

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

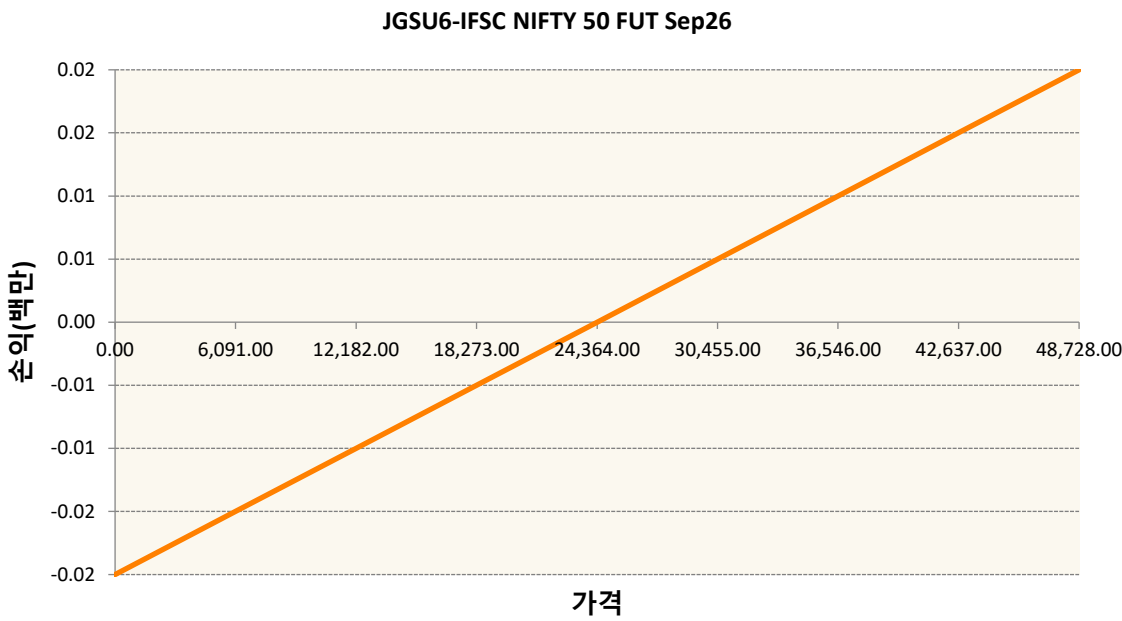
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	338	0	338	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSU6	IFSC NIFTY 50 FUT Sep26	27
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

19

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

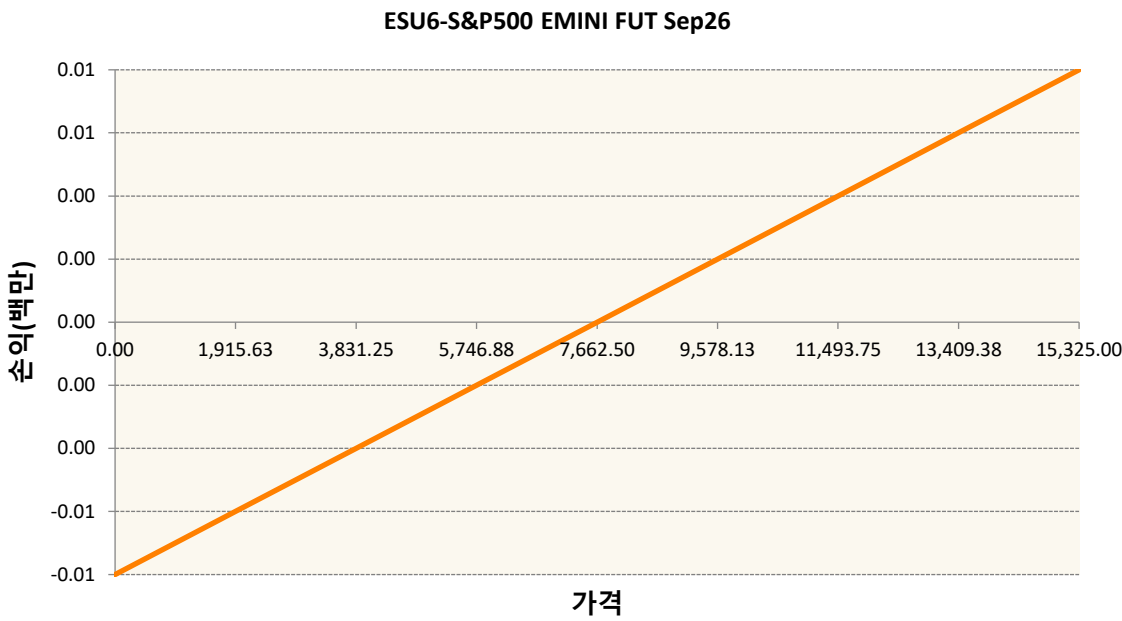
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	585	0	585	

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)

39

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

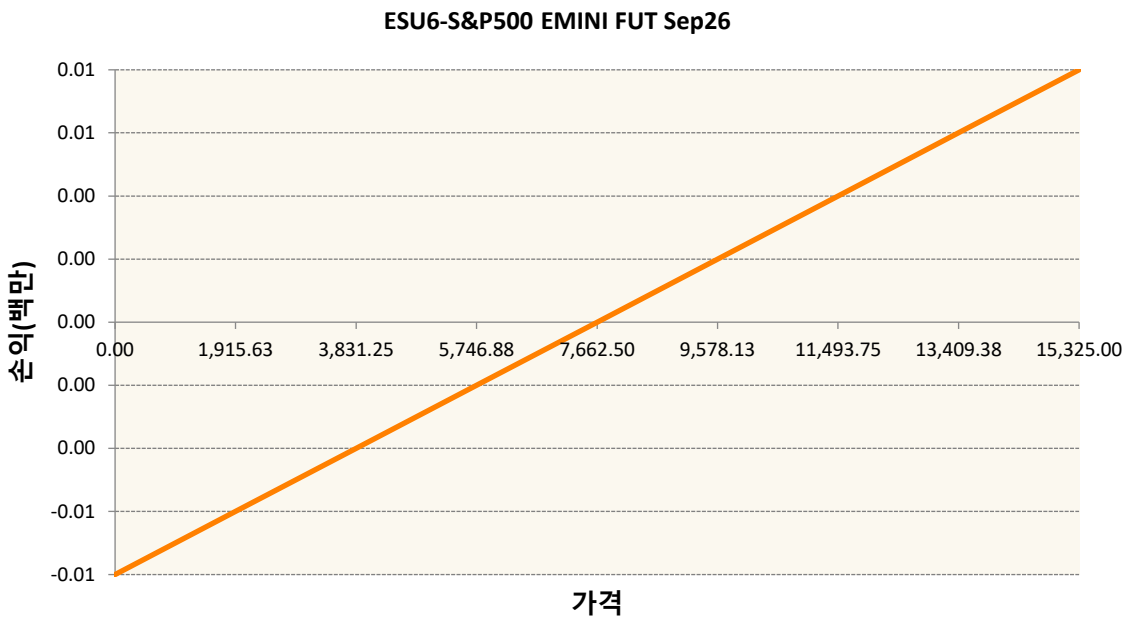
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	578	0	578	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	46
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

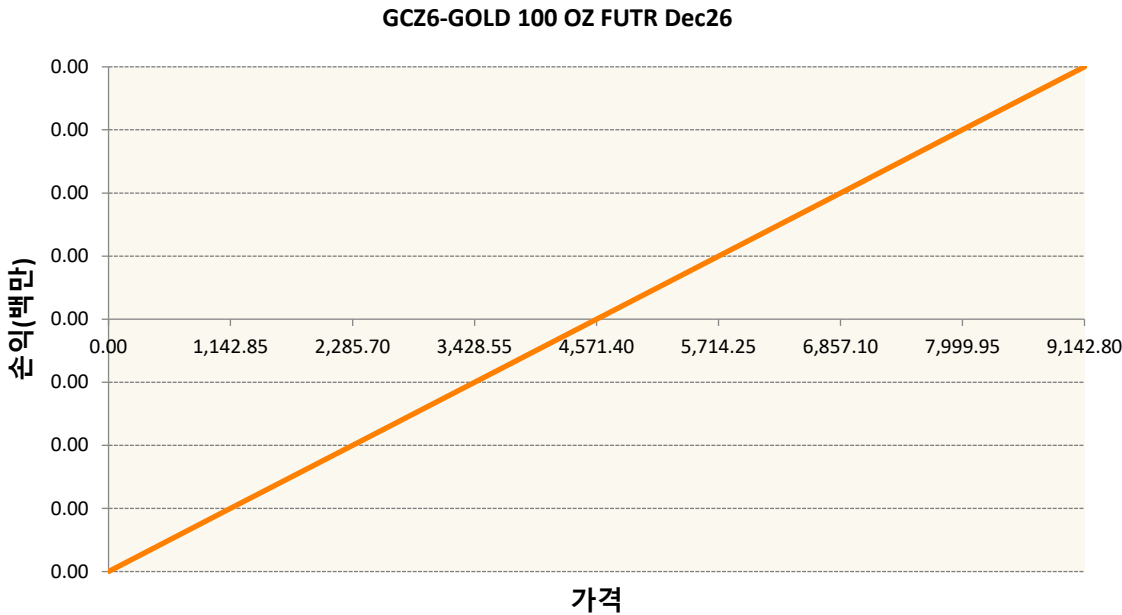
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,237	0	5,237	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCA GLD US 08/21/26 C400 EQUITY	2
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	419

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

(단위:백만원)

552

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

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	35
AOPLTRPUS' PLTR US 08/21/26 P185 EQUITY	20
AOPLTUSAC' PLTR US 08/21/26 C180 EQUITY	1
AOPLTUSAP' PLTR US 08/21/26 P180 EQUITY	10

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

(단위:백만원)

226

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

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

0.37

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

(단위:백만원)

0

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

(단위:백만원)

14,064

공시일 2026-08-24

기준일 2026-08-21

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	2026-08-24
기준일	2026-08-21

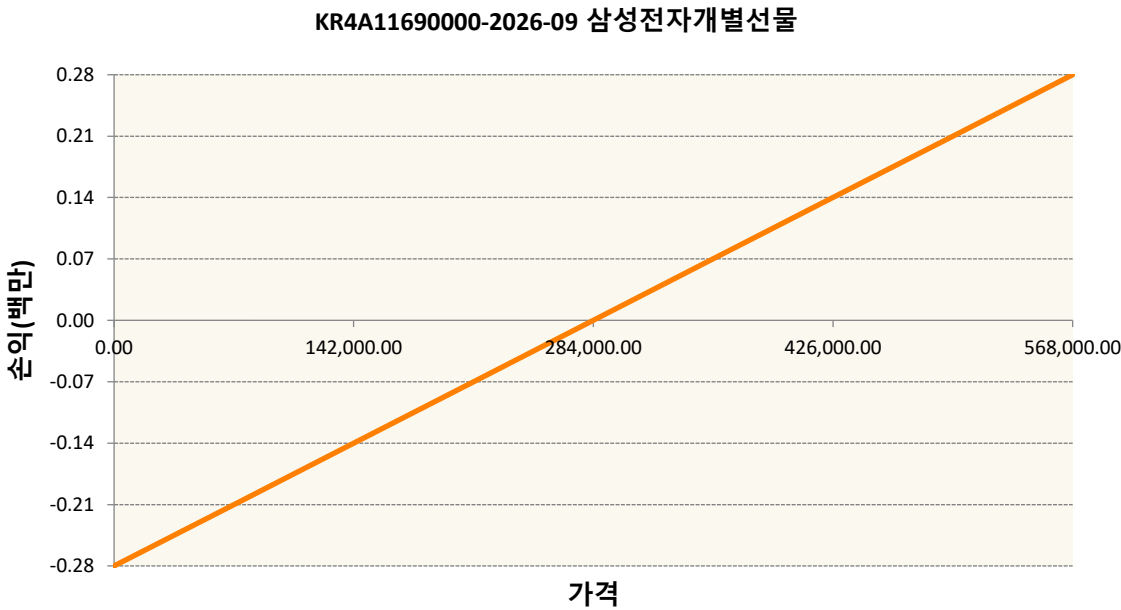
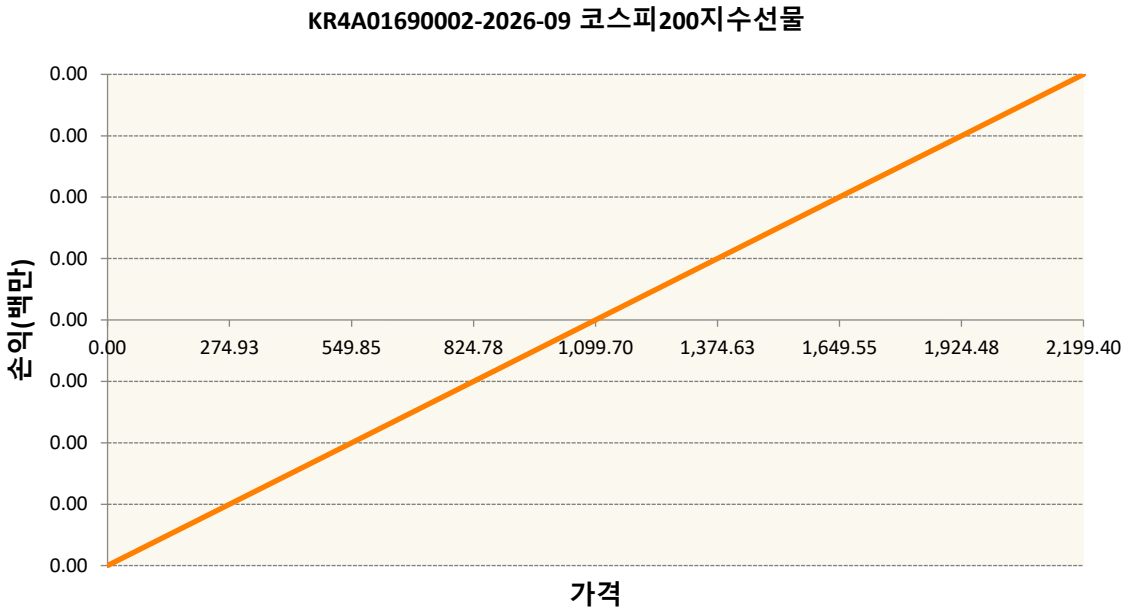
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	22,484	0	22,484	장내
누계	유가증권	옵션	0	55,529	-55,529	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,170.00 with major ticks every 271.25 units. The y-axis, labeled '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A blue line starts at the point (1,085.00, 0.00) and ends at the point (2,170.00, 0.00).

