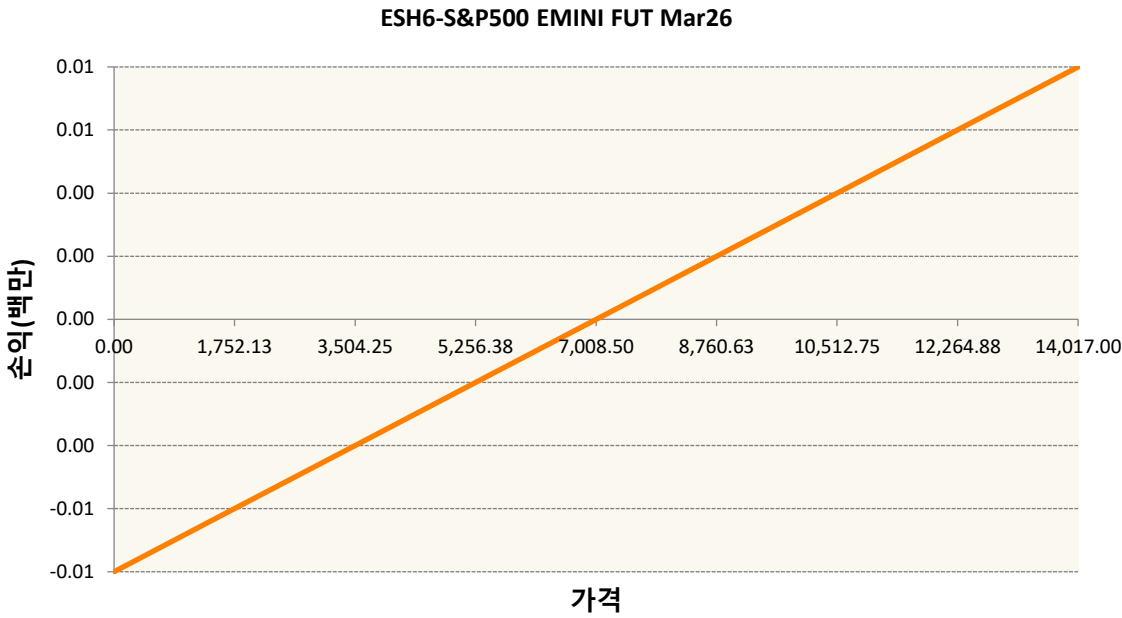
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	207	0	207	장내
누계	지수	선물	518	0	518	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	41
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	17

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	50

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

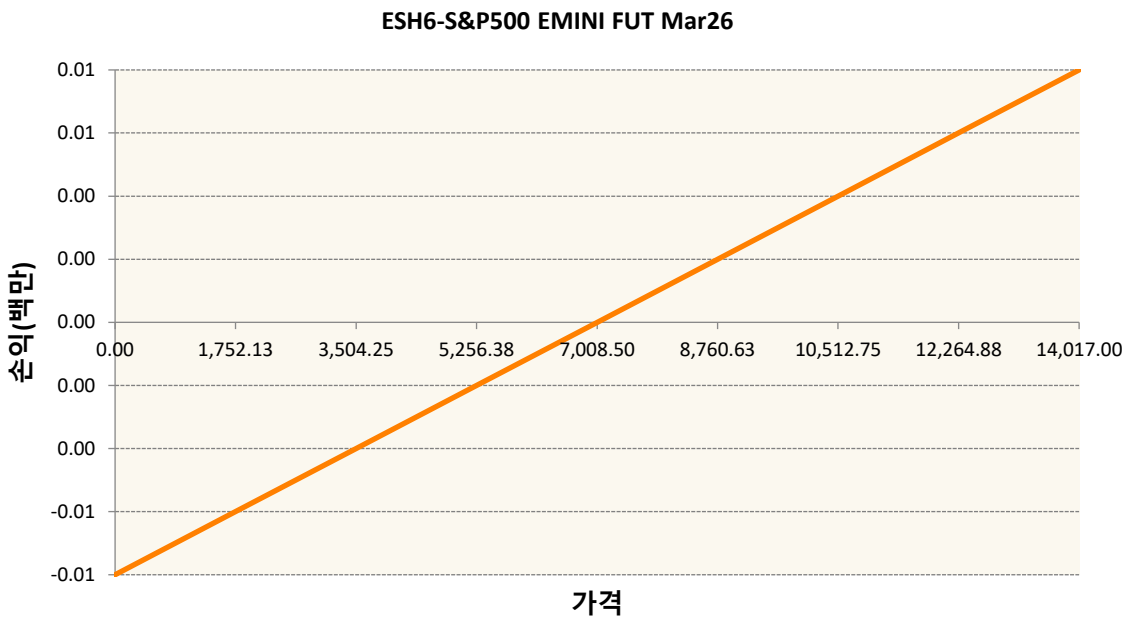
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

107

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

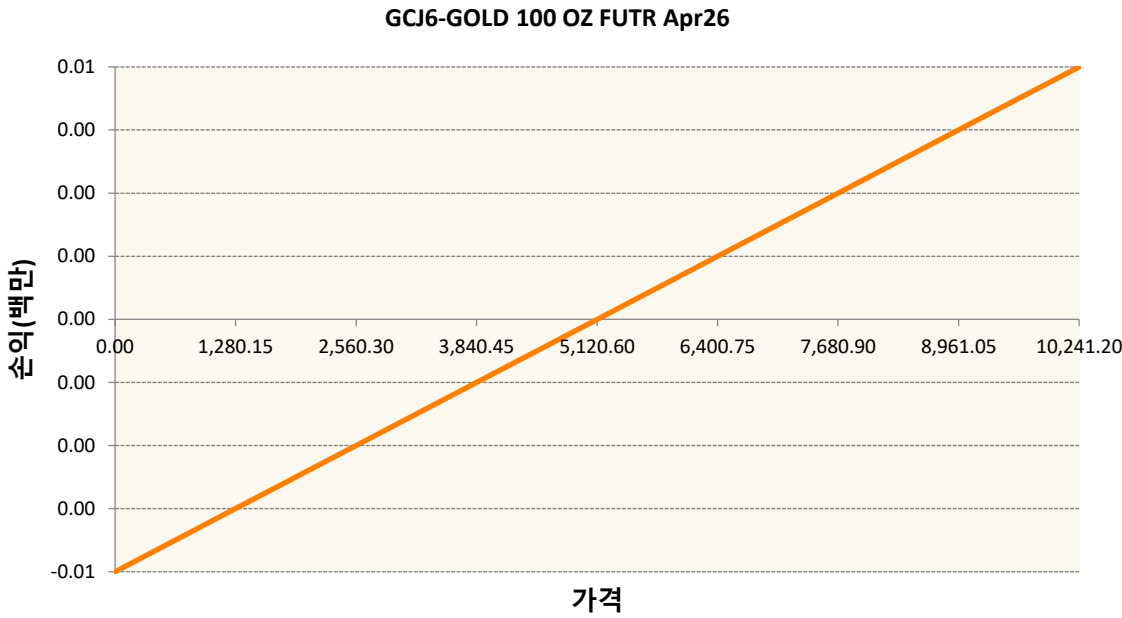
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,370	0	4,370	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 01/30/26 C460 EQUITY	5
GCI6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	350

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

(단위:백만원)

342

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

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)

AOPLTRCSS1PLTR US 01/30/26 C175 EQUITY	148
AOPLTRPSS1PLTR US 01/30/26 P175 EQUITY	27

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

(단위:백만원)

659

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSCC(TLT US 01/30/26 C89 EQUITY

3

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

(단위:백만원)

2

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

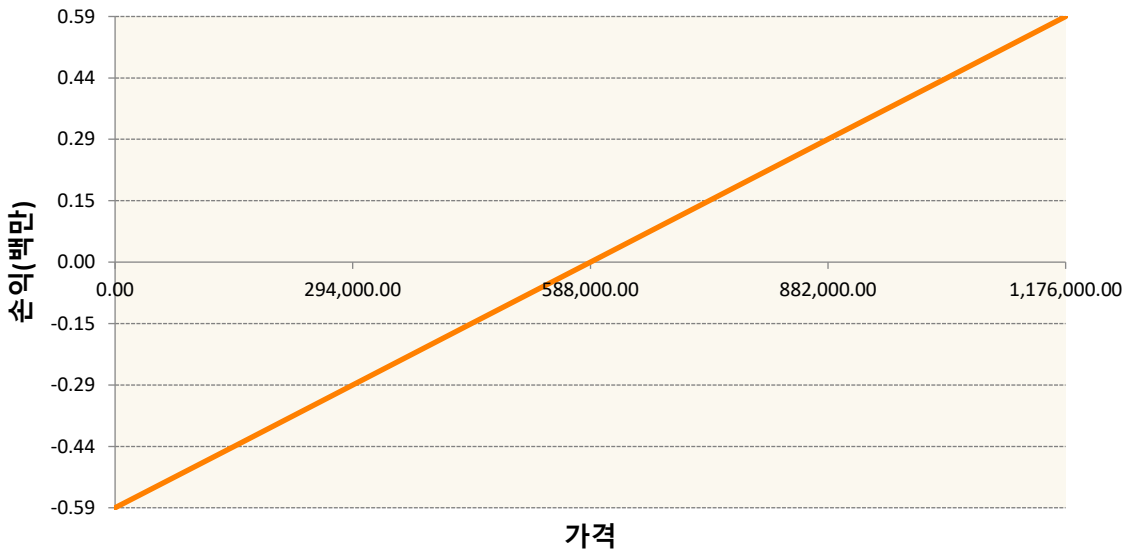
1. 계약금액

(단위:백만원)

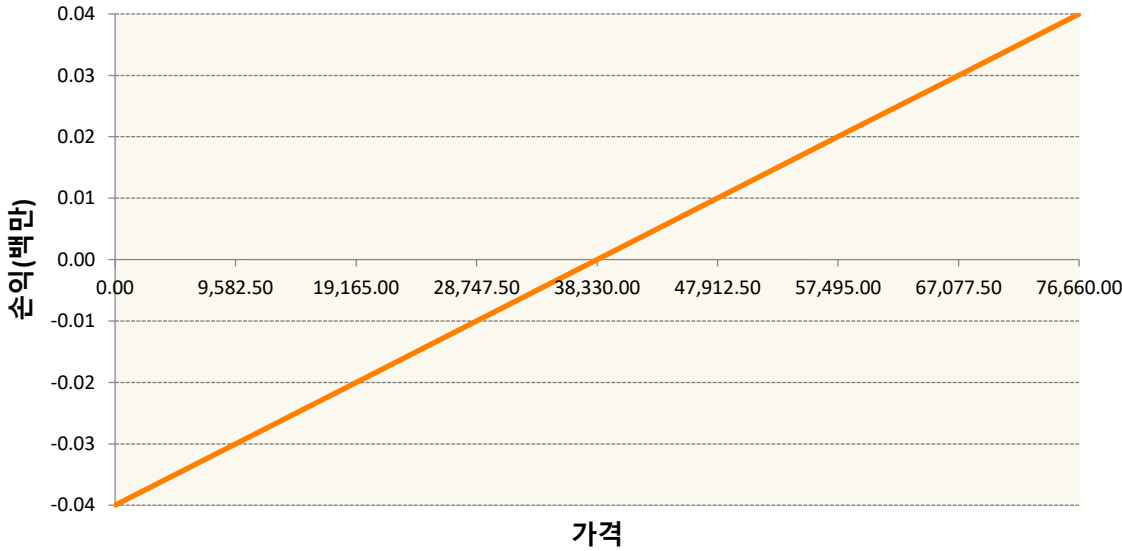
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	856	-856	장내
누계	유가증권	선물	23,583	0	23,583	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4AFD620008-2026-02 HD현대중공업개별선물



KR4AM7630007-2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD620008			2026-02 HD현대중공업개별선물				939
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-939	-939	-939	-939	-939	-939	-939
-5.33%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-2.67%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	313	313	313	313	313	313	313
5.33%	626	626	626	626	626	626	626
8.00%	939	939	939	939	939	939	939
KR4AM7630007			2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물				939
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-939	-939	-939	-939	-939	-939	-939
-5.33%	-626	-626	-626	-626	-626	-626	-626
-2.67%	-313	-313	-313	-313	-313	-313	-313
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	313	313	313	313	313	313	313
5.33%	626	626	626	626	626	626	626
8.00%	939	939	939	939	939	939	939

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

1,673

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

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	2026-01-29
기준일	2026-01-28

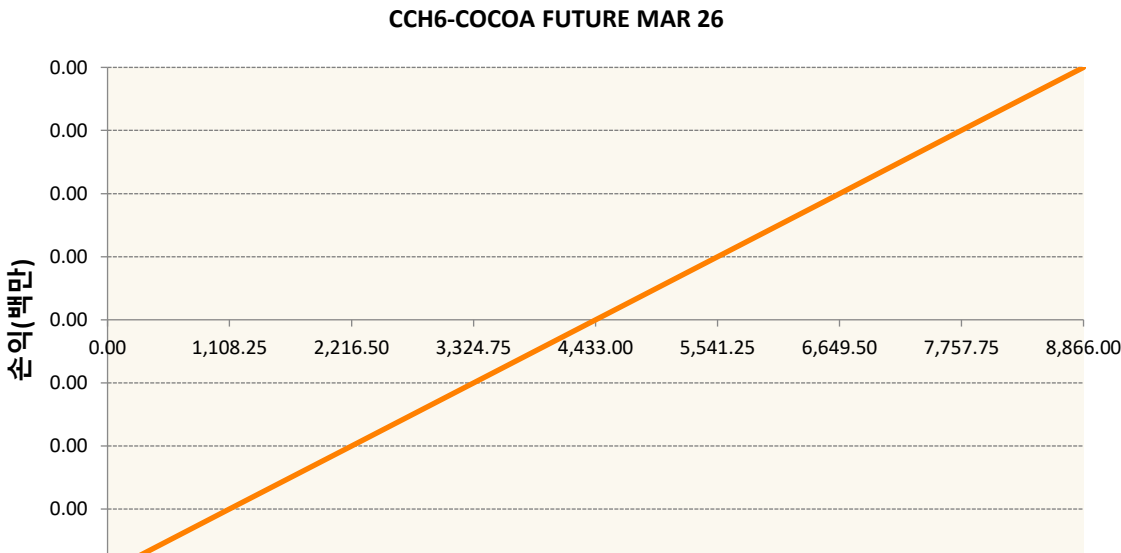
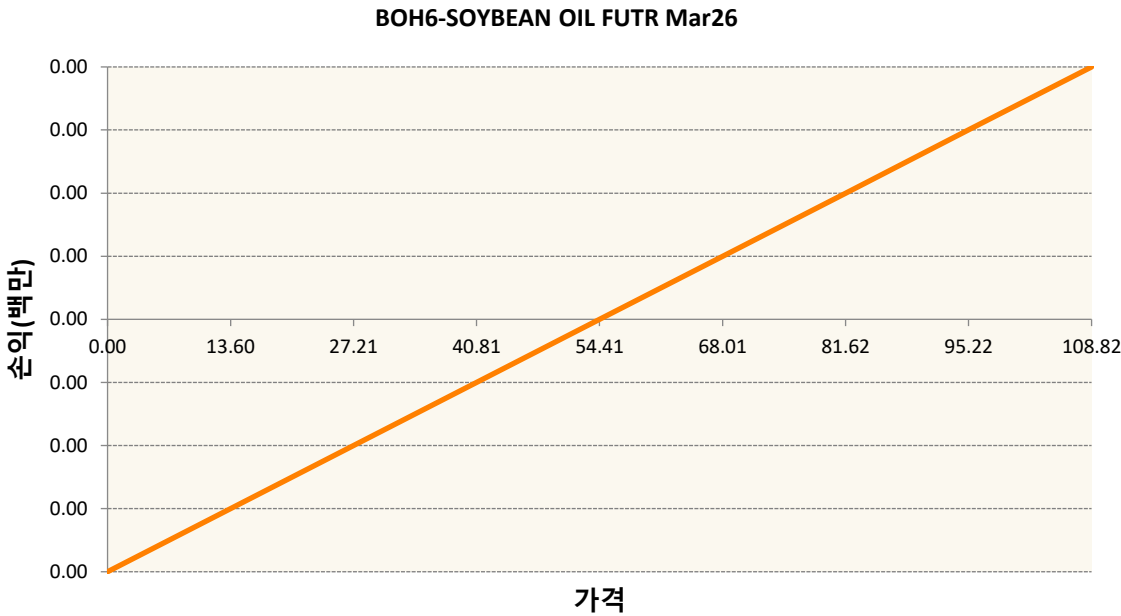
포커스농산물모(채권-파생형)

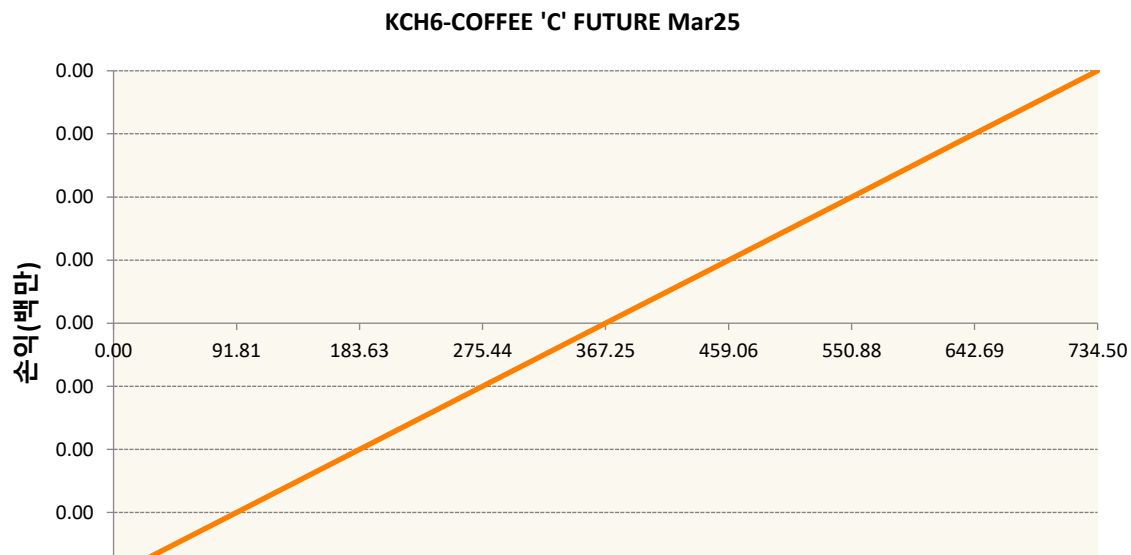
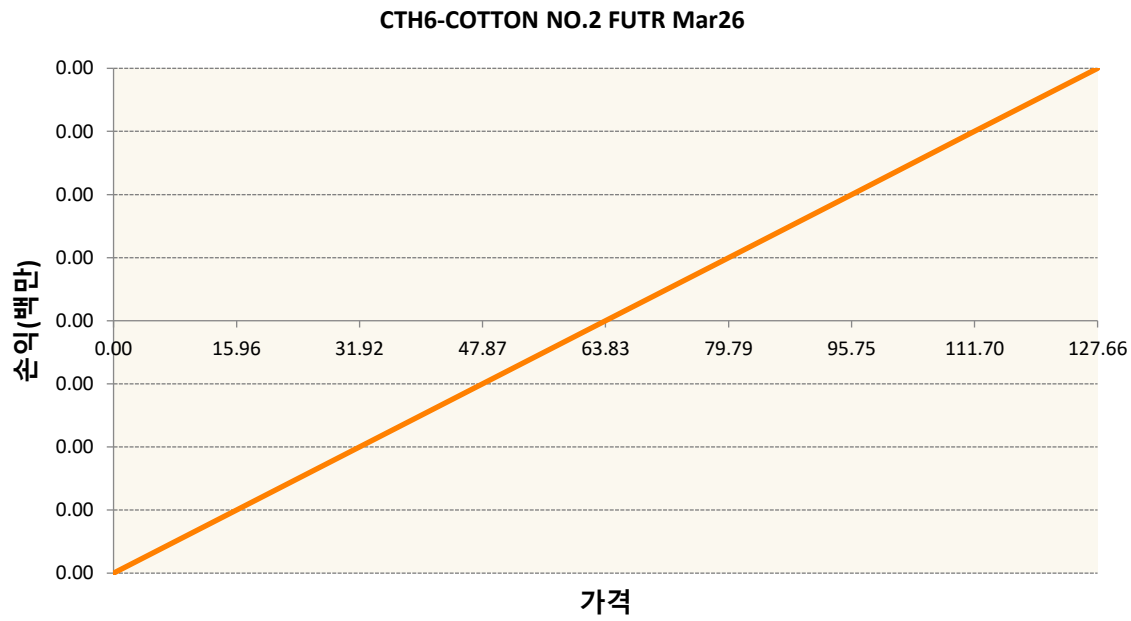
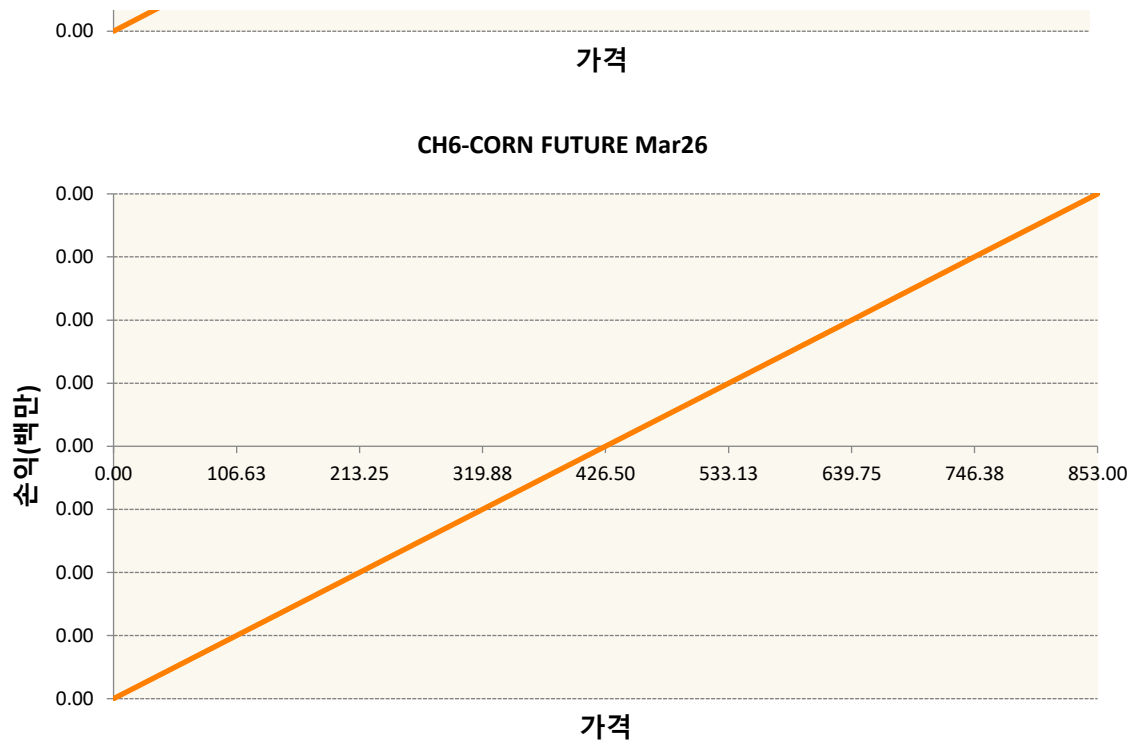
1. 계약금액

