

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

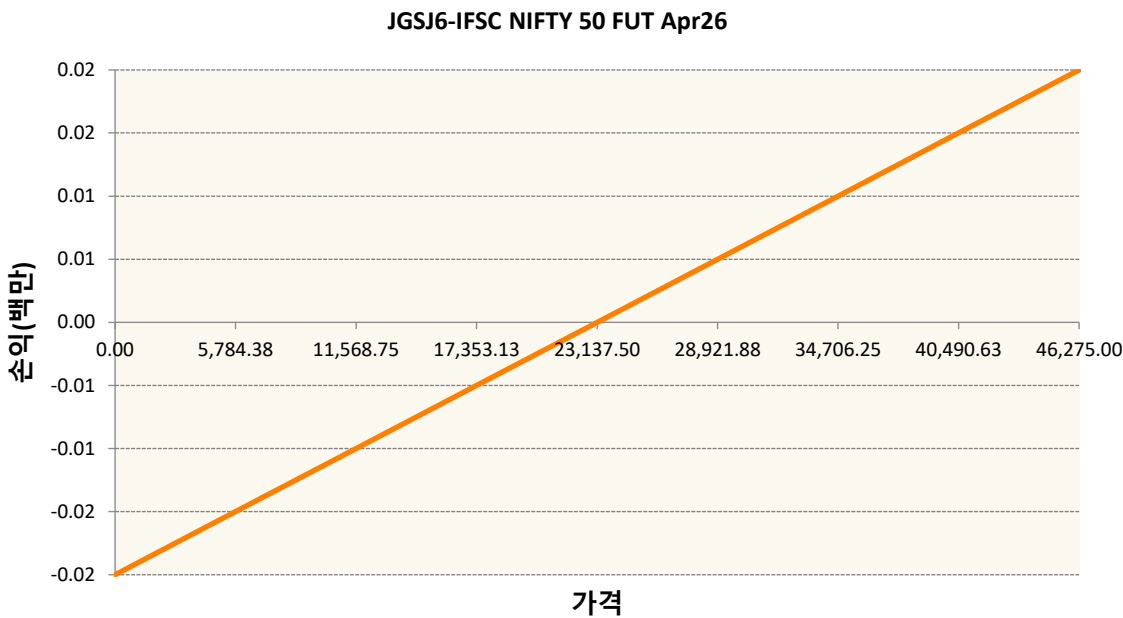
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	628	0	628	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ6 IFSC NIFTY 50 FUT Apr26

50

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

(단위:백만원)

34

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

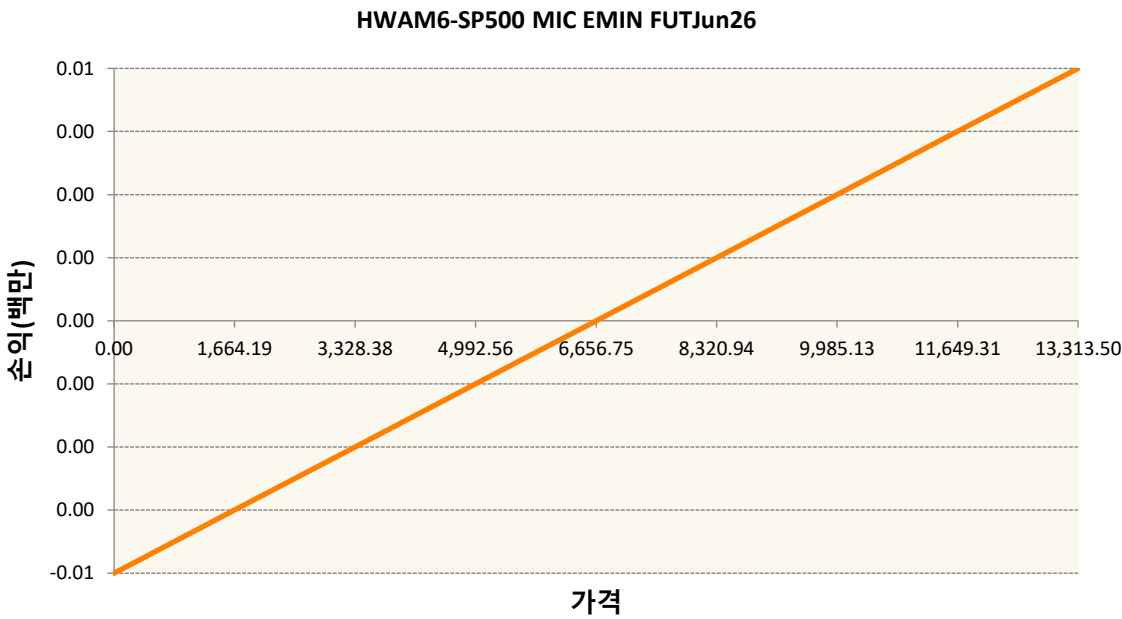
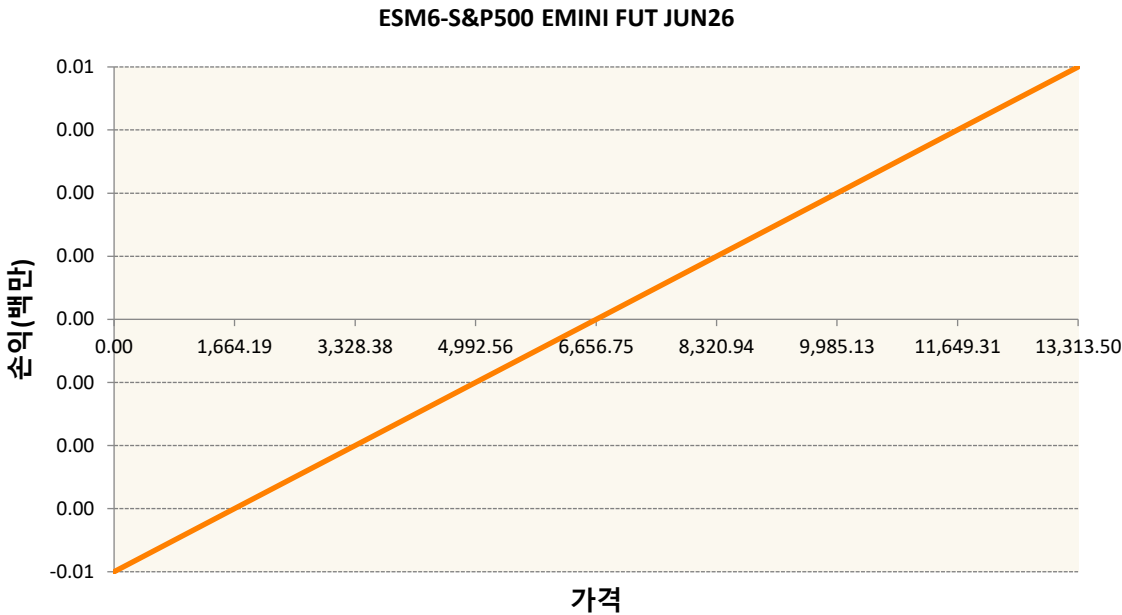
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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
누계	지수	선물	500	0	500	
누계	지수	선물	250	0	250	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	40
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	20

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	52

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

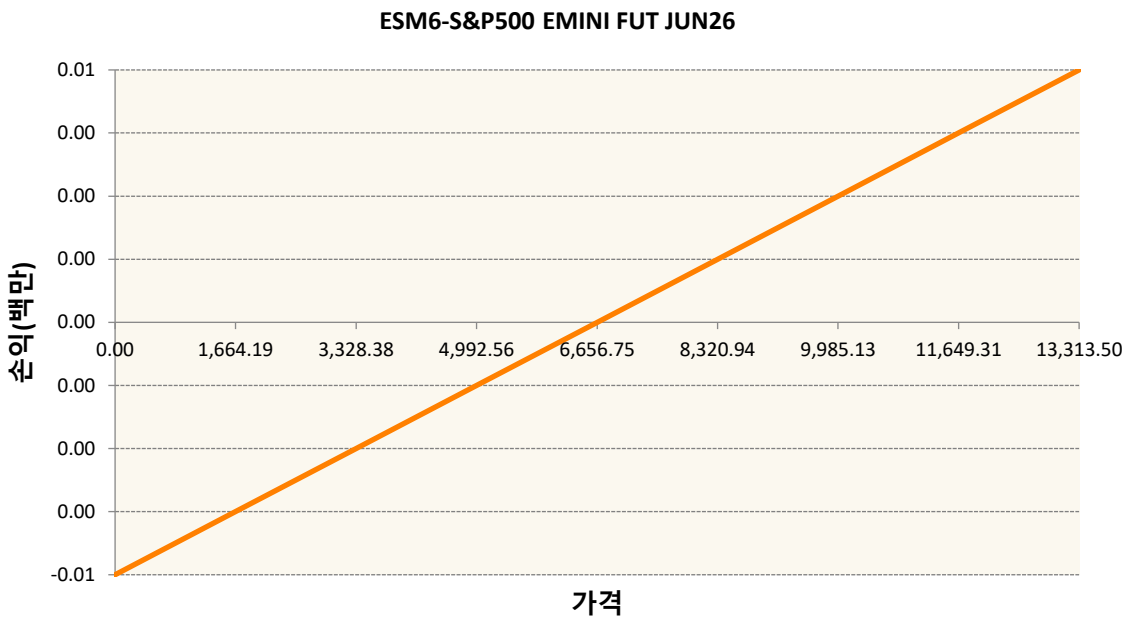
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	999	0	999	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	80
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

70

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

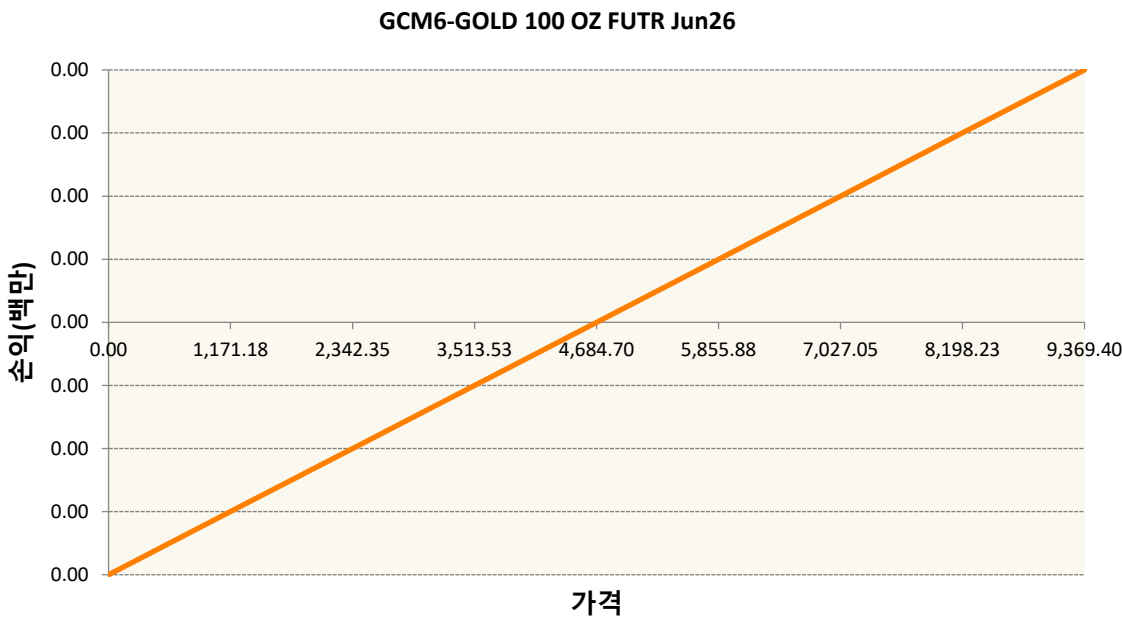
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	4,941	0	4,941	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 04/10/26 C435 EQUITY	15
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	395

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

(단위:백만원)

516

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

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 04/10/26 C152.5 EQUITY	112
AOPLTRUP1!PLTR US 04/10/26 P152.5 EQUITY	43

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

(단위:백만원)

513

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

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)

AOTLTUSC8(TLT US 04/10/26 C86.5 EQUITY

18

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

(단위:백만원)

12

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

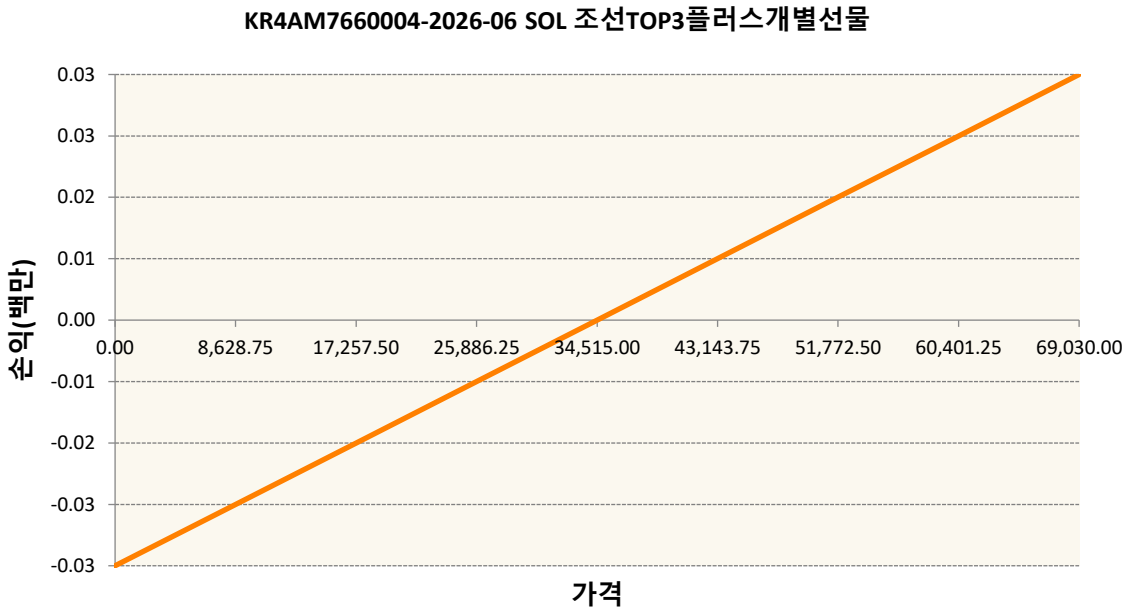
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	152,232	0	152,232	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-04-09

