

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

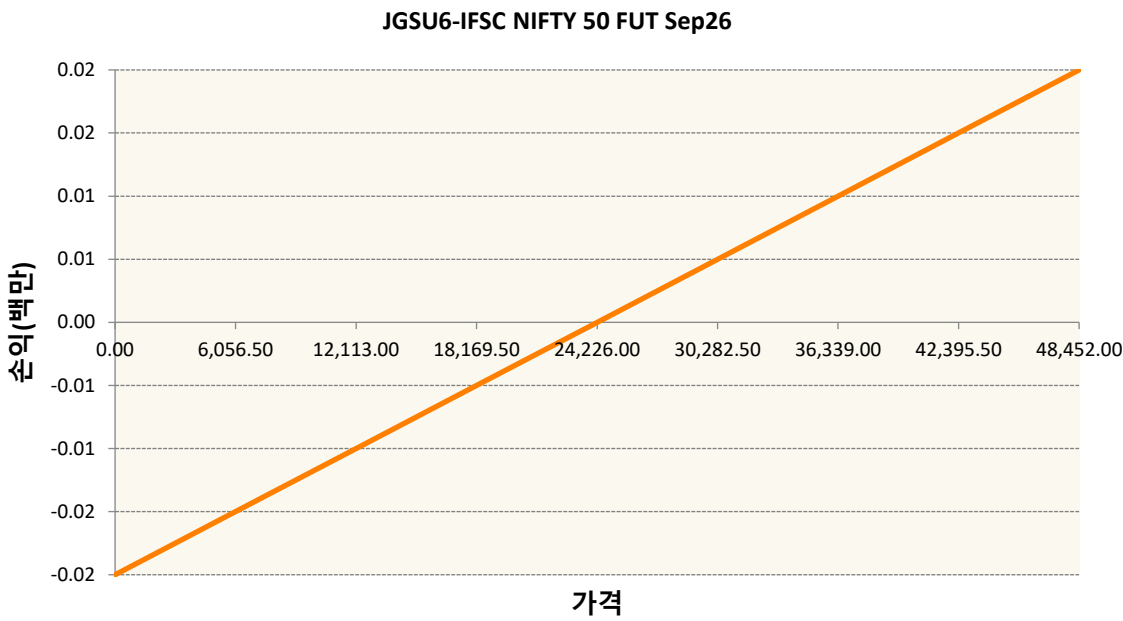
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	336	0	336	

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	2026-09-02
기준일	2026-09-01

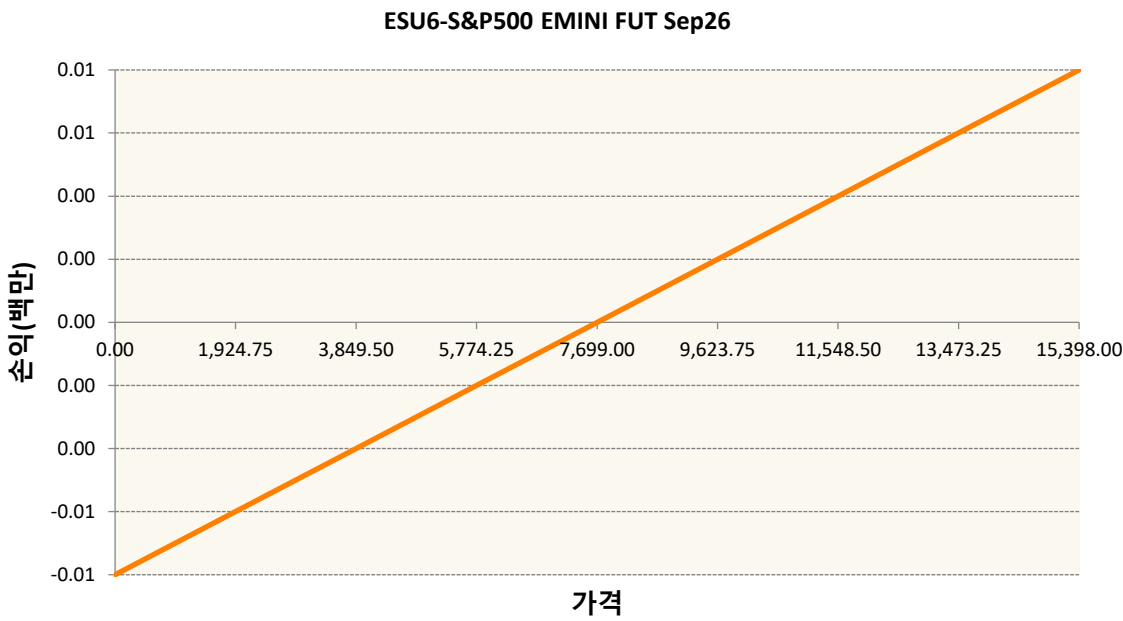
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-09-02
기준일	2026-09-01

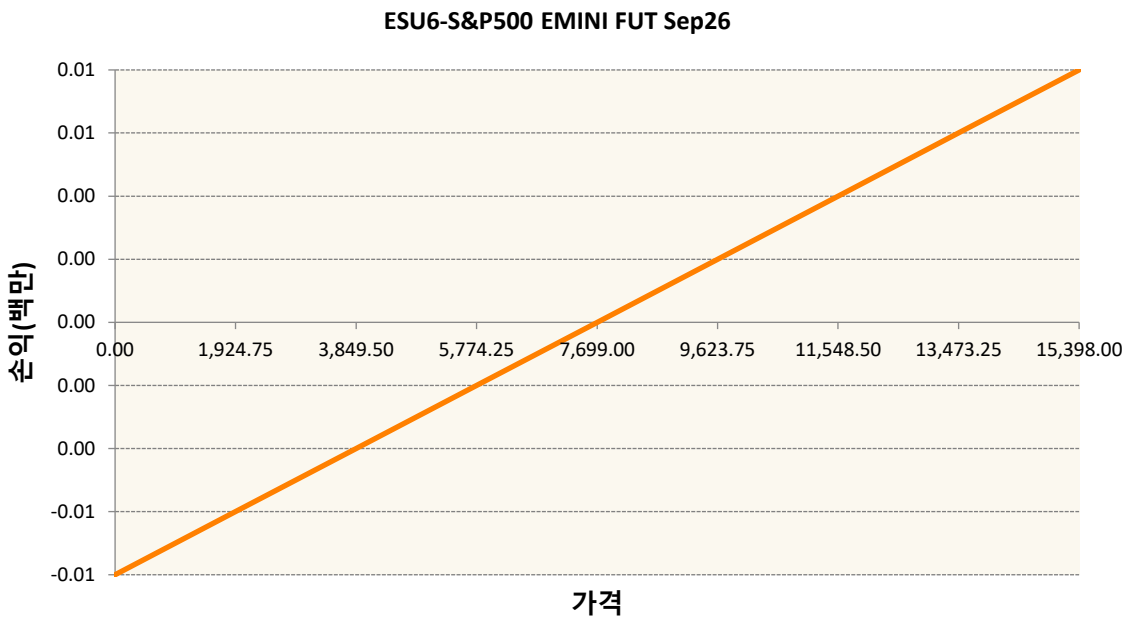
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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	2026-09-02
기준일	2026-09-01

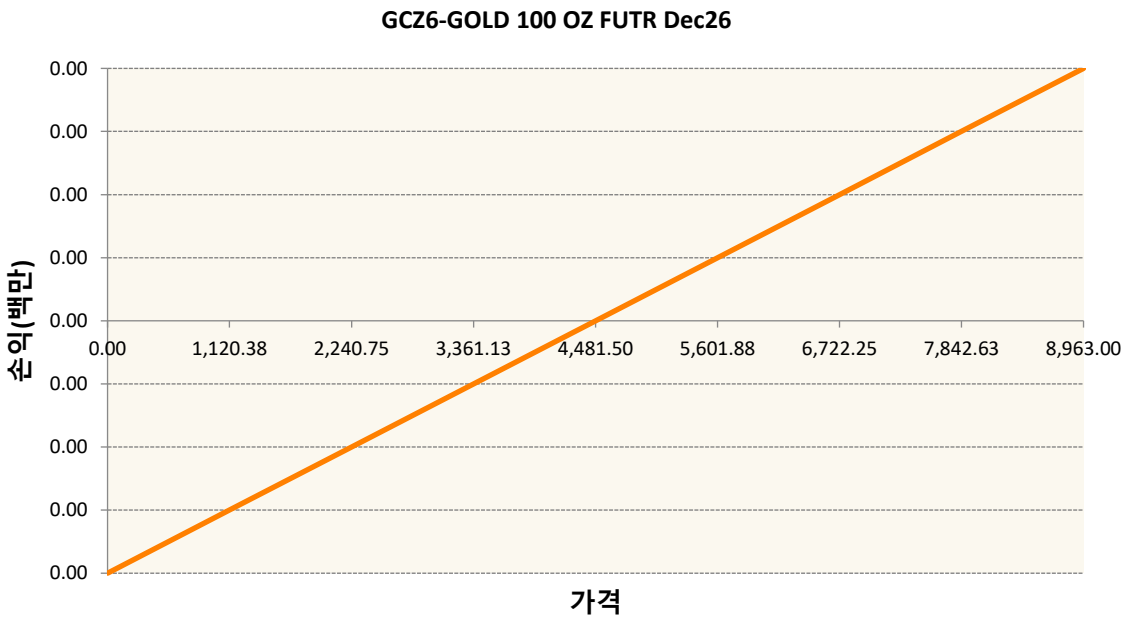
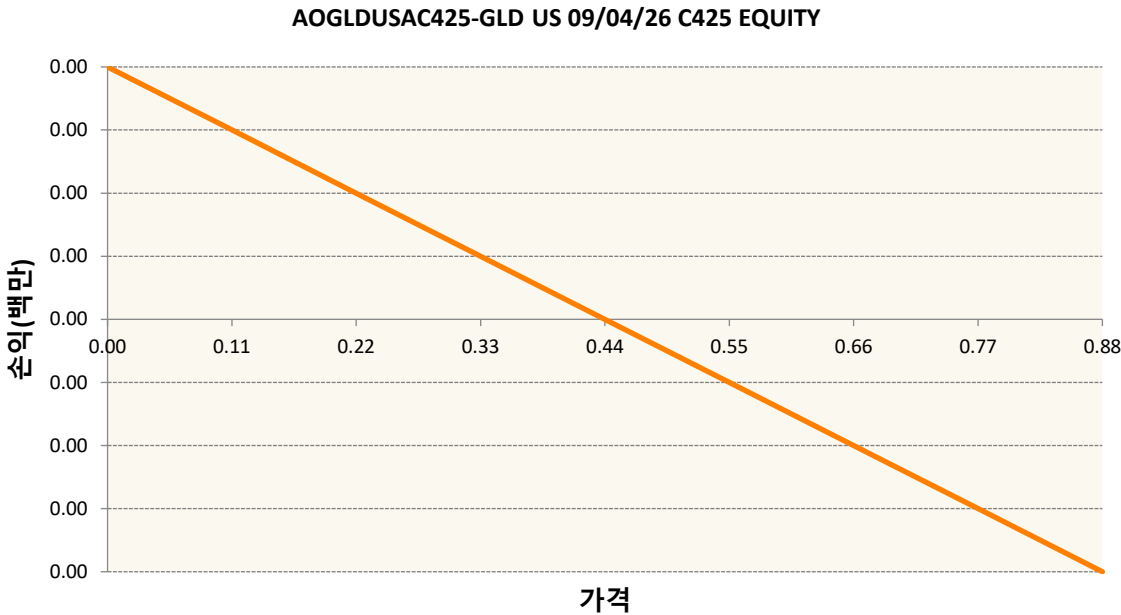
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,754	0	5,754	
누계	실물자산	옵션	0	23	-23	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSAC GLD US 09/04/26 C425 EQUITY		2
GCZ6	GOLD 100 OZ FUTR Dec26	460

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	611

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

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	117

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

(단위:백만원)

427

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

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

3

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

(단위:백만원)

1

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

(단위:백만원)

14,557

공시일 2026-09-02

기준일 2026-09-01

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	2026-09-02
기준일	2026-09-01

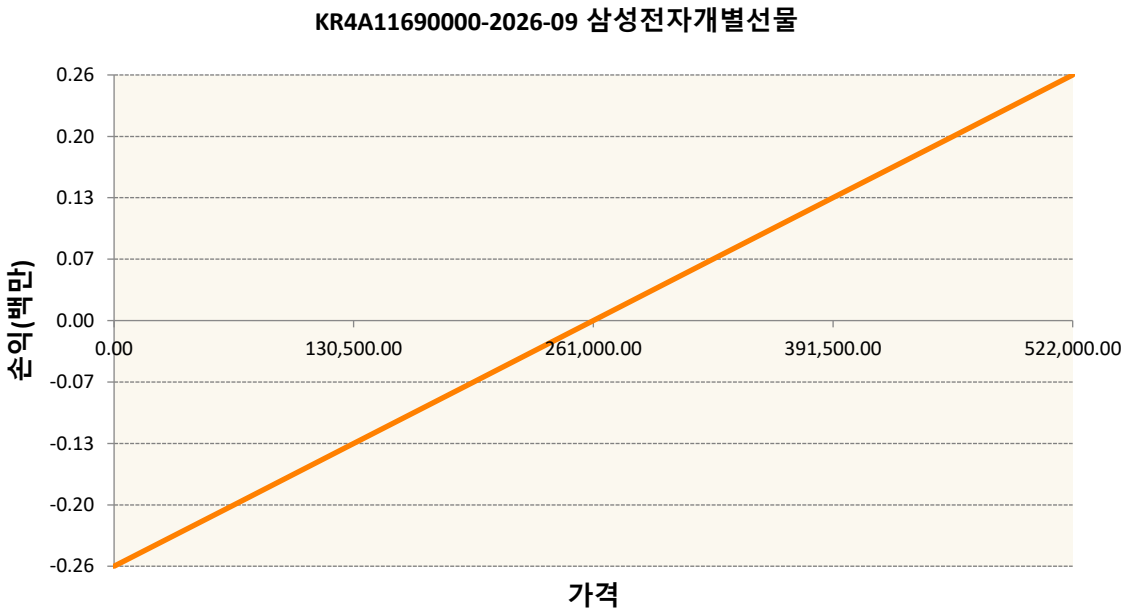
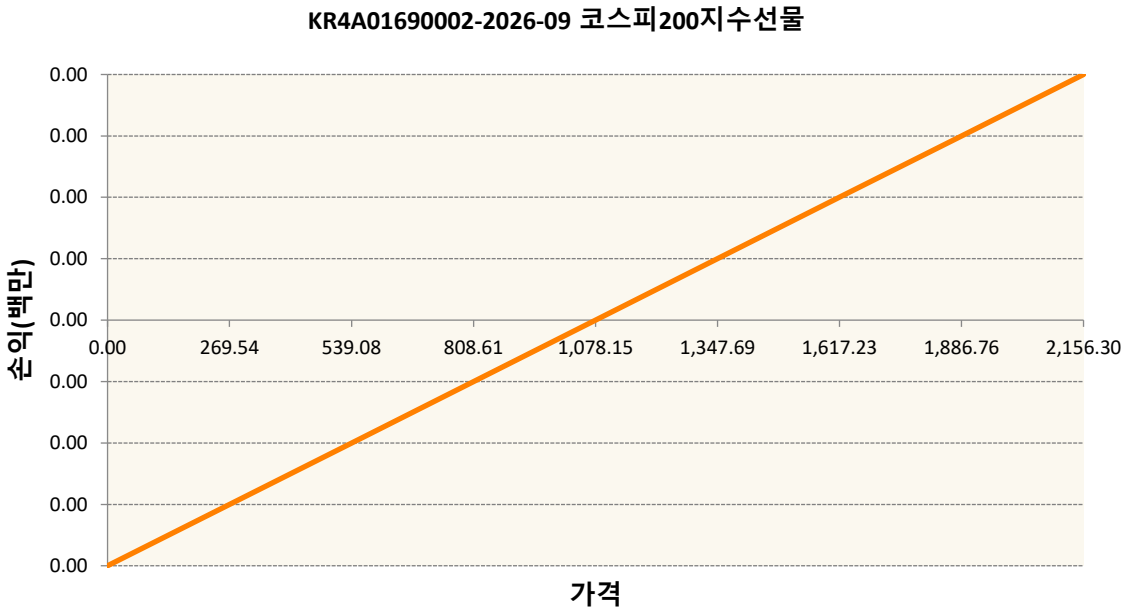
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