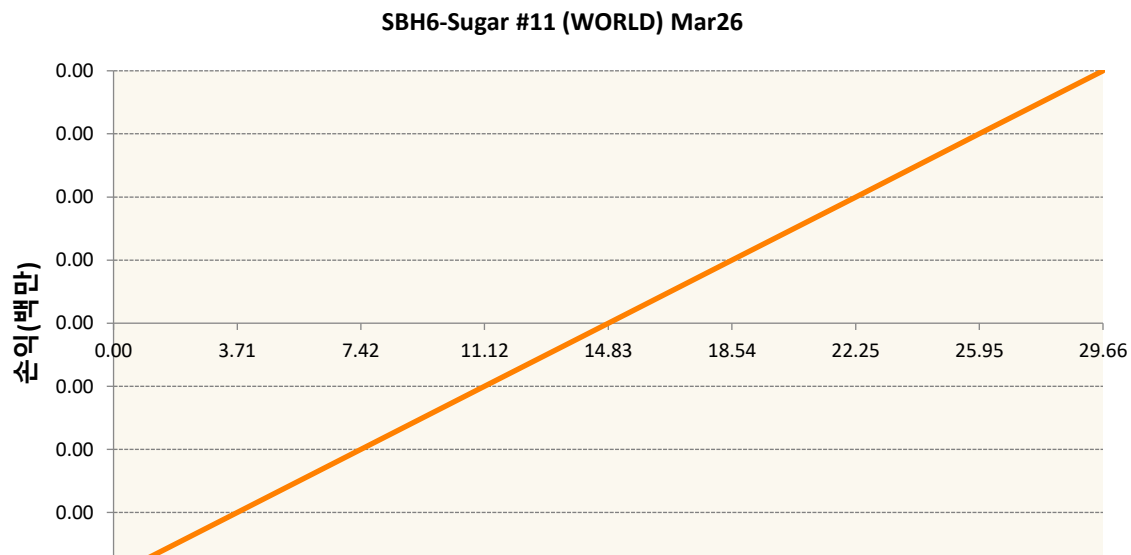
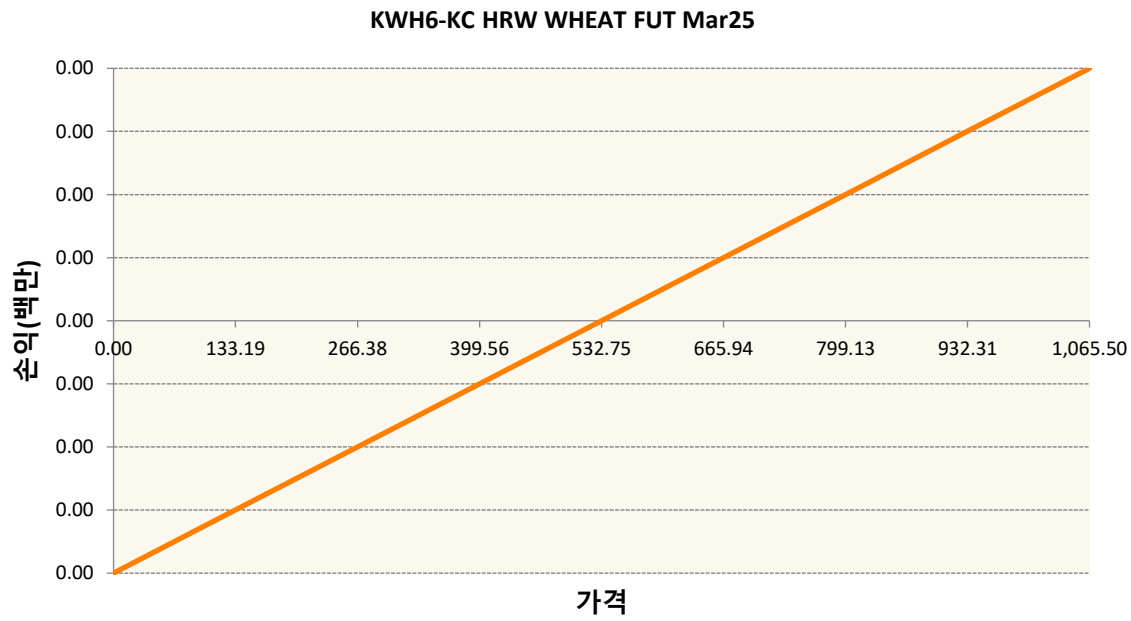
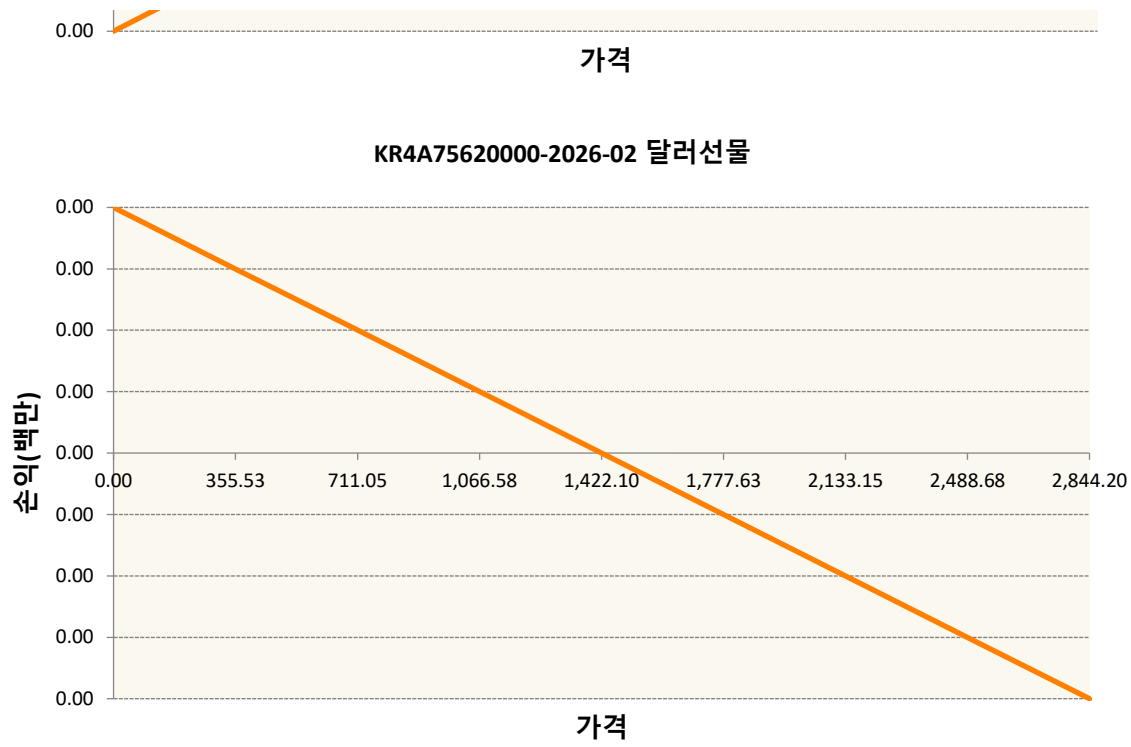
(단위:USD 백만)

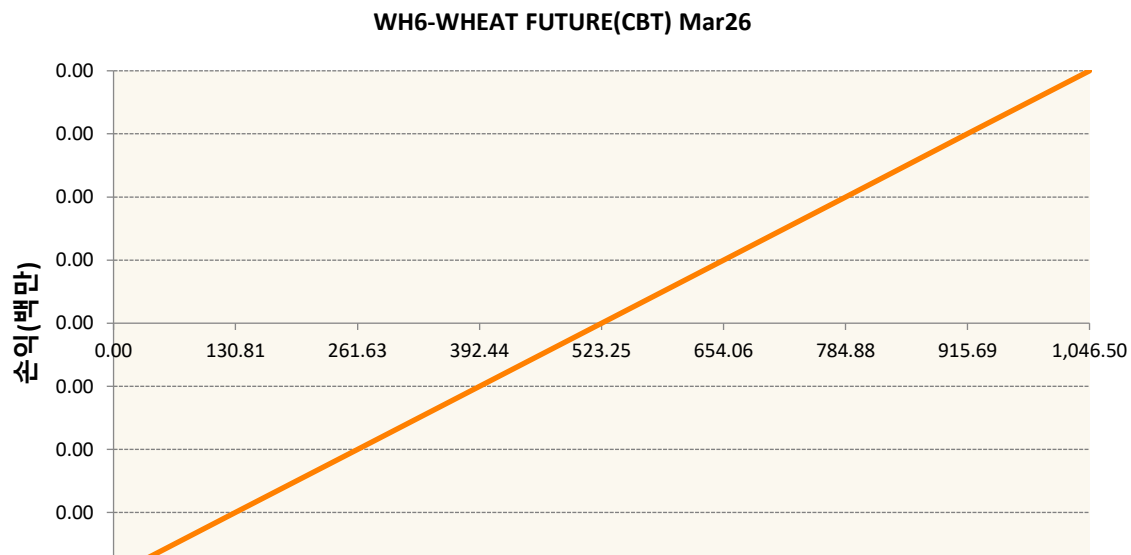
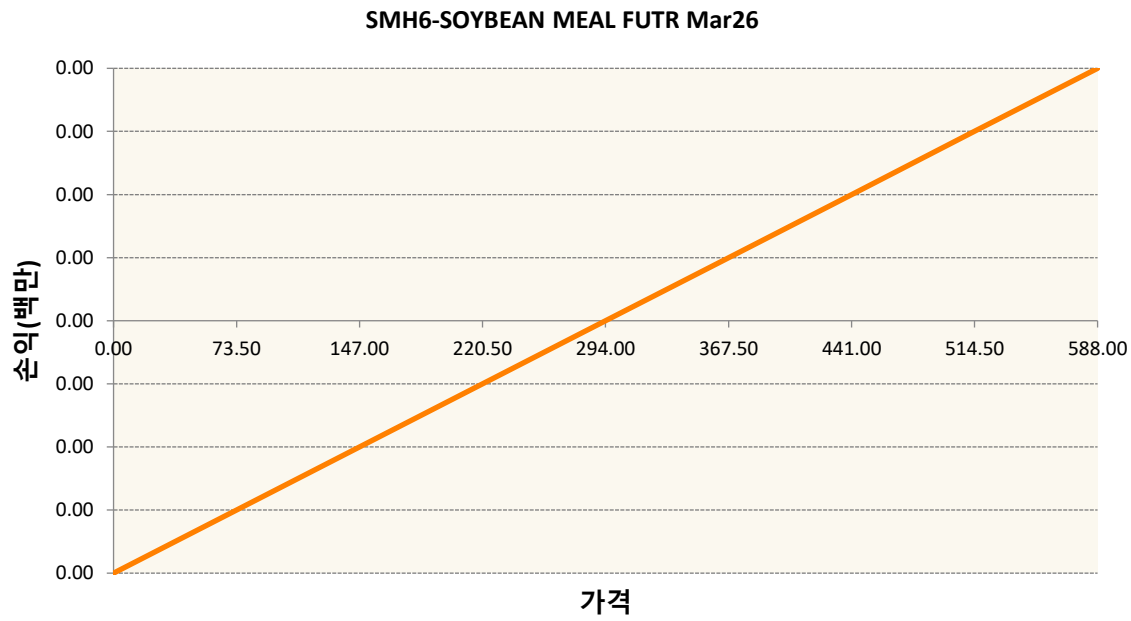
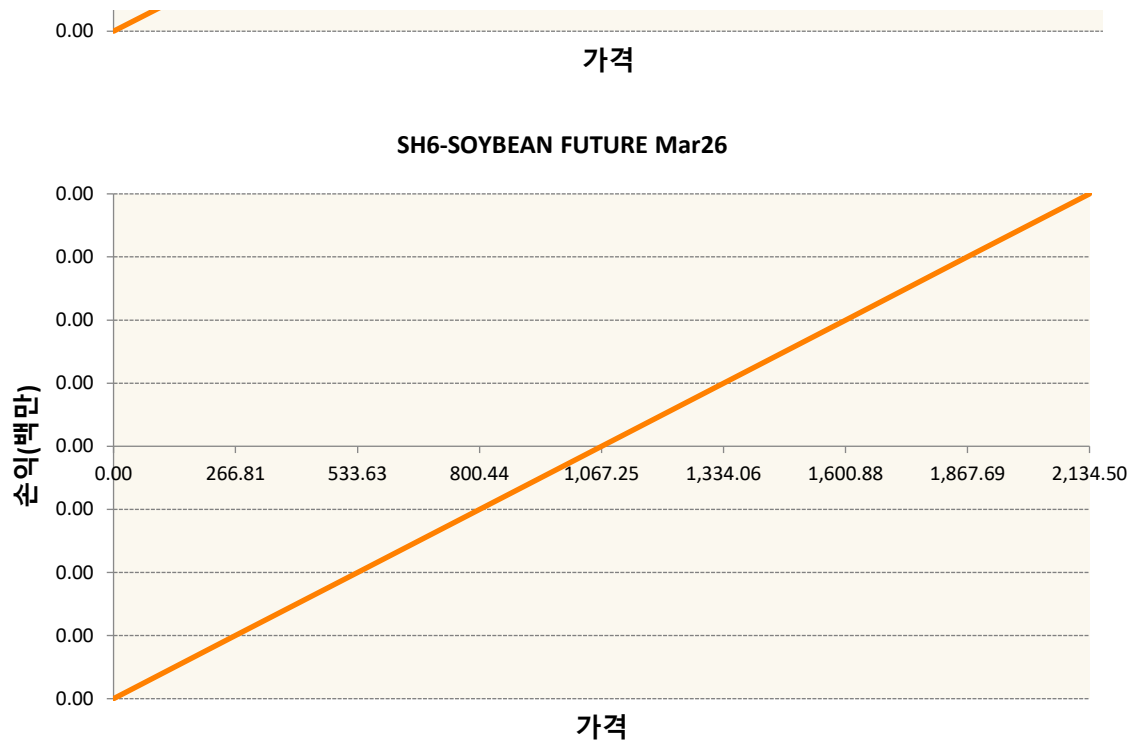
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	418	0	418	
누계	유가증권	선물	2,660	0	2,660	
누계	통화	선물	0	299	-299	장내

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	2026-01-29
기준일	2026-01-28

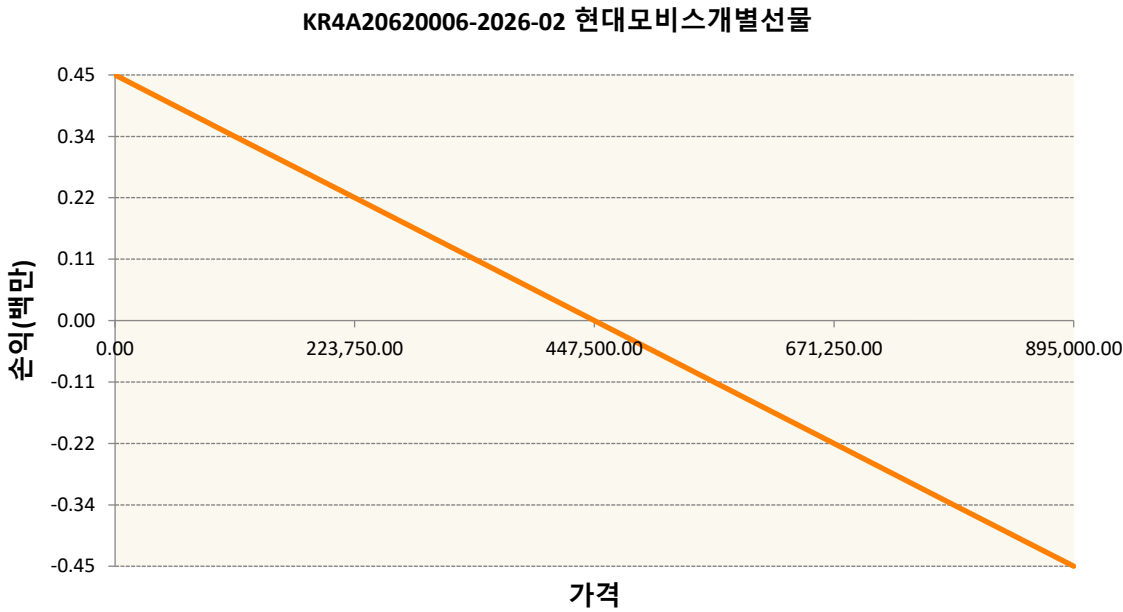
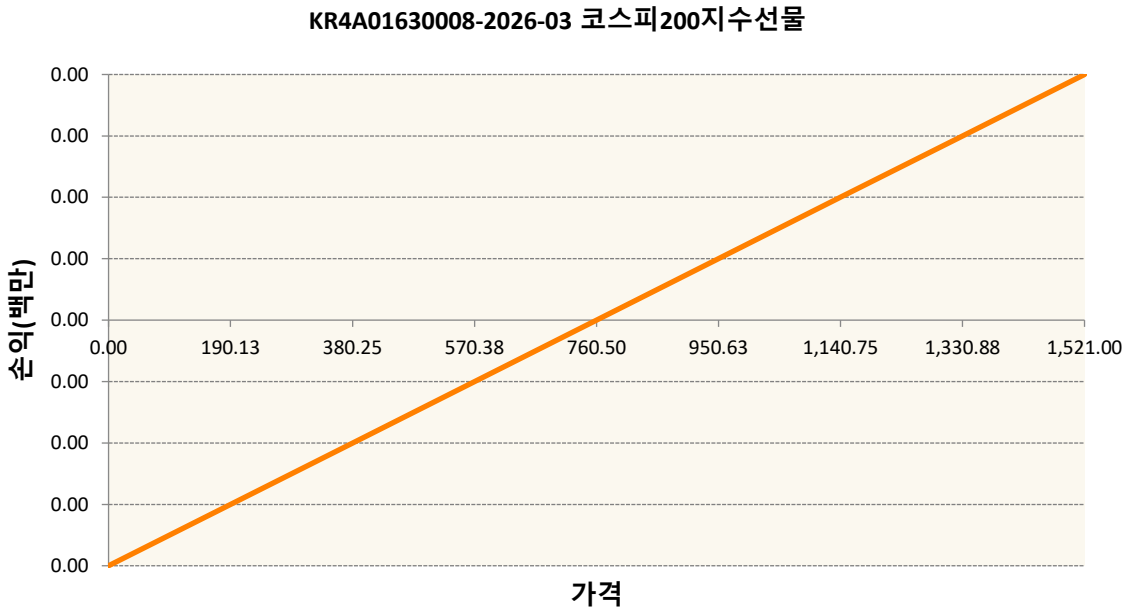
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	63	-63	장내
누계	유가증권	선물	3,042	63	2,979	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		243
KR4A206200 2026-02 현대모비스개별선물		5

