

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

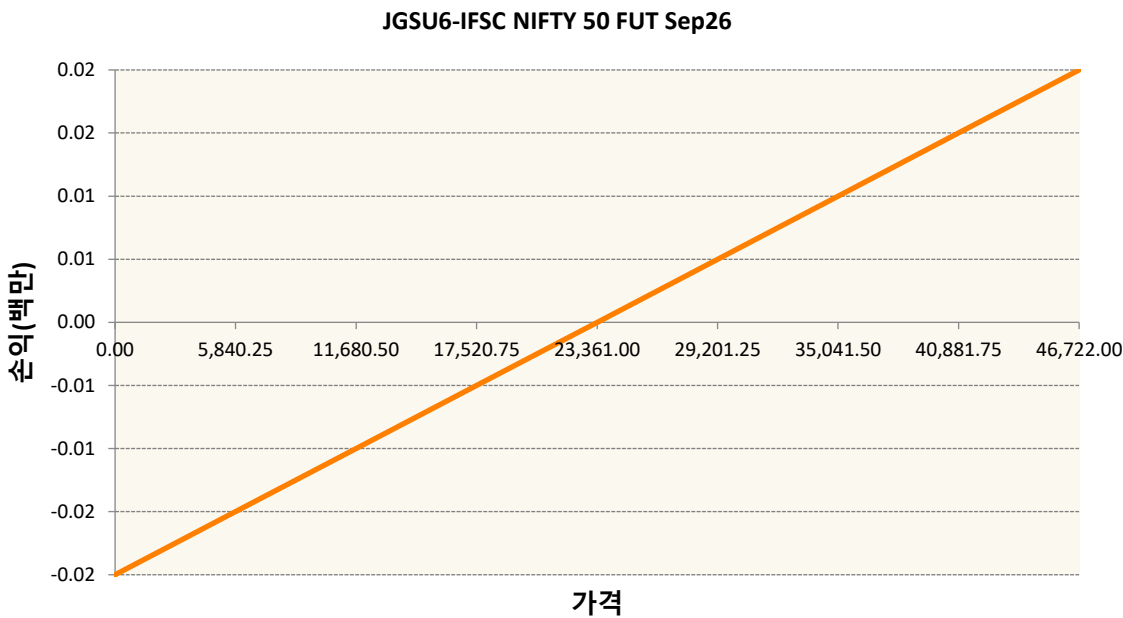
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-09-22
기준일	2026-09-21

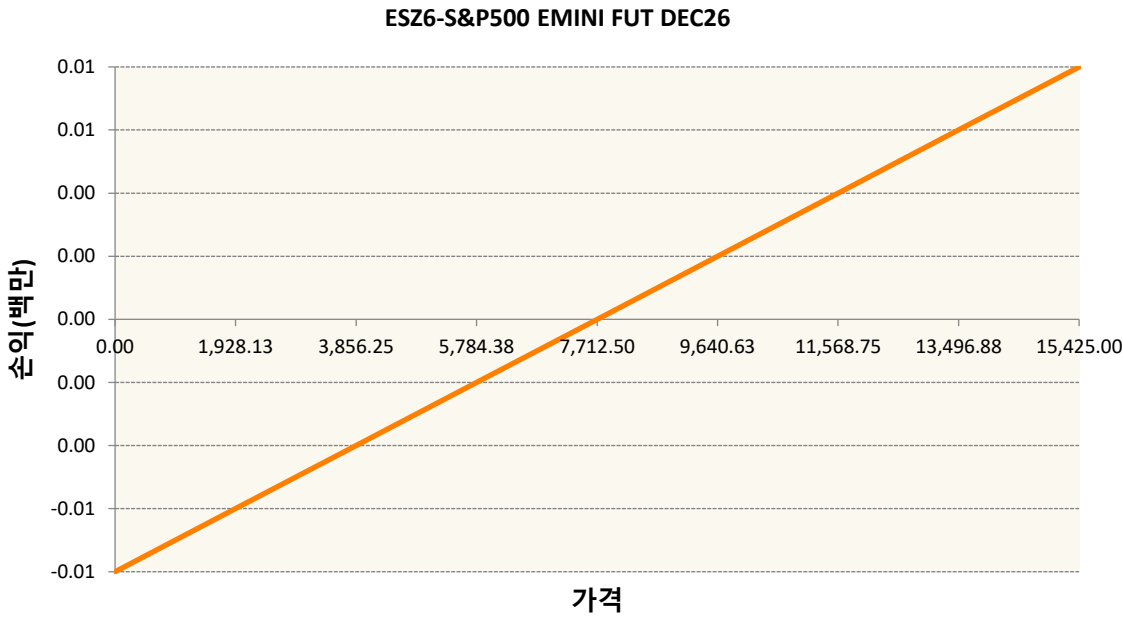
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-09-22
기준일	2026-09-21

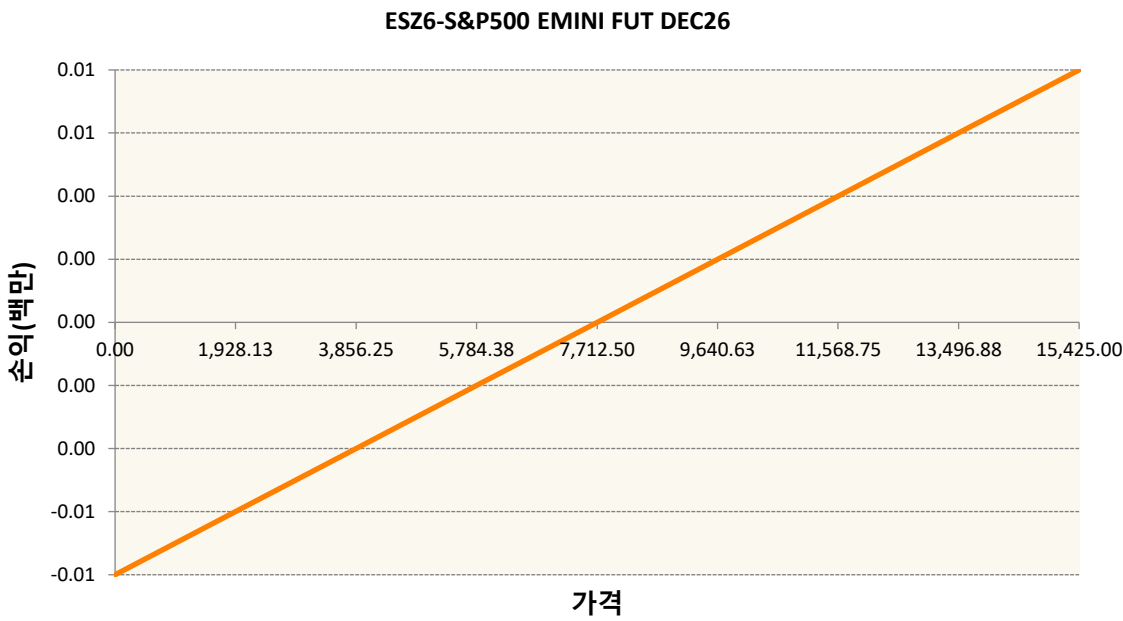
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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	2026-09-22
기준일	2026-09-21

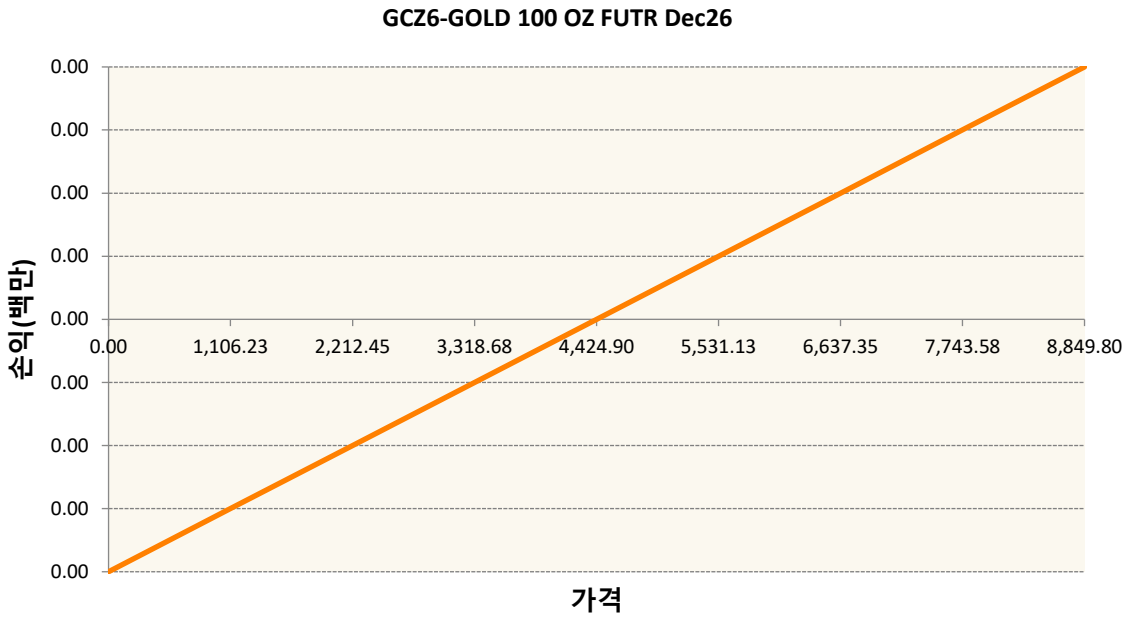
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			6,292	0	6,292	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 09/23/26 C410 EQUITY	1
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	503

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

(단위:백만원)

660

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

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 09/25/26 C182.5 EQUITY	124
AOPLTRUP1\$PLTR US 09/25/26 P182.5 EQUITY	9

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

(단위:백만원)

458

공시일 2026-09-22

기준일 2026-09-21

SOL팔란티어미국채커버드콜혼합상장

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

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

(단위:백만원)

13,376

공시일 2026-09-22

기준일 2026-09-21

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	2026-09-22
기준일	2026-09-21

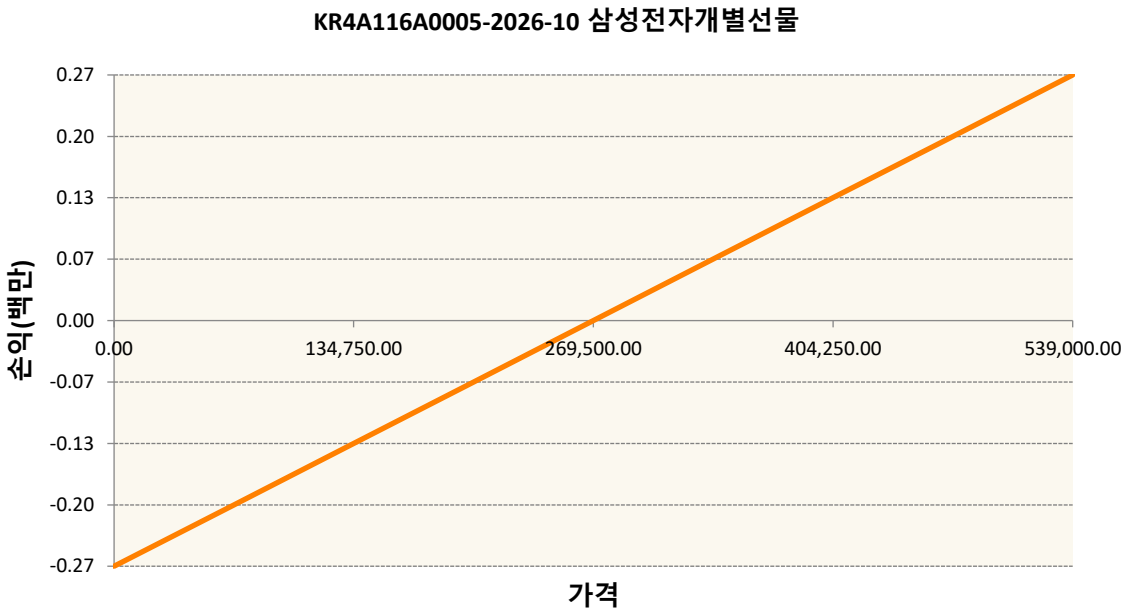
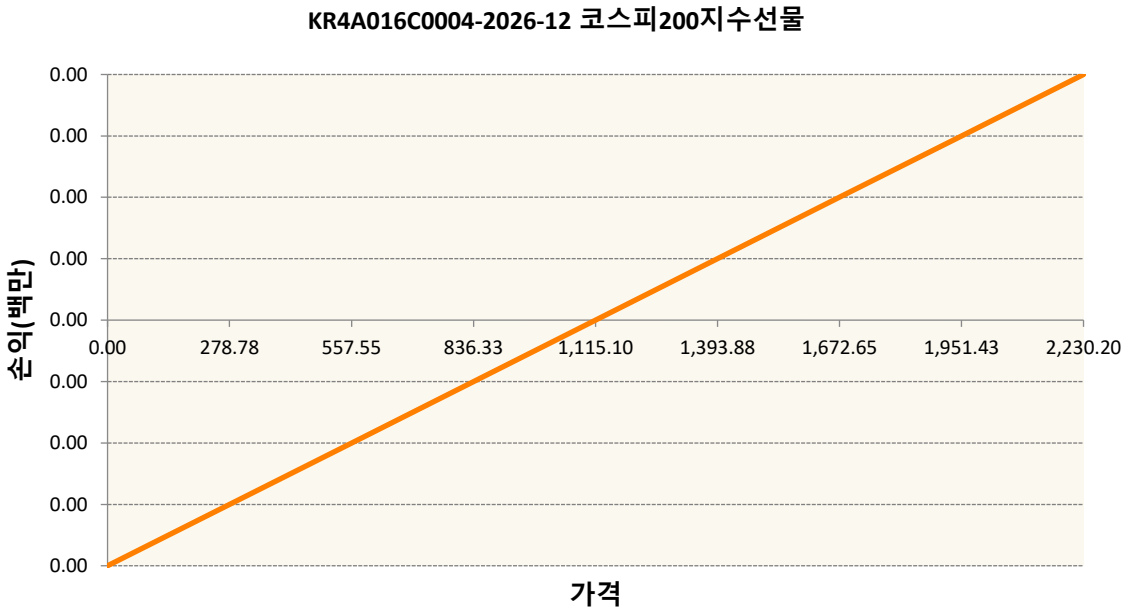
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	88,622	-88,622	장내
누계	유가증권	선물	21,801	0	21,801	장내
누계	유가증권	옵션	0	87,688	-87,688	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 2,225.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. An orange line represents the relationship, starting at the origin (0, 0) and ending at the point (1,112.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,112.50	0.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순이익). The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 2,230.00. The y-axis represents the net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,115, 0.00).

