

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

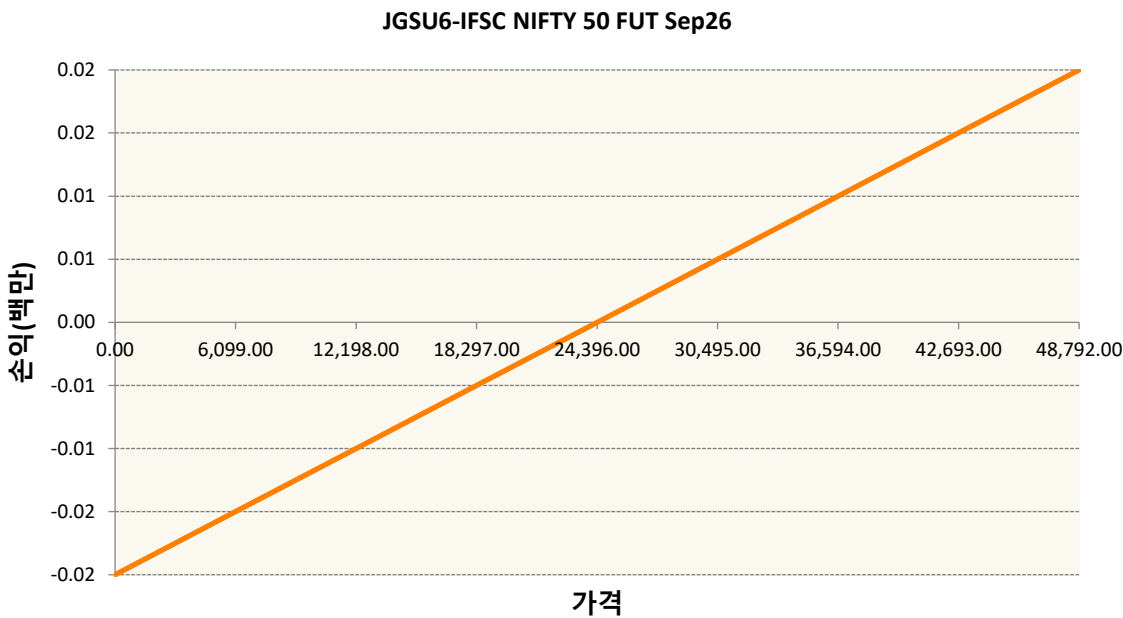
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-08-28
기준일	2026-08-27

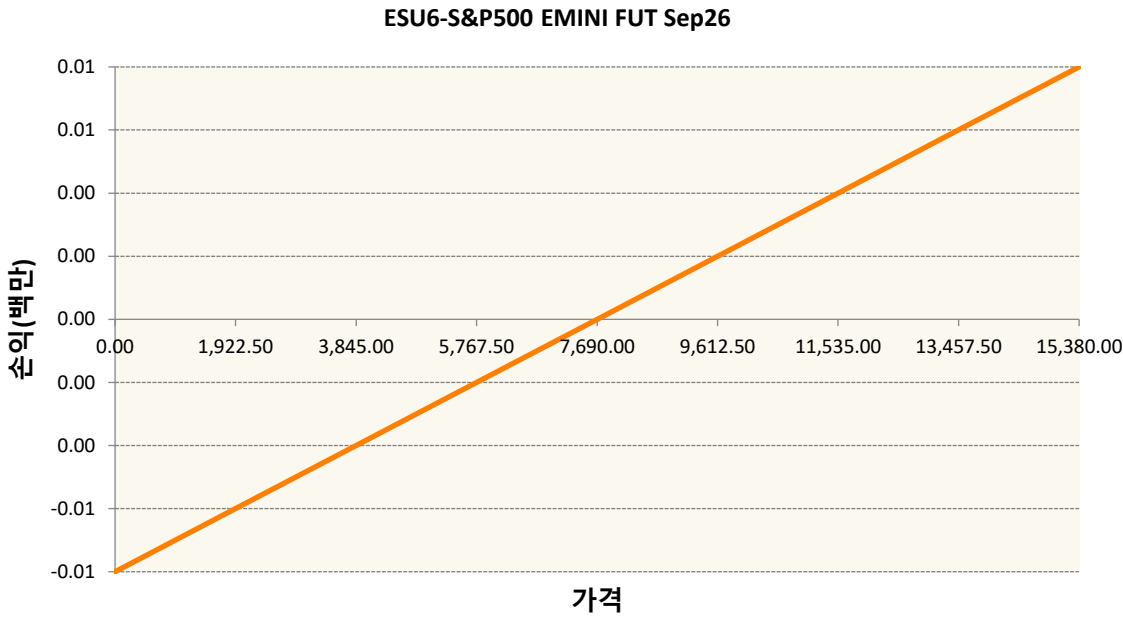
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

39

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

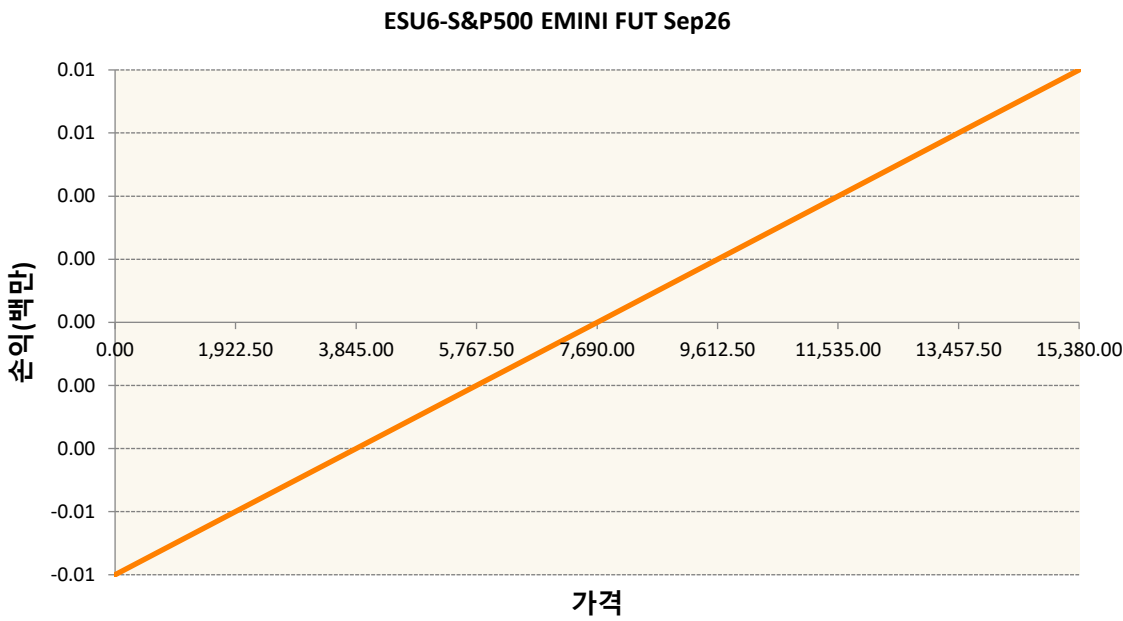
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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)

38

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

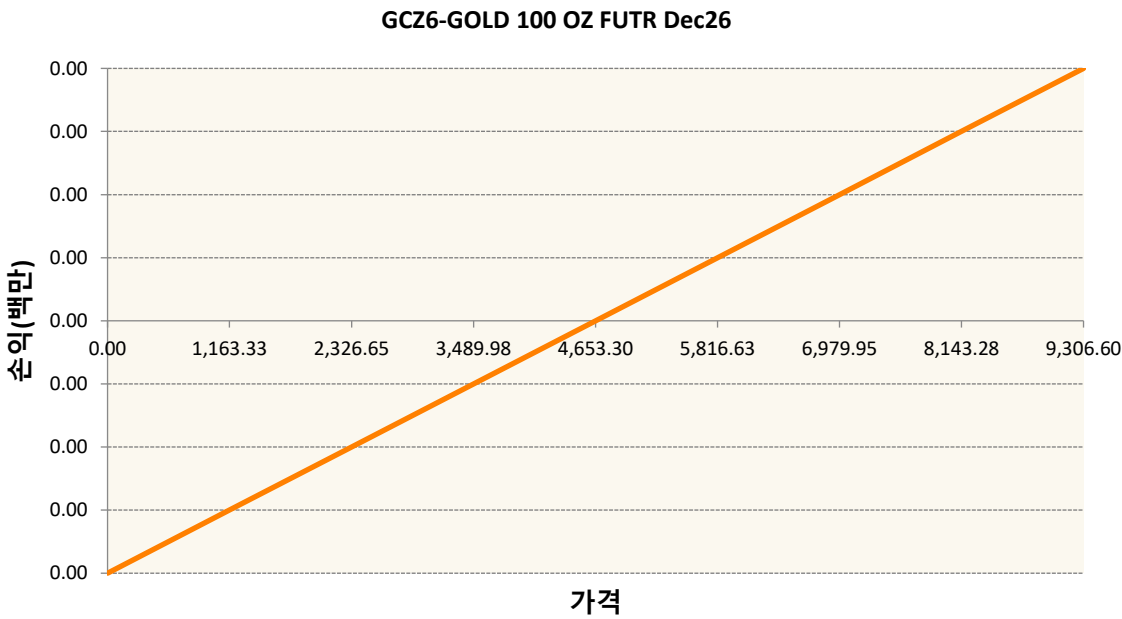
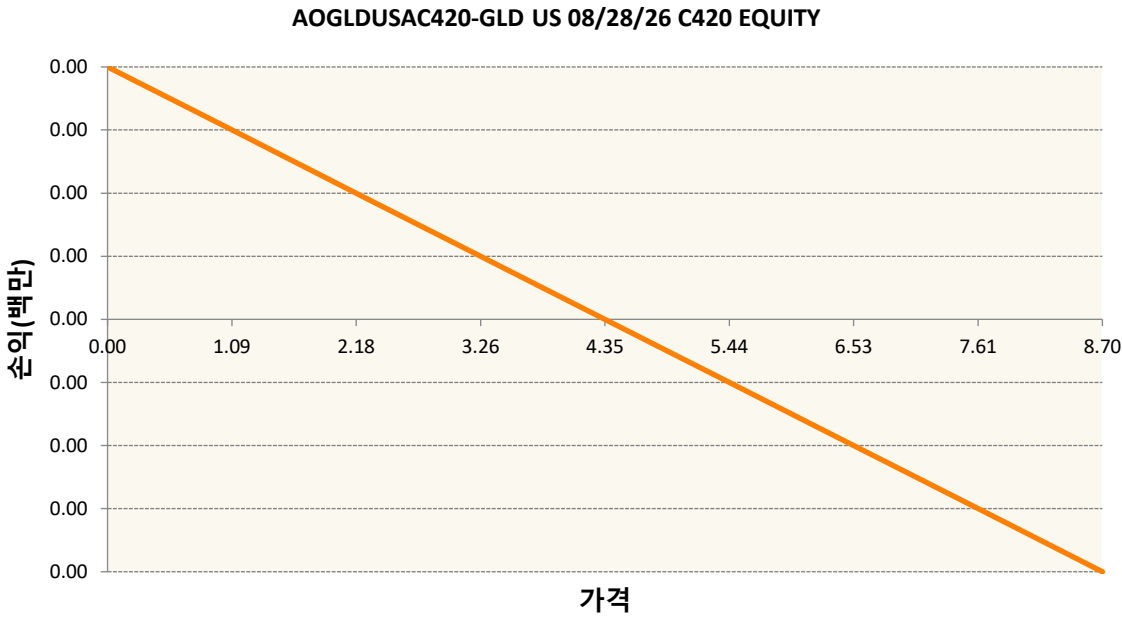
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,970	0	5,970	
누계	실물자산	옵션	0	199	-199	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSAC GLD US 08/28/26 C420 EQUITY		16
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26		478

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	649

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

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	322
AOPLTRUAP PLTR US 08/28/26 P180 EQUITY	15

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

(단위:백만원)

1,140

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

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)

15,186

공시일 2026-08-28

기준일 2026-08-27

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	2026-08-28
기준일	2026-08-27

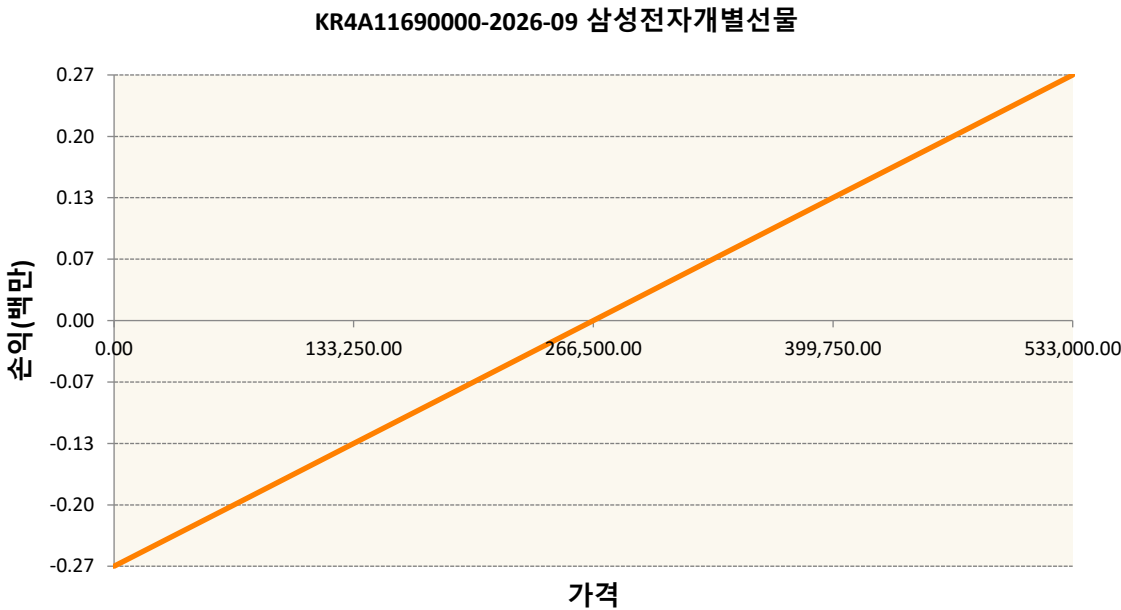
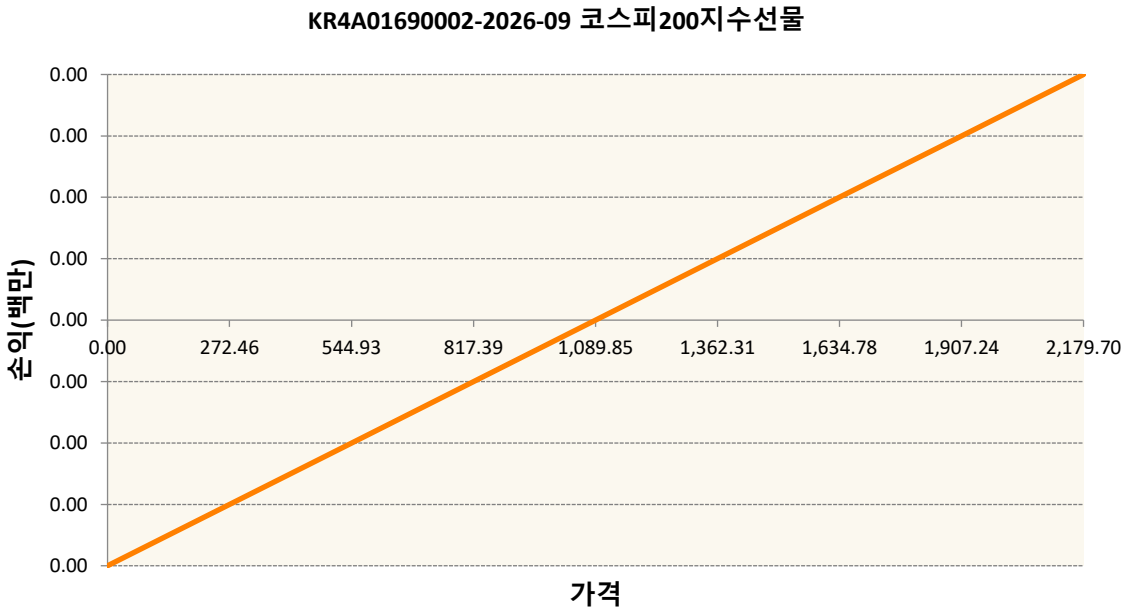
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

