

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

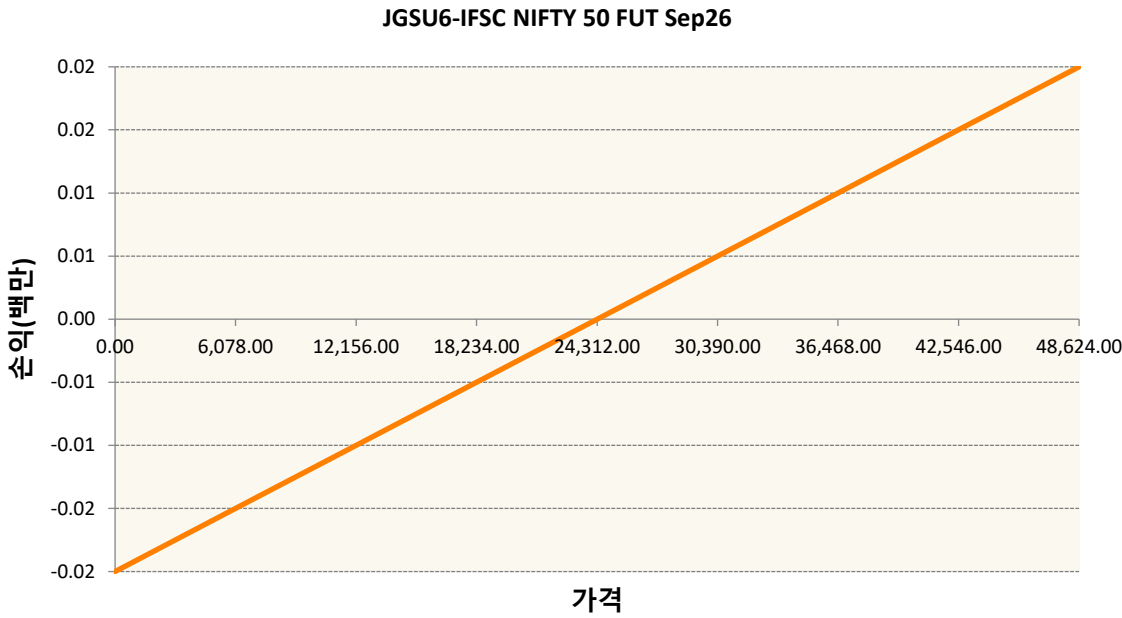
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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)

18

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

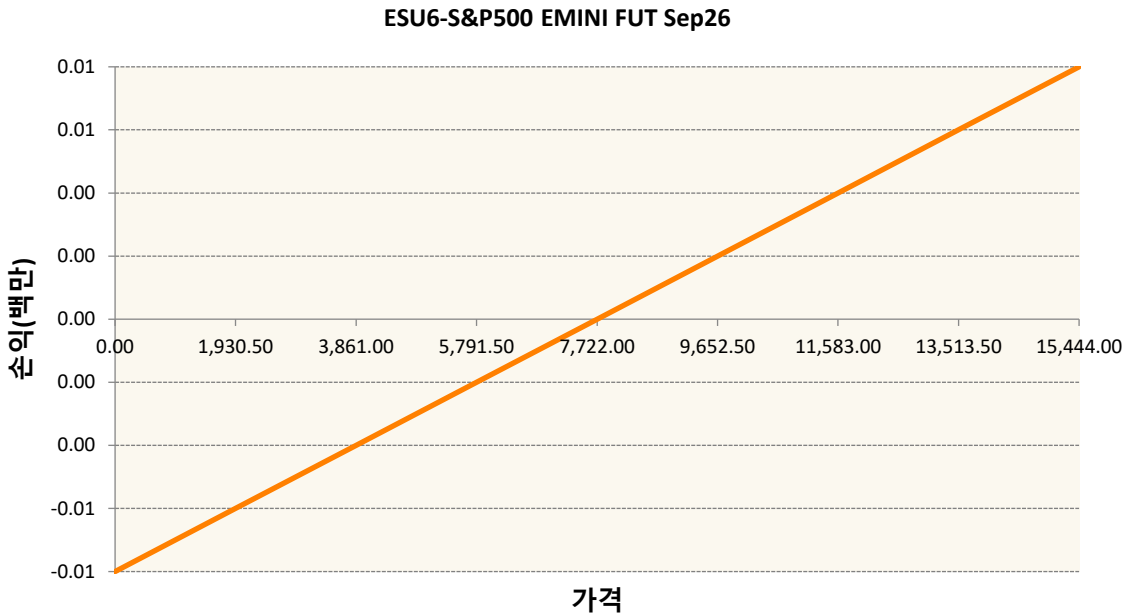
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	589	0	589	

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	2026-09-01
기준일	2026-08-31

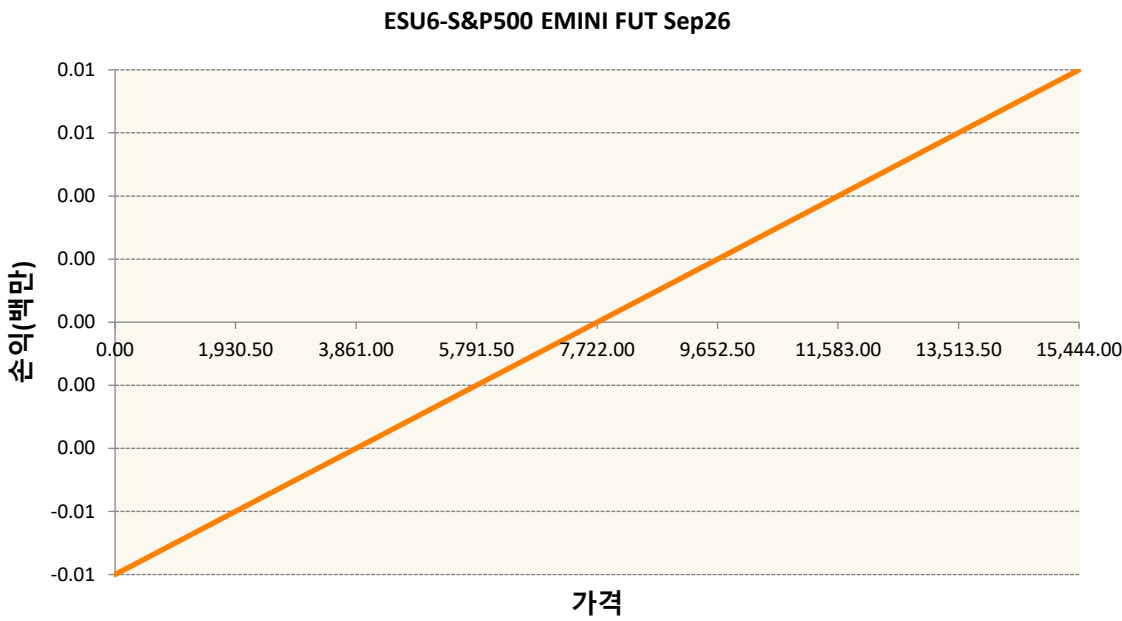
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	582	0	582	

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	2026-09-01
기준일	2026-08-31

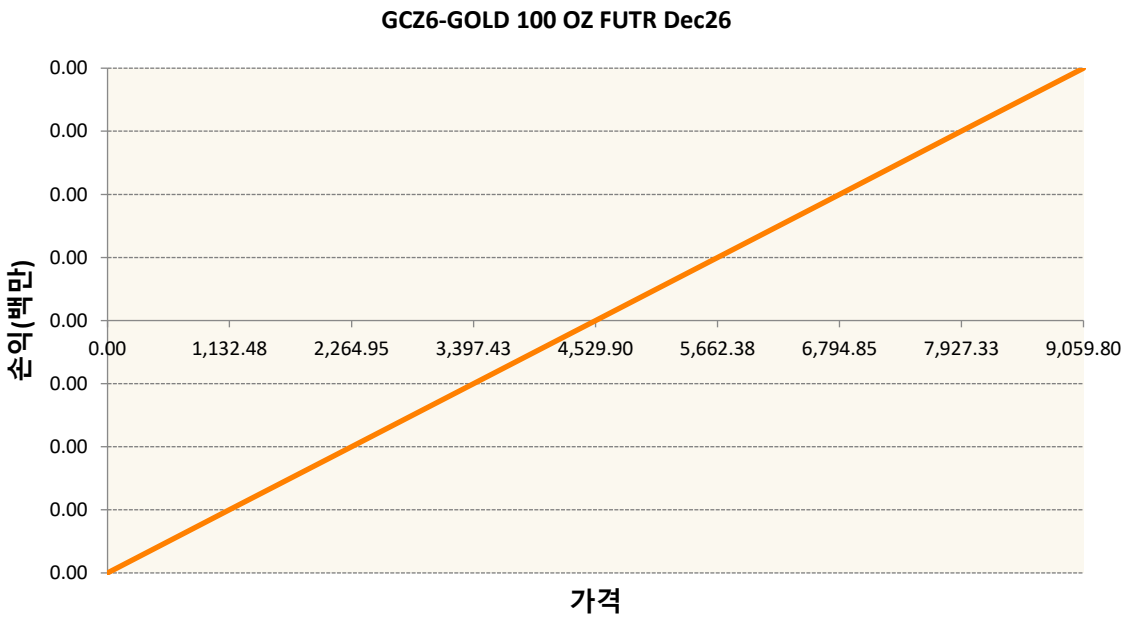
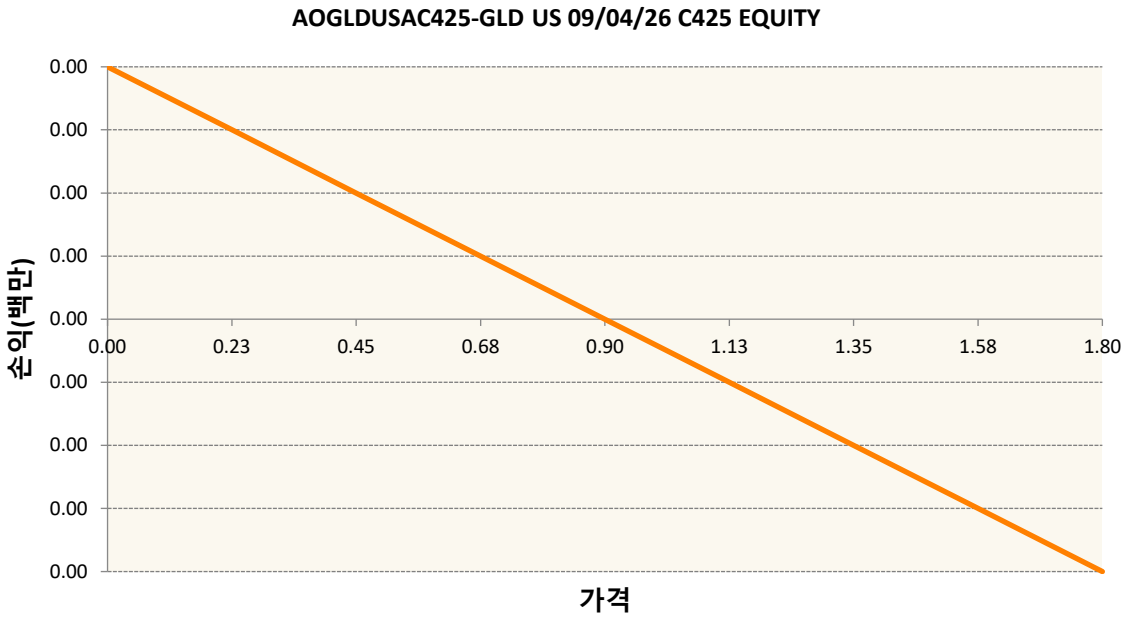
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,813	0	5,813	
누계	실물자산	옵션	0	14	-14	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSAC GLD US 09/04/26 C425 EQUITY		1
GCZ6	GOLD 100 OZ FUTR Dec26	465

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	616

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

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)

AOPLTRUP1\$PLTR US 09/04/26 P192.5 EQUITY	9
AOPLTRUS1\$PLTR US 09/04/26 C192.5 EQUITY	97

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

(단위:백만원)

359

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

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 09/04/26 C83.5 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

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

(단위:백만원)

14,510

공시일 2026-09-01

기준일 2026-08-31

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	2026-09-01
기준일	2026-08-31

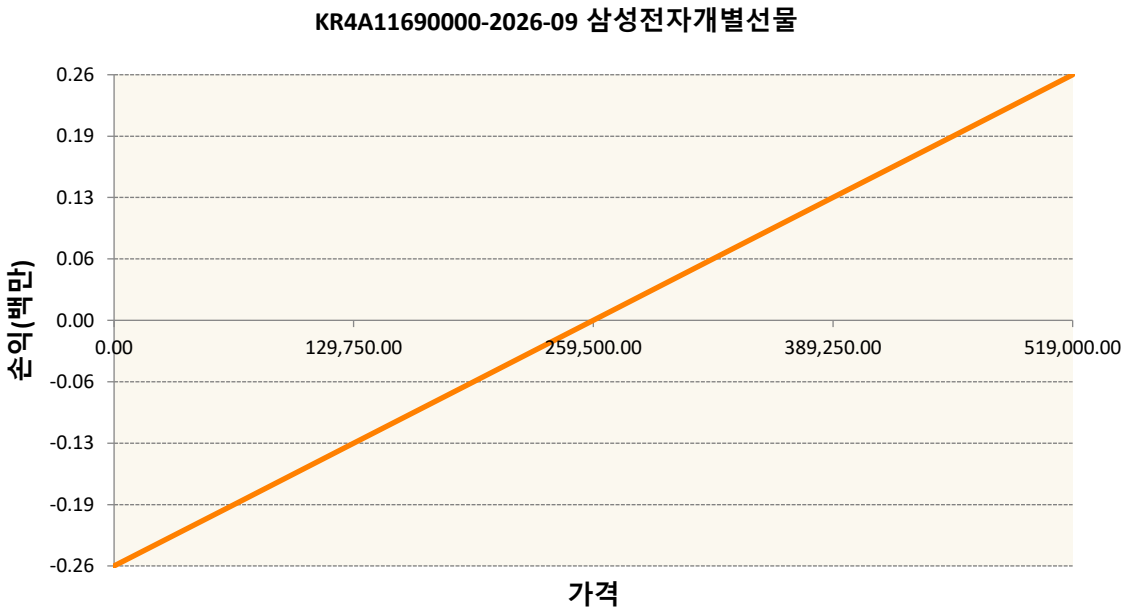
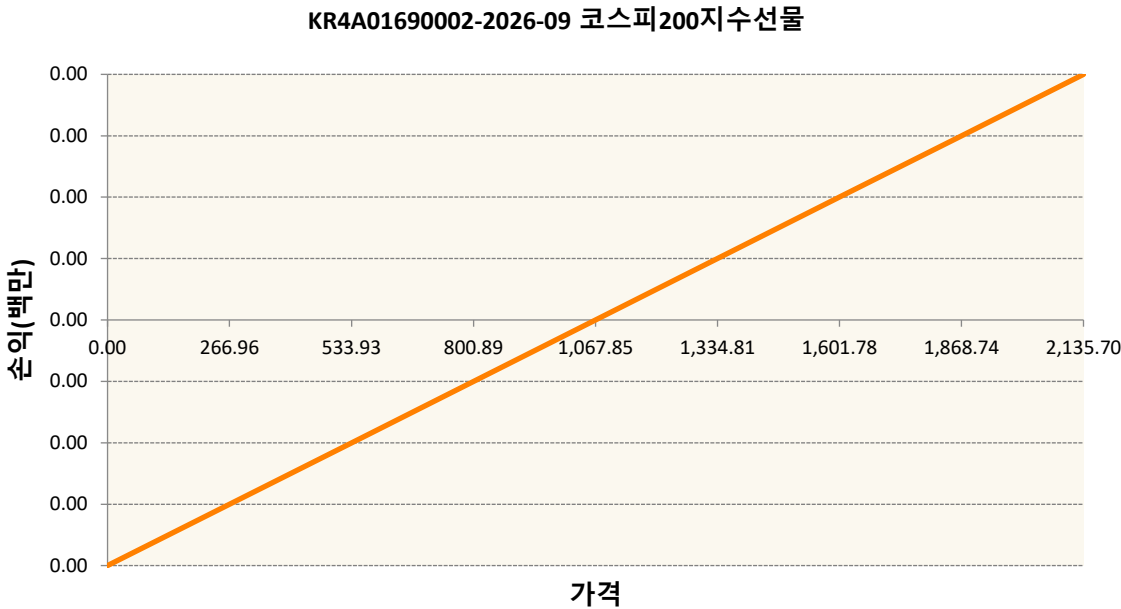
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