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

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

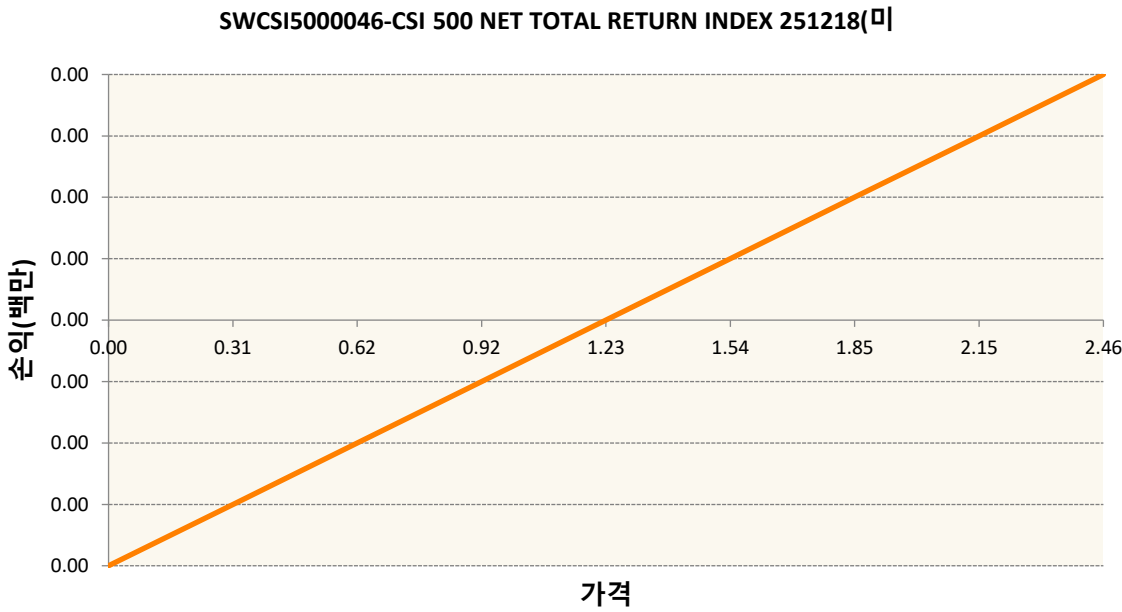
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,681	0	5,681	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

454

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

544

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

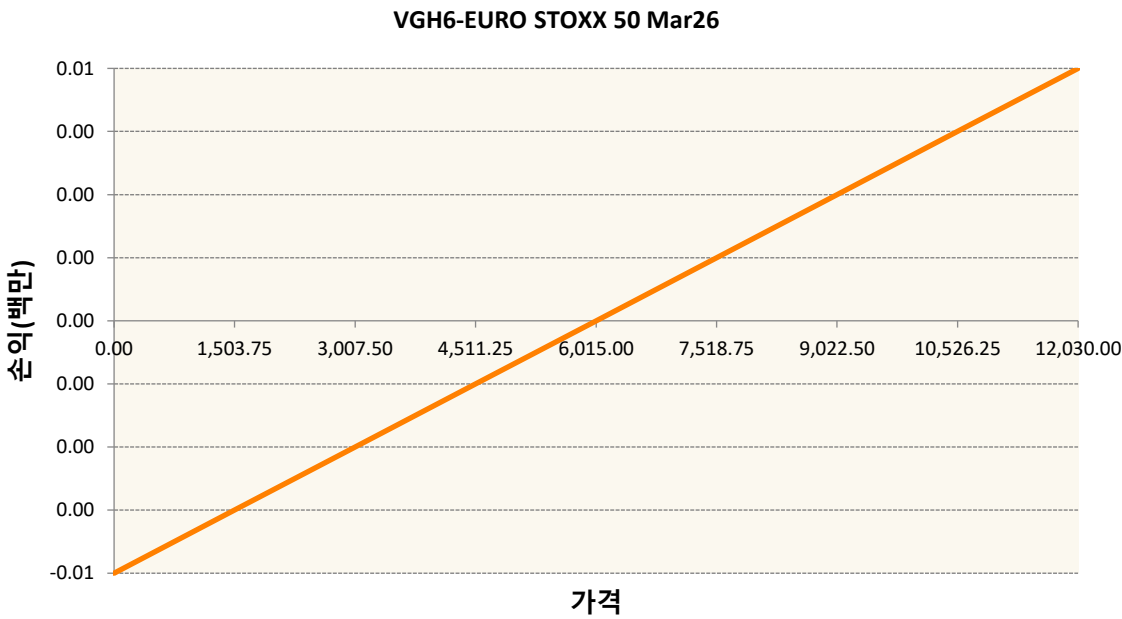
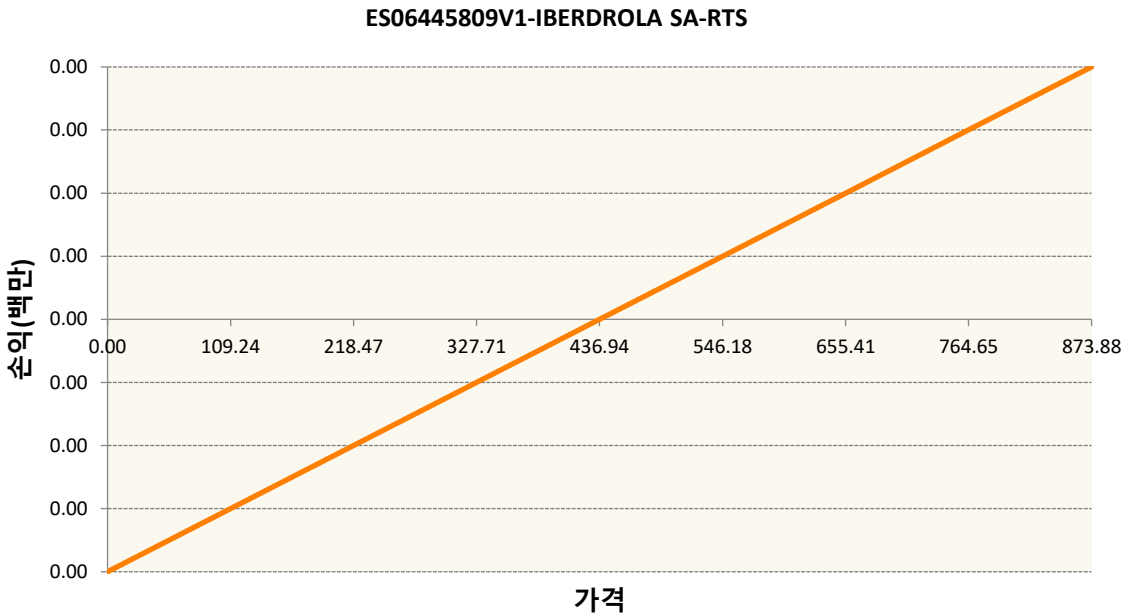
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	938	0	938	

2. 만기시점의 손익구조



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

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

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

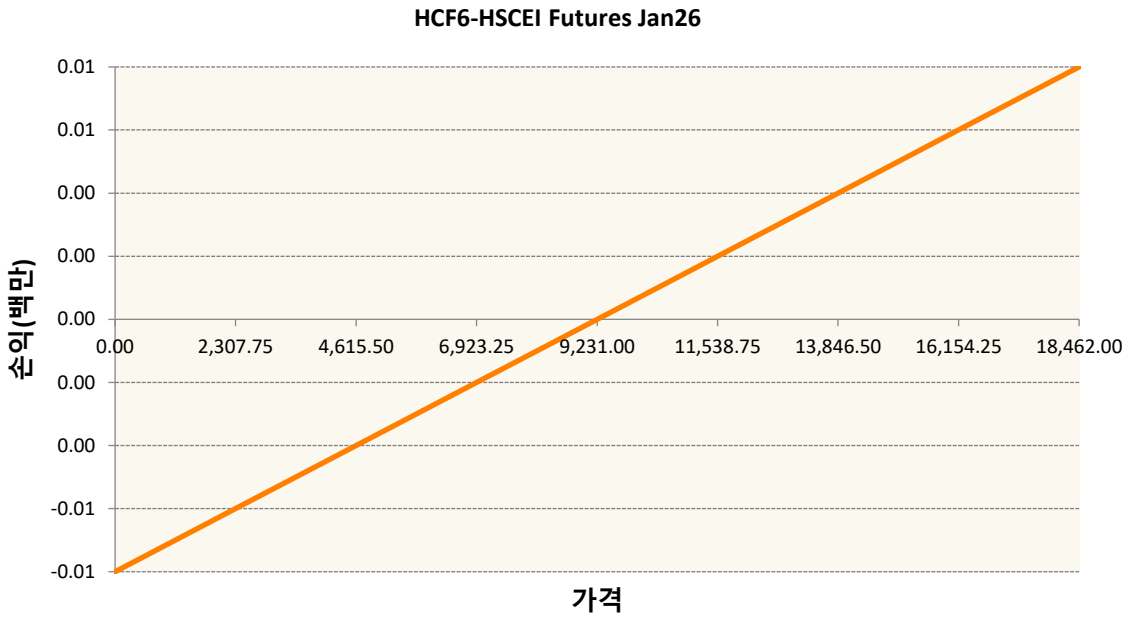
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,063	0	2,063	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCF6	HSCEI Futures Jan26	165
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

231

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

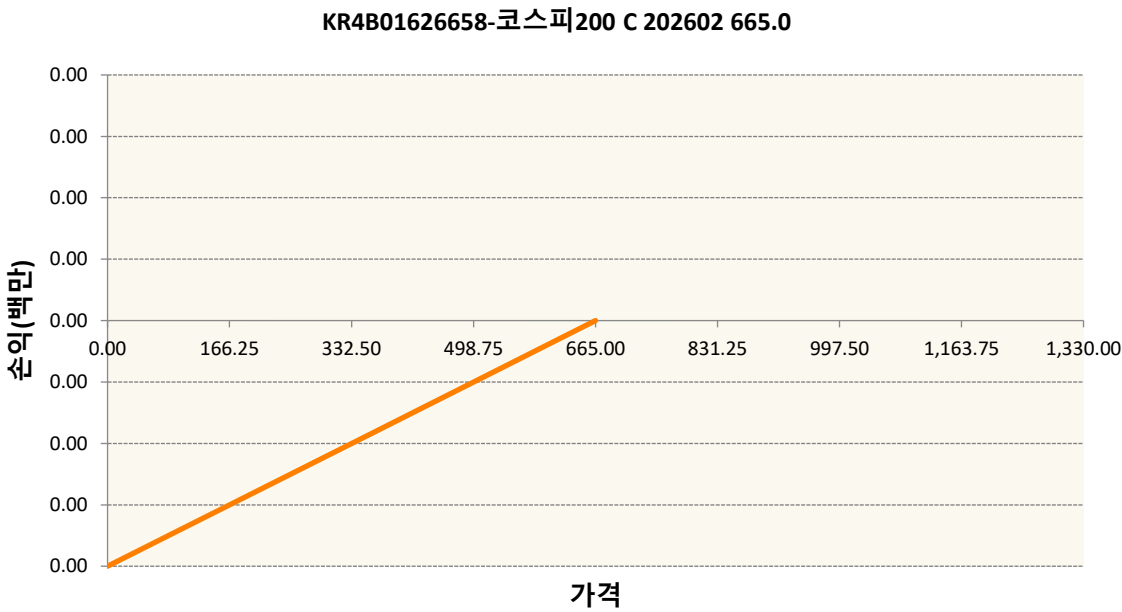
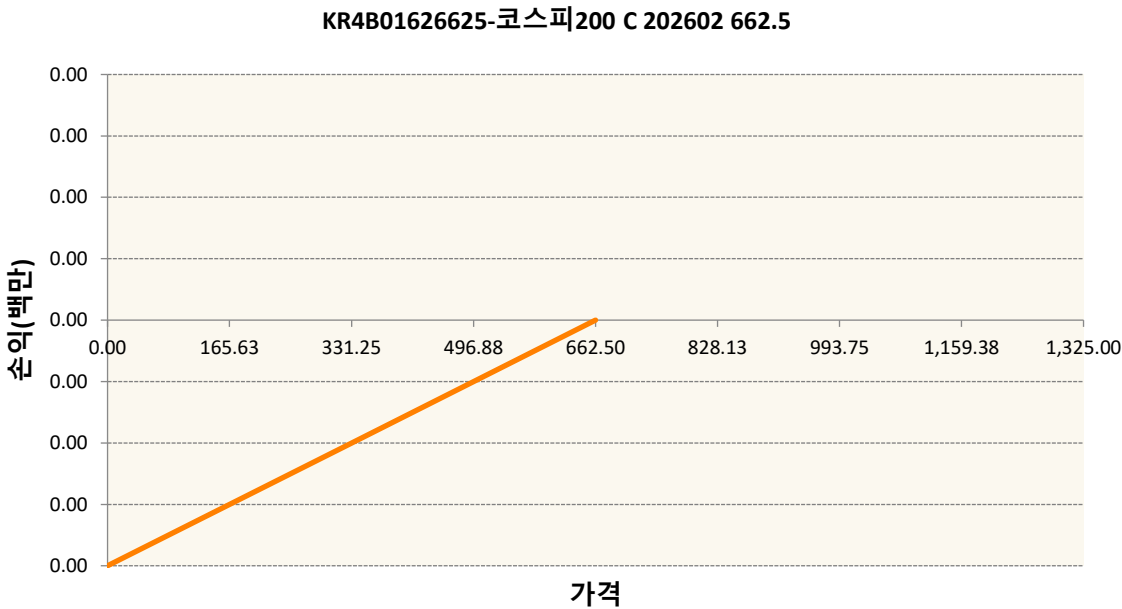
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

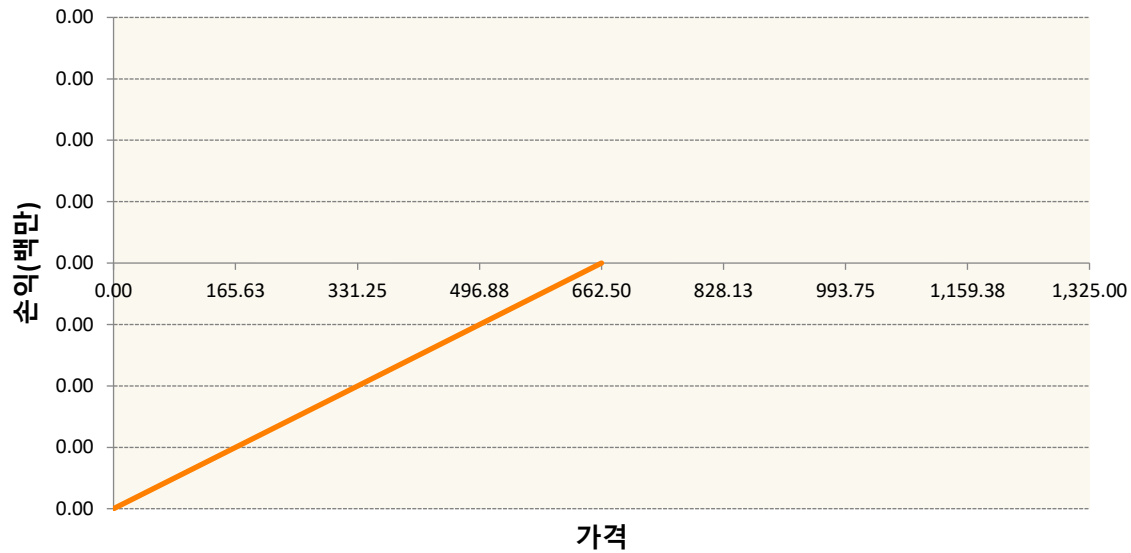
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	709	0	709	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,543	-32,543	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01626624-코스피200 P 202602 662.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016266 코스피200 C 202602 662.5

358

KR4B016266 코스피200 C 202602 665.0

1,716

KR4C016266 코스피200 P 202602 662.5

530

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-01-29

기준일 2026-01-28

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	2026-01-29
기준일	2026-01-28

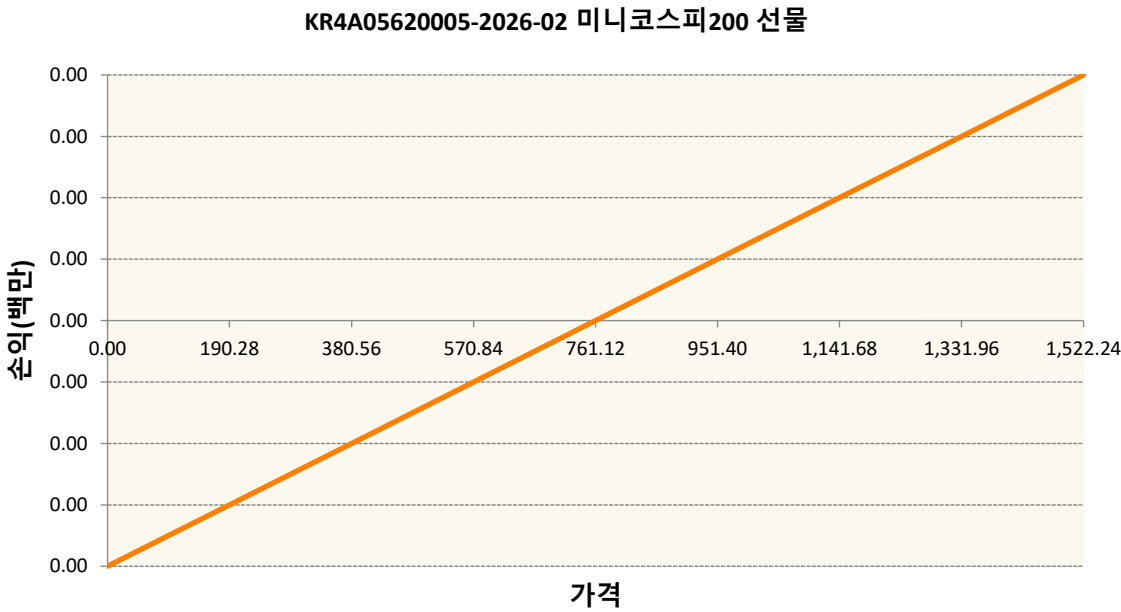
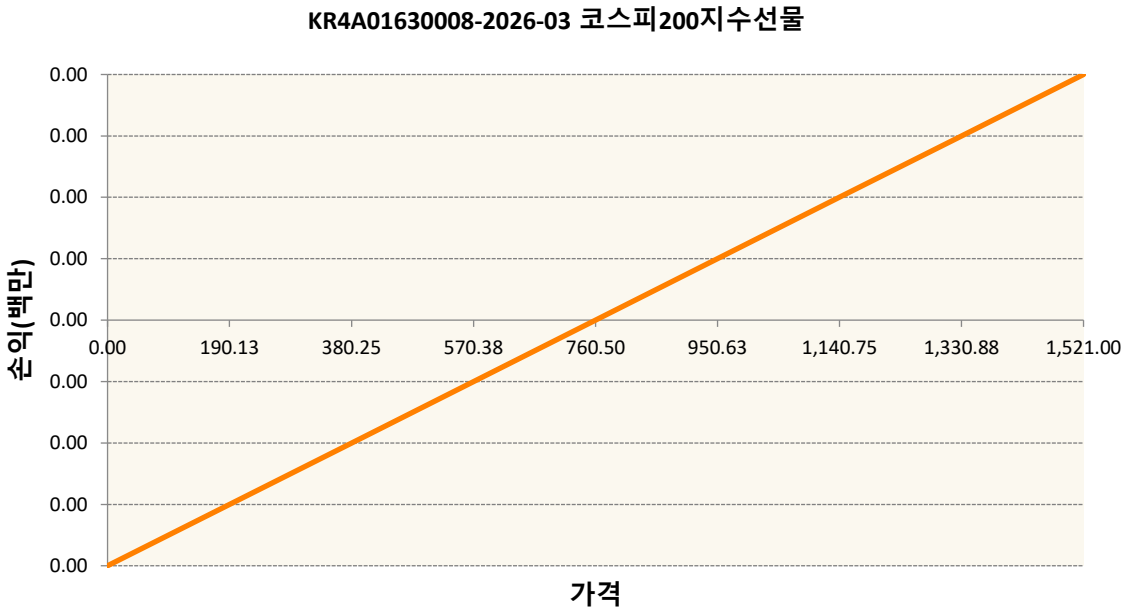
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

