

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

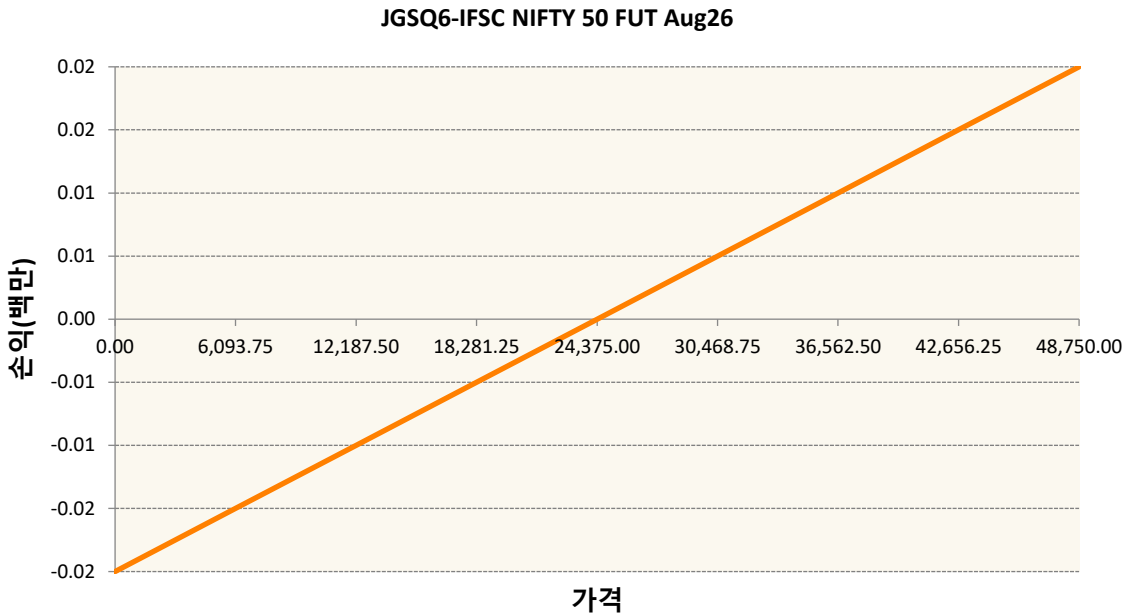
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	357	0	357	

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	2026-08-19
기준일	2026-08-18

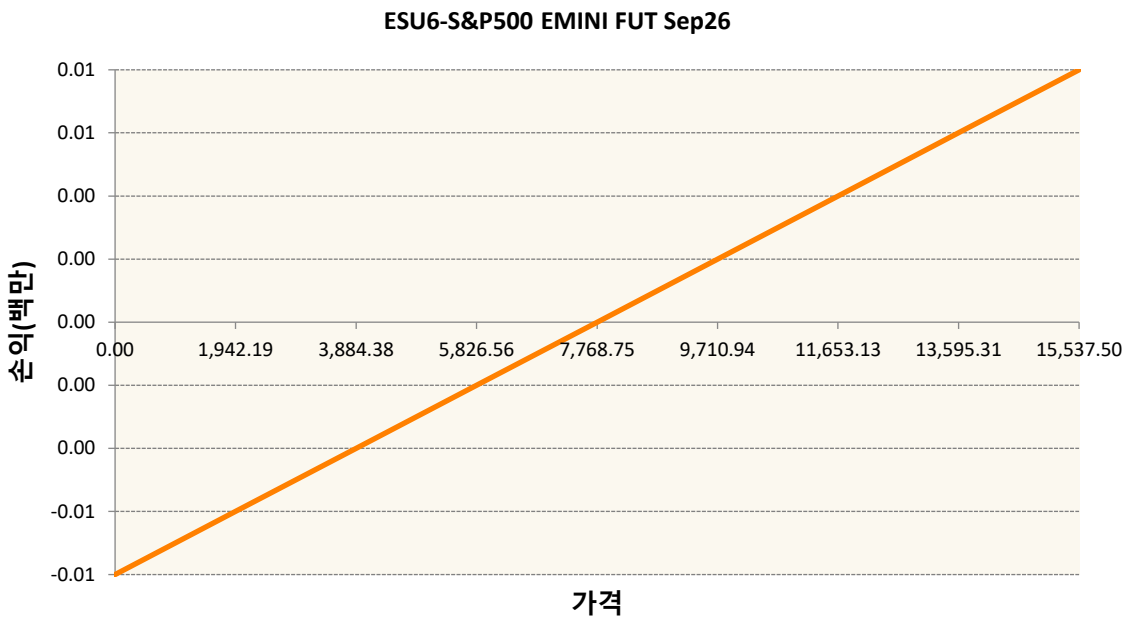
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-08-19
기준일	2026-08-18

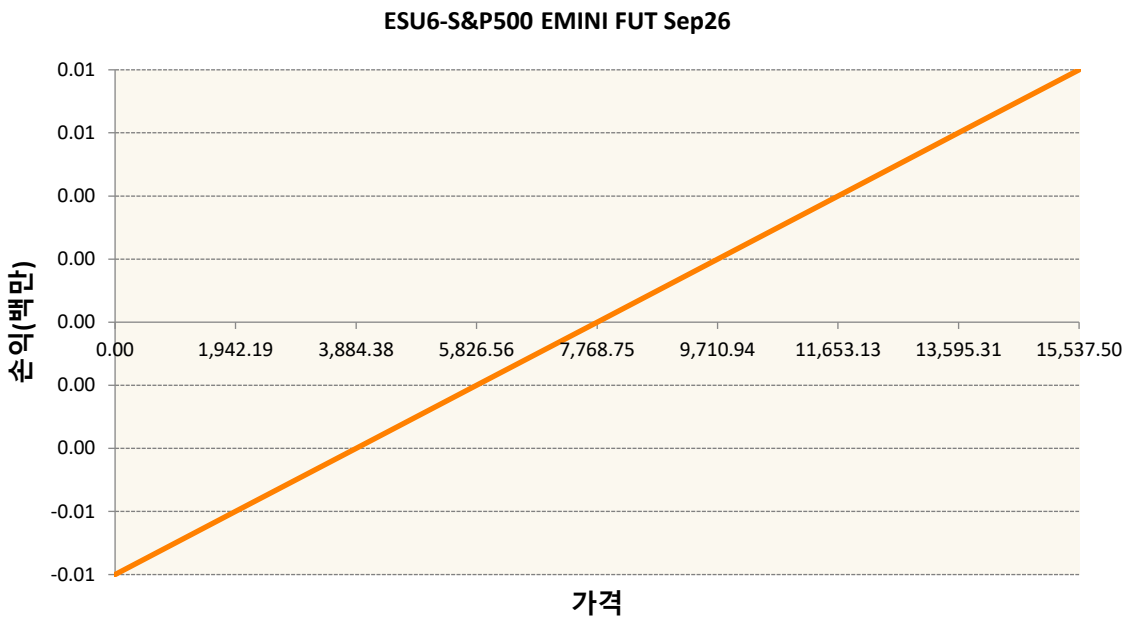
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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	2026-08-19
기준일	2026-08-18

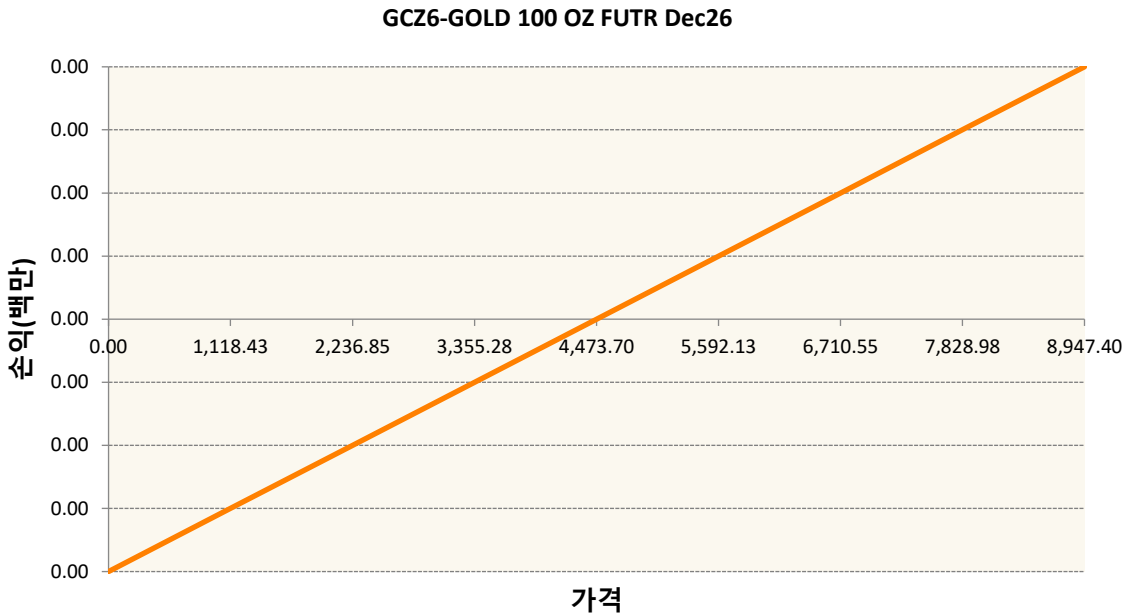
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,137	0	5,137	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCA GLD US 08/21/26 C400 EQUITY	11
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	411

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

(단위:백만원)

551

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

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)

AOPLTRCUS' PLTR US 08/21/26 C185 EQUITY	17
AOPLTRPUS' PLTR US 08/21/26 P185 EQUITY	17

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

(단위:백만원)

119

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

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)

AOTLTUSC8:TLT US 08/21/26 C83 EQUITY

0.49

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

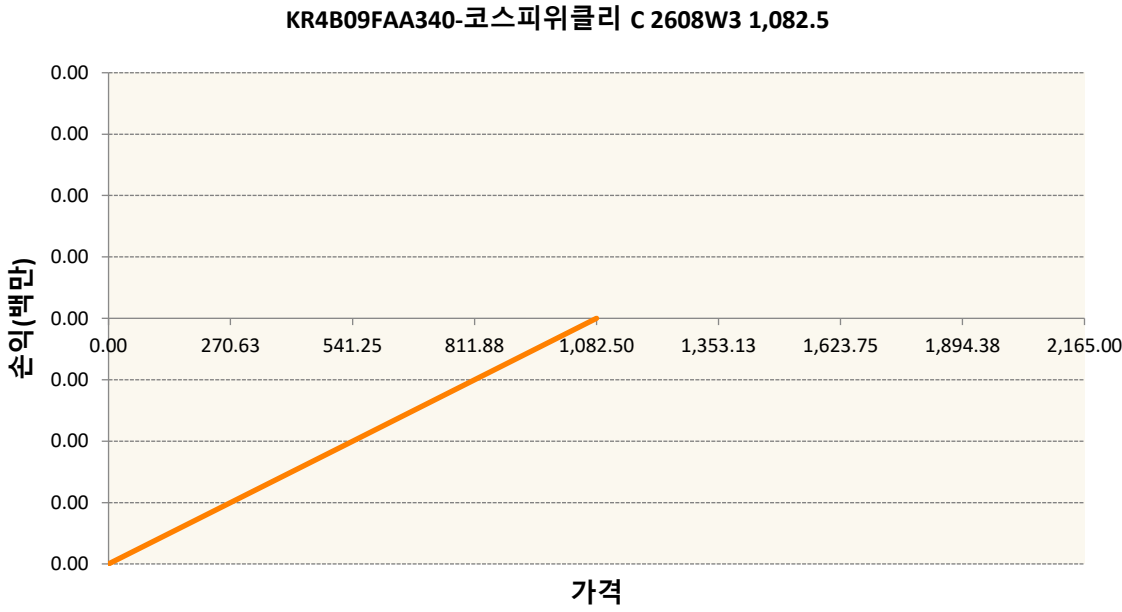
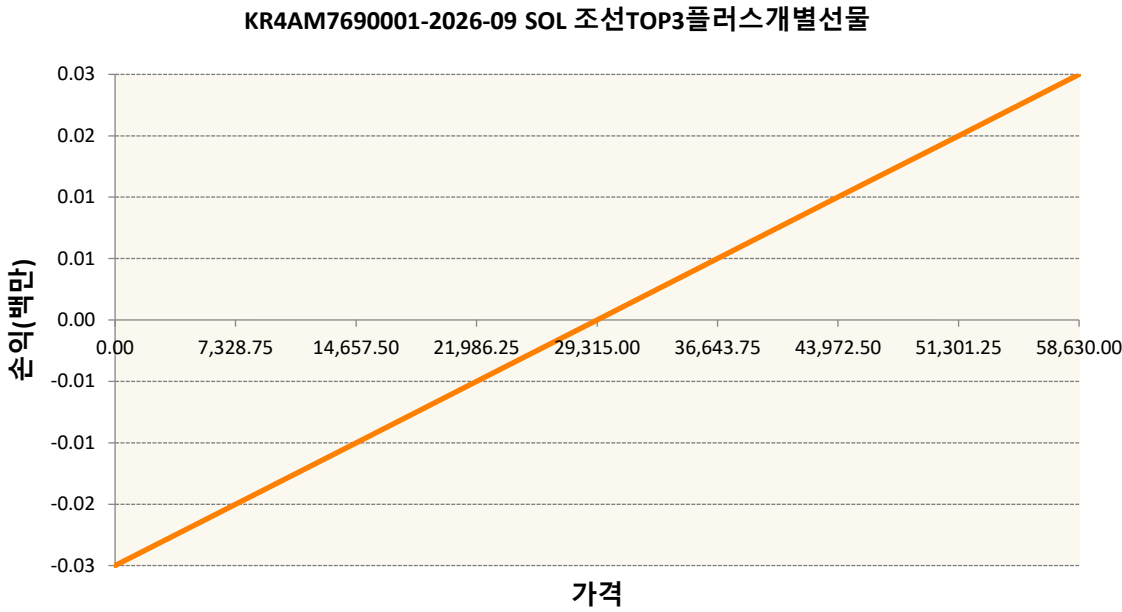
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