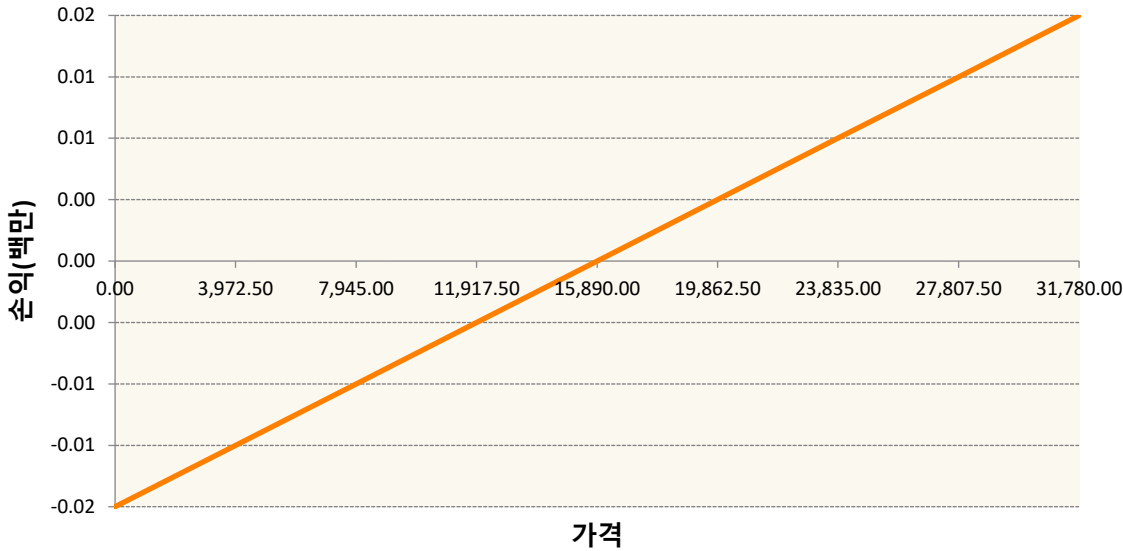
(단위:백만원)

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	21,173	0	21,173	장내
누계	유가증권	옵션	0	55,017	-55,017	장내

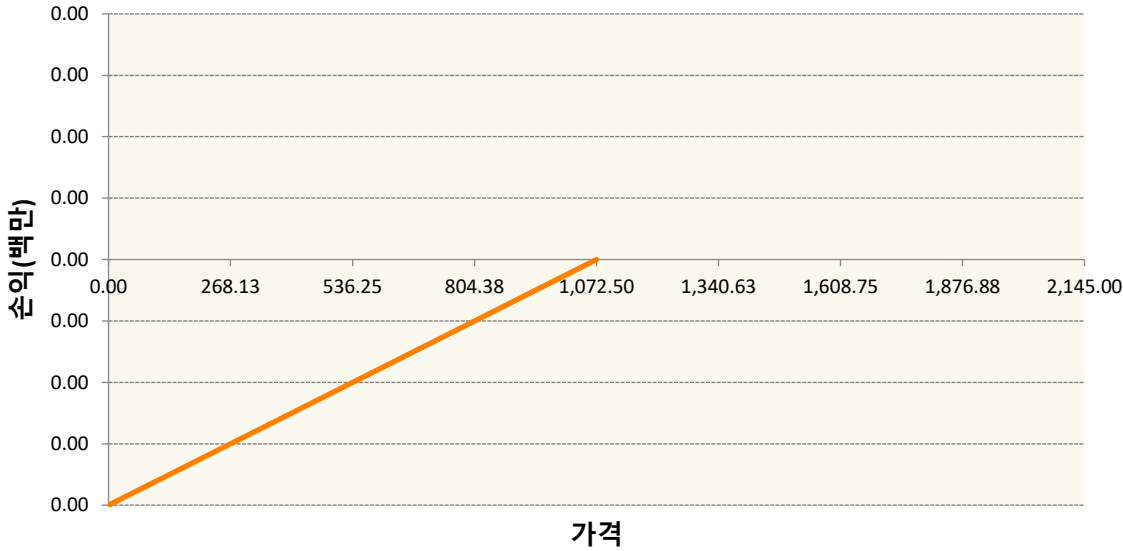
2. 만기시점의 손익구조



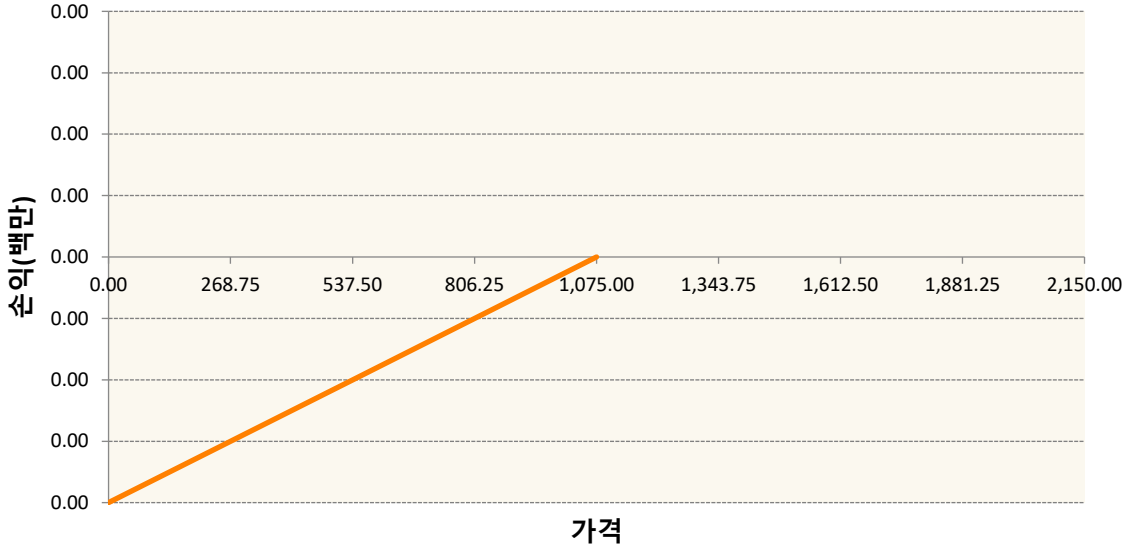
KR4AFB690003-2026-09 SK아이이테크놀로지개별선물



KR4B09FCA304-코스피위클리 C 2609W1 1,072.5



KR4B09FCA312-코스피위클리 C 2609W1 1,075.0



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		559		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-559	-559	-559	-559	-559	-559	-559				
-5.33%	-373	-373	-373	-373	-373	-373	-373				
-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%	373	373	373	373	373	373	373				
8.00%	559	559	559	559	559	559	559				
KR4A11690000							2026-09 삼성전자개별선물		1,128		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128				
-5.33%	-752	-752	-752	-752	-752	-752	-752				
-2.67%	-376	-376	-376	-376	-376	-376	-376				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	376	376	376	376	376	376	376				
5.33%	752	752	752	752	752	752	752				
8.00%	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128				
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		2,183		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-2,172	-2,173	-2,173	-2,174	-2,176	-2,179	-2,183				
-5.33%	-1,295	-1,299	-1,306	-1,314	-1,325	-1,337	-1,351				
-2.67%	-475	-497	-521	-547	-574	-602	-631				
0%	106	71	35	0	-35	-71	-106				
2.67%	336	317	296	273	248	222	195				
5.33%	379	375	369	362	352	340	326				
8.00%	382	382	381	379	377	374	369				
KR4B09FCA312							코스피위클리 C 2609W1 1,075.0		1,481		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,475	-1,475	-1,475	-1,476	-1,477	-1,478	-1,481
-5.33%	-889	-891	-895	-900	-906	-914	-922
-2.67%	-335	-349	-364	-380	-397	-415	-434
0%	71	47	24	0	-24	-47	-71
2.67%	243	229	213	197	179	161	142
5.33%	277	274	269	263	256	248	238
8.00%	279	279	279	278	276	273	270

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

(단위:백만원)

12,667

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

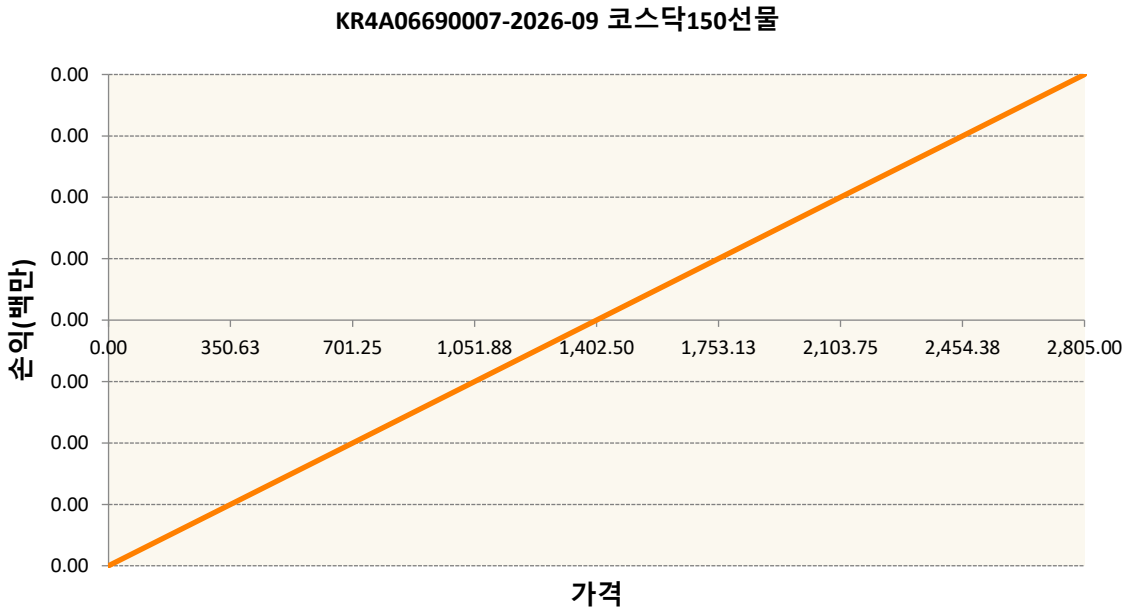
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	645	0	645	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)

16,888

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

(단위:백만원)

52,020

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

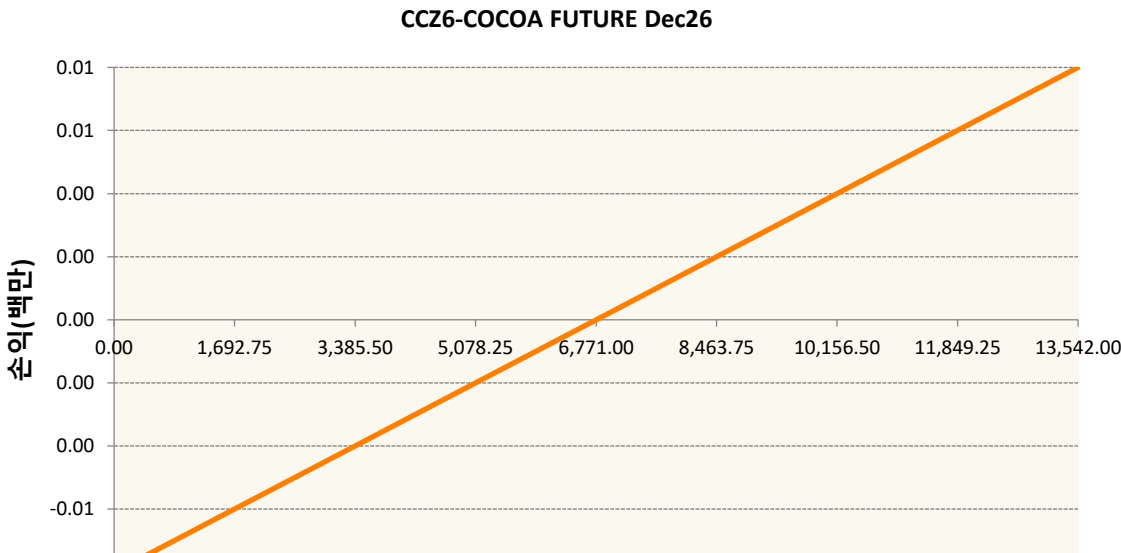
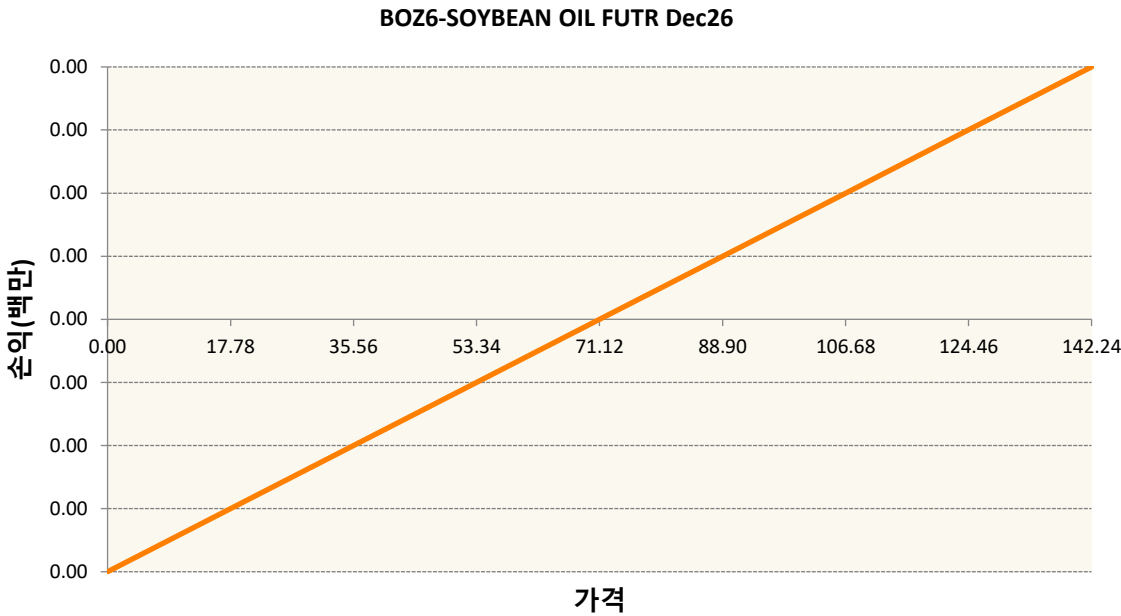
포커스농산물모(채권-파생형)

