

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

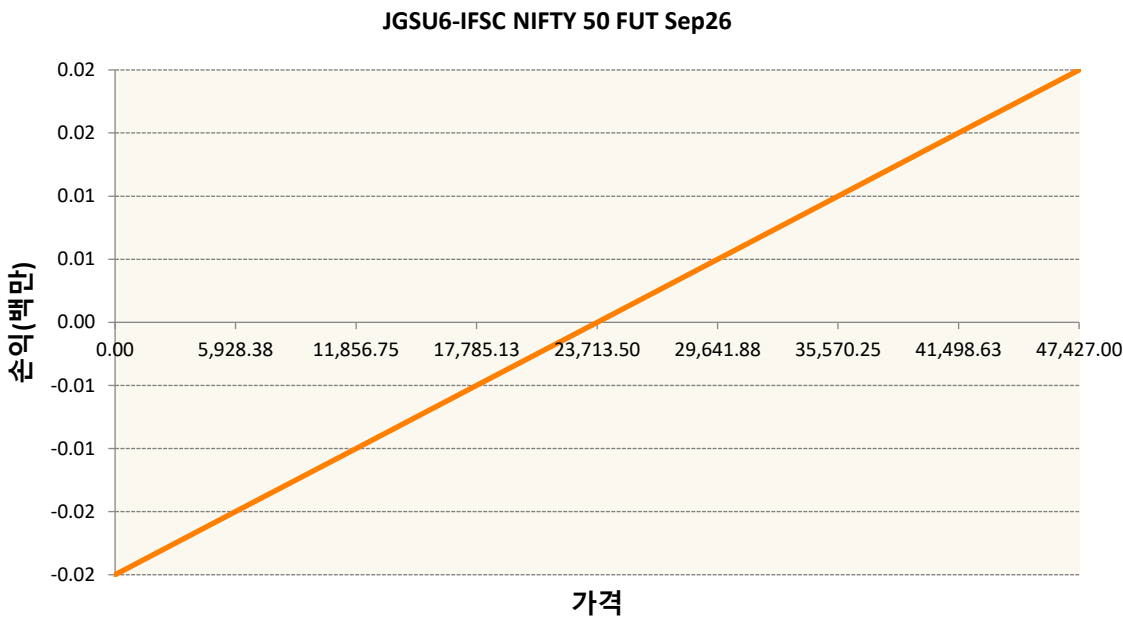
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	329	0	329	

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	2026-09-10
기준일	2026-09-09

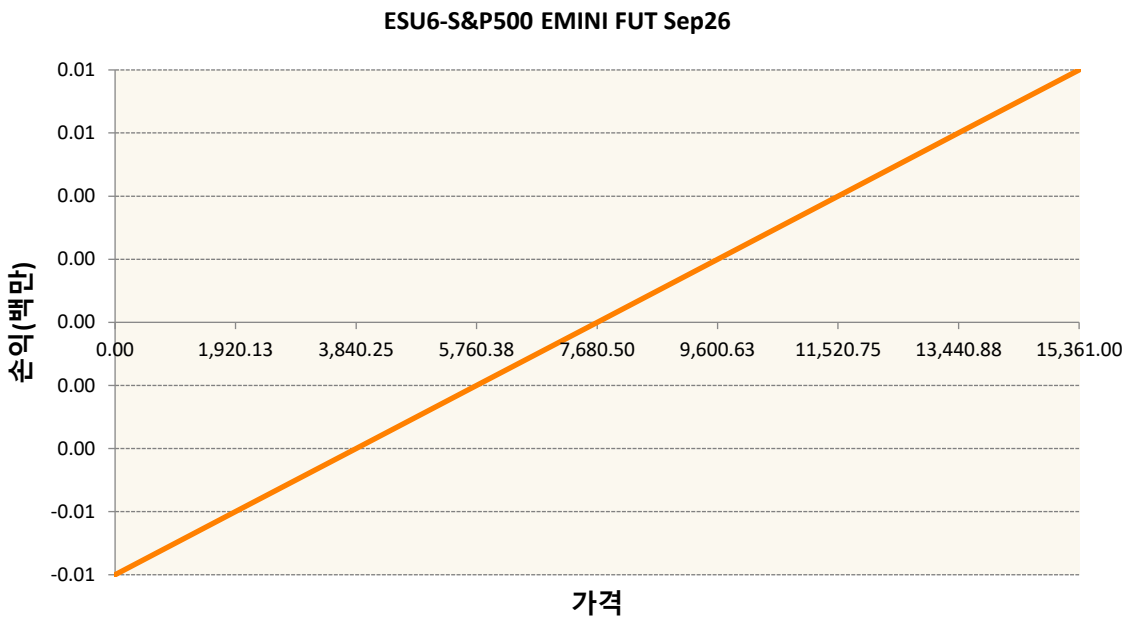
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	586	0	586	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	47
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

37

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

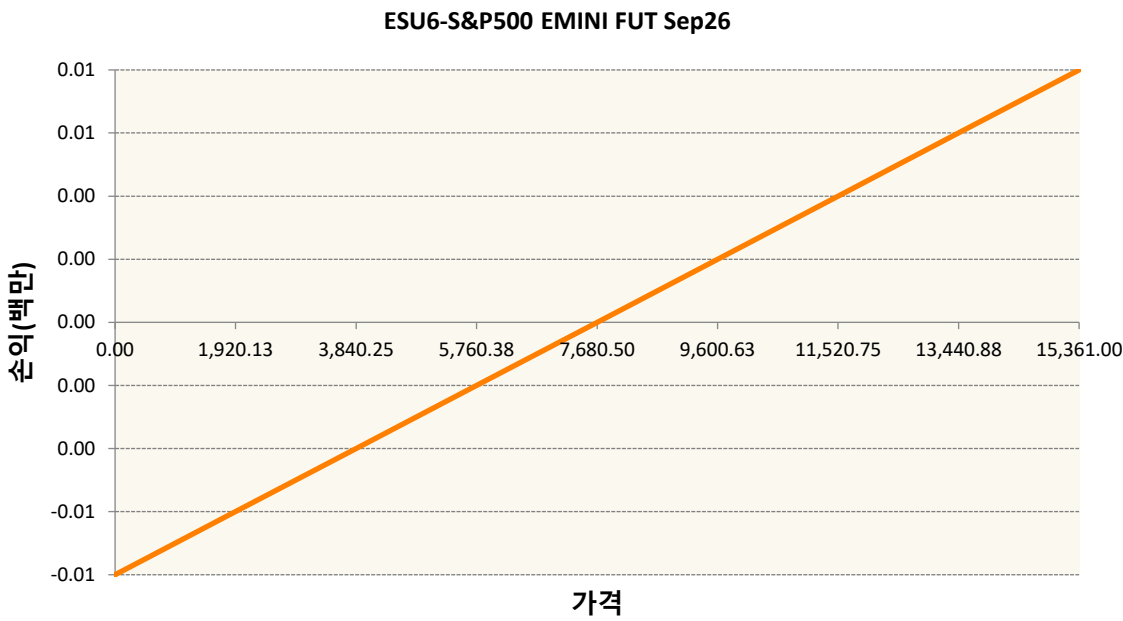
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	579	0	579	

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)

37

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

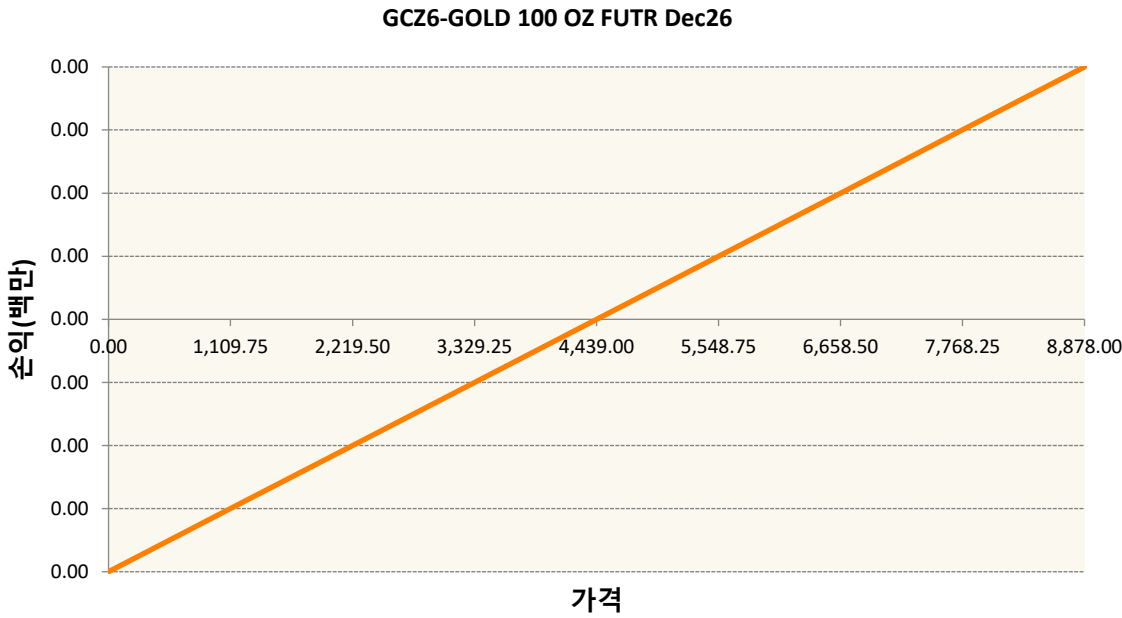
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			6,300	0	6,300	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 09/11/26 C417 EQUITY	4
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	504

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

(단위:백만원)

675

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

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	47
AOPLTRAP1{PLTR US 09/11/26 P187.5 EQUITY	11
AOPLTRSP1{PLTR US 09/11/26 P182.5 EQUITY	21

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

(단위:백만원)

273

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

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)

14,899

공시일 2026-09-10

기준일 2026-09-09

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	2026-09-10
기준일	2026-09-09

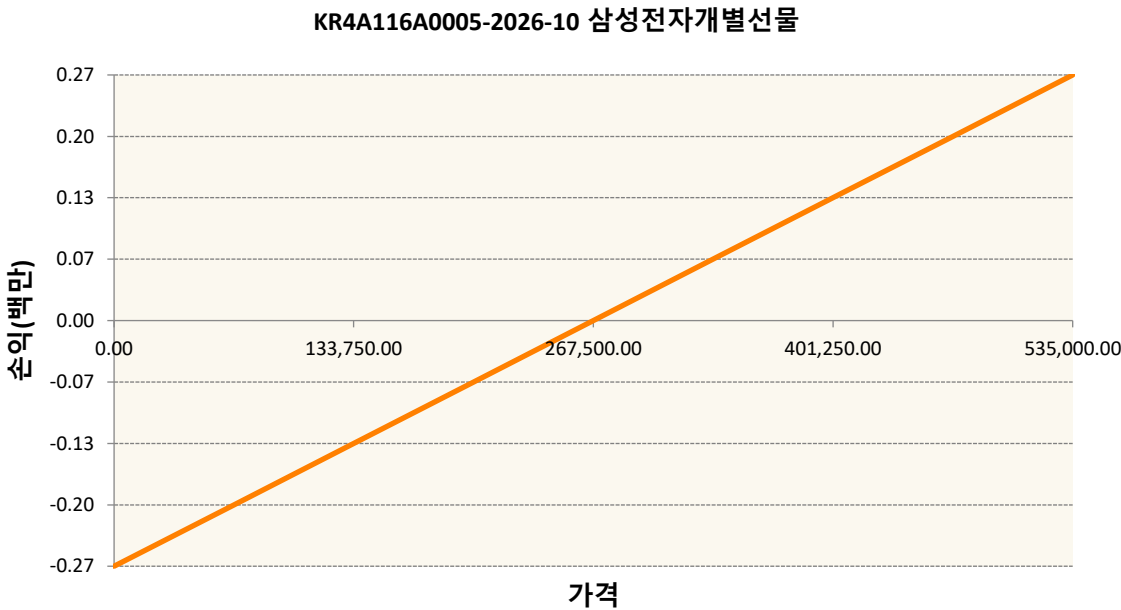
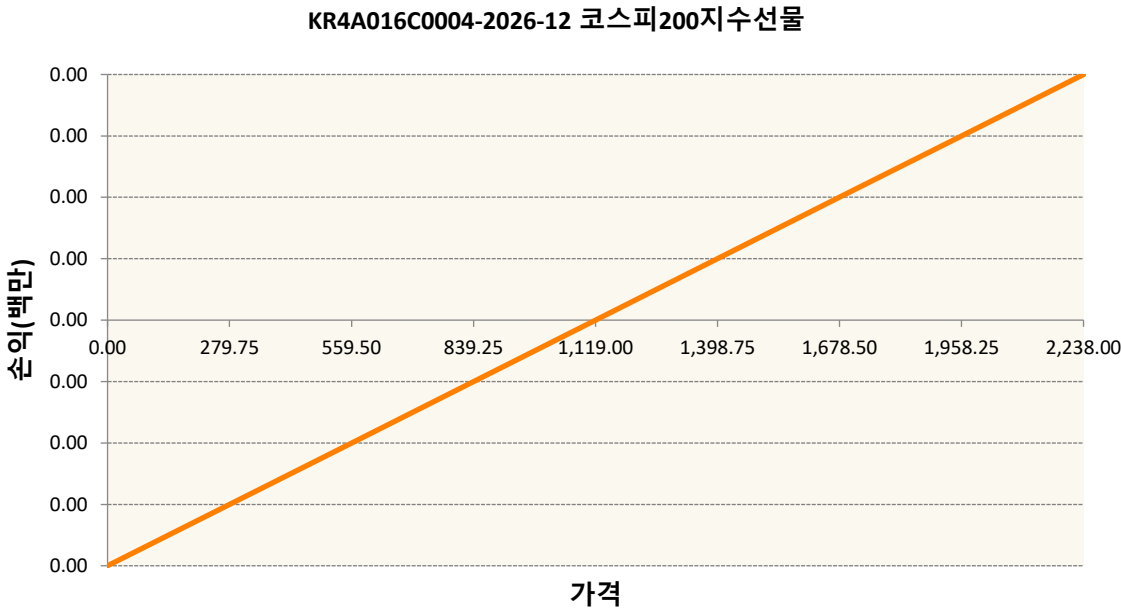
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

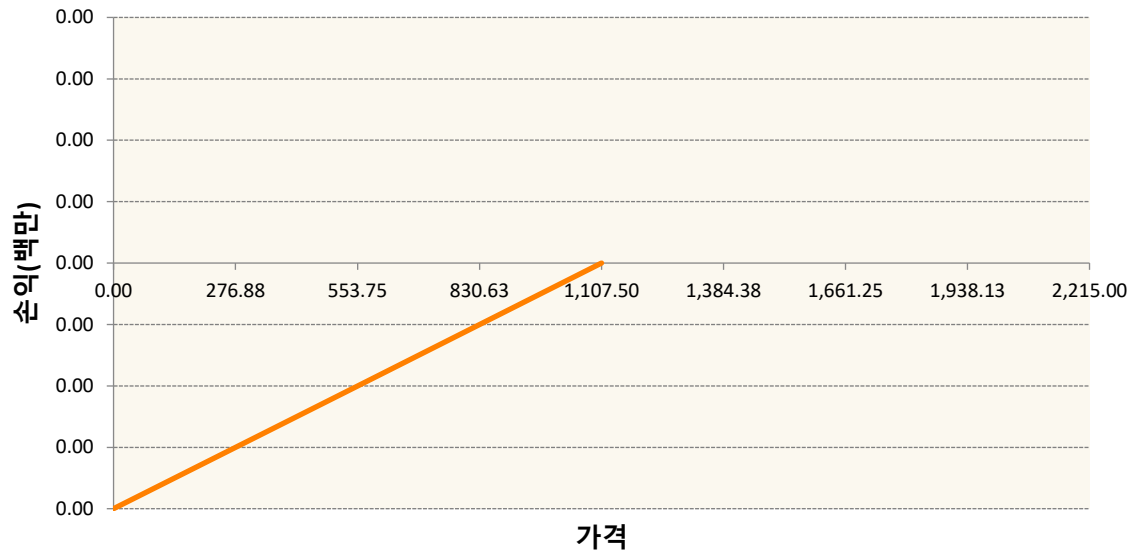
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,215	0	7,215	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	21,719	0	21,719	장내
누계	유가증권	옵션	0	53,485	-53,485	장내

