

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

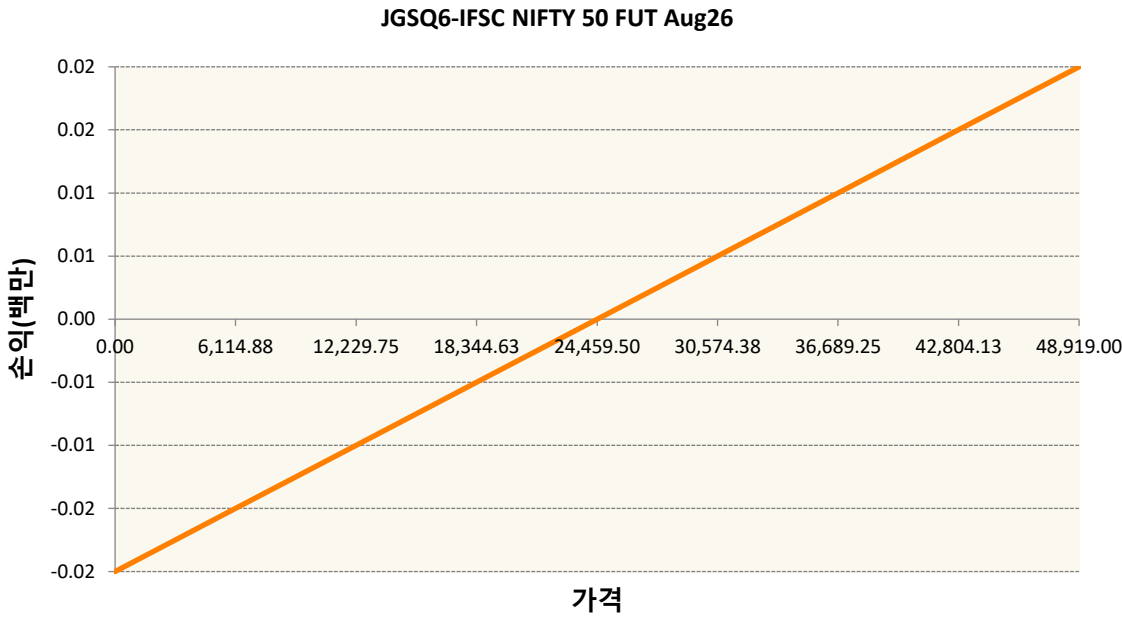
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	358	0	358	

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	2026-08-18
기준일	2026-08-14

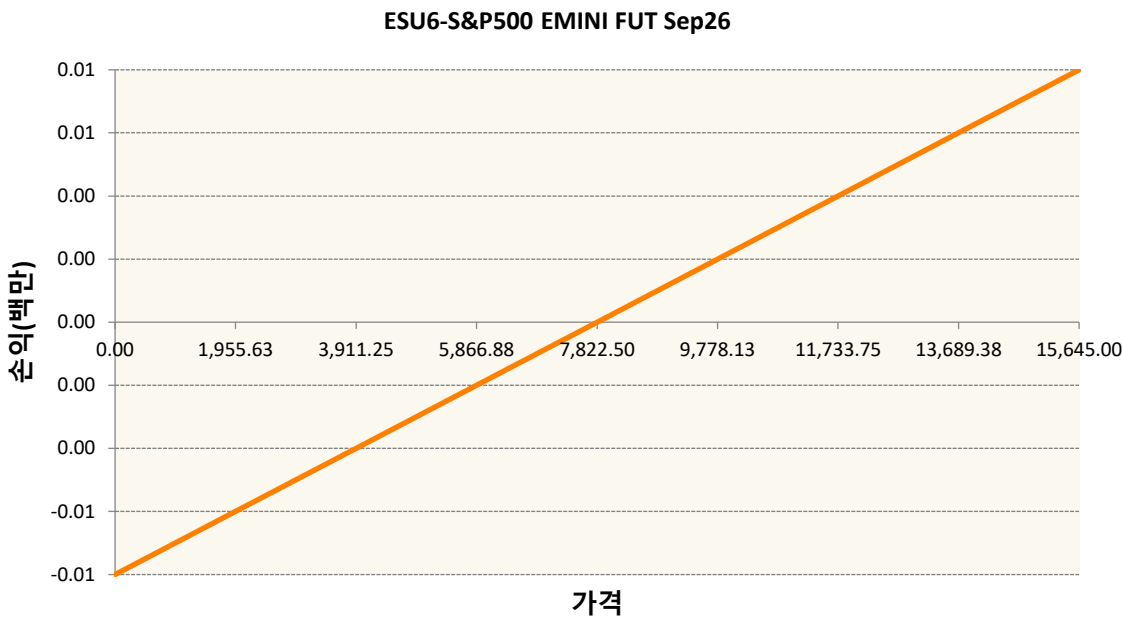
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	596	0	596	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	48
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

40

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

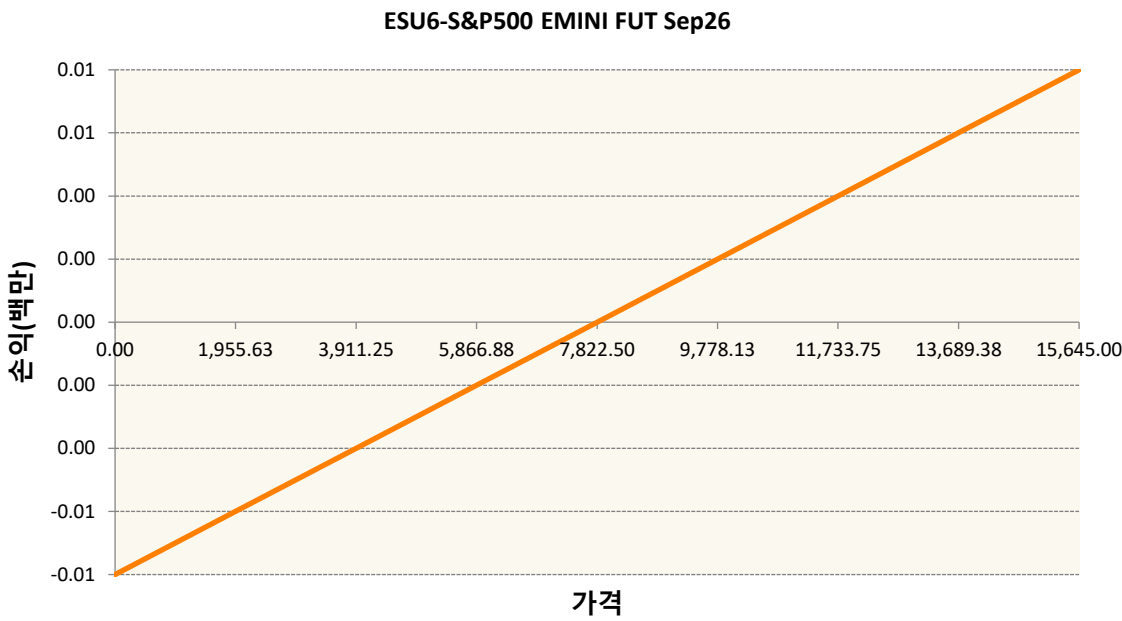
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	590	0	590	

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	2026-08-18
기준일	2026-08-14

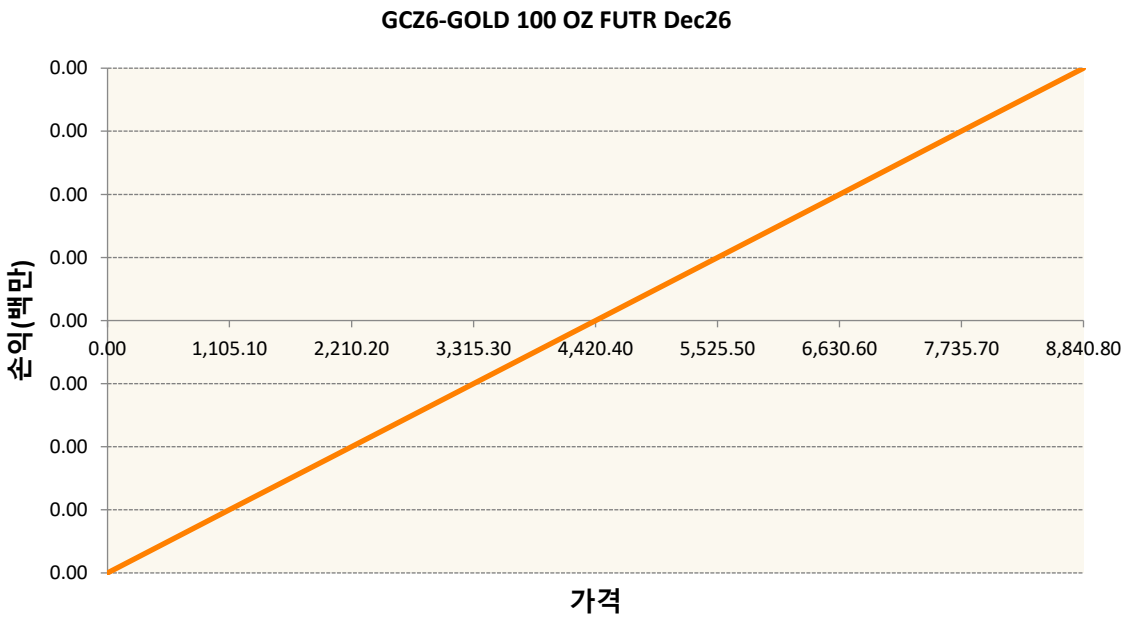
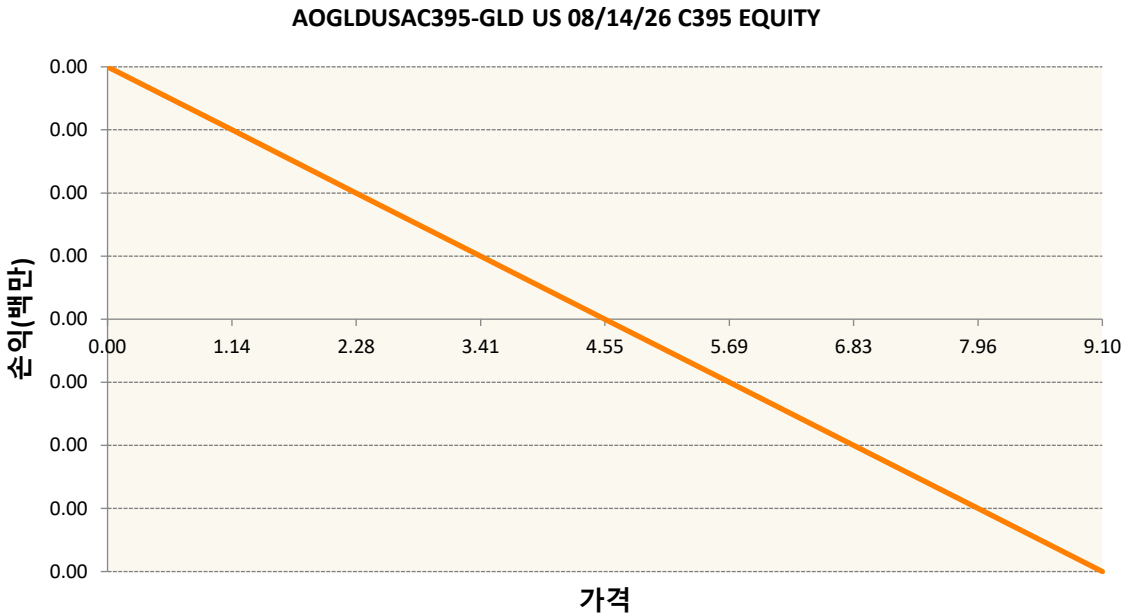
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,078	0	5,078	
누계	실물자산	옵션	0	181	-181	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSAC GLD US 08/14/26 C395 EQUITY		14
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26		406

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	550

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

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	21
AOPLTRUSC' PLTR US 08/14/26 C170 Equity	129

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

(단위:백만원)

516

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

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)

17,457

공시일 2026-08-18

기준일 2026-08-14

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	2026-08-18
기준일	2026-08-14

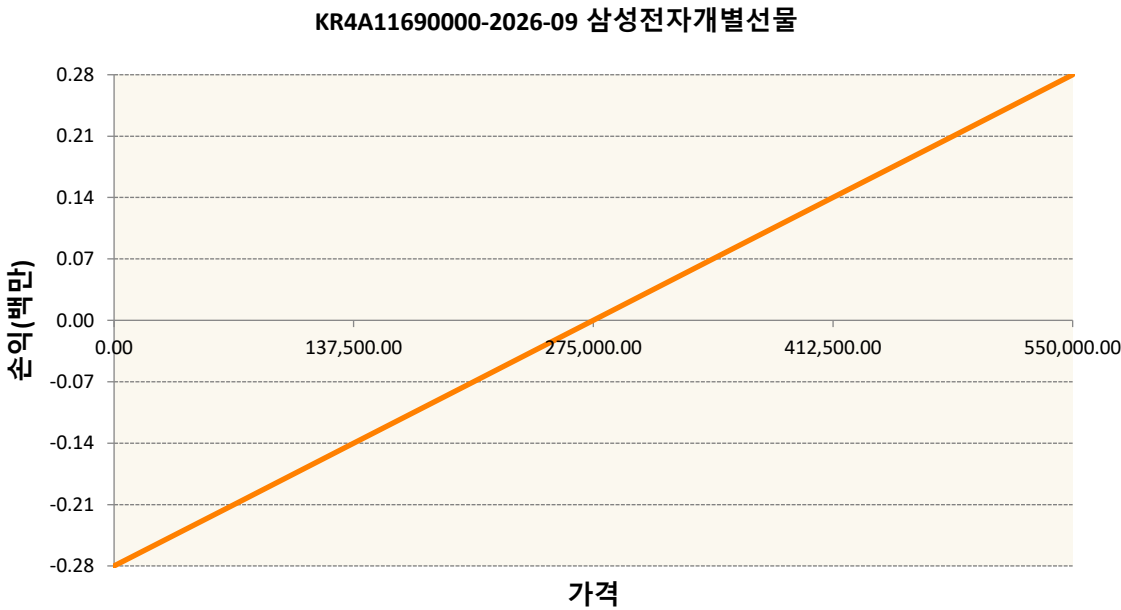
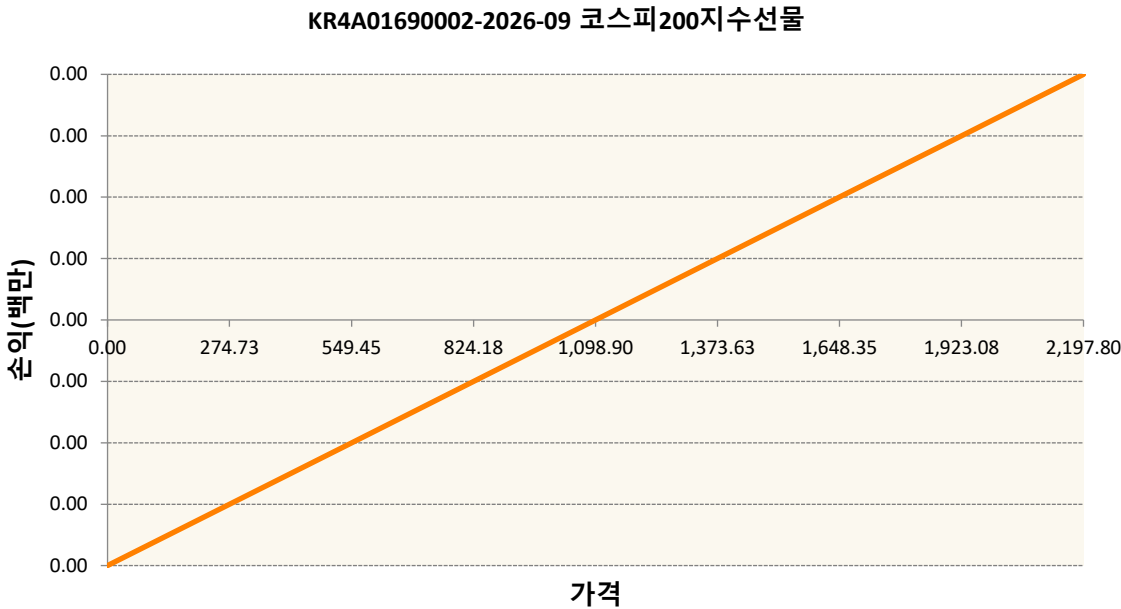
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	21,993	0	21,993	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 the point (1,070.00, 0.00) and ends at the point (2,140.00, 0.00).

