

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

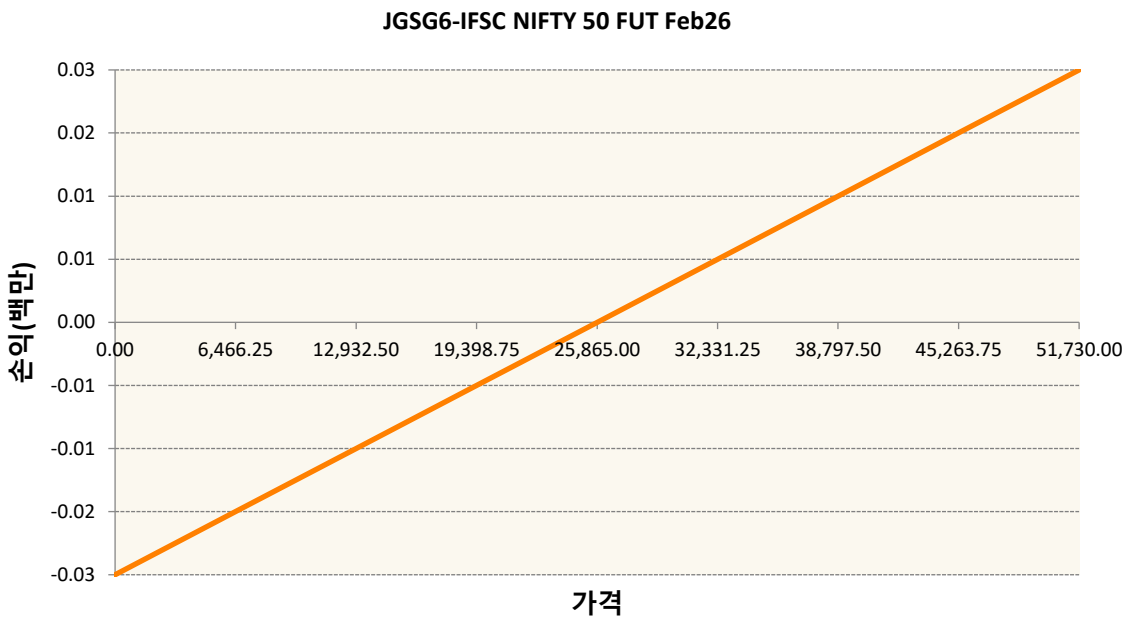
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	671	0	671	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSG6	IFSC NIFTY 50 FUT Feb26	54
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

34

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

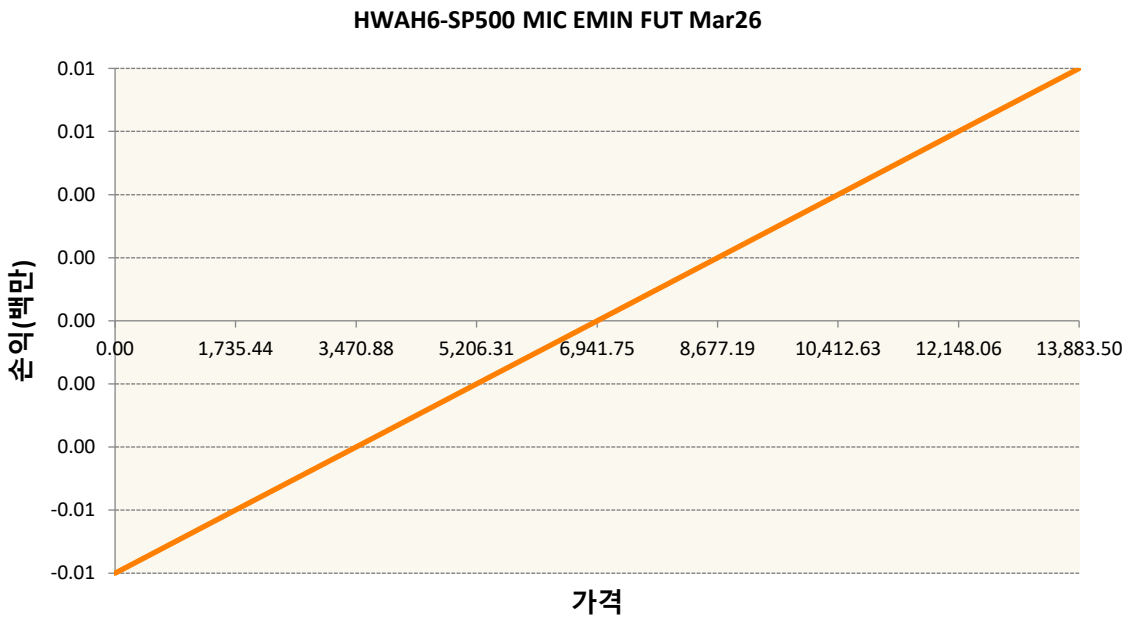
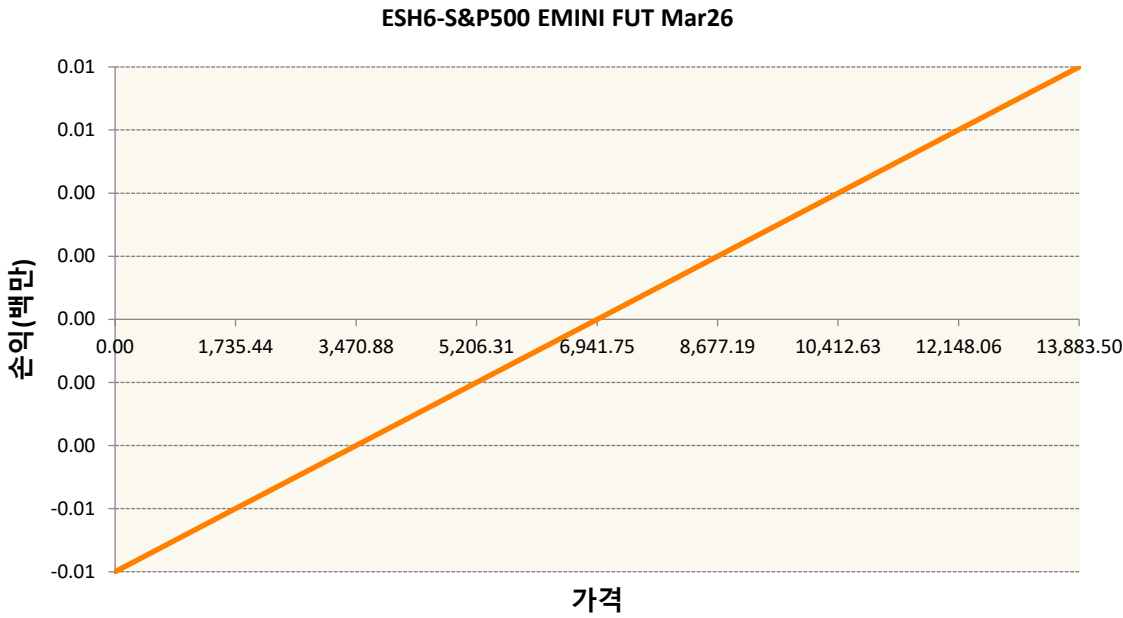
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	154	0	154	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	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	46

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

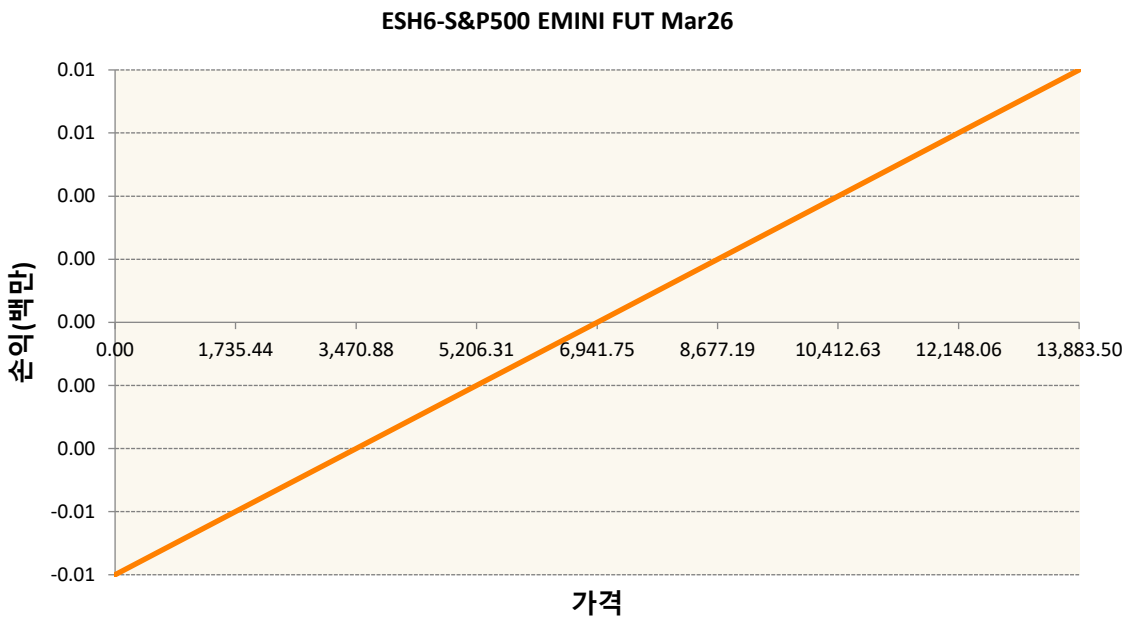
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,539	0	1,539	

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	2026-02-05
기준일	2026-02-04

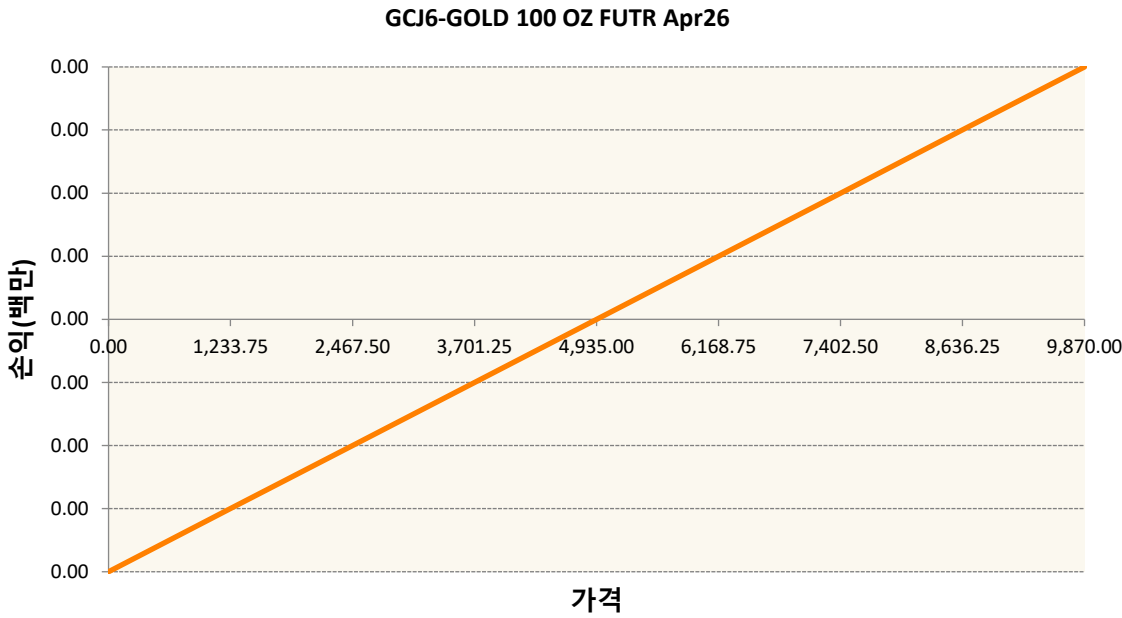
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,931	0	4,931	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 02/06/26 C485 EQUITY	4
GCI6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	395

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

(단위:백만원)

450

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

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	118
AOPLTRUCS' PLTR US 02/06/26 C160 EQUITY	2
AOPLTRUPP' PLTR US 02/06/26 P165 EQUITY	203

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

(단위:백만원)

1,220

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

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

4

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

(단위:백만원)

2

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

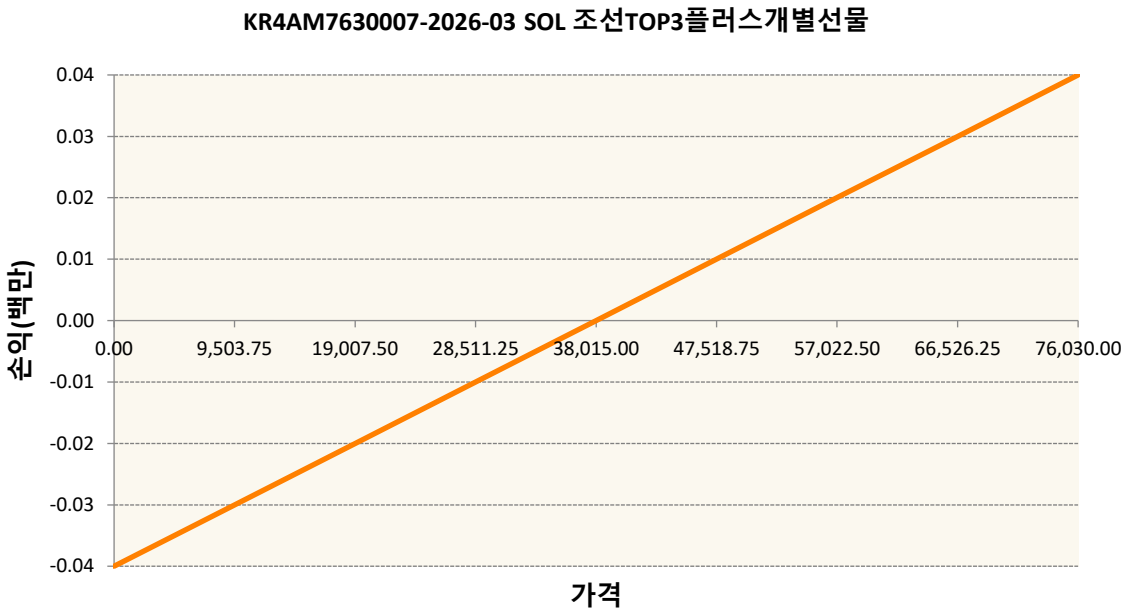
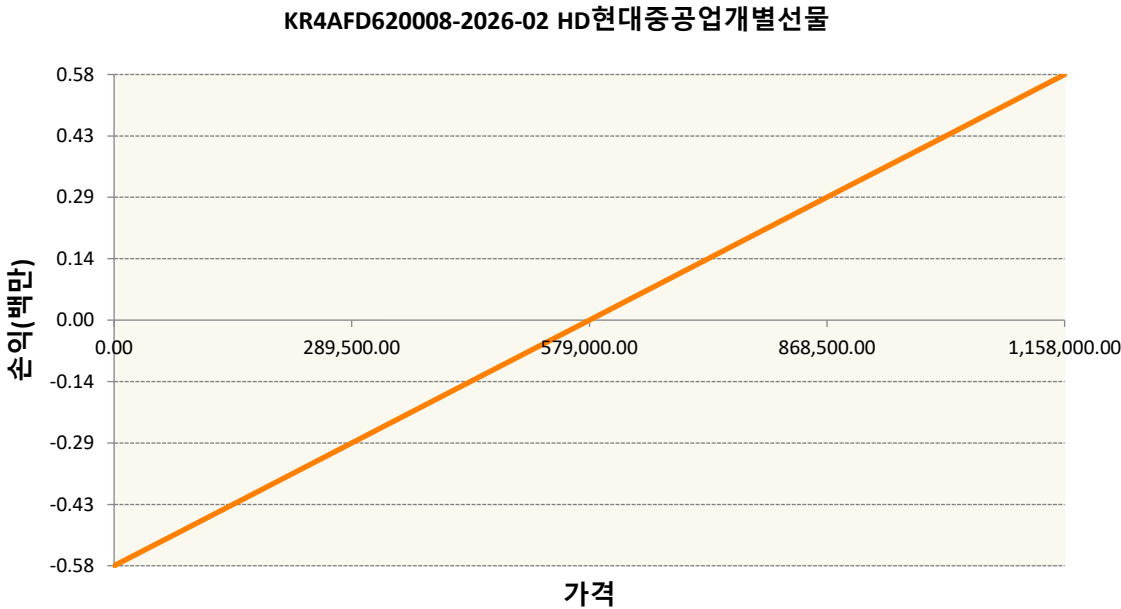
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	384	0	384	장내
누계	유가증권	선물	25,016	0	25,016	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AFD620008		2026-02 HD현대중공업개별선물					935
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-935	-935	-935	-935	-935	-935	-935
-5.33%	-623	-623	-623	-623	-623	-623	-623
-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%	623	623	623	623	623	623	623
8.00%	935	935	935	935	935	935	935
KR4AM7630007		2026-03 SOL 조선TOP3플러스개별선물					1,071
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,071	-1,071	-1,071	-1,071	-1,071	-1,071	-1,071
-5.33%	-714	-714	-714	-714	-714	-714	-714
-2.67%	-357	-357	-357	-357	-357	-357	-357
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	357	357	357	357	357	357	357
5.33%	714	714	714	714	714	714	714
8.00%	1,071	1,071	1,071	1,071	1,071	1,071	1,071

