

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

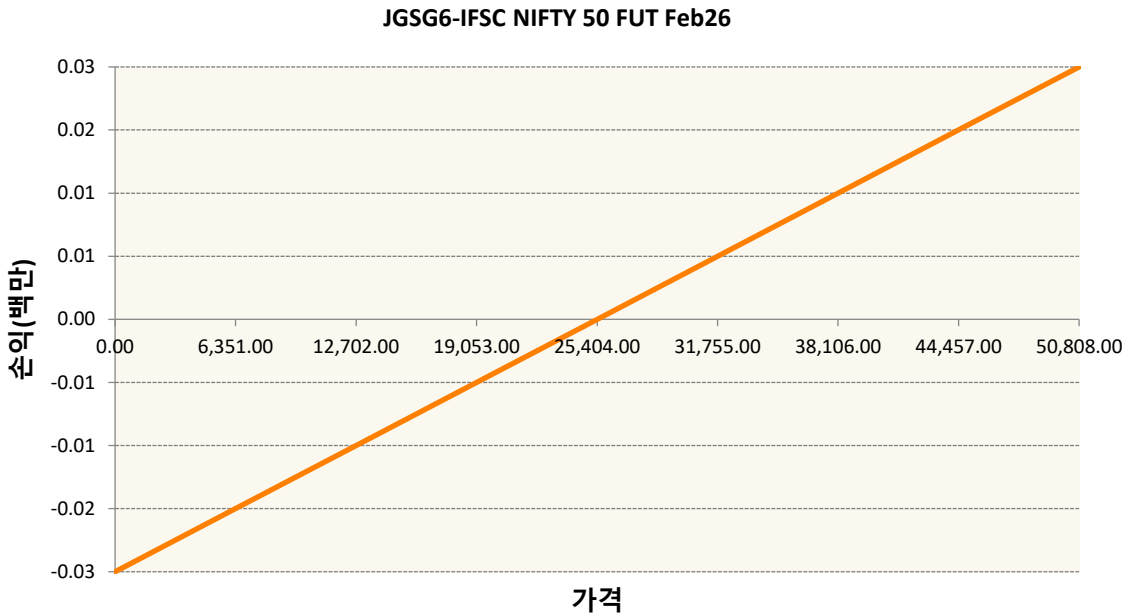
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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)

32

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

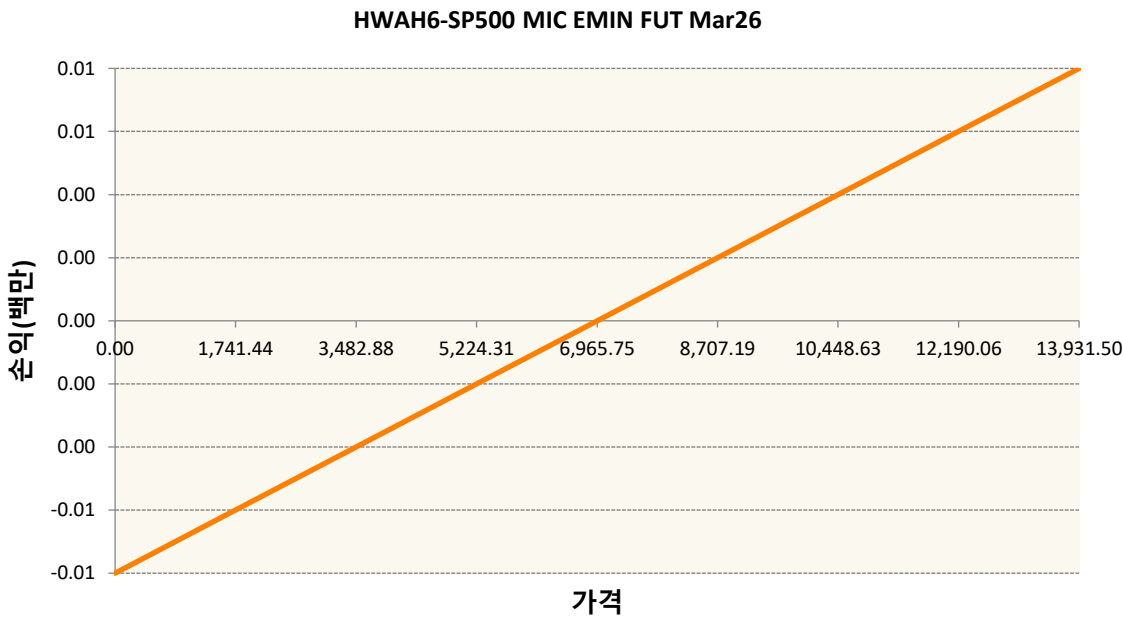
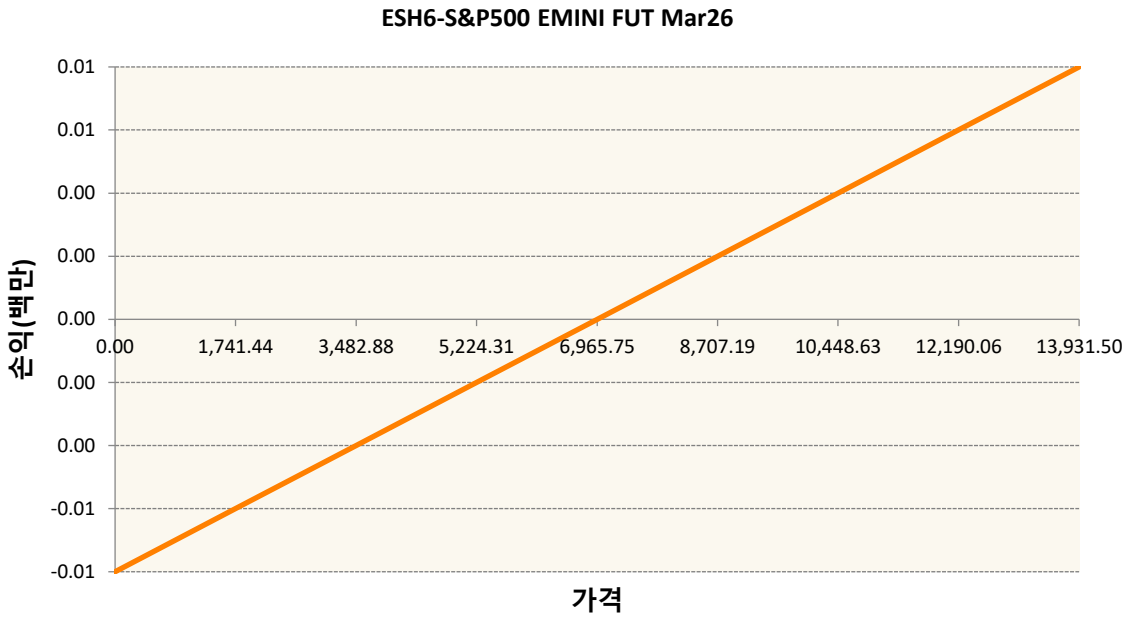
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	206	0	206	장내
누계	지수	선물	515	0	515	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	41
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	16

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	49

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

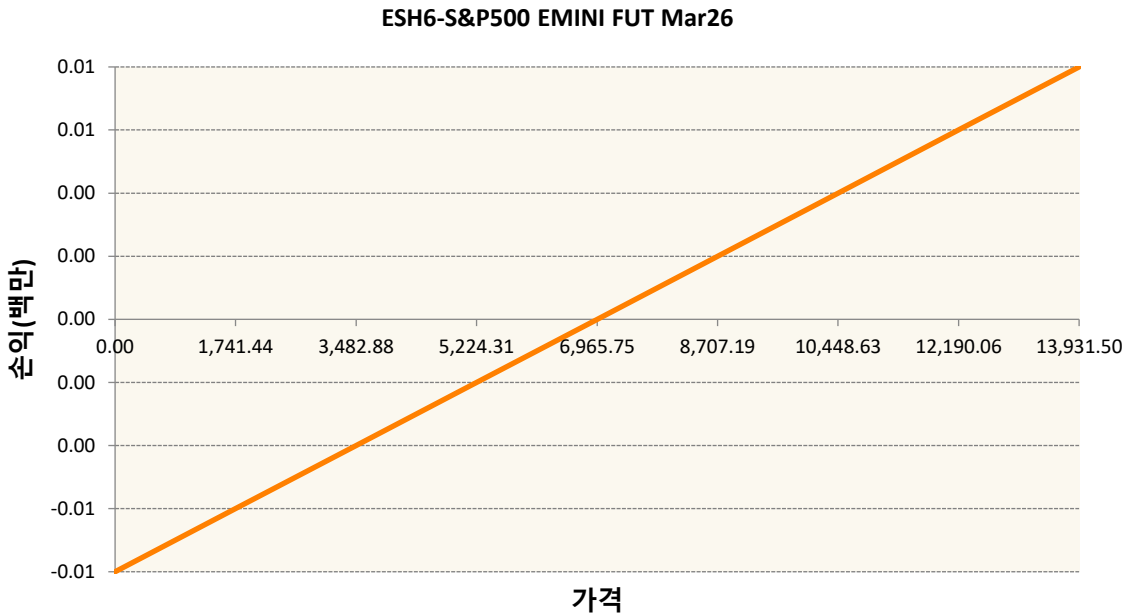
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,544	0	1,544	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

106

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

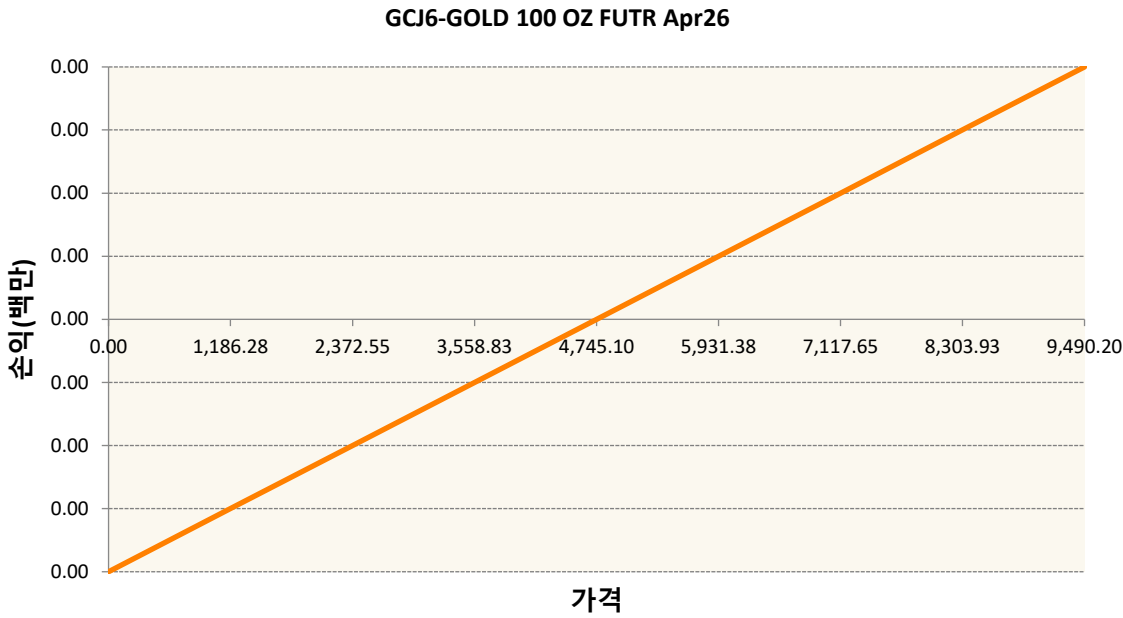
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,735	0	4,735	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 02/06/26 C485 EQUITY	3
GCI6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	379

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

(단위:백만원)

420

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

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)

AOPLTRUCP' PLTR US 02/06/26 C165 EQUITY	87
AOPLTRUPP' PLTR US 02/06/26 P165 EQUITY	129

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

(단위:백만원)

814

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

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)

AOTLTUSC8TLT US 02/06/26 C88.5 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

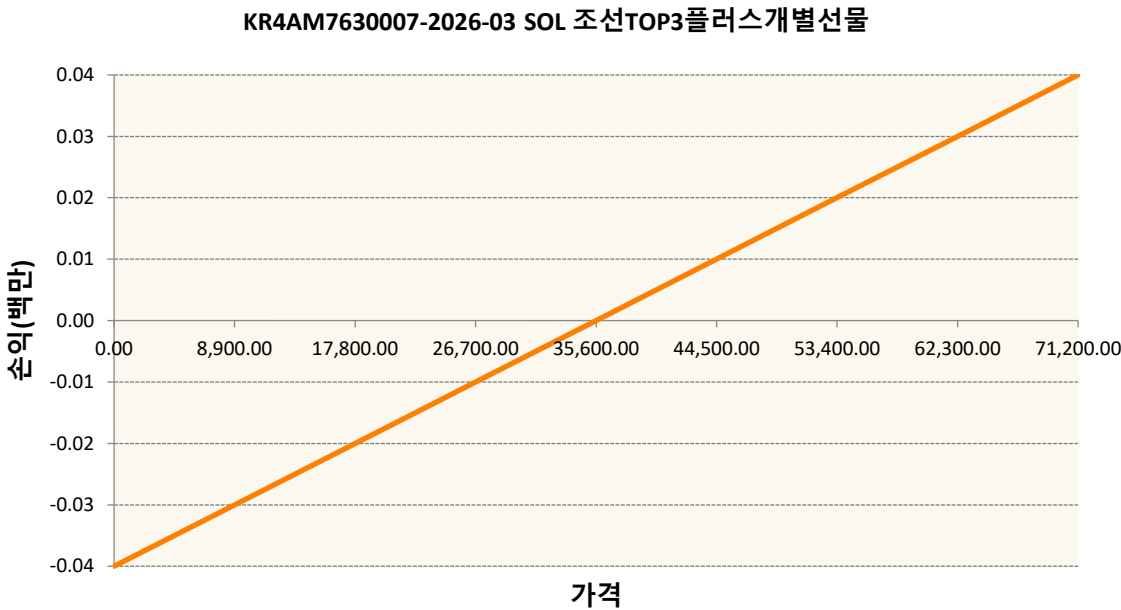
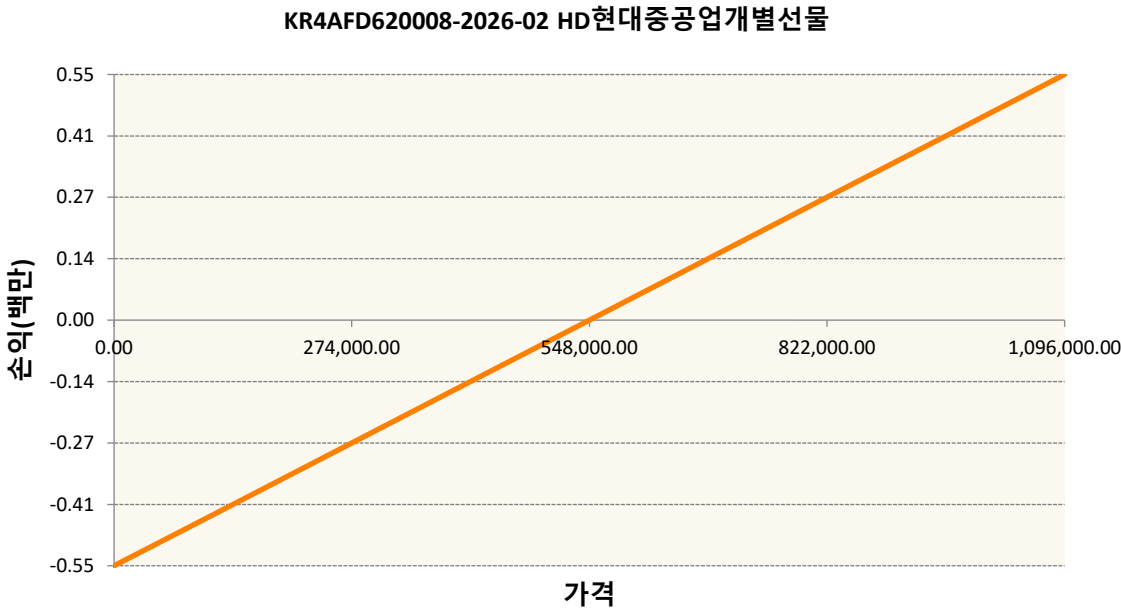
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	4	-4	장내
누계	유가증권	선물	21,937	0	21,937	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD620008			2026-02 HD현대중공업개별선물				880
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-880	-880	-880	-880	-880	-880	-880
-5.33%	-587	-587	-587	-587	-587	-587	-587
-2.67%	-293	-293	-293	-293	-293	-293	-293
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	293	293	293	293	293	293	293
5.33%	587	587	587	587	587	587	587
8.00%	880	880	880	880	880	880	880
KR4AM7630007			2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물				871
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-871	-871	-871	-871	-871	-871	-871
-5.33%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581
-2.67%	-290	-290	-290	-290	-290	-290	-290
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	290	290	290	290	290	290	290
5.33%	581	581	581	581	581	581	581
8.00%	871	871	871	871	871	871	871

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

1,586

공시일 2026-02-03

기준일 2026-02-02

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	2026-02-03
기준일	2026-02-02

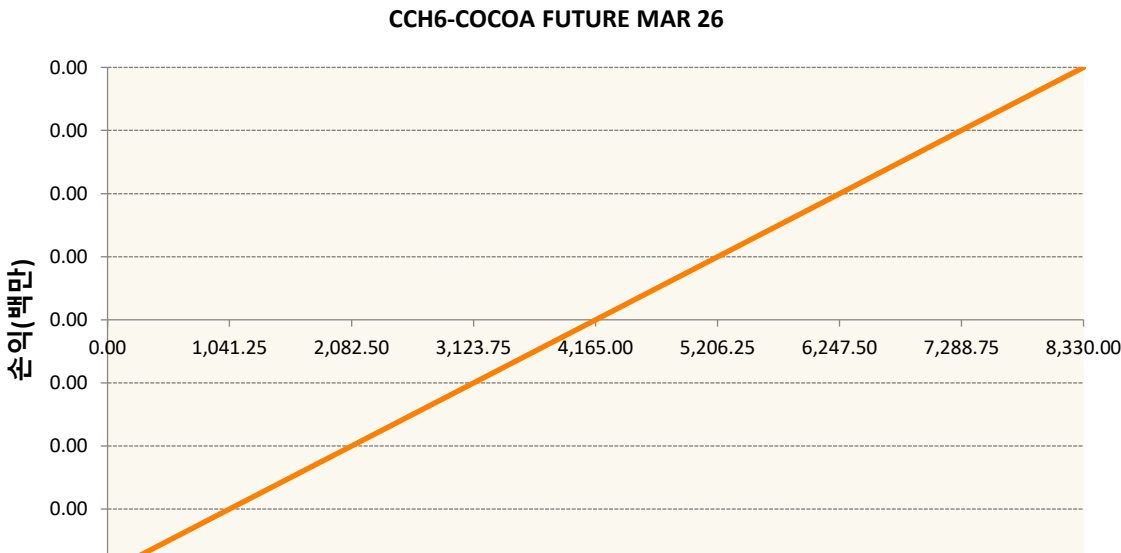
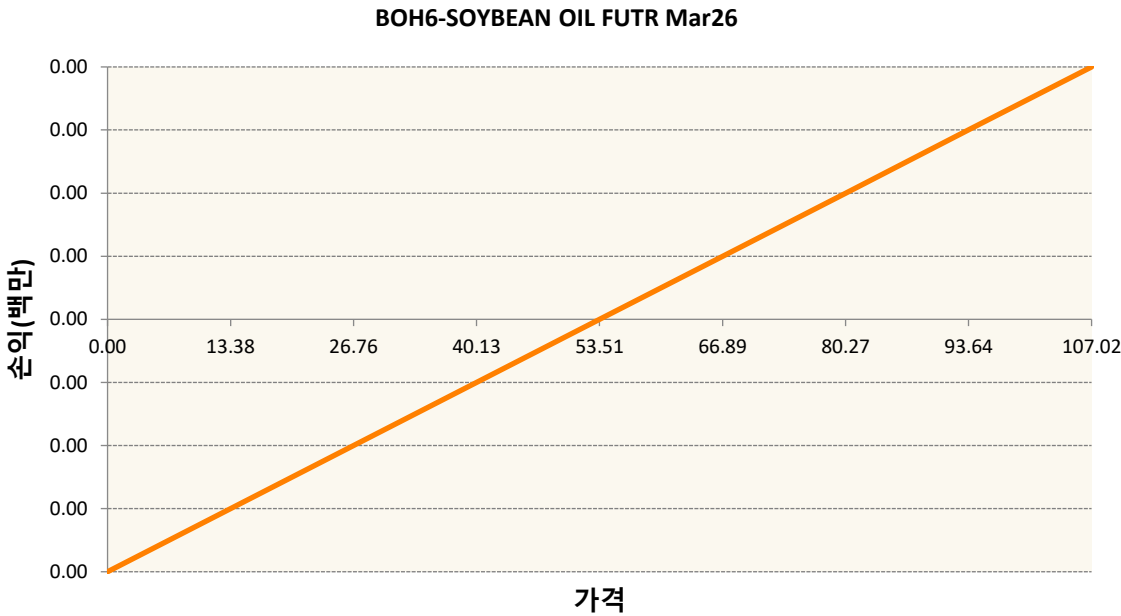
포커스농산물모(채권-파생형)

