

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

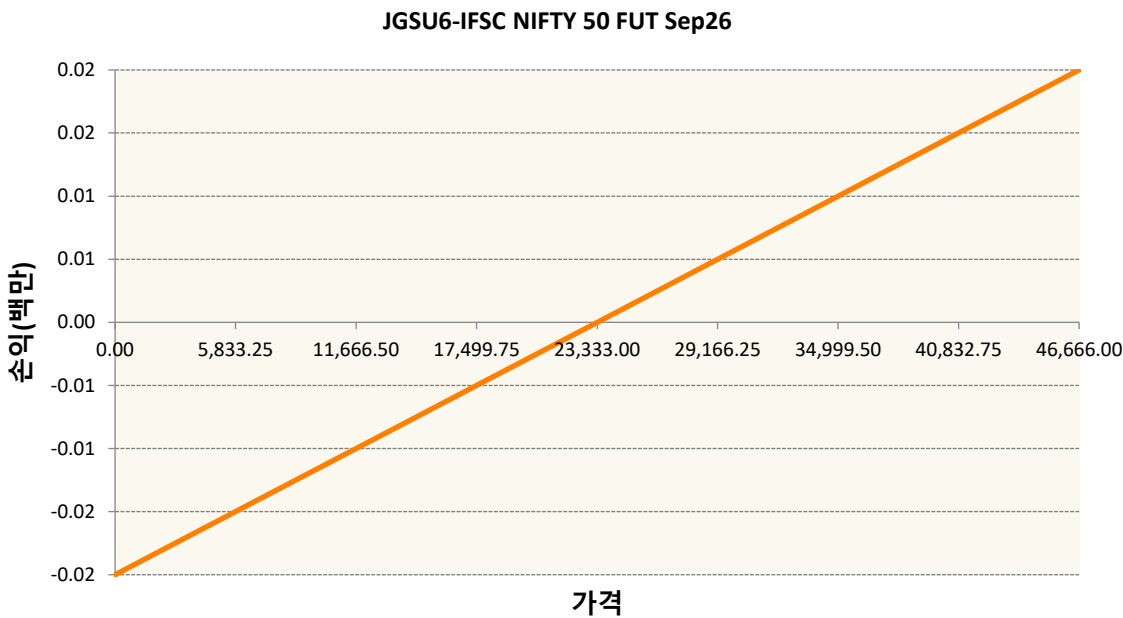
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	324	0	324	

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	2026-09-21
기준일	2026-09-18

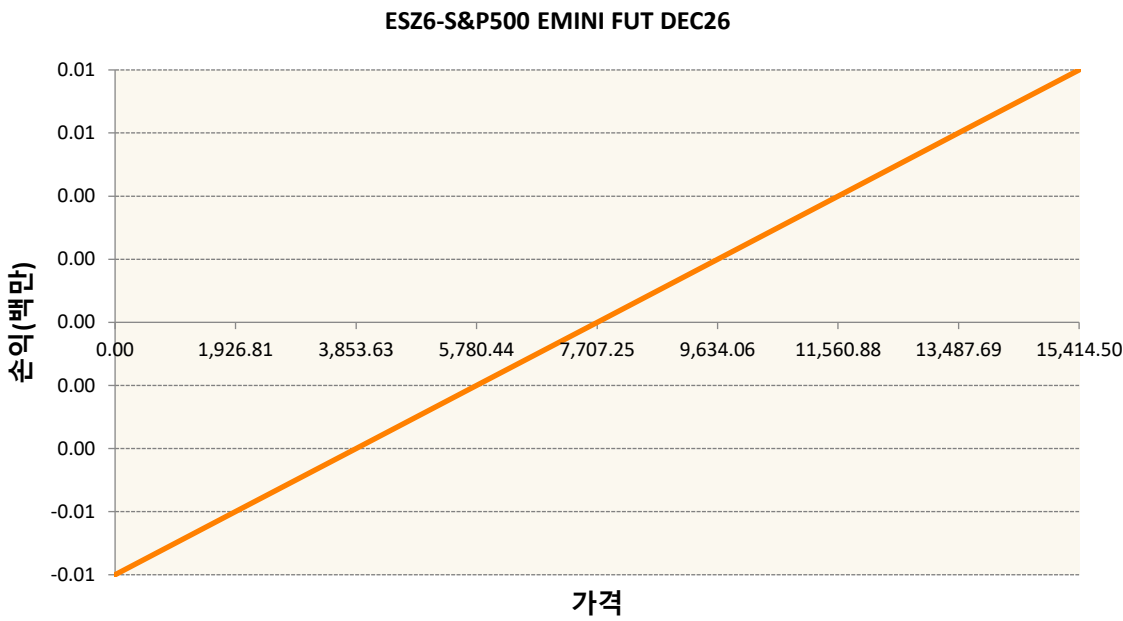
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	533	0	533	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	43
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

27

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

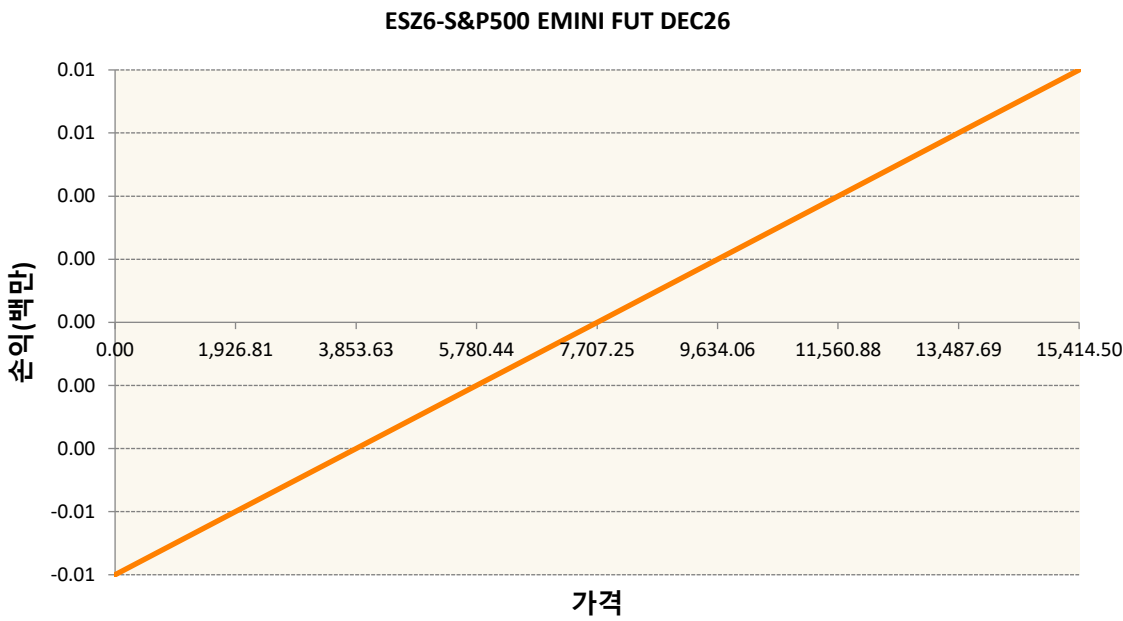
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	533	0	533	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	43
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

27

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

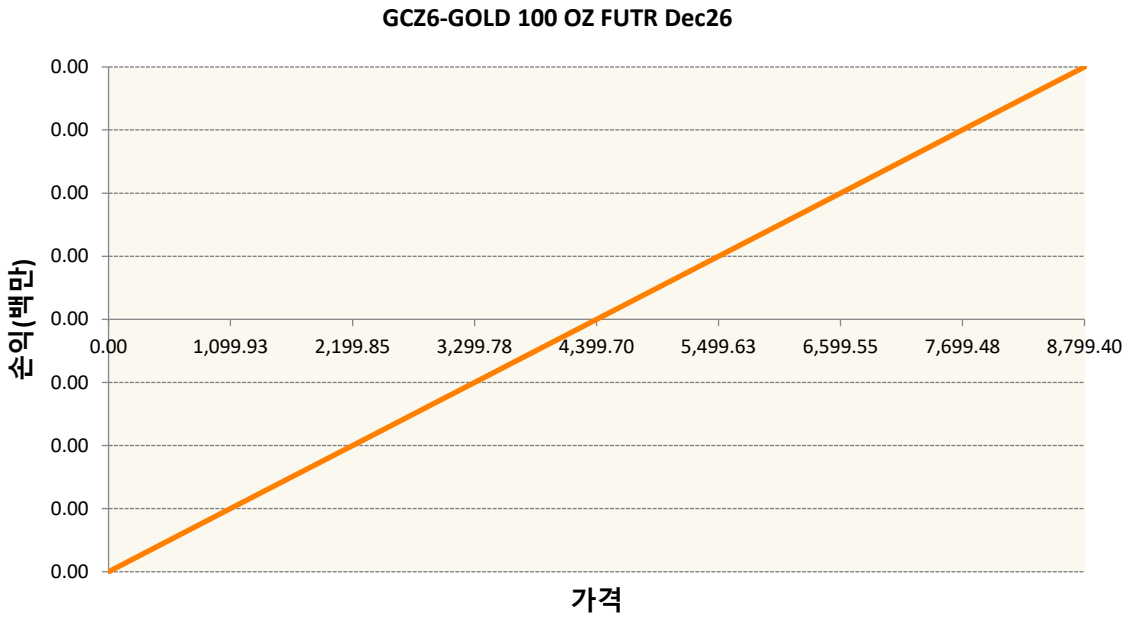
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			6,258	0	6,258	
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	501

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

(단위:백만원)

666

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

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	19
AOPLTRUP1 PLTR US 09/18/26 P172.5 EQUITY	54

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

(단위:백만원)

250

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

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

1

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

(단위:백만원)

0

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

(단위:백만원)

13,999

공시일 2026-09-21

기준일 2026-09-18

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	2026-09-21
기준일	2026-09-18

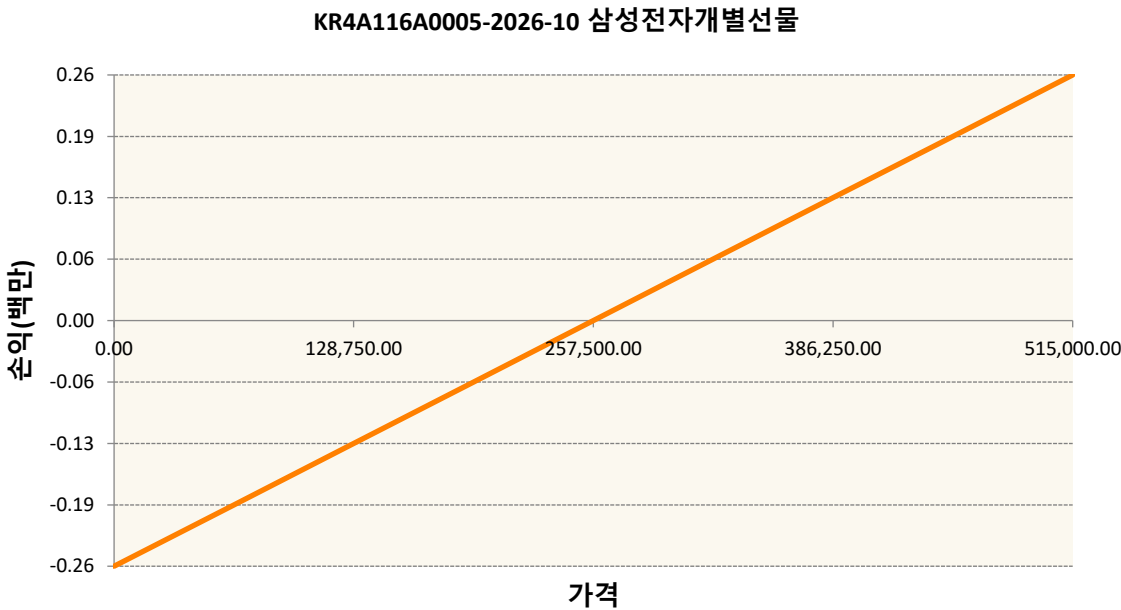
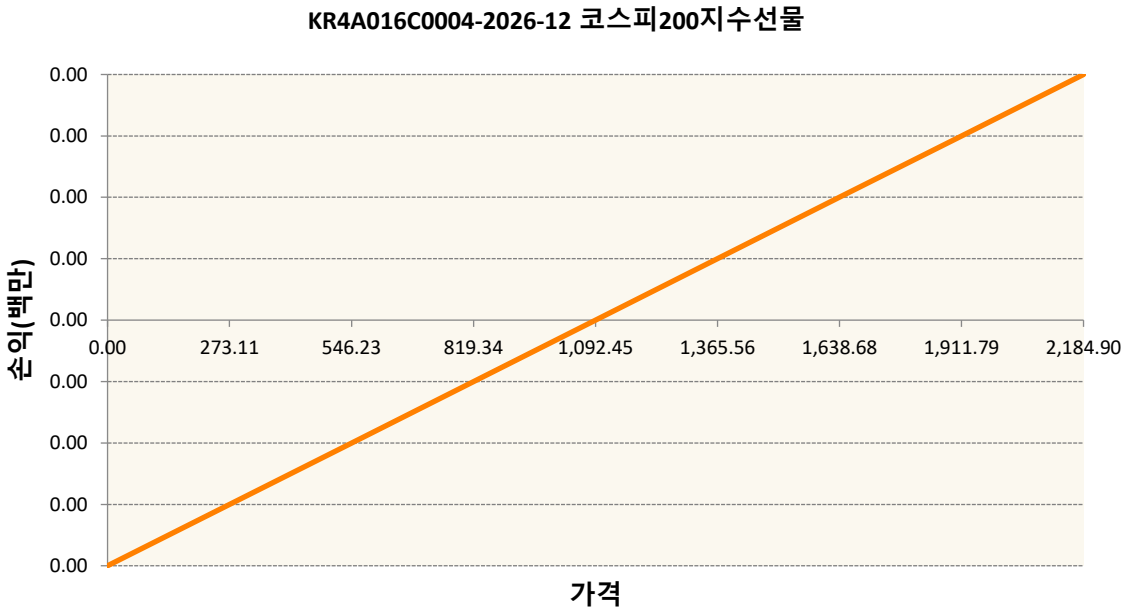
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	21,006	0	21,006	장내
누계	유가증권	옵션	0	76,923	-76,923	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between the price of a product and the profit generated from it. The x-axis represents the price (가격) in thousands of won, with major ticks at 0.00, 265.00, 530.00, 795.00, 1,060.00, 1,325.00, 1,590.00, 1,855.00, and 2,120.00. The y-axis represents the profit (이익) in thousands of won, with major ticks at 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, and 0.00. A blue line starts at a profit of 0.00 at a price of 1,060.00 and decreases linearly to a profit of 0.00 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 a price of 1,062.50 with a profit/loss of 0.00 and ends at a price of 2,125.00 with a profit/loss of 0.00.