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

(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		571
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-571	-571	-571	-571	-571	-571	-571	-571	
-5.33%	-381	-381	-381	-381	-381	-381	-381	-381	
-2.67%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	190	190	190	190	190	190	190	190	
5.33%	381	381	381	381	381	381	381	381	
8.00%	571	571	571	571	571	571	571	571	
KR4A11690000							2026-09 삼성전자개별선물		1,186
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186	-1,186
-5.33%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791
-2.67%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	395	395	395	395	395	395	395
5.33%	791	791	791	791	791	791	791
8.00%	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186	1,186
KR4BAFBSA289 코스피위클리M C 2608W3 1,067.5							2,356

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,251	1,221	1,187	1,149	1,109	1,066	1,021
-5.33%	1,085	1,032	978	923	866	809	752
-2.67%	731	668	605	543	480	418	355
0%	162	110	56	0	-57	-115	-173
2.67%	-575	-607	-643	-682	-725	-770	-818
5.33%	-1,407	-1,421	-1,440	-1,463	-1,490	-1,521	-1,555
8.00%	-2,278	-2,283	-2,290	-2,301	-2,316	-2,334	-2,356
KR4BAFBSA297 코스피위클리M C 2608W3 1,070.0							1,545

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	799	780	758	734	708	681	652
-5.33%	697	663	628	592	555	518	481
-2.67%	474	433	391	350	308	267	226
0%	110	74	38	0	-38	-77	-116
2.67%	-369	-392	-417	-444	-473	-504	-536
5.33%	-916	-926	-939	-955	-974	-995	-1,019
8.00%	-1,490	-1,494	-1,499	-1,507	-1,517	-1,530	-1,545

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

(단위:백만원)

13,662

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

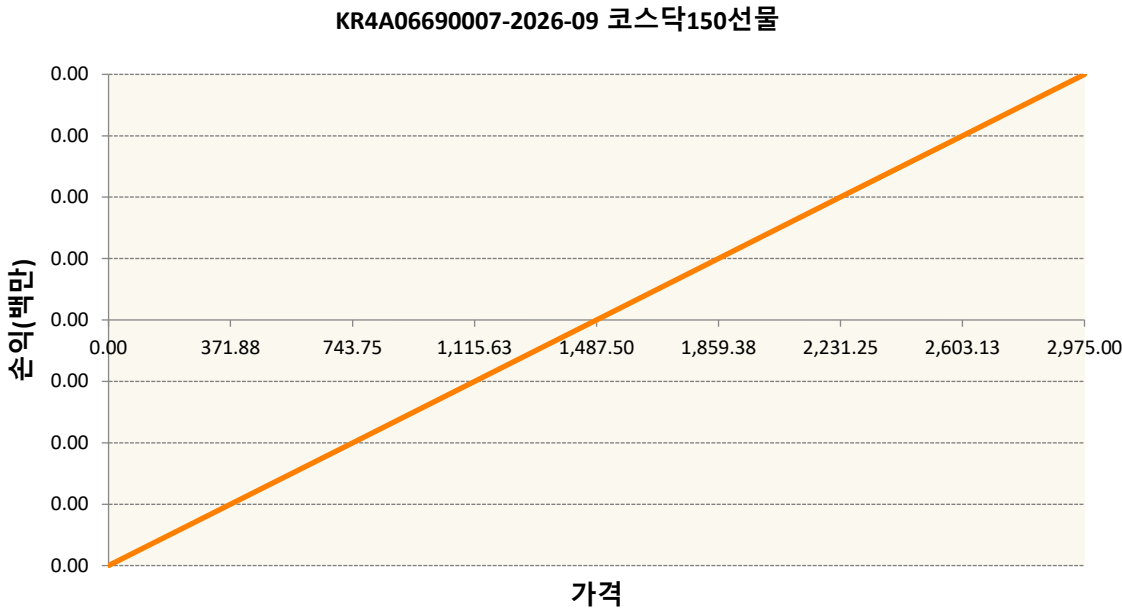
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	863	0	863	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)

19,394

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

(단위:백만원)

48,149

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

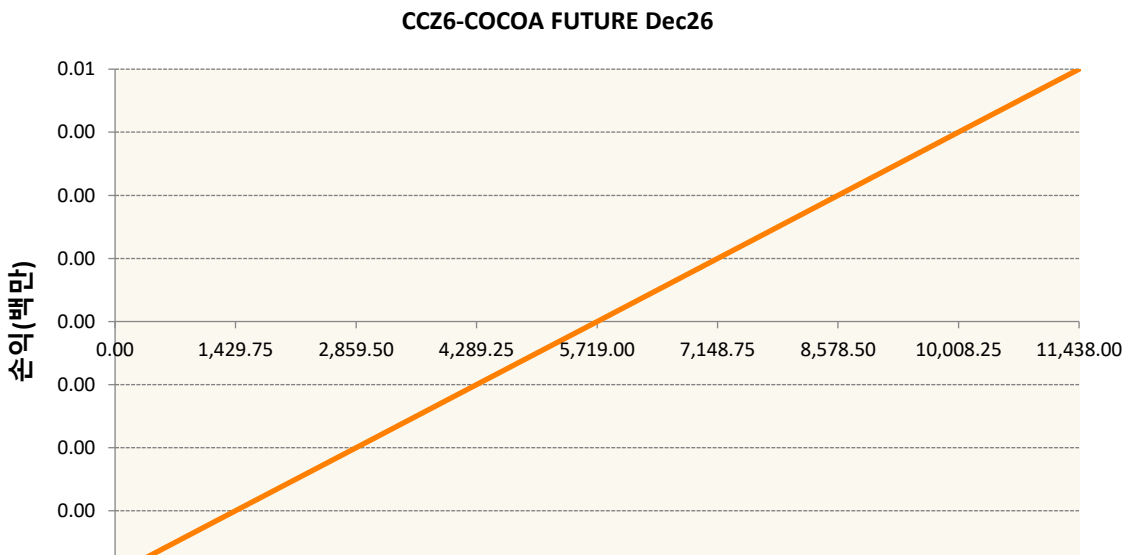
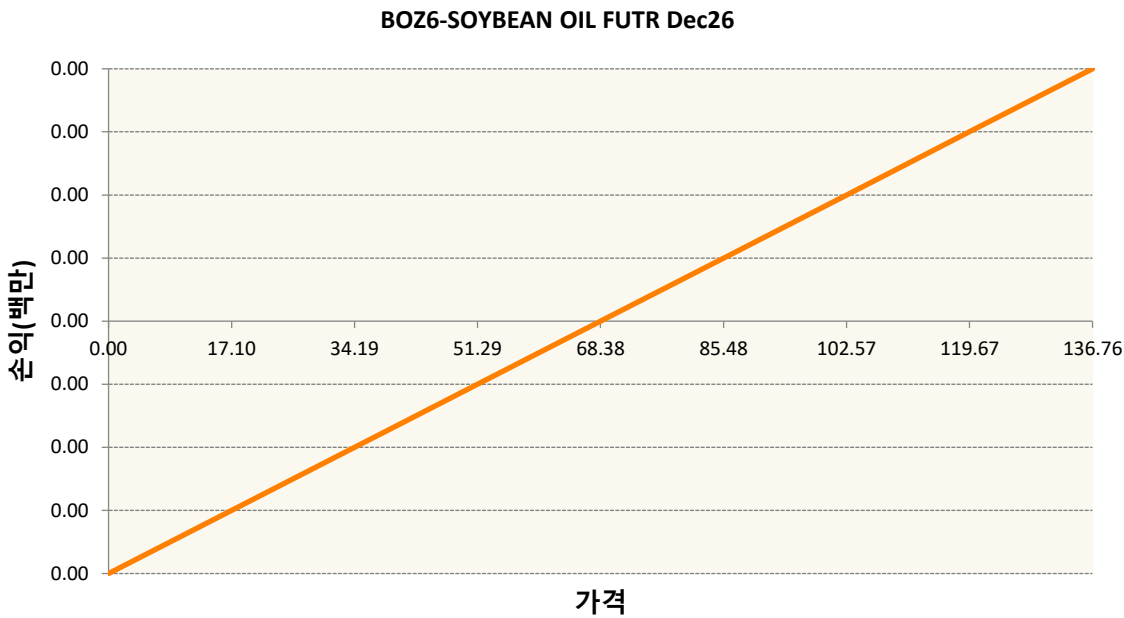
포커스농산물모(채권-파생형)

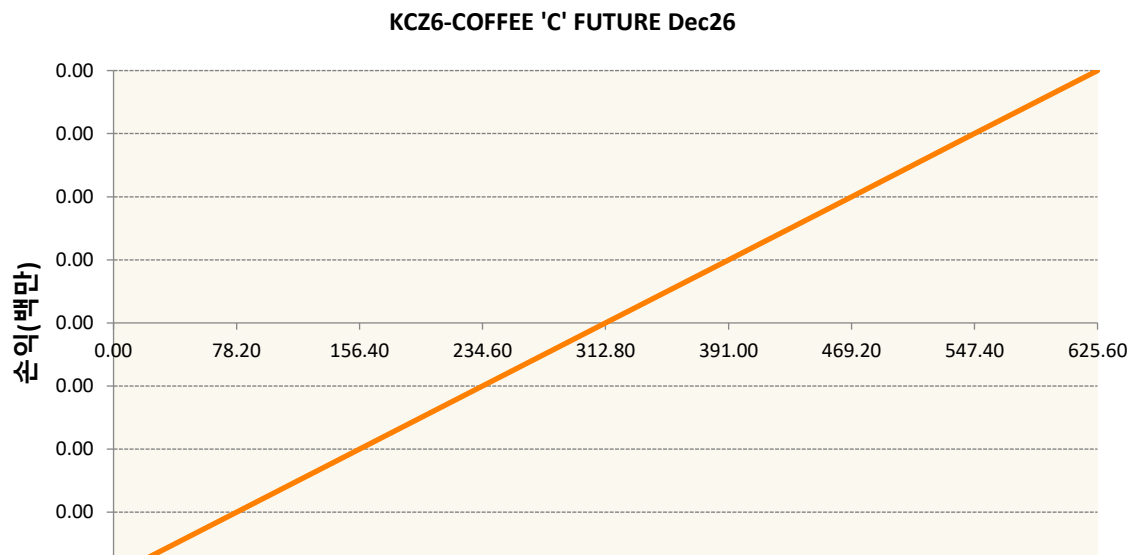
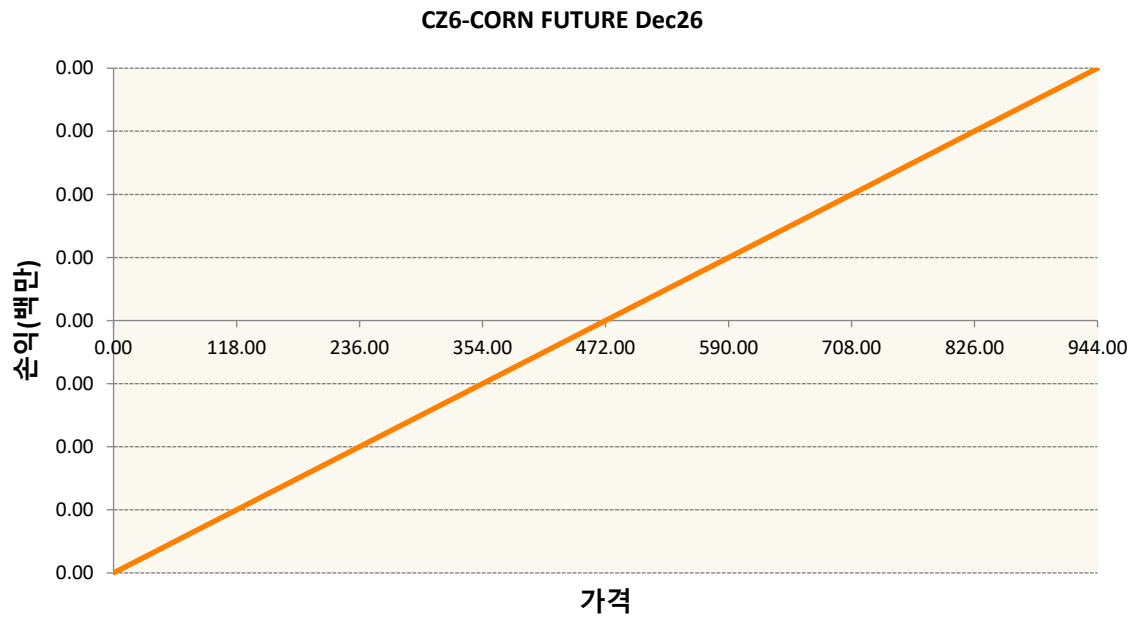
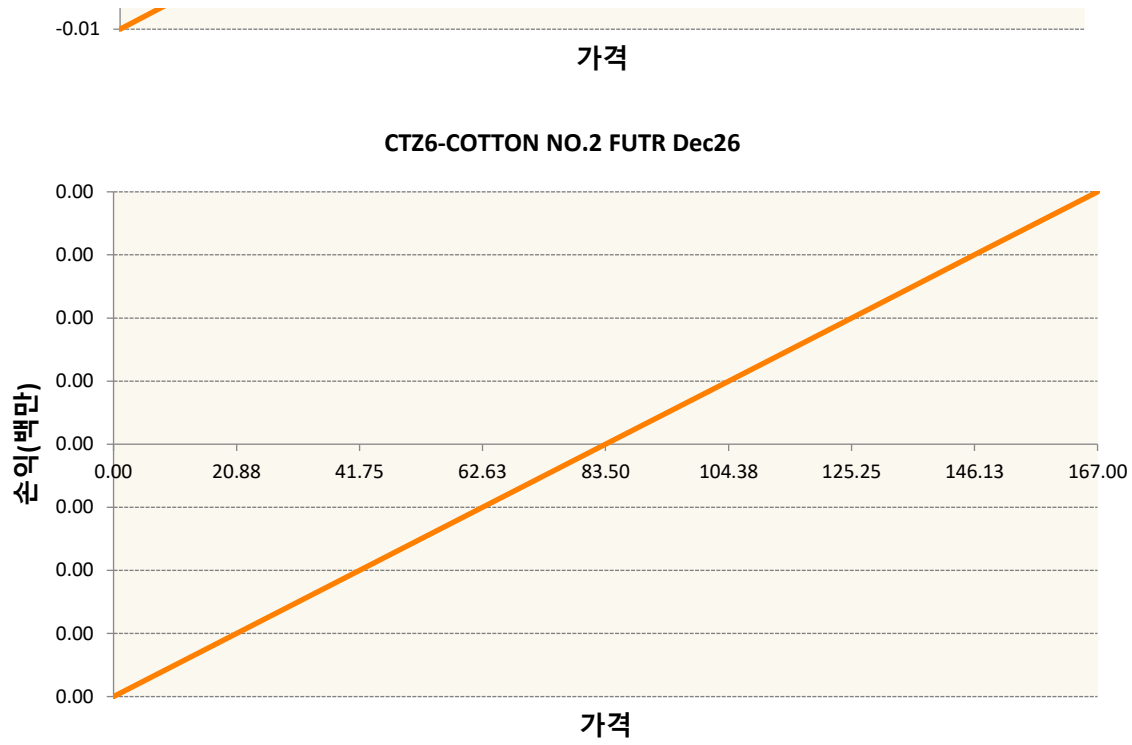
1. 계약금액

