

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

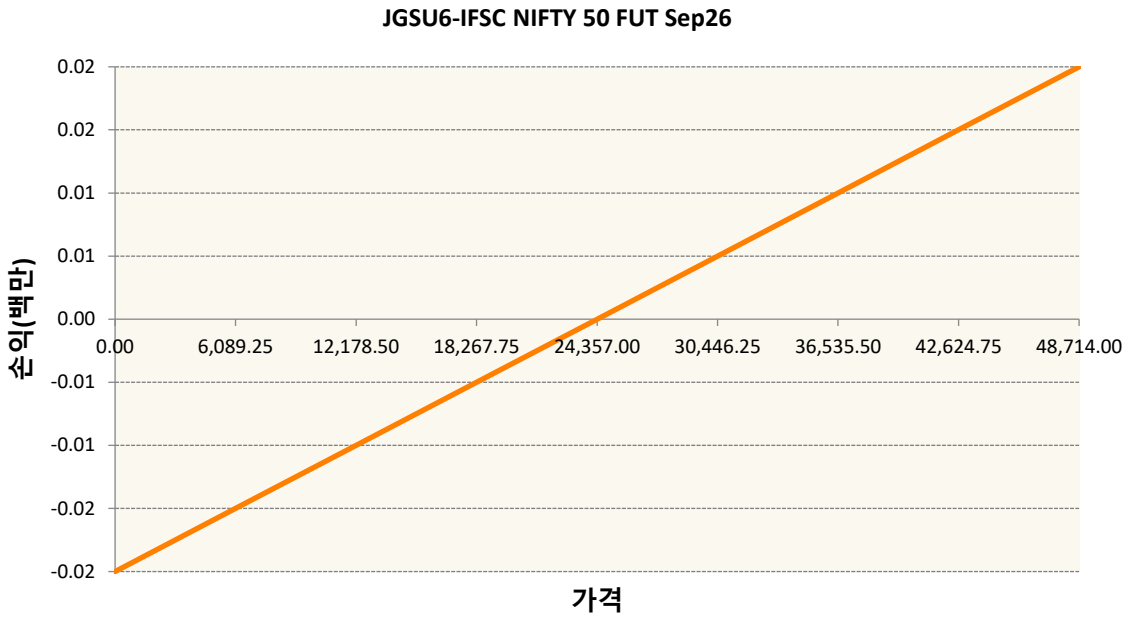
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-08-25
기준일	2026-08-24

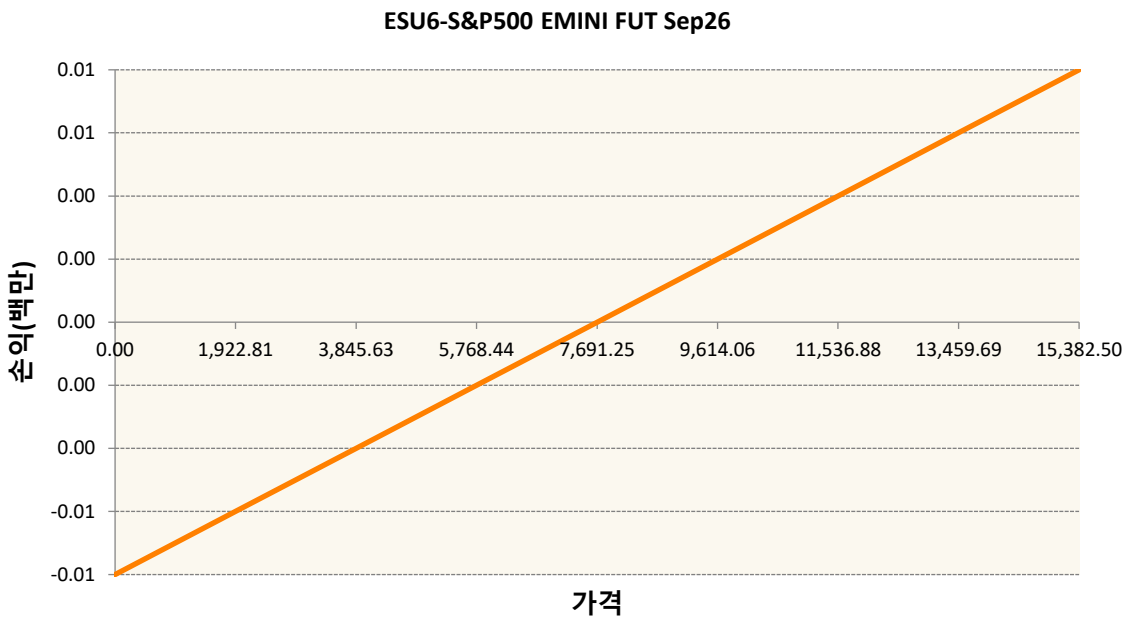
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	587	0	587	

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	2026-08-25
기준일	2026-08-24

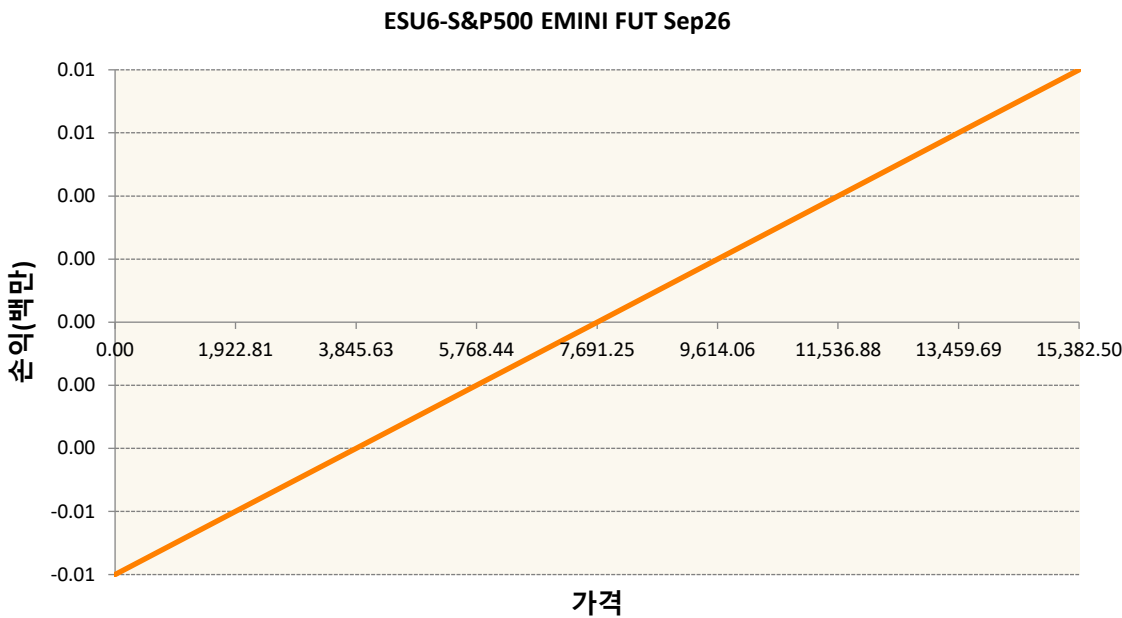
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	580	0	580	

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	2026-08-25
기준일	2026-08-24

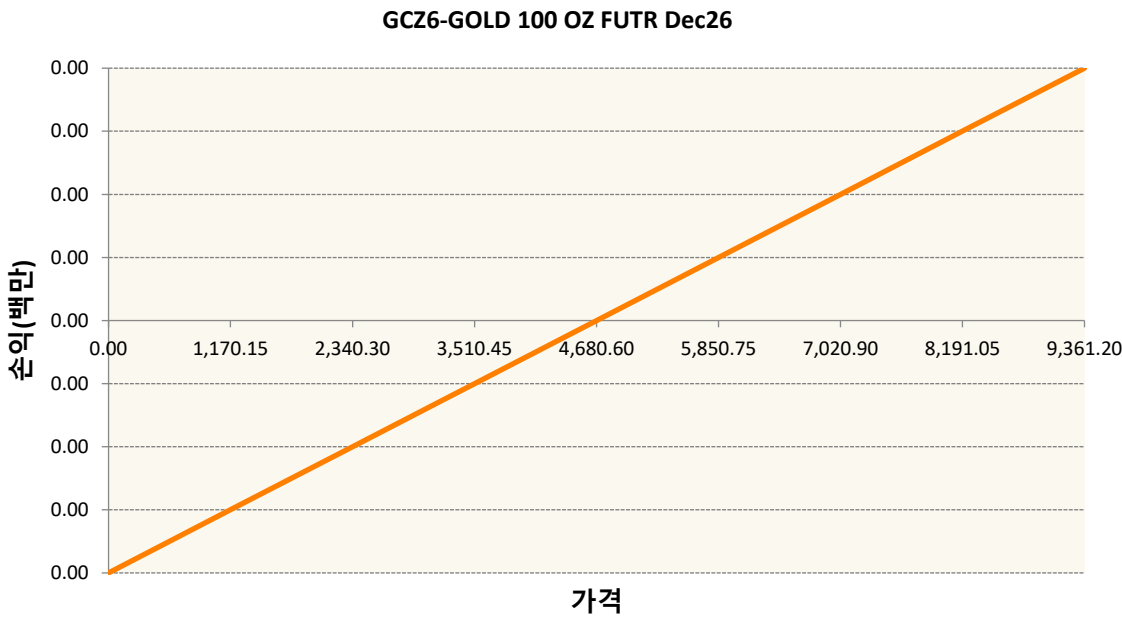
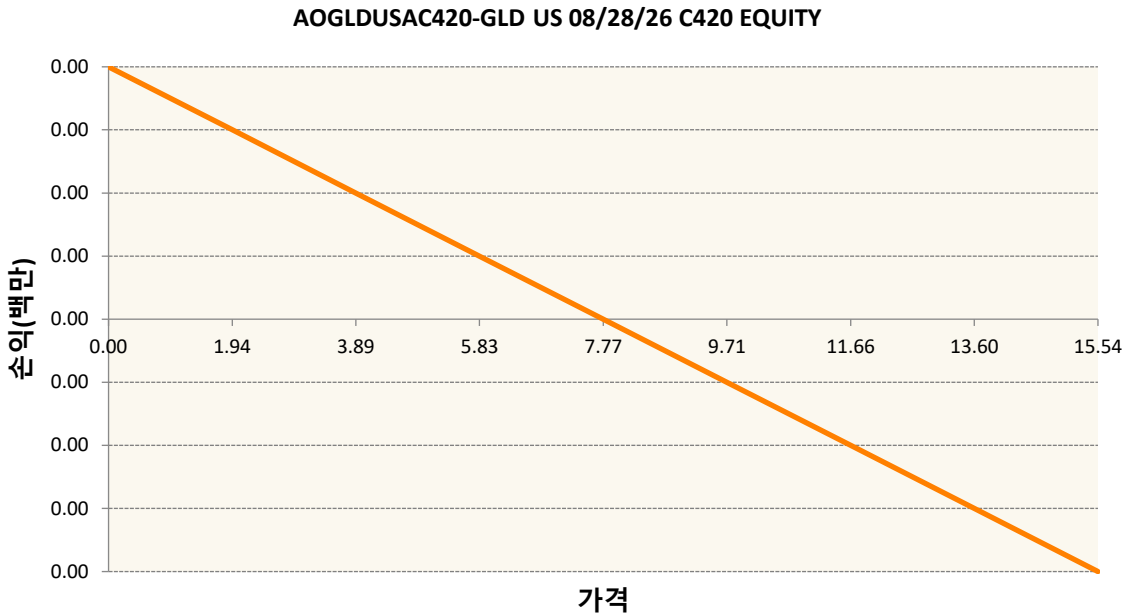
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,357	0	5,357	
누계	실물자산	옵션	0	137	-137	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSAC GLD US 08/28/26 C420 EQUITY		11
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26		429

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	578

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

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)

AOPLTRUAC PLTR US 08/28/26 C180 EQUITY	208
AOPLTRUAP PLTR US 08/28/26 P180 EQUITY	15

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

(단위:백만원)

764

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOTLTUSAC\TLT US 08/28/26 C82.5 EQUITY

4

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

(단위:백만원)

2

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

(단위:백만원)

