

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

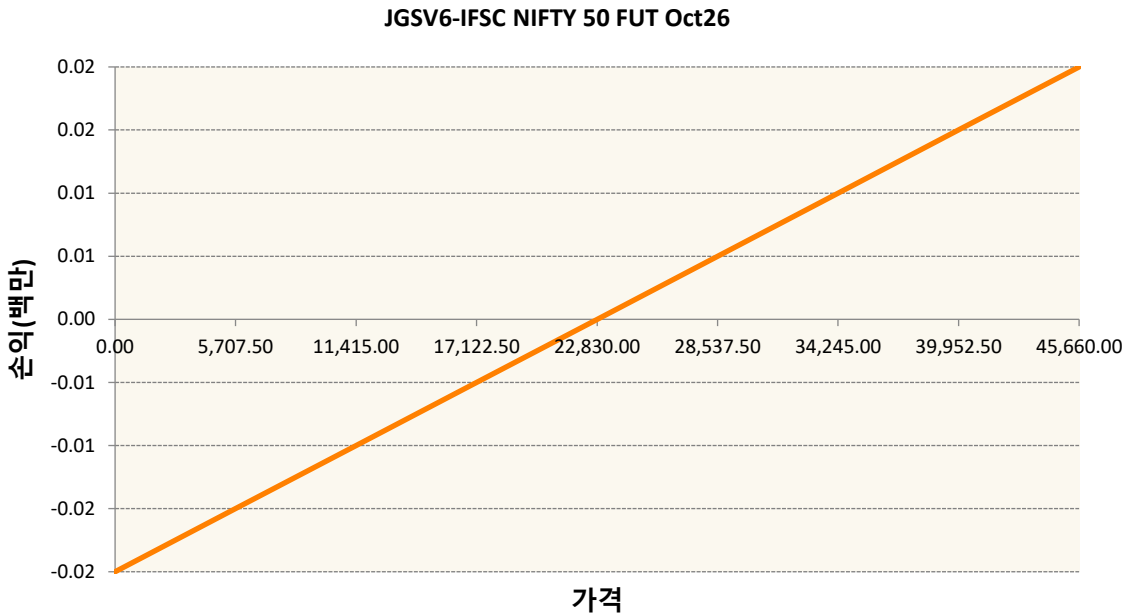
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	312	0	312	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSV6	IFSC NIFTY 50 FUT Oct26	25
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

17

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

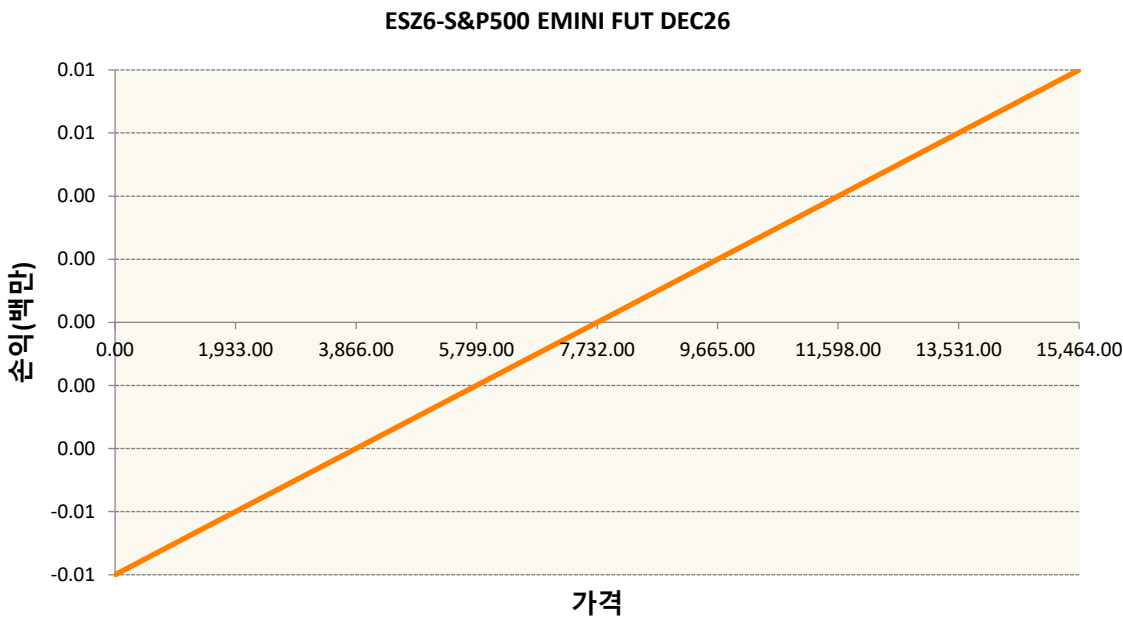
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	535	0	535	

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)

26

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

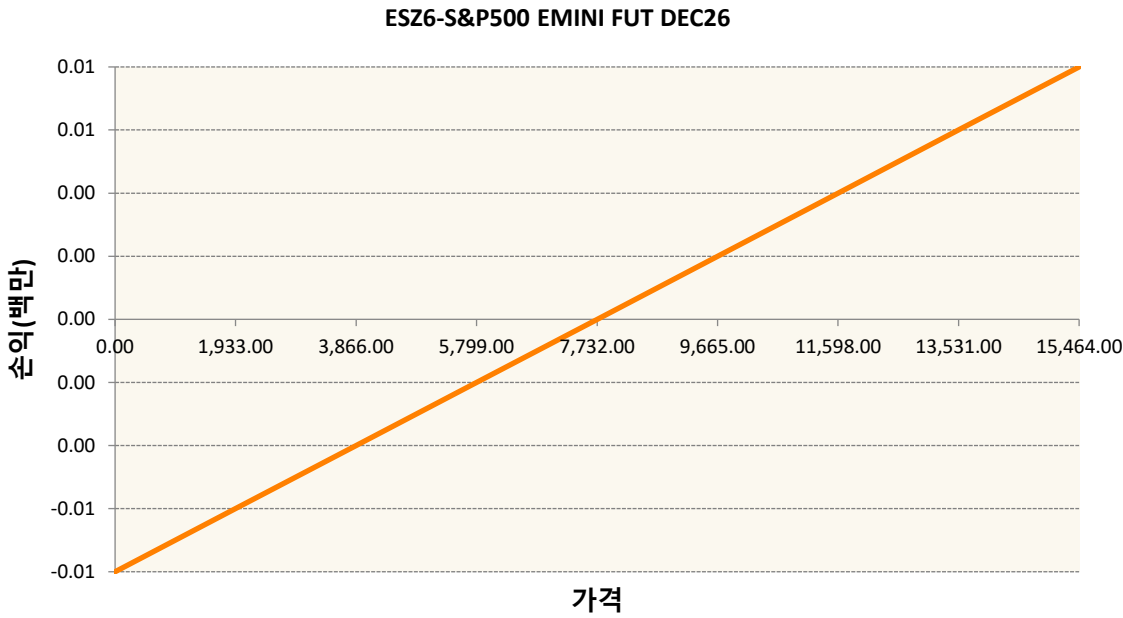
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	534	0	534	

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)

26

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

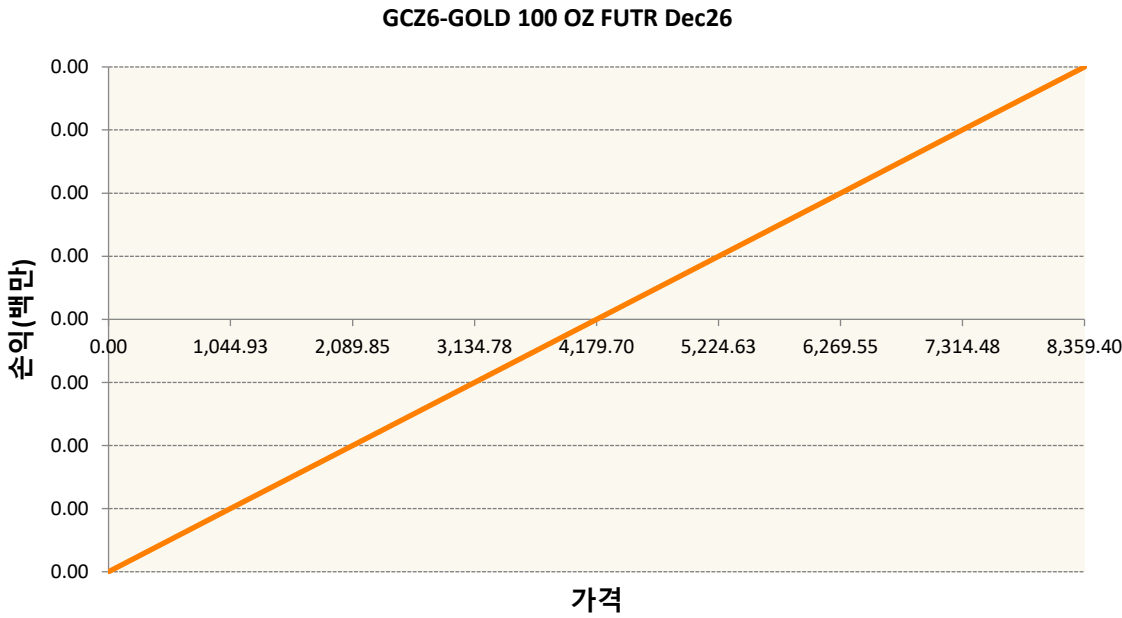
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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			5,954	0	5,954	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC3 GLD US 10/02/26 C395 EQUITY	0.27
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	476

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

(단위:백만원)

618

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

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)

AOPLTRUBC' PLTR US 10/02/26 C195 EQUITY	87
AOPLTRUPP' PLTR US 10/02/26 P195 EQUITY	4

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

(단위:백만원)

314

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

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 10/02/26 C79.5 EQUITY

3

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

(단위:백만원)

2

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

(단위:백만원)

12,699

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

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	2026-10-01
기준일	2026-09-30

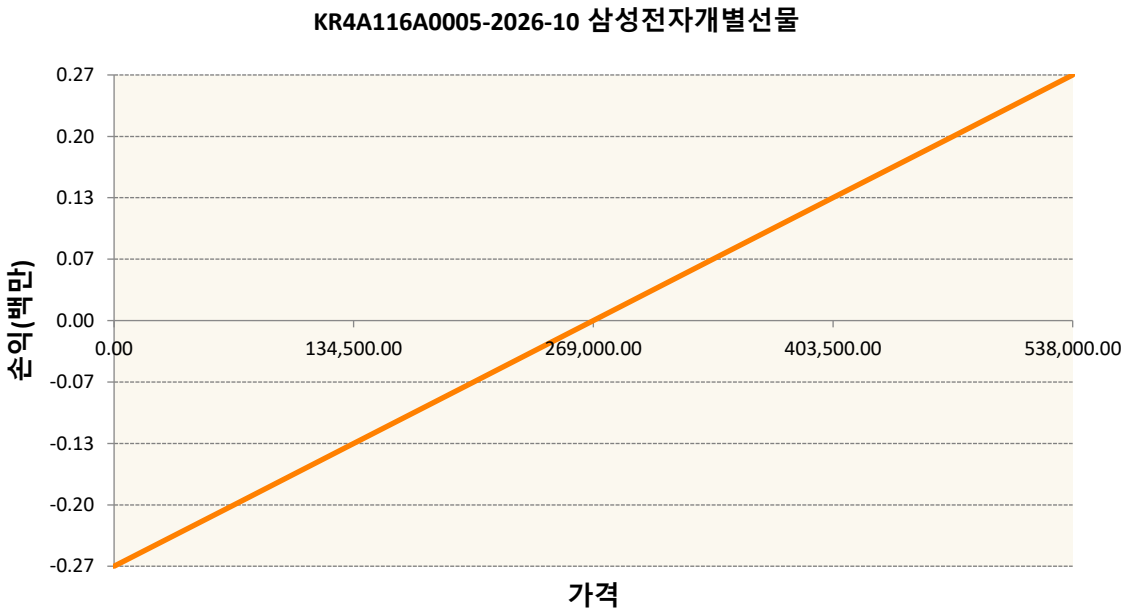
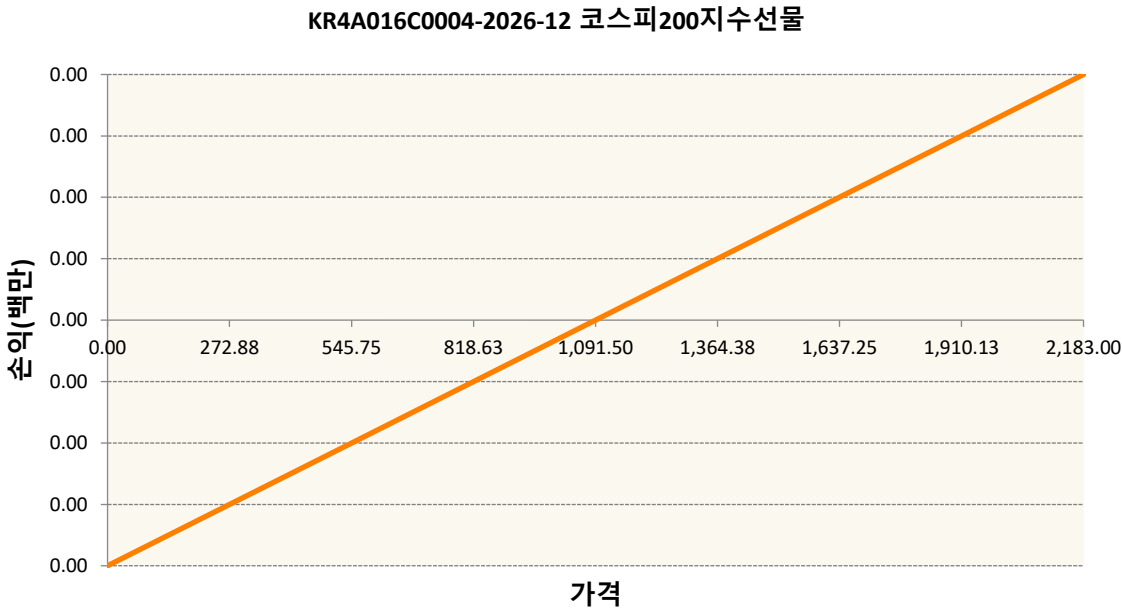
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	21,621	0	21,621	장내
누계	유가증권	옵션	0	74,905	-74,905	장내

2. 만기시점의 손익구조



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 2,190.00. 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 (1,095.00, 0.00).