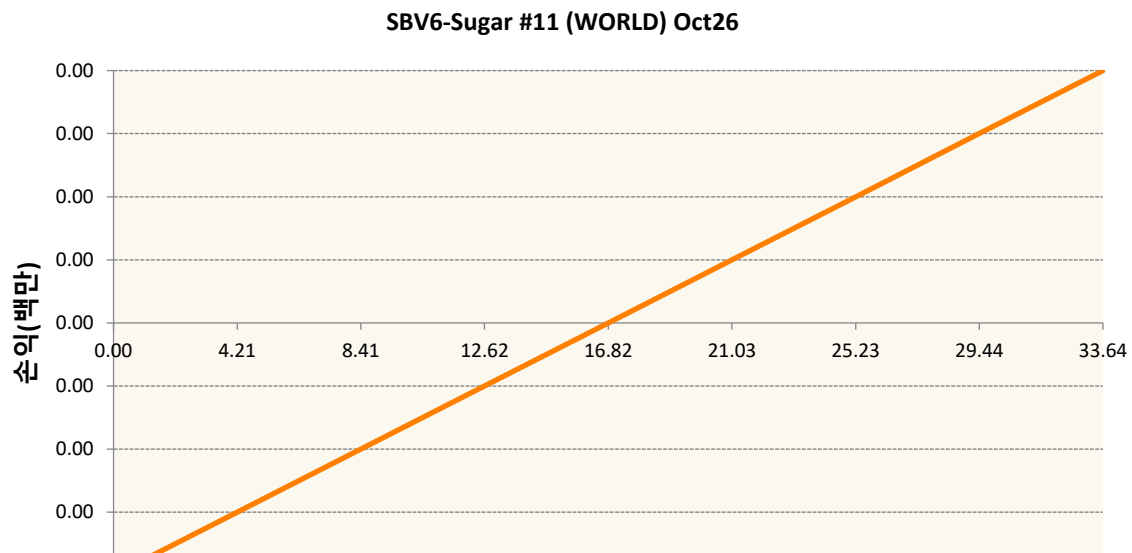
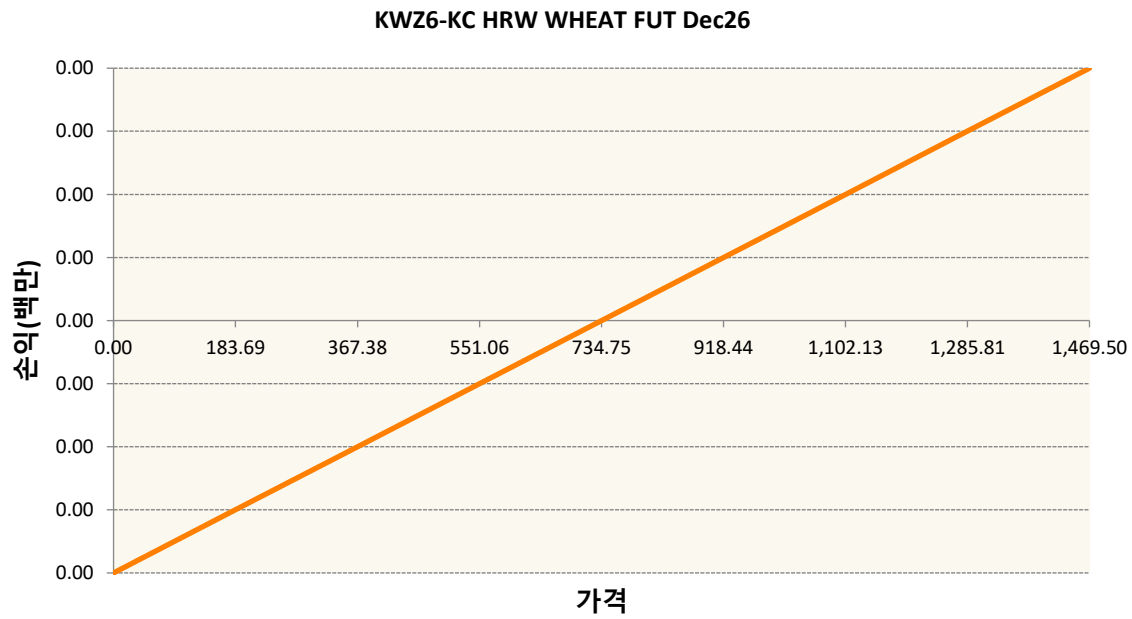
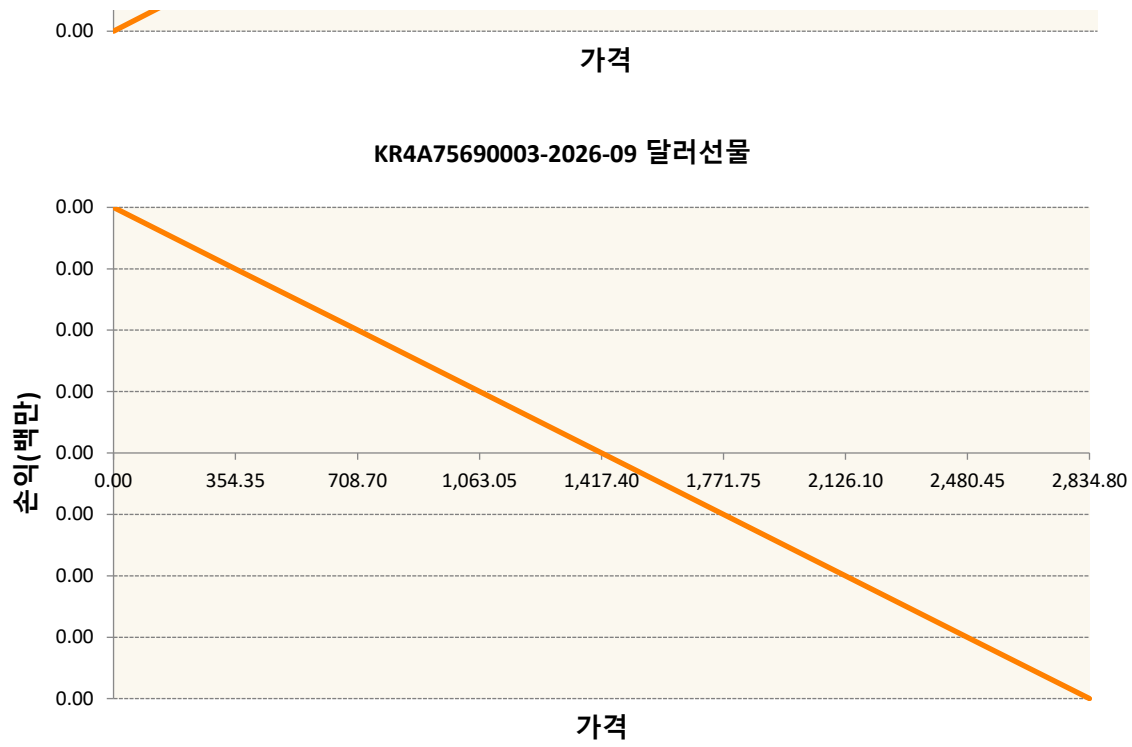
(단위:USD 백만)

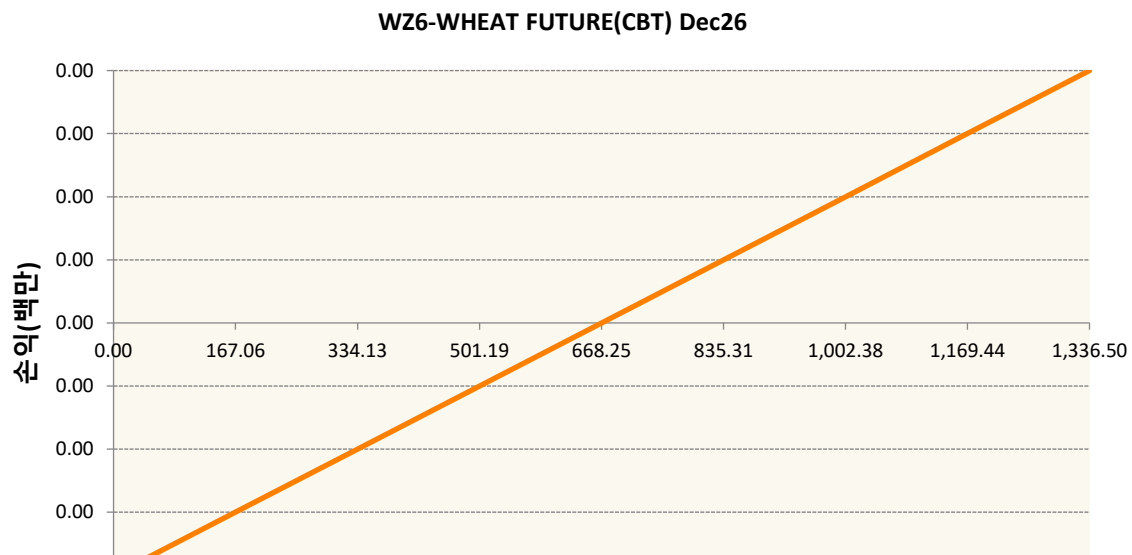
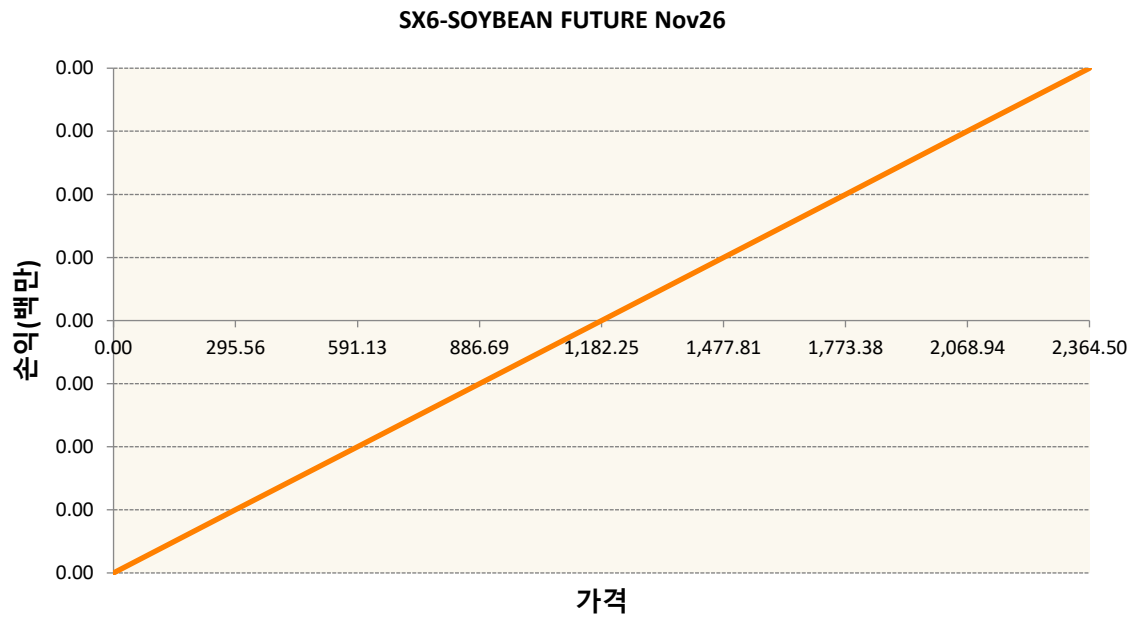
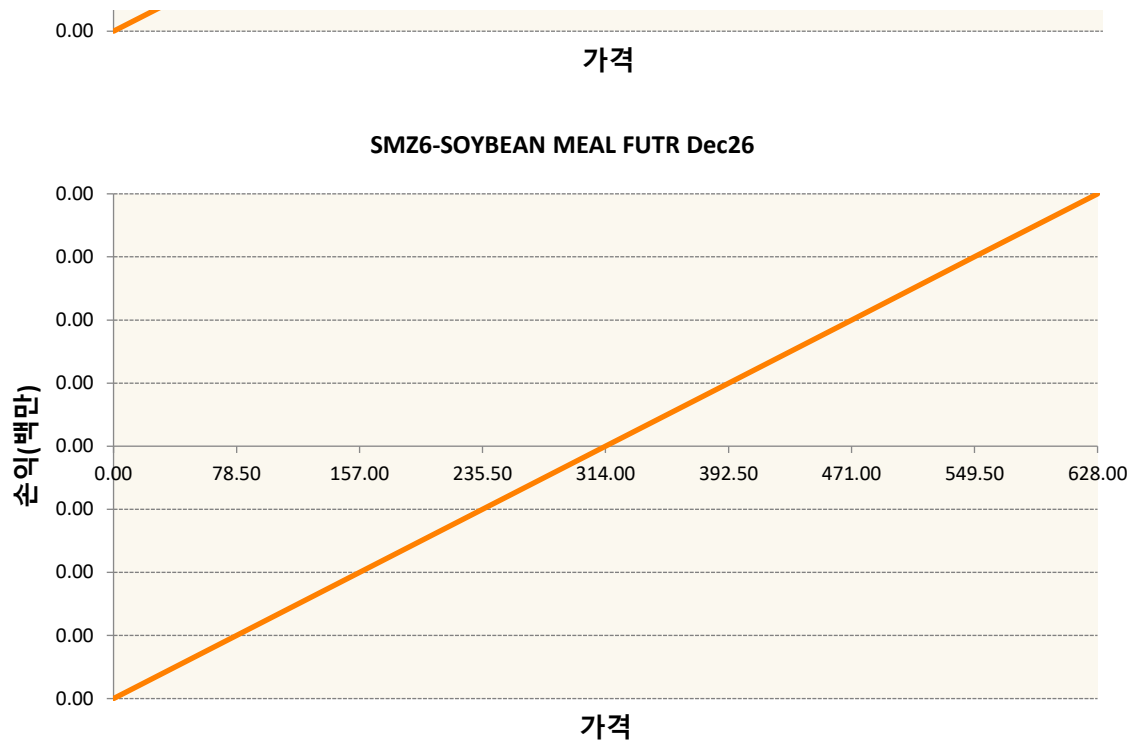
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	453	0	453	
누계	유가증권	선물	2,252	0	2,252	
누계	통화	선물	0	354	-354	장내

