

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

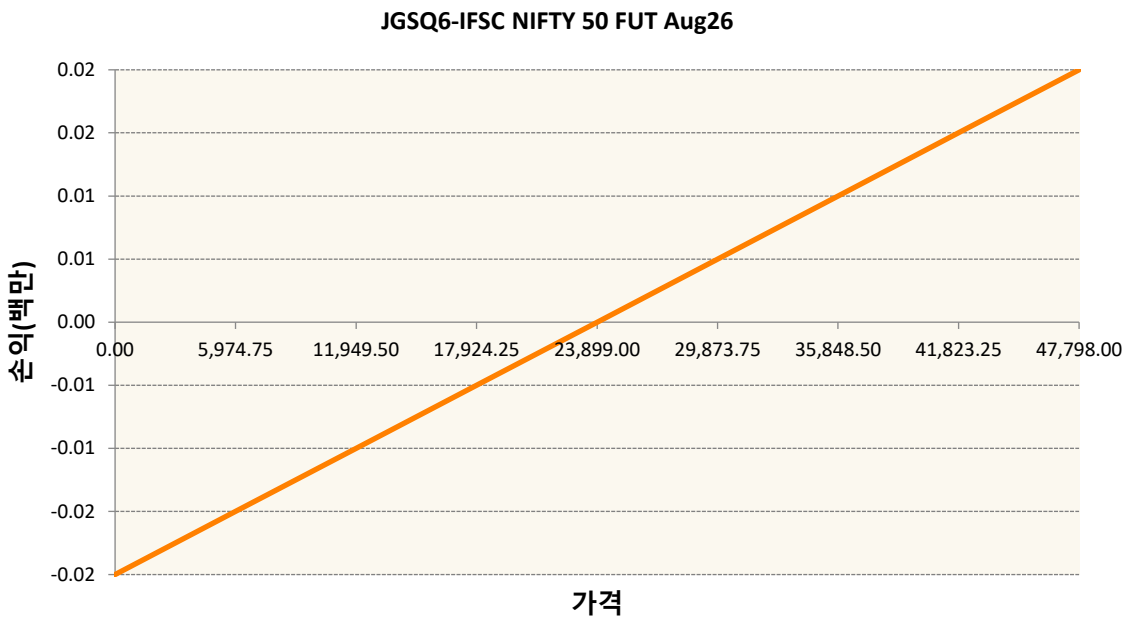
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	350	0	350	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSQ6 IFSC NIFTY 50 FUT Aug26

28

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

(단위:백만원)

20

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

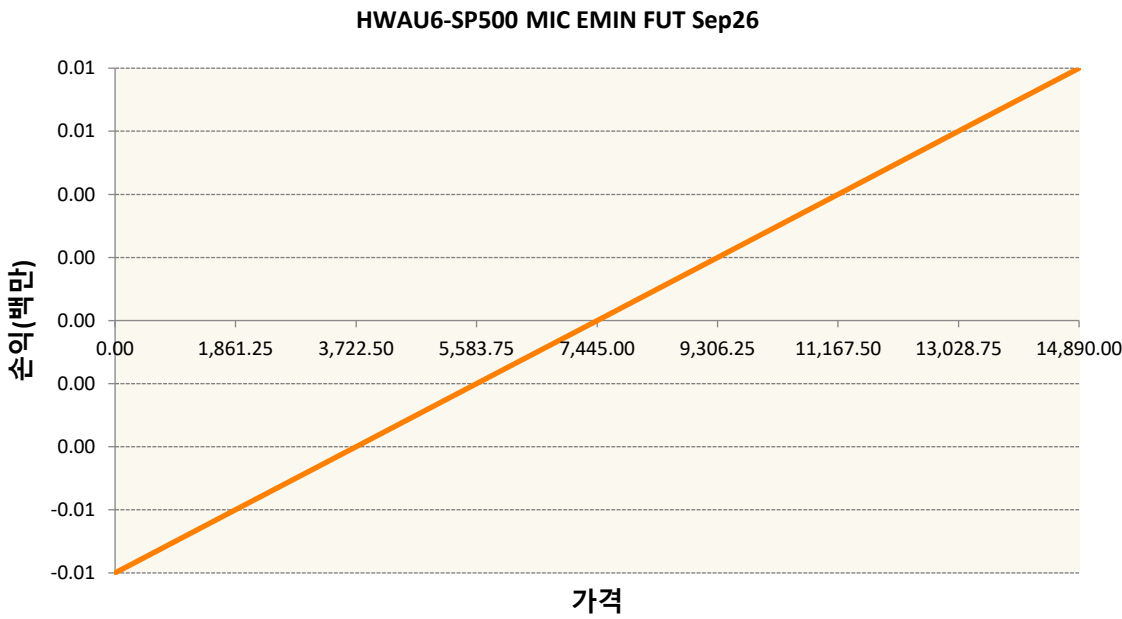
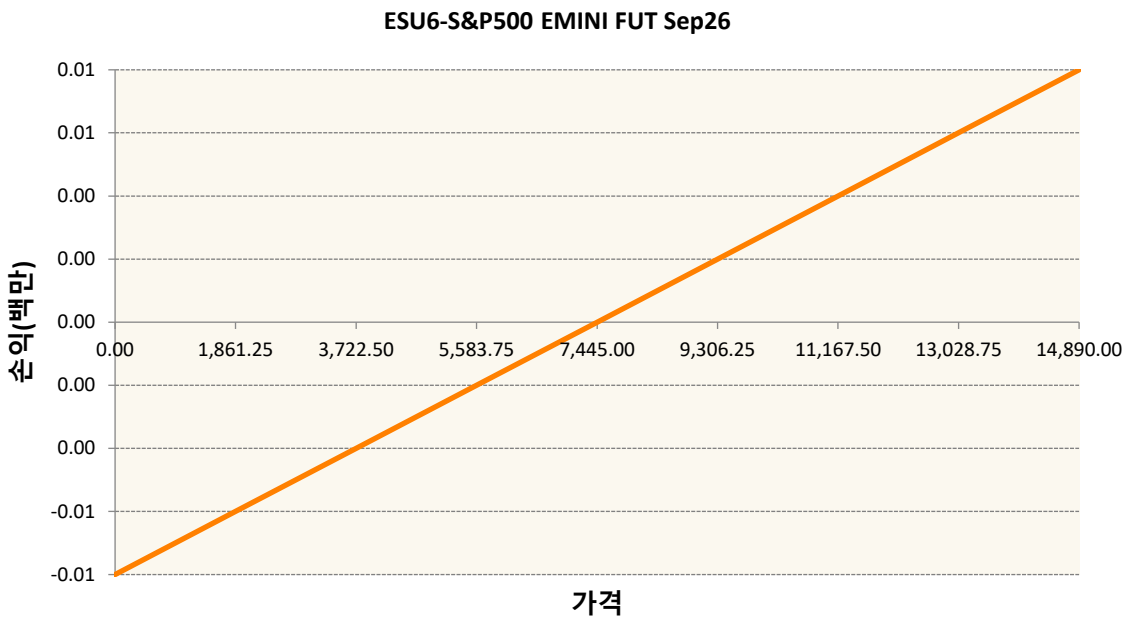
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	569	0	569	
누계	지수	선물	57	0	57	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	46
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	43

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

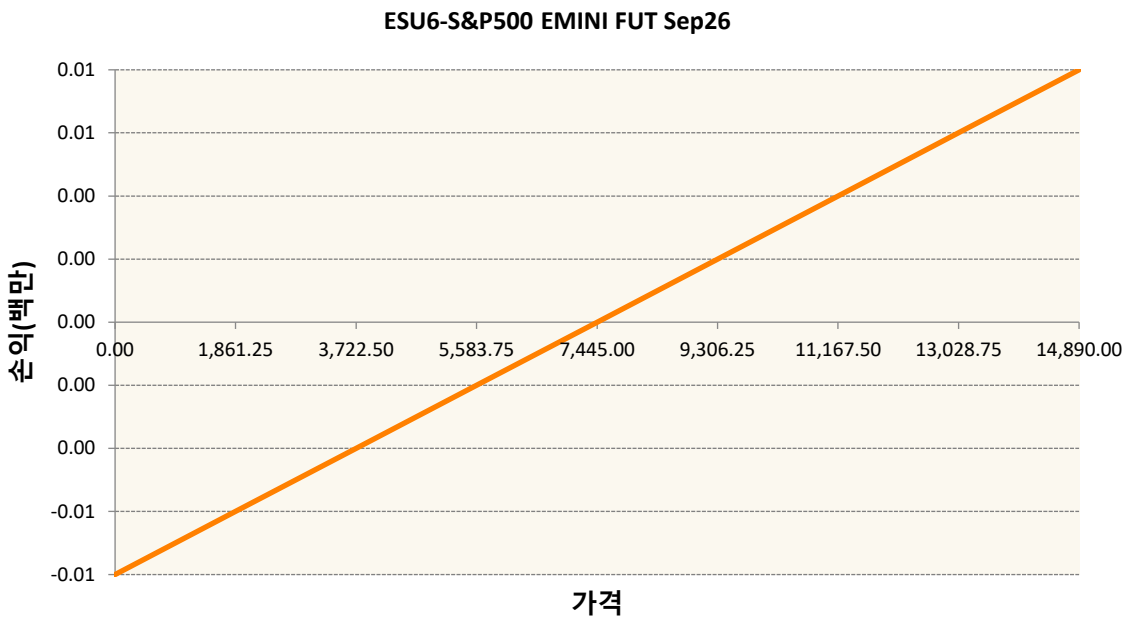
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	563	0	563	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	45
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

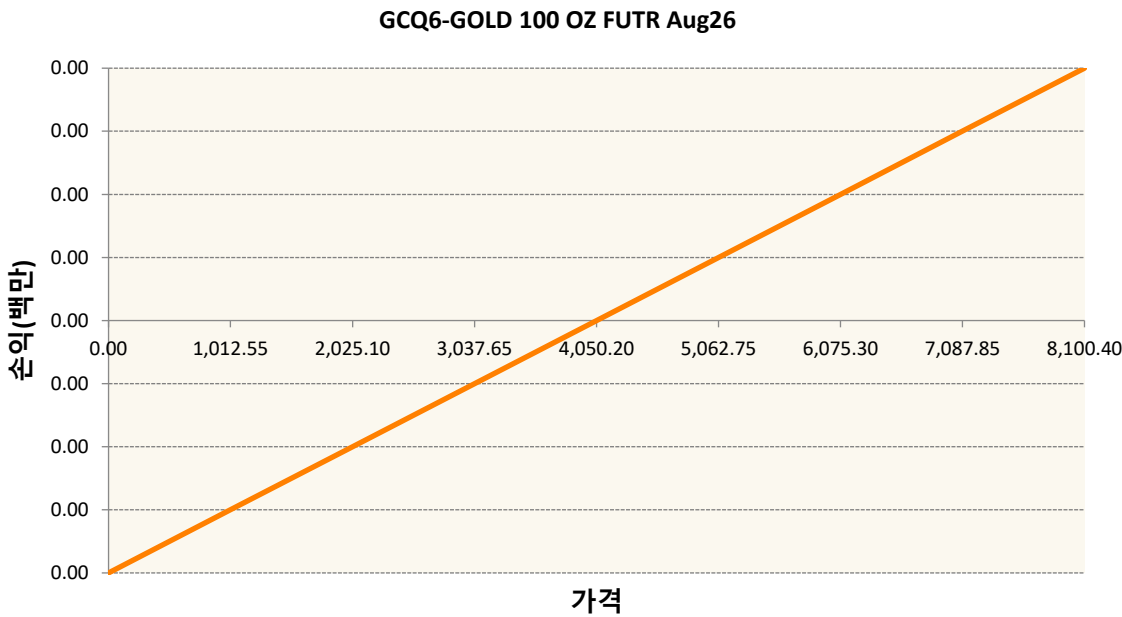
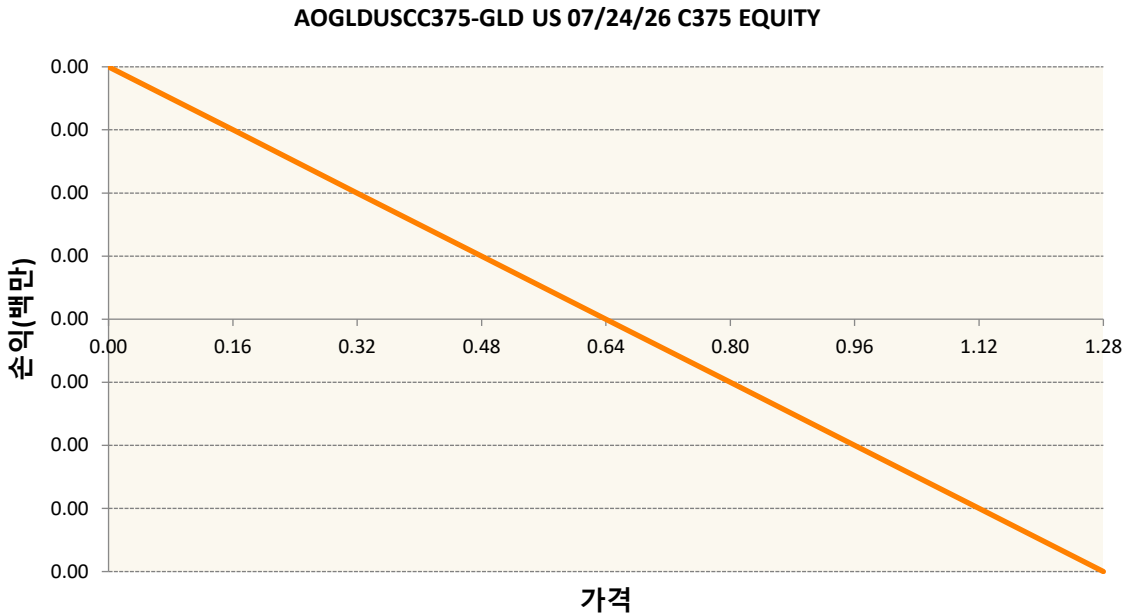
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,878	0	4,878	
누계	실물자산	옵션	0	138	-138	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSCC GLD US 07/24/26 C375 EQUITY		11
GCQ6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26		390

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	526

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

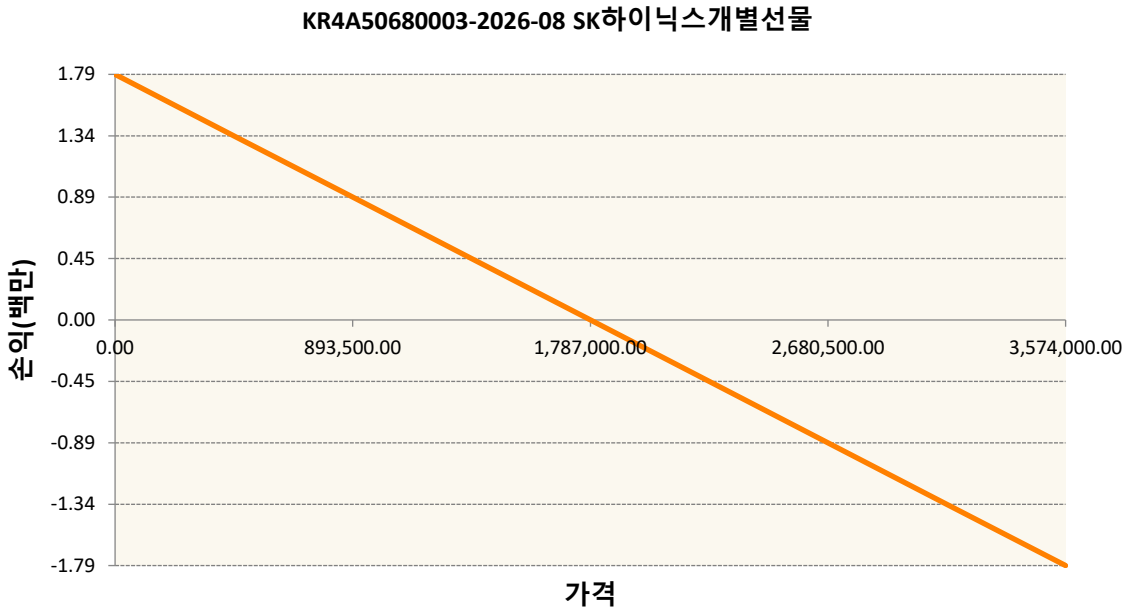
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	1,966	-1,966	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUAC PLTR US 07/24/26 C140 EQUITY	75
AOPLTRUAP PLTR US 07/24/26 P140 EQUITY	2
AOPLTRUC0 PLTR US 07/24/26 C135 EQUITY	0.07
KR4A506800 2026-08 SK하이닉스개별선물	157

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

(단위:백만원)

236

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

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 07/24/26 C84.5 EQUITY

10

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

(단위:백만원)

5

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

(단위:백만원)