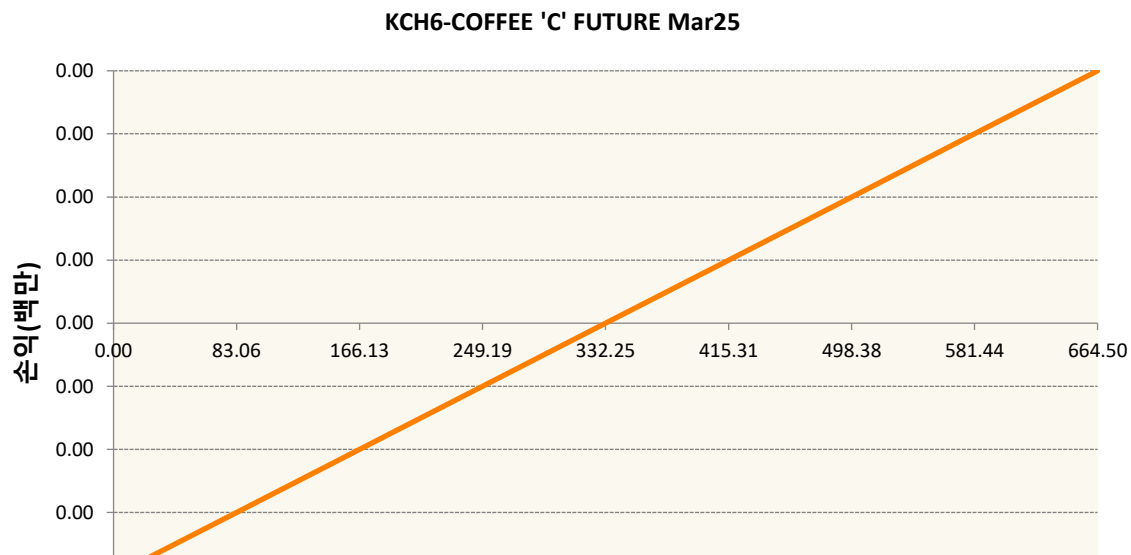
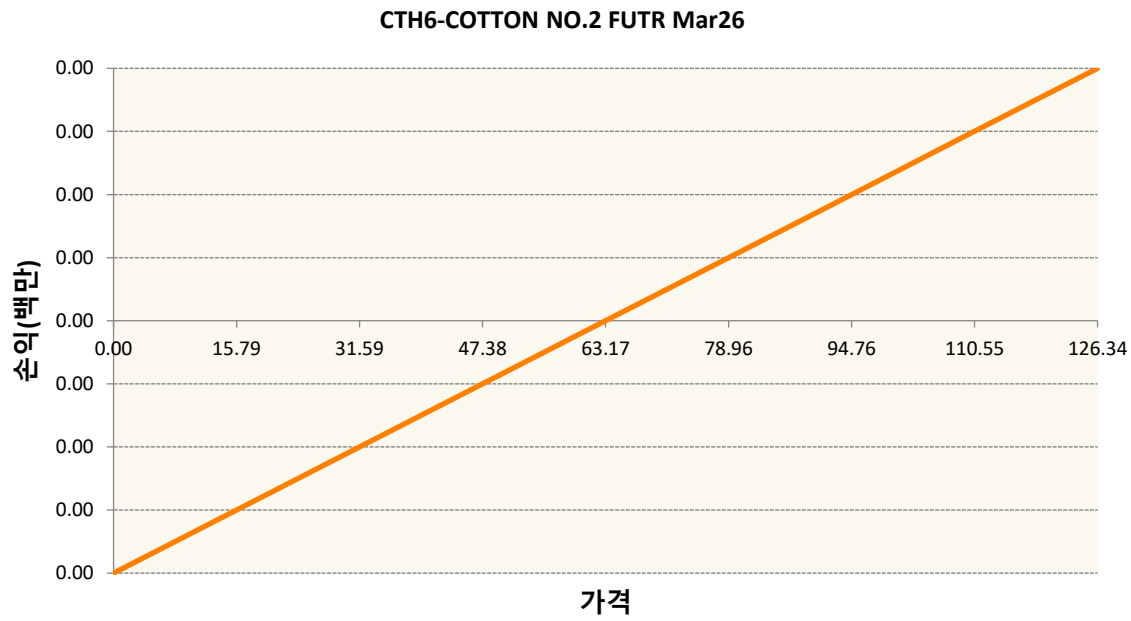
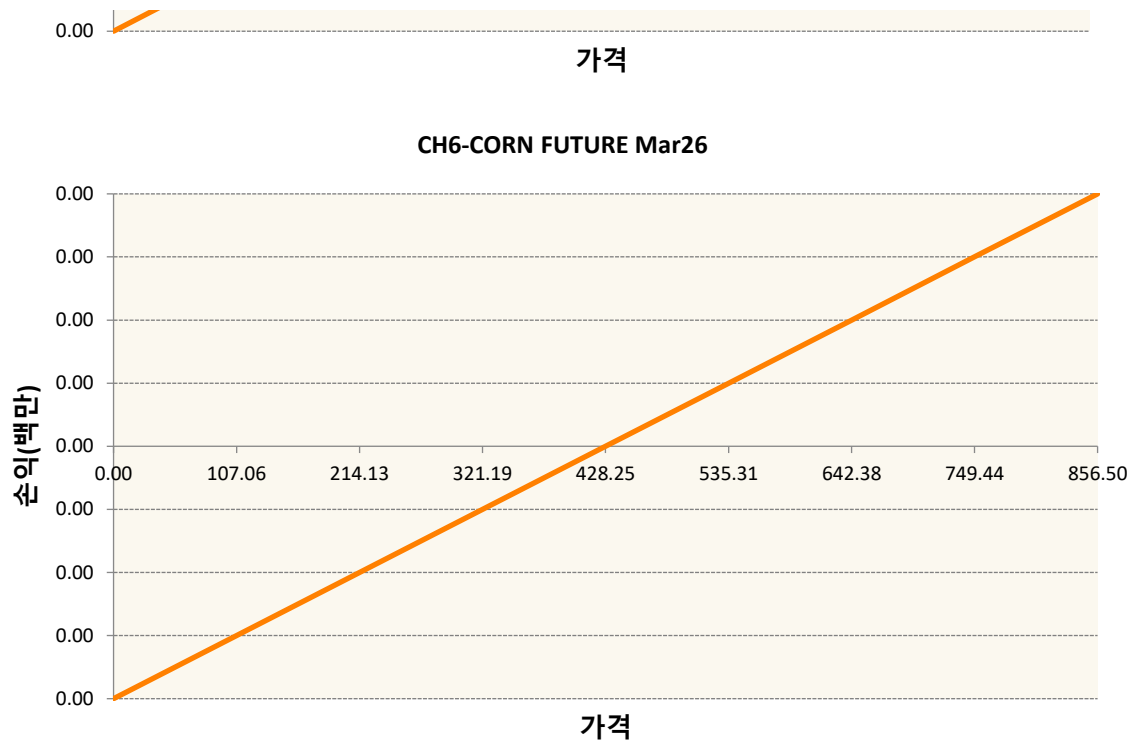
1. 계약금액

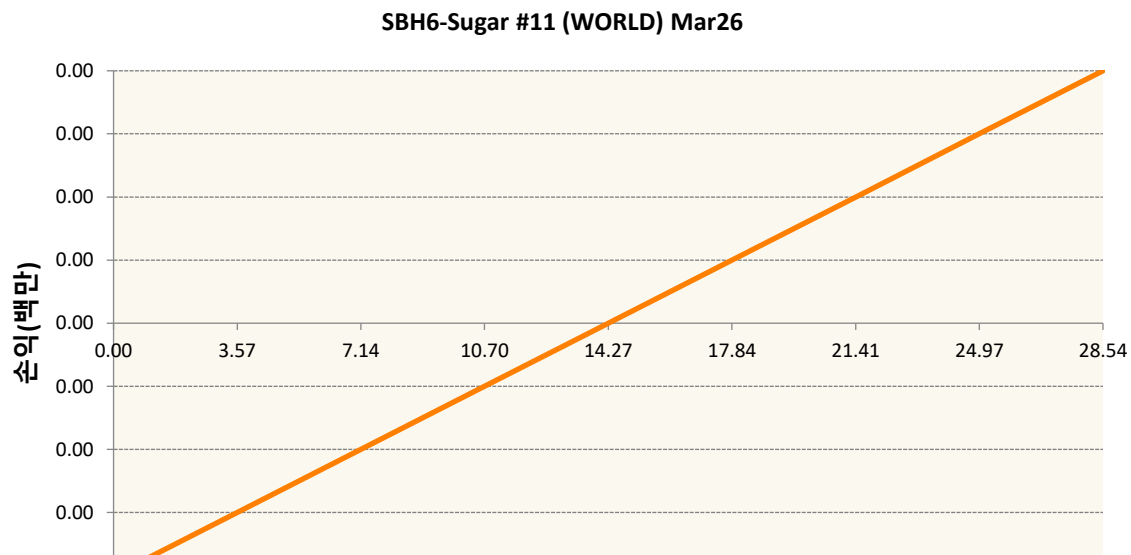
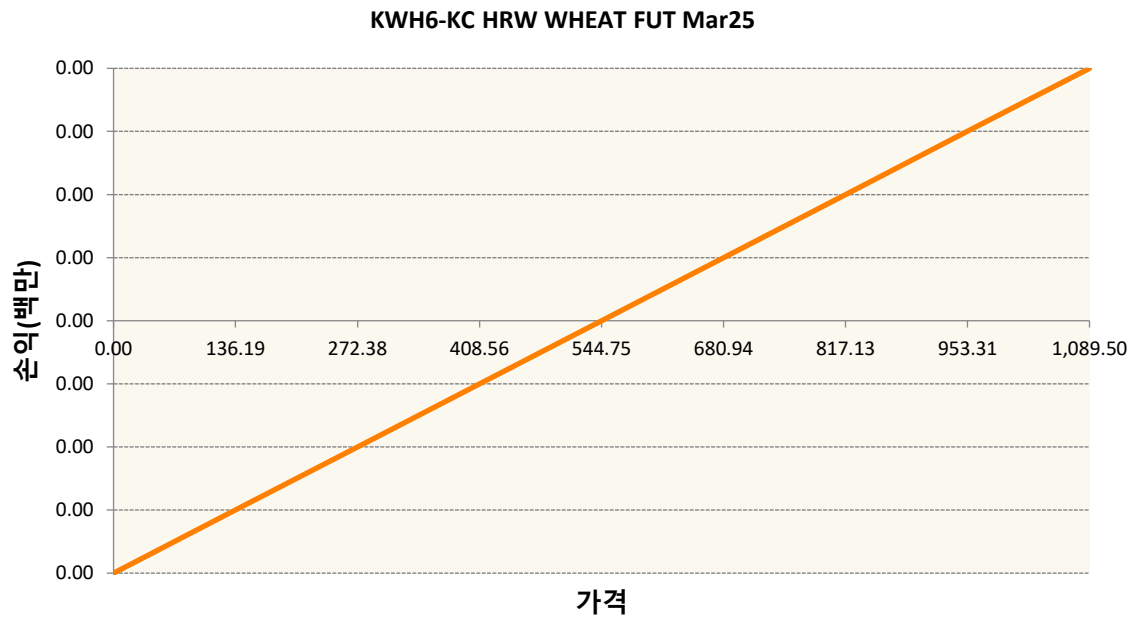
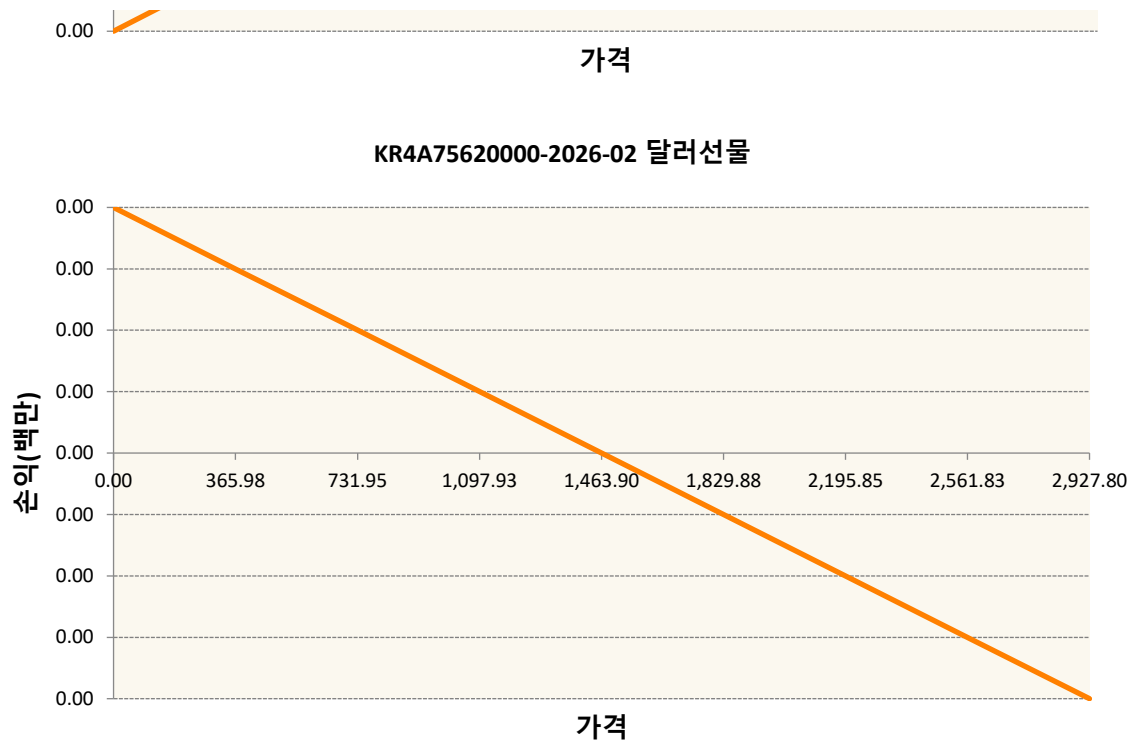
(단위:USD 백만)

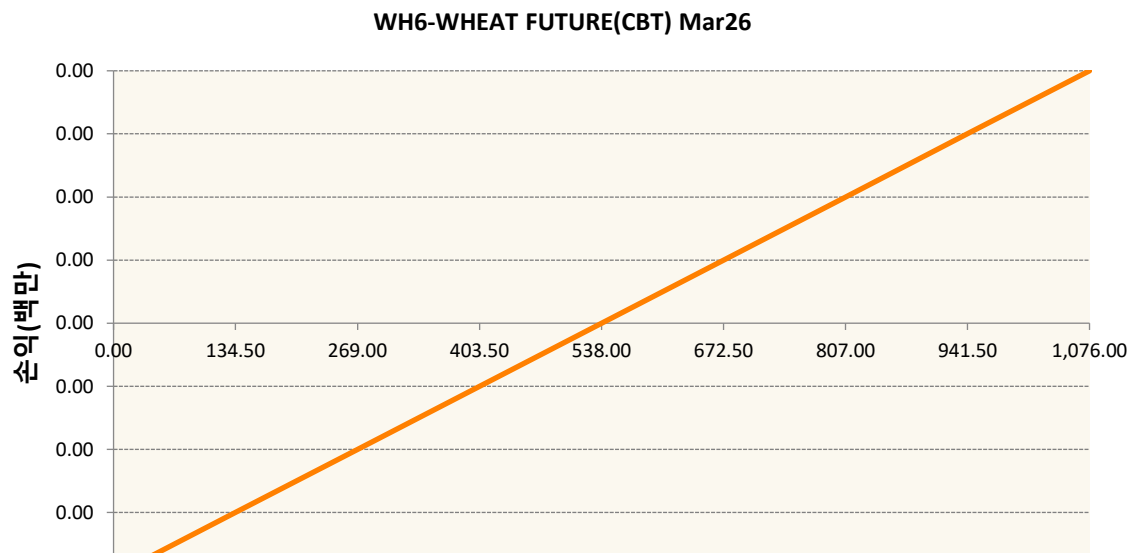
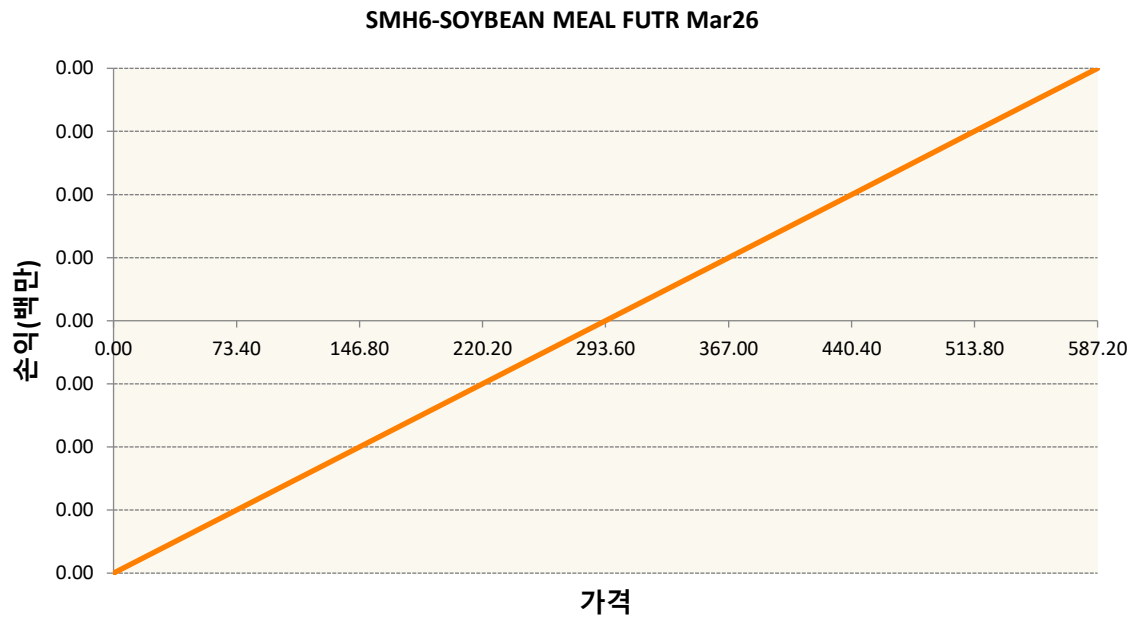
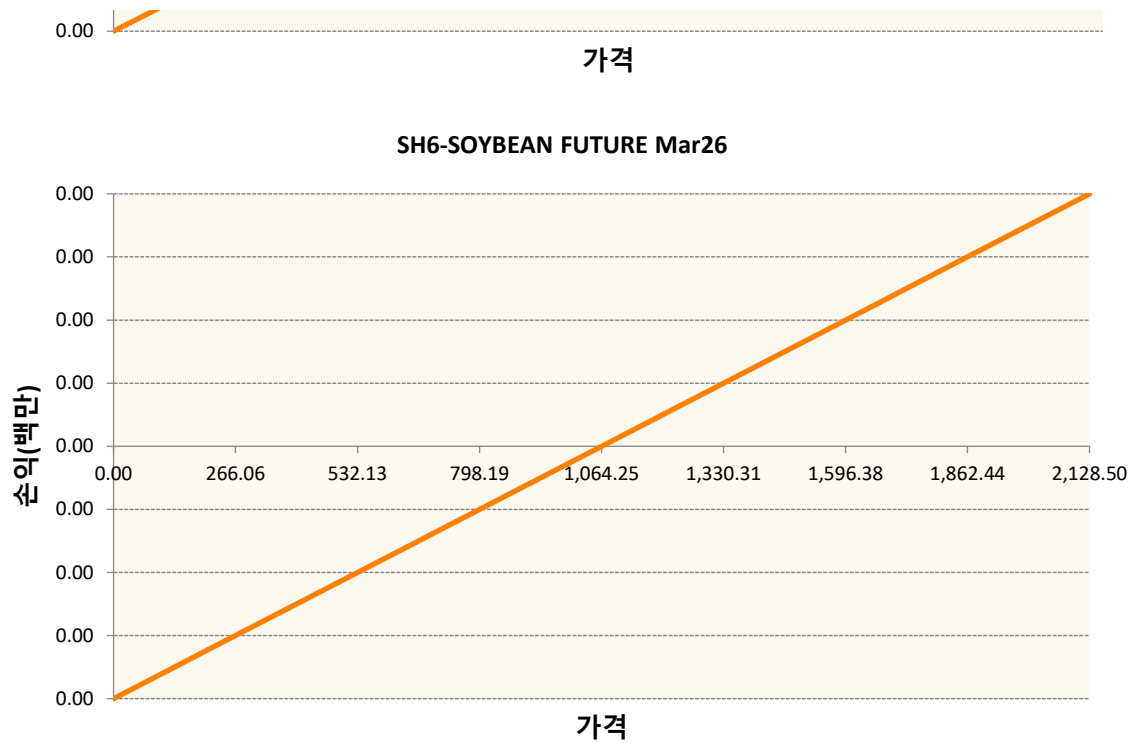
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	406	0	406	
누계	유가증권	선물	2,616	0	2,616	
누계	통화	선물	0	307	-307	장내

