

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

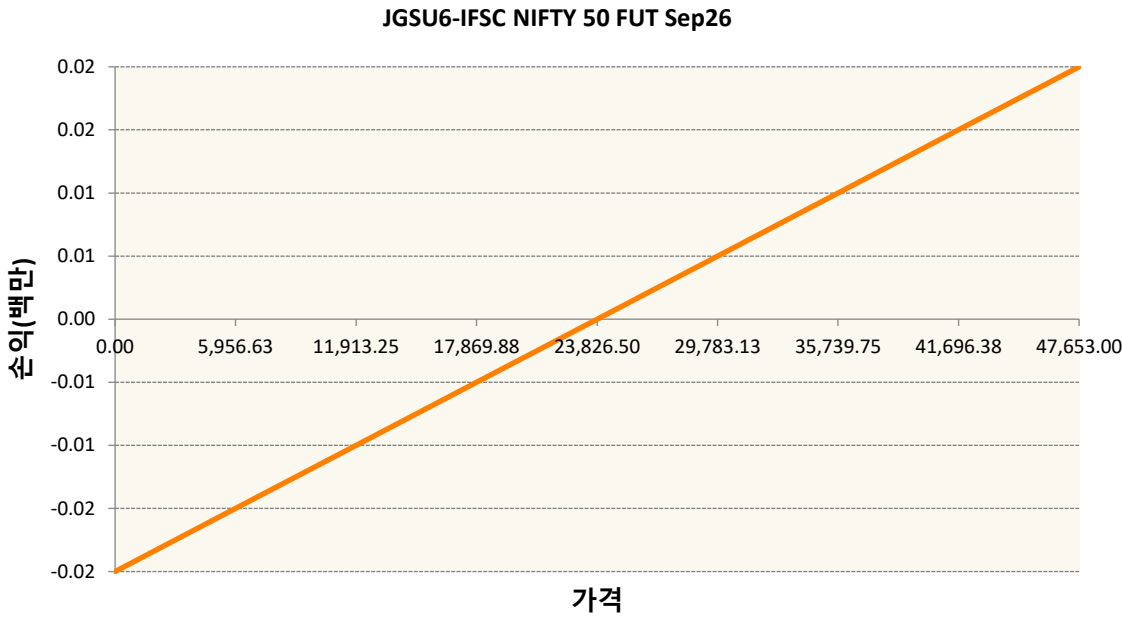
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	331	0	331	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSU6	IFSC NIFTY 50 FUT Sep26	26
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

17

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

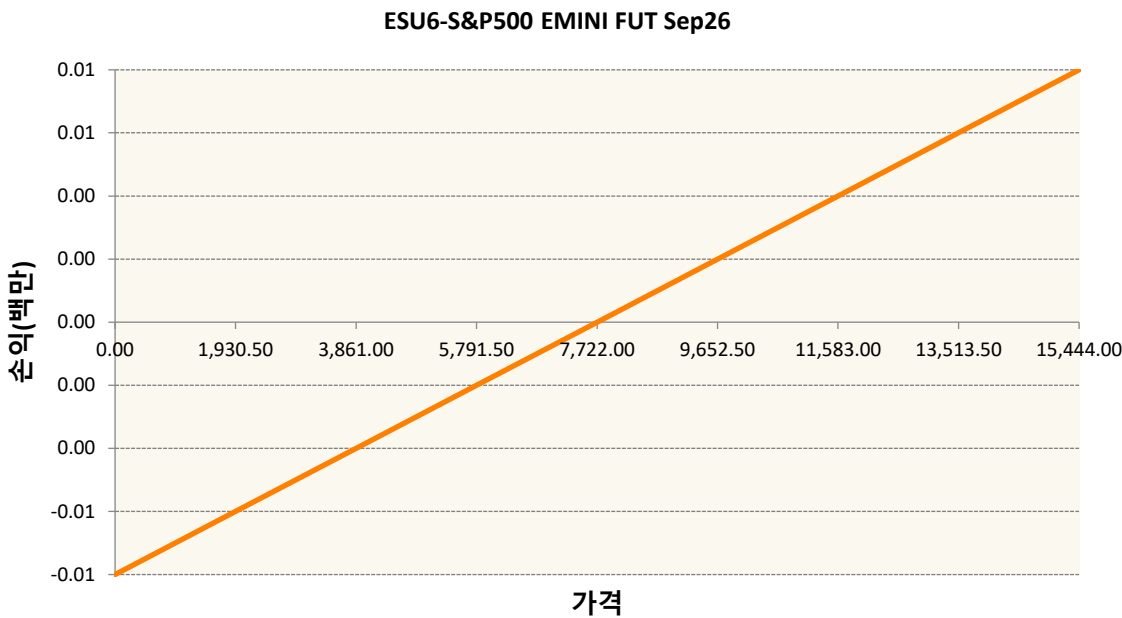
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-09-09
기준일	2026-09-08

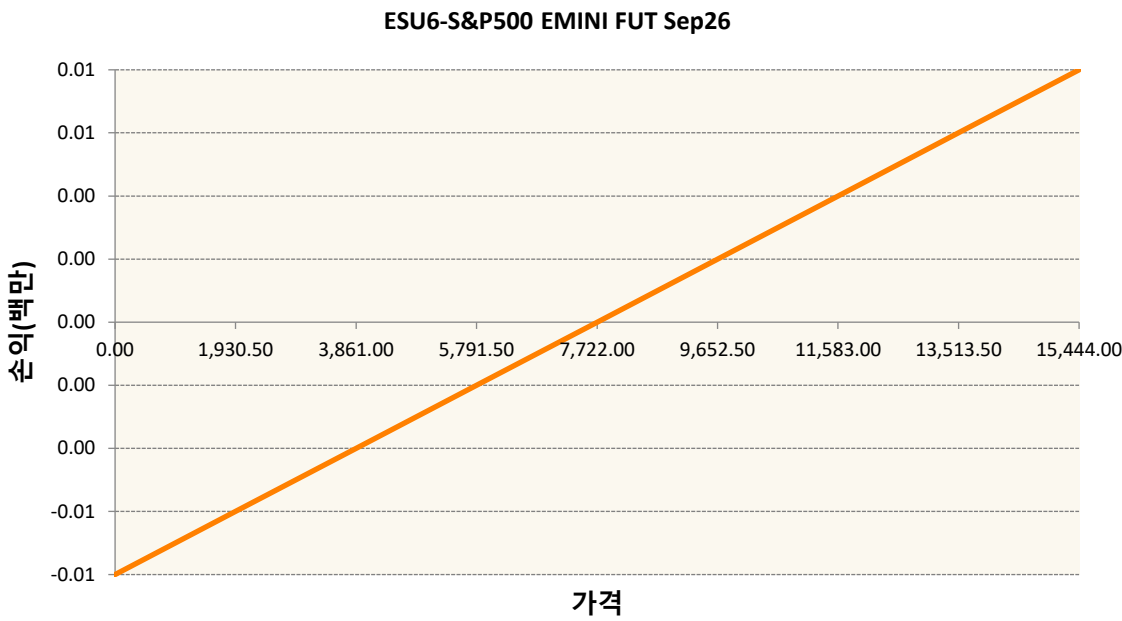
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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	2026-09-09
기준일	2026-09-08

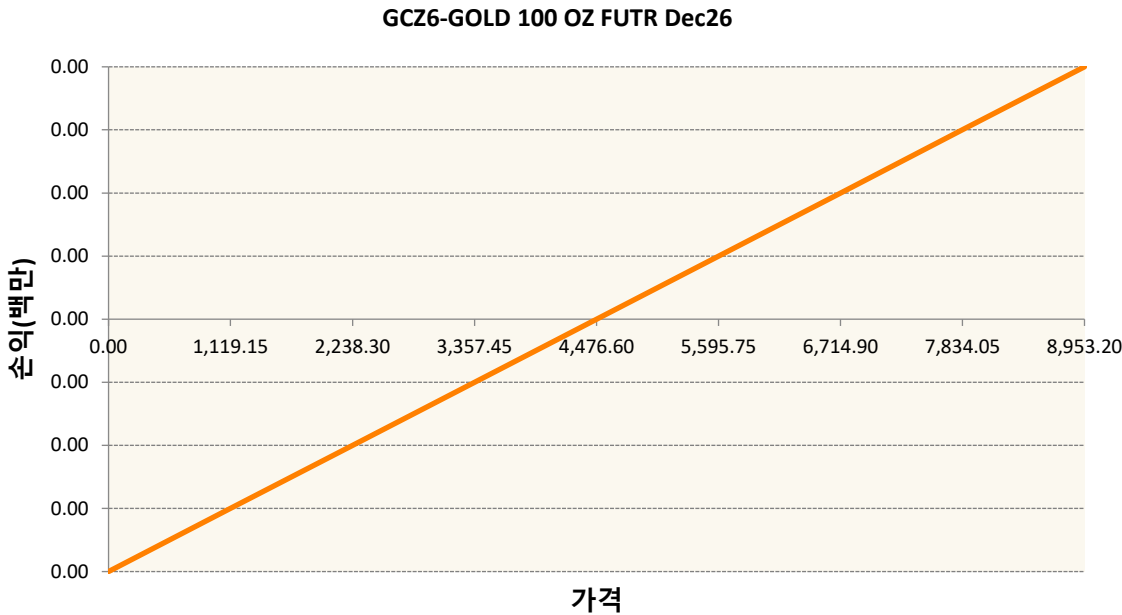
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			6,353	0	6,353	
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)

680

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

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	2026-09-09
기준일	2026-09-08

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)

14,477

공시일 2026-09-09

기준일 2026-09-08

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	2026-09-09
기준일	2026-09-08

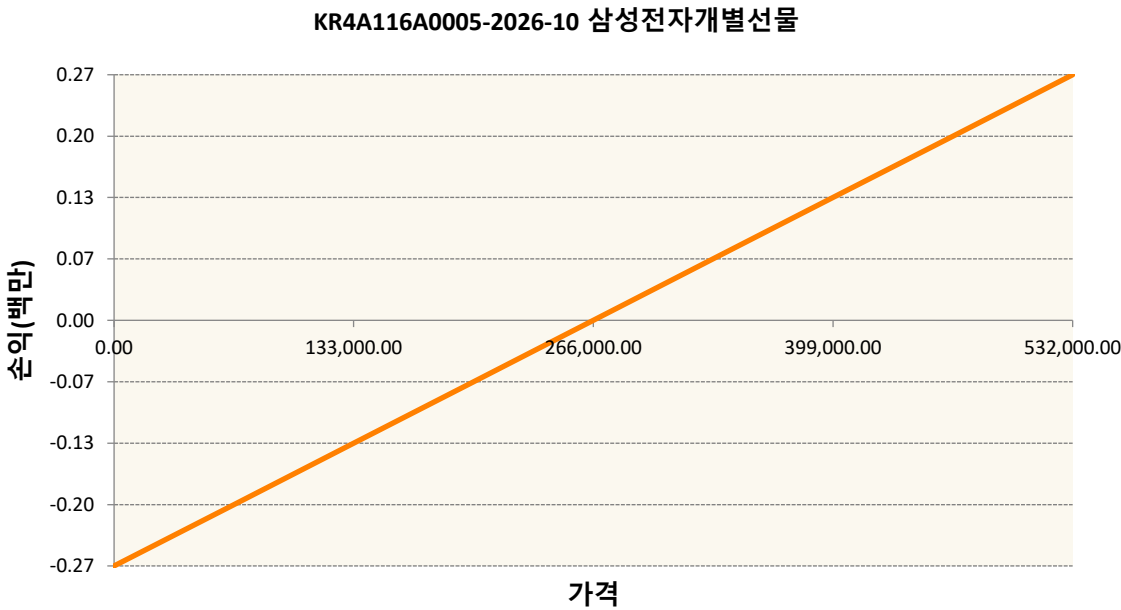
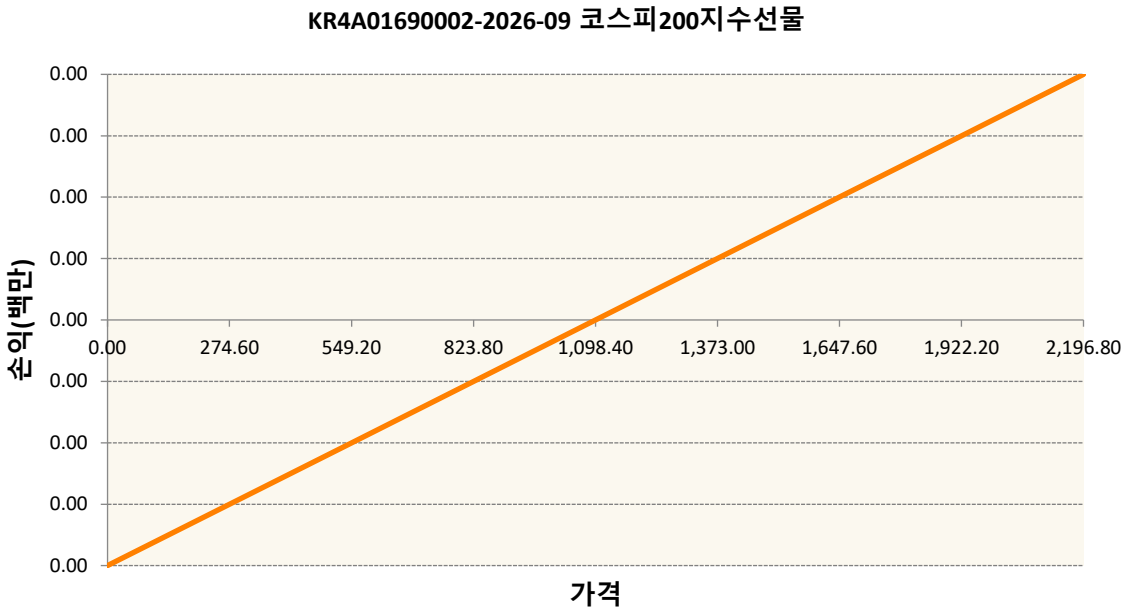
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

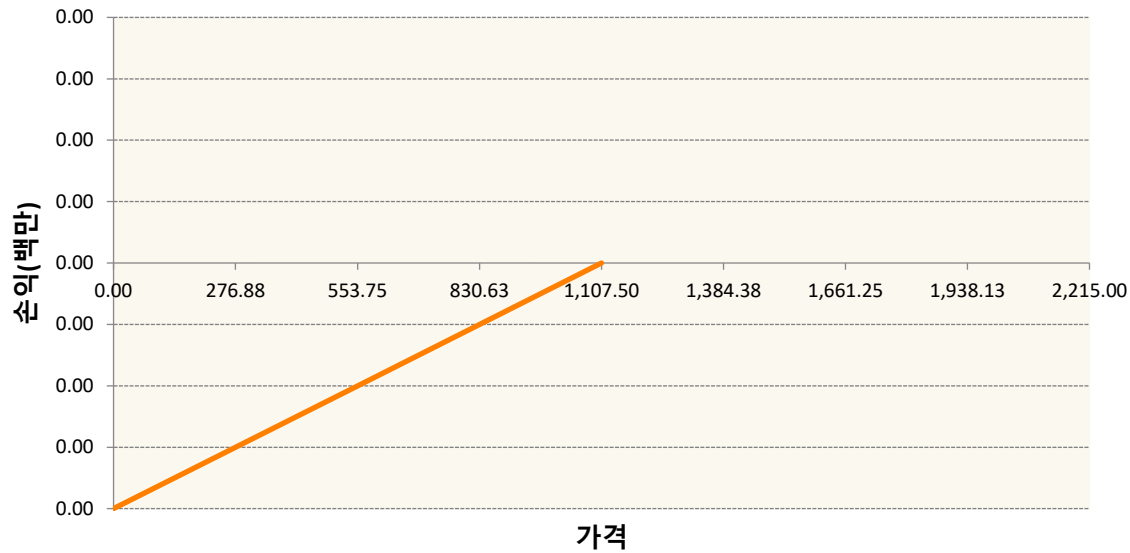
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	14,761	0	14,761	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	21,504	0	21,504	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,485	-53,485	장내

