

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

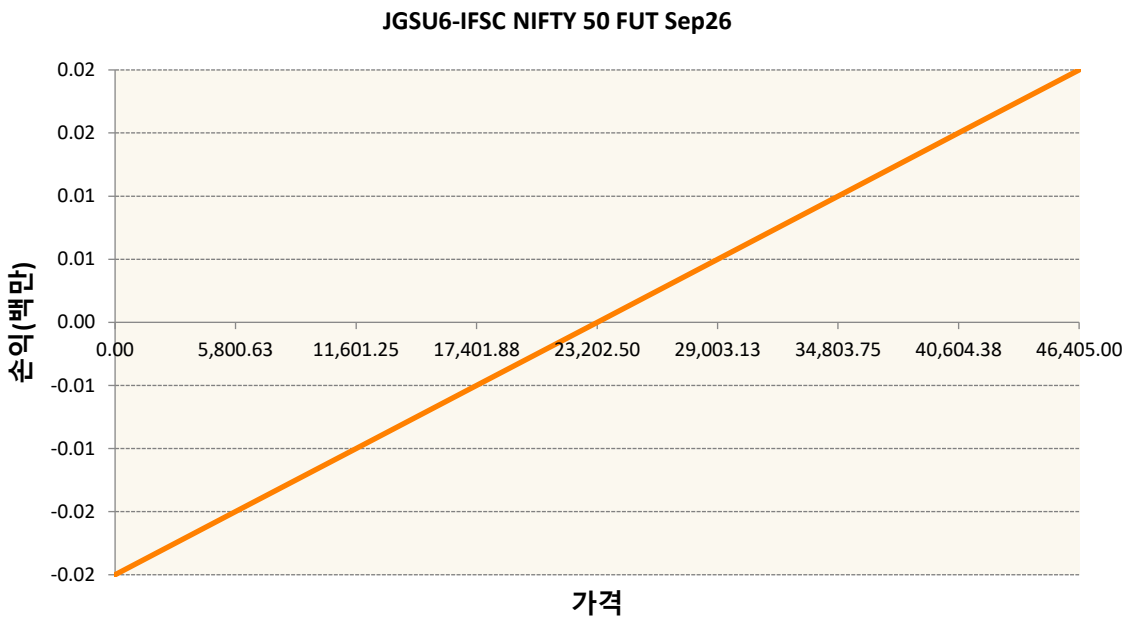
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	322	0	322	

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	2026-09-17
기준일	2026-09-16

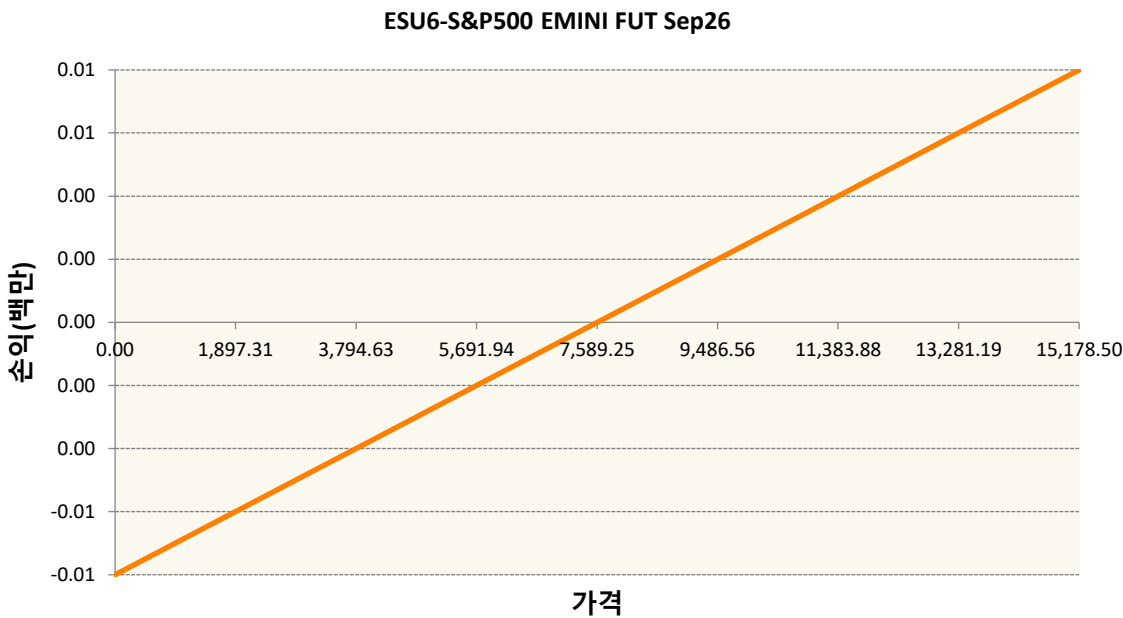
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

30

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

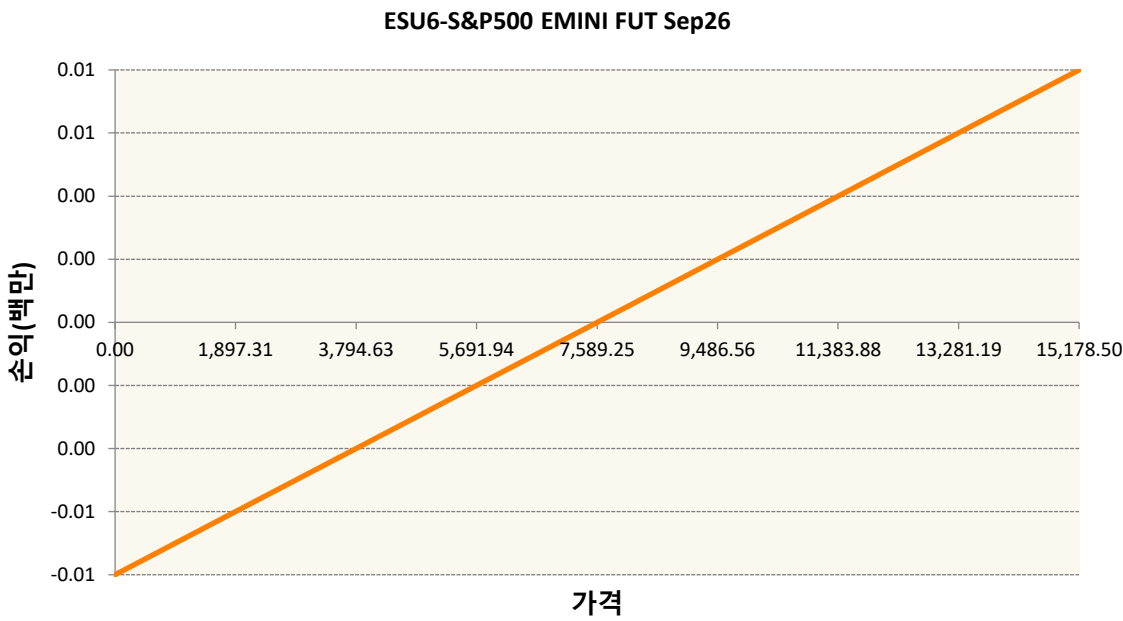
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	573	0	573	

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)

29

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

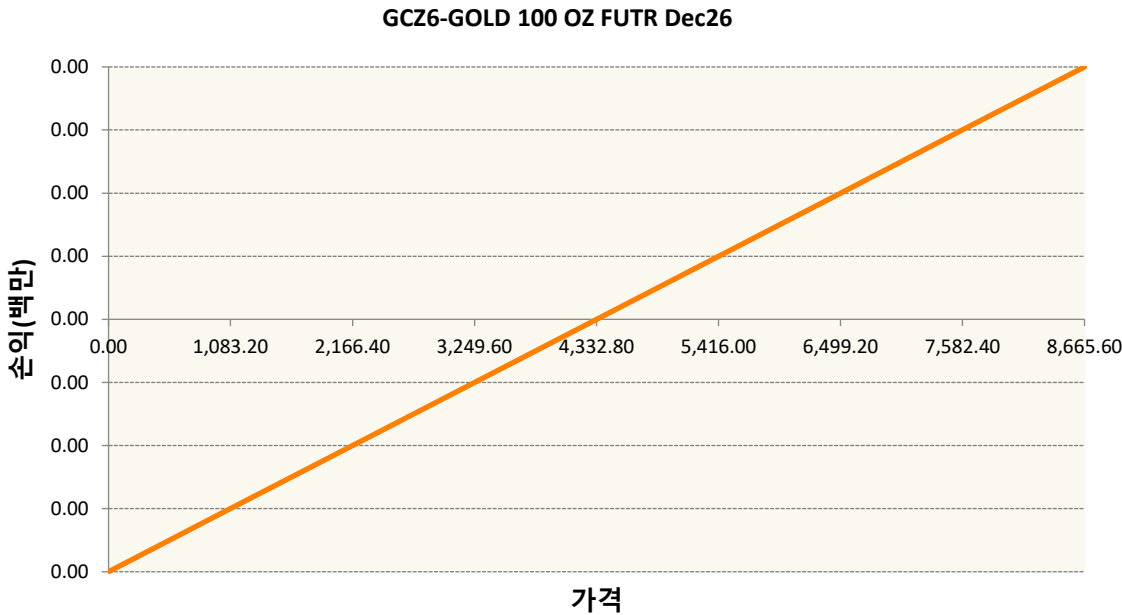
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			6,163	0	6,163	
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	493

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

(단위:백만원)

655

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

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	7
AOPLTRUP1 PLTR US 09/18/26 P172.5 EQUITY	41

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

(단위:백만원)

167

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

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

6

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

(단위:백만원)

3

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

(단위:백만원)

13,443

공시일 2026-09-17

기준일 2026-09-16

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	2026-09-17
기준일	2026-09-16

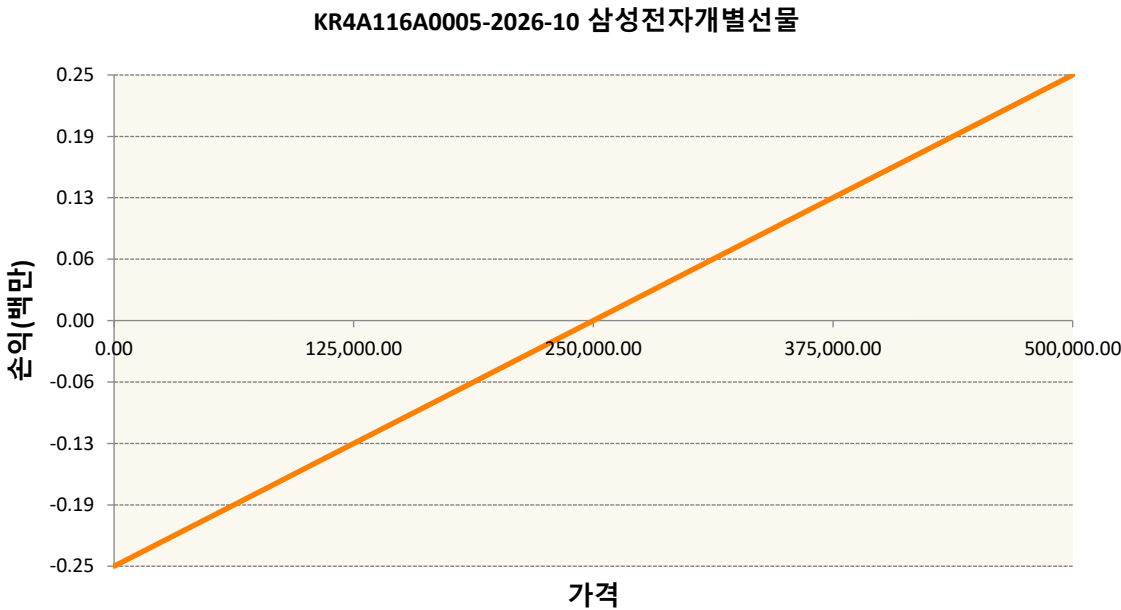
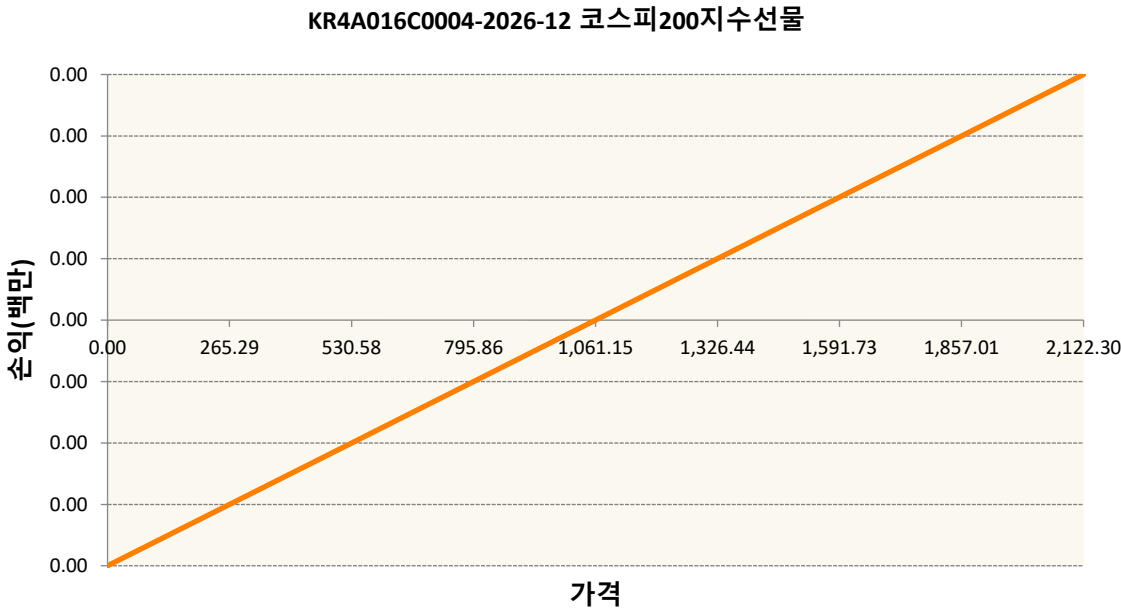
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	20,397	0	20,397	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 a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가액' (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 the origin (0, 0) and ending at the point (1,055.00, 0.00).