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	2026-02-03
기준일	2026-02-02

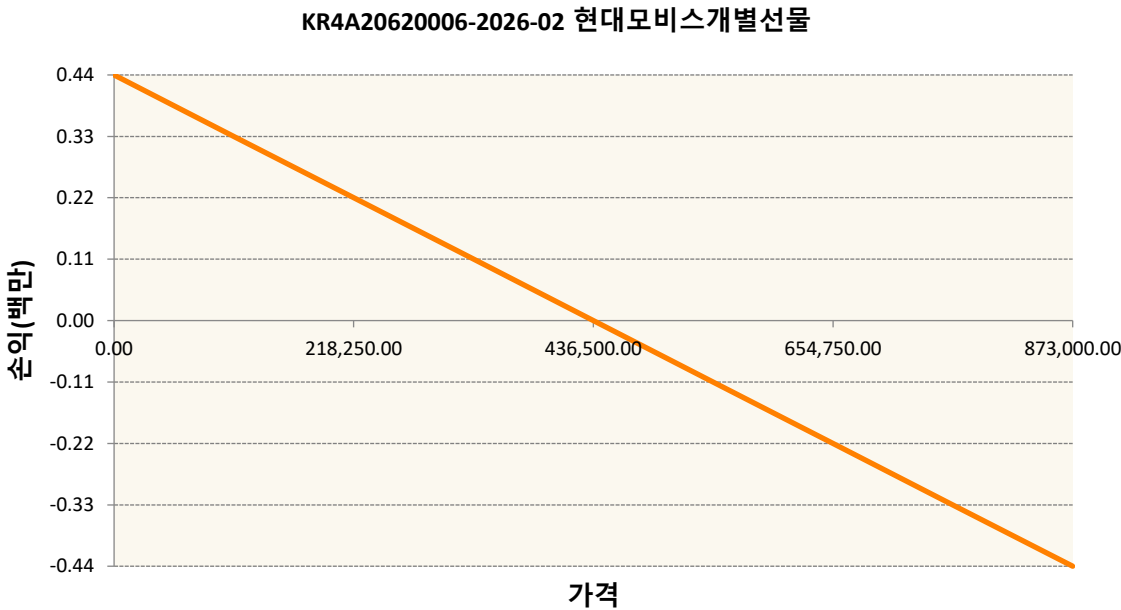
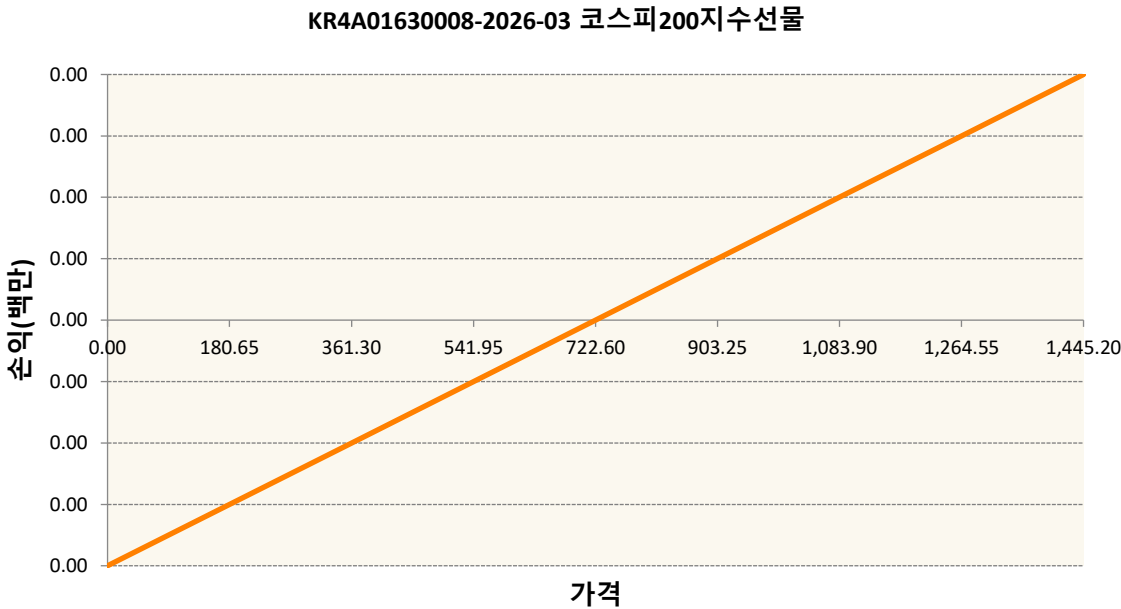
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,890	61	2,829	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		231
KR4A206200 2026-02 현대모비스개별선물		5

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

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

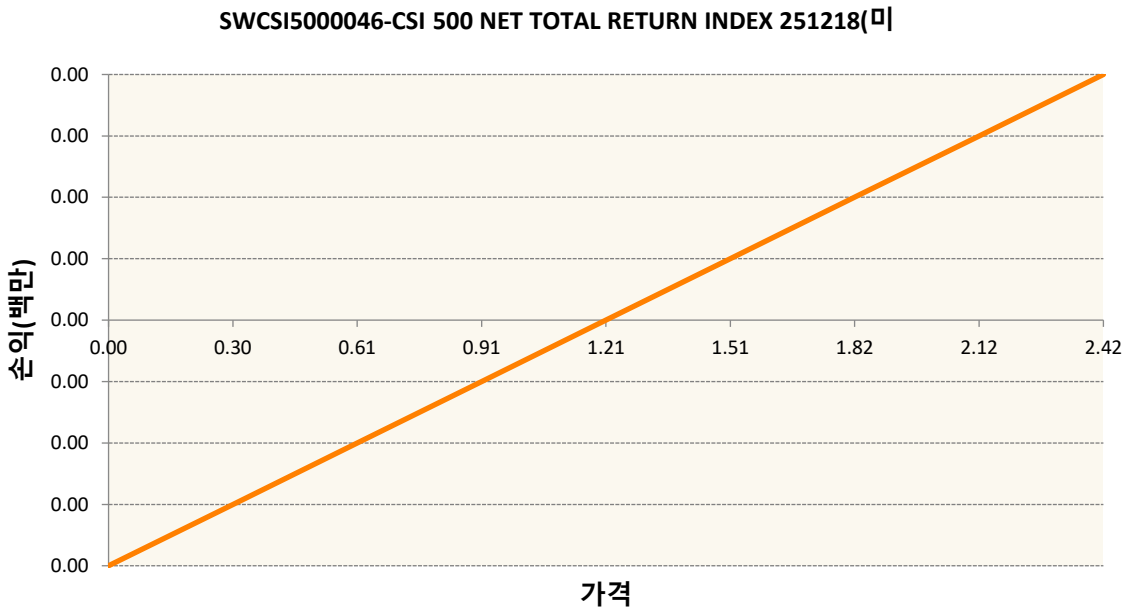
SOL차이나강소기업CSI500상장

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)

539

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

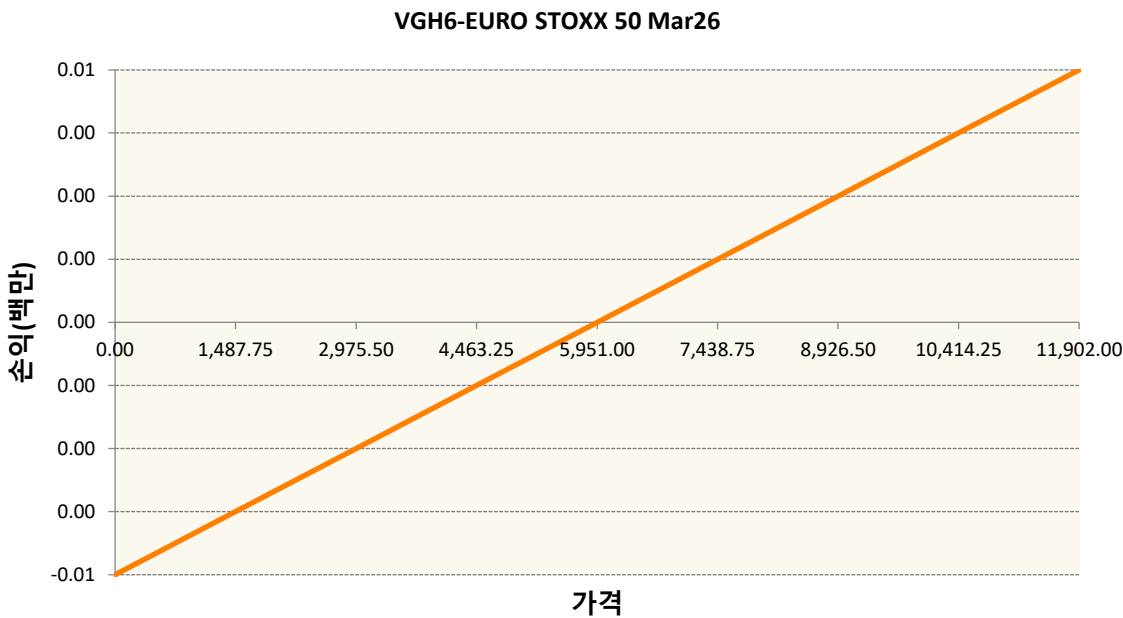
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	928	0	928	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EURO STOXX 50 Mar26	74
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

60

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

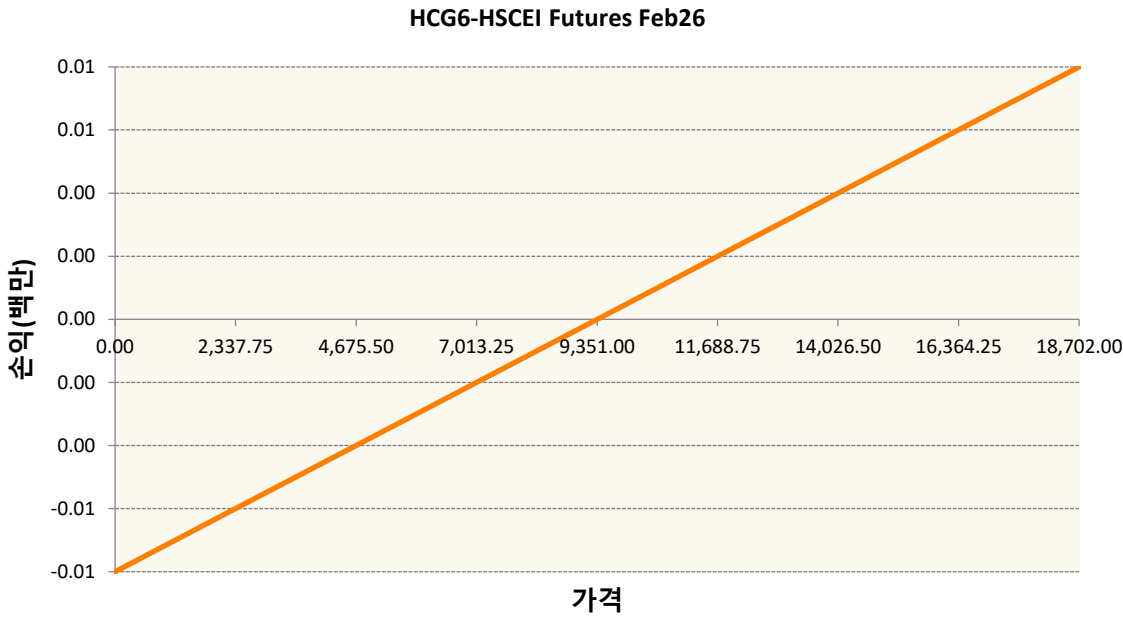
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2,136	0	2,136	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG6	HSCEI Futures Feb26	171
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

240

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

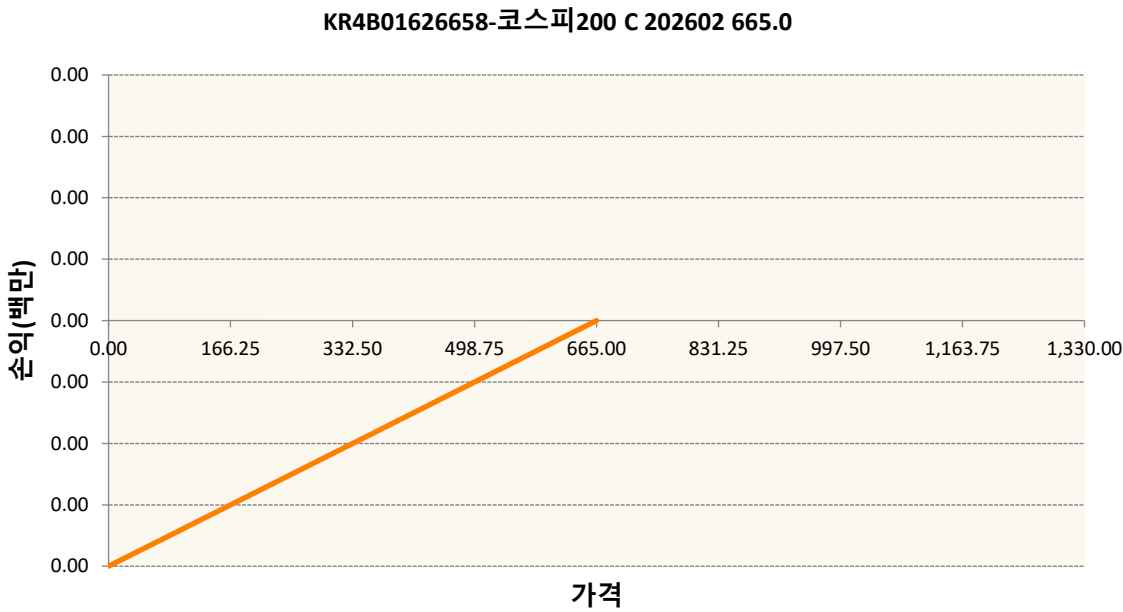
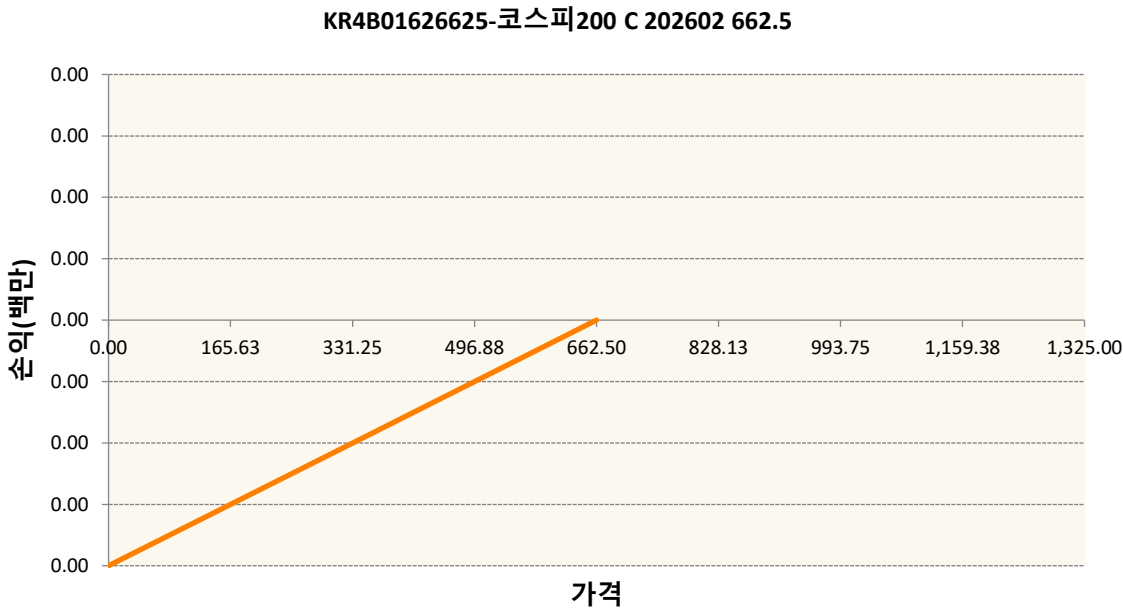
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

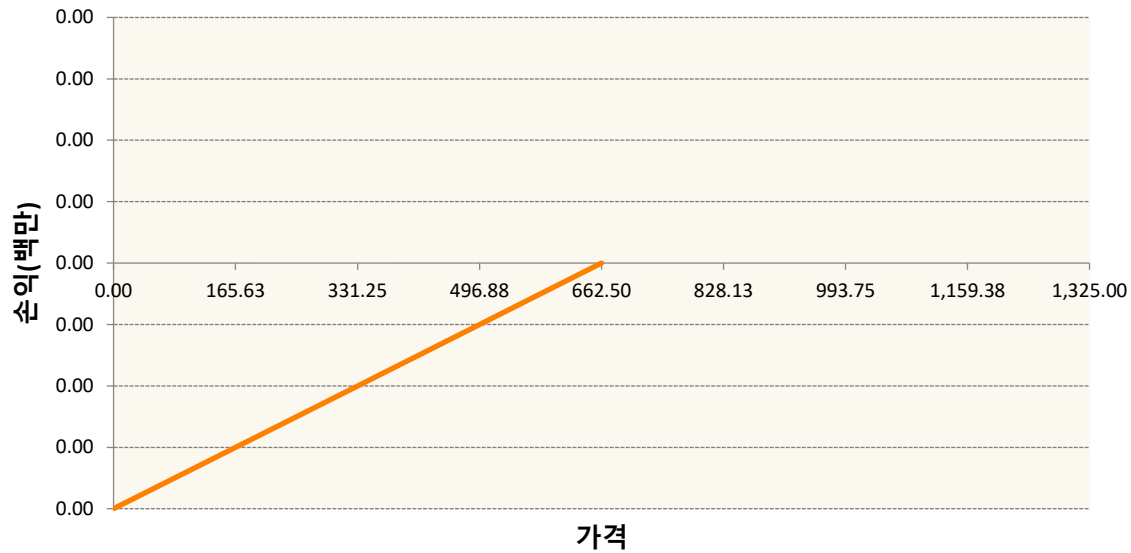
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,044	-32,044	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