13,970

공시일 2026-08-25

기준일 2026-08-24

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	2026-08-25
기준일	2026-08-24

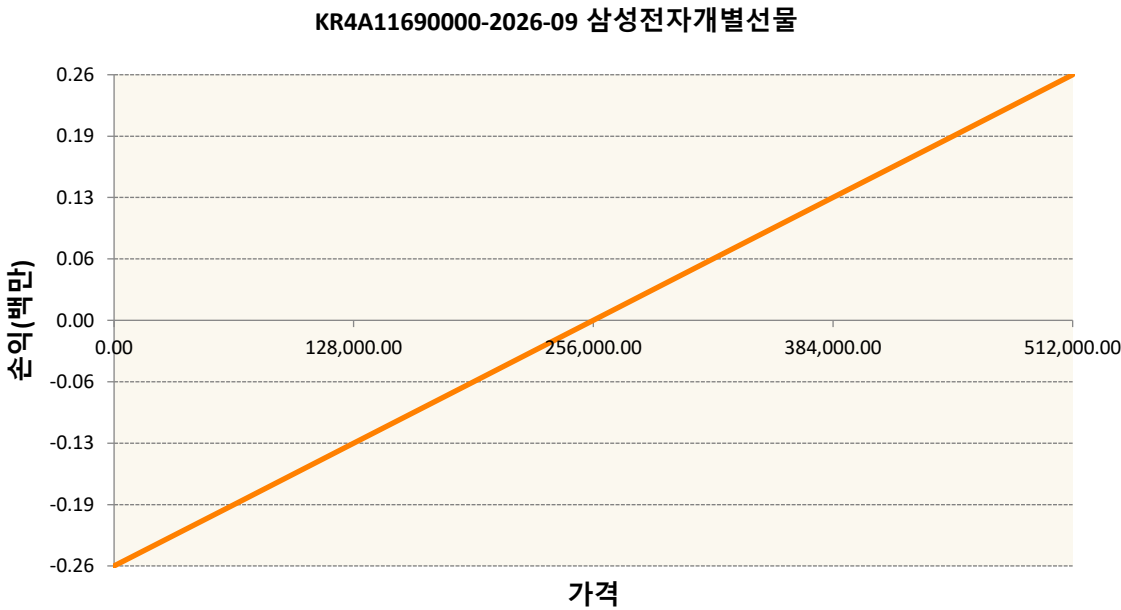
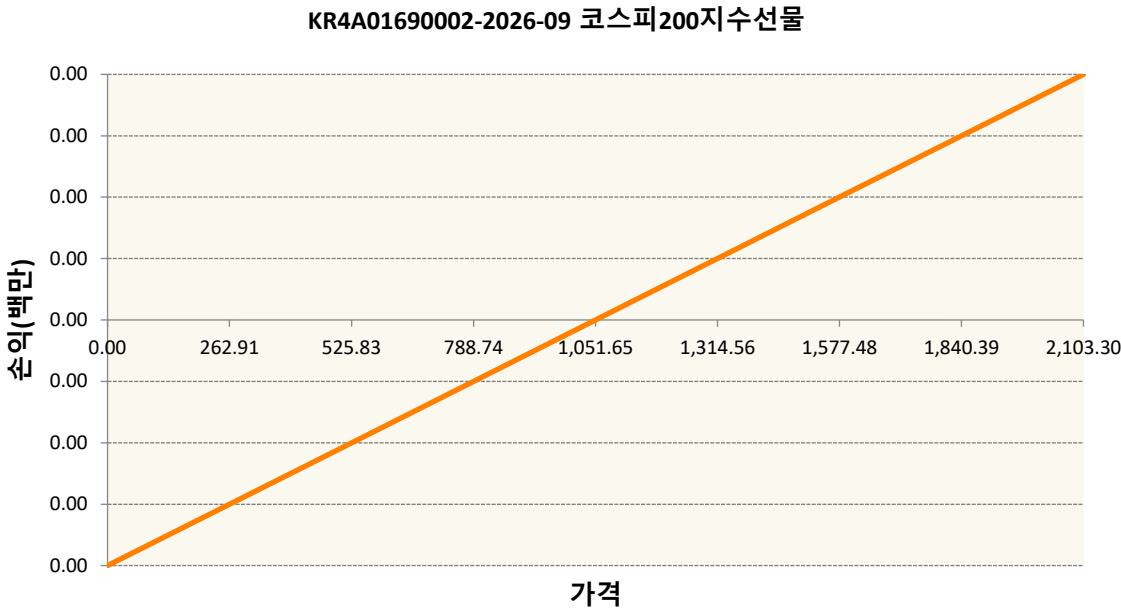
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	43,625	-43,625	장내
누계	유가증권	선물	20,660	0	20,660	장내
누계	유가증권	옵션	0	42,768	-42,768	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 2,110.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,055.00, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,055.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,115.00. The y-axis, labeled '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,057.50, 0.00).

가격	손익 (백만)
0.00	0.00
1,057.50	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					548
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548
-5.33%	-365	-365	-365	-365	-365	-365	-365
-2.67%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	183	183	183	183	183	183	183
5.33%	365	365	365	365	365	365	365
8.00%	548	548	548	548	548	548	548
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물					1,110
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110	-1,110
-5.33%	-740	-740	-740	-740	-740	-740	-740
-2.67%	-370	-370	-370	-370	-370	-370	-370
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	370	370	370	370	370	370	370
5.33%	740	740	740	740	740	740	740
8.00%	1,110	1,110	1,110	1,110	1,110	1,110	1,110
KR4B09FBA231 코스피위클리 C 2608W4 1,055.0							1,592

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,518	-1,524	-1,533	-1,544	-1,557	-1,573	-1,592
-5.33%	-868	-886	-907	-932	-958	-987	-1,017
-2.67%	-294	-329	-367	-405	-444	-484	-525
0%	135	90	45	0	-45	-90	-135
2.67%	389	351	311	271	230	188	146
5.33%	502	480	455	427	397	365	331
8.00%	540	530	518	503	485	464	441

KR4B09FBA249 코스피위클리 C 2608W4 1,057.5							1,082
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,036	-1,040	-1,045	-1,052	-1,060	-1,070	-1,082
-5.33%	-598	-609	-623	-638	-655	-673	-693
-2.67%	-207	-230	-254	-279	-305	-331	-358
0%	91	60	30	0	-30	-60	-91
2.67%	270	244	217	189	161	133	104
5.33%	353	337	320	300	279	257	234
8.00%	382	375	366	355	342	328	311

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

(단위:백만원)

10,767

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

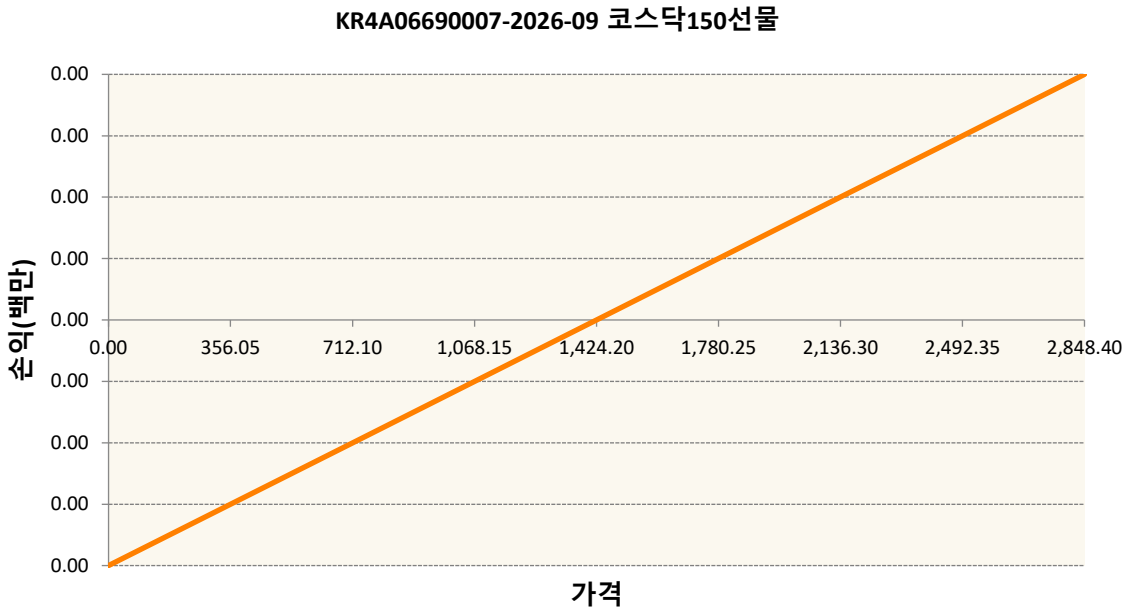
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	655	0	655	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)

17,139

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

(단위:백만원)

60,647

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

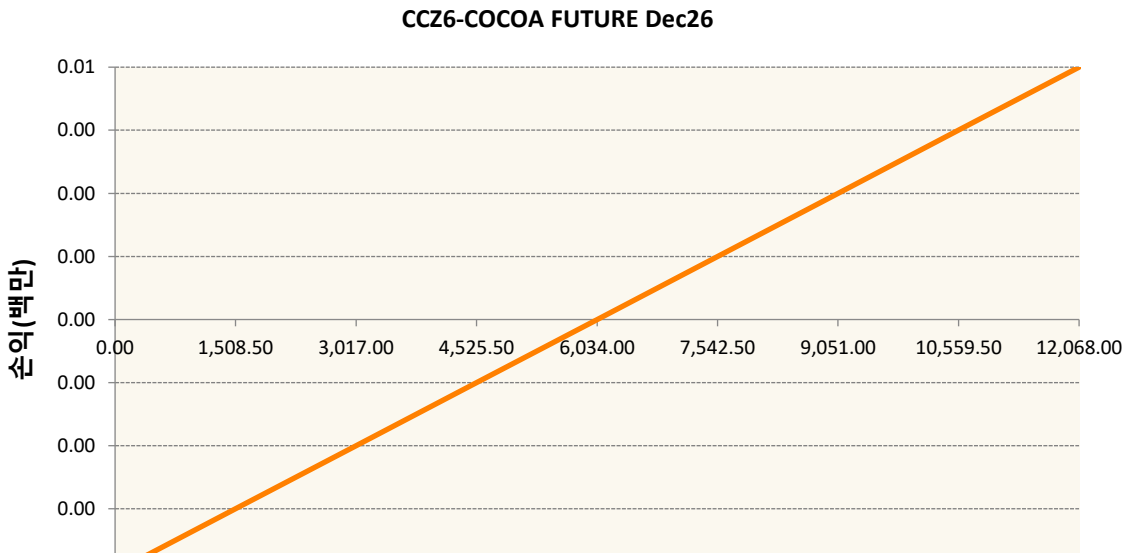
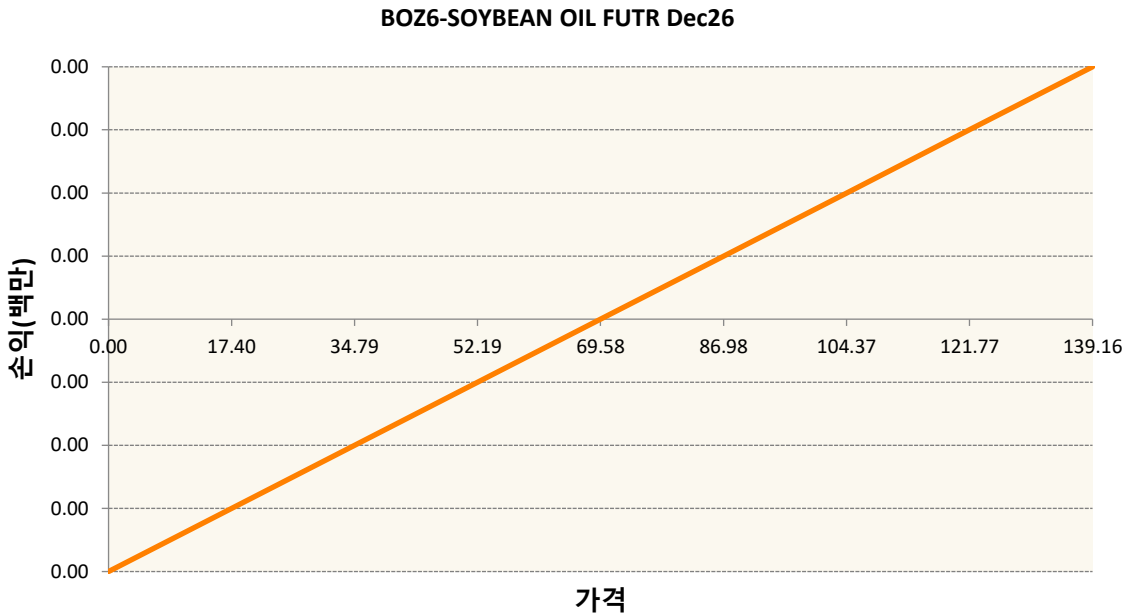
포커스농산물모(채권-파생형)