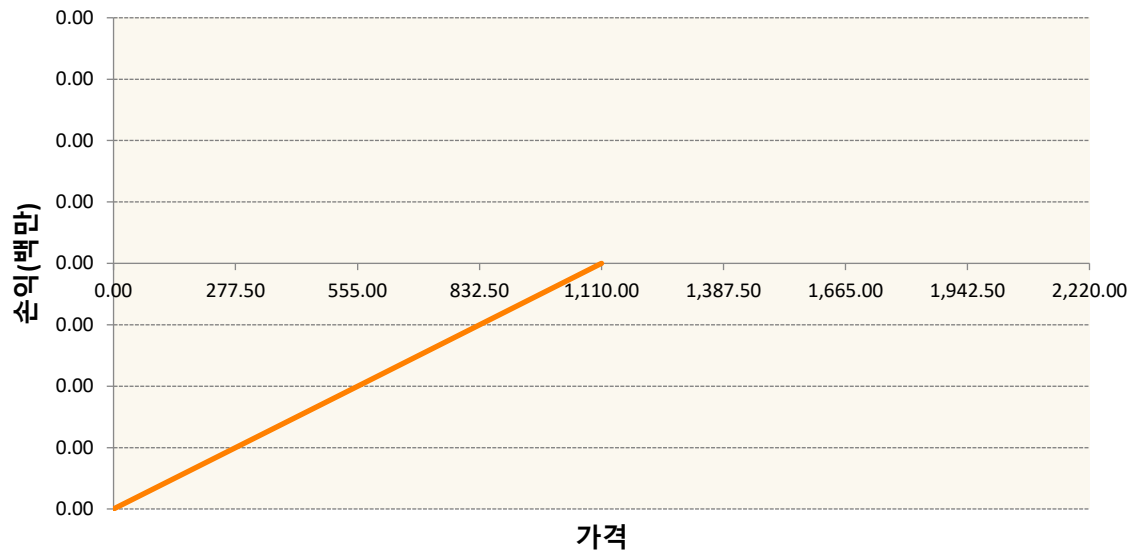
2. 만기시점의 손익구조



KR4B0169A444-코스피|200 C 202609 1107.5



KR4B0169A451-코스피|200 C 202609 1110.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					572
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572
-5.33%	-381	-381	-381	-381	-381	-381	-381
-2.67%	-191	-191	-191	-191	-191	-191	-191
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	191	191	191	191	191	191	191
5.33%	381	381	381	381	381	381	381
8.00%	572	572	572	572	572	572	572
KR4A116A0005		2026-10 삼성전자개별선물					1,164
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164	-1,164
-5.33%	-776	-776	-776	-776	-776	-776	-776
-2.67%	-388	-388	-388	-388	-388	-388	-388
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	388	388	388	388	388	388	388
5.33%	776	776	776	776	776	776	776
8.00%	1,164	1,164	1,164	1,164	1,164	1,164	1,164
KR4B0169A444 코스피200 C 202609 1107.5							2,179

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,162	-2,163	-2,164	-2,166	-2,169	-2,173	-2,179
-5.33%	-1,317	-1,322	-1,329	-1,339	-1,351	-1,365	-1,381
-2.67%	-514	-536	-560	-587	-615	-644	-675
0%	120	80	40	0	-40	-80	-121
2.67%	465	432	397	362	325	288	250
5.33%	578	564	548	528	506	482	457
8.00%	598	595	591	584	575	564	551
KR4B0169A451 코스피200 C 202609 1110.0							1,465

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,455	-1,455	-1,456	-1,457	-1,459	-1,461	-1,465
-5.33%	-893	-896	-900	-906	-913	-922	-932
-2.67%	-356	-369	-384	-401	-418	-437	-457
0%	78	52	26	0	-26	-53	-79
2.67%	324	301	277	253	228	203	177
5.33%	409	399	387	373	357	341	323
8.00%	425	423	419	414	408	400	390

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

(단위:백만원)

13,124

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

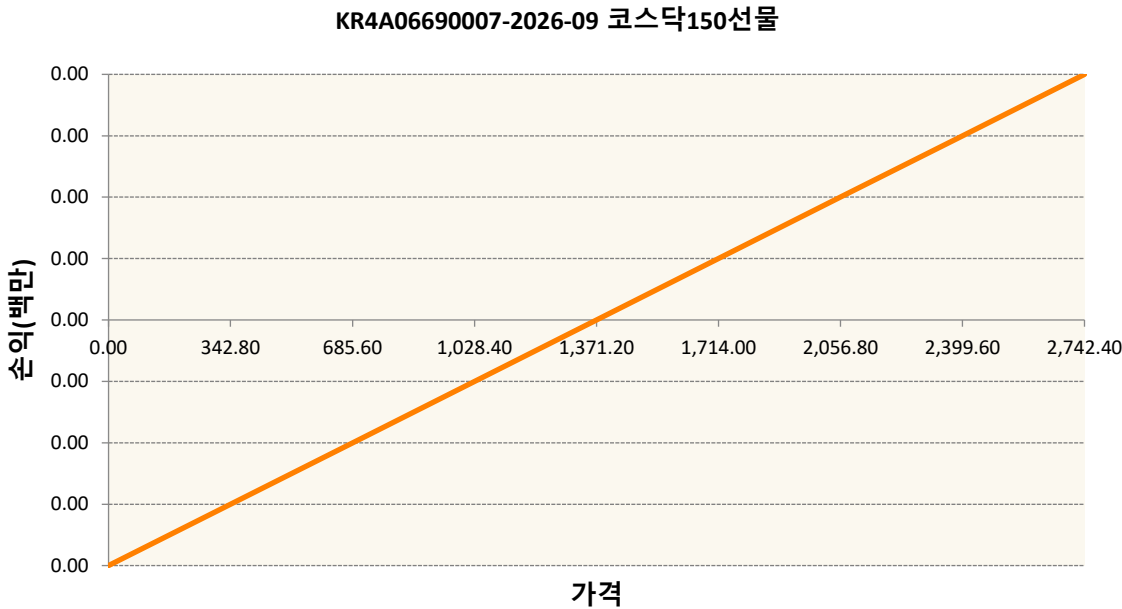
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	631	0	631	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007		2026-09 코스닥150선물					51
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-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%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	51	51	51	51	51	51	51

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

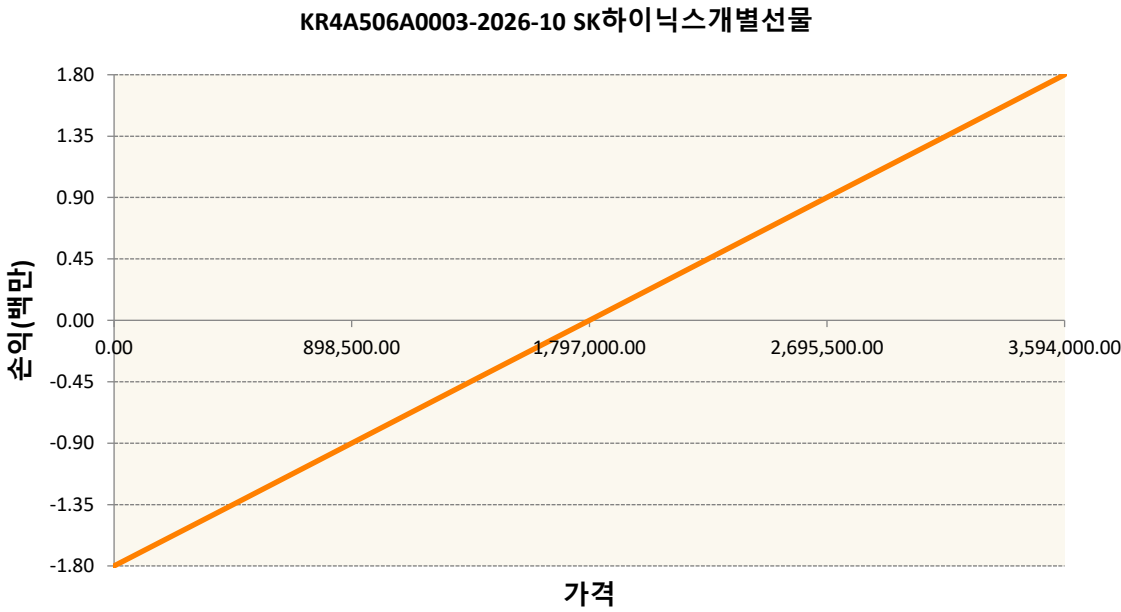
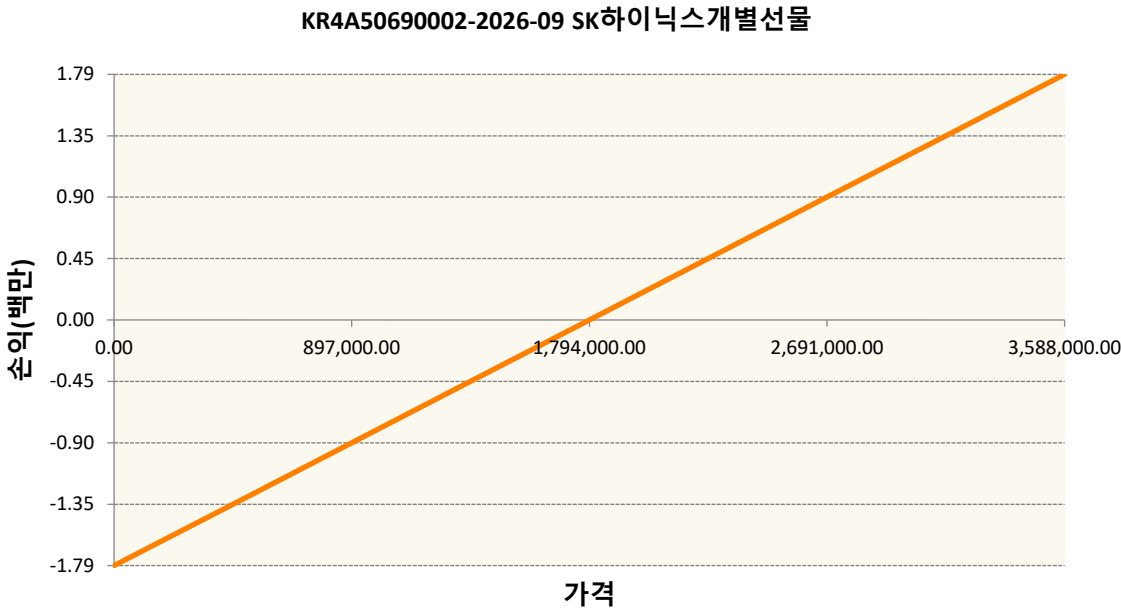
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,536	11,410	-874	장내
누계	유가증권	선물	46,107	0	46,107	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A50690002		2026-09 SK하이닉스개별선물					1,918
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,918	-1,918	-1,918	-1,918	-1,918	-1,918	-1,918
-5.33%	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279
-2.67%	-639	-639	-639	-639	-639	-639	-639
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	639	639	639	639	639	639	639
5.33%	1,279	1,279	1,279	1,279	1,279	1,279	1,279
8.00%	1,918	1,918	1,918	1,918	1,918	1,918	1,918
KR4A506A0003		2026-10 SK하이닉스개별선물					1,766
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,766	-1,766	-1,766	-1,766	-1,766	-1,766	-1,766
-5.33%	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177	-1,177
-2.67%	-589	-589	-589	-589	-589	-589	-589
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	589	589	589	589	589	589	589
5.33%	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177	1,177
8.00%	1,766	1,766	1,766	1,766	1,766	1,766	1,766

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

17,330

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

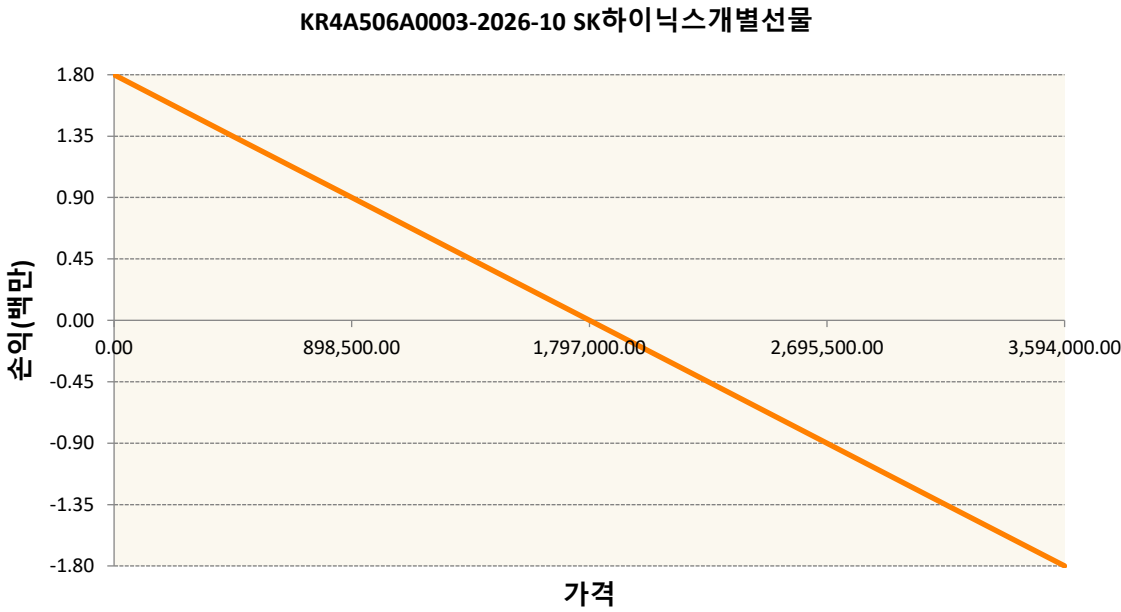
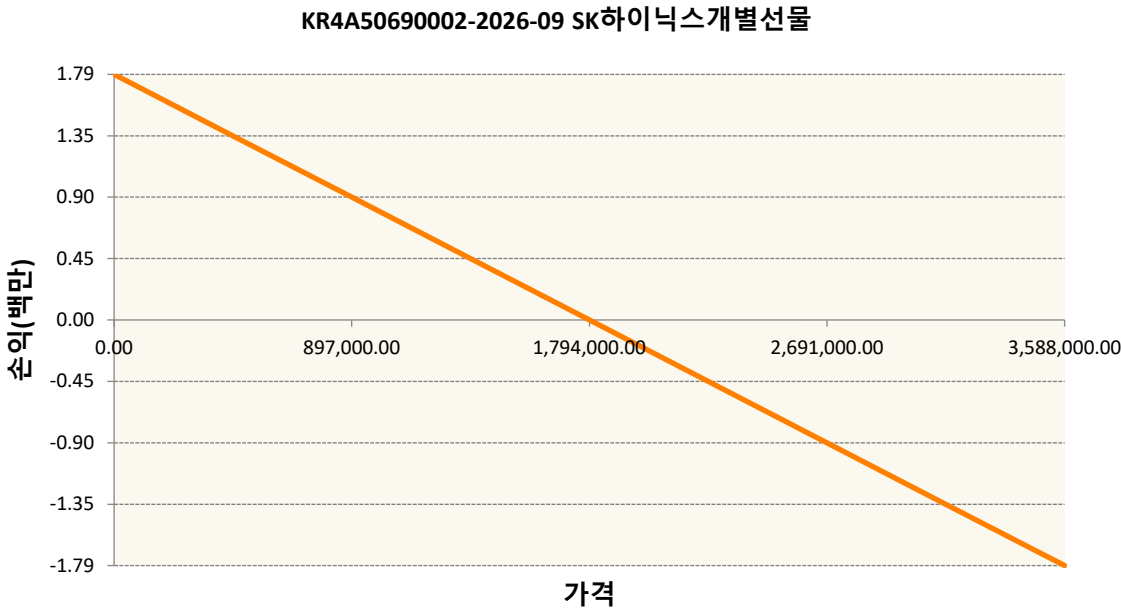
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	30,793	47,213	-16,420	장내
누계	유가증권	선물	0	133,167	-133,167	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A50690002				2026-09 SK하이닉스개별선물				5,548
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,548	5,548	5,548	5,548	5,548	5,548	5,548	
-5.33%	3,699	3,699	3,699	3,699	3,699	3,699	3,699	
-2.67%	1,849	1,849	1,849	1,849	1,849	1,849	1,849	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-1,849	-1,849	-1,849	-1,849	-1,849	-1,849	-1,849	
5.33%	-3,699	-3,699	-3,699	-3,699	-3,699	-3,699	-3,699	
8.00%	-5,548	-5,548	-5,548	-5,548	-5,548	-5,548	-5,548	
KR4A506A0003				2026-10 SK하이닉스개별선물				5,091
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	5,091	5,091	5,091	5,091	5,091	5,091	5,091	
-5.33%	3,394	3,394	3,394	3,394	3,394	3,394	3,394	
-2.67%	1,697	1,697	1,697	1,697	1,697	1,697	1,697	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-1,697	-1,697	-1,697	-1,697	-1,697	-1,697	-1,697	
5.33%	-3,394	-3,394	-3,394	-3,394	-3,394	-3,394	-3,394	
8.00%	-5,091	-5,091	-5,091	-5,091	-5,091	-5,091	-5,091	