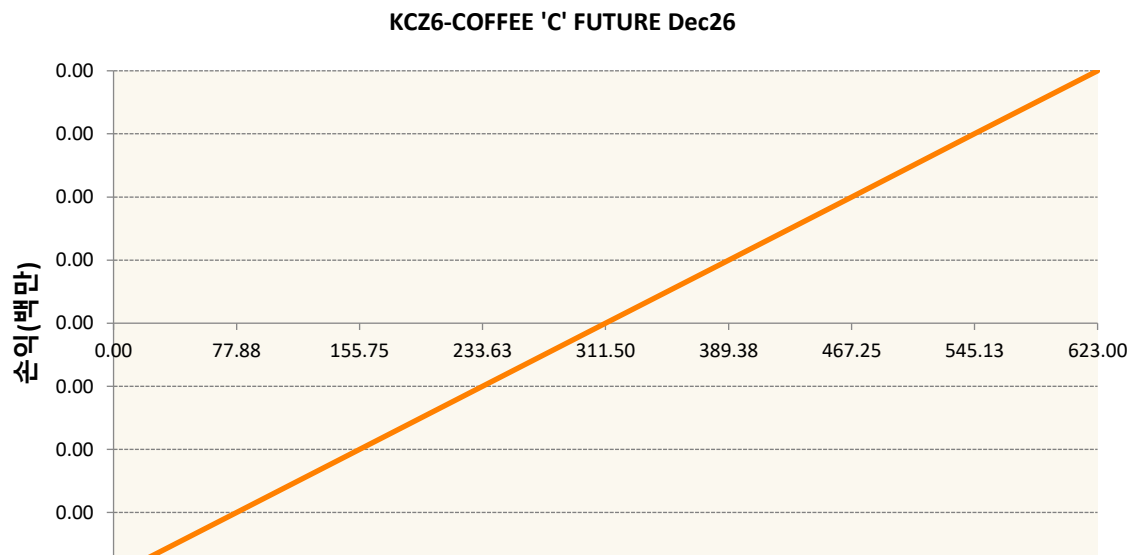
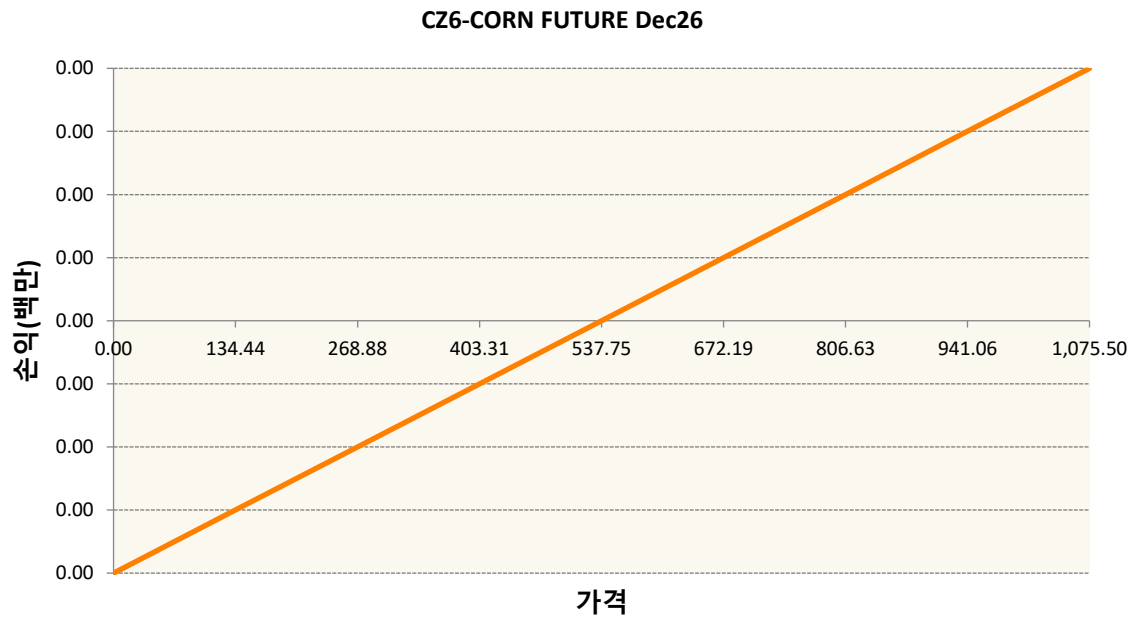
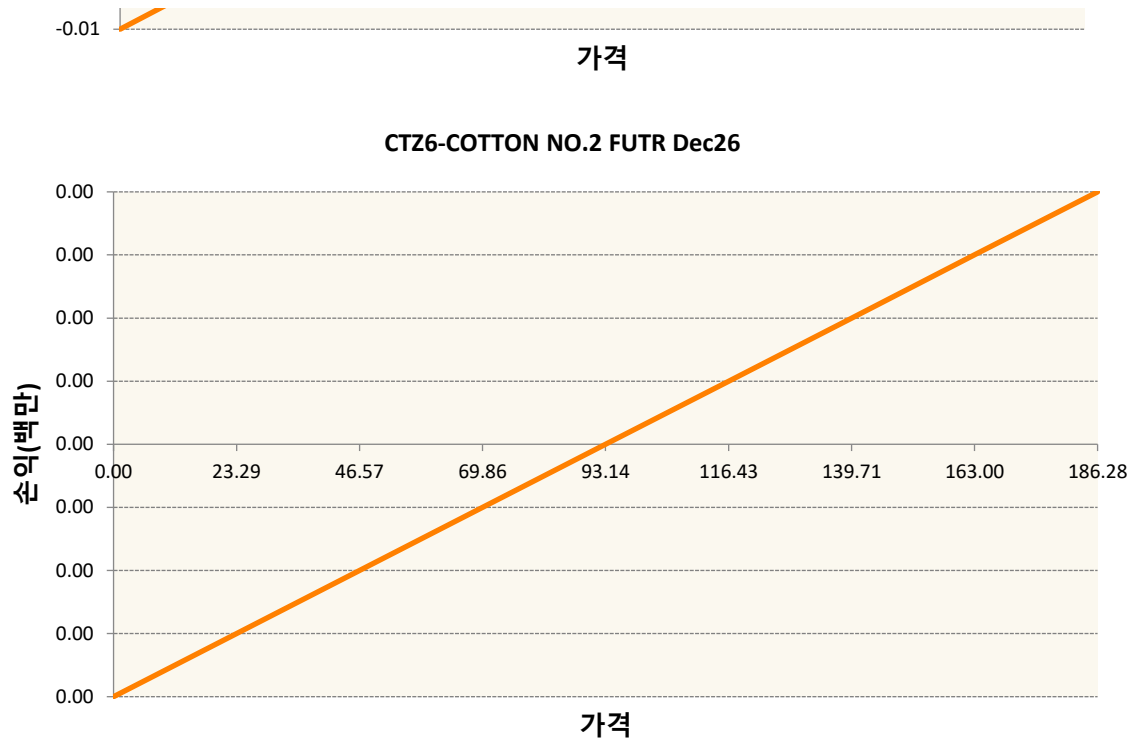
1. 계약금액

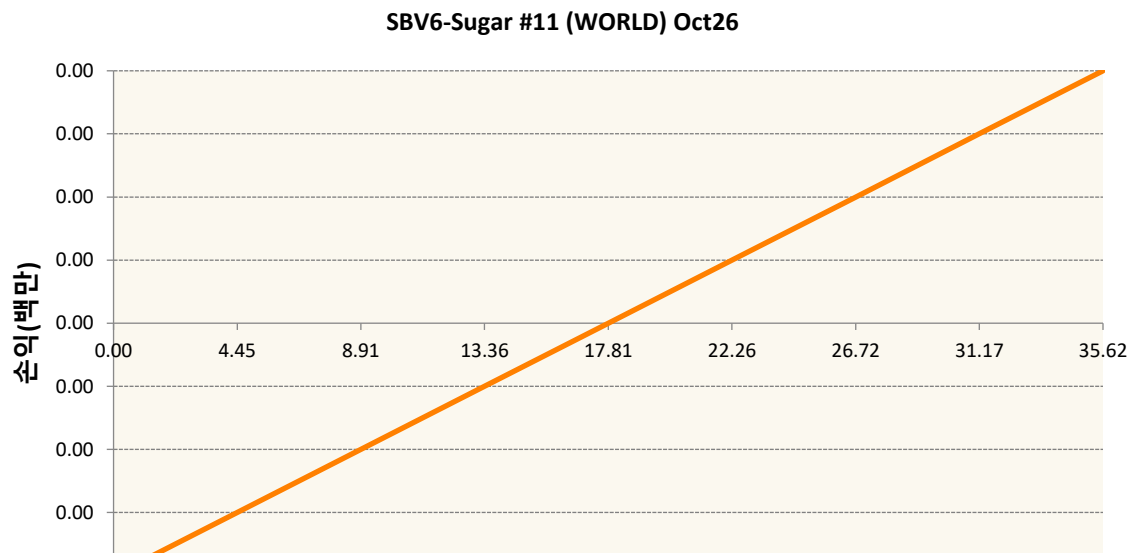
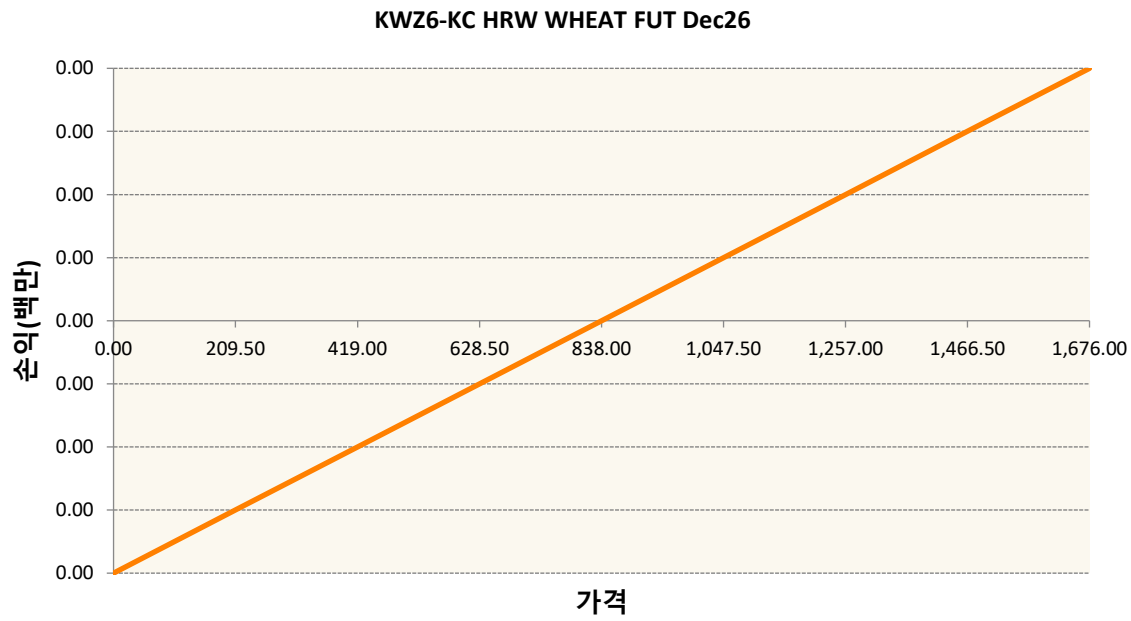
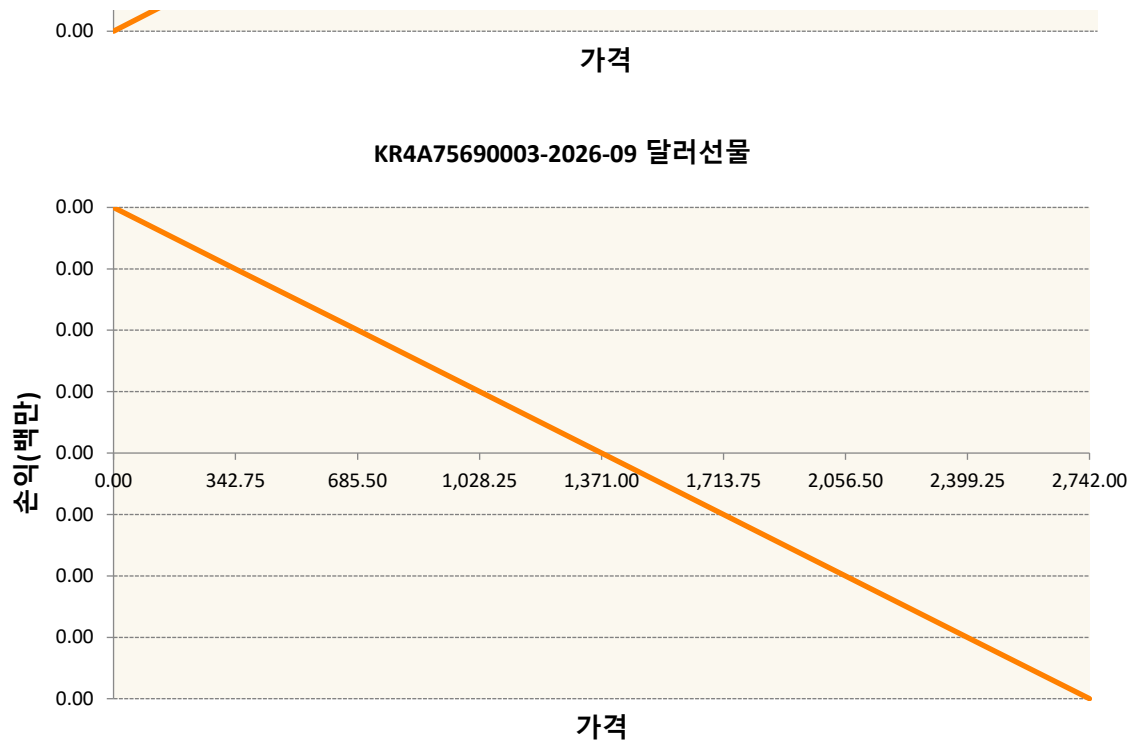
(단위:USD 백만)