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

(단위:백만원)

KR4A016C0004				2026-12 코스피200지수선물				567
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-567	-567	-567	-567	-567	-567	-567	
-5.33%	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378	
-2.67%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	189	189	189	189	189	189	189	
5.33%	378	378	378	378	378	378	378	
8.00%	567	567	567	567	567	567	567	
KR4A116A0005				2026-10 삼성전자개별선물				1,128
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128	-1,128
-5.33%	-752	-752	-752	-752	-752	-752	-752
-2.67%	-376	-376	-376	-376	-376	-376	-376
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	376	376	376	376	376	376	376
5.33%	752	752	752	752	752	752	752
8.00%	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128	1,128
KR4BAFBYA253 코스피위클리M C 2609W3 1,060.0							3,482

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,640	1,619	1,593	1,562	1,527	1,489	1,447
-5.33%	1,479	1,426	1,370	1,313	1,254	1,193	1,132
-2.67%	1,013	943	873	803	733	663	593
0%	164	112	57	0	-59	-120	-182
2.67%	-956	-978	-1,006	-1,039	-1,076	-1,117	-1,161
5.33%	-2,188	-2,194	-2,203	-2,217	-2,234	-2,256	-2,281
8.00%	-3,447	-3,448	-3,451	-3,455	-3,461	-3,470	-3,482
KR4BAFBYA261 코스피위클리M C 2609W3 1,062.5							2,303

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,045	1,032	1,016	997	975	951	924
-5.33%	949	915	880	843	804	765	725
-2.67%	659	613	566	519	473	426	379
0%	114	78	40	0	-41	-82	-125
2.67%	-621	-638	-658	-681	-707	-736	-767
5.33%	-1,439	-1,443	-1,451	-1,460	-1,473	-1,488	-1,506
8.00%	-2,278	-2,279	-2,280	-2,284	-2,288	-2,295	-2,303

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

(단위:백만원)

17,393

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

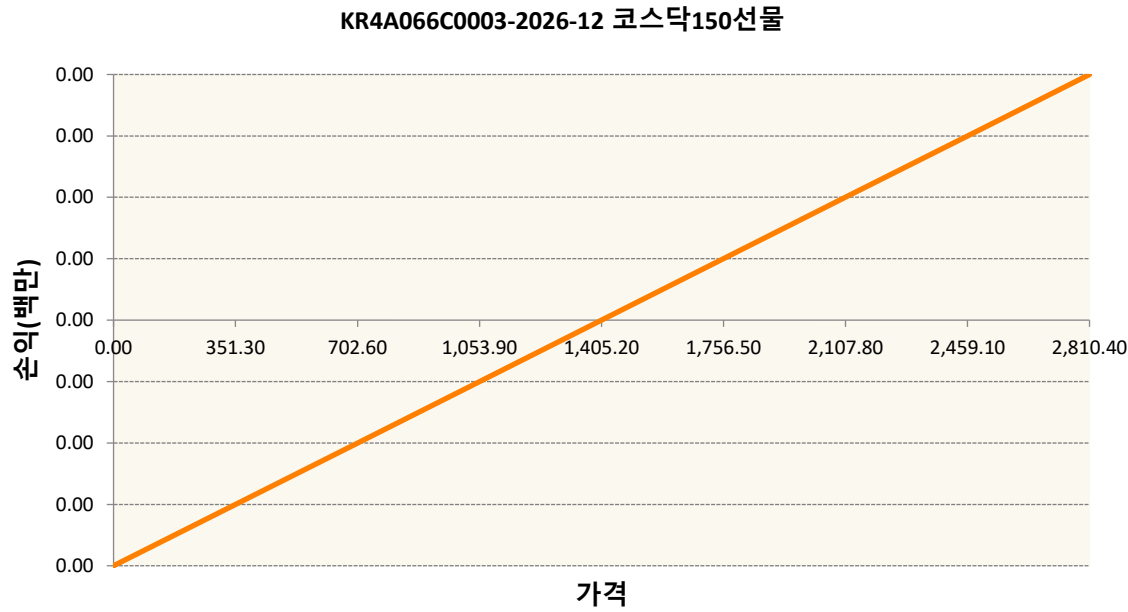
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	646	0	646	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)

14,384

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

(단위:백만원)

63,823

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

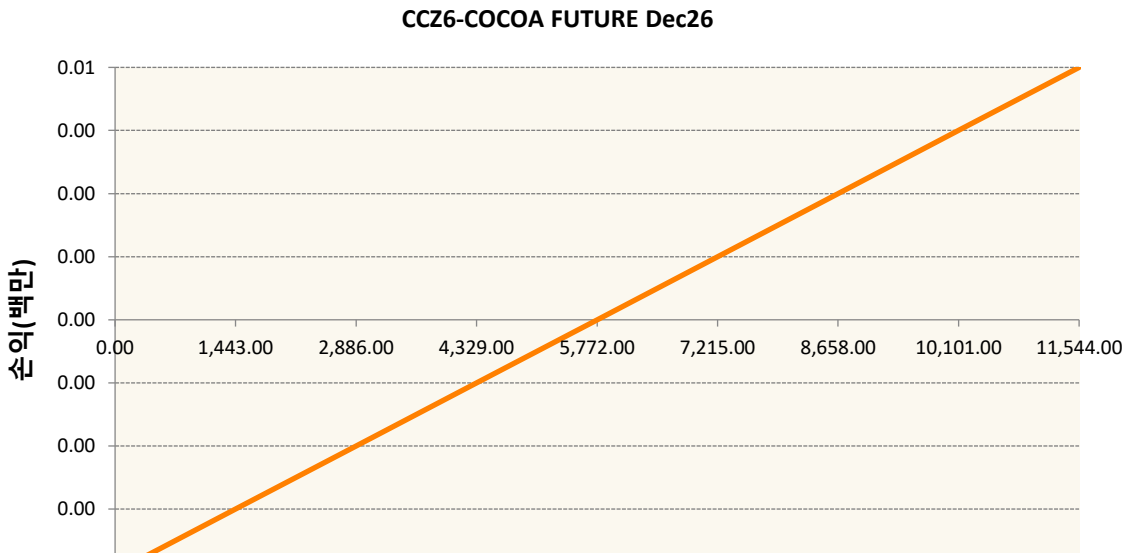
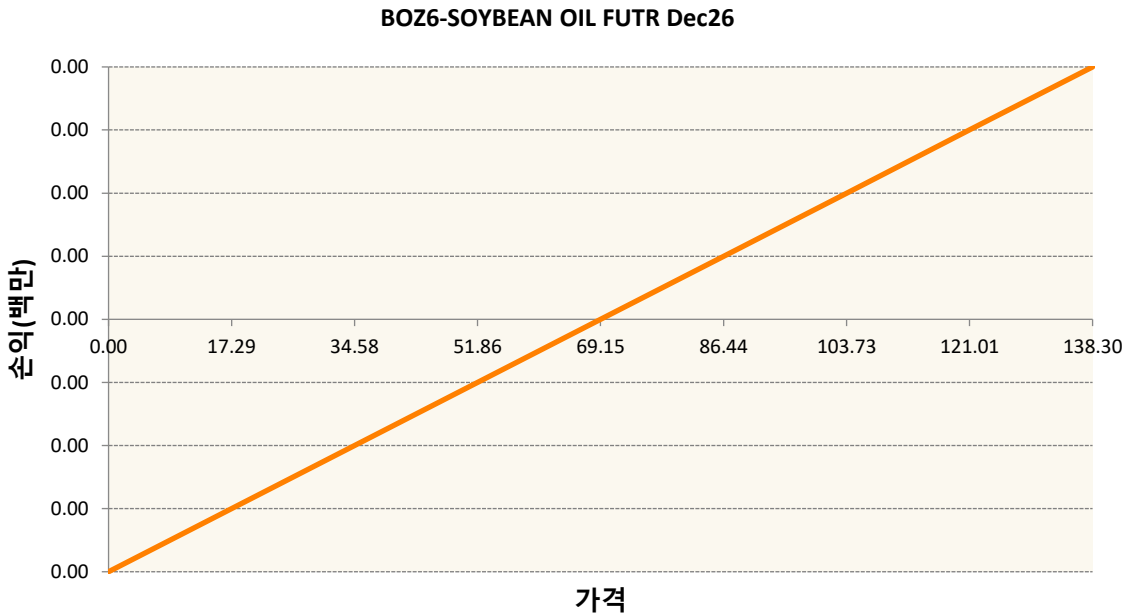
포커스농산물모(채권-파생형)

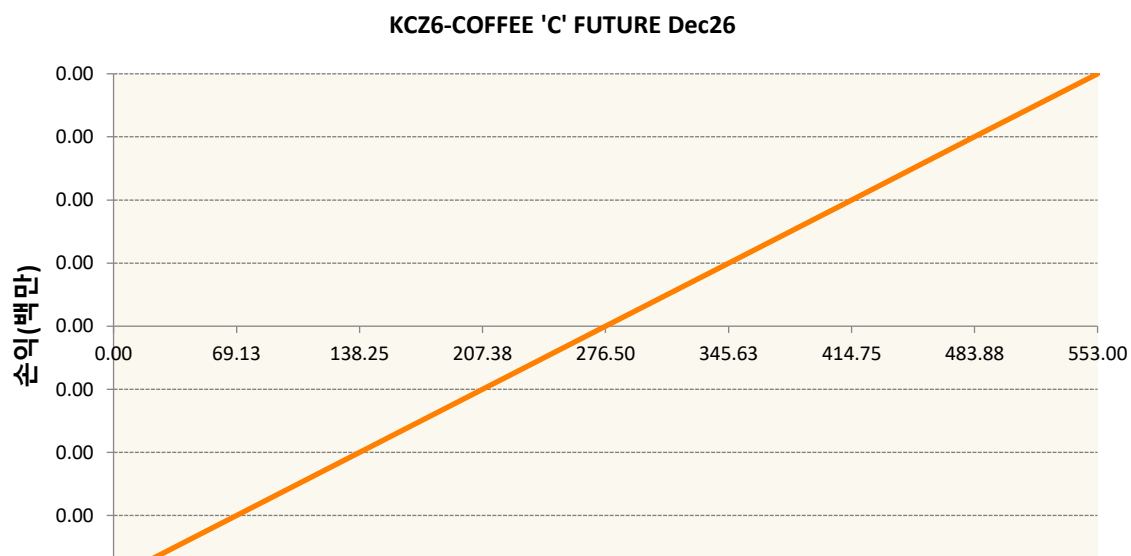
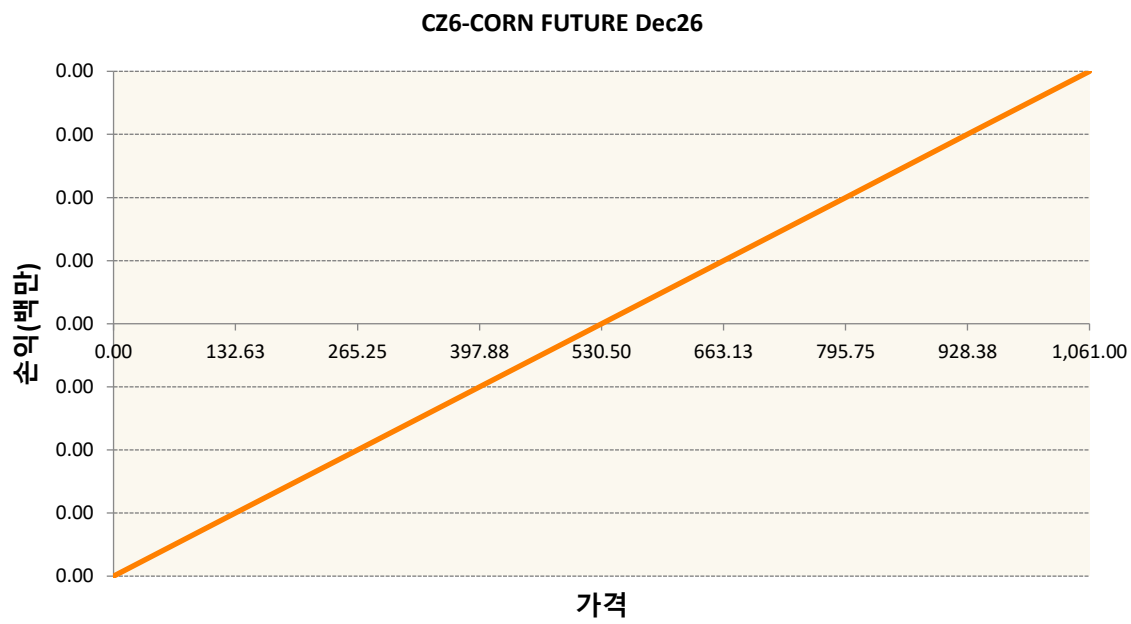
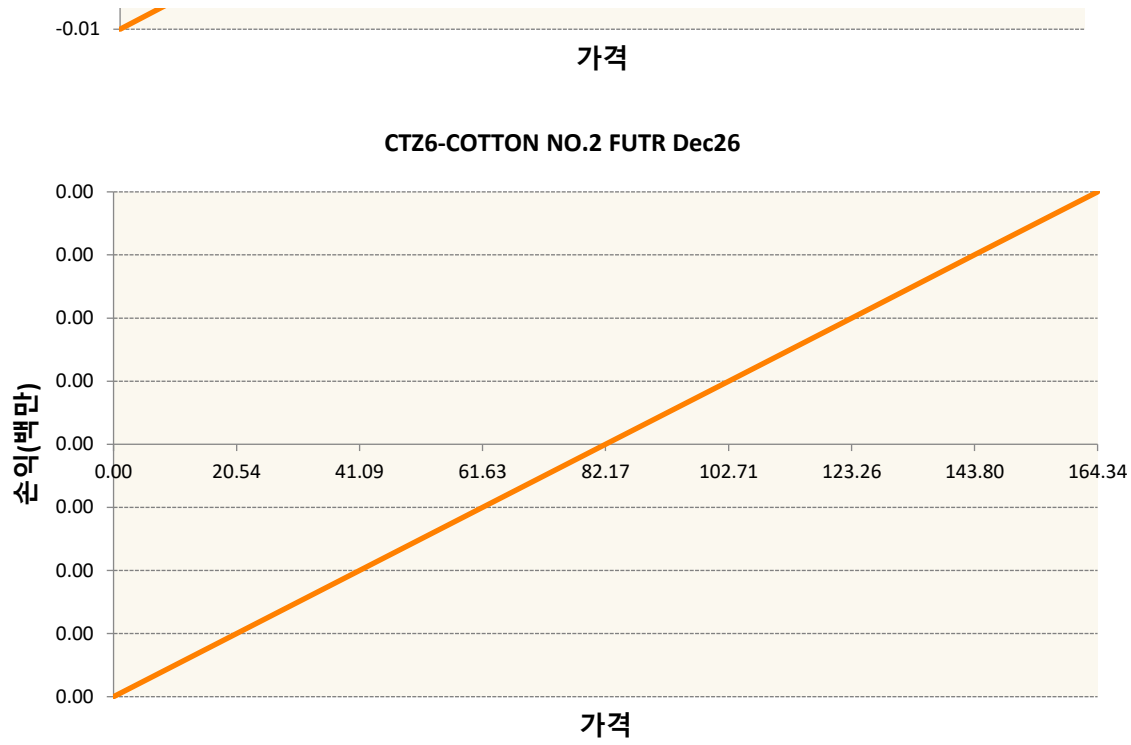
1. 계약금액

