

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

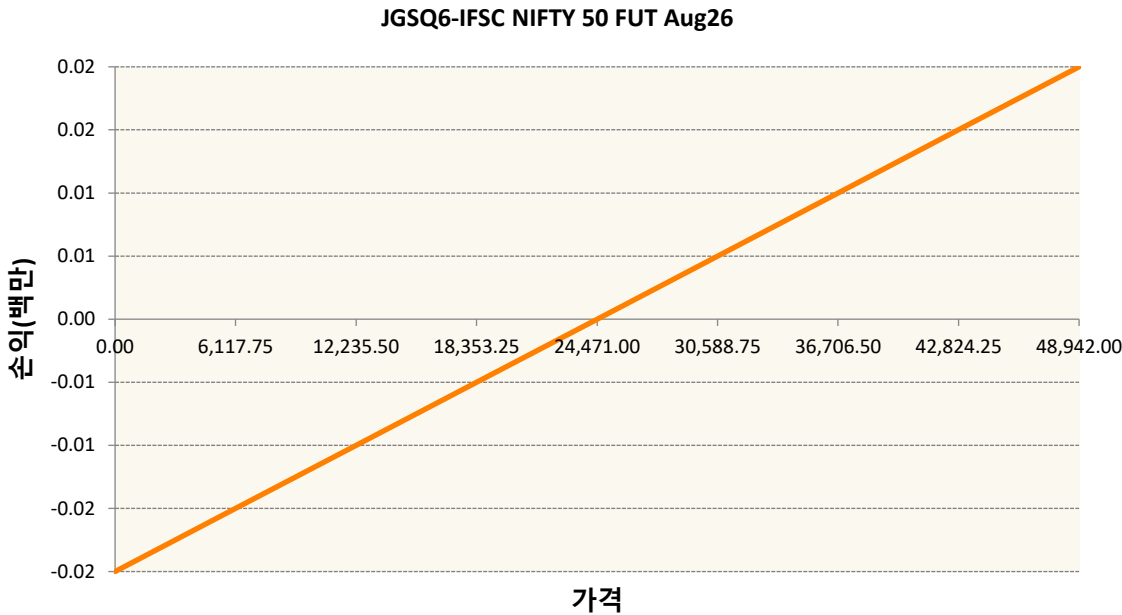
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	359	0	359	

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	2026-08-14
기준일	2026-08-13

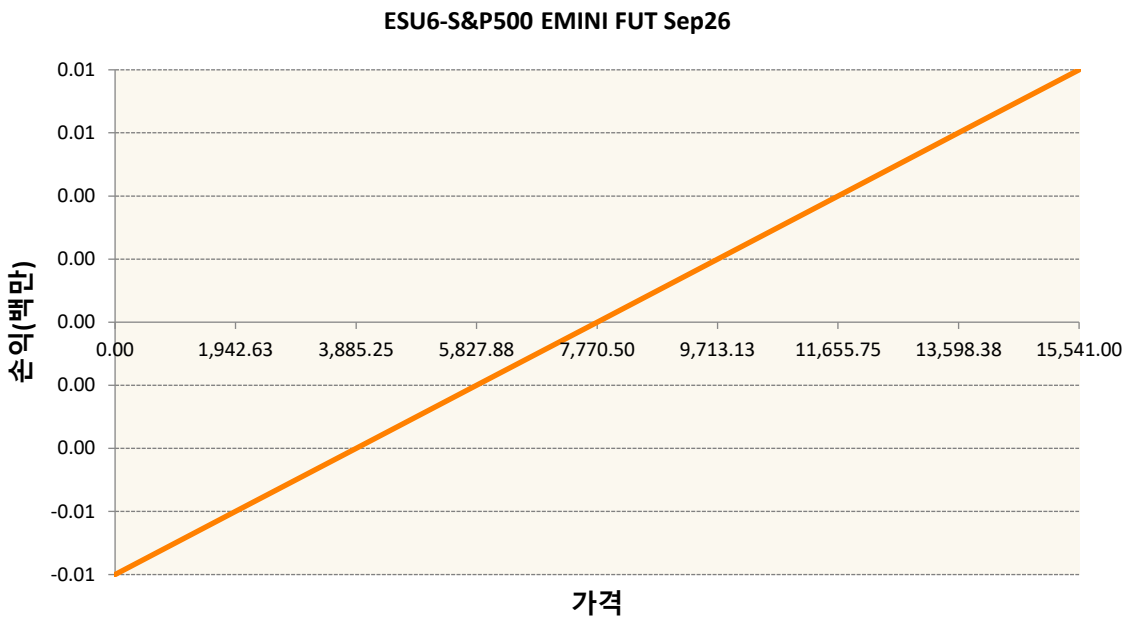
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	592	0	592	

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)

40

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

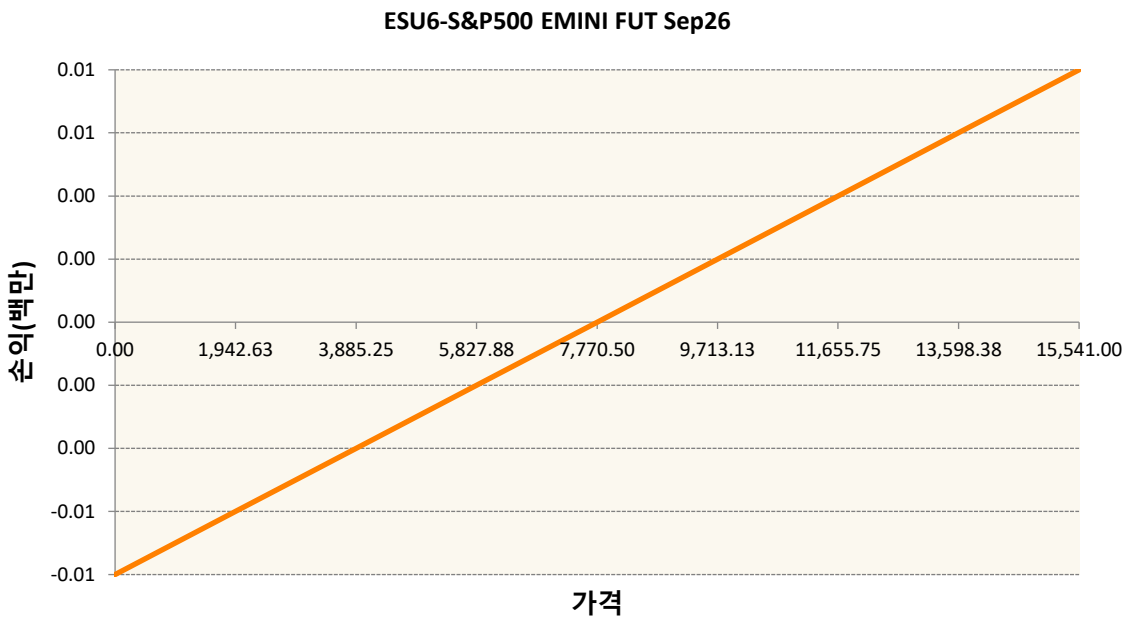
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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)

40

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

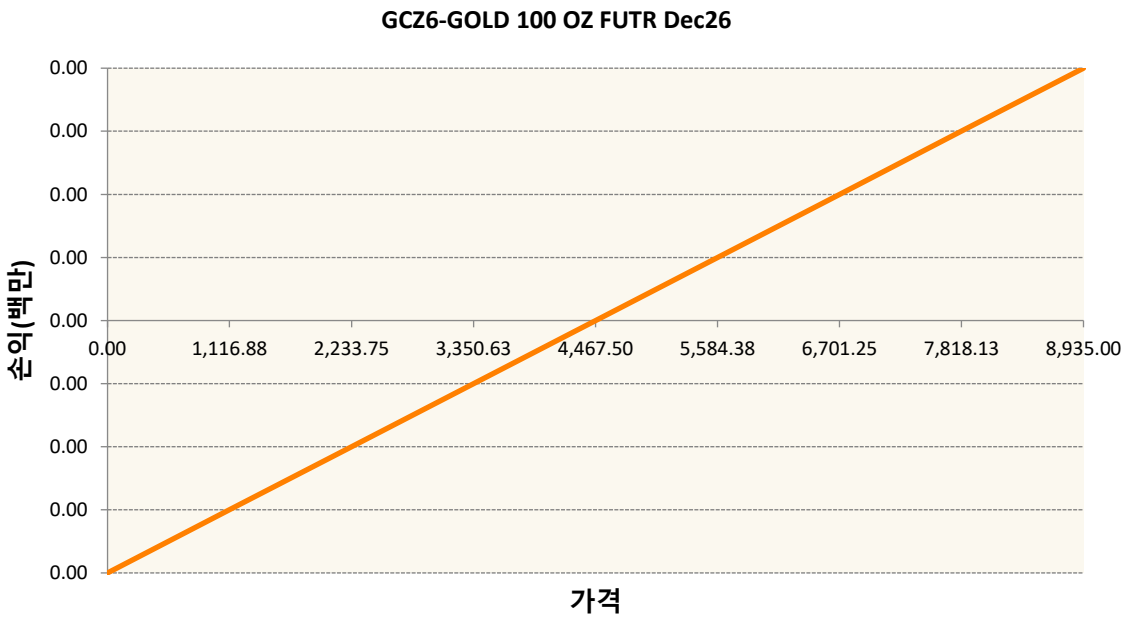
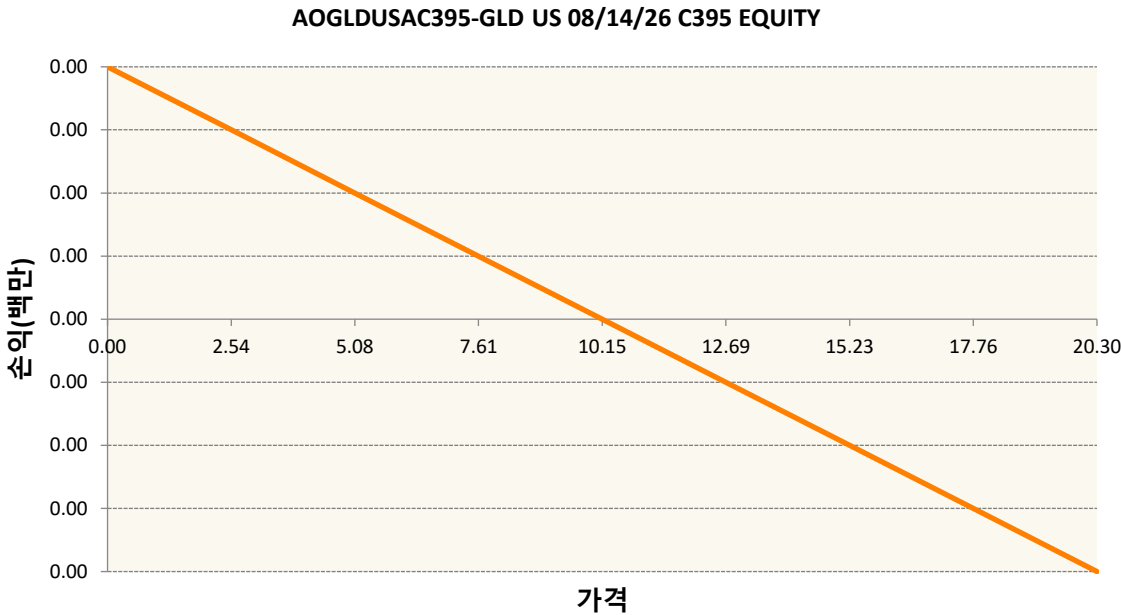
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,132	0	5,132	
누계	실물자산	옵션	0	77	-77	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSAC GLD US 08/14/26 C395 EQUITY		6
GCZ6	GOLD 100 OZ FUTR Dec26	411

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	545

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

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)

AOPLTRUAP' PLTR US 08/14/26 P170 Equity	16
AOPLTRUSC' PLTR US 08/14/26 C170 Equity	407

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

(단위:백만원)

1,448

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

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)

AOTLTUSAS(TLT US 08/14/26 C83 EQUITY

8

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

(단위:백만원)

4

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

(단위:백만원)