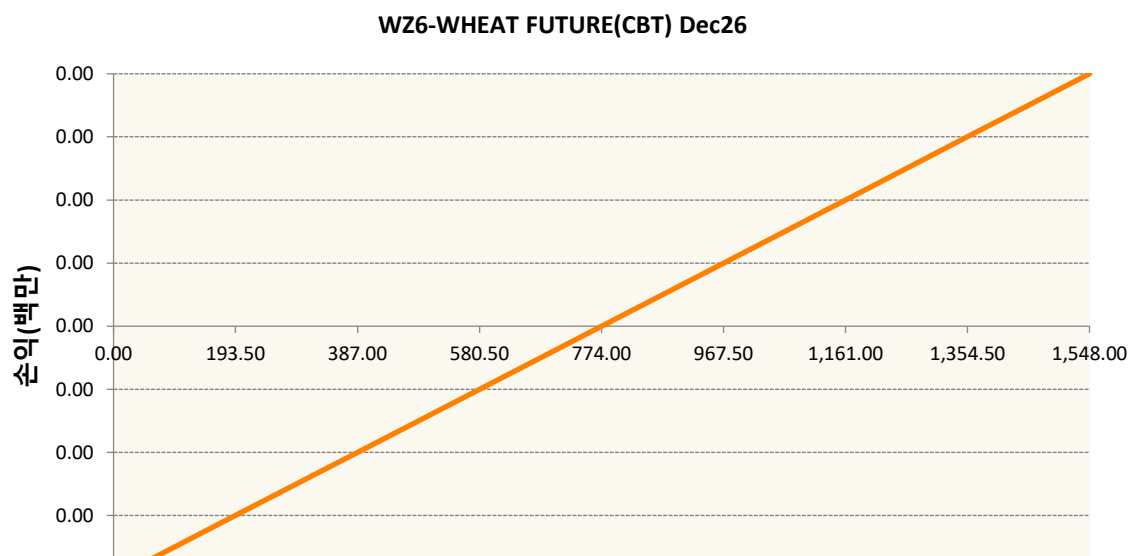
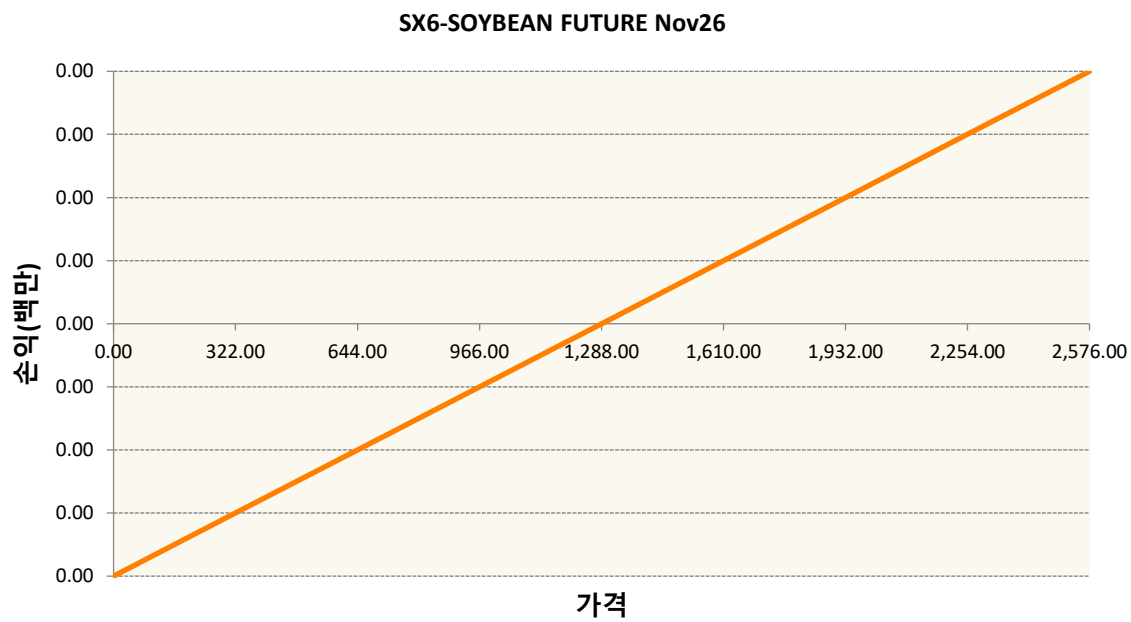
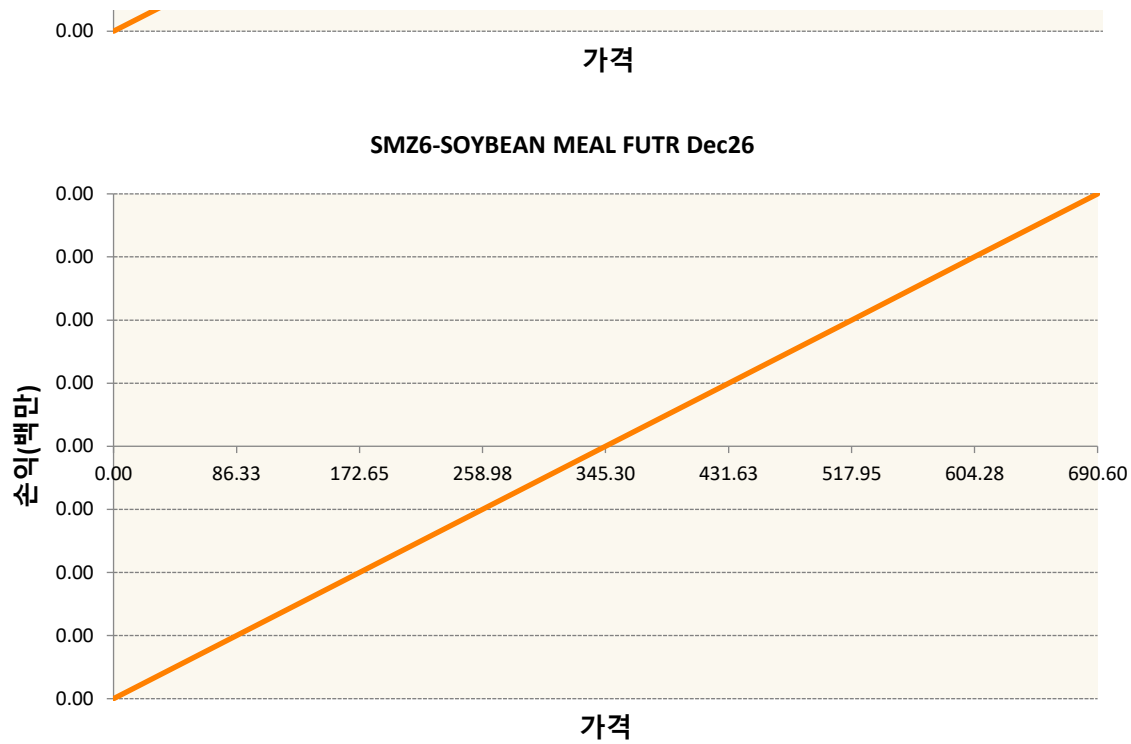
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	481	0	481	
누계	유가증권	선물	2,535	0	2,535	
누계	통화	선물	0	343	-343	장내

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	2026-09-02
기준일	2026-09-01

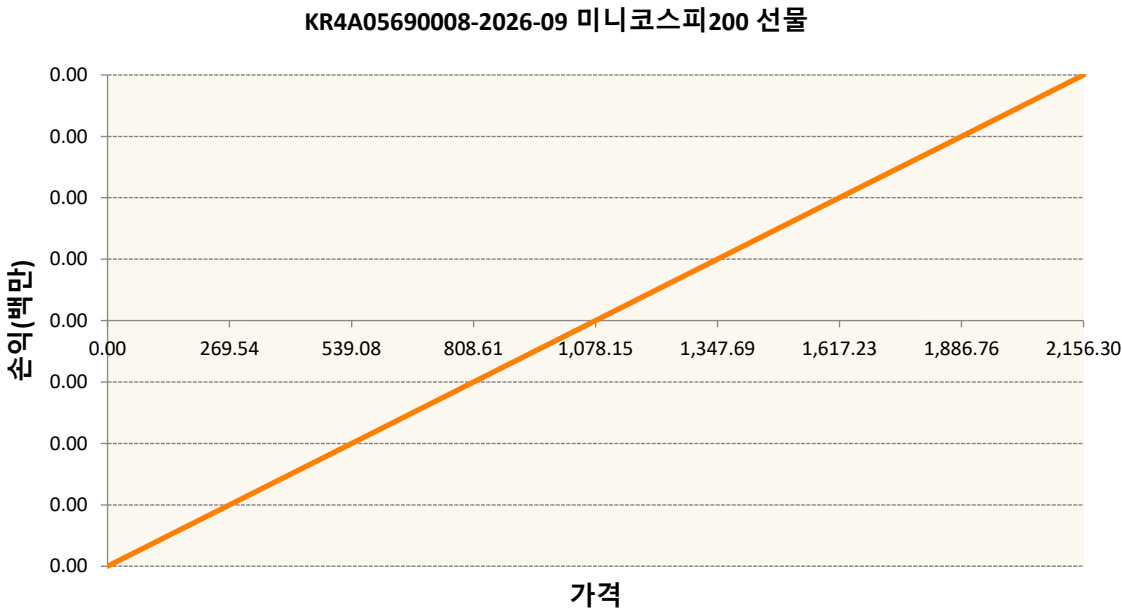
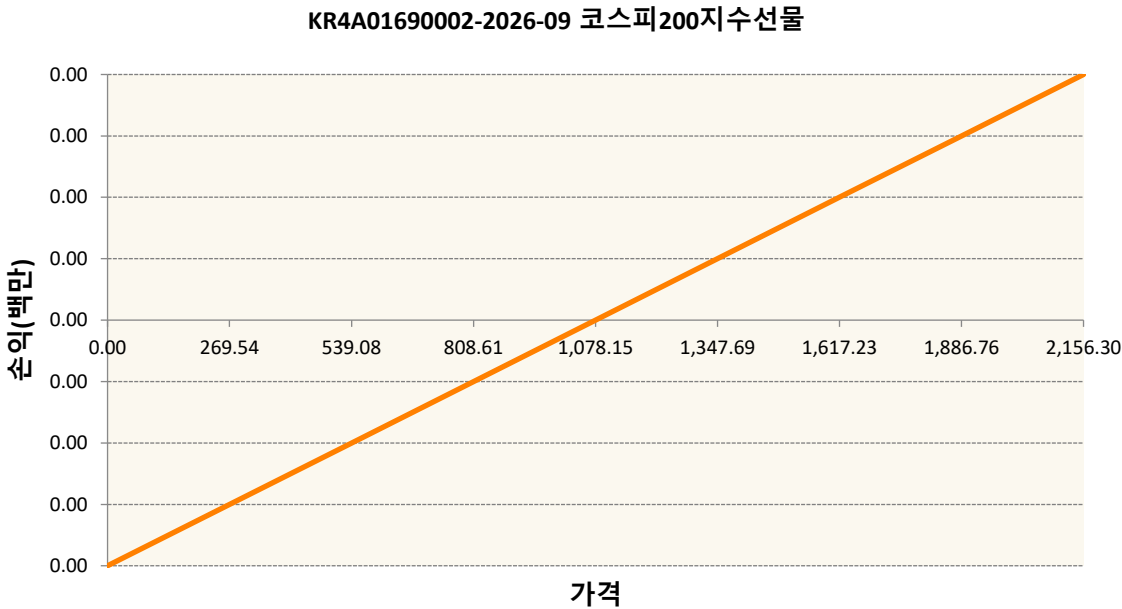
스마트인덱스모

1. 계약금액

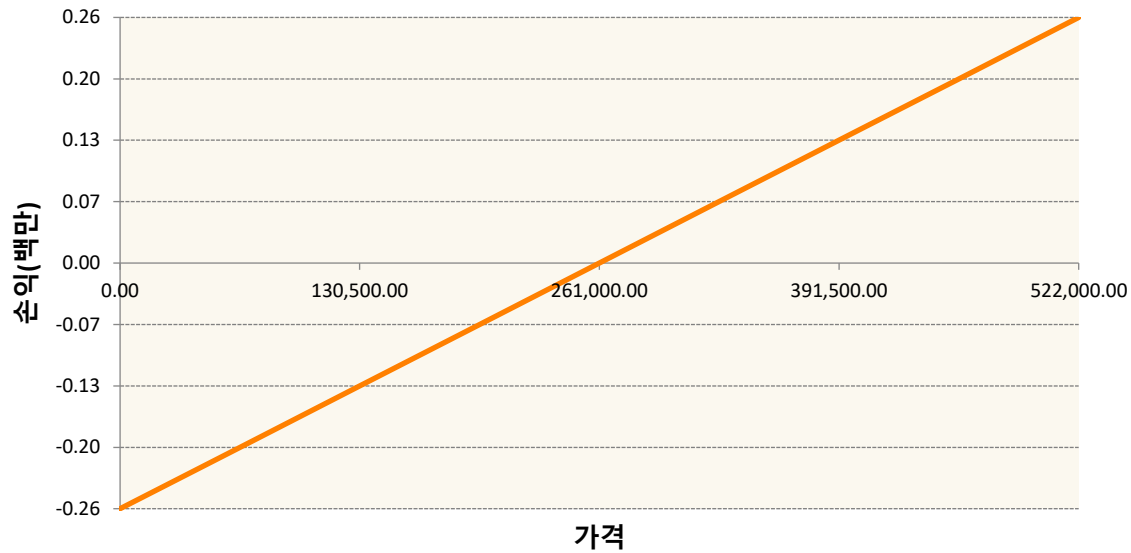
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,145	0	4,145	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002 2026-09 코스피200지수선물								215
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215
-5.33%	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143	-143
-2.67%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	72	72	72	72	72	72	72	72
5.33%	143	143	143	143	143	143	143	143
8.00%	215	215	215	215	215	215	215	215
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	-22
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	14	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	22	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	-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)