기준일 2026-04-08

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	2026-04-09
기준일	2026-04-08

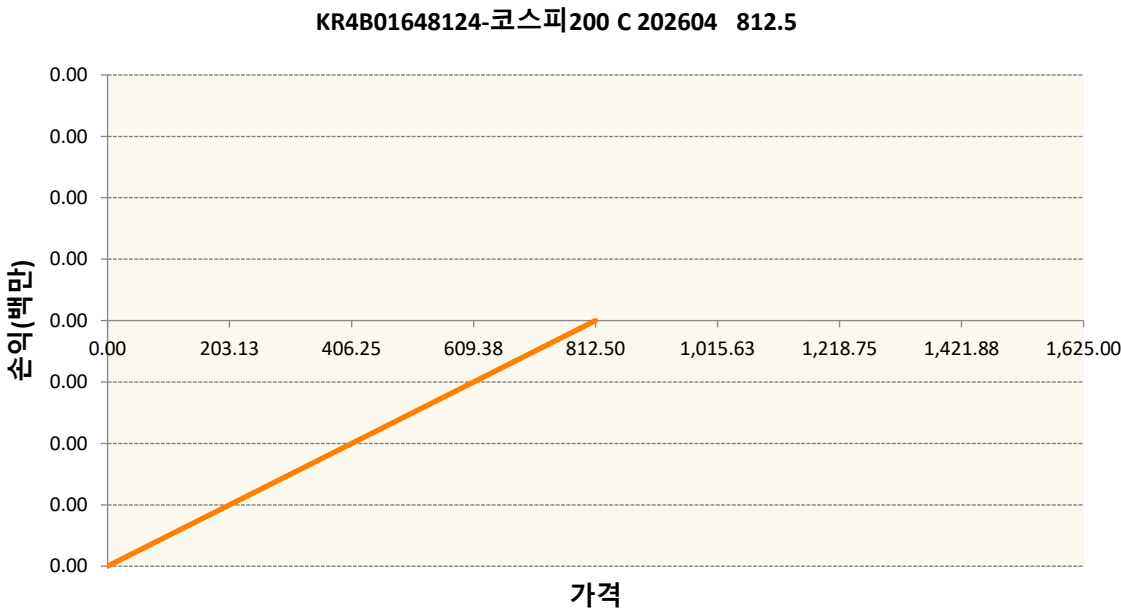
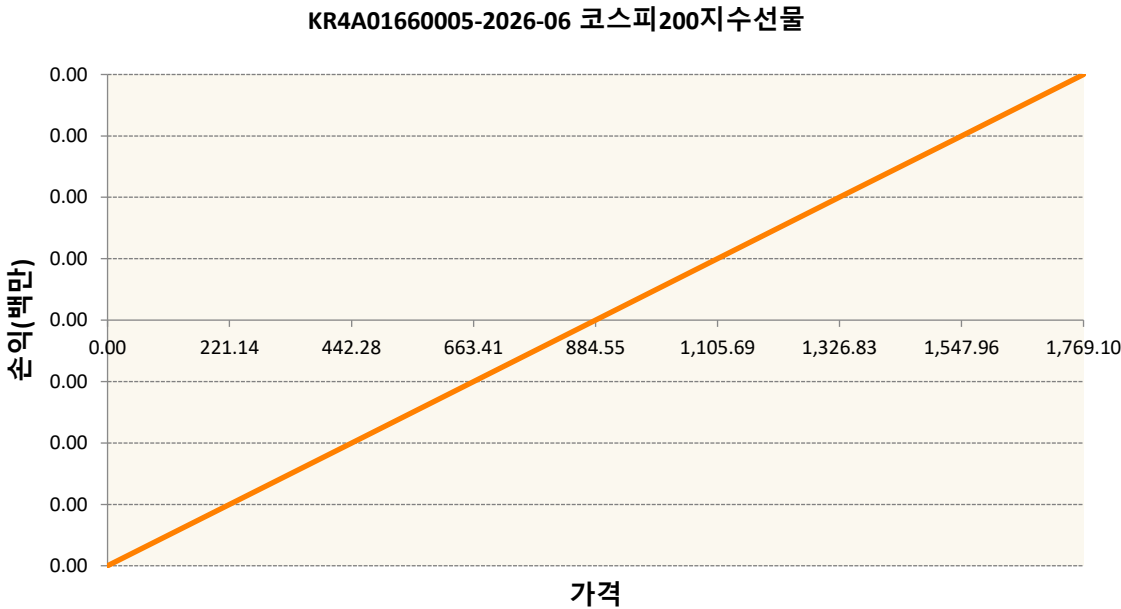
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

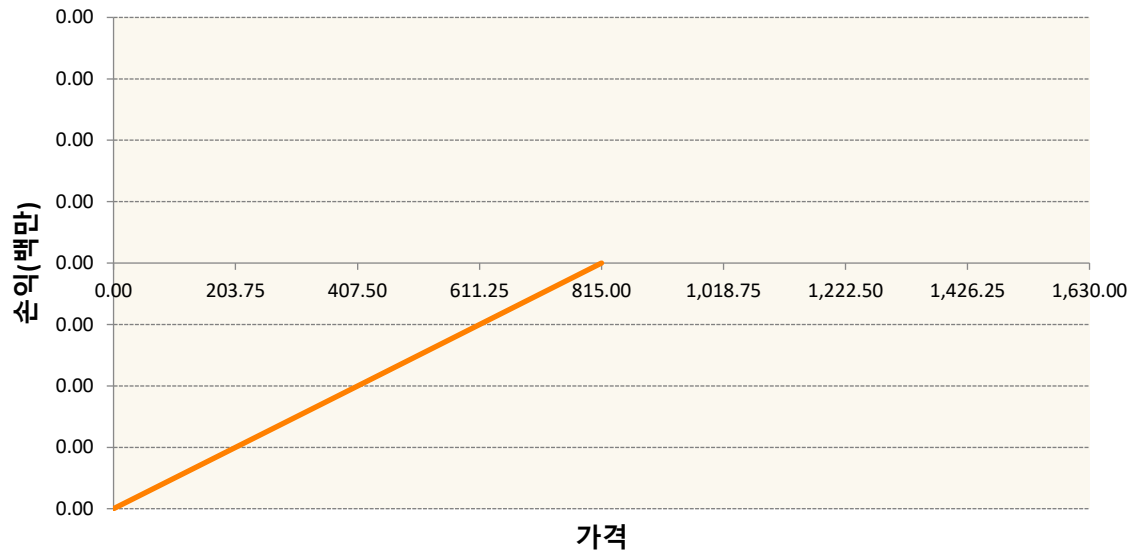
(단위:백만원)

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	5,750	0	5,750	장내
누계	유가증권	옵션	0	9,356	-9,356	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4B01648157-코스피200 C 202604 815.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					459
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-459	-459	-459	-459	-459	-459	-459
-5.33%	-306	-306	-306	-306	-306	-306	-306
-2.67%	-153	-153	-153	-153	-153	-153	-153
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	153	153	153	153	153	153	153
5.33%	306	306	306	306	306	306	306
8.00%	459	459	459	459	459	459	459
KR4B01648124		코스피200 C 202604 812.5					87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-58	-64	-70	-75	-81	-87
-5.33%	-7	-10	-14	-18	-22	-26	-30
-2.67%	0	-1	-1	-2	-4	-6	-8
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4B01648157		코스피200 C 202604 815.0					67
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-47	-51	-55	-59	-63	-67
-5.33%	-7	-9	-12	-15	-18	-21	-24
-2.67%	0	-1	-1	-2	-3	-5	-6
0%	0	0	0	0	0	-1	-1

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

1,030

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

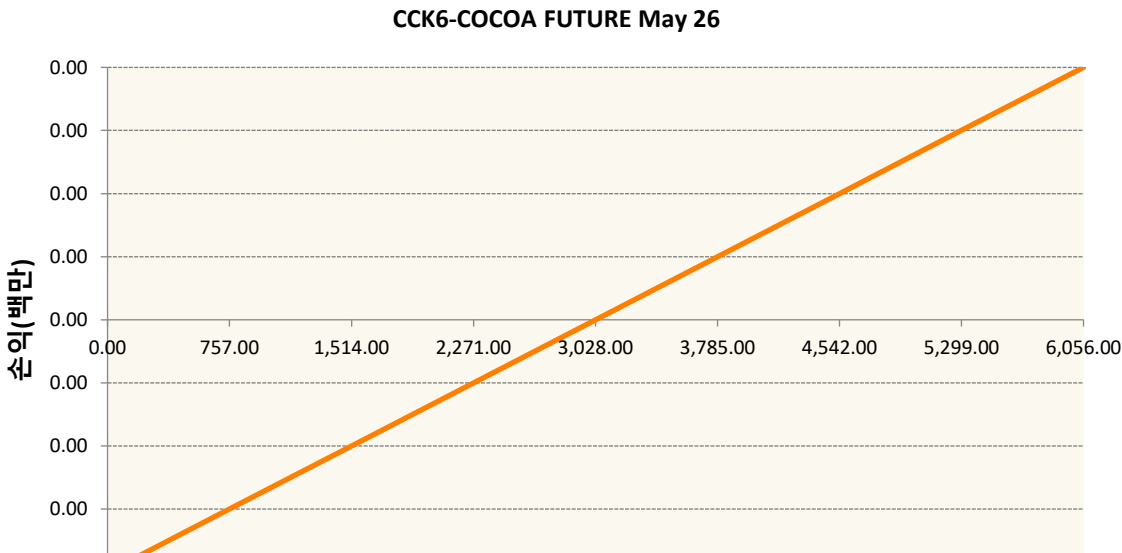
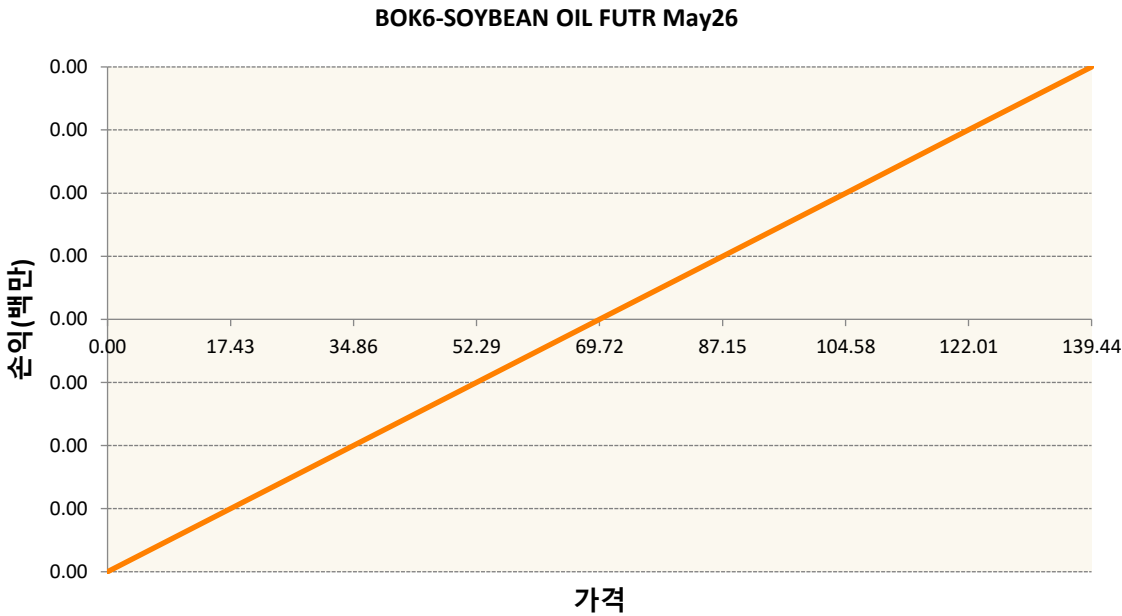
포커스농산물모(채권-파생형)

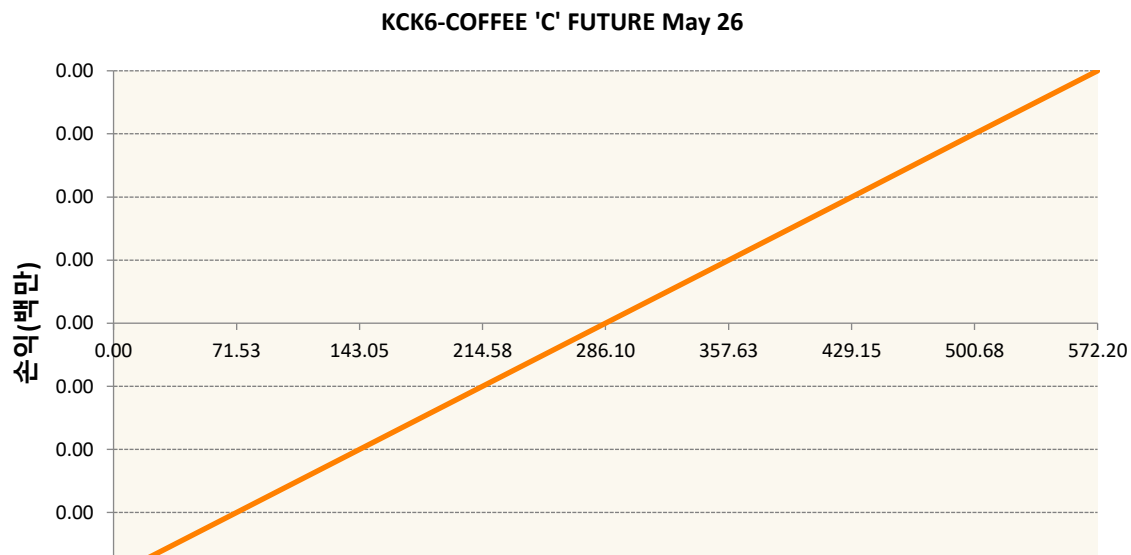
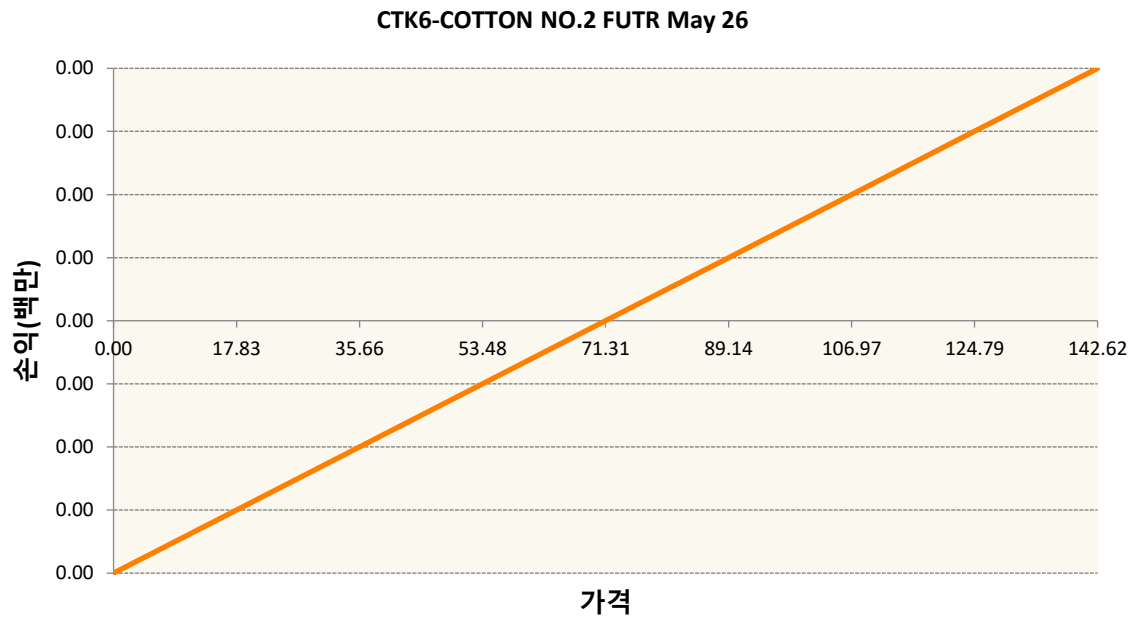
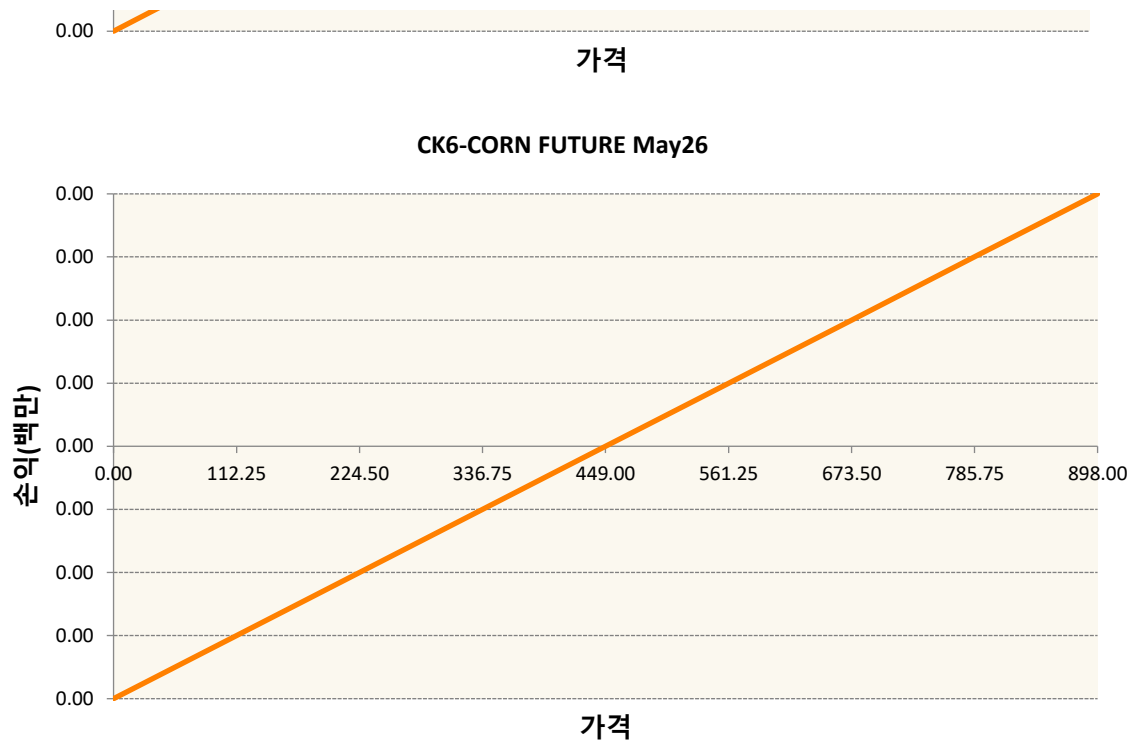
1. 계약금액