가액	순이익 (백만)
0.00	0.00
1,115.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A016C0004							2026-12 코스피200지수선물		578
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-578	-578	-578	-578	-578	-578	-578		
-5.33%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386		
-2.67%	-193	-193	-193	-193	-193	-193	-193		
0%	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	193	193	193	193	193	193	193		
5.33%	386	386	386	386	386	386	386		
8.00%	578	578	578	578	578	578	578		
KR4A116A0005							2026-10 삼성전자개별선물		1,184
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,184	-1,184	-1,184	-1,184	-1,184	-1,184	-1,184
-5.33%	-789	-789	-789	-789	-789	-789	-789
-2.67%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	395	395	395	395	395	395	395
5.33%	789	789	789	789	789	789	789
8.00%	1,184	1,184	1,184	1,184	1,184	1,184	1,184
KR4B09FEA466 코스피위클리 C 2609W4 1,112.5							3,545

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,531	-3,531	-3,532	-3,533	-3,536	-3,539	-3,545
-5.33%	-2,134	-2,140	-2,148	-2,159	-2,174	-2,191	-2,212
-2.67%	-811	-842	-877	-915	-955	-997	-1,041
0%	169	113	56	0	-56	-113	-169
2.67%	589	555	518	478	436	392	346
5.33%	674	666	655	641	623	602	578
8.00%	681	680	679	676	672	665	657

KR4B09FEA474 코스피위클리 C 2609W4 1,115.0							2,400
--------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-------

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,391	-2,392	-2,392	-2,393	-2,394	-2,396	-2,400
-5.33%	-1,460	-1,463	-1,467	-1,474	-1,483	-1,493	-1,506
-2.67%	-569	-588	-609	-633	-658	-685	-713
0%	113	75	38	0	-38	-75	-113
2.67%	422	397	370	342	313	282	250
5.33%	489	483	474	464	451	435	418
8.00%	495	494	493	491	488	483	477

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

(단위:백만원)

17,126

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

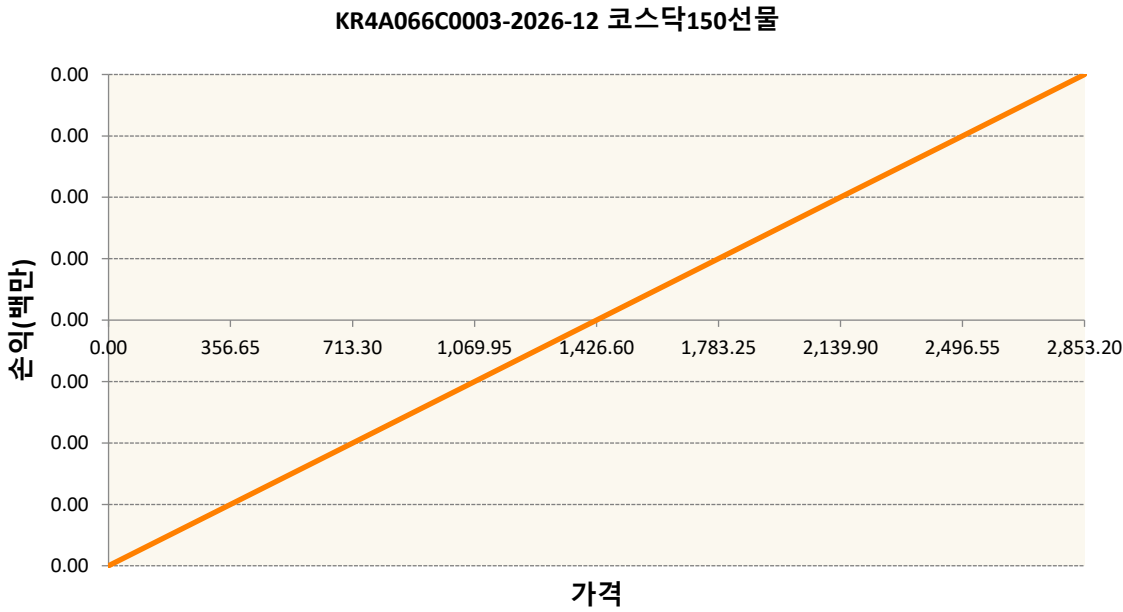
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	656	0	656	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003			2026-12 코스닥150선물				52
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-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%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	52	52	52	52	52	52	52

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

(단위:백만원)

14,934

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

(단위:백만원)

61,106

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

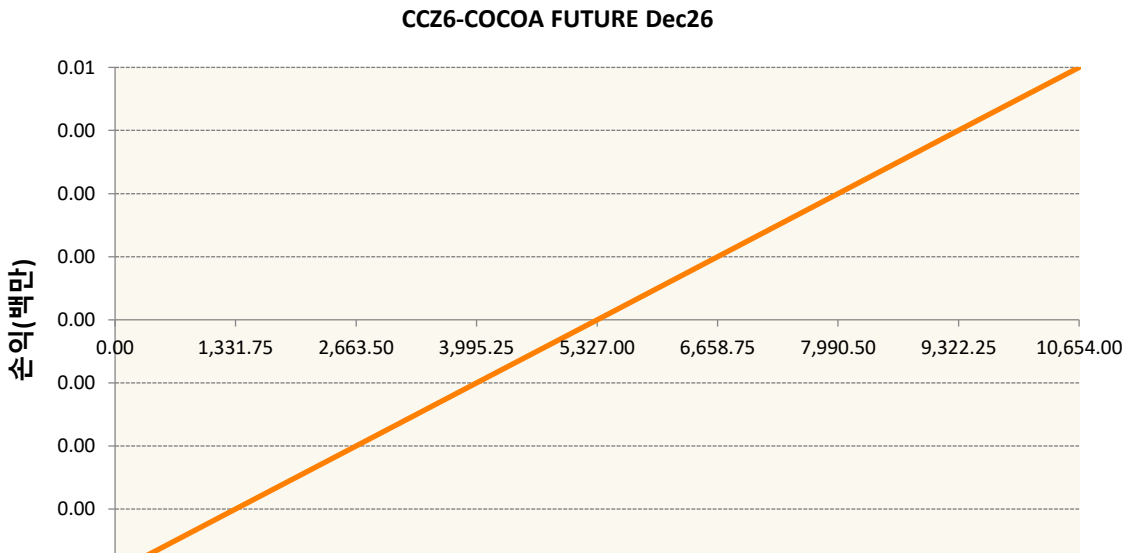
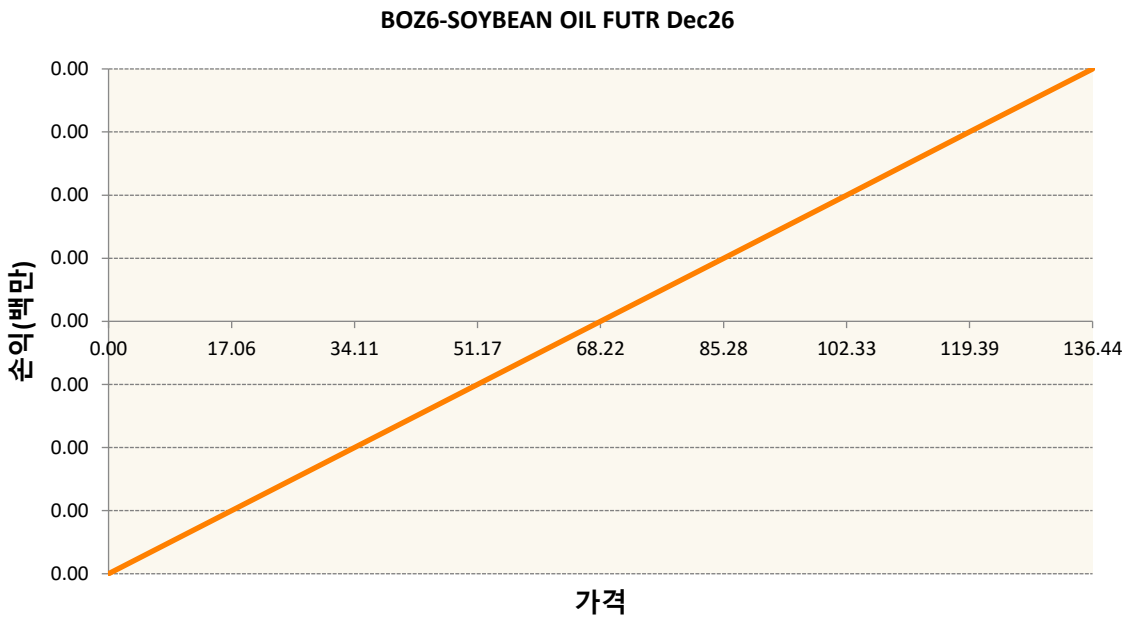
포커스농산물모(채권-파생형)

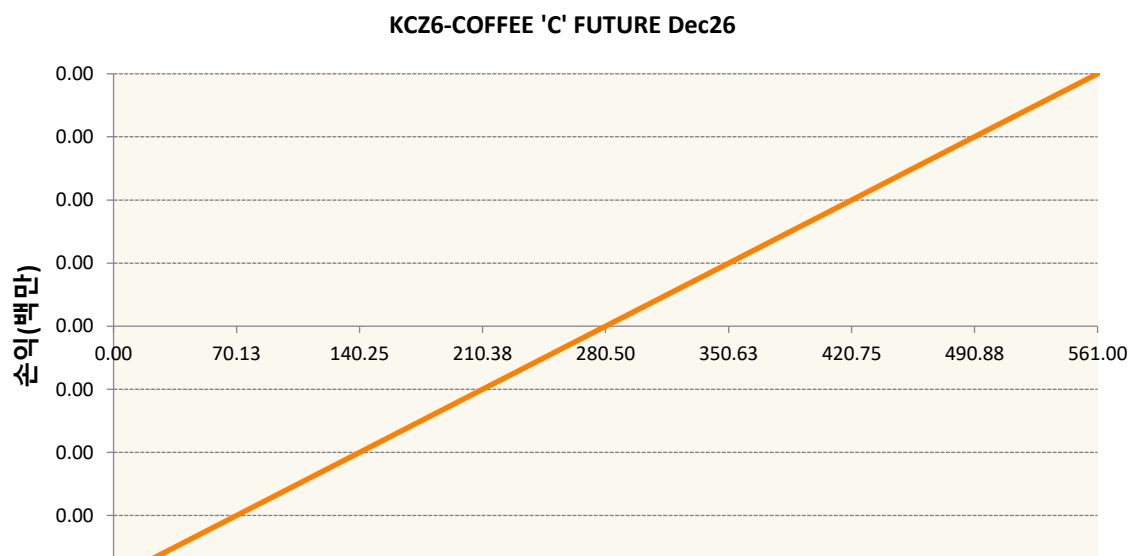
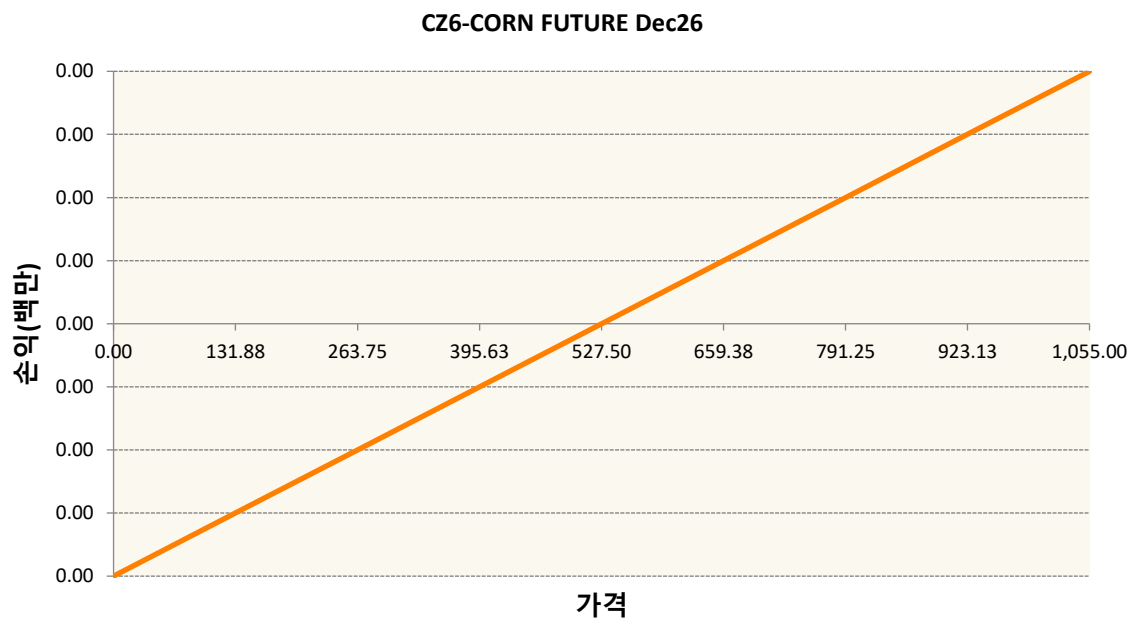
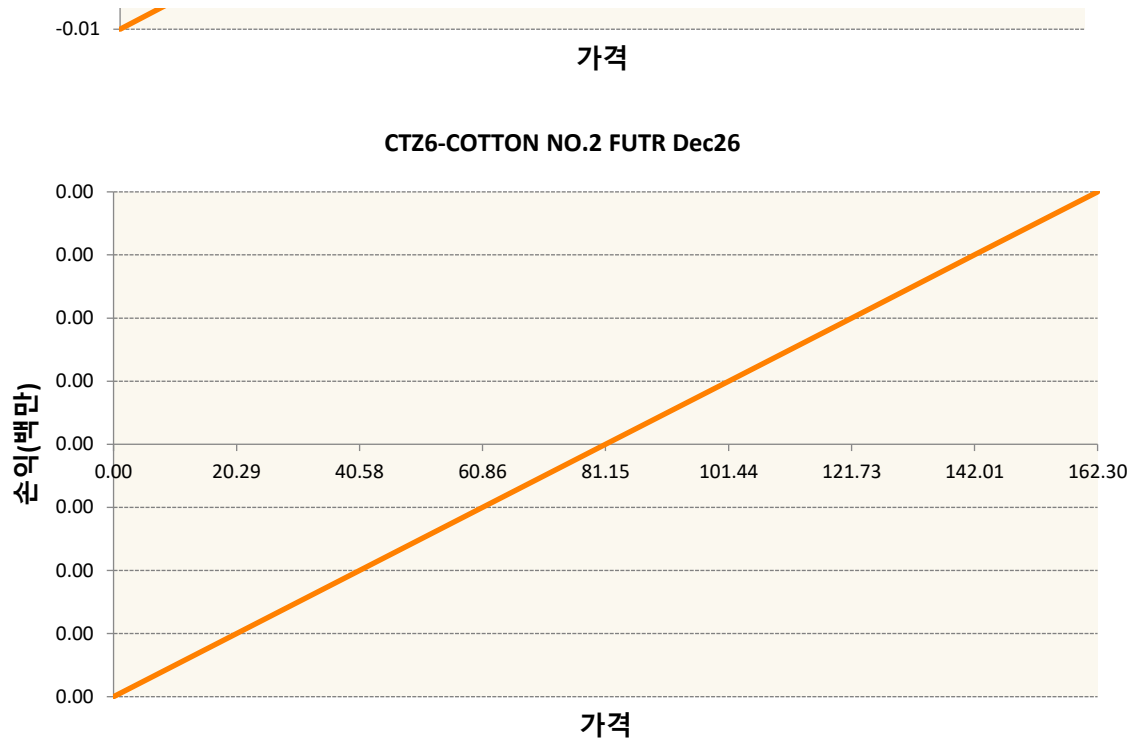
1. 계약금액

