

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

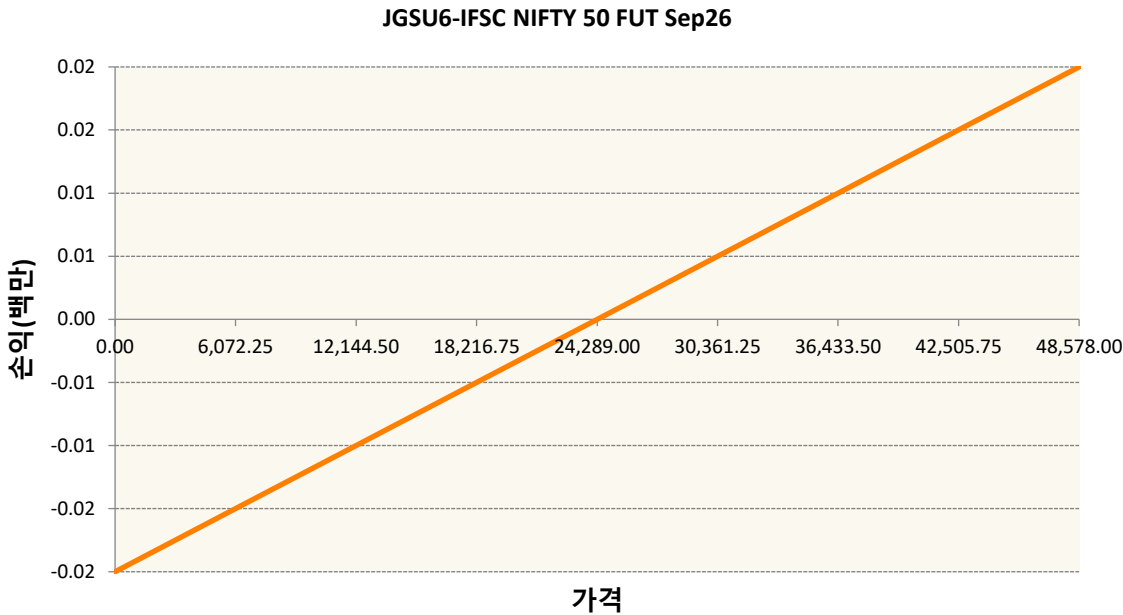
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	337	0	337	

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	2026-08-26
기준일	2026-08-25

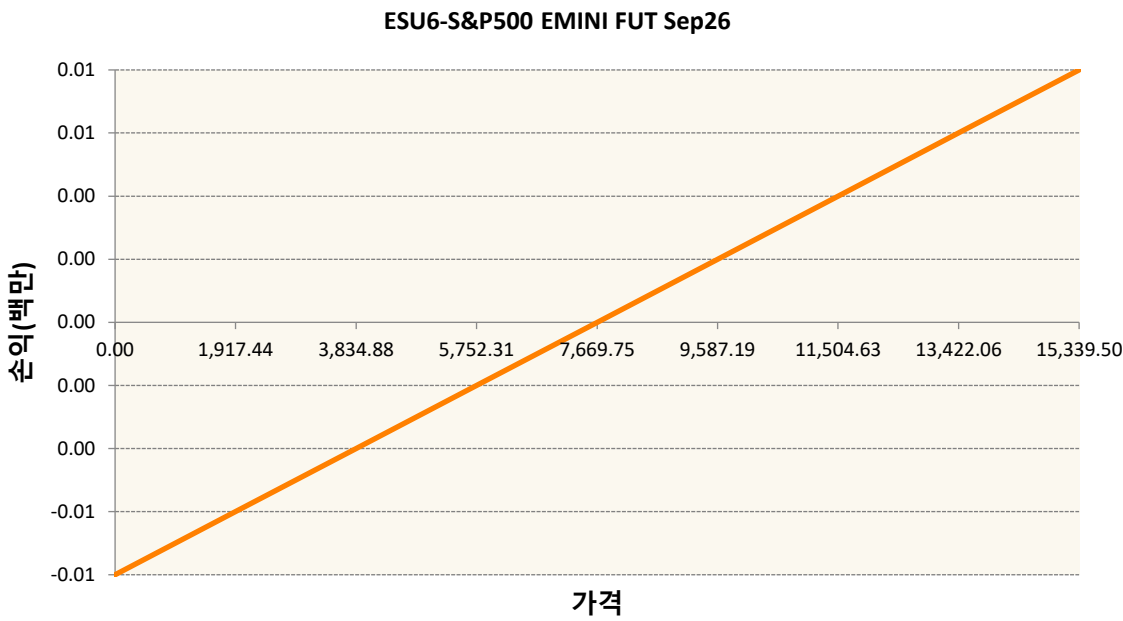
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-08-26
기준일	2026-08-25

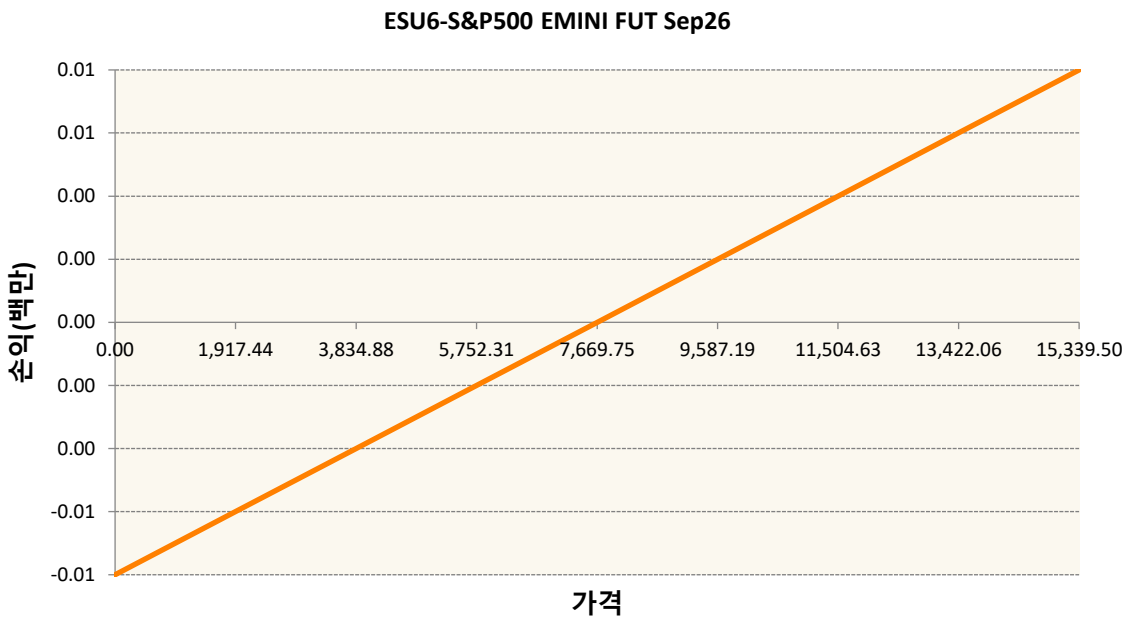
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	579	0	579	

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	2026-08-26
기준일	2026-08-25

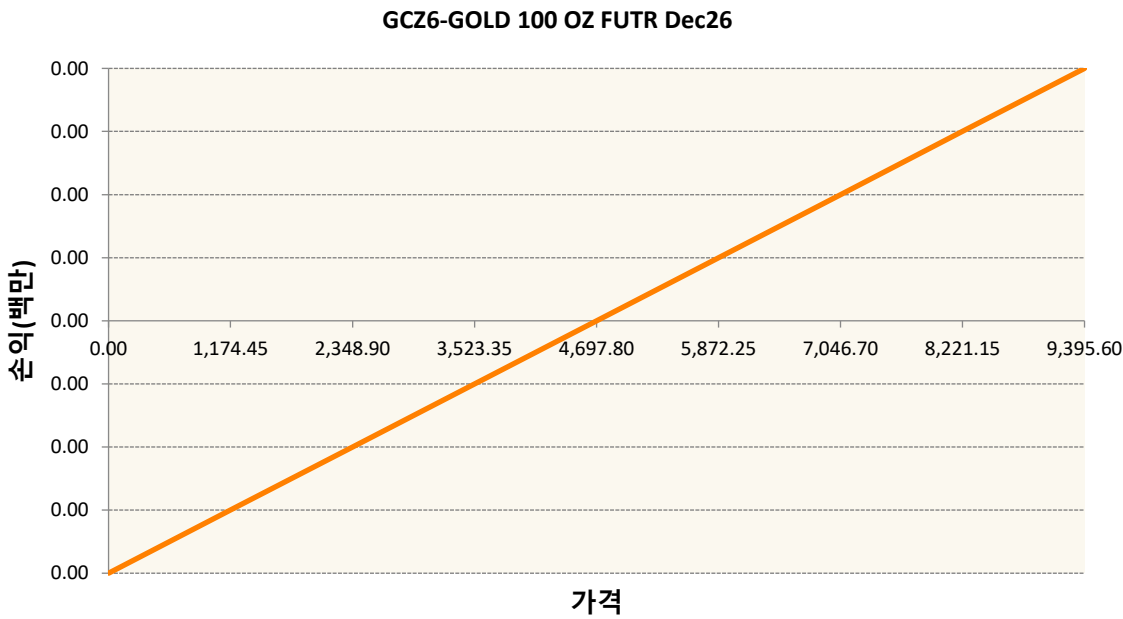
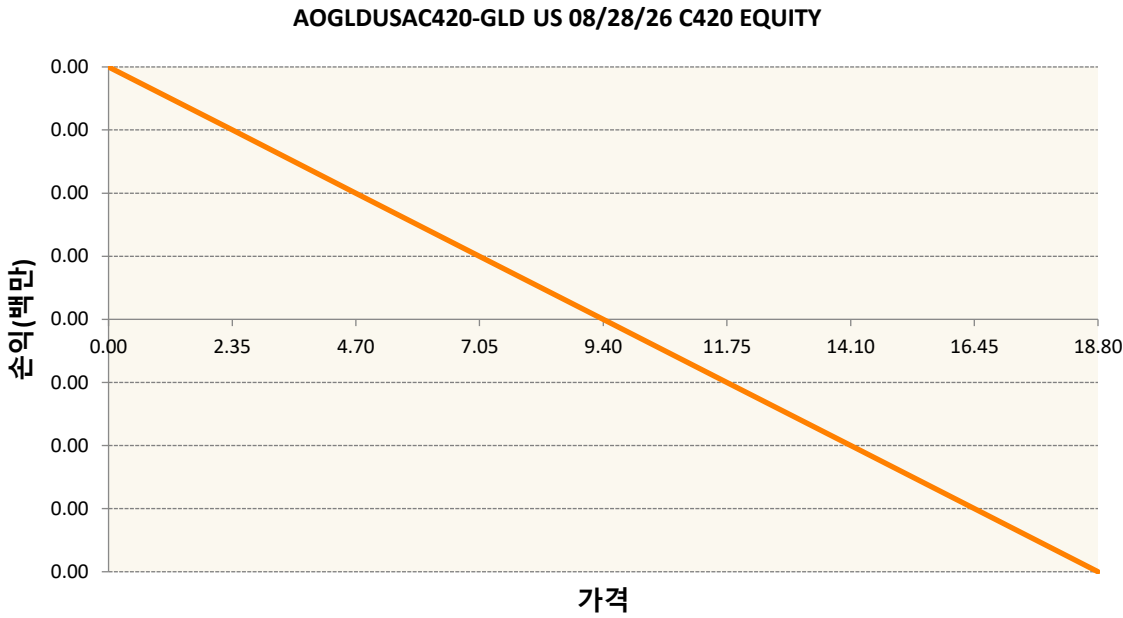
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,377	0	5,377	
누계	실물자산	옵션	0	108	-108	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSAC GLD US 08/28/26 C420 EQUITY		9
GCZ6	GOLD 100 OZ FUTR Dec26	430

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	577

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

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	315
AOPLTRUAP PLTR US 08/28/26 P180 EQUITY	9

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

(단위:백만원)

1,112

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

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

1

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

(단위:백만원)

1

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

(단위:백만원)