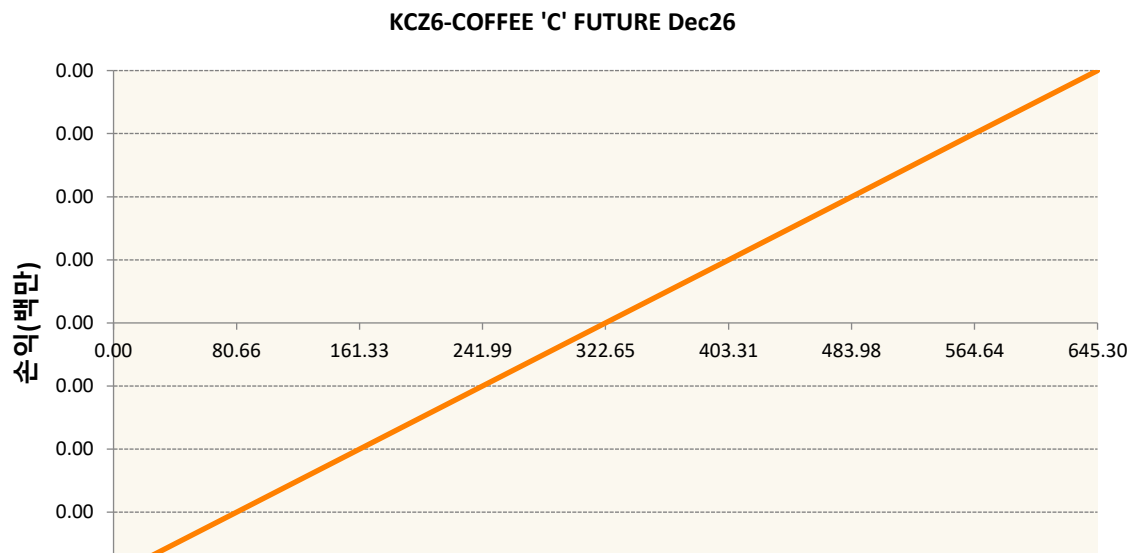
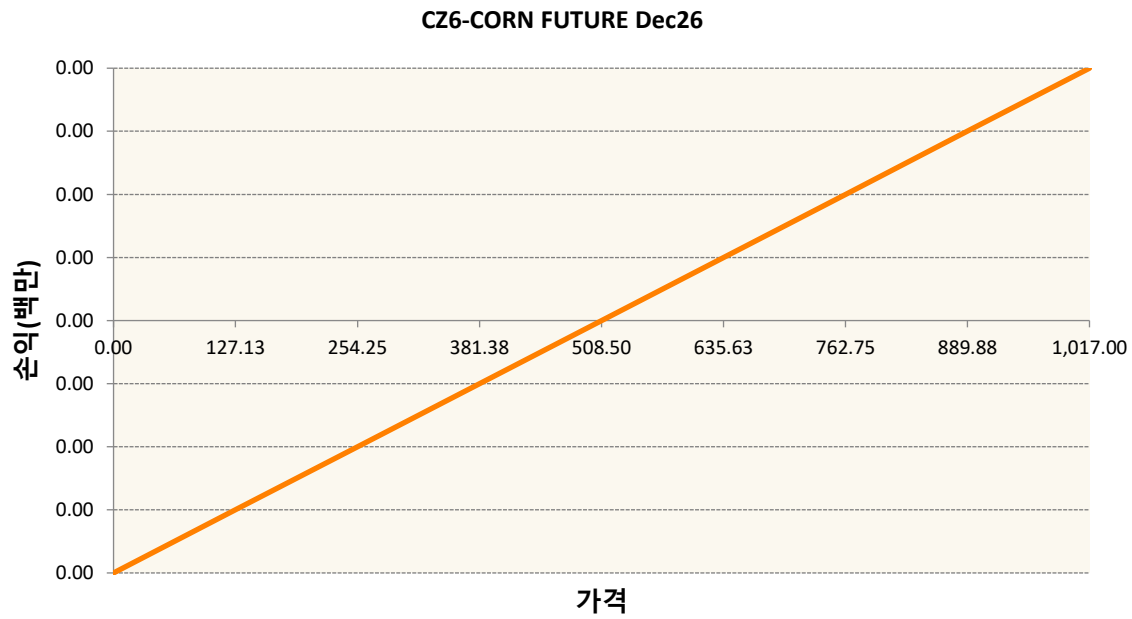
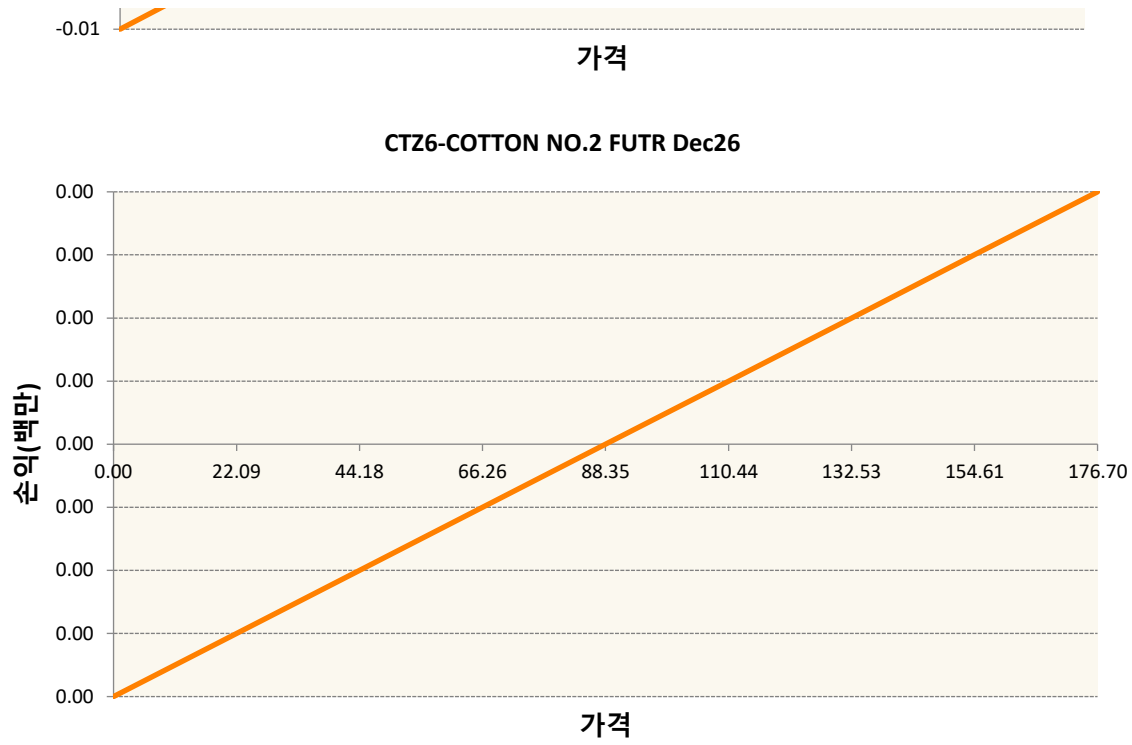
1. 계약금액

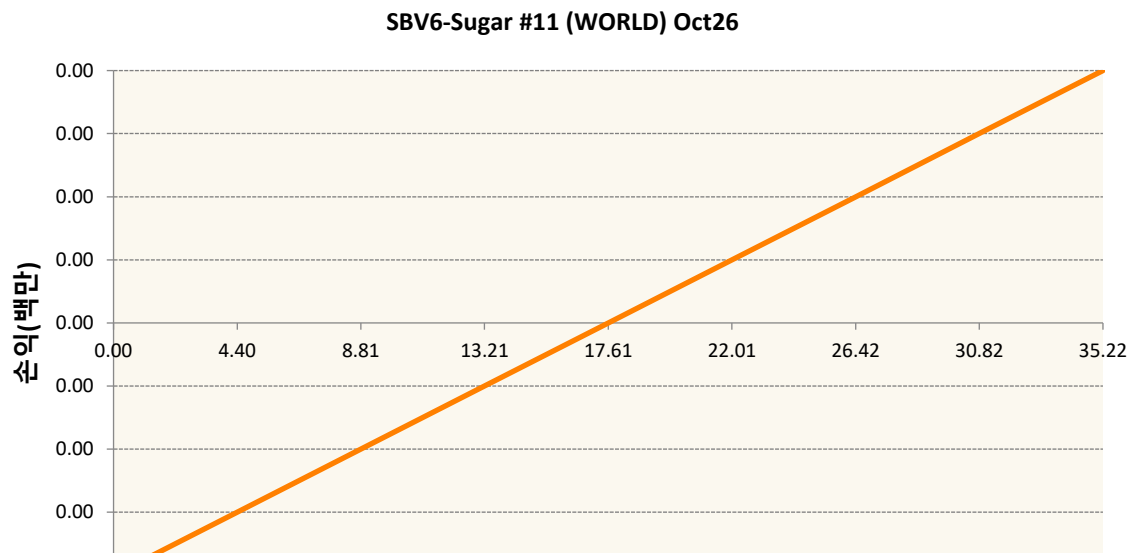
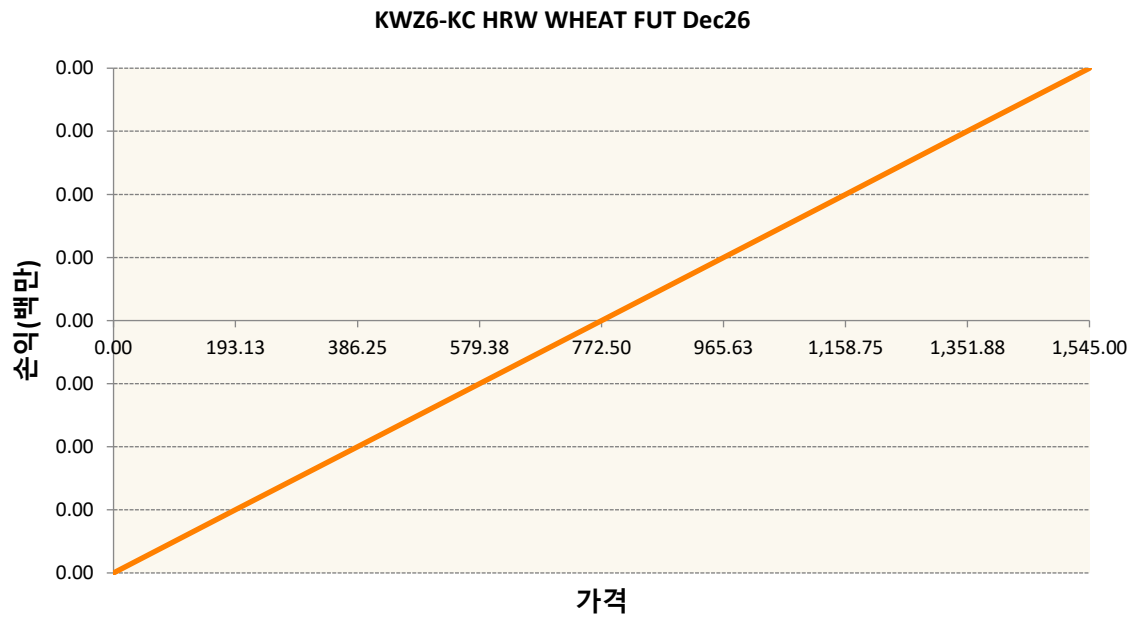
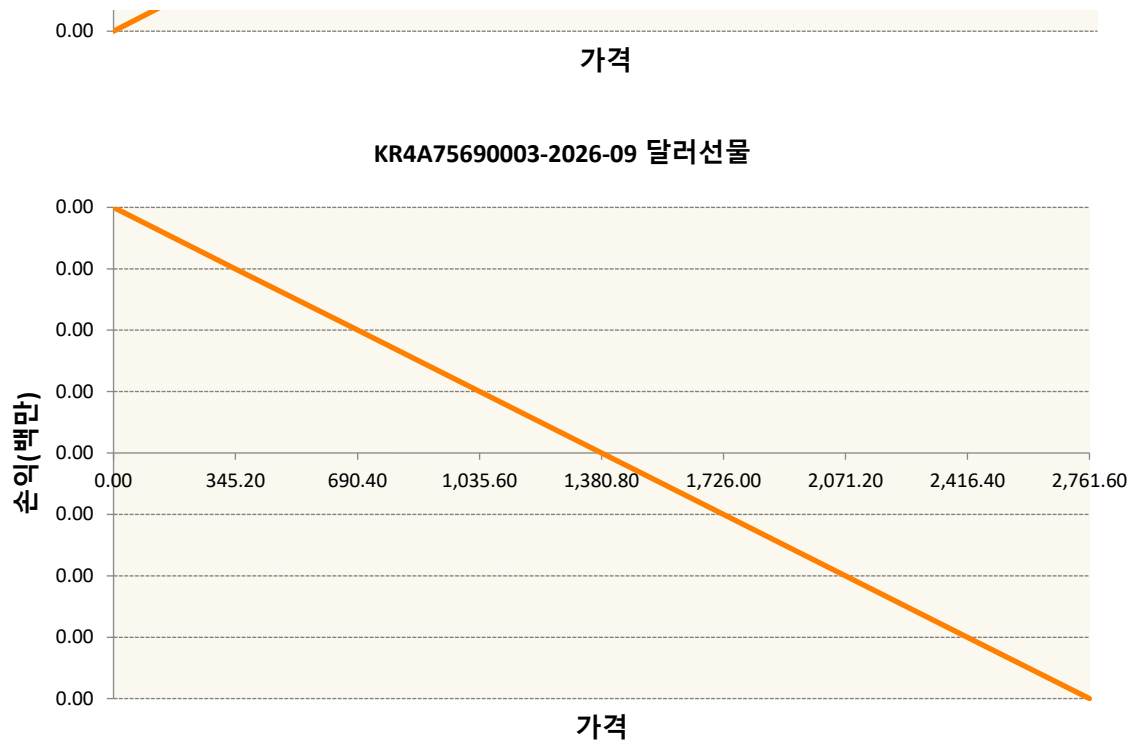
(단위:USD 백만)

