

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

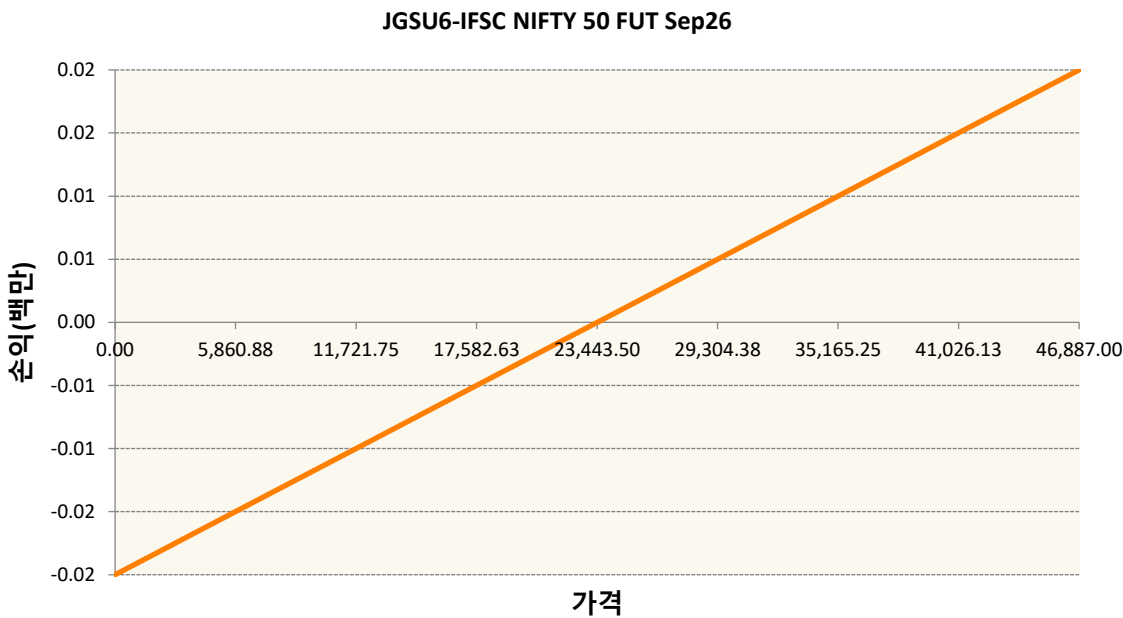
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	325	0	325	

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	2026-09-16
기준일	2026-09-15

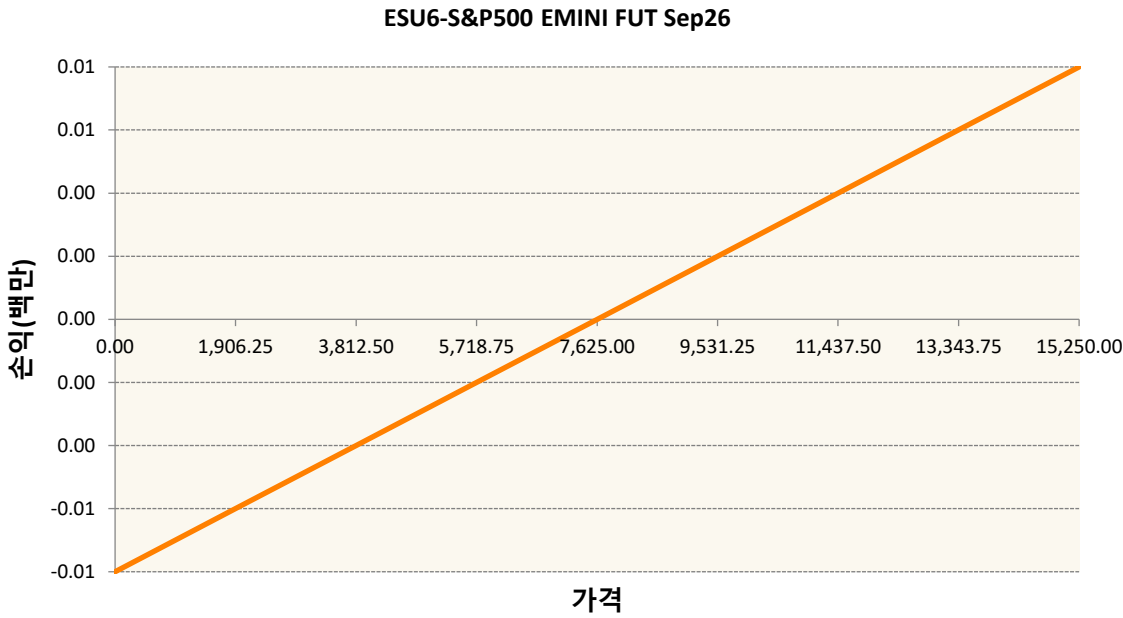
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

31

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

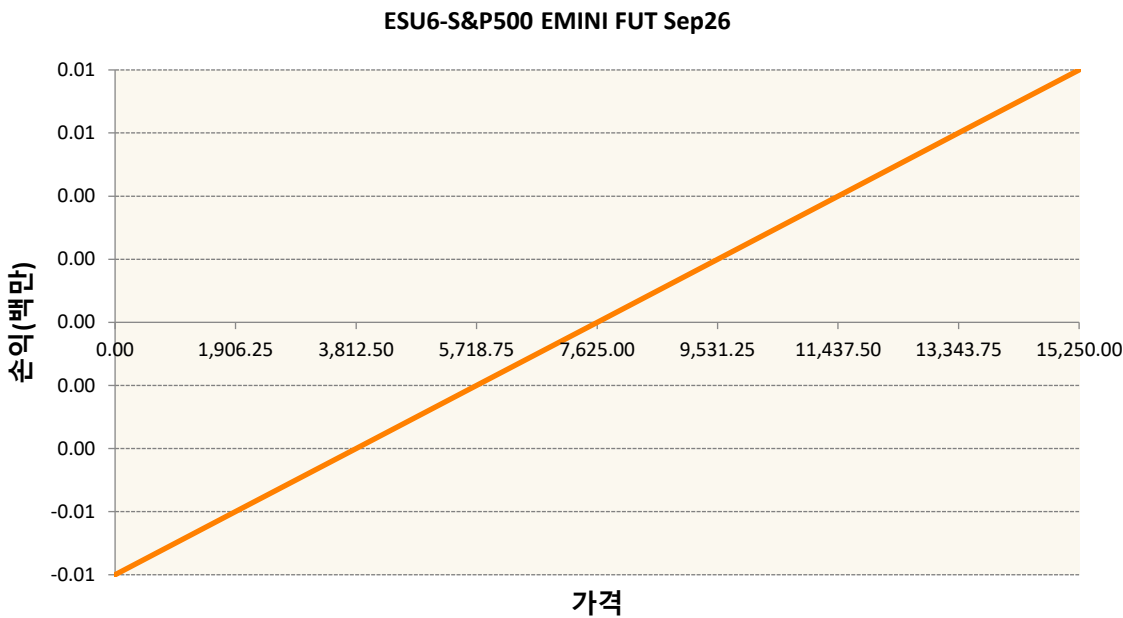
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	575	0	575	

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)

30

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

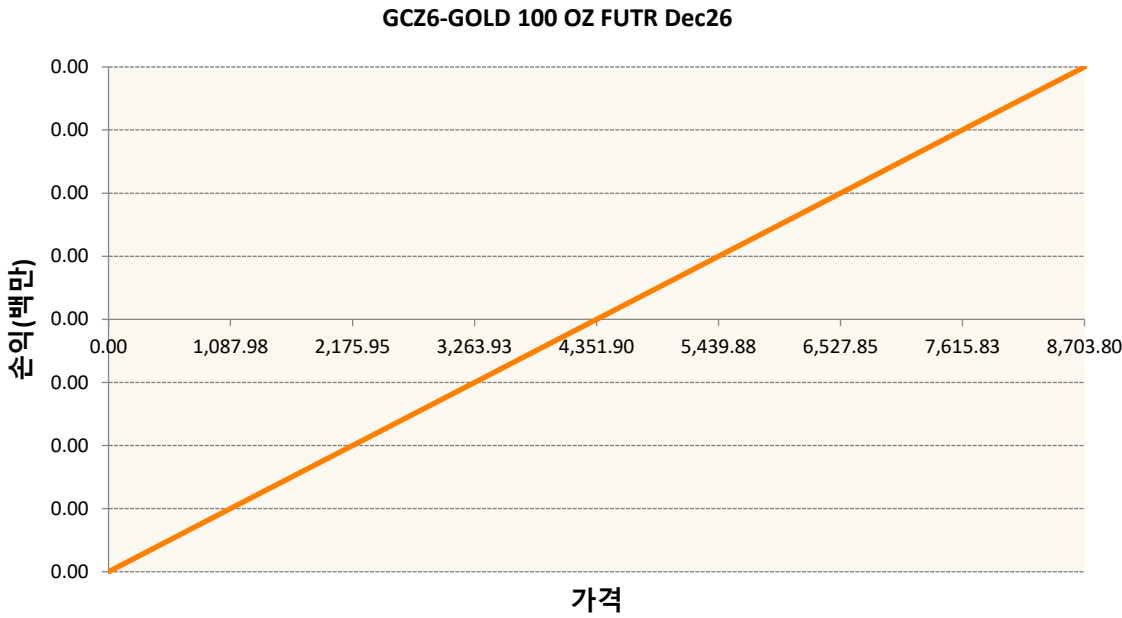
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			6,188	0	6,188	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSAC GLD US 09/18/26 C405 EQUITY	7
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	495

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

(단위:백만원)

661

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

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)

AOPLTRUC1 PLTR US 09/18/26 C172.5 EQUITY	31
AOPLTRUP1 PLTR US 09/18/26 P172.5 EQUITY	42

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

(단위:백만원)

249

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

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 09/18/26 C81 EQUITY

5

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

(단위:백만원)

3

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

(단위:백만원)

13,632

공시일 2026-09-16

기준일 2026-09-15

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	2026-09-16
기준일	2026-09-15

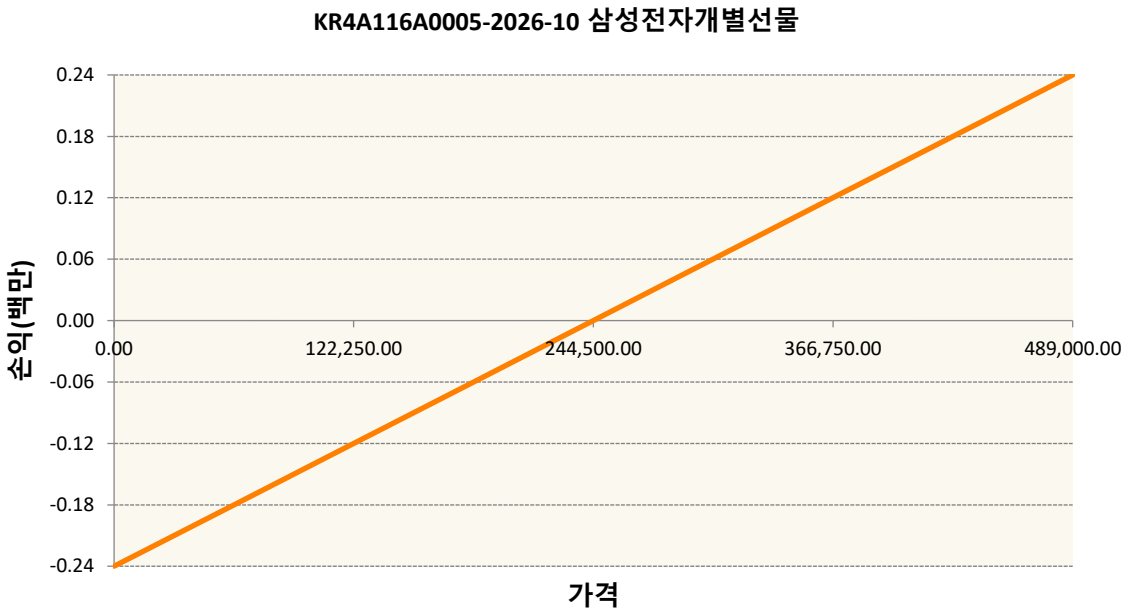
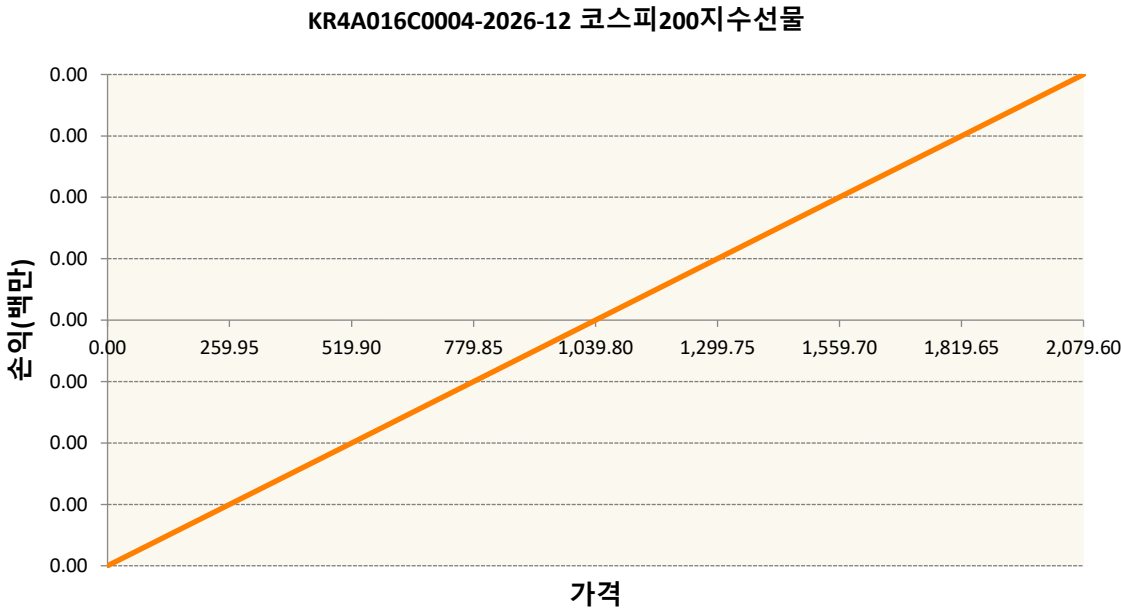
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	19,962	0	19,962	장내
누계	유가증권	옵션	0	51,095	-51,095	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 2,105.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. An orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,052.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,052.50	0.00

The graph illustrates the relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,110.00. The y-axis, labeled '순이익 (백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the data, starting at (0, 0) and ending at (1,055.00, 0.00).