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

2,016

공시일 2026-02-05

기준일 2026-02-04

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	2026-02-05
기준일	2026-02-04

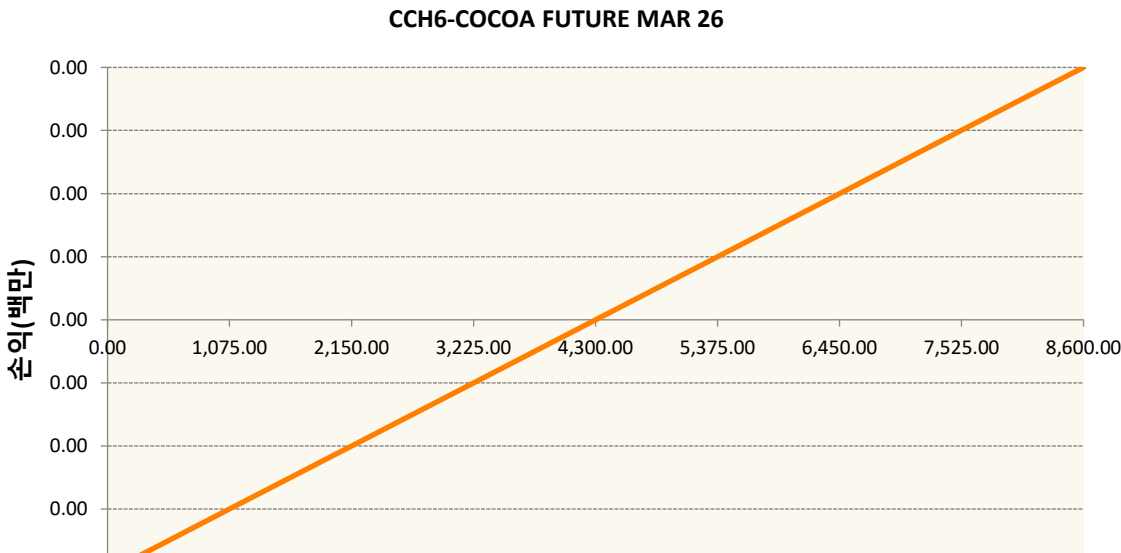
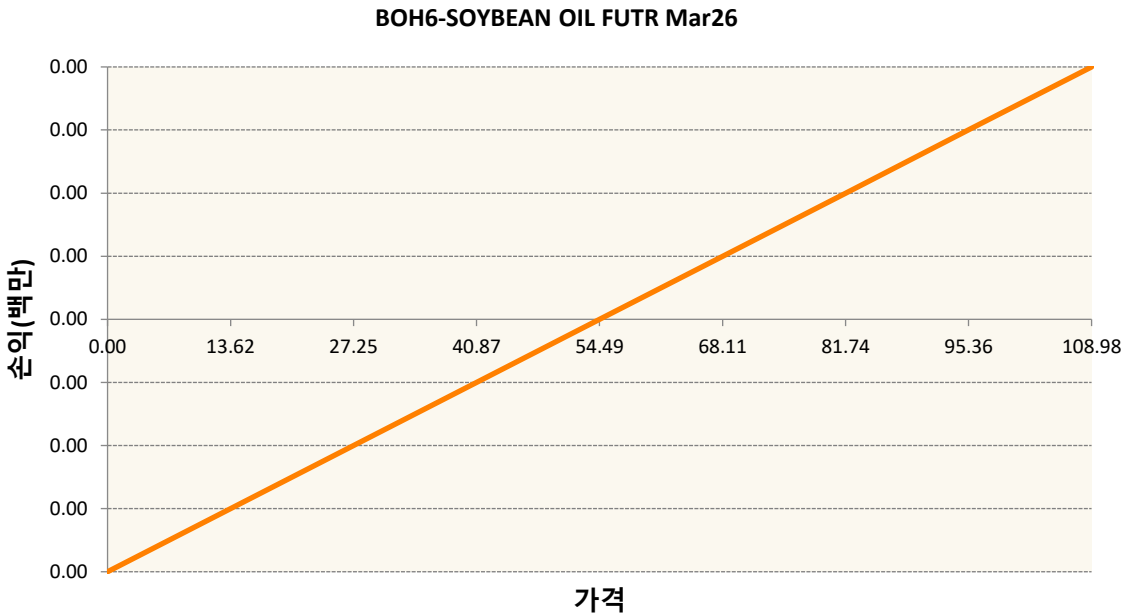
포커스농산물모(채권-파생형)

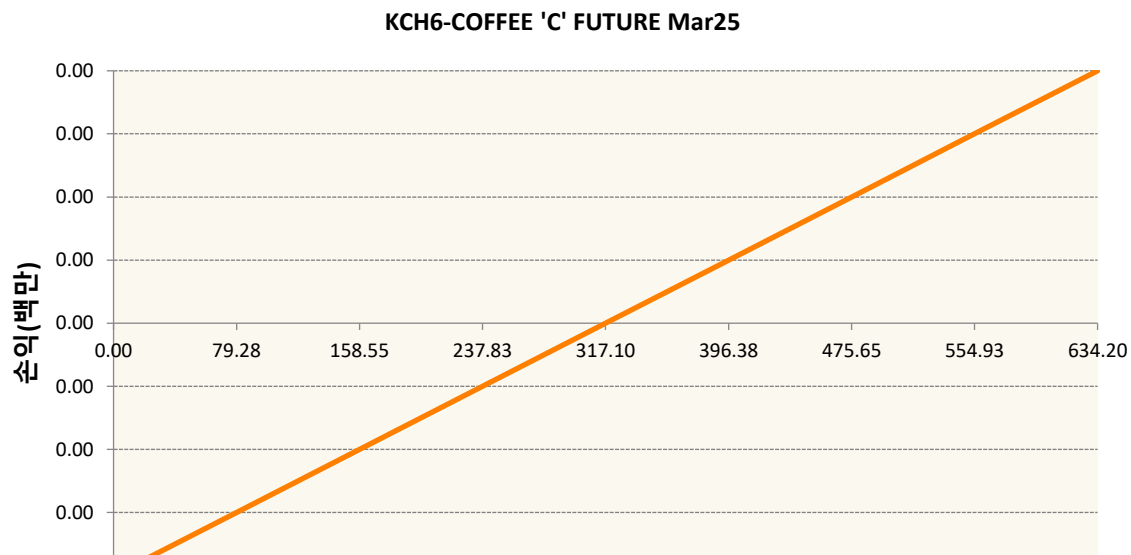
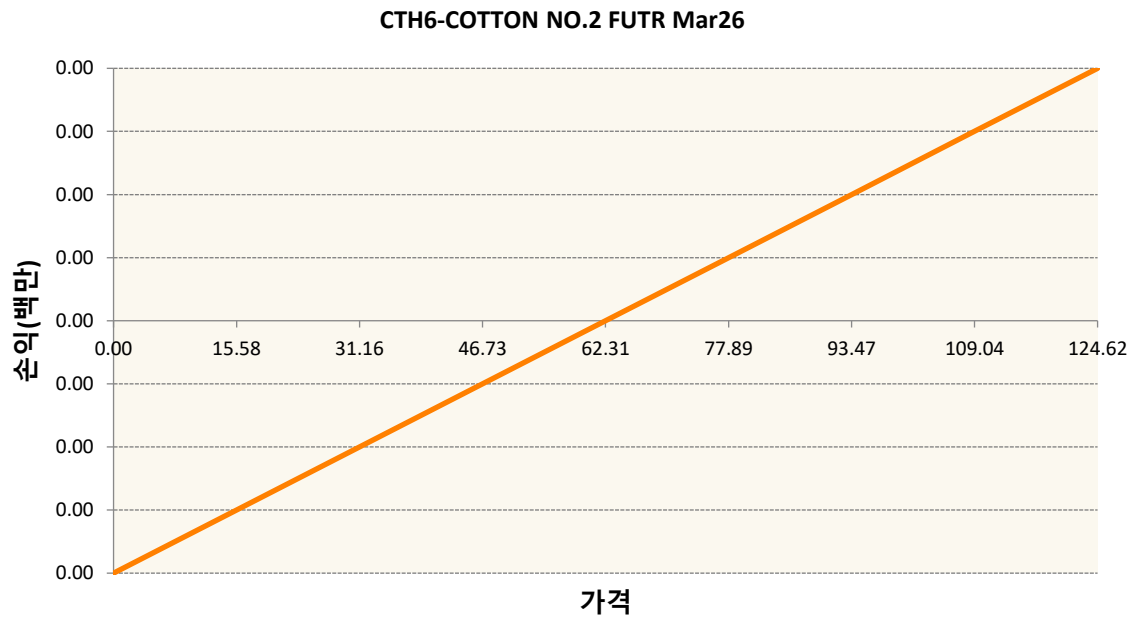
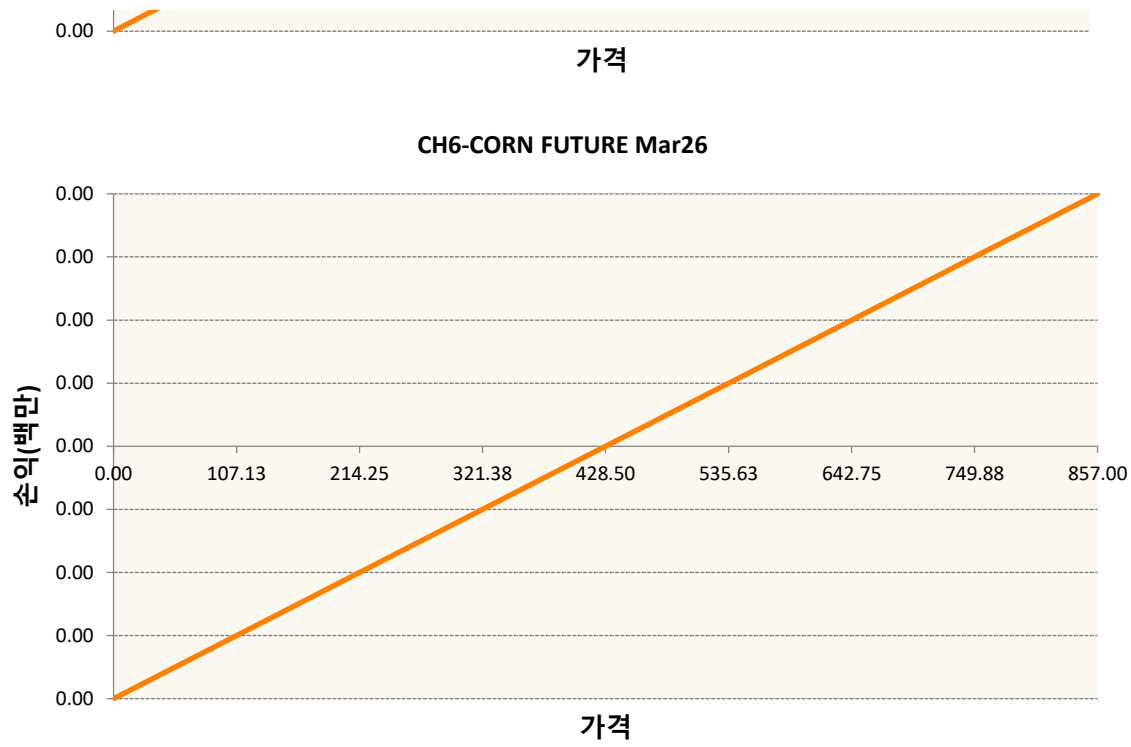
1. 계약금액

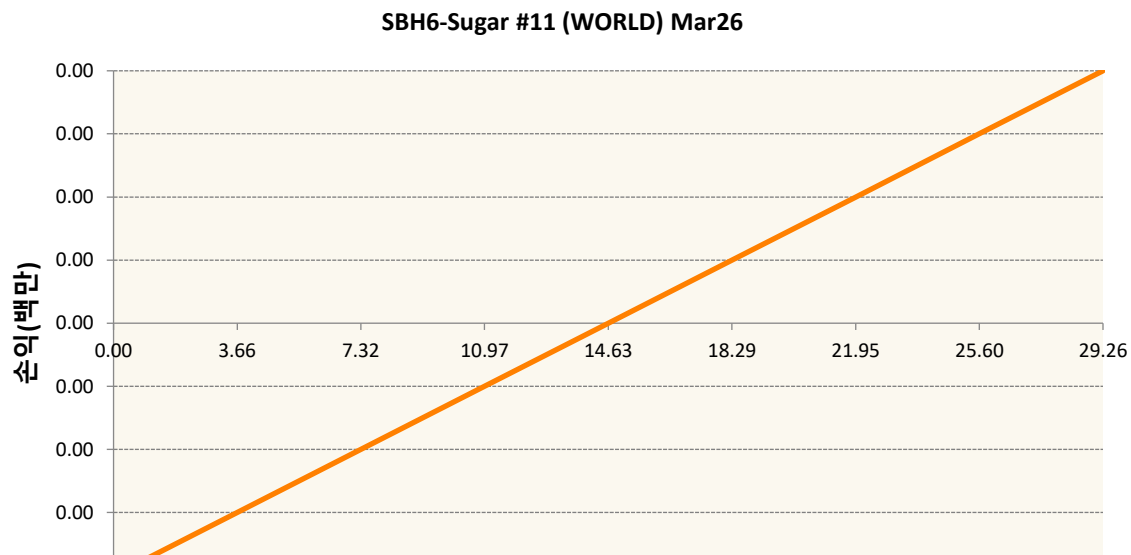
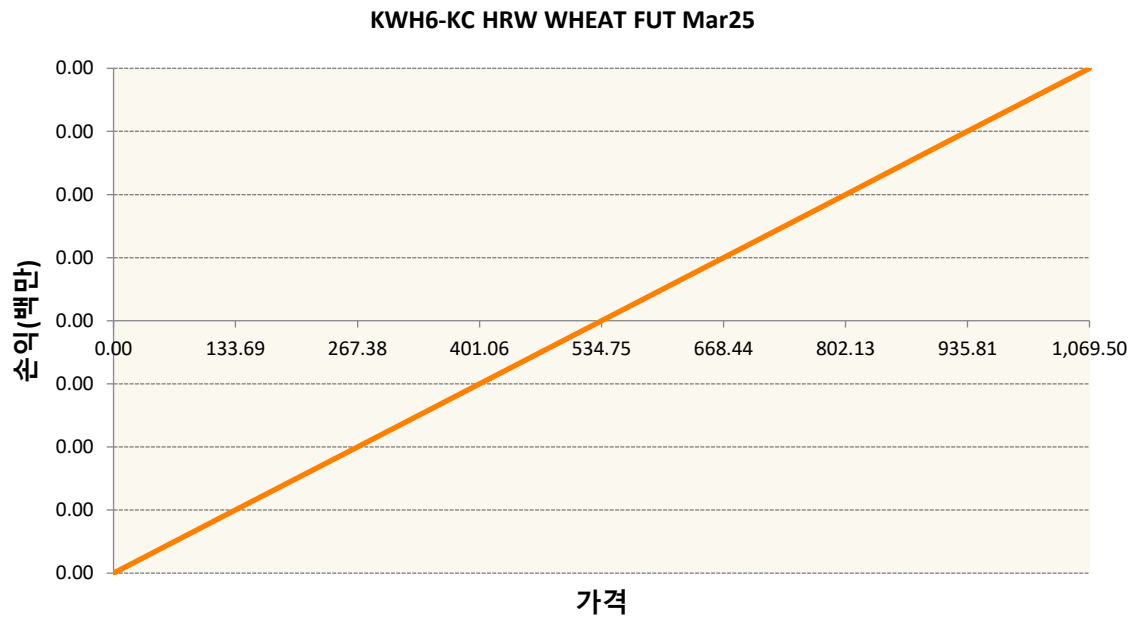
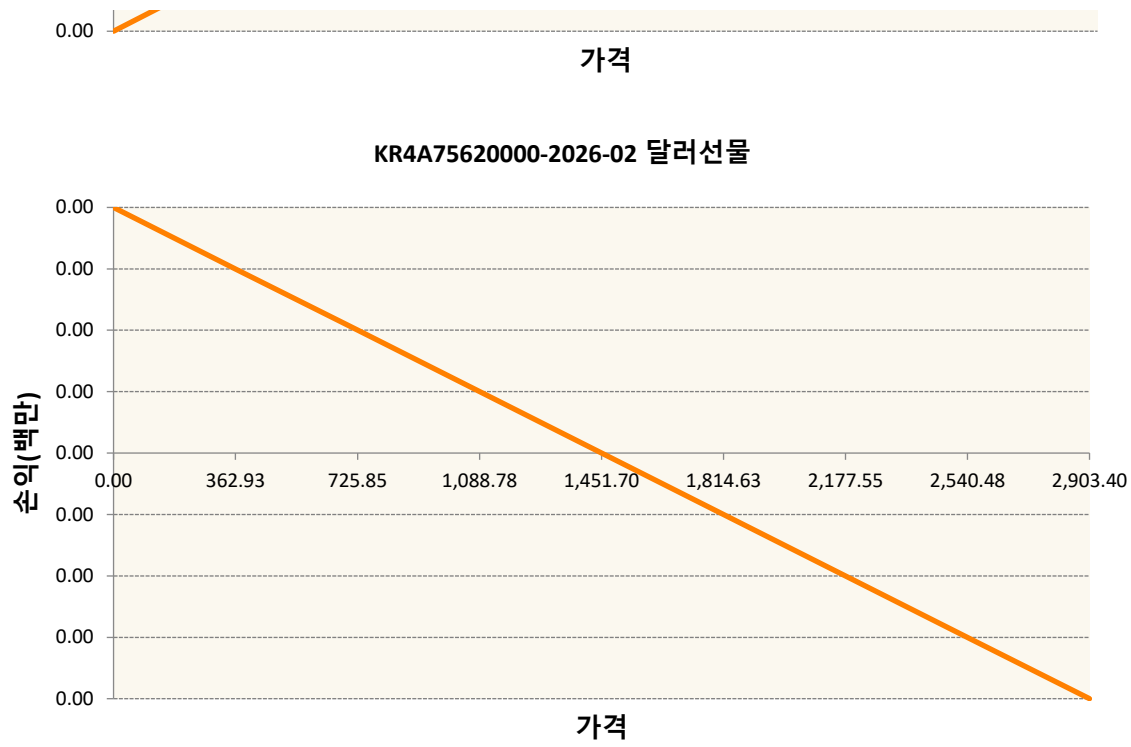
(단위:USD 백만)