16,388

공시일 2026-08-14

기준일 2026-08-13

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	2026-08-14
기준일	2026-08-13

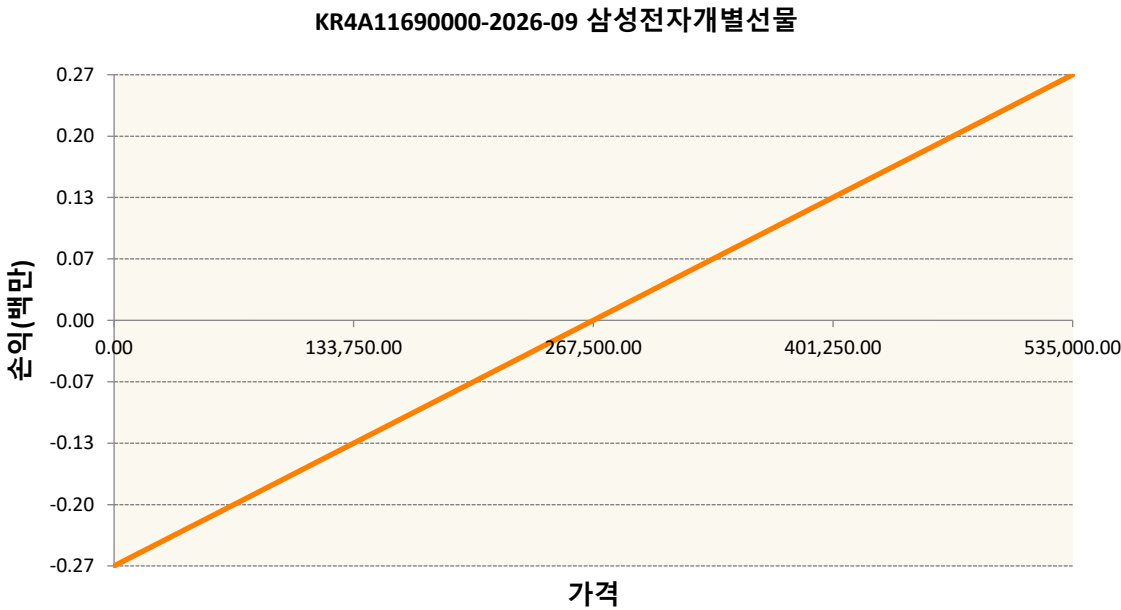
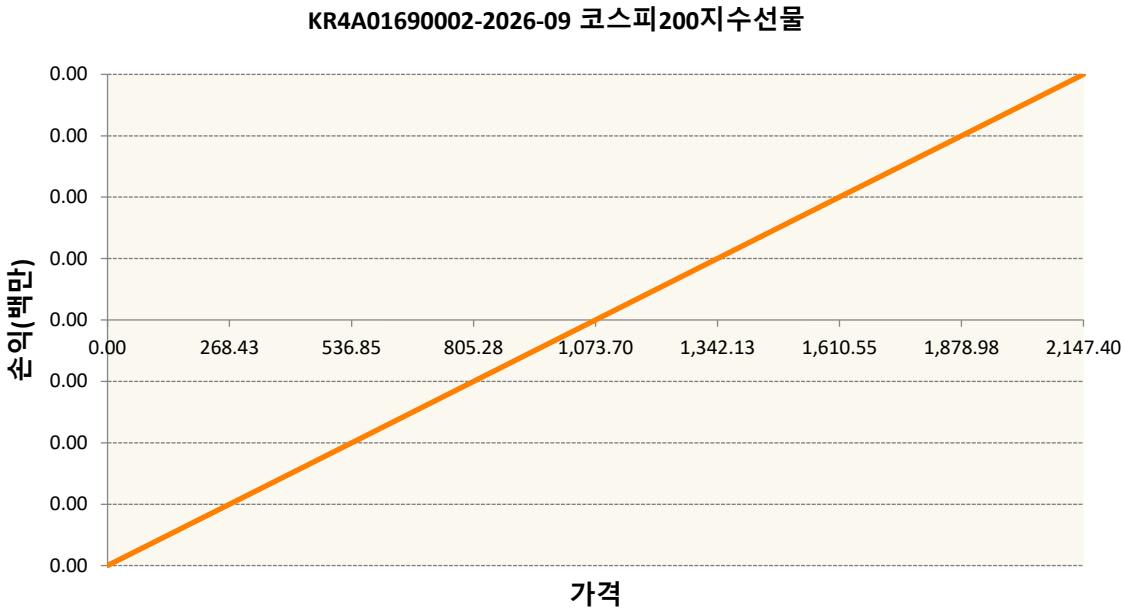
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	54,676	-54,676	장내
누계	유가증권	선물	21,424	0	21,424	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,692	-53,692	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between the price of a product and its profit. The x-axis represents the price (가격) in thousands of won, with major ticks at 0.00, 266.88, 533.75, 800.63, 1,067.50, 1,334.38, 1,601.25, 1,868.13, and 2,135.00. The y-axis represents the profit (이익) in thousands of won, with major ticks at 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, and 0.00. A blue line starts at a profit of 0.00 at a price of 1,067.50 and decreases linearly to a profit of 0.00 at a price of 2,135.00.

가격 (Price)	이익 (Profit)
1,067.50	0.00
2,135.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,140.00. The y-axis, labeled '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at (1,070.00, 0.00) and ends at (2,140.00, 0.00).

가격	손익 (백만)
1,070.00	0.00
2,140.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				557
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-557	-557	-557	-557	-557	-557	-557	
-5.33%	-371	-371	-371	-371	-371	-371	-371	
-2.67%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	186	186	186	186	186	186	186	
5.33%	371	371	371	371	371	371	371	
8.00%	557	557	557	557	557	557	557	
KR4A11690000				2026-09 삼성전자개별선물				1,158
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,158	-1,158	-1,158	-1,158	-1,158	-1,158	-1,158
-5.33%	-772	-772	-772	-772	-772	-772	-772
-2.67%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	386	386	386	386	386	386	386
5.33%	772	772	772	772	772	772	772
8.00%	1,158	1,158	1,158	1,158	1,158	1,158	1,158
KR4BAFBSA289 코스피위클리M C 2608W3 1,067.5							2,042

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	877	856	830	800	765	727	686
-5.33%	791	748	702	652	600	546	490
-2.67%	586	523	458	393	327	261	194
0%	212	141	71	0	-71	-141	-212
2.67%	-344	-404	-467	-531	-596	-662	-728
5.33%	-1,046	-1,087	-1,132	-1,181	-1,233	-1,288	-1,344
8.00%	-1,840	-1,862	-1,889	-1,921	-1,958	-1,998	-2,042
KR4BAFBSA297 코스피위클리M C 2608W3 1,070.0							1,334

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	557	544	528	509	487	463	436
-5.33%	505	478	448	416	383	347	311
-2.67%	377	336	295	252	209	166	122
0%	140	94	47	0	-47	-94	-140
2.67%	-217	-258	-300	-343	-387	-431	-475
5.33%	-674	-702	-733	-767	-802	-839	-877
8.00%	-1,194	-1,210	-1,229	-1,251	-1,277	-1,304	-1,334

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

(단위:백만원)

11,995

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

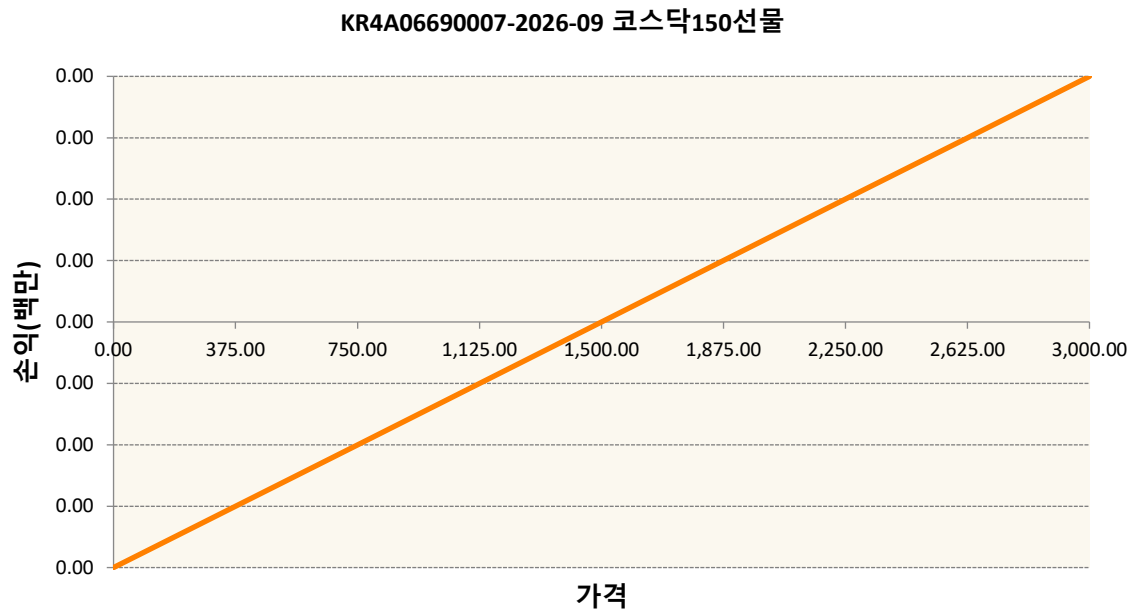
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	870	0	870	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				69
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	46	46	46	46	46	46	46
8.00%	69	69	69	69	69	69	69

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

(단위:백만원)

18,761

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

(단위:백만원)

48,824

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

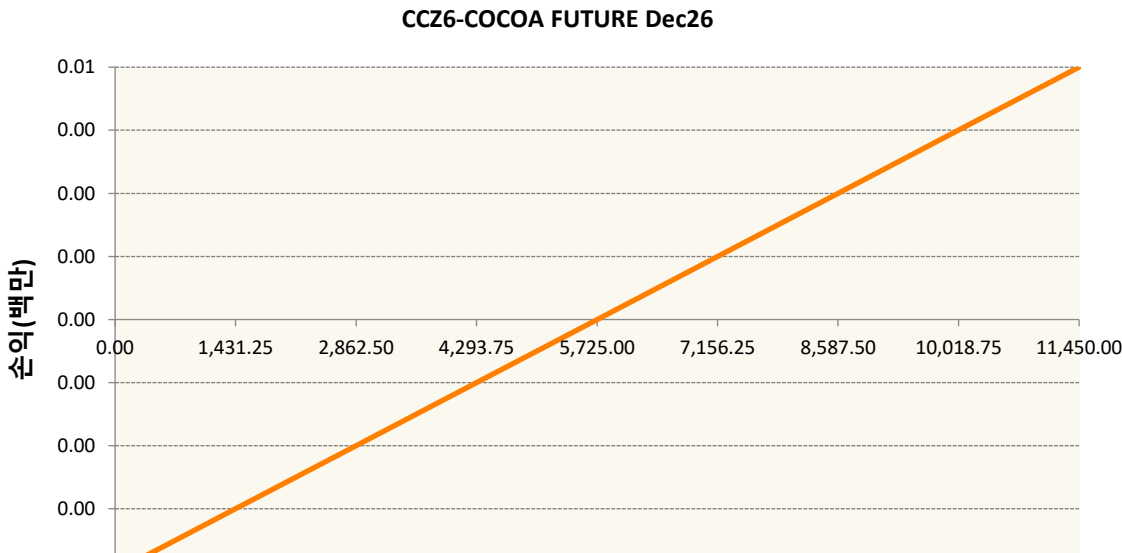
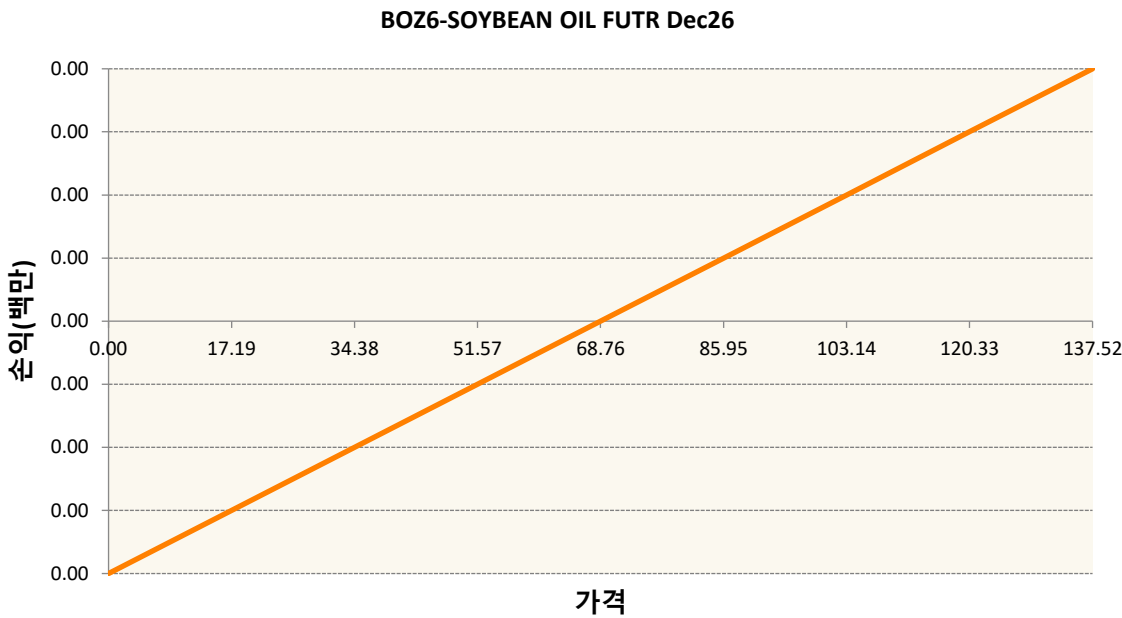
포커스농산물모(채권-파생형)