가액	순이익 (백만)
0.00	0.00
1,095.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A016C0004				2026-12 코스피200지수선물				563
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-563	-563	-563	-563	-563	-563	-563	
-5.33%	-375	-375	-375	-375	-375	-375	-375	
-2.67%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	188	188	188	188	188	188	188	
5.33%	375	375	375	375	375	375	375	
8.00%	563	563	563	563	563	563	563	
KR4A116A0005				2026-10 삼성전자개별선물				1,160
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160
-5.33%	-773	-773	-773	-773	-773	-773	-773
-2.67%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	387	387	387	387	387	387	387
5.33%	773	773	773	773	773	773	773
8.00%	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160
KR4B09FFA380 코스피위클리 C 2610W1 1,092.5							3,319

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,319	-3,319	-3,319	-3,319	-3,319	-3,319	-3,319
-5.33%	-2,136	-2,136	-2,136	-2,137	-2,138	-2,139	-2,141
-2.67%	-958	-962	-969	-977	-988	-1,000	-1,014
0%	91	62	31	0	-32	-63	-96
2.67%	593	570	545	519	492	464	434
5.33%	662	660	656	650	642	633	622
8.00%	664	664	664	663	663	661	659

KR4B09FFA398 코스피위클리 C 2610W1 1,095.0							2,248
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2,248	-2,248	-2,248	-2,248	-2,248	-2,248	-2,248
-5.33%	-1,454	-1,454	-1,454	-1,455	-1,455	-1,456	-1,457
-2.67%	-663	-665	-669	-674	-680	-687	-696
0%	58	39	20	0	-20	-41	-62
2.67%	432	415	397	378	358	338	318
5.33%	490	488	485	480	474	467	459
8.00%	492	492	492	492	491	490	489

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

(단위:백만원)

17,526

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

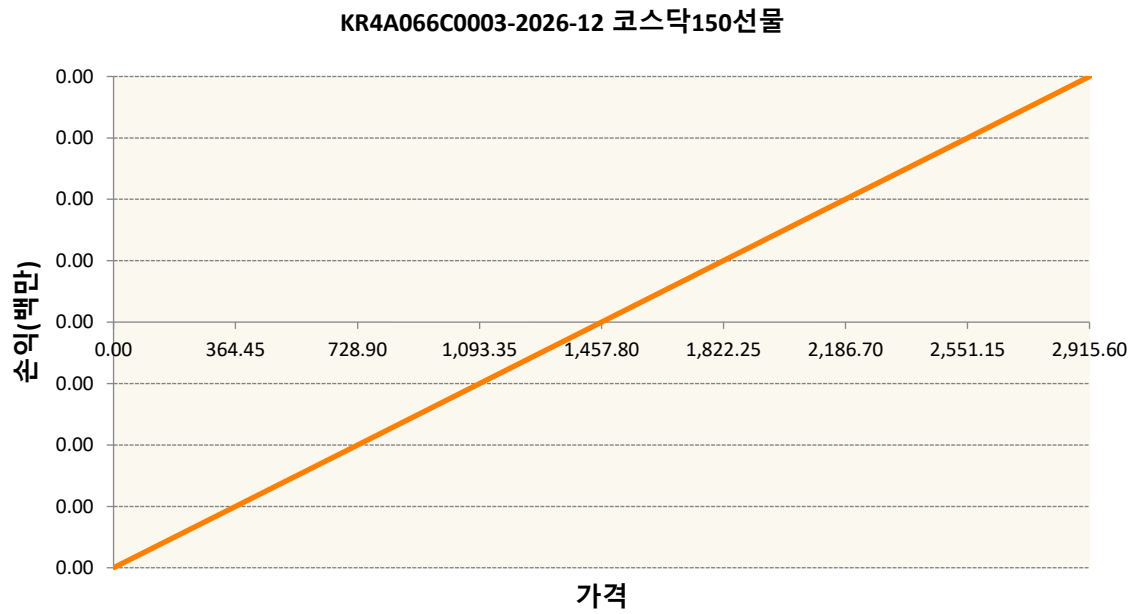
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	598	0	598	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003			2026-12 코스닥150선물				48
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	48	48	48	48	48	48	48

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

(단위:백만원)

12,790

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

(단위:백만원)

76,375

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

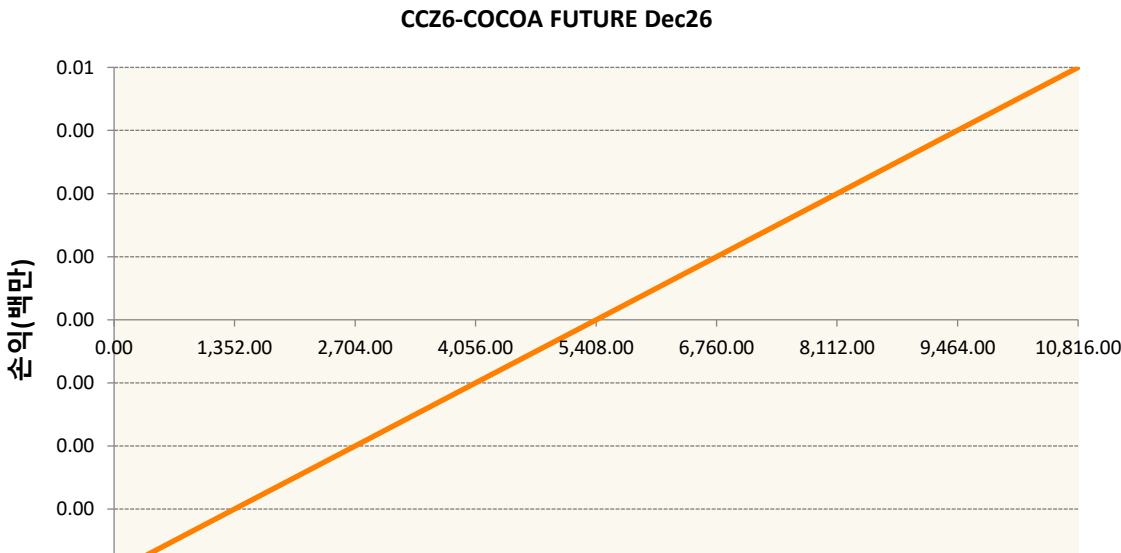
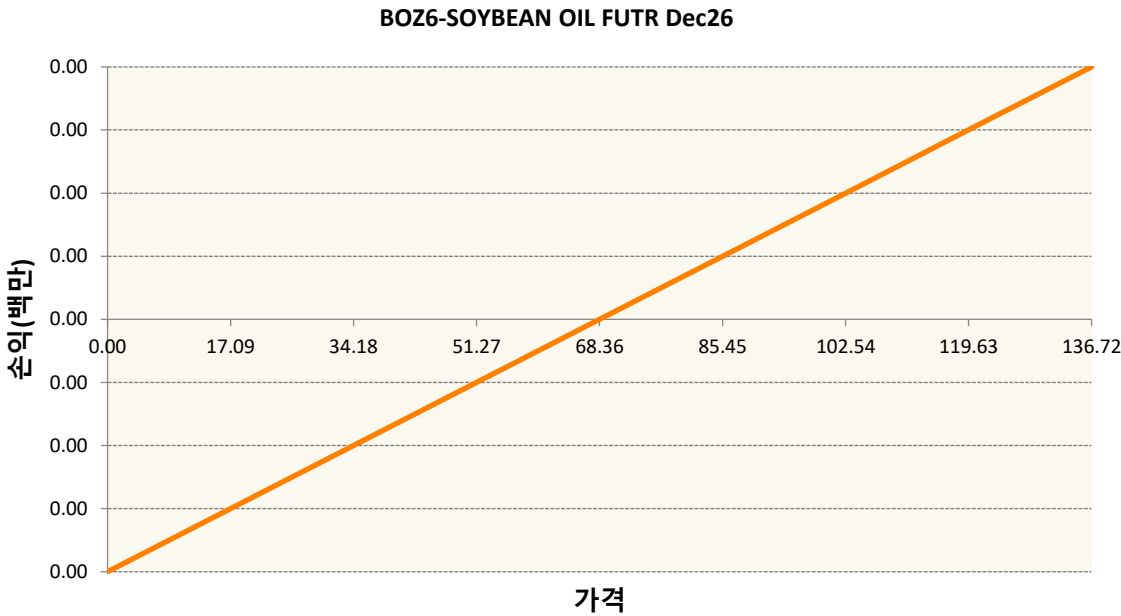
포커스농산물모(채권-파생형)

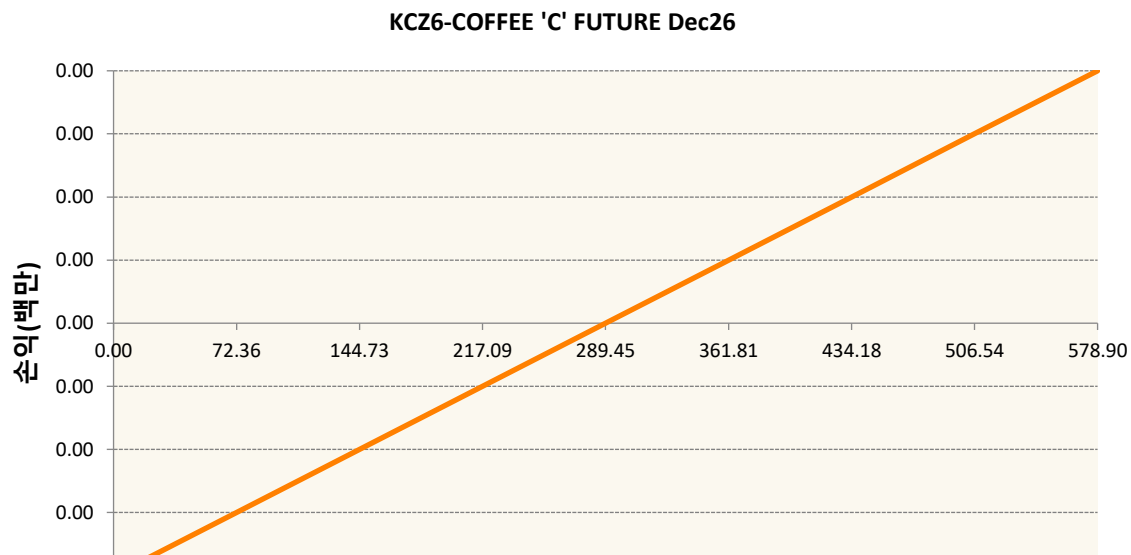
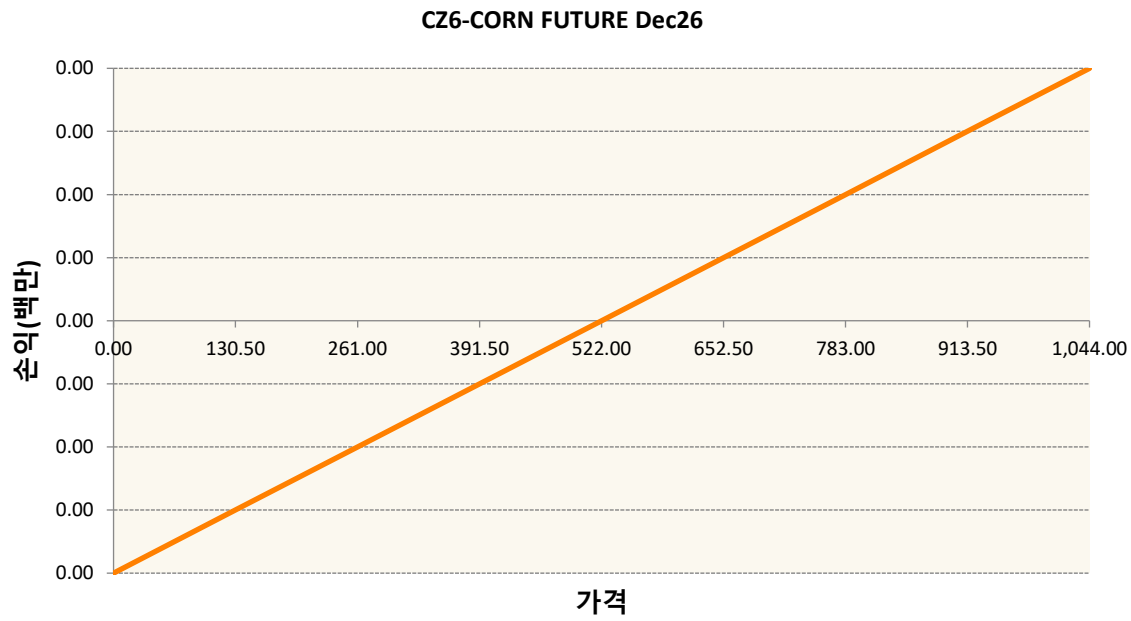
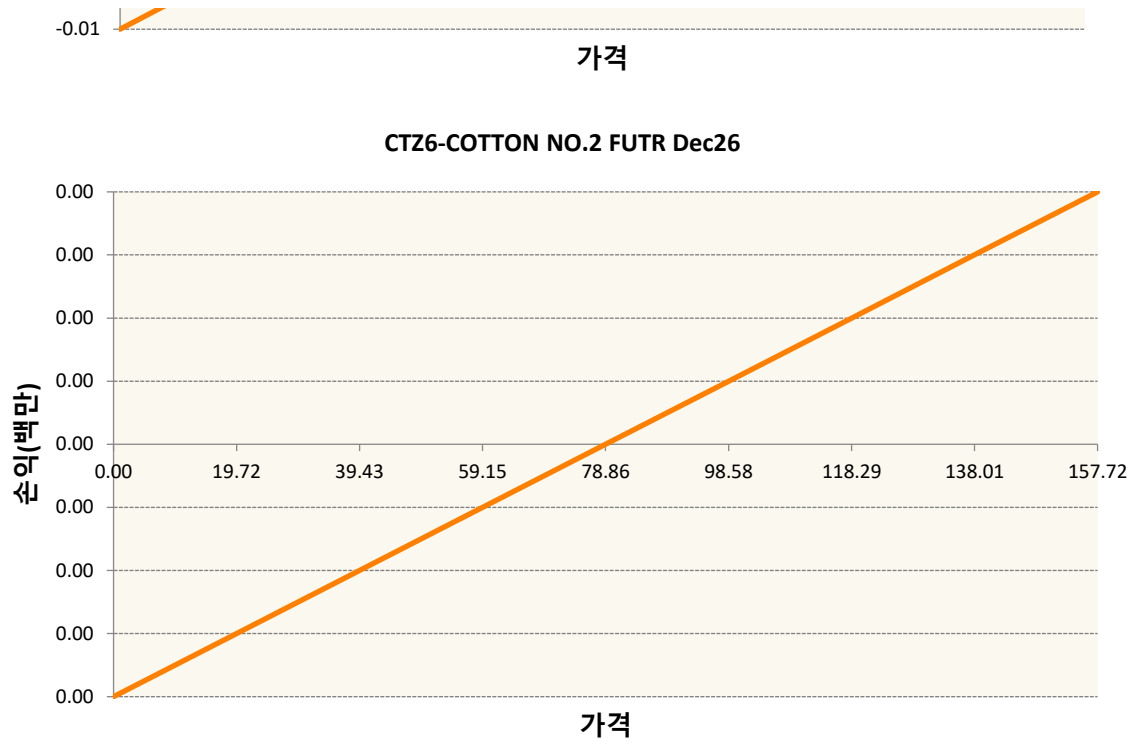
1. 계약금액