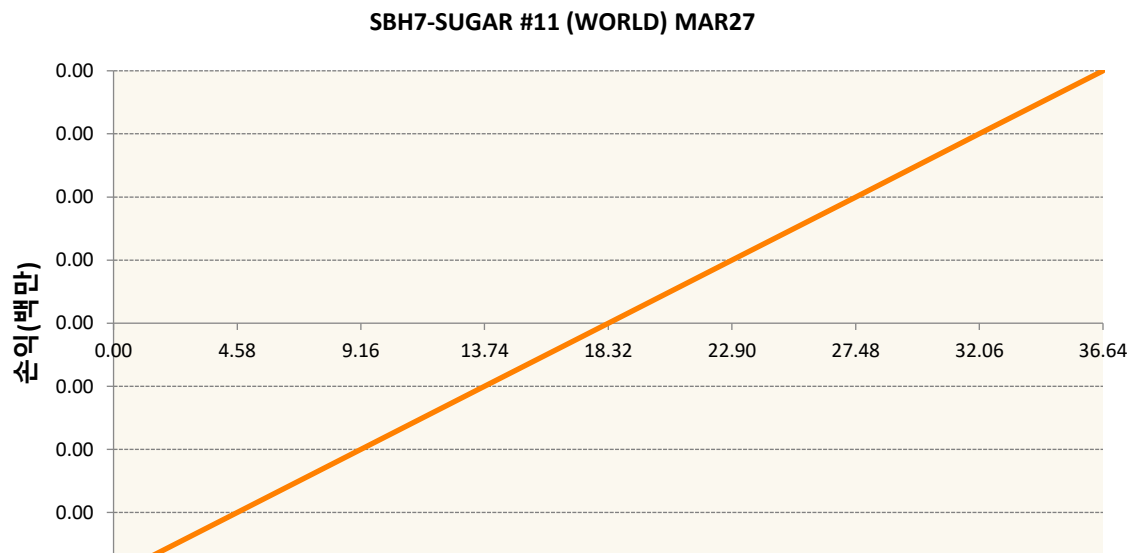
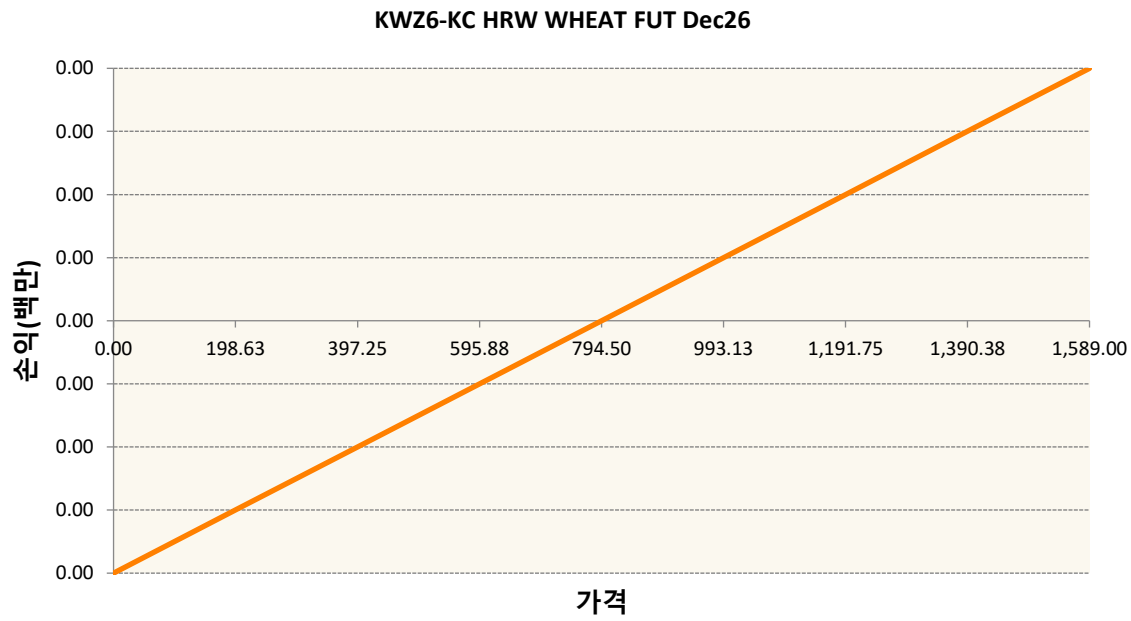
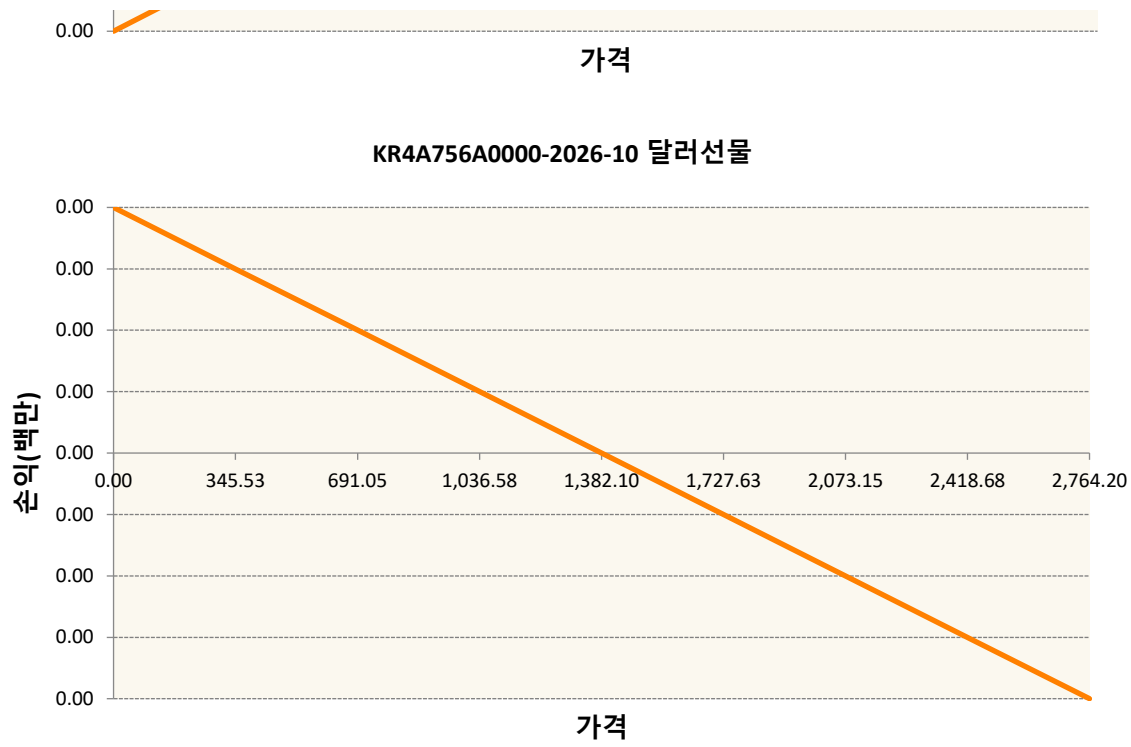
(단위:USD 백만)

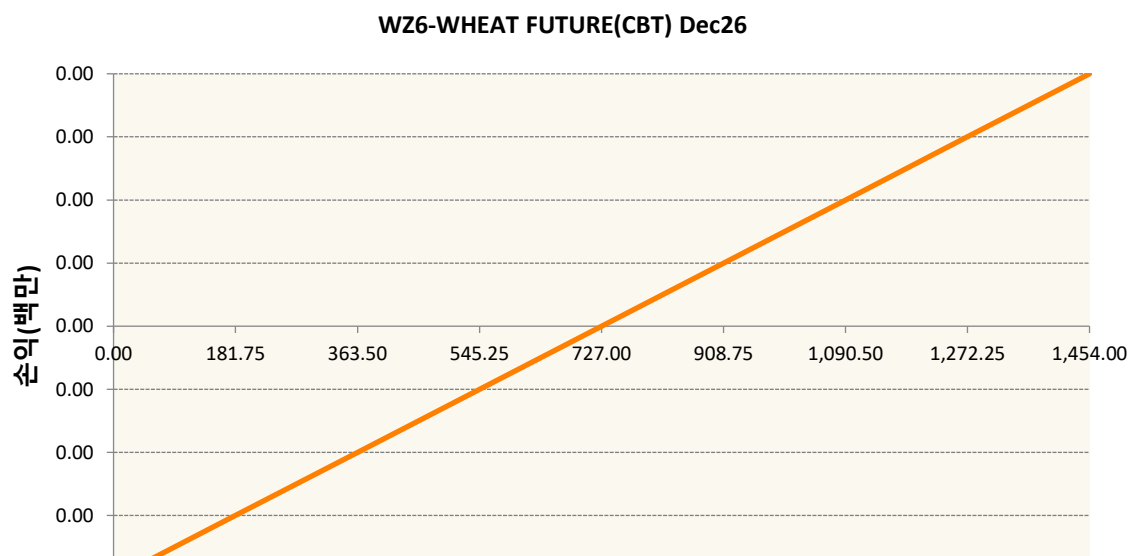
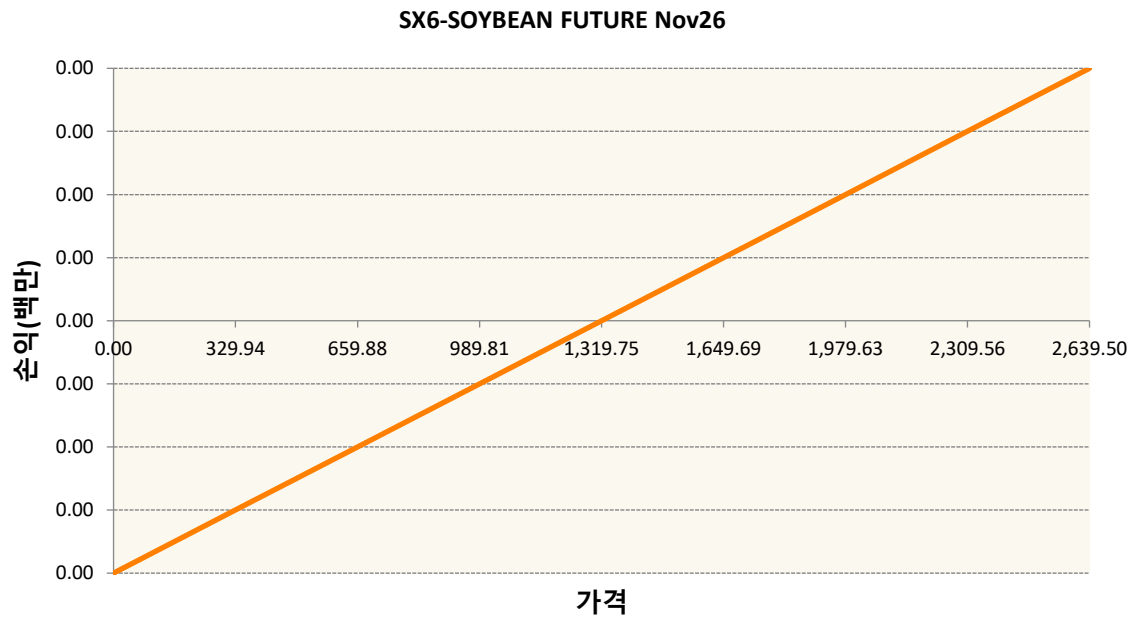
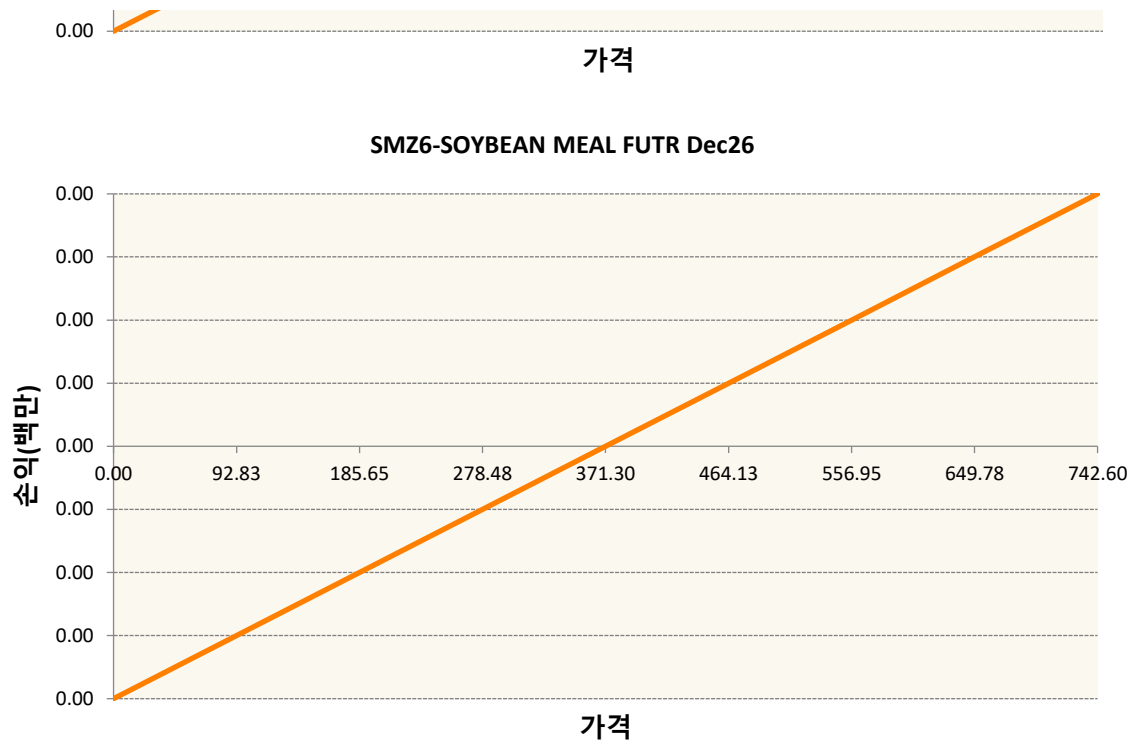
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	395	0	395	
누계	유가증권	선물	2,410	0	2,410	
누계	통화	선물	0	346	-346	장내