15,590

공시일 2026-07-27

기준일 2026-07-24

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	2026-07-27
기준일	2026-07-24

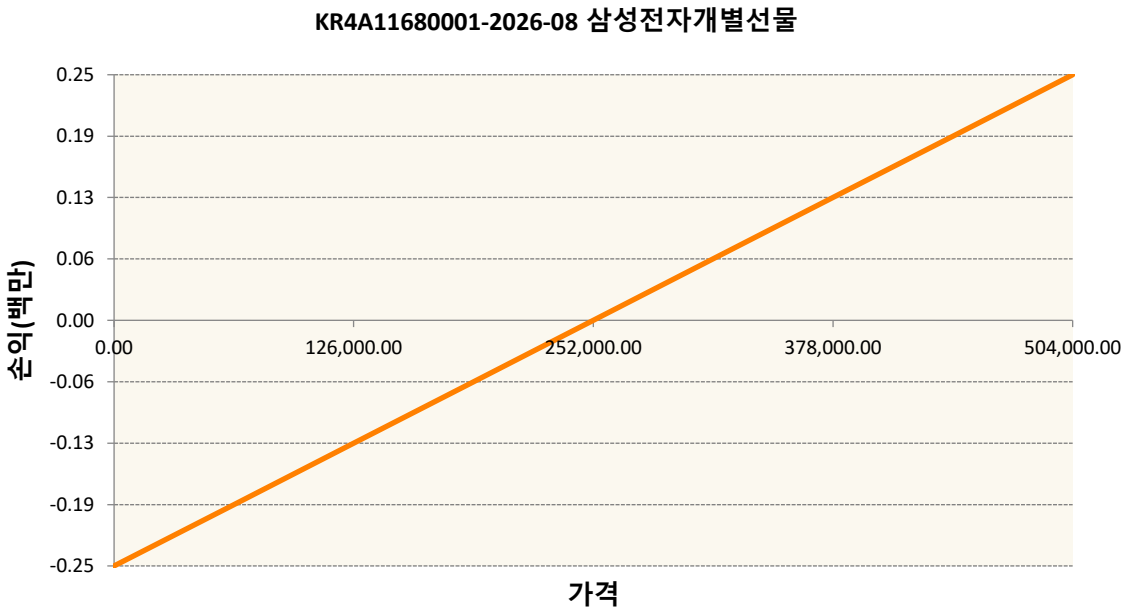
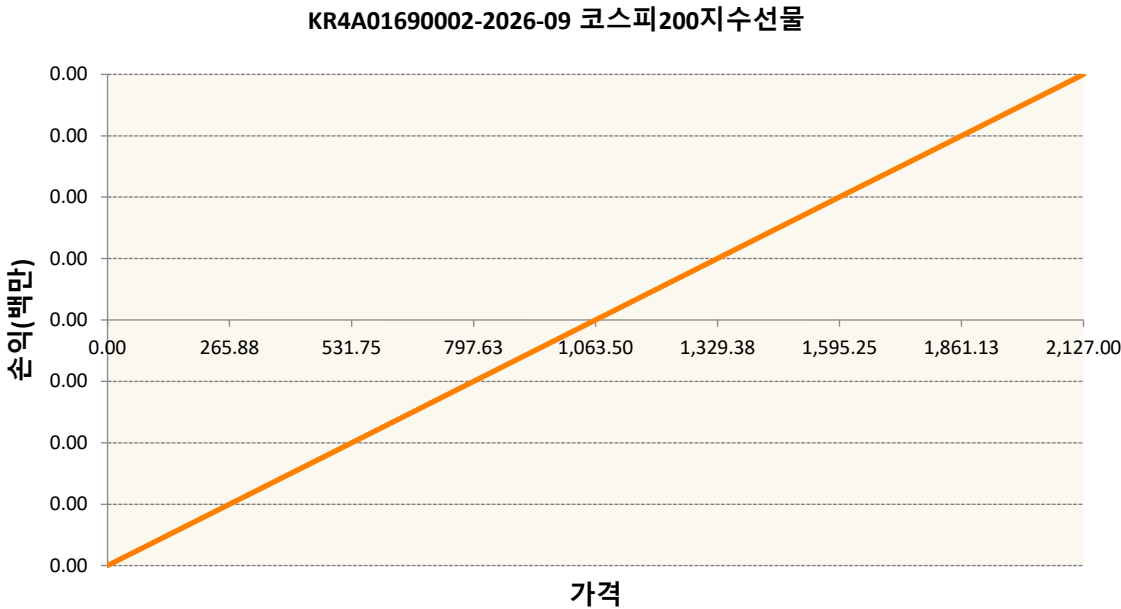
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	20,521	44,294	-23,773	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 2,255.00. The y-axis represents Net Income, ranging from 0.00 to 0.00. A solid orange line shows the relationship, starting at (0, 0.00) and ending at (2,255.00, 0.00).

가격	순이익(백만)
0.00	0.00
281.88	0.00
563.75	0.00
845.63	0.00
1,127.50	0.00
1,409.38	0.00
1,691.25	0.00
1,973.13	0.00
2,255.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the profit/loss (손익). The x-axis represents the price in millions of KRW, ranging from 0.00 to 2,260.00. The y-axis represents the profit/loss in millions of KRW, ranging from -1,000.00 to 1,000.00. The blue line shows that as the price increases, the profit/loss decreases linearly, starting at 0.00 when the price is 0.00 and reaching -1,000.00 when the price is 2,260.00.

가액 (Price)	손익 (Profit/Loss)
0.00	0.00
282.50	-200.00
565.00	-400.00
847.50	-600.00
1,130.00	-800.00
1,412.50	-1,000.00
1,695.00	-1,200.00
1,977.50	-1,400.00
2,260.00	-1,600.00

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					549
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-549	-549	-549	-549	-549	-549	-549
-5.33%	-366	-366	-366	-366	-366	-366	-366
-2.67%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	183	183	183	183	183	183	183
5.33%	366	366	366	366	366	366	366
8.00%	549	549	549	549	549	549	549
KR4A11680001		2026-08 삼성전자개별선물					1,078
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078
-5.33%	-719	-719	-719	-719	-719	-719	-719
-2.67%	-359	-359	-359	-359	-359	-359	-359
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	359	359	359	359	359	359	359
5.33%	719	719	719	719	719	719	719
8.00%	1,078	1,078	1,078	1,078	1,078	1,078	1,078
KR4BAFBPA525 코스피위클리M C 2607W4 1,127.5							1,984

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,984	1,984	1,984	1,984	1,984	1,984	1,984
-5.33%	1,323	1,323	1,323	1,323	1,323	1,323	1,323
-2.67%	661	661	661	661	661	661	661
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-661	-661	-661	-661	-661	-661	-661
5.33%	-1,323	-1,323	-1,323	-1,323	-1,323	-1,323	-1,323
8.00%	-1,984	-1,984	-1,984	-1,984	-1,984	-1,984	-1,984

KR4BAFBPA533 코스피위클리M C 2607W4 1,130.0							1,330
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330	1,330
-5.33%	887	887	887	887	887	887	887
-2.67%	443	443	443	443	443	443	443
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-443	-443	-443	-443	-443	-443	-443
5.33%	-887	-887	-887	-887	-887	-887	-887
8.00%	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330	-1,330

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

(단위:백만원)

15,224

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

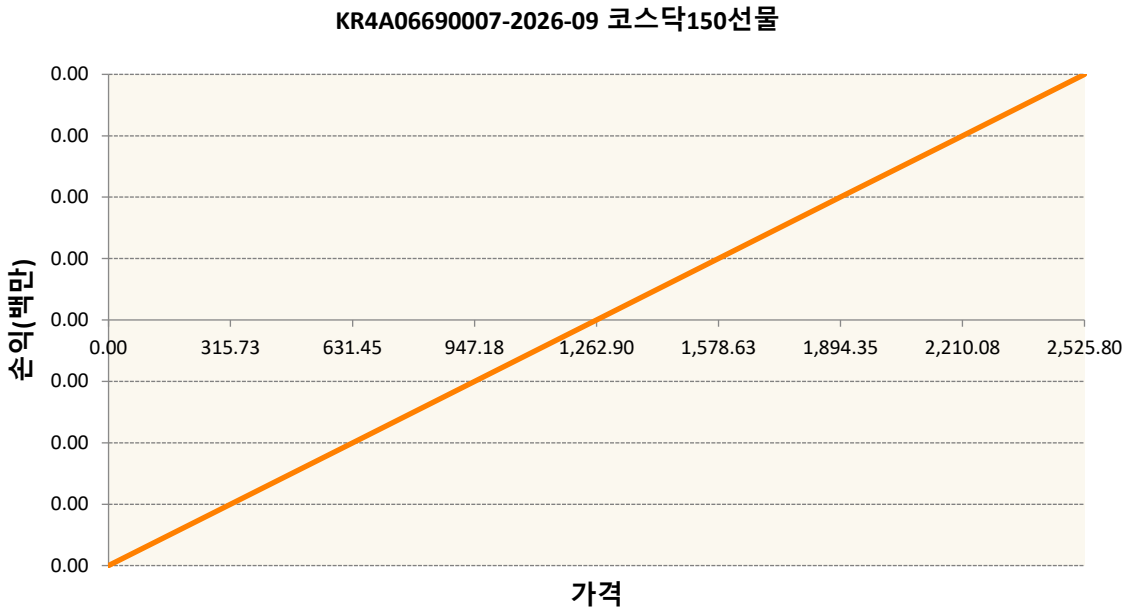
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	732	0	732	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007		2026-09 코스닥150선물					59
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-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%	39	39	39	39	39	39	39
8.00%	59	59	59	59	59	59	59

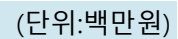
4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

170

SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

(단위:백만원)

KR4A50680003-2026-08 SK하이닉스개별선물[illegible]

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

(단위:백만원)

18,419

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

(단위:백만원)

163,699

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

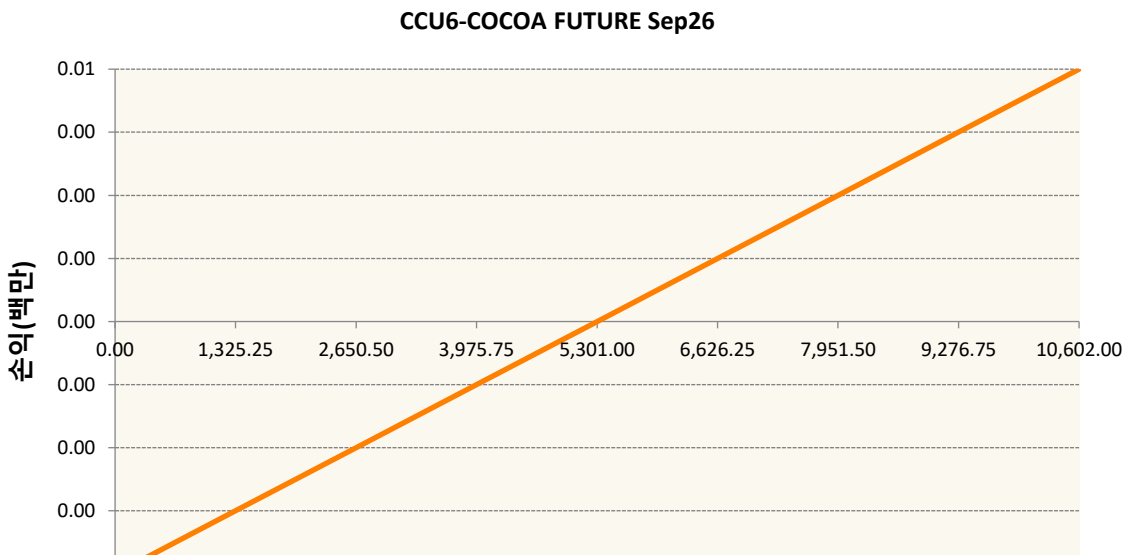
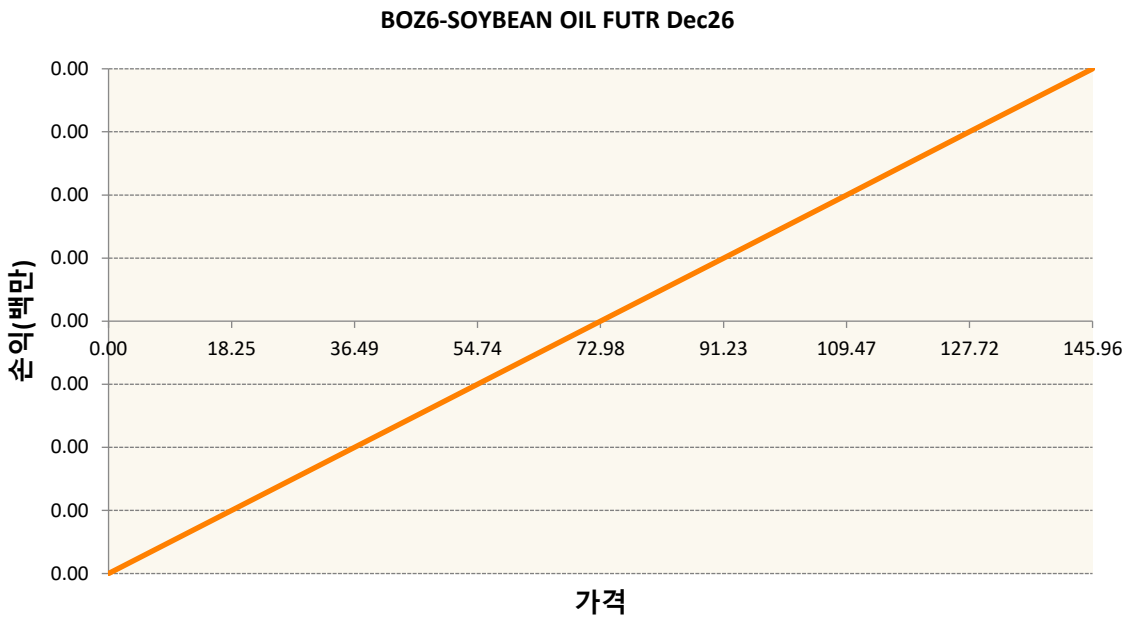
포커스농산물모(채권-파생형)

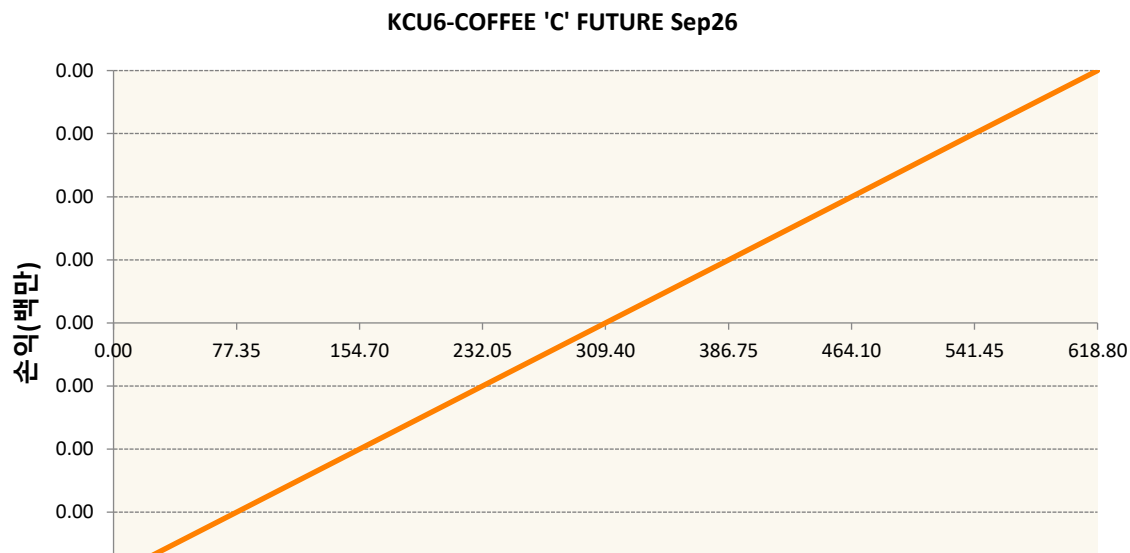
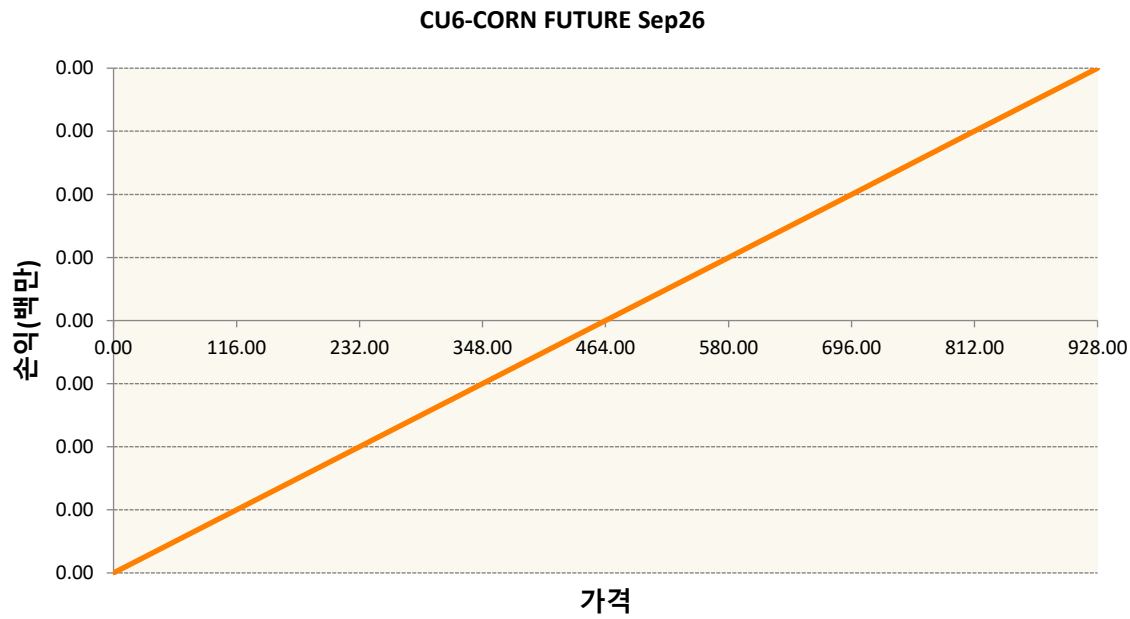
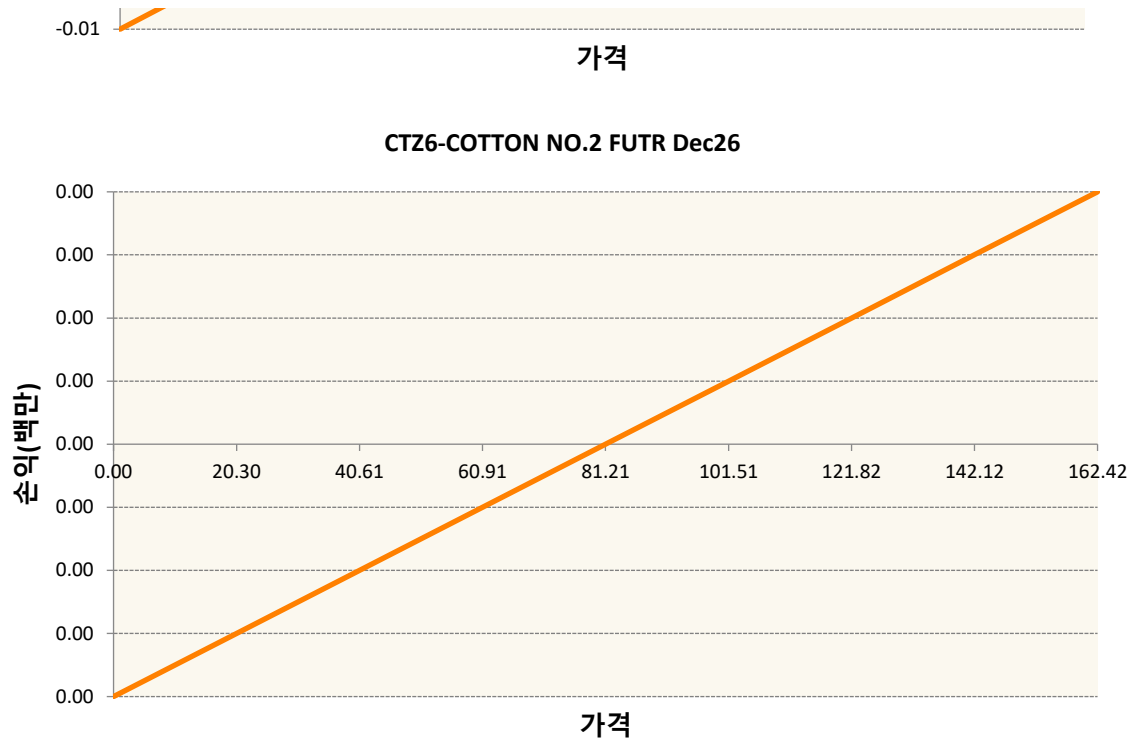
1. 계약금액

