

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

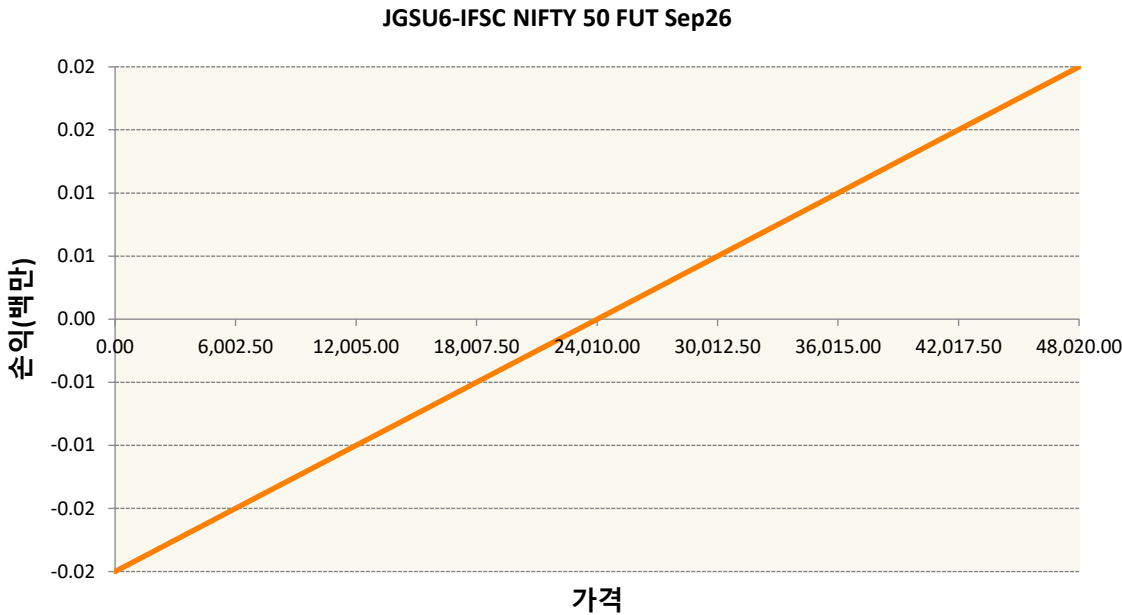
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	333	0	333	

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	2026-09-08
기준일	2026-09-07

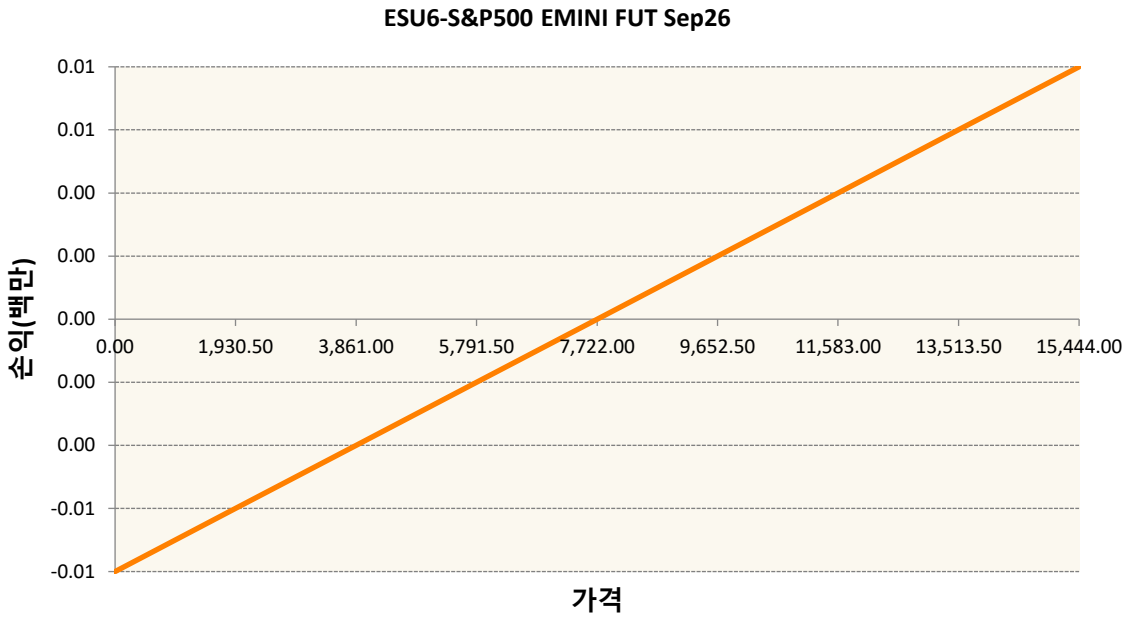
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	588	0	588	

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	2026-09-08
기준일	2026-09-07

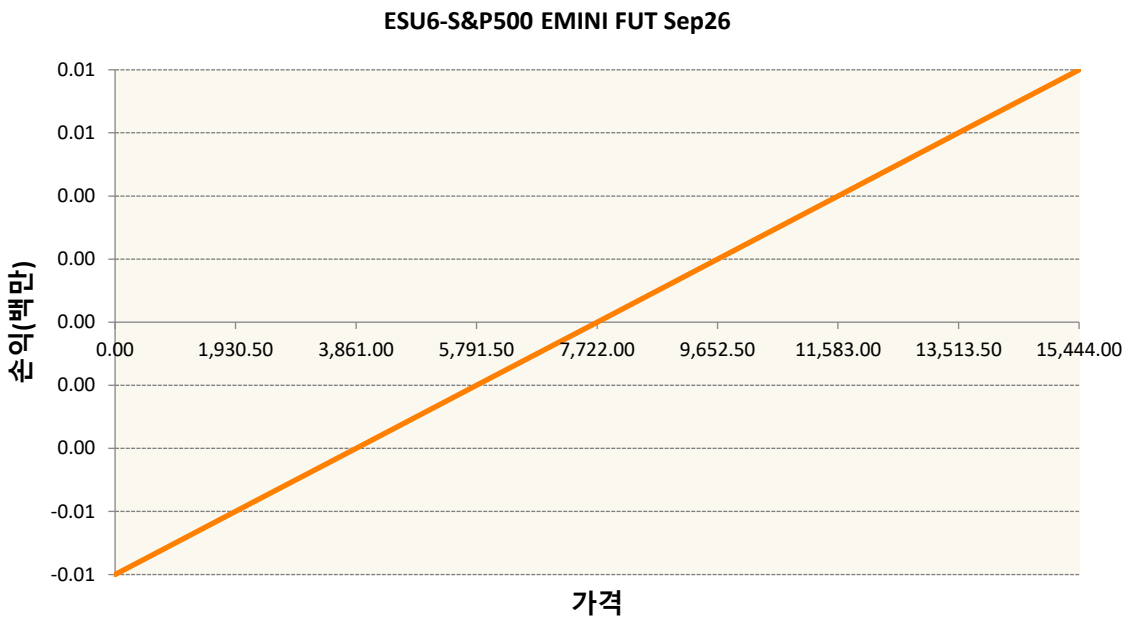
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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)

38

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

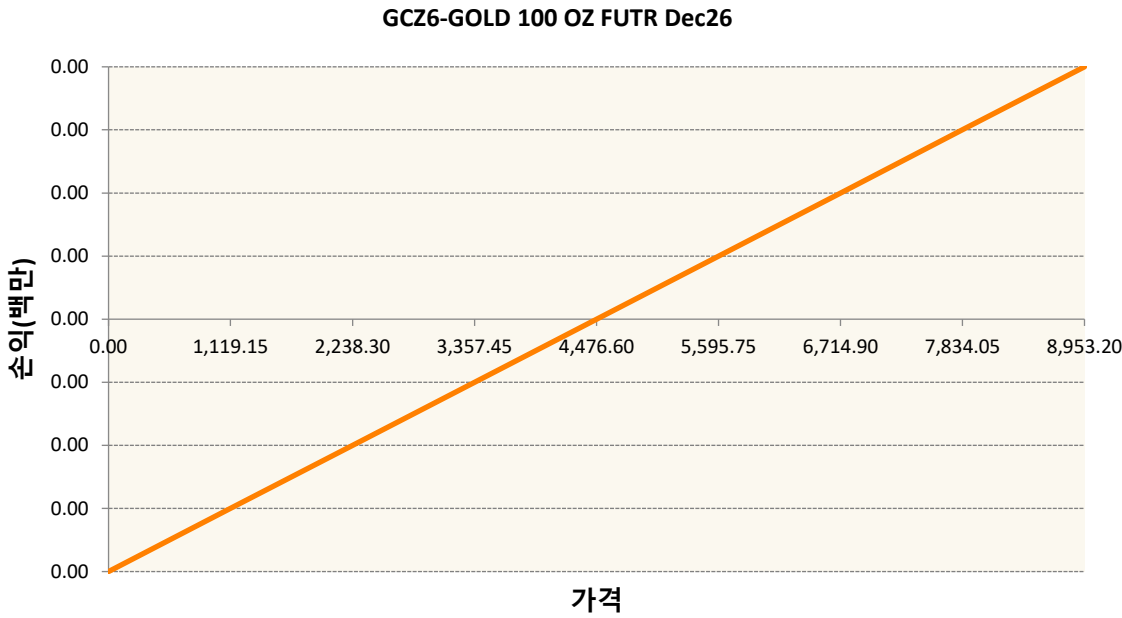
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			6,352	0	6,352	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 09/11/26 C417 EQUITY	3
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	508

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

(단위:백만원)

679

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

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)

AOPLTRAC1\$PLTR US 09/11/26 C187.5 EQUITY	28
AOPLTRAP1\$PLTR US 09/11/26 P187.5 EQUITY	15

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

(단위:백만원)

146

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

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)

AOTLTUSCC\TLT US 09/11/26 C82.5 EQUITY

3

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

(단위:백만원)

2

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

(단위:백만원)

14,610

공시일 2026-09-08

기준일 2026-09-07

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	2026-09-08
기준일	2026-09-07

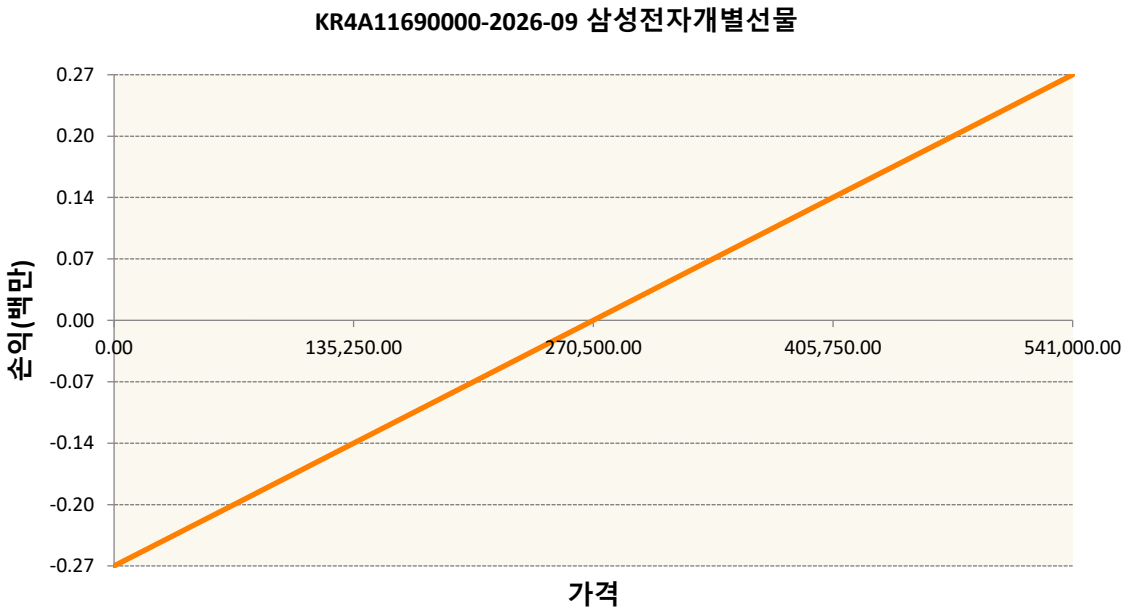
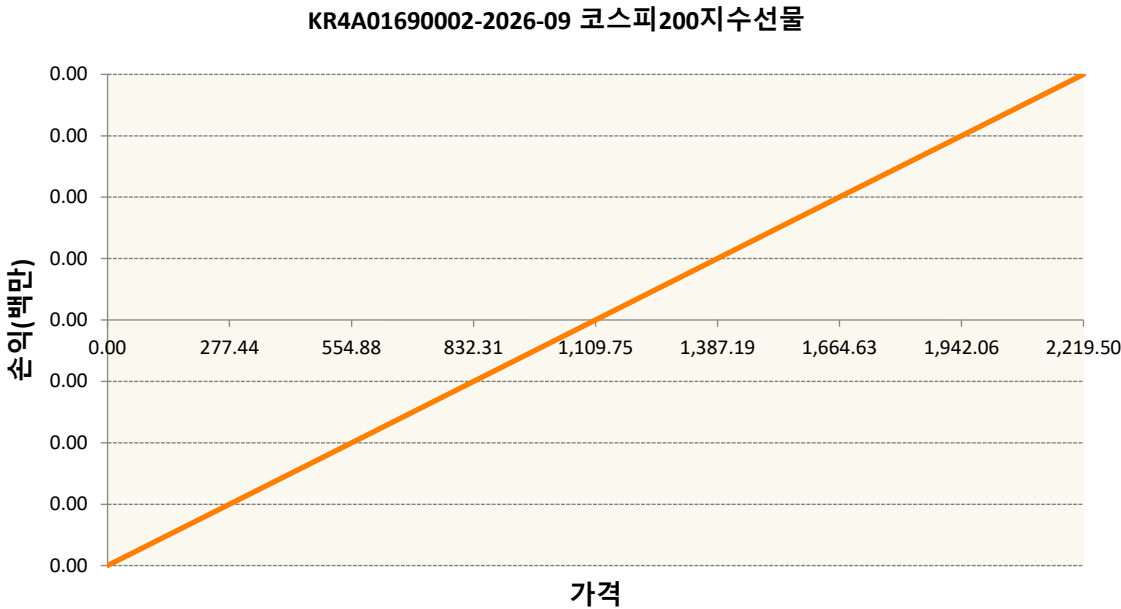
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	54,383	-54,383	장내
누계	유가증권	선물	21,820	0	21,820	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,485	-53,485	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 2,215.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the relationship, starting at the origin (0, 0) and ending at the point (1,107.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,107.50	0.00

The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), has major tick marks at 0.00, 277.50, 555.00, 832.50, 1,110.00, 1,387.50, 1,665.00, 1,942.50, and 2,220.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), has major tick marks at 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, and 0.00. A single orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,110, 0.00).

