

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

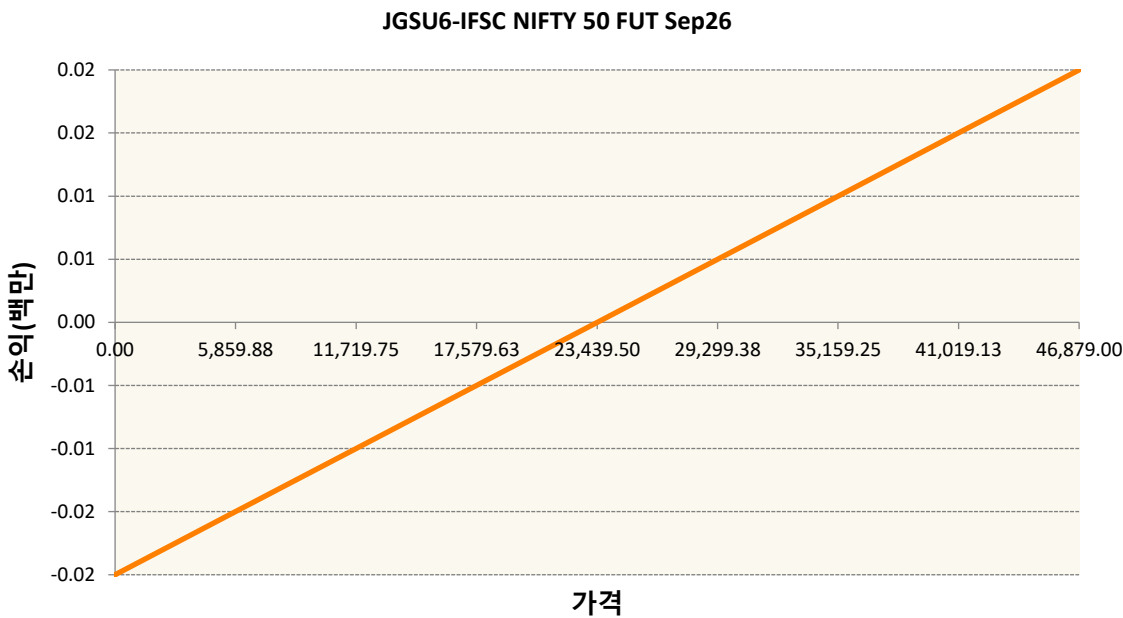
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSU6	IFSC NIFTY 50 FUT Sep26	26
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

17

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

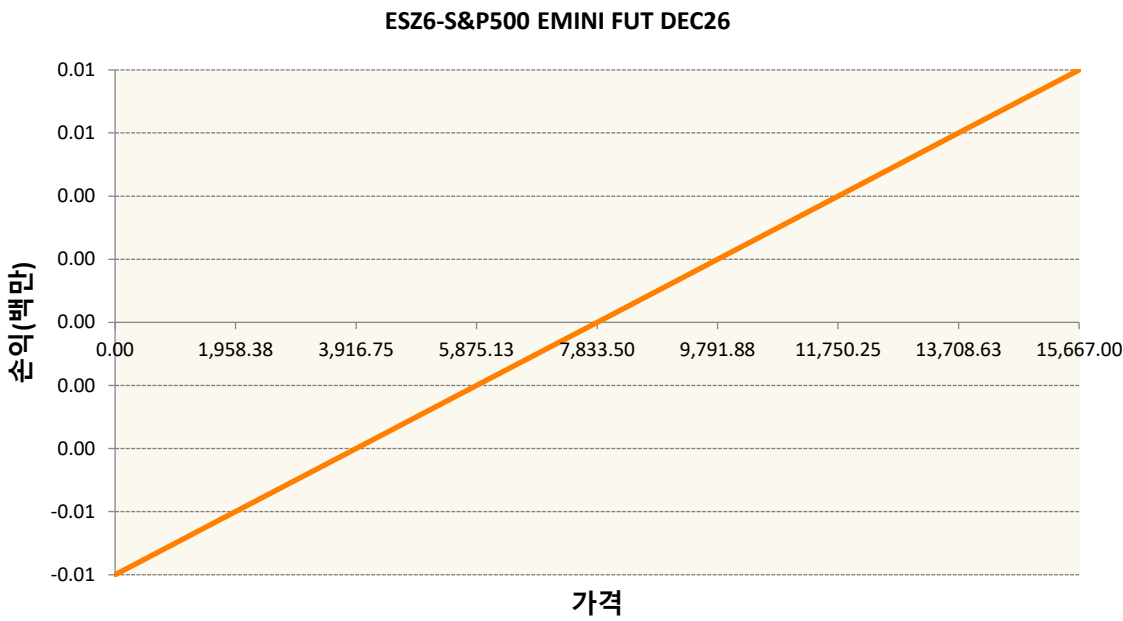
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	542	0	542	

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)

28

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

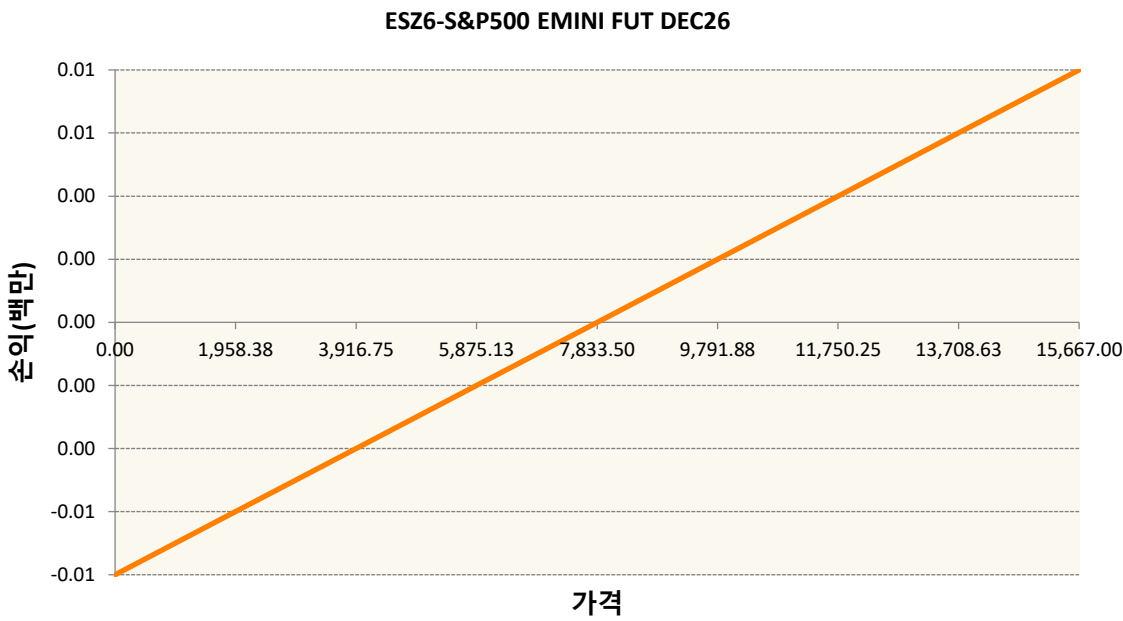
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	541	0	541	

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)

28

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

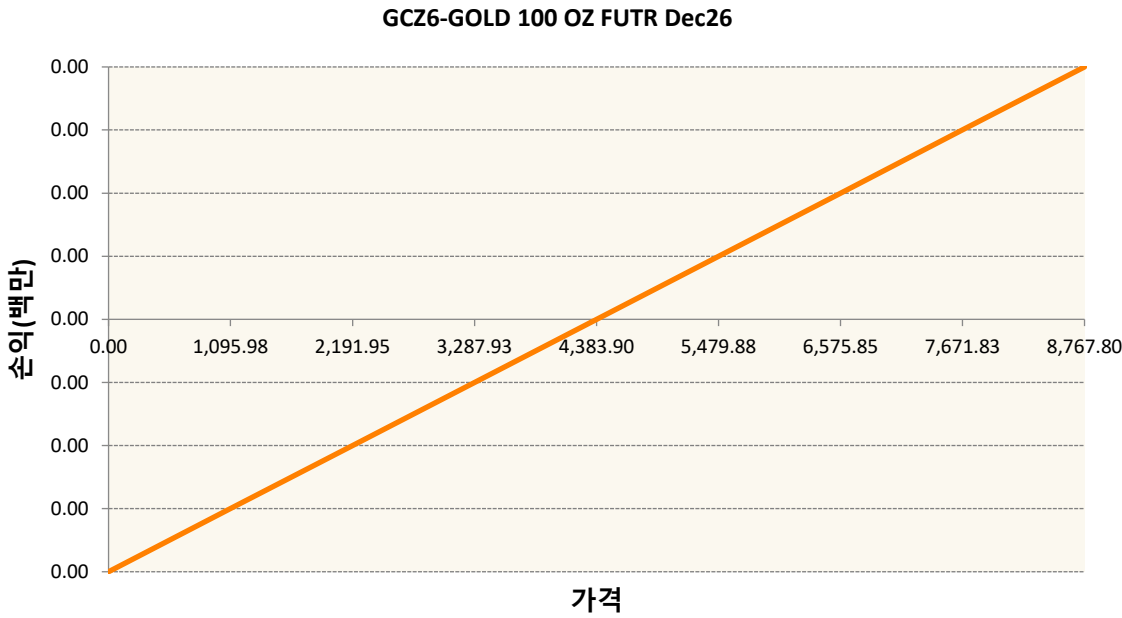
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			6,231	0	6,231	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 09/23/26 C410 EQUITY	2
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	498

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

(단위:백만원)

652

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

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	33
AOPLTRUP1\$PLTR US 09/25/26 P182.5 EQUITY	15

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

(단위:백만원)

166

공시일 2026-09-23

기준일 2026-09-22

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)

13,340

공시일 2026-09-23

기준일 2026-09-22

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	2026-09-23
기준일	2026-09-22

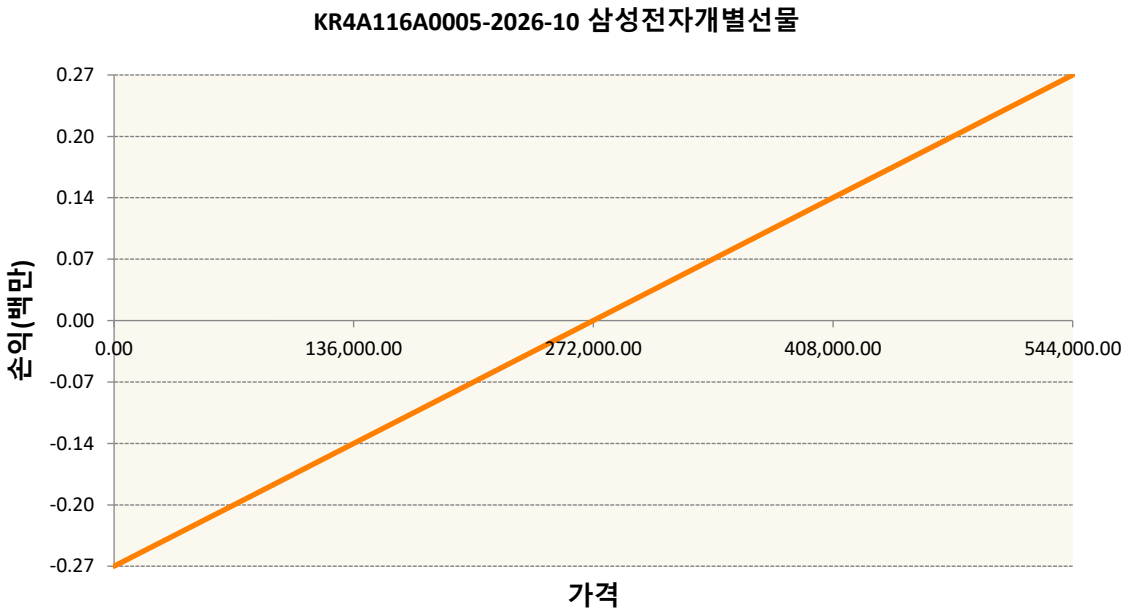
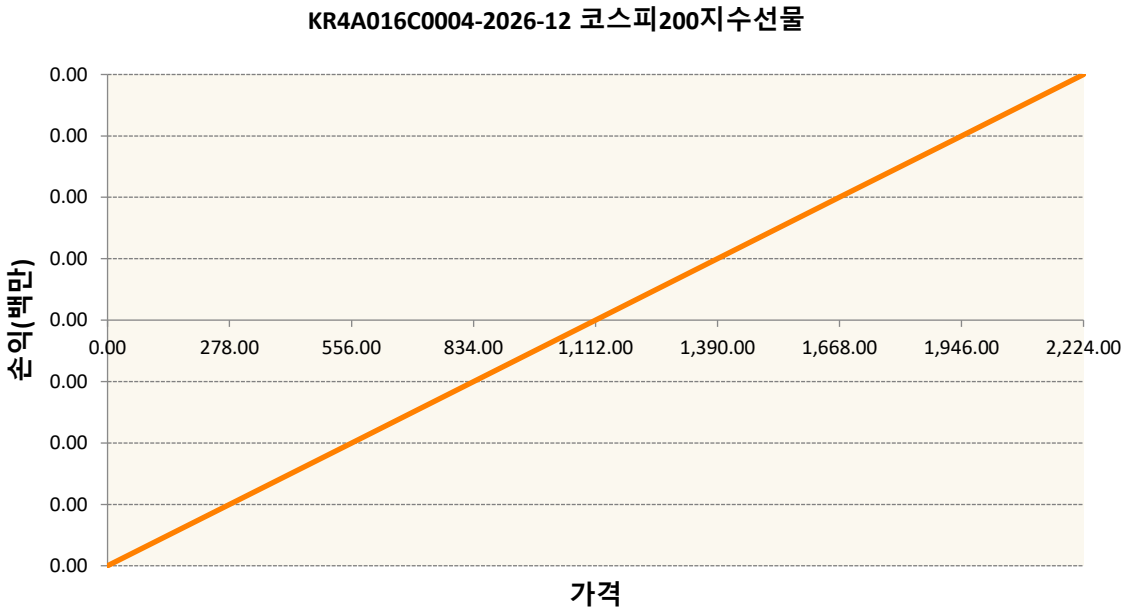
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	21,916	0	21,916	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				579
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-579	-579	-579	-579	-579	-579	-579	
-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%	579	579	579	579	579	579	579	
KR4A116A0005				2026-10 삼성전자개별선물				1,194
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194	-1,194
-5.33%	-796	-796	-796	-796	-796	-796	-796
-2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	398	398	398	398	398	398	398
5.33%	796	796	796	796	796	796	796
8.00%	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194	1,194
KR4B09FEA466 코스피위클리 C 2609W4 1,112.5							3,697