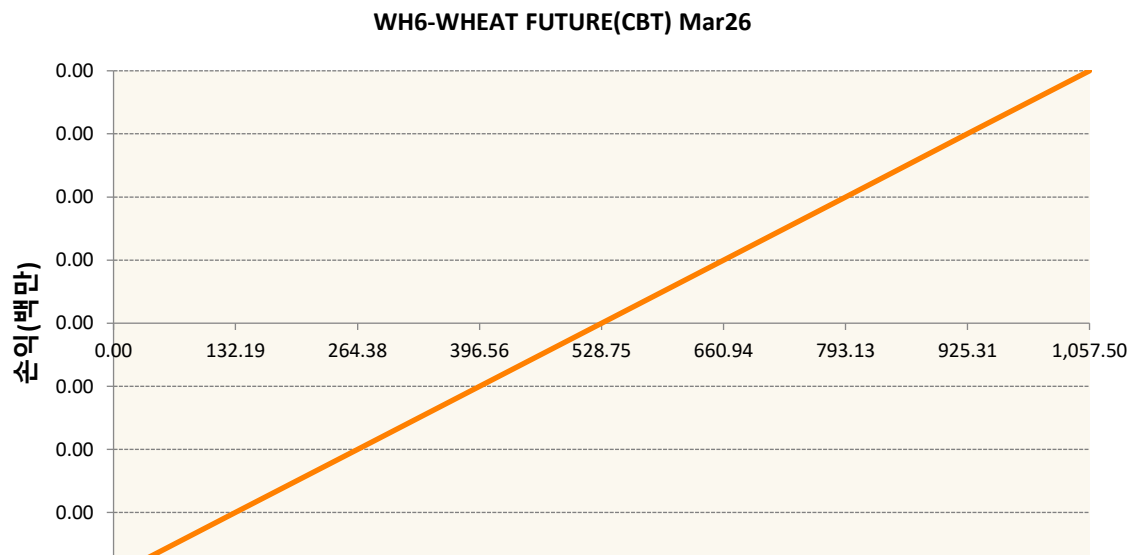
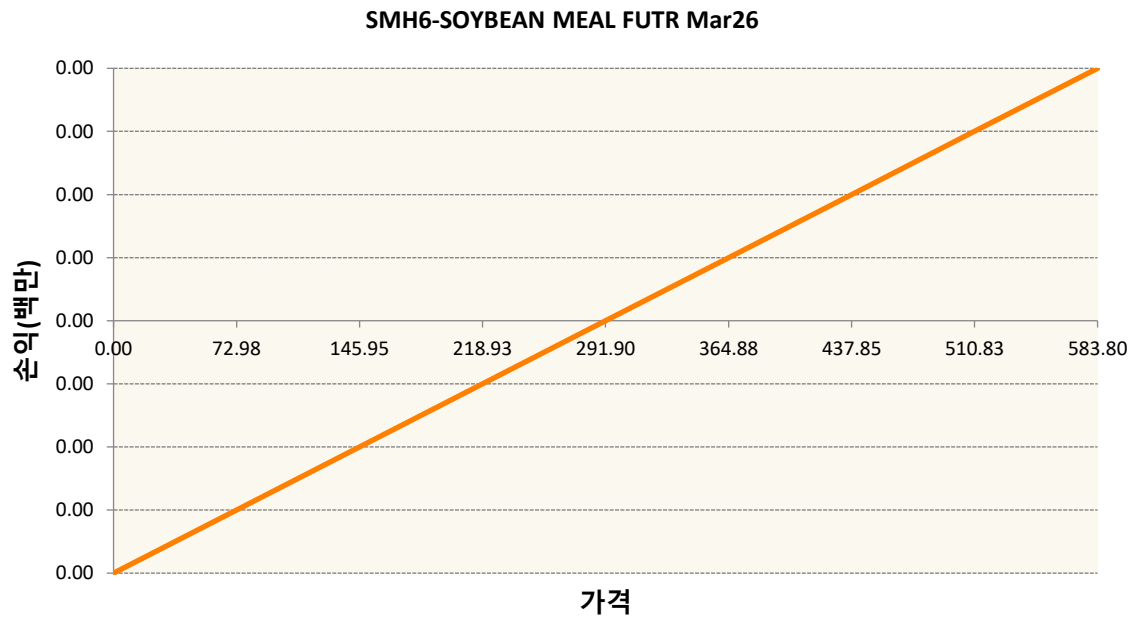
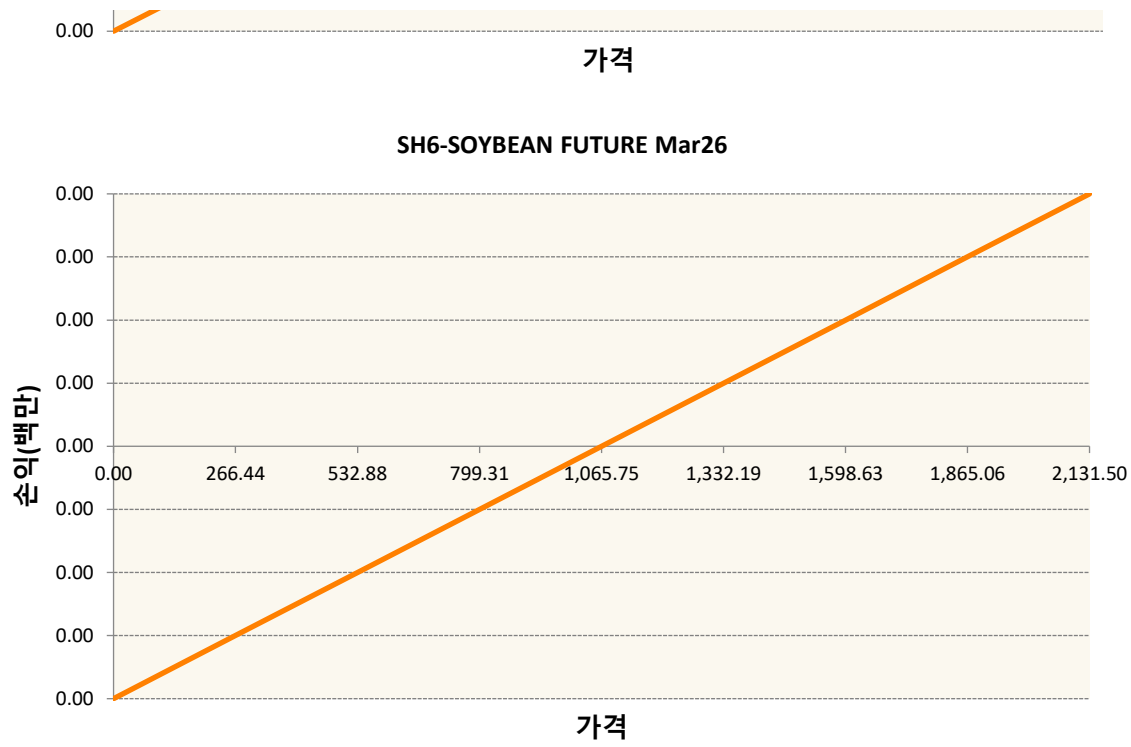
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	415	0	415	
누계	유가증권	선물	2,598	0	2,598	
누계	통화	선물	0	305	-305	장내

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	2026-02-05
기준일	2026-02-04

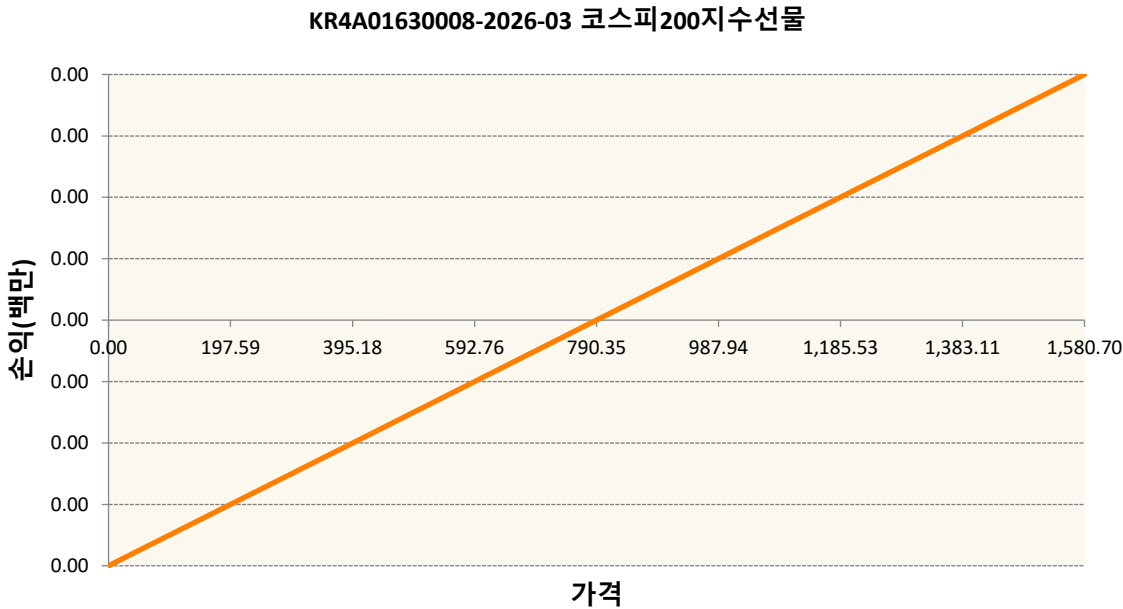
스마트인덱스모

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	3,161	0	3,161	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물	253
-------------------------------	-----

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

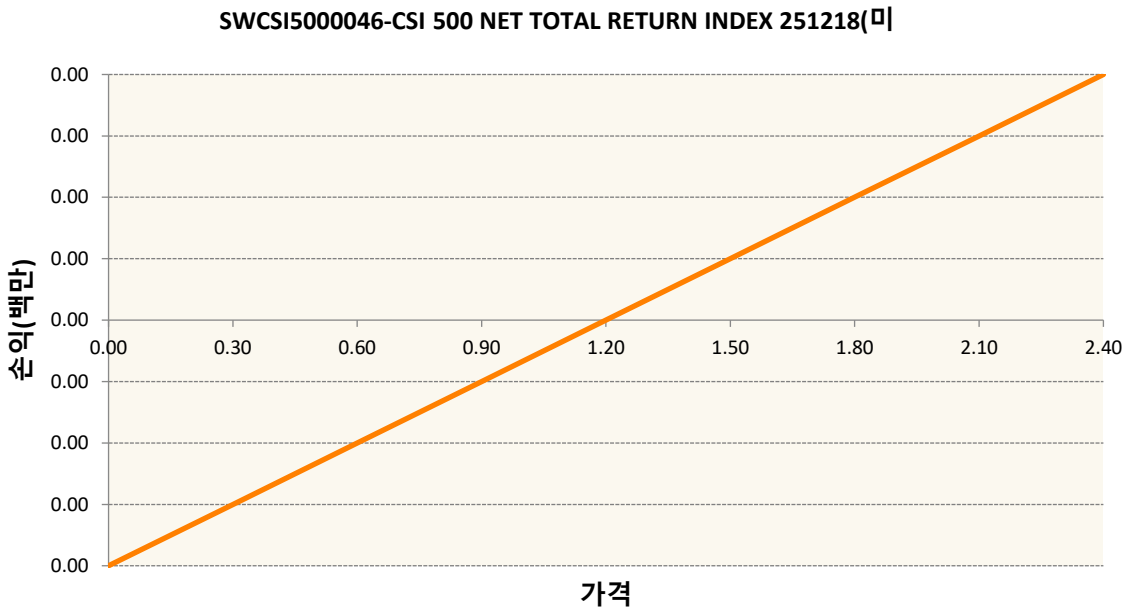
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,543	0	5,543	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 251218(미

443

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

549

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

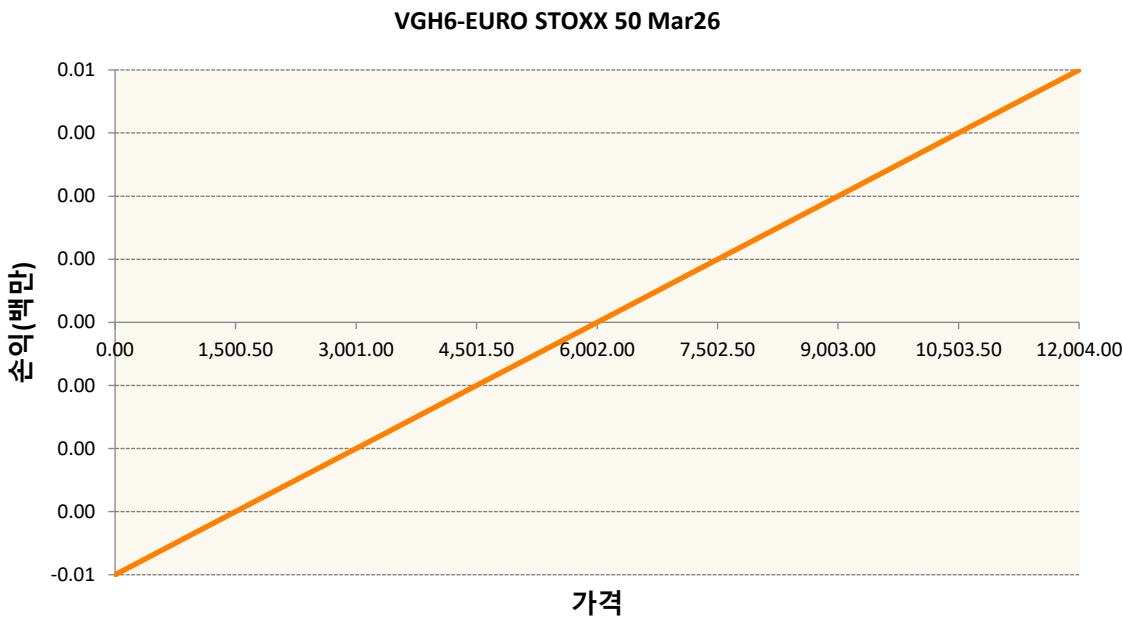
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	935	0	935	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH6	EURO STOXX 50 Mar26	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

61

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

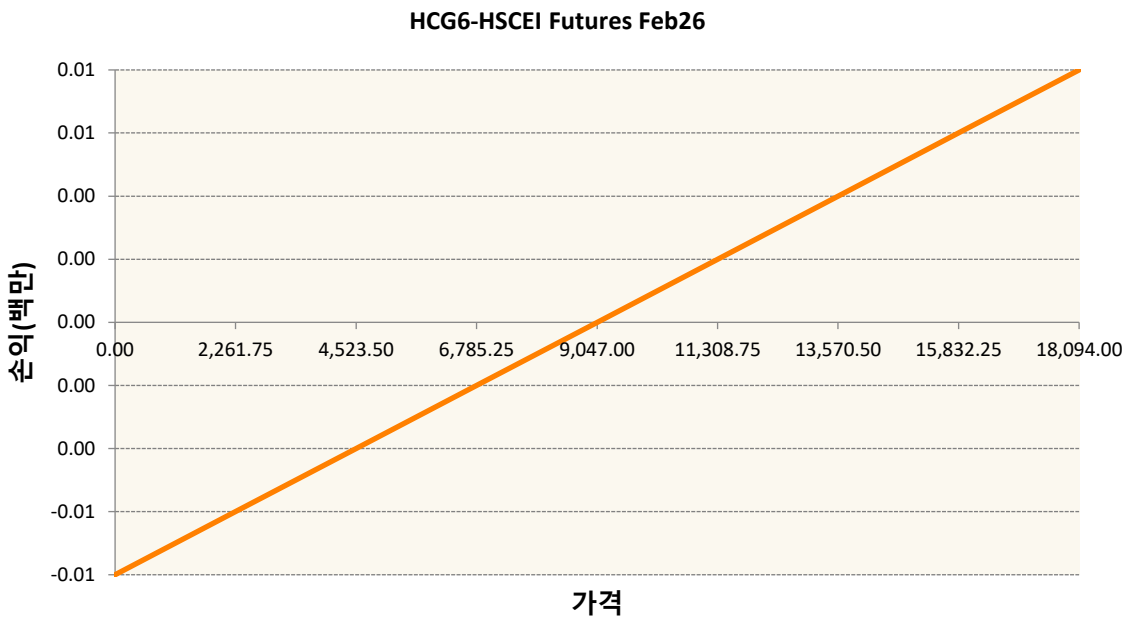
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,983	0	1,983	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG6	HSCEI Futures Feb26	159
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

224

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

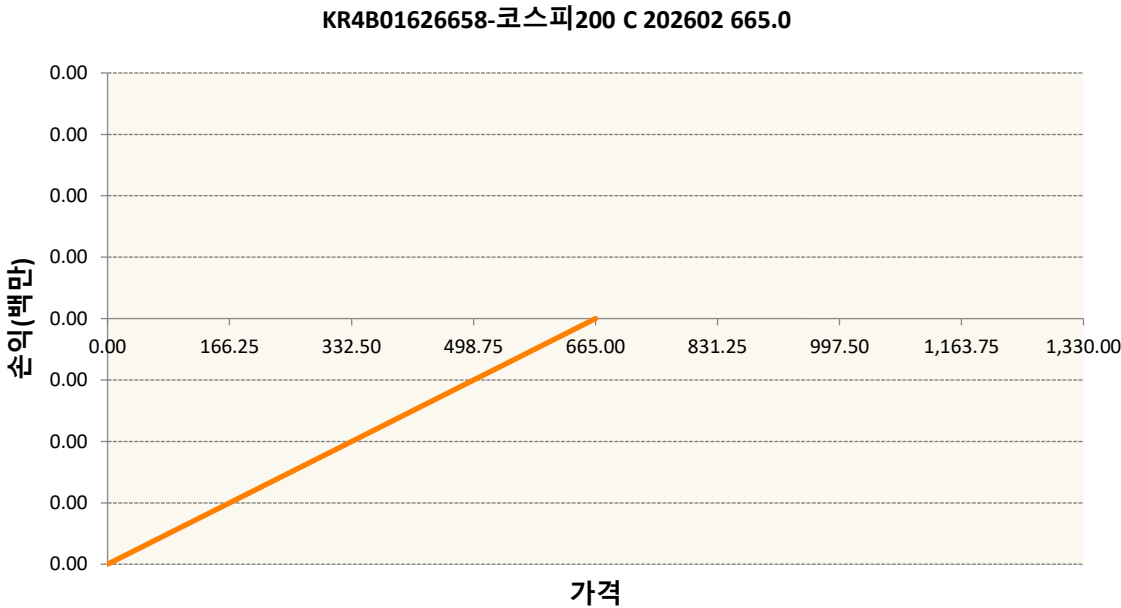
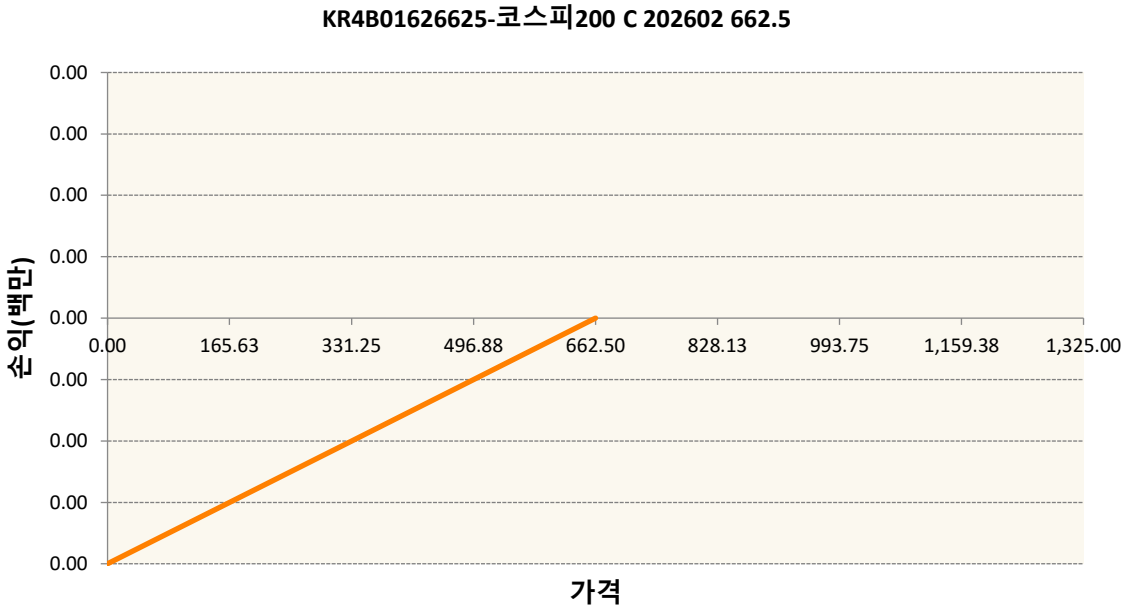
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