14,501

공시일 2026-08-26

기준일 2026-08-25

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	2026-08-26
기준일	2026-08-25

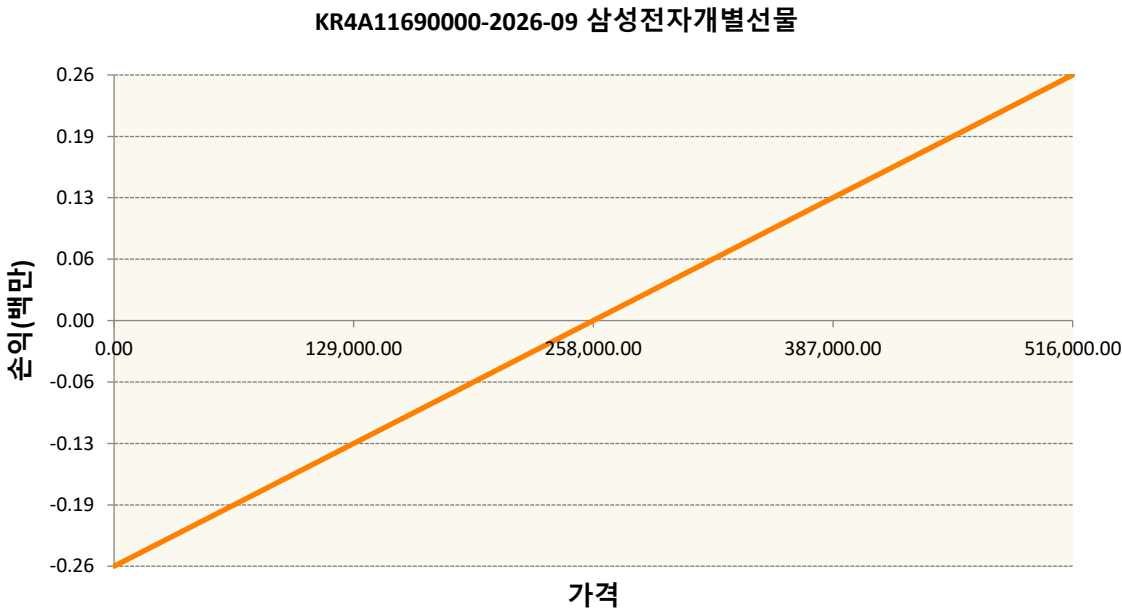
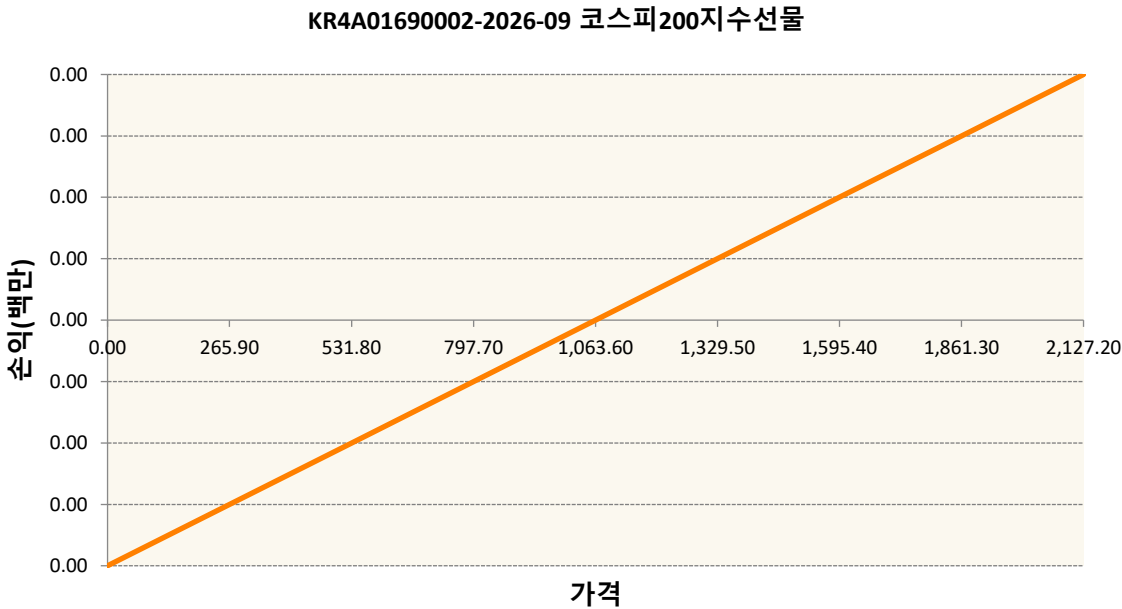
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	20,845	0	20,845	장내
누계	유가증권	옵션	0	42,768	-42,768	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,055.00	0.00

The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The profit is zero at a price of 1,057.50 thousand won.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	0.00
264.38	0.00
528.75	0.00
793.13	0.00
1,057.50	0.00
1,321.88	0.00
1,586.25	0.00
1,850.63	0.00
2,115.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					552
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-552	-552	-552	-552	-552	-552	-552
-5.33%	-368	-368	-368	-368	-368	-368	-368
-2.67%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	184	184	184	184	184	184	184
5.33%	368	368	368	368	368	368	368
8.00%	552	552	552	552	552	552	552
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							1,587

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,545	-1,548	-1,552	-1,558	-1,565	-1,575	-1,587
-5.33%	-879	-892	-907	-924	-944	-965	-988
-2.67%	-295	-324	-355	-387	-419	-452	-485
0%	109	73	36	0	-36	-73	-109
2.67%	302	278	252	224	195	165	134
5.33%	361	352	340	326	309	290	270
8.00%	372	370	366	361	354	345	334

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%	-1,057	-1,058	-1,061	-1,064	-1,069	-1,075	-1,082
-5.33%	-608	-616	-625	-636	-649	-662	-677
-2.67%	-209	-228	-248	-269	-290	-311	-333
0%	74	49	25	0	-25	-49	-74
2.67%	214	197	178	159	139	118	97
5.33%	259	252	243	233	221	208	194
8.00%	268	266	264	260	255	248	240

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

(단위:백만원)

10,679

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

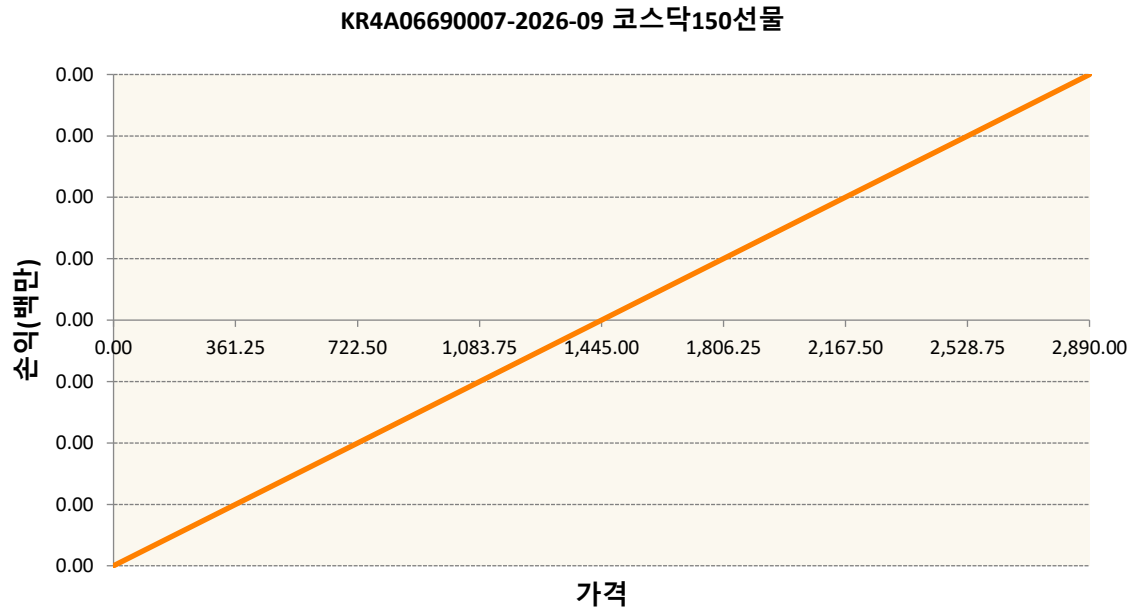
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	665	0	665	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				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

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

(단위:백만원)

17,263

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

(단위:백만원)

60,472

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

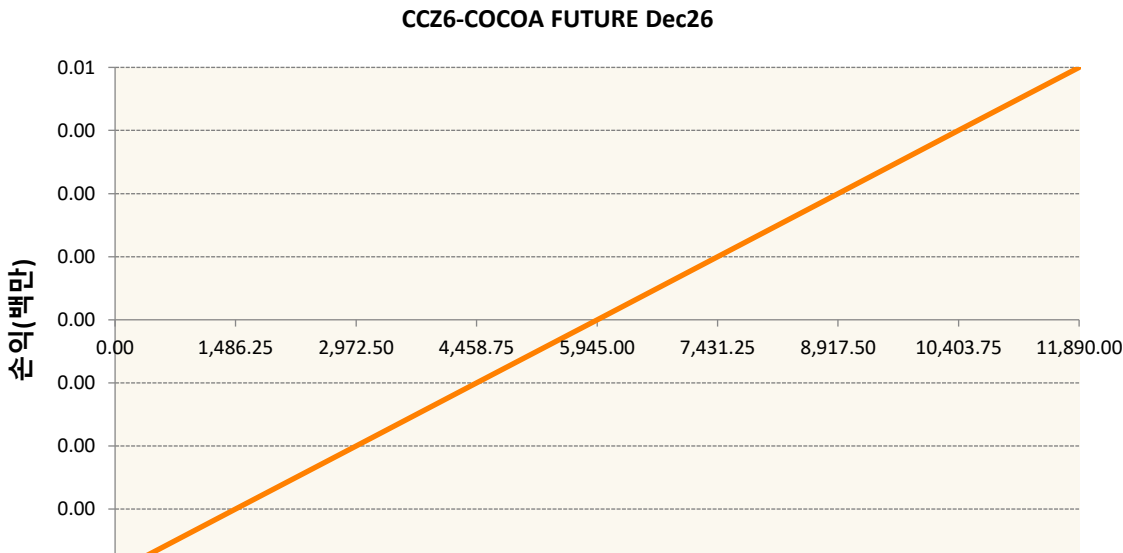
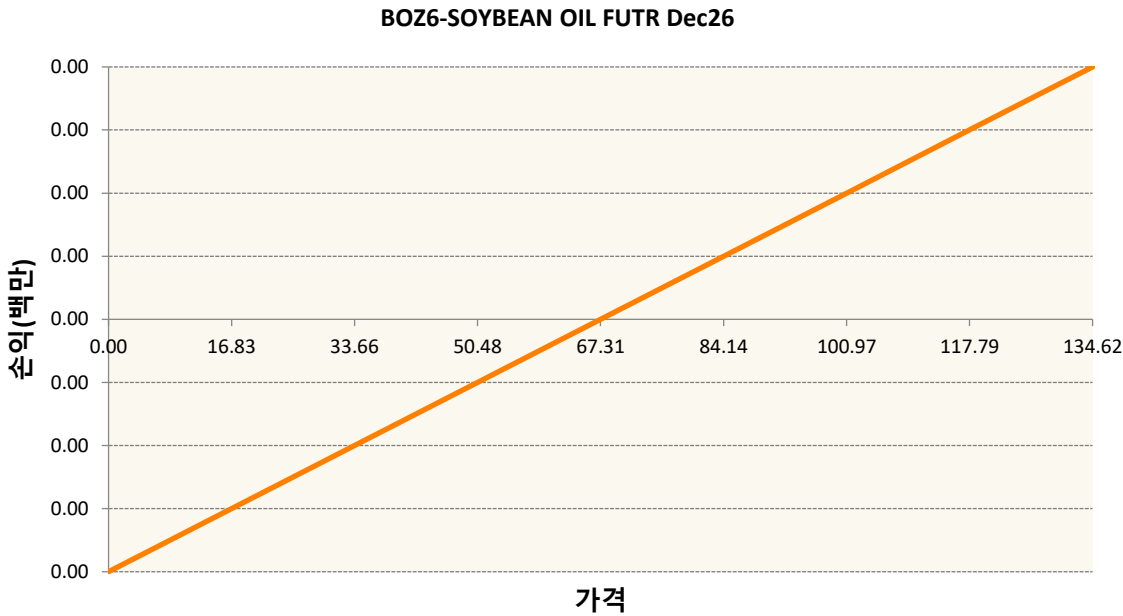
포커스농산물모(채권-파생형)