가액 (Price)	순이익 (백만) (Net Income)
0.00	0.00
1,055.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A016C0004				2026-12 코스피200지수선물				551
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-551	-551	-551	-551	-551	-551	-551	
-5.33%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367	
-2.67%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	184	184	184	184	184	184	184	
5.33%	367	367	367	367	367	367	367	
8.00%	551	551	551	551	551	551	551	
KR4A116A0005				2026-10 삼성전자개별선물				1,095
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095
-5.33%	-730	-730	-730	-730	-730	-730	-730
-2.67%	-365	-365	-365	-365	-365	-365	-365
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	365	365	365	365	365	365	365
5.33%	730	730	730	730	730	730	730
8.00%	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095
KR4B09FDA229 코스피위클리 C 2609W3 1,052.5							2,049

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,048	-2,048	-2,048	-2,048	-2,048	-2,049	-2,049
-5.33%	-1,229	-1,230	-1,231	-1,234	-1,237	-1,242	-1,248
-2.67%	-443	-457	-472	-488	-505	-522	-541
0%	67	45	23	0	-23	-46	-69
2.67%	184	179	173	165	155	145	132
5.33%	190	190	190	189	187	185	183
8.00%	190	190	190	190	190	190	190

KR4B09FDA237 코스피위클리 C 2609W3 1,055.0							1,407
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,406	-1,406	-1,406	-1,406	-1,406	-1,406	-1,407
-5.33%	-855	-856	-856	-858	-860	-862	-866
-2.67%	-322	-329	-338	-348	-359	-370	-381
0%	47	31	16	0	-16	-32	-48
2.67%	142	138	133	126	119	111	102
5.33%	147	147	147	146	145	143	141
8.00%	148	148	147	147	147	147	147

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

(단위:백만원)

12,140

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

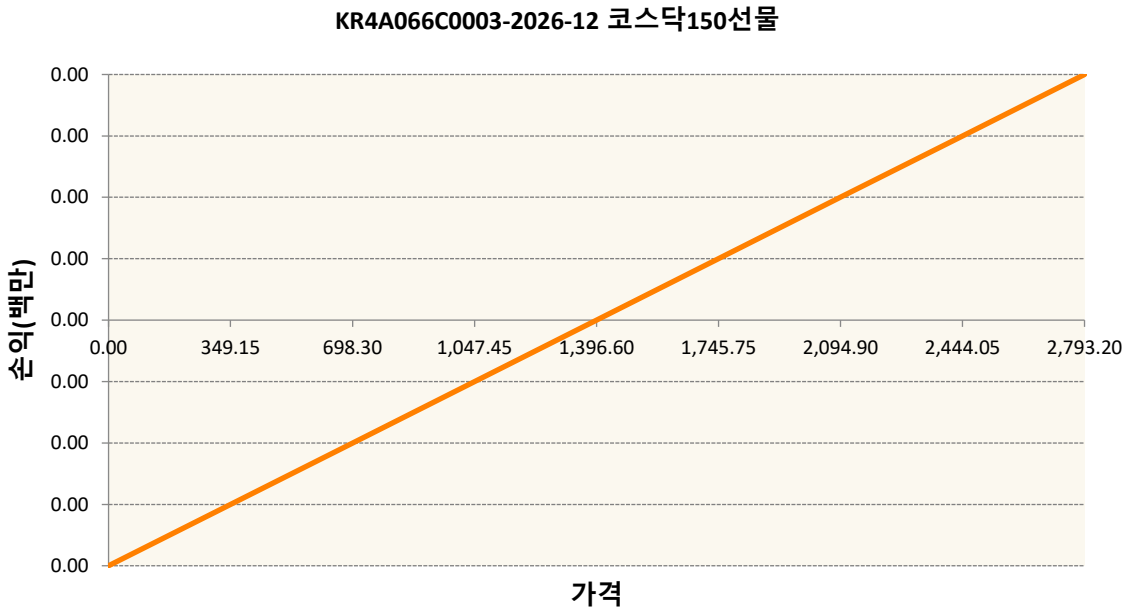
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	642	0	642	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)

12,996

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

(단위:백만원)

69,264

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

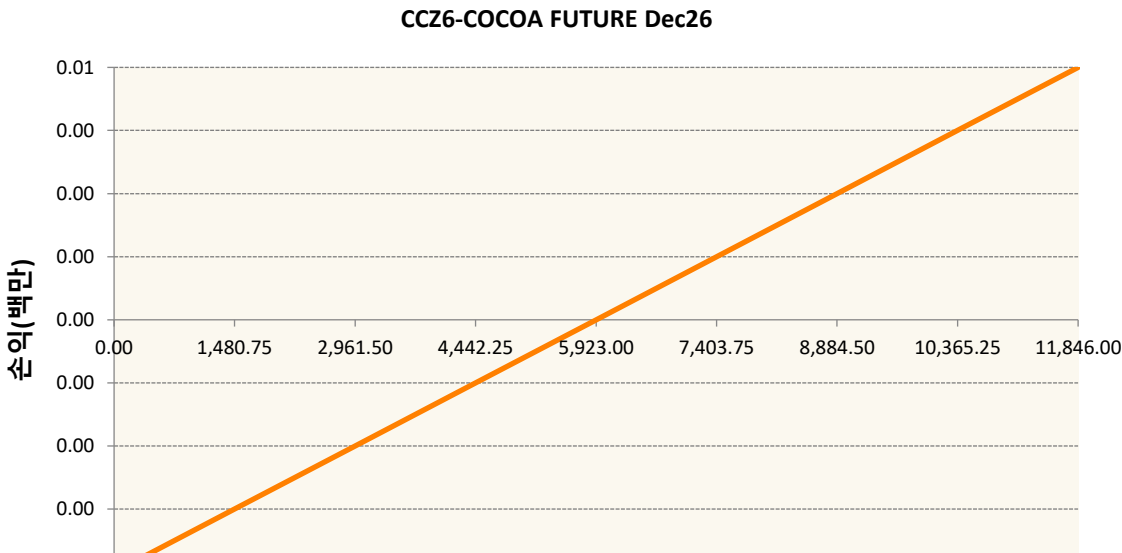
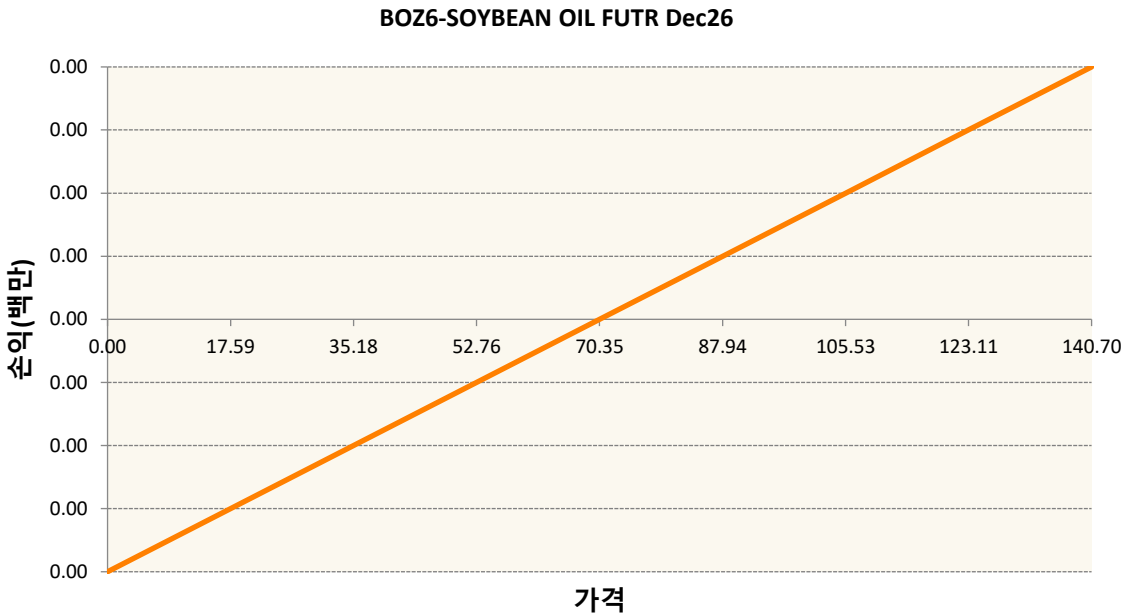
포커스농산물모(채권-파생형)

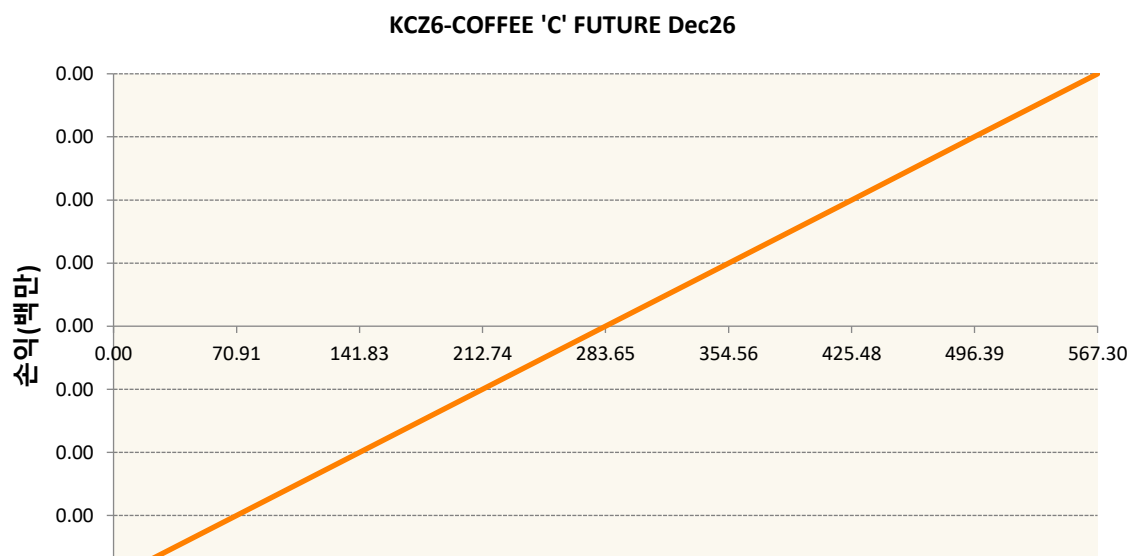
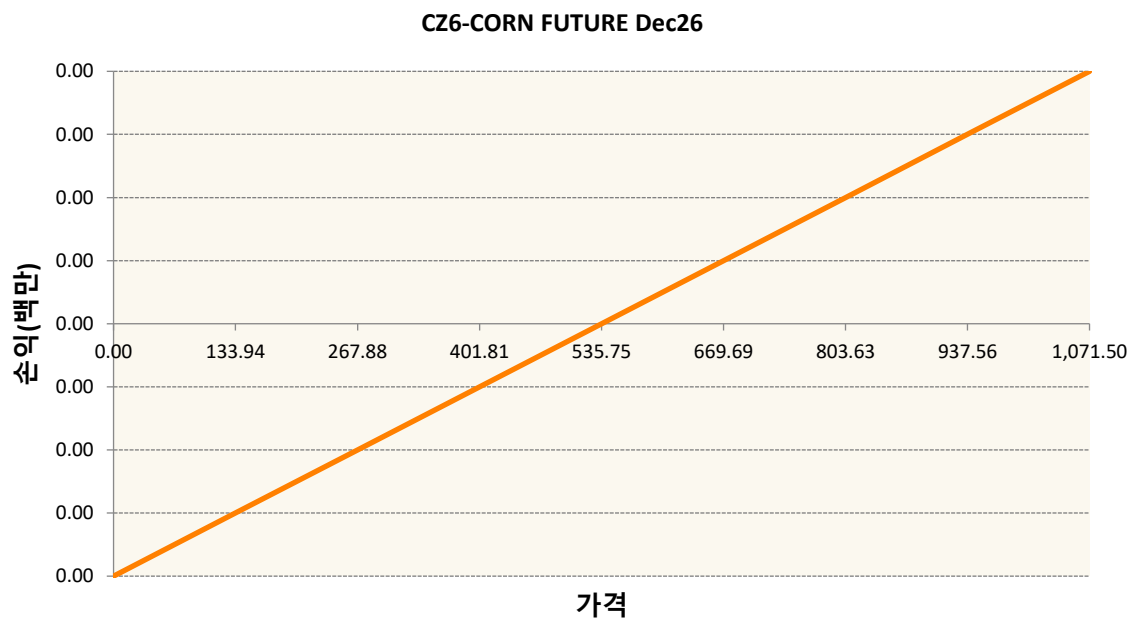
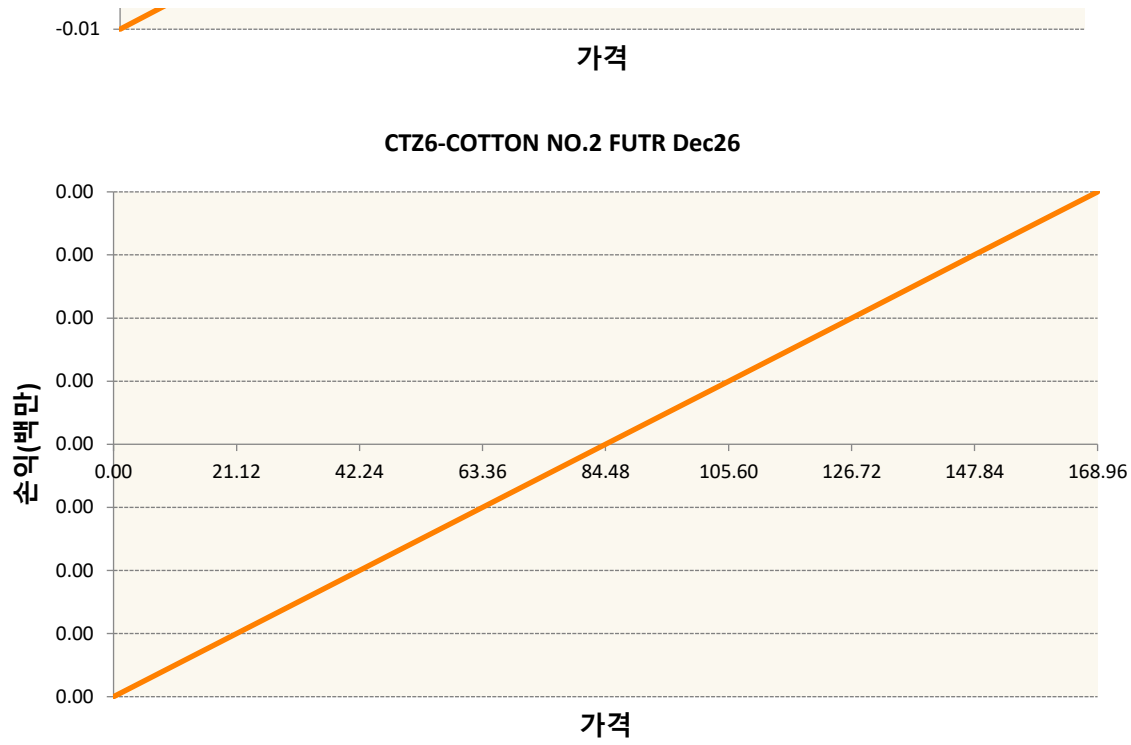
1. 계약금액