가격	손익 (백만)
1,085.00	0.00
2,170.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				570
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-570	-570	-570	-570	-570	-570	-570	
-5.33%	-380	-380	-380	-380	-380	-380	-380	
-2.67%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	190	190	190	190	190	190	190	
5.33%	380	380	380	380	380	380	380	
8.00%	570	570	570	570	570	570	570	
KR4A11690000				2026-09 삼성전자개별선물				1,216
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216	-1,216
-5.33%	-811	-811	-811	-811	-811	-811	-811
-2.67%	-405	-405	-405	-405	-405	-405	-405
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	405	405	405	405	405	405	405
5.33%	811	811	811	811	811	811	811
8.00%	1,216	1,216	1,216	1,216	1,216	1,216	1,216
KR4BAFBTA345 코스피위클리M C 2608W4 1,082.5							2,272

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	932	918	899	877	851	822	790
-5.33%	852	816	777	736	692	646	599
-2.67%	624	568	512	455	398	340	283
0%	173	116	58	0	-58	-117	-175
2.67%	-496	-536	-578	-624	-671	-720	-771
5.33%	-1,306	-1,325	-1,349	-1,377	-1,408	-1,443	-1,480
8.00%	-2,180	-2,187	-2,197	-2,210	-2,227	-2,248	-2,272
KR4BAFBTA352 코스피위클리M C 2608W4 1,085.0							1,498

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	594	585	573	559	543	524	504
-5.33%	546	523	498	471	443	413	383
-2.67%	404	367	330	293	255	217	179
0%	117	78	39	0	-39	-78	-118
2.67%	-318	-346	-375	-407	-439	-473	-507
5.33%	-852	-866	-883	-903	-924	-948	-974
8.00%	-1,432	-1,437	-1,445	-1,454	-1,467	-1,481	-1,498

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

(단위:백만원)

13,382

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

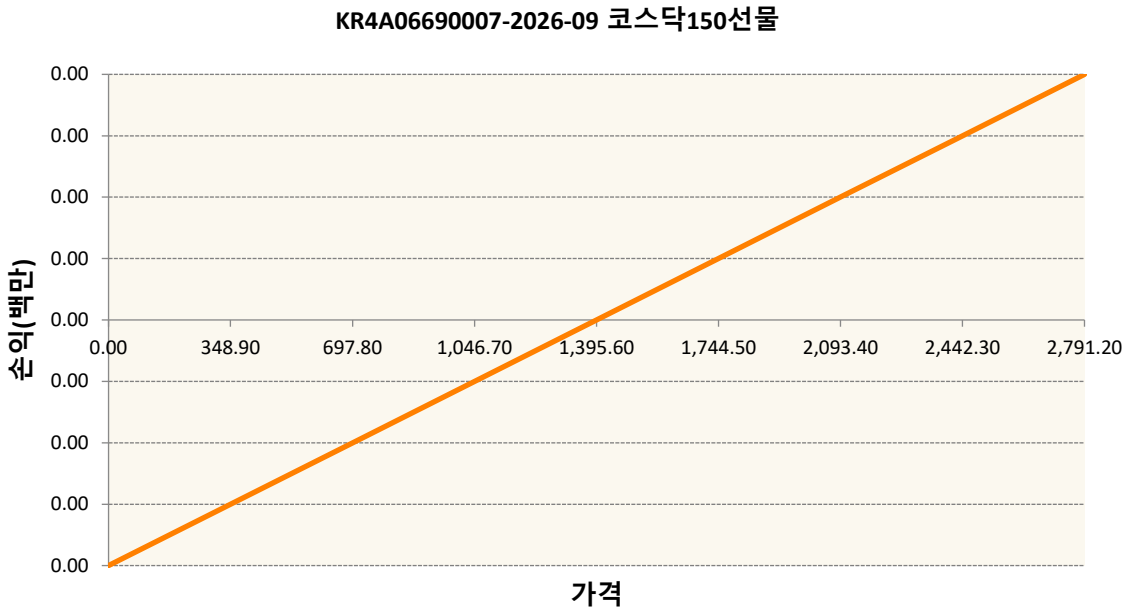
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	656	0	656	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007		2026-09 코스닥150선물					52
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	52	52	52	52	52	52	52

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

(단위:백만원)

19,253

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

(단위:백만원)

50,117

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

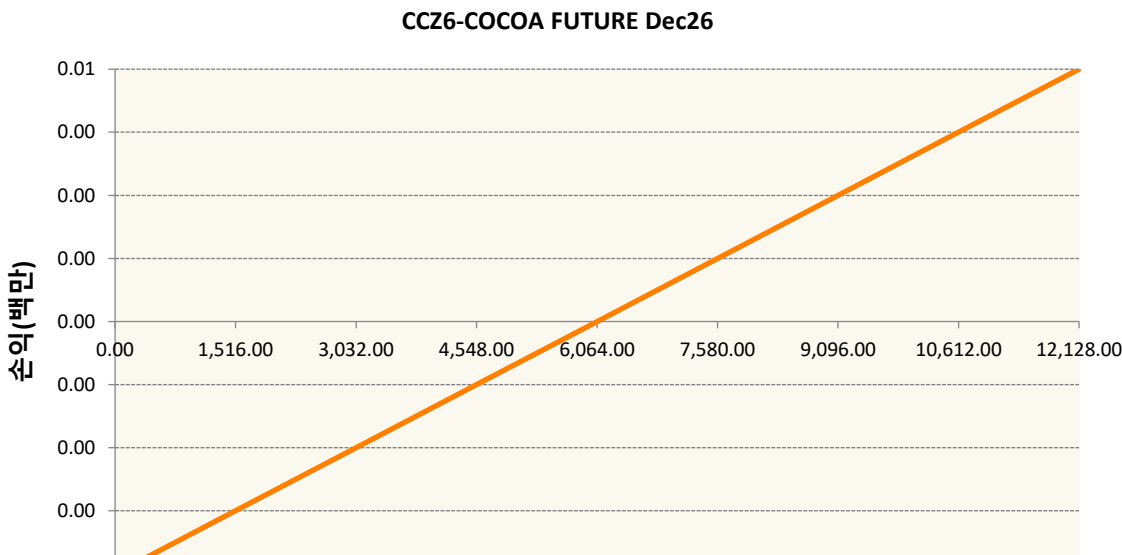
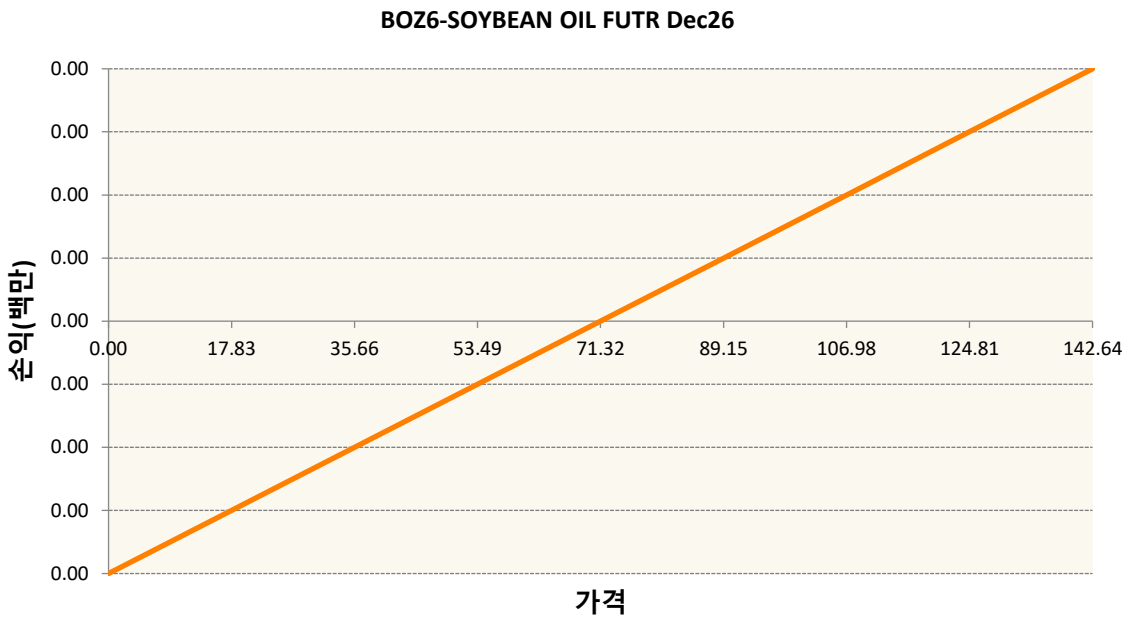
포커스농산물모(채권-파생형)

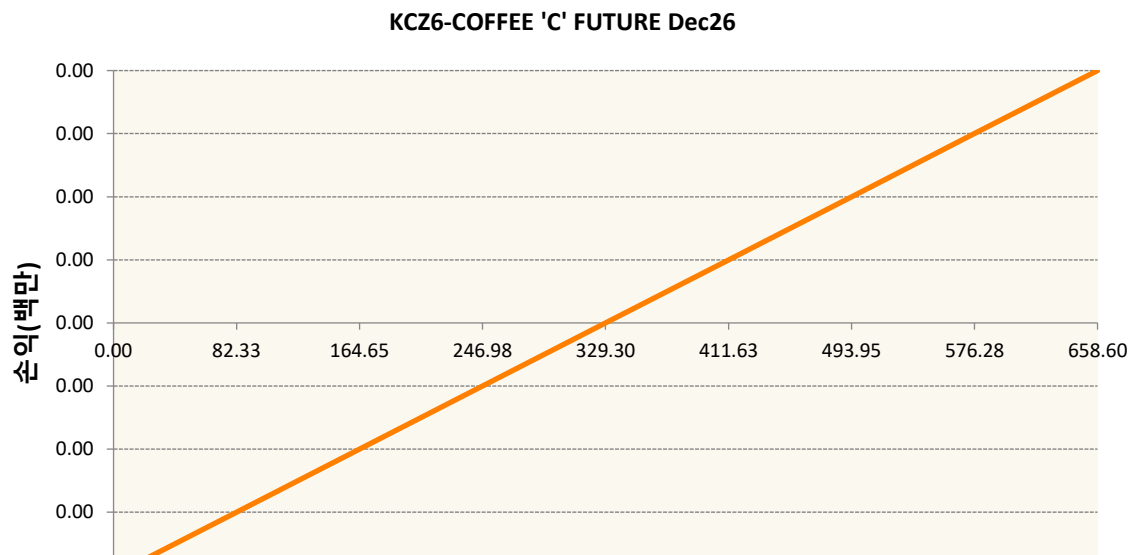
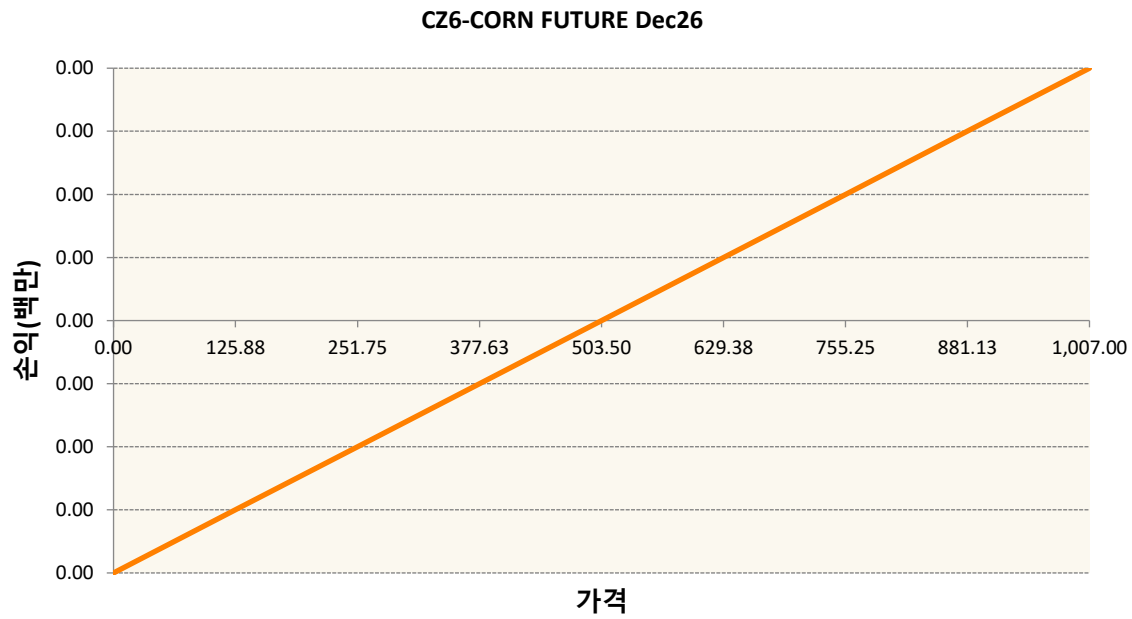
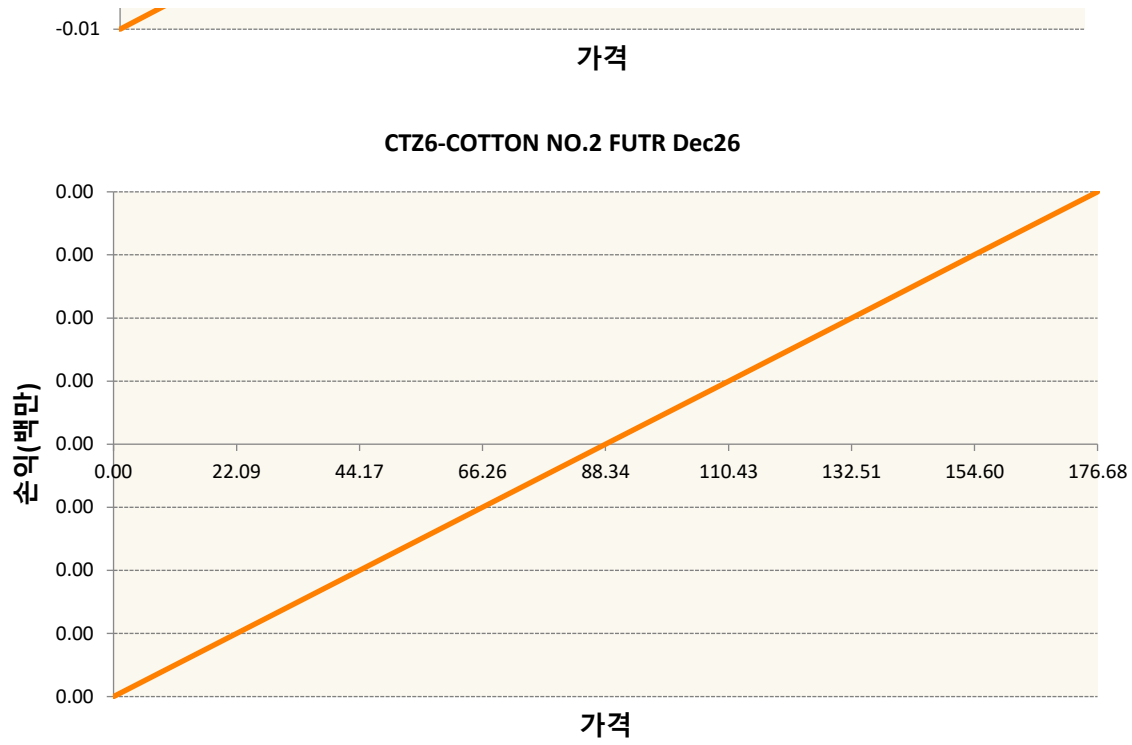
1. 계약금액