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	2026-09-21
기준일	2026-09-18

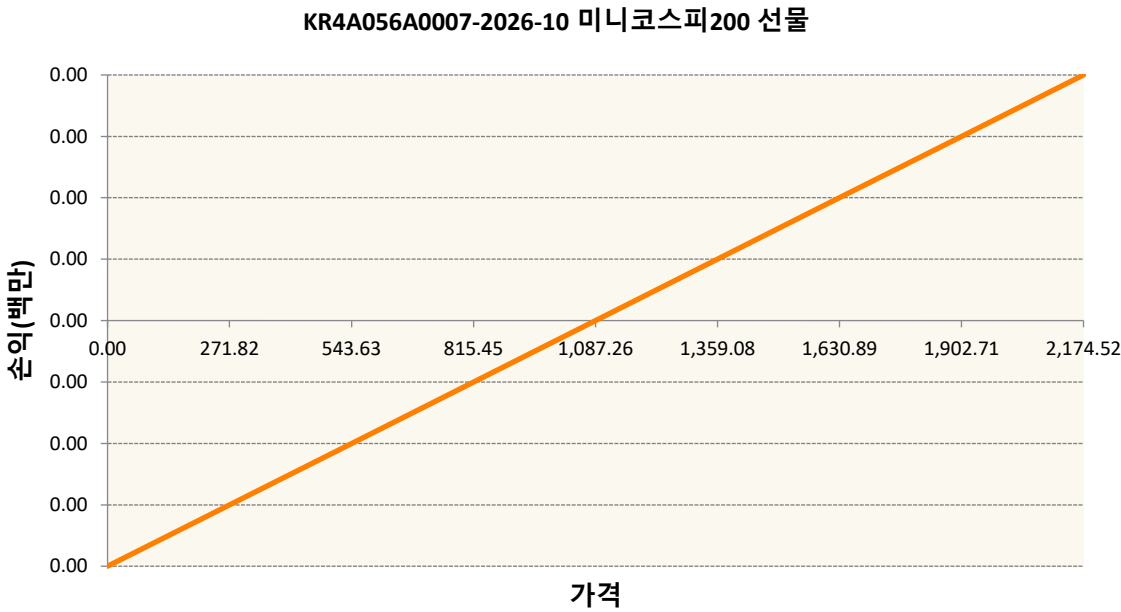
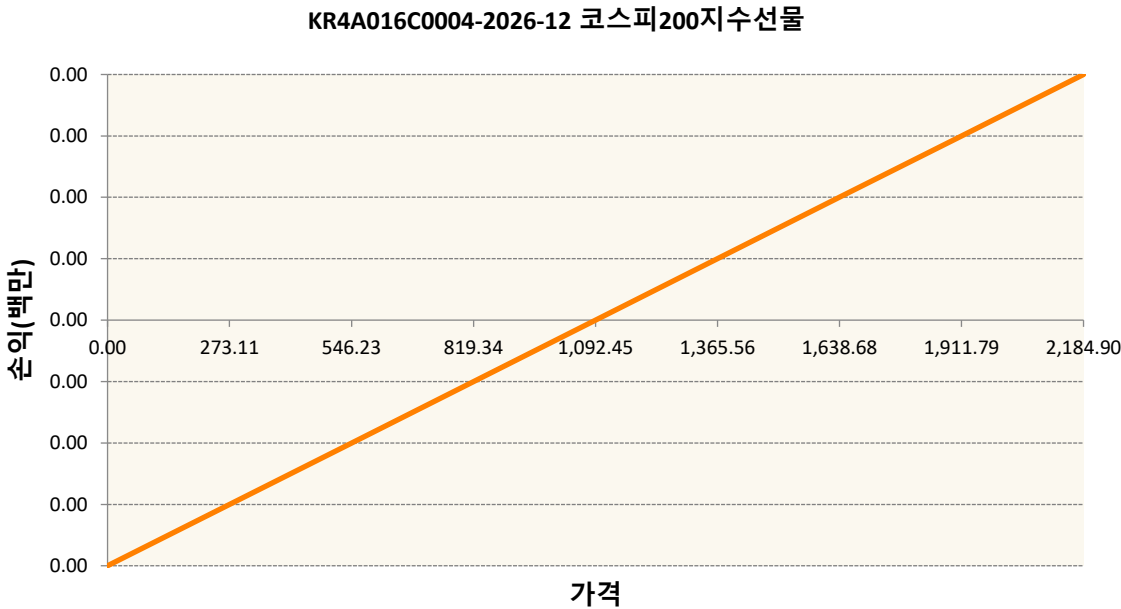
스마트인덱스모

1. 계약금액

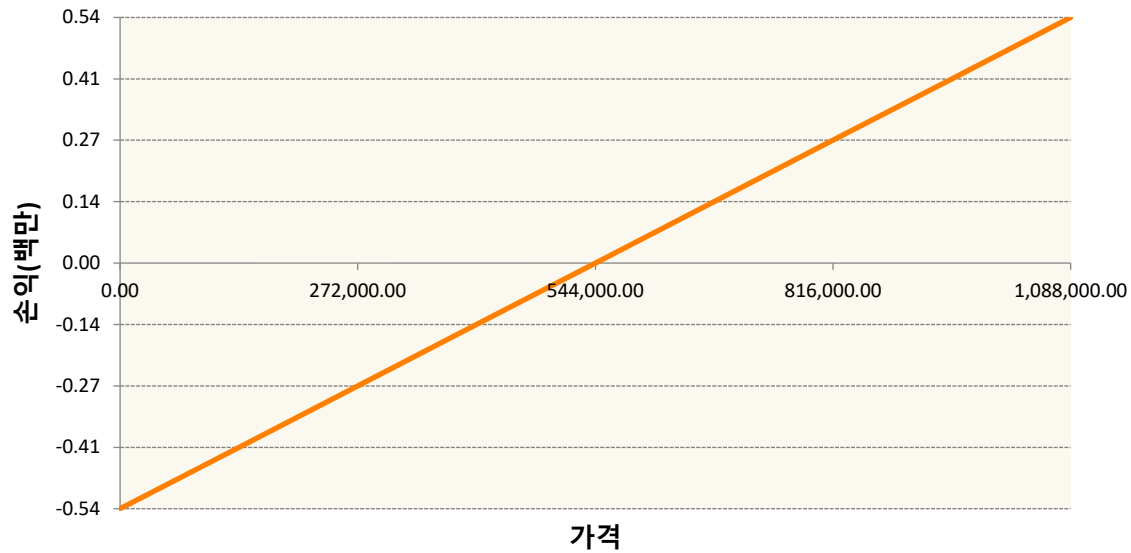
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	540	55	486	장내
누계	유가증권	선물	9,060	55	9,005	장내

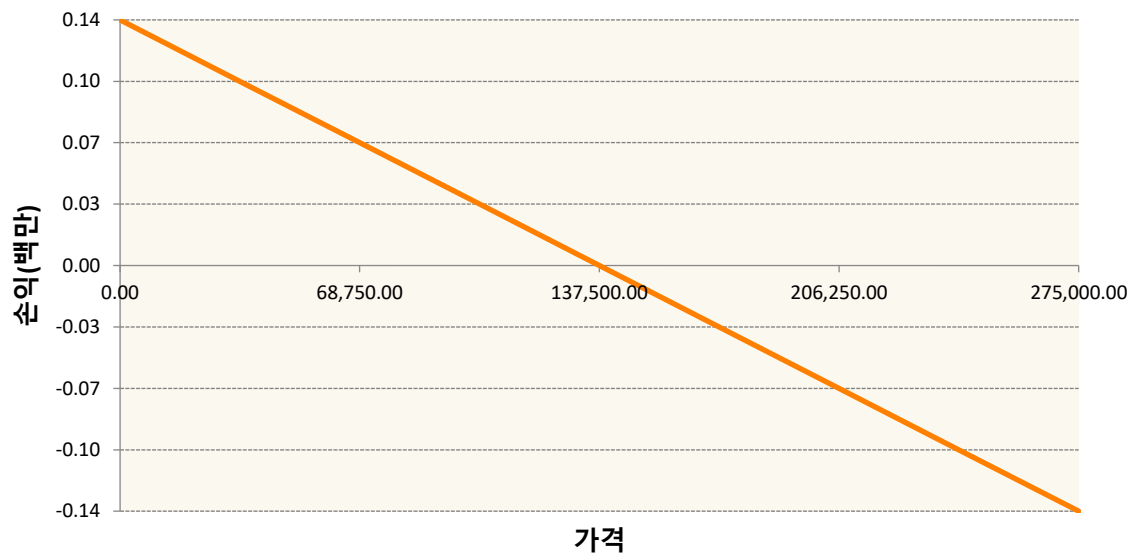
2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004			2026-12 코스피200지수선물				327
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
-5.33%	-218	-218	-218	-218	-218	-218	-218
-2.67%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	109	109	109	109	109	109	109
5.33%	218	218	218	218	218	218	218
8.00%	327	327	327	327	327	327	327
KR4A056A0007			2026-10 미니코스피200 선물				78
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	78	78	78	78	78	78	78
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

KR4A416A0002 2026-10 SK이노베이션개별선물							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)

1,389

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

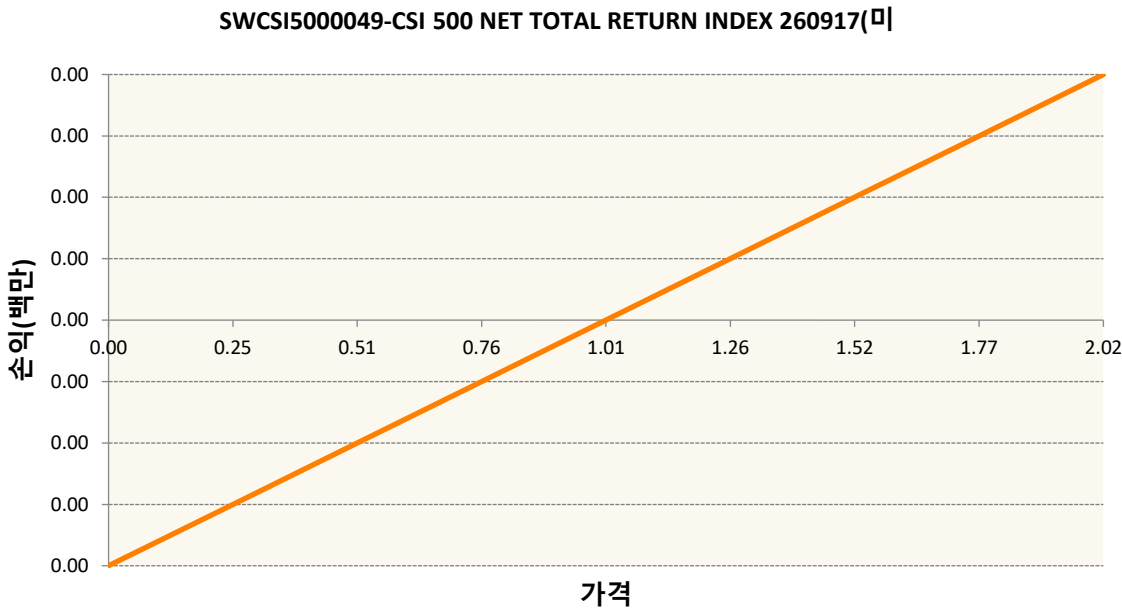
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,374	0	5,374	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미

431

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

677

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

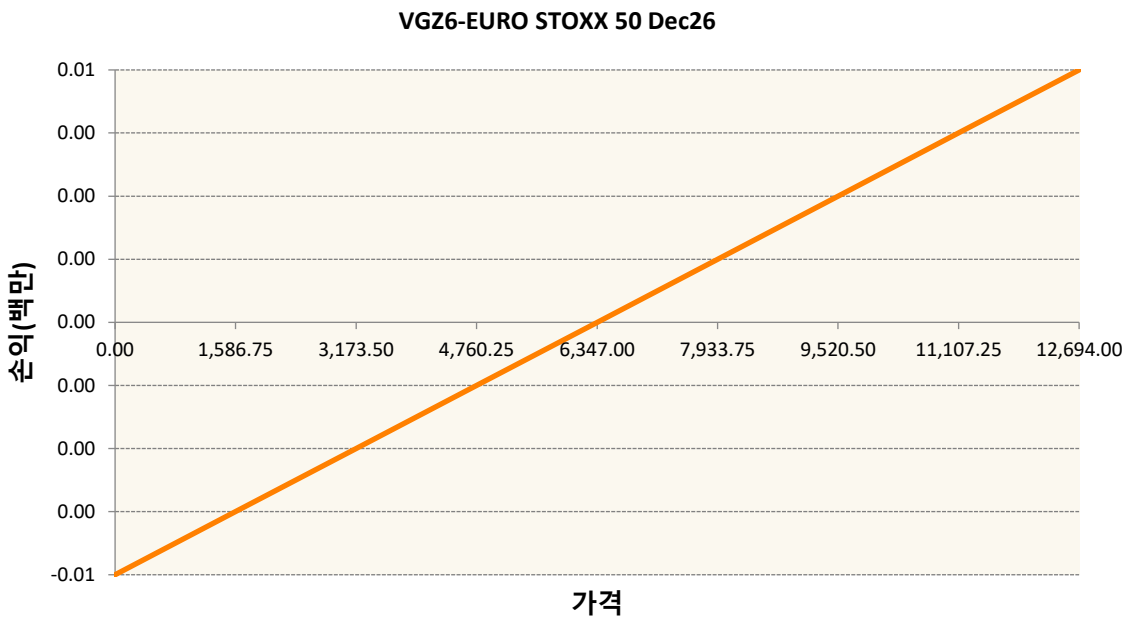
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,108	0	1,108	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

65

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

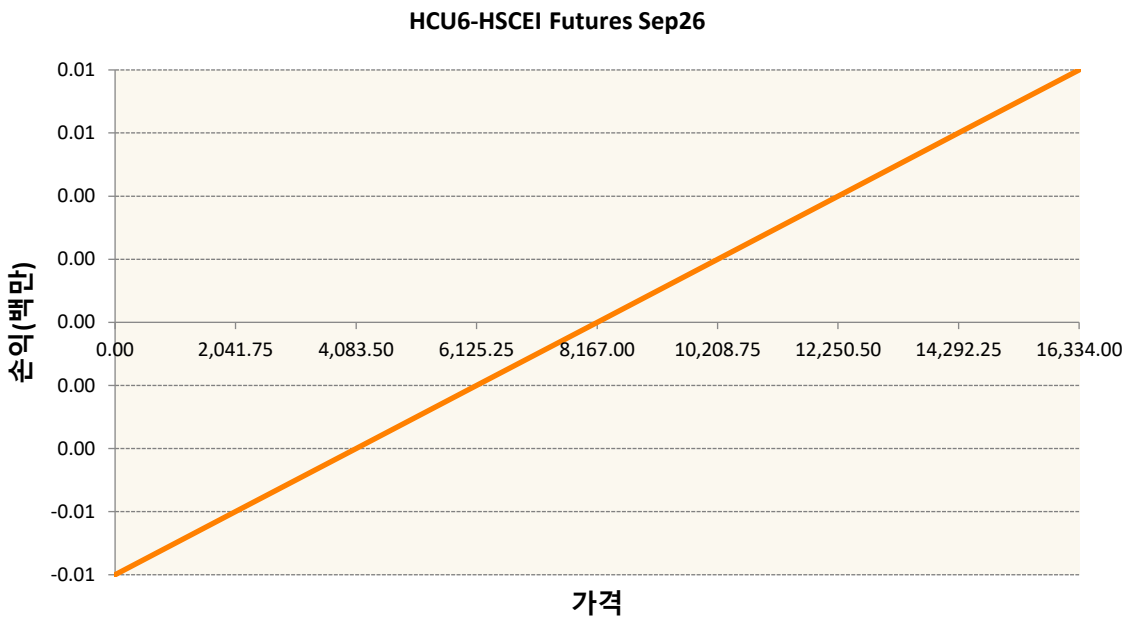
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,286	0	1,286	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	103
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