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					575
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-575	-575	-575	-575	-575	-575	-575
-5.33%	-383	-383	-383	-383	-383	-383	-383
-2.67%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	192	192	192	192	192	192	192
5.33%	383	383	383	383	383	383	383
8.00%	575	575	575	575	575	575	575
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물					1,166
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,166	-1,166	-1,166	-1,166	-1,166	-1,166	-1,166
-5.33%	-778	-778	-778	-778	-778	-778	-778
-2.67%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	389	389	389	389	389	389	389
5.33%	778	778	778	778	778	778	778
8.00%	1,166	1,166	1,166	1,166	1,166	1,166	1,166
KR4B0169A444 코스피200 C 202609 1107.5							2,089

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,053	-2,055	-2,058	-2,063	-2,070	-2,078	-2,089
-5.33%	-1,212	-1,223	-1,236	-1,253	-1,272	-1,293	-1,317
-2.67%	-442	-472	-505	-540	-575	-612	-650
0%	135	90	45	0	-45	-90	-135
2.67%	441	406	370	331	292	252	212
5.33%	546	531	512	491	467	440	412
8.00%	568	565	559	550	539	526	510

KR4B0169A451 코스피200 C 202609 1110.0							1,407
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,385	-1,386	-1,388	-1,391	-1,395	-1,400	-1,407
-5.33%	-825	-832	-840	-850	-862	-875	-890
-2.67%	-307	-327	-347	-369	-392	-416	-441
0%	89	60	30	0	-30	-60	-90
2.67%	307	283	258	232	205	178	150
5.33%	385	374	361	346	329	310	290
8.00%	403	400	395	389	381	371	360

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

(단위:백만원)

12,643

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

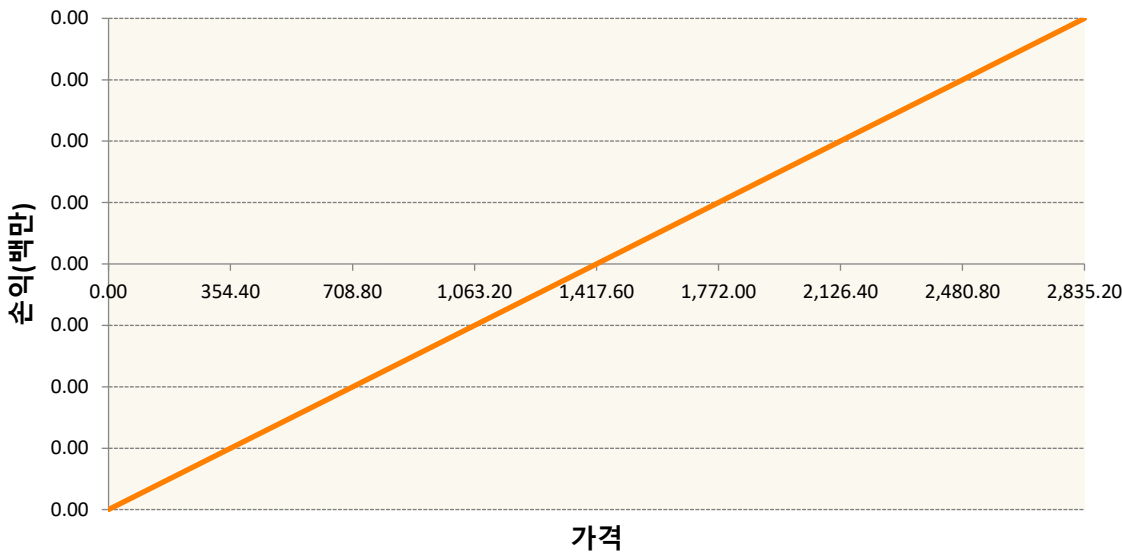
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	652	0	652	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A06690007-2026-09 코스닥150선물



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

공시일 2026-09-08

기준일 2026-09-07

SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

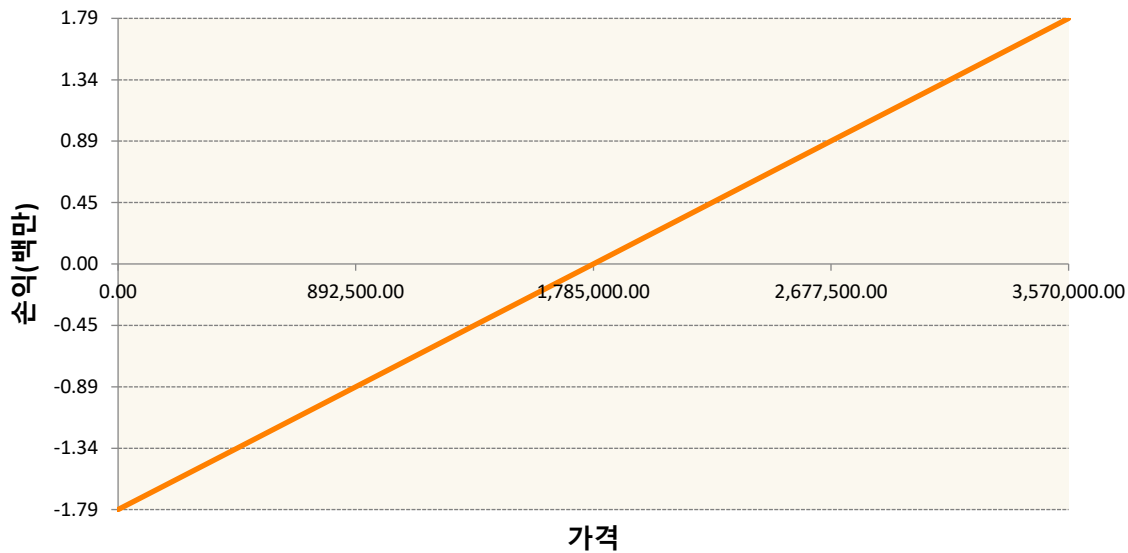
1. 계약금액

(단위:백만원)

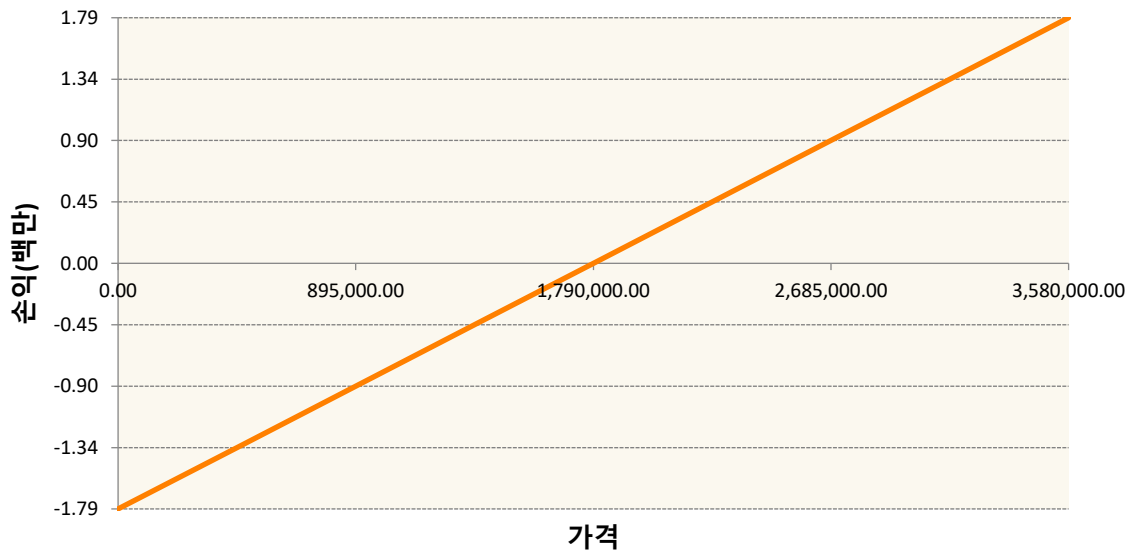
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	11,854	9,249	2,605	장내
누계	유가증권	선물	46,783	0	46,783	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A50690002-2026-09 SK하이닉스개별선물



KR4A506A0003-2026-10 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A50690002			2026-09 SK하이닉스개별선물				2,783
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,783	-2,783	-2,783	-2,783	-2,783	-2,783	-2,783
-5.33%	-1,855	-1,855	-1,855	-1,855	-1,855	-1,855	-1,855
-2.67%	-928	-928	-928	-928	-928	-928	-928
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	928	928	928	928	928	928	928
5.33%	1,855	1,855	1,855	1,855	1,855	1,855	1,855
8.00%	2,783	2,783	2,783	2,783	2,783	2,783	2,783
KR4A506A0003			2026-10 SK하이닉스개별선물				953
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-953	-953	-953	-953	-953	-953	-953
-5.33%	-635	-635	-635	-635	-635	-635	-635
-2.67%	-318	-318	-318	-318	-318	-318	-318
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	318	318	318	318	318	318	318
5.33%	635	635	635	635	635	635	635
8.00%	953	953	953	953	953	953	953

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

17,575

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

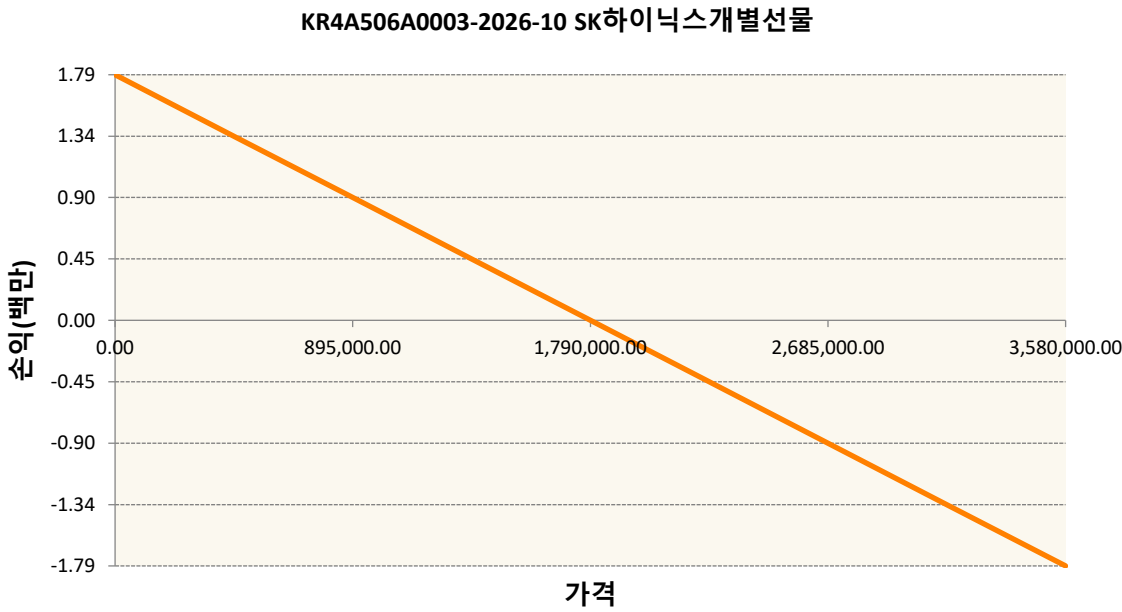
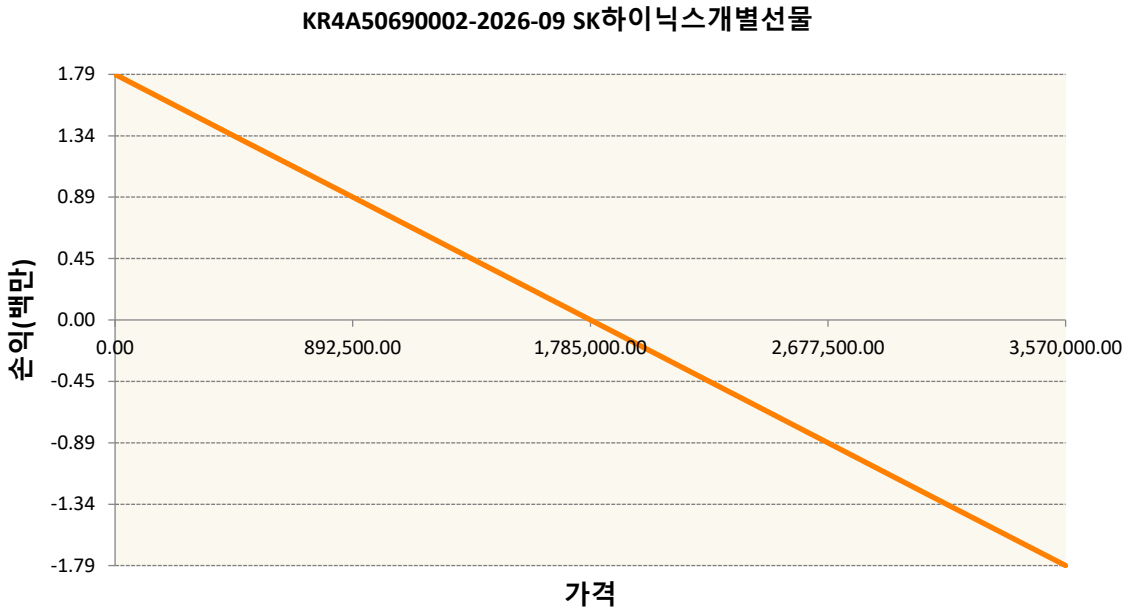
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	67,054	29,864	37,190	장내
누계	유가증권	선물	0	116,109	-116,109	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A50690002		2026-09 SK하이닉스개별선물					6,871
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6,871	6,871	6,871	6,871	6,871	6,871	6,871
-5.33%	4,581	4,581	4,581	4,581	4,581	4,581	4,581
-2.67%	2,290	2,290	2,290	2,290	2,290	2,290	2,290
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2,290	-2,290	-2,290	-2,290	-2,290	-2,290	-2,290
5.33%	-4,581	-4,581	-4,581	-4,581	-4,581	-4,581	-4,581
8.00%	-6,871	-6,871	-6,871	-6,871	-6,871	-6,871	-6,871
KR4A506A0003		2026-10 SK하이닉스개별선물					2,401
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,401	2,401	2,401	2,401	2,401	2,401	2,401
-5.33%	1,600	1,600	1,600	1,600	1,600	1,600	1,600
-2.67%	800	800	800	800	800	800	800
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-800	-800	-800	-800	-800	-800	-800
5.33%	-1,600	-1,600	-1,600	-1,600	-1,600	-1,600	-1,600
8.00%	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401	-2,401