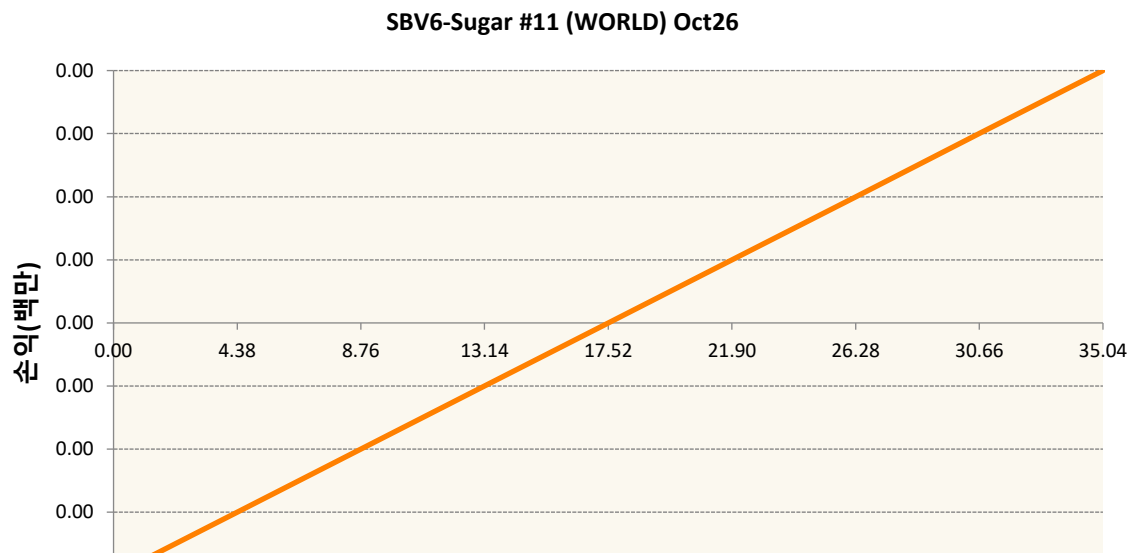
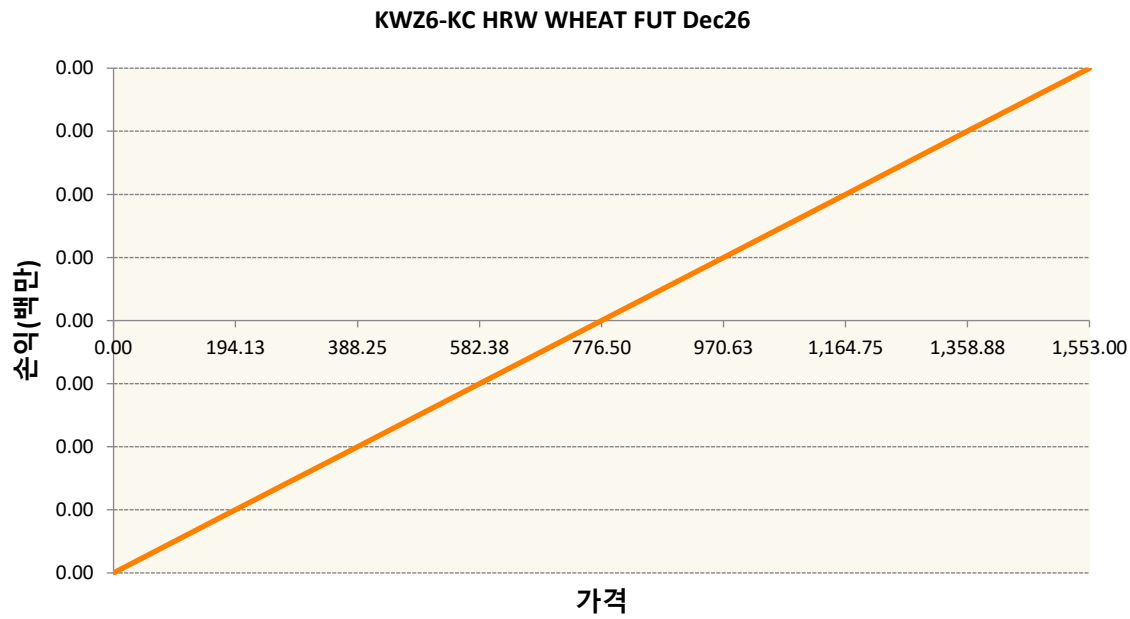
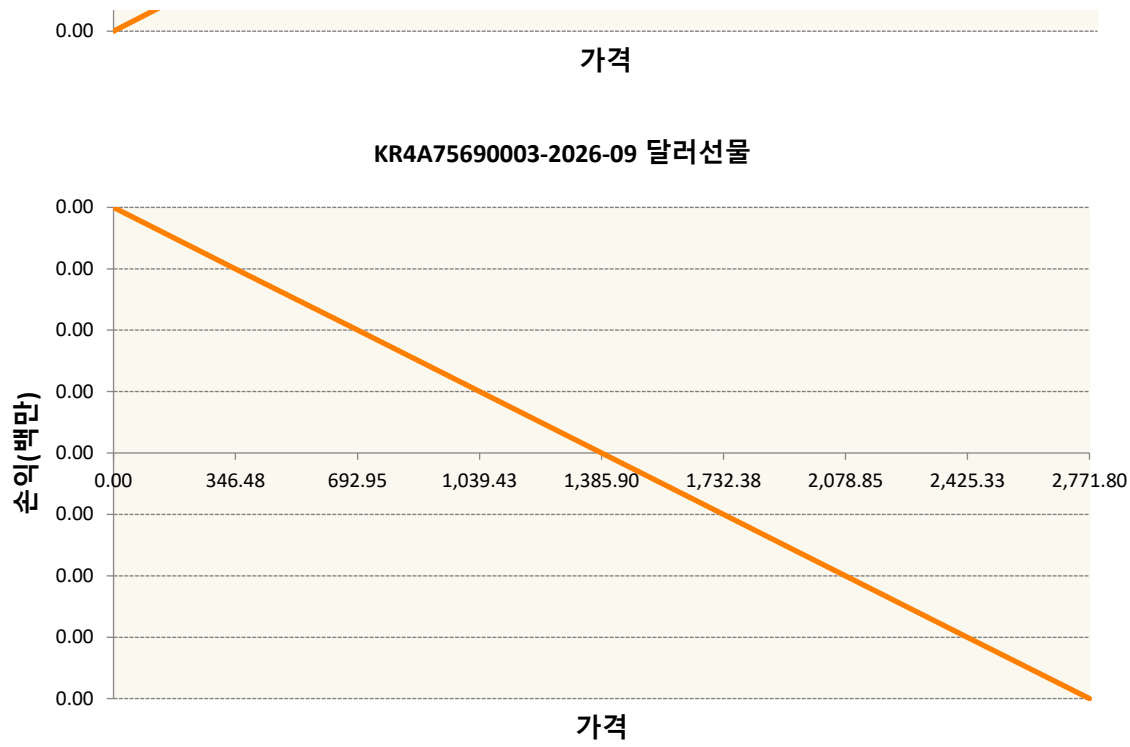
(단위:USD 백만)