98

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

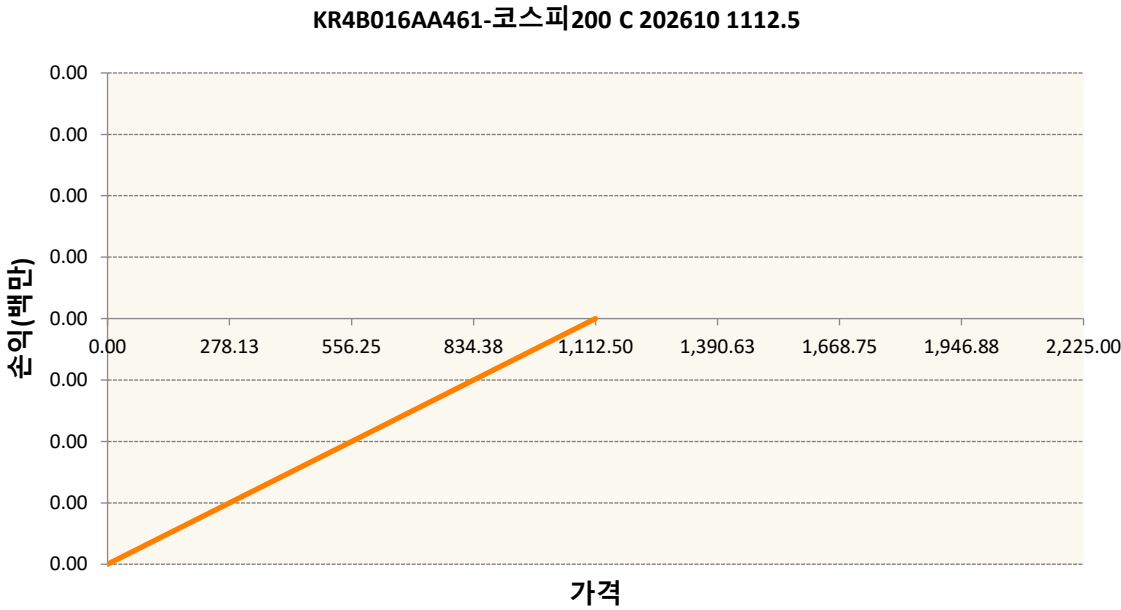
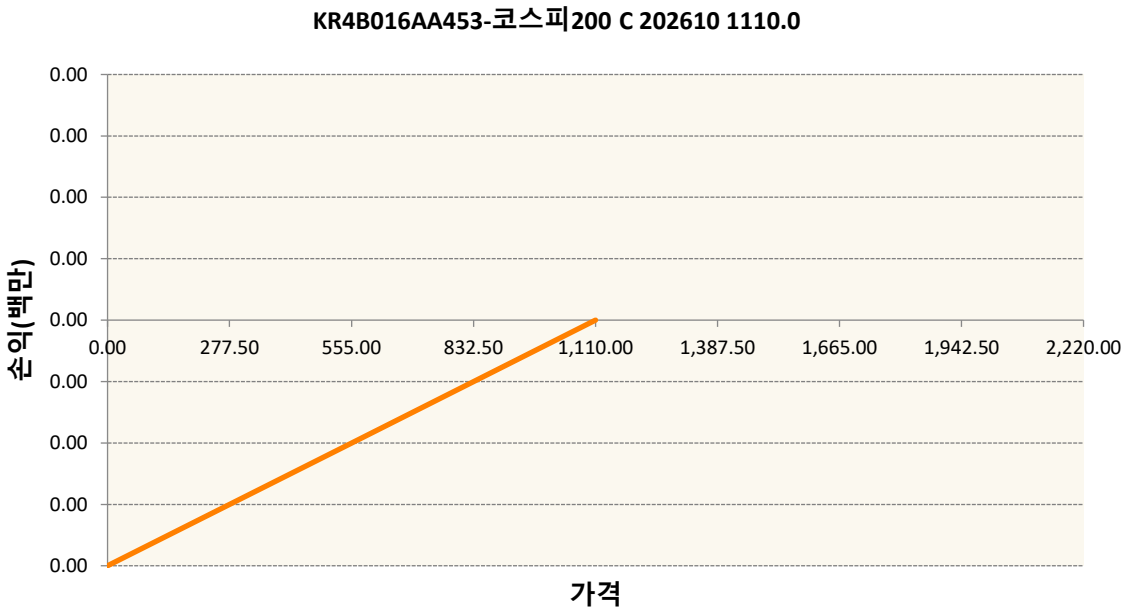
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

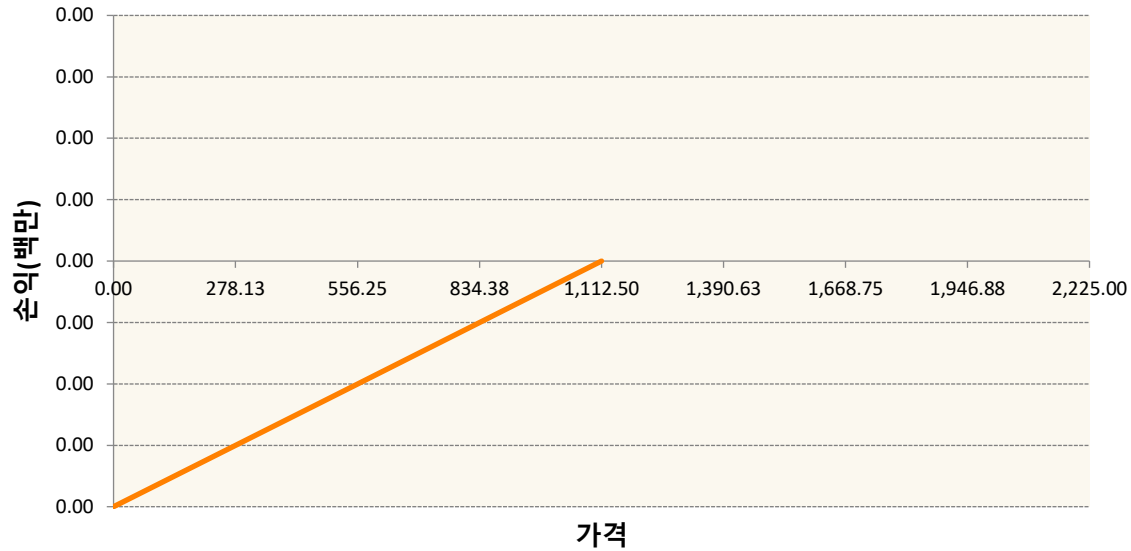
(단위:백만원)

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)

KR4B016AA453 코스피200 C 202610 1110.0							439
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-355	-365	-378	-392	-407	-422	-439
-5.33%	-192	-208	-226	-244	-262	-282	-302
-2.67%	-49	-70	-91	-112	-134	-157	-179
0%	71	48	24	0	-24	-48	-72
2.67%	166	142	117	93	69	44	20
5.33%	236	213	190	167	144	120	96
8.00%	284	265	245	224	203	181	158
KR4B016AA461 코스피200 C 202610 1112.5							1,958
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,592	-1,638	-1,691	-1,751	-1,816	-1,885	-1,958
-5.33%	-869	-938	-1,012	-1,091	-1,173	-1,258	-1,345
-2.67%	-227	-317	-410	-504	-601	-698	-797
0%	314	210	105	0	-106	-211	-317
2.67%	743	635	527	419	310	202	94
5.33%	1,061	960	857	753	649	543	437
8.00%	1,281	1,195	1,105	1,012	916	818	718
KR4C016AA460 코스피200 P 202610 1112.5							562
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-457	-470	-485	-502	-521	-541	-562
-5.33%	-249	-269	-291	-313	-337	-361	-386
-2.67%	-65	-91	-118	-145	-172	-200	-229
0%	90	60	30	0	-30	-61	-91

2.67%	213	182	151	120	89	58	27
5.33%	304	275	246	216	186	156	125
8.00%	368	343	317	290	263	235	206

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

4,768

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

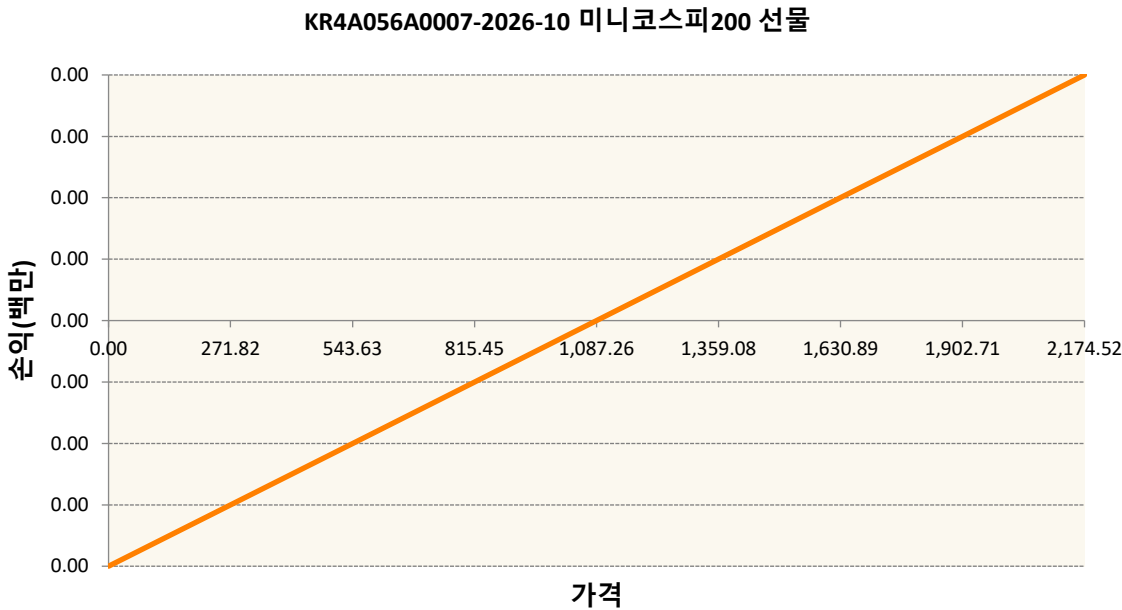
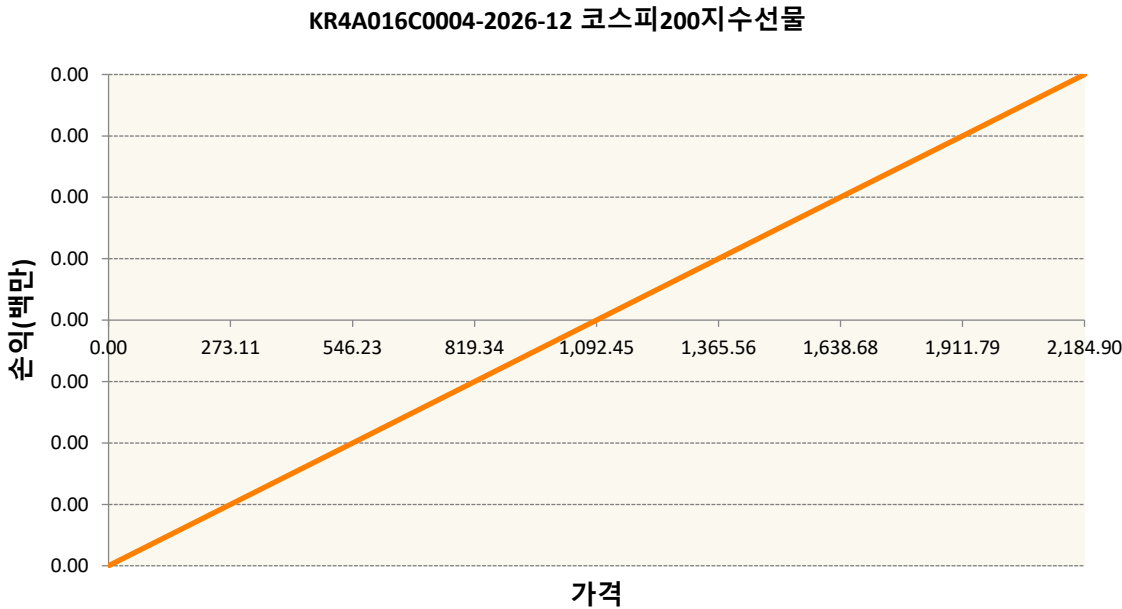
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

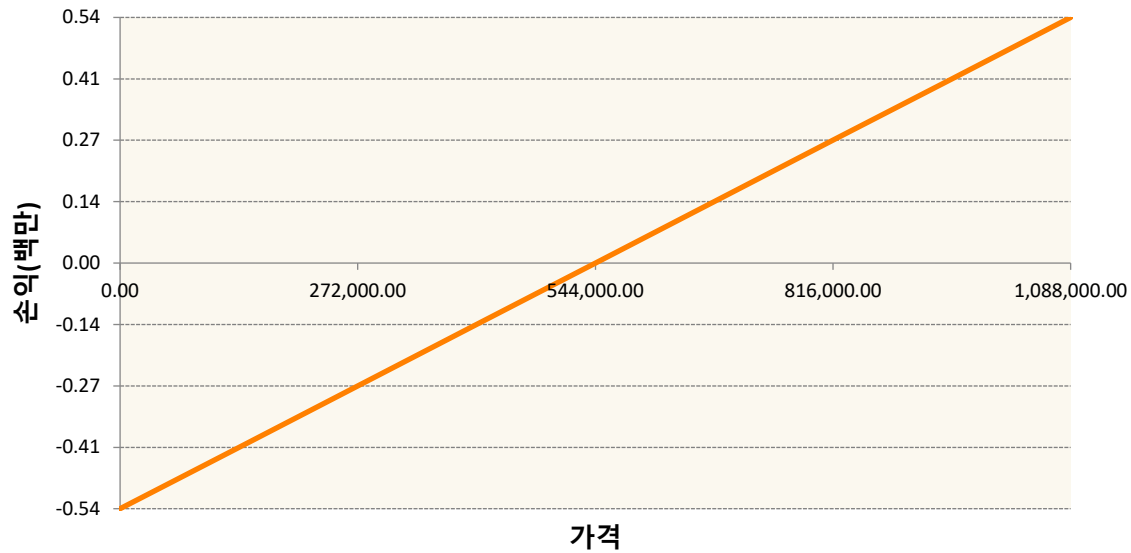
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	270	55	215	장내
누계	유가증권	선물	2,505	55	2,450	장내