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
1,055.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A016C0004				2026-12 코스피200지수선물				542
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542	
-5.33%	-361	-361	-361	-361	-361	-361	-361	
-2.67%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	181	181	181	181	181	181	181	
5.33%	361	361	361	361	361	361	361	
8.00%	542	542	542	542	542	542	542	
KR4A116A0005				2026-10 삼성전자개별선물				1,074
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,074	-1,074	-1,074	-1,074	-1,074	-1,074	-1,074
-5.33%	-716	-716	-716	-716	-716	-716	-716
-2.67%	-358	-358	-358	-358	-358	-358	-358
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	358	358	358	358	358	358	358
5.33%	716	716	716	716	716	716	716
8.00%	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074	1,074
KR4B09FDA229 코스피위클리 C 2609W3 1,052.5							2,135

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,128	-2,128	-2,129	-2,129	-2,130	-2,132	-2,135
-5.33%	-1,324	-1,326	-1,329	-1,334	-1,341	-1,350	-1,360
-2.67%	-544	-558	-574	-593	-614	-636	-659
0%	99	67	33	0	-34	-67	-101
2.67%	454	424	394	363	332	300	267
5.33%	560	549	536	520	503	483	462
8.00%	576	574	571	566	560	552	543

KR4B09FDA237 코스피위클리 C 2609W3 1,055.0							1,453
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,449	-1,449	-1,449	-1,450	-1,450	-1,452	-1,453
-5.33%	-908	-909	-911	-914	-918	-923	-930
-2.67%	-380	-389	-399	-410	-423	-437	-452
0%	65	44	22	0	-22	-45	-67
2.67%	322	302	280	259	237	215	192
5.33%	404	396	386	375	362	348	333
8.00%	417	416	414	410	405	399	392

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

(단위:백만원)

12,767

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

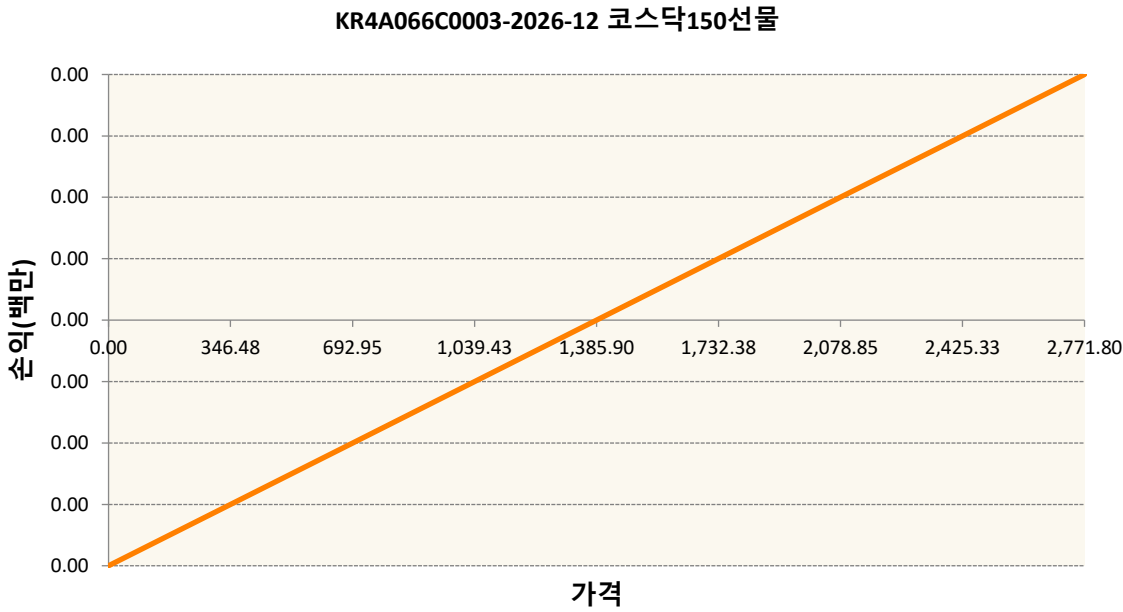
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	638	0	638	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003			2026-12 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

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

(단위:백만원)

11,724

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

(단위:백만원)

100,046

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

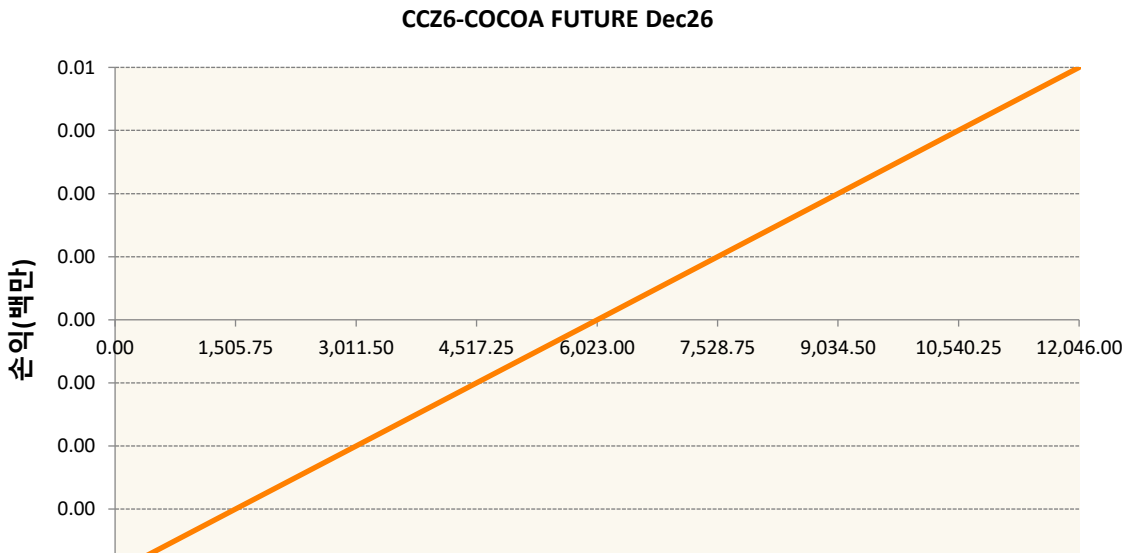
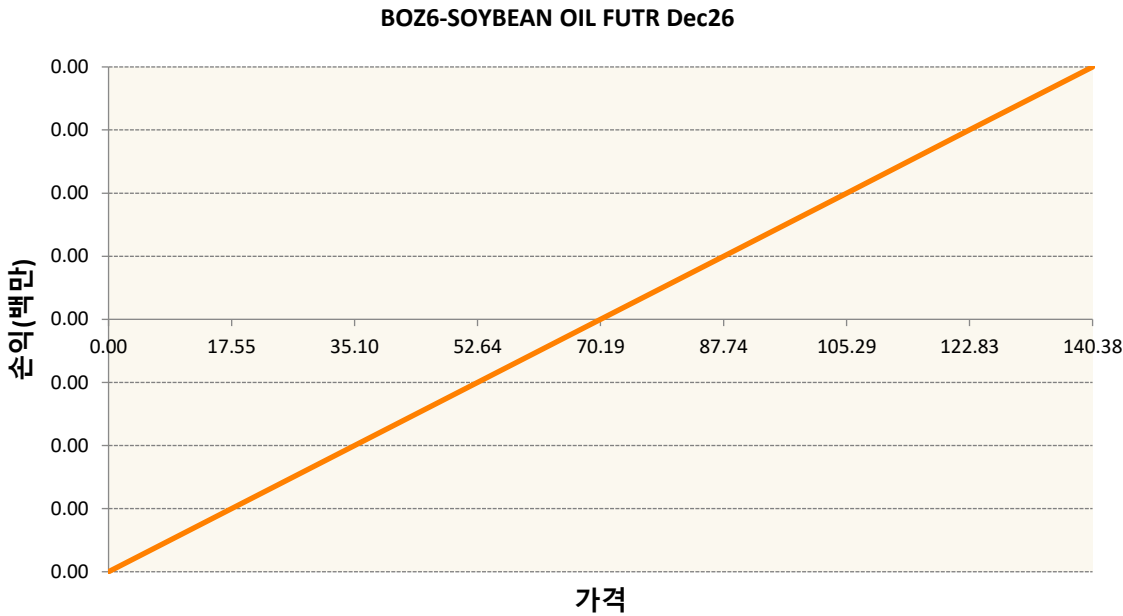
포커스농산물모(채권-파생형)

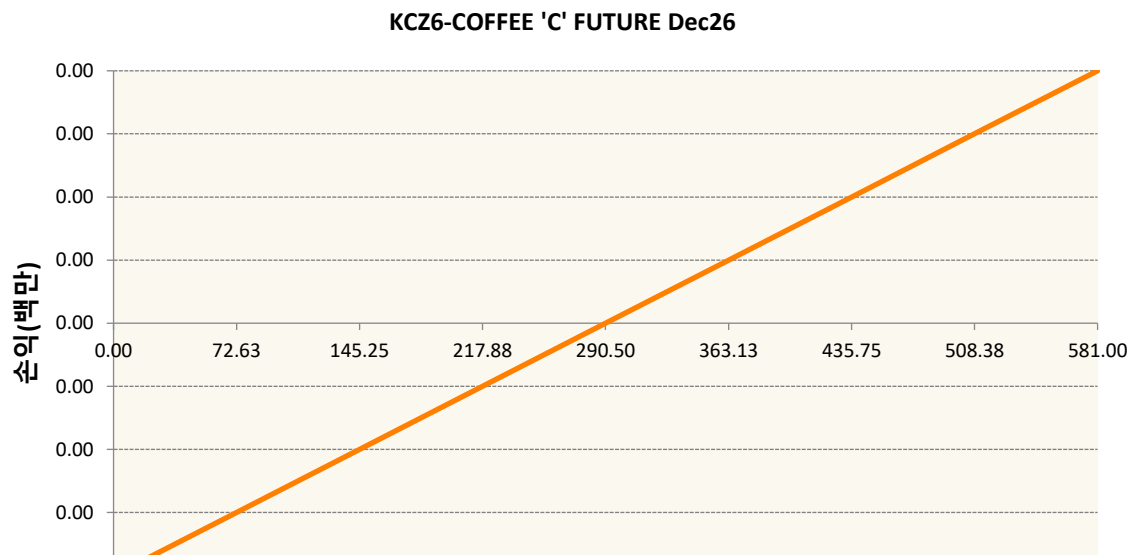
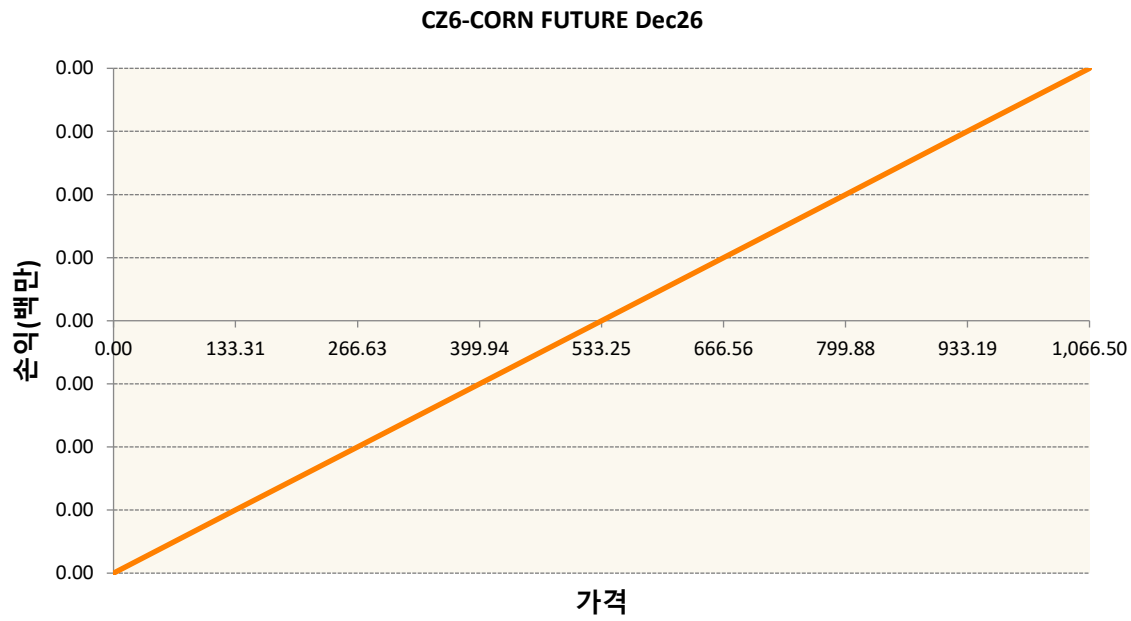
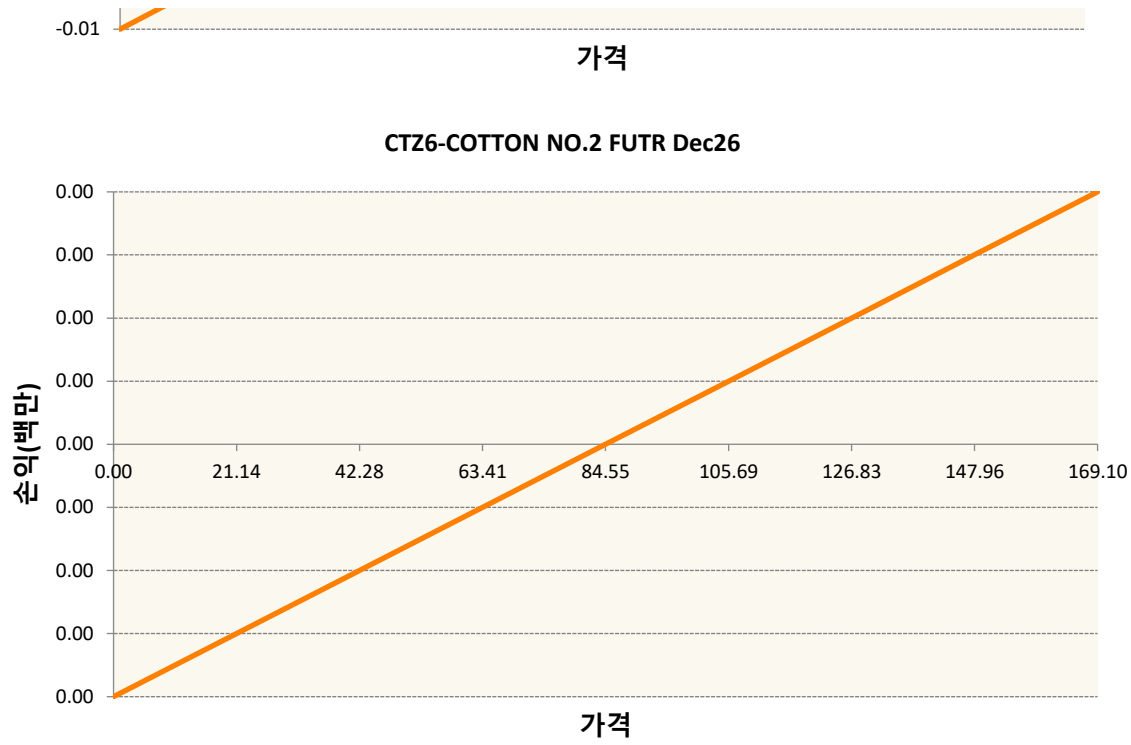
1. 계약금액