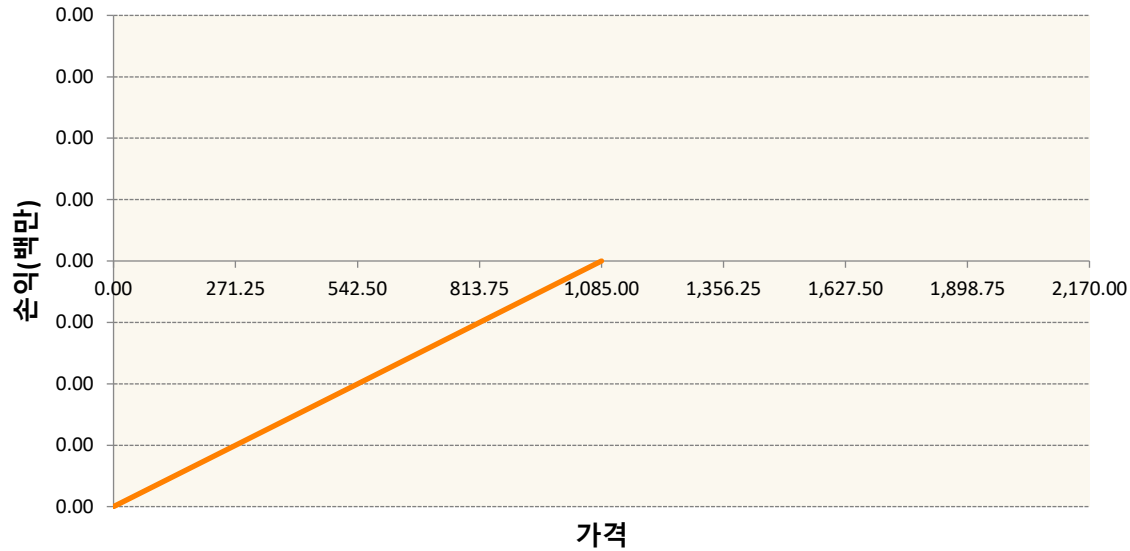
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	436	-436	장내
신규	유가증권	옵션	0	3,297	-3,297	장내
누계	유가증권	선물	11,934	0	11,934	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,252	-3,252	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4B09FAA357-코스피위클리 C 2608W3 1,085.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4AM7690001			2026-09 SOL 조선TOP3플러스개별선물				9,458
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9,458	-9,458	-9,458	-9,458	-9,458	-9,458	-9,458
-5.33%	-6,305	-6,305	-6,305	-6,305	-6,305	-6,305	-6,305
-2.67%	-3,153	-3,153	-3,153	-3,153	-3,153	-3,153	-3,153
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3,153	3,153	3,153	3,153	3,153	3,153	3,153
5.33%	6,305	6,305	6,305	6,305	6,305	6,305	6,305
8.00%	9,458	9,458	9,458	9,458	9,458	9,458	9,458
KR4B09FAA340			코스피위클리 C 2608W3 1,082.5				87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-85	-85	-85	-85	-86	-86	-87
-5.33%	-49	-50	-51	-51	-52	-53	-55
-2.67%	-17	-19	-20	-22	-24	-25	-27
0%	6	4	2	0	-2	-4	-6
2.67%	18	17	15	14	12	10	8
5.33%	23	22	21	20	19	18	17
8.00%	24	24	23	23	23	22	21
KR4B09FAA357			코스피위클리 C 2608W3 1,085.0				123
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-121	-121	-121	-122	-122	-123
-5.33%	-71	-72	-73	-74	-75	-76	-78
-2.67%	-26	-28	-30	-32	-34	-36	-39
0%	8	6	3	0	-3	-6	-8

2.67%	27	25	23	20	18	15	13
5.33%	34	33	32	30	29	27	25
8.00%	36	35	35	34	34	33	32

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

(단위:백만원)

16,541

공시일 2026-08-19

기준일 2026-08-18

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	2026-08-19
기준일	2026-08-18

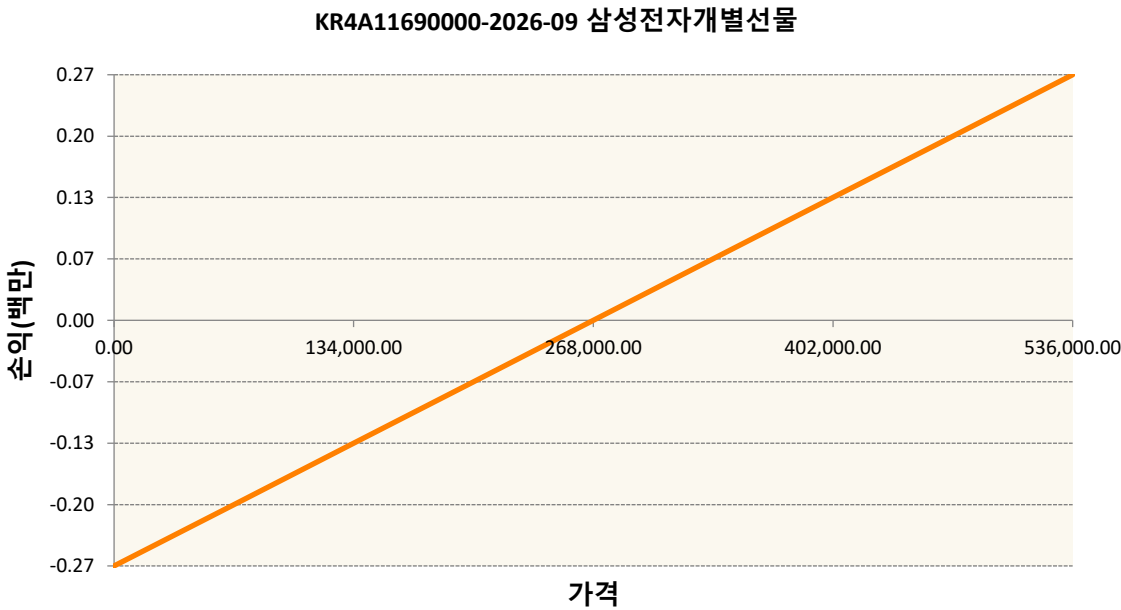
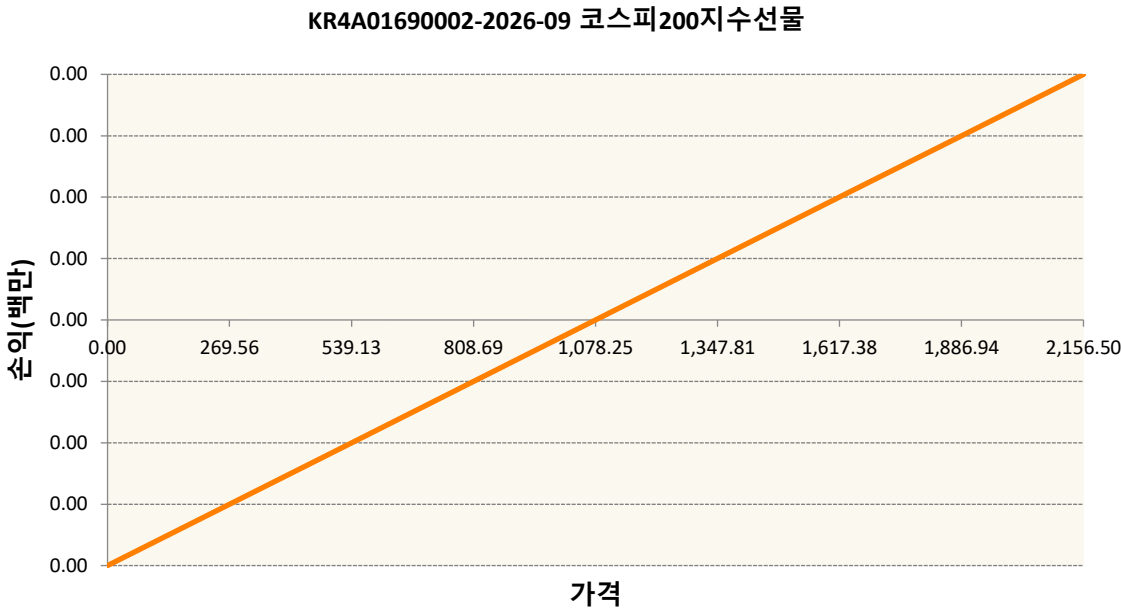
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	21,481	0	21,481	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					563
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-563	-563	-563	-563	-563	-563	-563
-5.33%	-375	-375	-375	-375	-375	-375	-375
-2.67%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	188	188	188	188	188	188	188
5.33%	375	375	375	375	375	375	375
8.00%	563	563	563	563	563	563	563
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물					1,160
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160
-5.33%	-773	-773	-773	-773	-773	-773	-773
-2.67%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	387	387	387	387	387	387	387
5.33%	773	773	773	773	773	773	773
8.00%	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160

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

6,438

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

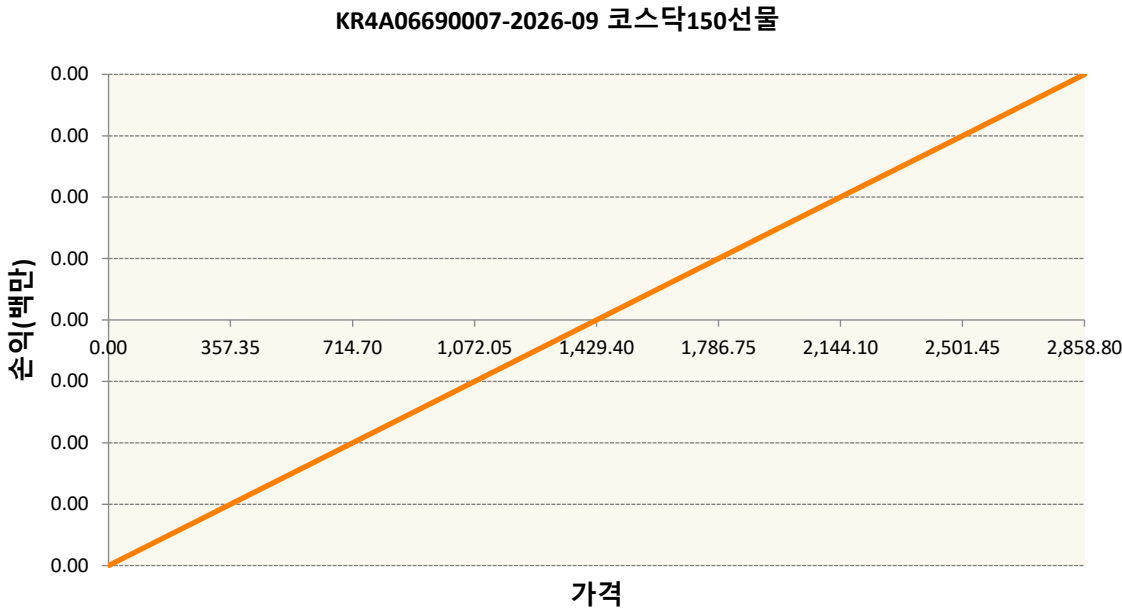
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	829	0	829	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007		2026-09 코스닥150선물					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)

19,263

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

(단위:백만원)

51,596

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

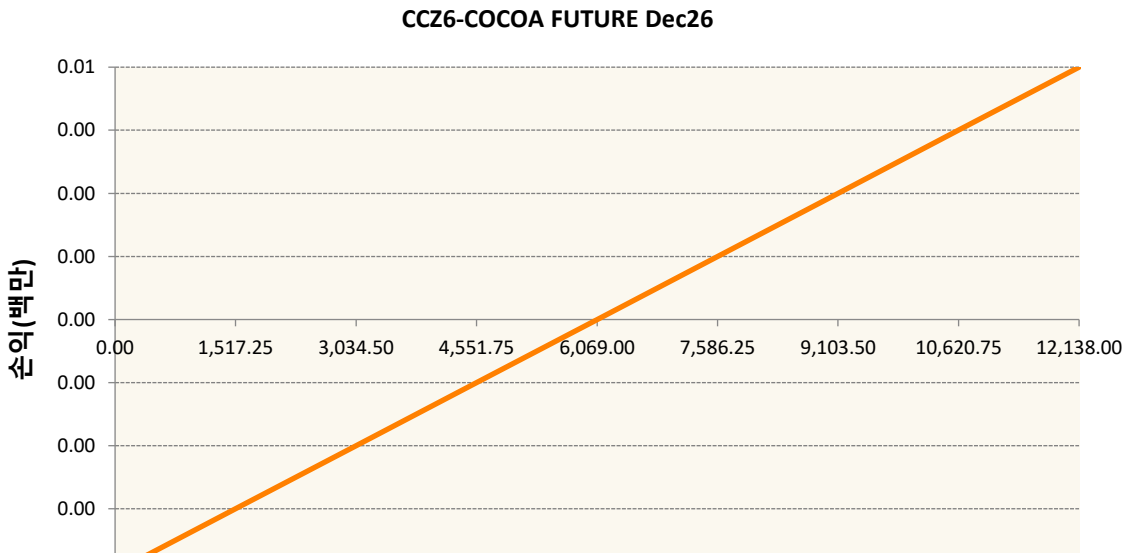
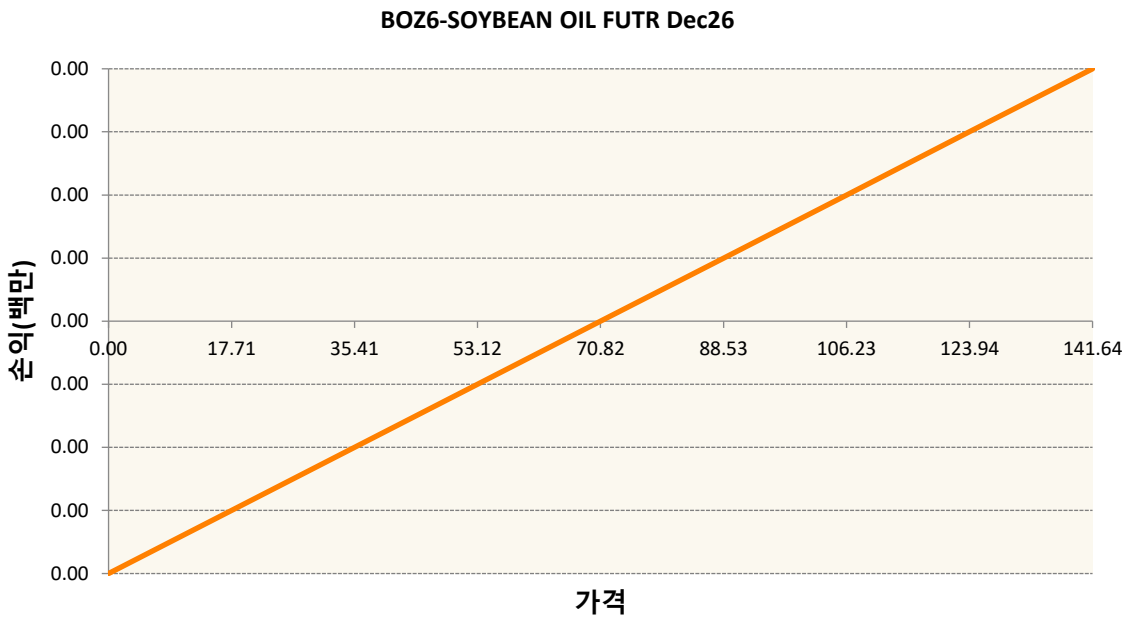
포커스농산물모(채권-파생형)

