

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

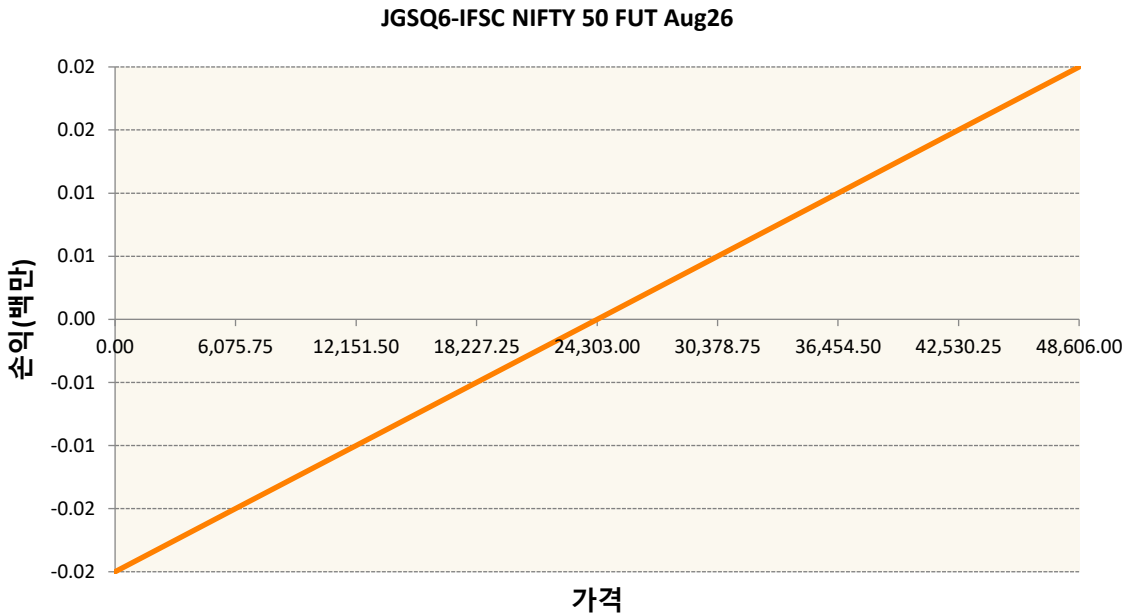
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	356	0	356	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSQ6	IFSC NIFTY 50 FUT Aug26	29
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

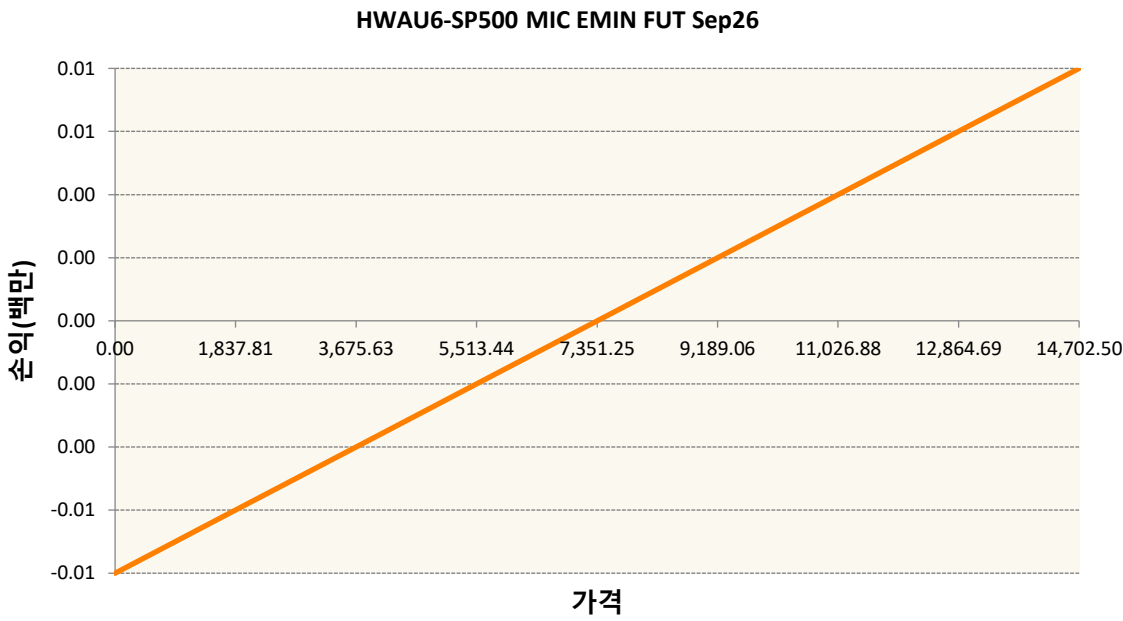
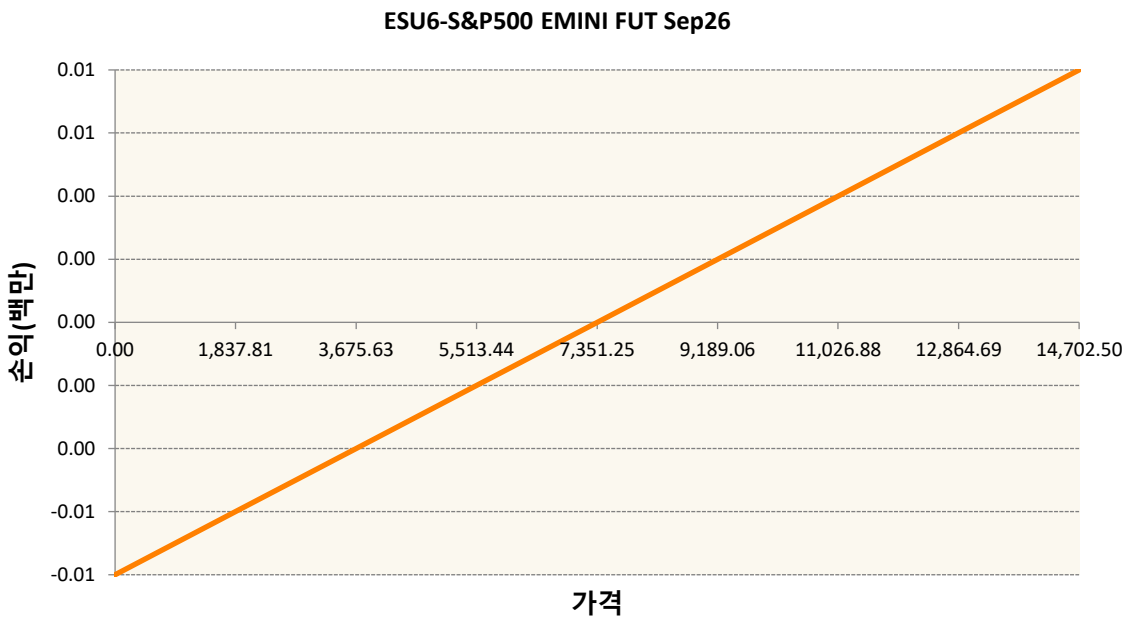
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	562	0	562	
누계	지수	선물	56	0	56	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	45
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	4

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

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

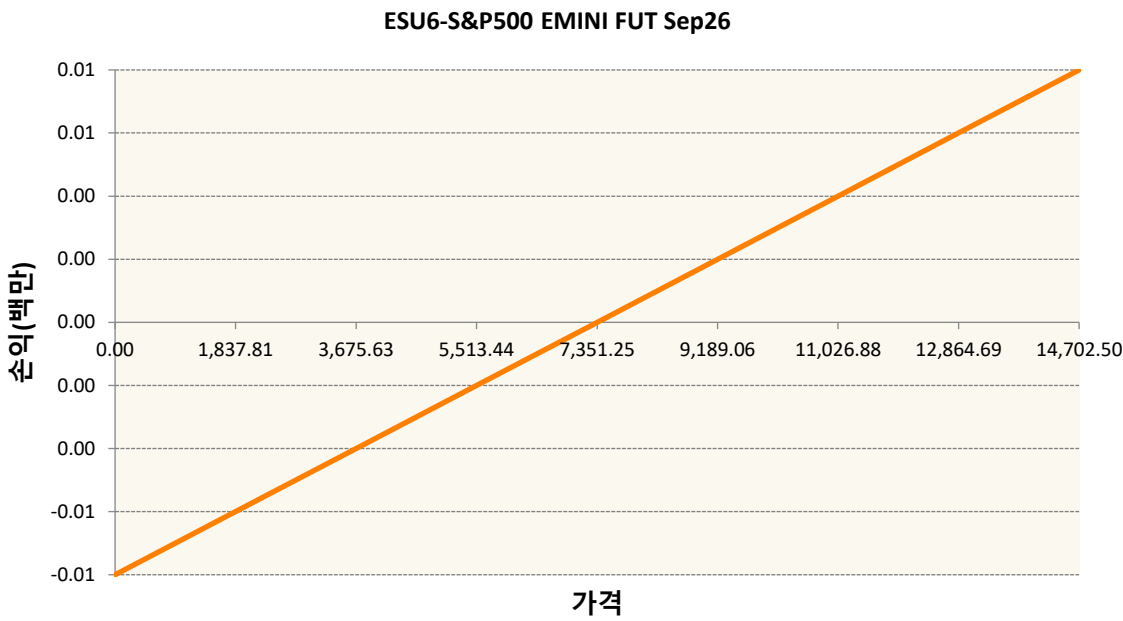
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	556	0	556	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	44
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

38

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

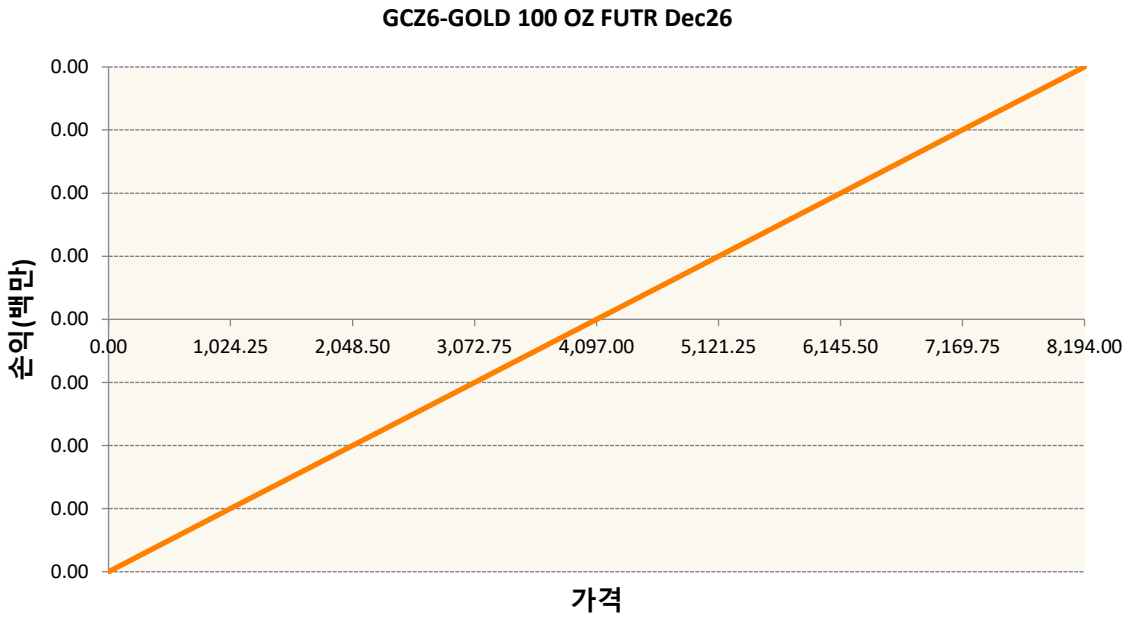
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계			4,711	0	4,711	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSSC GLD US 07/31/26 C375 EQUITY	7
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	377

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

(단위:백만원)

498

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

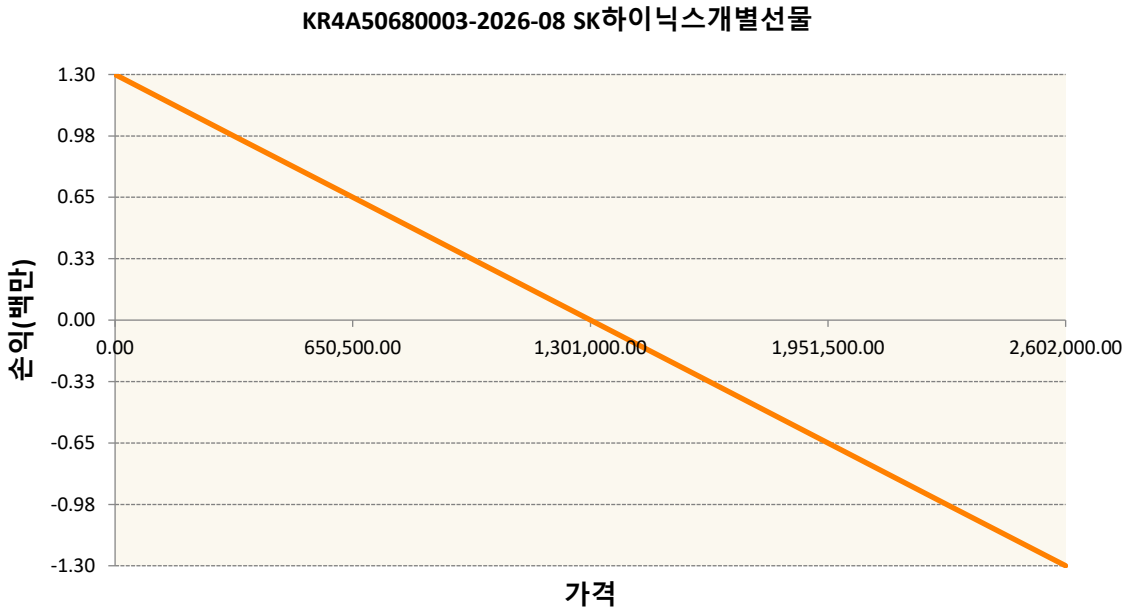
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	1,431	-1,431	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUAC PLTR US 07/31/26 C130 EQUITY	66
AOPLTRUAP PLTR US 07/31/26 P130 EQUITY	29
KR4A506800 2026-08 SK하이닉스개별선물	114

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

(단위:백만원)

292

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

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 07/31/26 C83.5 EQUITY

8

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

(단위:백만원)

5

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

(단위:백만원)

