

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

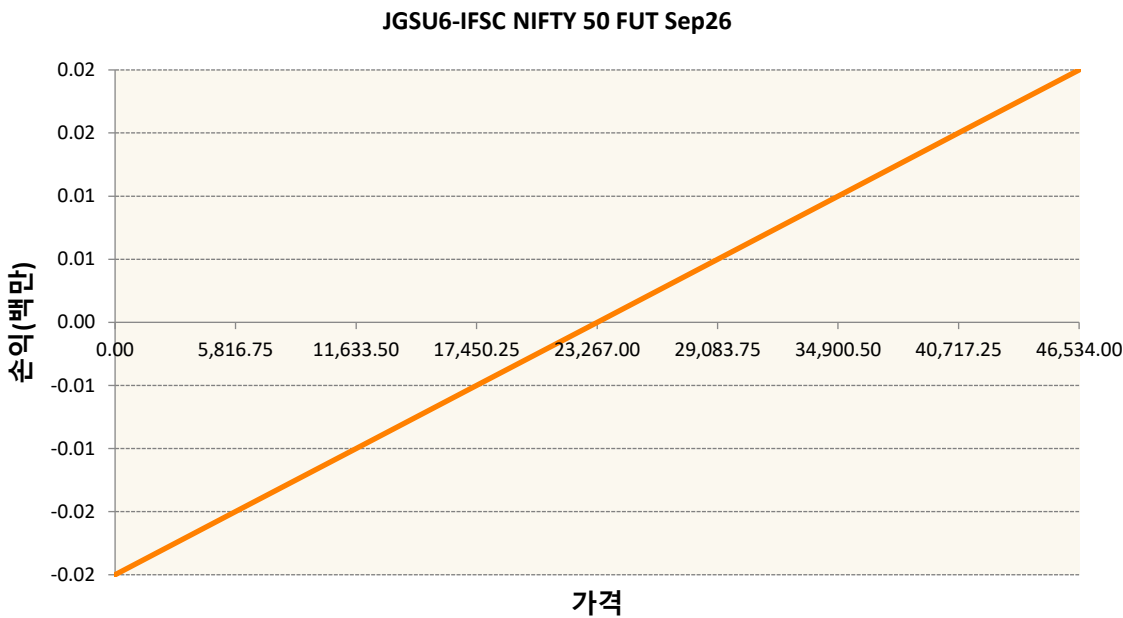
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	323	0	323	

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	2026-09-18
기준일	2026-09-17

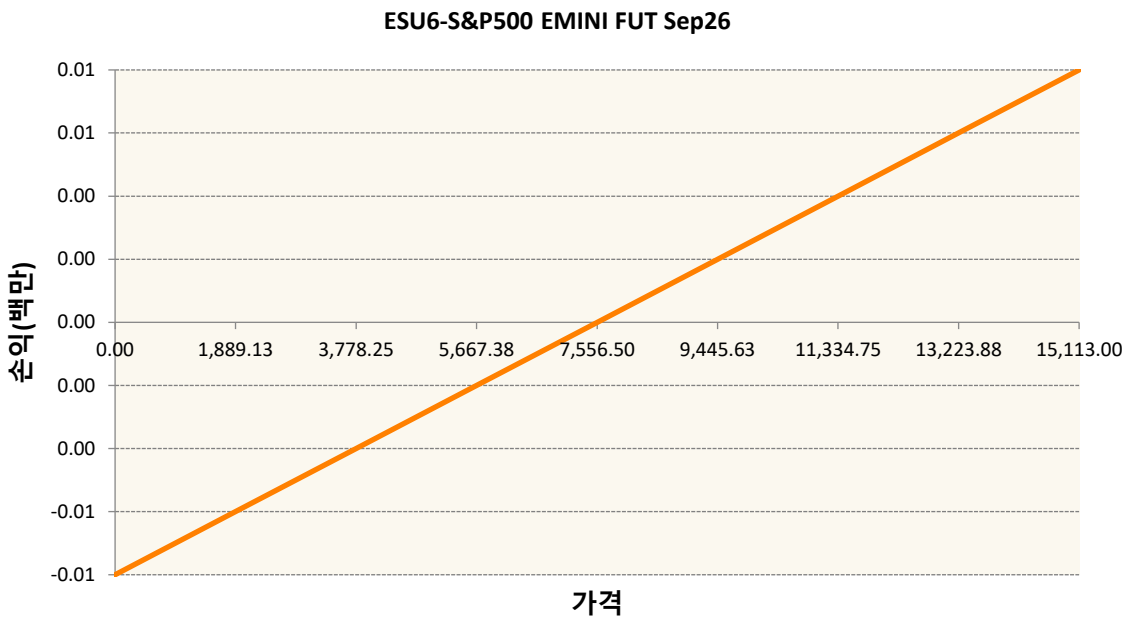
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	577	0	577	

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	2026-09-18
기준일	2026-09-17

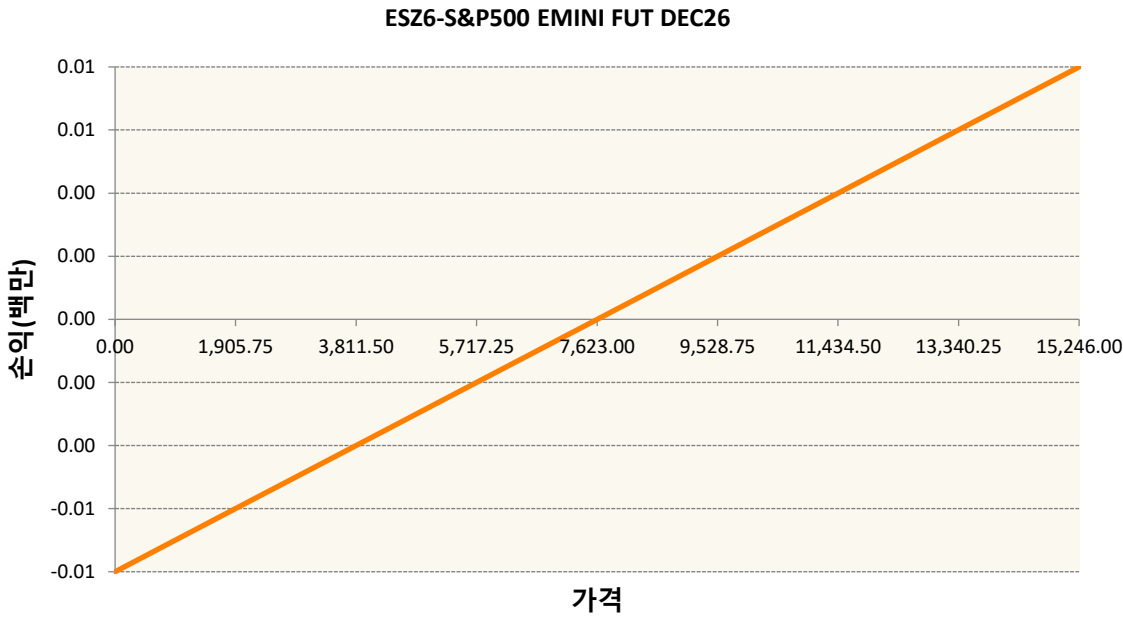
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	527	0	527	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	42
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

27

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

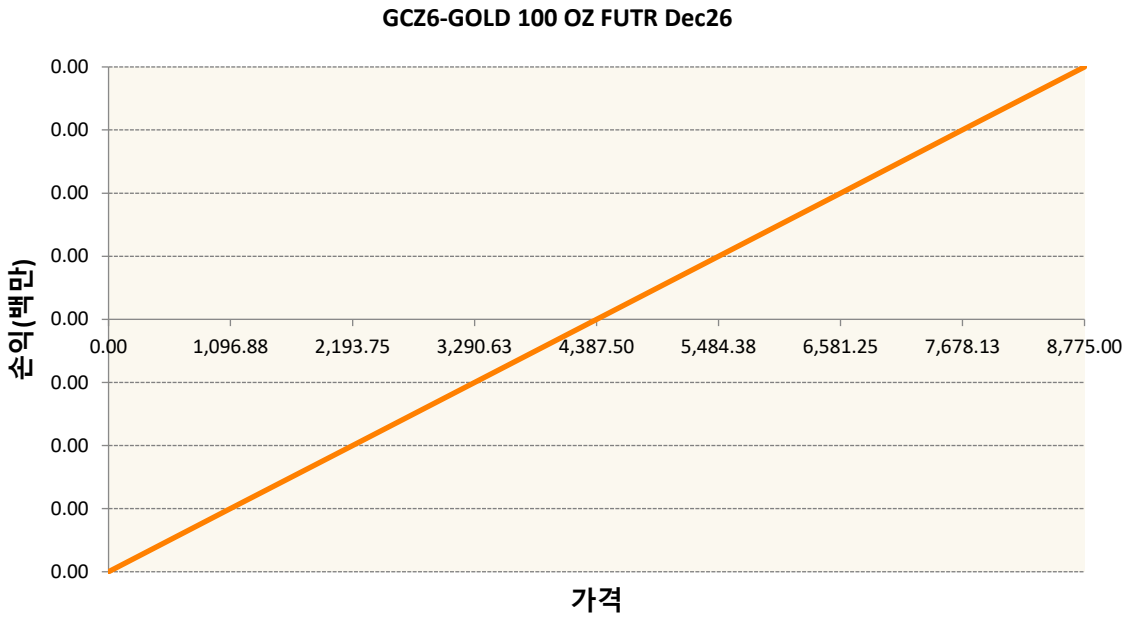
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			6,241	0	6,241	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSAC GLD US 09/18/26 C405 EQUITY	8
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	499

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

(단위:백만원)

665

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

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)

AOPLTRUC11PLTR US 09/18/26 C172.5 EQUITY	3
AOPLTRUP11PLTR US 09/18/26 P172.5 EQUITY	48

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

(단위:백만원)

173

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

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

7

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

(단위:백만원)

4

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

(단위:백만원)

14,595

공시일 2026-09-18

기준일 2026-09-17

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	2026-09-18
기준일	2026-09-17

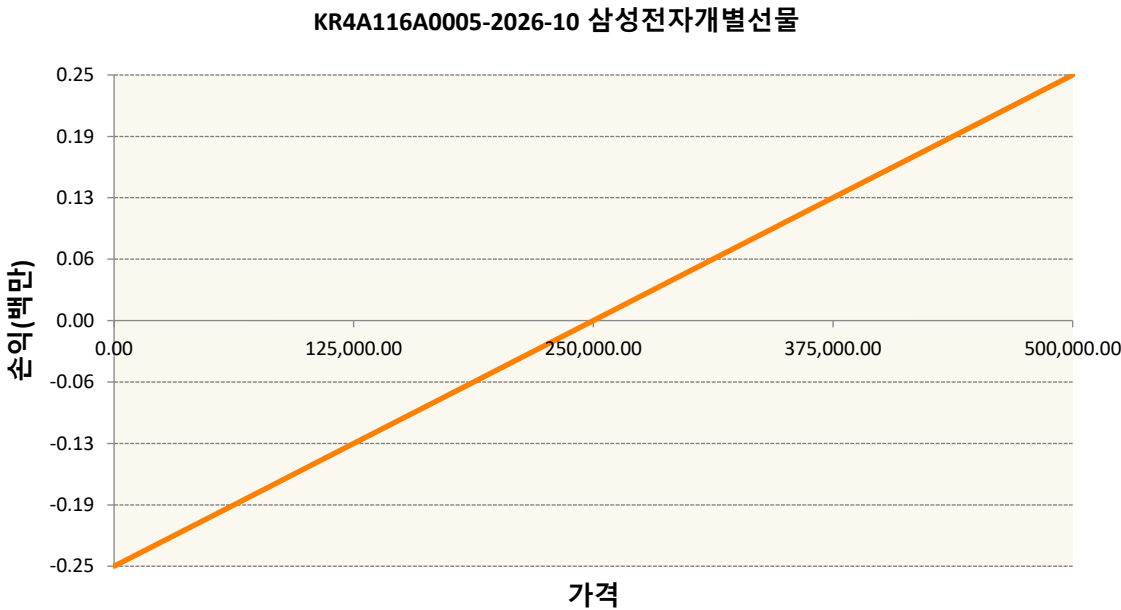
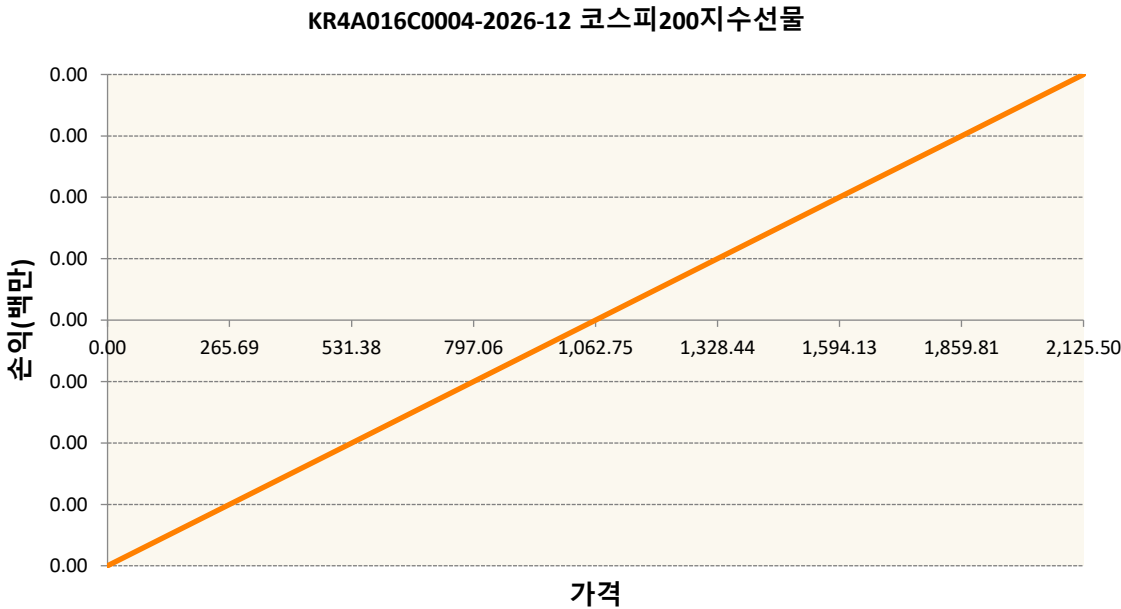
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	77,890	-77,890	장내
누계	유가증권	선물	20,408	0	20,408	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,923	-76,923	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The profit is zero at a price of 1,060.00 and decreases linearly to zero at a price of 2,120.00.

