

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

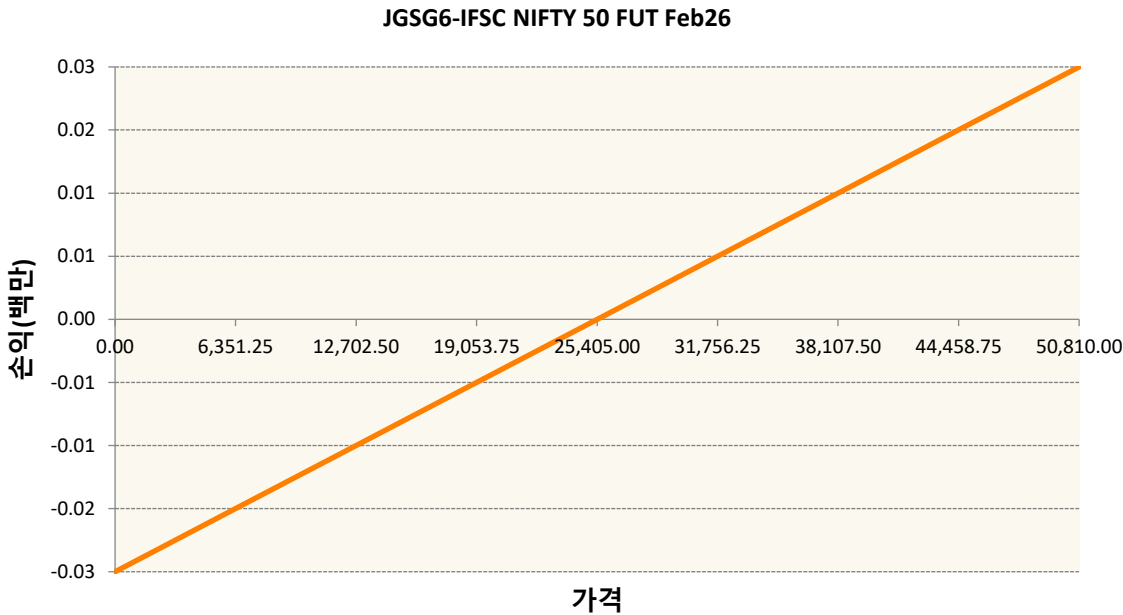
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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)

34

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

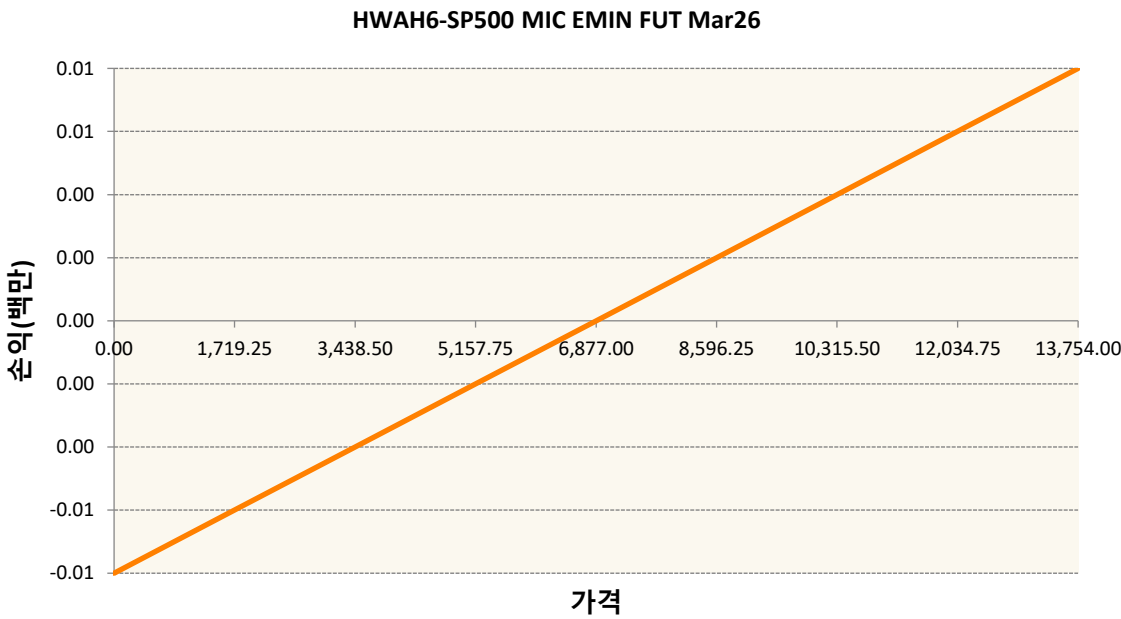
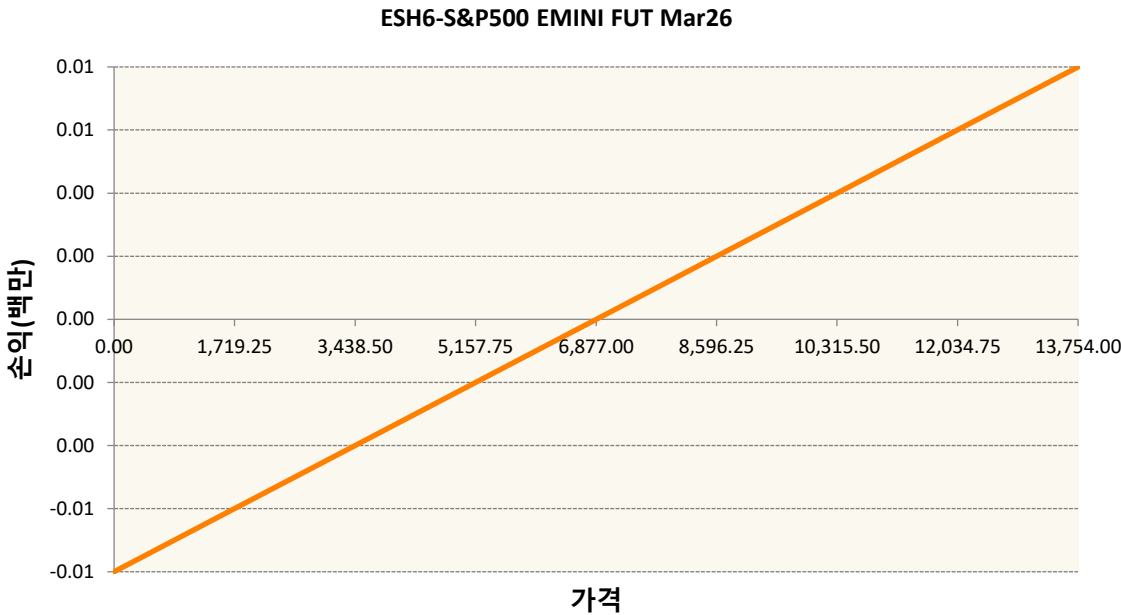
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	152	0	152	장내
누계	지수	선물	508	0	508	

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)
	45

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

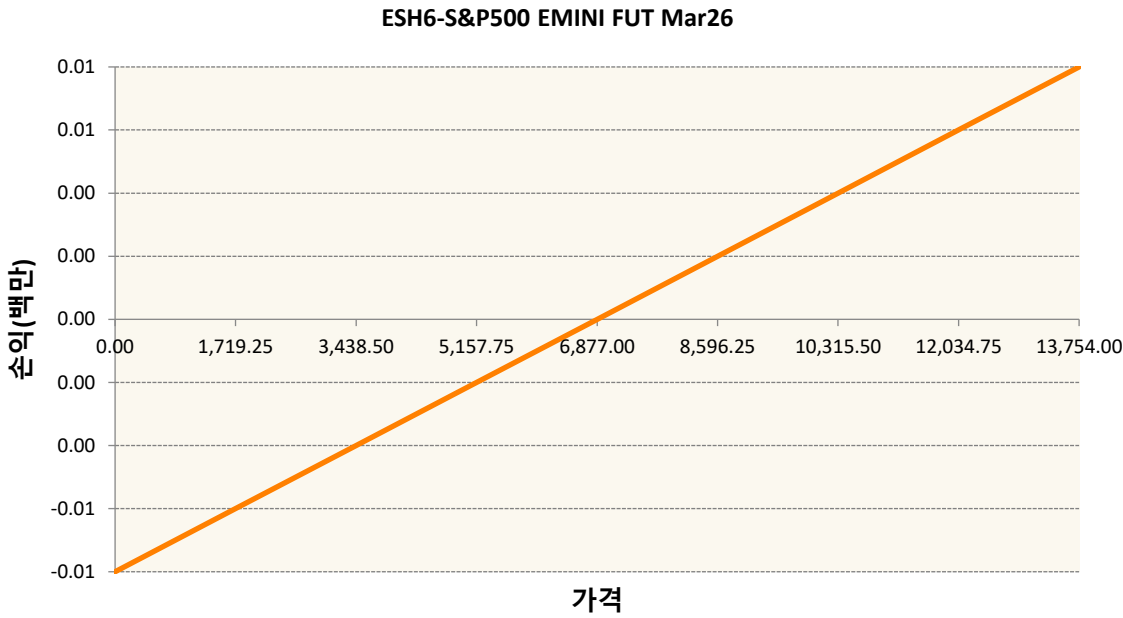
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,525	0	1,525	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	122
------	------------------------	-----

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

(단위:백만원)

104

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

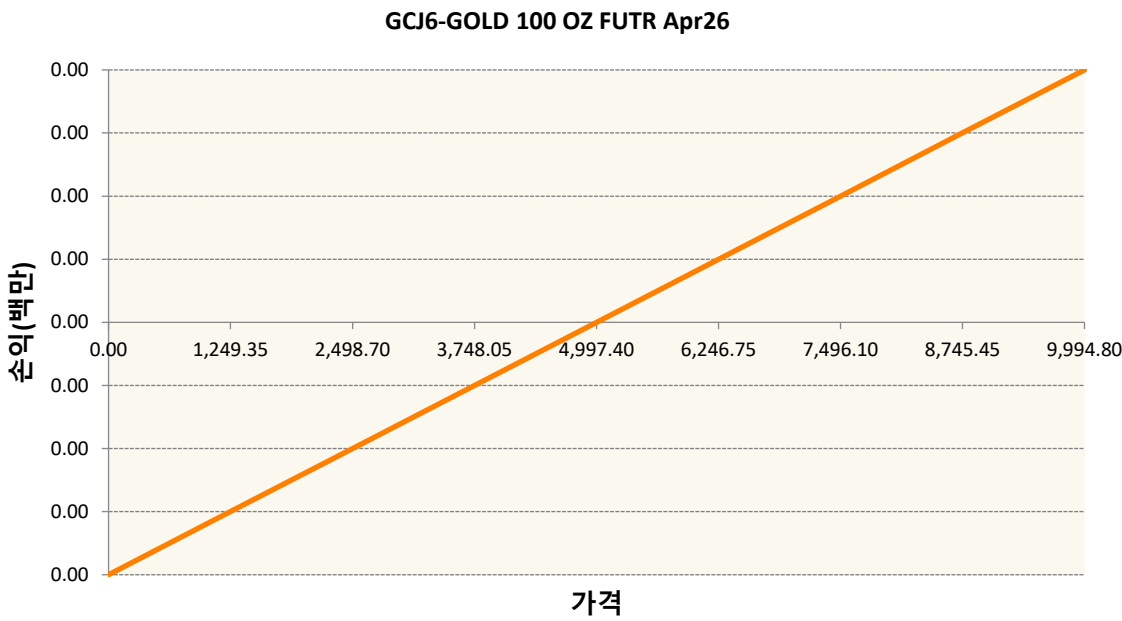
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,995	0	4,995	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 02/20/26 C465 EQUITY	18
GCI6 GOLD 100 OZ FUTR Apr26	400

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

(단위:백만원)

480

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

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)

AOPLTRUAC PLTR US 02/20/26 C150 EQUITY	115
AOPLTRUAP PLTR US 02/20/26 P150 EQUITY	57
AOPLTRUSC PLTR US 02/20/26 C145 EQUITY	0.42
AOPLTRUSP PLTR US 02/20/26 P145 EQUITY	17

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

(단위:백만원)

690

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

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 02/20/26 C90 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

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

(단위:백만원)

1,234

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

포커스채권(채권-파생형)(종)

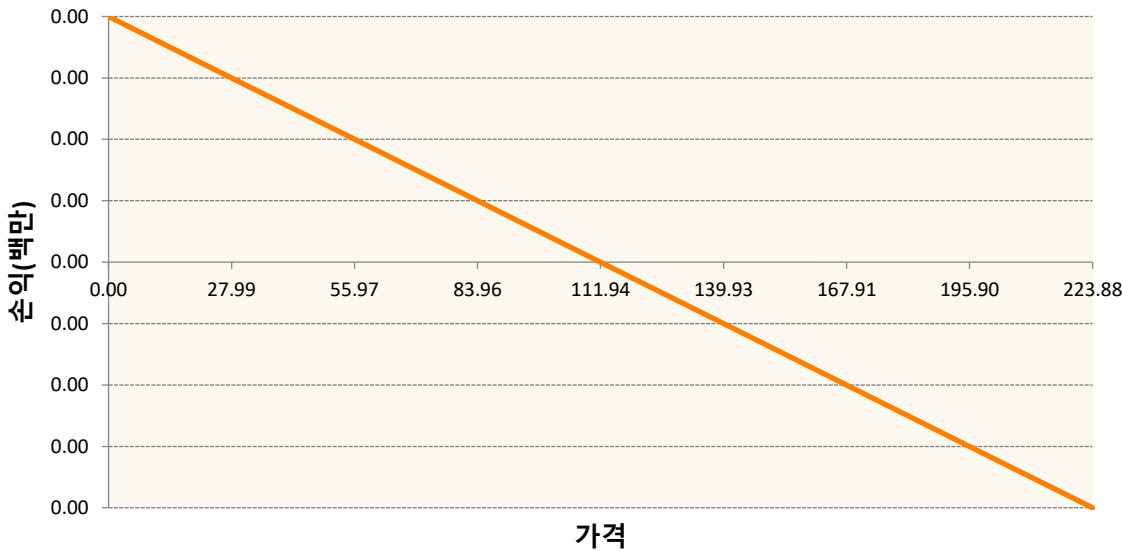
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	금리	선물	0	0	0	장내
누계	금리	선물	0	13,433	-13,433	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A67630009-2026-03 국채선물10(신)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A67630009			2026-03 국채선물10(신)				378
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378
-5.33%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	126	126	126	126	126	126	126
5.33%	252	252	252	252	252	252	252
8.00%	378	378	378	378	378	378	378

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

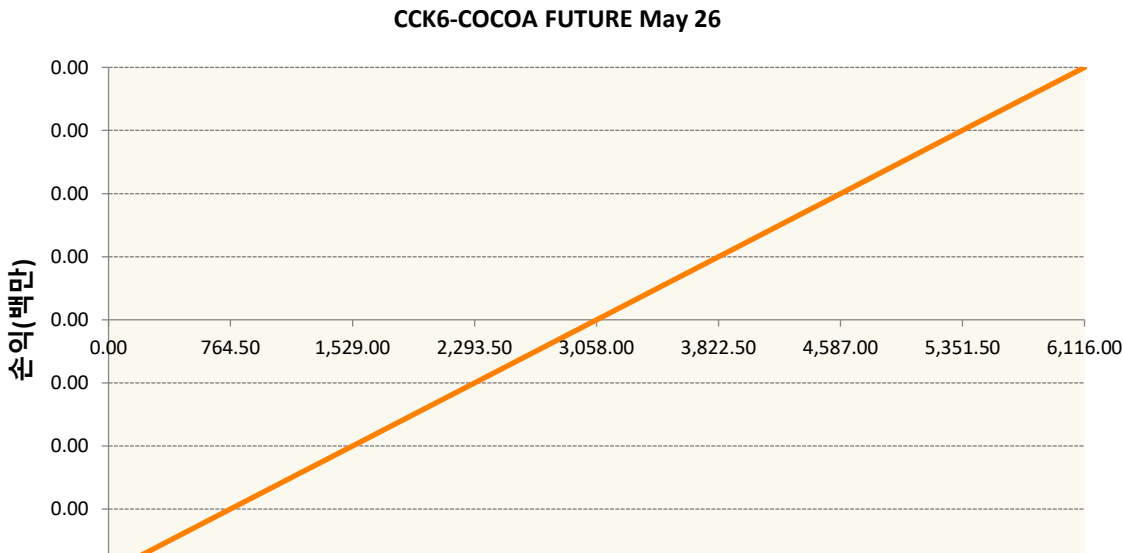
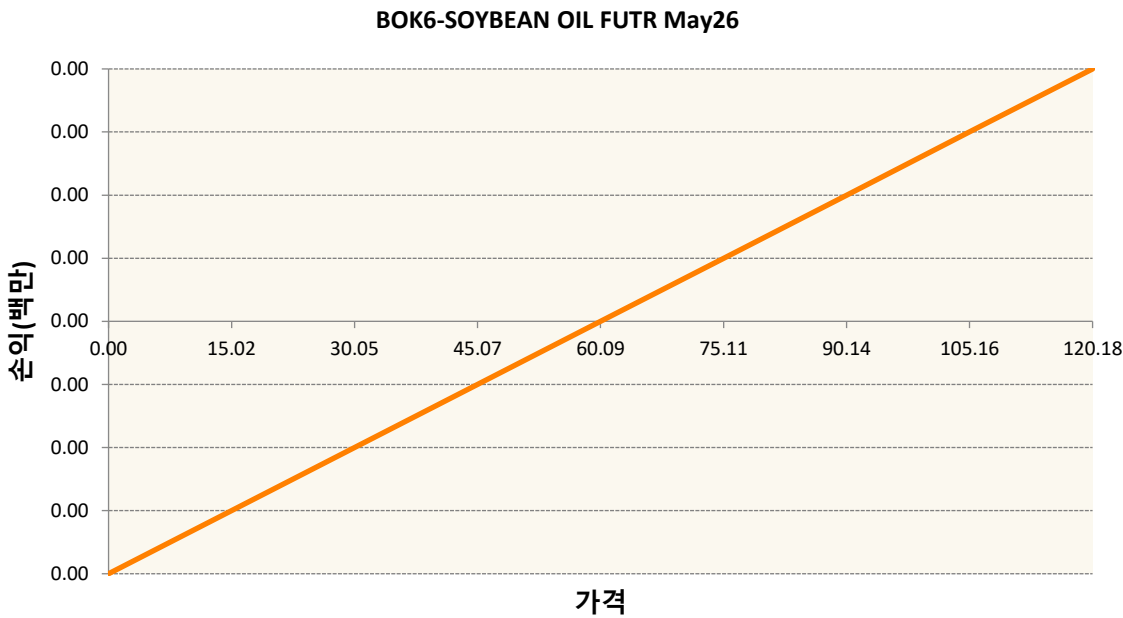
포커스농산물모(채권-파생형)