13,477

공시일 2026-07-31

기준일 2026-07-30

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	2026-07-31
기준일	2026-07-30

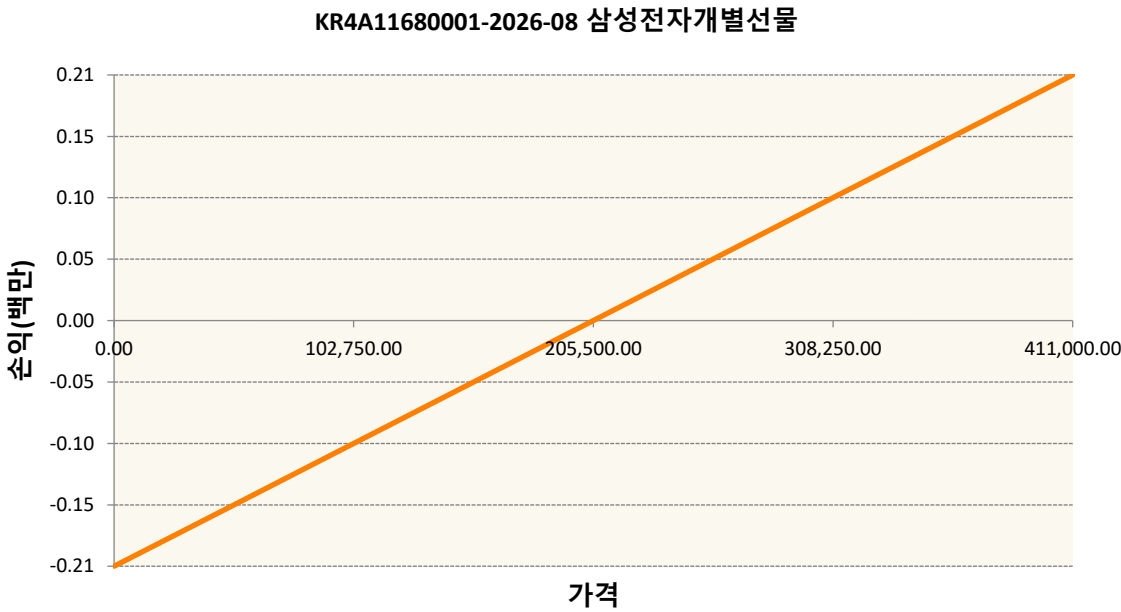
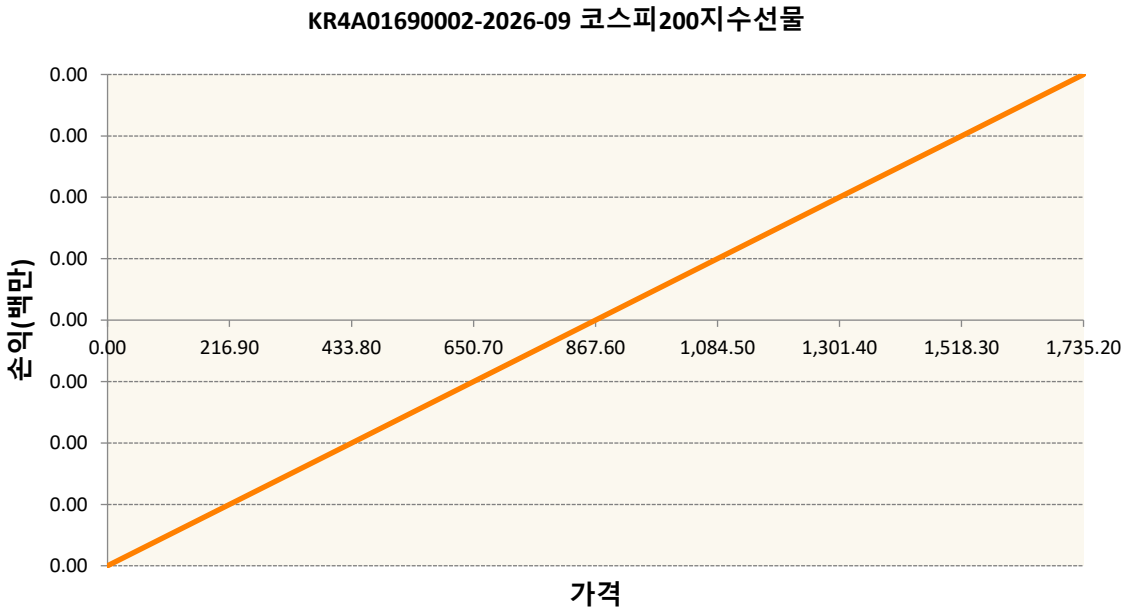
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	23,700	-23,700	장내
누계	유가증권	선물	16,736	22,995	-6,259	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격	손익(백만)
0.00	0.00
218.75	-200.00
437.50	-400.00
656.25	-600.00
875.00	-800.00
1,093.75	-1,000.00
1,312.50	-1,200.00
1,531.25	-1,400.00
1,750.00	-1,600.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순익). The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 1,755.00 with major ticks every 219.38. The y-axis represents the net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid blue line starts at the origin (0, 0.00) and extends to the point (1,755.00, 0.00), indicating a constant rate of change.

가액	순익 (백만)
0.00	0.00
219.38	0.00
438.75	0.00
658.13	0.00
877.50	0.00
1,096.88	0.00
1,316.25	0.00
1,535.63	0.00
1,755.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		454	
기초자산의 변동성										
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-454	-454	-454	-454	-454	-454	-454			
-5.33%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302			
-2.67%	-151	-151	-151	-151	-151	-151	-151			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	151	151	151	151	151	151	151			
5.33%	302	302	302	302	302	302	302			
8.00%	454	454	454	454	454	454	454			
KR4A11680001							2026-08 삼성전자개별선물		894	
기초자산의 변동성										

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-894	-894	-894	-894	-894	-894	-894
-5.33%	-596	-596	-596	-596	-596	-596	-596
-2.67%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	298	298	298	298	298	298	298
5.33%	596	596	596	596	596	596	596
8.00%	894	894	894	894	894	894	894
KR4BAFBQ8757 코스피위클리M C 2608W1 875.0							1,099

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,099	1,099	1,099	1,099	1,099	1,099	1,099
-5.33%	733	733	733	733	733	733	733
-2.67%	366	366	366	366	366	366	366
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-366	-366	-366	-366	-366	-366	-366
5.33%	-733	-733	-733	-733	-733	-733	-733
8.00%	-1,099	-1,099	-1,099	-1,099	-1,099	-1,099	-1,099
KR4BAFBQ8773 코스피위클리M C 2608W1 877.5							733

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	733	733	733	733	733	733	733
-5.33%	489	489	489	489	489	489	489
-2.67%	244	244	244	244	244	244	244
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
5.33%	-489	-489	-489	-489	-489	-489	-489
8.00%	-733	-733	-733	-733	-733	-733	-733

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

(단위:백만원)

10,271

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

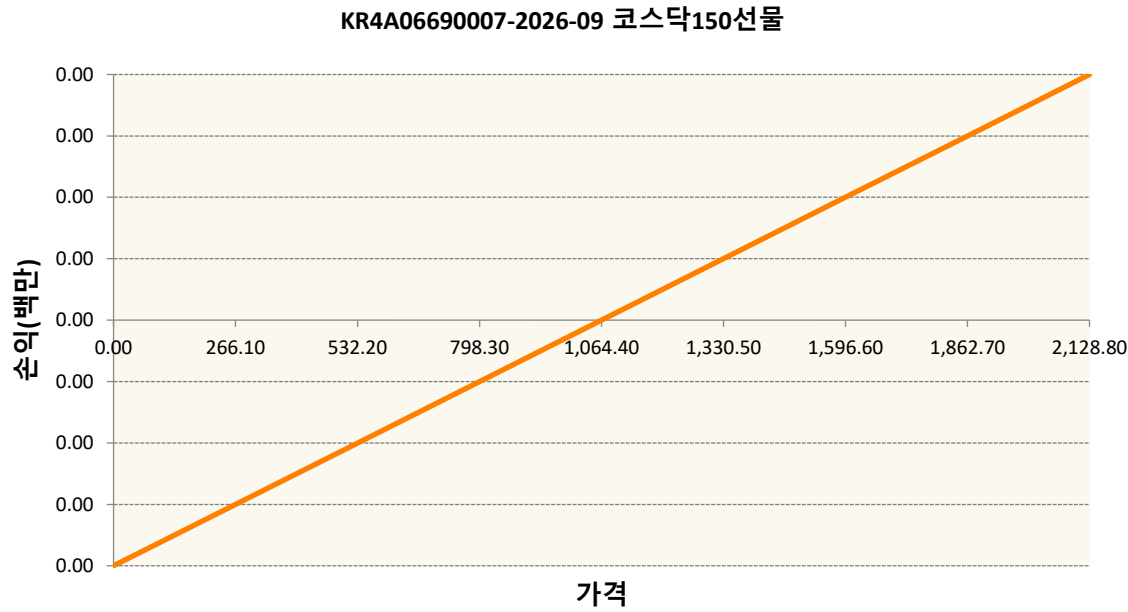
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	617	0	617	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				50
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	50	50	50	50	50	50	50

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

(단위:백만원)

13,167

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

(단위:백만원)

228,289

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

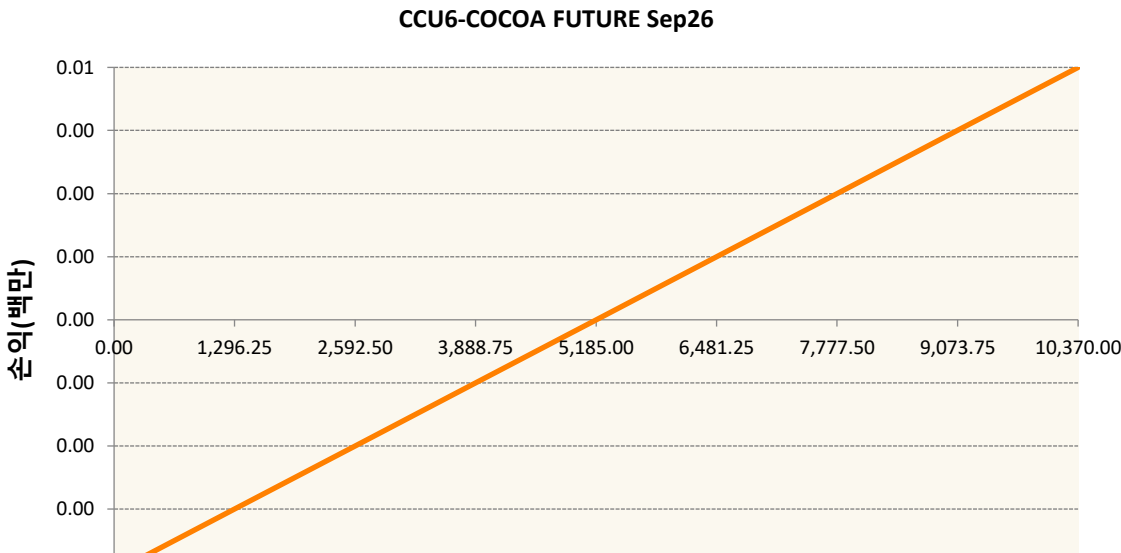
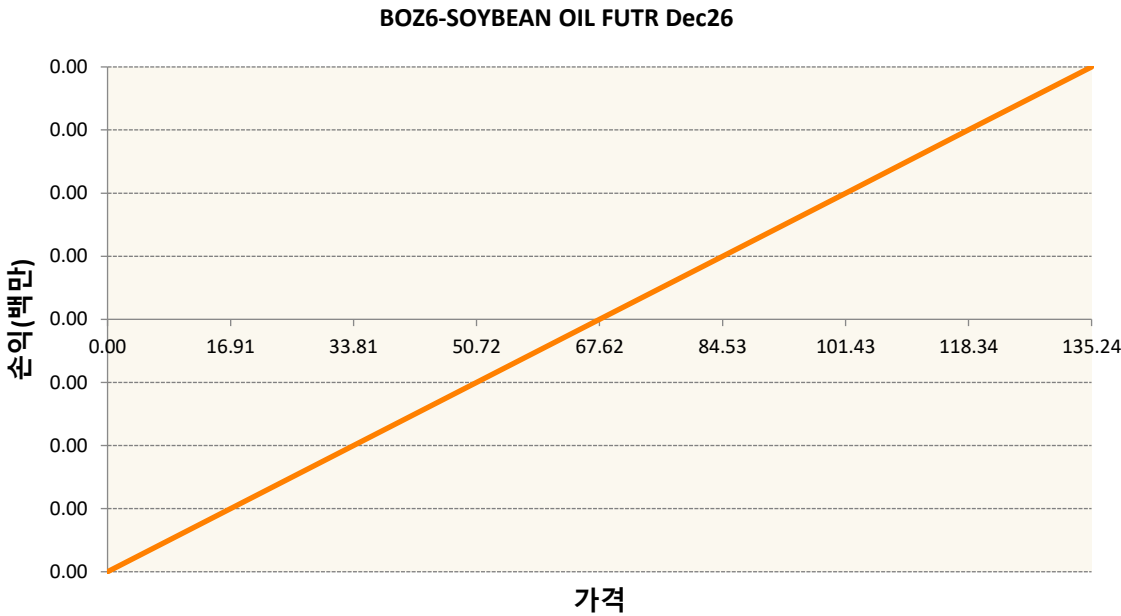
포커스농산물모(채권-파생형)

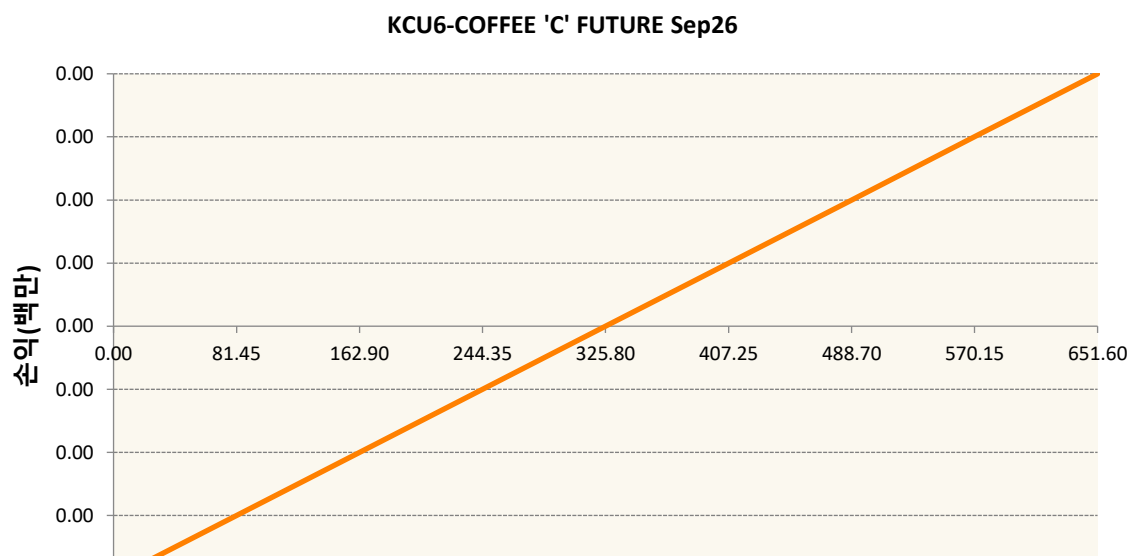
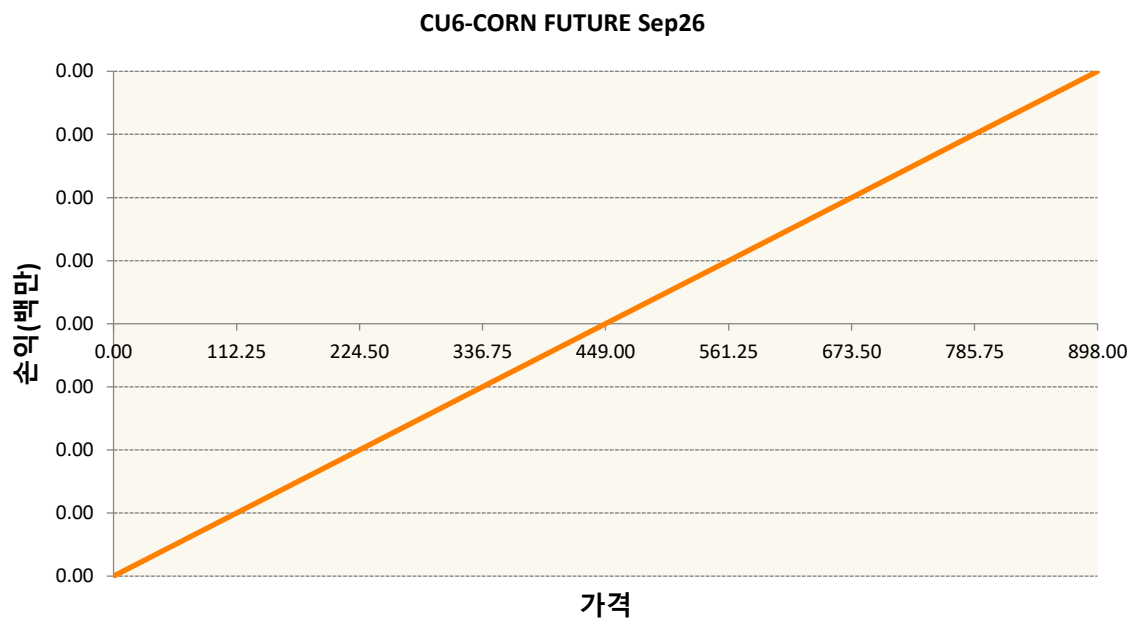
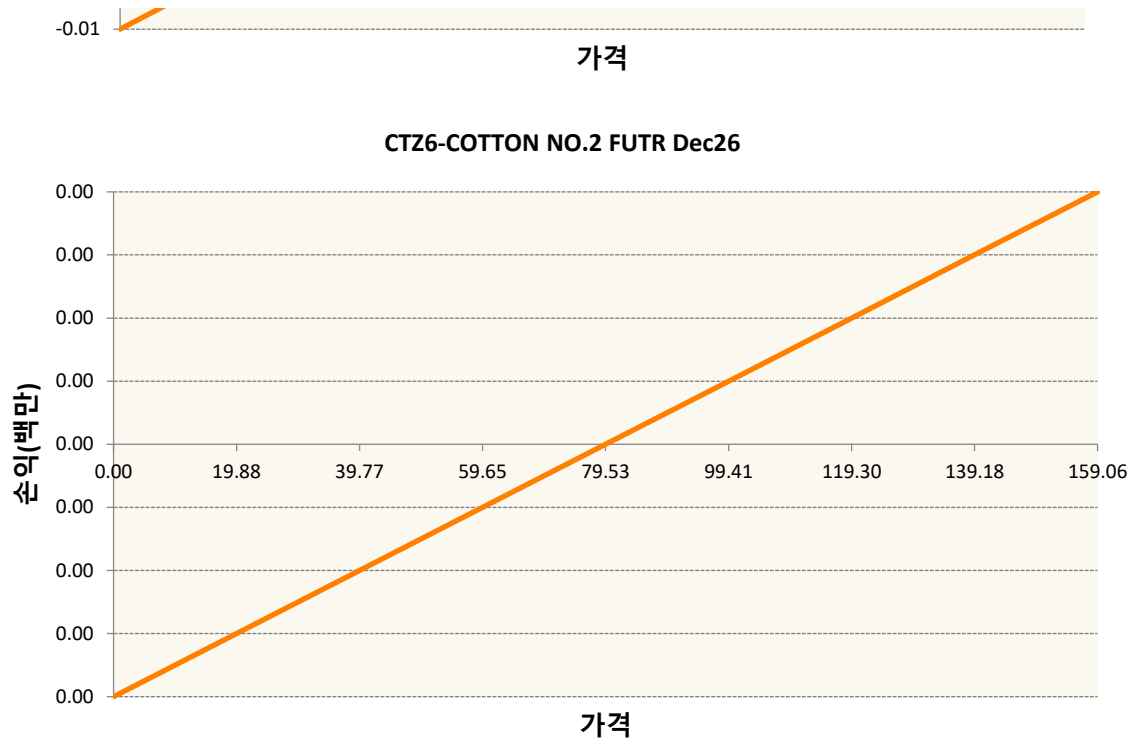
1. 계약금액