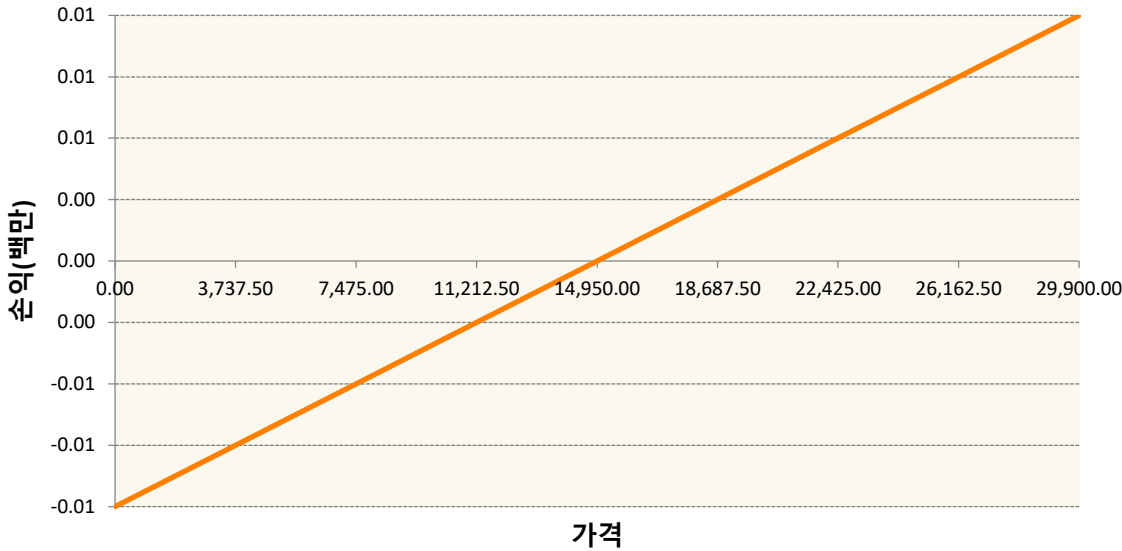
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	55,899	-55,899	장내
누계	유가증권	선물	21,021	0	21,021	장내
누계	유가증권	옵션	0	55,017	-55,017	장내

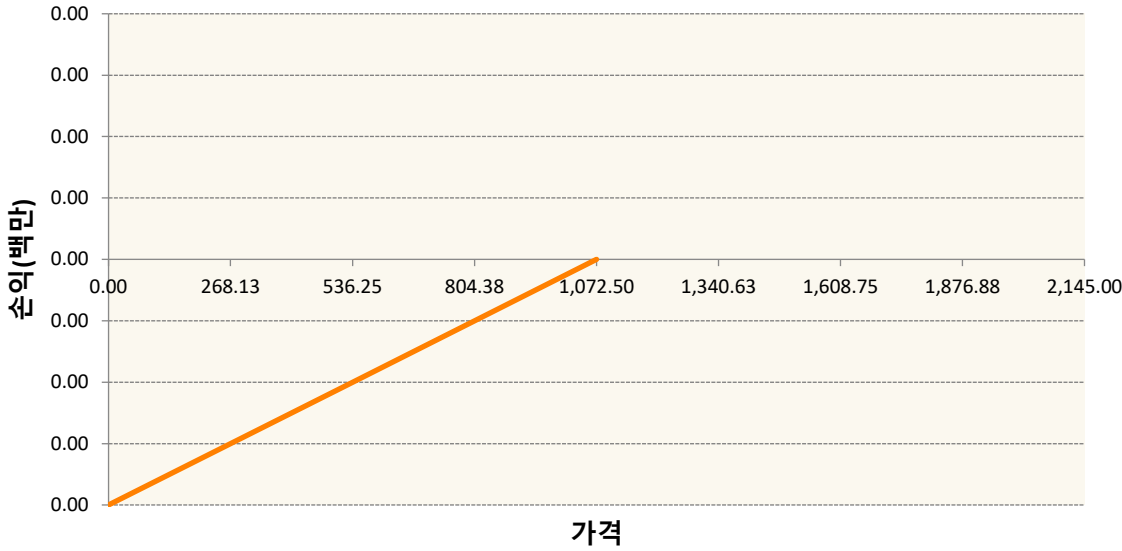
2. 만기시점의 손익구조



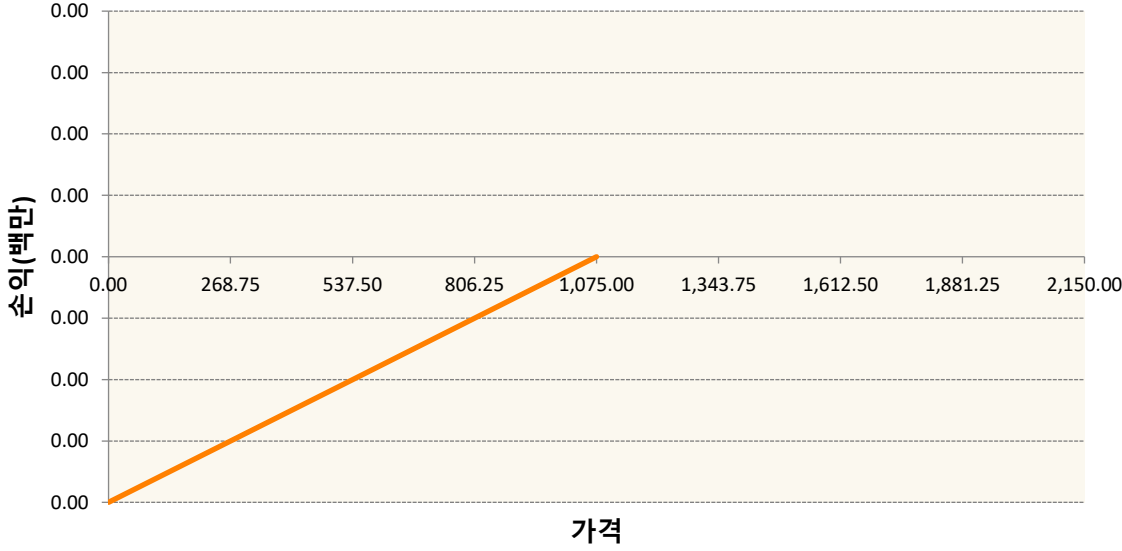
KR4AFB690003-2026-09 SK아이이테크놀로지개별선물



KR4B09FCA304-코스피위클리 C 2609W1 1,072.5



KR4B09FCA312-코스피위클리 C 2609W1 1,075.0



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		557					
기초자산의 변동성														
가격	-25.00%		-16.67%		-8.33%		0%		8.33%		16.67%		25.00%	
-8.00%	-557		-557		-557		-557		-557		-557		-557	
-5.33%	-372		-372		-372		-372		-372		-372		-372	
-2.67%	-186		-186		-186		-186		-186		-186		-186	
0%	0		0		0		0		0		0		0	
2.67%	186		186		186		186		186		186		186	
5.33%	372		372		372		372		372		372		372	
8.00%	557		557		557		557		557		557		557	
KR4A11690000							2026-09 삼성전자개별선물		1,123					
기초자산의 변동성														
가격	-25.00%		-16.67%		-8.33%		0%		8.33%		16.67%		25.00%	
-8.00%	-1,123		-1,123		-1,123		-1,123		-1,123		-1,123		-1,123	
-5.33%	-749		-749		-749		-749		-749		-749		-749	
-2.67%	-374		-374		-374		-374		-374		-374		-374	
0%	0		0		0		0		0		0		0	
2.67%	374		374		374		374		374		374		374	
5.33%	749		749		749		749		749		749		749	
8.00%	1,123		1,123		1,123		1,123		1,123		1,123		1,123	
KR4AFB690003							2026-09 SK아이이테크놀로지개별선물		6					
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	
KR4B09FCA304							코스피위클리 C 2609W1 1,072.5		2,132					
기초자산의 변동성														
가격	-25.00%		-16.67%		-8.33%		0%		8.33%		16.67%		25.00%	
-8.00%	-2,095		-2,097		-2,100		-2,105		-2,112		-2,121		-2,132	
-5.33%	-1,231		-1,242		-1,256		-1,273		-1,293		-1,315		-1,340	
-2.67%	-443		-475		-509		-545		-582		-620		-659	
0%	137		92		46		0		-46		-92		-137	
2.67%	436		402		366		328		289		250		209	
5.33%	534		520		502		482		459		433		405	
8.00%	553		550		545		537		527		514		499	
KR4B09FCA312							코스피위클리 C 2609W1 1,075.0		1,443					
기초자산의 변동성														

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,421	-1,422	-1,424	-1,427	-1,431	-1,436	-1,443
-5.33%	-843	-850	-858	-869	-881	-895	-911
-2.67%	-311	-331	-352	-375	-399	-424	-449
0%	91	61	30	0	-30	-61	-91
2.67%	306	282	257	231	204	177	149
5.33%	380	369	357	342	326	307	288
8.00%	395	393	389	383	375	366	356

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

(단위:백만원)

12,468

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

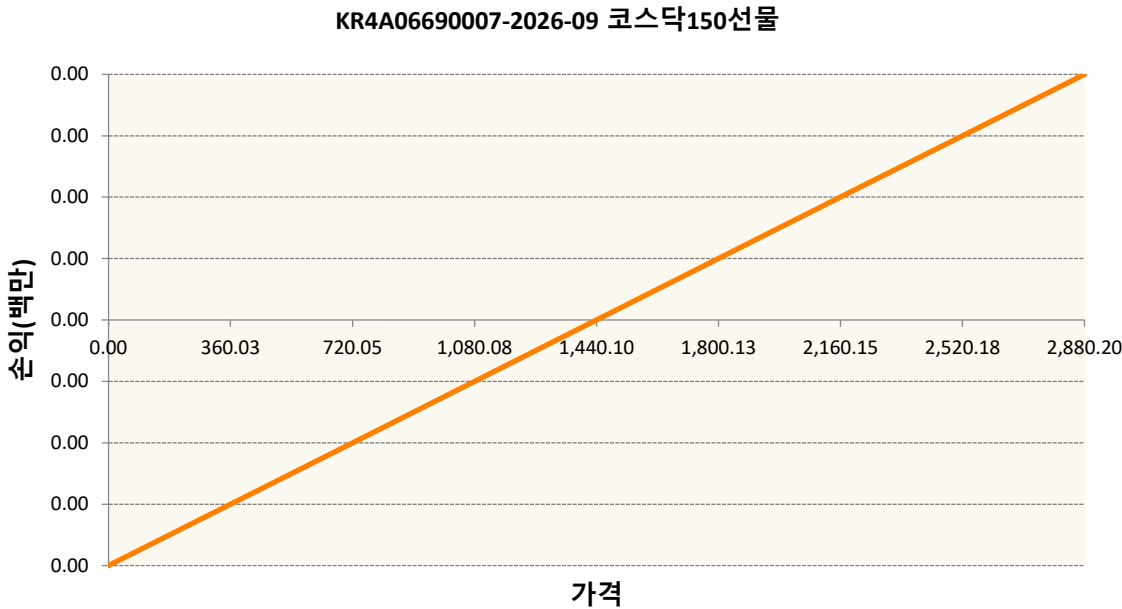
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	662	0	662	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)

16,358

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

(단위:백만원)