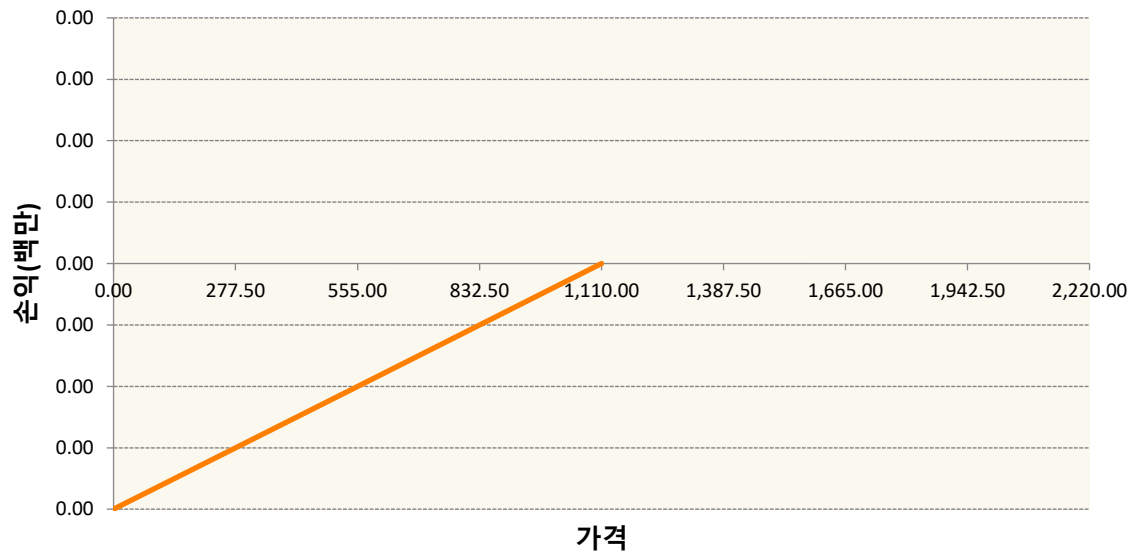
2. 만기시점의 손익구조



KR4B0169A444-코스피|200 C 202609 1107.5



KR4B0169A451-코스피|200 C 202609 1110.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004			2026-12 코스피200지수선물				580
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-580	-580	-580	-580	-580	-580	-580
-5.33%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386
-2.67%	-193	-193	-193	-193	-193	-193	-193
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	193	193	193	193	193	193	193
5.33%	386	386	386	386	386	386	386
8.00%	580	580	580	580	580	580	580
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							2,143

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,140	-2,140	-2,140	-2,140	-2,141	-2,142	-2,143
-5.33%	-1,279	-1,281	-1,284	-1,288	-1,293	-1,300	-1,308
-2.67%	-461	-478	-496	-515	-535	-556	-578
0%	79	53	27	0	-27	-54	-81
2.67%	226	218	208	197	183	169	153
5.33%	237	237	236	234	231	227	223
8.00%	237	237	237	237	237	236	236

KR4B0169A451 코스피200 C 202609 1110.0							1,450
-------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-------

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,448	-1,448	-1,448	-1,448	-1,449	-1,449	-1,450
-5.33%	-877	-878	-879	-881	-884	-888	-893
-2.67%	-328	-337	-348	-360	-373	-386	-400
0%	54	36	18	0	-18	-36	-54
2.67%	168	162	154	146	136	125	114
5.33%	178	177	176	175	173	170	166
8.00%	178	178	178	178	178	177	176

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

(단위:백만원)

12,713

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

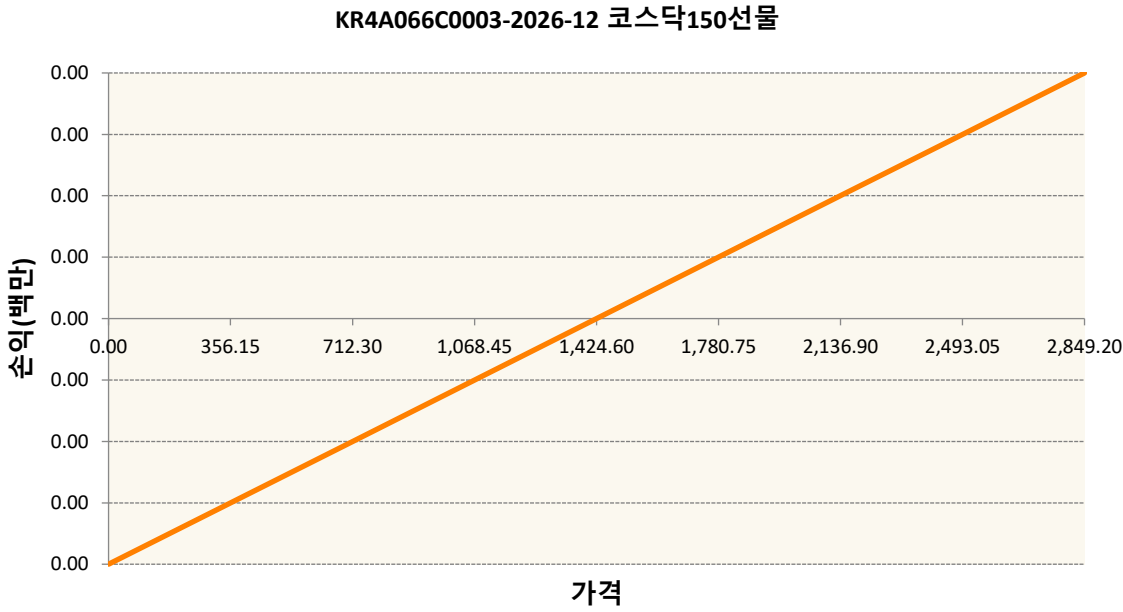
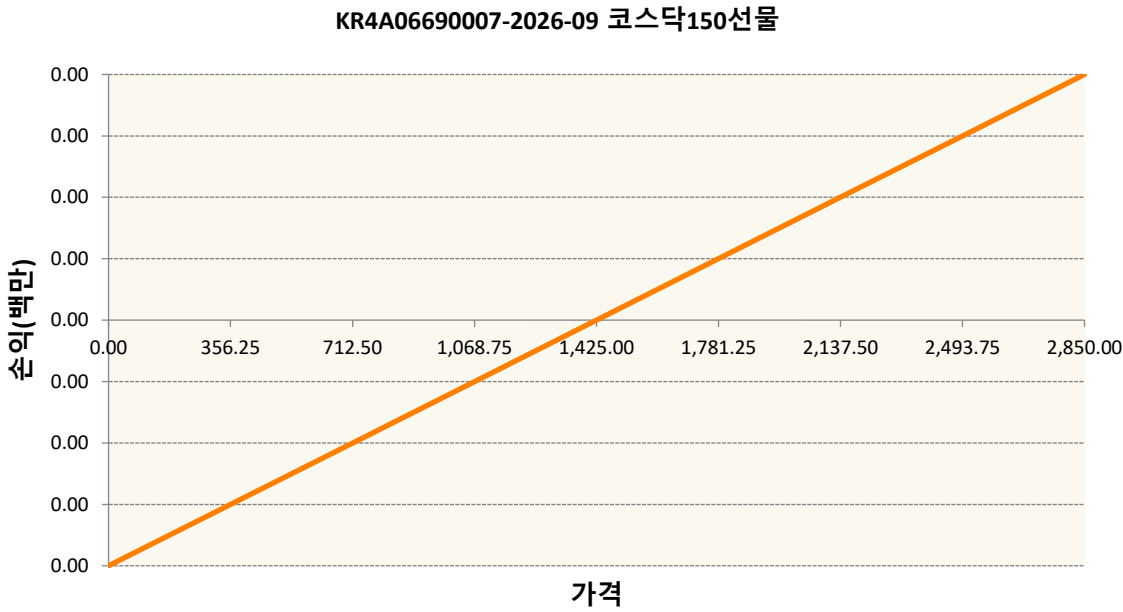
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	655	0	655	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A06690007		2026-09 코스닥150선물					37
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	37	37	37	37	37	37	37
KR4A066C0003		2026-12 코스닥150선물					16
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	16	16	16	16	16	16	16

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

166

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

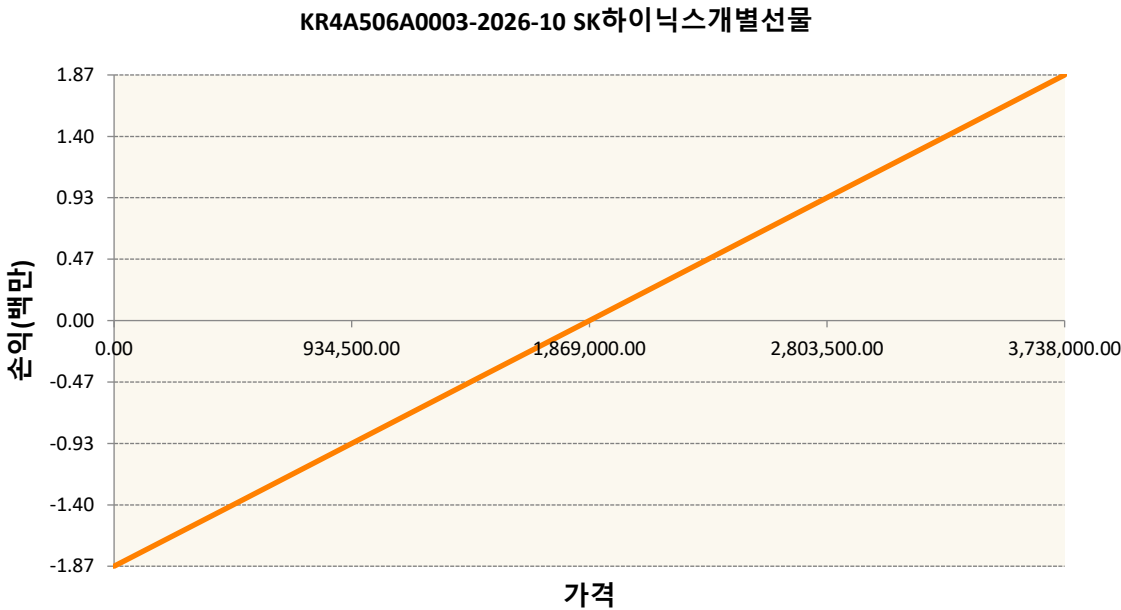
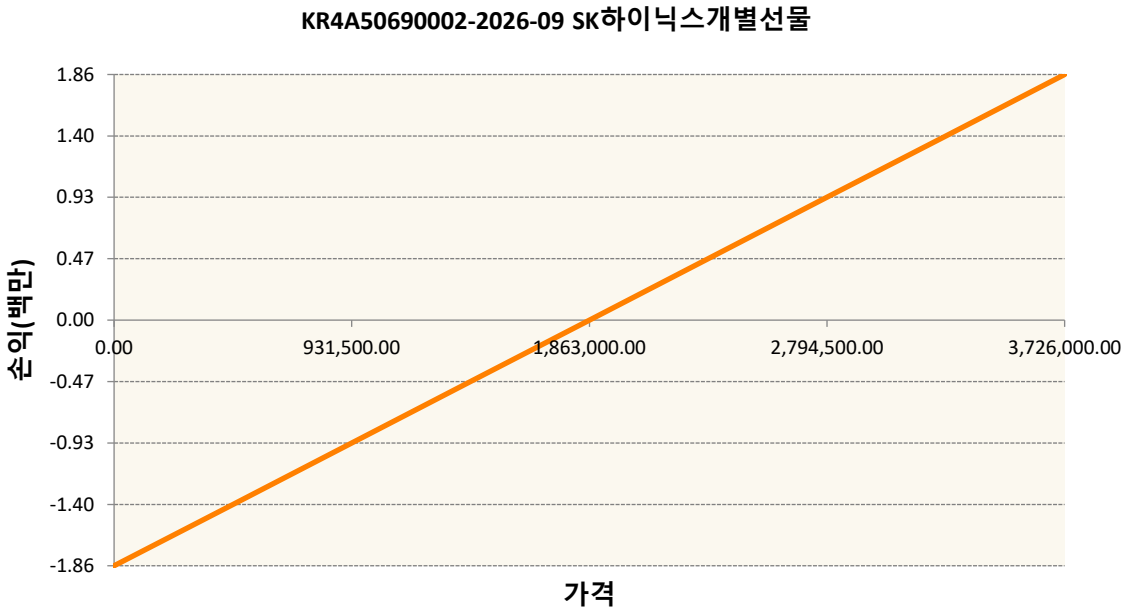
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	14,954	13,052	1,902	장내
누계	유가증권	선물	49,827	0	49,827	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A50690002		2026-09 SK하이닉스개별선물					941
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-941	-941	-941	-941	-941	-941	-941
-5.33%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-2.67%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	314	314	314	314	314	314	314
5.33%	628	628	628	628	628	628	628
8.00%	941	941	941	941	941	941	941
KR4A506A0003		2026-10 SK하이닉스개별선물					3,020
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,020	-3,020	-3,020	-3,020	-3,020	-3,020	-3,020
-5.33%	-2,013	-2,013	-2,013	-2,013	-2,013	-2,013	-2,013
-2.67%	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007	-1,007
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,007	1,007	1,007	1,007	1,007	1,007	1,007
5.33%	2,013	2,013	2,013	2,013	2,013	2,013	2,013
8.00%	3,020	3,020	3,020	3,020	3,020	3,020	3,020

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

18,636

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

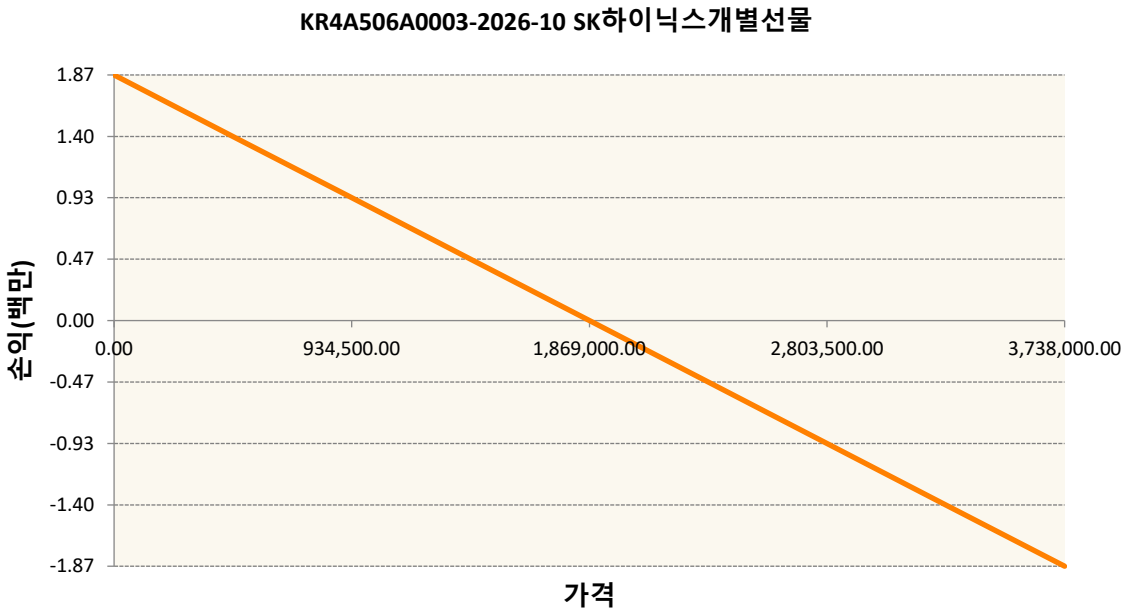
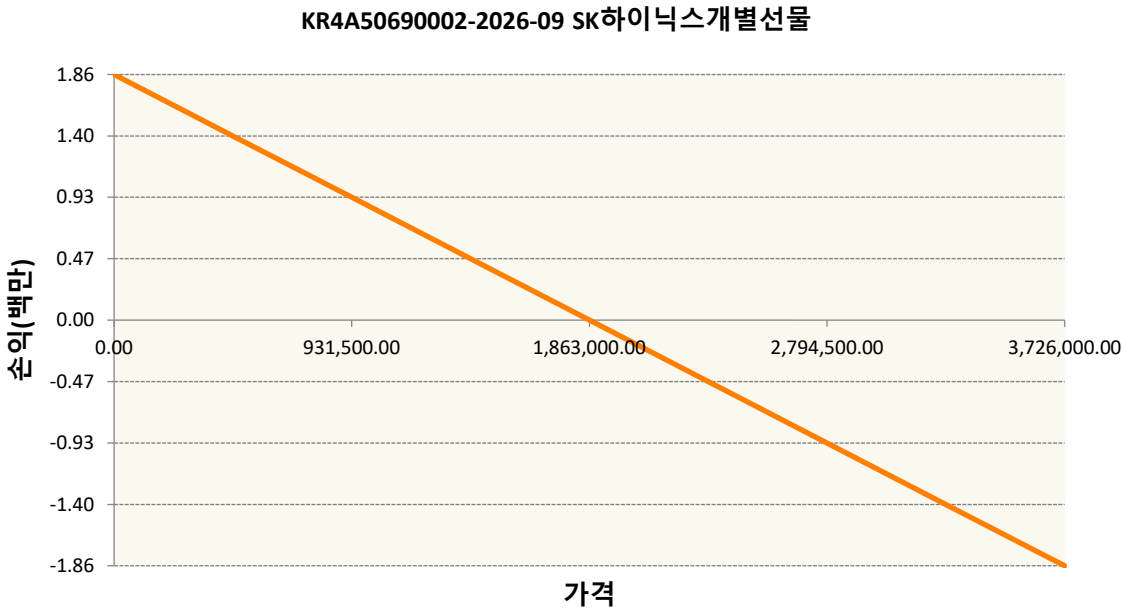
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	66,000	98,487	-32,488	장내
누계	유가증권	선물	0	173,021	-173,021	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A50690002			2026-09 SK하이닉스개별선물				3,516
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,516	3,516	3,516	3,516	3,516	3,516	3,516
-5.33%	2,344	2,344	2,344	2,344	2,344	2,344	2,344
-2.67%	1,172	1,172	1,172	1,172	1,172	1,172	1,172
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172
5.33%	-2,344	-2,344	-2,344	-2,344	-2,344	-2,344	-2,344
8.00%	-3,516	-3,516	-3,516	-3,516	-3,516	-3,516	-3,516
KR4A506A0003			2026-10 SK하이닉스개별선물				10,241
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	10,241	10,241	10,241	10,241	10,241	10,241	10,241
-5.33%	6,827	6,827	6,827	6,827	6,827	6,827	6,827
-2.67%	3,414	3,414	3,414	3,414	3,414	3,414	3,414
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-3,414	-3,414	-3,414	-3,414	-3,414	-3,414	-3,414
5.33%	-6,827	-6,827	-6,827	-6,827	-6,827	-6,827	-6,827
8.00%	-10,241	-10,241	-10,241	-10,241	-10,241	-10,241	-10,241