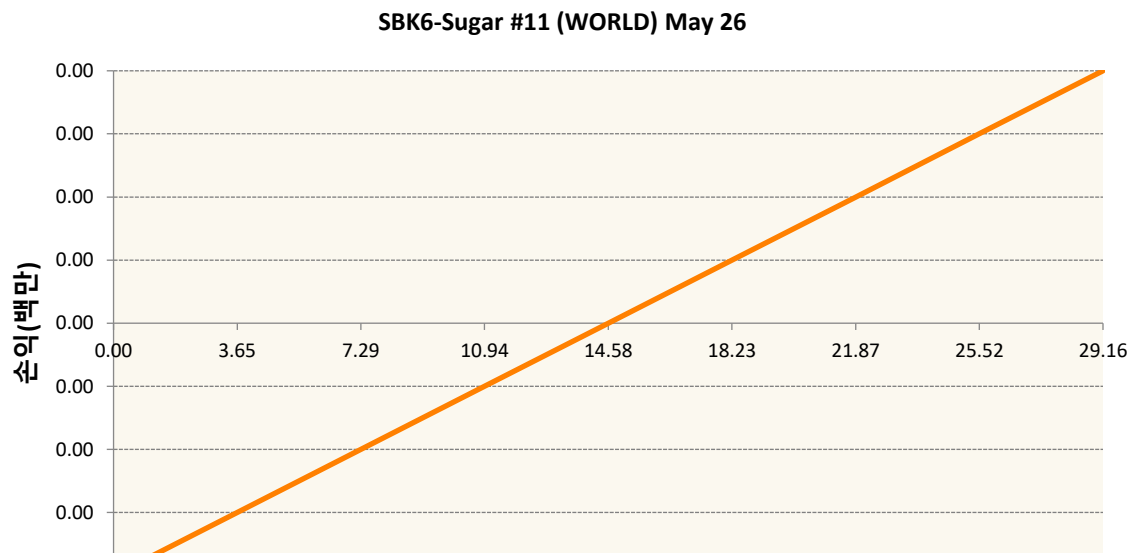
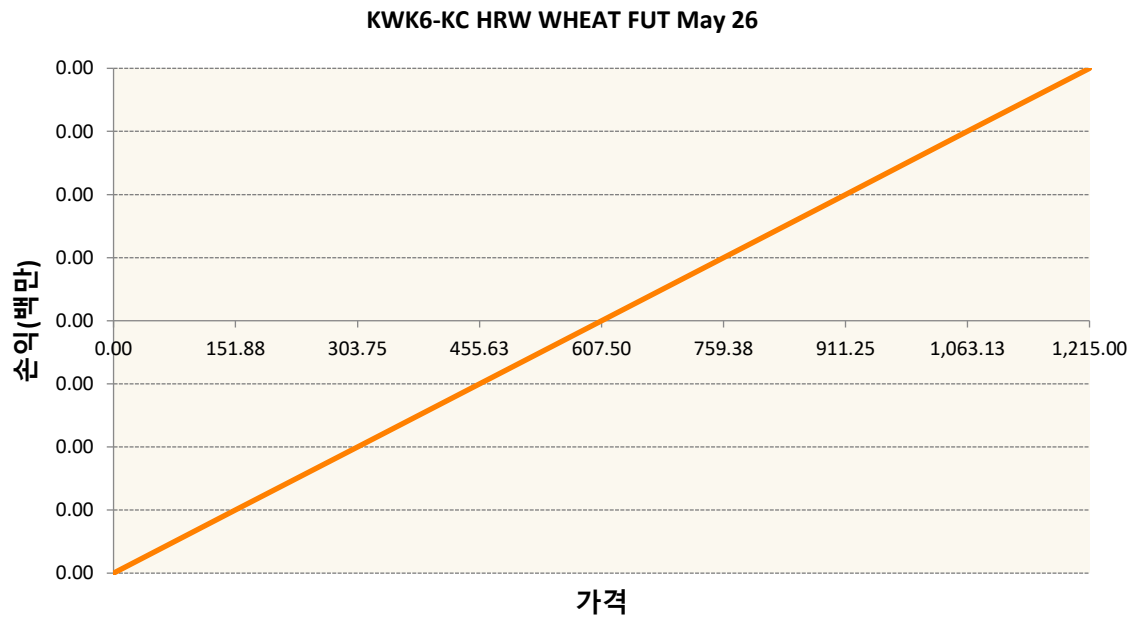
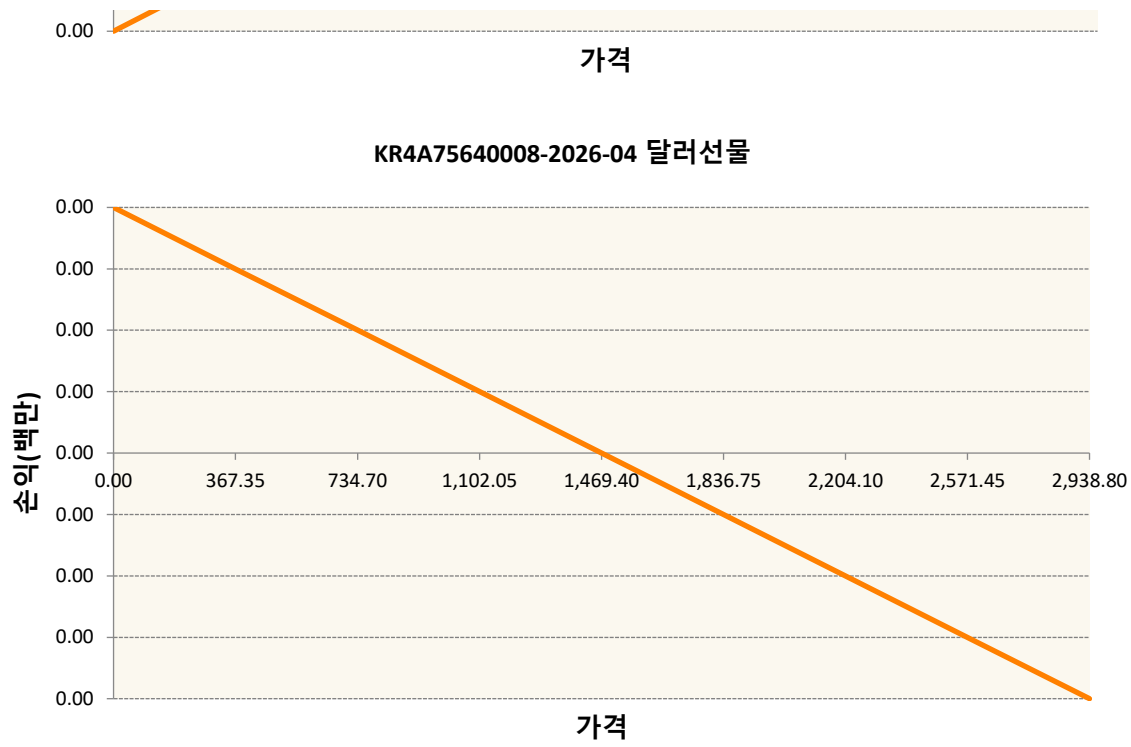
(단위:USD 백만)

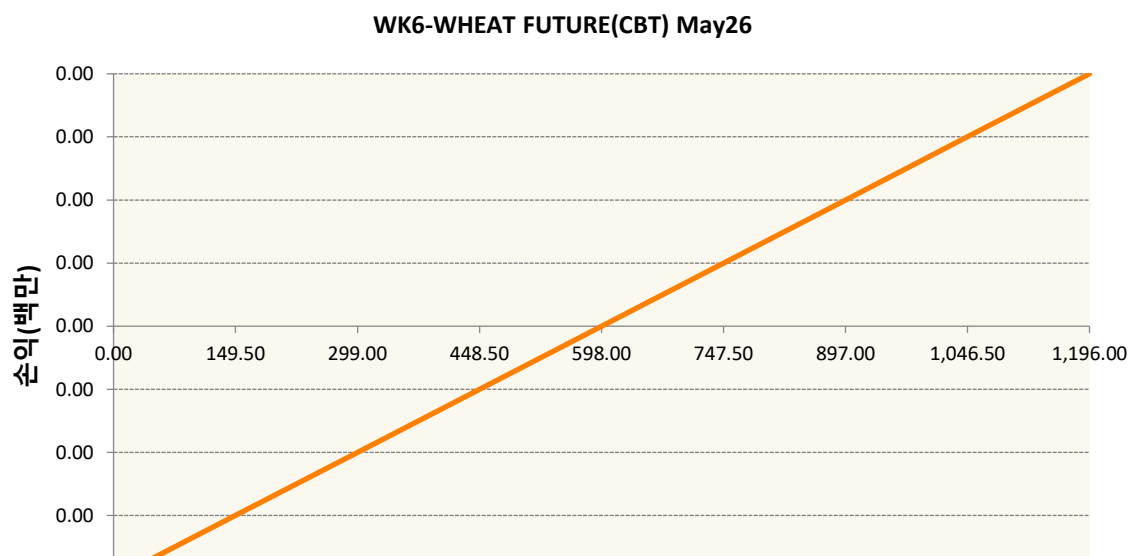
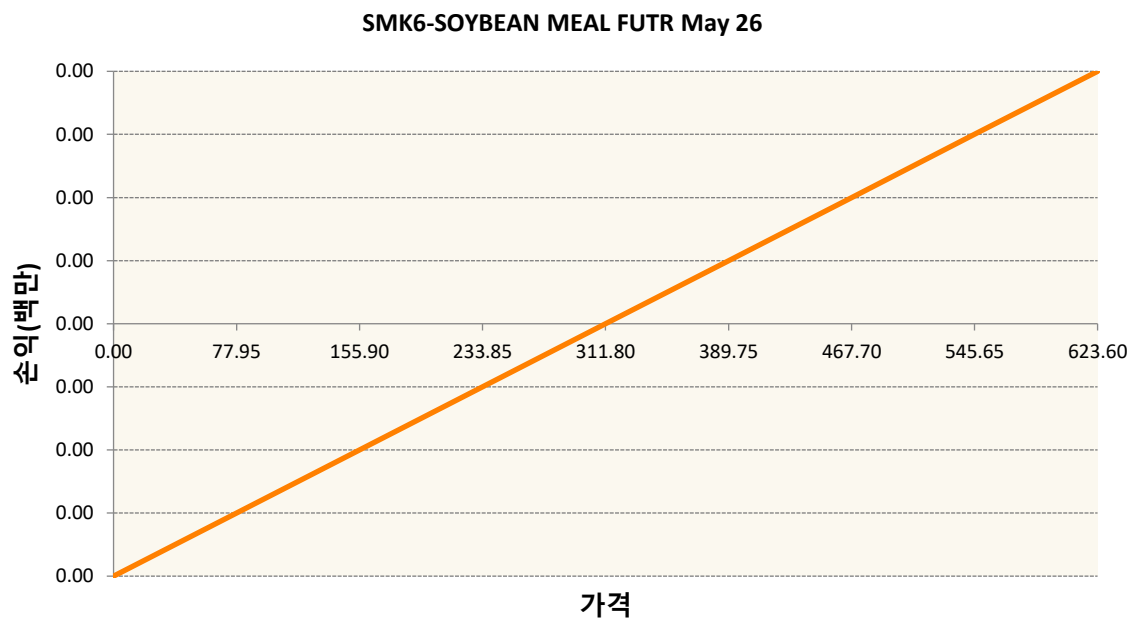
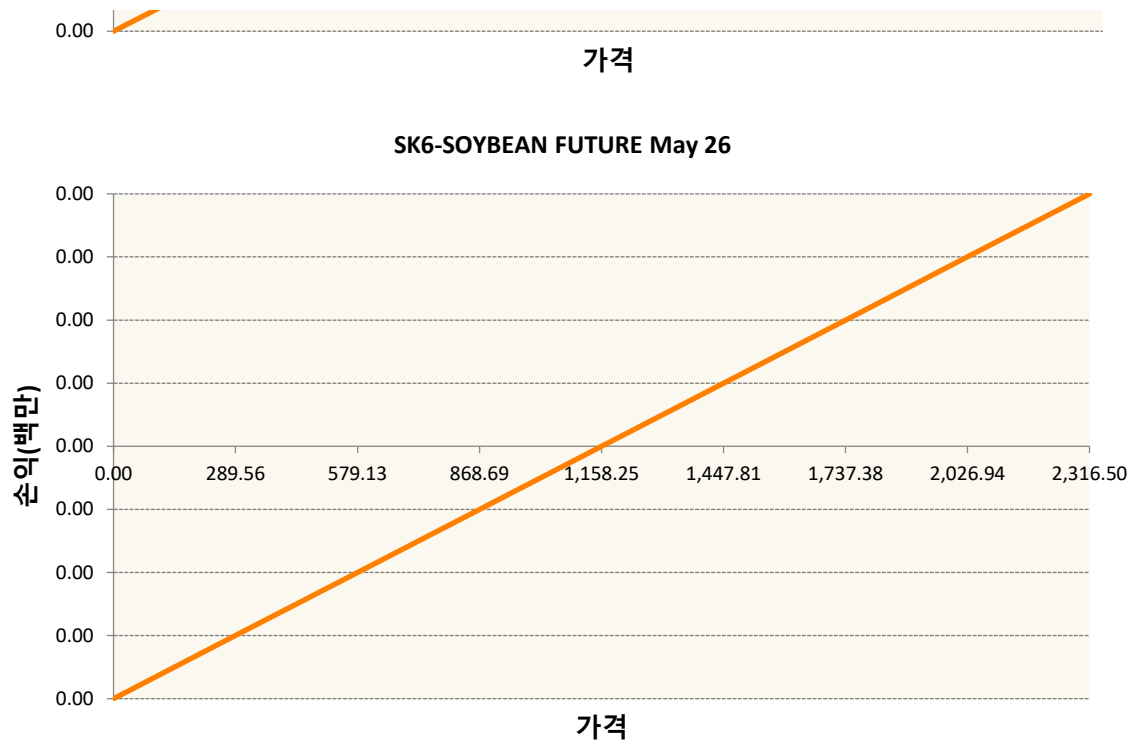
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	59	0	59	장내
누계	실물자산	선물	1,297	0	1,297	
누계	유가증권	선물	1,559	0	1,559	
누계	통화	선물	0	353	-353	장내