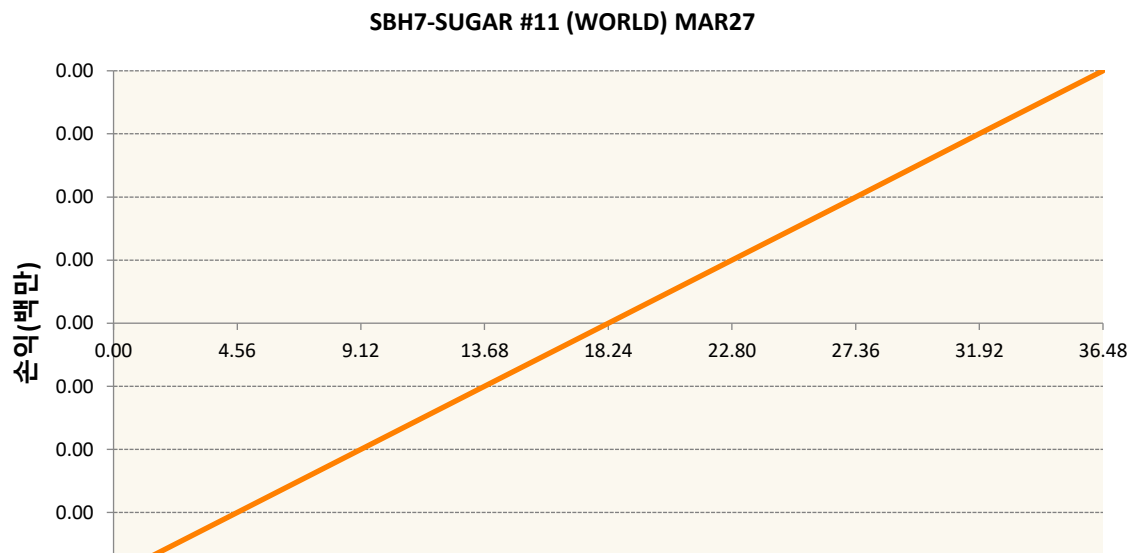
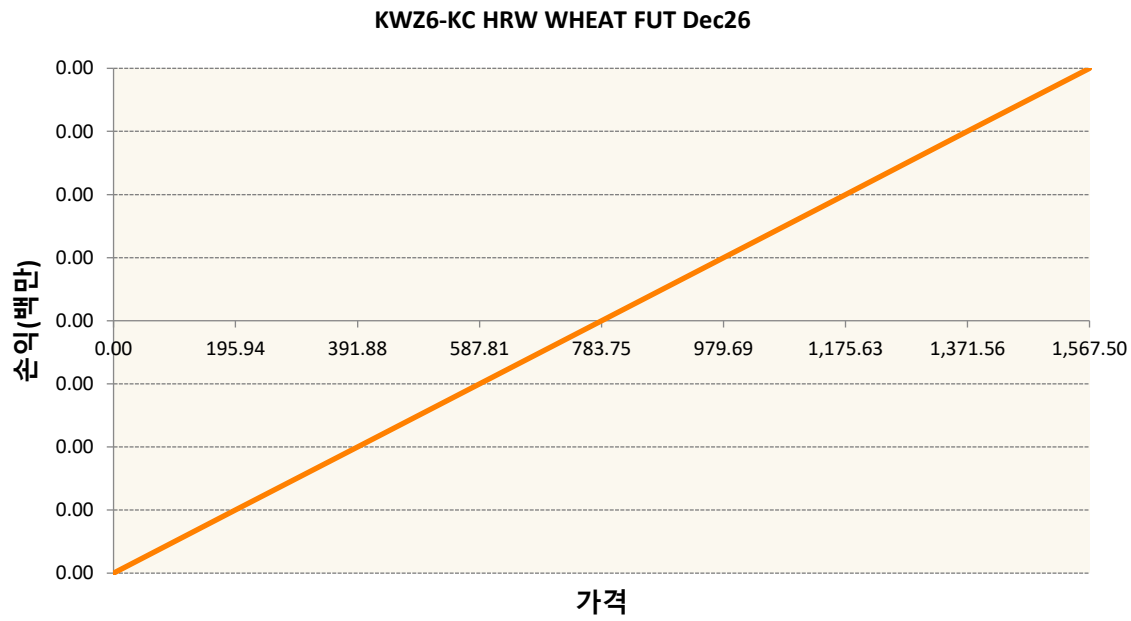
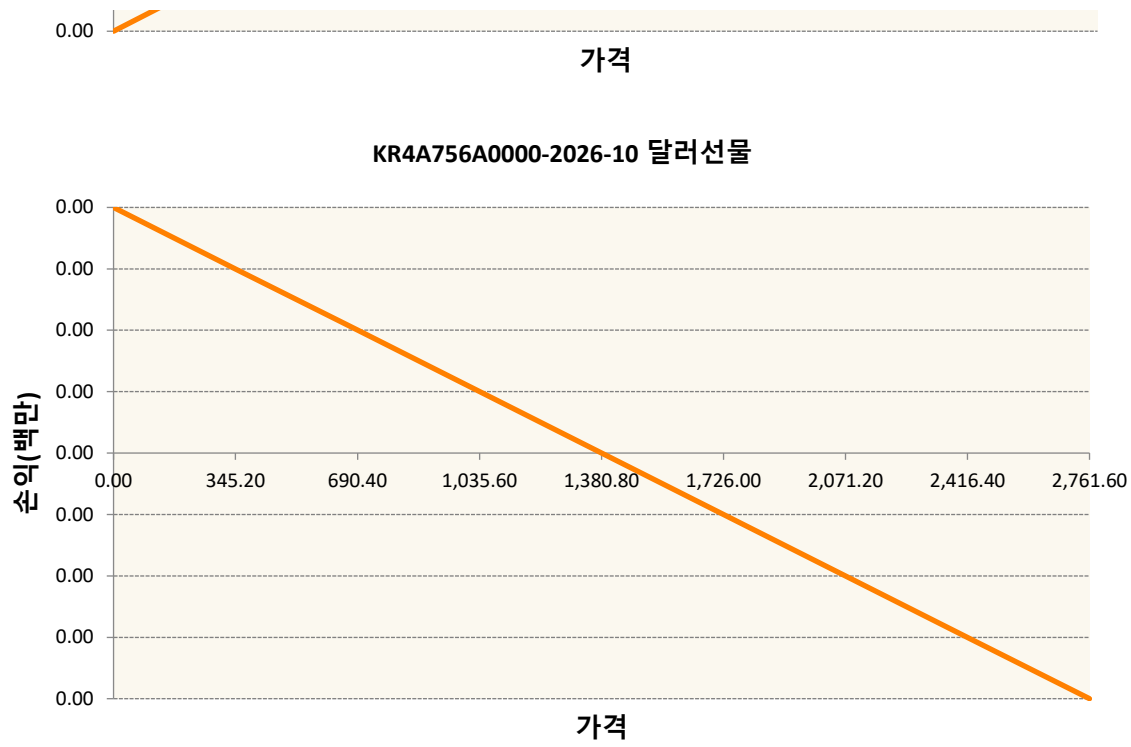
(단위:USD 백만)

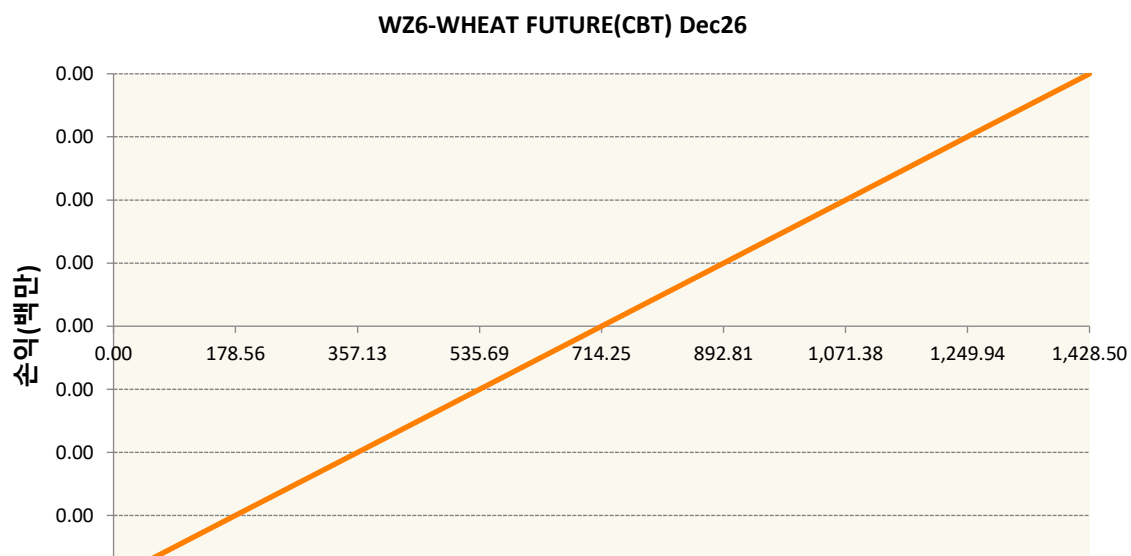
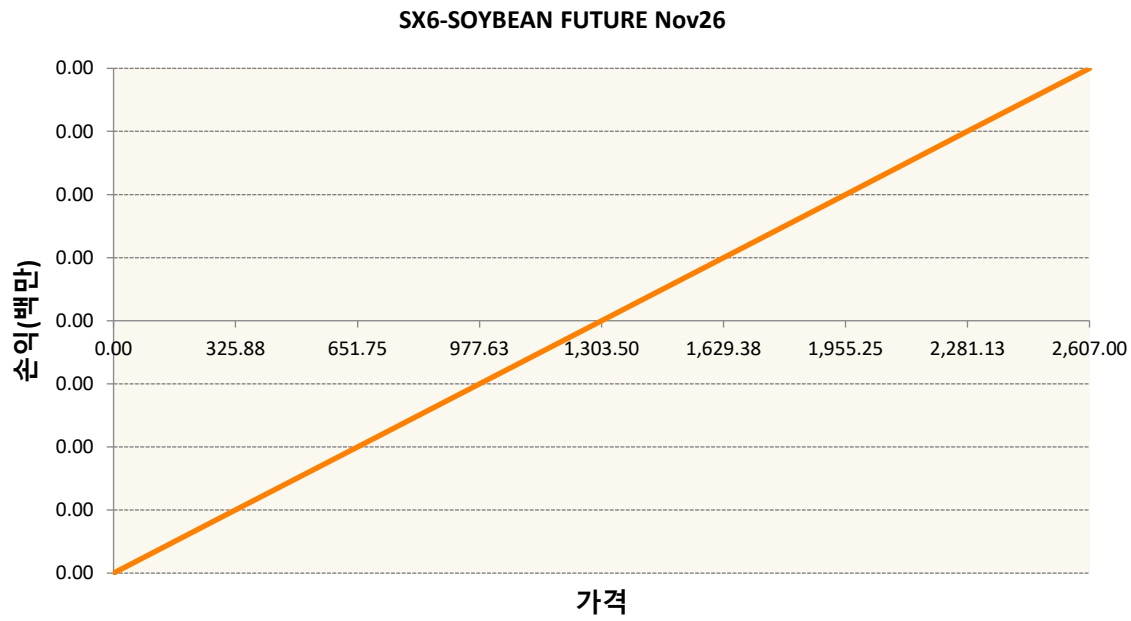
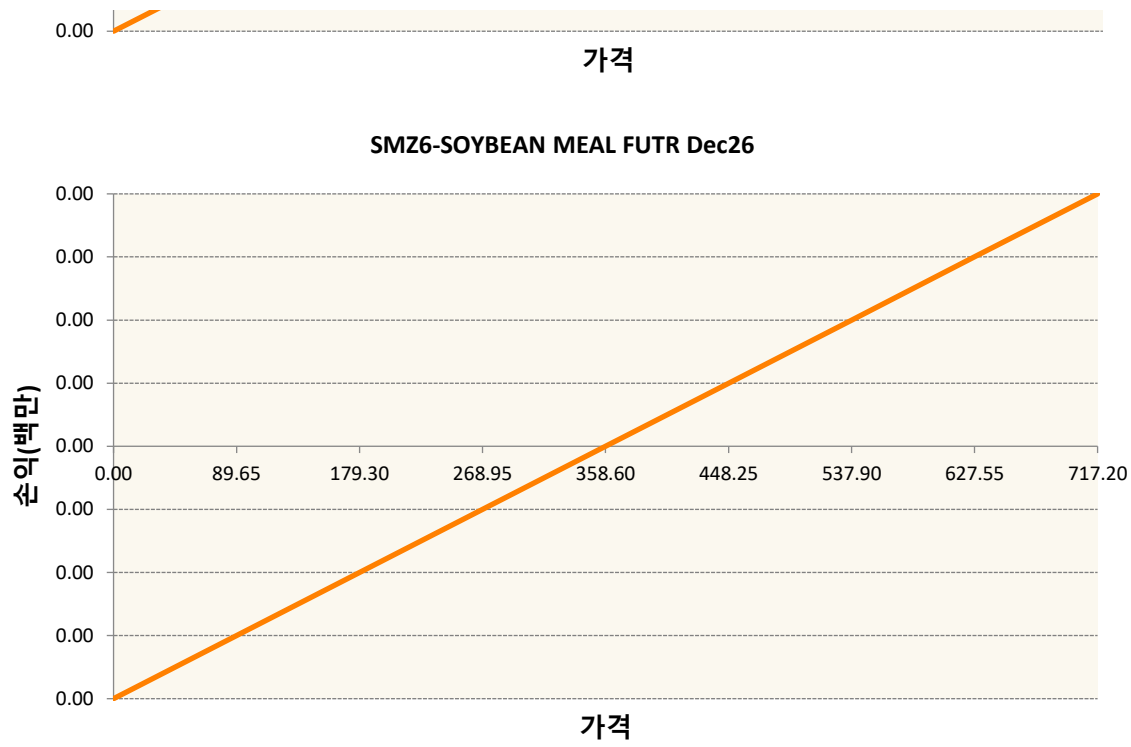
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	385	0	385	
누계	유가증권	선물	2,383	0	2,383	
누계	통화	선물	0	345	-345	장내