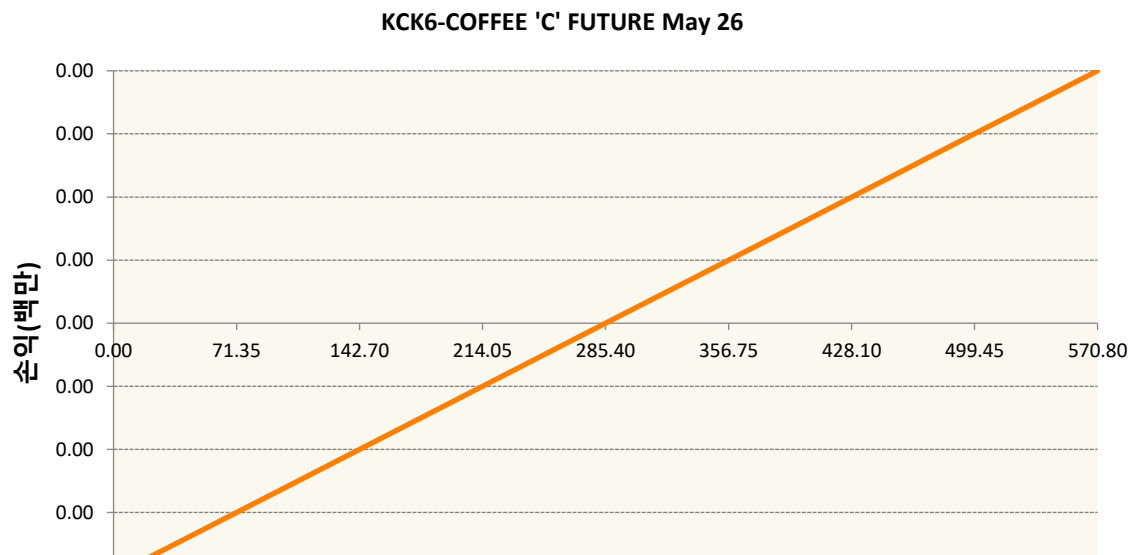
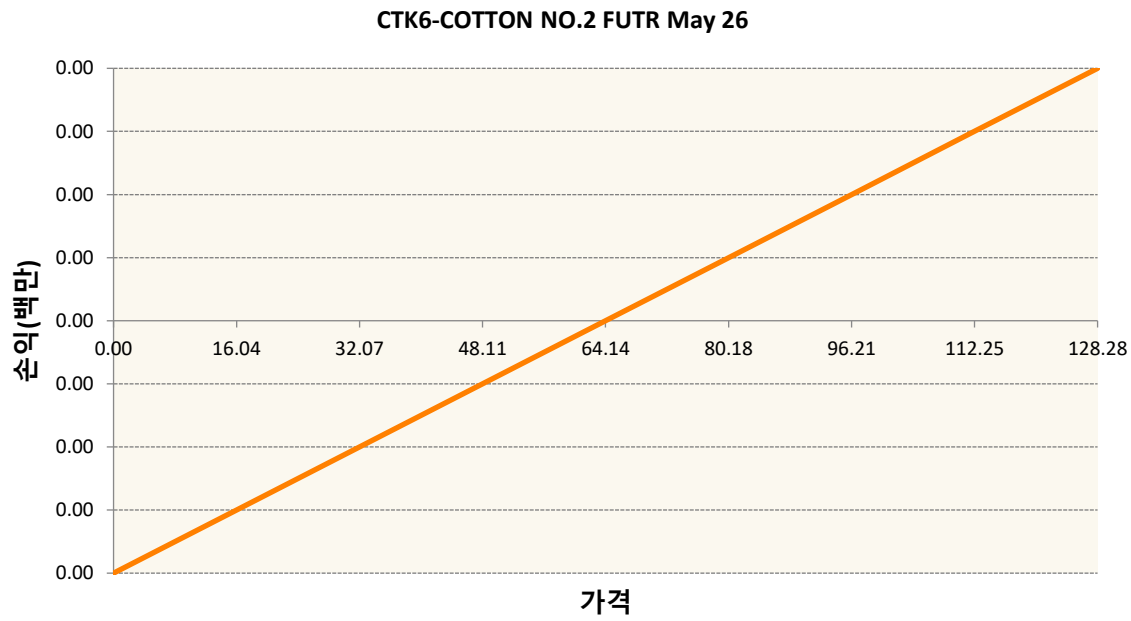
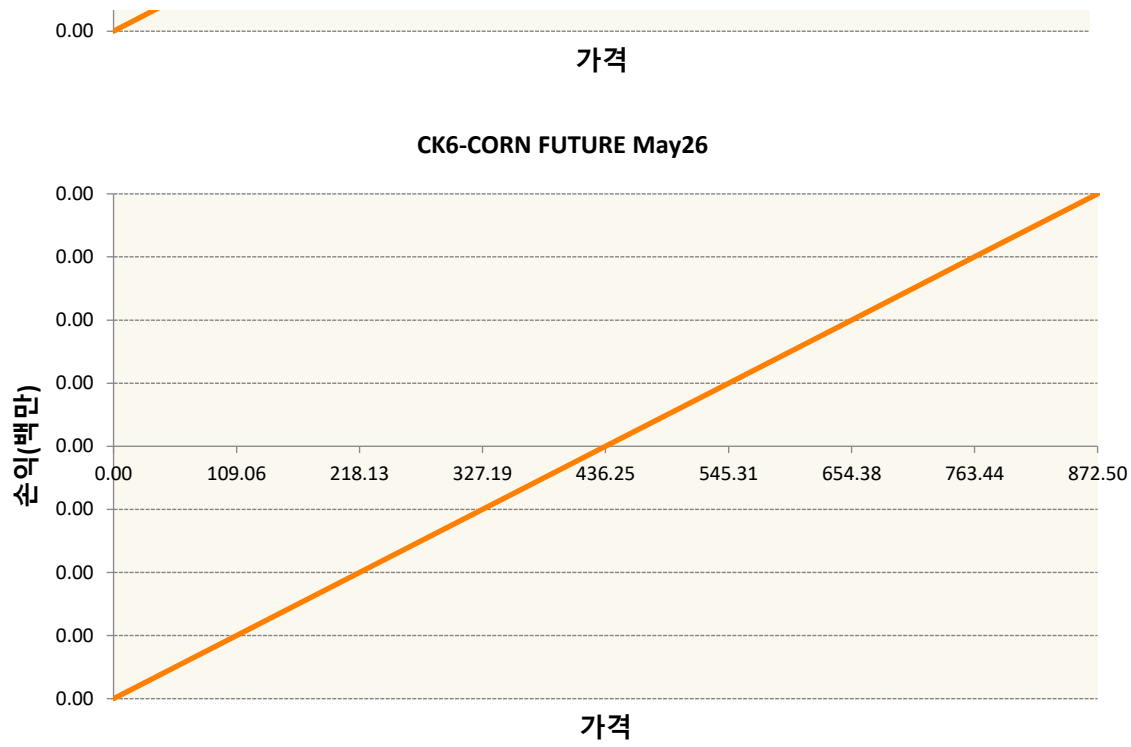
1. 계약금액

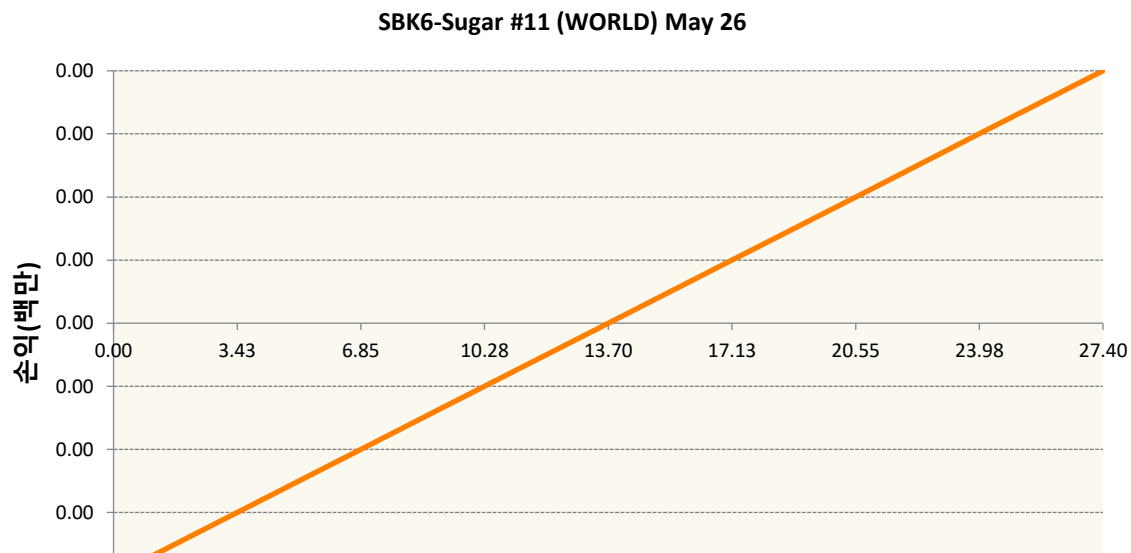
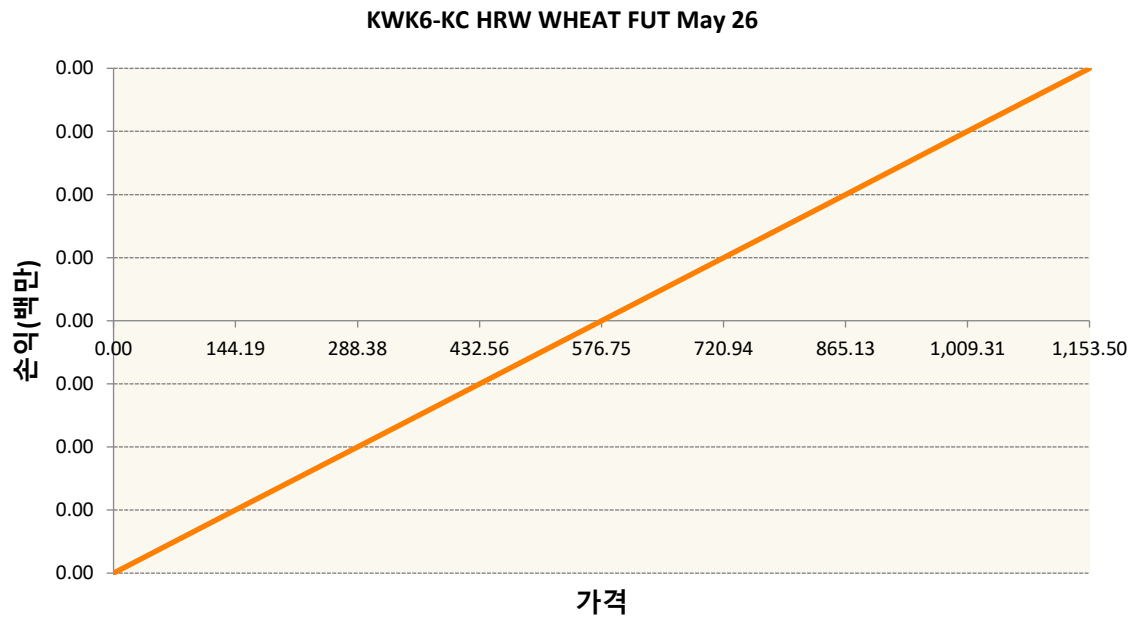
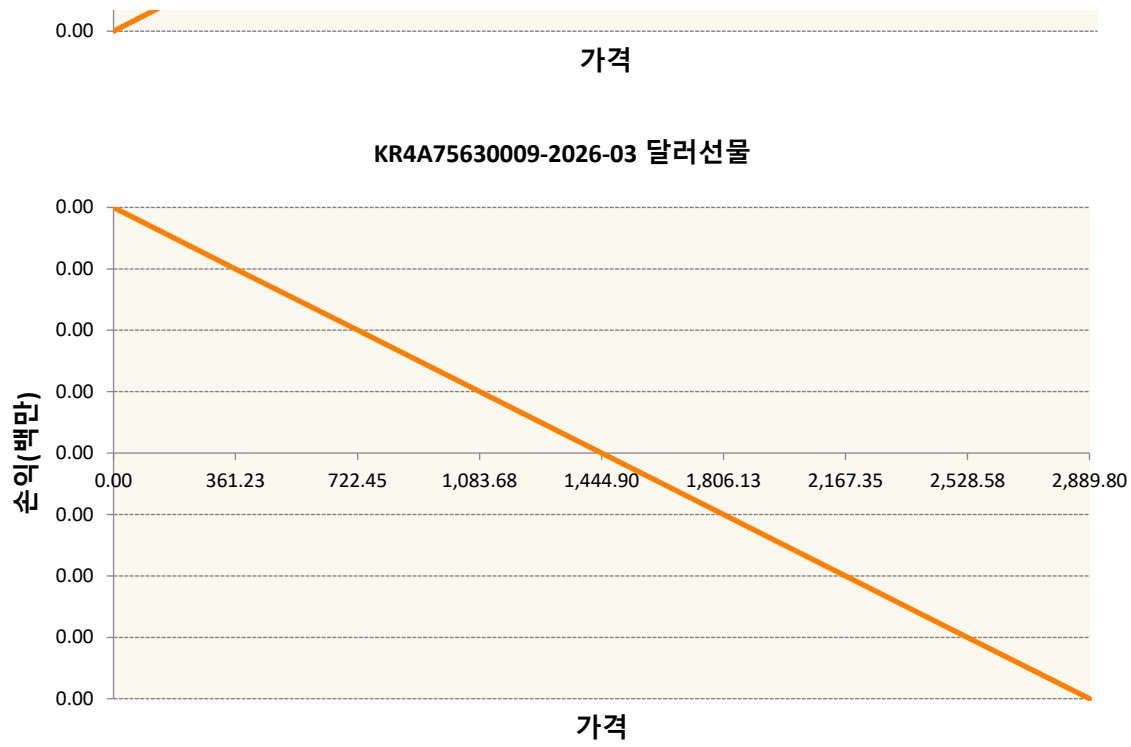
(단위:USD 백만)

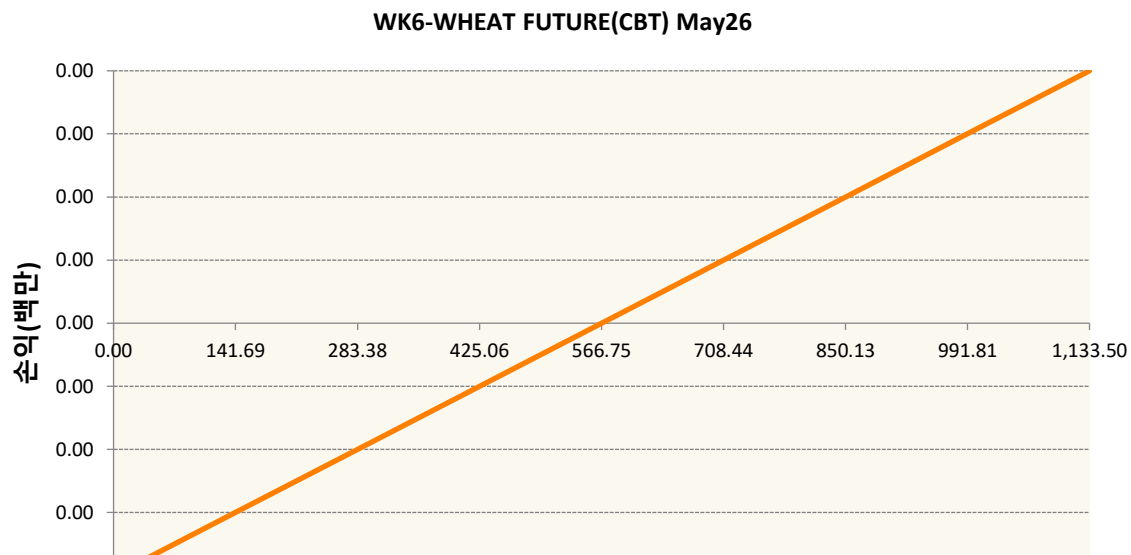
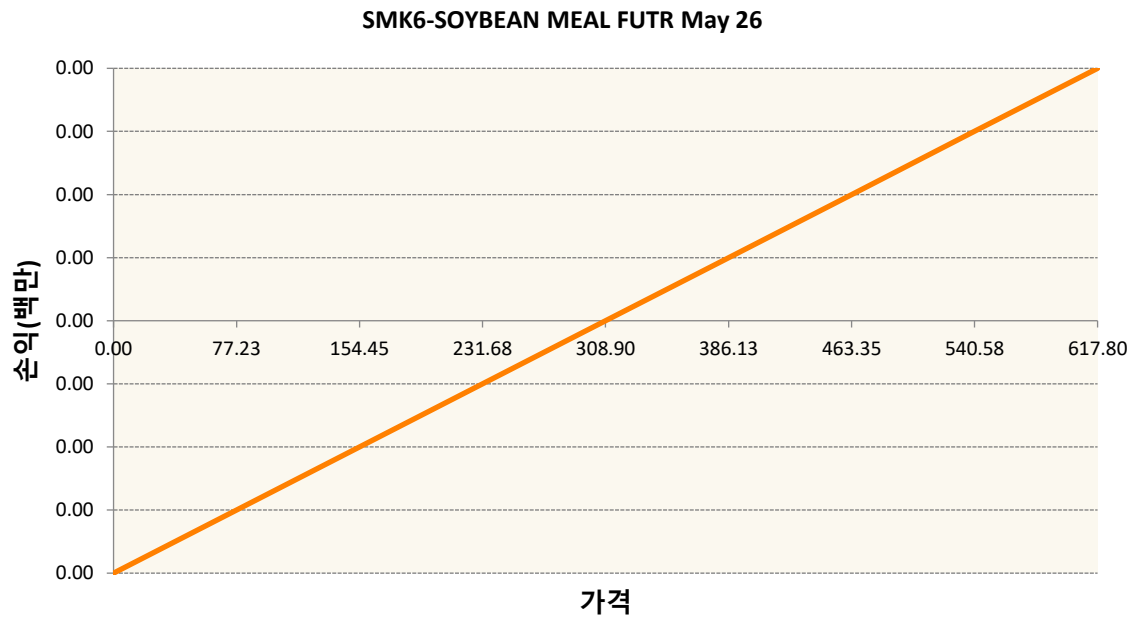
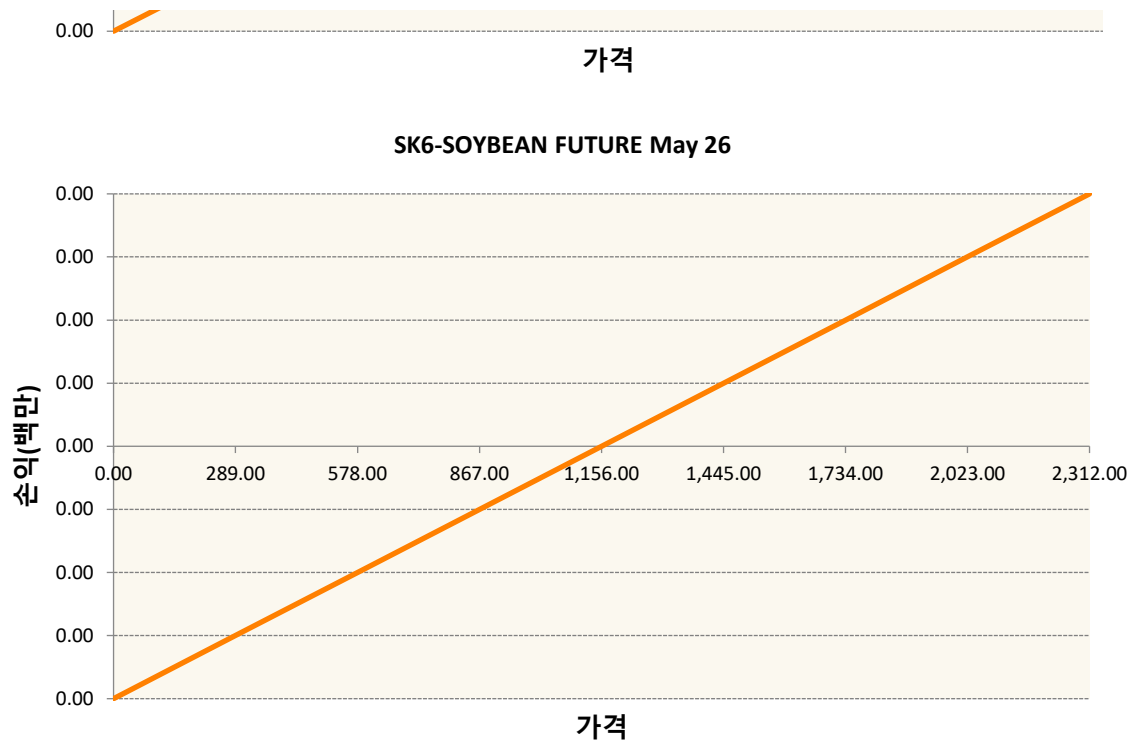
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	1,228	0	1,228	
누계	유가증권	선물	1,762	0	1,762	
누계	통화	선물	0	303	-303	장내