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	2026-04-09
기준일	2026-04-08

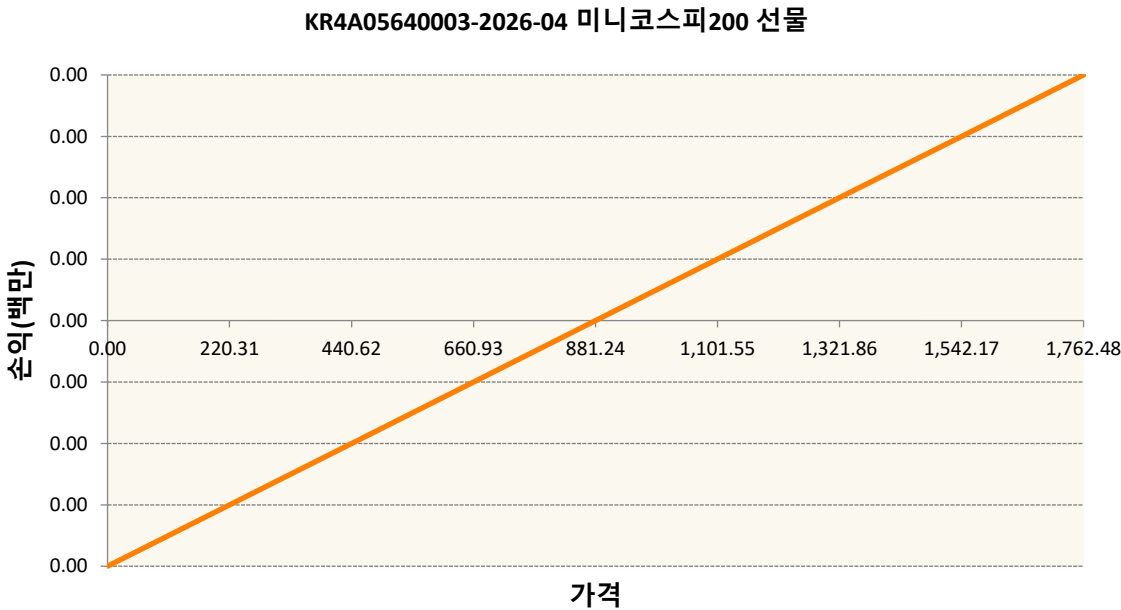
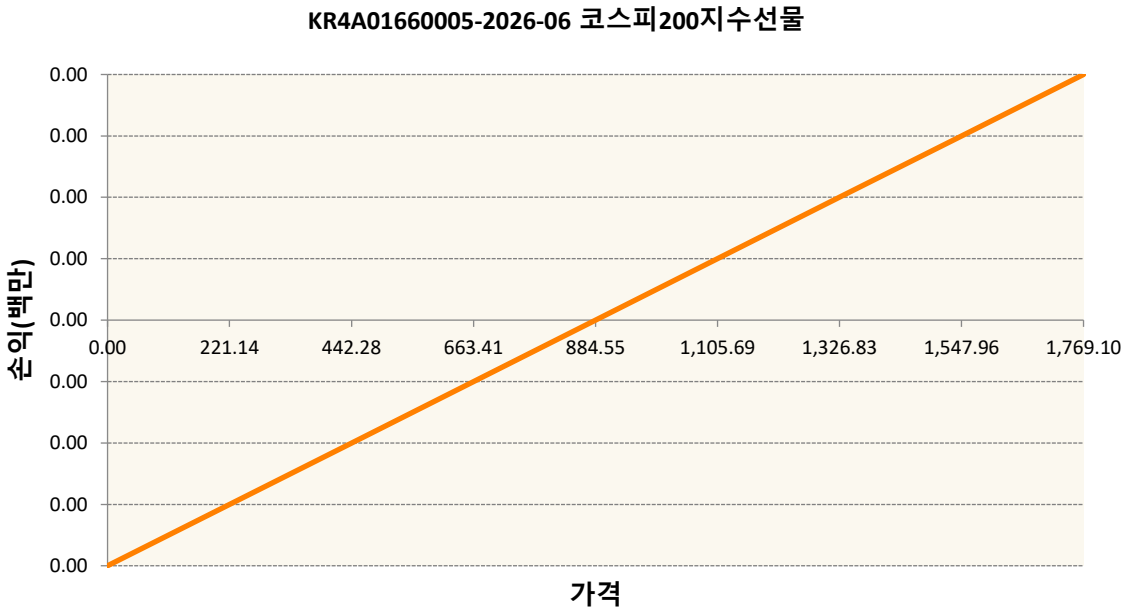
스마트인덱스모

1. 계약금액

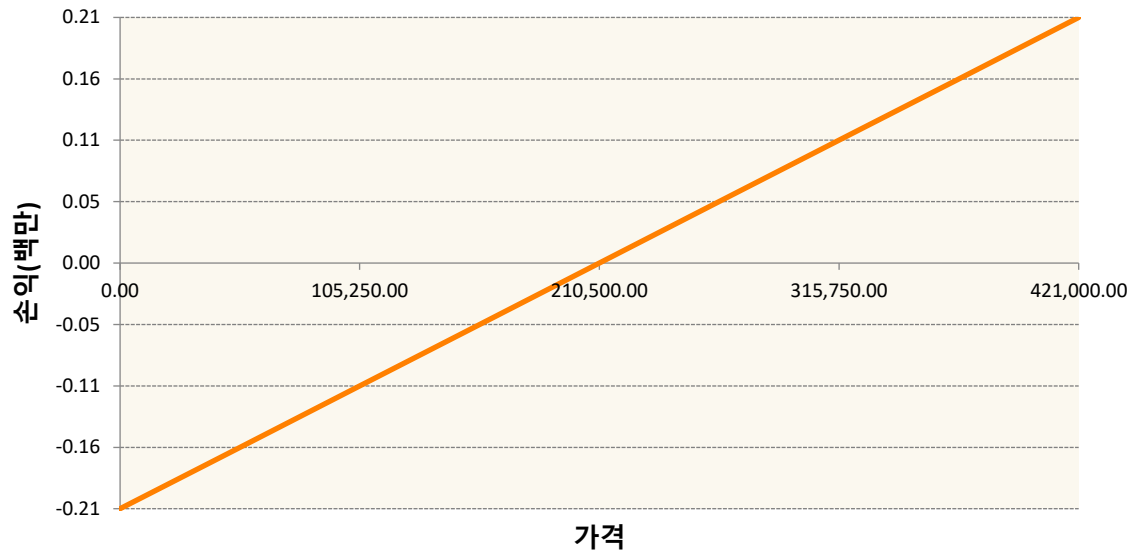
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,331	0	4,331	장내

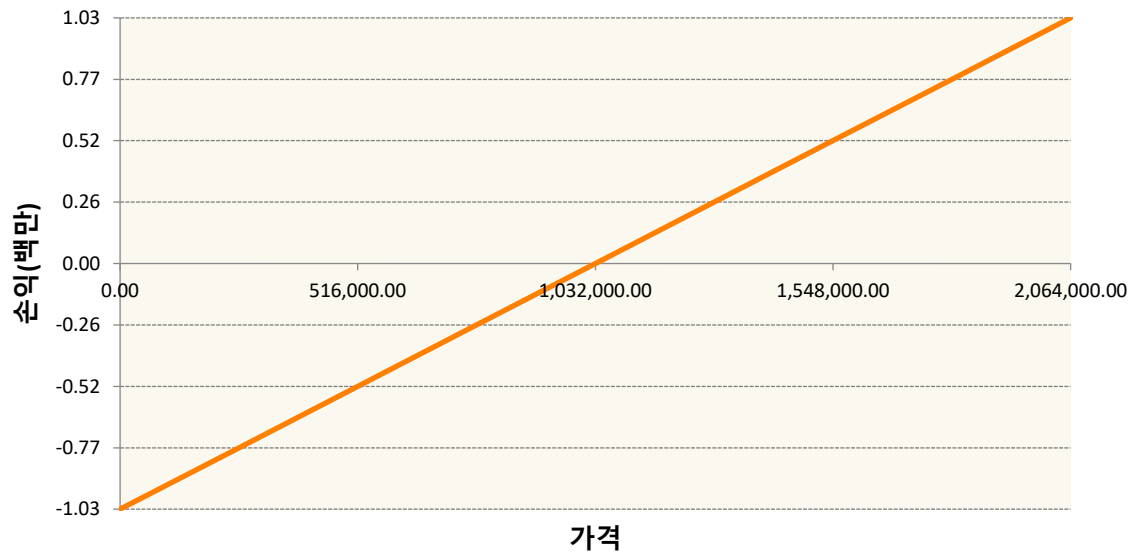
2. 만기시점의 손익구조



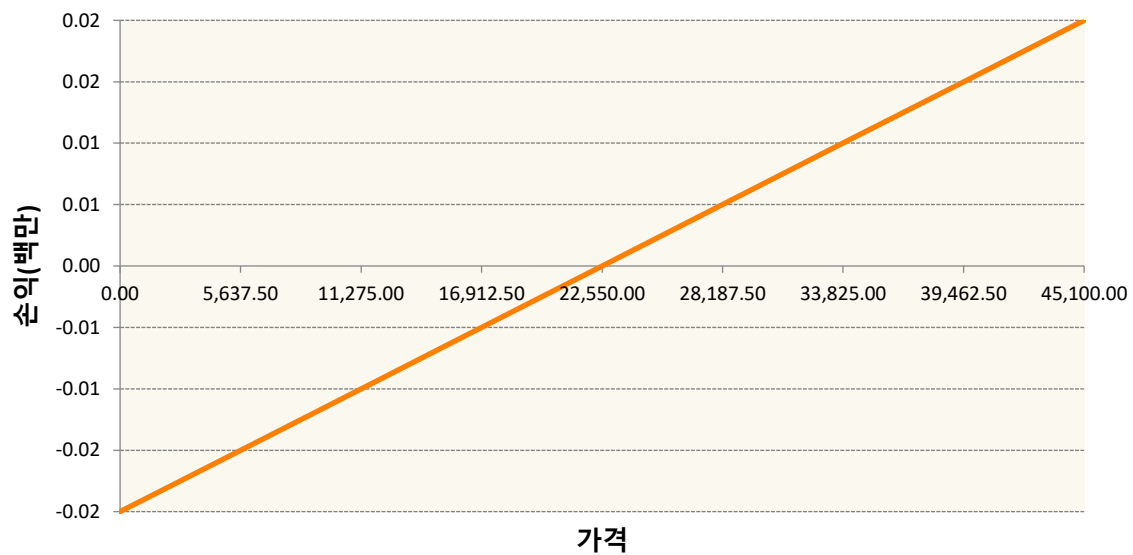
KR4A11640005-2026-04 삼성전자개별선물



KR4A50640007-2026-04 SK하이닉스개별선물



KR4AFT640008-2026-04 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		212		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-212	-212	-212	-212	-212	-212	-212				
-5.33%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141				
-2.67%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	71	71	71	71	71	71	71				
5.33%	141	141	141	141	141	141	141				
8.00%	212	212	212	212	212	212	212				
KR4A05640003							2026-04 미니코스피200 선물		7		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7				
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5				
-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%	5	5	5	5	5	5	5				
8.00%	7	7	7	7	7	7	7				
KR4A11640005							2026-04 삼성전자개별선물		89		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89				
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59				
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	30	30	30	30	30	30	30				
5.33%	59	59	59	59	59	59	59				
8.00%	89	89	89	89	89	89	89				
KR4A50640007							2026-04 SK하이닉스개별선물		9		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9				
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6				
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	3	3	3	3	3	3	3				
5.33%	6	6	6	6	6	6	6				
8.00%	9	9	9	9	9	9	9				
KR4AFT640008							2026-04 대우건설개별선물		1		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

(단위:백만원)

737

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

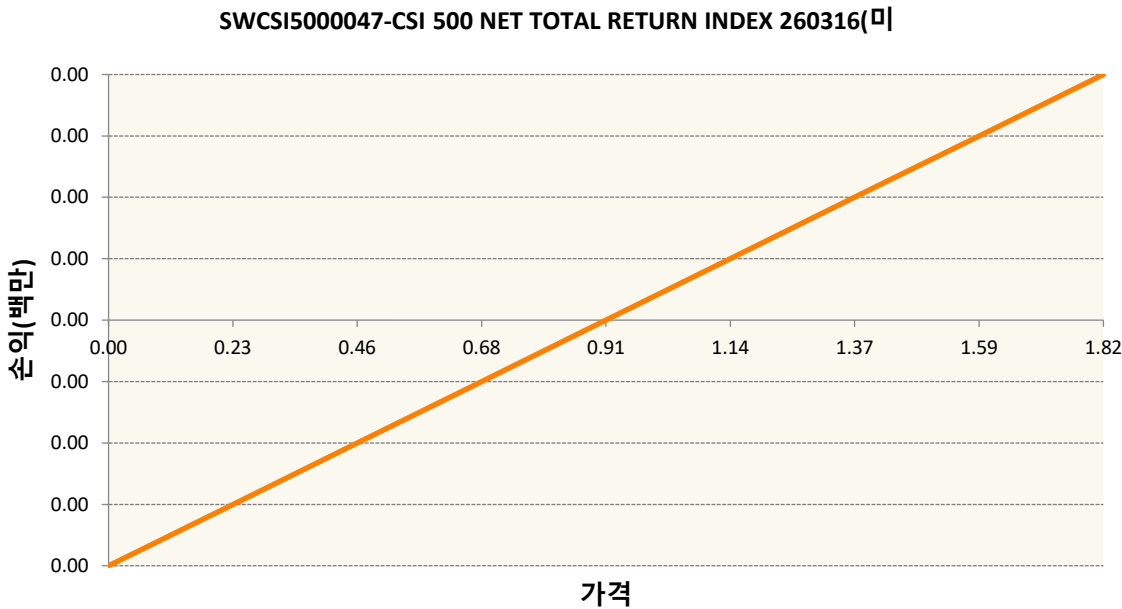
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,136	0	5,136	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

