

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

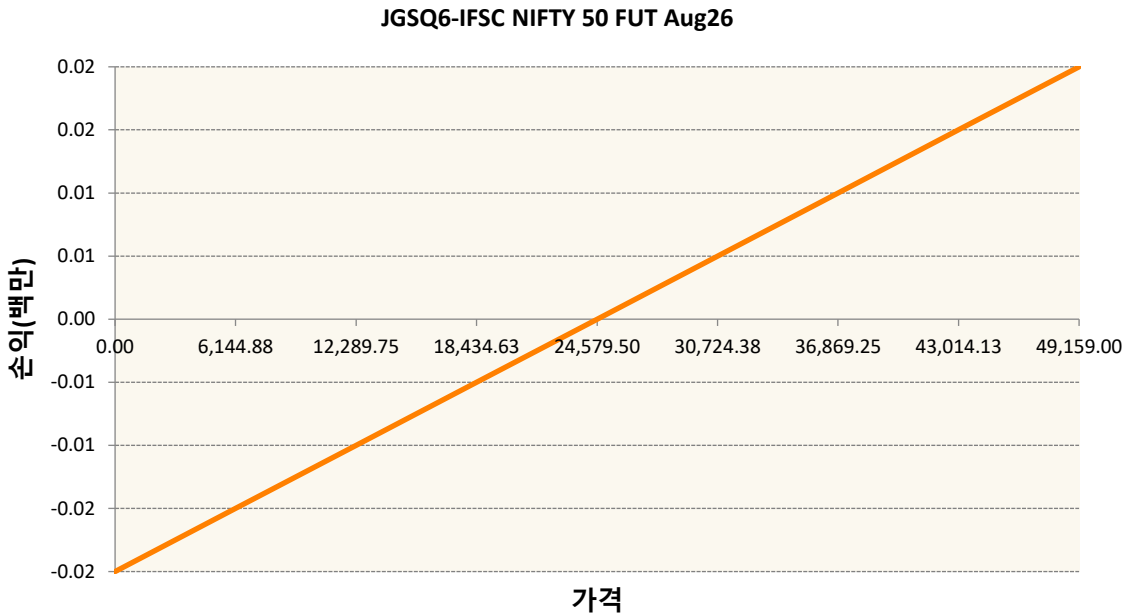
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	360	0	360	

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)

21

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

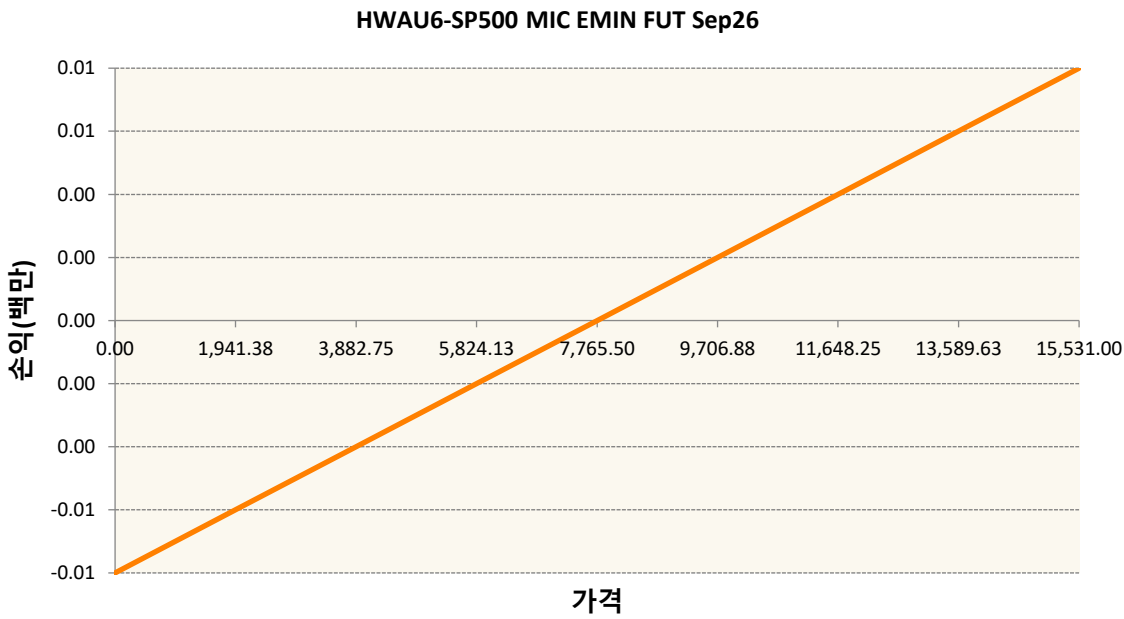
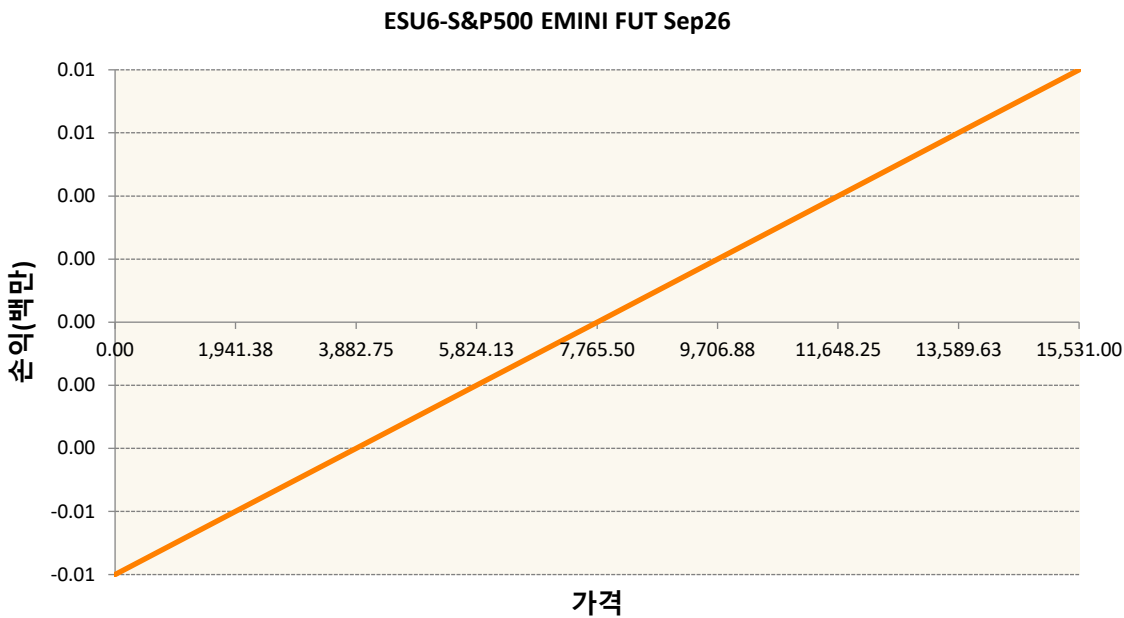
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	592	0	592	
누계	지수	선물	59	0	59	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	47
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	45

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

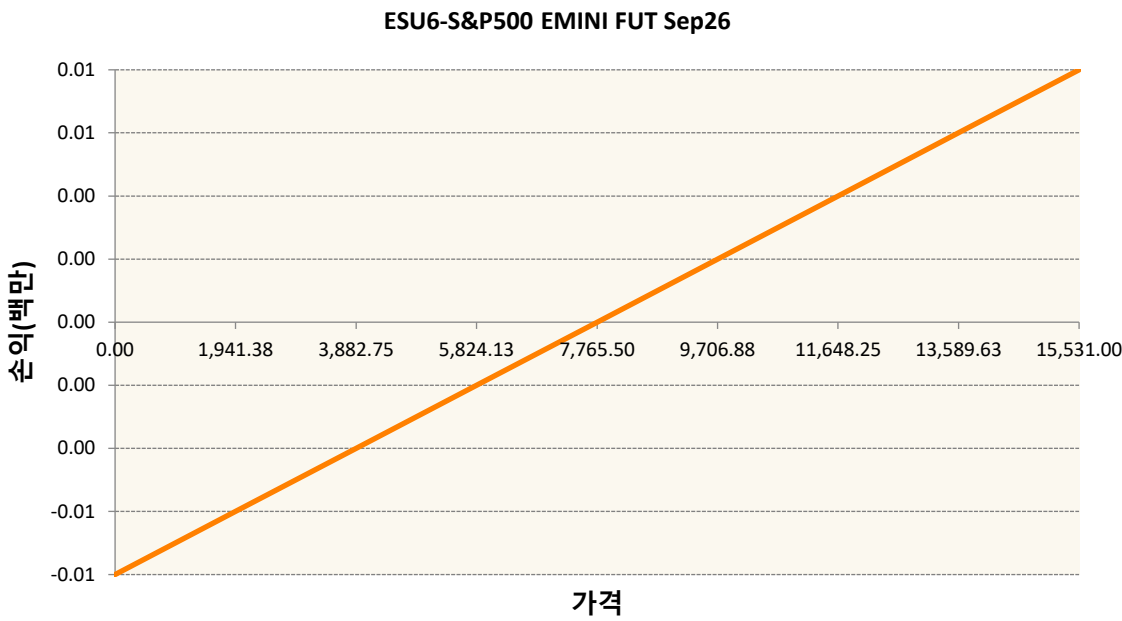
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	586	0	586	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6 S&P500 EMINI FUT Sep26

47

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

(단위:백만원)

41

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

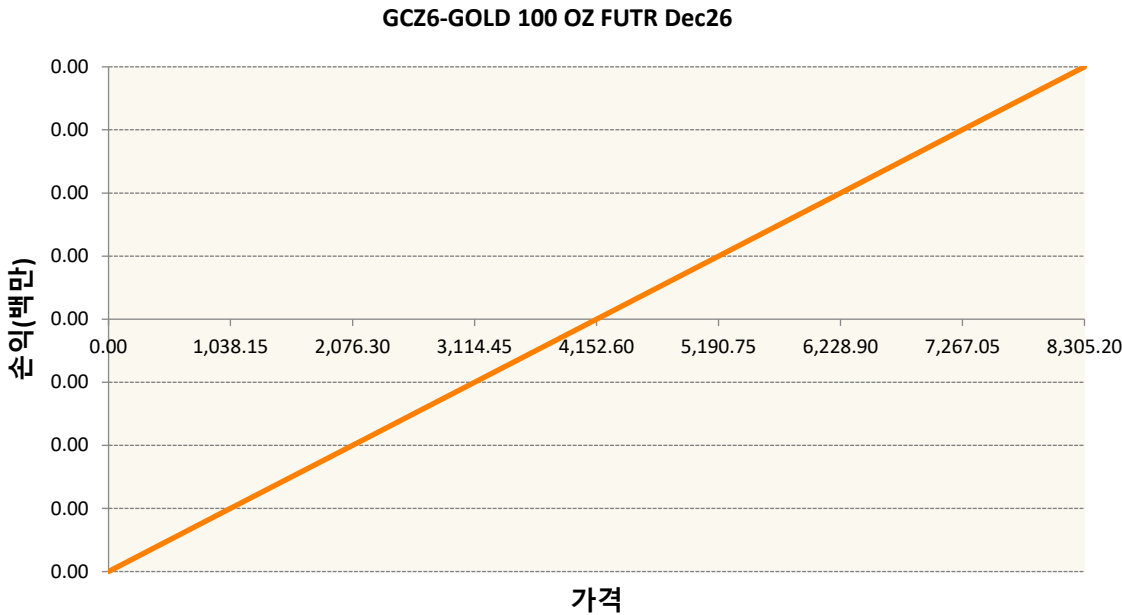
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			4,775	0	4,775	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 08/07/26 C378 EQUITY	2
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	382

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

(단위:백만원)

499

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

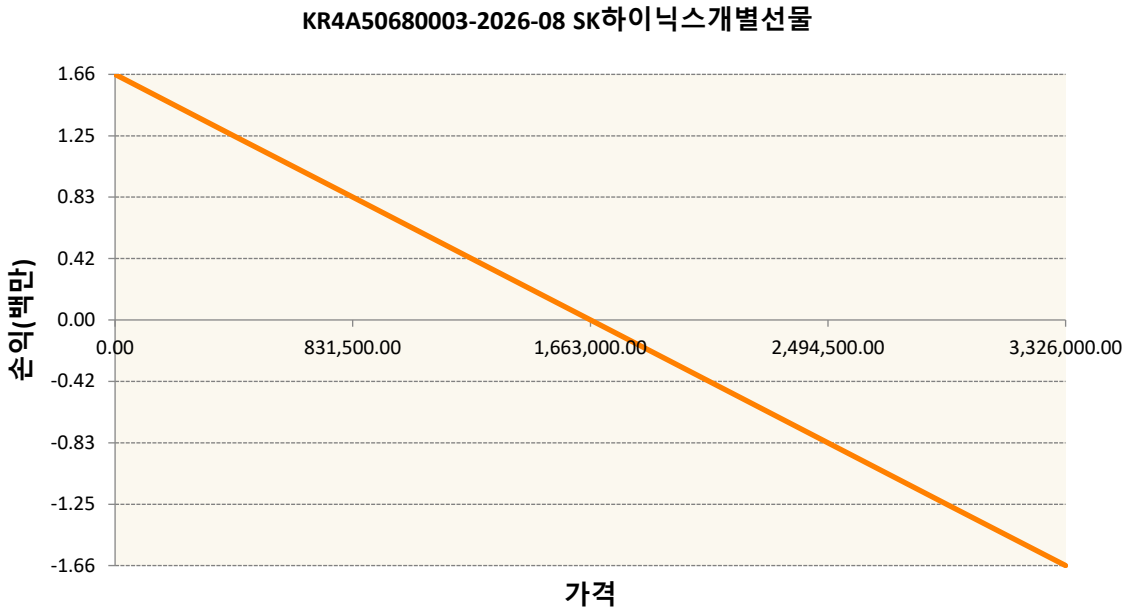
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	1,829	-1,829	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUBC` PLTR US 08/07/26 C130 EQUITY	984
AOPLTRUBP` PLTR US 08/07/26 P130 EQUITY	96
KR4A506800 2026-08 SK하이닉스개별선물	146

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

(단위:백만원)

3,679

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

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)

AOTLTUSAC(TLT US 08/07/26 C83 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

0

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

(단위:백만원)

16,444

공시일 2026-08-06

기준일 2026-08-05

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	2026-08-06
기준일	2026-08-05

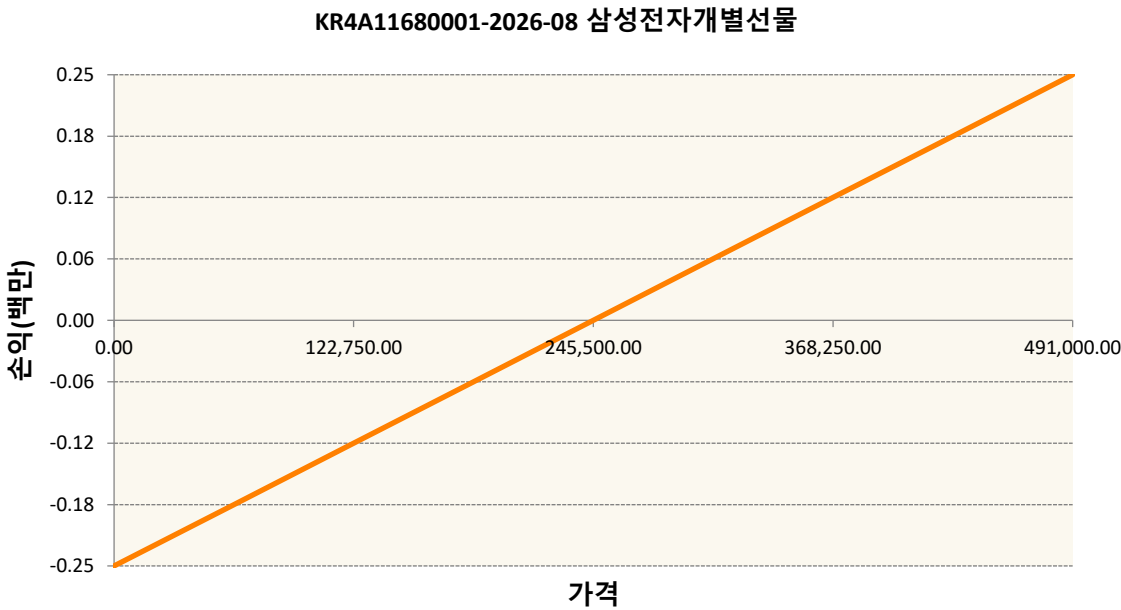
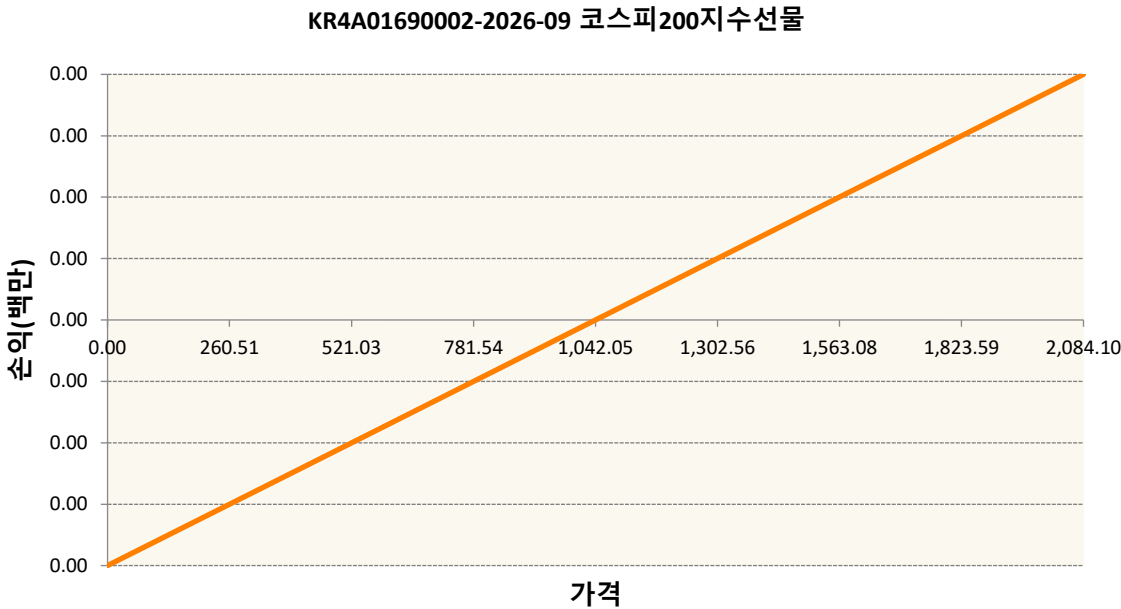
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