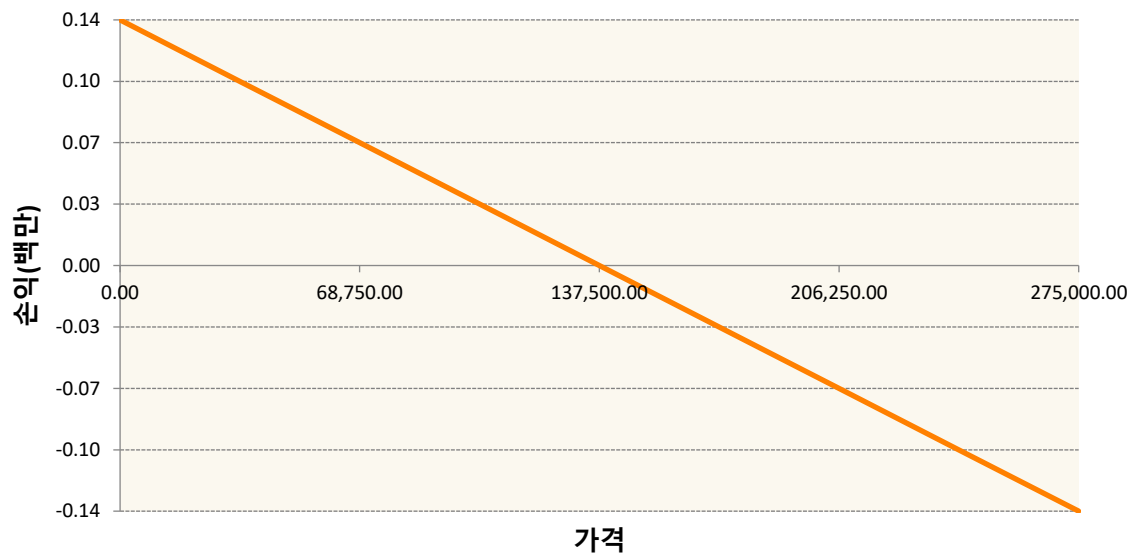
2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물					65
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-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%	65	65	65	65	65	65	65
KR4A056A0007		2026-10 미니코스피200 선물					26
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	26	26	26	26	26	26	26
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

KR4A416A0002 2026-10 SK이노베이션개별선물							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)

324

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

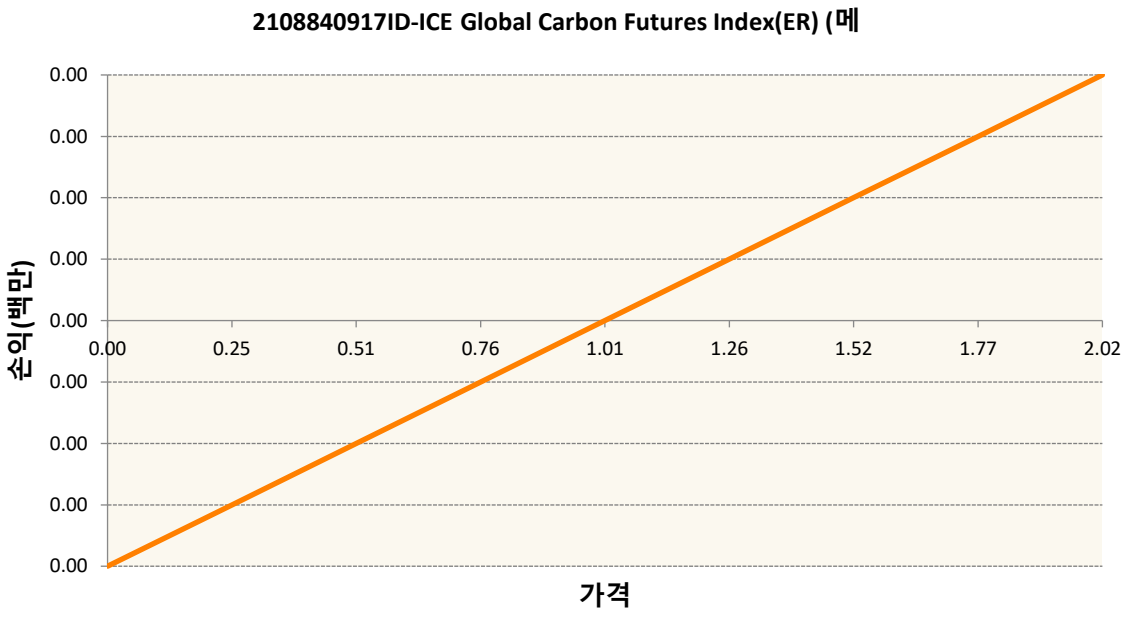
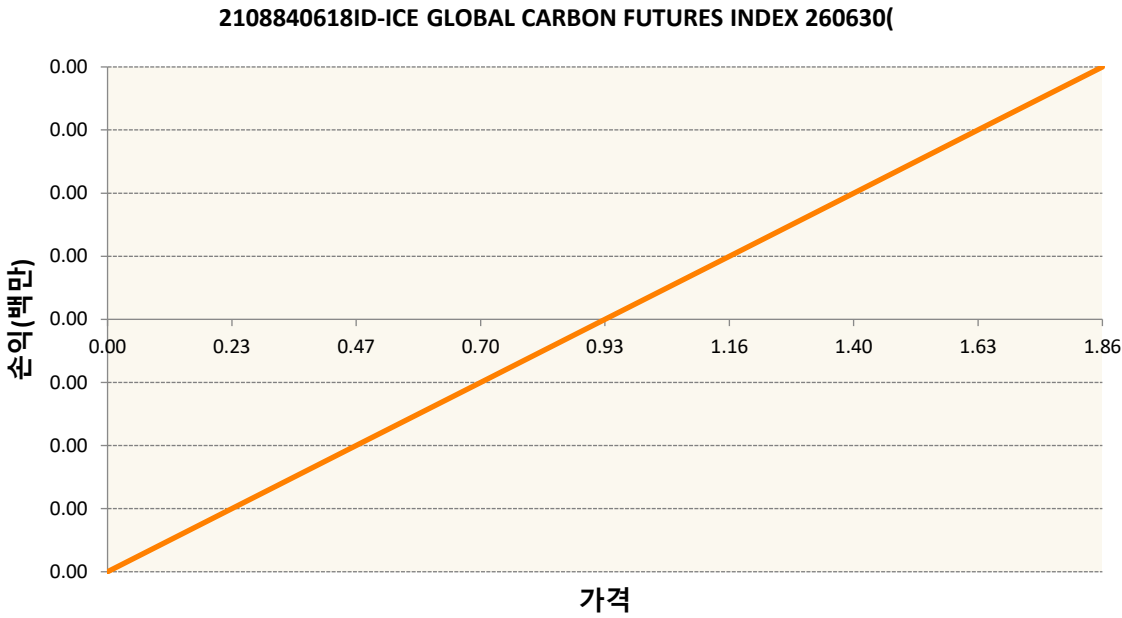
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,090	0	7,090	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		454
2108840917IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		115

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	601

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

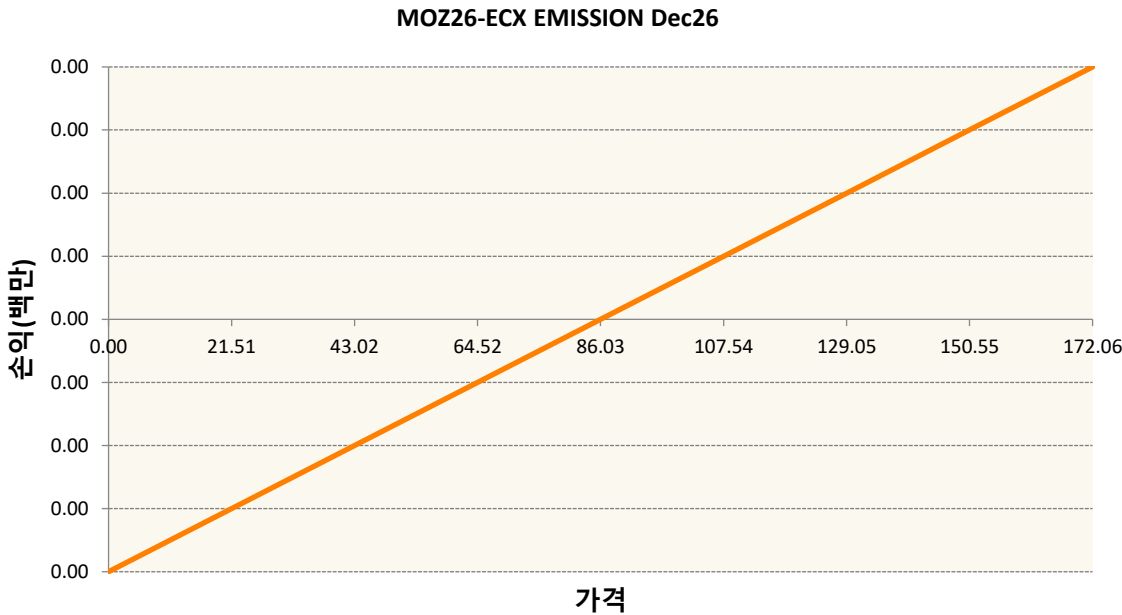
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,086	0	6,086	
누계	통화	선도	0	2,637	-2,637	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\KRW/EUR 30-09-26E	211
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	487

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

(단위:백만원)

750

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

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	-2,240	0	-2,240	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)

285

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

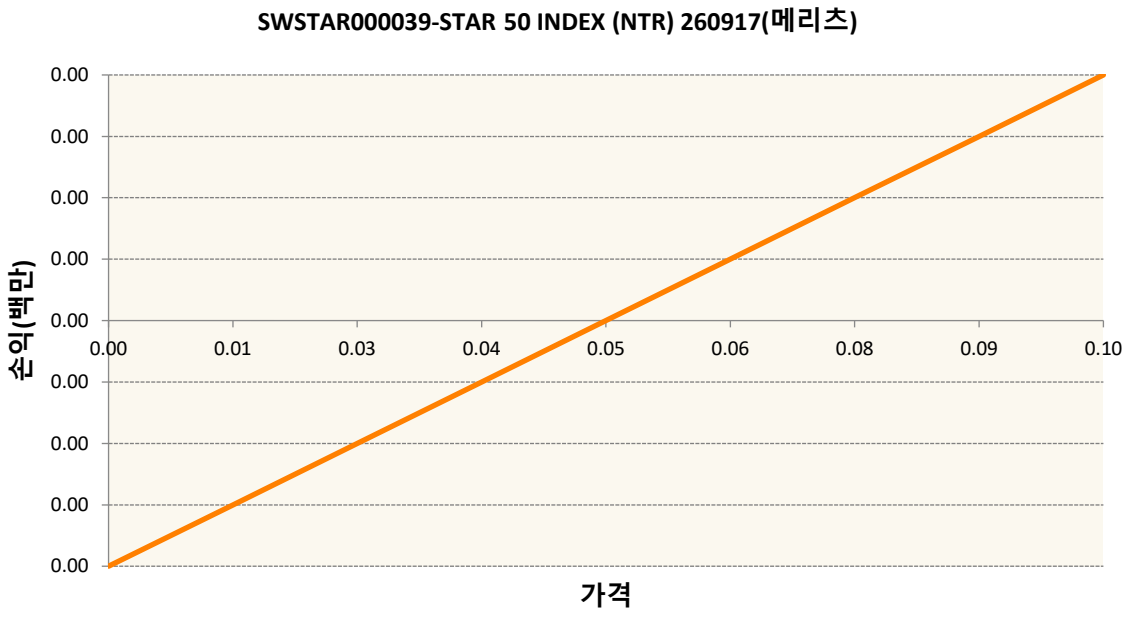
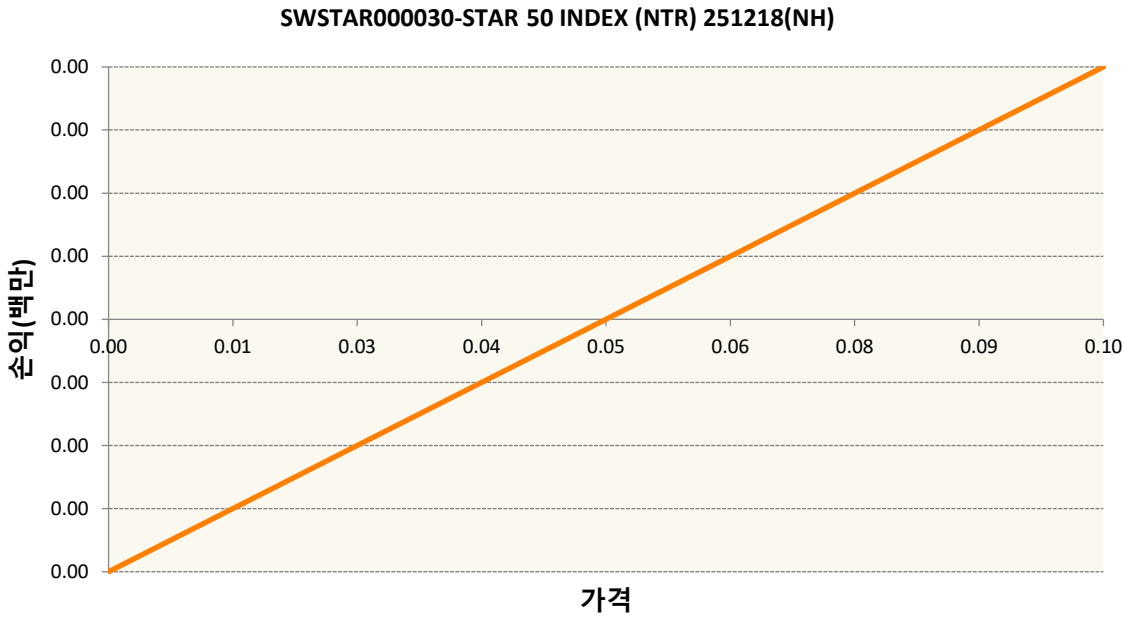
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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)		13
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)		209
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)		27