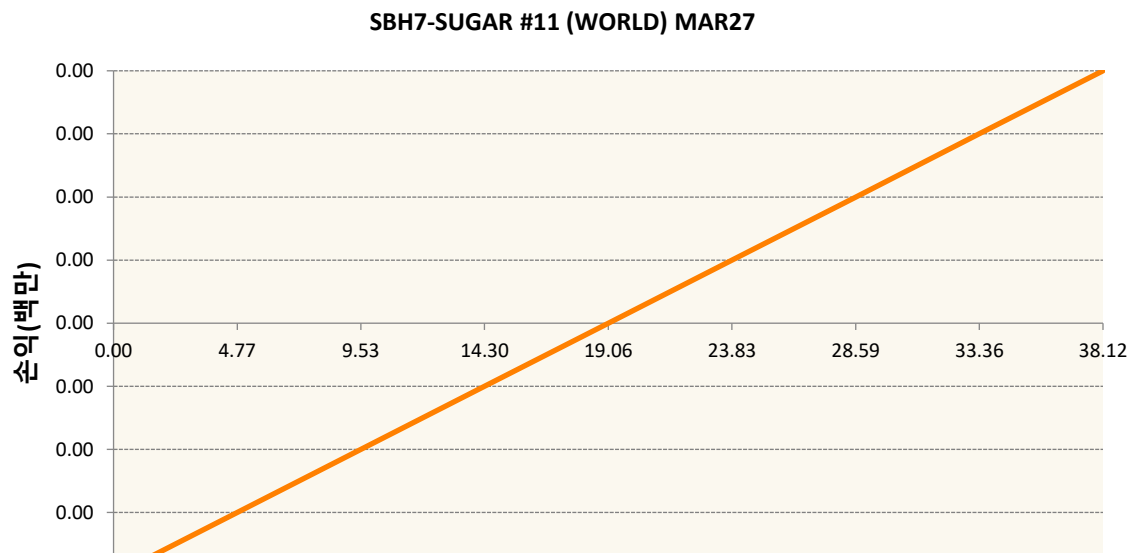
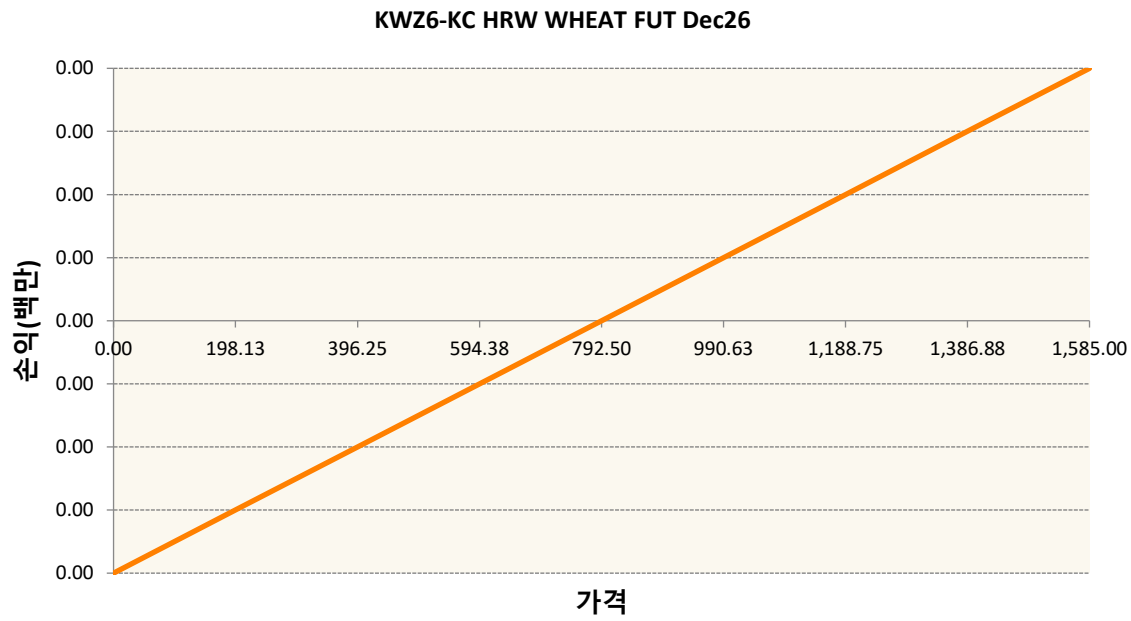
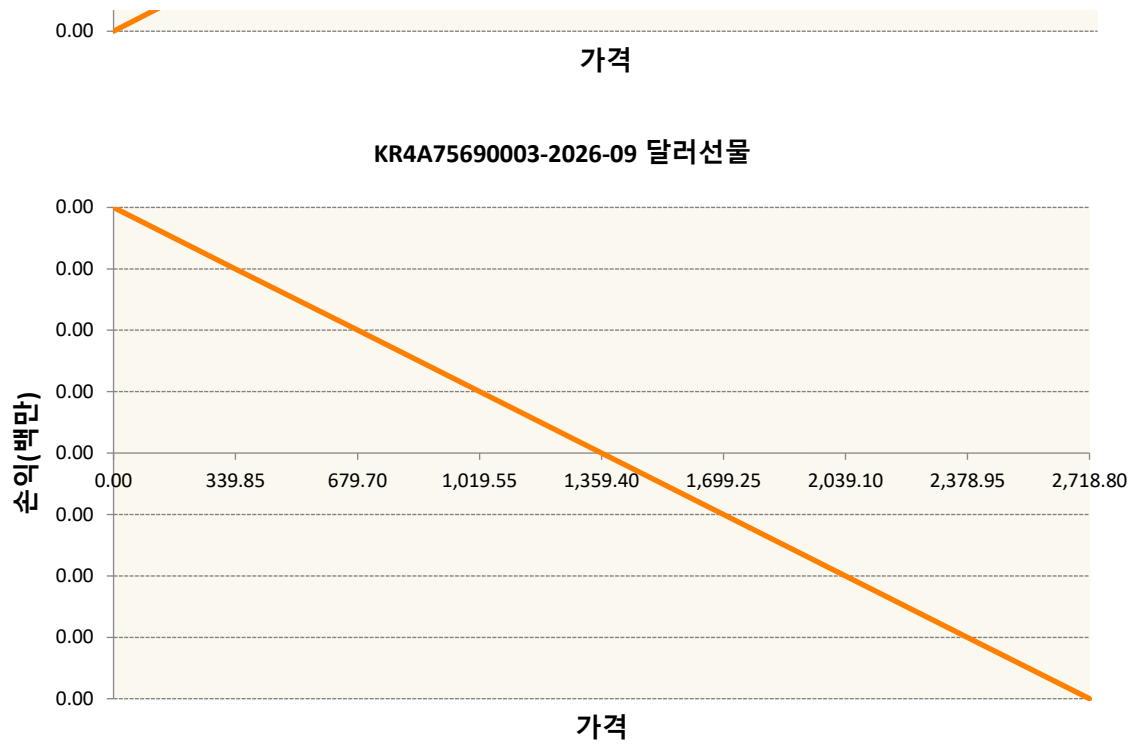
(단위:USD 백만)

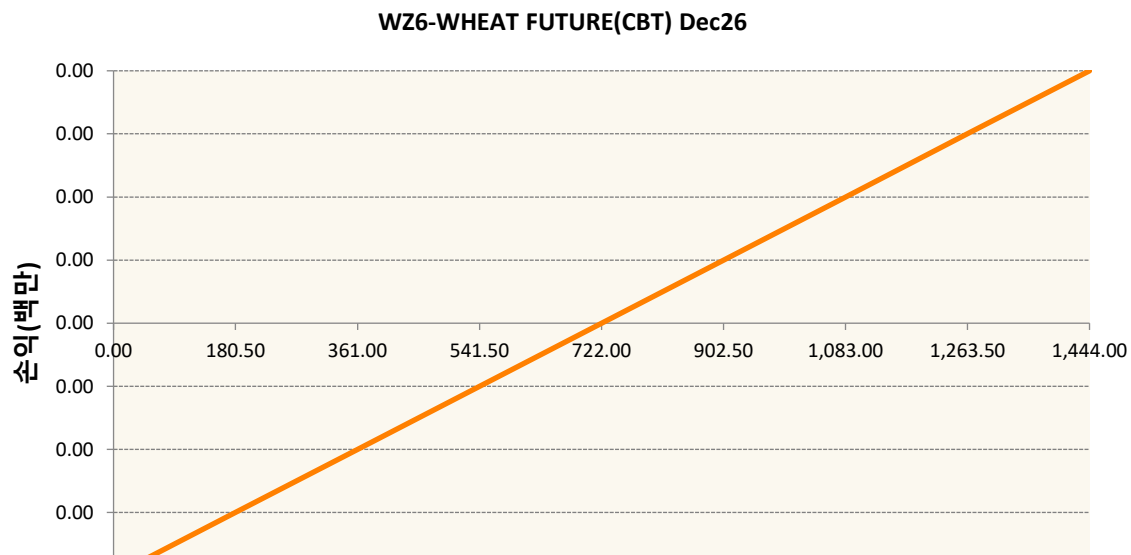
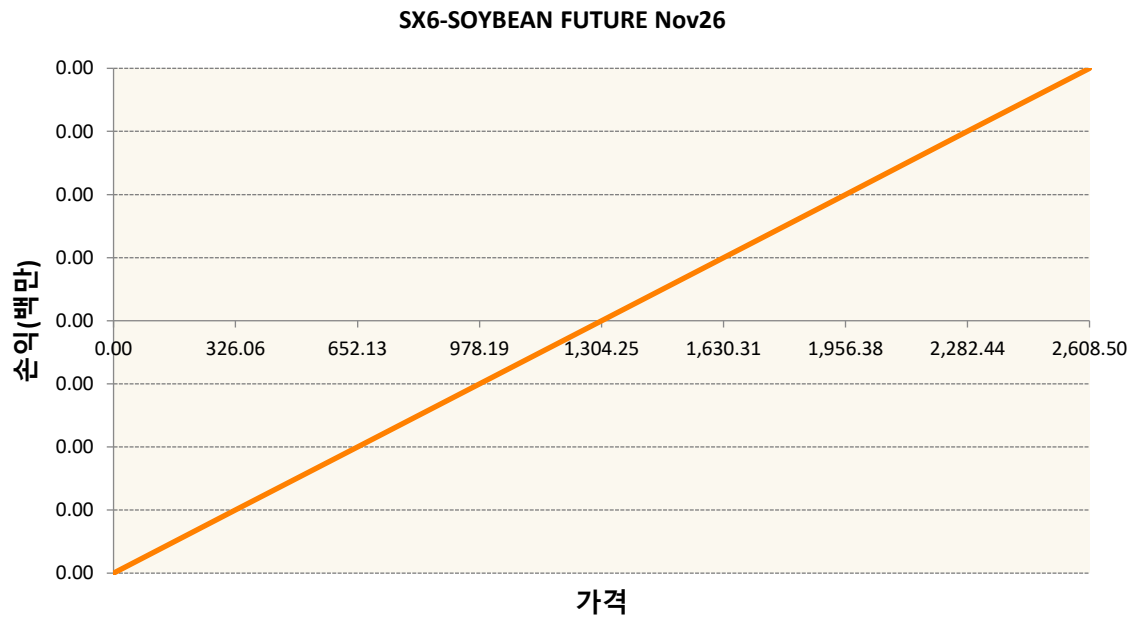
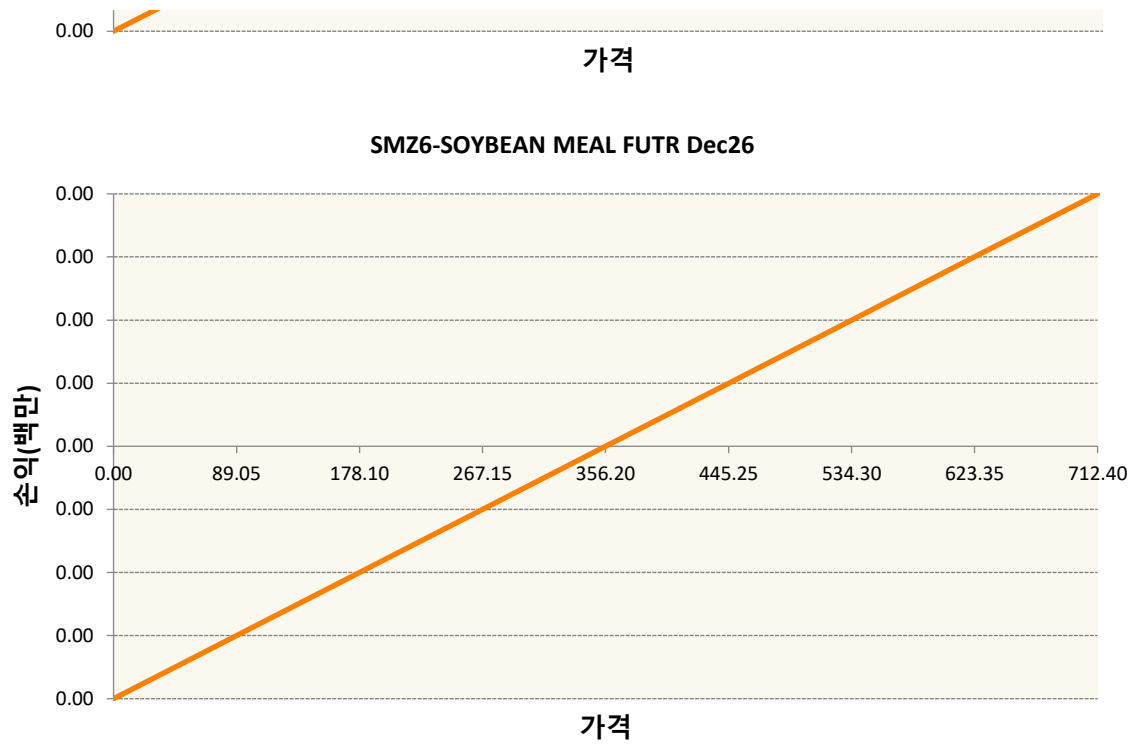
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	466	0	466	
누계	유가증권	선물	2,413	0	2,413	
누계	통화	선물	0	340	-340	장내