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,696	-3,696	-3,696	-3,696	-3,696	-3,696	-3,697
-5.33%	-2,293	-2,294	-2,295	-2,297	-2,301	-2,305	-2,312
-2.67%	-917	-932	-950	-970	-993	-1,018	-1,044
0%	123	82	41	0	-41	-82	-123
2.67%	446	432	414	394	372	348	321
5.33%	470	470	468	465	461	456	448
8.00%	471	471	471	471	470	470	469

KR4B09FEA474 코스피위클리 C 2609W4 1,115.0							2,503
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,502	-2,502	-2,502	-2,502	-2,502	-2,502	-2,503
-5.33%	-1,567	-1,567	-1,568	-1,569	-1,571	-1,574	-1,578
-2.67%	-645	-654	-664	-676	-690	-705	-721
0%	82	55	27	0	-27	-55	-82
2.67%	332	321	307	292	276	258	239
5.33%	354	353	352	349	346	342	336
8.00%	354	354	354	354	354	353	352

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

(단위:백만원)

18,053

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

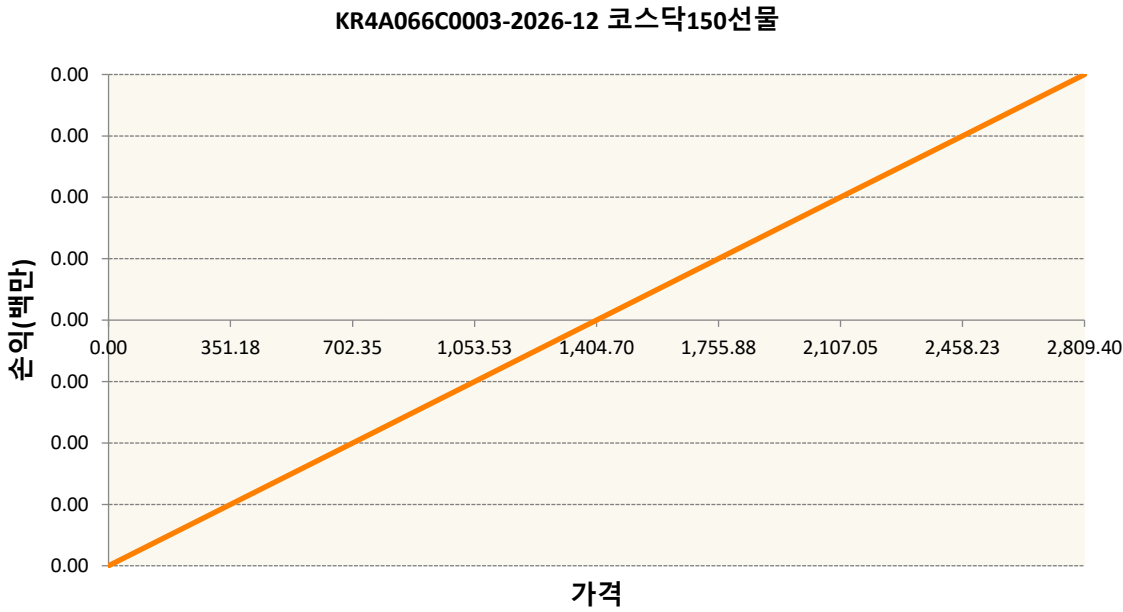
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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				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)

14,268

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

(단위:백만원)

81,385

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

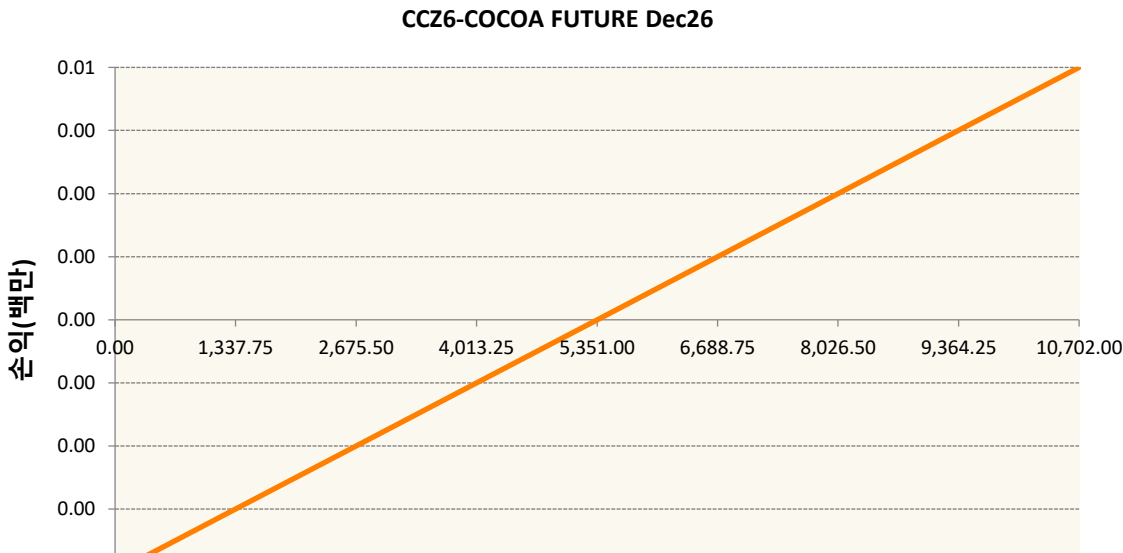
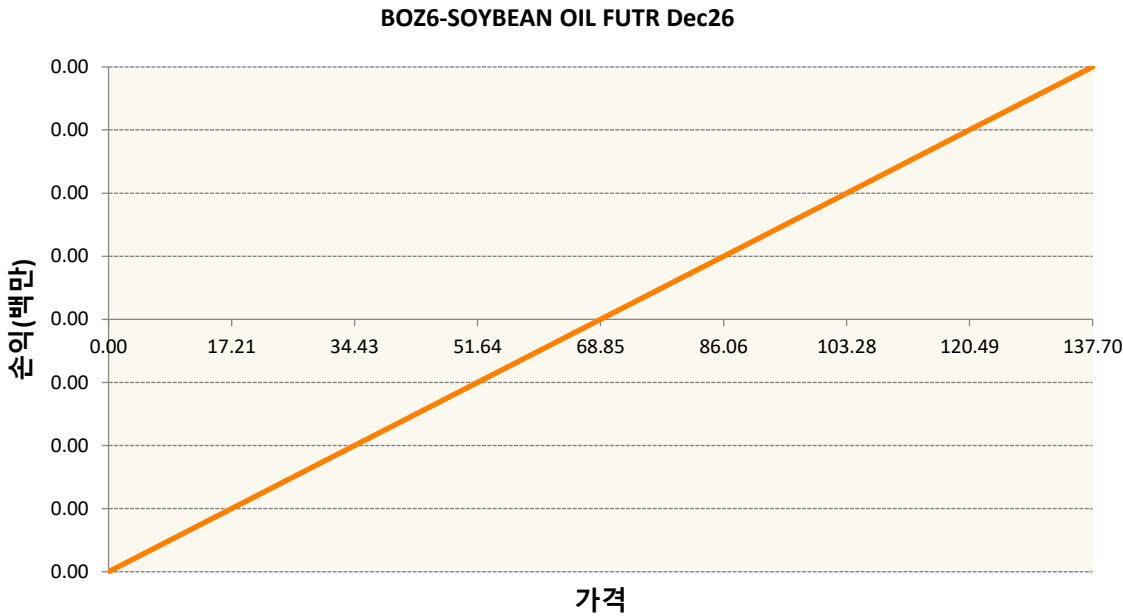
포커스농산물모(채권-파생형)

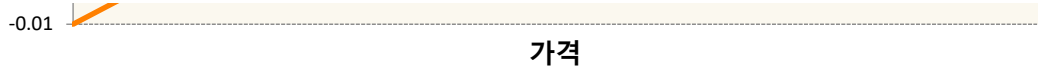
1. 계약금액

(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	388	0	388	
누계	유가증권	선물	2,423	0	2,423	
누계	통화	선물	0	340	-340	장내

