

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

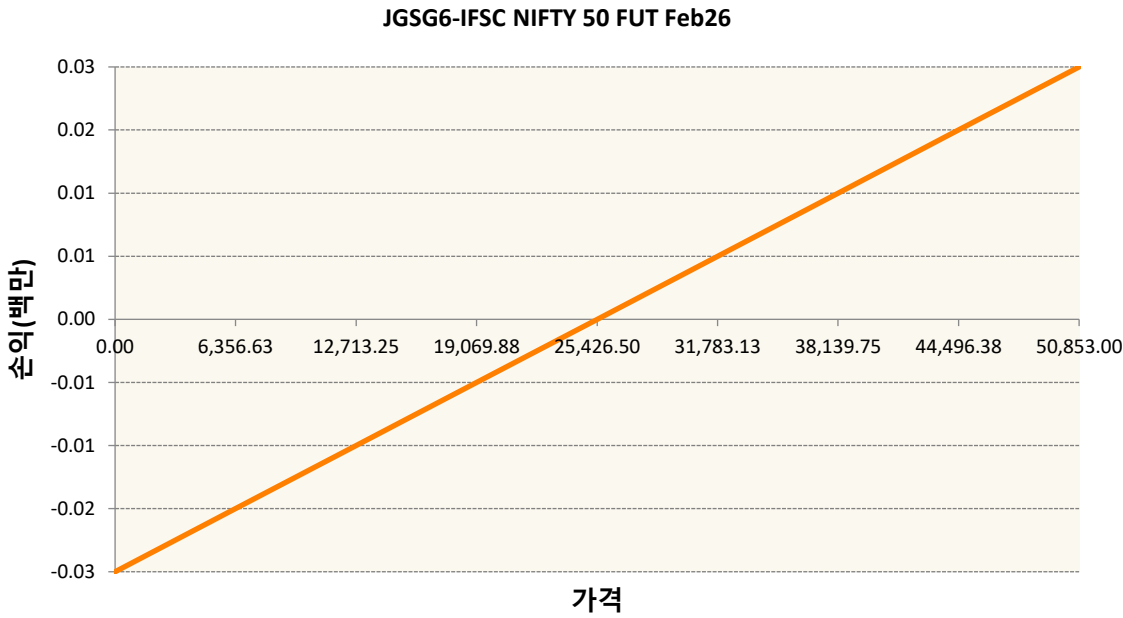
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-01-30
기준일	2026-01-29

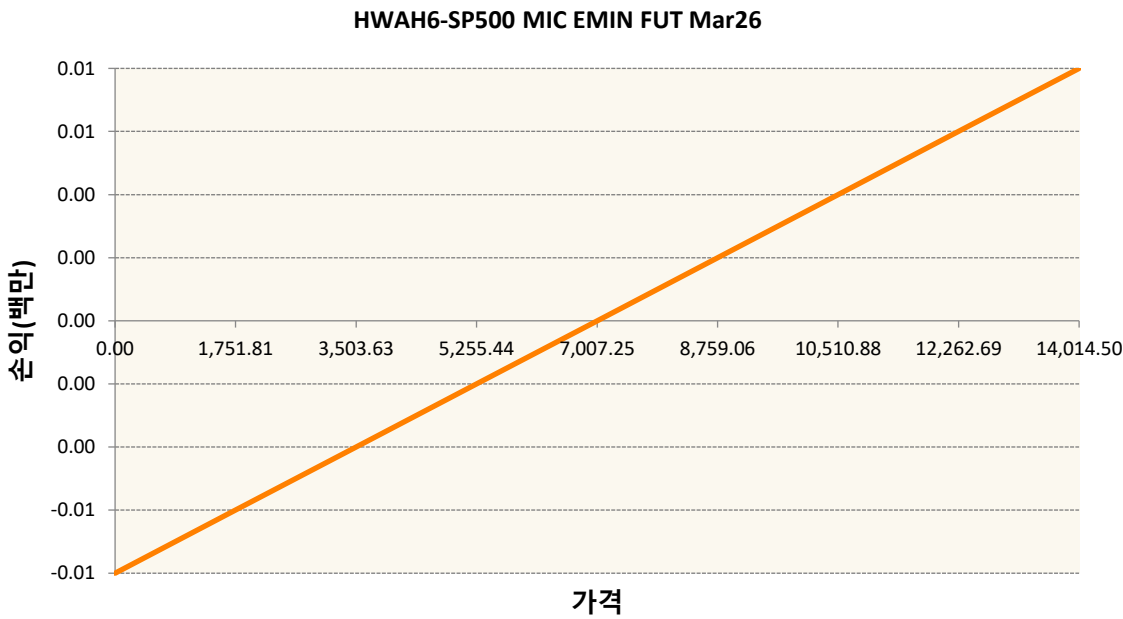
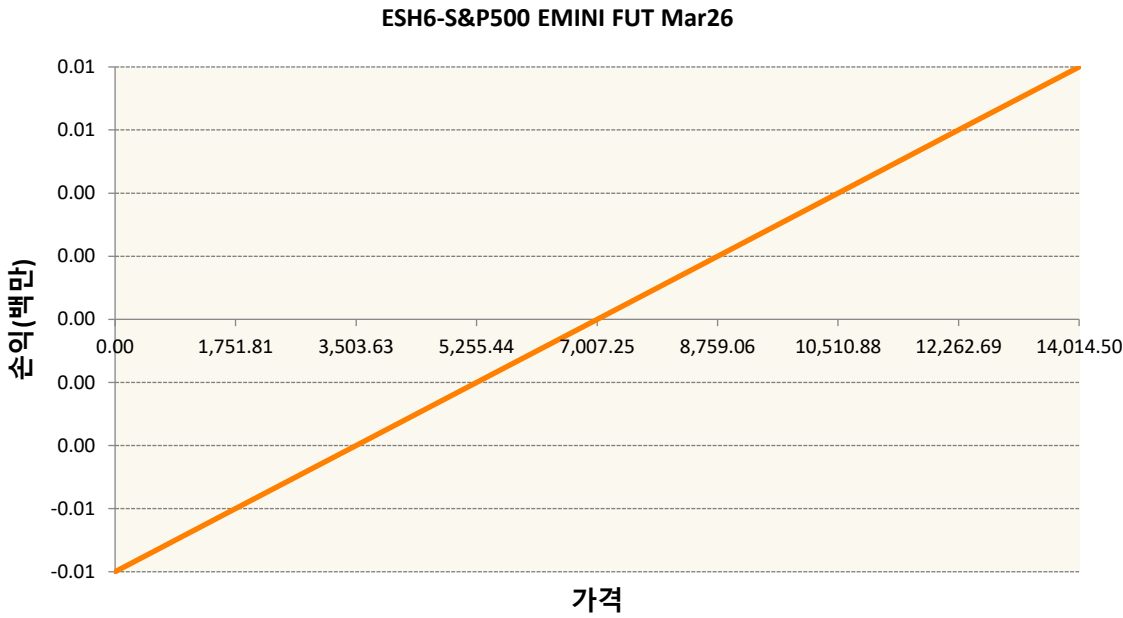
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-01-30
기준일	2026-01-29

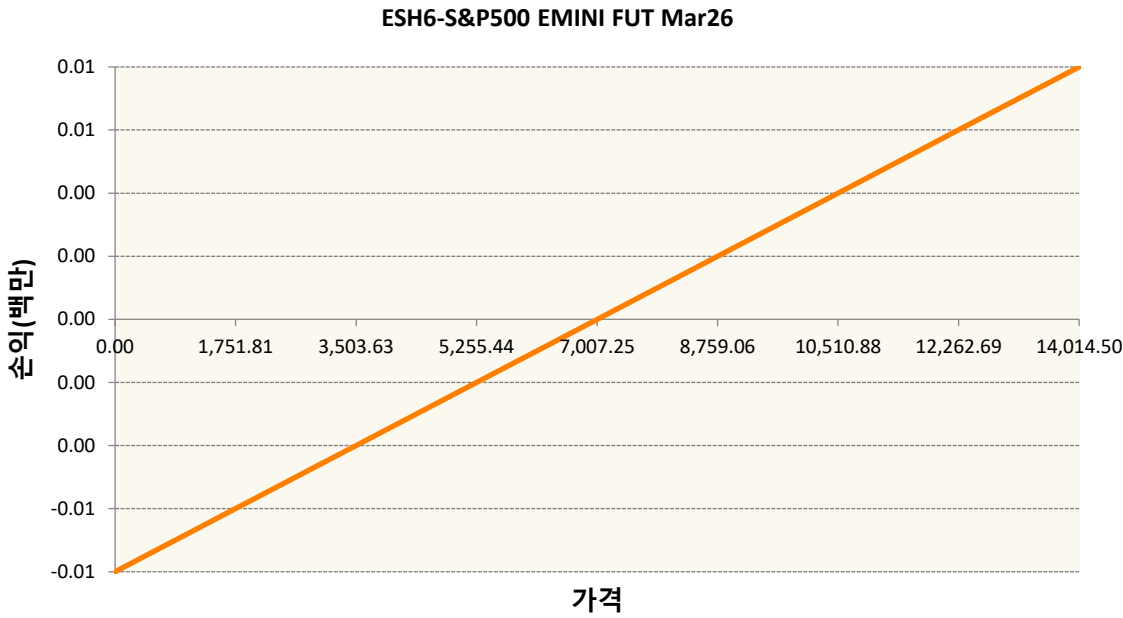
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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	2026-01-30
기준일	2026-01-29

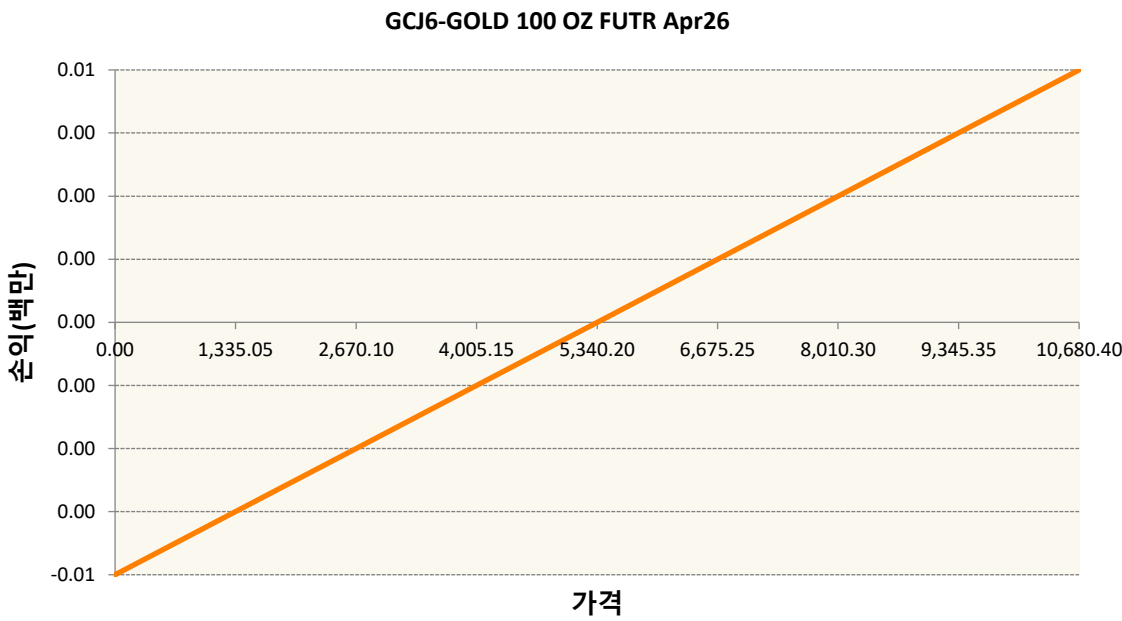
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,558	0	4,558	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 01/30/26 C460 EQUITY	24
GCI6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	365

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

(단위:백만원)

380

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

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	163
AOPLTRPSS1PLTR US 01/30/26 P175 EQUITY	2

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

(단위:백만원)

620

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

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

4

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

(단위:백만원)

3

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

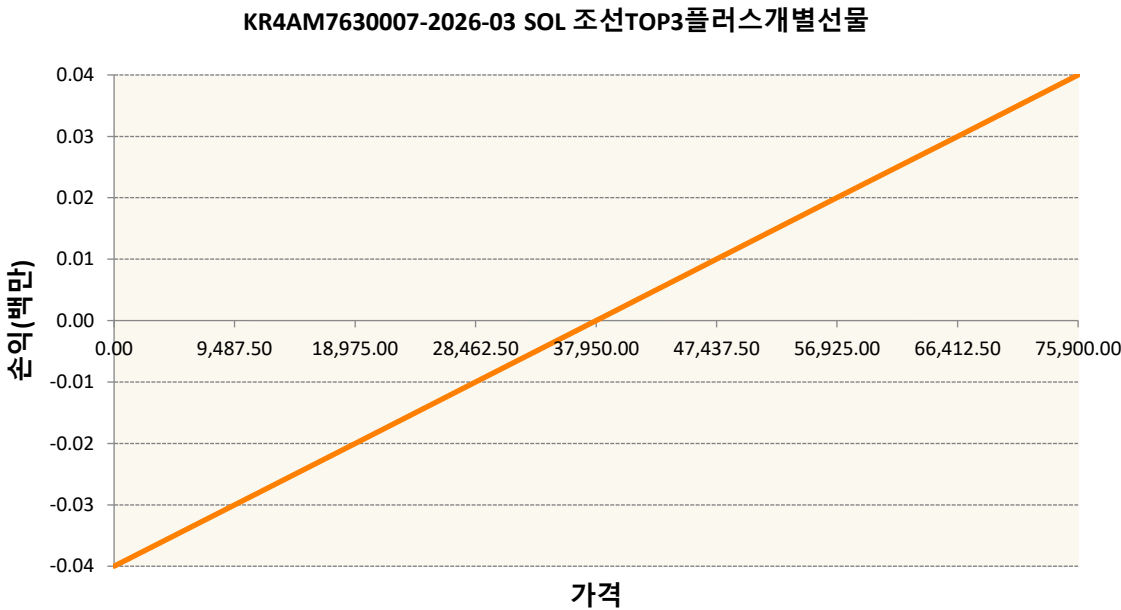
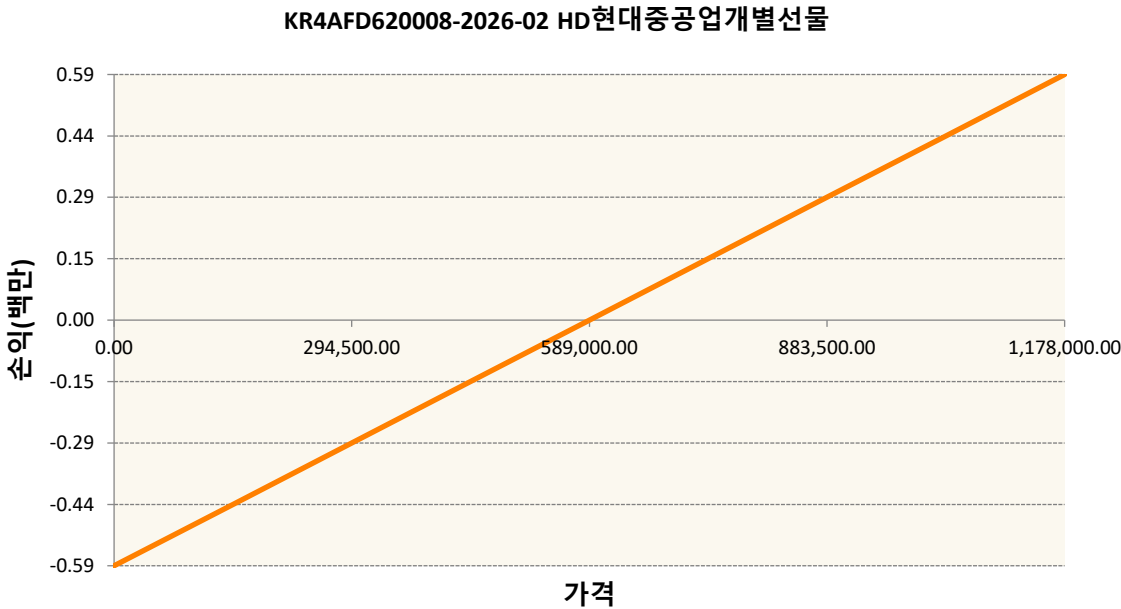
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	23,486	0	23,486	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD620008			2026-02 HD현대중공업개별선물				943
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-943	-943	-943	-943	-943	-943	-943
-5.33%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-2.67%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	314	314	314	314	314	314	314
5.33%	628	628	628	628	628	628	628
8.00%	943	943	943	943	943	943	943
KR4AM7630007			2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물				936
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-936	-936	-936	-936	-936	-936	-936
-5.33%	-624	-624	-624	-624	-624	-624	-624
-2.67%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	312	312	312	312	312	312	312
5.33%	624	624	624	624	624	624	624
8.00%	936	936	936	936	936	936	936

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

1,677

공시일 2026-01-30

기준일 2026-01-29

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	2026-01-30
기준일	2026-01-29

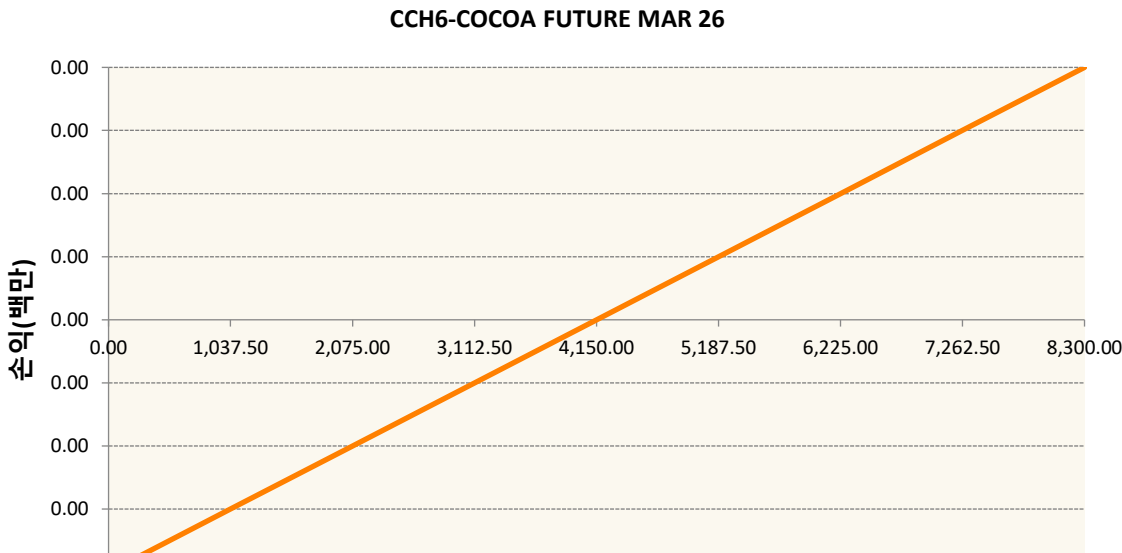
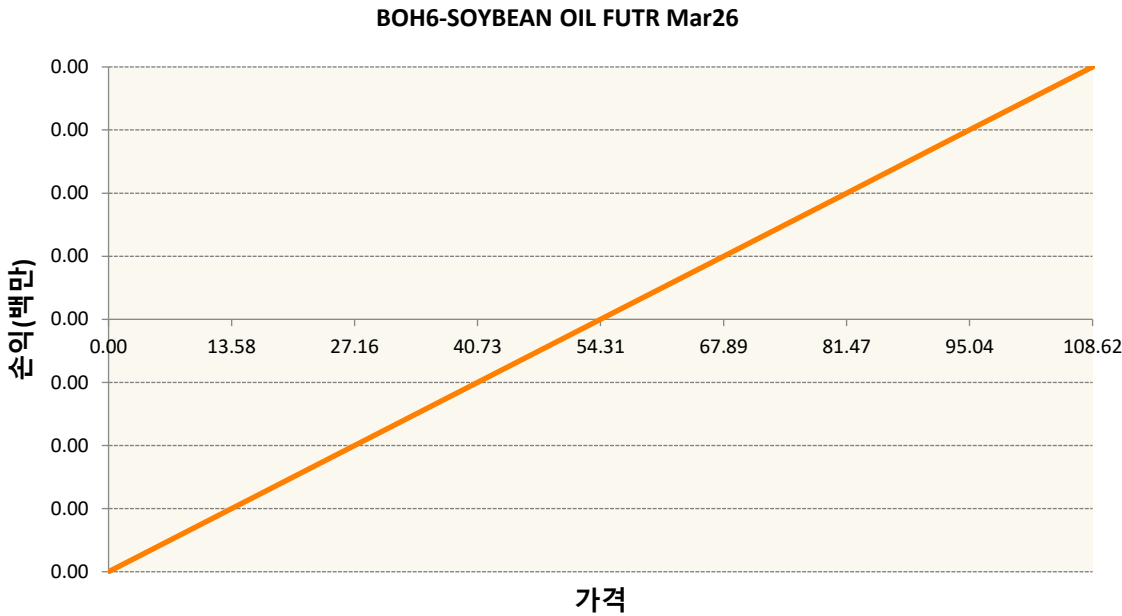
포커스농산물모(채권-파생형)