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	2026-09-16
기준일	2026-09-15

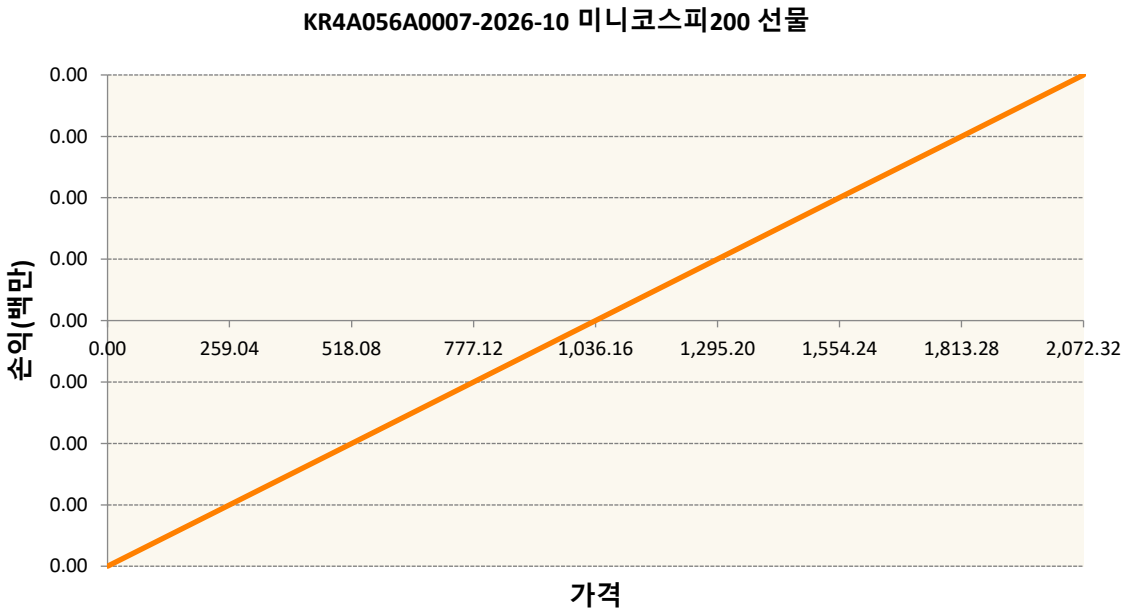
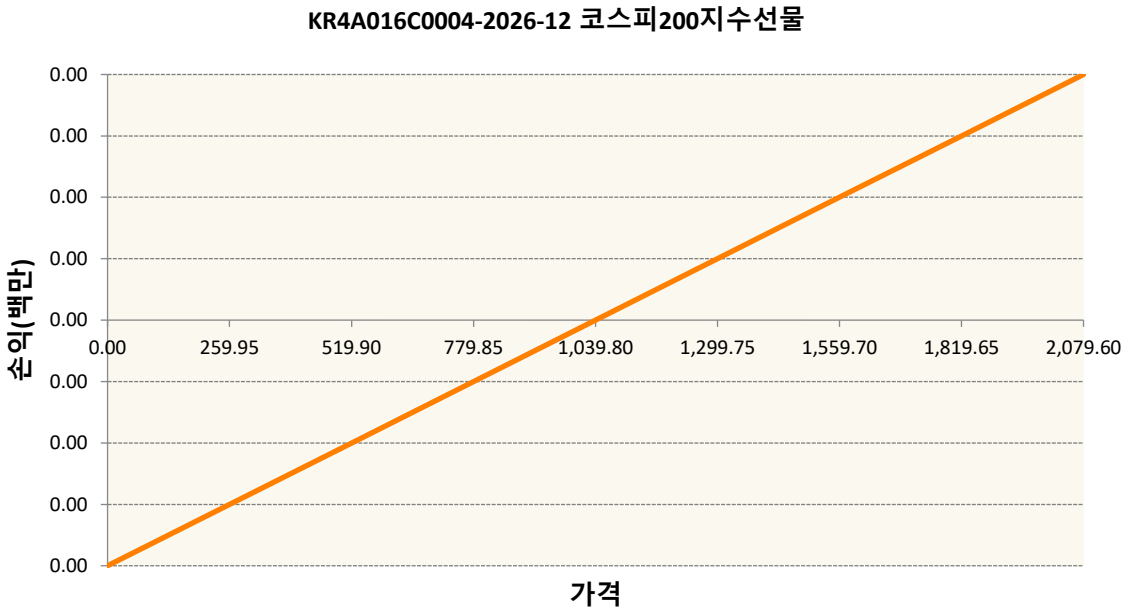
스마트인덱스모

1. 계약금액

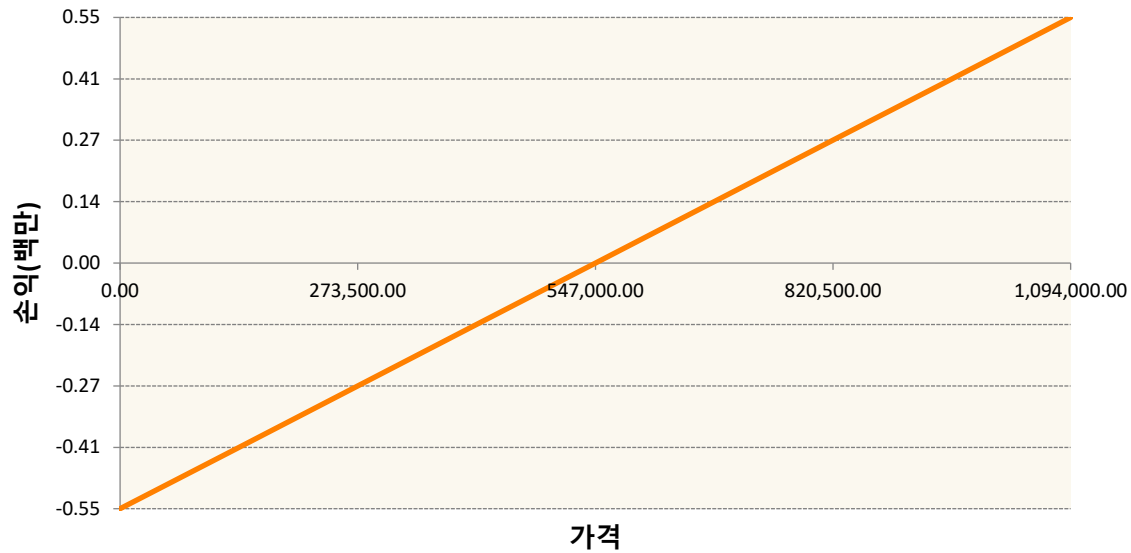
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,305	0	1,305	장내
누계	유가증권	선물	7,078	0	7,078	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물								292
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292	-292
-5.33%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-2.67%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	97	97	97	97	97	97	97	97
5.33%	195	195	195	195	195	195	195	195
8.00%	292	292	292	292	292	292	292	292
KR4A056A0007 2026-10 미니코스피200 선물								54
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54	54
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	-6
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	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)

1,183

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

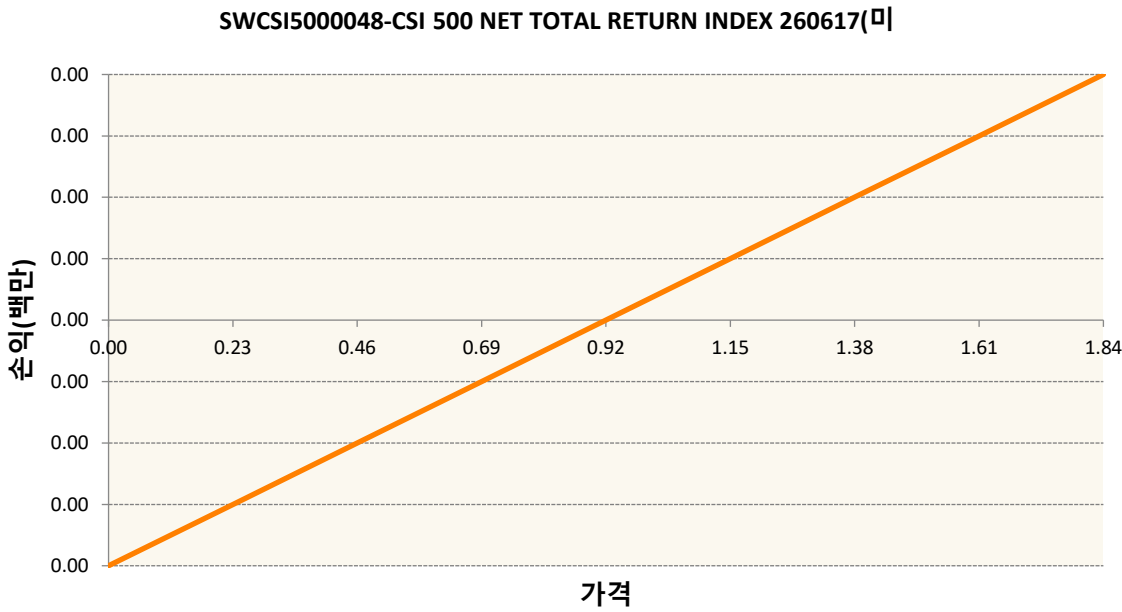
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,333	0	5,333	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

428

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

670

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

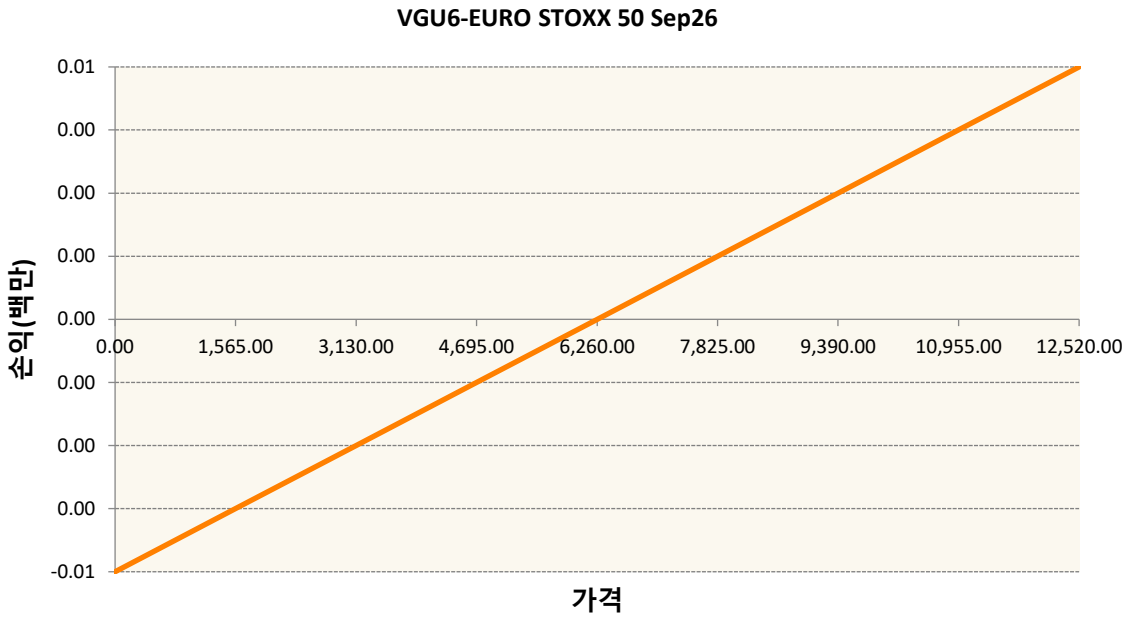
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,193	0	1,193	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