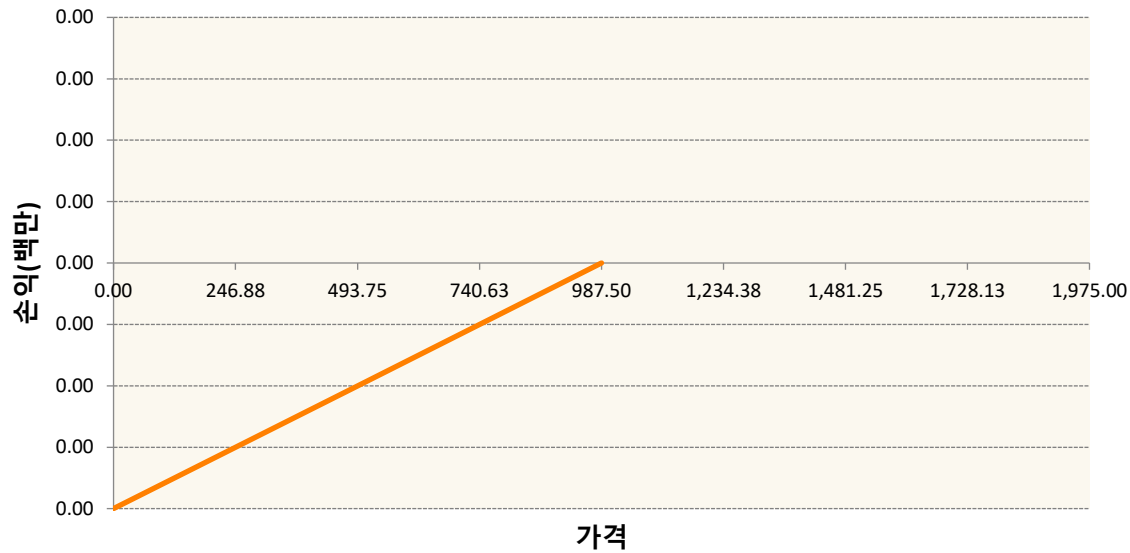
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	20,030	0	20,030	장내
누계	유가증권	옵션	0	26,689	-26,689	장내

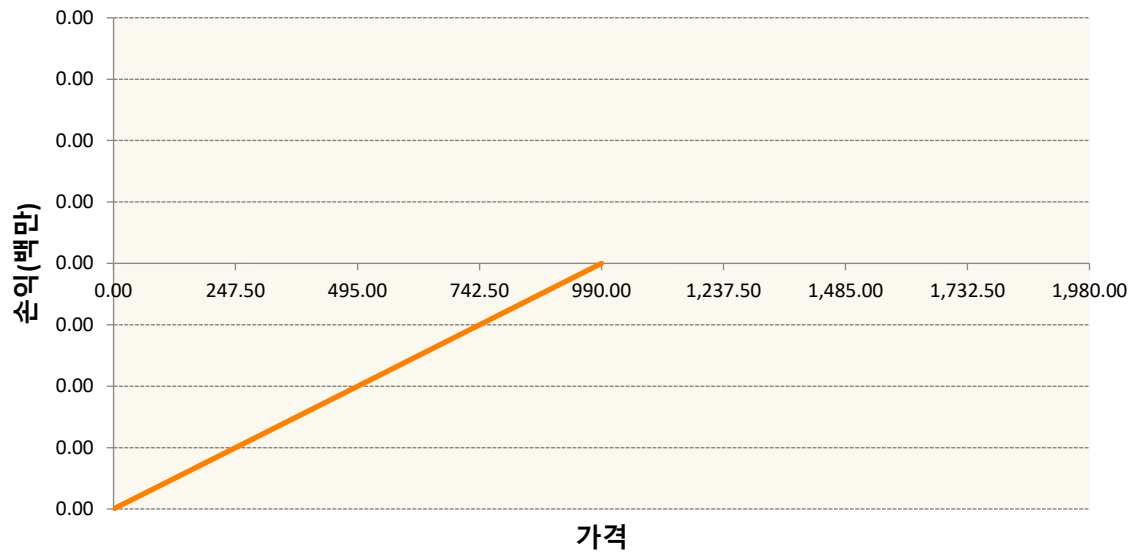
2. 만기시점의 손익구조



KR4B09F99872-코스피위클리 C 2608W1 987.5



KR4B09F99906-코스피위클리 C 2608W1 990.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물			540
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-540	-540	-540	-540	-540	-540	-540
-5.33%	-360	-360	-360	-360	-360	-360	-360
-2.67%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	180	180	180	180	180	180	180
5.33%	360	360	360	360	360	360	360
8.00%	540	540	540	540	540	540	540
KR4A11680001				2026-08 삼성전자개별선물			1,063
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063
-5.33%	-708	-708	-708	-708	-708	-708	-708
-2.67%	-354	-354	-354	-354	-354	-354	-354
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	354	354	354	354	354	354	354
5.33%	708	708	708	708	708	708	708
8.00%	1,063	1,063	1,063	1,063	1,063	1,063	1,063
KR4B09F99872 코스피위클리 C 2608W1 987.5							619

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-518	-532	-548	-565	-582	-600	-619
-5.33%	-201	-224	-247	-270	-293	-316	-340
-2.67%	-30	-48	-68	-88	-108	-129	-151
0%	29	21	11	0	-13	-27	-42
2.67%	42	40	37	32	27	19	11
5.33%	44	43	43	41	39	37	33
8.00%	44	44	44	43	43	42	41
KR4B09F99906 코스피위클리 C 2608W1 990.0							426

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-362	-371	-381	-391	-402	-414	-426
-5.33%	-145	-160	-175	-190	-205	-221	-236
-2.67%	-23	-36	-49	-63	-77	-91	-105
0%	21	15	8	0	-9	-19	-29
2.67%	31	29	27	24	20	15	9
5.33%	32	32	32	31	29	27	25
8.00%	32	32	32	32	32	31	30

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

(단위:백만원)

7,000

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

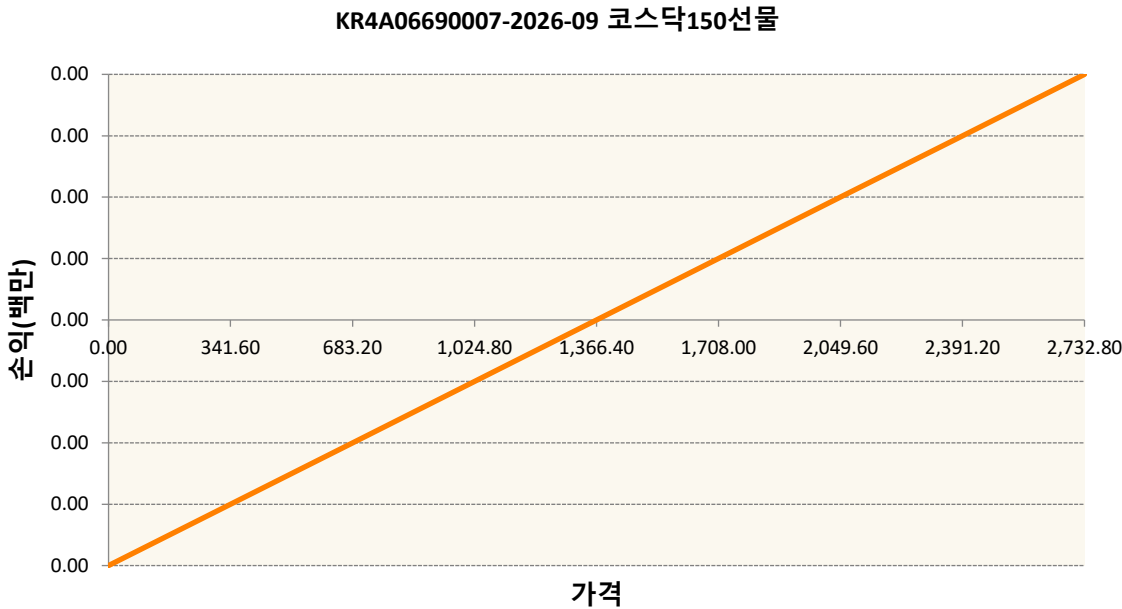
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	793	0	793	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				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)

22,715

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

(단위:백만원)

78,565

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

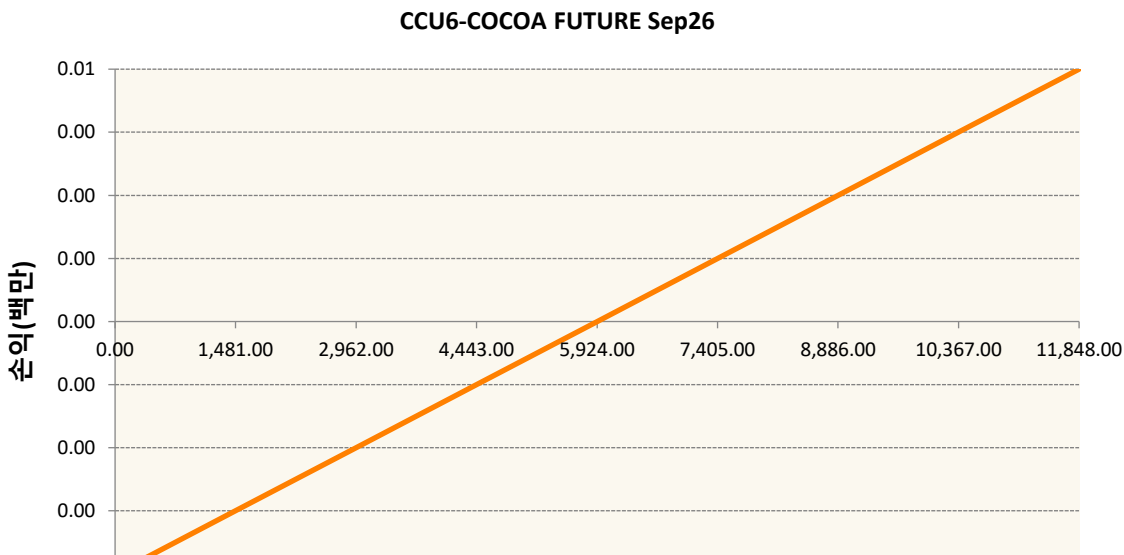
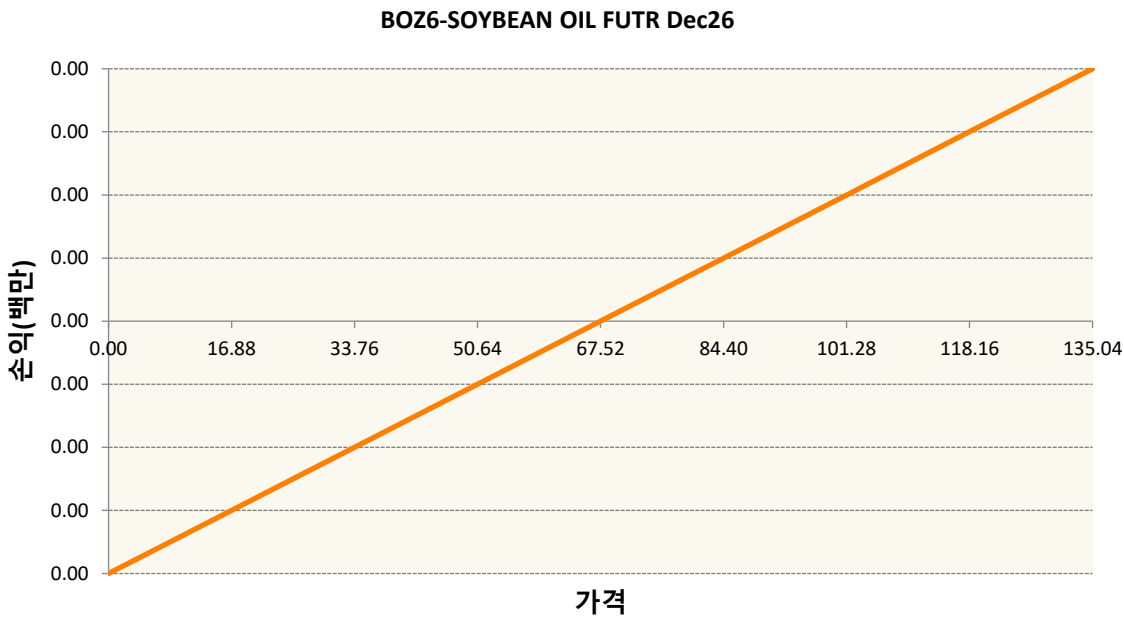
포커스농산물모(채권-파생형)

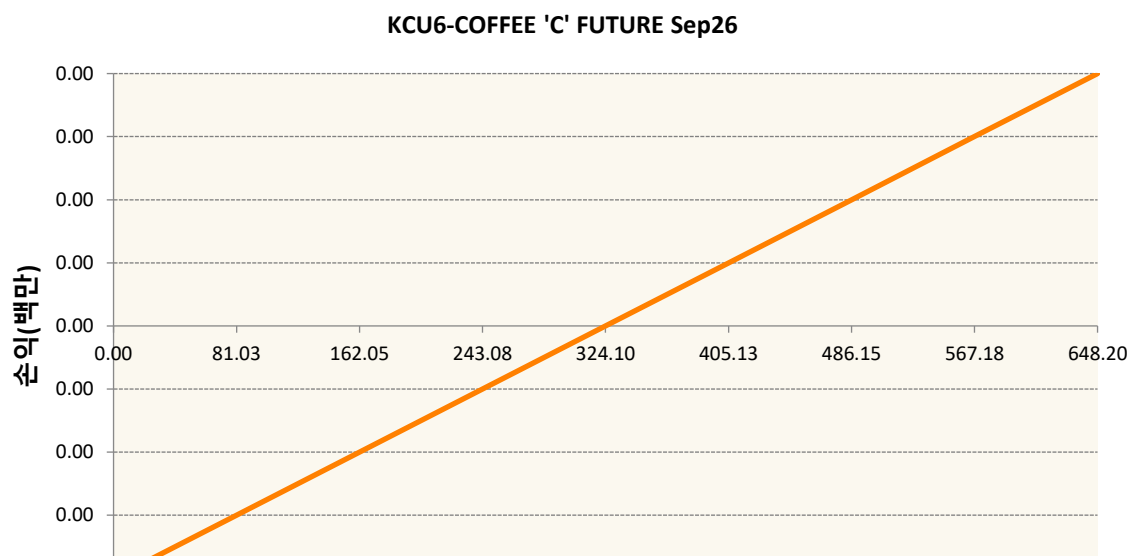
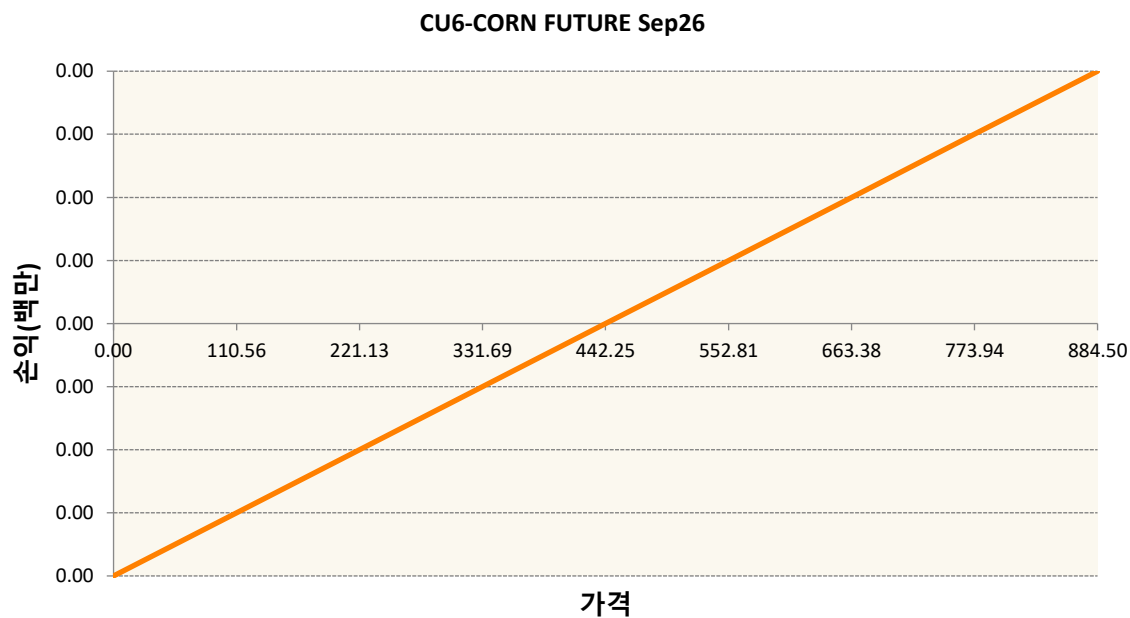
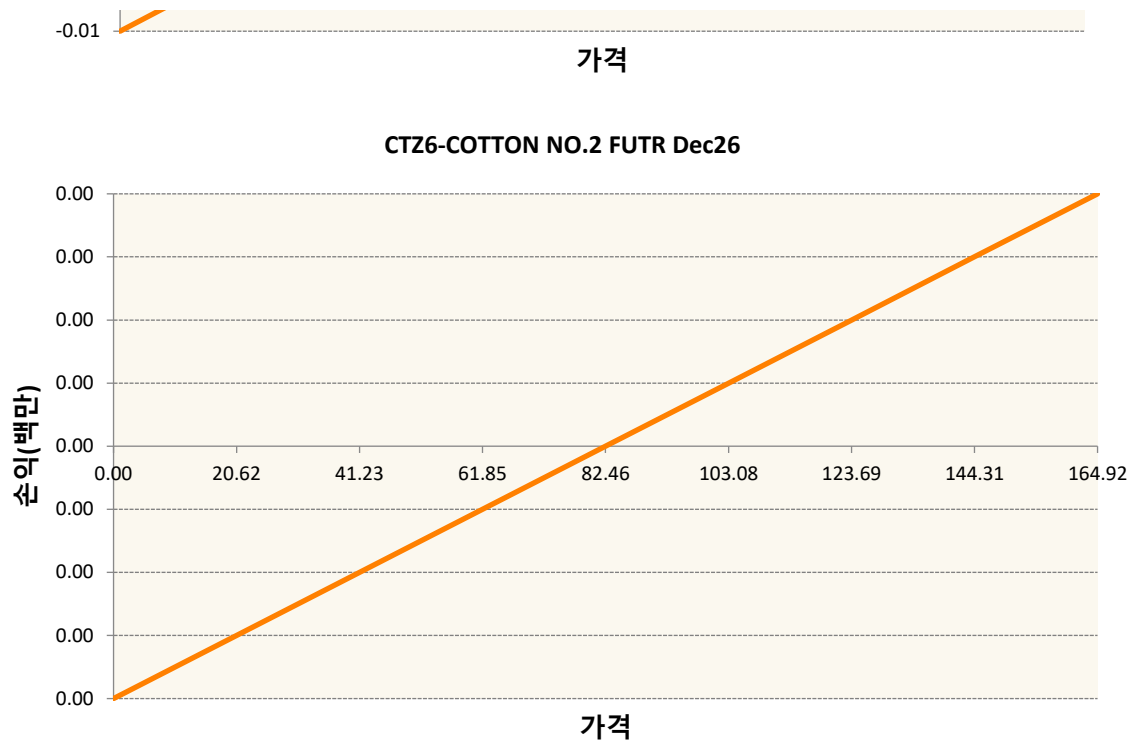
1. 계약금액