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

64,716

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

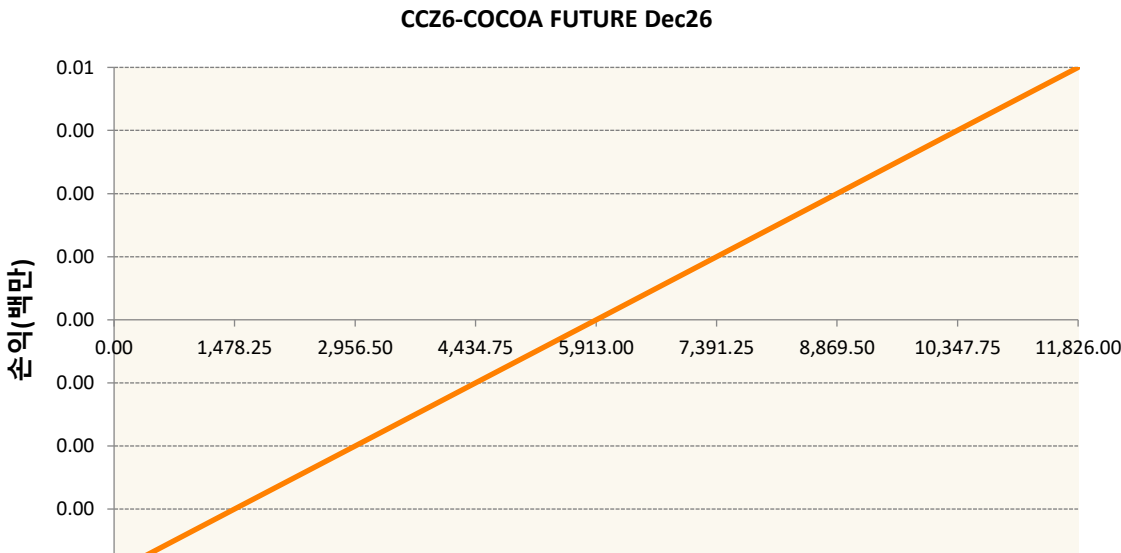
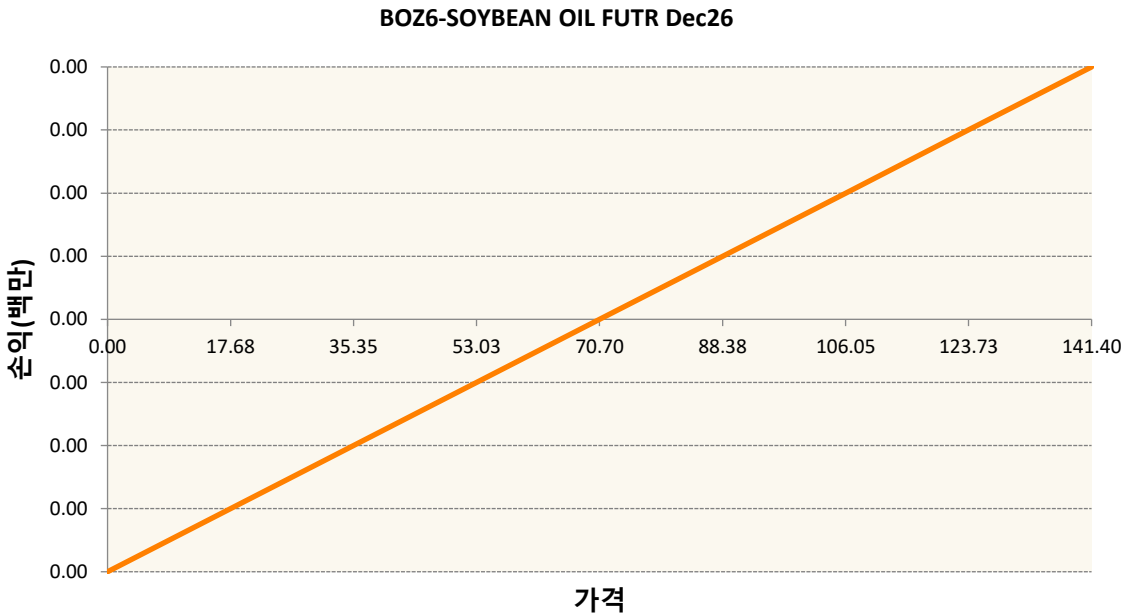
포커스농산물모(채권-파생형)

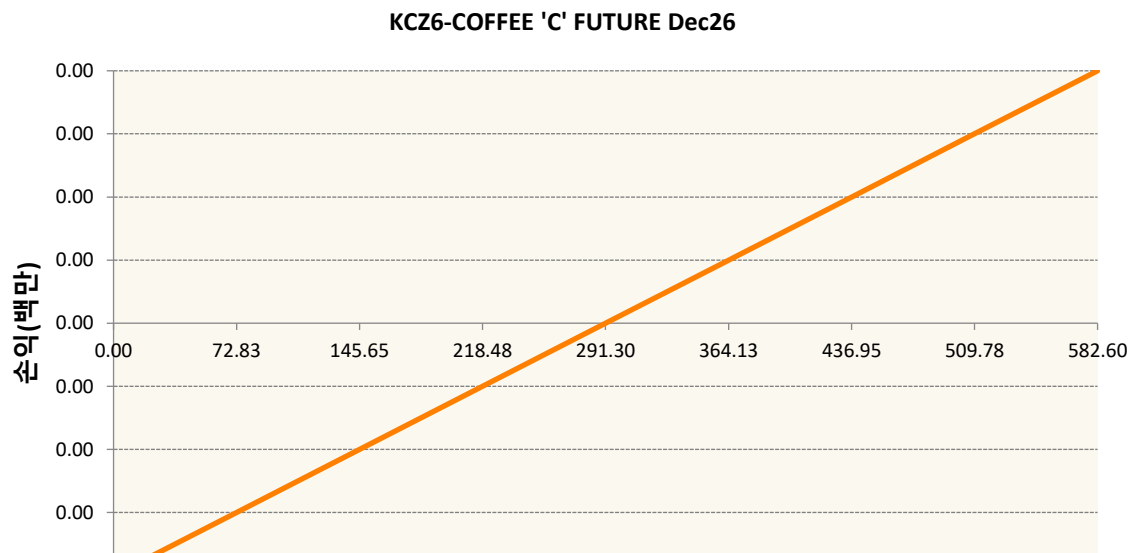
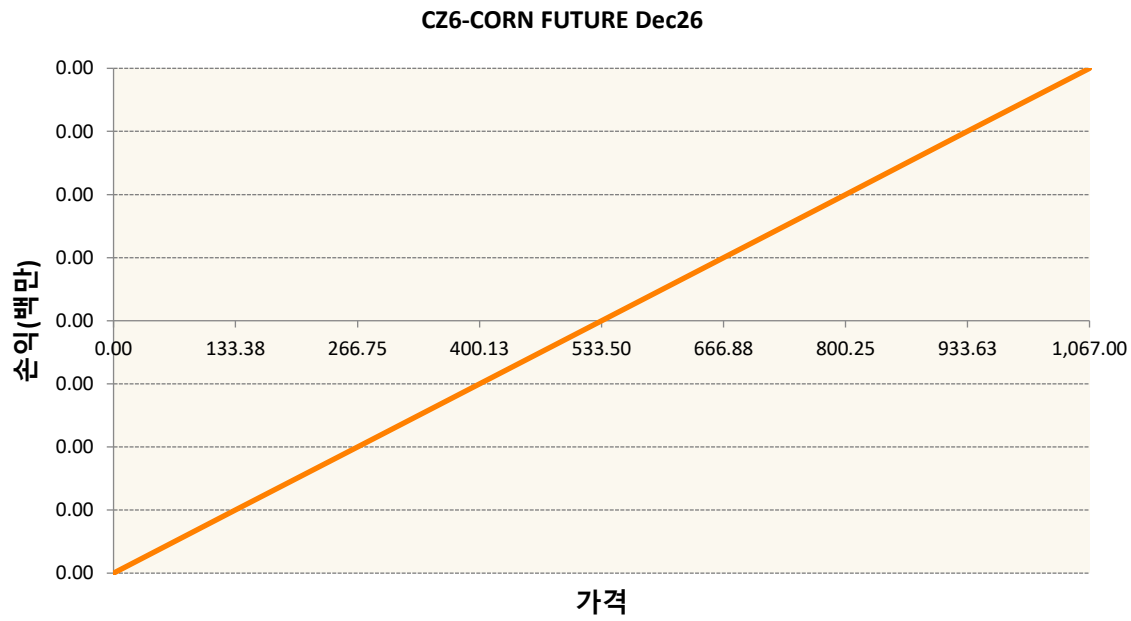
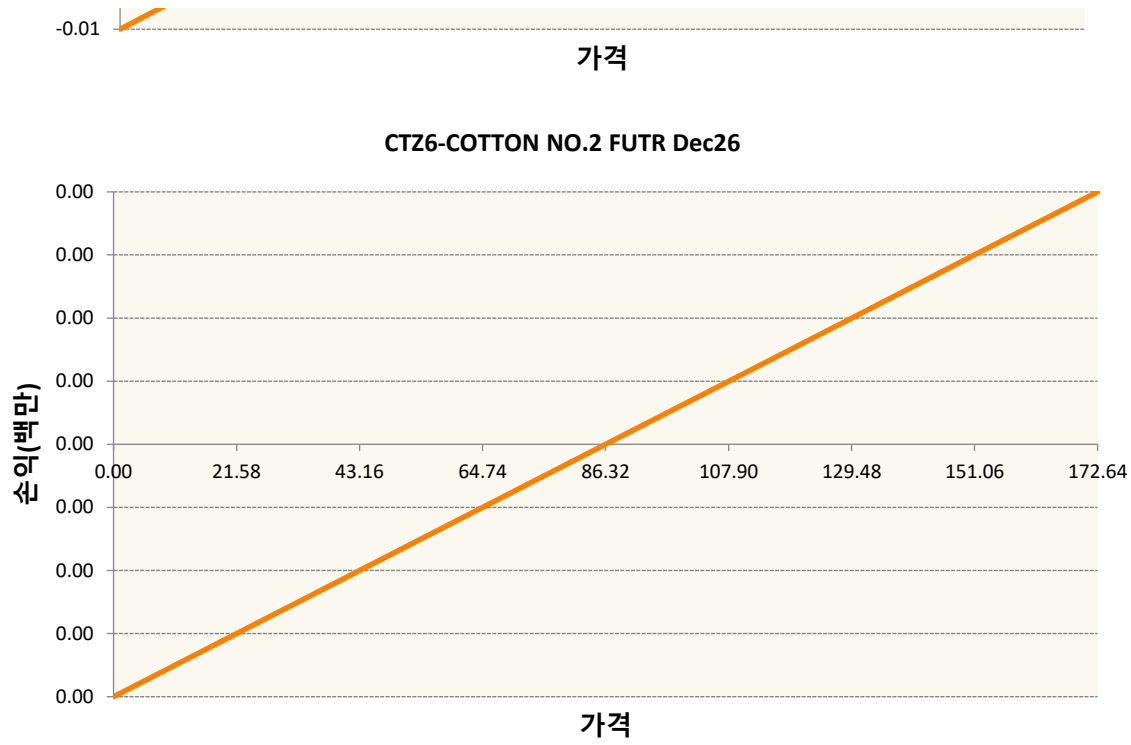
1. 계약금액