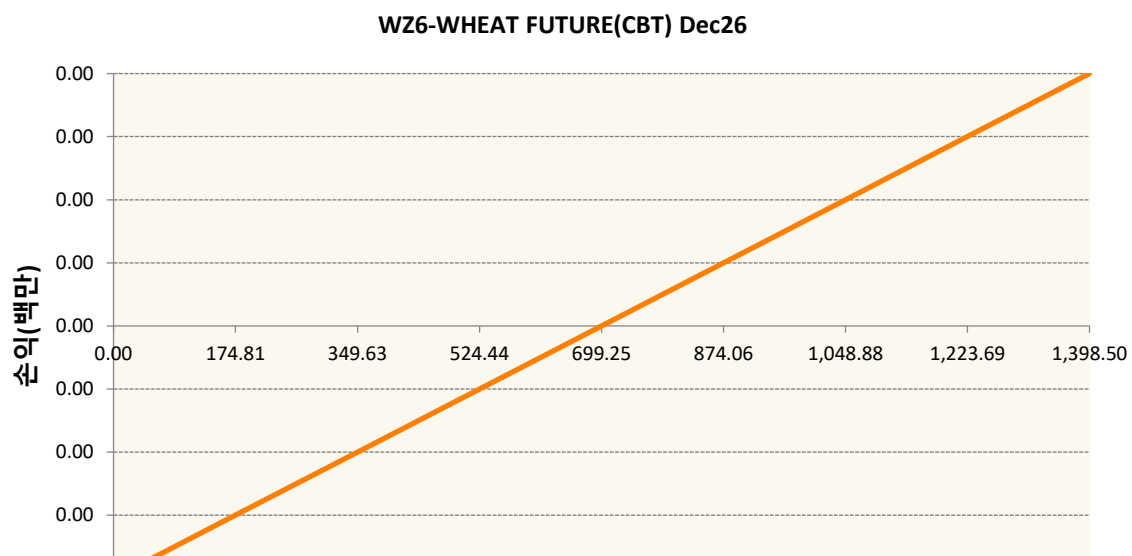
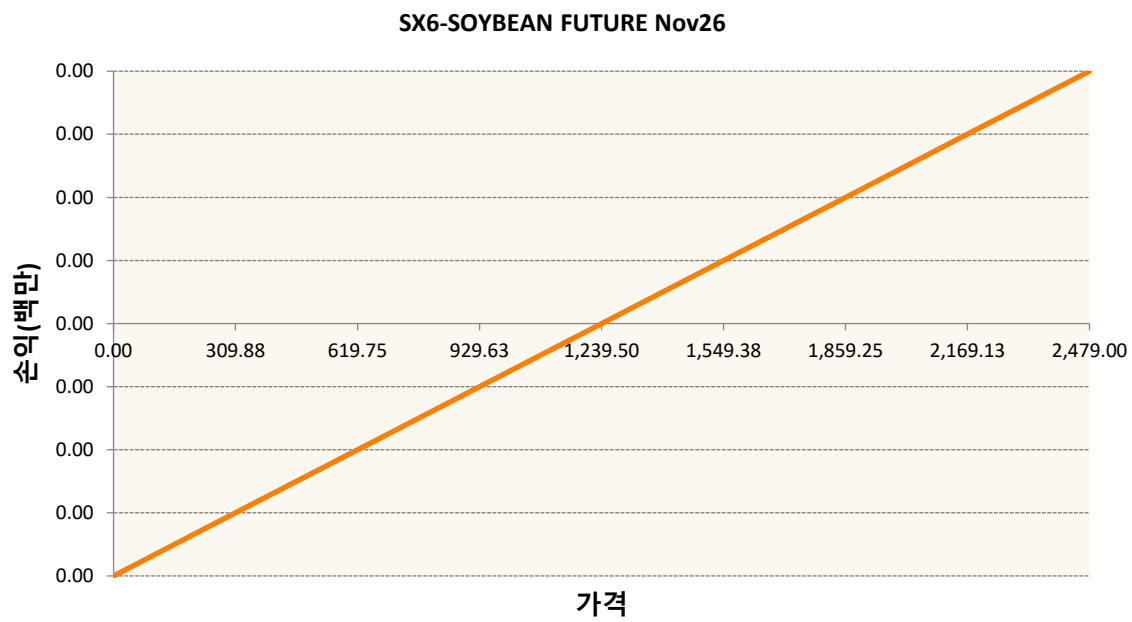
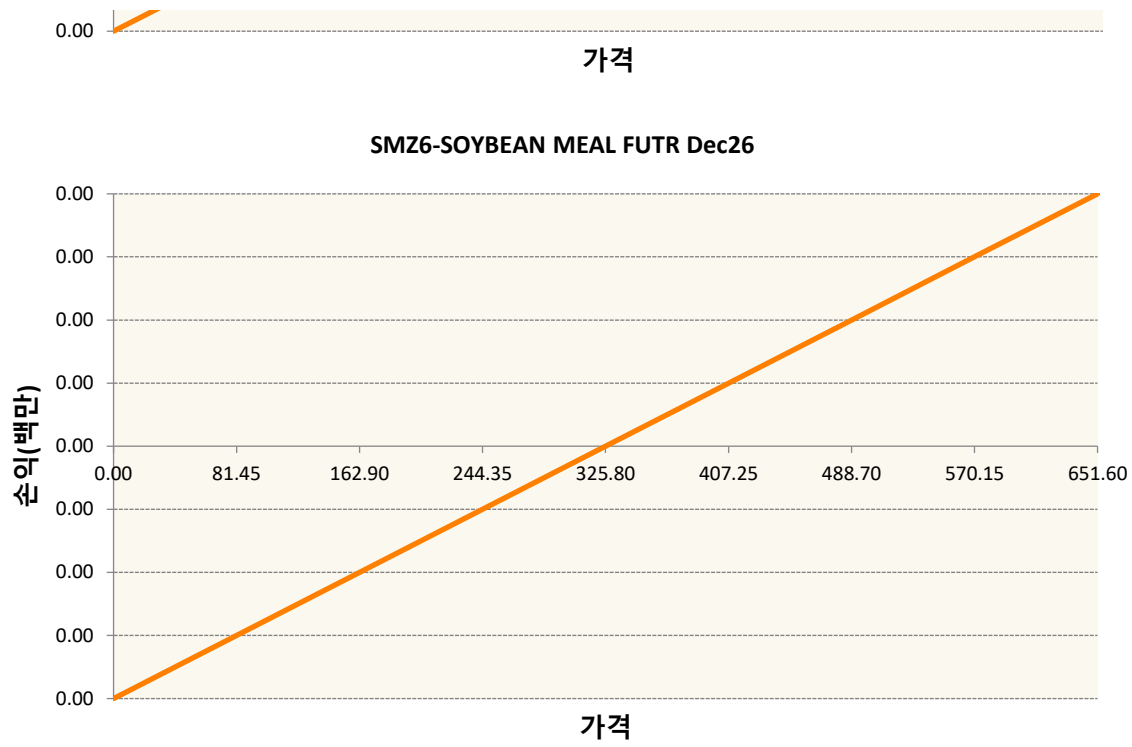
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	464	0	464	
누계	유가증권	선물	2,388	0	2,388	
누계	통화	선물	0	345	-345	장내

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	2026-08-25
기준일	2026-08-24

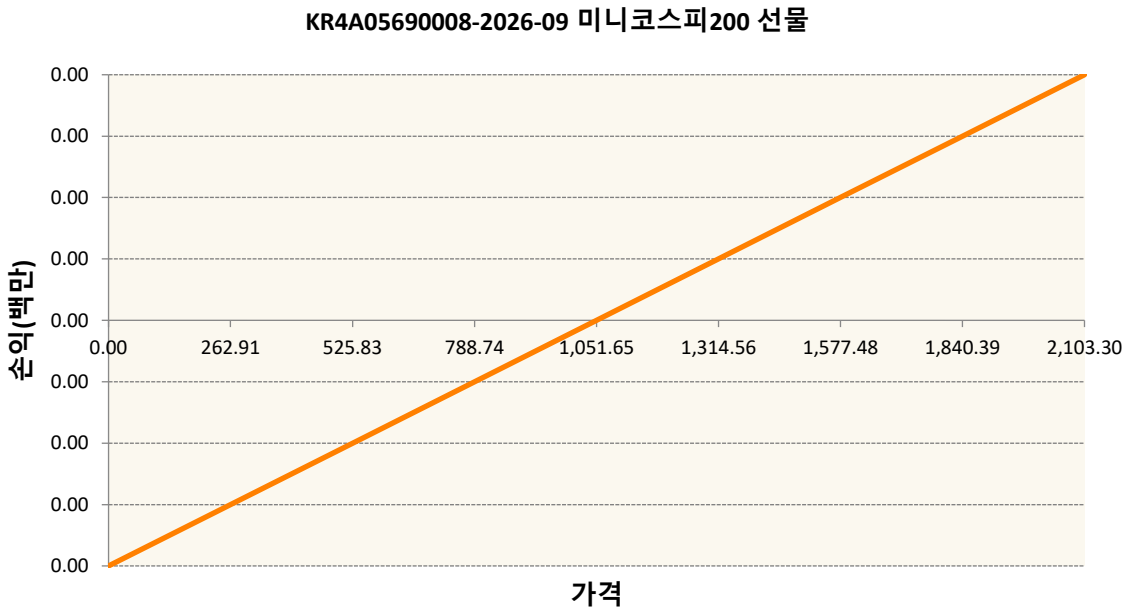
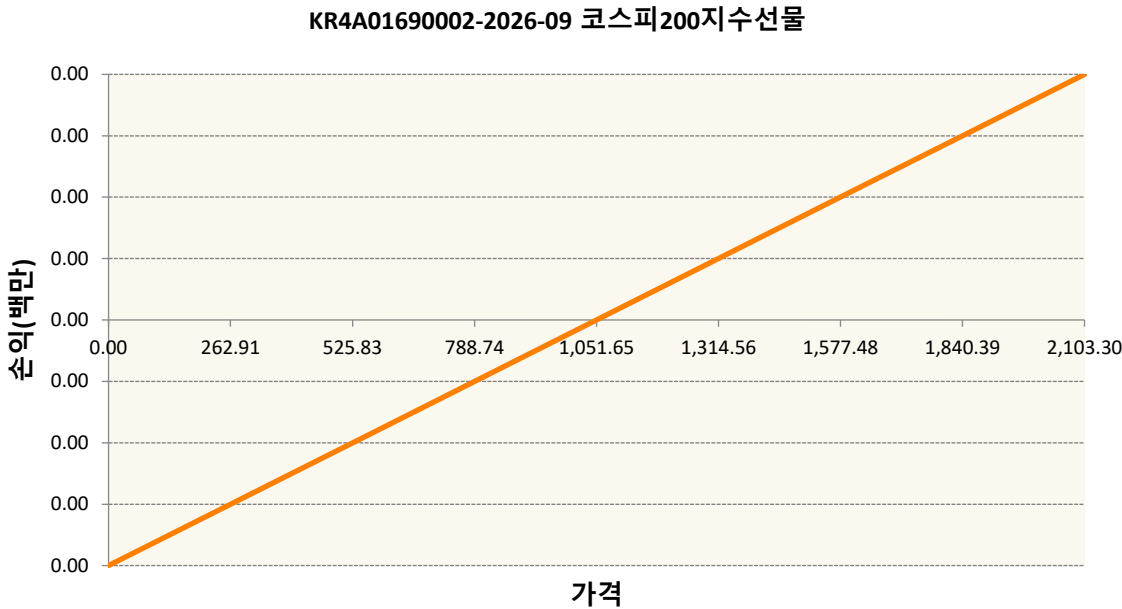
스마트인덱스모

1. 계약금액

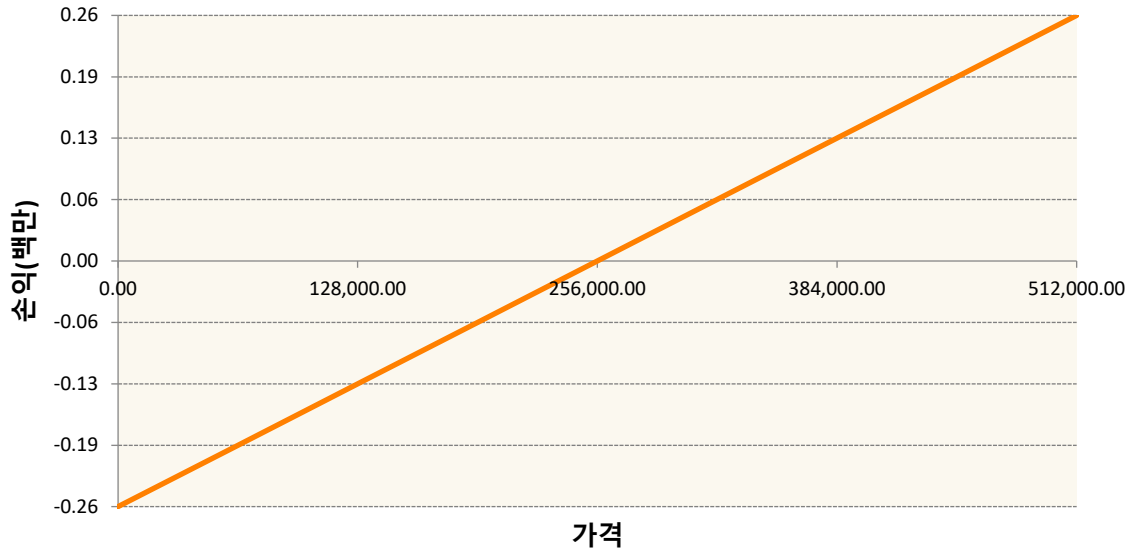
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,306	0	4,306	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002 2026-09 코스피200지수선물								190
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
-5.33%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	126	126	126	126	126	126	126	126
8.00%	190	190	190	190	190	190	190	190
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	-30
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	20	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	30	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	-8
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-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
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

766

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

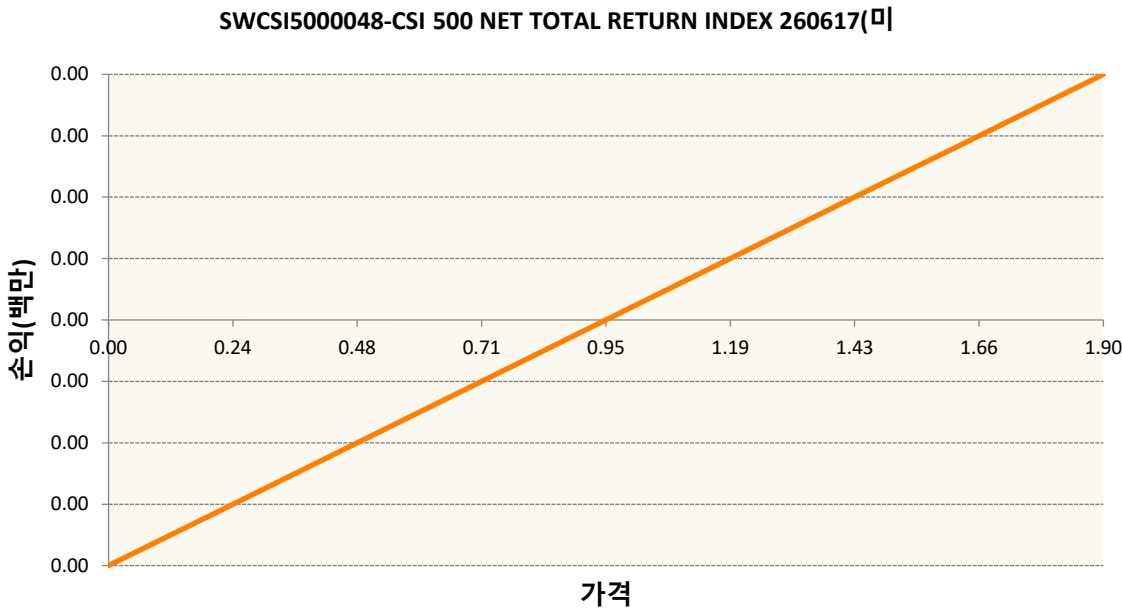
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	2026-08-25
기준일	2026-08-24