가격 (Price)	이익 (Profit)
1,060.00	0.00
2,120.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,125.00. The y-axis, labeled '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the point (1,062.50, 0.00) and ends at the point (2,125.00, 0.00).

가격	손익 (백만)
1,062.50	0.00
2,125.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A016C0004				2026-12 코스피200지수선물			550
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-550	-550	-550	-550	-550	-550	-550
-5.33%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367
-2.67%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	183	183	183	183	183	183	183
5.33%	367	367	367	367	367	367	367
8.00%	550	550	550	550	550	550	550
KR4A116A0005				2026-10 삼성전자개별선물			1,091
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091	-1,091
-5.33%	-727	-727	-727	-727	-727	-727	-727
-2.67%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	364	364	364	364	364	364	364
5.33%	727	727	727	727	727	727	727
8.00%	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091	1,091
KR4BAFBYA253 코스피위클리M C 2609W3 1,060.0							2,892

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	899	891	879	862	841	816	787
-5.33%	853	824	790	751	707	660	610
-2.67%	676	616	553	488	421	353	284
0%	234	156	78	0	-78	-156	-234
2.67%	-537	-602	-669	-738	-809	-881	-954
5.33%	-1,567	-1,604	-1,646	-1,692	-1,743	-1,797	-1,854
8.00%	-2,734	-2,748	-2,767	-2,791	-2,820	-2,854	-2,892
KR4BAFBYA261 코스피위클리M C 2609W3 1,062.5							1,899

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	566	561	554	544	531	515	497
-5.33%	539	522	500	475	448	418	386
-2.67%	432	393	353	311	267	223	178
0%	156	104	52	0	-52	-104	-156
2.67%	-339	-384	-430	-478	-526	-575	-624
5.33%	-1,014	-1,040	-1,070	-1,102	-1,137	-1,175	-1,214
8.00%	-1,786	-1,796	-1,810	-1,828	-1,849	-1,872	-1,899

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

(단위:백만원)

14,221

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

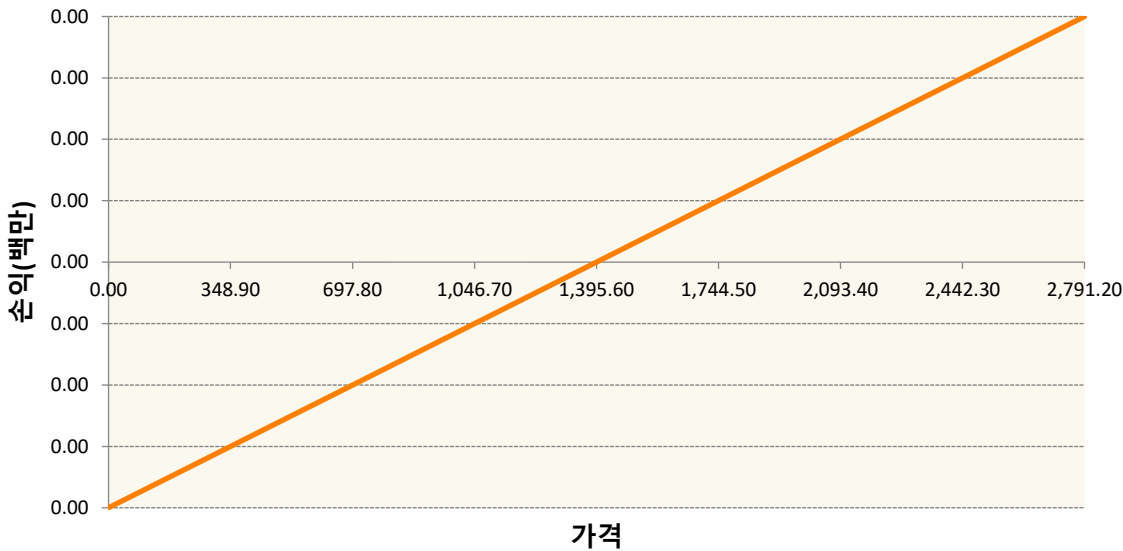
1. 계약금액

(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

KR4A066C0003-2026-12 코스닥150선물



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)

12,562

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

(단위:백만원)

60,832

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

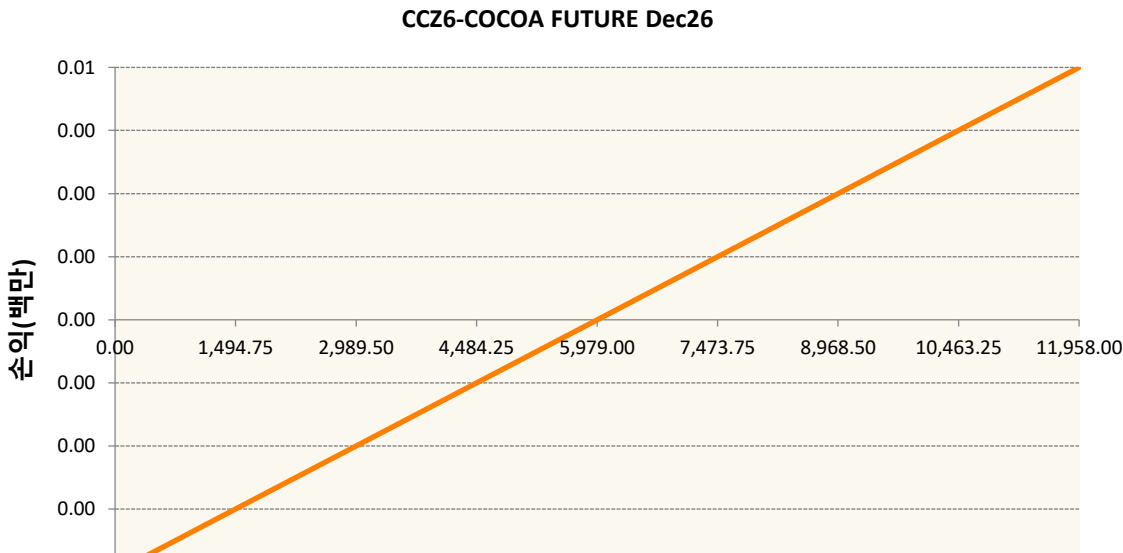
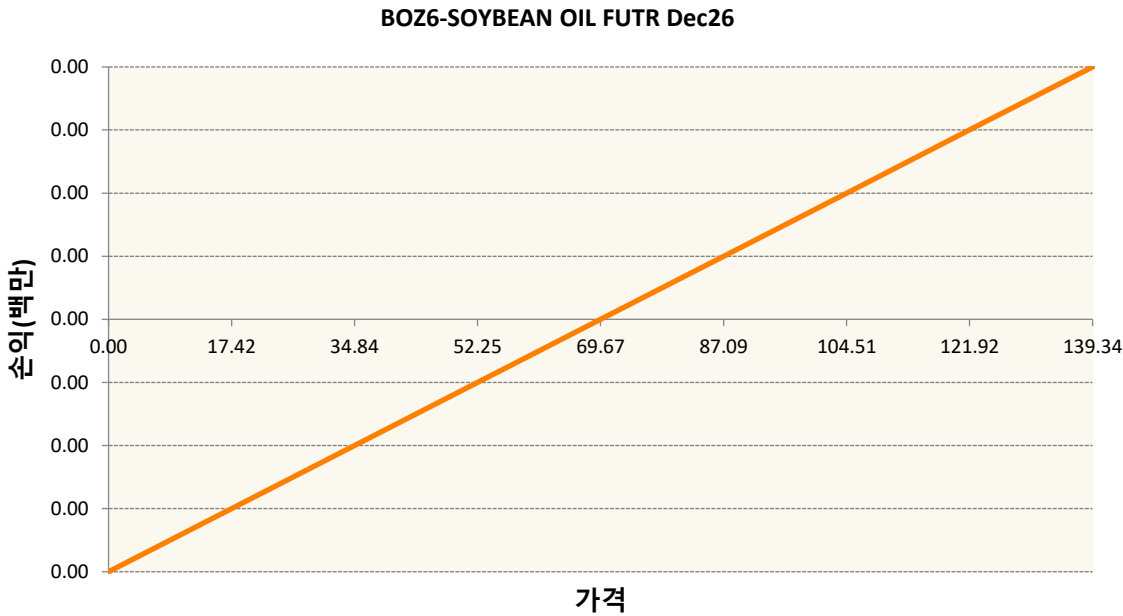
포커스농산물모(채권-파생형)

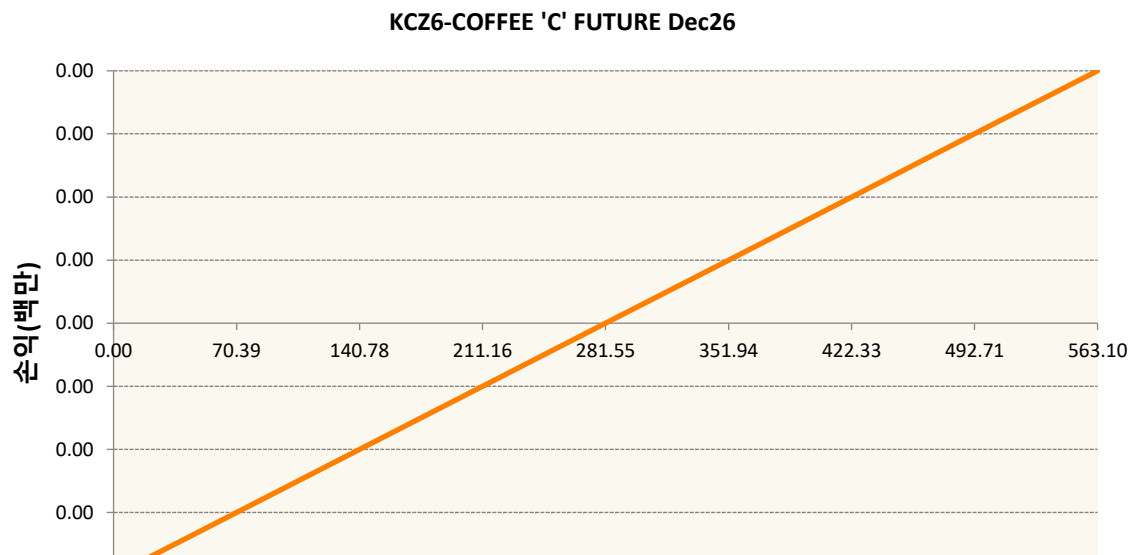
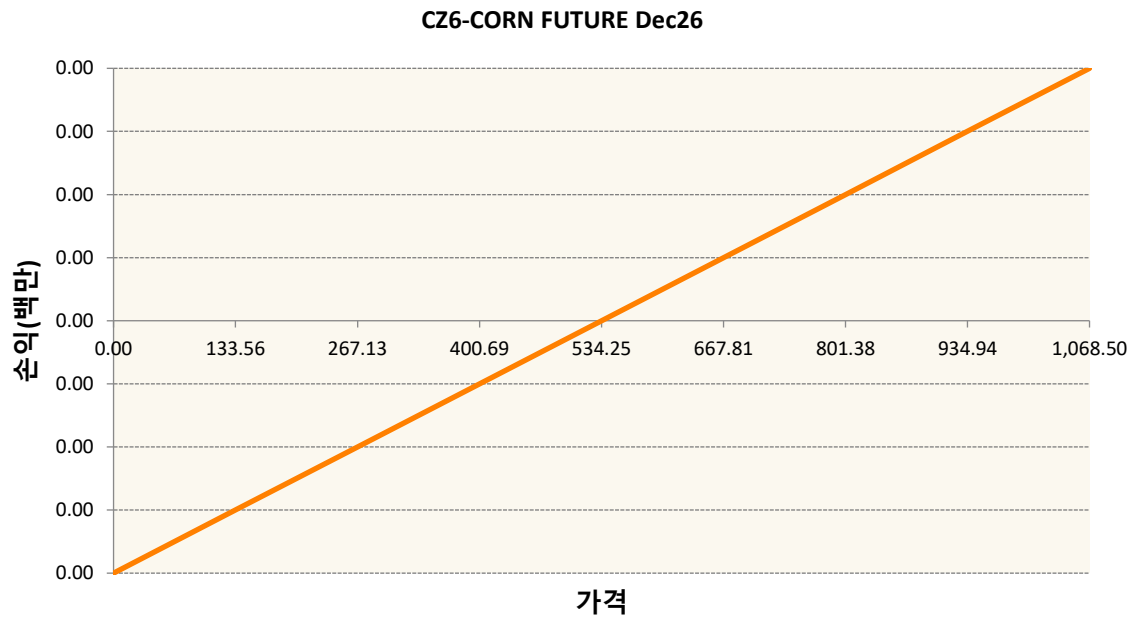
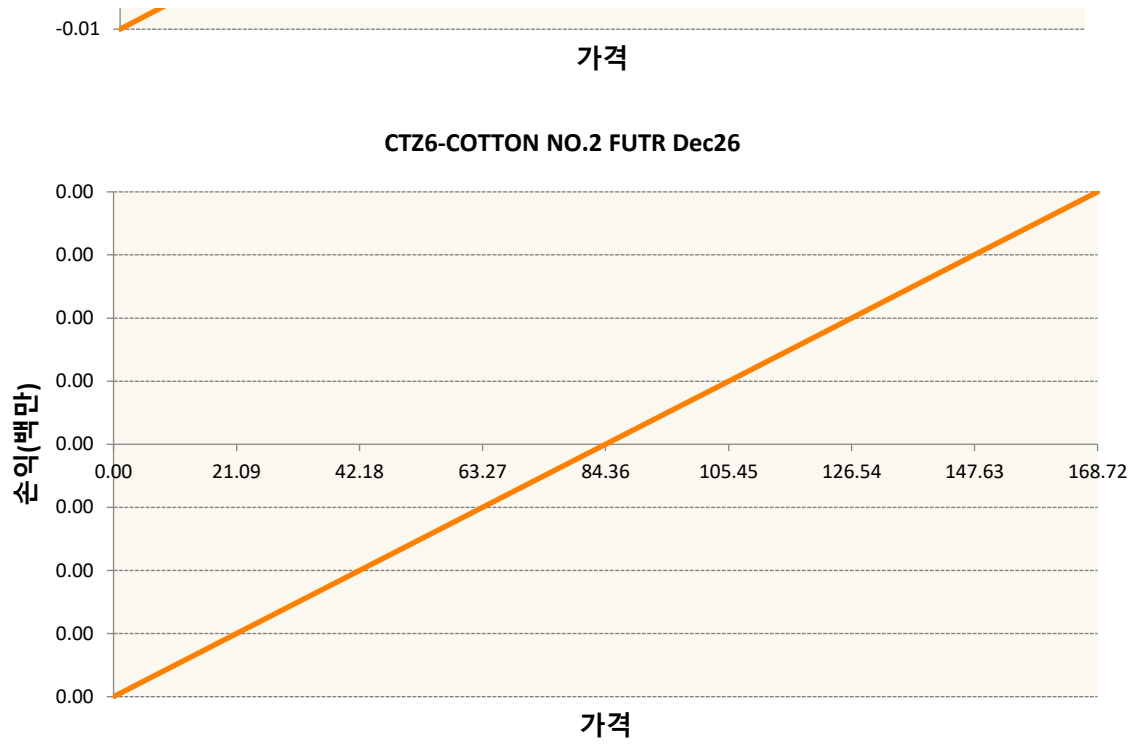
1. 계약금액