825

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

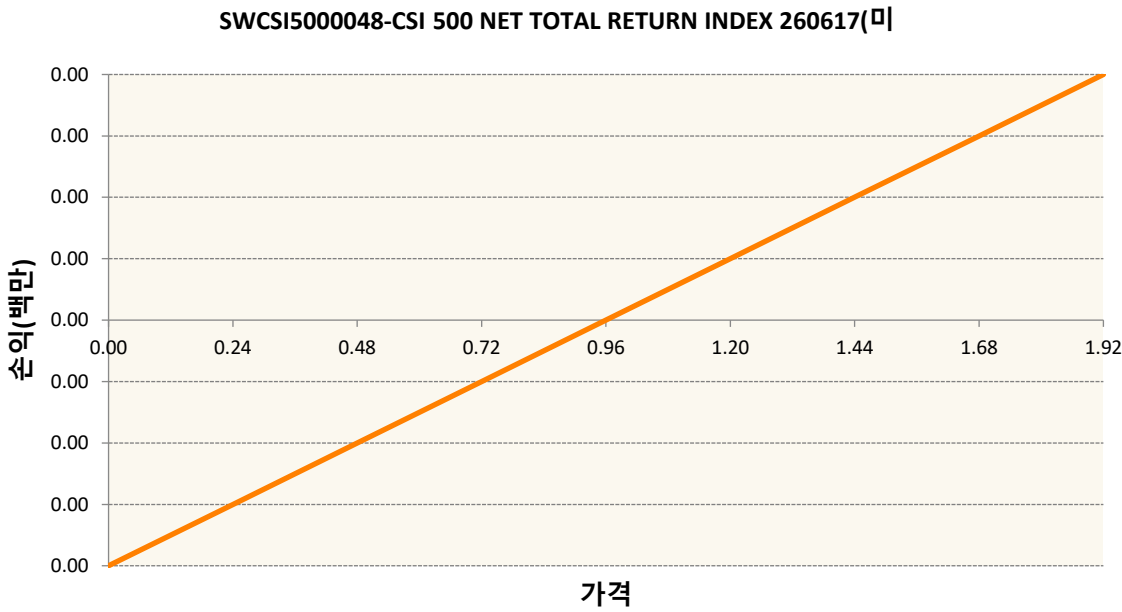
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,565	0	5,565	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

446

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

711

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

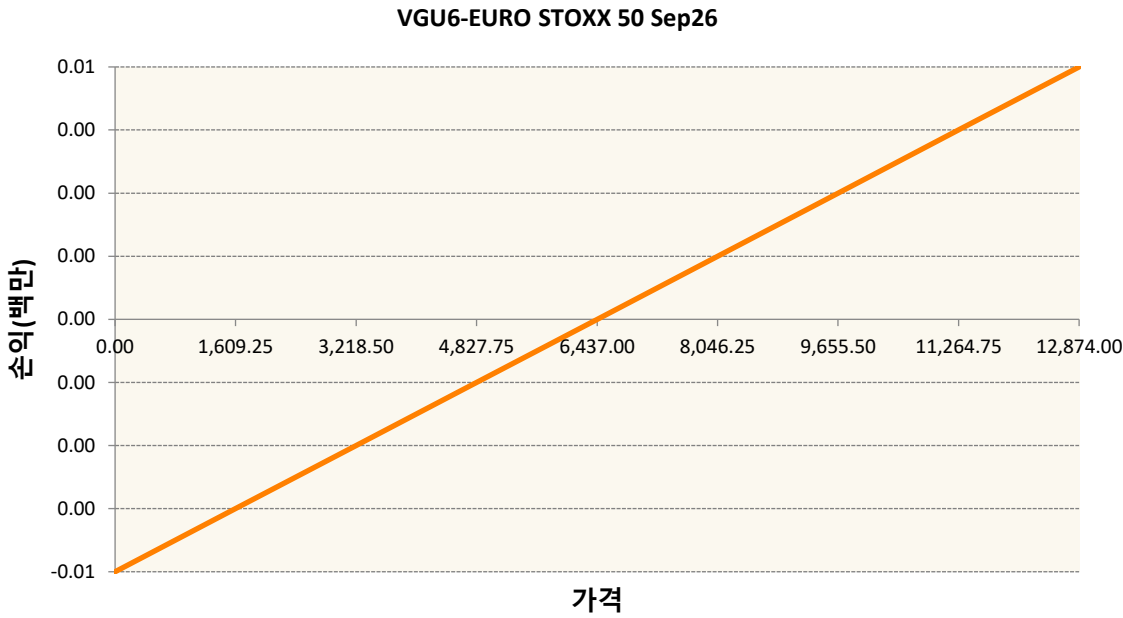
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,224	0	1,224	

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	2026-09-02
기준일	2026-09-01

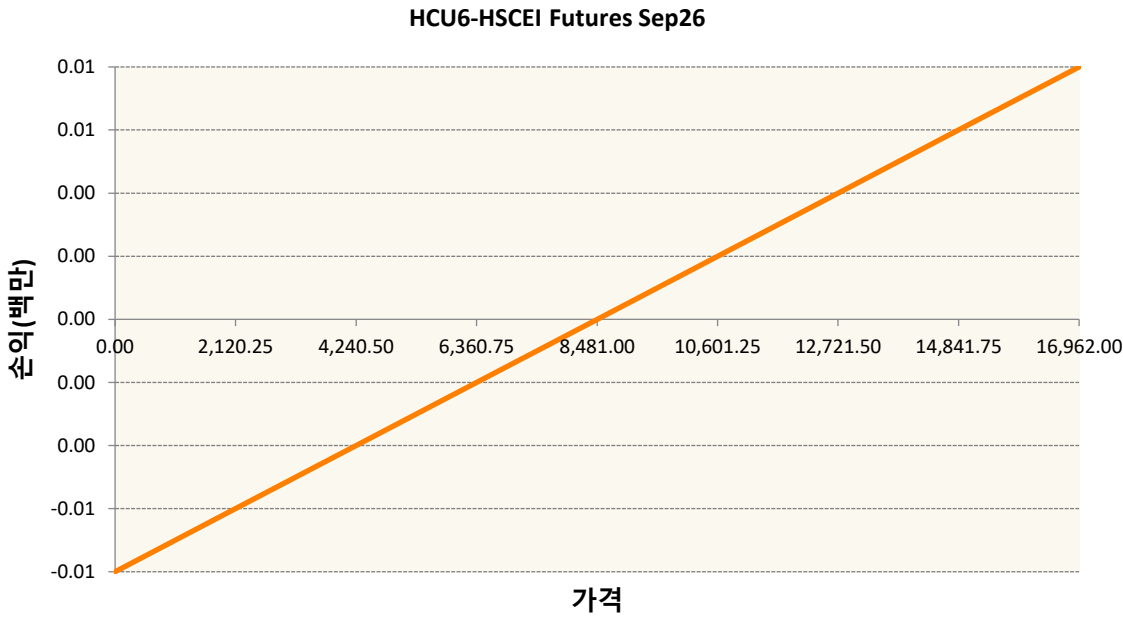
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,485	0	1,485	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	2026-09-02
기준일	2026-09-01

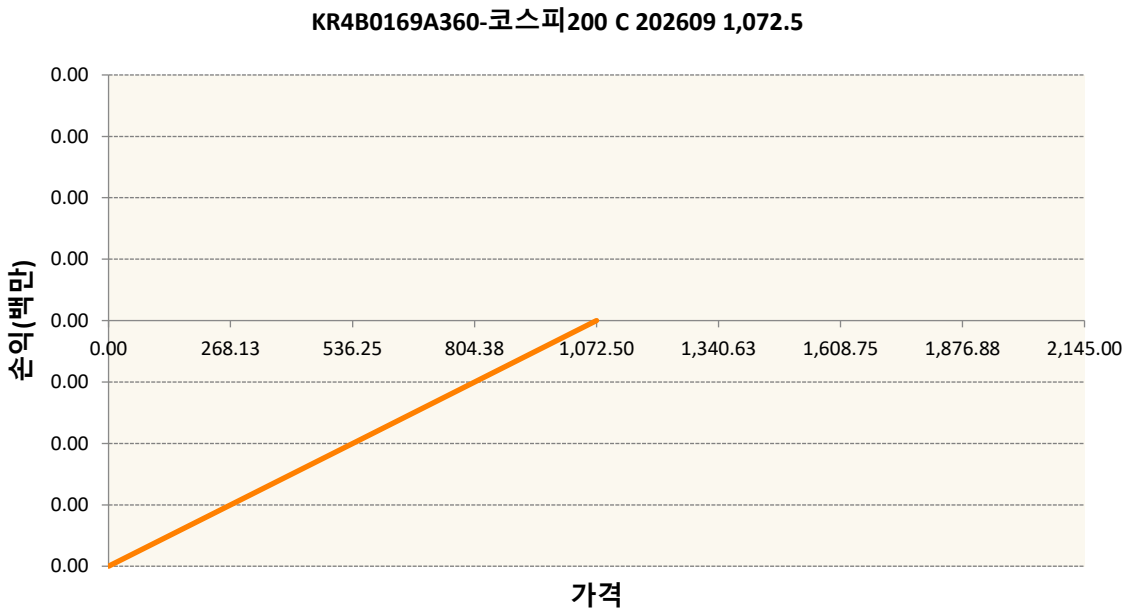
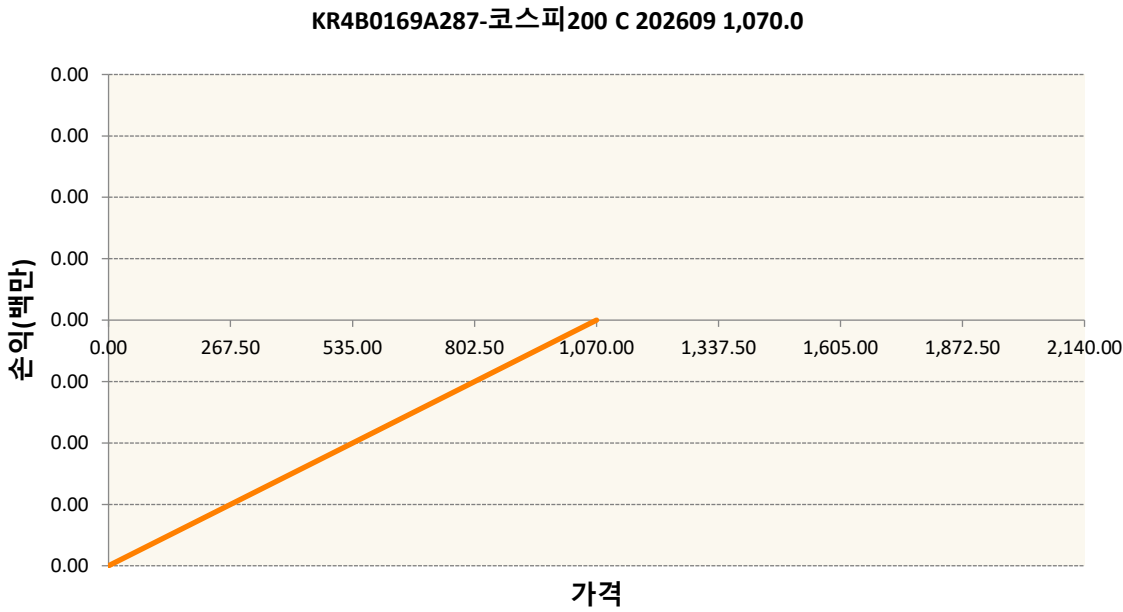
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

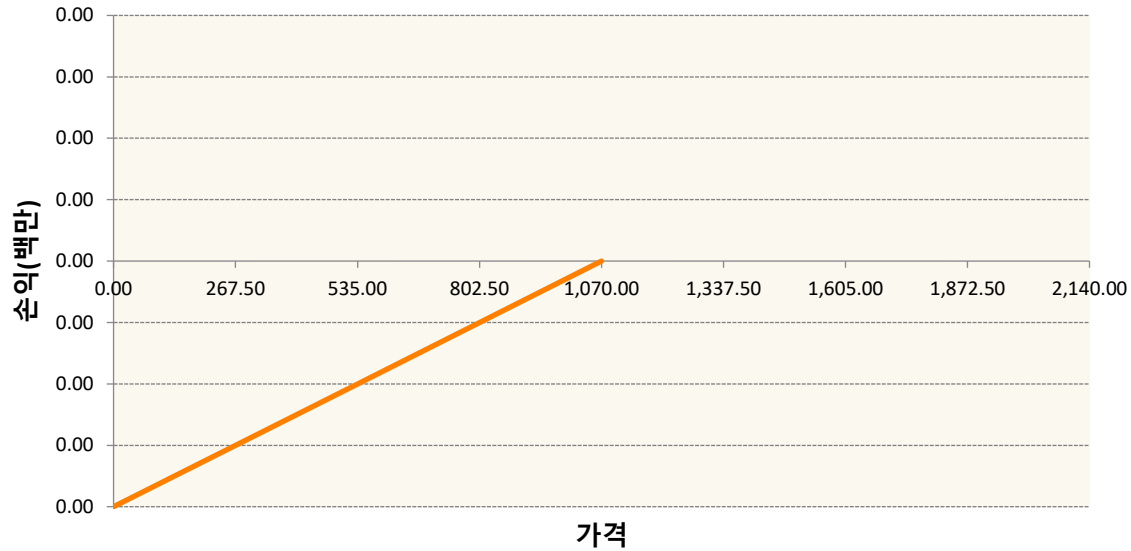
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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							810
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-716	-727	-740	-755	-772	-790	-810
-5.33%	-387	-407	-429	-453	-477	-502	-528
-2.67%	-110	-139	-168	-198	-228	-258	-289
0%	95	63	32	0	-32	-63	-95
2.67%	225	198	170	141	112	83	53
5.33%	295	276	256	234	210	185	160
8.00%	326	316	303	288	271	253	233
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							1,184
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,054	-1,069	-1,087	-1,108	-1,131	-1,157	-1,184
-5.33%	-575	-603	-634	-667	-701	-737	-774
-2.67%	-168	-209	-251	-293	-336	-379	-422
0%	137	92	46	0	-46	-92	-137
2.67%	334	294	253	211	168	125	82
5.33%	442	413	383	350	315	278	241
8.00%	491	475	455	433	407	380	350
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							498
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-441	-447	-456	-465	-475	-486	-498
-5.33%	-238	-251	-264	-279	-294	-309	-325
-2.67%	-68	-86	-104	-122	-140	-159	-178
0%	58	39	19	0	-19	-39	-58