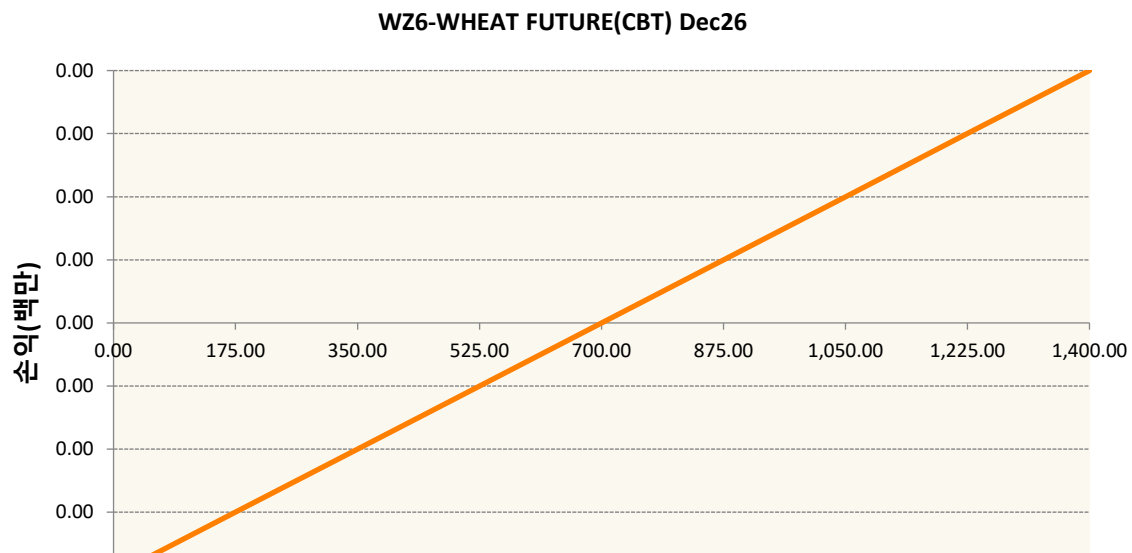
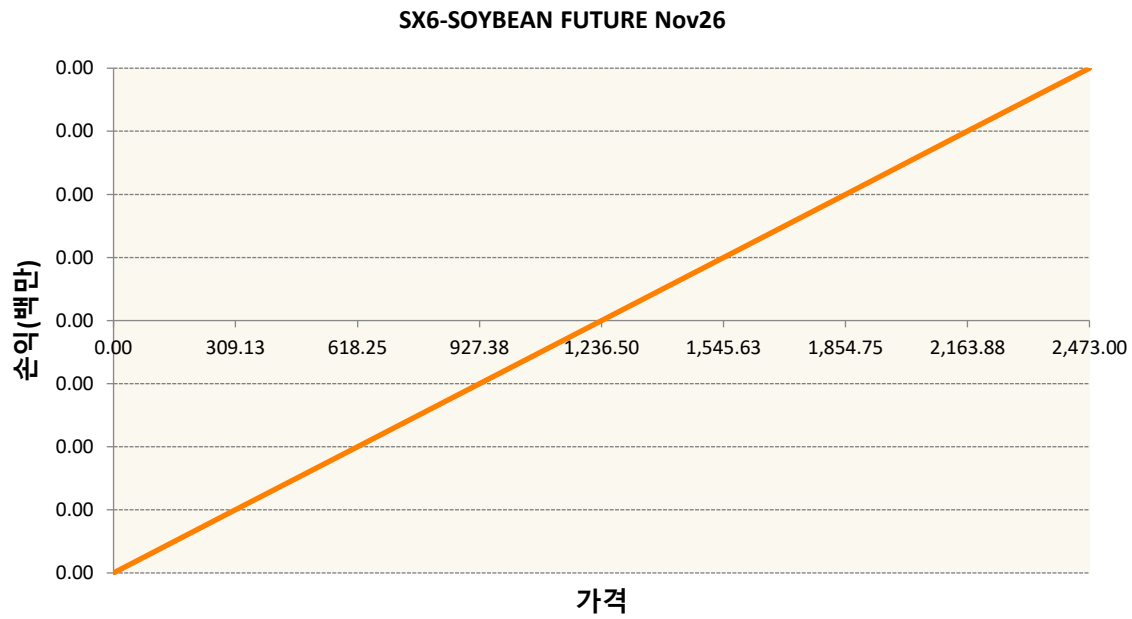
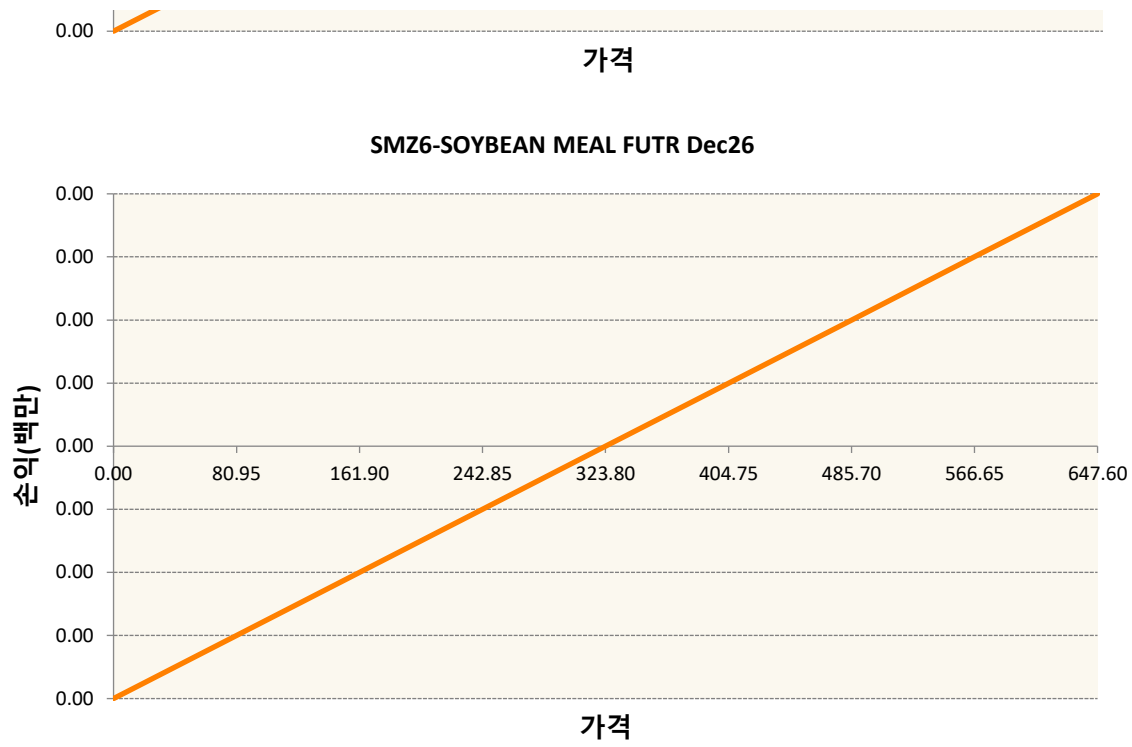
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	473	0	473	
누계	유가증권	선물	2,358	0	2,358	
누계	통화	선물	0	346	-346	장내

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	2026-08-24
기준일	2026-08-21

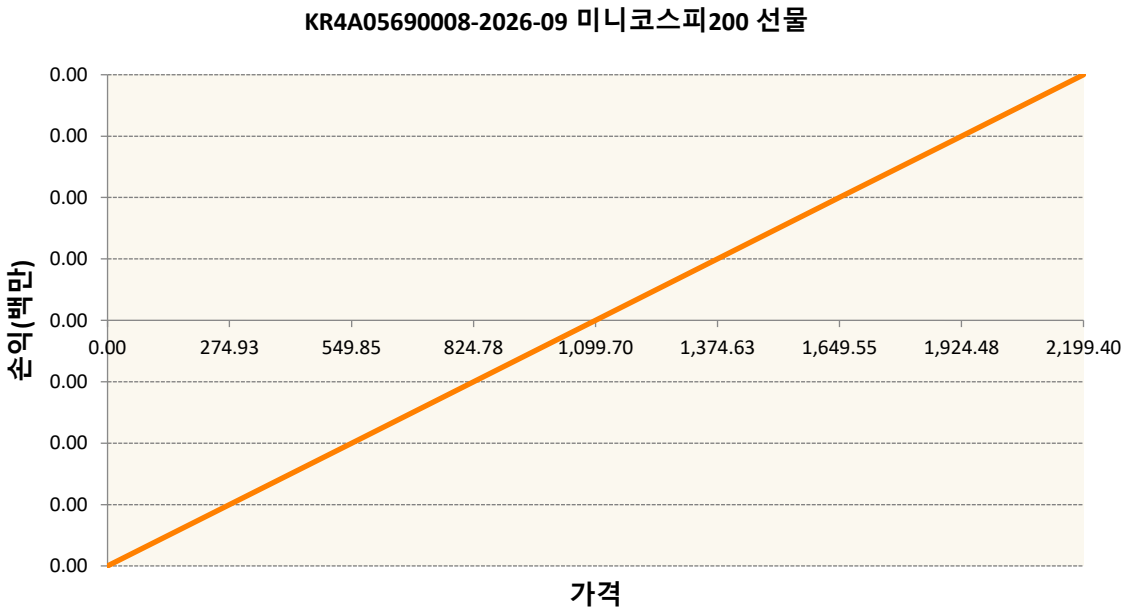
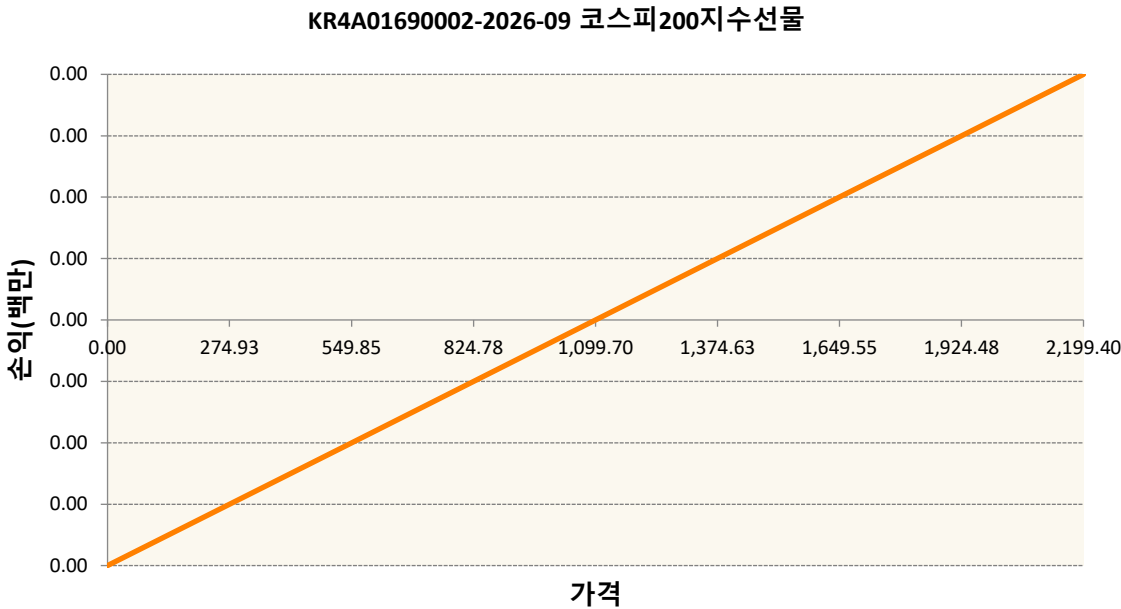
스마트인덱스모

1. 계약금액

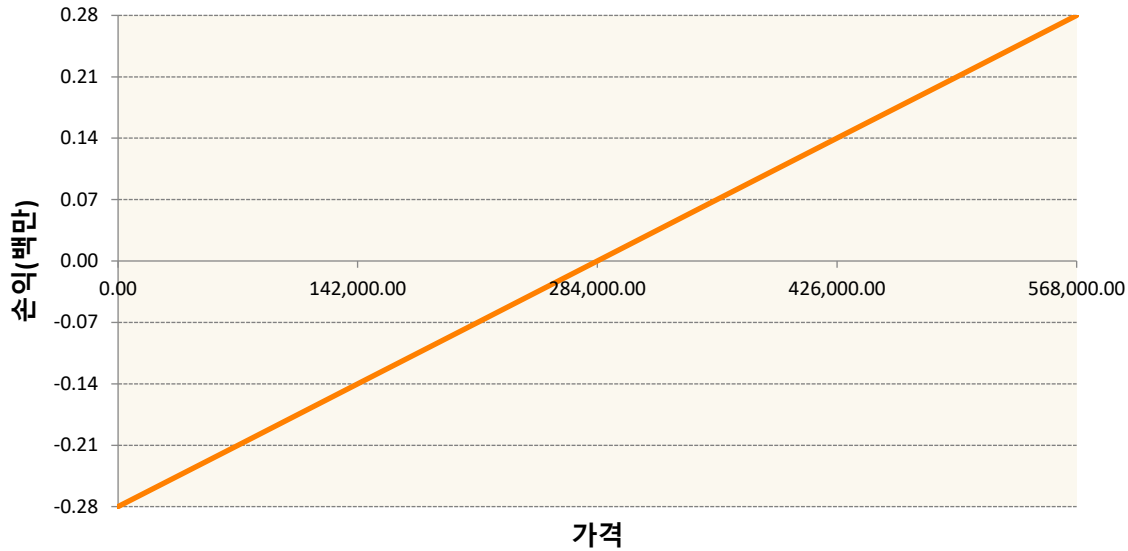
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,510	0	4,510	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물						197
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197	
-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%	197	197	197	197	197	197	197	
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

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

(단위:백만원)

797

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

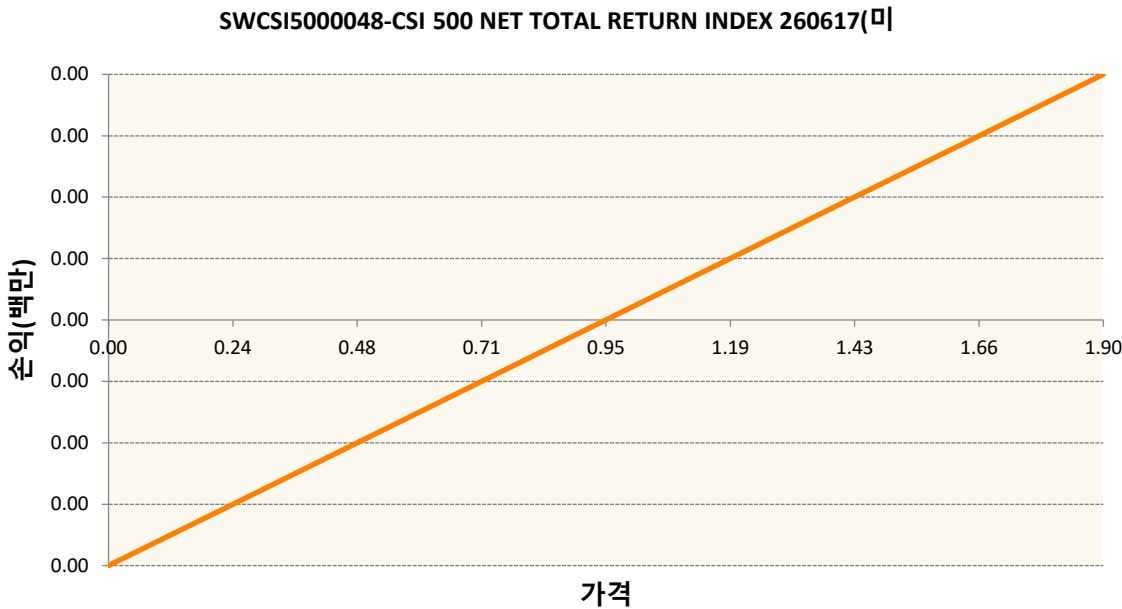
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,507	0	5,507	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