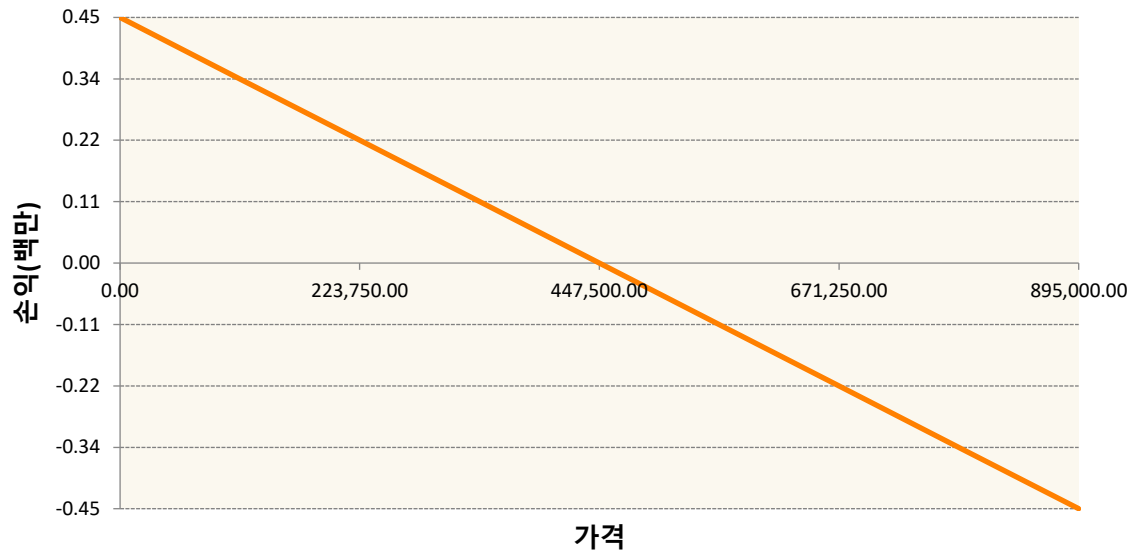
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	571	230	341	장내
누계	유가증권	선물	3,234	40	3,194	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A20620006-2026-02 현대모비스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물
 KR4A056200 2026-02 미니코스피200 선물
 KR4A206200 2026-02 현대모비스개별선물

76
37
3

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

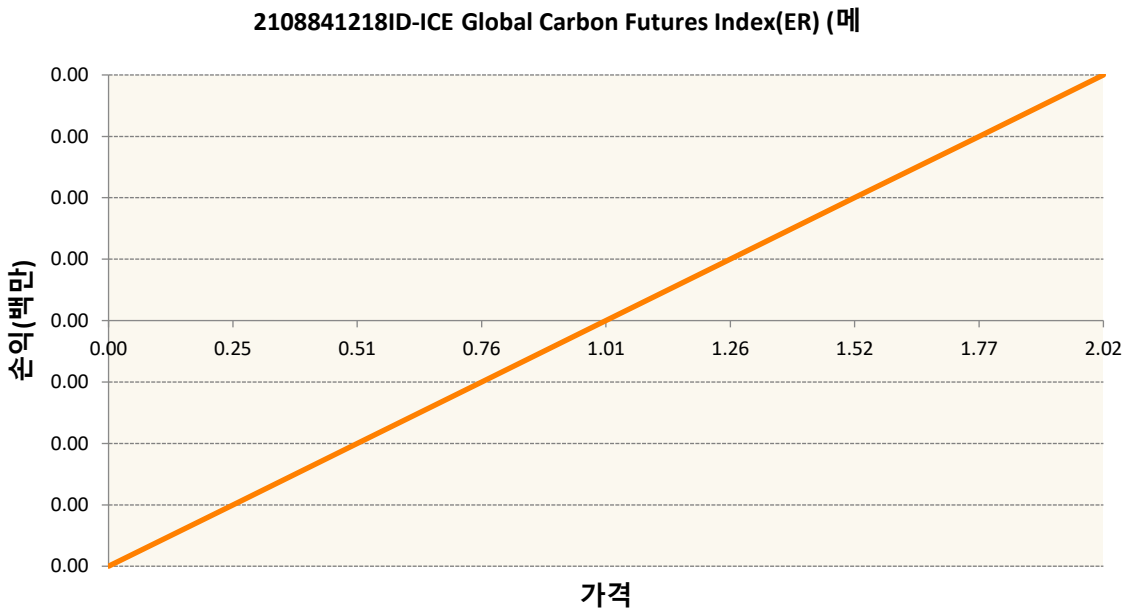
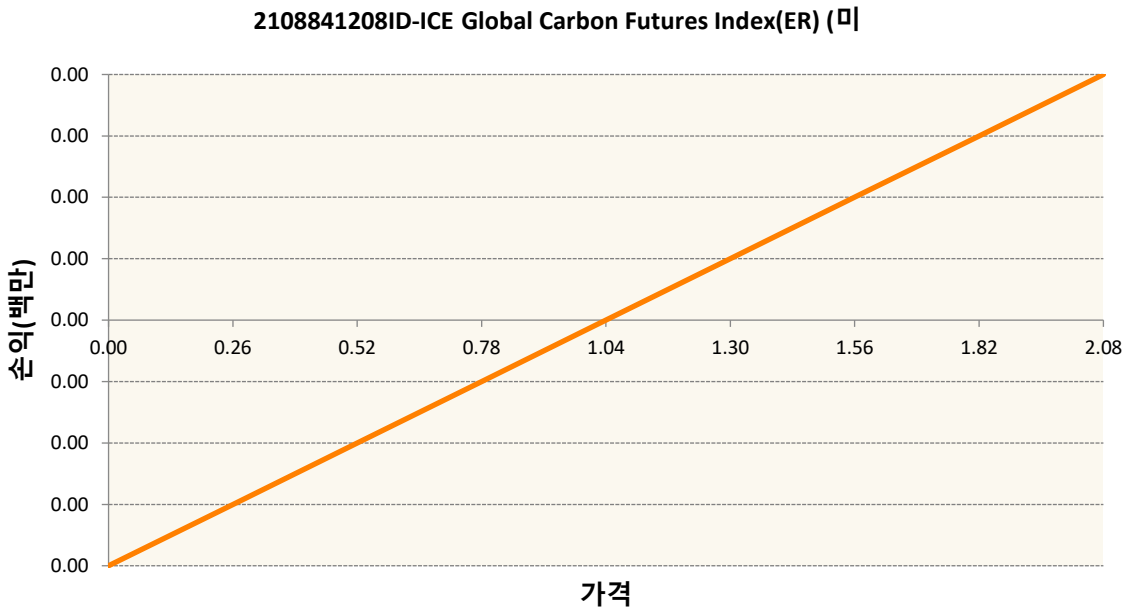
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,592	0	7,592	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		487
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		122

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	593

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

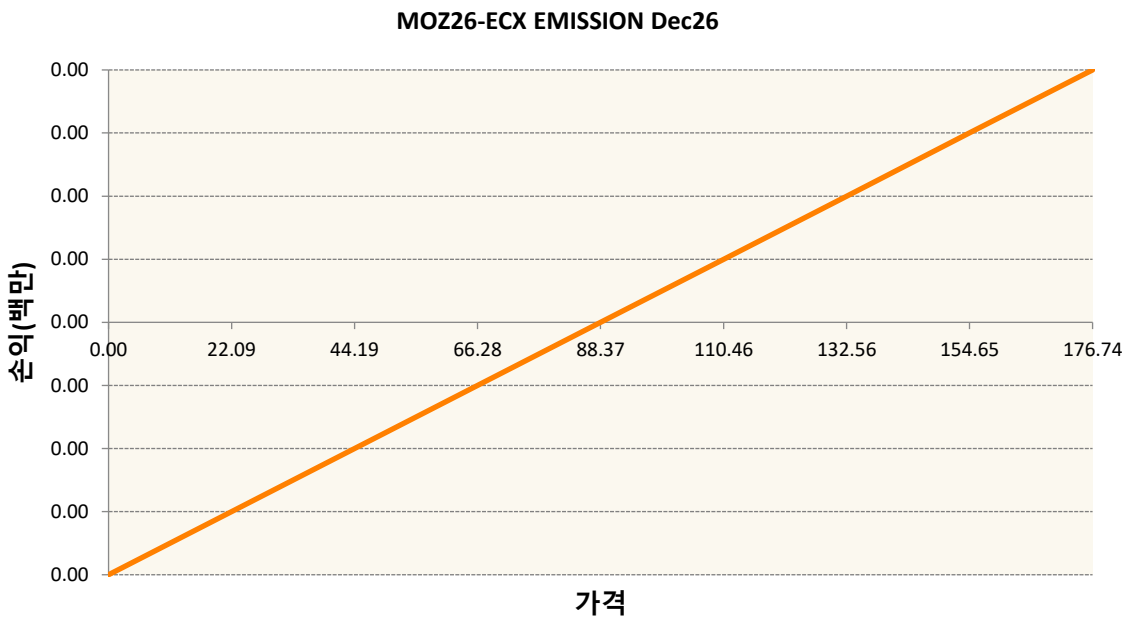
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,863	0	5,863	
누계	통화	선도	0	6,545	-6,545	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213FCP(KRW/EUR 30-01-26E	226
FXW213G1E(KRW/EUR 30-01-26E	42
FXW213G1V(KRW/EUR 27-02-26E	255
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	469

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

(단위:백만원)

944

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

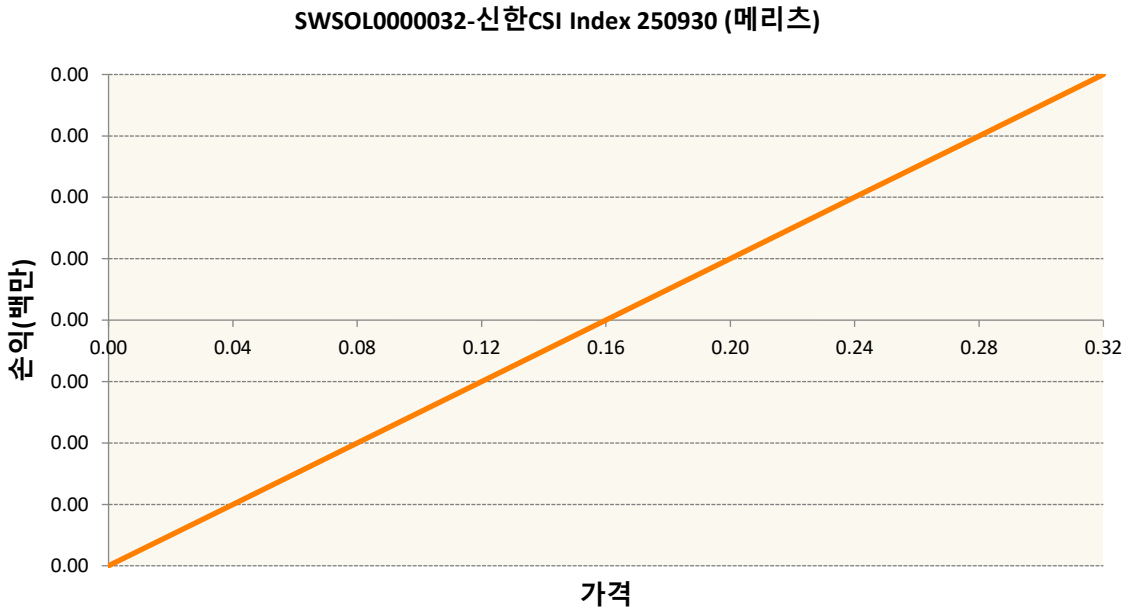
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,161	0	3,161	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	20
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	14
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	14
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	34

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

(단위:백만원)

144

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

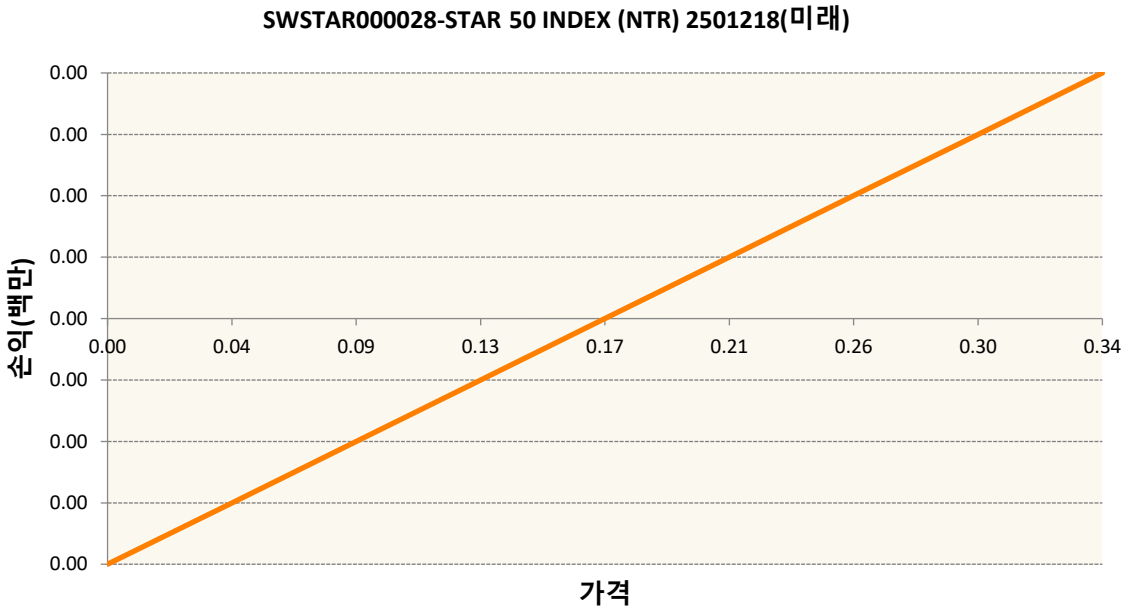
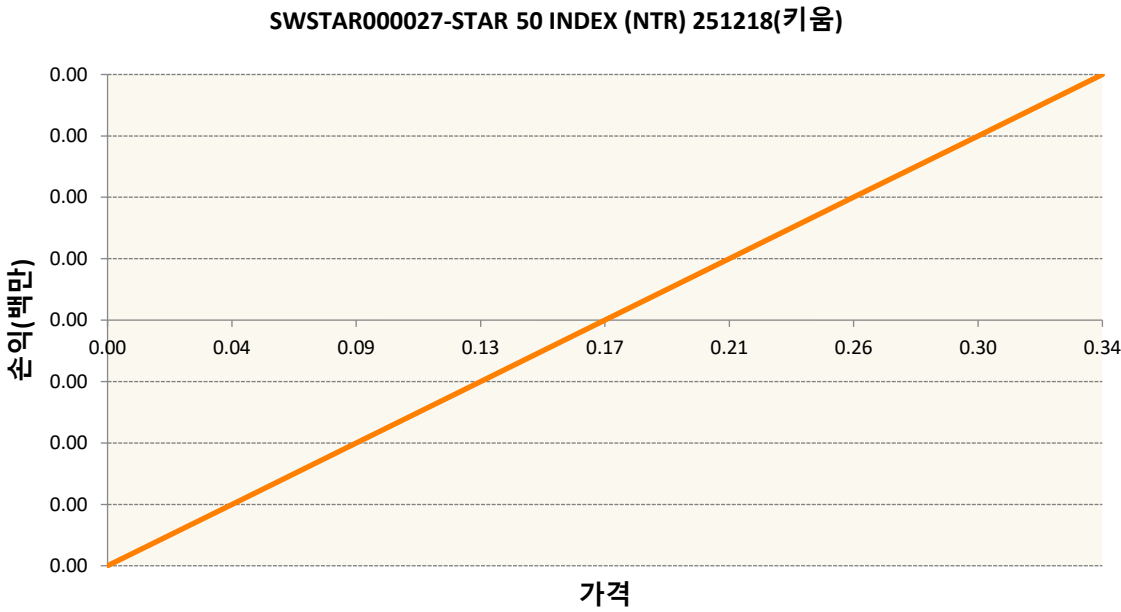
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

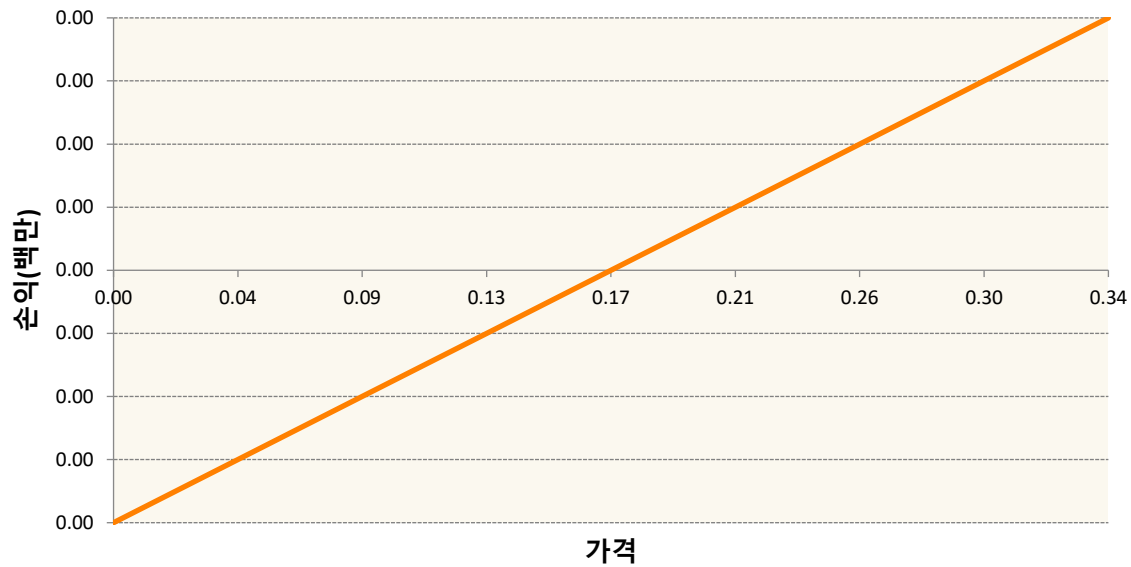
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,950	0	2,950	장외