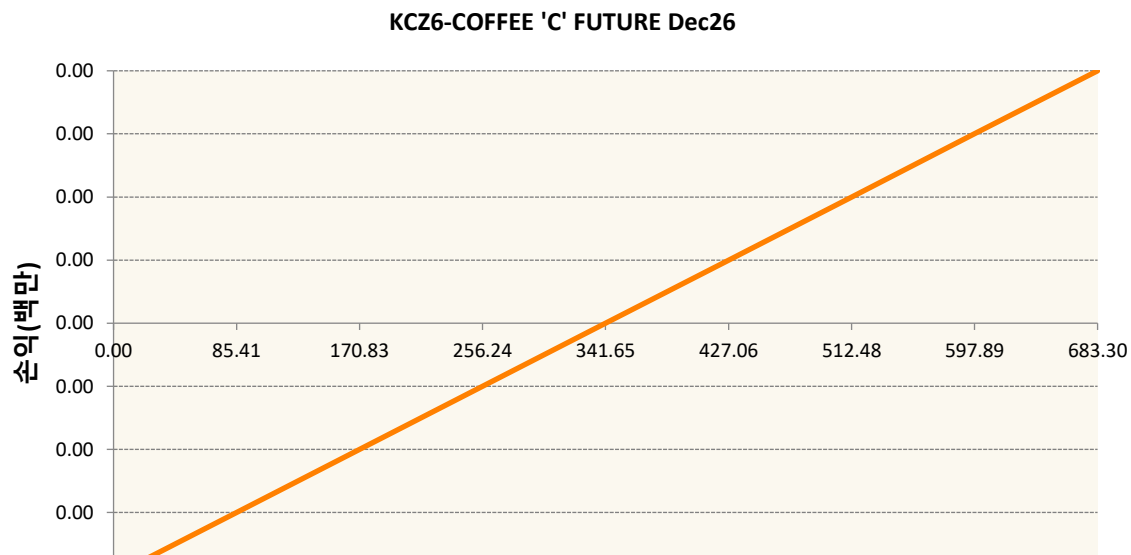
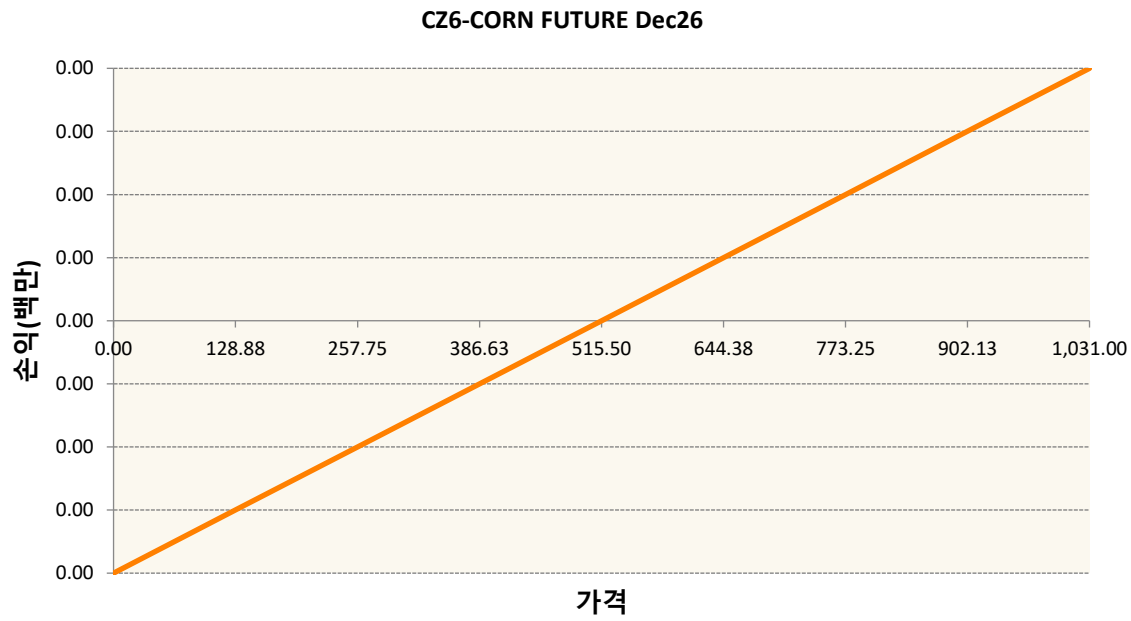
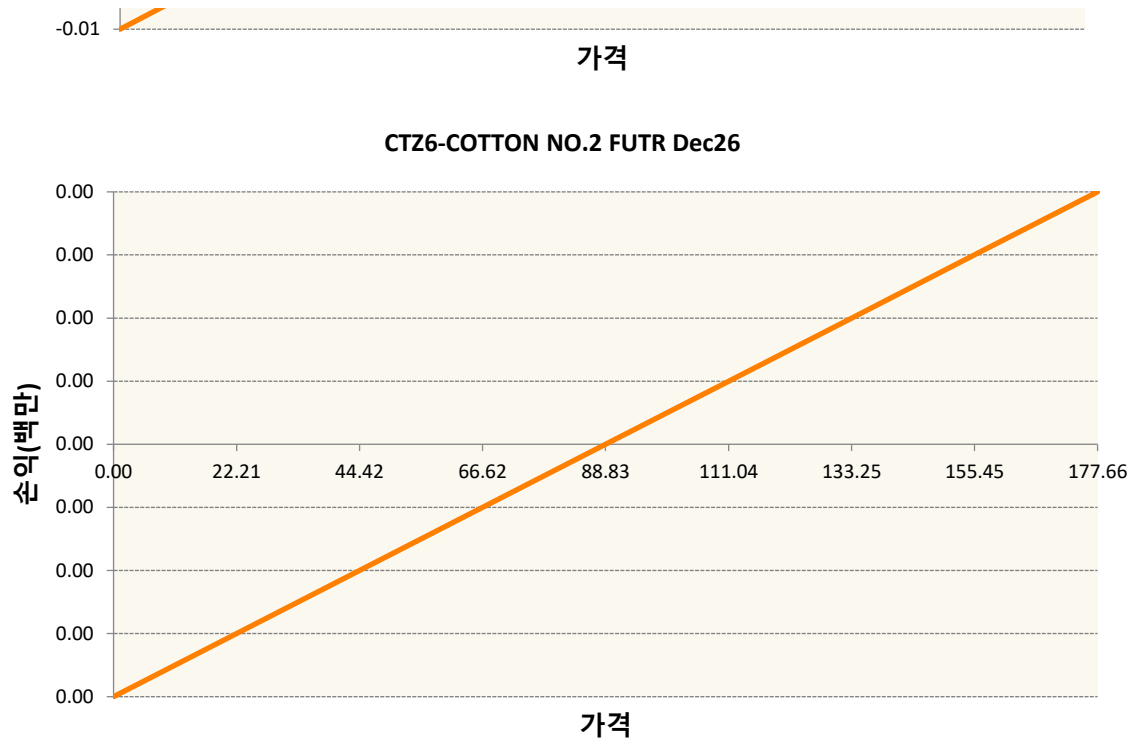
1. 계약금액

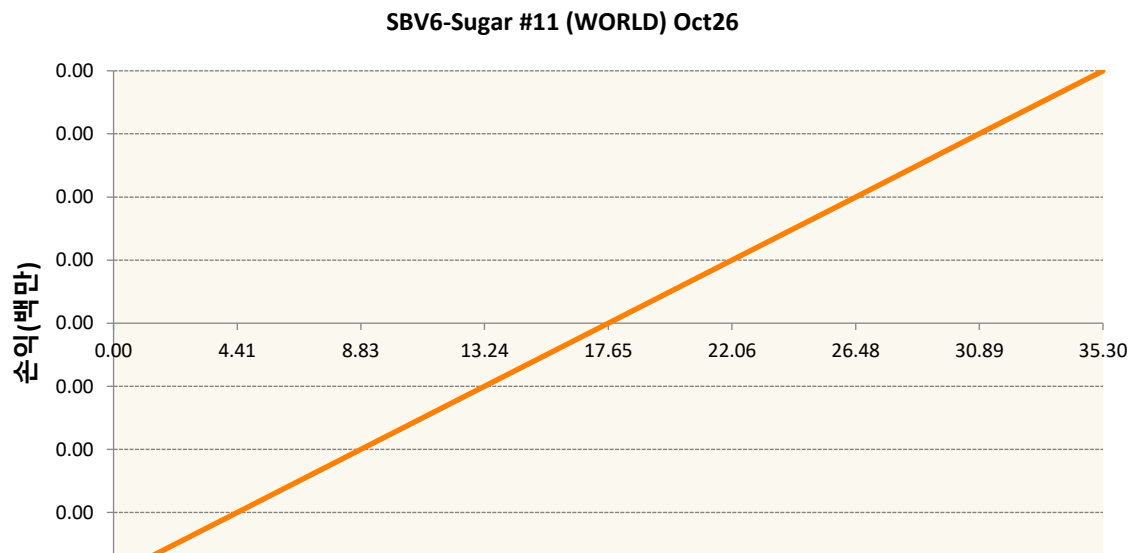
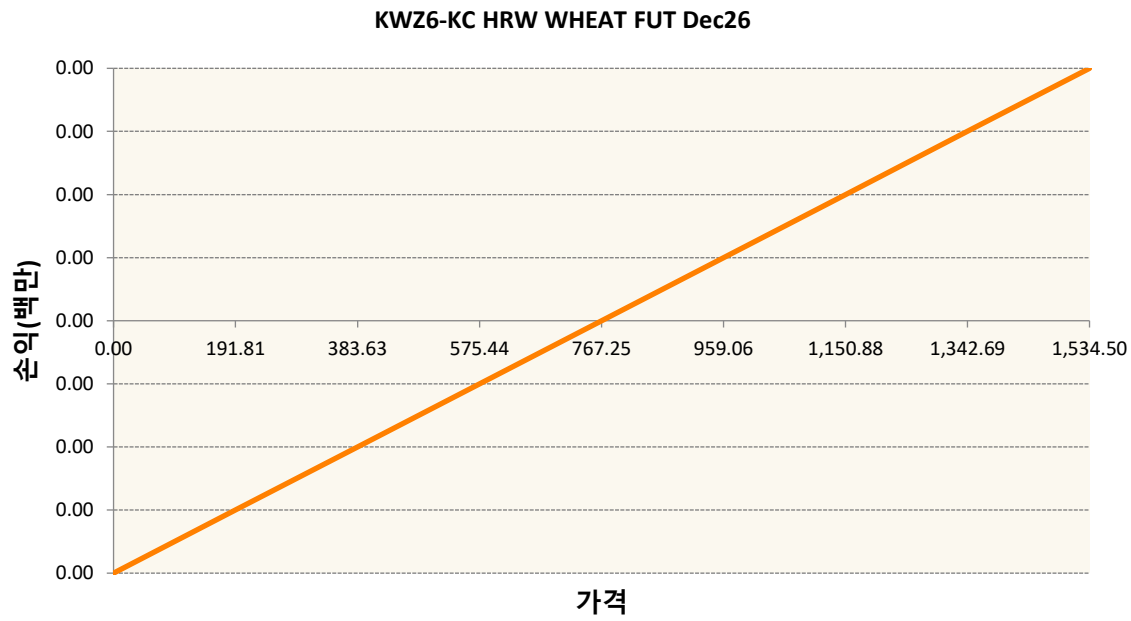
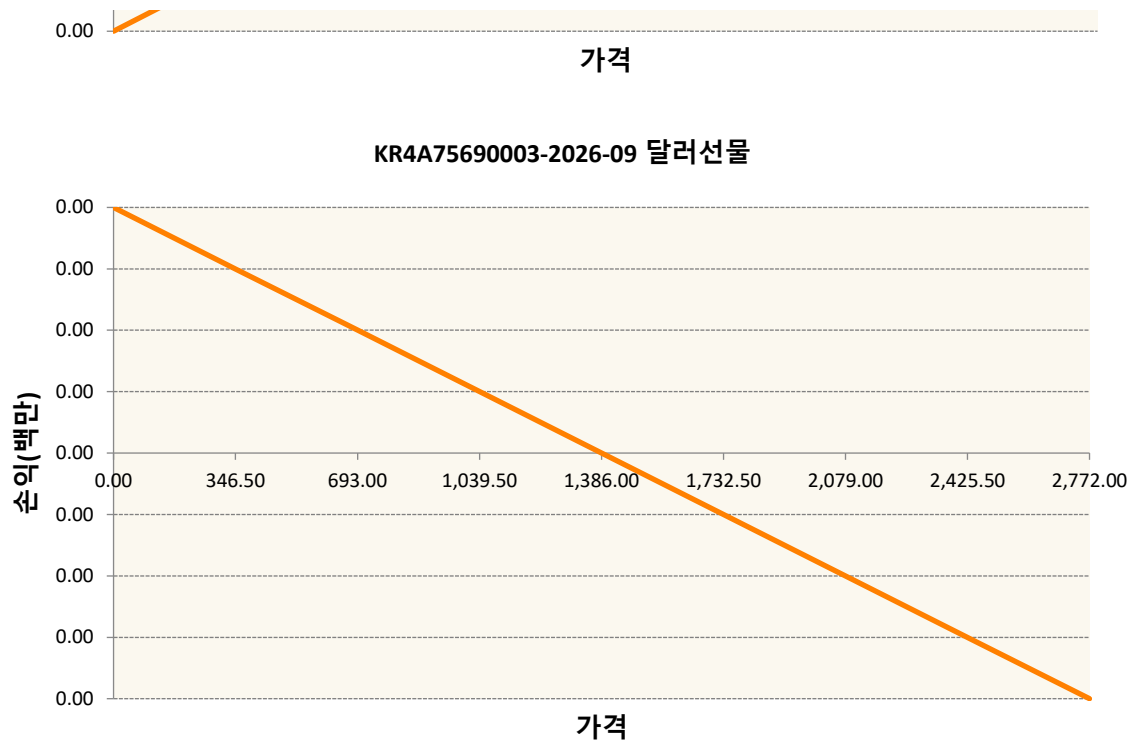
(단위:USD 백만)