440

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

706

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

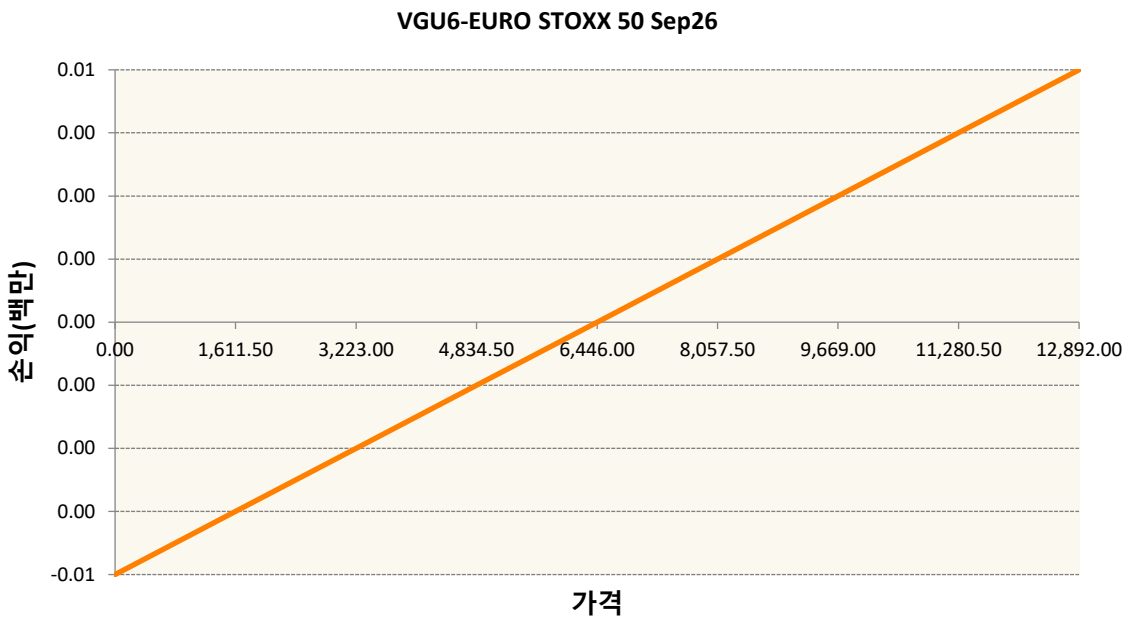
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,122	0	1,122	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	90
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

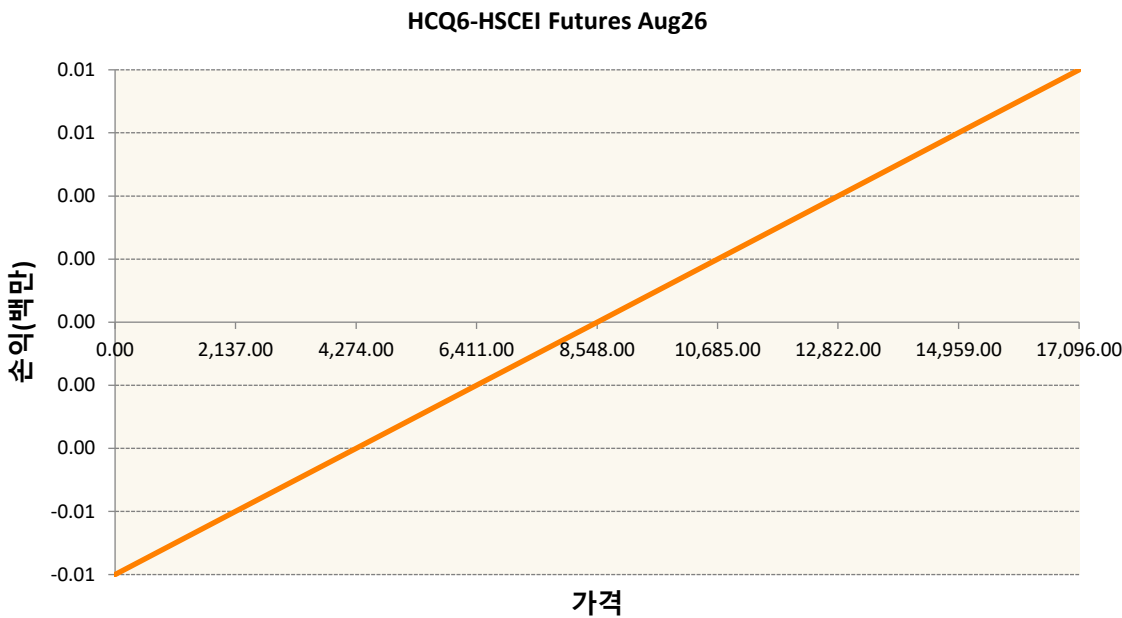
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,572	0	1,572	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ6	HSCEI Futures Aug26	126
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

143

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

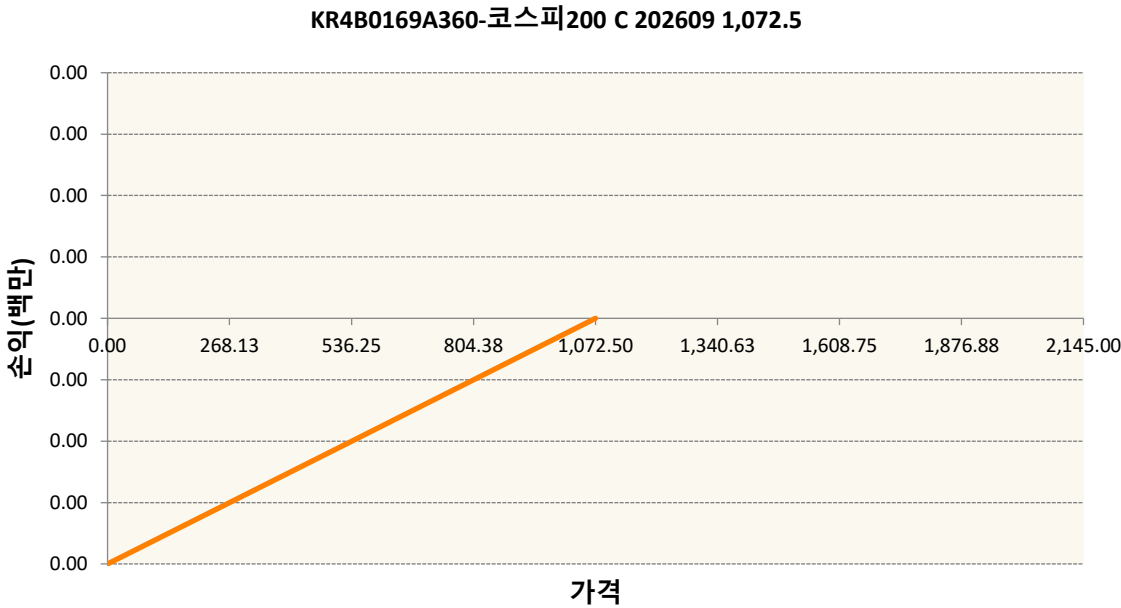
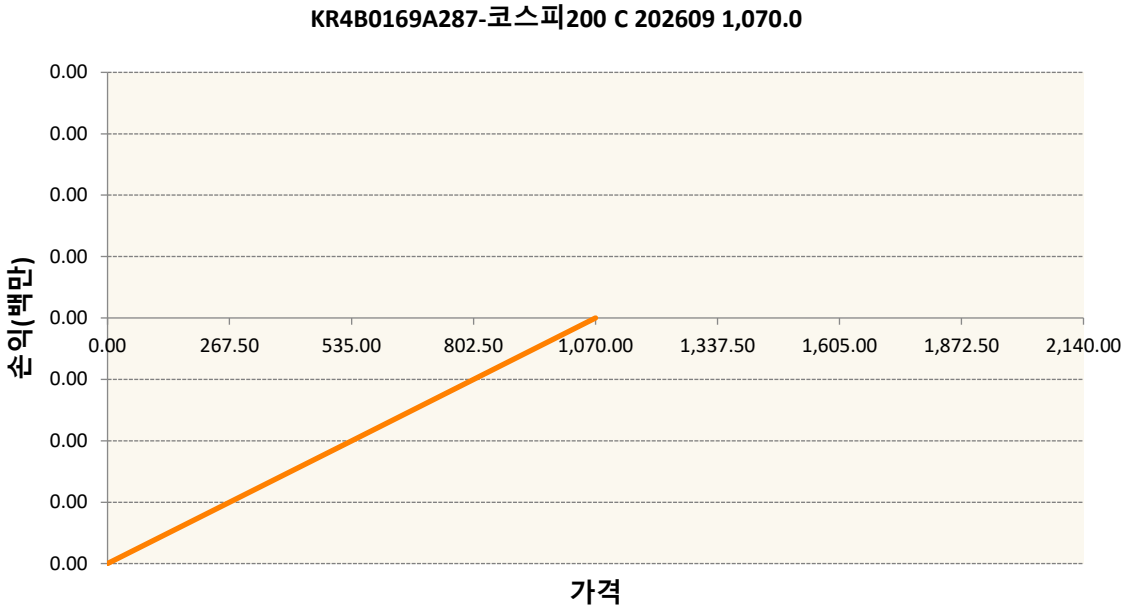
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

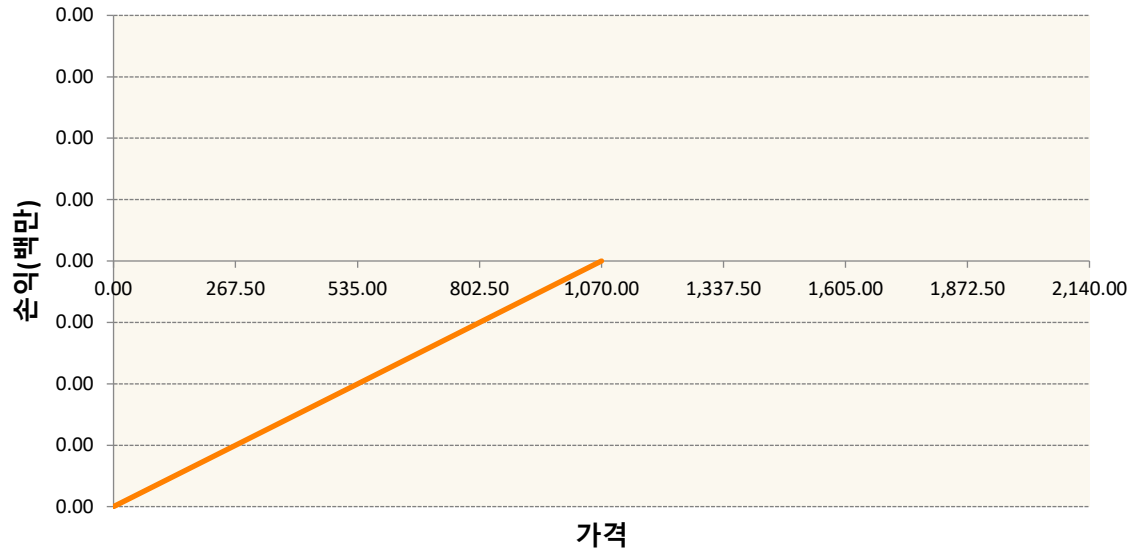
(단위:백만원)

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							762
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-423	-477	-532	-589	-646	-704	-762
-5.33%	-179	-240	-301	-362	-424	-486	-548
-2.67%	25	-39	-102	-166	-230	-294	-358
0%	190	127	63	0	-64	-127	-191
2.67%	317	259	199	138	77	15	-48
5.33%	412	361	306	250	193	134	75
8.00%	480	437	390	340	288	234	178
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							1,109
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-622	-700	-779	-860	-942	-1,025	-1,109
-5.33%	-266	-353	-441	-530	-618	-707	-797
-2.67%	33	-59	-151	-243	-335	-428	-520
0%	275	184	92	0	-92	-184	-277
2.67%	463	378	291	203	113	24	-67
5.33%	604	529	450	368	284	199	112
8.00%	706	642	573	500	424	345	264
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							396
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-219	-248	-276	-306	-335	-365	-396
-5.33%	-93	-124	-156	-188	-220	-252	-284
-2.67%	13	-20	-53	-86	-119	-153	-186
0%	99	66	33	0	-33	-66	-99

2.67%	165	134	103	72	40	8	-25
5.33%	214	187	159	130	100	70	39
8.00%	249	227	203	177	150	121	93

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

(단위:백만원)