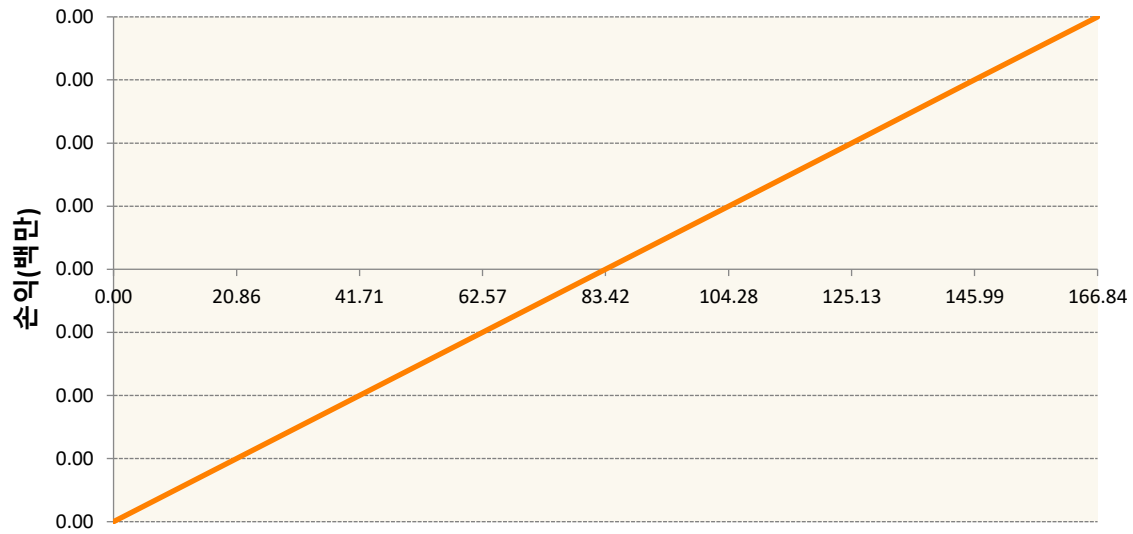
2. 만기시점의 손익구조





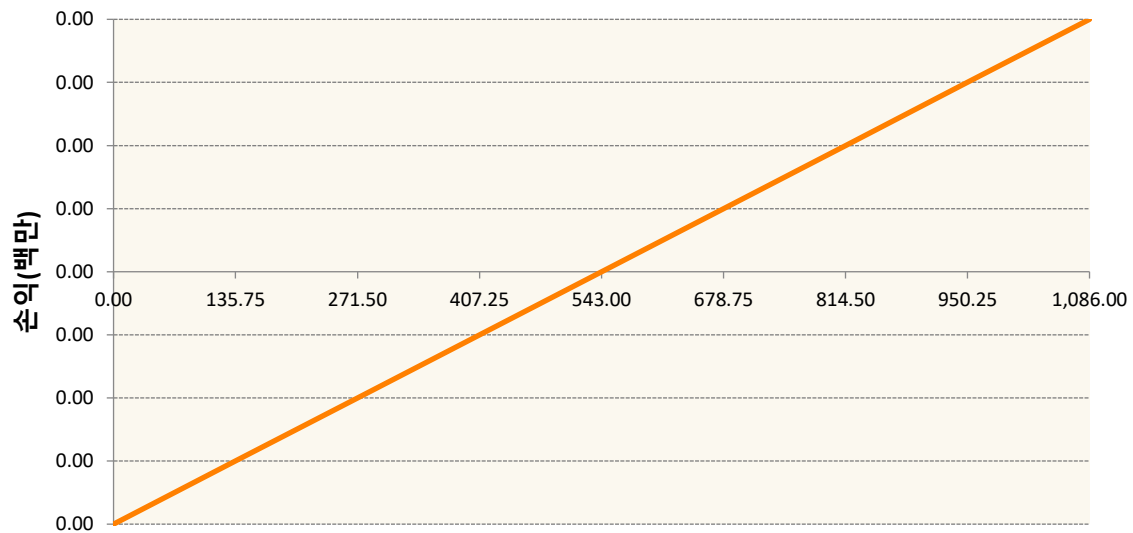
가격

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26



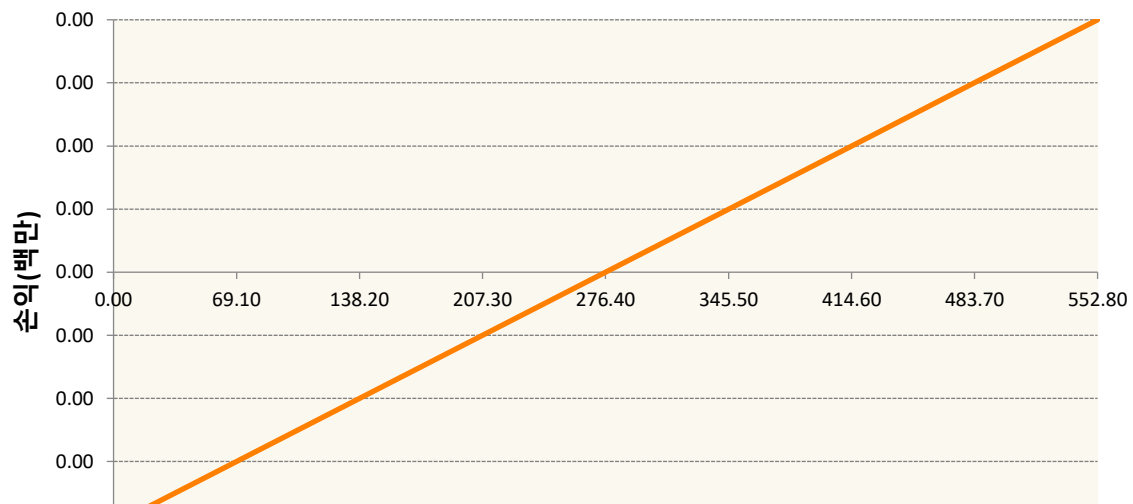
가격

CZ6-CORN FUTURE Dec26

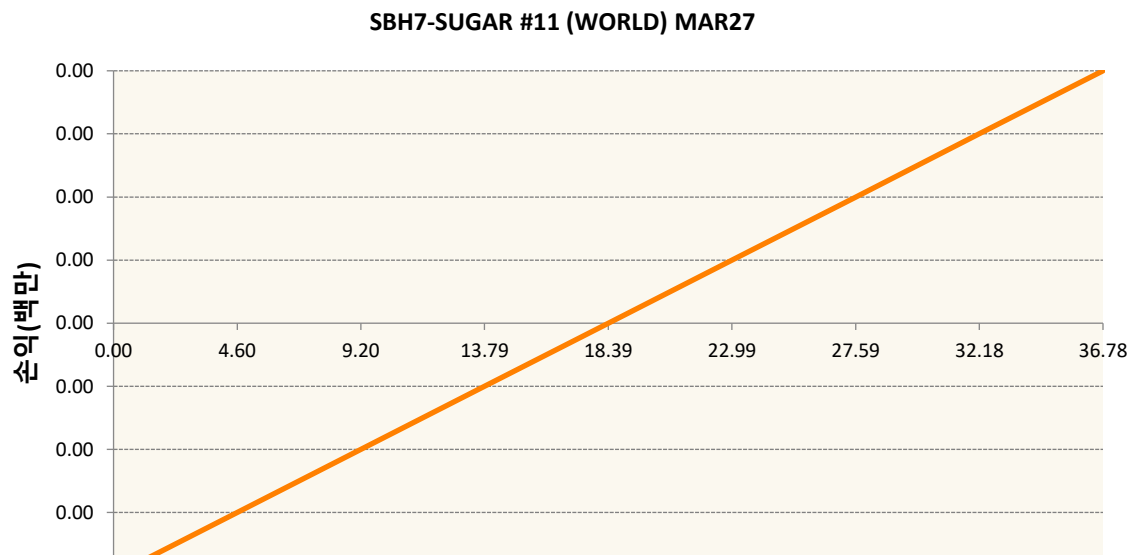
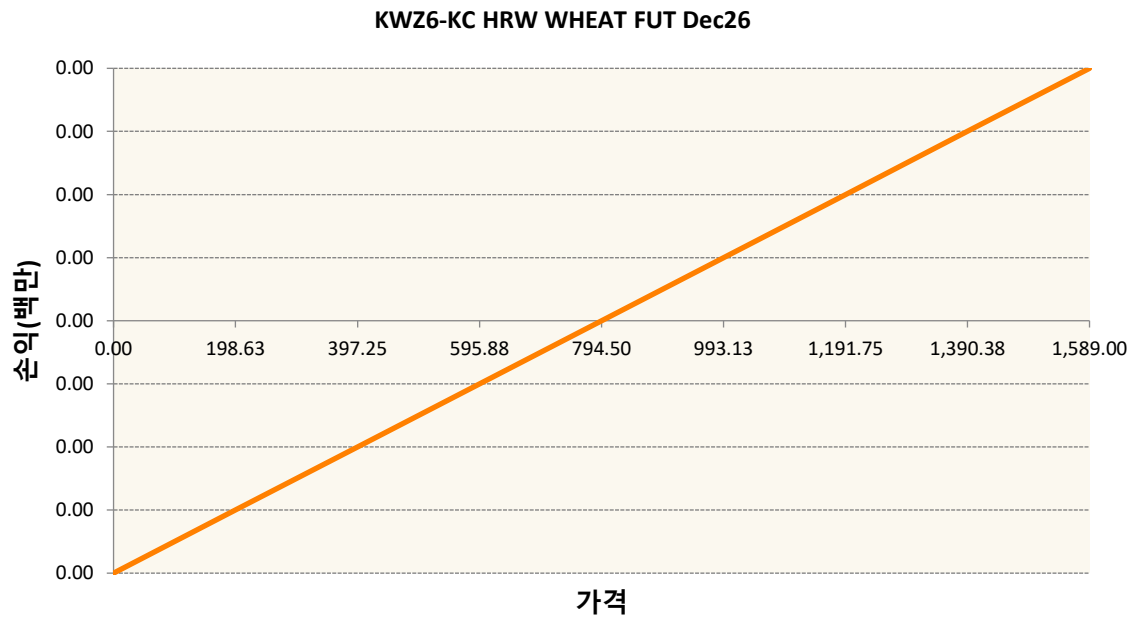
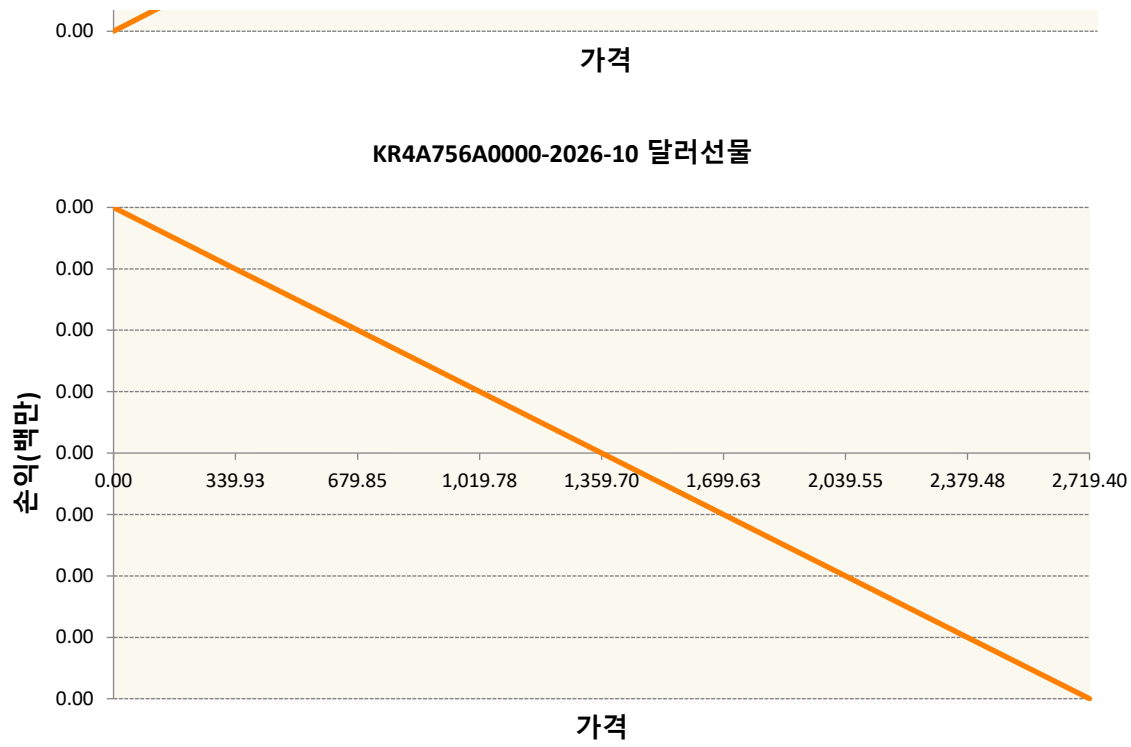


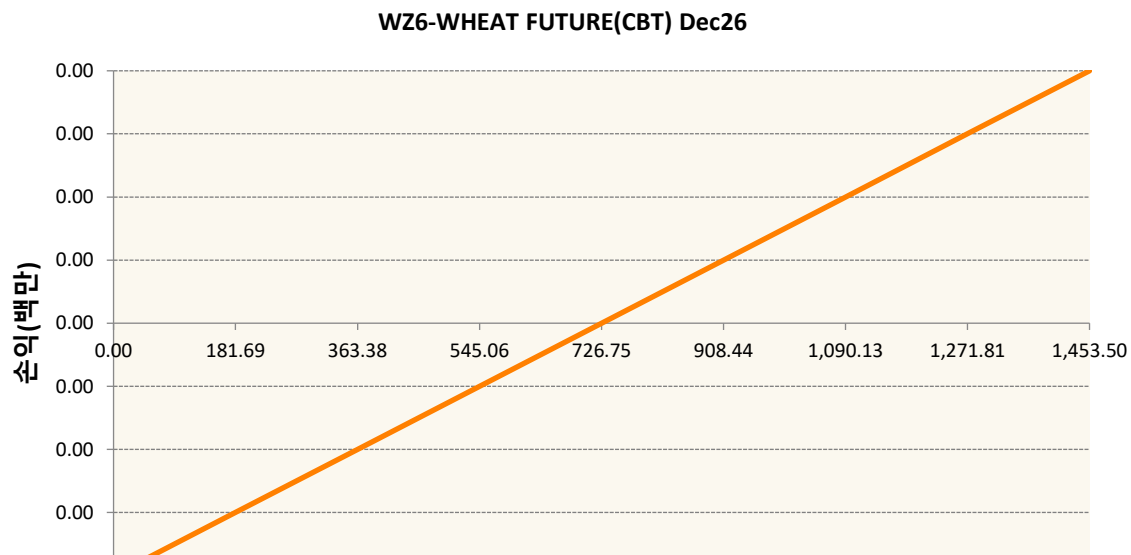
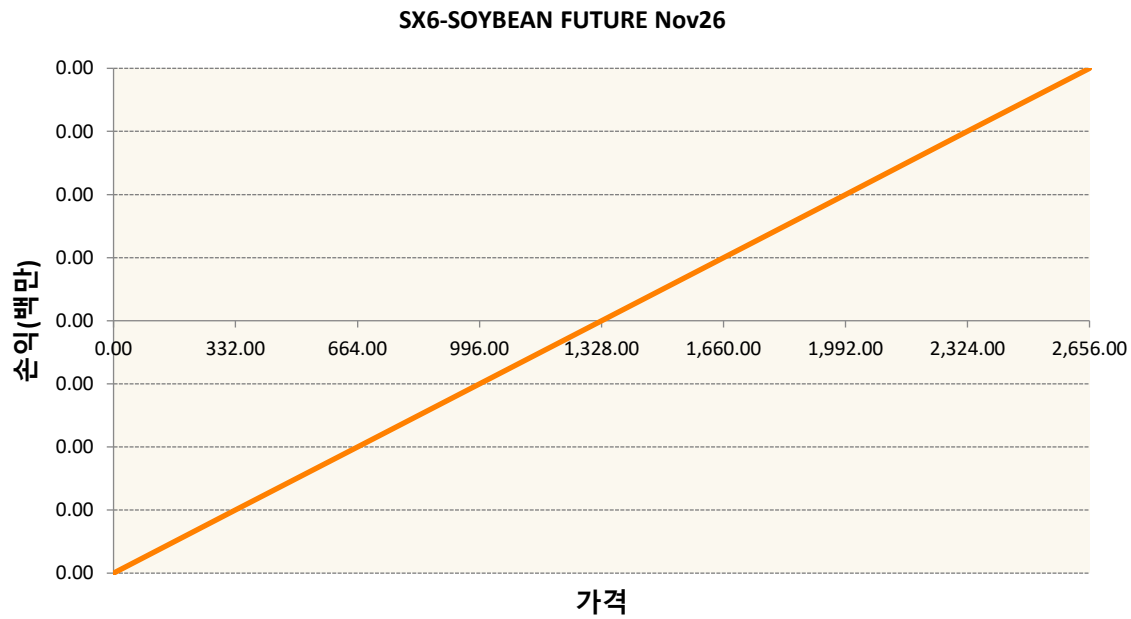
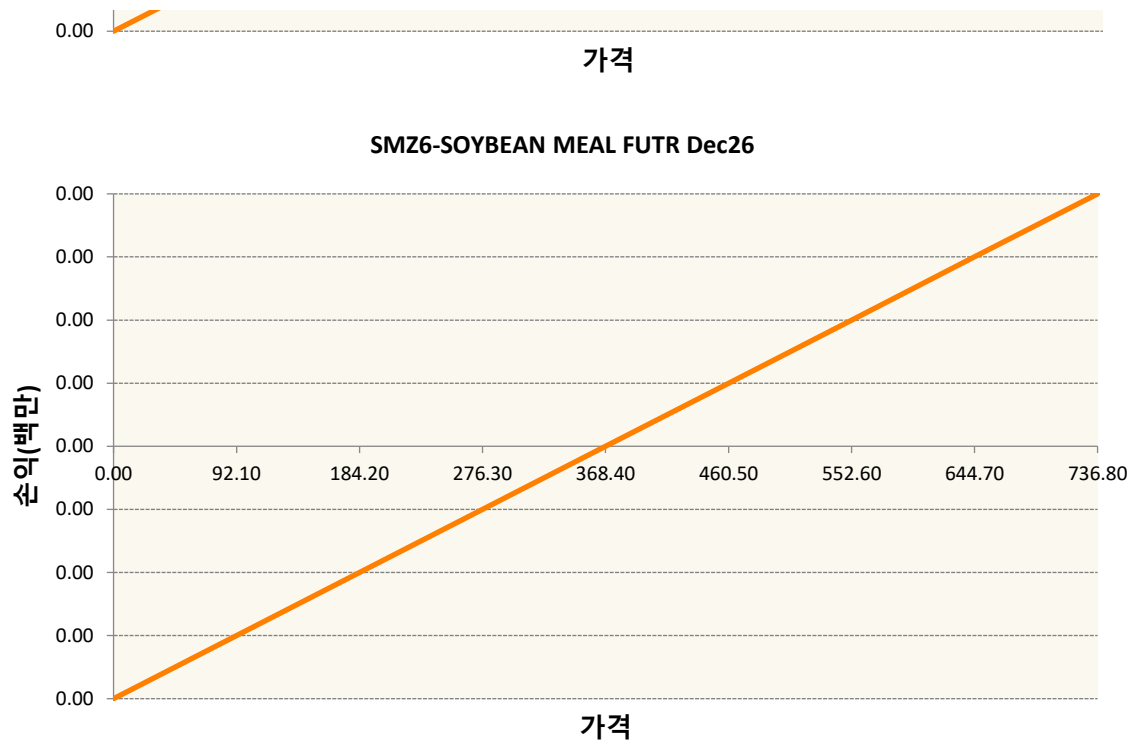
가격

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26



손익(백만)