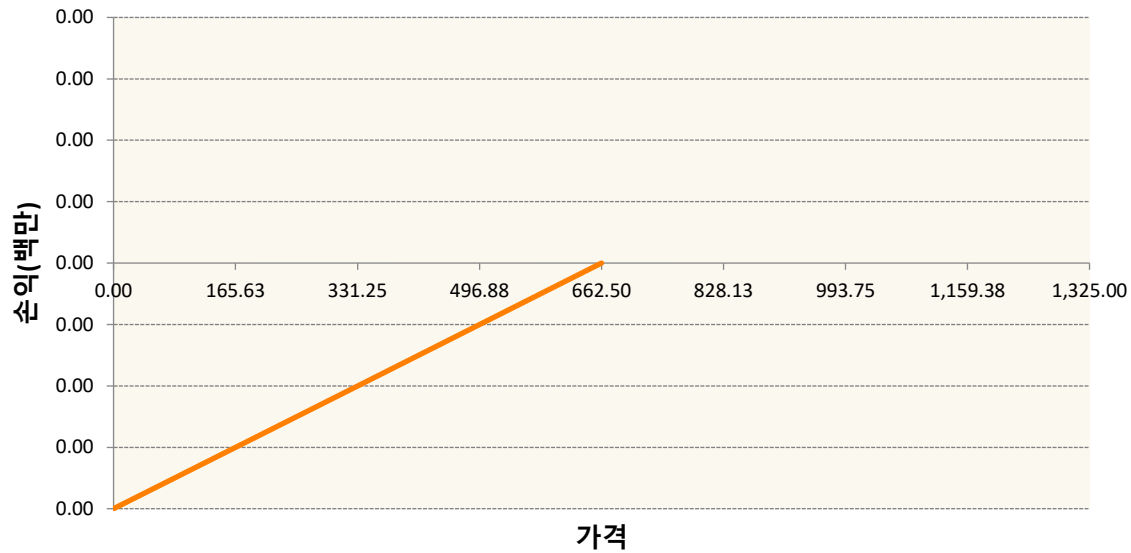
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	737	0	737	장내
누계	유가증권	옵션	0	31,214	-31,214	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

1,636

KR4C016266 코스피200 P 202602 662.5

504

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-02-05

기준일 2026-02-04

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	2026-02-05
기준일	2026-02-04

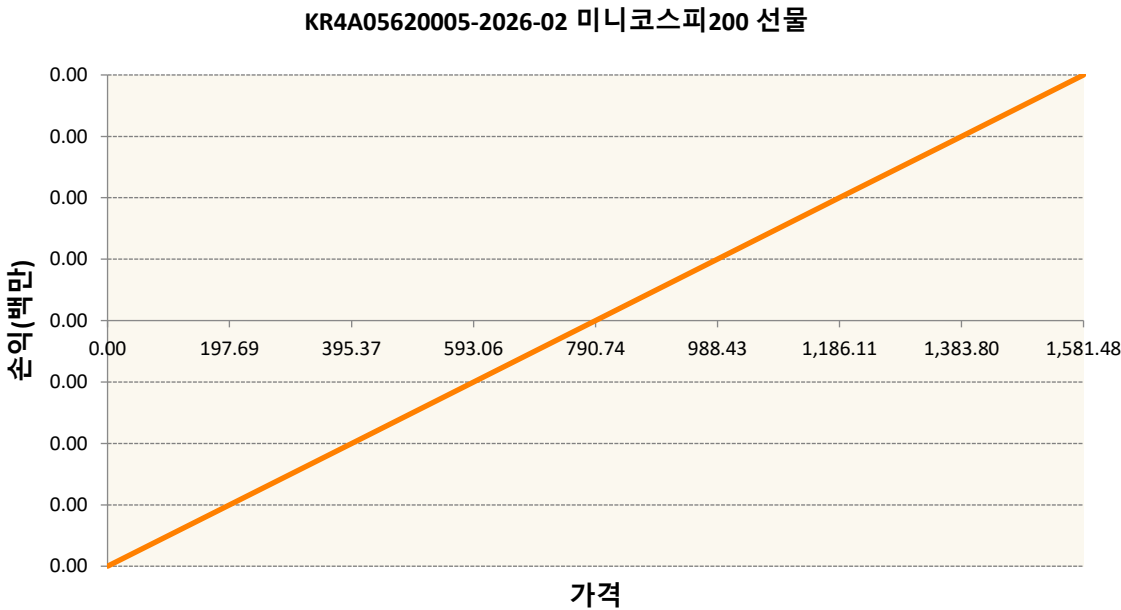
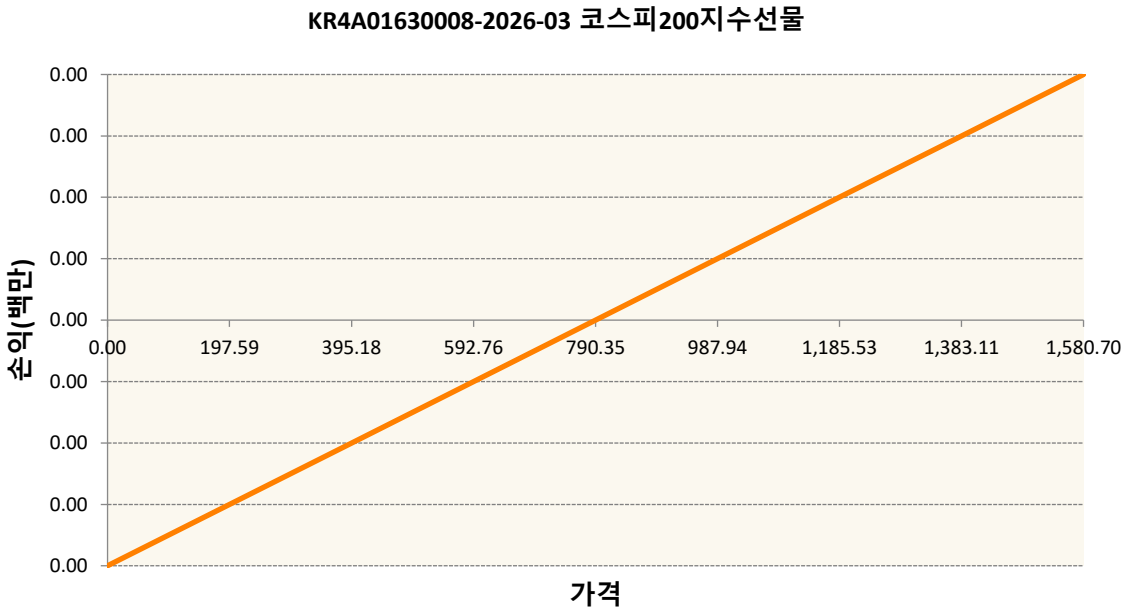
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

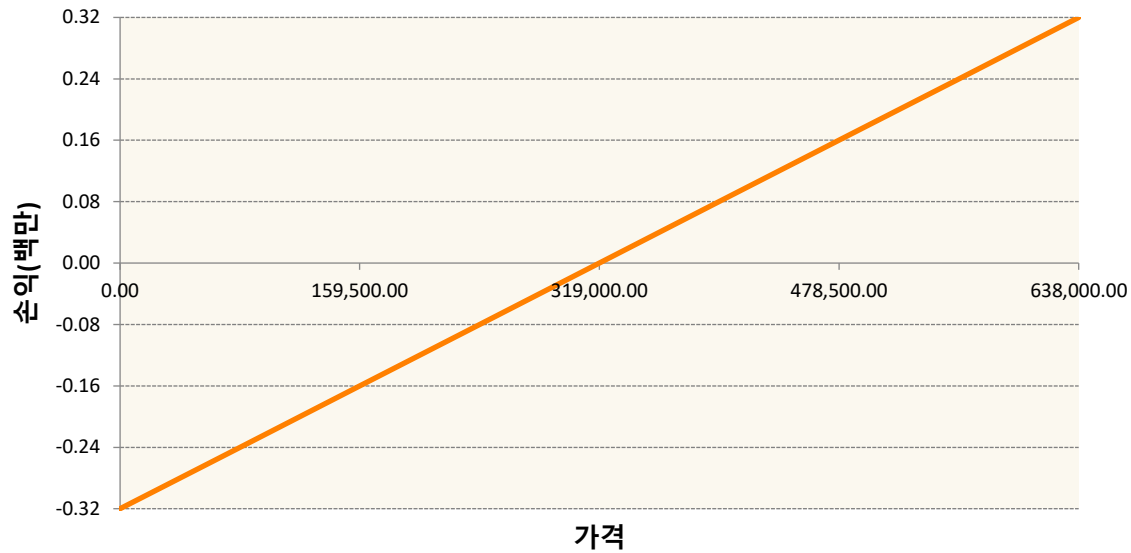
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	196	-196	장내
누계	유가증권	선물	3,634	0	3,634	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A47620005-2026-02 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물	79
KR4A056200 2026-02 미니코스피200 선물	41
KR4A476200 2026-02 LG화학개별선물	6

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

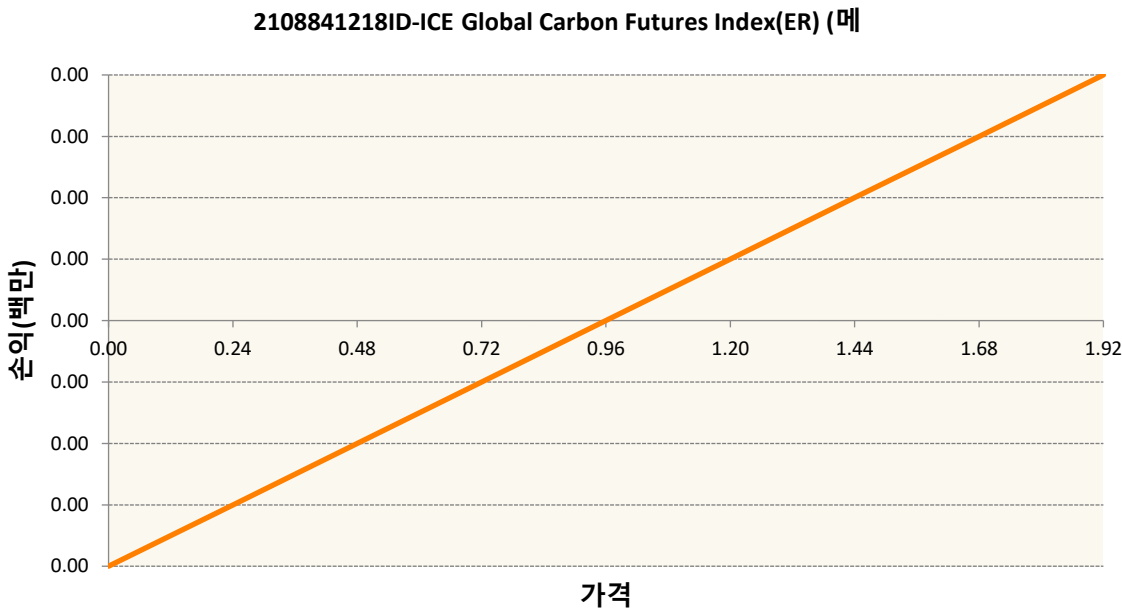
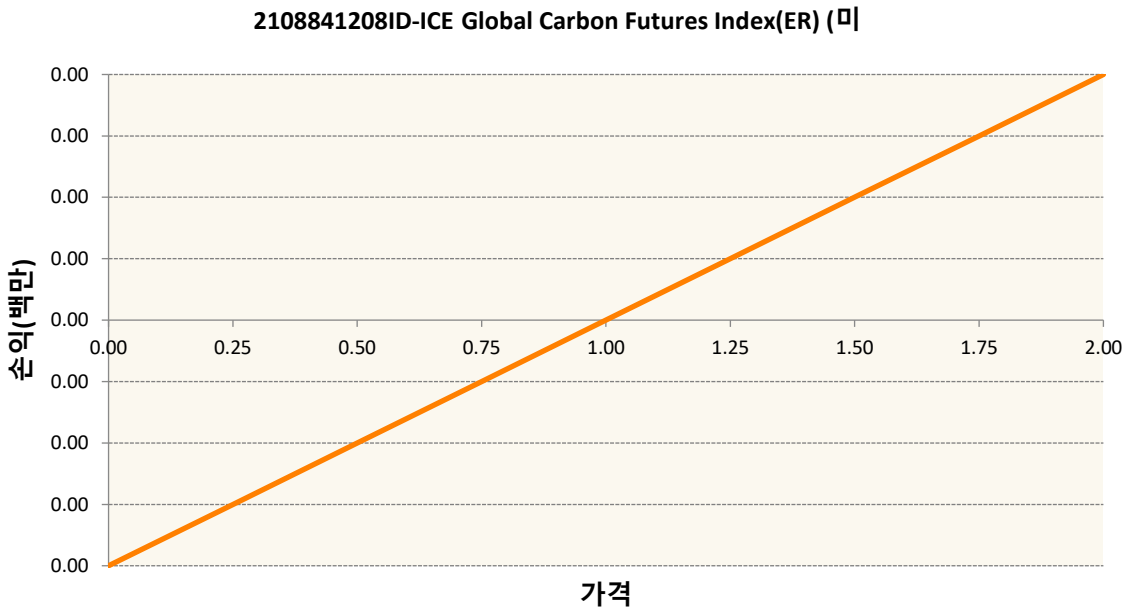
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,284	0	7,284	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		465
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		117

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	574

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

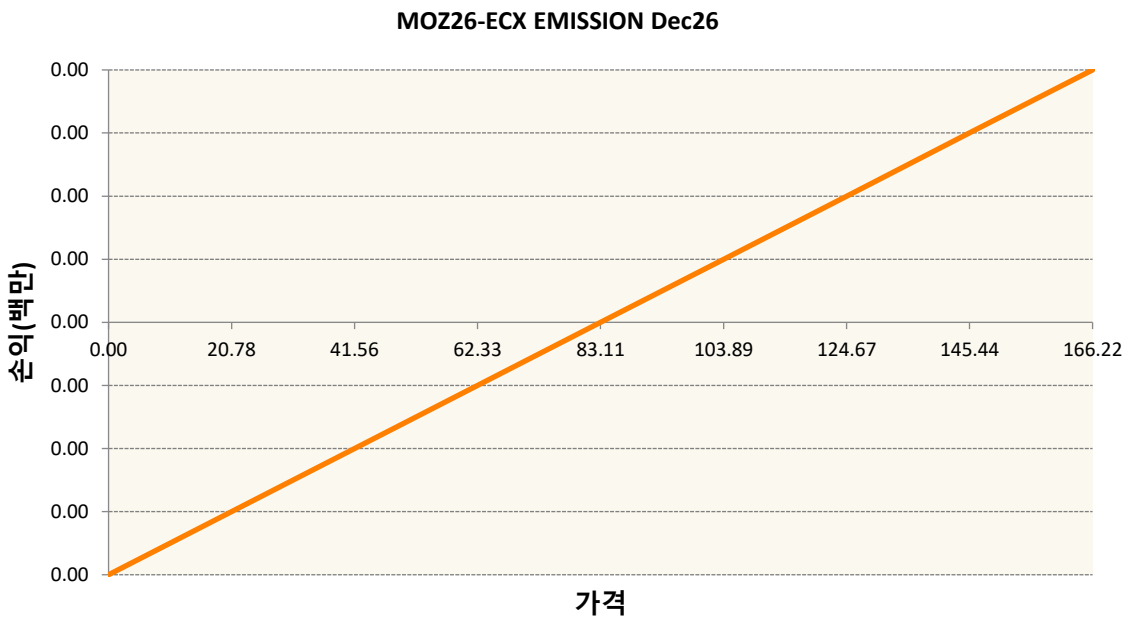
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,513	0	5,513	
누계	통화	선도	343	3,206	-2,862	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G1V\KRW/EUR 27-02-26E	256
FXW213G22\EUR/KRW 27-02-26E	27
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	441

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

(단위:백만원)

757

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

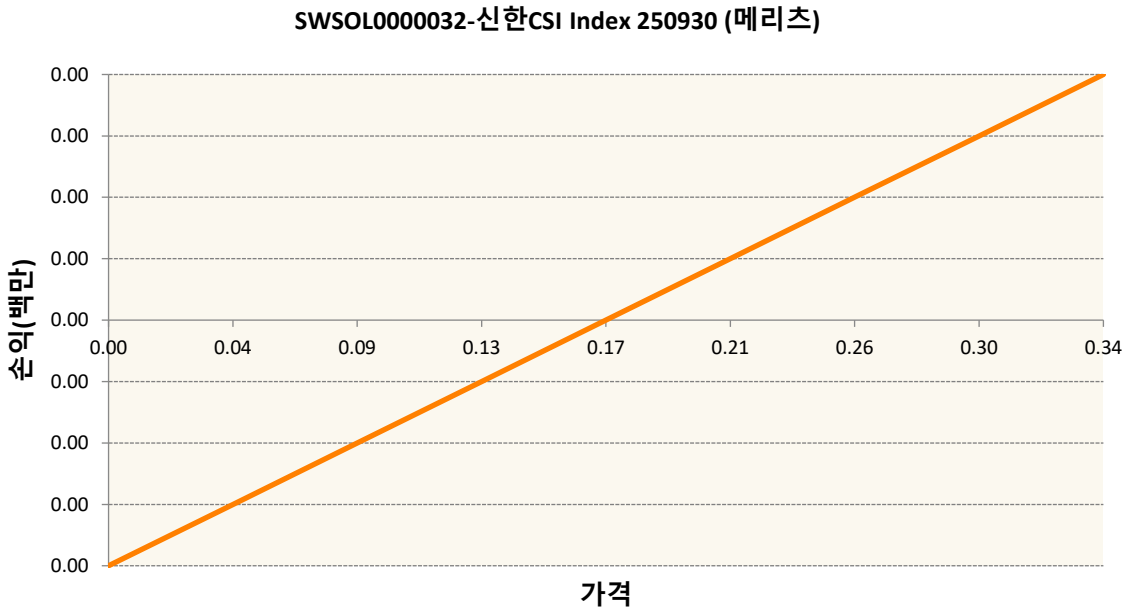
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,188	0	3,188	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	22
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	15
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	15
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	37