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	2026-09-22
기준일	2026-09-21

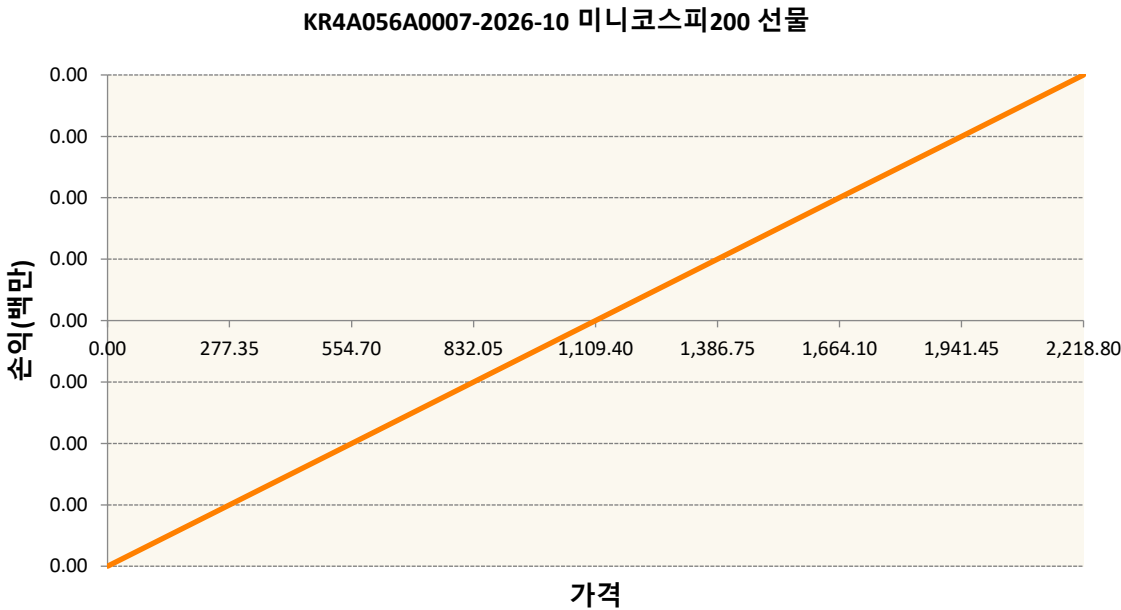
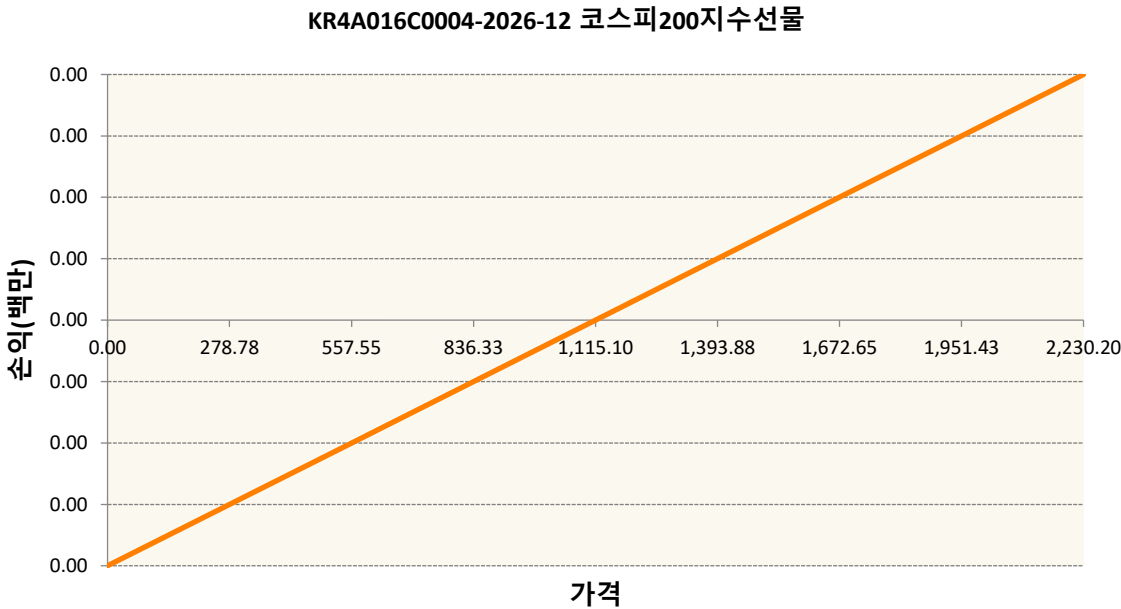
스마트인덱스모

1. 계약금액

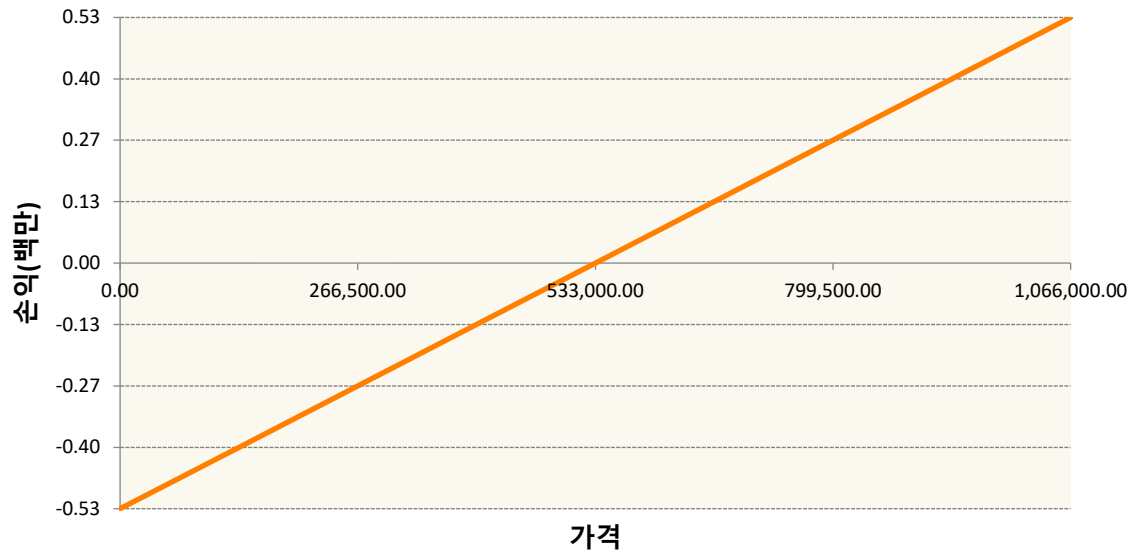
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,104	-1,104	장내
누계	유가증권	선물	8,134	57	8,077	장내

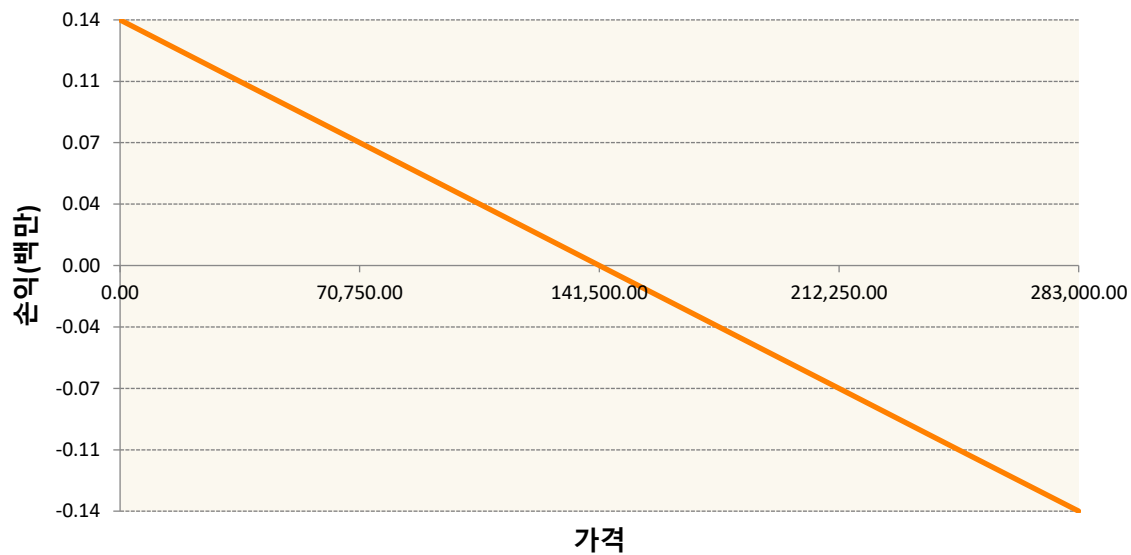
2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004				2026-12 코스피200지수선물				334
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-334	-334	-334	-334	-334	-334	-334	
-5.33%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222	
-2.67%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	111	111	111	111	111	111	111	
5.33%	222	222	222	222	222	222	222	
8.00%	334	334	334	334	334	334	334	
KR4A056A0007				2026-10 미니코스피200 선물				62
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-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%	62	62	62	62	62	62	62
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							5
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

1,357

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

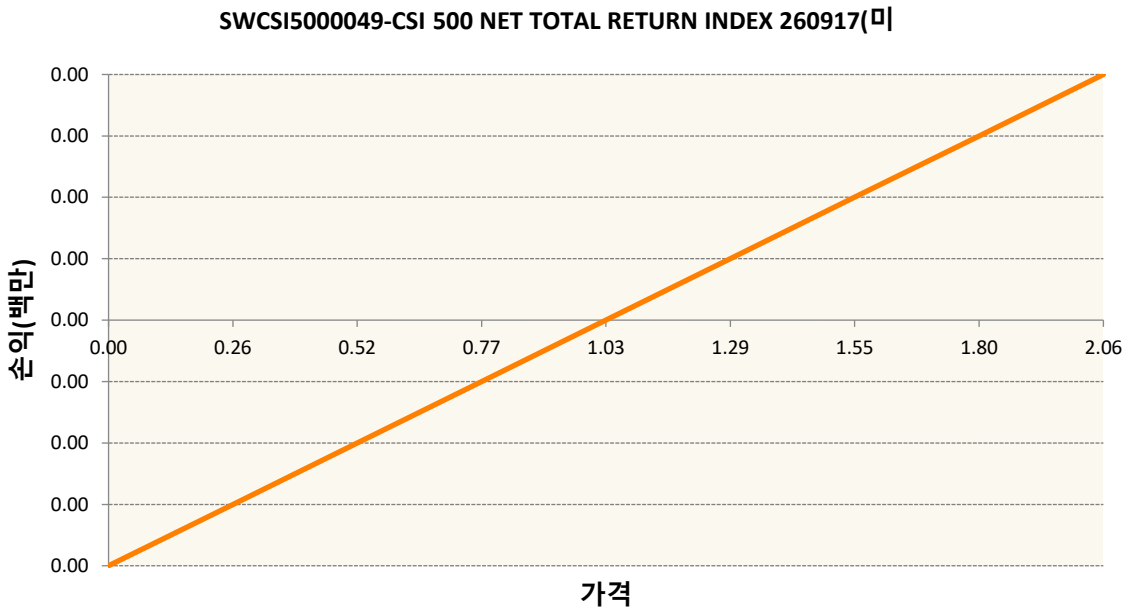
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,481	0	5,481	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미

440

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

689

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

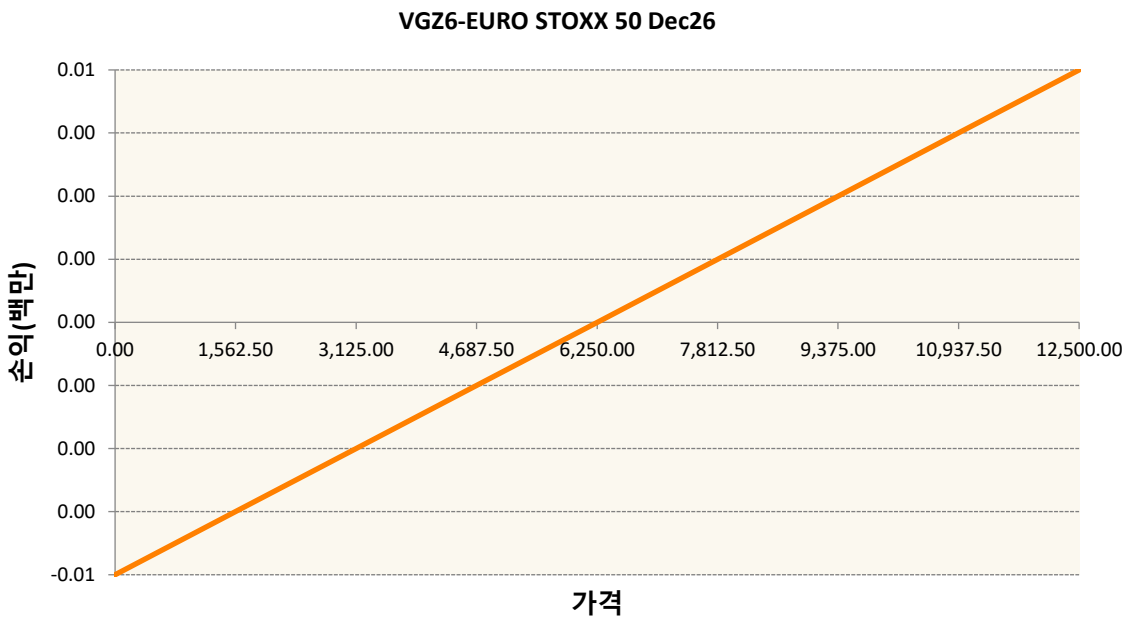
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,091	0	1,091	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	87
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

64

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

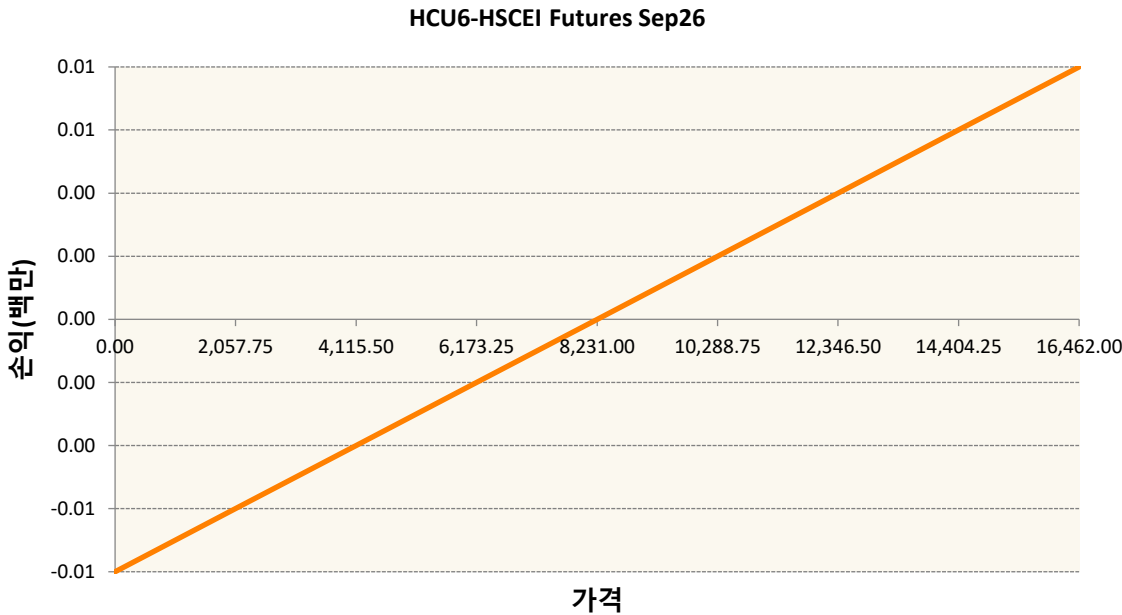
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,297	0	1,297	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	104
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