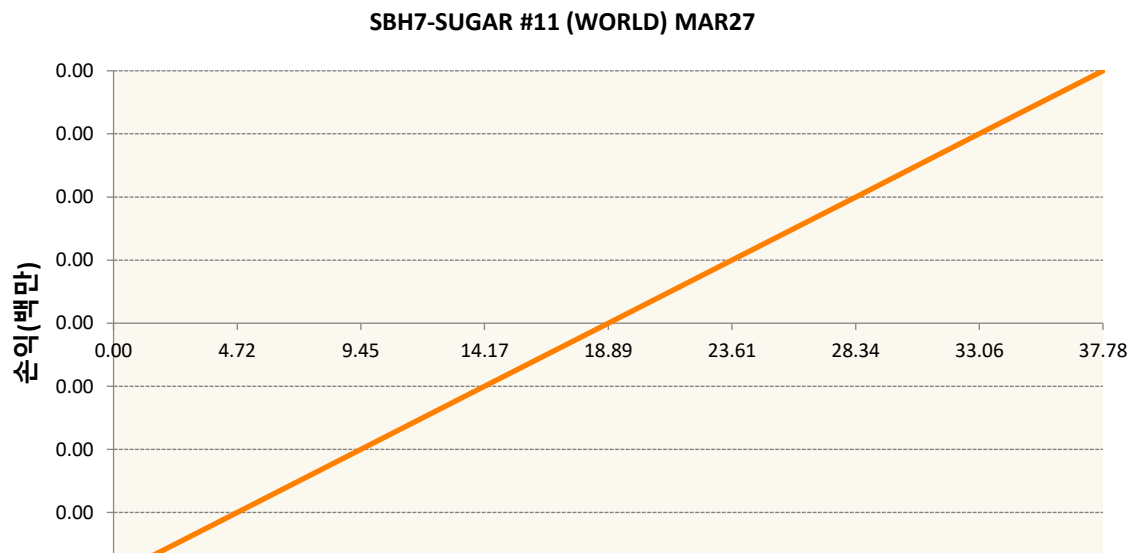
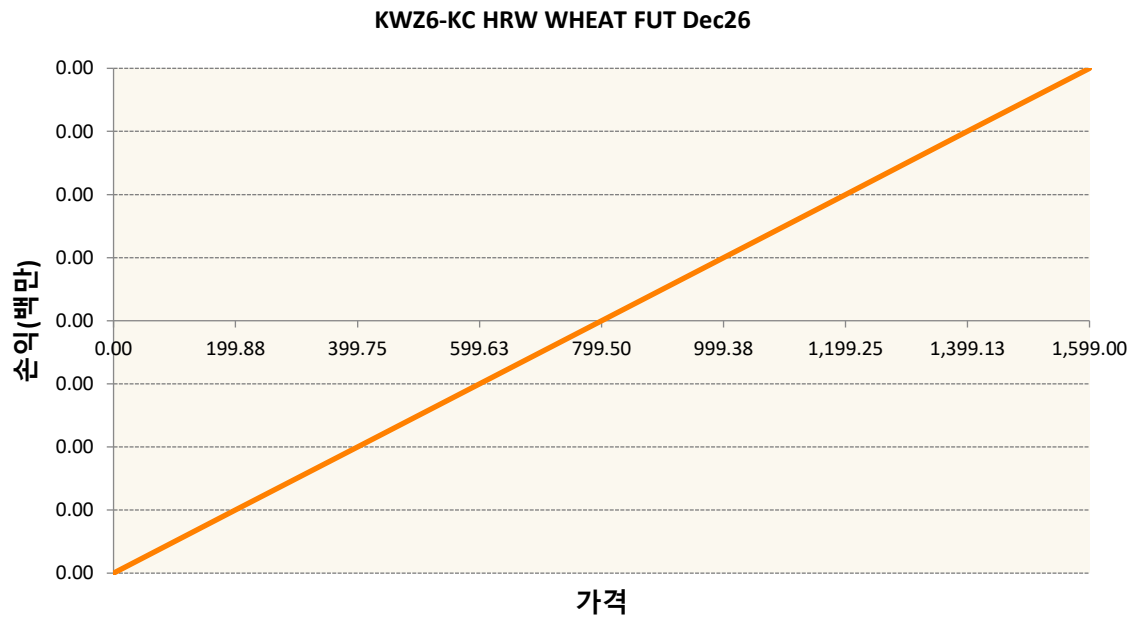
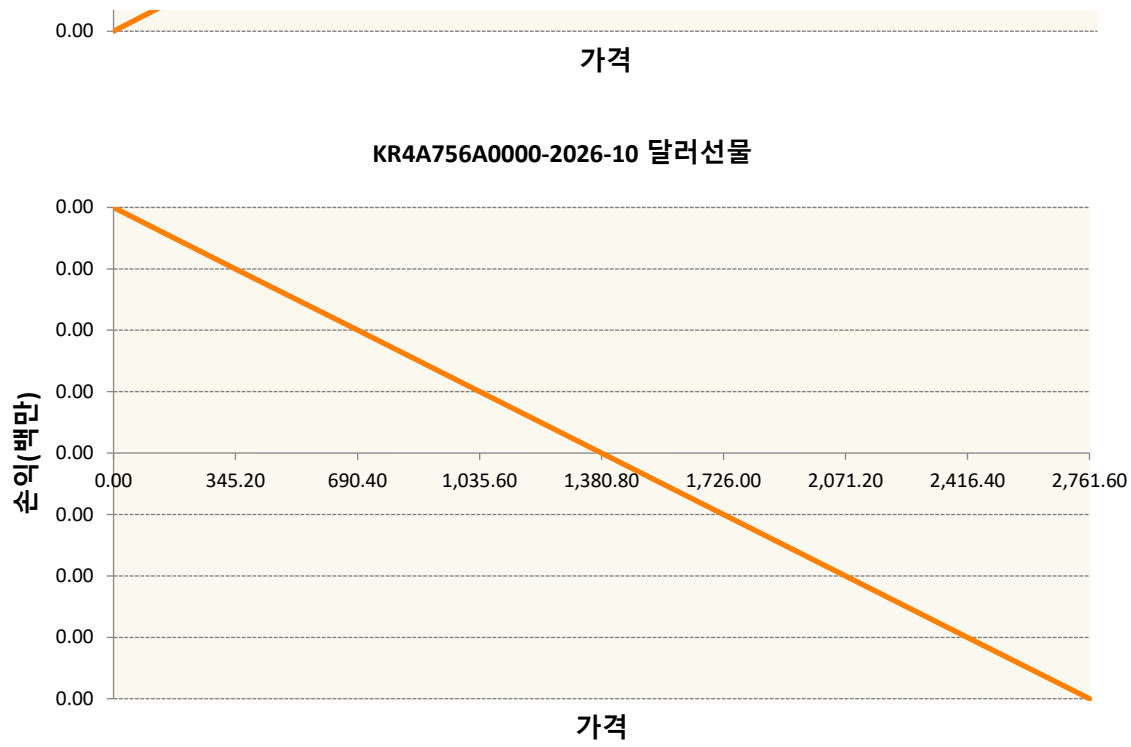
(단위:USD 백만)

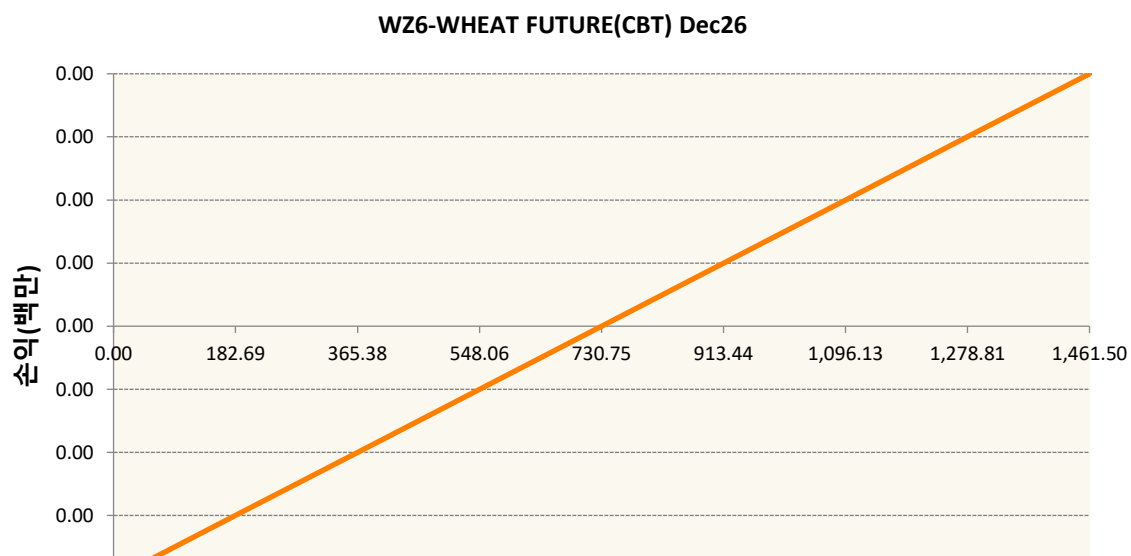
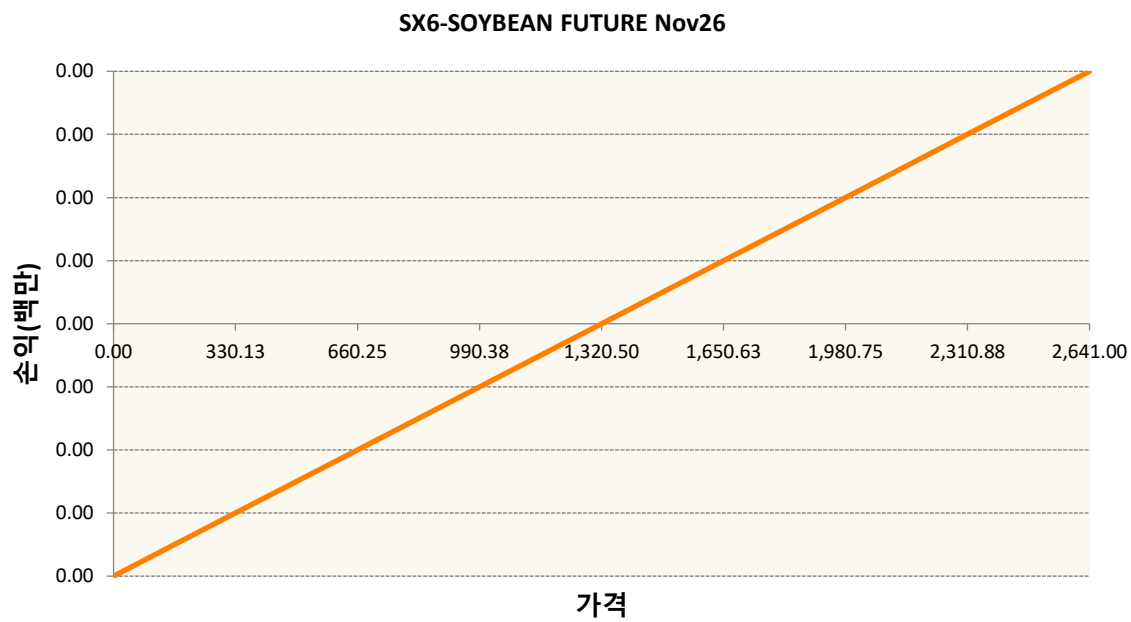
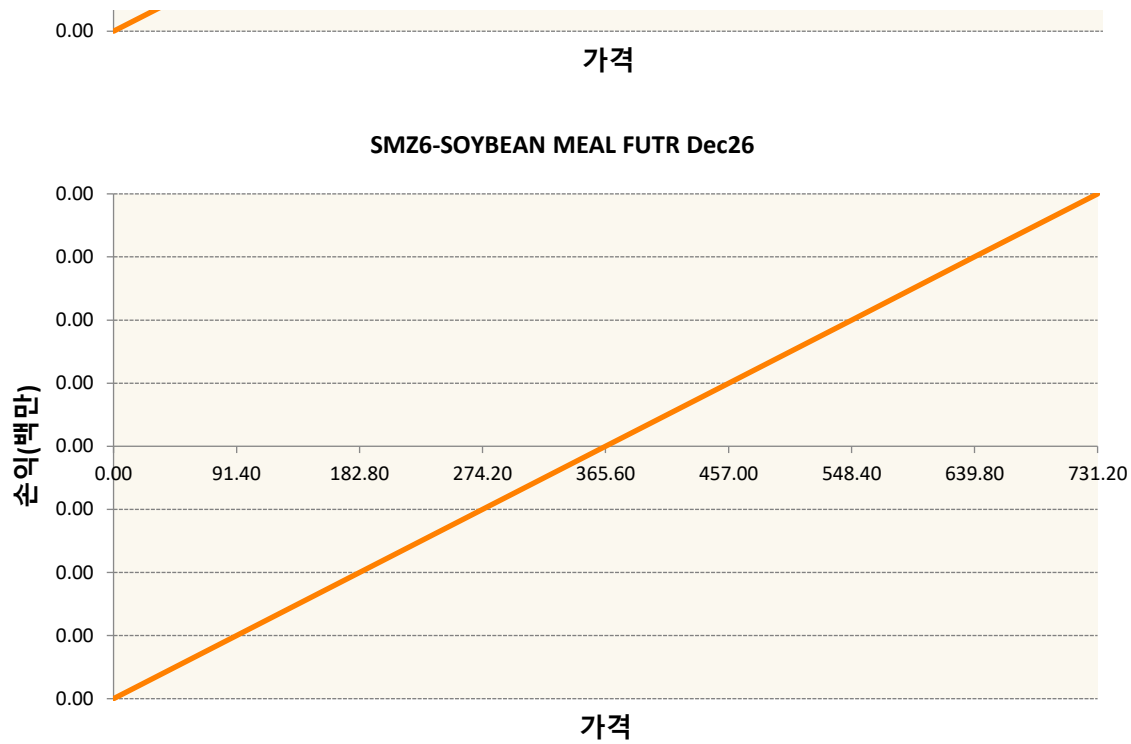
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	345	-345	장내
누계	실물자산	선물	400	0	400	
누계	유가증권	선물	2,428	0	2,428	
누계	통화	선물	0	345	-345	장내