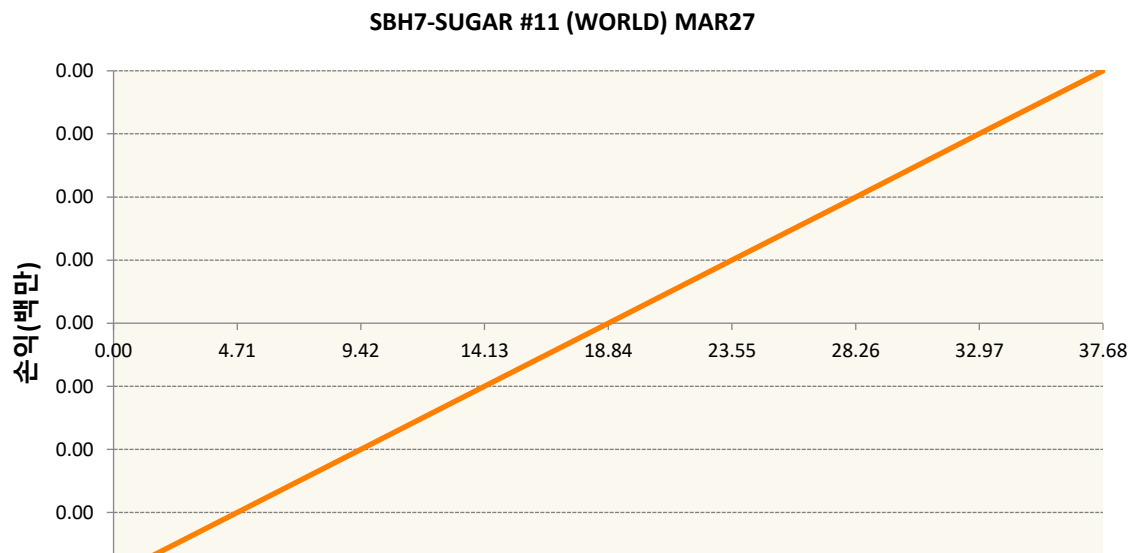
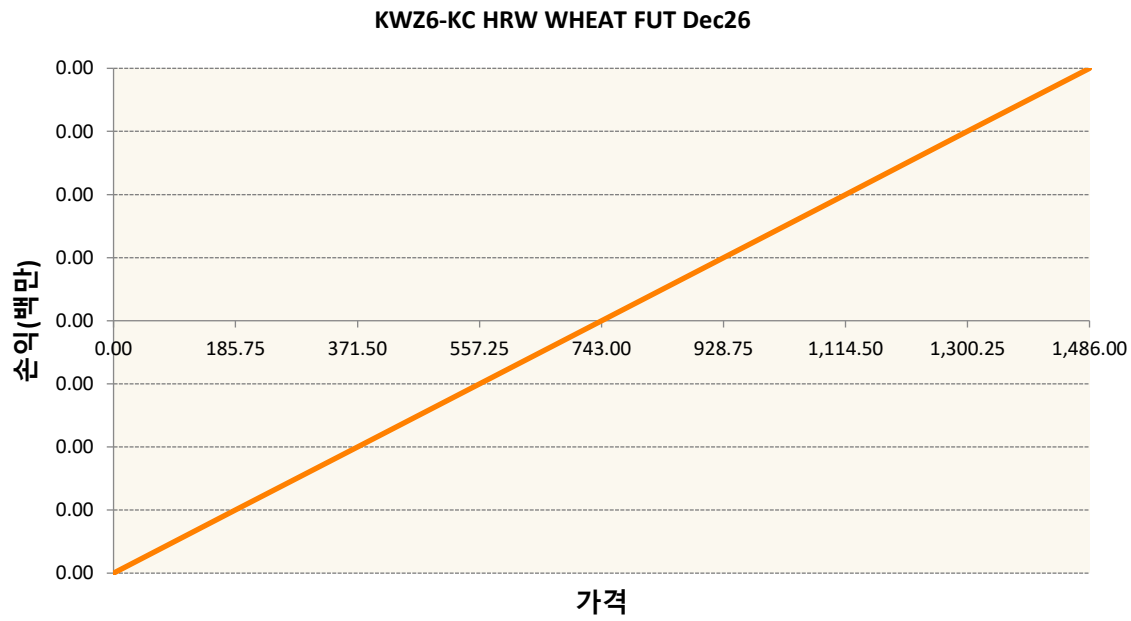
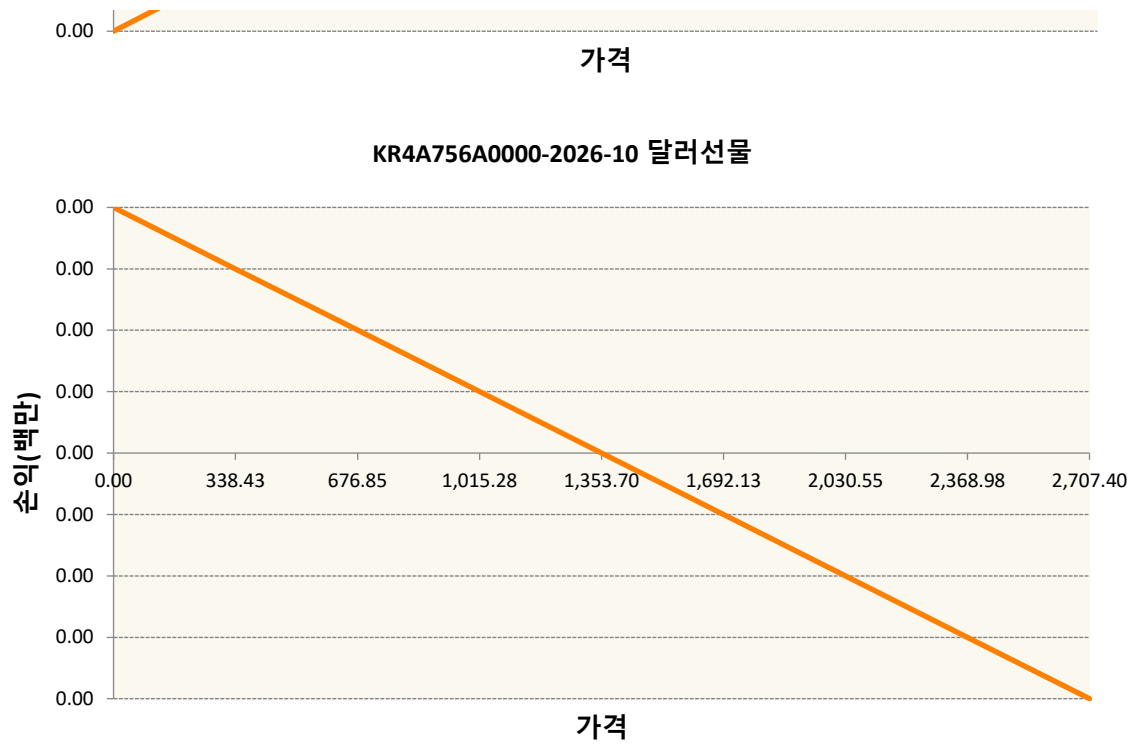
(단위:USD 백만)

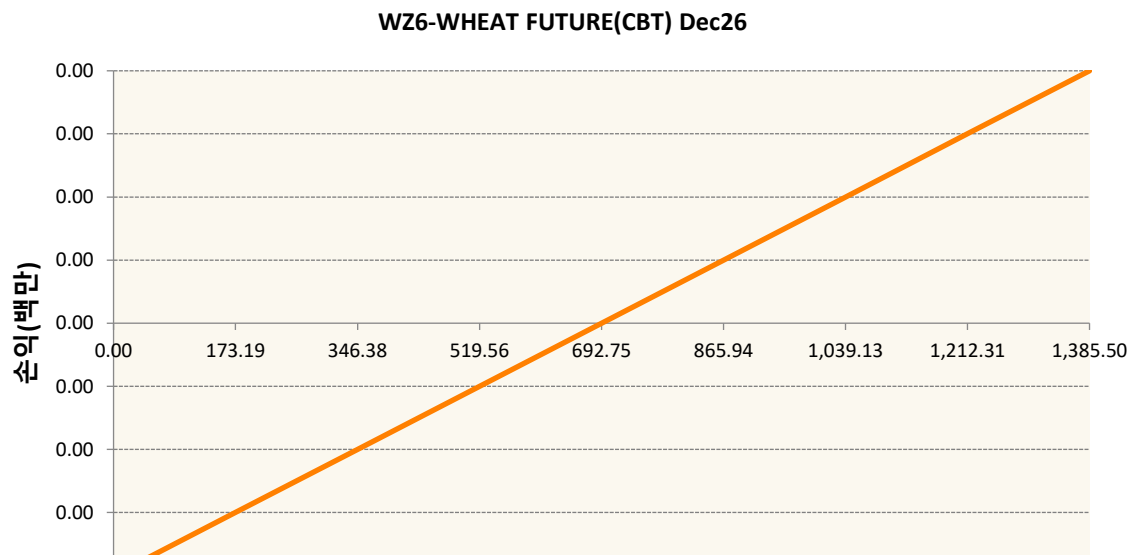
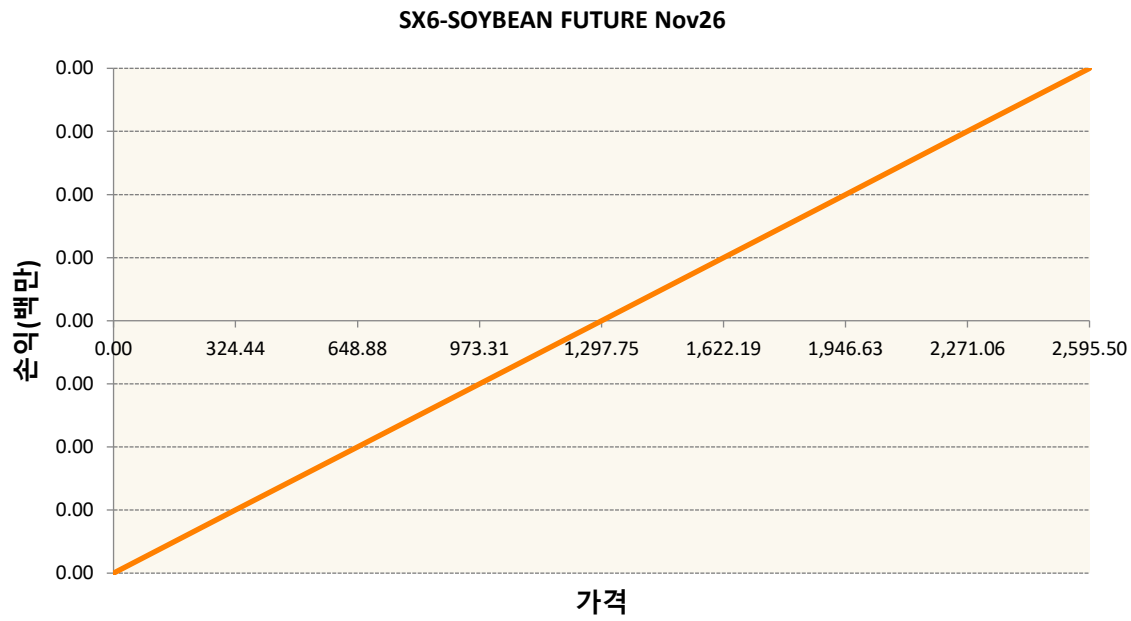
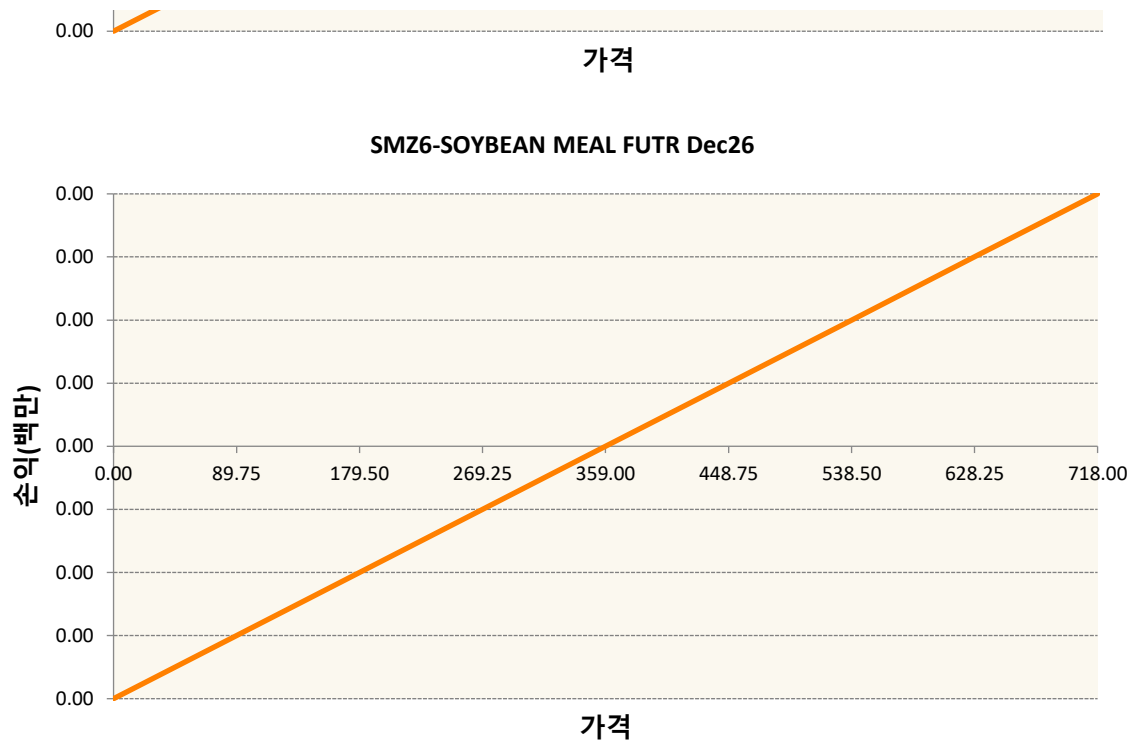
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	386	0	386	
누계	유가증권	선물	2,396	0	2,396	
누계	통화	선물	0	338	-338	장내