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	2026-09-23
기준일	2026-09-22

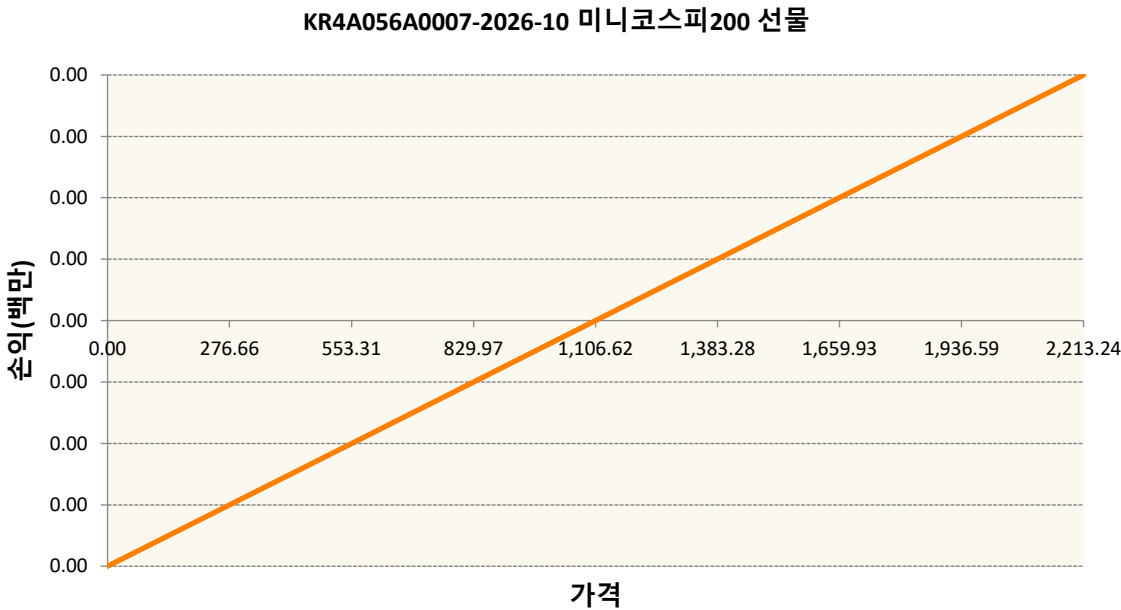
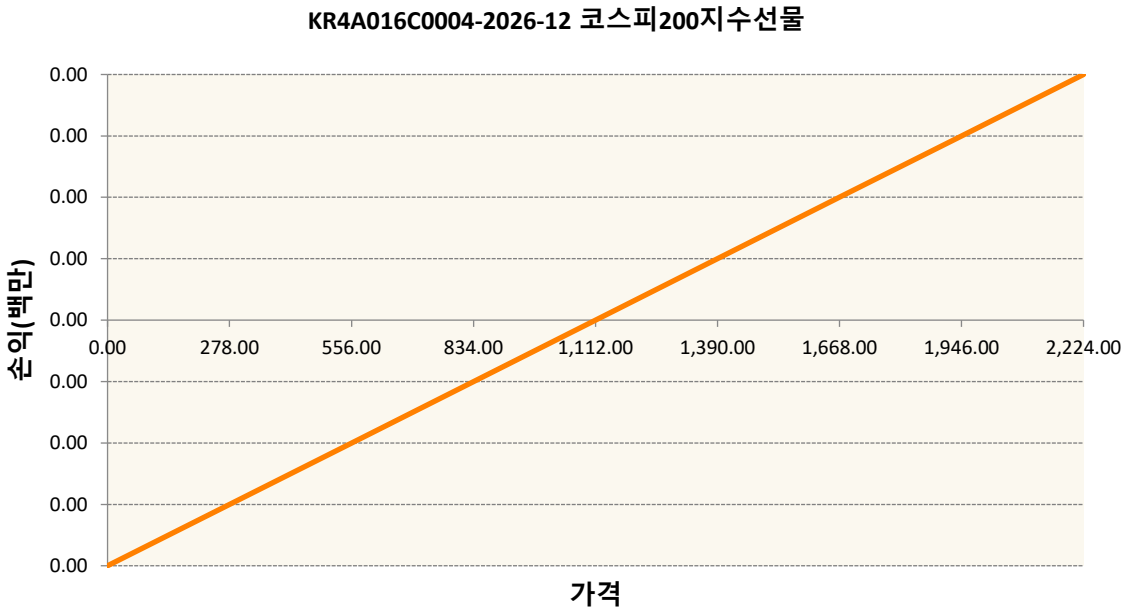
스마트인덱스모

1. 계약금액

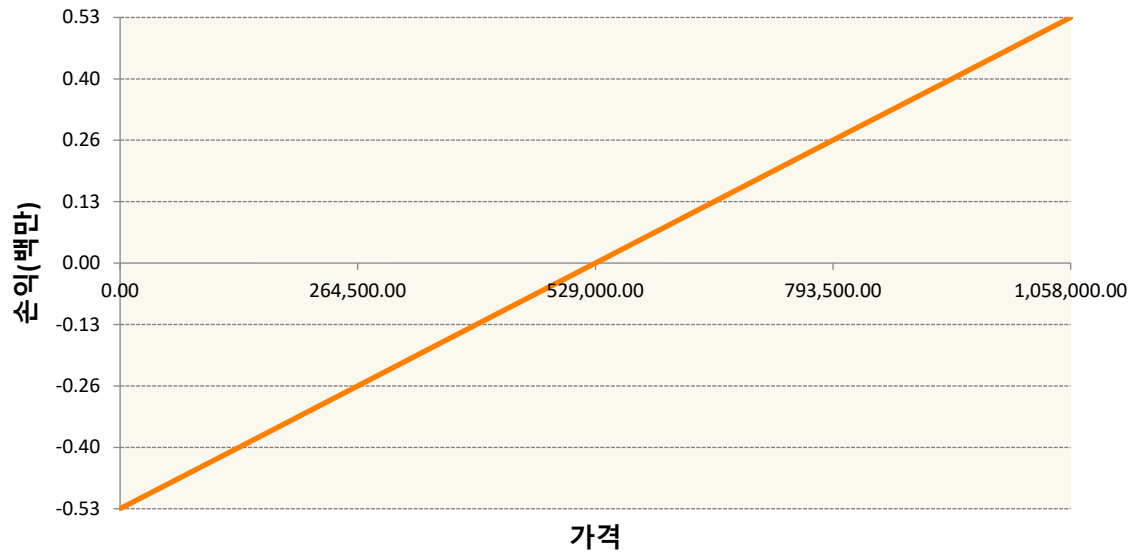
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	843	0	843	장내
누계	유가증권	선물	8,942	57	8,885	장내

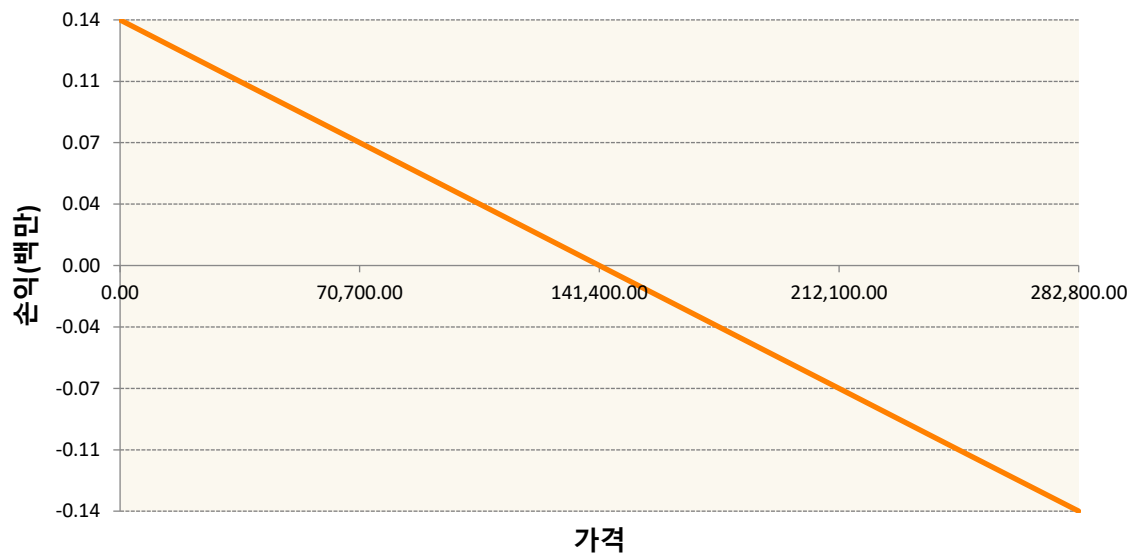
2. 만기시점의 손익구조



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%	-223	-223	-223	-223	-223	-223	-223
-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%	223	223	223	223	223	223	223
8.00%	334	334	334	334	334	334	334
KR4A056A0007		2026-10 미니코스피200 선물					76
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	76	76	76	76	76	76	76
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)

1,403

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

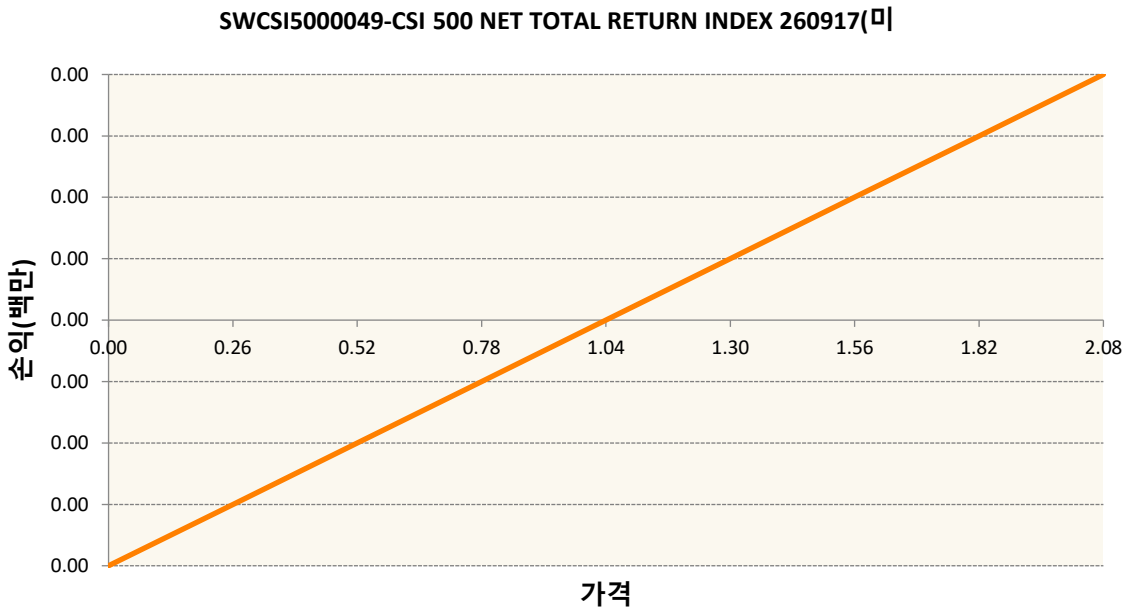
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,534	0	5,534	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미

443

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

694

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

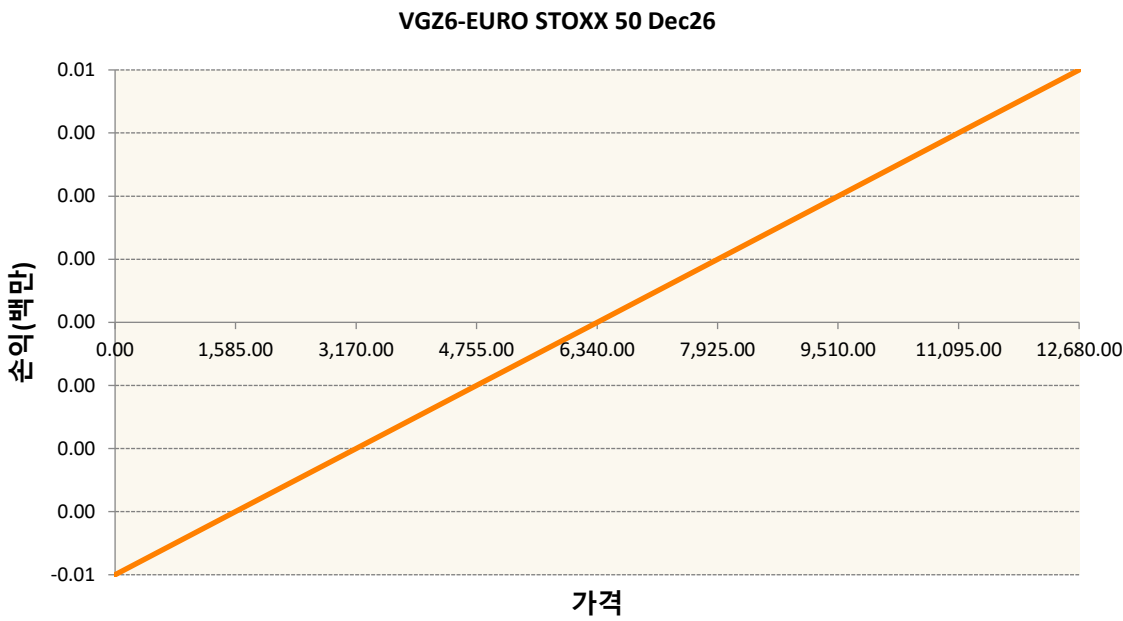
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,106	0	1,106	

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	2026-09-23
기준일	2026-09-22

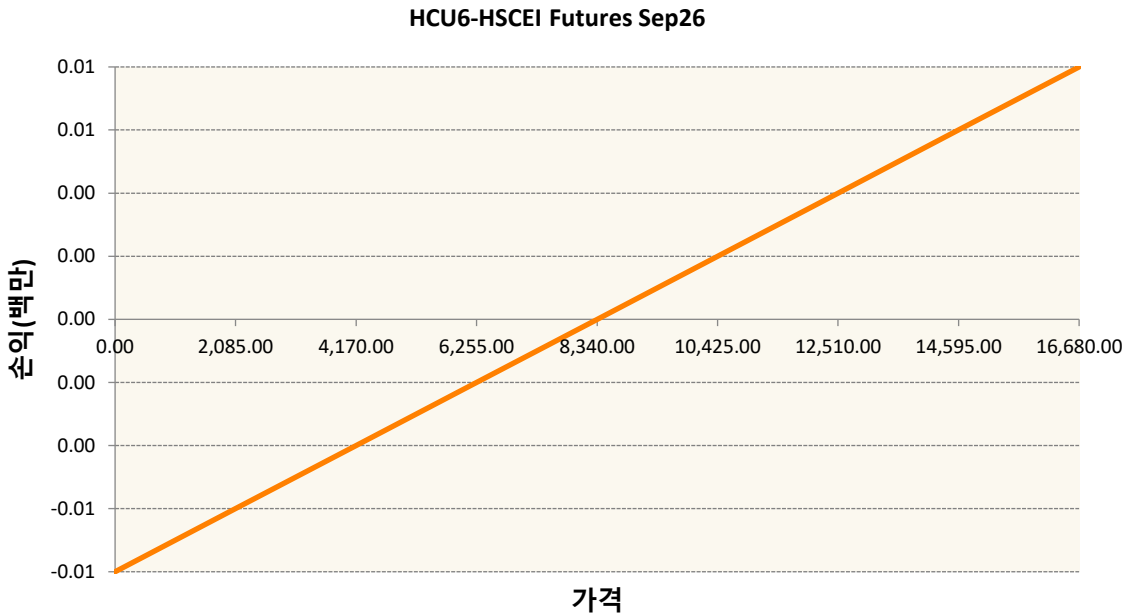
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,314	0	1,314	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCU6	HSCEI Futures Sep26	105
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