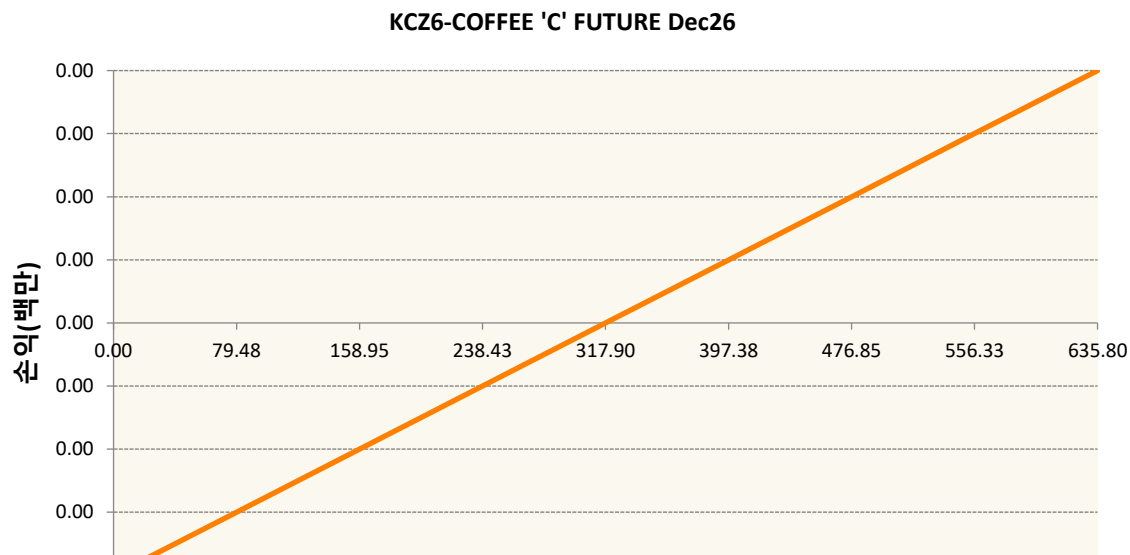
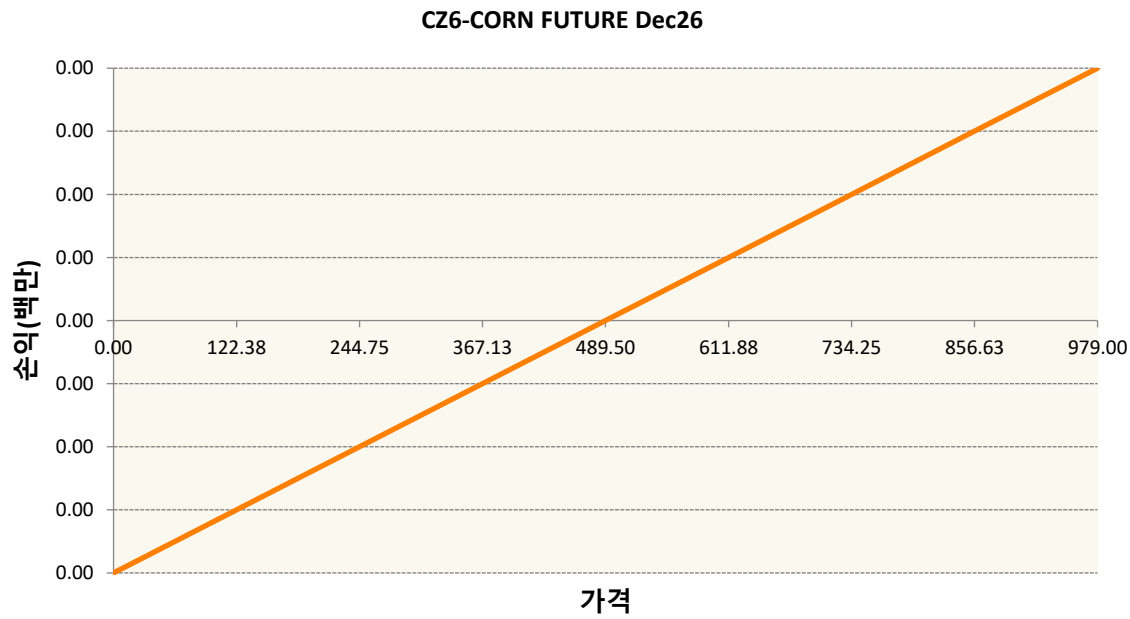
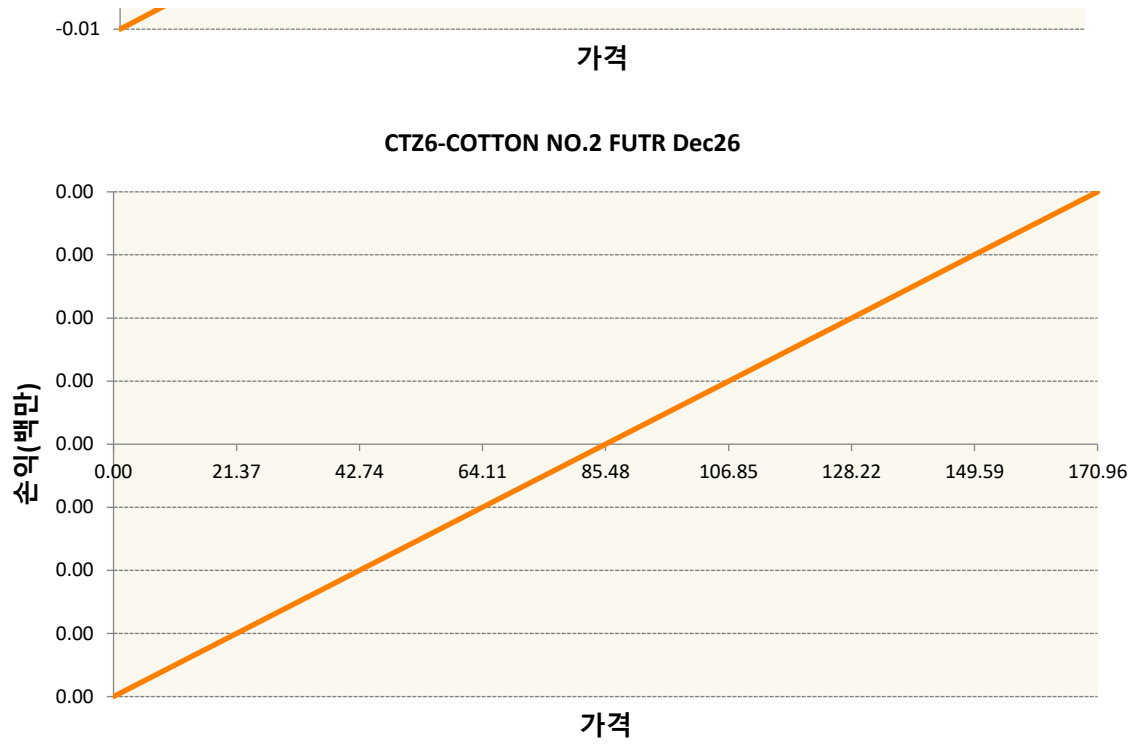
1. 계약금액

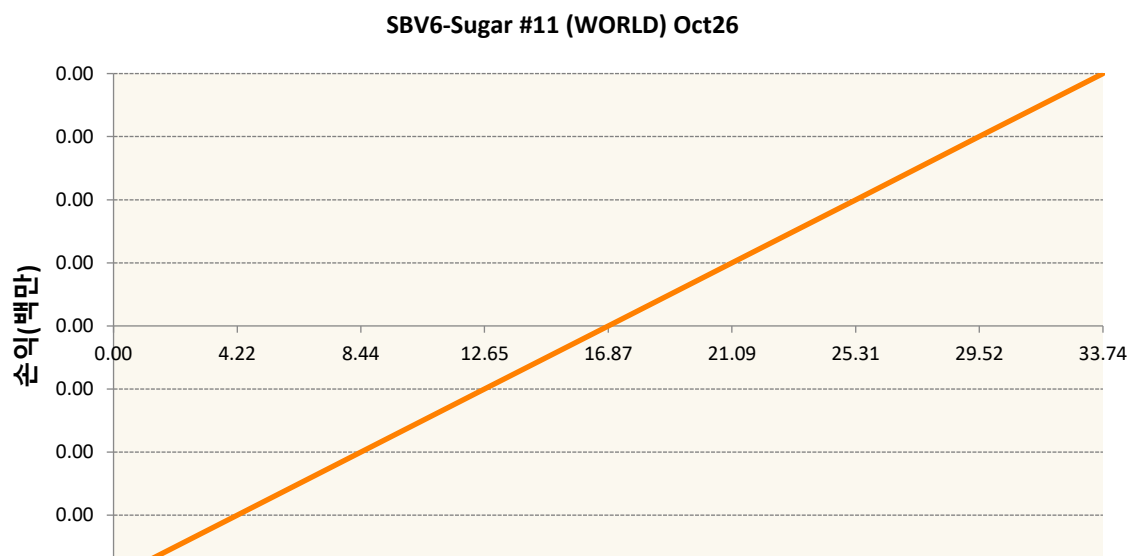
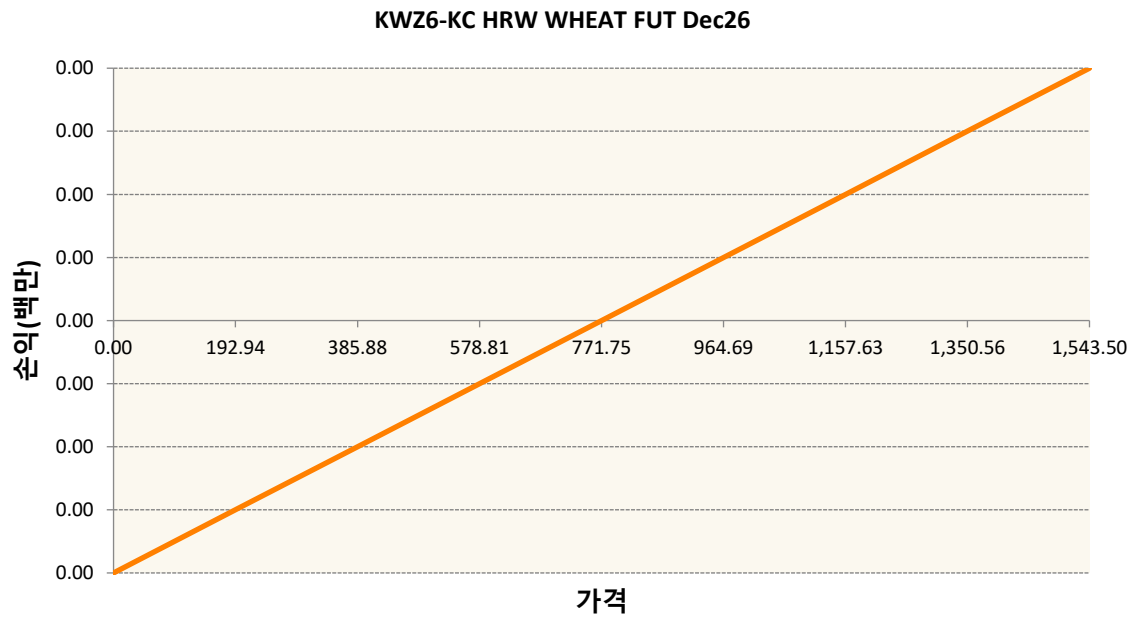
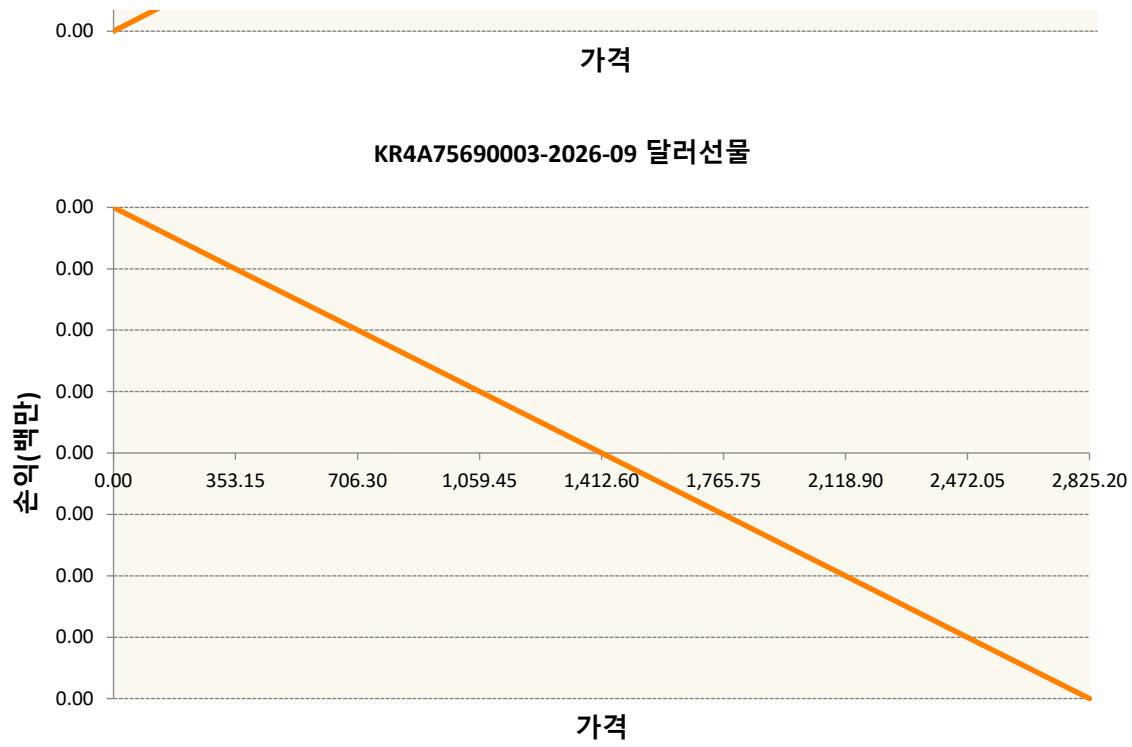
(단위:USD 백만)