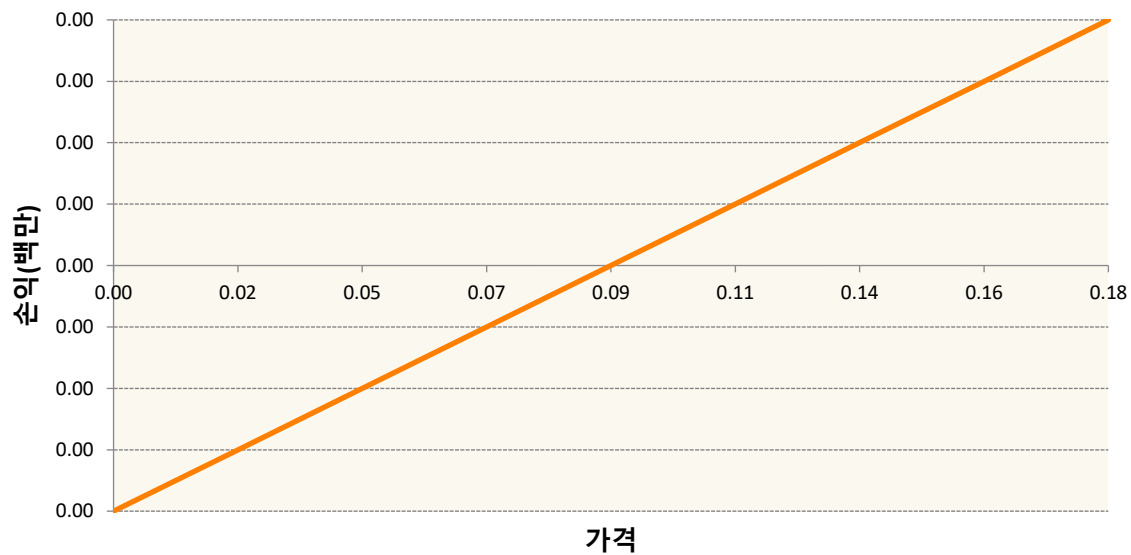
2. 만기시점의 손익구조



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))	11
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))	74
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))	38
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠))	117

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

(단위:백만원)

439

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

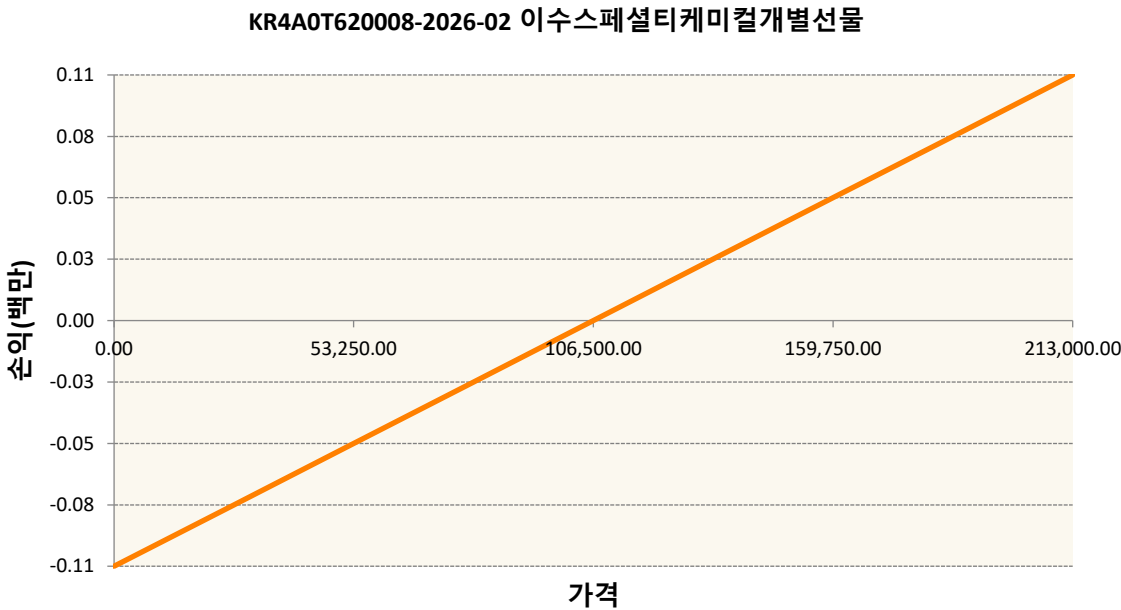
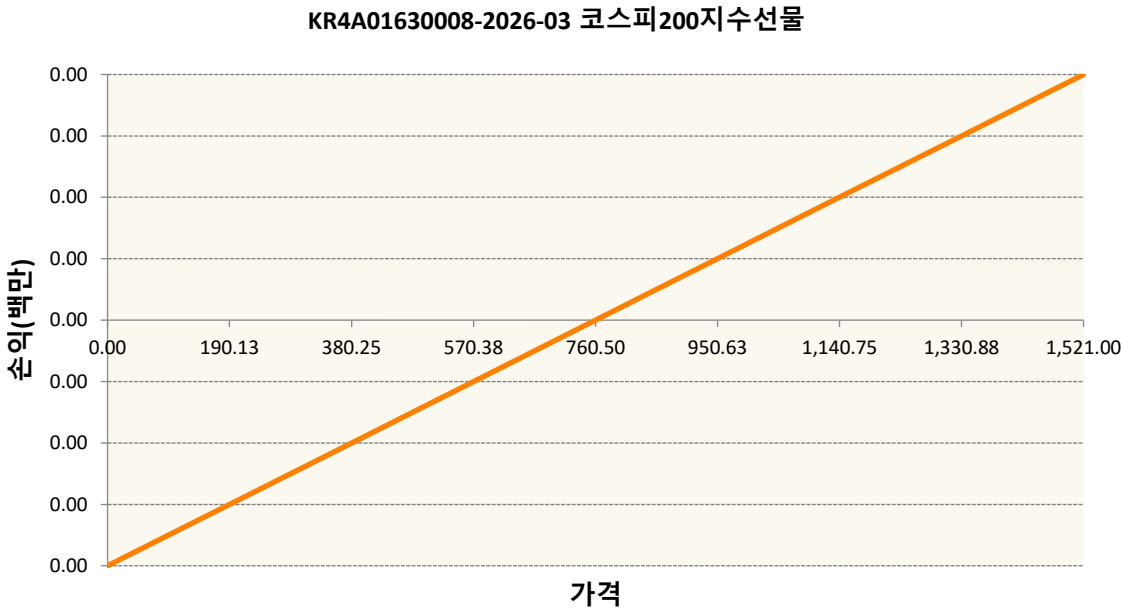
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

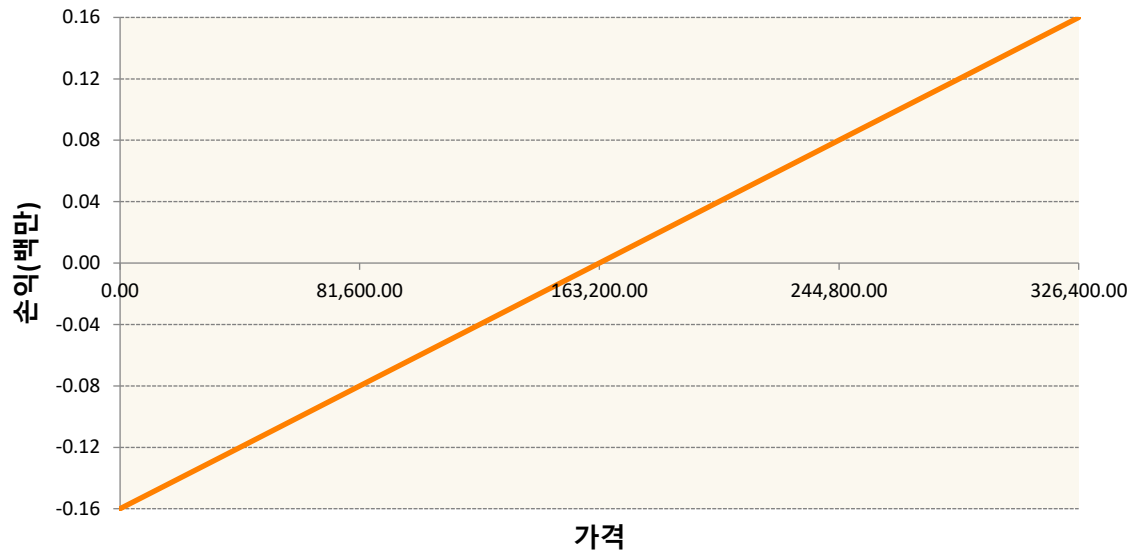
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,279	2,763	-484	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	13,807	5,169	8,638	장내
누계	유가증권	스왑	5	0	5	장외