3,108

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

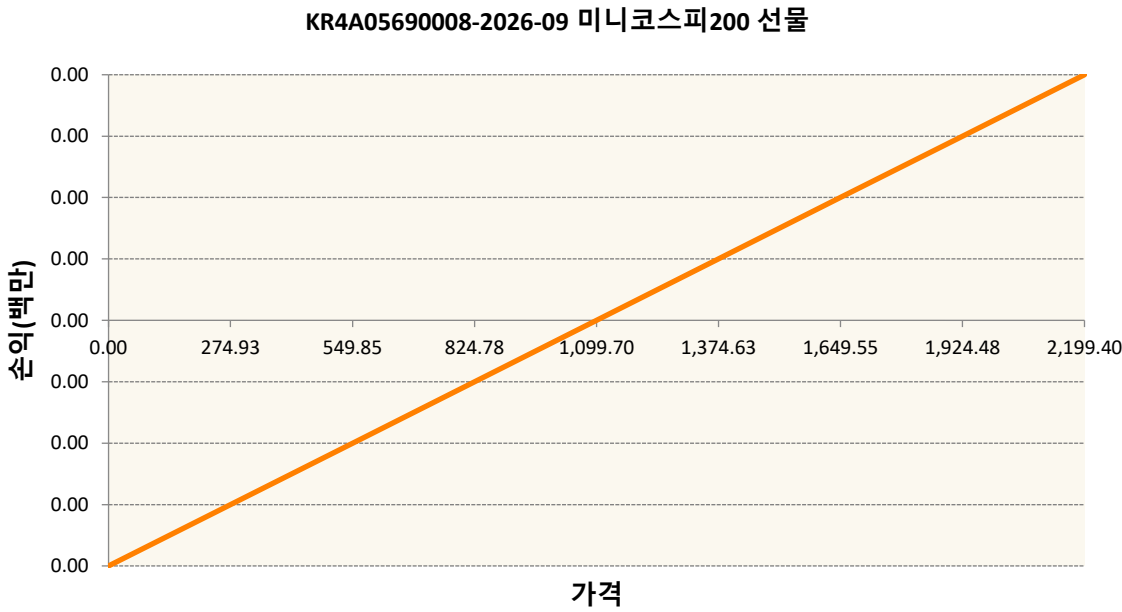
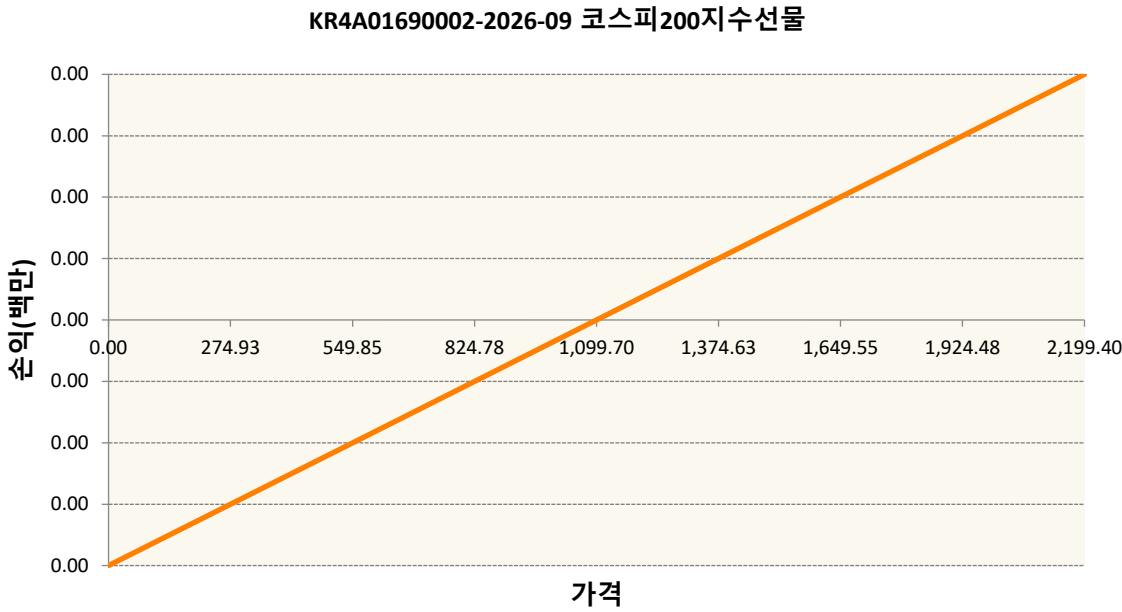
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

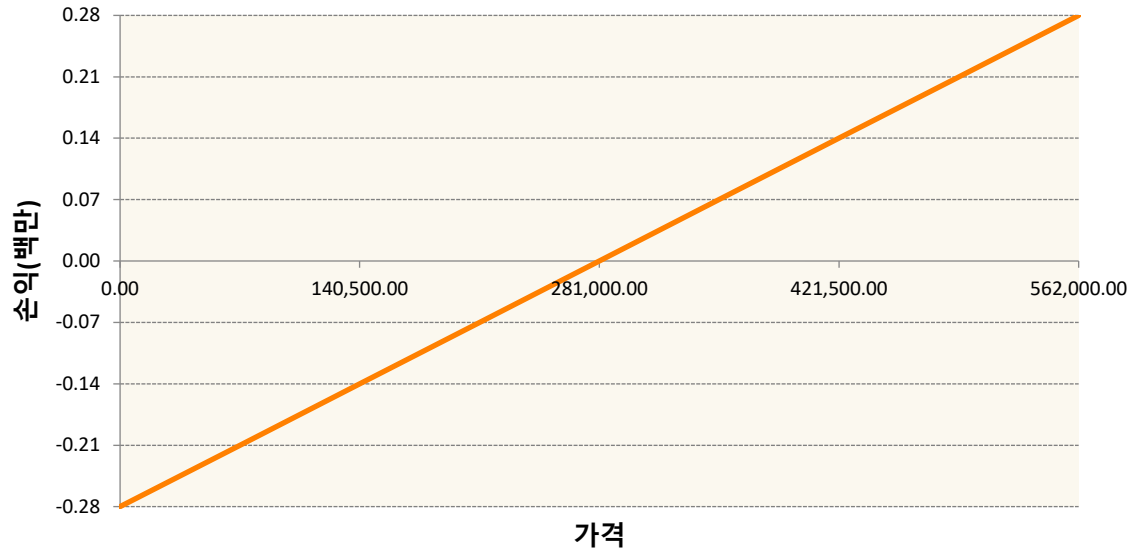
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	58	0	58	장내
누계	유가증권	선물	1,434	0	1,434	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A116A0005-2026-10 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002 2026-09 코스피200지수선물								44
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	29	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	44	44	44	44	44	44	44	44
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	-13
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	9	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	13	13	13	13	13	13	13	13
KR4A116A0005 2026-10 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)

209

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

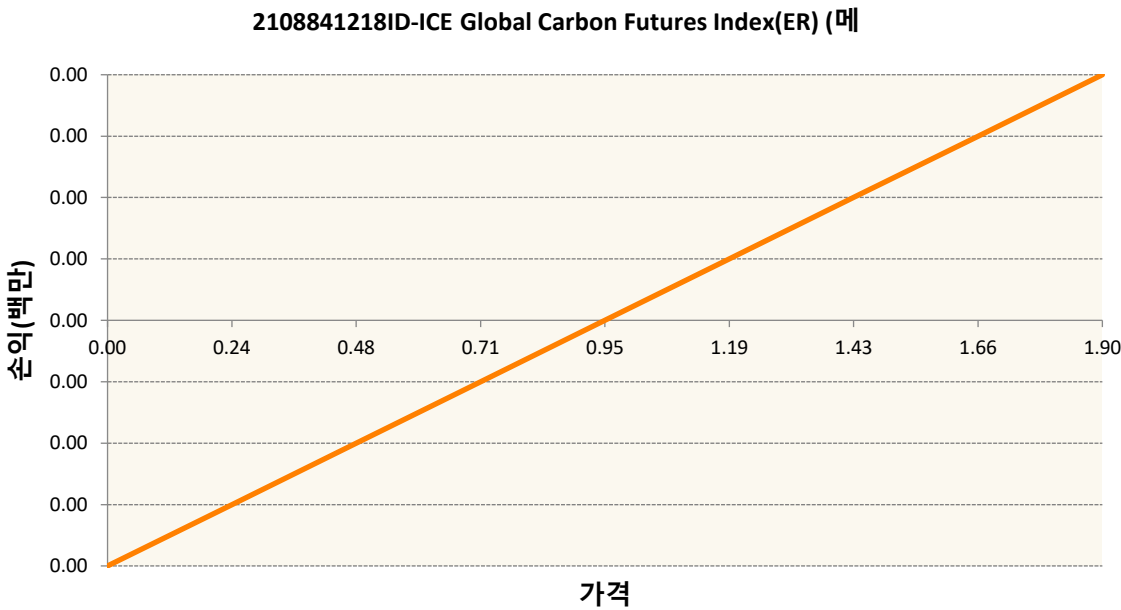
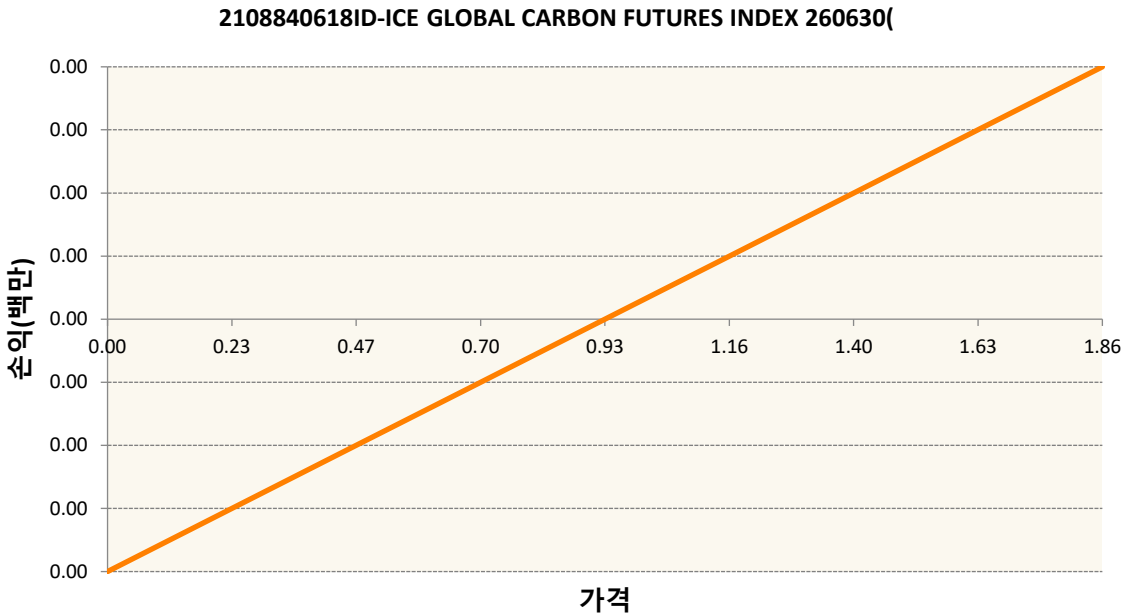
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,089	0	7,089	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		454
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		115

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	630

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

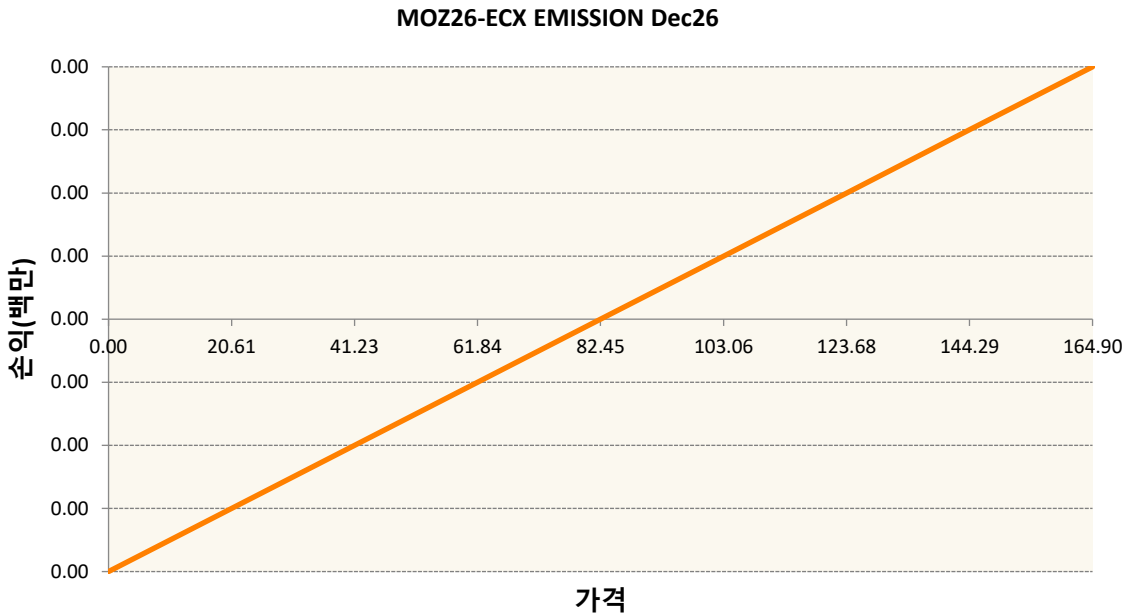
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,332	0	5,332	
누계	통화	선도	0	2,545	-2,545	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G7XIKRW/EUR 31-08-26E	204
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	427

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

(단위:백만원)

690

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

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	-1,810	0	-1,810	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	60
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	28
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	24
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	36

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

(단위:백만원)

236

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

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	-5,196	0	-5,196	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	44
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	192
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	177

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

(단위:백만원)