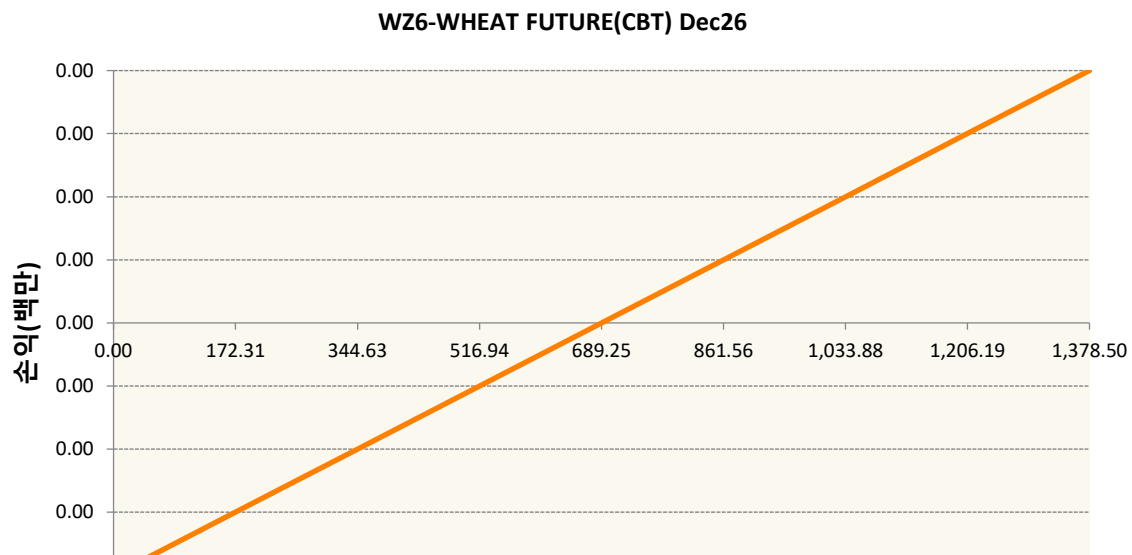
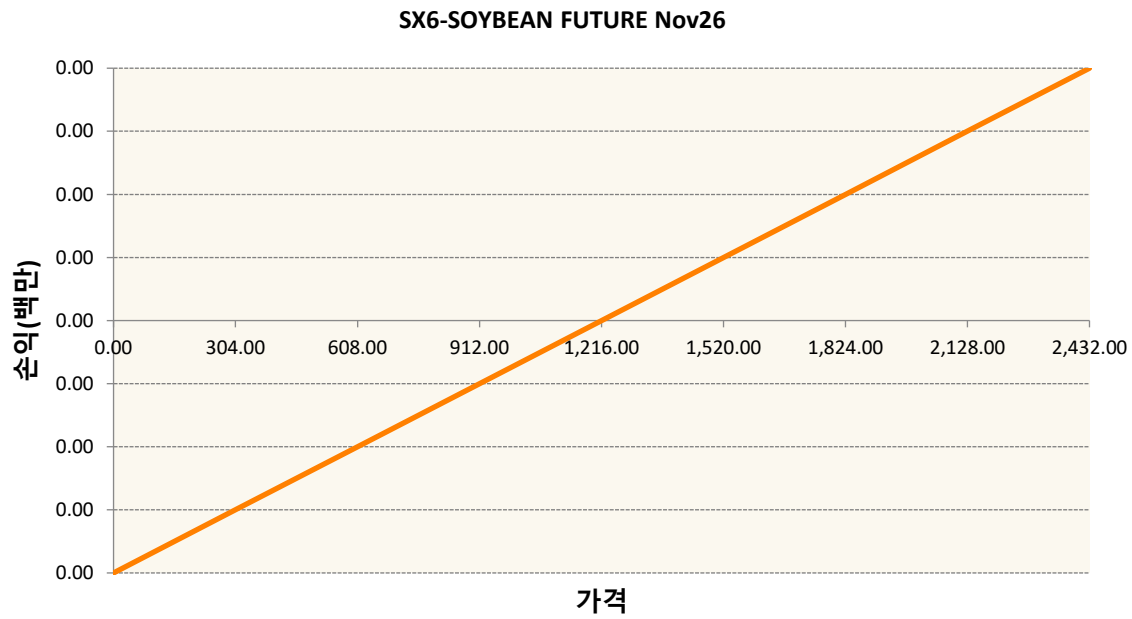
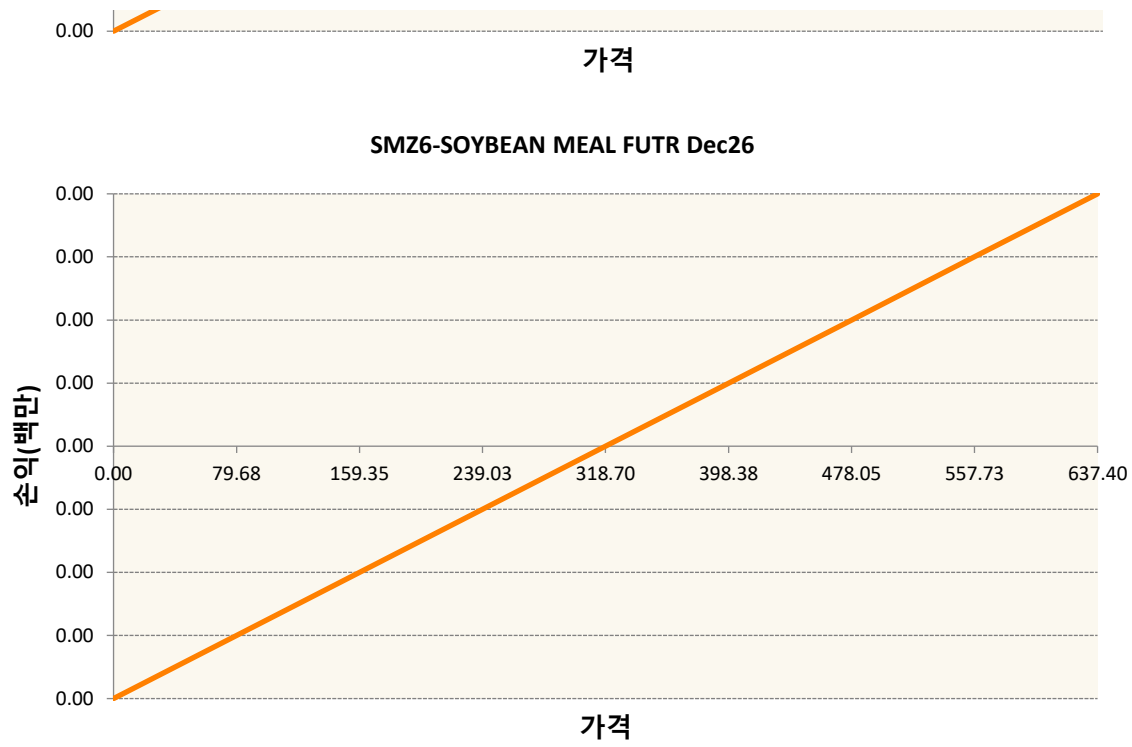
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	470	0	470	
누계	유가증권	선물	2,310	0	2,310	
누계	통화	선물	0	353	-353	장내

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	2026-08-19
기준일	2026-08-18

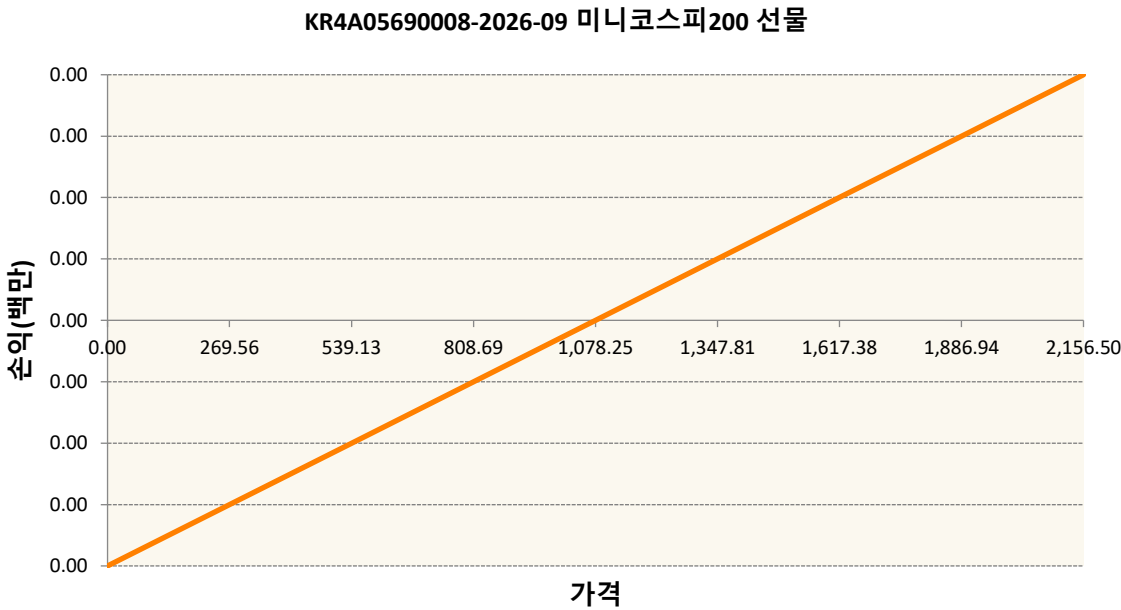
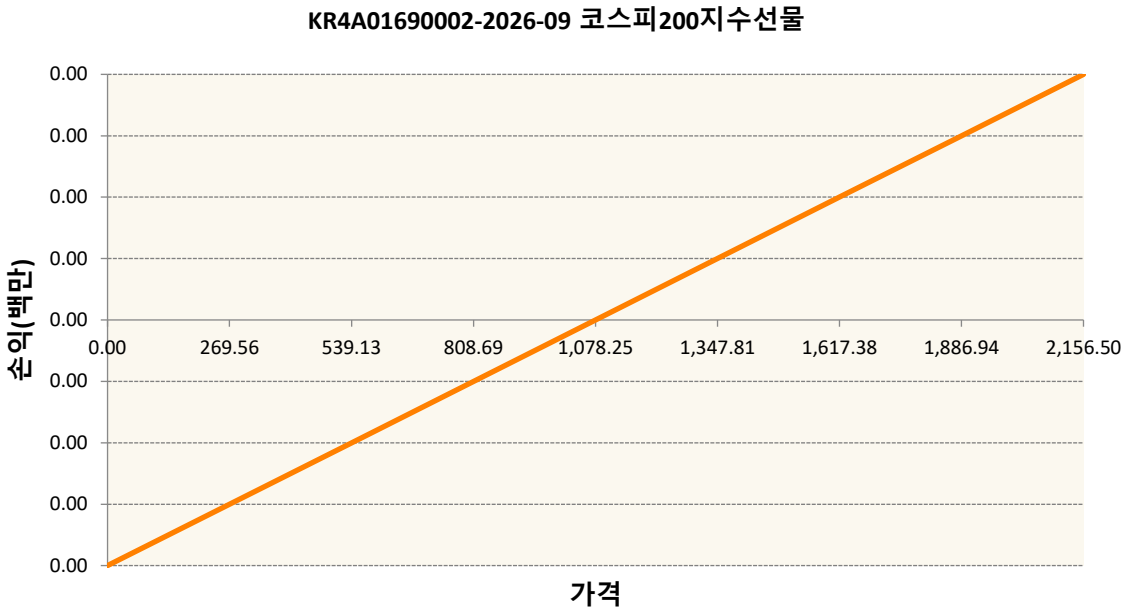
스마트인덱스모

1. 계약금액

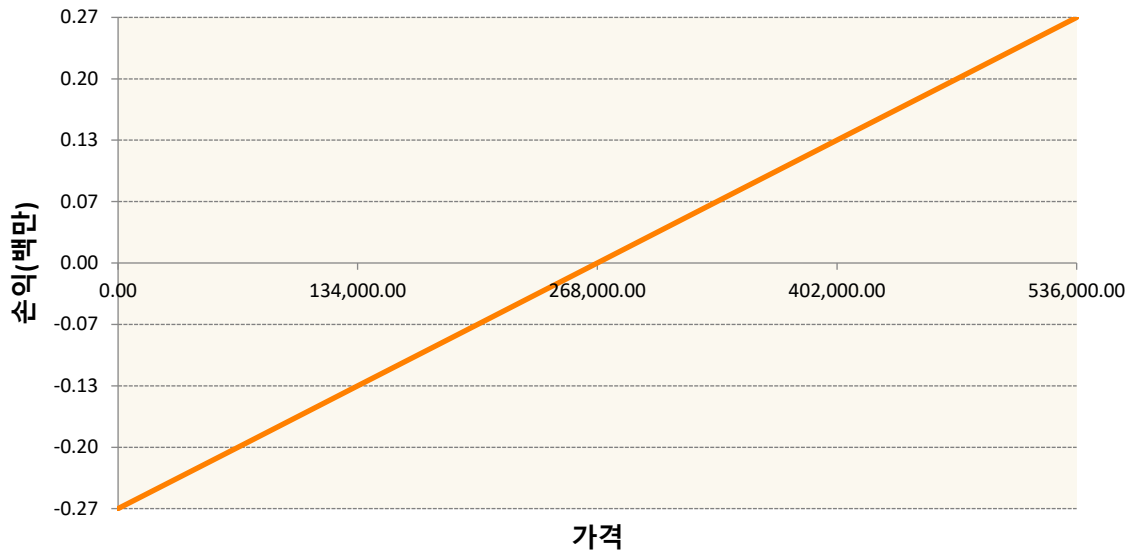
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,418	142	4,275	장내

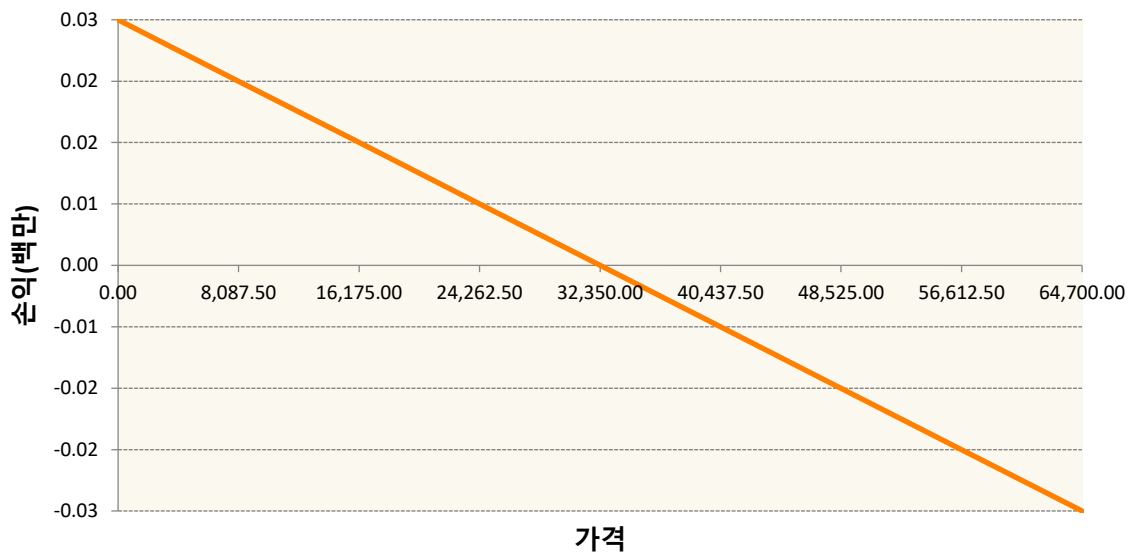
2. 만기시점의 손익구조



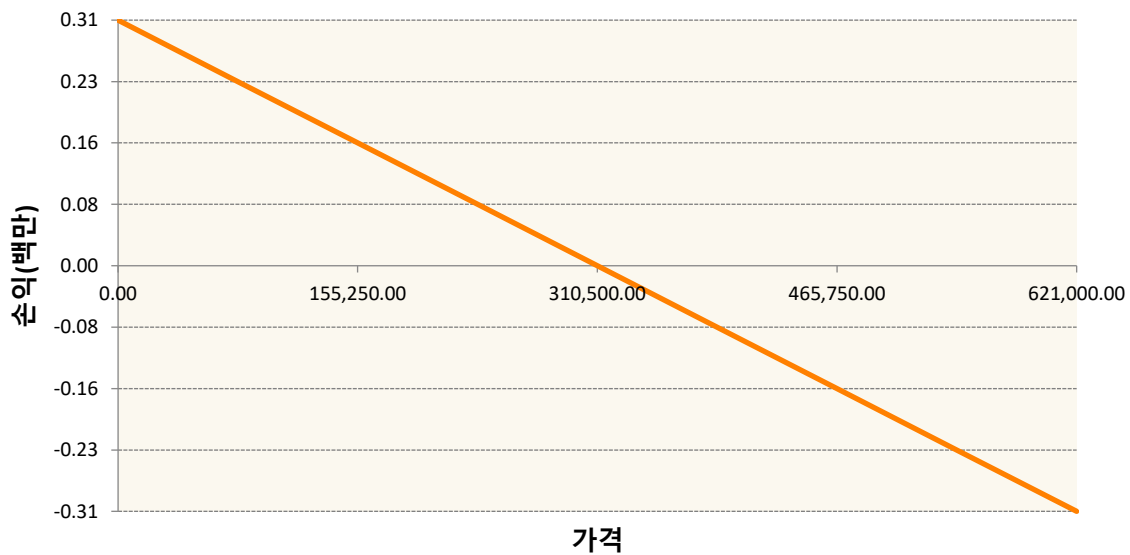
KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