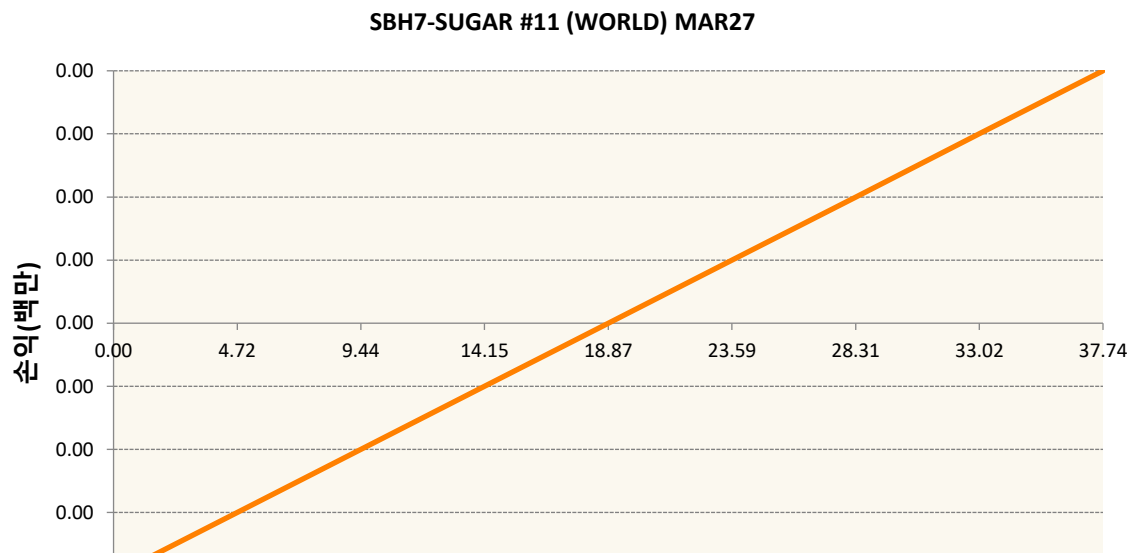
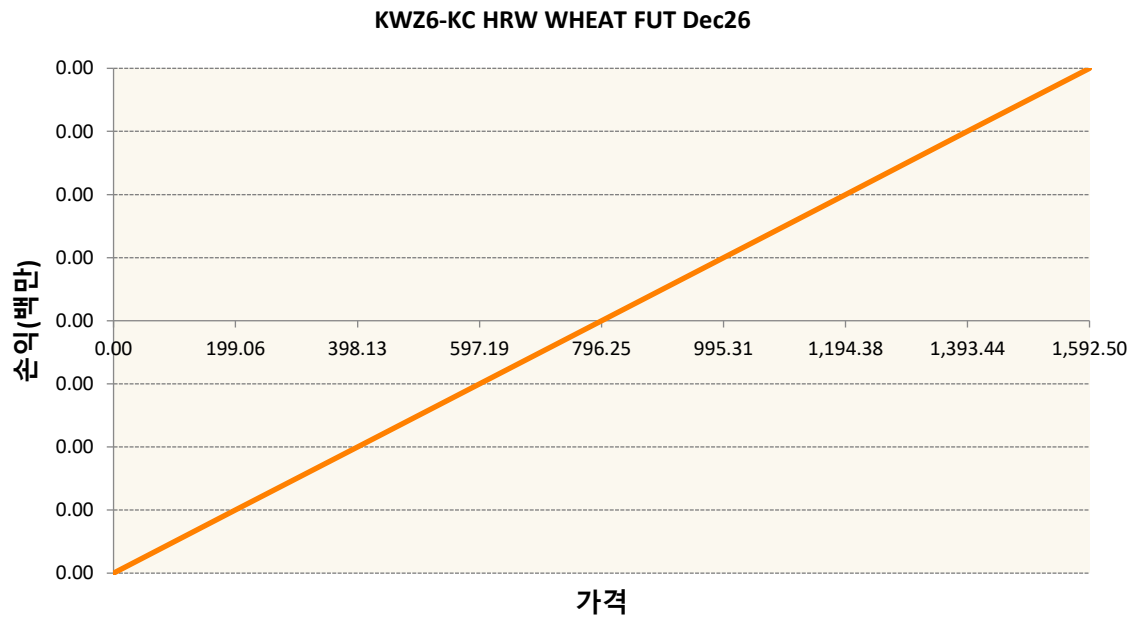
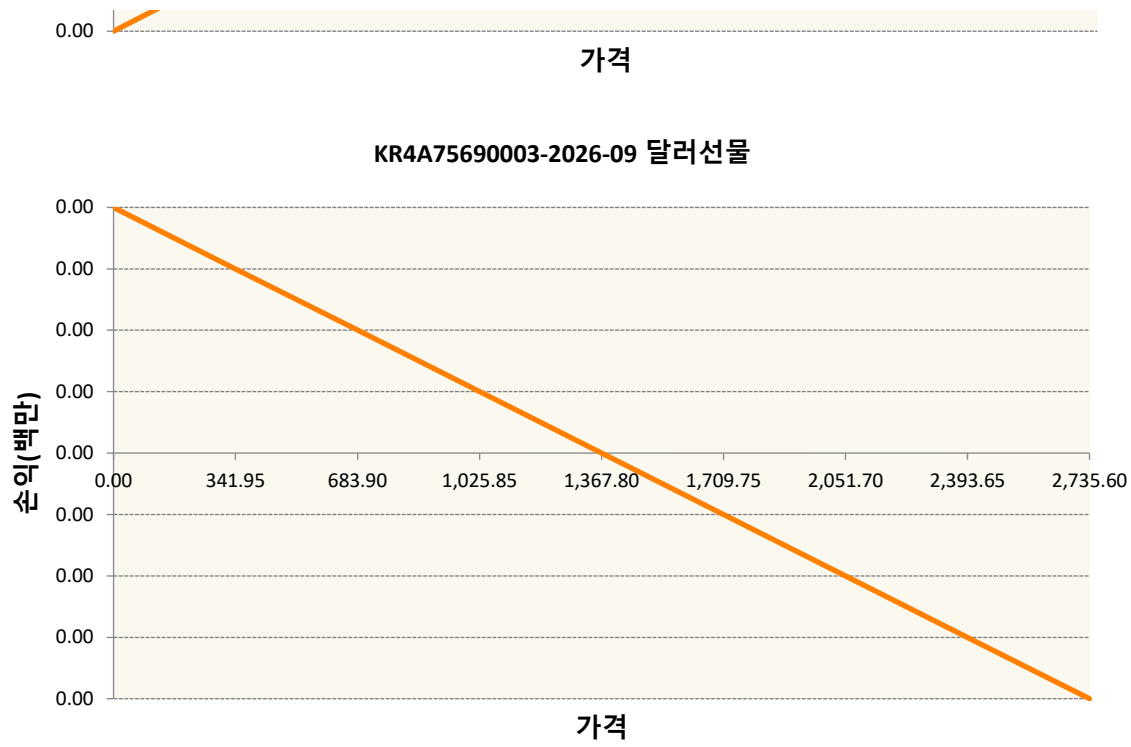
(단위:USD 백만)

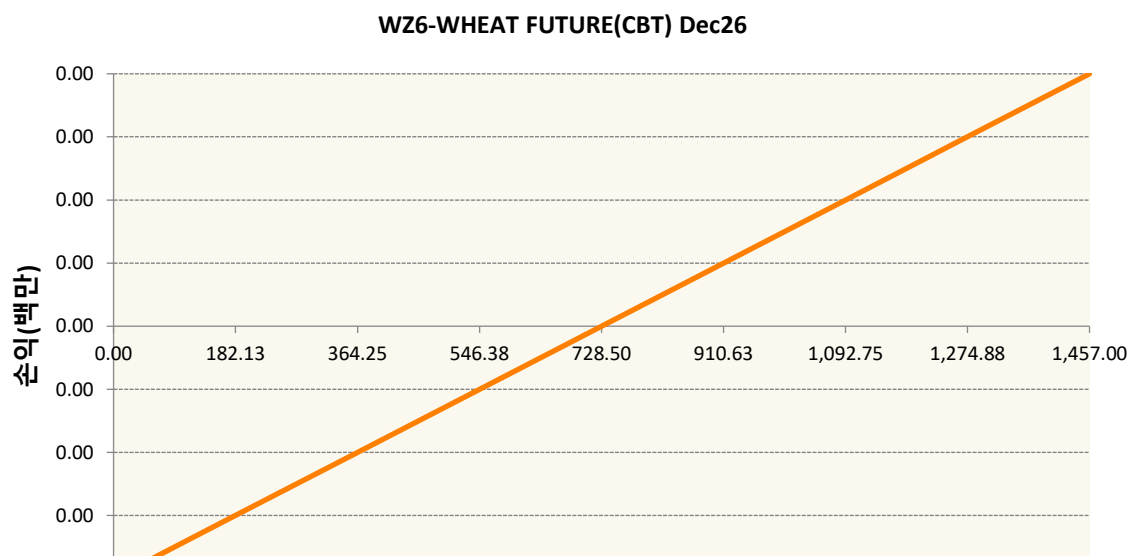
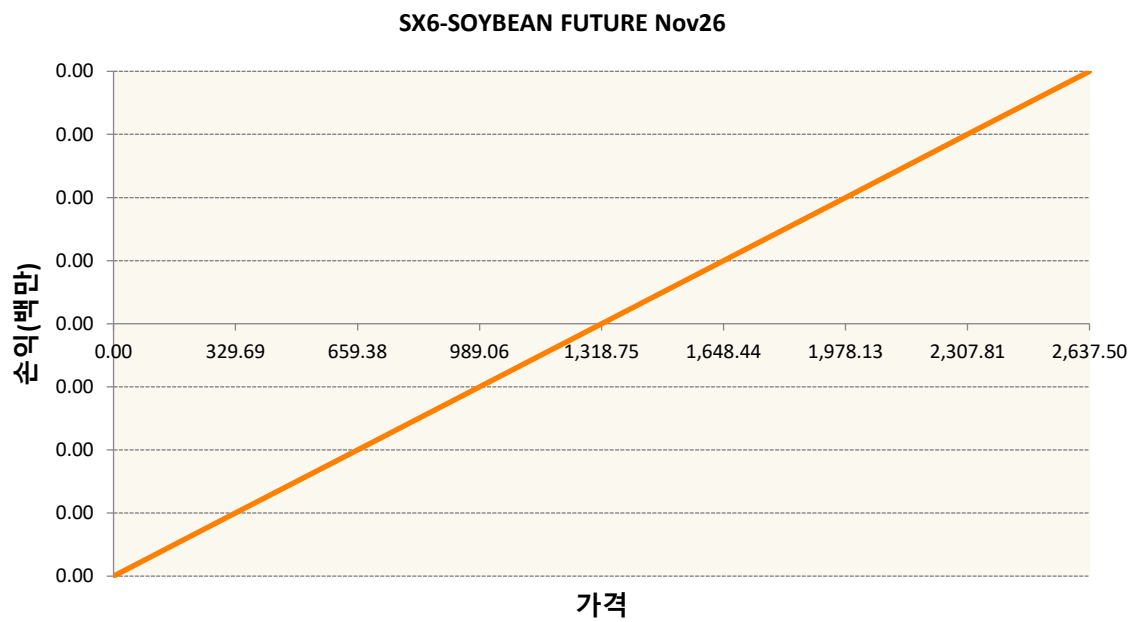
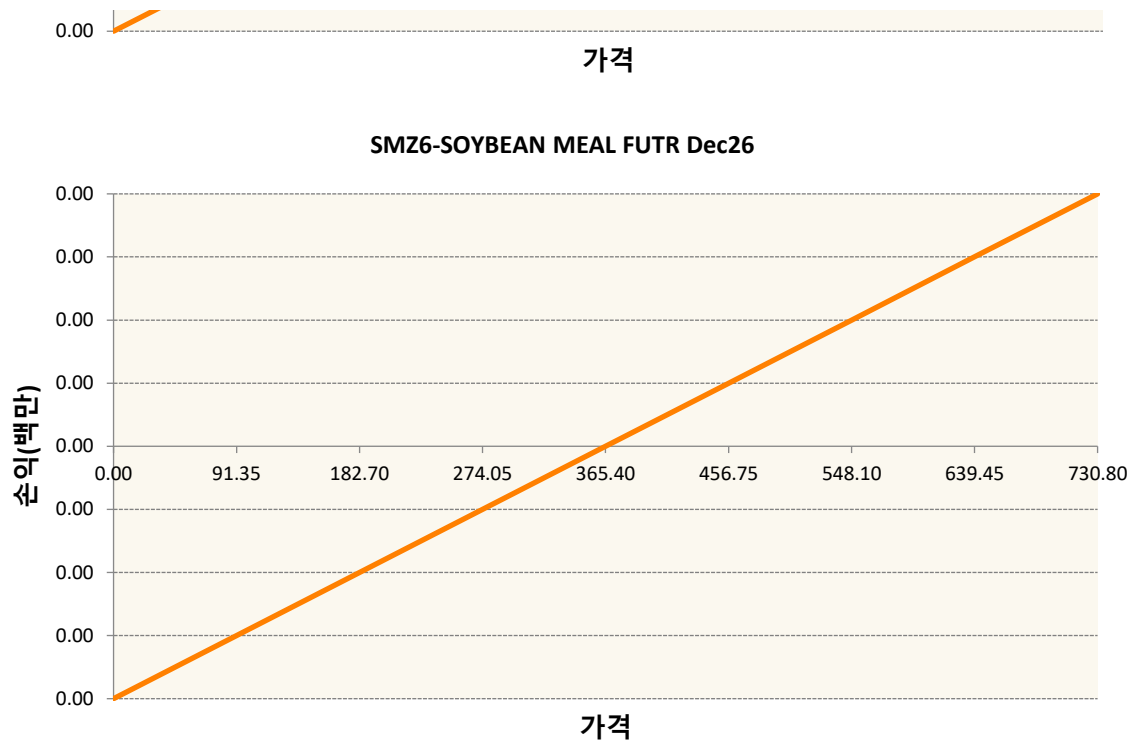
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	466	0	466	
누계	유가증권	선물	2,426	0	2,426	
누계	통화	선물	0	342	-342	장내