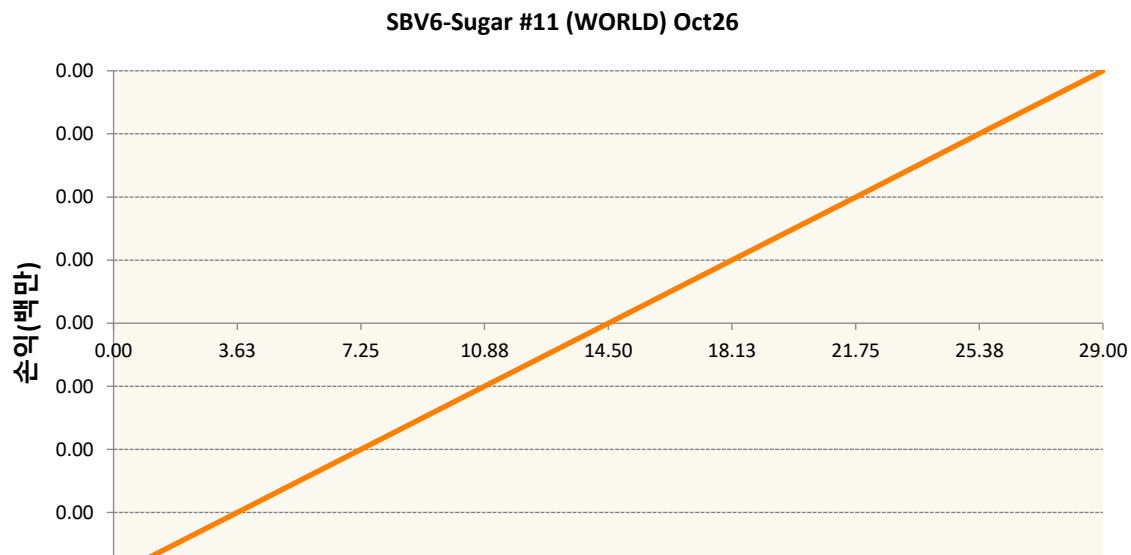
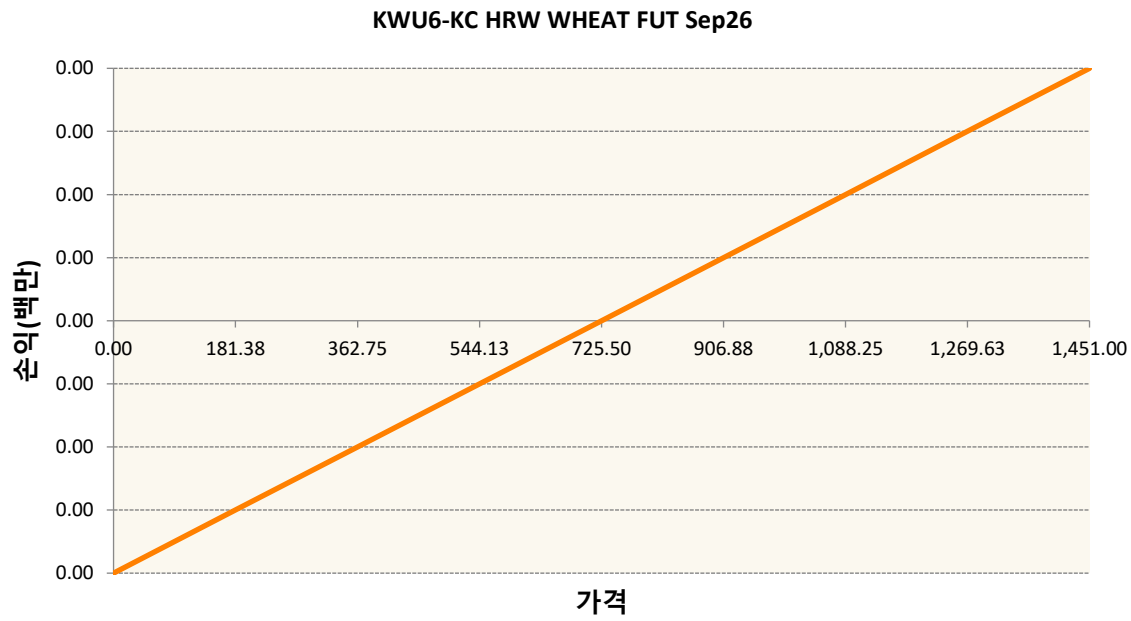
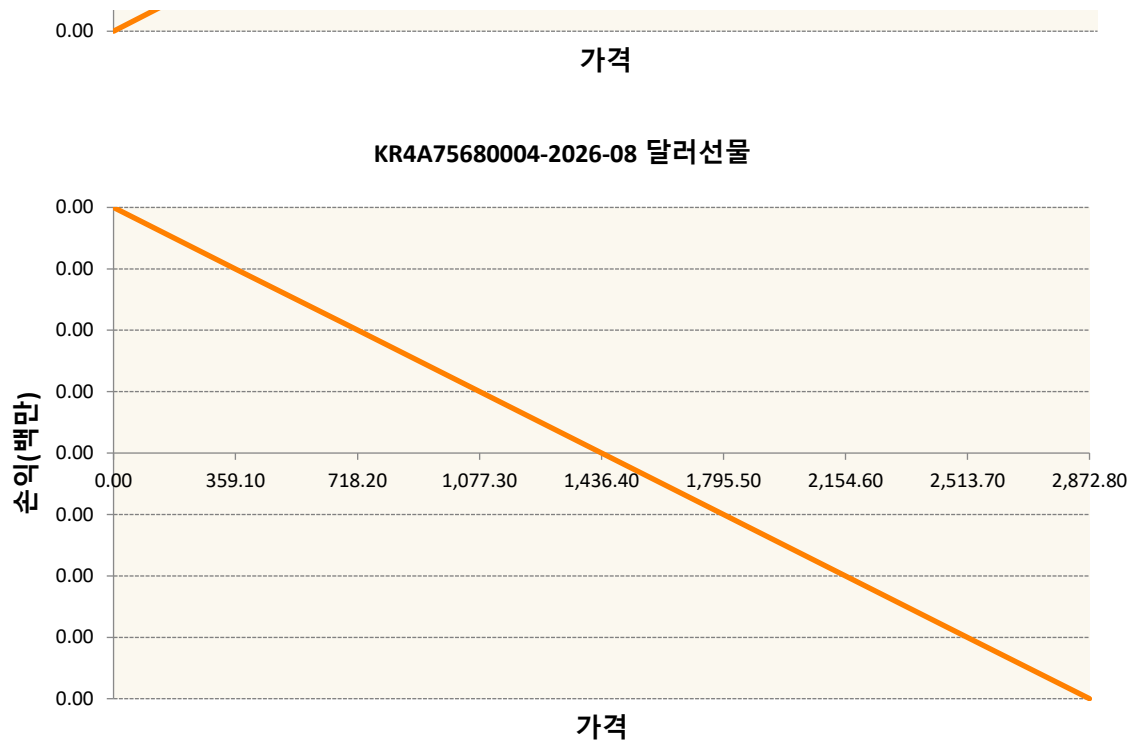
(단위:USD 백만)

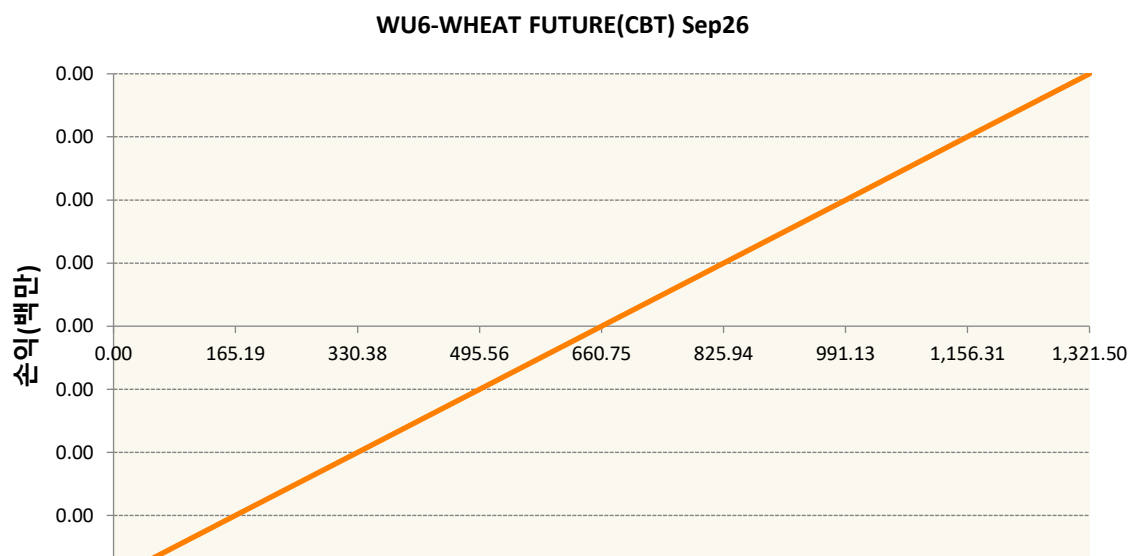
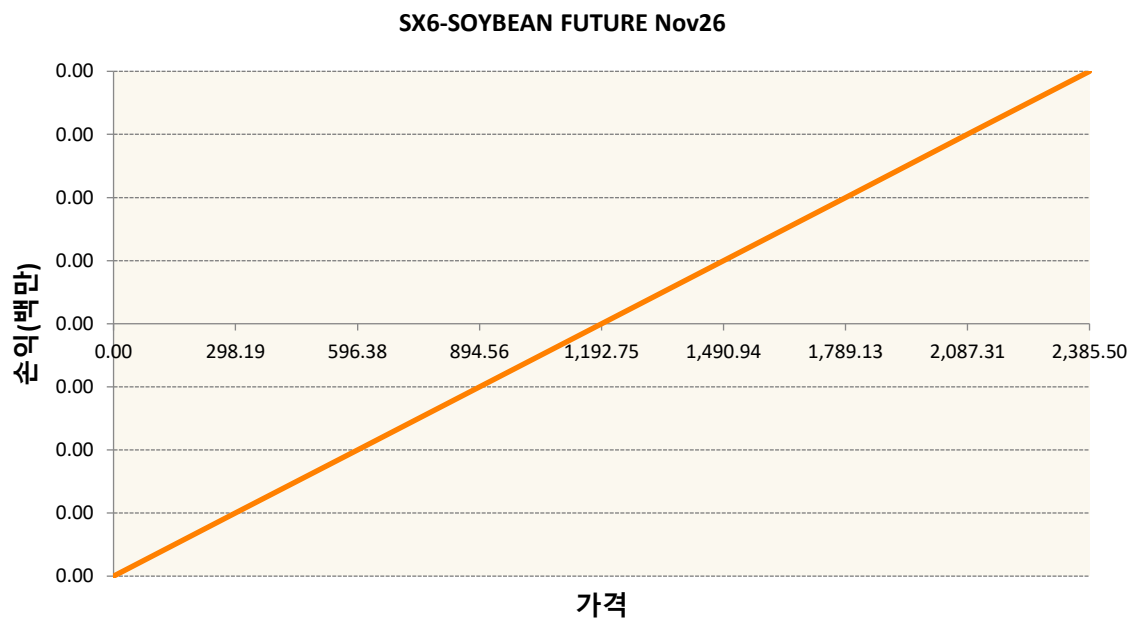
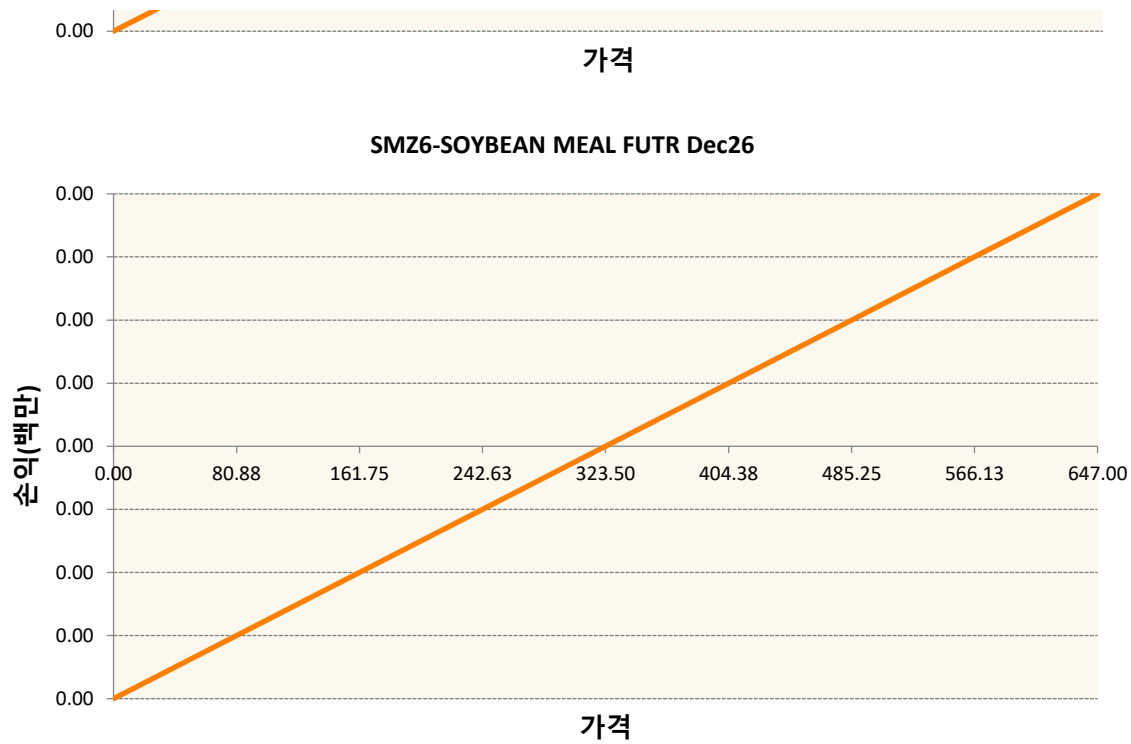
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	450	0	450	
누계	유가증권	선물	2,273	0	2,273	
누계	통화	선물	0	388	-388	장내