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

43,620

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

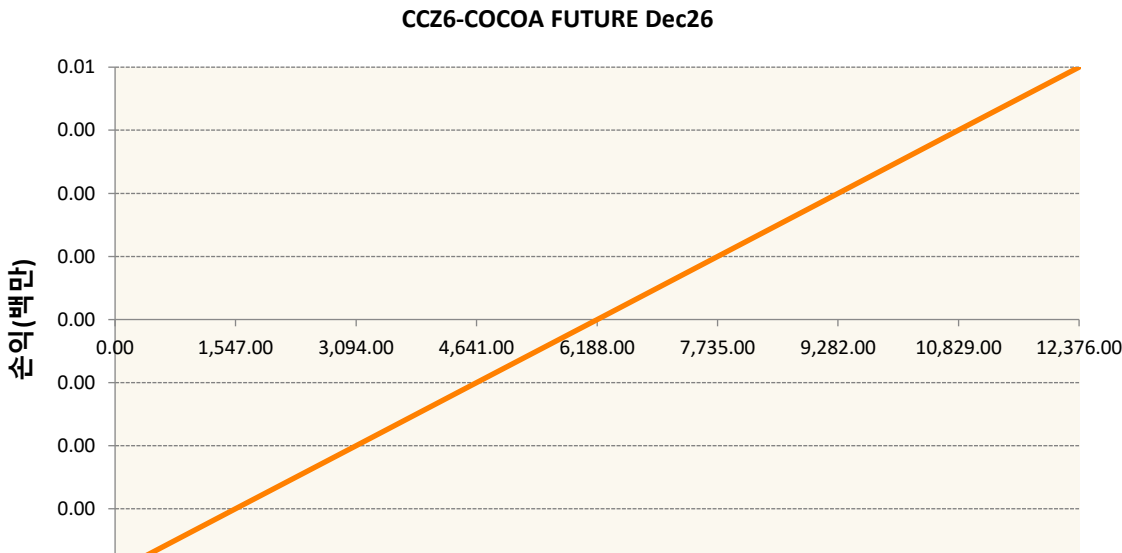
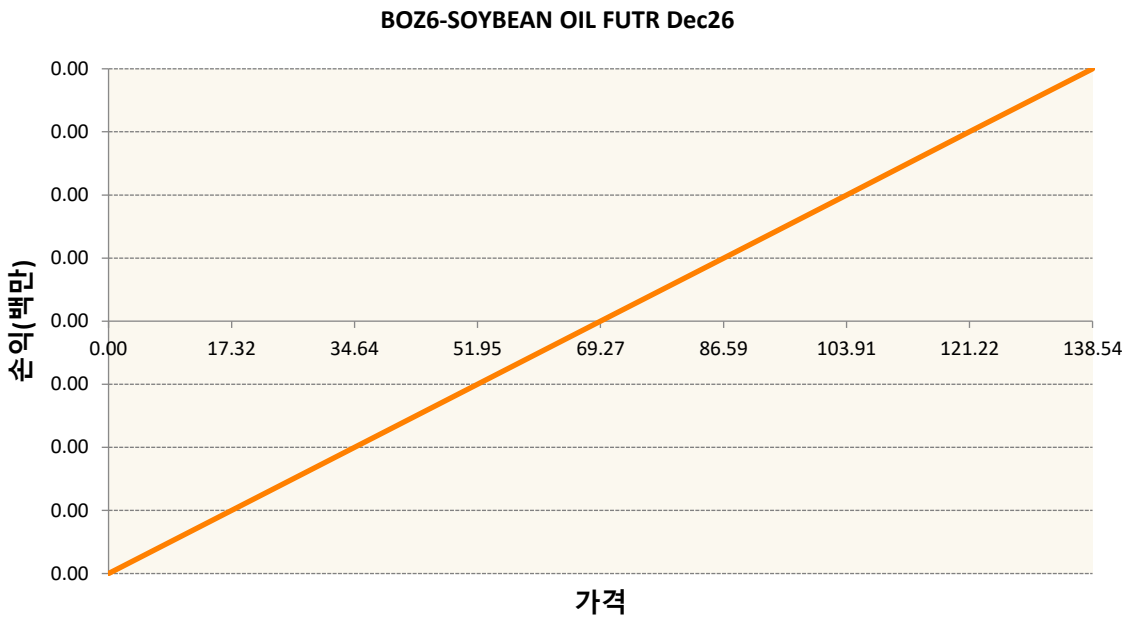
포커스농산물모(채권-파생형)

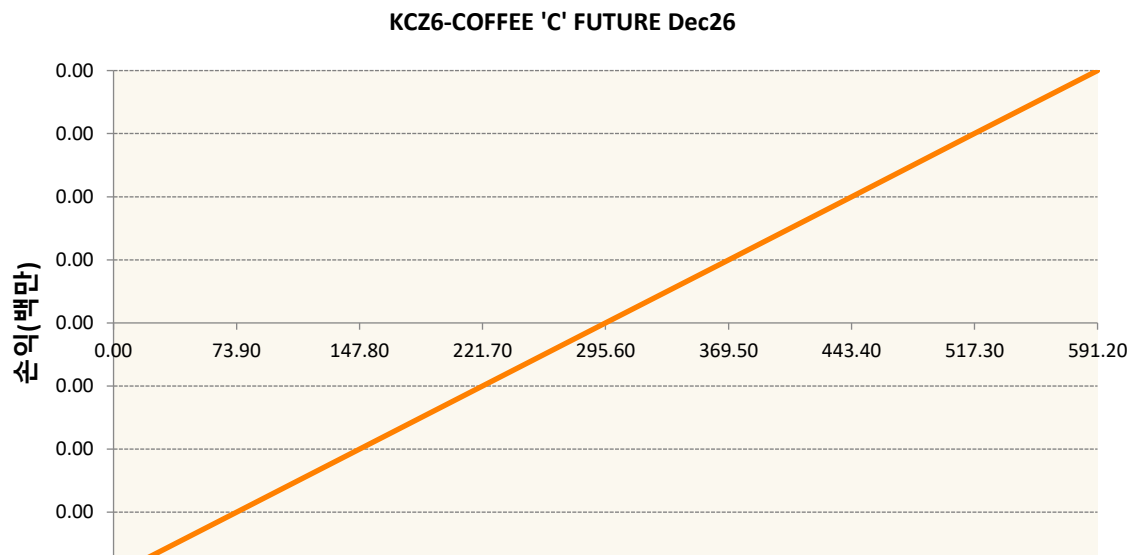
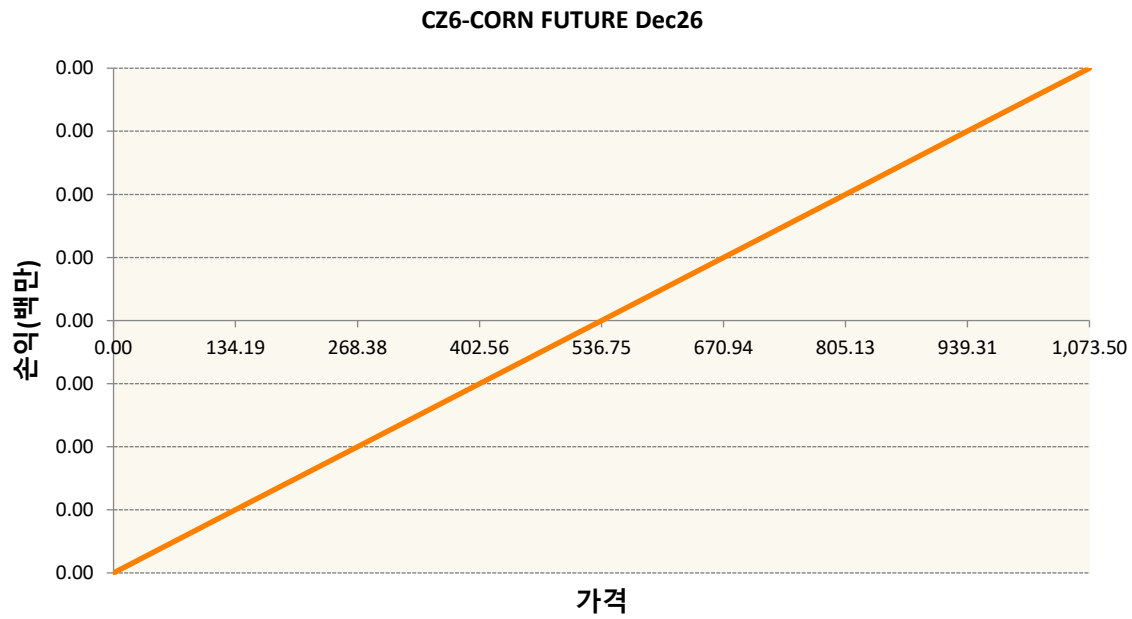
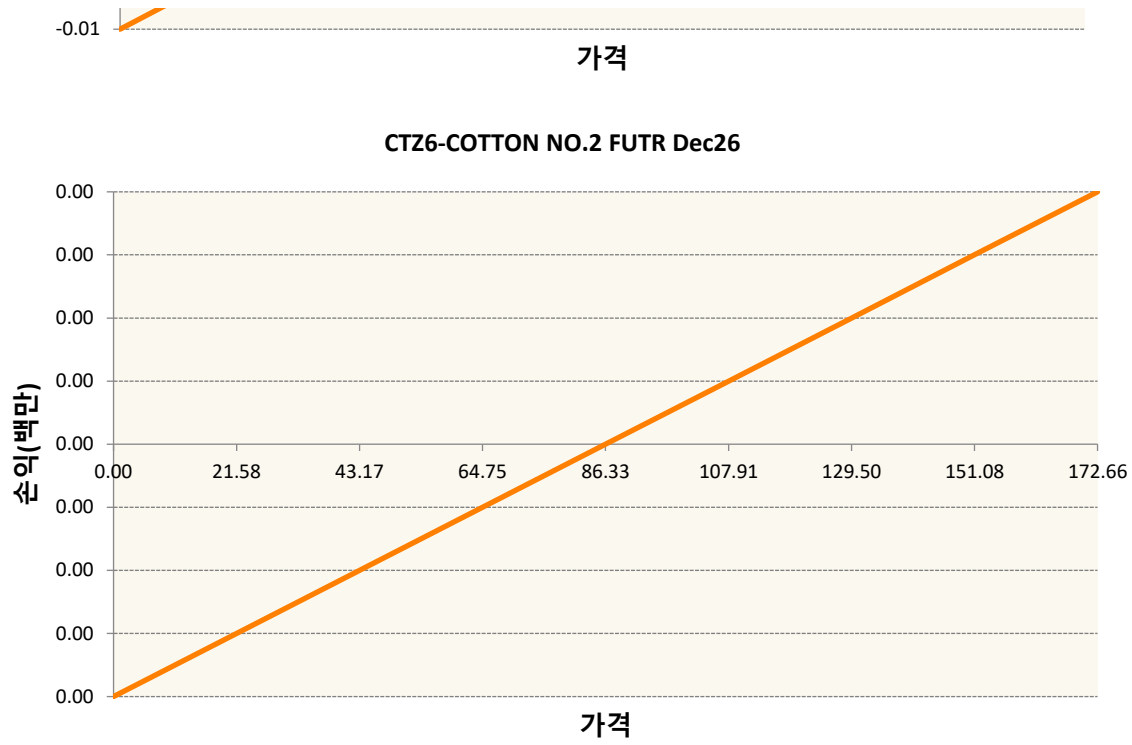
1. 계약금액

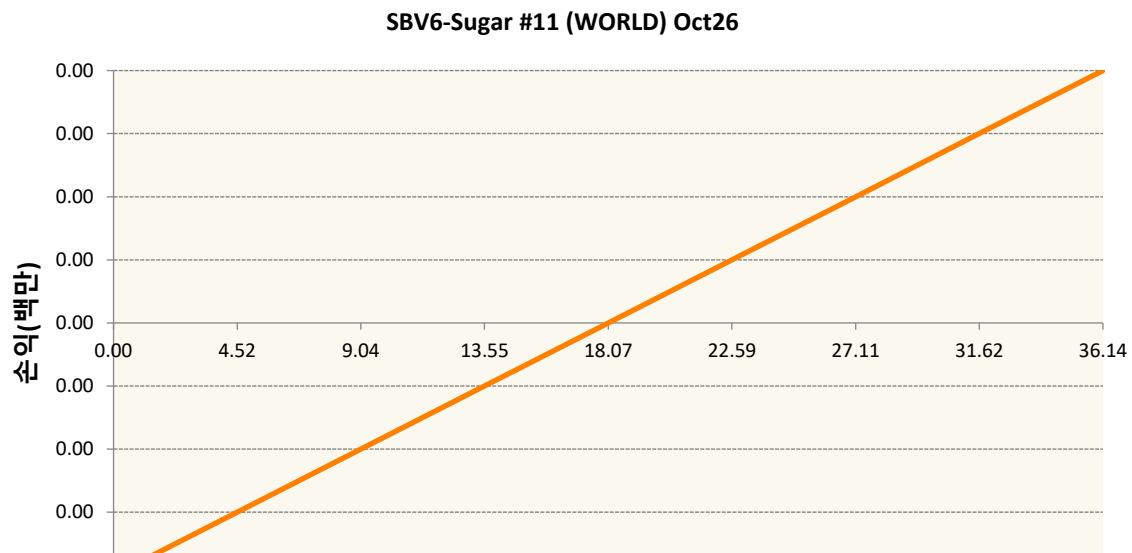
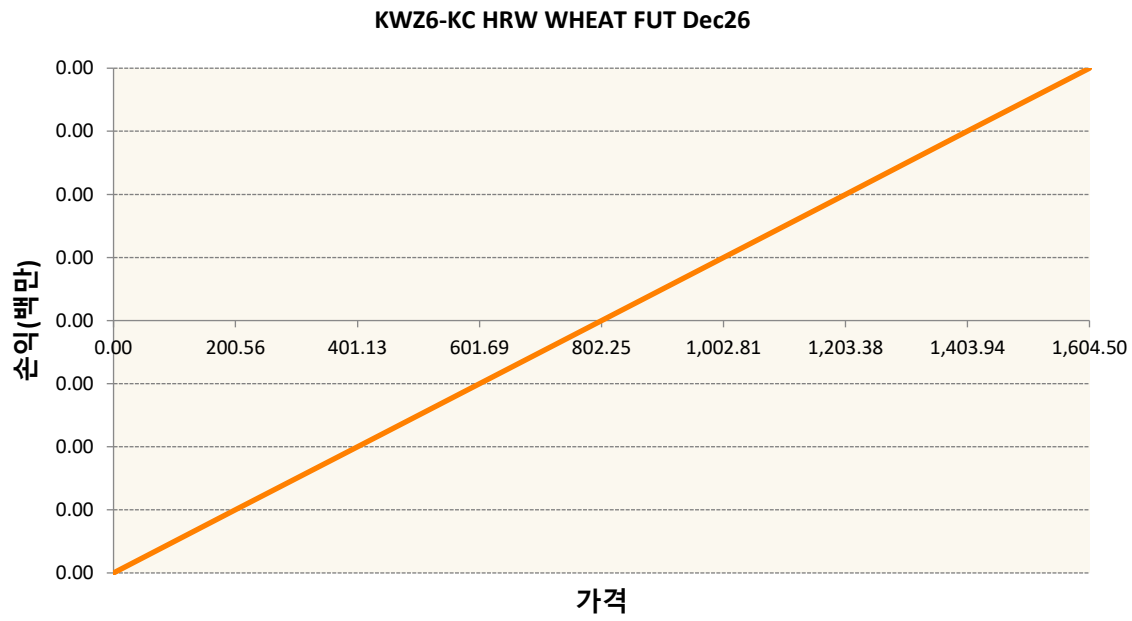
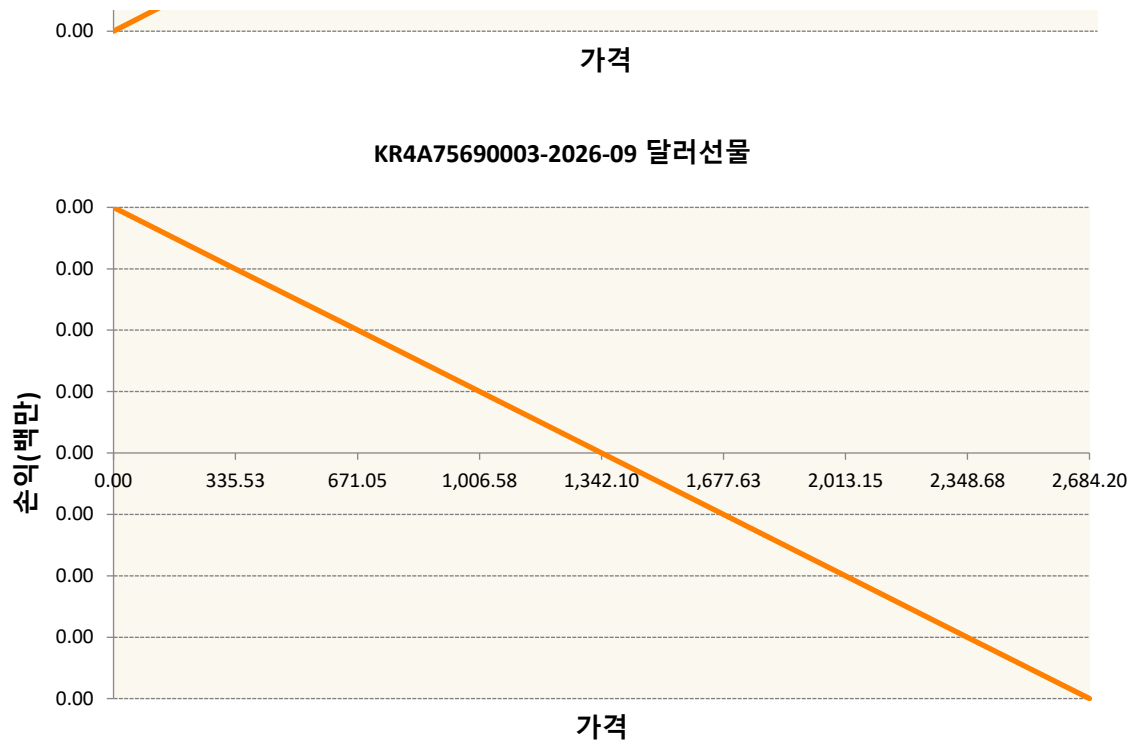
(단위:USD 백만)