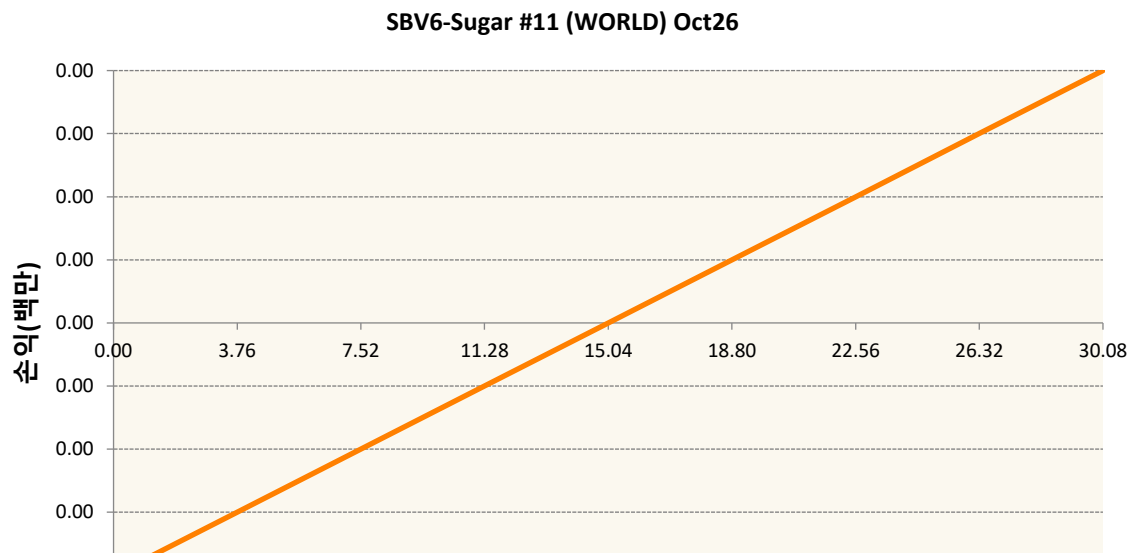
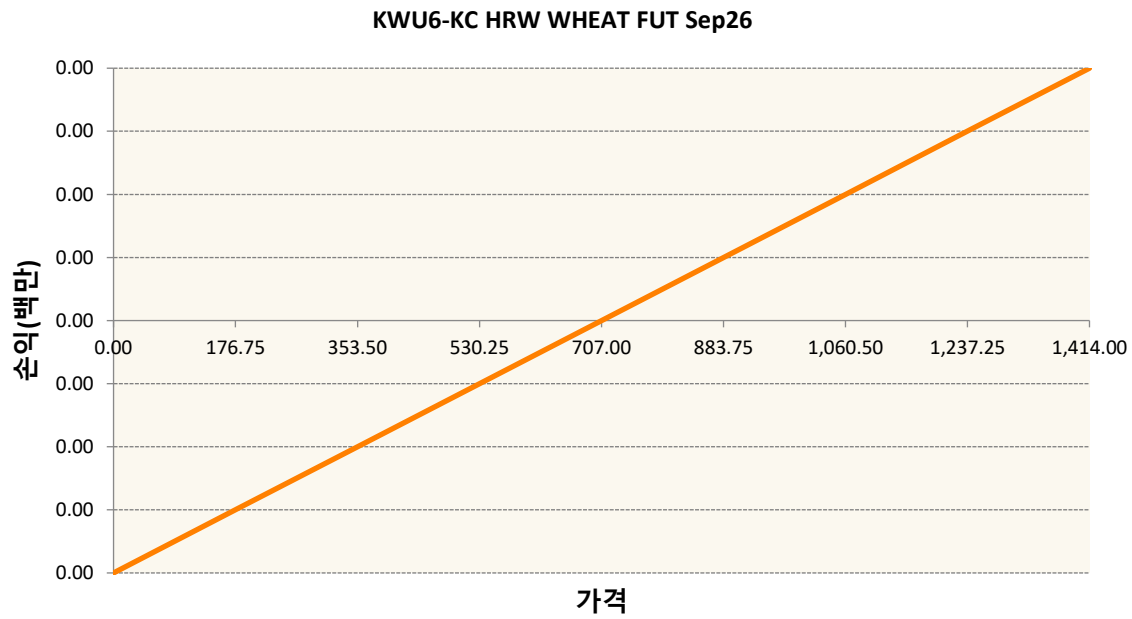
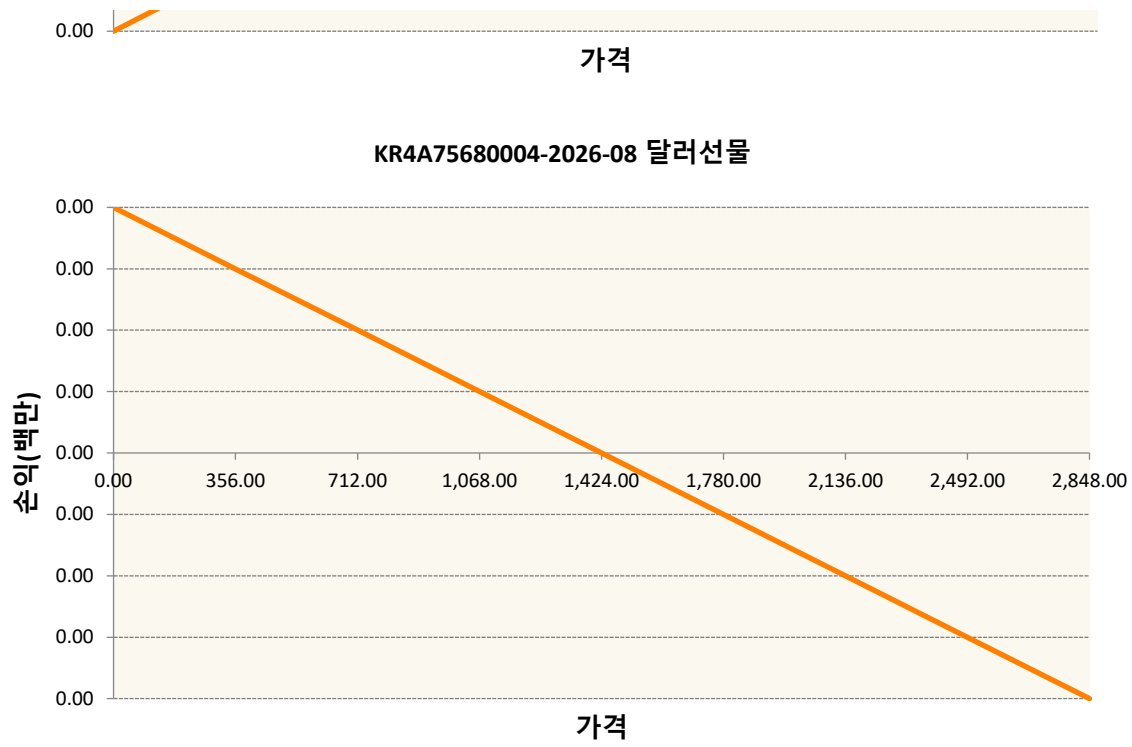
(단위:USD 백만)

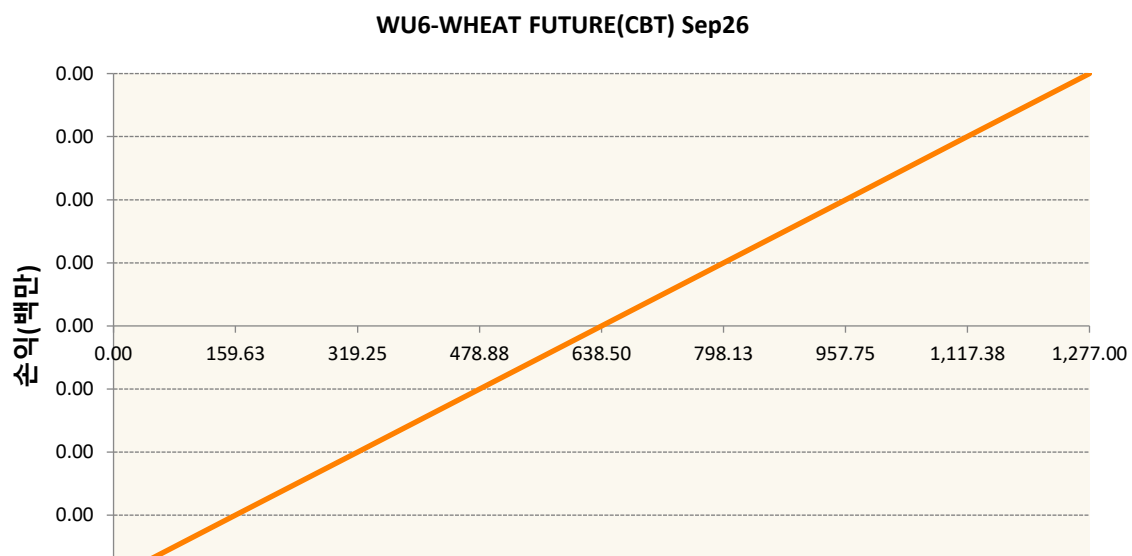
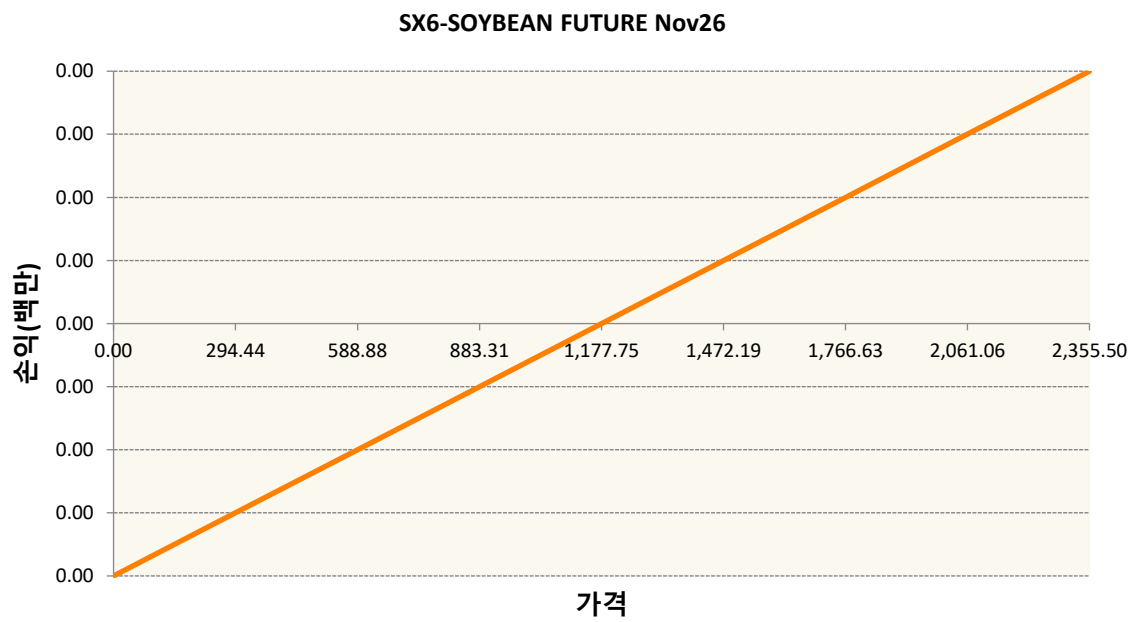
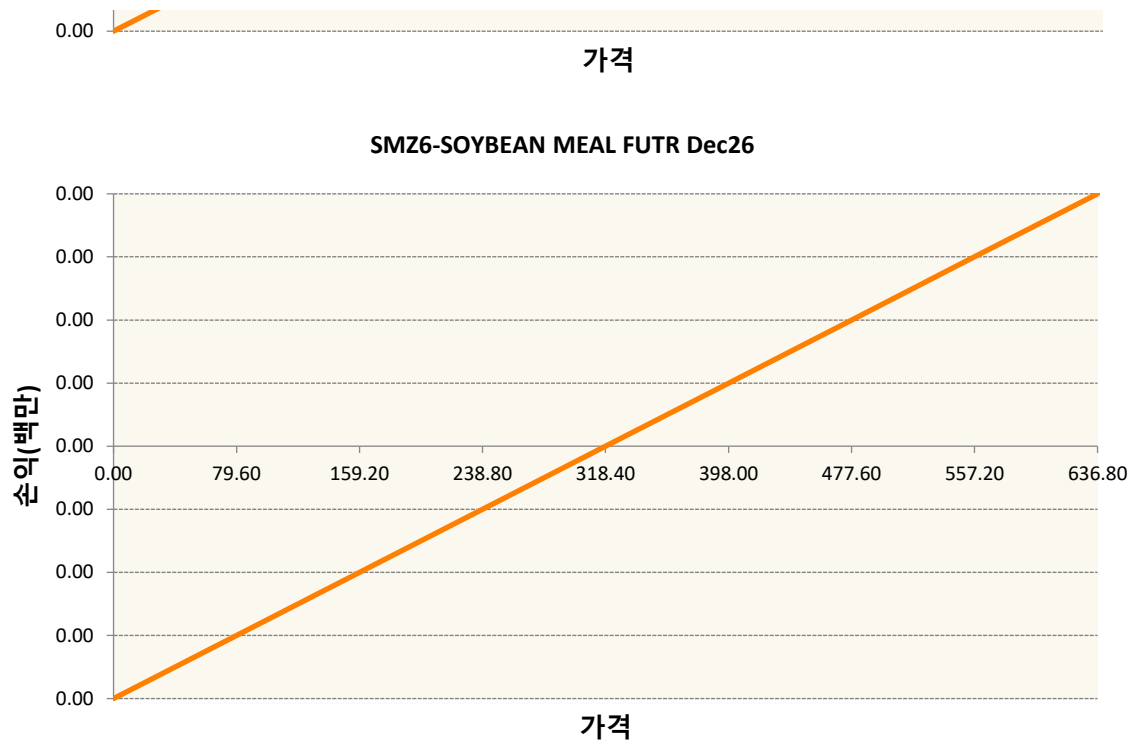
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	518	0	518	
누계	유가증권	선물	2,255	0	2,255	
누계	통화	선물	0	356	-356	장내