55,723

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

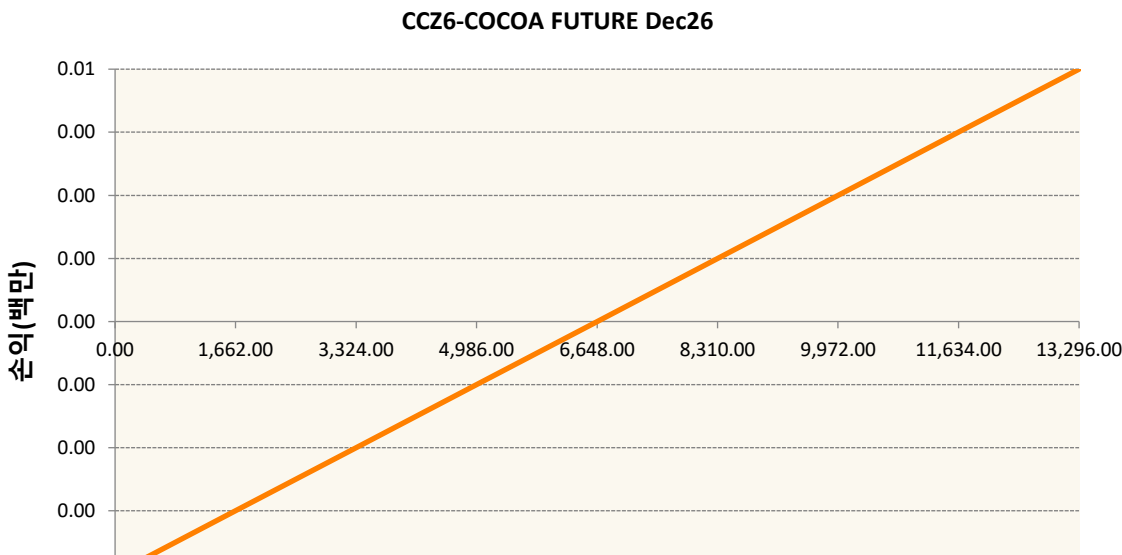
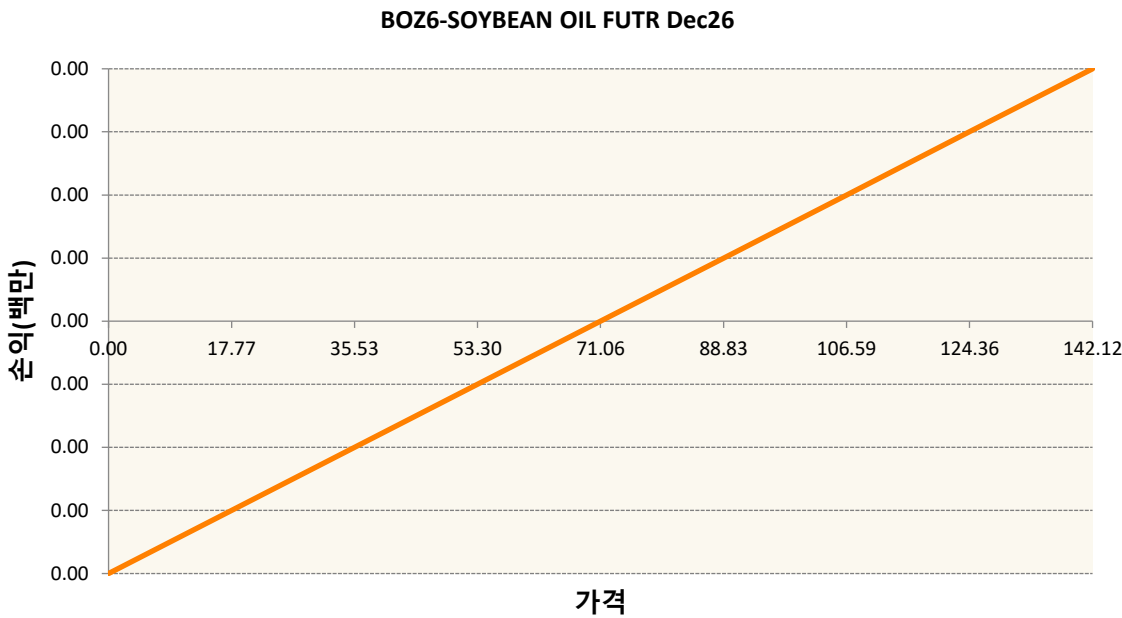
포커스농산물모(채권-파생형)

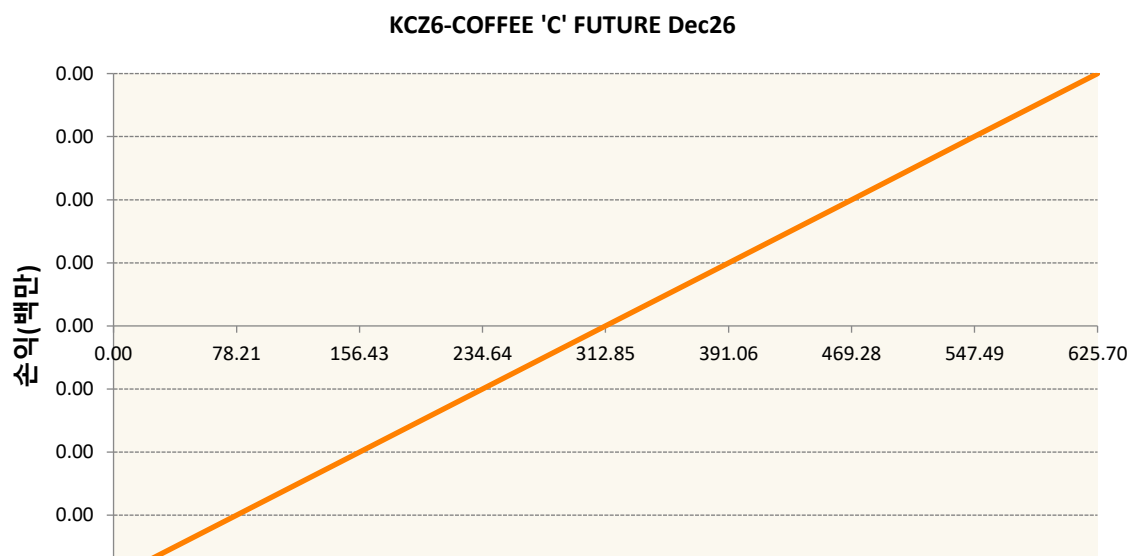
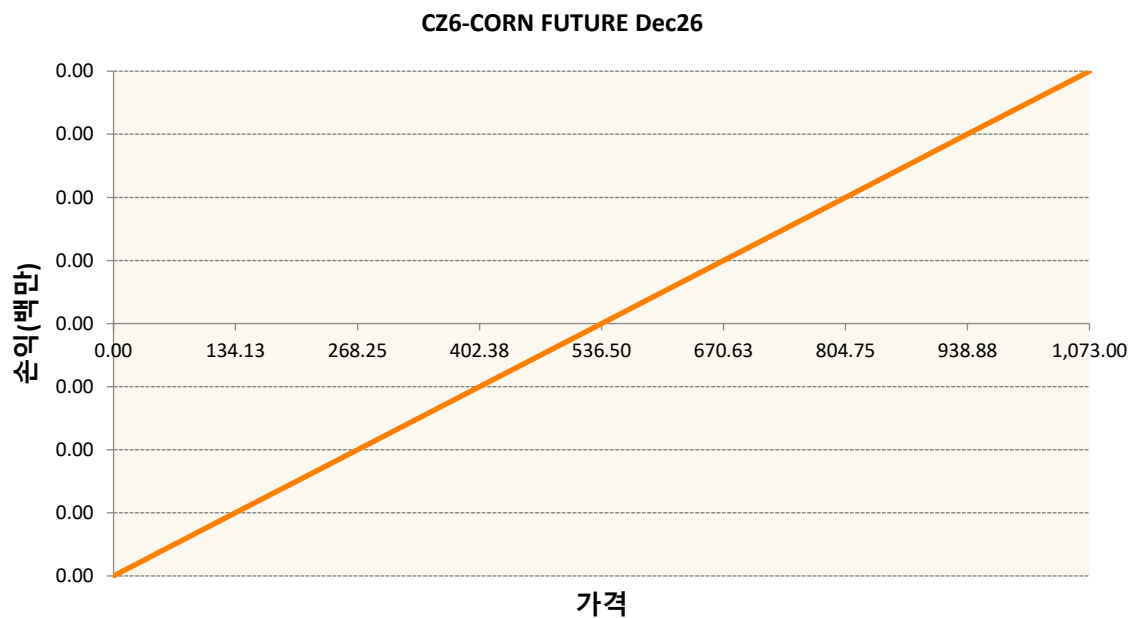
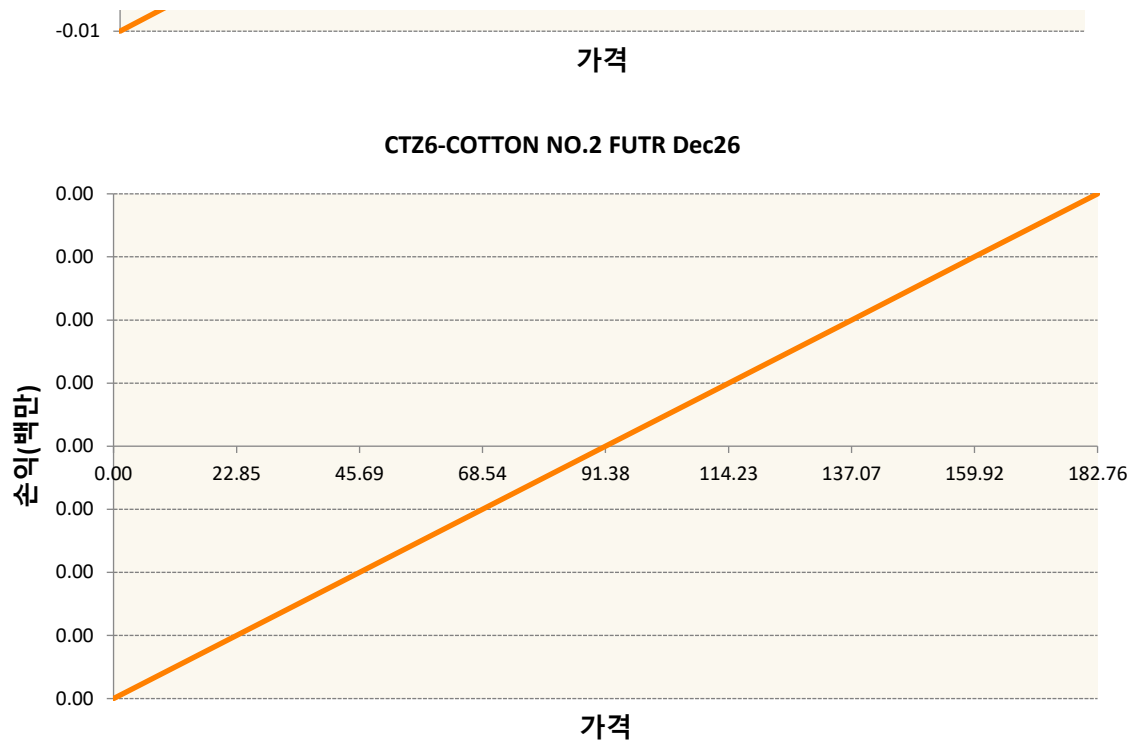
1. 계약금액

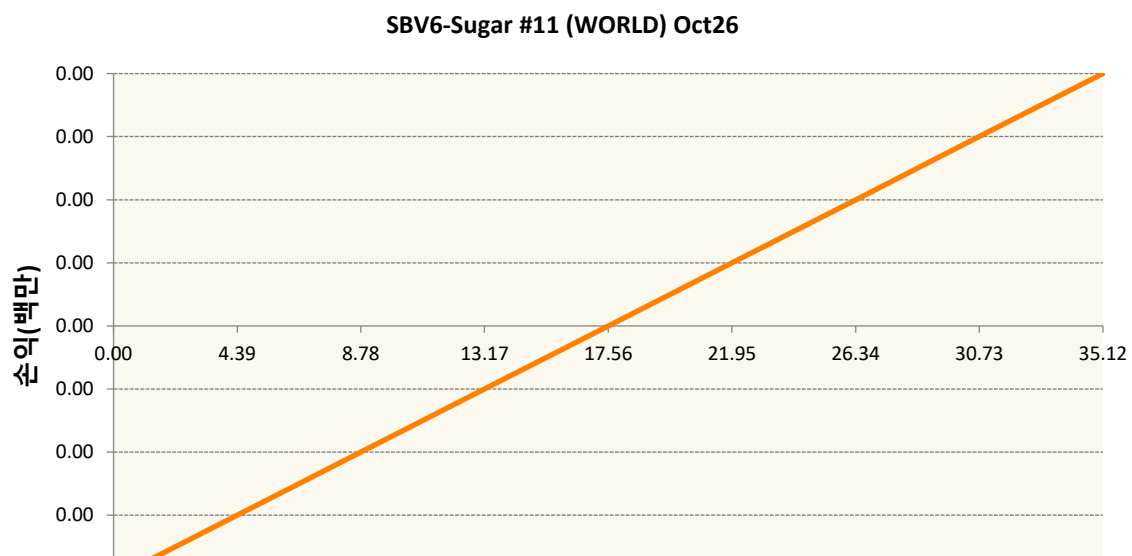
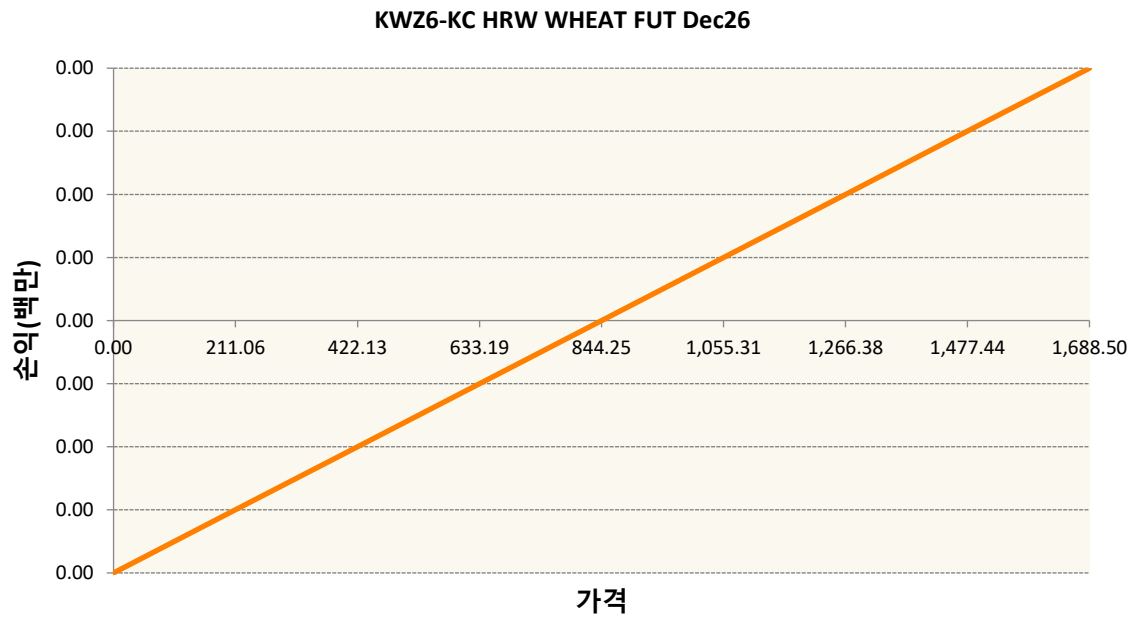
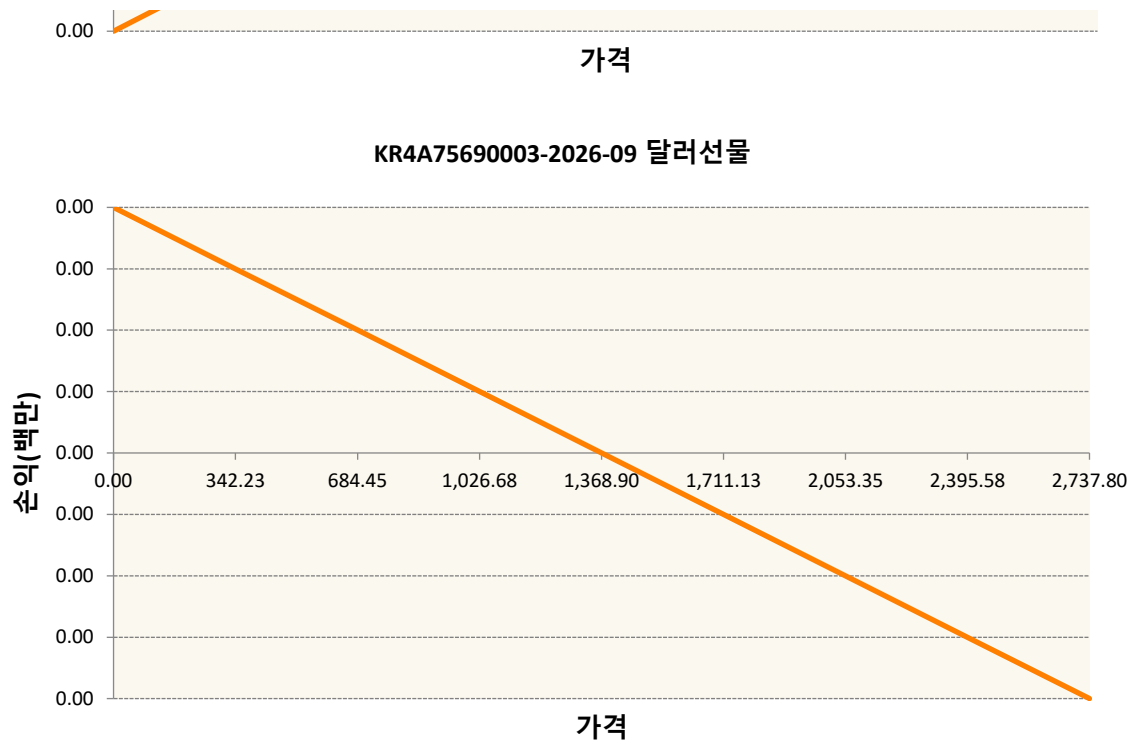
(단위:USD 백만)