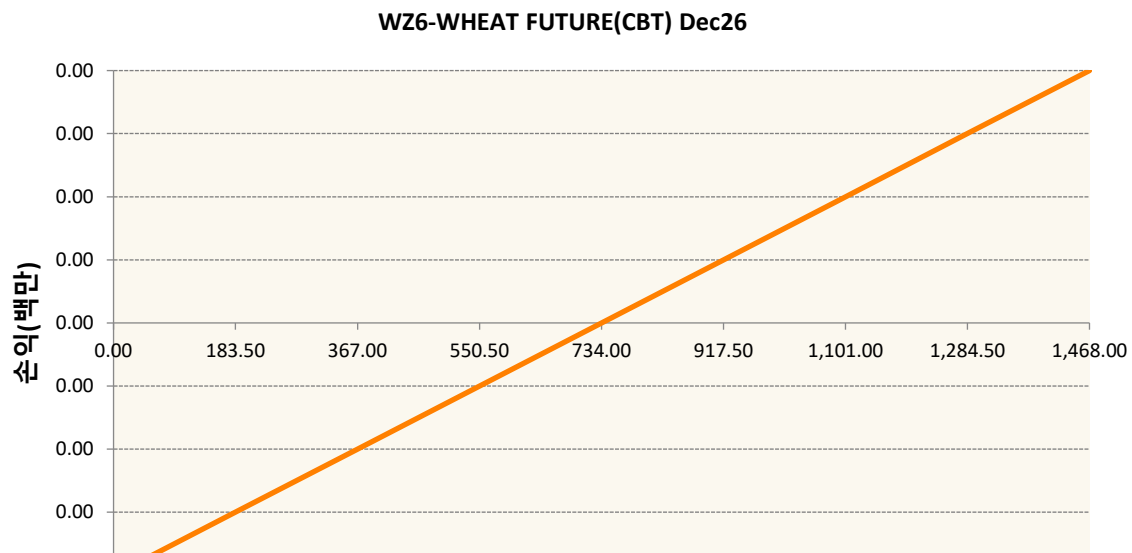
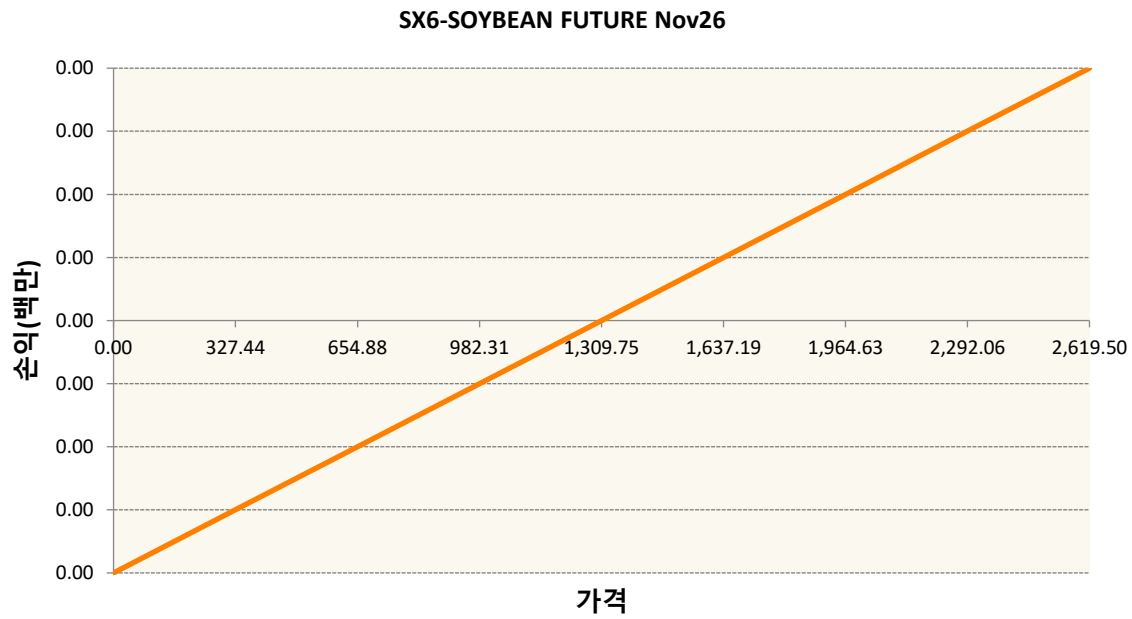
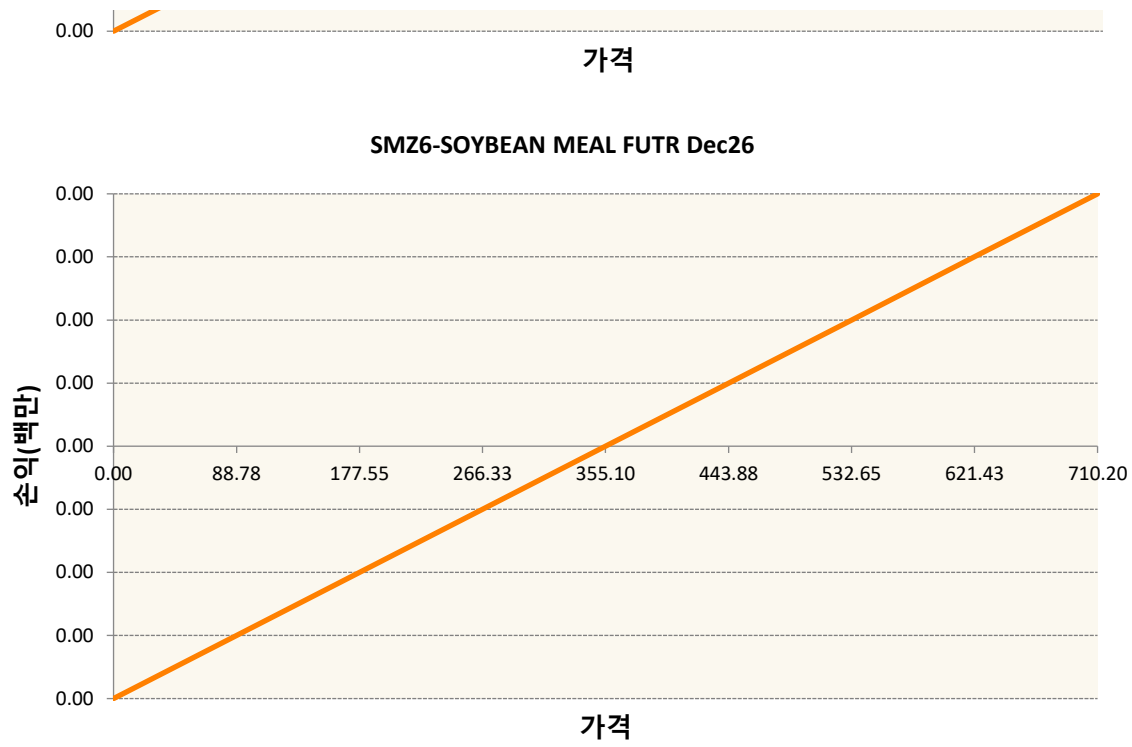
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	464	0	464	
누계	유가증권	선물	2,498	0	2,498	
누계	통화	선물	0	336	-336	장내

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	2026-09-08
기준일	2026-09-07

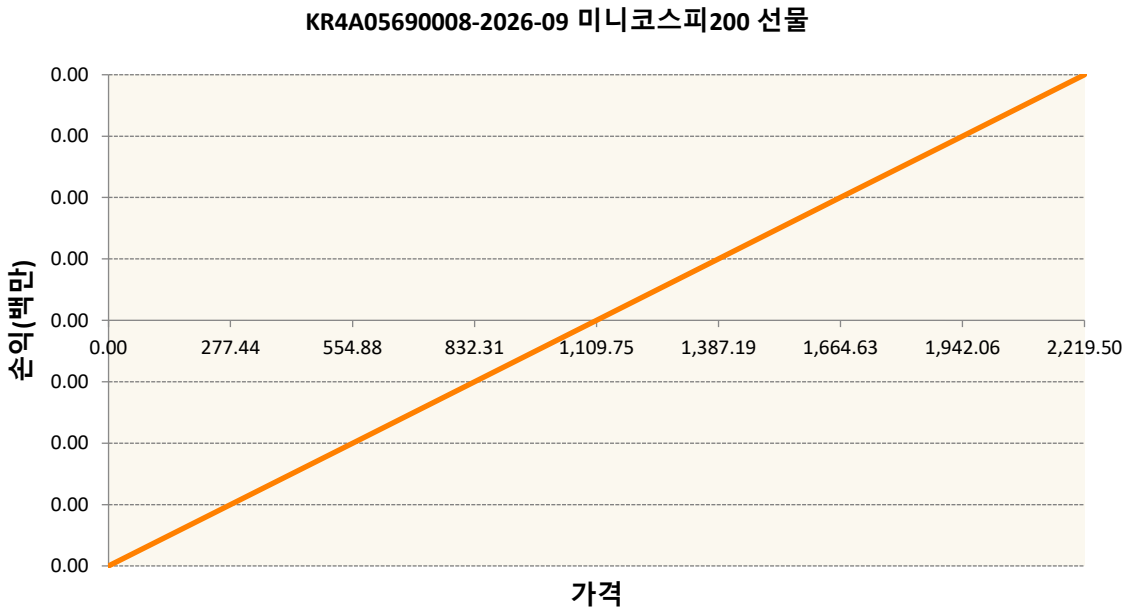
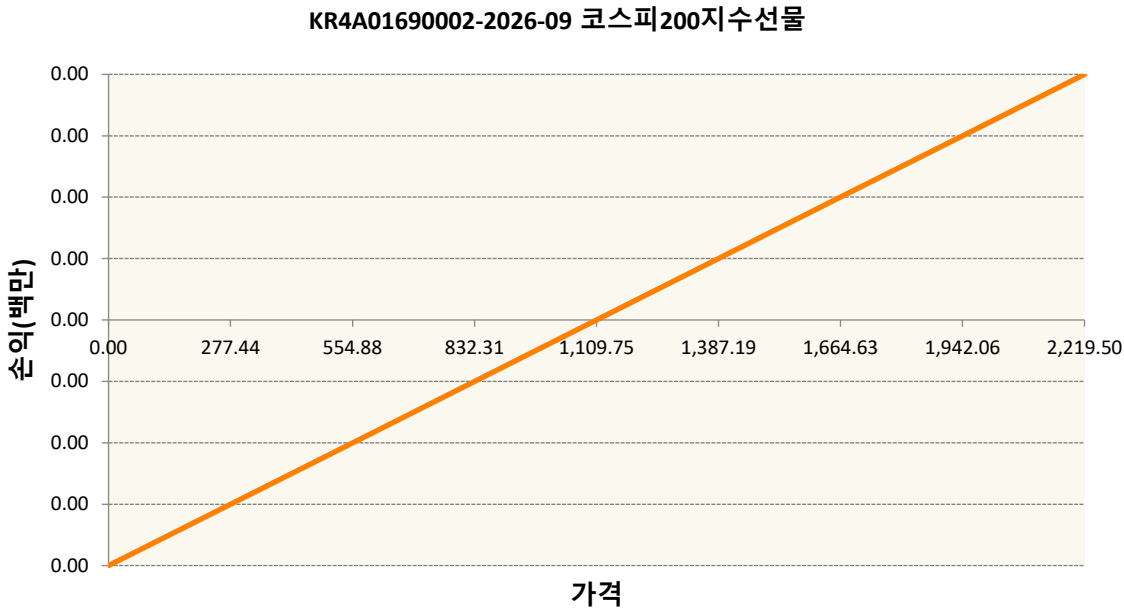
스마트인덱스모

1. 계약금액

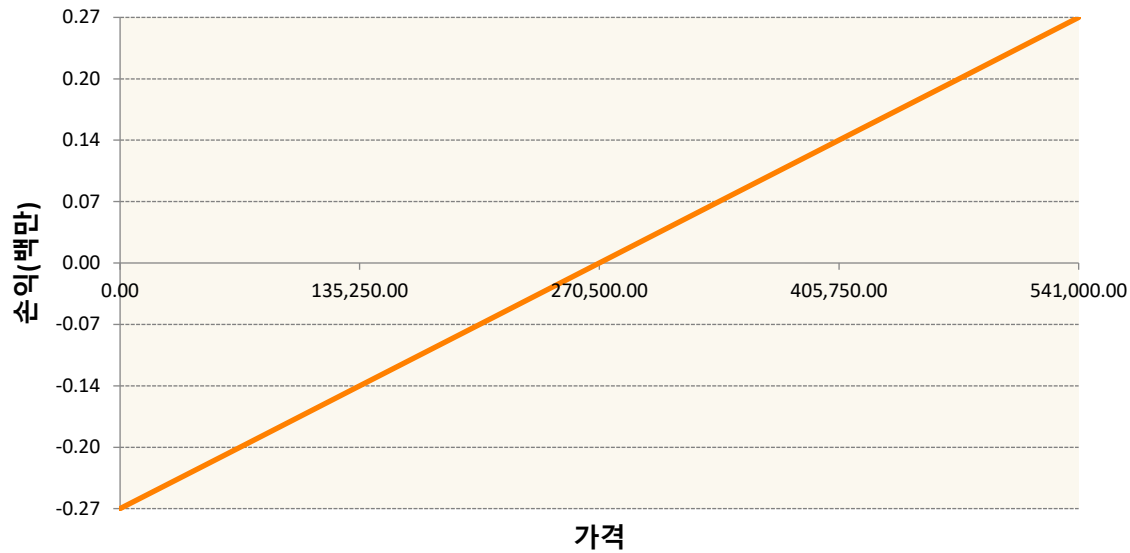
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	71	583	-512	장내
누계	유가증권	선물	4,300	0	4,300	장내