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	2026-08-06
기준일	2026-08-05

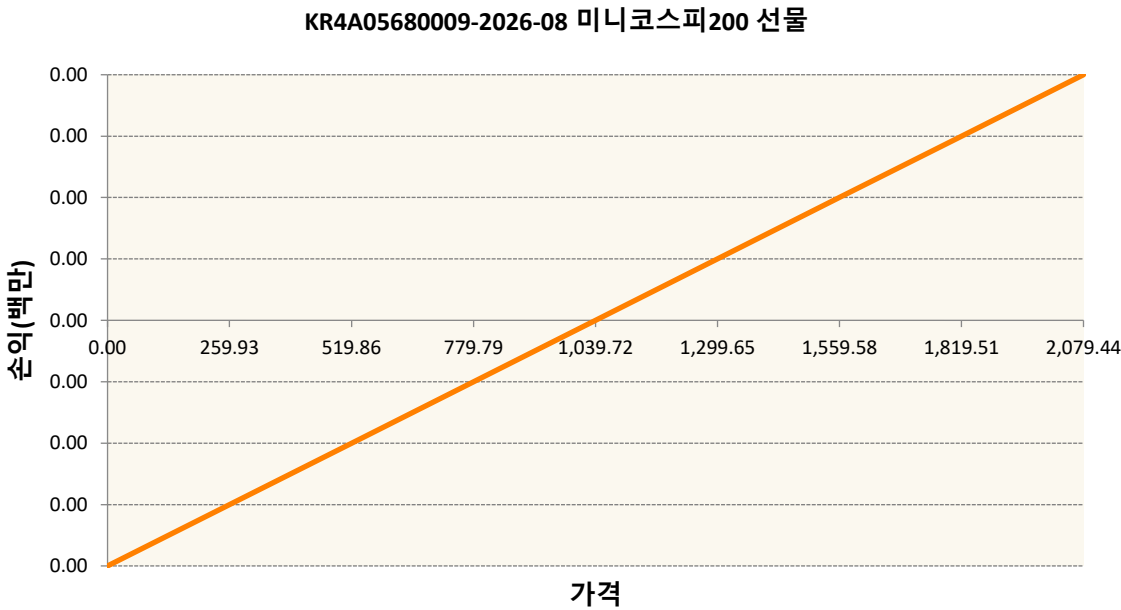
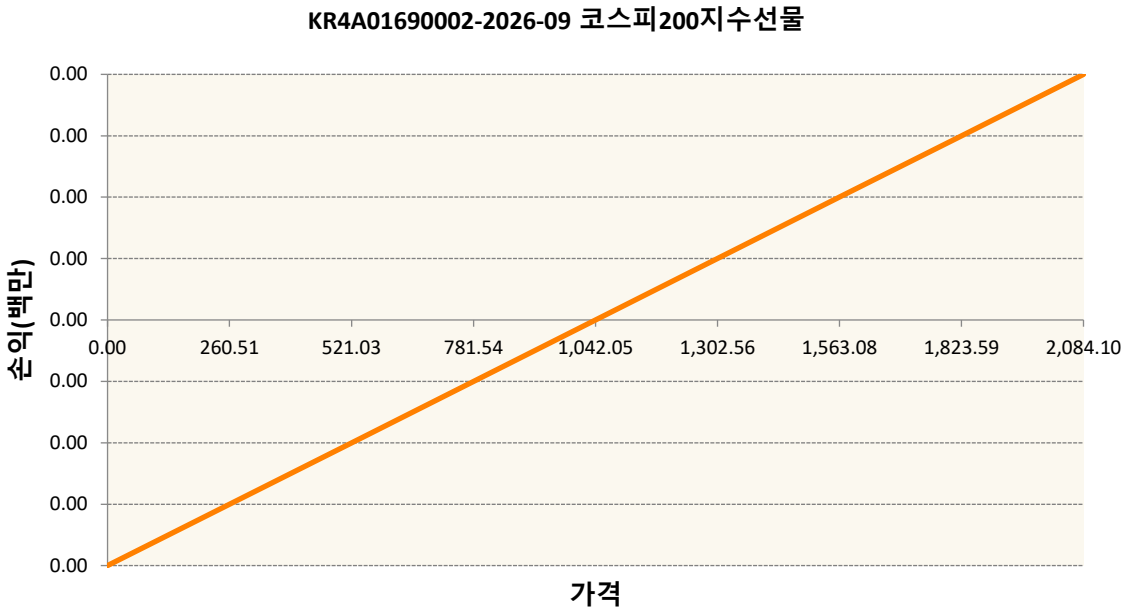
스마트인덱스모

1. 계약금액

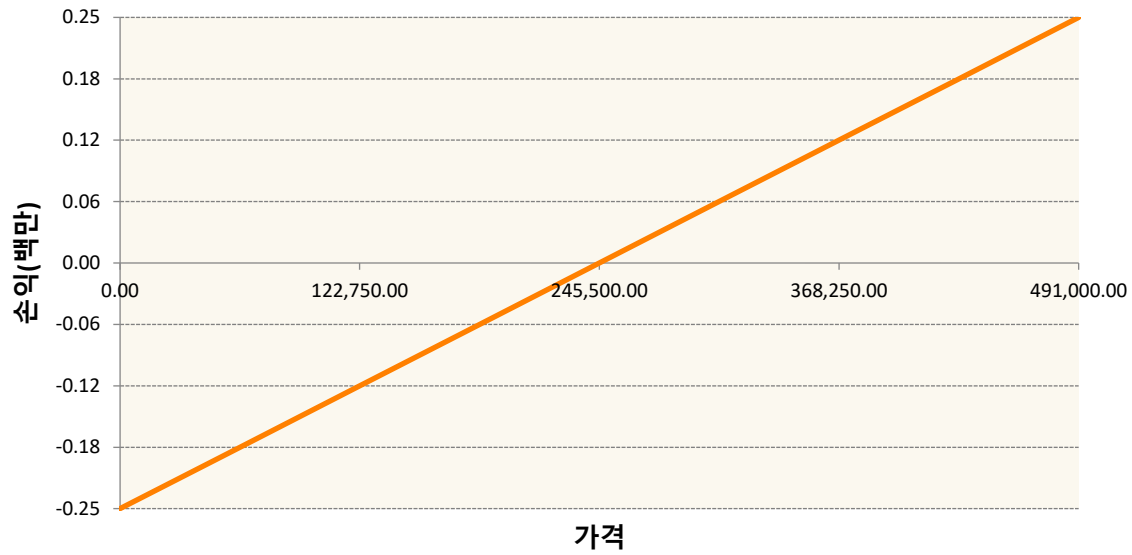
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	68	-68	장내
누계	유가증권	선물	3,803	69	3,734	장내

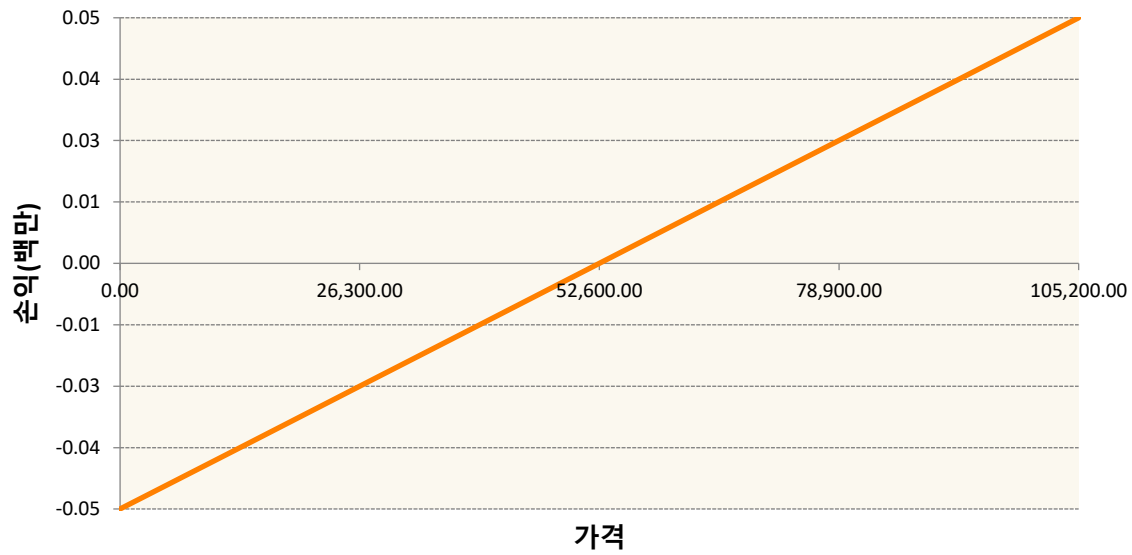
2. 만기시점의 손익구조



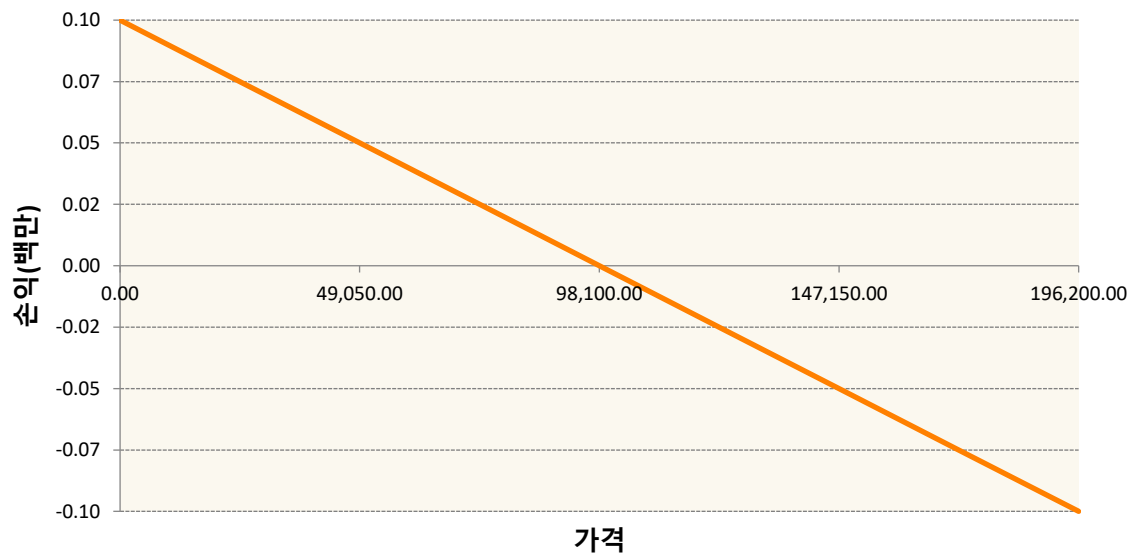
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



KR4A17680005-2026-08 삼성증권개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		187		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187				
-5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125				
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	62	62	62	62	62	62	62				
5.33%	125	125	125	125	125	125	125				
8.00%	187	187	187	187	187	187	187				
KR4A05680009							2026-08 미니코스피200 선물		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				
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				
KR4A17680005							2026-08 삼성증권개별선물		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%	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%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

711

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

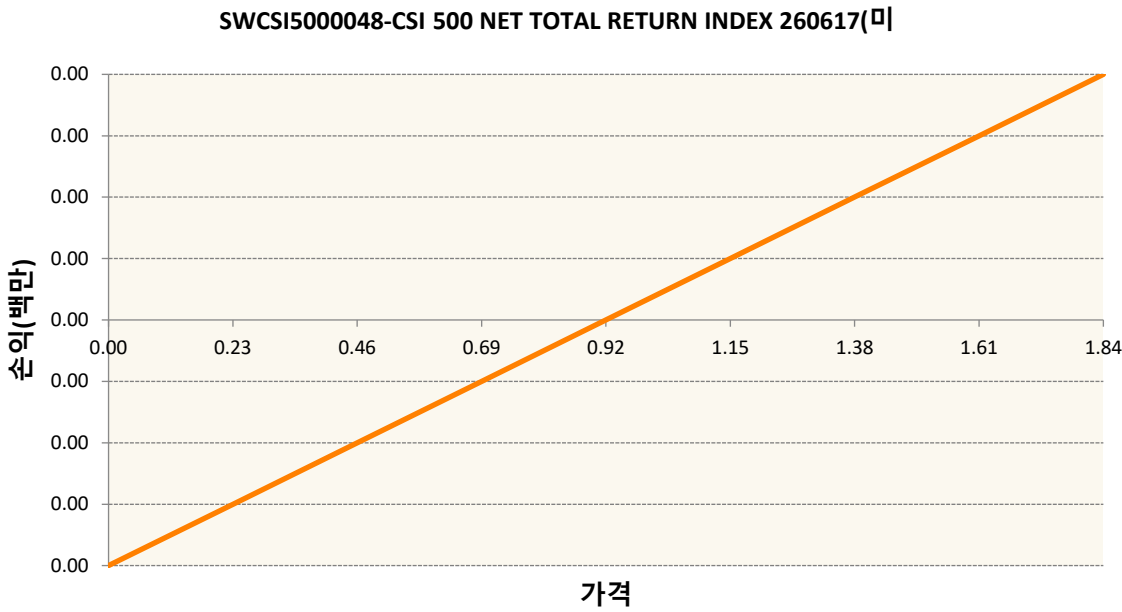
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	424
--	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

664

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

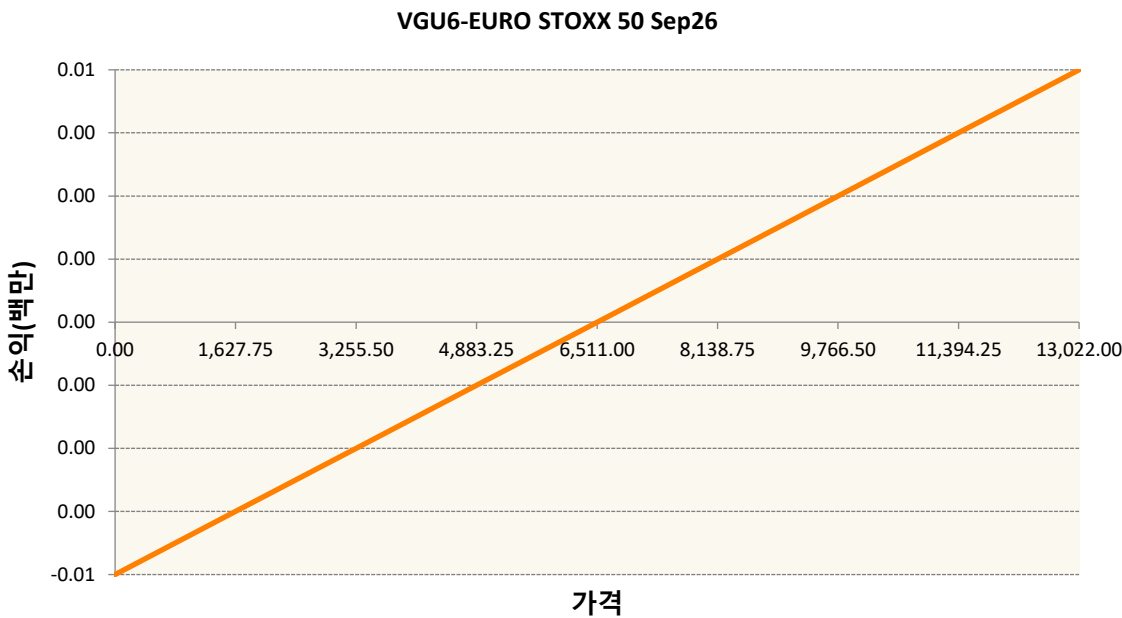
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,027	0	1,027	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	82
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

72

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

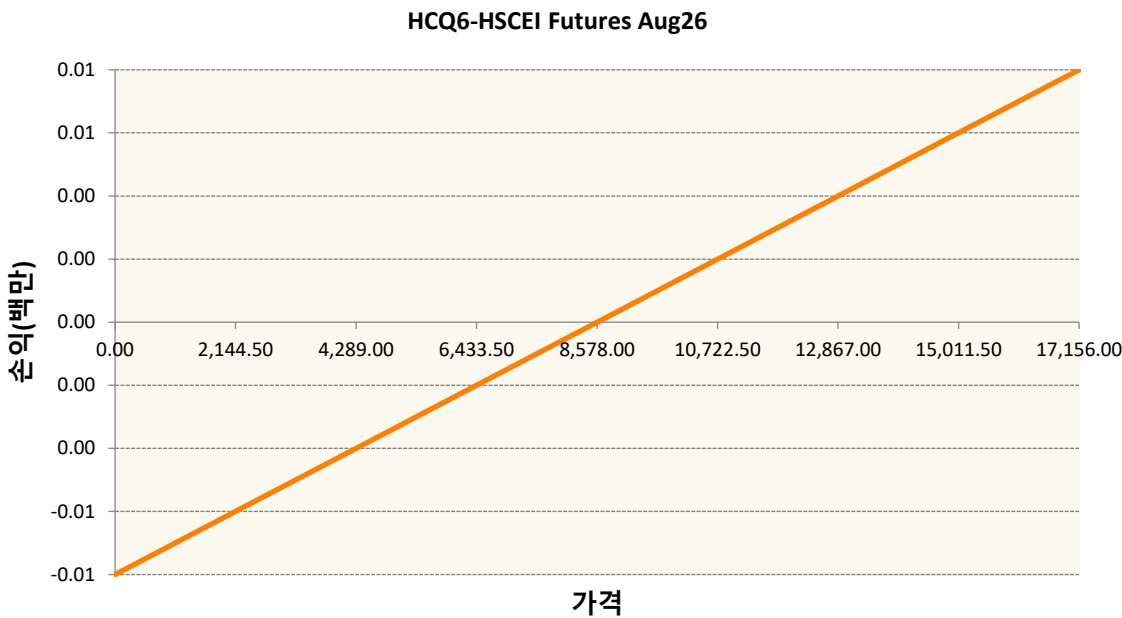
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,502	0	1,502	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ6	HSCEI Futures Aug26	120
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