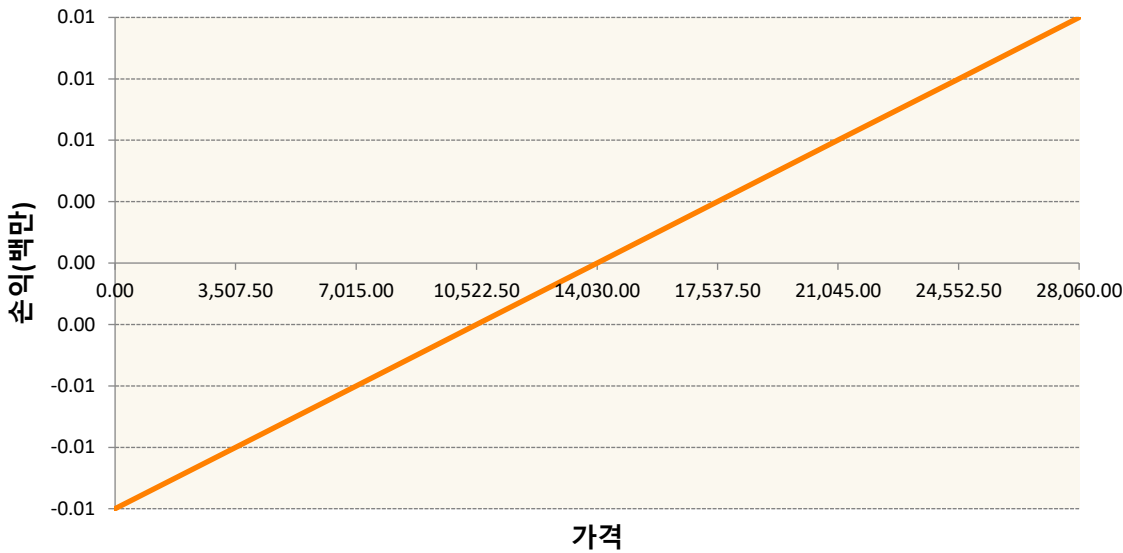
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	64	0	64	장내
신규	유가증권	옵션	0	59,540	-59,540	장내
누계	유가증권	선물	21,538	0	21,538	장내
누계	유가증권	옵션	0	58,641	-58,641	장내

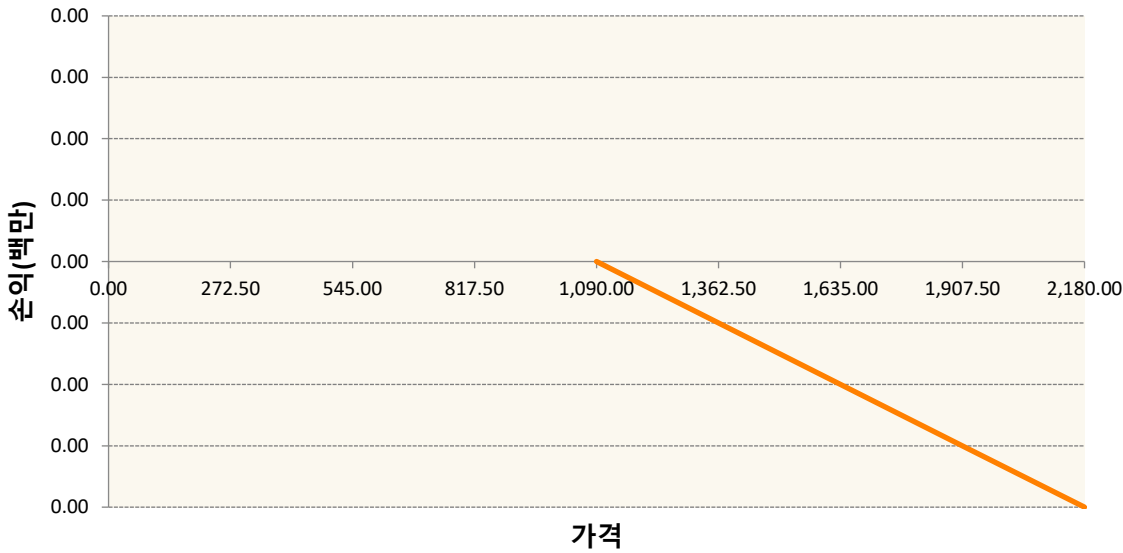
2. 만기시점의 손익구조



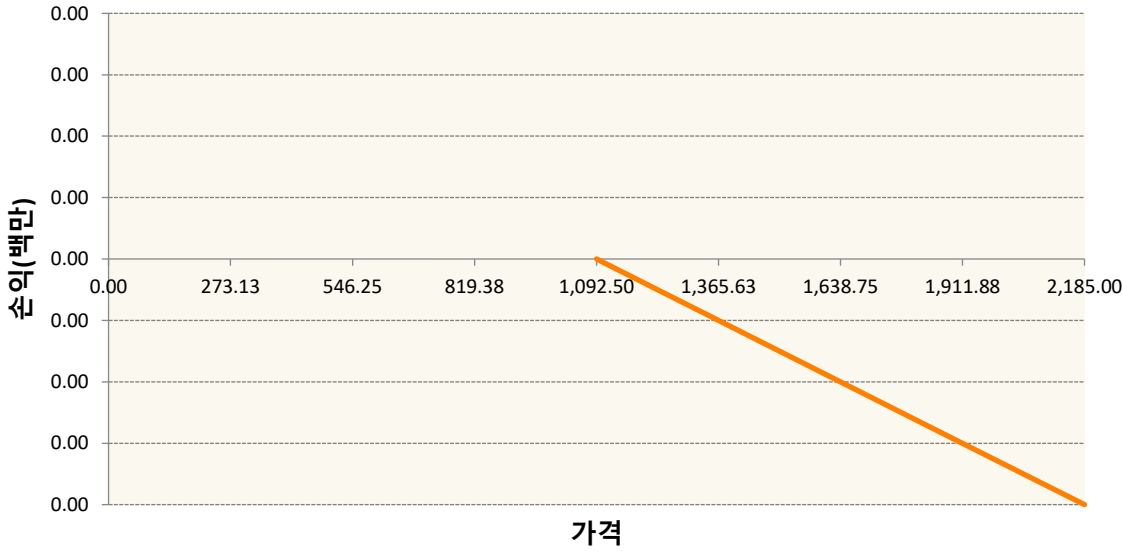
KR4AFB690003-2026-09 SK아이이테크놀로지개별선물



KR4BAFBVA374-코스피위클리M C 2608W5 1,090.0



KR4BAFBVA382-코스피위클리M C 2608W5 1,092.5



(단위:백만원)

KR4A01690002						2026-09 코스피200지수선물		566
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-566	-566	-566	-566	-566	-566	-566	
-5.33%	-377	-377	-377	-377	-377	-377	-377	
-2.67%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	189	189	189	189	189	189	189	
5.33%	377	377	377	377	377	377	377	
8.00%	566	566	566	566	566	566	566	
KR4A11690000						2026-09 삼성전자개별선물		1,149
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	-1,149	
-5.33%	-766	-766	-766	-766	-766	-766	-766	
-2.67%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	383	383	383	383	383	383	383	
5.33%	766	766	766	766	766	766	766	
8.00%	1,149	1,149	1,149	1,149	1,149	1,149	1,149	
KR4AFB690003						2026-09 SK아이이테크놀로지개별선물		7
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	
-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%	7	7	7	7	7	7	7	
KR4BAFBVA374						코스피위클리M C 2608W5 1,090.0		2,195
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	729	720	708	692	673	650	624	
-5.33%	685	659	629	595	557	517	475	
-2.67%	535	485	433	380	325	269	213	
0%	189	126	63	0	-63	-126	-189	
2.67%	-396	-449	-504	-561	-618	-677	-736	
5.33%	-1,172	-1,203	-1,239	-1,279	-1,322	-1,367	-1,414	
8.00%	-2,053	-2,066	-2,084	-2,106	-2,132	-2,162	-2,195	
KR4BAFBVA382						코스피위클리M C 2608W5 1,092.5		1,443
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	461	456	449	439	427	412	396
-5.33%	435	419	400	378	354	329	301
-2.67%	344	312	278	243	207	171	134
0%	126	84	42	0	-42	-84	-126
2.67%	-251	-287	-325	-364	-403	-442	-482
5.33%	-759	-781	-807	-834	-864	-895	-928
8.00%	-1,342	-1,352	-1,365	-1,381	-1,399	-1,420	-1,443

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

(단위:백만원)

12,537

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

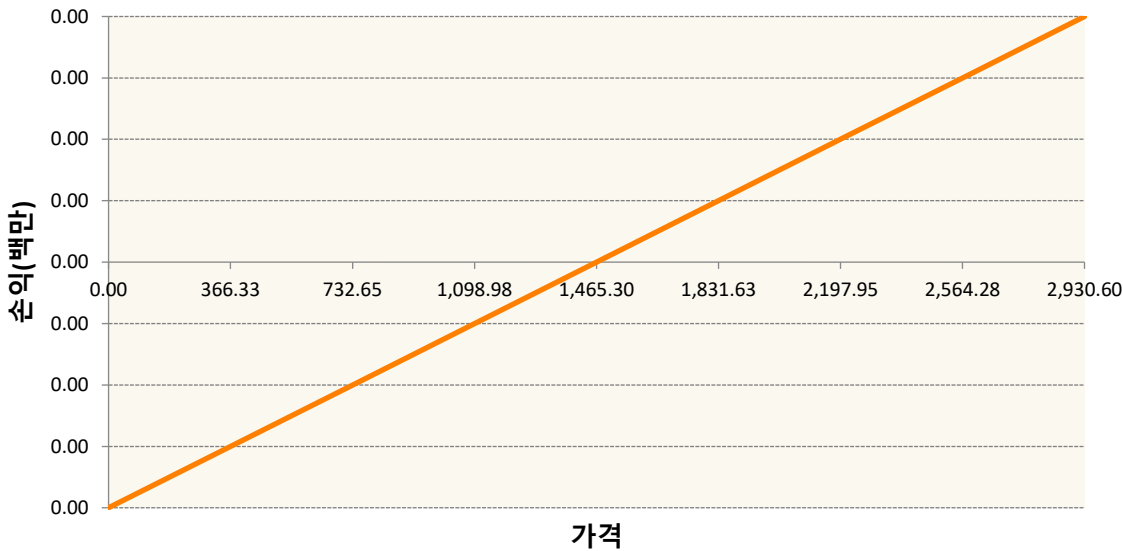
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	674	0	674	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A06690007-2026-09 코스닥150선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				54
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-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%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

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

(단위:백만원)

17,520

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

(단위:백만원)