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	2026-07-31
기준일	2026-07-30

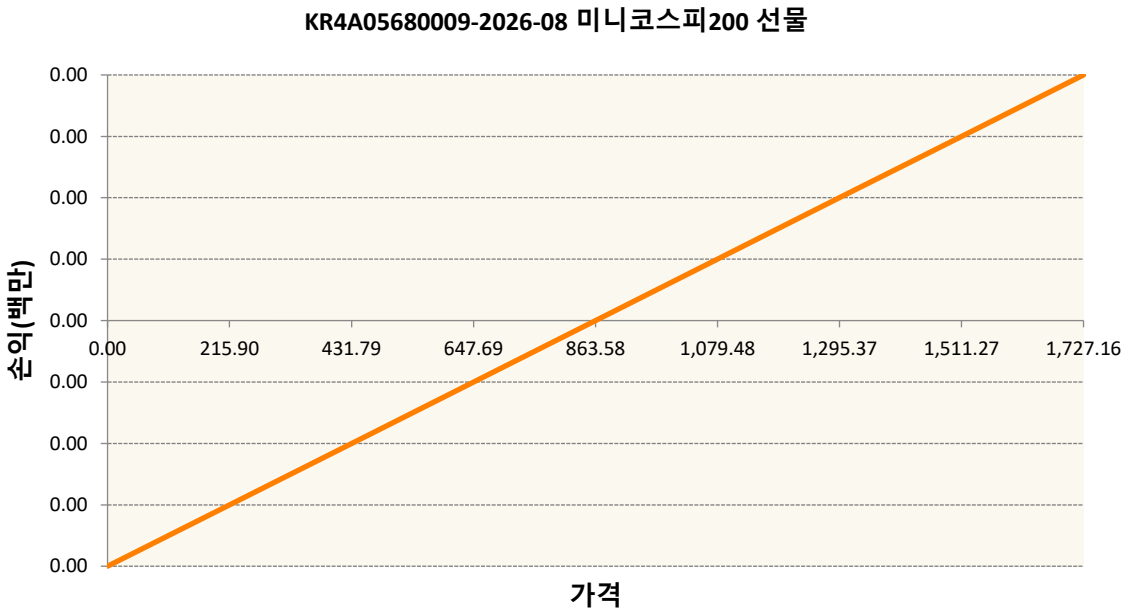
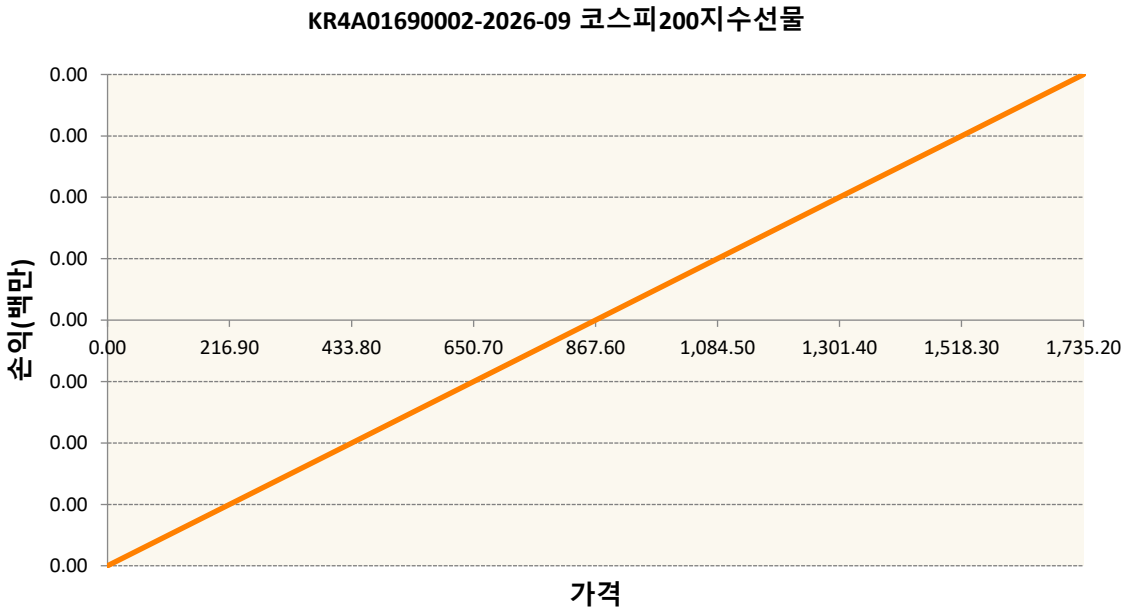
스마트인덱스모

1. 계약금액

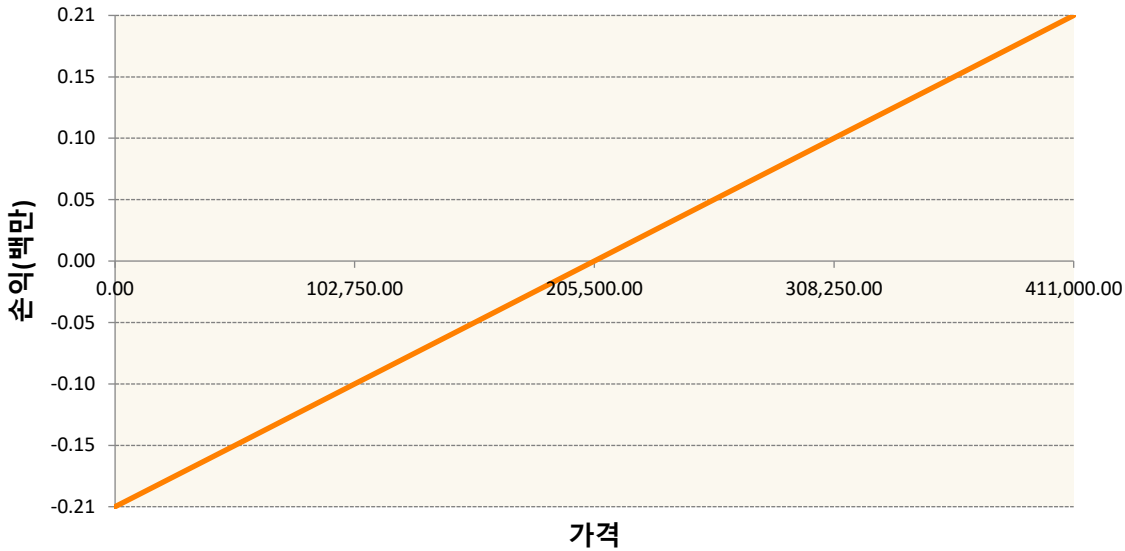
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	879	-879	장내
누계	유가증권	선물	3,176	0	3,176	장내

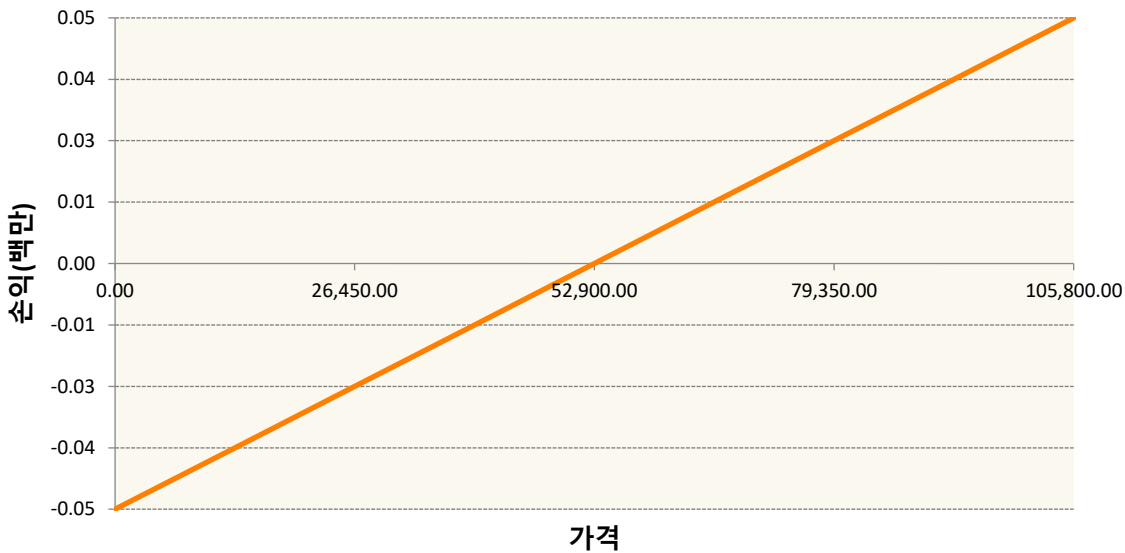
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					174
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
-5.33%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-2.67%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	58	58	58	58	58	58	58
5.33%	116	116	116	116	116	116	116
8.00%	174	174	174	174	174	174	174
KR4A05680009		2026-08 미니코스피200 선물					14
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	14	14	14	14	14	14	14

KR4A11680001

2026-08 삼성전자개별선물

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

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

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

(단위:백만원)

604

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

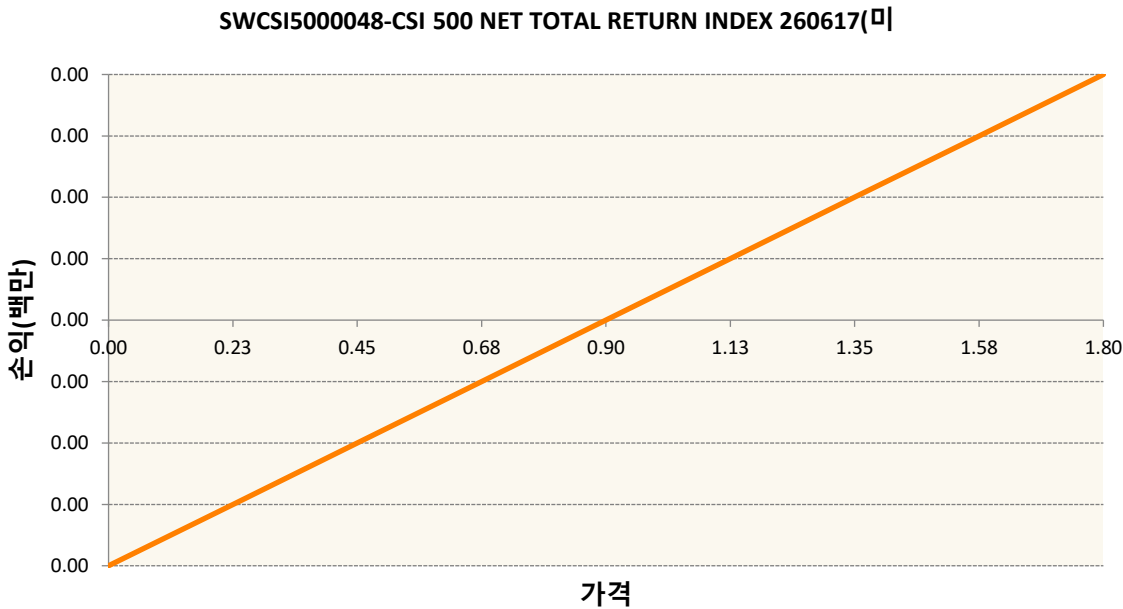
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,217	0	5,217	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

419

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

646

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

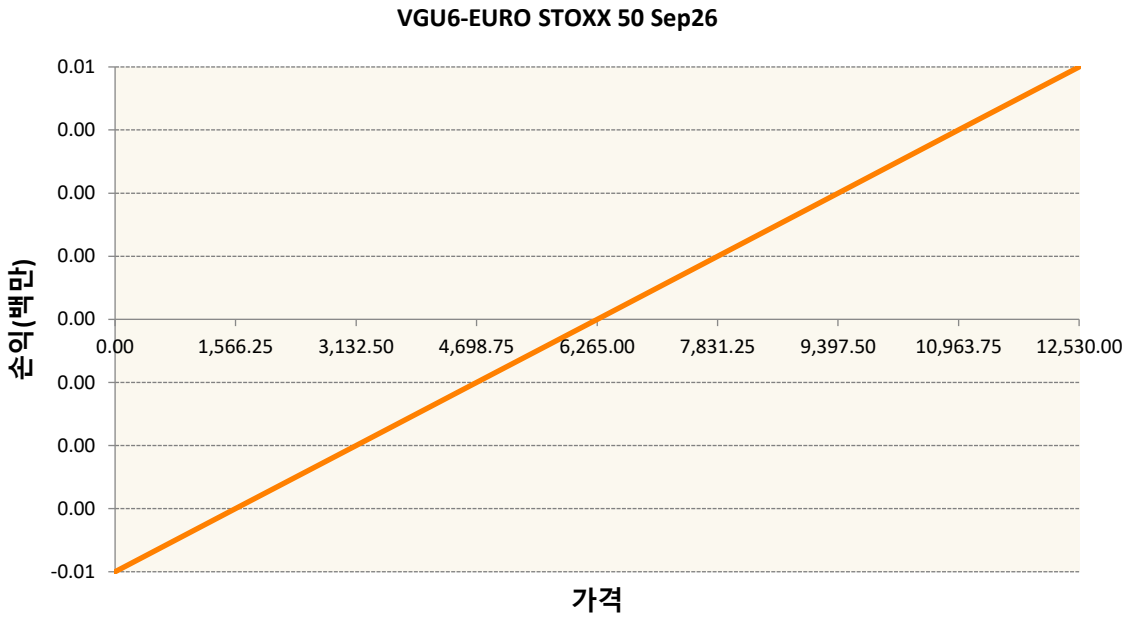
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	991	0	991	

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	2026-07-31
기준일	2026-07-30

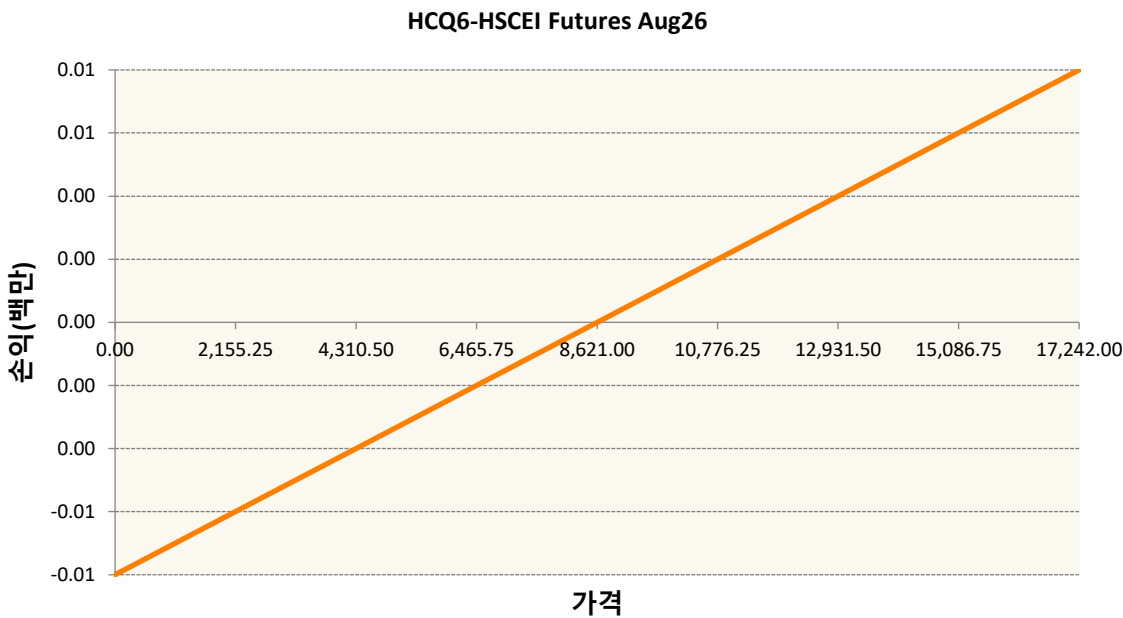
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,510	0	1,510	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ6	HSCEI Futures Aug26	121
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

140

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

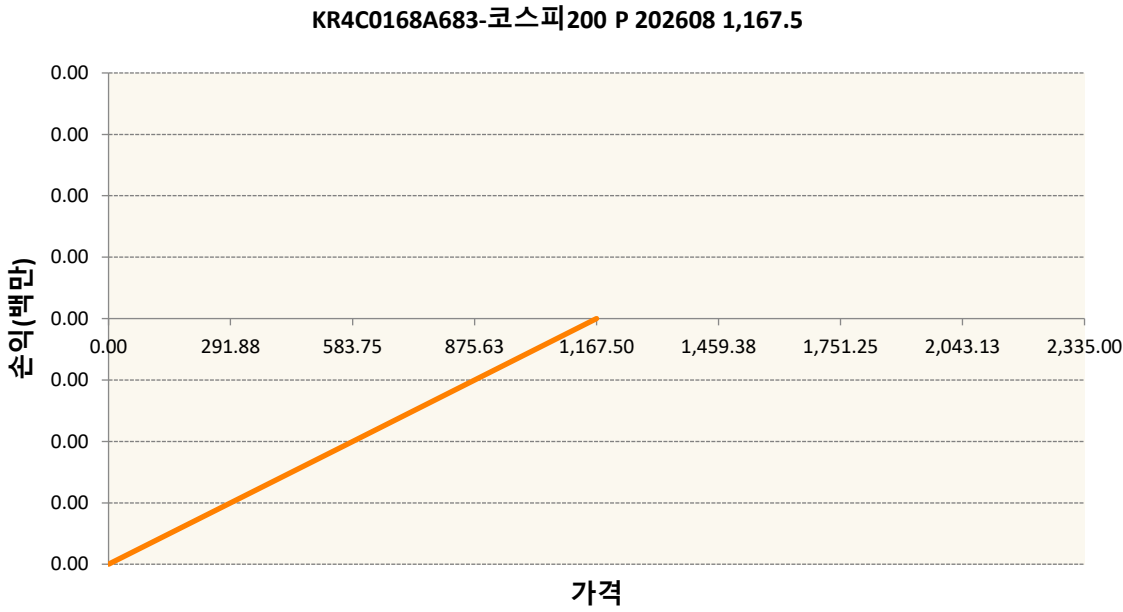
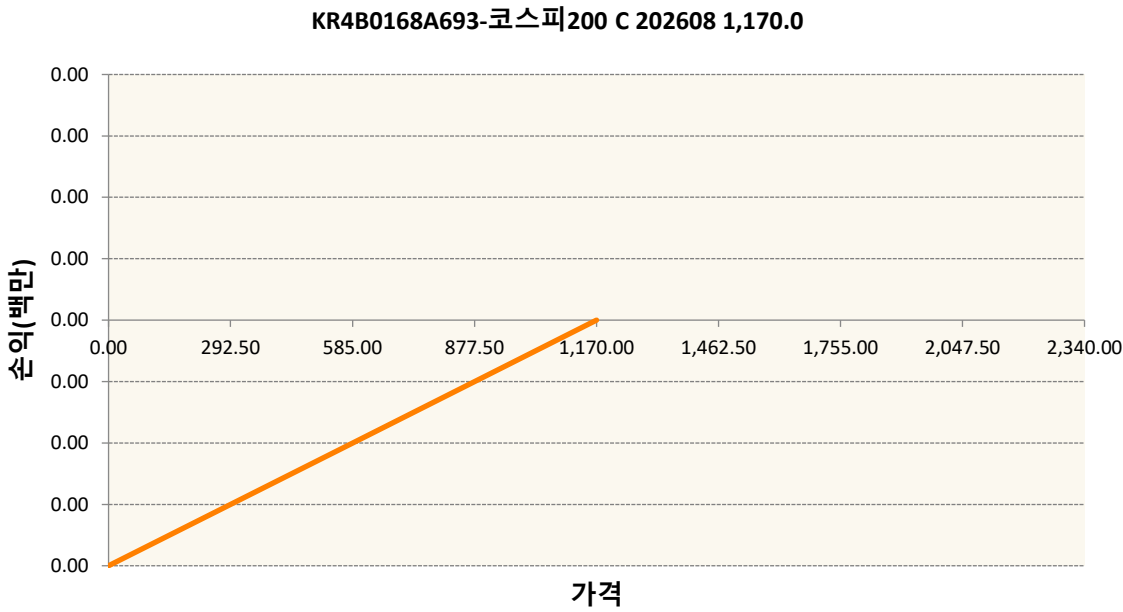
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