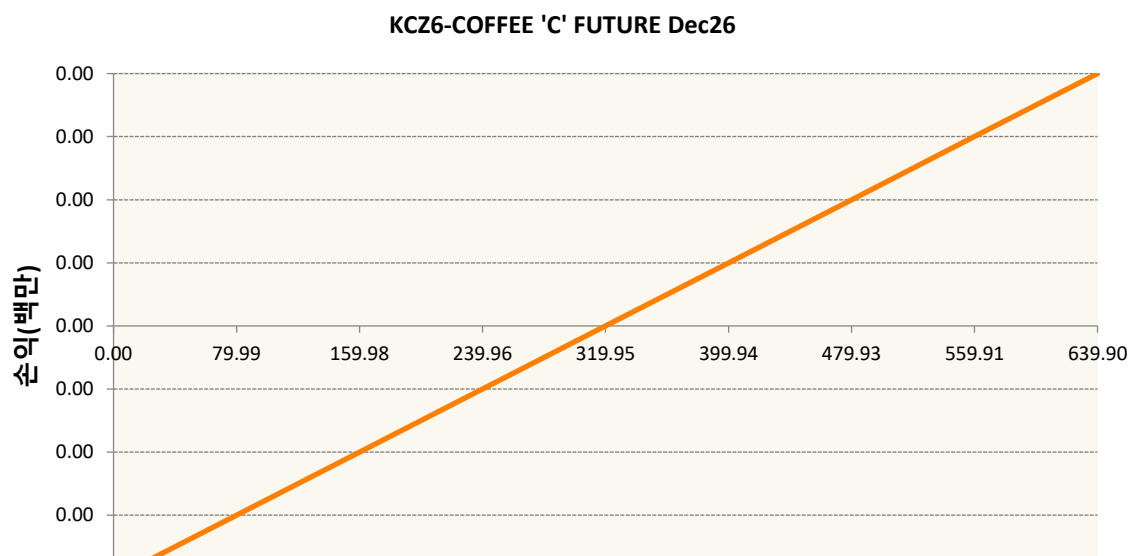
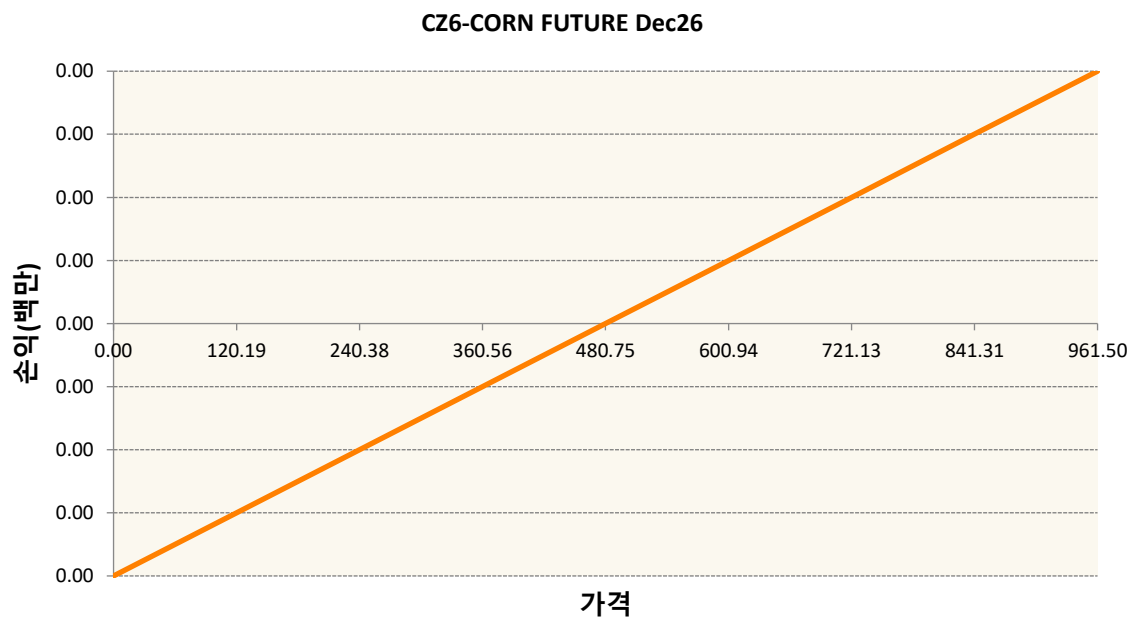
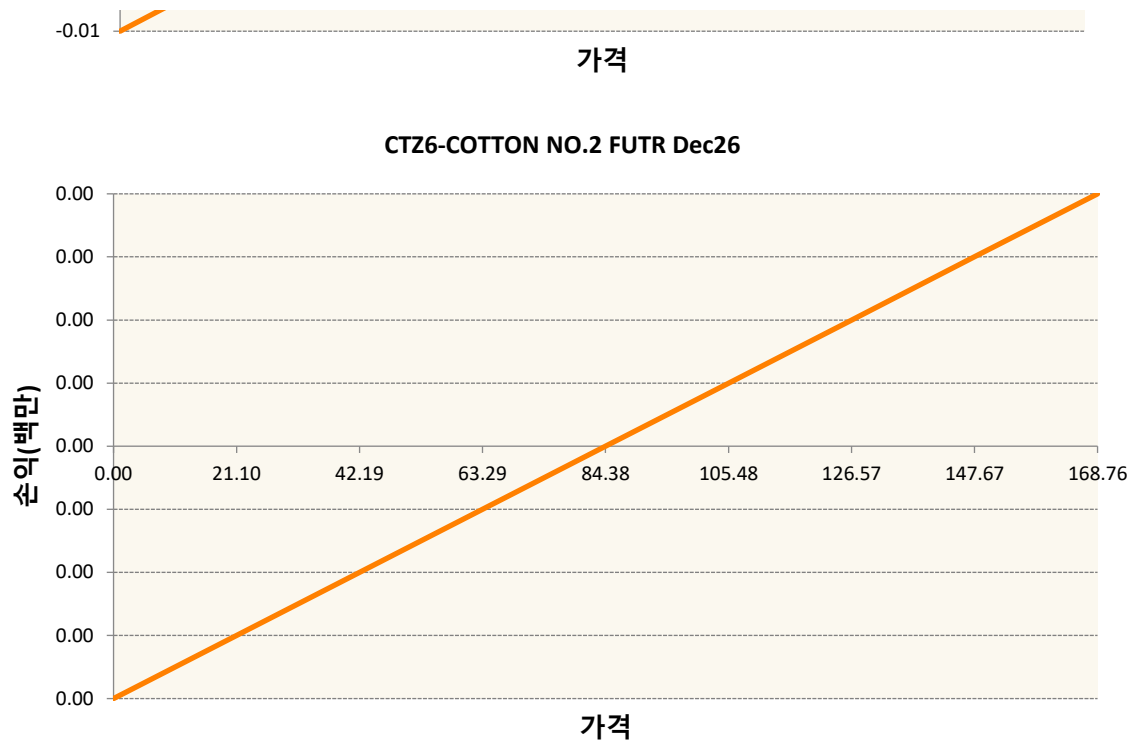
1. 계약금액

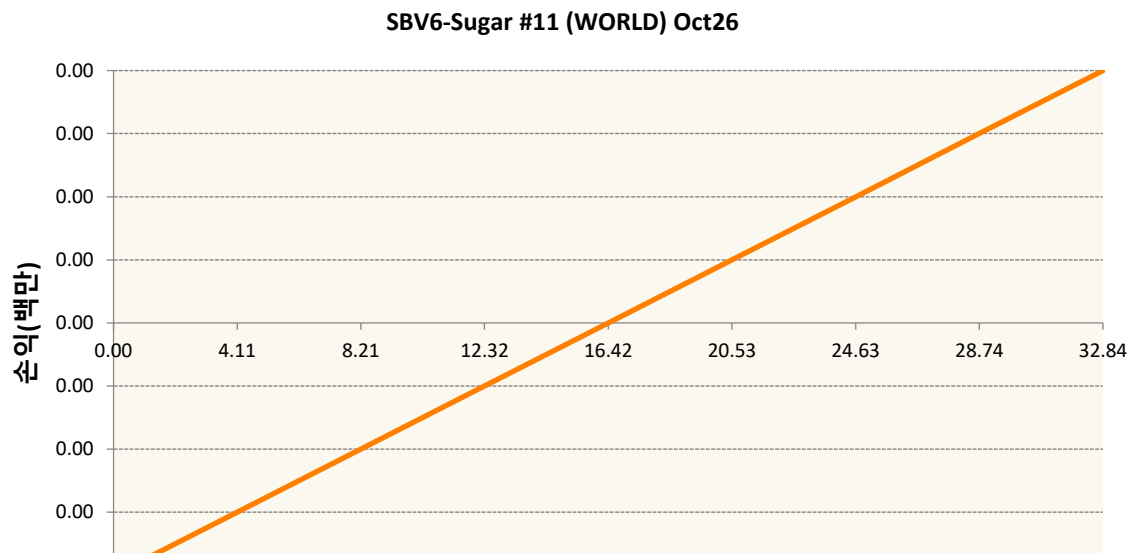
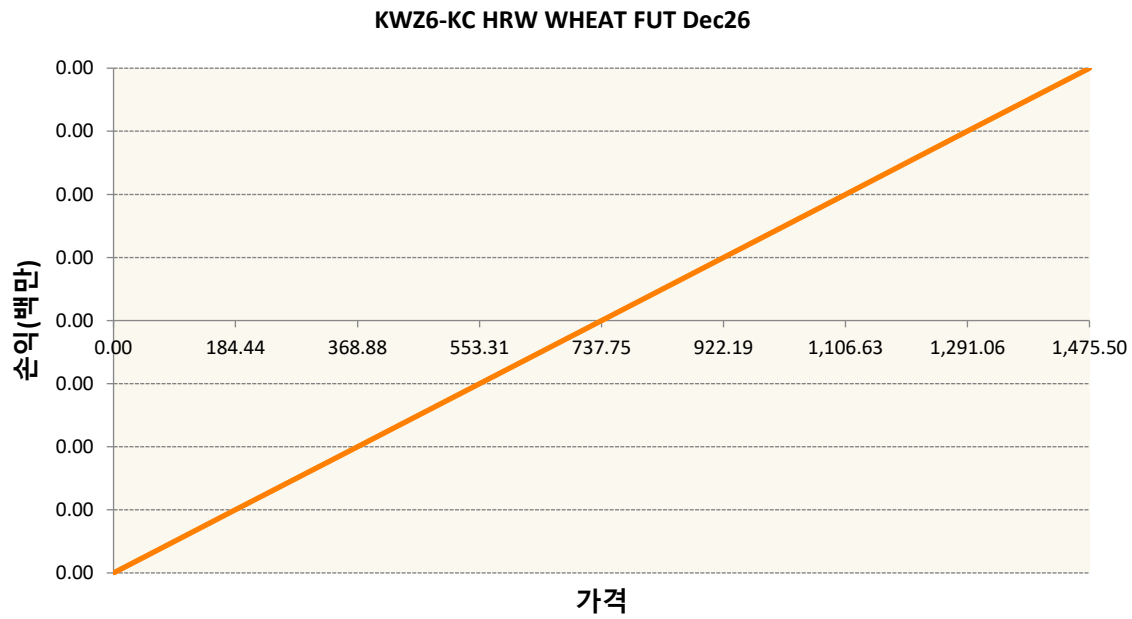
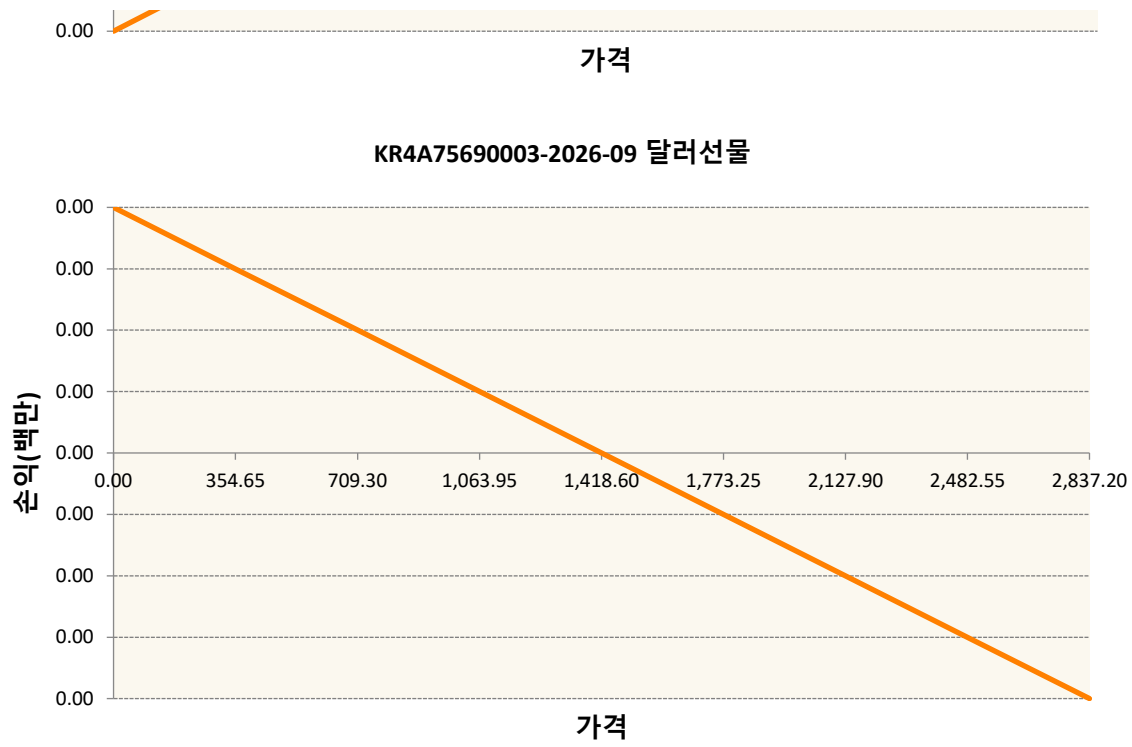
(단위:USD 백만)