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	2026-10-01
기준일	2026-09-30

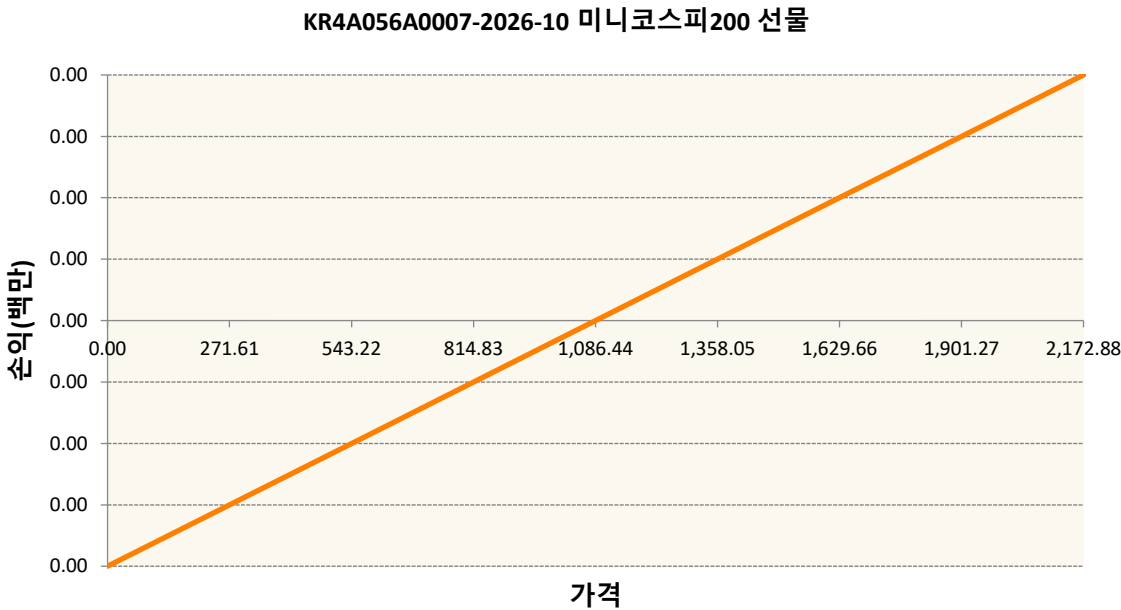
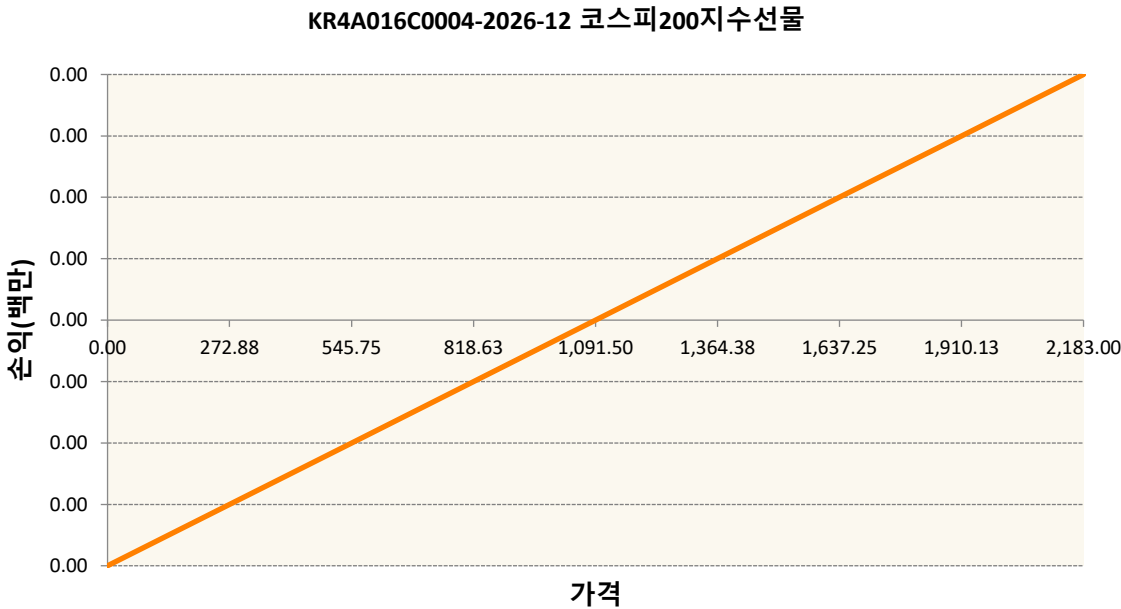
스마트인덱스모

1. 계약금액

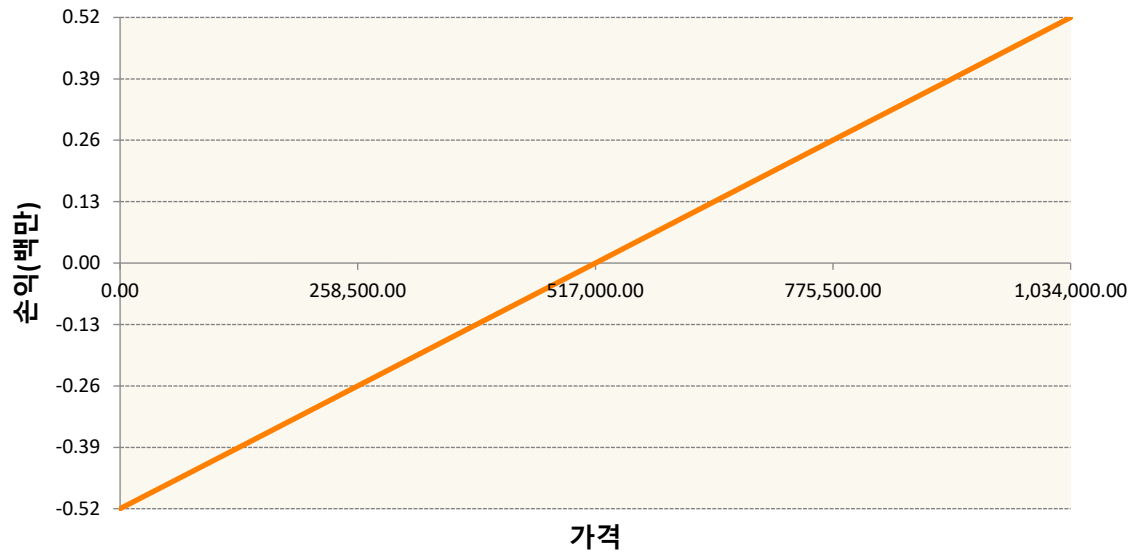
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,100	275	825	장내
누계	유가증권	선물	10,138	0	10,138	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004 2026-12 코스피200지수선물								368
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-368	-368	-368	-368	-368	-368	-368	-368
-5.33%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245
-2.67%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	123	123	123	123	123	123	123	123
5.33%	245	245	245	245	245	245	245	245
8.00%	368	368	368	368	368	368	368	368
KR4A056A0007 2026-10 미니코스피200 선물								87
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87	87
KR4A226A0002 2026-10 삼성SDI개별선물								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
-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	2026-10-01
기준일	2026-09-30

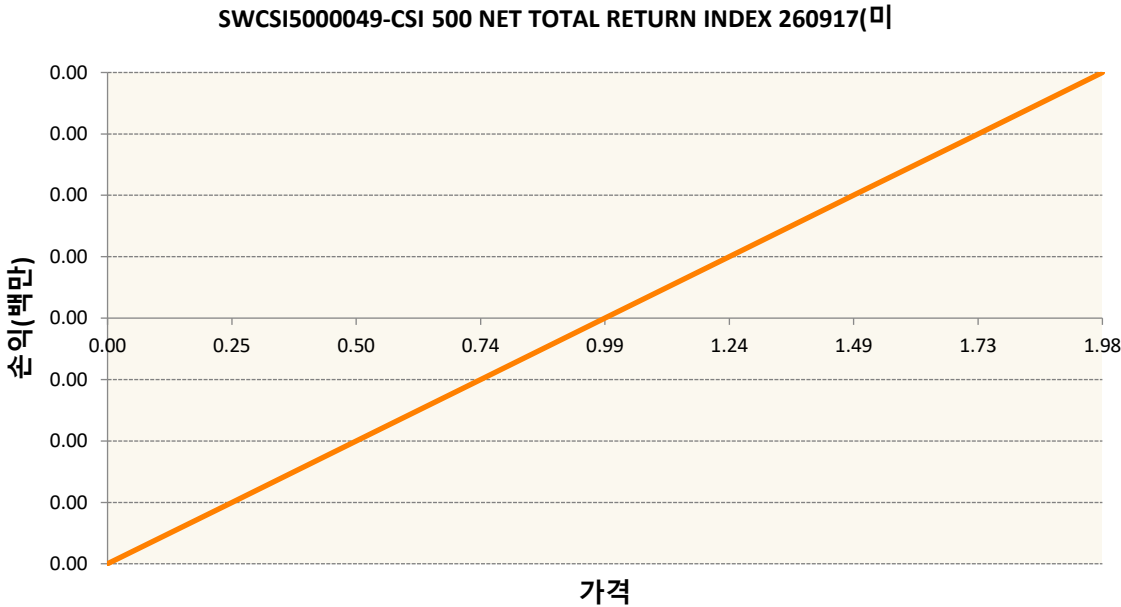
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,268	0	5,268	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미

420

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

669

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

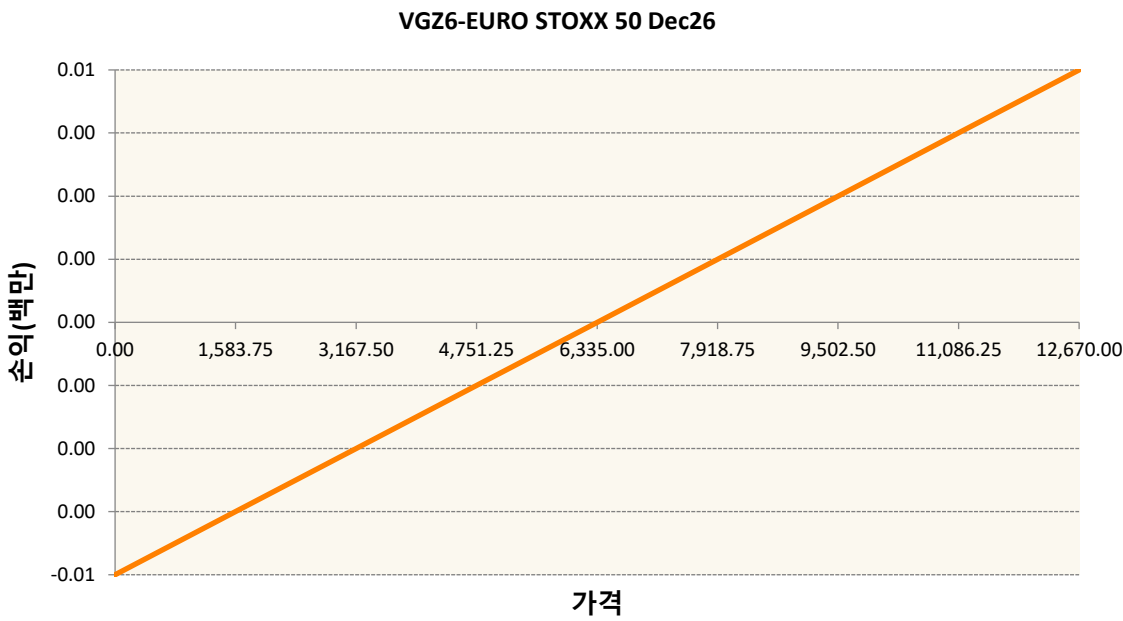
유로인덱스모(주식-파생형)

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	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