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	2026-09-17
기준일	2026-09-16

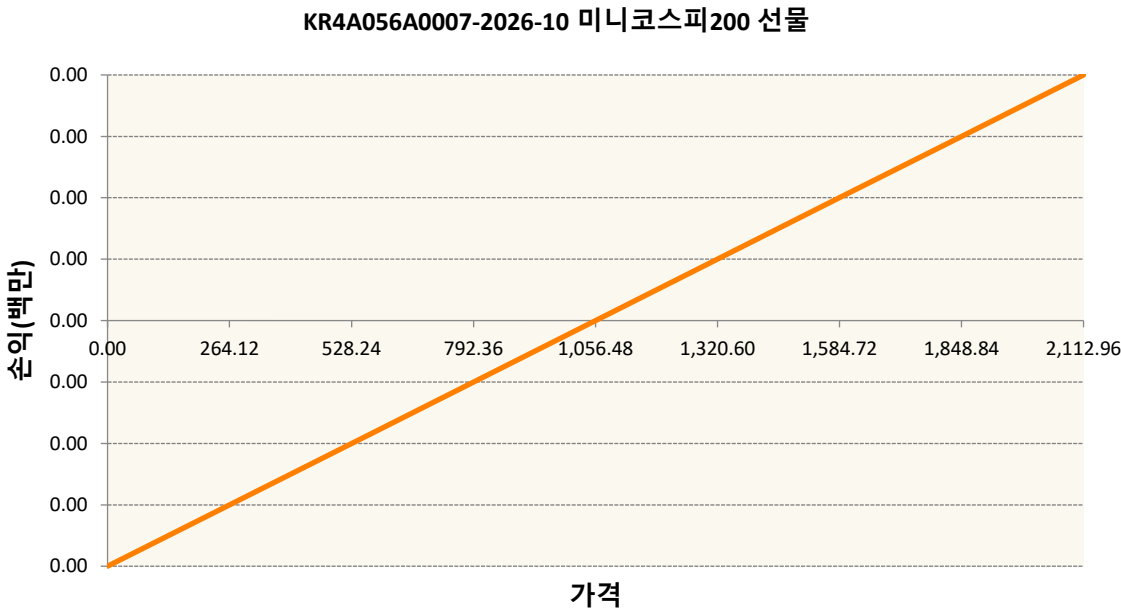
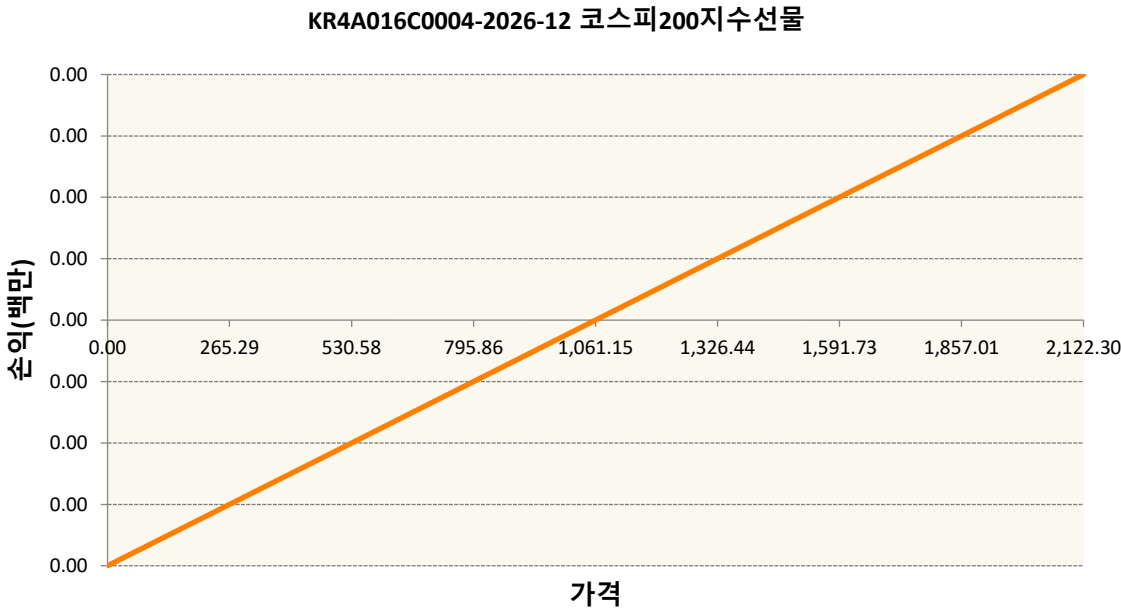
스마트인덱스모

1. 계약금액

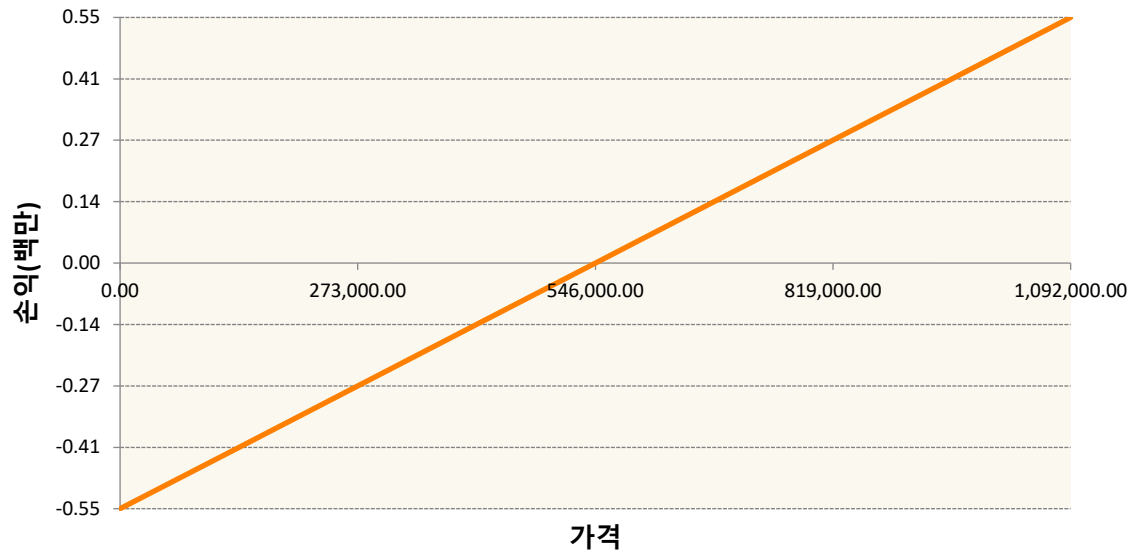
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	786	0	786	장내
누계	유가증권	선물	8,011	0	8,011	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물								297
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297	-297
-5.33%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
-2.67%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	99	99	99	99	99	99	99	99
5.33%	198	198	198	198	198	198	198	198
8.00%	297	297	297	297	297	297	297	297
KR4A056A0007 2026-10 미니코스피200 선물								68
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-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	23
5.33%	45	45	45	45	45	45	45	45
8.00%	68	68	68	68	68	68	68	68
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)

1,246

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

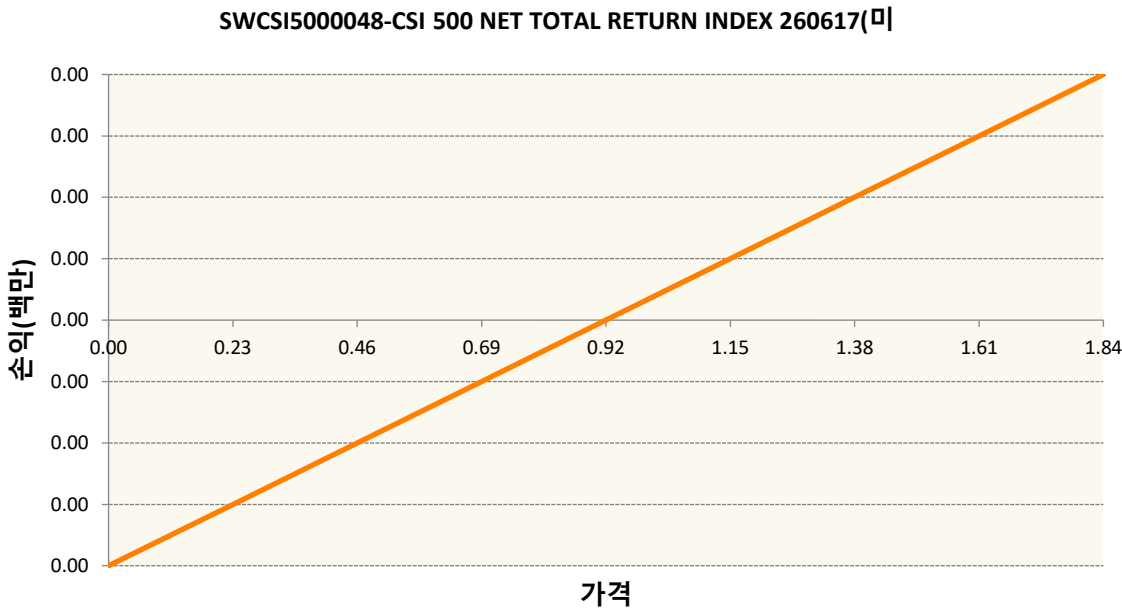
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