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	2026-08-18
기준일	2026-08-14

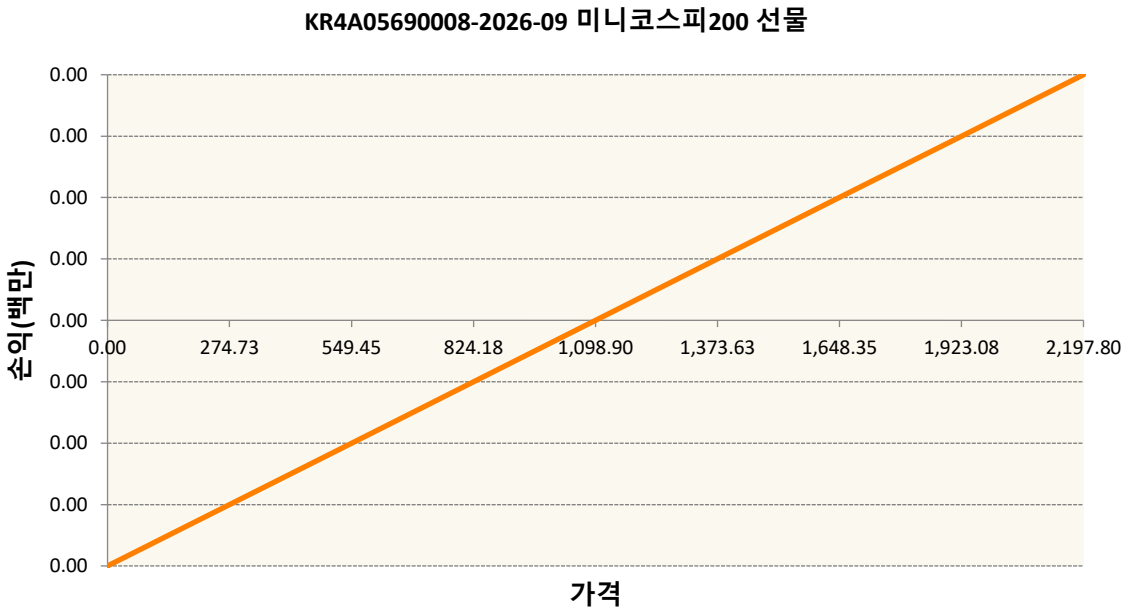
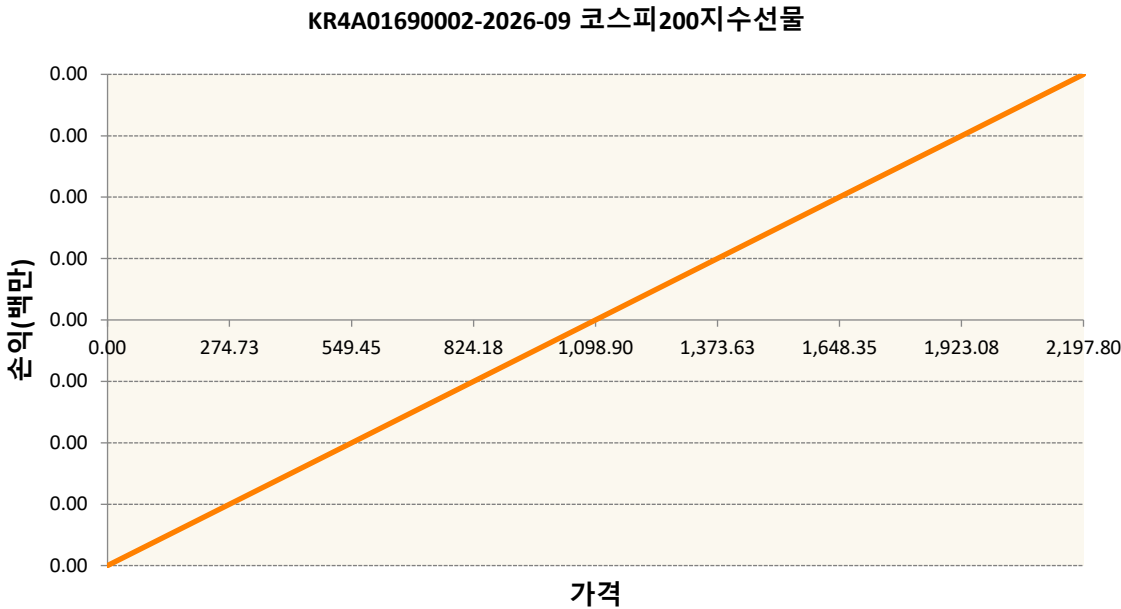
스마트인덱스모

1. 계약금액

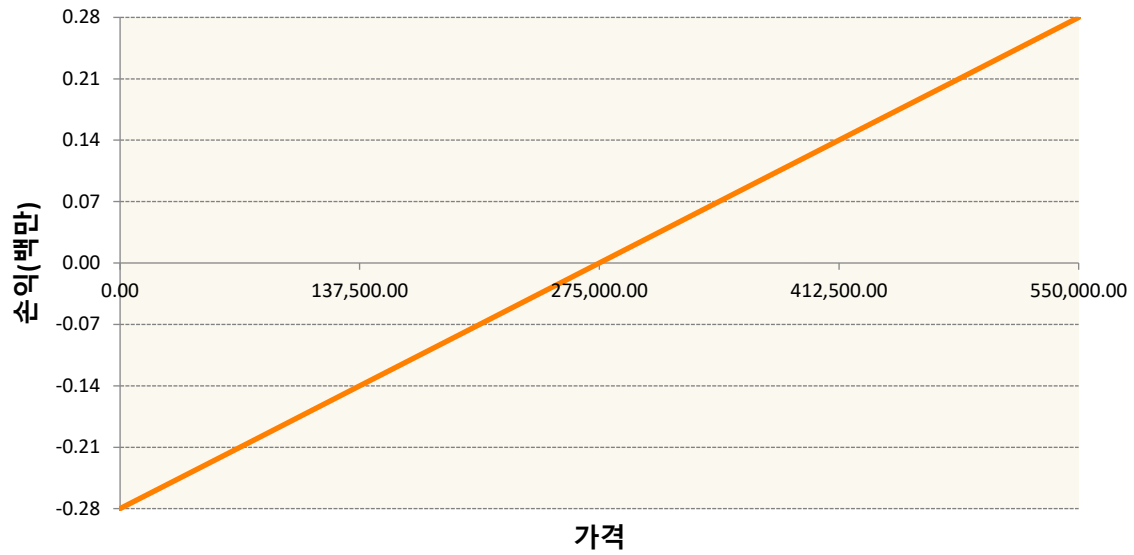
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,503	141	4,362	장내

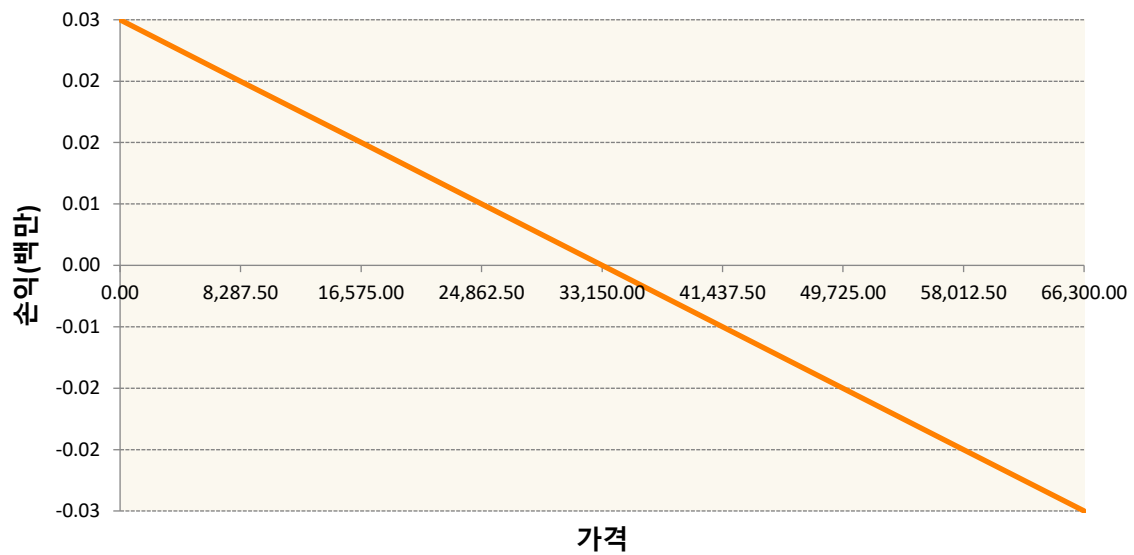
2. 만기시점의 손익구조



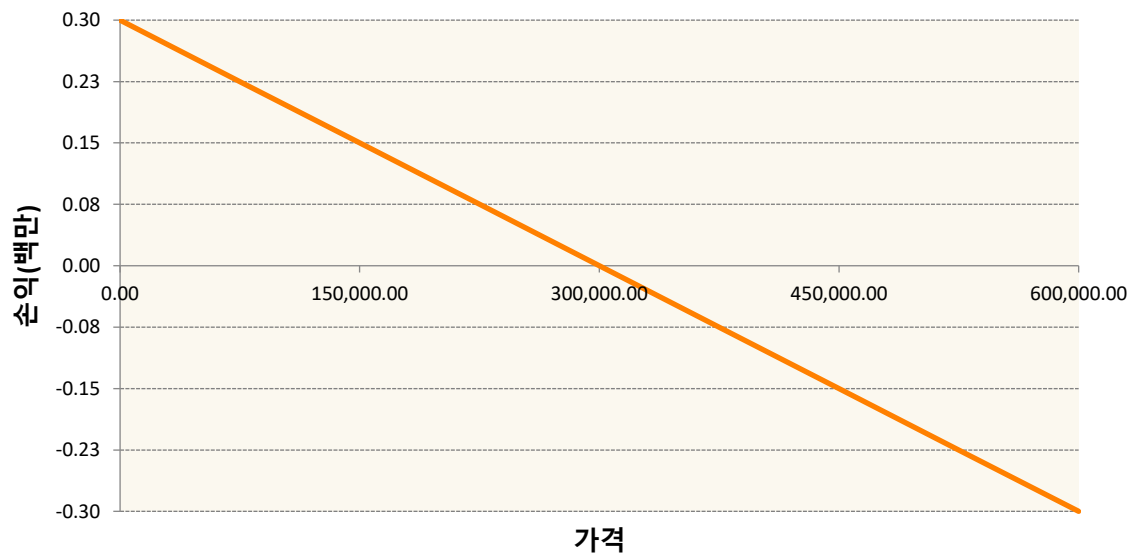
KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



KR4A15690006-2026-09 한국전력개별선물



KR4ABD690005-2026-09 삼성생명개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		198	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198			
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132			
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	66	66	66	66	66	66	66			
5.33%	132	132	132	132	132	132	132			
8.00%	198	198	198	198	198	198	198			
KR4A05690008							2026-09 미니코스피200 선물		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%	-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%	31	31	31	31	31	31	31			
KR4A11690000							2026-09 삼성전자개별선물		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			
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)

794

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

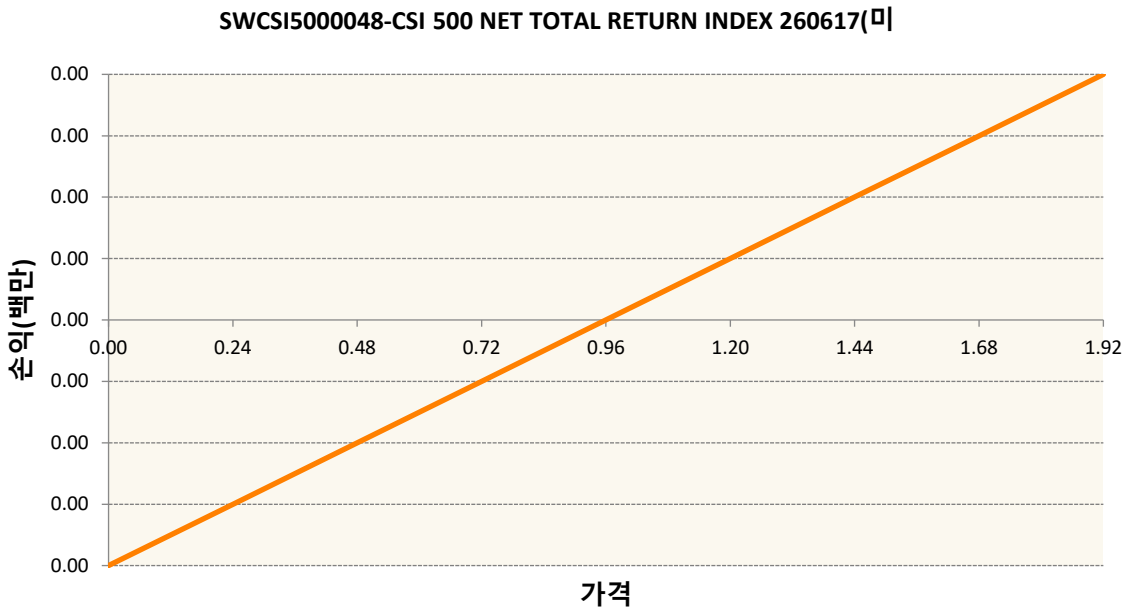
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,565	0	5,565	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