138

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

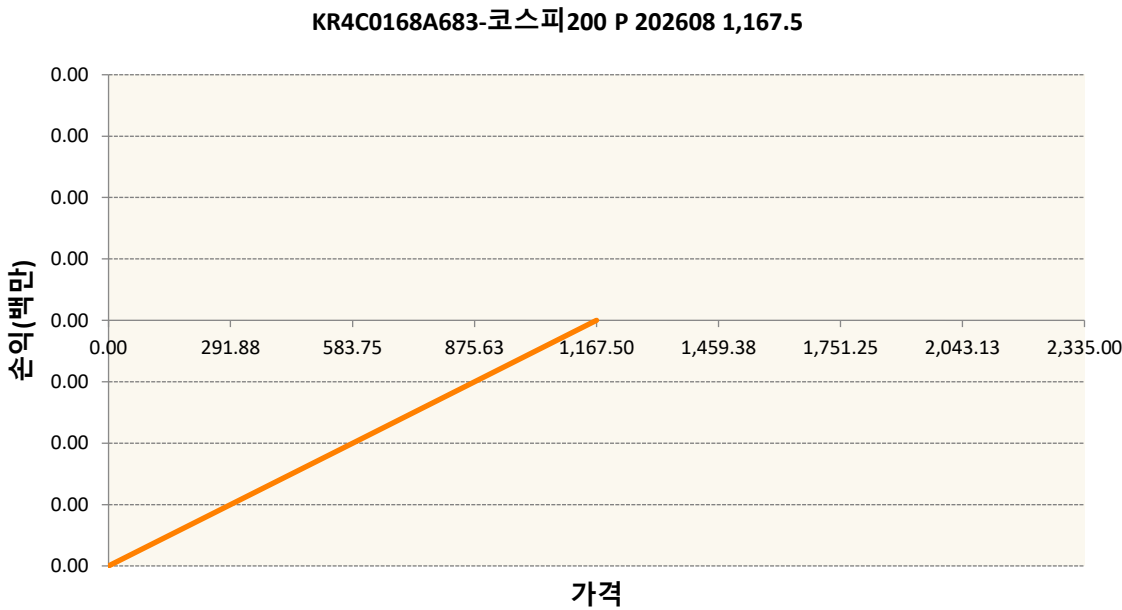
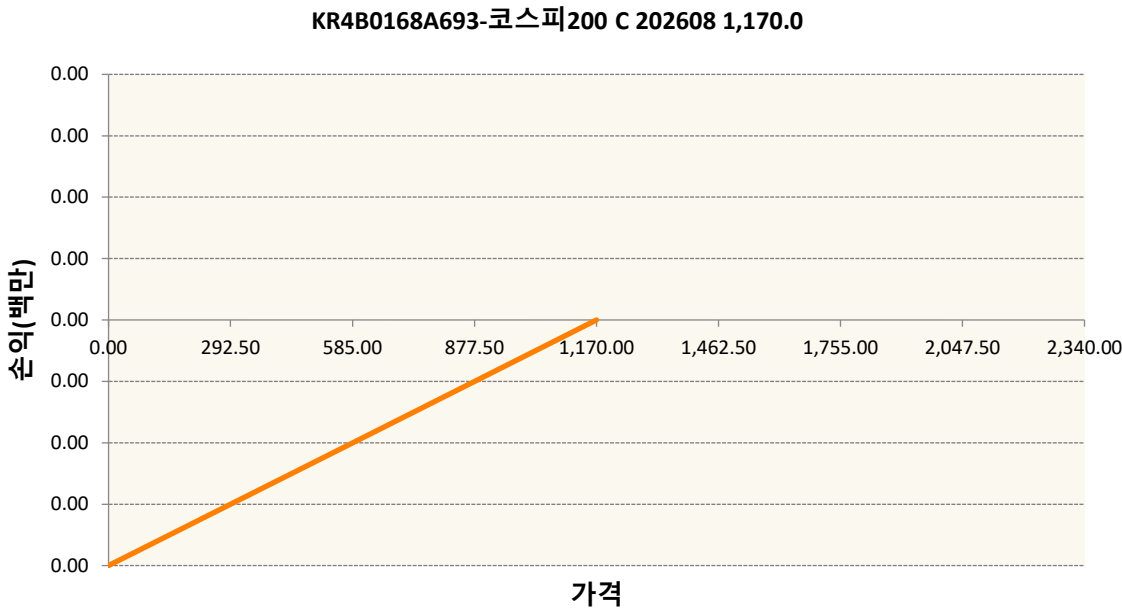
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

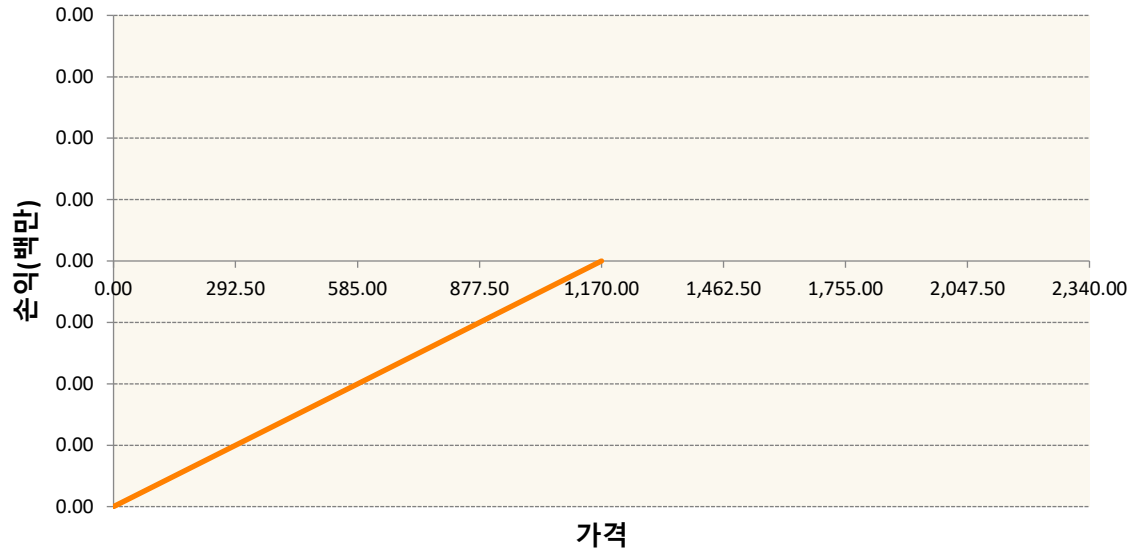
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	43,281	-43,281	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0168A691-코스피200 P 202608 1,170.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0168A693 코스피200 C 202608 1,170.0							2,364
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,161	-2,177	-2,199	-2,229	-2,267	-2,312	-2,364
-5.33%	-1,344	-1,371	-1,407	-1,452	-1,506	-1,566	-1,633
-2.67%	-546	-590	-644	-706	-777	-854	-937
0%	222	157	82	0	-89	-183	-282
2.67%	944	856	760	658	552	441	327
5.33%	1,607	1,496	1,380	1,261	1,139	1,015	888
8.00%	2,197	2,067	1,936	1,803	1,669	1,533	1,397
KR4C0168A683 코스피200 P 202608 1,167.5							292
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-267	-269	-271	-275	-280	-286	-292
-5.33%	-165	-169	-174	-179	-186	-194	-202
-2.67%	-67	-72	-79	-87	-96	-106	-116
0%	28	20	10	0	-11	-23	-35
2.67%	117	106	94	81	68	54	40
5.33%	199	185	170	155	140	124	109
8.00%	271	255	238	222	205	188	171
KR4C0168A691 코스피200 P 202608 1,170.0							234
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-214	-216	-218	-221	-225	-229	-234
-5.33%	-133	-136	-140	-144	-149	-155	-162
-2.67%	-54	-58	-64	-70	-77	-85	-93
0%	22	16	8	0	-9	-18	-28

2.67%	94	85	75	65	55	44	32
5.33%	159	148	137	125	113	101	88
8.00%	218	205	192	179	165	152	139

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,270

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

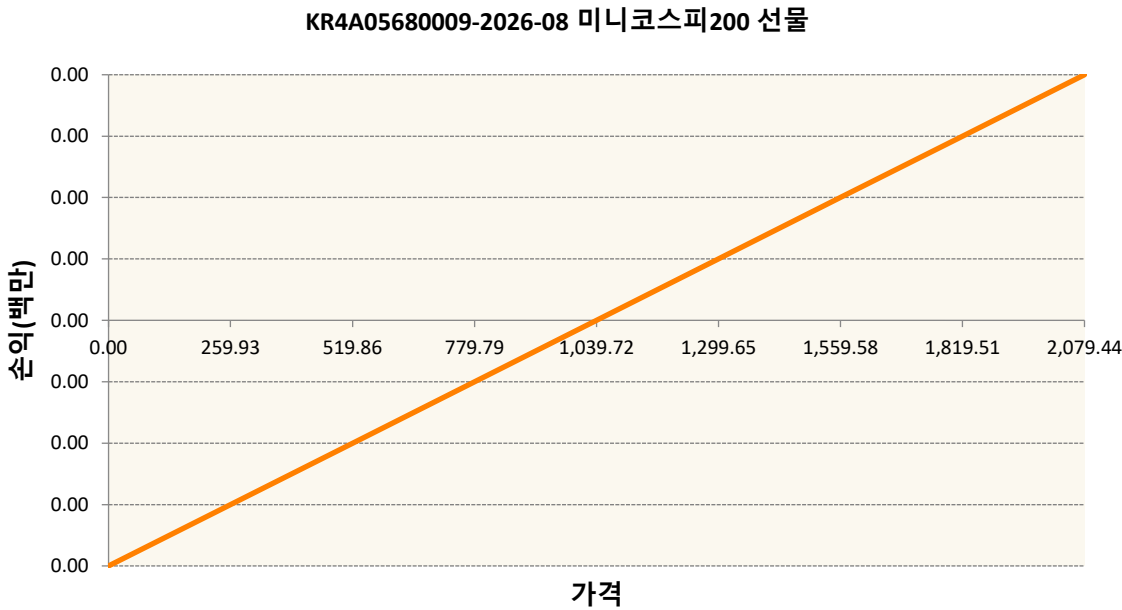
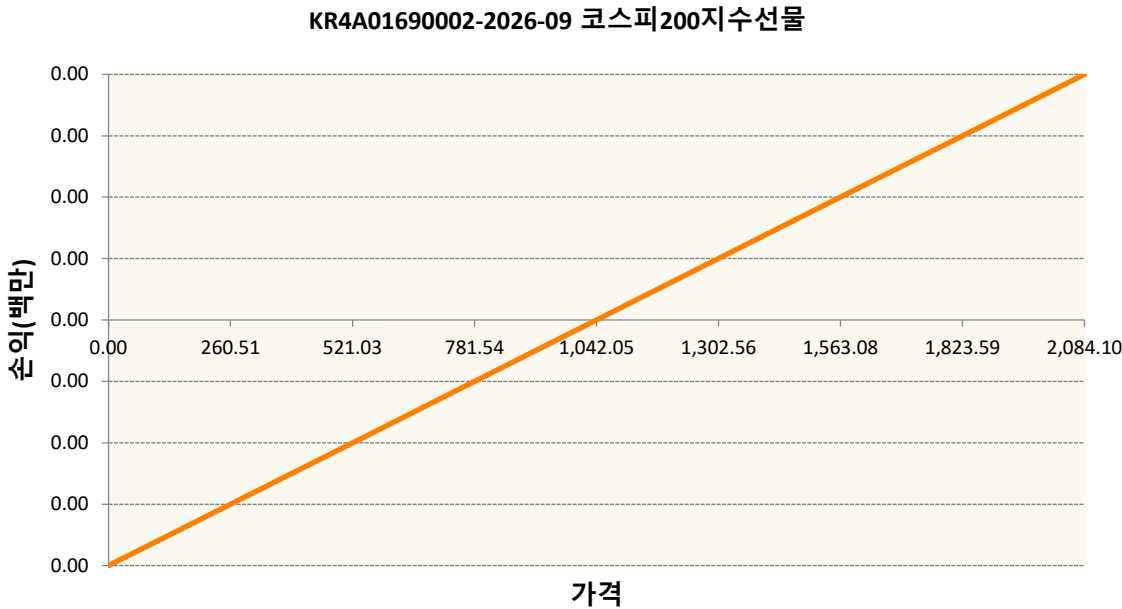
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

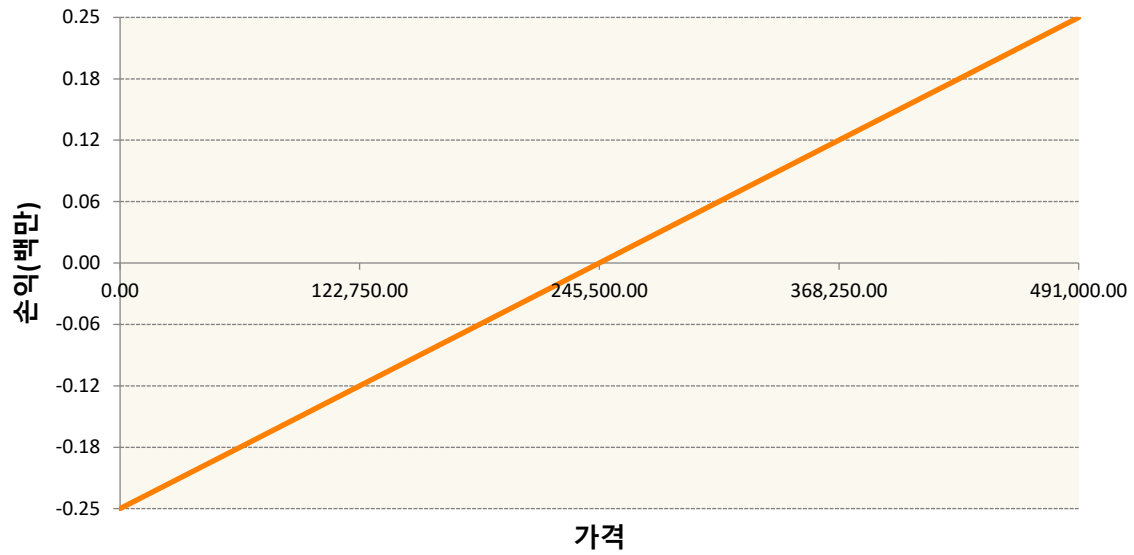
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	259	-259	장내
누계	유가증권	선물	1,391	0	1,391	장내

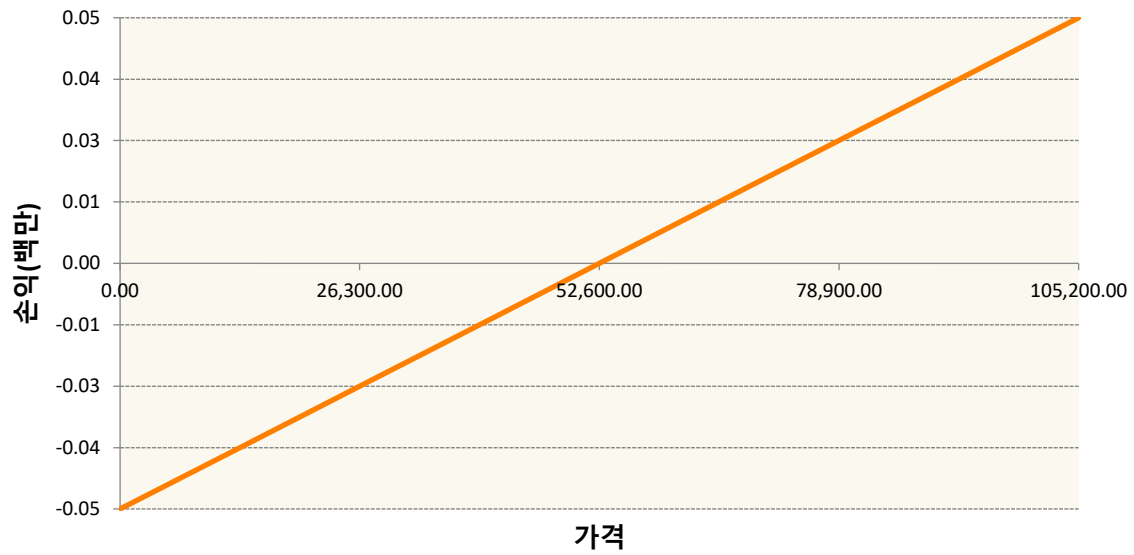
2. 만기시점의 손익구조



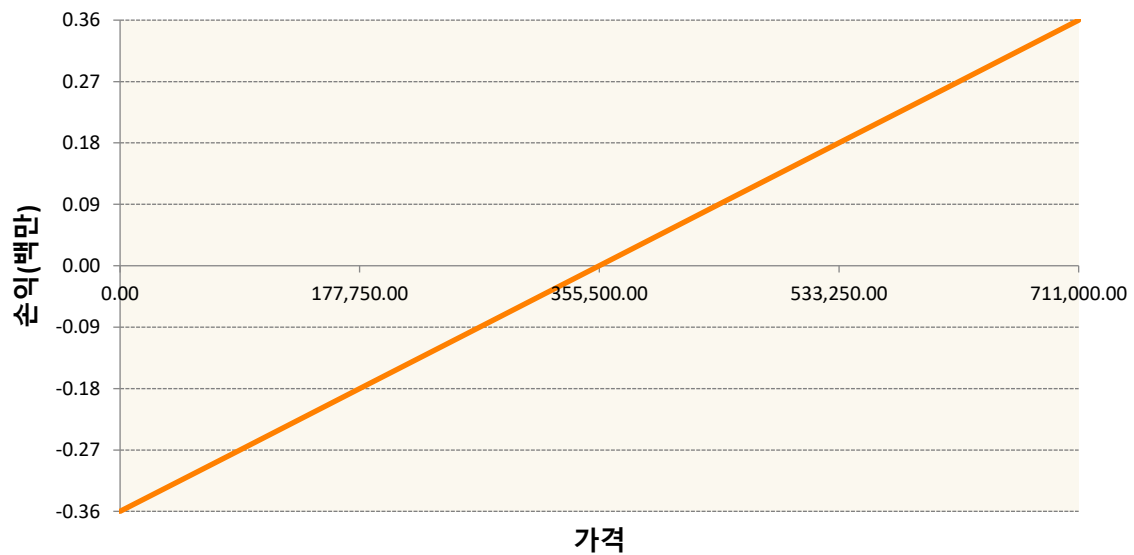
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