98

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

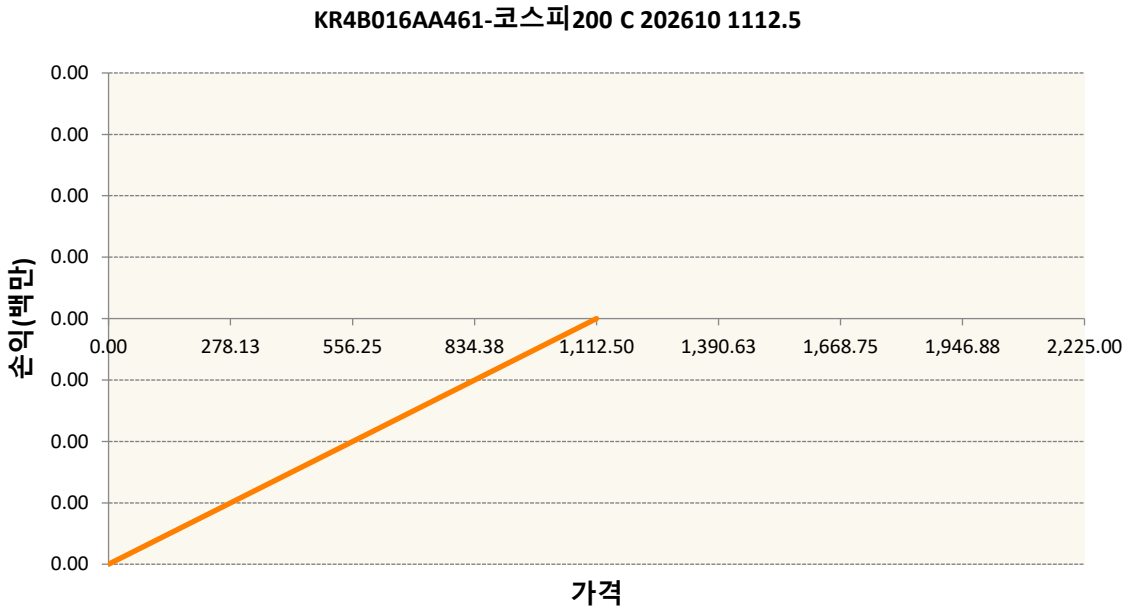
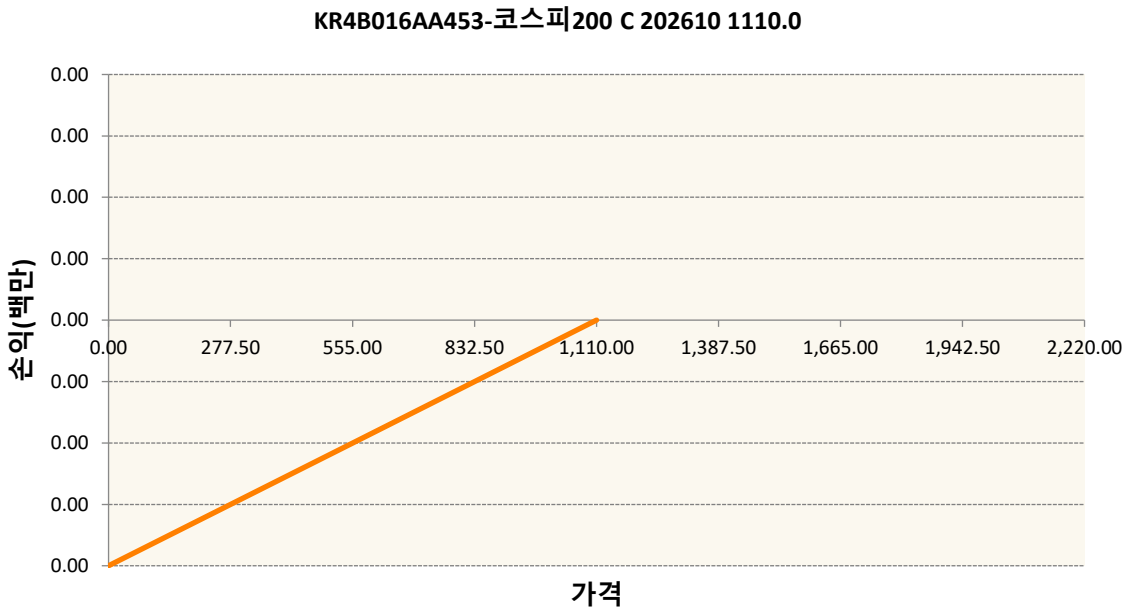
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

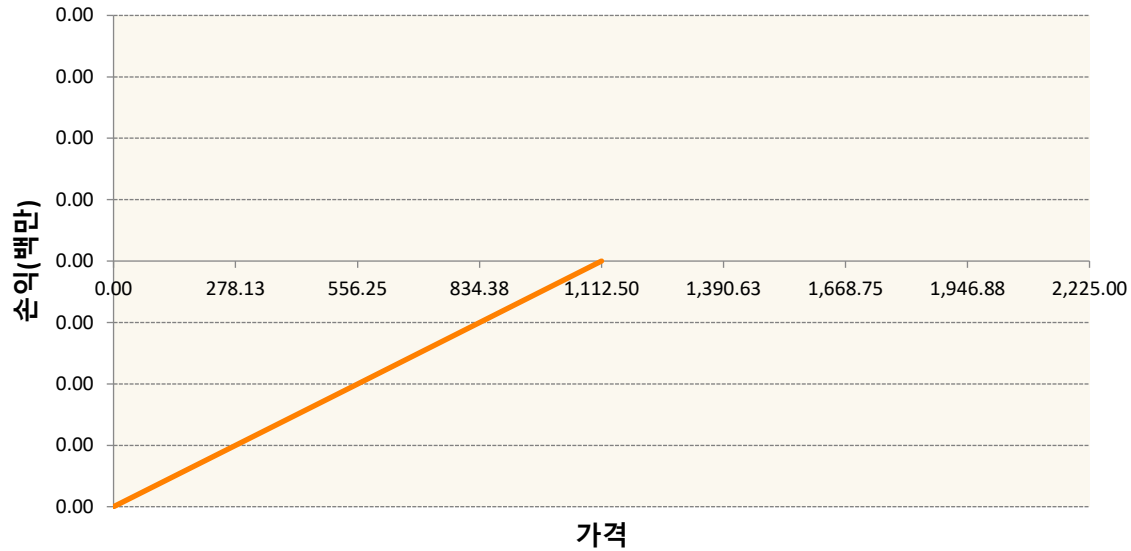
(단위:백만원)

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							415
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-327	-339	-352	-367	-382	-398	-415
-5.33%	-170	-187	-205	-224	-243	-262	-282
-2.67%	-37	-58	-80	-101	-123	-144	-166
0%	68	45	23	0	-23	-45	-68
2.67%	144	123	101	79	58	36	14
5.33%	194	177	158	139	119	99	79
8.00%	226	212	198	182	165	148	129
KR4B016AA461 코스피200 C 202610 1112.5							1,856
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,471	-1,523	-1,581	-1,644	-1,712	-1,782	-1,856
-5.33%	-771	-846	-924	-1,006	-1,089	-1,175	-1,261
-2.67%	-174	-267	-360	-455	-550	-646	-742
0%	300	200	100	0	-100	-200	-300
2.67%	647	552	456	359	262	164	66
5.33%	880	800	717	631	542	452	360
8.00%	1,024	964	898	826	751	671	589
KR4C016AA460 코스피200 P 202610 1112.5							533
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-422	-437	-454	-472	-491	-511	-533
-5.33%	-221	-243	-265	-289	-313	-337	-362
-2.67%	-50	-76	-103	-131	-158	-185	-213
0%	86	57	29	0	-29	-57	-86

2.67%	186	158	131	103	75	47	19
5.33%	253	230	206	181	156	130	103
8.00%	294	277	258	237	215	193	169

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

(단위:백만원)

4,341

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

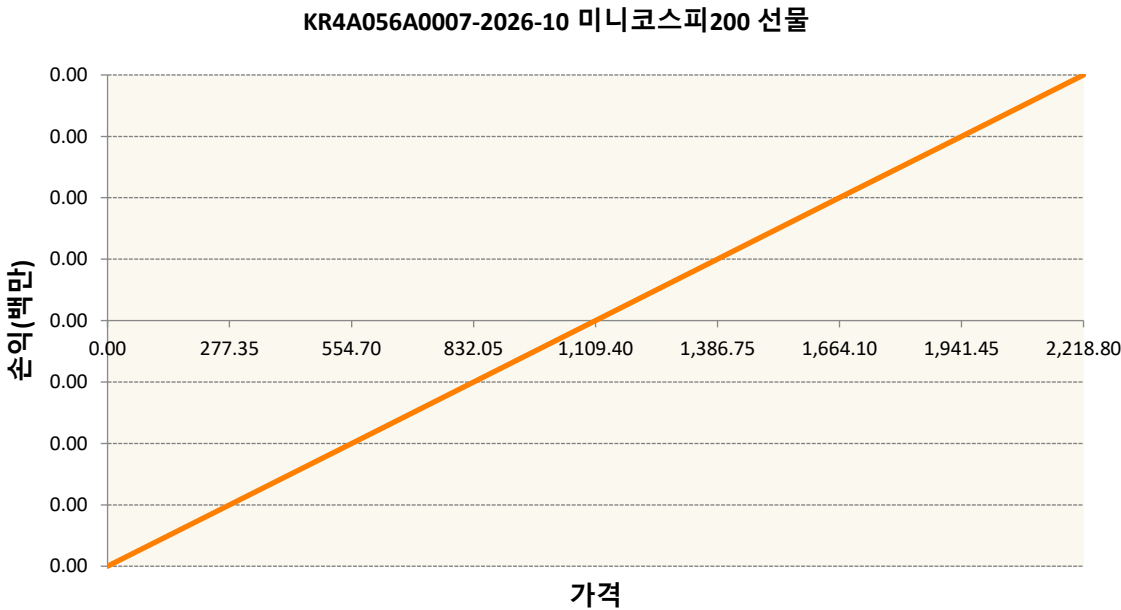
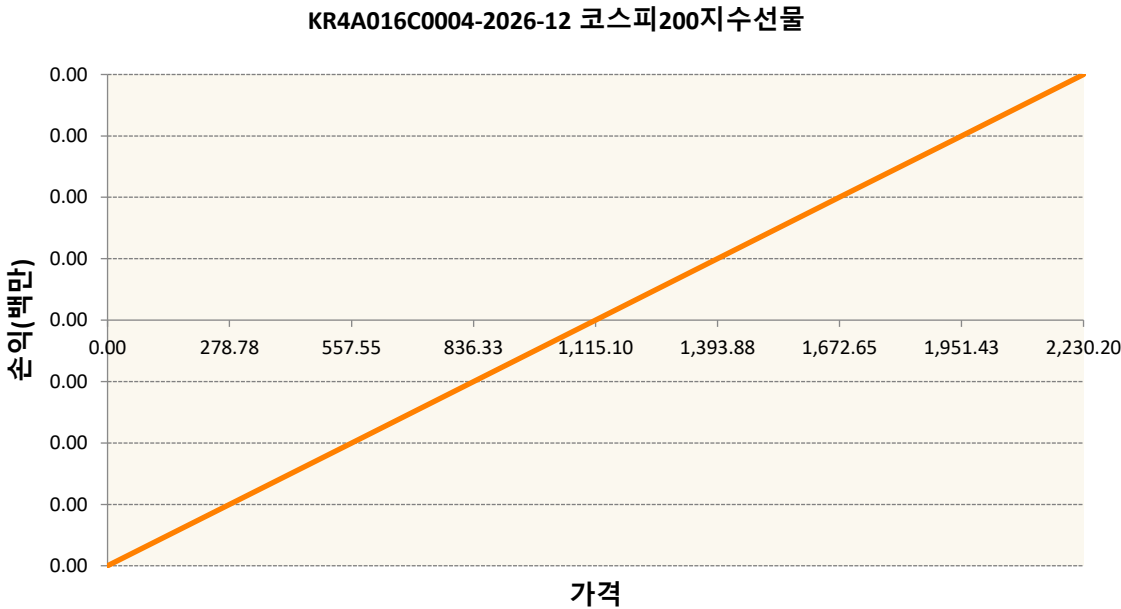
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

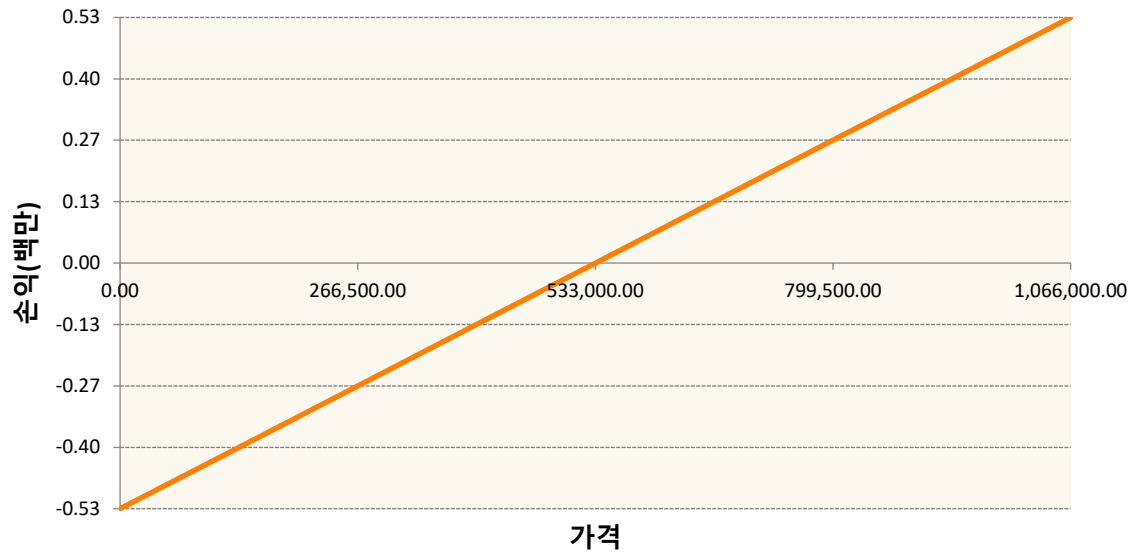
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,554	57	2,497	장내