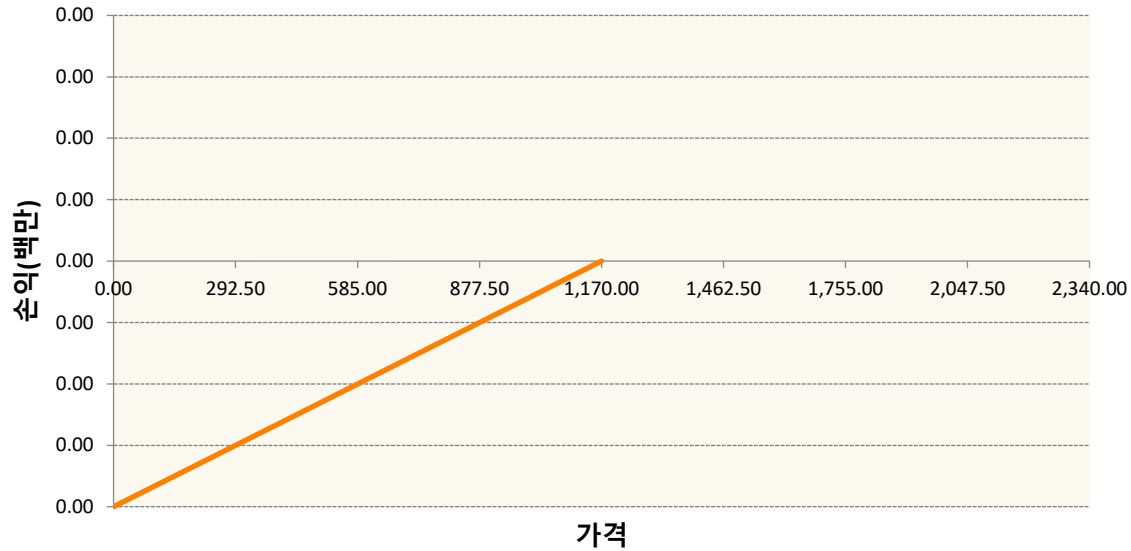
(단위:백만원)

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							2,061
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,922	-1,928	-1,938	-1,955	-1,979	-2,011	-2,050
-5.33%	-1,245	-1,255	-1,271	-1,295	-1,327	-1,368	-1,417
-2.67%	-571	-586	-609	-642	-685	-736	-797
0%	99	77	44	0	-54	-118	-191
2.67%	763	730	686	630	562	485	399
5.33%	1,418	1,373	1,314	1,244	1,162	1,071	971
8.00%	2,061	2,001	1,927	1,841	1,744	1,638	1,524
KR4C0168A683 코스피200 P 202608 1,167.5							264
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-246	-247	-248	-250	-253	-258	-263
-5.33%	-159	-161	-163	-166	-170	-175	-182
-2.67%	-73	-75	-78	-82	-88	-94	-102
0%	13	10	6	0	-7	-15	-25
2.67%	98	94	88	81	72	62	51
5.33%	182	176	168	159	149	137	124
8.00%	264	256	247	235	223	209	194
KR4C0168A691 코스피200 P 202608 1,170.0							211
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-198	-199	-201	-203	-206	-210
-5.33%	-128	-129	-130	-133	-136	-140	-145
-2.67%	-59	-60	-63	-66	-70	-76	-82
0%	10	8	4	0	-6	-12	-20

2.67%	78	75	70	65	58	50	41
5.33%	145	141	135	128	119	110	100
8.00%	211	205	198	189	179	168	156

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

(단위:백만원)

4,766

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

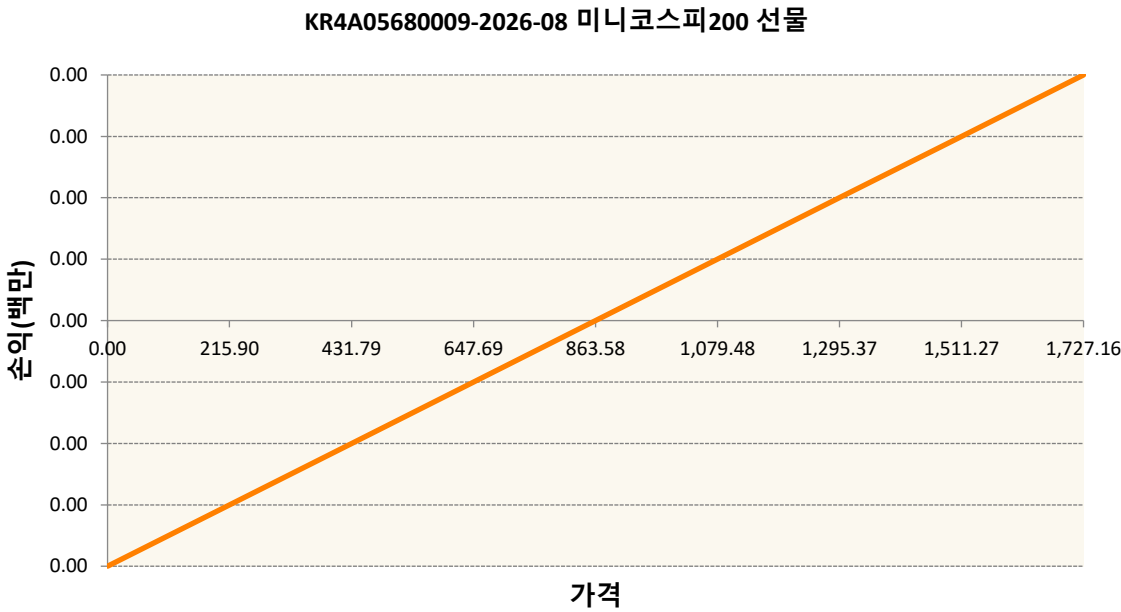
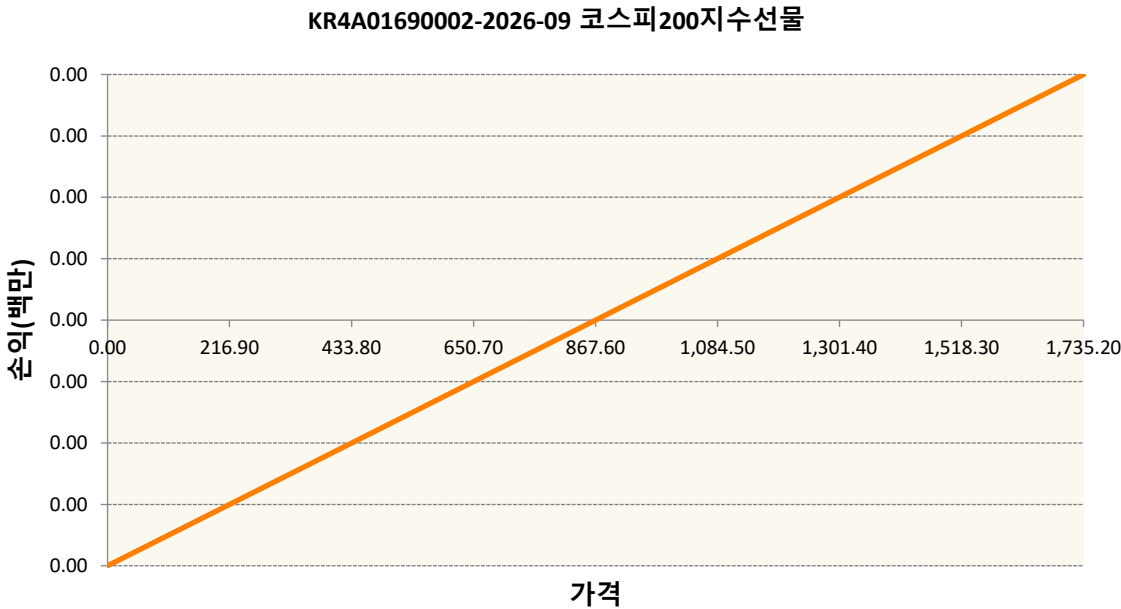
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

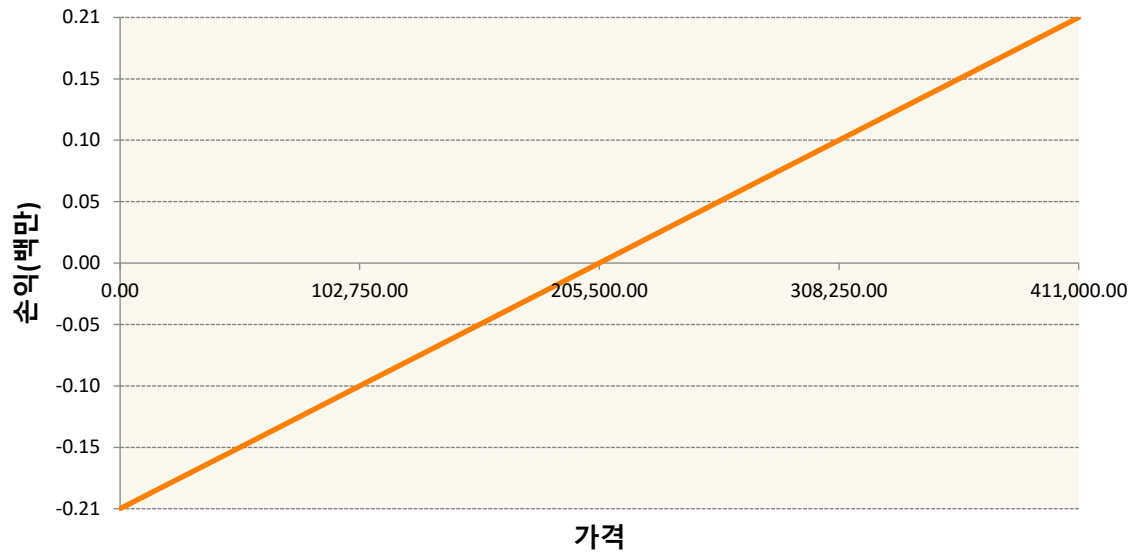
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	884	-884	장내
누계	유가증권	선물	2,059	98	1,961	장내

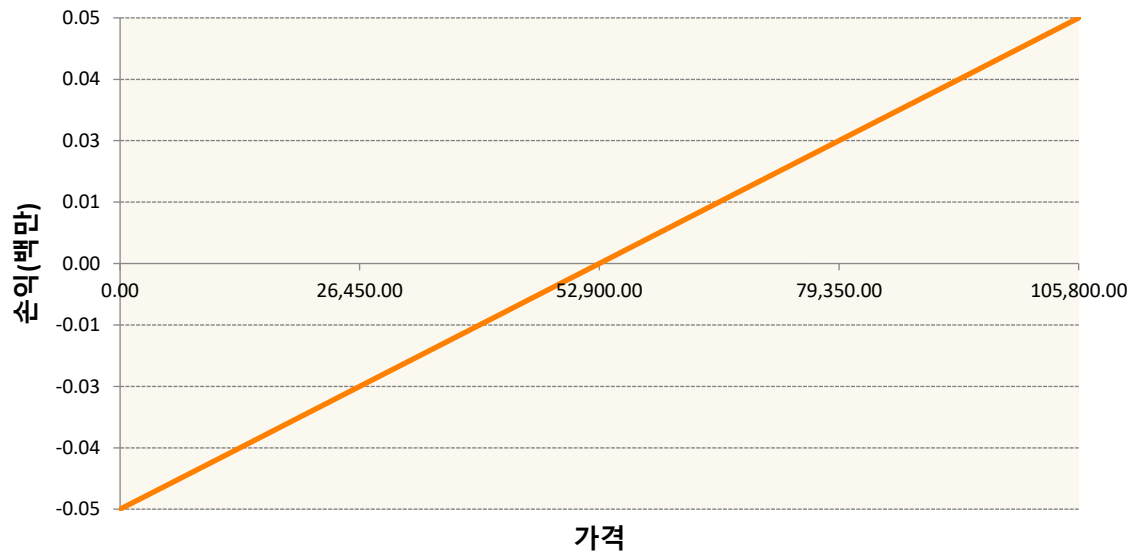
2. 만기시점의 손익구조



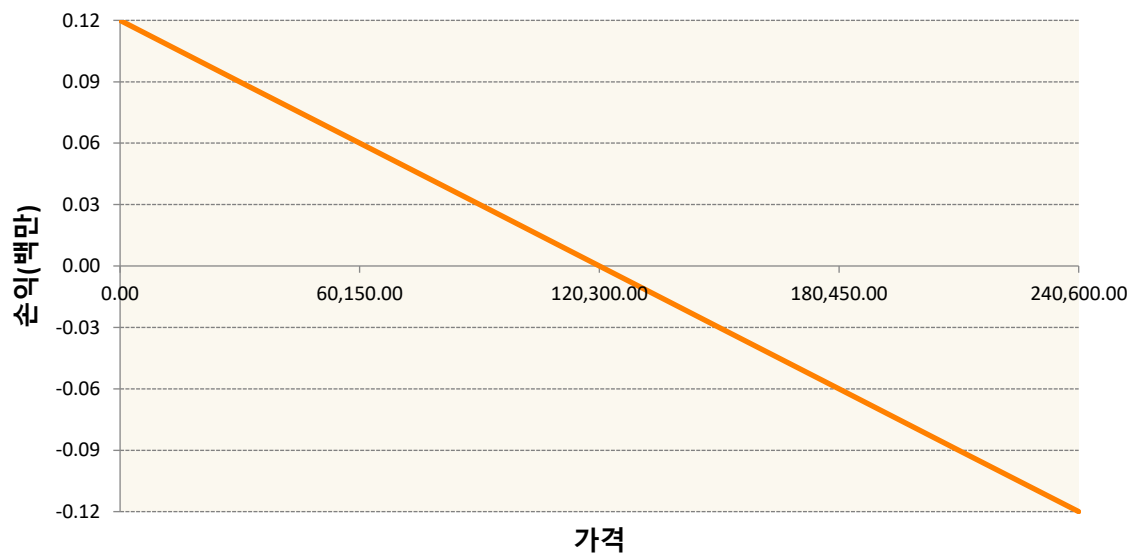
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



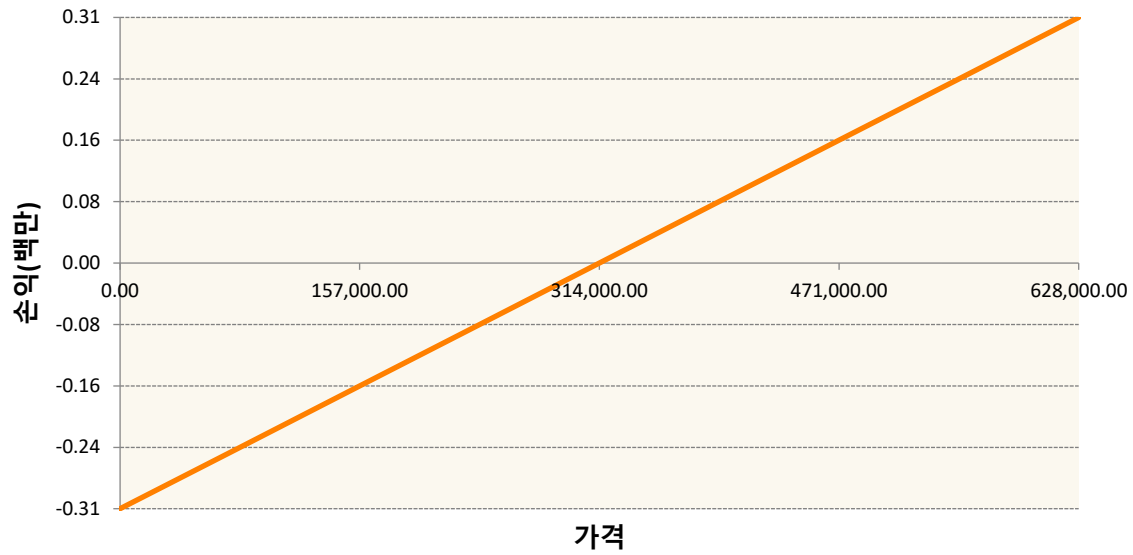
KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