444

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

699

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

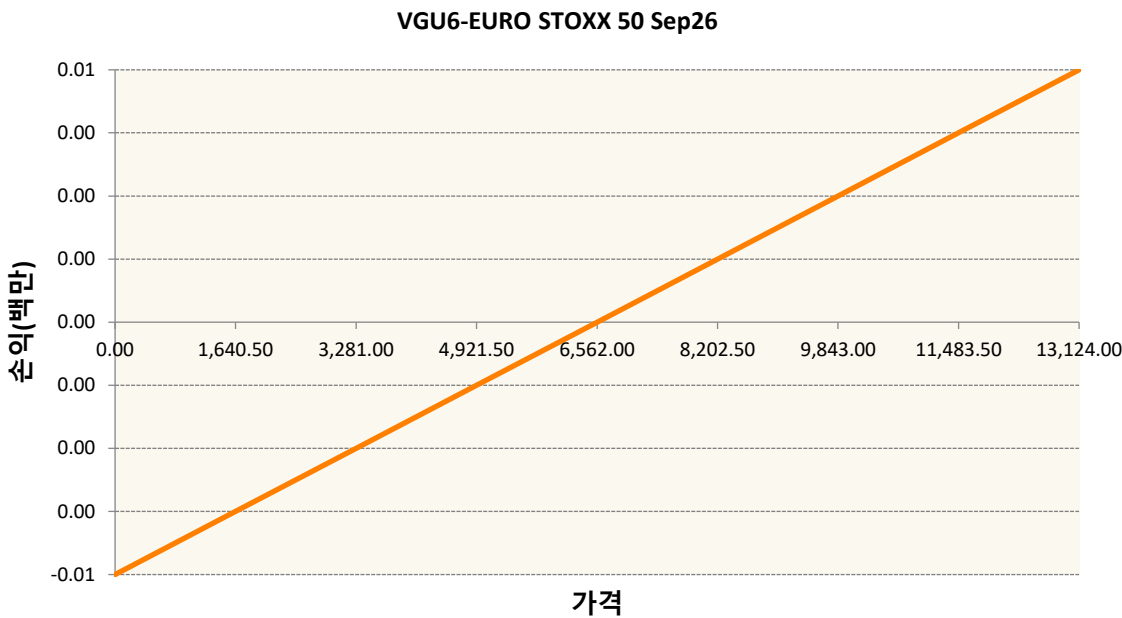
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,034	0	1,034	

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	2026-08-18
기준일	2026-08-14

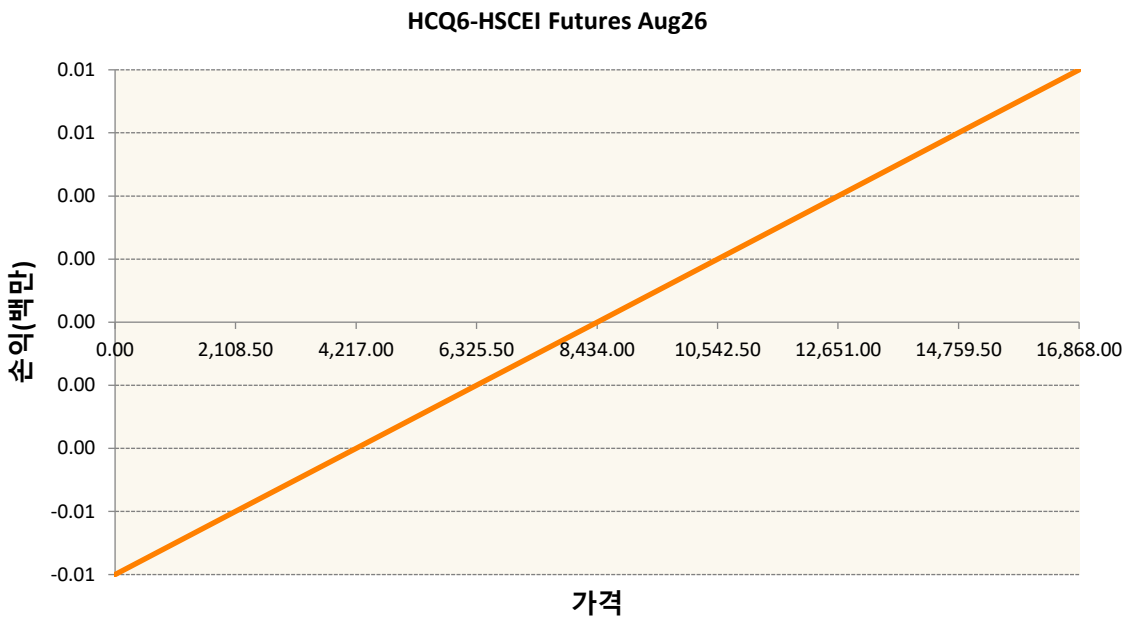
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,477	0	1,477	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

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

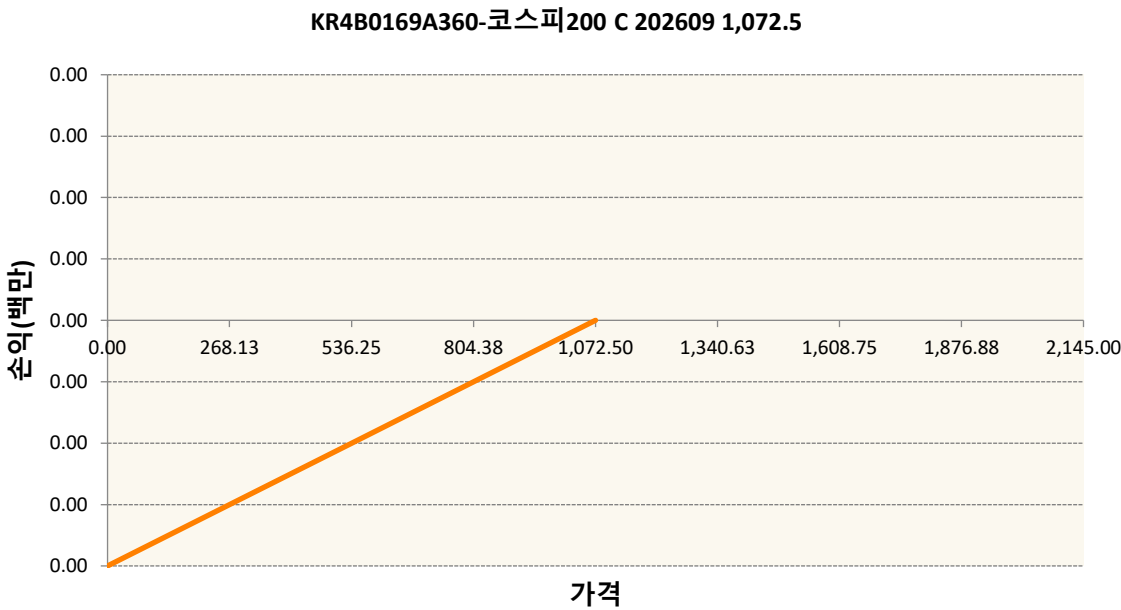
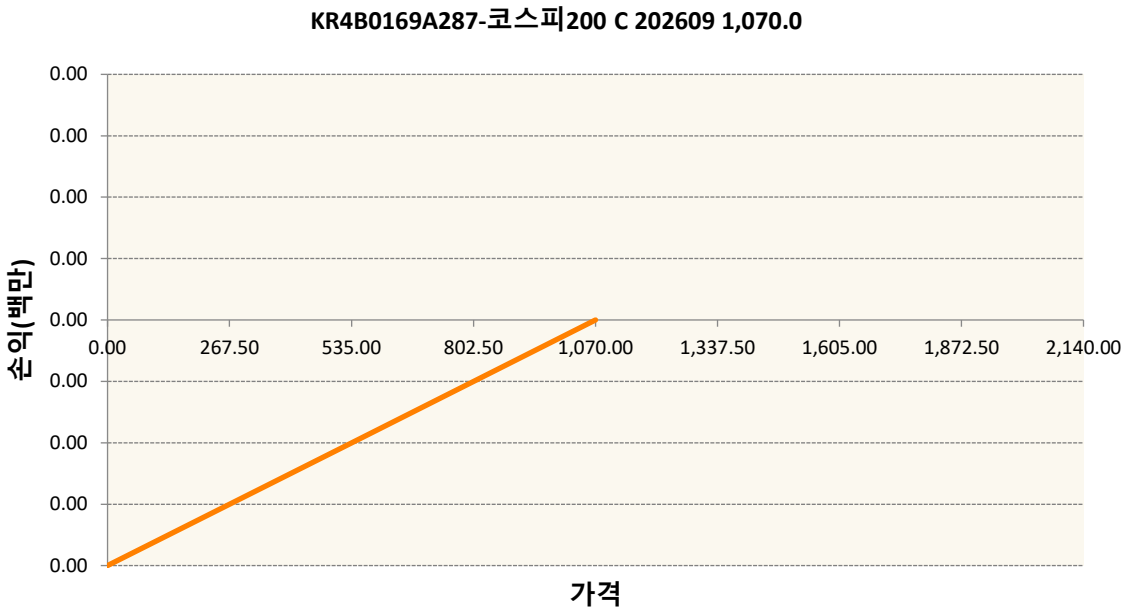
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

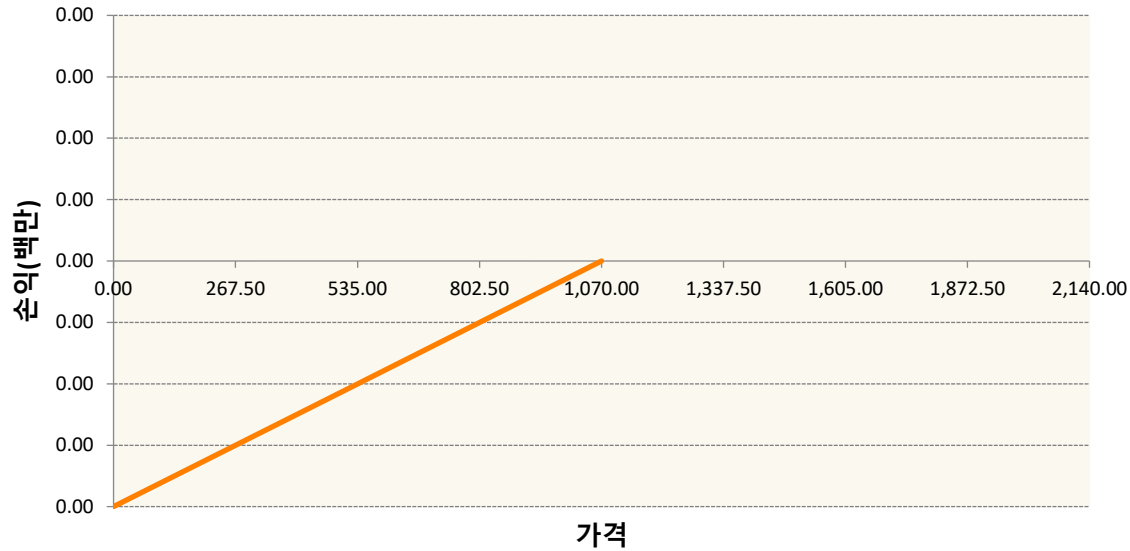
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	43,814	-43,814	장내
누계	유가증권	옵션	0	41,242	-41,242	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0169A285-코스피200 P 202609 1,070.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0169A287 코스피200 C 202609 1,070.0							769
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-390	-451	-513	-576	-640	-704	-769
-5.33%	-154	-221	-289	-356	-424	-492	-560
-2.67%	45	-25	-95	-164	-234	-304	-374
0%	208	139	69	0	-70	-139	-209
2.67%	336	271	206	139	71	3	-65
5.33%	435	377	316	254	190	125	59
8.00%	508	458	404	348	289	228	166
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							1,117
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-574	-661	-750	-841	-932	-1,024	-1,117
-5.33%	-229	-326	-423	-520	-618	-716	-814
-2.67%	62	-39	-140	-240	-341	-442	-542
0%	301	201	101	0	-101	-202	-303
2.67%	490	396	300	203	105	7	-93
5.33%	636	551	463	372	279	185	89
8.00%	745	672	593	510	424	336	245
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							399
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-202	-234	-266	-299	-332	-365	-399
-5.33%	-80	-115	-150	-185	-220	-255	-291
-2.67%	23	-13	-49	-85	-122	-158	-194
0%	108	72	36	0	-36	-72	-109

2.67%	175	141	107	72	37	2	-34
5.33%	226	196	164	132	99	65	31
8.00%	264	238	210	180	150	118	86

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

(단위:백만원)

3,064

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

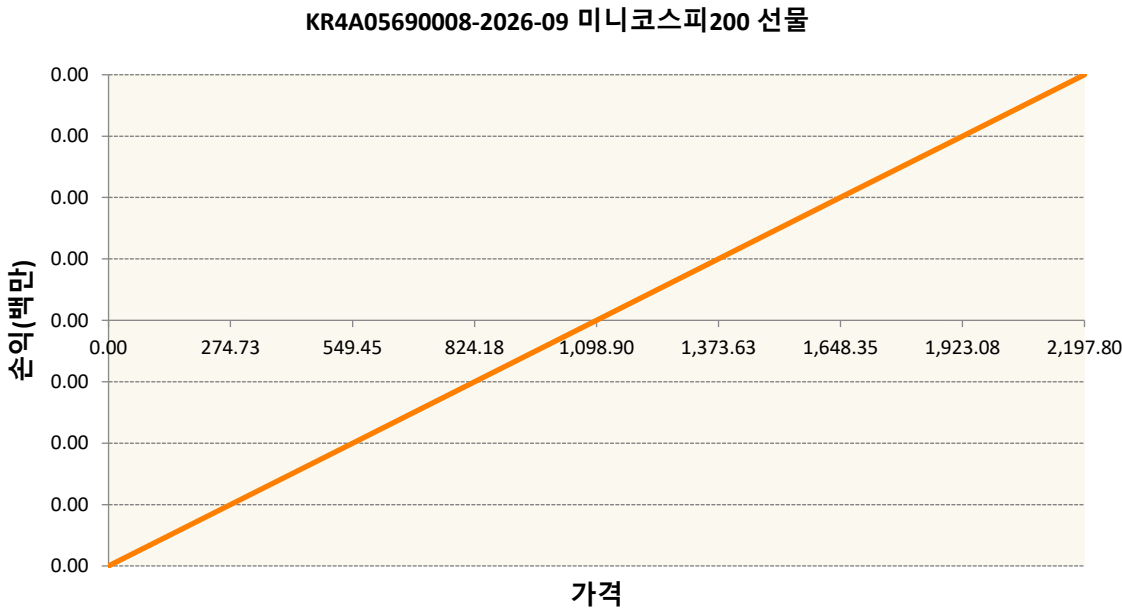
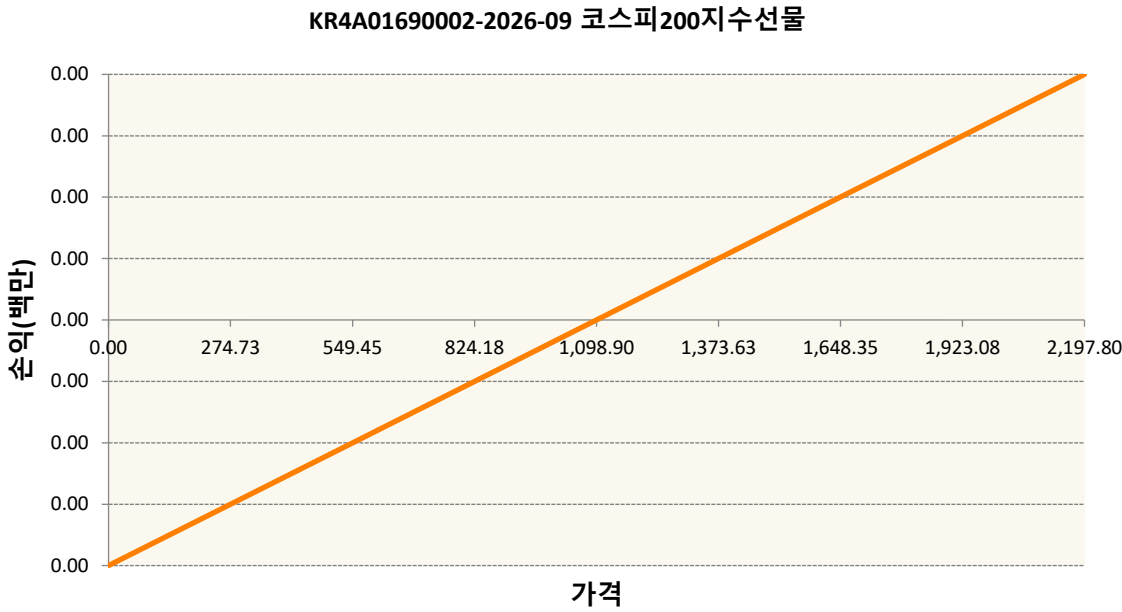
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