1,676

KR4C016266 코스피200 P 202602 662.5

530

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-02-03

기준일 2026-02-02

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	2026-02-03
기준일	2026-02-02

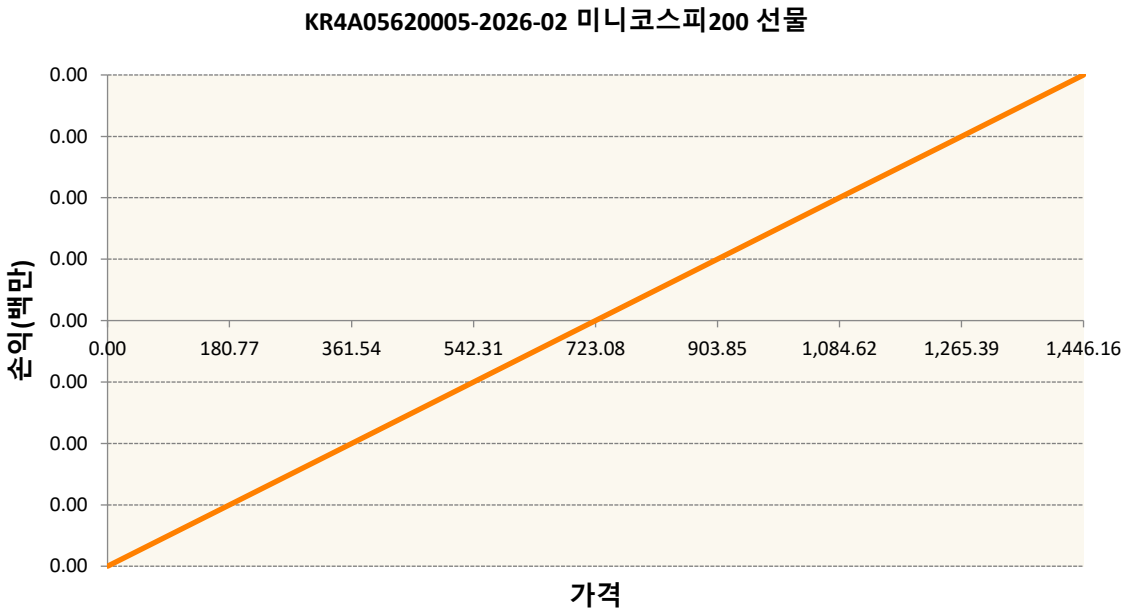
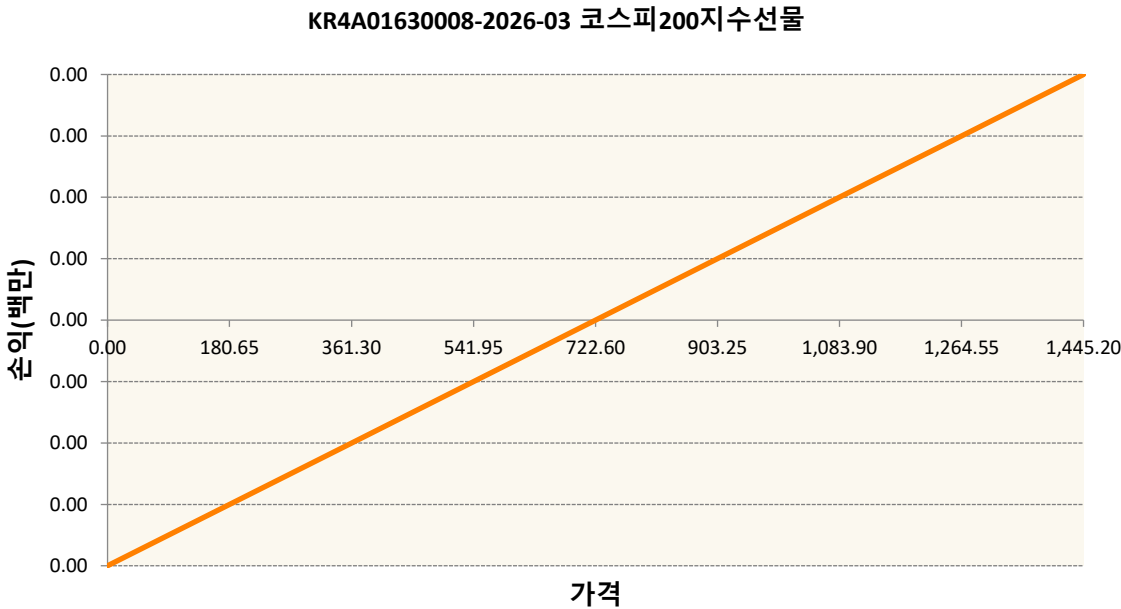
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

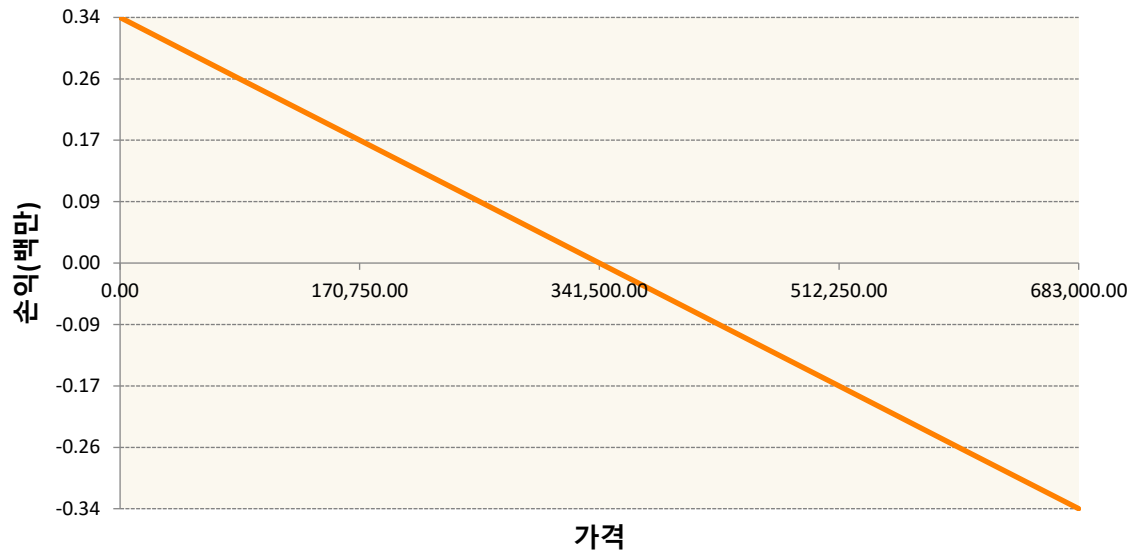
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	557	23	535	장내
누계	유가증권	선물	4,589	217	4,373	장내

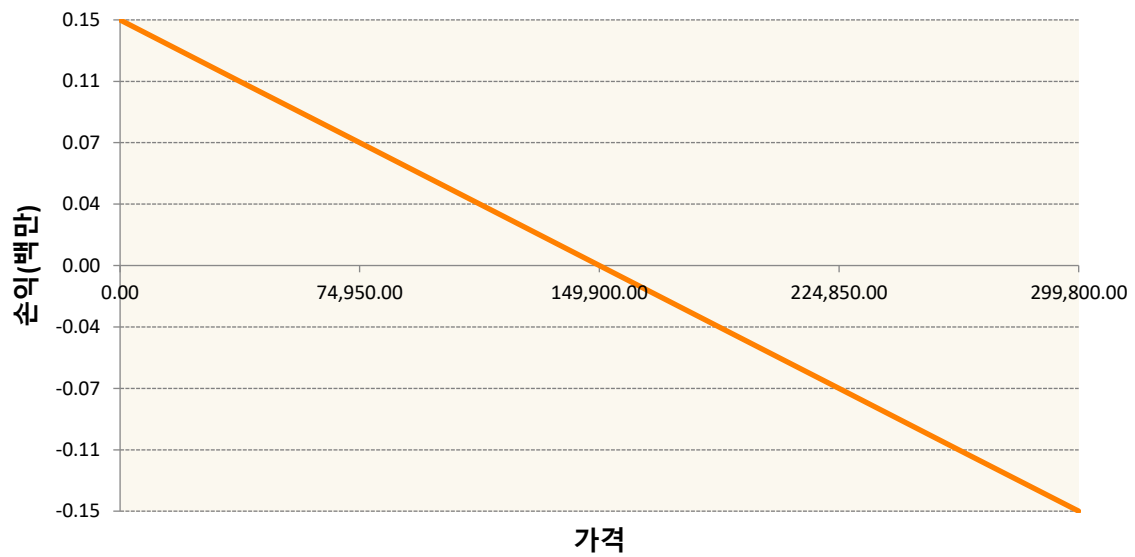
2. 만기시점의 손익구조



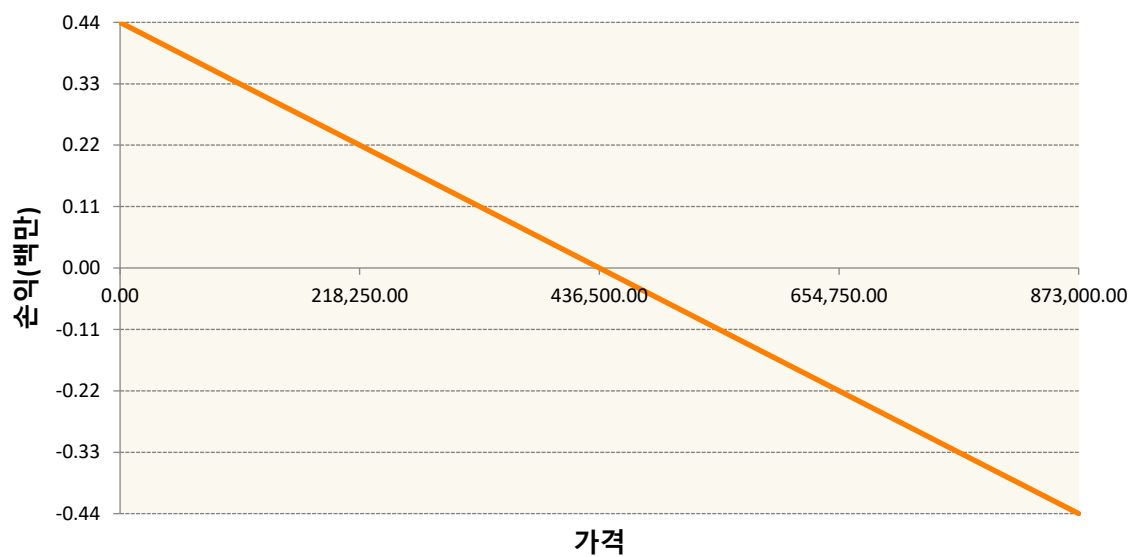
KR4A13620005-2026-02 POSCO홀딩스개별선물



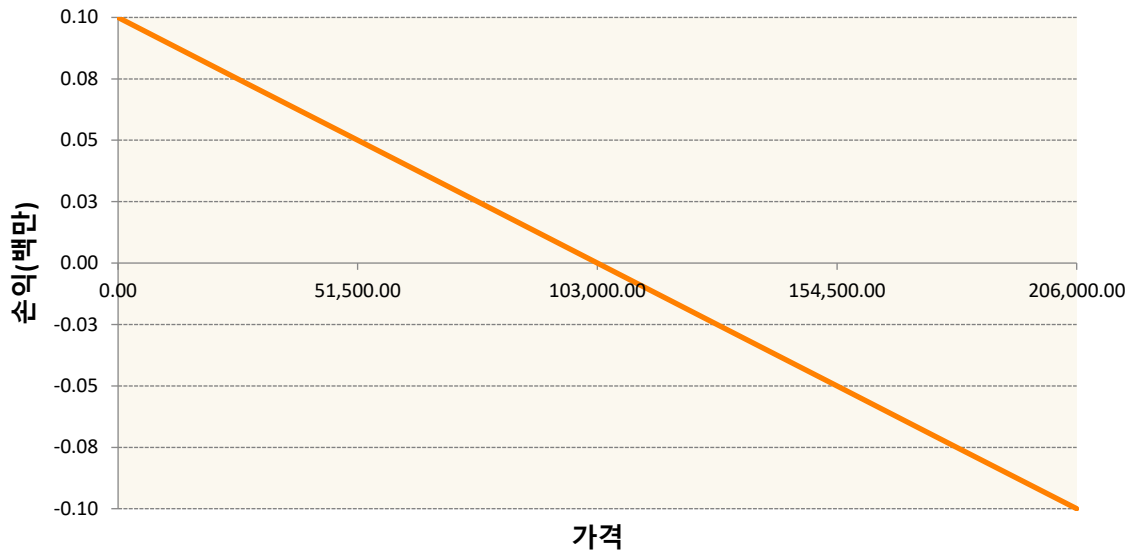
KR4A19620009-2026-02 기아개별선물



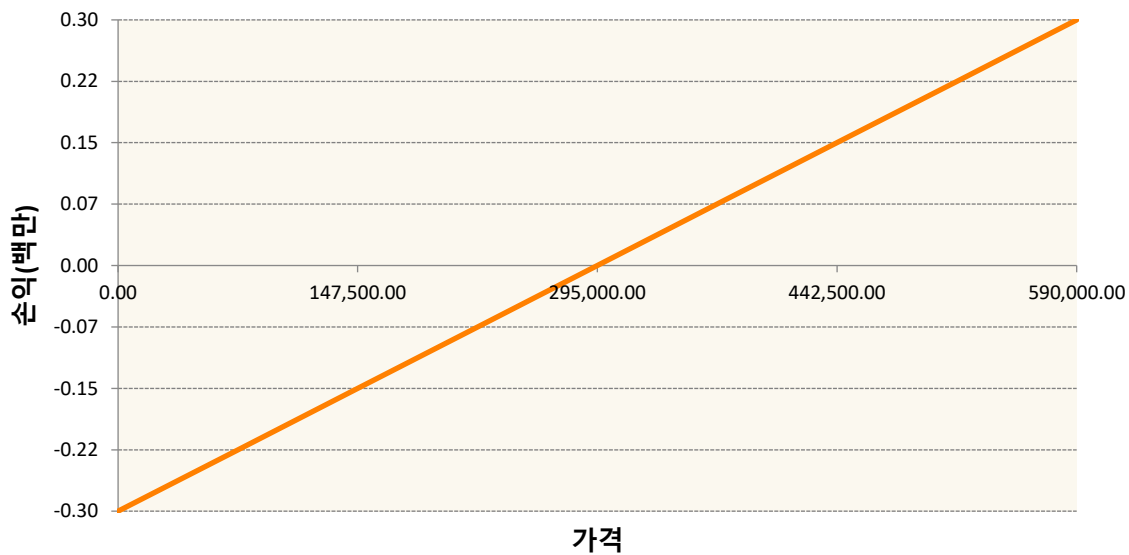
KR4A20620006-2026-02 현대모비스개별선물



KR4A40620002-2026-02 하나금융지주개별선물



KR4A47620005-2026-02 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물	72
KR4A056200 2026-02 미니코스피200 선물	58
KR4A136200 2026-02 POSCO홀딩스개별선물	6
KR4A196200 2026-02 기아개별선물	6
KR4A206200 2026-02 현대모비스개별선물	3
KR4A406200 2026-02 하나금융지주개별선물	2
KR4A476200 2026-02 LG화학개별선물	6

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

(단위:백만원)

12

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

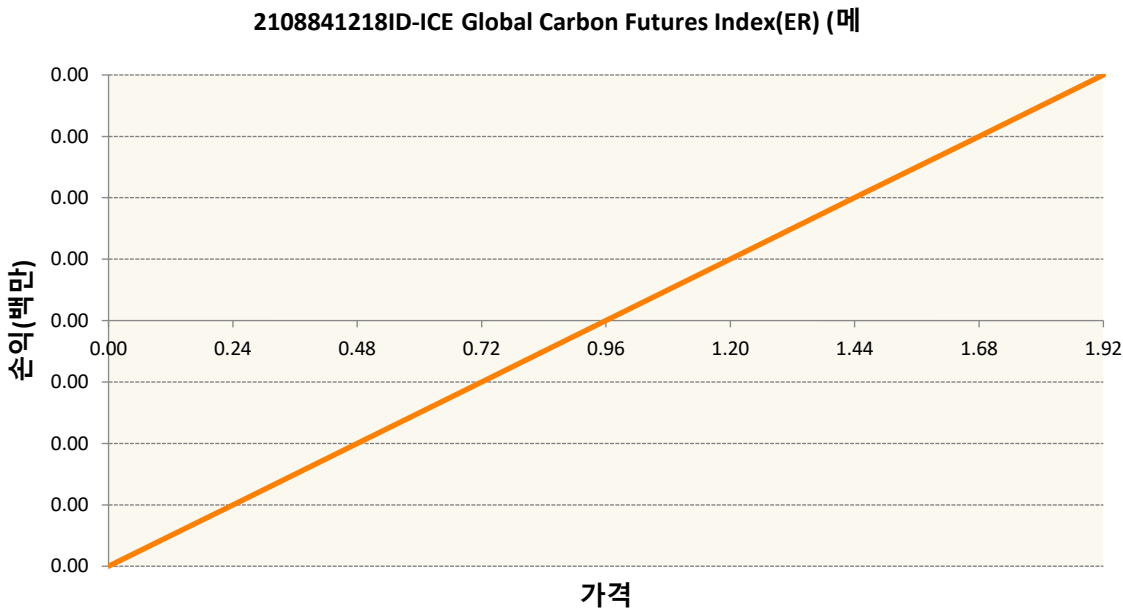
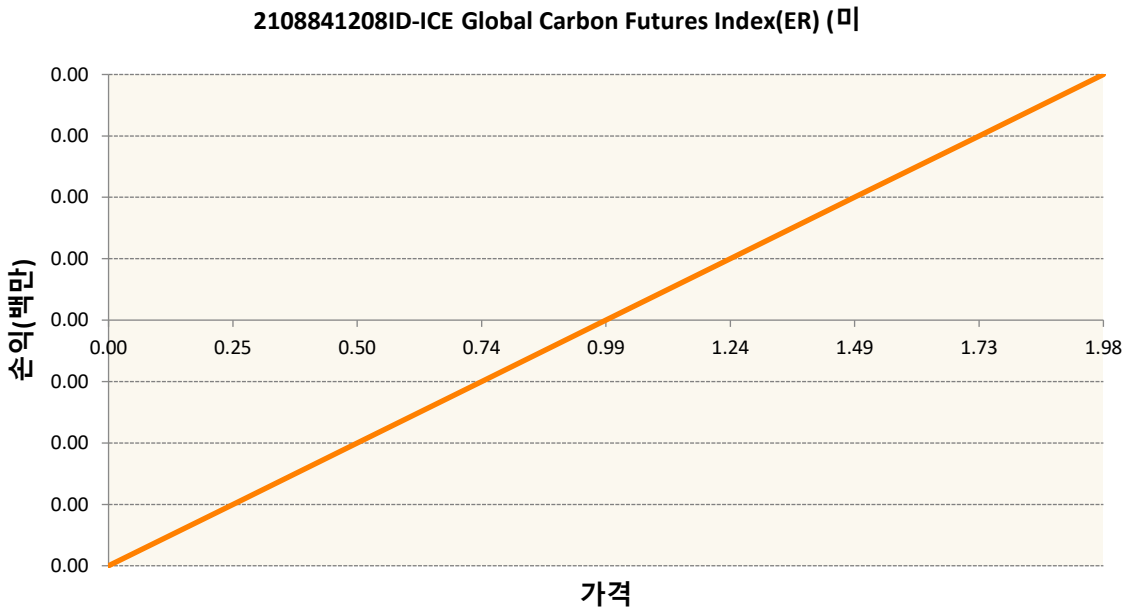
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,225	0	7,225	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		464
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		116

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	575

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

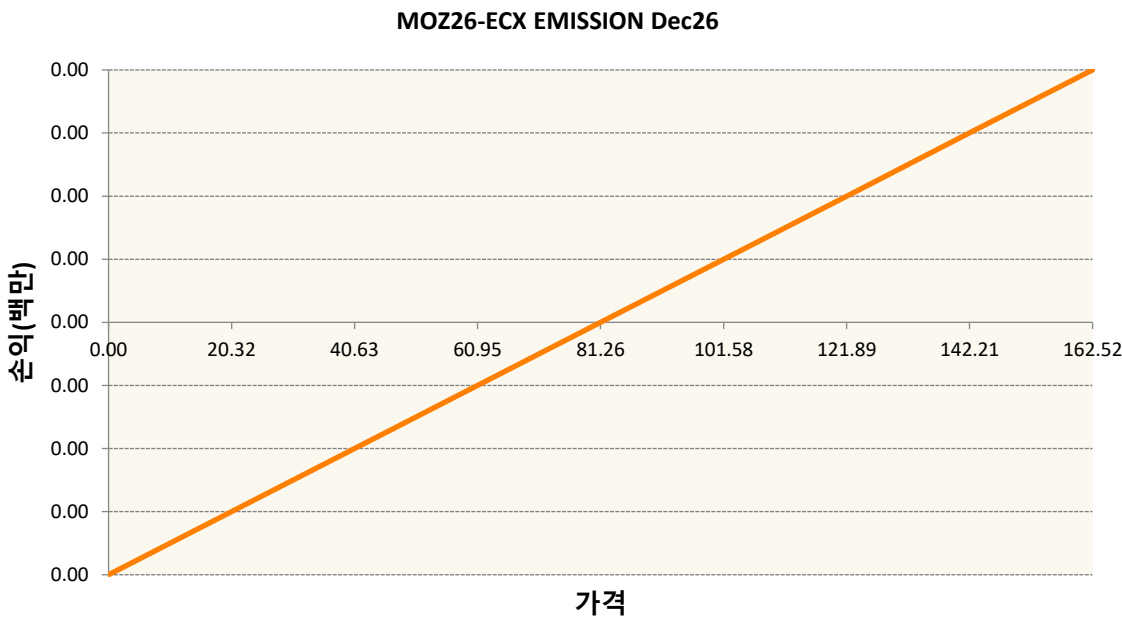
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,387	0	5,387	
누계	통화	선도	347	3,242	-2,895	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G1V\KRW/EUR 27-02-26E	259
FXW213G22\EUR/KRW 27-02-26E	28
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	431

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

(단위:백만원)