KR4A15690006-2026-09 한국전력개별선물



KR4ABD690005-2026-09 삼성생명개별선물



(단위:백만원)

	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)

783

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

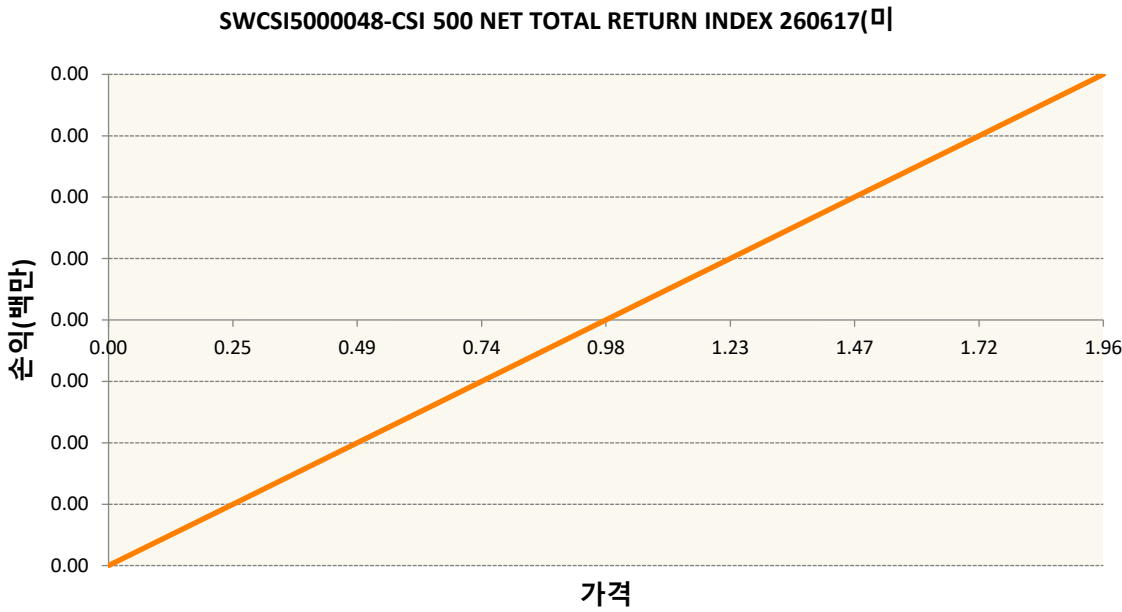
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,681	0	5,681	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

456

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

717

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

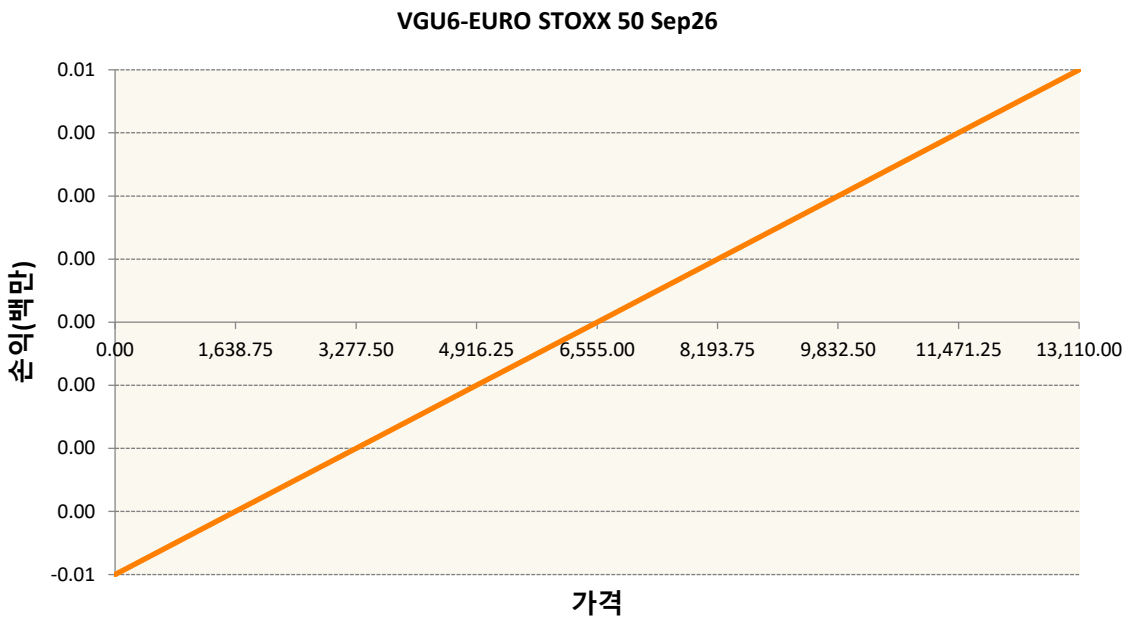
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2026-08-19
기준일	2026-08-18

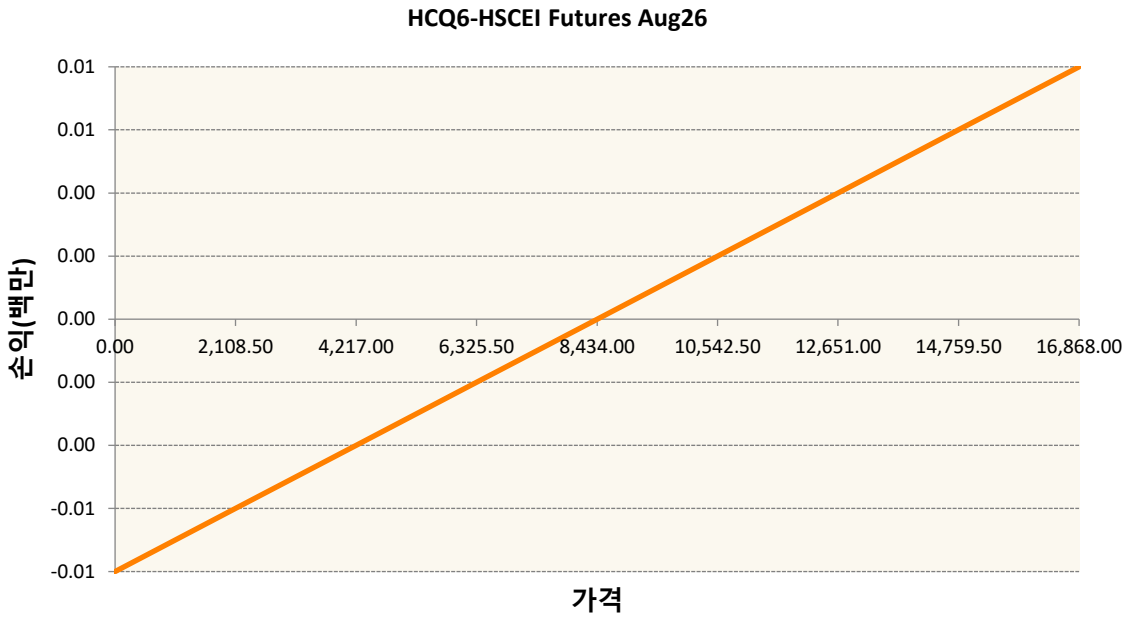
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	2026-08-19
기준일	2026-08-18

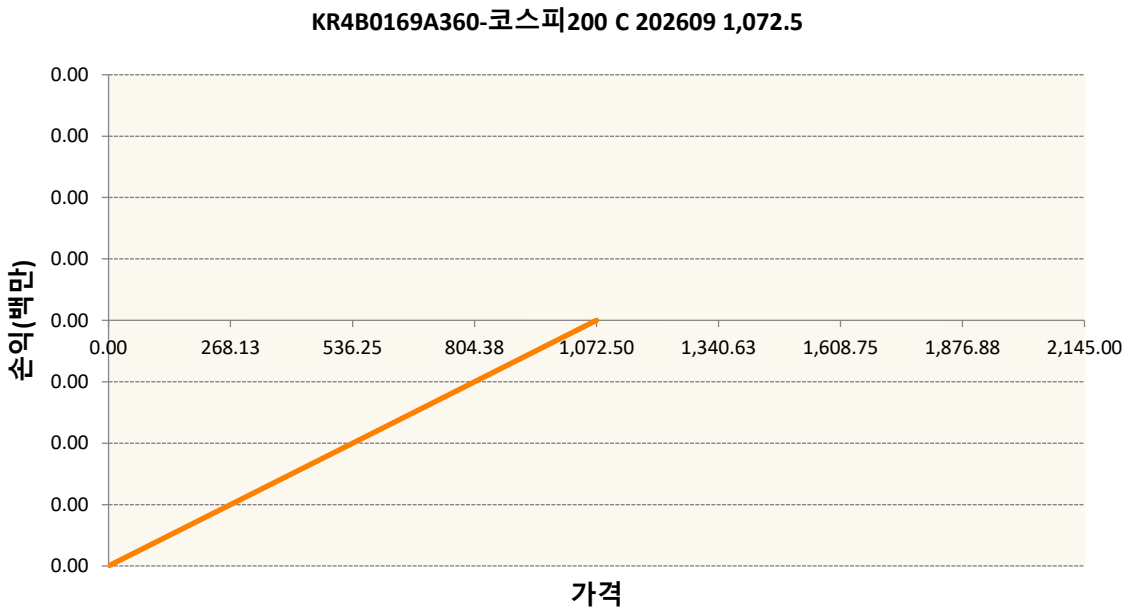
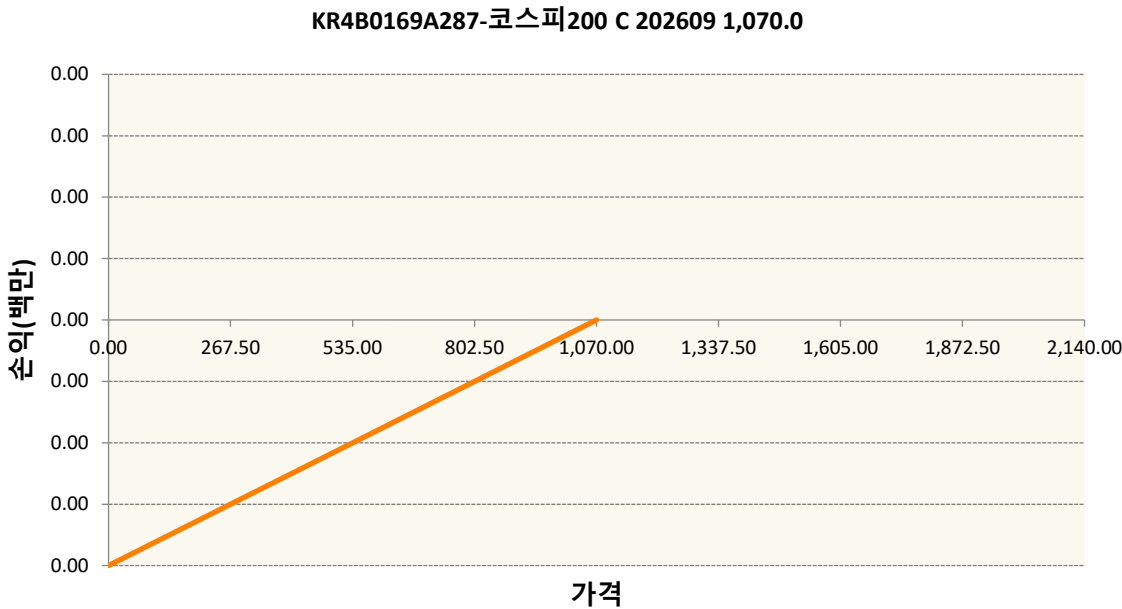
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

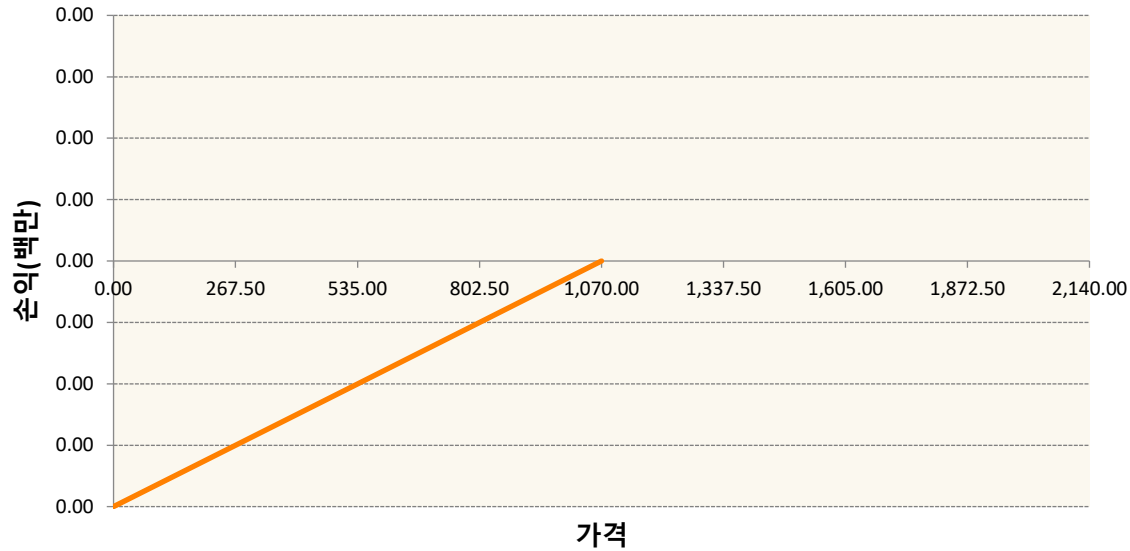
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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							796
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-439	-495	-553	-612	-673	-734	-796
-5.33%	-188	-252	-316	-381	-446	-512	-578
-2.67%	28	-40	-109	-177	-245	-314	-382
0%	208	139	69	0	-69	-139	-208
2.67%	353	286	219	151	82	14	-55
5.33%	467	405	342	277	212	145	78
8.00%	553	498	441	381	320	257	193
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							1,156
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-646	-726	-808	-893	-980	-1,067	-1,156
-5.33%	-279	-370	-463	-556	-650	-744	-839
-2.67%	37	-61	-160	-258	-357	-456	-554
0%	301	201	100	0	-100	-201	-301
2.67%	514	417	319	221	122	22	-77
5.33%	682	592	500	406	311	214	117
8.00%	810	730	646	559	470	379	286
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							413
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-228	-257	-287	-318	-349	-381	-413
-5.33%	-98	-131	-164	-198	-232	-266	-300
-2.67%	15	-21	-56	-92	-127	-163	-198
0%	108	72	36	0	-36	-72	-108

2.67%	183	149	114	78	43	7	-29
5.33%	242	210	177	144	110	75	41
8.00%	287	259	229	198	166	134	100

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

(단위:백만원)