776

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

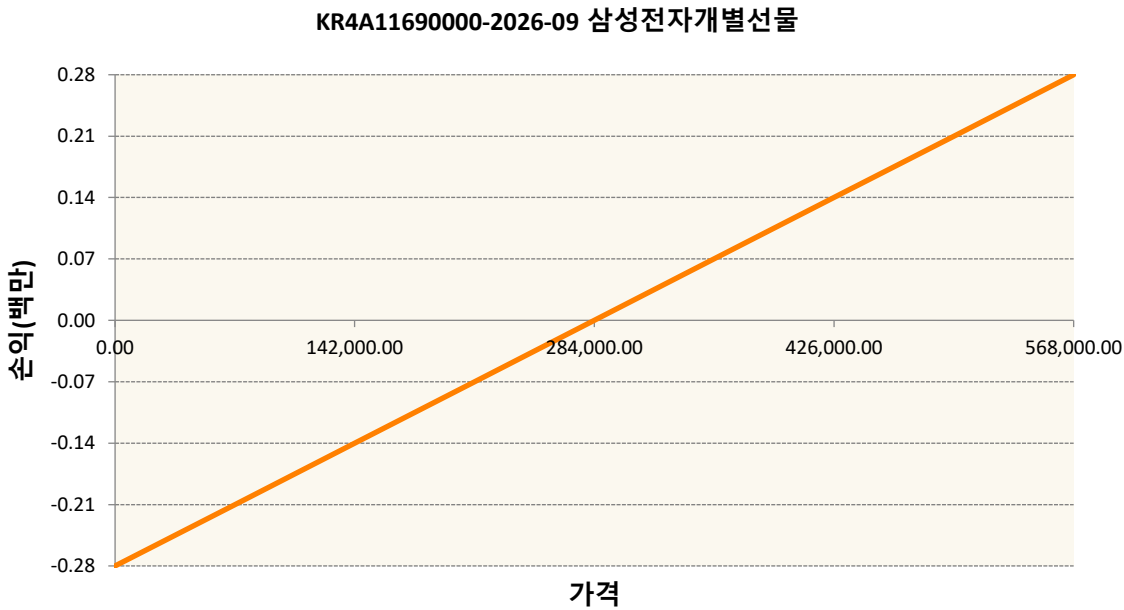
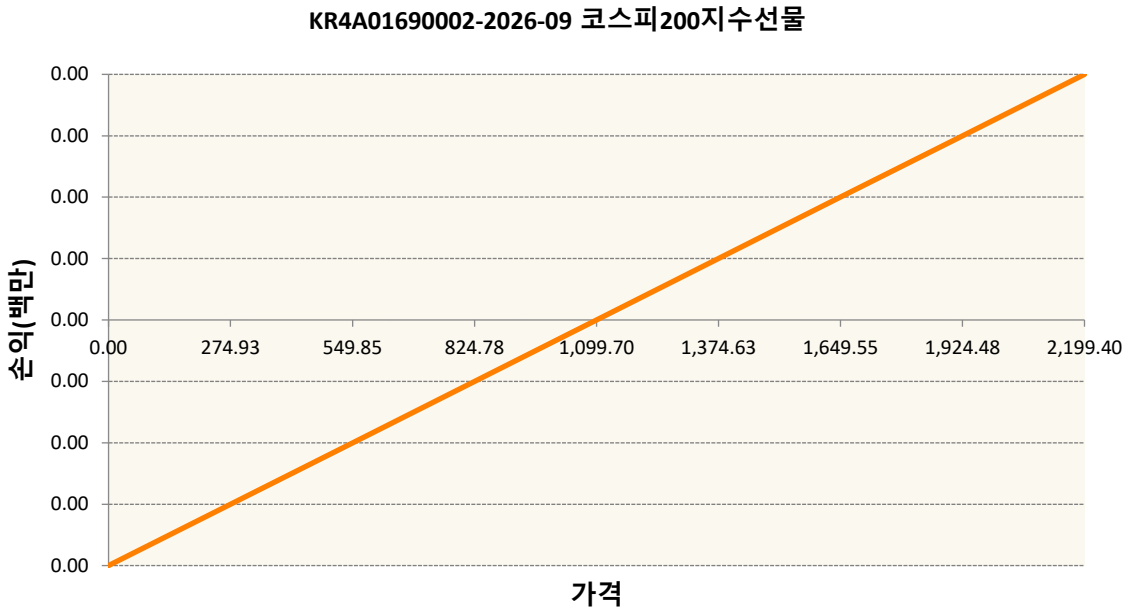
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,221	-2,221	장내
누계	유가증권	선물	24,527	0	24,527	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					1,666
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,666	-1,666	-1,666	-1,666	-1,666	-1,666	-1,666
-5.33%	-1,111	-1,111	-1,111	-1,111	-1,111	-1,111	-1,111
-2.67%	-555	-555	-555	-555	-555	-555	-555
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	555	555	555	555	555	555	555
5.33%	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111	1,111
8.00%	1,666	1,666	1,666	1,666	1,666	1,666	1,666
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물					288
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-288	-288	-288	-288	-288	-288	-288
-5.33%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
-2.67%	-96	-96	-96	-96	-96	-96	-96
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	96	96	96	96	96	96	96
5.33%	192	192	192	192	192	192	192
8.00%	288	288	288	288	288	288	288

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

6,721

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

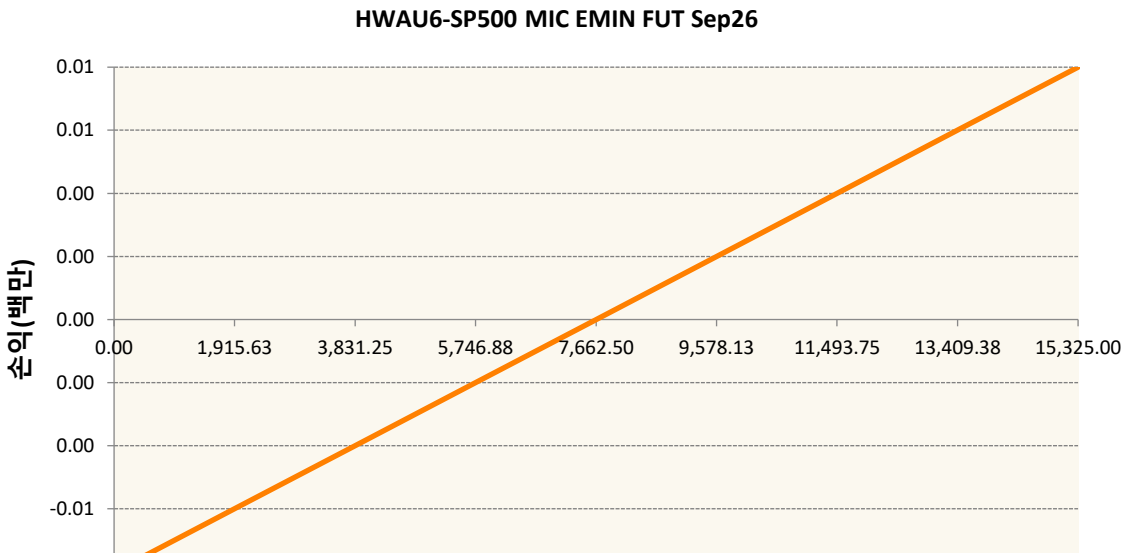
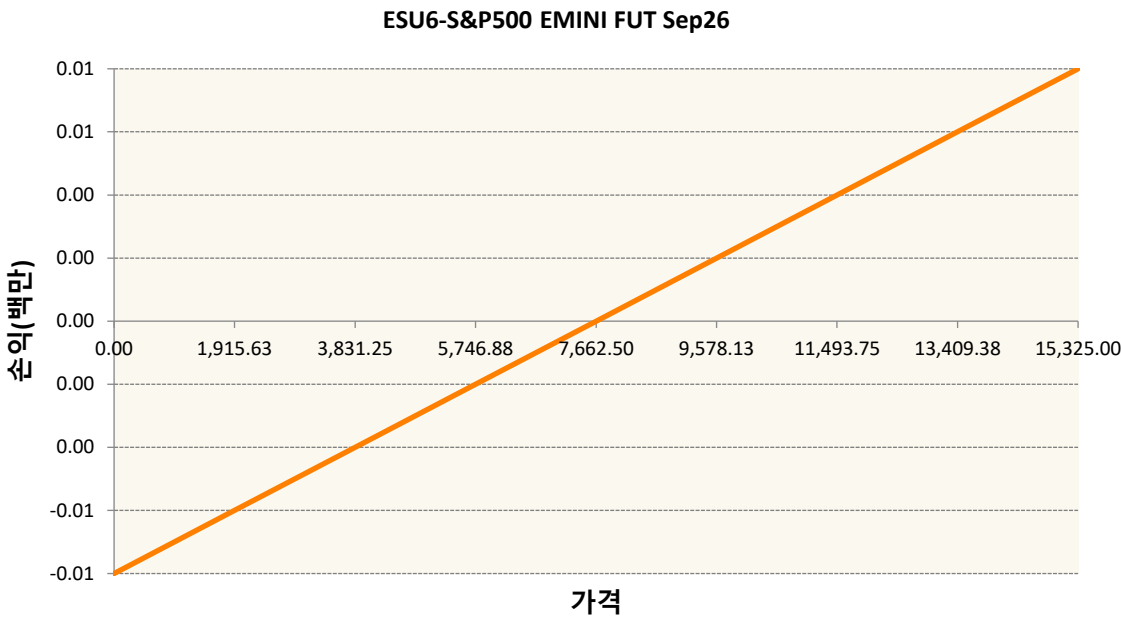
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

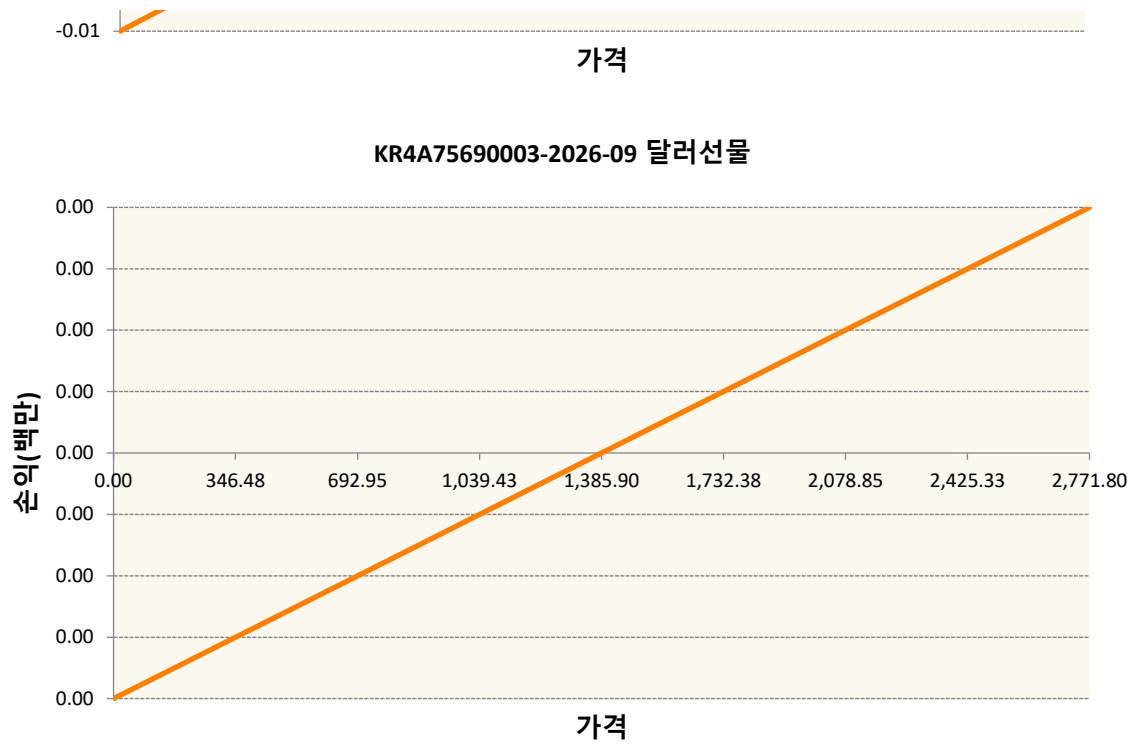
1. 계약금액

(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	693	0	693	장내
누계	지수	선물	71,105	0	71,105	
누계	지수	선물	176	0	176	장내
누계	통화	선물	11,226	0	11,226	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	5,688
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	14
KR4A756900	2026-09 달러선물	898

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

4,800

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

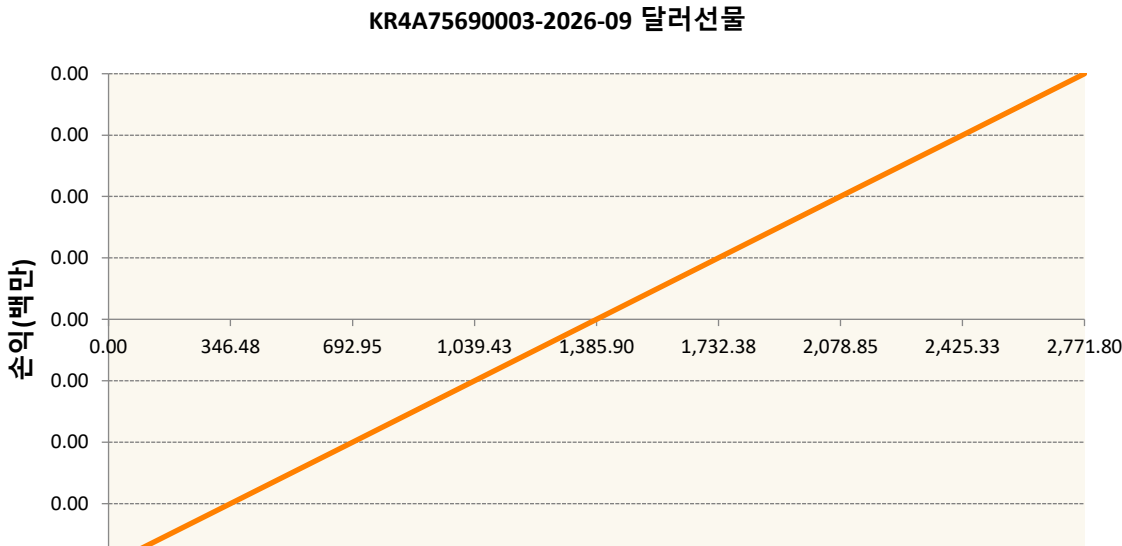
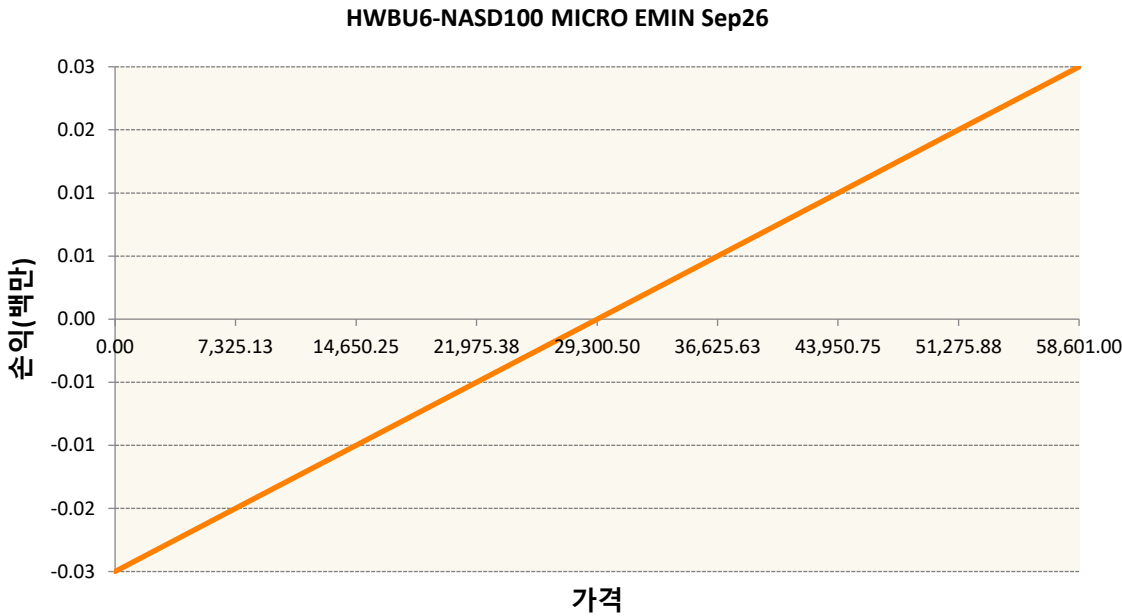
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