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

50,054

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

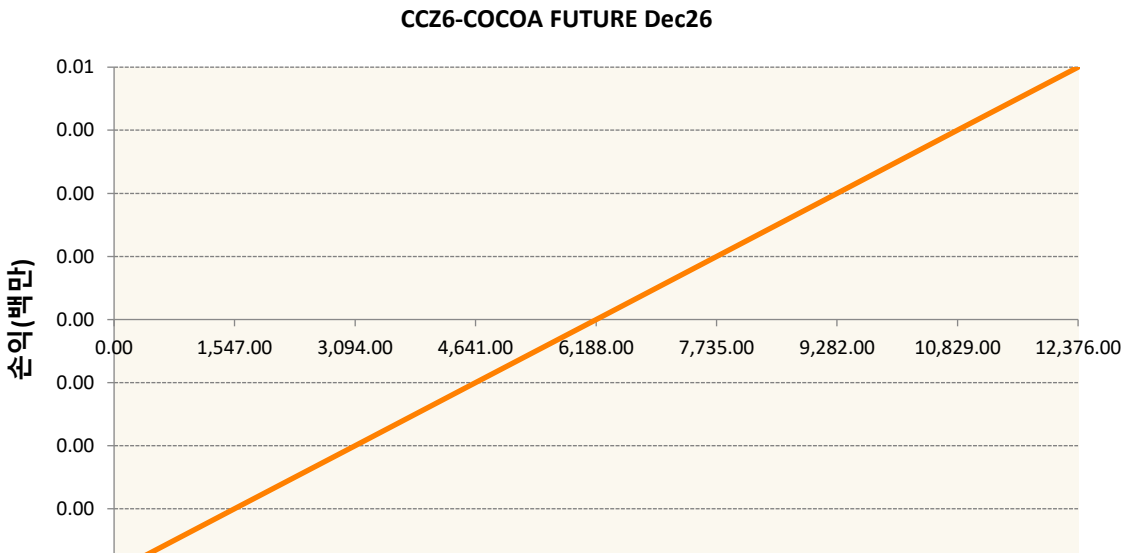
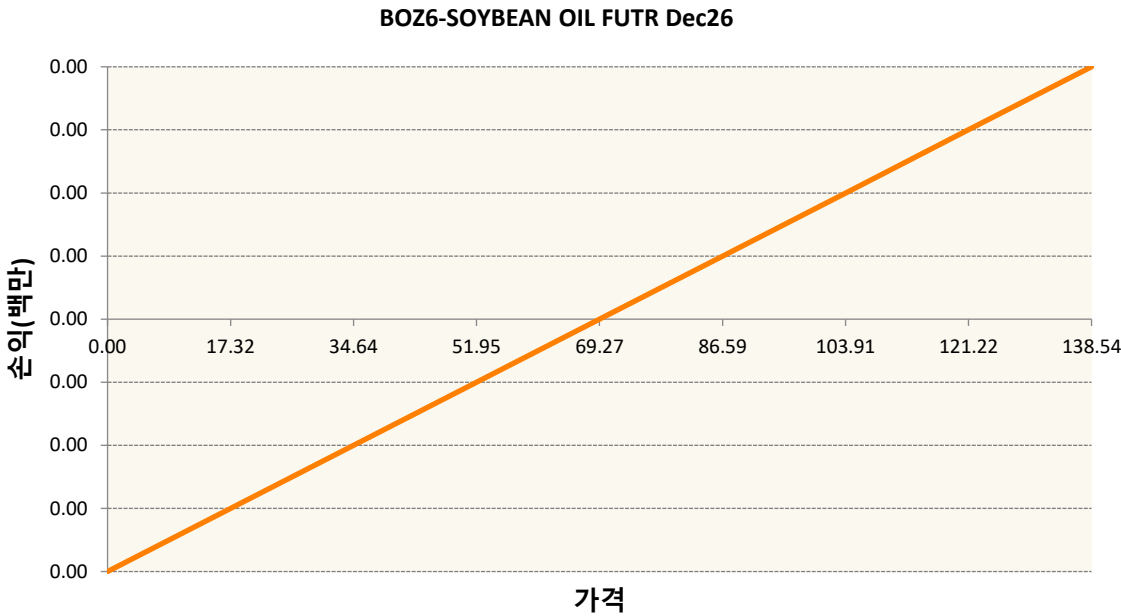
포커스농산물모(채권-파생형)

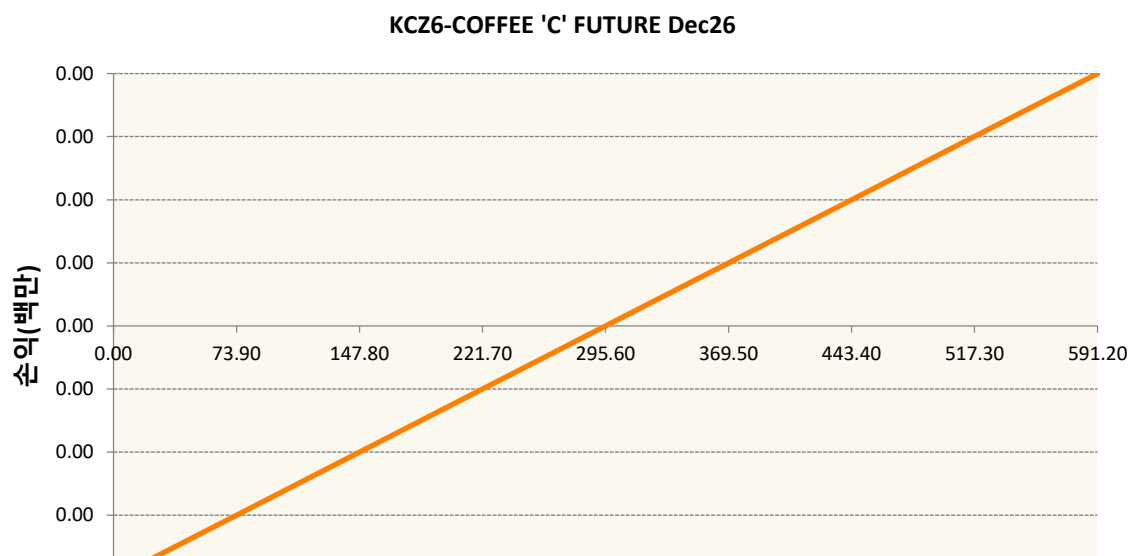
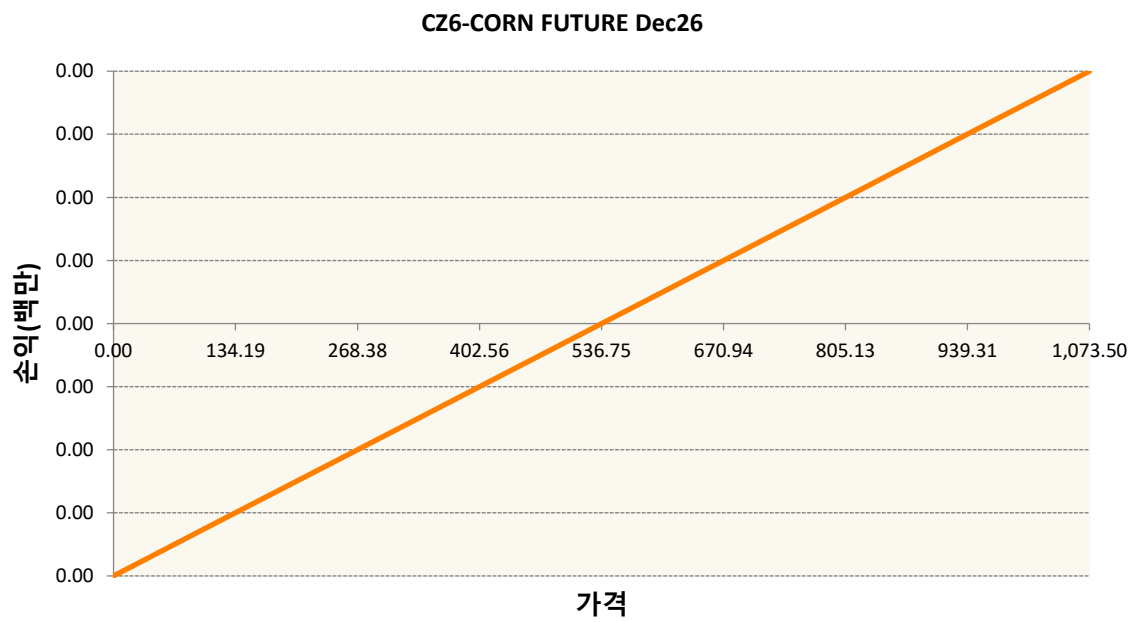
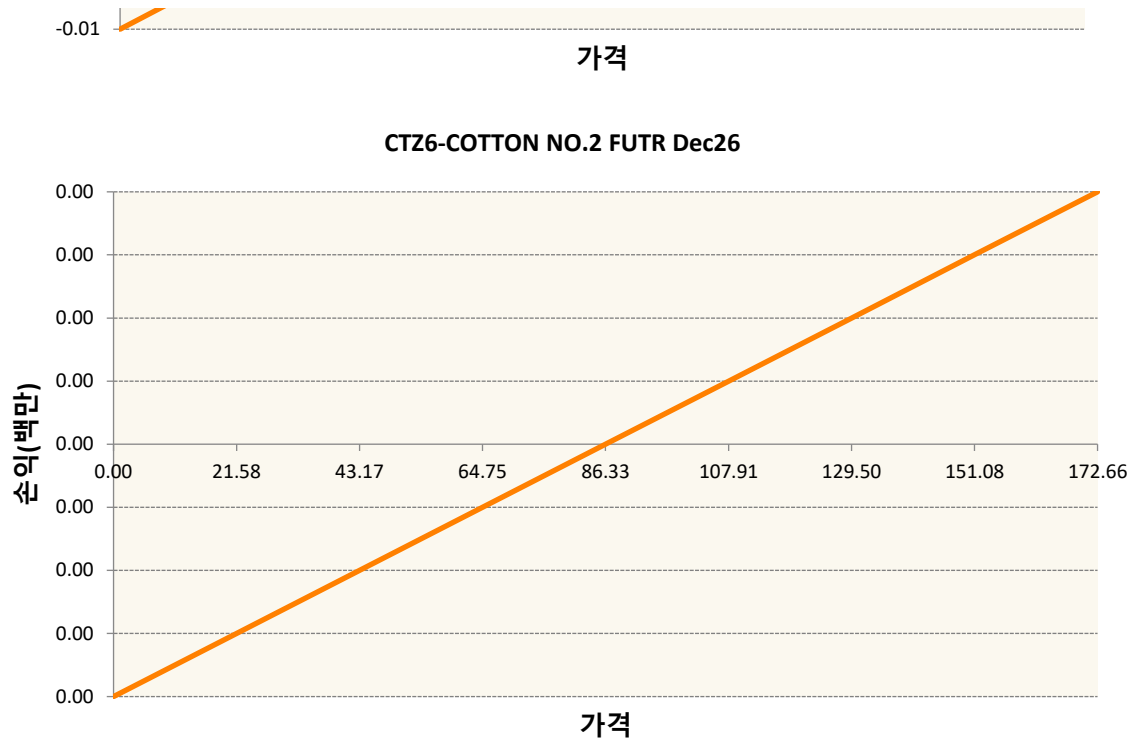
1. 계약금액