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

(단위:백만원)

158

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

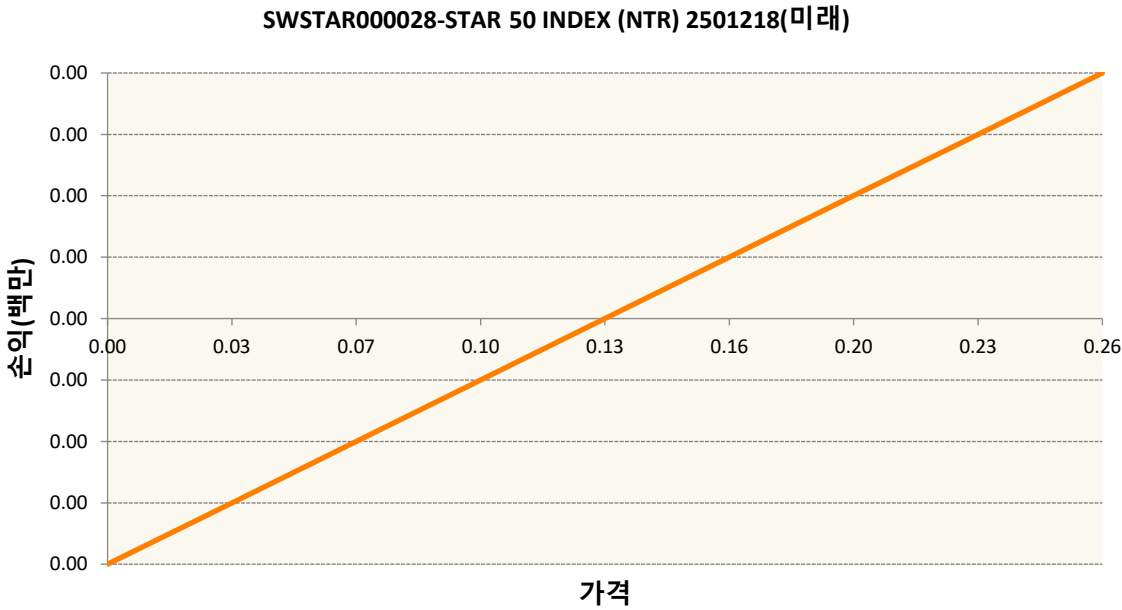
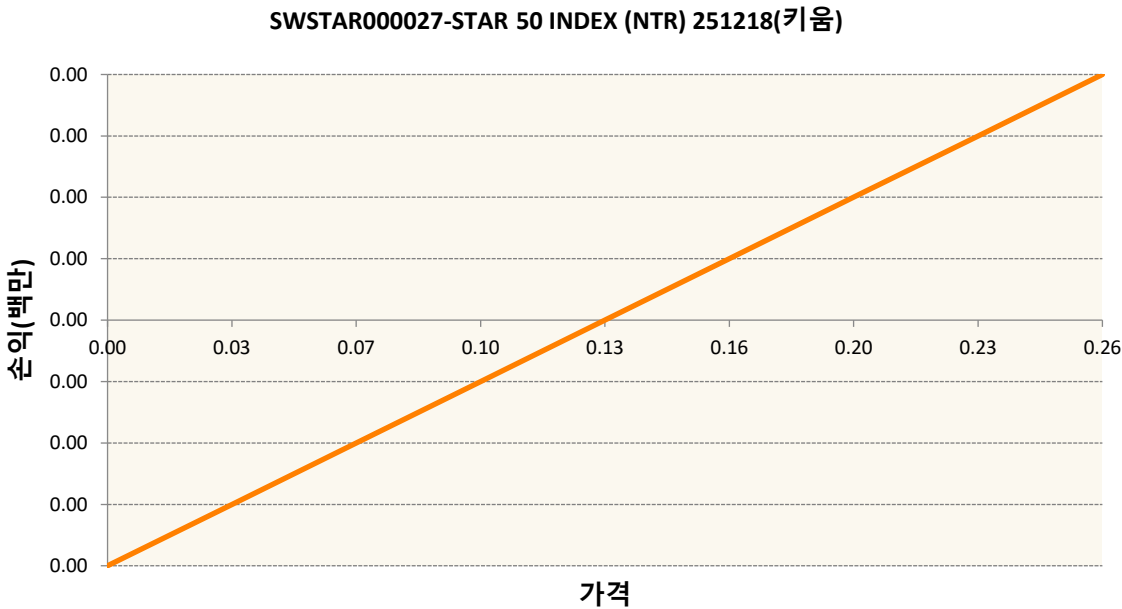
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

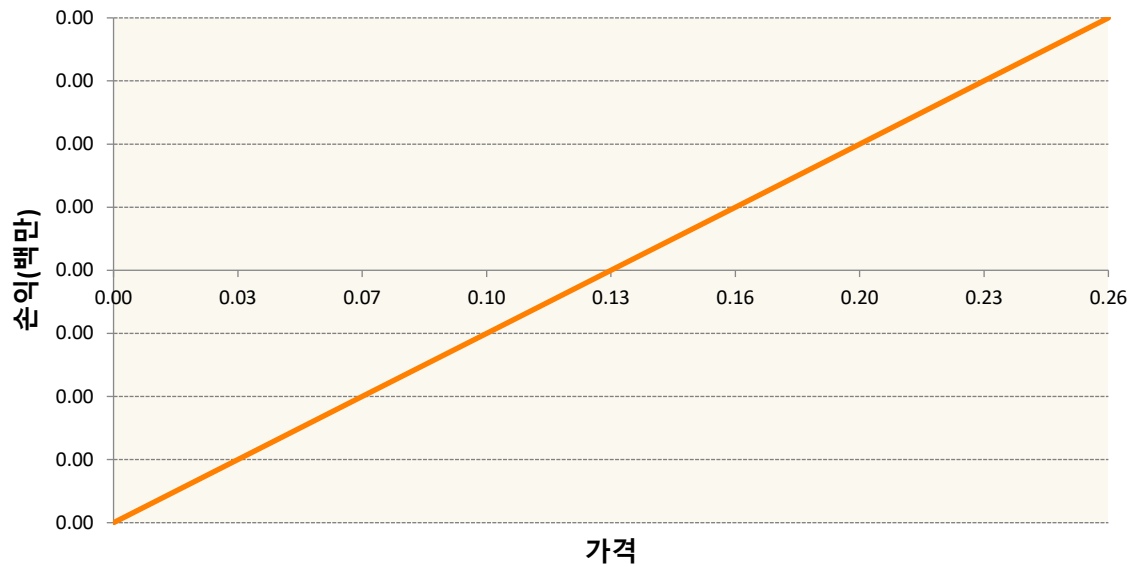
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,119	0	2,119	장외

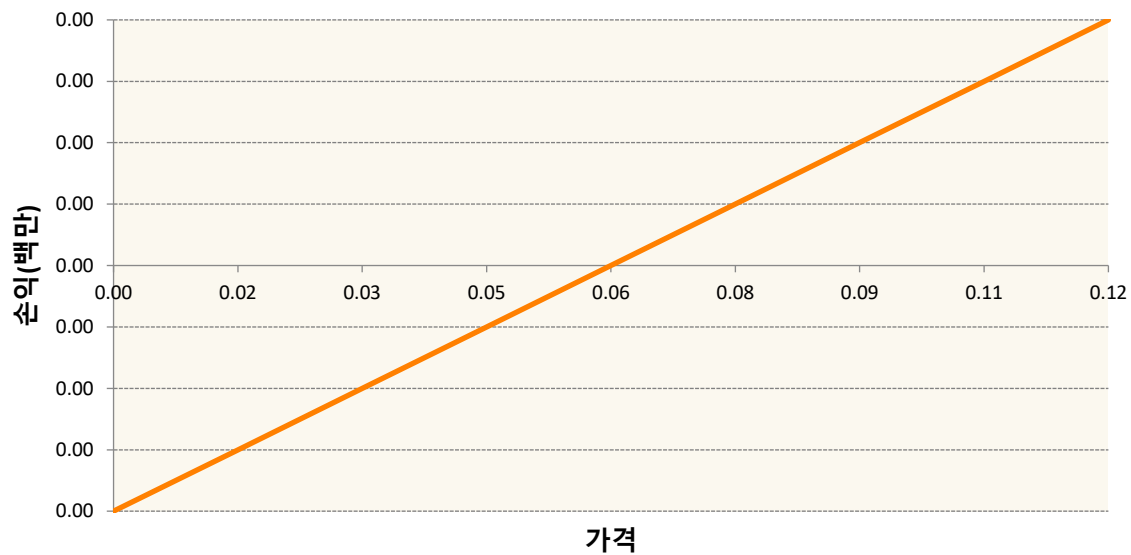
2. 만기시점의 손익구조



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))
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠))

9
56
29
69

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

(단위:백만원)

298

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

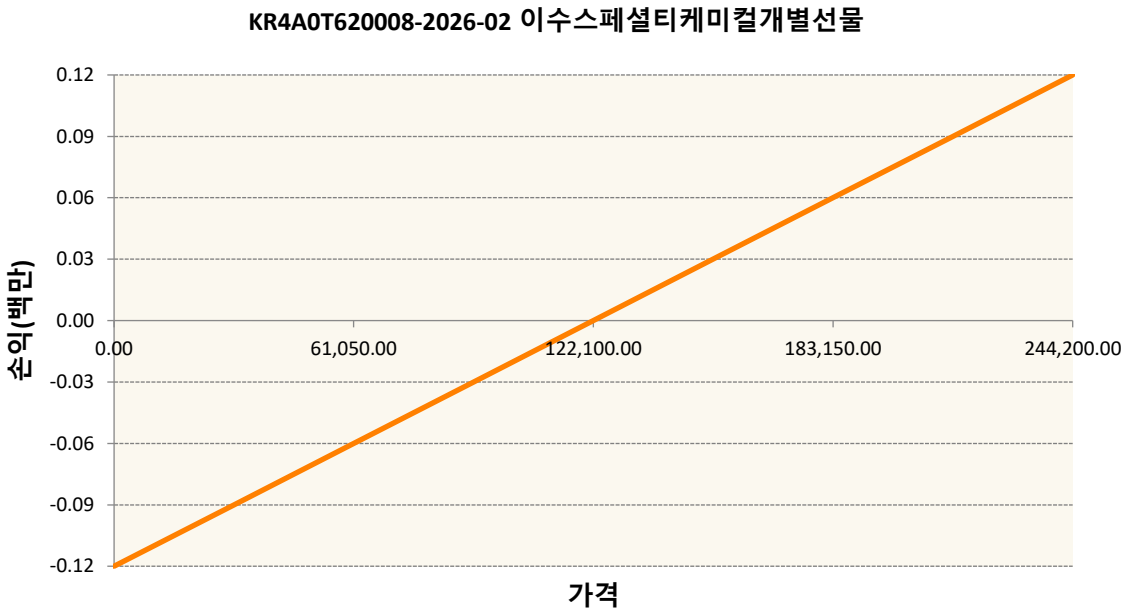
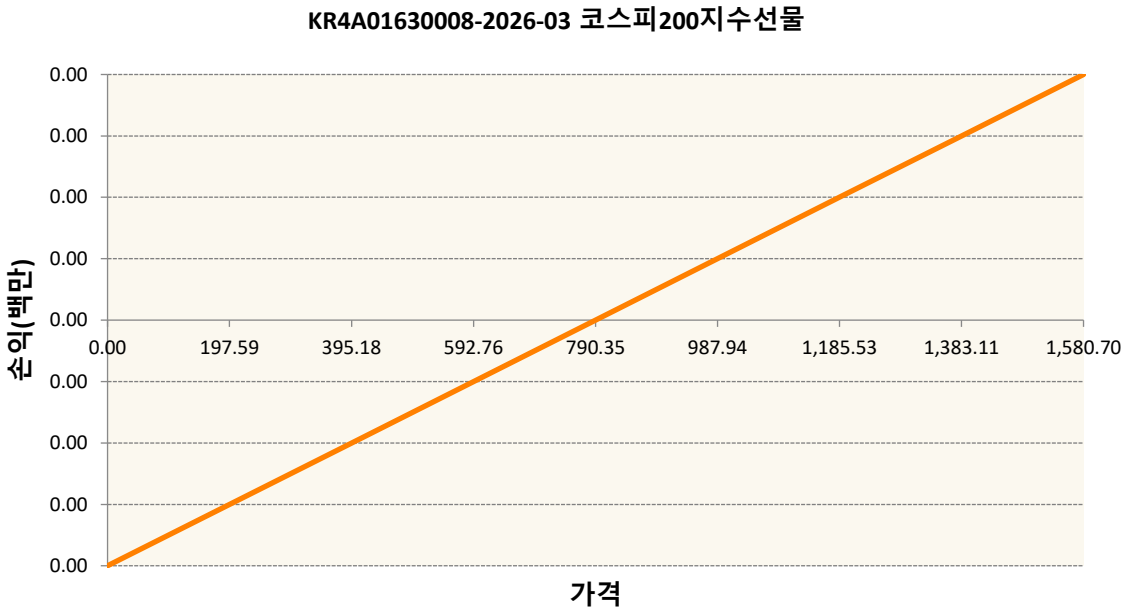
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

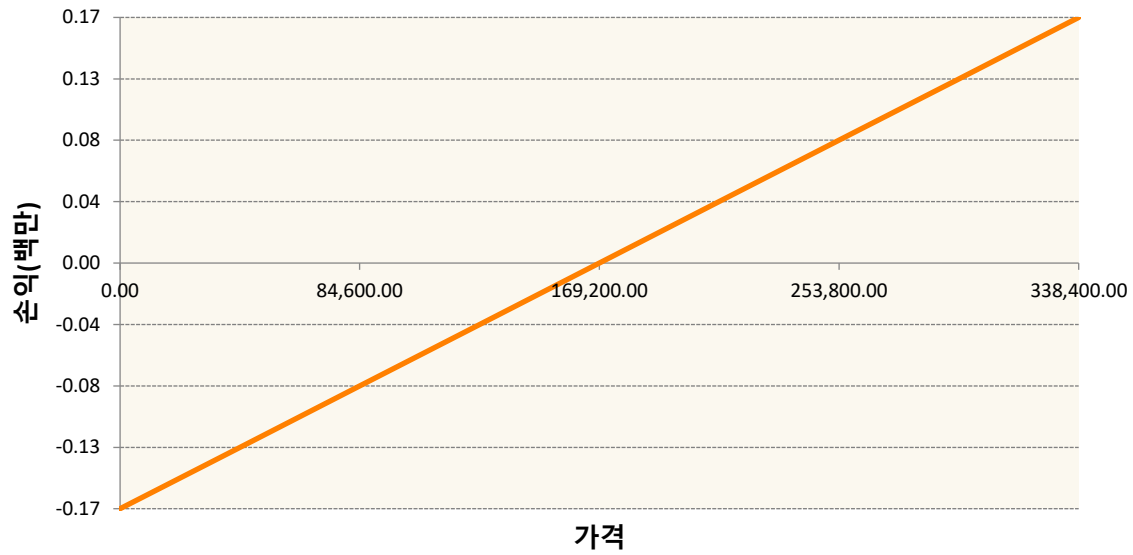
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,376	835	541	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	6,983	1,169	5,815	장내
누계	유가증권	스왑	6	0	6	장외