427

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

668

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

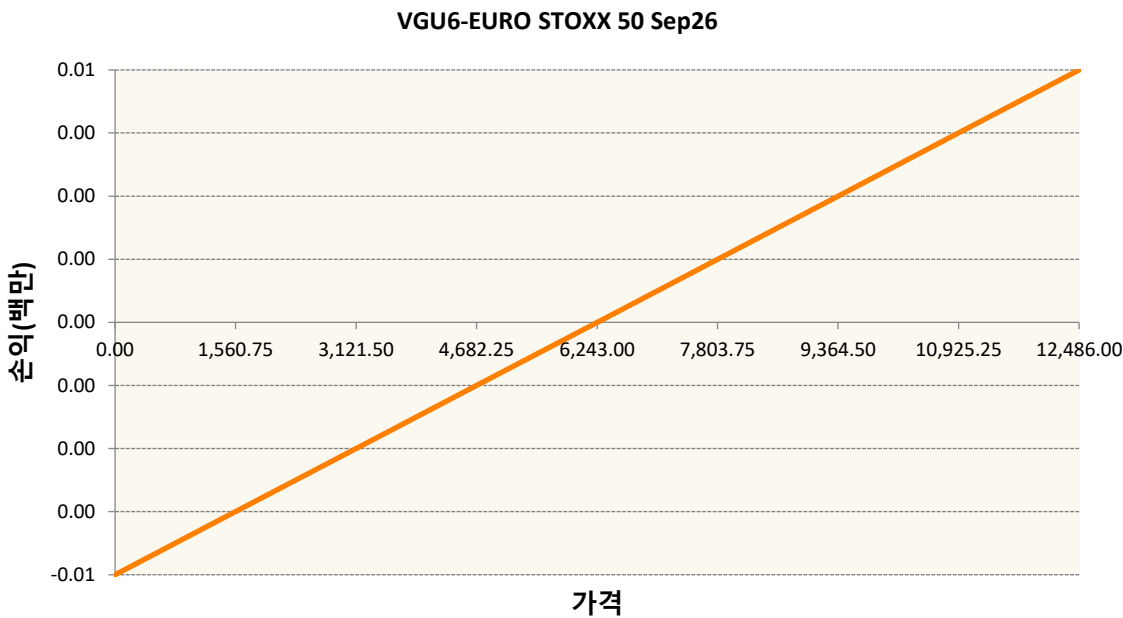
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,190	0	1,190	

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	2026-09-17
기준일	2026-09-16

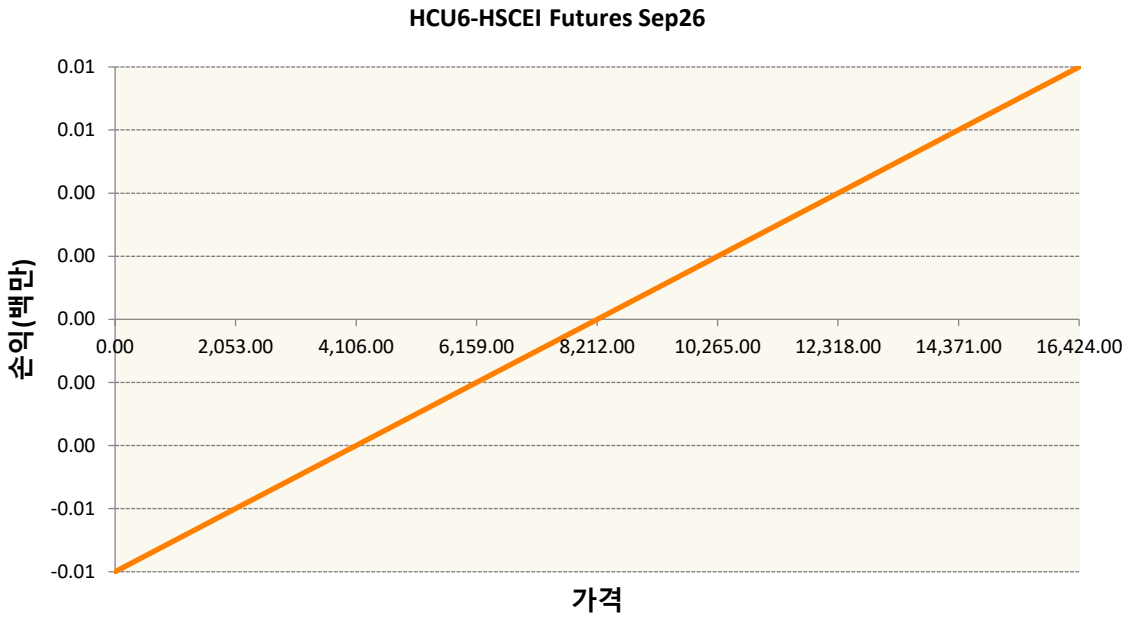
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,438	0	1,438	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	115
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

109

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

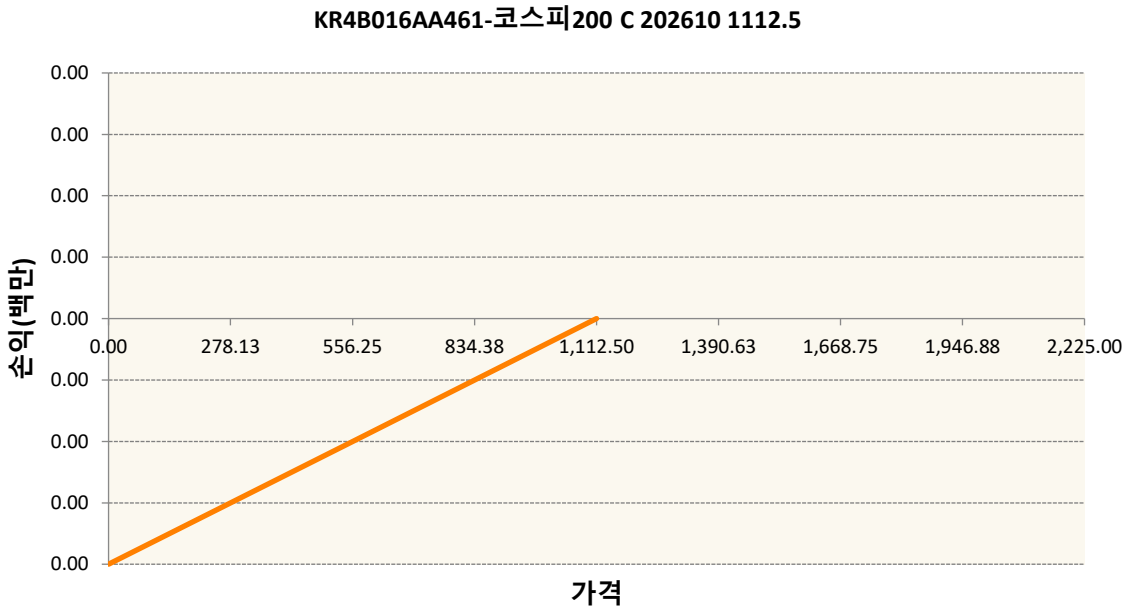
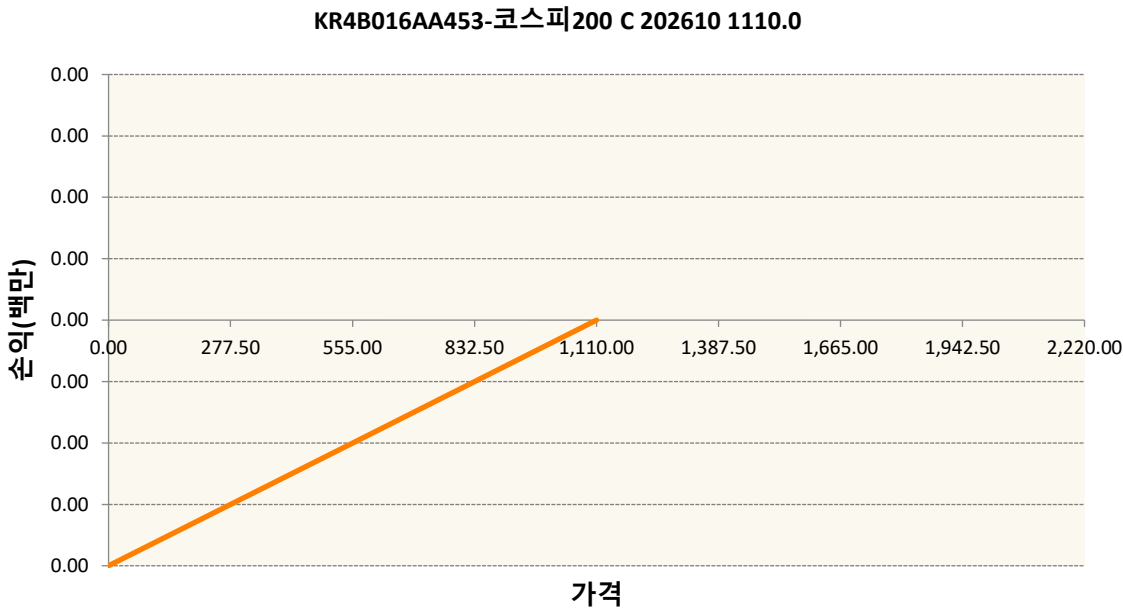
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

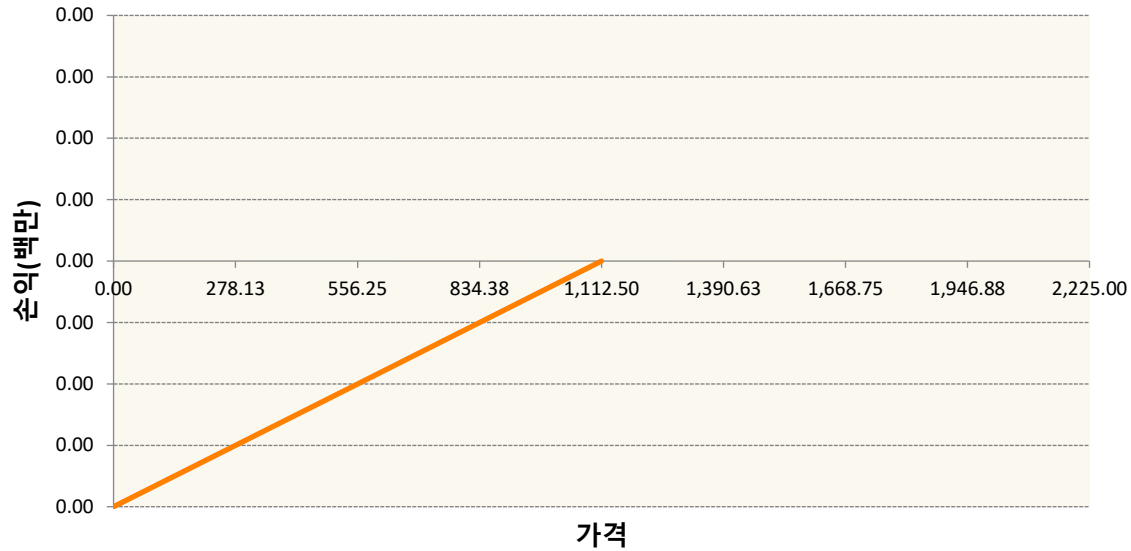
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	1,131	-1,131	장내
누계	유가증권	옵션	0	48,378	-48,378	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C016AA460-코스피200 P 202610 1112.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016AA453 코스피200 C 202610 1110.0							462
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-388	-396	-406	-418	-432	-446	-462
-5.33%	-221	-234	-249	-265	-282	-300	-319
-2.67%	-67	-85	-105	-125	-146	-167	-189
0%	69	47	24	0	-24	-48	-72
2.67%	185	160	134	108	83	57	31
5.33%	279	252	226	200	173	147	120
8.00%	350	325	300	274	248	223	197
KR4B016AA461 코스피200 C 202610 1112.5							2,054
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,733	-1,769	-1,813	-1,865	-1,922	-1,986	-2,054
-5.33%	-993	-1,049	-1,113	-1,183	-1,258	-1,338	-1,421
-2.67%	-307	-386	-470	-558	-650	-744	-841
0%	304	205	104	0	-105	-211	-319
2.67%	825	712	599	485	372	258	143
5.33%	1,247	1,130	1,013	896	779	662	545
8.00%	1,571	1,459	1,346	1,232	1,118	1,003	887
KR4C016AA460 코스피200 P 202610 1112.5							589
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-497	-508	-520	-535	-552	-570	-589
-5.33%	-285	-301	-319	-340	-361	-384	-408
-2.67%	-88	-111	-135	-160	-187	-214	-241
0%	87	59	30	0	-30	-61	-91

2.67%	237	204	172	139	107	74	41
5.33%	358	324	291	257	223	190	156
8.00%	451	419	386	354	321	288	255

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

(단위:백만원)