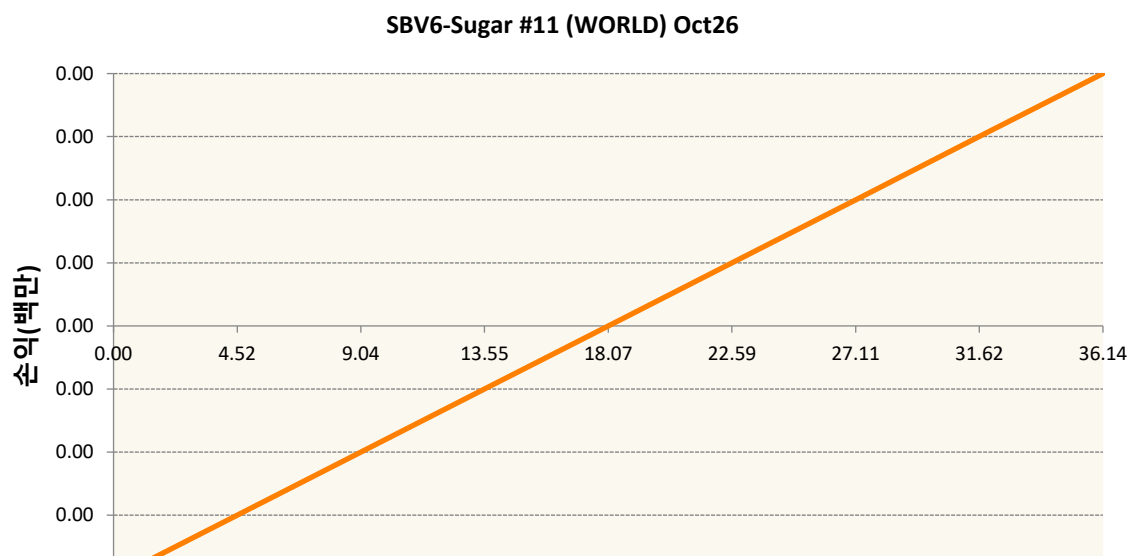
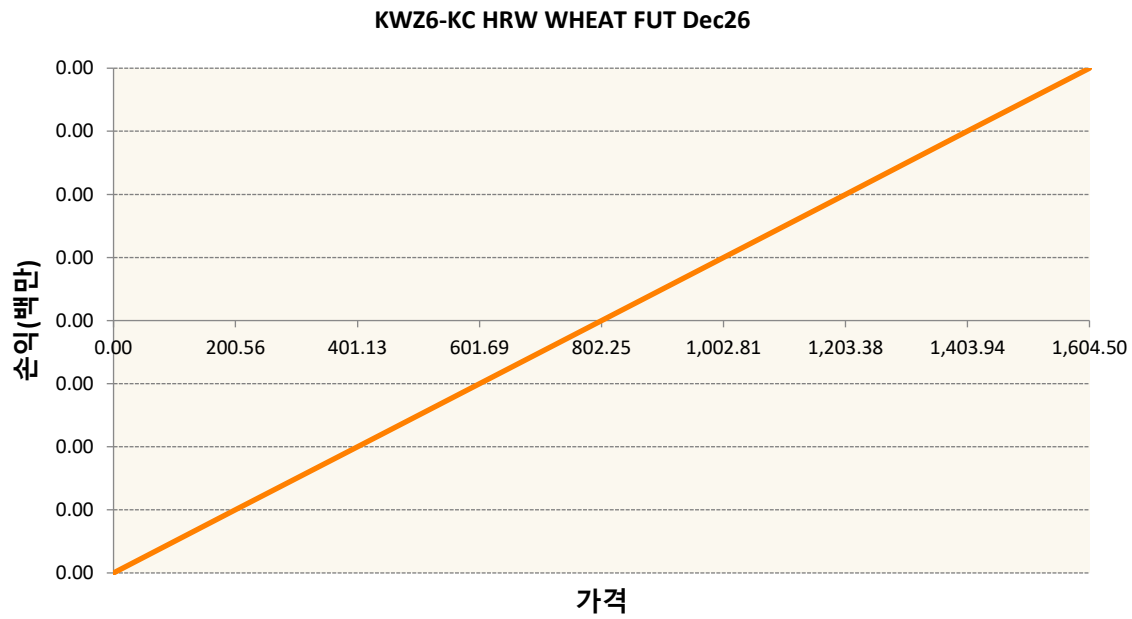
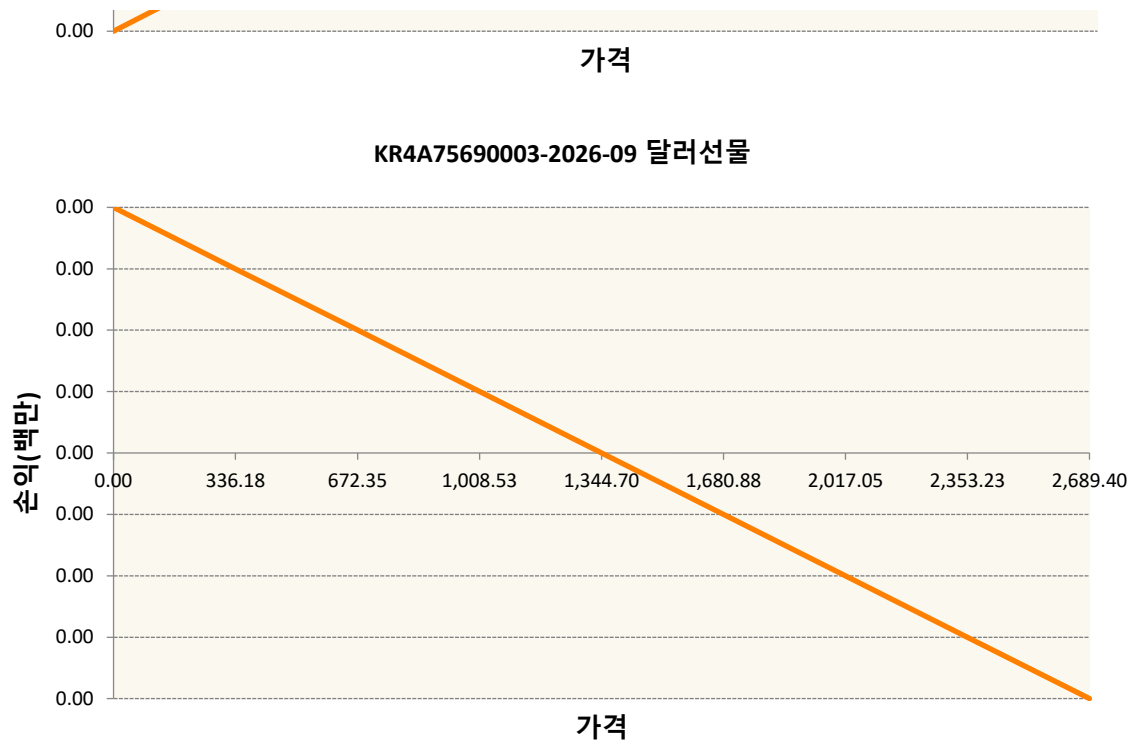
(단위:USD 백만)

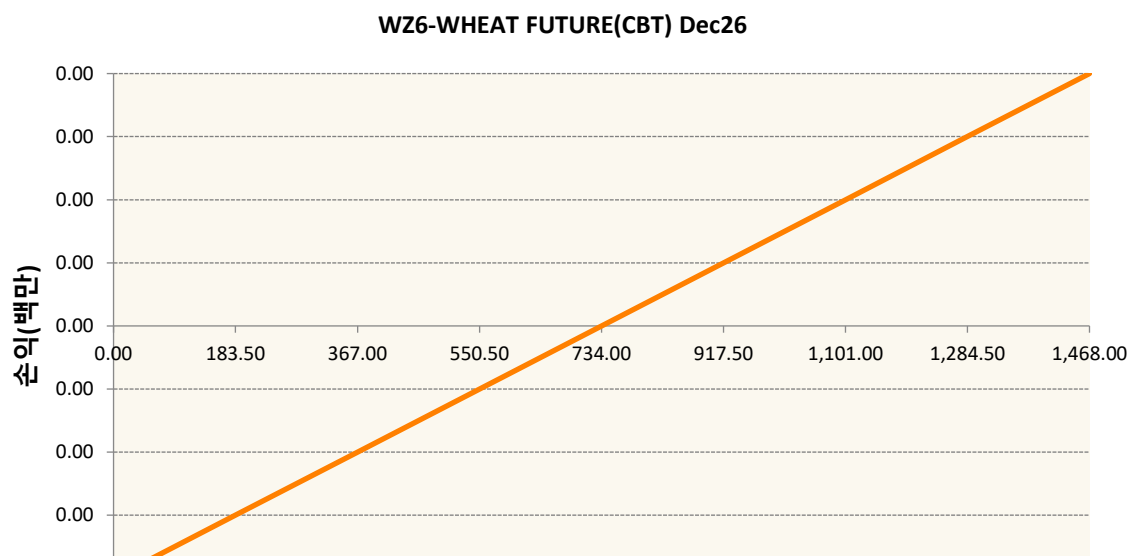
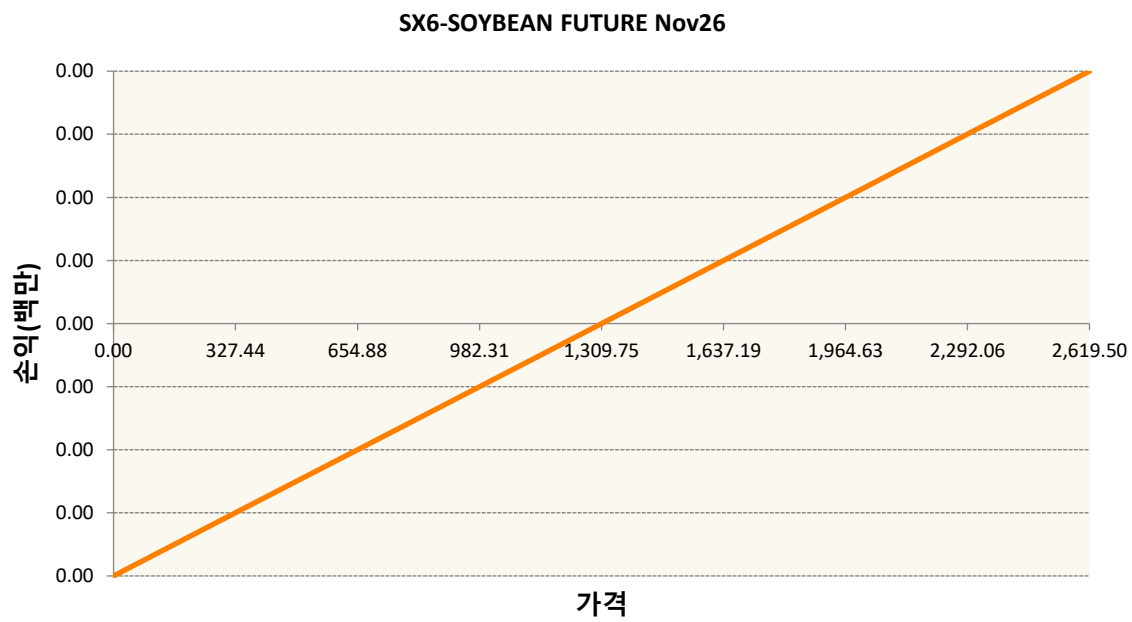
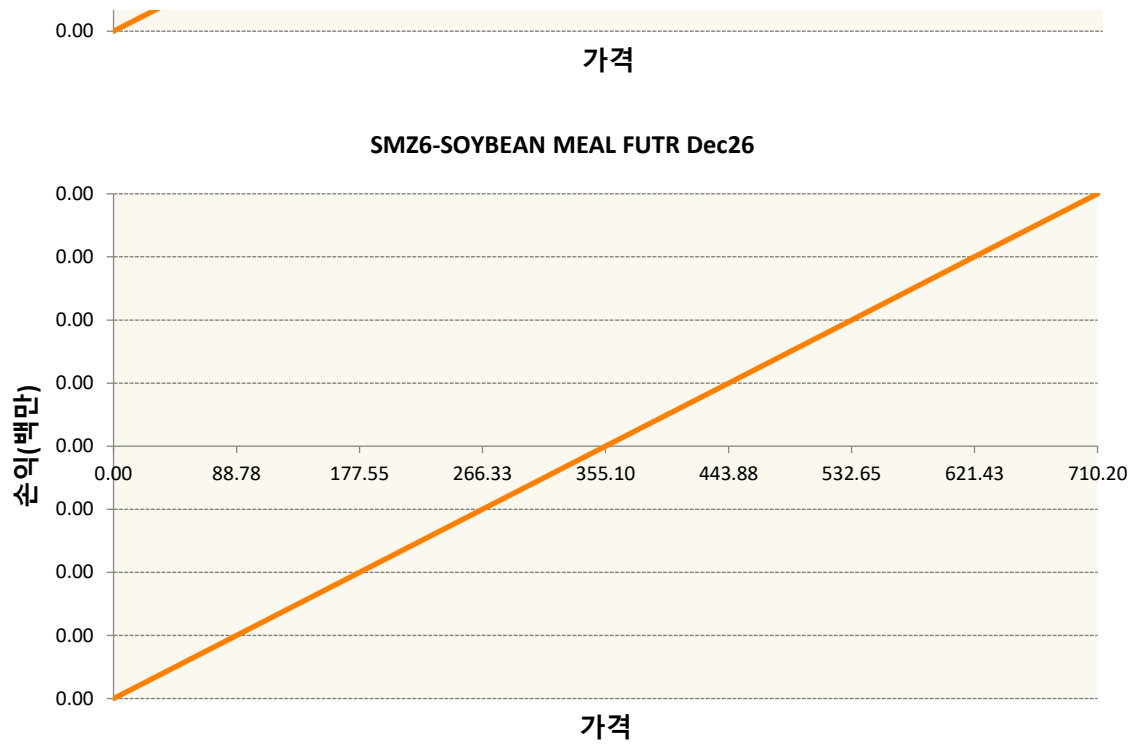
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	464	0	464	
누계	유가증권	선물	2,499	0	2,499	
누계	통화	선물	0	336	-336	장내

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	2026-09-09
기준일	2026-09-08

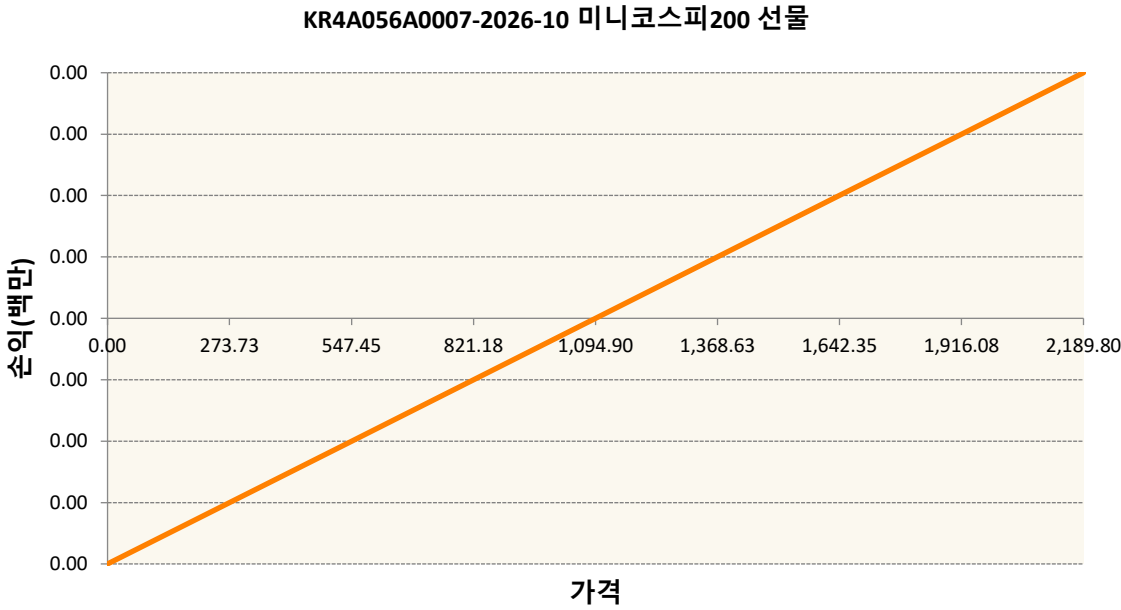
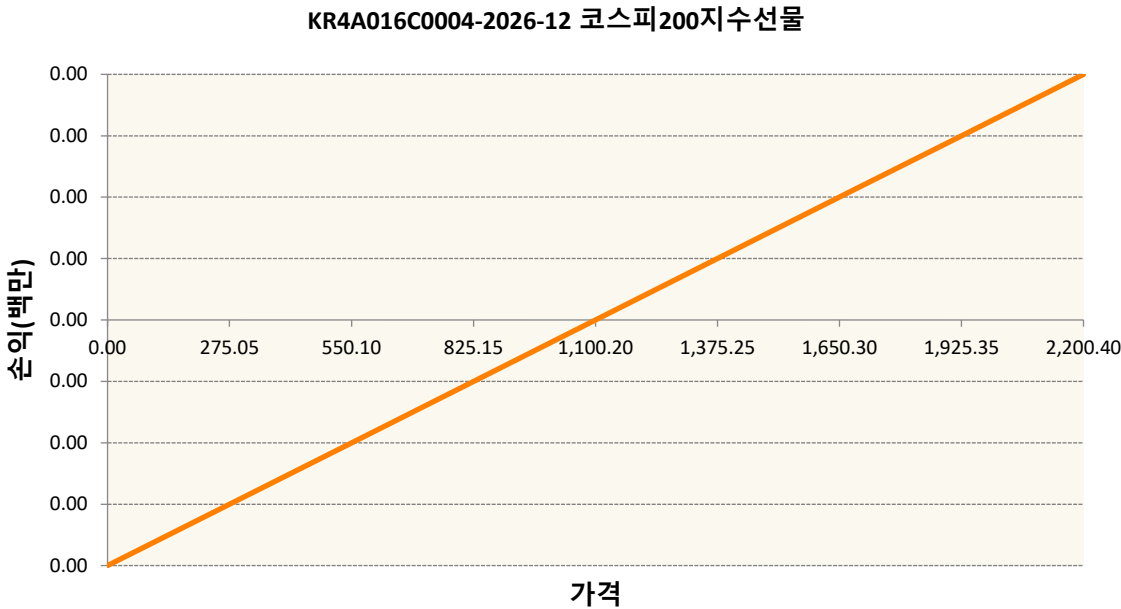
스마트인덱스모