747

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

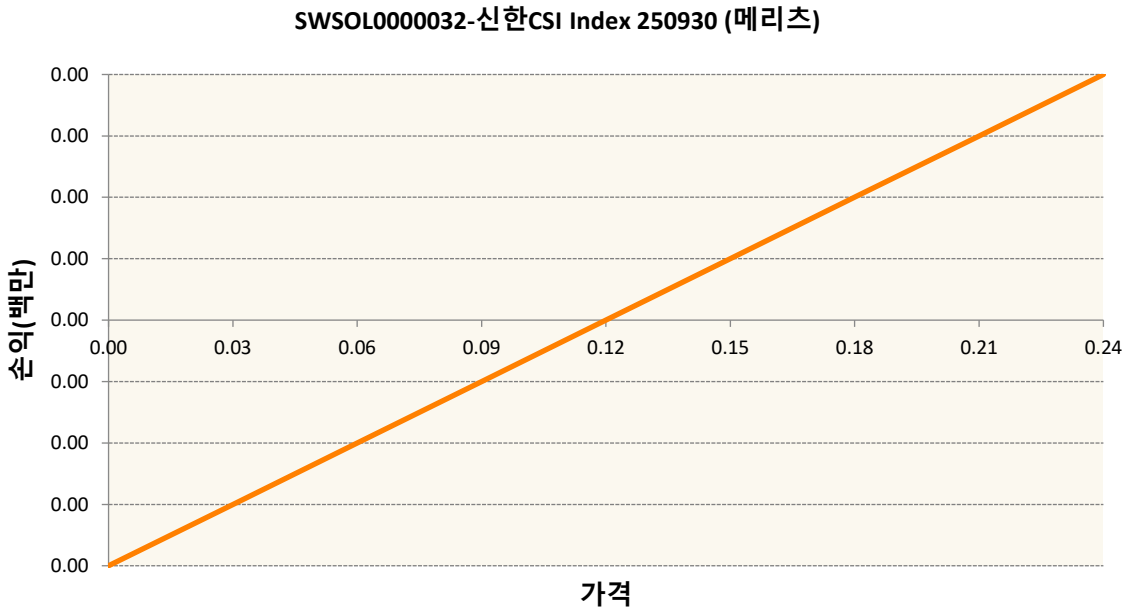
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,051	0	3,051	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	16
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	11
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	11
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	27

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

(단위:백만원)

115

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

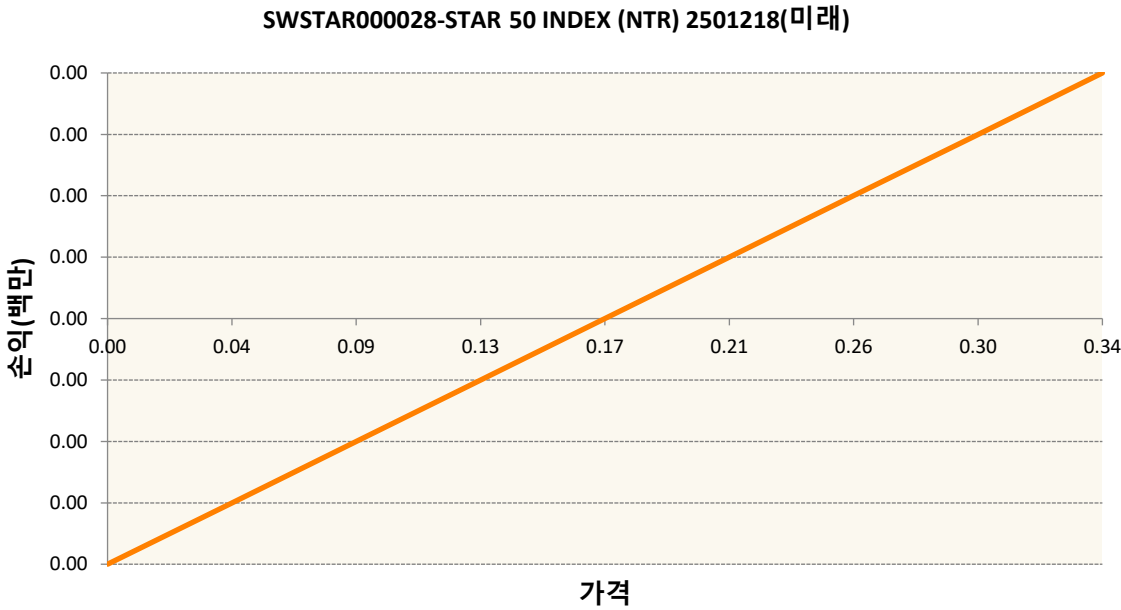
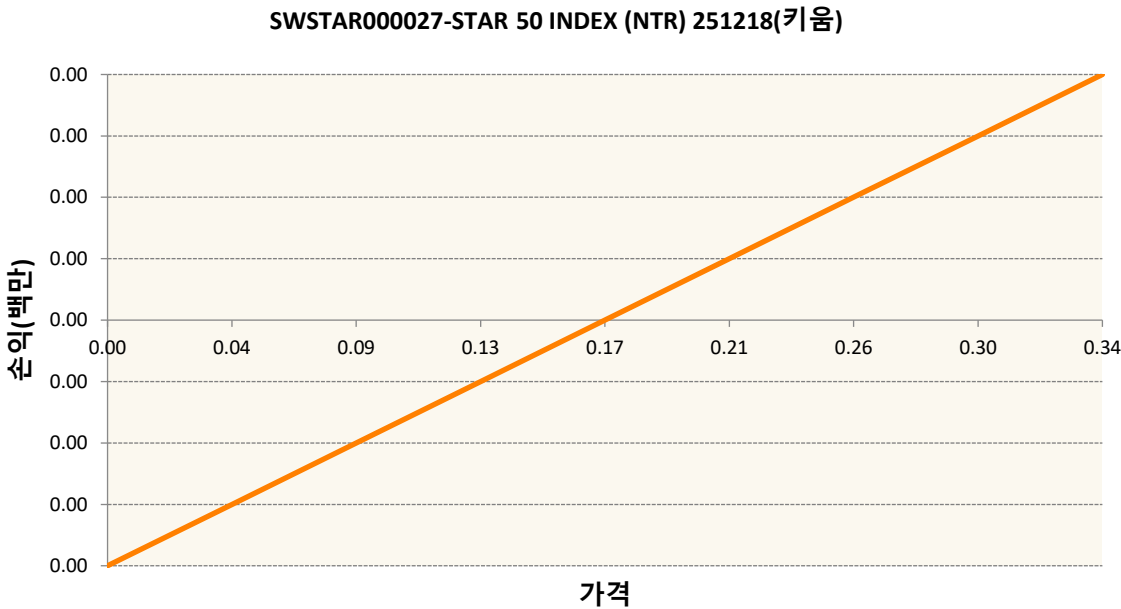
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

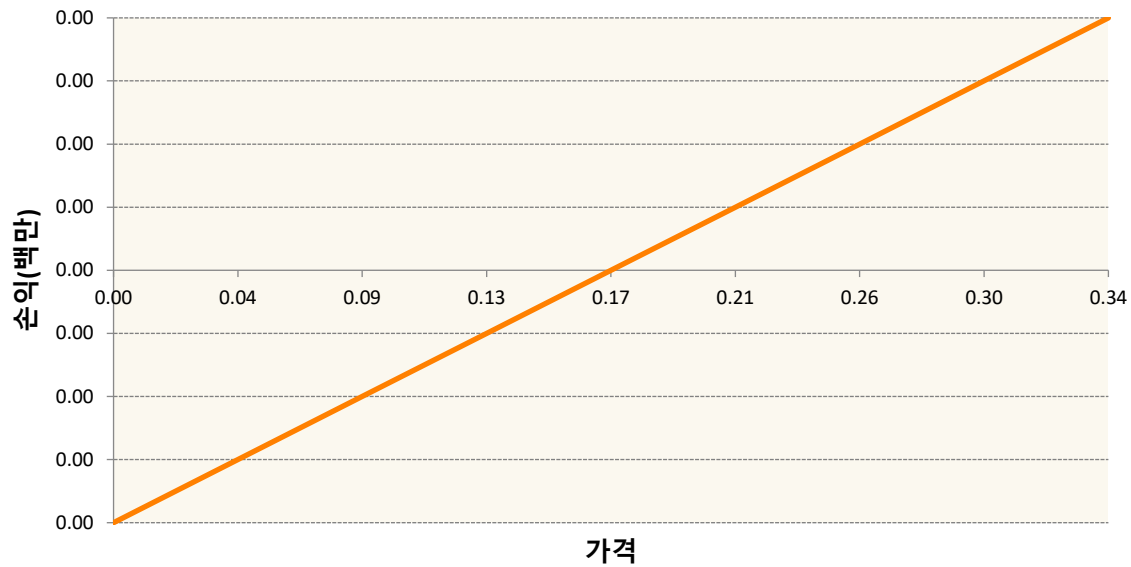
(단위:백만원)

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

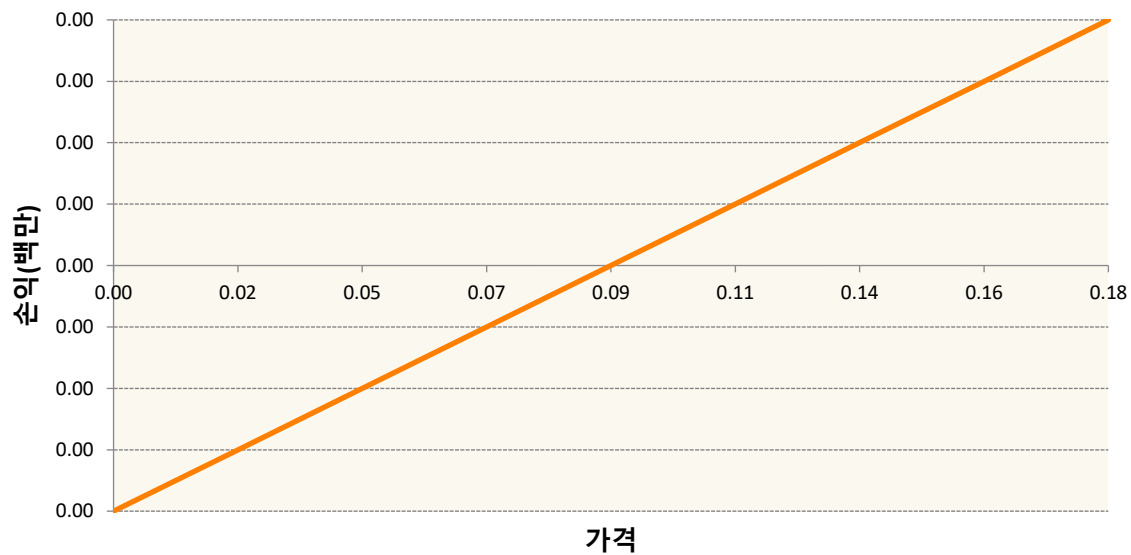
2. 만기시점의 손익구조



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)	73
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	38
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	114

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

(단위:백만원)

429

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

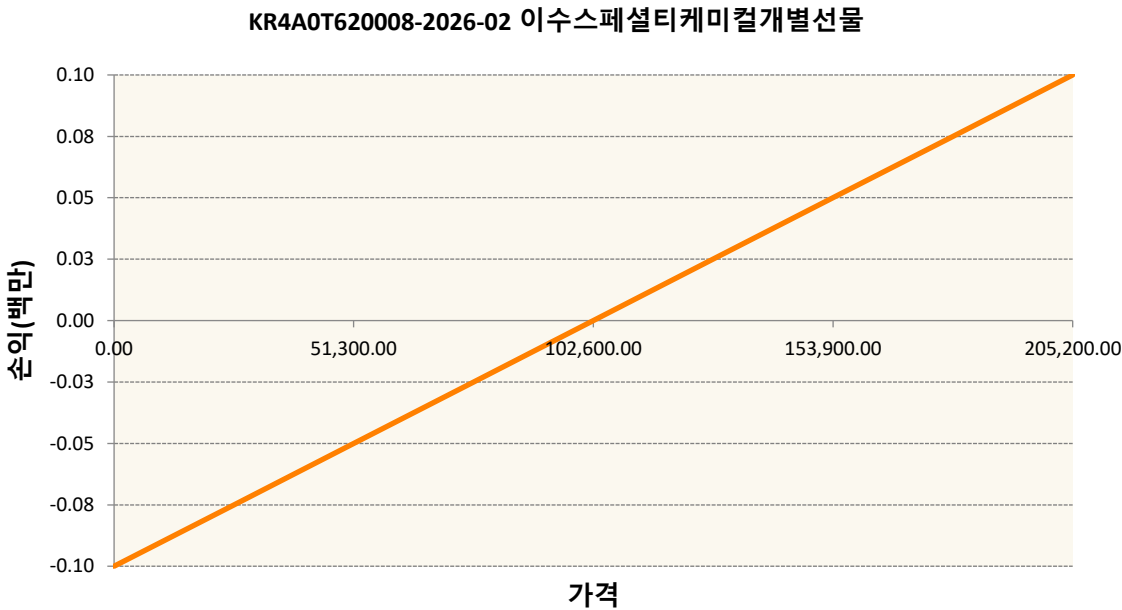
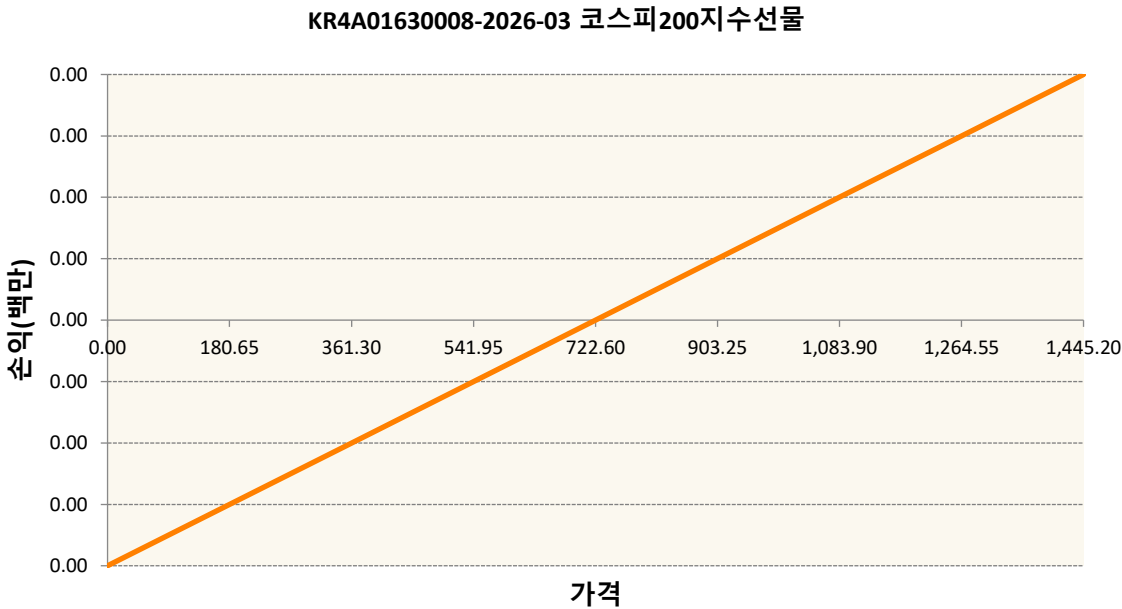
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

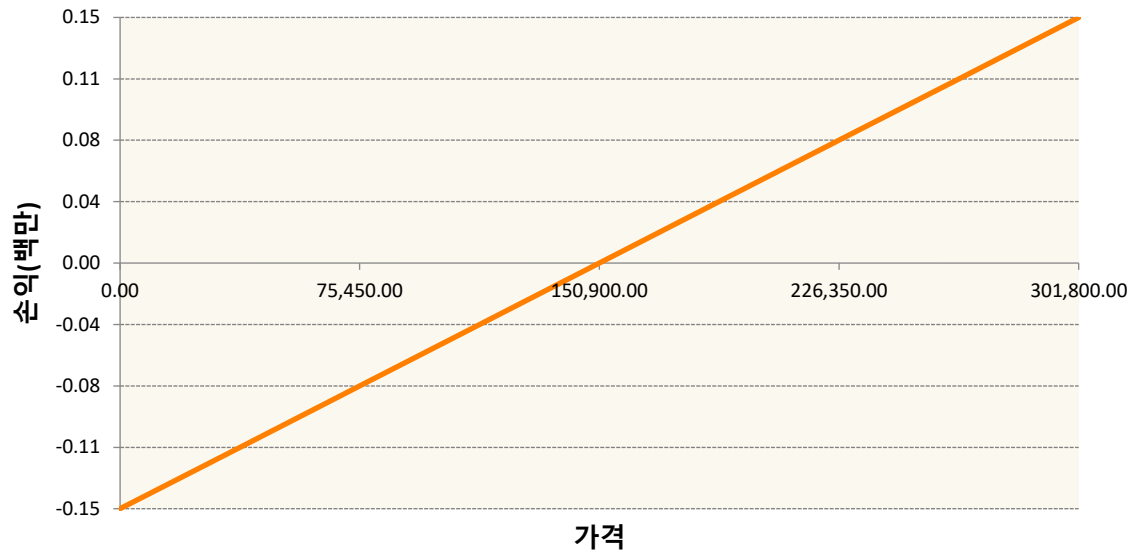
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,275	1,400	-125	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	13,415	6,109	7,306	장내
누계	유가증권	스왑	5	0	5	장외