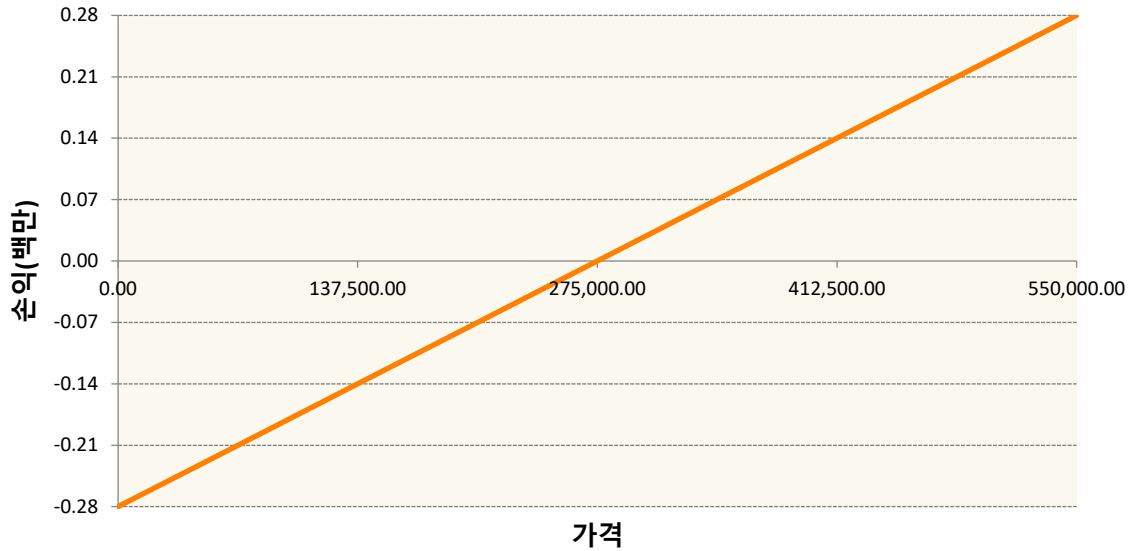
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,706	0	1,706	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				66
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-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%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	66	66	66	66	66	66	66
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)

279

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

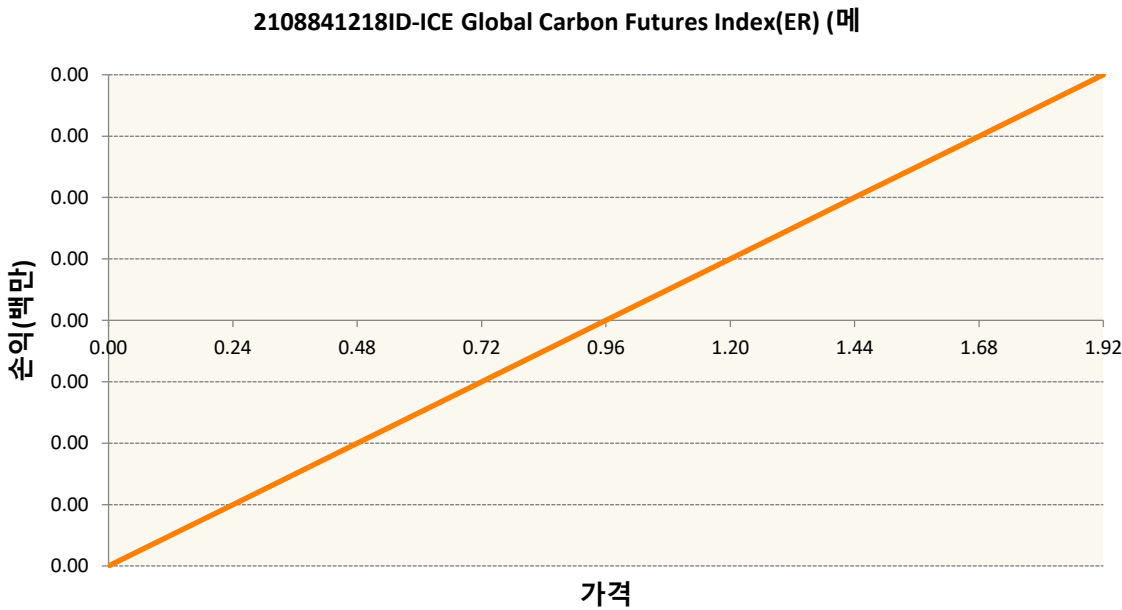
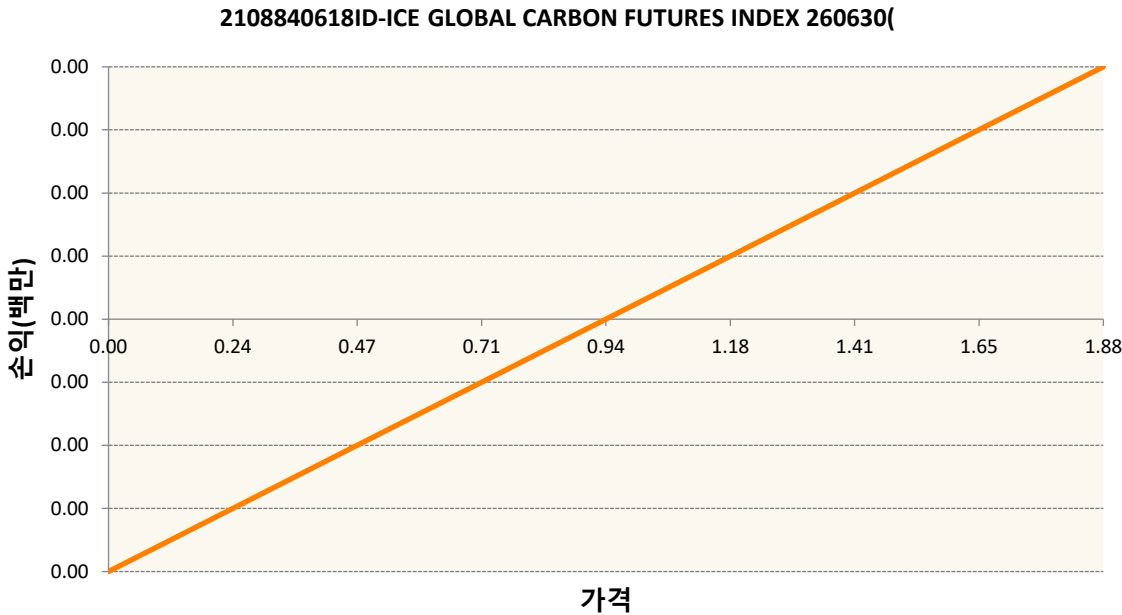
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,165	0	7,165	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		459
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		116

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	640

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

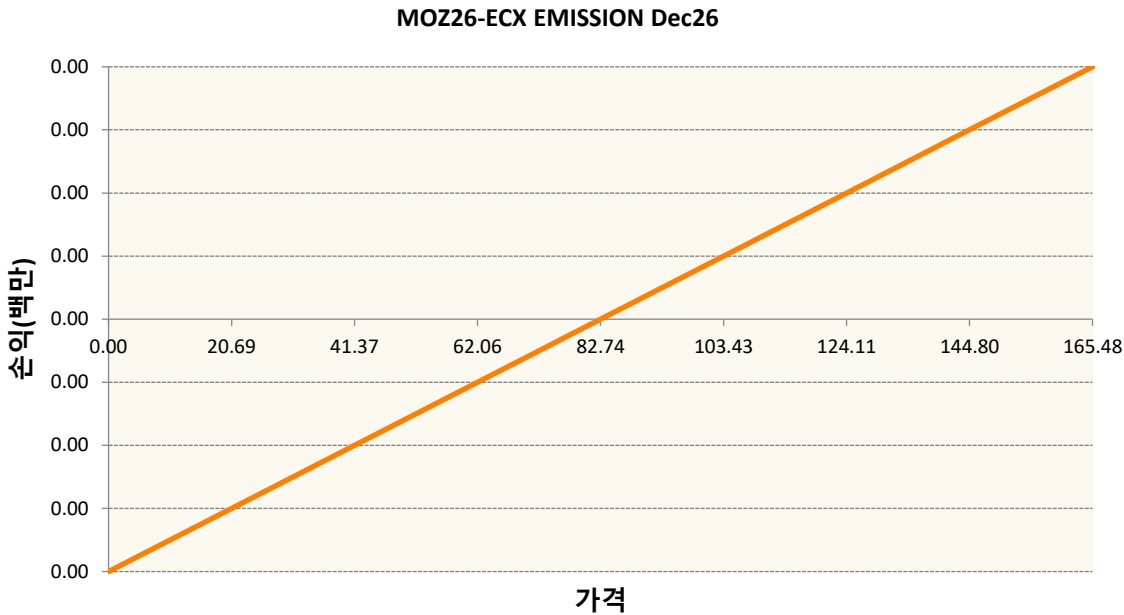
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,350	0	5,350	
누계	통화	선도	0	2,570	-2,570	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G7XIKRW/EUR 31-08-26E	206
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	428

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

(단위:백만원)

697

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

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)	52
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	25
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	21
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	31

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

(단위:백만원)

206

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

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	-4,038	0	-4,038	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	26
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	158
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	141

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

(단위:백만원)

605

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

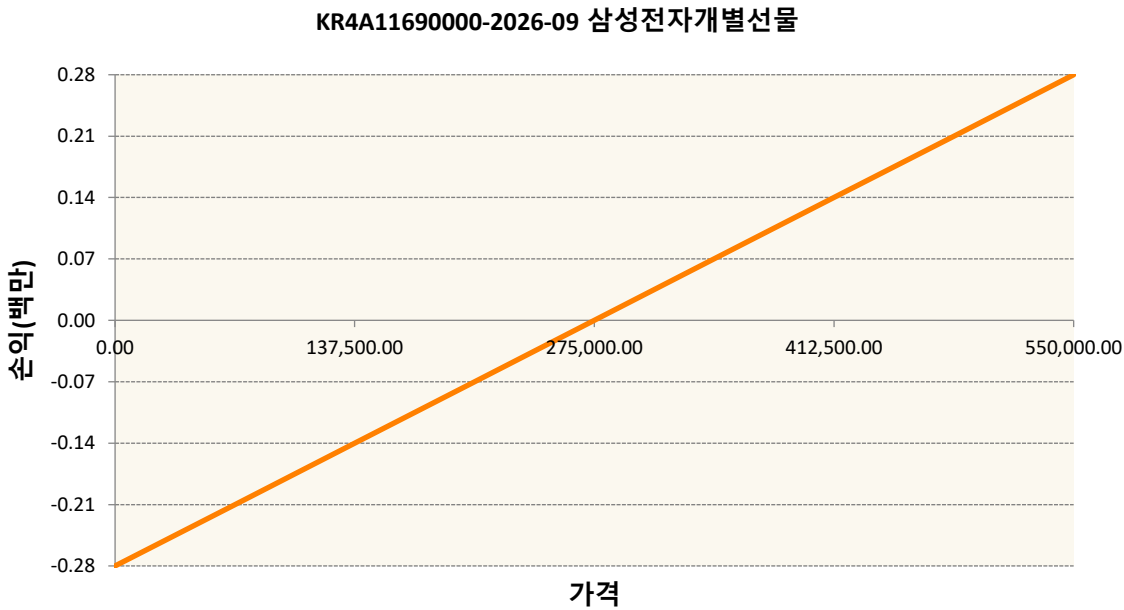
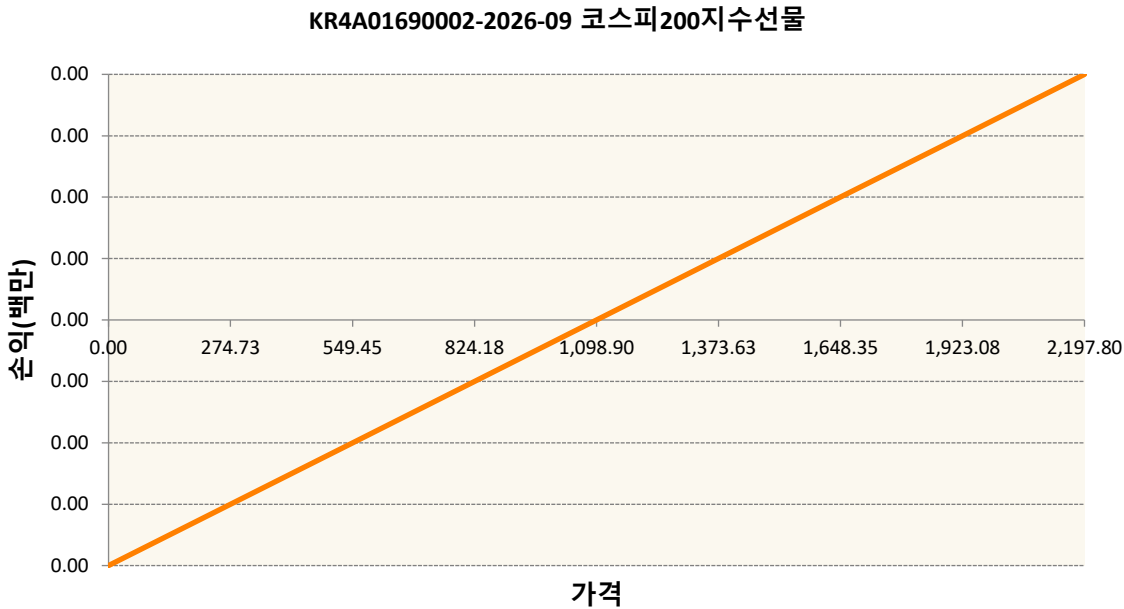
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