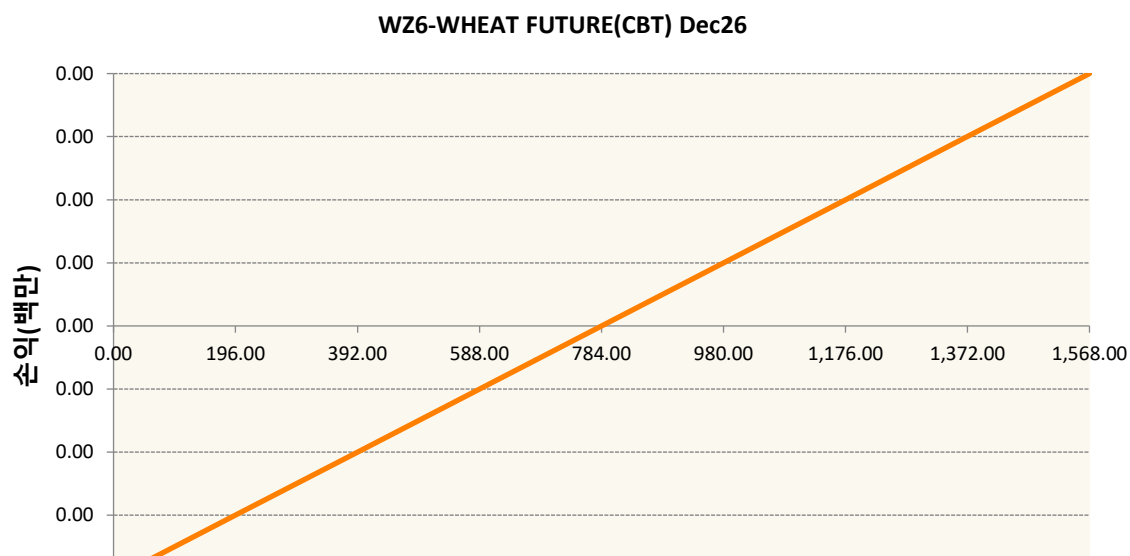
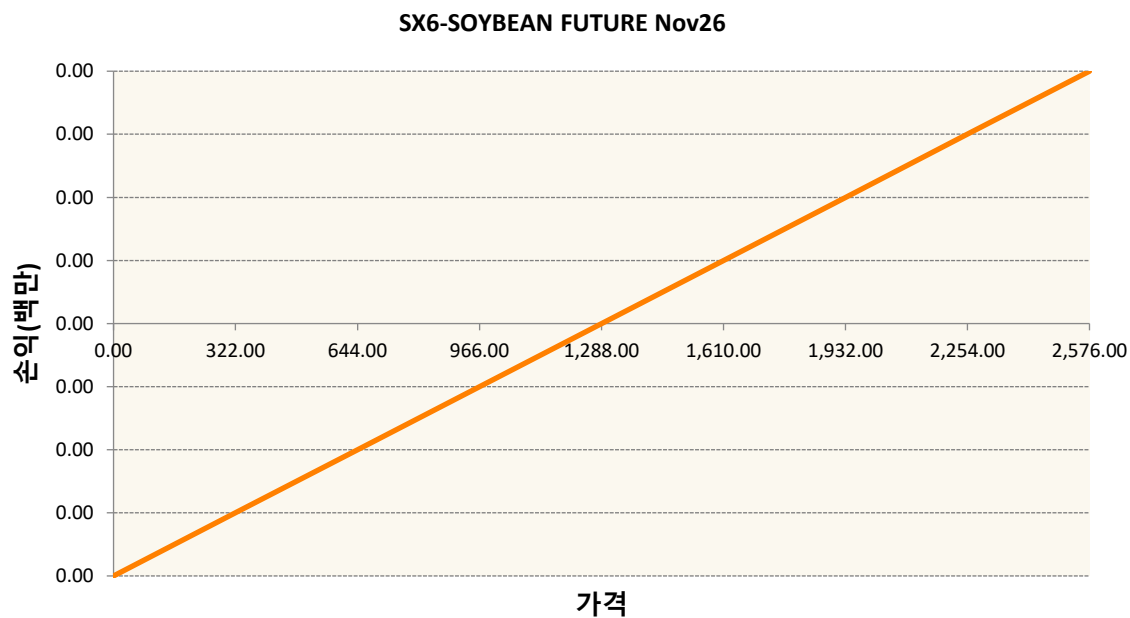
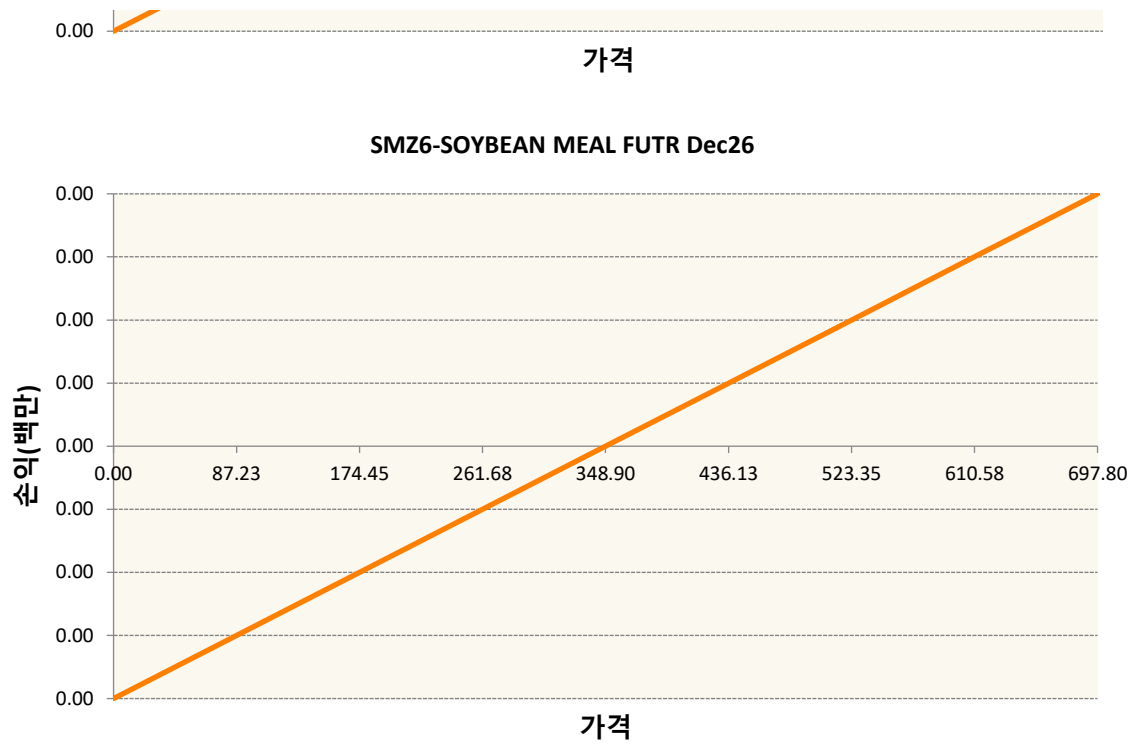
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	479	0	479	
누계	유가증권	선물	2,498	0	2,498	
누계	통화	선물	0	342	-342	장내

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	2026-09-01
기준일	2026-08-31

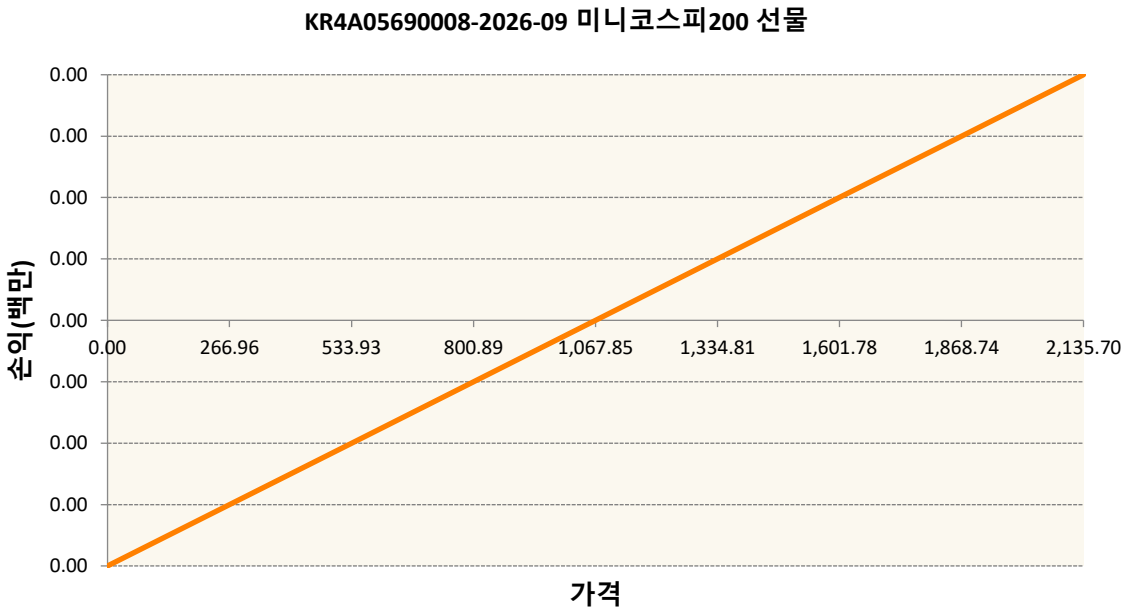
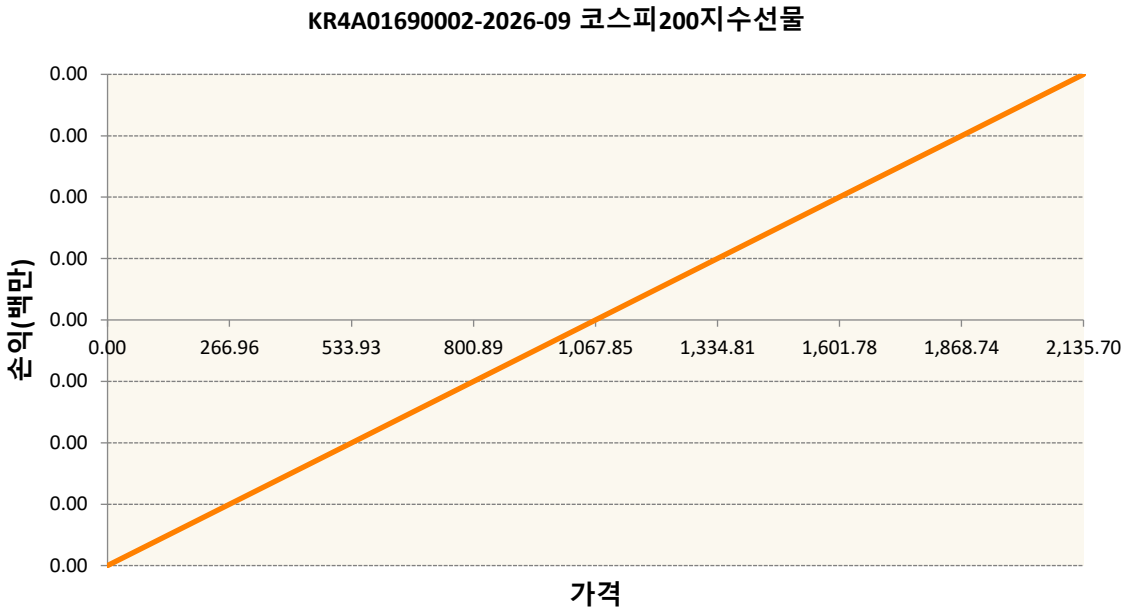
스마트인덱스모