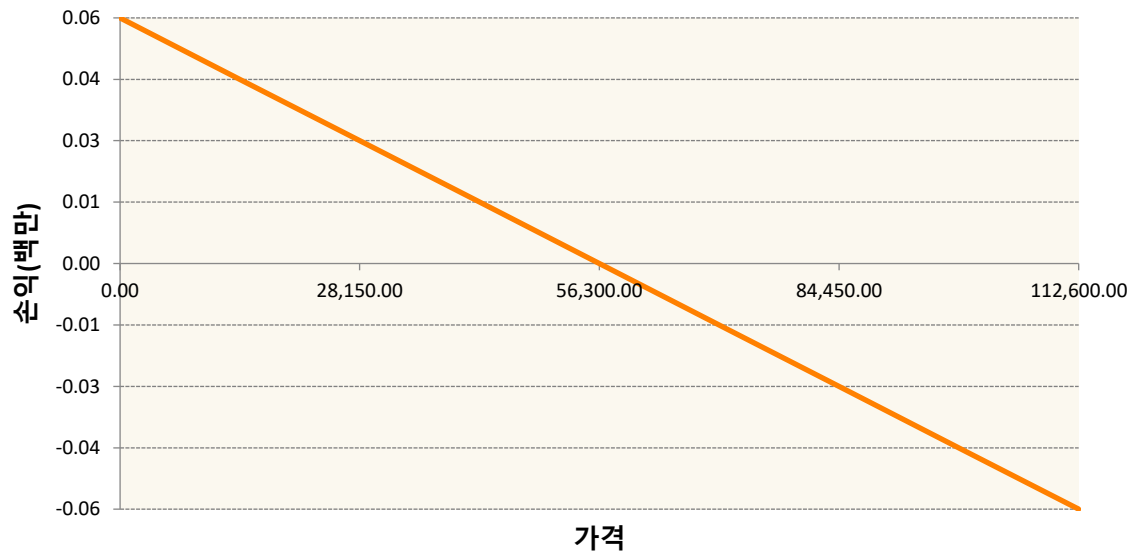
2. 만기시점의 손익구조



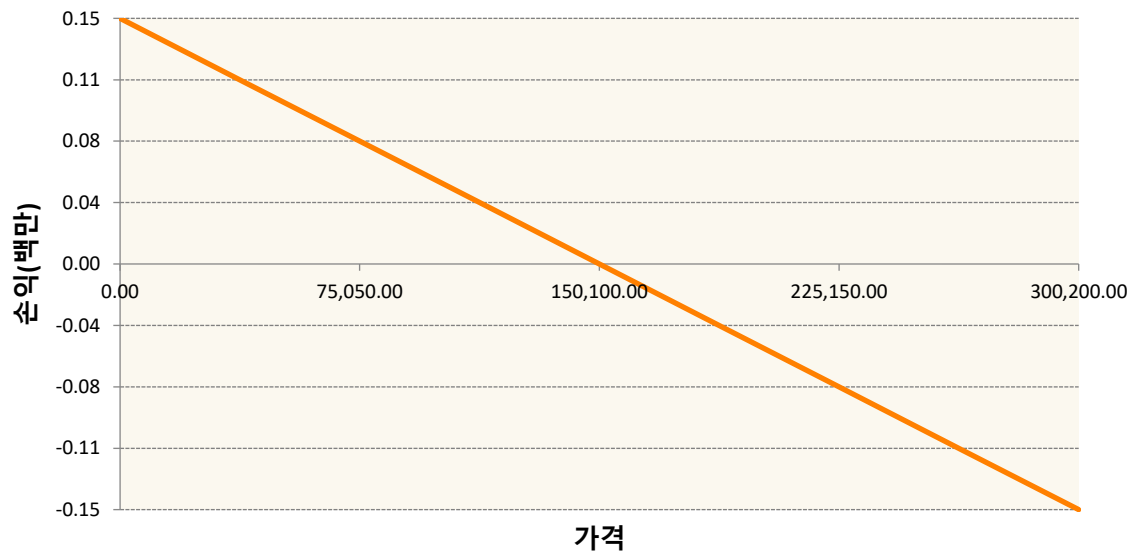
KR4A11620007-2026-02 삼성전자개별선물



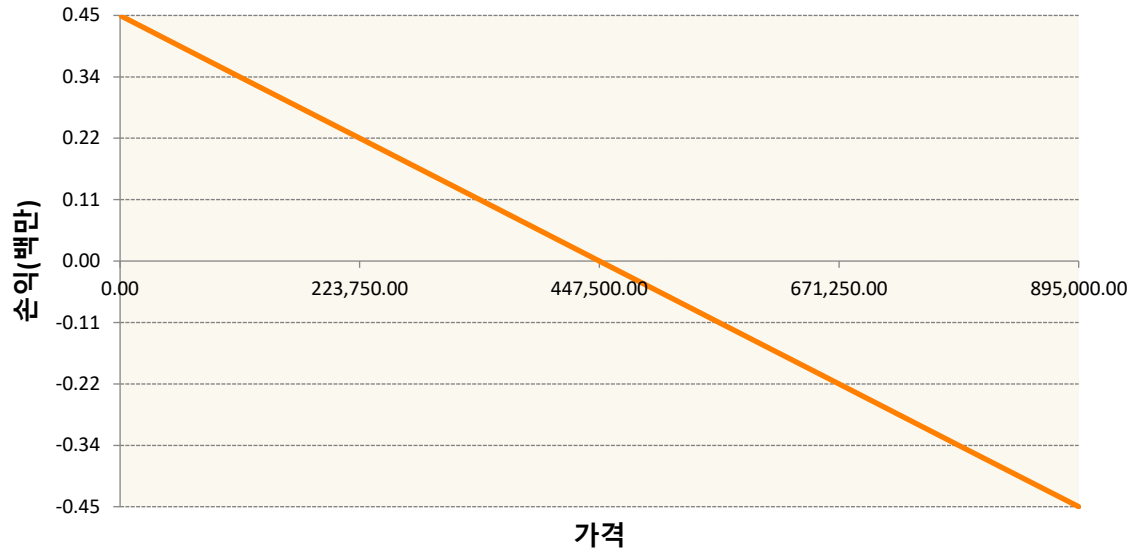
KR4A14620004-2026-02 KT개별선물



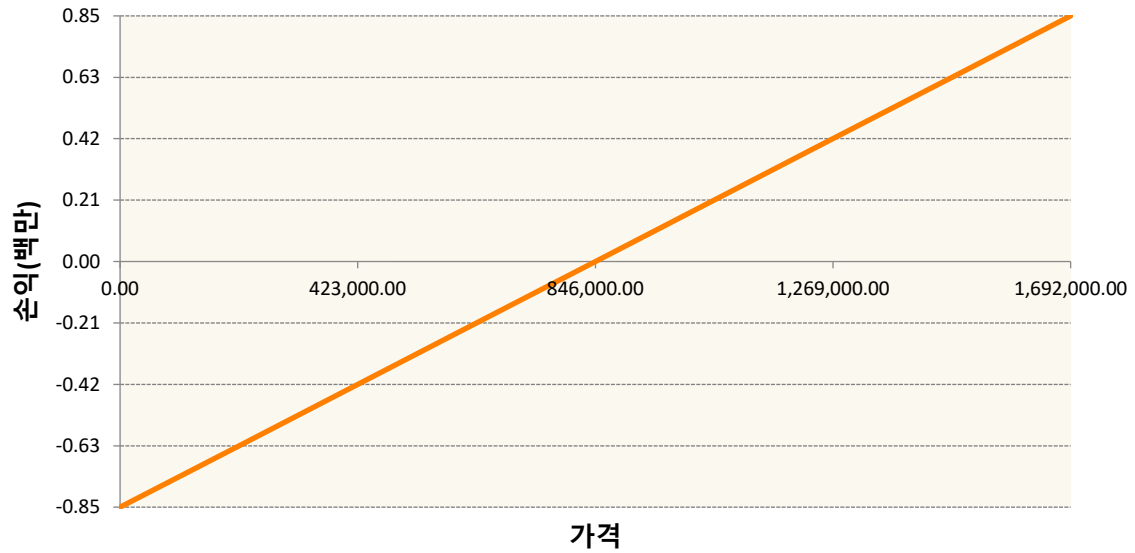
KR4A19620009-2026-02 기아개별선물



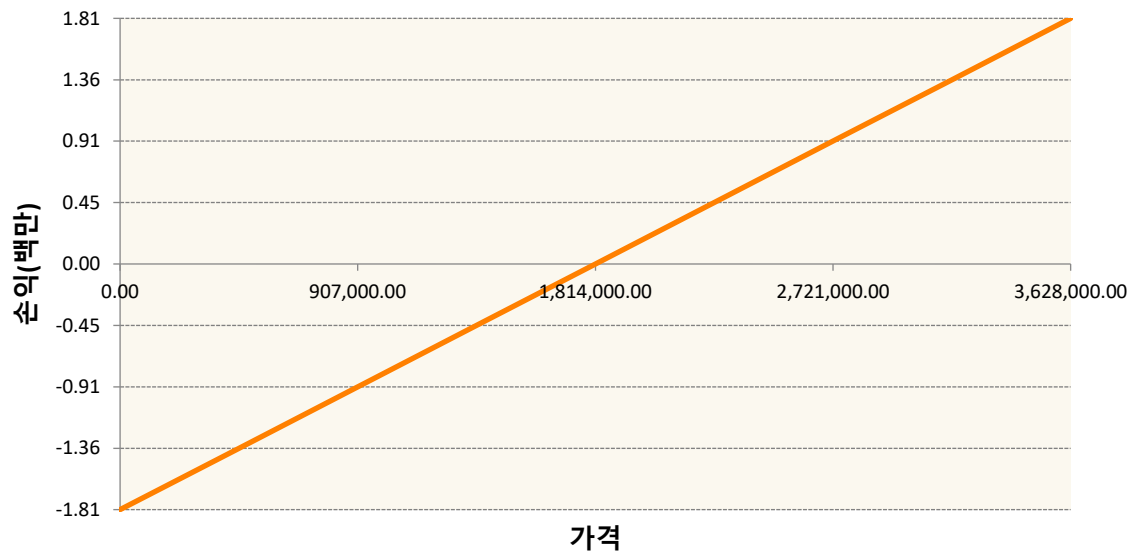
KR4A20620006-2026-02 현대모비스개별선물



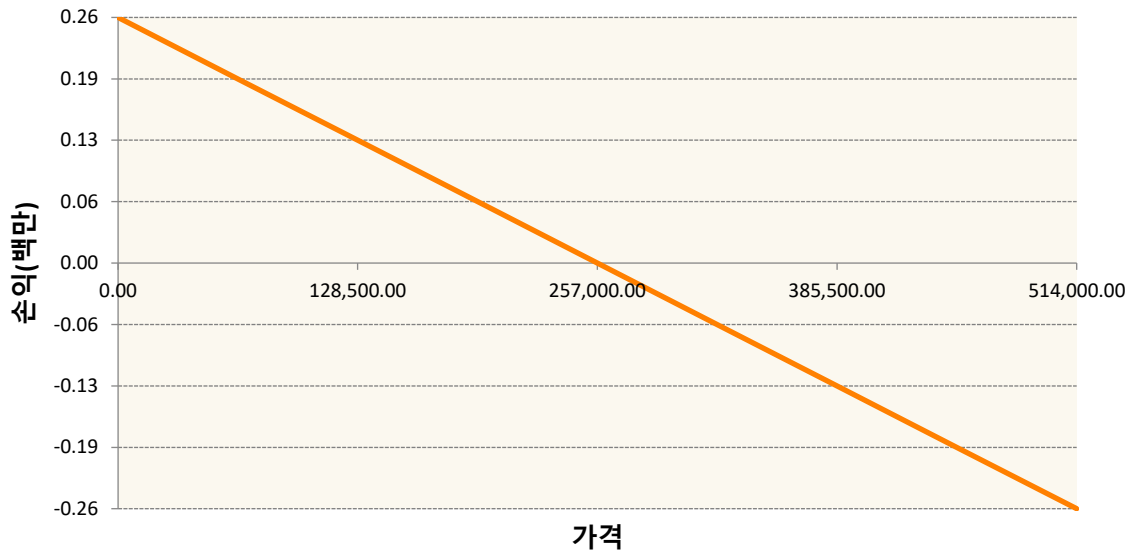
KR4A50620009-2026-02 SK하이닉스개별선물



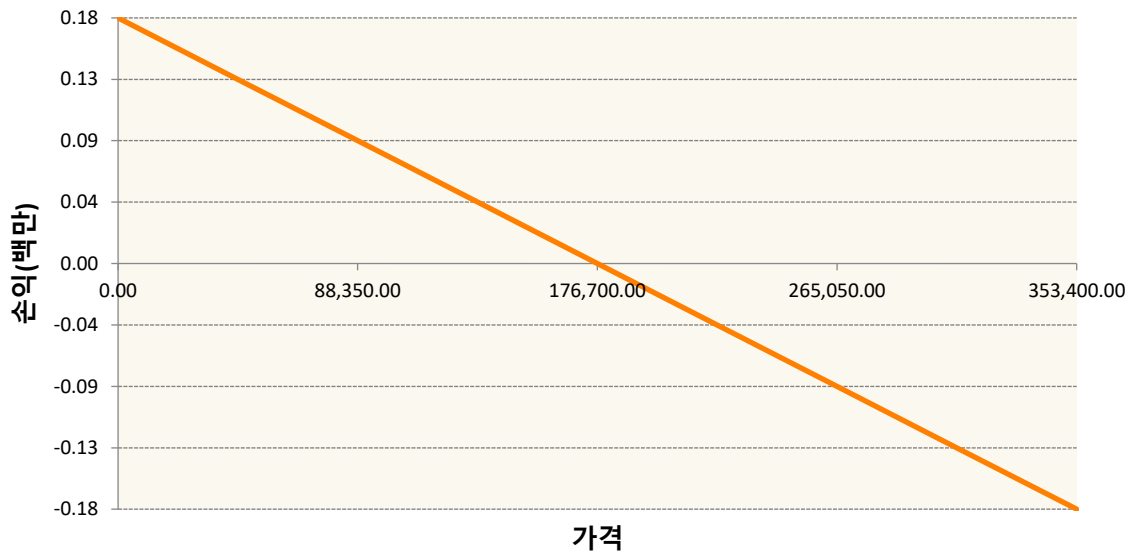
KR4AB3620005-2026-02 고려아연개별선물



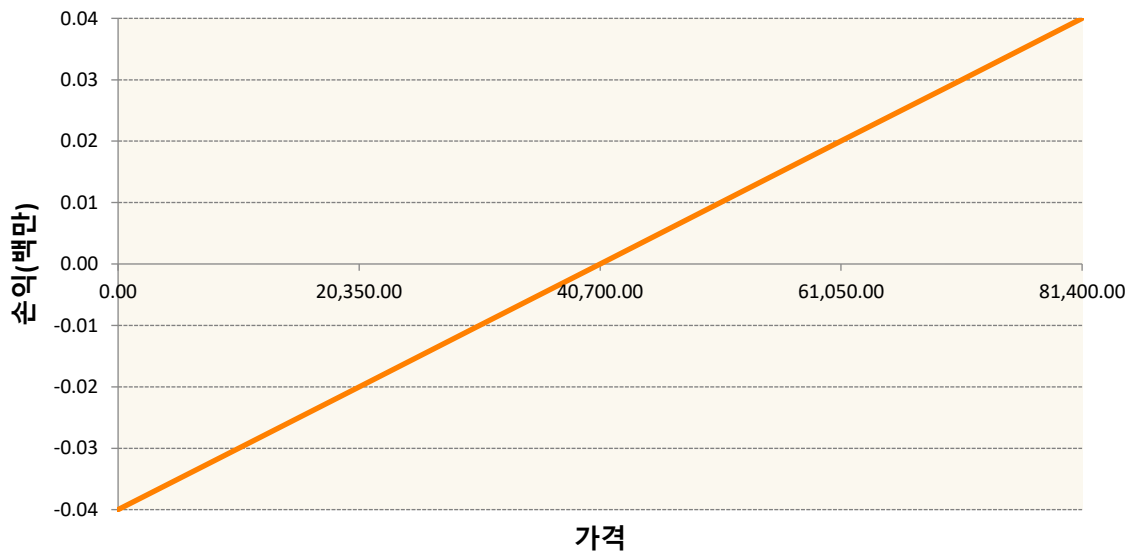
KR4ABY620007-2026-02 LG이노텍개별선물



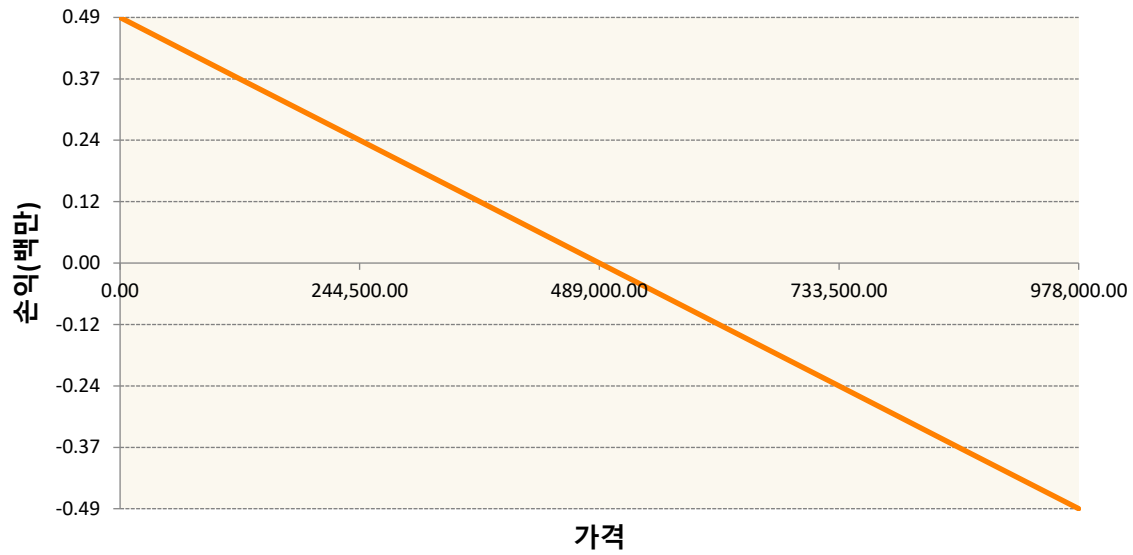
KR4AC5620001-2026-02 삼성에스디에스개별선물



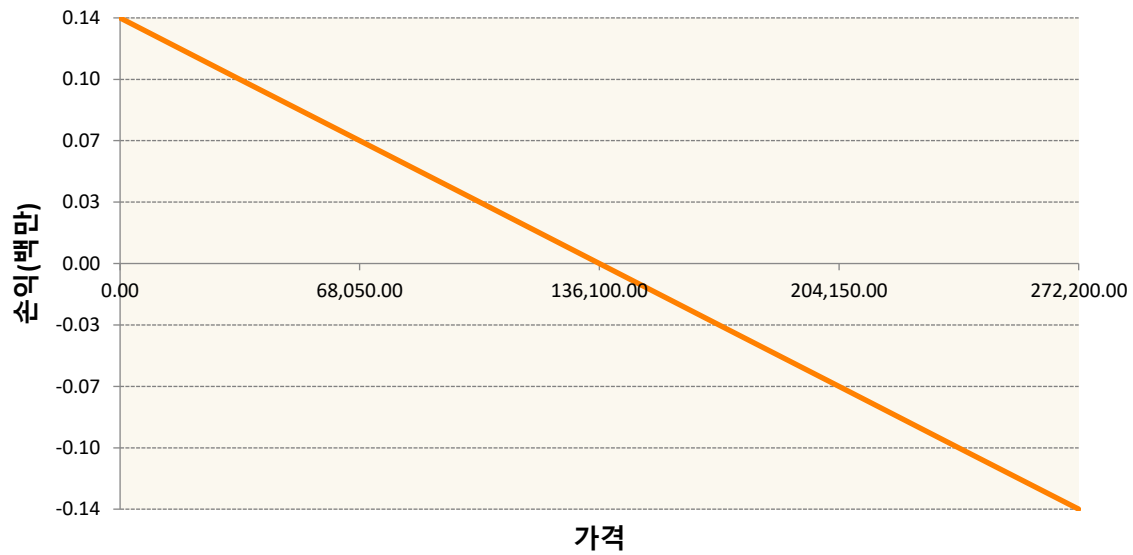
KR4ACN620009-2026-02 포스코DX개별선물



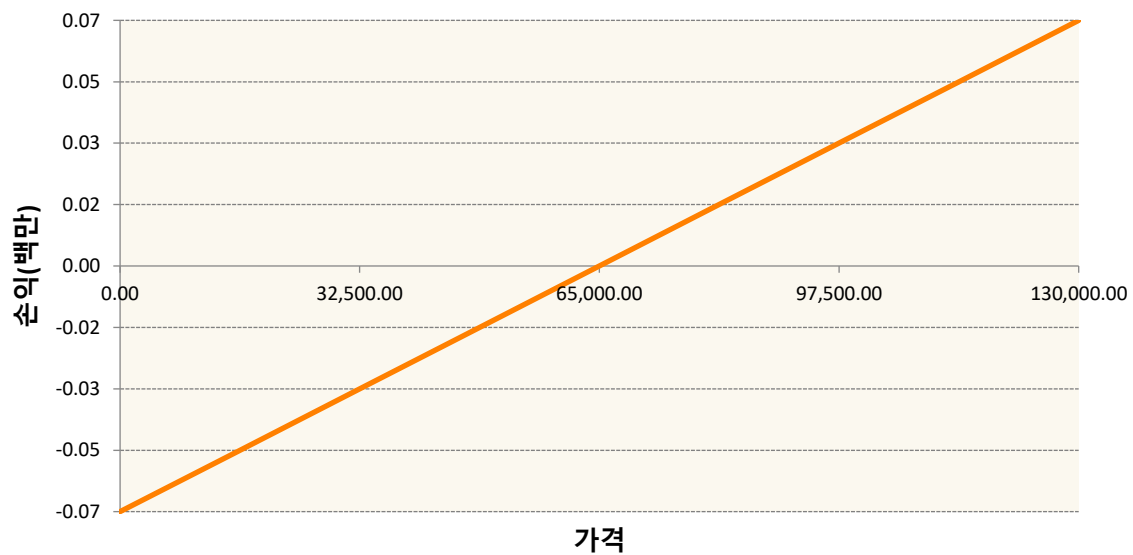
KR4ACT620003-2026-02 삼성화재개별선물



KR4AD0620004-2026-02 DB손해보험개별선물



KR4AF7620002-2026-02 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01630008							2026-03 코스피200지수선물		744	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-744	-744	-744	-744	-744	-744	-744	-744		
-5.33%	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496		
-2.67%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	248	248	248	248	248	248	248	248		
5.33%	496	496	496	496	496	496	496	496		
8.00%	744	744	744	744	744	744	744	744		
KR4A11620007								2026-02 삼성전자개별선물		108
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108		
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72		
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	36	36	36	36	36	36	36	36		
5.33%	72	72	72	72	72	72	72	72		
8.00%	108	108	108	108	108	108	108	108		
KR4A14620004								2026-02 KT개별선물		67
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	67	67	67	67	67	67	67	67		
-5.33%	45	45	45	45	45	45	45	45		
-2.67%	22	22	22	22	22	22	22	22		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22		
5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45		
8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67		
KR4A19620009								2026-02 기아개별선물		80
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	80	80	80	80	80	80	80	80		
-5.33%	53	53	53	53	53	53	53	53		
-2.67%	27	27	27	27	27	27	27	27		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27		
5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53		
8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80		
KR4A20620006								2026-02 현대모비스개별선물		79

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	79	79	79	79	79	79	79
-5.33%	53	53	53	53	53	53	53
-2.67%	26	26	26	26	26	26	26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79

KR4A50620009 2026-02 SK하이닉스개별선물 101

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	34	34	34	34	34	34	34
5.33%	67	67	67	67	67	67	67
8.00%	101	101	101	101	101	101	101

KR4AB3620005 2026-02 고려아연개별선물 125

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-5.33%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	42	42	42	42	42	42	42
5.33%	84	84	84	84	84	84	84
8.00%	125	125	125	125	125	125	125

KR4ABY620007 2026-02 LG이노텍개별선물 38

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	38	38	38	38	38	38	38
-5.33%	26	26	26	26	26	26	26
-2.67%	13	13	13	13	13	13	13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38

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%	47	47	47	47	47	47	47
-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%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70

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

45

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	45	45	45	45	45	45	45
-5.33%	30	30	30	30	30	30	30
-2.67%	15	15	15	15	15	15	15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45

KR4AD0620004

2026-02 DB손해보험개별선물

33

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33
-5.33%	22	22	22	22	22	22	22
-2.67%	11	11	11	11	11	11	11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33

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)

1,763

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

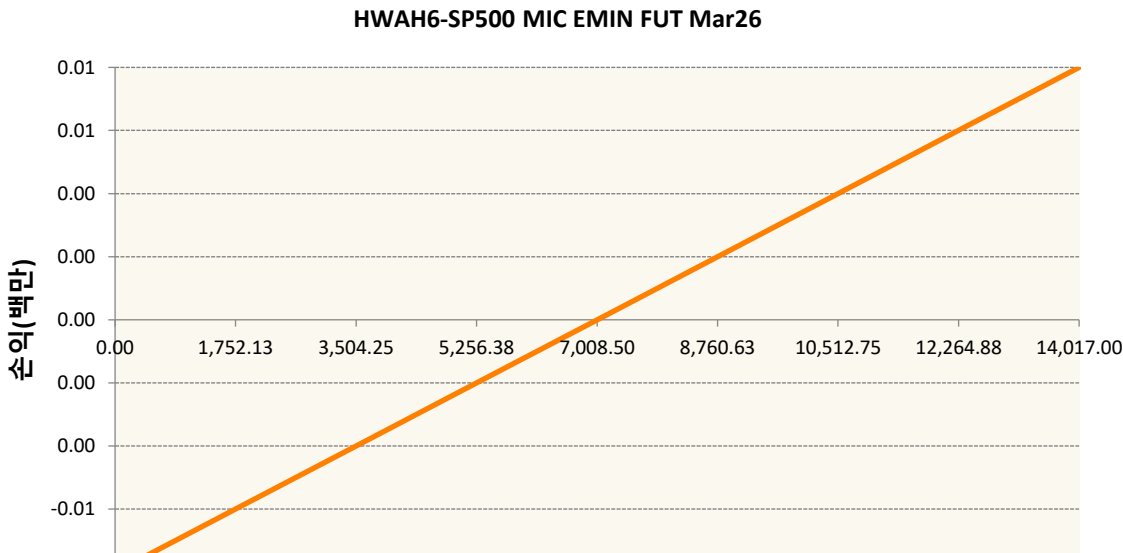
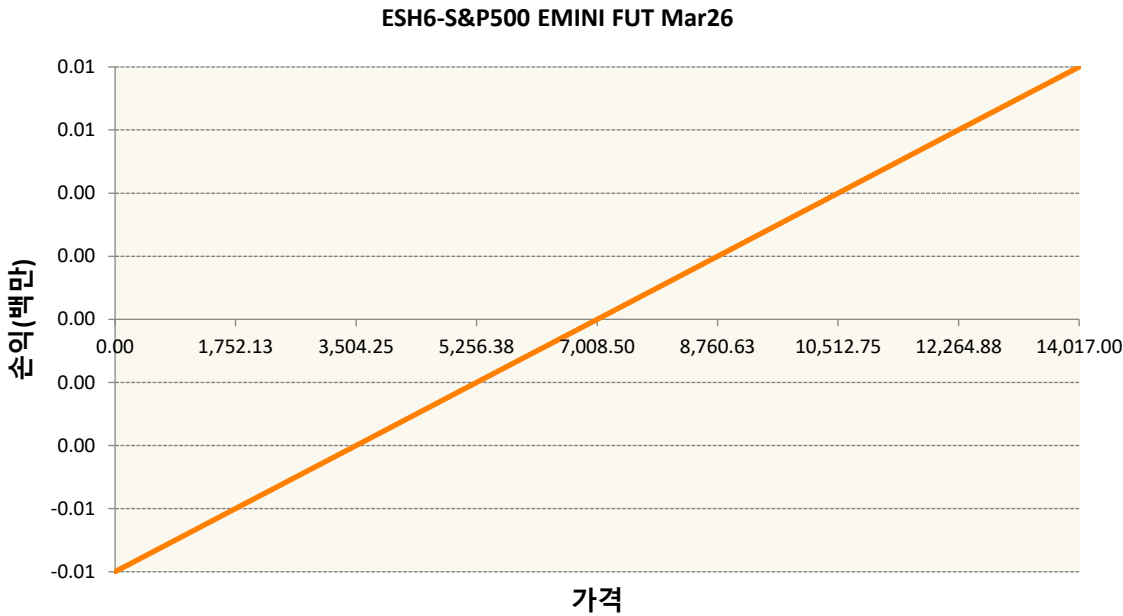
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

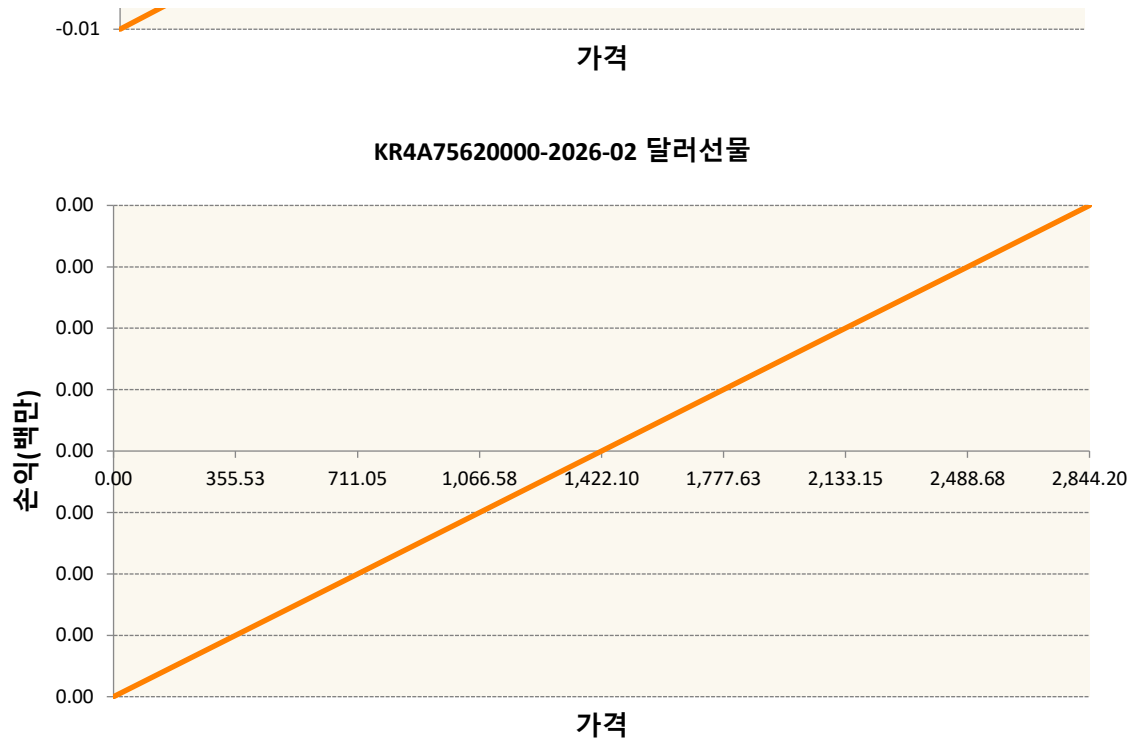
1. 계약금액

(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	1,139	0	1,139	장내
누계	지수	선물	55,755	0	55,755	
누계	통화	선물	4,266	0	4,266	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26		4,460
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26		91
KR4A756200 2026-02 달러선물			341