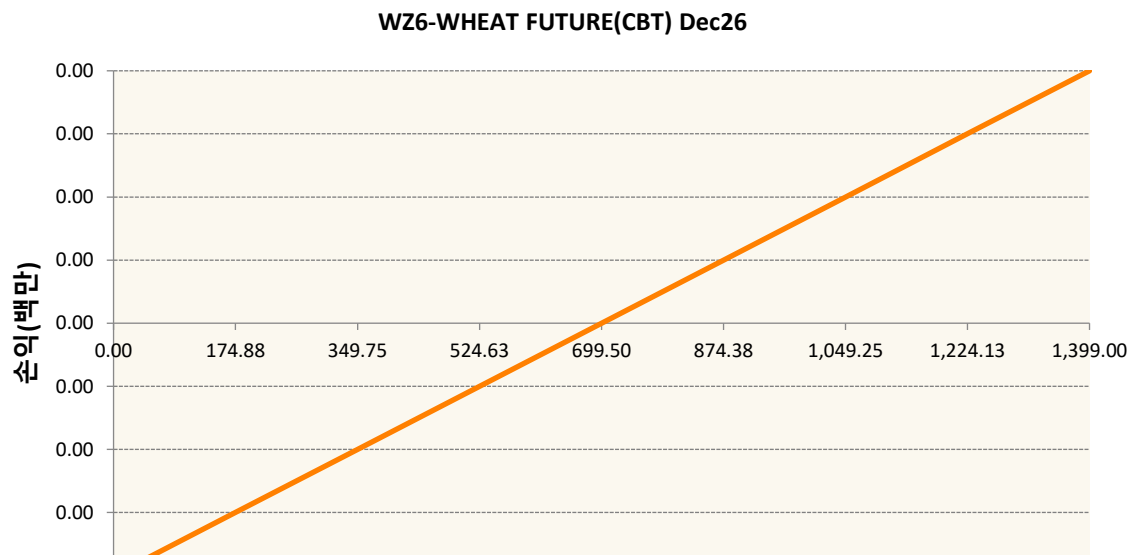
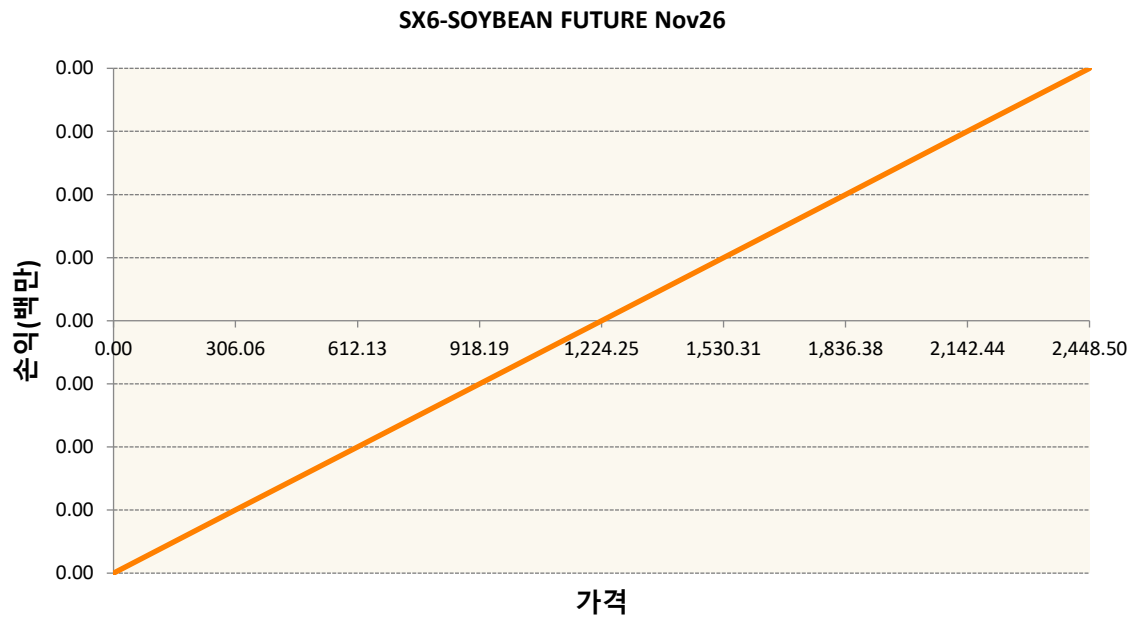
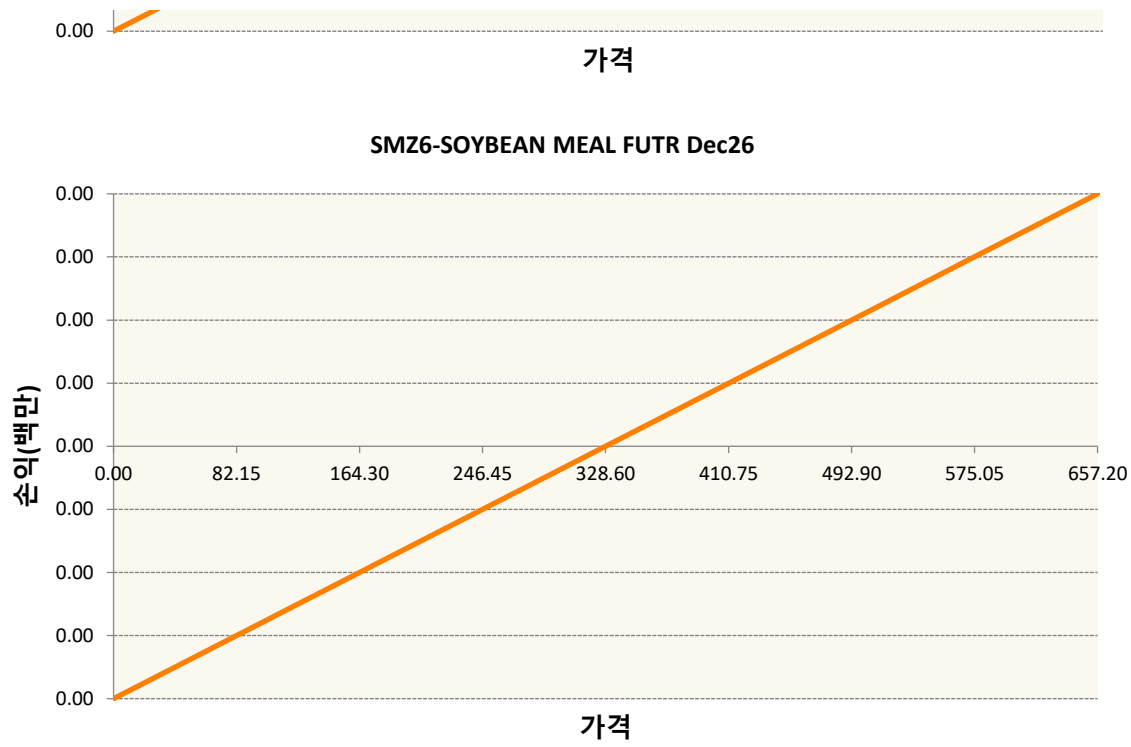
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	451	0	451	
누계	유가증권	선물	2,402	0	2,402	
누계	통화	선물	0	347	-347	장내

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	2026-08-26
기준일	2026-08-25

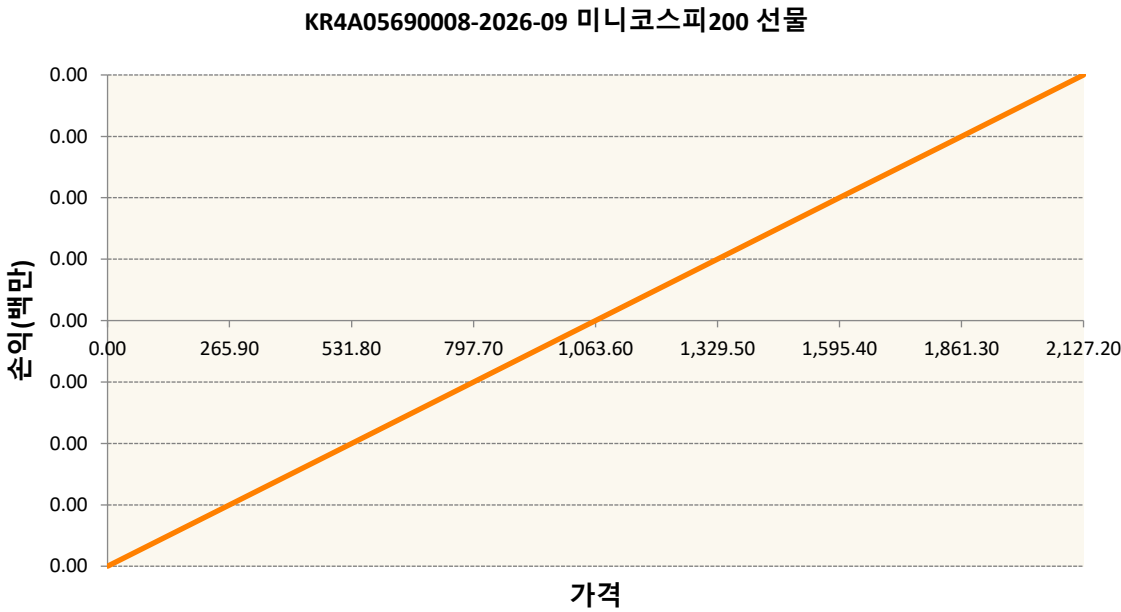
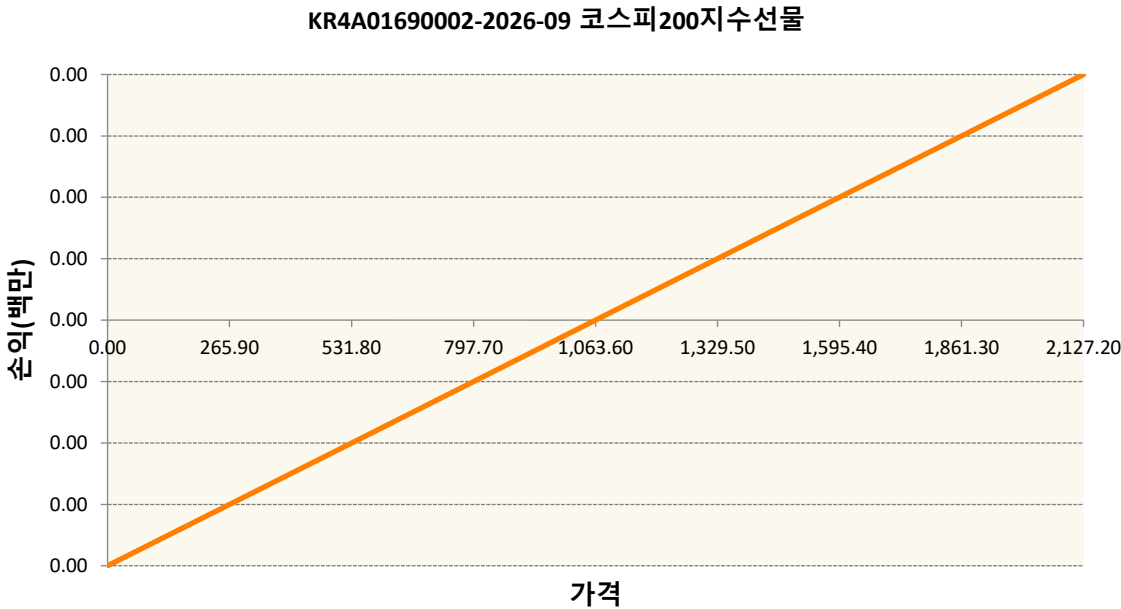
스마트인덱스모

1. 계약금액

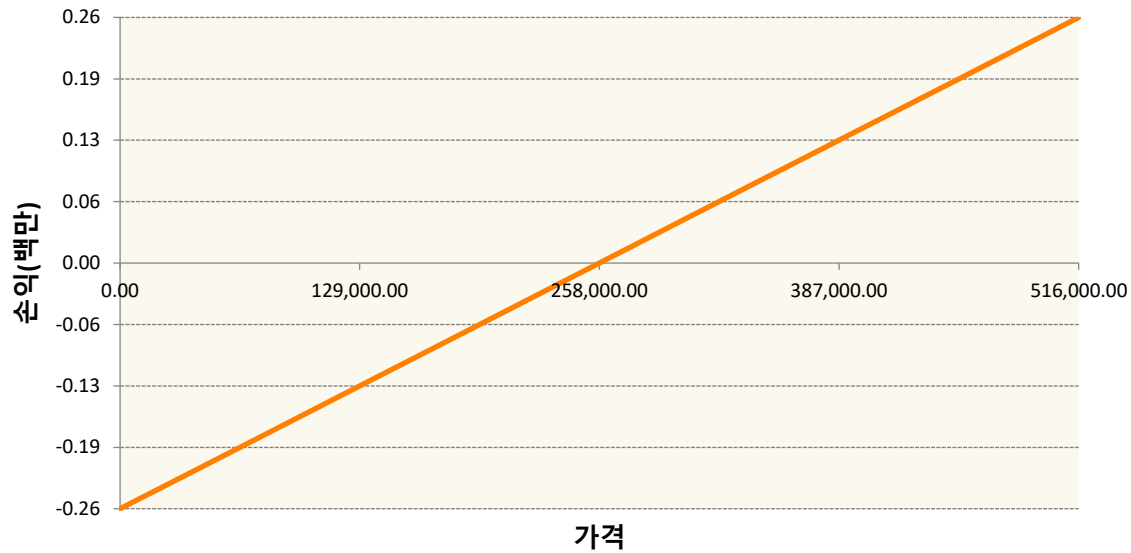
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	264	529	-265	장내
누계	유가증권	선물	4,089	0	4,089	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				212
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
-5.33%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141
-2.67%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	71	71	71	71	71	71	71
5.33%	141	141	141	141	141	141	141
8.00%	212	212	212	212	212	212	212
KR4A05690008			2026-09 미니코스피200 선물				21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	21	21	21	21	21	21	21
KR4A11690000			2026-09 삼성전자개별선물				8
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-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%	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)
	814

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

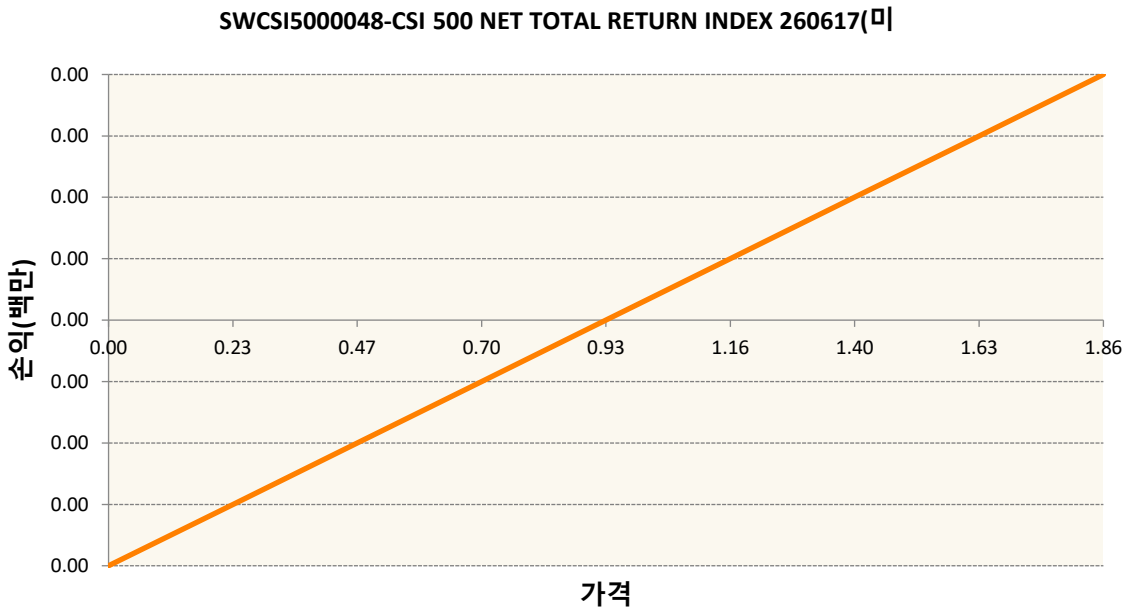
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,391	0	5,391	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