100

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

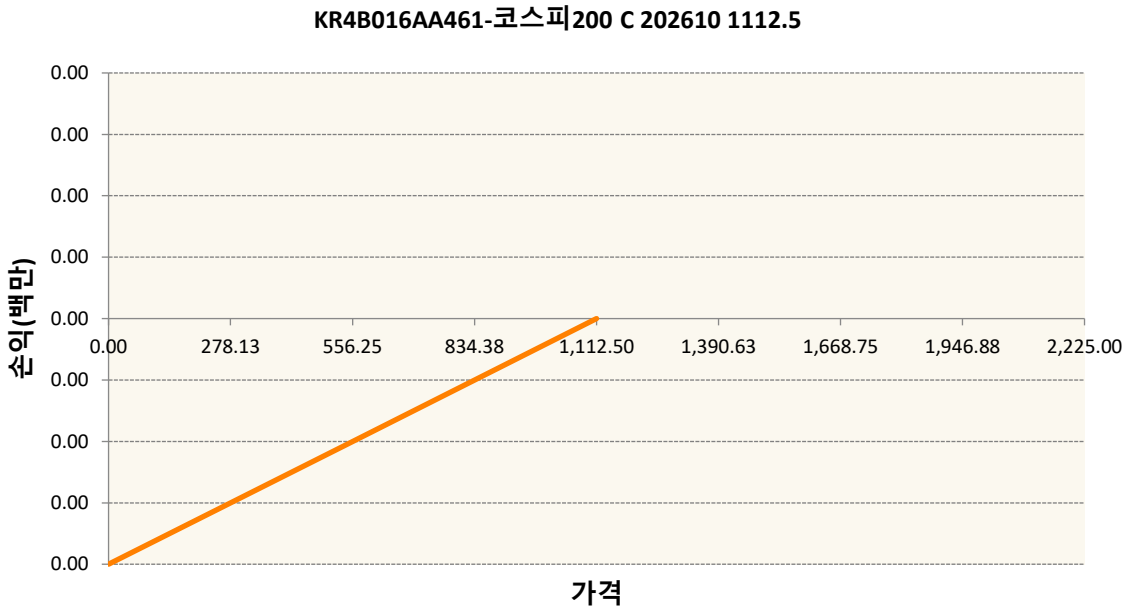
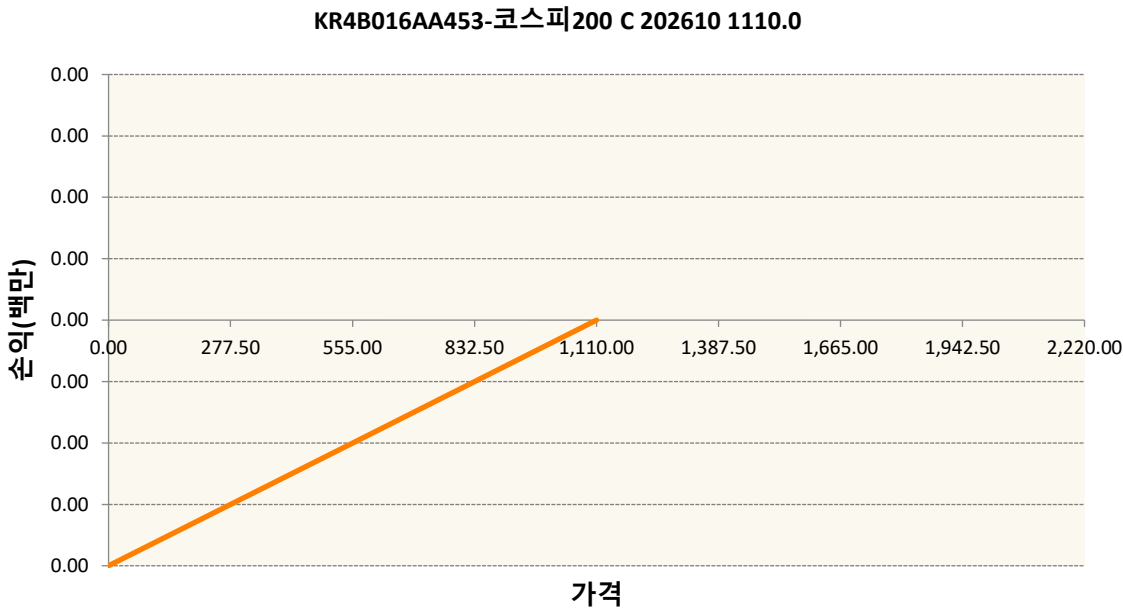
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

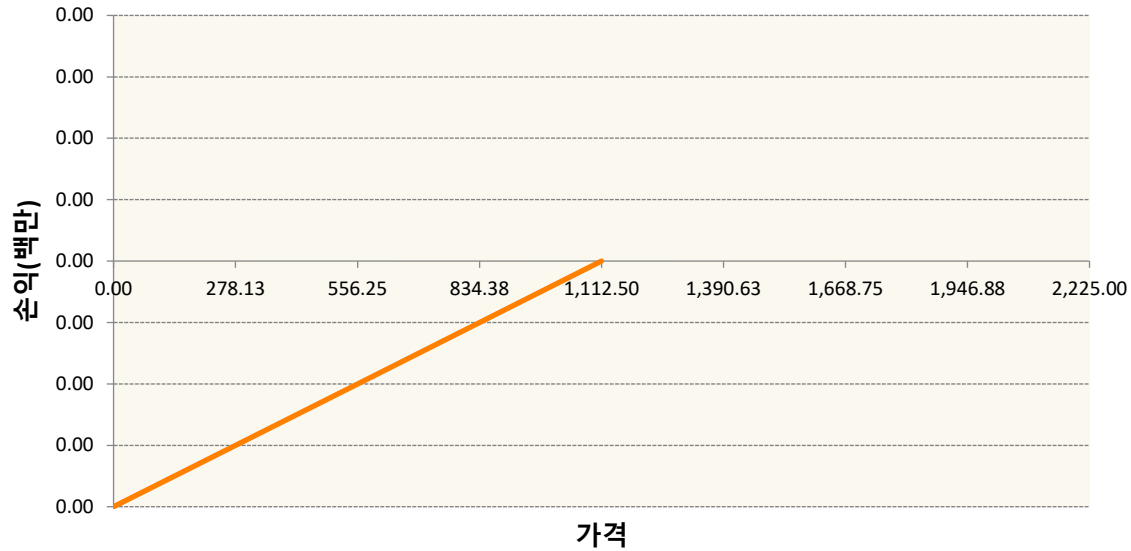
(단위:백만원)

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							414
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-325	-337	-351	-365	-381	-397	-414
-5.33%	-169	-186	-204	-223	-242	-261	-281
-2.67%	-36	-58	-79	-100	-122	-144	-165
0%	67	45	22	0	-22	-45	-67
2.67%	142	121	100	79	57	35	13
5.33%	192	175	157	138	118	98	78
8.00%	222	210	195	180	163	146	128
KR4B016AA461 코스피200 C 202610 1112.5							1,850
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,465	-1,517	-1,575	-1,639	-1,706	-1,777	-1,850
-5.33%	-766	-841	-920	-1,001	-1,085	-1,170	-1,257
-2.67%	-171	-264	-358	-452	-547	-643	-738
0%	298	199	99	0	-99	-199	-298
2.67%	641	547	452	356	260	162	65
5.33%	870	792	709	624	537	447	356
8.00%	1,010	952	887	816	742	664	583
KR4C016AA460 코스피200 P 202610 1112.5							531
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-420	-435	-452	-470	-490	-510	-531
-5.33%	-220	-241	-264	-287	-311	-336	-361
-2.67%	-49	-76	-103	-130	-157	-184	-212
0%	86	57	29	0	-29	-57	-86

2.67%	184	157	130	102	74	47	19
5.33%	250	227	204	179	154	128	102
8.00%	290	273	254	234	213	191	167

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

(단위:백만원)

4,318

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

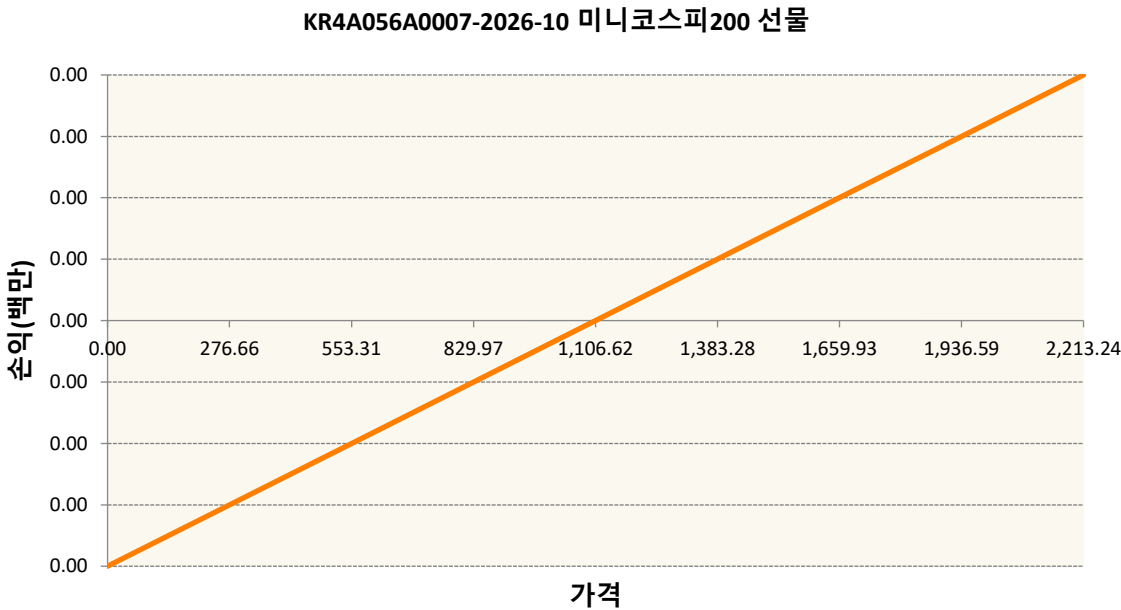
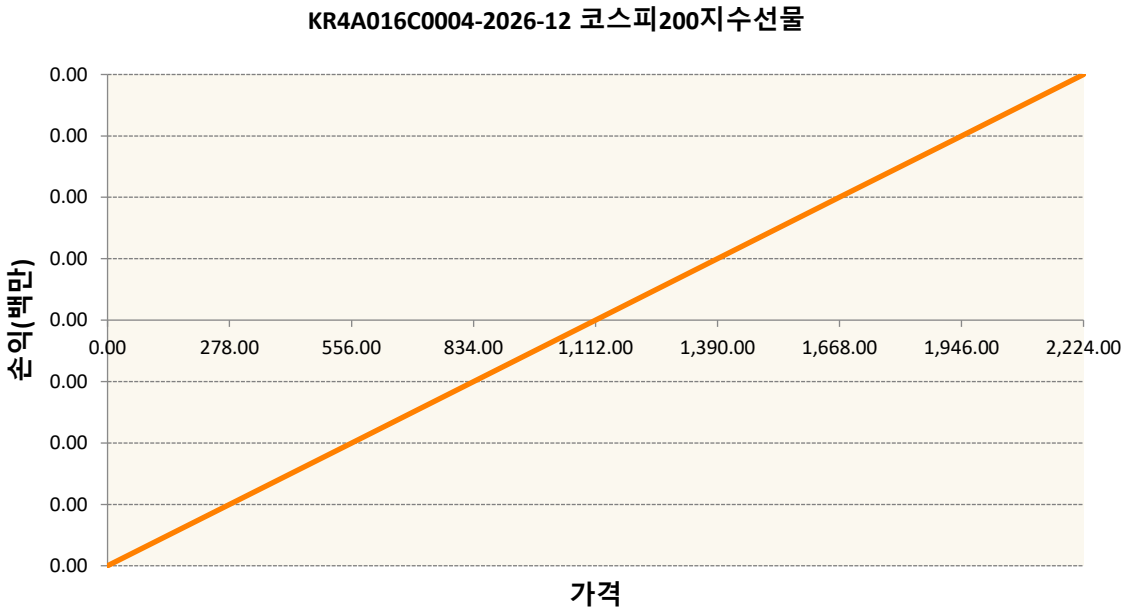
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

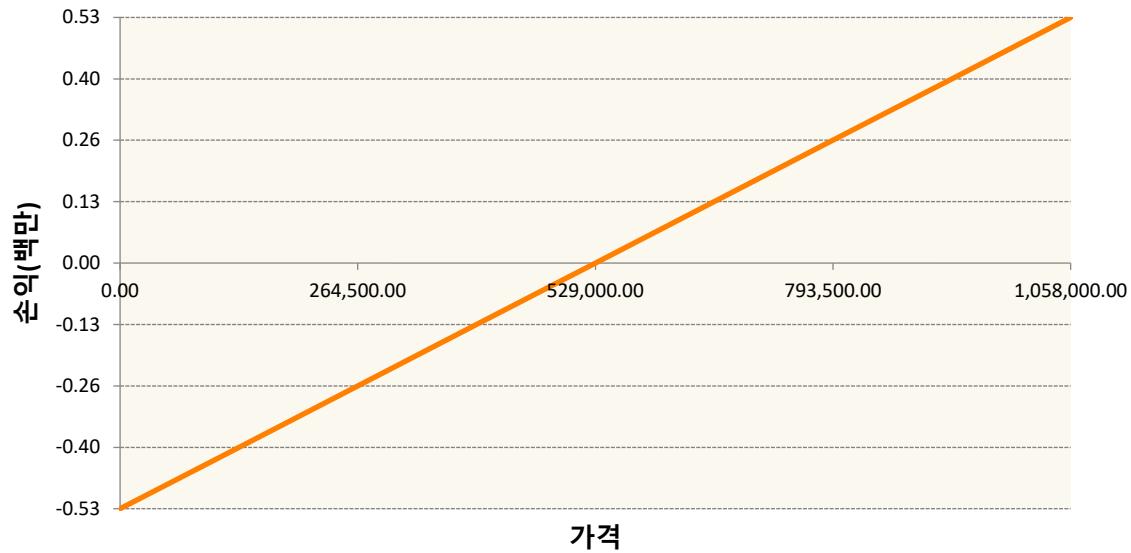
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,547	57	2,490	장내