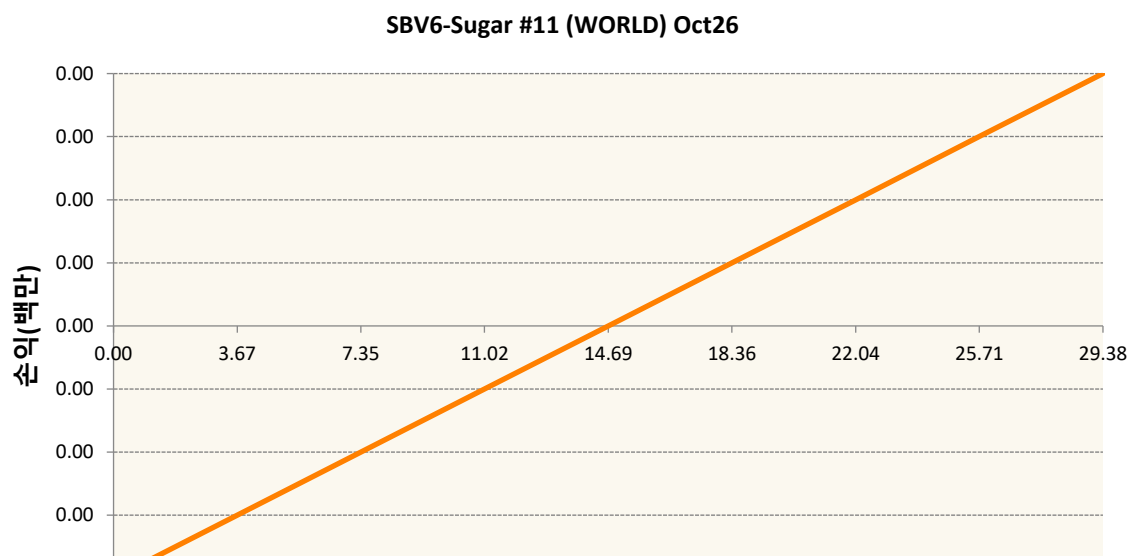
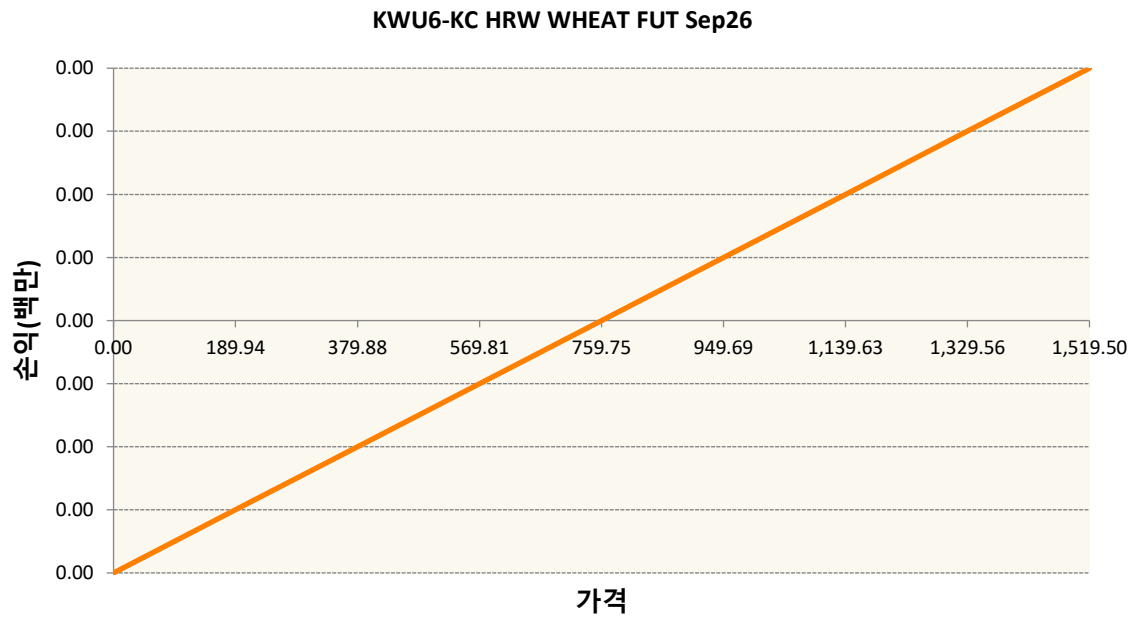
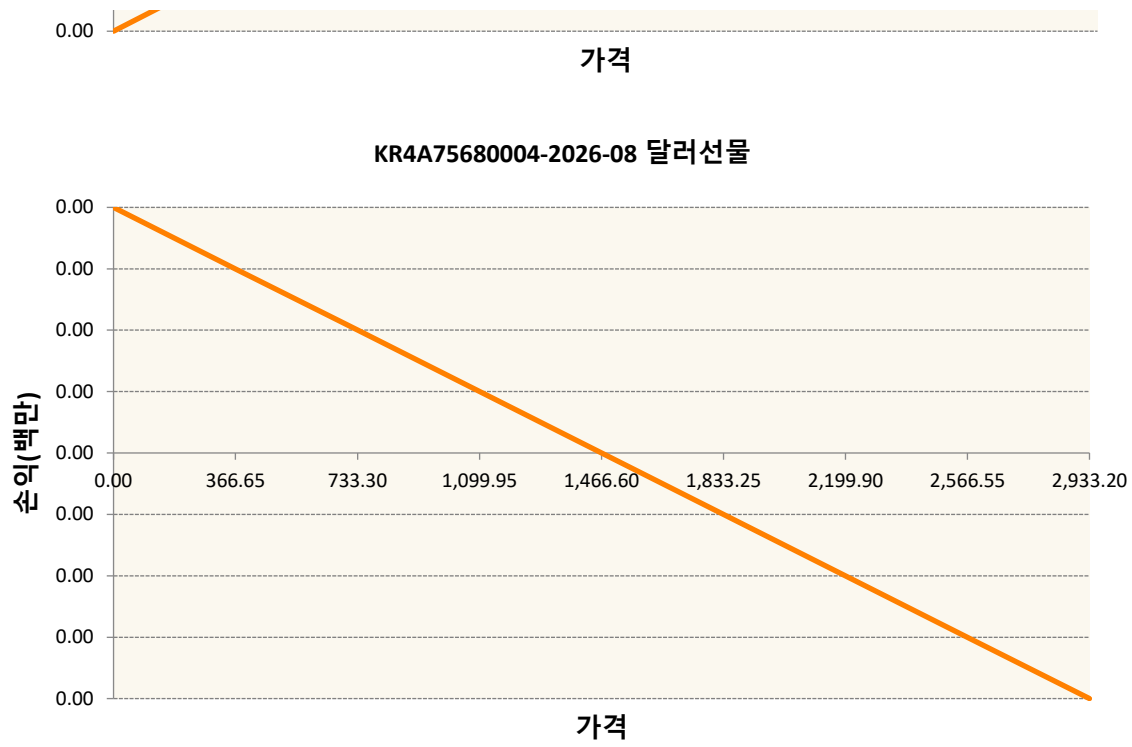
(단위:USD 백만)

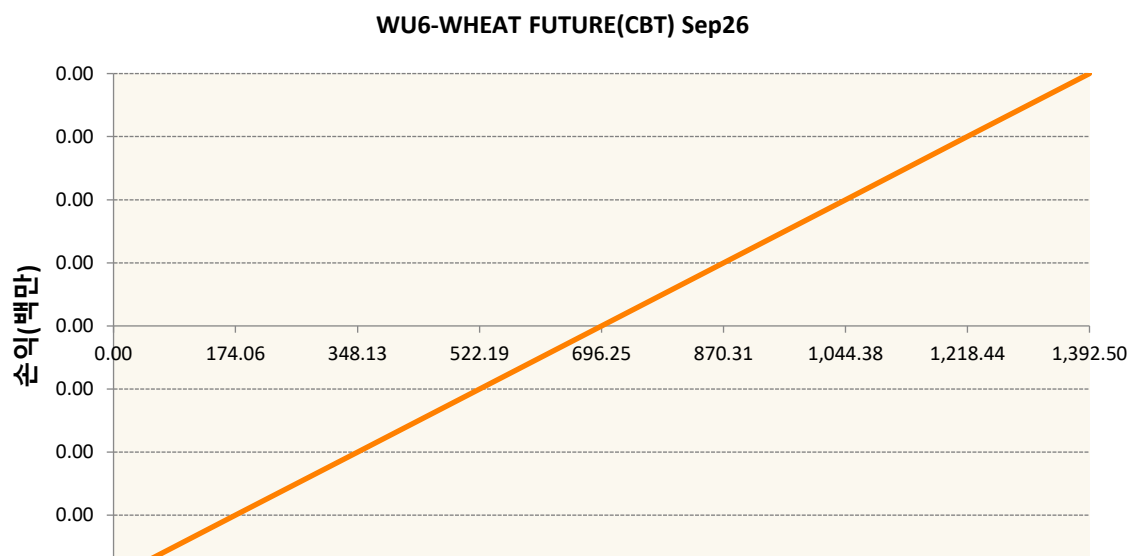
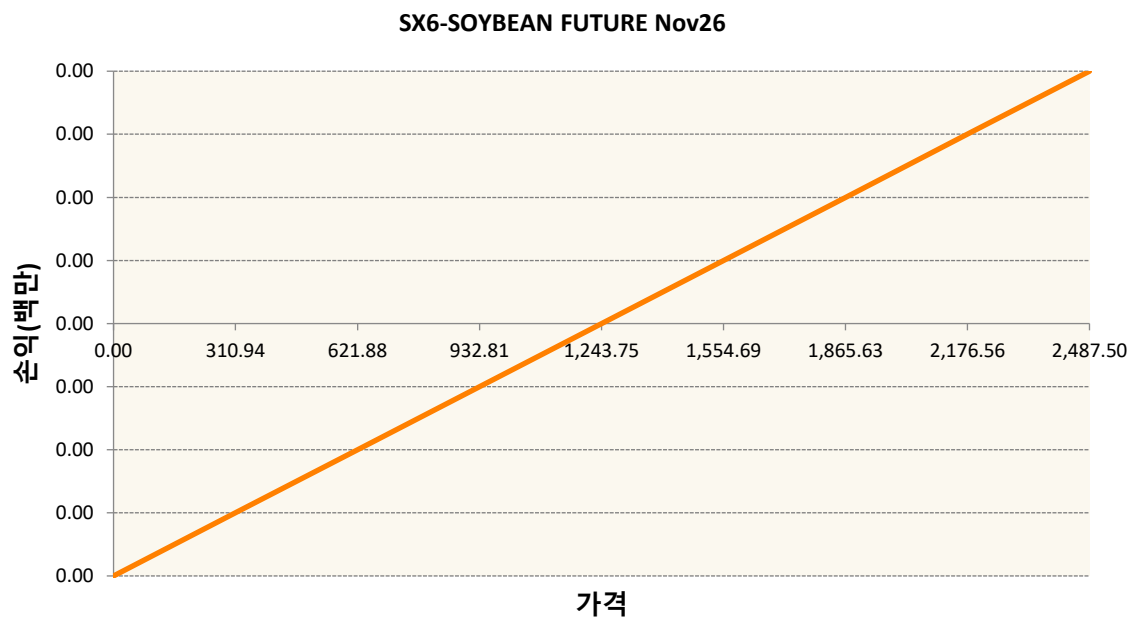
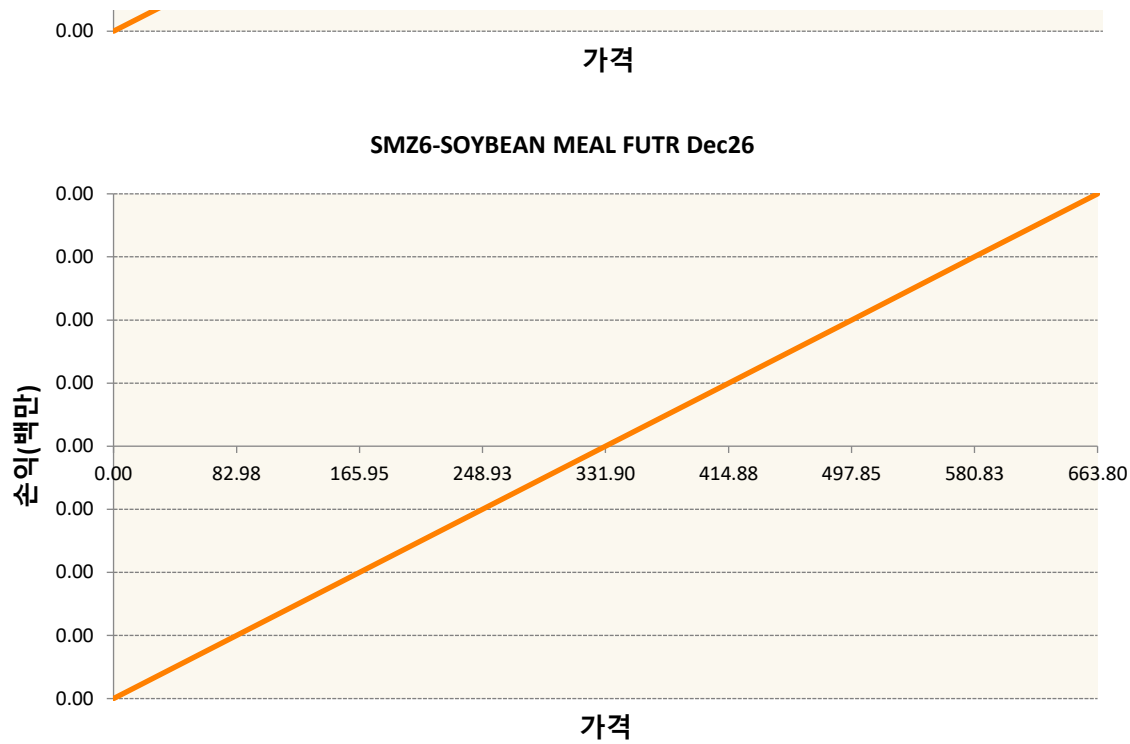
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	480	0	480	
누계	유가증권	선물	2,338	0	2,338	
누계	통화	선물	0	396	-396	장내

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	2026-07-27
기준일	2026-07-24

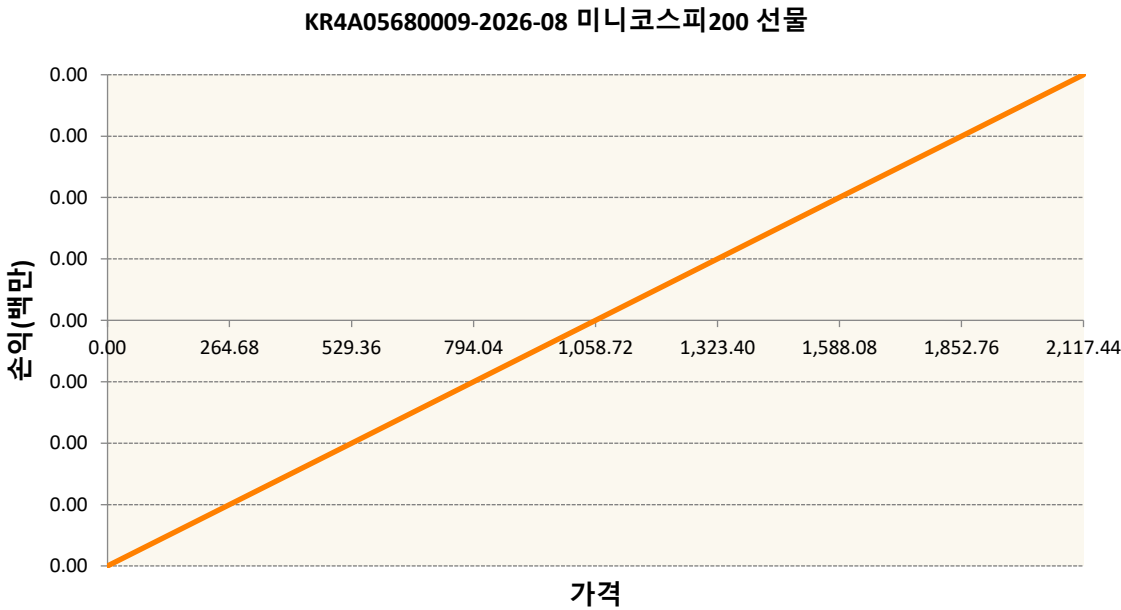
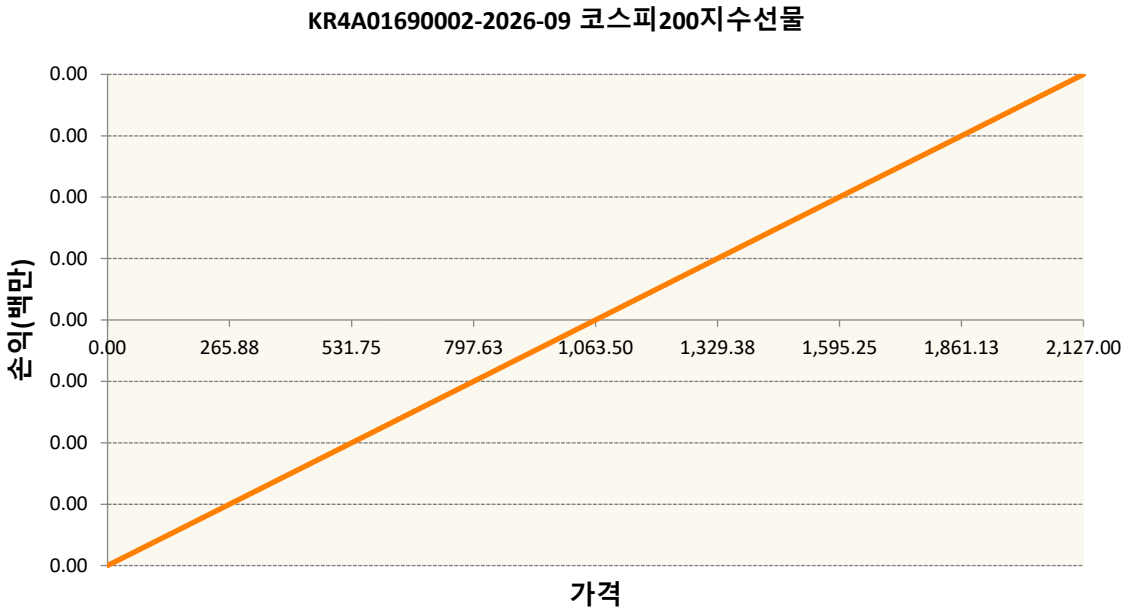
스마트인덱스모