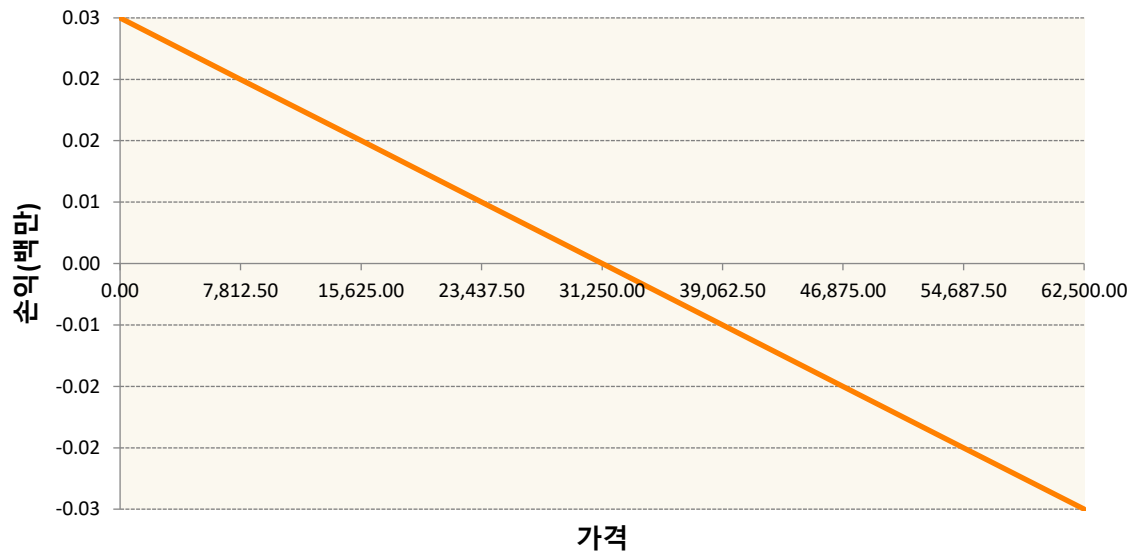
2. 만기시점의 손익구조



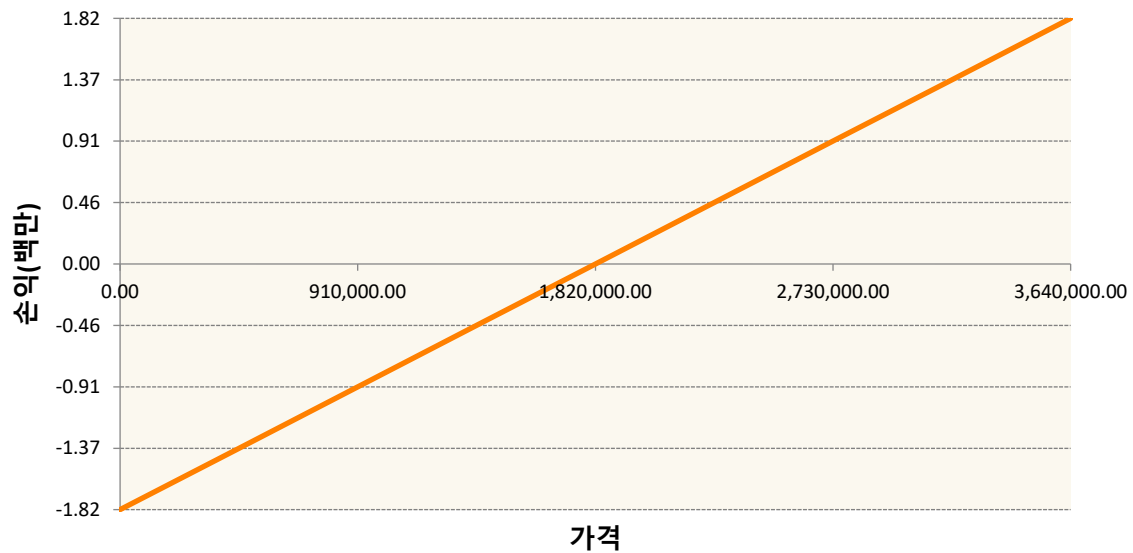
KR4A11620007-2026-02 삼성전자개별선물



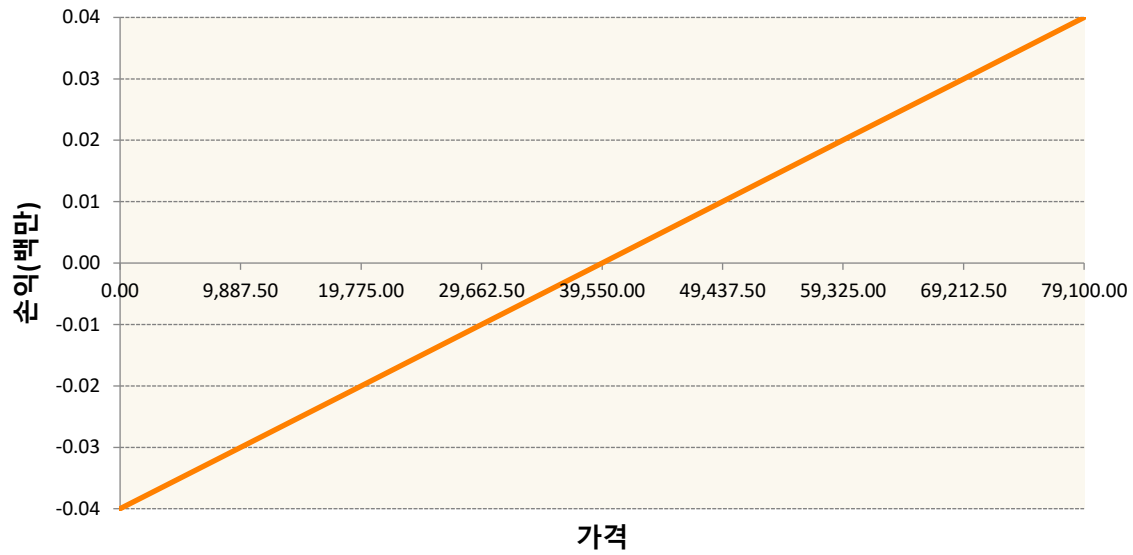
KR4A32620002-2026-02 현대제철개별선물



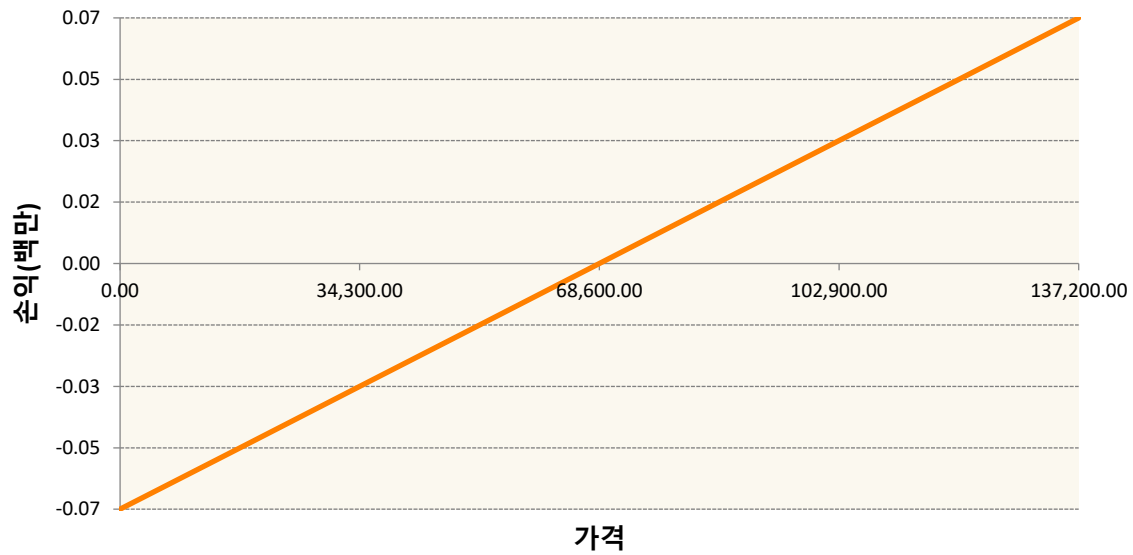
KR4AB3620005-2026-02 고려아연개별선물



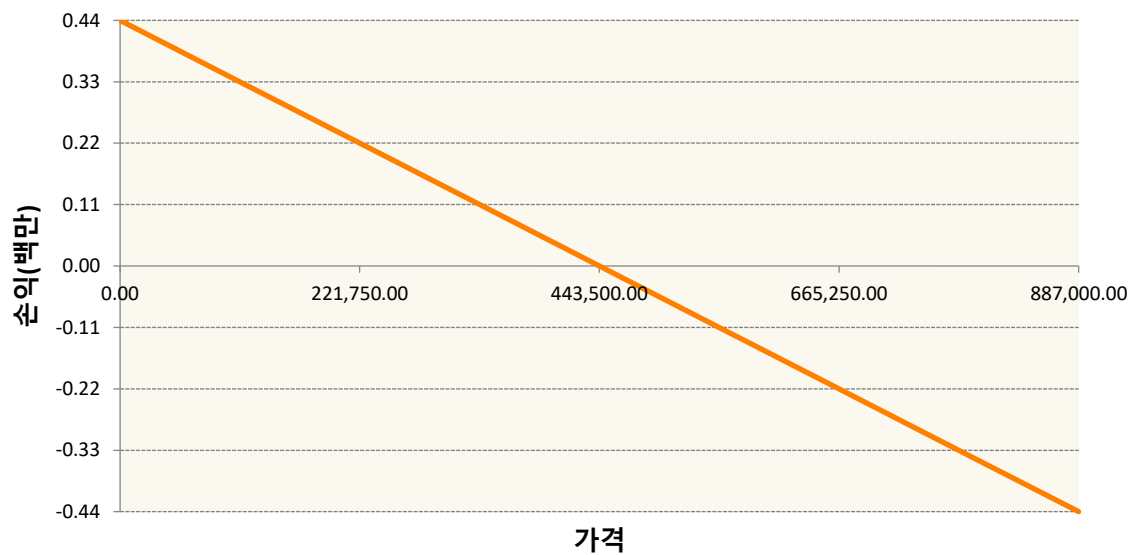
KR4ACN620009-2026-02 포스코DX개별선물



KR4AF7620002-2026-02 카카오페이개별선물



KR4AHE620005-2026-02 키움증권개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01630008							2026-03 코스피200지수선물		395	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395		
-5.33%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263		
-2.67%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	132	132	132	132	132	132	132	132		
5.33%	263	263	263	263	263	263	263	263		
8.00%	395	395	395	395	395	395	395	395		
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	-14		
-5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10		
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	5	5	5	5	5	5	5	5		
5.33%	10	10	10	10	10	10	10	10		
8.00%	14	14	14	14	14	14	14	14		
KR4A32620002								2026-02 현대제철개별선물		28
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	28	28	28	28	28	28	28	28		
-5.33%	18	18	18	18	18	18	18	18		
-2.67%	9	9	9	9	9	9	9	9		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9		
5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18		
8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28		
KR4AB3620005								2026-02 고려아연개별선물		127
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127		
-5.33%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85		
-2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	42	42	42	42	42	42	42	42		
5.33%	85	85	85	85	85	85	85	85		
8.00%	127	127	127	127	127	127	127	127		
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
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
KR4AHE620005 2026-02 키움증권개별선물							66
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	66	66	66	66	66	66	66
-5.33%	44	44	44	44	44	44	44
-2.67%	22	22	22	22	22	22	22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66

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

(단위:백만원)

686

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

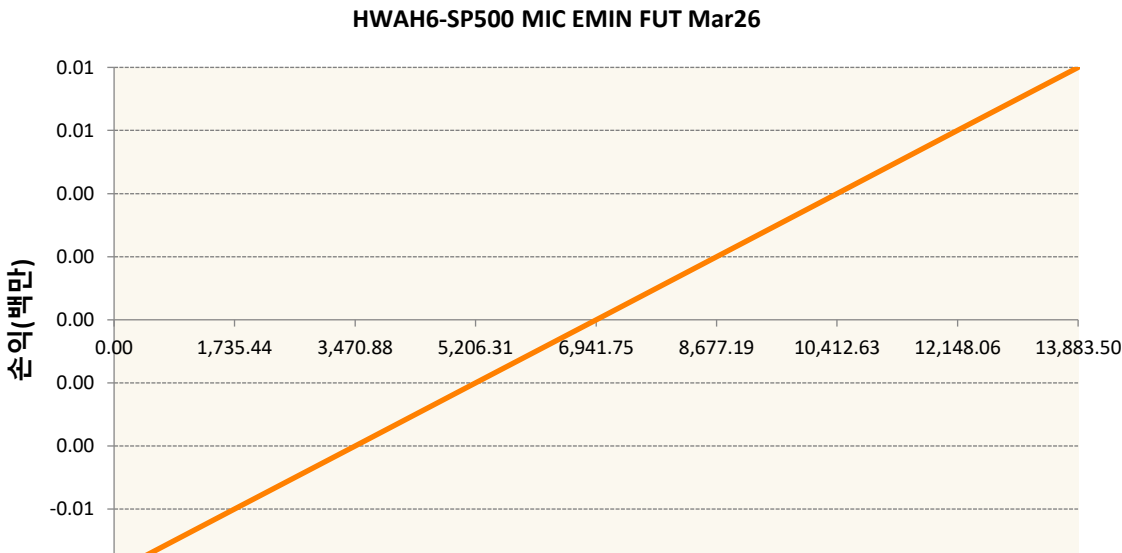
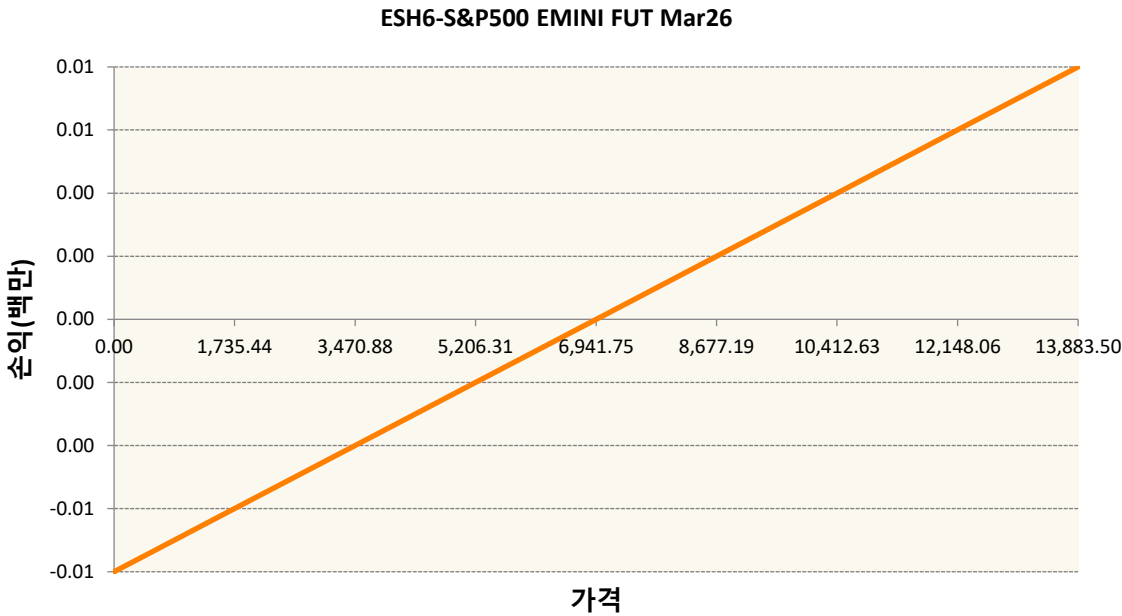
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

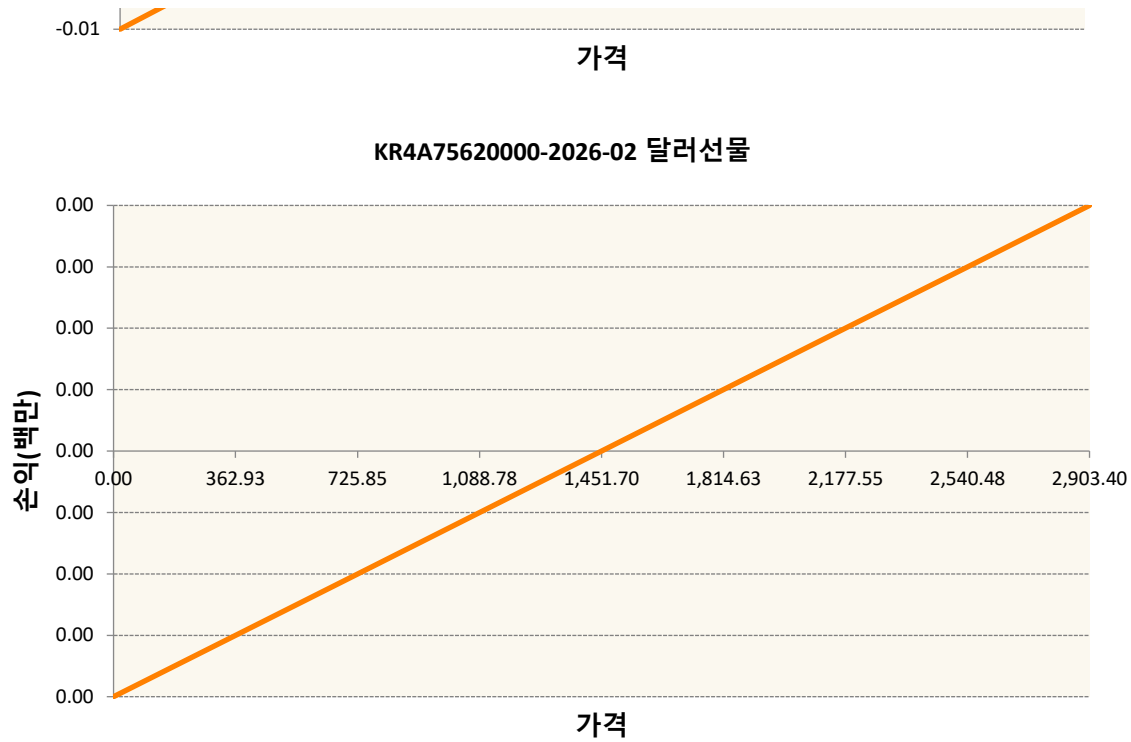
1. 계약금액

(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	55,258	0	55,258	
누계	통화	선물	3,774	0	3,774	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	4,421
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	90
KR4A756200	2026-02 달러선물	302

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

3,869

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

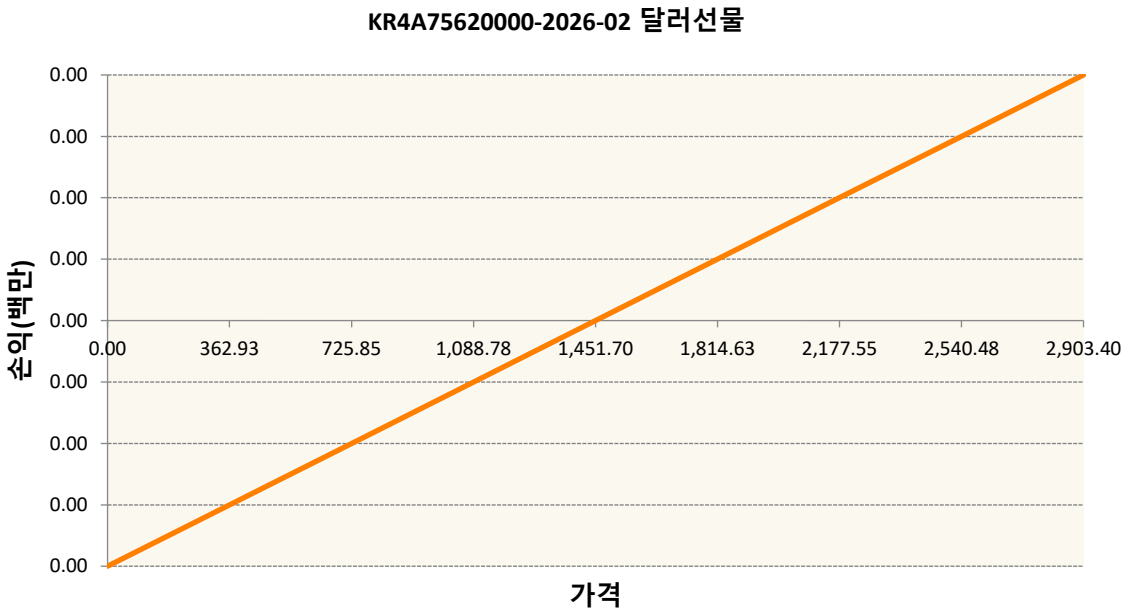
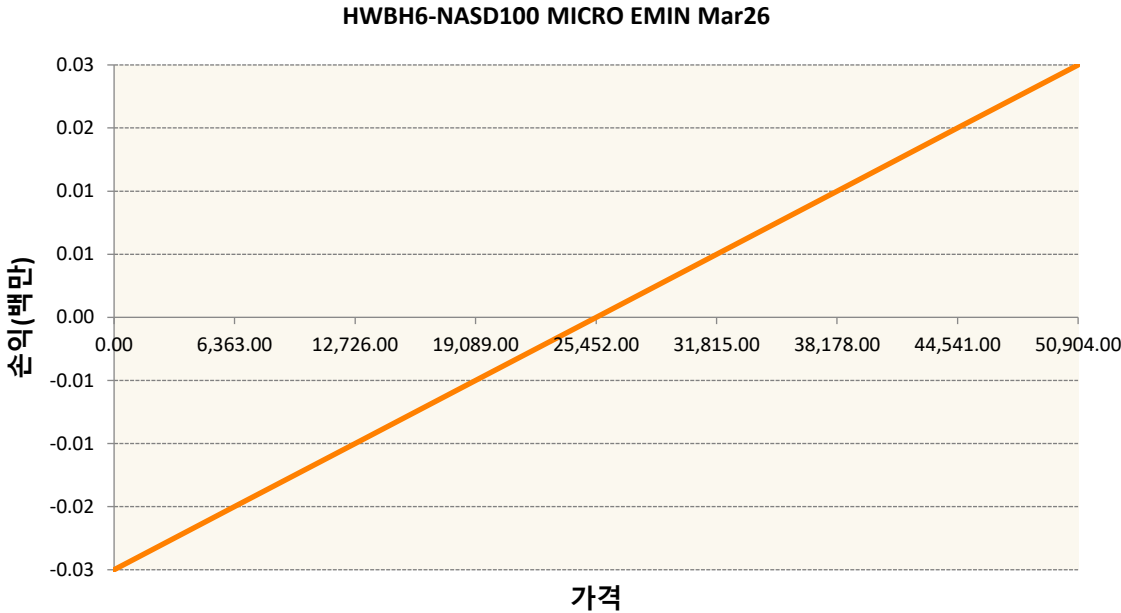
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