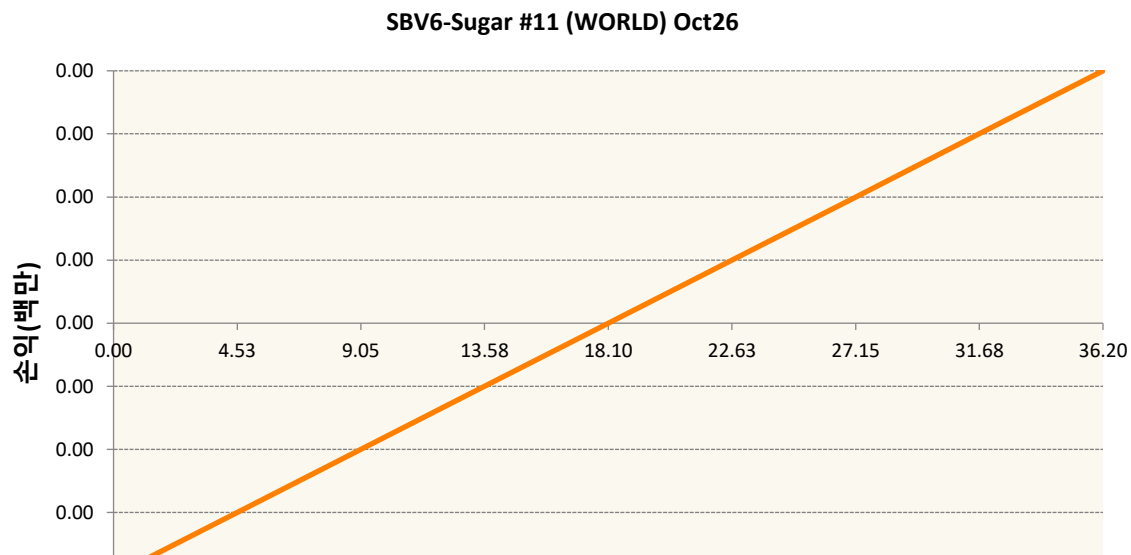
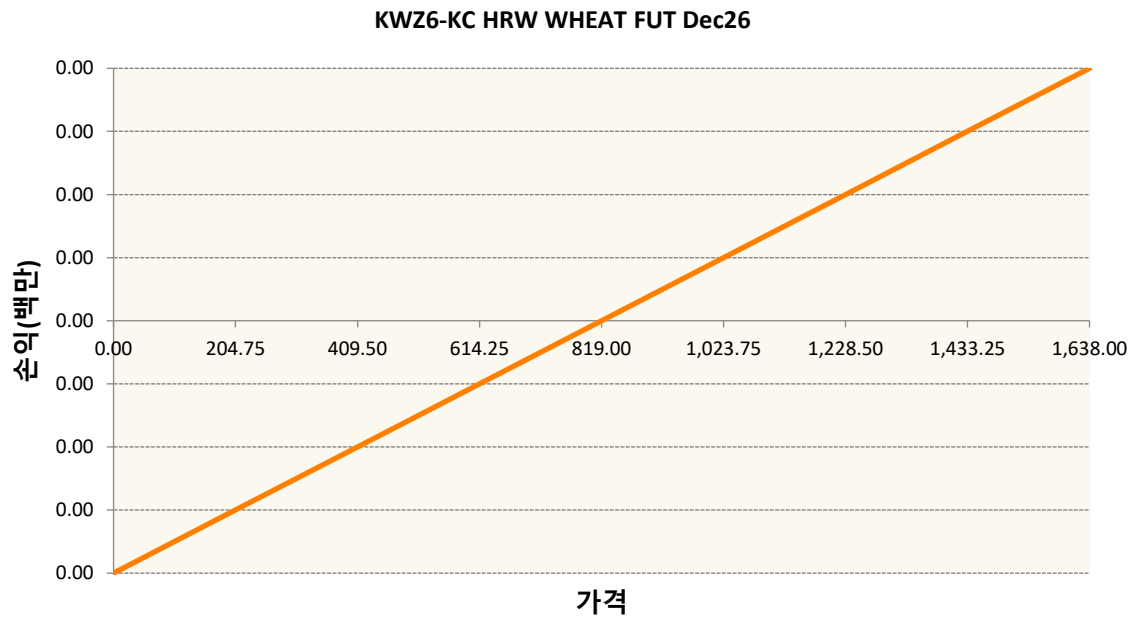
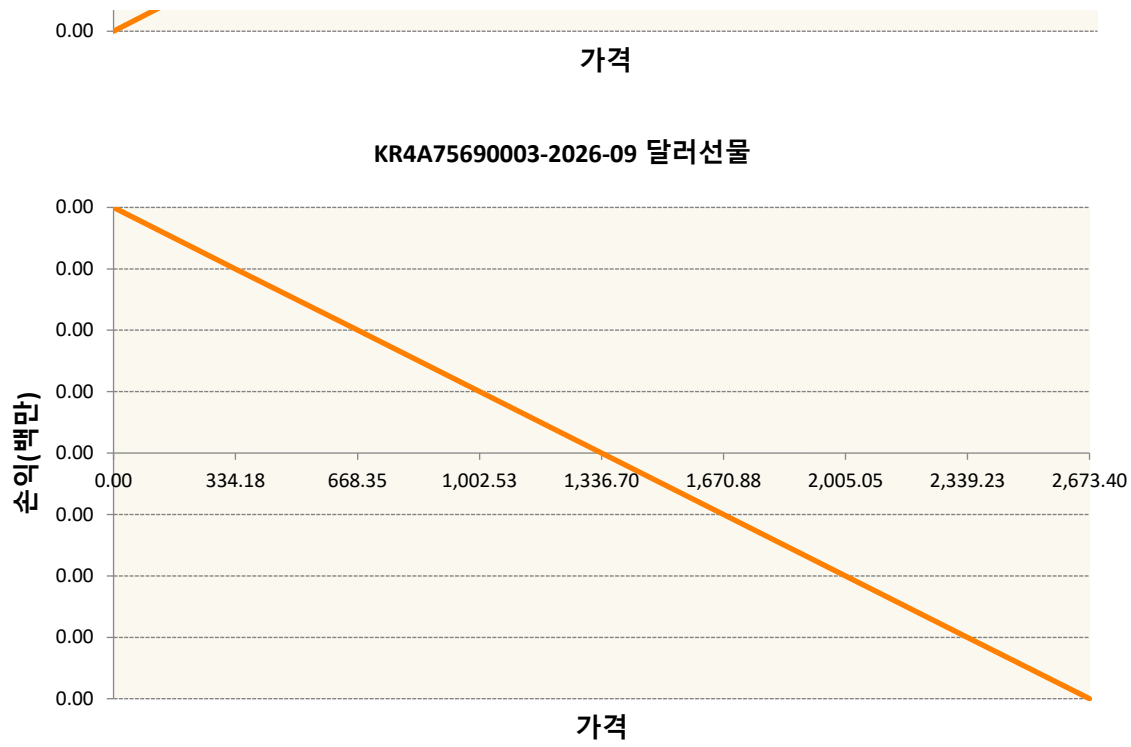
(단위:USD 백만)

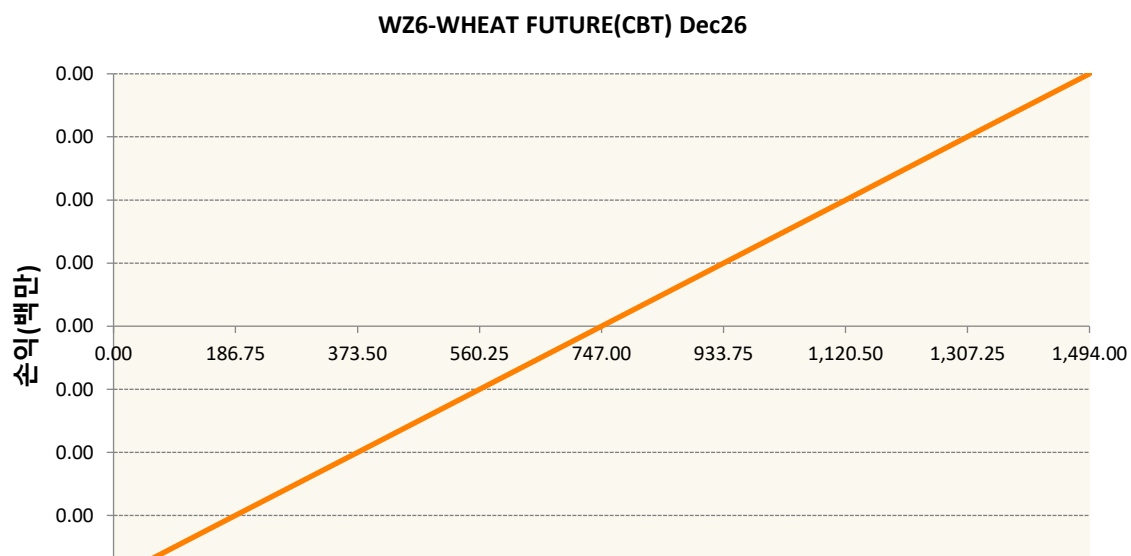
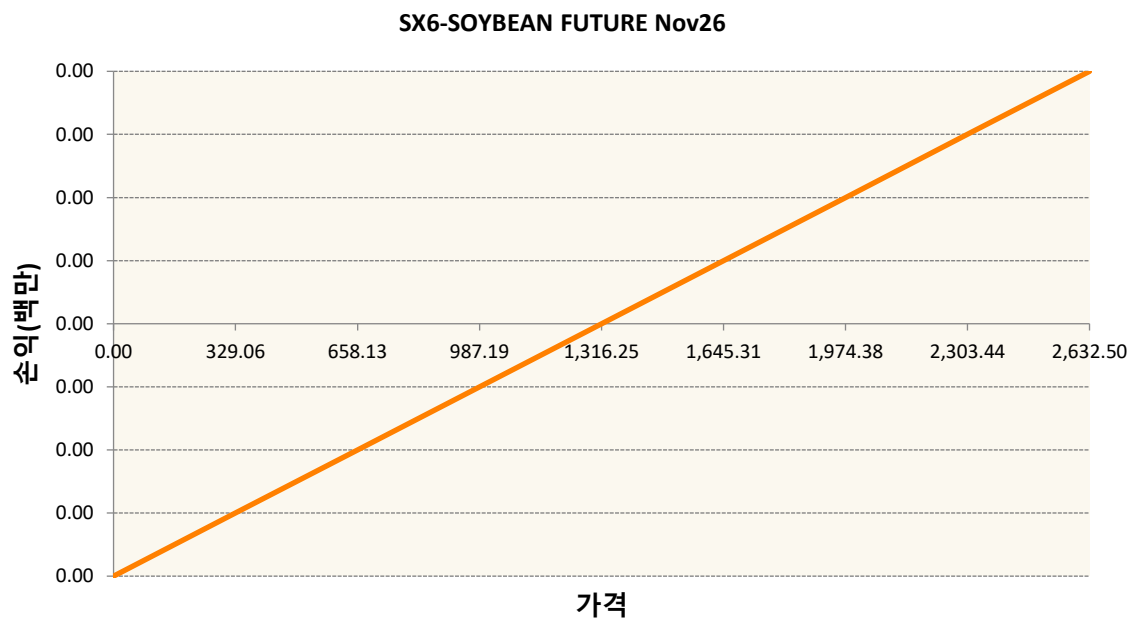
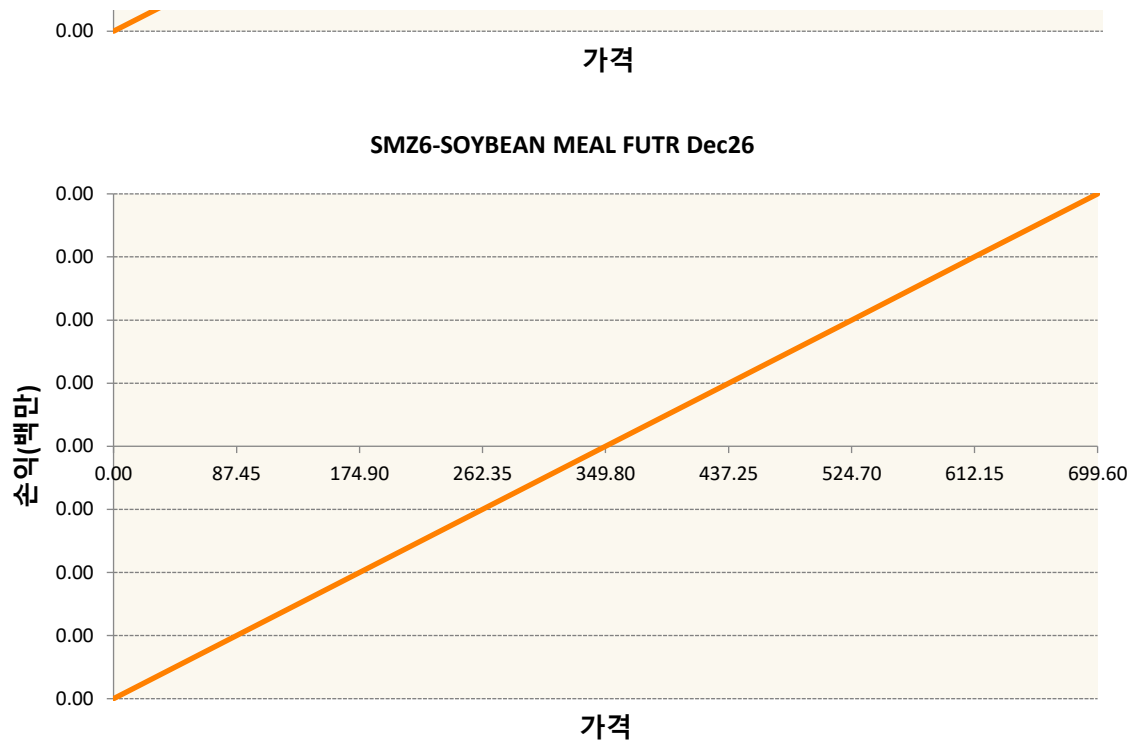
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	467	0	467	
누계	유가증권	선물	2,501	0	2,501	
누계	통화	선물	0	334	-334	장내

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	2026-09-10
기준일	2026-09-09

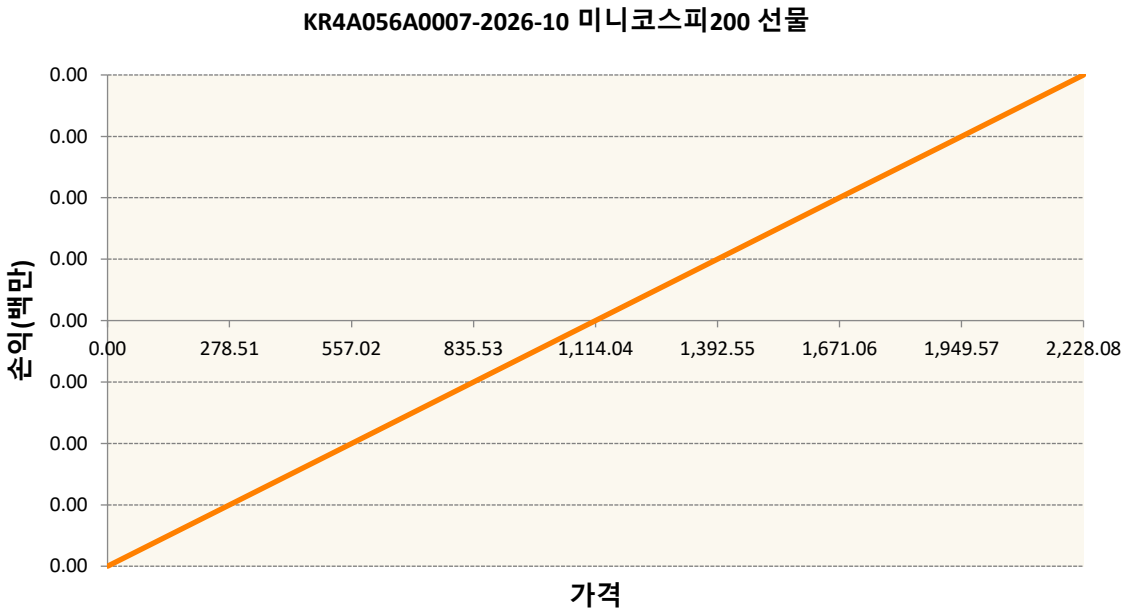
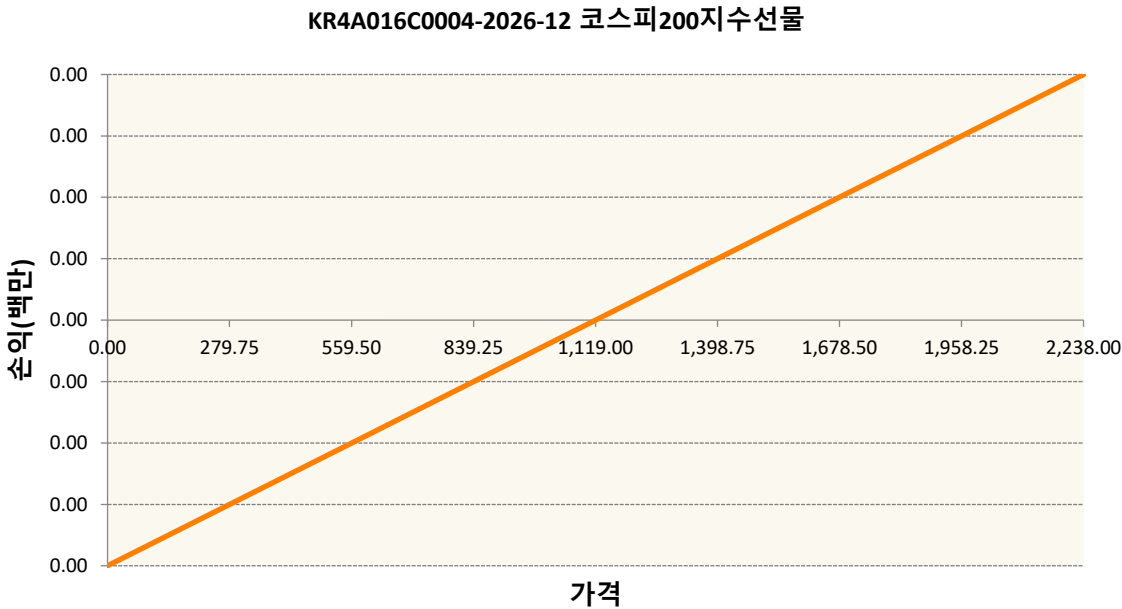
스마트인덱스모