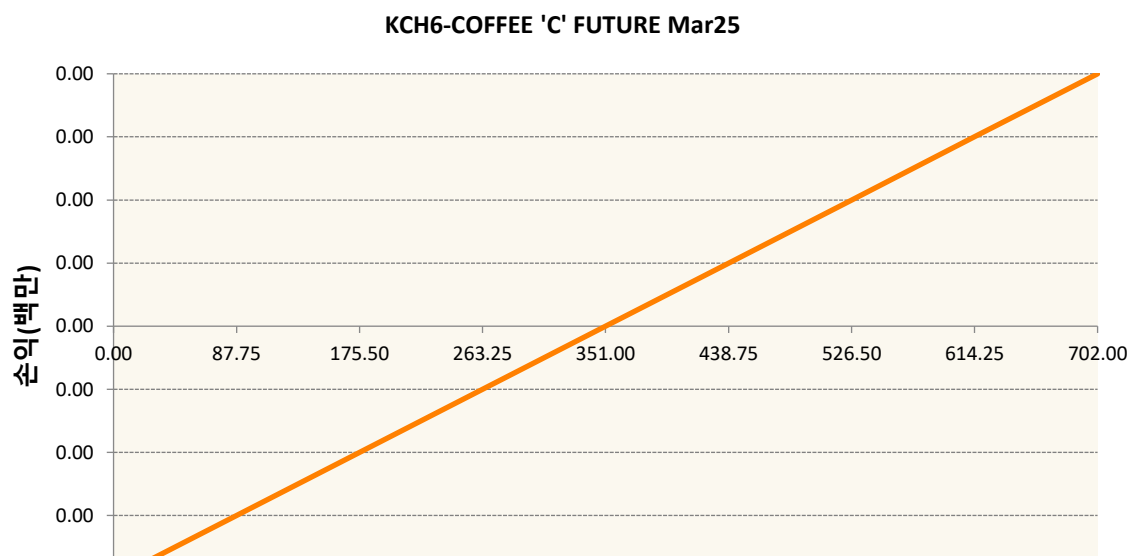
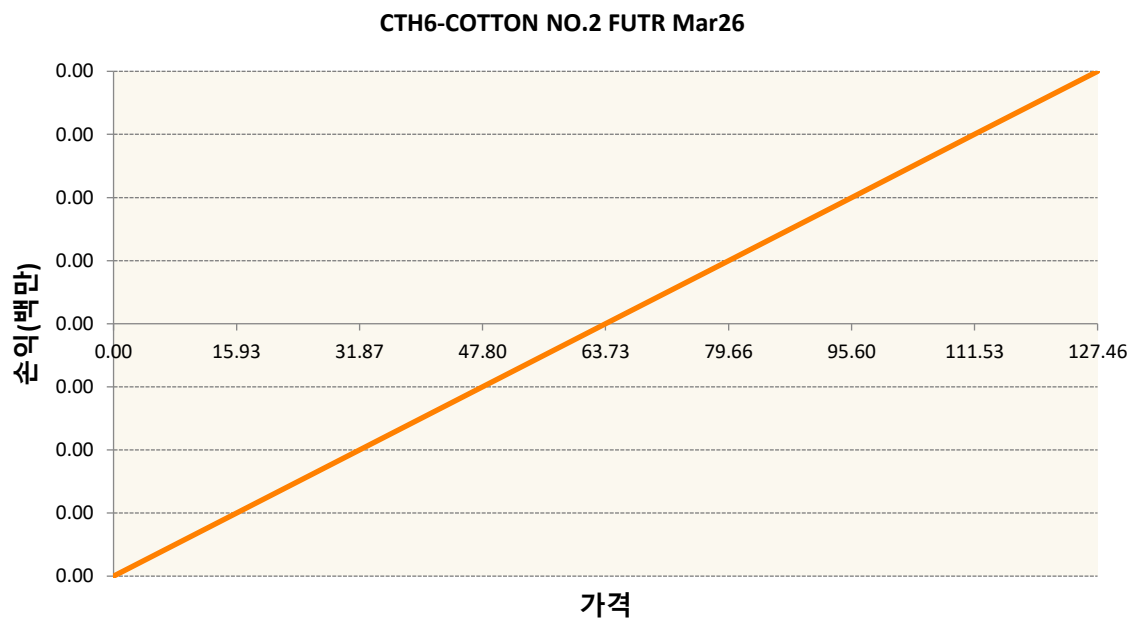
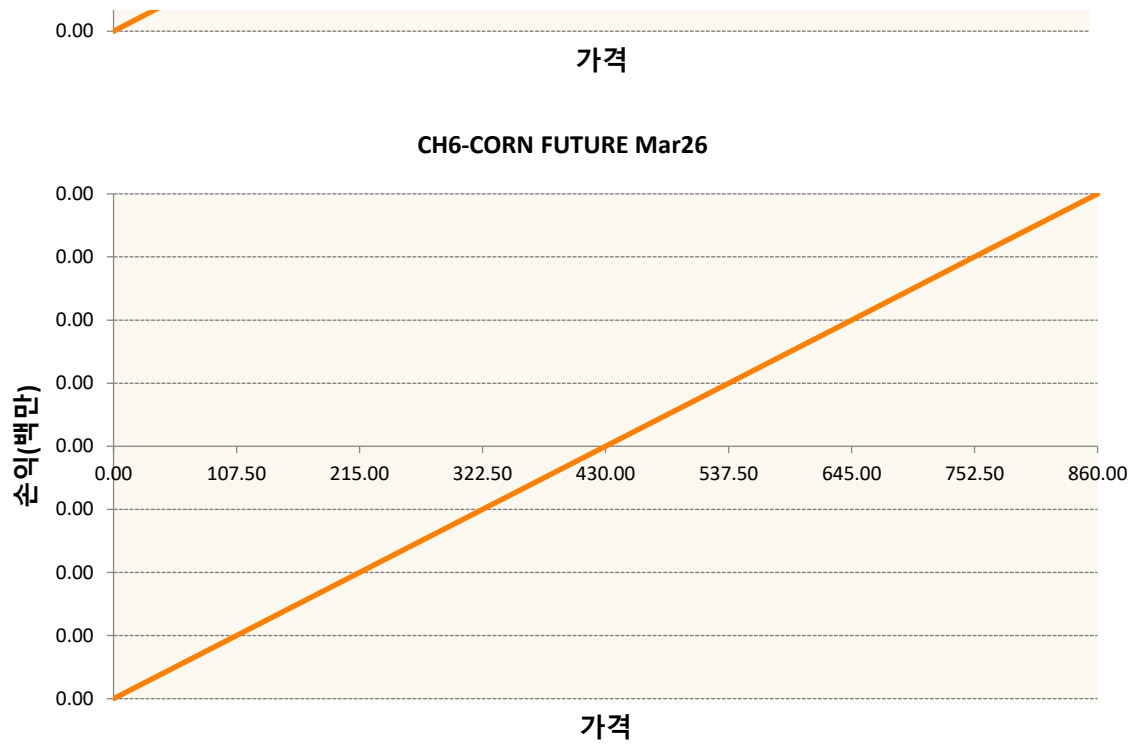
1. 계약금액

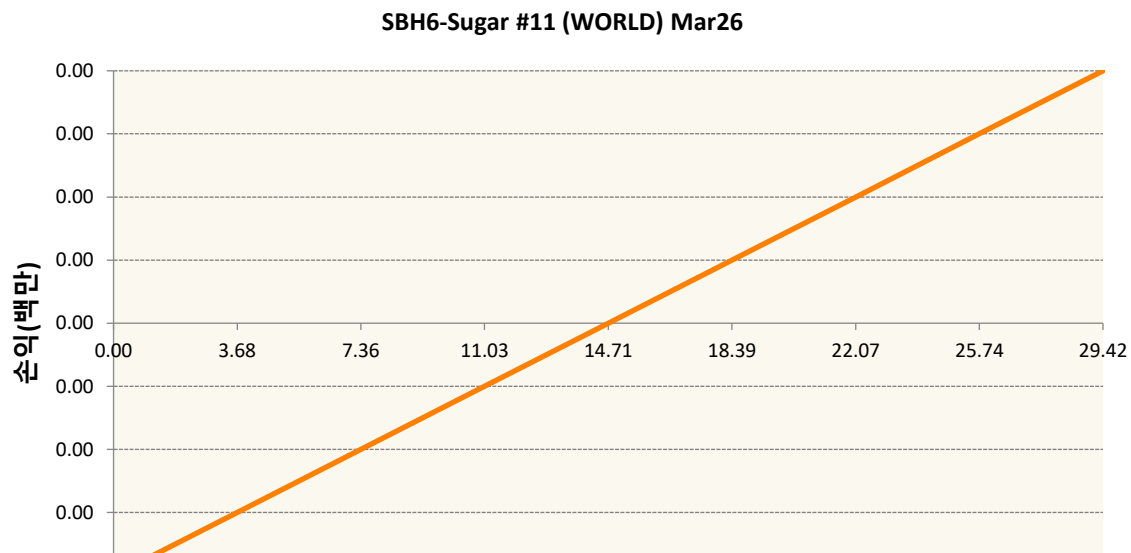
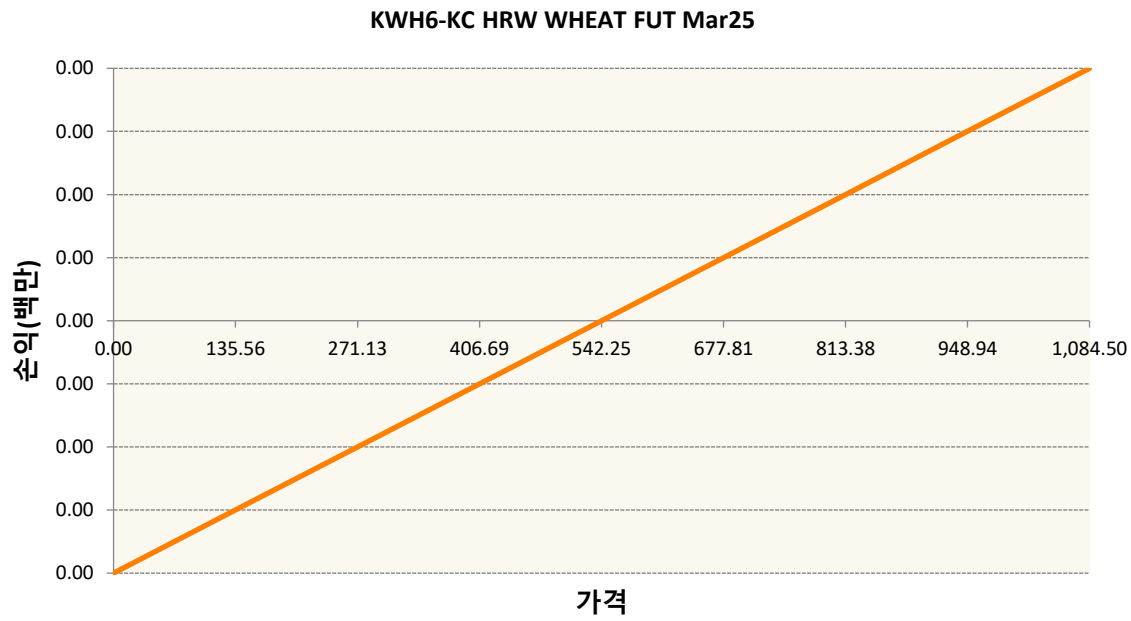
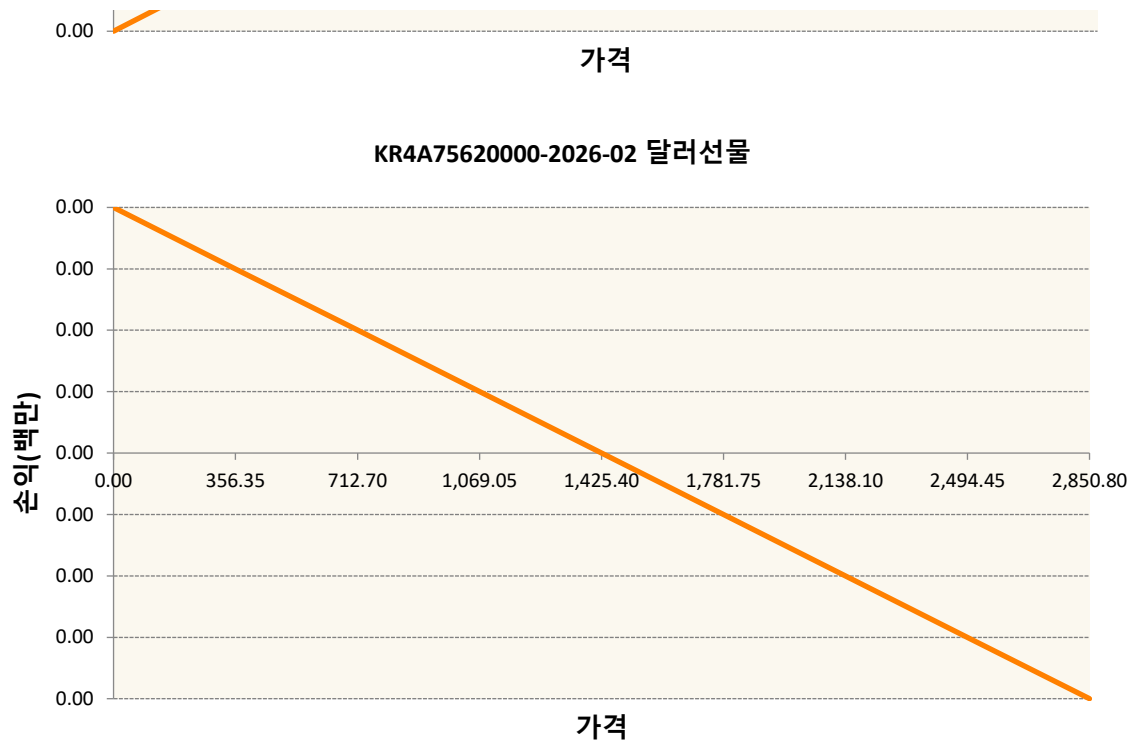
(단위:USD 백만)

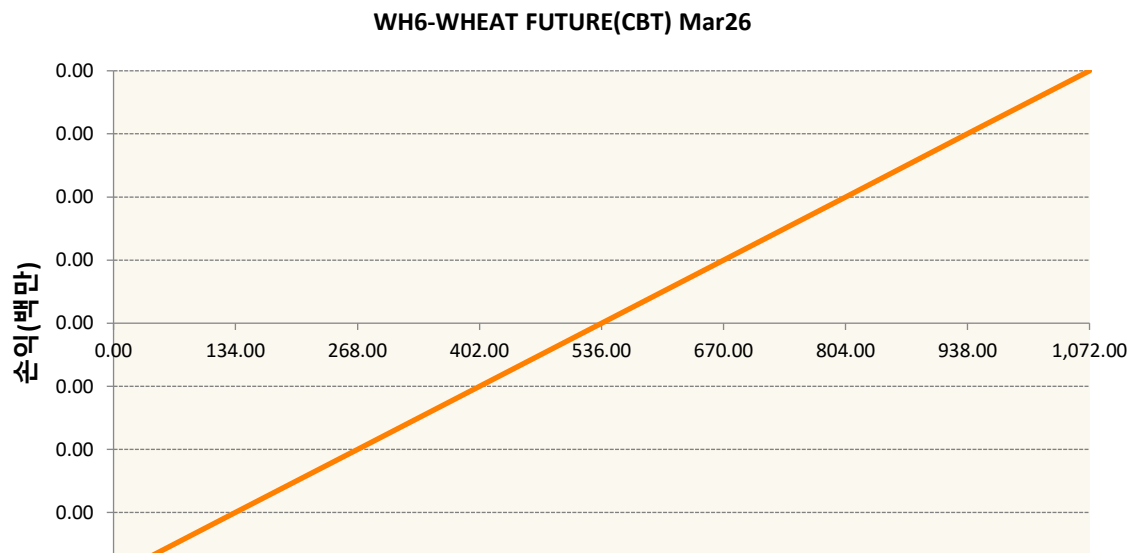
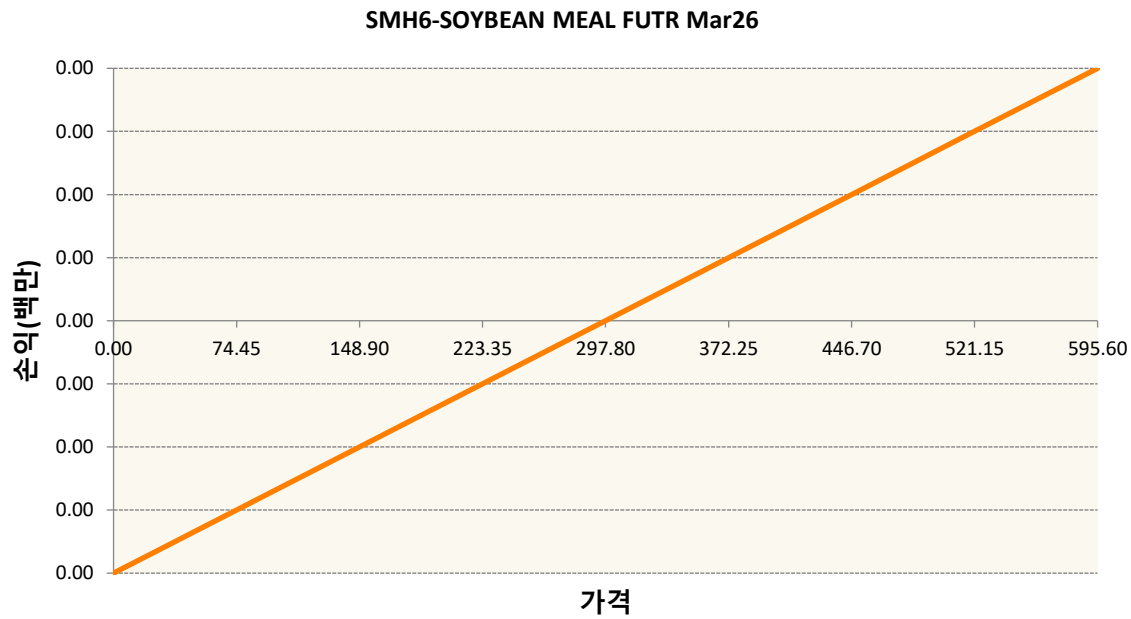
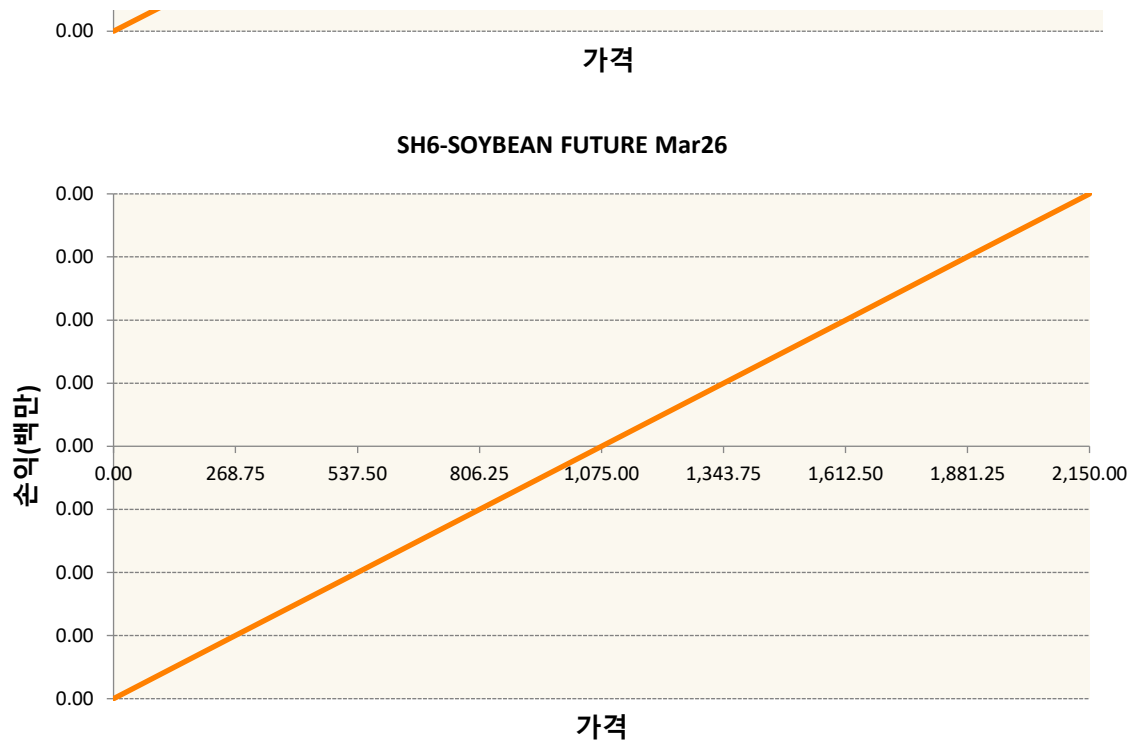
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	410	0	410	
누계	유가증권	선물	2,661	0	2,661	
누계	통화	선물	0	299	-299	장내