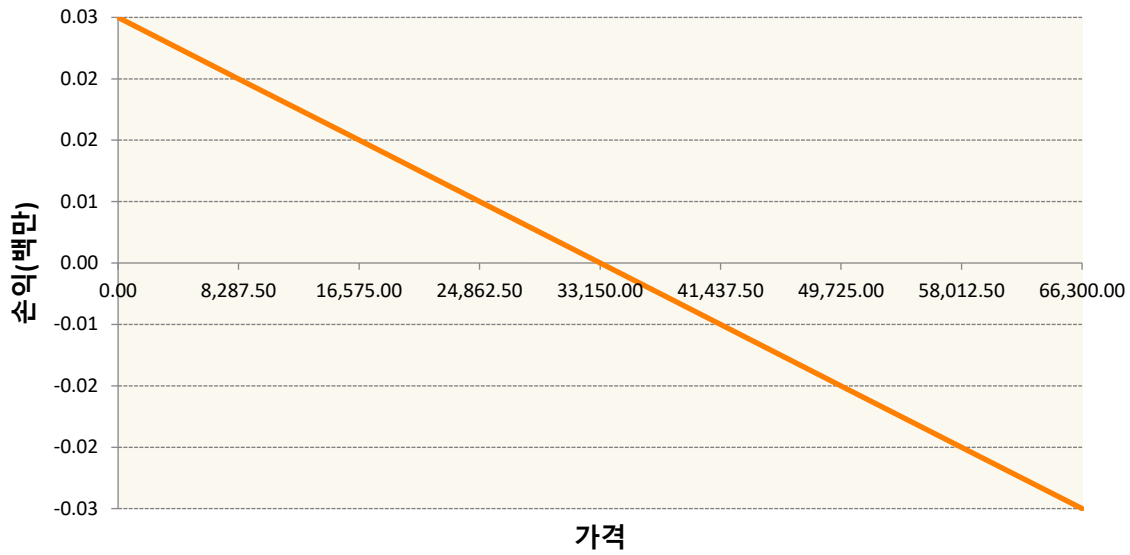
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	274	-274	장내
누계	유가증권	선물	25,499	2,220	23,278	장내

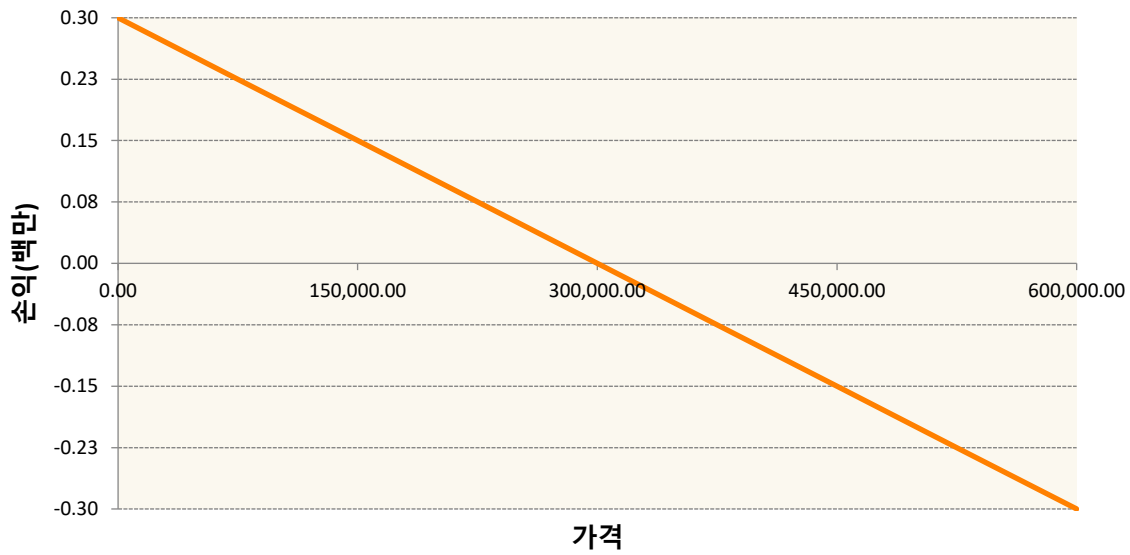
2. 만기시점의 손익구조



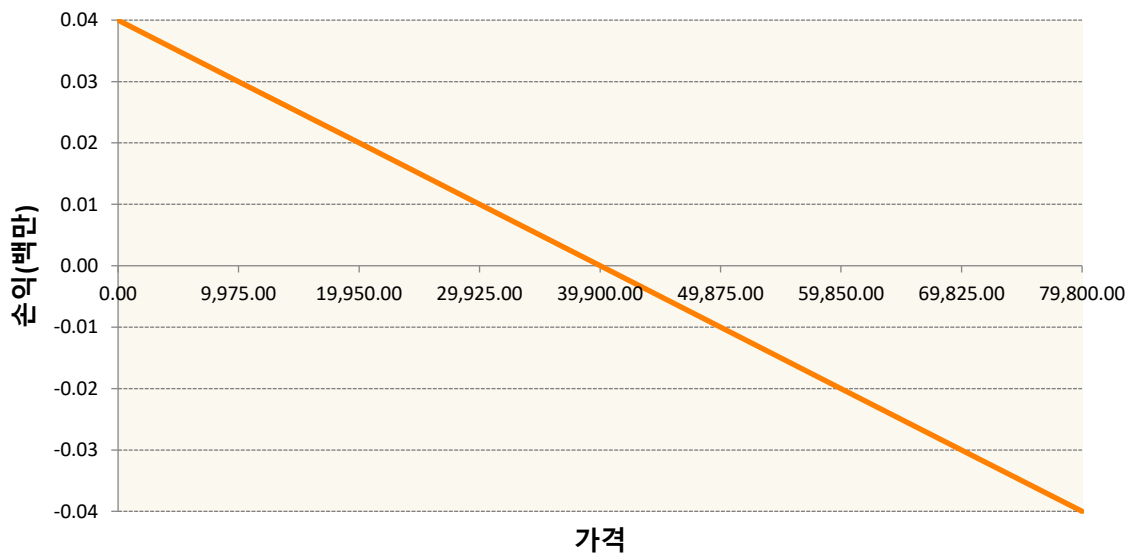
KR4A15690006-2026-09 한국전력개별선물



KR4ABD690005-2026-09 삼성생명개별선물



KR4ACF690002-2026-09 카카오개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		1,713		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713	-1,713				
-5.33%	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142	-1,142				
-2.67%	-571	-571	-571	-571	-571	-571	-571				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	571	571	571	571	571	571	571				
5.33%	1,142	1,142	1,142	1,142	1,142	1,142	1,142				
8.00%	1,713	1,713	1,713	1,713	1,713	1,713	1,713				
KR4A11690000							2026-09 삼성전자개별선물		325		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-325	-325	-325	-325	-325	-325	-325				
-5.33%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-217				
-2.67%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	108	108	108	108	108	108	108				
5.33%	217	217	217	217	217	217	217				
8.00%	325	325	325	325	325	325	325				
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		55		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55				
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37				
-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%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37				
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55				
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)

7,101

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

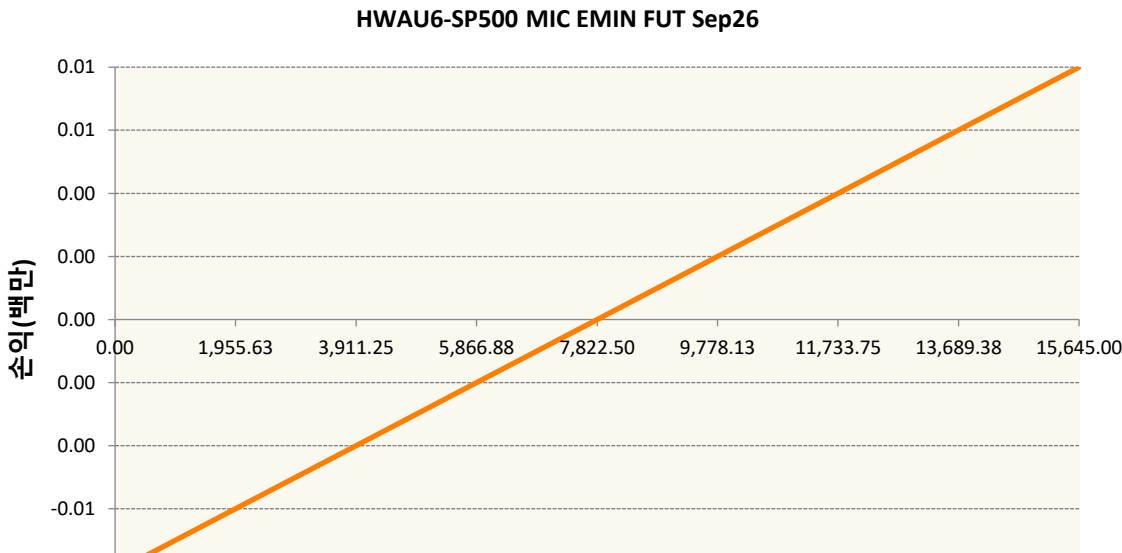
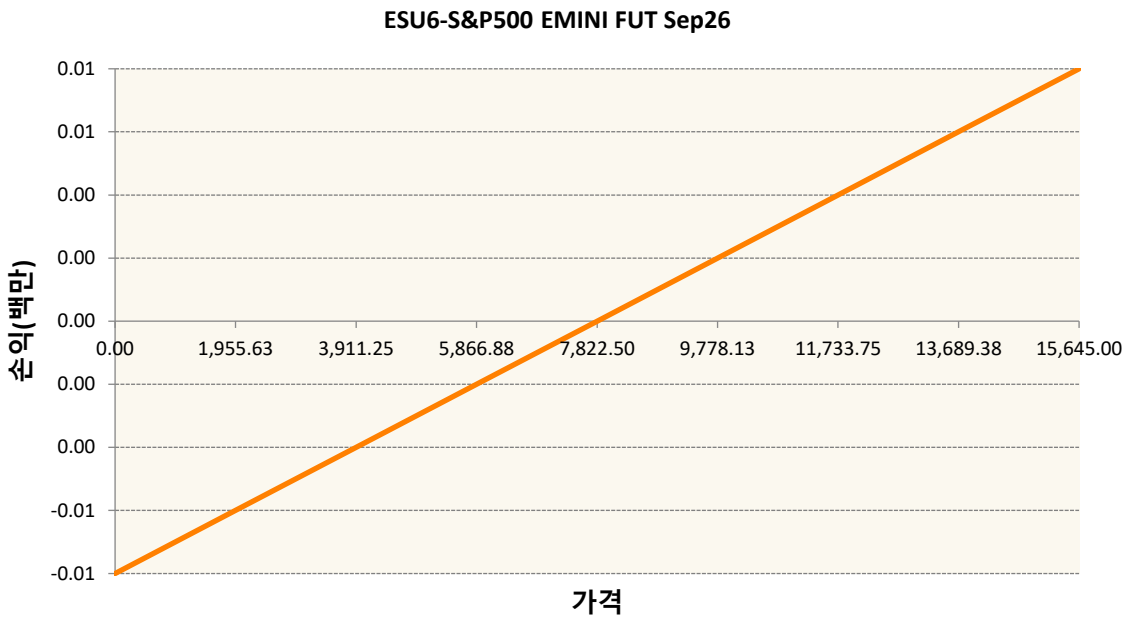
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

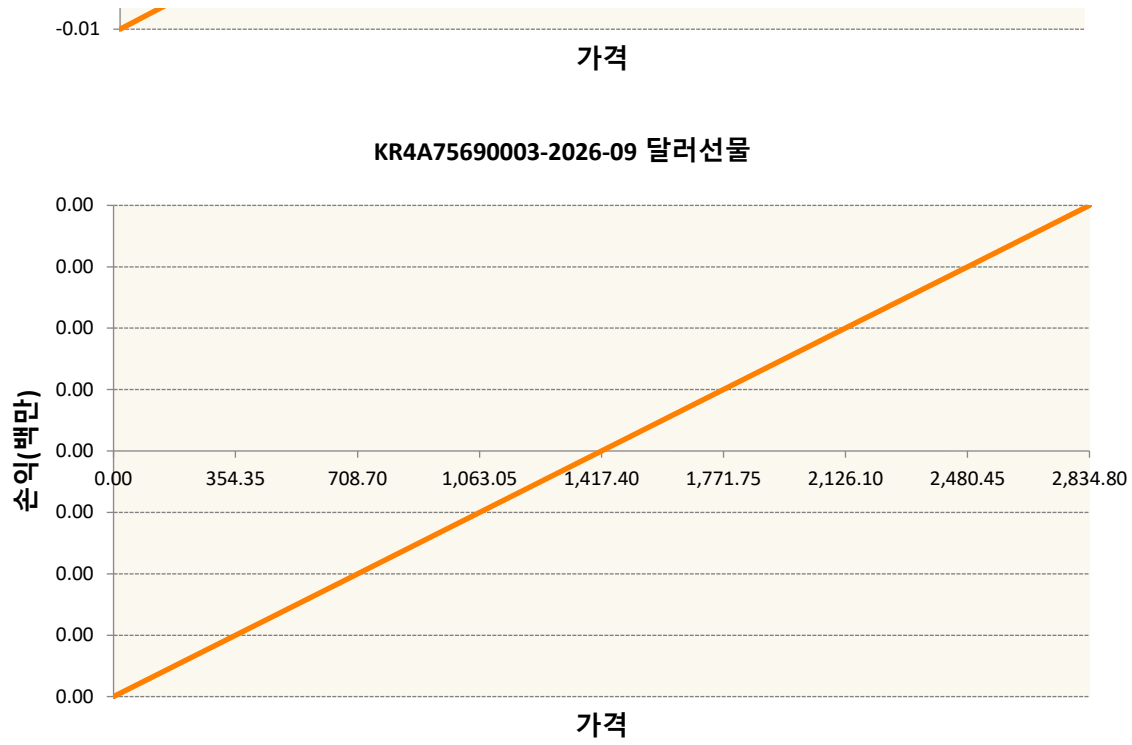
1. 계약금액

(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	72,520	0	72,520	
누계	지수	선물	179	0	179	장내
누계	통화	선물	10,772	0	10,772	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		5,802
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		14
KR4A756900 2026-09 달러선물			862