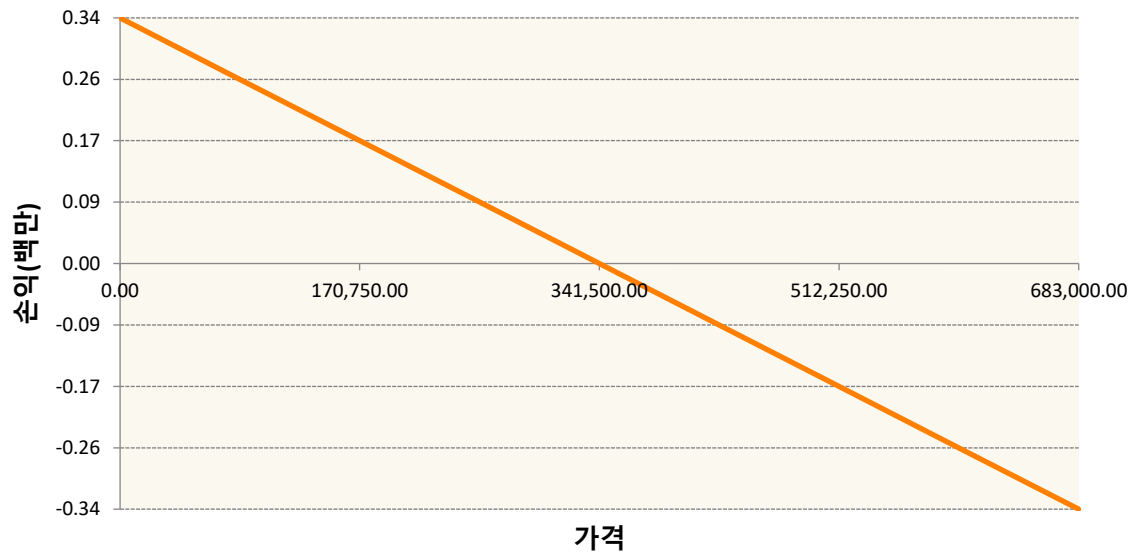
2. 만기시점의 손익구조



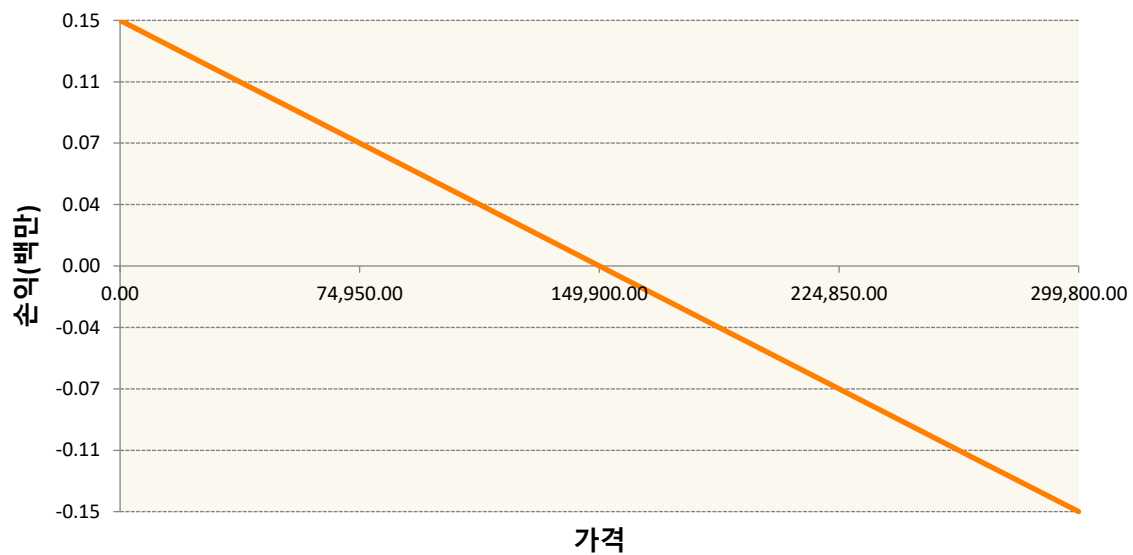
KR4A11620007-2026-02 삼성전자개별선물



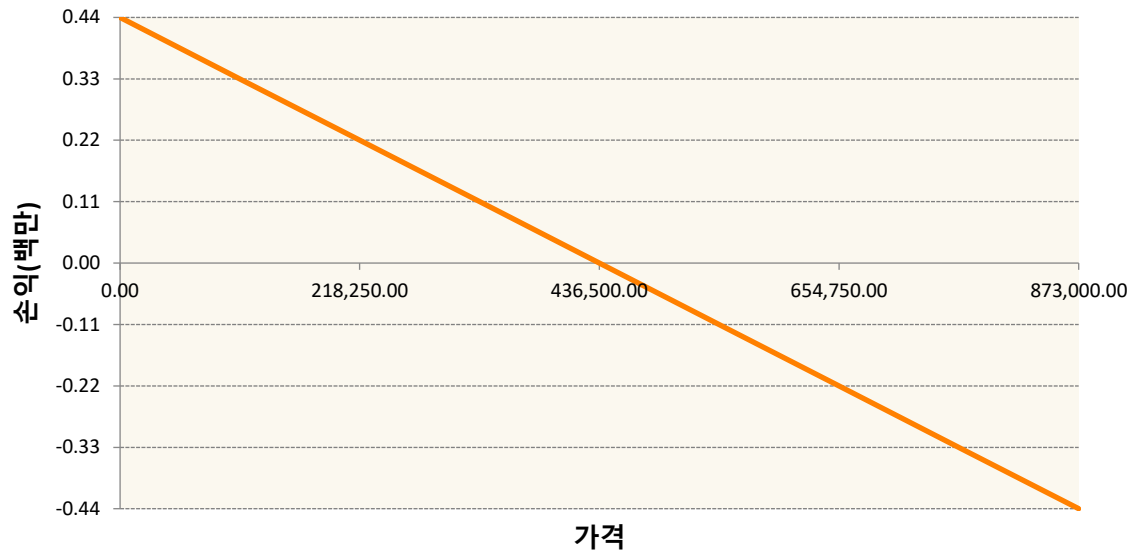
KR4A13620005-2026-02 POSCO홀딩스개별선물



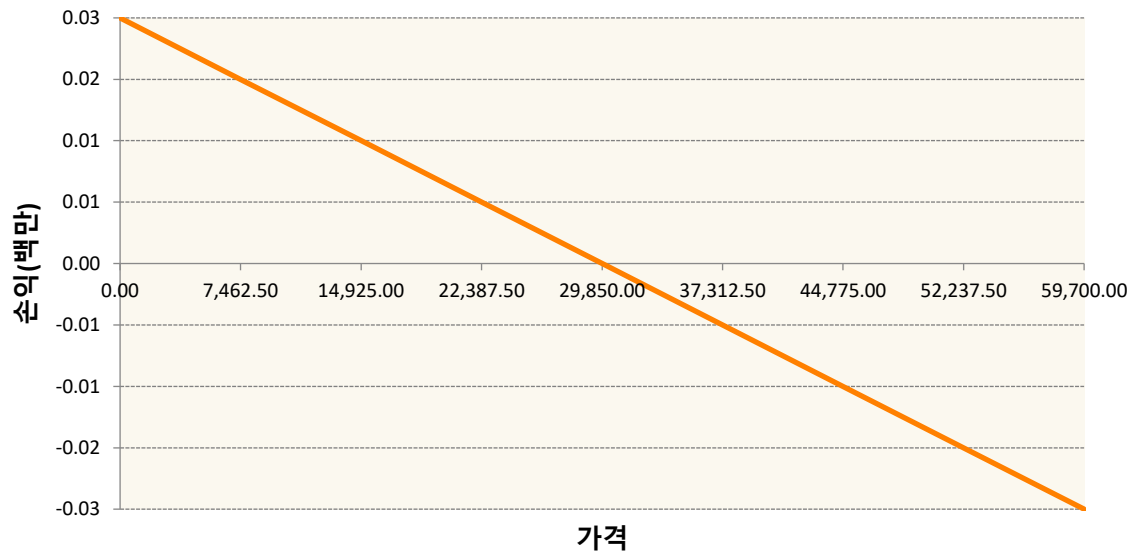
KR4A19620009-2026-02 기아개별선물



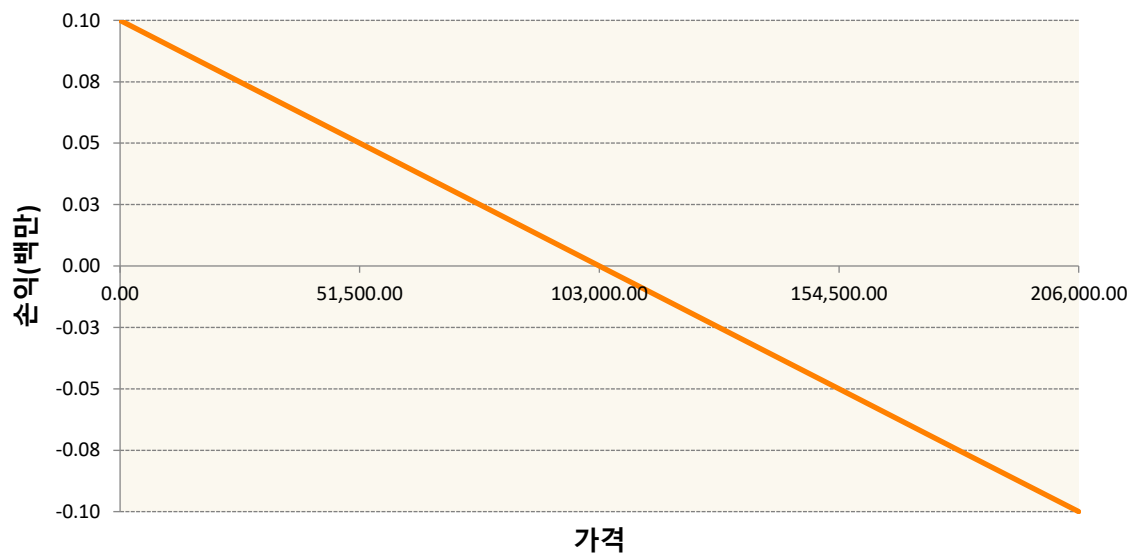
KR4A20620006-2026-02 현대모비스개별선물



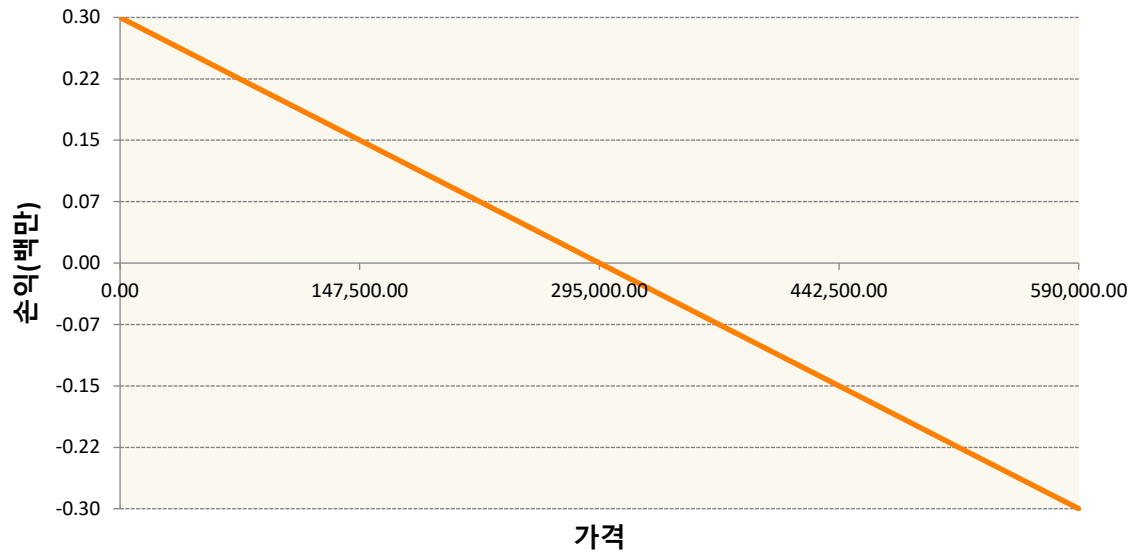
KR4A32620002-2026-02 현대제철개별선물



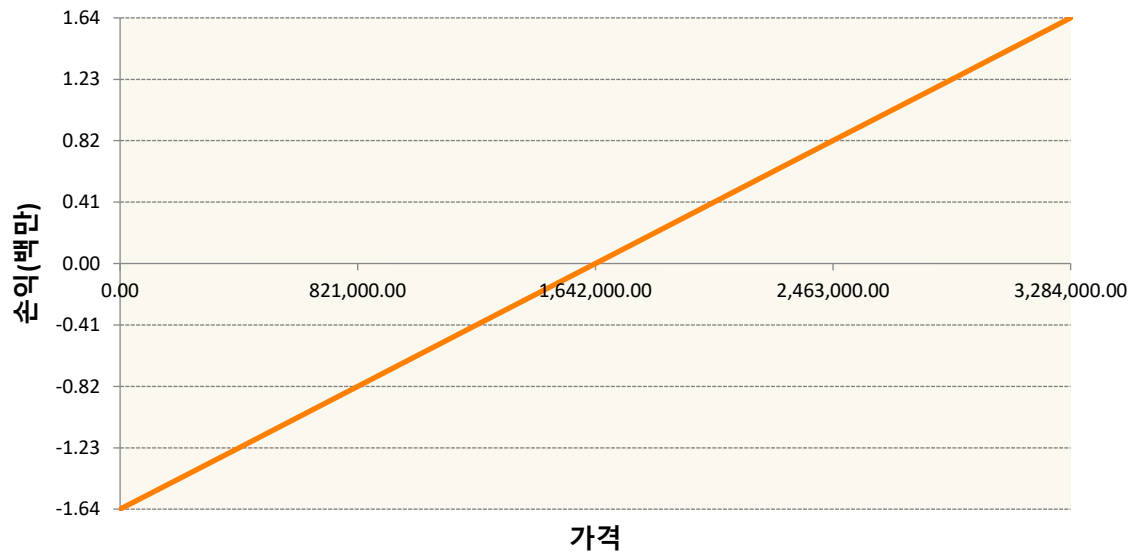
KR4A40620002-2026-02 하나금융지주개별선물



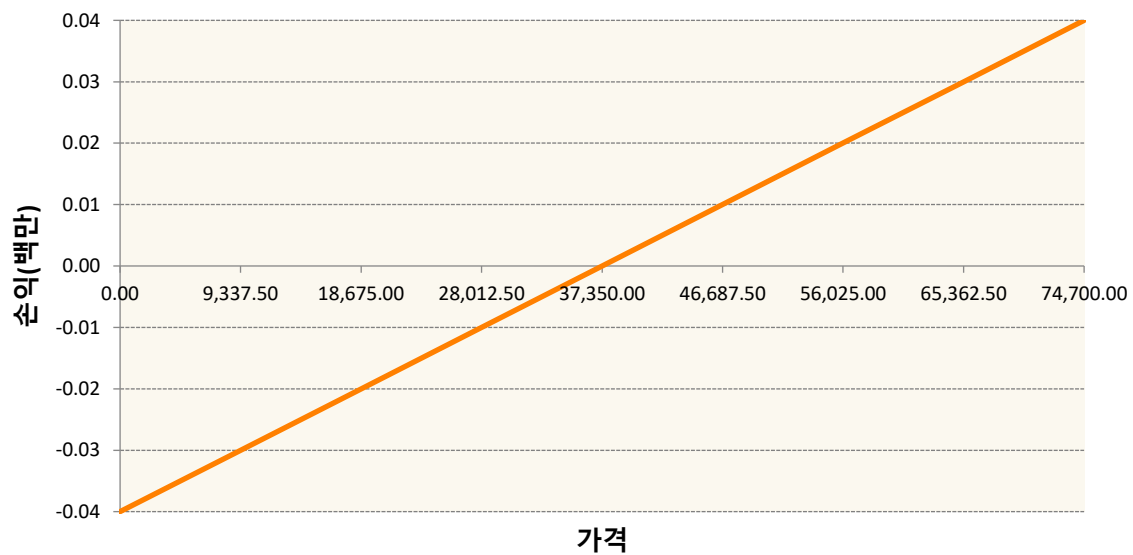
KR4A47620005-2026-02 LG화학개별선물



KR4AB3620005-2026-02 고려아연개별선물



KR4ACN620009-2026-02 포스코DX개별선물



The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 434,000.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -0.22 to 0.22. A solid orange line represents the profit function, starting at a profit of 0.22 when the price is 0.00 and decreasing linearly to a profit of -0.22 at a price of 434,000.00. The line intersects the x-axis at a price of 217,000.00, where the profit is zero.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.22
108,500.00	0.11
217,000.00	0.00
325,500.00	-0.11
434,000.00	-0.22

가격	순이익 (백만)
0.00	-0.06
31,700.00	-0.03
63,400.00	0.00
95,100.00	0.03
126,800.00	0.06

(단위:백만원)

KR4A01630008		2026-03 코스피200지수선물					929
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-929	-929	-929	-929	-929	-929	-929
-5.33%	-619	-619	-619	-619	-619	-619	-619
-2.67%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	310	310	310	310	310	310	310
5.33%	619	619	619	619	619	619	619
8.00%	929	929	929	929	929	929	929
KR4A11620007		2026-02 삼성전자개별선물					13

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

KR4A13620005 2026-02 POSCO홀딩스개별선물 76

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	76	76	76	76	76	76
-5.33%	50	50	50	50	50	50	50
-2.67%	25	25	25	25	25	25	25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76

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
-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%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80

KR4A20620006 2026-02 현대모비스개별선물 77

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	77	77	77	77	77	77	77
-5.33%	52	52	52	52	52	52	52
-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%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77

KR4A32620002 2026-02 현대제철개별선물 26

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	26	26	26	26	26	26	26
-5.33%	17	17	17	17	17	17	17
-2.67%	9	9	9	9	9	9	9

0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26

KR4A40620002 2026-02 하나금융지주개별선물 85

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	85	85	85	85	85	85	85
-5.33%	57	57	57	57	57	57	57
-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%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
8.00%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85

KR4A47620005 2026-02 LG화학개별선물 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

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 20

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-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%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	20	20	20	20	20	20	20

KR4AE8620004 2026-02 포스코퓨처엠개별선물 75

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	75	75	75	75	75	75
-5.33%	50	50	50	50	50	50	50
-2.67%	25	25	25	25	25	25	25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75

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)

1,784

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

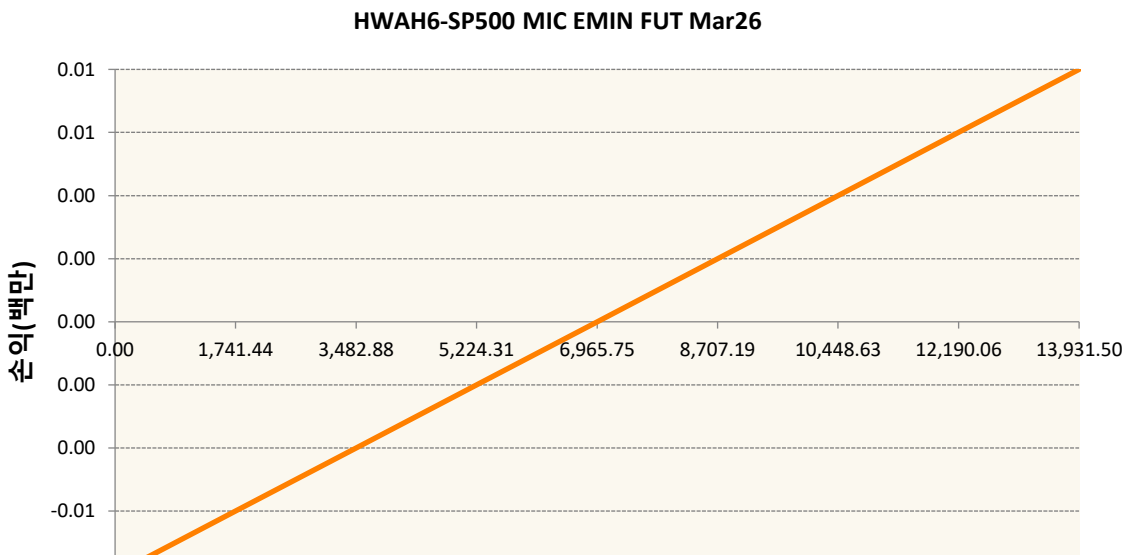
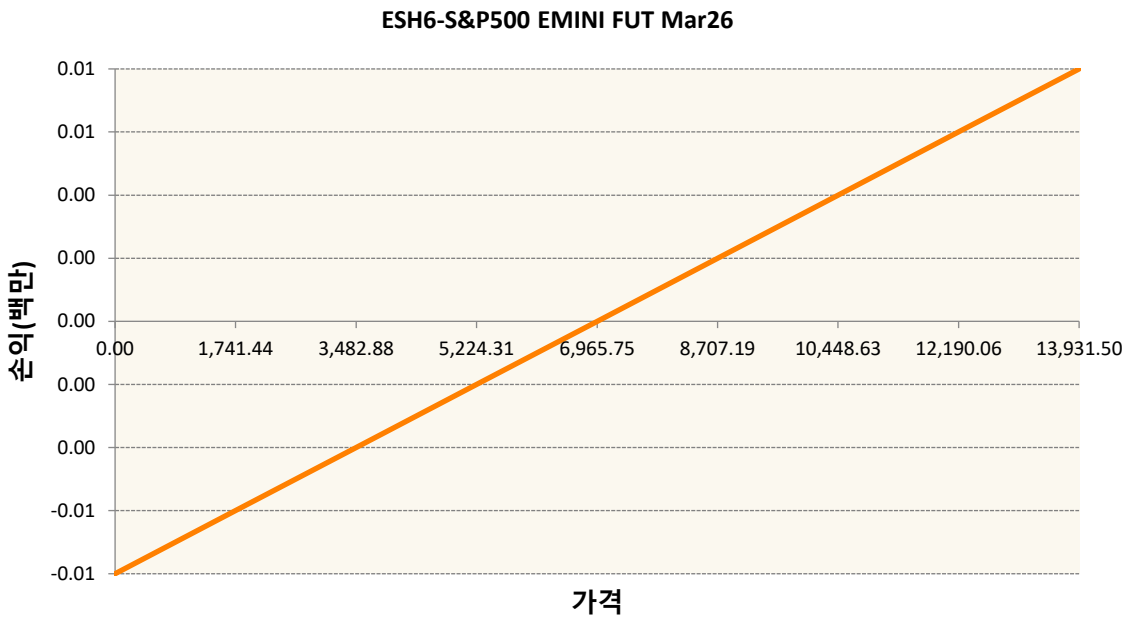
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

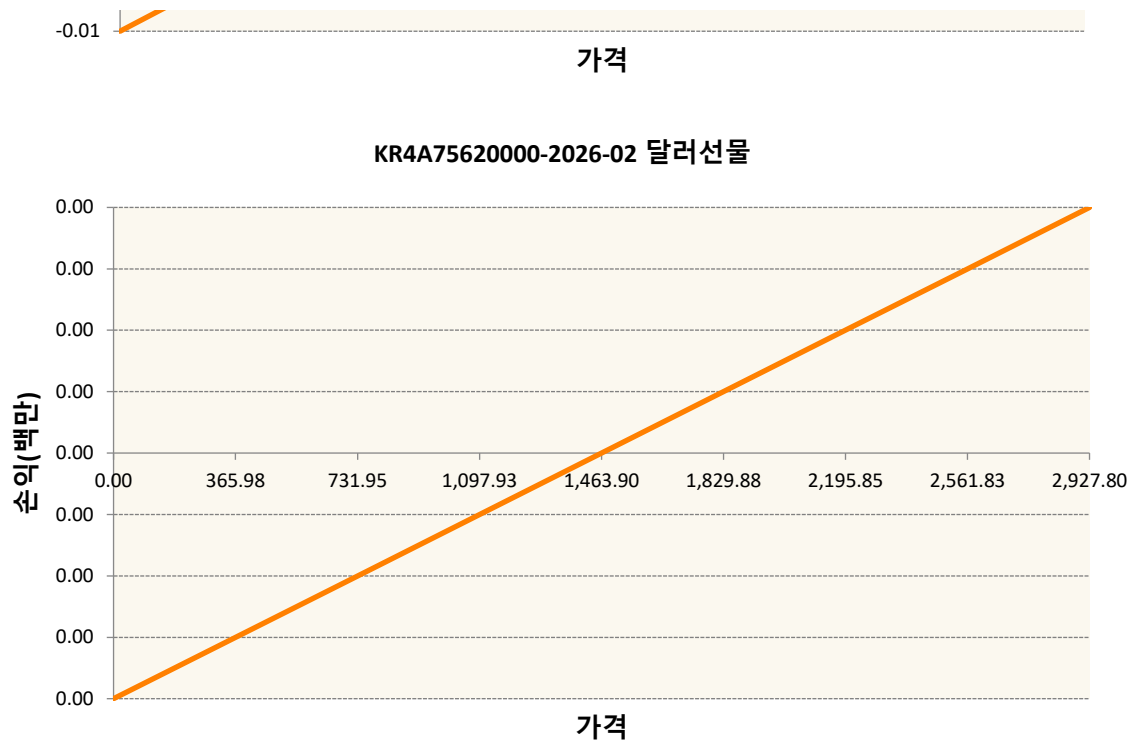
1. 계약금액

(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	292	-292	장내
누계	유가증권	선물	1,132	0	1,132	장내
누계	지수	선물	55,456	0	55,456	
누계	통화	선물	4,099	0	4,099	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26		4,436
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26		91
KR4A756200 2026-02 달러선물			328