410

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

547

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

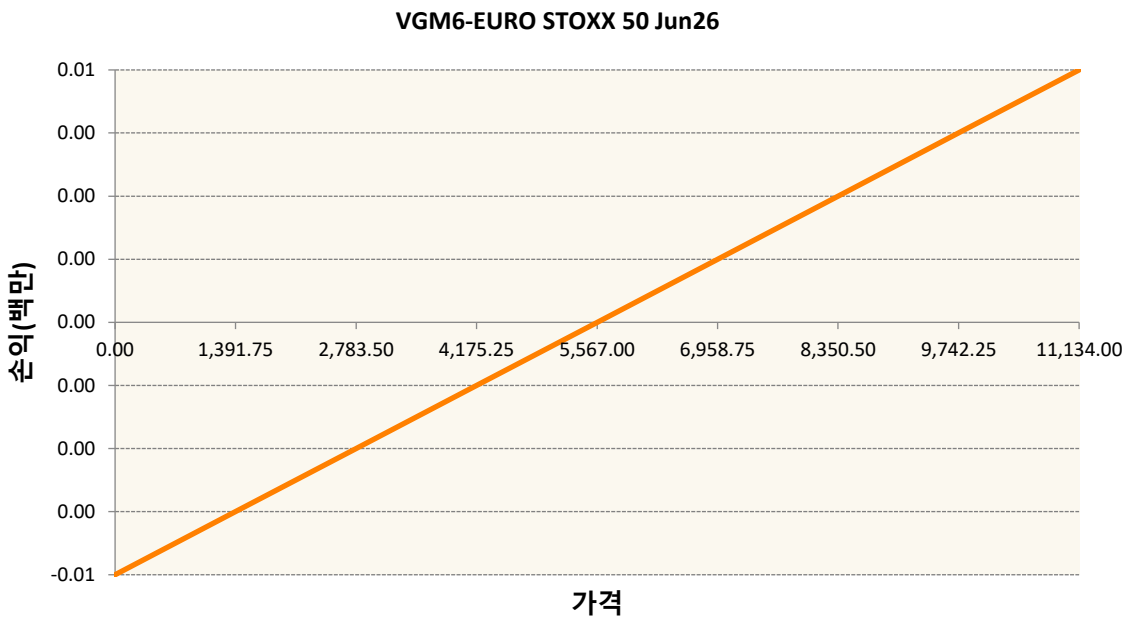
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	858	0	858	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	69
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

58

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

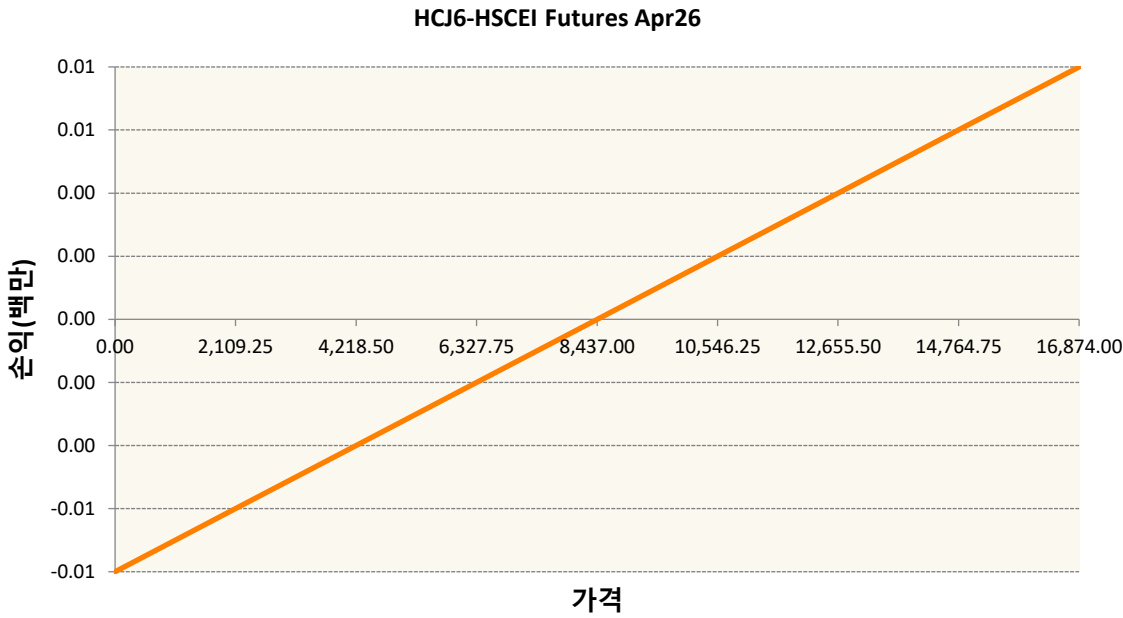
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,465	0	1,465	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI6	HSCEI Futures Apr26	117
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

142

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

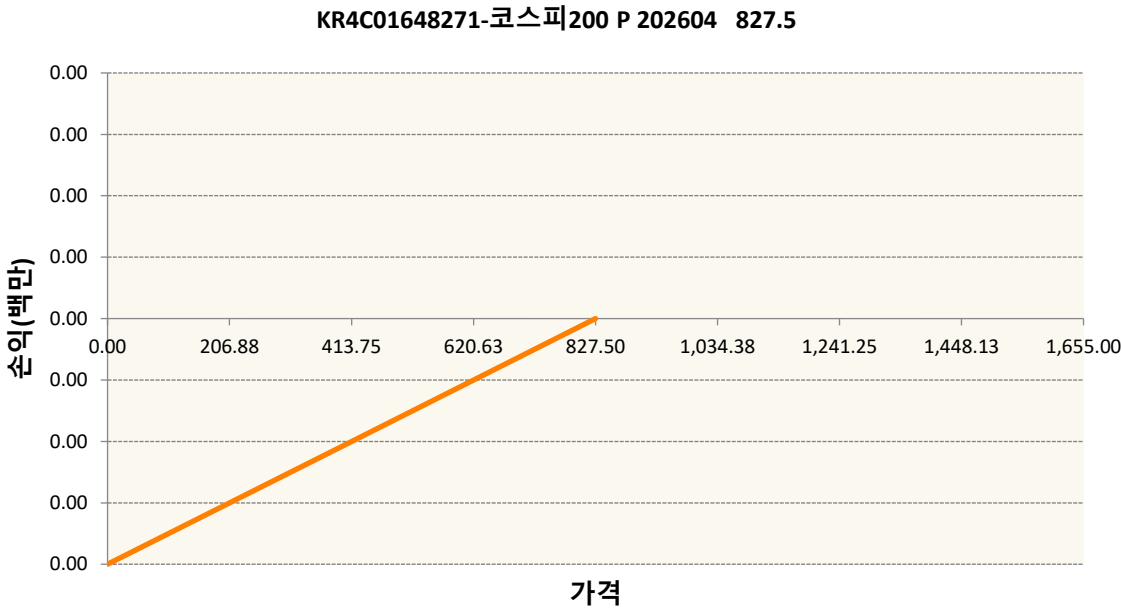
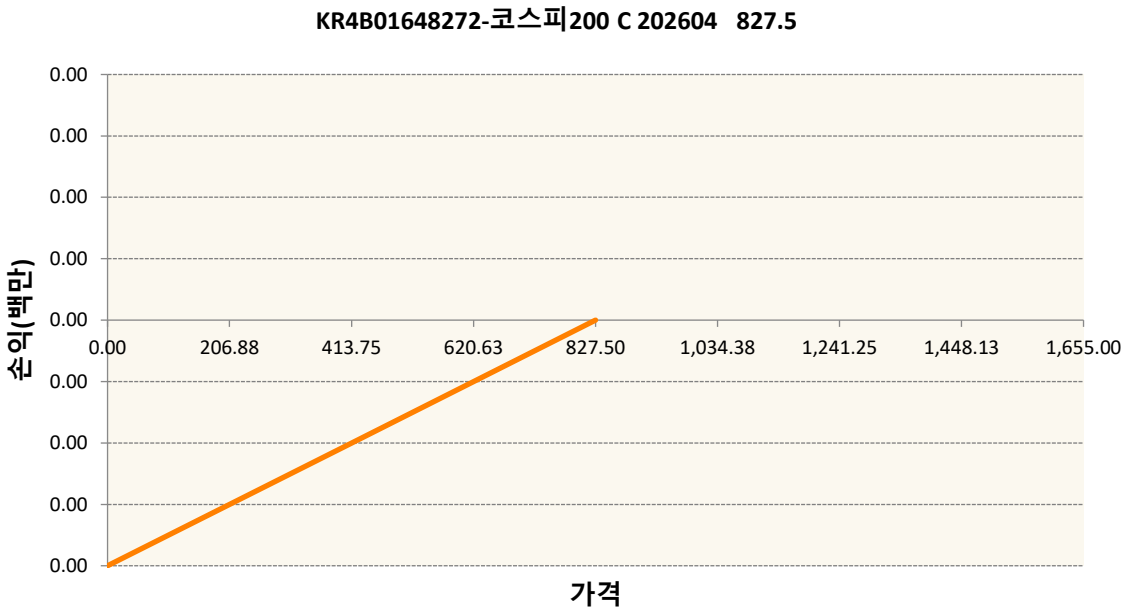
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,534	0	1,534	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,203	-36,203	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01648272 코스피200 C 202604 827.5							766
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-615	-638	-662	-687	-713	-740	-766
-5.33%	-148	-176	-205	-234	-264	-293	-323
-2.67%	-10	-20	-32	-46	-62	-80	-99
0%	6	5	3	0	-5	-11	-18
2.67%	7	7	7	6	6	5	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	6
8.00%	7	7	7	7	7	7	7
KR4C01648271 코스피200 P 202604 827.5							185
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-148	-154	-160	-166	-172	-178	-185
-5.33%	-36	-43	-49	-56	-64	-71	-78
-2.67%	-2	-5	-8	-11	-15	-19	-24
0%	2	1	1	0	-1	-3	-4
2.67%	2	2	2	2	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

447

공시일 2026-04-09

기준일 2026-04-08

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

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	2026-04-09
기준일	2026-04-08

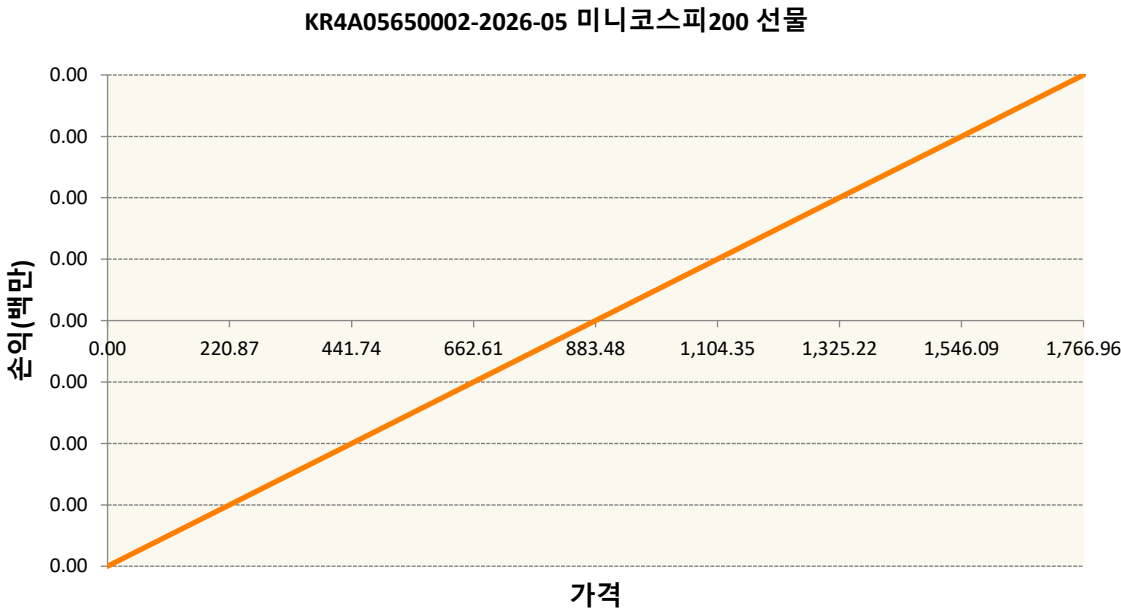
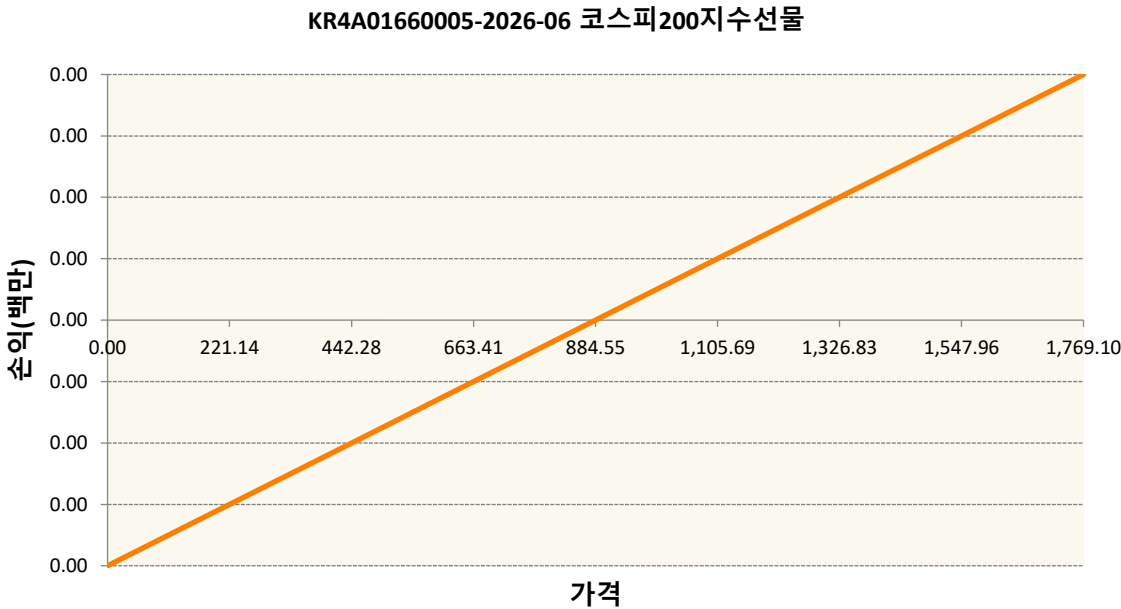
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

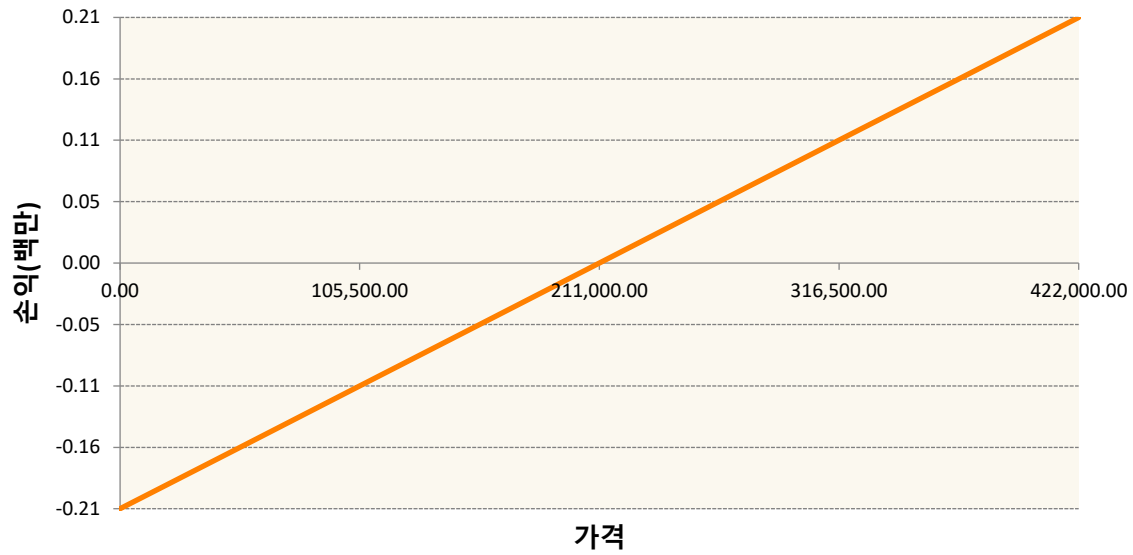
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	218	44	173	장내
누계	유가증권	선물	4,058	45	4,013	장내