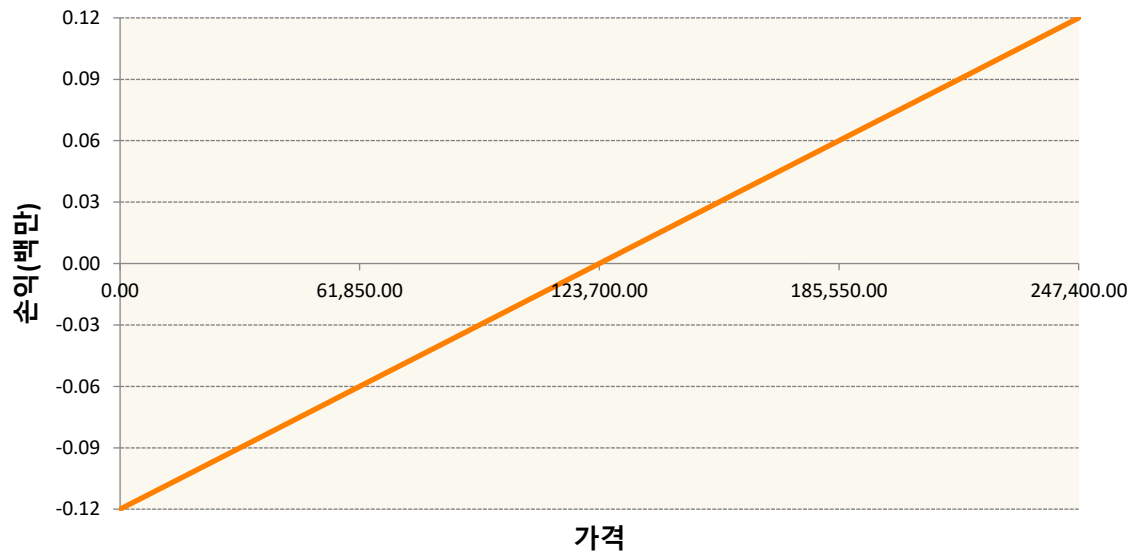
KR4A19680003-2026-08 기아개별선물



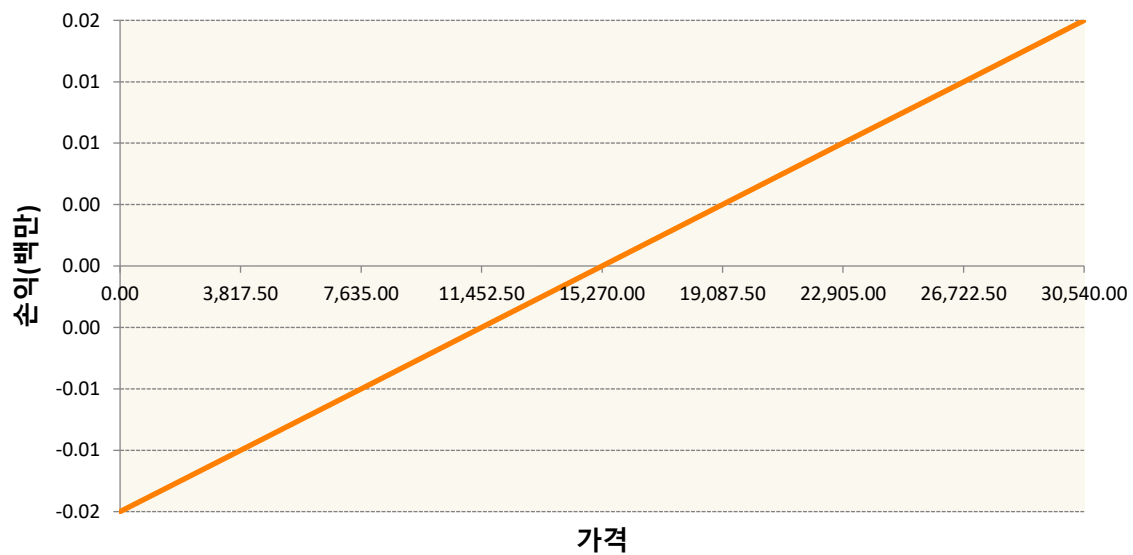
KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



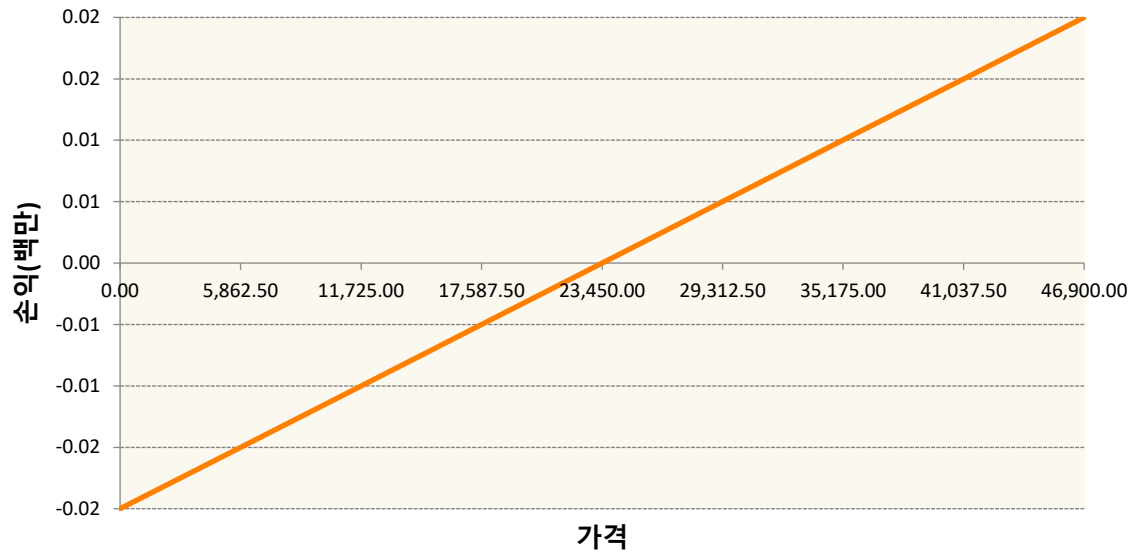
KR4A40680006-2026-08 하나금융지주개별선물



KR4AB0680002-2026-08 LG유플러스개별선물



KR4ACB680007-2026-08 한화솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				52
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-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%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	52	52	52	52	52	52	52
KR4A05680009			2026-08 미니코스피200 선물				17
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	17	17	17	17	17	17	17
KR4A11680001			2026-08 삼성전자개별선물				3
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-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%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

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	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
2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

KR4A1Q680004	2026-08 에이피알개별선물	3
--------------	------------------	---

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-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%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	3	3	3	3	3	3	3

KR4A40680006	2026-08 하나금융지주개별선물	9
--------------	--------------------	---

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-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%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9

KR4AB0680002	2026-08 LG유플러스개별선물	2
--------------	--------------------	---

	기초자산의 변동성
--	-----------

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)

248

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

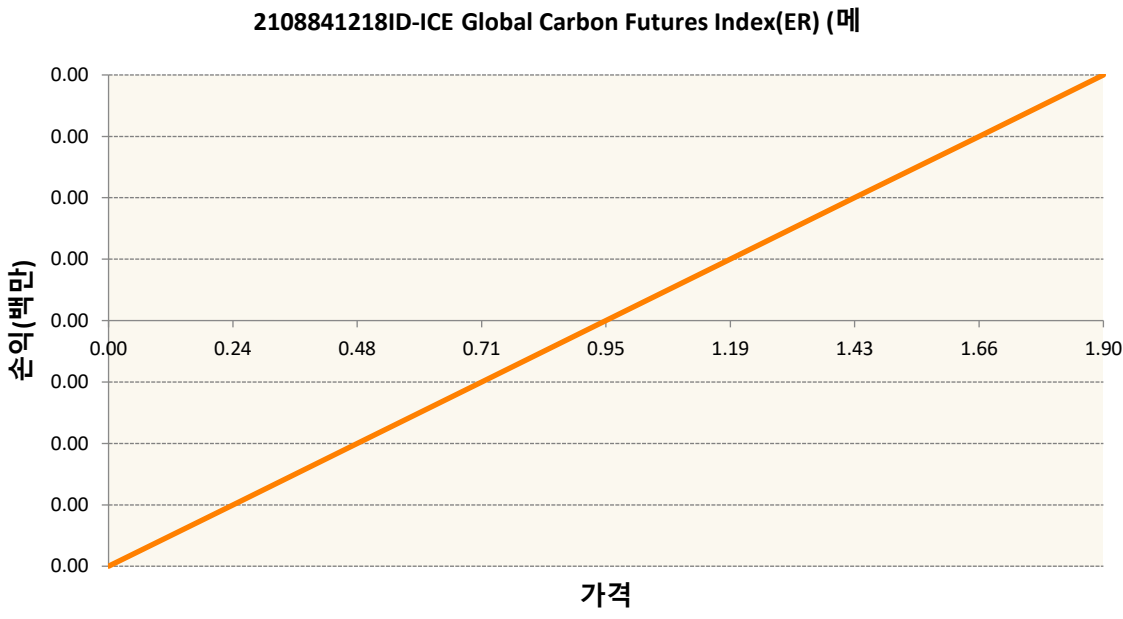
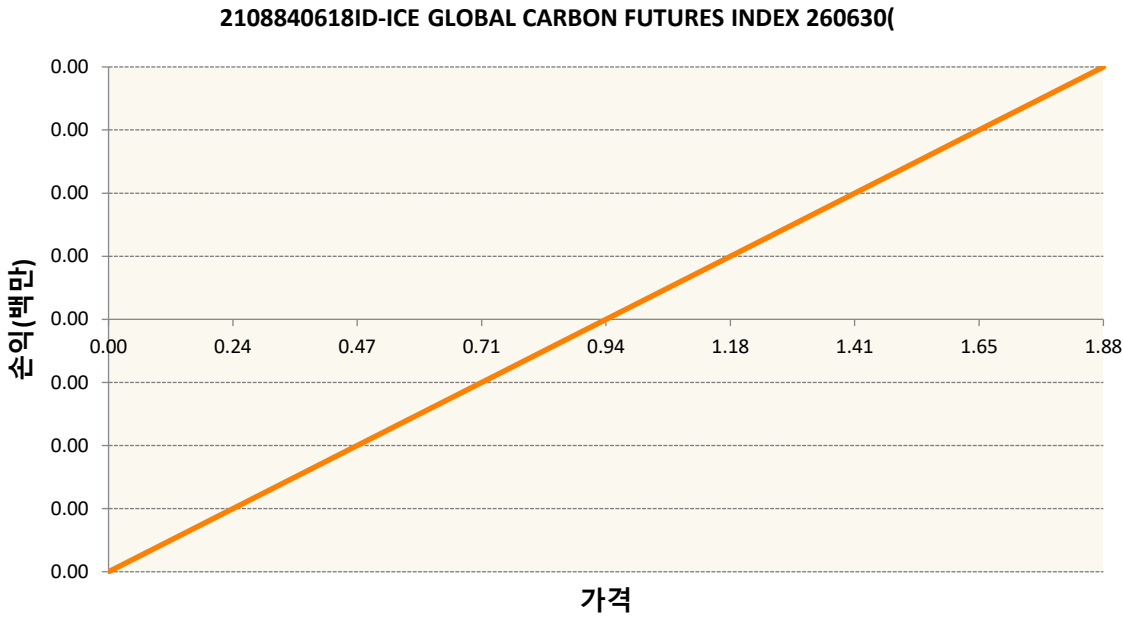
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,150	0	7,150	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		456
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		115

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	643

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

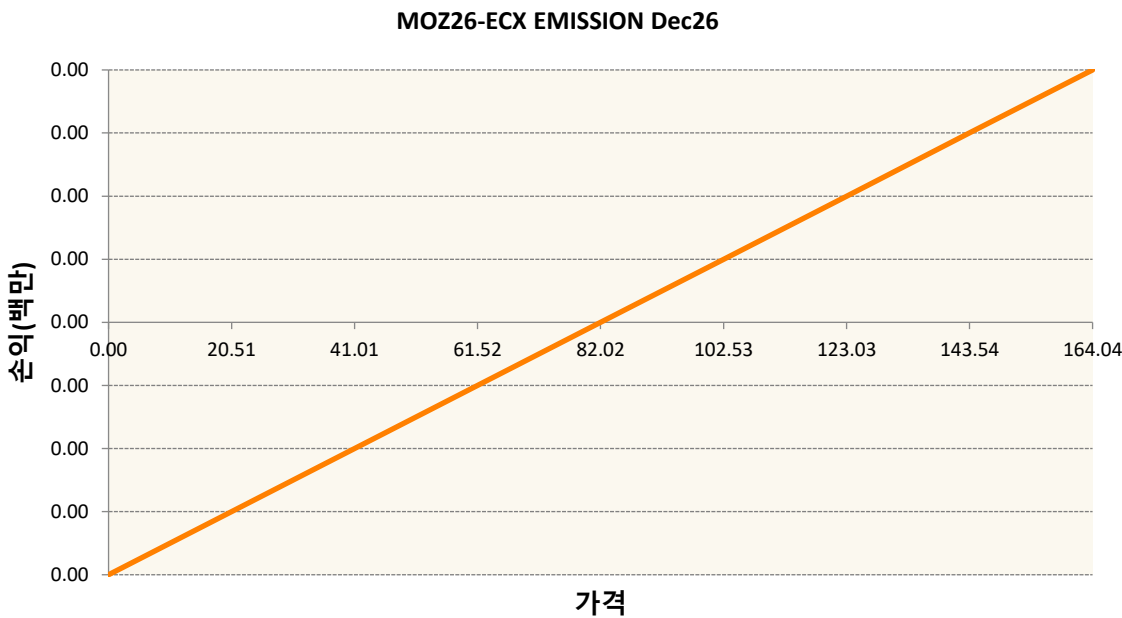
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,305	0	5,305	
누계	통화	선도	0	5,167	-5,167	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G6S(KRW/EUR 31-07-26E	207
FXW213G7X(KRW/EUR 31-08-26E	207
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	424

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

(단위:백만원)

835

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

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	-1,884	0	-1,884	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	61
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	28
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	25
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	36

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

(단위:백만원)

239

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

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	-4,270	0	-4,270	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	30
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	164
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	147

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

(단위:백만원)