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	2026-01-30
기준일	2026-01-29

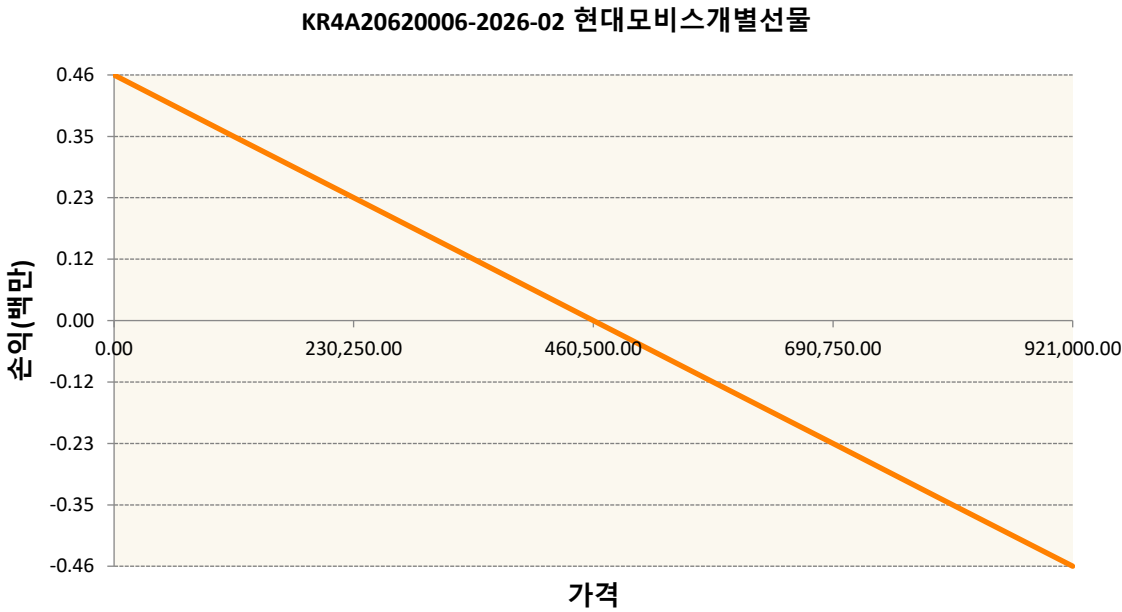
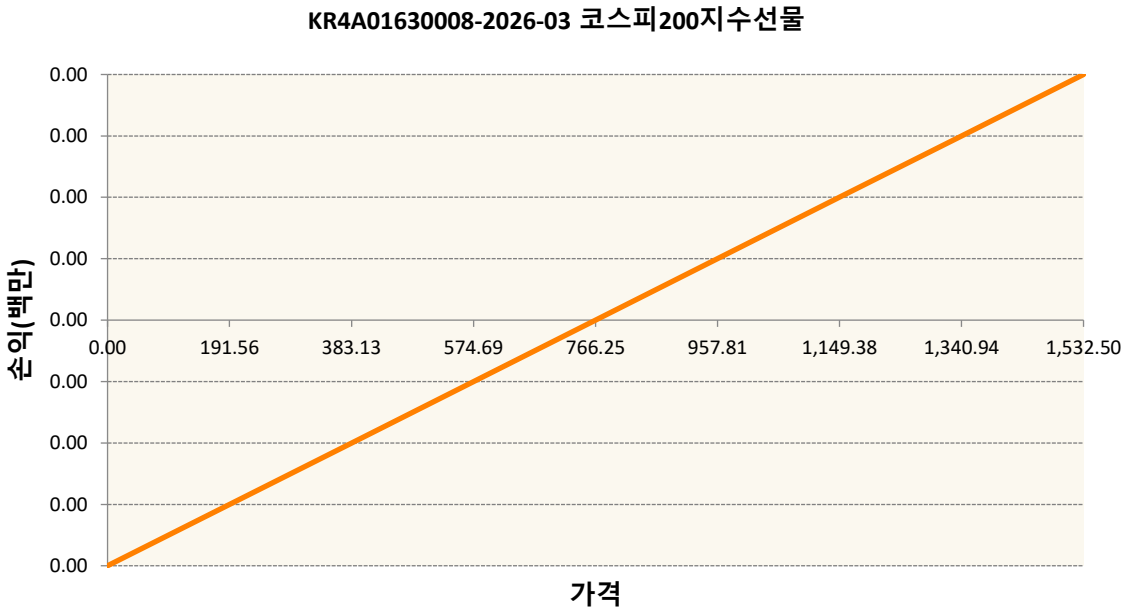
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,065	64	3,001	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		245
KR4A206200 2026-02 현대모비스개별선물		5

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

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

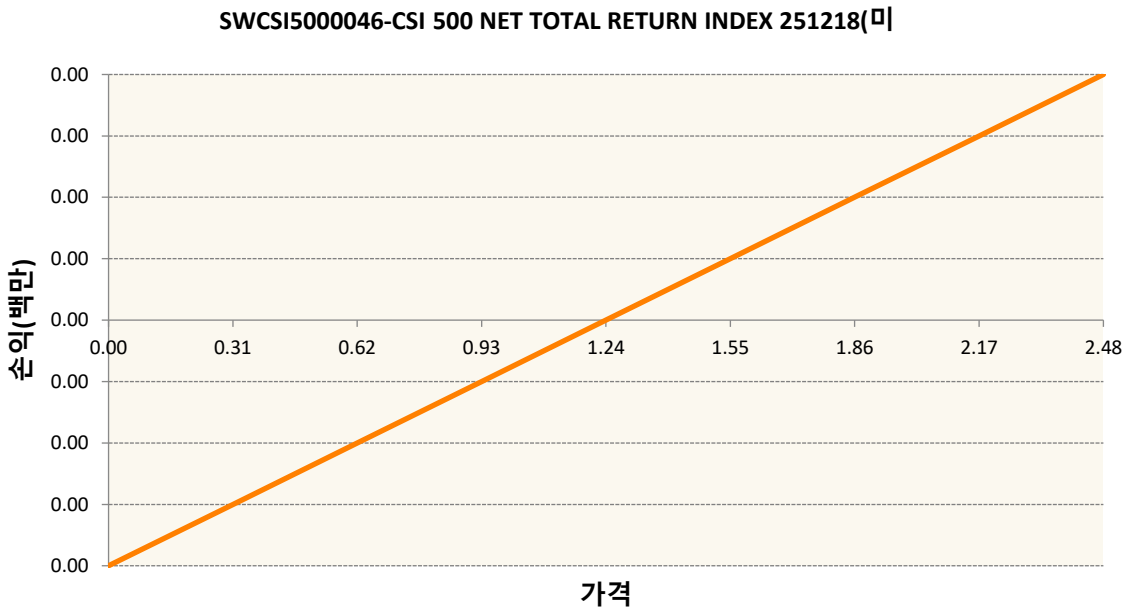
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,728	0	5,728	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

457

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

548

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

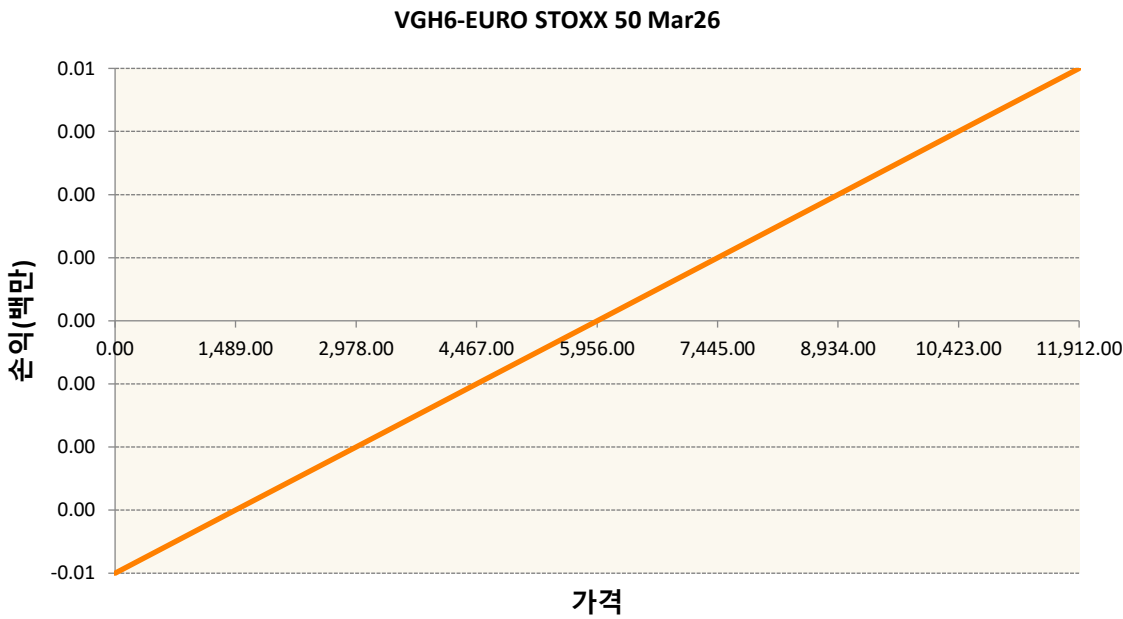
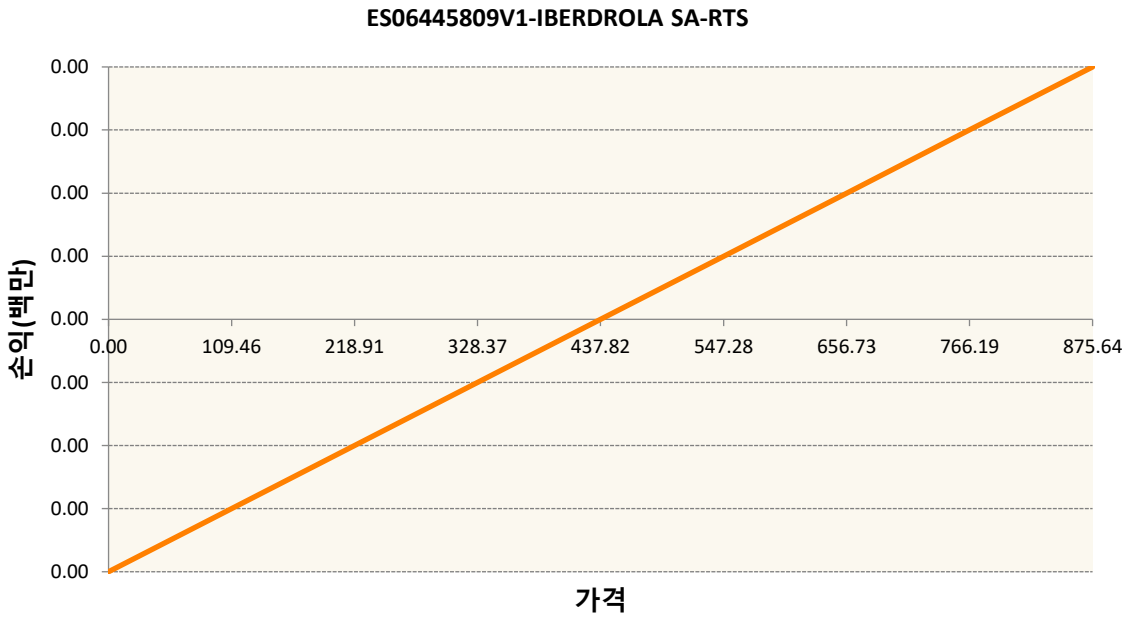
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	929	0	929	

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	2026-01-30
기준일	2026-01-29

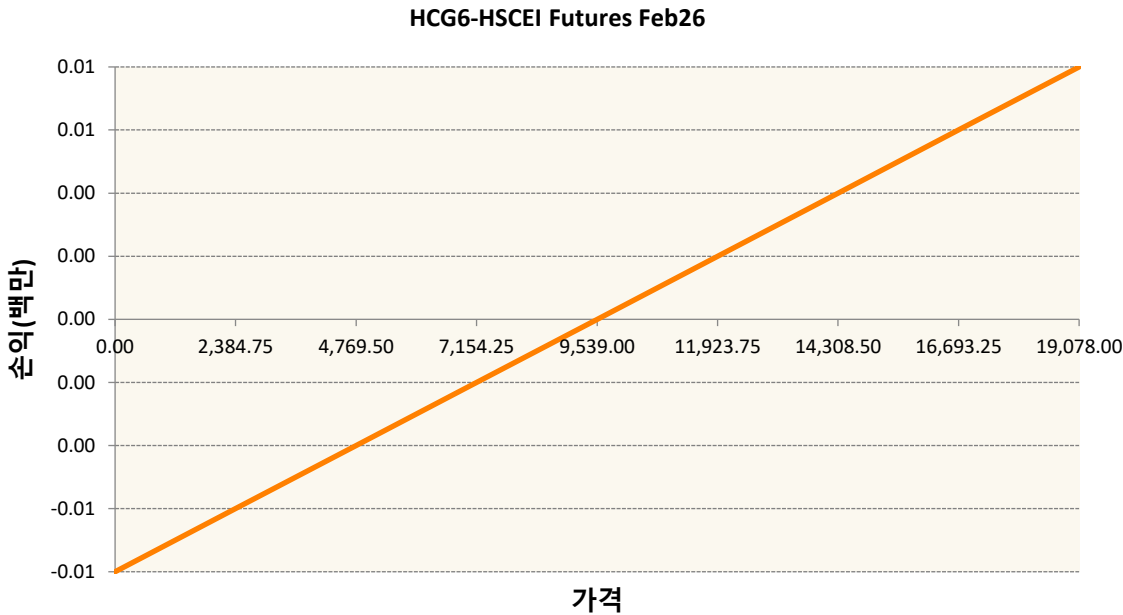
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,180	0	2,180	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG6	HSCEI Futures Feb26	174
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

245

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

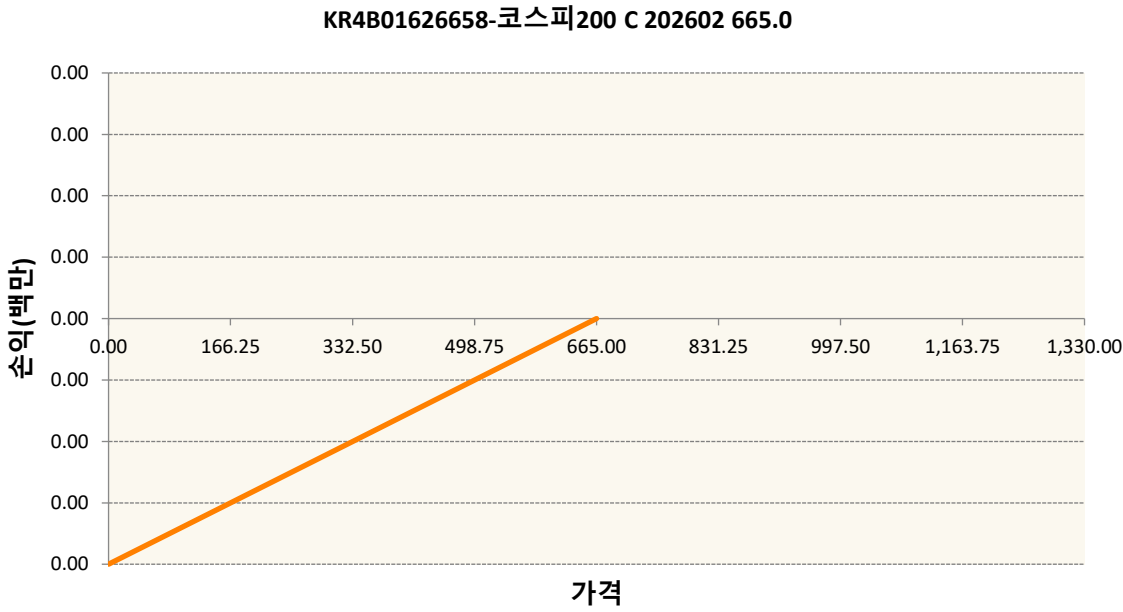
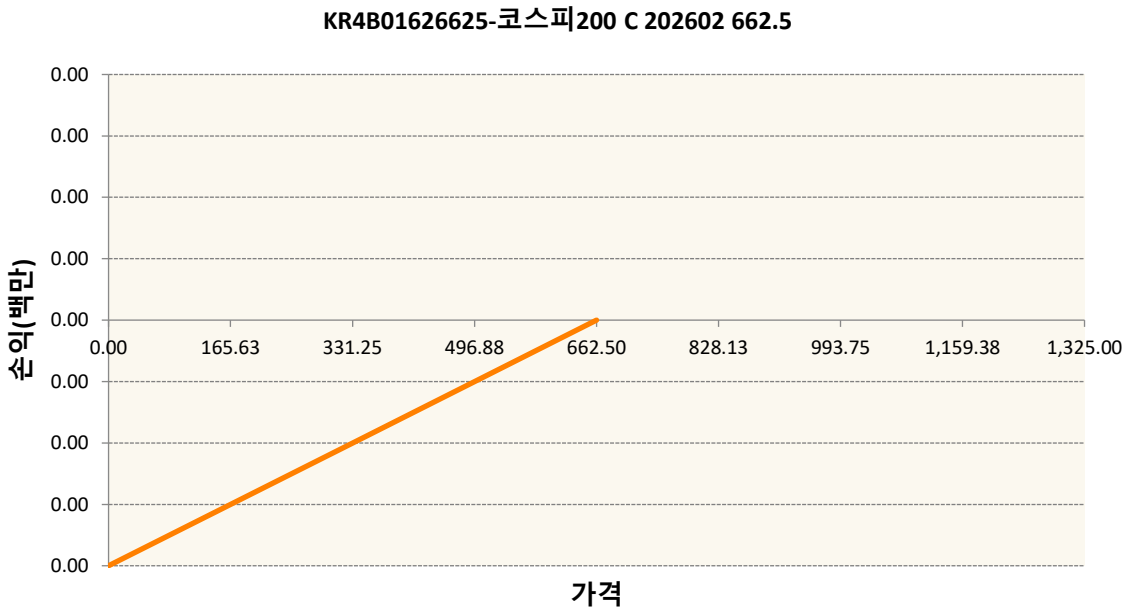
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