3,287

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

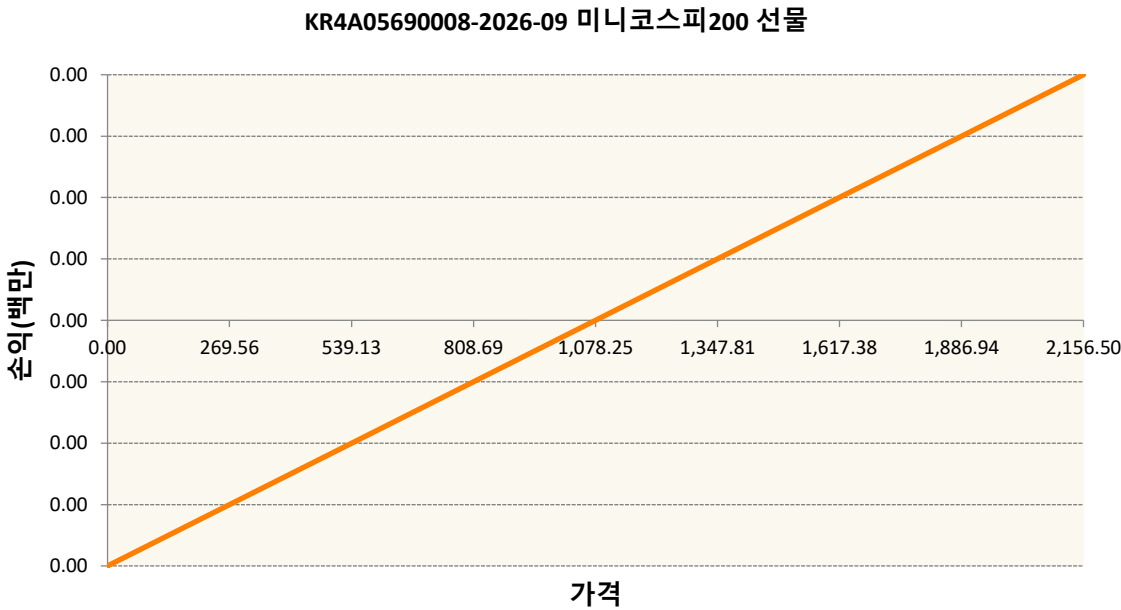
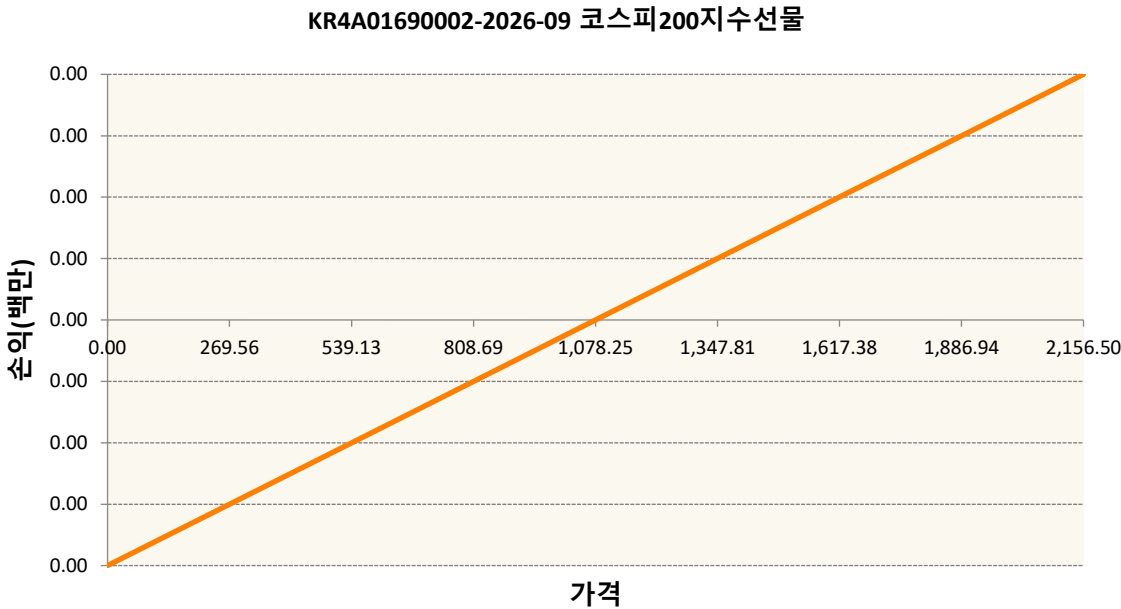
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

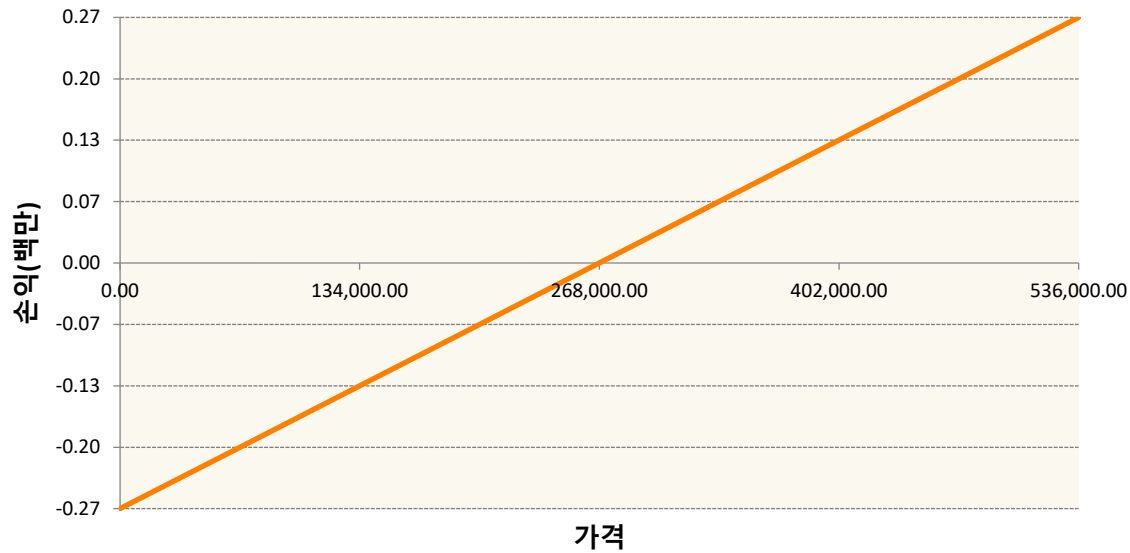
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	281	-281	장내
누계	유가증권	선물	1,404	0	1,404	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002 2026-09 코스피200지수선물								65
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	43	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	65	65	65	65	65	65	65	65
KR4A05690008 2026-09 미니코스피200 선물								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	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	6	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9	9
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
-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
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)

260

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

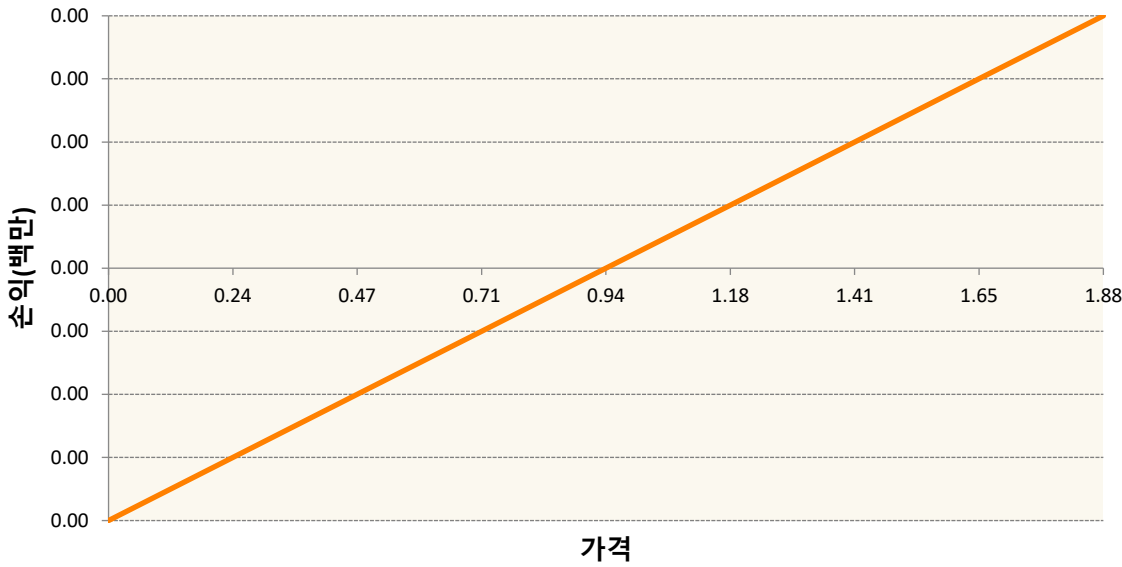
1. 계약금액

(단위:백만원)

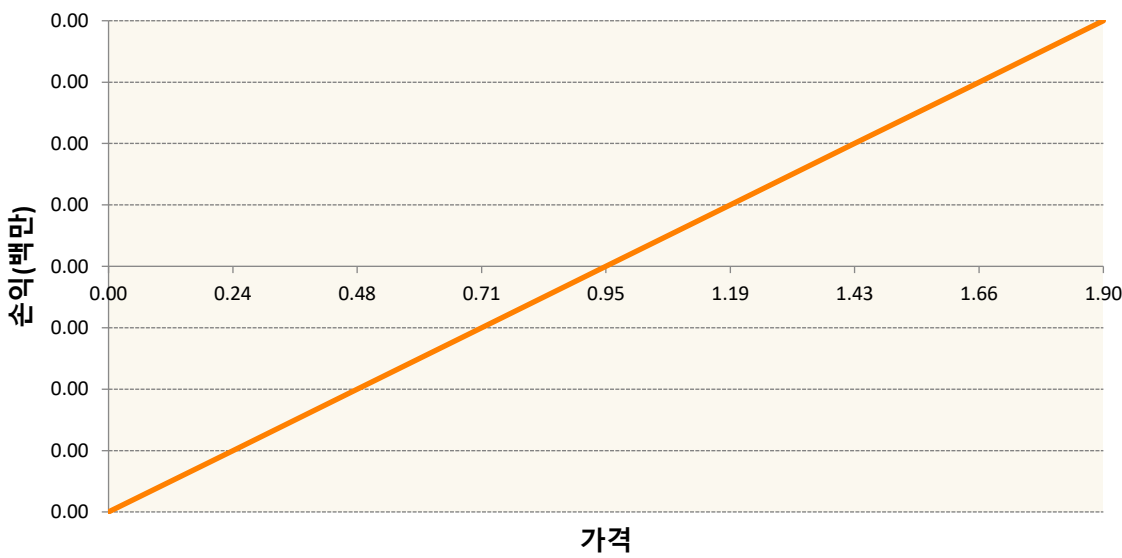
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,150	0	7,150	장외

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(		455
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		115

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	633

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

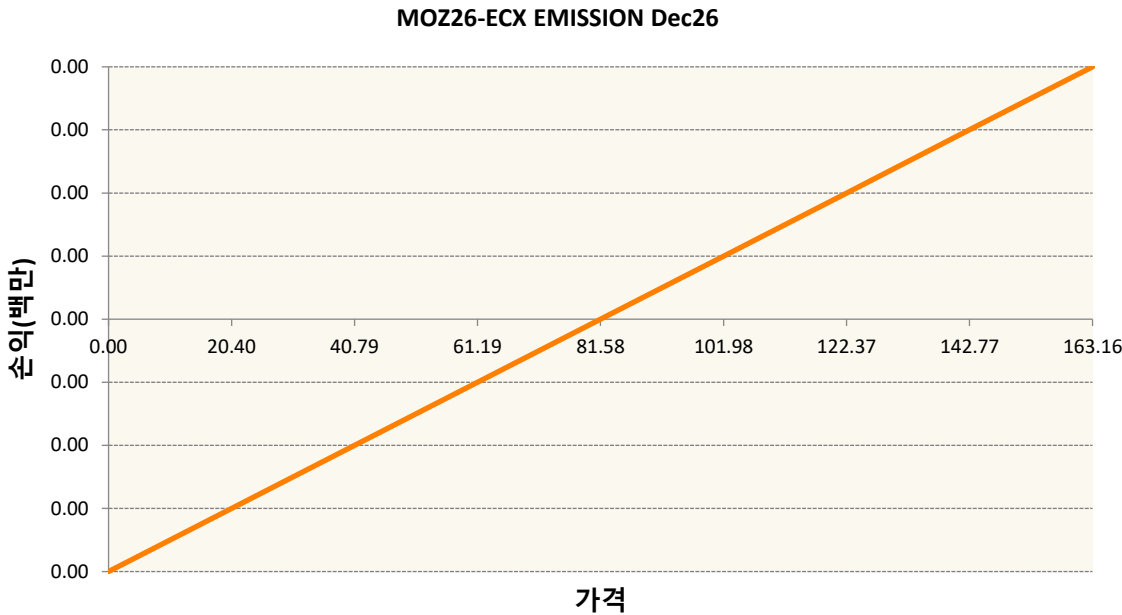
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,278	0	5,278	
누계	통화	선도	0	2,565	-2,565	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G7XIKRW/EUR 31-08-26E	205
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	422

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

(단위:백만원)

688

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

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	20
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	29

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

(단위:백만원)

192

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

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	-3,343	0	-3,343	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	15
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	137
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	117

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

(단위:백만원)