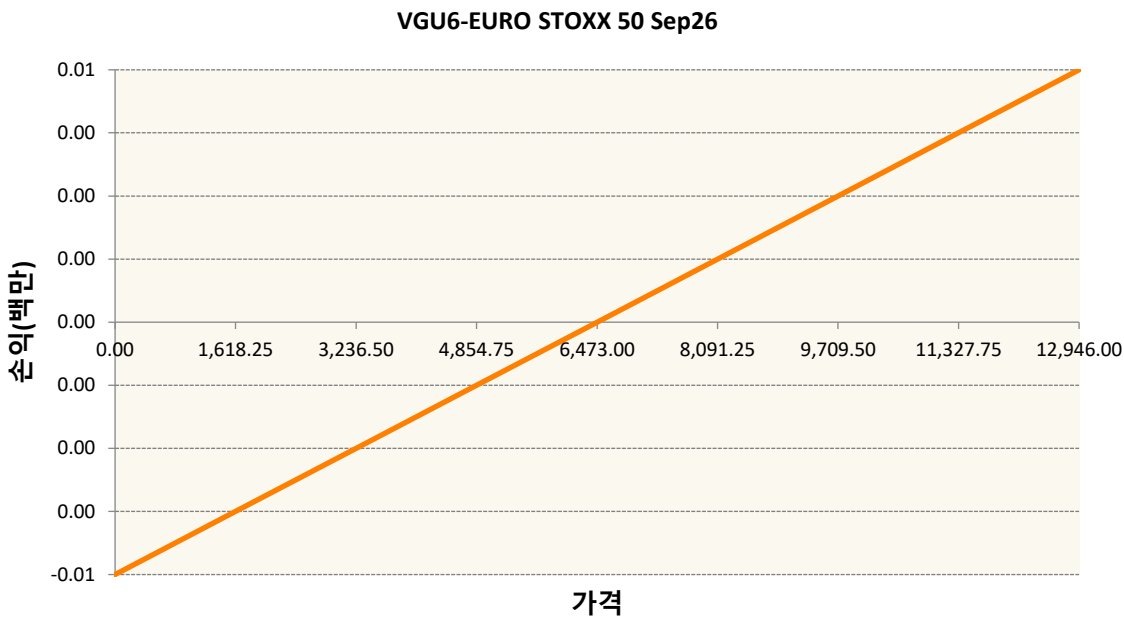
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,126	0	1,126	

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	2026-08-25
기준일	2026-08-24

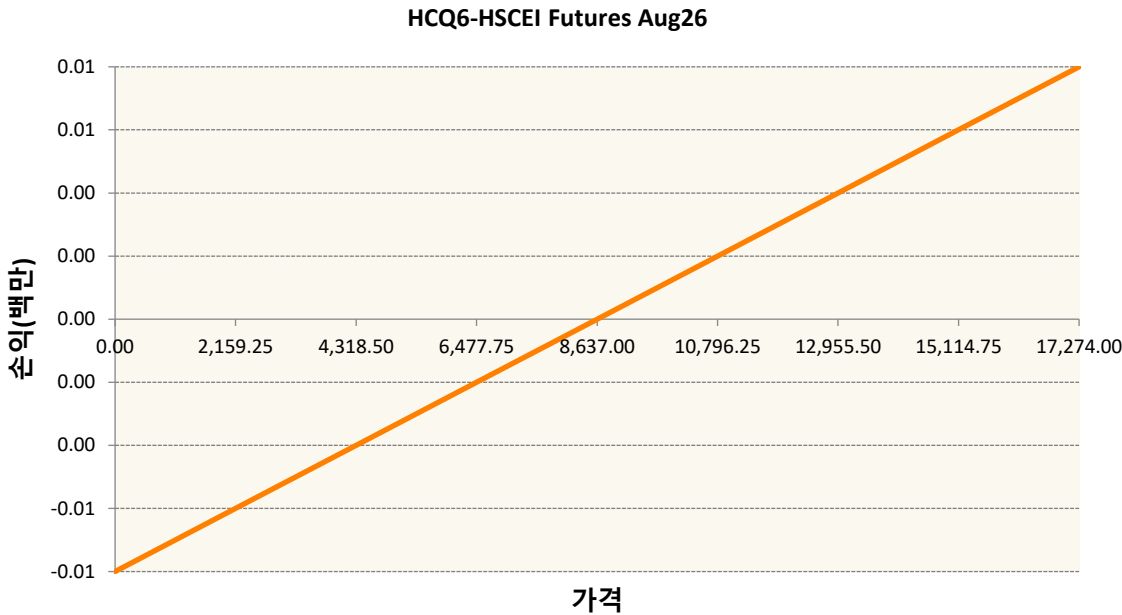
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,588	0	1,588	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ6	HSCEI Futures Aug26	127
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

144

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

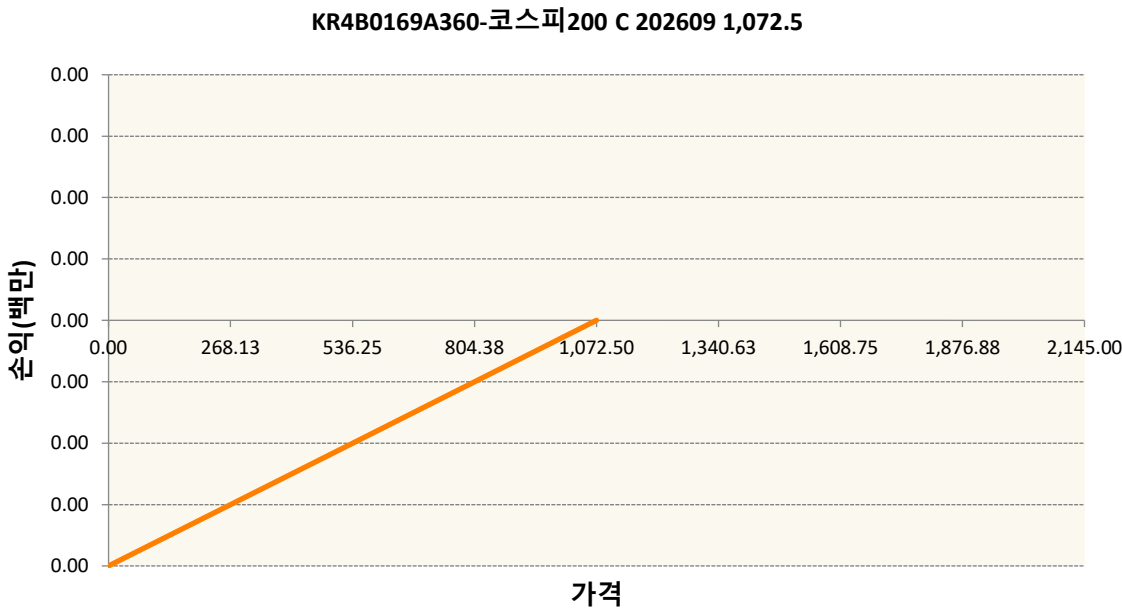
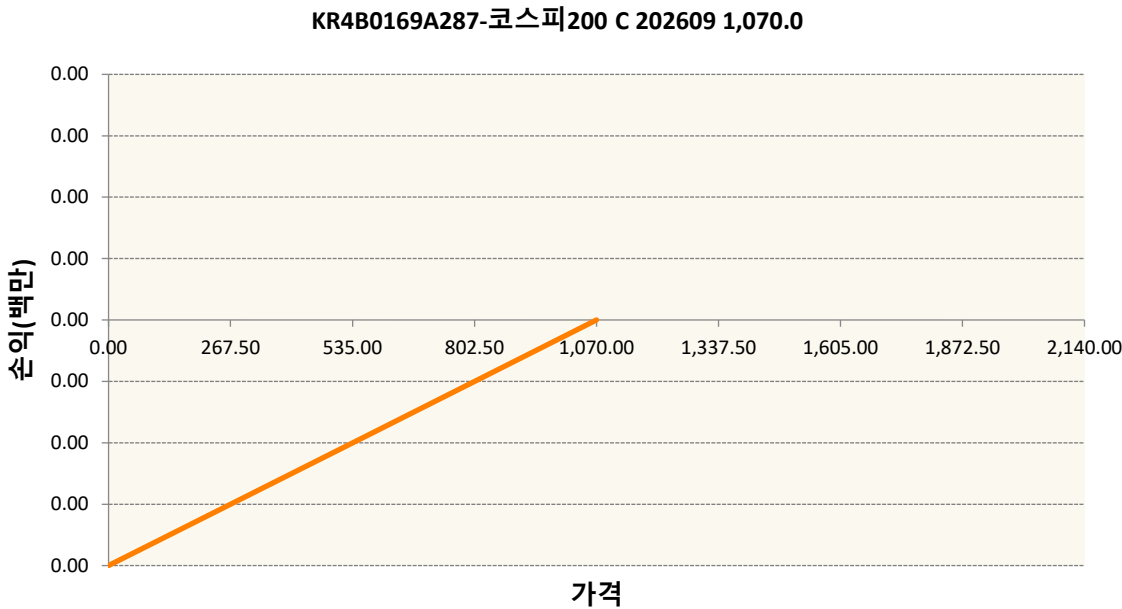
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

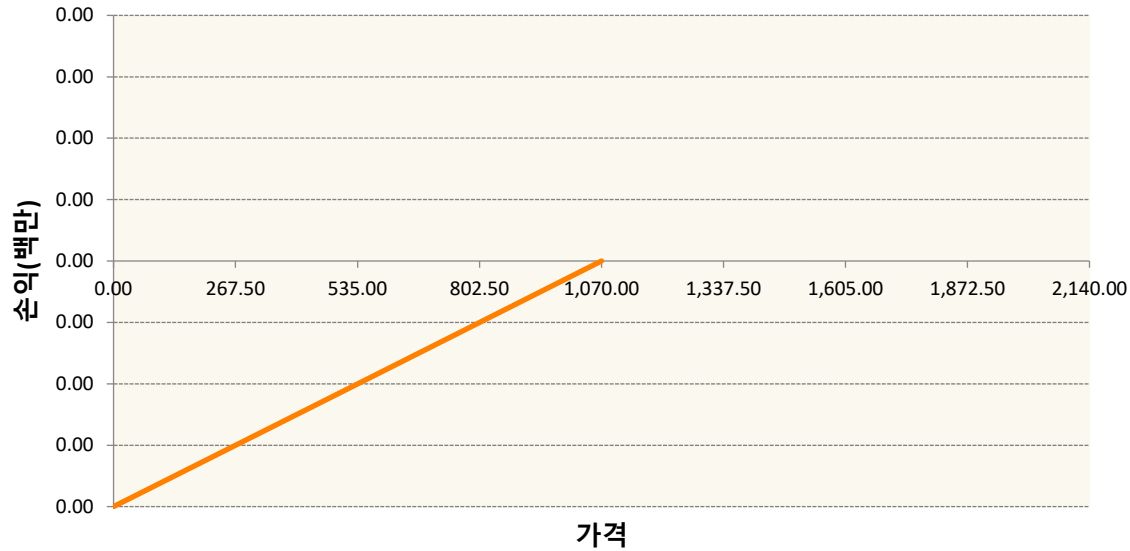
(단위:백만원)

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							835
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-591	-626	-664	-704	-746	-790	-835
-5.33%	-301	-346	-392	-440	-489	-539	-590
-2.67%	-45	-98	-151	-205	-259	-314	-369
0%	172	115	57	0	-58	-115	-173
2.67%	349	291	232	174	116	57	-1
5.33%	487	431	375	319	262	205	147
8.00%	589	540	489	436	383	328	273
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							1,213
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-867	-915	-969	-1,026	-1,086	-1,149	-1,213
-5.33%	-444	-507	-574	-642	-712	-784	-857
-2.67%	-70	-145	-222	-299	-377	-456	-535
0%	248	165	83	0	-83	-166	-249
2.67%	508	424	339	255	171	86	2
5.33%	711	631	550	467	385	302	219
8.00%	864	792	717	640	562	483	403
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							434
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-307	-325	-345	-366	-387	-410	-434
-5.33%	-156	-179	-204	-228	-254	-280	-306
-2.67%	-23	-51	-78	-106	-135	-163	-192
0%	89	60	30	0	-30	-60	-90

2.67%	181	151	121	90	60	30	0
5.33%	253	224	195	166	136	106	76
8.00%	306	280	254	227	199	170	142

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

(단위:백만원)