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	2026-02-23
기준일	2026-02-20

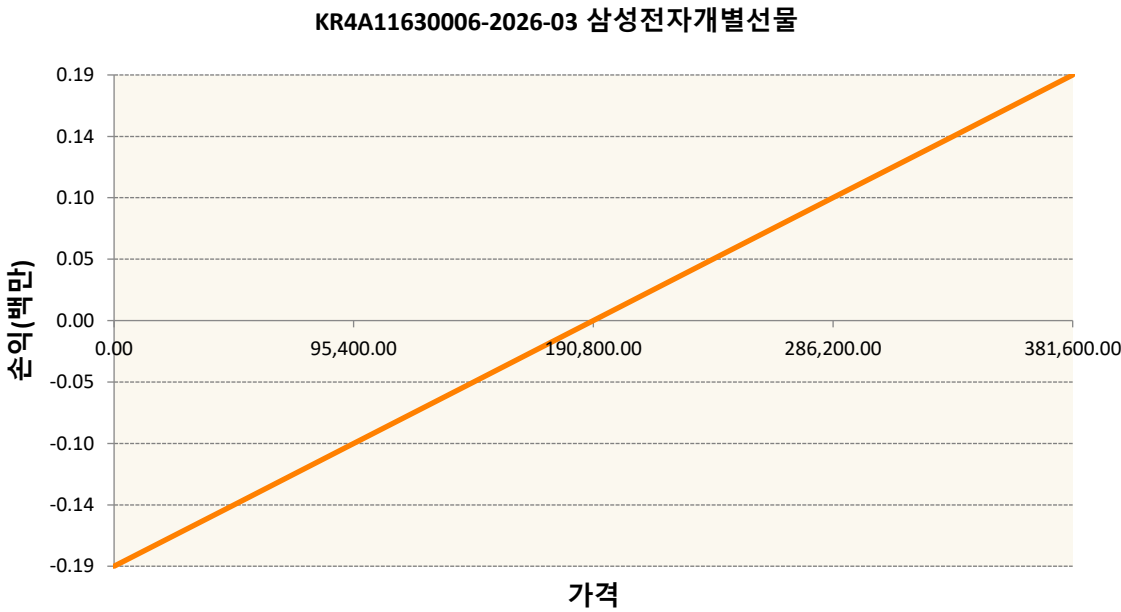
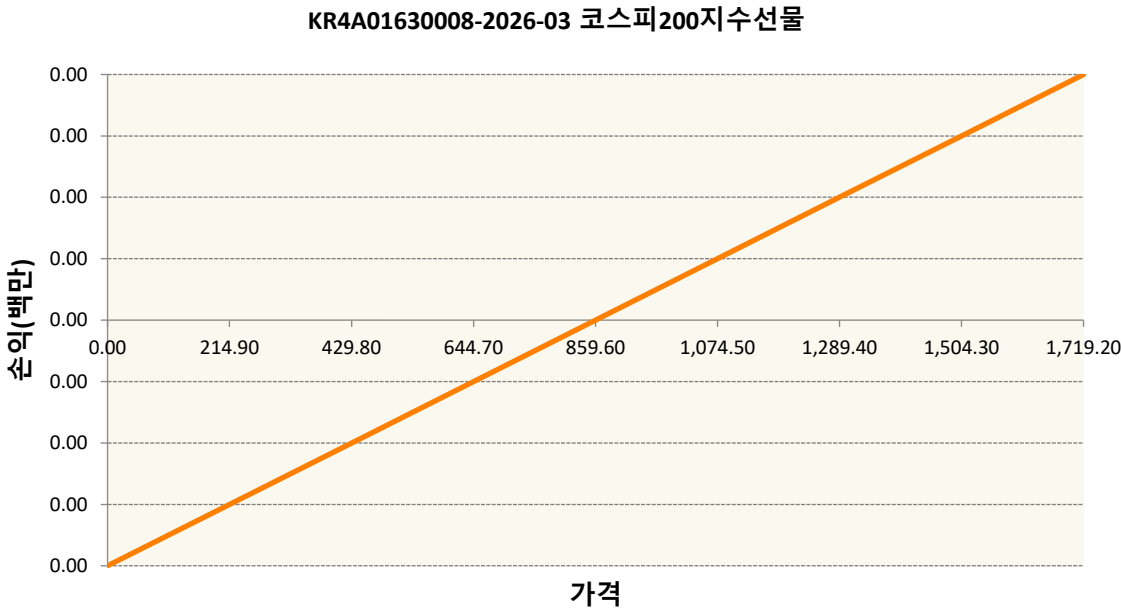
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	38	0	38	장내
누계	유가증권	선물	3,477	0	3,477	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		275
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		3

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	6

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

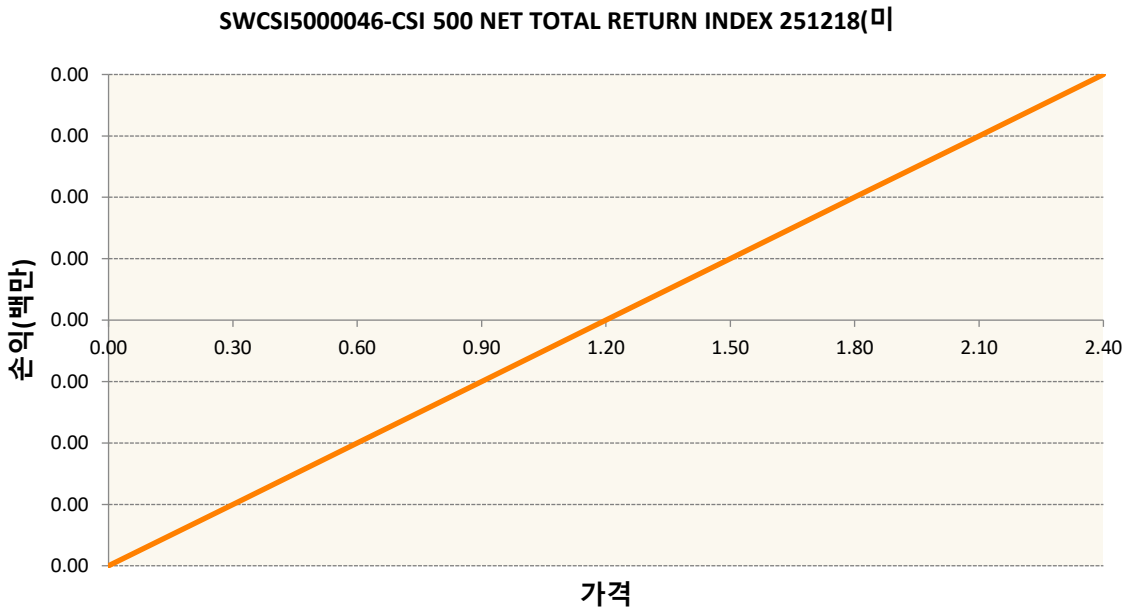
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

445

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

553

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

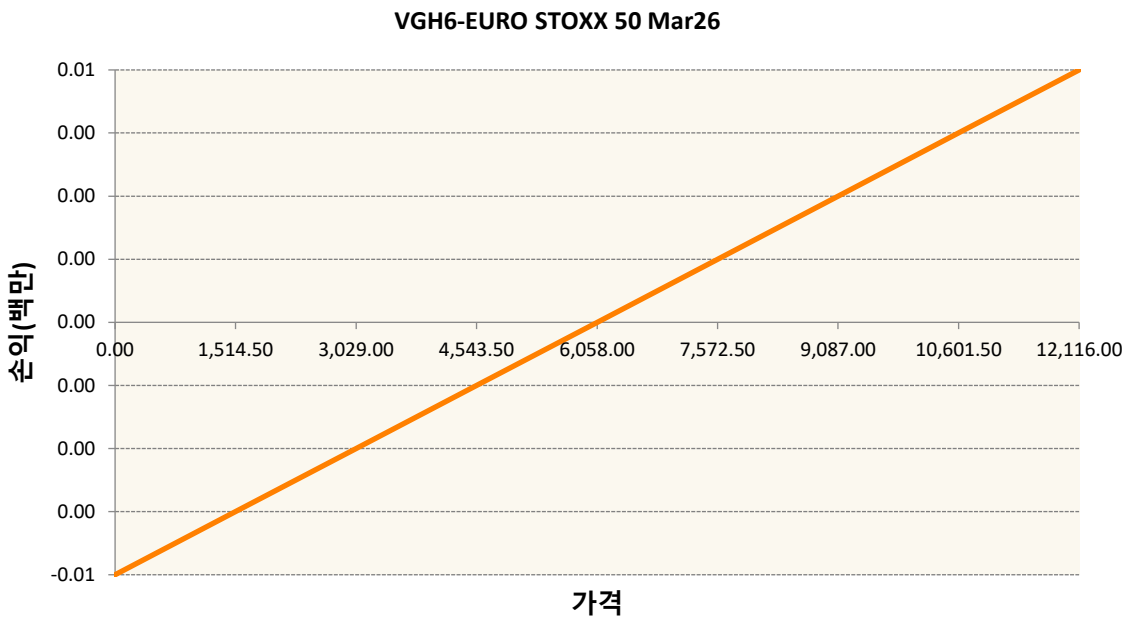
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	943	0	943	

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	2026-02-23
기준일	2026-02-20

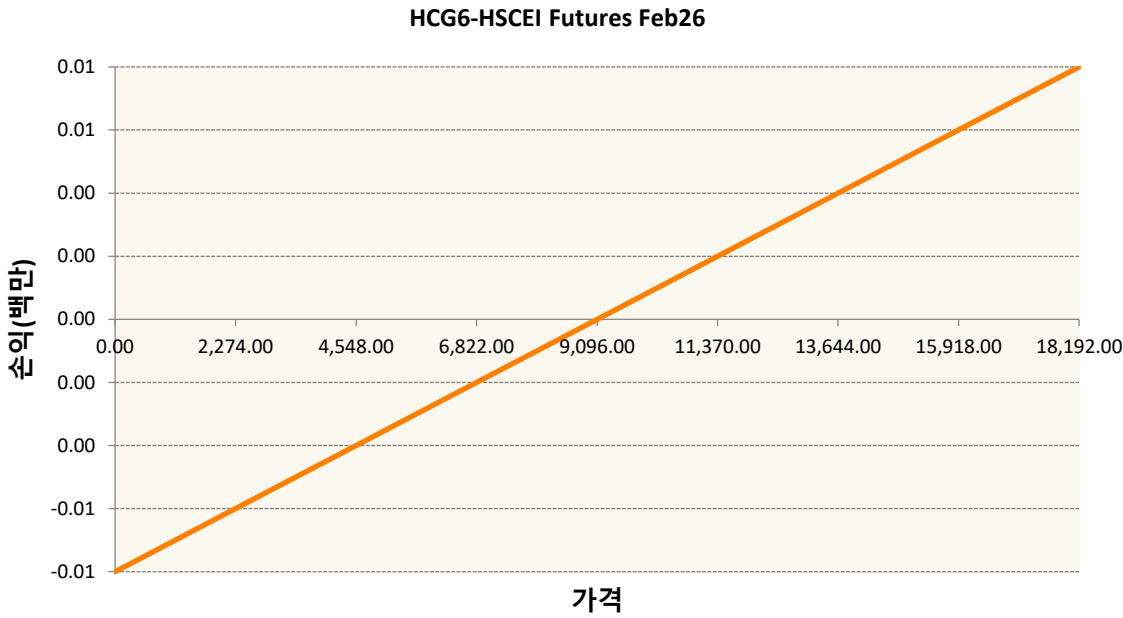
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,911	0	1,911	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCG6	HSCEI Futures Feb26	153
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

206

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

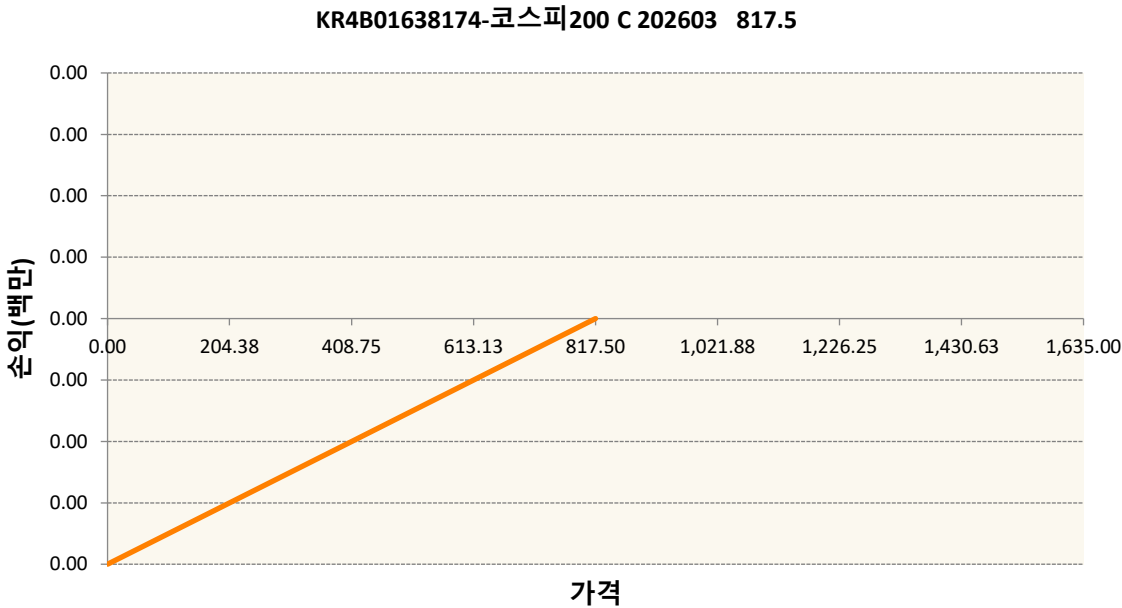
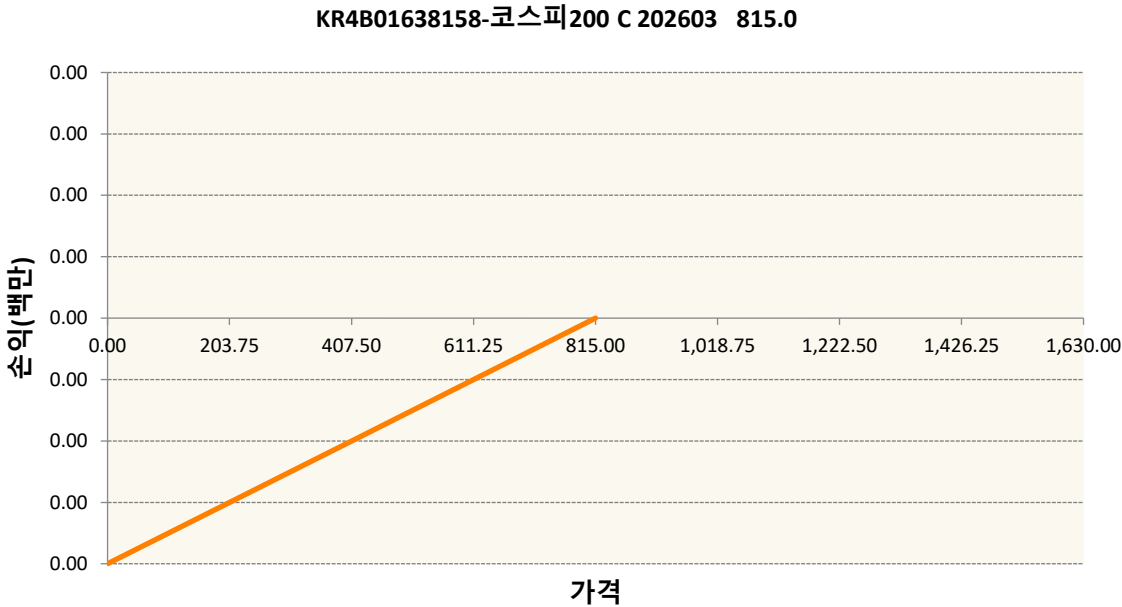
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

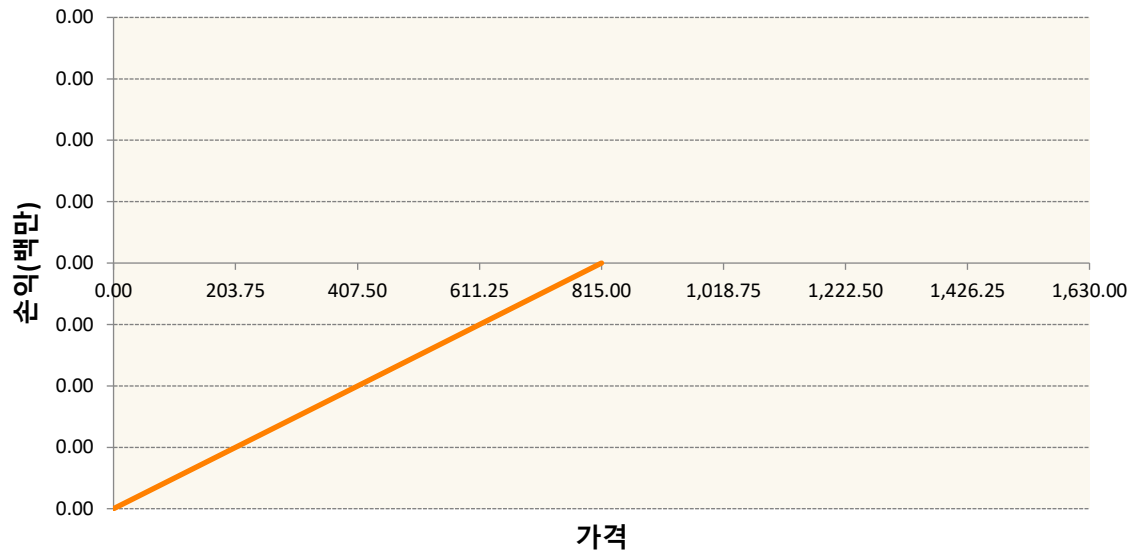
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	571	0	571	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,896	-34,896	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01638157-코스피200 P 202603 815.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016381 코스피200 C 202603 815.0
 KR4B016381 코스피200 C 202603 817.5
 KR4C016381 코스피200 P 202603 815.0