1. 계약금액

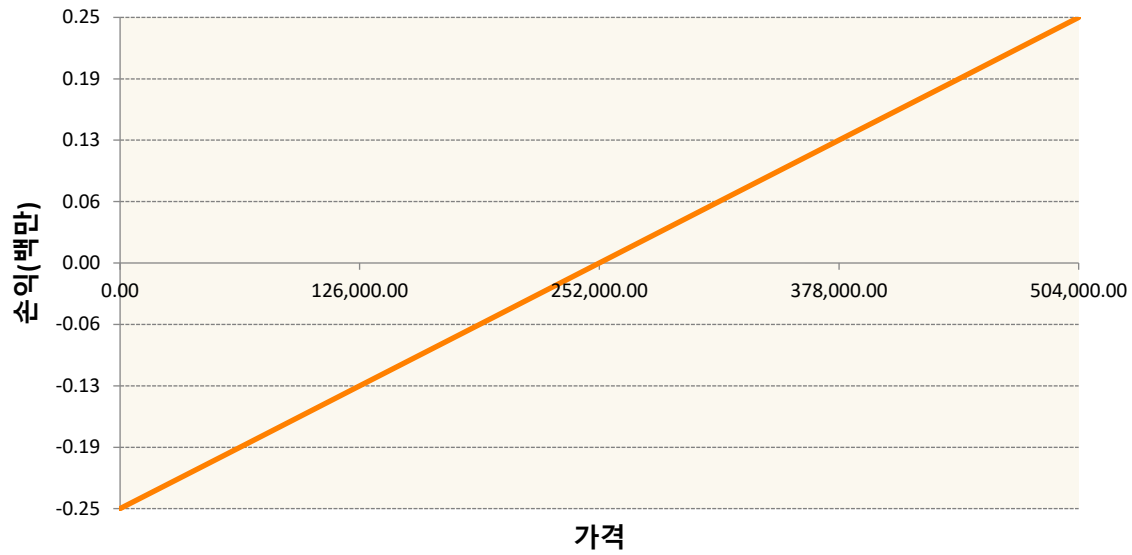
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,331	630	701	장내
누계	유가증권	선물	3,881	92	3,790	장내

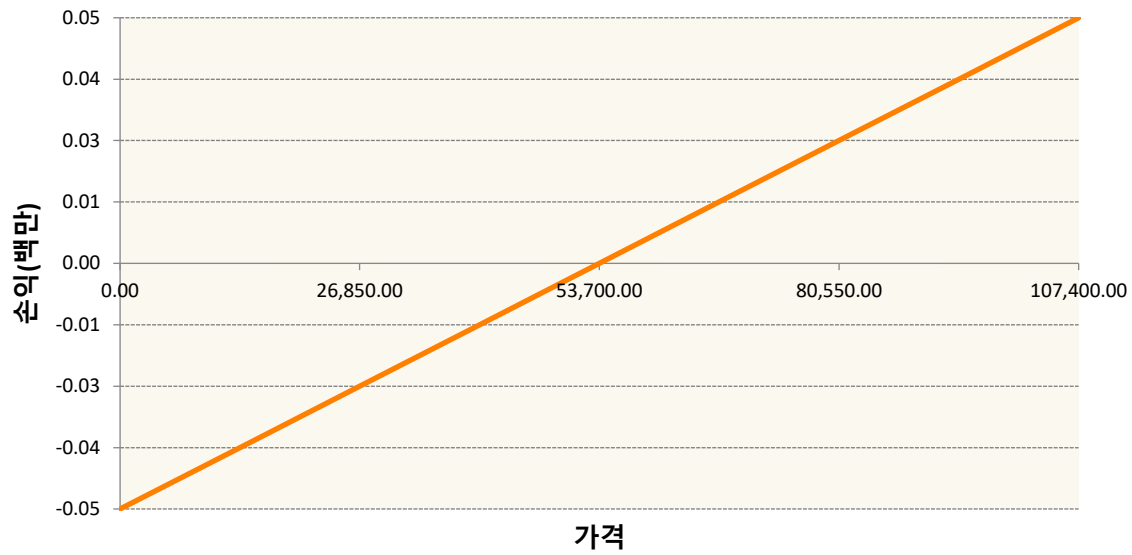
2. 만기시점의 손익구조



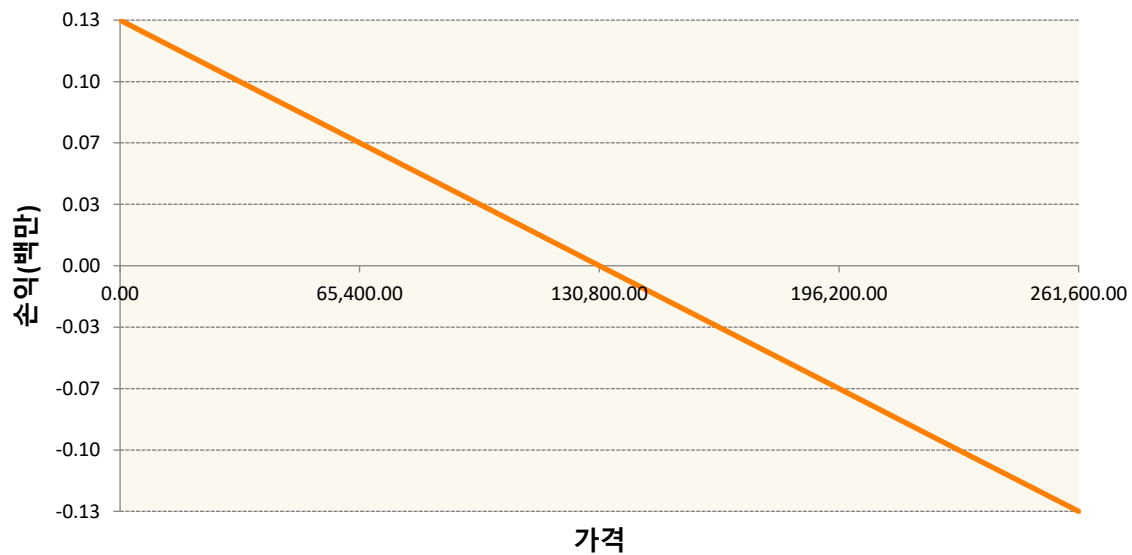
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



KR4A19680003-2026-08 기아개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					232
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-232	-232	-232	-232	-232	-232	-232
-5.33%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
-2.67%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	77	77	77	77	77	77	77
5.33%	155	155	155	155	155	155	155
8.00%	232	232	232	232	232	232	232
KR4A05680009		2026-08 미니코스피200 선물					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%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-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%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	13	13	13	13	13	13	13
KR4A11680001		2026-08 삼성전자개별선물					8
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	8	8	8	8	8	8	8
KR4A14680008		2026-08 KT개별선물					5
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5
KR4A19680003		2026-08 기아개별선물					7
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

768

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

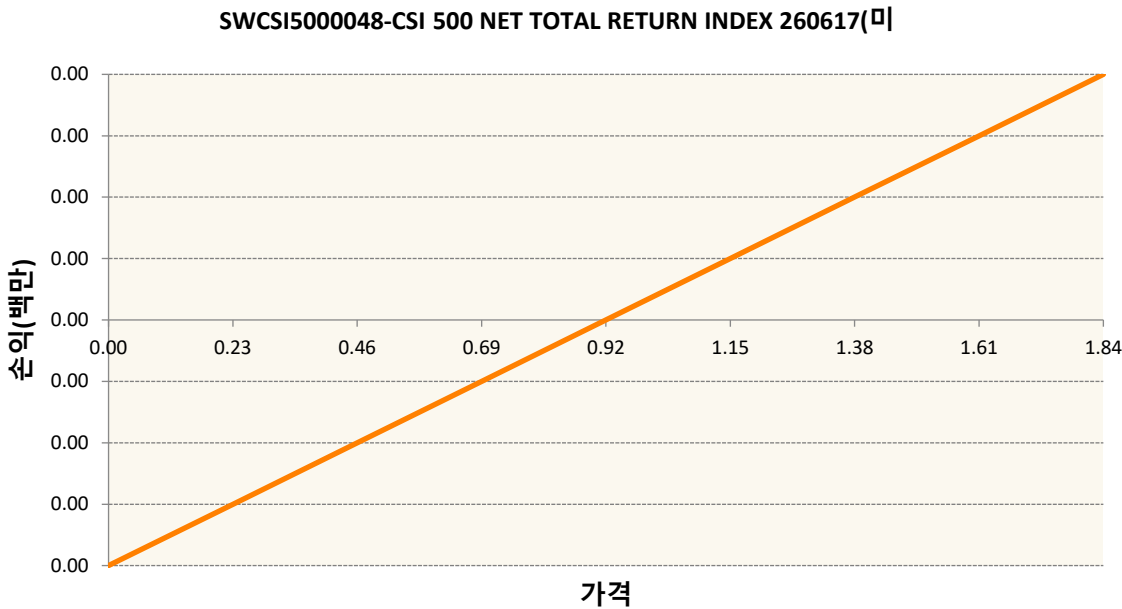
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,333	0	5,333	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

429

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

649

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

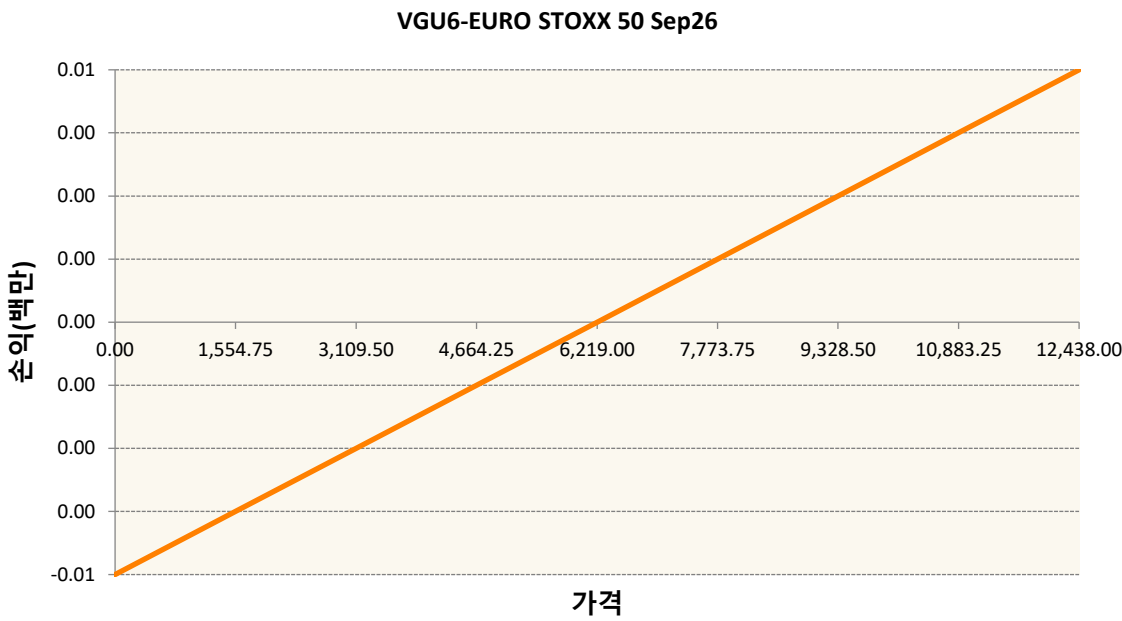
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	984	0	984	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	79
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

70

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

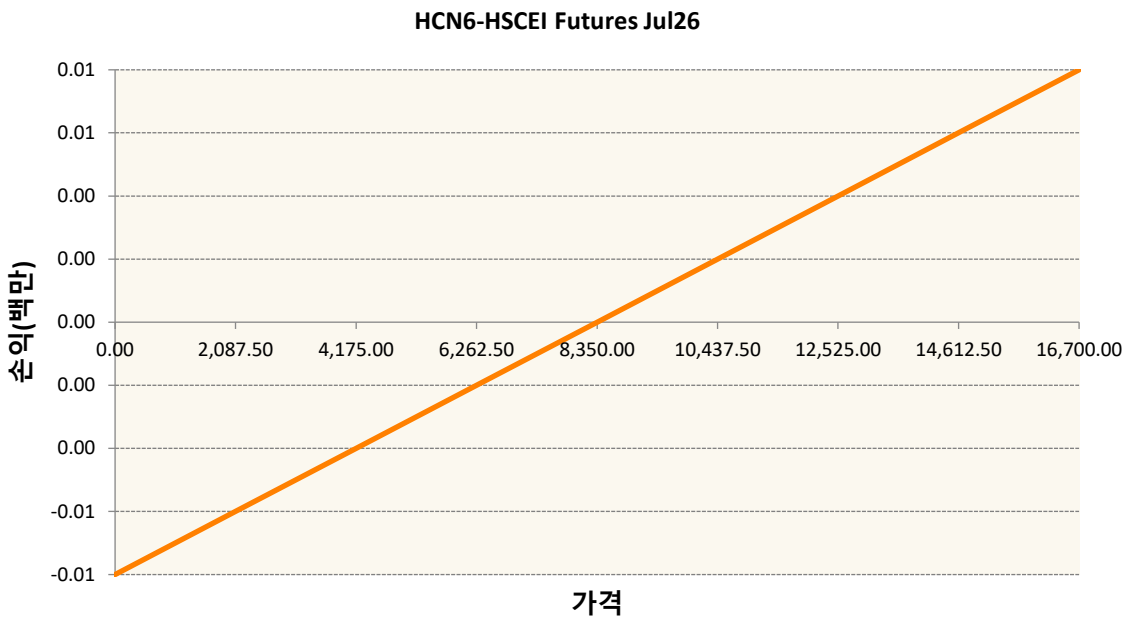
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,378	0	1,378	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN6	HSCEI Futures Jul26	110
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

128

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

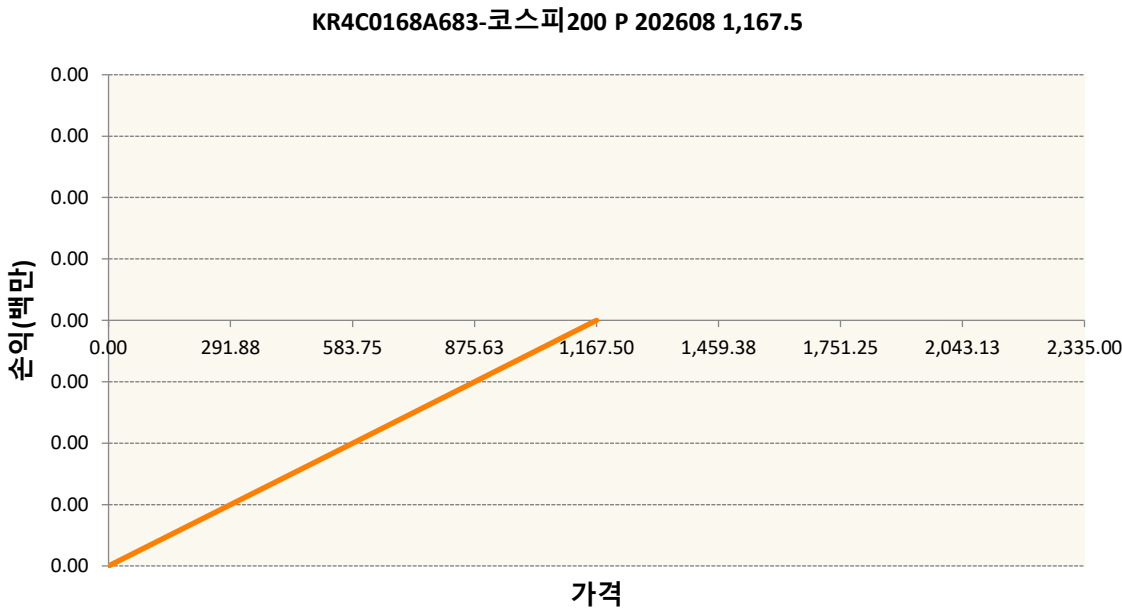
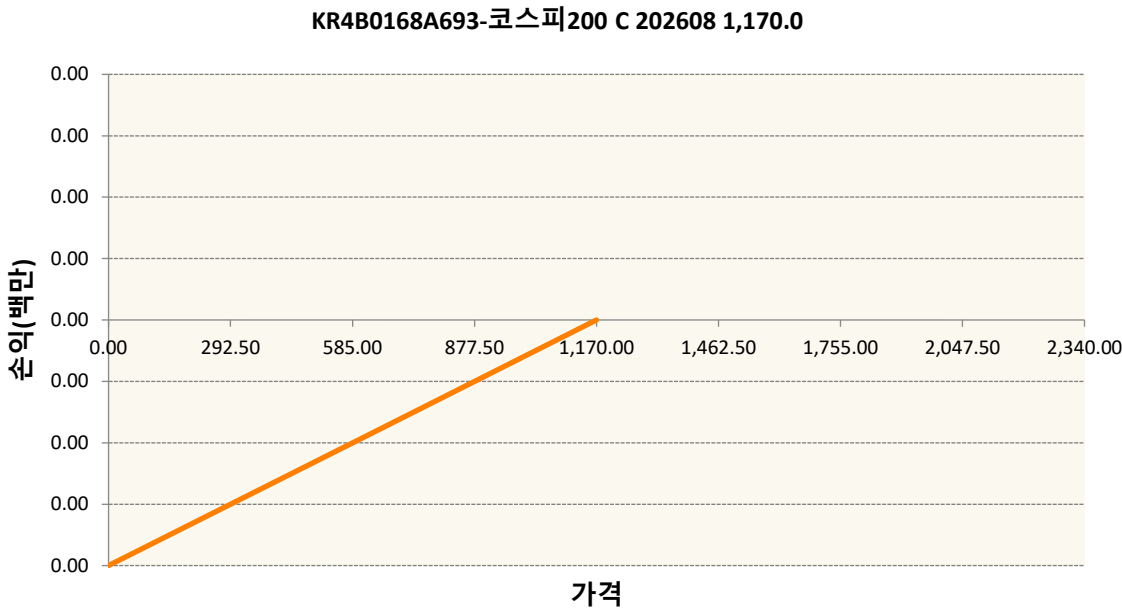
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