3,802

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

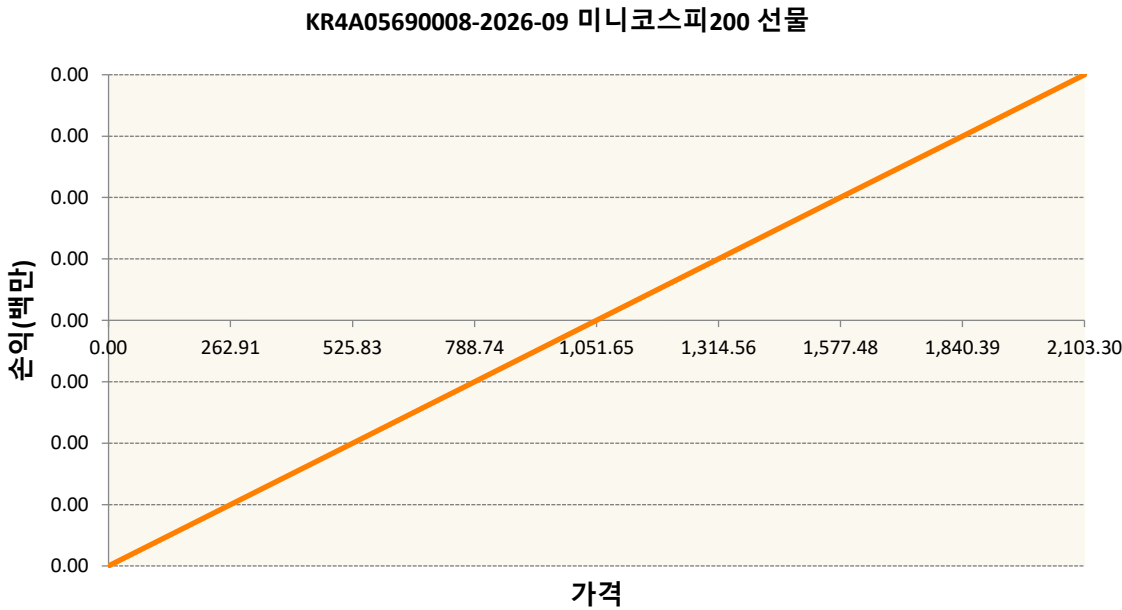
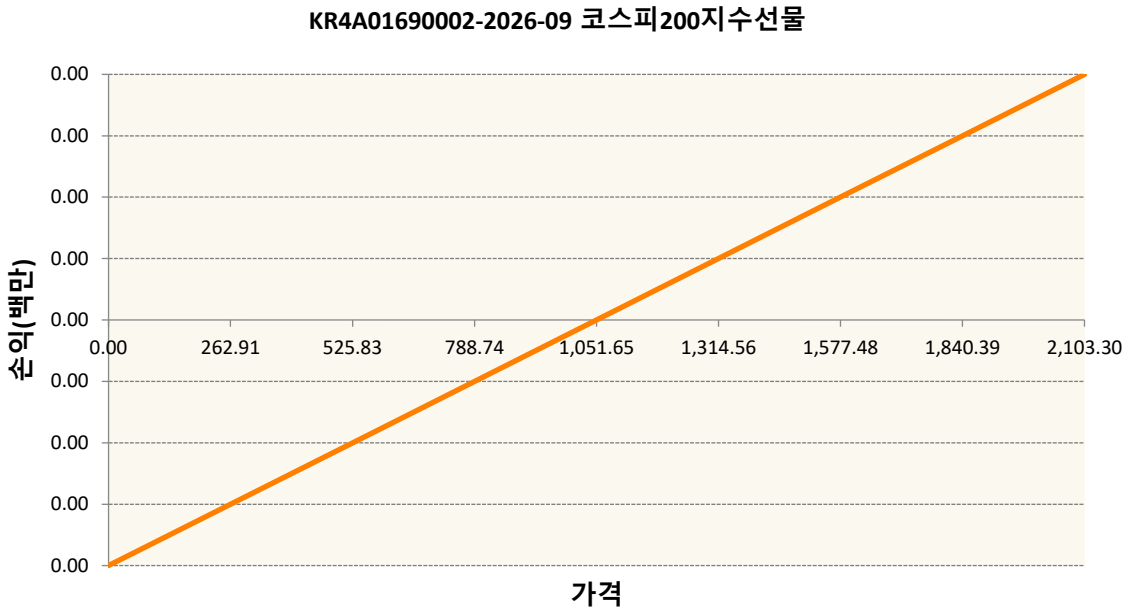
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

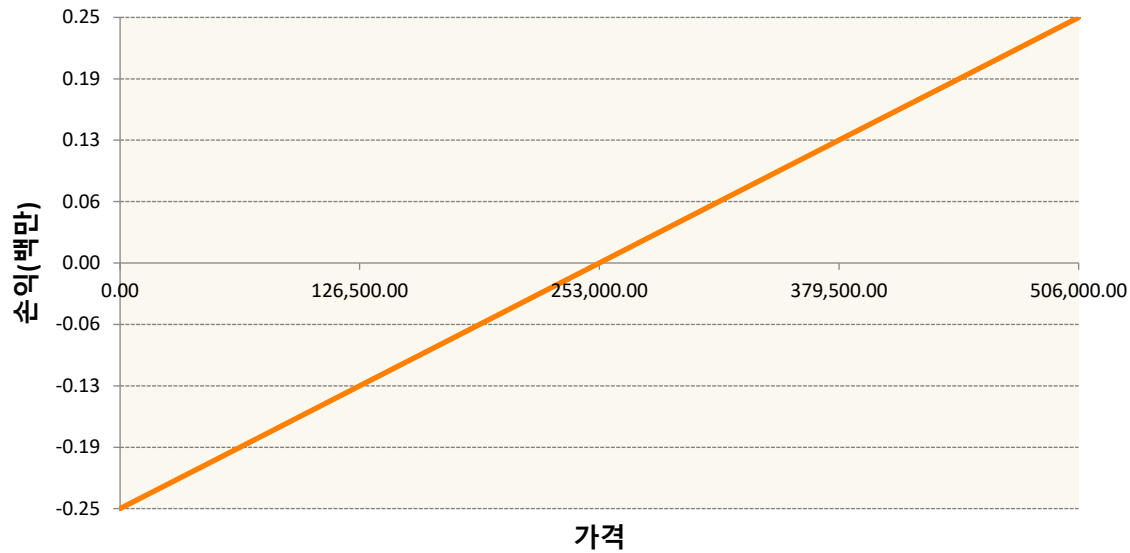
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	263	-263	장내
누계	유가증권	선물	1,105	0	1,105	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A116A0005-2026-10 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				42
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	28	28	28	28	28	28	28
8.00%	42	42	42	42	42	42	42
KR4A05690008			2026-09 미니코스피200 선물				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
KR4A116A0005			2026-10 삼성전자개별선물				4
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

187

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

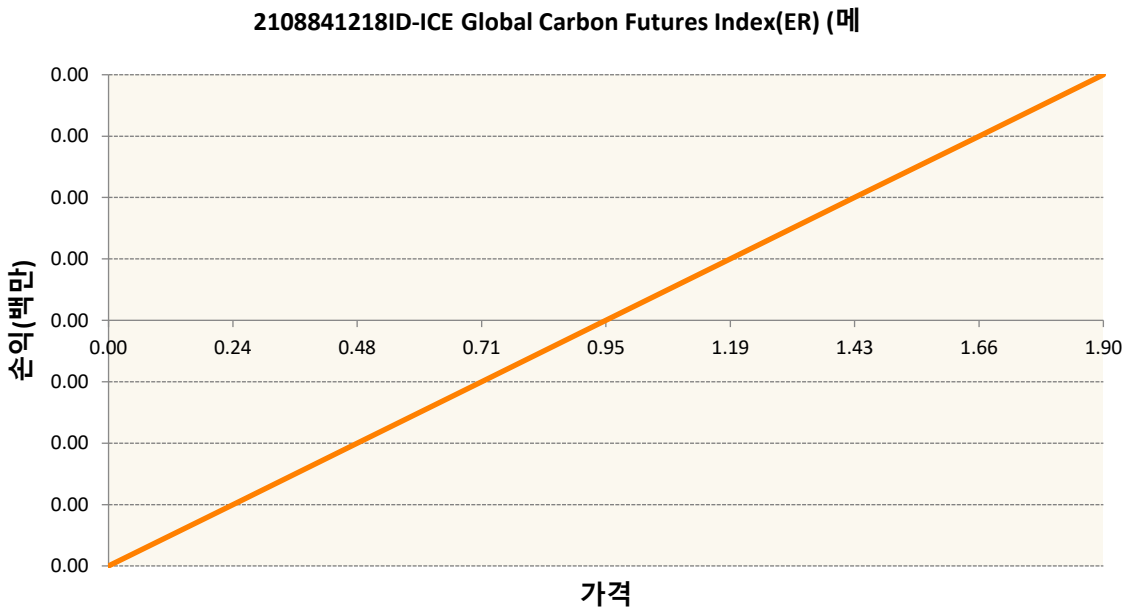
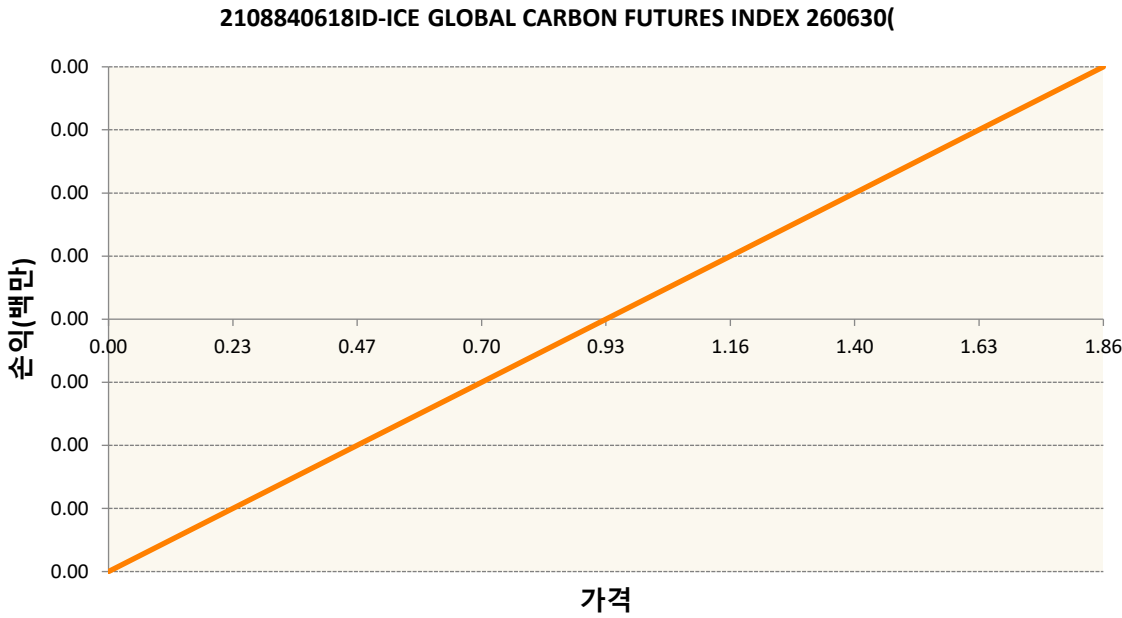
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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(		453
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		114

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	629

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

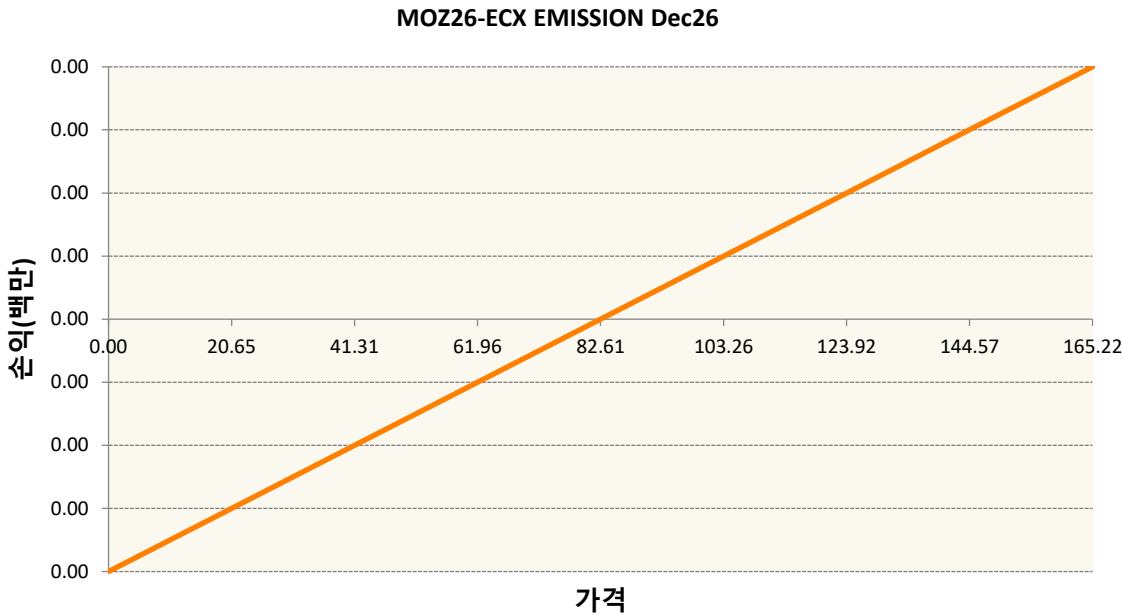
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,342	0	5,342	
누계	통화	선도	0	2,534	-2,534	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G7XIKRW/EUR 31-08-26E	203
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	427

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

(단위:백만원)

688

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

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)	59
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	2026-08-25
기준일	2026-08-24

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	-5,237	0	-5,237	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)	193
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	179

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

(단위:백만원)