831
1,422
538

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-02-23

기준일 2026-02-20

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	2026-02-23
기준일	2026-02-20

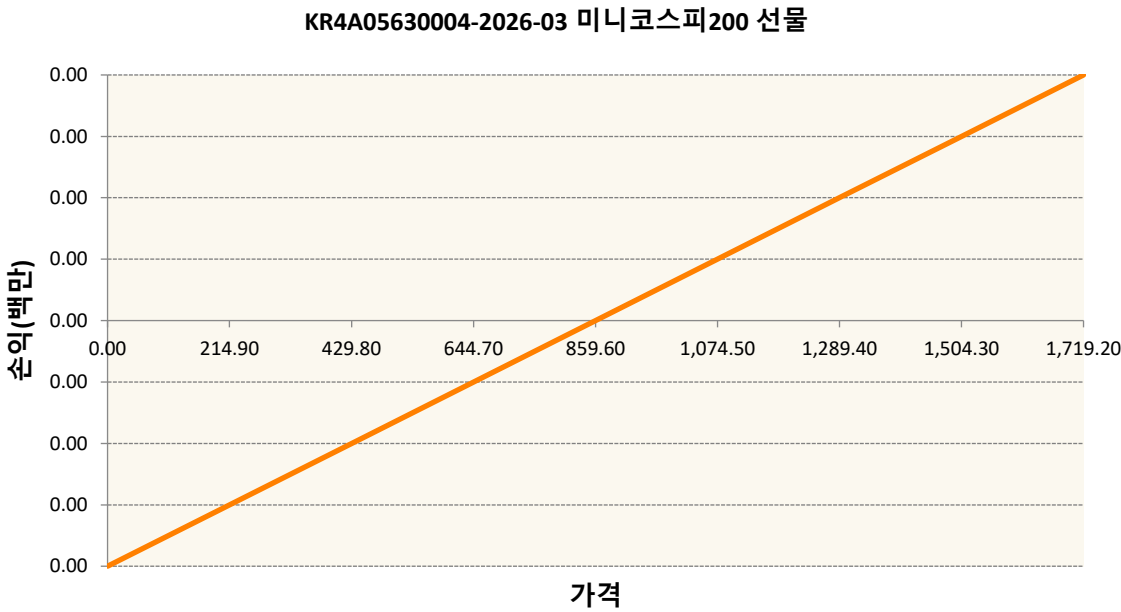
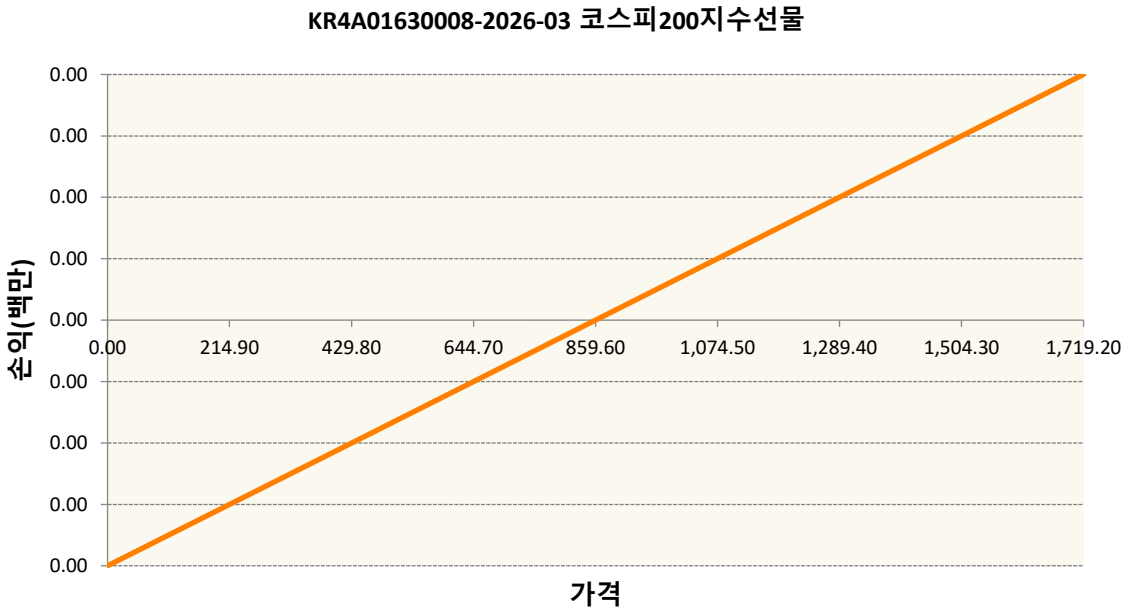
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

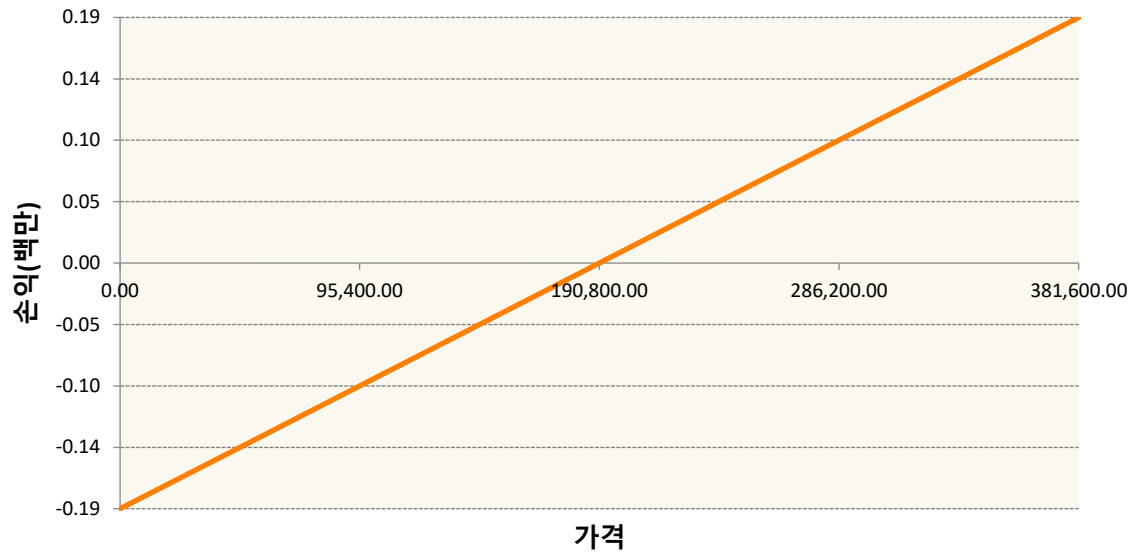
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	904	215	689	장내
누계	유가증권	선물	6,331	35	6,295	장내

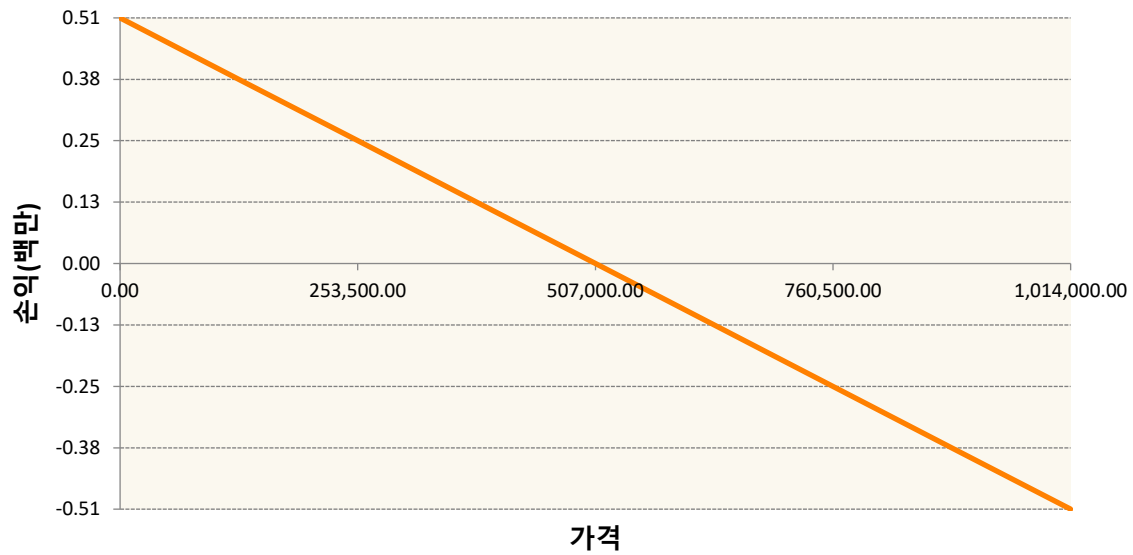
2. 만기시점의 손익구조



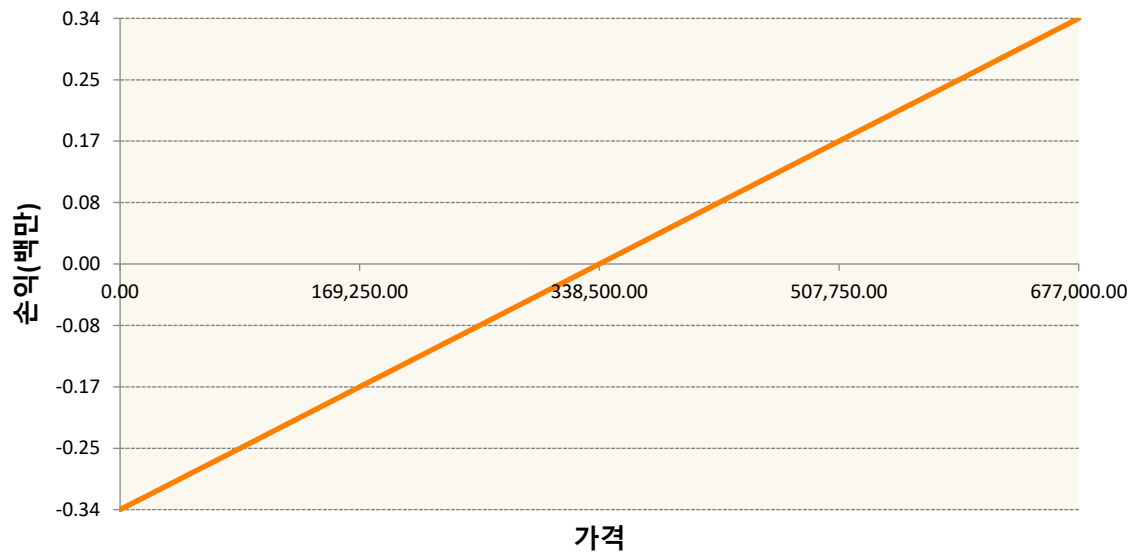
KR4A11630006-2026-03 삼성전자개별선물



KR4A16630001-2026-03 현대차개별선물



KR4A47630004-2026-03 LG화학개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A016300 2026-03 코스피200지수선물		86
KR4A056300 2026-03 미니코스피200 선물		83
KR4A116300 2026-03 삼성전자개별선물		1
KR4A166300 2026-03 현대차개별선물		3
KR4A476300 2026-03 LG화학개별선물		6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	9

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

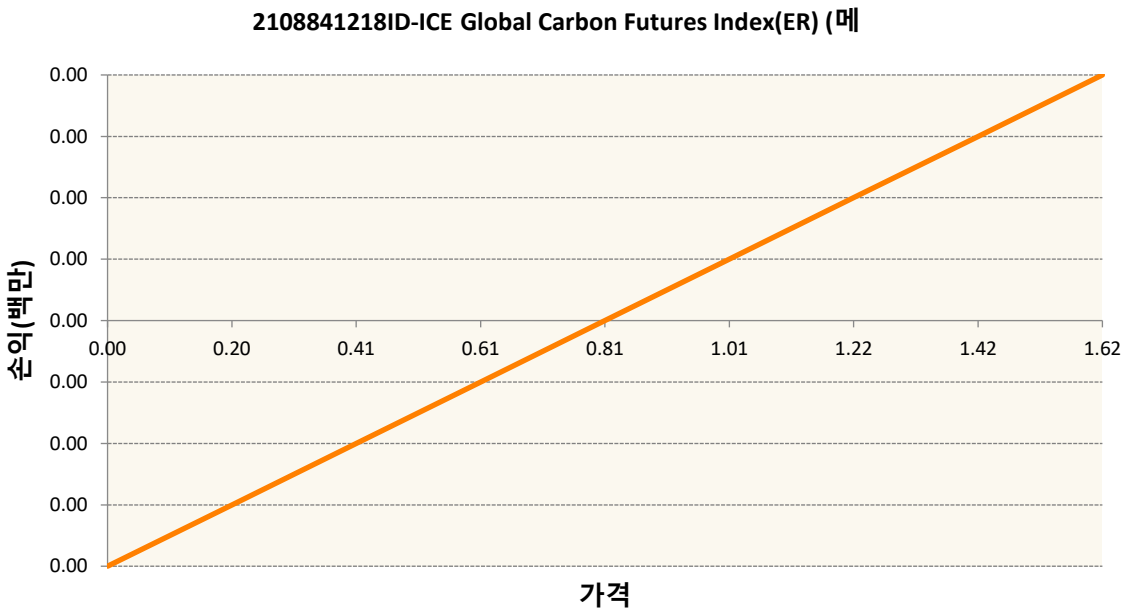
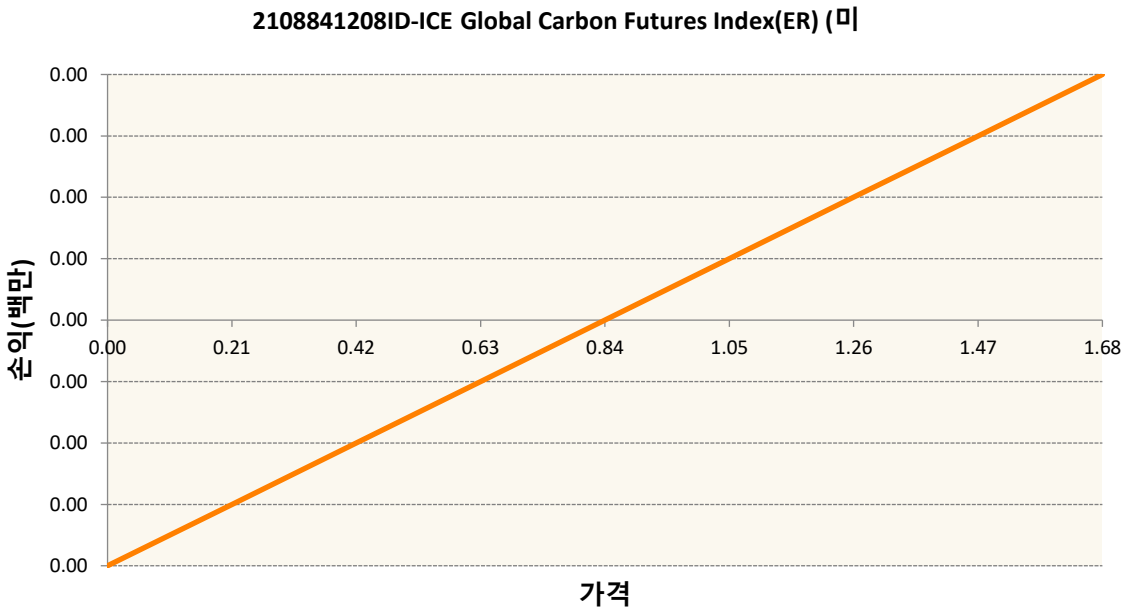
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,124	0	6,124	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108841208IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		394
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		99

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	524

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

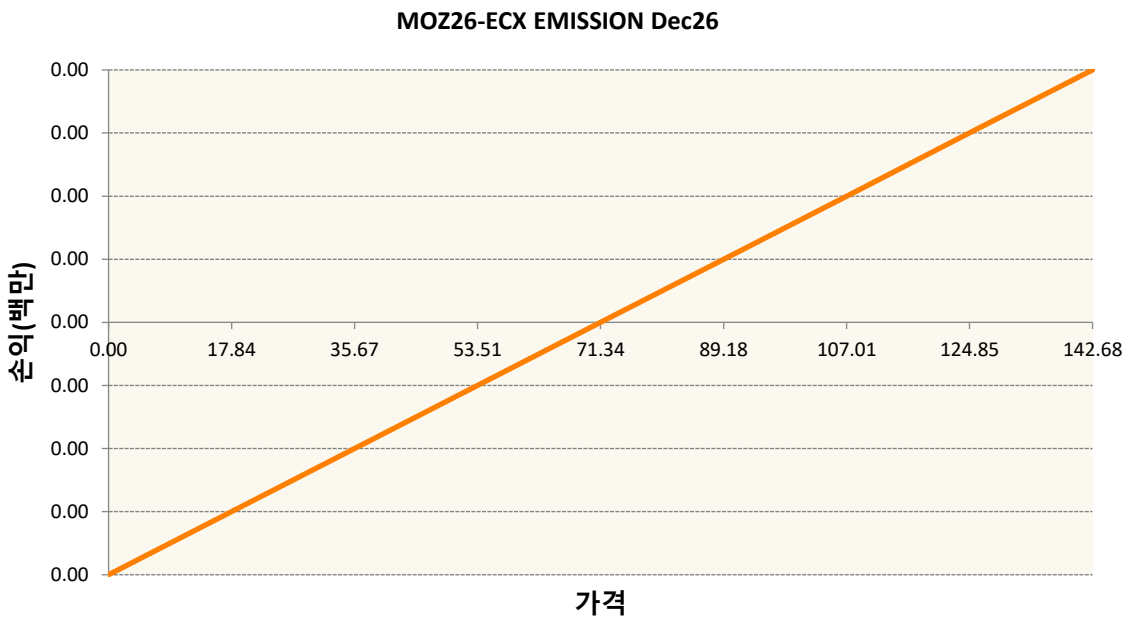
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,732	0	4,732	
누계	통화	선도	612	3,176	-2,564	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G1V\ KRW/EUR 27-02-26E	254
FXW213G22\ EUR/KRW 27-02-26E	27
FXW213G29\ EUR/KRW 27-02-26E	14
FXW213G2L\ EUR/KRW 27-02-26E	8
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	379