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	2026-09-18
기준일	2026-09-17

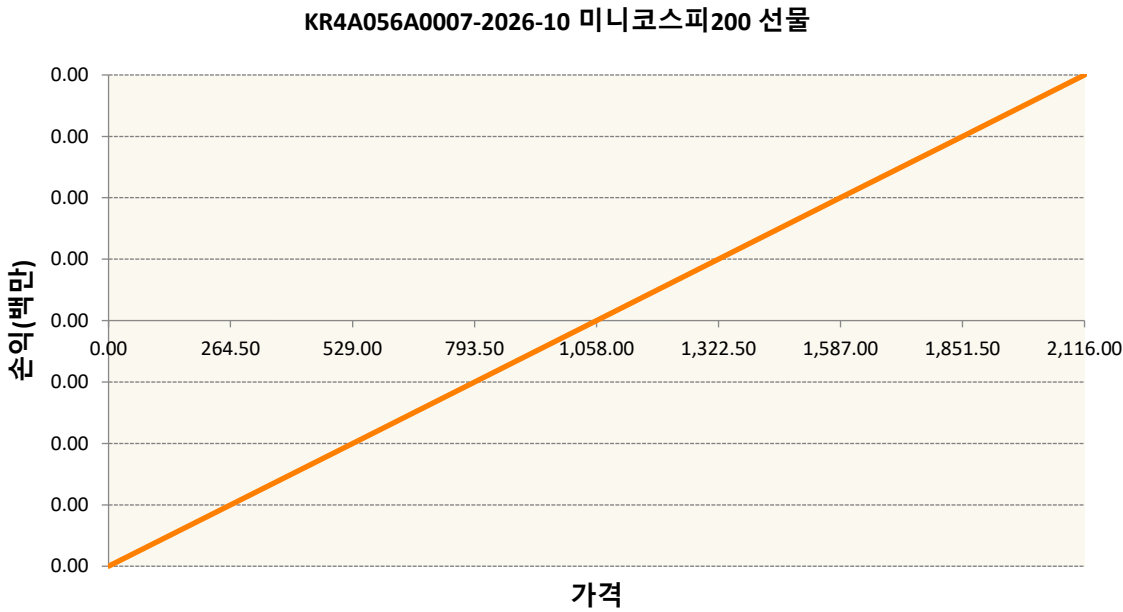
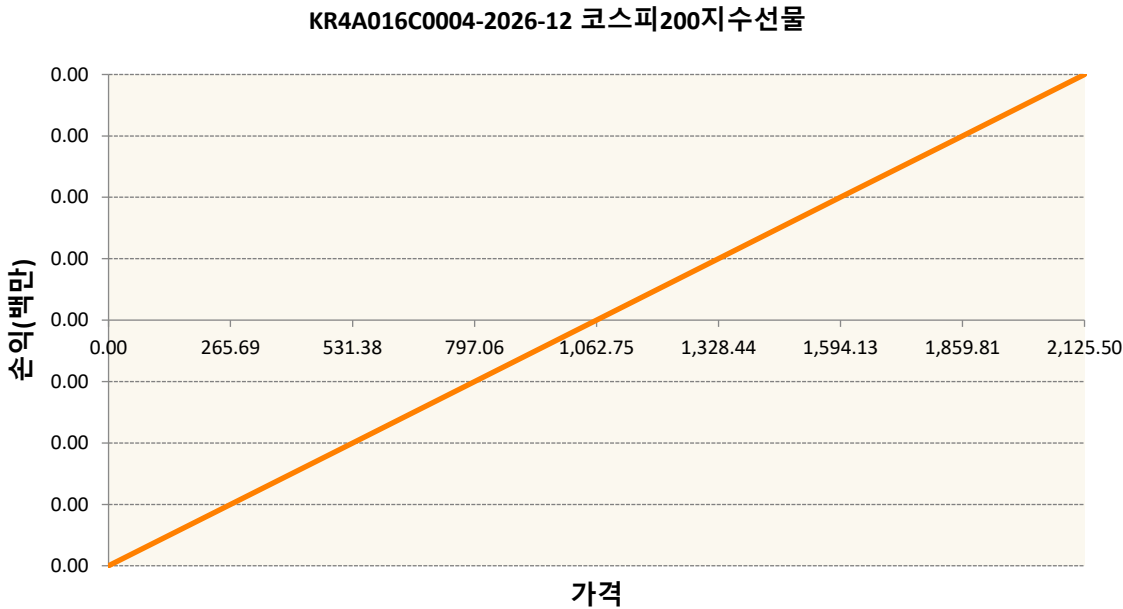
스마트인덱스모

1. 계약금액

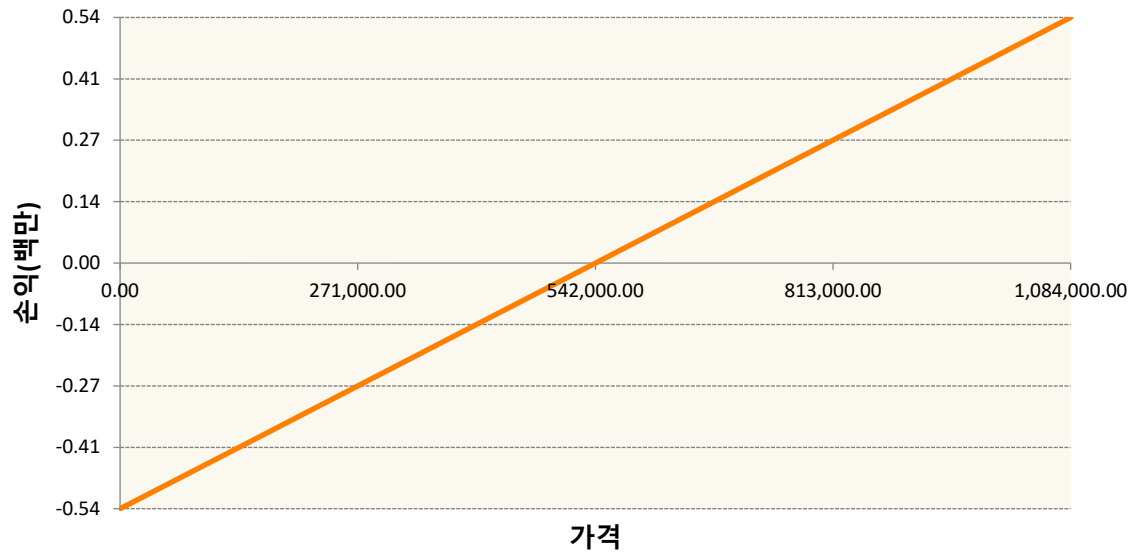
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	268	0	268	장내
누계	유가증권	선물	8,288	0	8,288	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물								317
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317	-317
-5.33%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212
-2.67%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	106	106	106	106	106	106	106	106
5.33%	212	212	212	212	212	212	212	212
8.00%	317	317	317	317	317	317	317	317
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

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

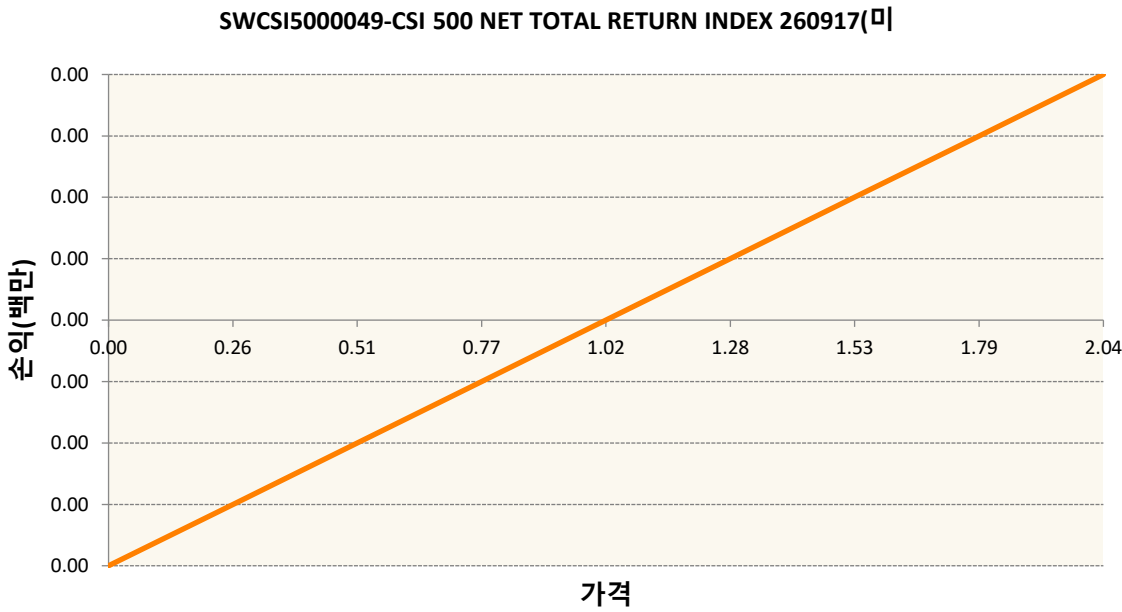
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,427	0	5,427	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미

433

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

679

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

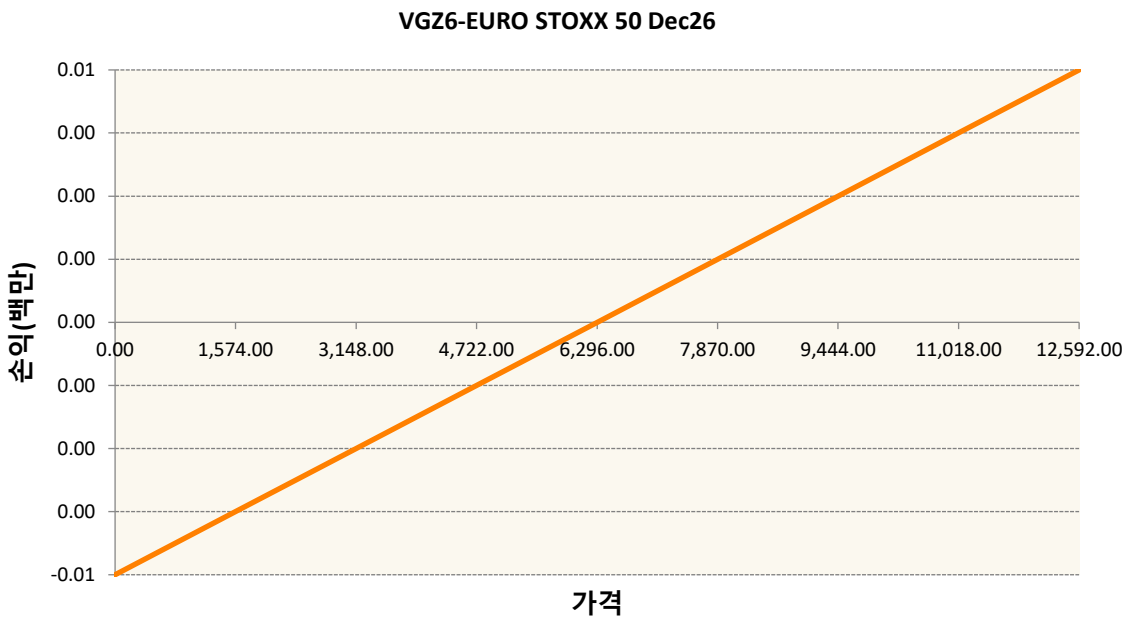
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,099	0	1,099	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