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,908

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

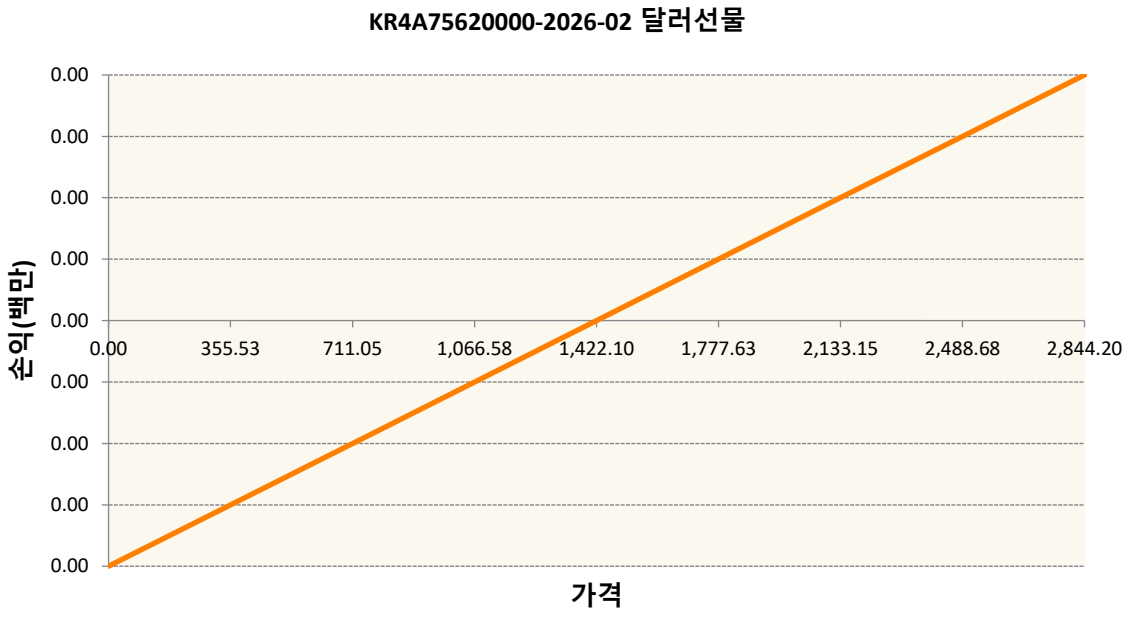
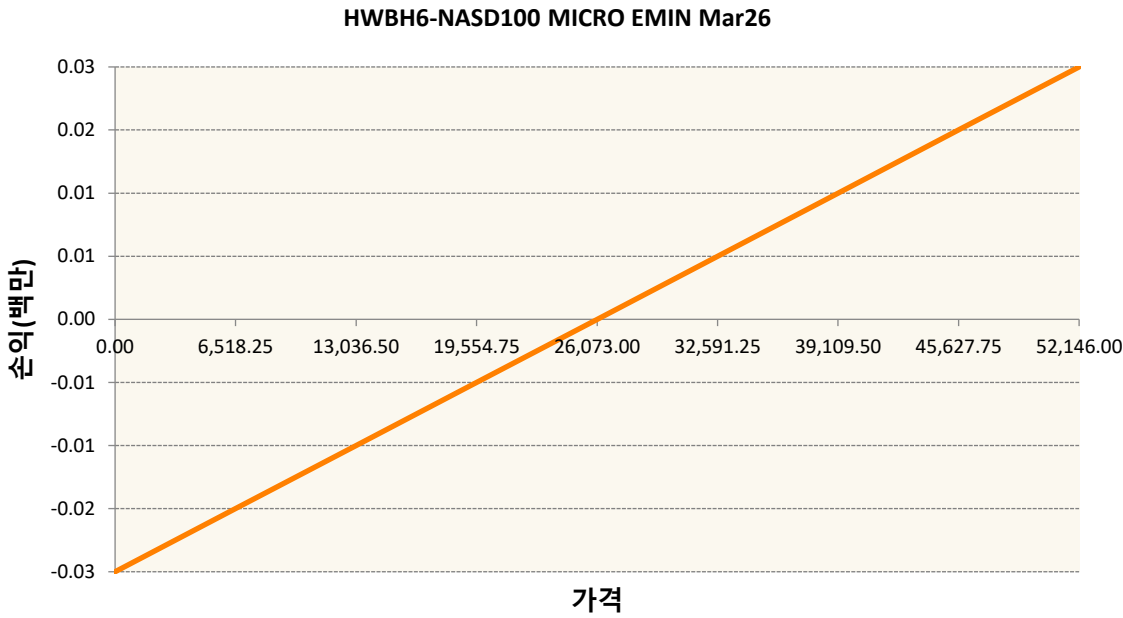
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

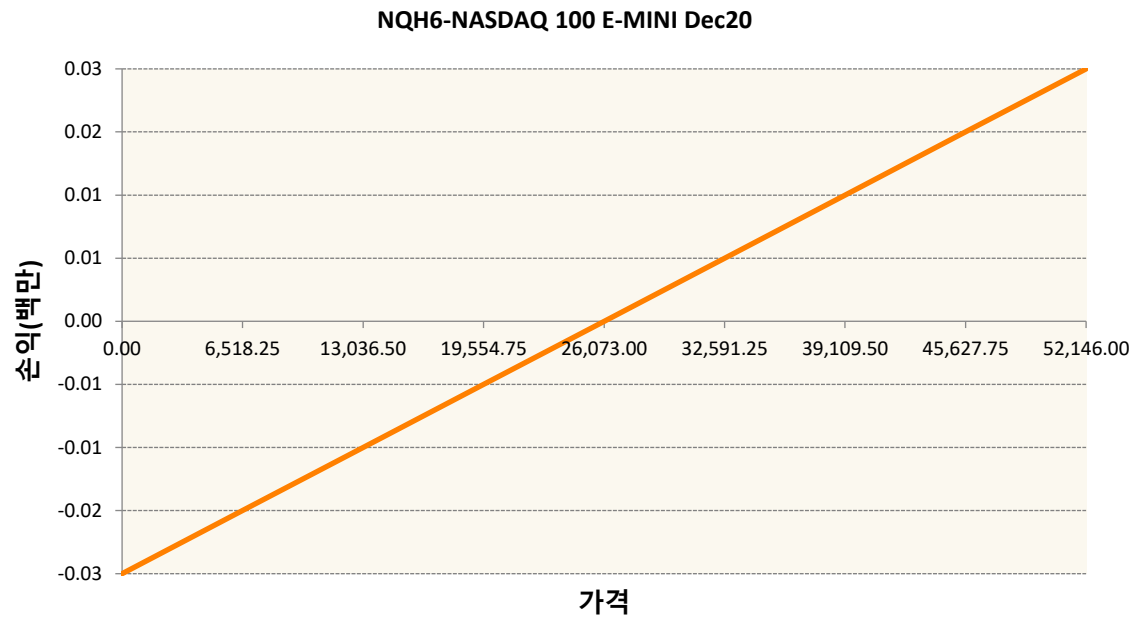
1. 계약금액

(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	25,517	0	25,517	장내
누계	통화	선물	1,564	0	1,564	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN Mar26		74
KR4A756200	2026-02 달러선물		125
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,968

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,225

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

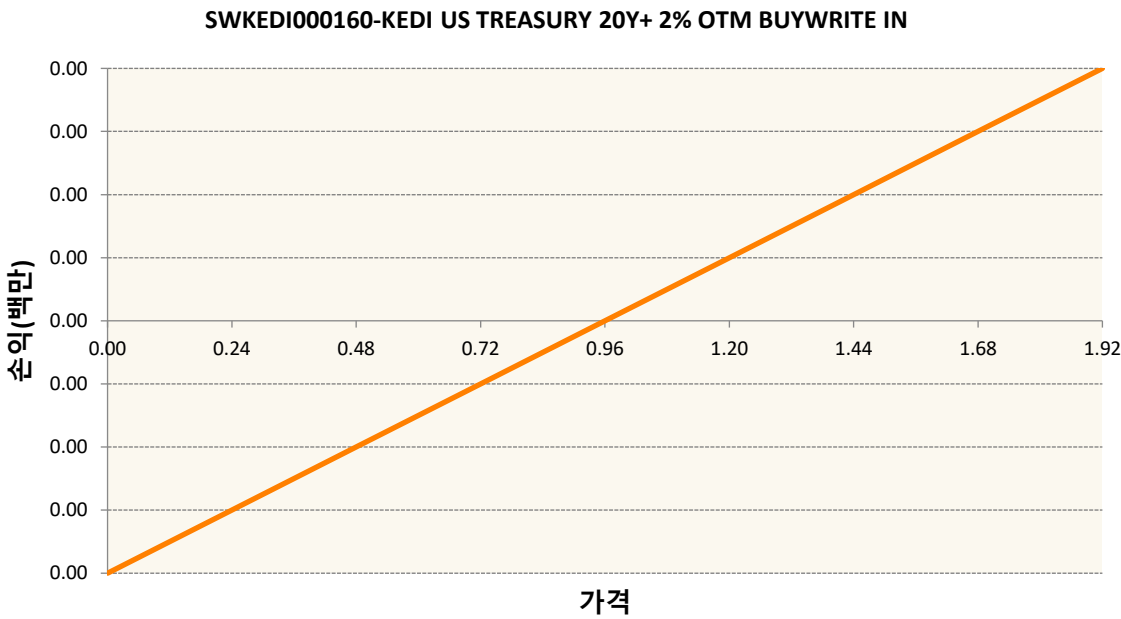
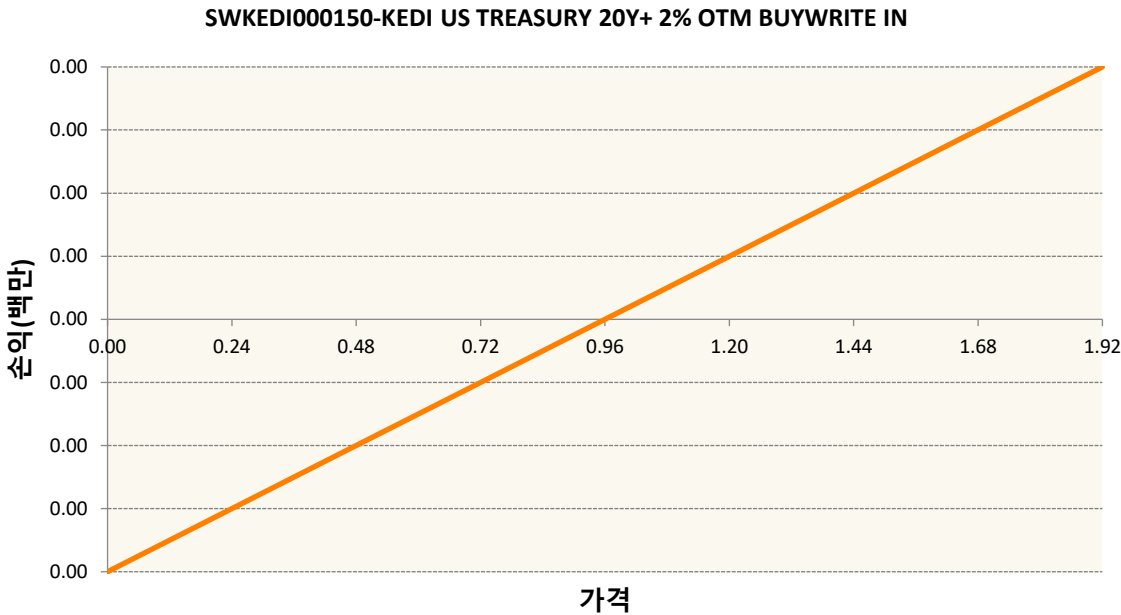
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

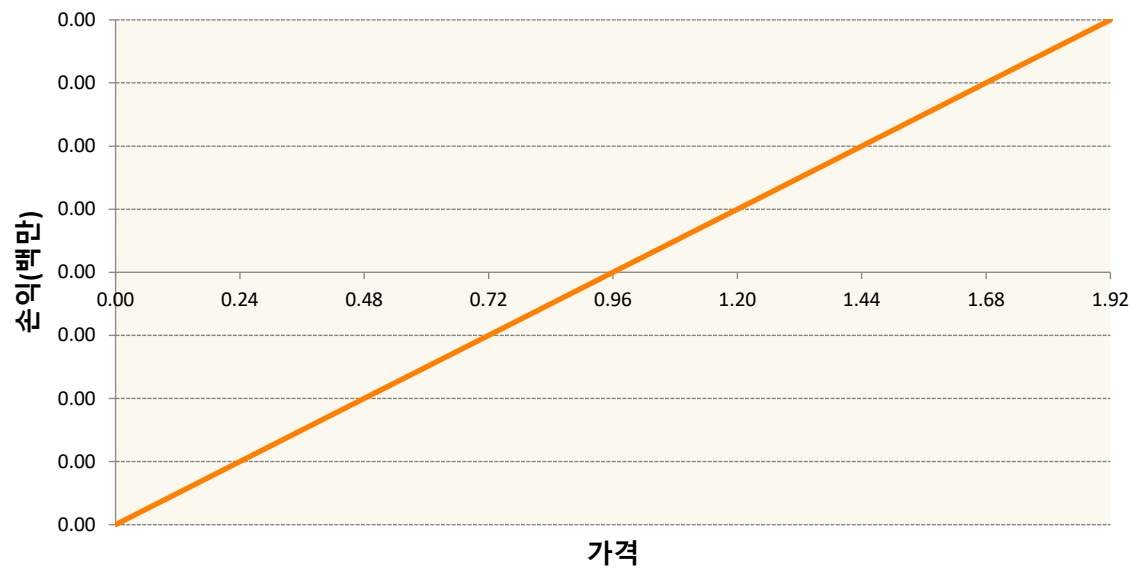
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	375,563	0	375,563	장외

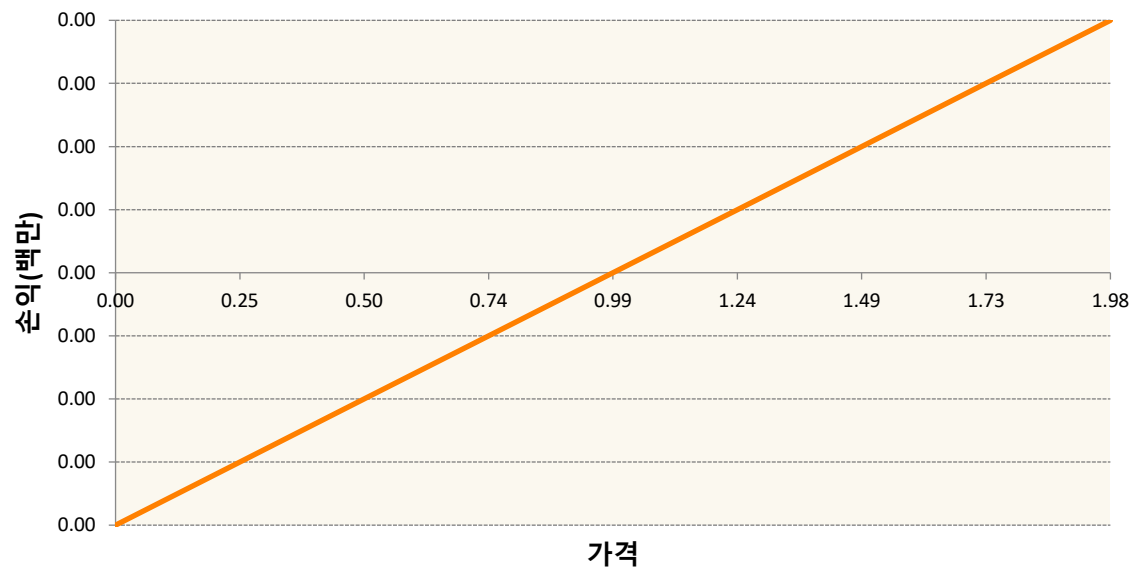
2. 만기시점의 손익구조



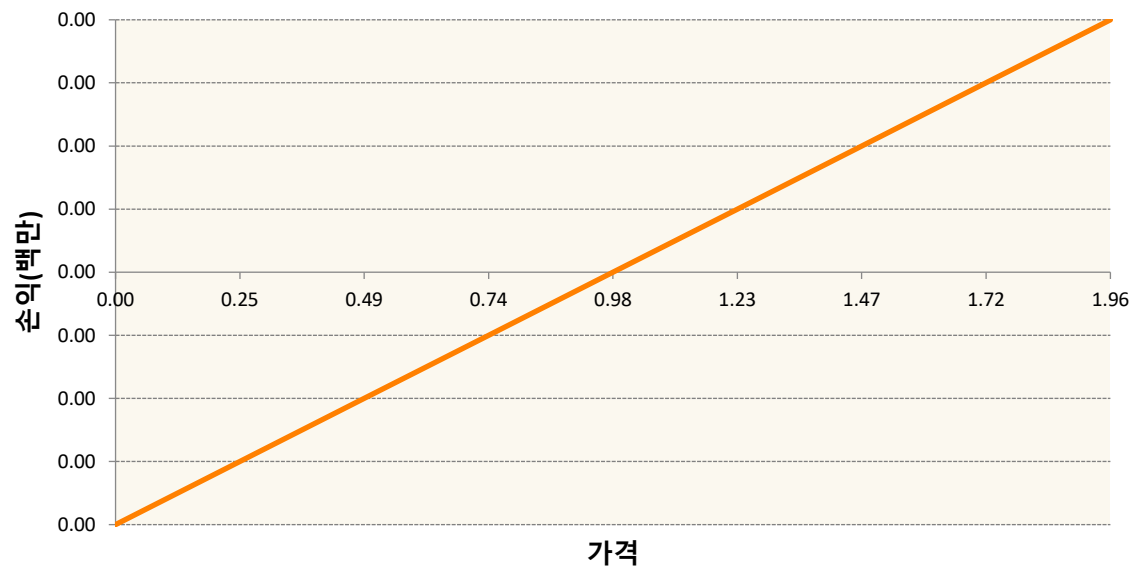
SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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



SWKEDI000166-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,955
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,094
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,563
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		144
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		10,370

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,717

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

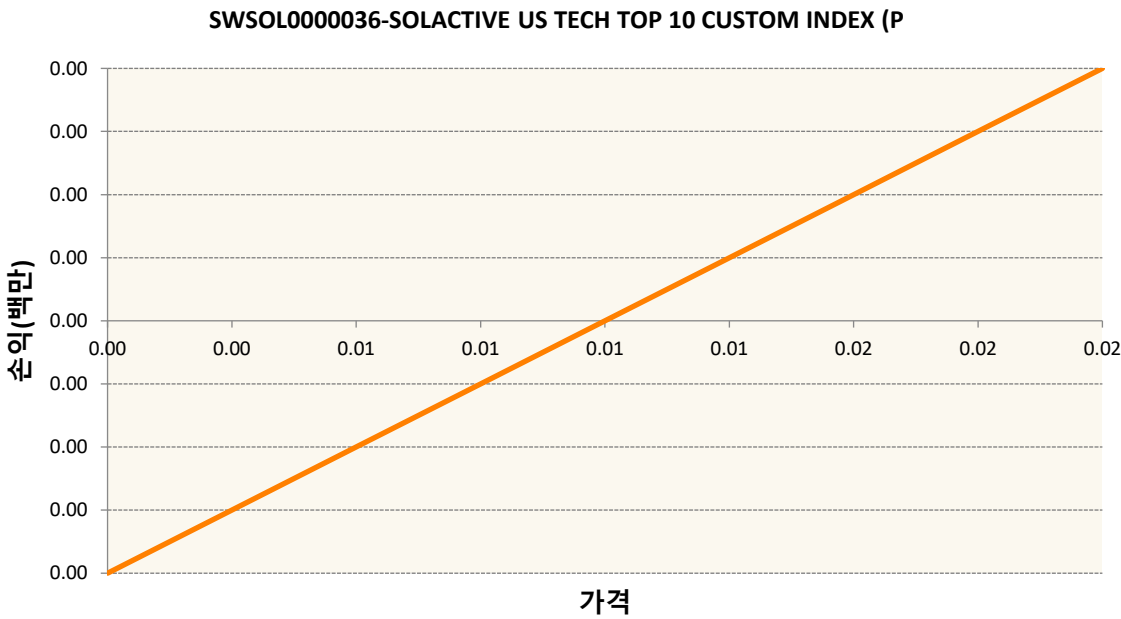
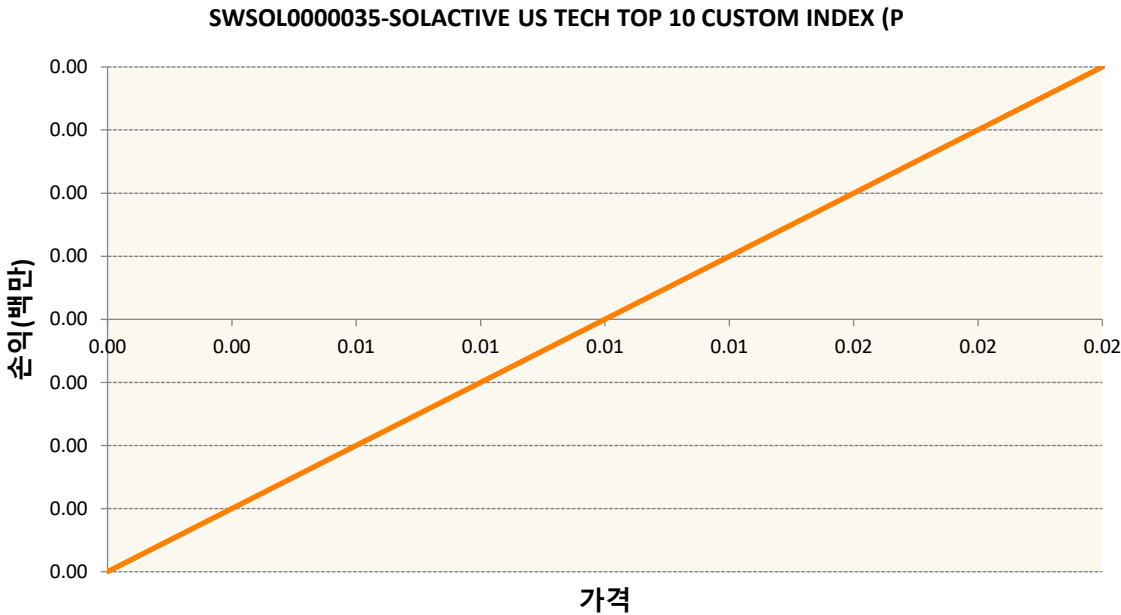
SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