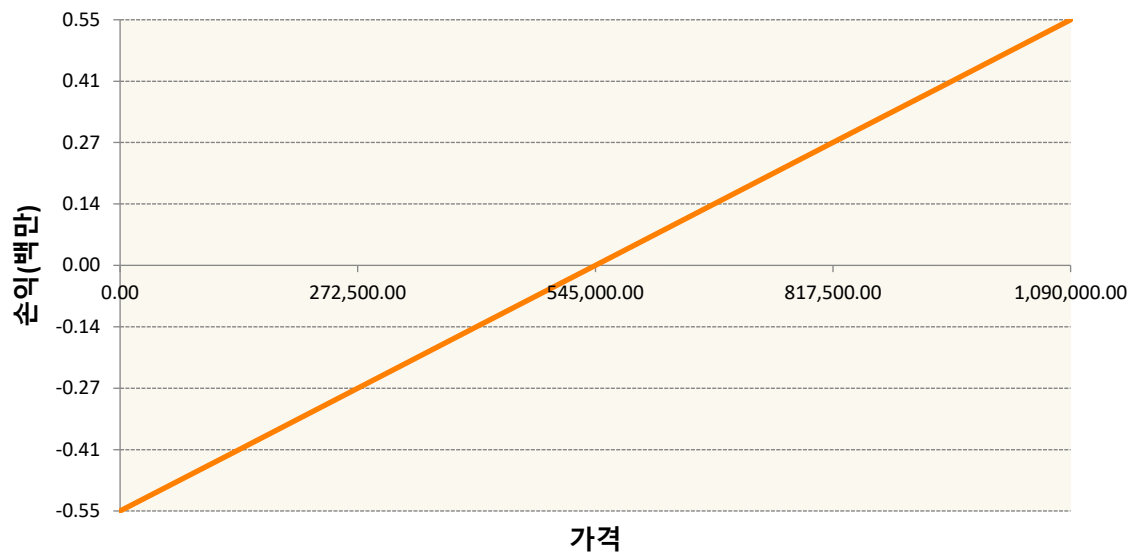
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11690000-2026-09 삼성전자개별선물



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					243
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	81	81	81	81	81	81	81
5.33%	162	162	162	162	162	162	162
8.00%	243	243	243	243	243	243	243
KR4A05690008		2026-09 미니코스피200 선물					18
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-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%	18	18	18	18	18	18	18
KR4A11690000 2026-09 삼성전자개별선물							5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-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%	5	5	5	5	5	5	5

KR4A226A0002 2026-10 삼성SDI개별선물							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

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

(단위:백만원)

914

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

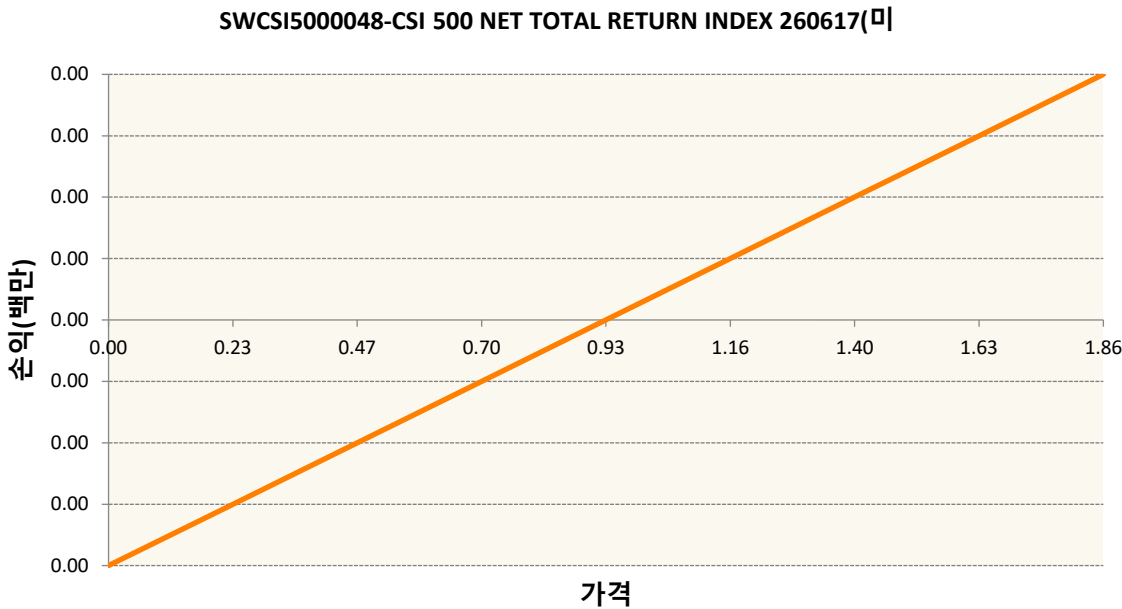
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

432

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

686

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

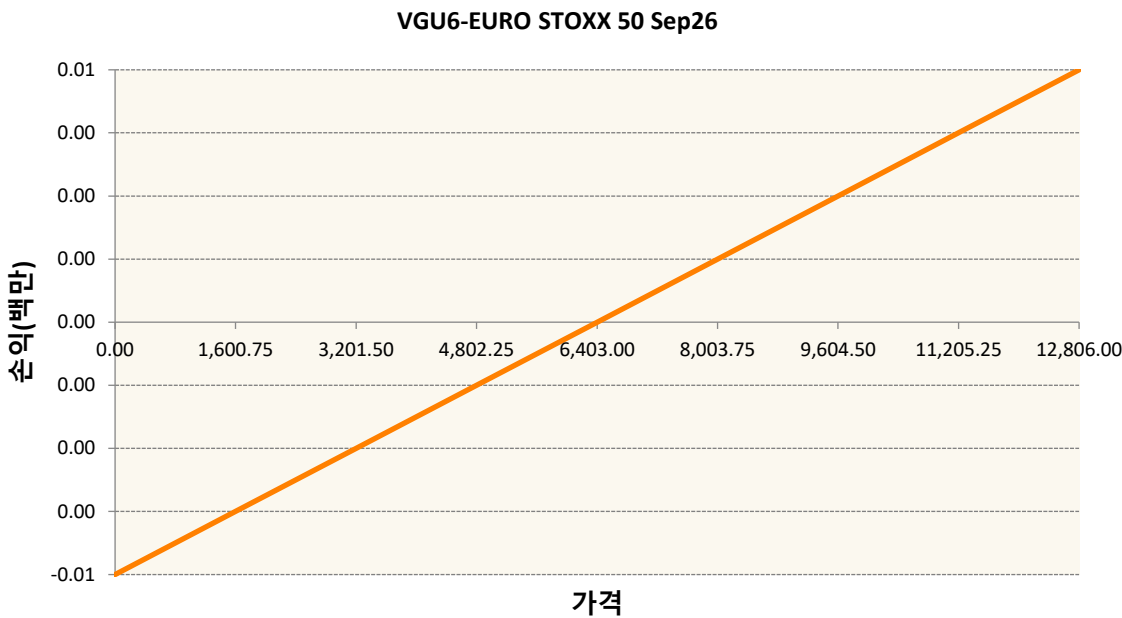
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,218	0	1,218	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

76

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

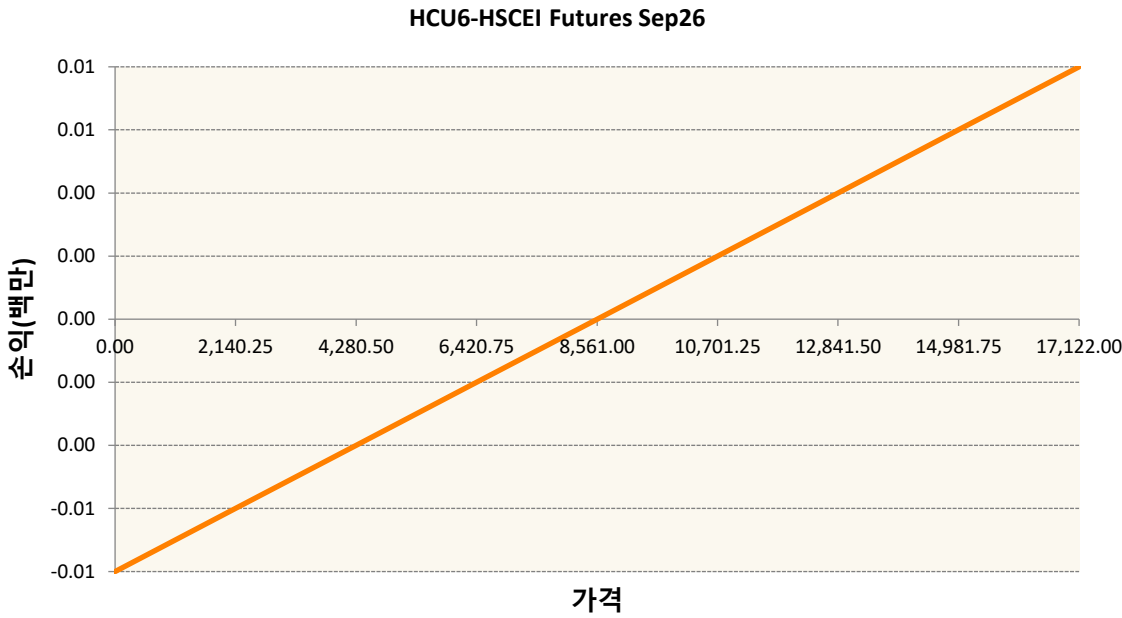
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,498	0	1,498	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	120
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

114

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

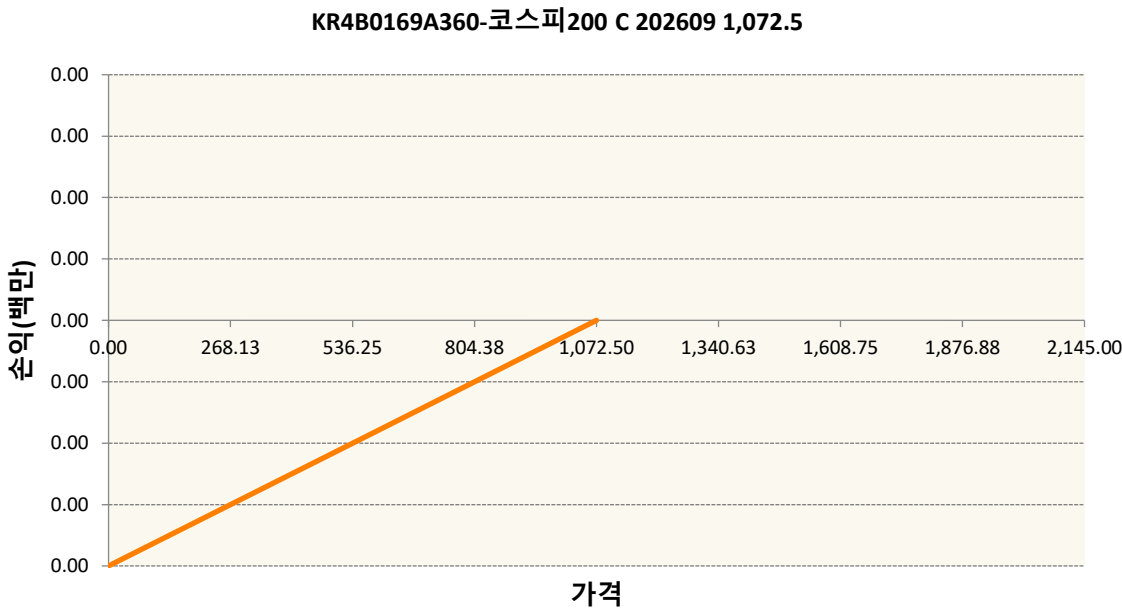
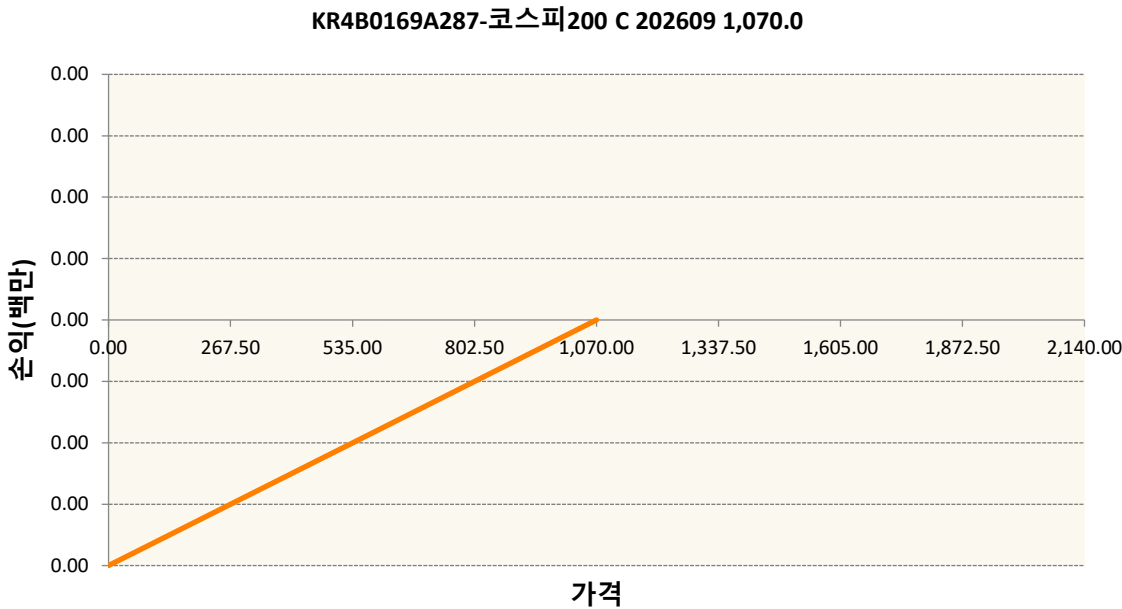
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

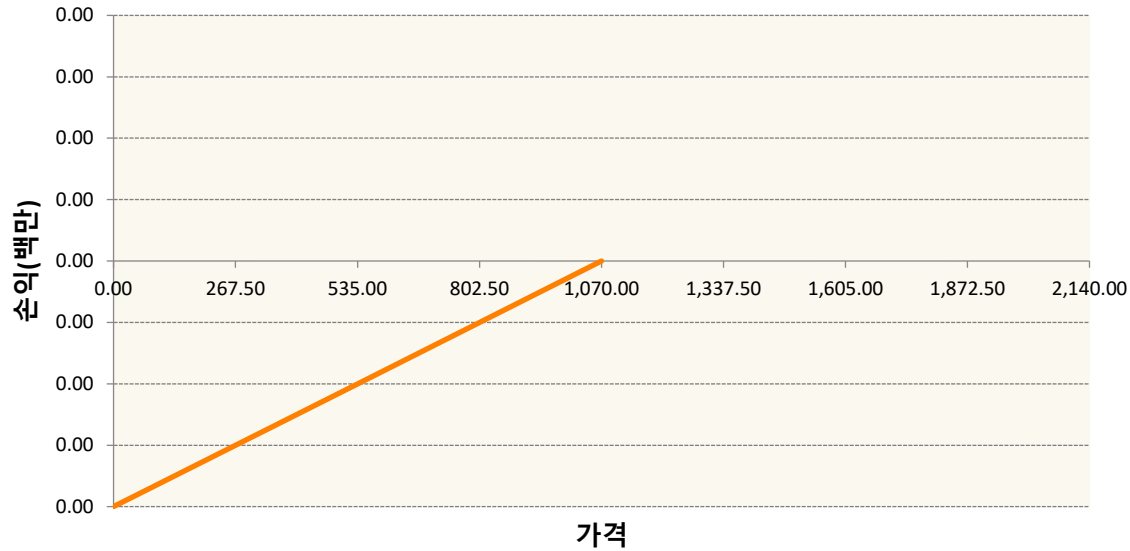
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	43,382	-43,382	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0169A285-코스피200 P 202609 1,070.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0169A287 코스피200 C 202609 1,070.0								716
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-659	-665	-673	-682	-693	-704	-716	
-5.33%	-309	-326	-343	-360	-378	-396	-415	
-2.67%	-69	-89	-109	-130	-151	-171	-192	
0%	43	29	15	0	-16	-33	-50	
2.67%	74	70	64	56	47	38	27	
5.33%	79	79	77	74	71	67	61	
8.00%	80	80	80	79	78	76	74	
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5								1,006
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-932	-940	-950	-962	-975	-990	-1,006	
-5.33%	-447	-468	-491	-514	-538	-562	-587	
-2.67%	-104	-132	-160	-188	-216	-245	-273	
0%	61	42	22	0	-23	-46	-70	
2.67%	110	103	94	83	71	56	41	
5.33%	119	118	115	111	106	100	92	
8.00%	120	120	119	118	117	115	111	
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0								417
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-383	-387	-392	-397	-403	-410	-417	
-5.33%	-180	-189	-199	-210	-220	-231	-241	
-2.67%	-40	-52	-64	-76	-88	-100	-112	
0%	25	17	9	0	-9	-19	-29	