784

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

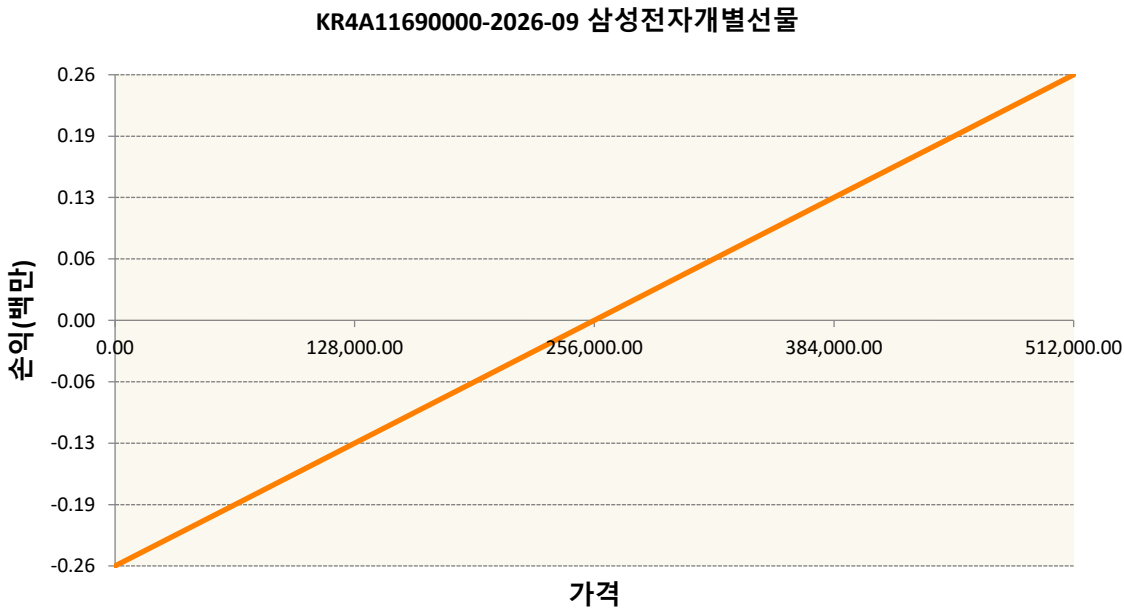
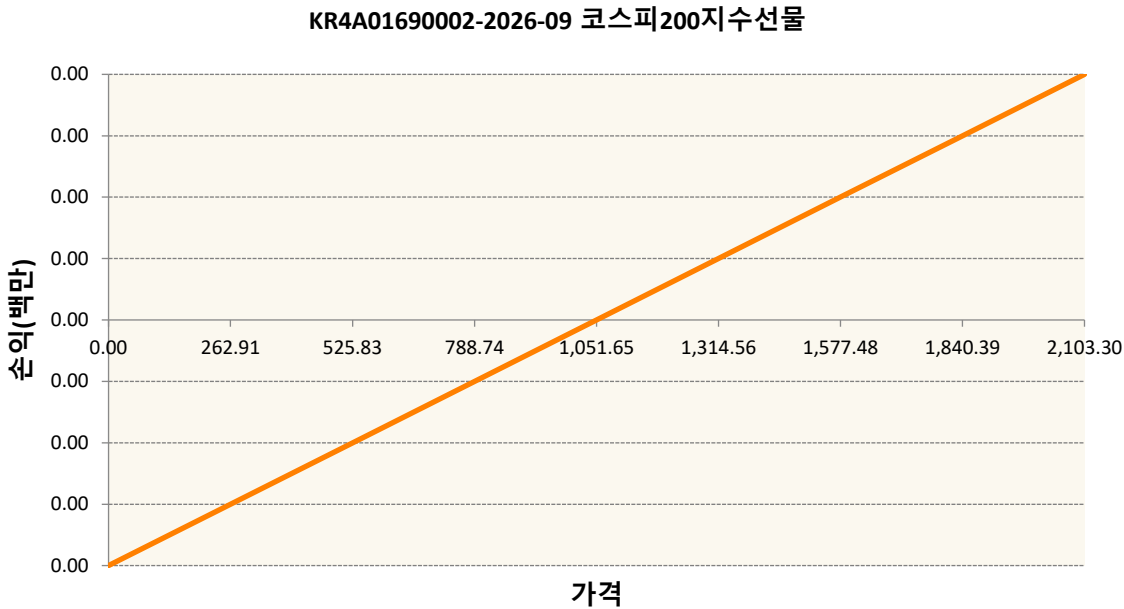
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,584	4,038	-2,455	장내
누계	유가증권	선물	20,889	0	20,889	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물						1,412
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	-1,412	
-5.33%	-942	-942	-942	-942	-942	-942	-942	
-2.67%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	471	471	471	471	471	471	471	
5.33%	942	942	942	942	942	942	942	
8.00%	1,412	1,412	1,412	1,412	1,412	1,412	1,412	
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물						263
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263	
-5.33%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175	
-2.67%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	88	88	88	88	88	88	88	
5.33%	175	175	175	175	175	175	175	
8.00%	263	263	263	263	263	263	263	

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

5,793

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

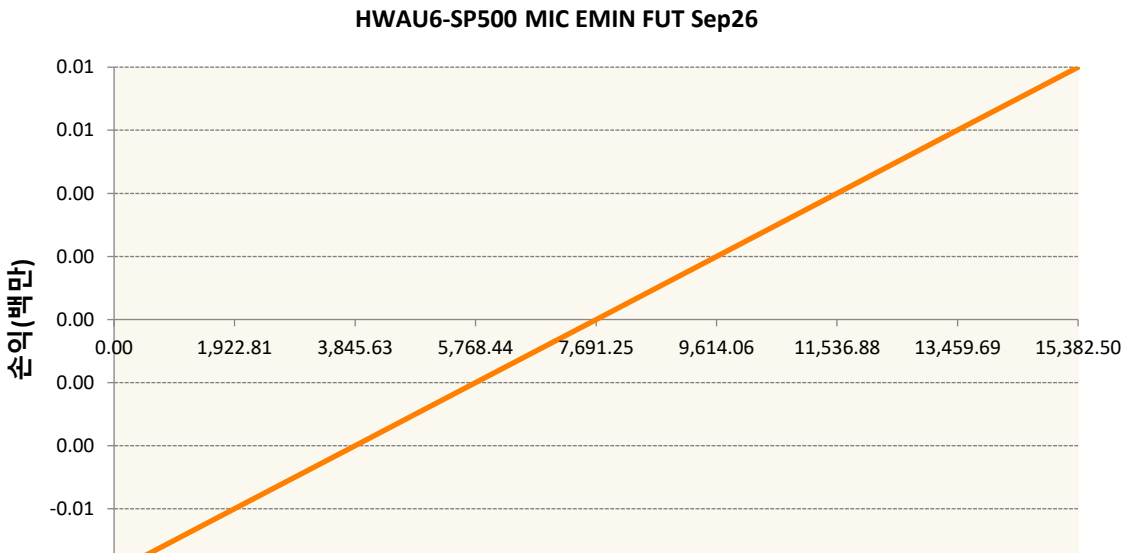
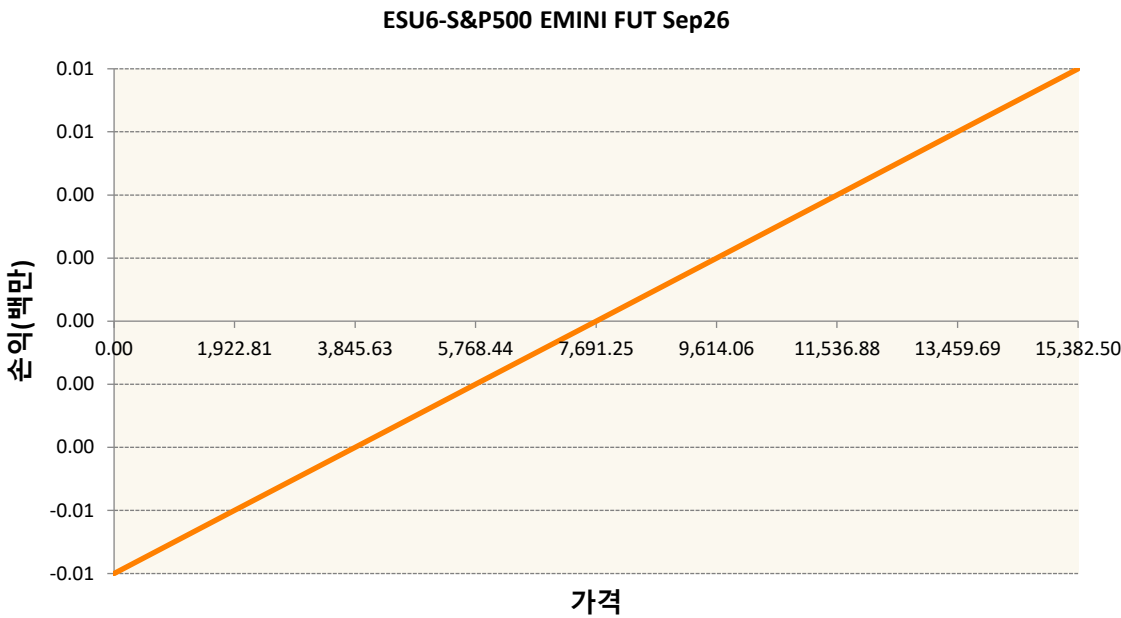
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

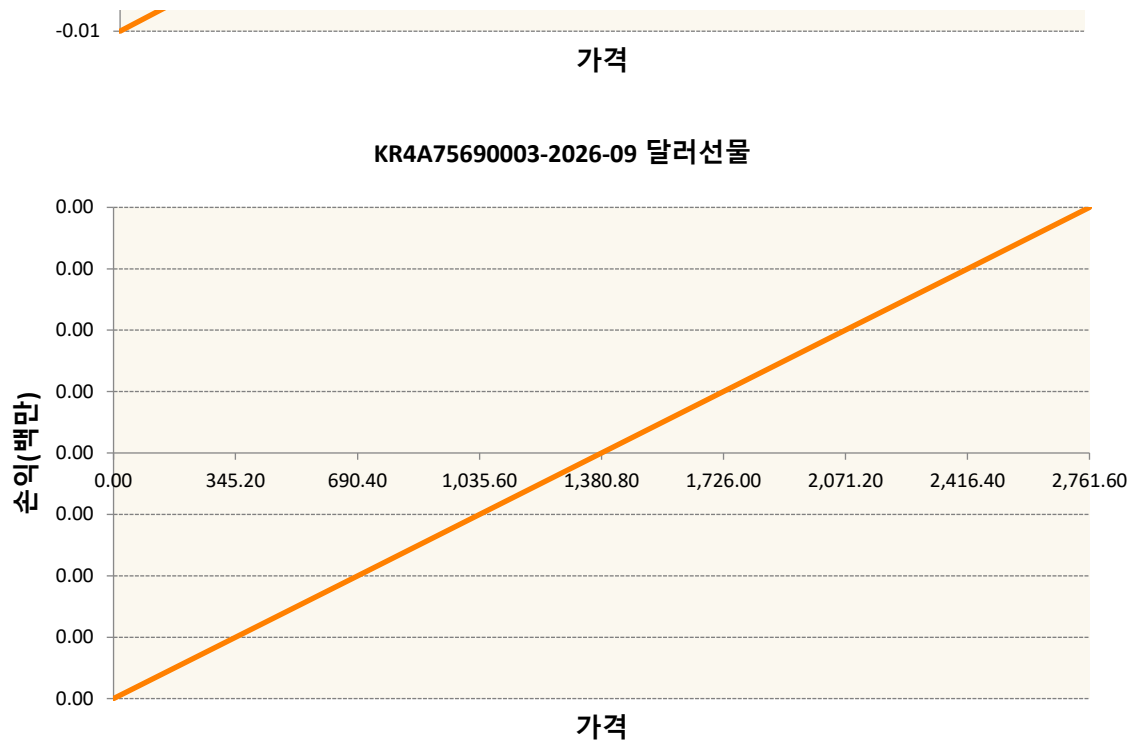
1. 계약금액

(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	71,347	0	71,347	
누계	지수	선물	176	0	176	장내
누계	통화	선물	11,184	0	11,184	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		5,708
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		14
KR4A756900 2026-09 달러선물			895

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,811

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

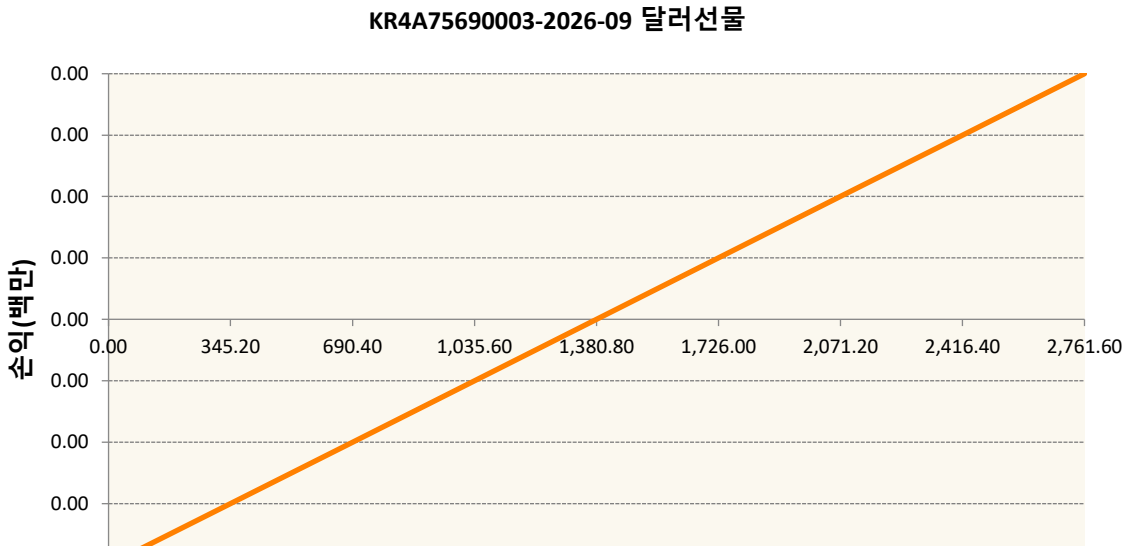
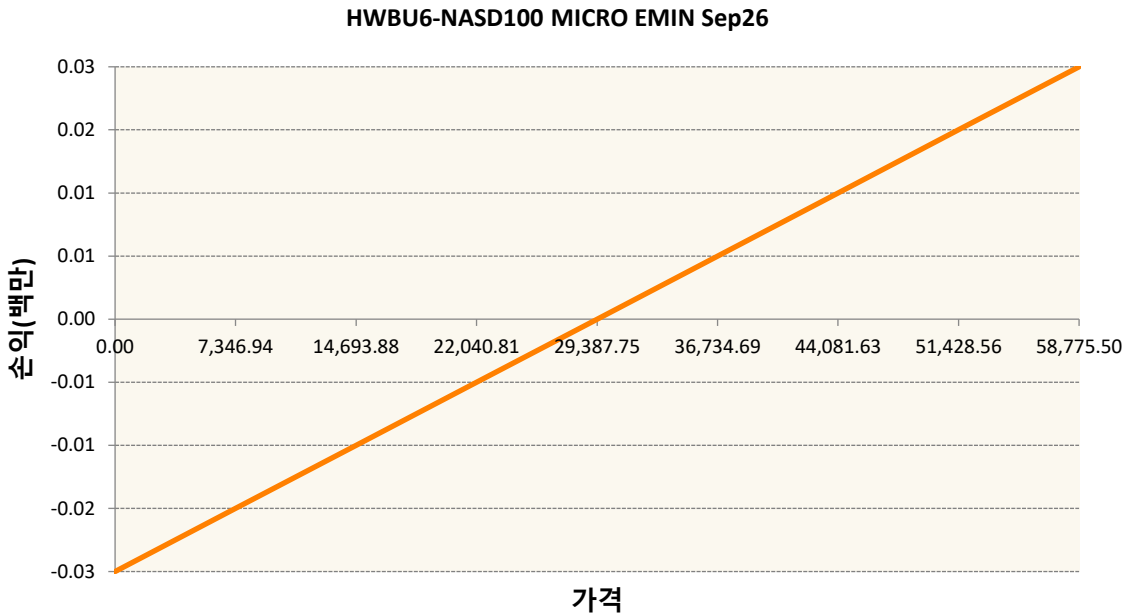
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