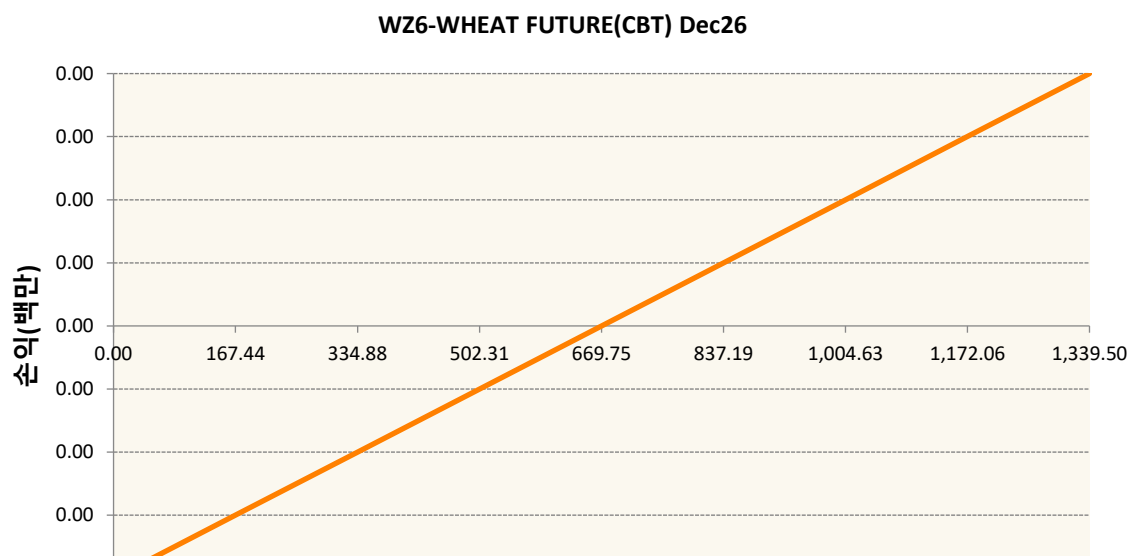
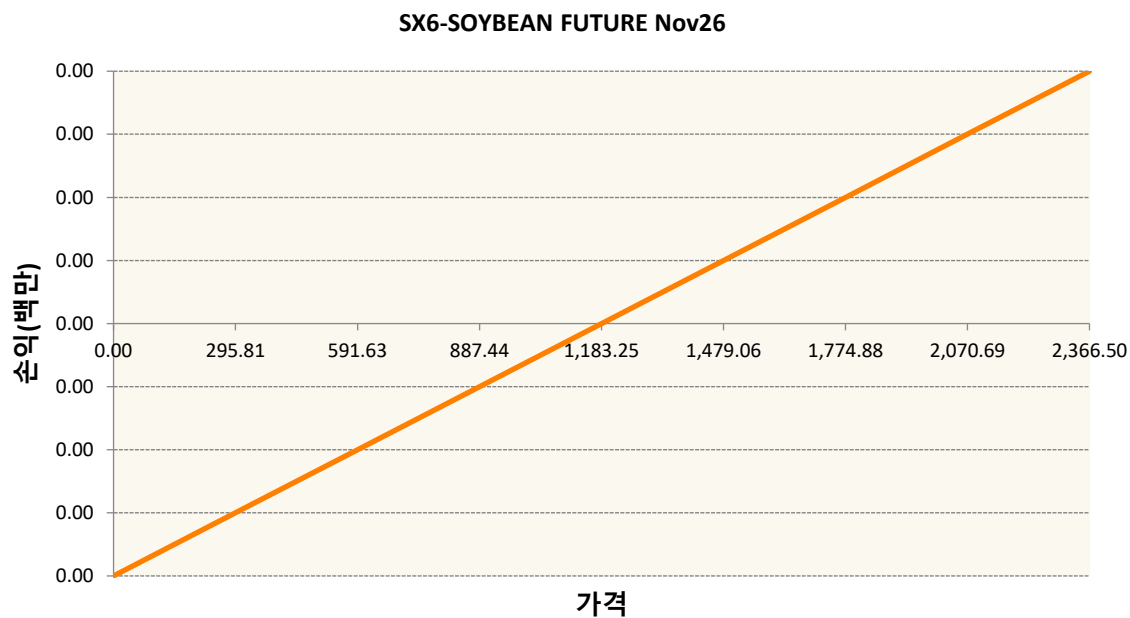
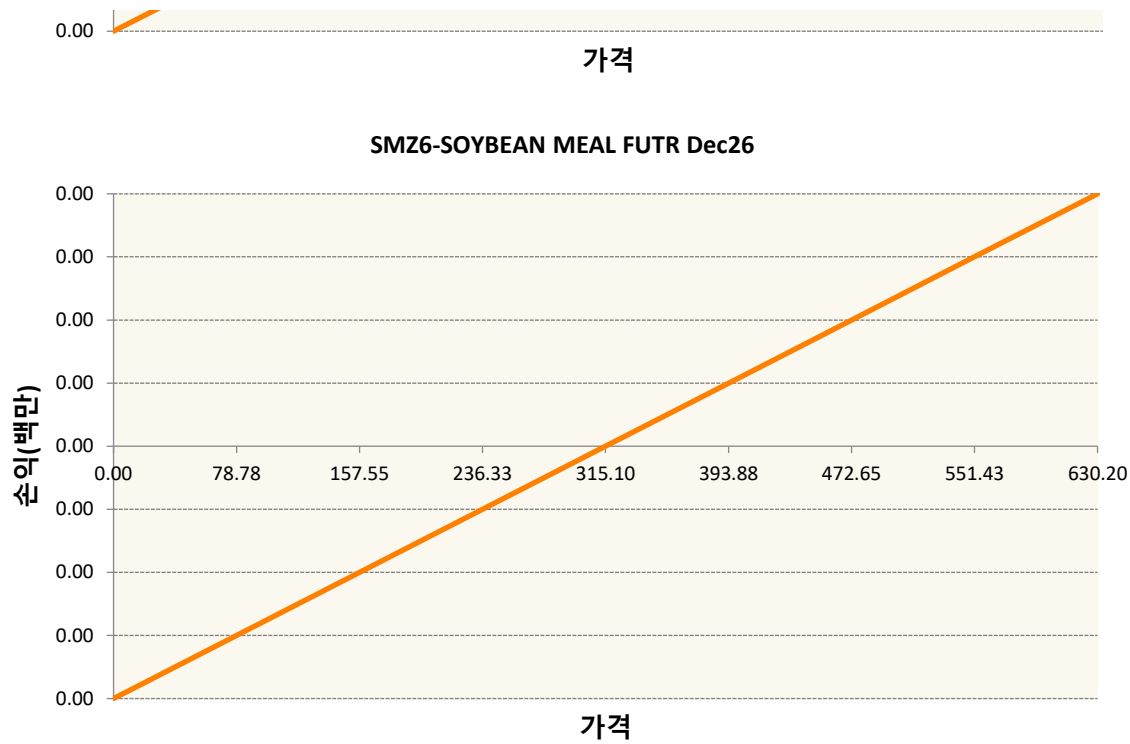
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	455	0	455	
누계	유가증권	선물	2,262	0	2,262	
누계	통화	선물	0	355	-355	장내

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	2026-08-14
기준일	2026-08-13

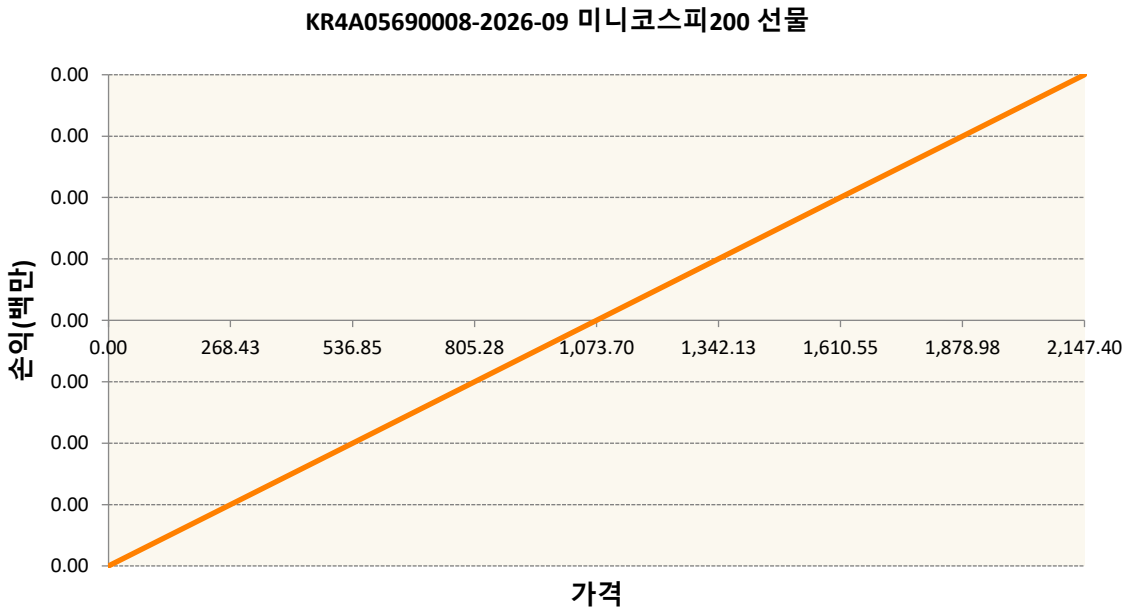
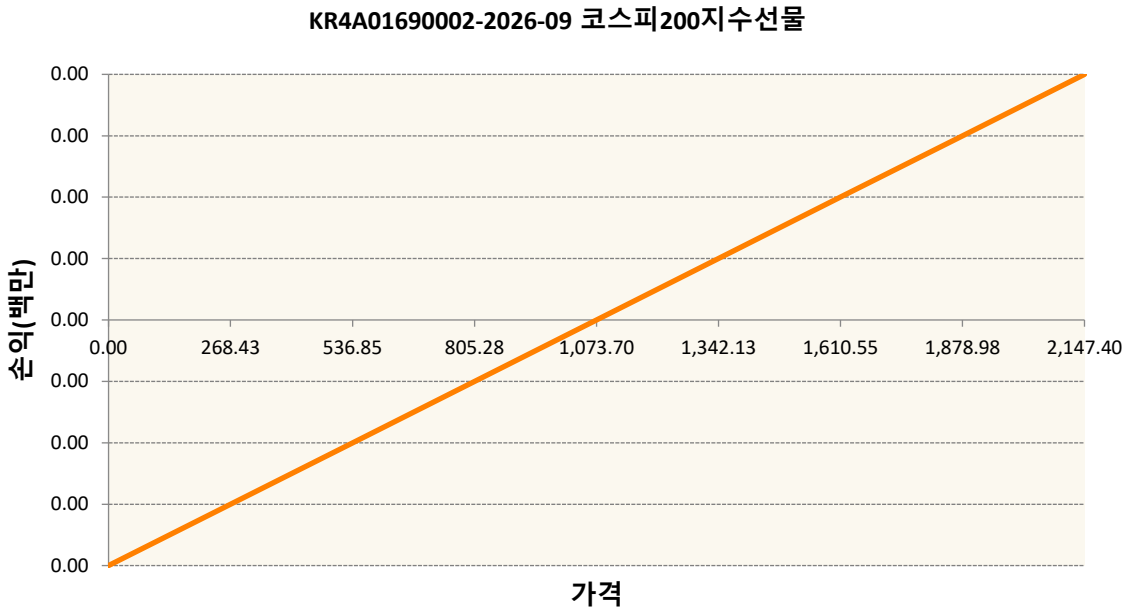
스마트인덱스모

1. 계약금액

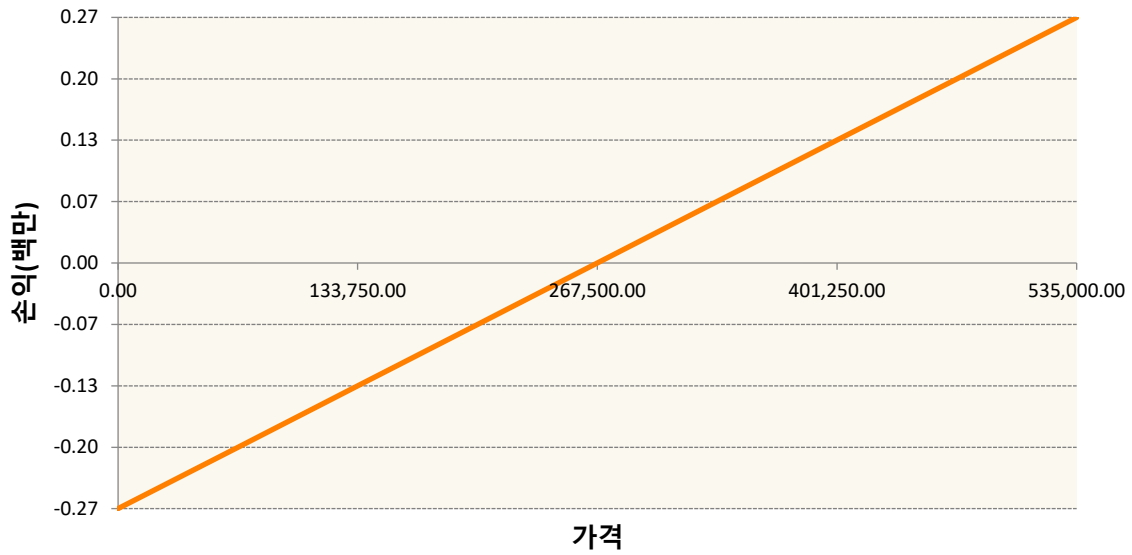
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	141	-141	장내
누계	유가증권	선물	4,399	138	4,261	장내

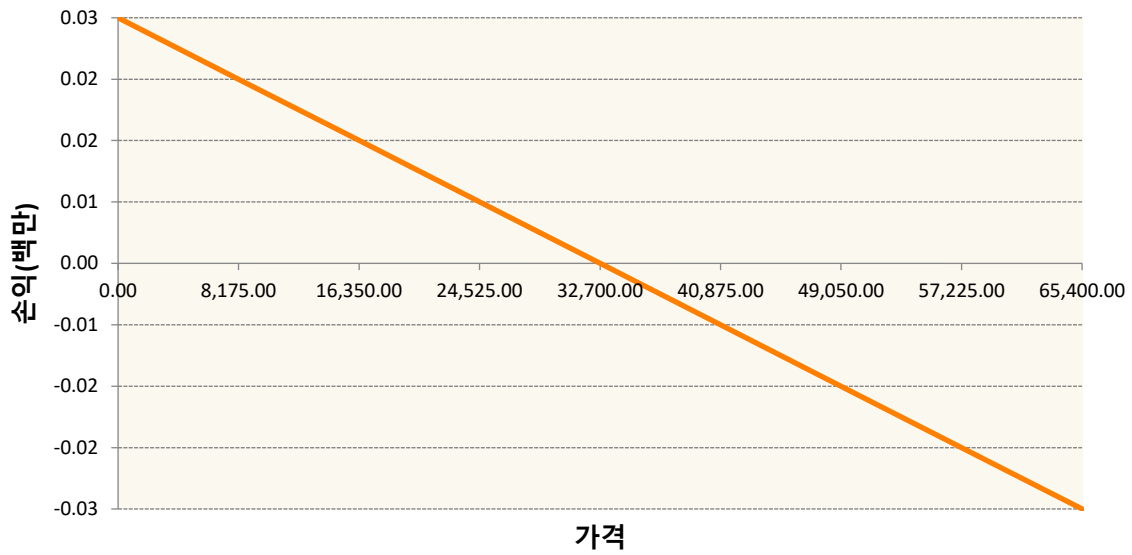
2. 만기시점의 손익구조



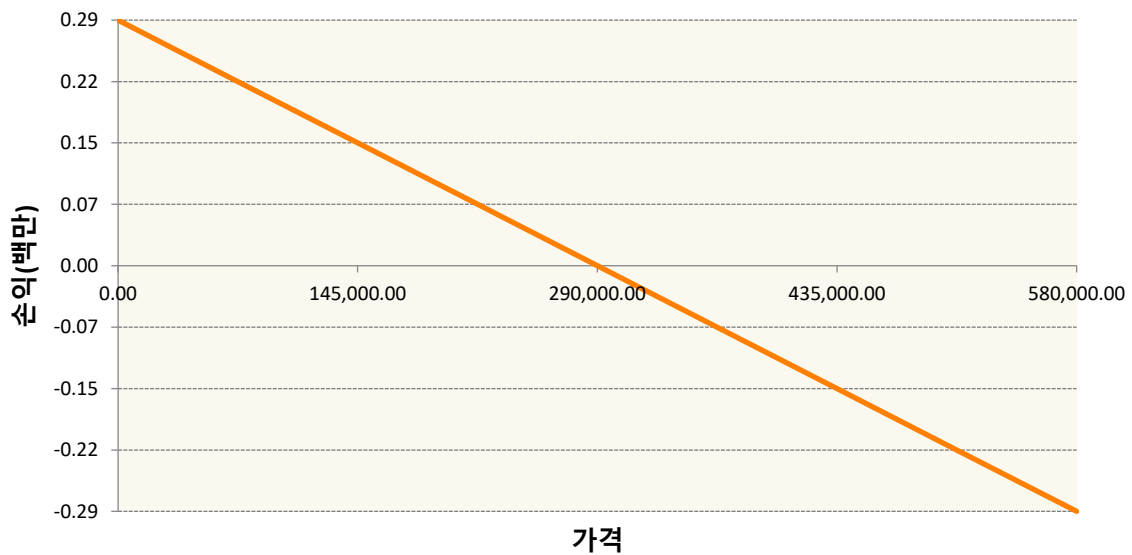
KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