66

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

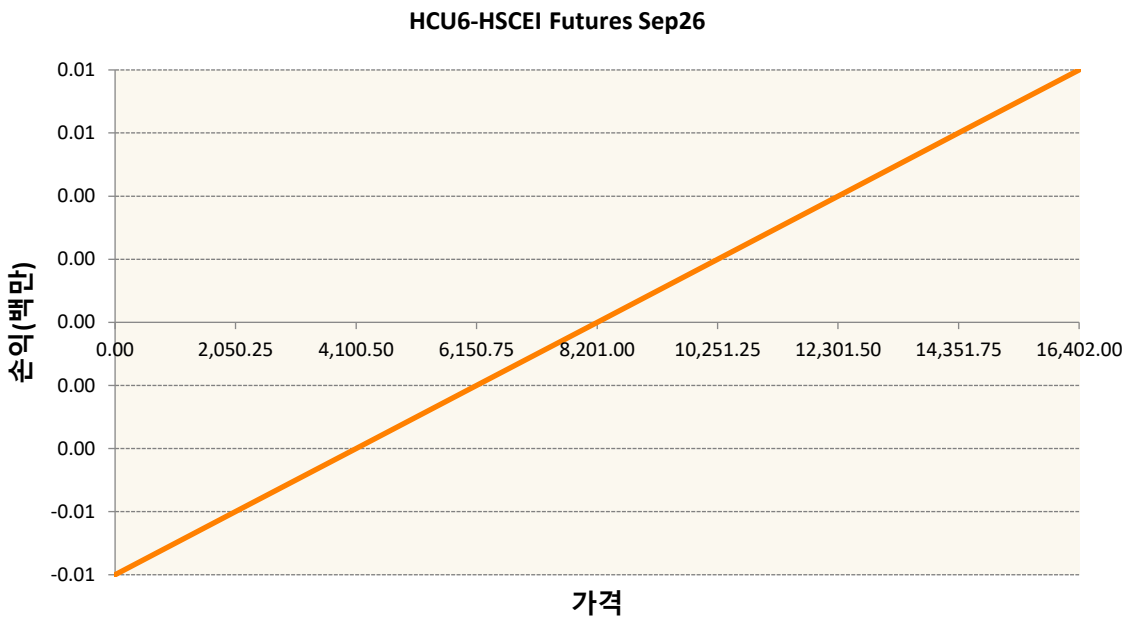
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,364	0	1,364	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	109
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

104

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

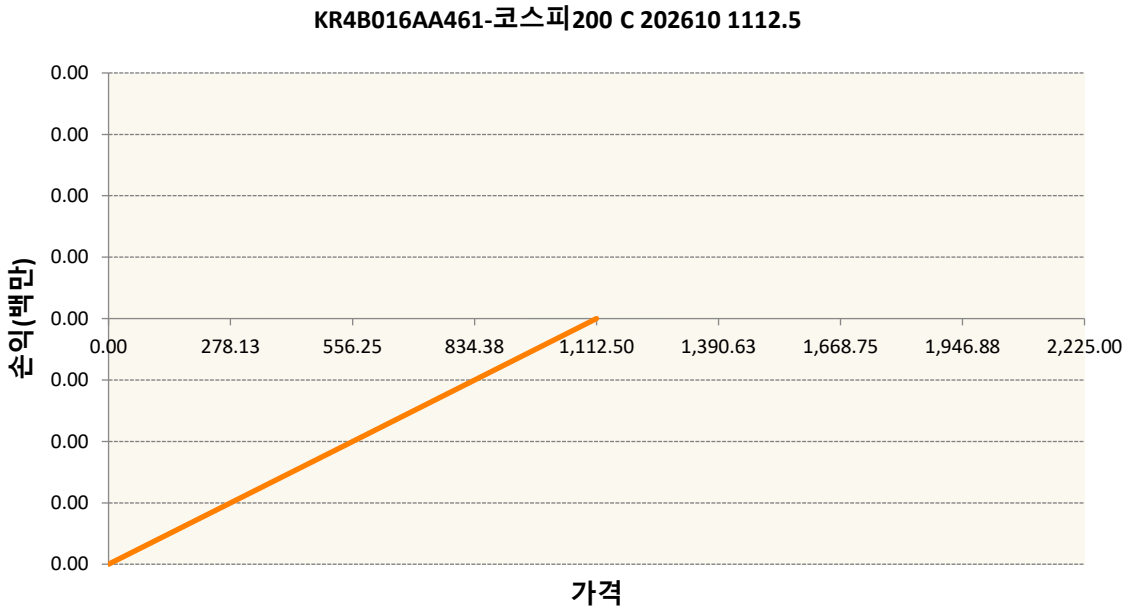
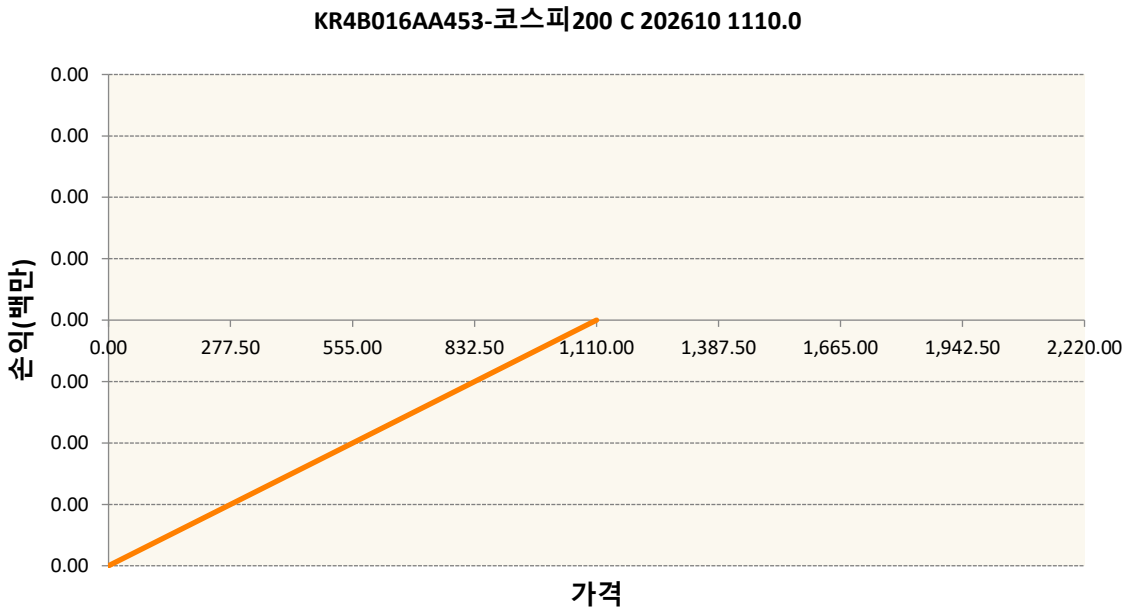
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

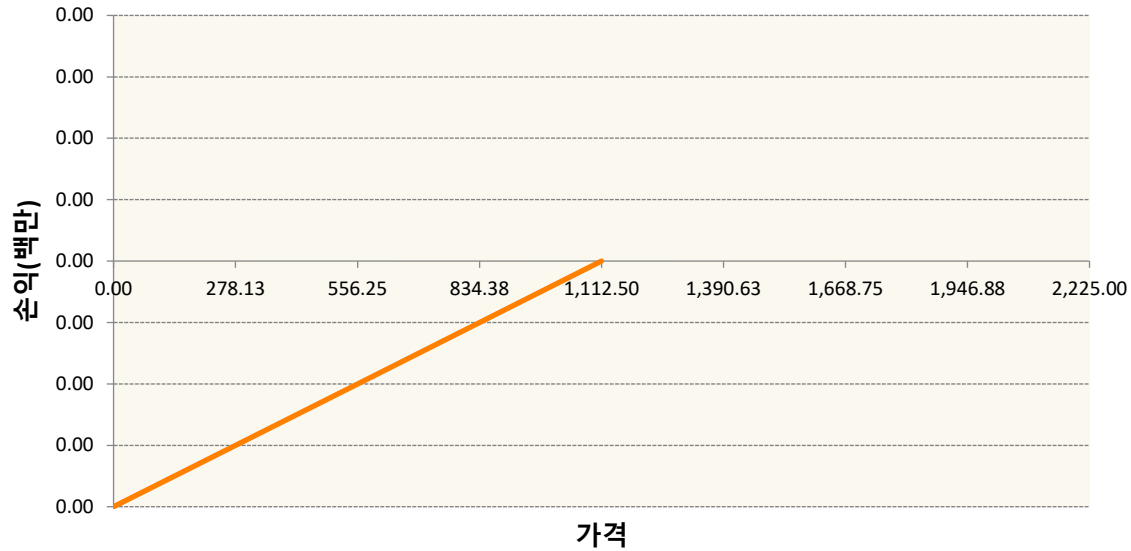
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4C016AA460-코스피200 P 202610 1112.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016AA453코스피200 C 202610 1110.0							466
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-402	-409	-417	-428	-439	-452	-466
-5.33%	-233	-244	-257	-271	-287	-303	-320
-2.67%	-76	-92	-109	-128	-147	-167	-187
0%	64	43	22	0	-22	-45	-68
2.67%	183	159	135	111	86	62	38
5.33%	278	253	228	203	178	153	128
8.00%	350	327	303	279	254	230	205
KR4B016AA461코스피200 C 202610 1112.5							2,071
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,797	-1,826	-1,863	-1,906	-1,956	-2,011	-2,071
-5.33%	-1,046	-1,094	-1,149	-1,211	-1,278	-1,349	-1,424
-2.67%	-346	-416	-492	-572	-655	-742	-831
0%	281	190	96	0	-98	-197	-297
2.67%	815	709	603	496	389	282	174
5.33%	1,245	1,135	1,024	913	802	692	581
8.00%	1,573	1,467	1,360	1,252	1,144	1,035	926
KR4C016AA460코스피200 P 202610 1112.5							594
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-516	-524	-535	-547	-561	-577	-594
-5.33%	-300	-314	-330	-347	-367	-387	-409
-2.67%	-99	-119	-141	-164	-188	-213	-238
0%	81	54	28	0	-28	-56	-85

2.67%	234	203	173	142	112	81	50
5.33%	357	326	294	262	230	198	167
8.00%	451	421	390	359	328	297	266

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,355

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

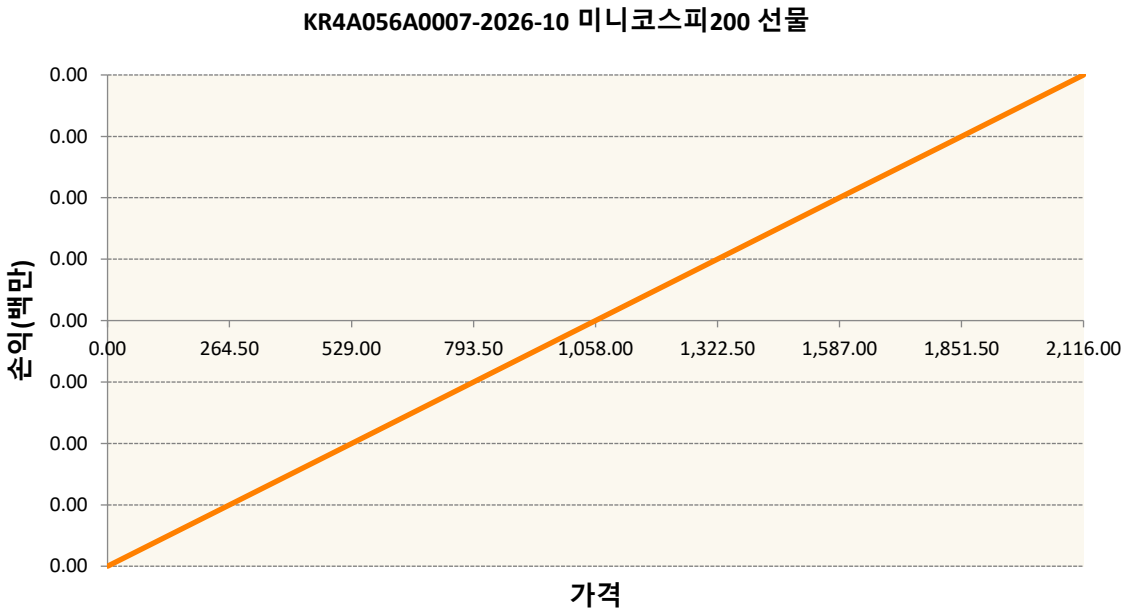
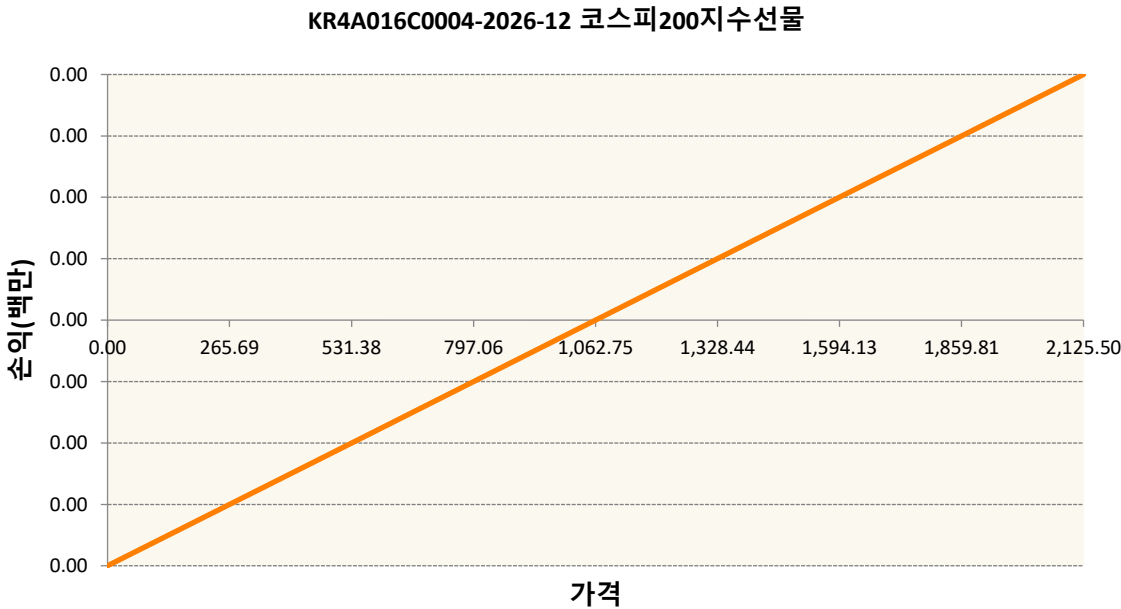
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