65

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

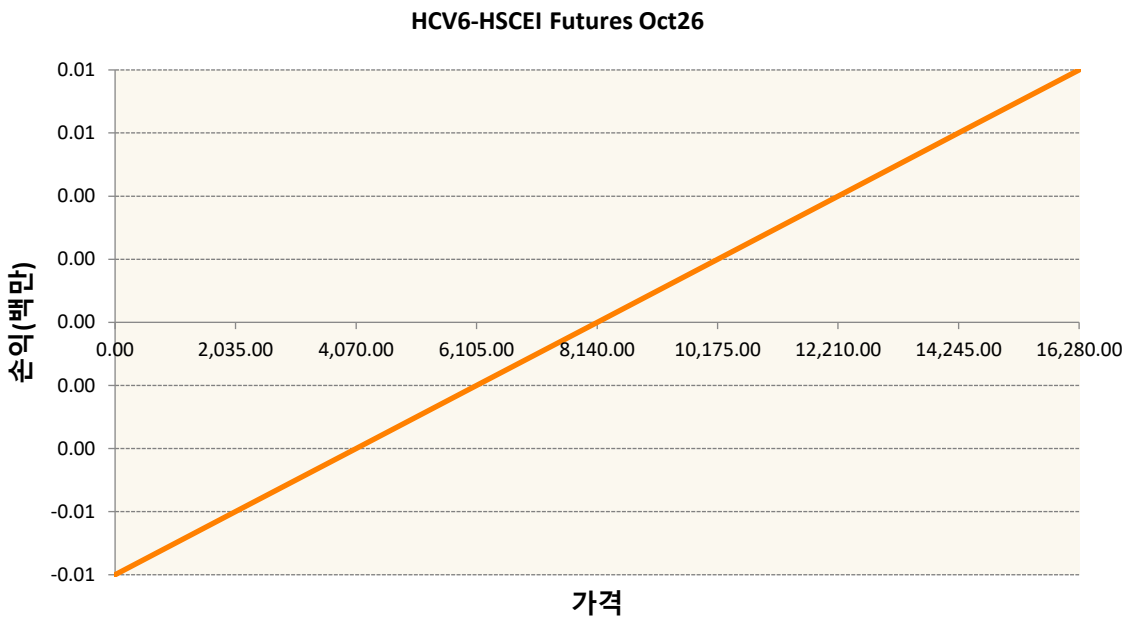
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,275	0	1,275	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV6	HSCEI Futures Oct26	102
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

96

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

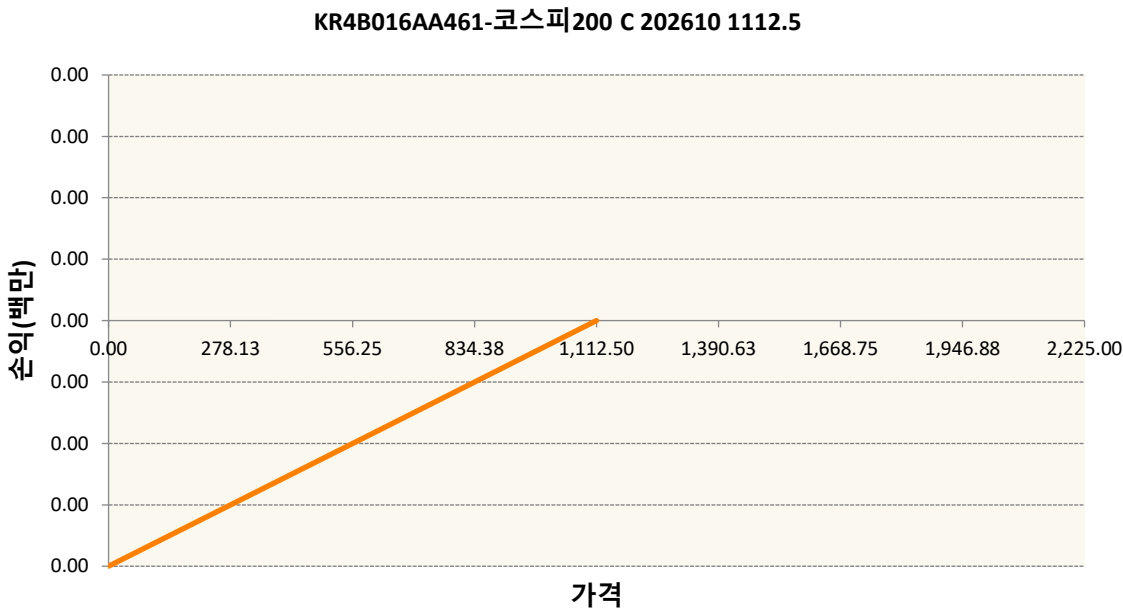
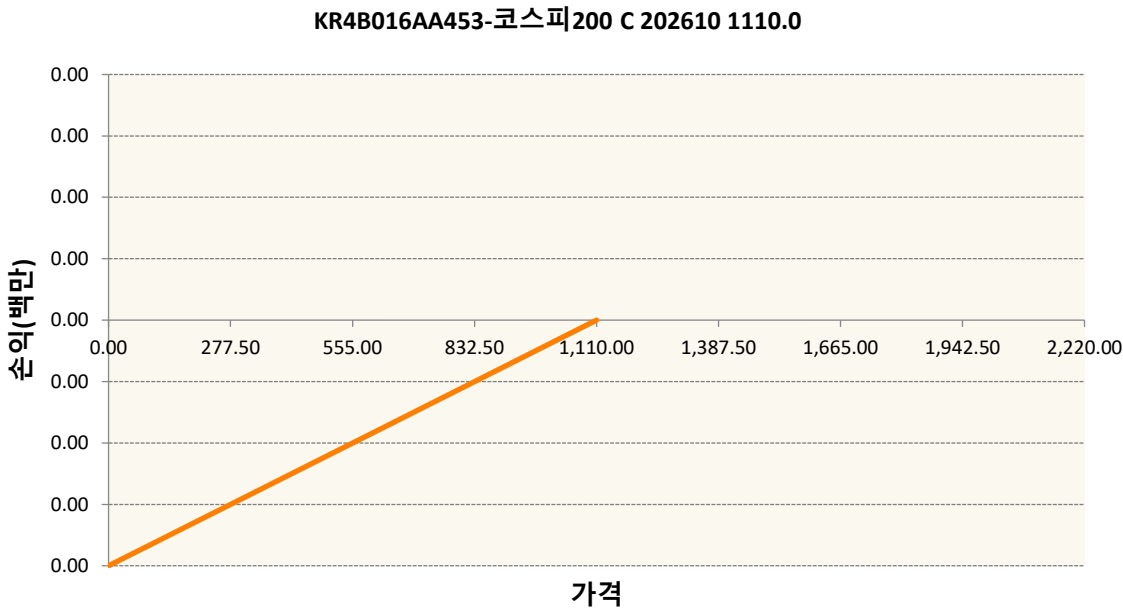
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

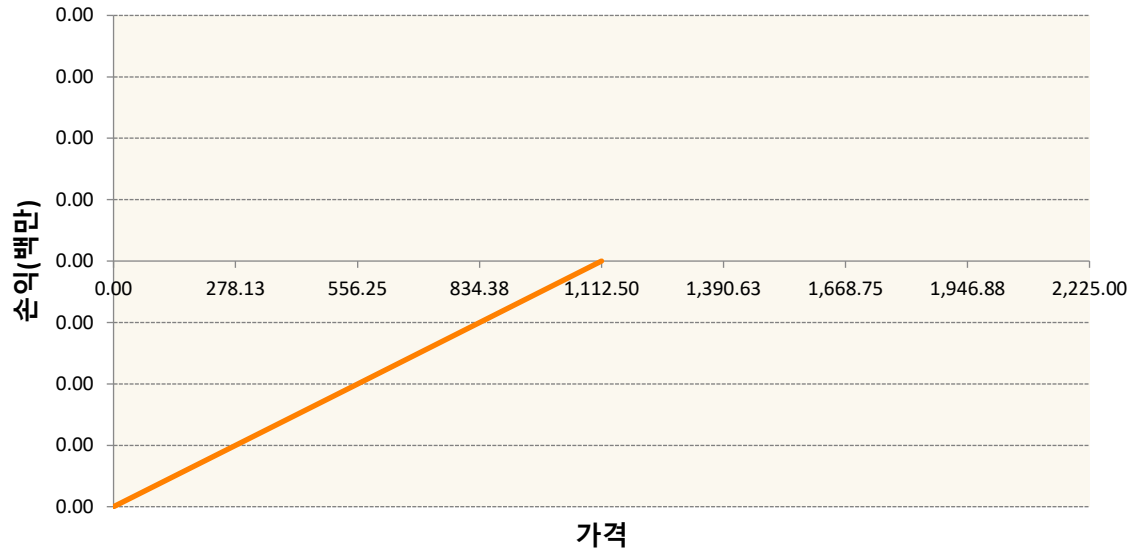
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,490	-49,490	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C016AA460-코스피200 P 202610 1112.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B016AA453 코스피200 C 202610 1110.0								477
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-454	-456	-458	-462	-466	-471	-477	
-5.33%	-272	-277	-283	-289	-297	-305	-314	
-2.67%	-103	-112	-122	-133	-144	-156	-169	
0%	42	28	14	0	-14	-29	-44	
2.67%	152	136	120	105	89	73	58	
5.33%	223	209	195	180	166	151	136	
8.00%	261	252	241	230	218	205	192	
KR4B016AA461 코스피200 C 202610 1112.5								2,163
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,067	-2,074	-2,084	-2,098	-2,116	-2,138	-2,163	
-5.33%	-1,247	-1,266	-1,290	-1,319	-1,352	-1,388	-1,427	
-2.67%	-478	-518	-561	-609	-659	-711	-765	
0%	186	125	63	0	-64	-129	-195	
2.67%	694	624	553	483	412	342	271	
5.33%	1,028	965	900	833	766	699	631	
8.00%	1,213	1,168	1,118	1,065	1,010	952	893	
KR4C016AA460 코스피200 P 202610 1112.5								647
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-618	-620	-624	-628	-633	-639	-647	
-5.33%	-373	-379	-386	-395	-404	-415	-427	
-2.67%	-143	-155	-168	-182	-197	-213	-229	
0%	56	38	19	0	-19	-39	-58	

2.67%	208	187	166	144	123	102	81
5.33%	308	289	269	249	229	209	189
8.00%	363	349	334	319	302	285	267

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

(단위:백만원)

5,824

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

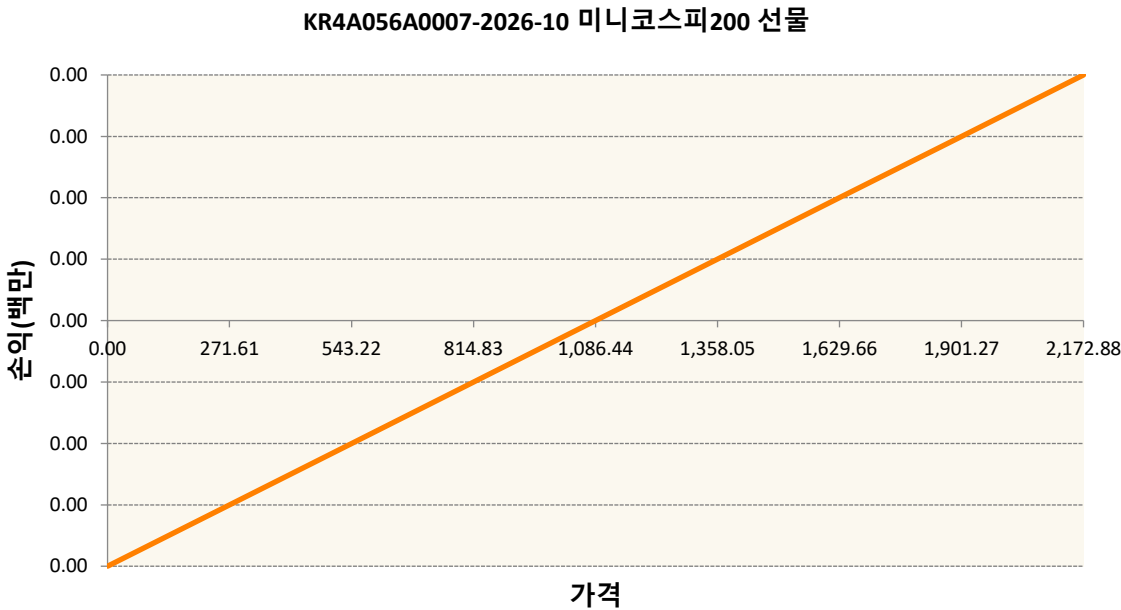
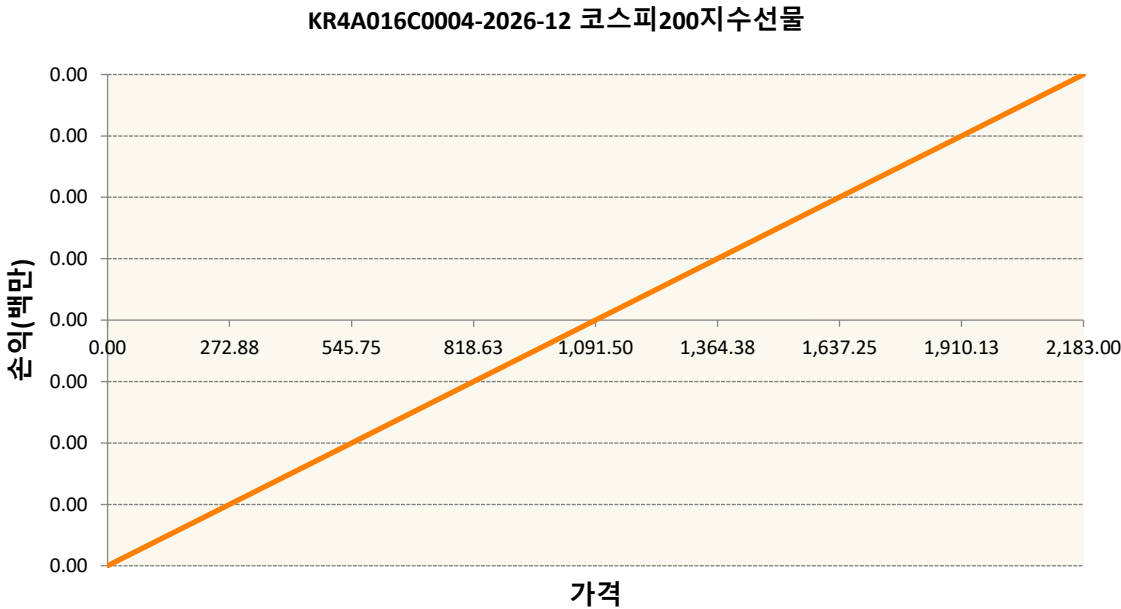
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