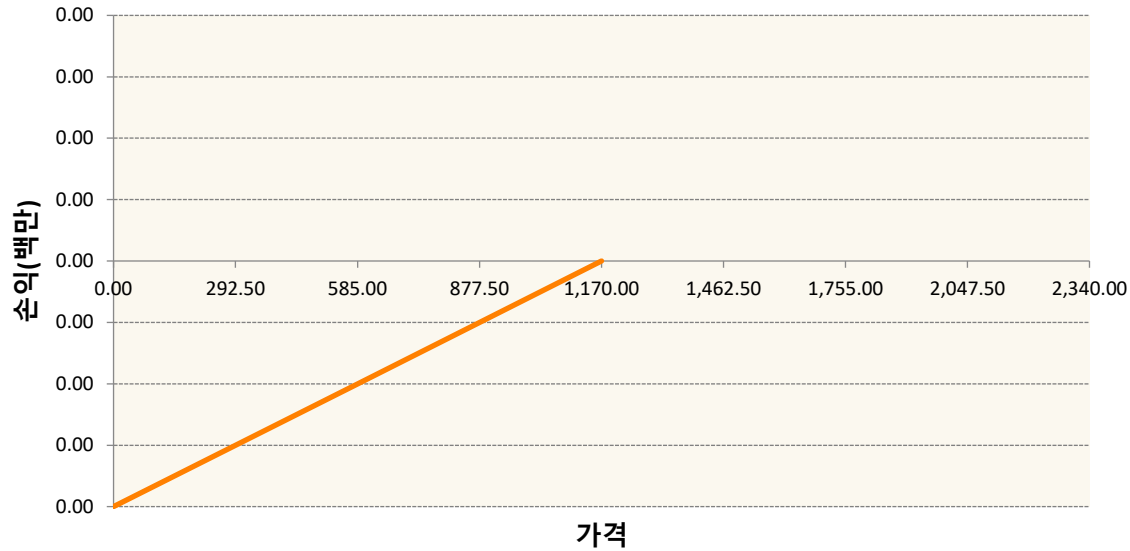
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	42,111	-42,111	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0168A691-코스피200 P 202608 1,170.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B0168A693			코스피200 C 202608 1,170.0				2,236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,486	-1,584	-1,695	-1,817	-1,949	-2,089	-2,236
-5.33%	-776	-897	-1,031	-1,174	-1,324	-1,482	-1,644
-2.67%	-104	-250	-405	-567	-736	-909	-1,086
0%	524	355	180	0	-184	-372	-561
2.67%	1,102	913	721	526	329	129	-71
5.33%	1,627	1,423	1,217	1,010	802	593	384
8.00%	2,097	1,882	1,667	1,452	1,237	1,021	806
KR4C0168A683			코스피200 P 202608 1,167.5				286
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-189	-202	-216	-232	-249	-267	-286
-5.33%	-98	-114	-131	-150	-169	-189	-210
-2.67%	-12	-31	-51	-72	-94	-116	-139
0%	68	46	23	0	-24	-48	-72
2.67%	141	117	92	67	42	16	-10
5.33%	208	182	155	129	102	75	48
8.00%	268	240	212	185	157	130	102
KR4C0168A691			코스피200 P 202608 1,170.0				229
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-152	-162	-174	-186	-200	-214	-229
-5.33%	-80	-92	-106	-120	-136	-152	-169
-2.67%	-11	-26	-41	-58	-75	-93	-111
0%	54	36	18	0	-19	-38	-58

2.67%	113	94	74	54	34	13	-7
5.33%	167	146	125	104	82	61	39
8.00%	215	193	171	149	127	105	83

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

(단위:백만원)

4,268

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

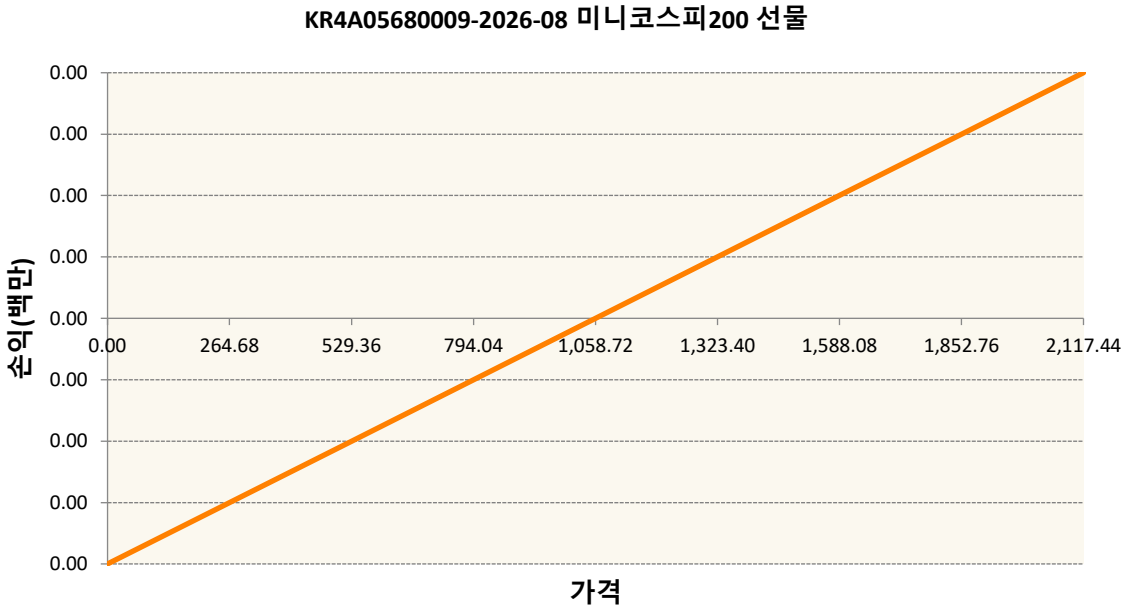
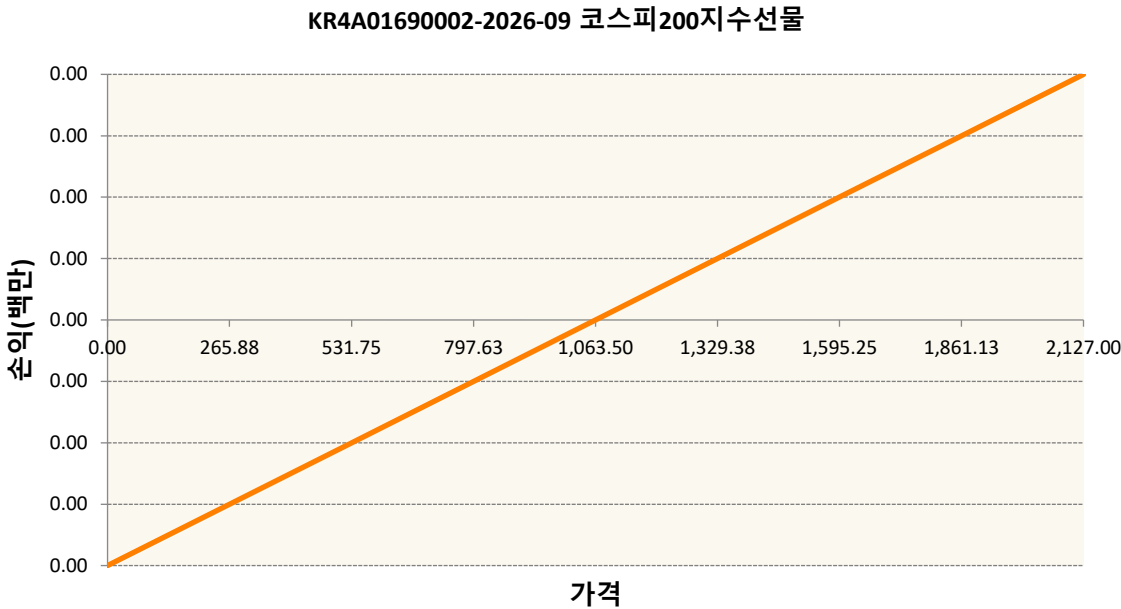
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

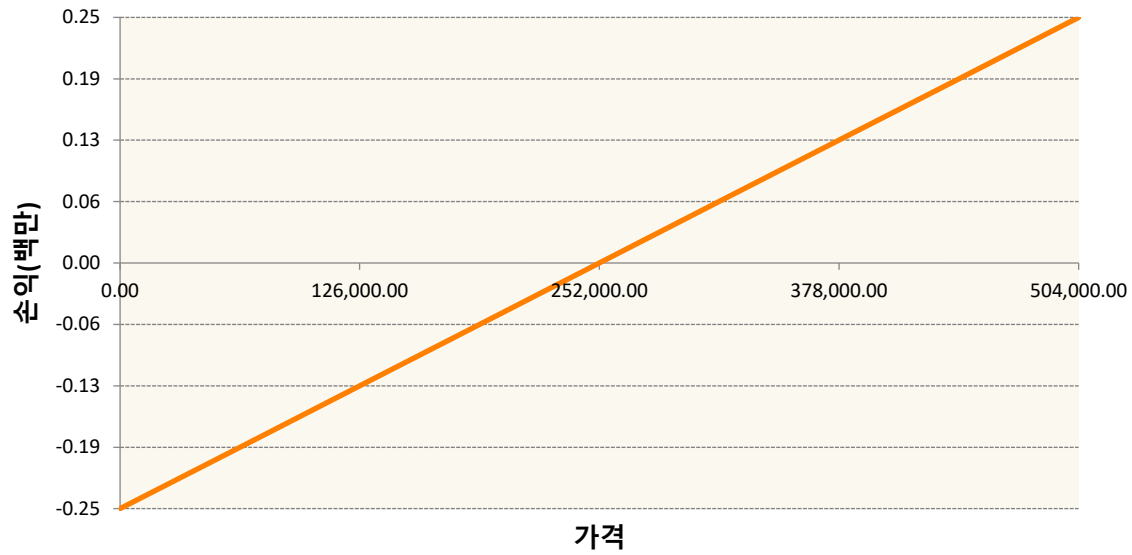
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	536	322	214	장내
누계	유가증권	선물	3,269	52	3,217	장내

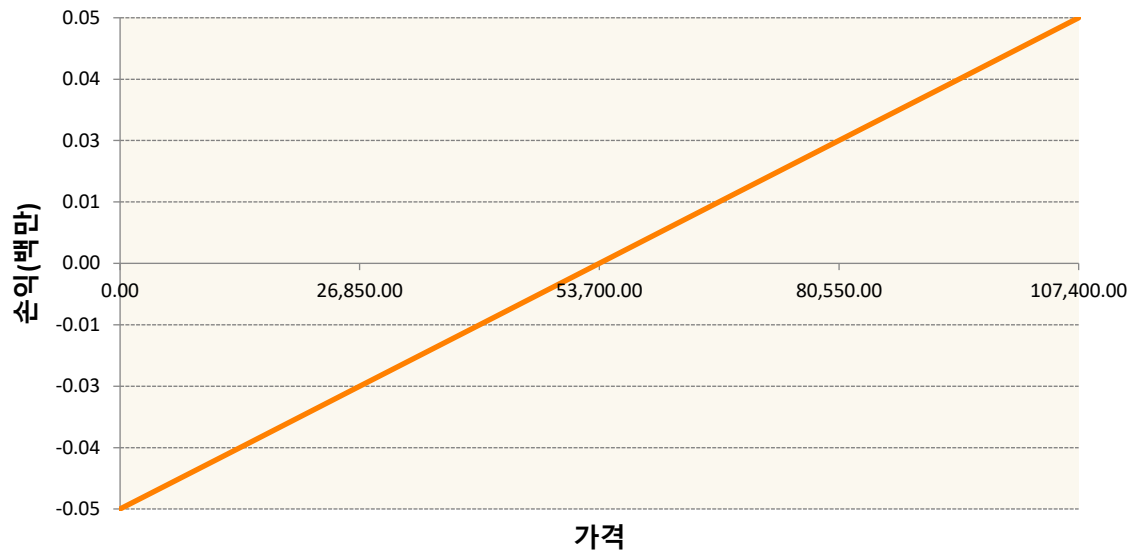
2. 만기시점의 손익구조



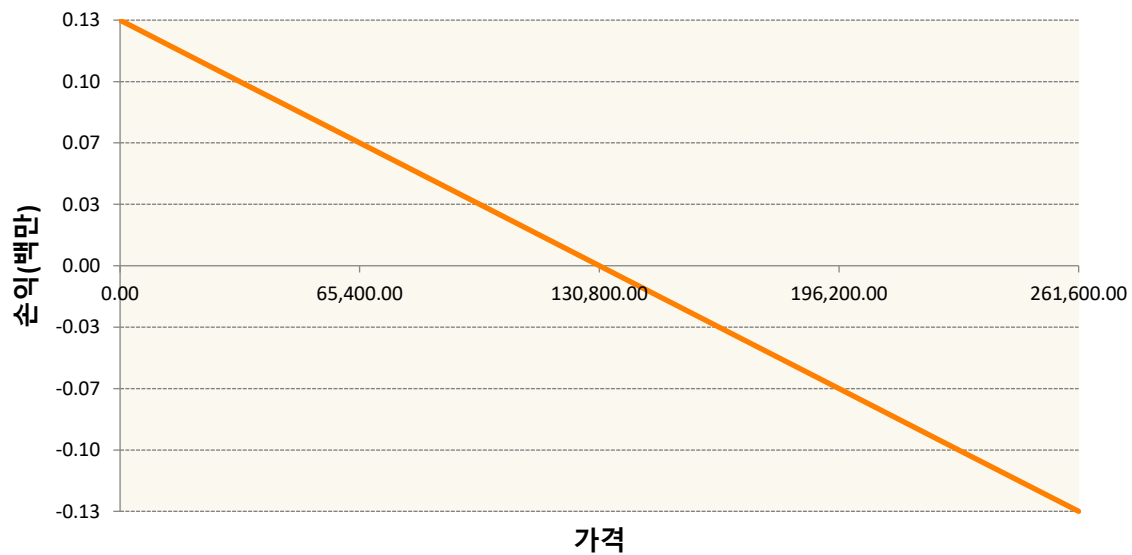
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



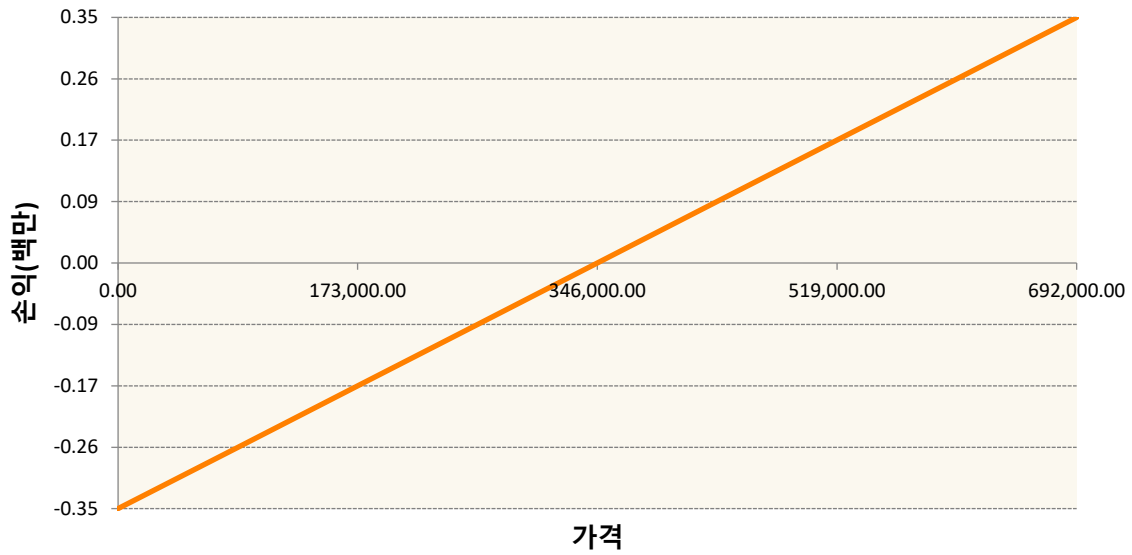
KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