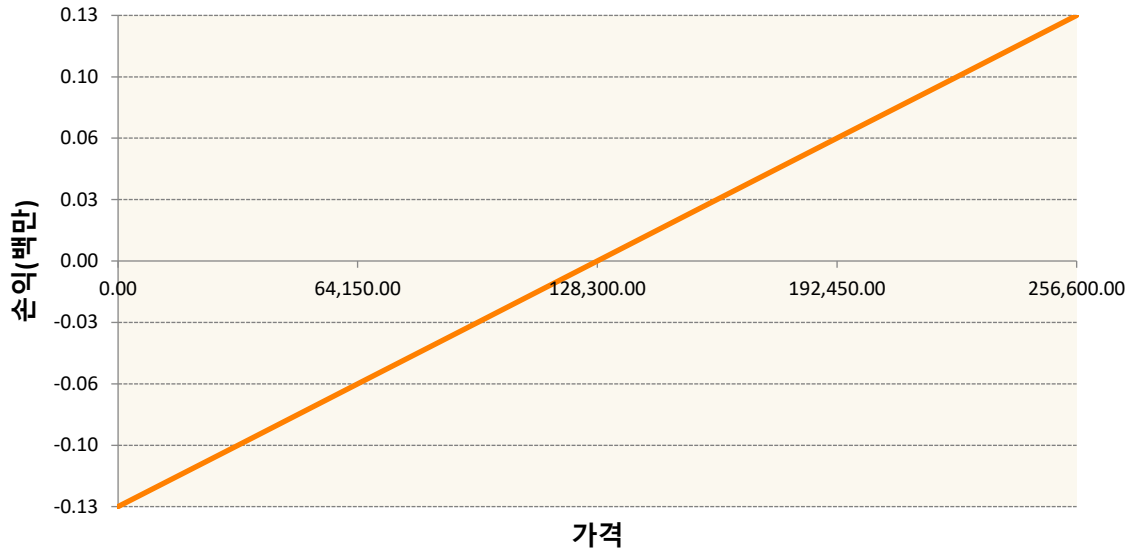
KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



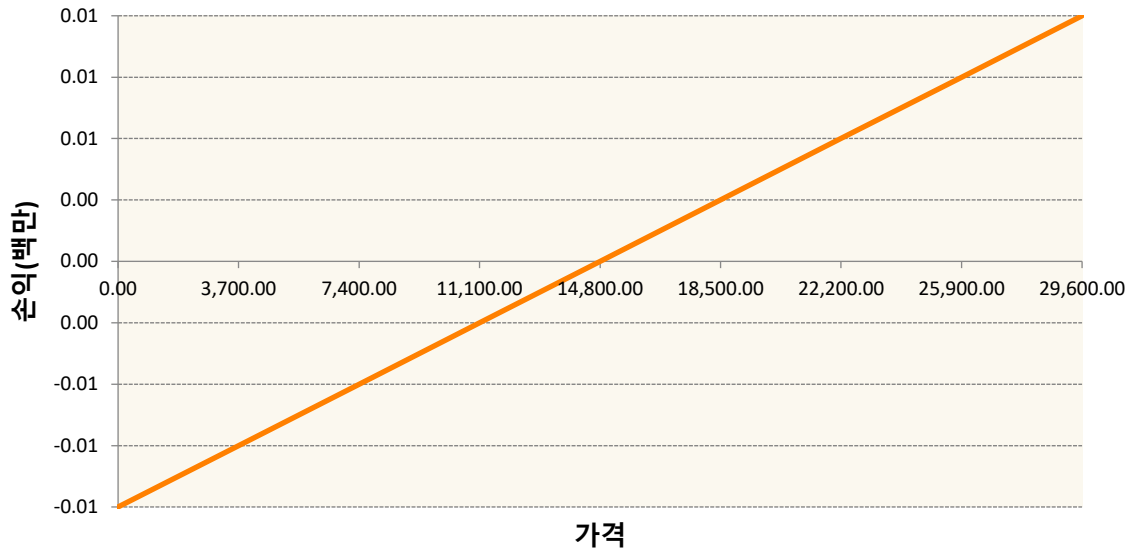
KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



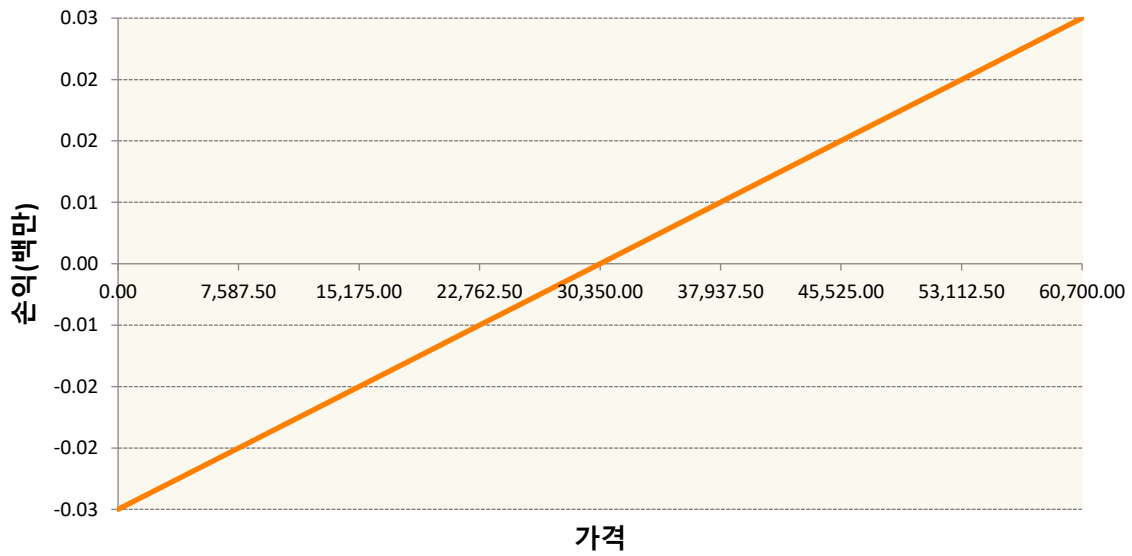
KR4A40680006-2026-08 하나금융지주개별선물



KR4AB0680002-2026-08 LG유플러스개별선물



KR4ACB680007-2026-08 한화솔루션개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		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	-62		
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42		
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	21	21	21	21	21	21	21	21		
5.33%	42	42	42	42	42	42	42	42		
8.00%	62	62	62	62	62	62	62	62		
KR4A05680009							2026-08 미니코스피200 선물		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	-4		
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3		
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1		
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3		
8.00%	4	4	4	4	4	4	4	4		
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	-4		
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3		
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	1	1	1	1	1	1	1	1		
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3		
8.00%	4	4	4	4	4	4	4	4		
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		
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3		
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2		
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3		
8.00%	5	5	5	5	5	5	5	5		
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

13

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

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)

250

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

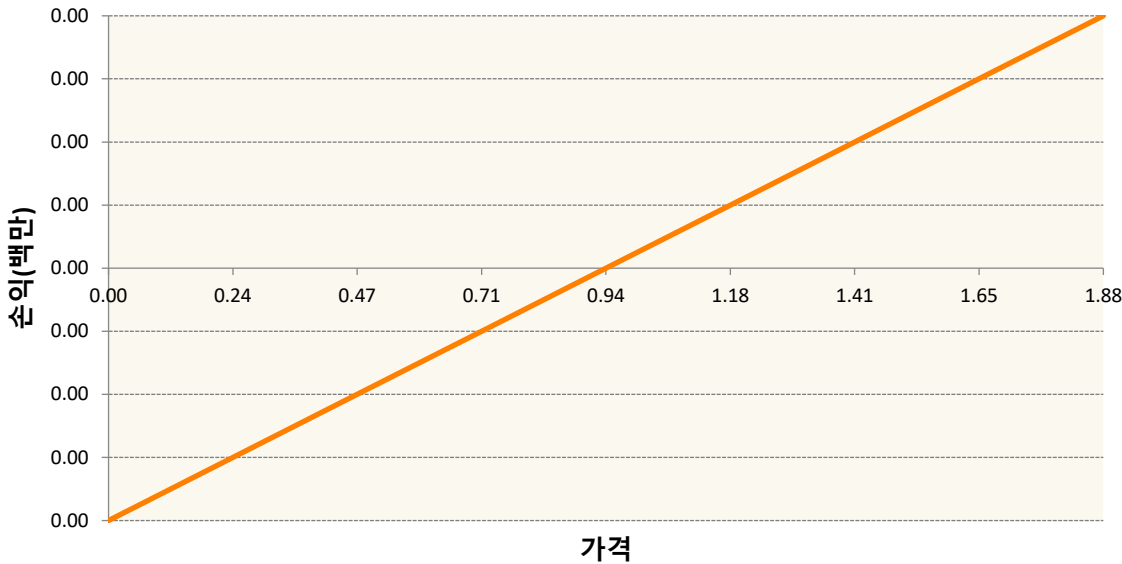
1. 계약금액

(단위:백만원)

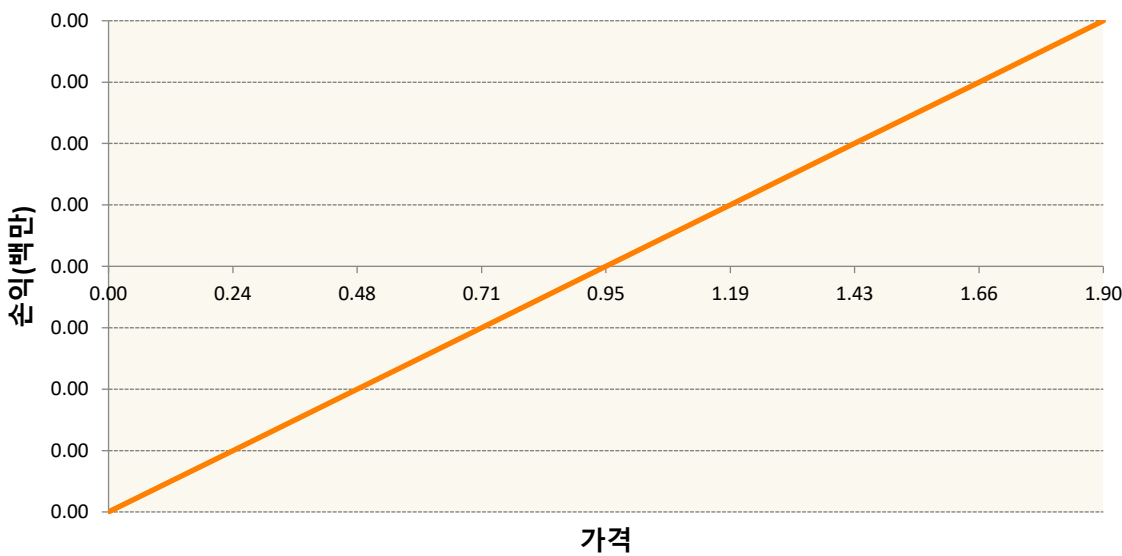
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,150	0	7,150	장외

2. 만기시점의 손익구조

2108840618ID-ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(



2108841218ID-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (매



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)
	642

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

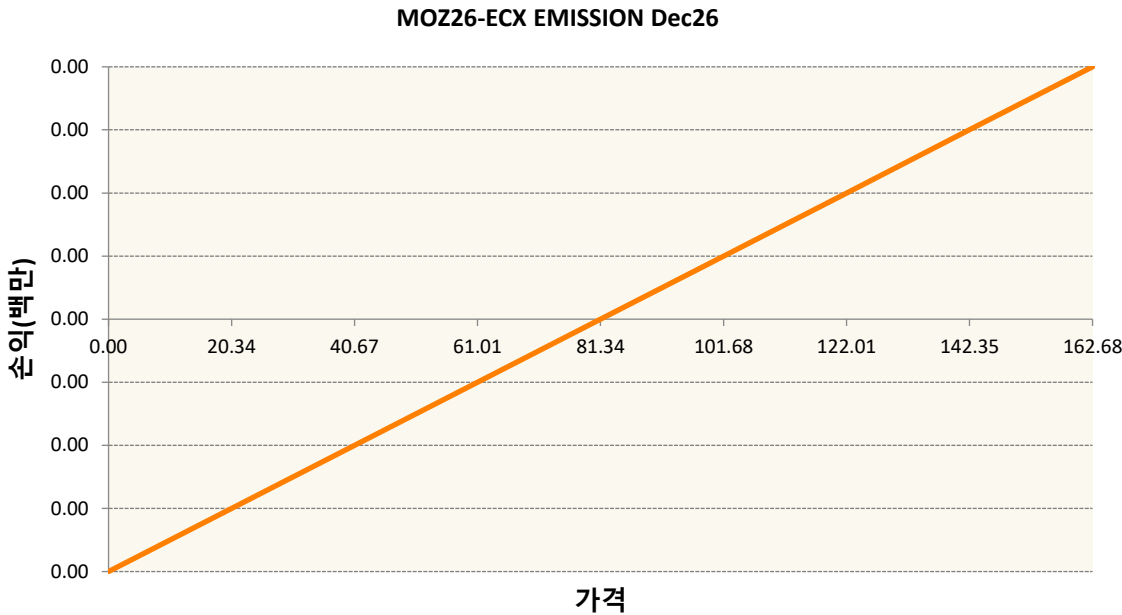
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,262	0	5,262	
누계	통화	선도	0	2,582	-2,582	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G7XIKRW/EUR 31-08-26E	207
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	421

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

(단위:백만원)

696

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

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	-1,736	0	-1,736	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	56
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	26
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	23
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	34

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

(단위:백만원)

222

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

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	-5,098	0	-5,098	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	43
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	190
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	176

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

(단위:백만원)

764

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

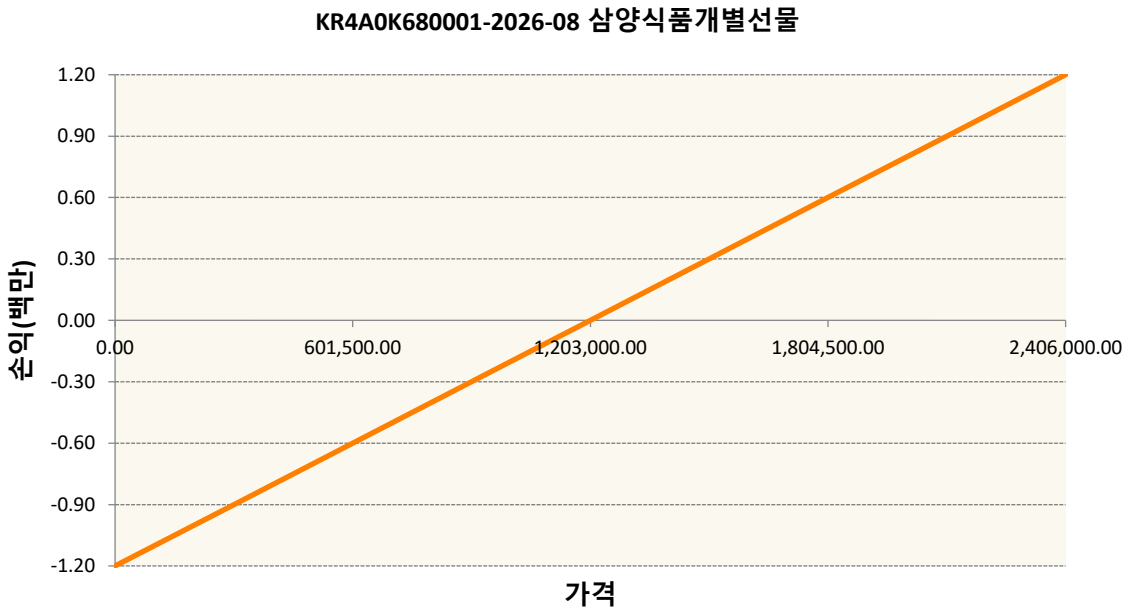
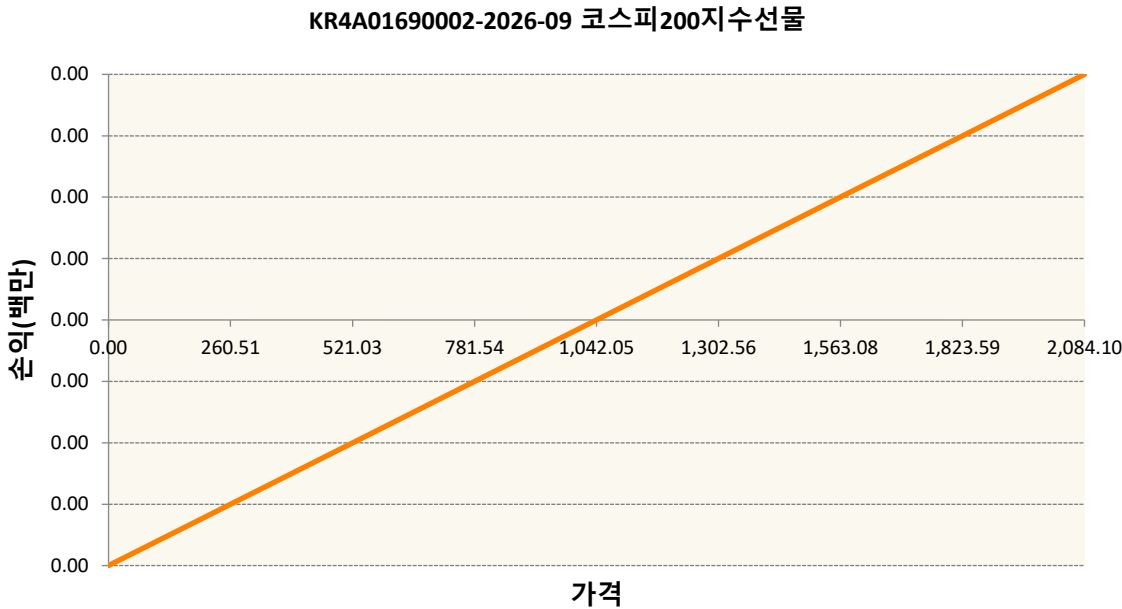
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