KR4A15690006-2026-09 한국전력개별선물



KR4ABD690005-2026-09 삼성생명개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		193	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-193	-193	-193	-193	-193	-193	-193			
-5.33%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129			
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	64	64	64	64	64	64	64			
5.33%	129	129	129	129	129	129	129			
8.00%	193	193	193	193	193	193	193			
KR4A05690008							2026-09 미니코스피200 선물		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			
KR4A11690000							2026-09 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%	-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%	8	8	8	8	8	8	8			
KR4A15690006							2026-09 한국전력개별선물		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			
KR4ABD690005							2026-09 삼성생명개별선물		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

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

(단위:백만원)

775

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

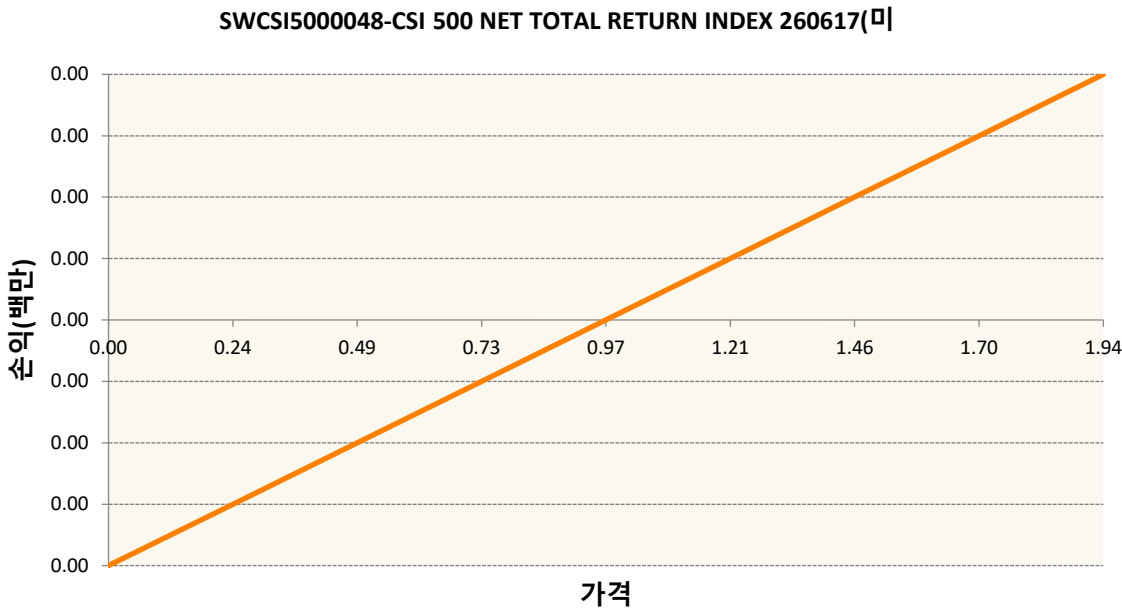
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,623	0	5,623	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

448

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

705

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

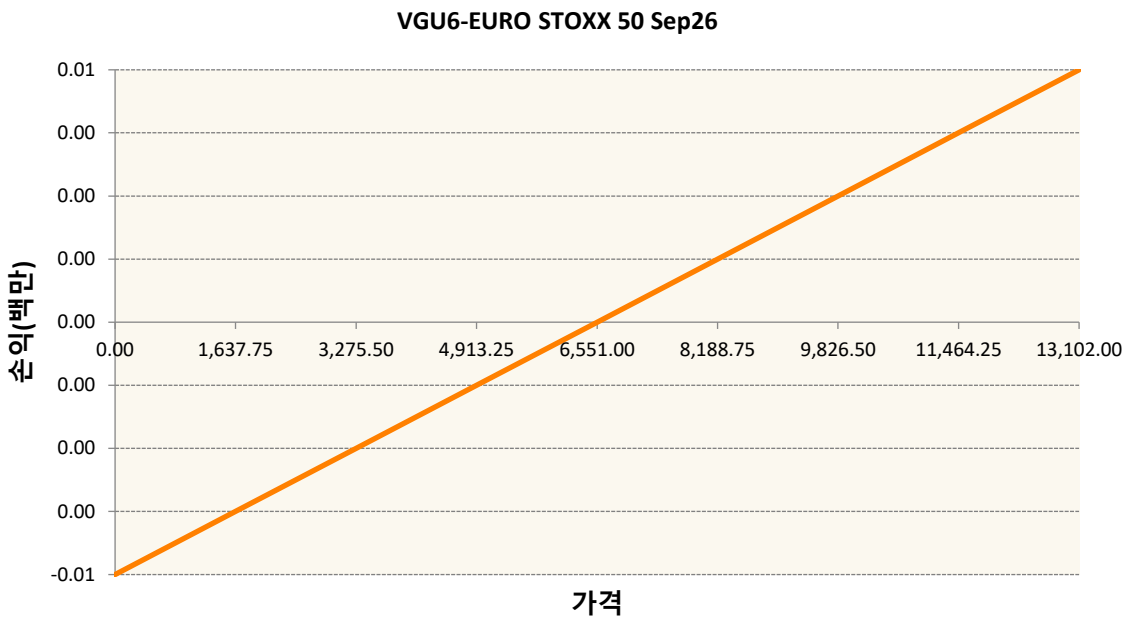
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,033	0	1,033	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	83
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

71

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

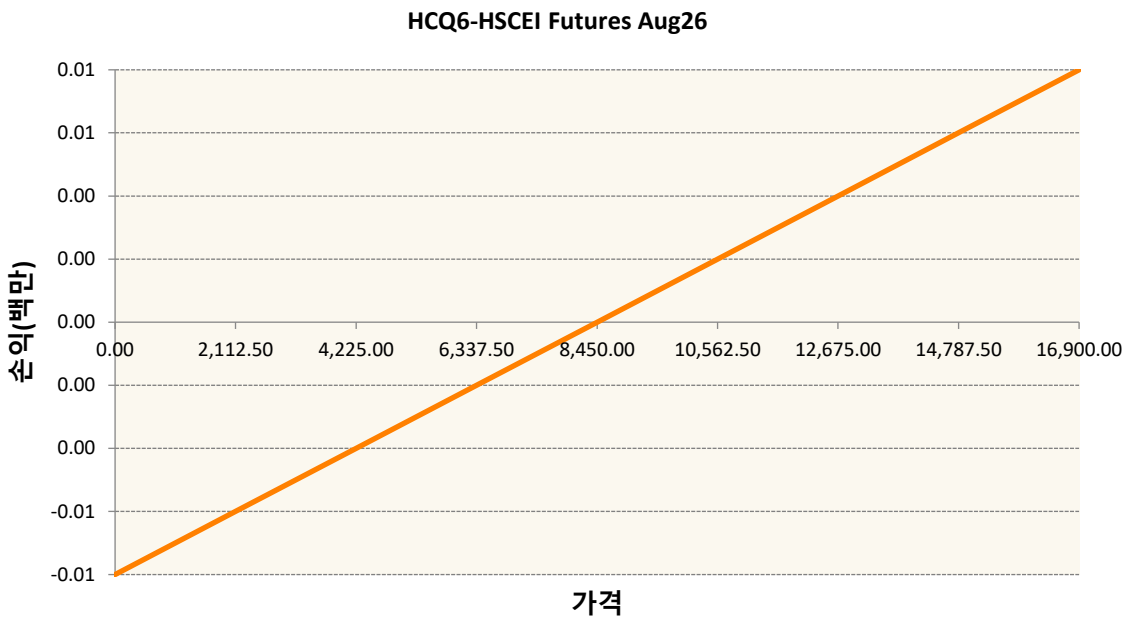
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,480	0	1,480	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ6	HSCEI Futures Aug26	118
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

134

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

(단위:백만원)

2,679

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

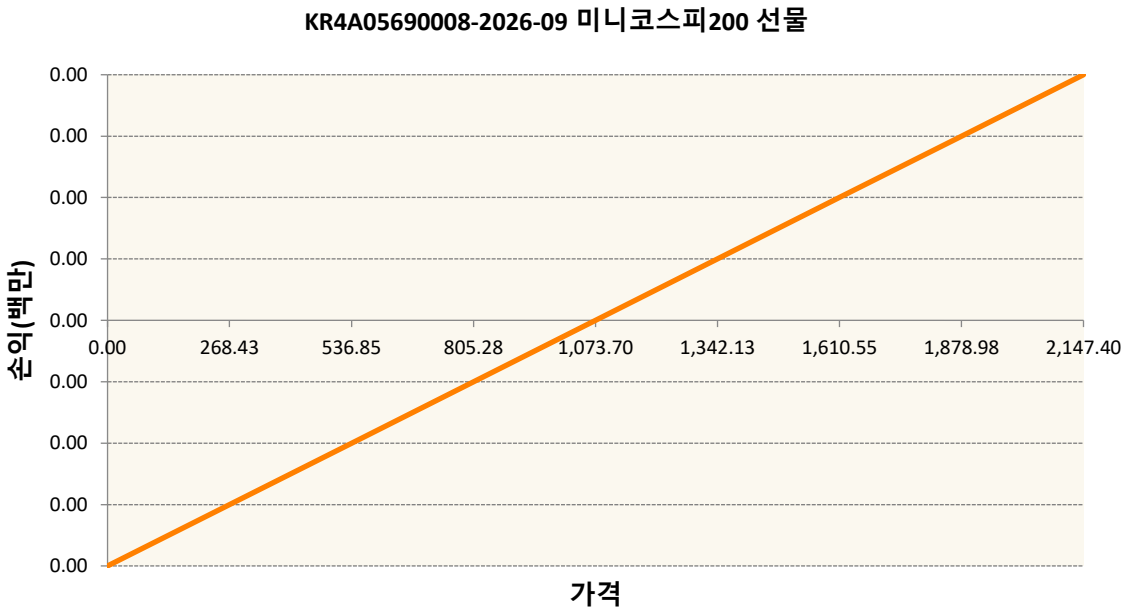
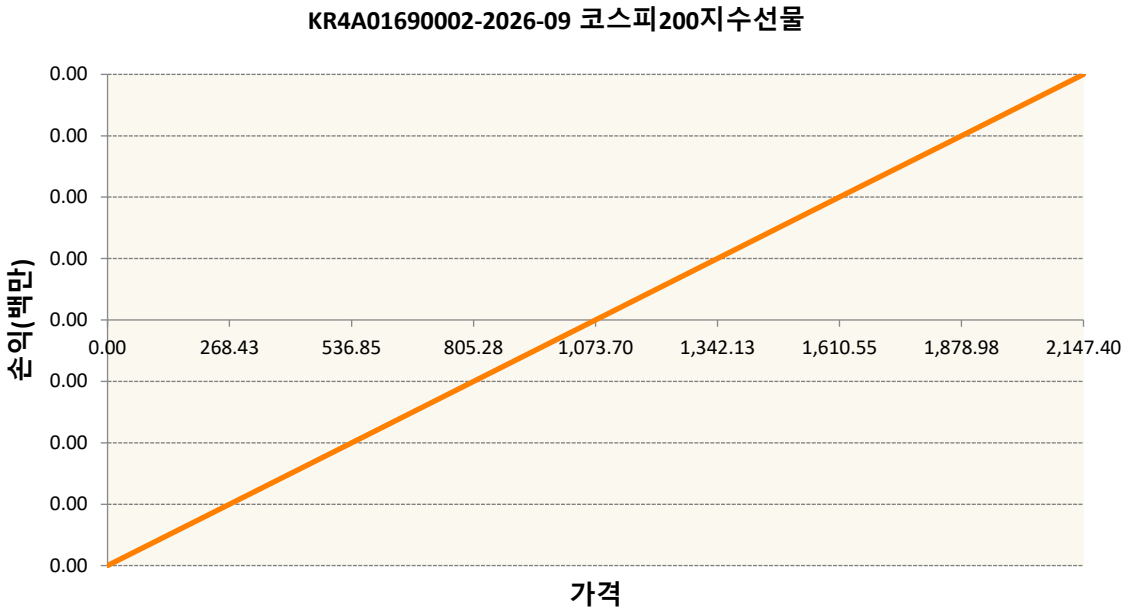
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

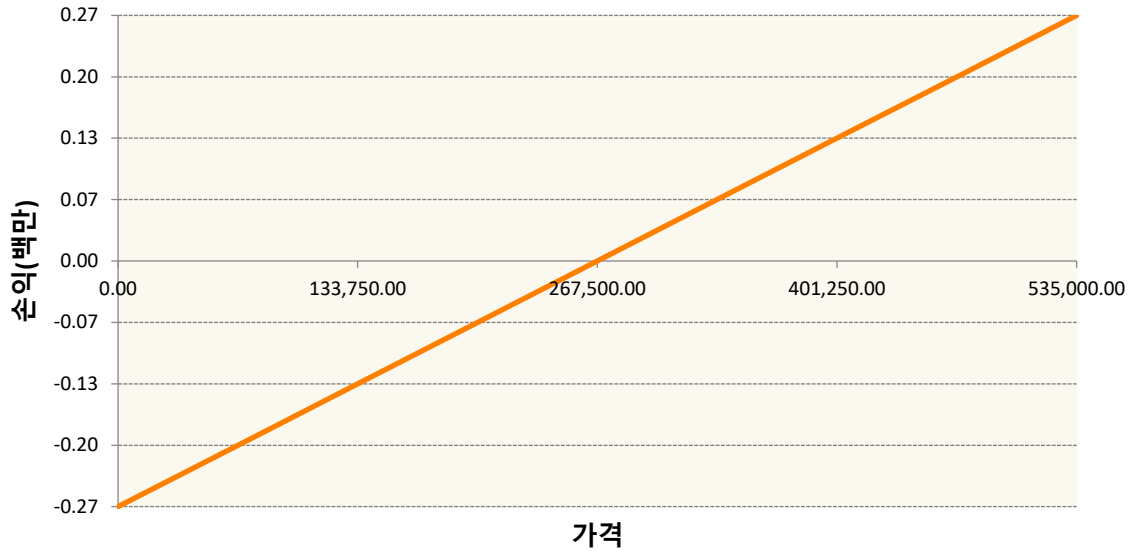
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	541	0	541	장내
누계	유가증권	선물	1,667	0	1,667	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물						64
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
-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%	43	43	43	43	43	43	43	
8.00%	64	64	64	64	64	64	64	
KR4A05690008		2026-09 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%	-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	
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물						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)