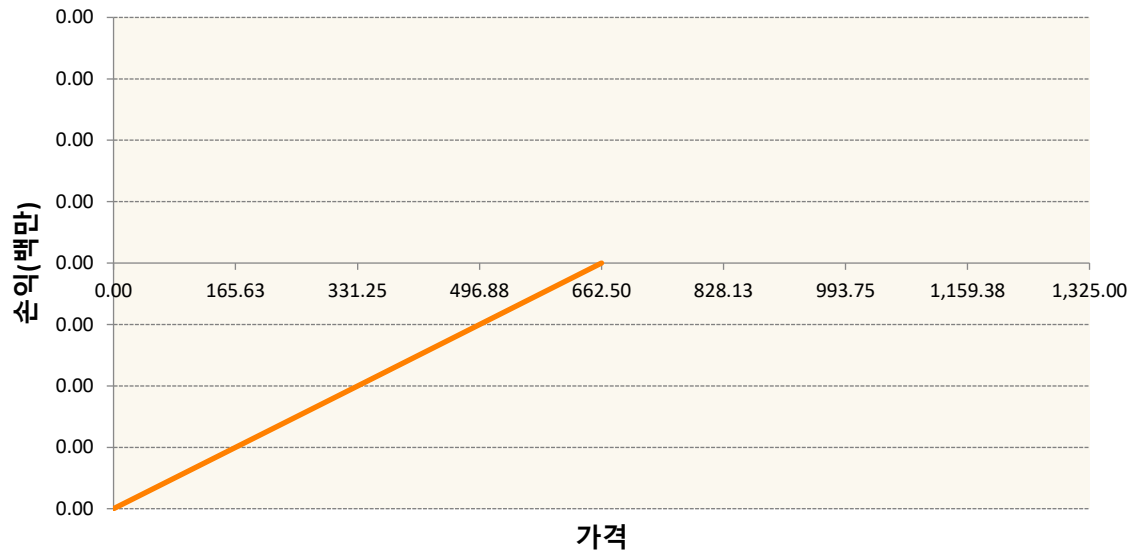
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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 2026-01-30

기준일 2026-01-29

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	2026-01-30
기준일	2026-01-29

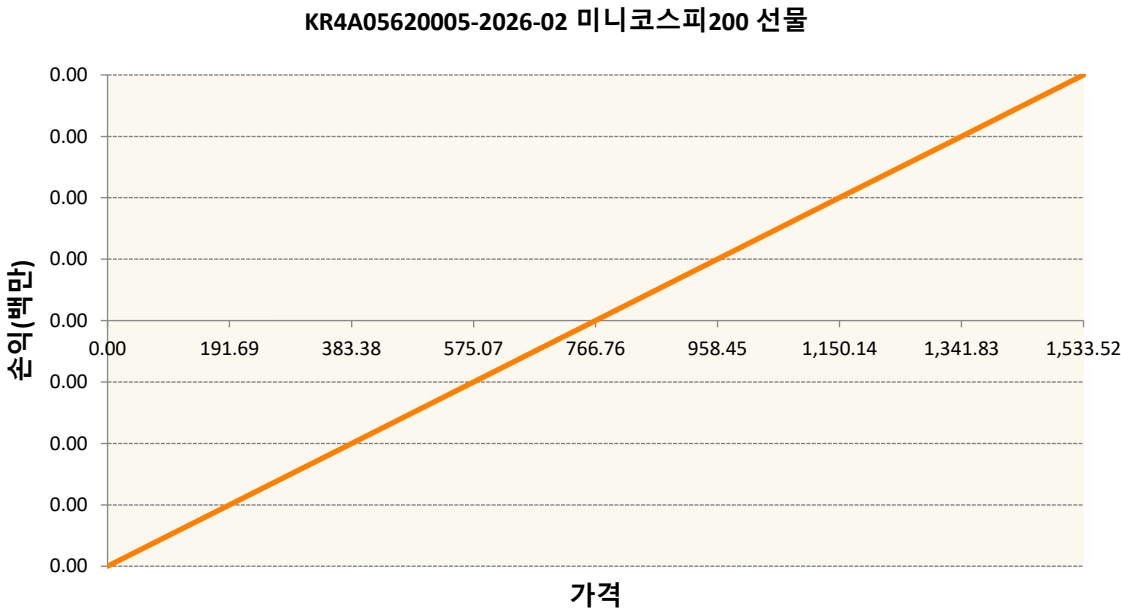
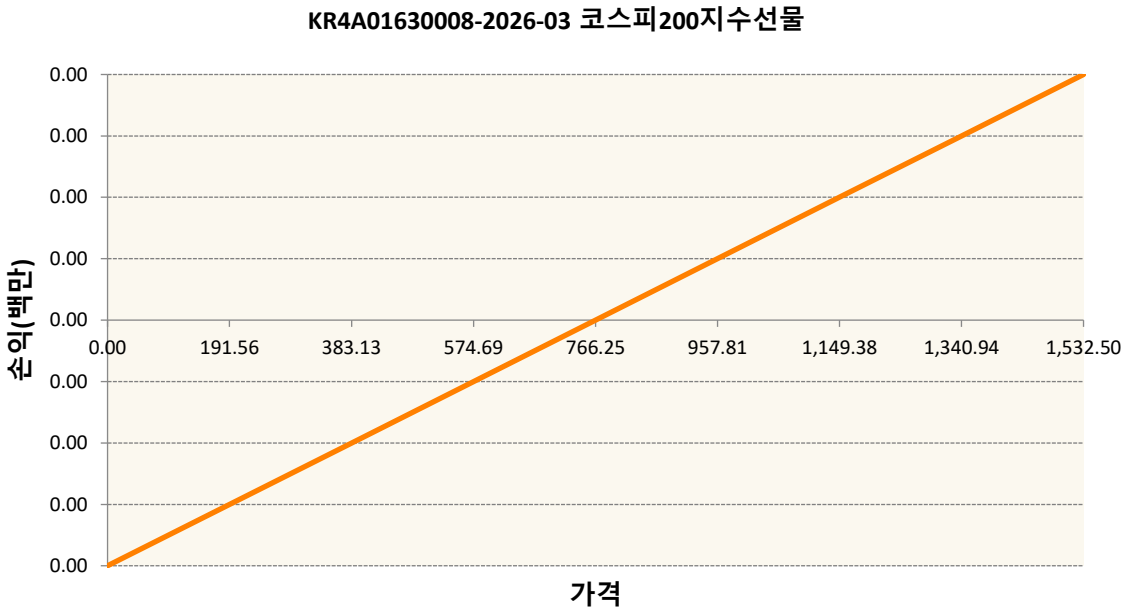
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

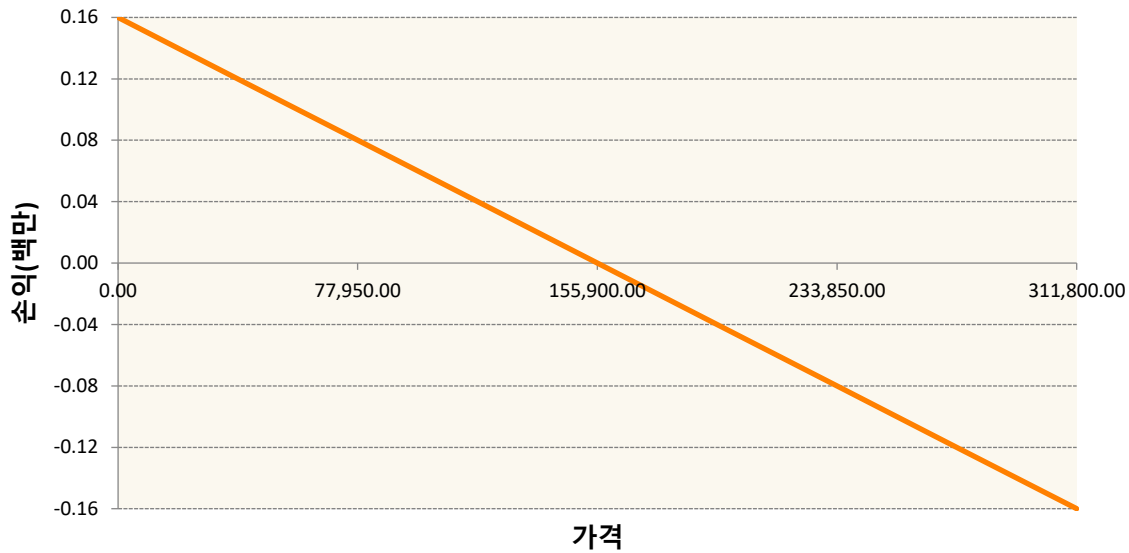
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	961	648	313	장내
누계	유가증권	선물	3,641	124	3,517	장내

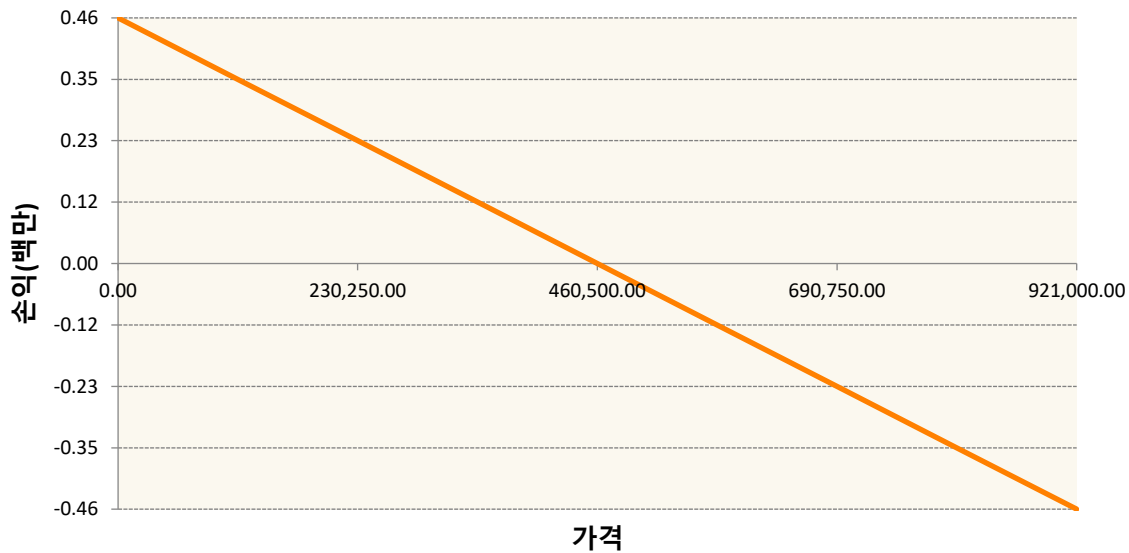
2. 만기시점의 손익구조



KR4A19620009-2026-02 기아개별선물



KR4A20620006-2026-02 현대모비스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물	77
KR4A056200 2026-02 미니코스피200 선물	43
KR4A196200 2026-02 기아개별선물	7
KR4A206200 2026-02 현대모비스개별선물	3

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

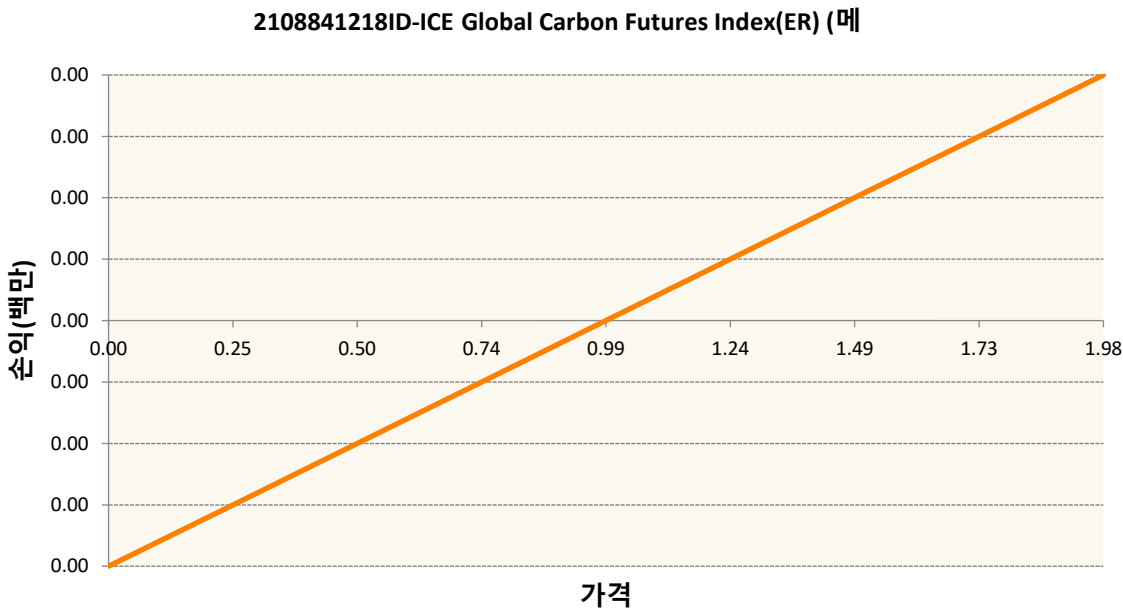
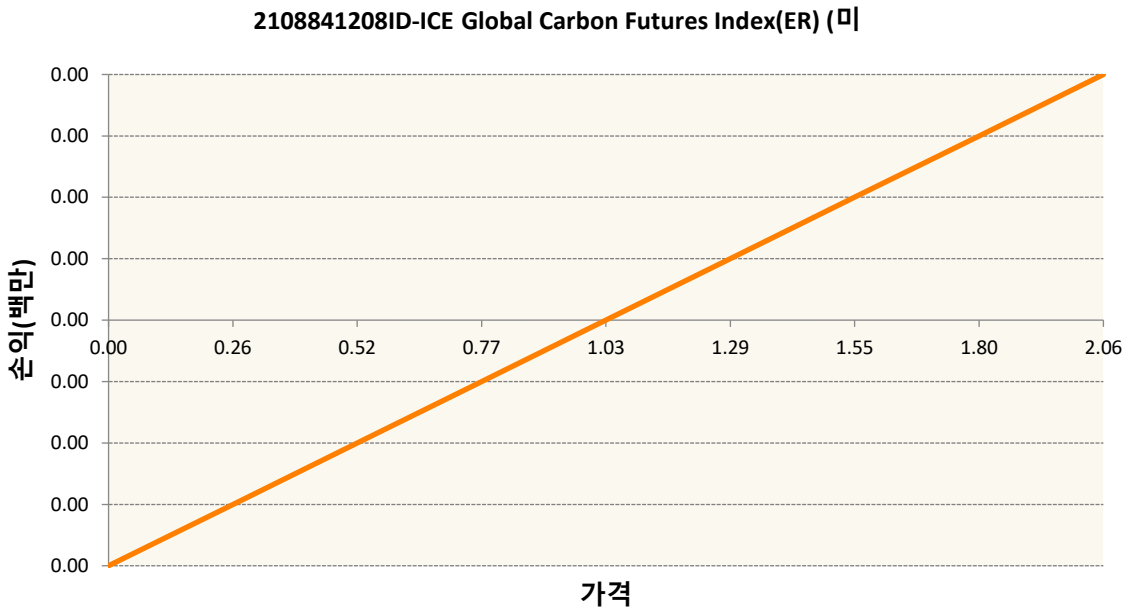
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,504	0	7,504	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		481
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		121

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	586

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

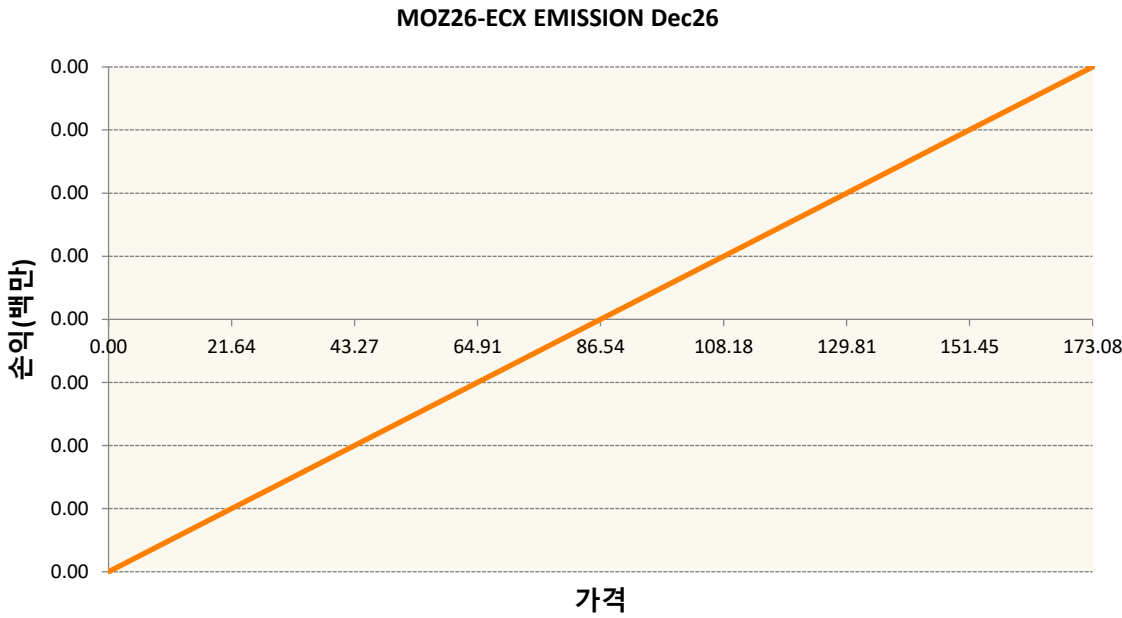
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,741	0	5,741	
누계	통화	선도	0	6,558	-6,558	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213FCP(KRW/EUR 30-01-26E	227
FXW213G1E(KRW/EUR 30-01-26E	42
FXW213G1V(KRW/EUR 27-02-26E	255
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	459

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

(단위:백만원)