1. 계약금액

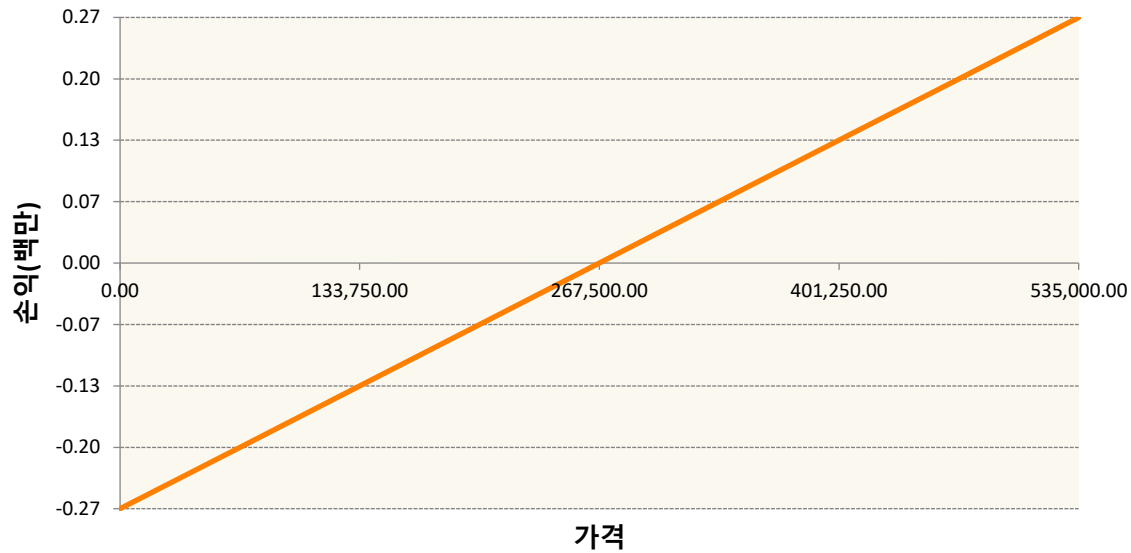
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,333	0	4,333	장내

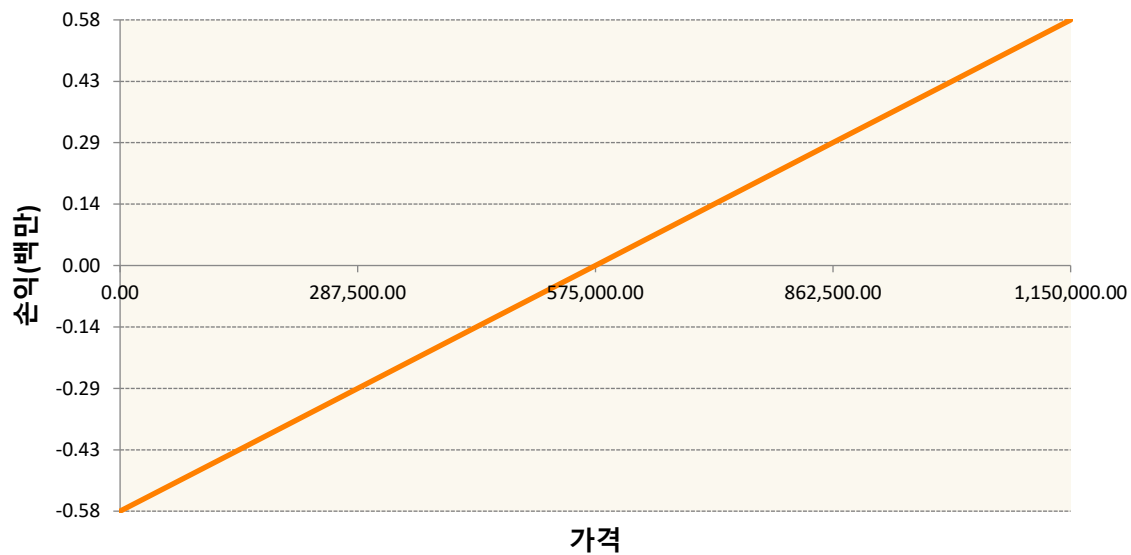
2. 만기시점의 손익구조



KR4A116A0005-2026-10 삼성전자개별선물



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004			2026-12 코스피200지수선물				245	
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
-5.33%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163	
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	82	82	82	82	82	82	82	
5.33%	163	163	163	163	163	163	163	
8.00%	245	245	245	245	245	245	245	
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)

922

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

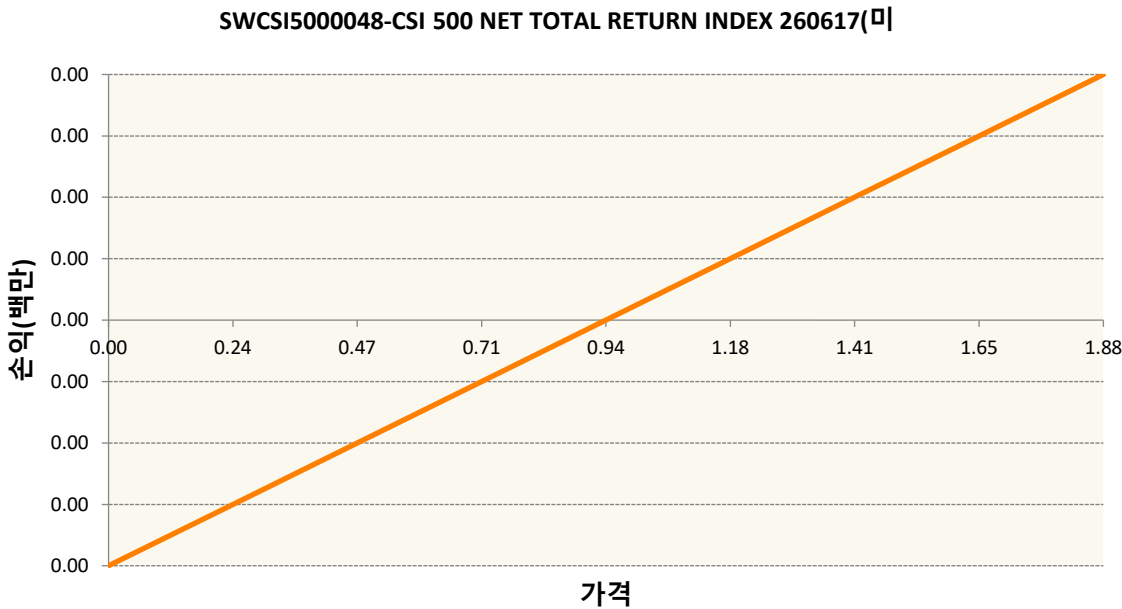
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

438

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

696

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

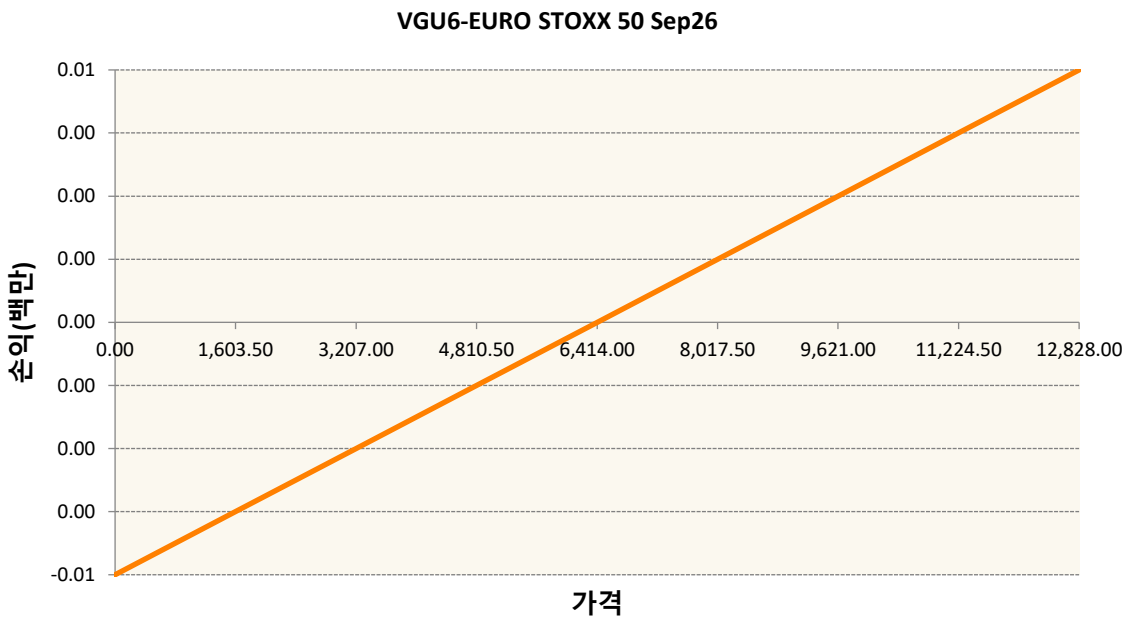
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,220	0	1,220	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	98
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

73

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

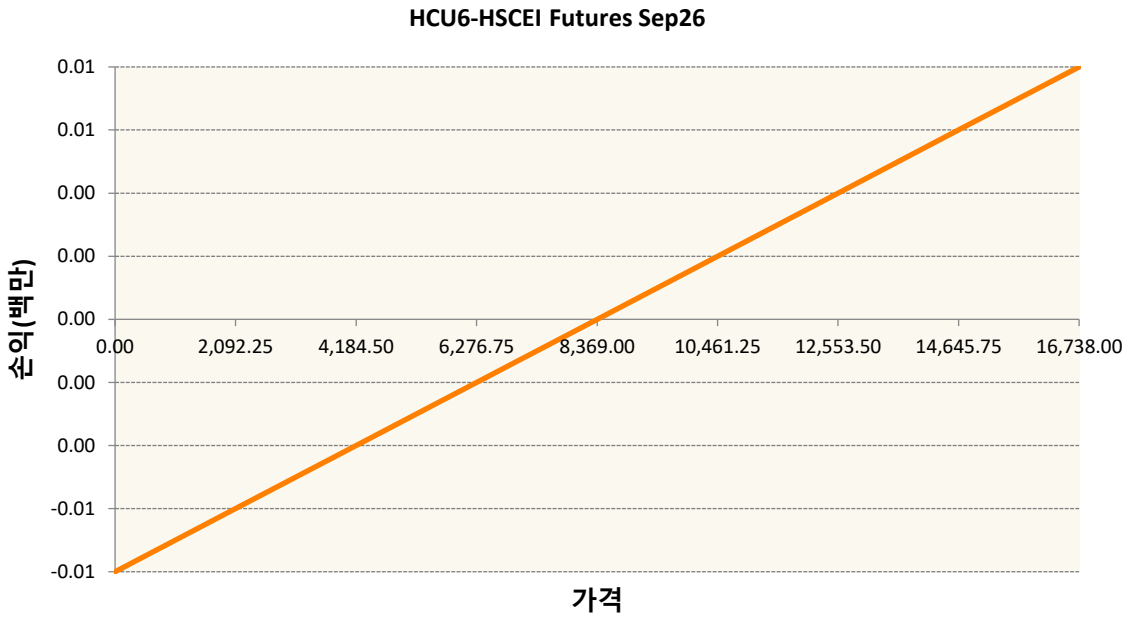
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,466	0	1,466	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	117
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

112

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

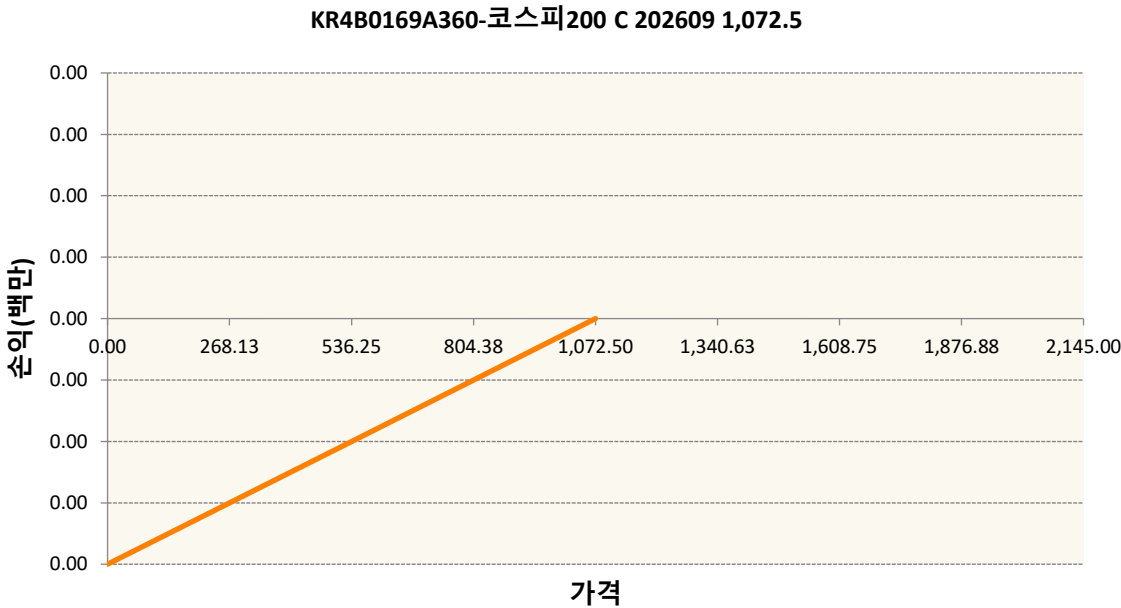
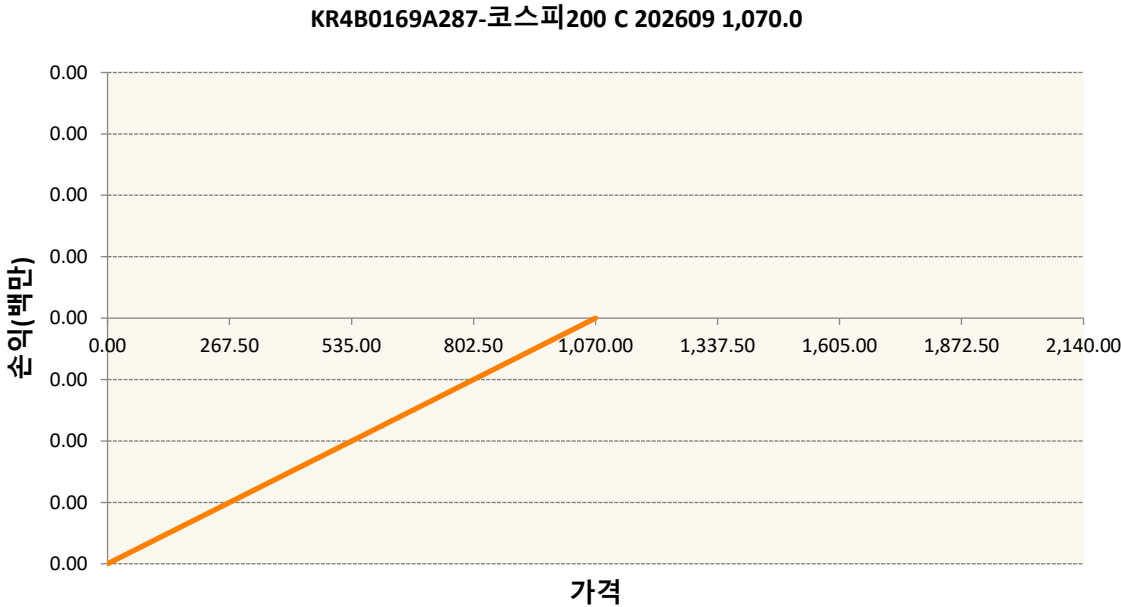
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