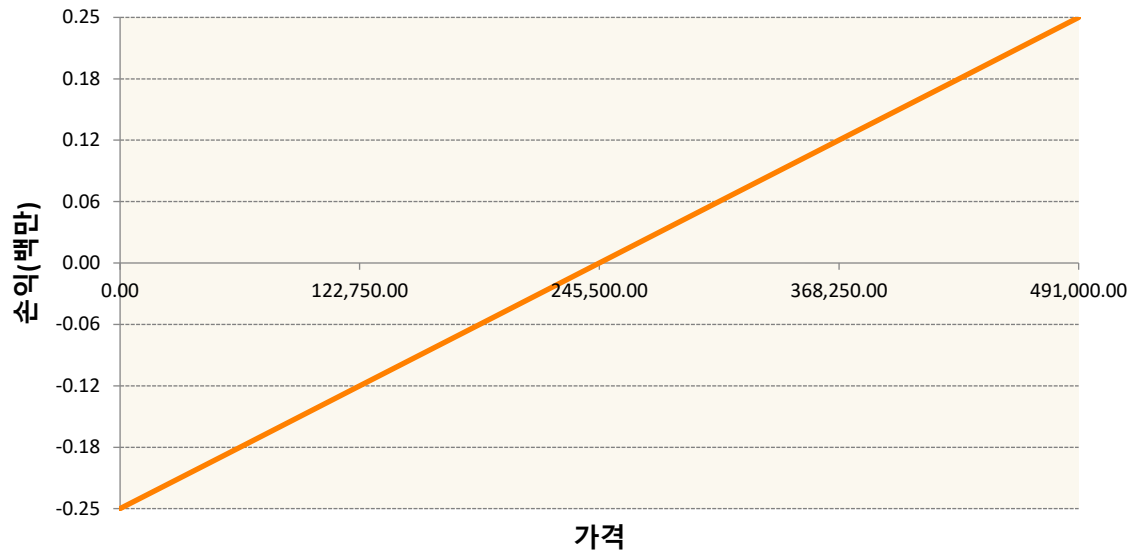
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3,120	-3,120	장내
누계	유가증권	선물	26,390	1,358	25,032	장내

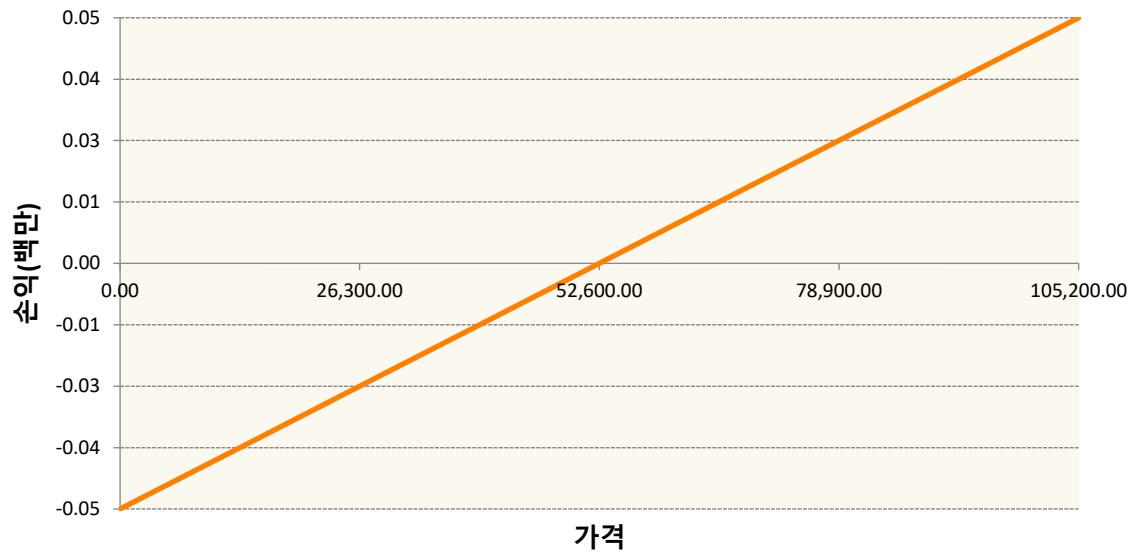
2. 만기시점의 손익구조



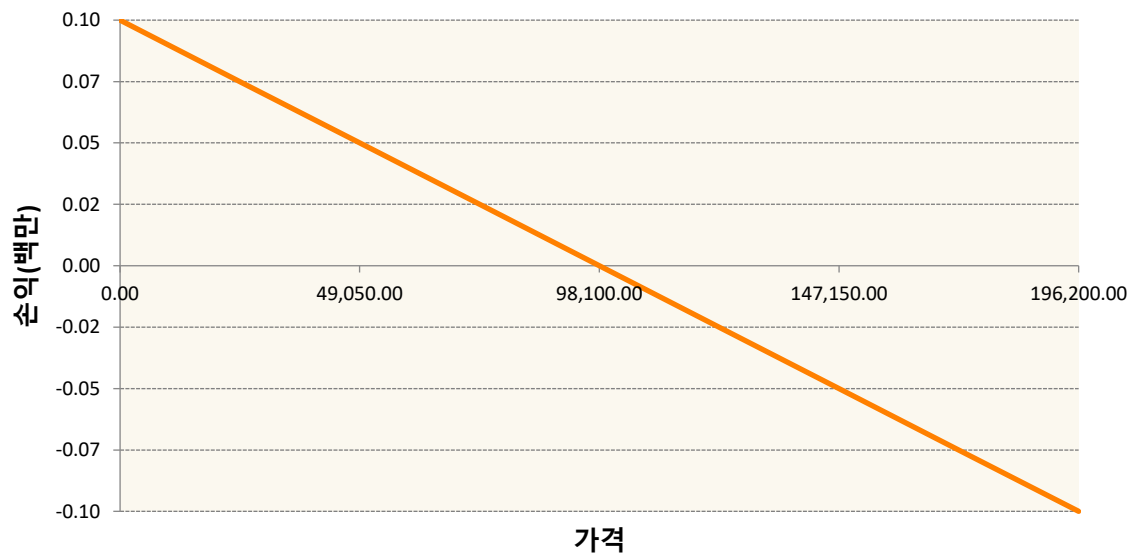
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



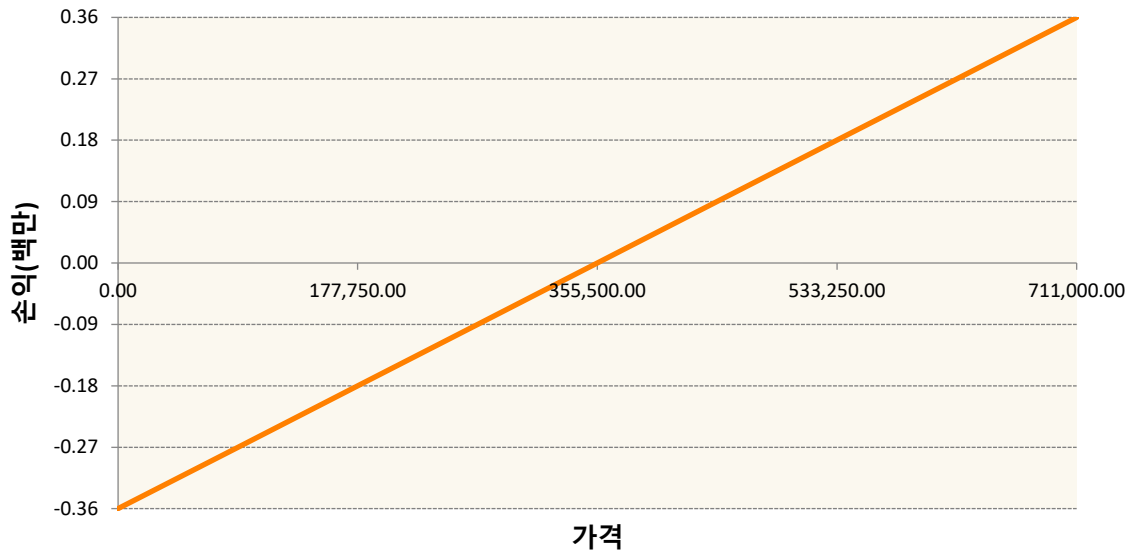
KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



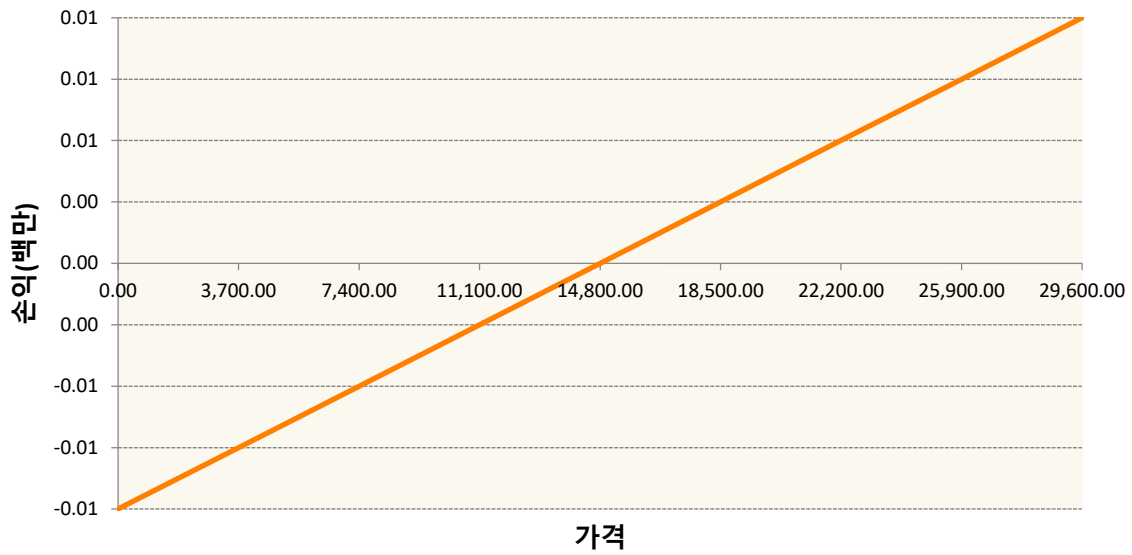
KR4A17680005-2026-08 삼성증권개별선물



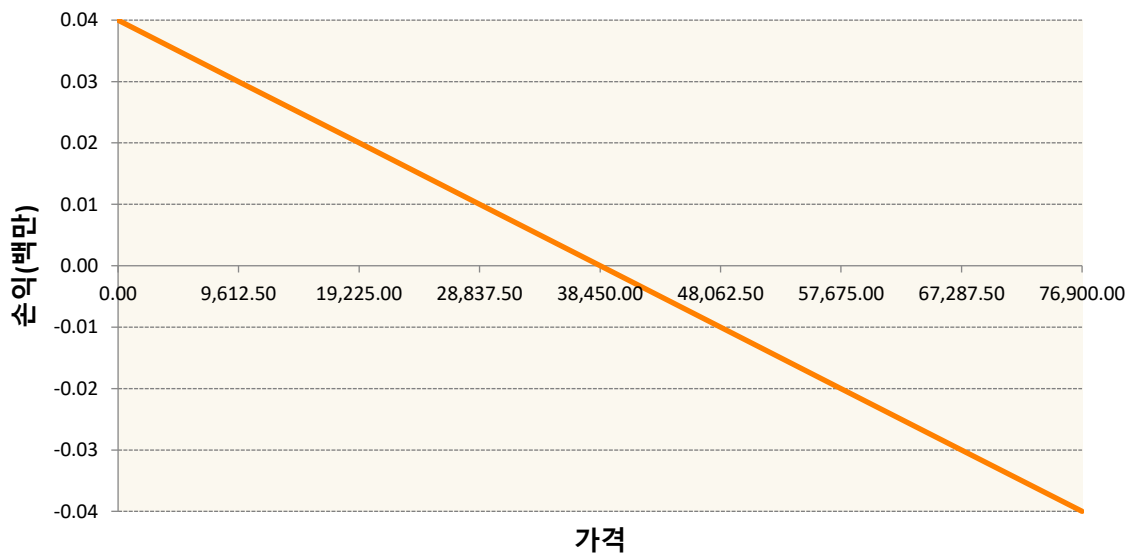
KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



KR4AB0680002-2026-08 LG유플러스개별선물



KR4ACF680003-2026-08 카카오개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					1,703
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703	-1,703
-5.33%	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136	-1,136
-2.67%	-568	-568	-568	-568	-568	-568	-568
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	568	568	568	568	568	568	568
5.33%	1,136	1,136	1,136	1,136	1,136	1,136	1,136
8.00%	1,703	1,703	1,703	1,703	1,703	1,703	1,703
KR4A0K680001		2026-08 삼양식품개별선물					30
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-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%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	30	30	30	30	30	30	30
KR4A11680001		2026-08 삼성전자개별선물					291
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-291
-5.33%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
-2.67%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	97	97	97	97	97	97	97
5.33%	194	194	194	194	194	194	194
8.00%	291	291	291	291	291	291	291
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
KR4A17680005		2026-08 삼성증권개별선물					41
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	41	41	41	41	41	41	41
-5.33%	27	27	27	27	27	27	27
-2.67%	14	14	14	14	14	14	14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
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							67
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	67	67	67	67	67	67
-5.33%	45	45	45	45	45	45	45
-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%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67

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

(단위:백만원)

6,813

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

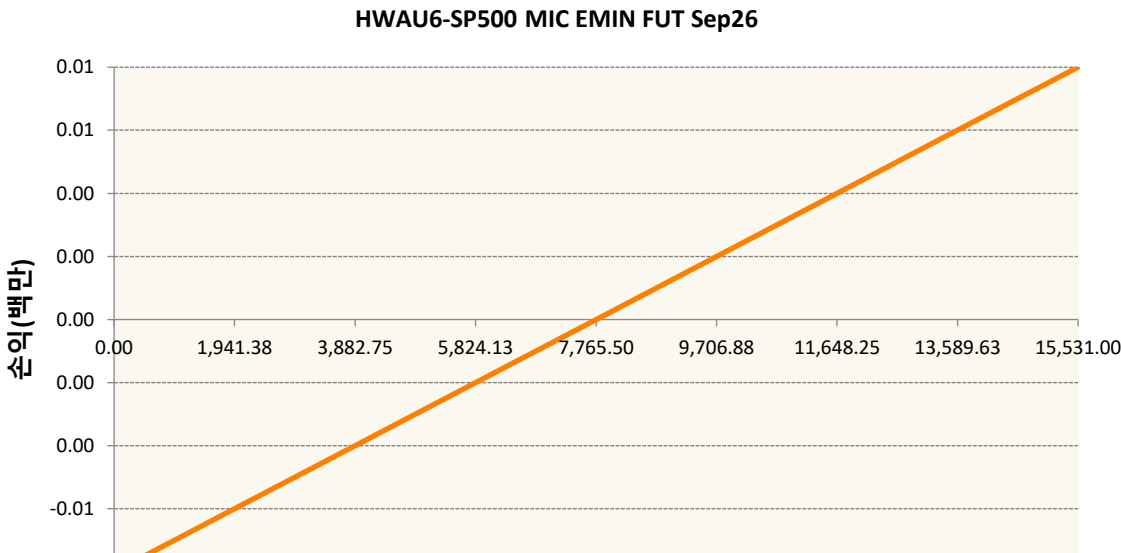
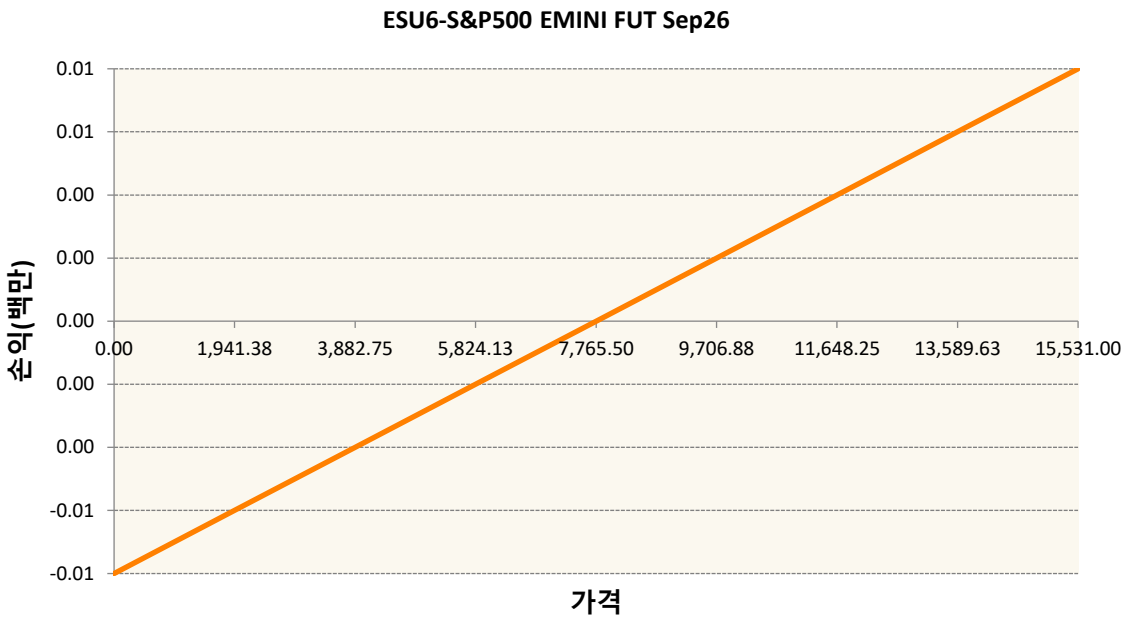
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