47,771

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

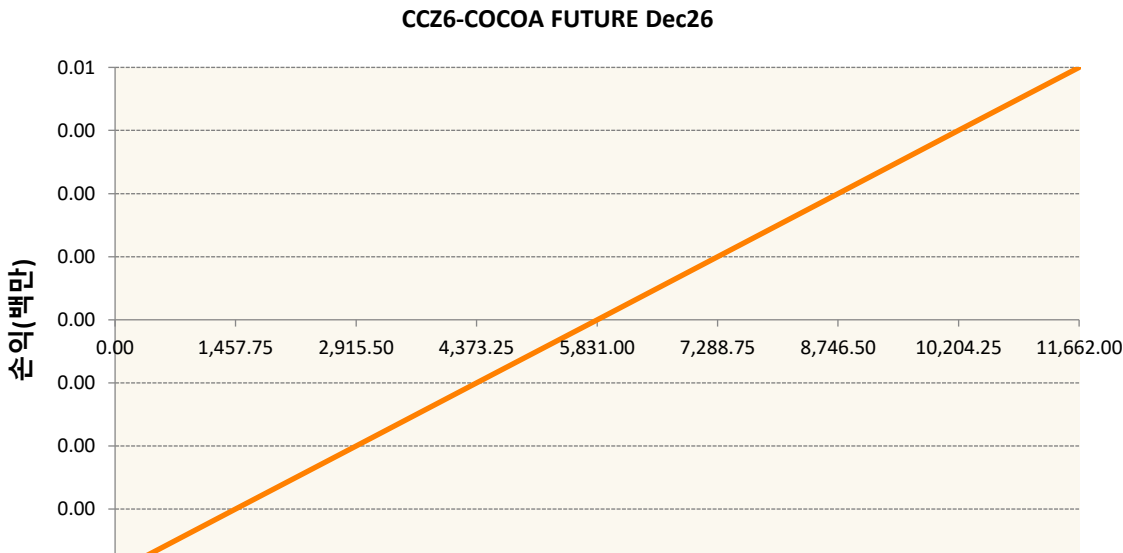
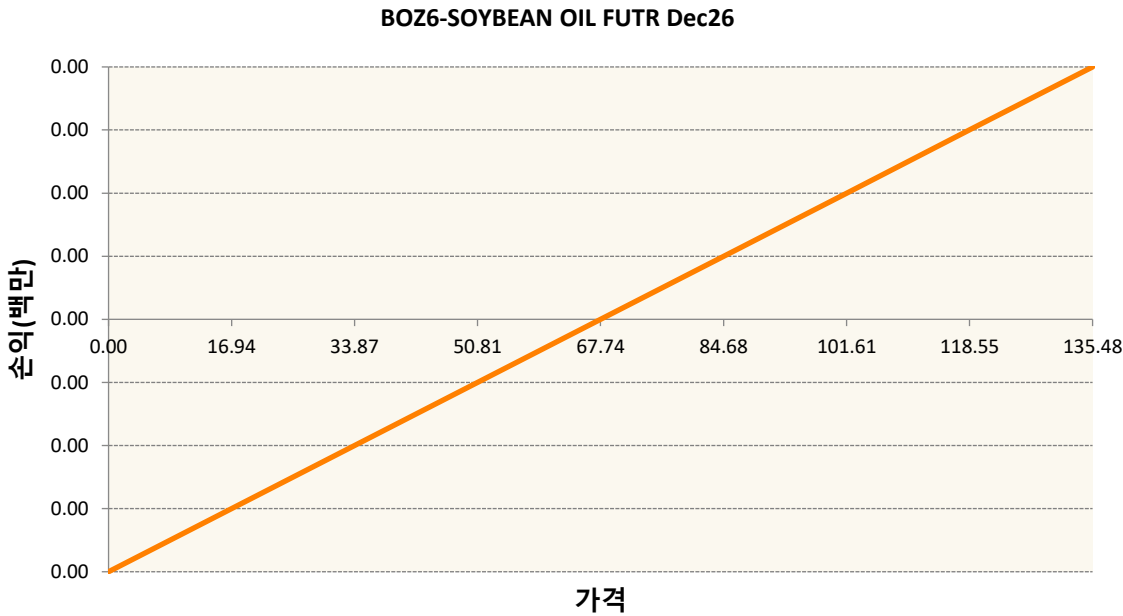
포커스농산물모(채권-파생형)

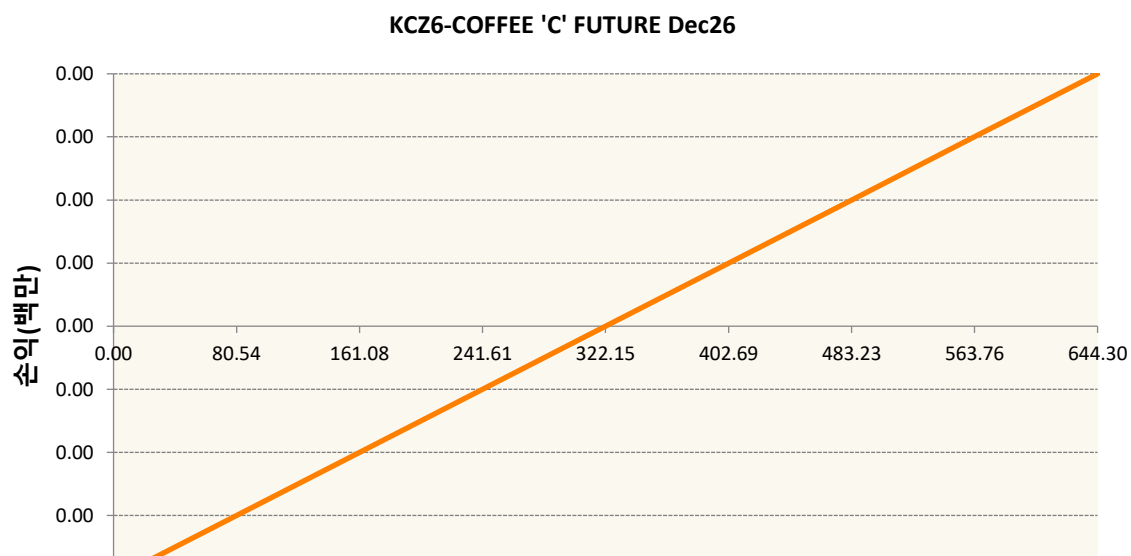
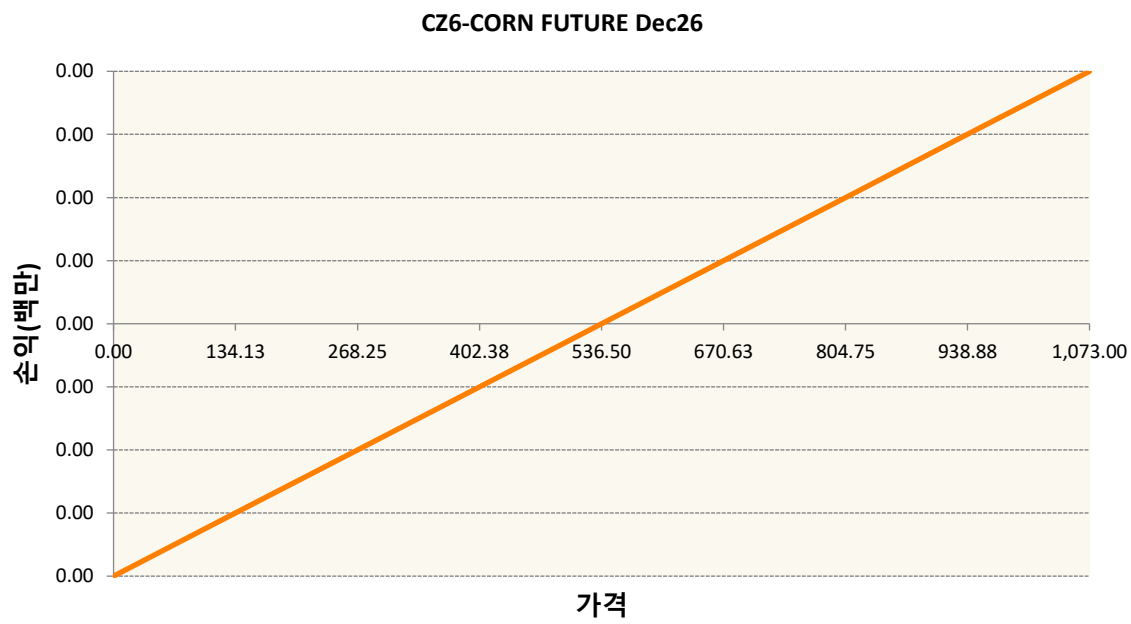
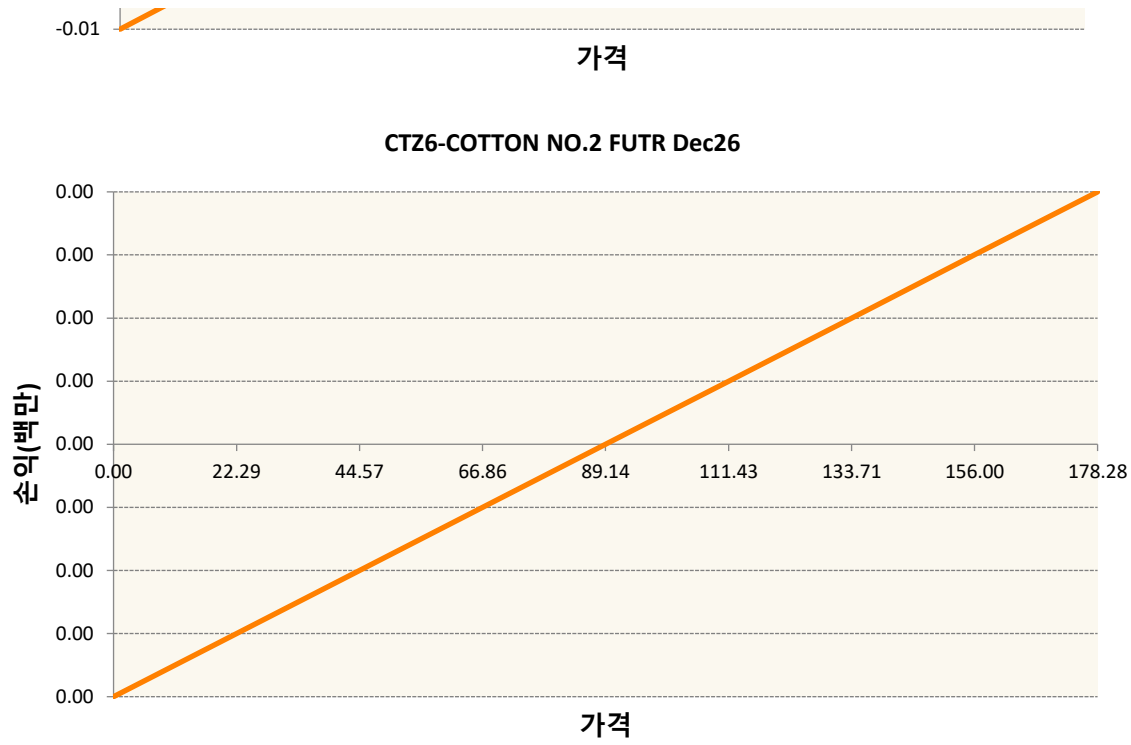
1. 계약금액

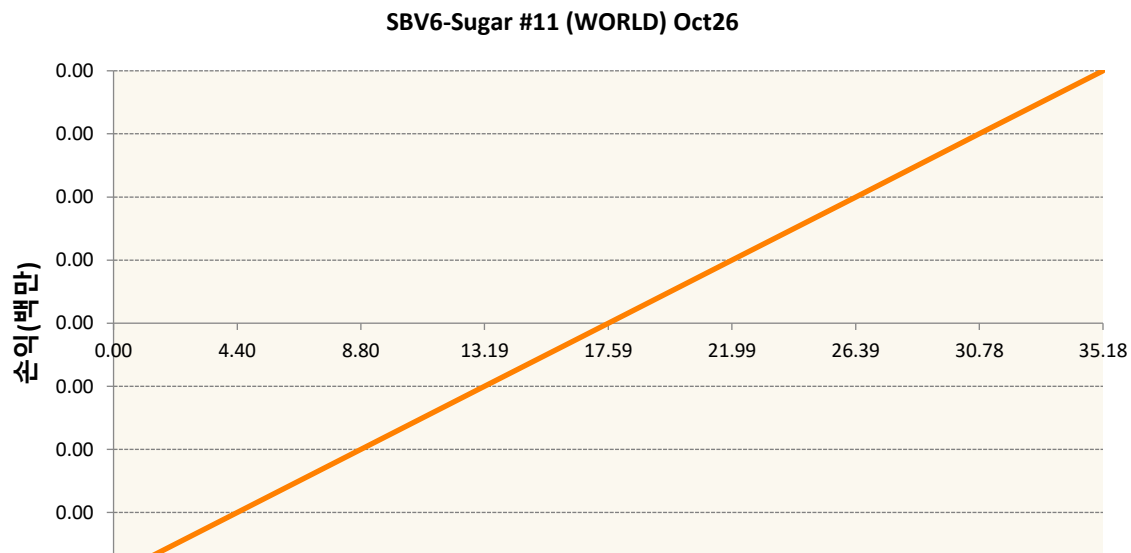
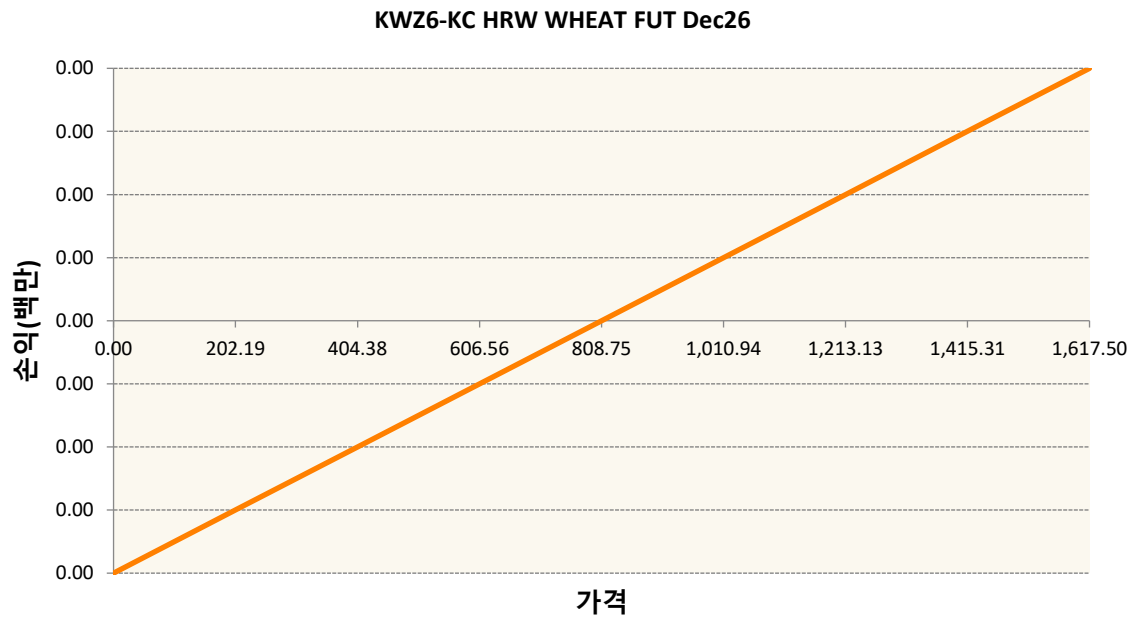
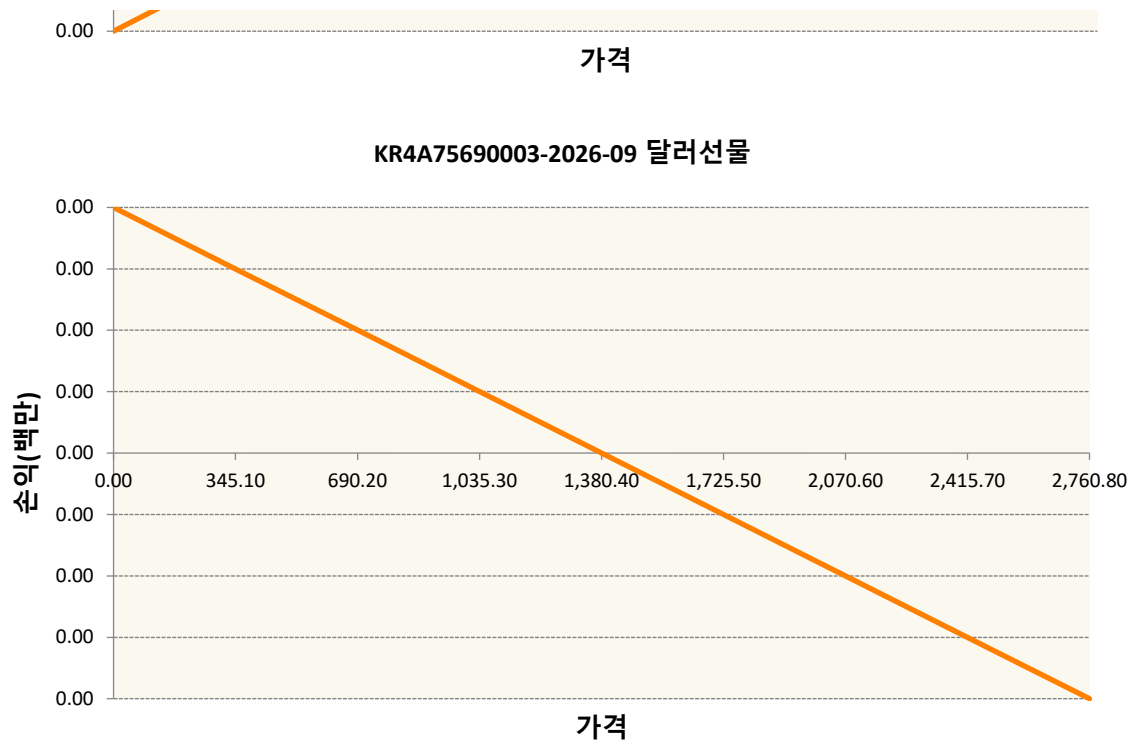
(단위:USD 백만)