2.67%	138	122	105	87	69	51	33
5.33%	181	170	157	144	129	114	98
8.00%	201	194	187	177	167	156	143

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

(단위:백만원)

3,943

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

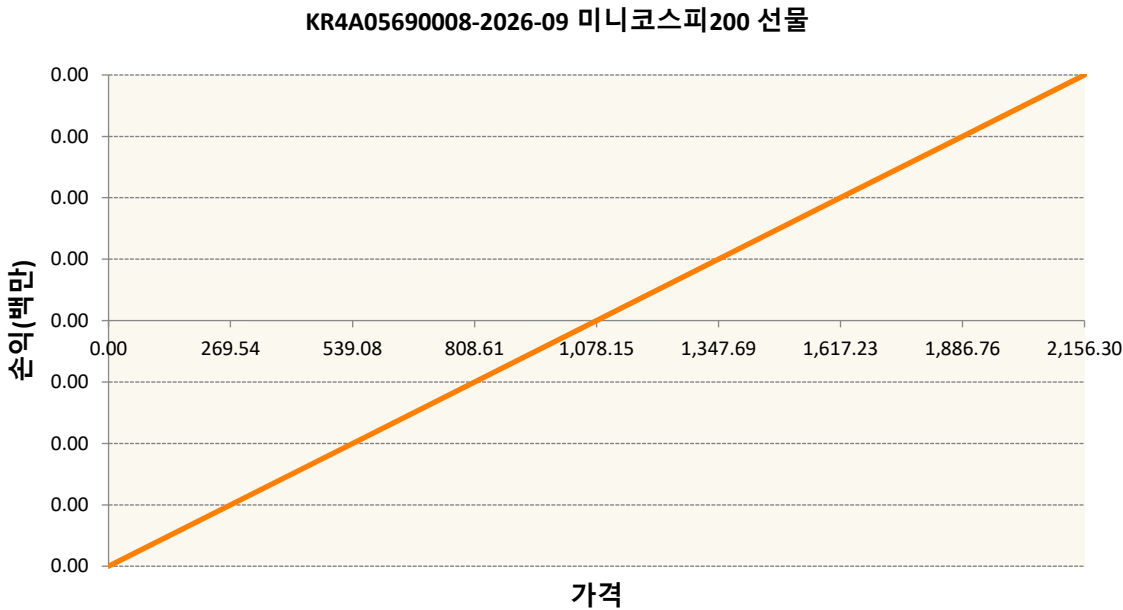
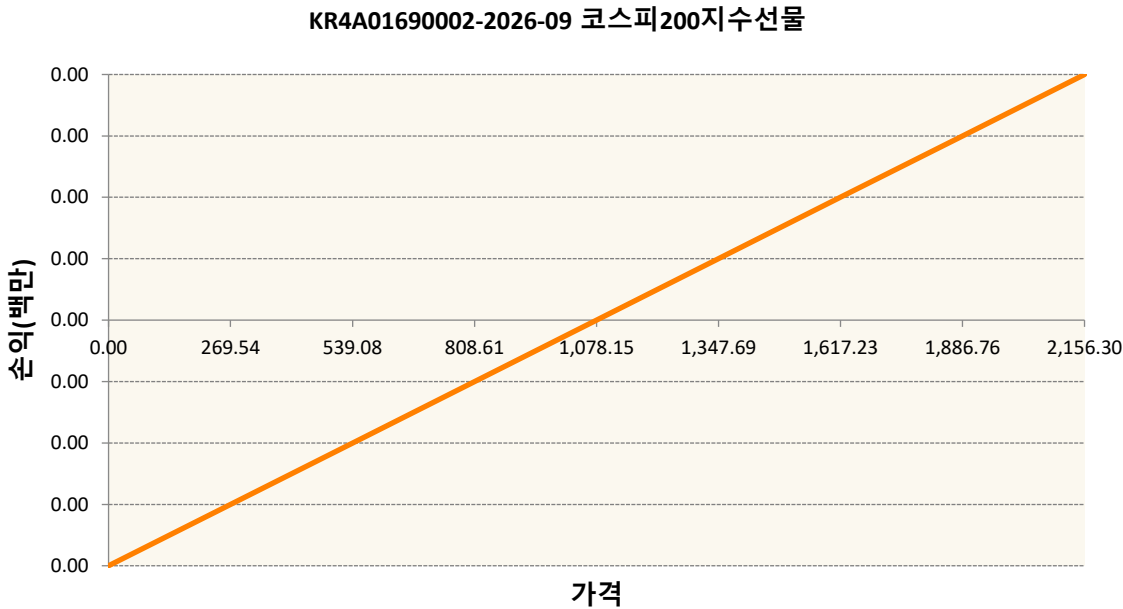
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

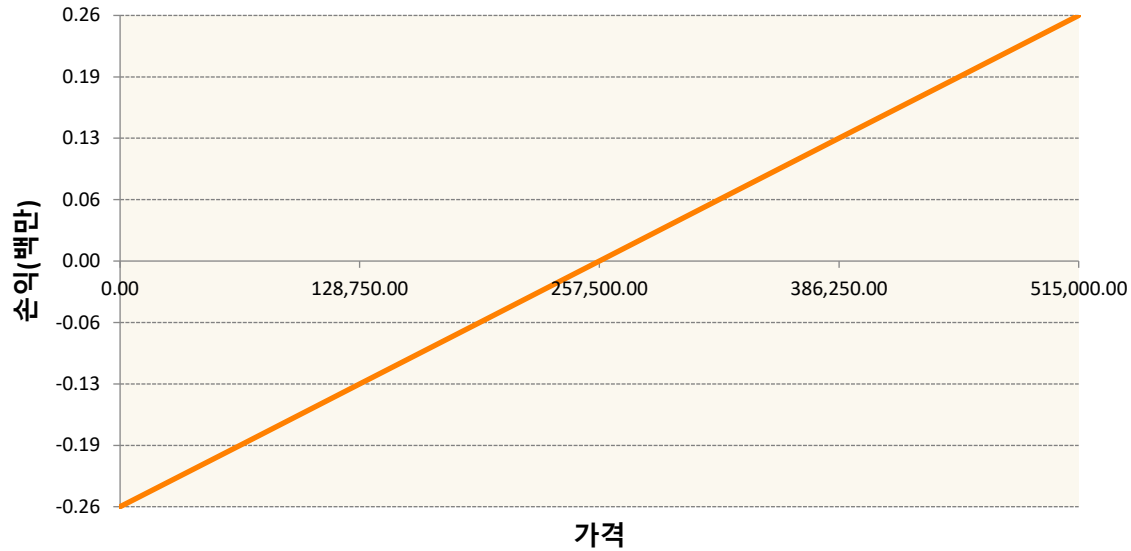
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	268	-268	장내
누계	유가증권	선물	1,132	0	1,132	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	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	29	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43	43
KR4A05690008 2026-09 미니코스피200 선물								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	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-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	3
5.33%	6	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9	9
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	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	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)
	191

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

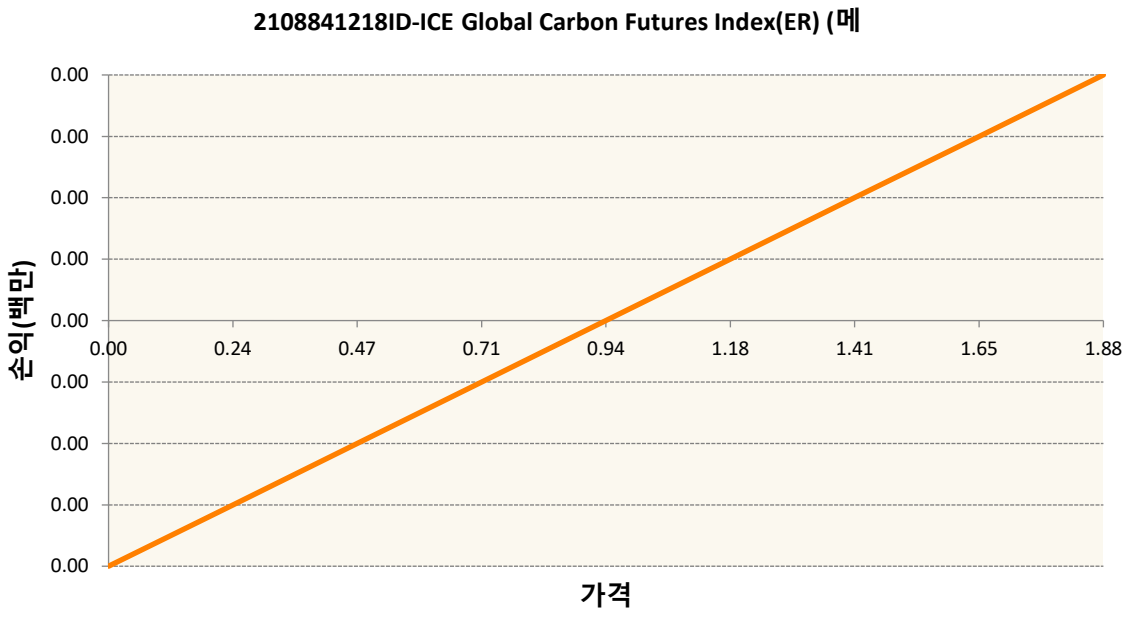
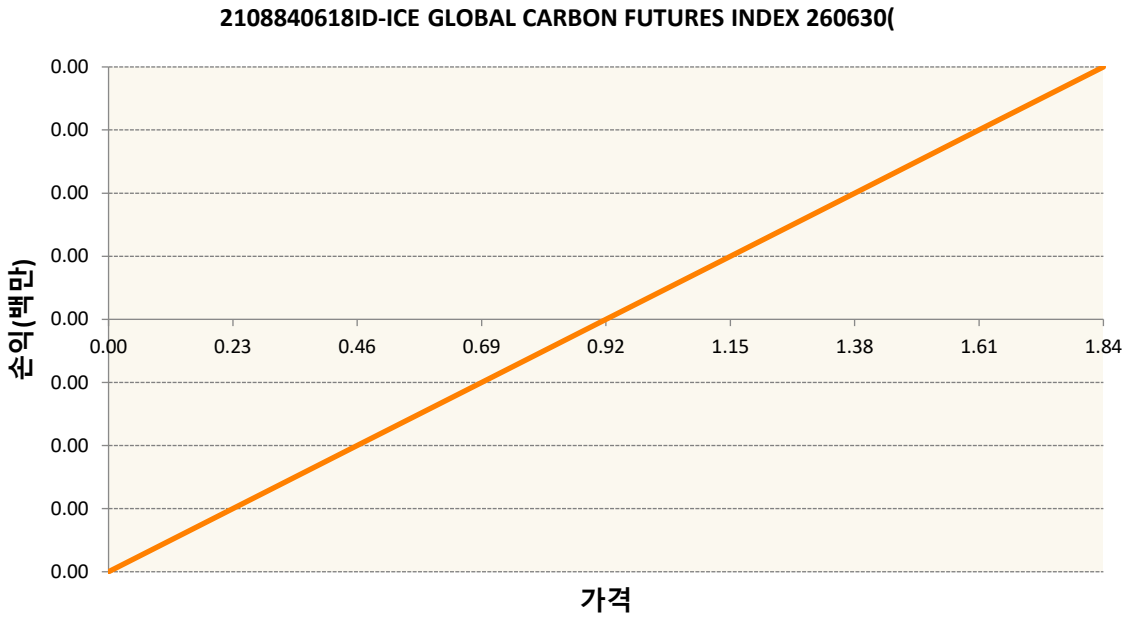
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,014	0	7,014	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		449
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		114

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	614

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

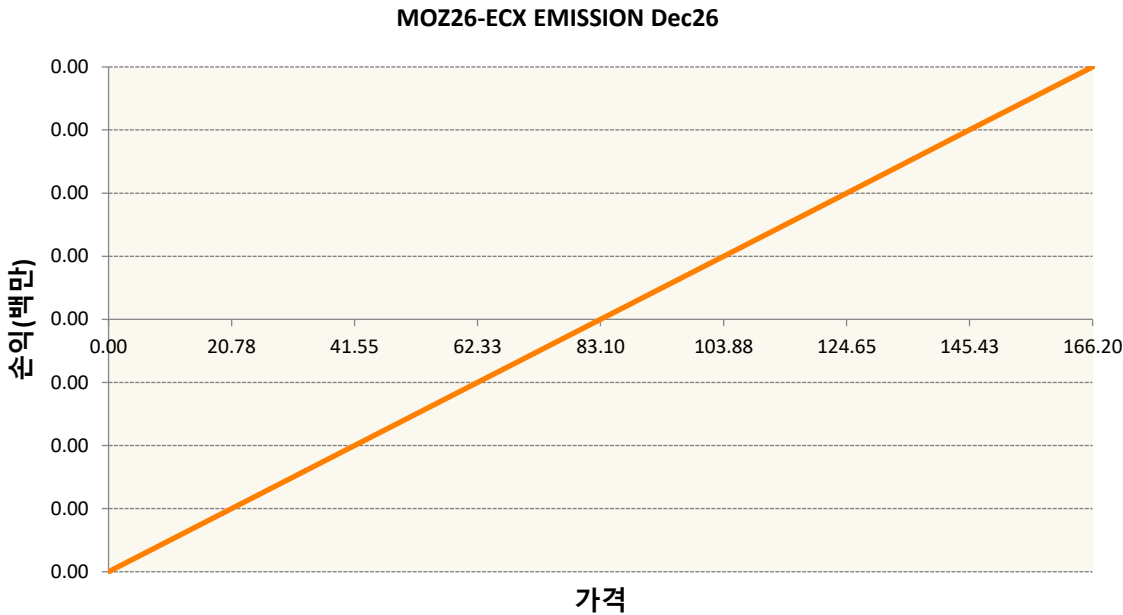
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,373	0	5,373	
누계	통화	선도	0	2,640	-2,640	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E	211
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	430