1. 계약금액

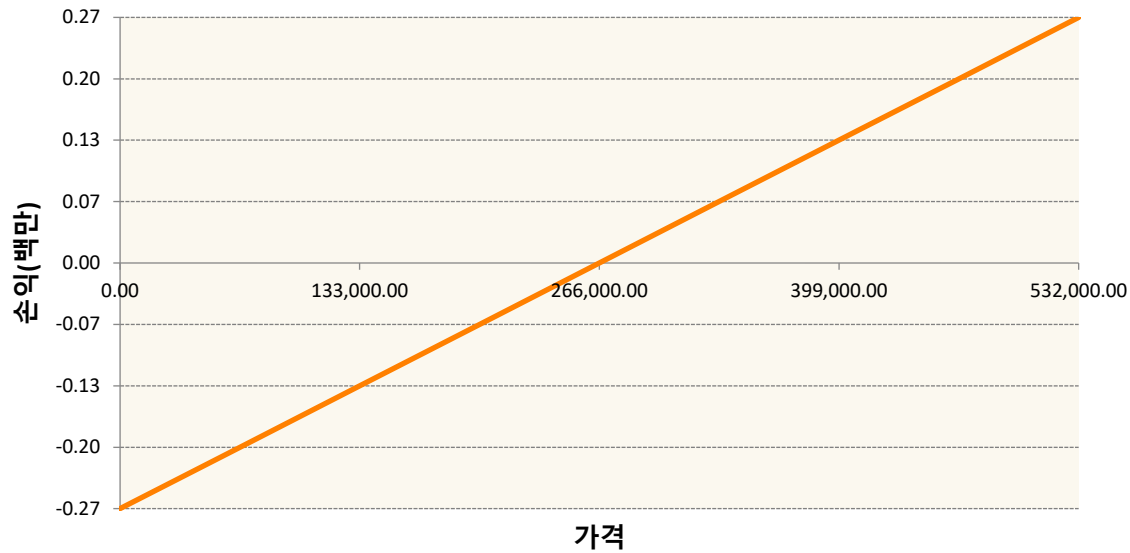
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,275	0	4,275	장내
누계	유가증권	선물	4,256	0	4,256	장내

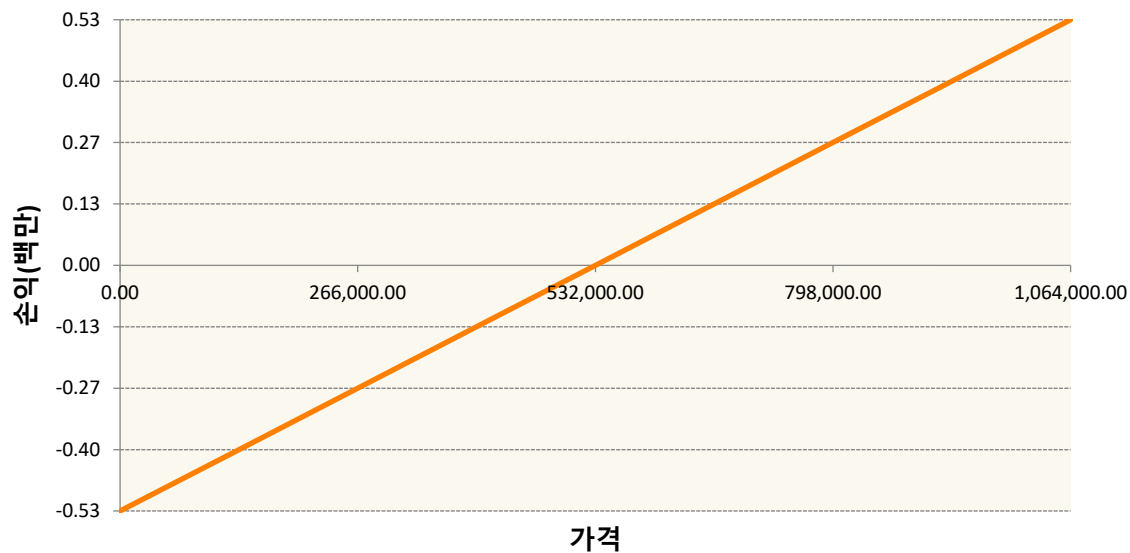
2. 만기시점의 손익구조



KR4A116A0005-2026-10 삼성전자개별선물



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물					242
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
-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%	161	161	161	161	161	161	161
8.00%	242	242	242	242	242	242	242
KR4A056A0007		2026-10 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
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%	-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)

909

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

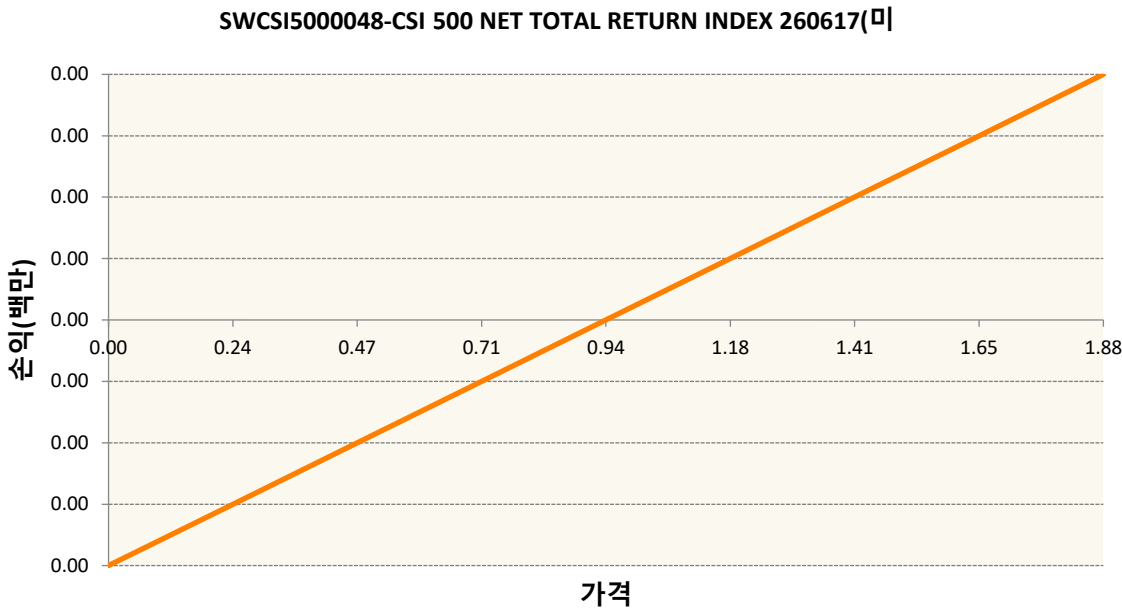
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

437

* 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	2026-09-09
기준일	2026-09-08

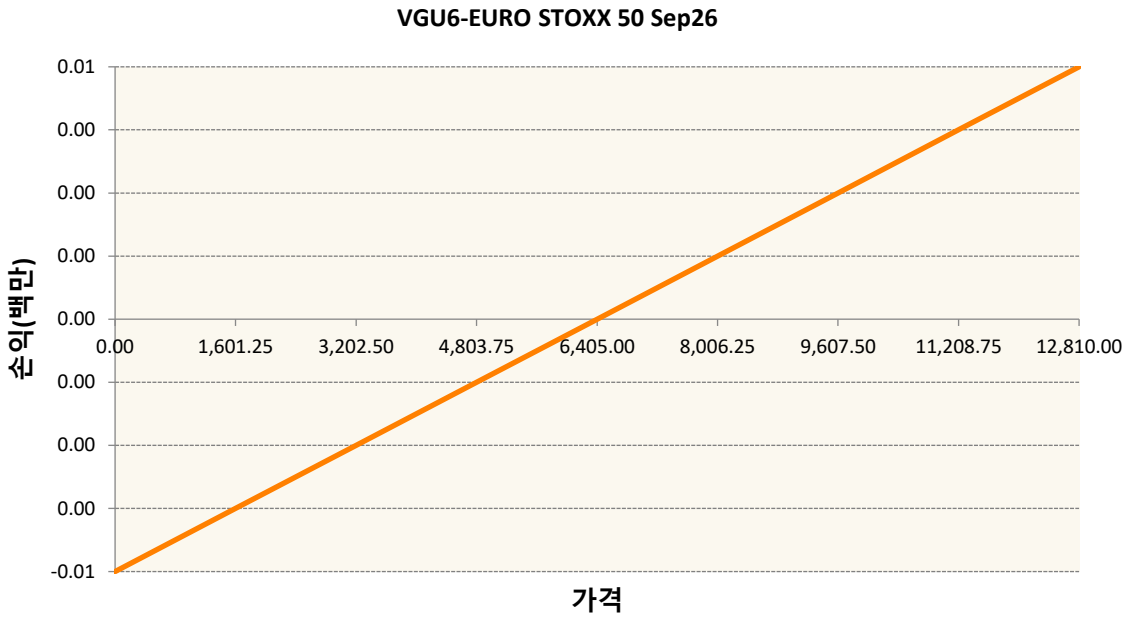
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

75

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

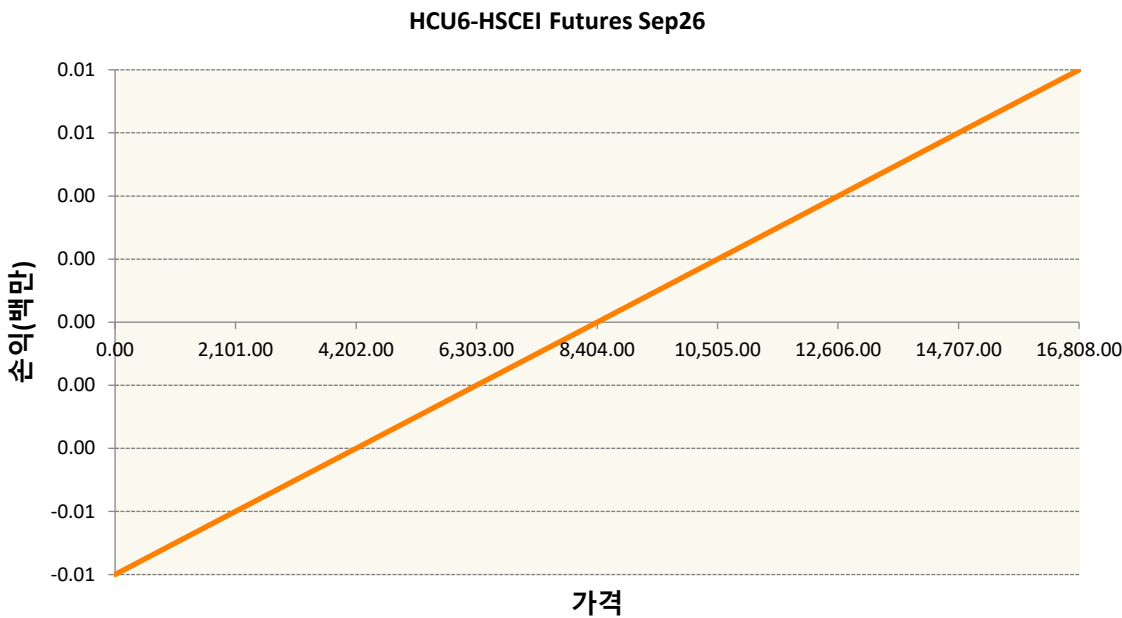
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,472	0	1,472	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	118
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

112

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

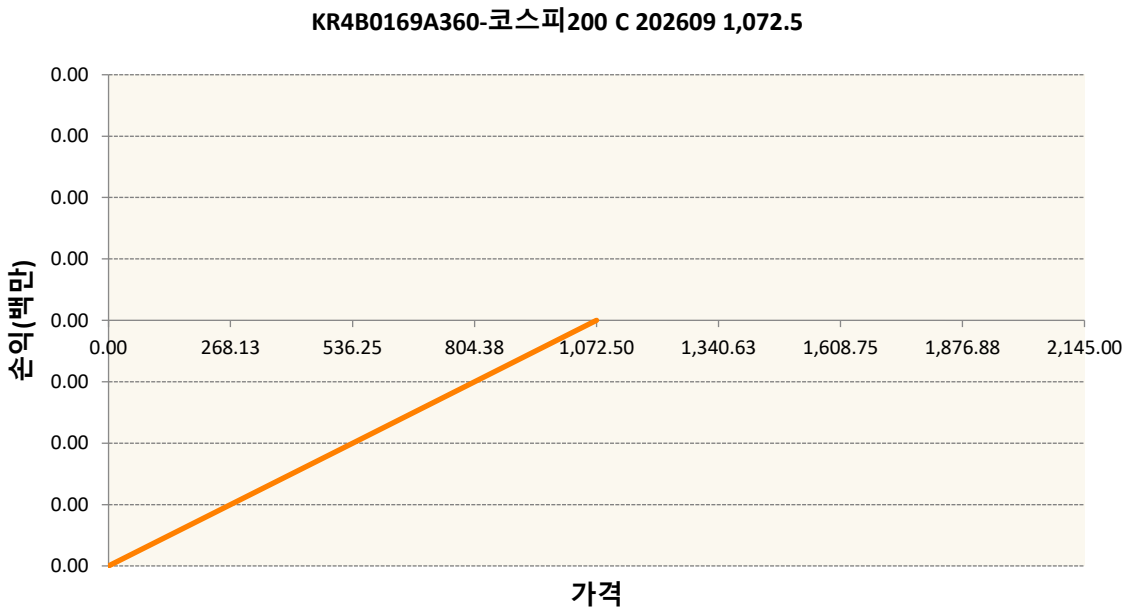
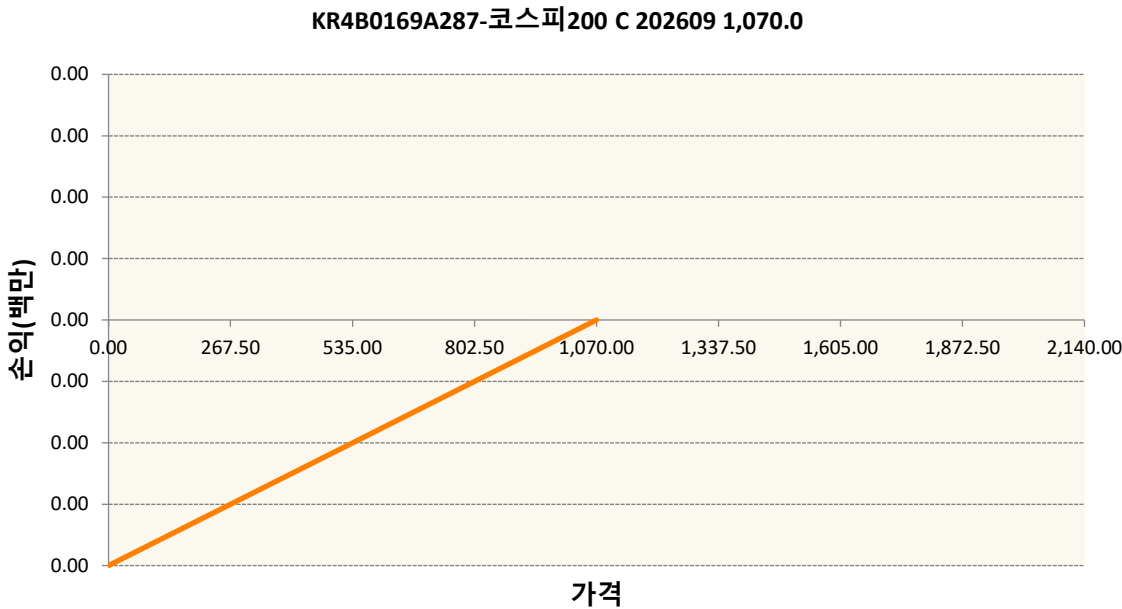
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

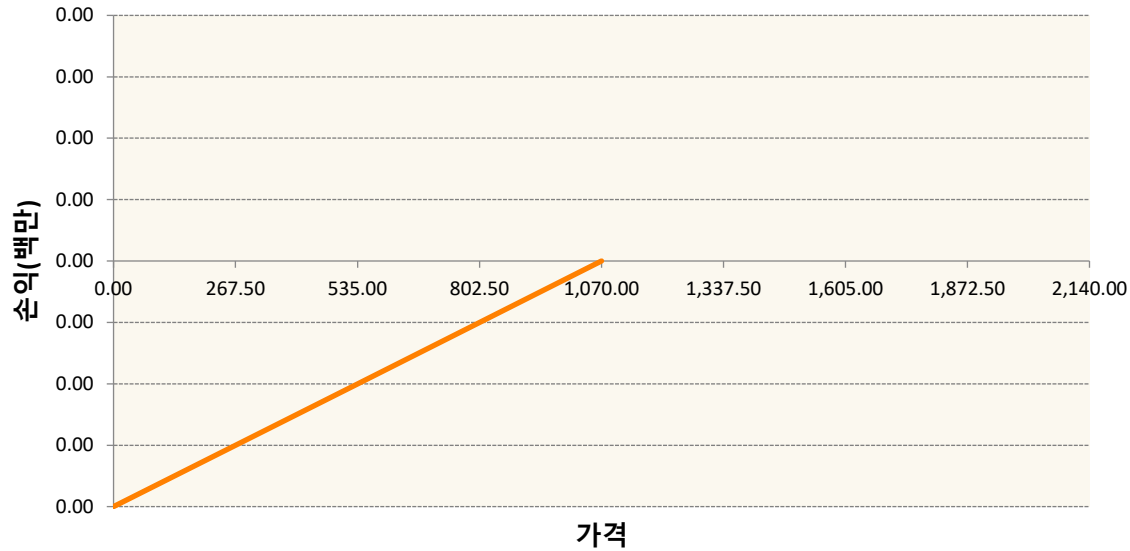
(단위:백만원)