433

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

695

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

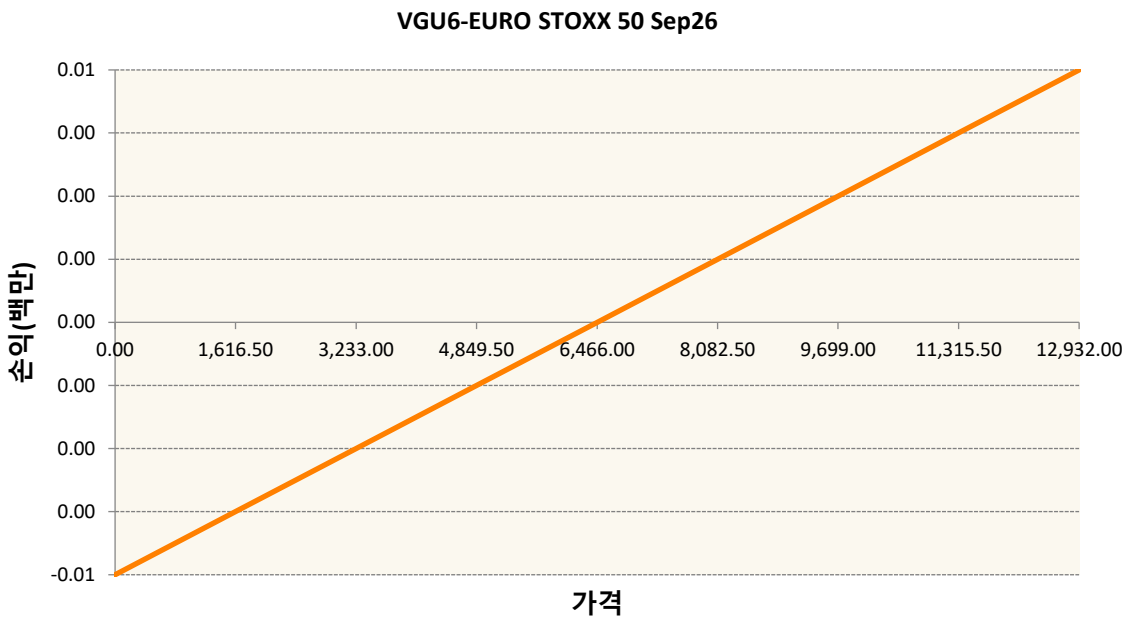
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,230	0	1,230	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	98
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

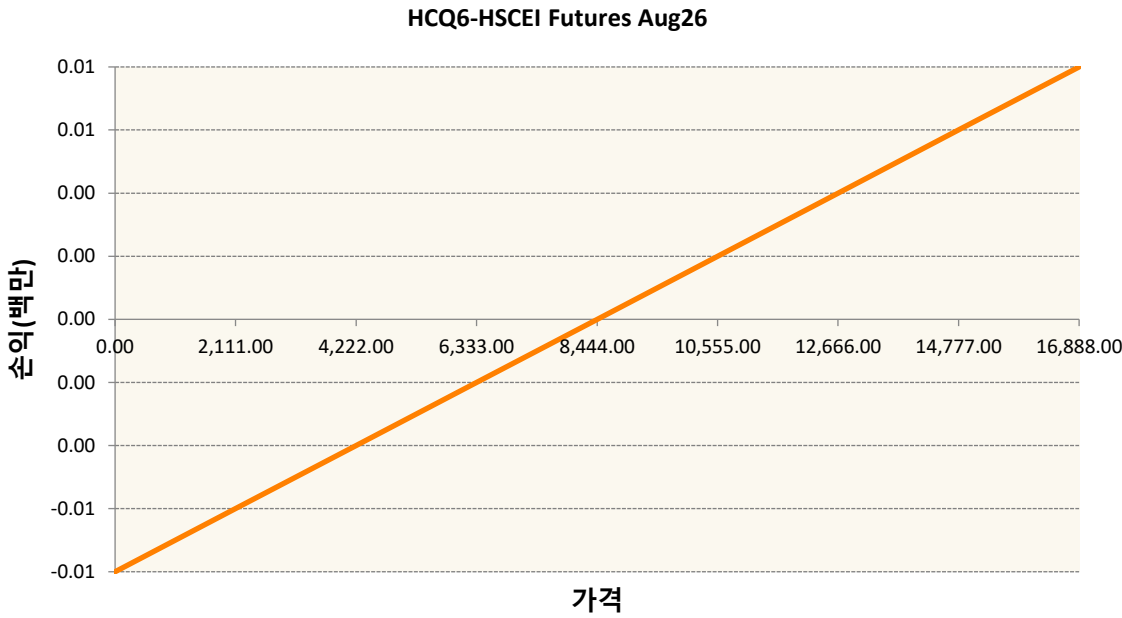
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,554	0	1,554	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCQ6	HSCEI Futures Aug26	124
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

120

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

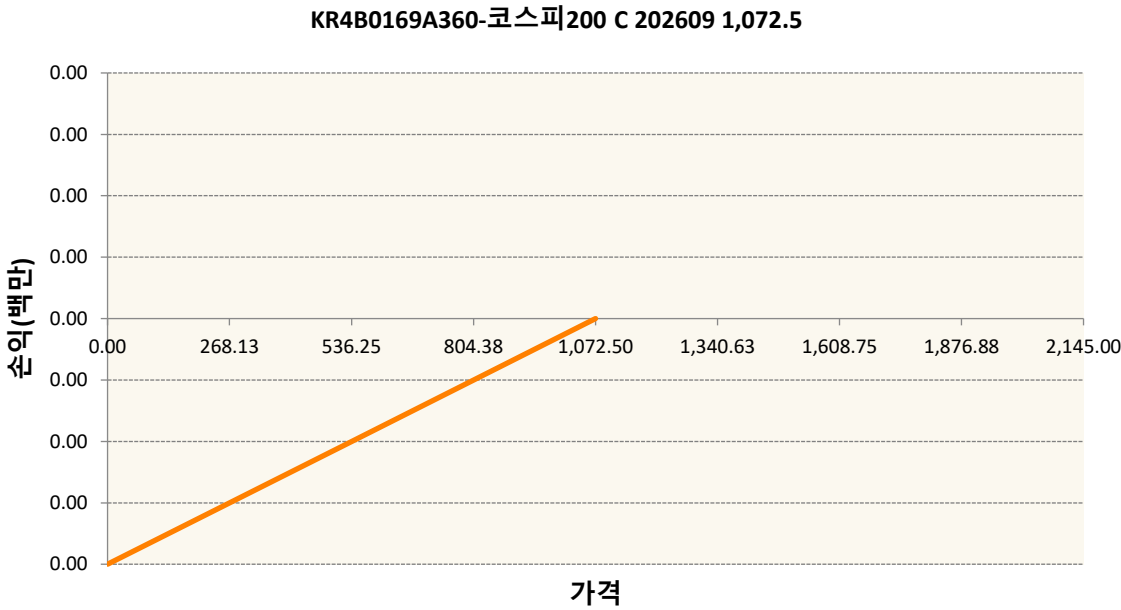
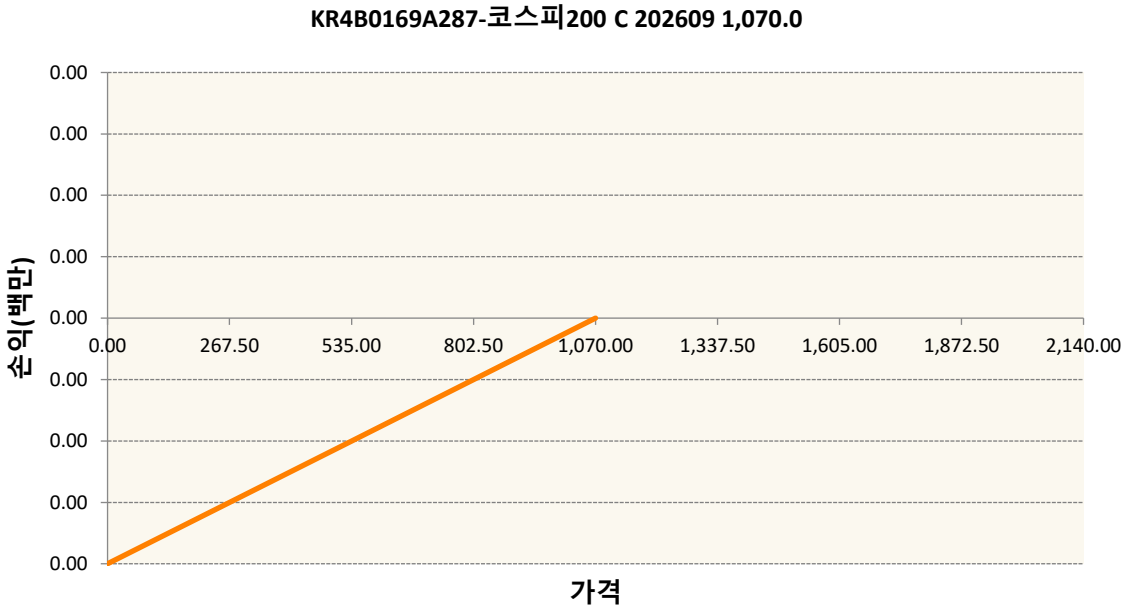
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

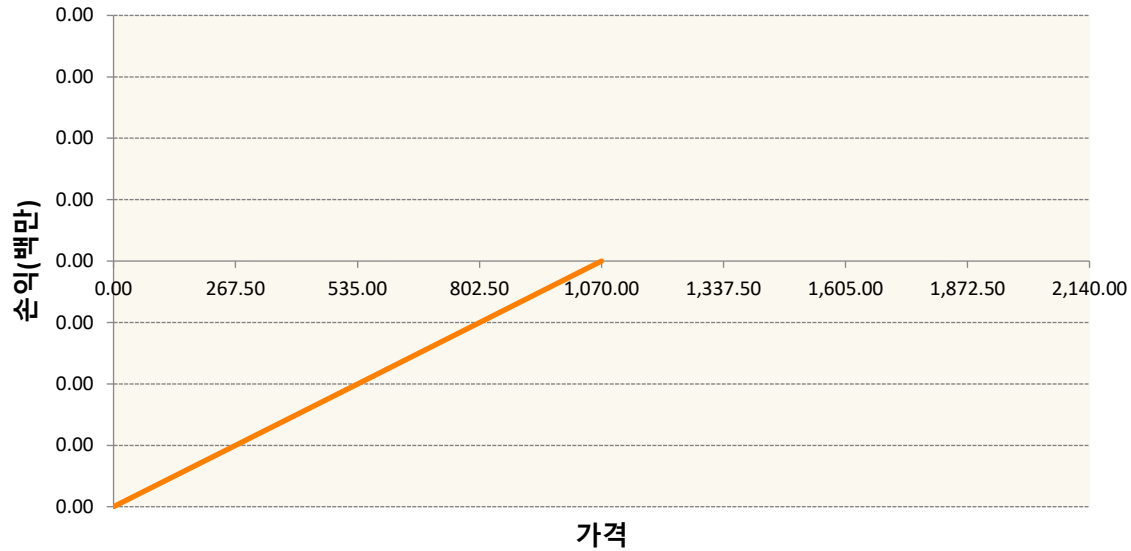
(단위:백만원)

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							824
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-584	-618	-656	-695	-737	-779	-824
-5.33%	-295	-339	-385	-432	-481	-530	-579
-2.67%	-43	-95	-147	-200	-253	-307	-360
0%	167	112	56	0	-56	-112	-167
2.67%	336	280	224	168	112	56	0
5.33%	463	412	359	306	252	197	143
8.00%	556	511	464	416	366	315	263
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							1,197
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-856	-905	-958	-1,014	-1,073	-1,134	-1,197
-5.33%	-436	-499	-564	-631	-700	-771	-842
-2.67%	-68	-142	-217	-293	-369	-446	-523
0%	241	161	80	0	-80	-161	-241
2.67%	489	408	328	247	165	84	3
5.33%	679	603	527	449	371	292	212
8.00%	817	751	682	611	538	464	388
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							428
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-303	-321	-340	-361	-382	-405	-428
-5.33%	-153	-176	-200	-224	-250	-275	-301
-2.67%	-23	-49	-77	-104	-132	-159	-187
0%	87	58	29	0	-29	-58	-87

2.67%	174	145	116	87	58	29	0
5.33%	241	214	187	159	131	103	74
8.00%	289	266	241	216	190	163	136

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

(단위:백만원)