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	471

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

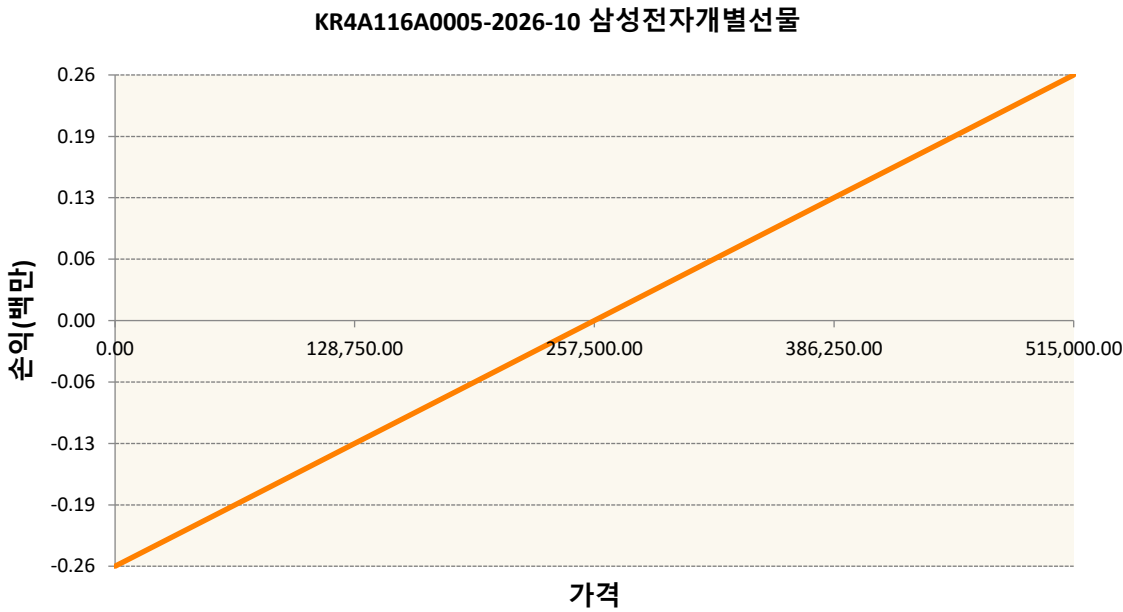
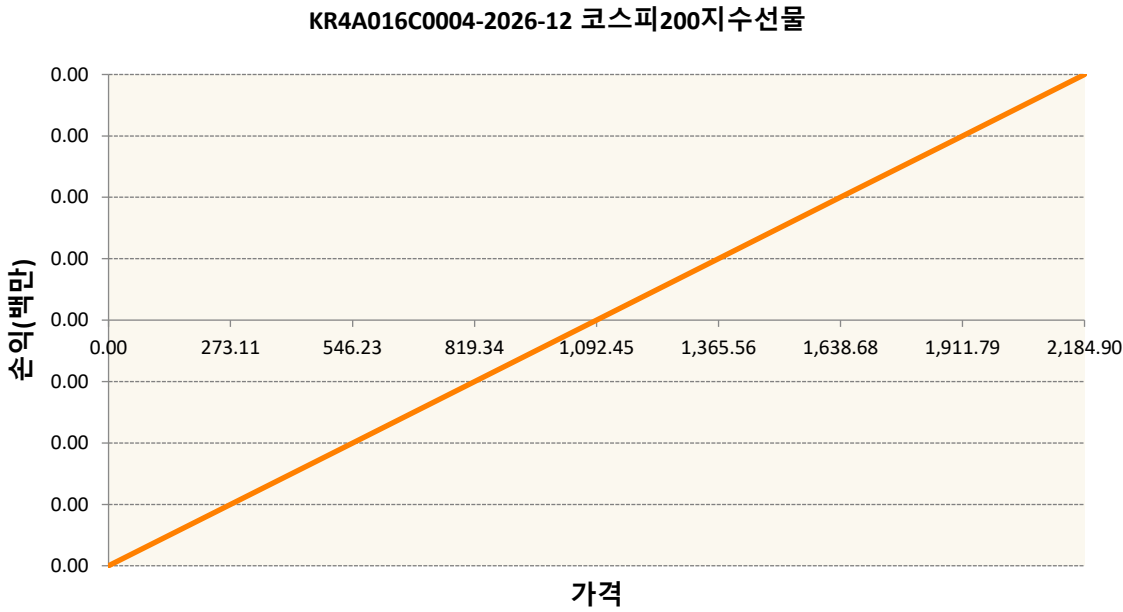
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

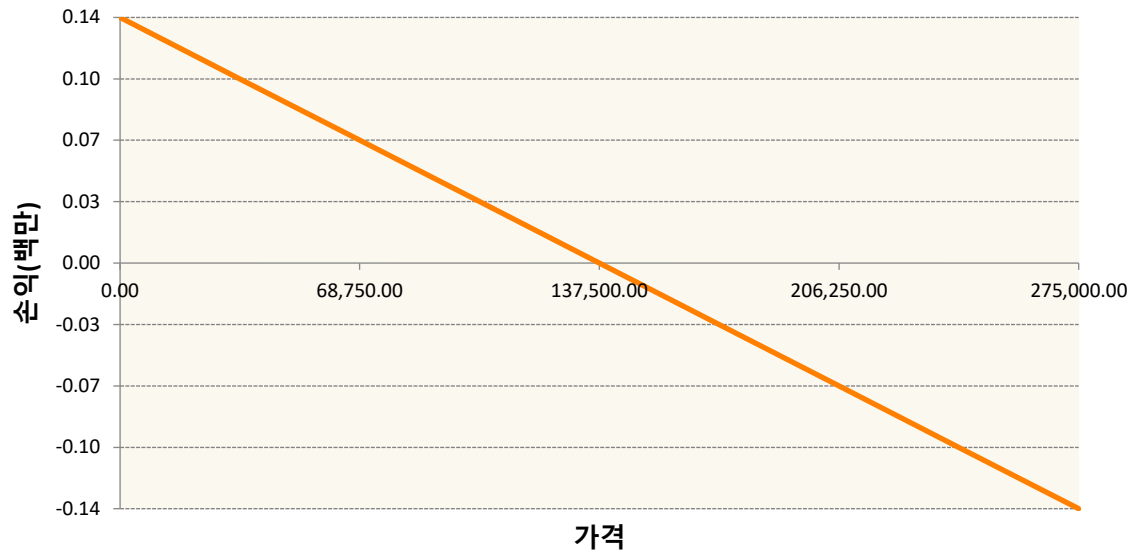
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	271	278	-6	장내
누계	유가증권	선물	17,768	279	17,489	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물						1,156
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,156	-1,156	-1,156	-1,156	-1,156	-1,156	-1,156	
-5.33%	-770	-770	-770	-770	-770	-770	-770	
-2.67%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	385	385	385	385	385	385	385	
5.33%	770	770	770	770	770	770	770	
8.00%	1,156	1,156	1,156	1,156	1,156	1,156	1,156	
KR4A116A0005		2026-10 삼성전자개별선물						267
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267	
-5.33%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178	
-2.67%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	89	89	89	89	89	89	89	
5.33%	178	178	178	178	178	178	178	
8.00%	267	267	267	267	267	267	267	
KR4A416A0002		2026-10 SK이노베이션개별선물						22
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22	
-5.33%	15	15	15	15	15	15	15	
-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%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)						(단위:백만원)
						5,020

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

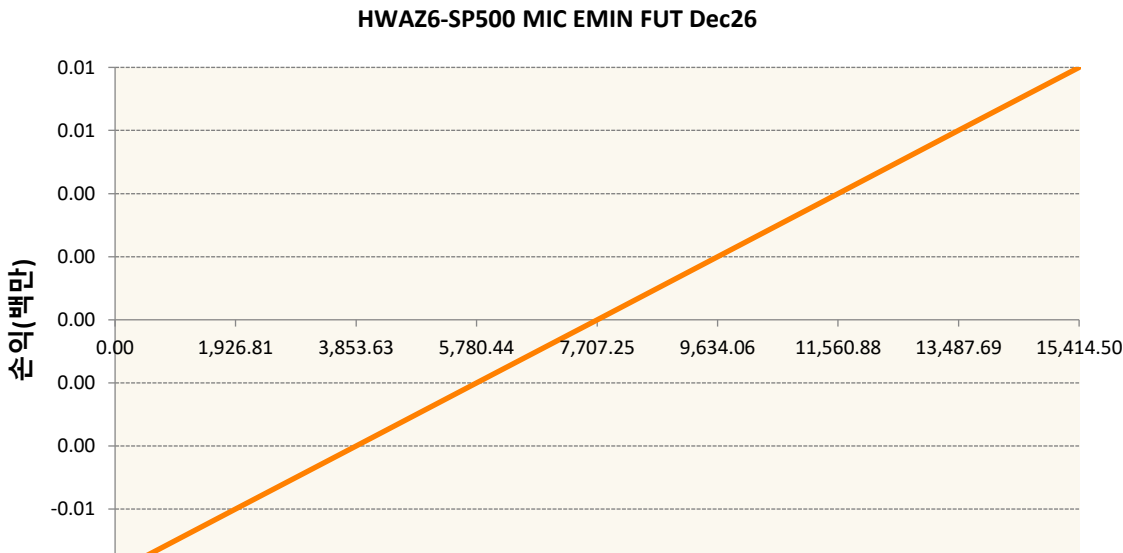
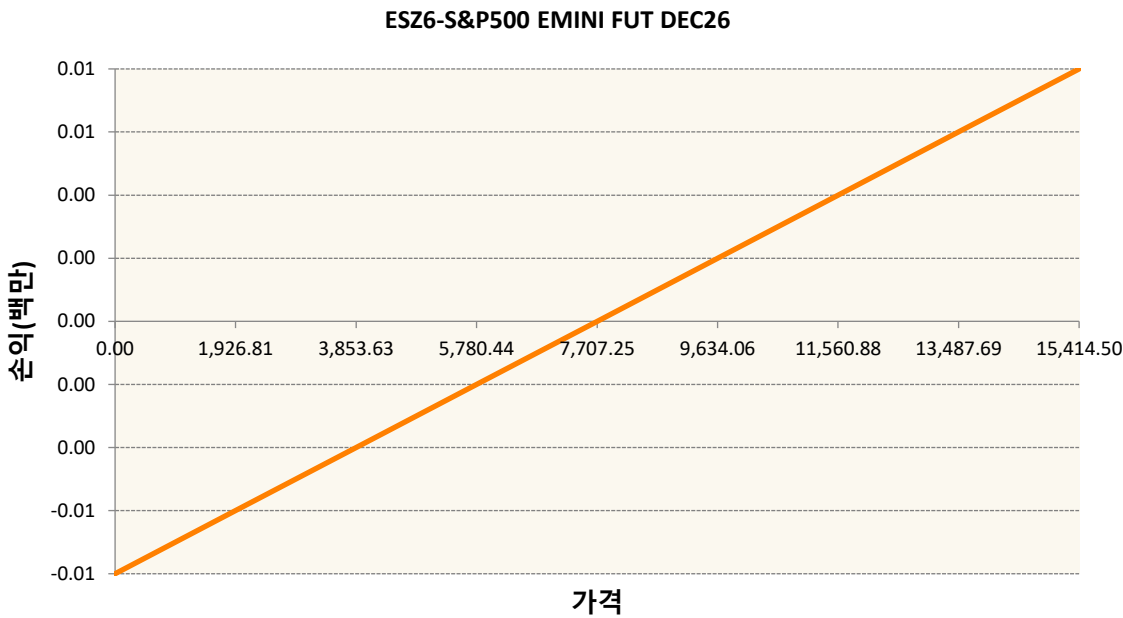
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

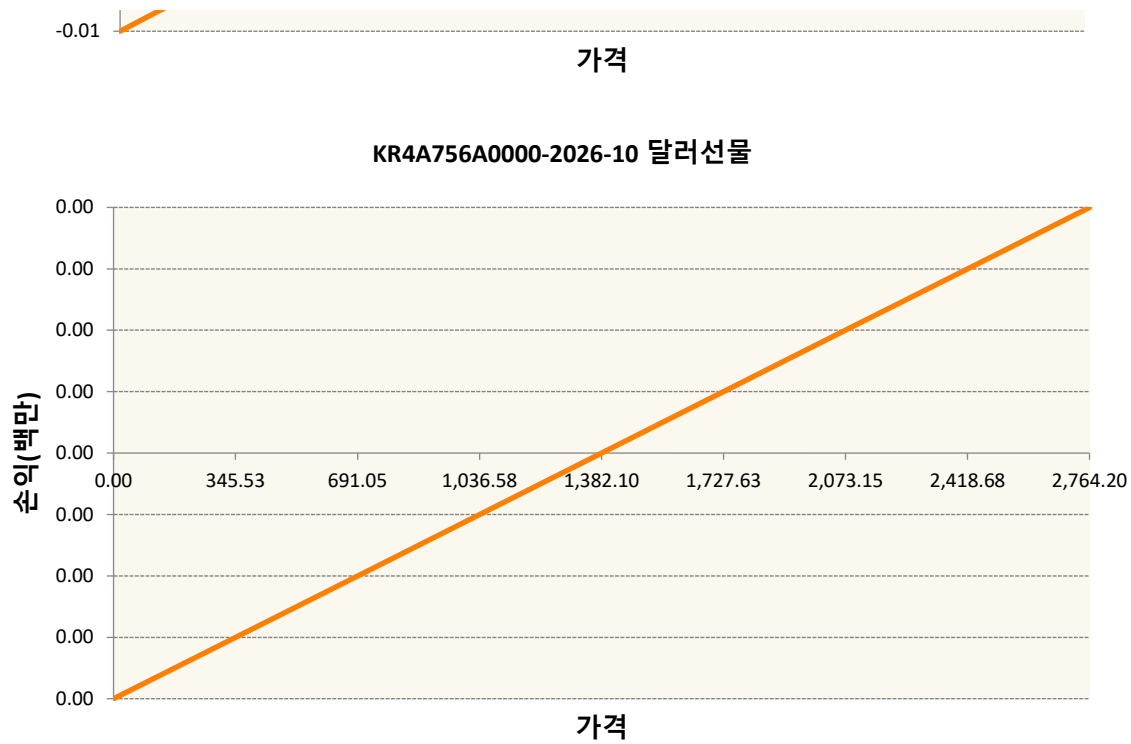
1. 계약금액

(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	72,973	0	72,973	
누계	지수	선물	373	0	373	장내
누계	통화	선물	11,886	0	11,886	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	5,838
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	951