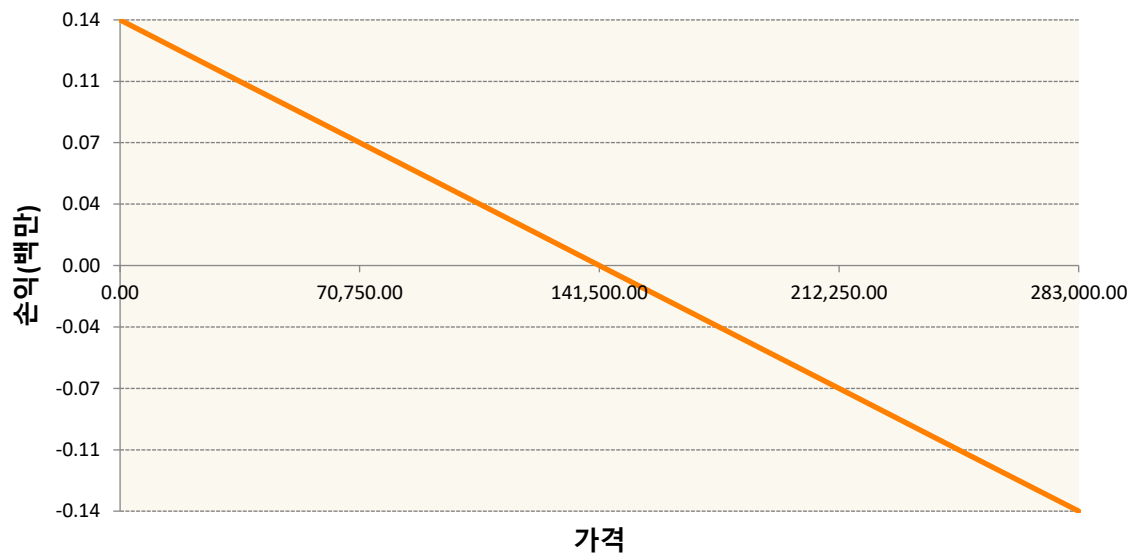
2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물					67
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-5.33%	-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%	67	67	67	67	67	67	67
KR4A056A0007		2026-10 미니코스피200 선물					27
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-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%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	27	27	27	27	27	27	27

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 5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	3	3	3	3	3	3	3
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

331

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

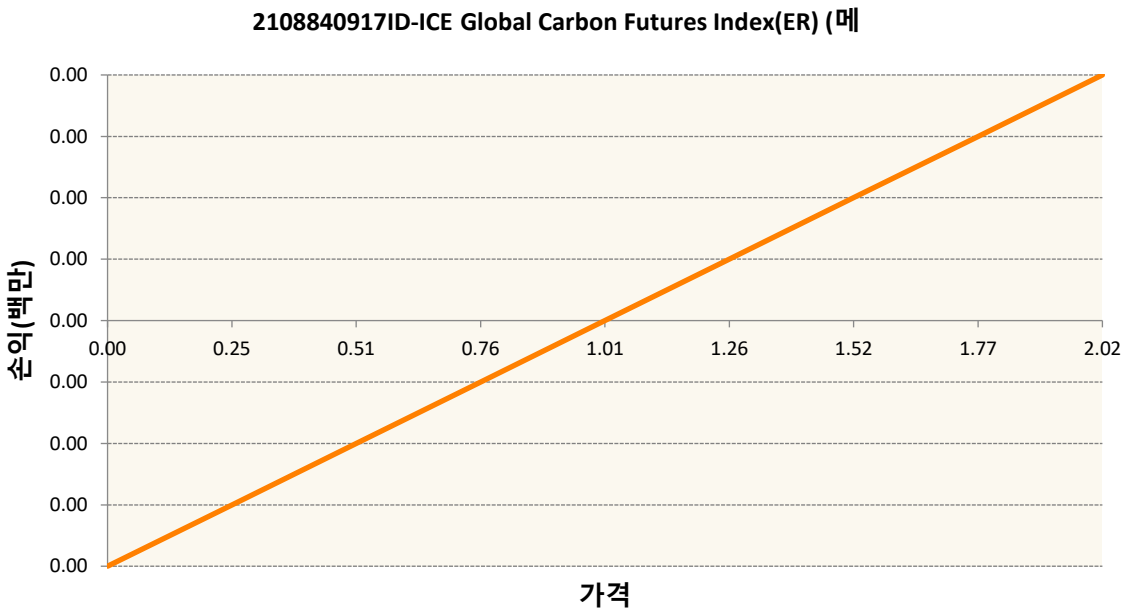
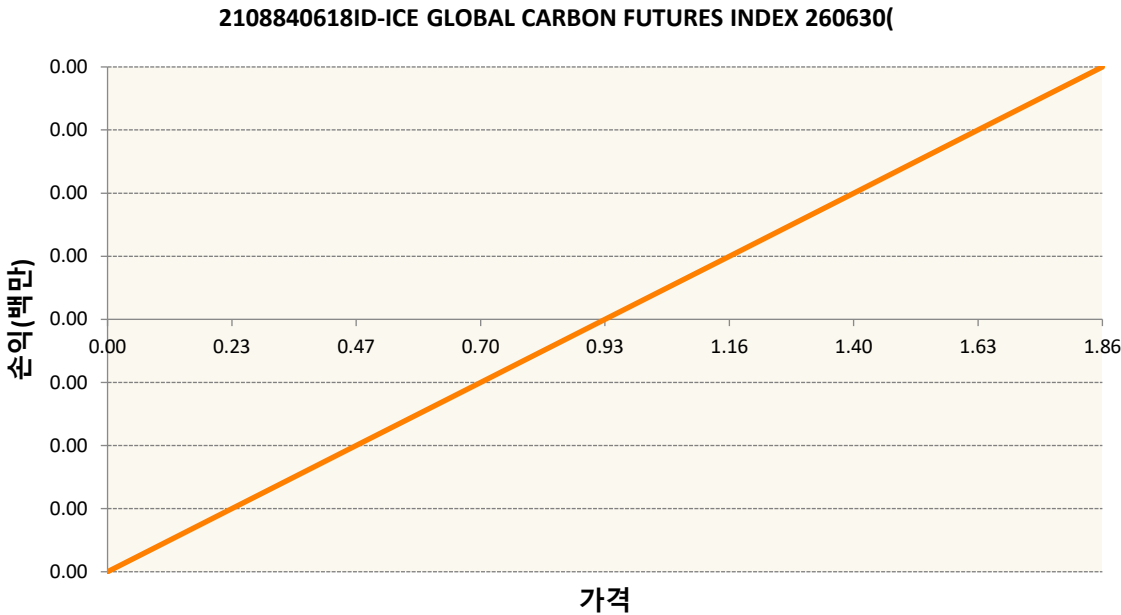
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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(		453
2108840917IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		115

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	600

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

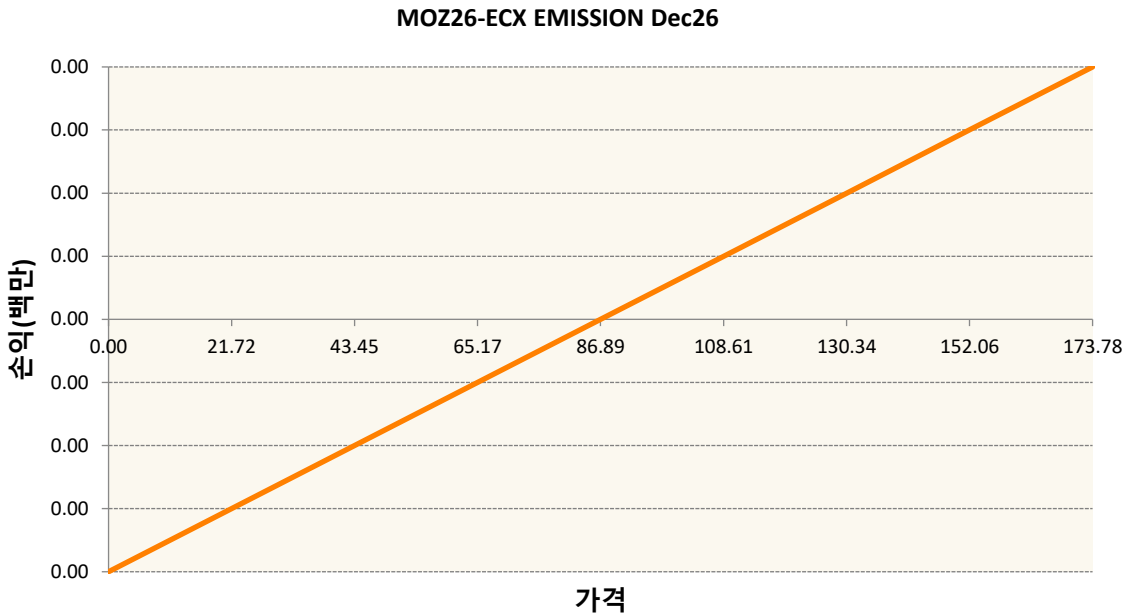
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,143	0	6,143	
누계	통화	선도	0	2,631	-2,631	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E	210
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	491

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

(단위:백만원)

754

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

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	-2,105	0	-2,105	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	68
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	31
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	27
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	41

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

(단위:백만원)

268

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

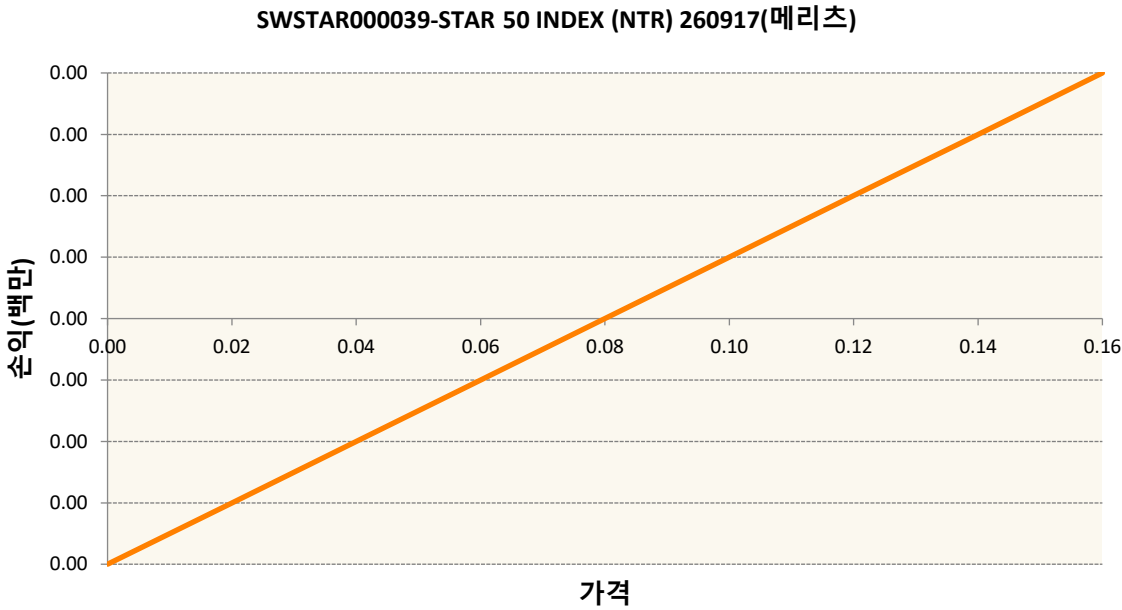
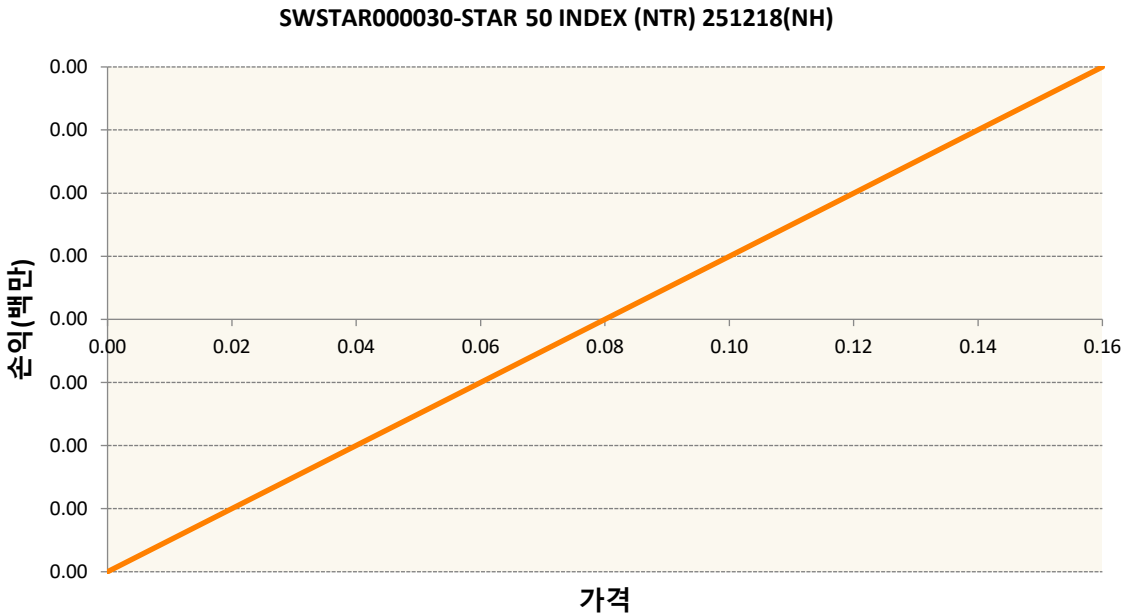
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	-1,589	0	-1,589	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	20
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	194
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	43