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

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

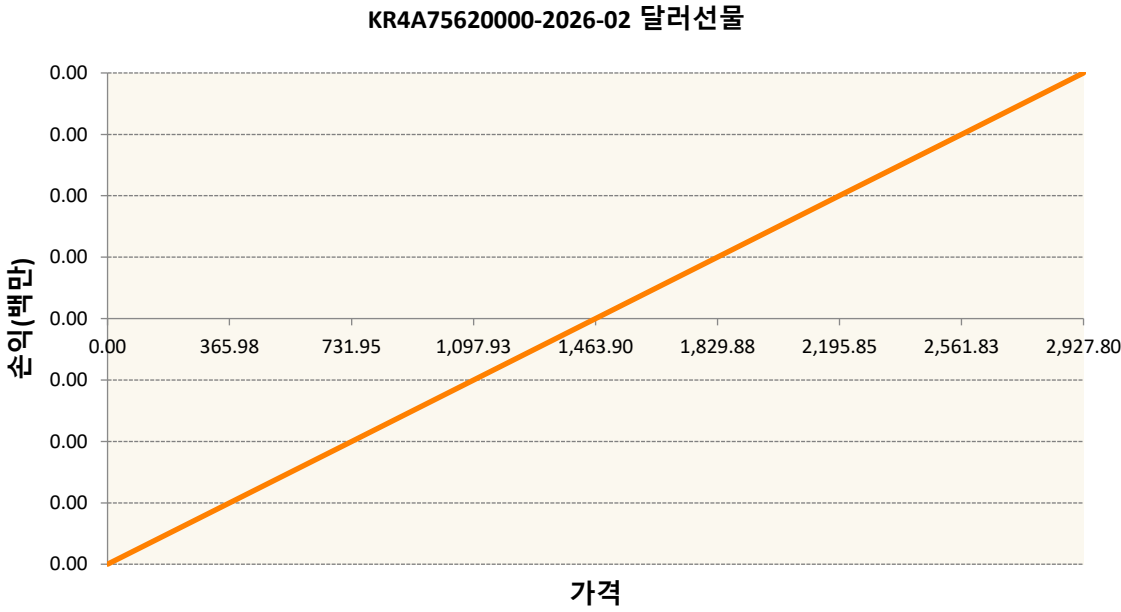
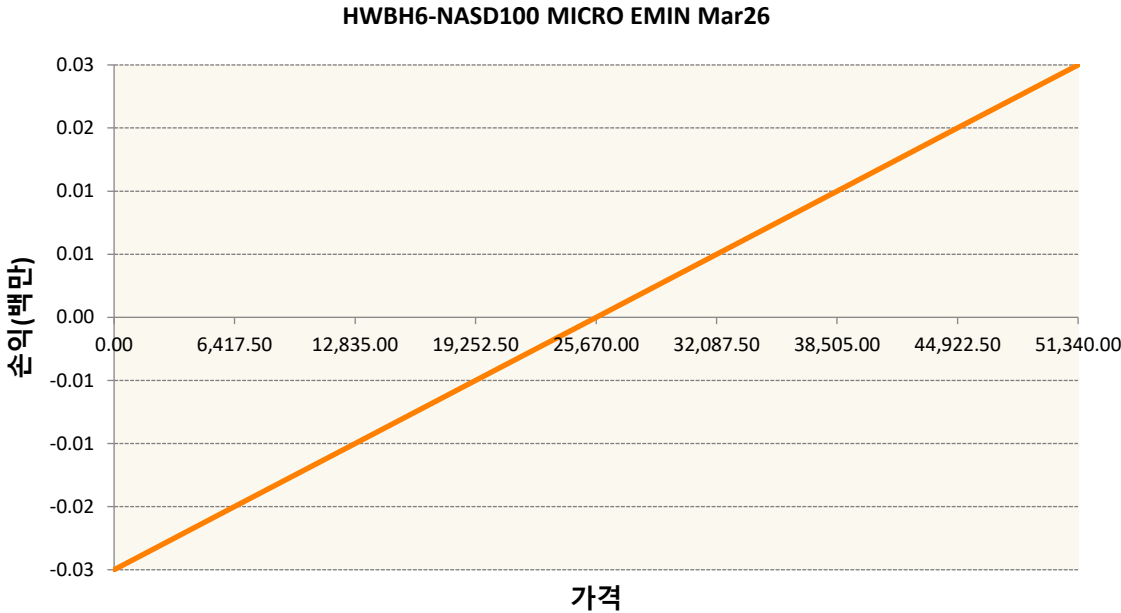
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

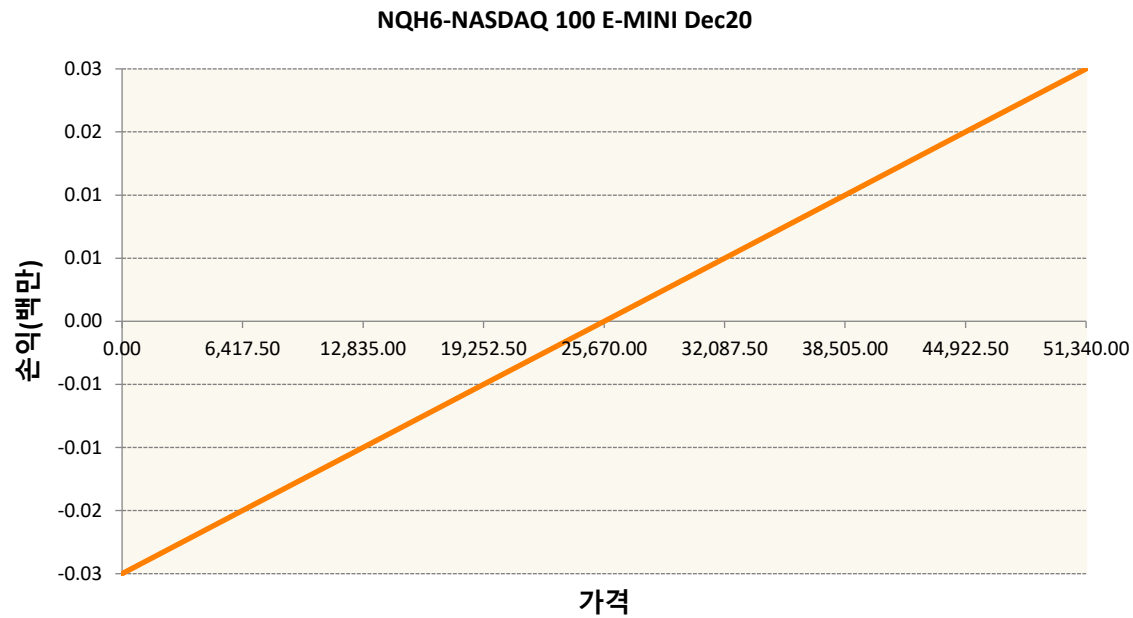
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	146	-146	장내
누계	지수	선물	25,151	0	25,151	장내
누계	통화	선물	1,464	0	1,464	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN	Mar26	73
KR4A756200	2026-02	달러선물	117
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI	Dec20	1,939

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,188

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

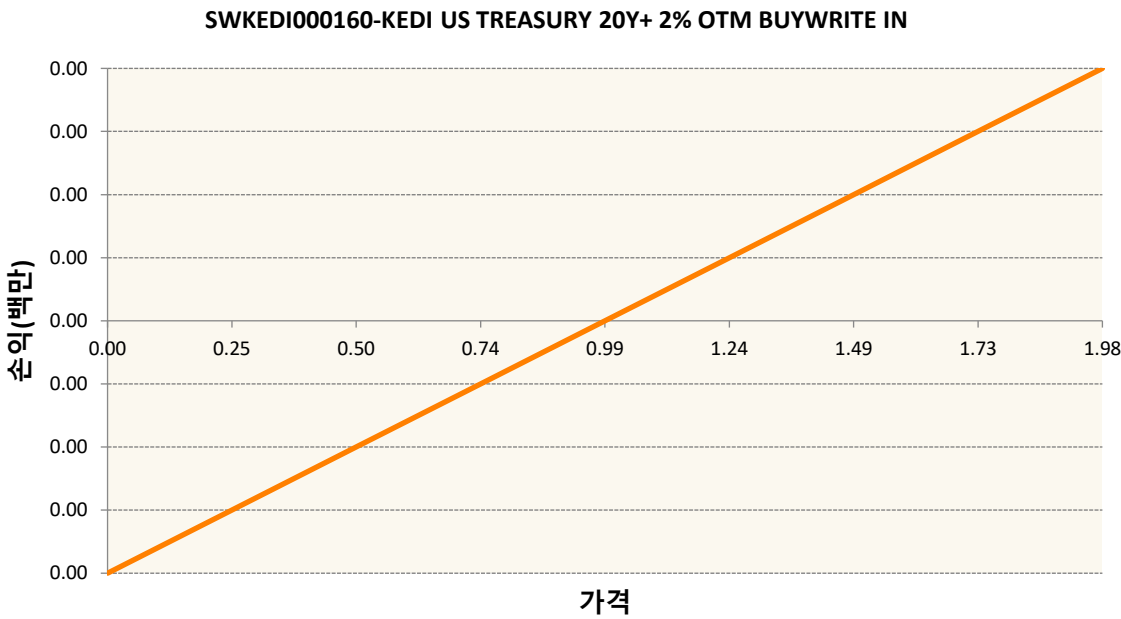
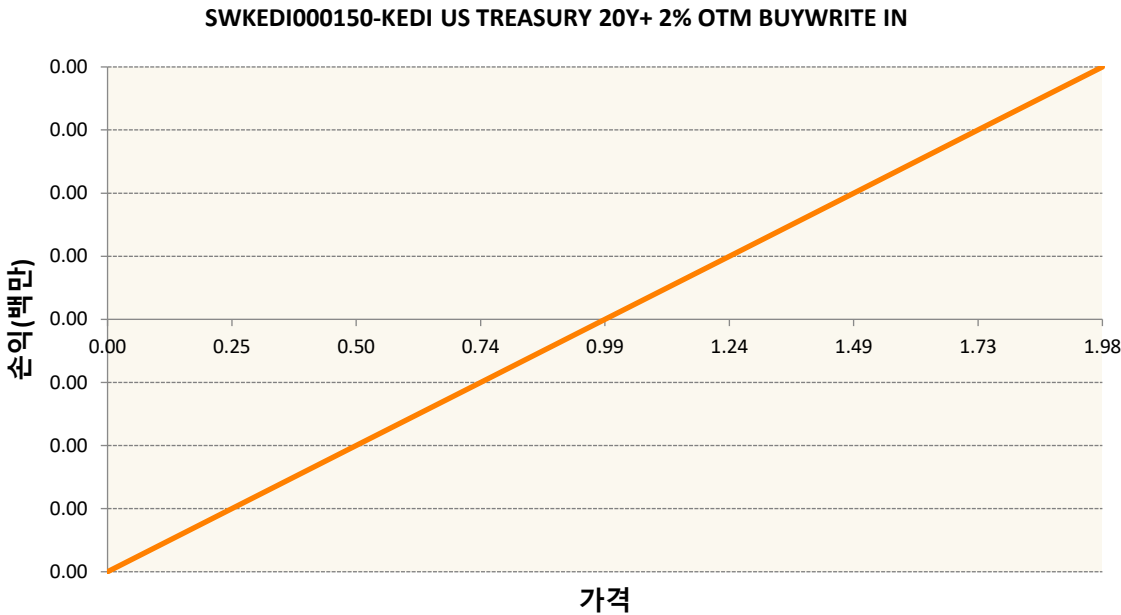
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

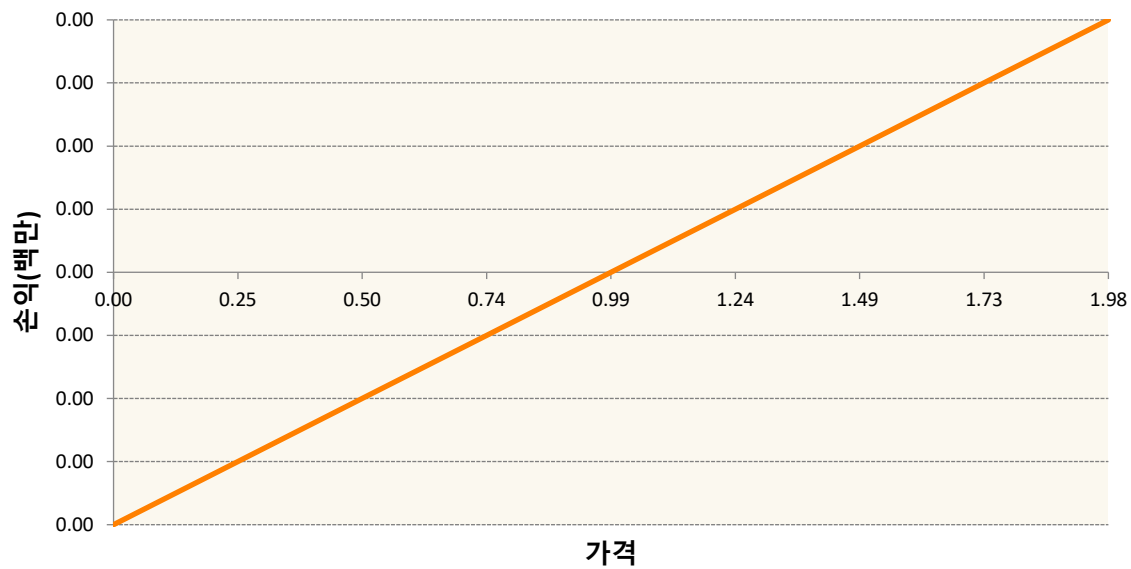
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	385,871	0	385,871	장외

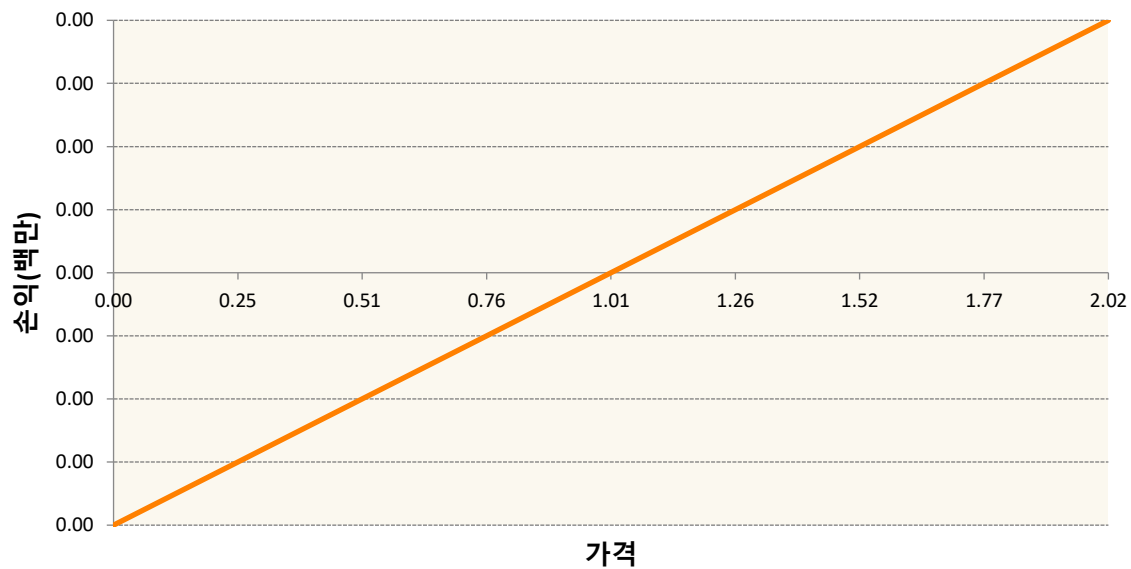
2. 만기시점의 손익구조



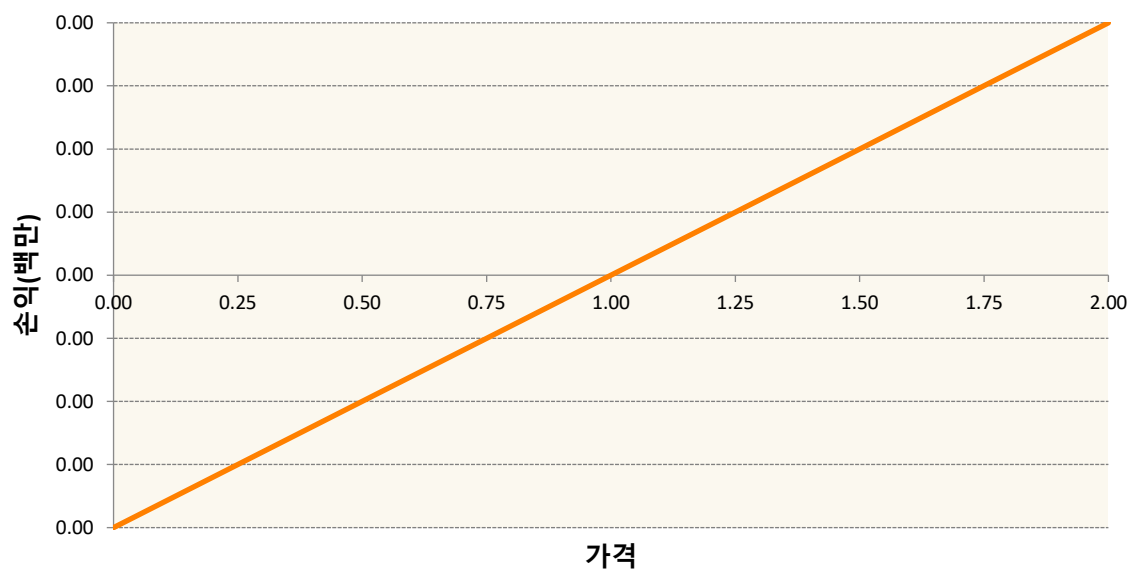
SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,130
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,273
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		10,598

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	14,019

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

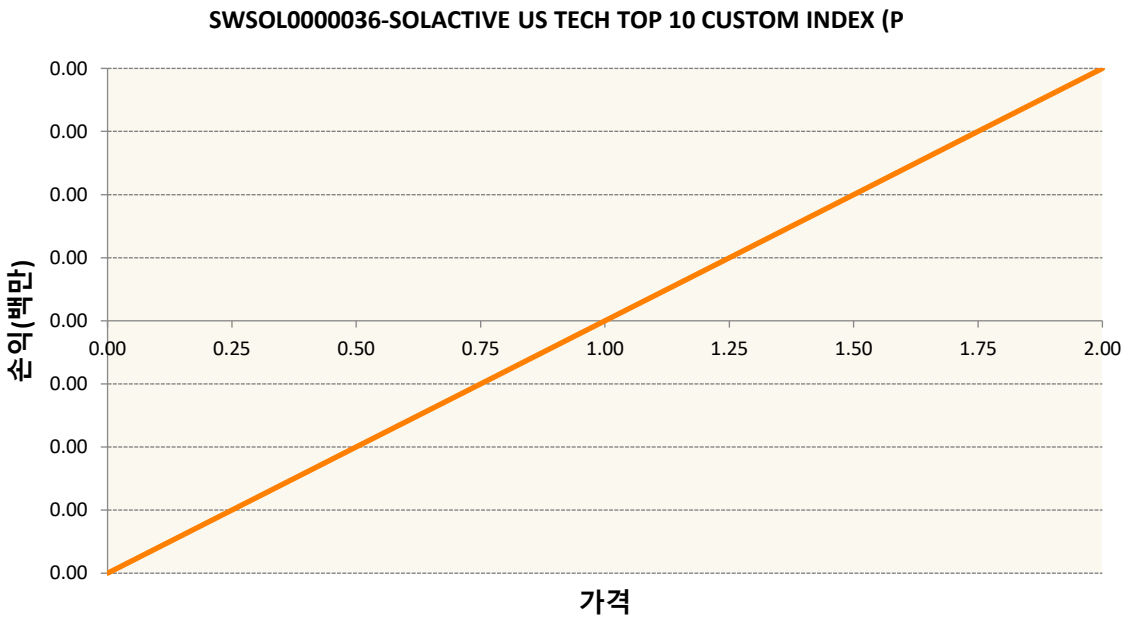
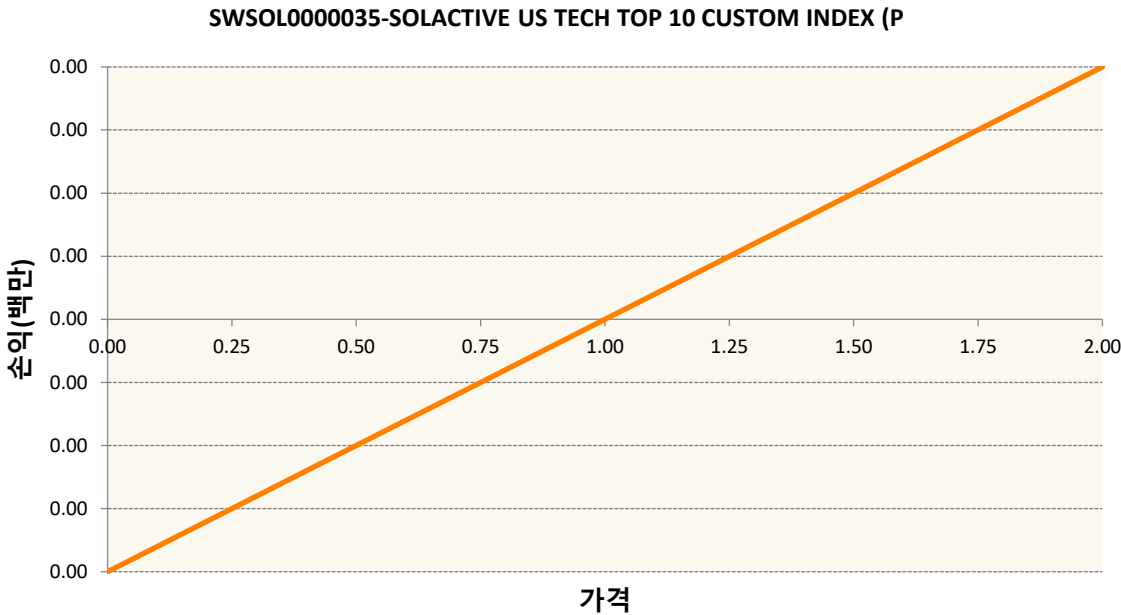
SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