272

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

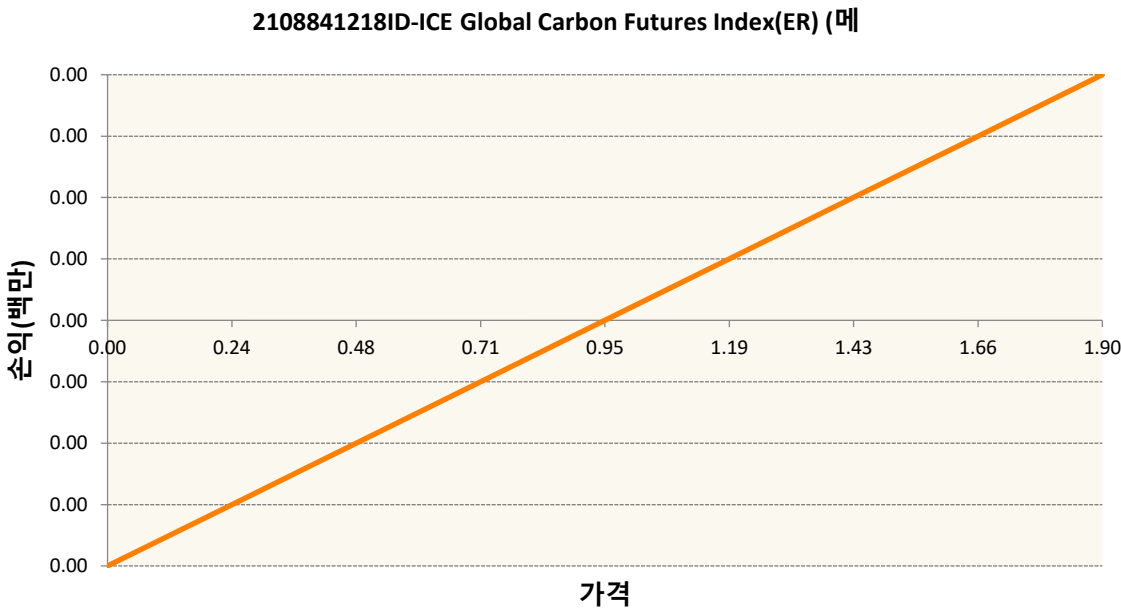
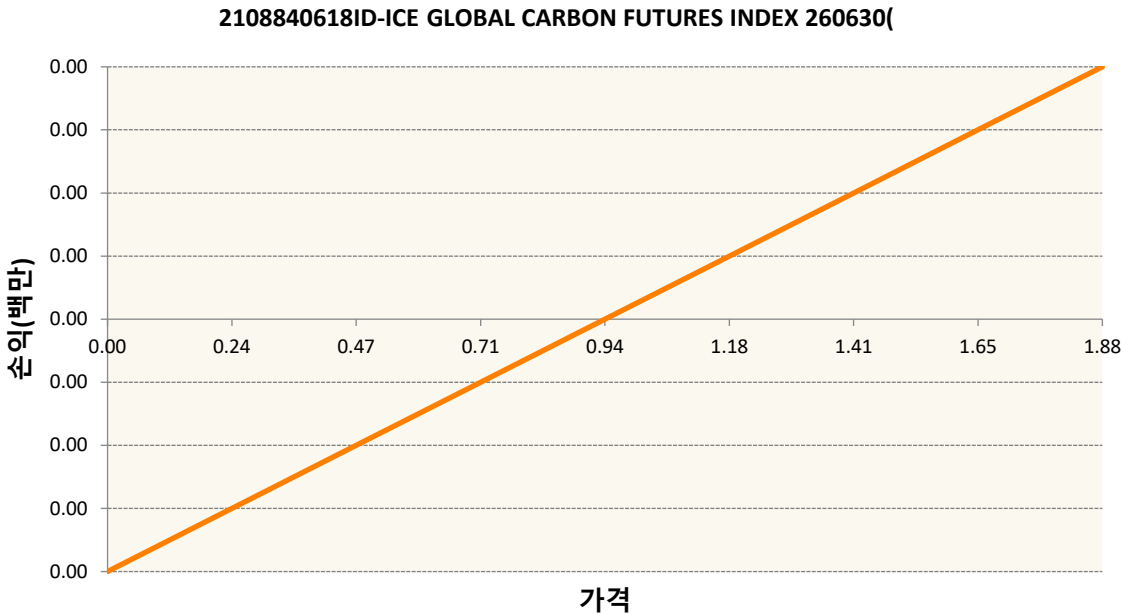
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)
	636

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

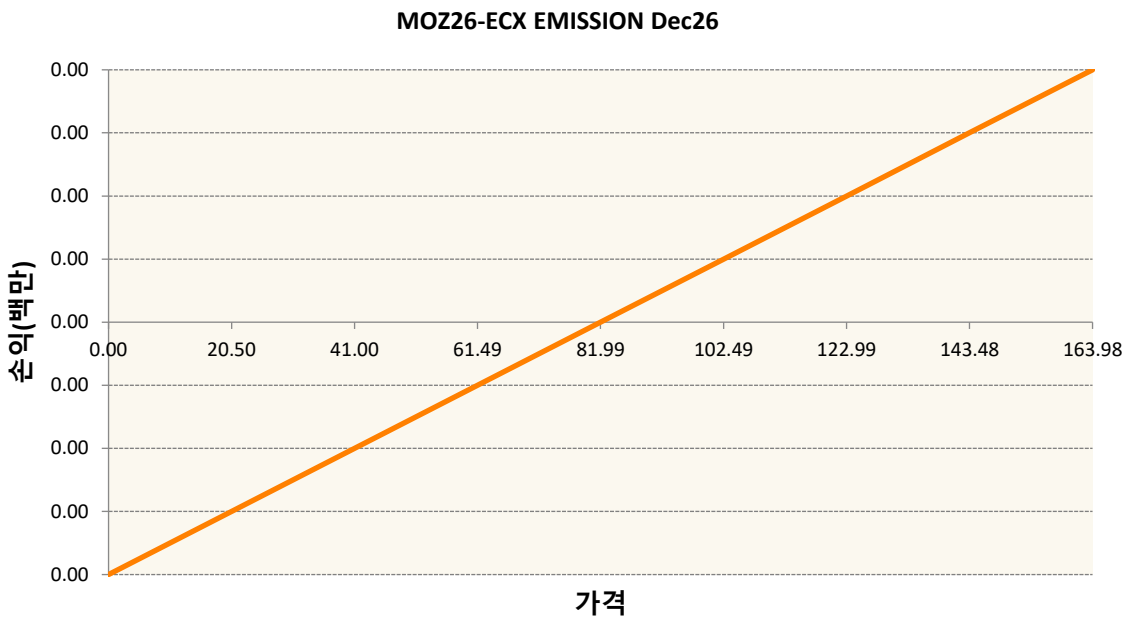
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,303	0	5,303	
누계	통화	선도	0	2,567	-2,567	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G7XIKRW/EUR 31-08-26E	205
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	424

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

(단위:백만원)

691

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

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	-1,515	0	-1,515	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	48
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	23
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	19
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	29

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

(단위:백만원)

191

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

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	-3,807	0	-3,807	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	23
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	151
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	133

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

(단위:백만원)

571

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

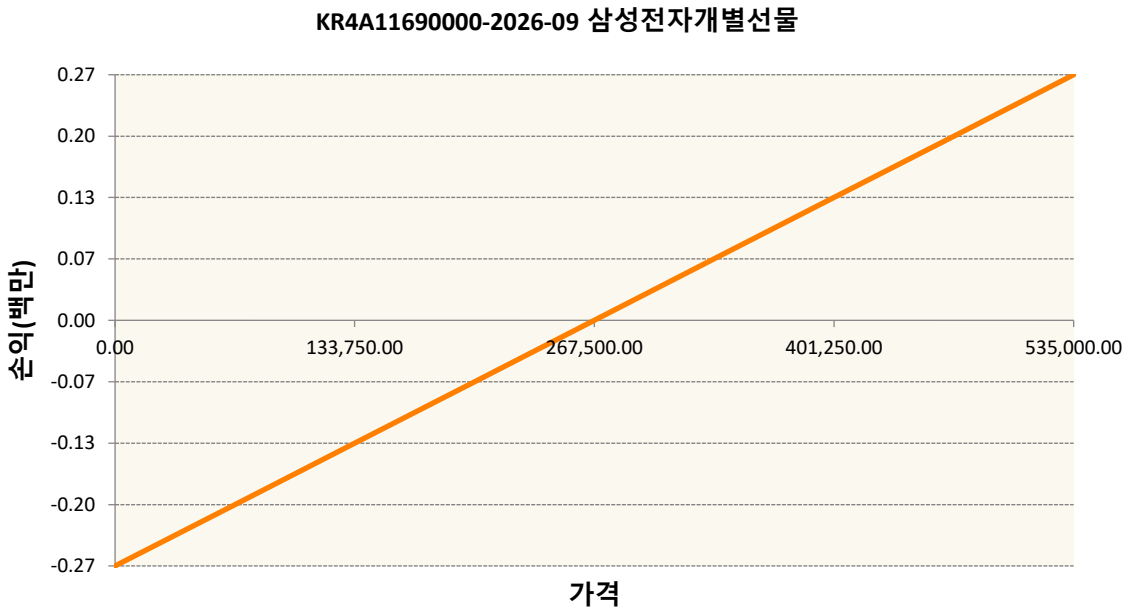
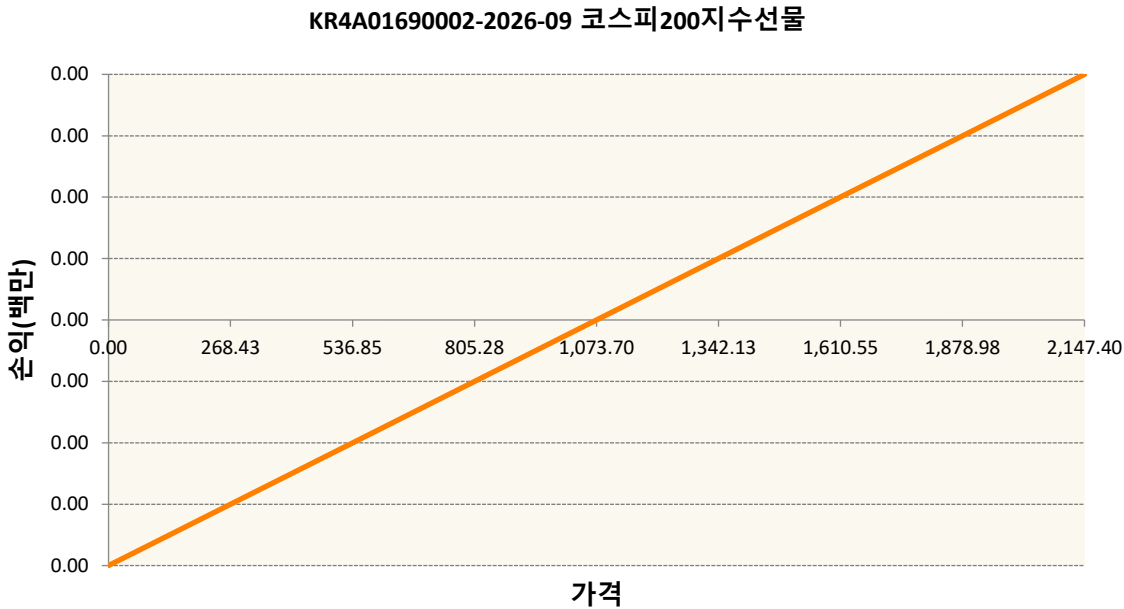
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

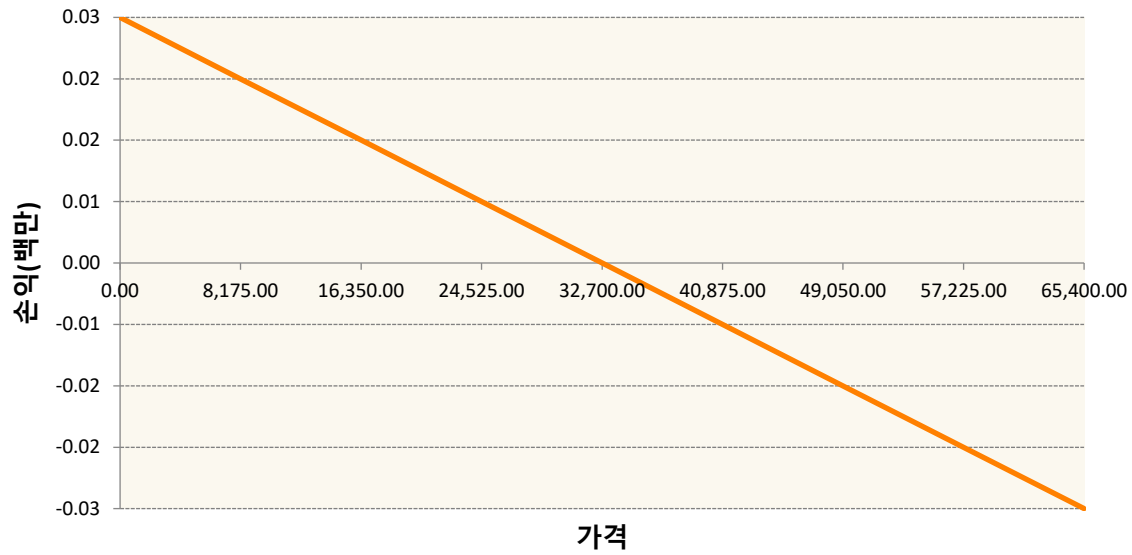
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	269	3,743	-3,474	장내
누계	유가증권	선물	25,165	2,189	22,976	장내