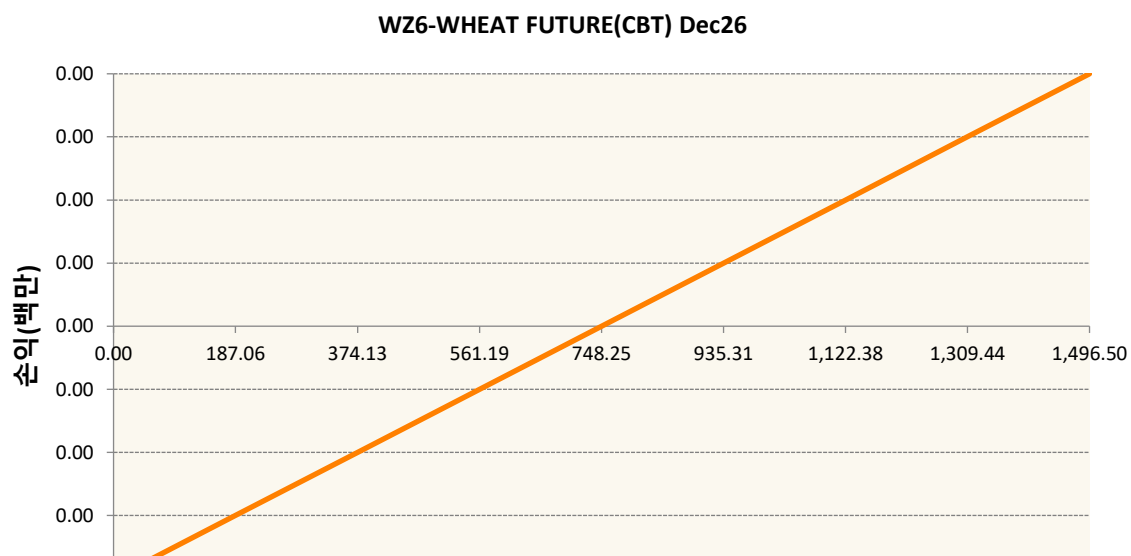
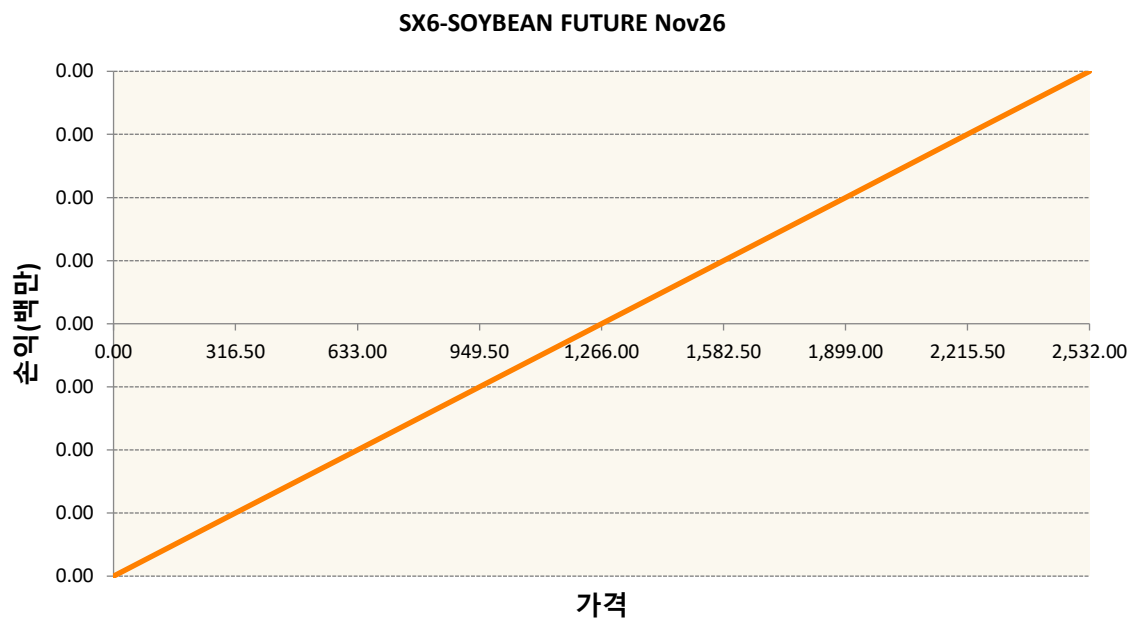
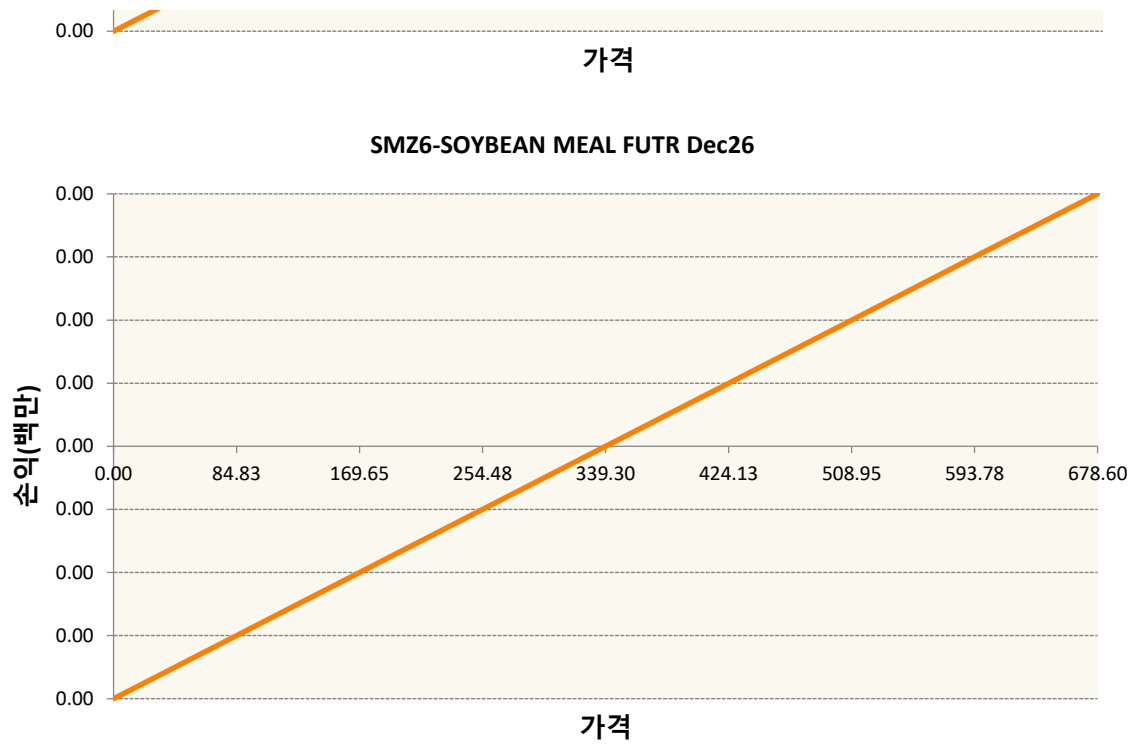
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	452	0	452	
누계	유가증권	선물	2,463	0	2,463	
누계	통화	선물	0	345	-345	장내

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	2026-08-28
기준일	2026-08-27

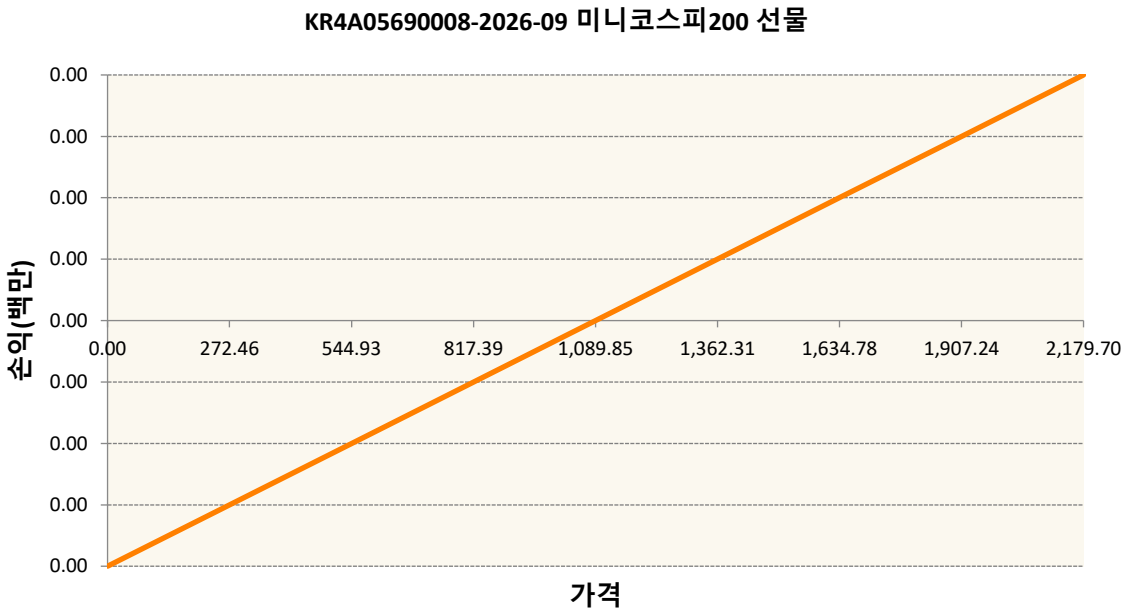
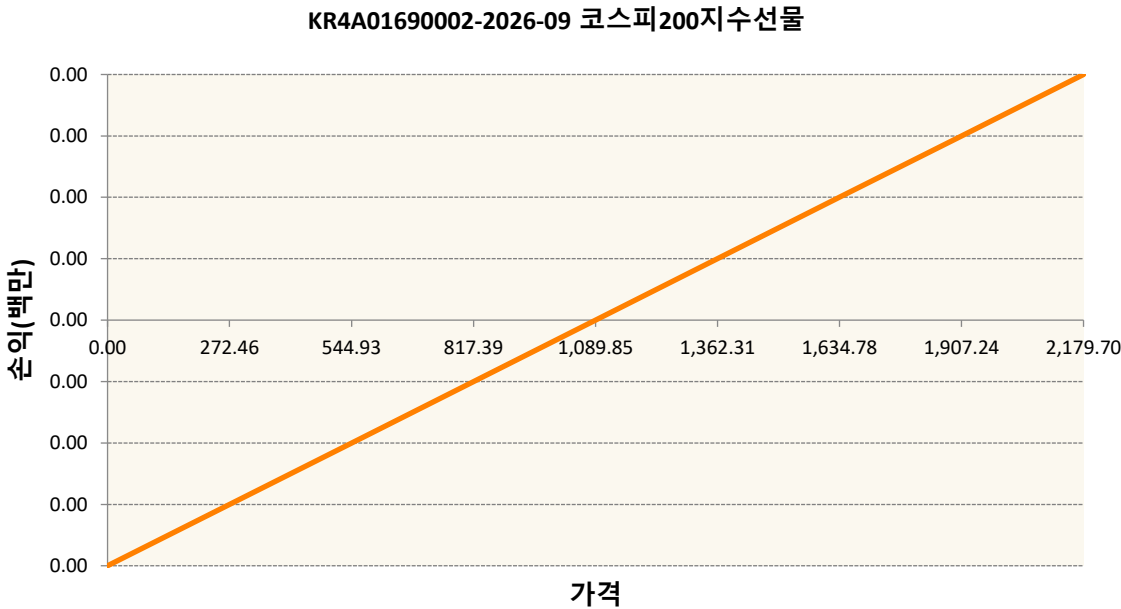
스마트인덱스모