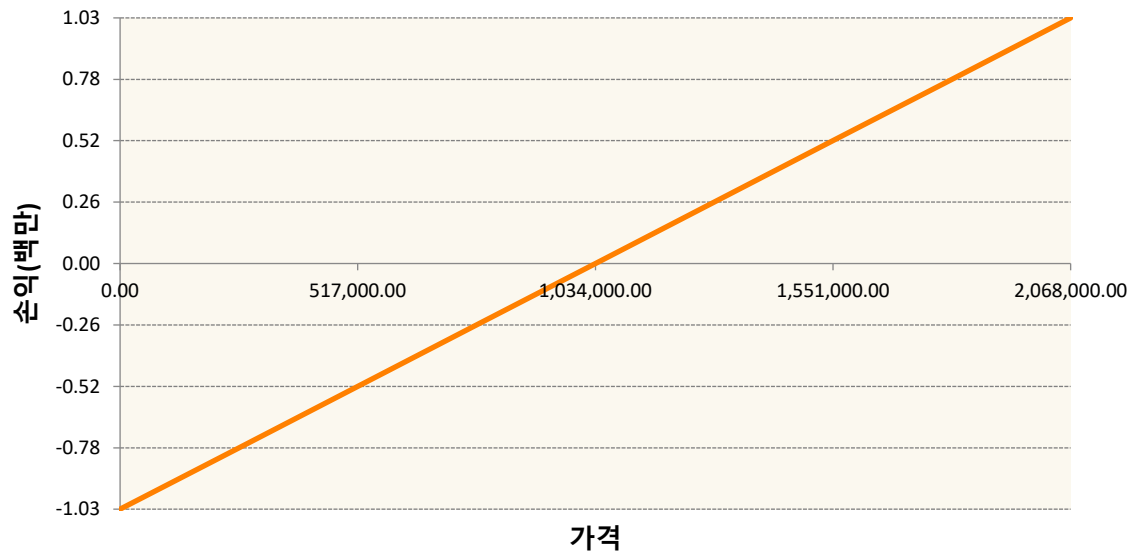
2. 만기시점의 손익구조



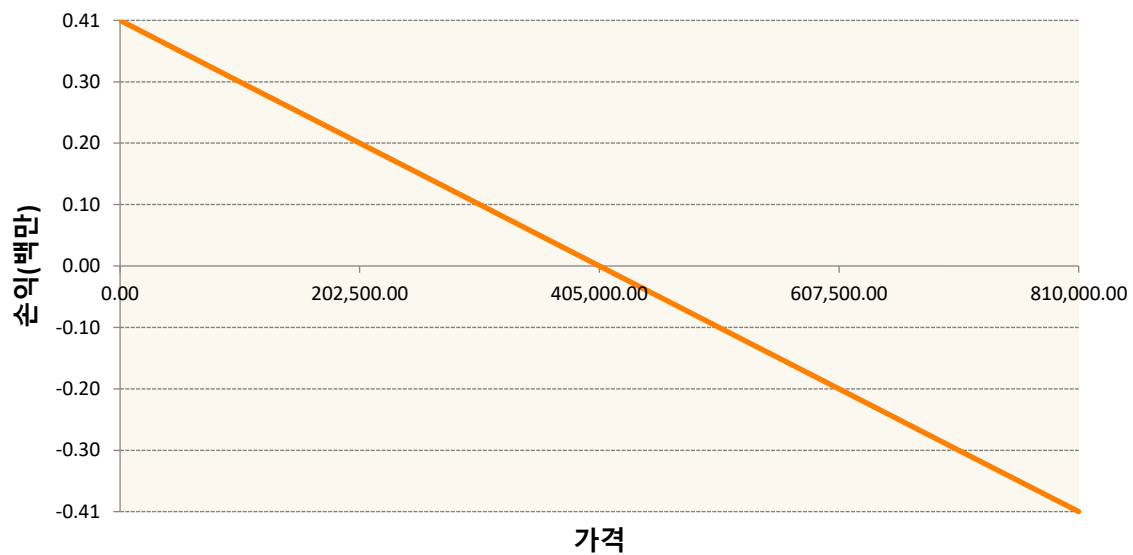
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AF5650001-2026-05 LG에너지솔루션개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		88
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88	
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	
-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%	59	59	59	59	59	59	59	59	
8.00%	88	88	88	88	88	88	88	88	
KR4A05650002							2026-05 미니코스피200 선물		46
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	15	15	15	15	15	15	15	15	
5.33%	31	31	31	31	31	31	31	31	
8.00%	46	46	46	46	46	46	46	46	
KR4A11650004							2026-05 삼성전자개별선물		2
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	
-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	1	
5.33%	1	1	1	1	1	1	1	1	
8.00%	2	2	2	2	2	2	2	2	
KR4A50650006							2026-05 SK하이닉스개별선물		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%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2	
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3	
8.00%	5	5	5	5	5	5	5	5	
KR4AF5650001							2026-05 LG에너지솔루션개별선물		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%	2	2	2	2	2	2	2
-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%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4

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

(단위:백만원)

315

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

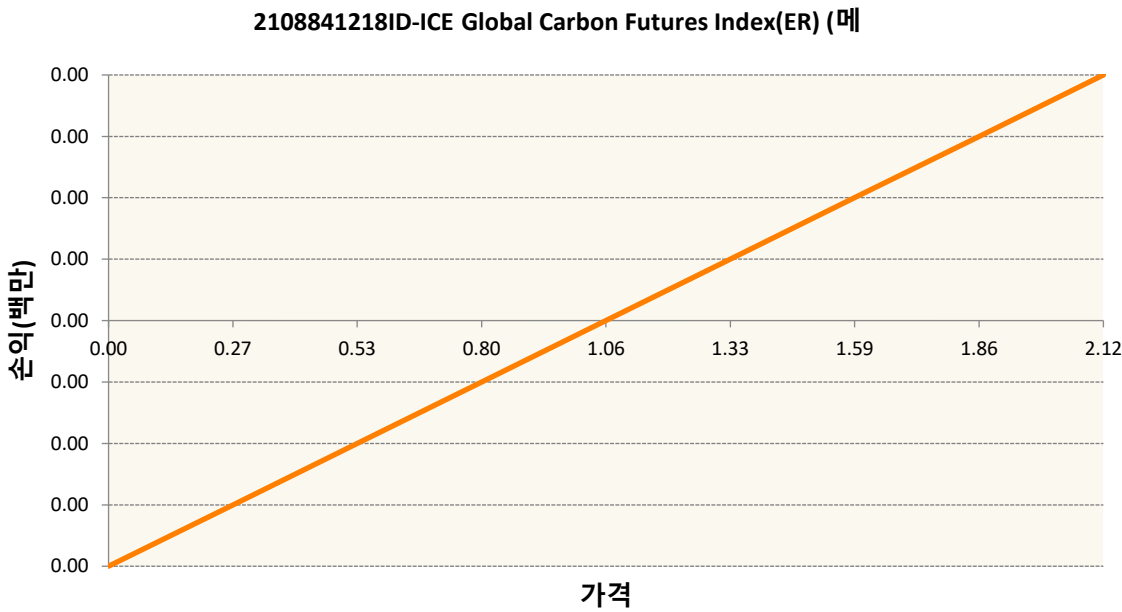
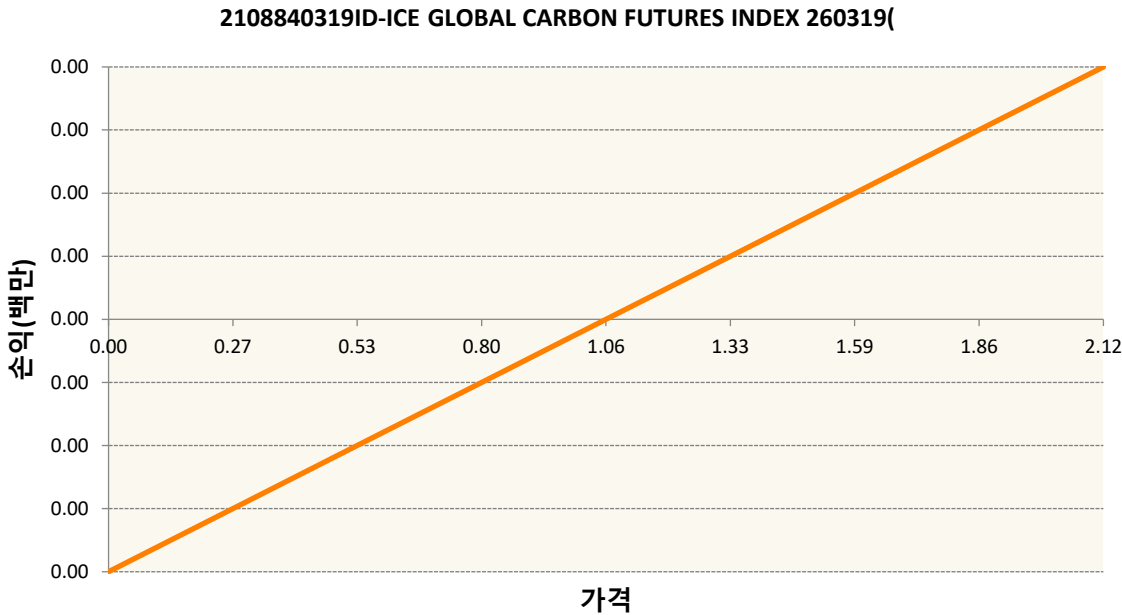
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,091	0	6,091	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		388
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		98

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	543

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

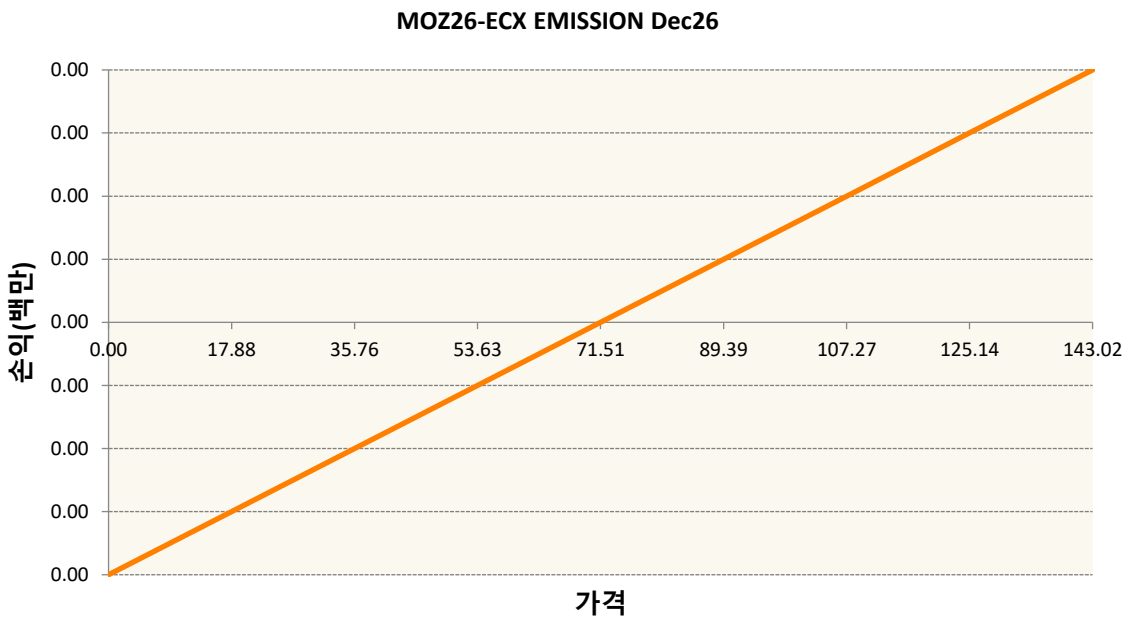
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,613	0	4,613	
누계	통화	선도	0	2,181	-2,181	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E	175
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	369

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

(단위:백만원)

639

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	1,333	0	1,333	장외
누계	지수	스왑	1,371	0	1,371	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	20
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	14
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	34
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	13

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

(단위:백만원)

129

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

SOL차이나육성산업액티브상장지

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	-1,518	0	-1,518	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)	4
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	15
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	78
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	29

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

(단위:백만원)

196

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

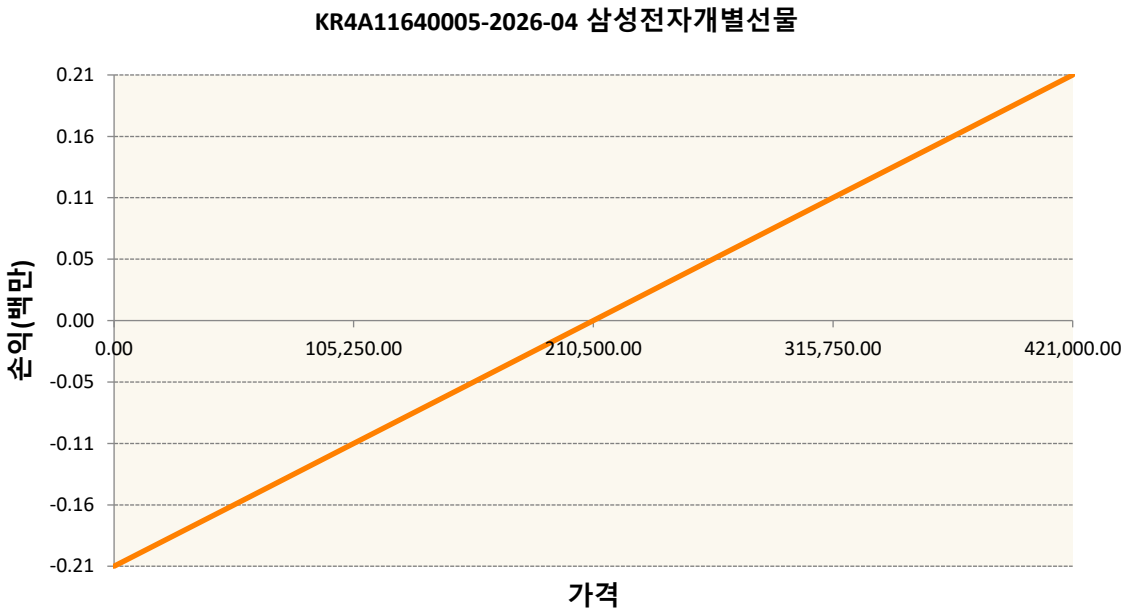
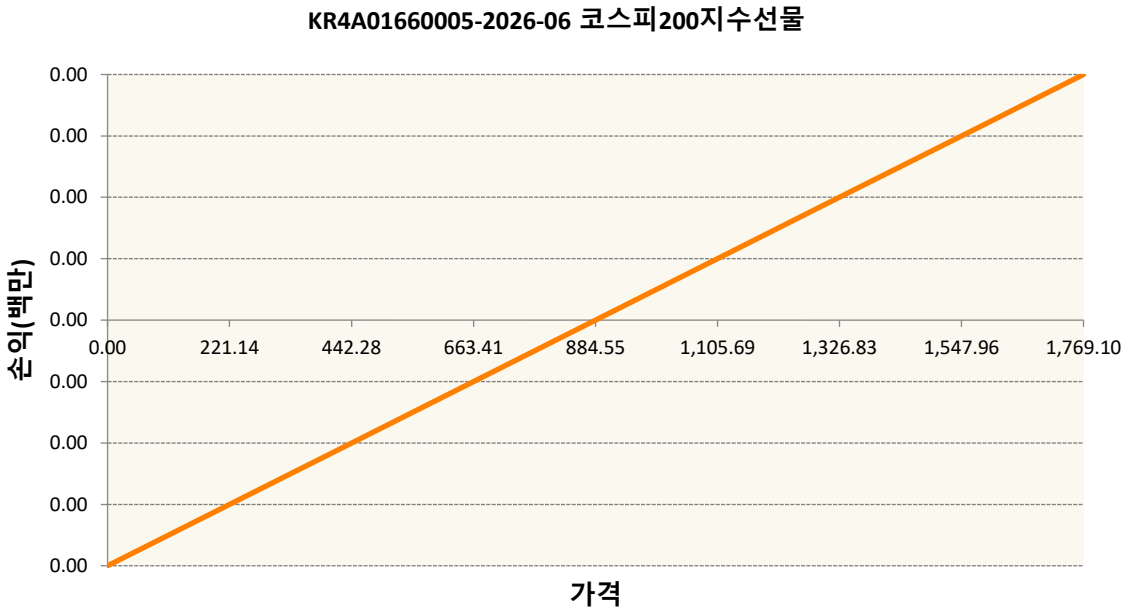
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