1. 계약금액

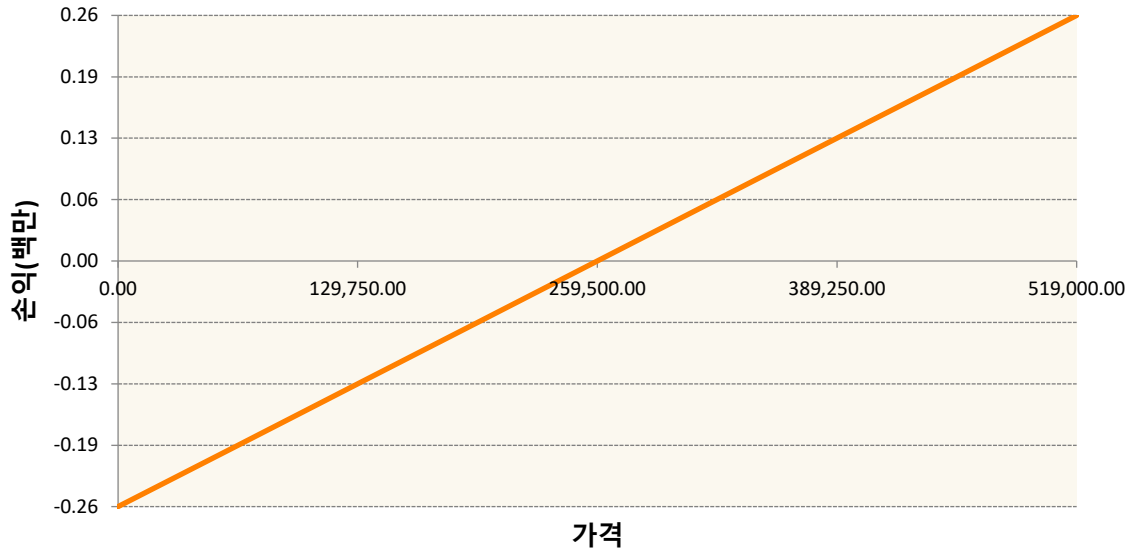
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,106	0	4,106	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				214
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214
-5.33%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
-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%	143	143	143	143	143	143	143
8.00%	214	214	214	214	214	214	214
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)
	823

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

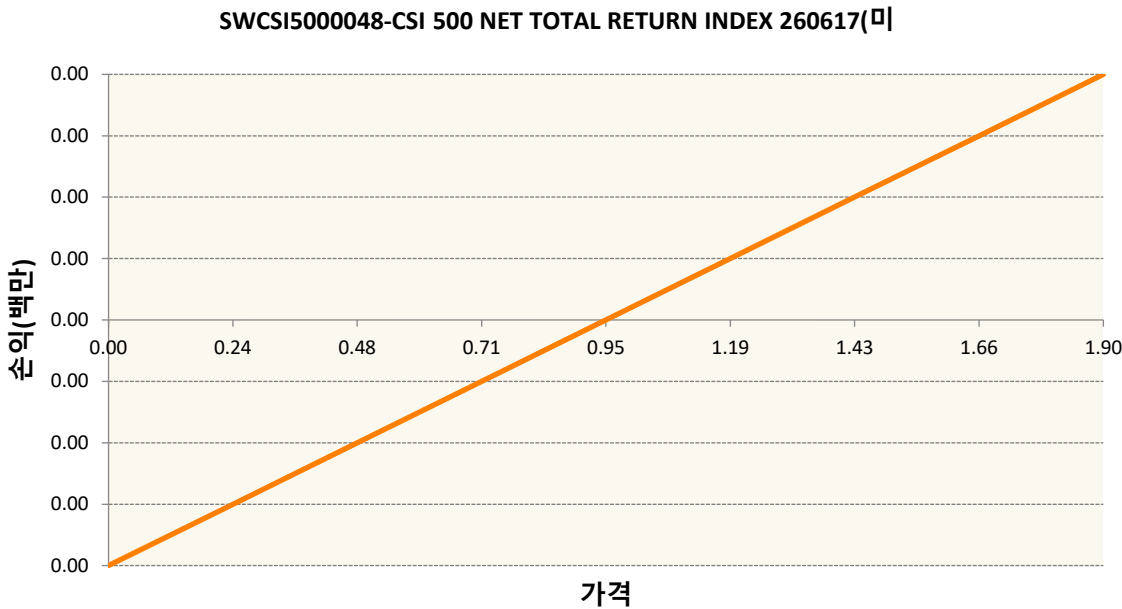
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

443

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

707

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

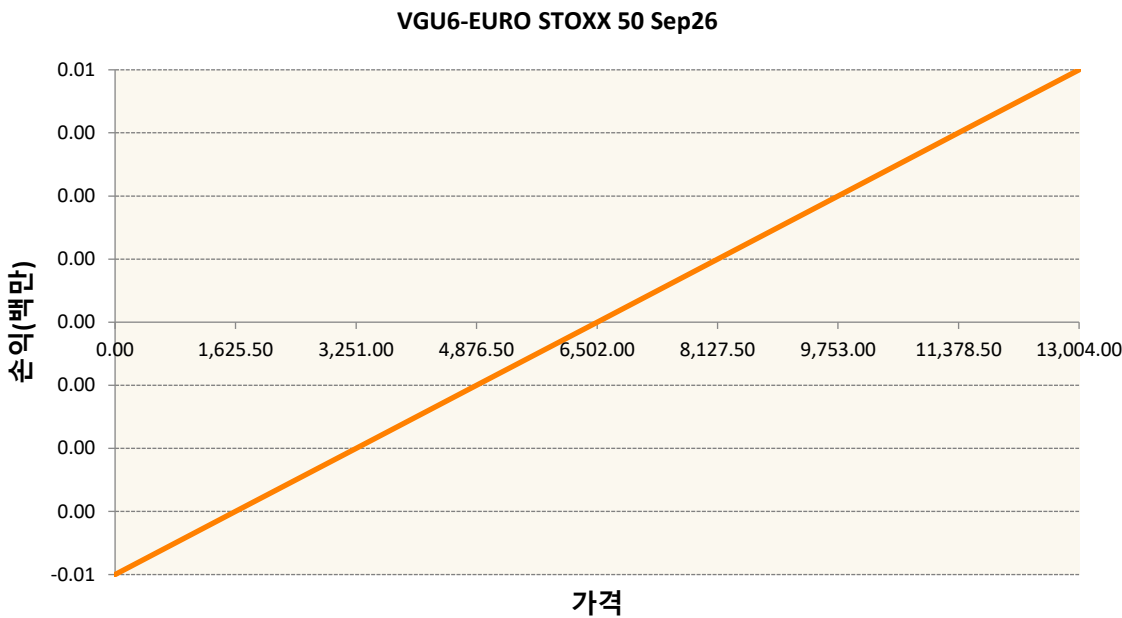
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,235	0	1,235	

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	2026-09-01
기준일	2026-08-31

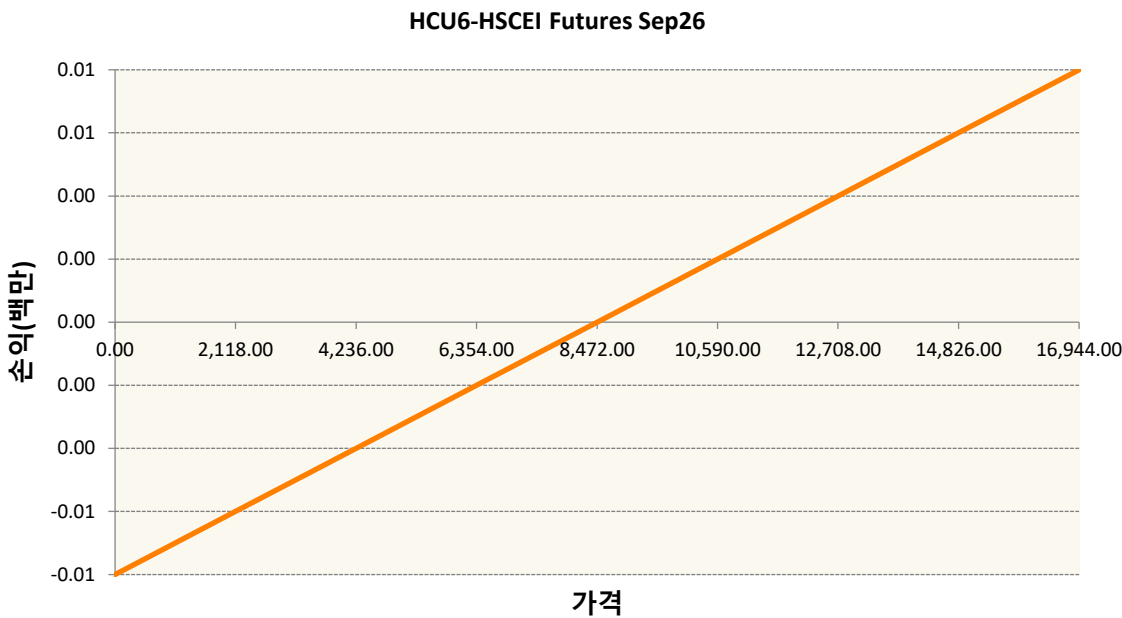
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,483	0	1,483	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	119
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

113

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

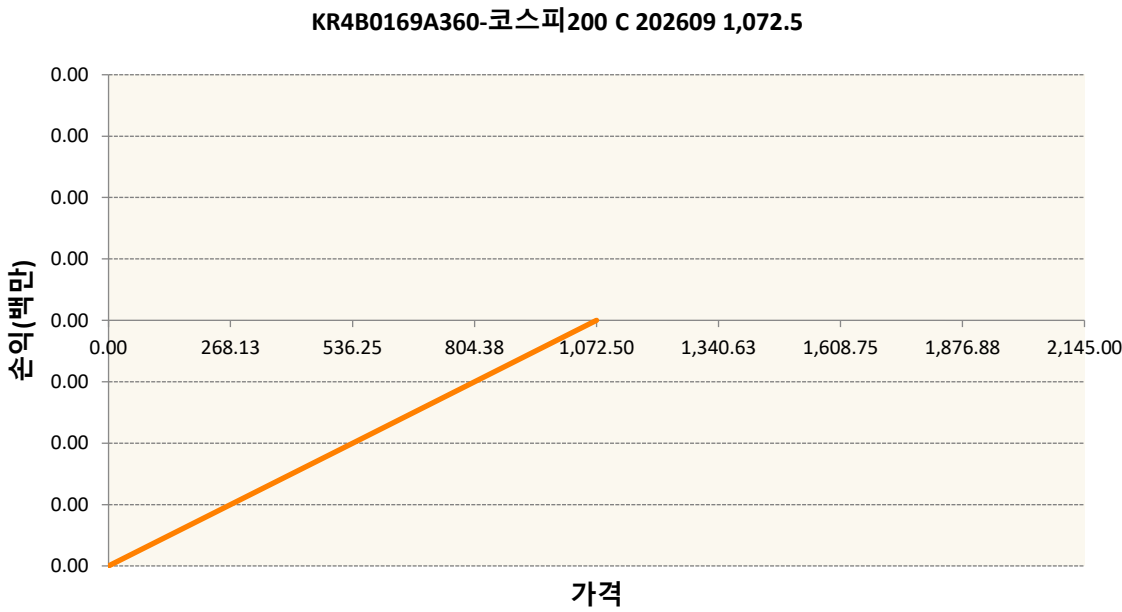
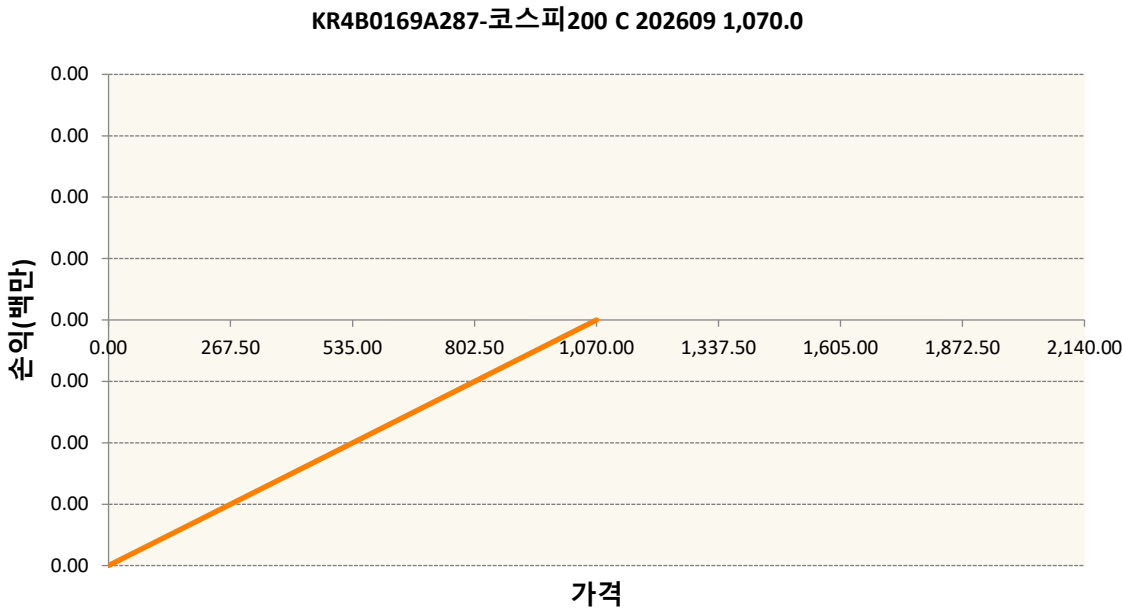
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