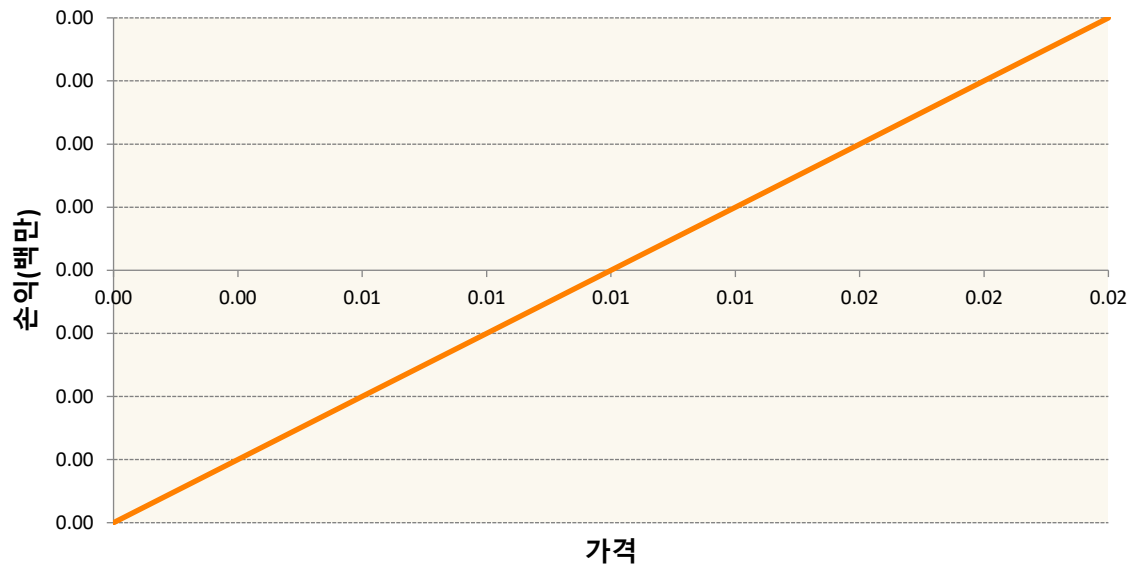
(단위:백만원)

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

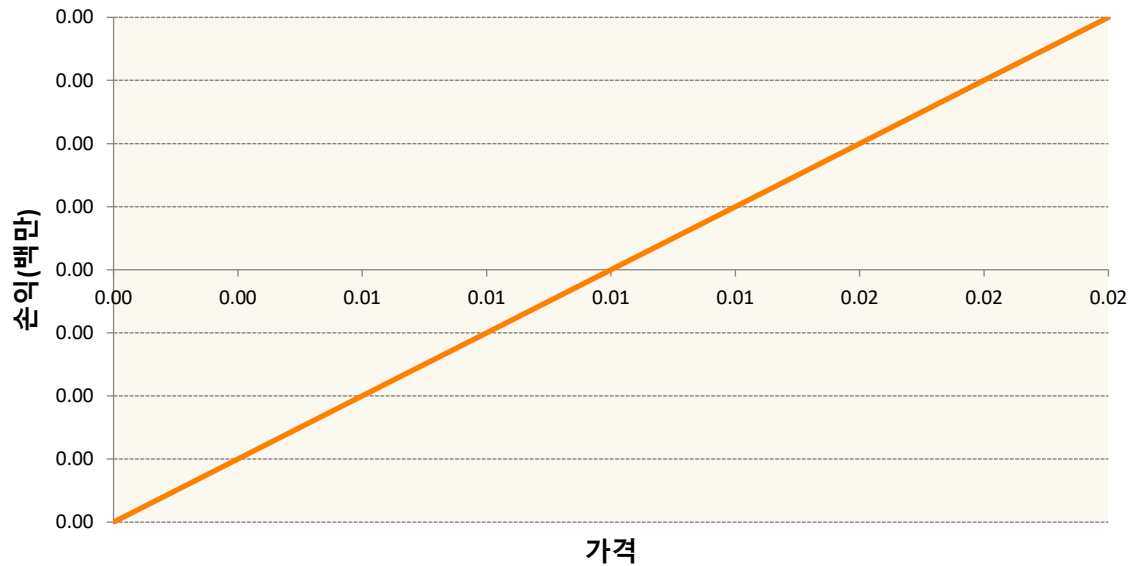
2. 만기시점의 손익구조



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)

4

공시일	2026-01-29
기준일	2026-01-28

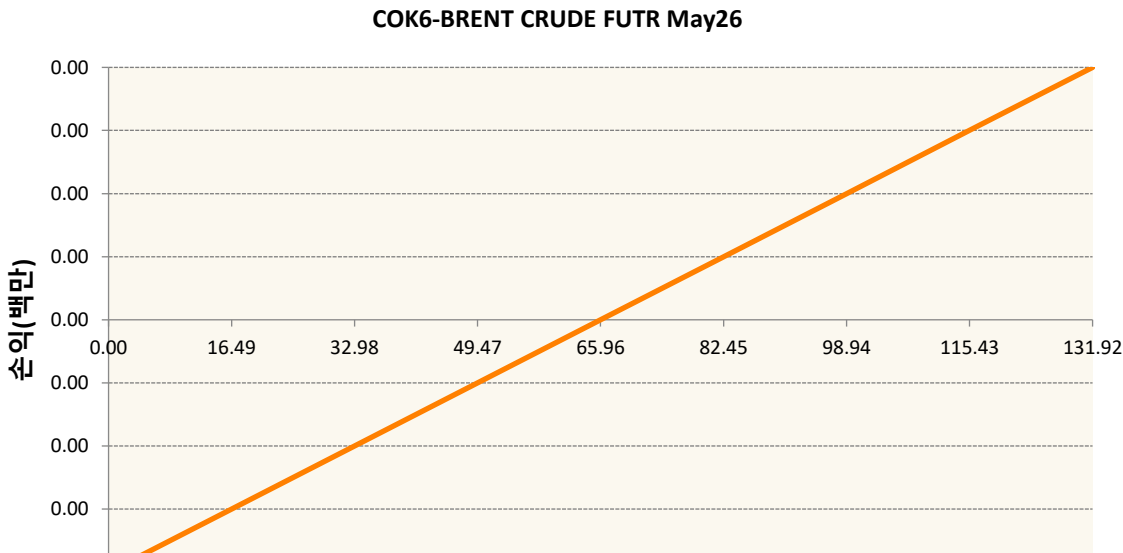
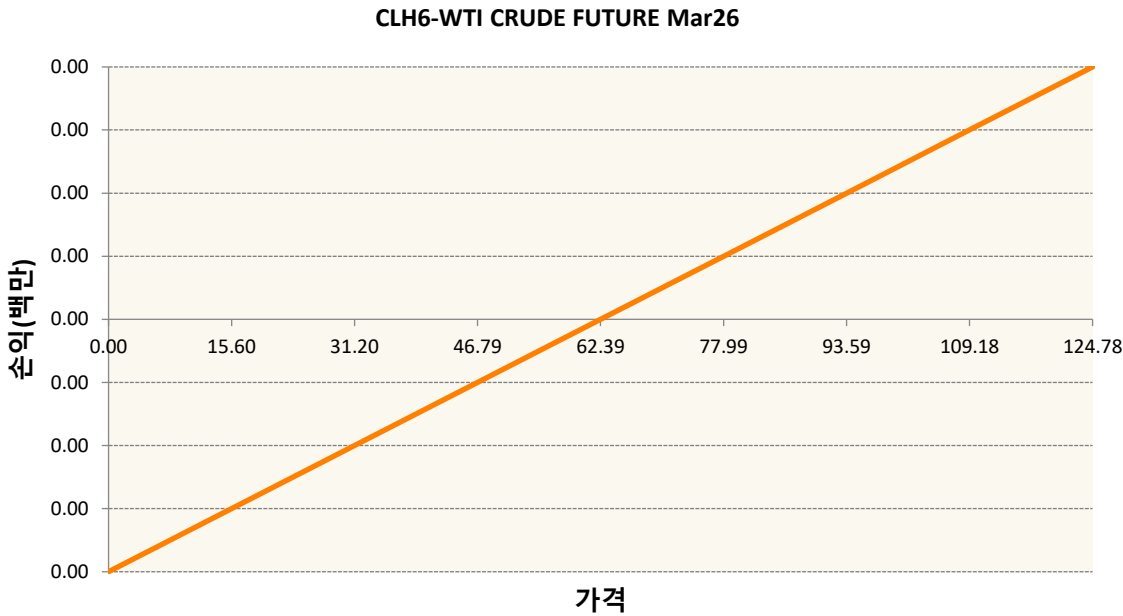
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

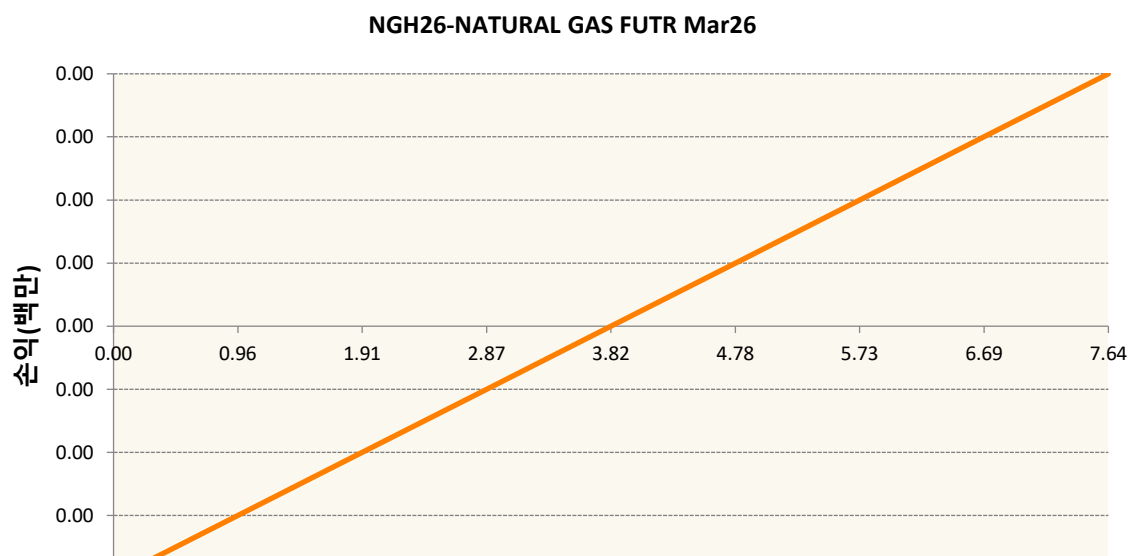
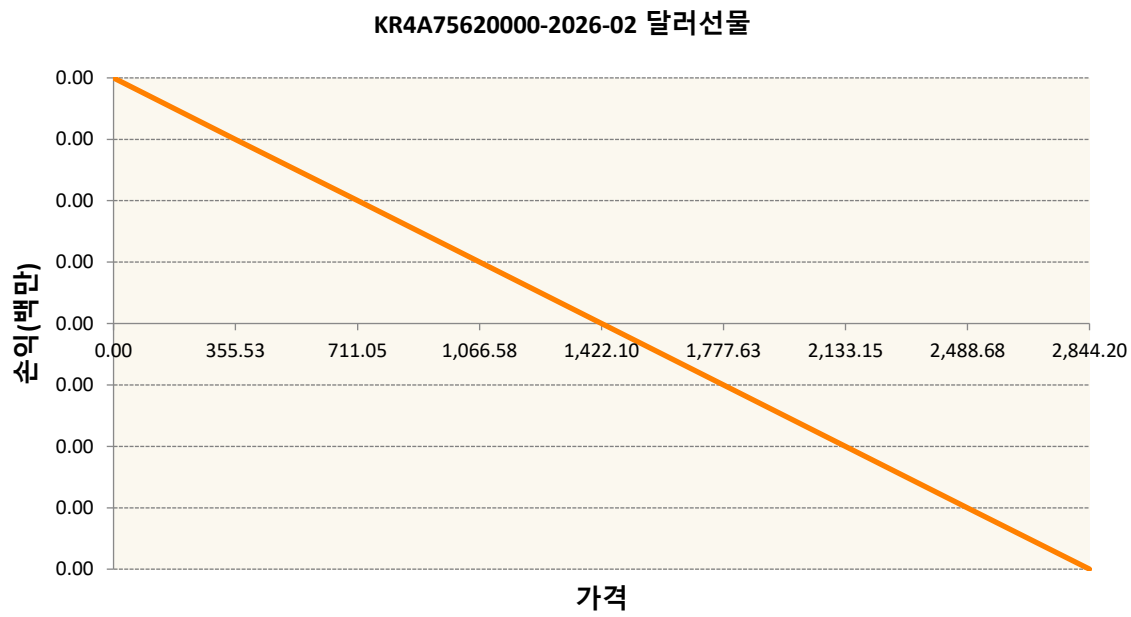
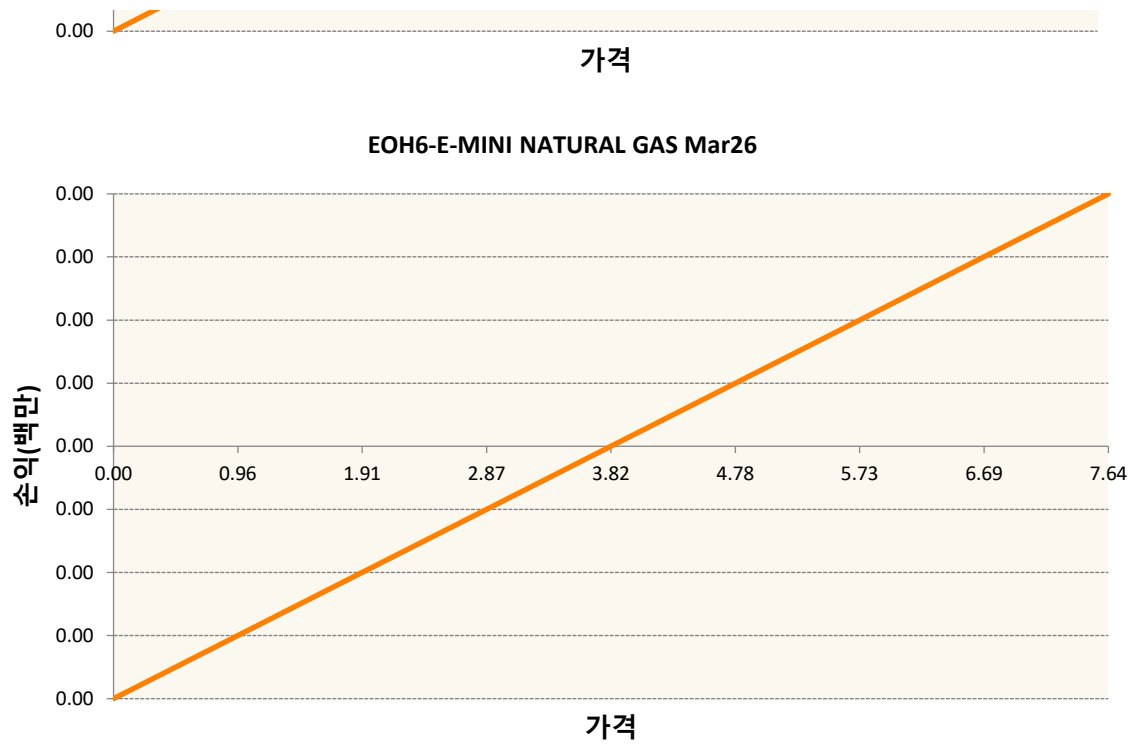
1. 계약금액

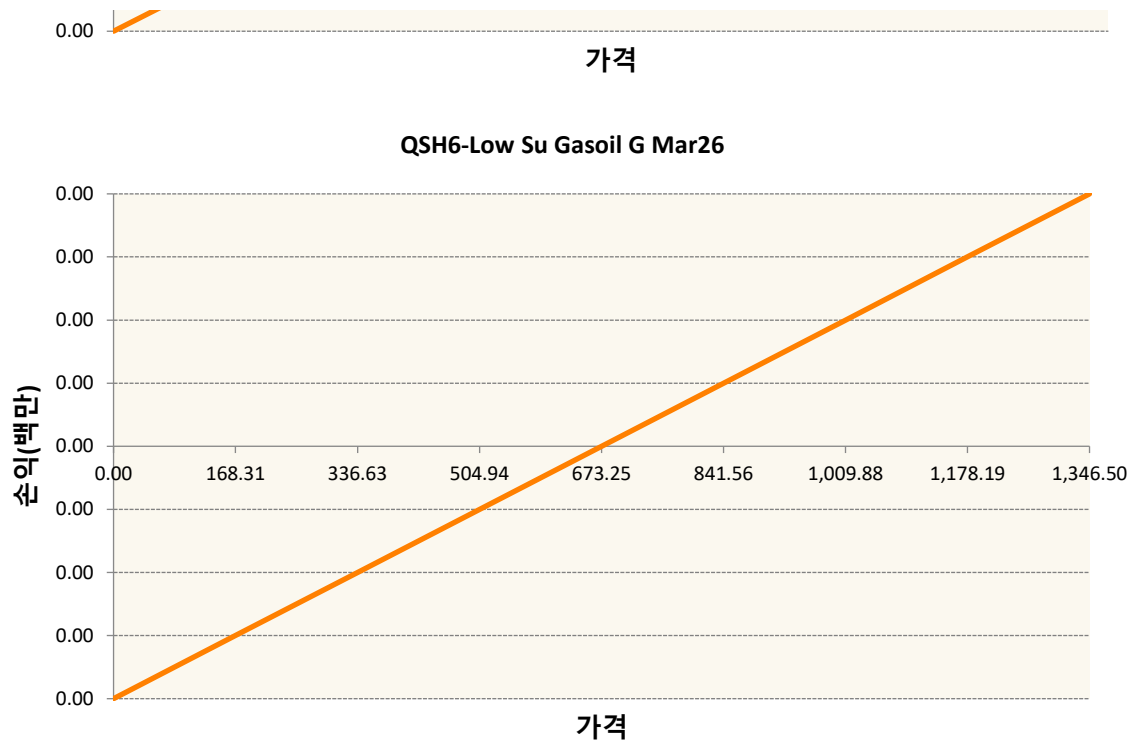
(단위:백만원)

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	140	0	140	
누계	유가증권	선물	384	0	384	
누계	통화	선물	0	114	-114	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH6	WTI CRUDE FUTURE Mar26	7
COK6	BRENT CRUDE FUTR May26	16
EOH6	E-MINI NATURAL GAS Mar26	2
KR4A756200	2026-02 달러선물	9
NGH26	NATURAL GAS FUTR Mar26	9
QSH6	Low Su Gasoil G Mar26	8

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

(단위:백만원)

94