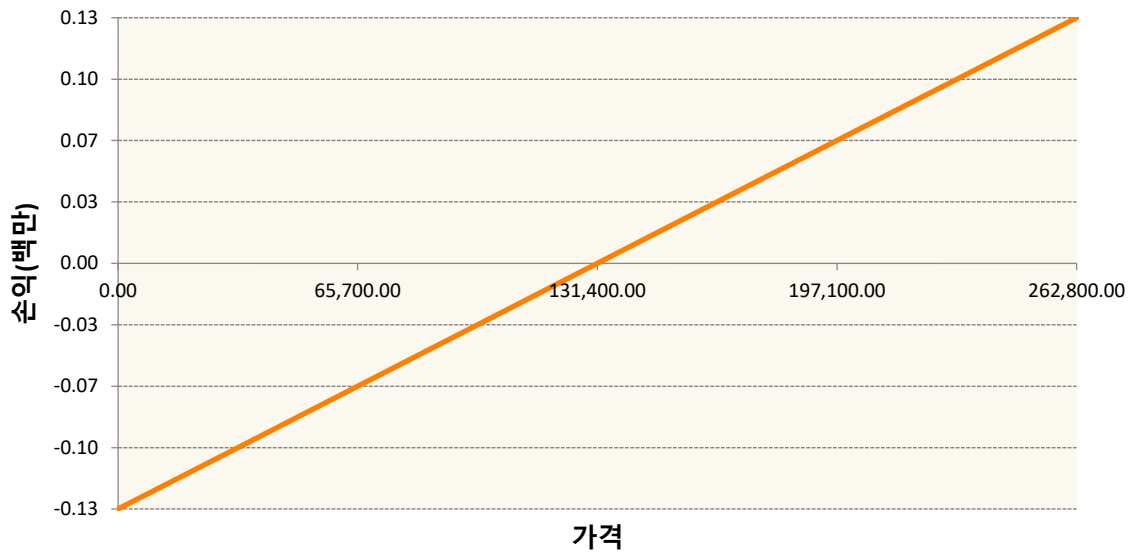
KR4A19680003-2026-08 기아개별선물



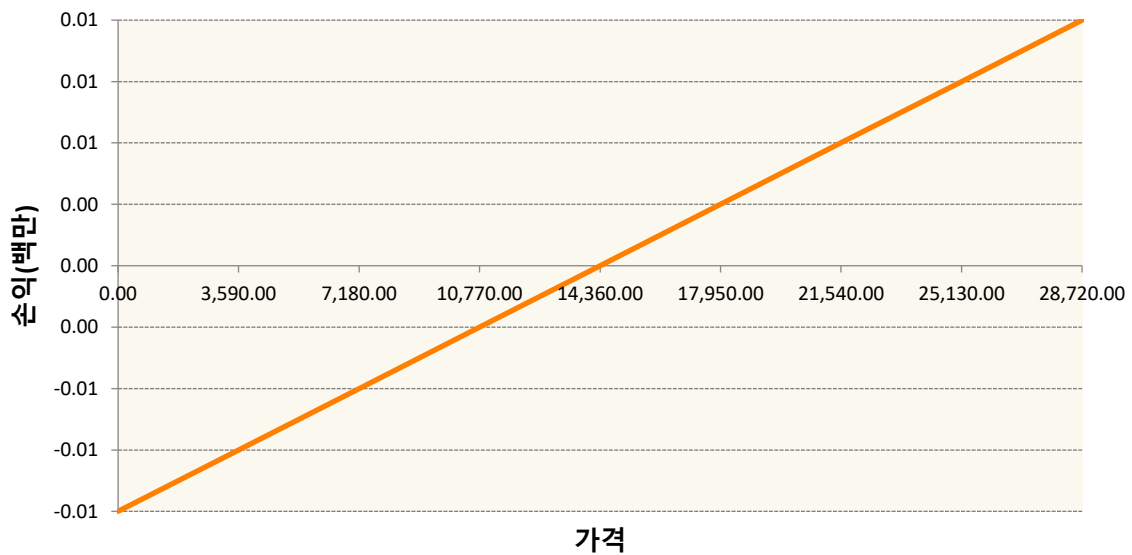
KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



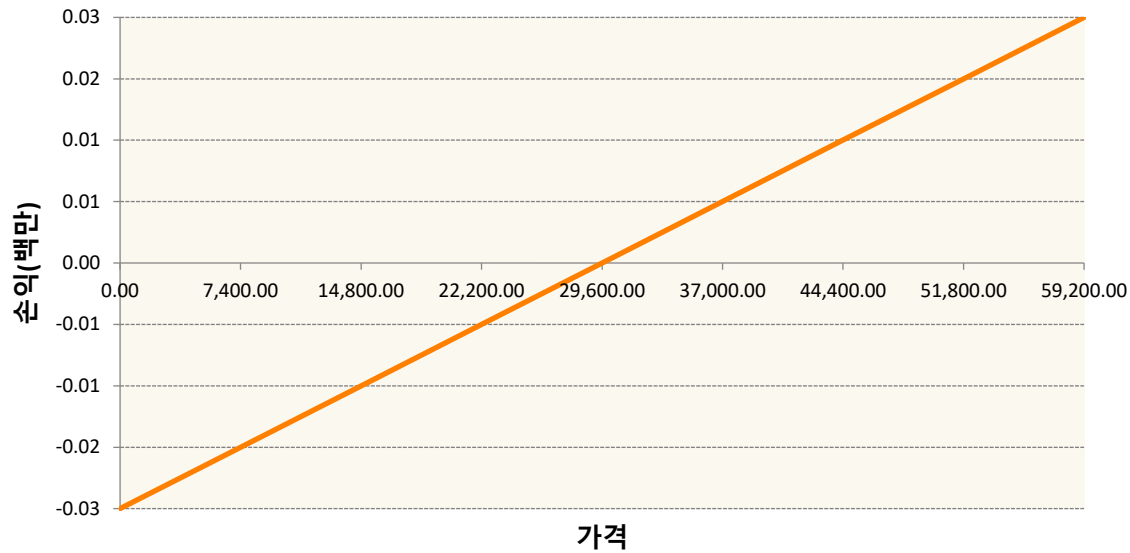
KR4A40680006-2026-08 하나금융지주개별선물



KR4AB0680002-2026-08 LG유플러스개별선물



KR4ACB680007-2026-08 한화솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-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%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	63	63	63	63	63	63	63
KR4A05680009			2026-08 미니코스피200 선물				34
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34
KR4A11680001			2026-08 삼성전자개별선물				4
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

KR4ACB680007

2026-08 한화솔루션개별선물

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)

328

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

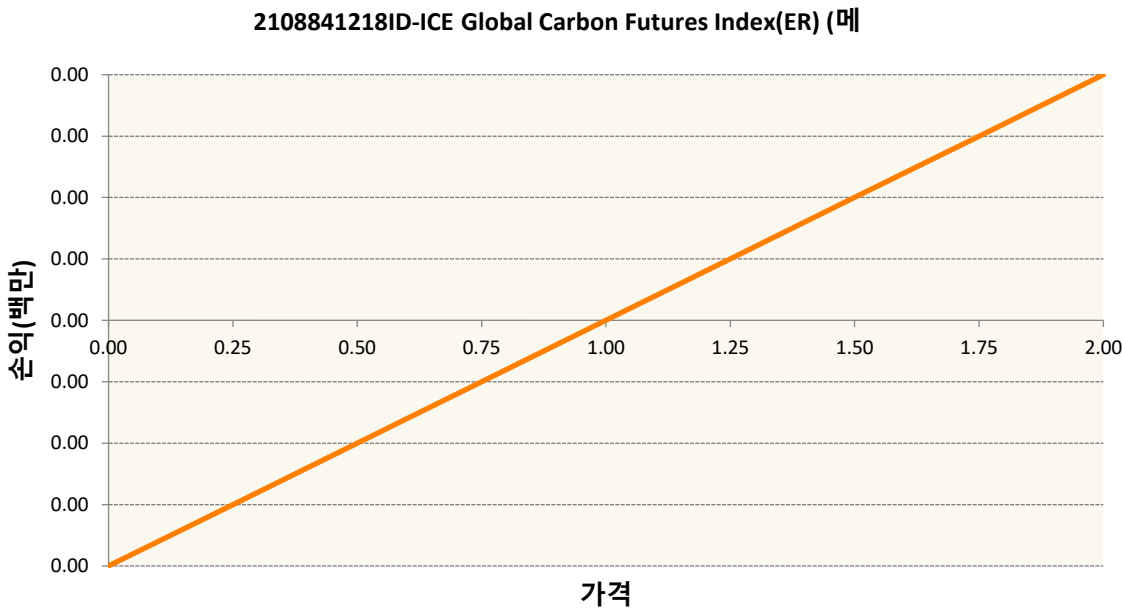
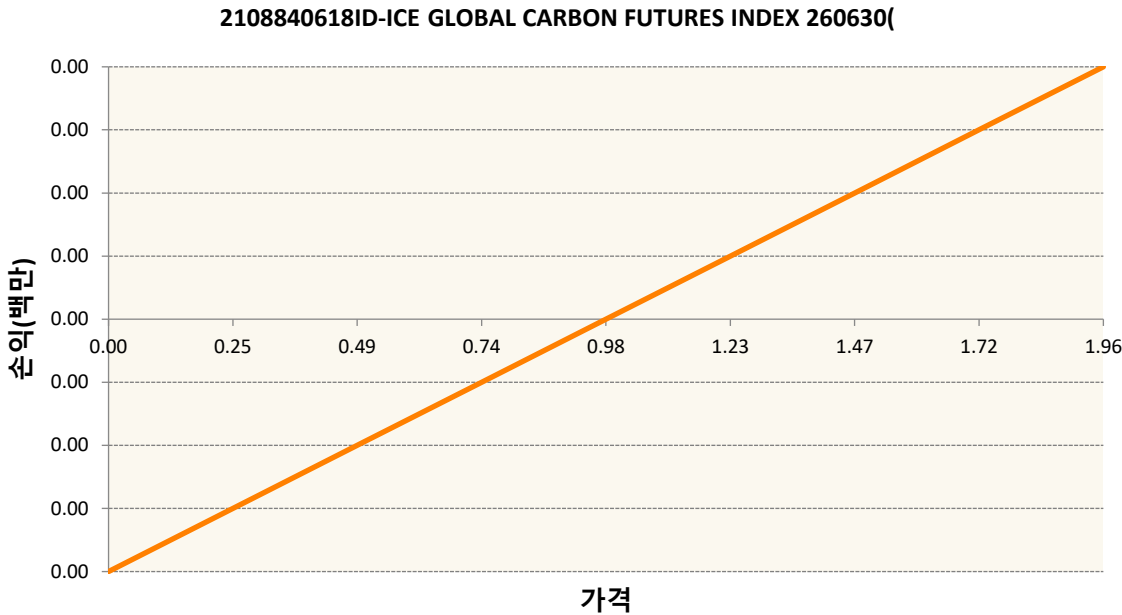
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,469	0	7,469	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		477
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		121

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	679

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

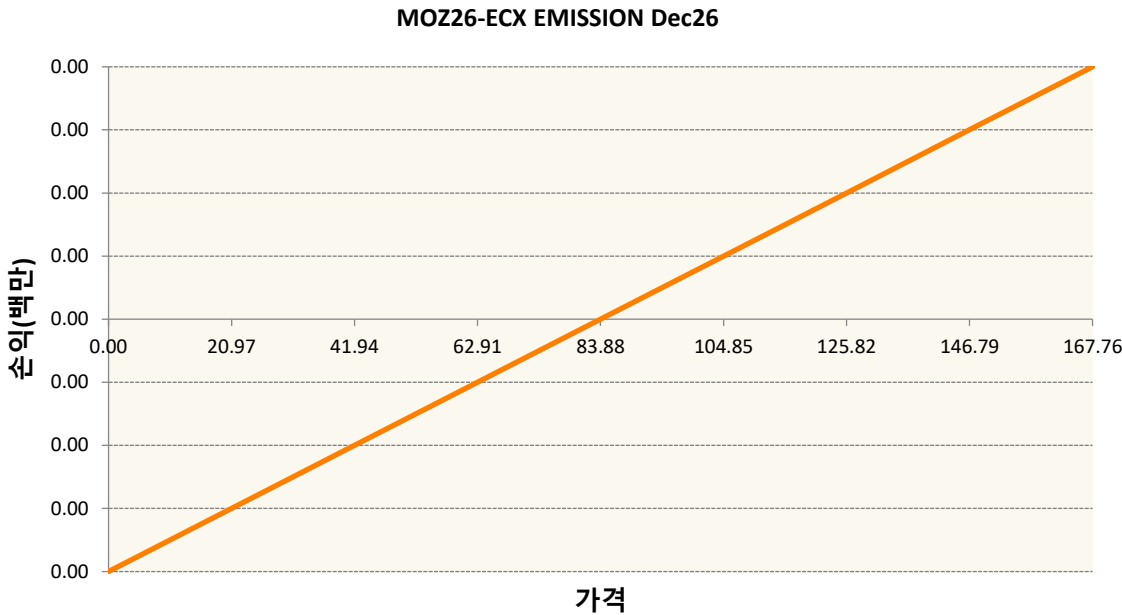
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,421	0	5,421	
누계	통화	선도	0	2,621	-2,621	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G6S(KRW/EUR 31-07-26E	210
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	434

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

(단위:백만원)

724

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	-1,589	0	-1,589	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	51
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	24
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	20
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	30

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

(단위:백만원)

200

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

SOL차이나육성산업액티브상장지

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	-2,608	0	-2,608	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	4
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	115
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	93

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

(단위:백만원)

386

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

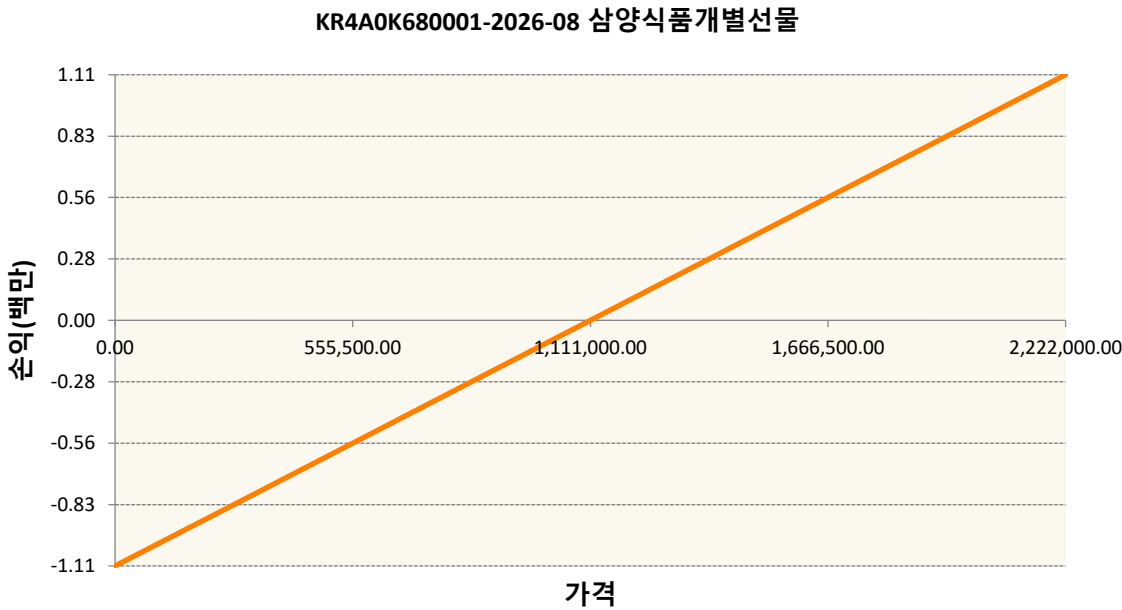
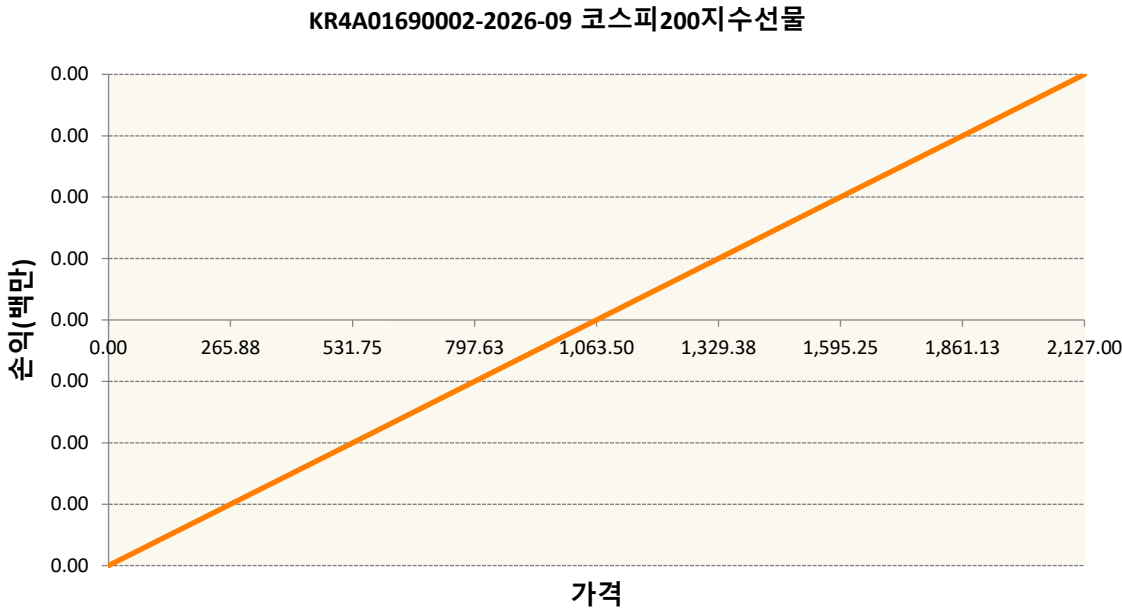
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