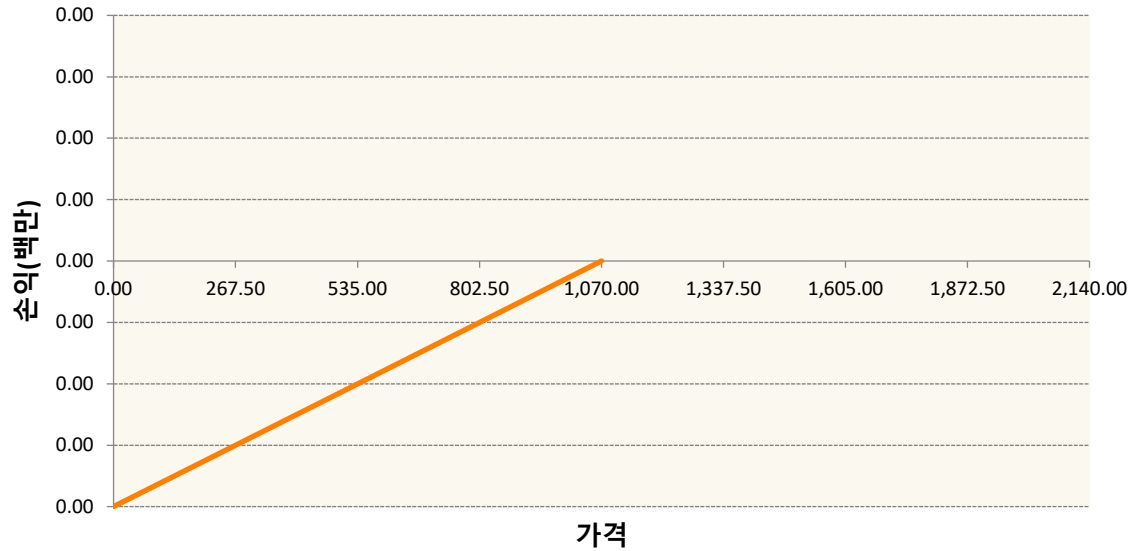
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,380	-1,380	장내
누계	유가증권	옵션	0	42,579	-42,579	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0169A285-코스피200 P 202609 1,070.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0169A287 코스피200 C 202609 1,070.0							814
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-701	-715	-731	-749	-769	-791	-814
-5.33%	-378	-402	-427	-453	-481	-509	-539
-2.67%	-104	-136	-168	-201	-235	-268	-301
0%	106	70	35	0	-35	-70	-106
2.67%	248	216	183	150	117	83	49
5.33%	332	308	282	254	226	196	166
8.00%	375	360	342	322	299	276	250
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							1,189
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,031	-1,050	-1,072	-1,098	-1,126	-1,156	-1,189
-5.33%	-560	-593	-629	-666	-705	-746	-787
-2.67%	-158	-204	-250	-297	-344	-392	-440
0%	153	102	51	0	-51	-102	-153
2.67%	366	319	271	223	174	125	75
5.33%	494	458	419	379	337	293	249
8.00%	561	538	510	480	447	412	374
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							501
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-431	-440	-450	-461	-473	-487	-501
-5.33%	-233	-247	-263	-279	-296	-313	-331
-2.67%	-64	-84	-104	-124	-144	-165	-186
0%	65	43	22	0	-22	-43	-65

2.67%	152	133	113	92	72	51	30
5.33%	204	189	173	157	139	121	102
8.00%	231	221	210	198	184	170	154

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

(단위:백만원)

3,971

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

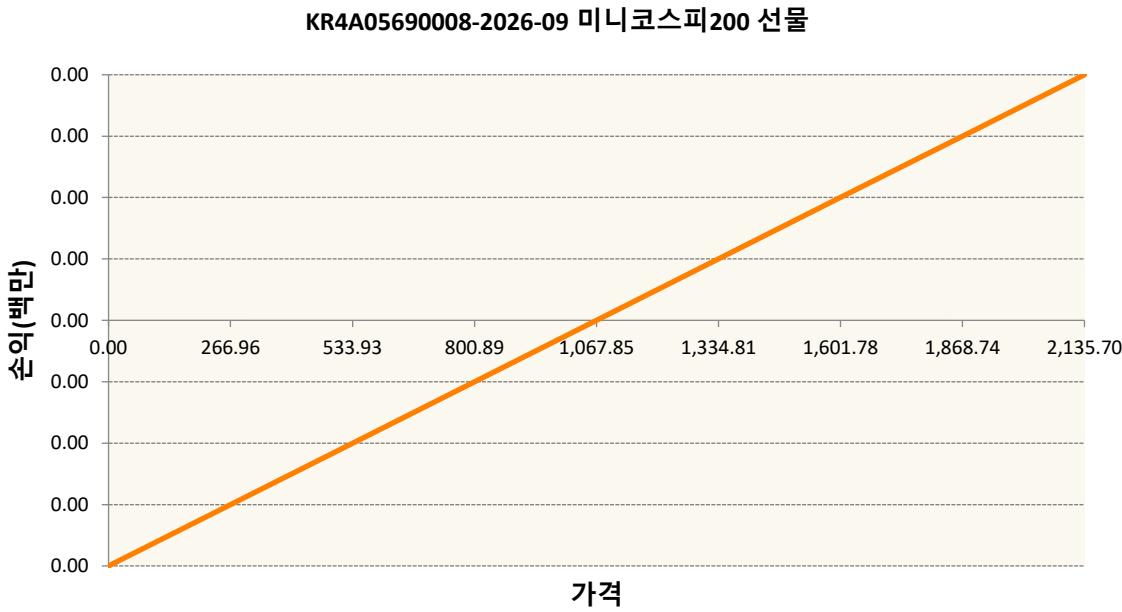
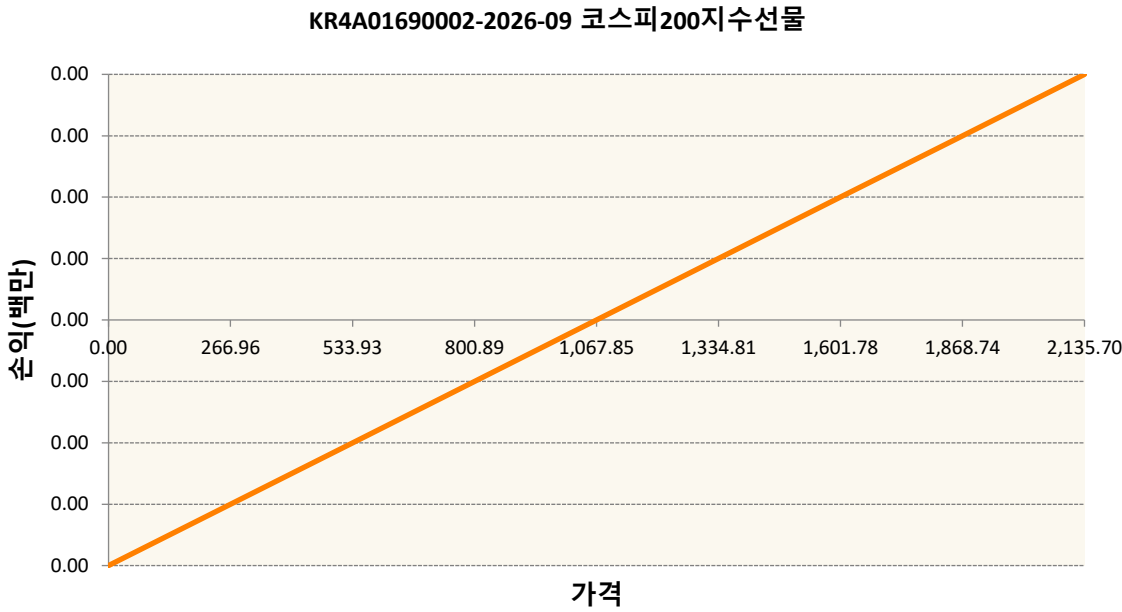
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

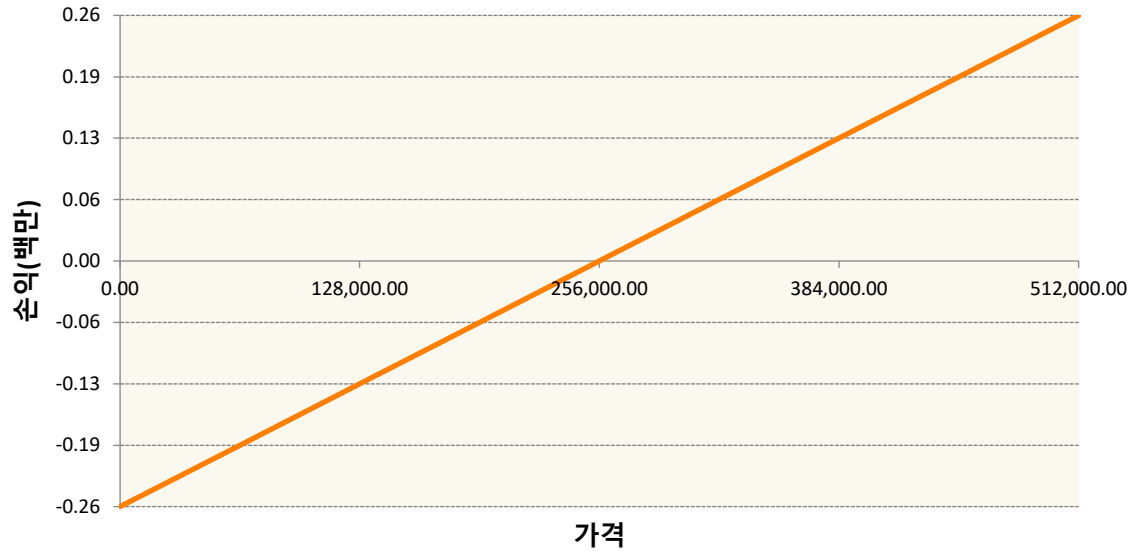
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,389	0	1,389	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A116A0005-2026-10 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					43
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-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%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43
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
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	13	13	13	13	13	13	13
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)

204

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

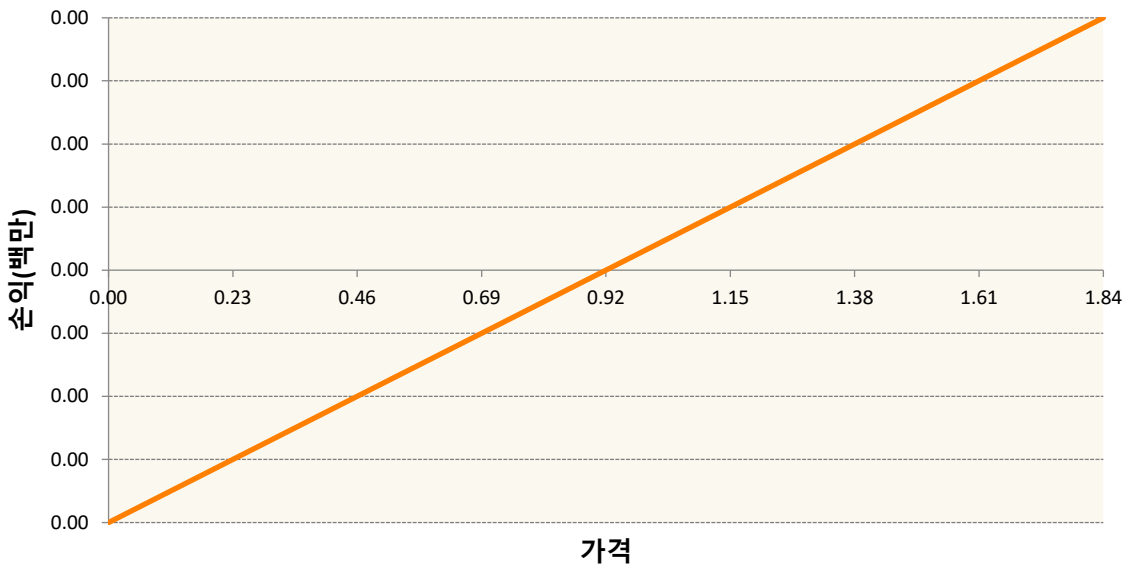
1. 계약금액

(단위:백만원)

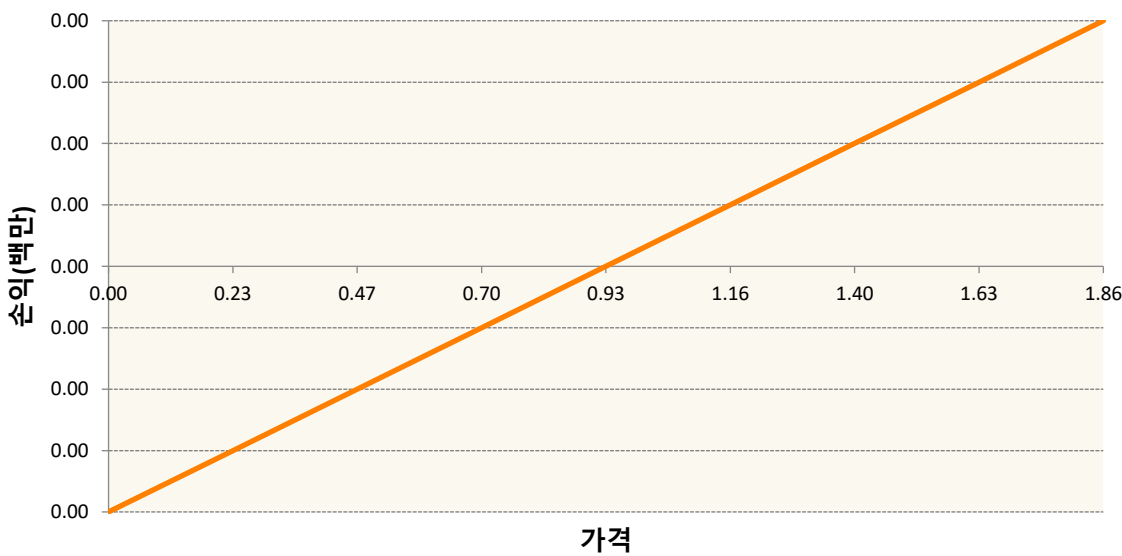
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,998	0	6,998	장외

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(		447
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		113

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		613

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

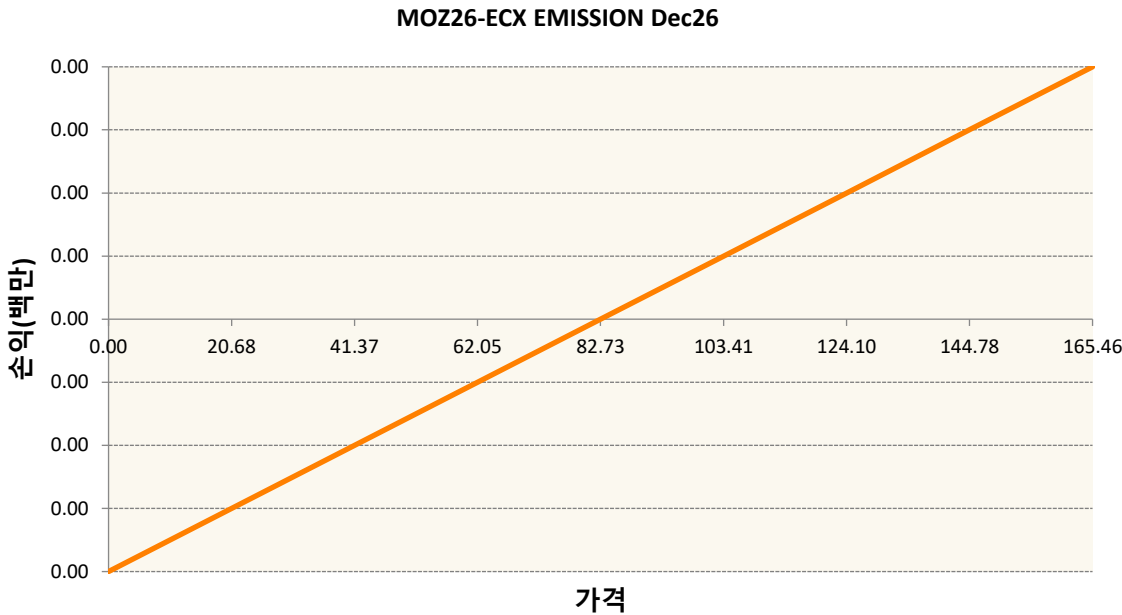
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,350	0	5,350	
누계	통화	선도	0	2,633	-2,633	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E	211
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	428