3,728

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

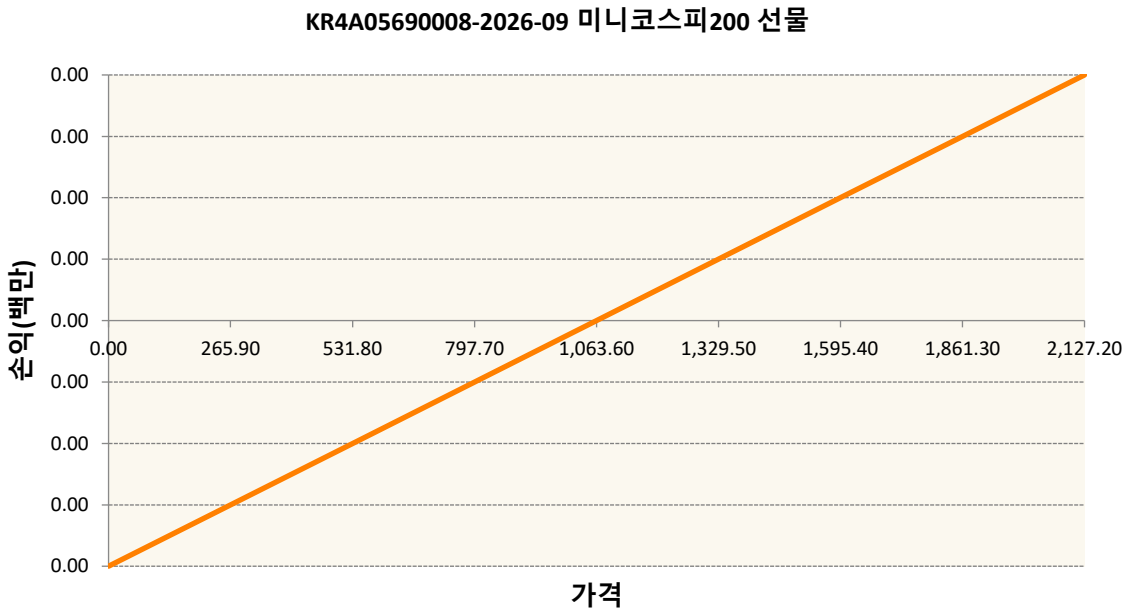
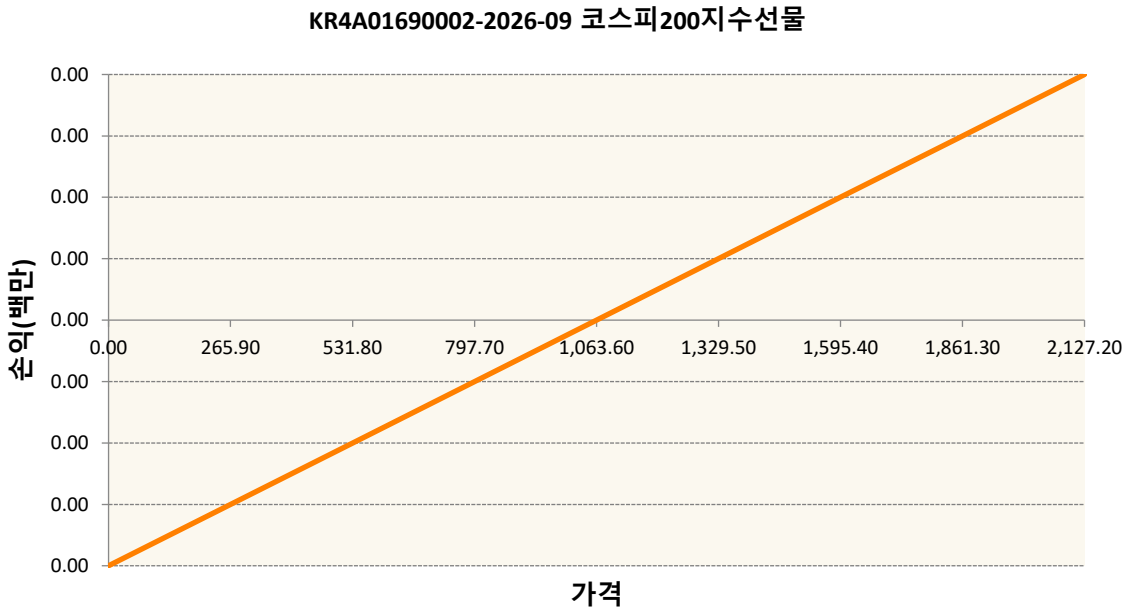
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

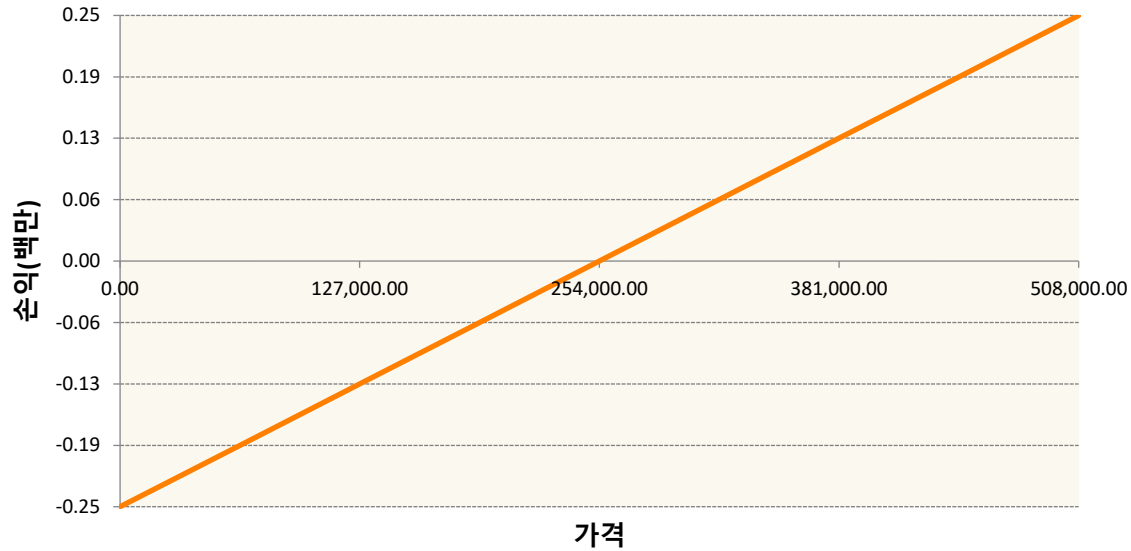
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,117	0	1,117	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)

188

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

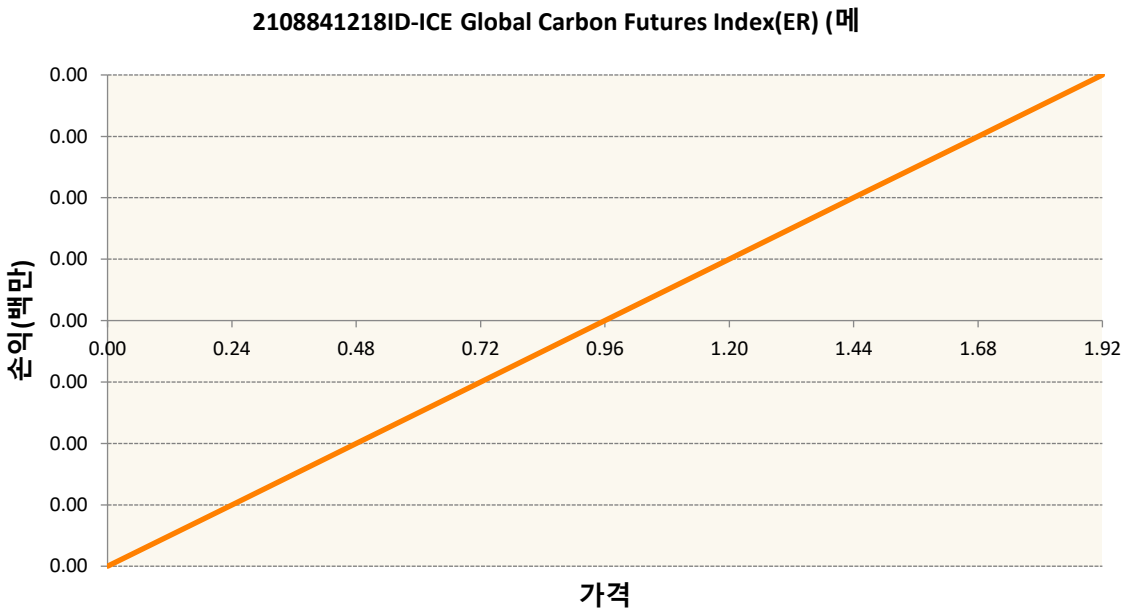
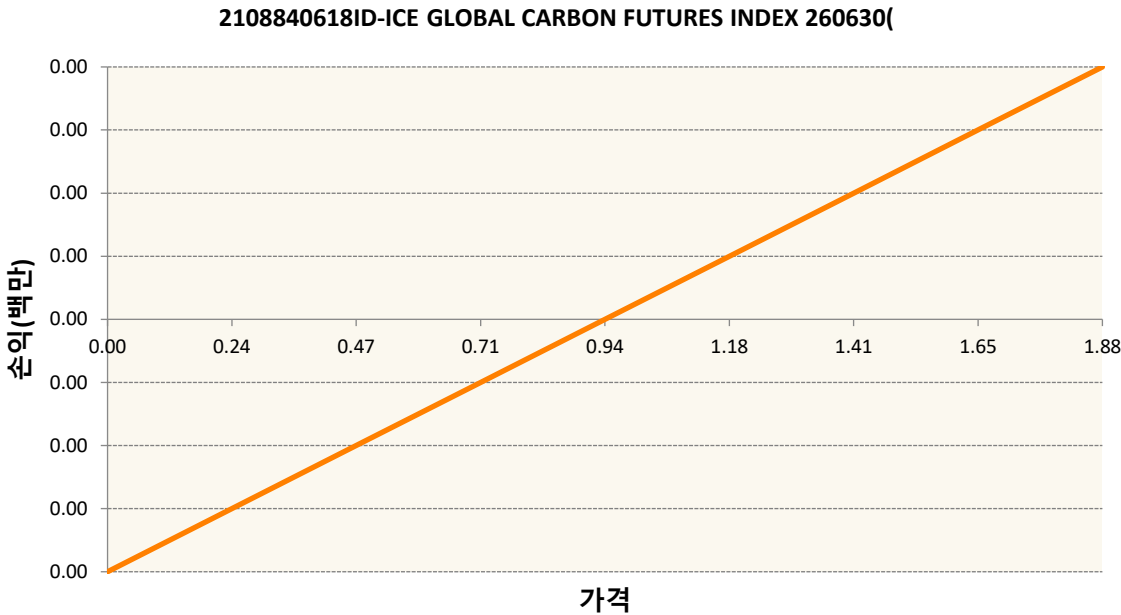
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)
	637

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

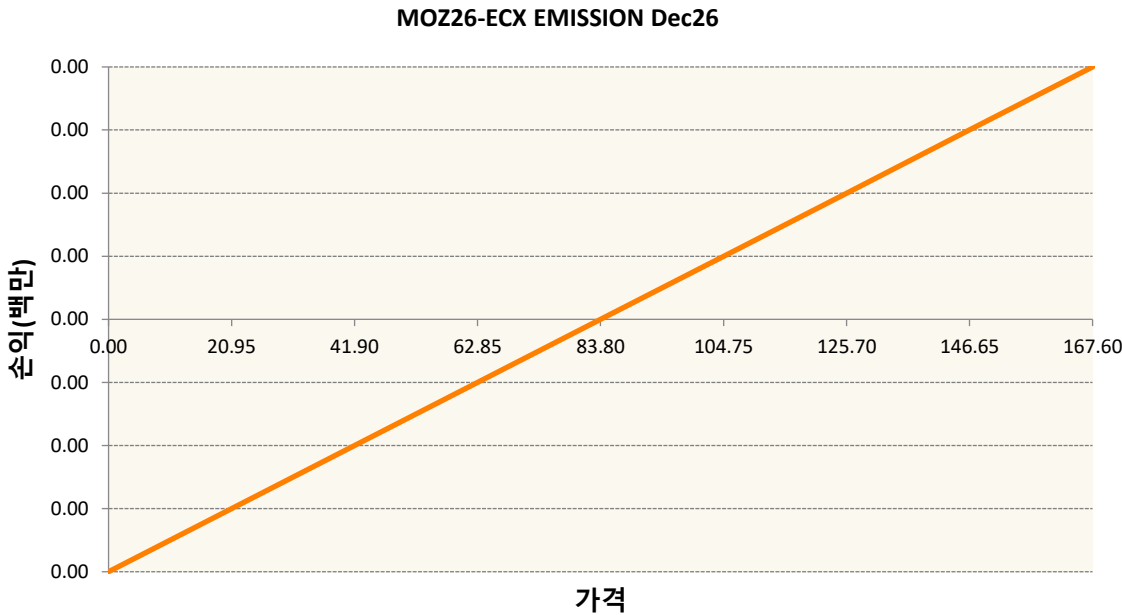
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,415	0	5,415	
누계	통화	선도	0	2,536	-2,536	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G7XIKRW/EUR 31-08-26E	203
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	433

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

(단위:백만원)

696

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

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	-1,884	0	-1,884	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	61
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	28
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	25
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	37

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

(단위:백만원)

243

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

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	-5,700	0	-5,700	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	53
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	209
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	196

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

(단위:백만원)