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

(단위:백만원)

715

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

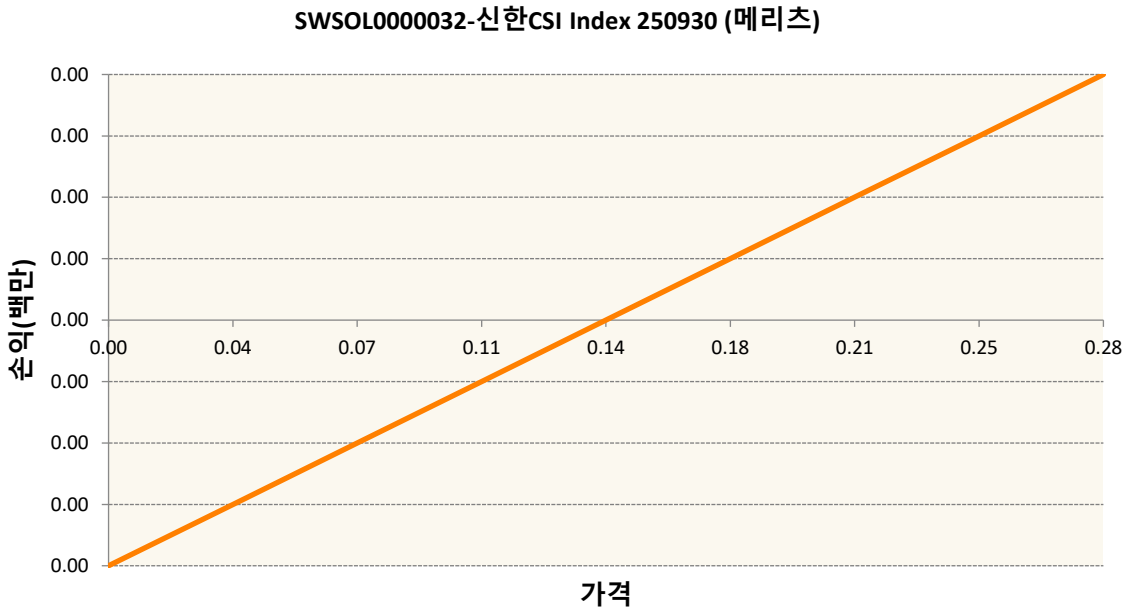
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	3,106	0	3,106	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	18
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (키움)	12
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	12
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	31

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

(단위:백만원)

133

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

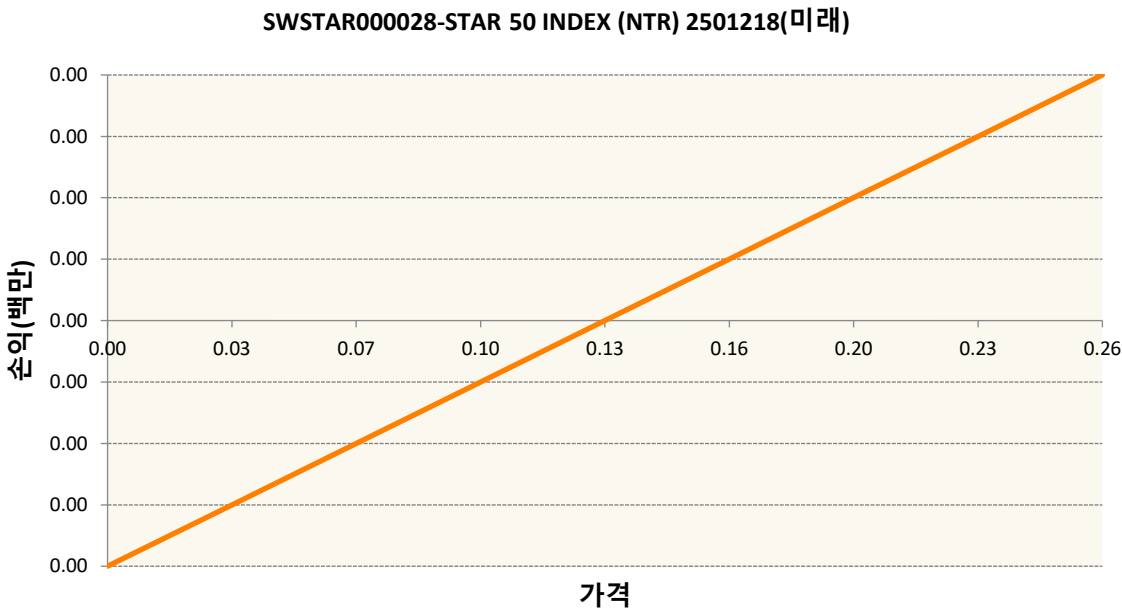
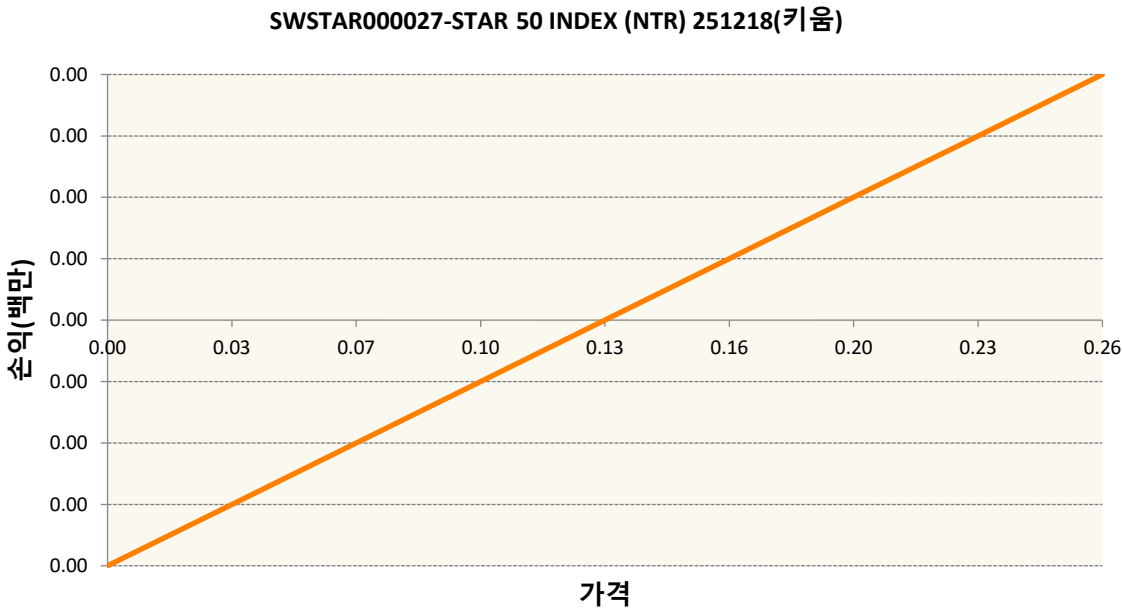
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

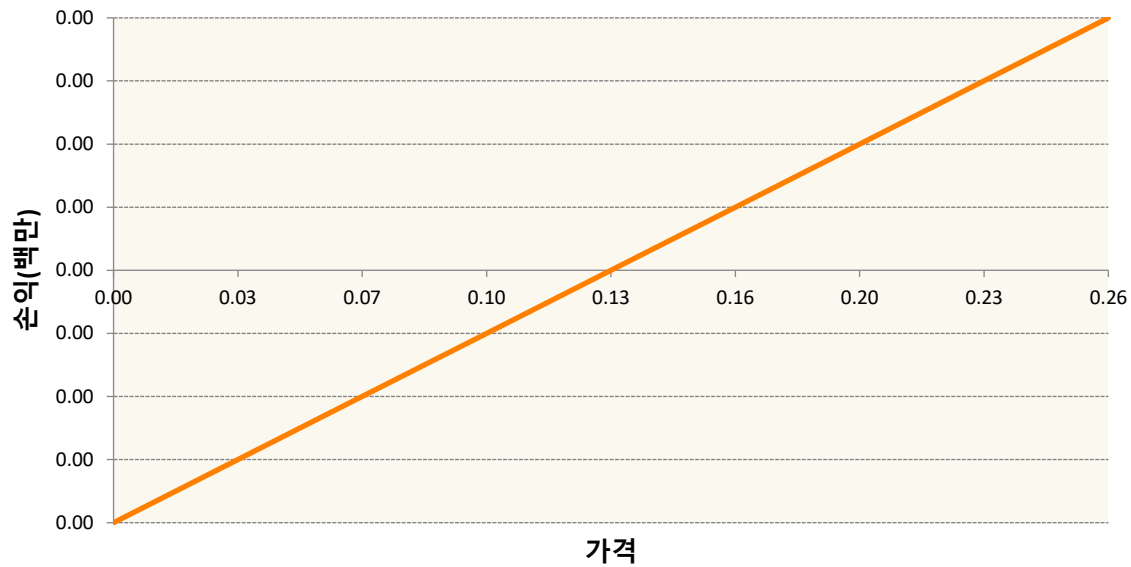
(단위:백만원)

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

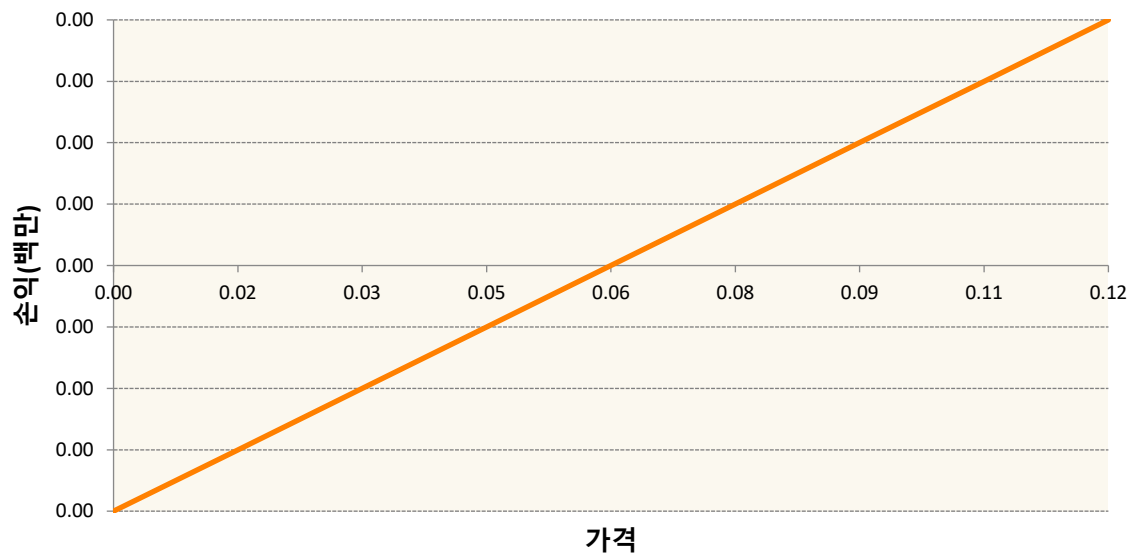
2. 만기시점의 손익구조



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))	9
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 2501218(미래))	56
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH))	29
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠))	69

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

(단위:백만원)

297

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

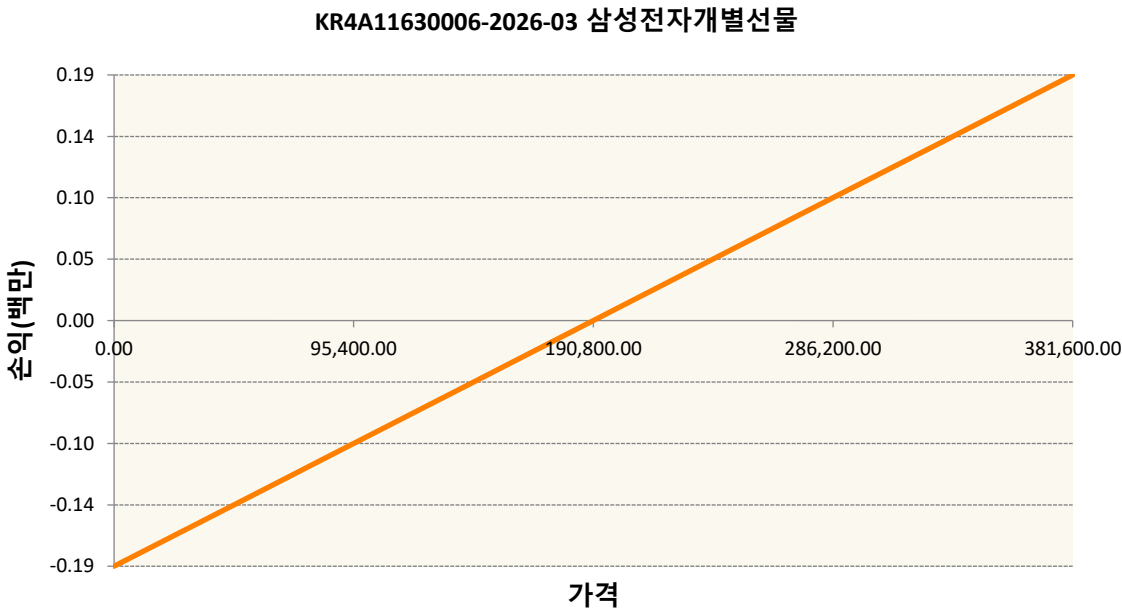
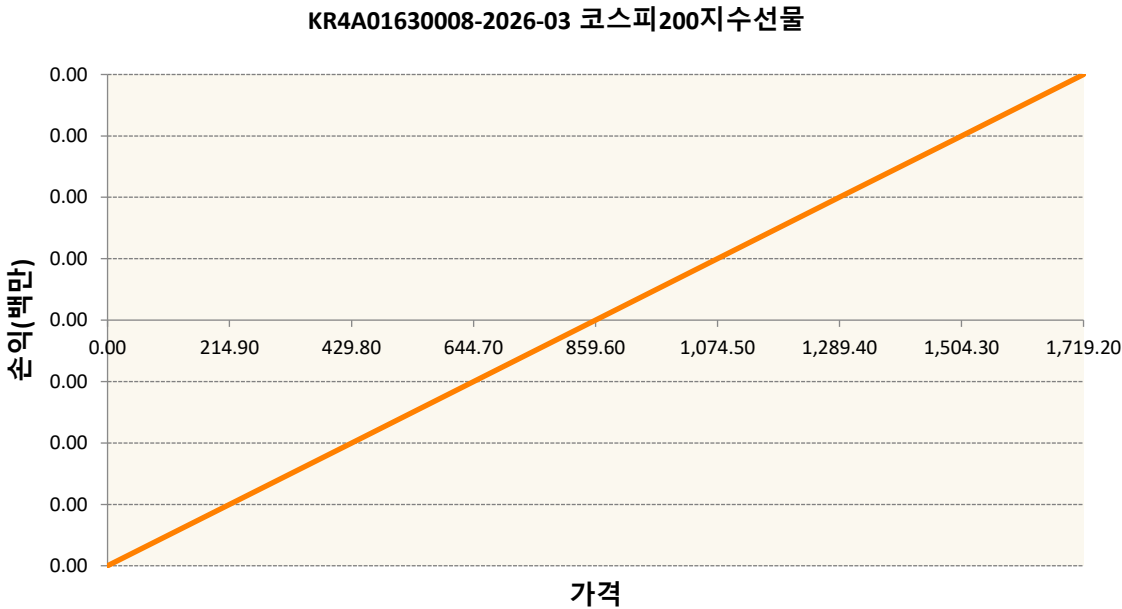
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

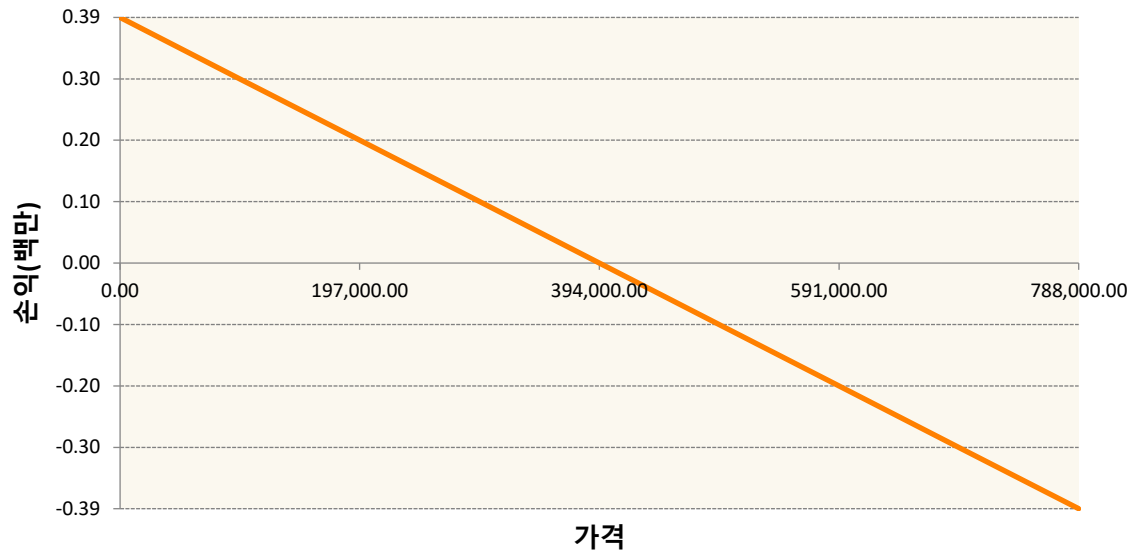
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,770	0	2,770	장내
누계	유가증권	선물	16,205	4,456	11,749	장내