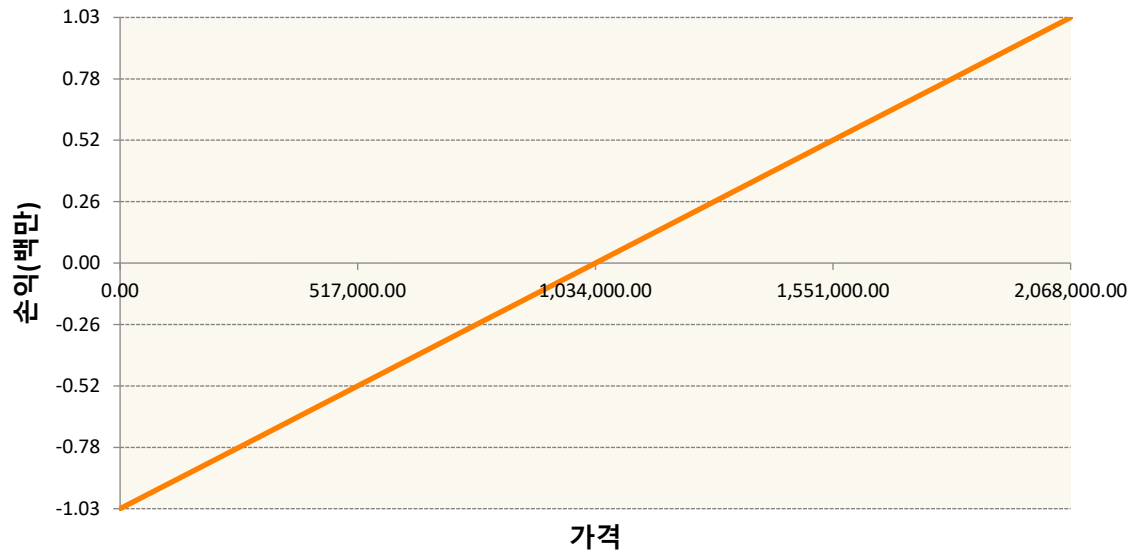
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,088	853	1,234	장내
누계	유가증권	선물	24,286	2,606	21,680	장내

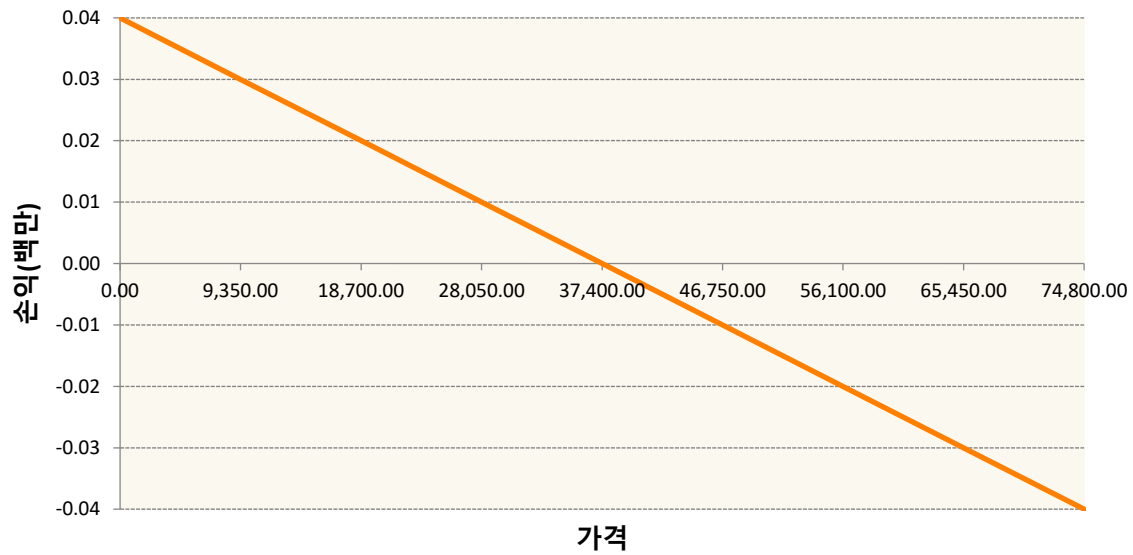
2. 만기시점의 손익구조



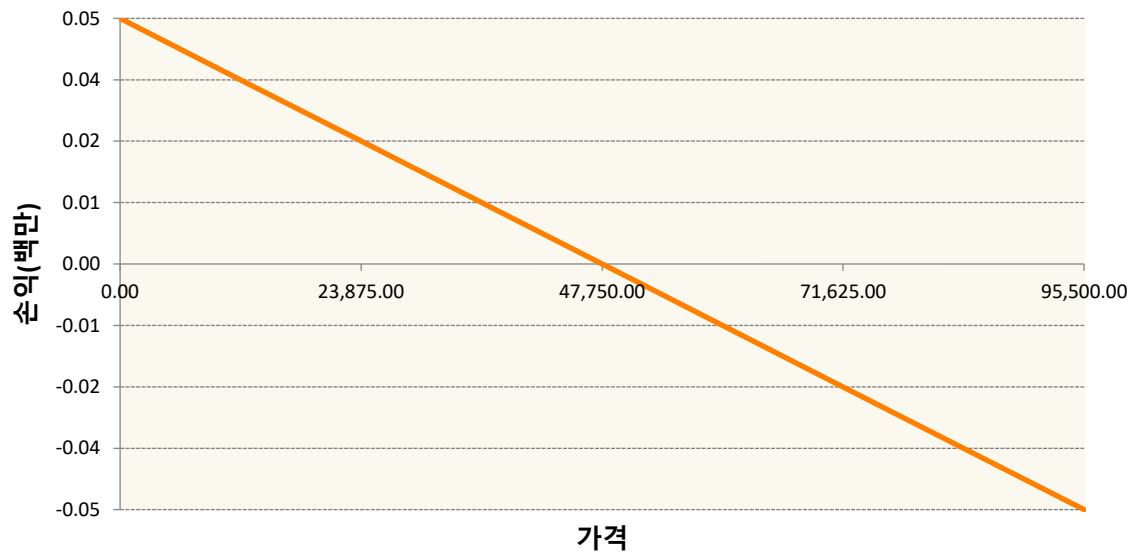
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4A51650005-2026-05 GS건설개별선물



KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 810,000.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -0.41 to 0.41. A solid orange line represents the profit function, starting at a profit of 0.41 when the price is 0.00 and decreasing linearly to a profit of -0.41 at a price of 810,000.00. The line intersects the x-axis at a price of 405,000.00, where profit is zero.

가격 (Price)	이익 (백만) (Profit in millions)
0.00	0.41
202,500.00	0.20
405,000.00	0.00
607,500.00	-0.20
810,000.00	-0.41

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격', represents price in millions, ranging from 0.00 to 45,100.00. The y-axis, labeled '손익 (백만)', represents profit or loss in millions, ranging from -0.02 to 0.02. A solid blue line shows that as the price increases, the profit/loss also increases linearly, crossing the zero point at a price of 22,550.00.

가격 (Price)	손익 (Profit/Loss)
0.00	-0.02
5,637.50	-0.015
11,275.00	-0.01
16,912.50	-0.005
22,550.00	0.00
28,187.50	0.005
33,825.00	0.01
39,462.50	0.015
45,100.00	0.02

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					1,642
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,642	-1,642	-1,642	-1,642	-1,642	-1,642	-1,642
-5.33%	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095
-2.67%	-547	-547	-547	-547	-547	-547	-547
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	547	547	547	547	547	547	547
5.33%	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095
8.00%	1,642	1,642	1,642	1,642	1,642	1,642	1,642
KR4A11640005		2026-04 삼성전자개별선물					174
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
-5.33%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-2.67%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	58	58	58	58	58	58	58
5.33%	116	116	116	116	116	116	116
8.00%	174	174	174	174	174	174	174

KR4A50650006 2026-05 SK하이닉스개별선물 89

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

KR4A51650005 2026-05 GS건설개별선물 18

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18	18	18	18	18	18	18
-5.33%	12	12	12	12	12	12	12
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18

KR4ACF650006 2026-05 카카오개별선물 122

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	122	122	122	122	122	122	122
-5.33%	81	81	81	81	81	81	81
-2.67%	41	41	41	41	41	41	41
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
5.33%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
8.00%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122

KR4AF5650001 2026-05 LG에너지솔루션개별선물 69

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	69	69	69	69	69
-5.33%	46	46	46	46	46	46	46
-2.67%	23	23	23	23	23	23	23
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
8.00%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
KR4AFT640008 2026-04 대우건설개별선물							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	34	34	34	34	34	34	34

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

(단위:백만원)

4,694

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

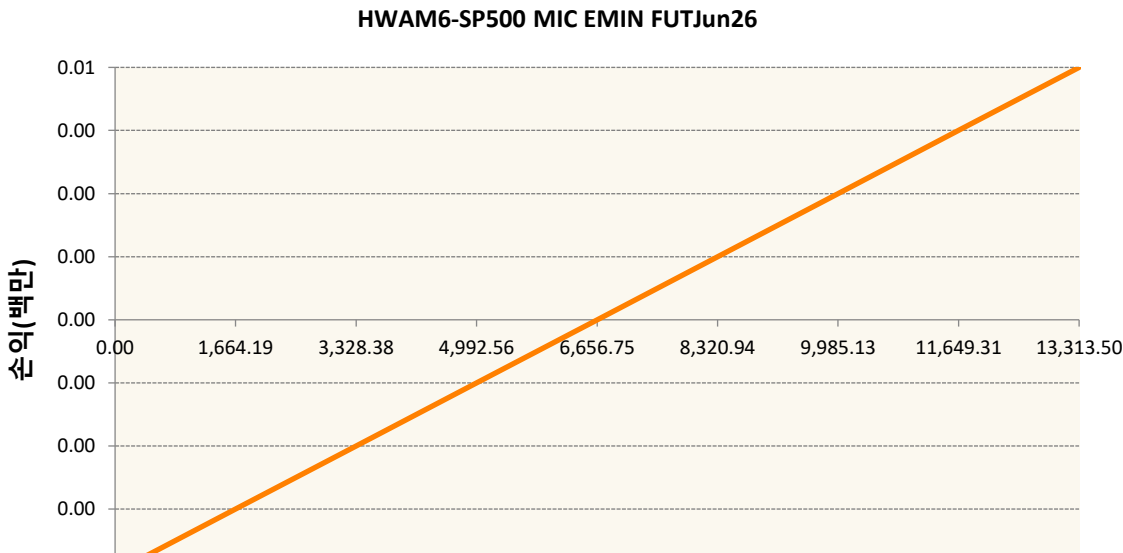
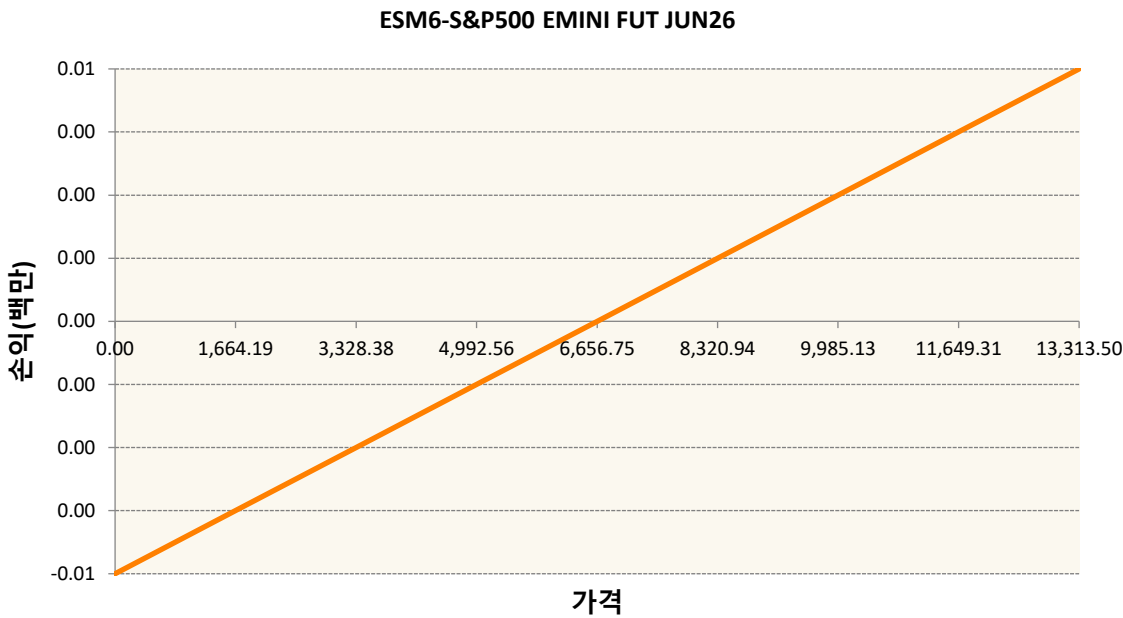
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