1. 계약금액

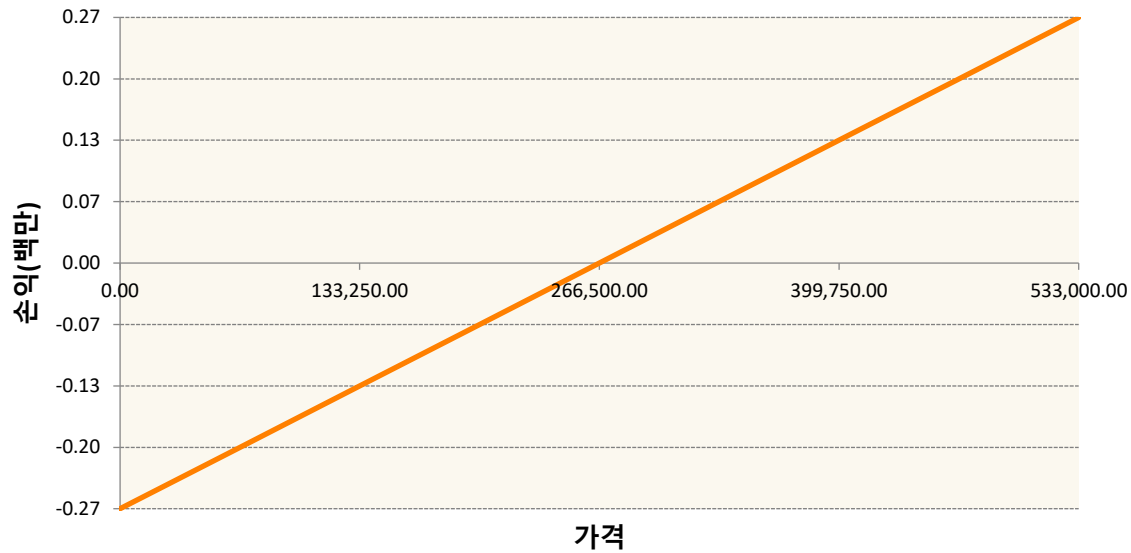
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,191	0	4,191	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물						218
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-218	-218	-218	-218	-218	-218	-218	
-5.33%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145	
-2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	73	73	73	73	73	73	73	
5.33%	145	145	145	145	145	145	145	
8.00%	218	218	218	218	218	218	218	
KR4A05690008		2026-09 미니코스피200 선물						22
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-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%	15	15	15	15	15	15	15	
8.00%	22	22	22	22	22	22	22	
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%	-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

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

(단위:백만원)

835

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

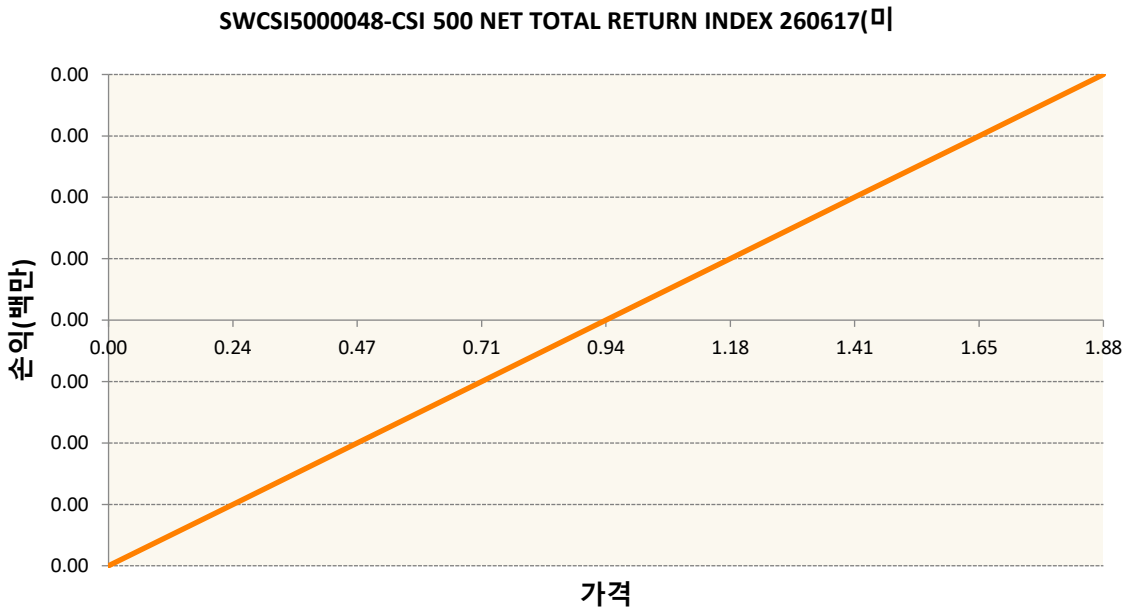
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,449	0	5,449	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

436

* 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	2026-08-28
기준일	2026-08-27

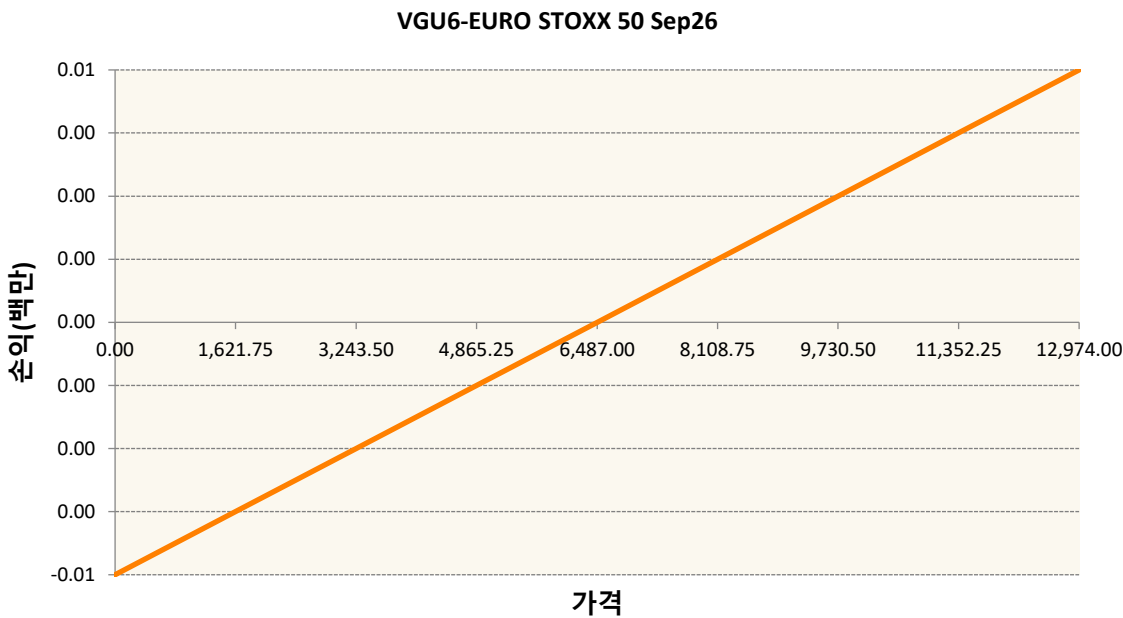
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,233	0	1,233	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	99
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

84

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

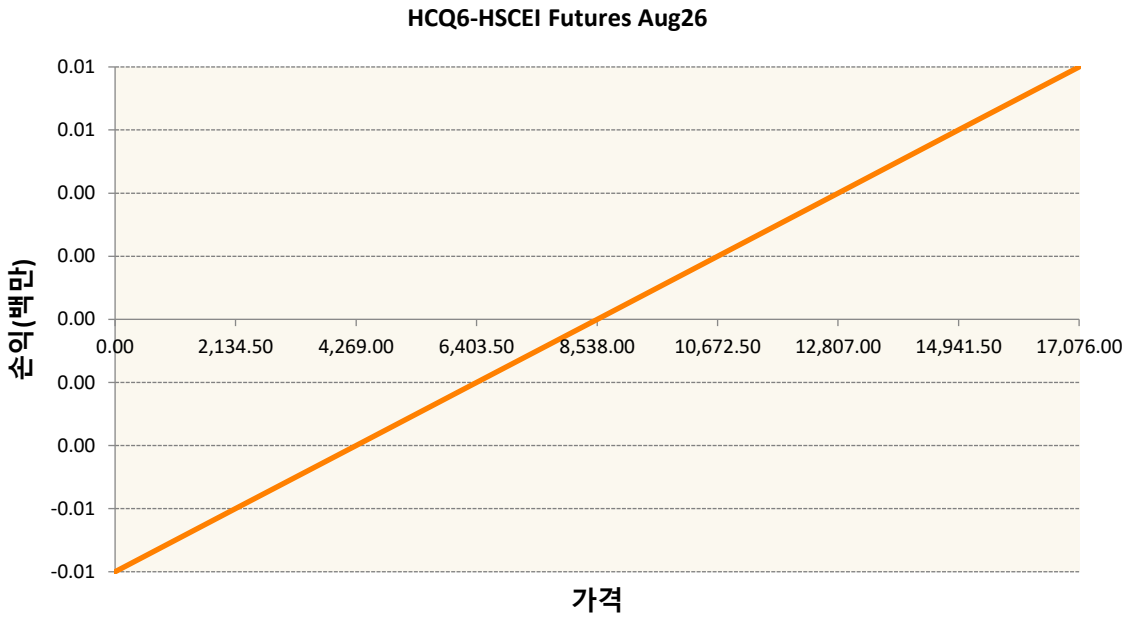
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,570	0	1,570	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

121

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

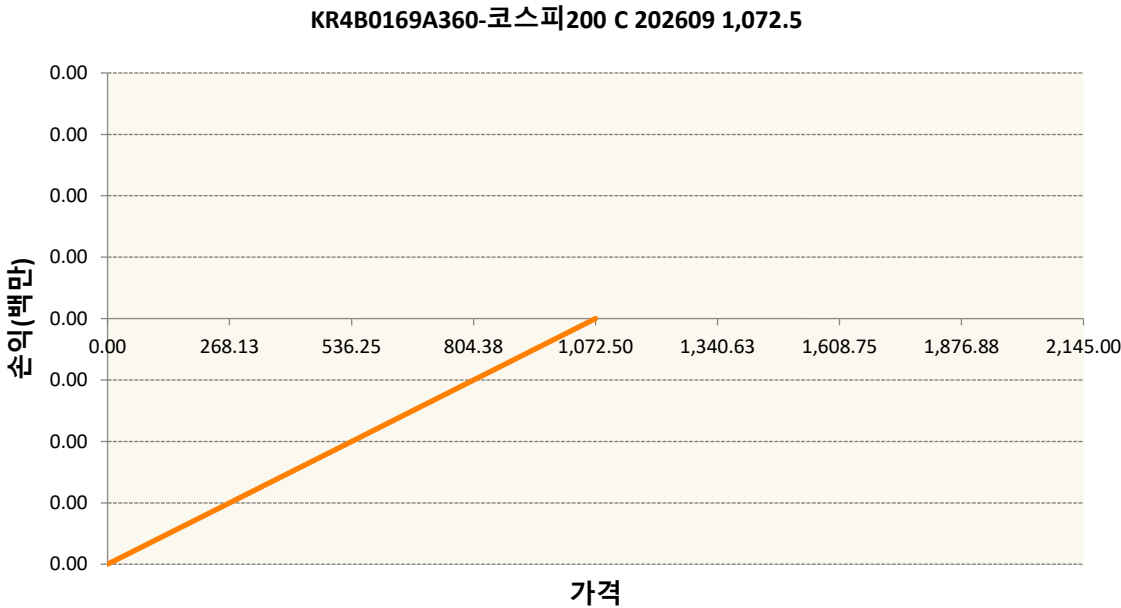
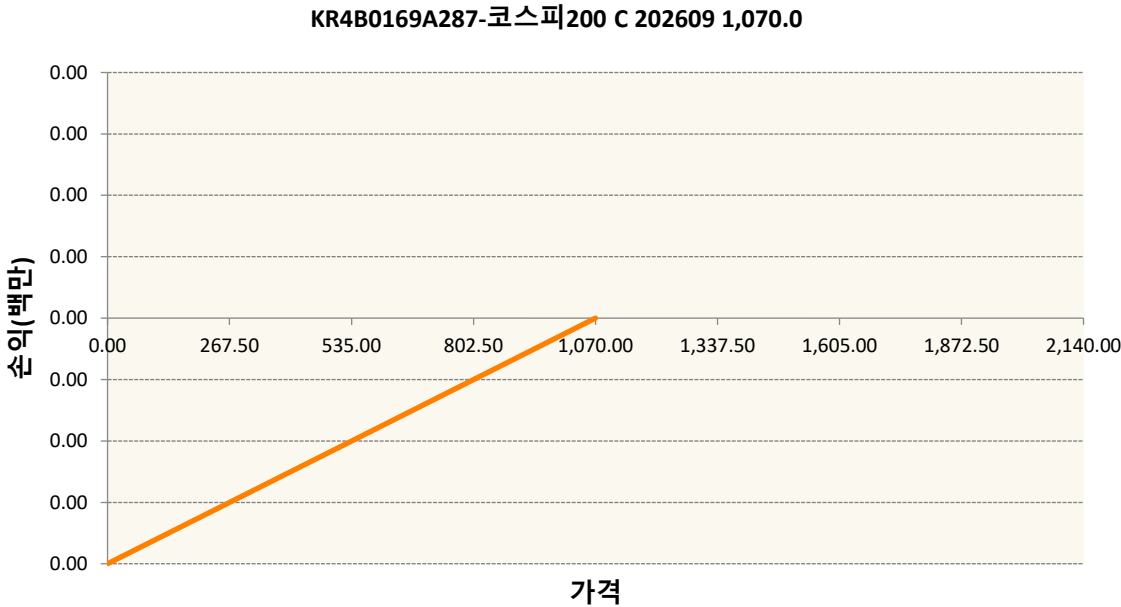
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

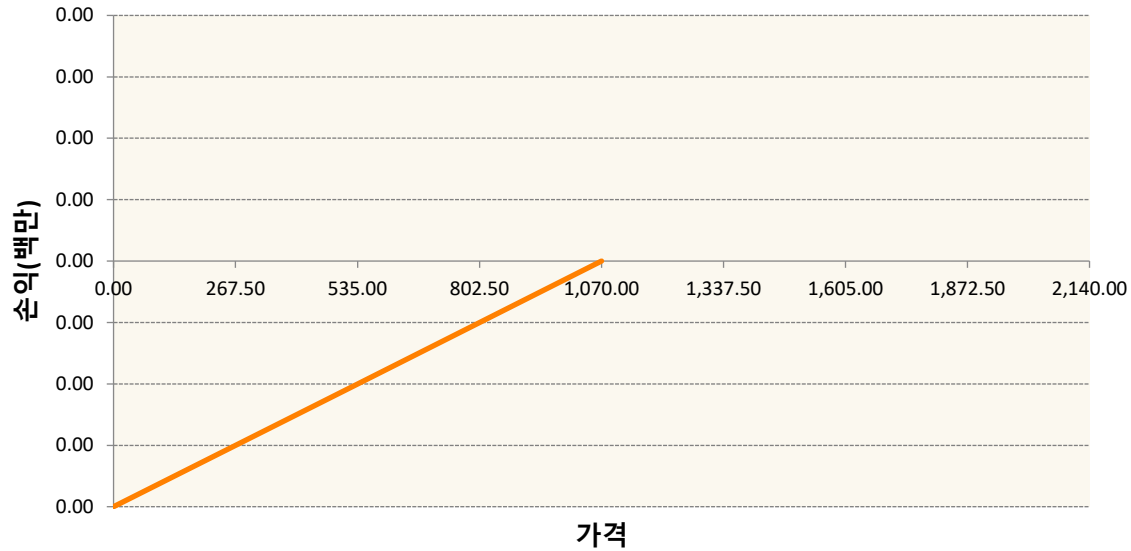
(단위:백만원)