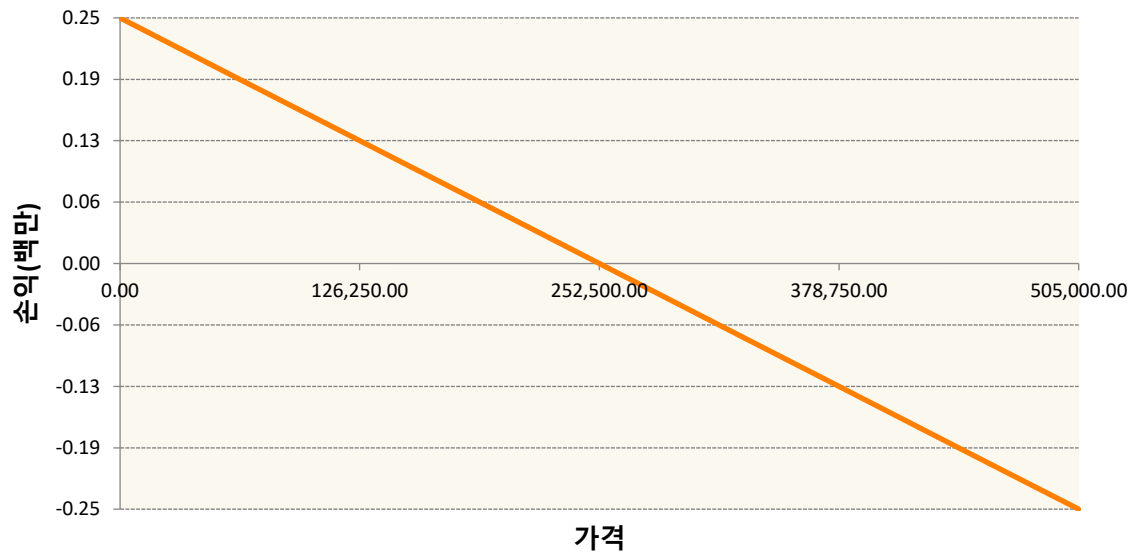
2. 만기시점의 손익구조



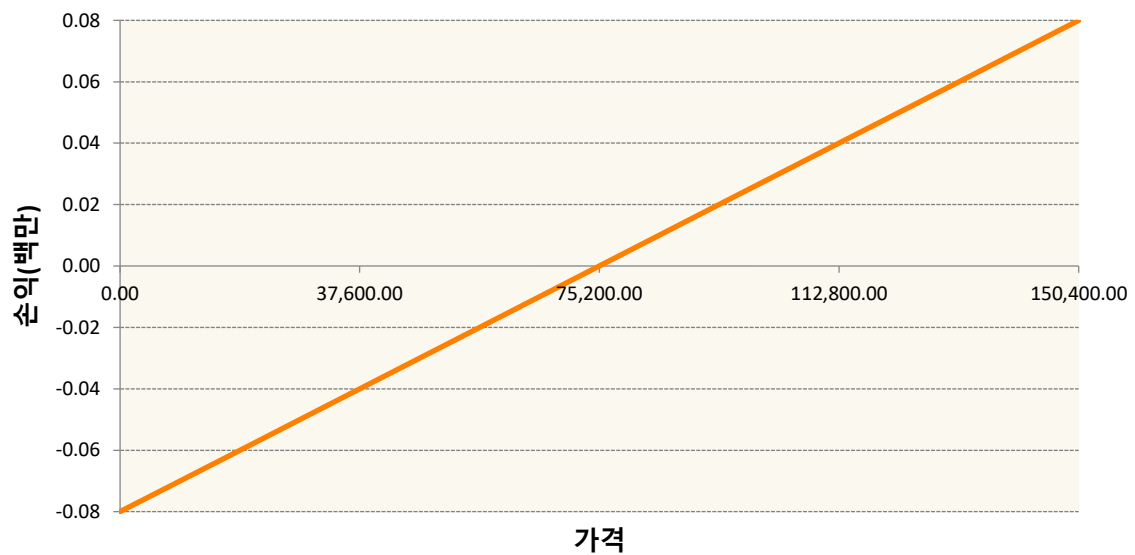
KR4A13630004-2026-03 POSCO홀딩스개별선물



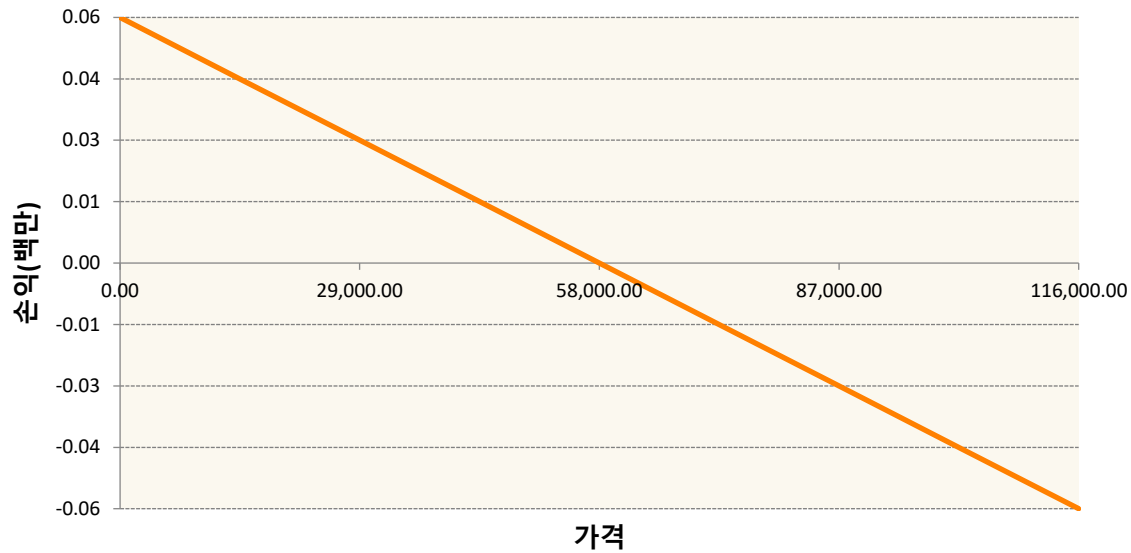
KR4A56630002-2026-03 NAVER개별선물



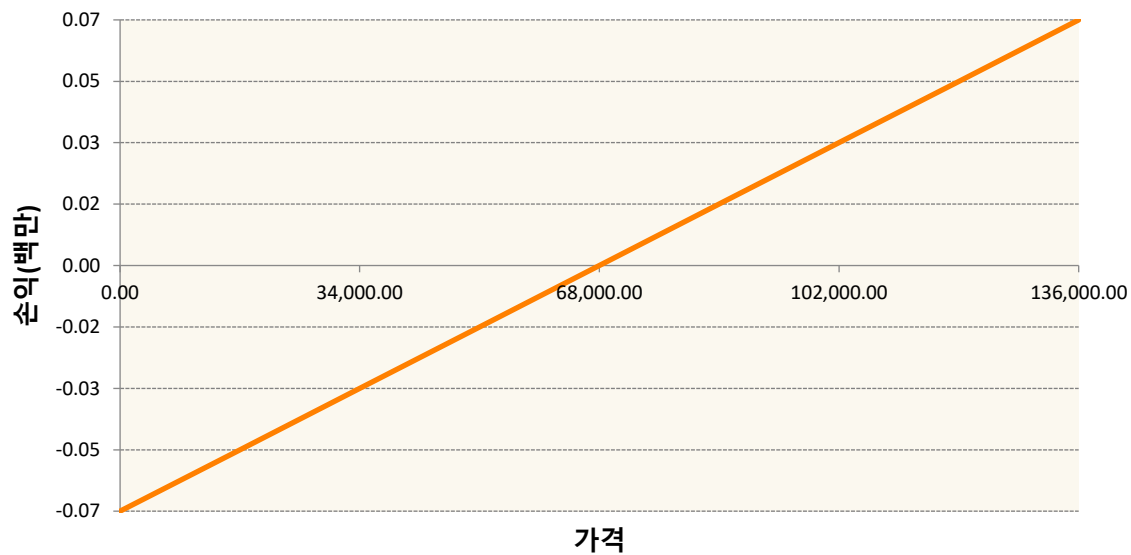
KR4AB7630000-2026-03 포스코인터내셔널개별선물



KR4ACF630008-2026-03 카카오개별선물



KR4AF7630001-2026-03 카카오페이개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01630008		2026-03 코스피200지수선물					946
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-946	-946	-946	-946	-946	-946	-946
-5.33%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630
-2.67%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	315	315	315	315	315	315	315
5.33%	630	630	630	630	630	630	630
8.00%	946	946	946	946	946	946	946
KR4A11630006		2026-03 삼성전자개별선물					287
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-287	-287	-287	-287	-287	-287	-287
-5.33%	-191	-191	-191	-191	-191	-191	-191
-2.67%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	96	96	96	96	96	96	96
5.33%	191	191	191	191	191	191	191
8.00%	287	287	287	287	287	287	287

KR4A13630004

2026-03 POSCO홀딩스개별선물

61

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	61	61	61	61	61	61
-5.33%	41	41	41	41	41	41	41
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61

KR4A56630002

2026-03 NAVER개별선물

149

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	149	149	149	149	149	149	149
-5.33%	99	99	99	99	99	99	99
-2.67%	50	50	50	50	50	50	50
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
5.33%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
8.00%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149

KR4AB7630000

2026-03 포스코인터내셔널개별선물

62

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

KR4ACF630008

2026-03 카카오개별선물

148

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	148	148	148	148	148	148	148
-5.33%	98	98	98	98	98	98	98
-2.67%	49	49	49	49	49	49	49
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
5.33%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
8.00%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
KR4AF7630001 2026-03 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)

2,329

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

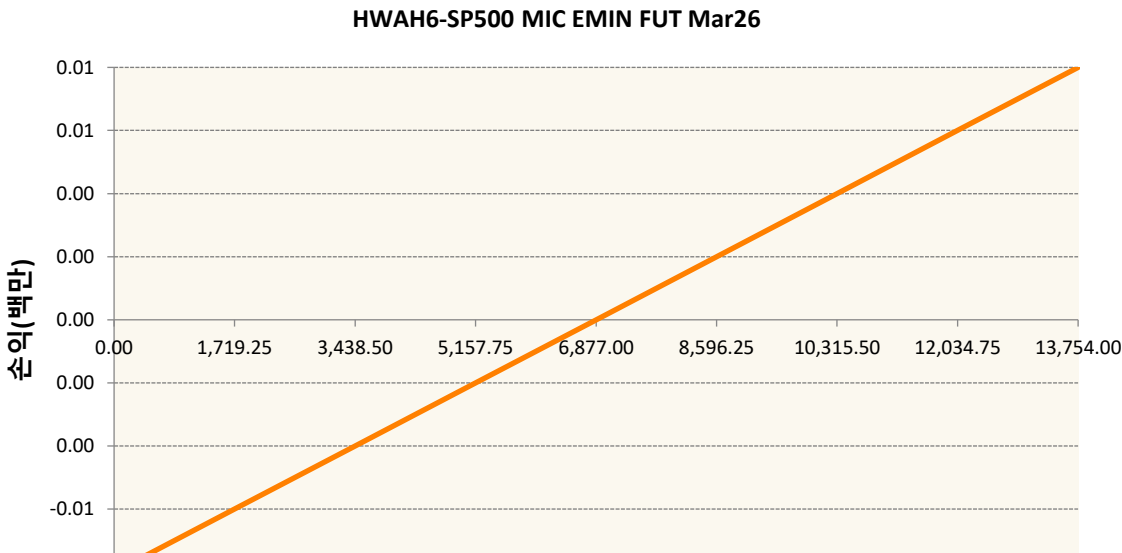
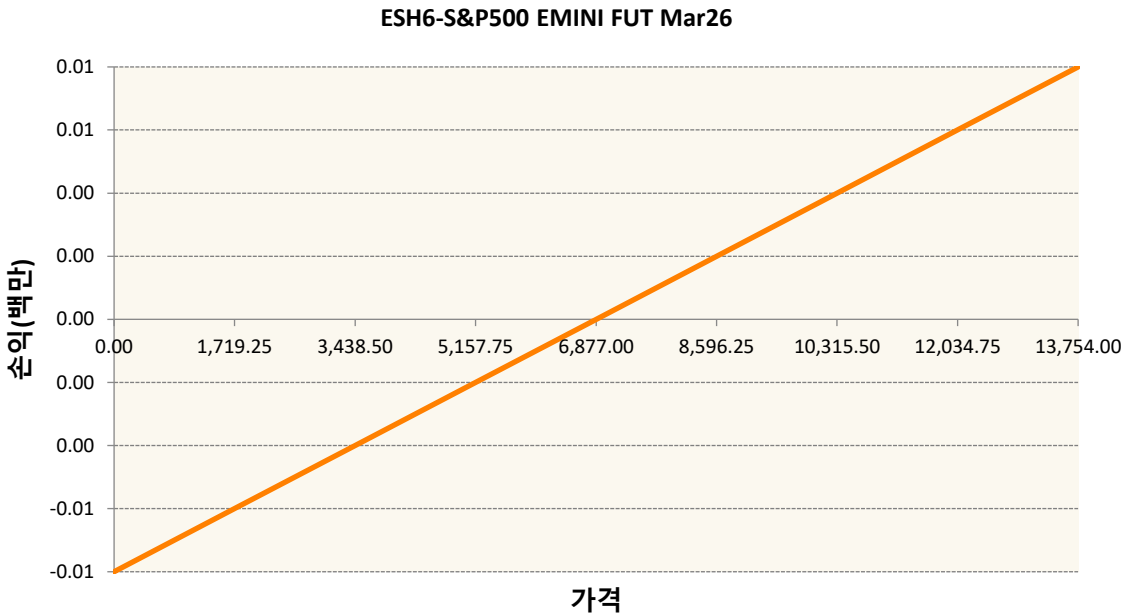
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

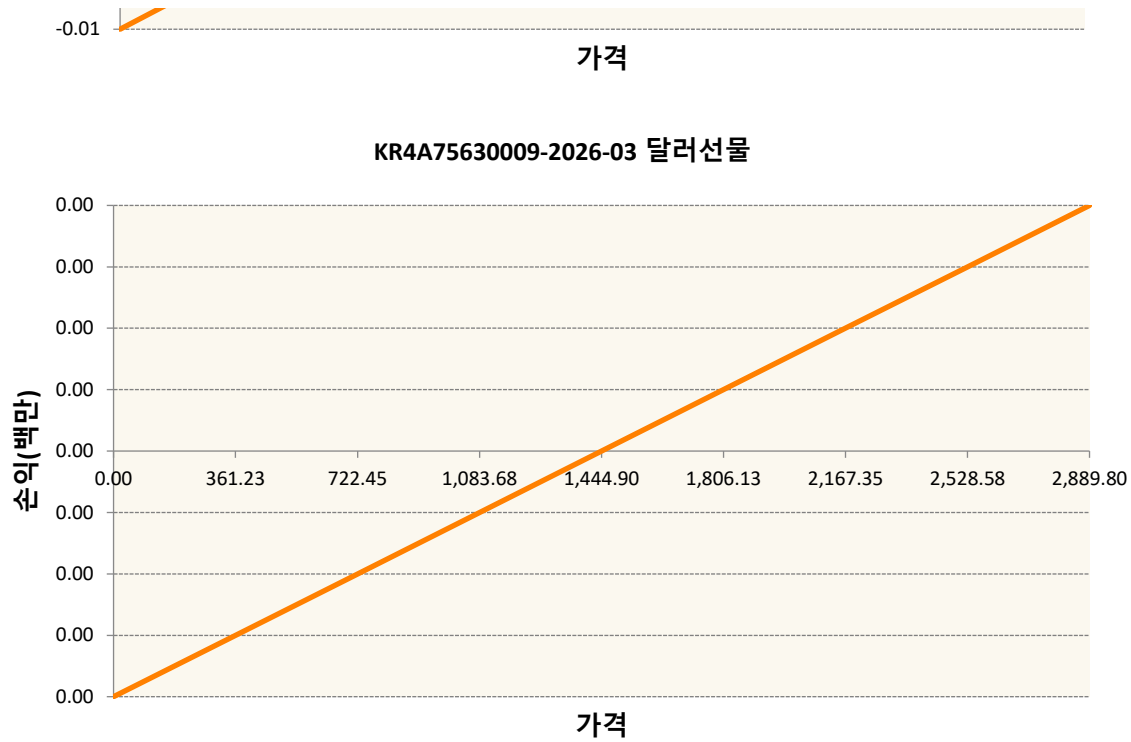
1. 계약금액

(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	1,118	0	1,118	장내
누계	지수	선물	53,226	0	53,226	
누계	통화	선물	8,091	0	8,091	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESH6	S&P500 EMINI FUT Mar26	4,258
HWAH6	SP500 MIC EMIN FUT Mar26	89
KR4A756300	2026-03 달러선물	647

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

3,716

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

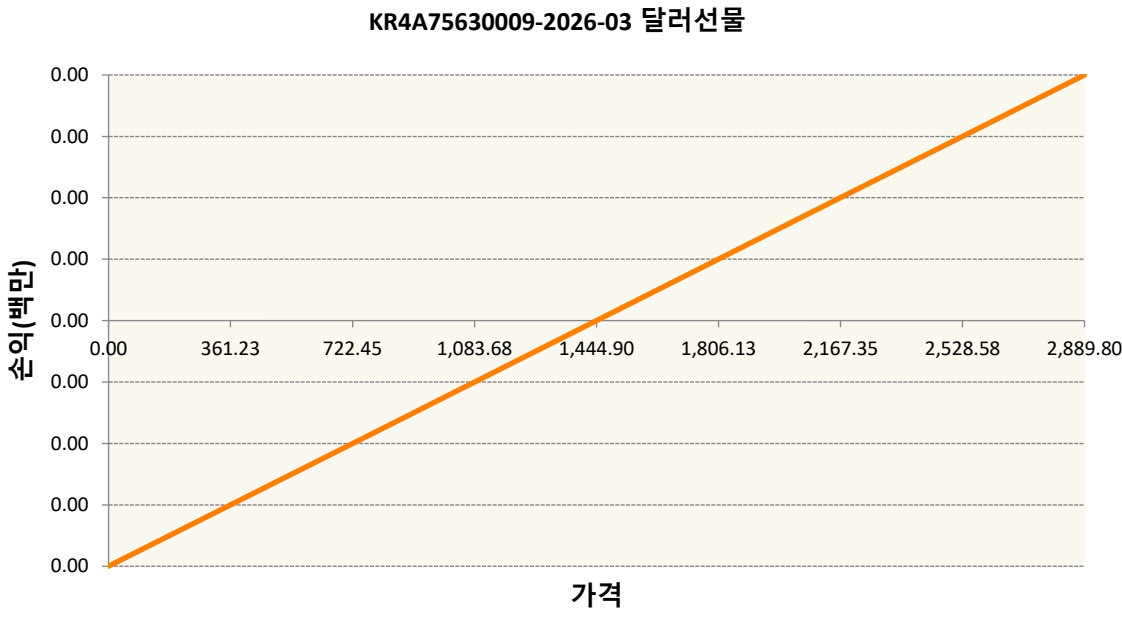
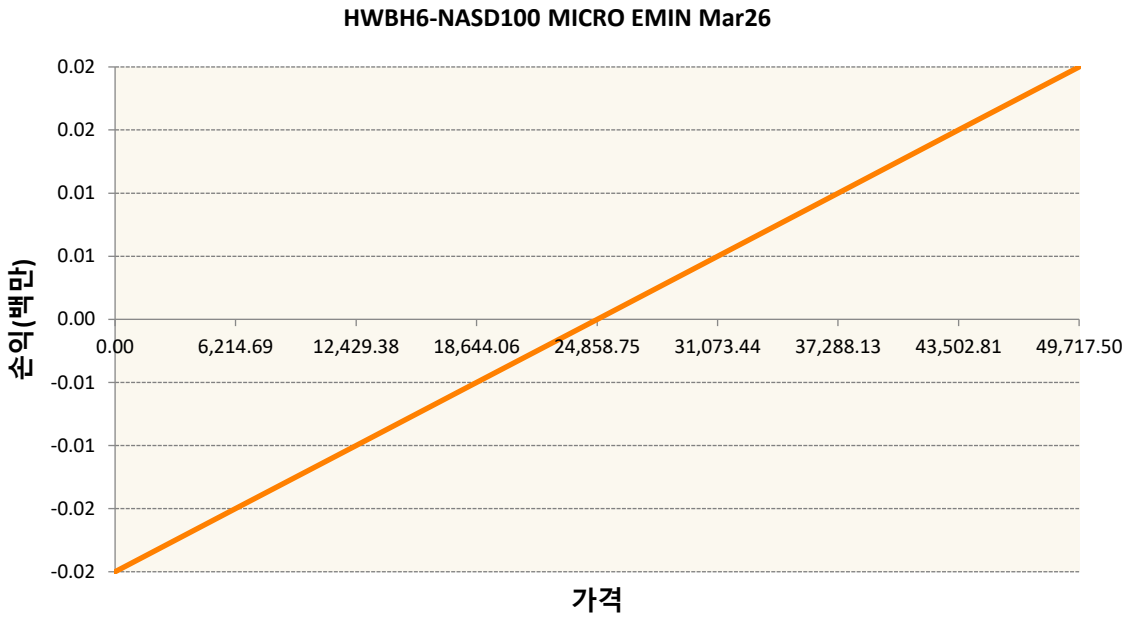
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