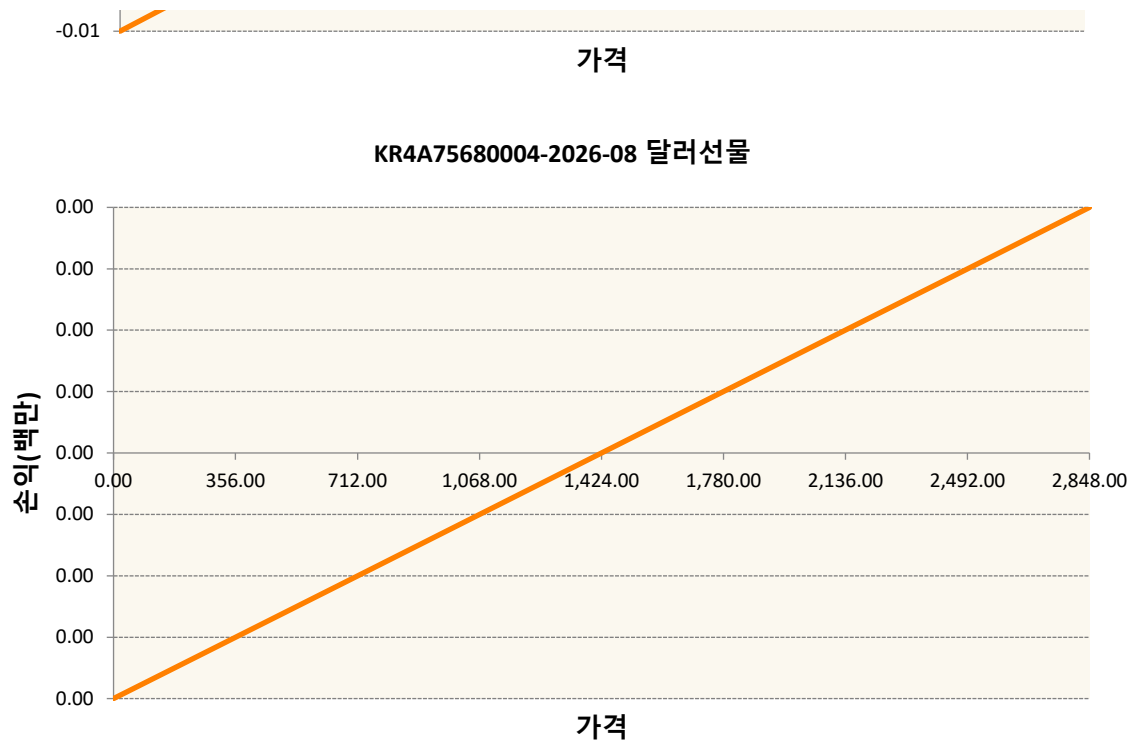
1. 계약금액

(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	72,030	0	72,030	
누계	지수	선물	178	0	178	장내
누계	통화	선물	10,110	0	10,110	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	5,762
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	14
KR4A756800	2026-08 달러선물	809

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

4,997

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

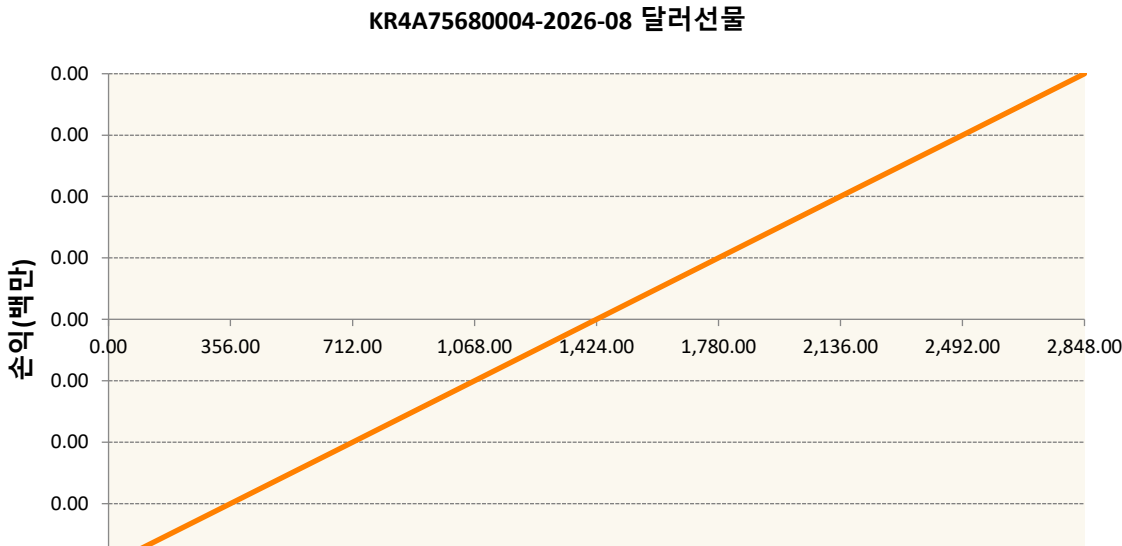
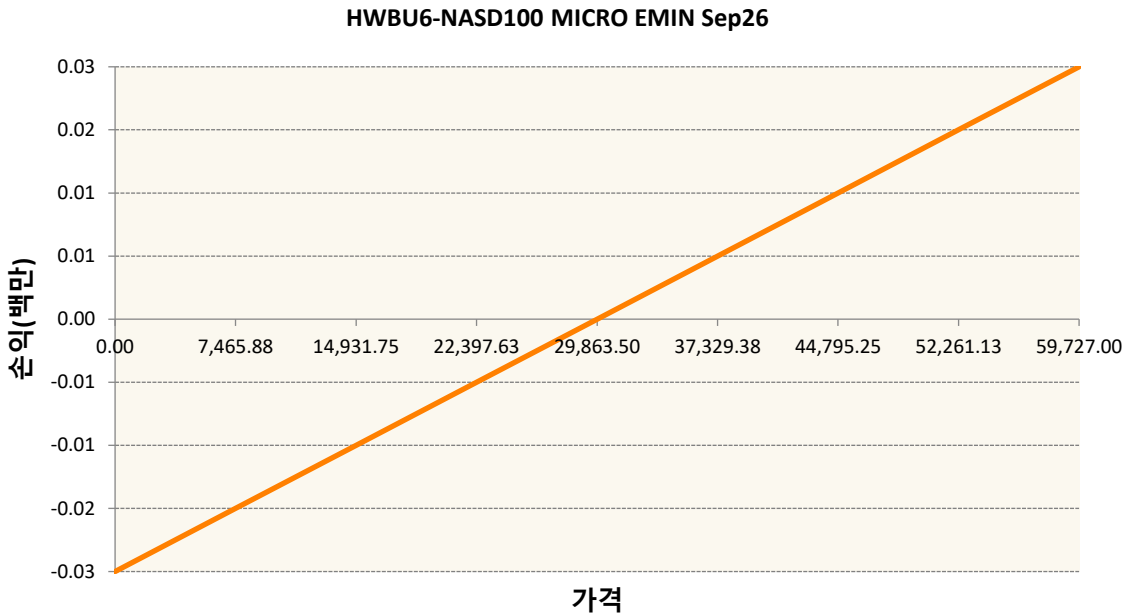
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

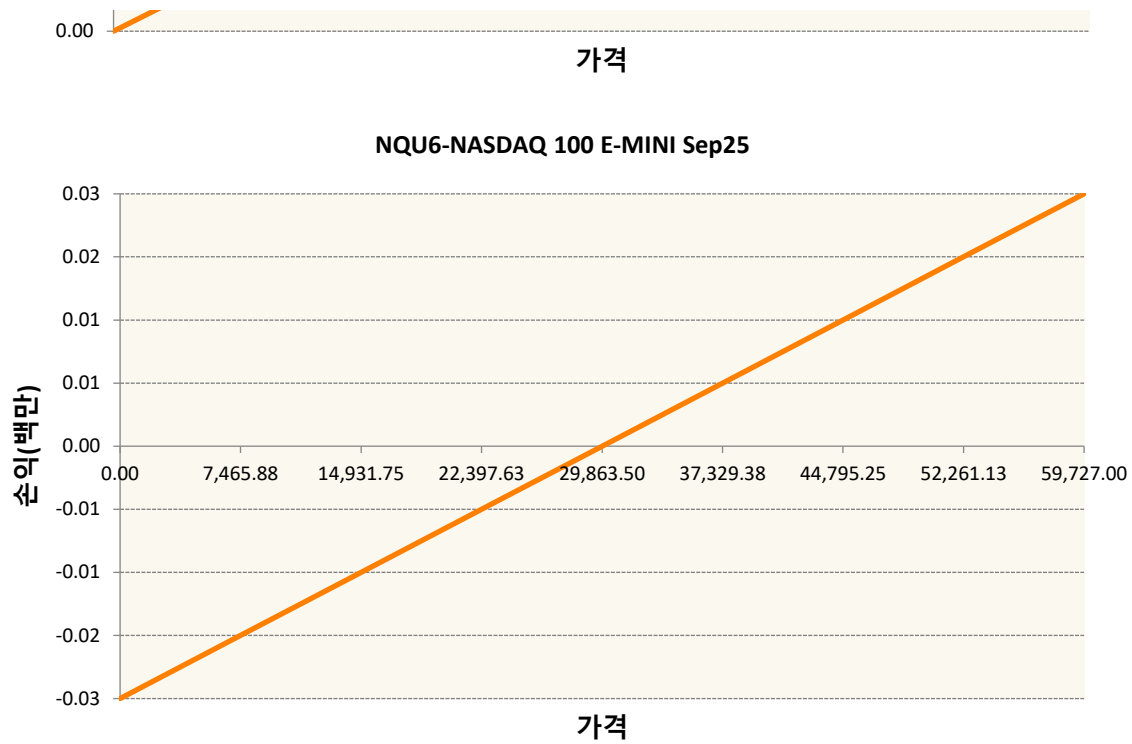
1. 계약금액

(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	717	0	717	장내
누계	지수	선물	34,355	0	34,355	
누계	통화	선물	3,717	0	3,717	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		57
KR4A756800	2026-08 달러선물		297
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,748

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,209

공시일	2026-08-06
기준일	2026-08-05

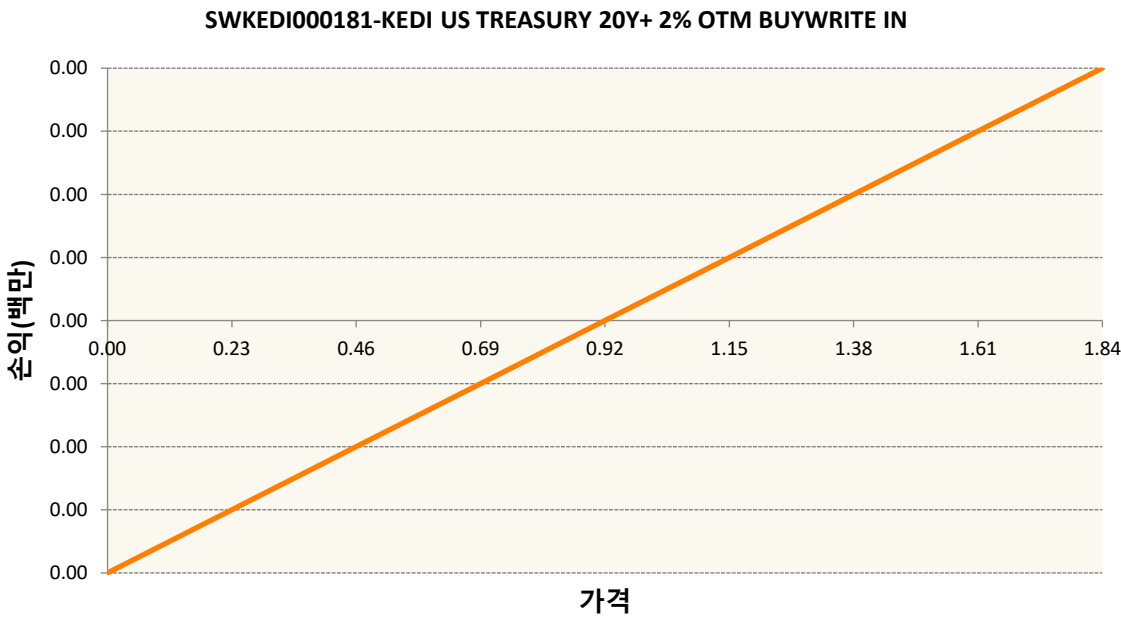
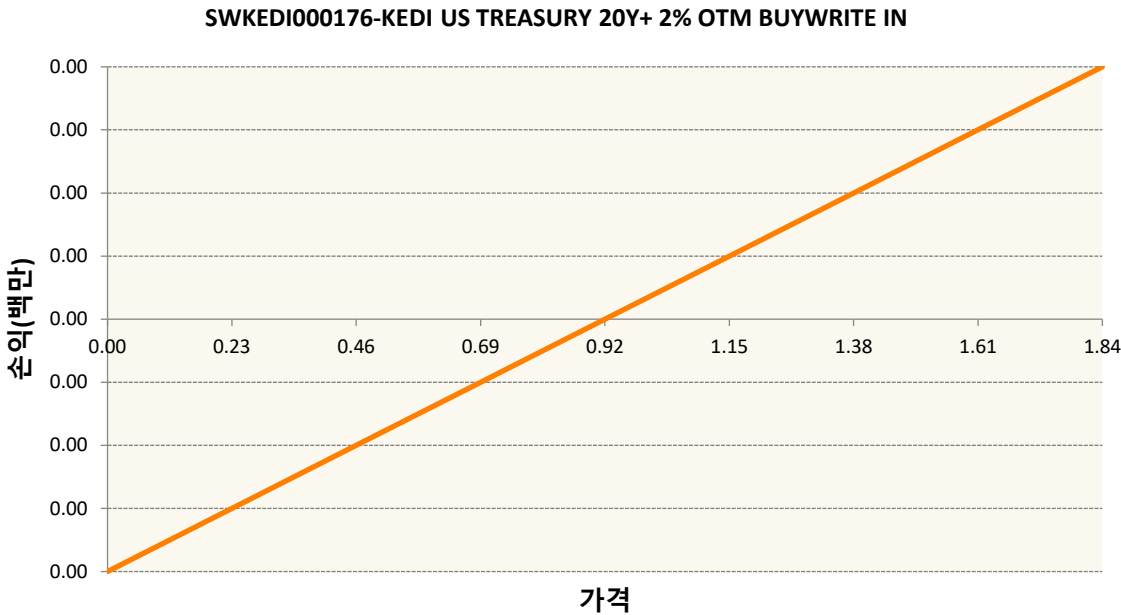
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

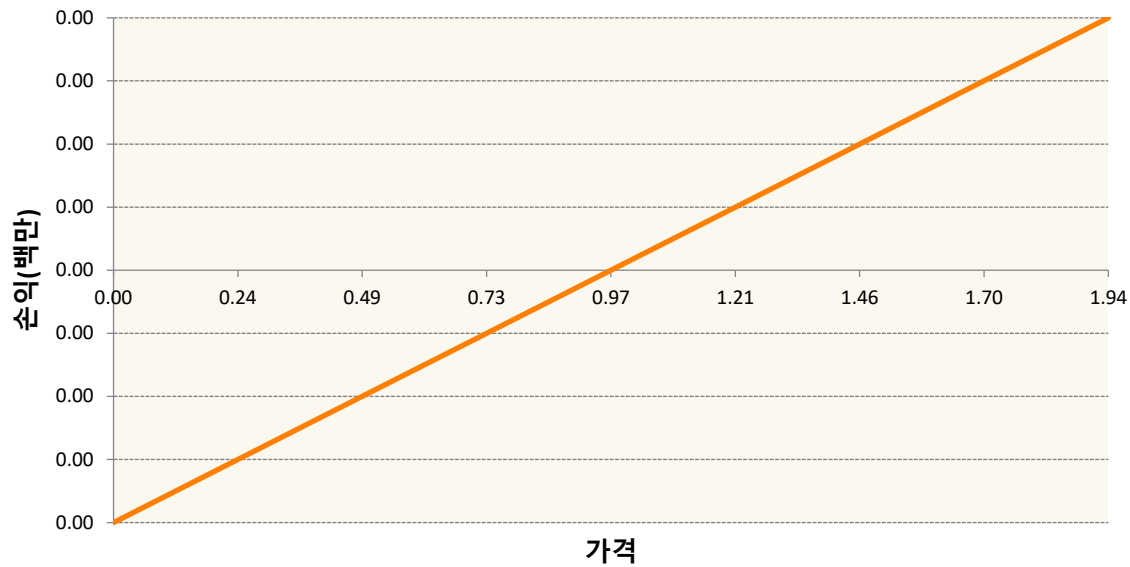
(단위:백만원)

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

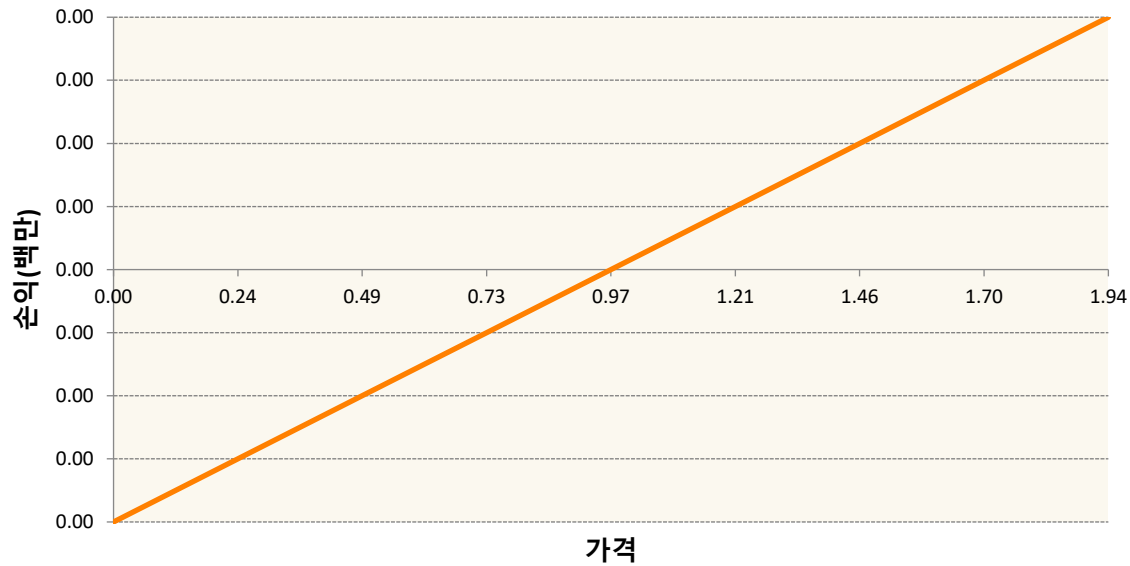
2. 만기시점의 손익구조



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	7,458
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,927
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,580
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,295

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

(단위:백만원)

10,037