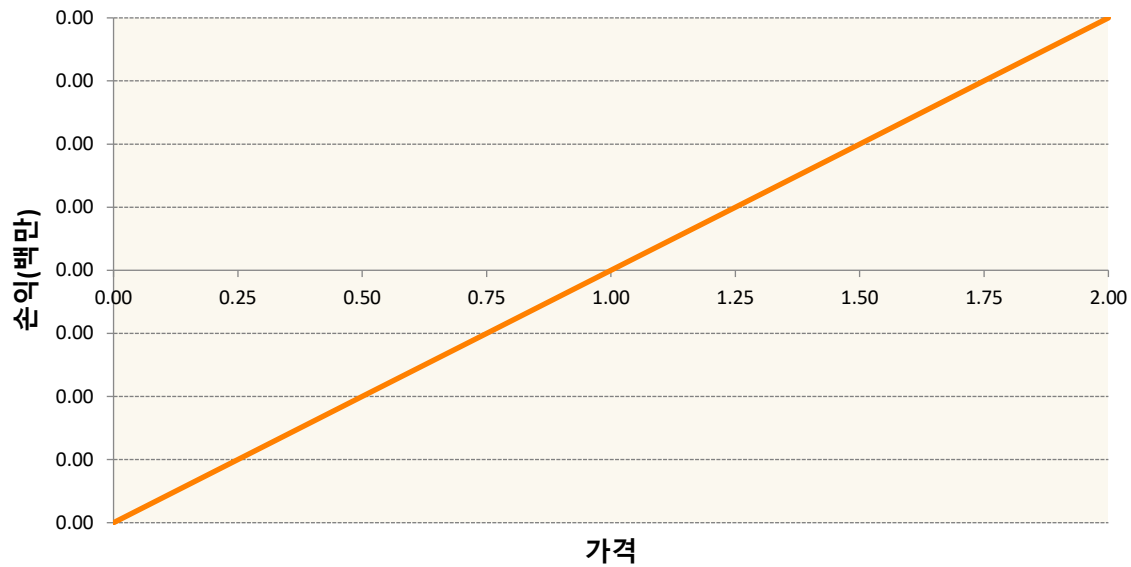
(단위:백만원)

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

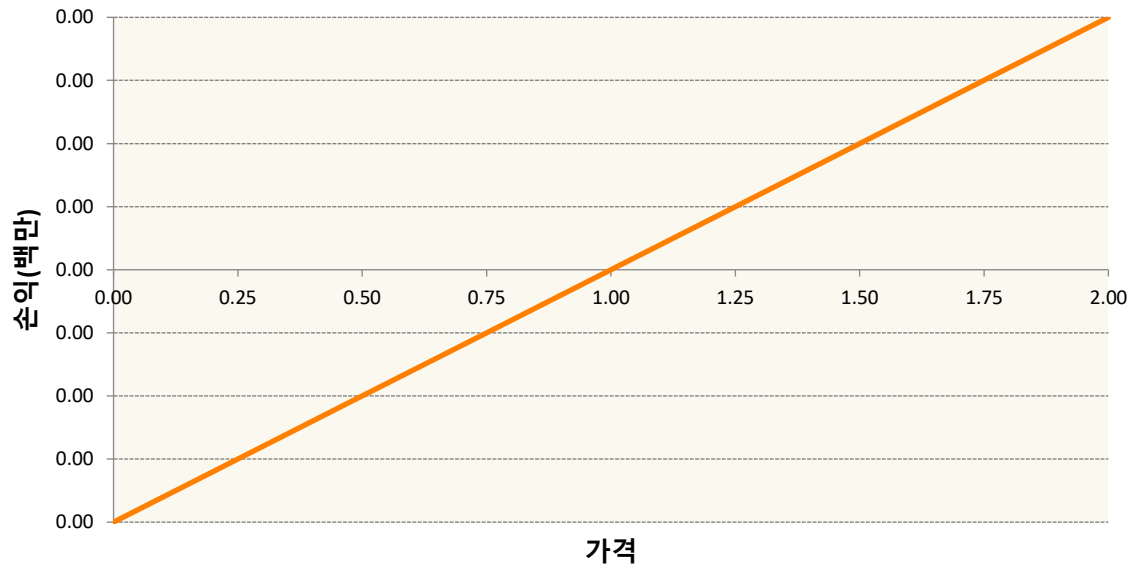
2. 만기시점의 손익구조



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	0.16
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.16
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.16
SWSOL0000(SOLACTIVE US TECH TOP 10 CUSTOM INDEX (P	0.16

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

(단위:백만원)

1

공시일	2026-02-03
기준일	2026-02-02

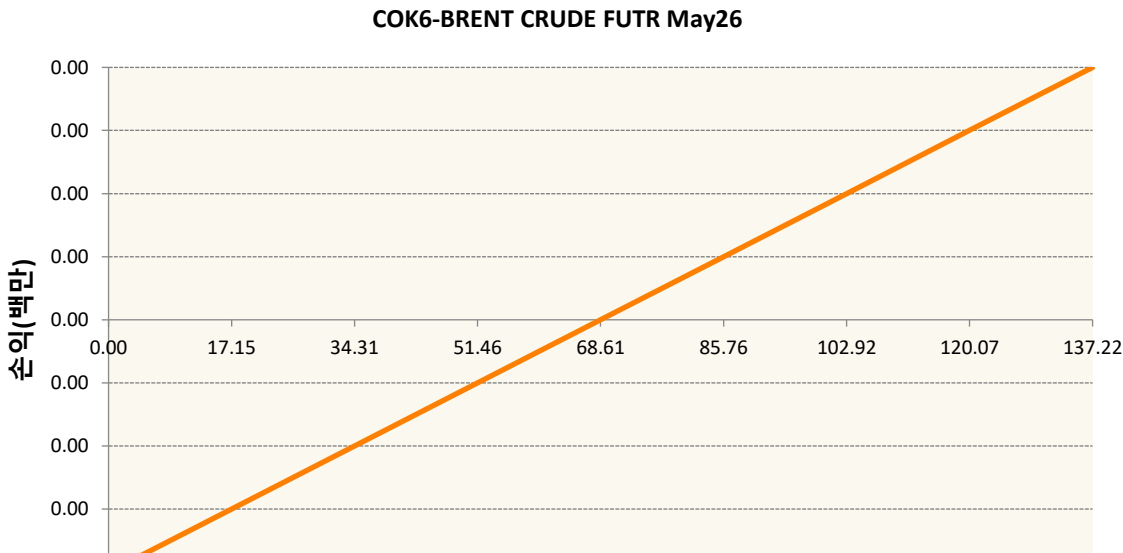
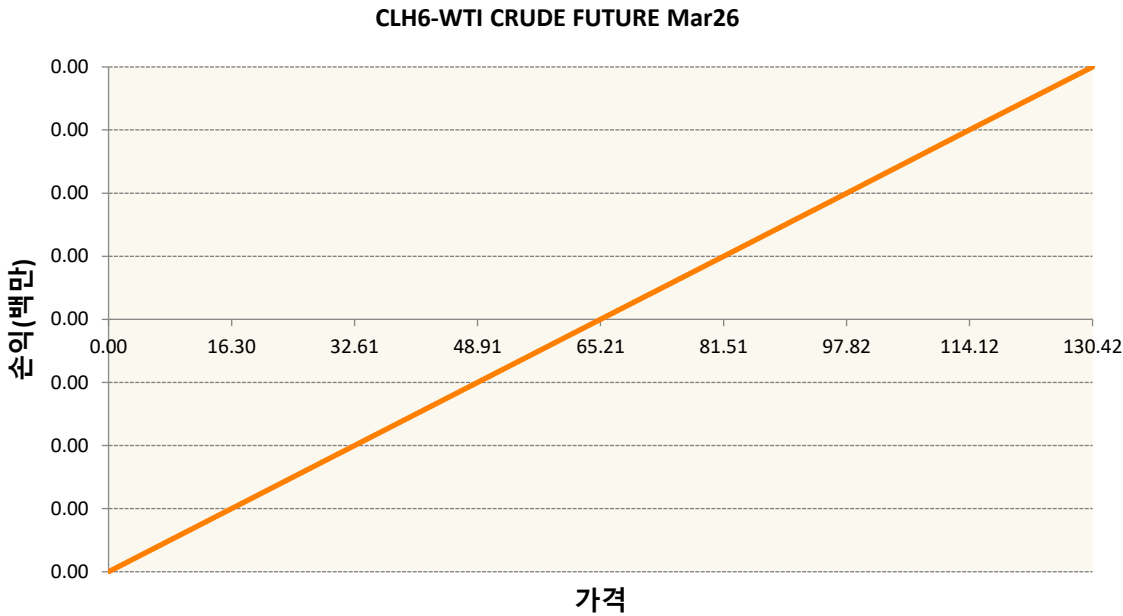
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

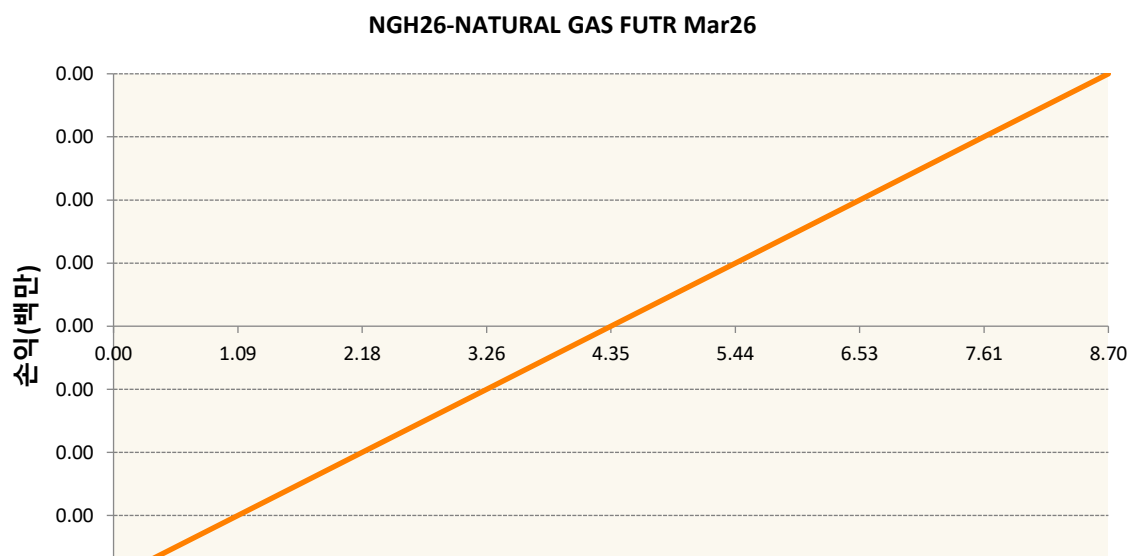
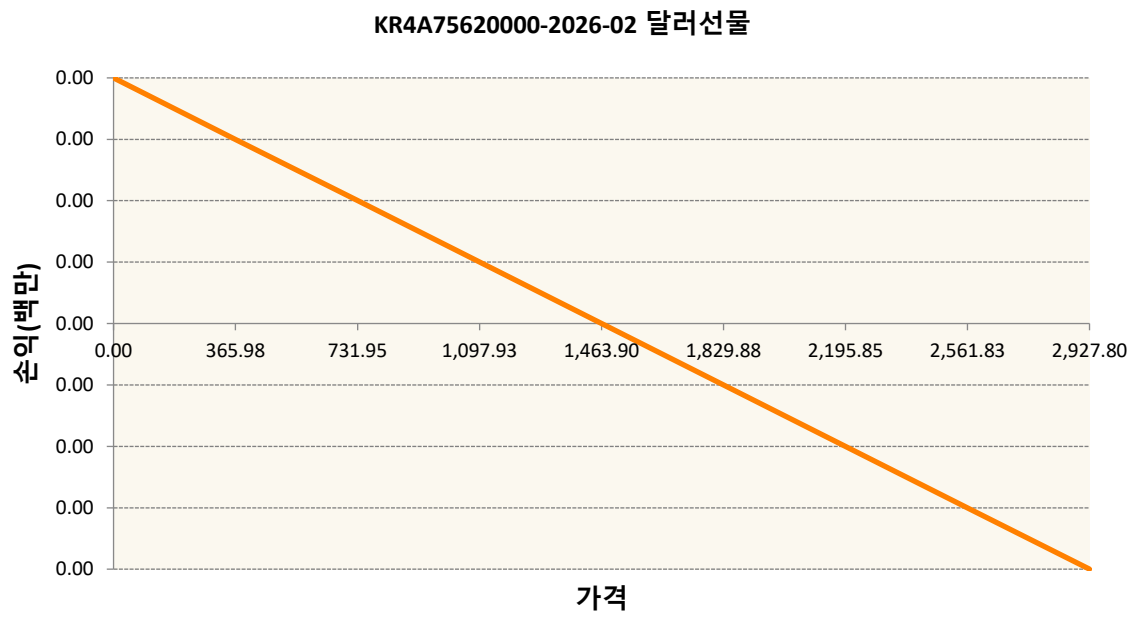
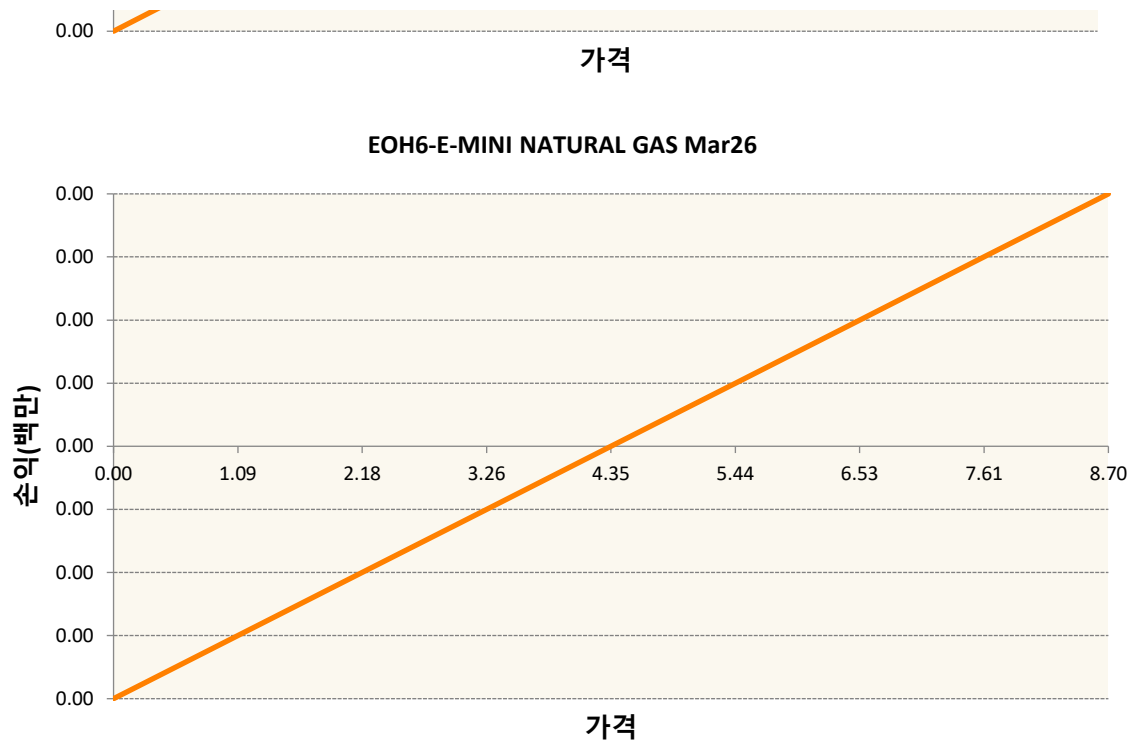
1. 계약금액

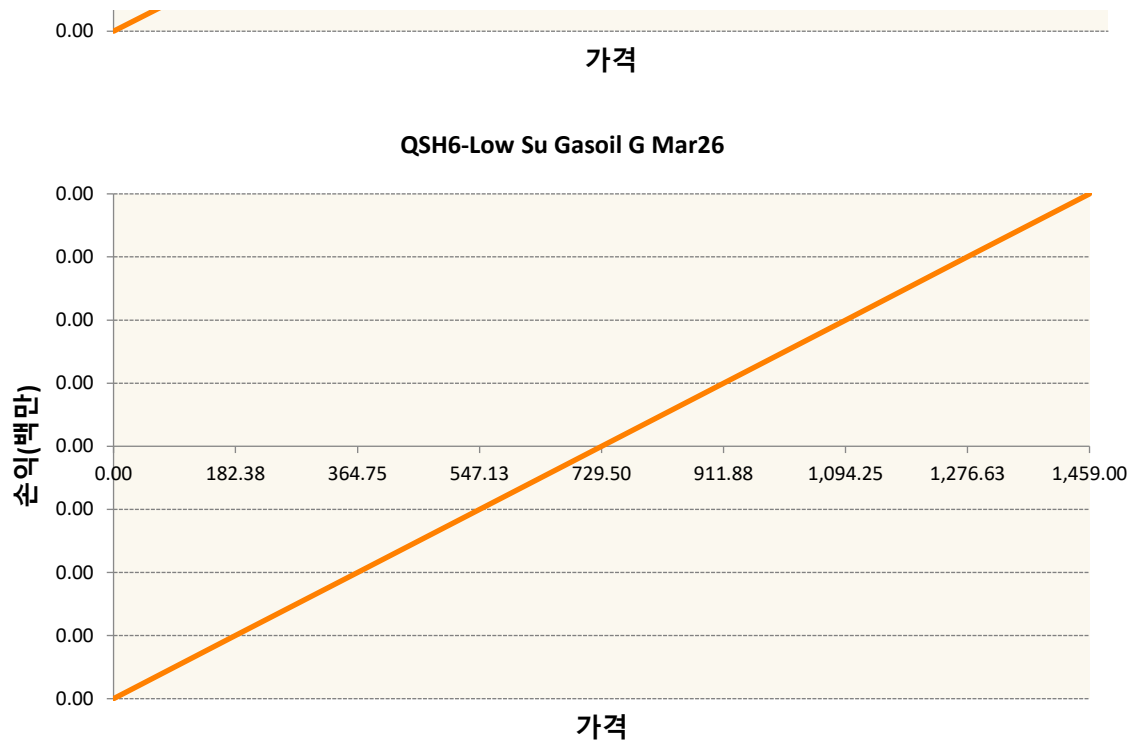
(단위:백만원)

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	160	0	160	
누계	유가증권	선물	405	0	405	
누계	통화	선물	0	117	-117	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

CLH6	WTI CRUDE FUTURE Mar26	8
COK6	BRENT CRUDE FUTR May26	16
EOH6	E-MINI NATURAL GAS Mar26	3
KR4A756200	2026-02 달러선물	9
NGH26	NATURAL GAS FUTR Mar26	10
QSH6	Low Su Gasoil G Mar26	9

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

(단위:백만원)

111