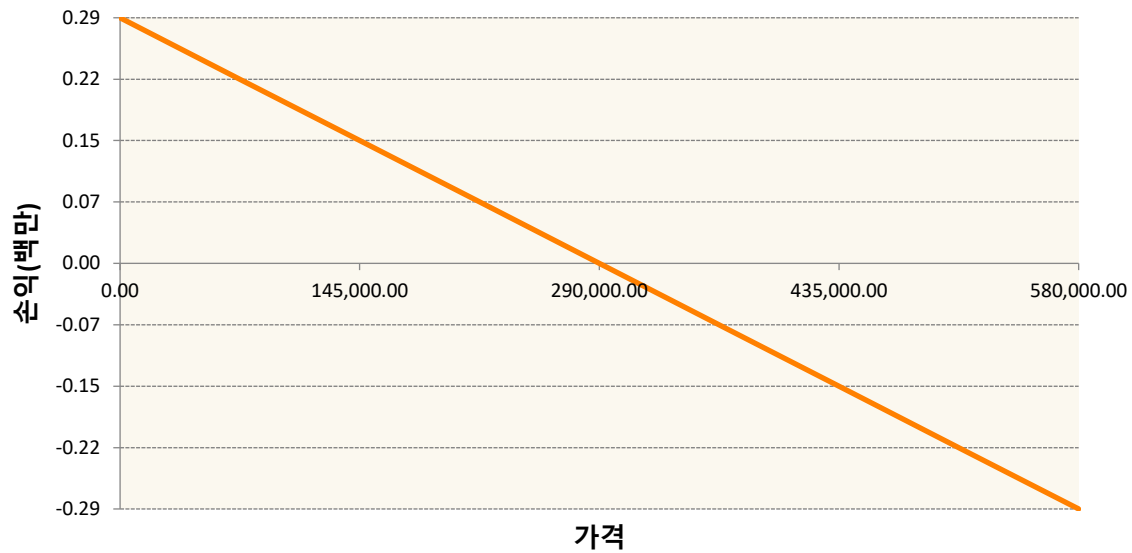
2. 만기시점의 손익구조



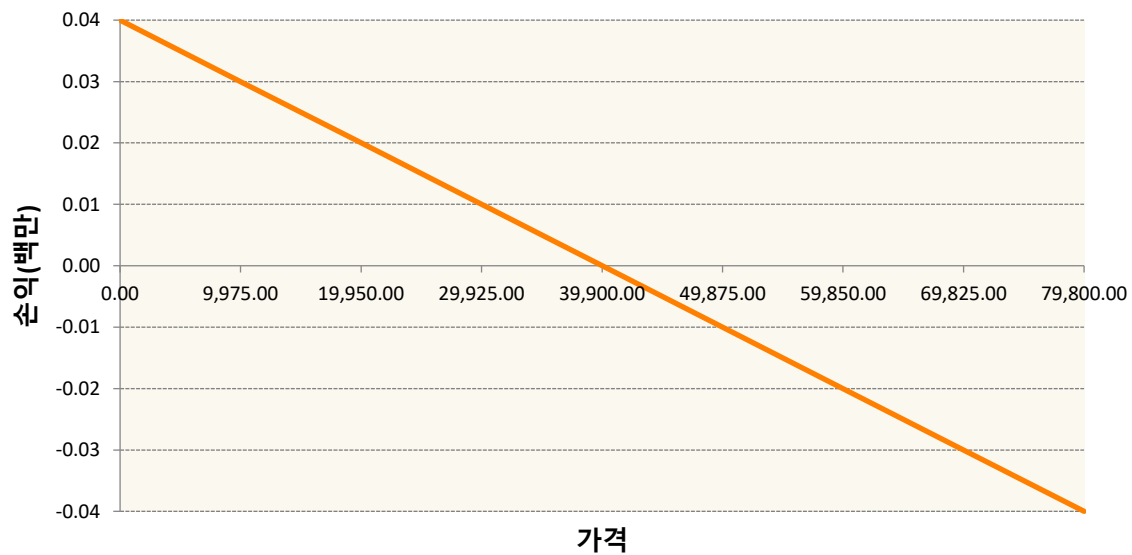
KR4A15690006-2026-09 한국전력개별선물



KR4ABD690005-2026-09 삼성생명개별선물



KR4ACF690002-2026-09 카카오개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					1,693
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,693	-1,693	-1,693	-1,693	-1,693	-1,693	-1,693
-5.33%	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128
-2.67%	-564	-564	-564	-564	-564	-564	-564
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	564	564	564	564	564	564	564
5.33%	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128
8.00%	1,693	1,693	1,693	1,693	1,693	1,693	1,693
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물					317
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-5.33%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
-2.67%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	106	106	106	106	106	106	106
5.33%	212	212	212	212	212	212	212
8.00%	317	317	317	317	317	317	317
KR4A15690006		2026-09 한국전력개별선물					53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
KR4ABD690005		2026-09 삼성생명개별선물					53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
KR4ACF690002		2026-09 카카오개별선물					70
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	70	70	70	70	70	70	70
-5.33%	47	47	47	47	47	47	47
-2.67%	23	23	23	23	23	23	23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70

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

(단위:백만원)

7,000

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

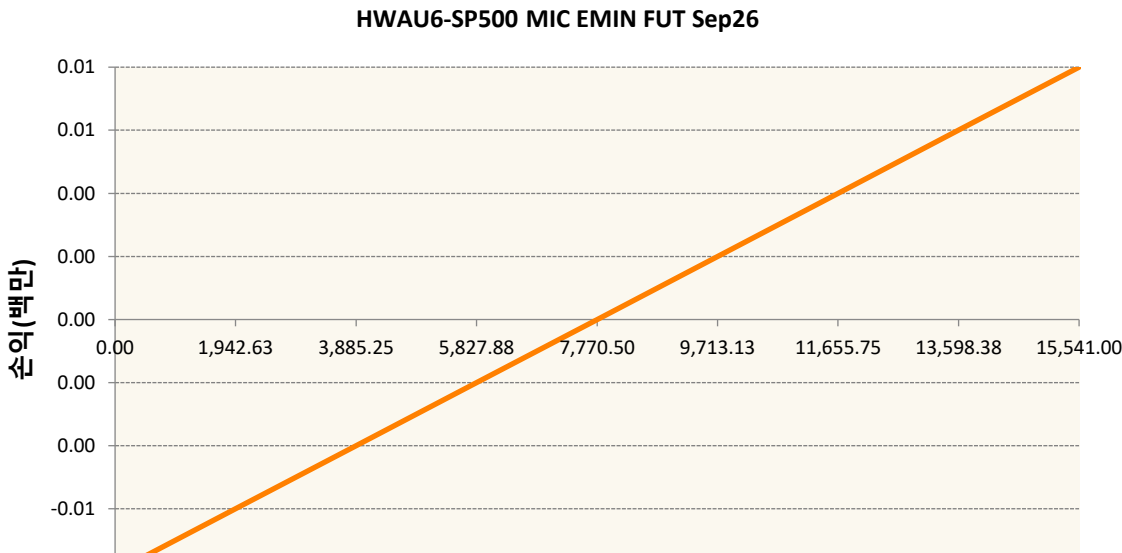
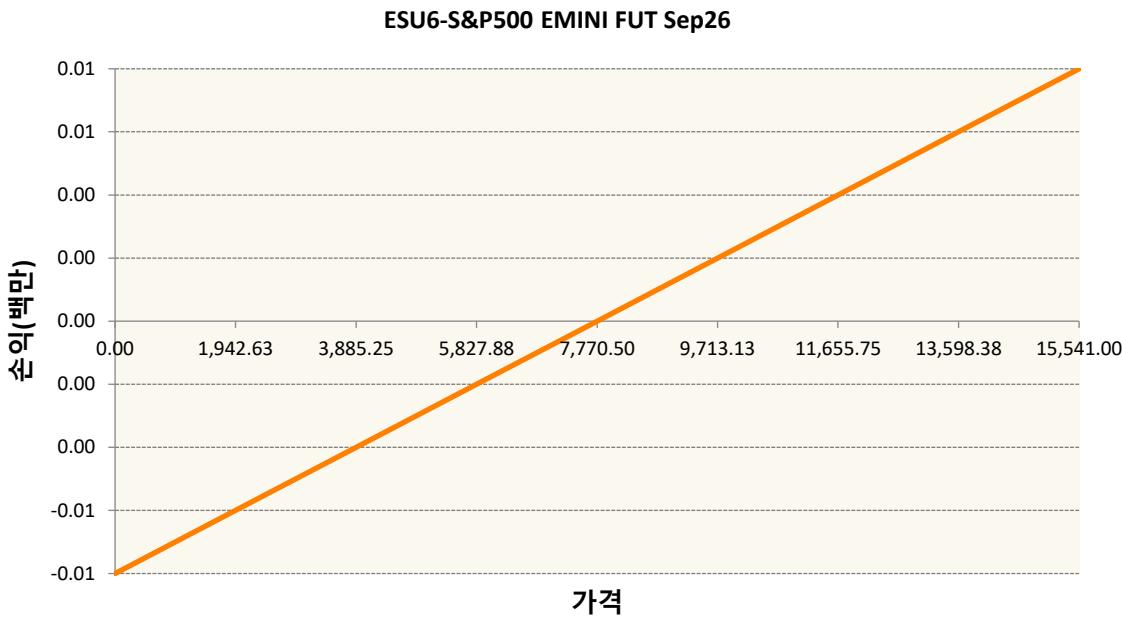
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

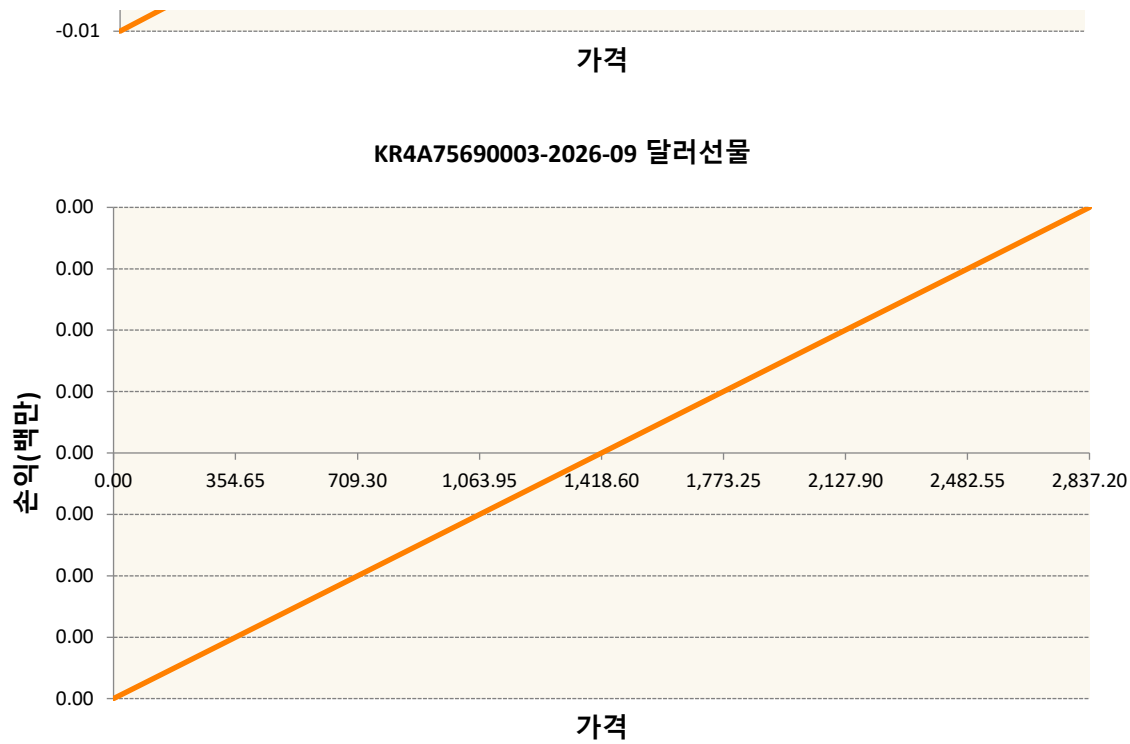
1. 계약금액

(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	72,067	0	72,067	
누계	지수	선물	178	0	178	장내
누계	통화	선물	10,781	0	10,781	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	5,765
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	14
KR4A756900	2026-09 달러선물	863