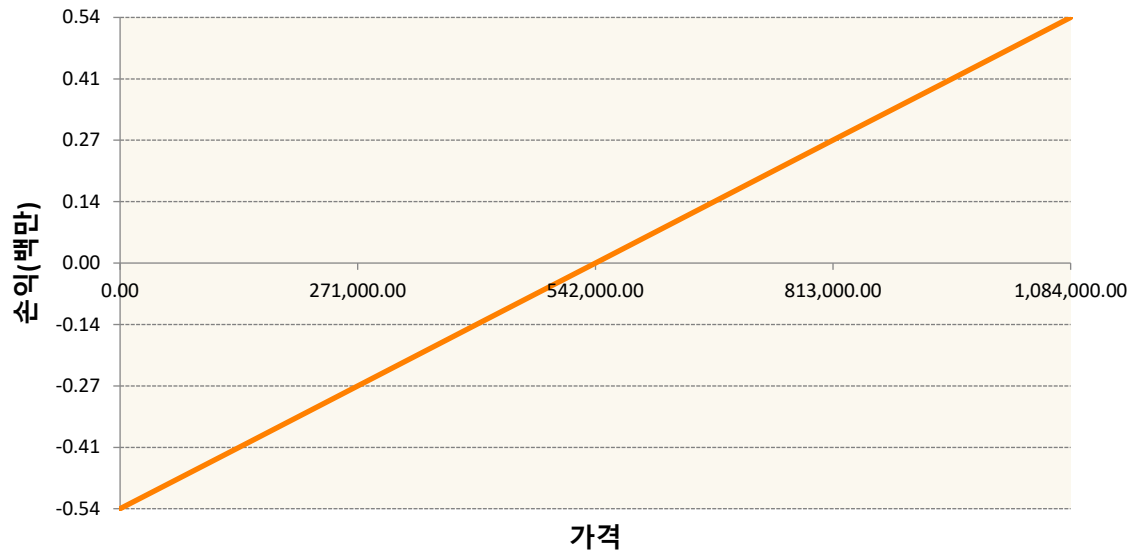
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,174	0	2,174	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

2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	296

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

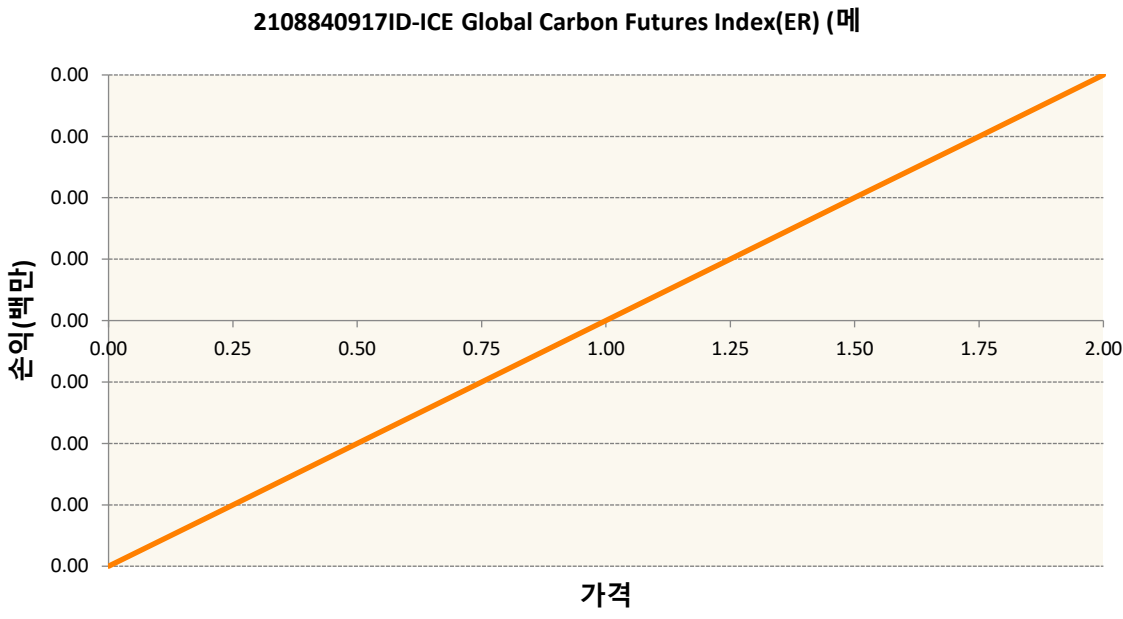
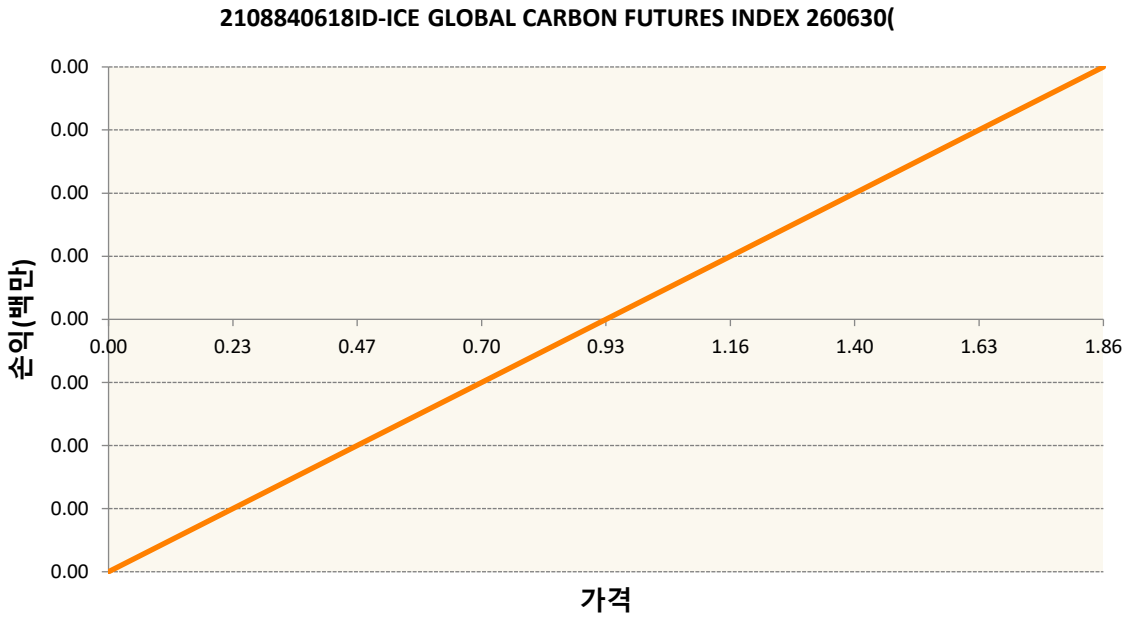
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,075	0	7,075	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		452
2108840917IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		114

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	599

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

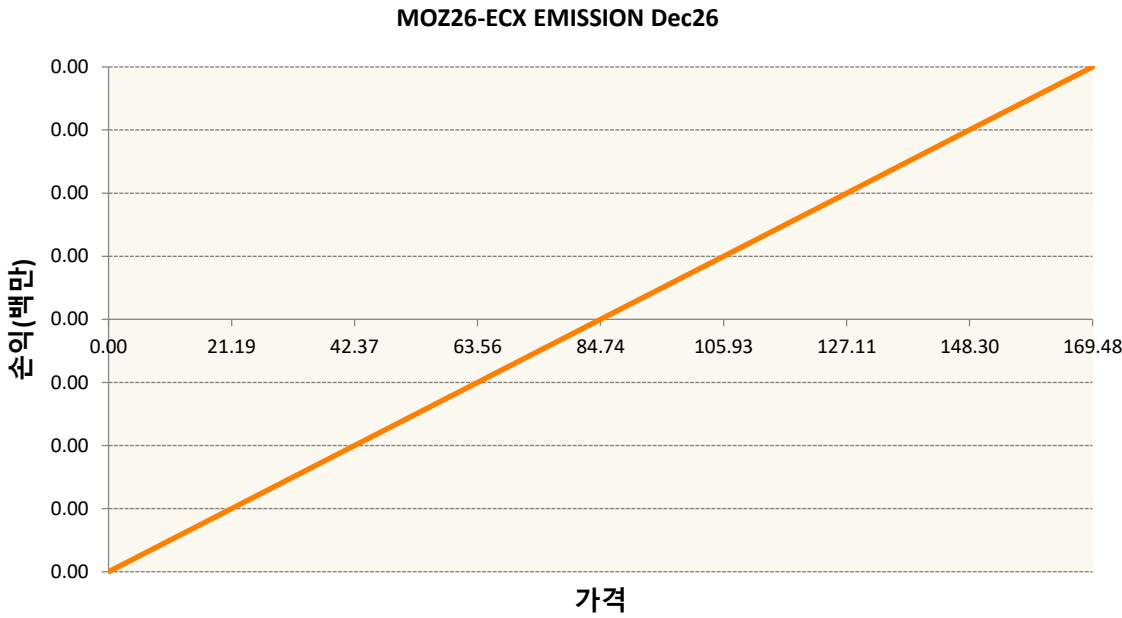
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,000	0	6,000	
누계	통화	선도	0	2,634	-2,634	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\KRW/EUR 30-09-26E	211
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	480

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

(단위:백만원)

740

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

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	2026-09-18
기준일	2026-09-17

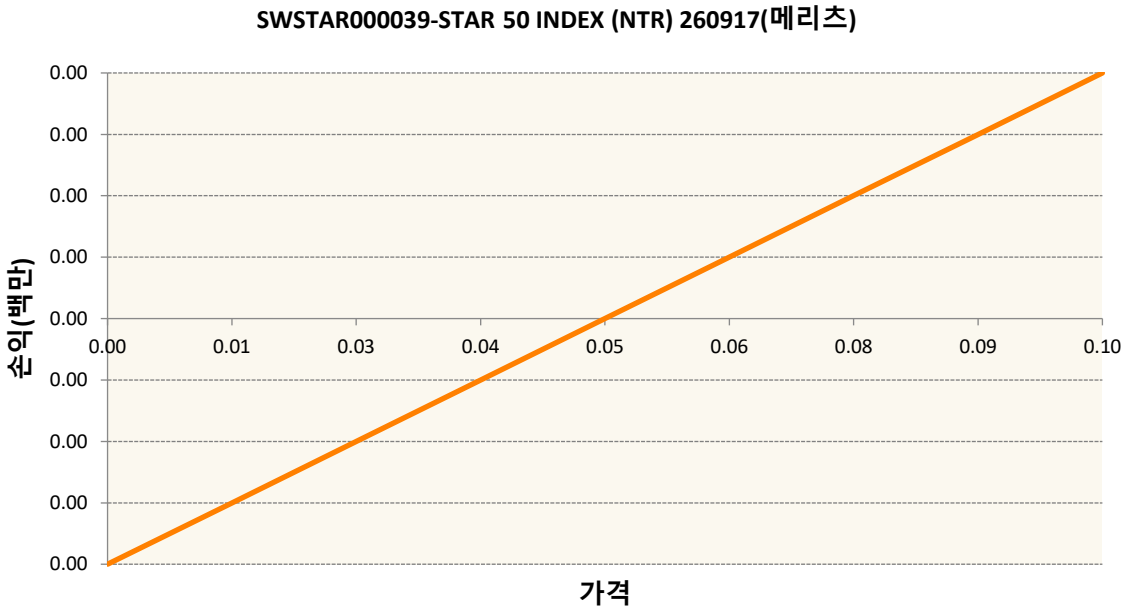
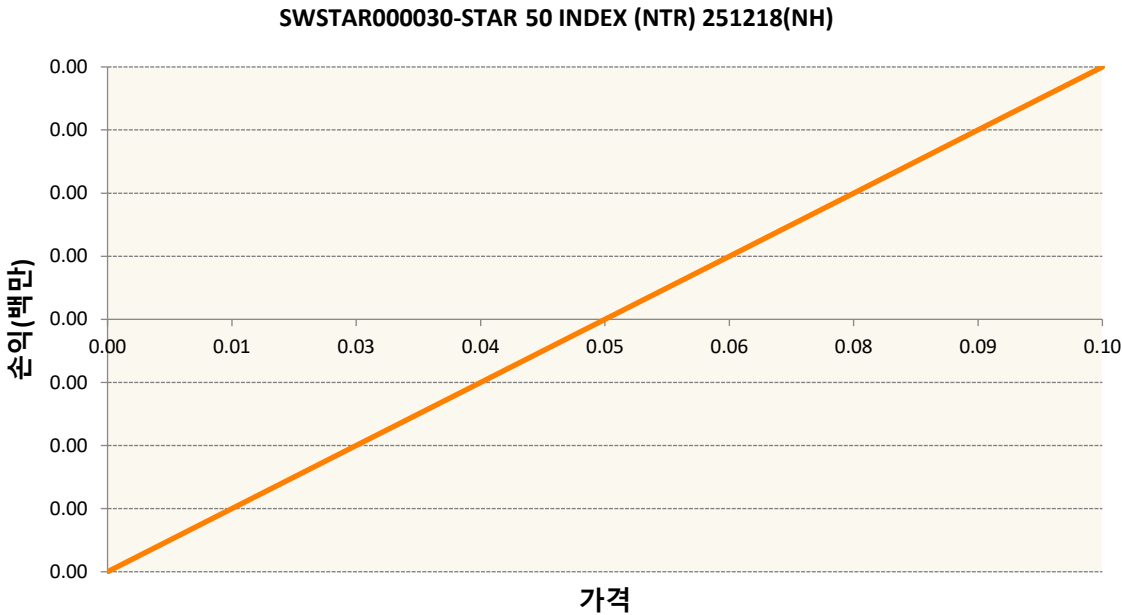
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	-2,085	0	-2,085	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)		14
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)		206
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)		29