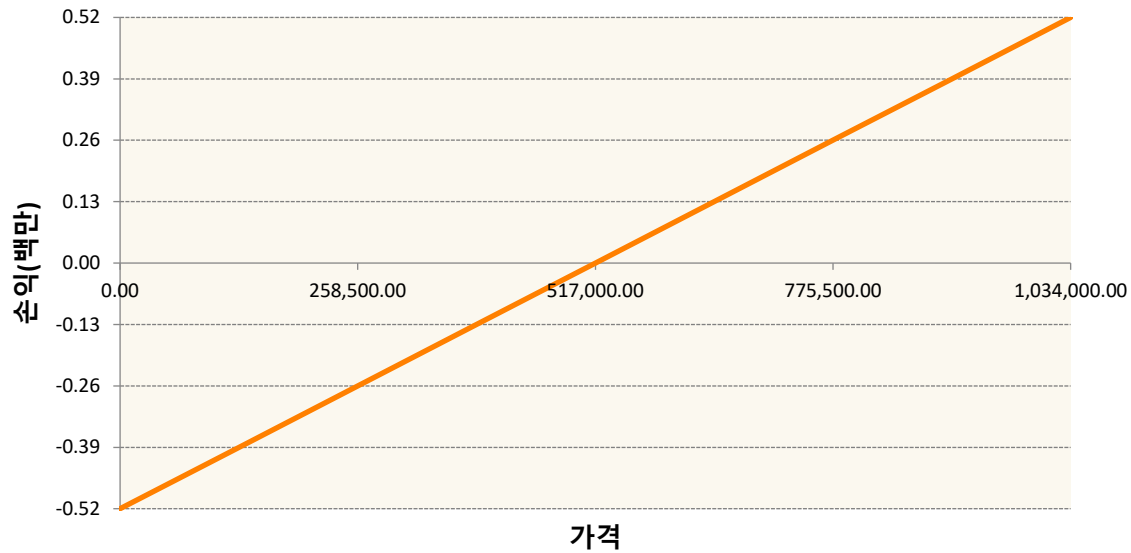
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	275	275	0	장내
누계	유가증권	선물	2,772	0	2,772	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A226A0002-2026-10 삼성SDI개별선물



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	-65
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	22	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	43	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	65	65	65	65	65	65	65	65
KR4A056A0007 2026-10 미니코스피200 선물								30
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	20	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	30	30	30	30	30	30	30	30
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	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	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)
	332

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

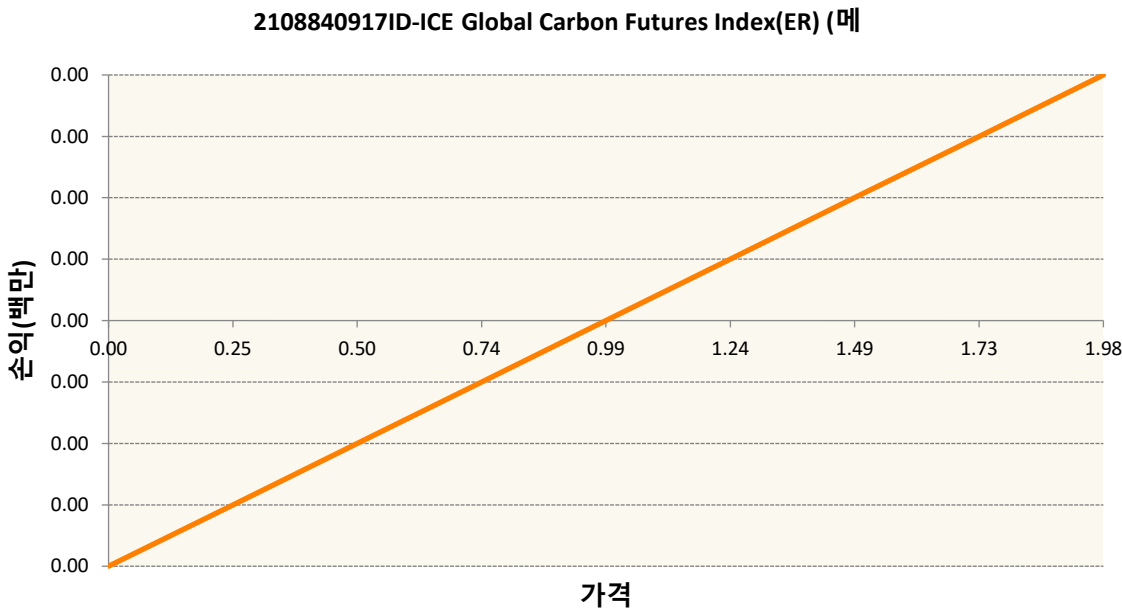
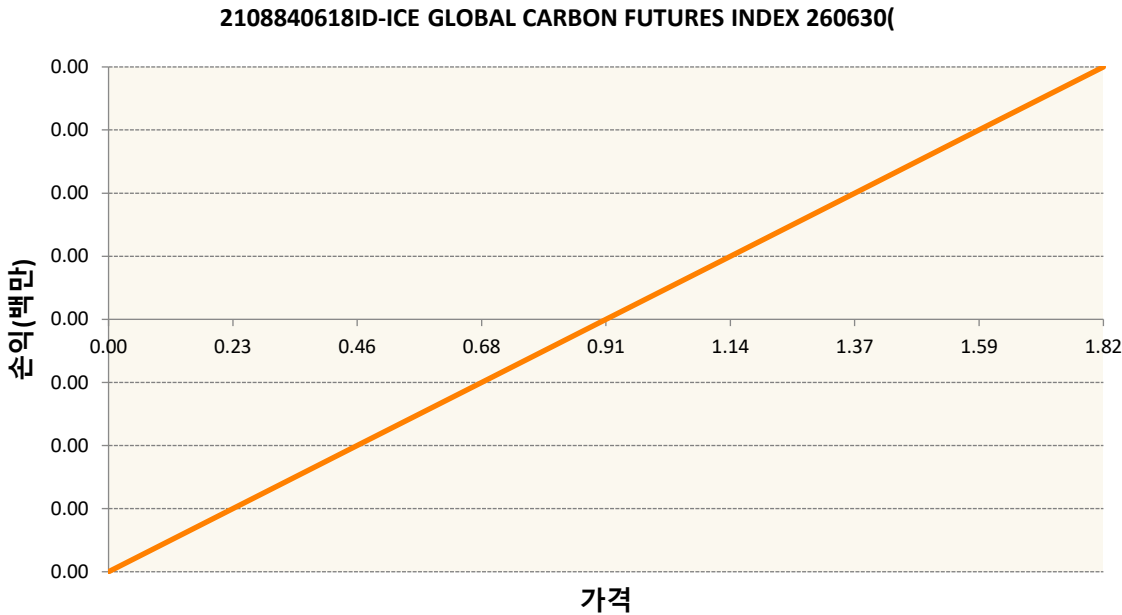
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,940	0	6,940	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		444
2108840917IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		112

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	582

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

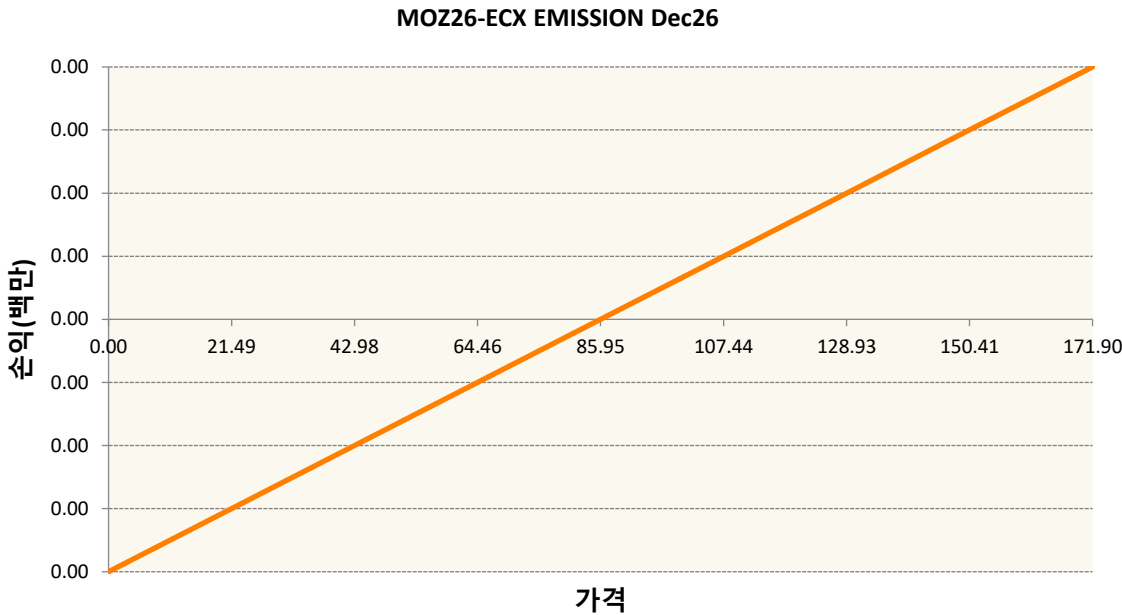
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,075	0	6,075	
누계	통화	선도	0	2,549	-2,549	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G9V\KRW/EUR 30-10-26E	204
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	486

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

(단위:백만원)

739

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

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	-314	0	-314	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	4
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	4
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	7
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	11

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

(단위:백만원)

40

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

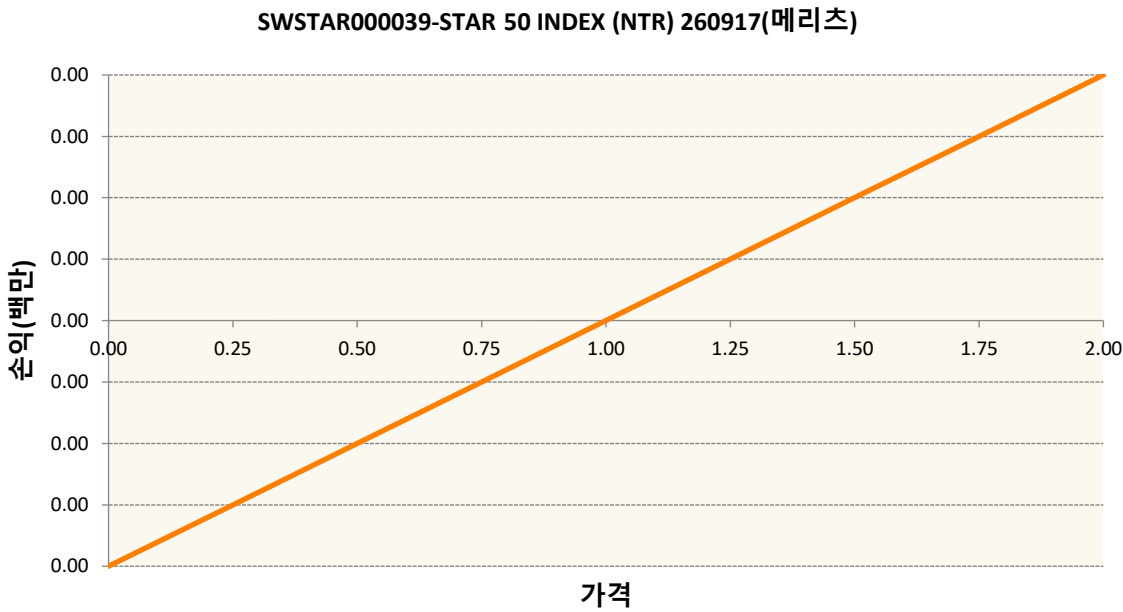
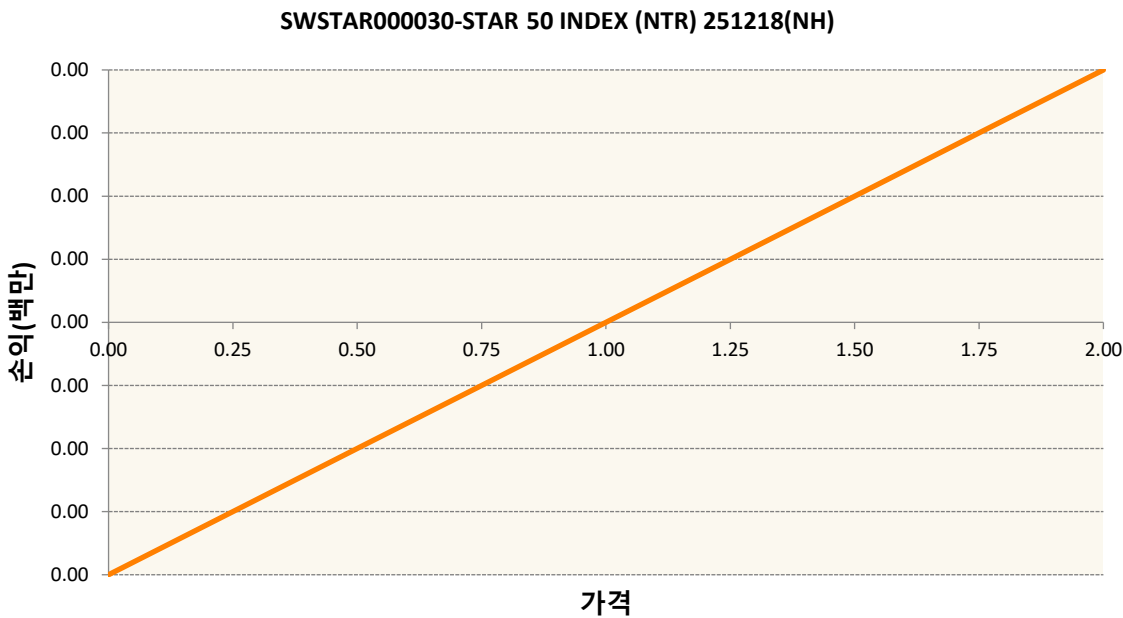
SOL차이나육성산업엑티브상장지

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	-2,881	0	-2,881	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	0.33
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	234
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	1