2.67%	43	40	37	33	28	22	15
5.33%	46	46	45	43	41	39	36
8.00%	47	46	46	46	45	44	43

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

(단위:백만원)

2,720

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

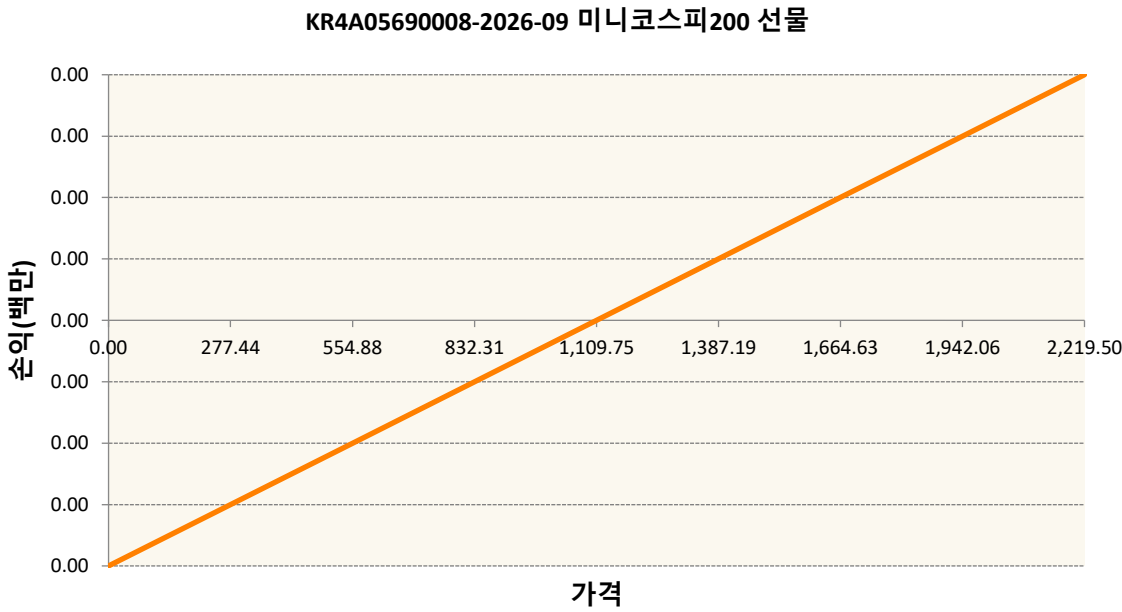
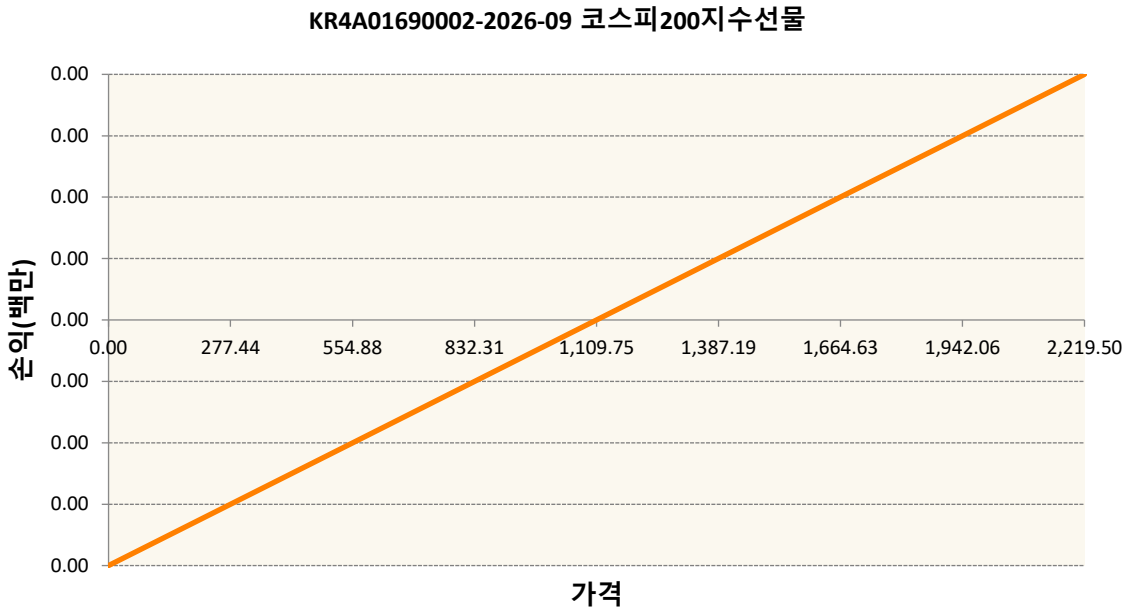
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

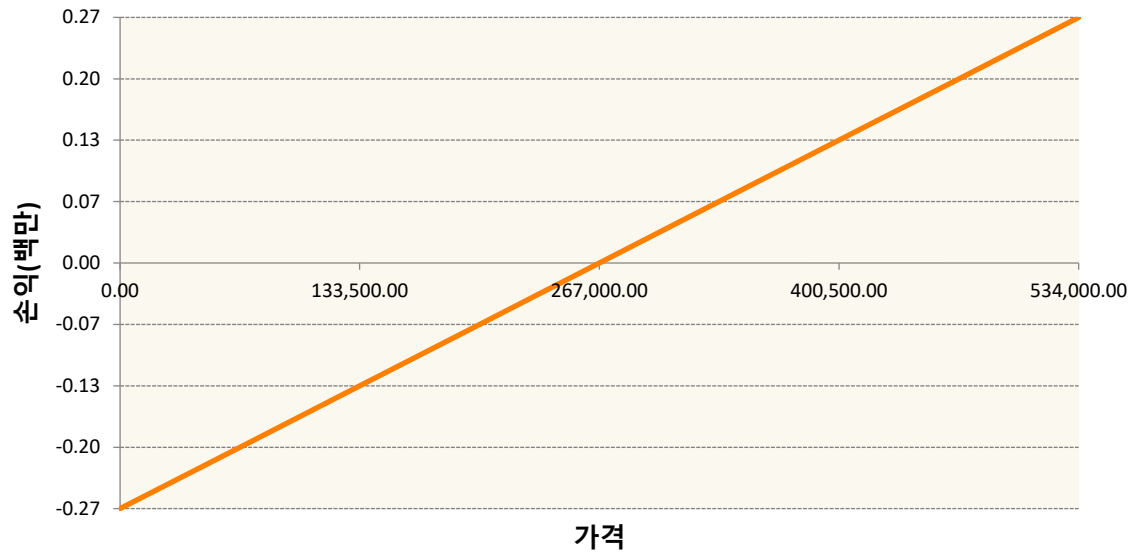
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	55	273	-218	장내
누계	유가증권	선물	1,775	0	1,775	장내

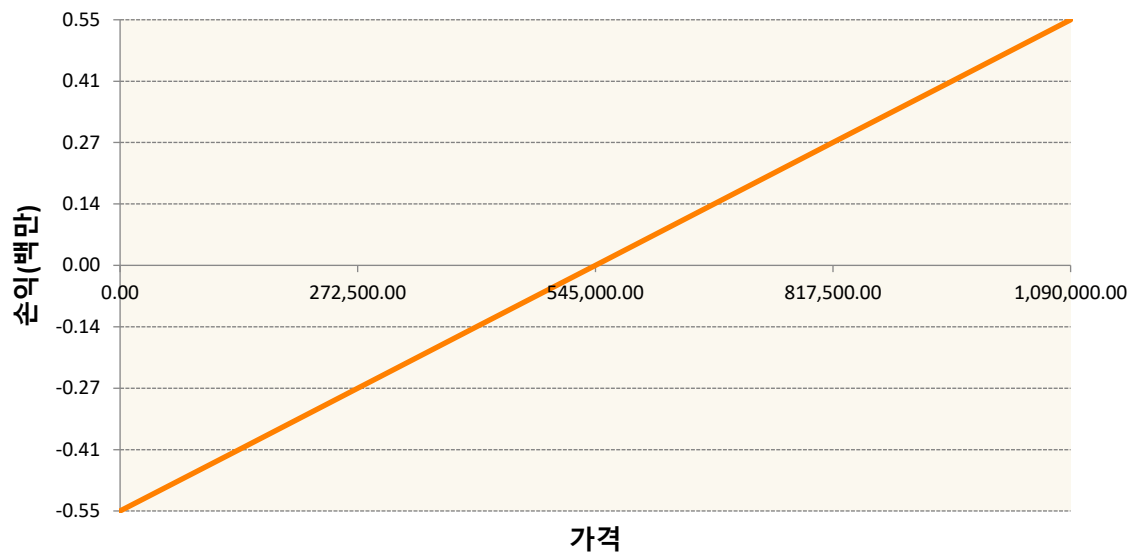
2. 만기시점의 손익구조



KR4A116A0005-2026-10 삼성전자개별선물



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					66
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	66	66	66	66	66	66	66
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 5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-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%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4A226A0002 2026-10 삼성SDI개별선물 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)

296

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

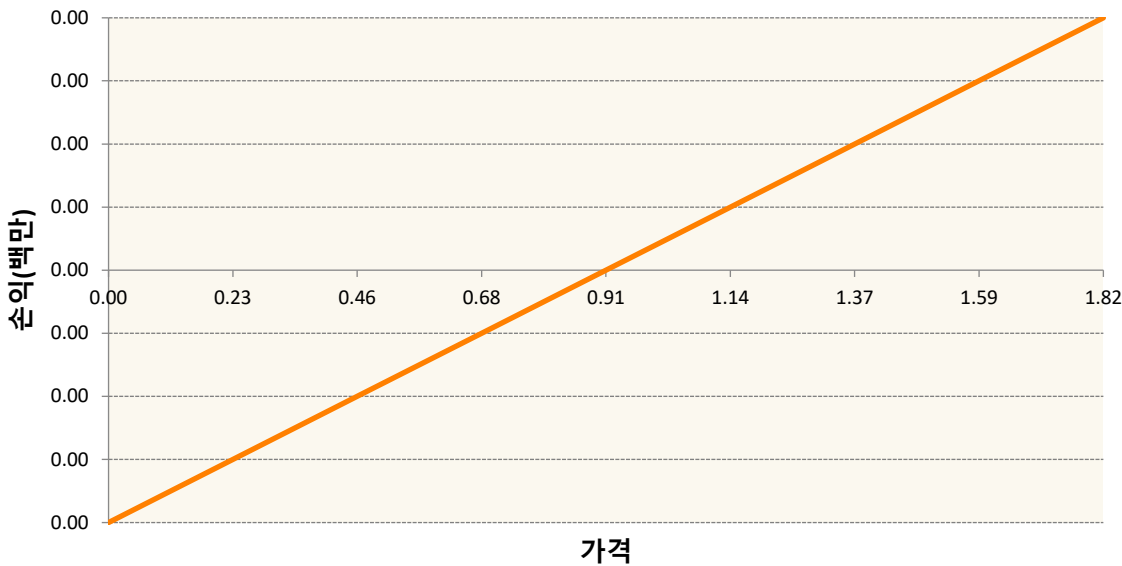
1. 계약금액

(단위:백만원)

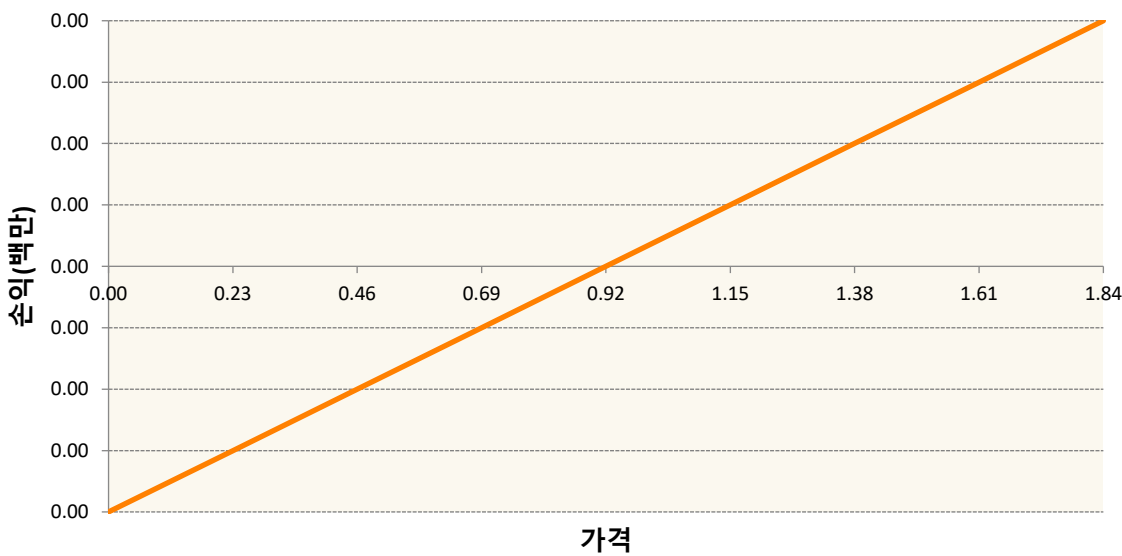
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,923	0	6,923	장외

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(		441
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		111

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		585

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

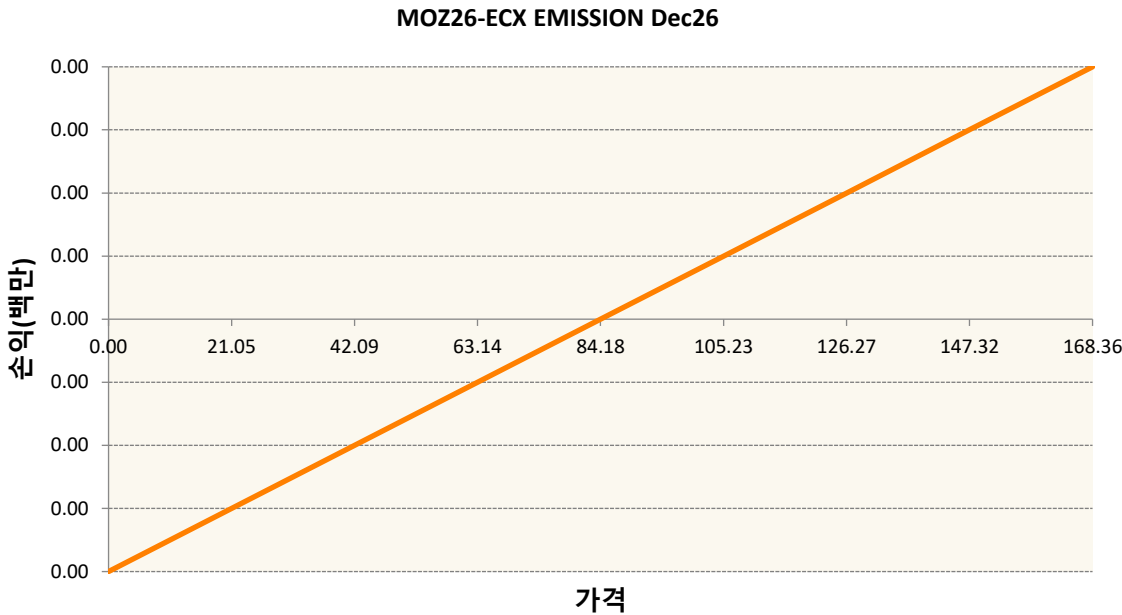
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,437	0	5,437	
누계	통화	선도	0	2,585	-2,585	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E	207
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	435