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							757
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-540	-573	-607	-643	-680	-718	-757
-5.33%	-263	-304	-346	-389	-432	-475	-518
-2.67%	-36	-82	-128	-174	-220	-266	-312
0%	138	92	46	0	-46	-93	-139
2.67%	261	220	178	135	92	48	3
5.33%	341	309	274	237	198	158	118
8.00%	390	366	339	309	277	243	207
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							1,105
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-797	-842	-891	-942	-995	-1,049	-1,105
-5.33%	-391	-450	-509	-570	-632	-694	-757
-2.67%	-57	-123	-189	-256	-322	-389	-455
0%	200	134	67	0	-67	-134	-201
2.67%	383	324	262	200	137	73	8
5.33%	505	456	404	350	294	236	176
8.00%	579	543	503	458	411	360	308
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							393
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-281	-297	-315	-334	-353	-373	-393
-5.33%	-137	-158	-180	-202	-224	-247	-269
-2.67%	-19	-42	-66	-90	-114	-138	-162
0%	72	48	24	0	-24	-48	-72

2.67%	135	114	93	70	48	25	2
5.33%	177	160	142	123	103	82	61
8.00%	203	190	176	161	144	126	107

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

(단위:백만원)

3,299

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

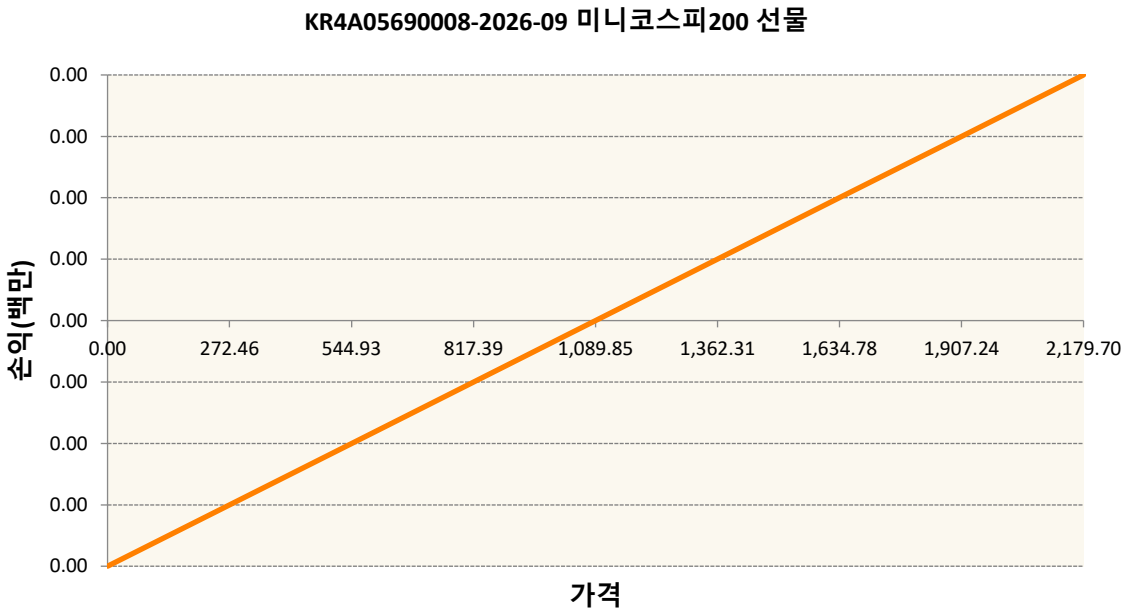
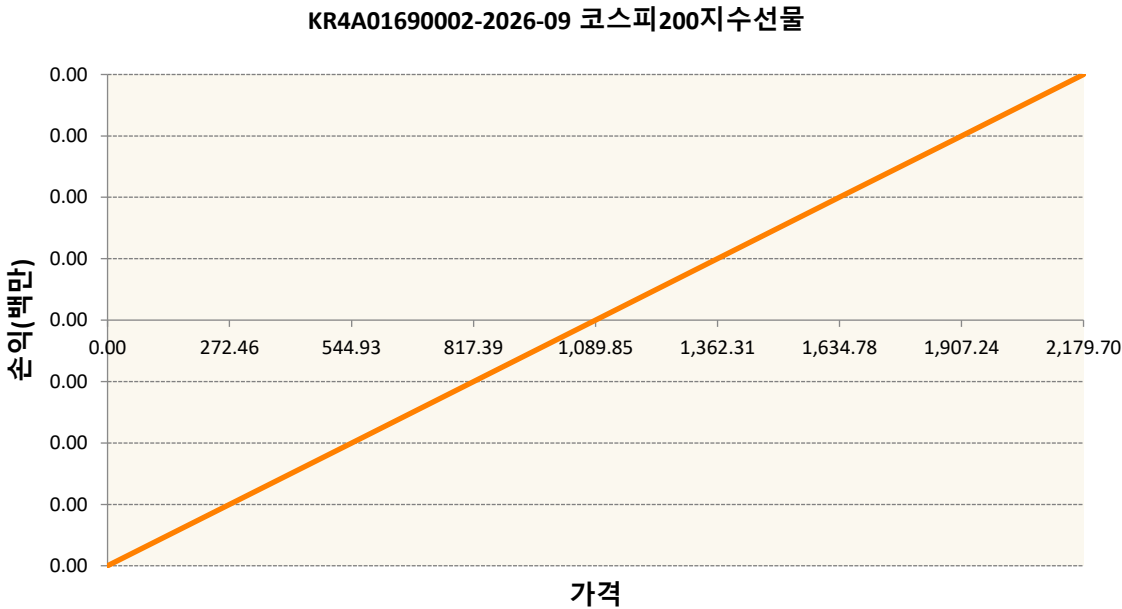
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

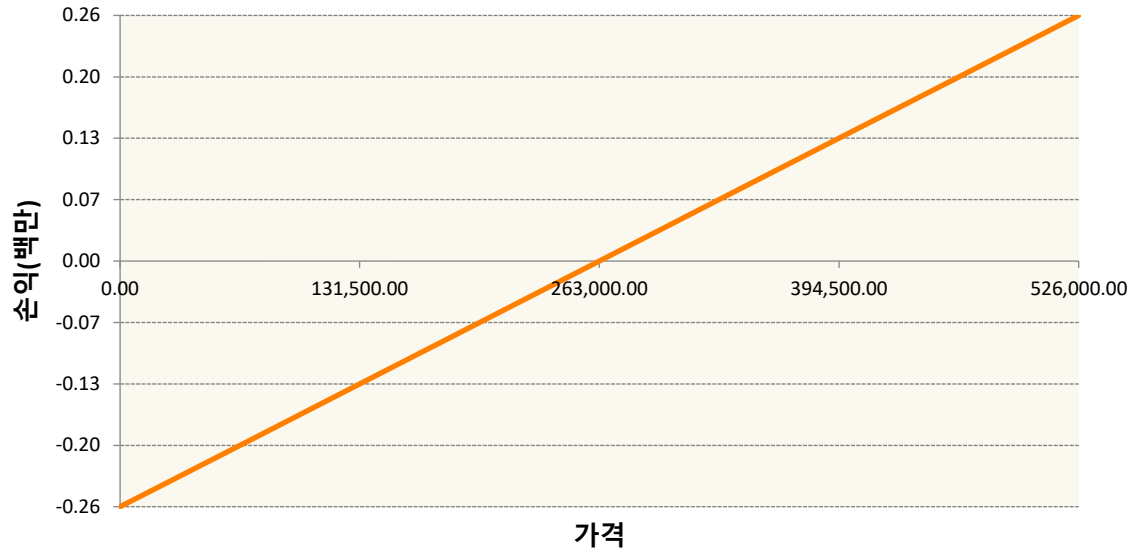
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,690	0	1,690	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
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	44	44	44	44	44	44	44
KR4A05690008			2026-09 미니코스피200 선물				17
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	17	17	17	17	17	17	17
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)
	222

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

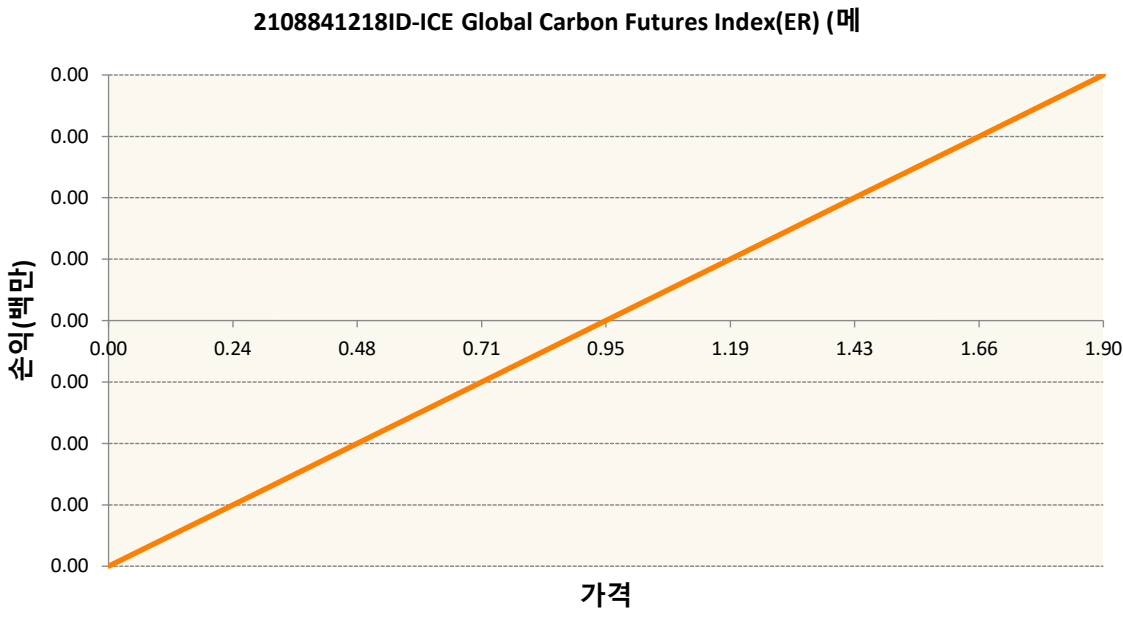
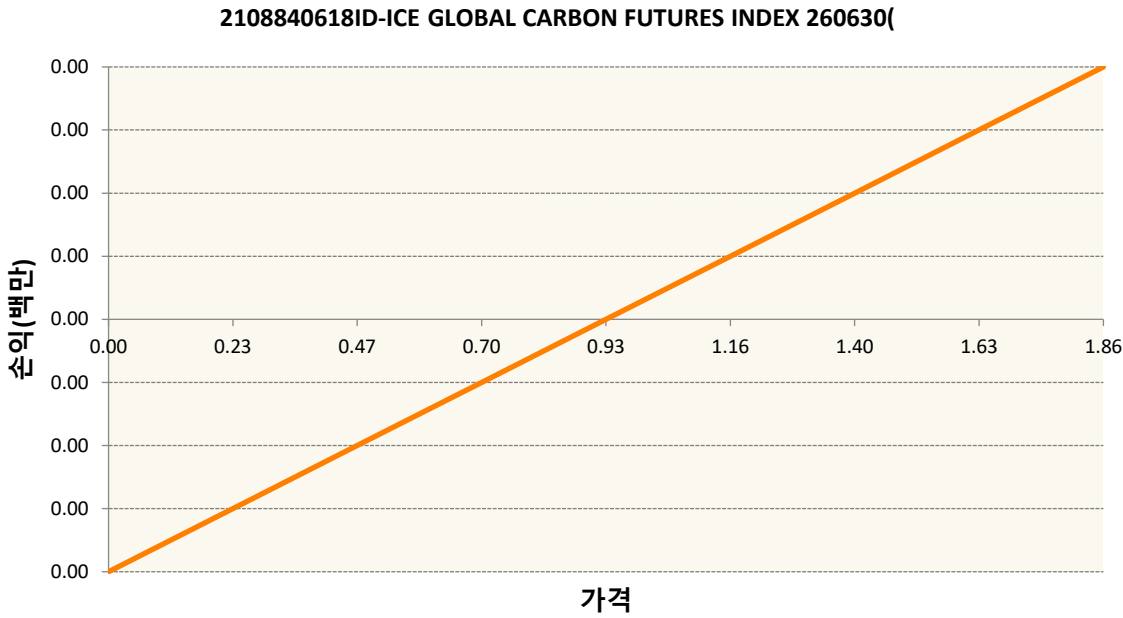
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)
	628

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

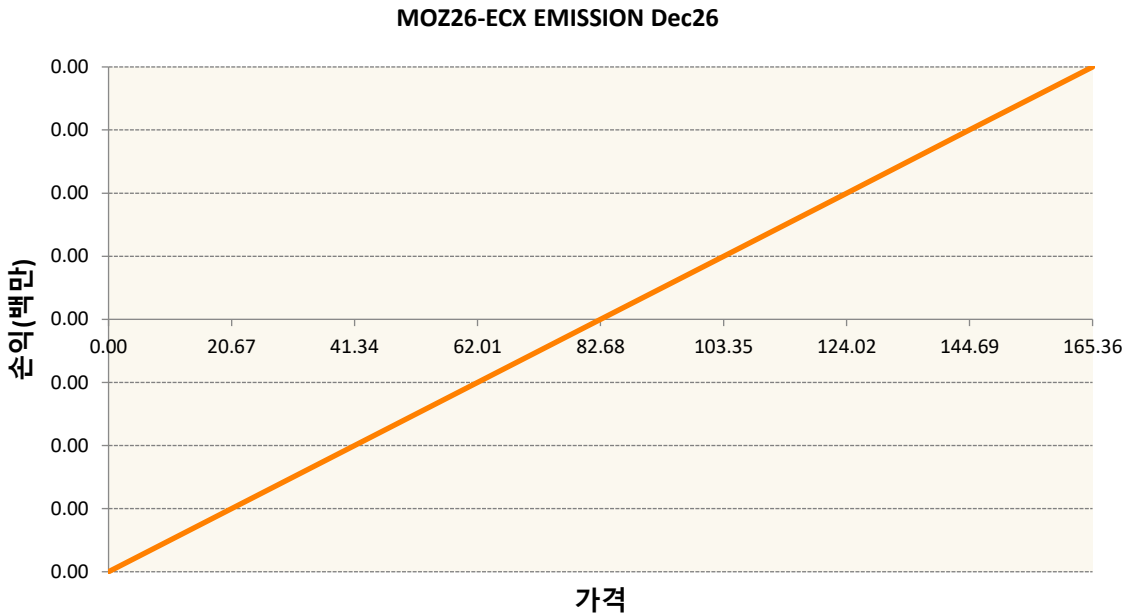
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,347	0	5,347	
누계	통화	선도	0	2,527	-2,527	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G7XI KRW/EUR 31-08-26E	202
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	428