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,929

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

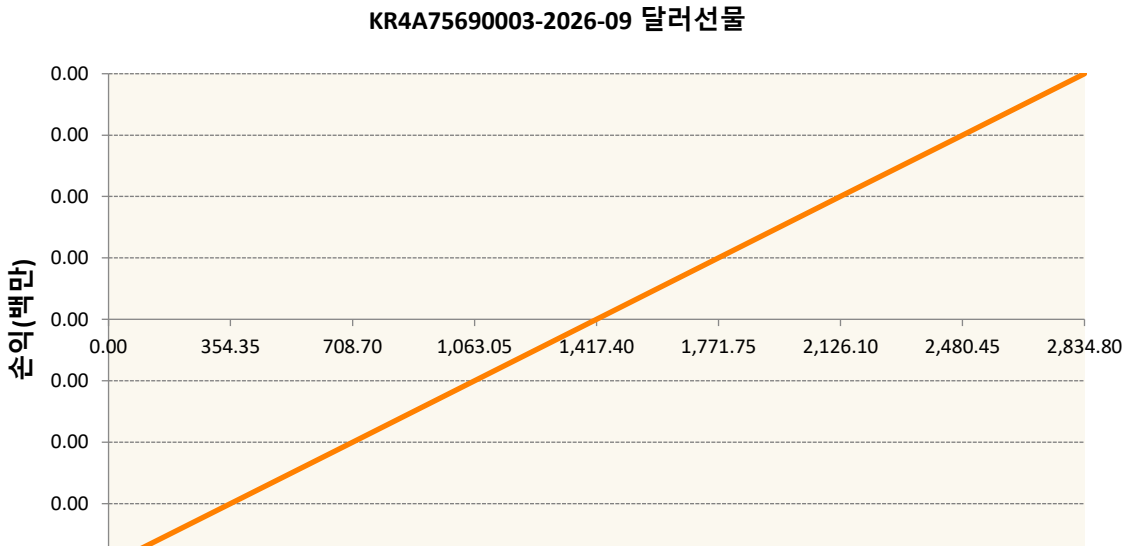
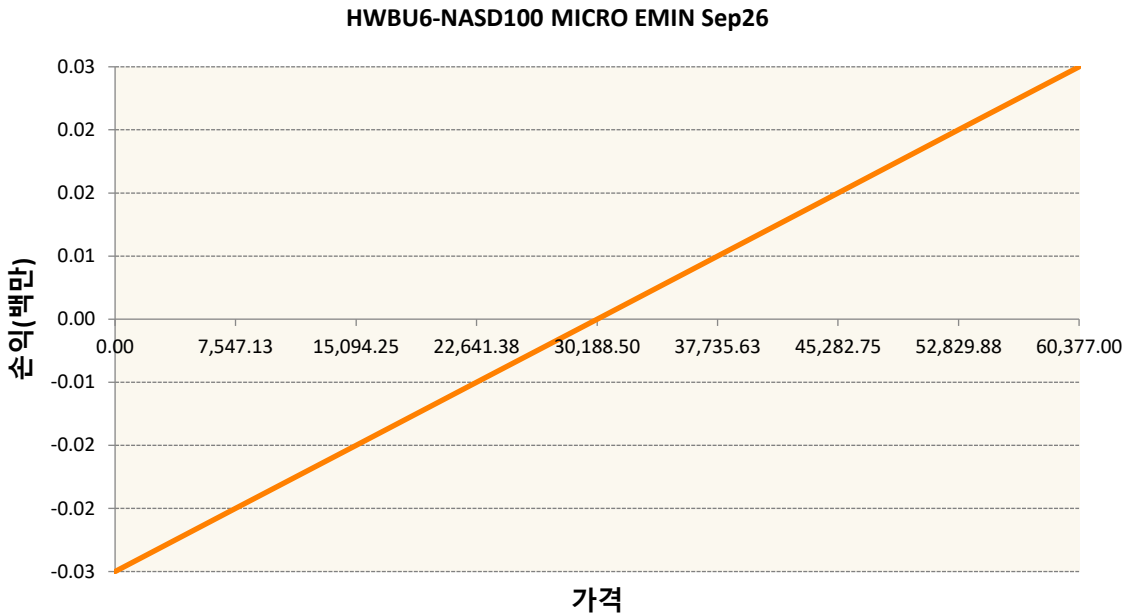
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

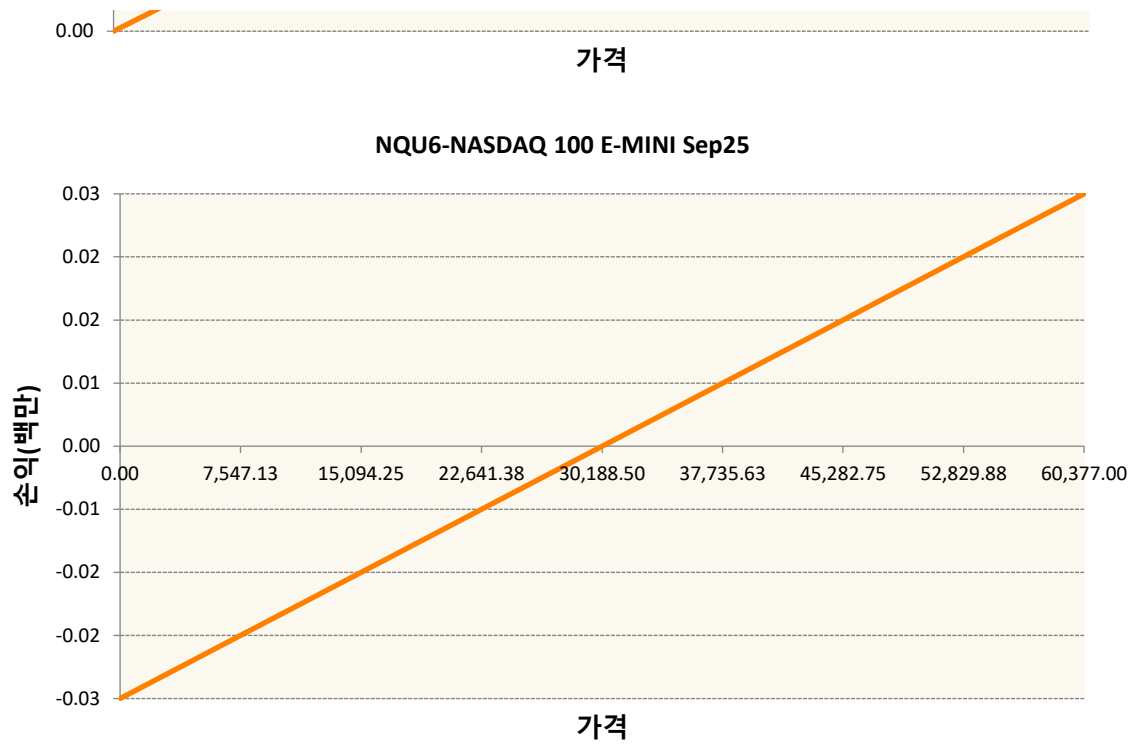
1. 계약금액

(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	724	0	724	장내
누계	지수	선물	34,709	0	34,709	
누계	통화	선물	4,054	0	4,054	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26	58
KR4A756900	2026-09 달러선물	324
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	2,777

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

3,182

공시일	2026-08-18
기준일	2026-08-14

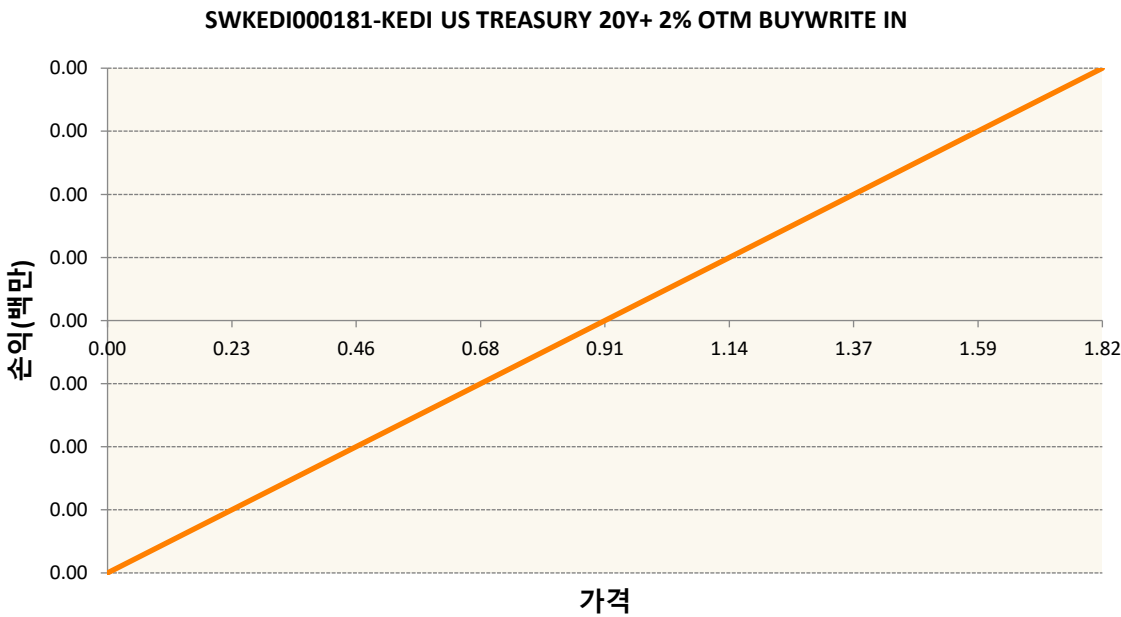
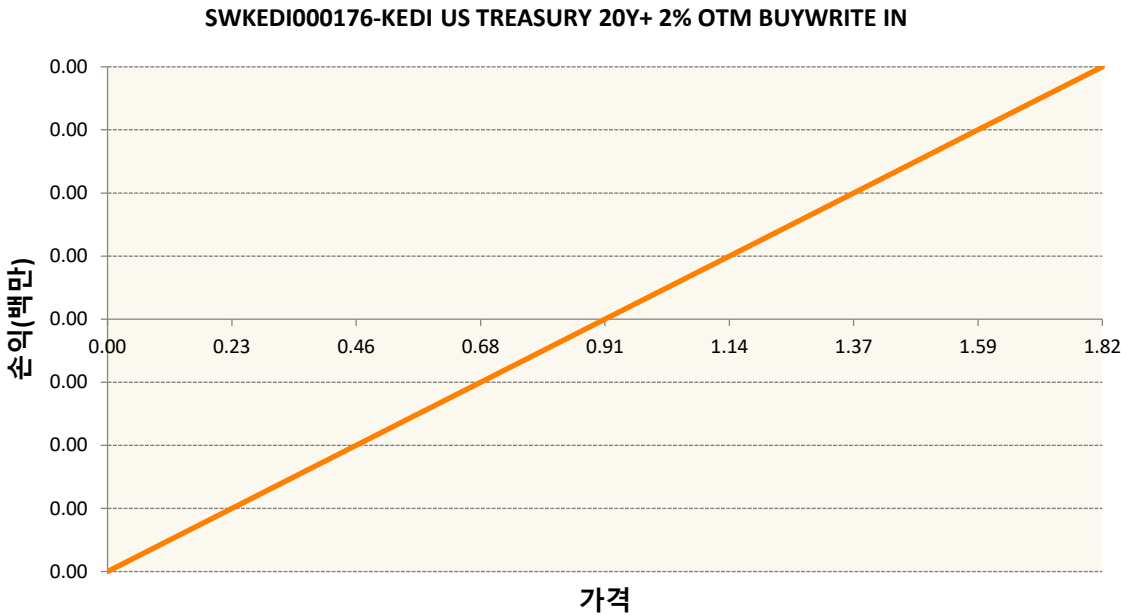
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

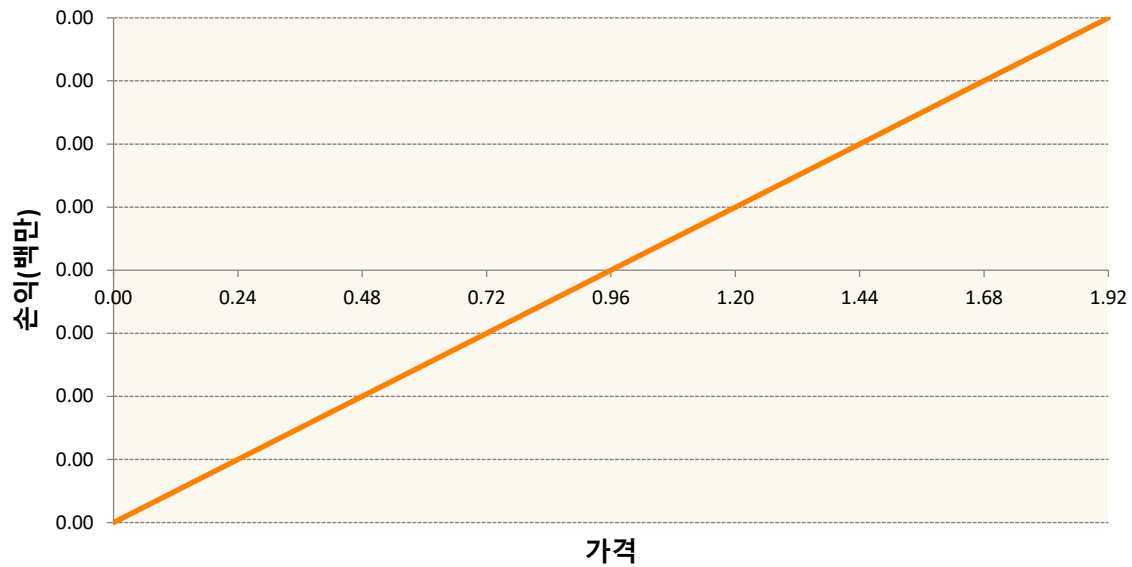
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	288,420	0	288,420	장외

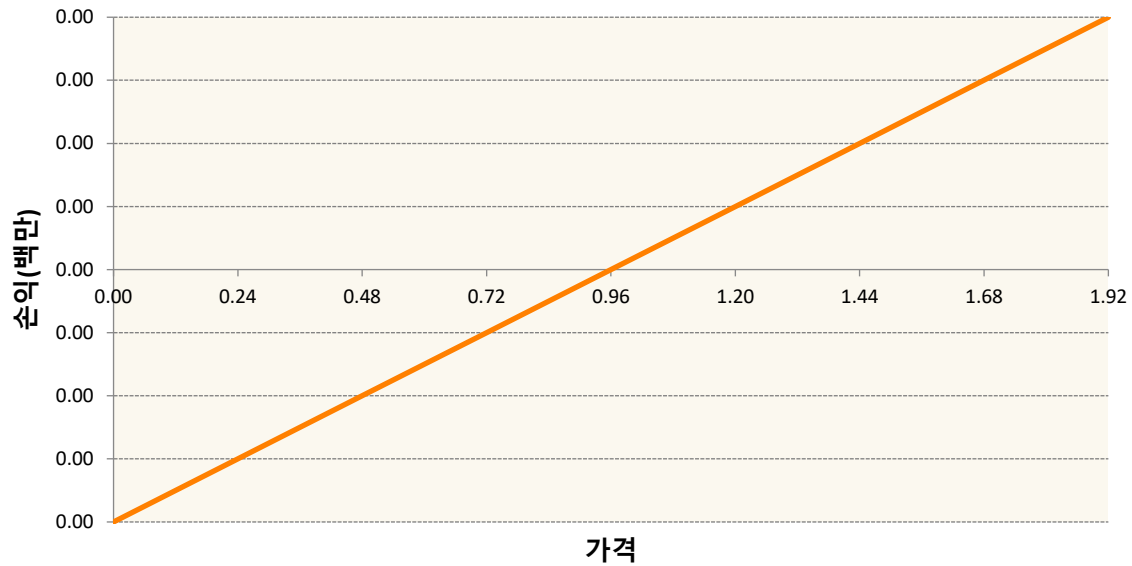
2. 만기시점의 손익구조



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	7,405
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,906
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,526
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,258

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

(단위:백만원)

9,922