71

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

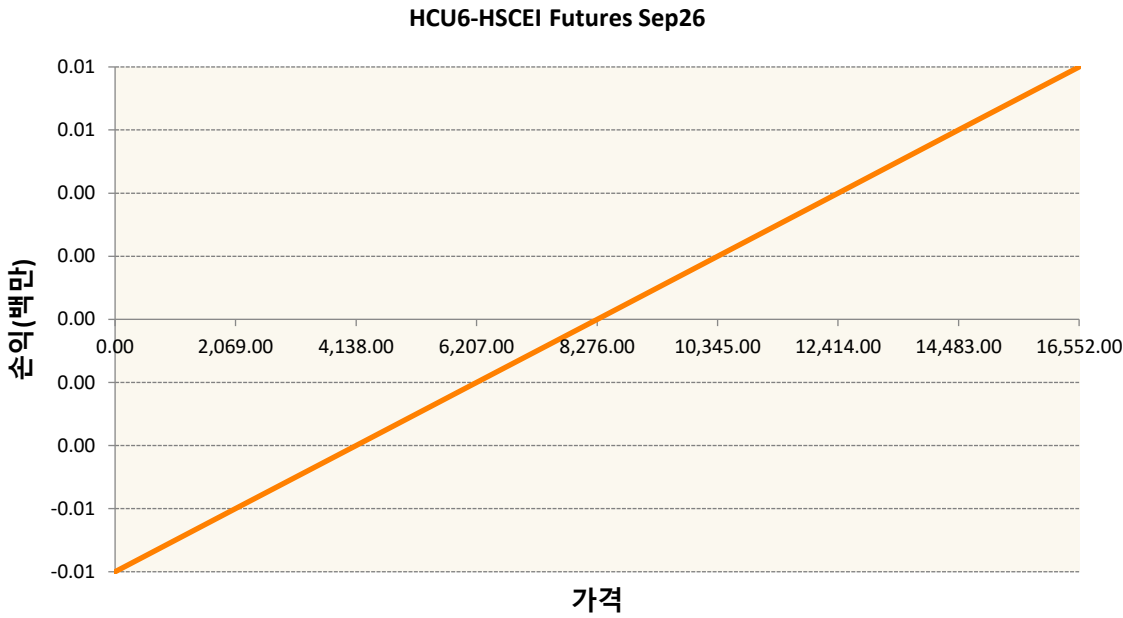
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,449	0	1,449	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	116
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

110

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

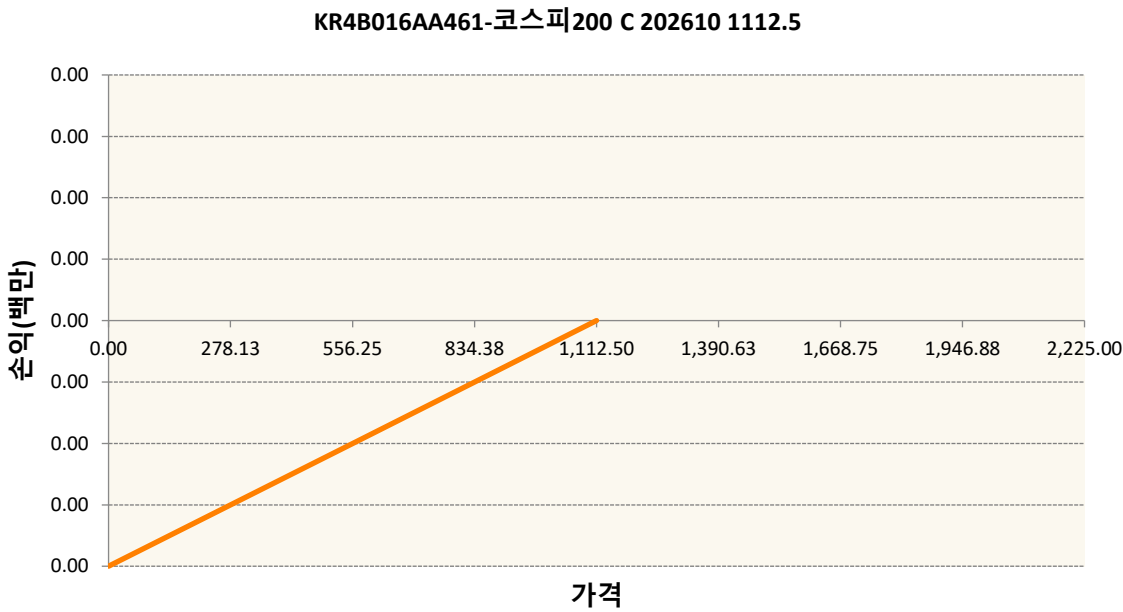
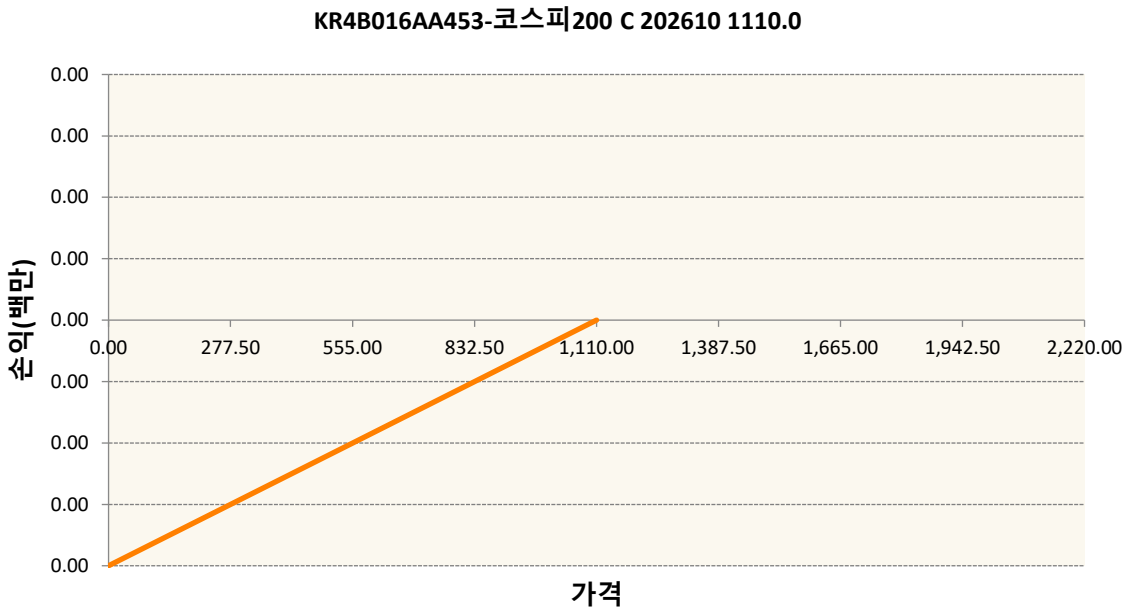
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

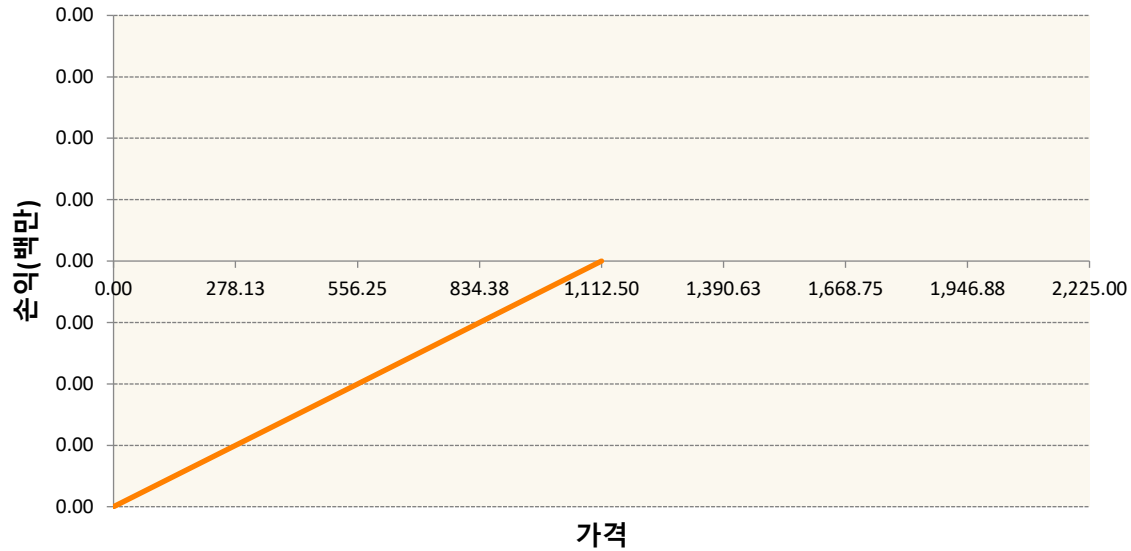
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	47,266	-47,266	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C016AA460-코스피200 P 202610 1112.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016AA453 코스피200 C 202610 1110.0								451
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-383	-390	-399	-410	-423	-436	-451	
-5.33%	-222	-234	-247	-262	-278	-295	-314	
-2.67%	-72	-88	-106	-125	-144	-165	-186	
0%	65	44	22	0	-23	-46	-70	
2.67%	185	161	136	111	85	60	34	
5.33%	286	260	233	206	180	153	126	
8.00%	367	341	314	287	260	233	206	
KR4B016AA461 코스피200 C 202610 1112.5								2,030
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,731	-1,763	-1,803	-1,851	-1,905	-1,965	-2,030	
-5.33%	-1,009	-1,060	-1,118	-1,183	-1,254	-1,330	-1,411	
-2.67%	-331	-402	-480	-564	-651	-742	-836	
0%	289	196	100	0	-102	-206	-312	
2.67%	833	724	613	501	388	274	160	
5.33%	1,293	1,174	1,055	935	816	697	577	
8.00%	1,664	1,544	1,424	1,303	1,182	1,062	941	
KR4C016AA460 코스피200 P 202610 1112.5								598
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-510	-519	-531	-545	-561	-579	-598	
-5.33%	-297	-312	-329	-349	-370	-392	-416	
-2.67%	-97	-118	-142	-166	-192	-219	-246	
0%	85	58	29	0	-30	-61	-92	

2.67%	246	213	181	148	114	81	47
5.33%	381	346	311	276	240	205	170
8.00%	490	455	419	384	348	313	277

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

(단위:백만원)

5,271

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

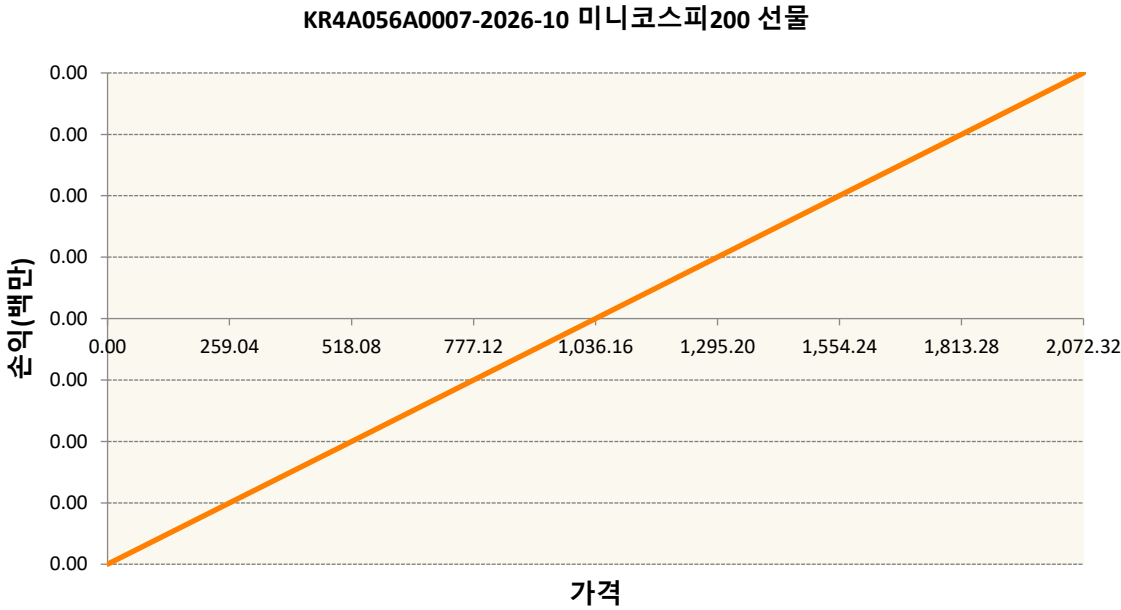
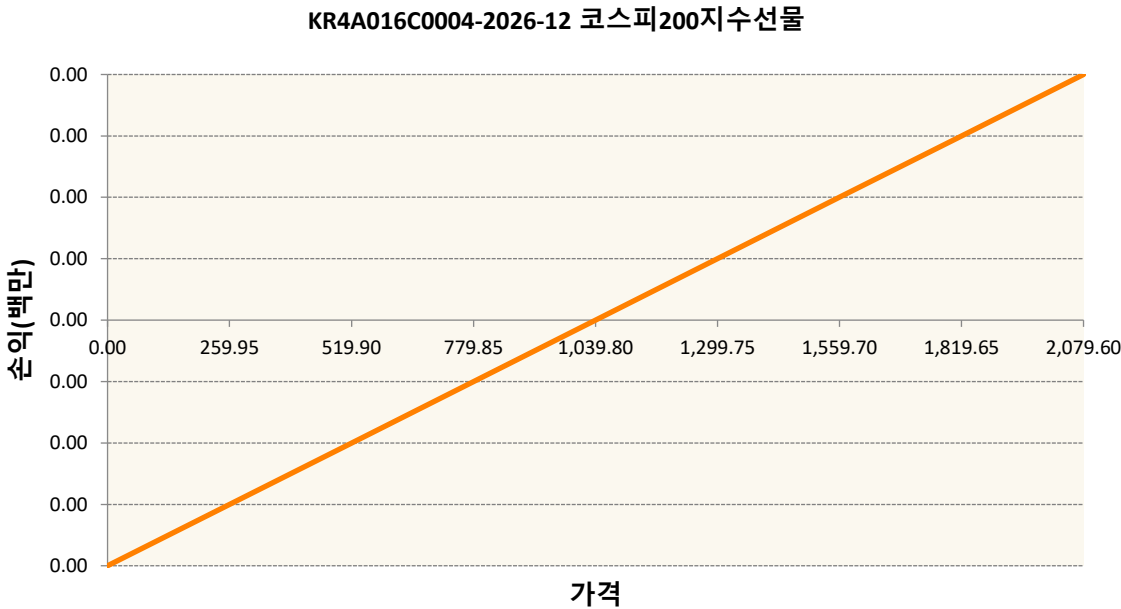
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