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							758
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-721	-724	-729	-735	-742	-749	-758
-5.33%	-352	-365	-378	-392	-407	-422	-437
-2.67%	-85	-103	-122	-141	-159	-178	-197
0%	40	28	14	0	-15	-30	-46
2.67%	73	69	64	57	50	41	31
5.33%	77	77	75	74	71	68	63
8.00%	77	77	77	77	76	75	74
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							1,064
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,017	-1,021	-1,027	-1,034	-1,042	-1,053	-1,064
-5.33%	-508	-524	-541	-559	-578	-598	-619
-2.67%	-128	-153	-179	-204	-230	-255	-281
0%	58	40	20	0	-21	-43	-65
2.67%	109	103	95	86	74	62	48
5.33%	117	116	114	111	107	102	95
8.00%	117	117	117	116	115	114	112
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							441
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-419	-421	-424	-427	-431	-436	-441
-5.33%	-205	-212	-220	-228	-237	-245	-254
-2.67%	-49	-60	-71	-82	-93	-104	-115
0%	23	16	8	0	-9	-18	-27

2.67%	42	40	37	33	29	24	18
5.33%	45	45	44	43	41	39	37
8.00%	45	45	45	45	44	44	43

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

(단위:백만원)

2,965

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

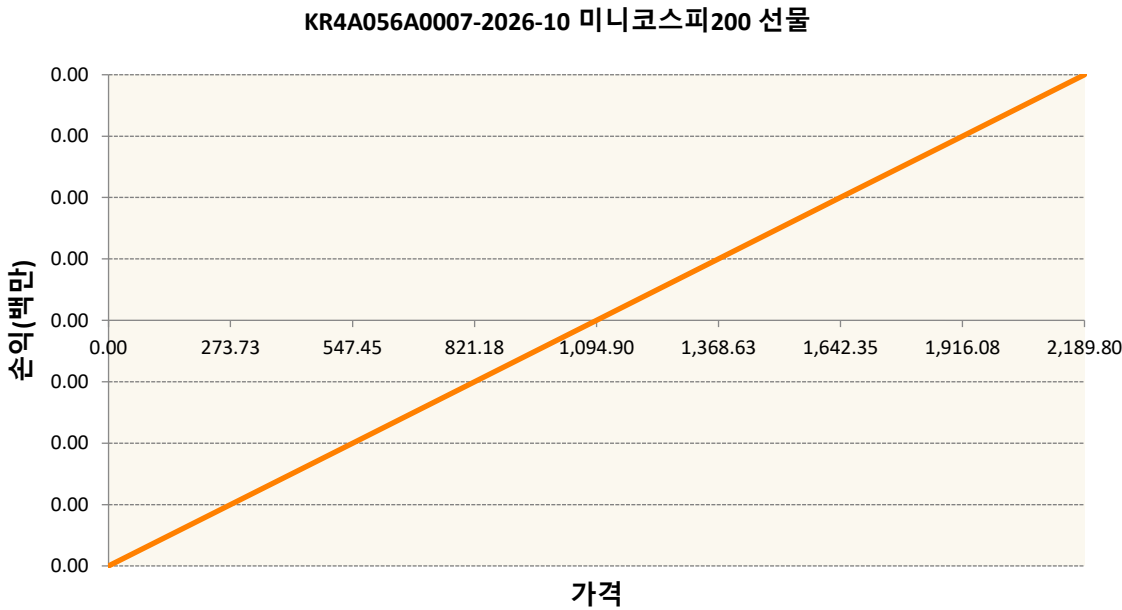
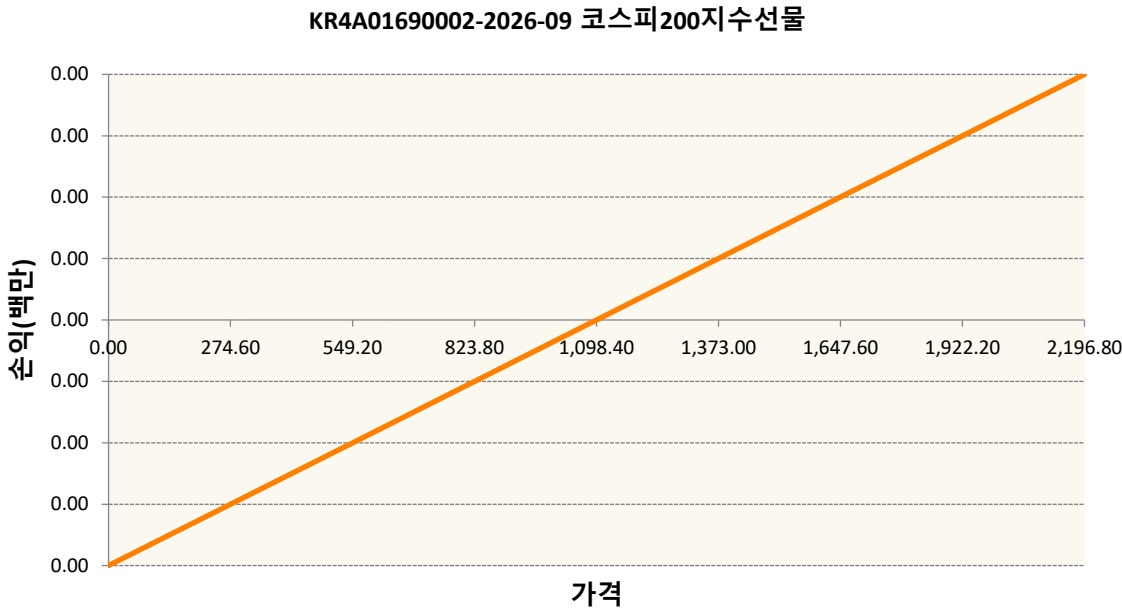
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

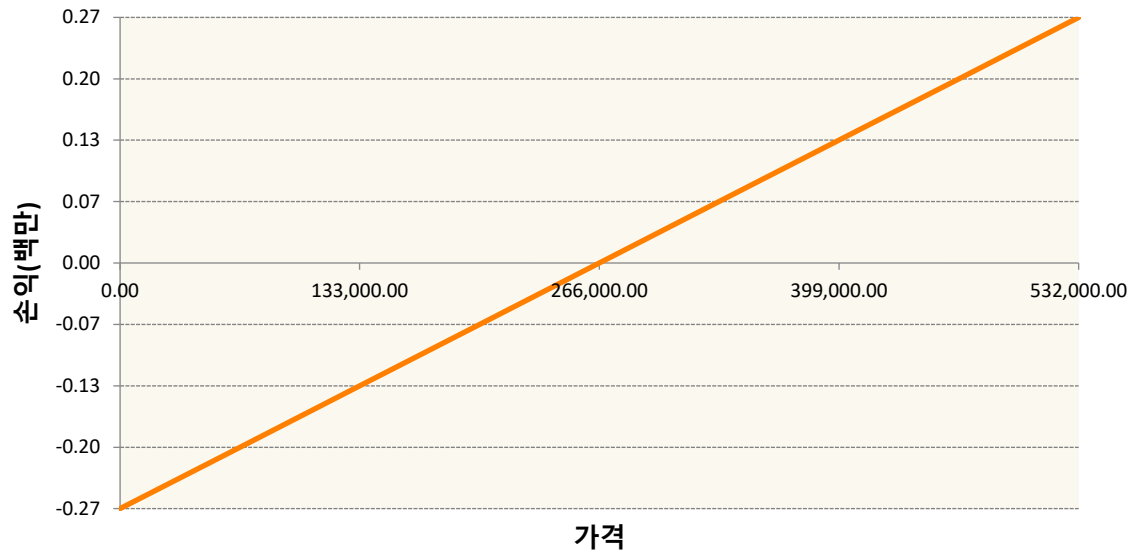
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	835	0	835	장내
누계	유가증권	선물	1,754	0	1,754	장내

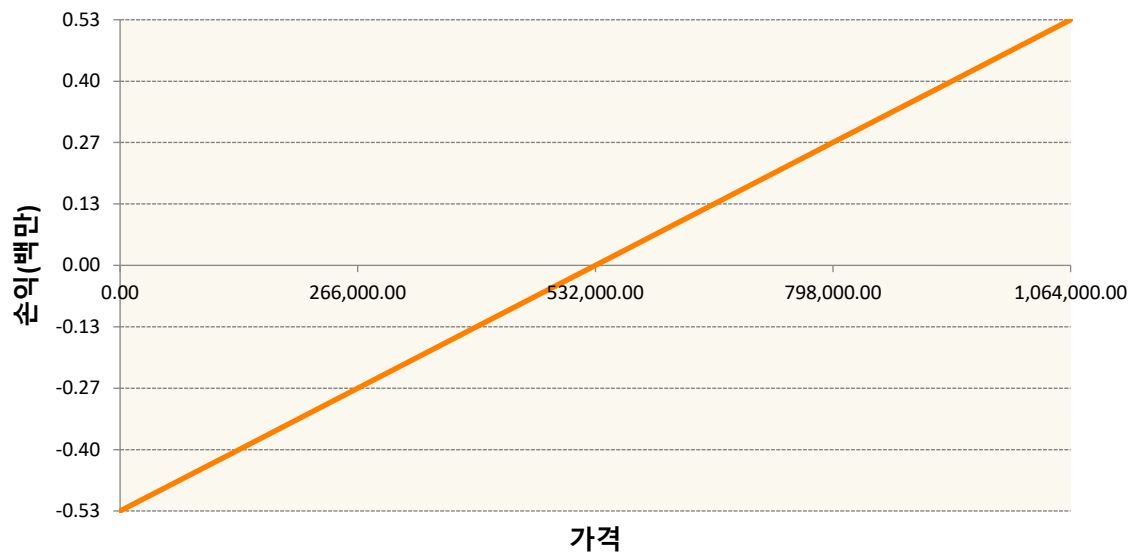
2. 만기시점의 손익구조



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
KR4A056A0007		2026-10 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)

295

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

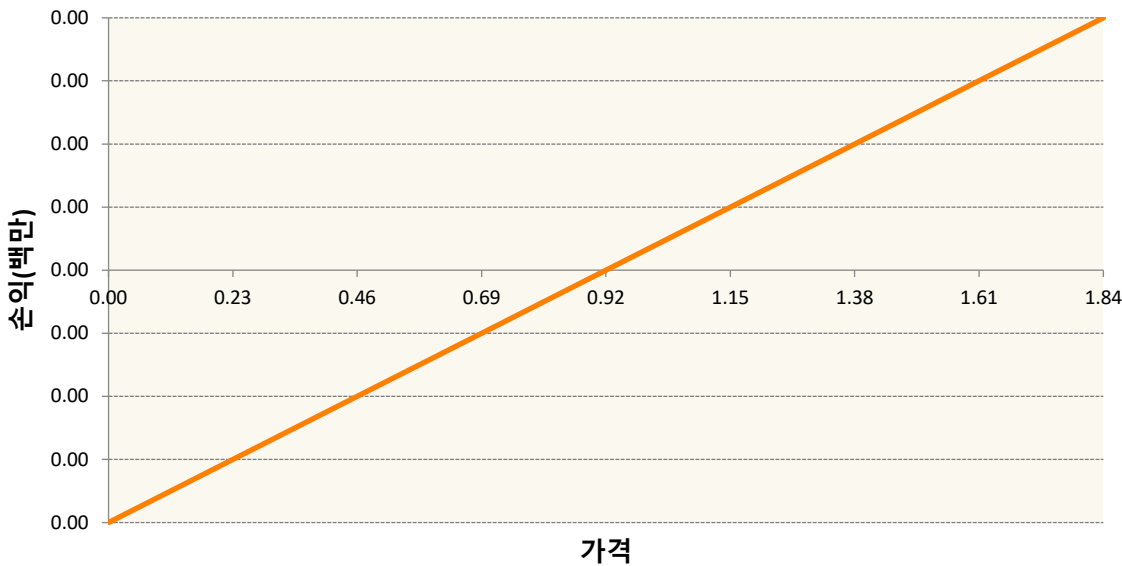
1. 계약금액

(단위:백만원)

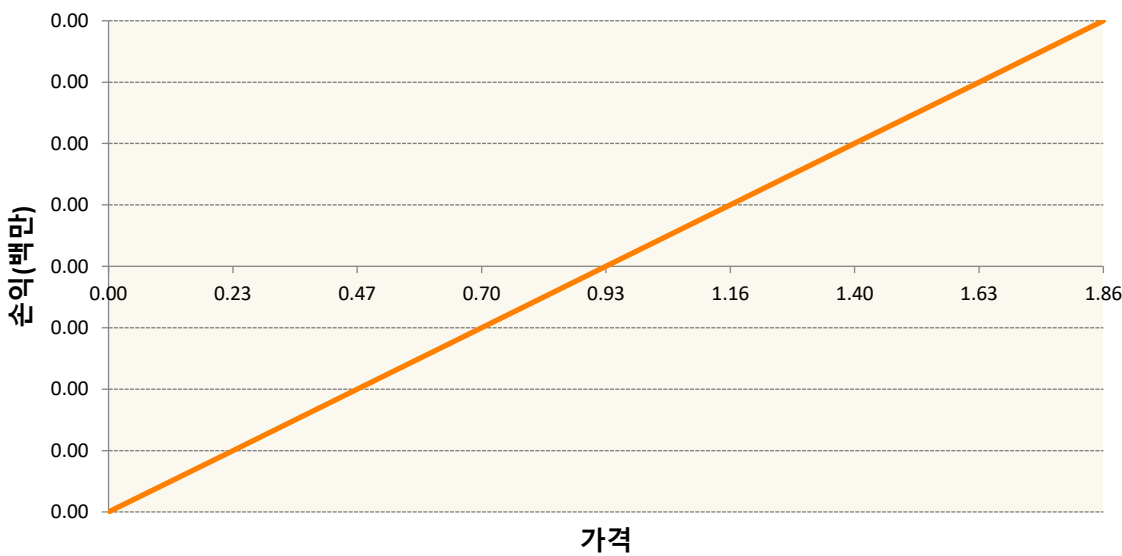
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,998	0	6,998	장외

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(		446
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		113