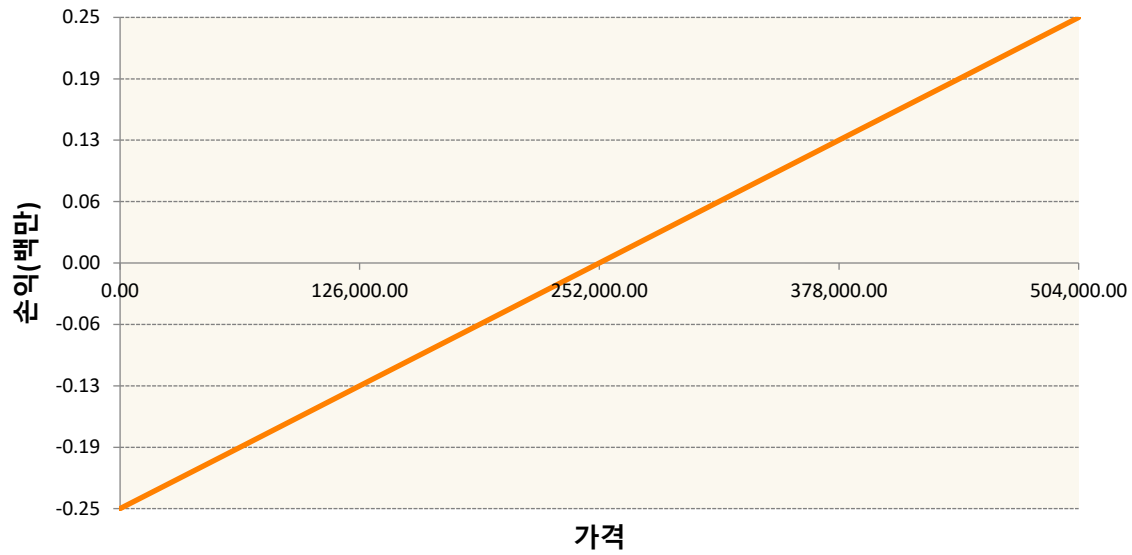
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,070	2,686	-1,616	장내
누계	유가증권	선물	26,341	1,839	24,502	장내

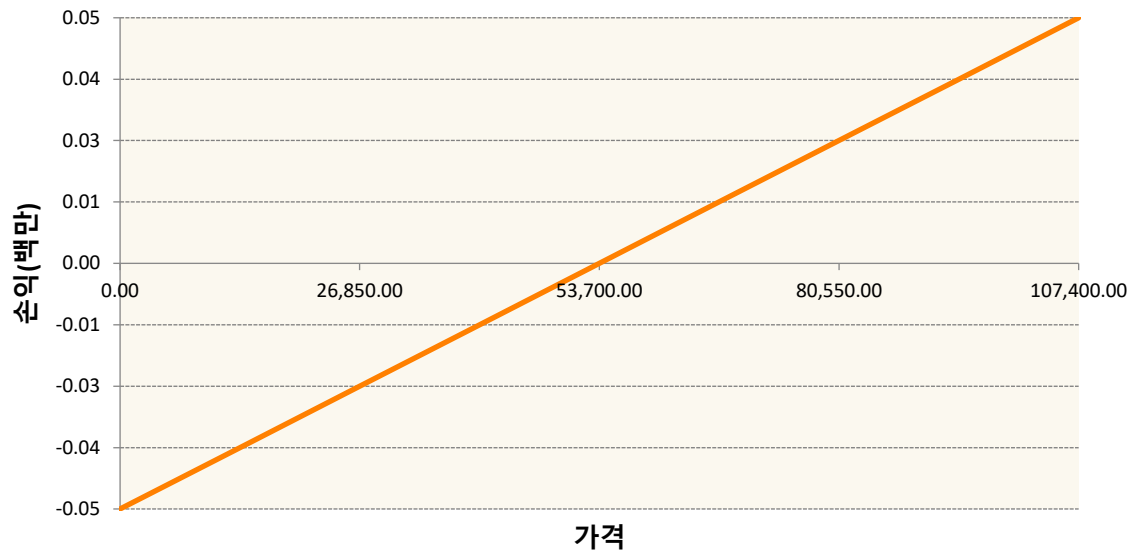
2. 만기시점의 손익구조



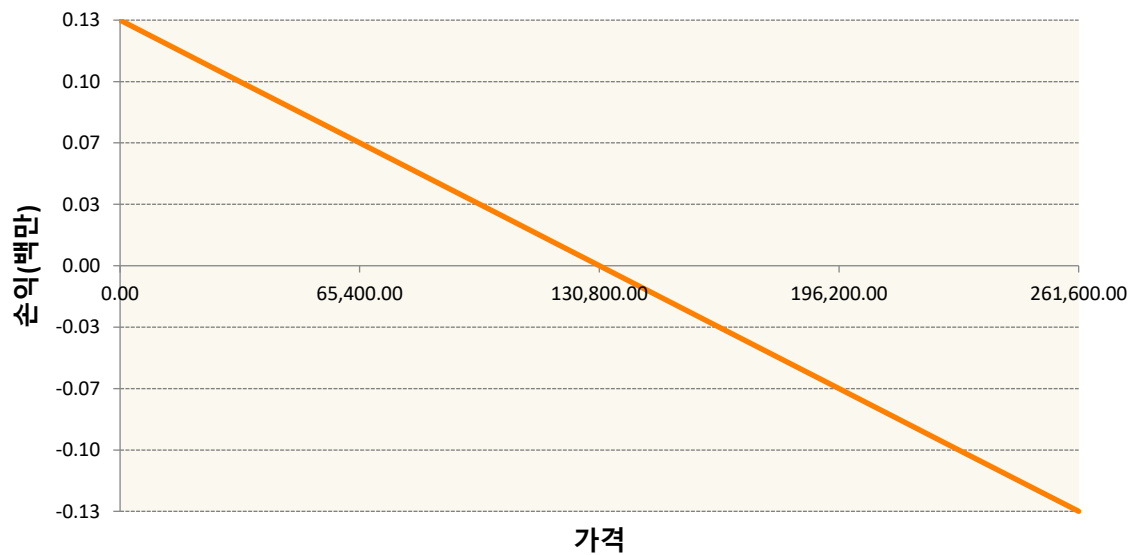
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



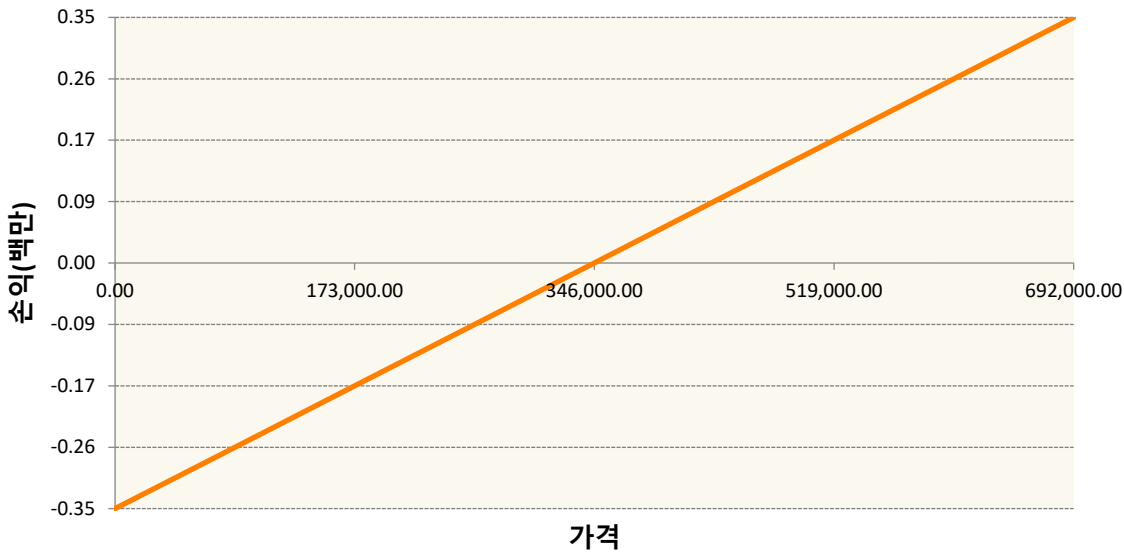
KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



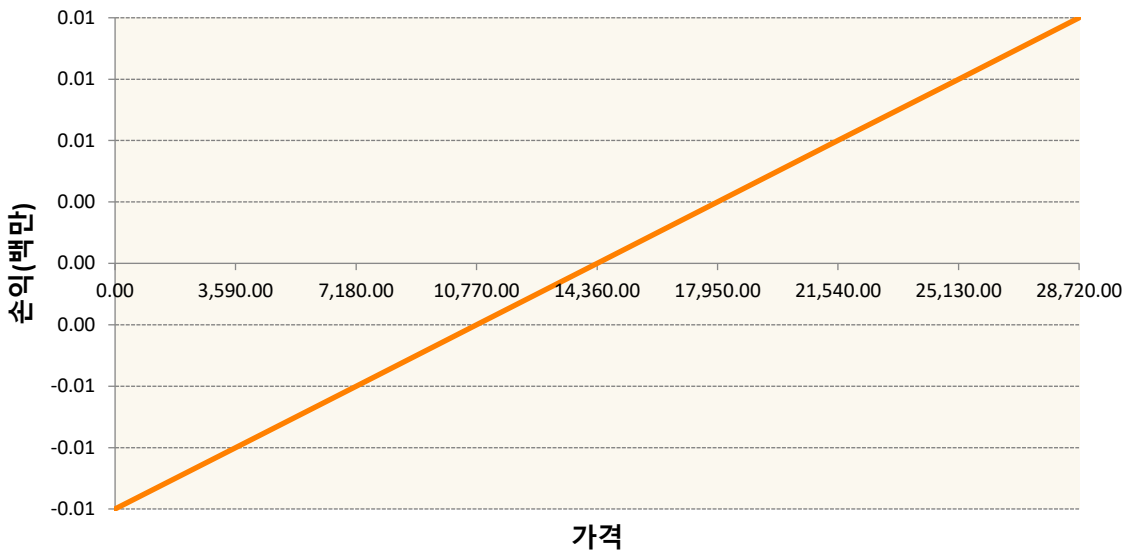
KR4A19680003-2026-08 기아개별선물



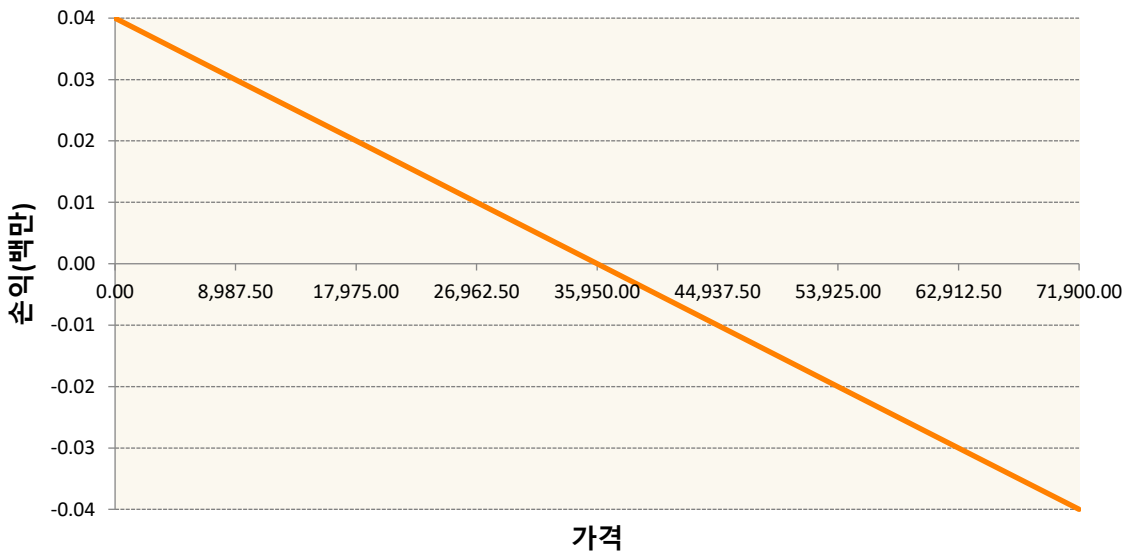
KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



KR4AB0680002-2026-08 LG유플러스개별선물



KR4ACF680003-2026-08 카카오개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		1,689	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689	-1,689			
-5.33%	-1,126	-1,126	-1,126	-1,126	-1,126	-1,126	-1,126			
-2.67%	-563	-563	-563	-563	-563	-563	-563			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	563	563	563	563	563	563	563			
5.33%	1,126	1,126	1,126	1,126	1,126	1,126	1,126			
8.00%	1,689	1,689	1,689	1,689	1,689	1,689	1,689			
KR4A0K680001							2026-08 삼양식품개별선물		29	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29			
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19			
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	10	10	10	10	10	10	10			
5.33%	19	19	19	19	19	19	19			
8.00%	29	29	29	29	29	29	29			
KR4A11680001							2026-08 삼성전자개별선물		295	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295			
-5.33%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197			
-2.67%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	98	98	98	98	98	98	98			
5.33%	197	197	197	197	197	197	197			
8.00%	295	295	295	295	295	295	295			
KR4A14680008							2026-08 KT개별선물		6	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6			
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4			
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	2	2	2	2	2	2	2			
5.33%	4	4	4	4	4	4	4			
8.00%	6	6	6	6	6	6	6			
KR4A19680003							2026-08 기아개별선물		84	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	84	84	84	84	84	84	84
-5.33%	56	56	56	56	56	56	56
-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%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84

KR4A1Q680004

2026-08 에이피알개별선물

51

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	51	51	51	51	51	51	51

KR4AB0680002

2026-08 LG유플러스개별선물

25

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	25	25	25	25	25	25	25

KR4ACF680003

2026-08 카카오개별선물

63

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	63	63	63	63
-5.33%	42	42	42	42	42	42	42
-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%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63

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

(단위:백만원)

6,303

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

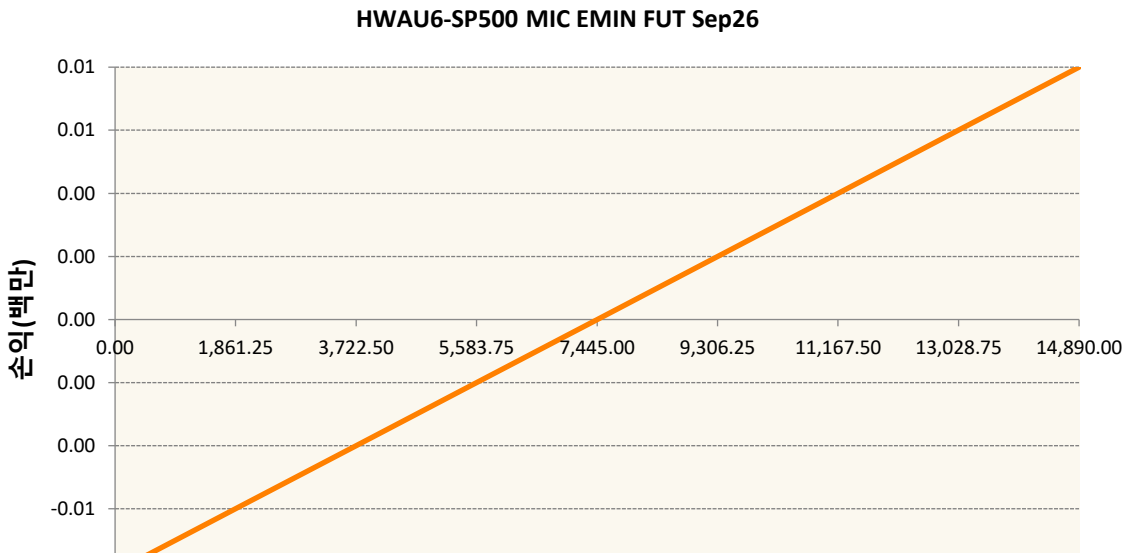
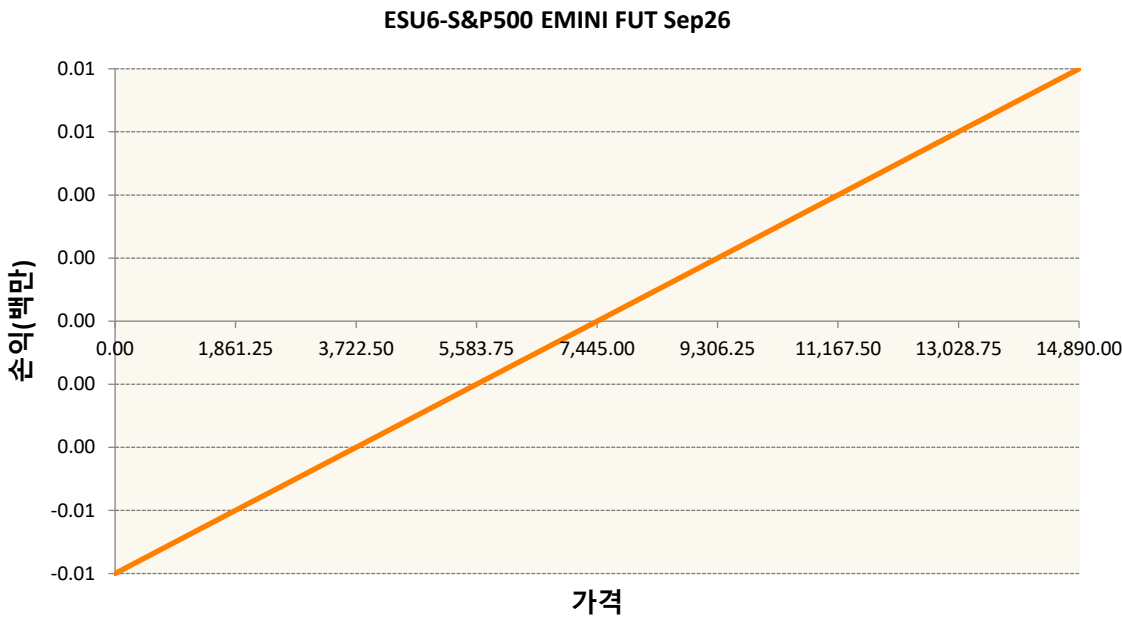
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