5,229

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

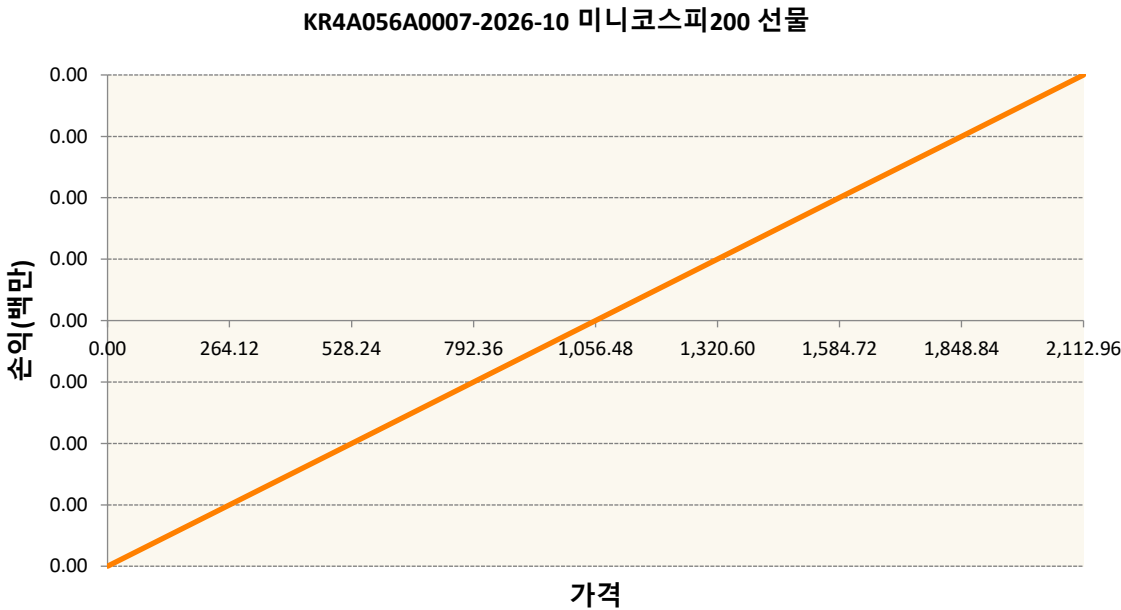
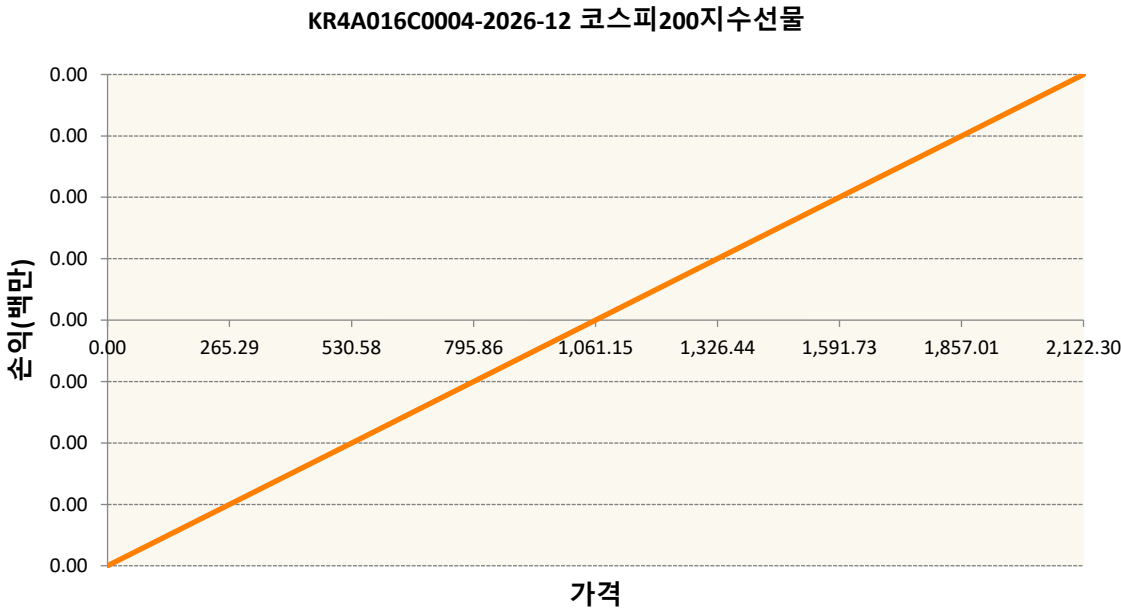
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

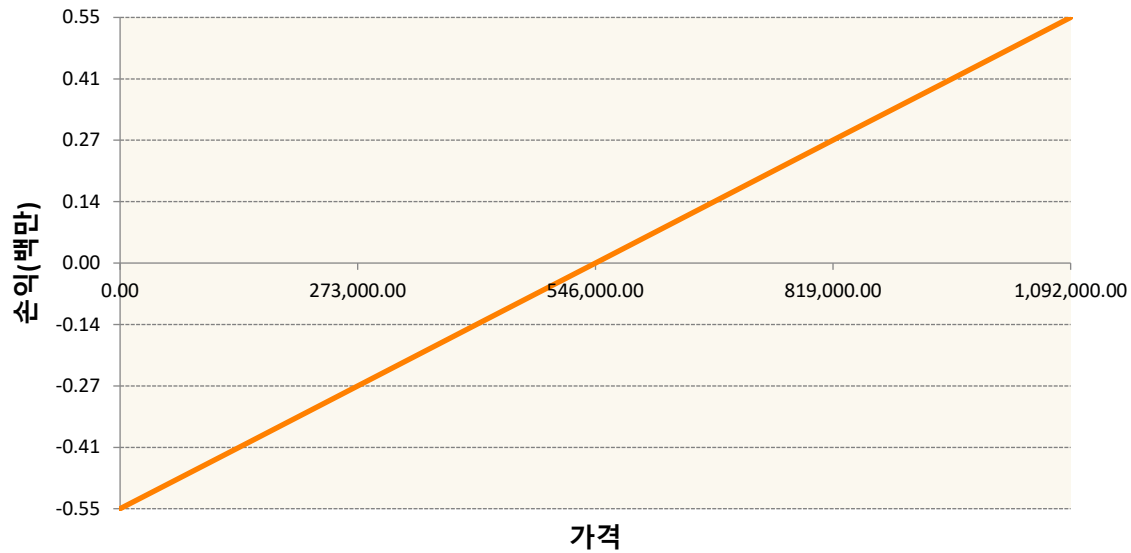
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,171	0	2,171	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물							
							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
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

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)

297

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

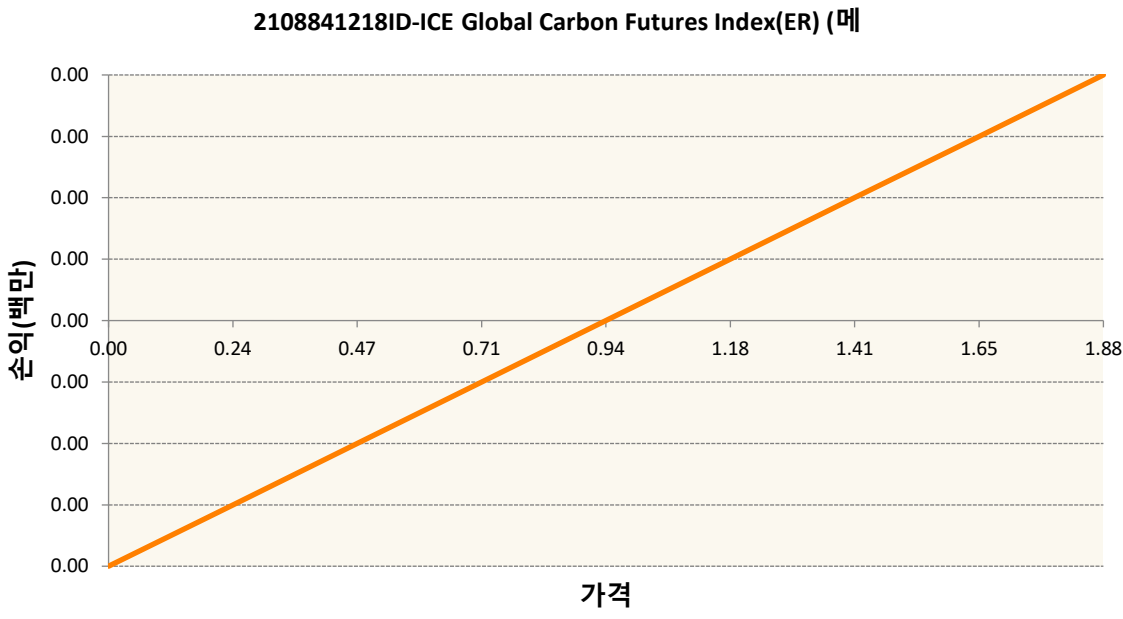
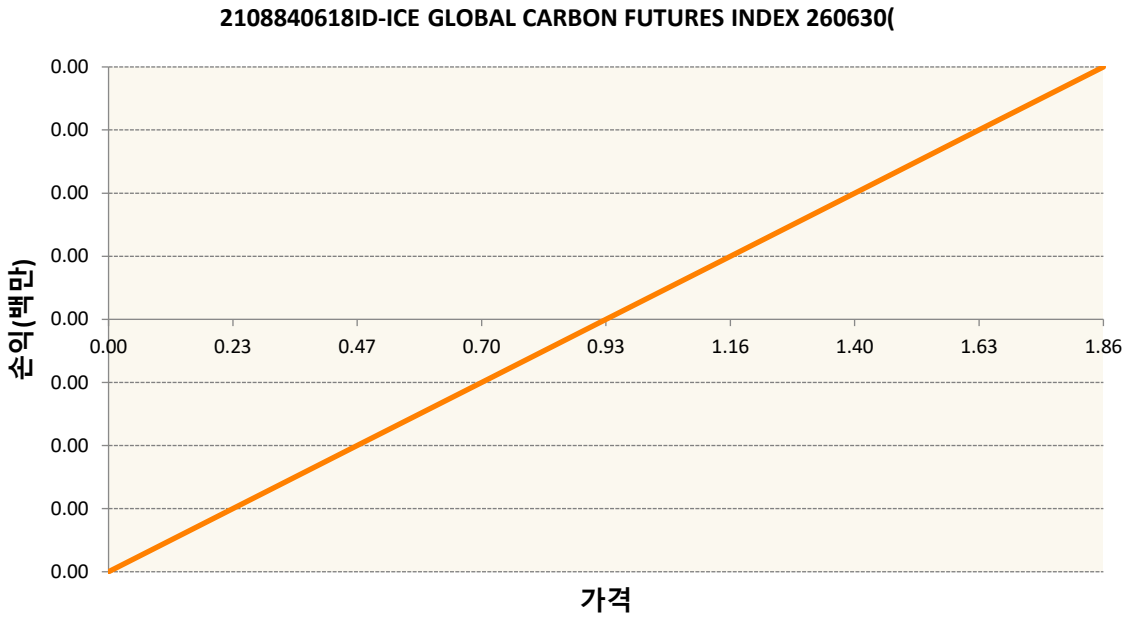
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,074	0	7,074	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		450
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		114

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	597

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

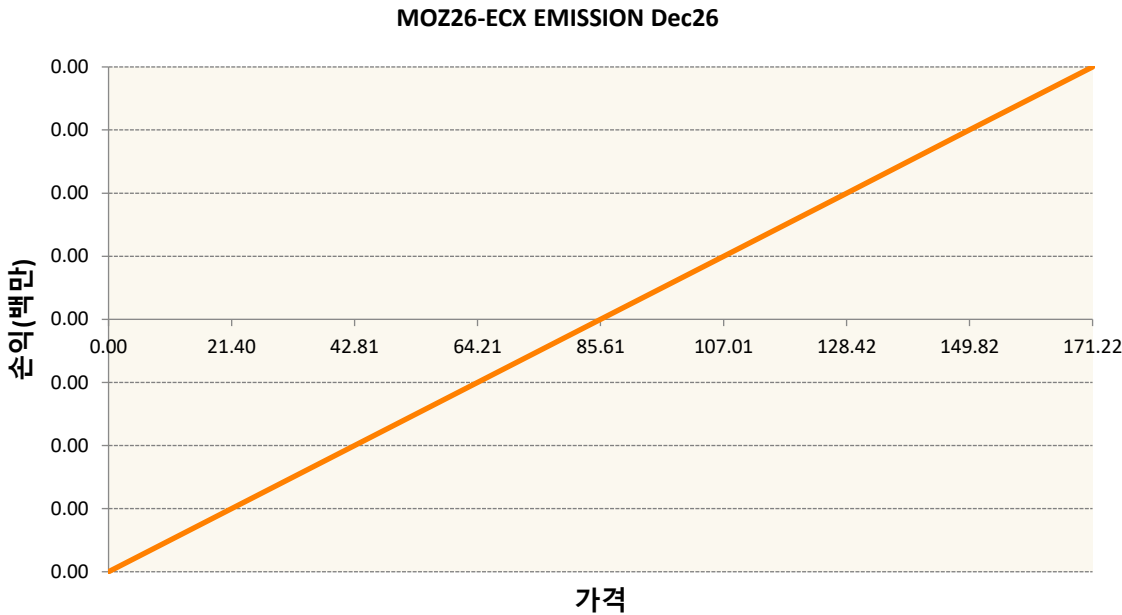
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,057	0	6,057	
누계	통화	선도	0	2,623	-2,623	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E	210
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	485

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

(단위:백만원)

746

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

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)

299

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

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)	65
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	233
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260715(메리츠)	222

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

(단위:백만원)