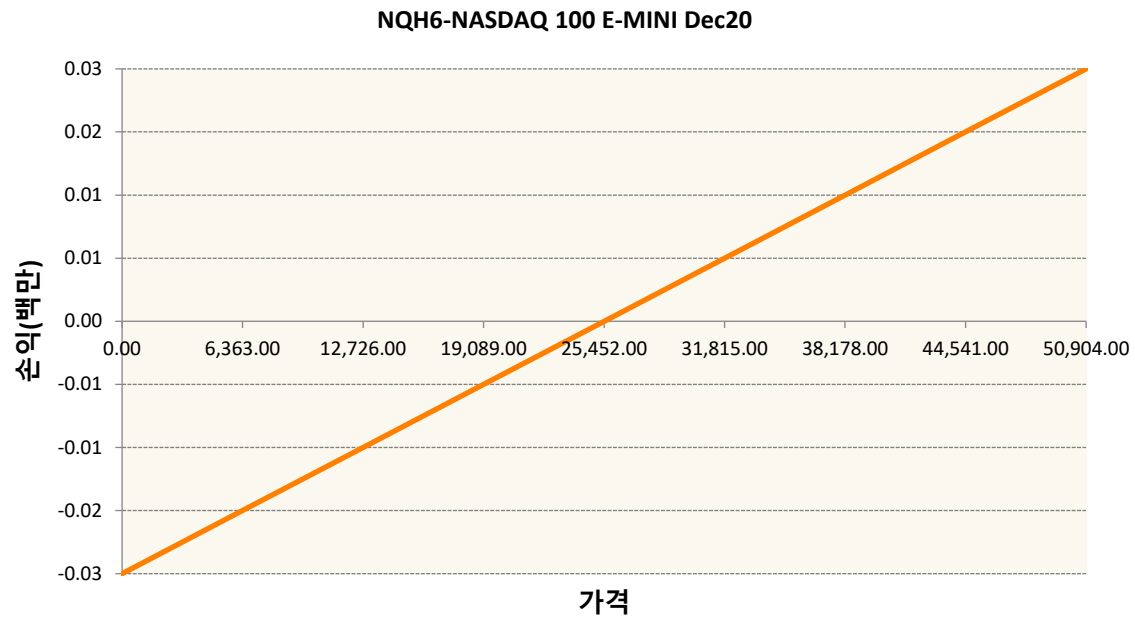
1. 계약금액

(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	24,335	0	24,335	장내
누계	통화	선물	1,307	0	1,307	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN	Mar26	24
KR4A756200	2026-02	달러선물	105
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI	Dec20	1,923

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,130

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

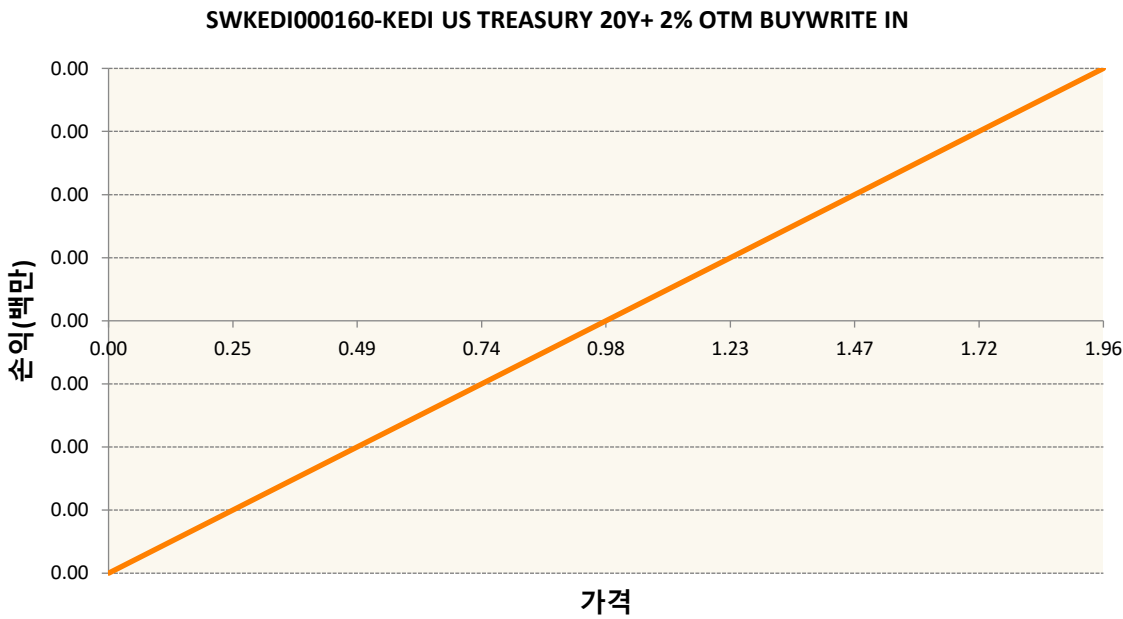
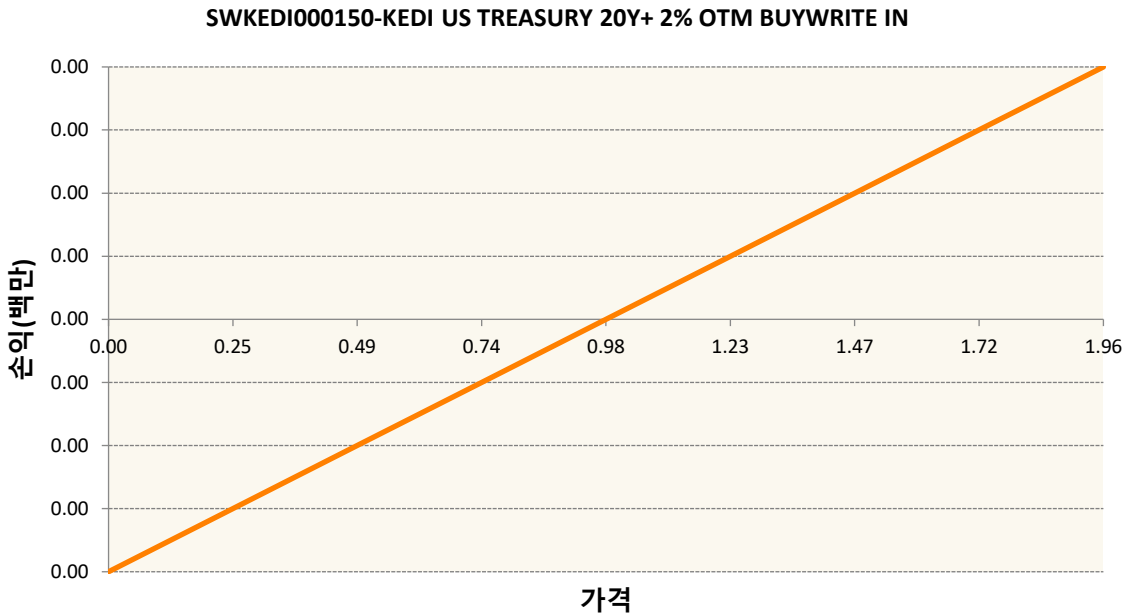
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

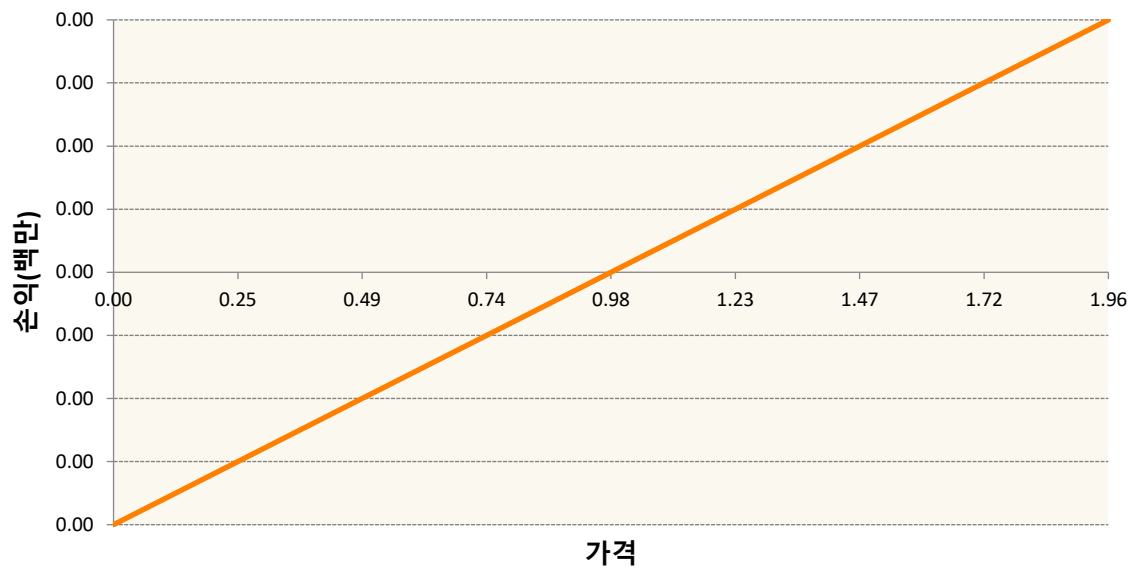
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	381,987	0	381,987	장외

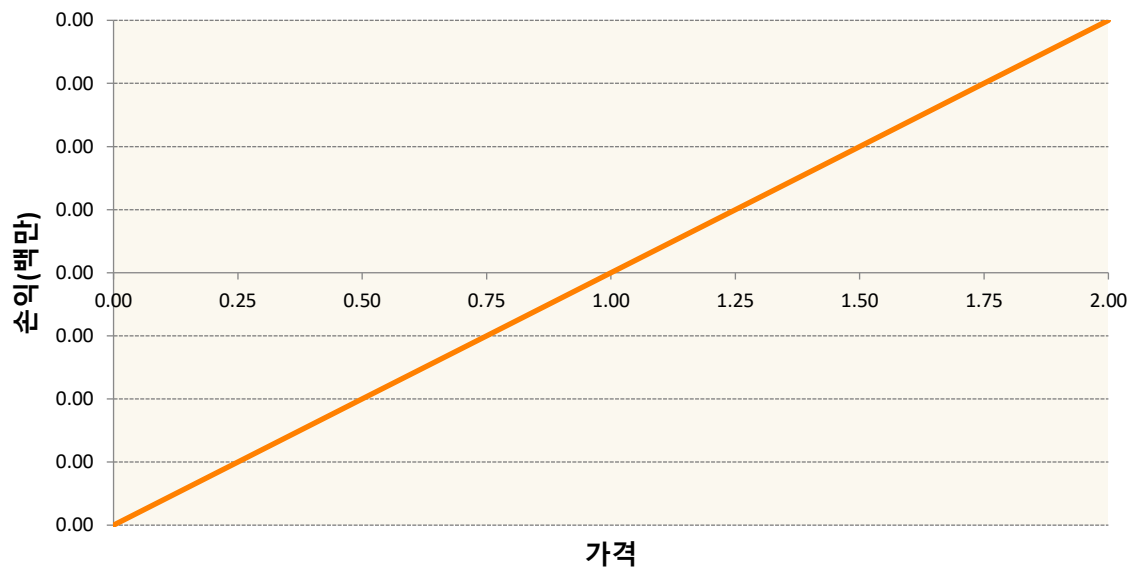
2. 만기시점의 손익구조



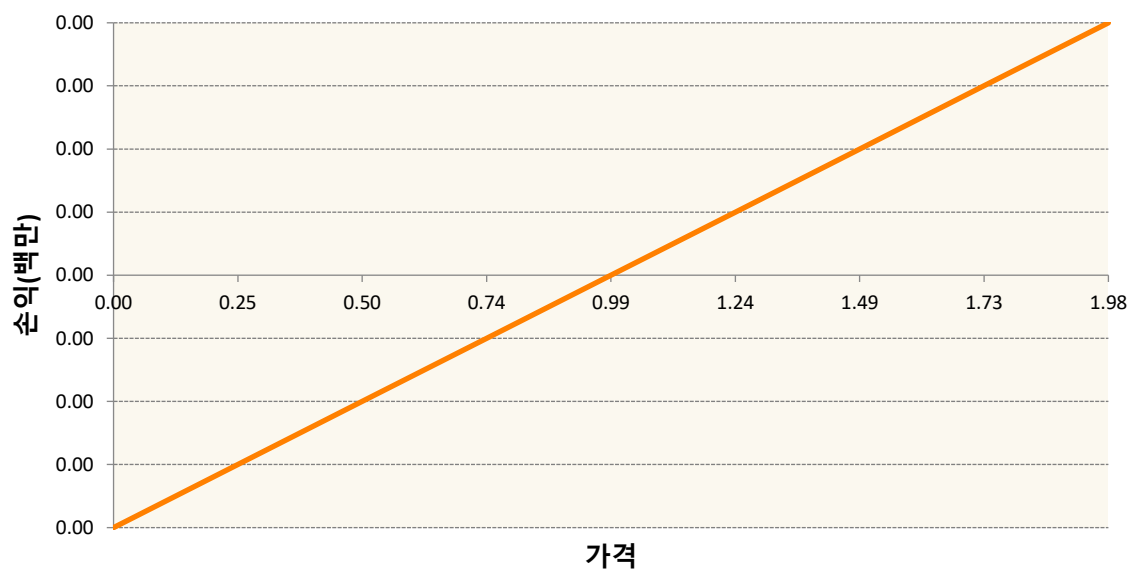
SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,049
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,190
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,605
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		146
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		10,493

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	13,879

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

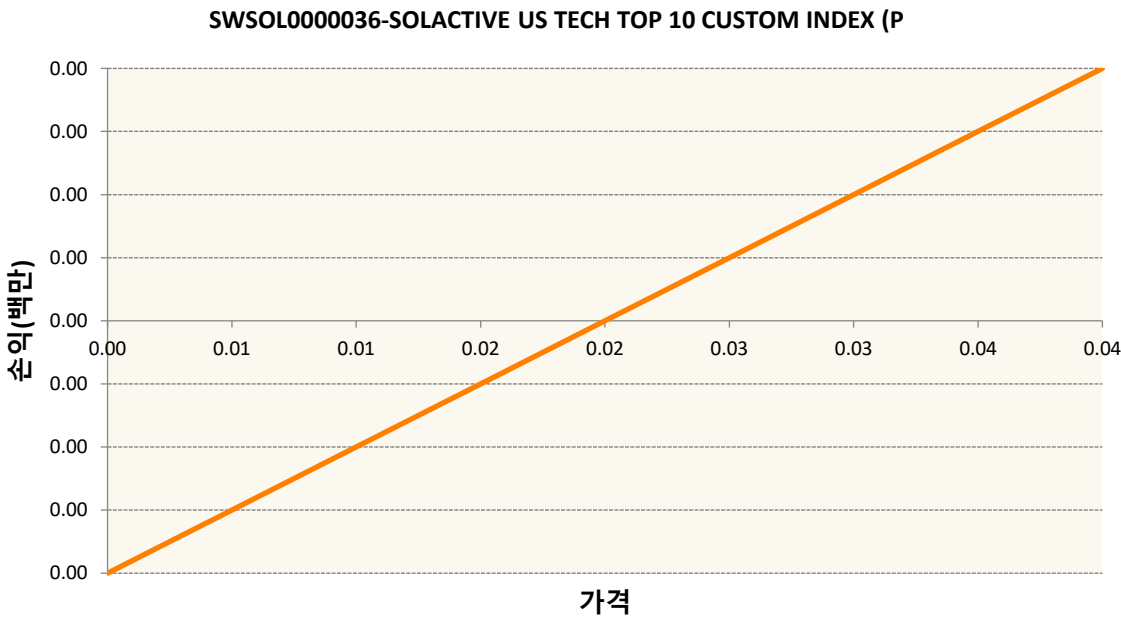
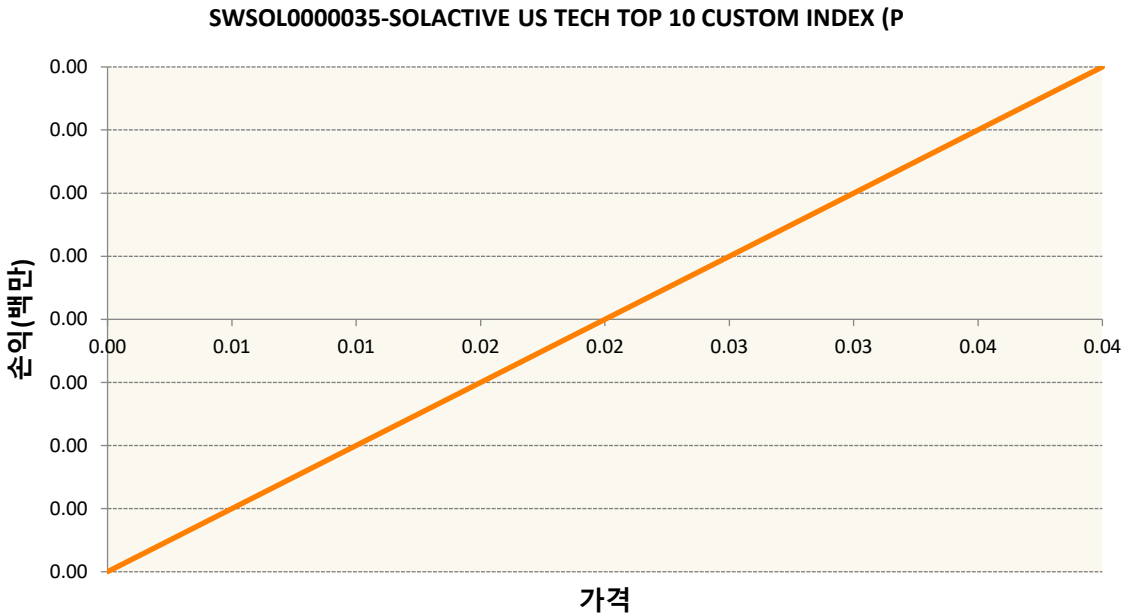
SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