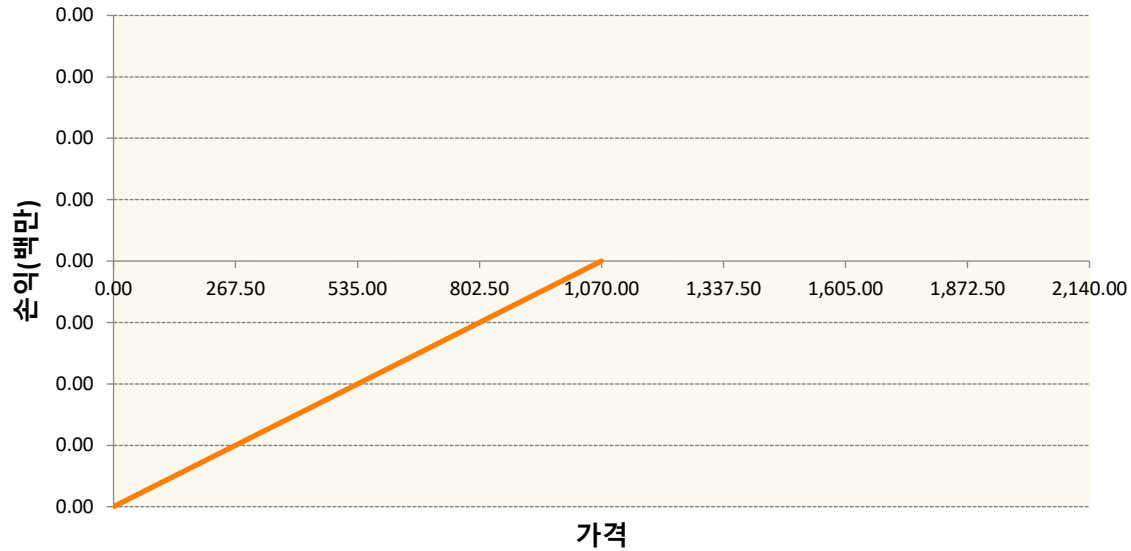
(단위:백만원)

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							623
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-604	-605	-607	-610	-614	-618	-623
-5.33%	-233	-243	-253	-264	-275	-286	-297
-2.67%	-30	-40	-51	-62	-73	-84	-96
0%	7	6	3	0	-4	-9	-14
2.67%	9	9	9	9	8	7	6
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	9	9	9	9	9	9	9
KR4B0169A360 코스피200 C 202609 1,072.5							889
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-867	-868	-870	-874	-878	-883	-889
-5.33%	-351	-364	-377	-391	-405	-419	-434
-2.67%	-51	-65	-80	-96	-112	-128	-144
0%	12	9	5	0	-6	-13	-22
2.67%	16	15	15	15	14	12	10
5.33%	16	16	16	16	15	15	15
8.00%	16	16	16	16	16	16	16
KR4C0169A285 코스피200 P 202609 1,070.0							362
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-351	-352	-353	-355	-357	-359	-362
-5.33%	-135	-141	-147	-153	-160	-166	-173
-2.67%	-18	-24	-30	-36	-42	-49	-56
0%	4	3	2	0	-2	-5	-8

2.67%	5	5	5	5	5	4	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

1,488

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

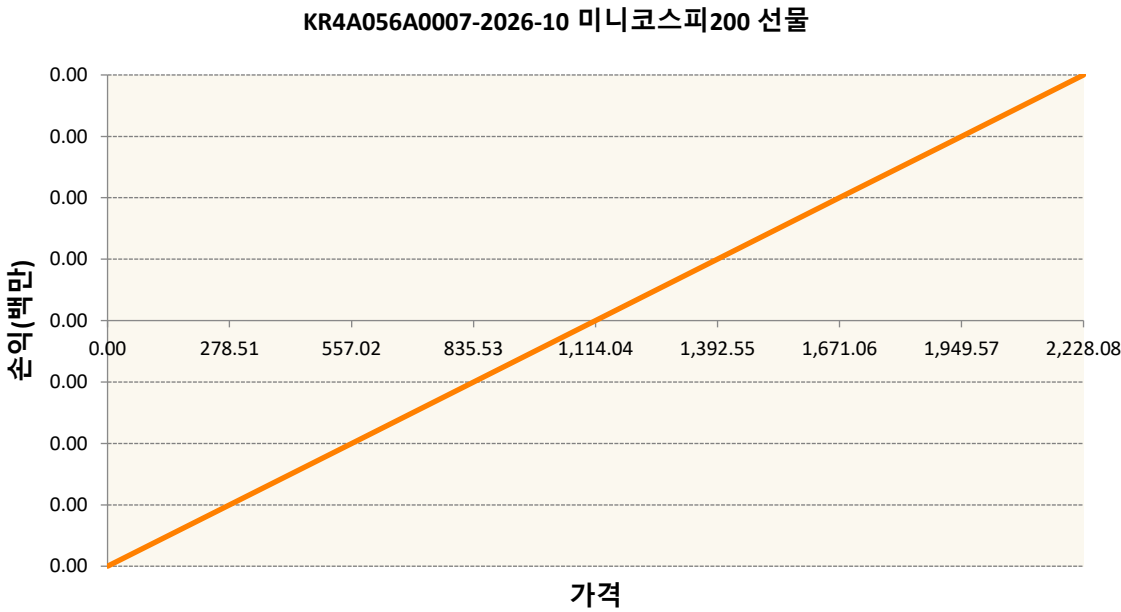
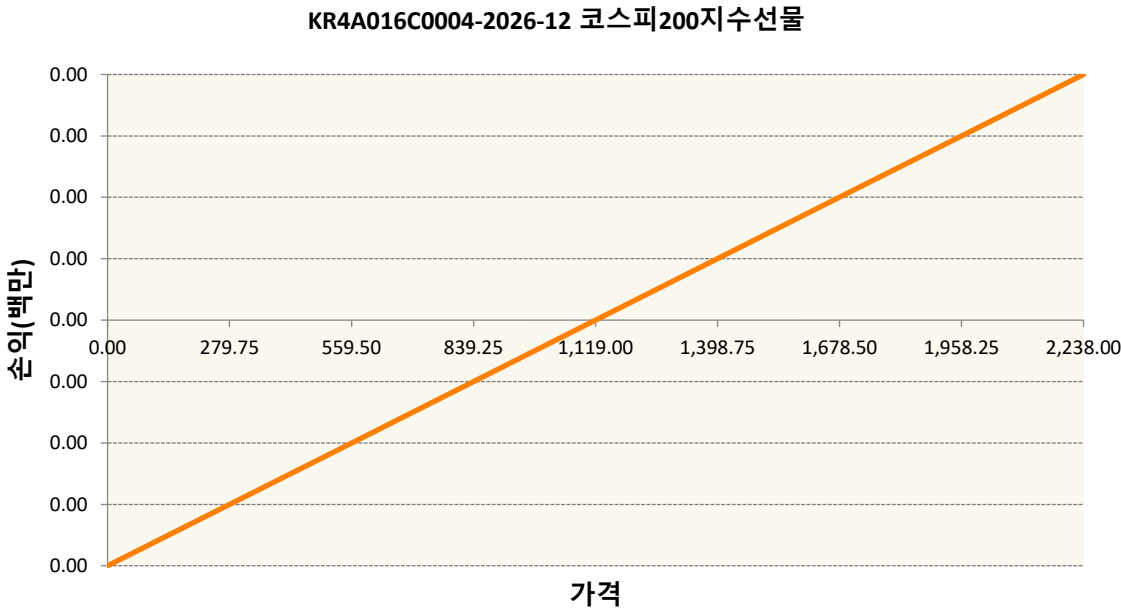
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

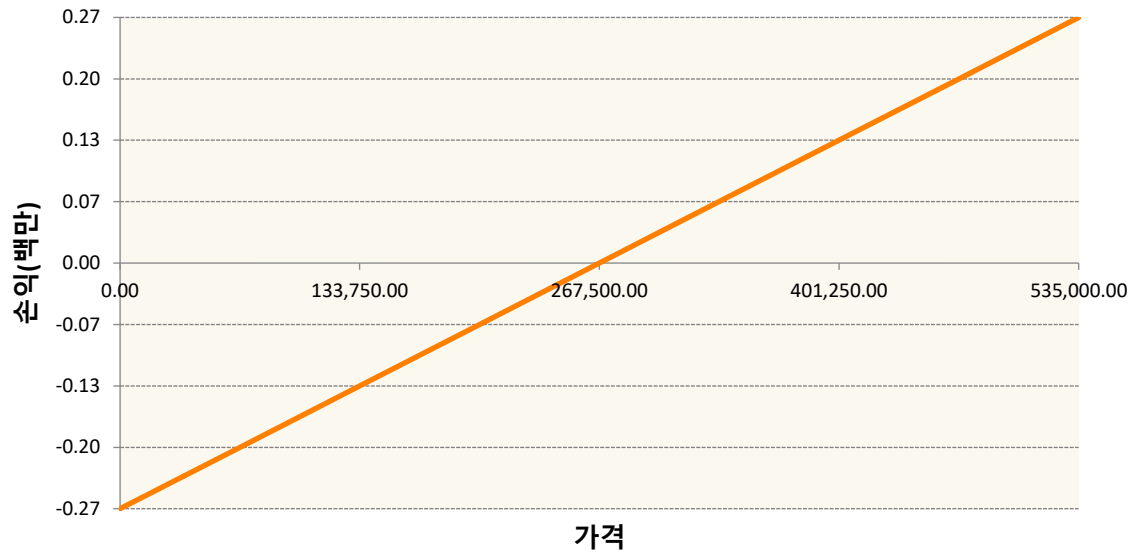
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	836	0	836	장내
누계	유가증권	선물	1,788	0	1,788	장내

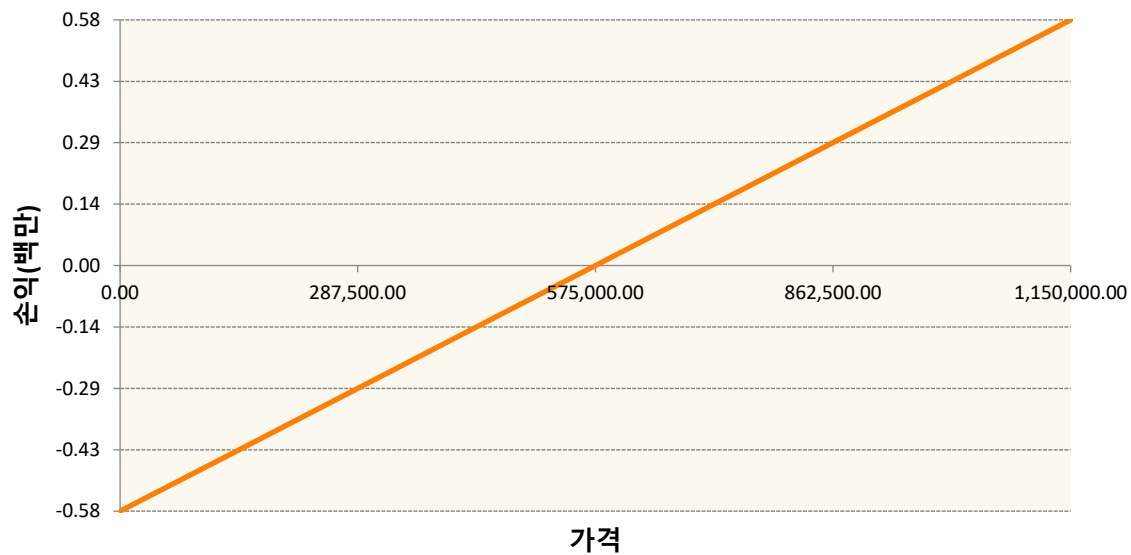
2. 만기시점의 손익구조



KR4A116A0005-2026-10 삼성전자개별선물



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물					67
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-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%	45	45	45	45	45	45	45
8.00%	67	67	67	67	67	67	67
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							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

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

(단위:백만원)

299

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

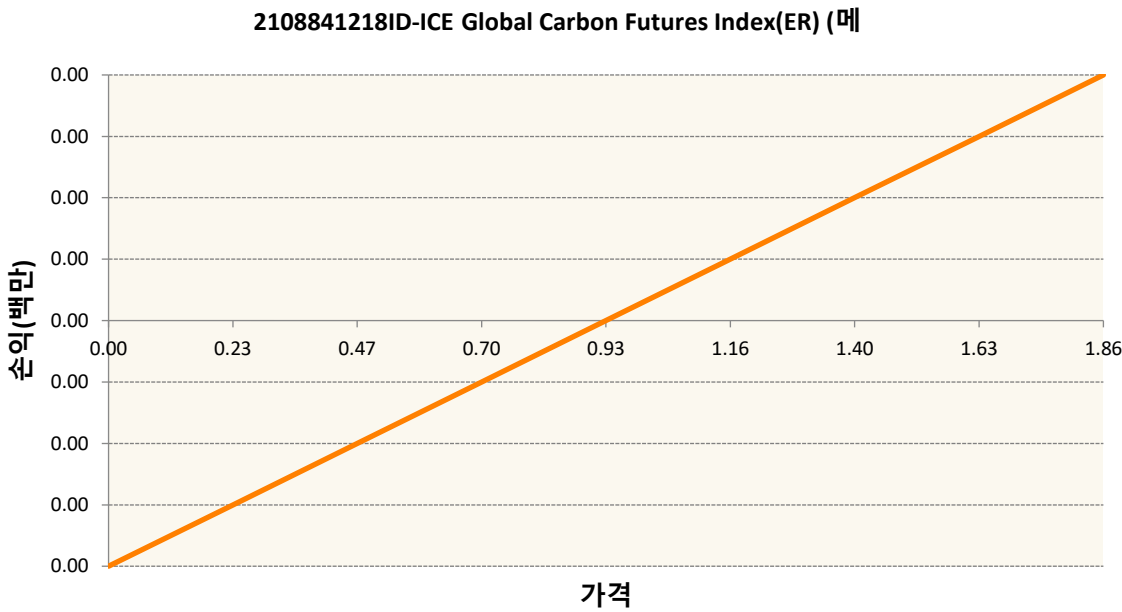
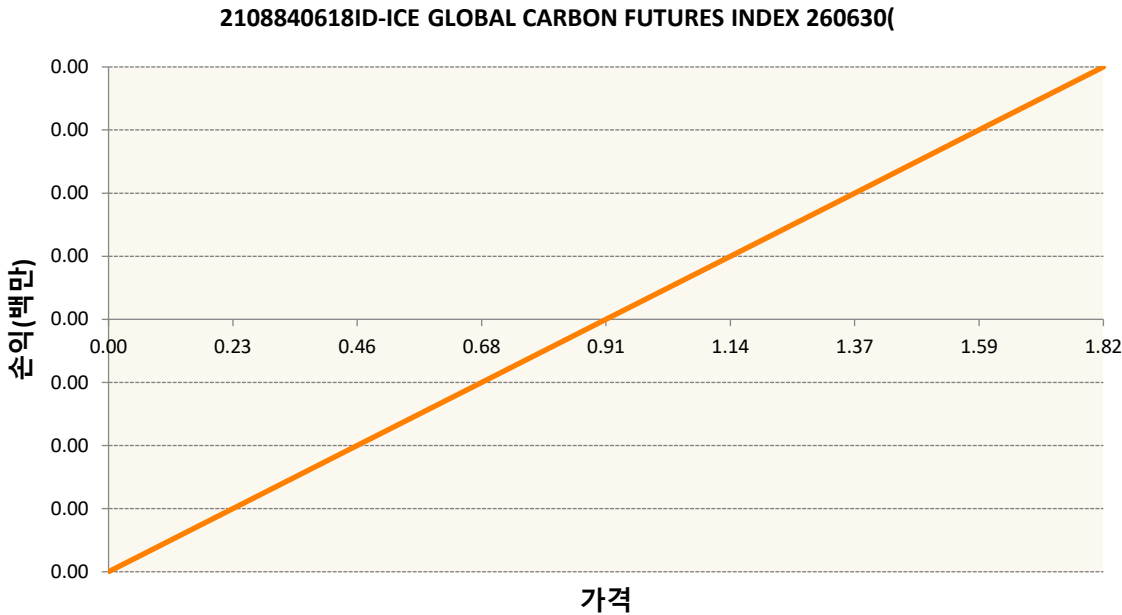
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,938	0	6,938	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		445
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		112