984

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

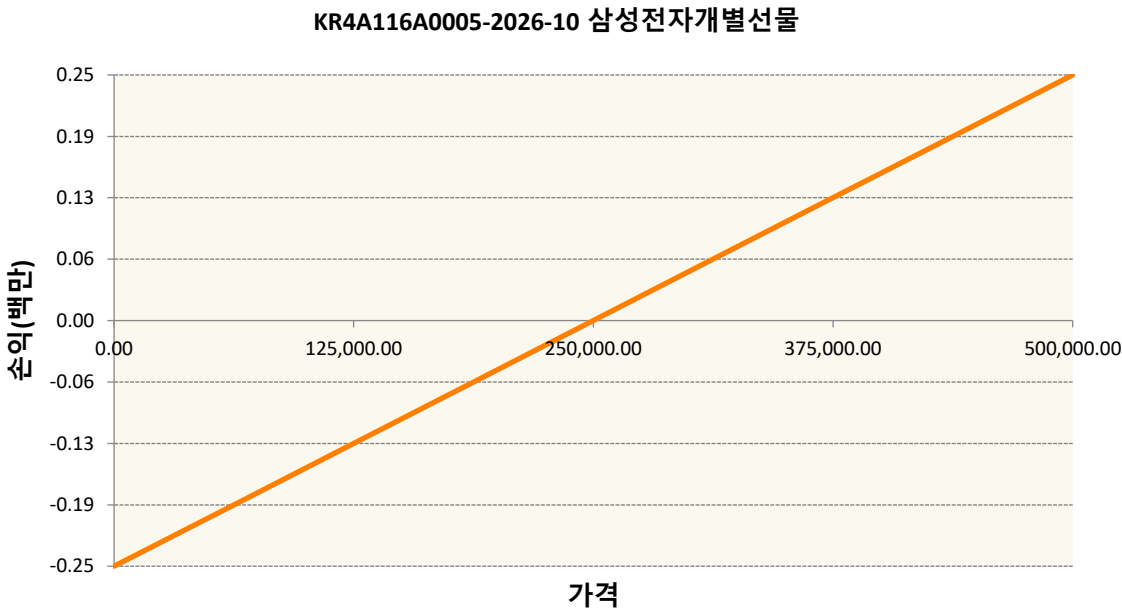
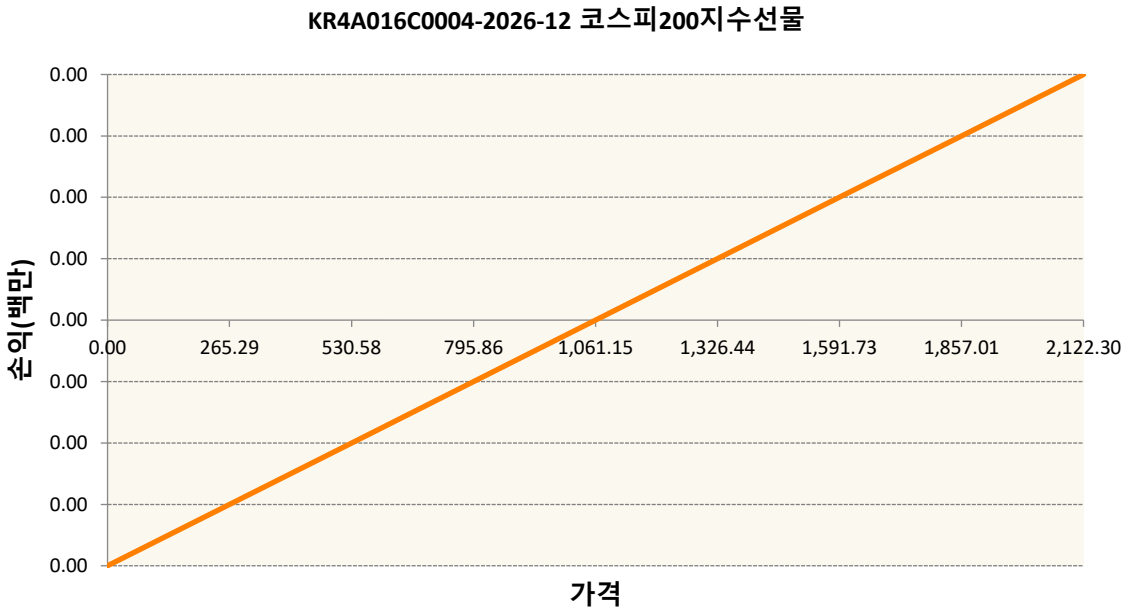
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	785	529	255	장내
누계	유가증권	선물	16,992	0	16,992	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물					1,102
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,102	-1,102	-1,102	-1,102	-1,102	-1,102	-1,102
-5.33%	-735	-735	-735	-735	-735	-735	-735
-2.67%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	367	367	367	367	367	367	367
5.33%	735	735	735	735	735	735	735
8.00%	1,102	1,102	1,102	1,102	1,102	1,102	1,102
KR4A116A0005		2026-10 삼성전자개별선물					259
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	173	173	173	173	173	173	173
8.00%	259	259	259	259	259	259	259

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

4,784

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

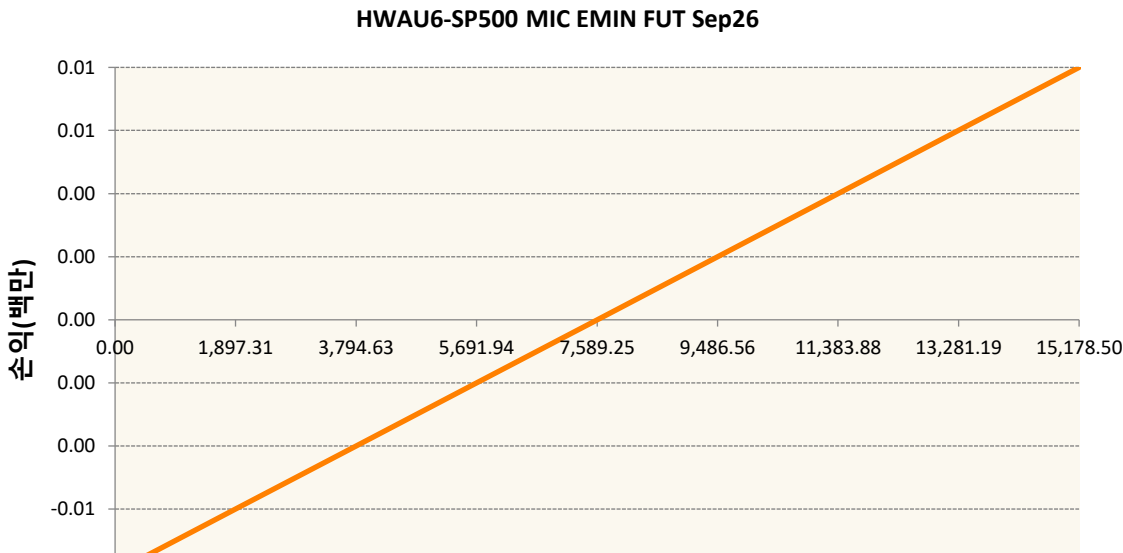
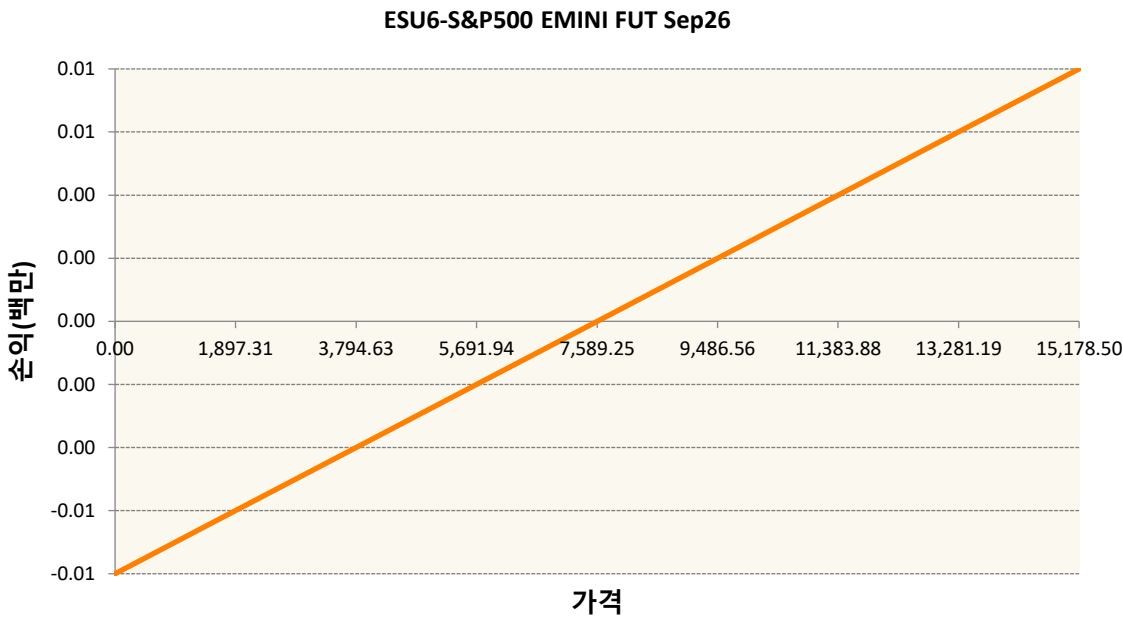
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

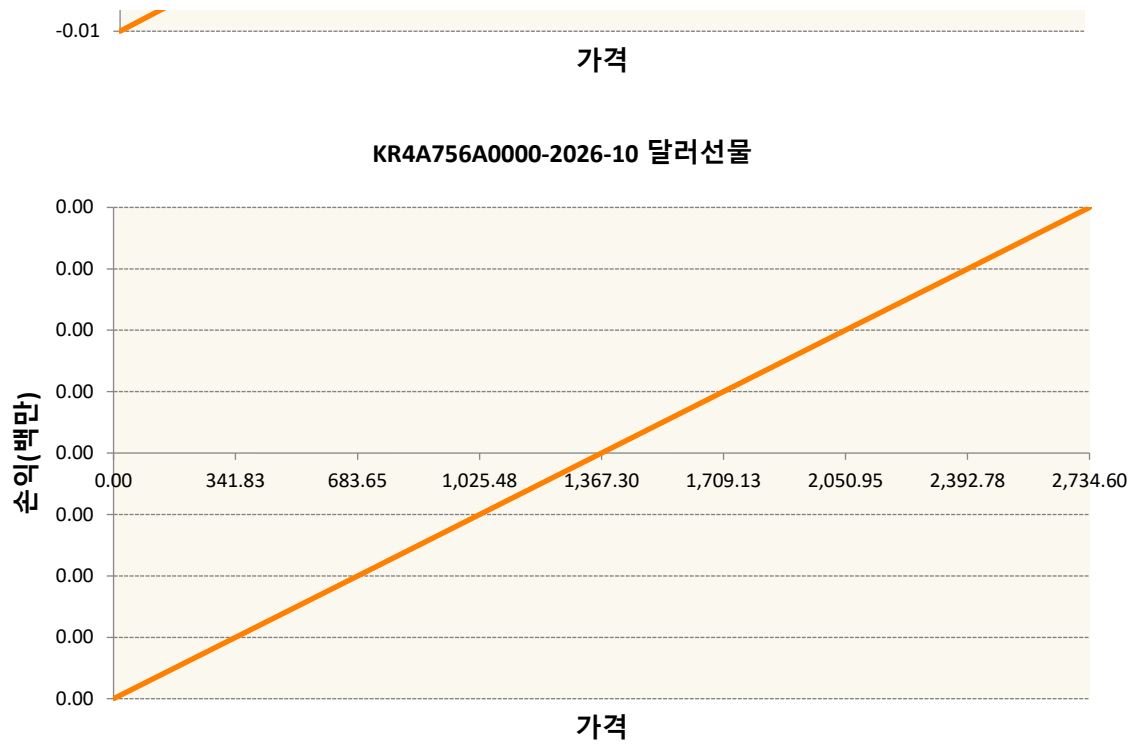
1. 계약금액

(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	11,073	0	11,073	장내
누계	지수	선물	80,309	0	80,309	
누계	지수	선물	378	0	378	장내
누계	통화	선물	11,075	0	11,075	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	6,425
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	30
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	886

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

(단위:백만원)

4,136

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

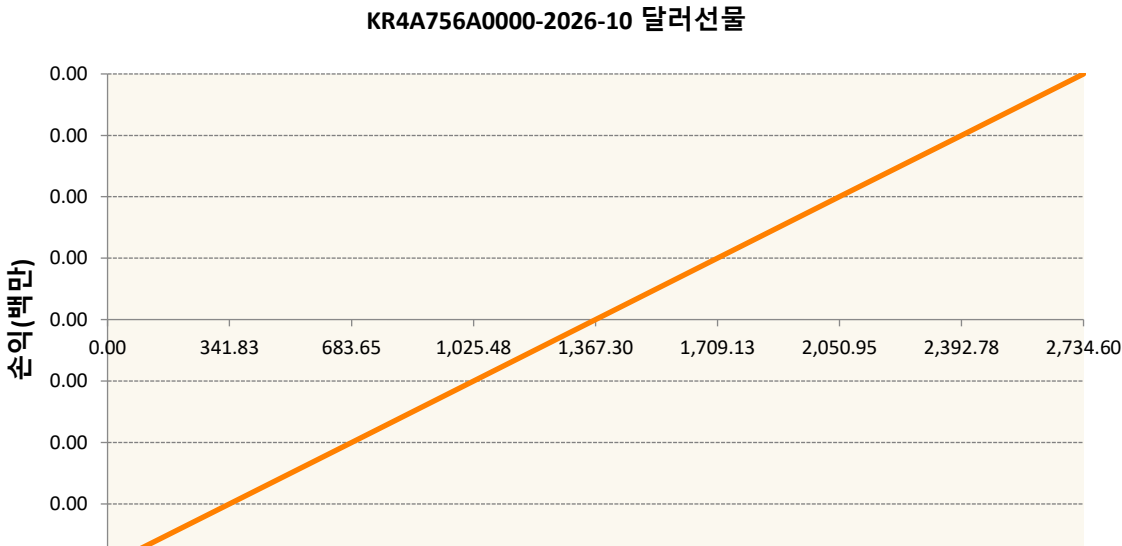
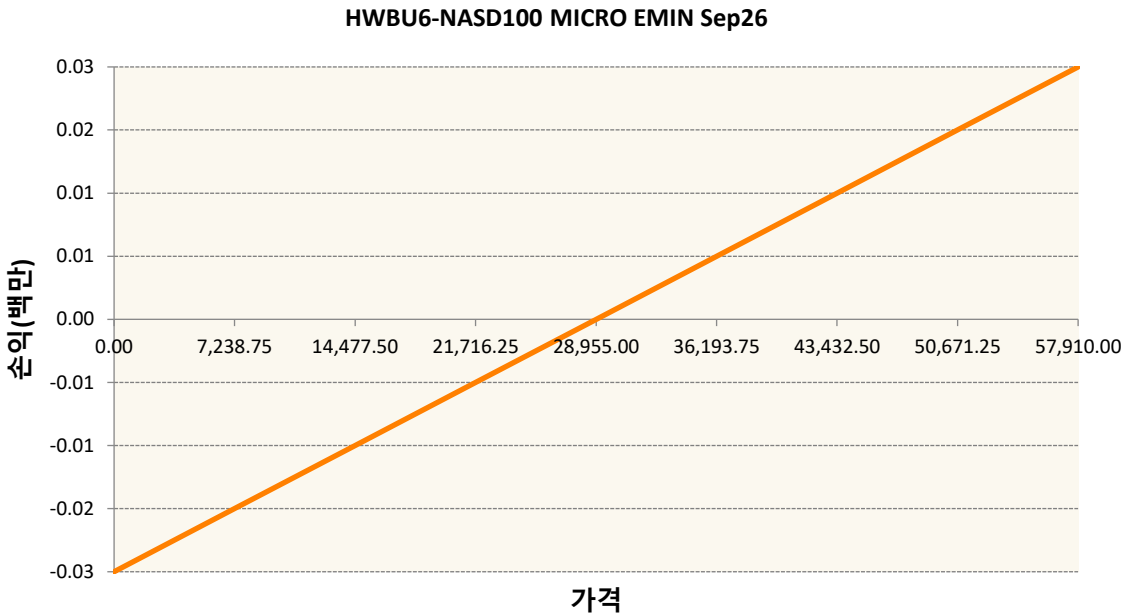
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