864

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

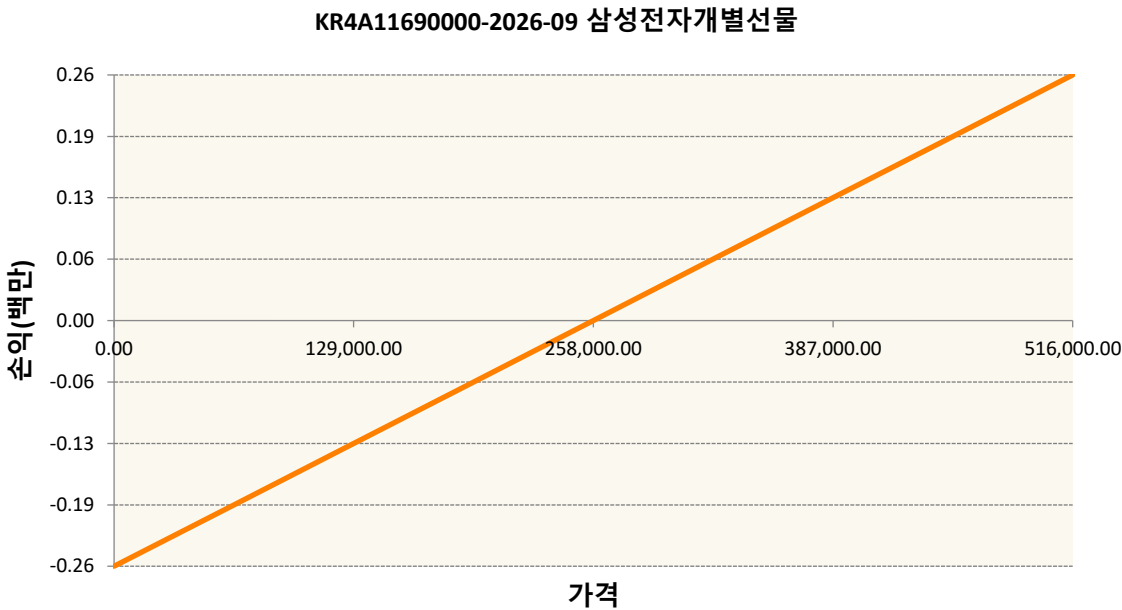
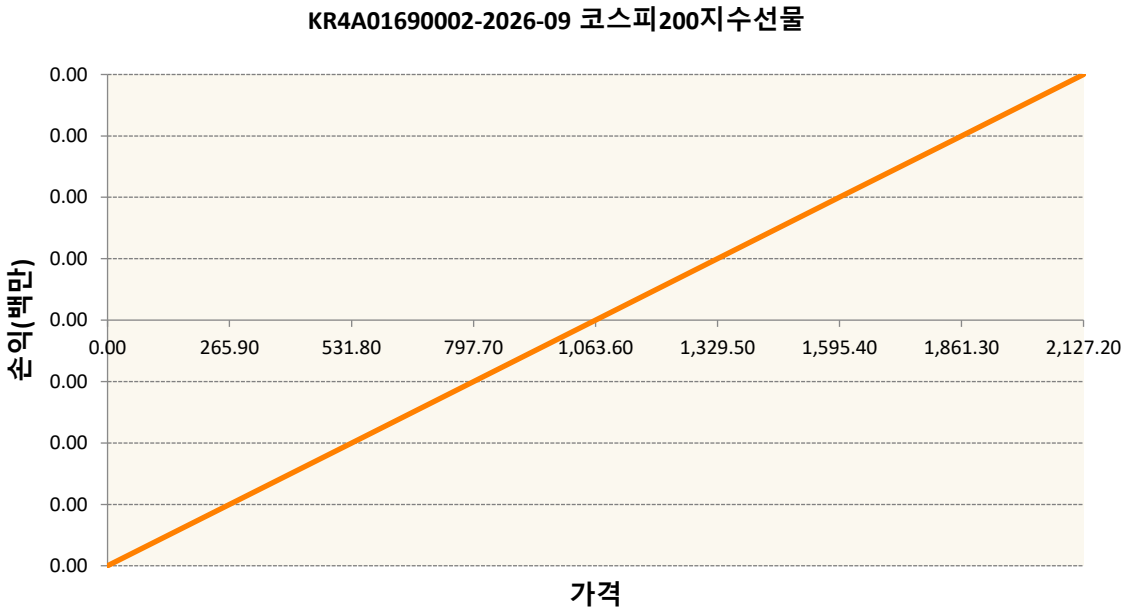
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	266	0	266	장내
누계	유가증권	선물	21,381	0	21,381	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					1,443
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443
-5.33%	-962	-962	-962	-962	-962	-962	-962
-2.67%	-481	-481	-481	-481	-481	-481	-481
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	481	481	481	481	481	481	481
5.33%	962	962	962	962	962	962	962
8.00%	1,443	1,443	1,443	1,443	1,443	1,443	1,443
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)

5,893

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

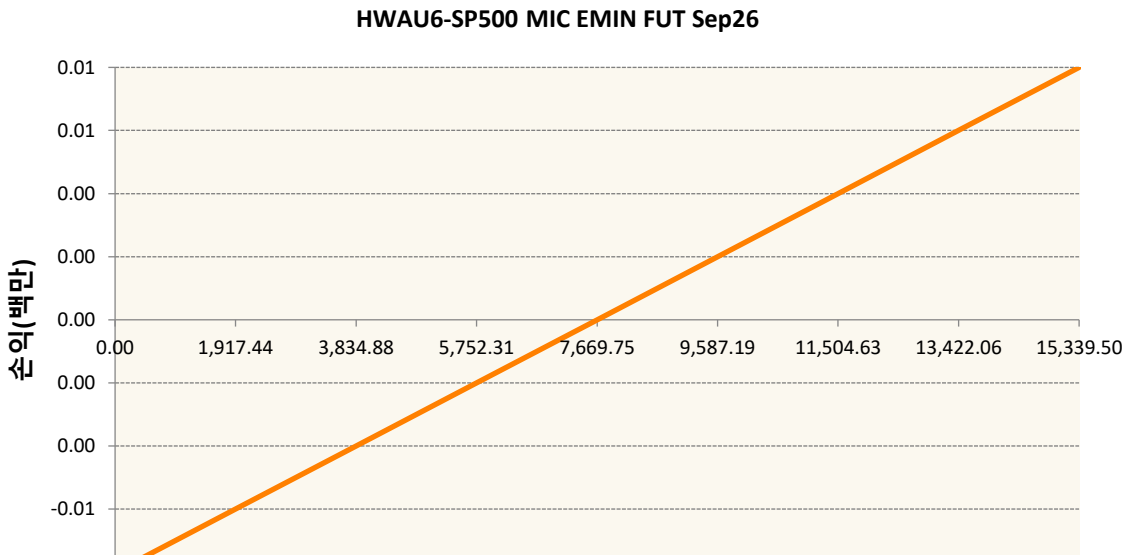
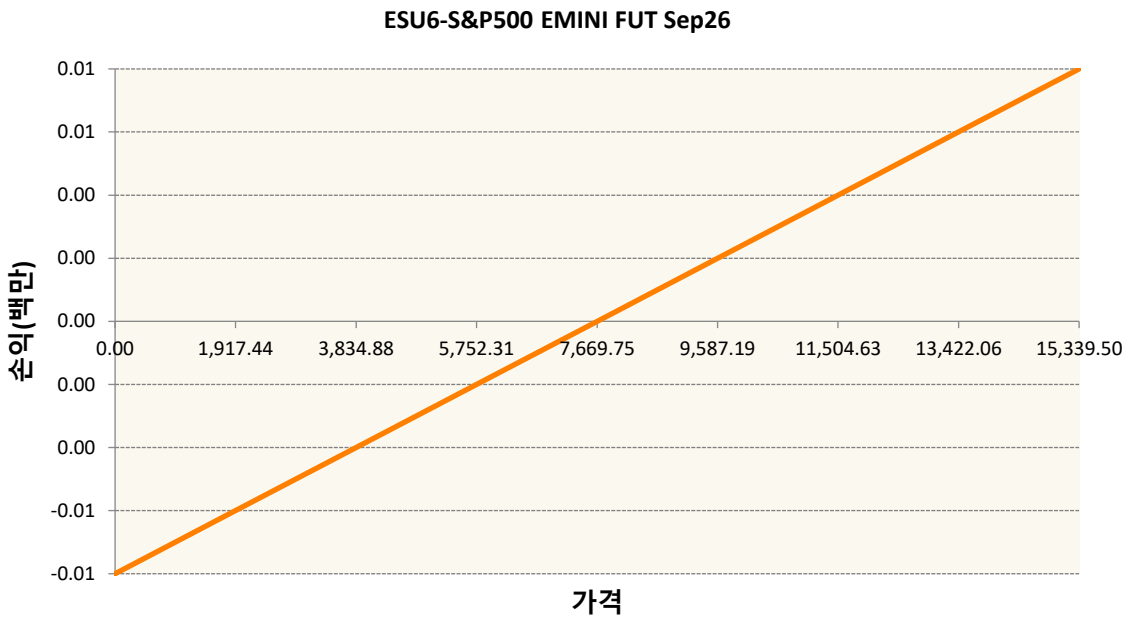
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

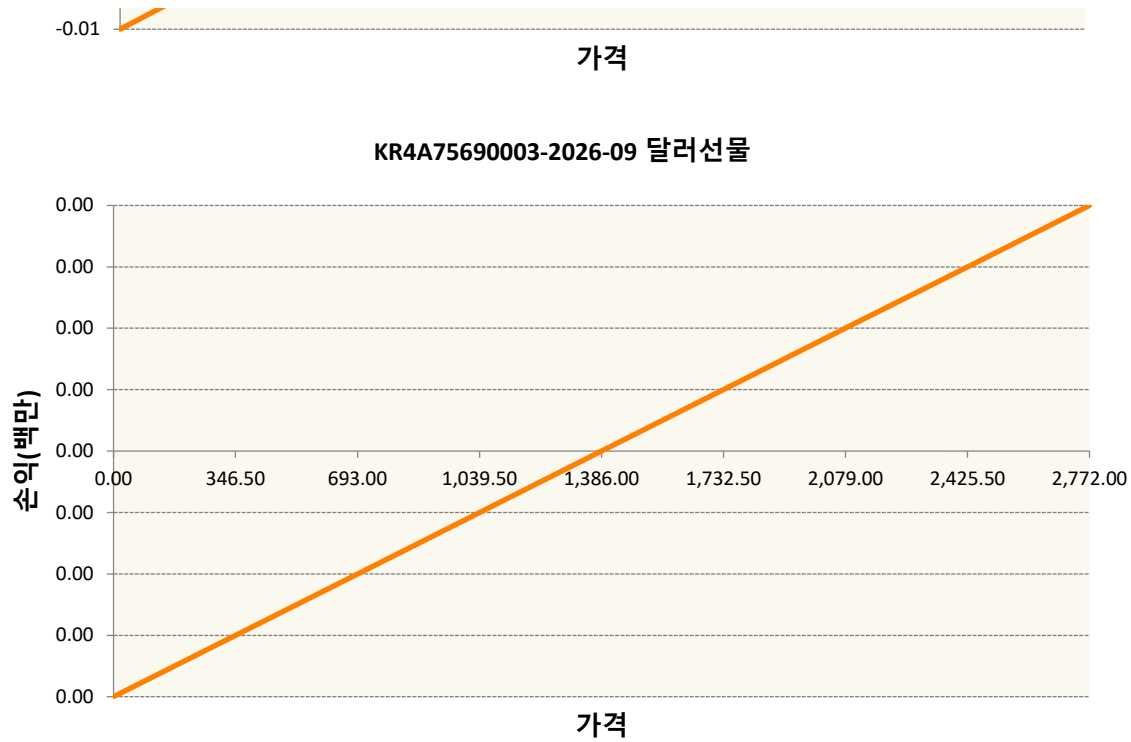
1. 계약금액

(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	72,761	0	72,761	
누계	지수	선물	176	0	176	장내
누계	통화	선물	11,227	0	11,227	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		5,821
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		14
KR4A756900 2026-09 달러선물			898

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,906

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

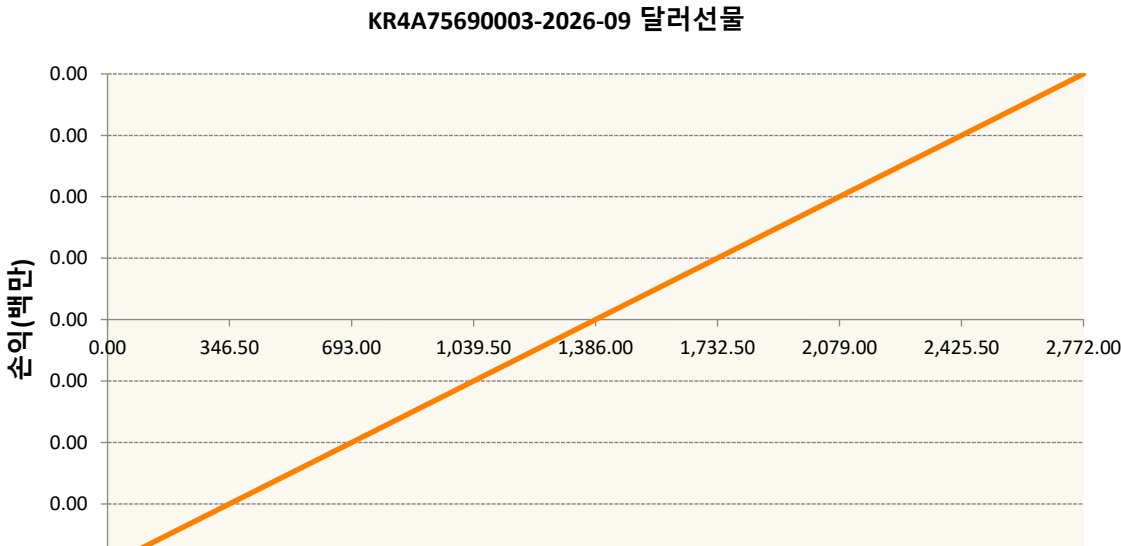
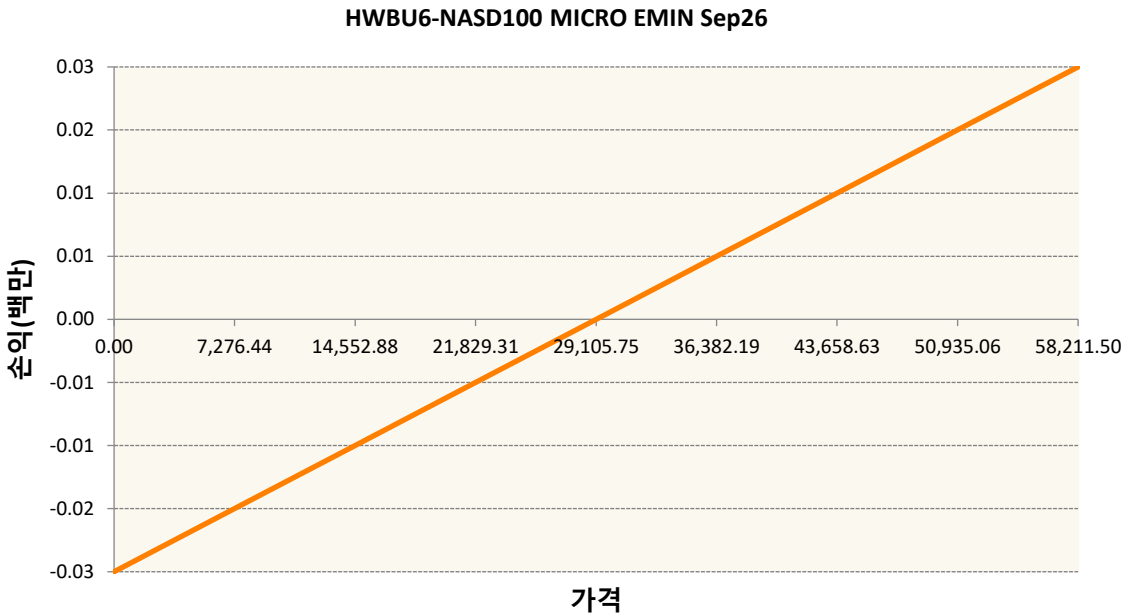
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