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	589

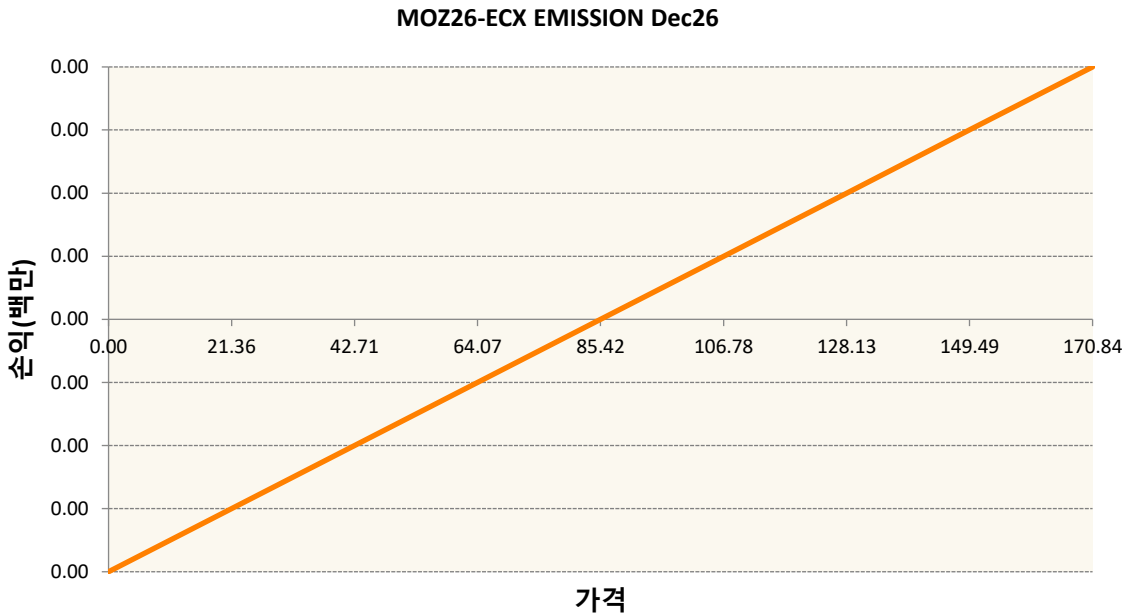
공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

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			5,510	0	5,510	
누계	통화	선도	0	2,581	-2,581	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E			207
MOZ26 ECX EMISSION Dec26			441

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	690

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

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	-2,253	0	-2,253	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	73
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	33
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	29
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	44

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

(단위:백만원)

288

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

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	-6,435	0	-6,435	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	64
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	232
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	221

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

(단위:백만원)

980

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

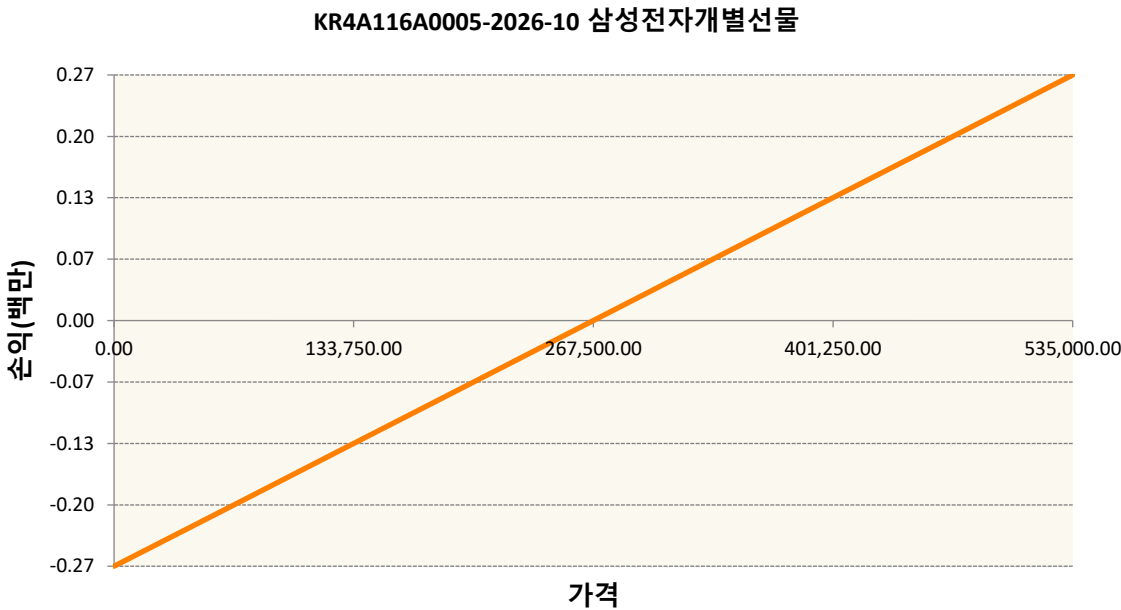
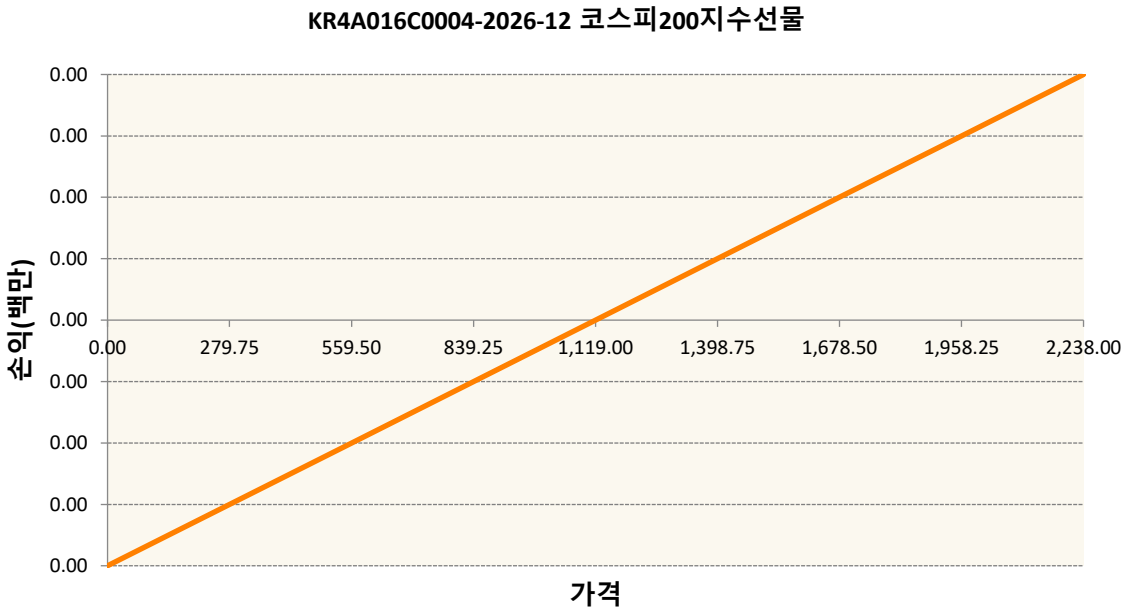
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

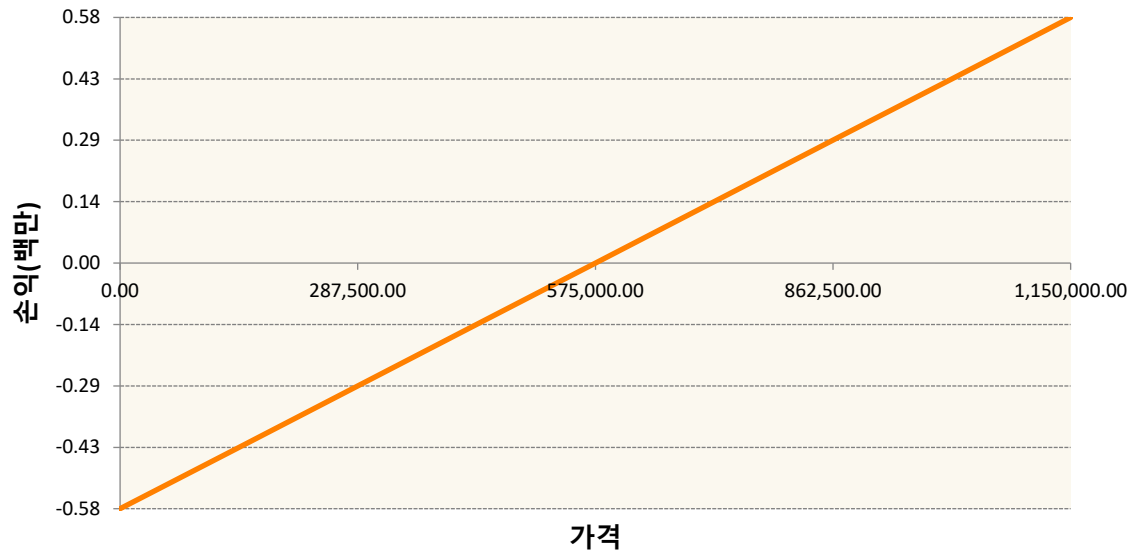
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	17,093	0	17,093	장내
누계	유가증권	선물	17,992	0	17,992	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물								1,092
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092	-1,092
-5.33%	-728	-728	-728	-728	-728	-728	-728	-728
-2.67%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	364	364	364	364	364	364	364	364
5.33%	728	728	728	728	728	728	728	728
8.00%	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092	1,092
KR4A116A0005 2026-10 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	-276
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	184	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	276	276	276	276	276	276	276	276
KR4A226A0002 2026-10 삼성SDI개별선물								69
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	46	46	46	46	46	46	46
8.00%	69	69	69	69	69	69	69

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

(단위:백만원)

4,958

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

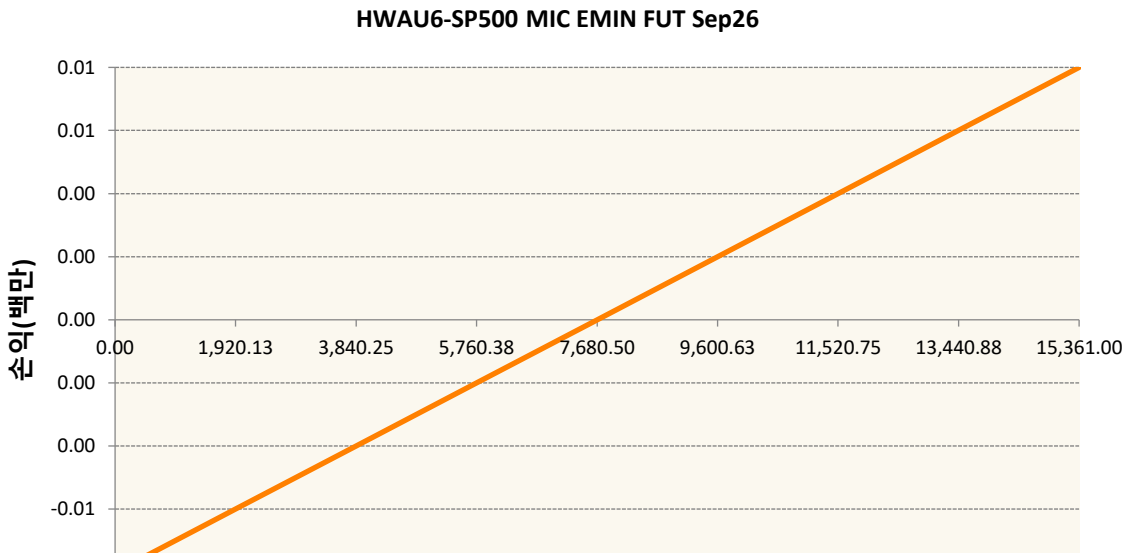
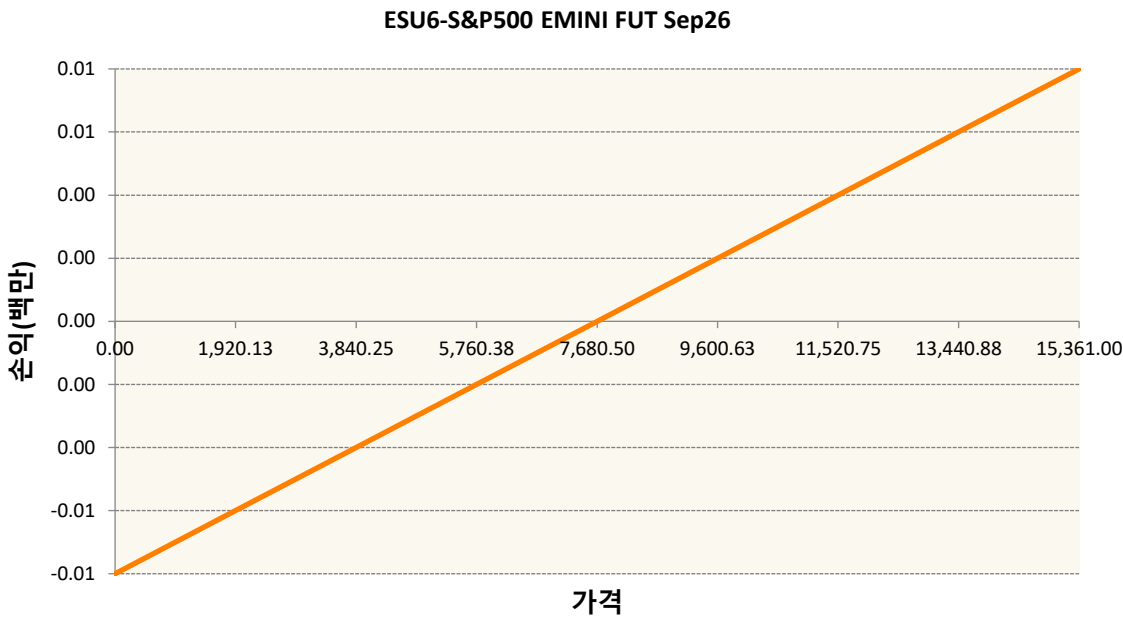
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

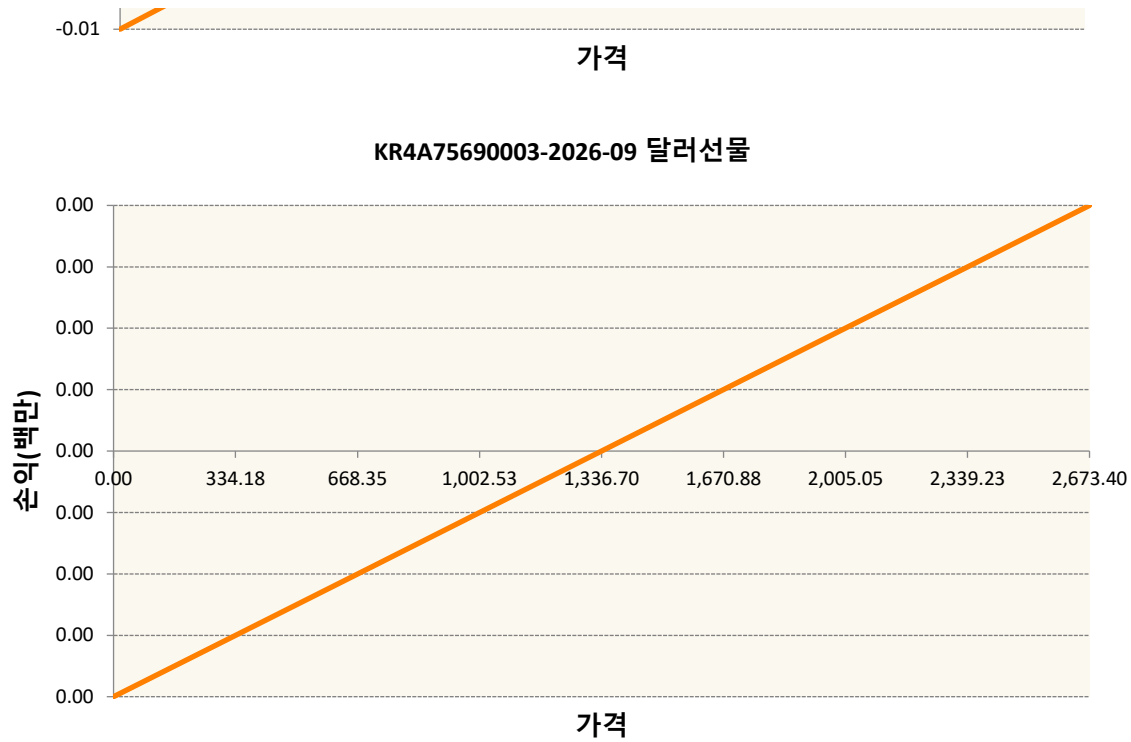
1. 계약금액

(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	78,601	0	78,601	
누계	지수	선물	383	0	383	장내
누계	통화	선물	9,491	0	9,491	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		6,288
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		31
KR4A756900 2026-09 달러선물			759