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	590

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

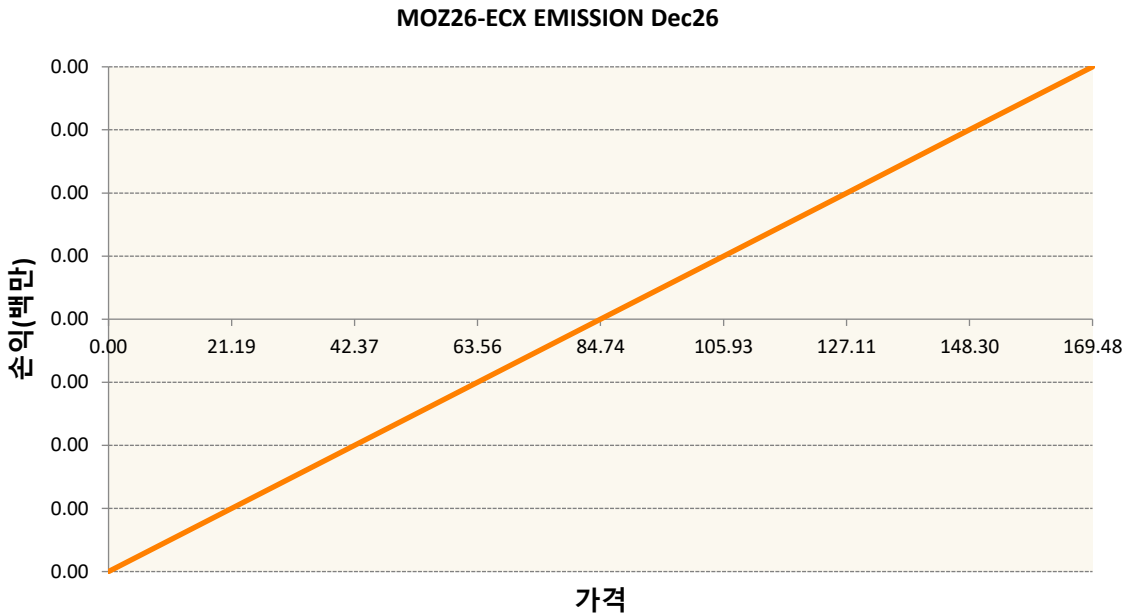
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,470	0	5,470	
누계	통화	선도	0	2,596	-2,596	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E	208
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	438

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

(단위:백만원)

687

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

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	-2,179	0	-2,179	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	72
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	33
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	29
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	43

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

(단위:백만원)

284

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

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	-6,163	0	-6,163	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	58
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	221
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	209

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

(단위:백만원)

923

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

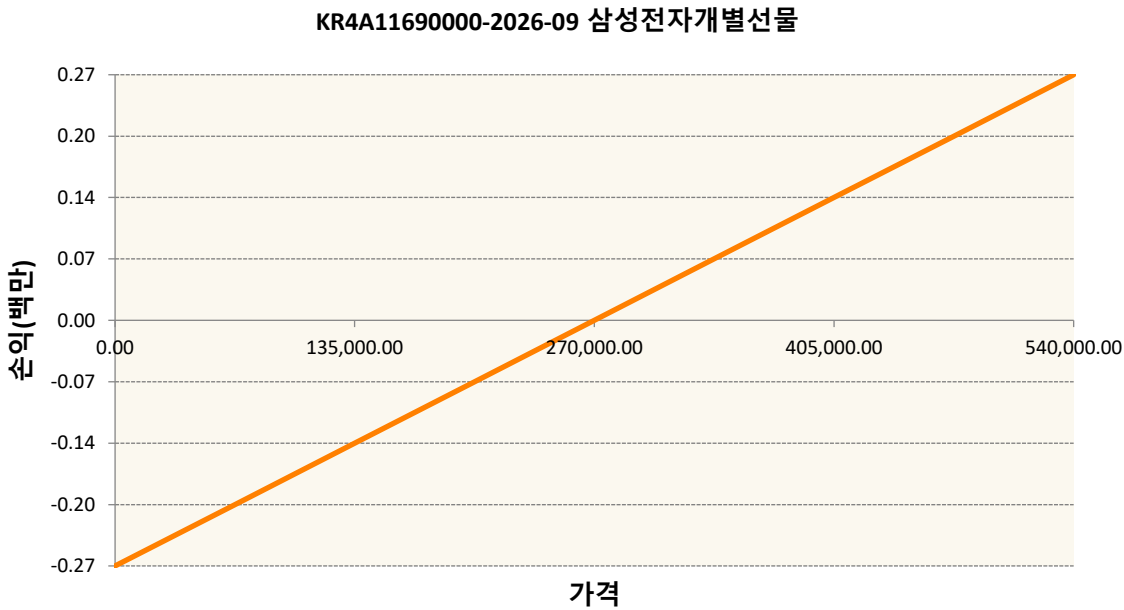
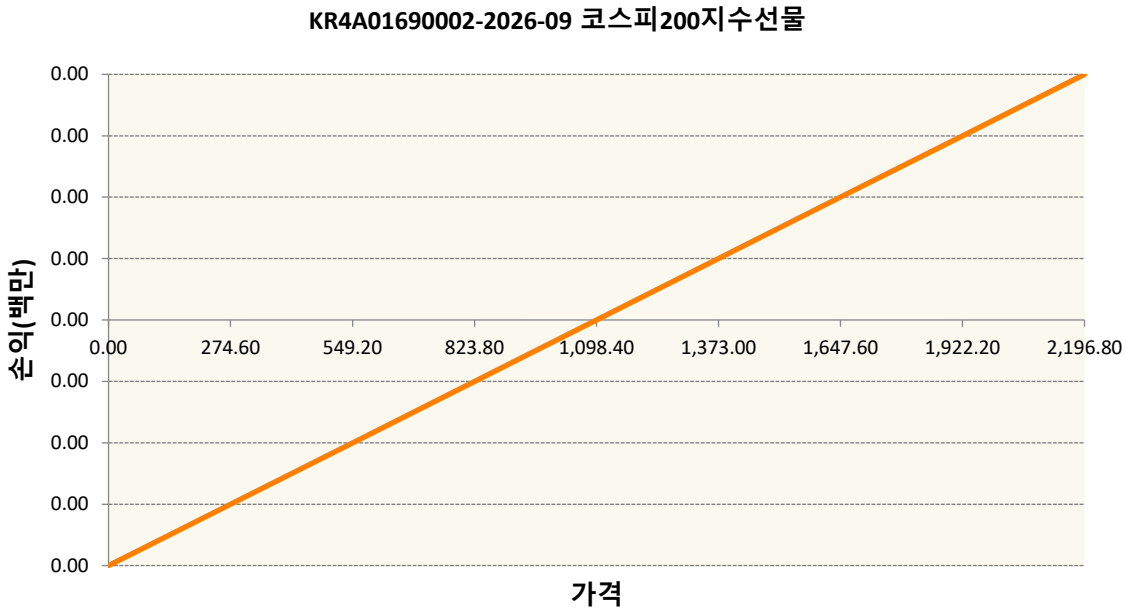
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

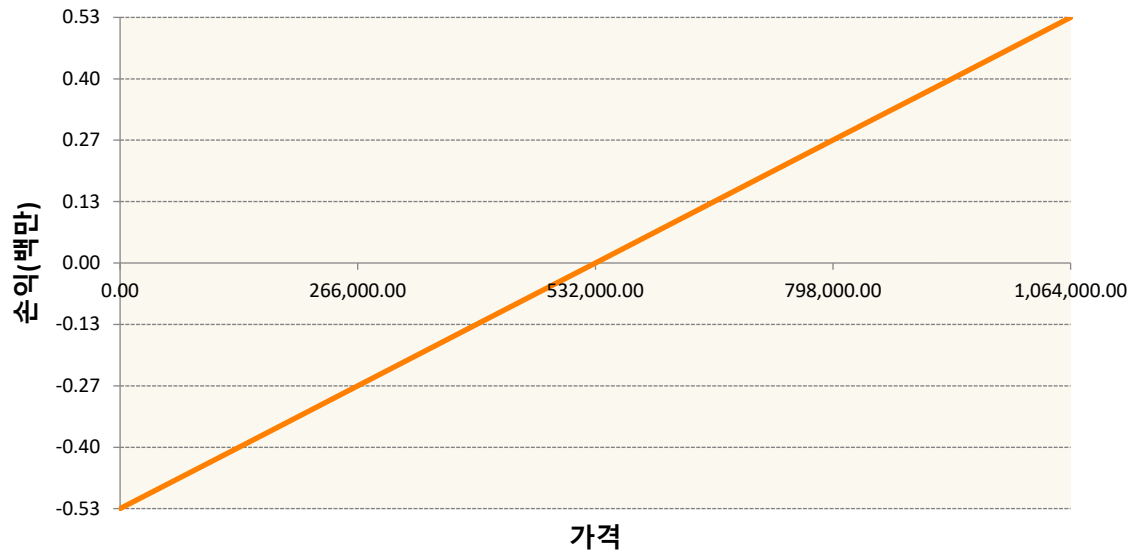
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,373	-1,373	장내
누계	유가증권	선물	17,707	0	17,707	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물						1,078
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	-1,078	
-5.33%	-719	-719	-719	-719	-719	-719	-719	
-2.67%	-359	-359	-359	-359	-359	-359	-359	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	359	359	359	359	359	359	359	
5.33%	719	719	719	719	719	719	719	
8.00%	1,078	1,078	1,078	1,078	1,078	1,078	1,078	
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						64
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64	
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42	
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21	
0%	0	0	0	0	0	0	0	

2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	64	64	64	64	64	64	64

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

(단위:백만원)

4,901

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

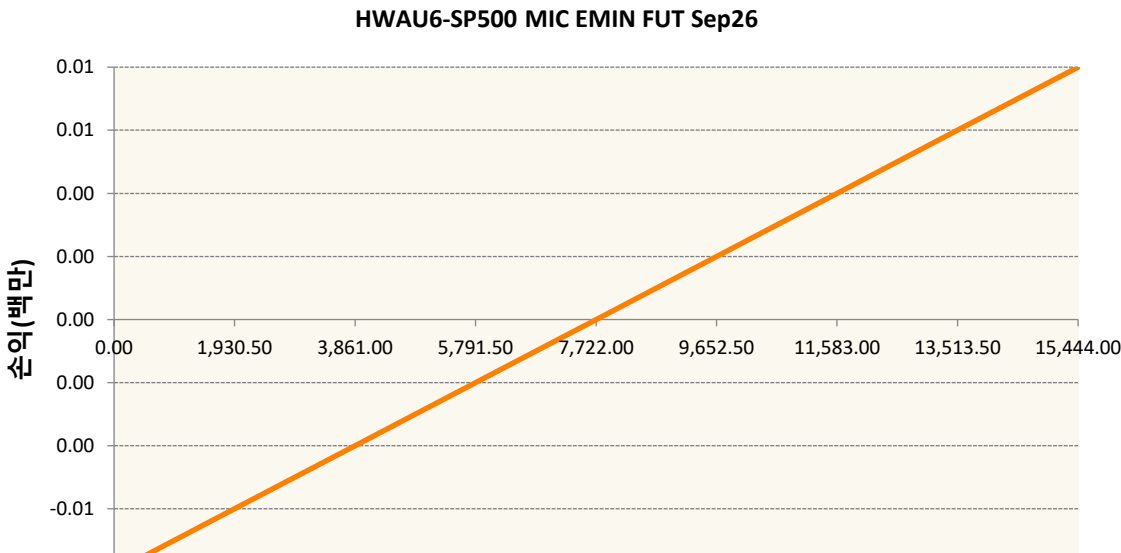
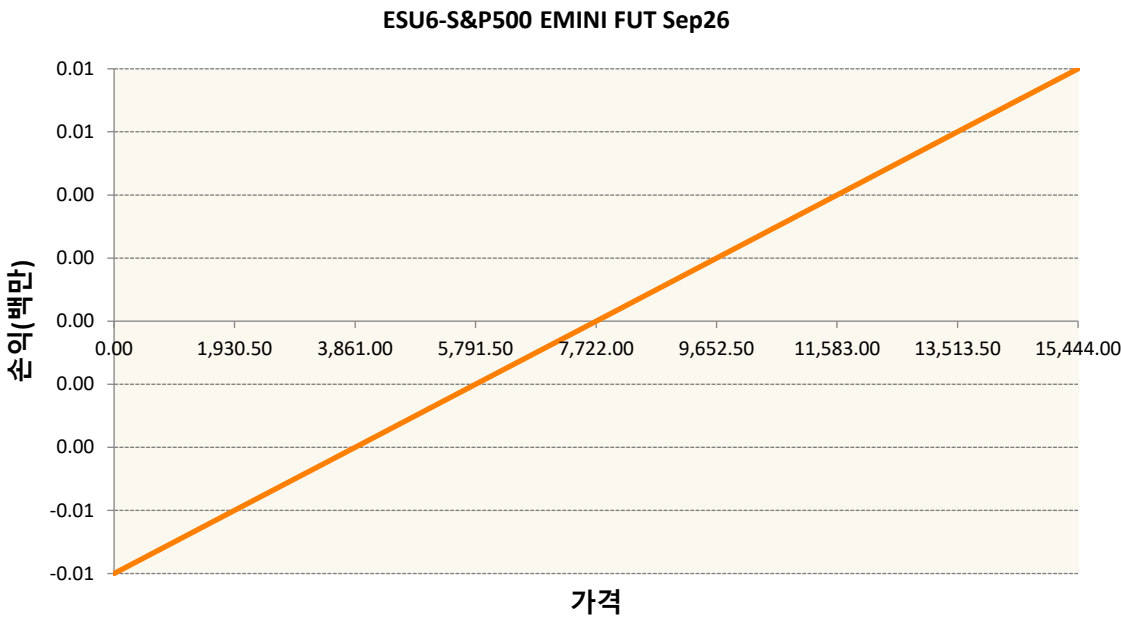
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

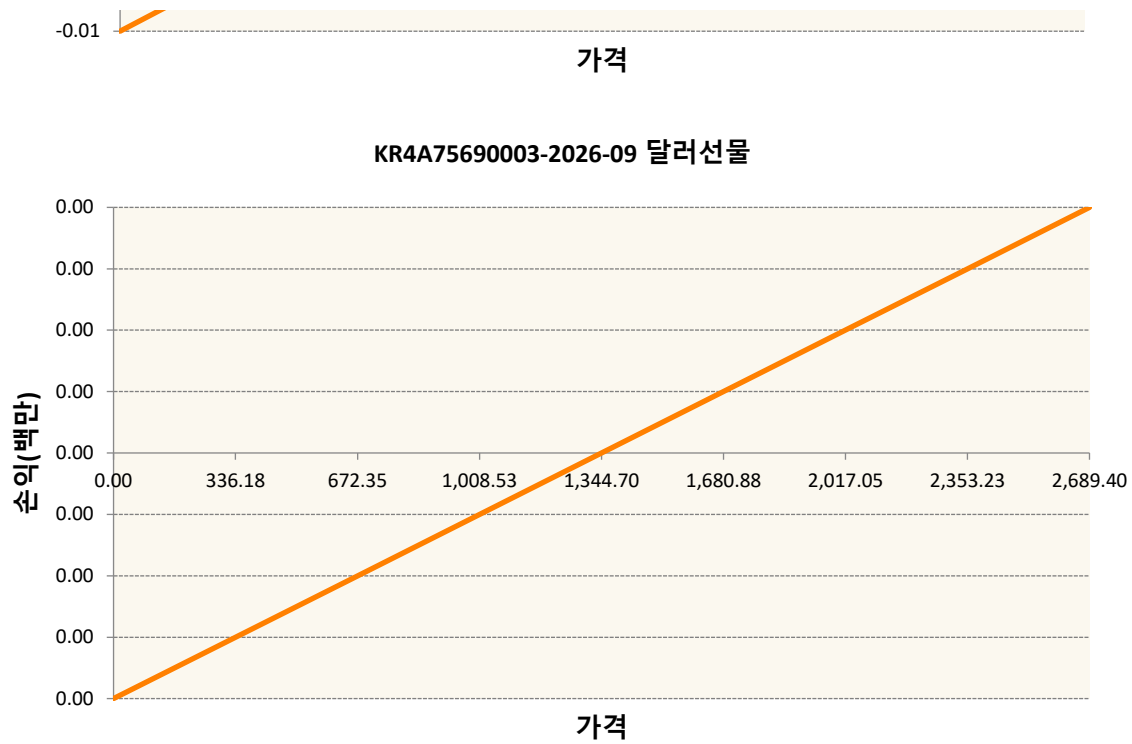
1. 계약금액

(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	672	0	672	장내
누계	지수	선물	78,991	0	78,991	
누계	지수	선물	385	0	385	장내
누계	통화	선물	9,547	0	9,547	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	6,319
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	31
KR4A756900	2026-09 달러선물	764