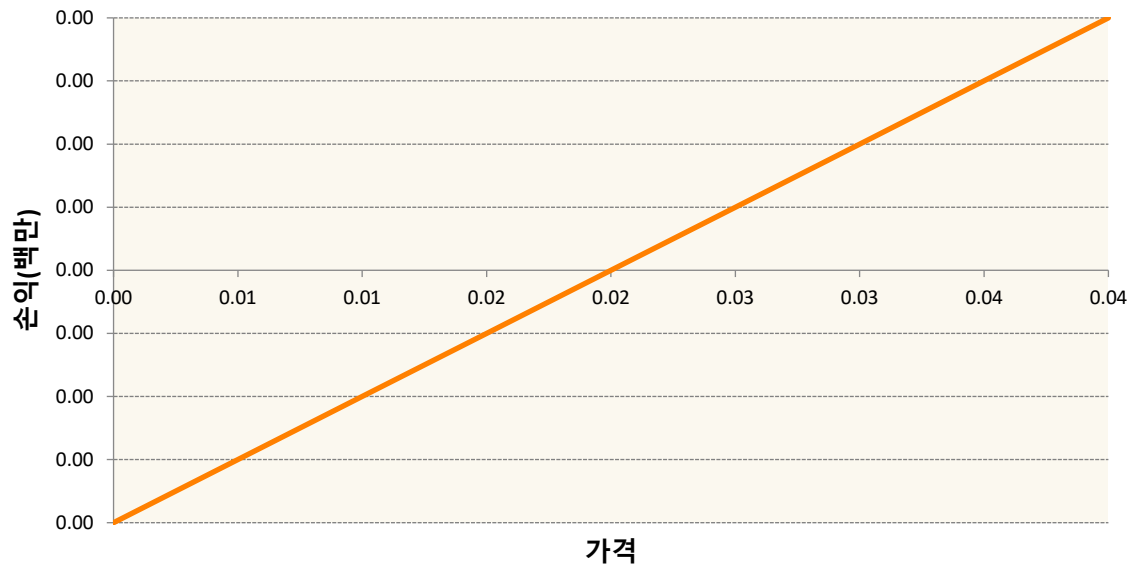
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	46	0	46	장외

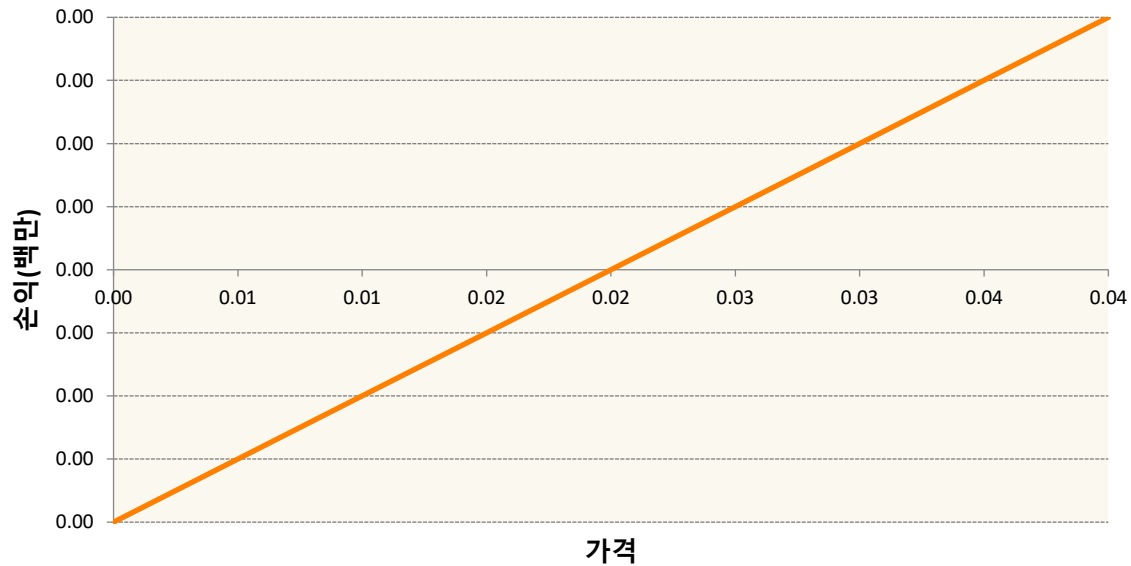
2. 만기시점의 손익구조



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)

5

공시일	2026-02-05
기준일	2026-02-04

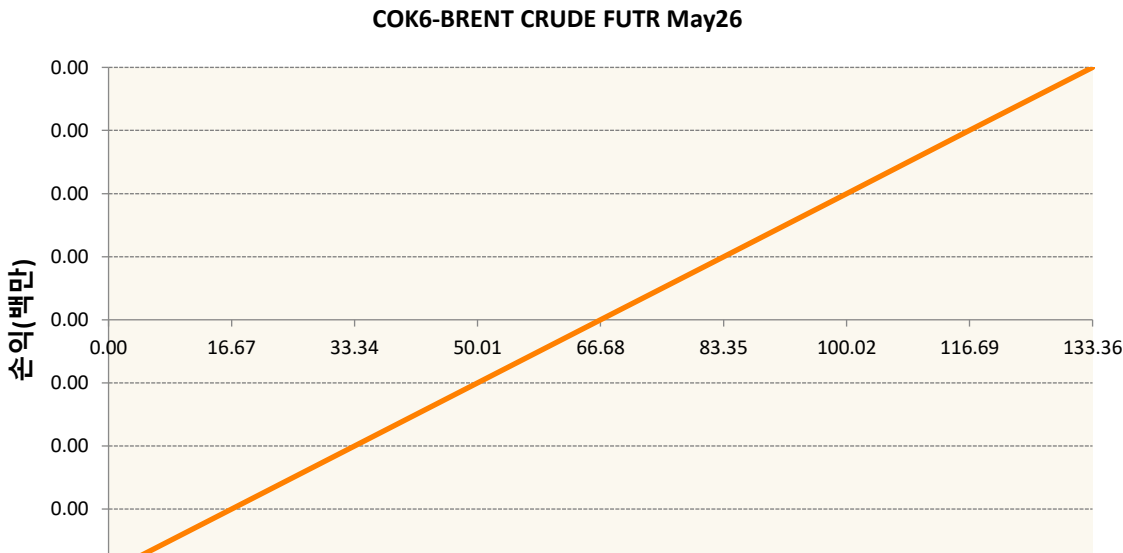
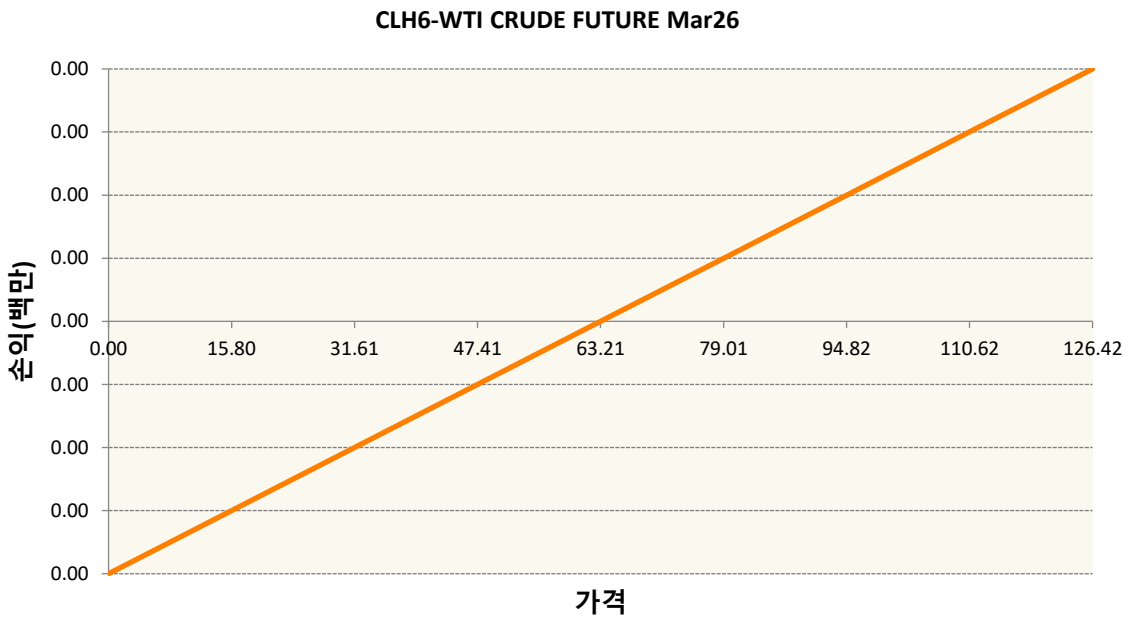
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

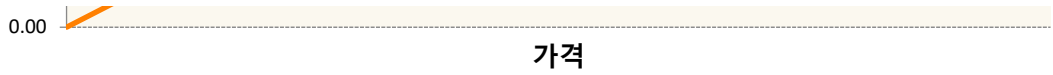
1. 계약금액

(단위:백만원)

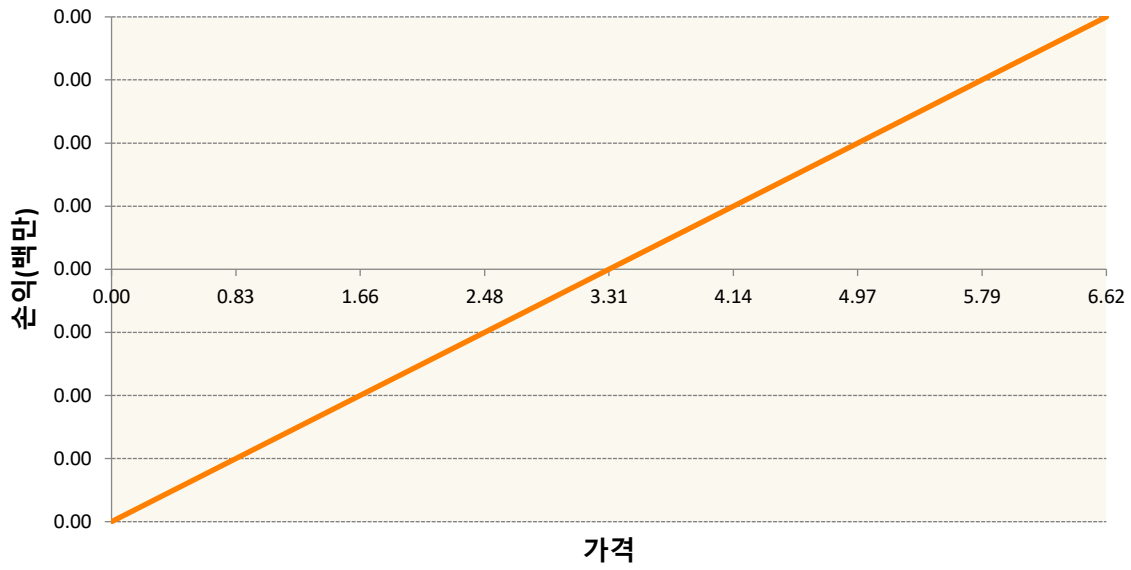
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	122	0	122	
누계	유가증권	선물	389	0	389	
누계	통화	선물	0	116	-116	장내

2. 만기시점의 손익구조

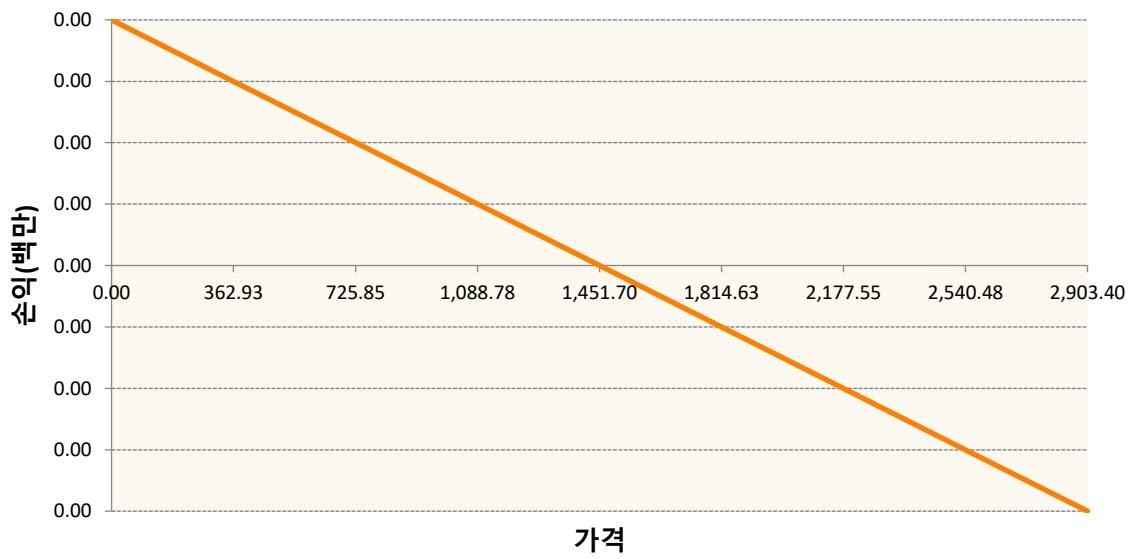




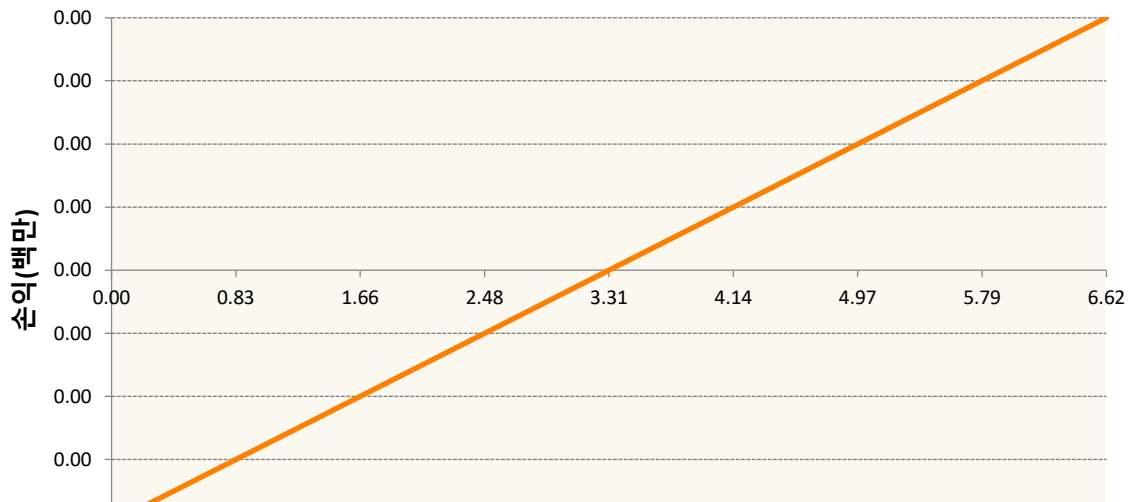
EOH6-E-MINI NATURAL GAS Mar26

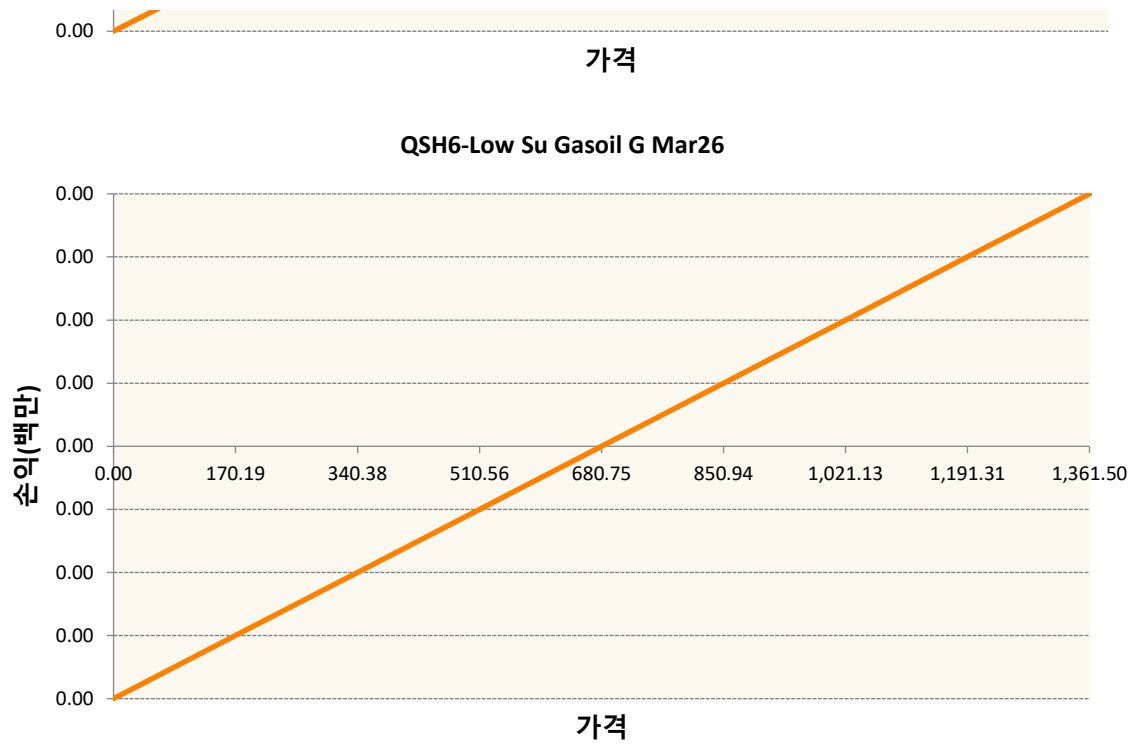


KR4A75620000-2026-02 달러선물



NGH26-NATURAL GAS FUTR Mar26





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

98