626

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

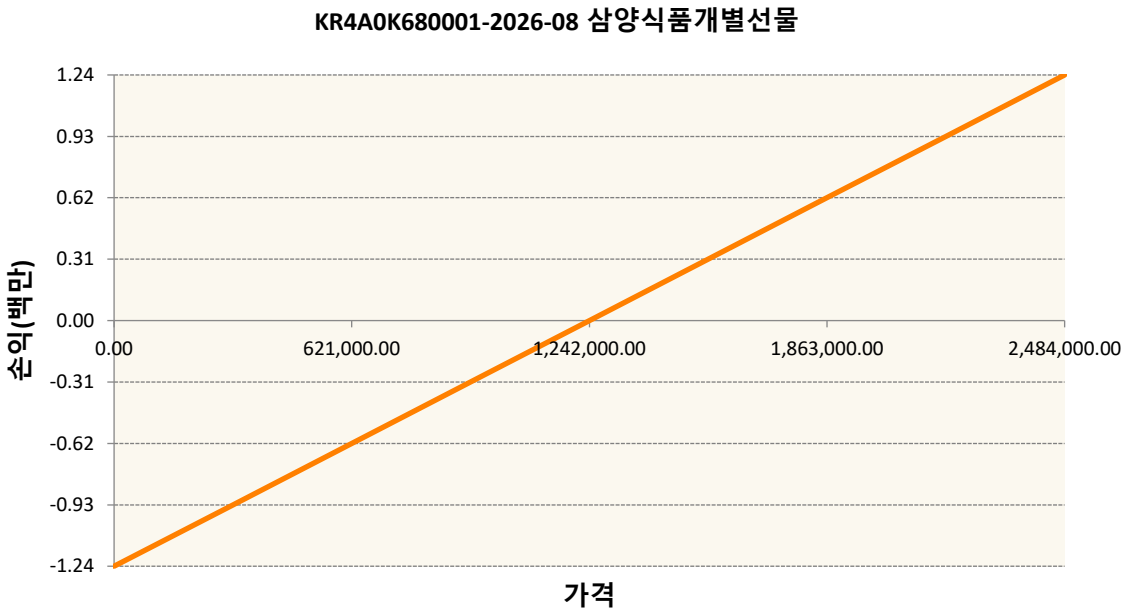
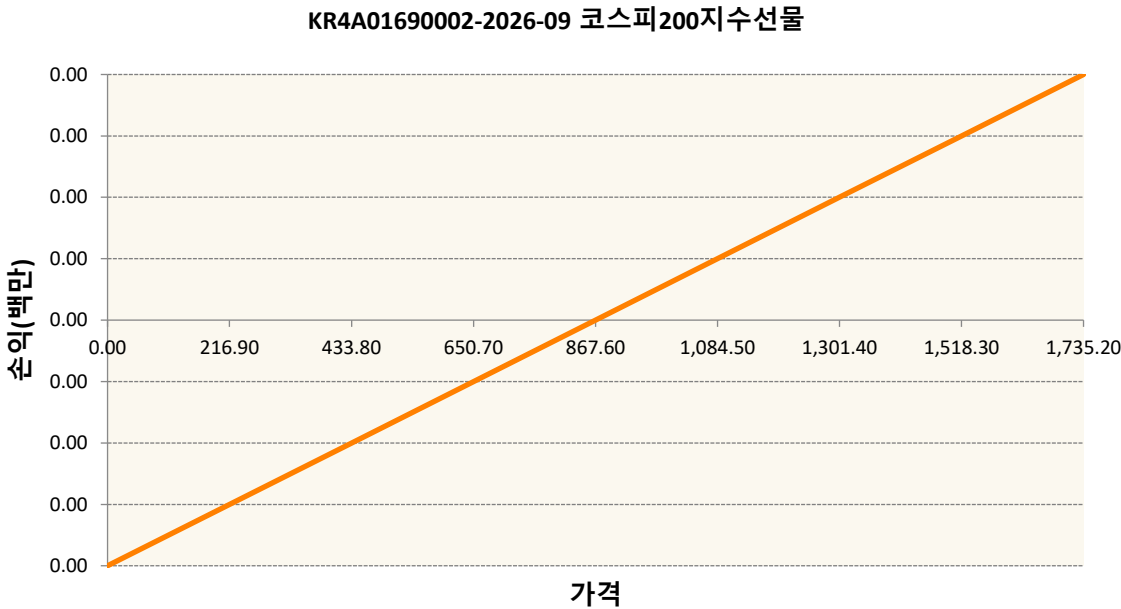
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

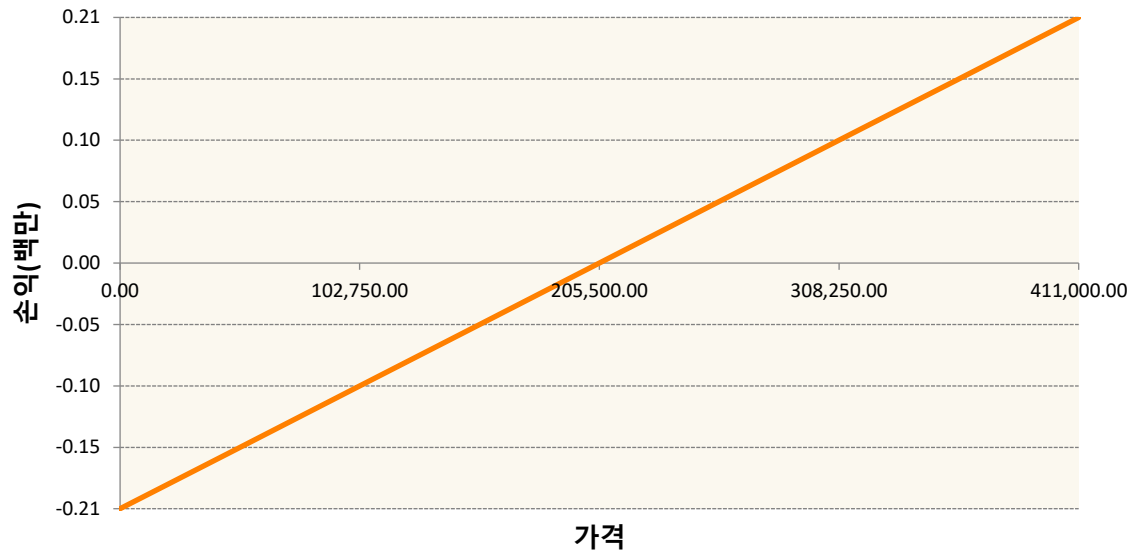
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,811	6,311	-3,499	장내
누계	유가증권	선물	24,555	792	23,763	장내

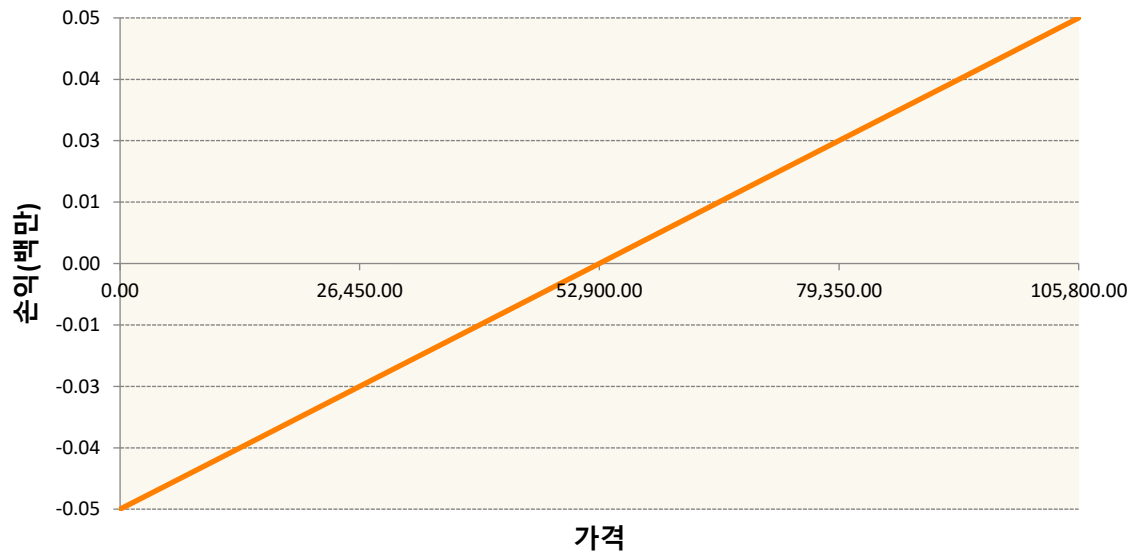
2. 만기시점의 손익구조



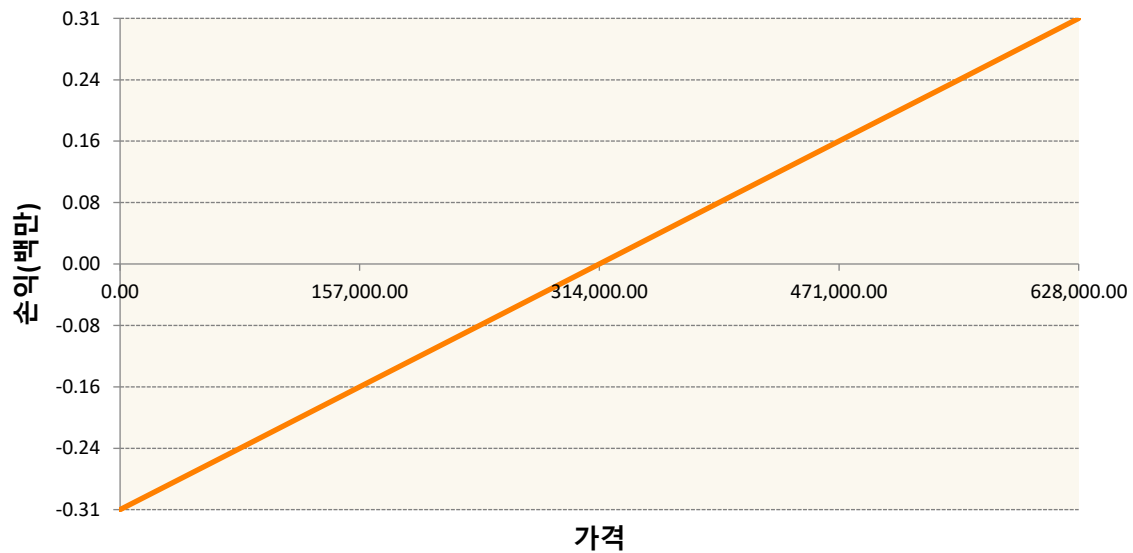
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



가격	손익(백만)
0.00	-0.02
3,817.50	-0.01
7,635.00	0.00
11,452.50	0.01
15,270.00	0.02
19,087.50	0.03
22,905.00	0.04
26,722.50	0.05
30,540.00	0.06

The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 72,400.00. The y-axis is labeled '이익 (백만)' (Profit in millions) and ranges from -0.04 to 0.04. A solid orange line represents the profit function, starting at (0, 0.04) and ending at (72,400, -0.04). The line crosses the x-axis at 36,200.00, indicating the break-even point where profit is zero.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.04
9,050.00	0.03
18,100.00	0.02
27,150.00	0.01
36,200.00	0.00
45,250.00	-0.01
54,300.00	-0.02
63,350.00	-0.03
72,400.00	-0.04

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				1,623
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,623	-1,623	-1,623	-1,623	-1,623	-1,623	-1,623	
-5.33%	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	-1,082	
-2.67%	-541	-541	-541	-541	-541	-541	-541	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	541	541	541	541	541	541	541	
5.33%	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082	1,082	
8.00%	1,623	1,623	1,623	1,623	1,623	1,623	1,623	
KR4A0K680001				2026-08 삼양식품개별선물				31
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-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%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

KR4A11680001

2026-08 삼성전자개별선물

245

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245
-5.33%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	82	82	82	82	82	82	82
5.33%	163	163	163	163	163	163	163
8.00%	245	245	245	245	245	245	245

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

KR4A1Q680004

2026-08 에이피알개별선물

45

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

KR4AB0680002

2026-08 LG유플러스개별선물

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
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)

5,975

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

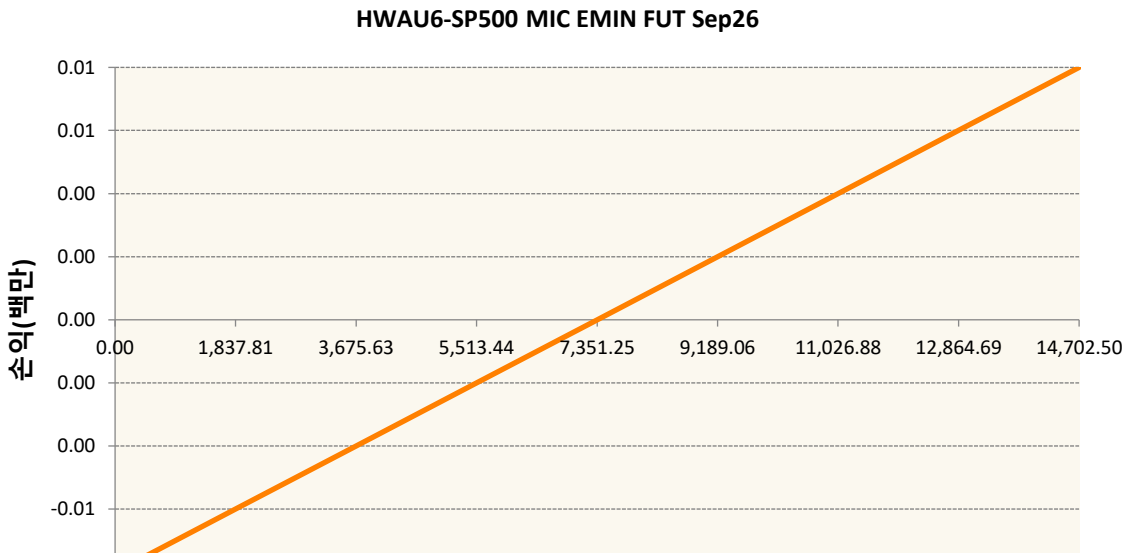
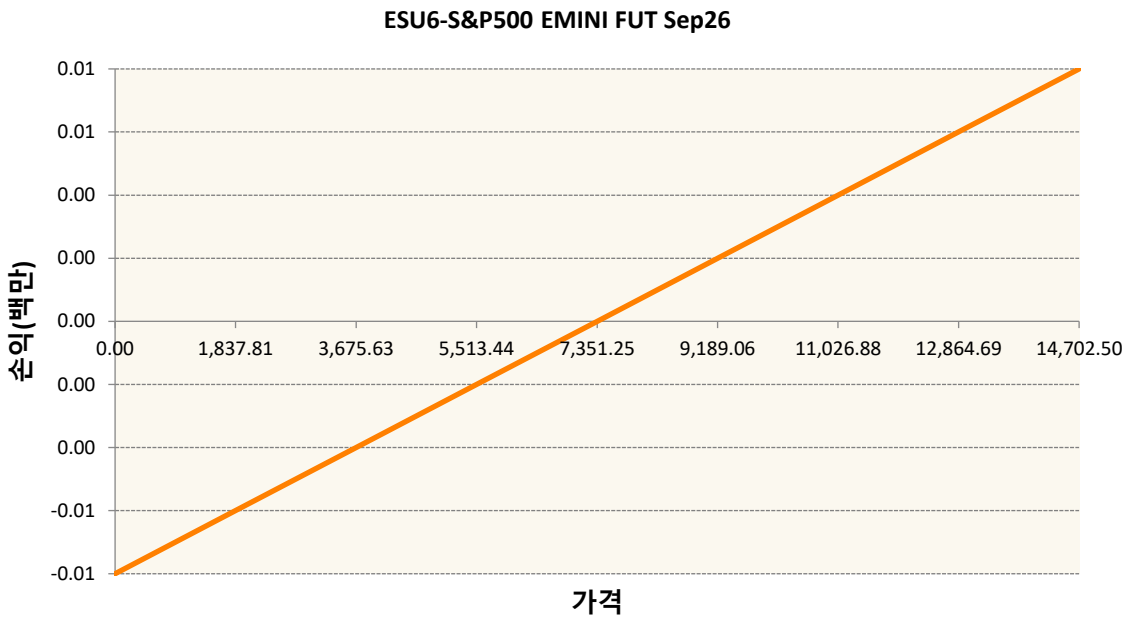
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

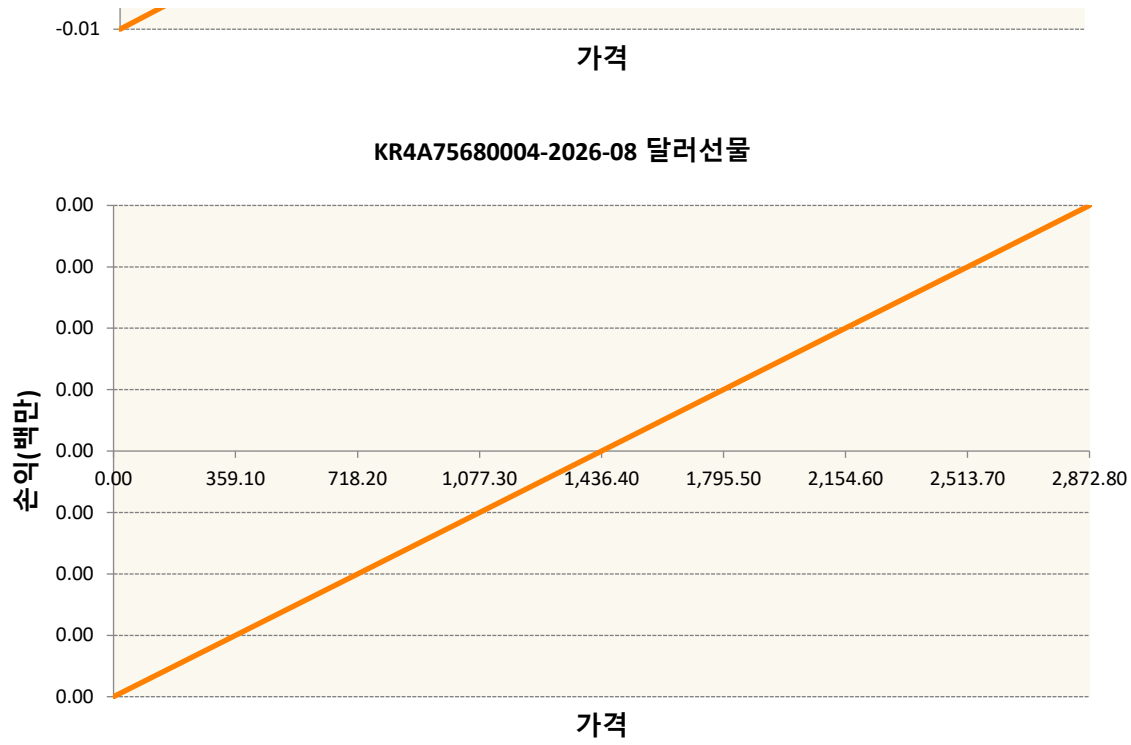
1. 계약금액

(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	68,384	0	68,384	
누계	지수	선물	169	0	169	장내
누계	통화	선물	10,198	0	10,198	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	5,471
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	14
KR4A756800	2026-08 달러선물	816