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	473

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

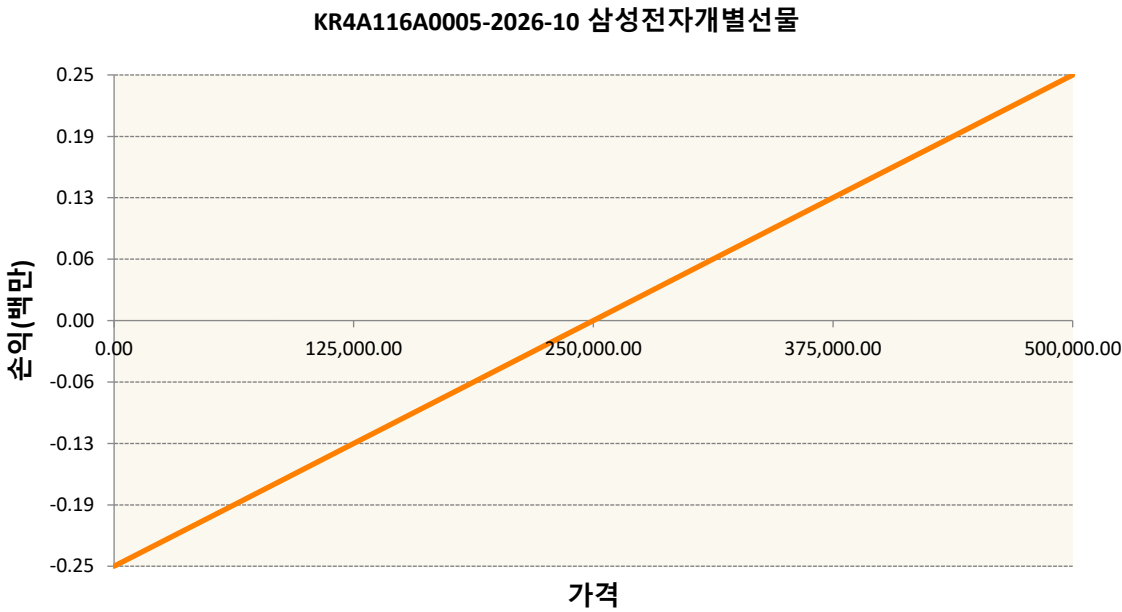
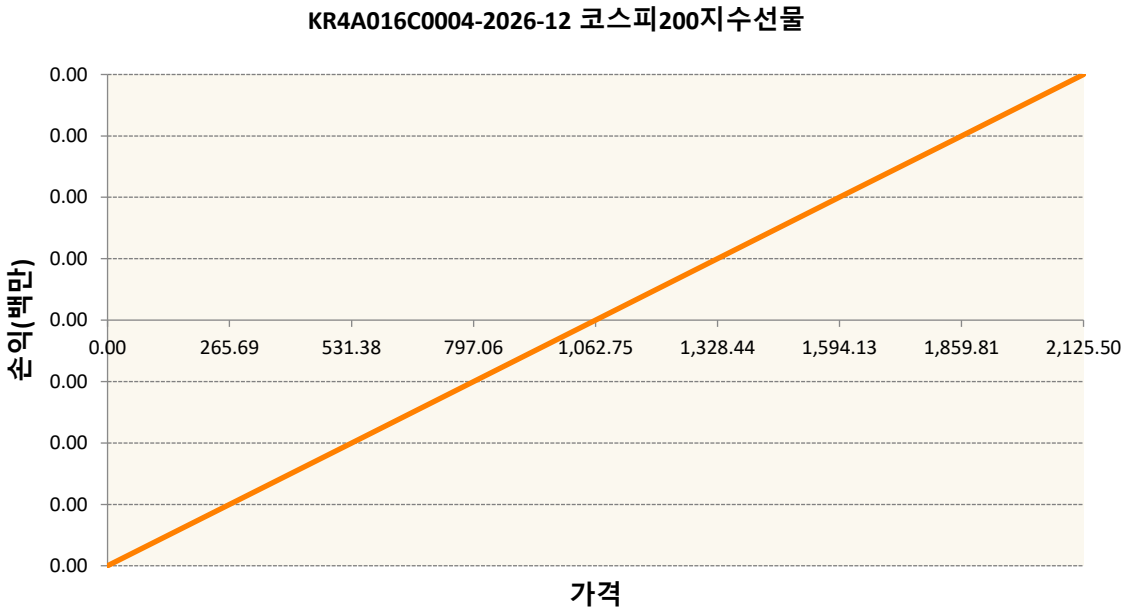
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

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	17,013	0	17,013	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물					1,101
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101	-1,101
-5.33%	-734	-734	-734	-734	-734	-734	-734
-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%	734	734	734	734	734	734	734
8.00%	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101	1,101
KR4A116A0005		2026-10 삼성전자개별선물					258
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-5.33%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-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%	172	172	172	172	172	172	172
8.00%	258	258	258	258	258	258	258

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

4,773

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

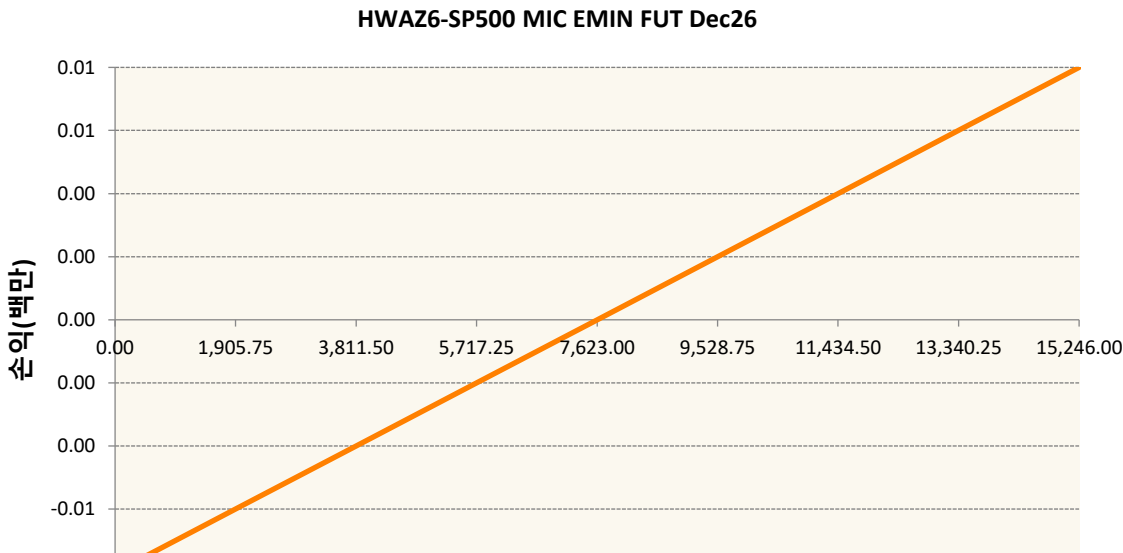
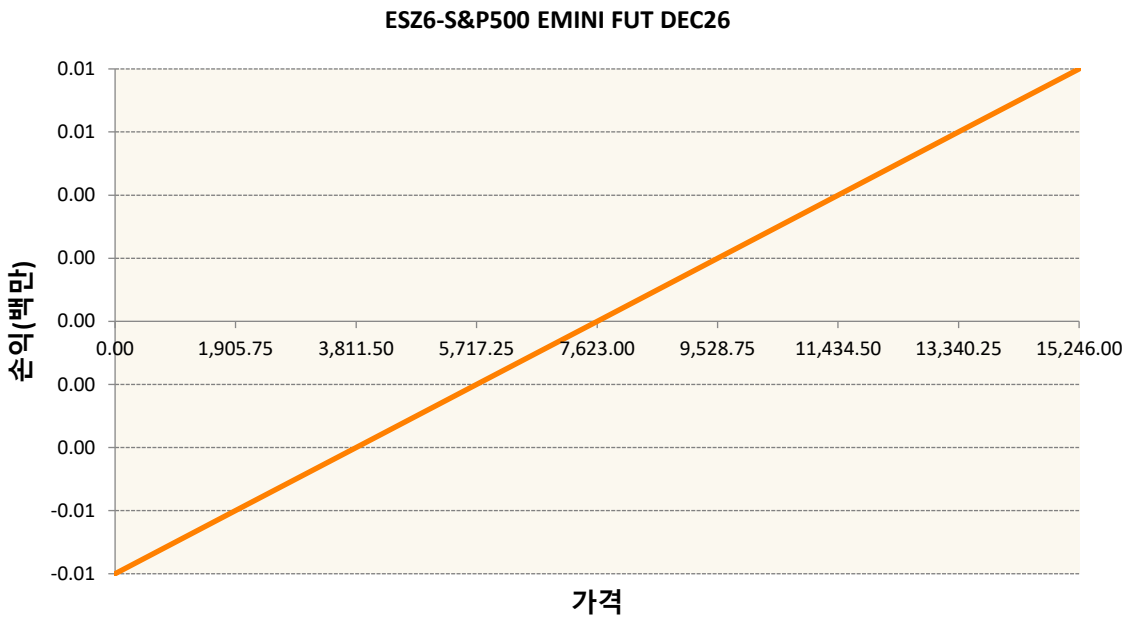
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

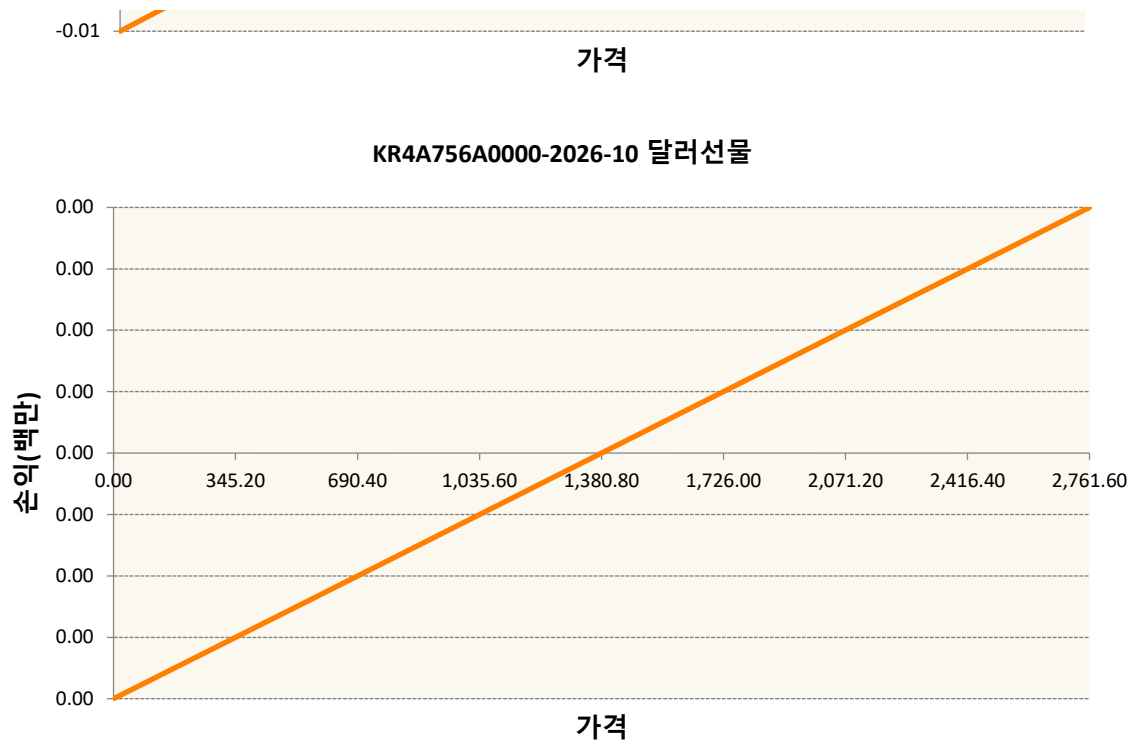
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	1	0	1	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	691	0	691	장내
누계	지수	선물	73,229	0	73,229	
누계	지수	선물	369	0	369	장내
누계	통화	선물	11,875	0	11,875	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26		5,858
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26		30
KR4A756A0C 2026-10 달러선물			950