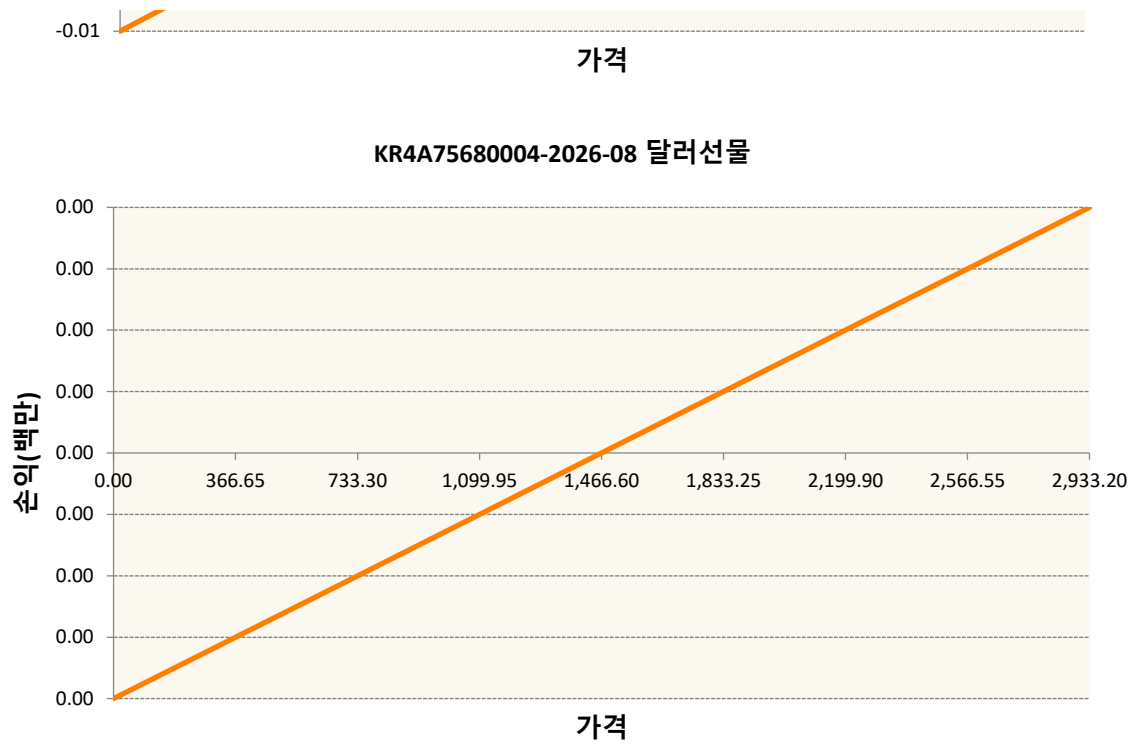
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	65,925	0	65,925	
누계	지수	선물	284	0	284	장내
누계	통화	선물	10,413	0	10,413	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	5,274
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	23
KR4A756800	2026-08 달러선물	833

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

4,574

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

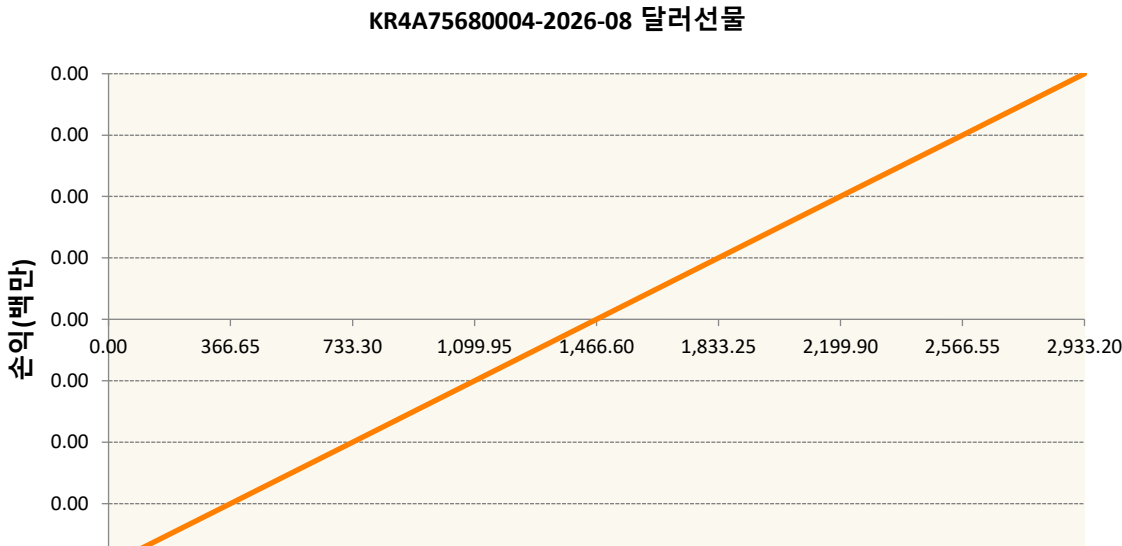
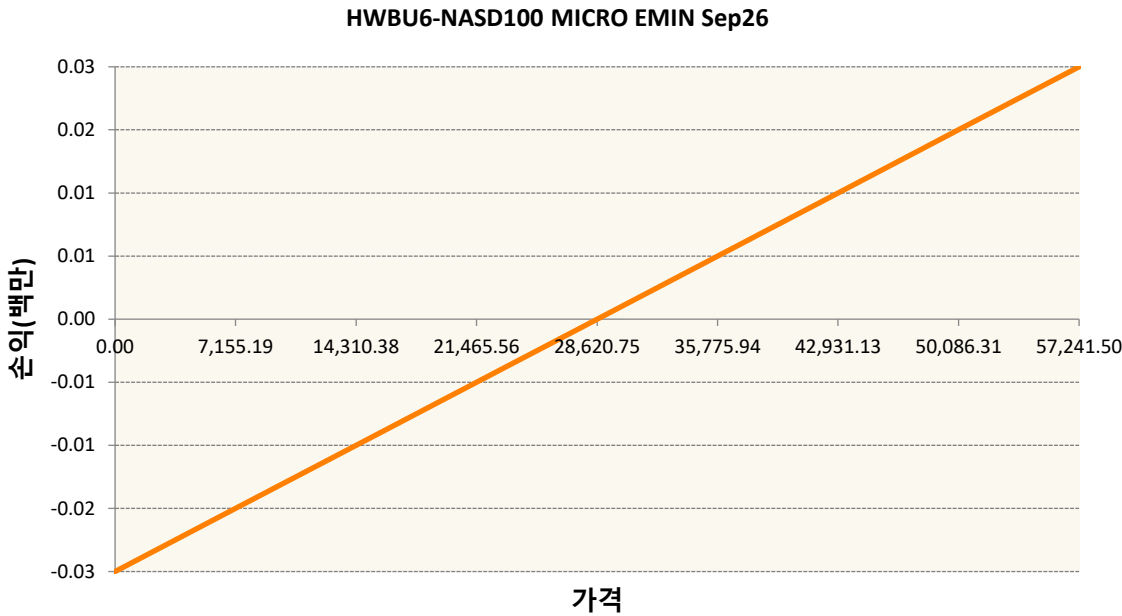
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

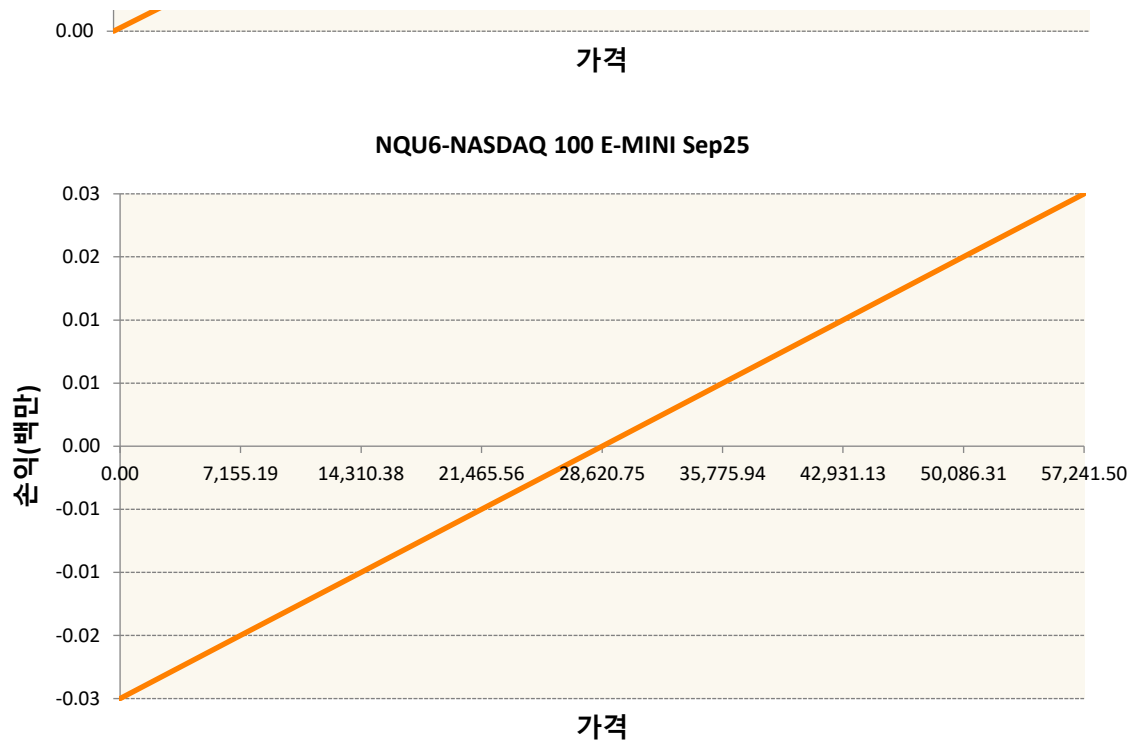
1. 계약금액

(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	688	0	688	장내
누계	지수	선물	32,951	0	32,951	
누계	통화	선물	3,828	0	3,828	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		55
KR4A756800	2026-08 달러선물		306
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,636

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,053

공시일	2026-07-27
기준일	2026-07-24

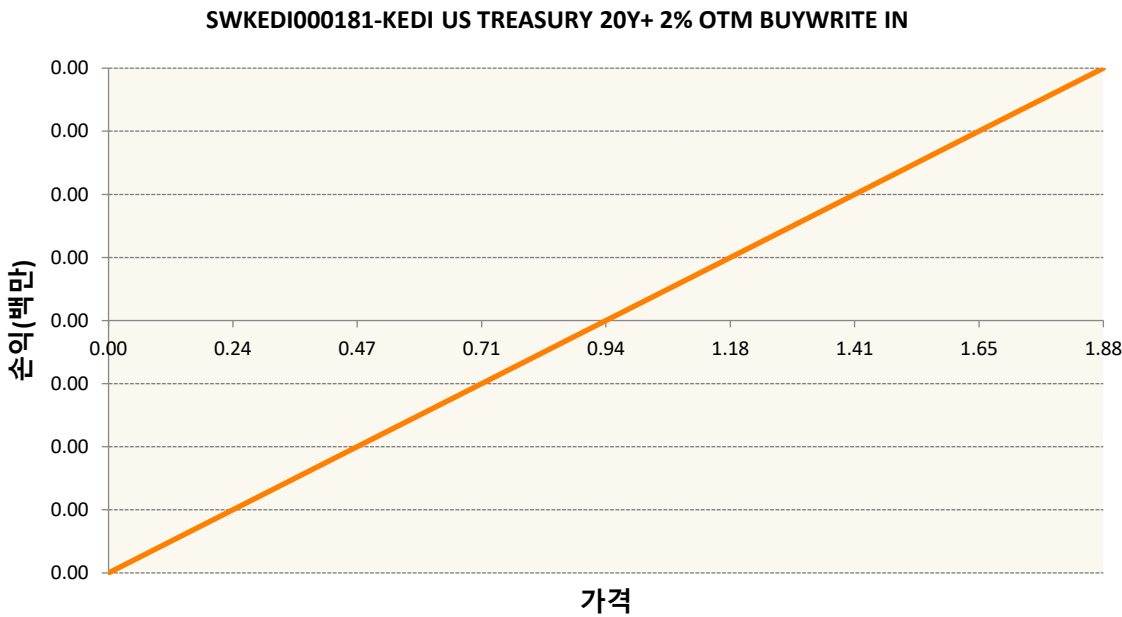
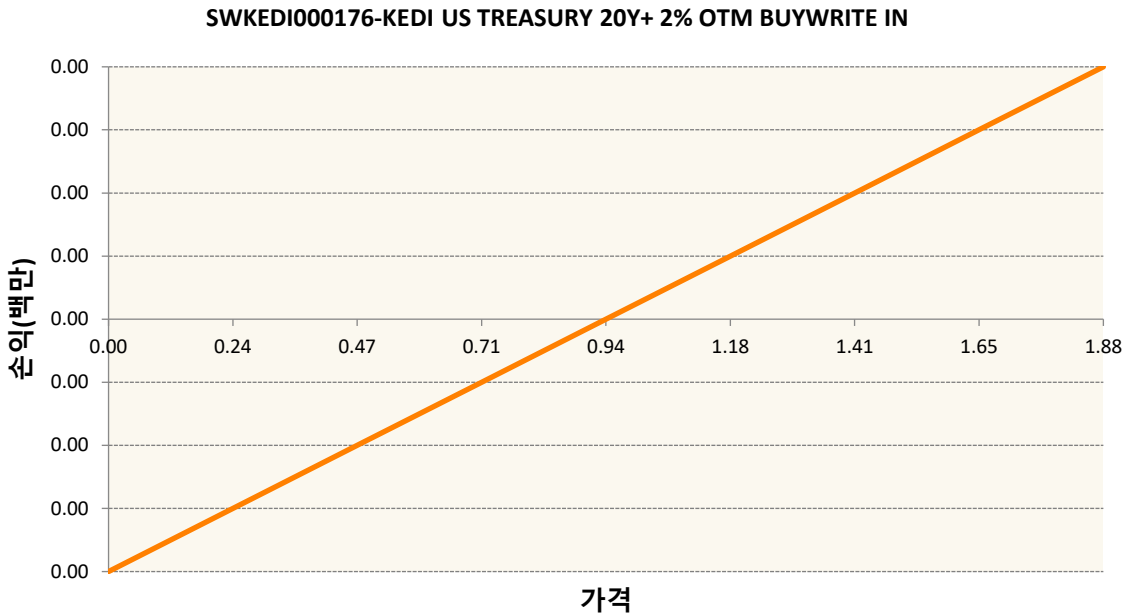
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

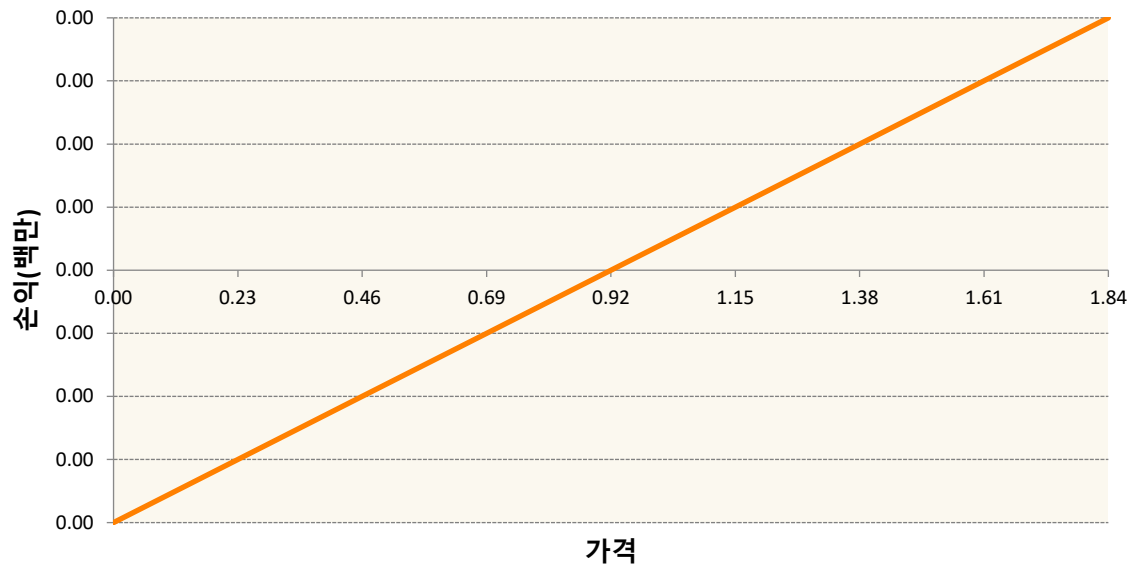
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	300,633	0	300,633	장외

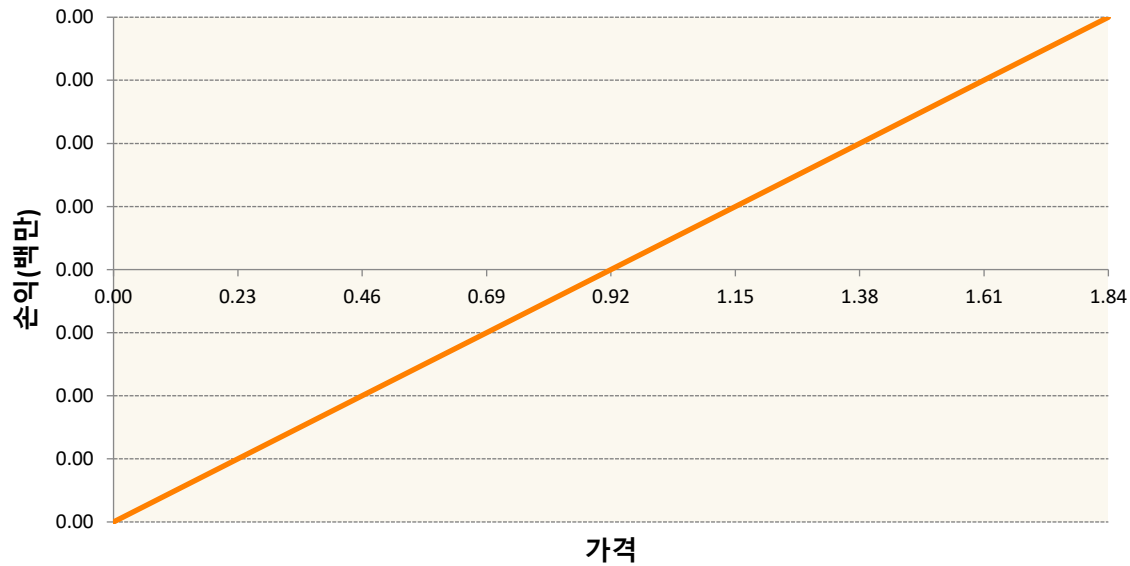
2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000184-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000185-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,677
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,013
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,841
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,530

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

(단위:백만원)

10,220