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

(단위:백만원)

688

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

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	-2,032	0	-2,032	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	65
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	30
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	26
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	39

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

(단위:백만원)

258

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

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	-5,005	0	-5,005	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	42
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	188
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	174

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

(단위:백만원)

762

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

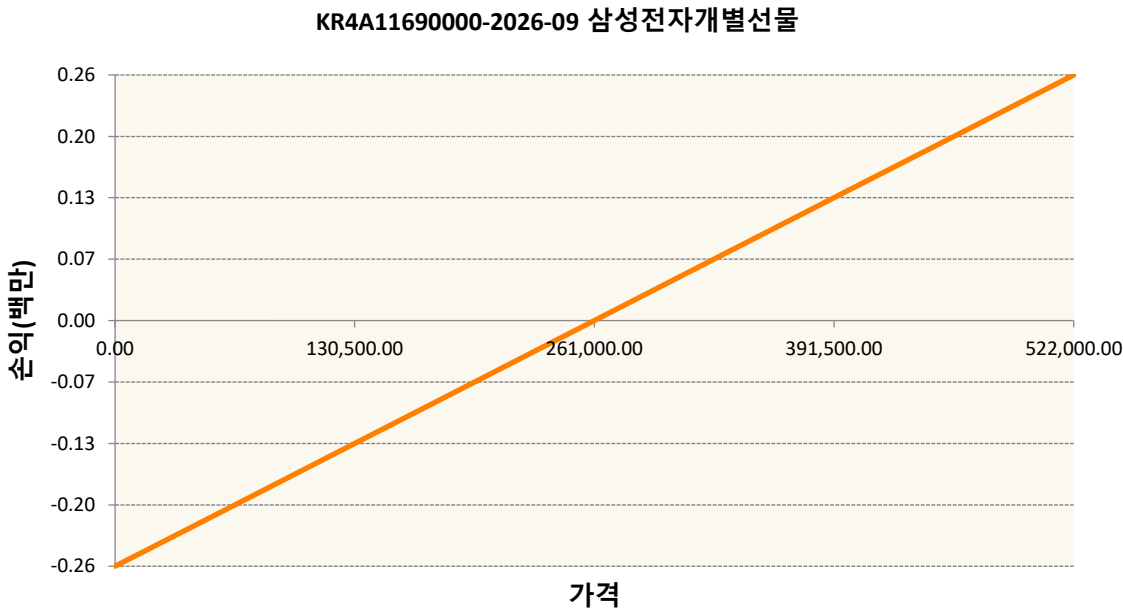
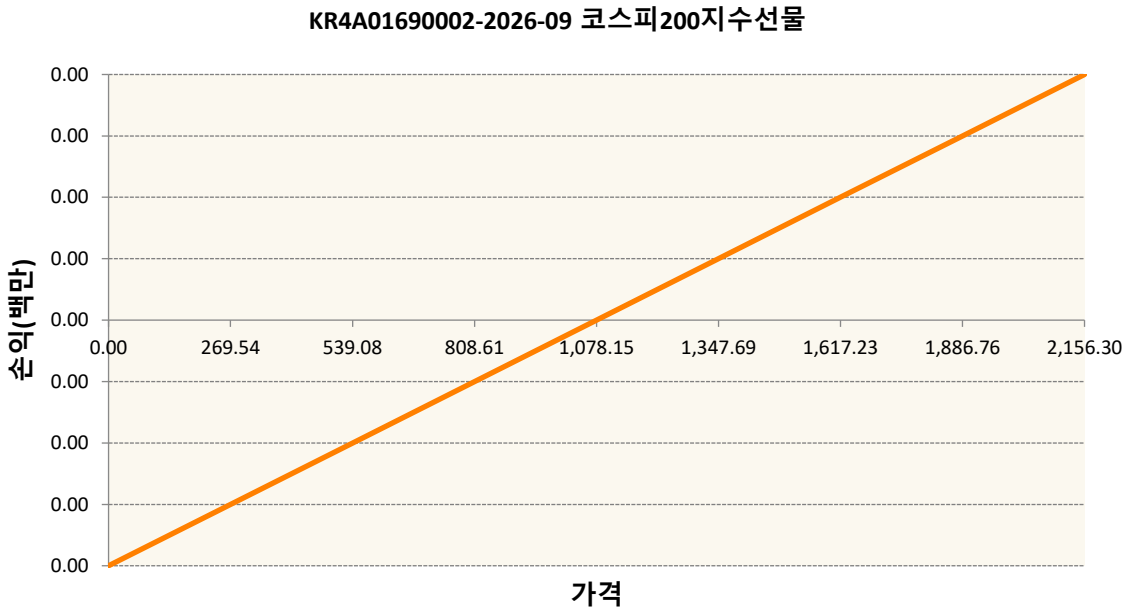
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	270	0	270	장내
누계	유가증권	선물	21,667	0	21,667	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					1,462
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462	-1,462
-5.33%	-975	-975	-975	-975	-975	-975	-975
-2.67%	-487	-487	-487	-487	-487	-487	-487
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	487	487	487	487	487	487	487
5.33%	975	975	975	975	975	975	975
8.00%	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462	1,462
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물					267
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267
-5.33%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178
-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%	178	178	178	178	178	178	178
8.00%	267	267	267	267	267	267	267

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

5,978

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

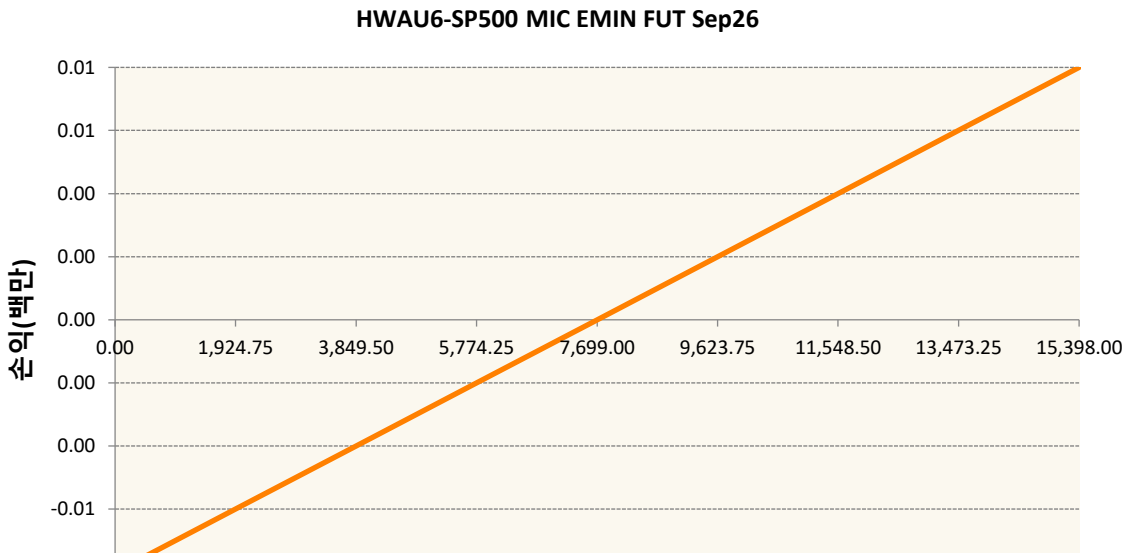
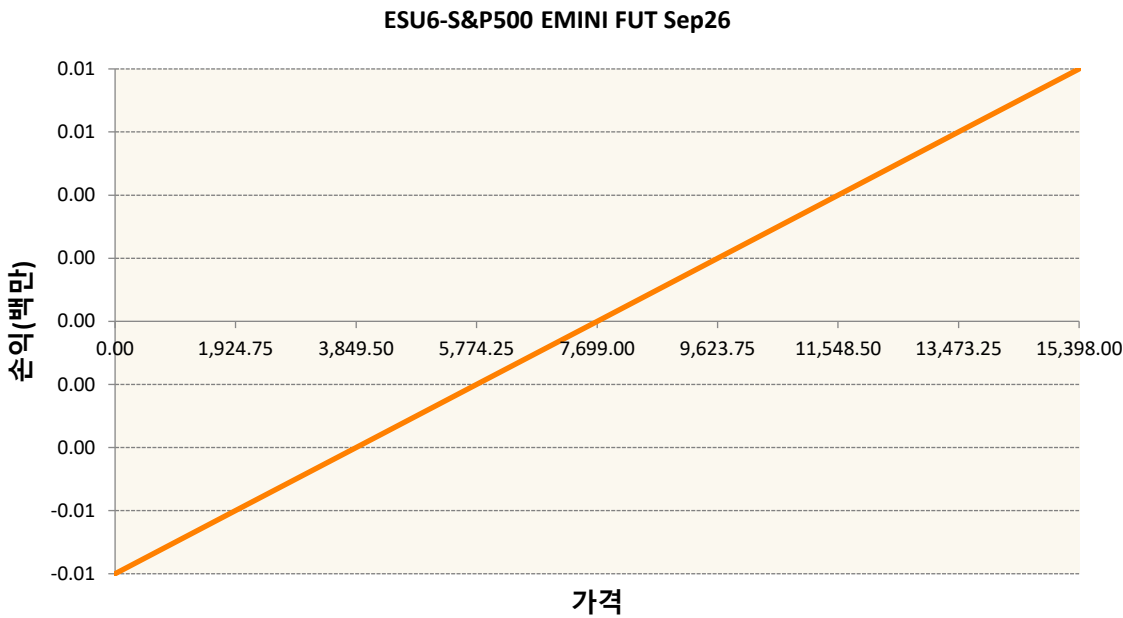
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

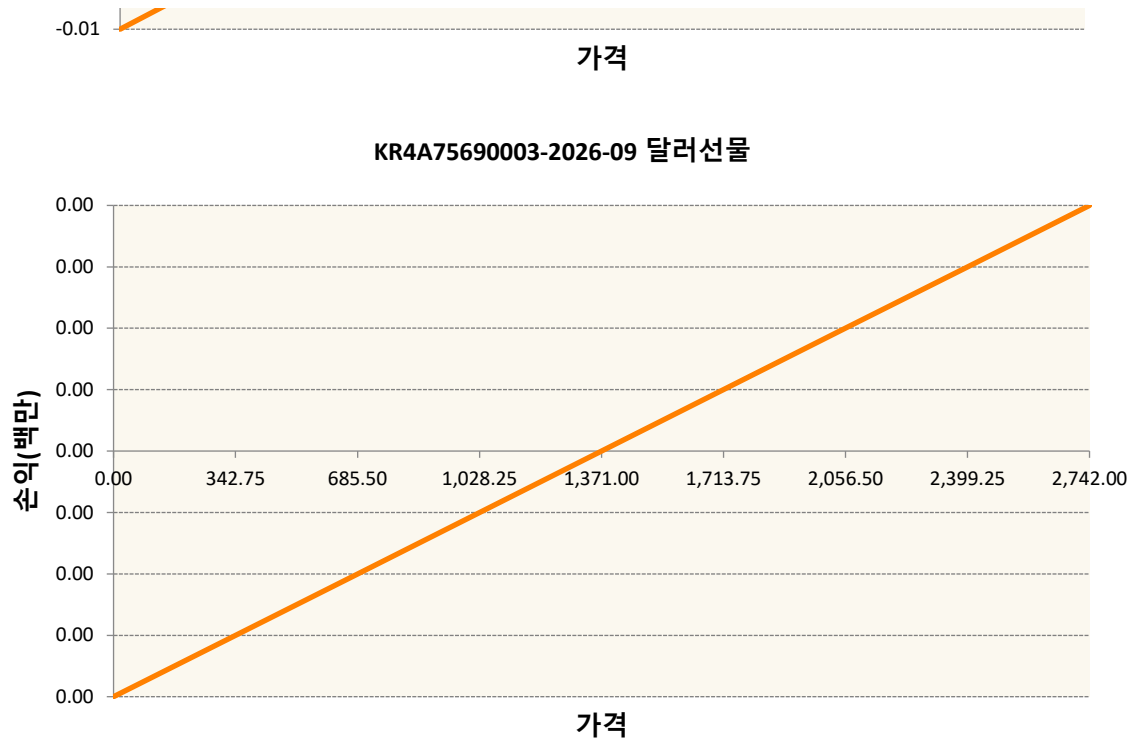
1. 계약금액

(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	685	0	685	장내
누계	지수	선물	76,728	0	76,728	
누계	지수	선물	176	0	176	장내
누계	통화	선물	9,049	0	9,049	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		6,138
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		14
KR4A756900 2026-09 달러선물			724