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

488

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

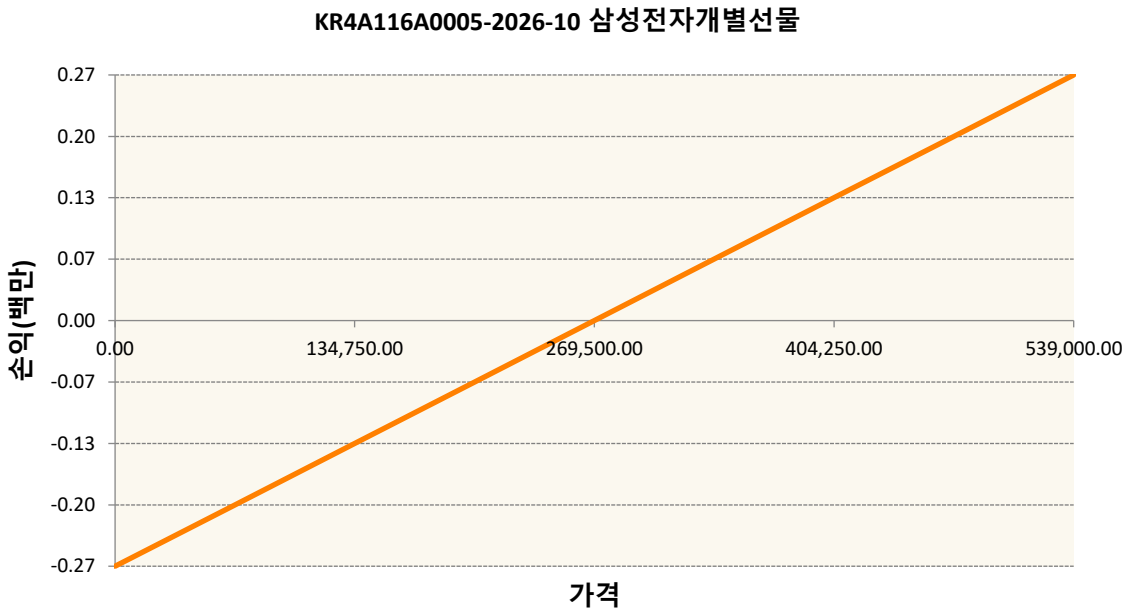
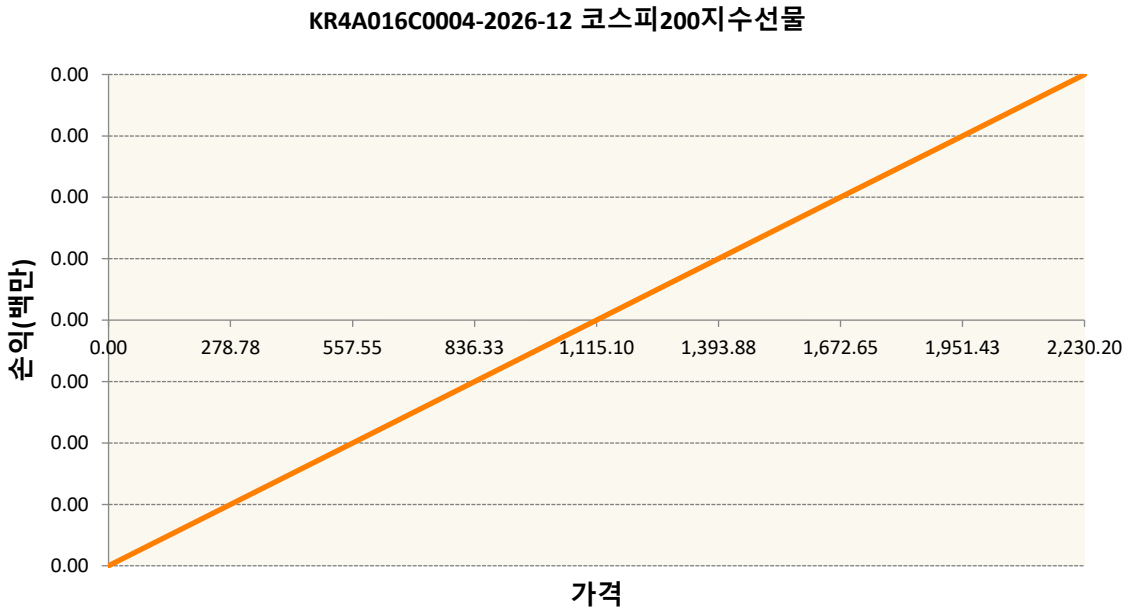
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

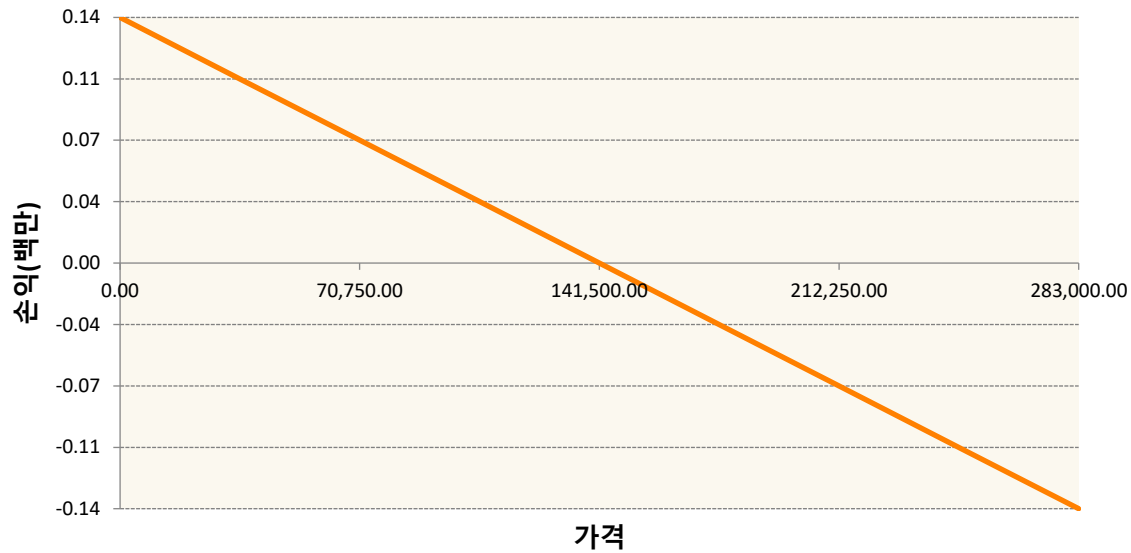
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,115	-1,115	장내
누계	유가증권	선물	17,107	287	16,820	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물								1,090
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090	-1,090
-5.33%	-727	-727	-727	-727	-727	-727	-727	-727
-2.67%	-363	-363	-363	-363	-363	-363	-363	-363
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	363	363	363	363	363	363	363	363
5.33%	727	727	727	727	727	727	727	727
8.00%	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090	1,090
KR4A116A0005 2026-10 삼성전자개별선물								280
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280
-5.33%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	187	187	187	187	187	187	187	187
8.00%	280	280	280	280	280	280	280	280
KR4A416A0002 2026-10 SK이노베이션개별선물								23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	23	23	23	23	23	23	23	23
-5.33%	15	15	15	15	15	15	15	15
-2.67%	8	8	8	8	8	8	8	8
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23

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

(단위:백만원)

4,855

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

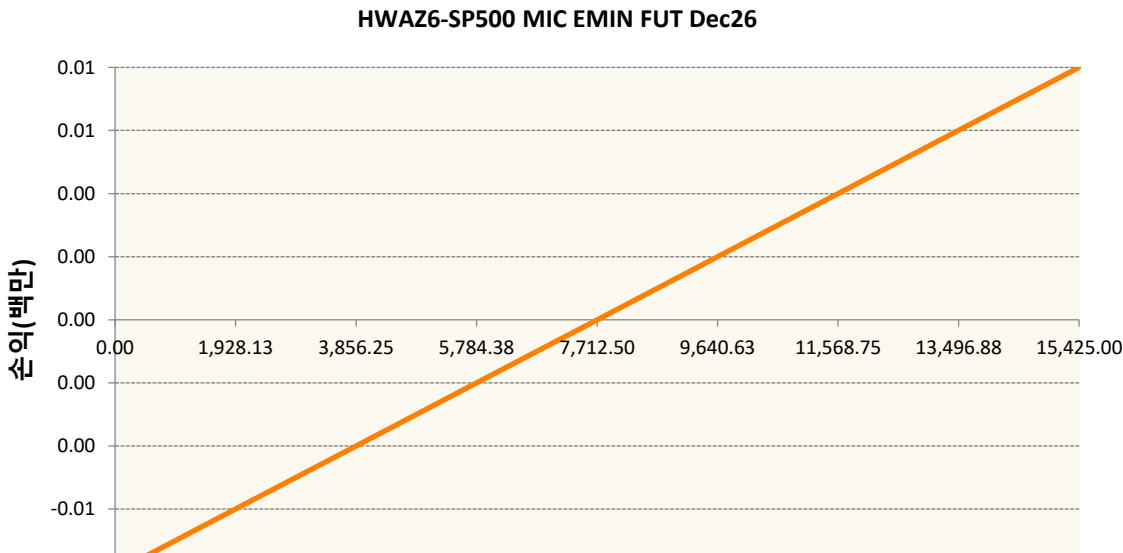
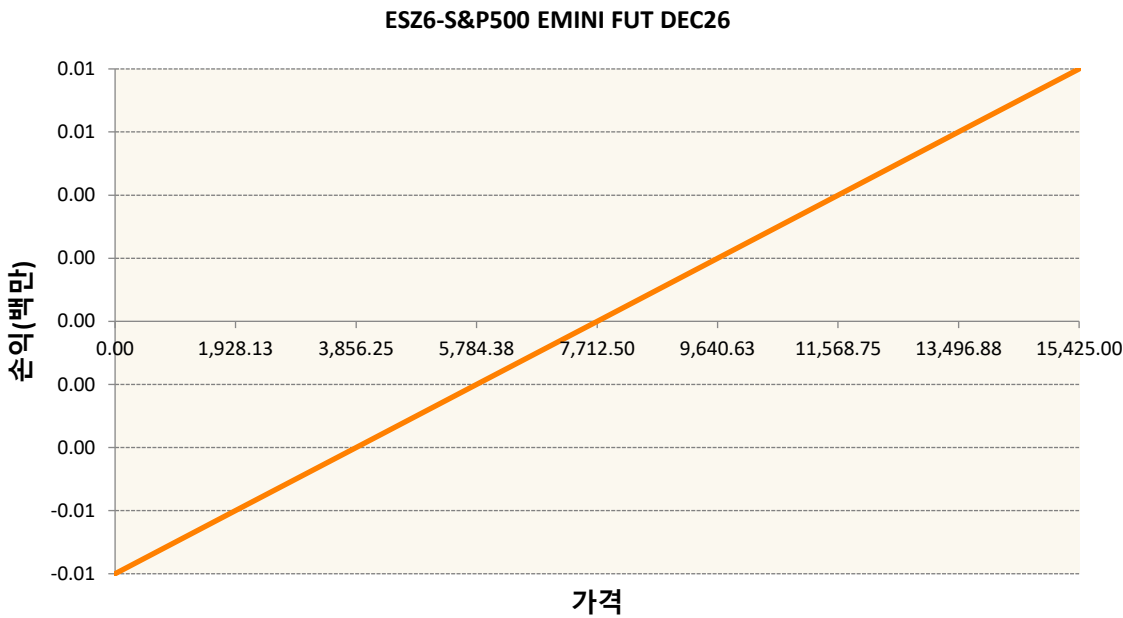
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

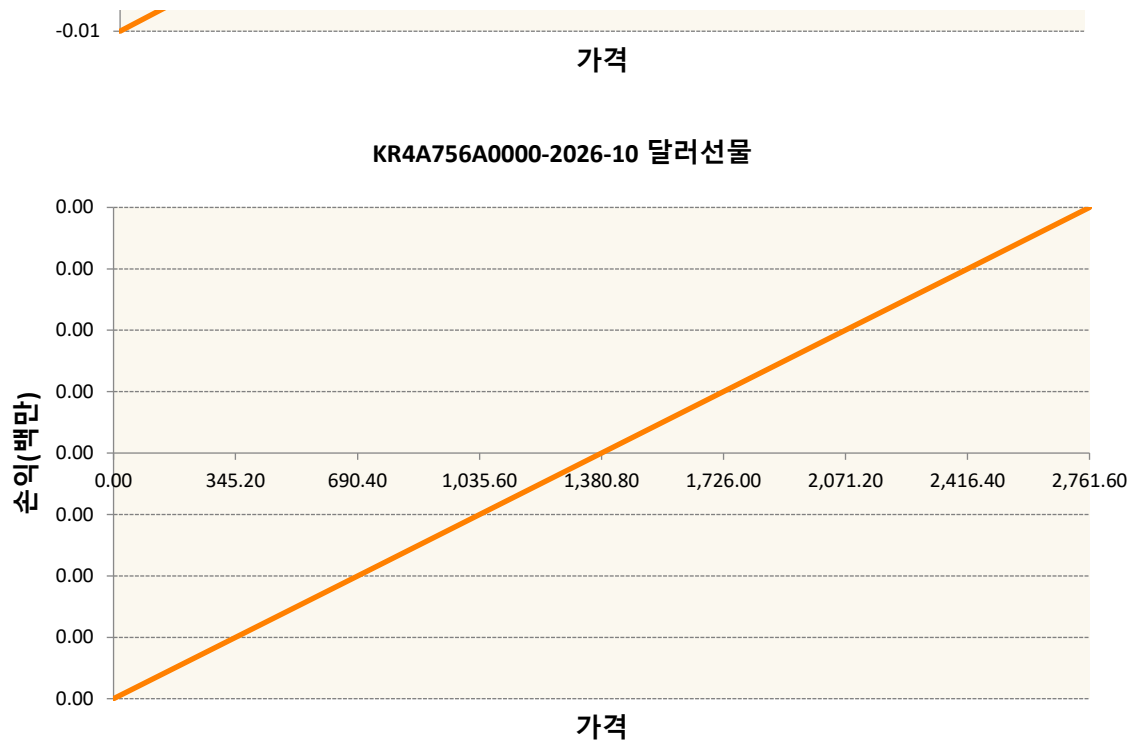
1. 계약금액

(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	691	0	691	장내
누계	지수	선물	73,022	0	73,022	
누계	지수	선물	373	0	373	장내
누계	통화	선물	12,565	0	12,565	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	5,842
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	1,005

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

(단위:백만원)