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,755

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

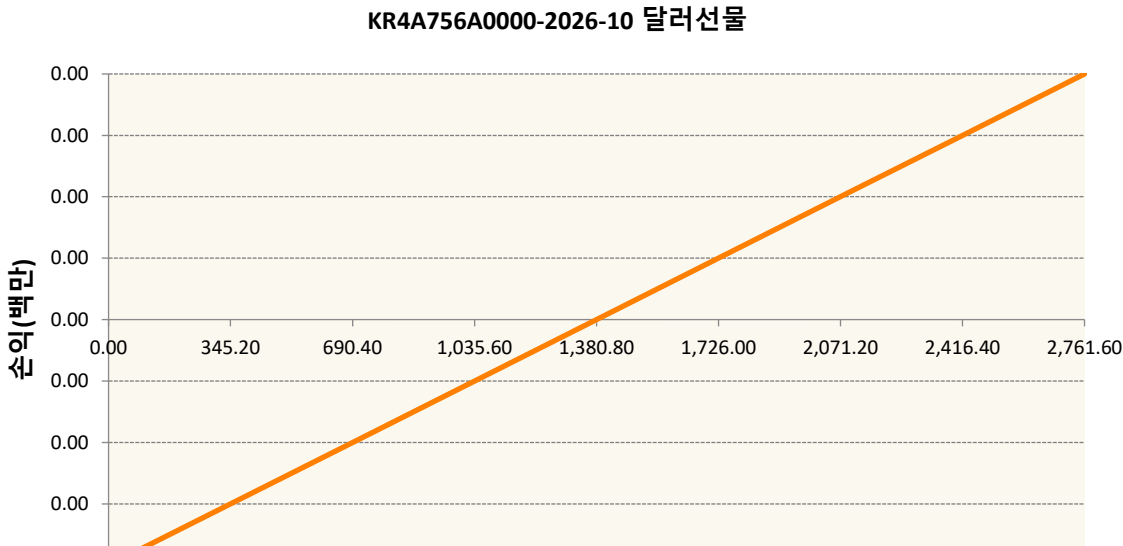
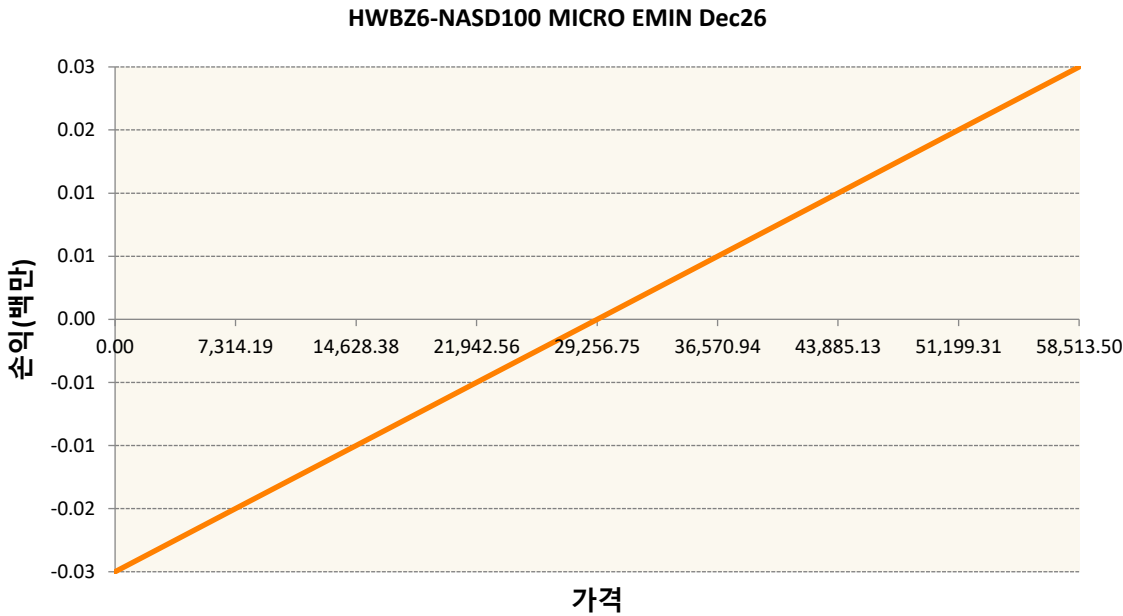
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

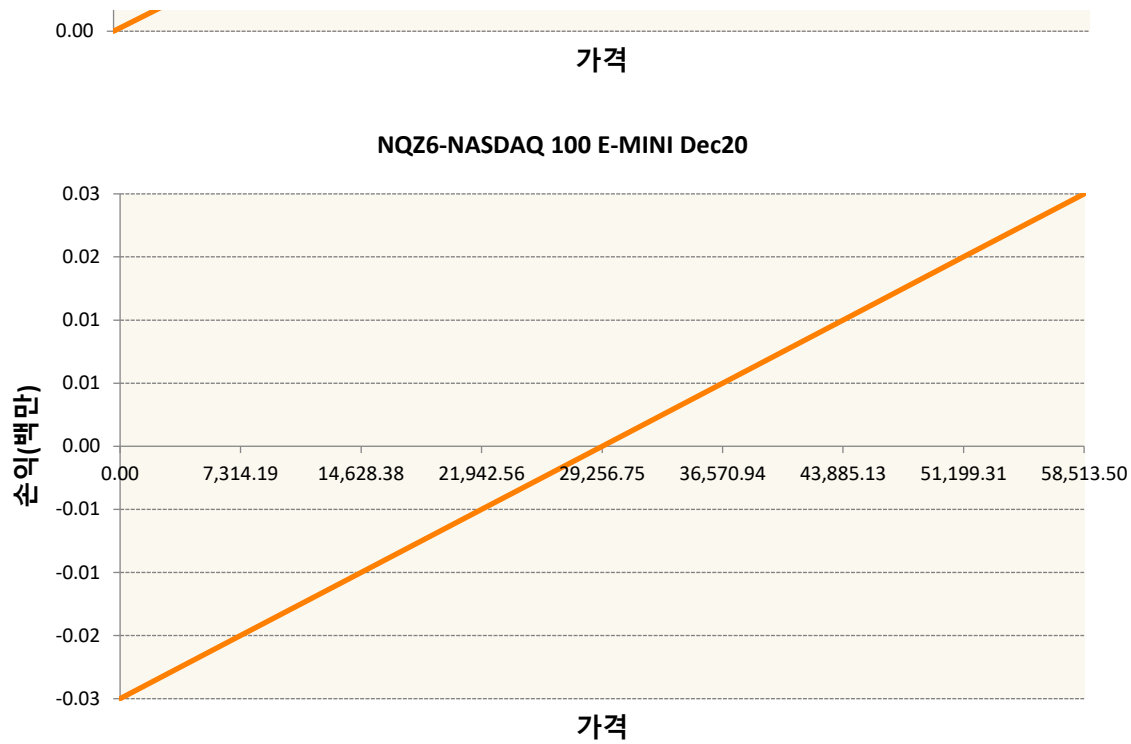
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	1	0	1	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	345	0	345	장내
누계	지수	선물	34,777	0	34,777	
누계	지수	선물	728	0	728	장내
누계	통화	선물	5,537	0	5,537	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26		58
KR4A756A0C	2026-10 달러선물		443
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		2,782

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,572

공시일	2026-09-18
기준일	2026-09-17

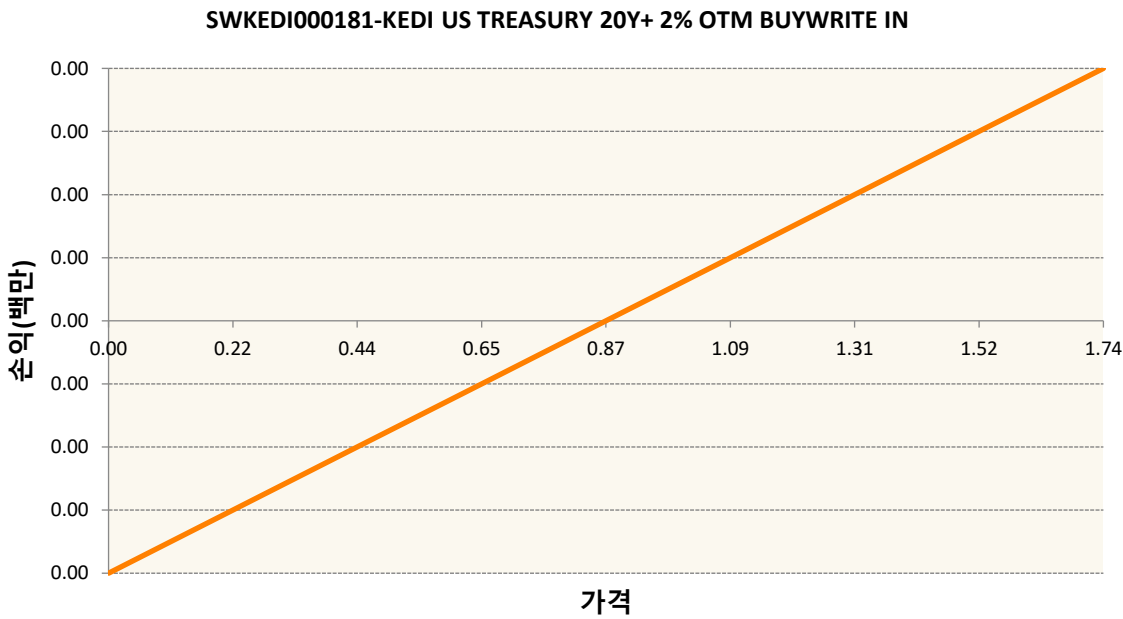
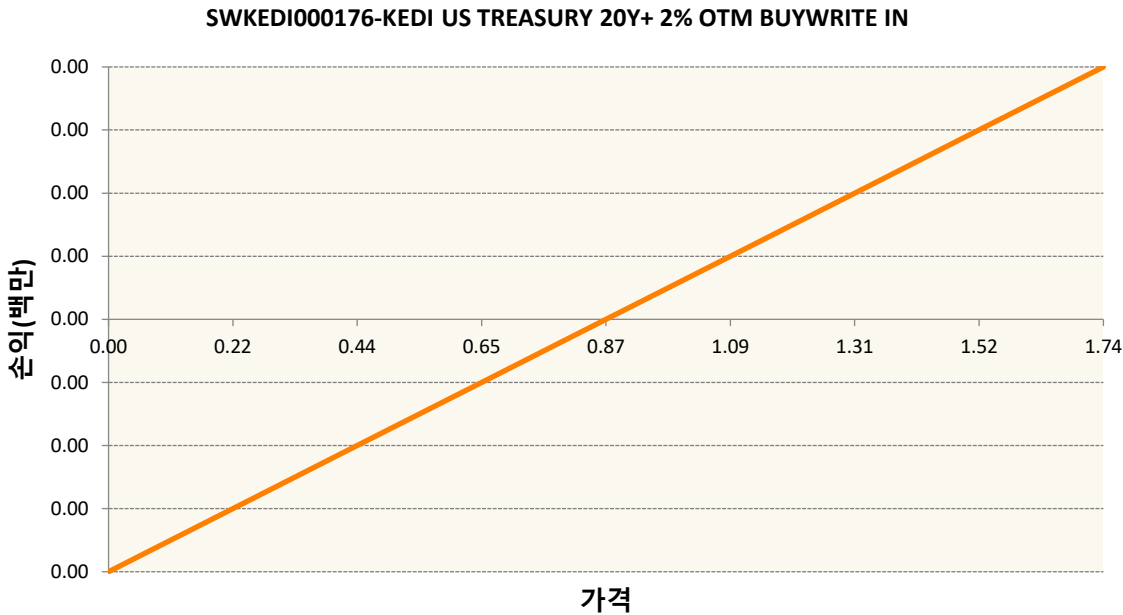
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

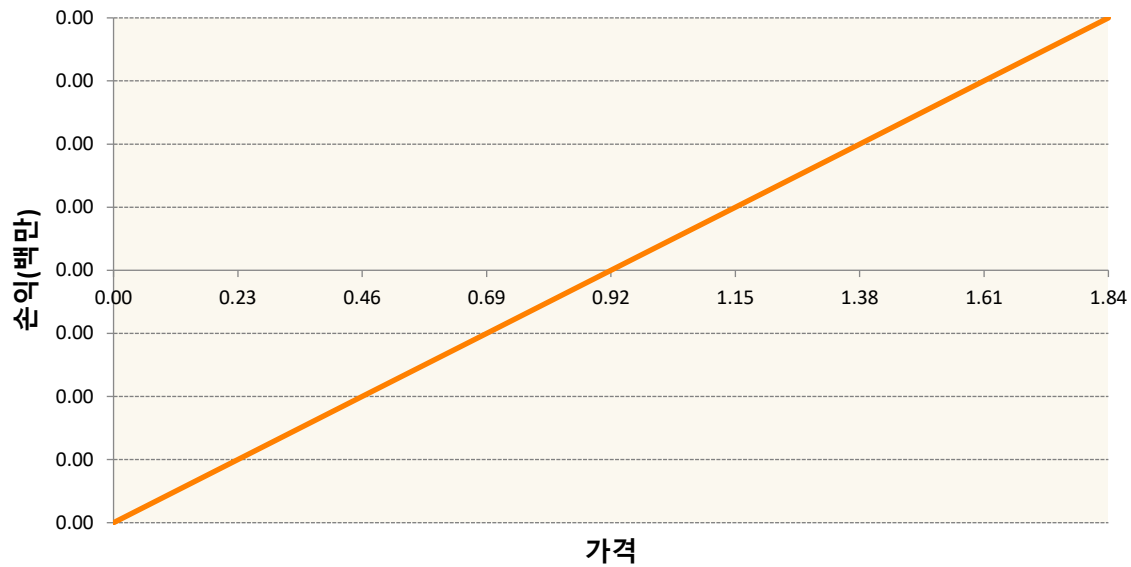
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	275,426	0	275,426	장외

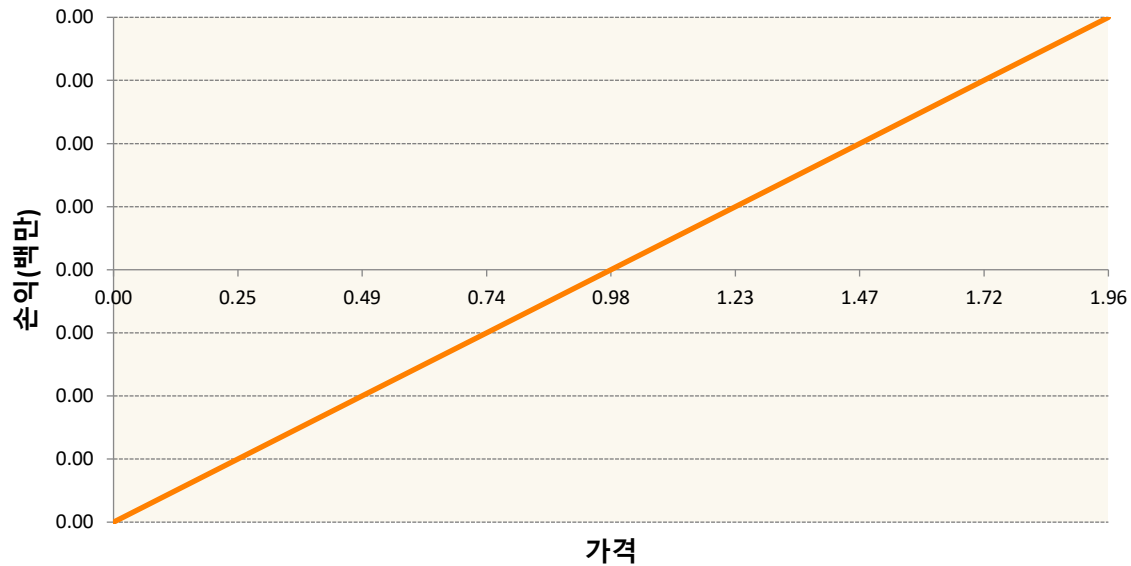
2. 만기시점의 손익구조



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	7,099
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,786
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,216
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,964

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

(단위:백만원)

8,762