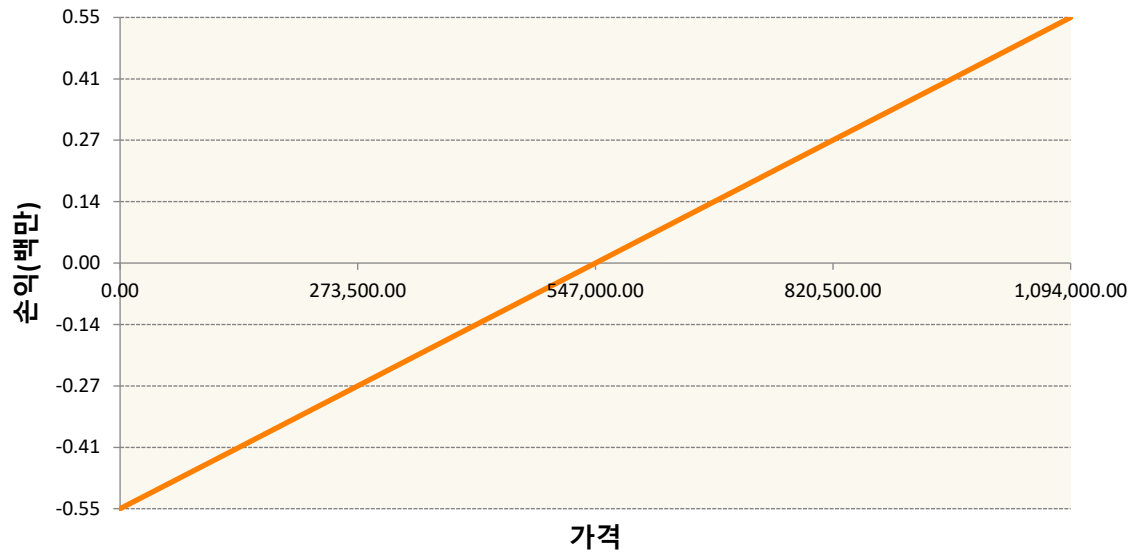
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	522	0	522	장내
누계	유가증권	선물	2,130	0	2,130	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004			2026-12 코스피200지수선물				63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-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%	63	63	63	63	63	63	63
KR4A056A0007			2026-10 미니코스피200 선물				21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	21	21	21	21	21	21	21
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

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

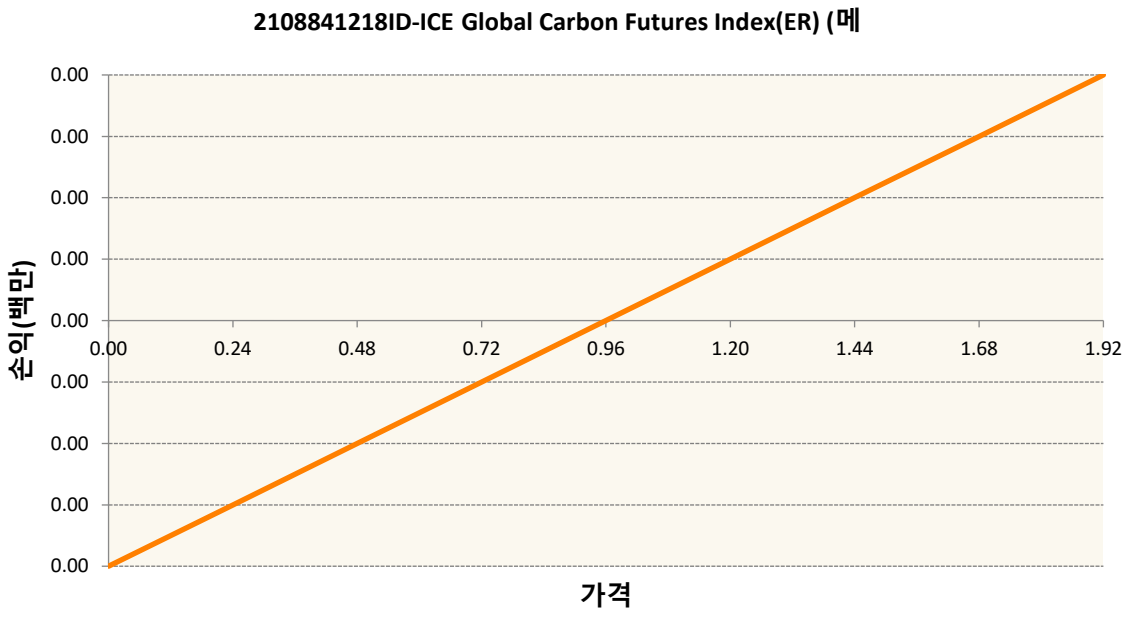
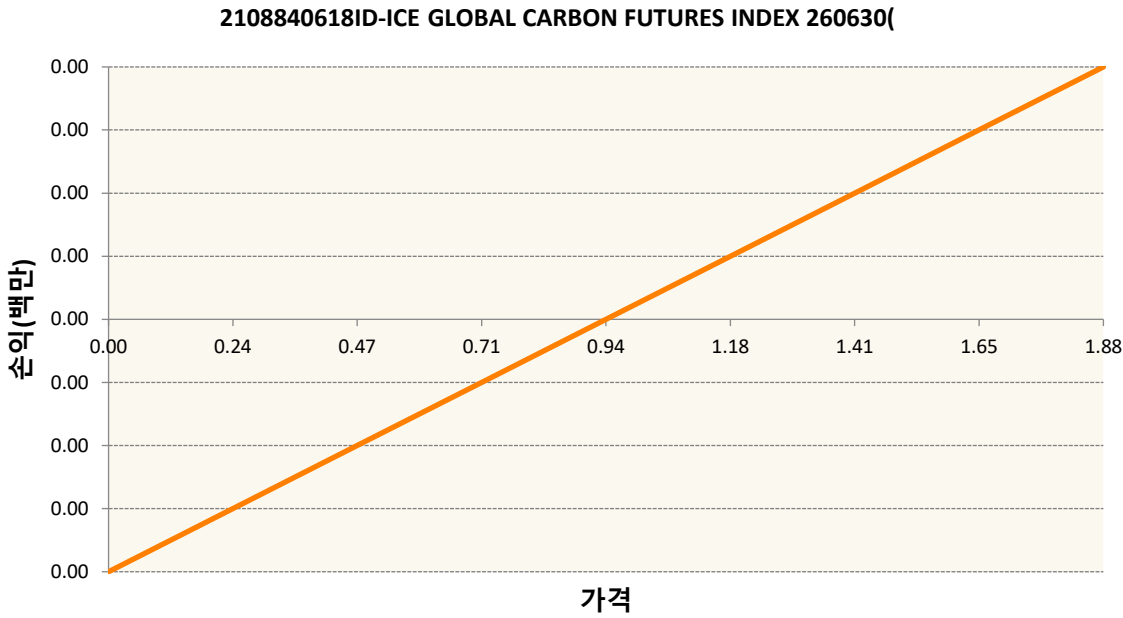
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,165	0	7,165	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		458
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		116

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	604

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

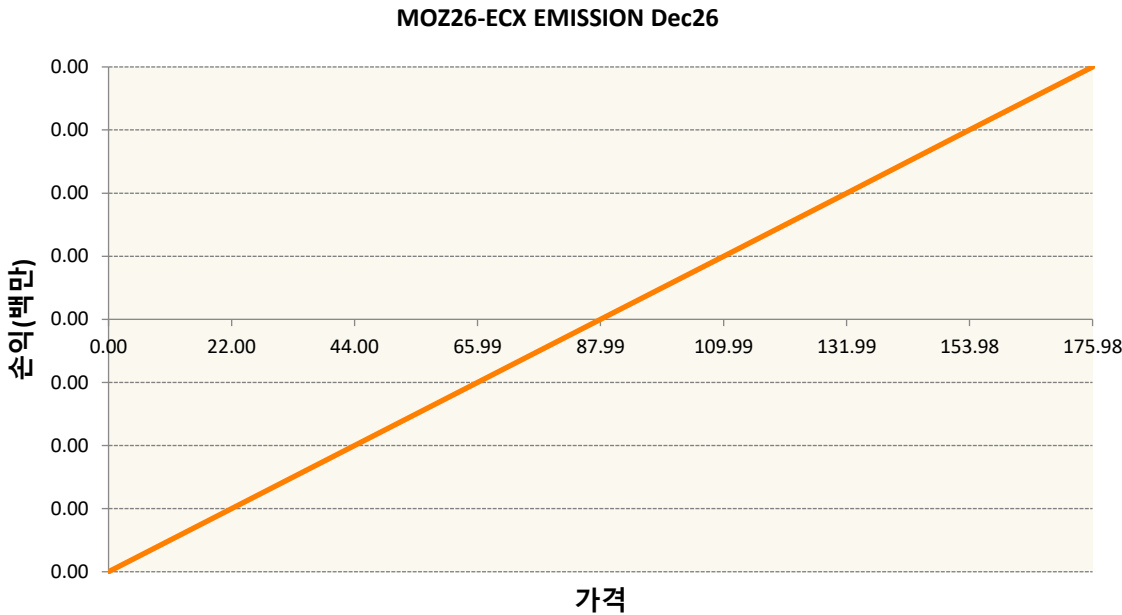
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,213	0	6,213	
누계	통화	선도	0	2,601	-2,601	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E	208
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	497

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

(단위:백만원)

758

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

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	2026-09-16
기준일	2026-09-15

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	-6,899	0	-6,899	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	71
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	245
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	235

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

(단위:백만원)

1,041

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

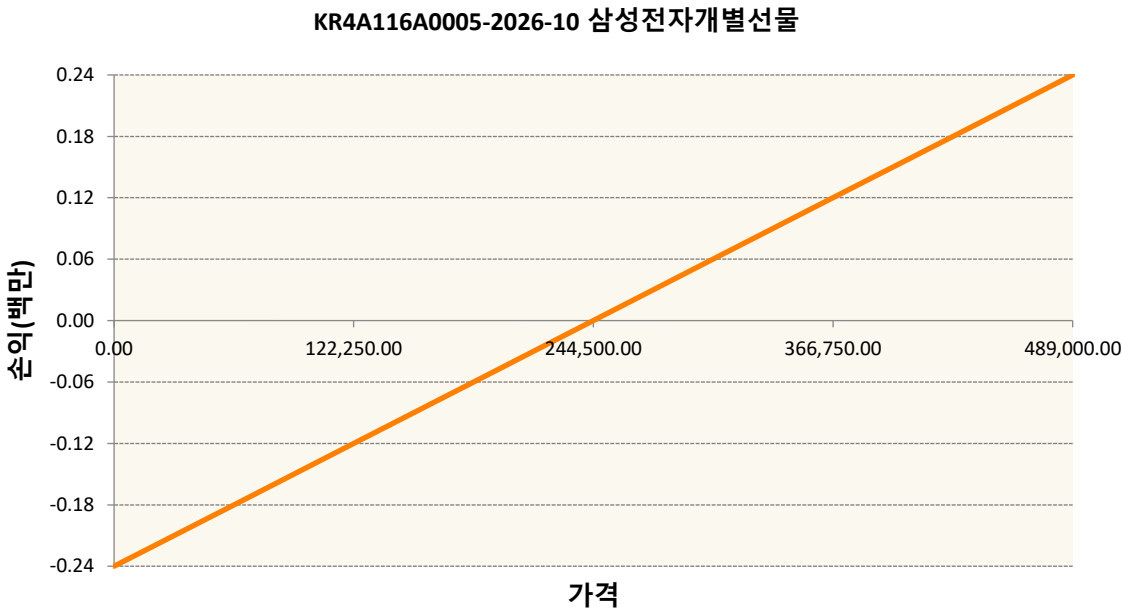
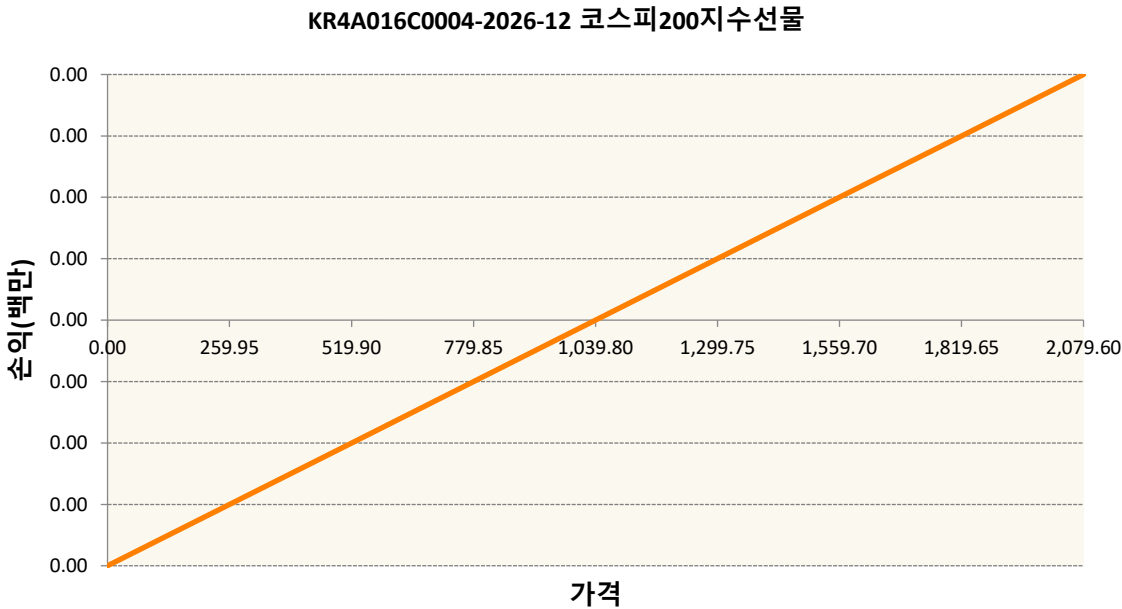
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