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

3,745

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

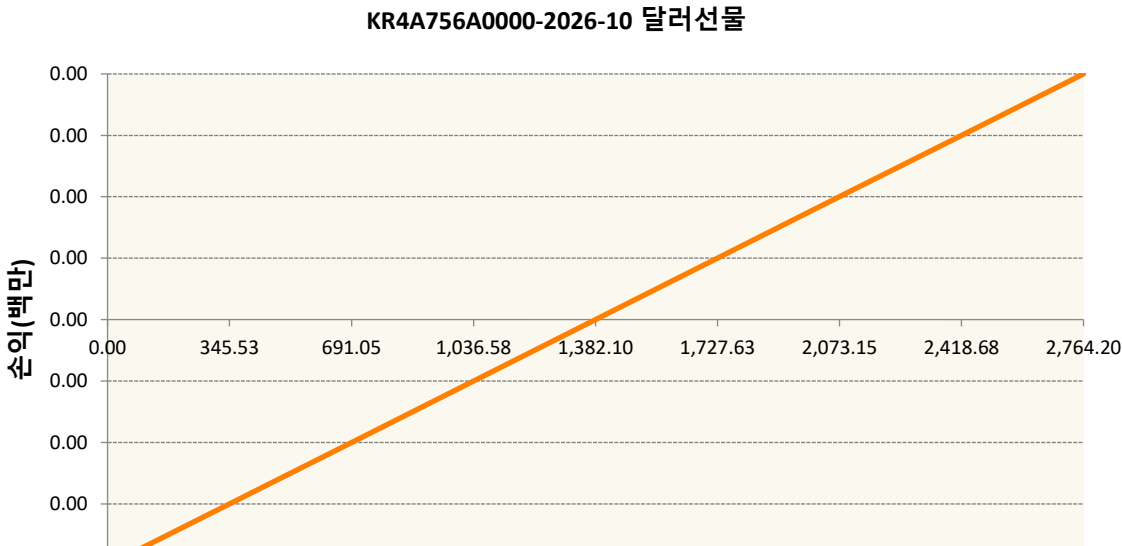
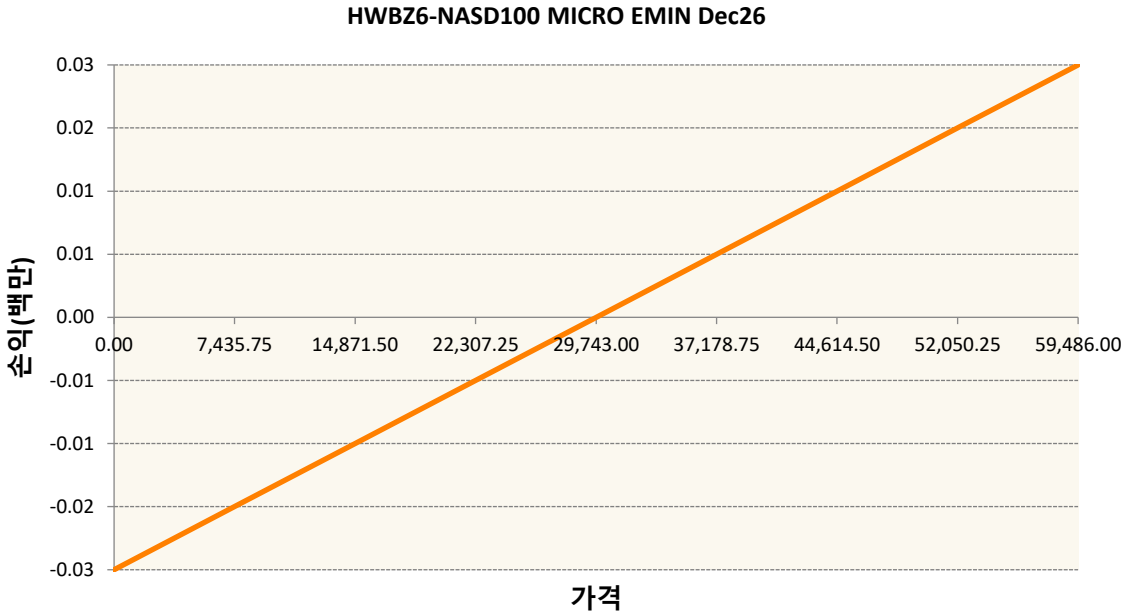
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

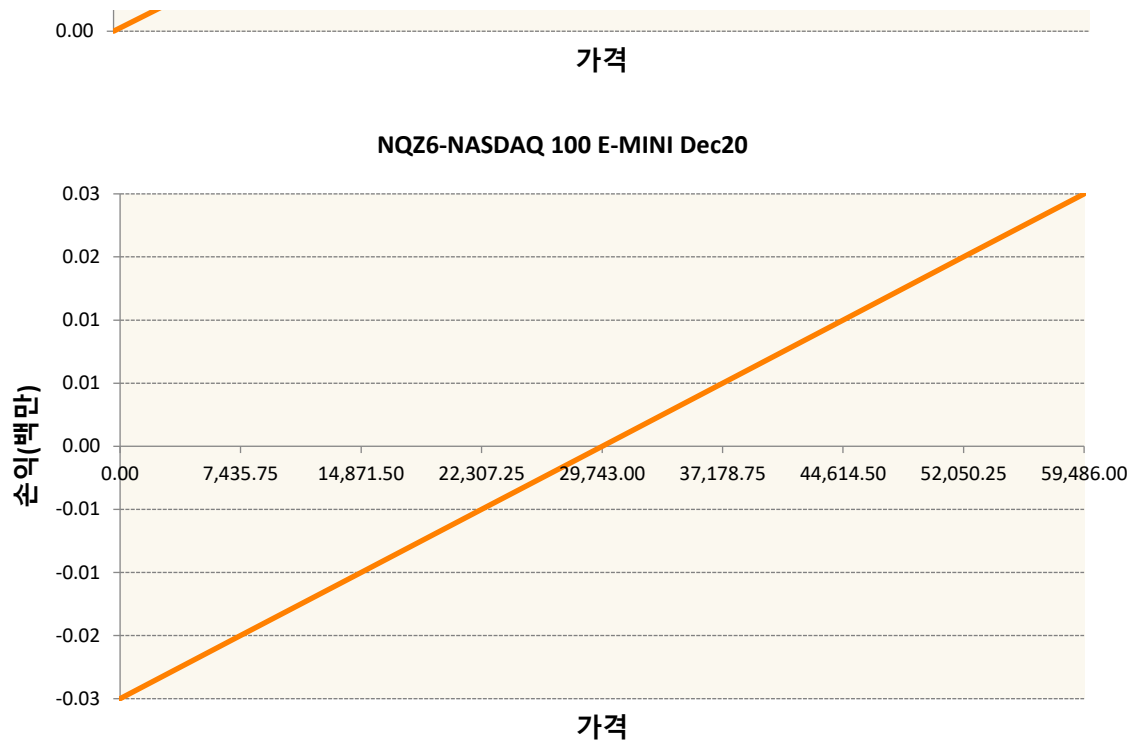
1. 계약금액

(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	35,355	0	35,355	
누계	지수	선물	411	0	411	장내
누계	통화	선물	5,542	0	5,542	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	33
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	443
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,828

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

2,604

공시일	2026-09-21
기준일	2026-09-18

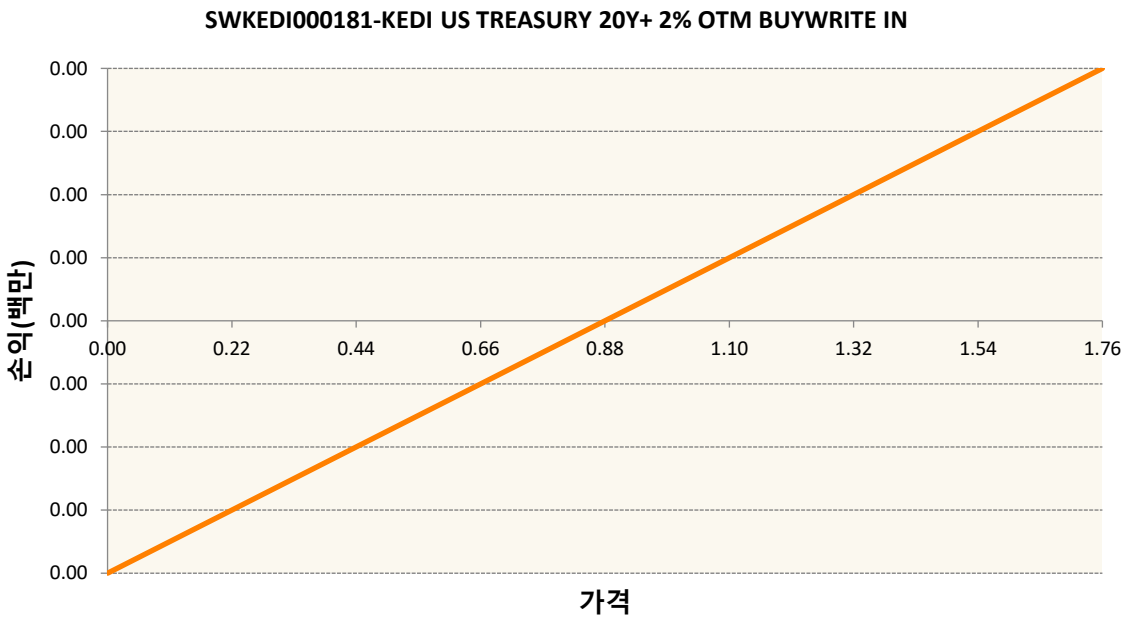
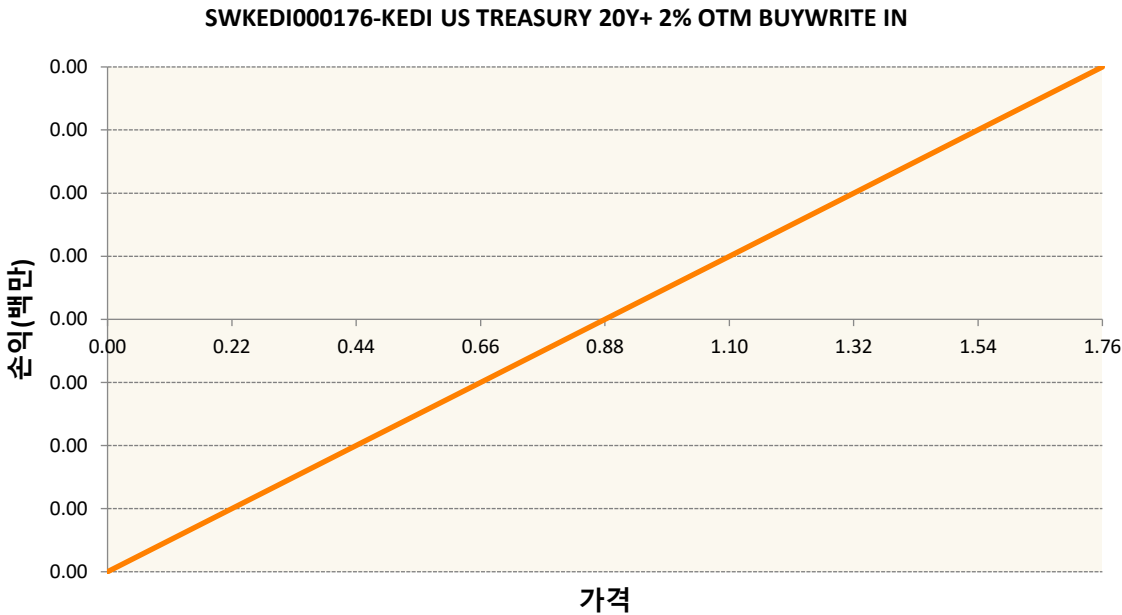
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

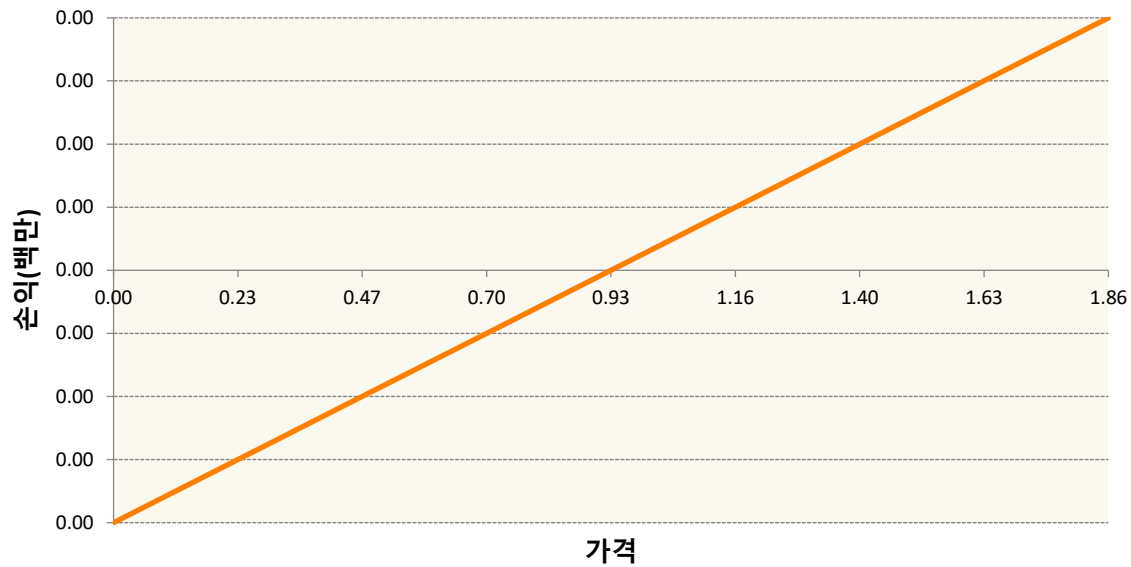
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	278,455	0	278,455	장외

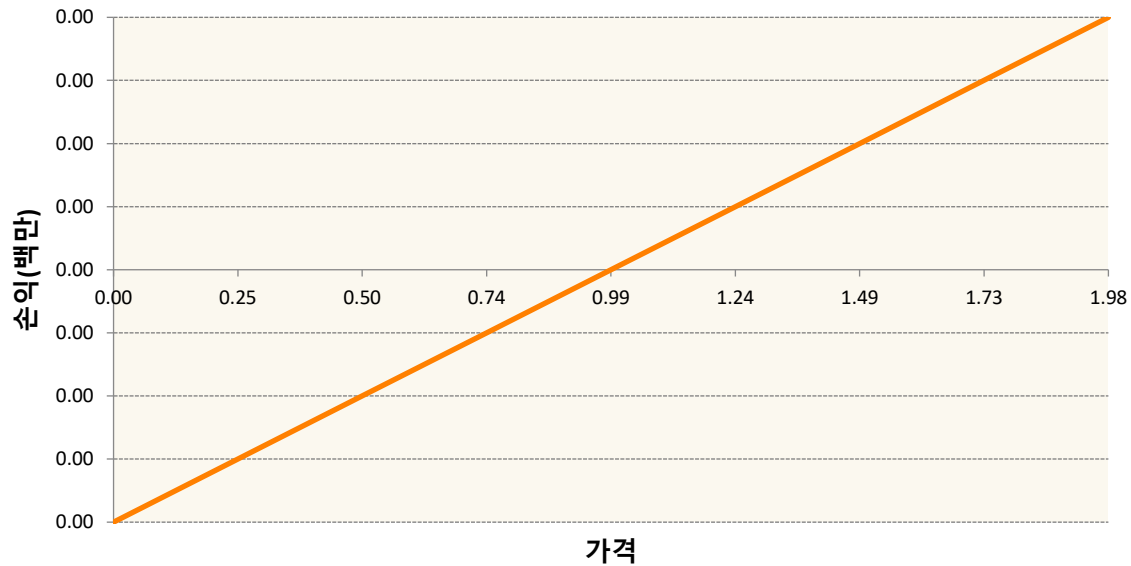
2. 만기시점의 손익구조



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	7,182
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,819
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,301
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,022

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

(단위:백만원)

8,897