939

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

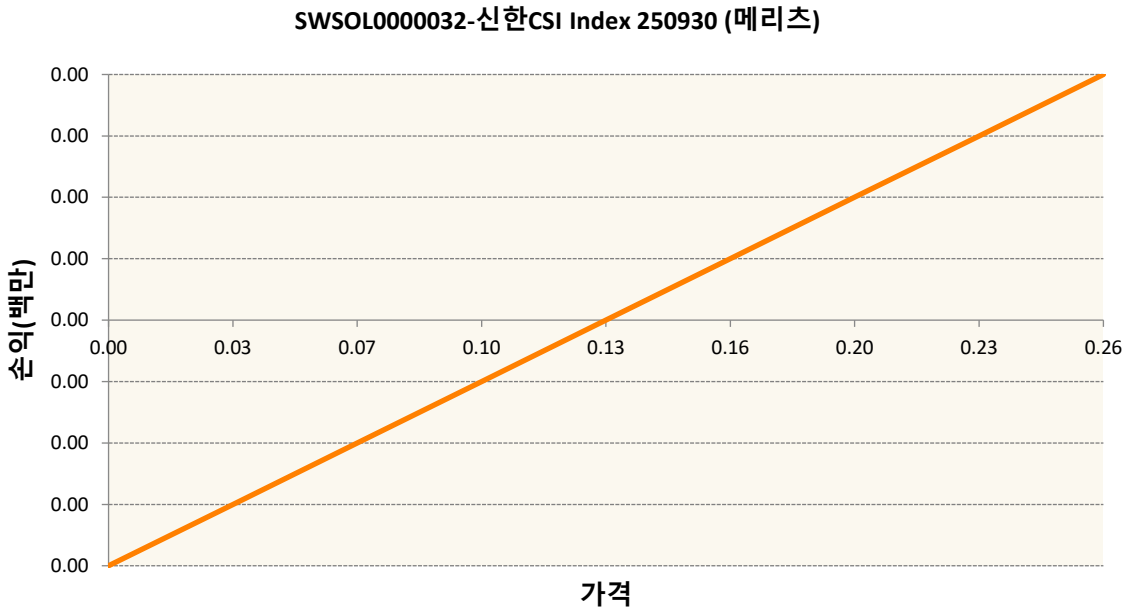
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,079	0	3,079	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	17
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	11
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	12
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	29

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

(단위:백만원)

122

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

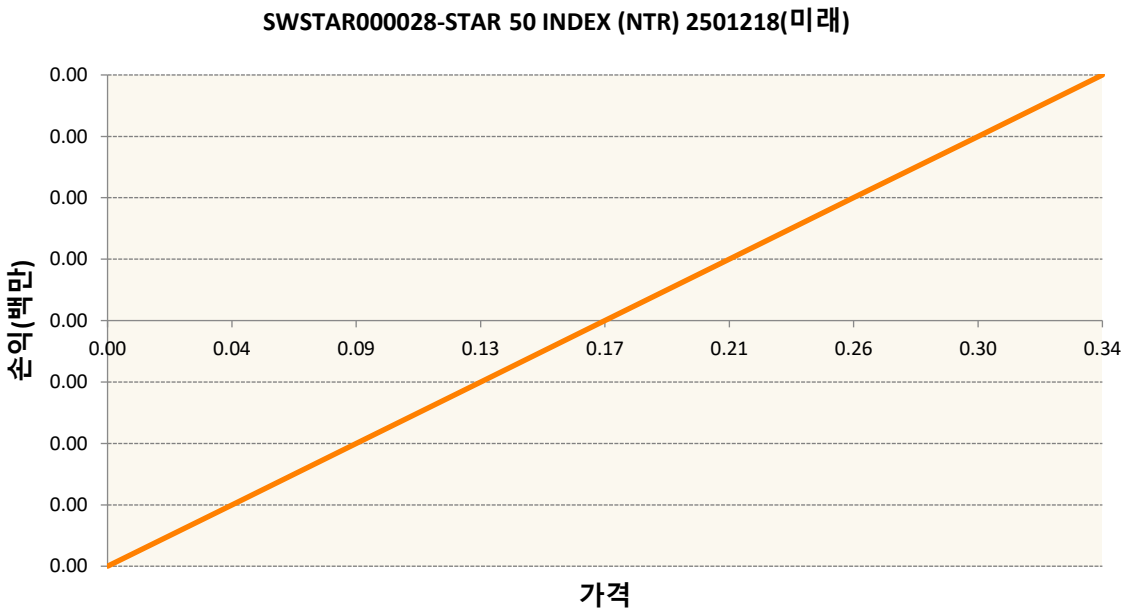
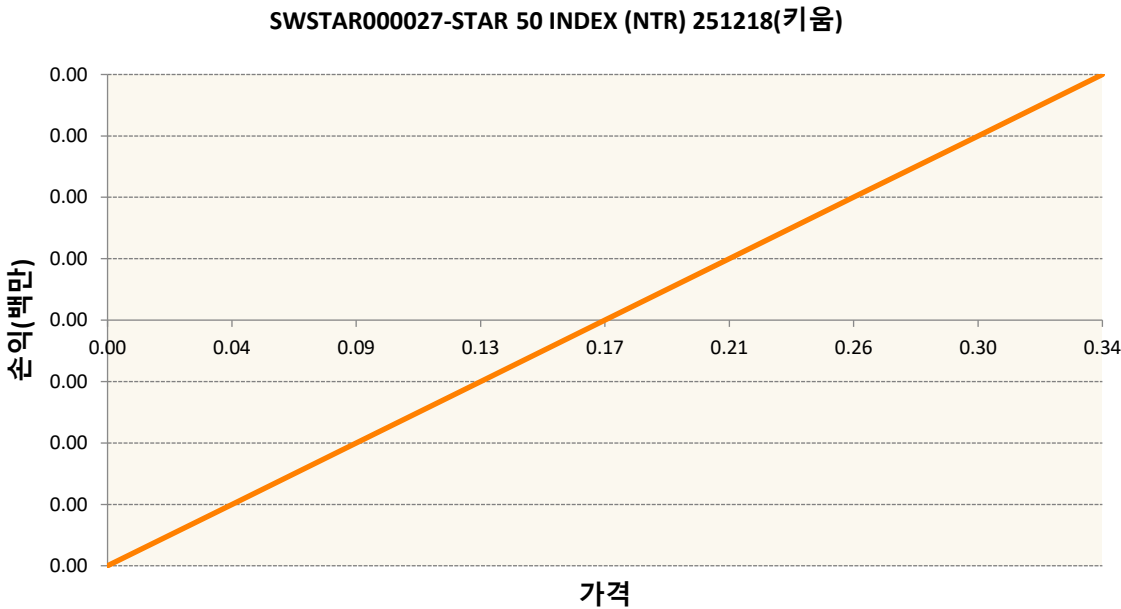
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

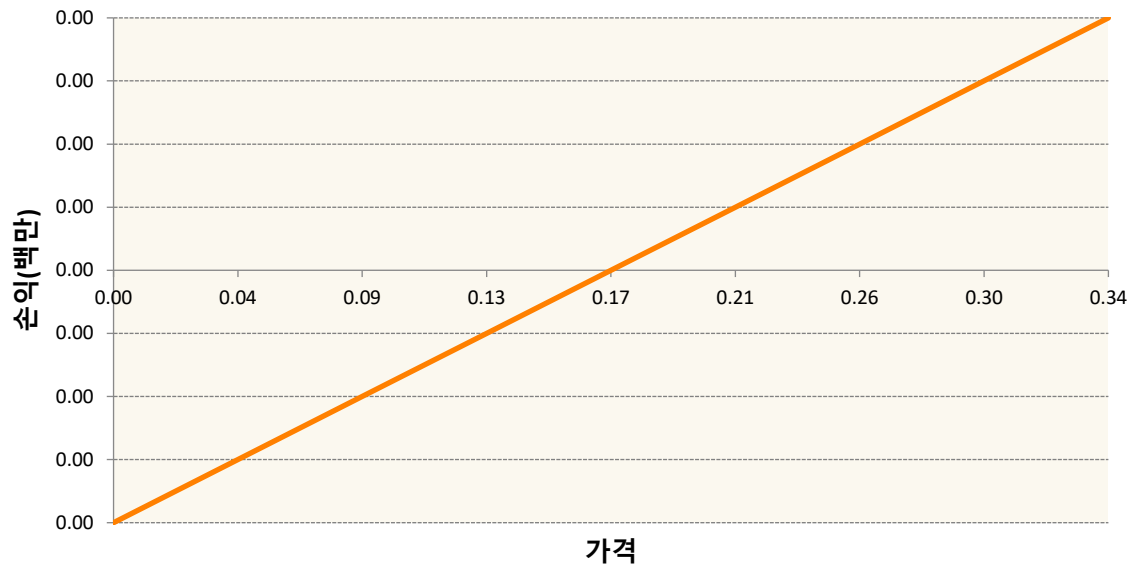
(단위:백만원)

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

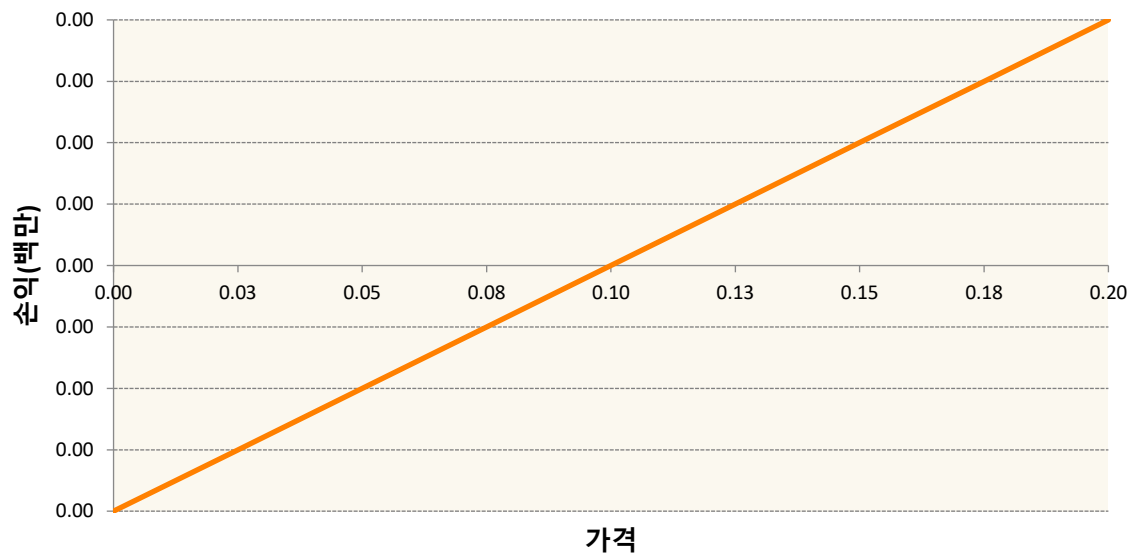
2. 만기시점의 손익구조



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



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움))	11
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))	75
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))	39
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠))	119

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

(단위:백만원)

446

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

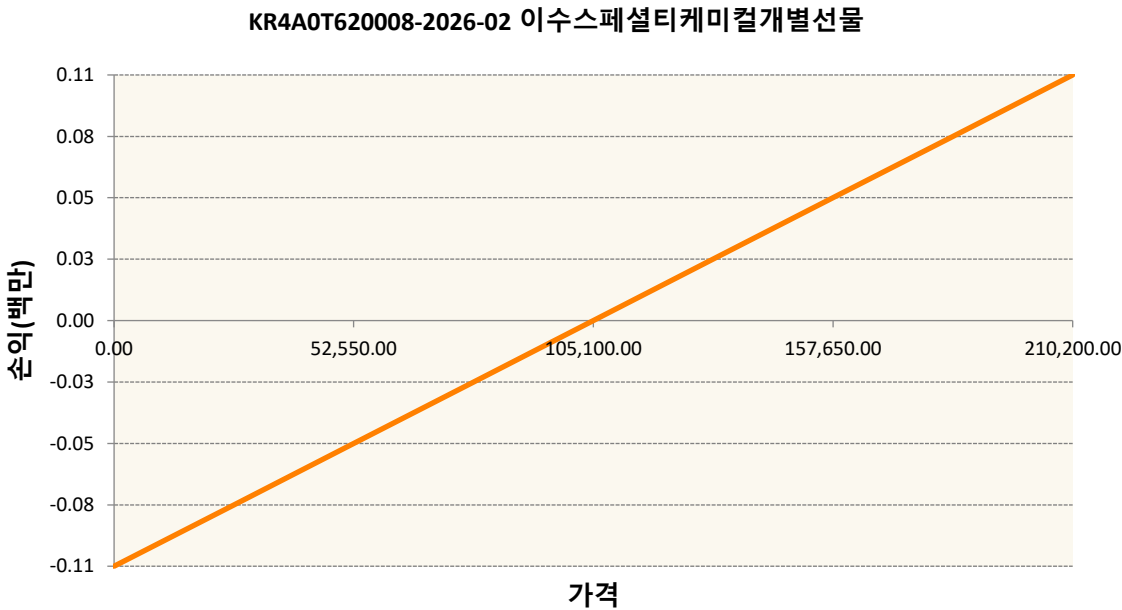
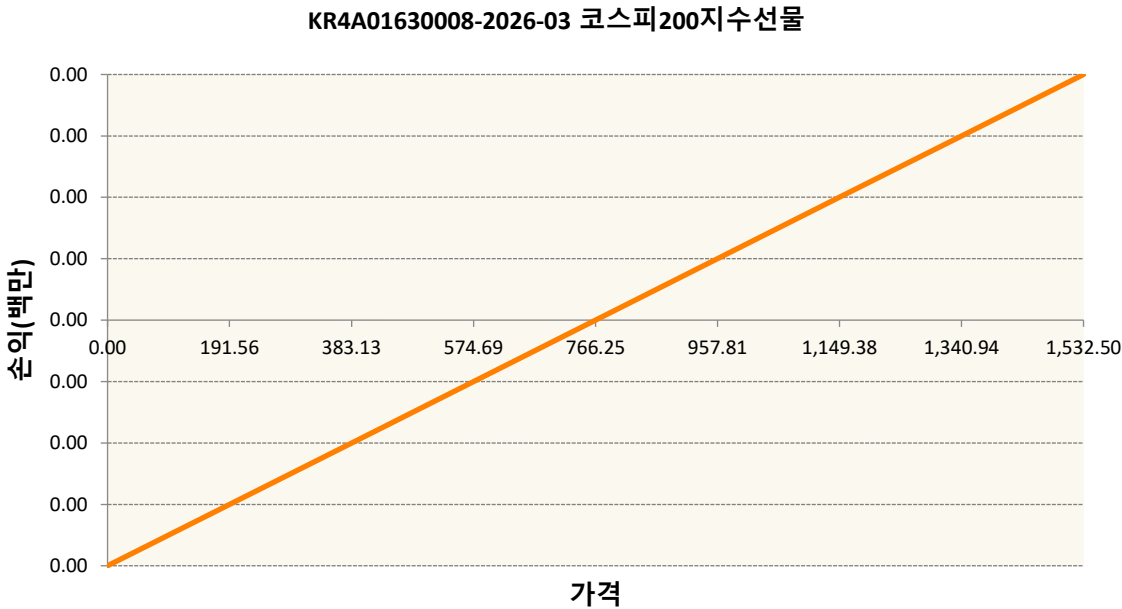
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

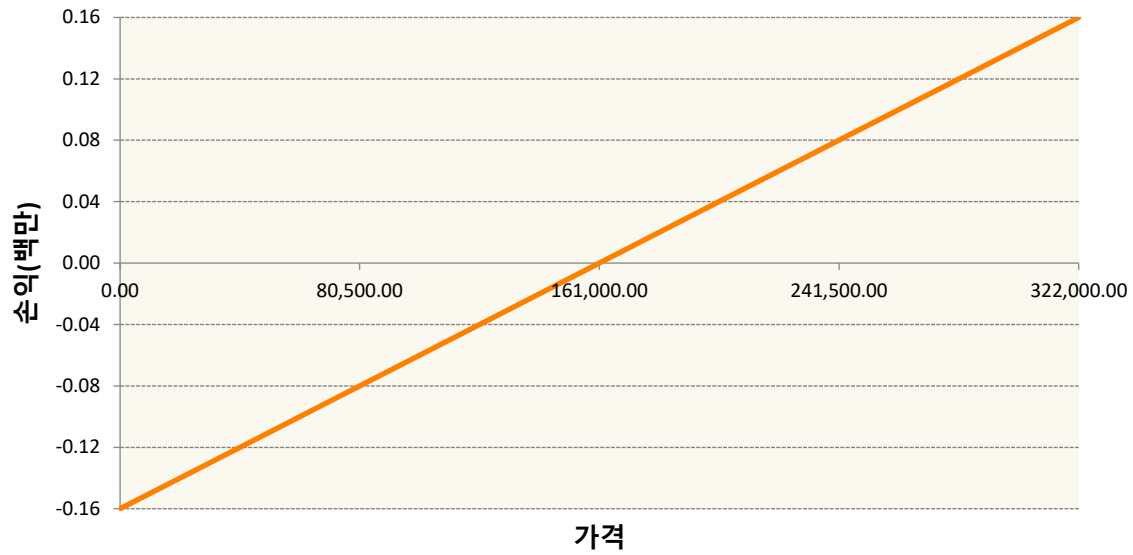
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,302	4,465	-2,163	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	11,544	3,077	8,467	장내
누계	유가증권	스왑	5	0	5	장외