3,748

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

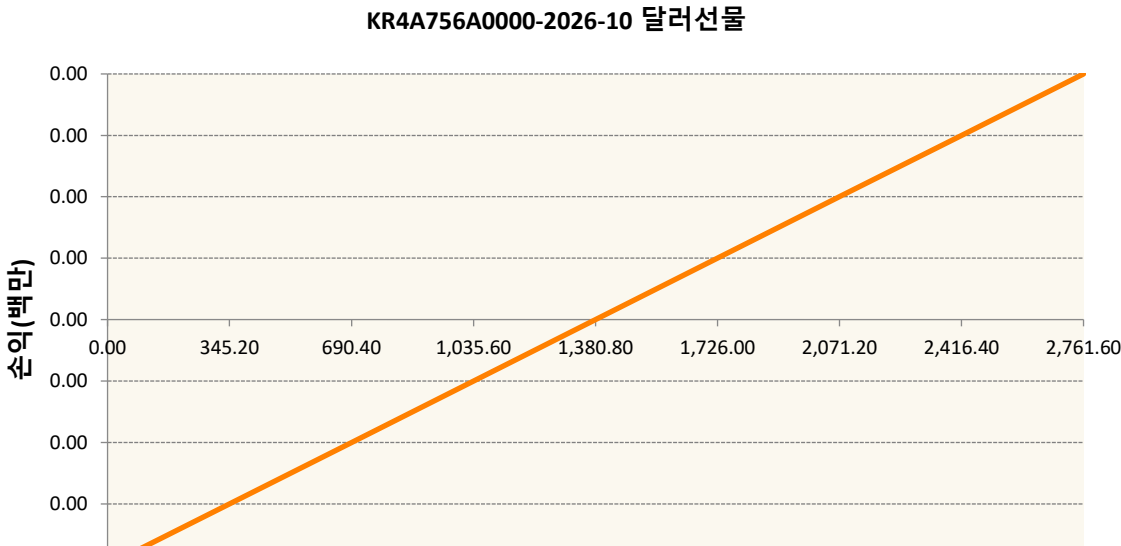
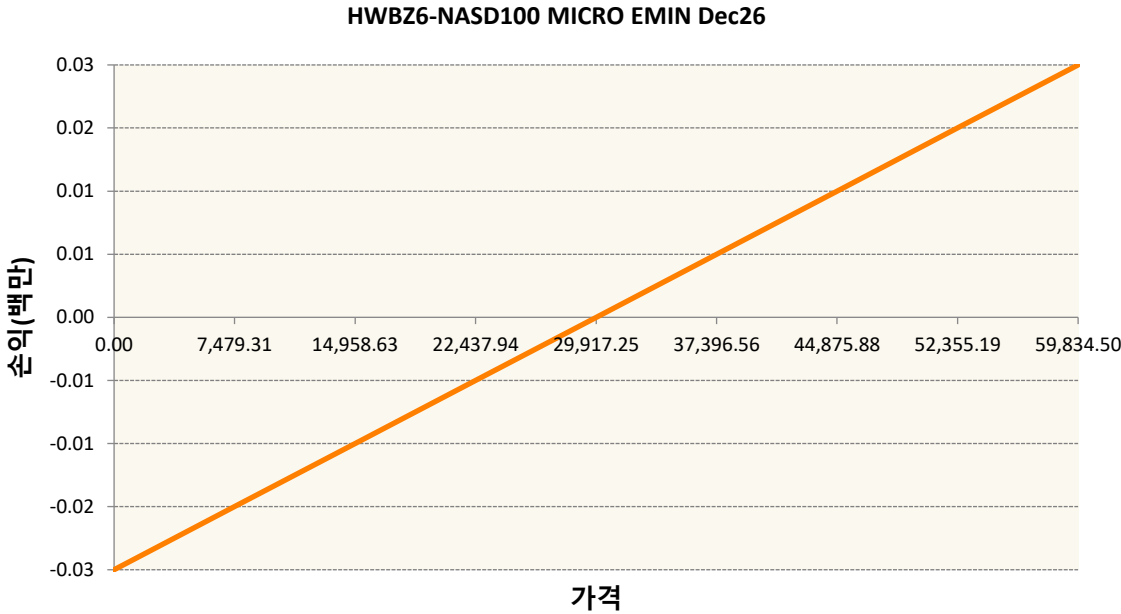
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

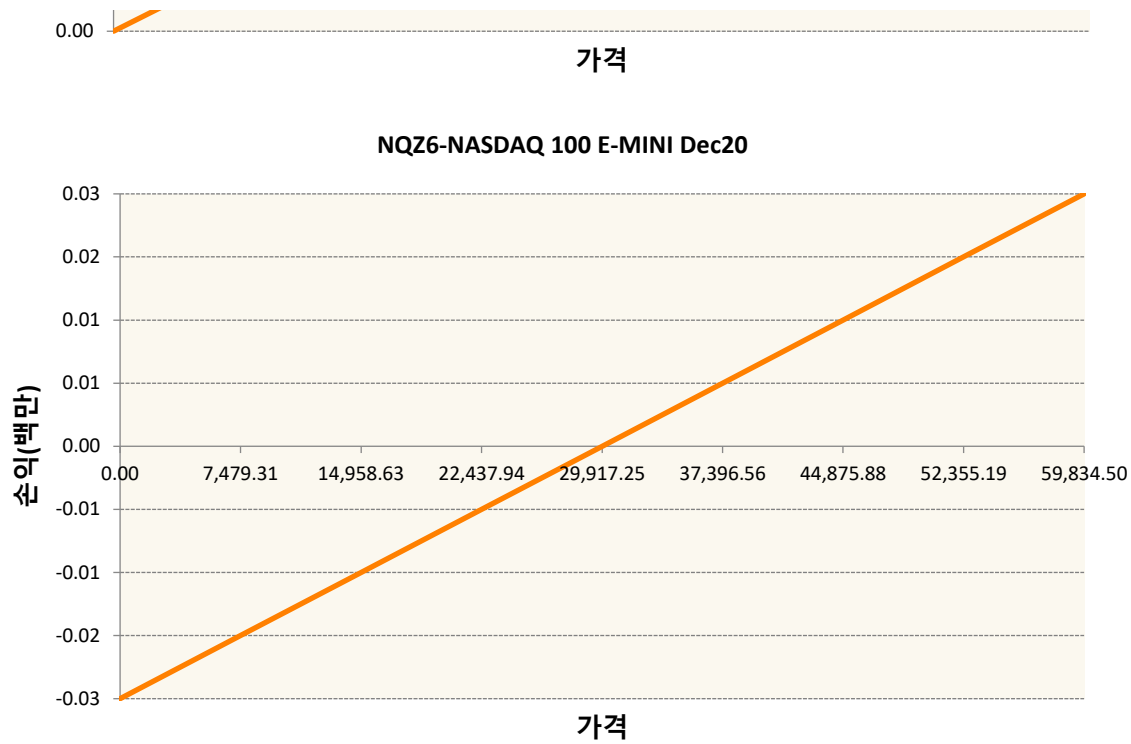
1. 계약금액

(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	345	0	345	장내
누계	지수	선물	35,562	0	35,562	
누계	지수	선물	413	0	413	장내
누계	통화	선물	5,882	0	5,882	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26		33
KR4A756A0C	2026-10 달러선물		471
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		2,845

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,620

공시일	2026-09-22
기준일	2026-09-21

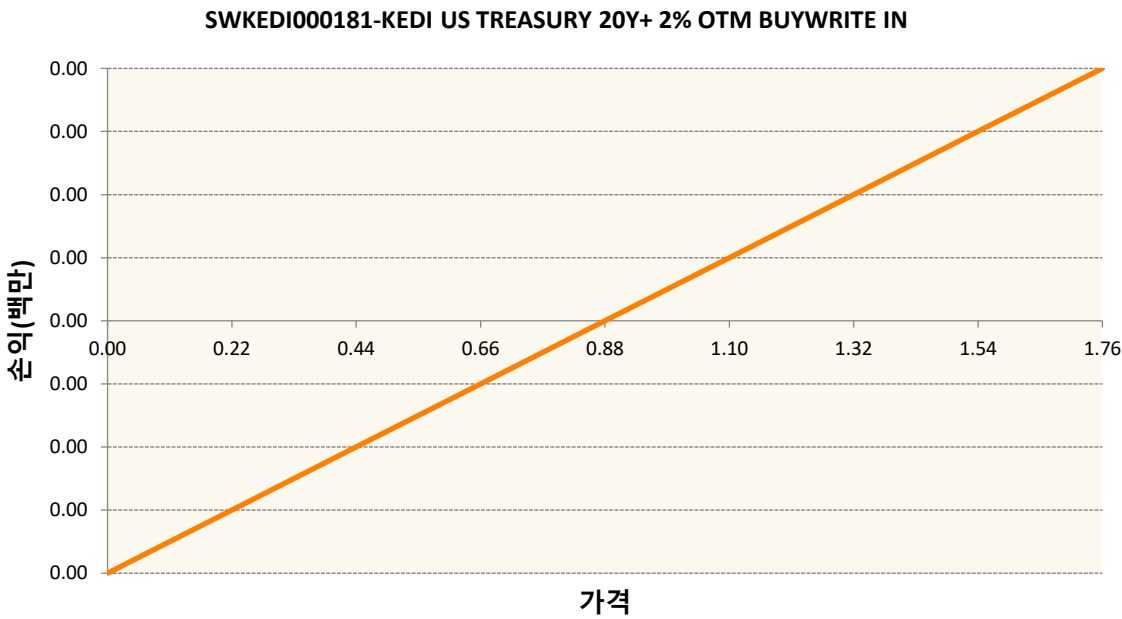
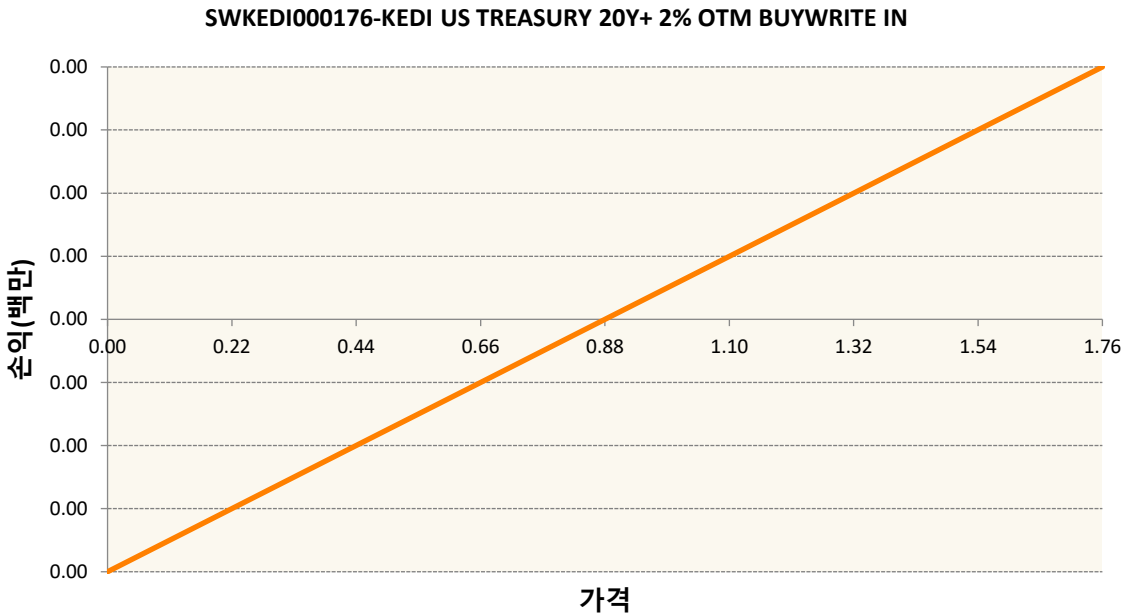
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

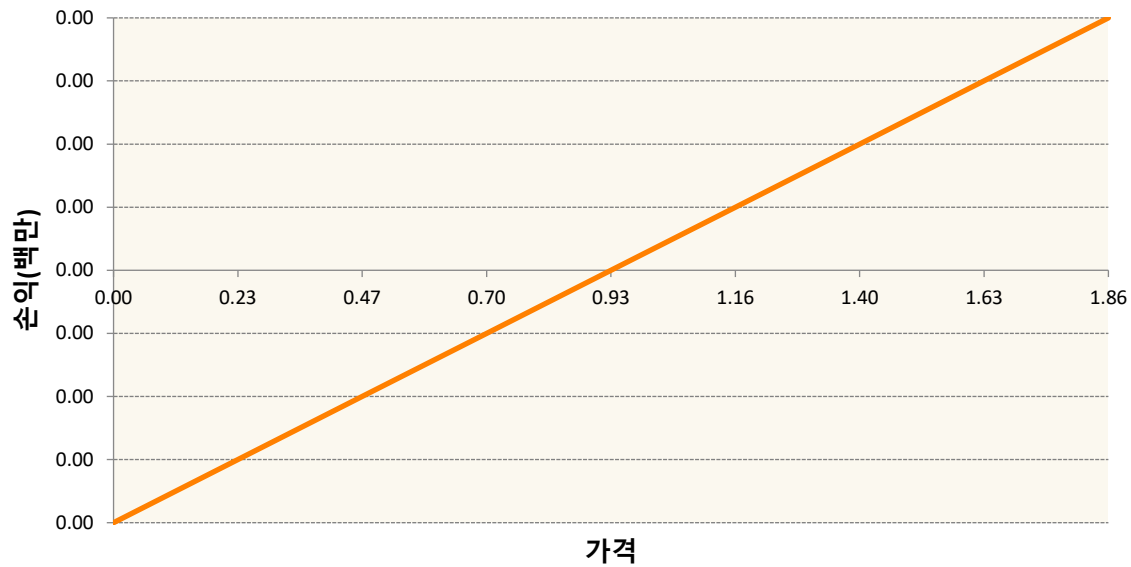
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	277,821	0	277,821	장외

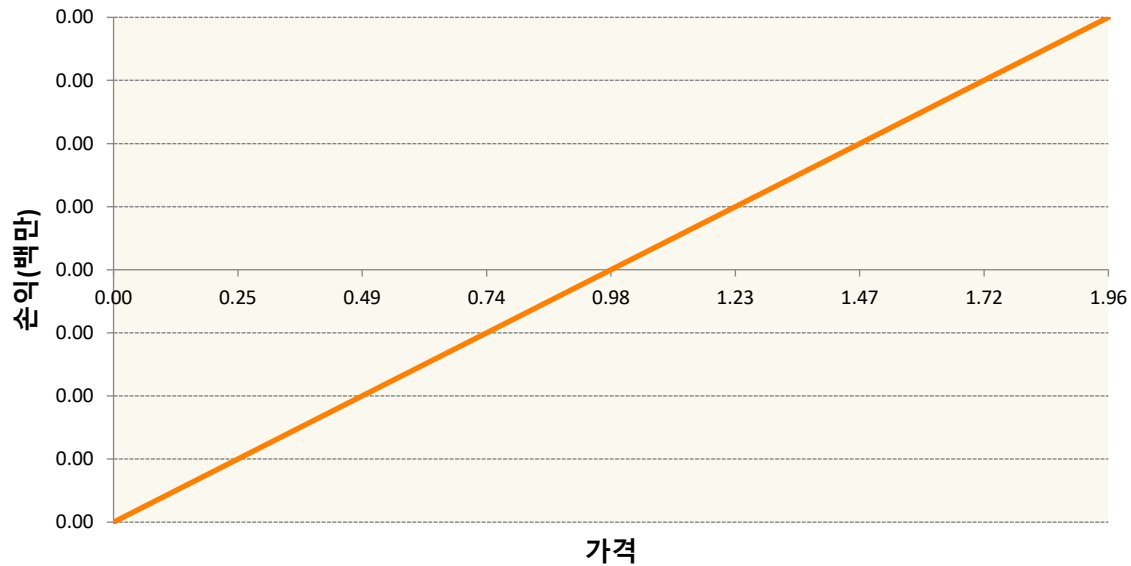
2. 만기시점의 손익구조



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	7,138
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,801
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,256
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,991

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

(단위:백만원)

8,842