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

(단위:백만원)

687

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

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	-1,958	0	-1,958	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	63
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	29
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	25
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	38

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

(단위:백만원)

249

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

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)	46
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	196
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	182

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

(단위:백만원)

802

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

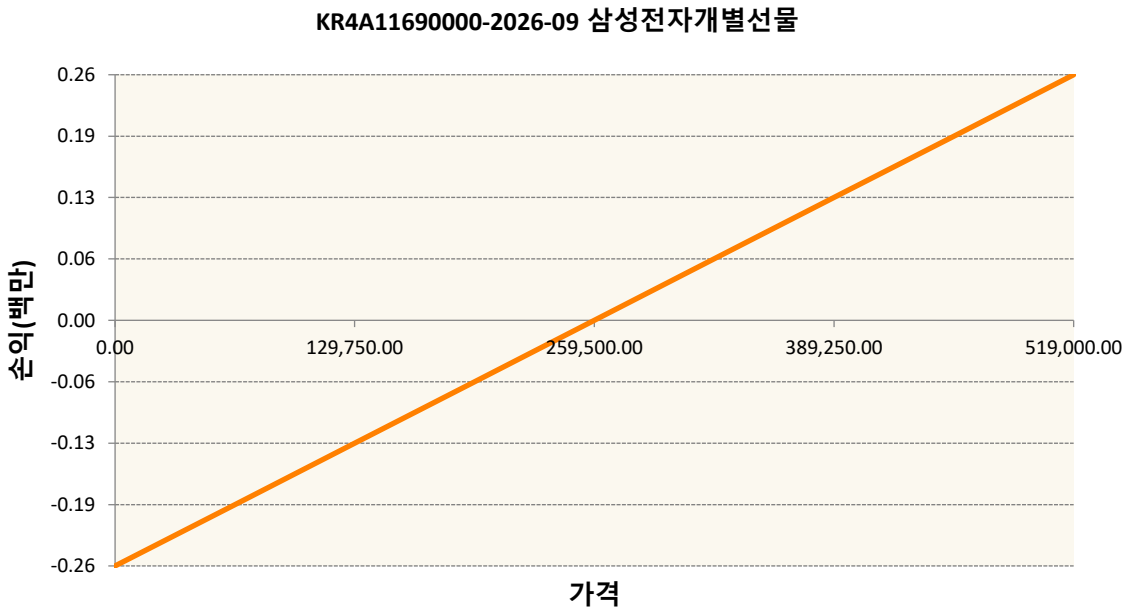
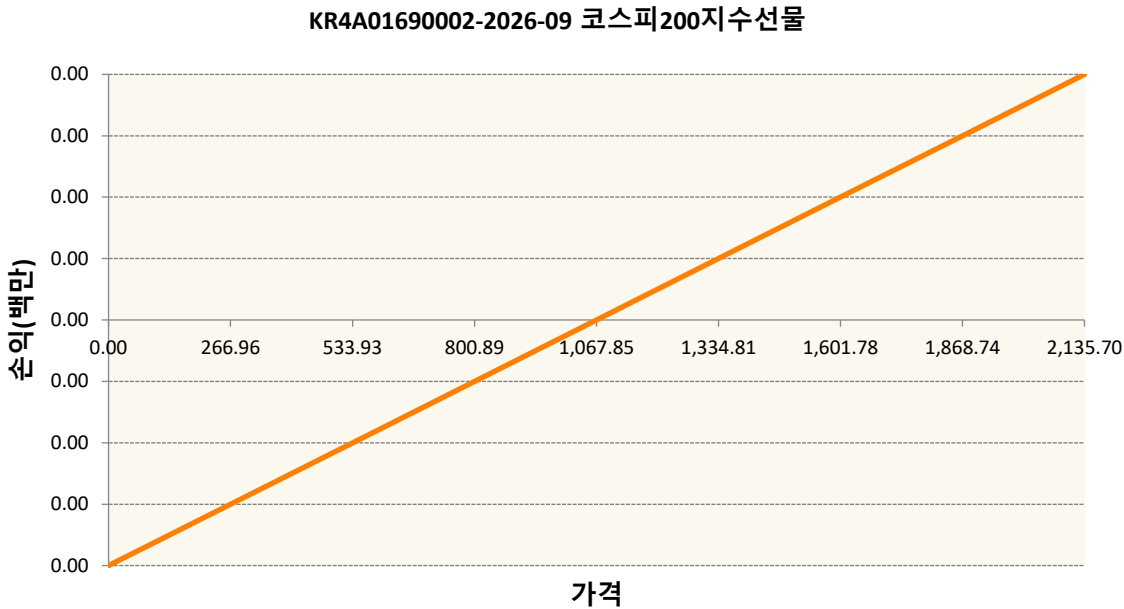
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	21,205	0	21,205	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					1,436
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,436	-1,436	-1,436	-1,436	-1,436	-1,436	-1,436
-5.33%	-958	-958	-958	-958	-958	-958	-958
-2.67%	-479	-479	-479	-479	-479	-479	-479
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	479	479	479	479	479	479	479
5.33%	958	958	958	958	958	958	958
8.00%	1,436	1,436	1,436	1,436	1,436	1,436	1,436
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물					266
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-266	-266	-266	-266	-266	-266	-266
-5.33%	-177	-177	-177	-177	-177	-177	-177
-2.67%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	89	89	89	89	89	89	89
5.33%	177	177	177	177	177	177	177
8.00%	266	266	266	266	266	266	266

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

5,887

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

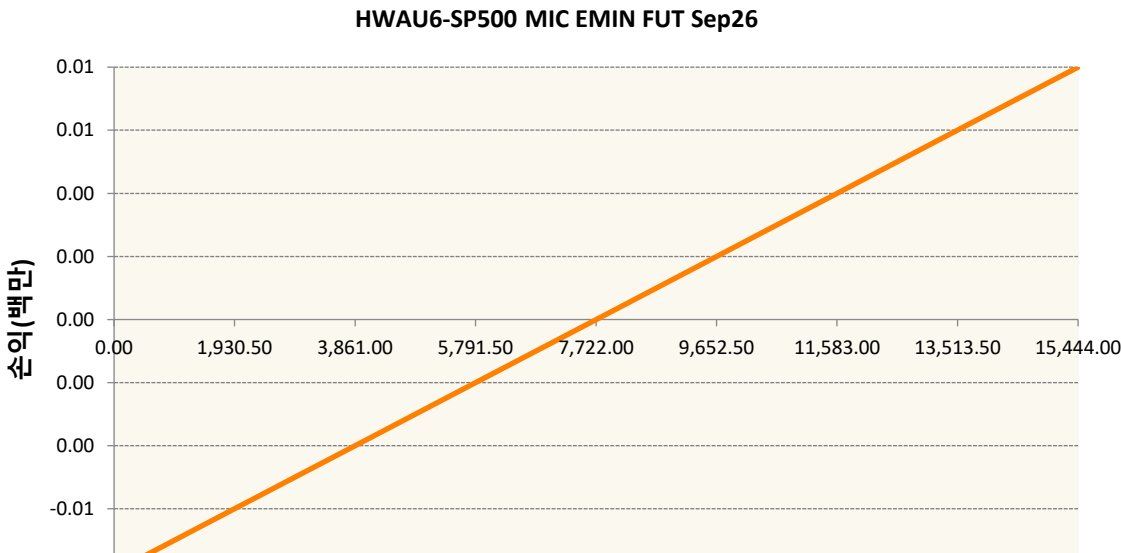
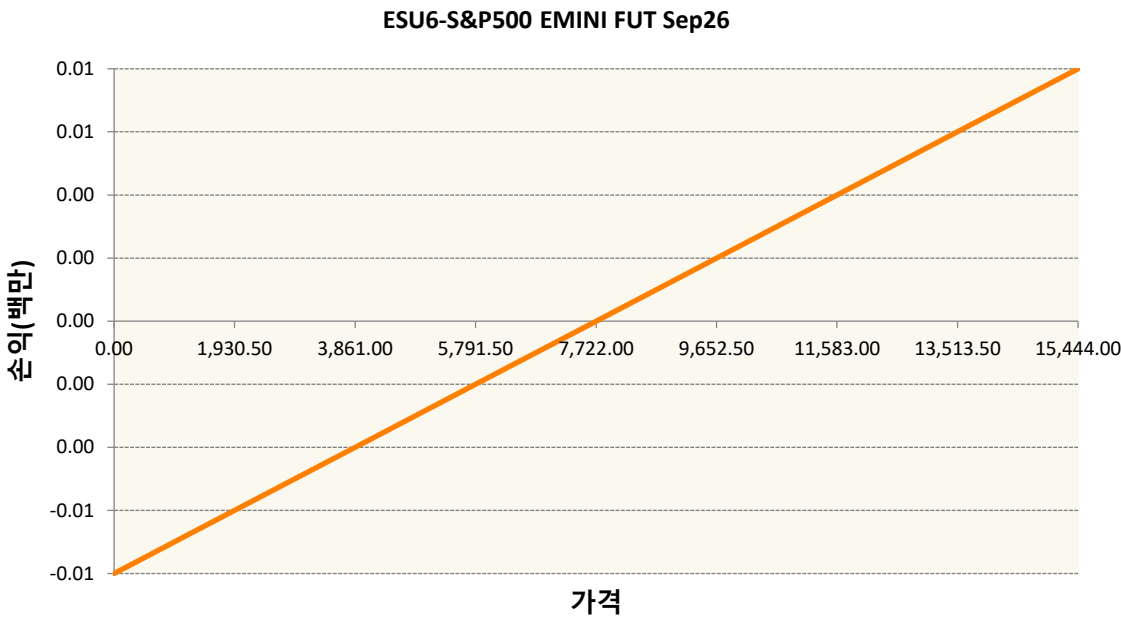
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

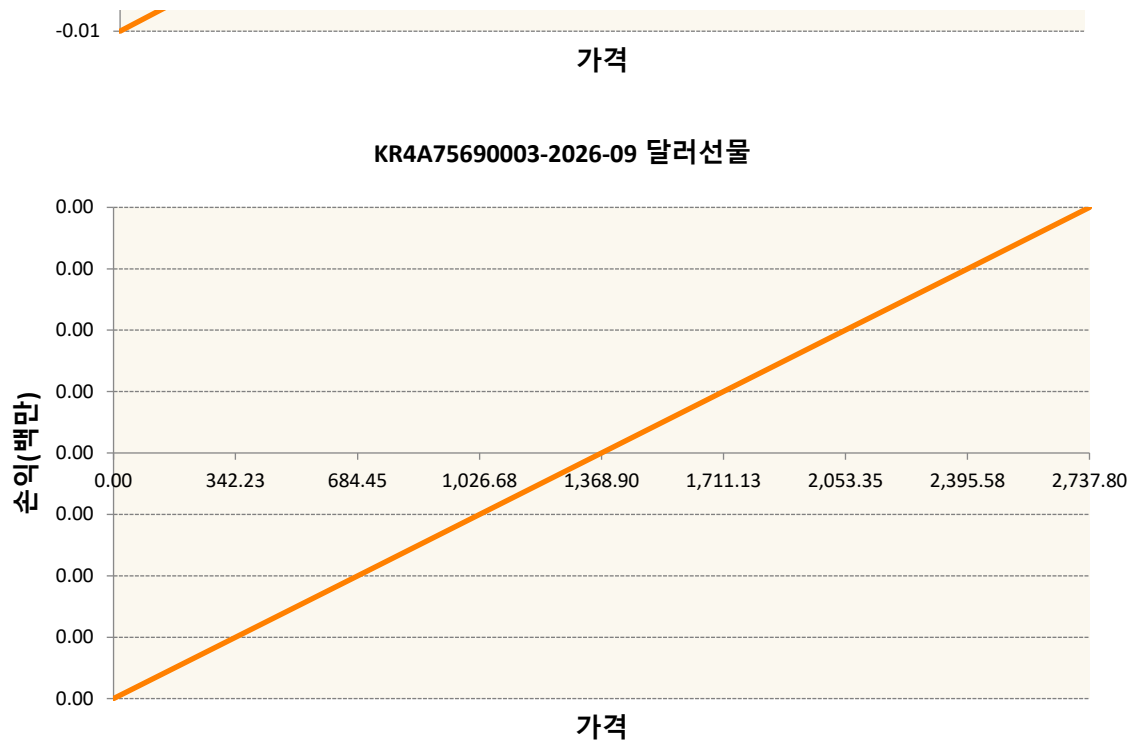
1. 계약금액

(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	3,425	-3,425	장내
누계	지수	선물	76,936	0	76,936	
누계	지수	선물	177	0	177	장내
누계	통화	선물	8,350	0	8,350	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		6,155
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		14
KR4A756900 2026-09 달러선물			668