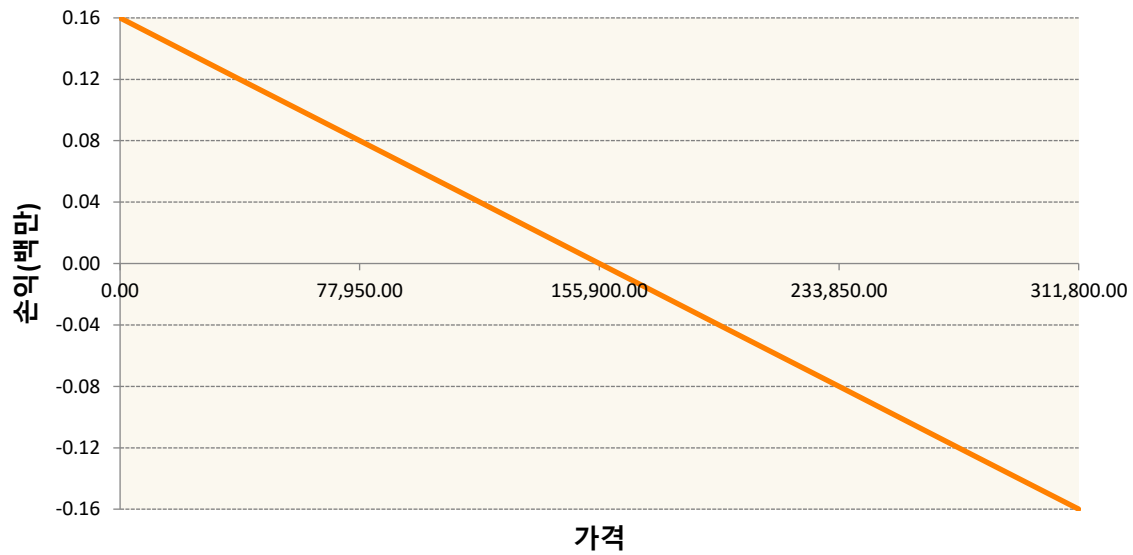
2. 만기시점의 손익구조



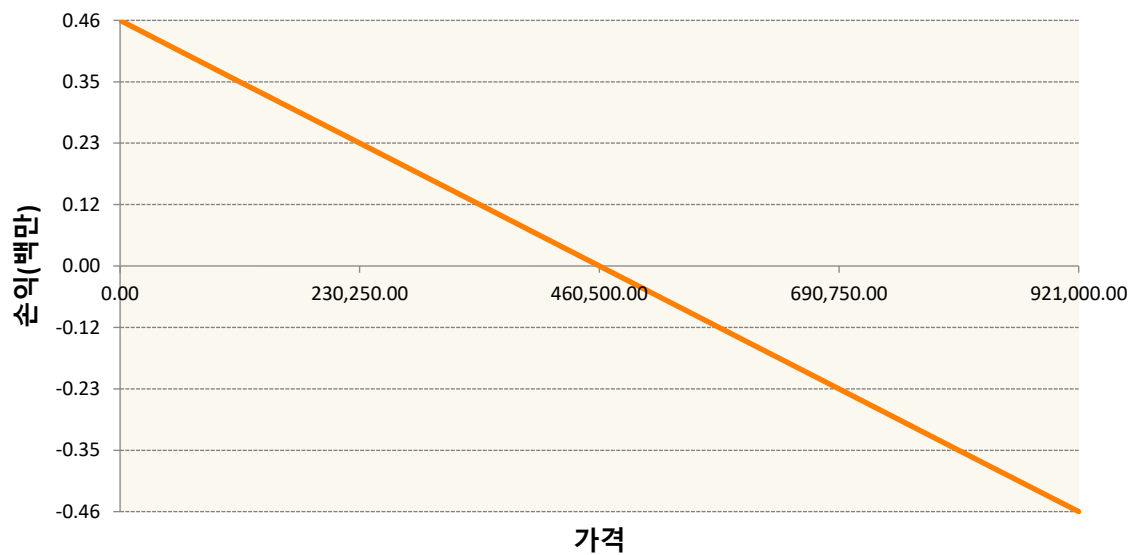
KR4A11620007-2026-02 삼성전자개별선물



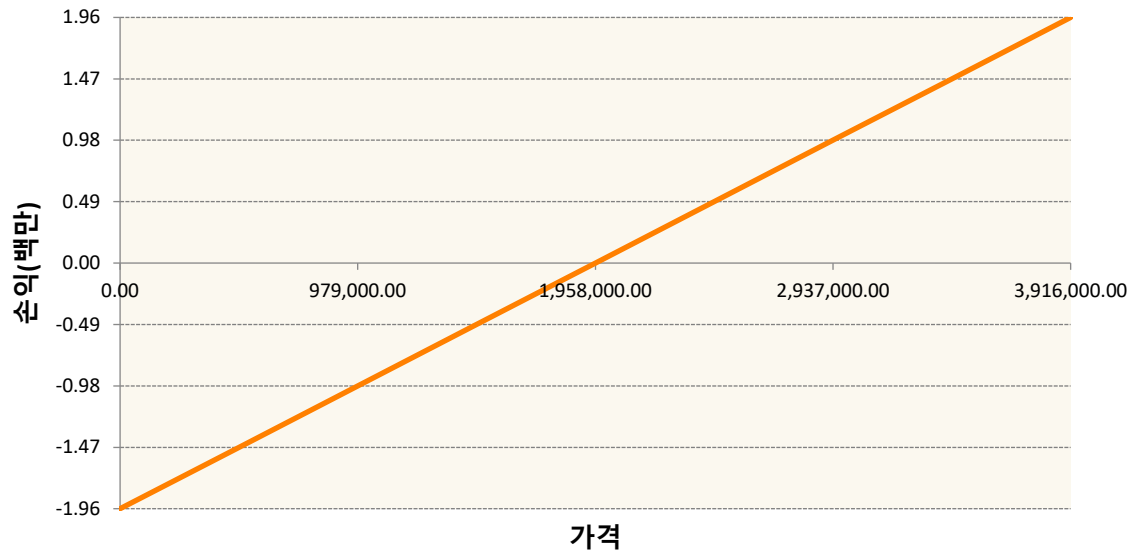
KR4A19620009-2026-02 기아개별선물



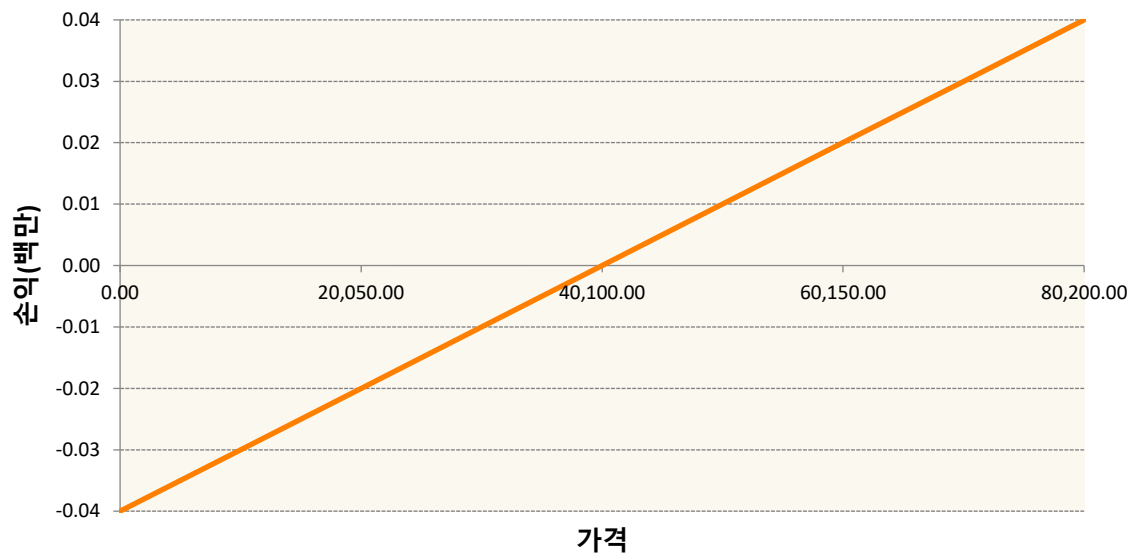
KR4A20620006-2026-02 현대모비스개별선물



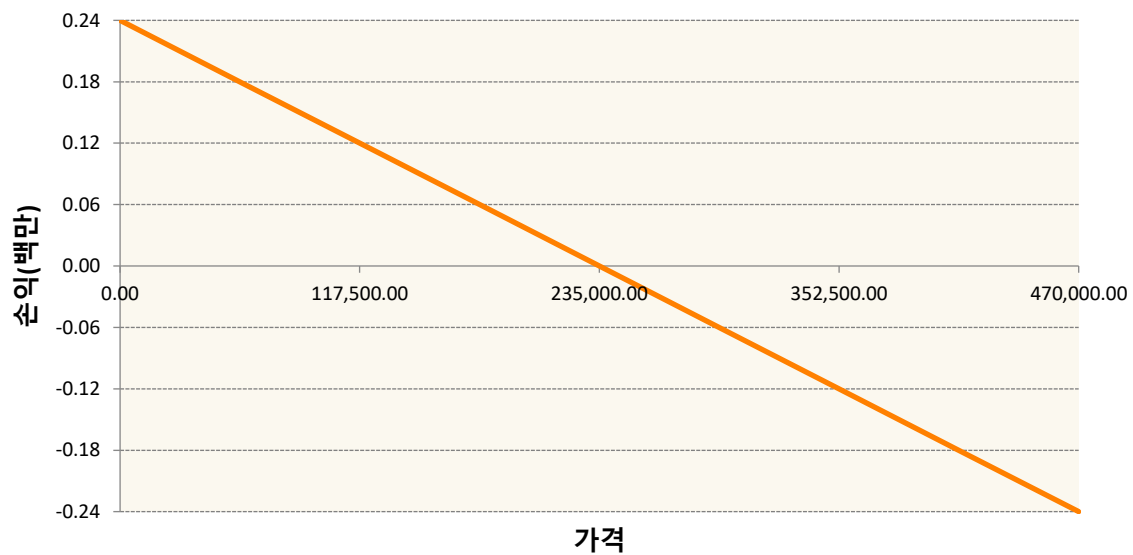
KR4AB3620005-2026-02 고려아연개별선물



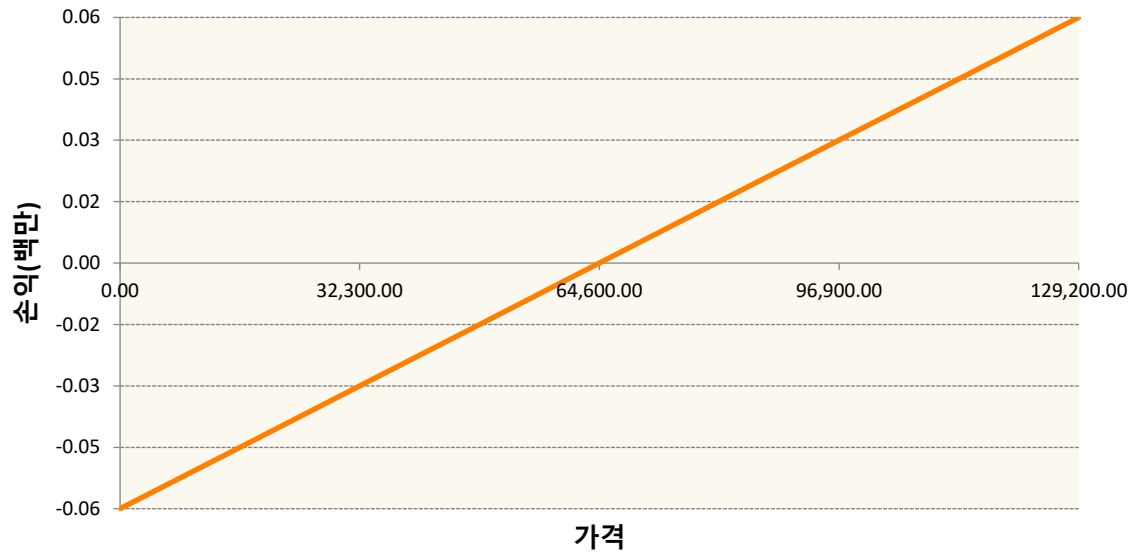
KR4ACN620009-2026-02 포스코DX개별선물



KR4AE8620004-2026-02 포스코퓨처엠개별선물



KR4AF7620002-2026-02 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01630008			2026-03 코스피200지수선물				750
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-750	-750	-750	-750	-750	-750	-750
-5.33%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
-2.67%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	250	250	250	250	250	250	250
5.33%	500	500	500	500	500	500	500
8.00%	750	750	750	750	750	750	750
KR4A11620007			2026-02 삼성전자개별선물				14
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	14	14	14	14	14	14	14
KR4A19620009			2026-02 기아개별선물				83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	83	83	83	83	83	83	83
-5.33%	55	55	55	55	55	55	55
-2.67%	28	28	28	28	28	28	28

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83

KR4A20620006 2026-02 현대모비스개별선물 81

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	81	81	81	81	81	81
-5.33%	54	54	54	54	54	54	54
-2.67%	27	27	27	27	27	27	27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81

KR4AB3620005 2026-02 고려아연개별선물 136

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-136	-136	-136	-136	-136	-136
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-2.67%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	45	45	45	45	45	45	45
5.33%	91	91	91	91	91	91	91
8.00%	136	136	136	136	136	136	136

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

KR4AE8620004 2026-02 포스코퓨처엠개별선물 81

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	81	81	81	81	81	81
-5.33%	54	54	54	54	54	54	54
-2.67%	27	27	27	27	27	27	27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81

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)

1,341

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

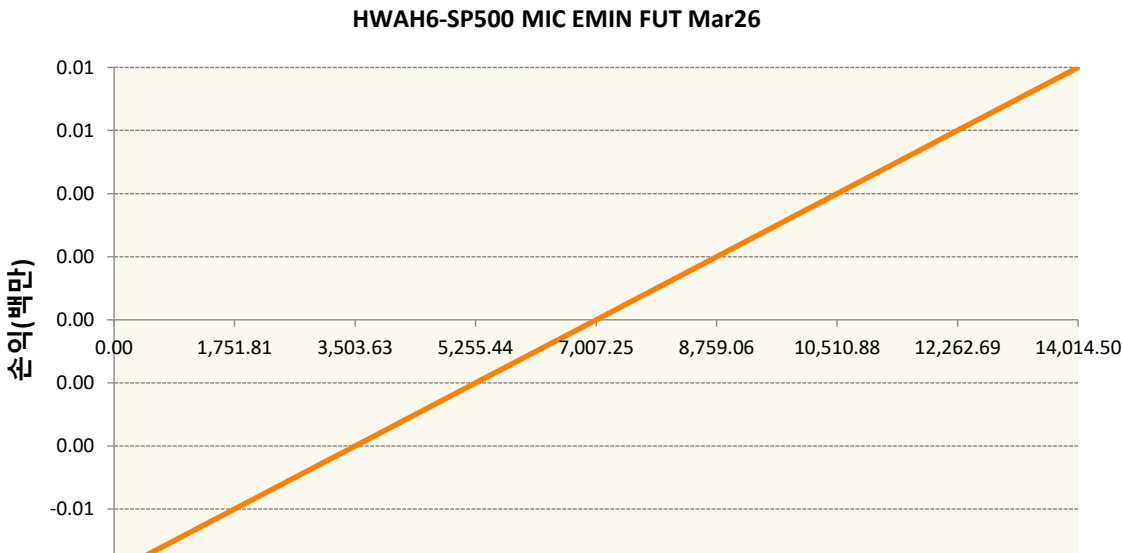
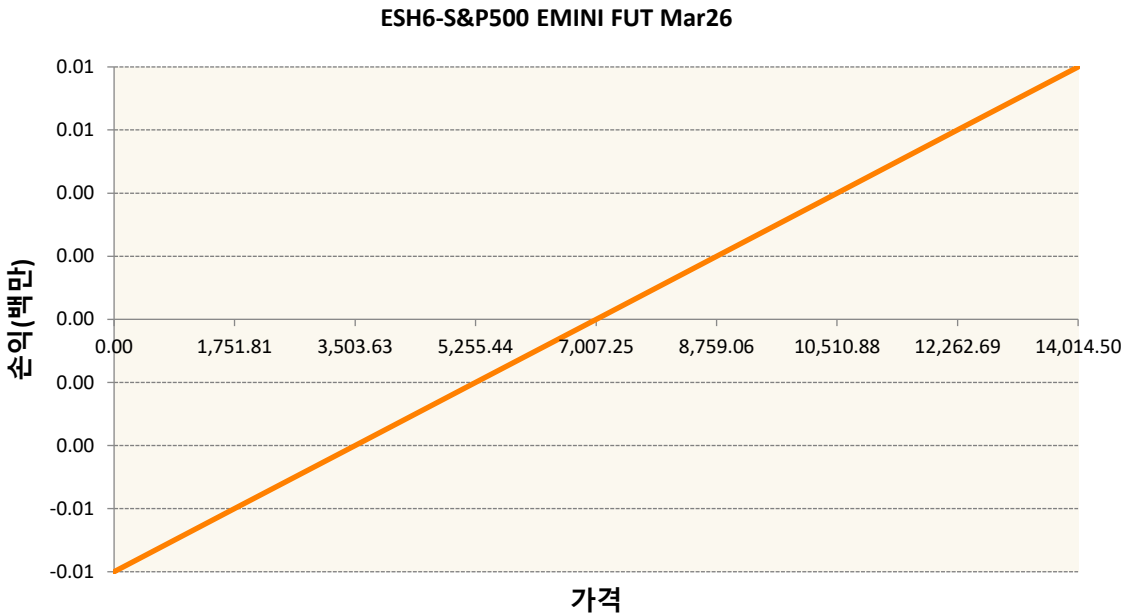
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

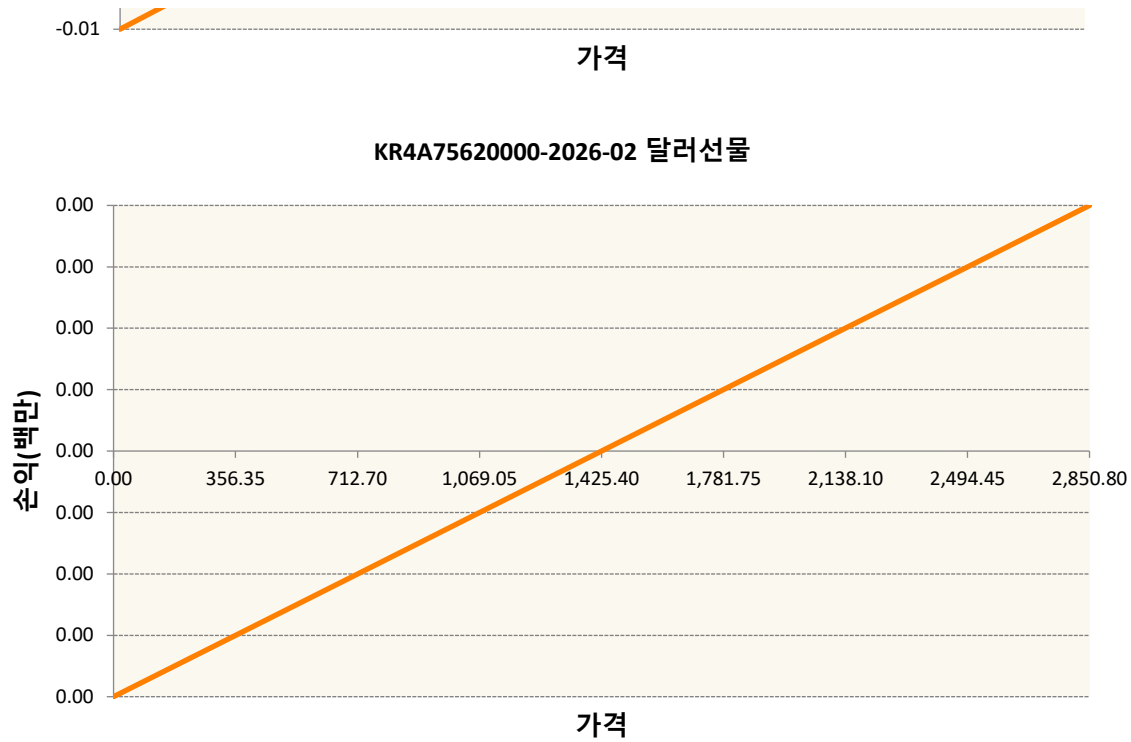
1. 계약금액

(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	1,138	0	1,138	장내
누계	지수	선물	55,748	0	55,748	
누계	통화	선물	4,276	0	4,276	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	342

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

(단위:백만원)