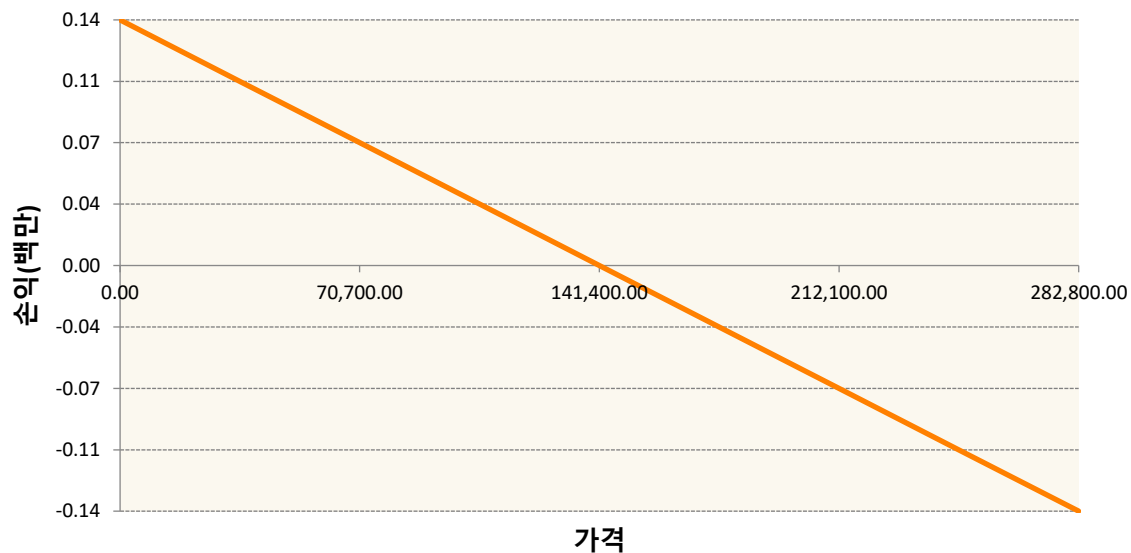
2. 만기시점의 손익구조



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%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-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%	45	45	45	45	45	45	45
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	2026-09-23
기준일	2026-09-22

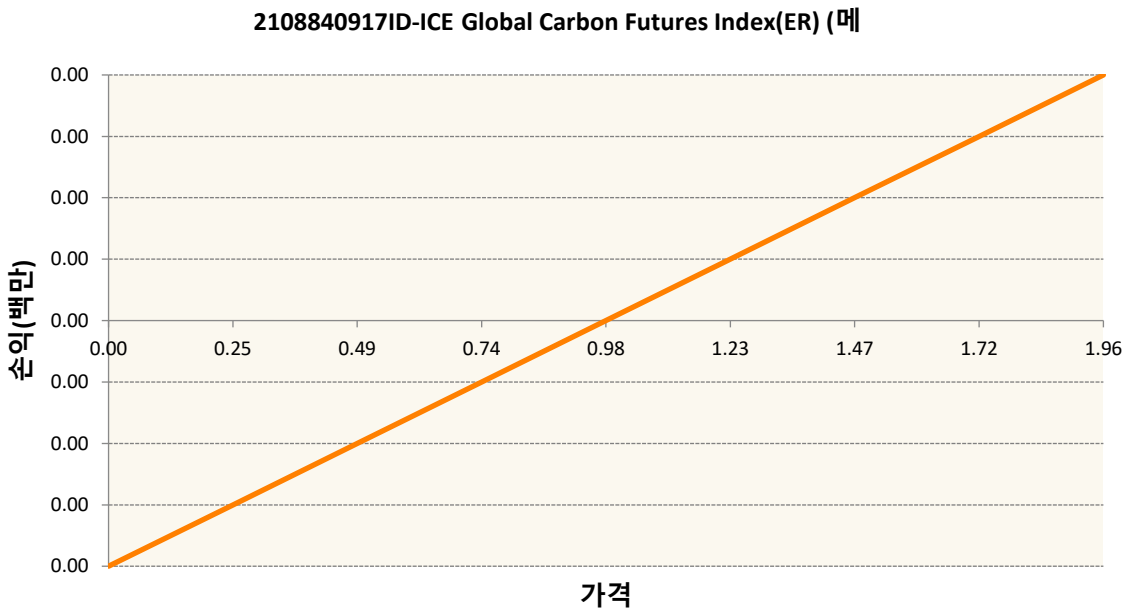
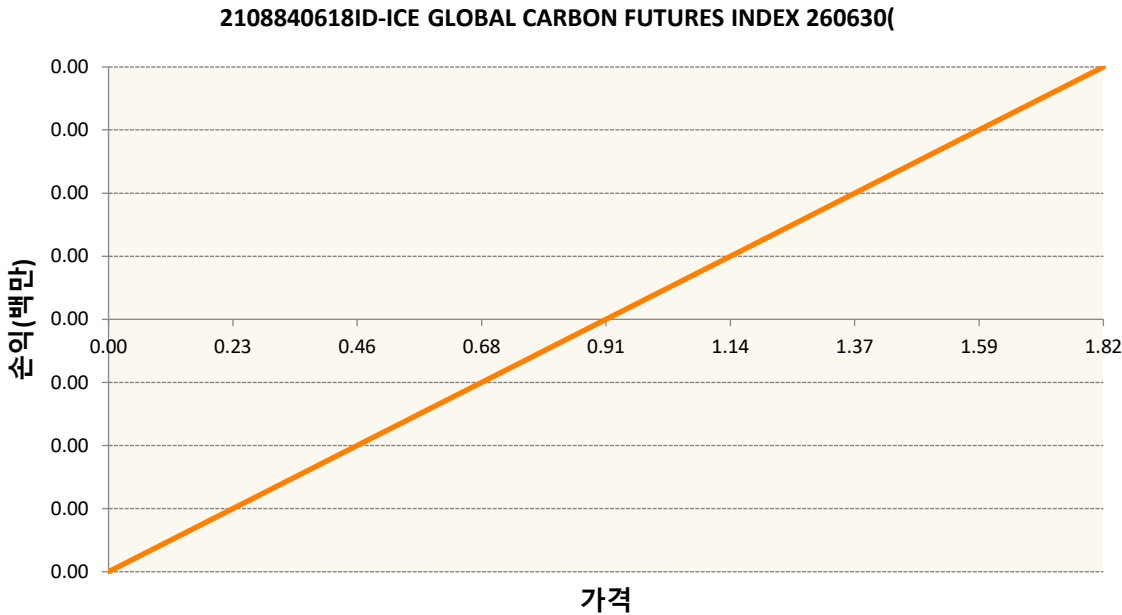
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,925	0	6,925	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		442
2108840917IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		112

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		585

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

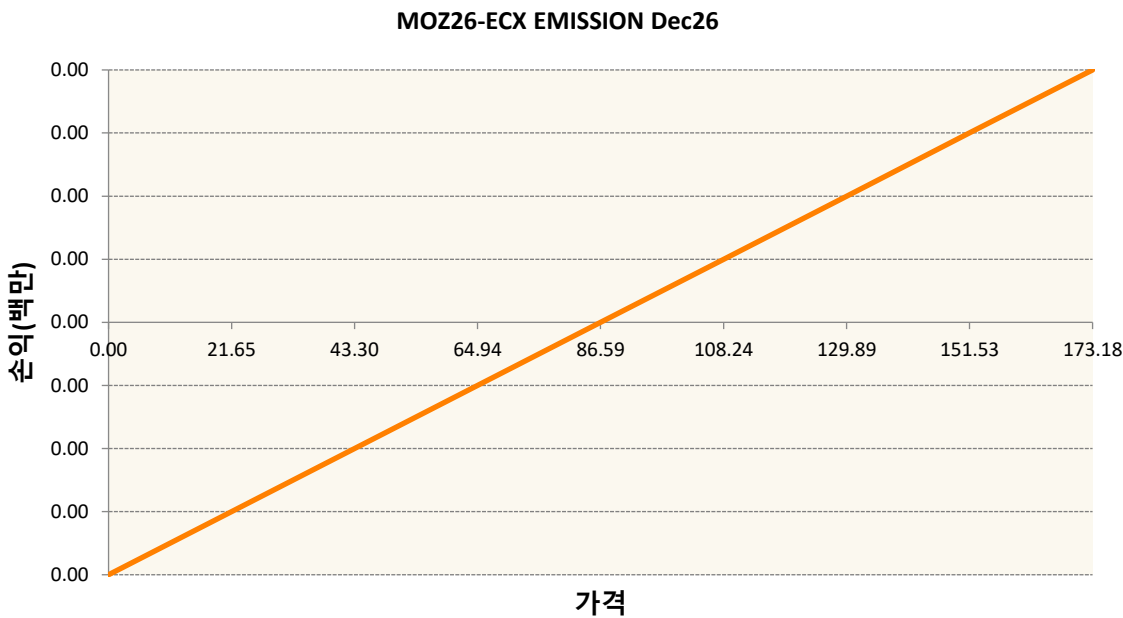
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,119	0	6,119	
누계	통화	선도	0	2,584	-2,584	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G8V\ KRW/EUR 30-09-26E	207
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	490

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

(단위:백만원)

749

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

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)	70
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	32
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	28
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	42

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

(단위:백만원)

277

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

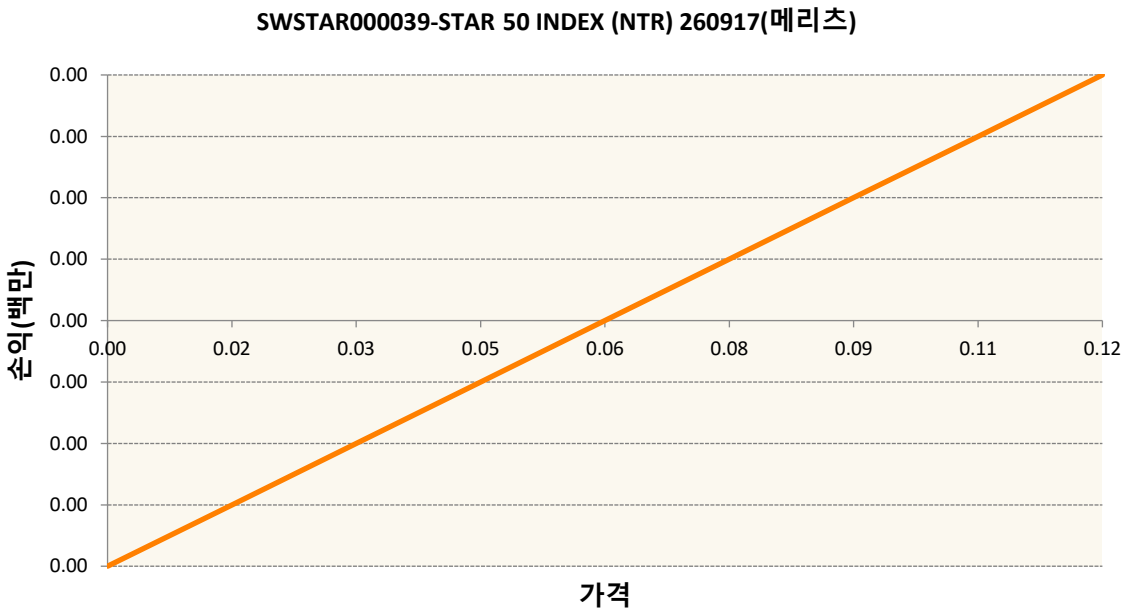
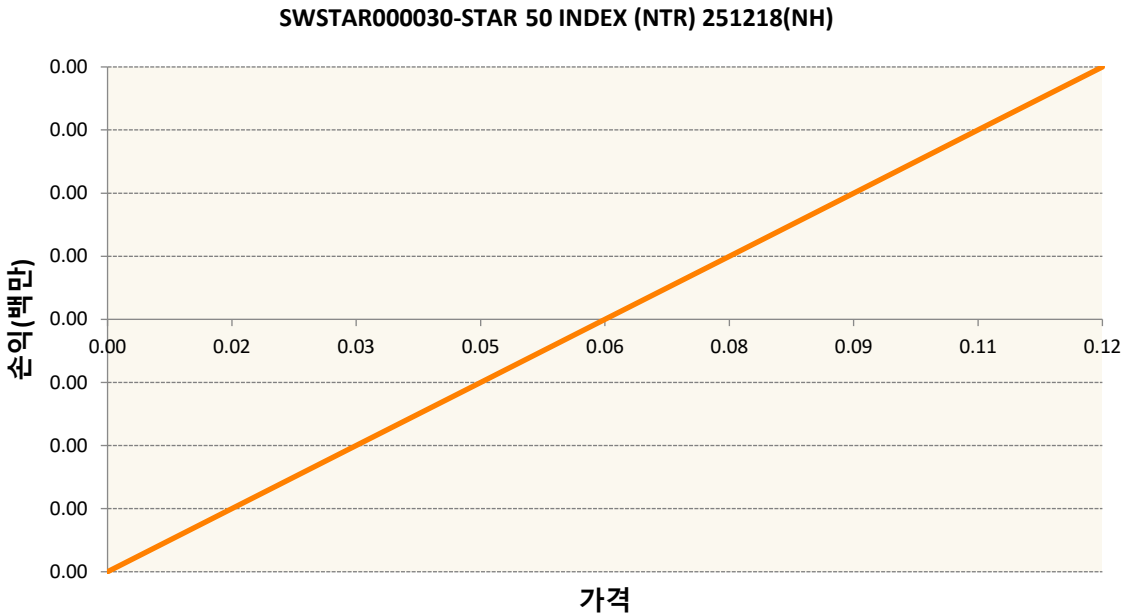
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	-1,889	0	-1,889	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)		16
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)		202
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)		34