503

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

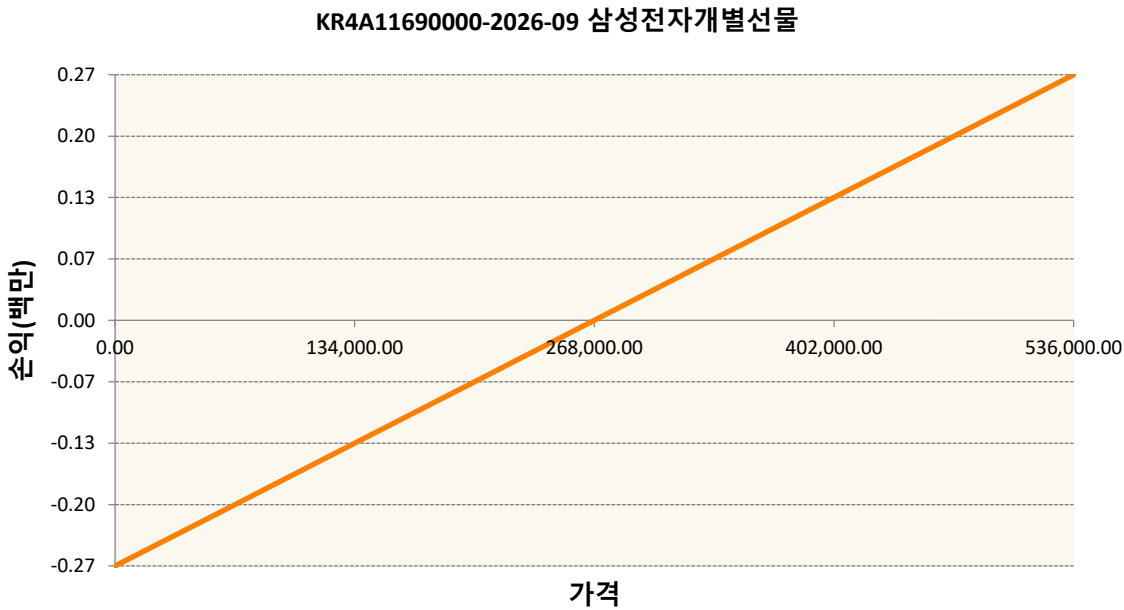
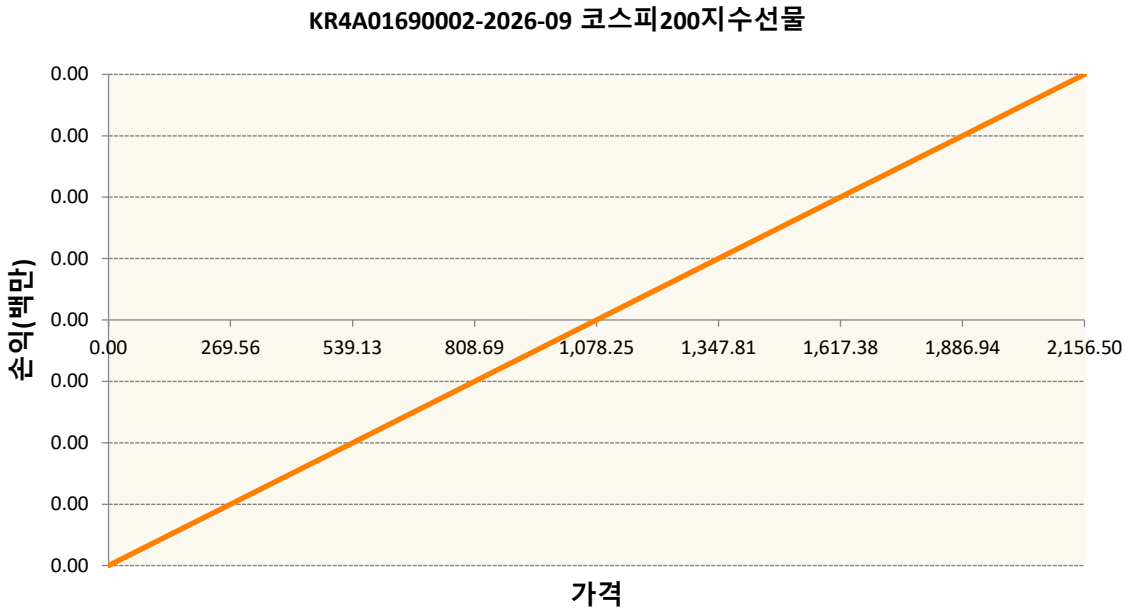
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

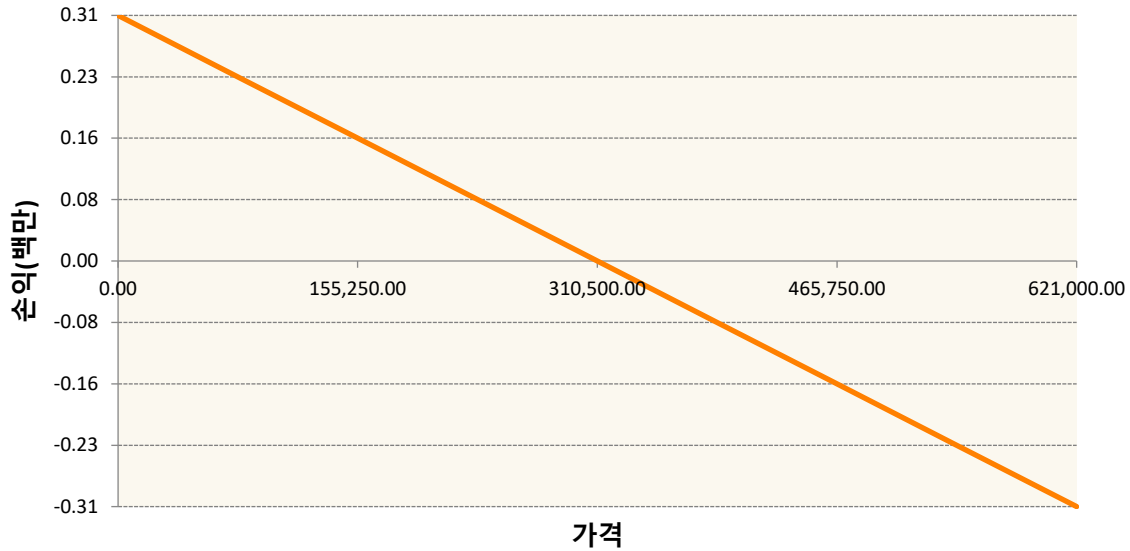
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	24,992	1,540	23,453	장내

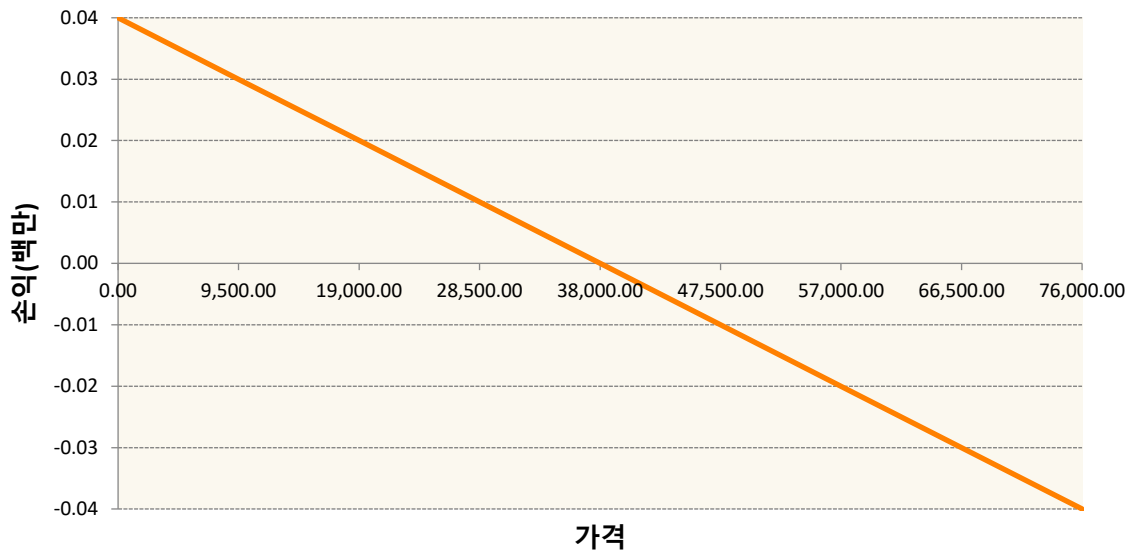
2. 만기시점의 손익구조



KR4ABD690005-2026-09 삼성생명개별선물



KR4ACF690002-2026-09 카카오개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물			1,688
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688	-1,688
-5.33%	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125
-2.67%	-563	-563	-563	-563	-563	-563	-563
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	563	563	563	563	563	563	563
5.33%	1,125	1,125	1,125	1,125	1,125	1,125	1,125
8.00%	1,688	1,688	1,688	1,688	1,688	1,688	1,688
KR4A11690000				2026-09 삼성전자개별선물			318
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
-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%	318	318	318	318	318	318	318
KR4ABD690005 2026-09 삼성생명개별선물							57

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57

KR4ACF690002 2026-09 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)

6,908

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

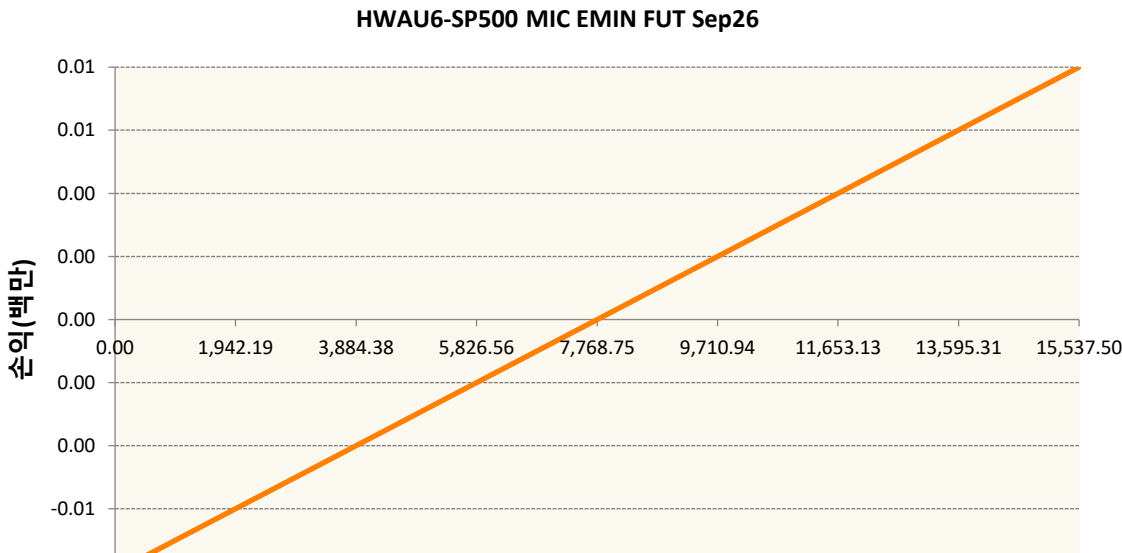
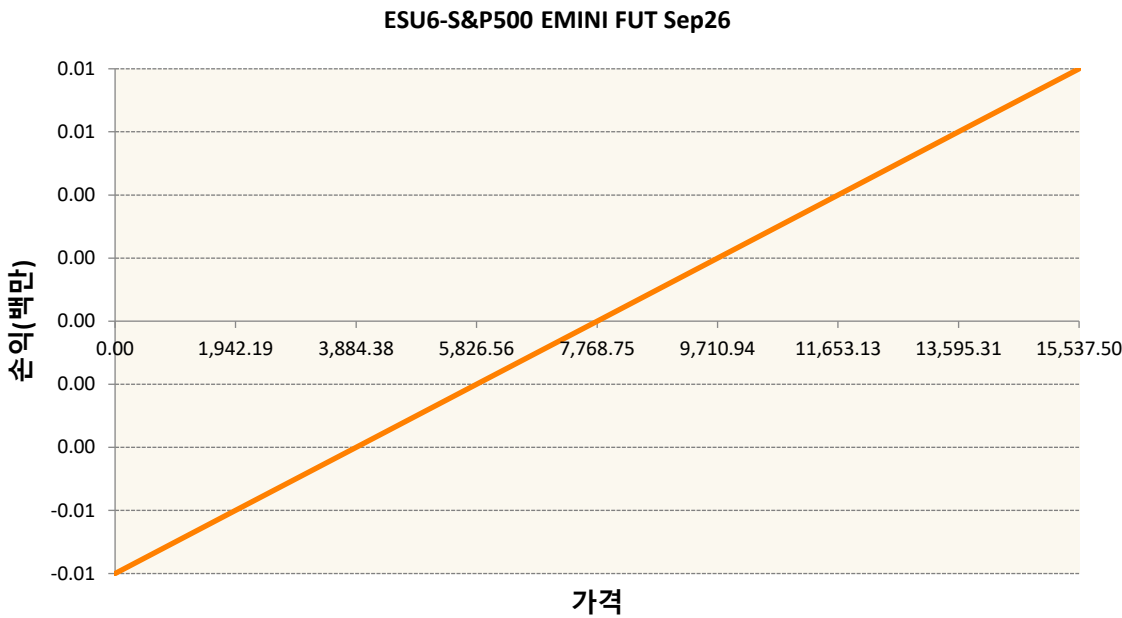
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

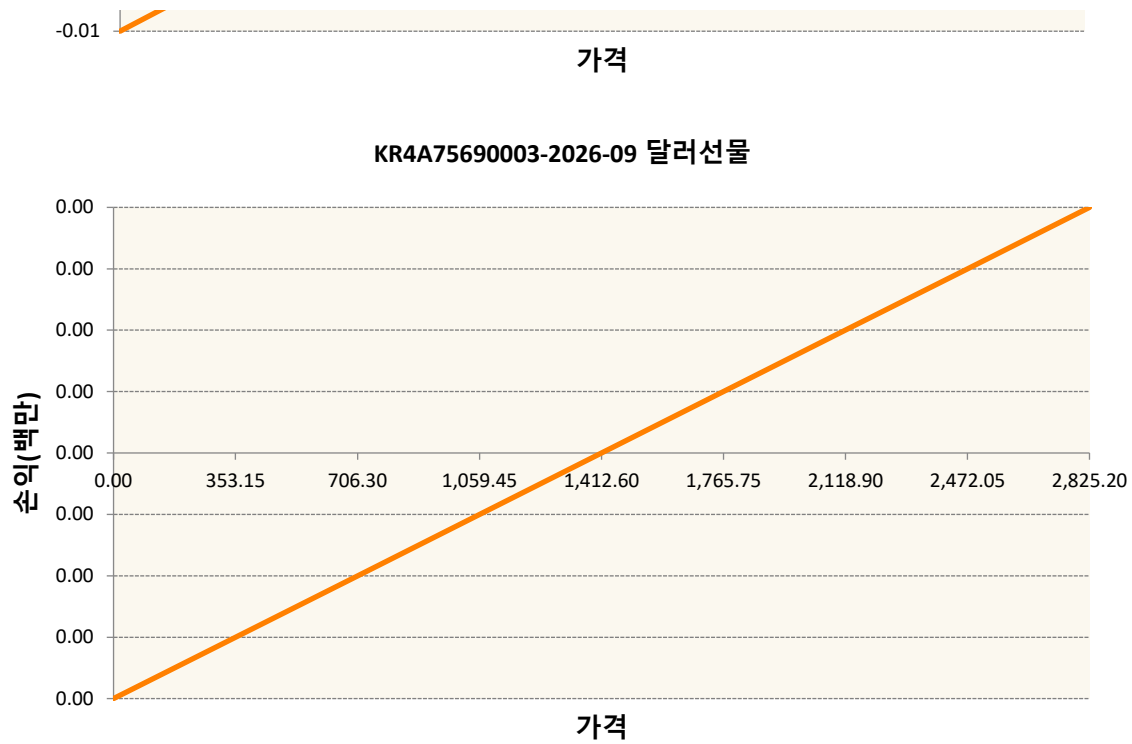
1. 계약금액

(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	72,042	0	72,042	
누계	지수	선물	178	0	178	장내
누계	통화	선물	10,736	0	10,736	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		5,763
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		14
KR4A756900 2026-09 달러선물			859