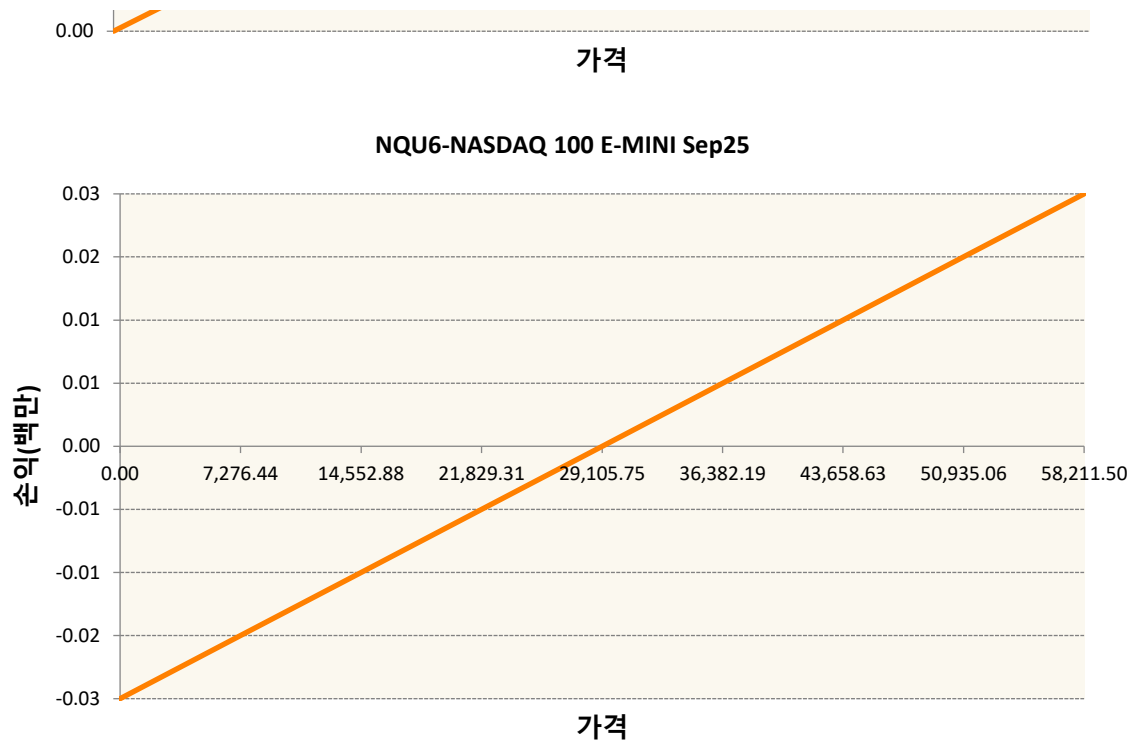
1. 계약금액

(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	700	0	700	장내
누계	지수	선물	35,189	0	35,189	
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		2,815

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,202

공시일	2026-08-26
기준일	2026-08-25

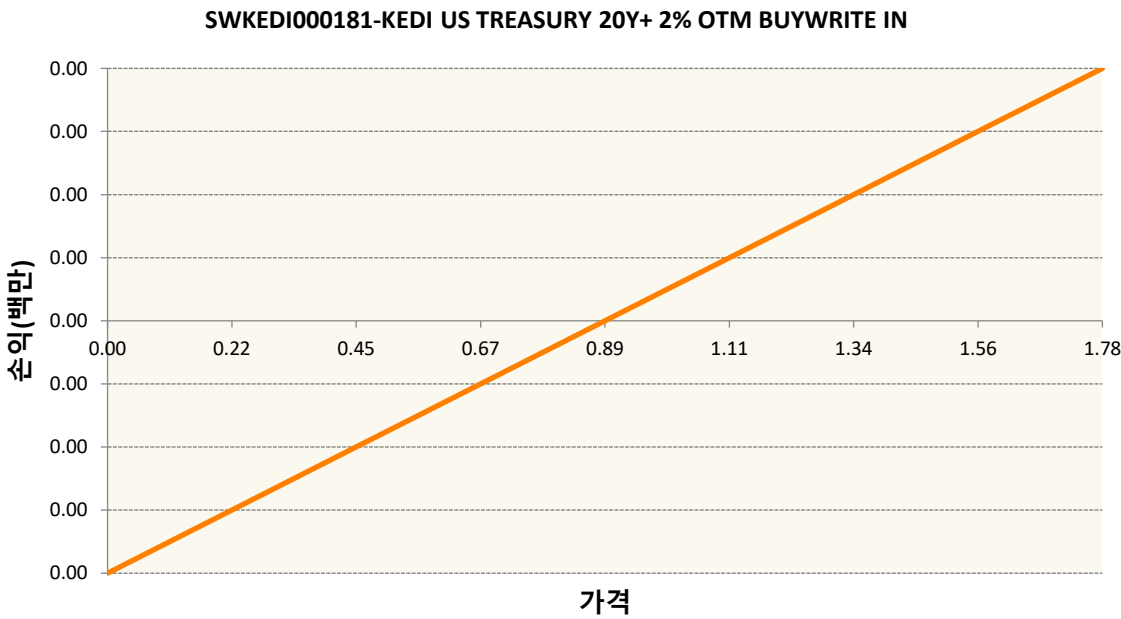
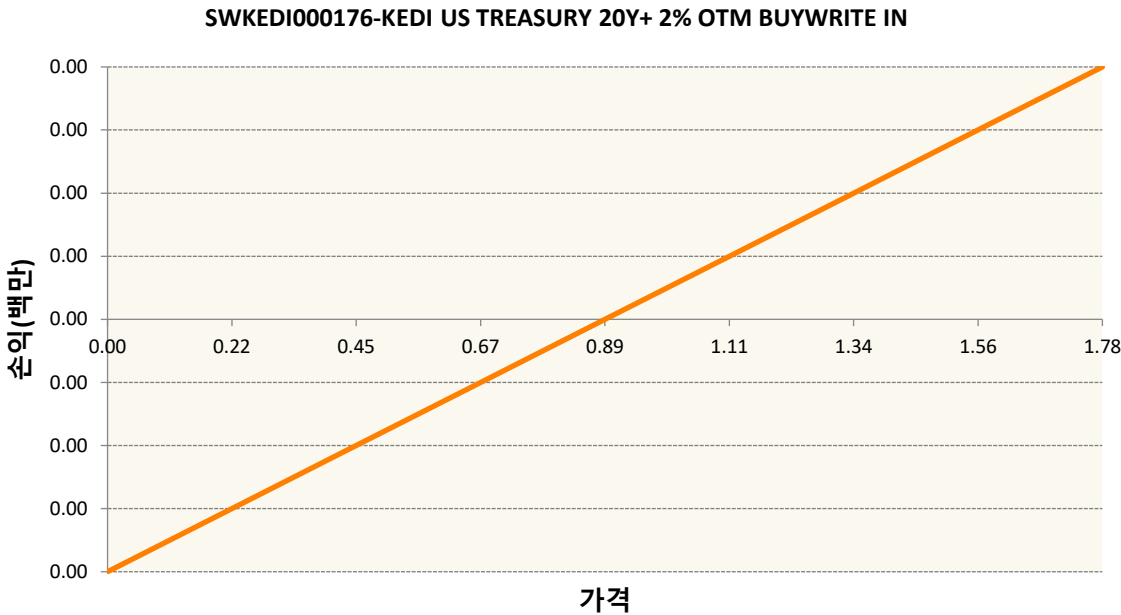
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

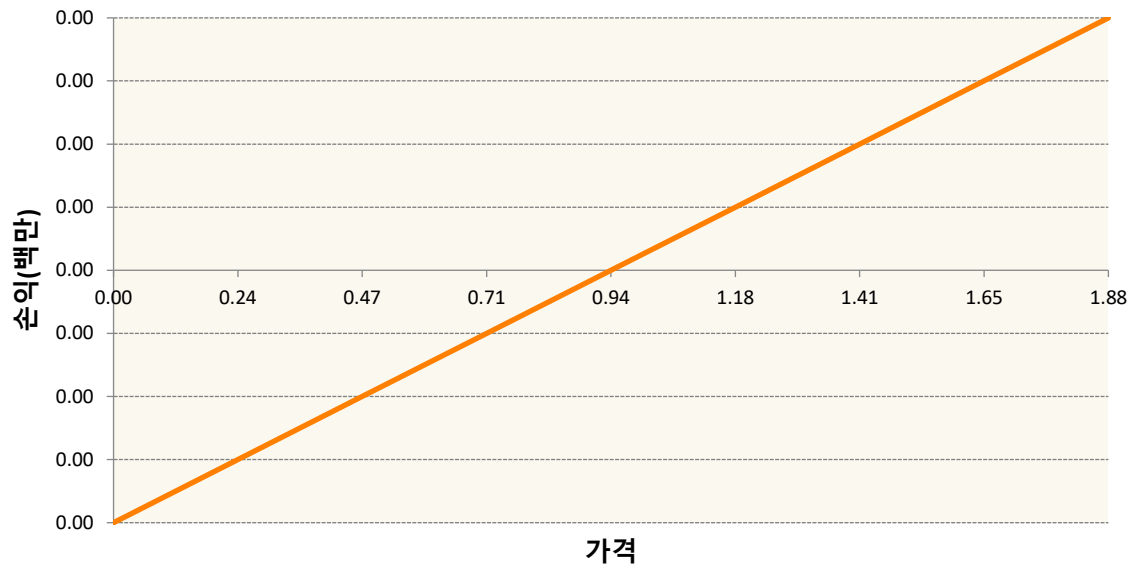
(단위:백만원)

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

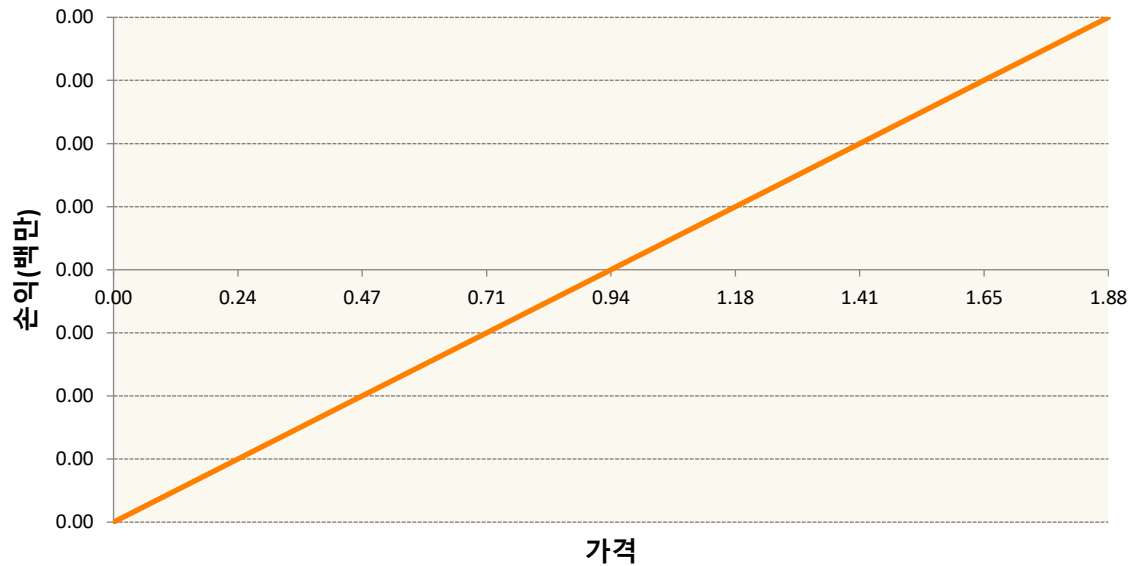
2. 만기시점의 손익구조



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	7,233
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,839
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,352
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,136

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

(단위:백만원)

9,484