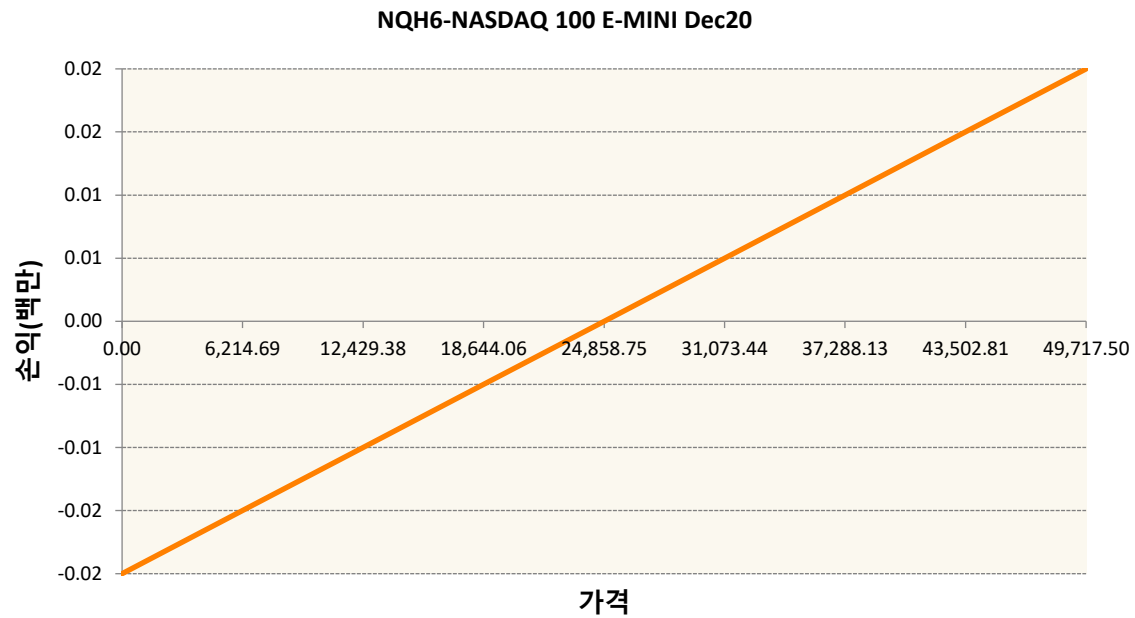
1. 계약금액

(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	23,043	0	23,043	장내
누계	통화	선물	3,107	0	3,107	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBH6	NASD100 MICRO EMIN	Mar26	24
KR4A756300	2026-03	달러선물	249
NQH6	NASDAQ 100 E-MINI	Dec20	1,820

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,001

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

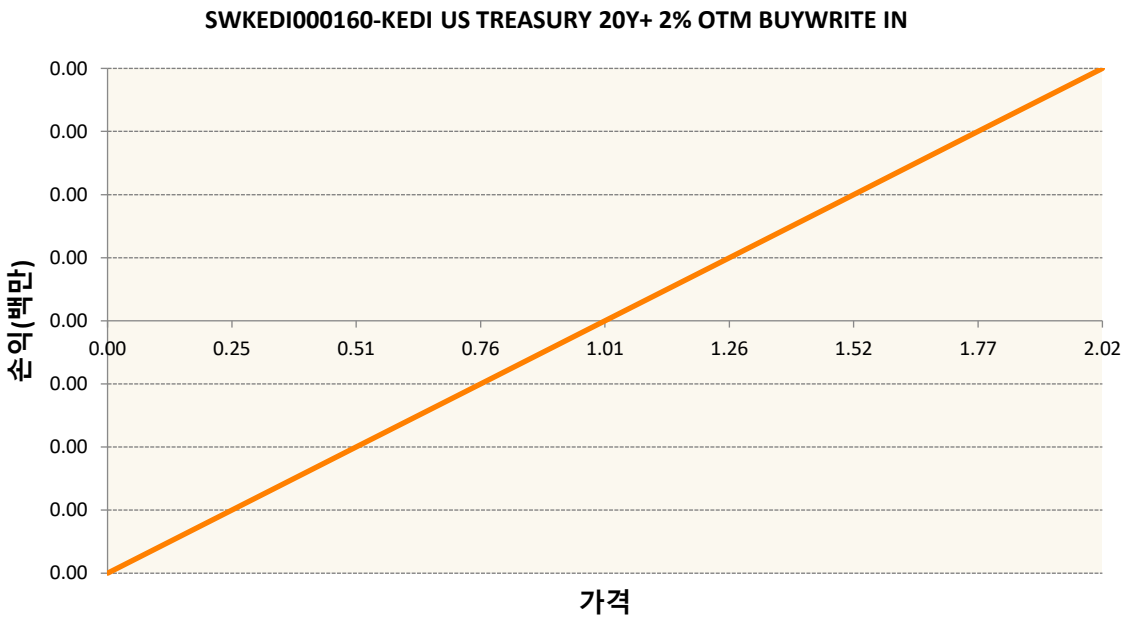
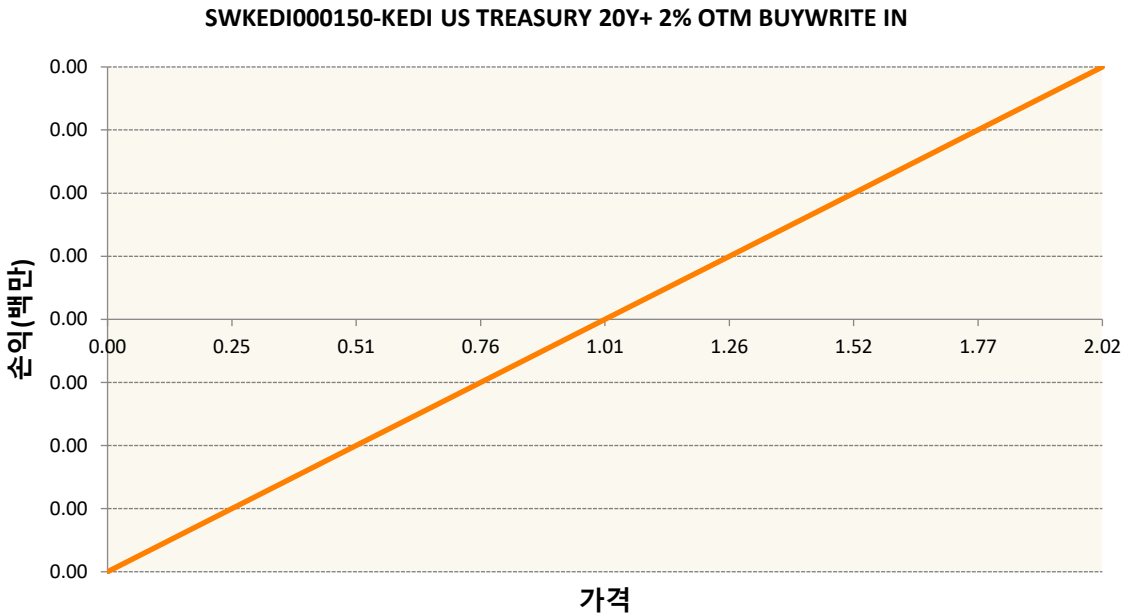
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

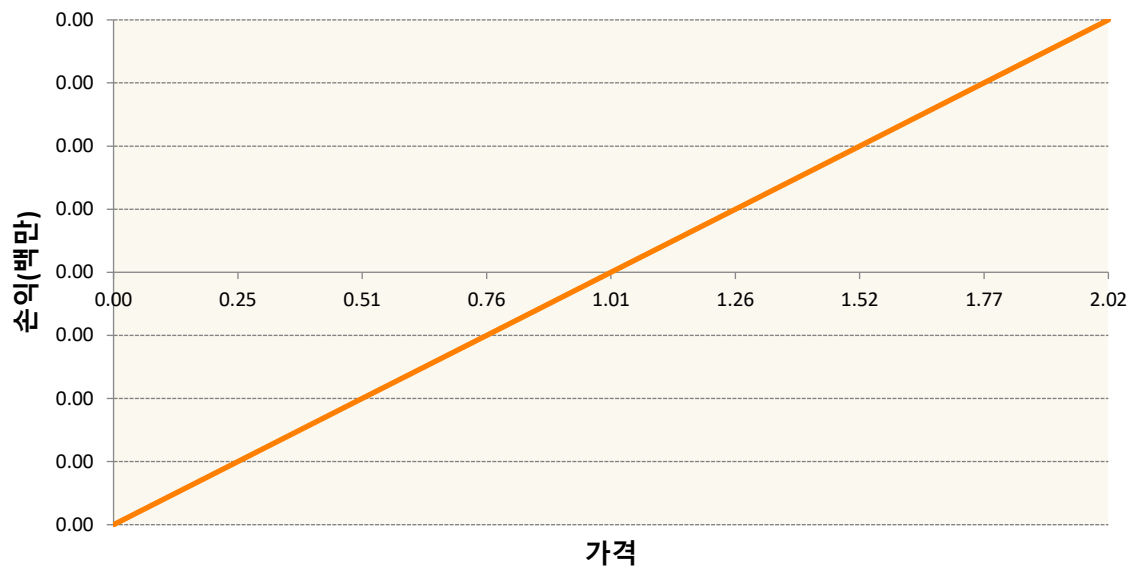
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	393,639	0	393,639	장외

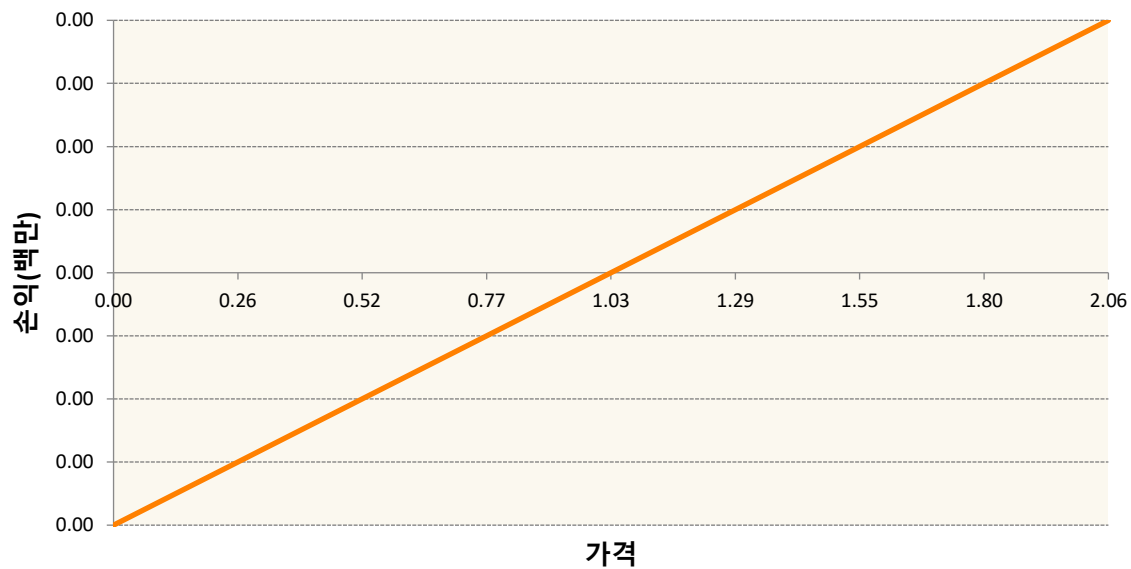
2. 만기시점의 손익구조



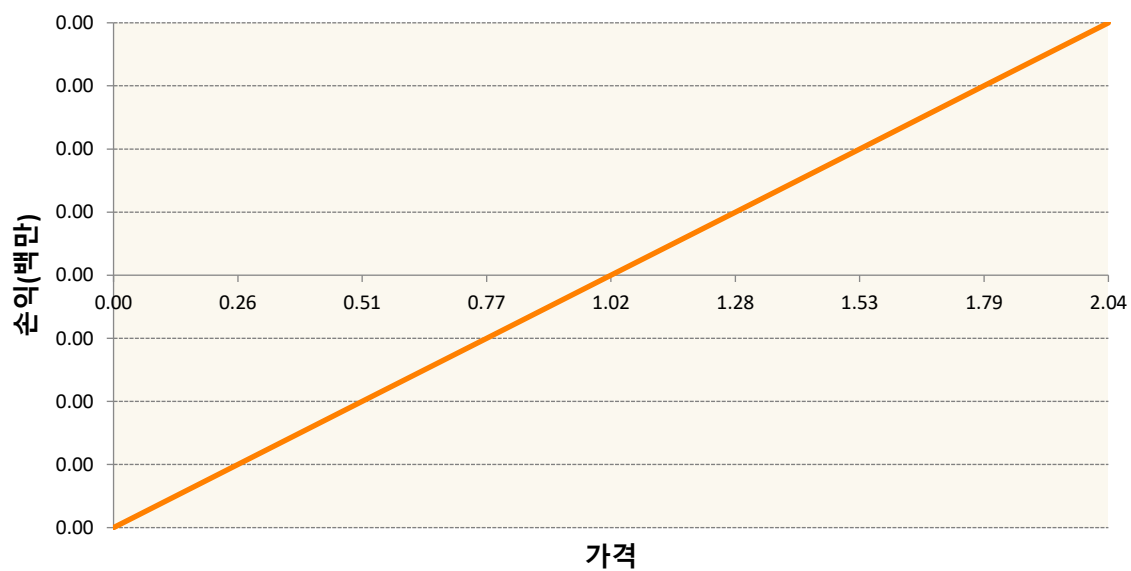
SWKEDI000161-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,287
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,433
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,712
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		150
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		10,803

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	14,245

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

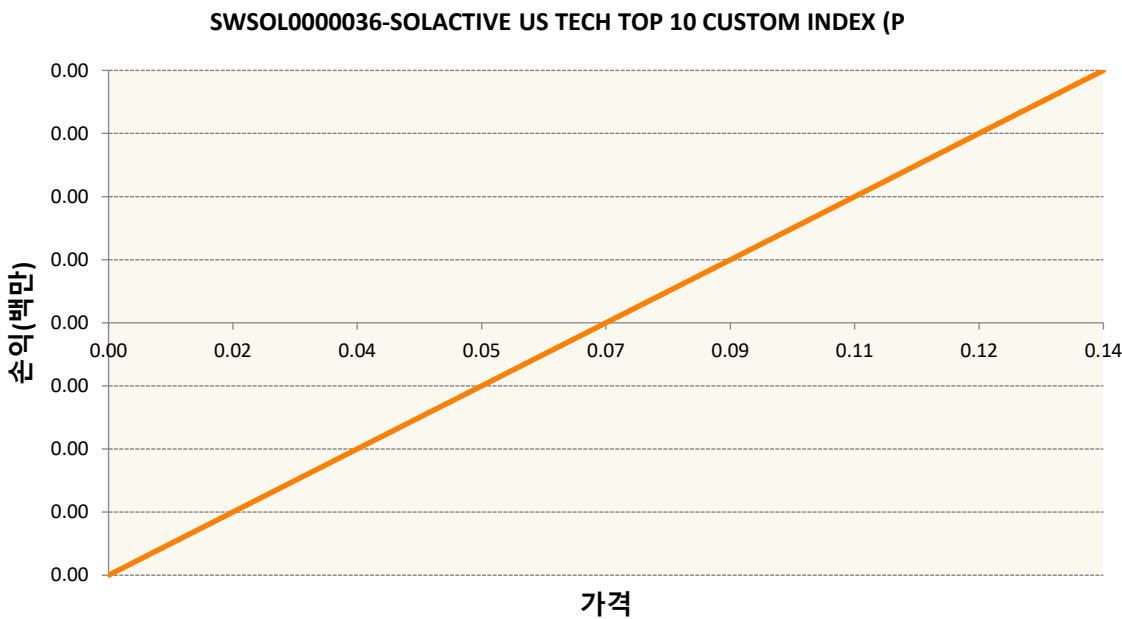
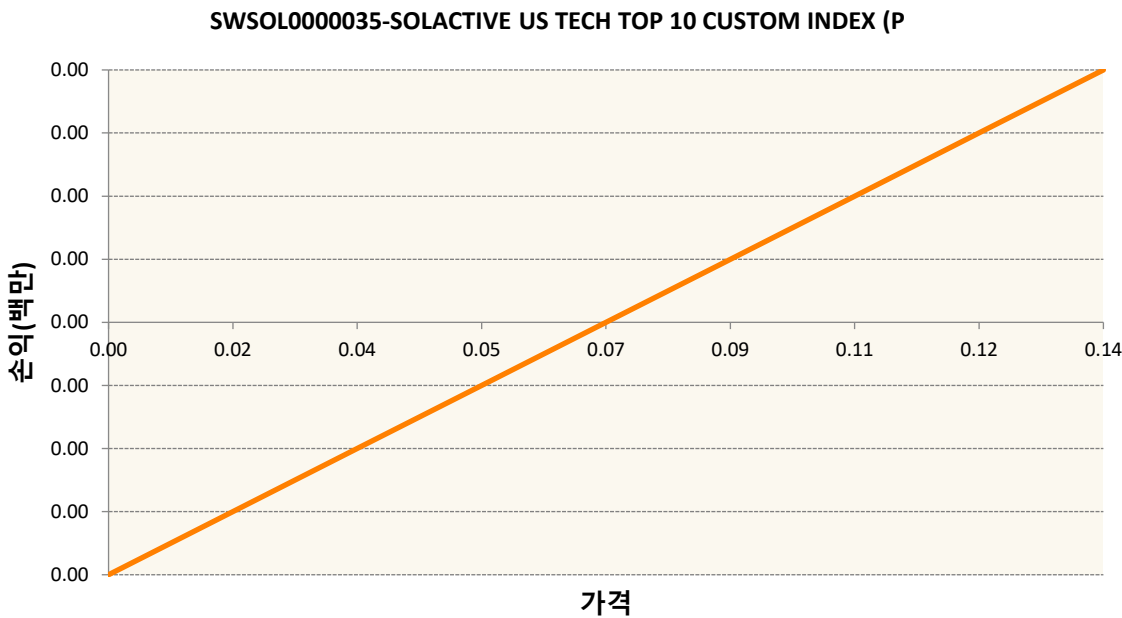
SOL미국테크TOP10인버스상장지수(주식혼합)