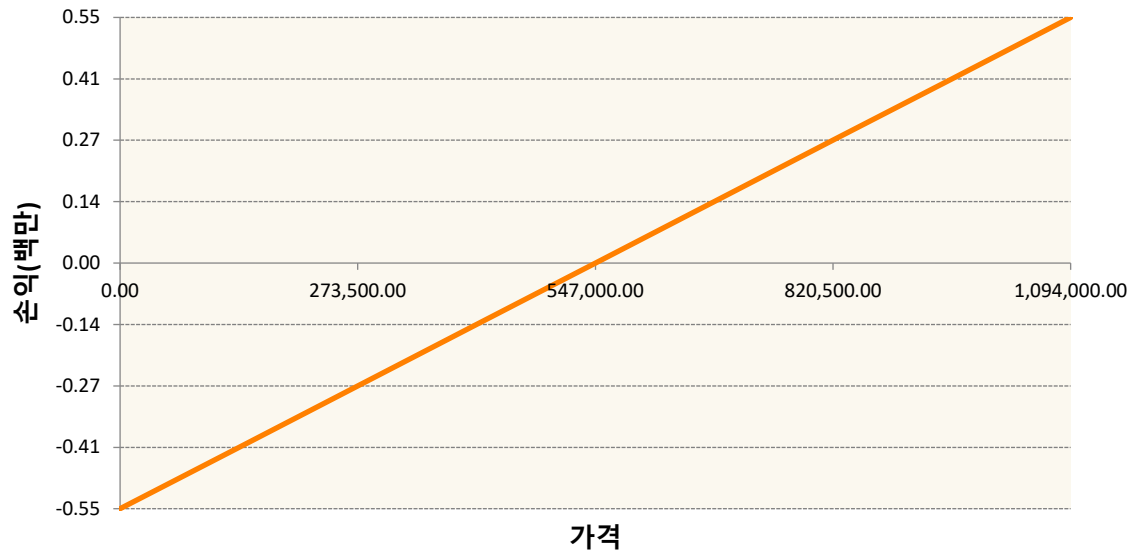
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	260	0	260	장내
누계	유가증권	선물	17,205	0	17,205	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물					1,063
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063	-1,063
-5.33%	-709	-709	-709	-709	-709	-709	-709
-2.67%	-354	-354	-354	-354	-354	-354	-354
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	354	354	354	354	354	354	354
5.33%	709	709	709	709	709	709	709
8.00%	1,063	1,063	1,063	1,063	1,063	1,063	1,063
KR4A116A0005		2026-10 삼성전자개별선물					254
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
-5.33%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	85	85	85	85	85	85	85
5.33%	170	170	170	170	170	170	170
8.00%	254	254	254	254	254	254	254
KR4A226A0002		2026-10 삼성SDI개별선물					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

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

(단위:백만원)

4,781

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

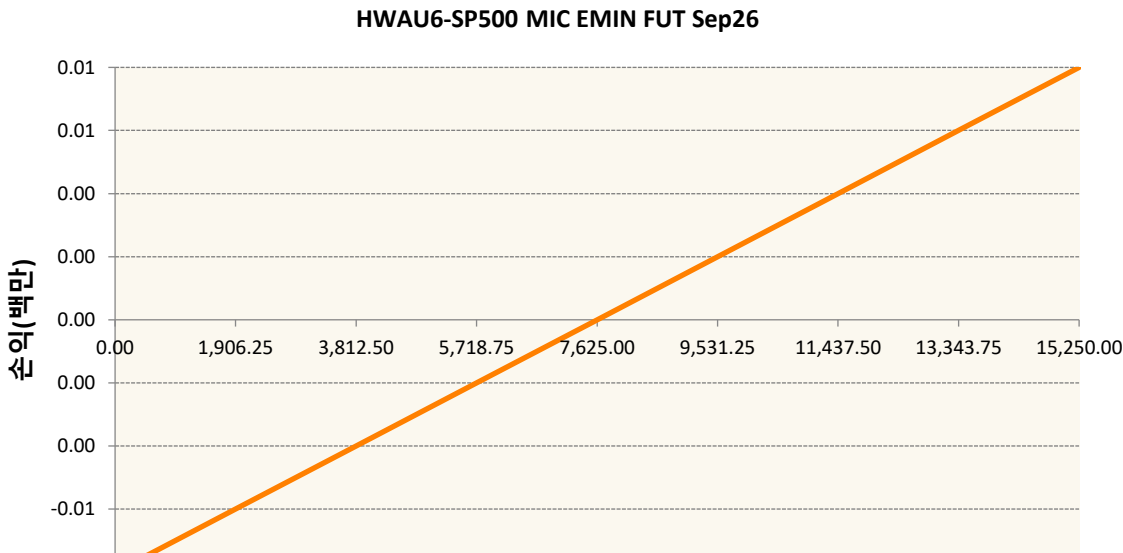
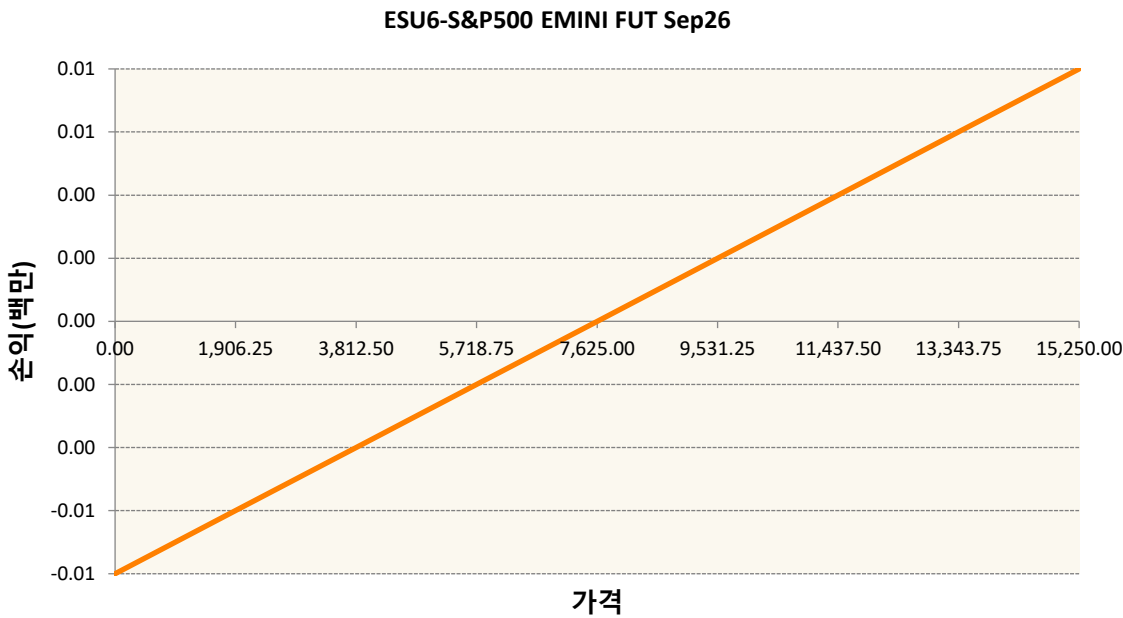
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

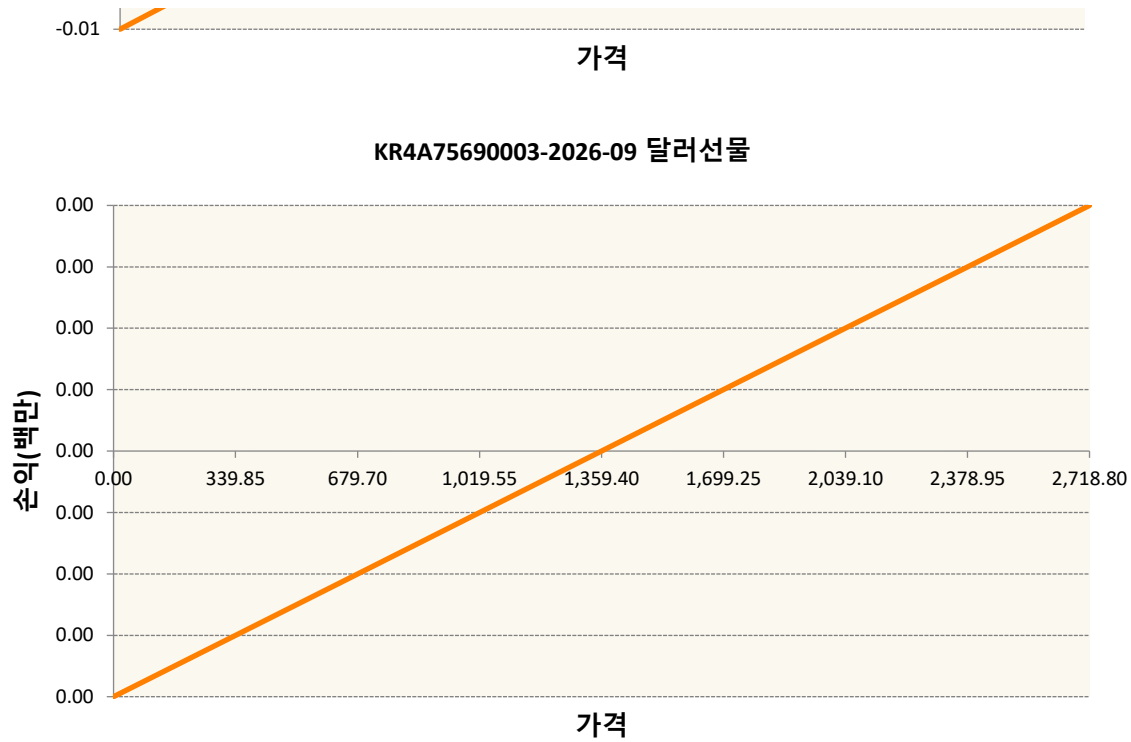
1. 계약금액

(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	80,654	0	80,654	
누계	지수	선물	380	0	380	장내
누계	통화	선물	10,331	0	10,331	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		6,452
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		30
KR4A756900 2026-09 달러선물			827

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,261

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

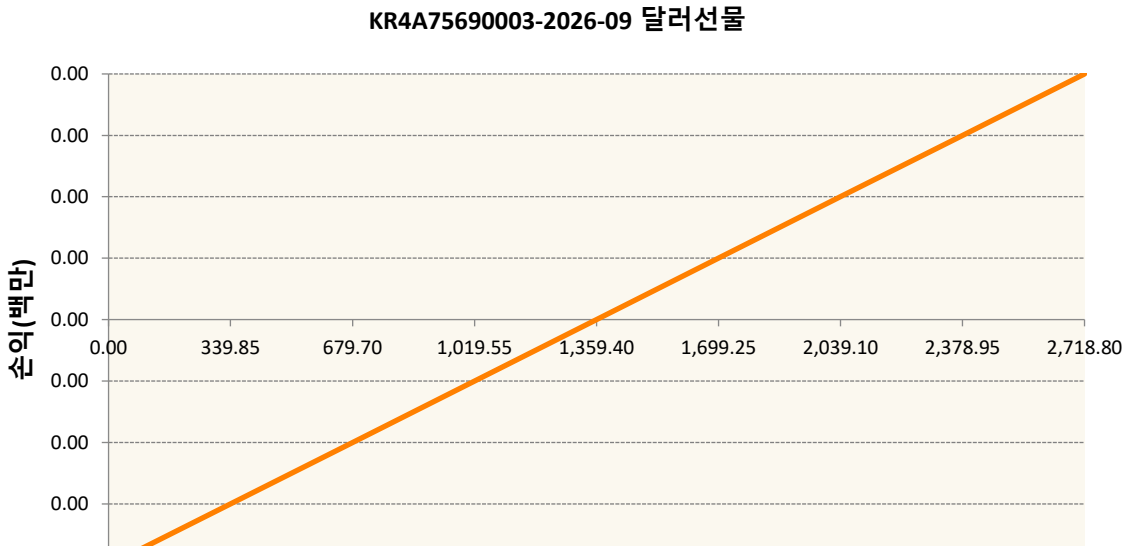
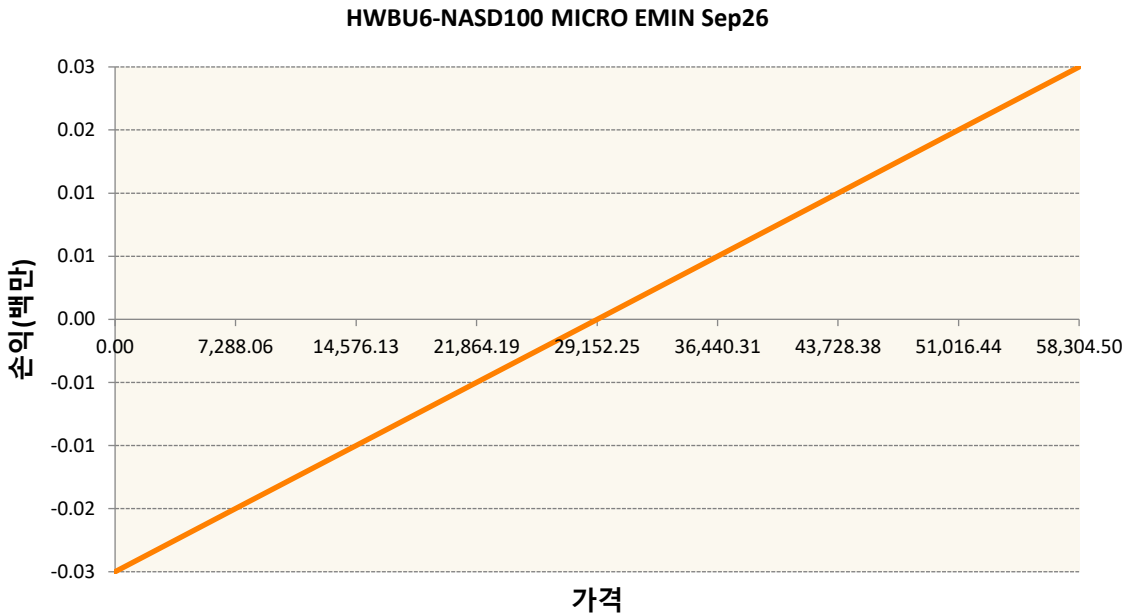
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