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

(단위:백만원)

4,731

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

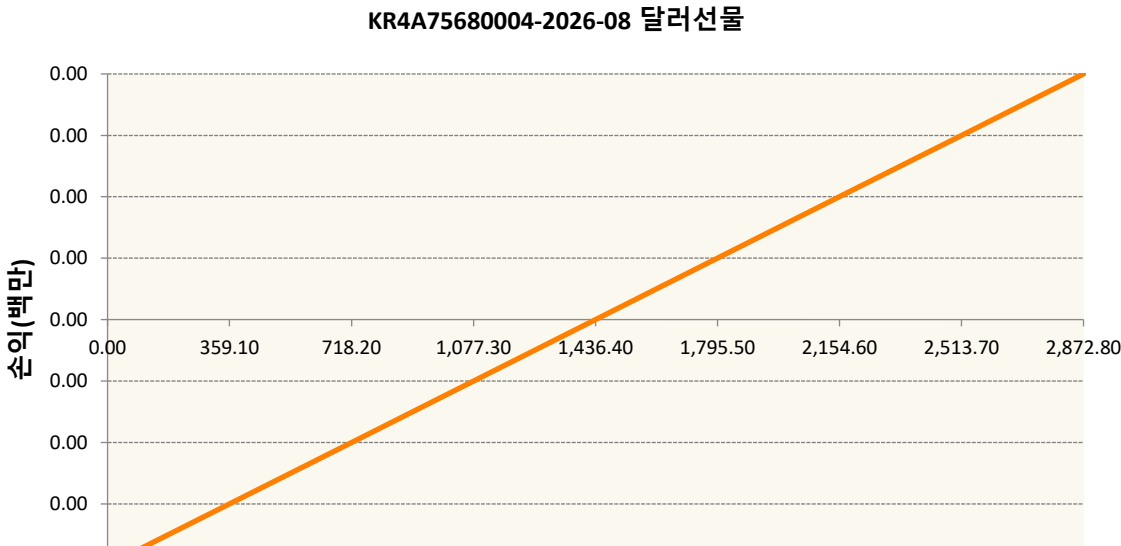
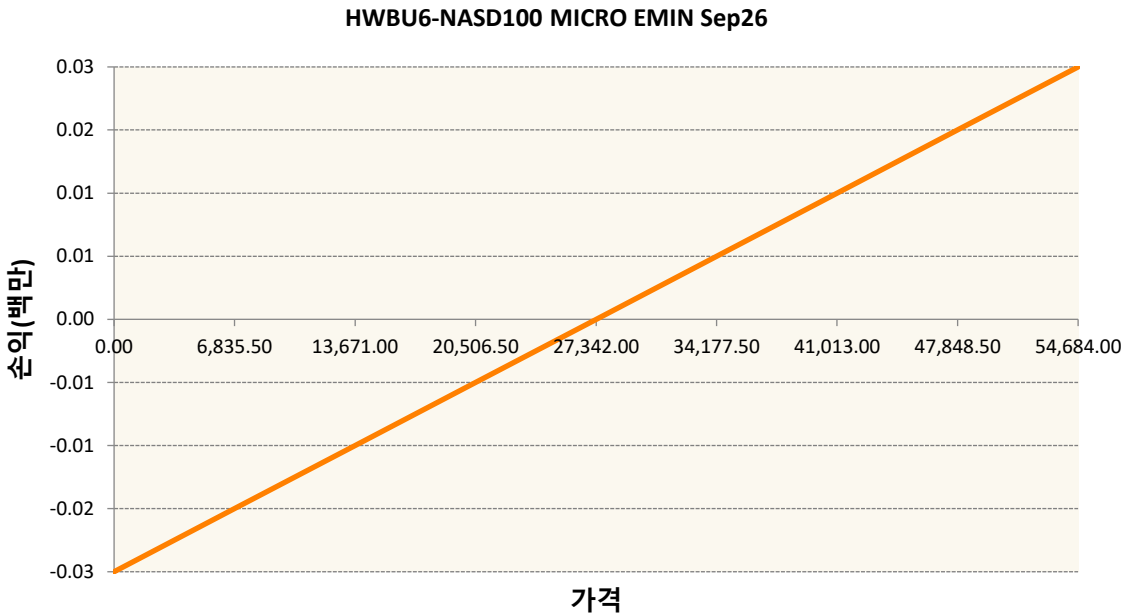
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

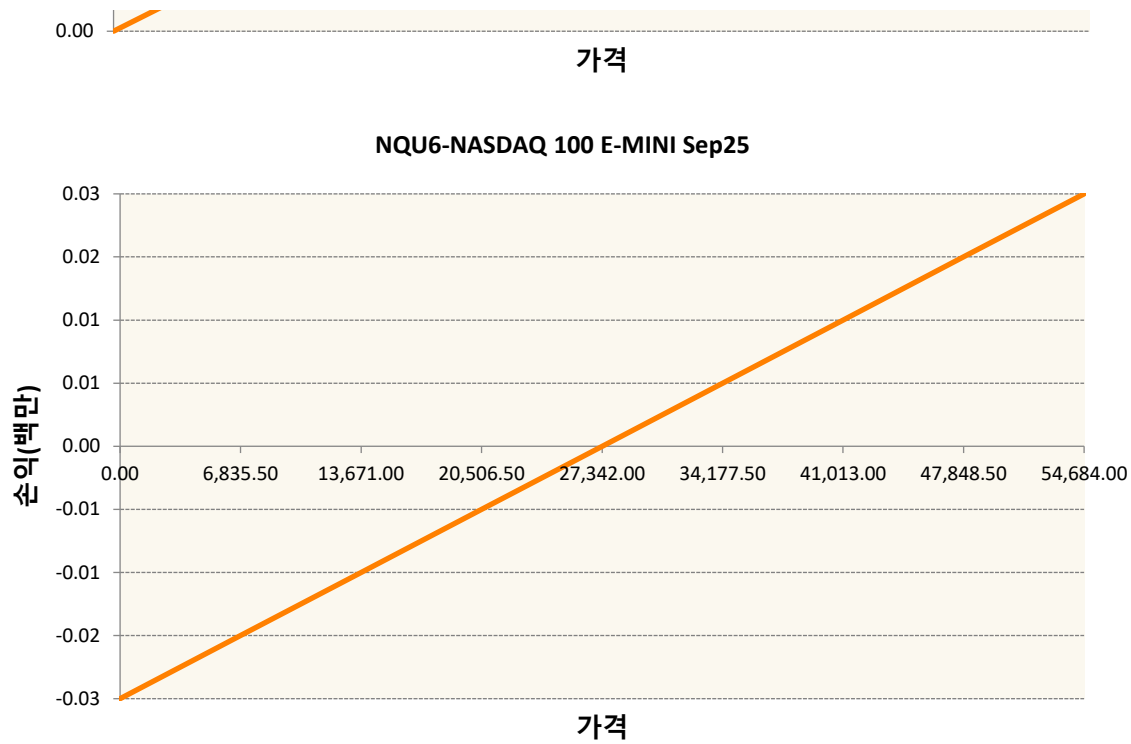
1. 계약금액

(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	659	0	659	장내
누계	지수	선물	31,595	0	31,595	
누계	통화	선물	3,749	0	3,749	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		53
KR4A756800	2026-08 달러선물		300
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,528

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,930

공시일	2026-07-31
기준일	2026-07-30

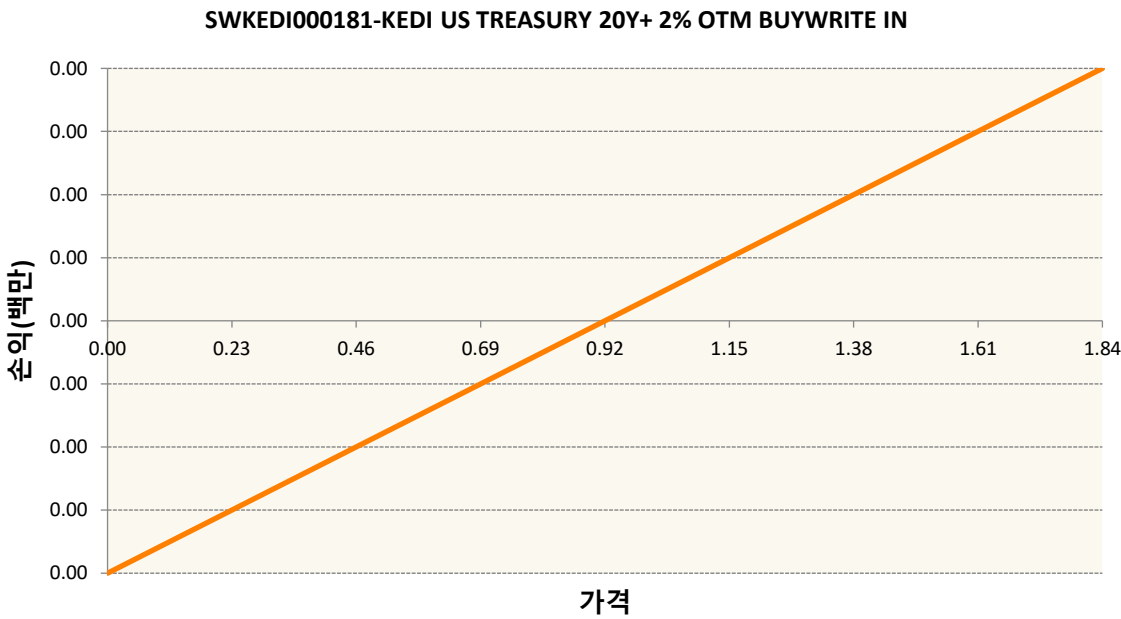
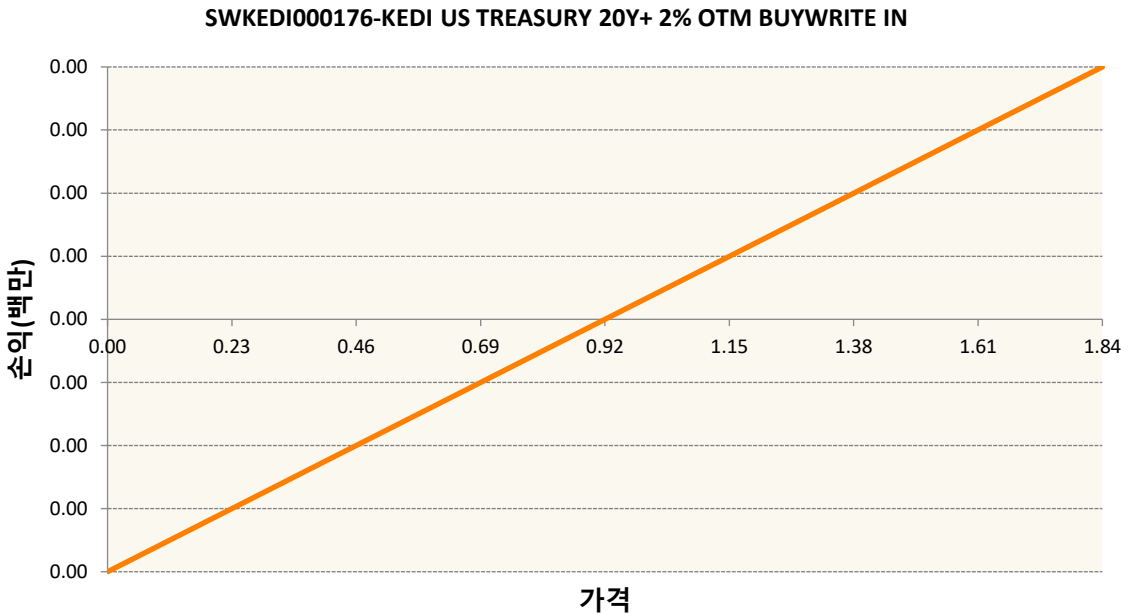
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

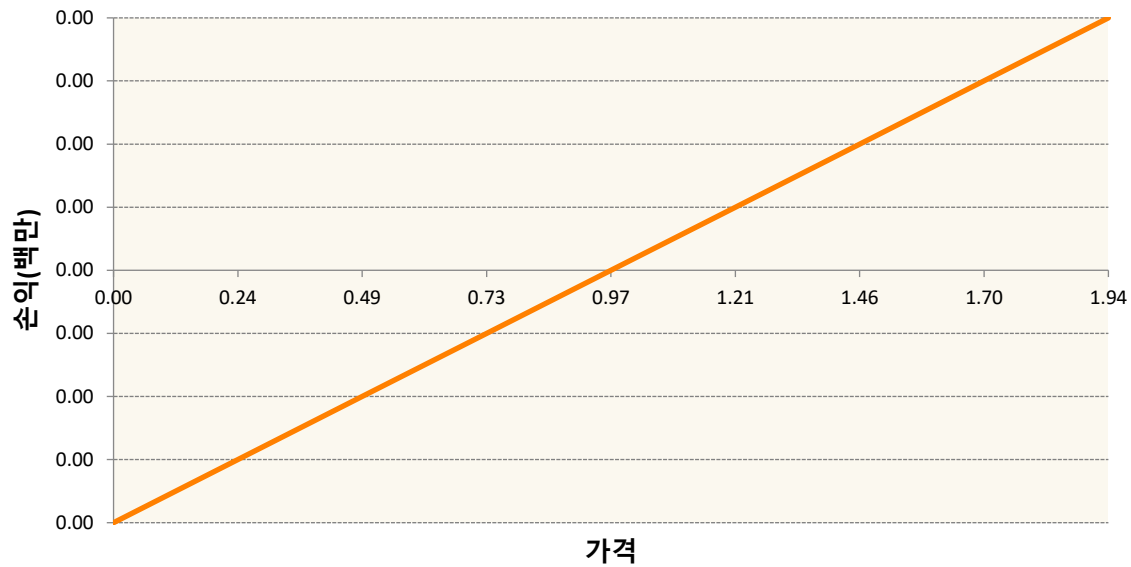
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	291,498	0	291,498	장외

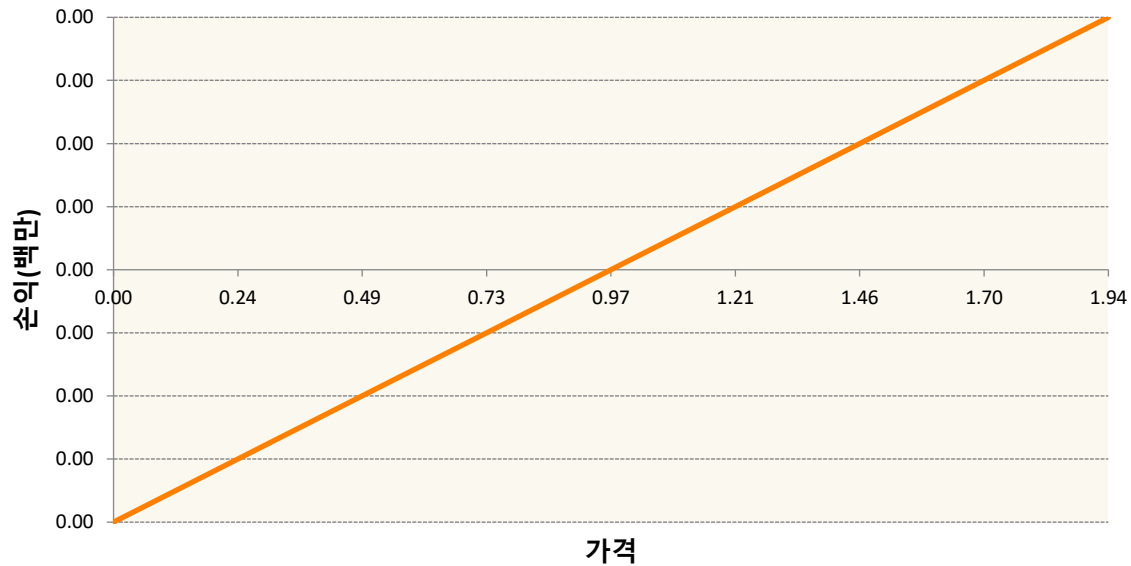
2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000187-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000188-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,500
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,943
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,622
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,325

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

(단위:백만원)

10,048