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,089

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

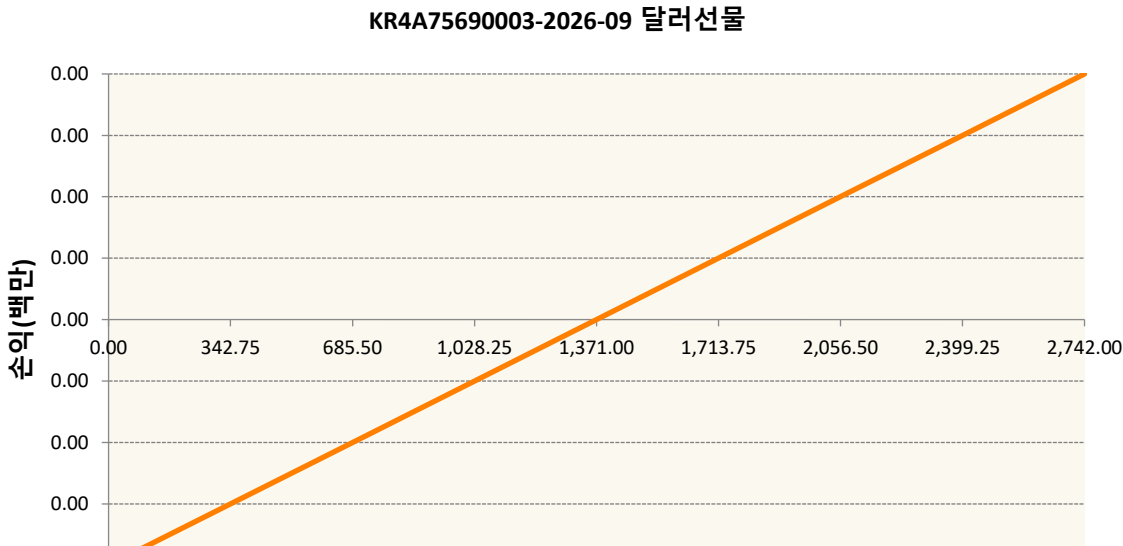
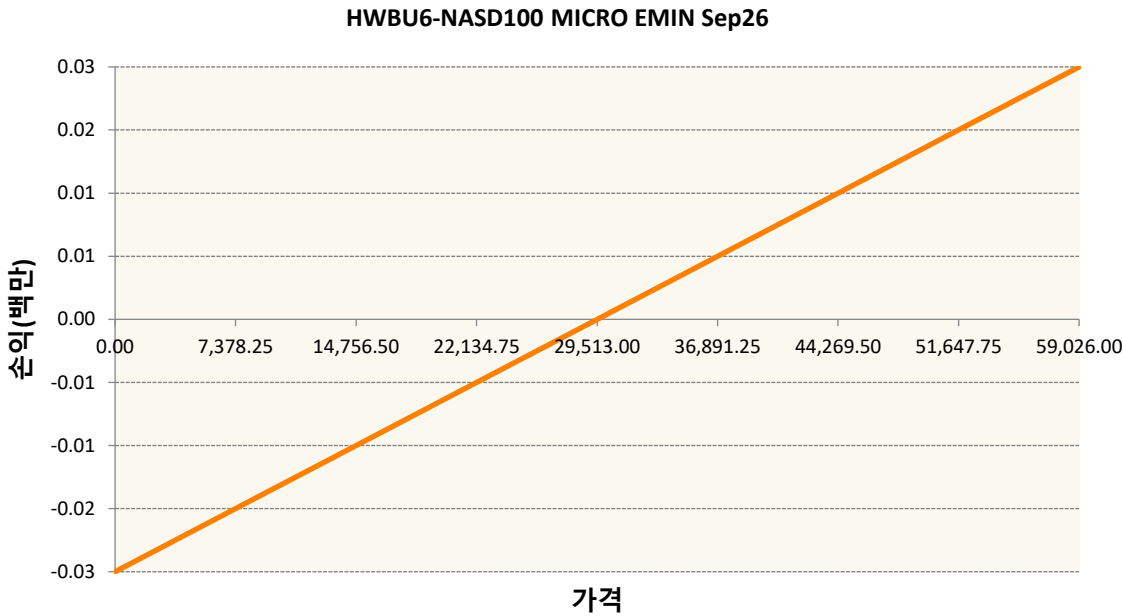
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

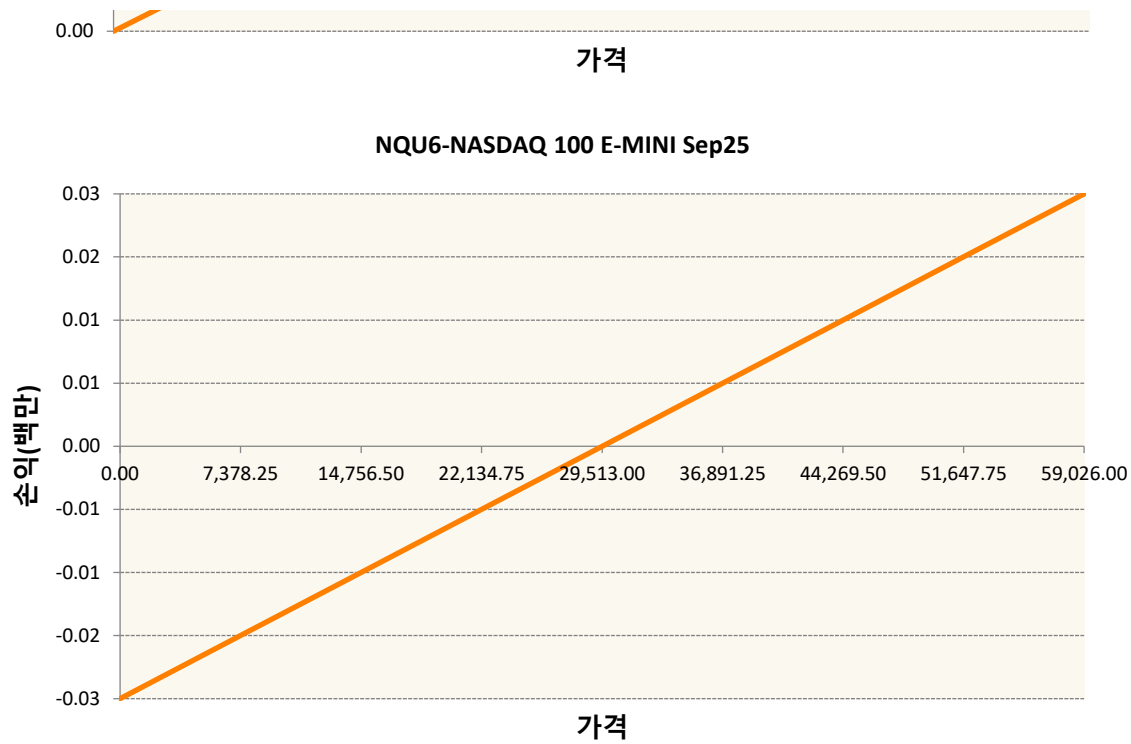
1. 계약금액

(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	343	0	343	장내
누계	유가증권	선물	1,363	0	1,363	장내
누계	지수	선물	36,467	0	36,467	
누계	통화	선물	4,127	0	4,127	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		109
KR4A756900	2026-09 달러선물		330
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,917

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

공시일	2026-09-02
기준일	2026-09-01

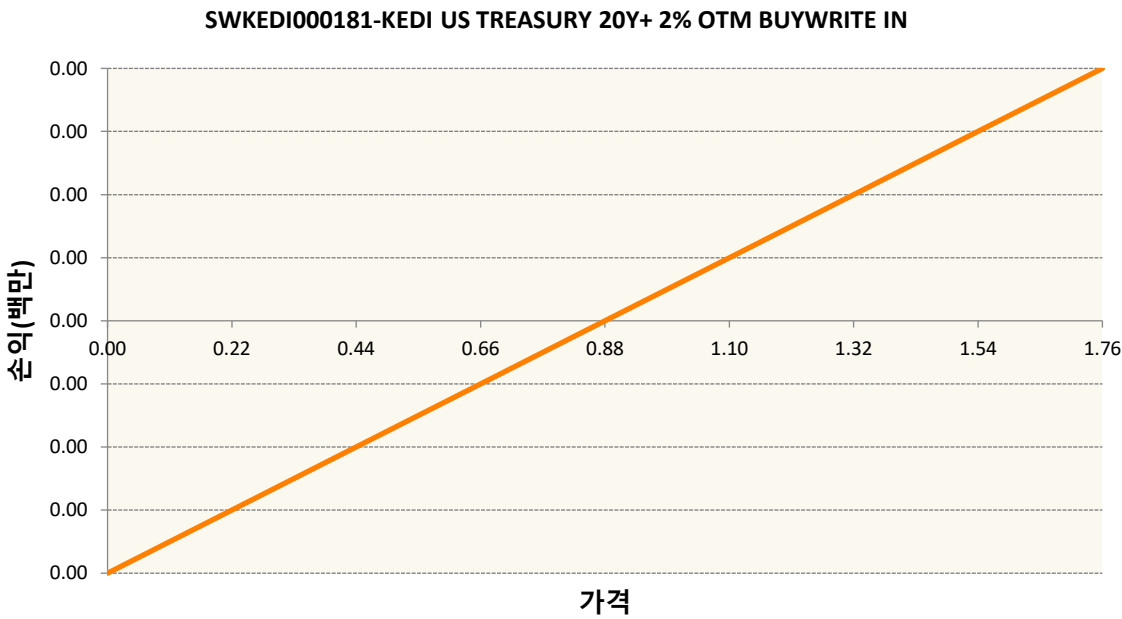
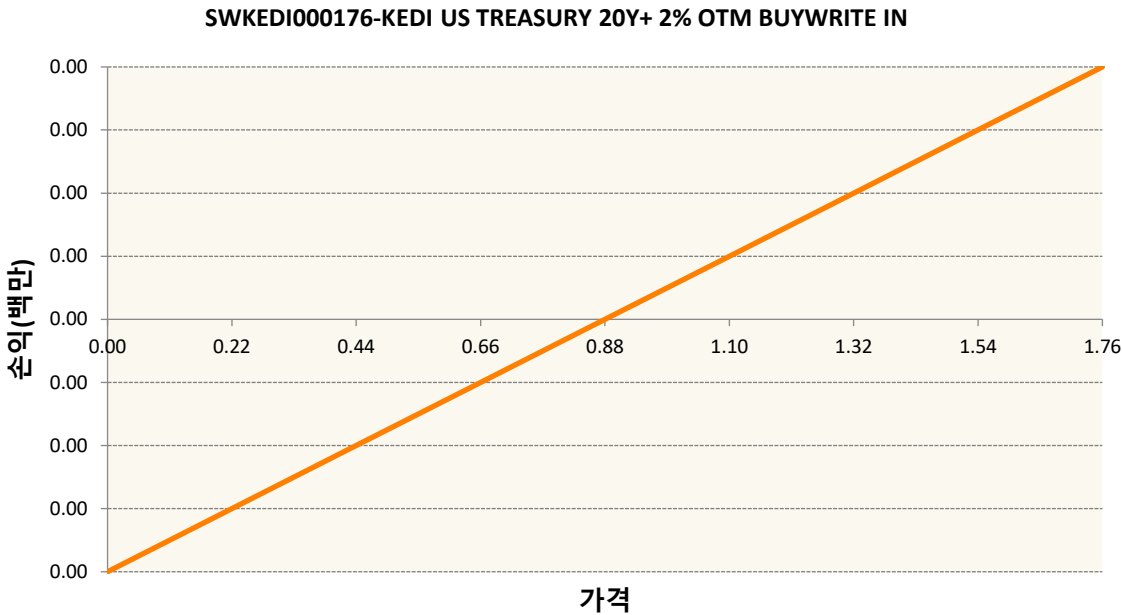
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

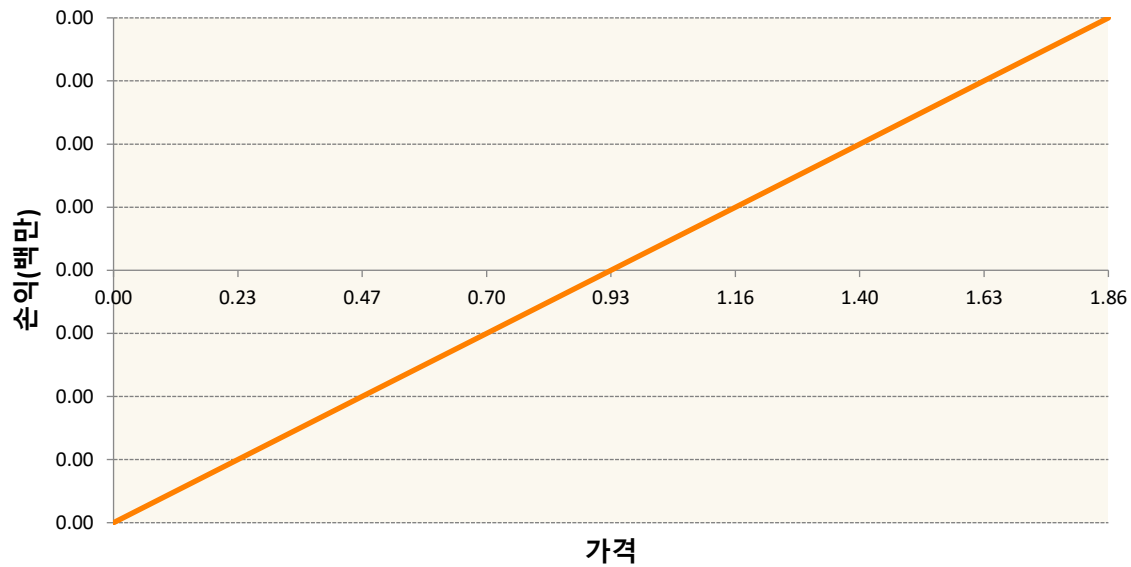
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	277,821	0	277,821	장외

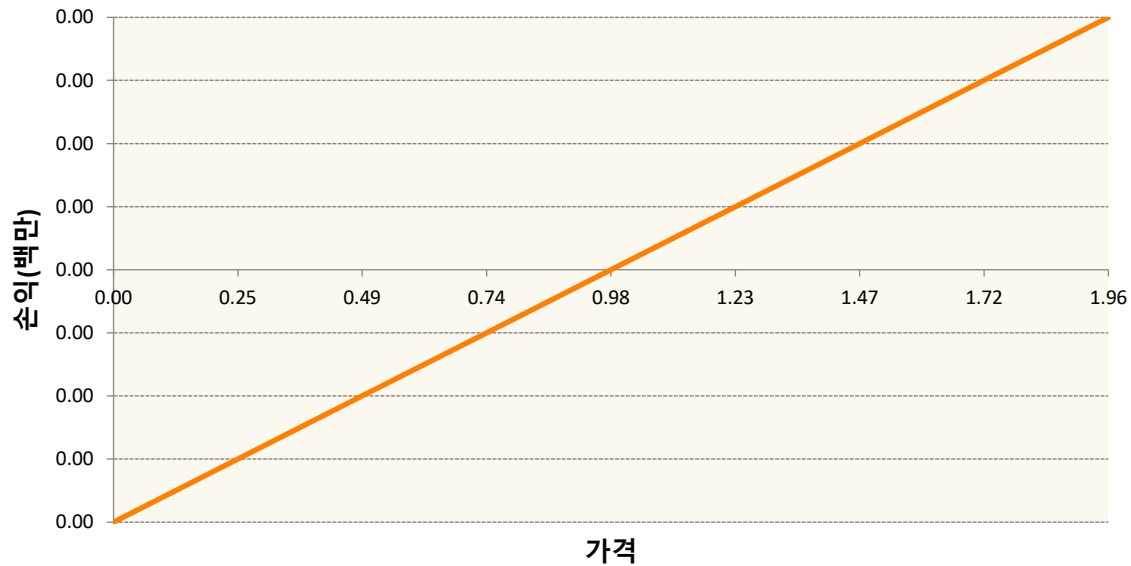
2. 만기시점의 손익구조



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	7,149
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,806
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,267
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,998

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

(단위:백만원)

9,017