3,906

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

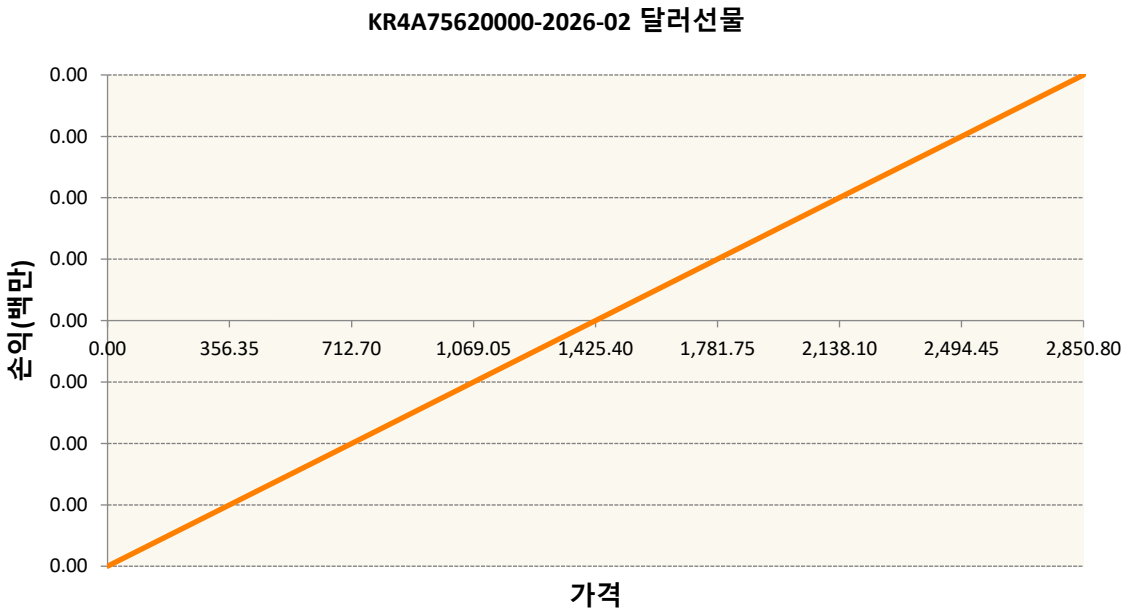
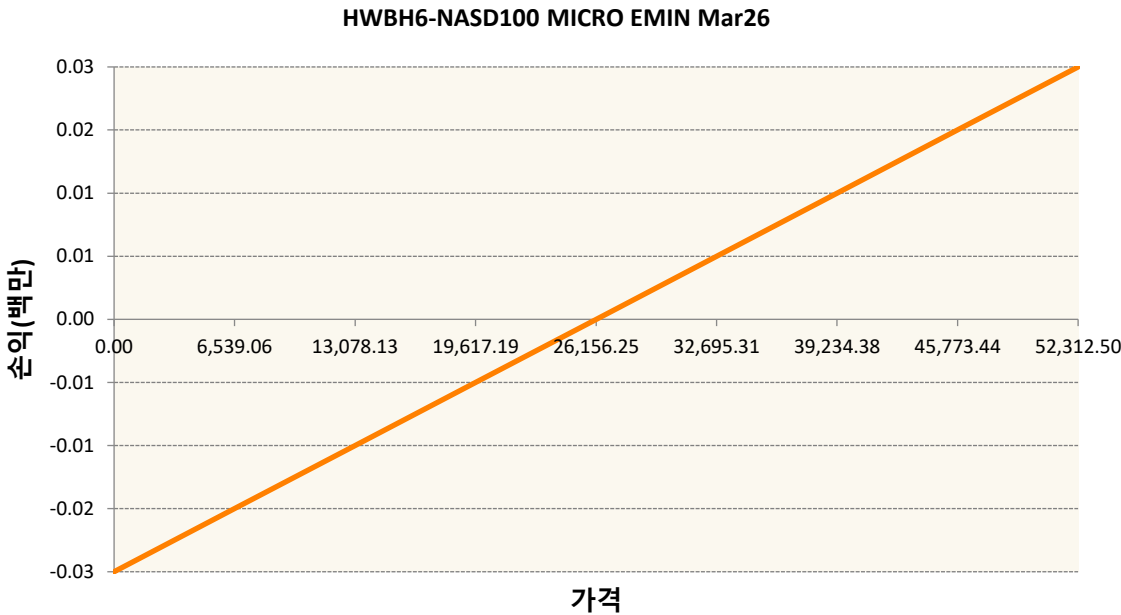
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

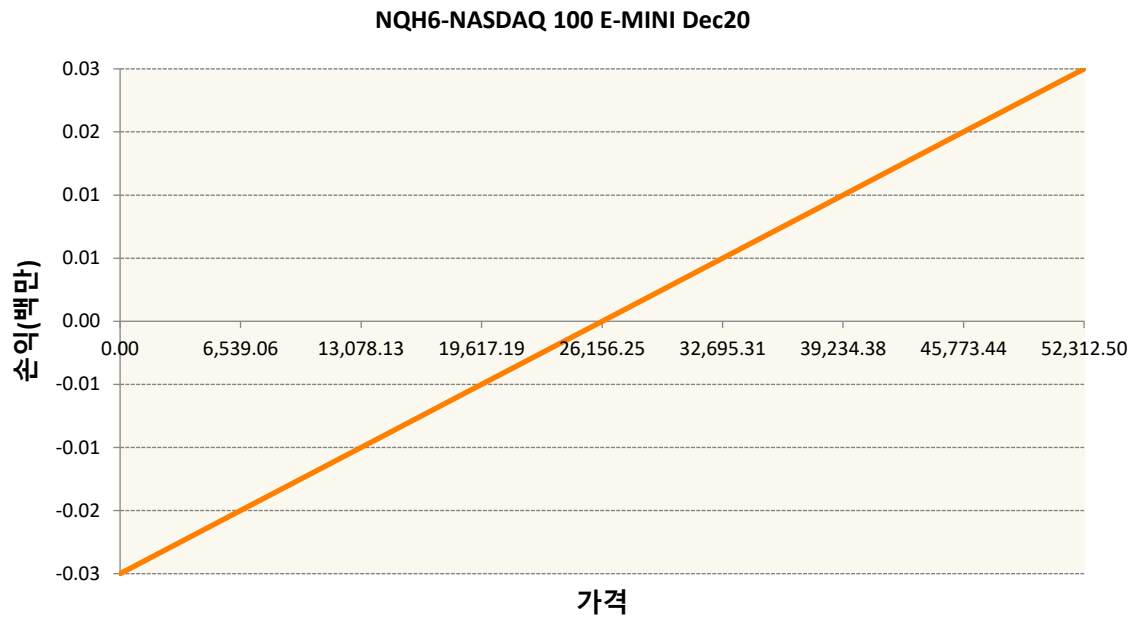
1. 계약금액

(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	25,598	0	25,598	장내
누계	통화	선물	1,568	0	1,568	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		1,974

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,227

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

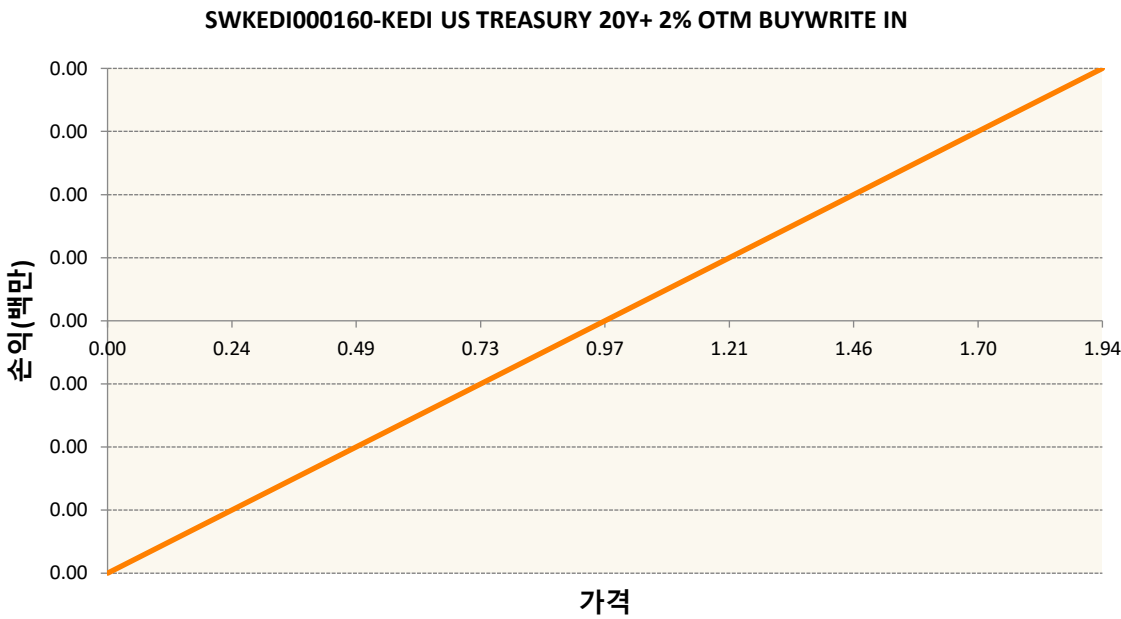
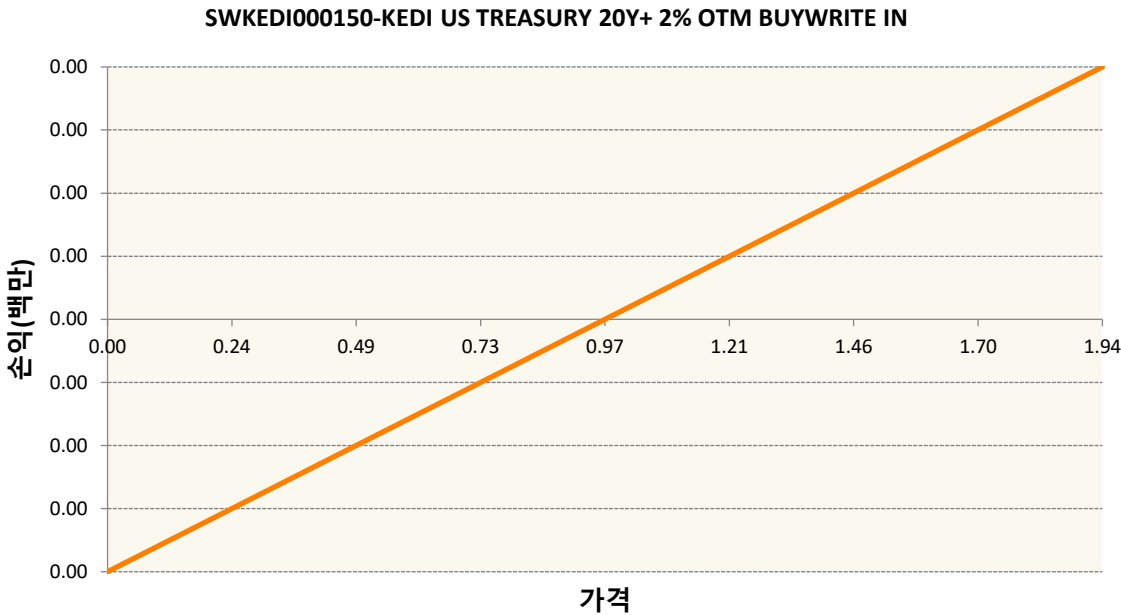
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

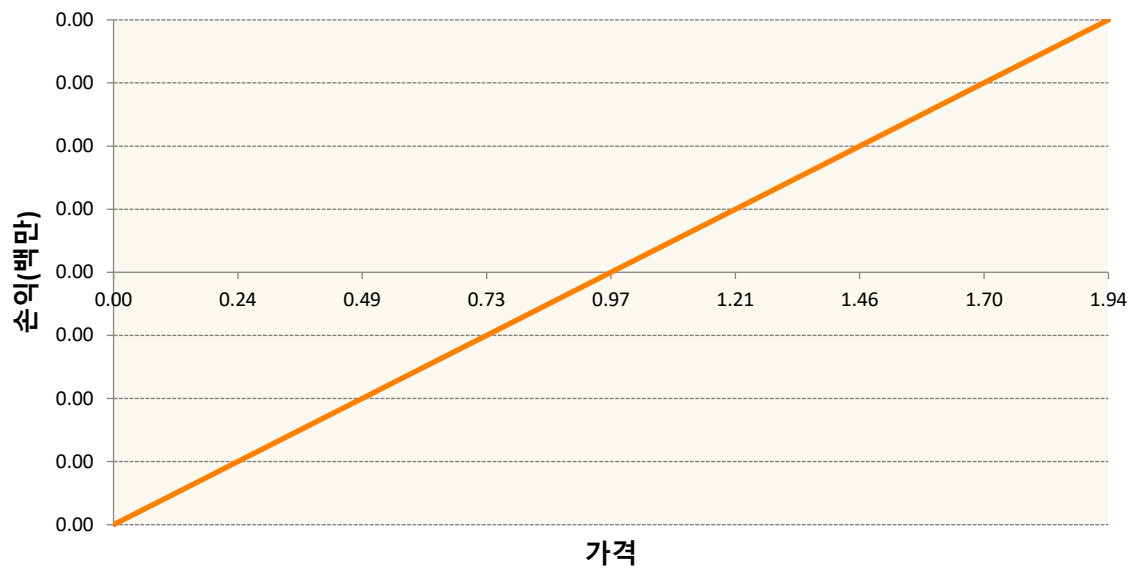
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	378,103	0	378,103	장외

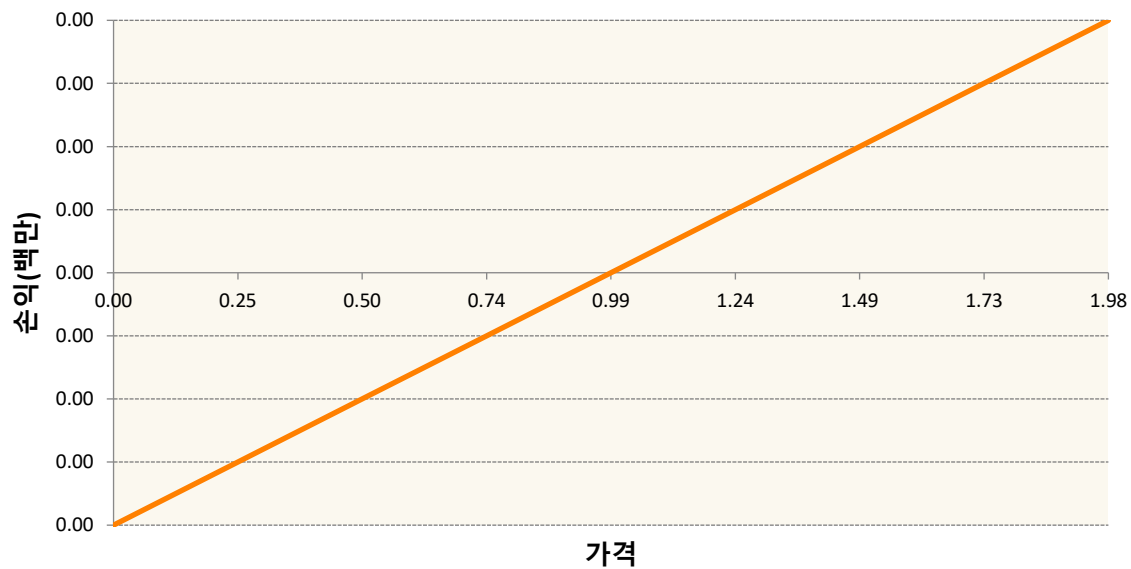
2. 만기시점의 손익구조



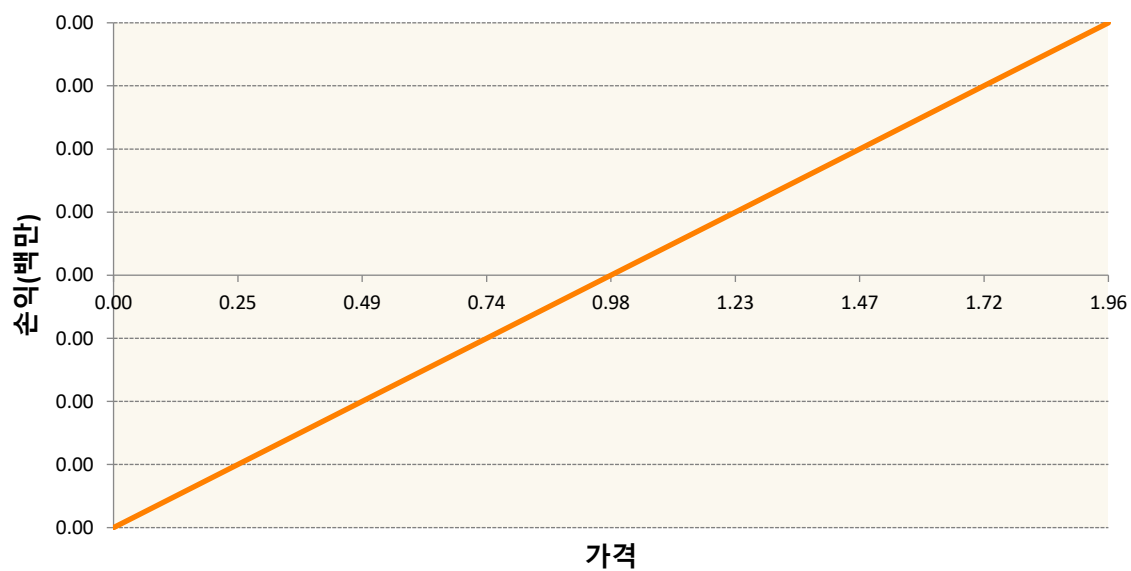
SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		7,960
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,100
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,565
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		144
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		10,377

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,727

공시일	2026-01-30
기준일	2026-01-29

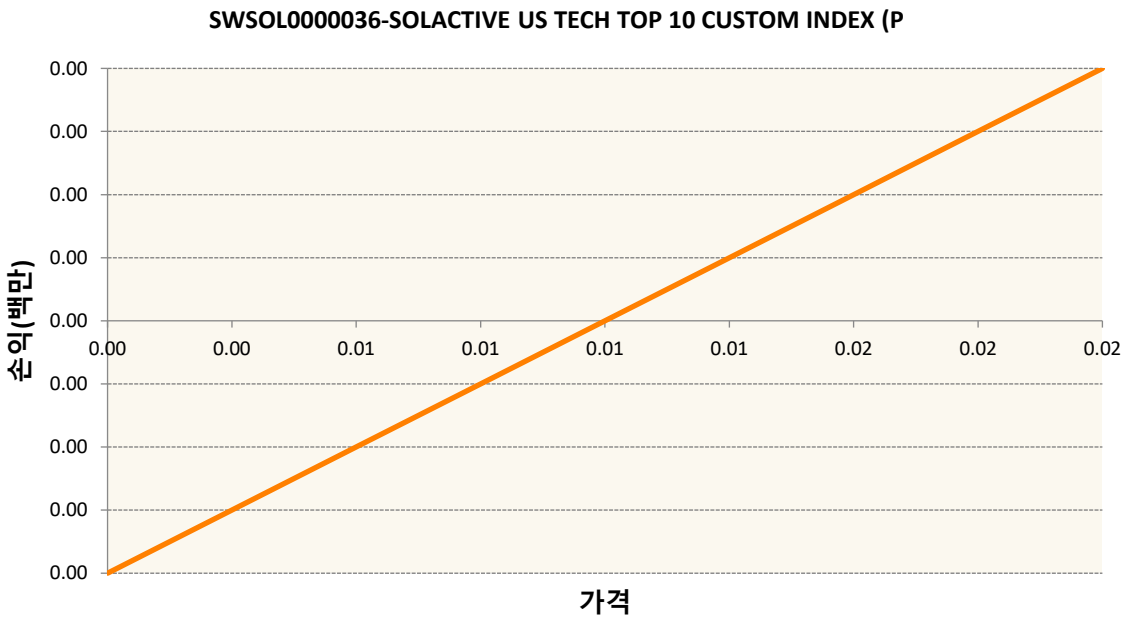
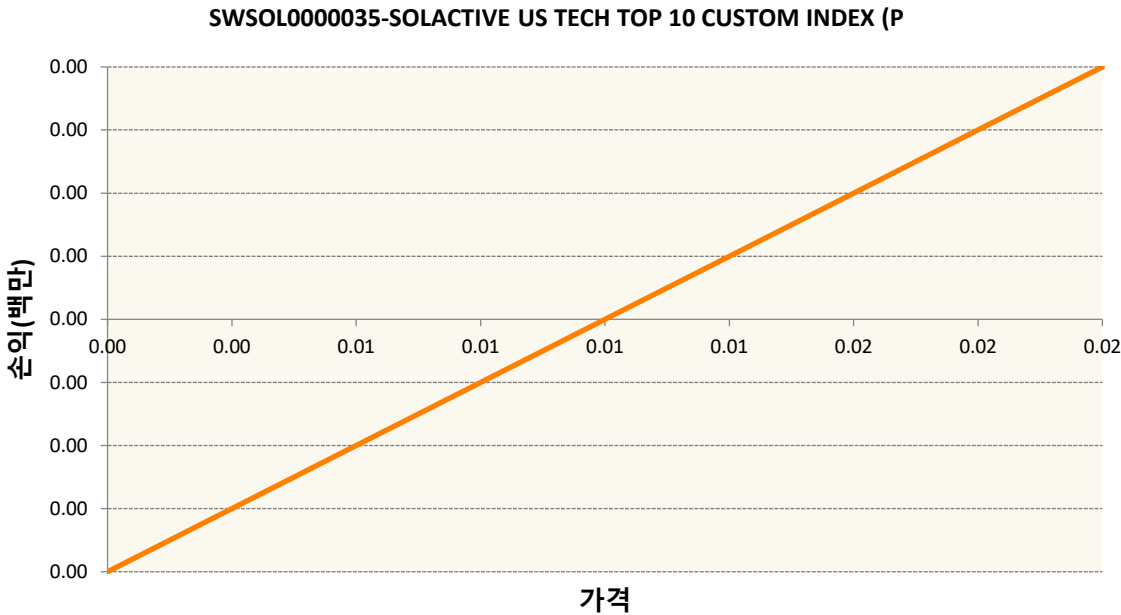
SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