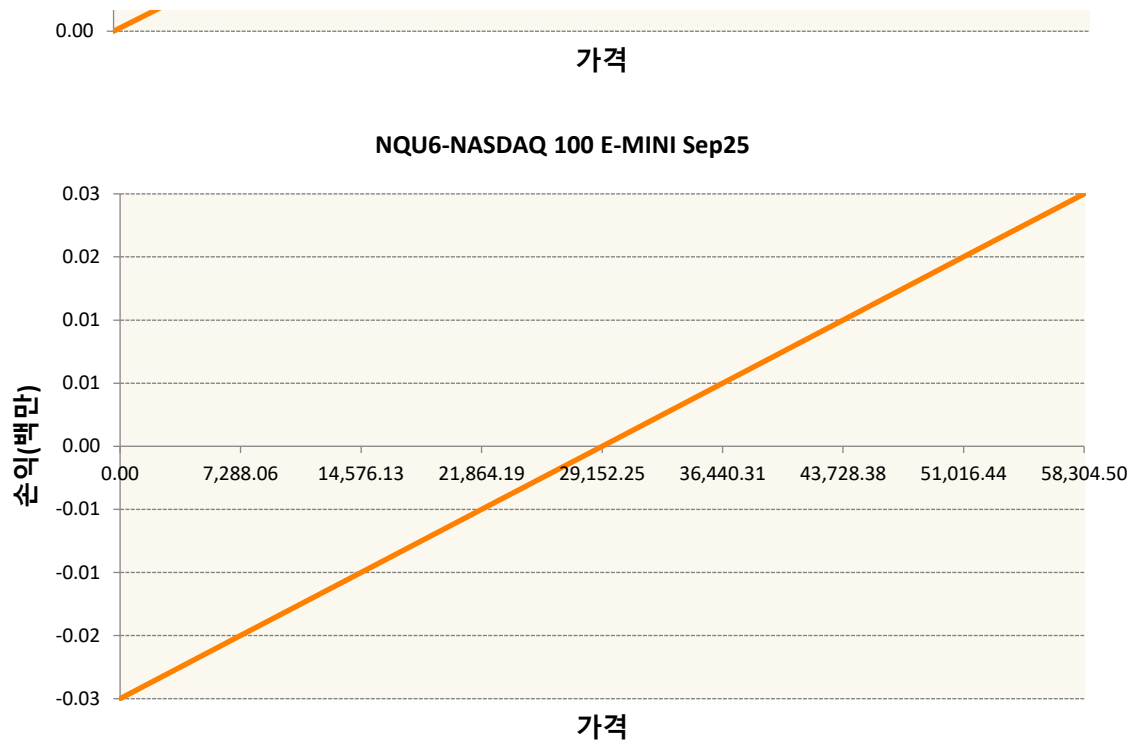
1. 계약금액

(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	731	0	731	장내
누계	지수	선물	37,640	0	37,640	
누계	통화	선물	4,771	0	4,771	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26	59
KR4A756900	2026-09 달러선물	382
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	3,011

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

2,842

공시일	2026-09-16
기준일	2026-09-15

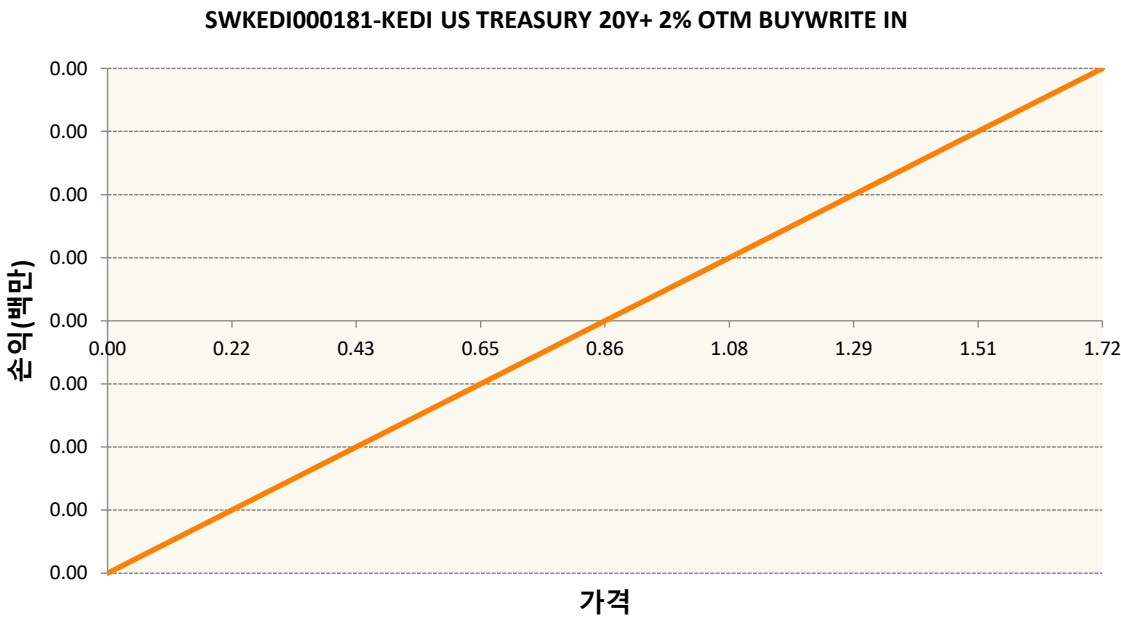
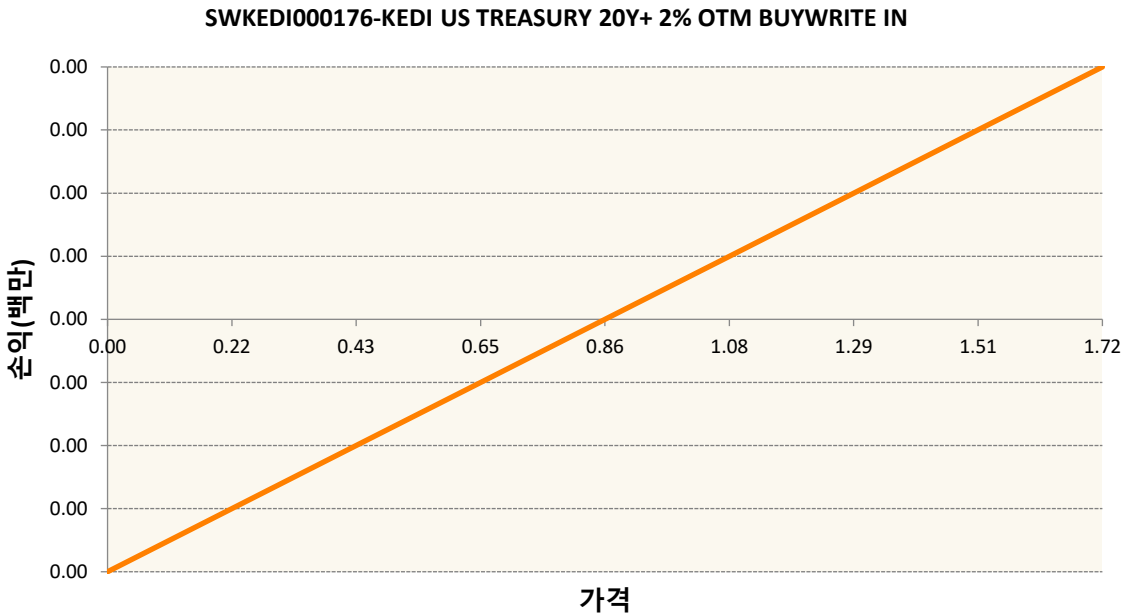
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

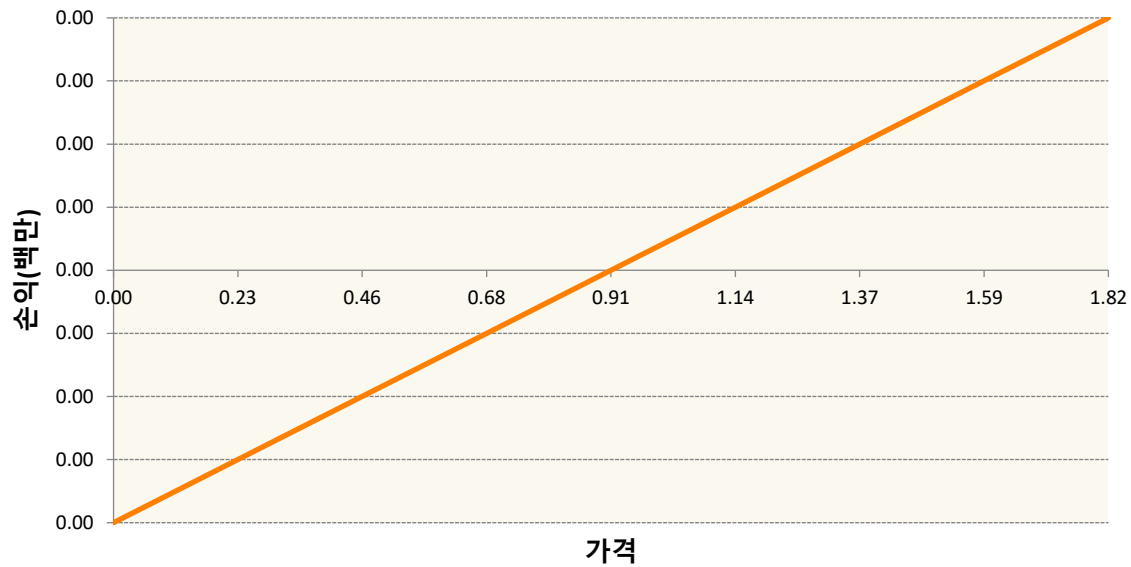
(단위:백만원)

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

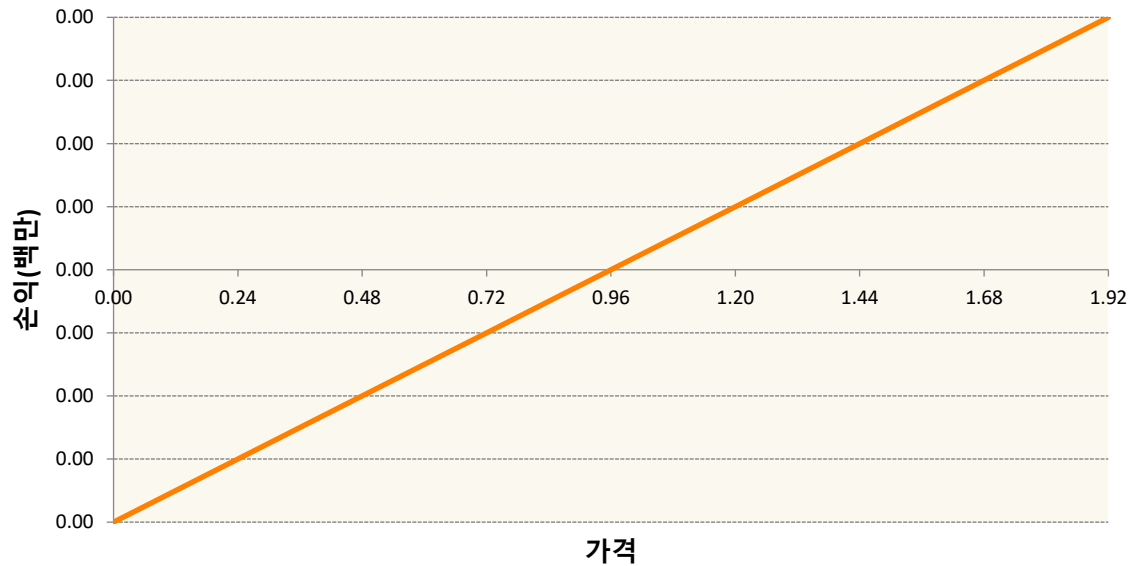
2. 만기시점의 손익구조



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	6,984
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,741
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,100
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,884

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

(단위:백만원)

8,641