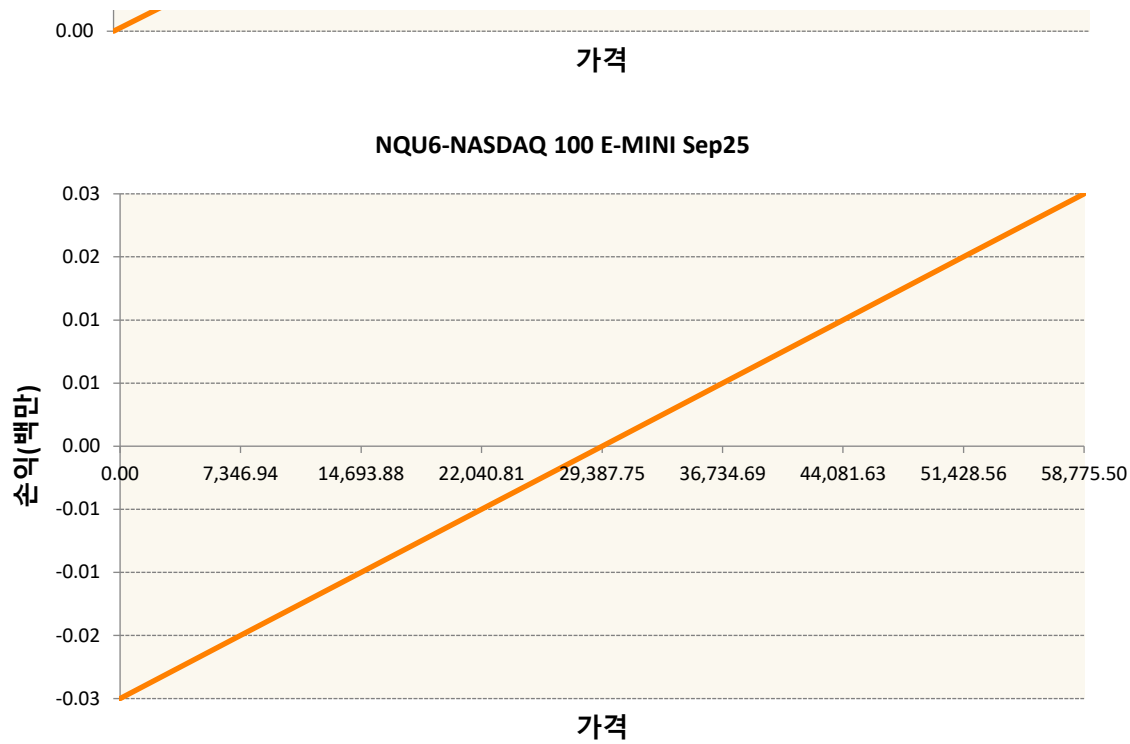
1. 계약금액

(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	706	0	706	장내
누계	지수	선물	33,875	0	33,875	
누계	통화	선물	4,294	0	4,294	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		56
KR4A756900	2026-09 달러선물		344
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,710

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,082

공시일	2026-08-25
기준일	2026-08-24

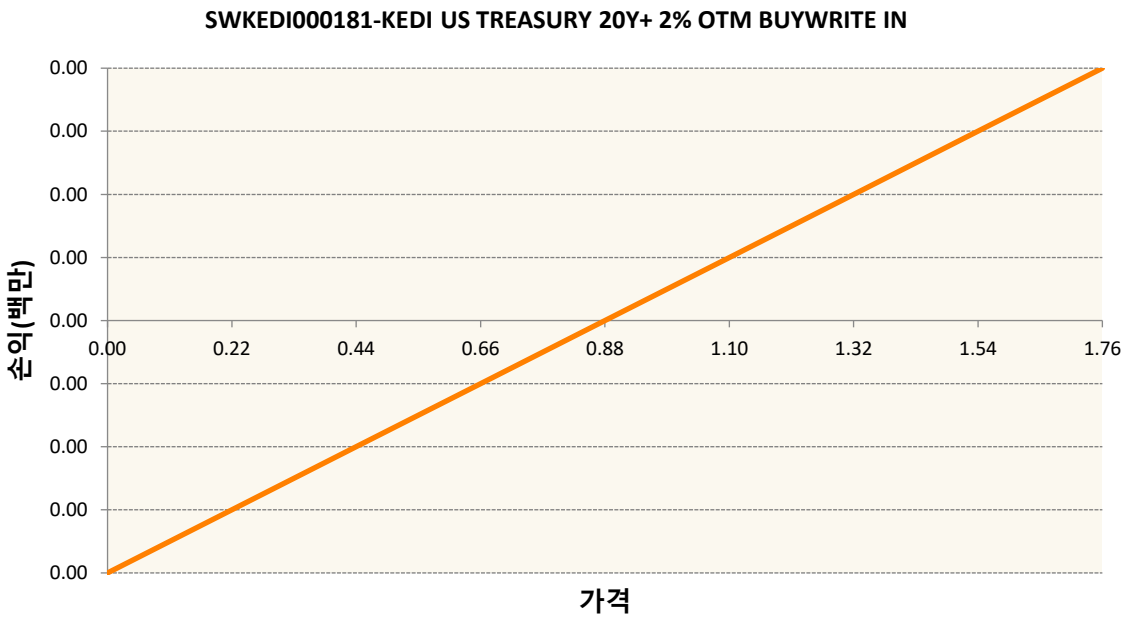
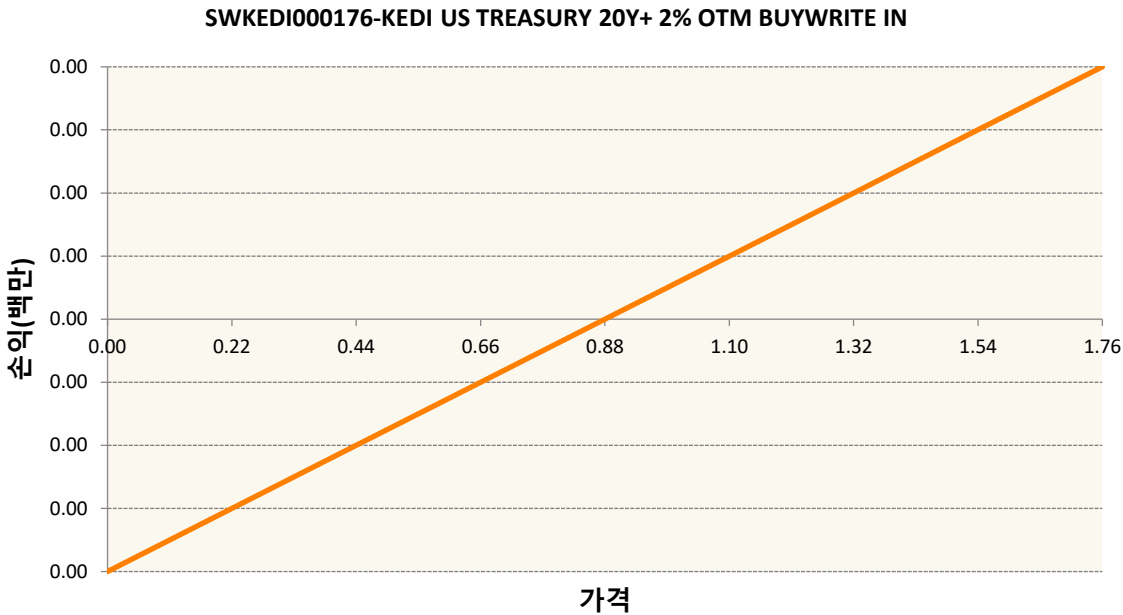
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

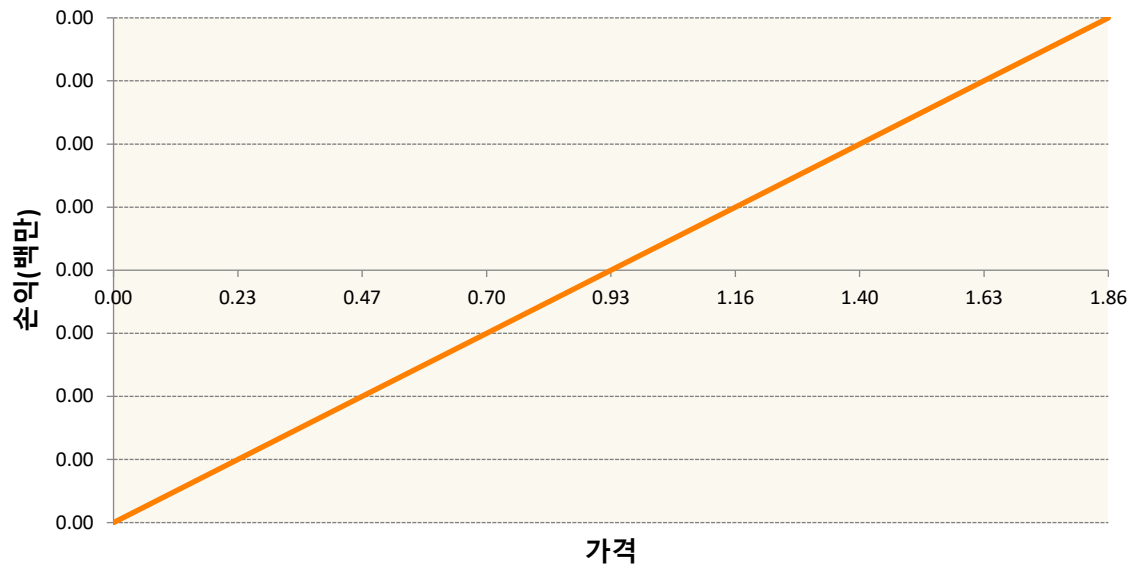
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	279,185	0	279,185	장외

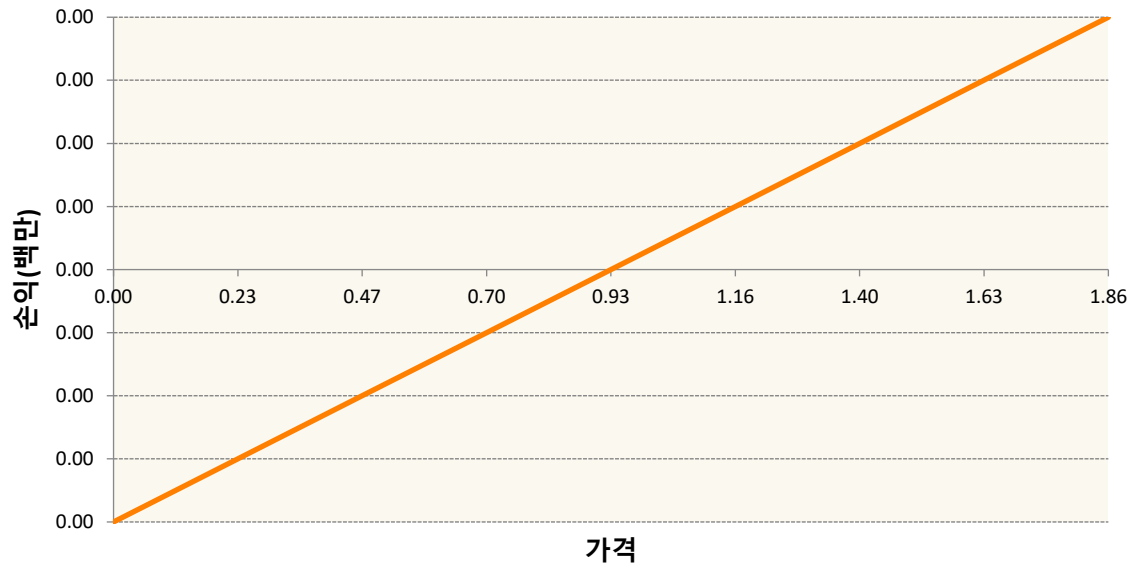
2. 만기시점의 손익구조



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	7,171
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,814
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,288
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,092

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

(단위:백만원)

9,532