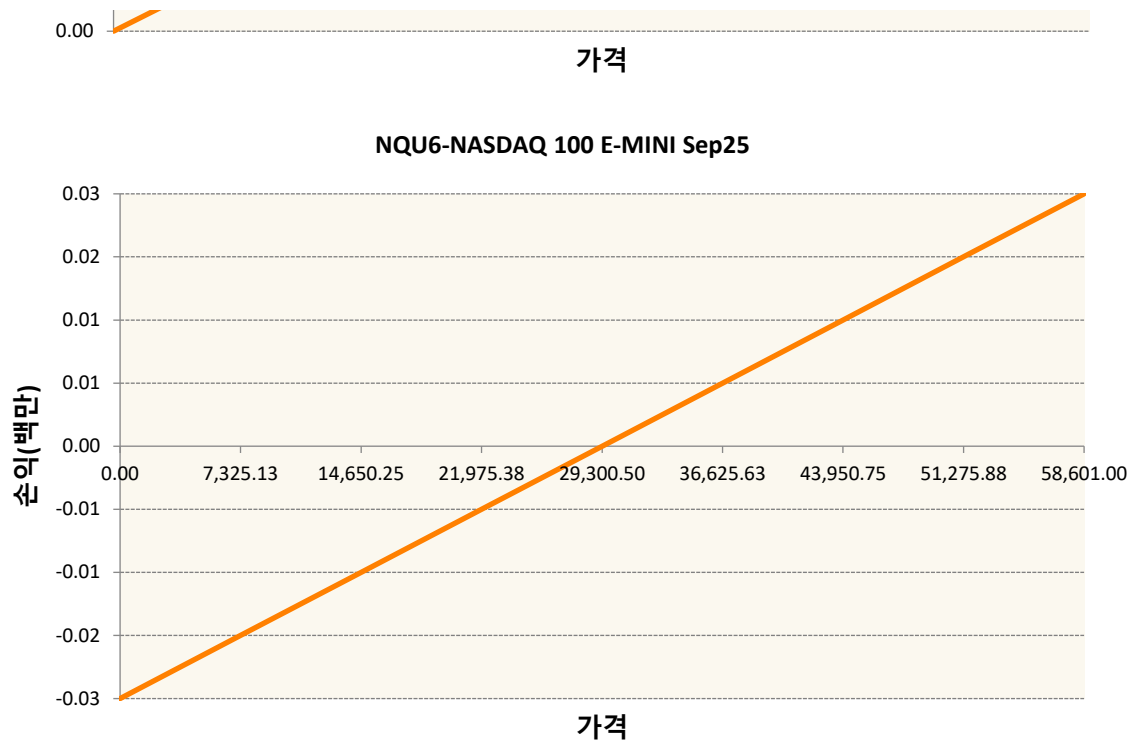
1. 계약금액

(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	346	0	346	장내
누계	유가증권	선물	704	0	704	장내
누계	지수	선물	33,780	0	33,780	
누계	통화	선물	4,310	0	4,310	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		56
KR4A756900	2026-09 달러선물		345
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,702

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,078

공시일	2026-08-24
기준일	2026-08-21

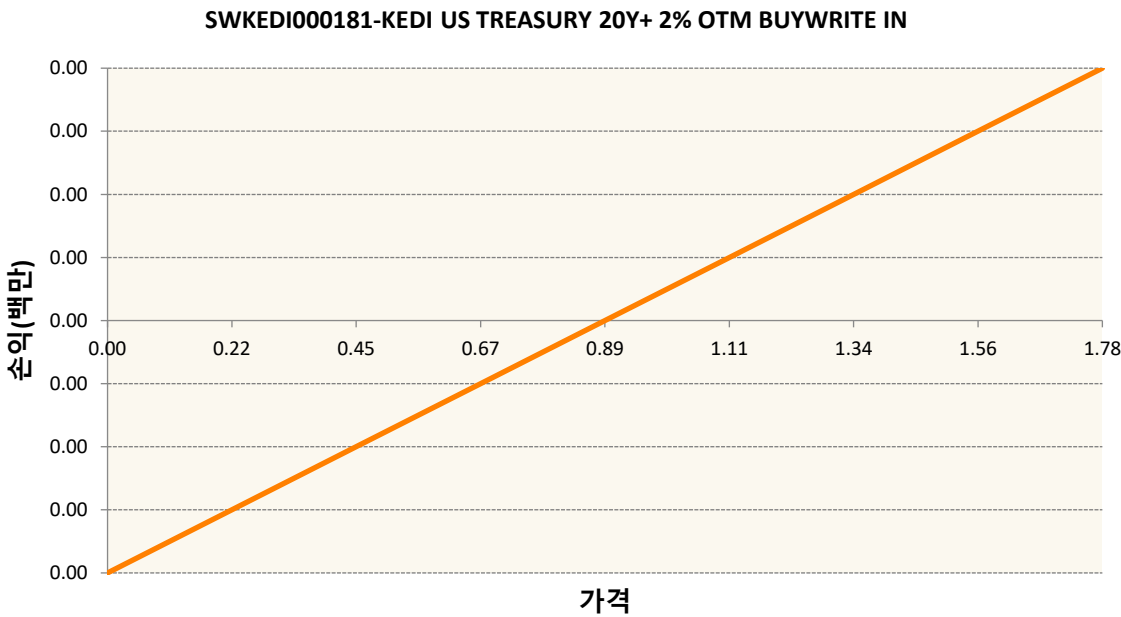
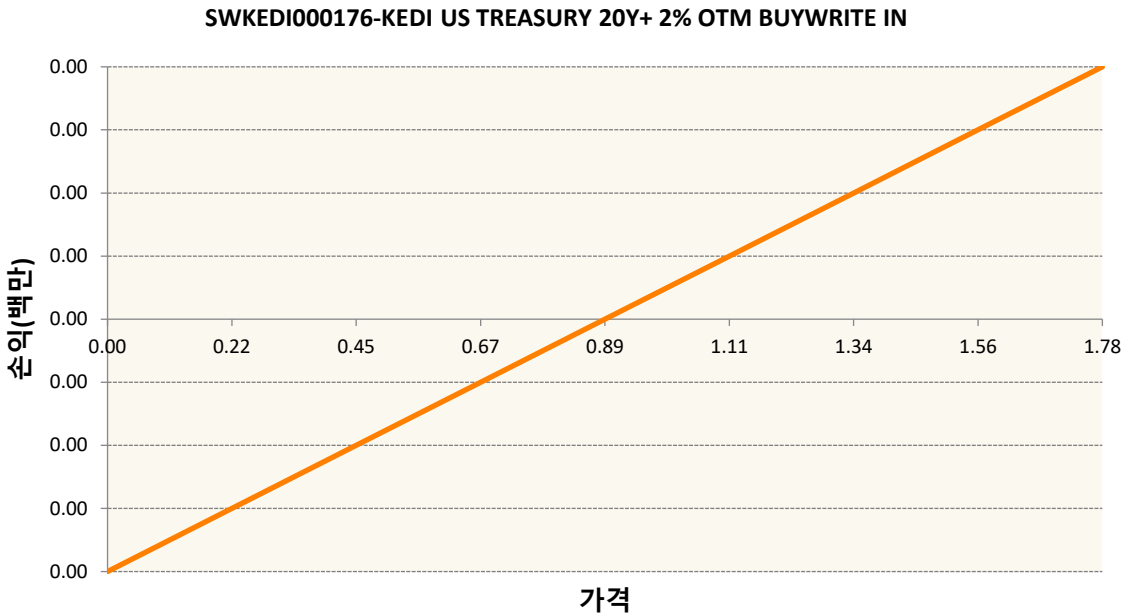
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

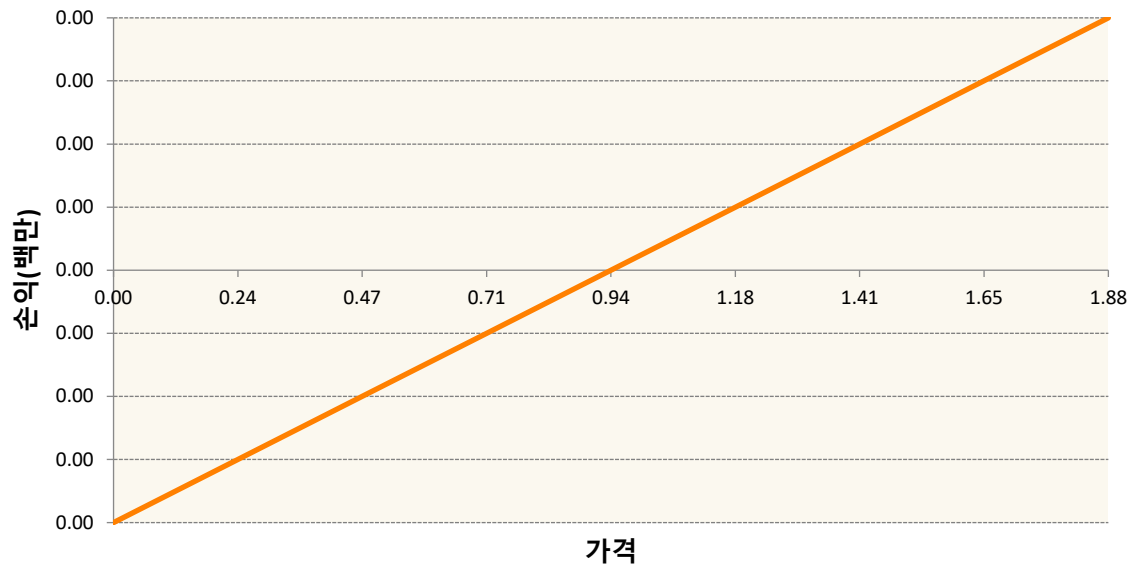
(단위:백만원)

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

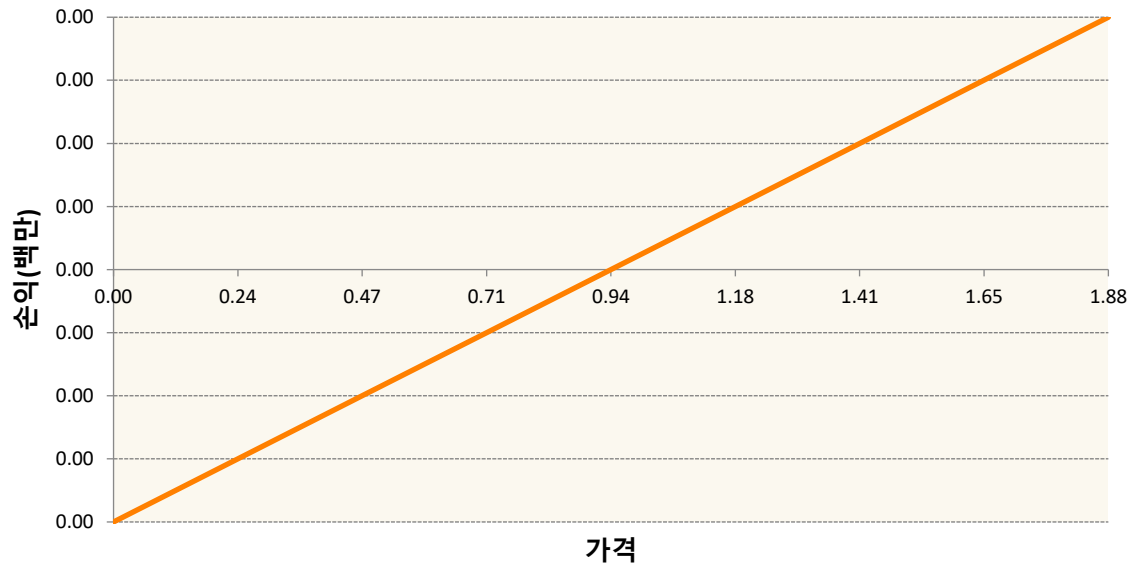
2. 만기시점의 손익구조



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	7,217
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,832
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,336
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,125

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

(단위:백만원)

9,834