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,886

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

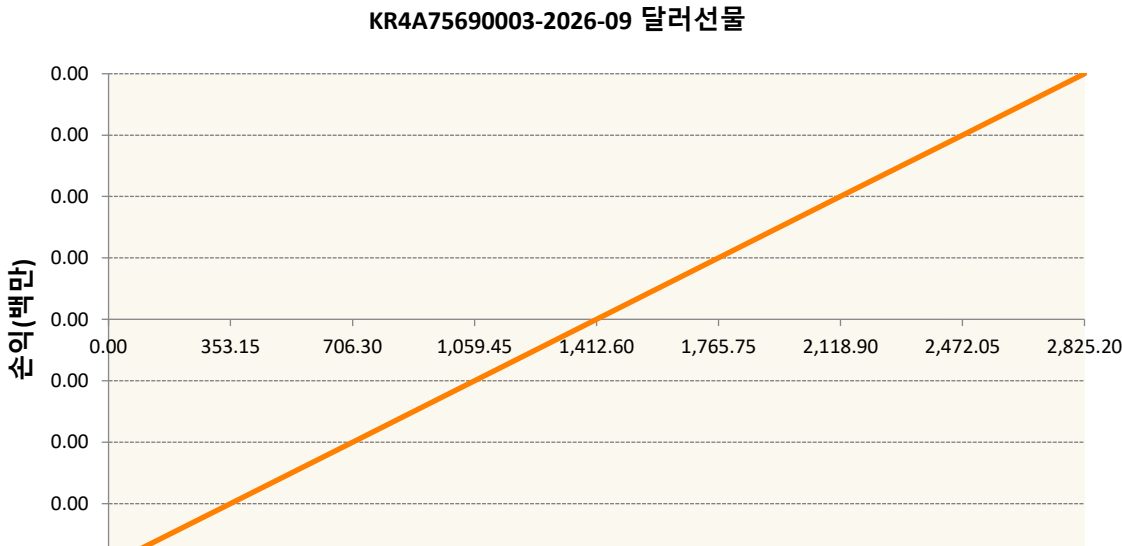
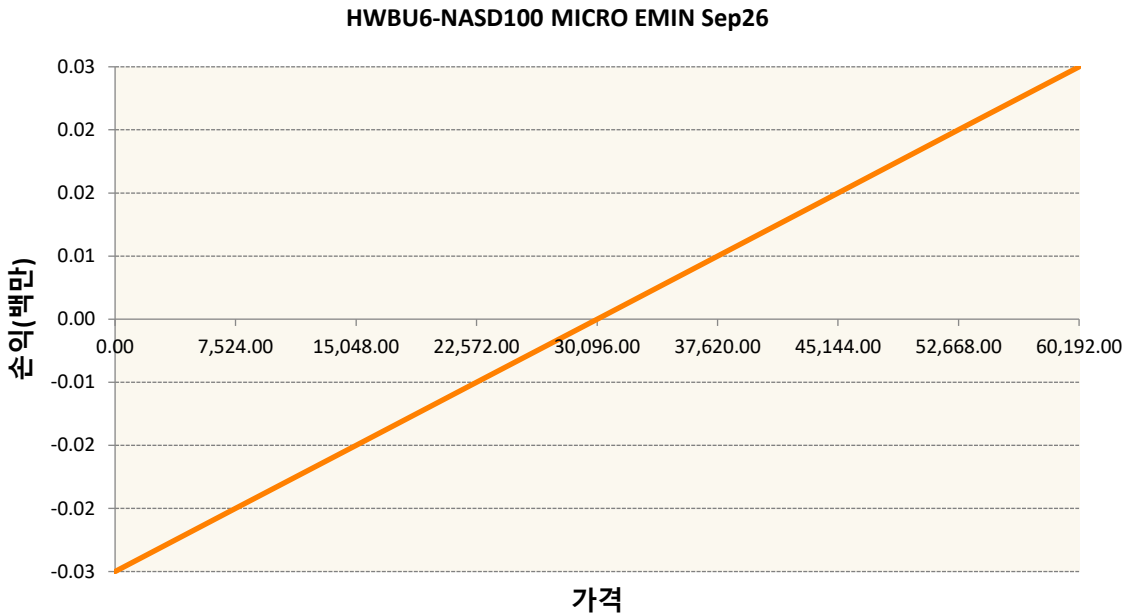
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

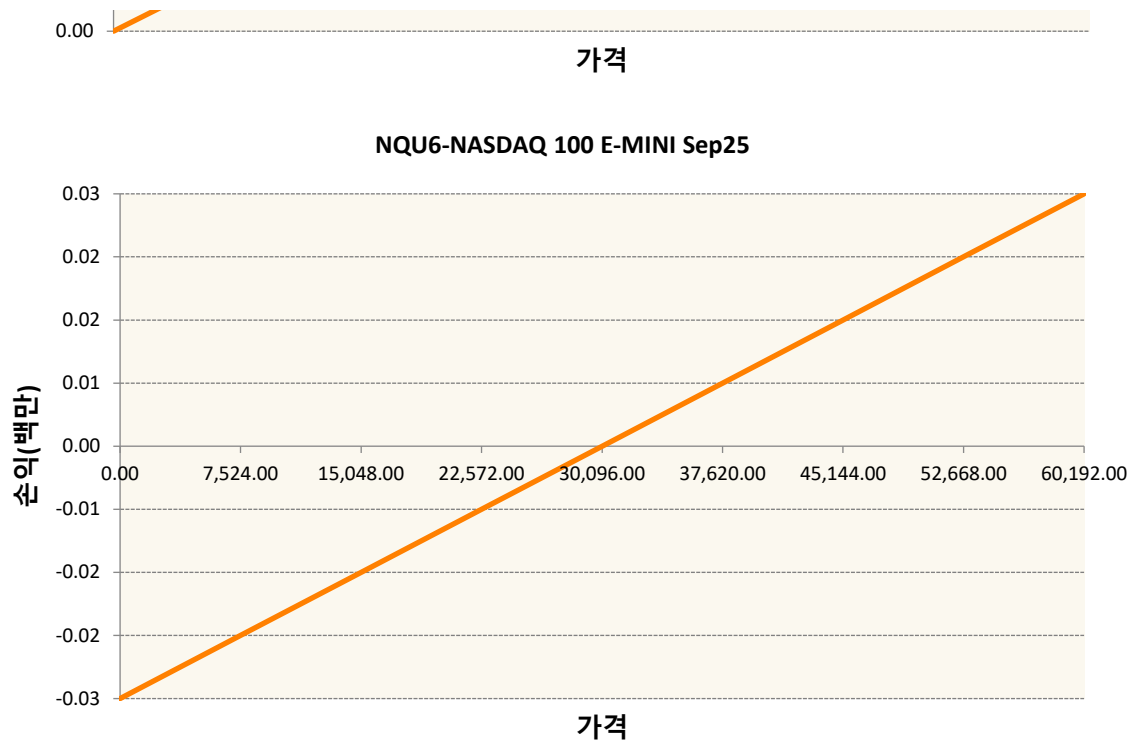
1. 계약금액

(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	722	0	722	장내
누계	지수	선물	34,610	0	34,610	
누계	통화	선물	4,040	0	4,040	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26	58
KR4A756900	2026-09 달러선물	323
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	2,769

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

3,163

공시일	2026-08-19
기준일	2026-08-18

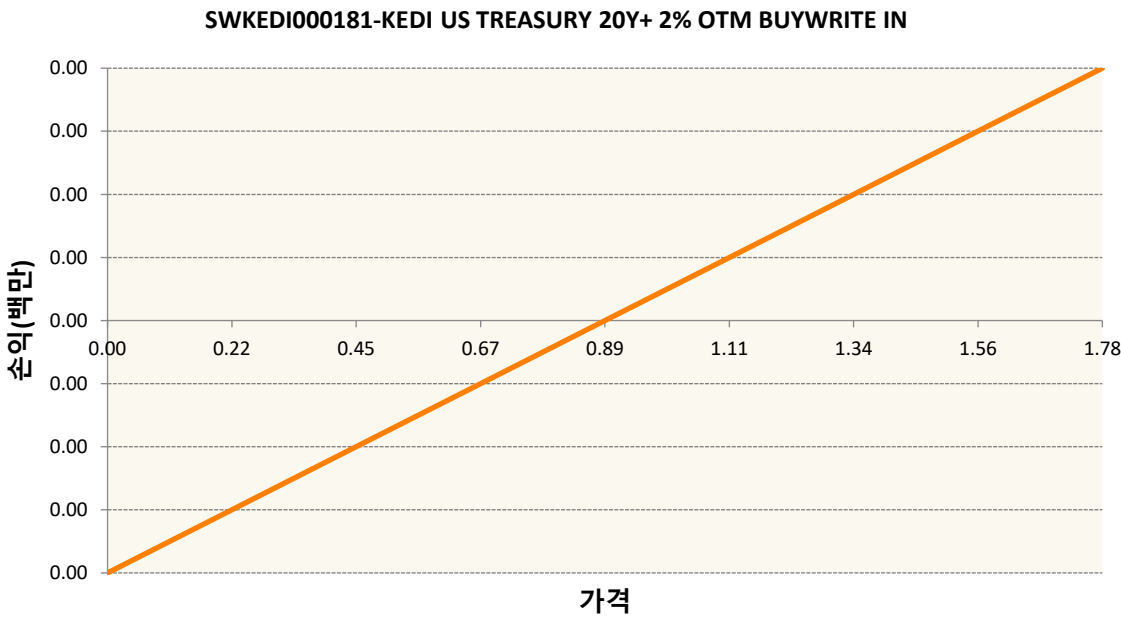
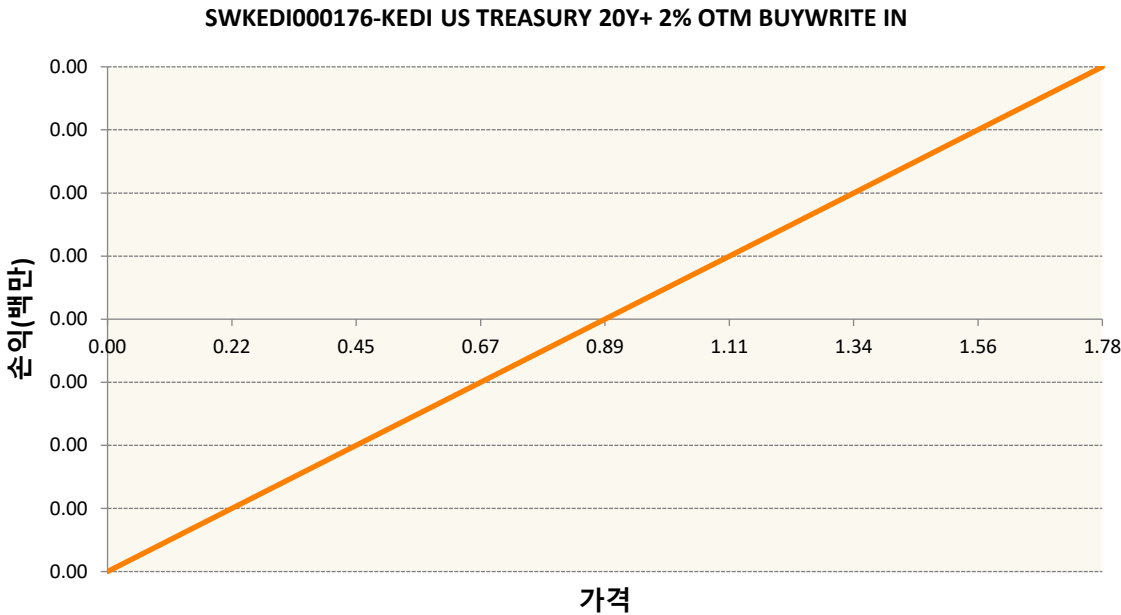
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

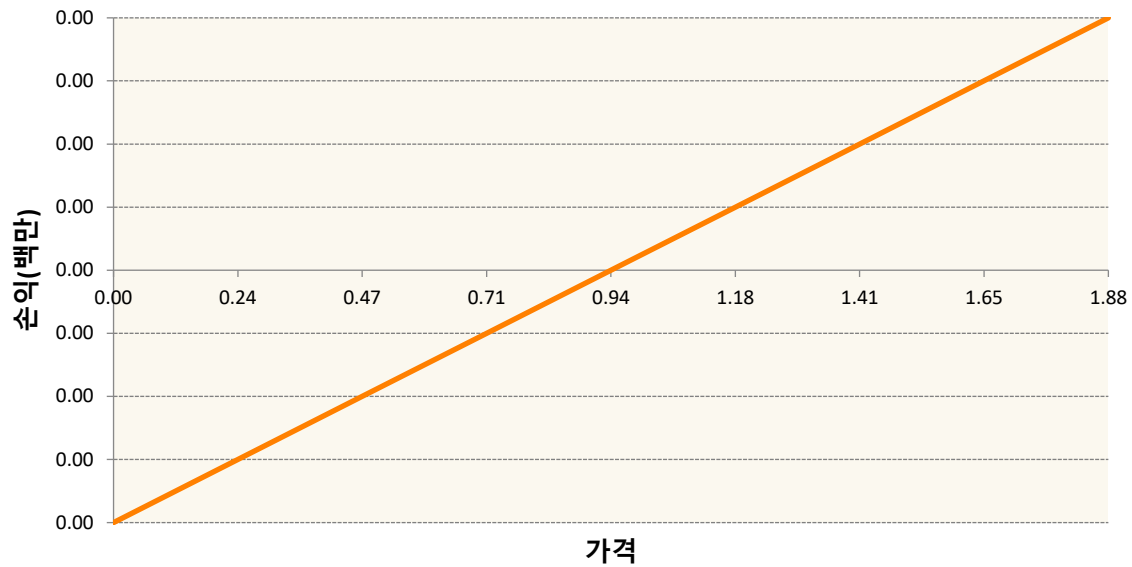
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	282,263	0	282,263	장외

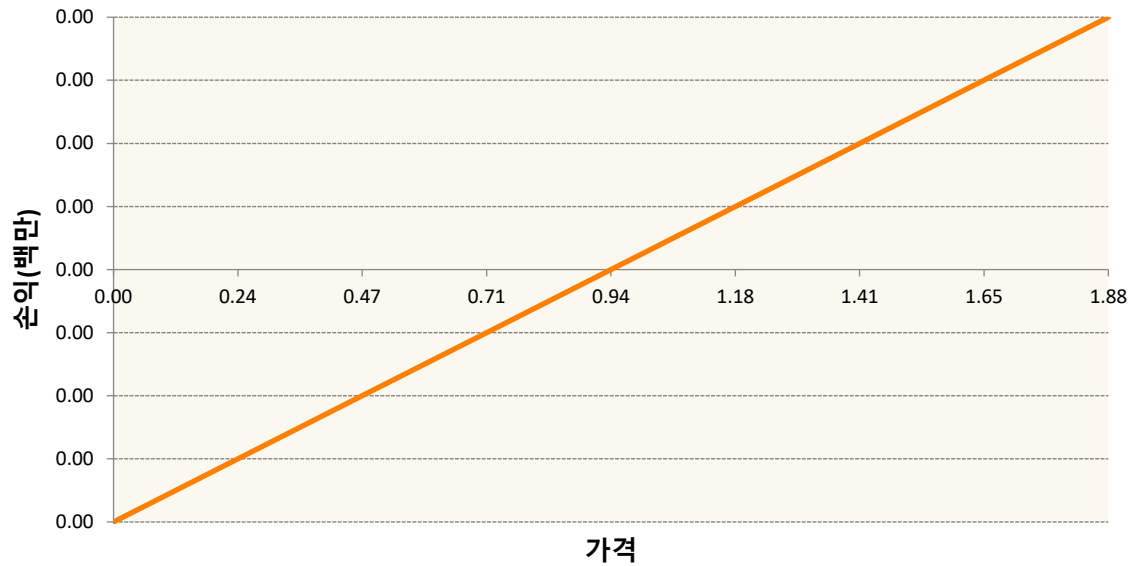
2. 만기시점의 손익구조



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	7,262
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,850
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,380
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,156

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

(단위:백만원)

9,752