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

5,231

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

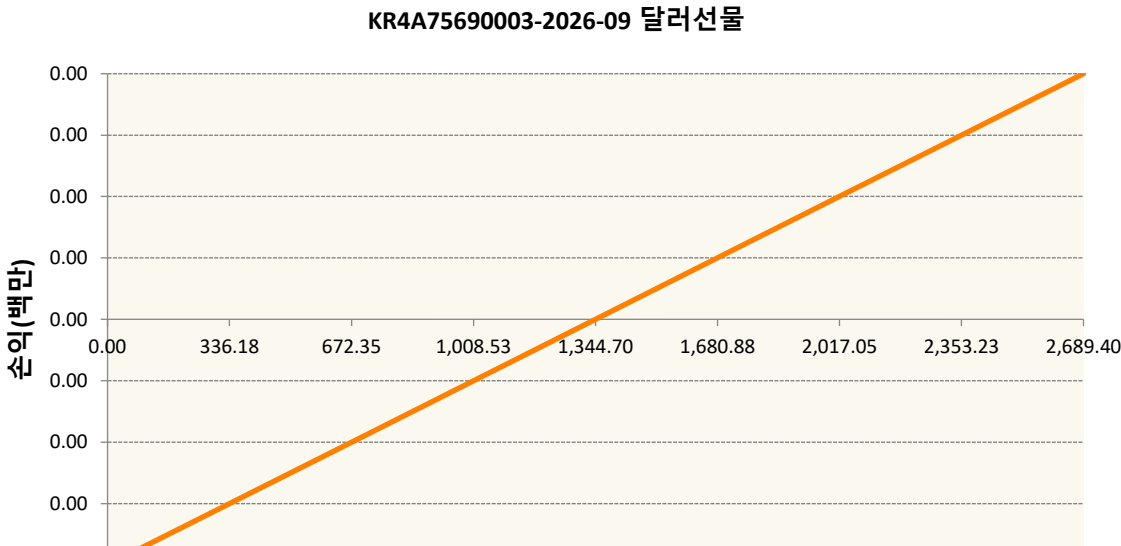
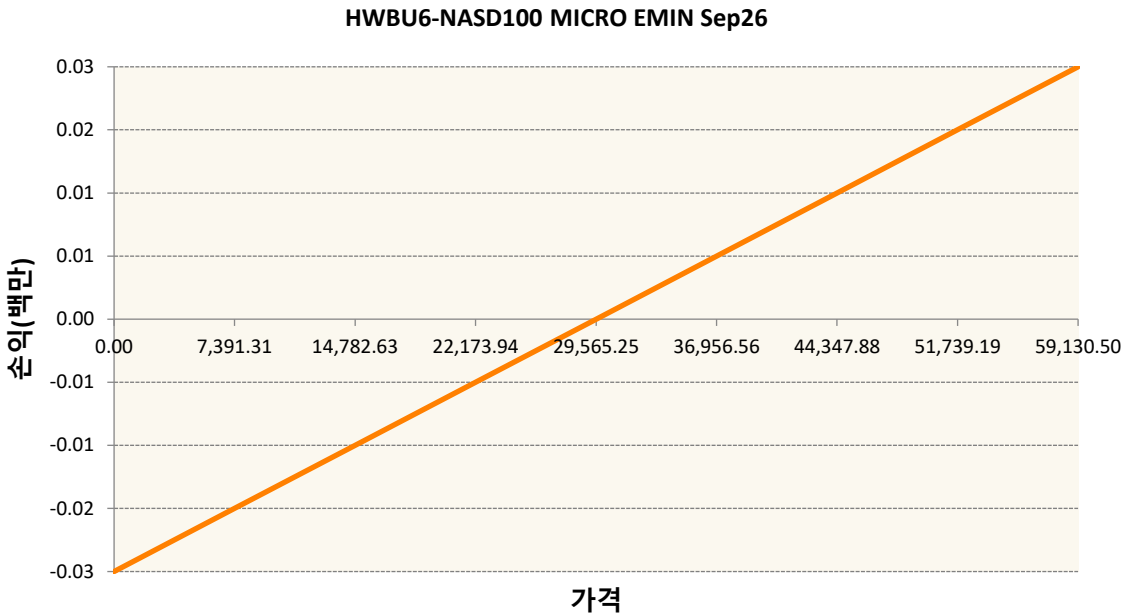
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

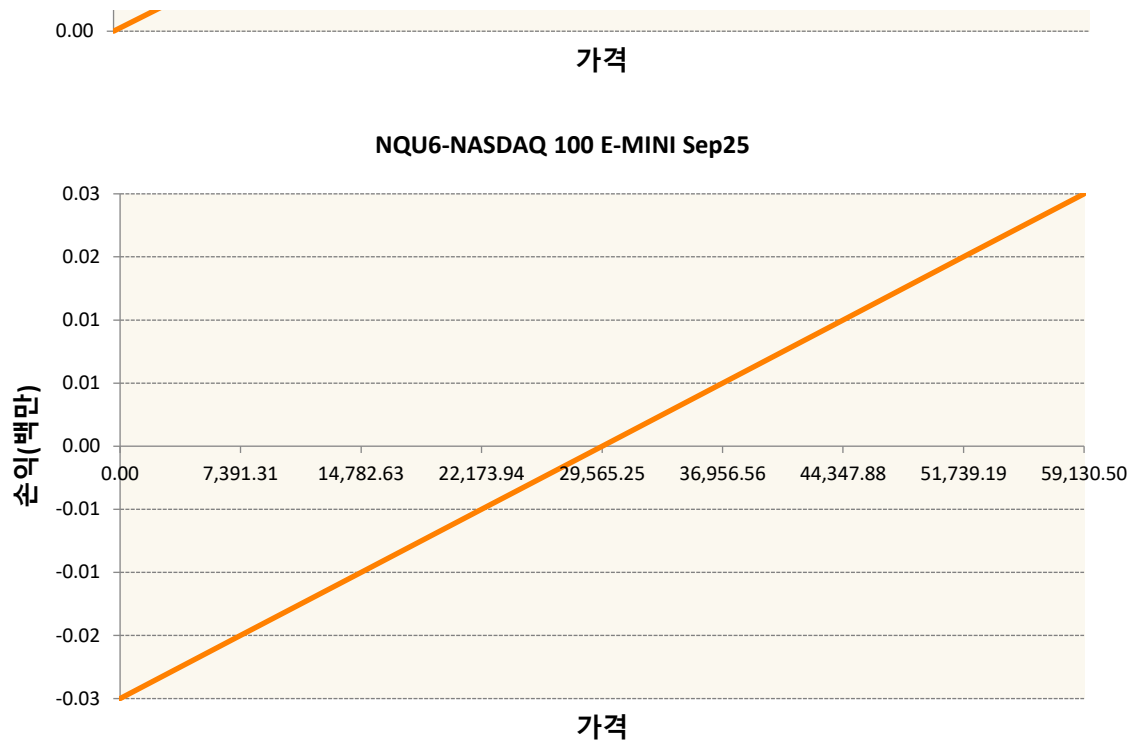
1. 계약금액

(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	336	0	336	장내
누계	유가증권	선물	741	0	741	장내
누계	지수	선물	38,133	0	38,133	
누계	통화	선물	4,384	0	4,384	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		59
KR4A756900	2026-09 달러선물		351
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		3,051

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,397

공시일	2026-09-09
기준일	2026-09-08

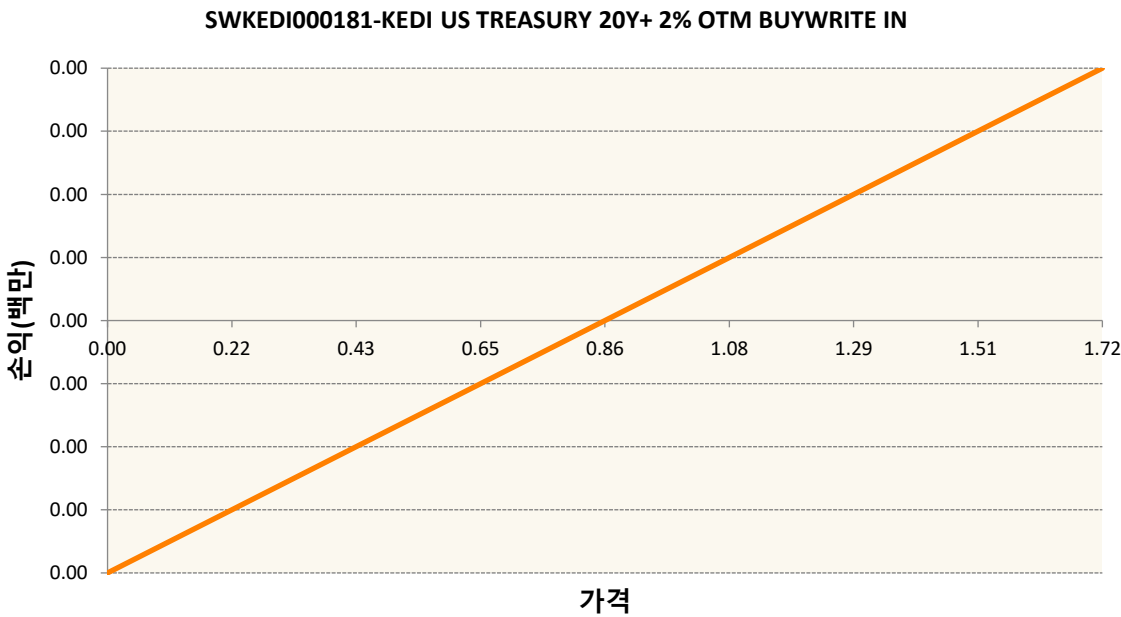
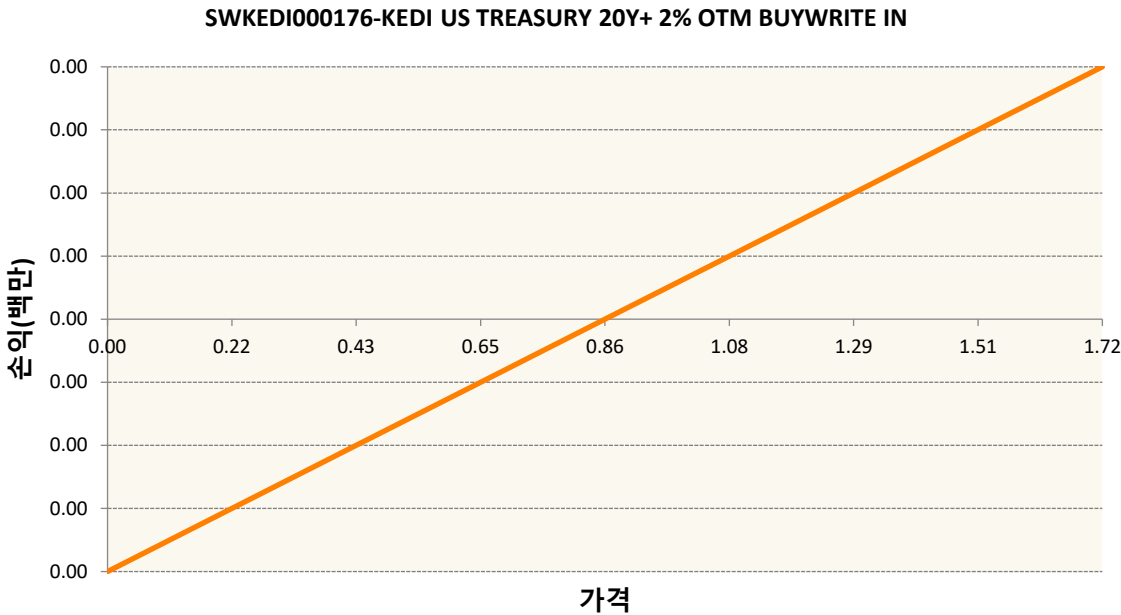
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

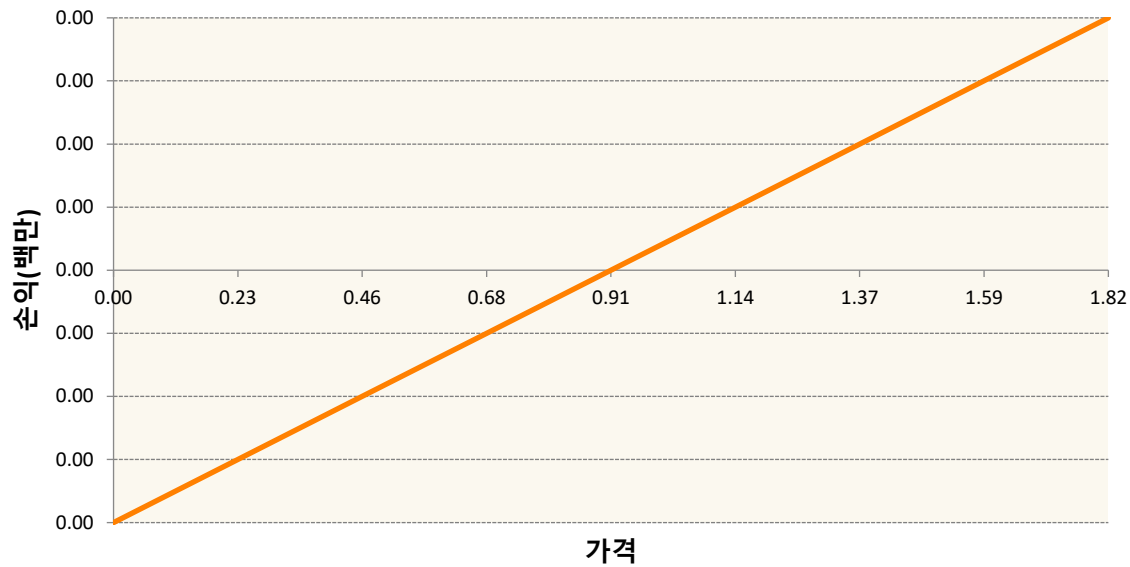
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	272,396	0	272,396	장외

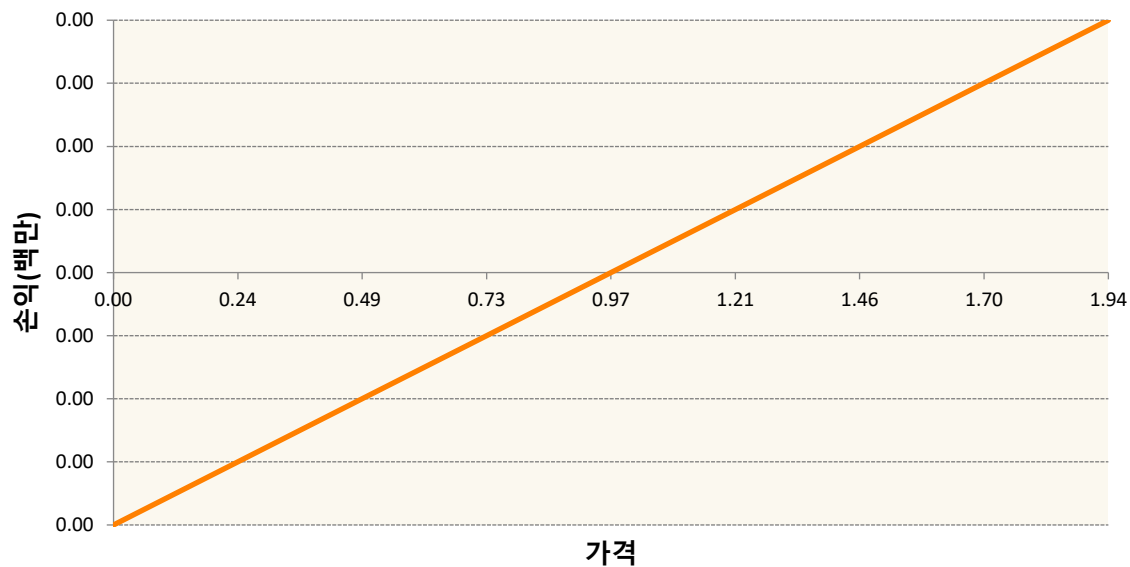
2. 만기시점의 손익구조



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	7,021
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,756
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,137
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,909

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

(단위:백만원)

8,676