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	479

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

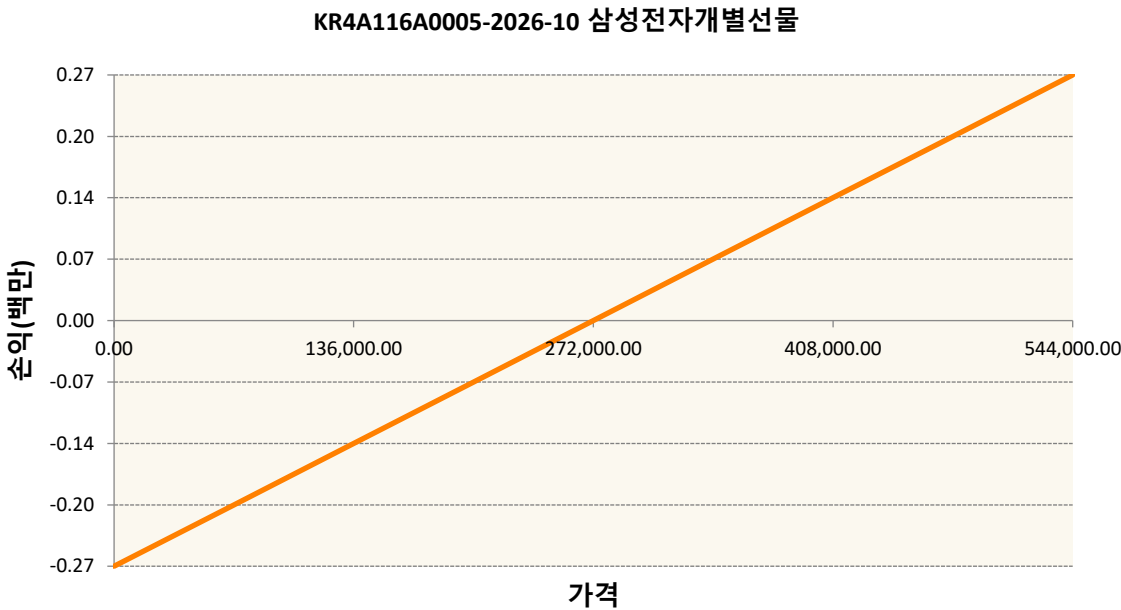
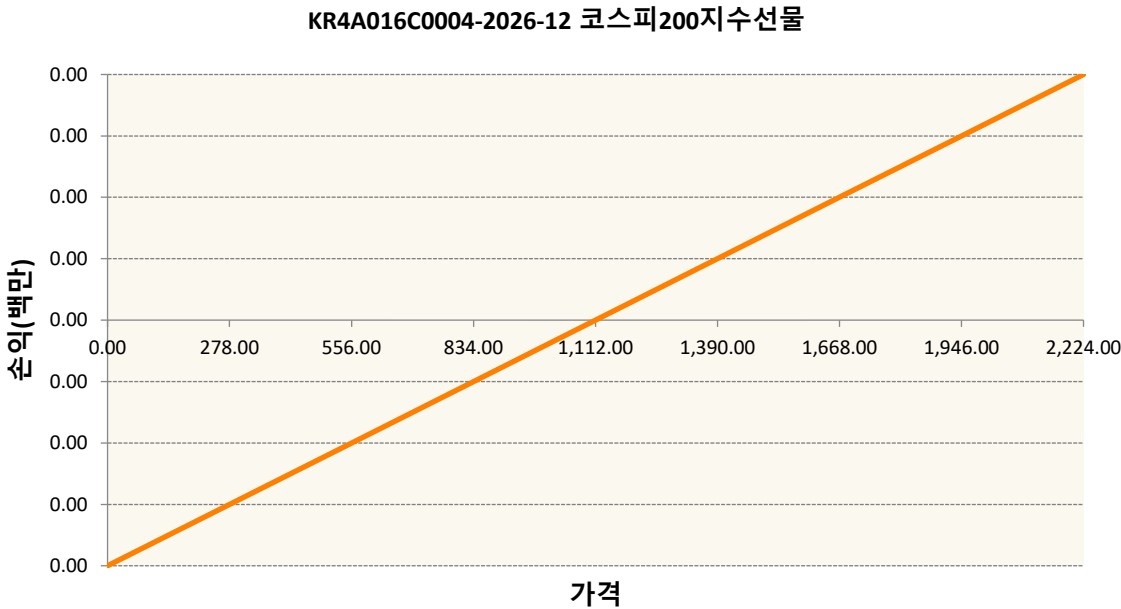
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

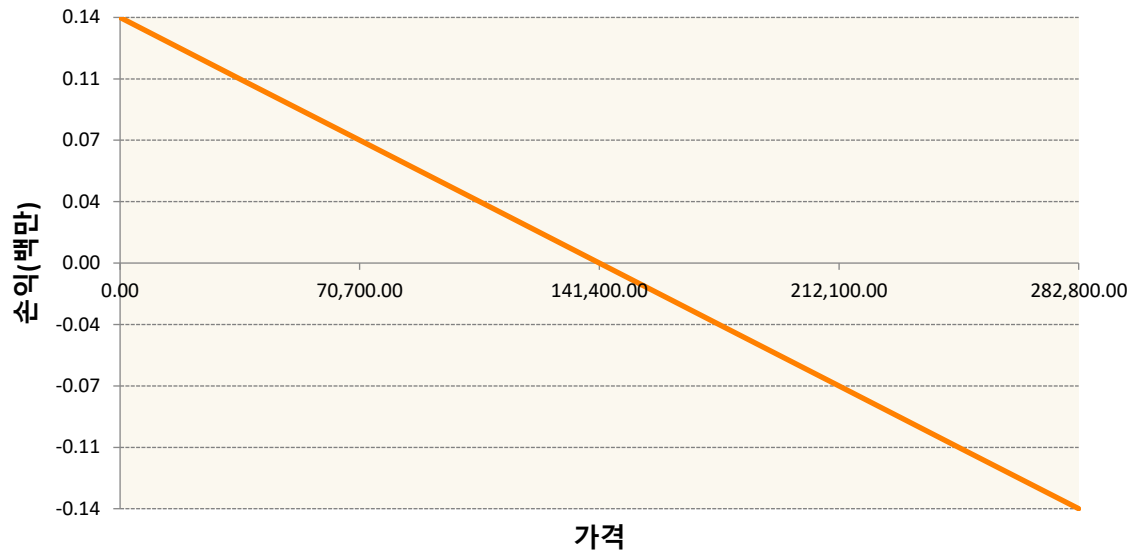
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	839	-839	장내
누계	유가증권	선물	16,267	287	15,980	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A416A0002-2026-10 SK이노베이션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물								1,024
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024	-1,024
-5.33%	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	341	341	341	341	341	341	341	341
5.33%	683	683	683	683	683	683	683	683
8.00%	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024	1,024
KR4A116A0005 2026-10 삼성전자개별선물								283
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
-5.33%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	94	94	94	94	94	94	94	94
5.33%	189	189	189	189	189	189	189	189
8.00%	283	283	283	283	283	283	283	283
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)

4,643

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

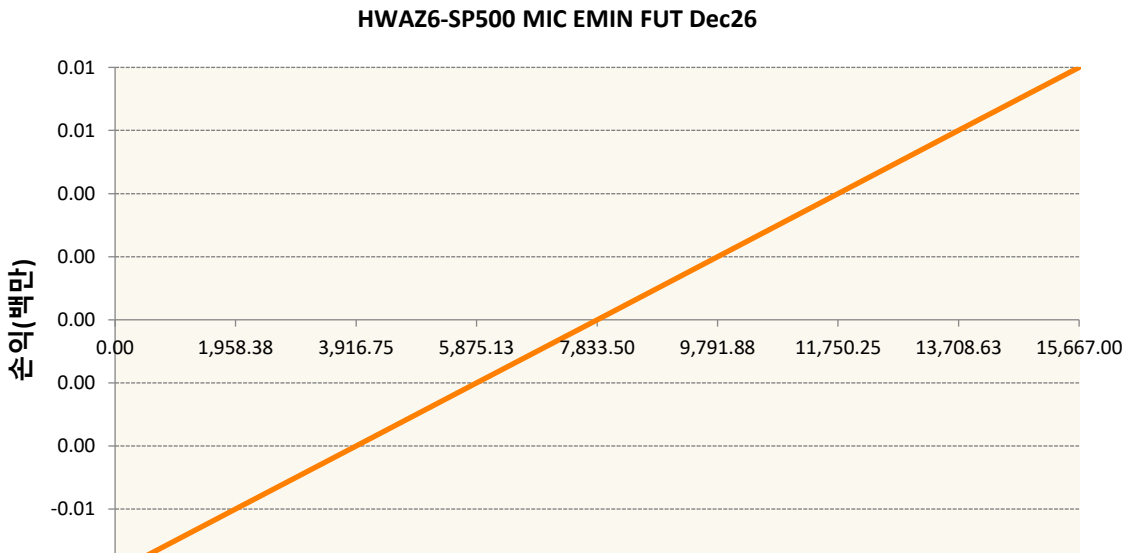
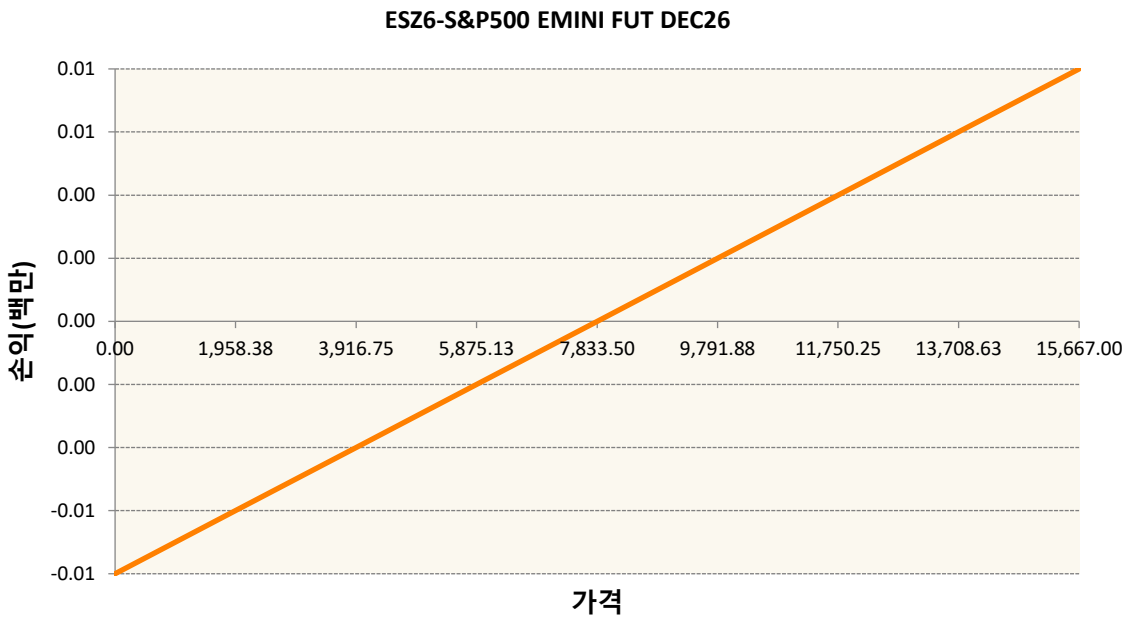
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

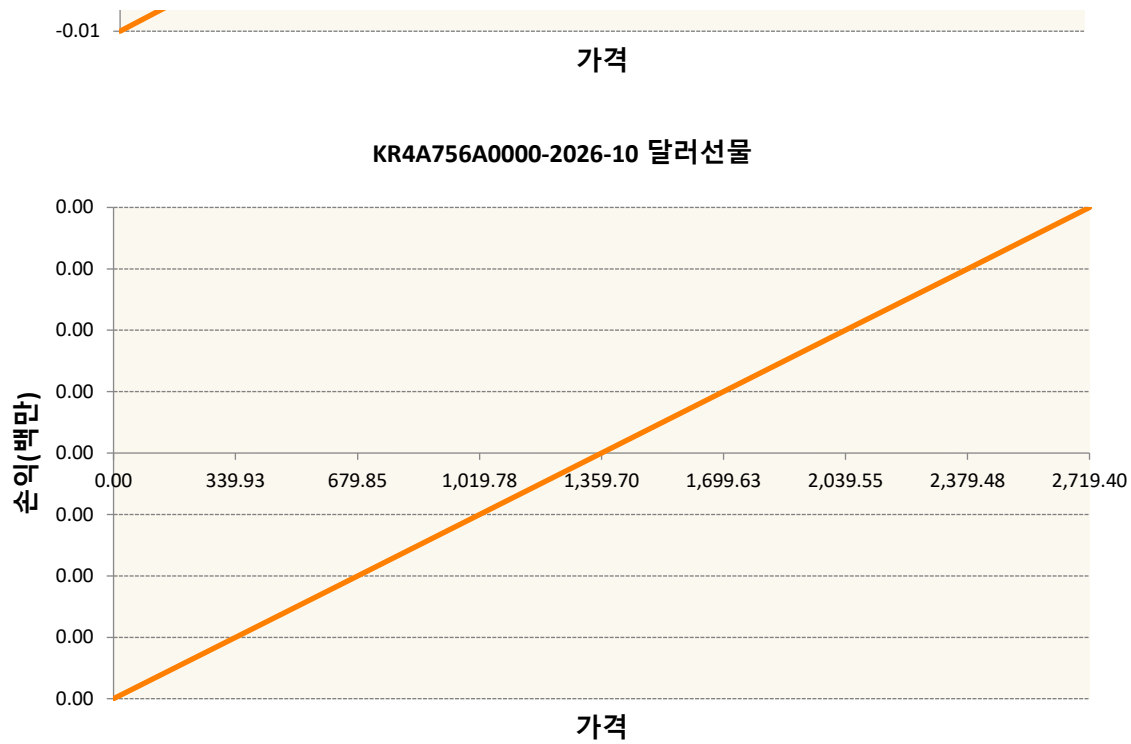
1. 계약금액

(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	679	0	679	장내
누계	지수	선물	74,140	0	74,140	
누계	지수	선물	379	0	379	장내
누계	통화	선물	13,053	0	13,053	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	5,931
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	1,044

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

(단위:백만원)