1. 계약금액

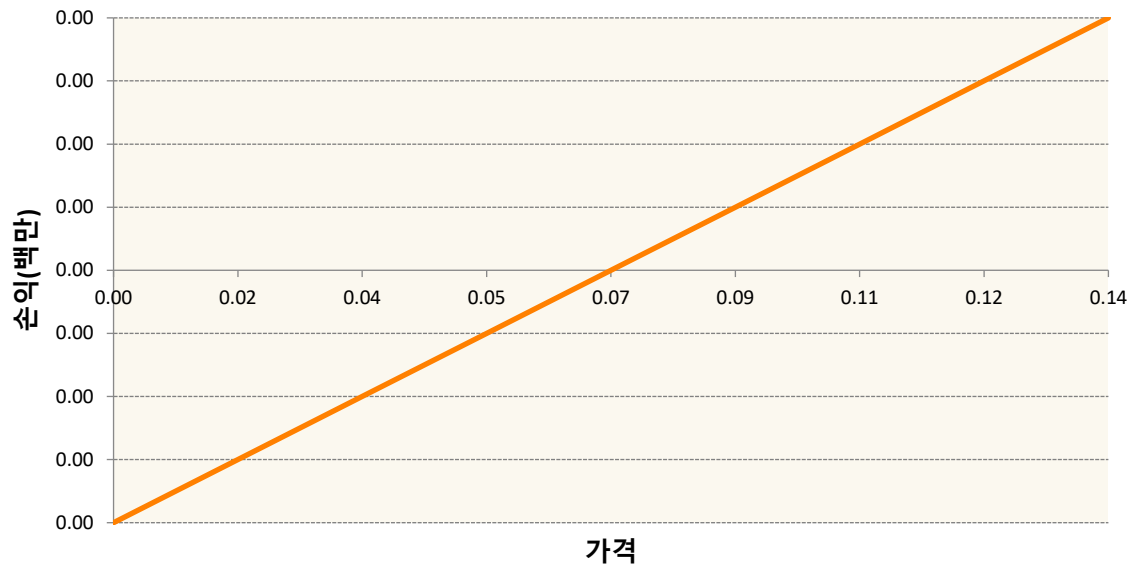
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	162	0	162	장외

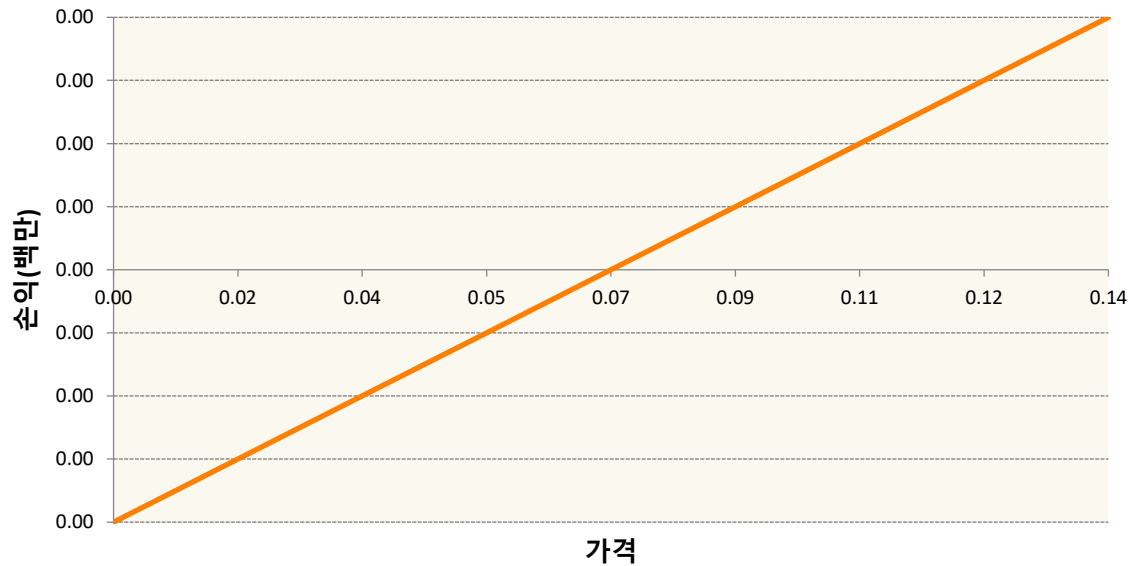
2. 만기시점의 손익구조



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

3
3
3
3

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

(단위:백만원)

16

공시일	2026-02-23
기준일	2026-02-20

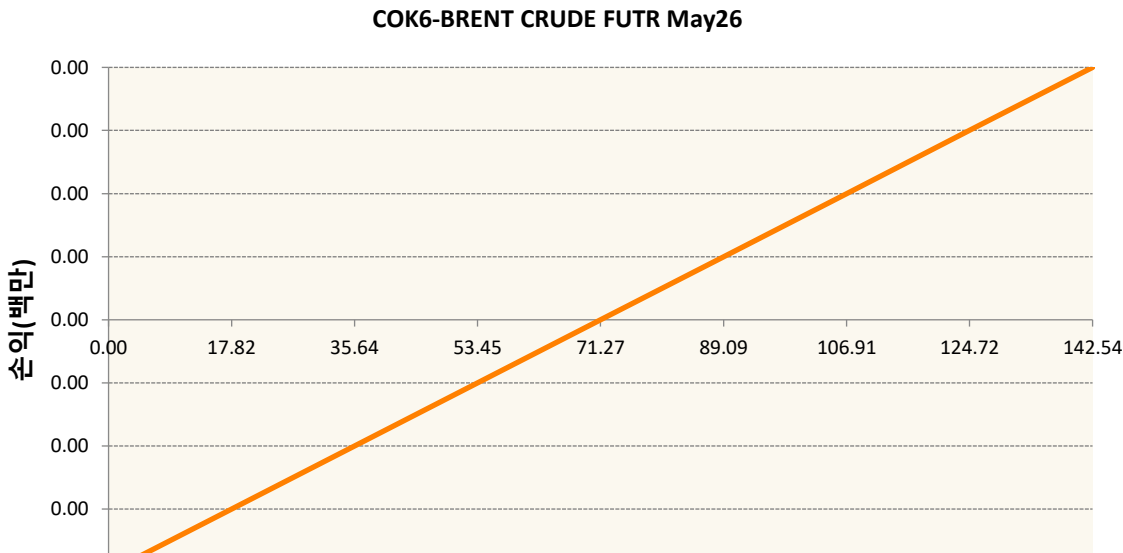
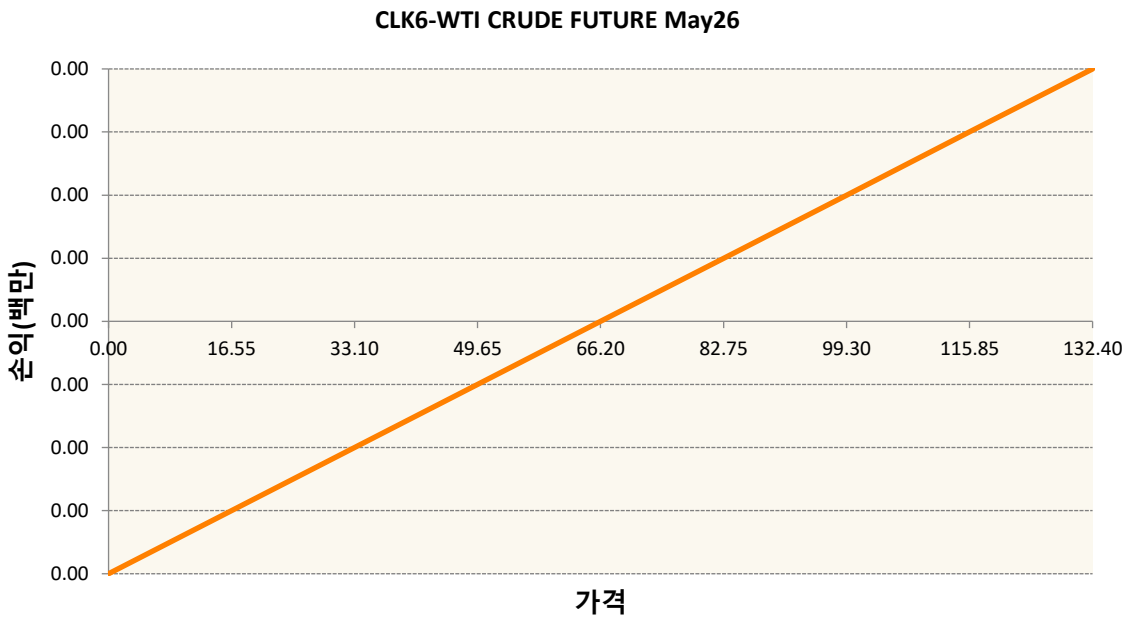
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

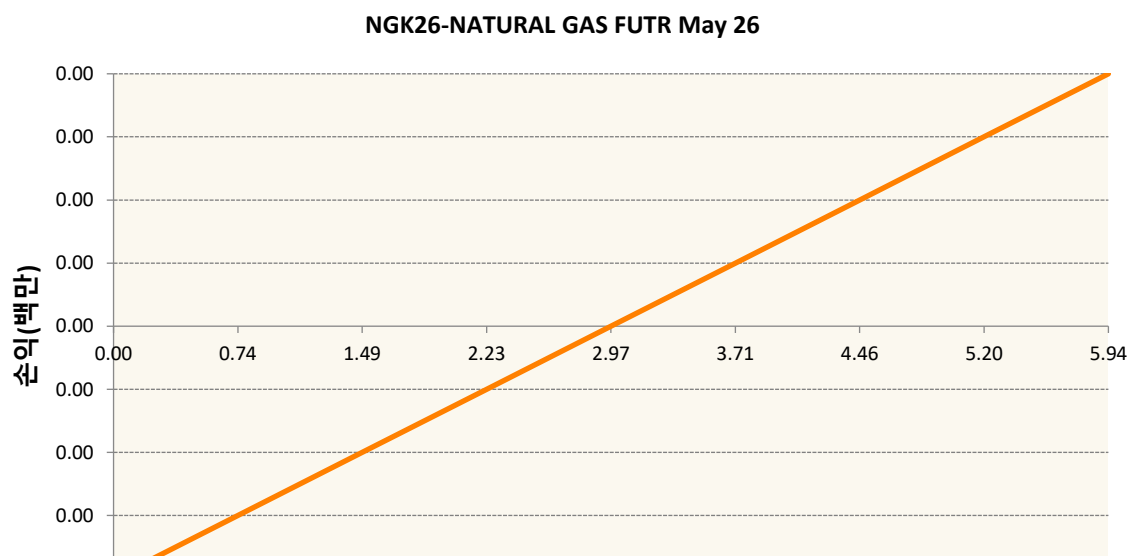
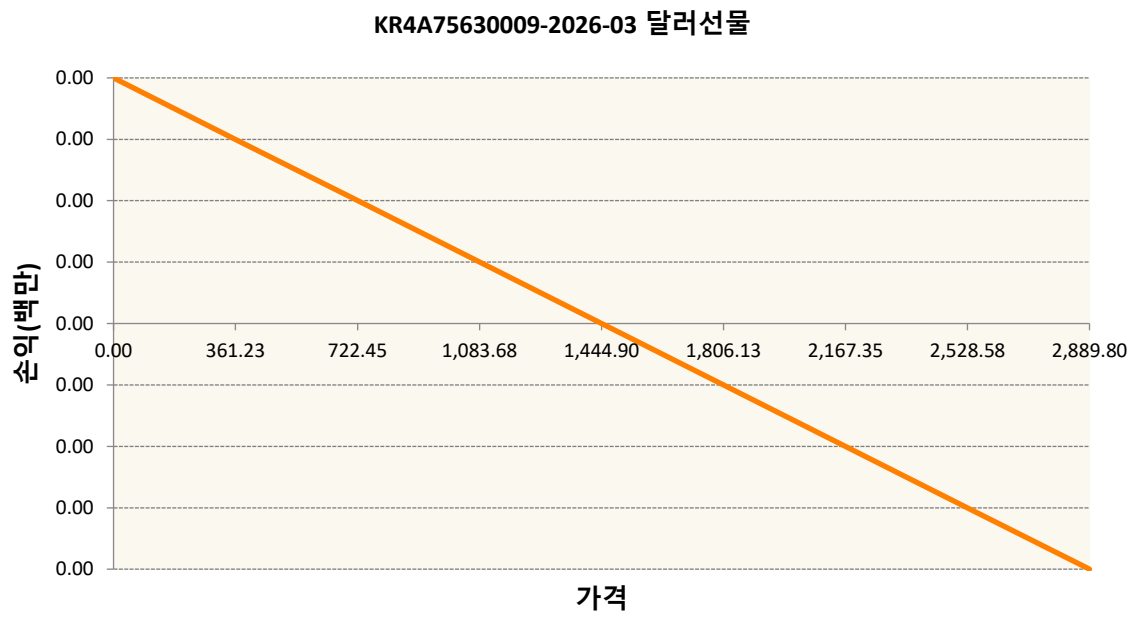
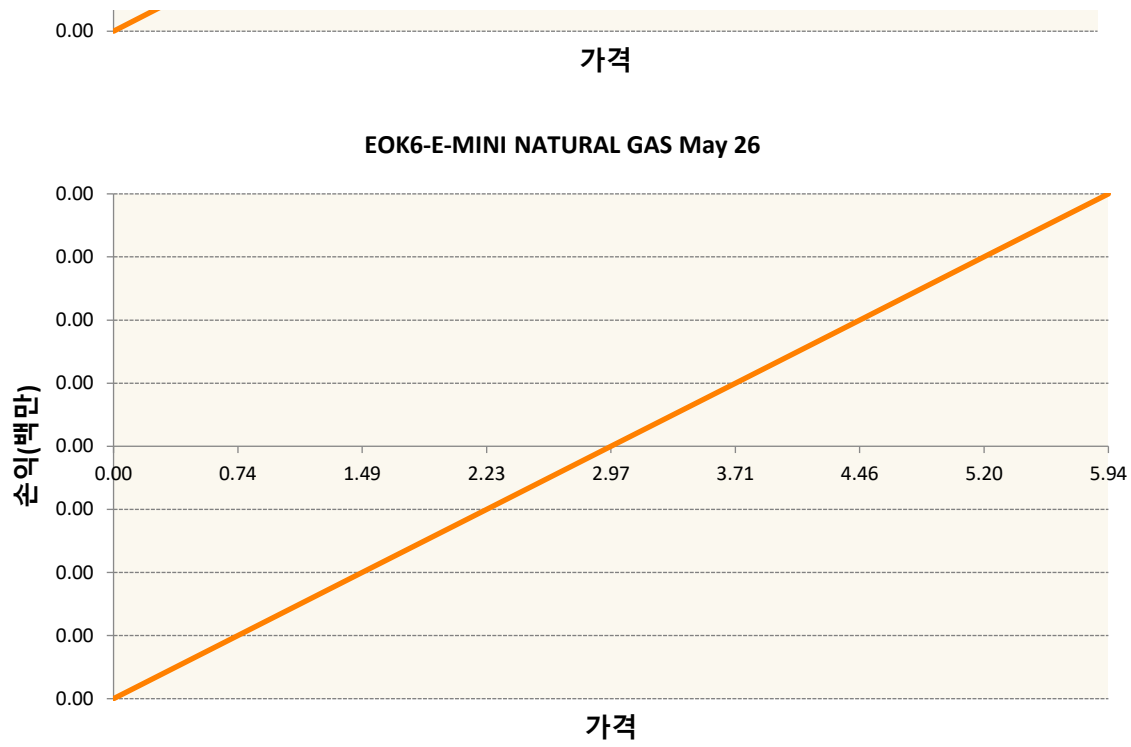
1. 계약금액

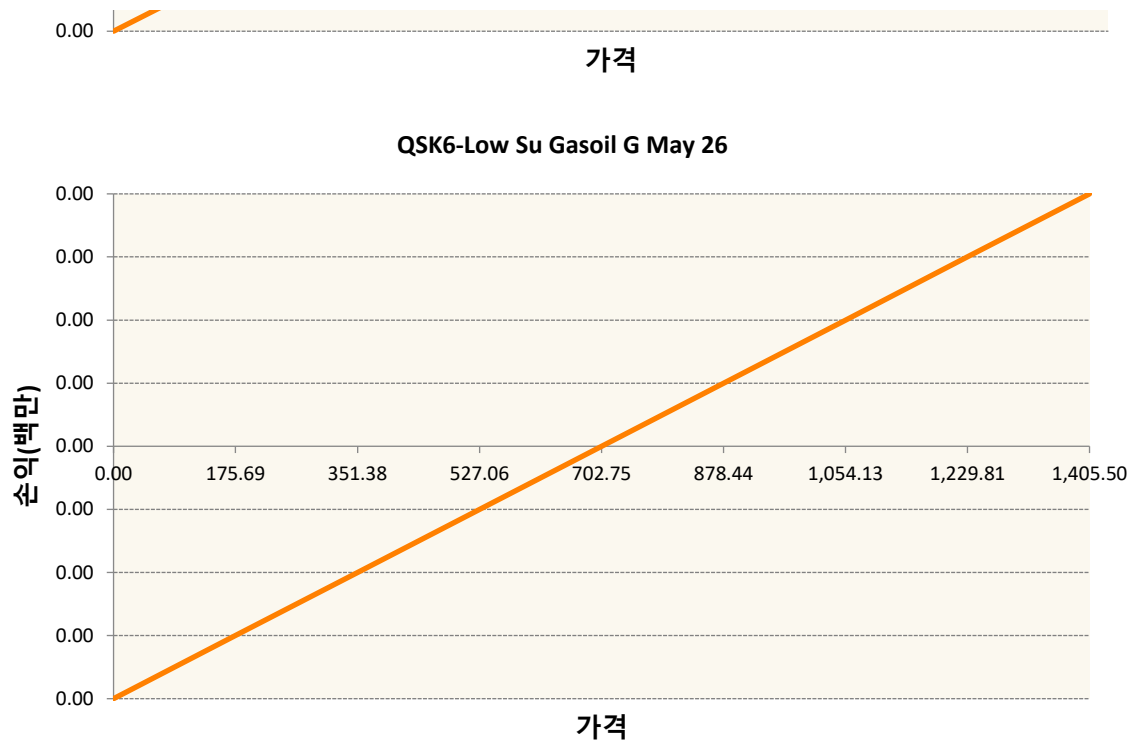
(단위:백만원)

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	188	0	188	
누계	유가증권	선물	338	0	338	
누계	통화	선물	0	101	-101	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
CLK6	WTI CRUDE FUTURE May26		8
COK6	BRENT CRUDE FUTR May26		17
EOK6	E-MINI NATURAL GAS May 26		3
KR4A756300	2026-03 달러선물		8
NGK26	NATURAL GAS FUTR May 26		7
QSK6	Low Su Gasoil G May 26		8

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