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

(단위:백만원)

682

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

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)	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)

239

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

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	-5,468	0	-5,468	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	48
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	201
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	188

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

(단위:백만원)

823

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

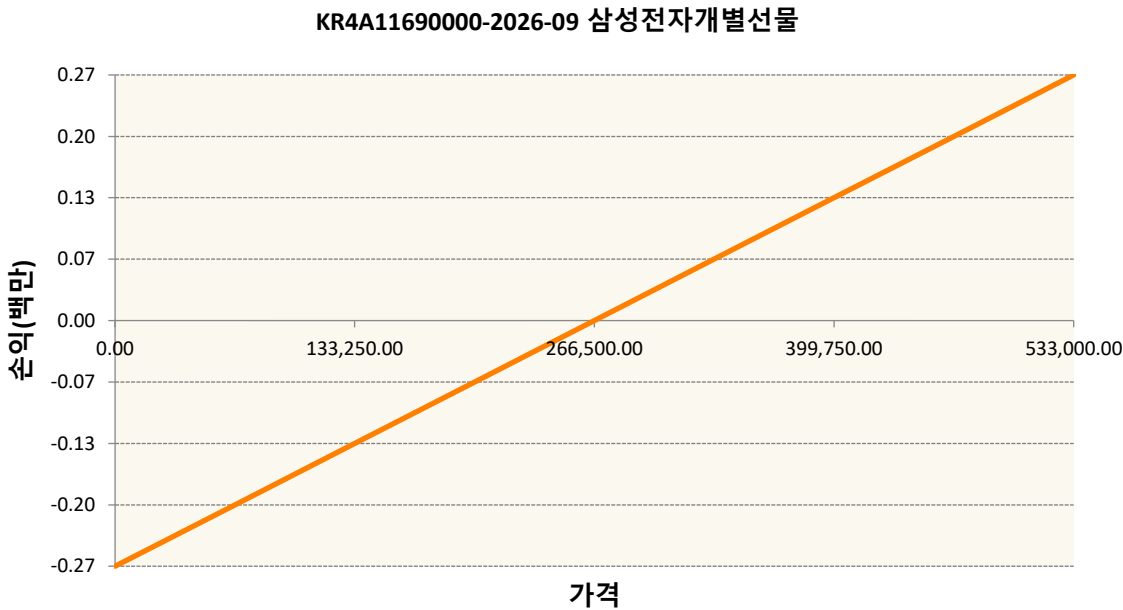
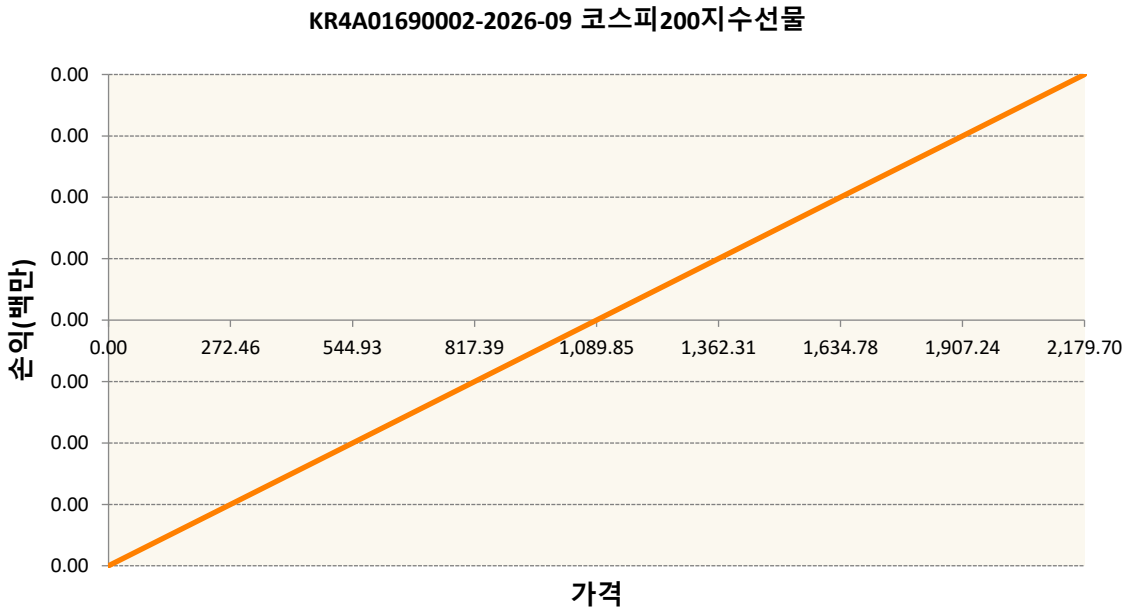
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	20,846	0	20,846	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					1,393
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393
-5.33%	-929	-929	-929	-929	-929	-929	-929
-2.67%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	464	464	464	464	464	464	464
5.33%	929	929	929	929	929	929	929
8.00%	1,393	1,393	1,393	1,393	1,393	1,393	1,393
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물					272
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272
-5.33%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	91	91	91	91	91	91	91
5.33%	181	181	181	181	181	181	181
8.00%	272	272	272	272	272	272	272

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

5,763

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

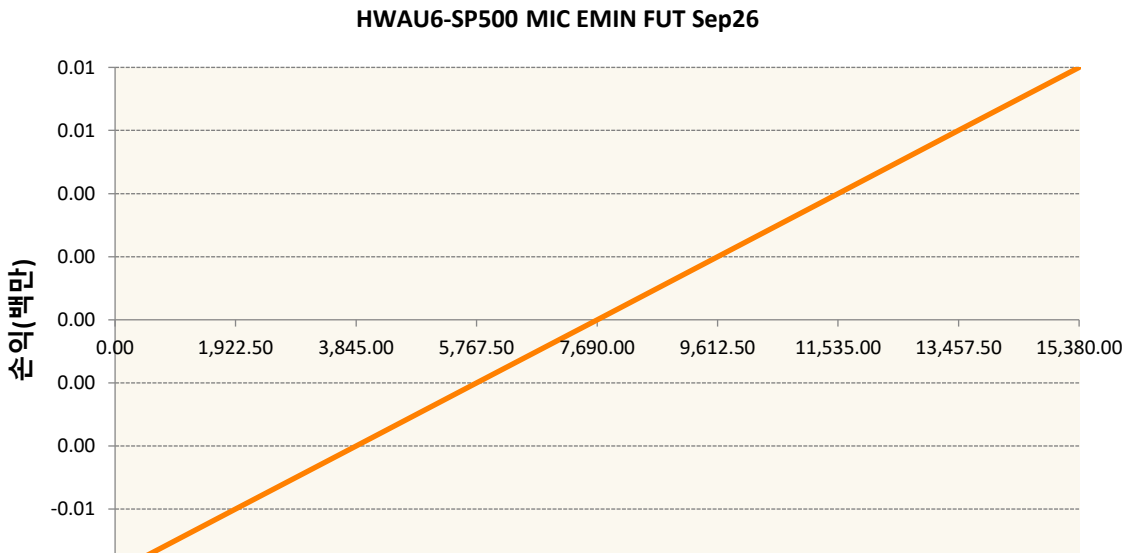
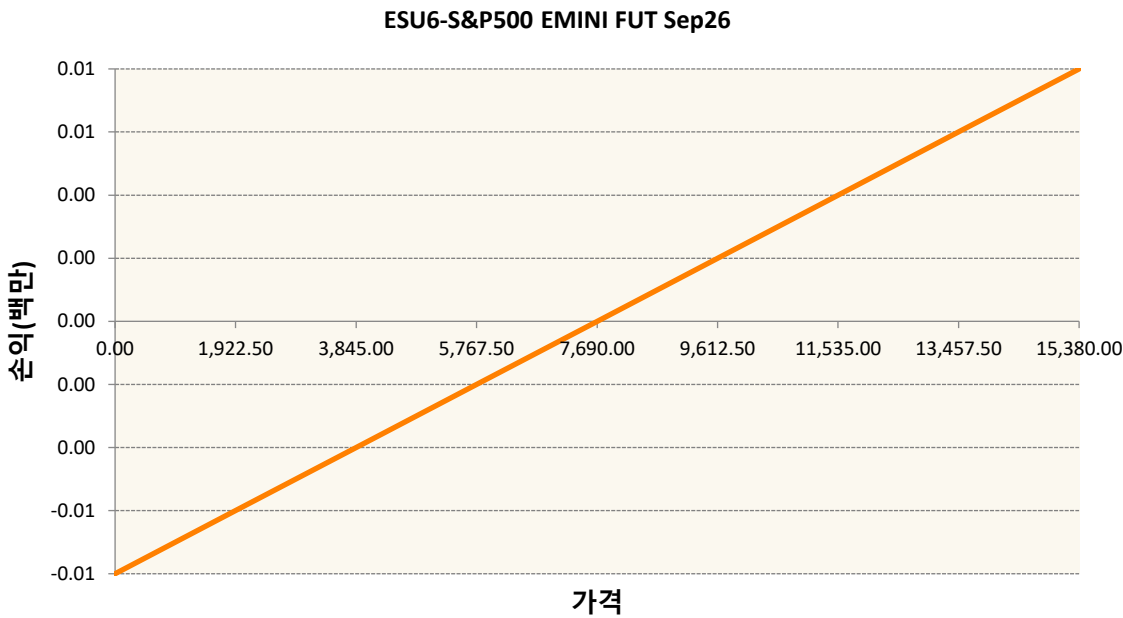
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

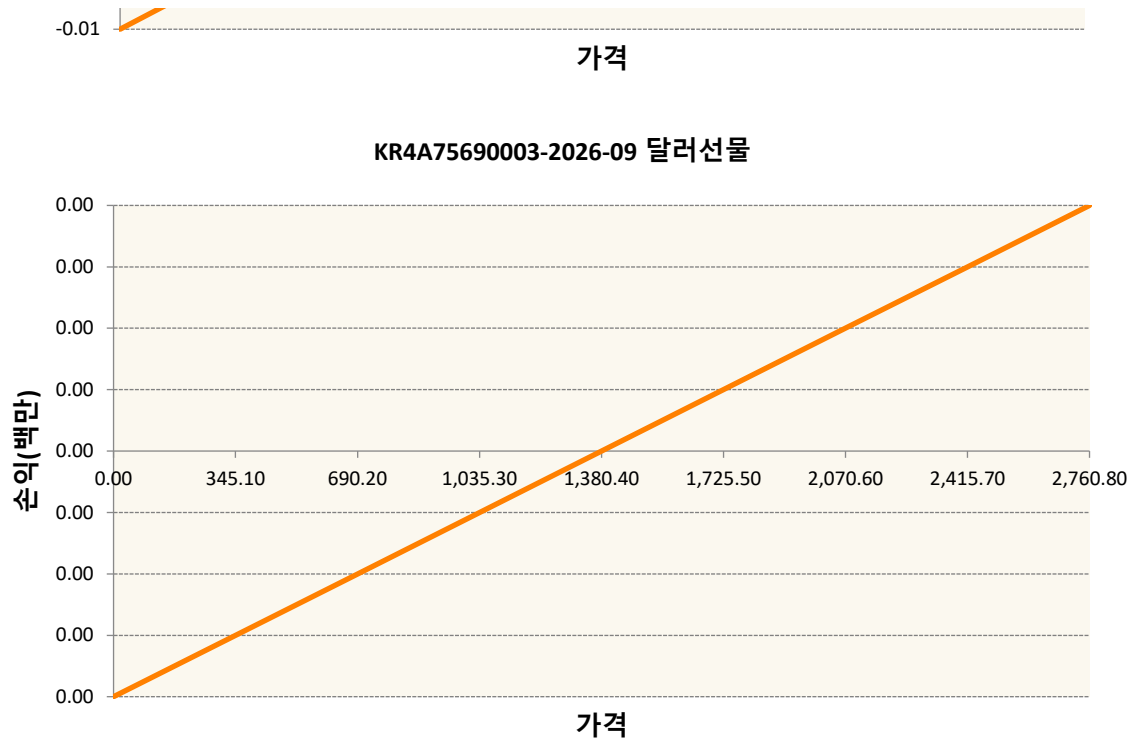
1. 계약금액

(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	76,654	0	76,654	
누계	지수	선물	176	0	176	장내
누계	통화	선물	11,871	0	11,871	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	6,132
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	14
KR4A756900	2026-09 달러선물	950

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

(단위:백만원)