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

4,901

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

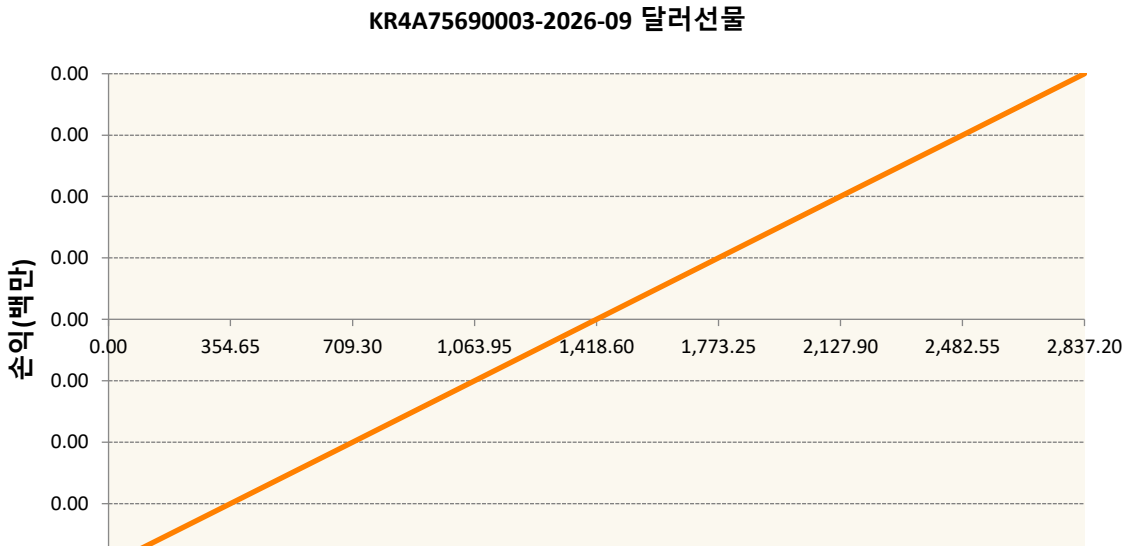
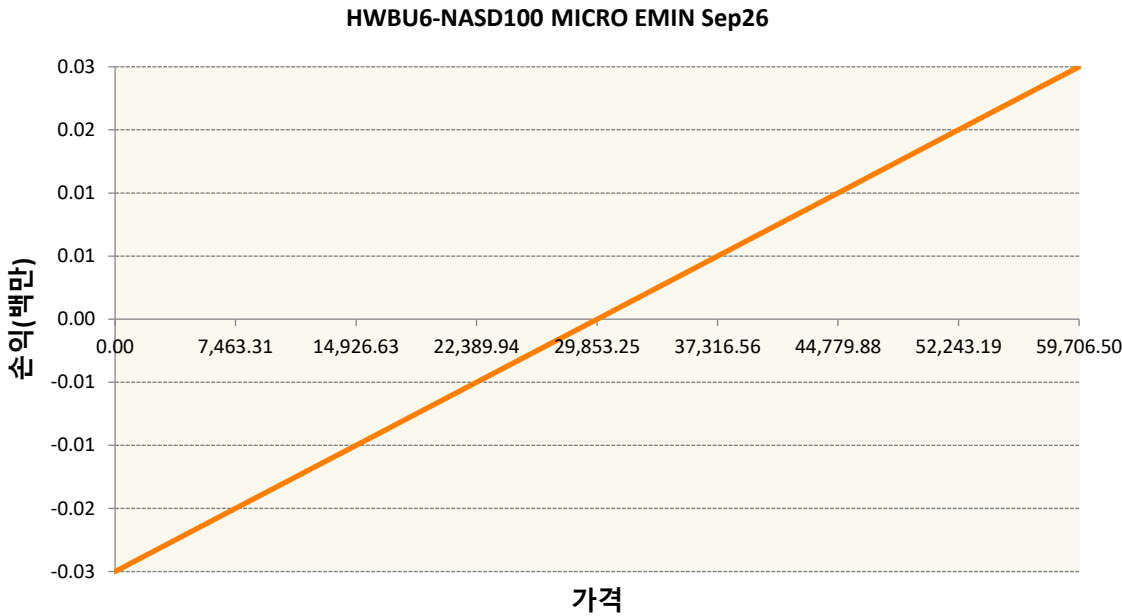
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

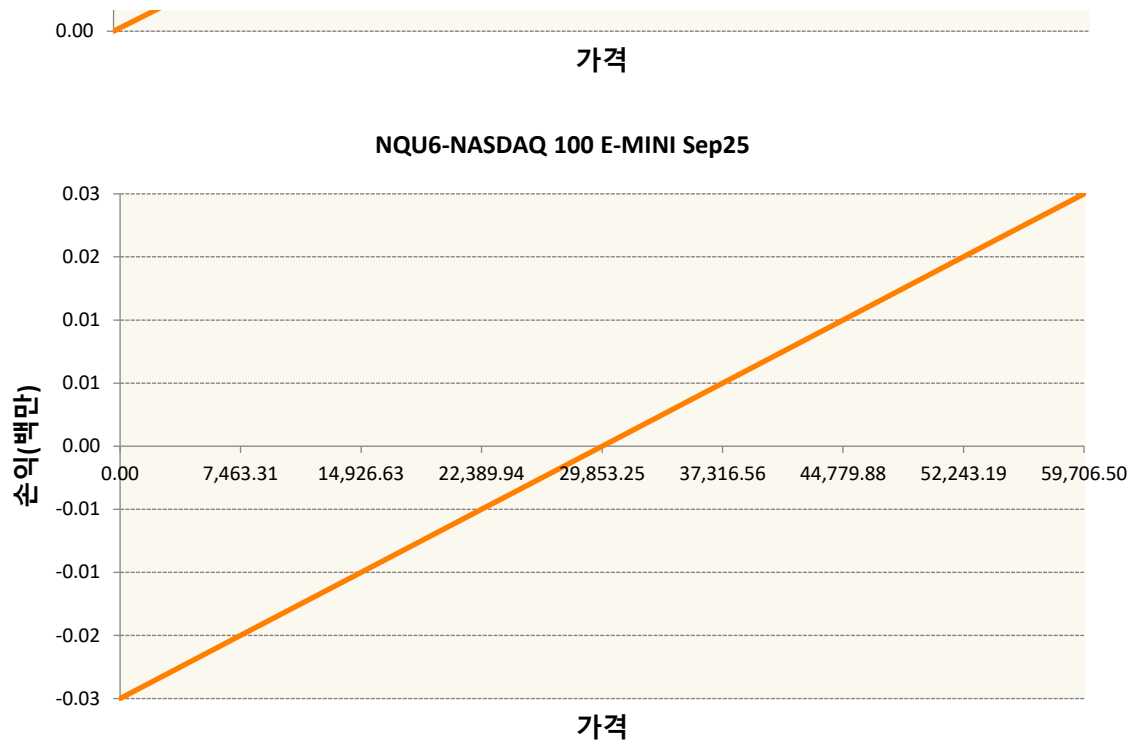
1. 계약금액

(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	34,347	0	34,347	
누계	통화	선물	4,057	0	4,057	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBU6 NASD100 MICRO EMIN Sep26

57

KR4A756900 2026-09 달러선물

325

NQU6 NASDAQ 100 E-MINI Sep25

2,748

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

(단위:백만원)

3,147

공시일	2026-08-14
기준일	2026-08-13

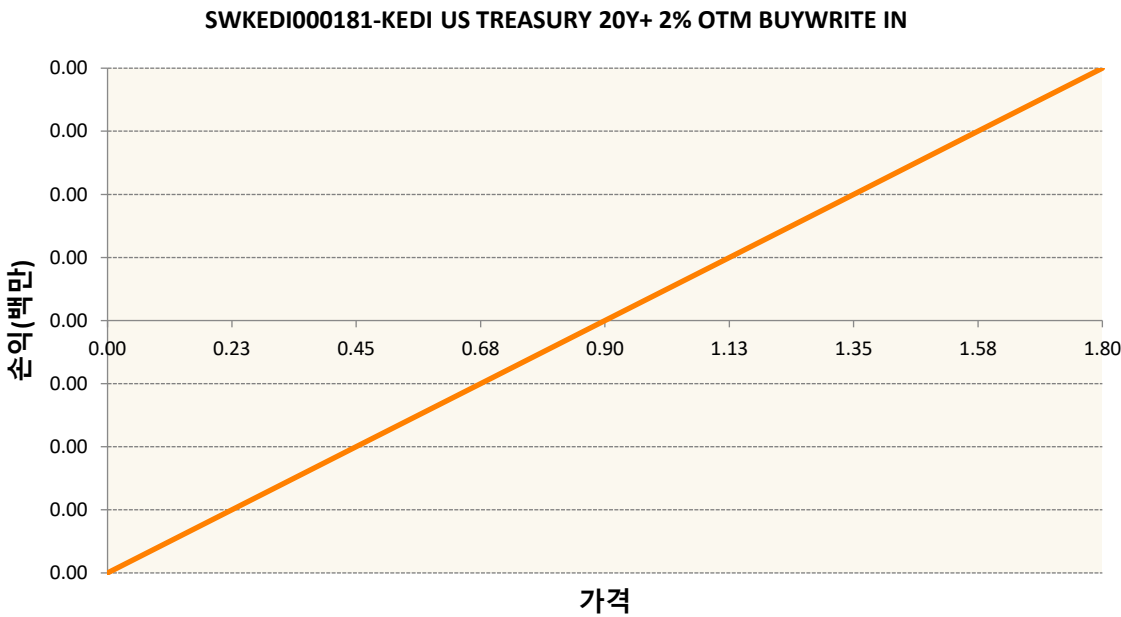
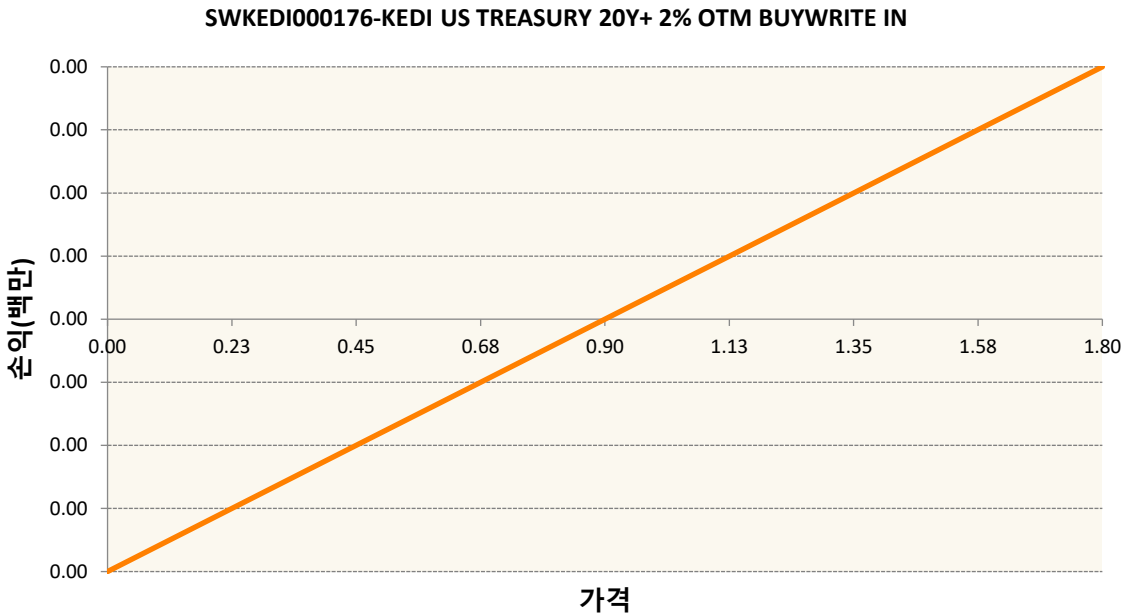
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

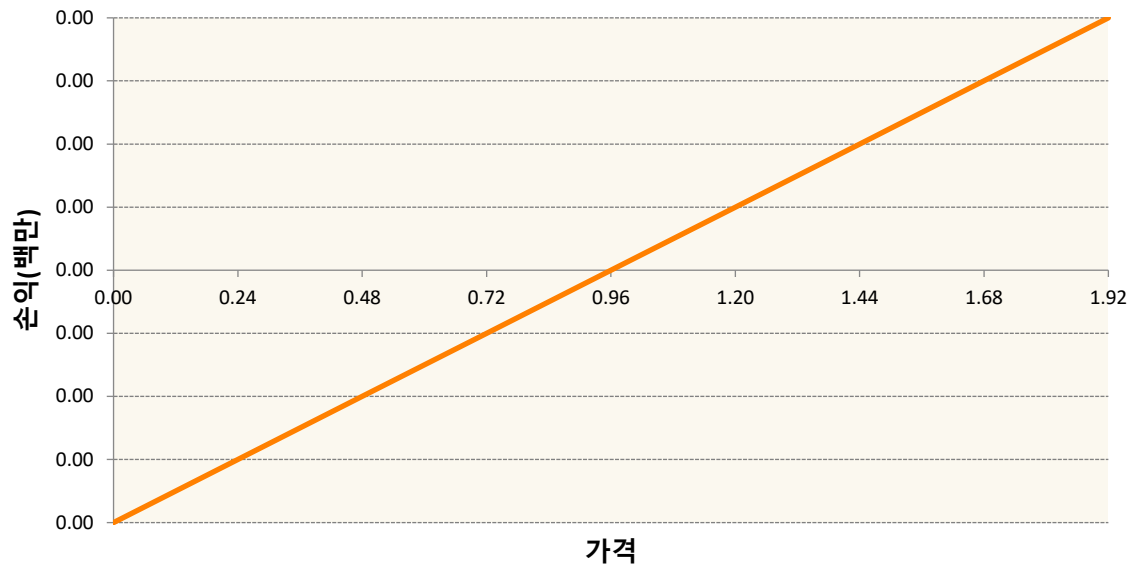
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	287,002	0	287,002	장외

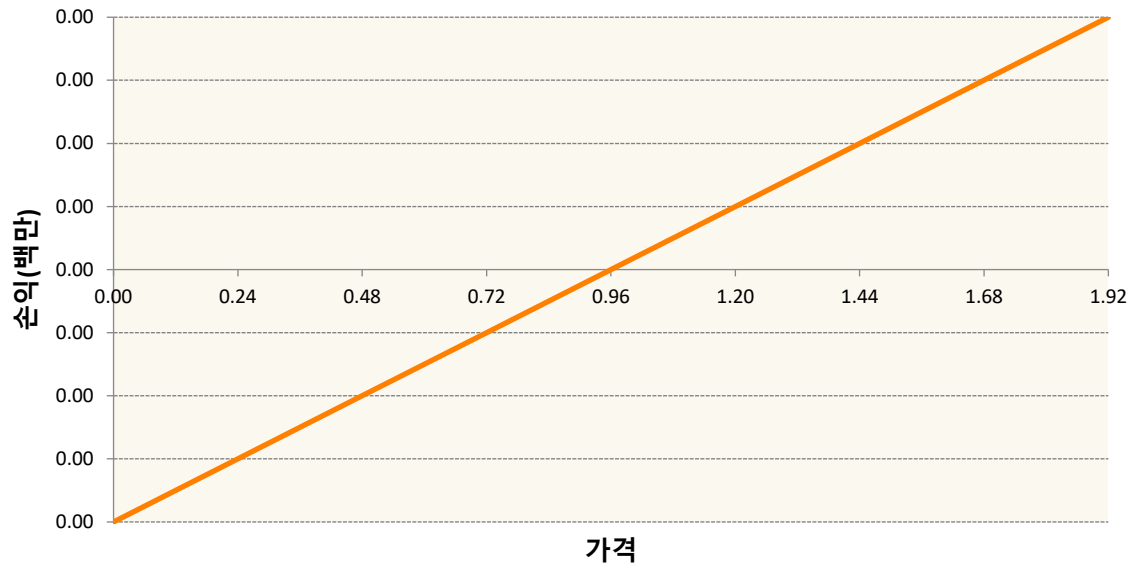
2. 만기시점의 손익구조



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	7,368
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,892
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,488
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,231

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

(단위:백만원)

9,905