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,033

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

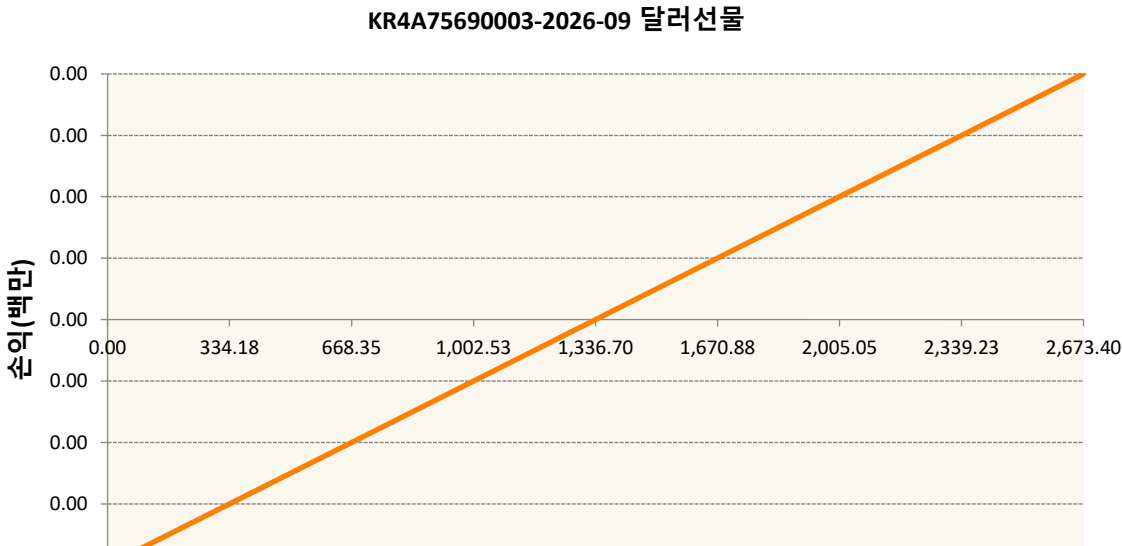
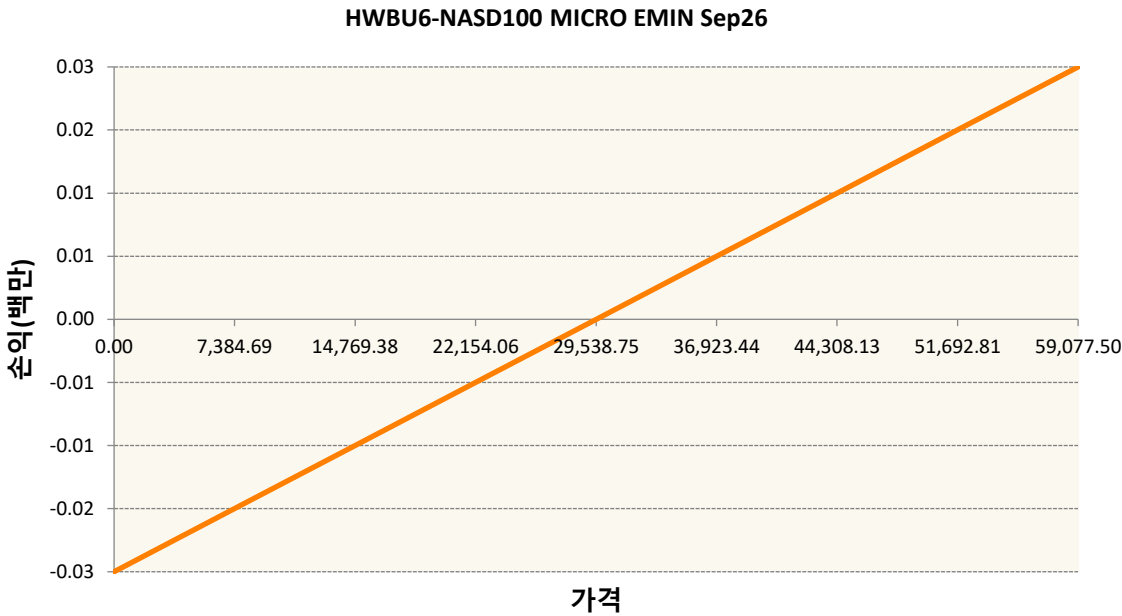
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

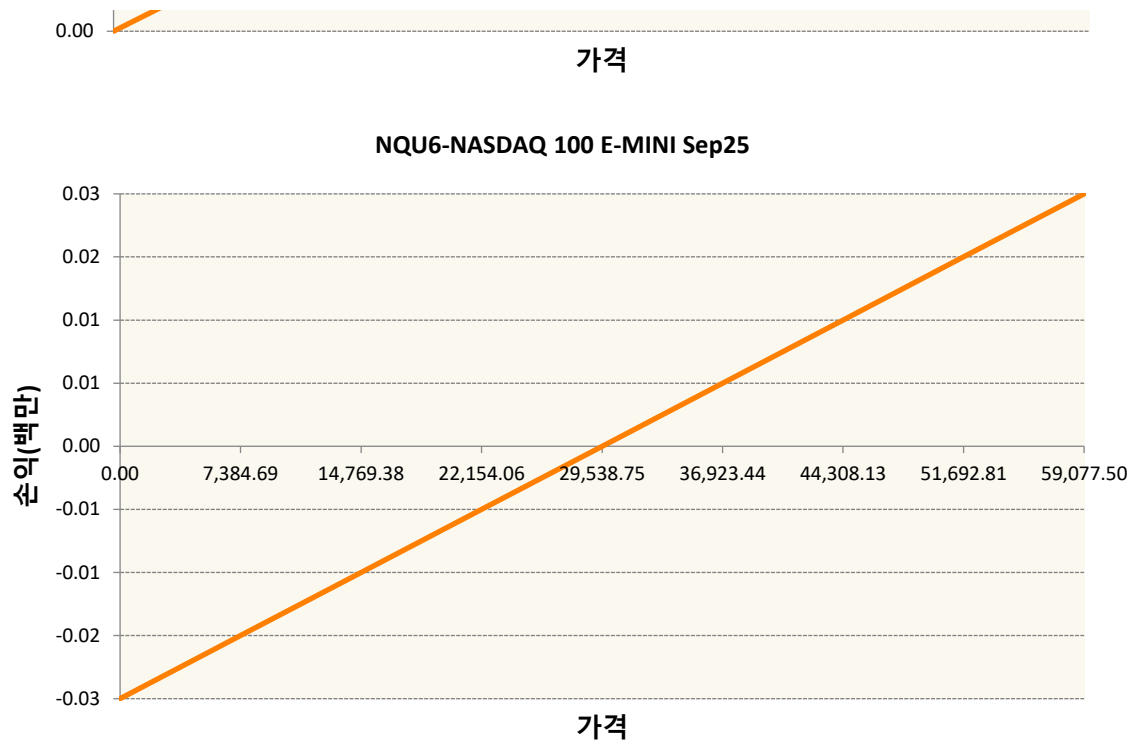
1. 계약금액

(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	741	0	741	장내
누계	지수	선물	38,109	0	38,109	
누계	통화	선물	4,358	0	4,358	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26	59
KR4A756900	2026-09 달러선물	349
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	3,049

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

(단위:백만원)

3,315

공시일	2026-09-10
기준일	2026-09-09

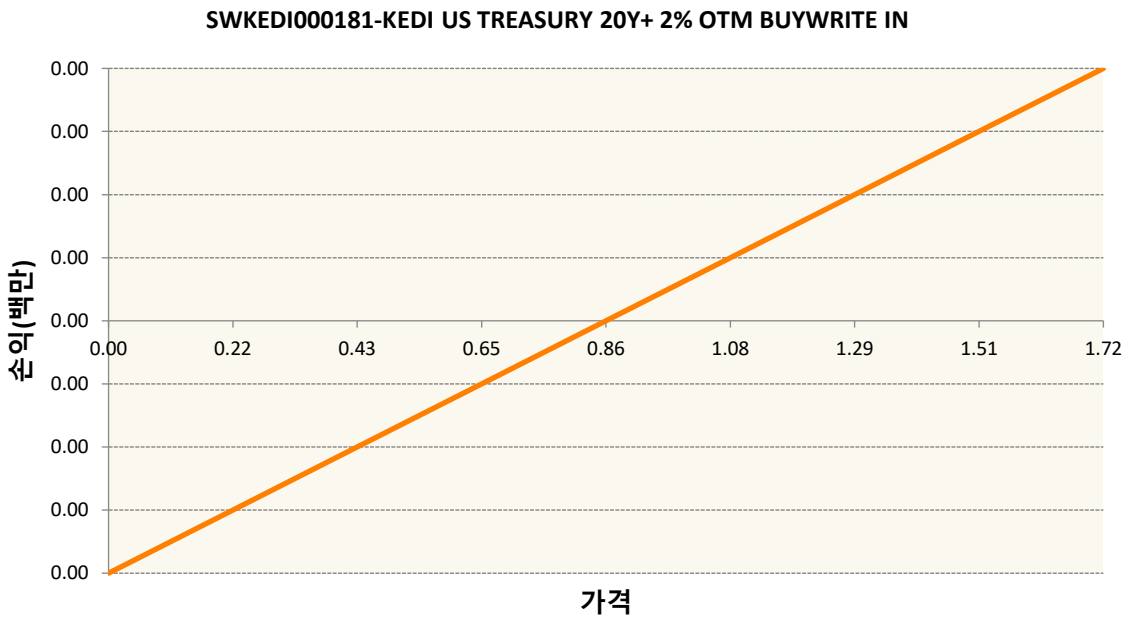
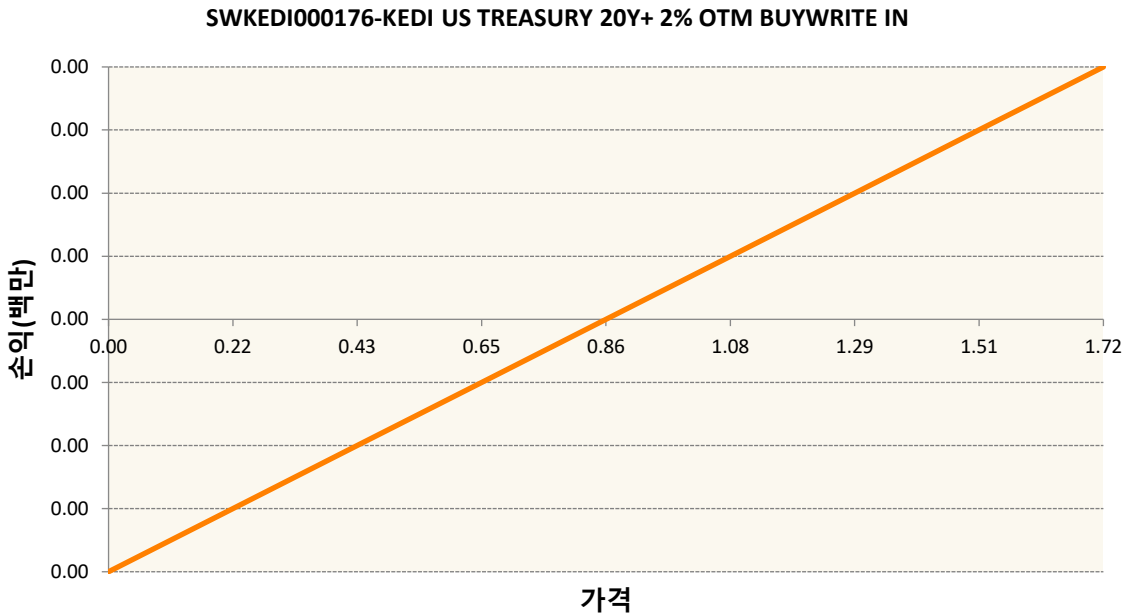
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

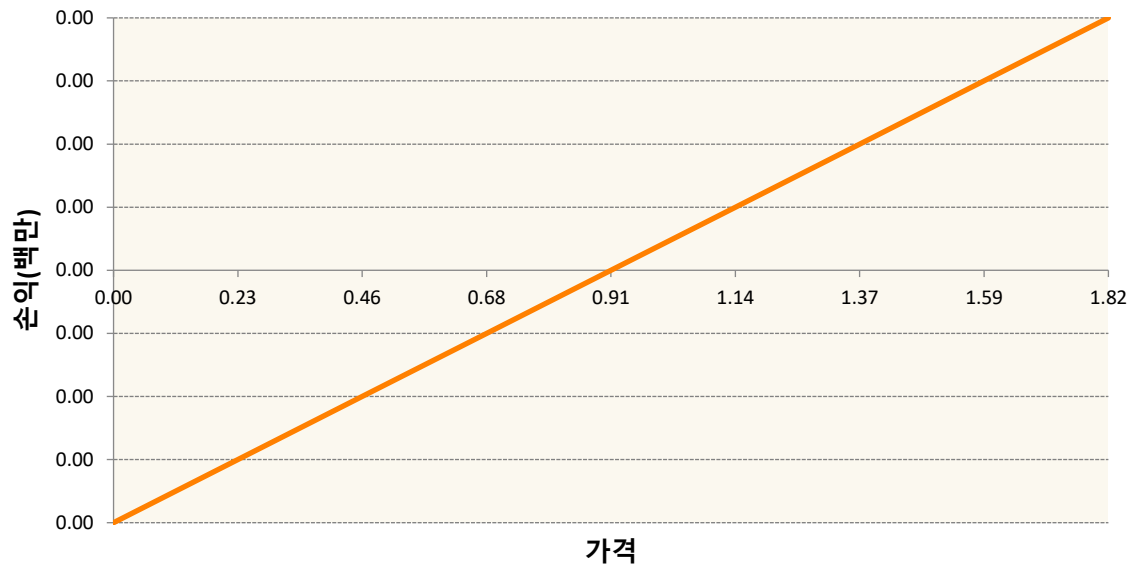
(단위:백만원)

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

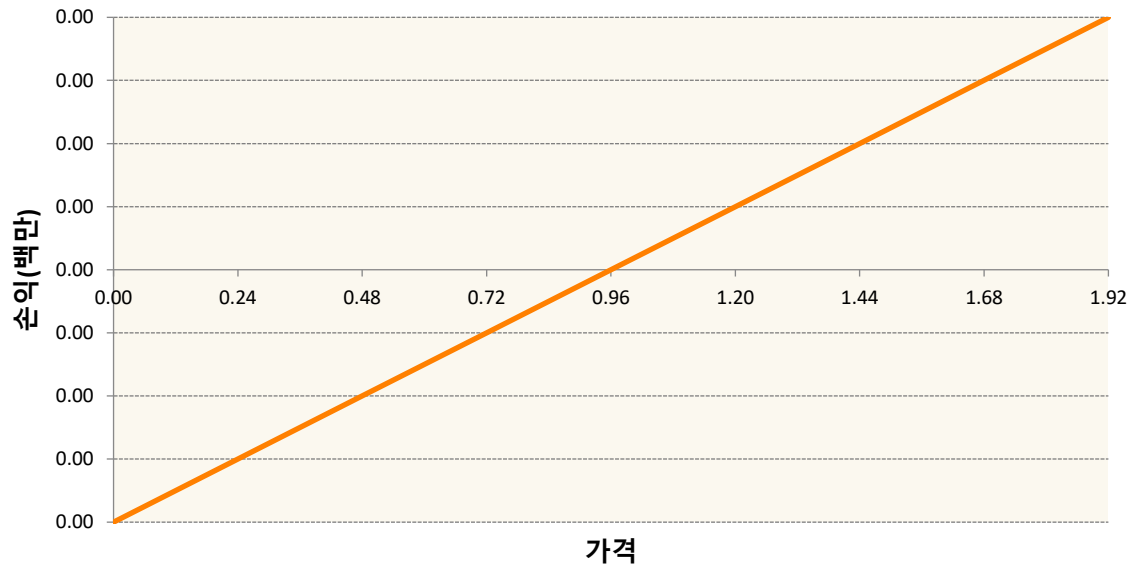
2. 만기시점의 손익구조



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	6,971
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,736
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,086
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,874

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

(단위:백만원)

8,593