5,090

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

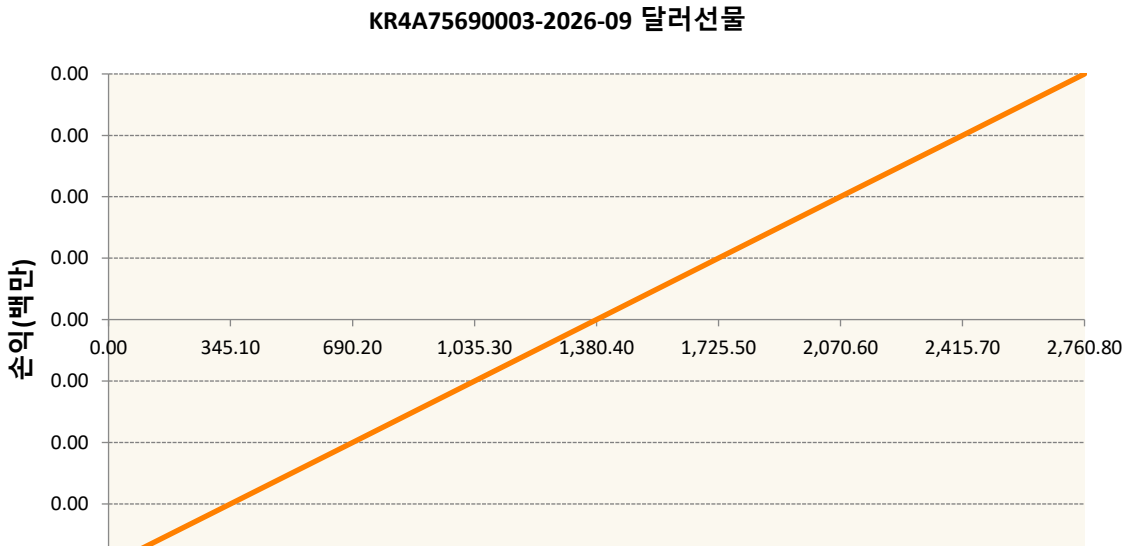
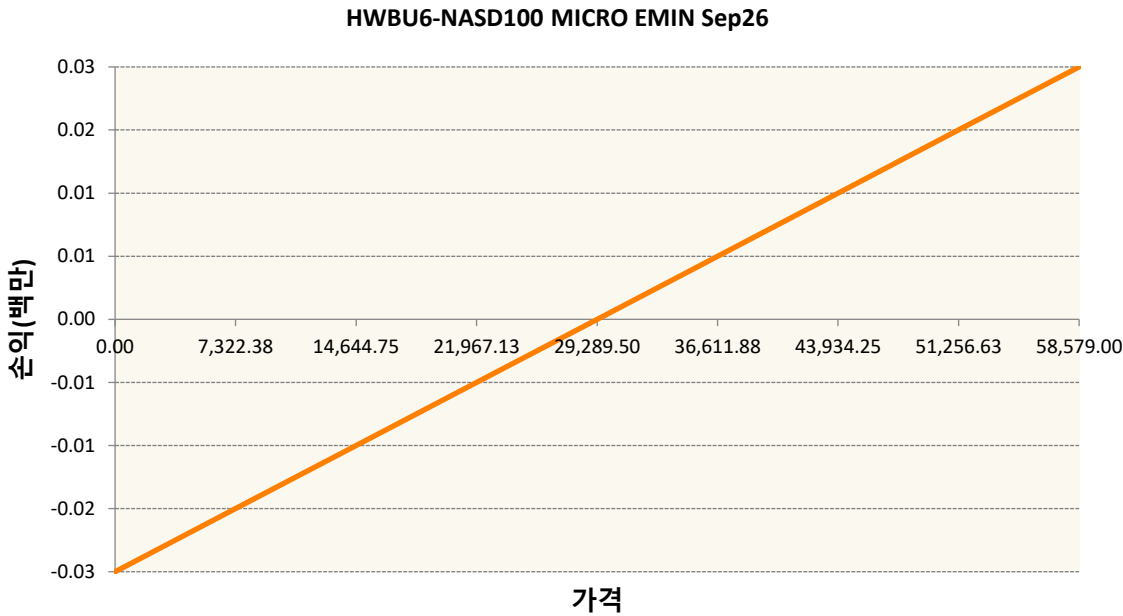
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

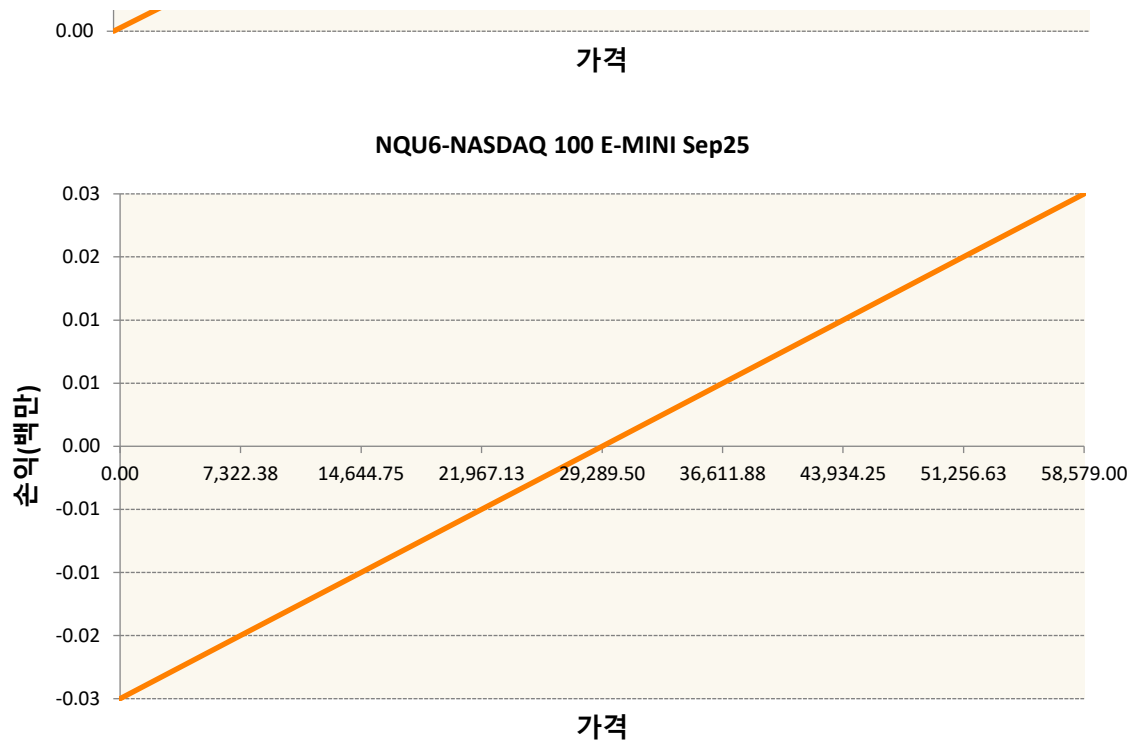
1. 계약금액

(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	1,353	0	1,353	장내
누계	지수	선물	36,206	0	36,206	
누계	통화	선물	4,638	0	4,638	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		108
KR4A756900	2026-09 달러선물		371
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,896

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,287

공시일	2026-08-28
기준일	2026-08-27

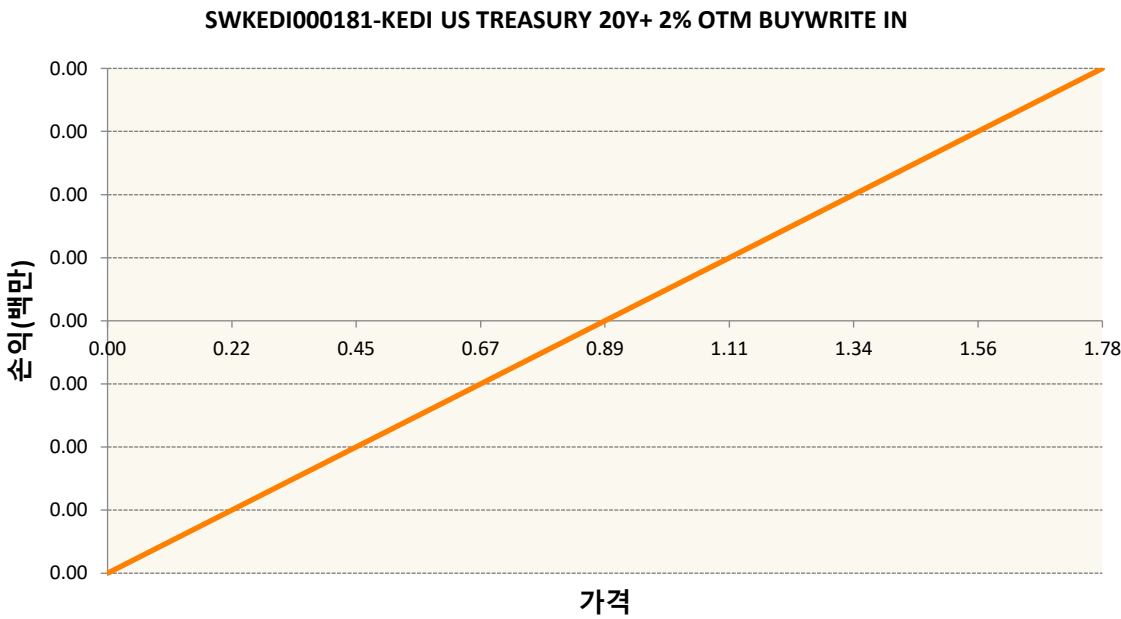
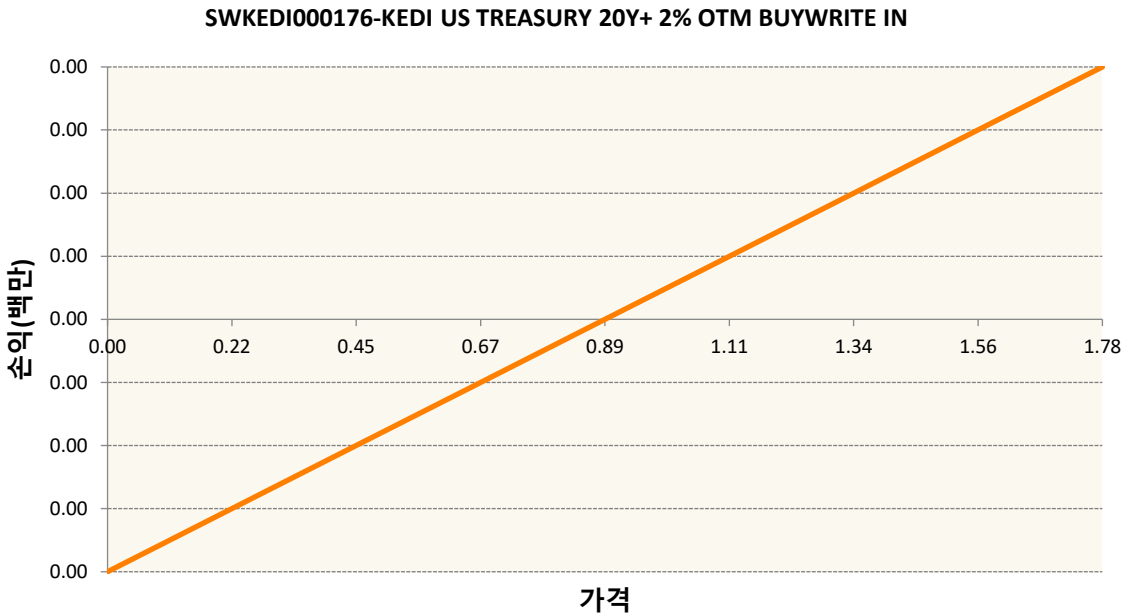
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

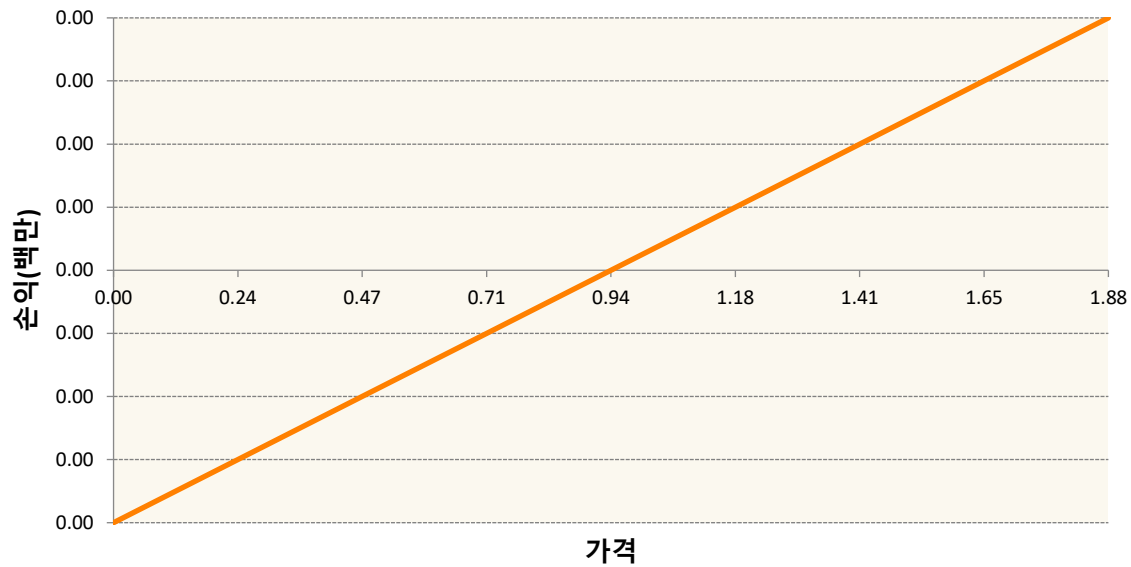
(단위:백만원)

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

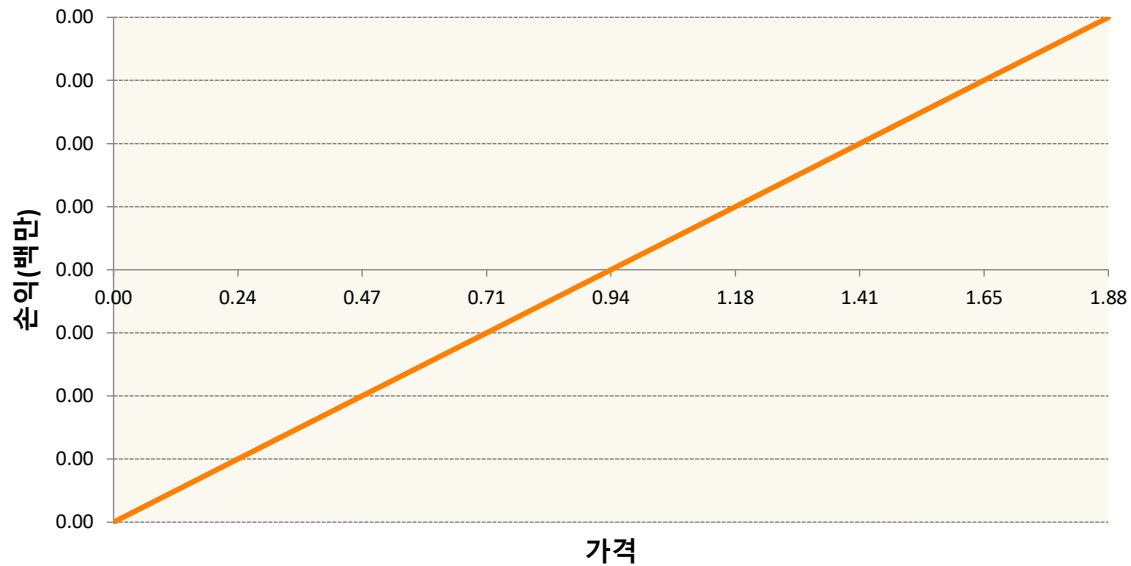
2. 만기시점의 손익구조



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	7,260
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,849
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,379
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,155

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

(단위:백만원)

9,211