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

(단위:백만원)

683

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

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	-2,327	0	-2,327	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	76
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	34
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	31
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	45

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

(단위:백만원)

298

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

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	-6,626	0	-6,626	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	66
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	235
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	224

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

(단위:백만원)

993

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

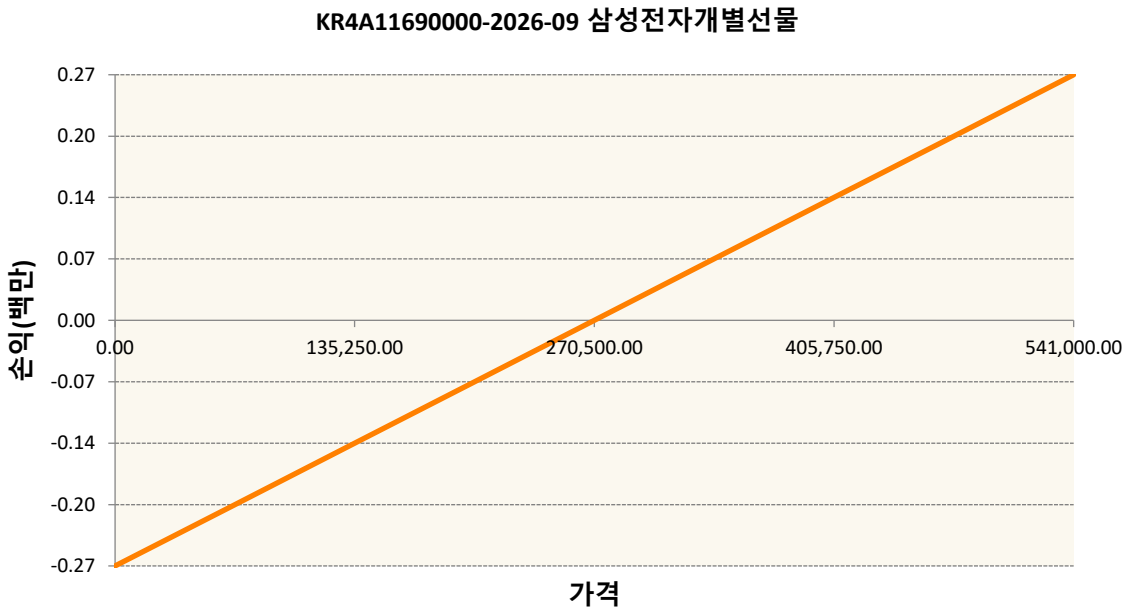
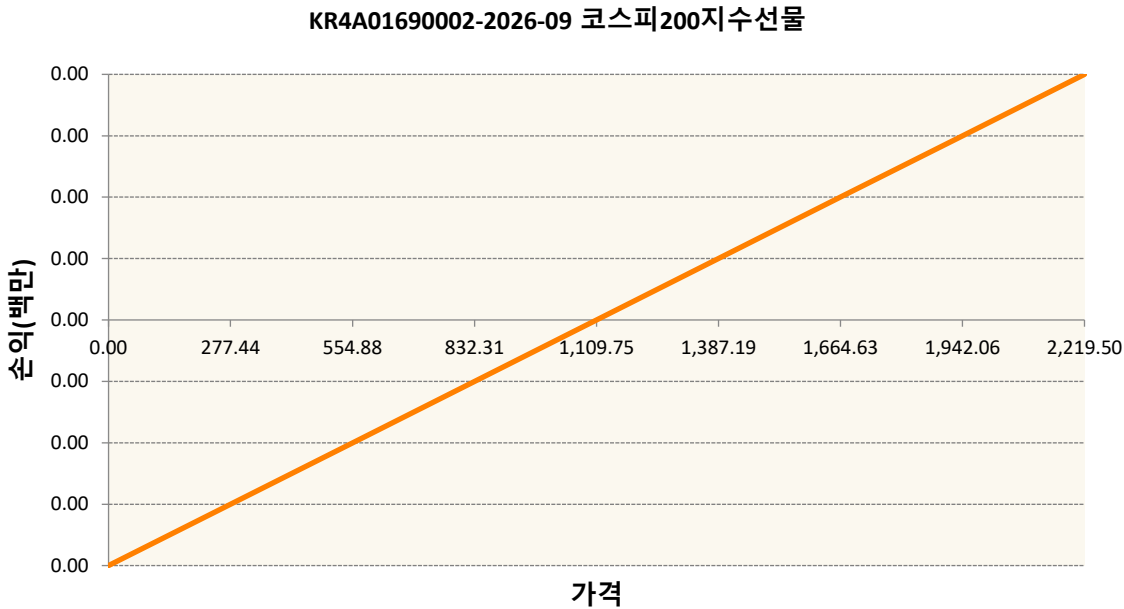
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

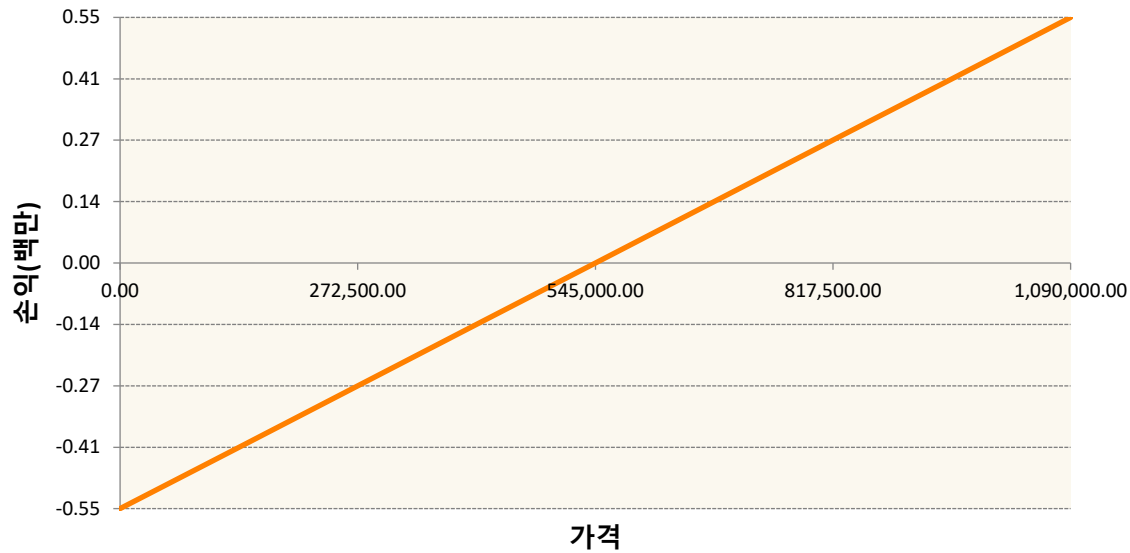
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	821	2,483	-1,662	장내
누계	유가증권	선물	19,259	0	19,259	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물						1,194
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	
-5.33%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796	
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	398	398	398	398	398	398	398	
5.33%	796	796	796	796	796	796	796	
8.00%	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	
KR4A11690000		2026-09 삼성전자개별선물						276
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-276	-276	-276	-276	-276	-276	-276	
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184	
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	92	92	92	92	92	92	92	
5.33%	184	184	184	184	184	184	184	
8.00%	276	276	276	276	276	276	276	
KR4A226A0002		2026-10 삼성SDI개별선물						65
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
0%	0	0	0	0	0	0	0	

2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	65	65	65	65	65	65	65

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

(단위:백만원)

5,295

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

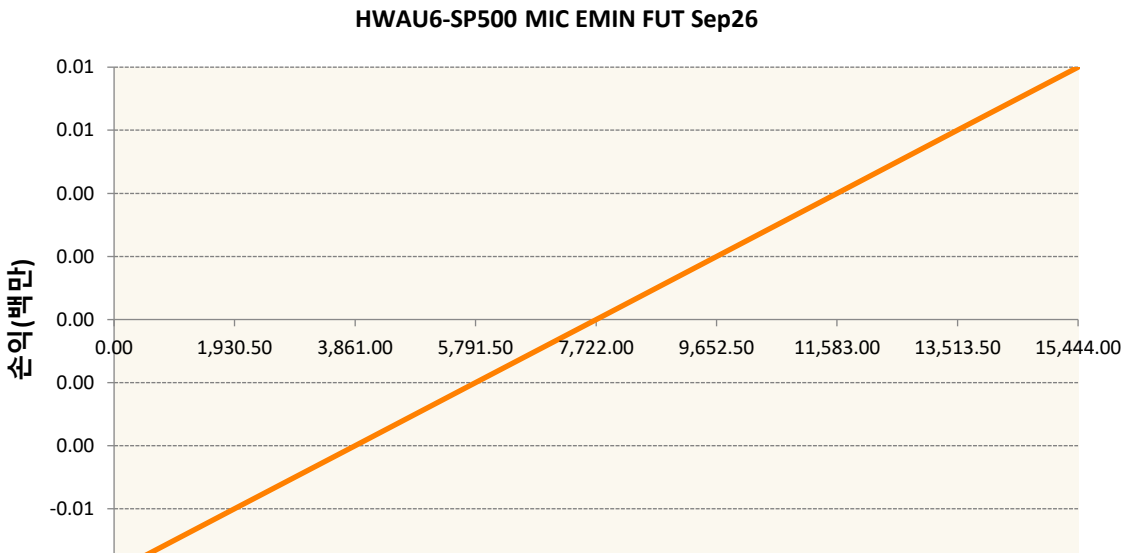
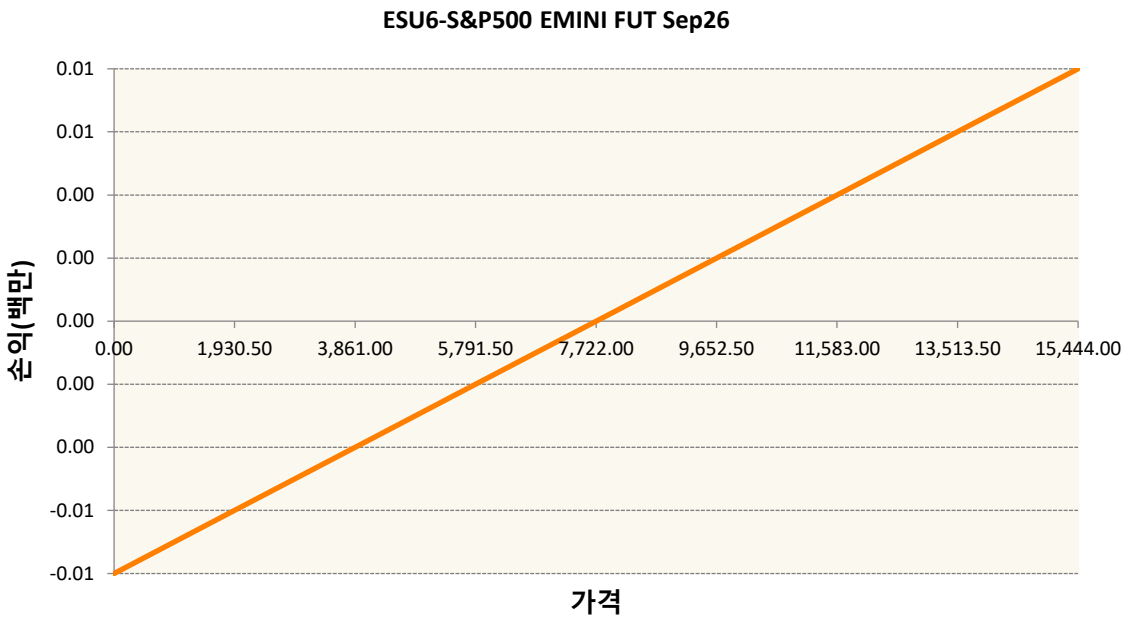
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

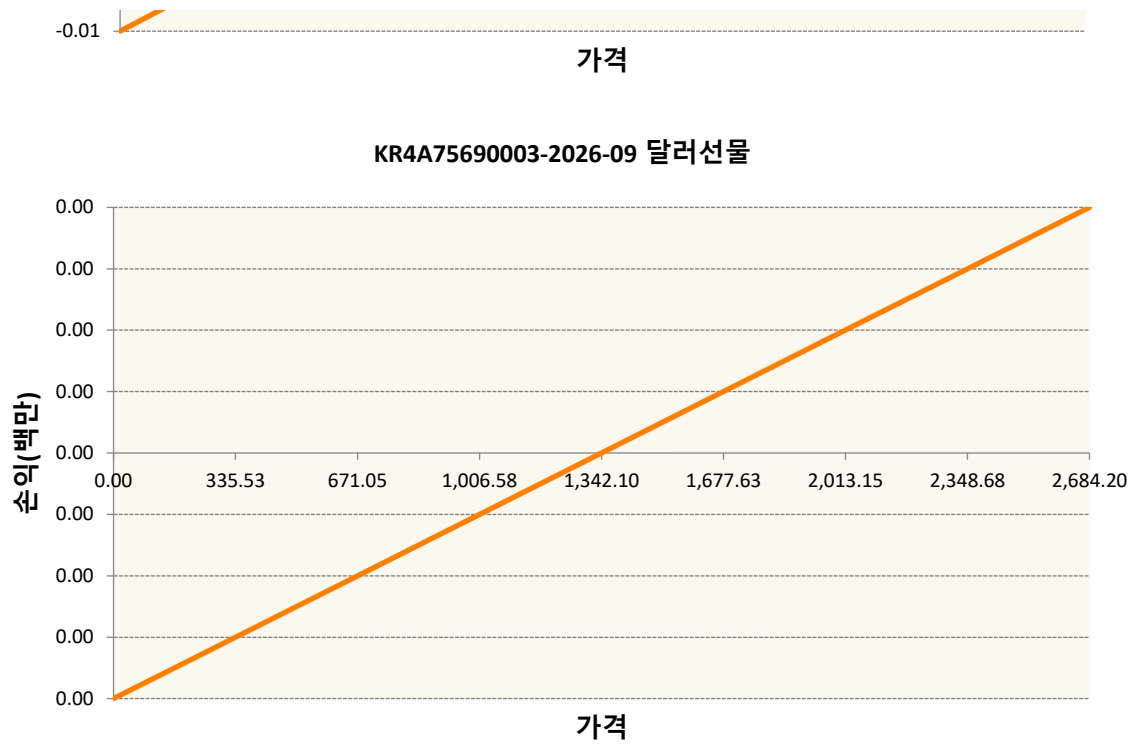
1. 계약금액

(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	76,908	0	76,908	
누계	지수	선물	177	0	177	장내
누계	통화	선물	8,858	0	8,858	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	6,153
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	14
KR4A756900	2026-09 달러선물	709