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,103

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

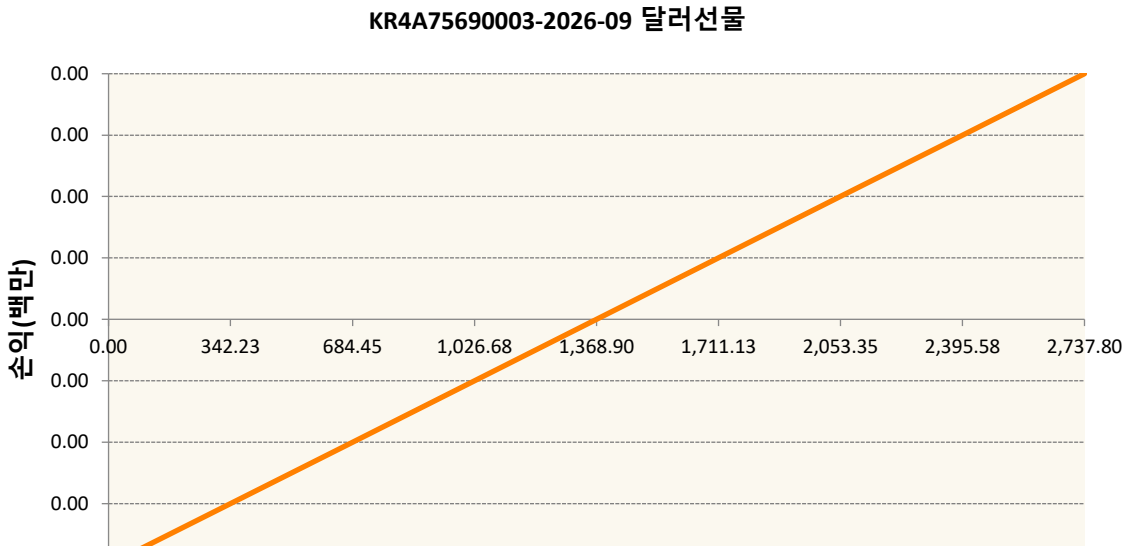
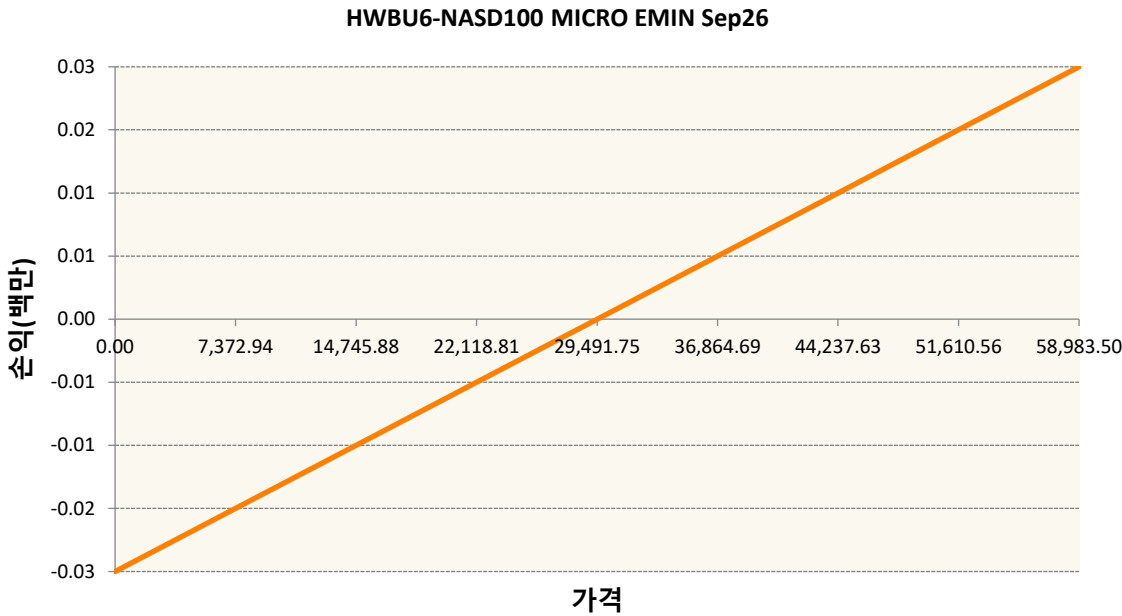
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

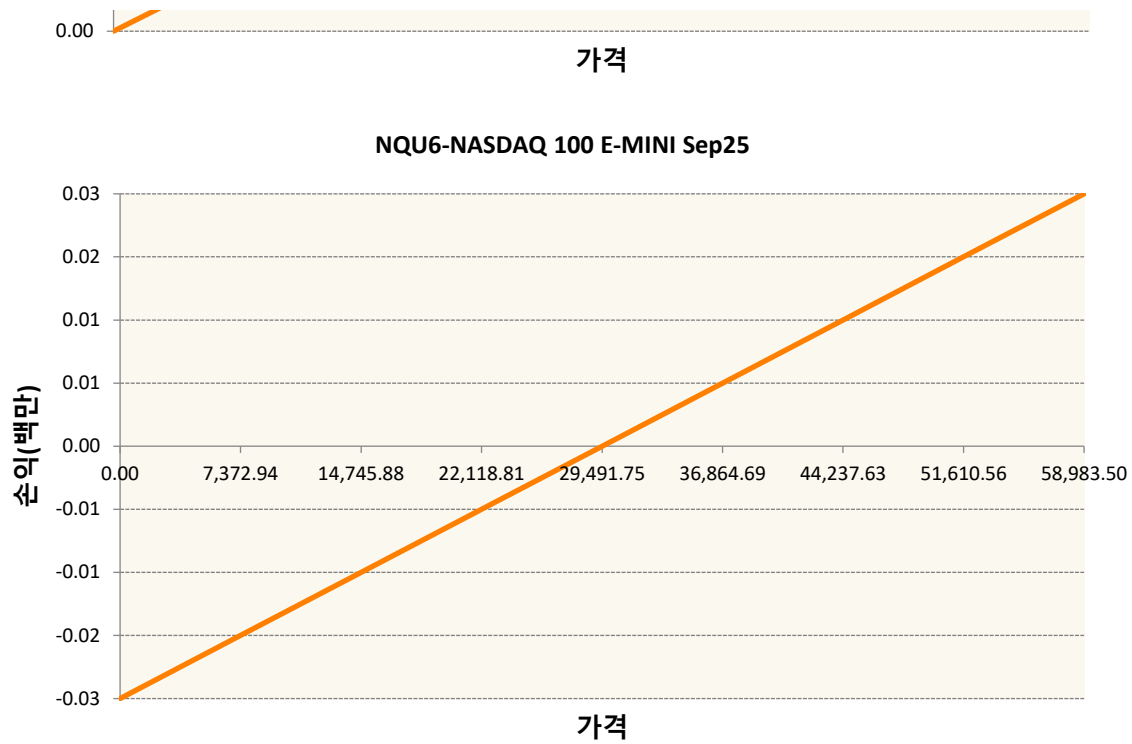
1. 계약금액

(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	822	-822	장내
누계	유가증권	선물	1,362	0	1,362	장내
누계	지수	선물	36,444	0	36,444	
누계	통화	선물	3,778	0	3,778	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		109
KR4A756900	2026-09 달러선물		302
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,915

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,306

공시일	2026-09-01
기준일	2026-08-31

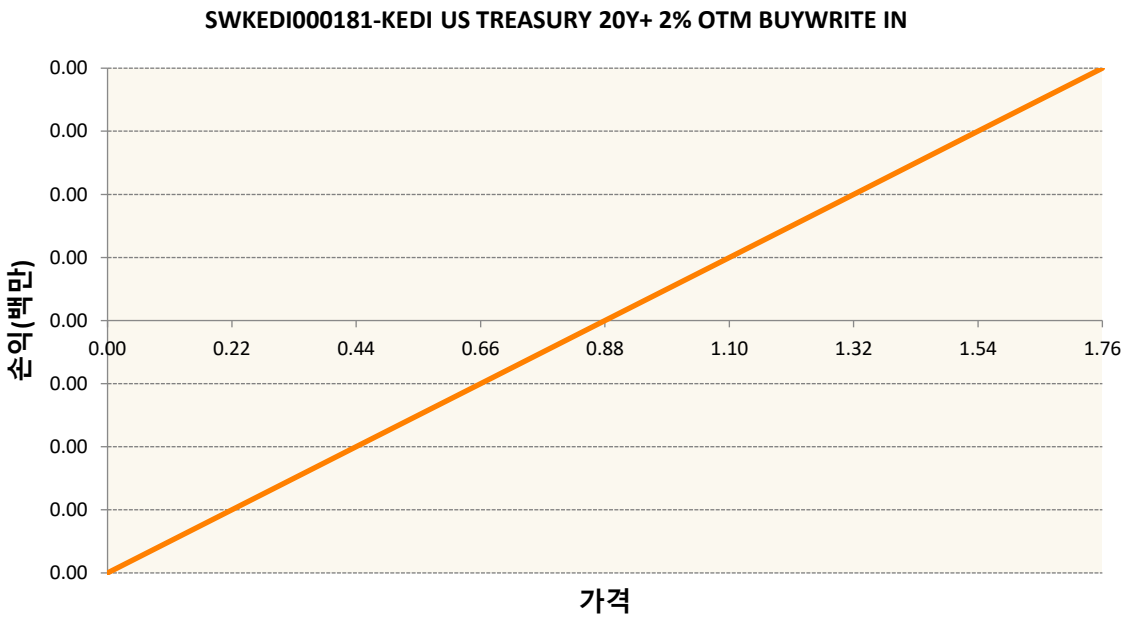
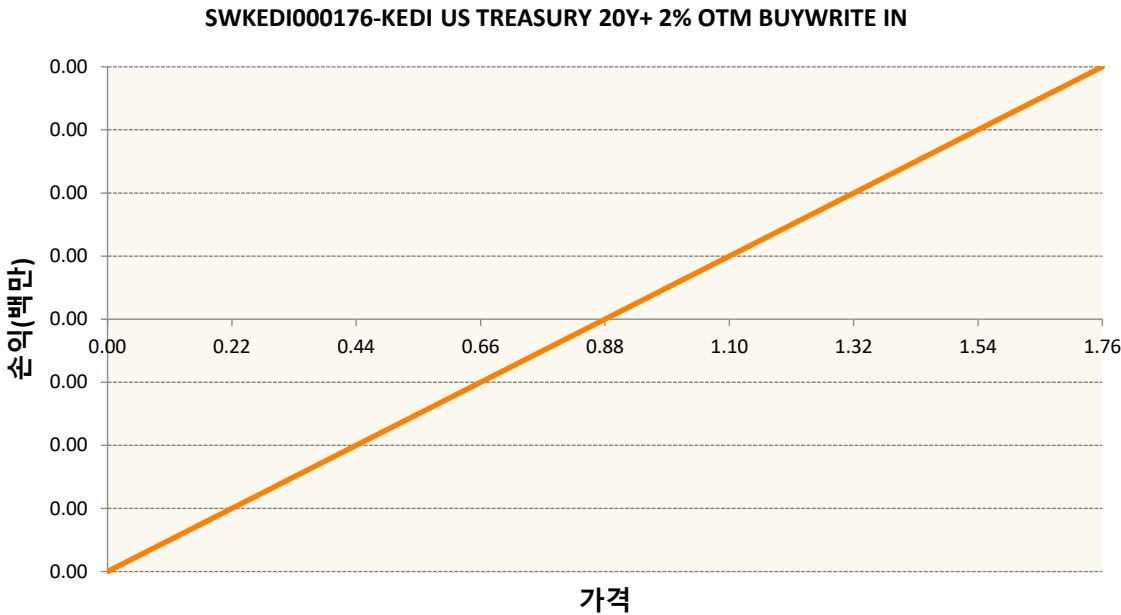
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

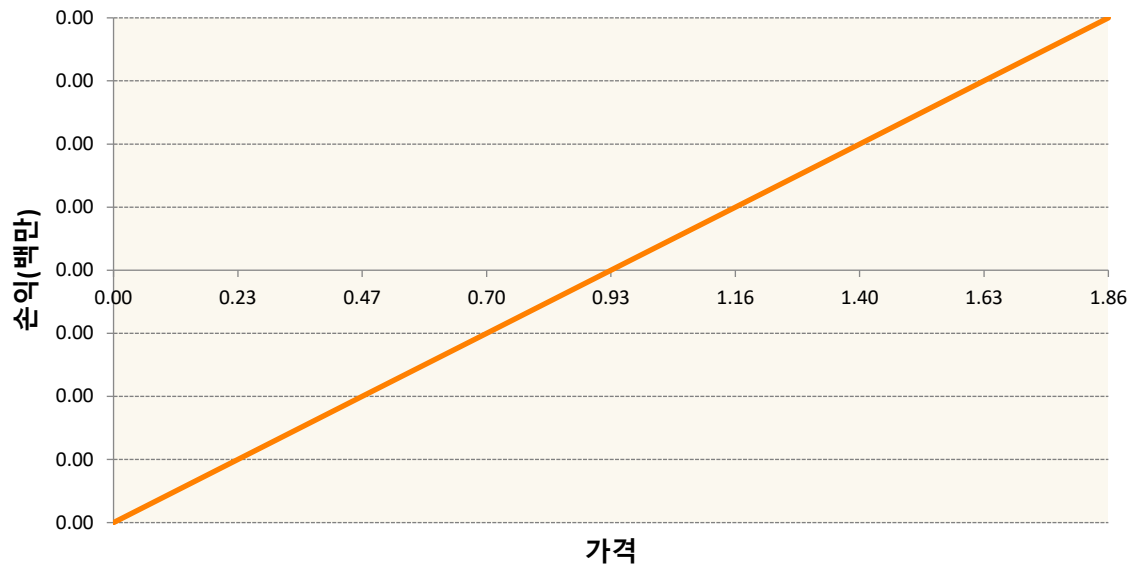
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	278,455	0	278,455	장외

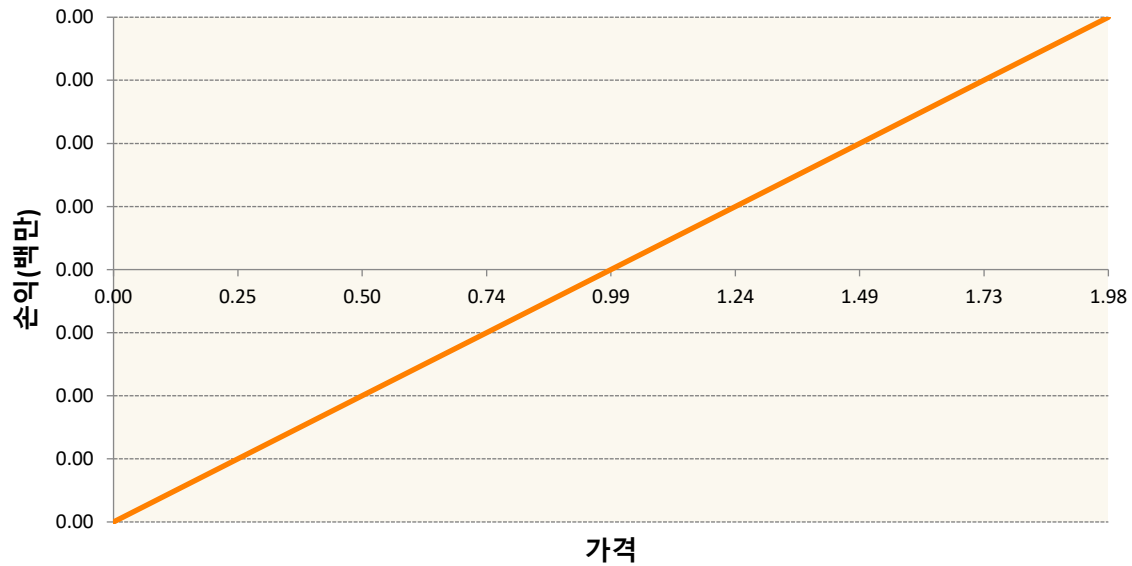
2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000187-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000189-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,168
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,813
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,286
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,011

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

(단위:백만원)

9,030