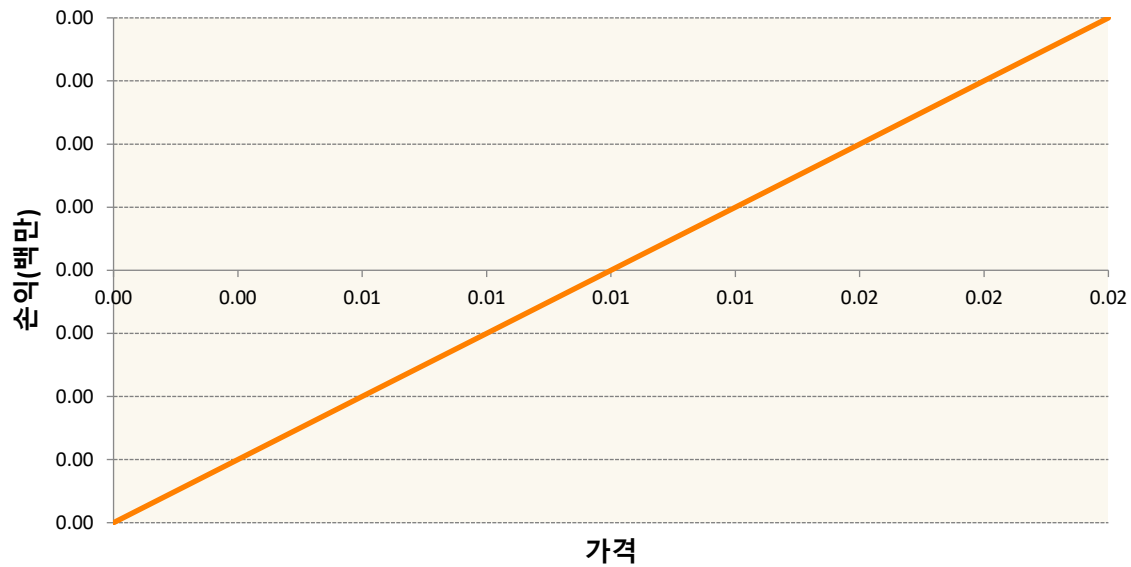
(단위:백만원)

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

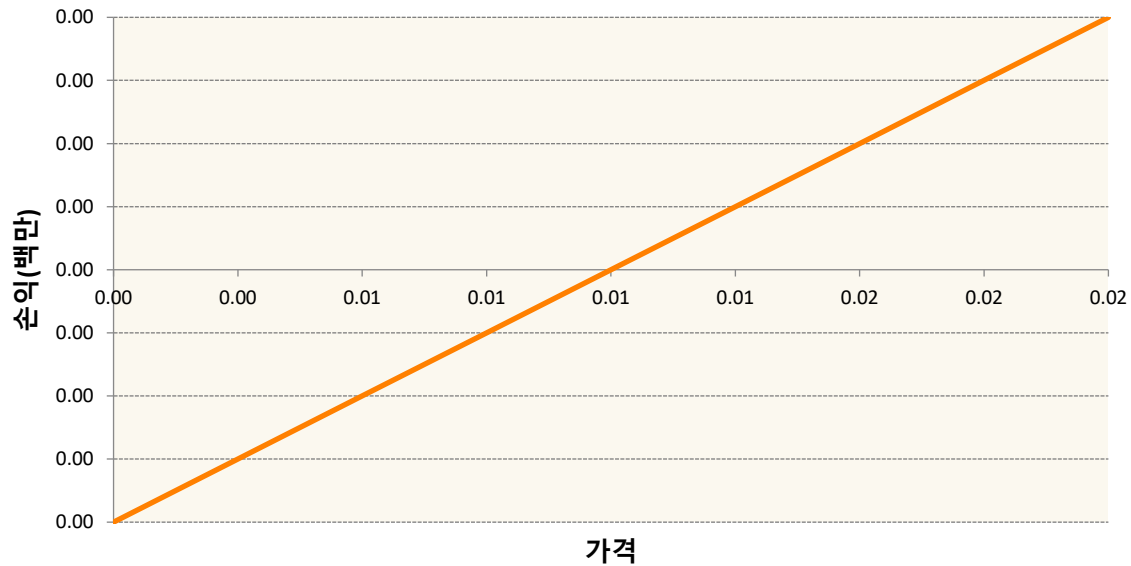
2. 만기시점의 손익구조



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	2026-01-30
기준일	2026-01-29

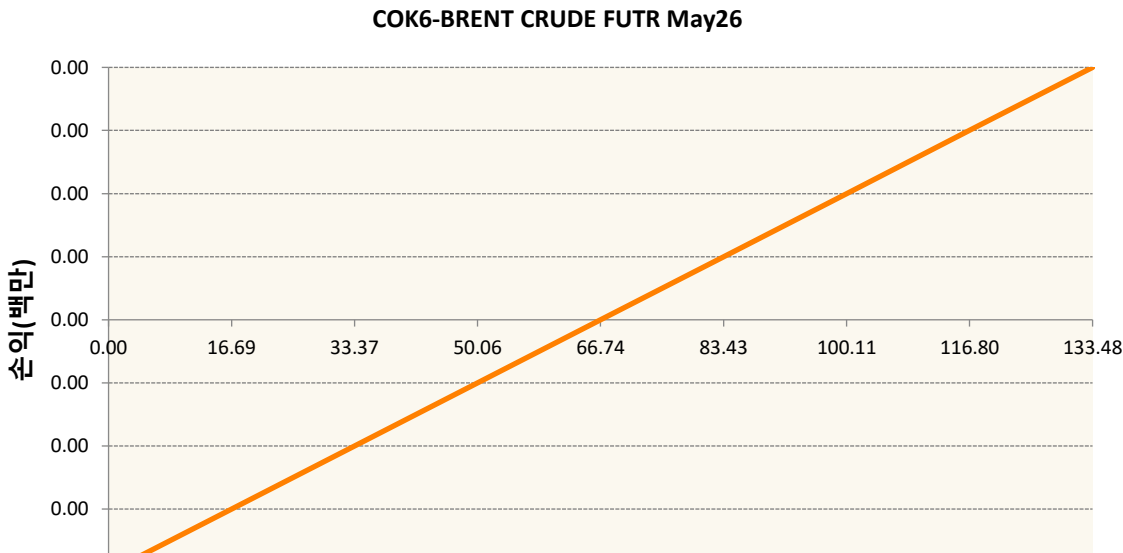
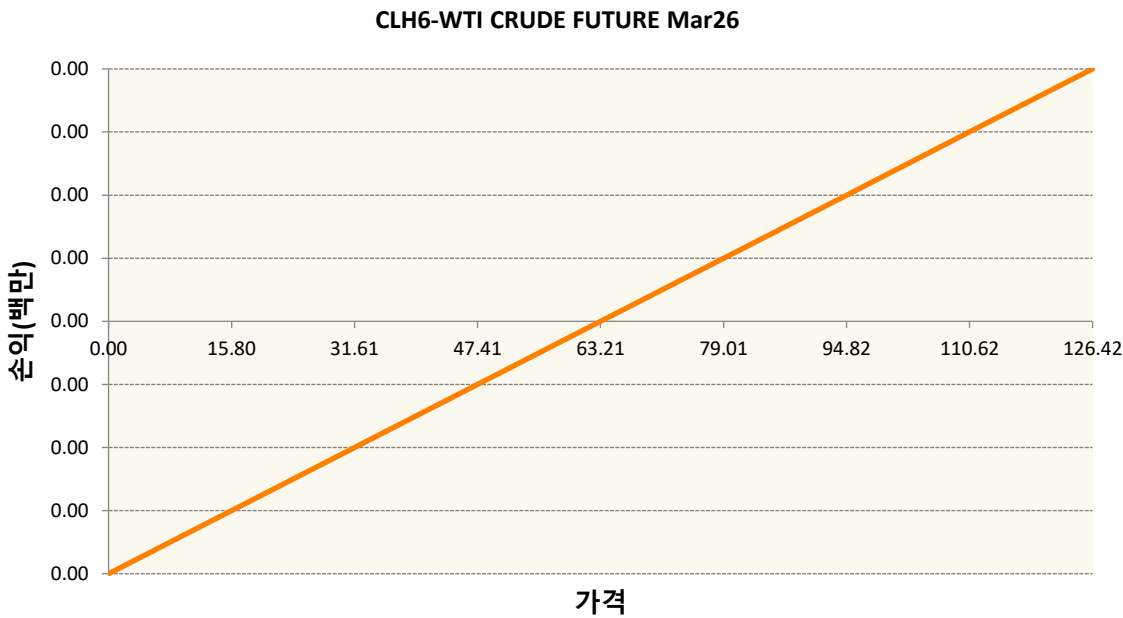
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

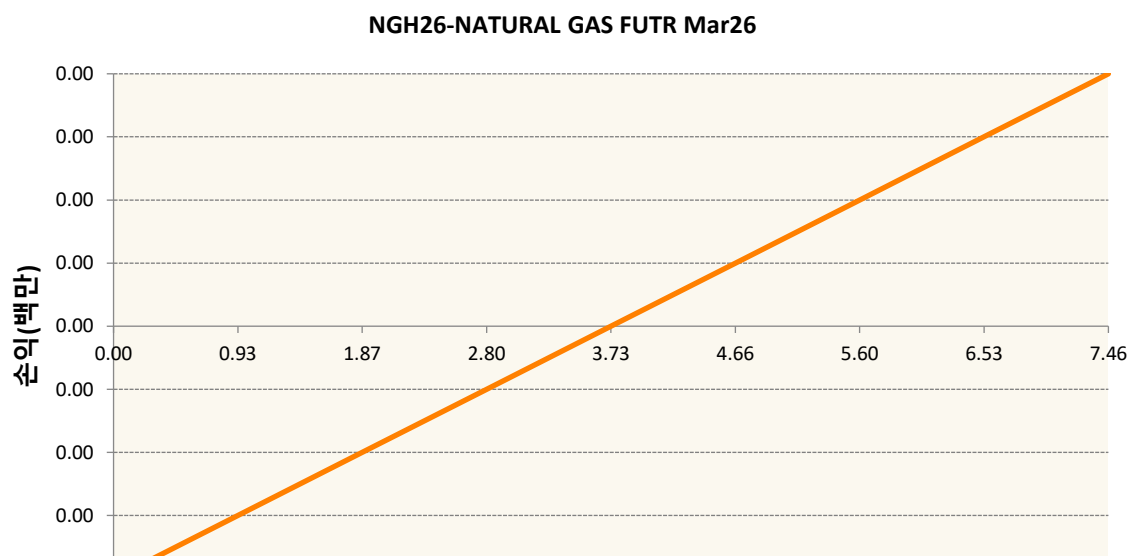
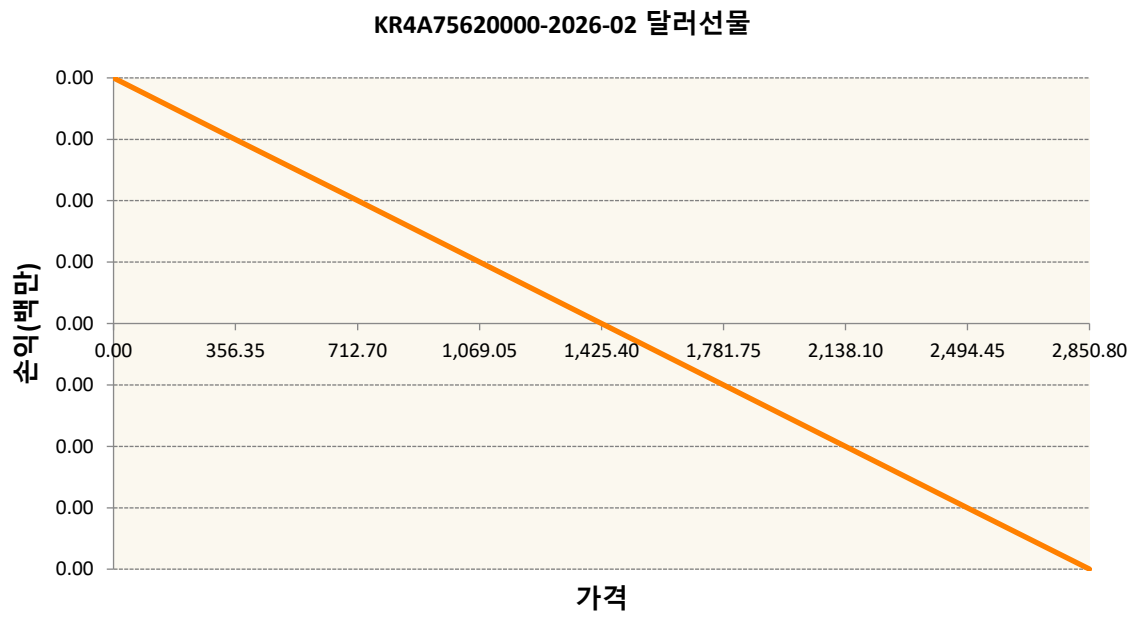
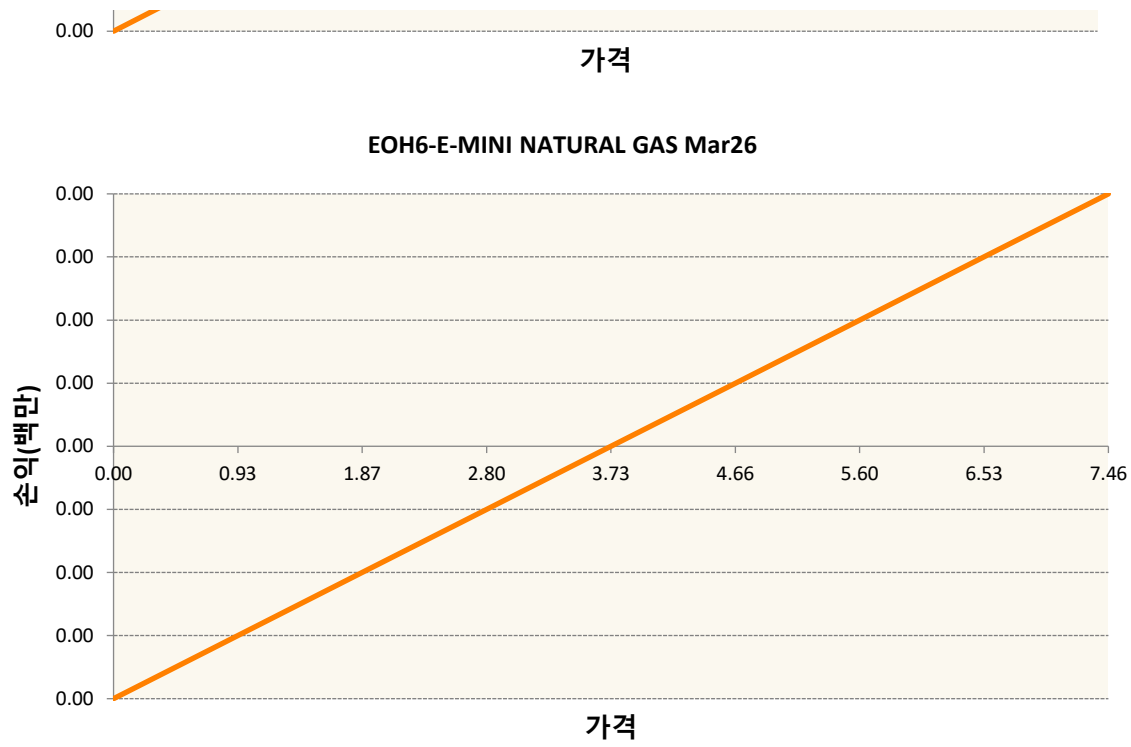
1. 계약금액

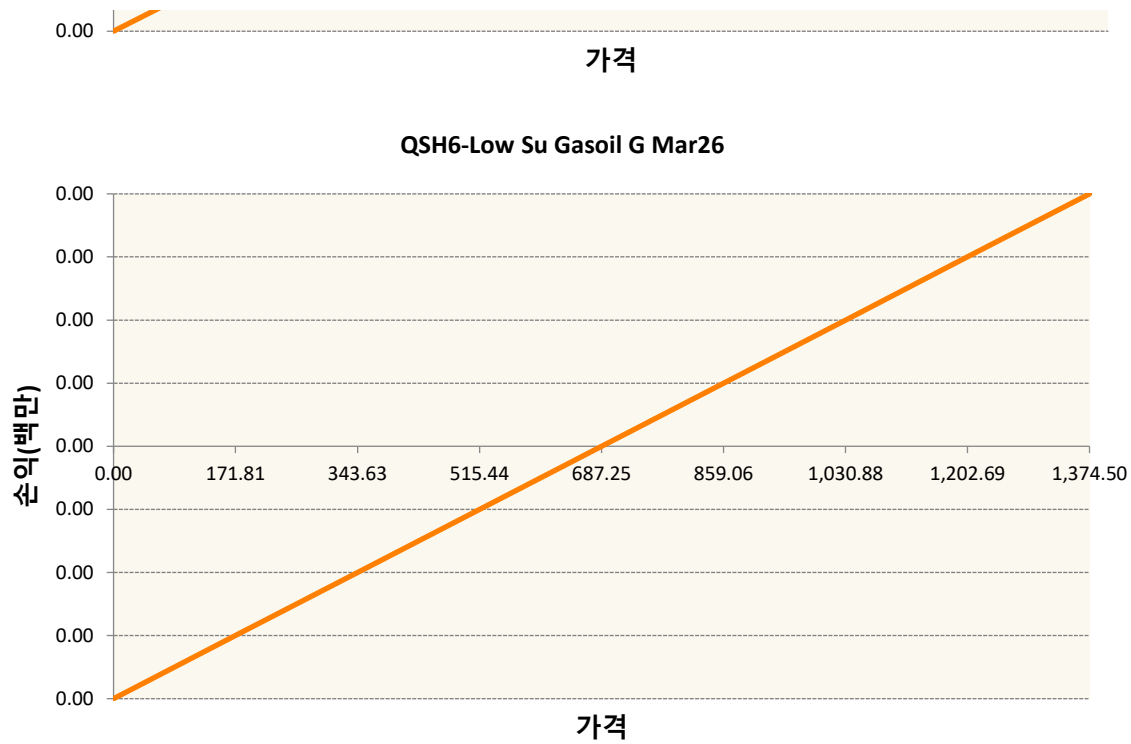
(단위:백만원)

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	137	0	137	
누계	유가증권	선물	390	0	390	
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)

93