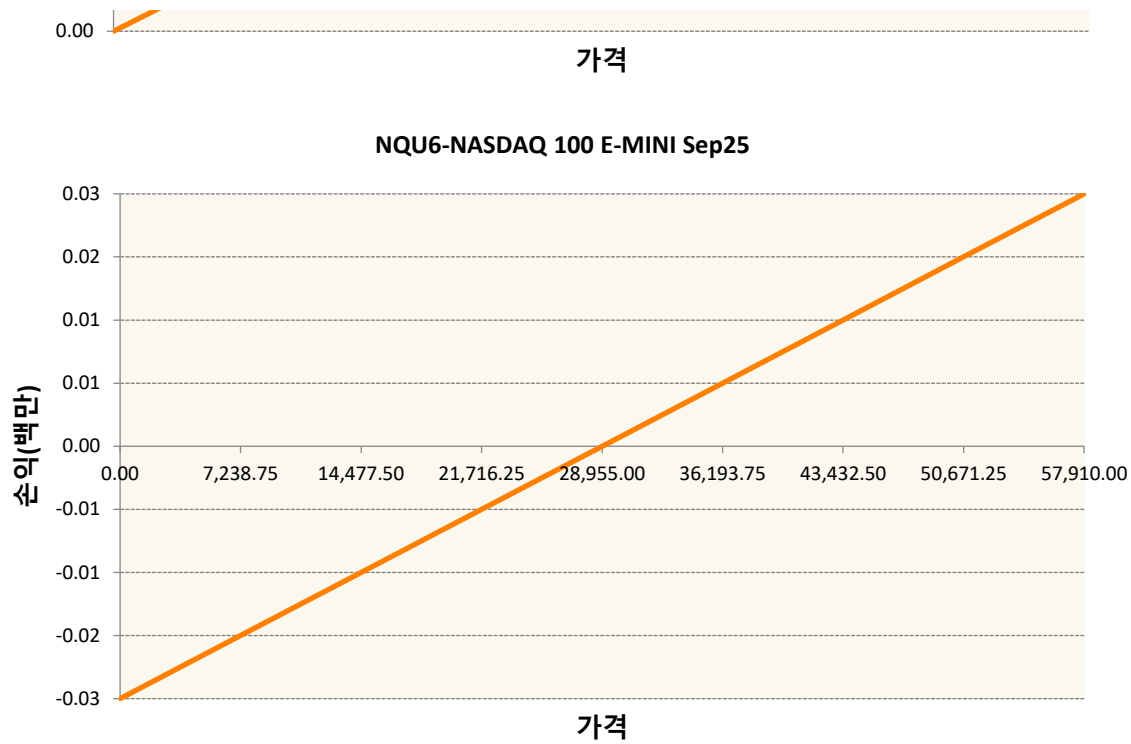
1. 계약금액

(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	5,140	0	5,140	장내
누계	유가증권	선물	727	0	727	장내
누계	지수	선물	37,399	0	37,399	
누계	통화	선물	5,141	0	5,141	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26	58
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	411
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	2,992

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

2,771

공시일	2026-09-17
기준일	2026-09-16

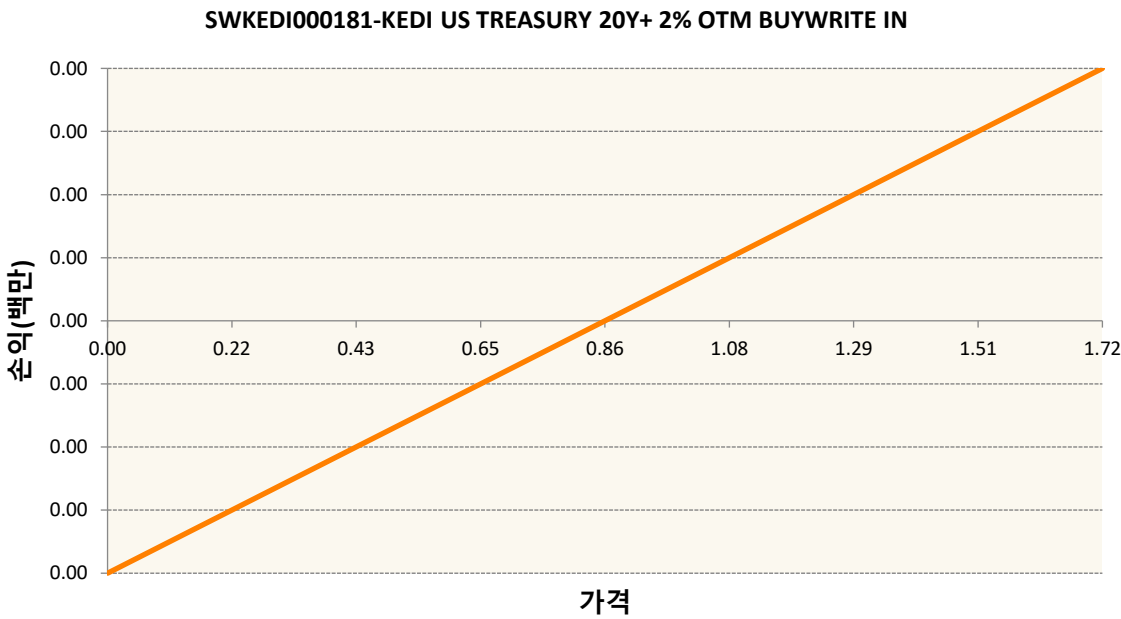
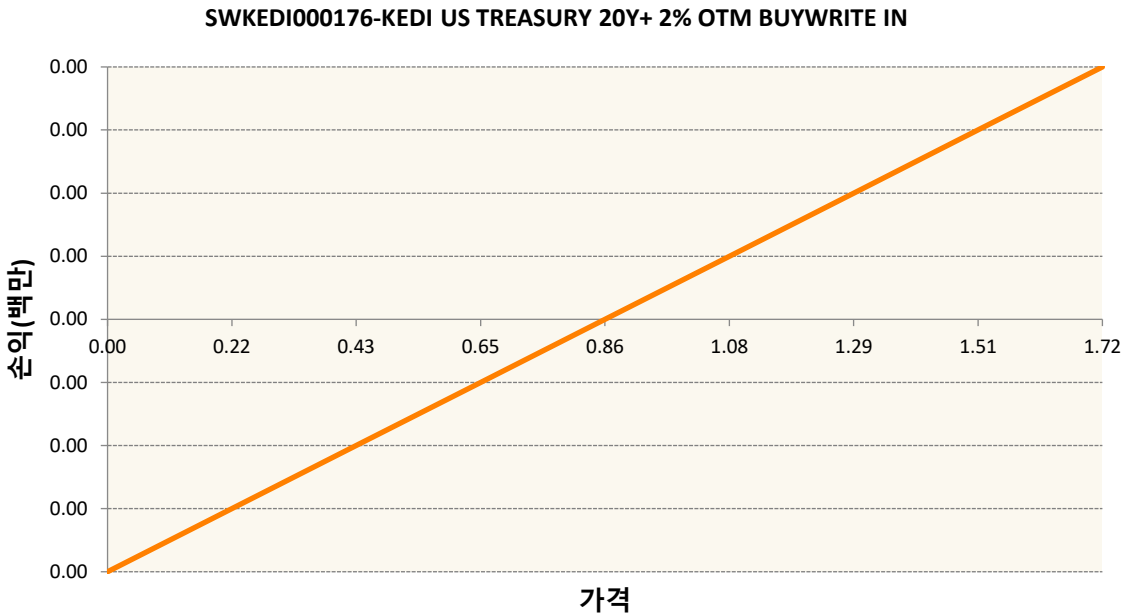
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

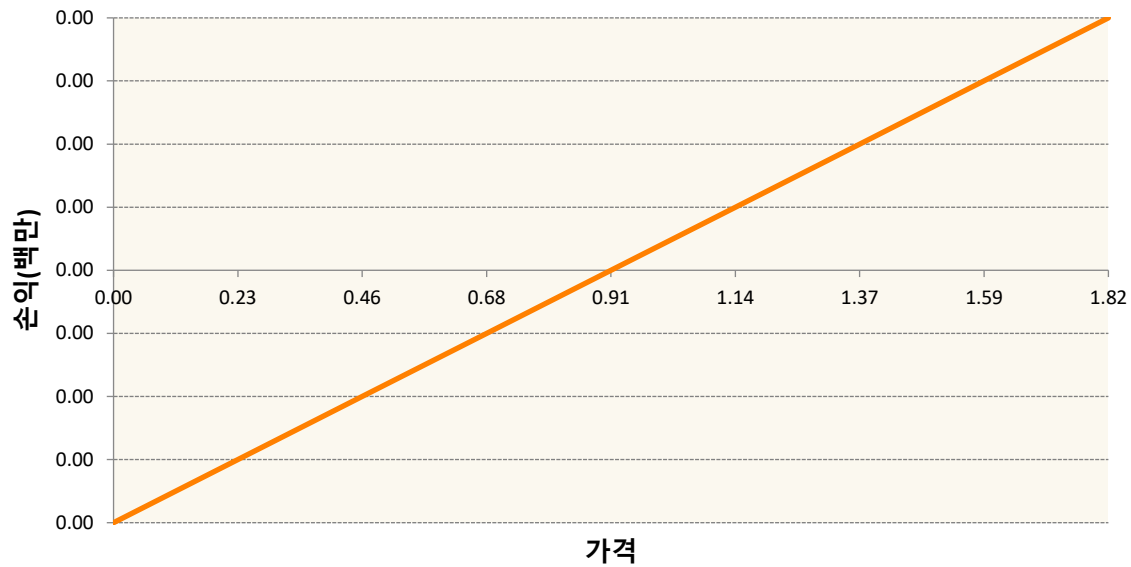
(단위:백만원)

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

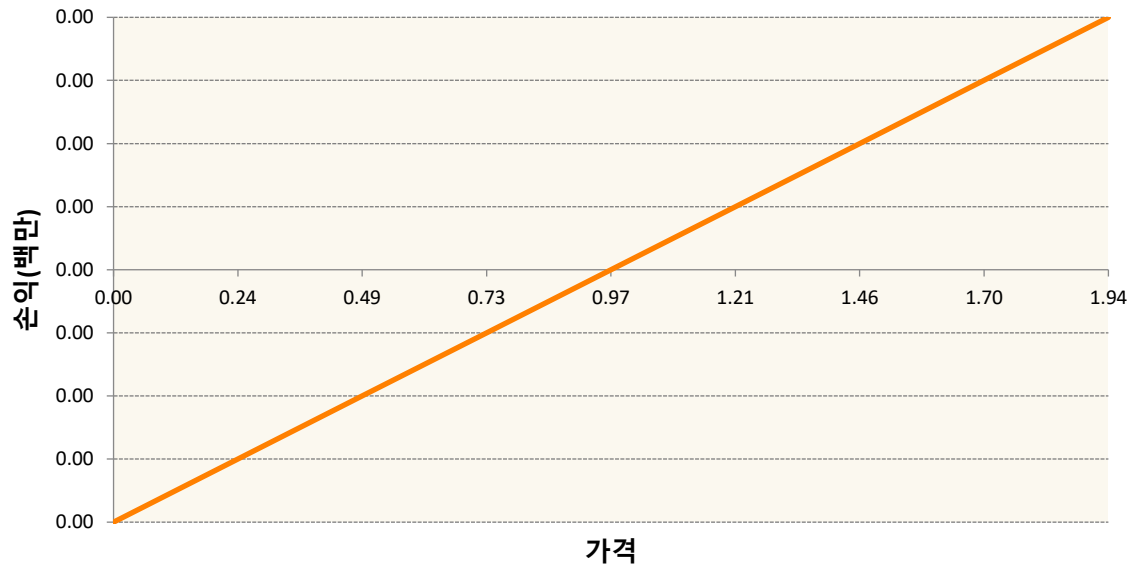
2. 만기시점의 손익구조



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	7,012
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,752
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,128
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,903

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

(단위:백만원)

8,654