3,797

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

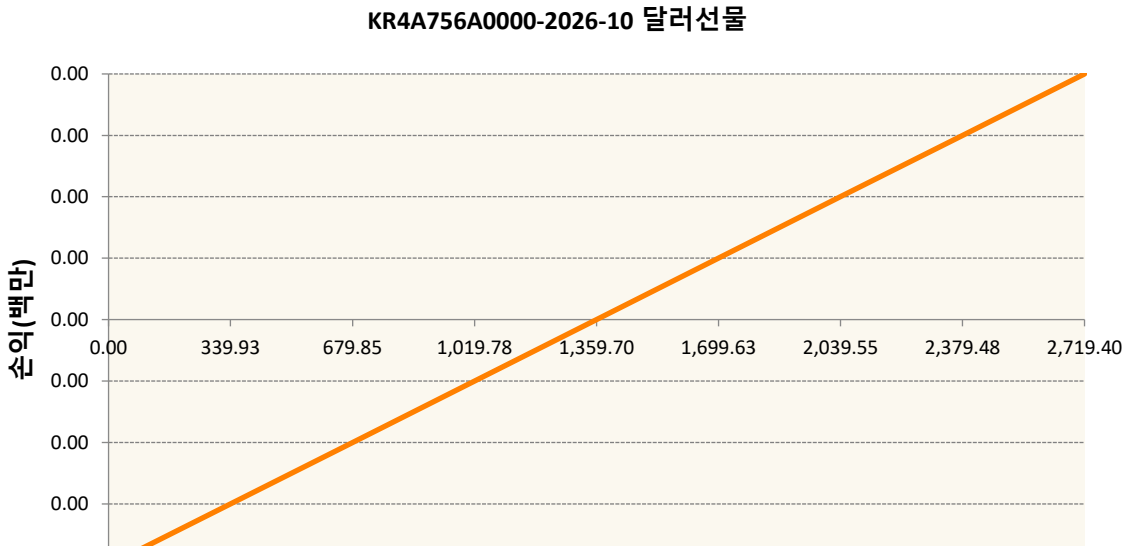
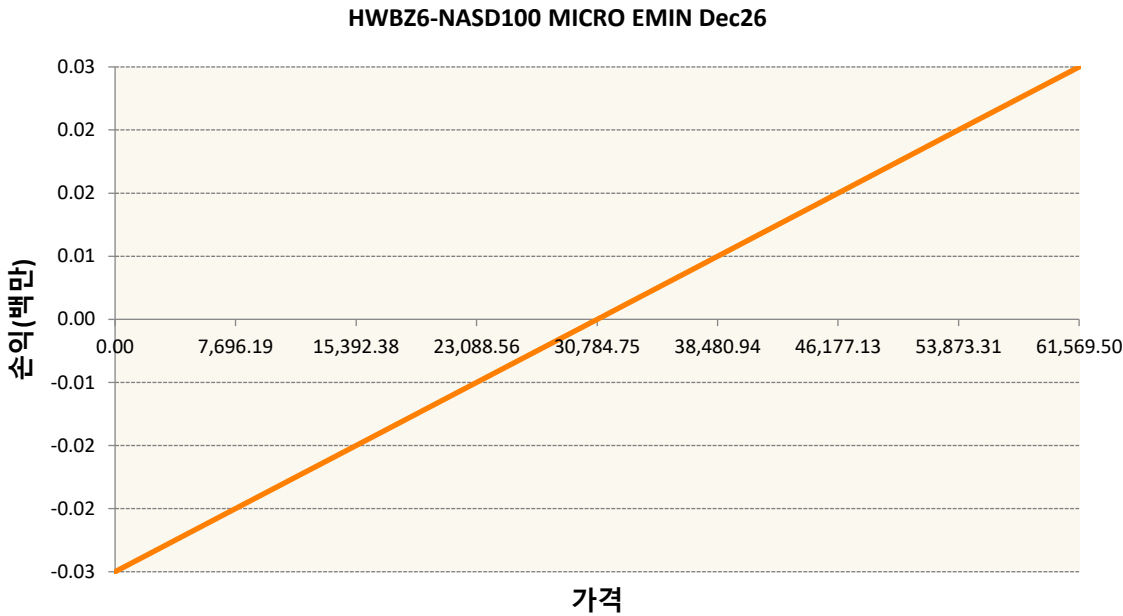
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

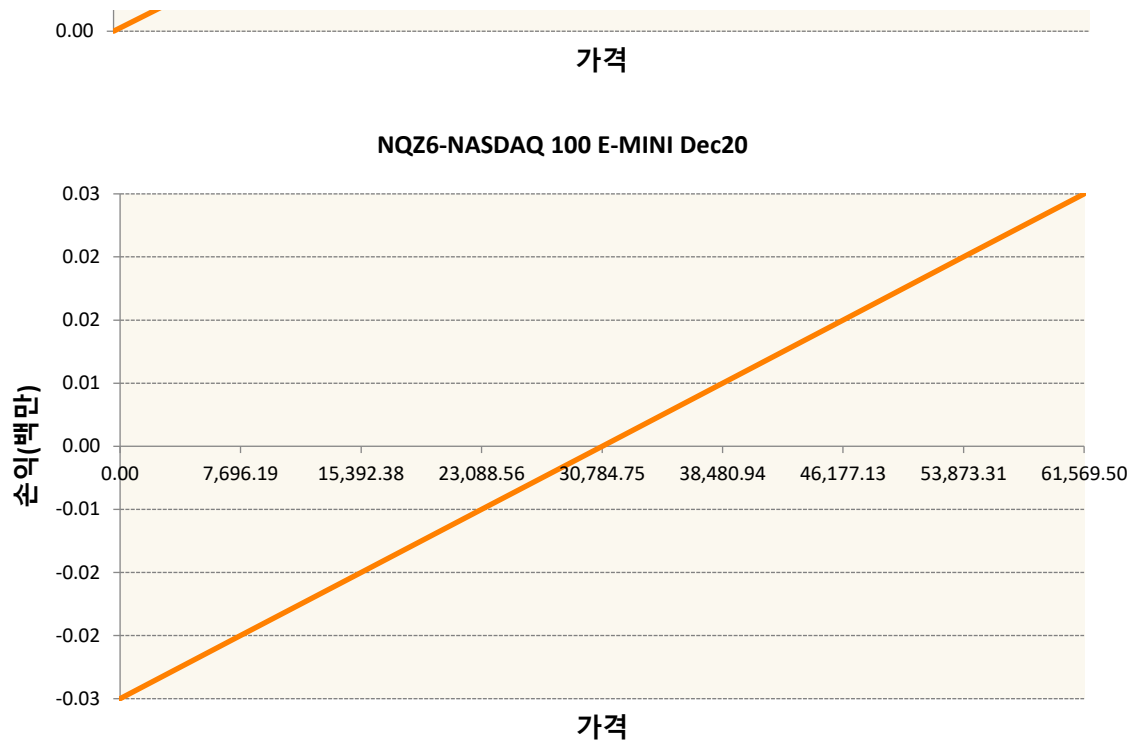
1. 계약금액

(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	340	0	340	장내
누계	지수	선물	36,564	0	36,564	
누계	지수	선물	425	0	425	장내
누계	통화	선물	6,132	0	6,132	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	34
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	491
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,925

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

2,704

공시일	2026-09-23
기준일	2026-09-22

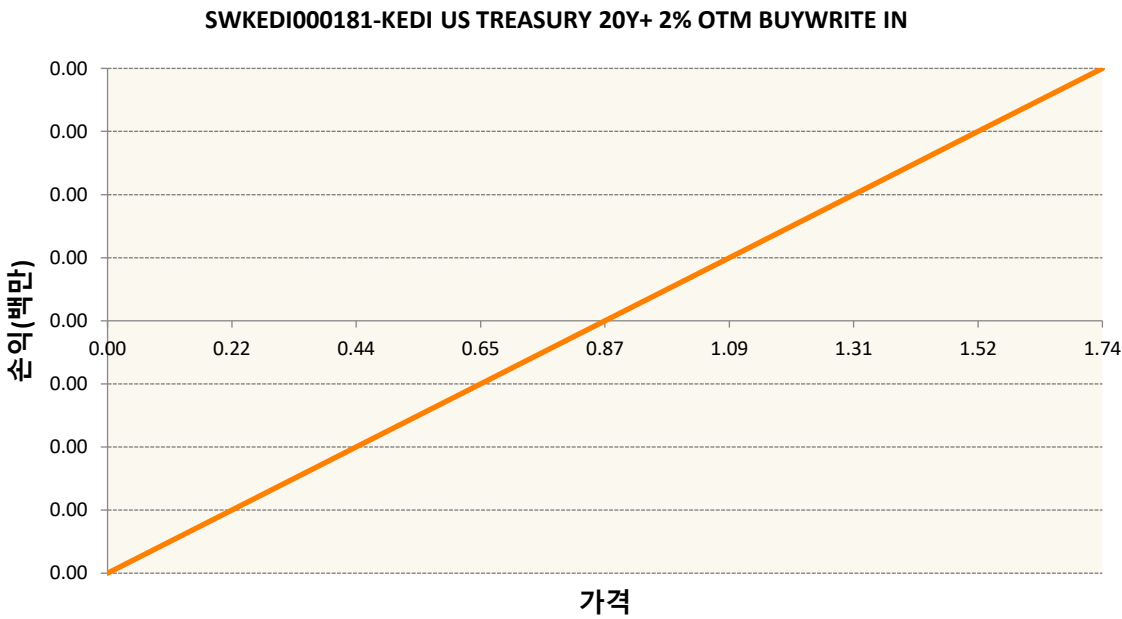
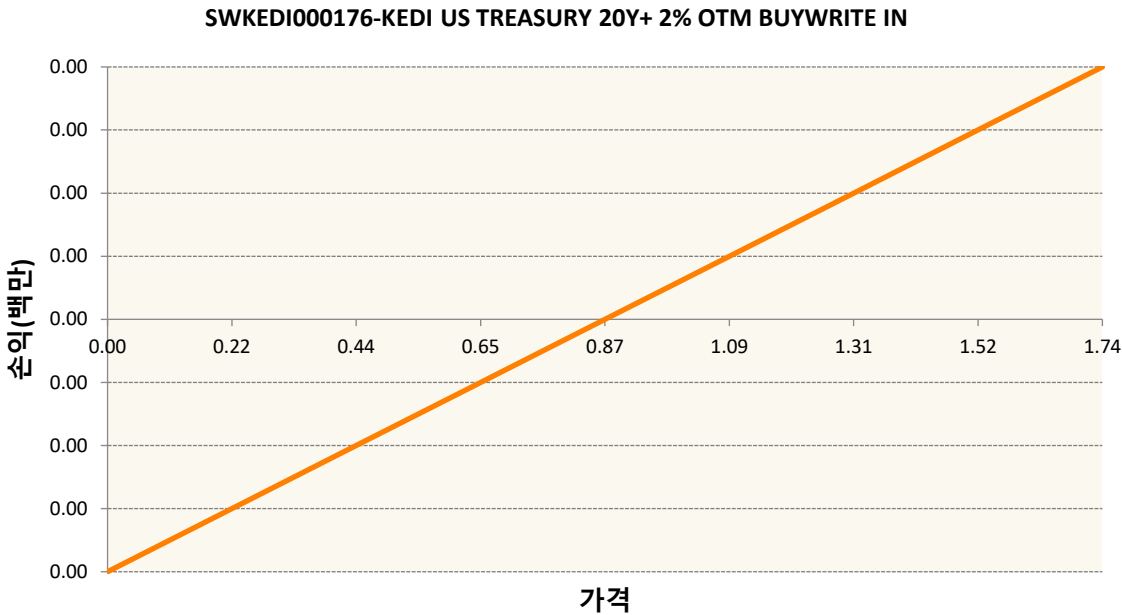
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

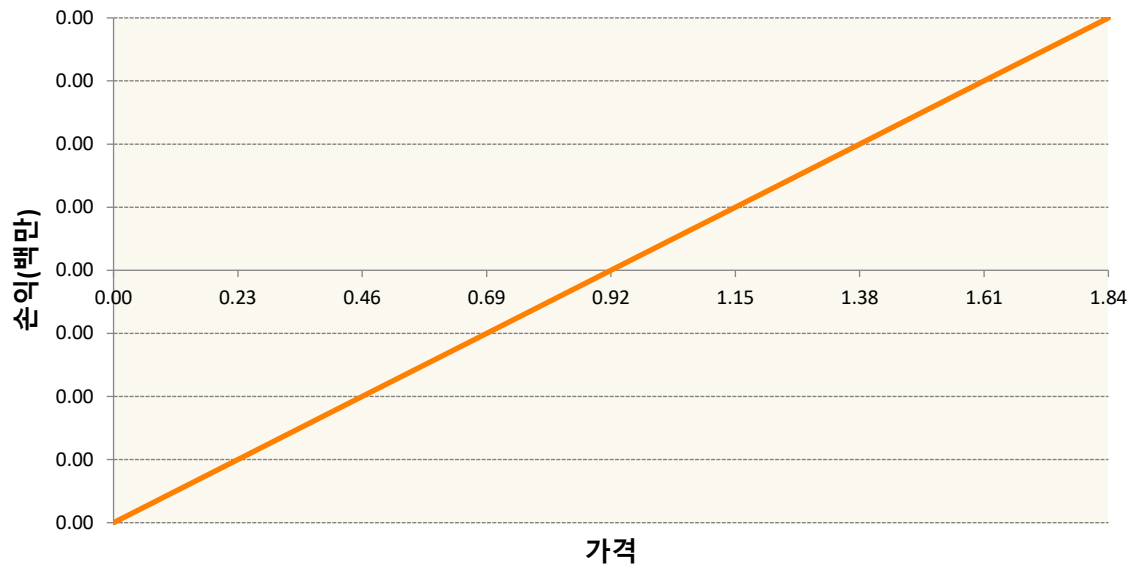
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	274,791	0	274,791	장외

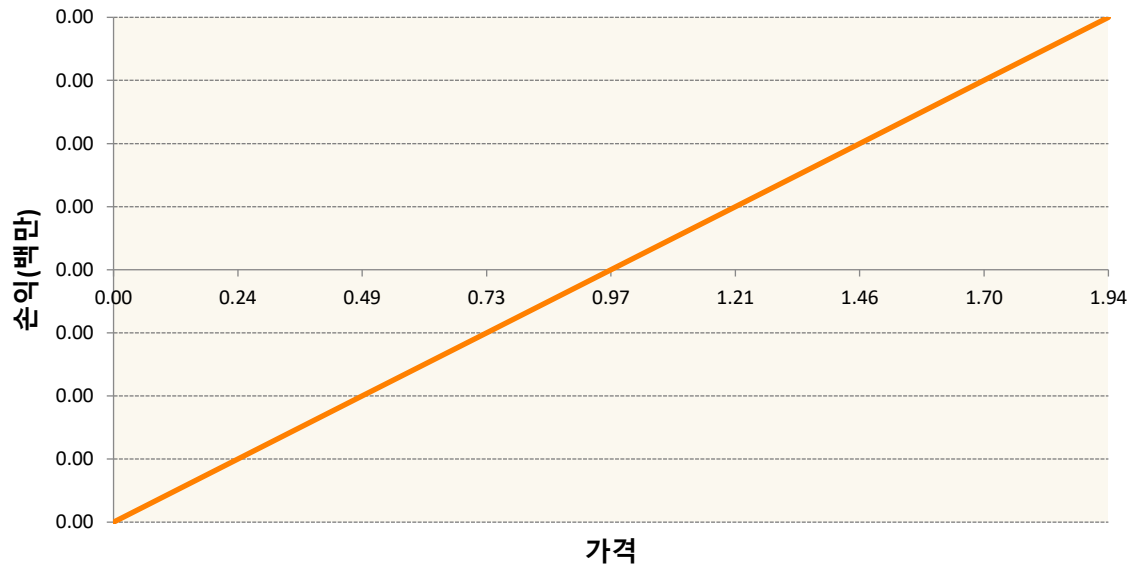
2. 만기시점의 손익구조



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	7,055
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,769
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,171
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,933

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

(단위:백만원)

8,749