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

5,080

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

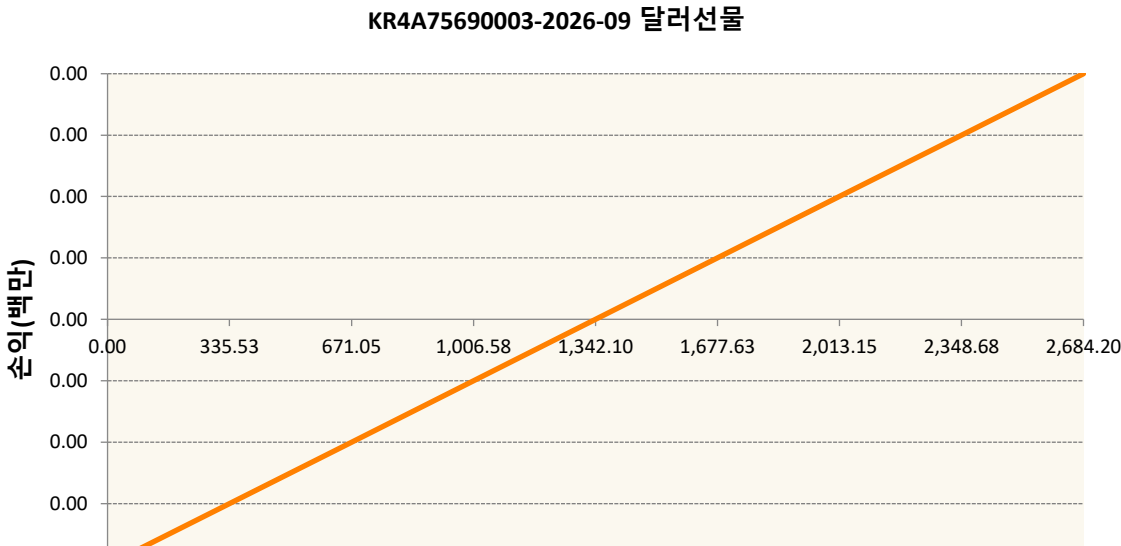
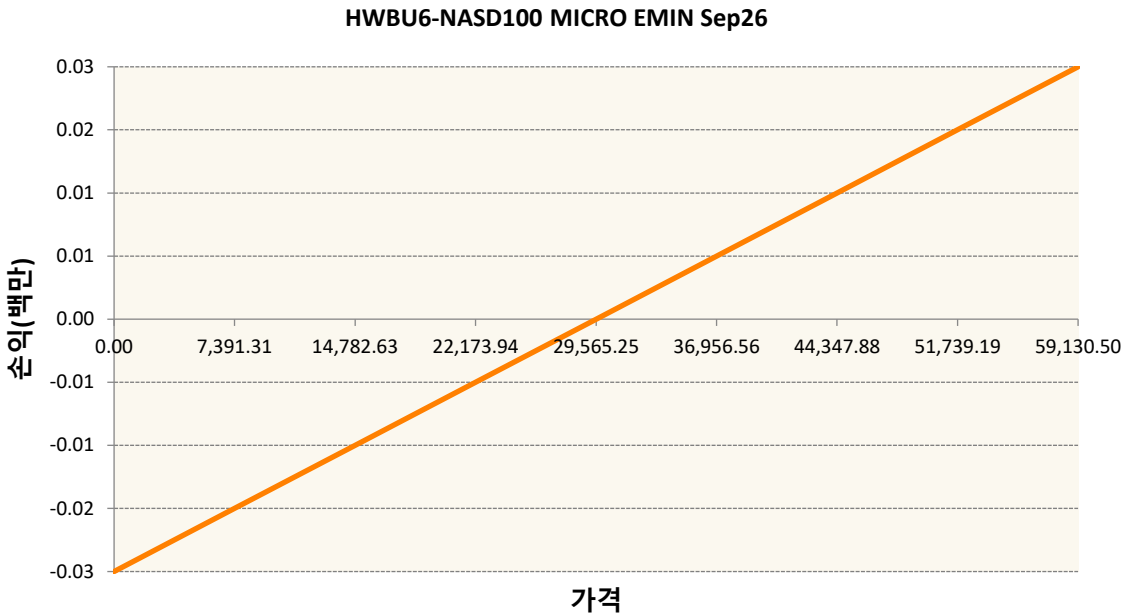
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

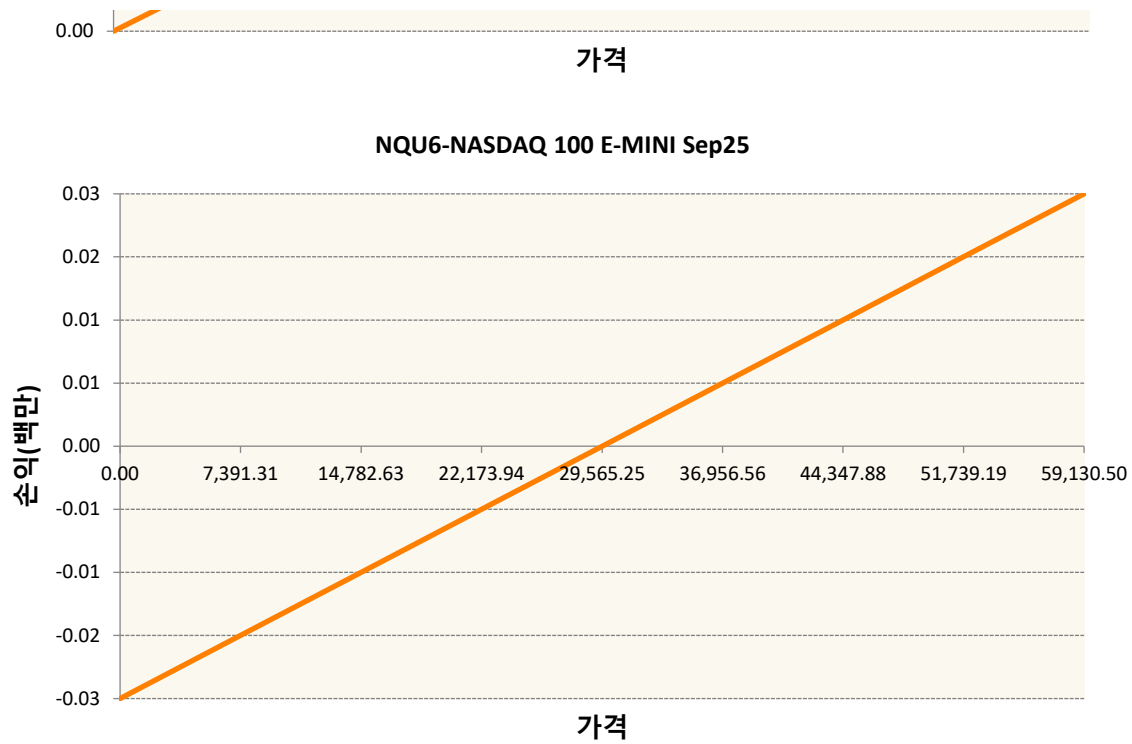
1. 계약금액

(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	1,365	0	1,365	장내
누계	지수	선물	36,545	0	36,545	
누계	통화	선물	4,040	0	4,040	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		109
KR4A756900	2026-09 달러선물		323
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,924

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,299

공시일	2026-09-08
기준일	2026-09-07

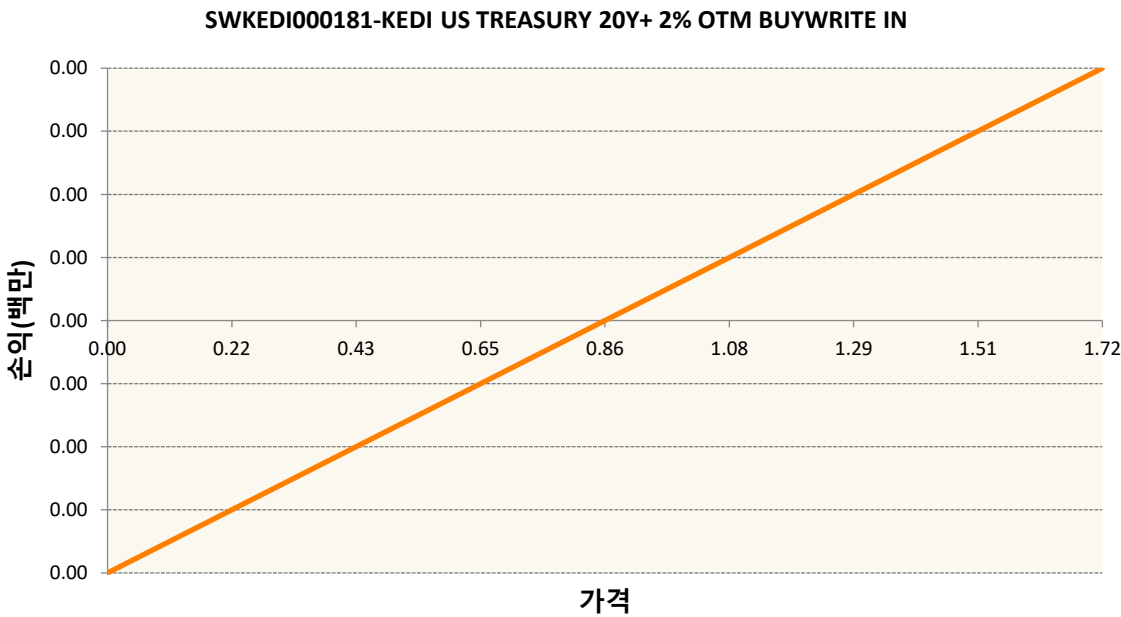
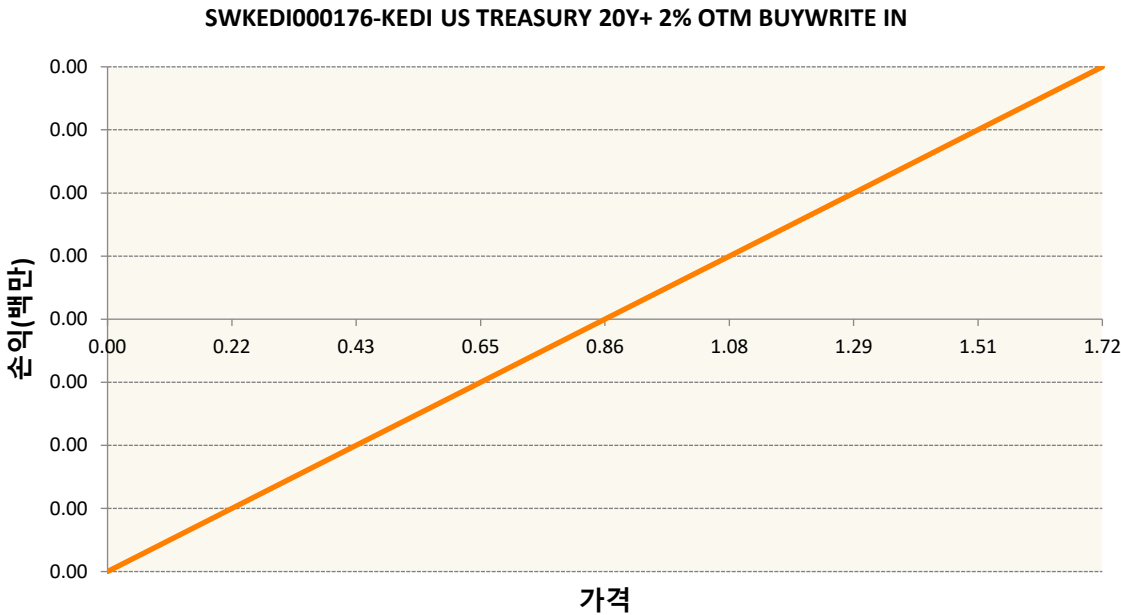
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

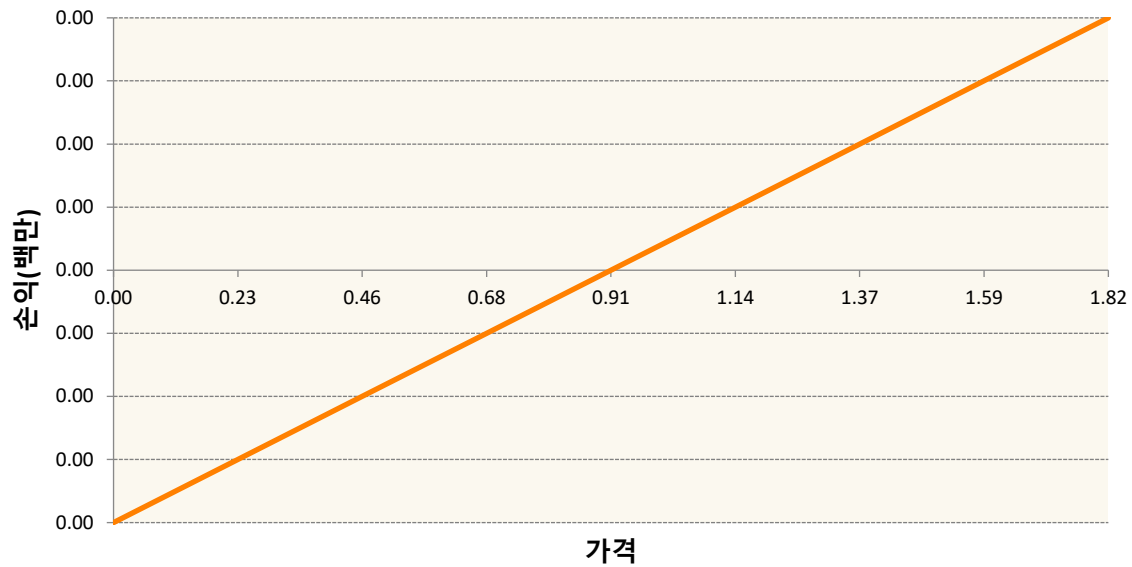
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	271,762	0	271,762	장외

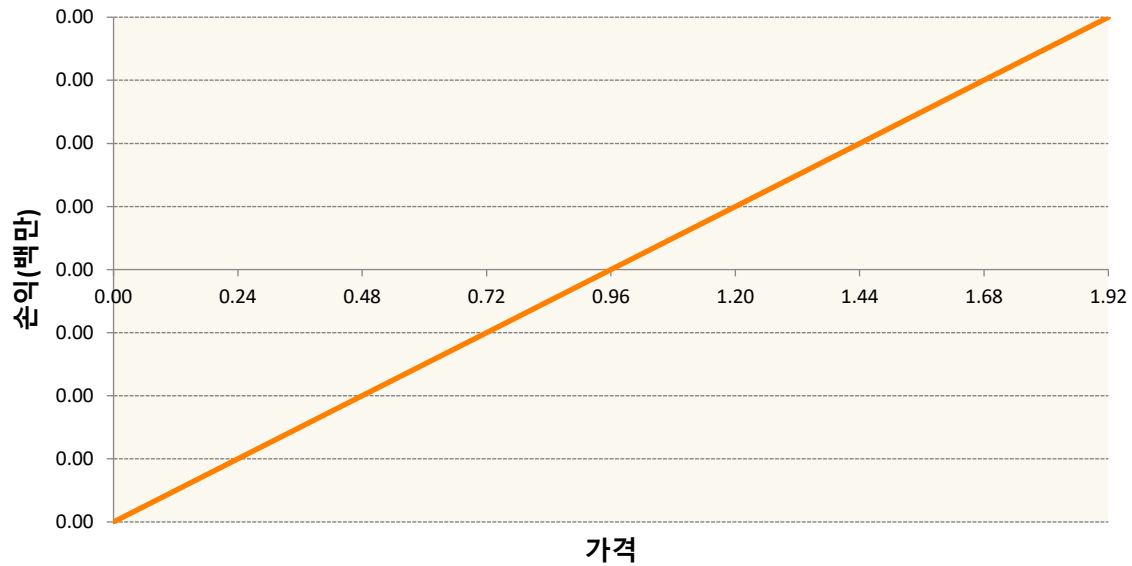
2. 만기시점의 손익구조



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	6,995
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,745
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,110
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,891

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

(단위:백만원)

8,654