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

437

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

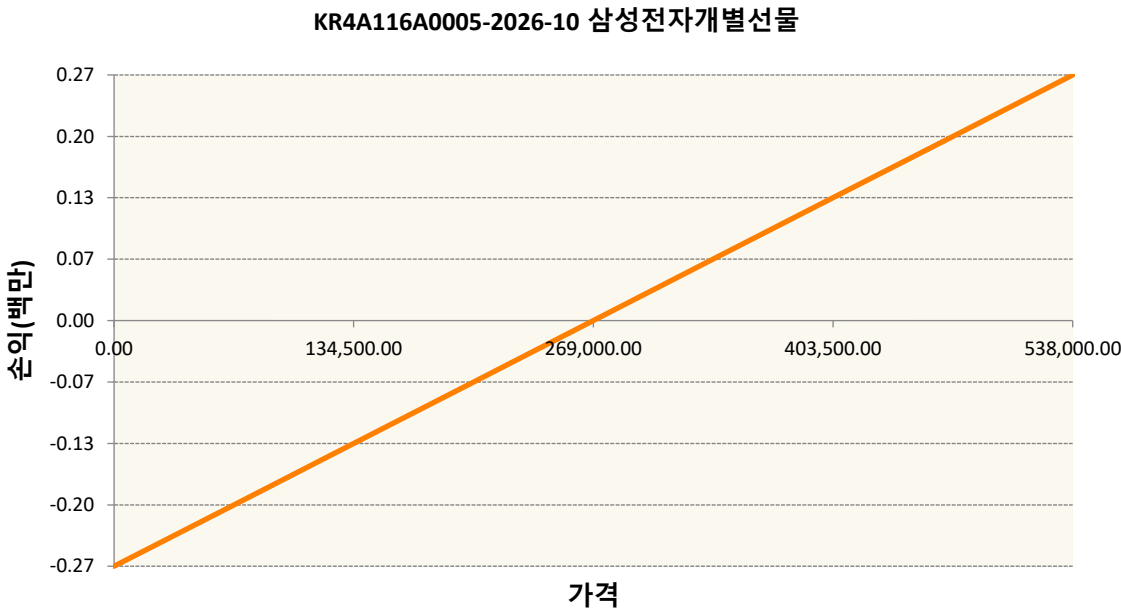
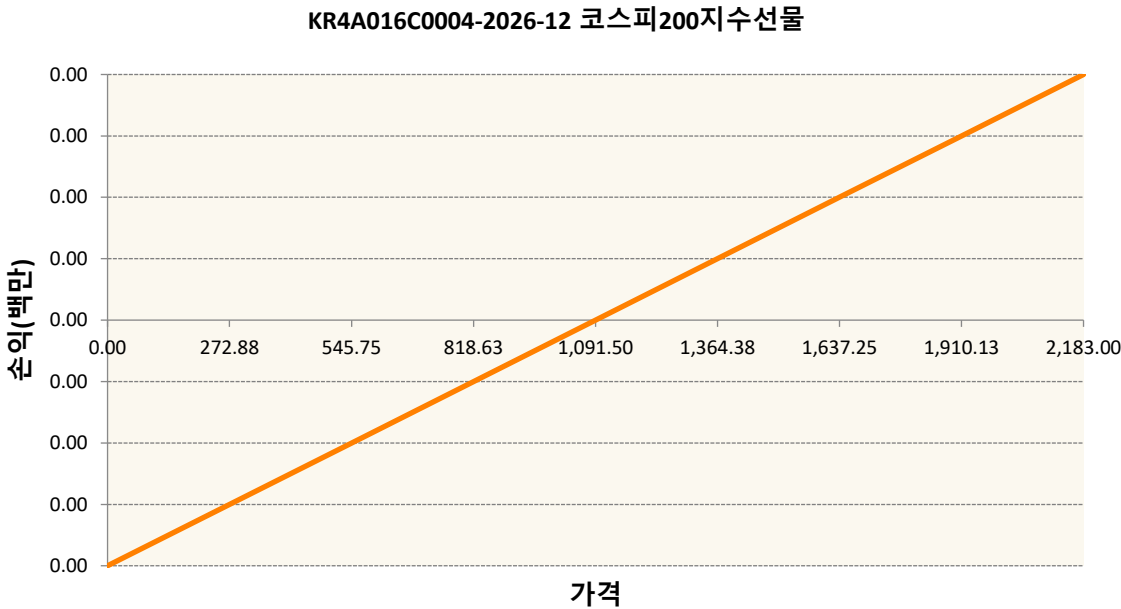
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	549	553	-4	장내
누계	유가증권	선물	17,630	0	17,630	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004		2026-12 코스피200지수선물					1,125
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125	-1,125
-5.33%	-750	-750	-750	-750	-750	-750	-750
-2.67%	-375	-375	-375	-375	-375	-375	-375
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	375	375	375	375	375	375	375
5.33%	750	750	750	750	750	750	750
8.00%	1,125	1,125	1,125	1,125	1,125	1,125	1,125
KR4A116A0005		2026-10 삼성전자개별선물					275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275

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

4,930

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

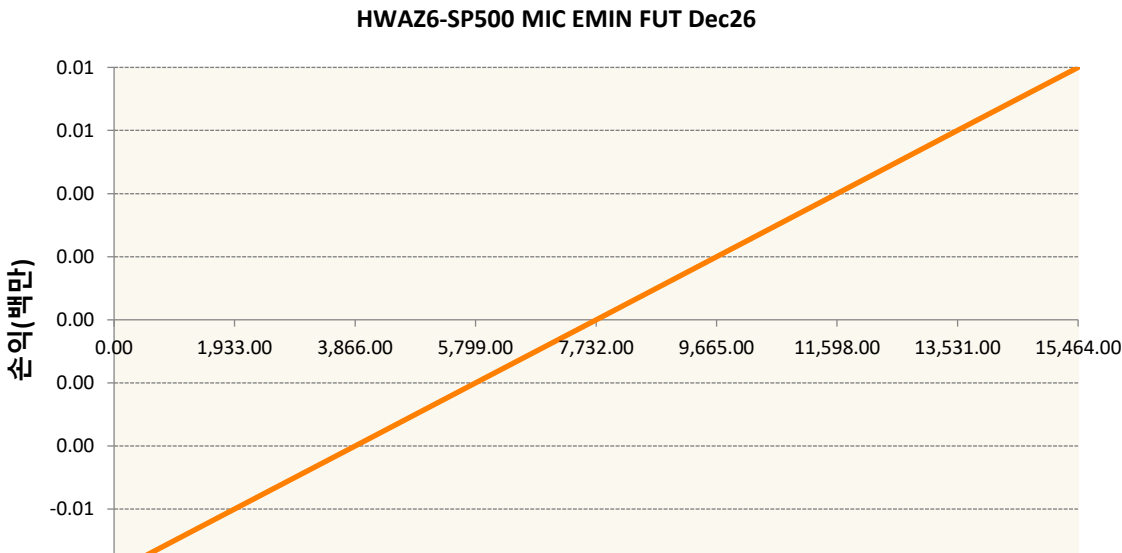
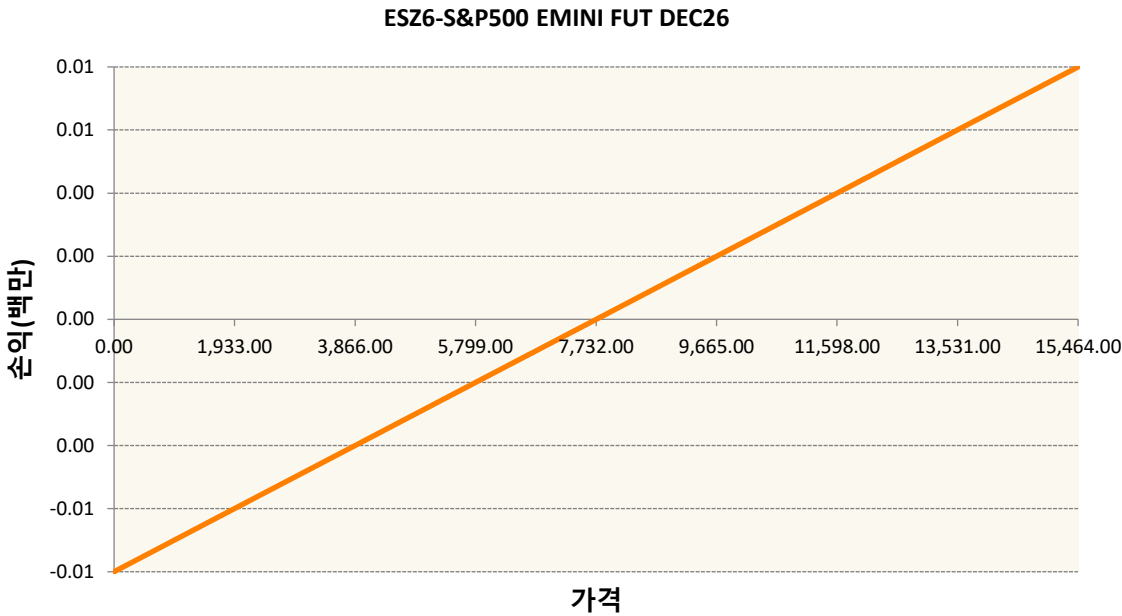
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

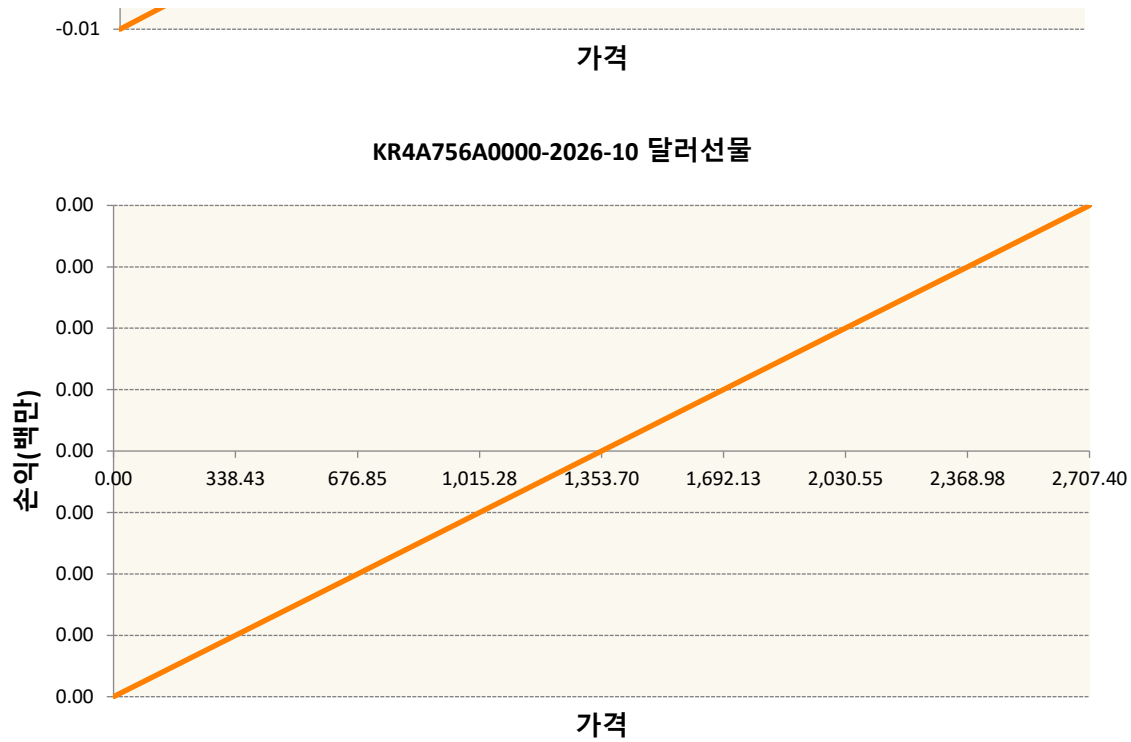
1. 계약금액

(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	75,819	0	75,819	
누계	지수	선물	374	0	374	장내
누계	통화	선물	14,349	0	14,349	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,066
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	1,148

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

(단위:백만원)

3,743

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

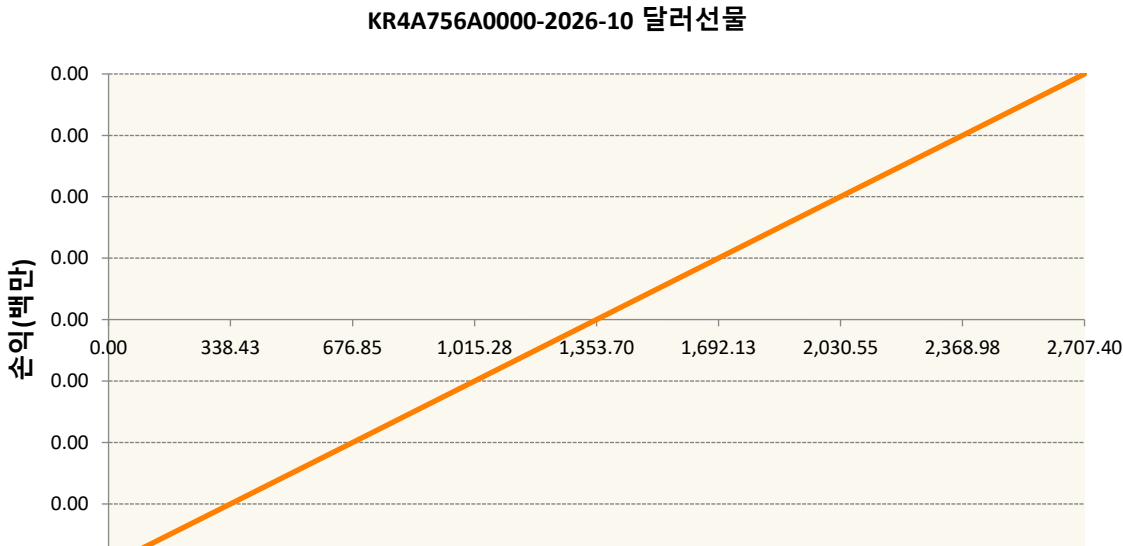
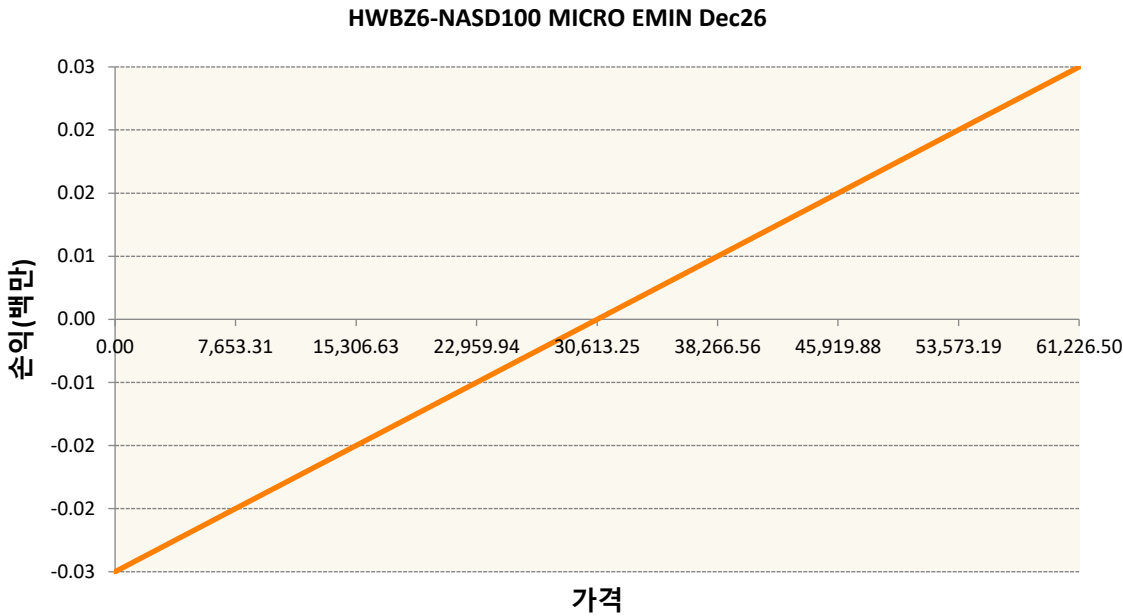
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

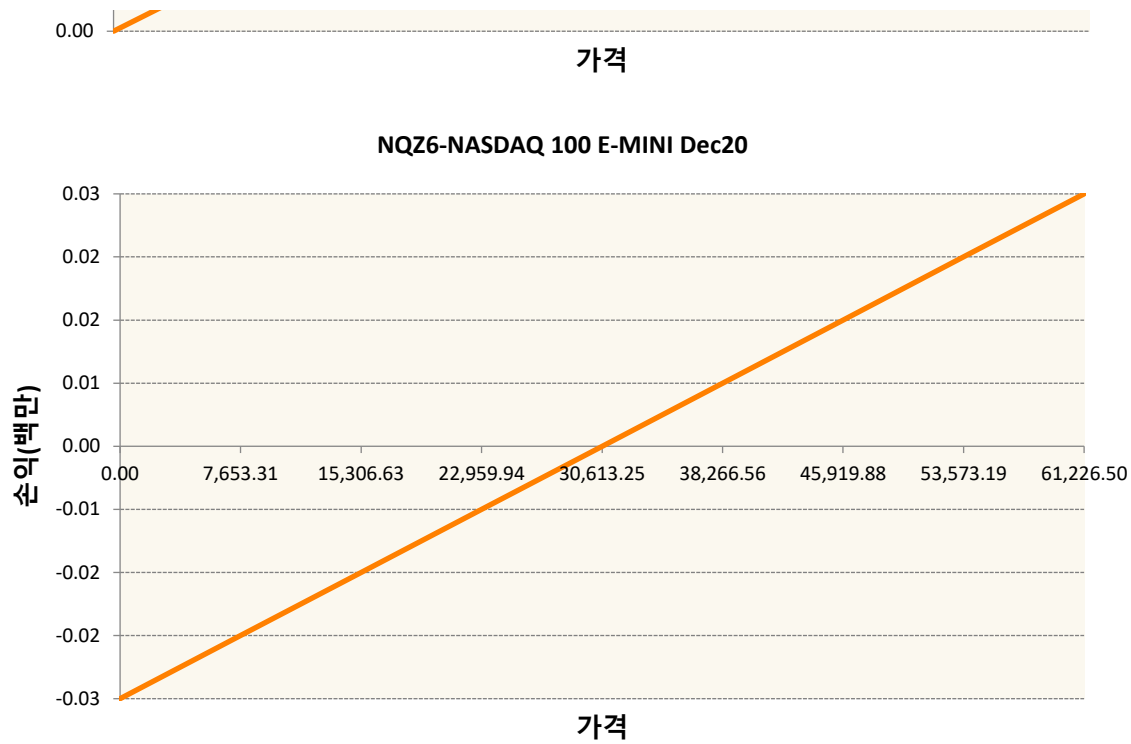
1. 계약금액

(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	35,513	0	35,513	
누계	지수	선물	423	0	423	장내
누계	통화	선물	6,782	0	6,782	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	34
KR4A756A0C	2026-10 달러선물	543
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,841

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

2,567

공시일	2026-10-01
기준일	2026-09-30

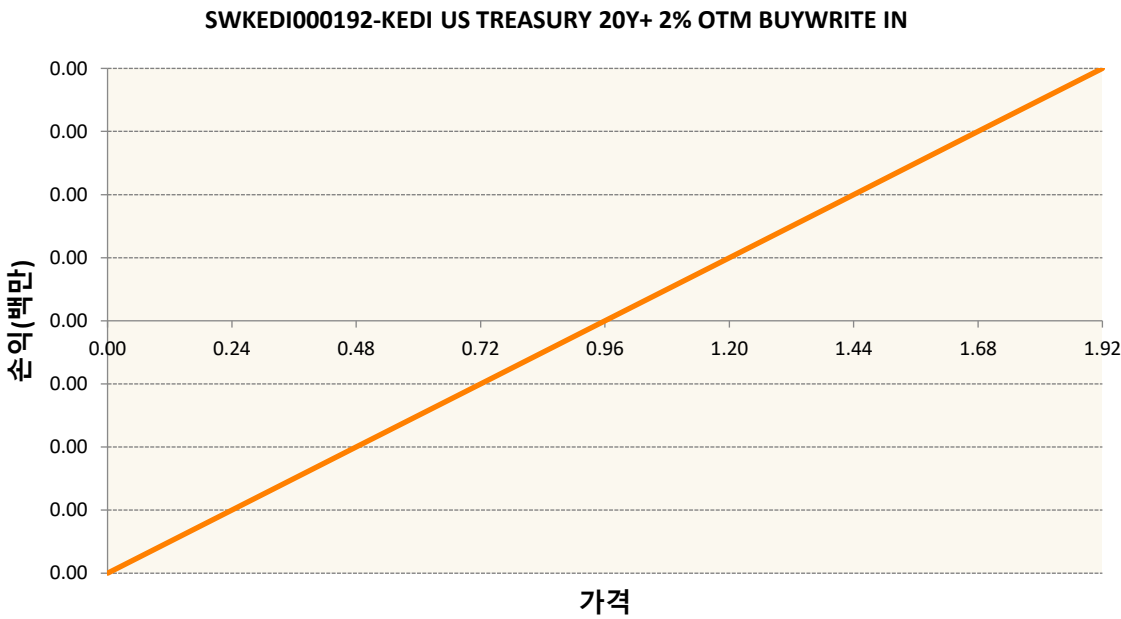
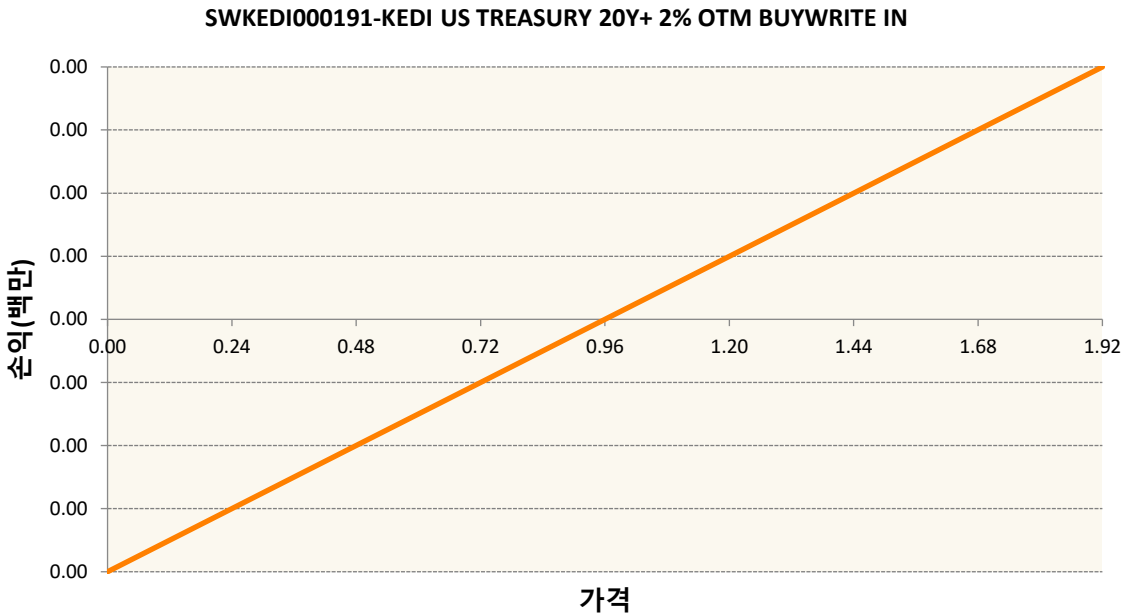
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

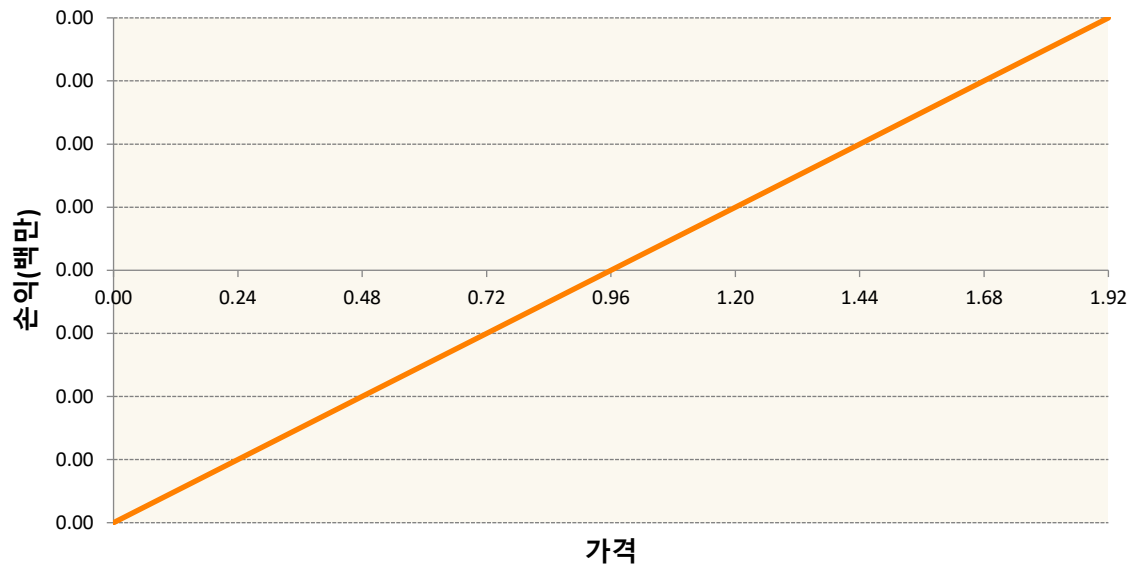
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	268,251	0	268,251	장외

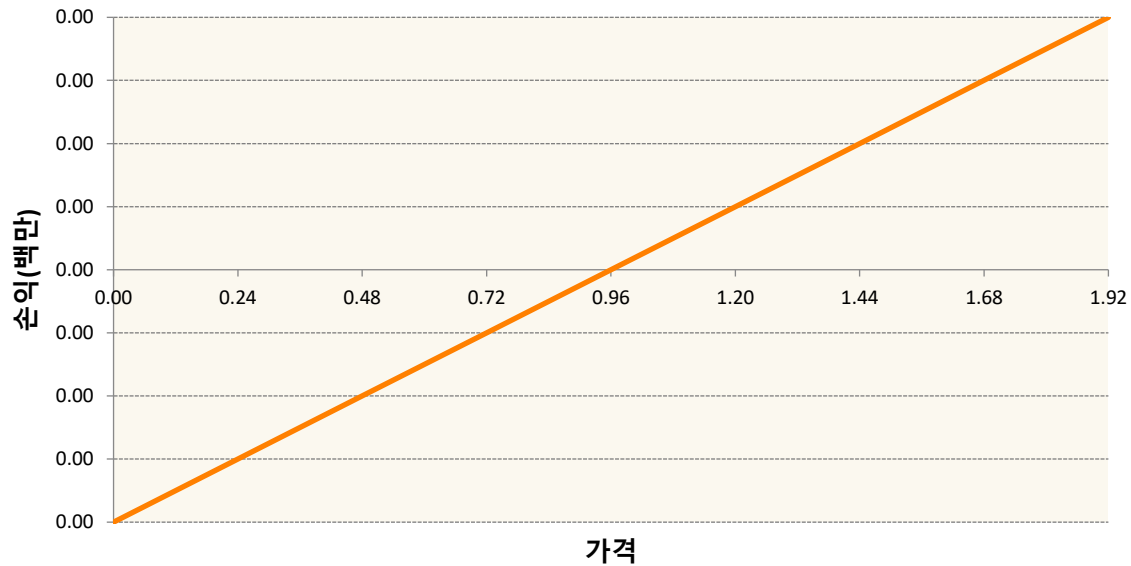
2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000193-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000194-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,620
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,660
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,774
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,410

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

(단위:백만원)

8,606