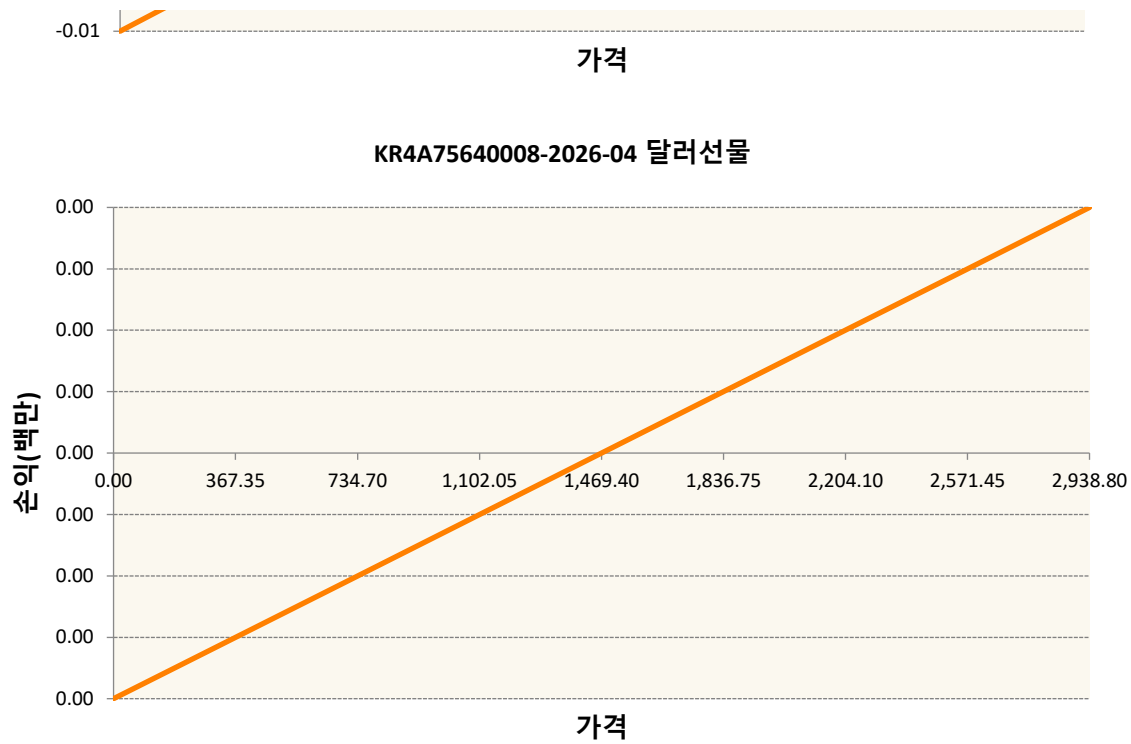
1. 계약금액

(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	1,768	-1,768	장내
누계	지수	선물	54,977	0	54,977	
누계	지수	선물	151	0	151	장내
누계	통화	선물	10,433	0	10,433	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,398
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	12
KR4A756400 2026-04 달러선물		835

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

(단위:백만원)

3,847

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

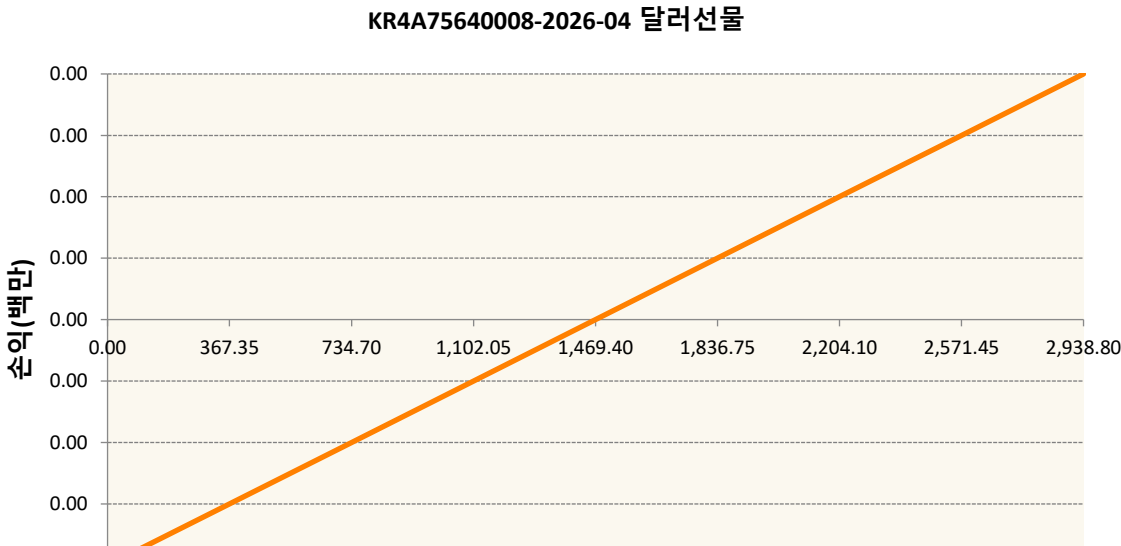
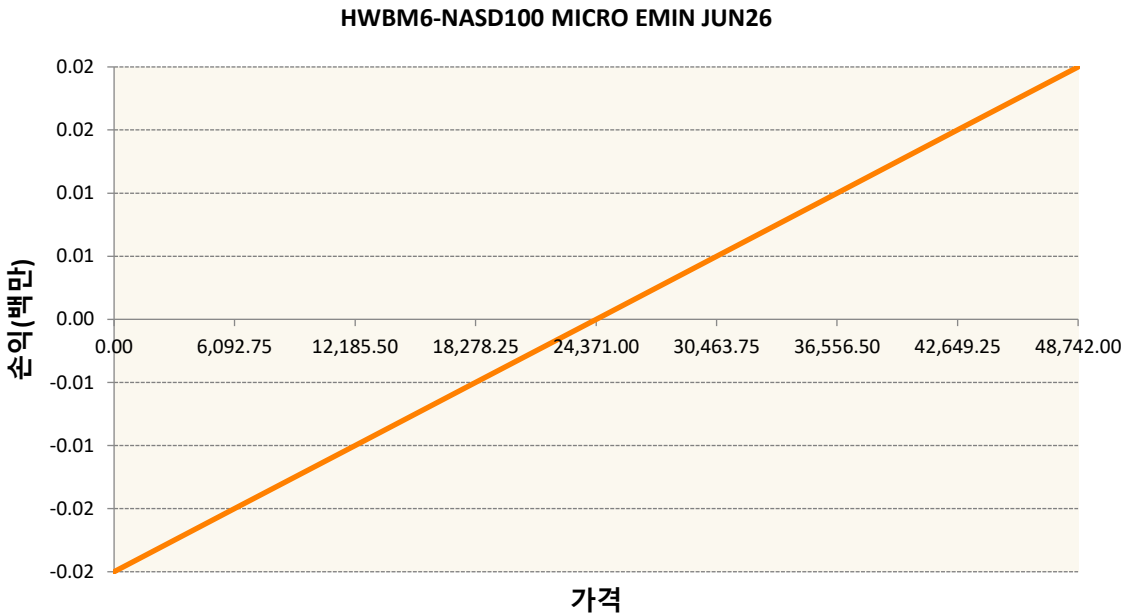
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

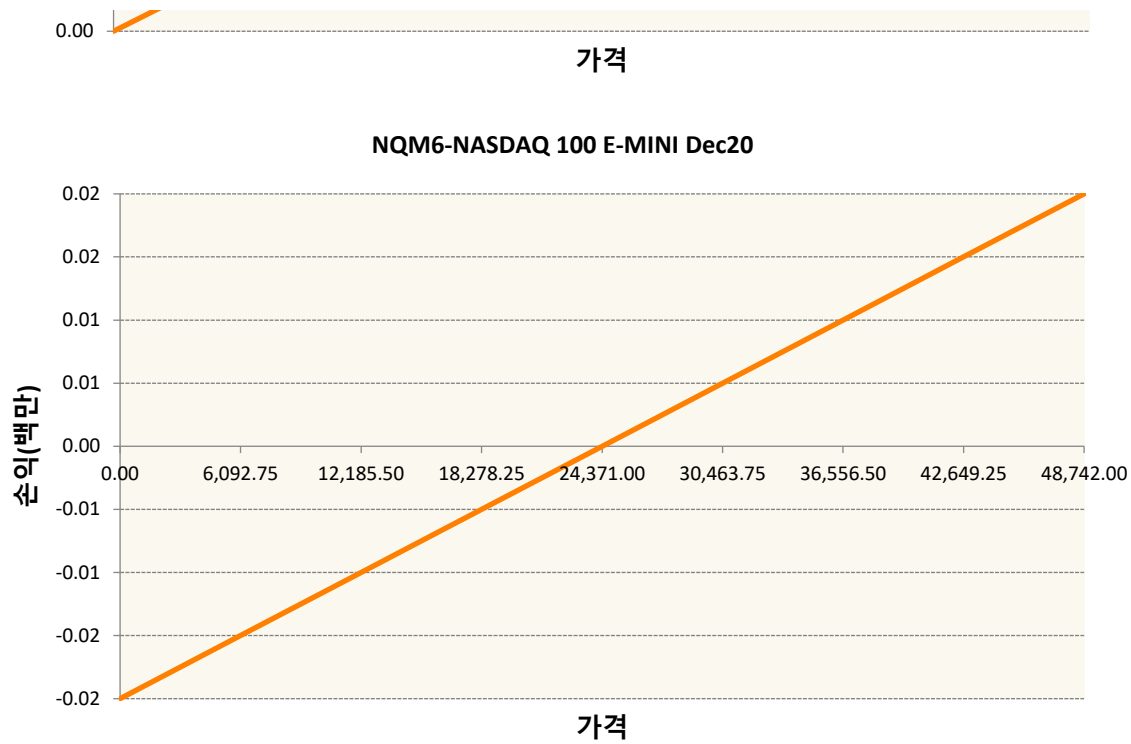
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	1,090	-1,090	장내
누계	유가증권	선물	22,691	0	22,691	
누계	유가증권	선물	218	0	218	장내
누계	통화	선물	3,835	0	3,835	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	17
KR4A756400	2026-04 달러선물	307
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,815

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

2,021

공시일	2026-04-09
기준일	2026-04-08

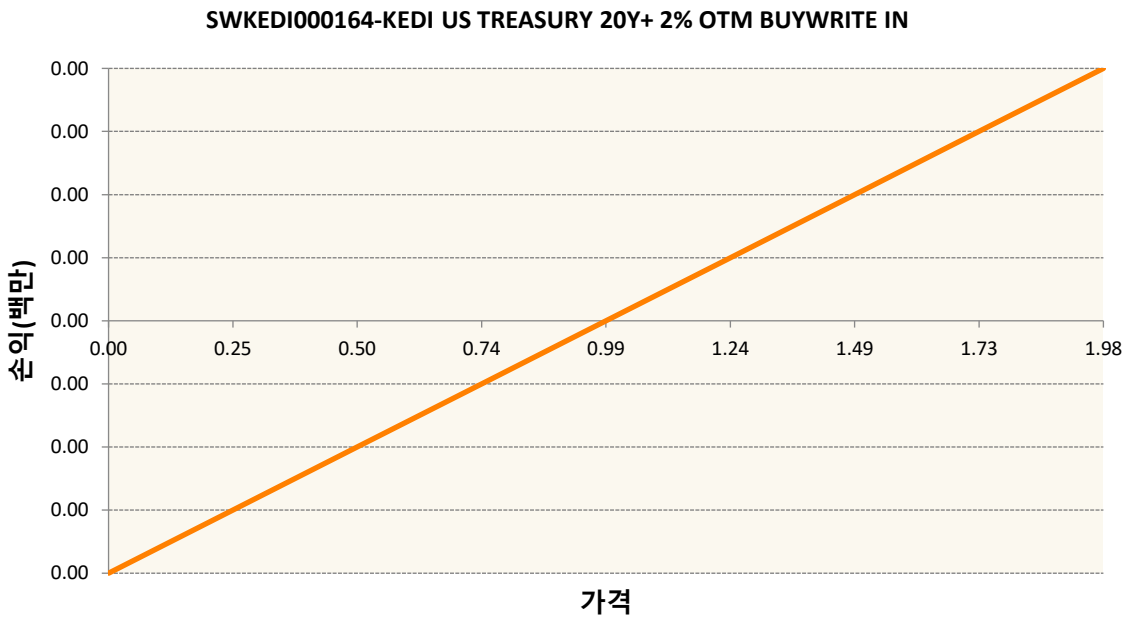
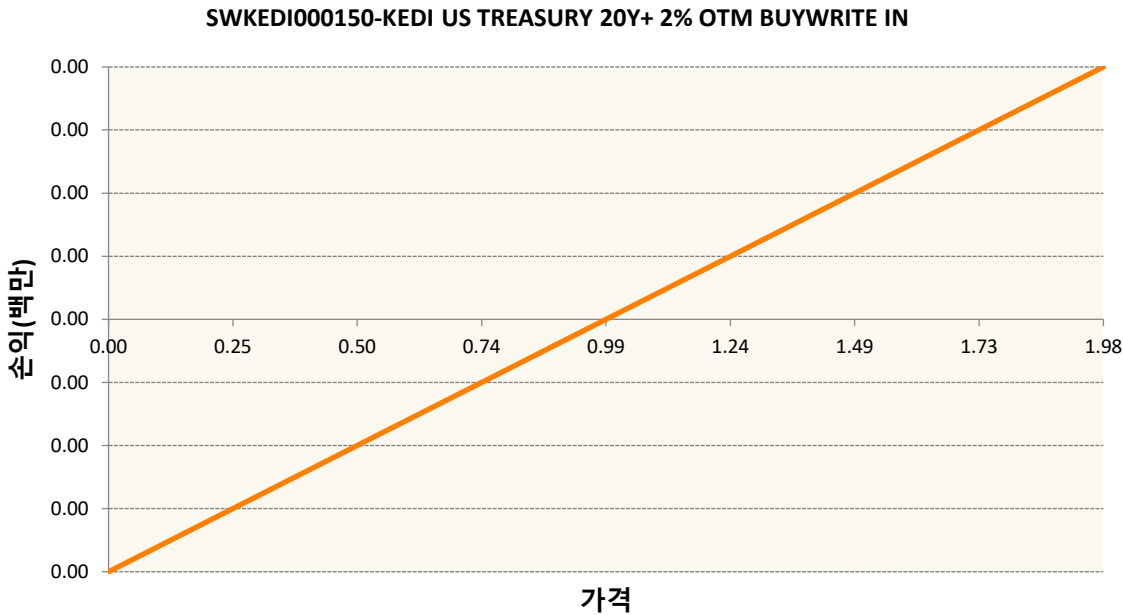
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

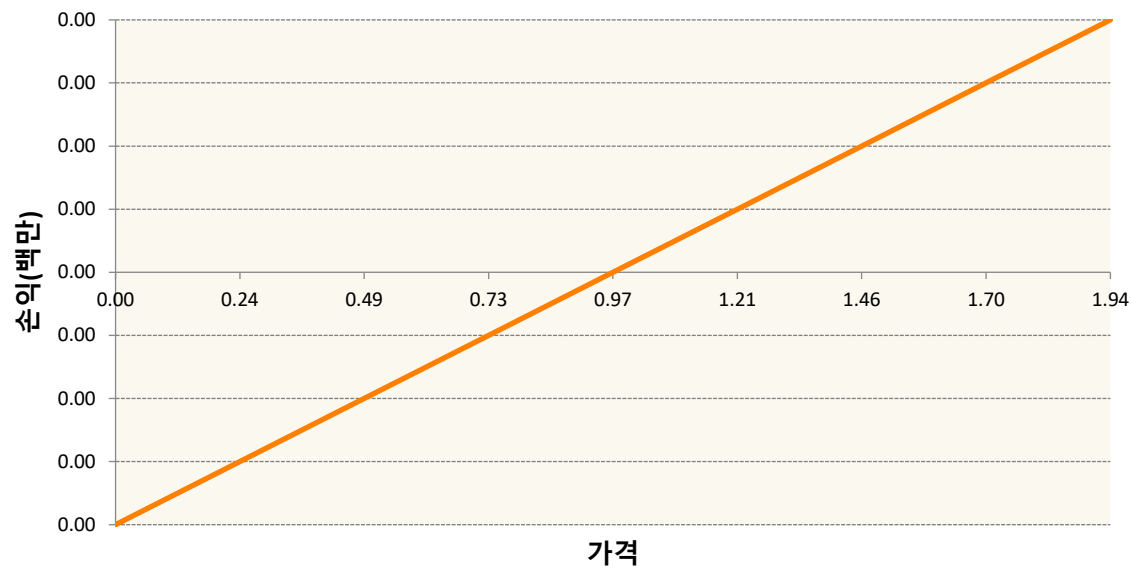
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	358,975	0	358,975	장외

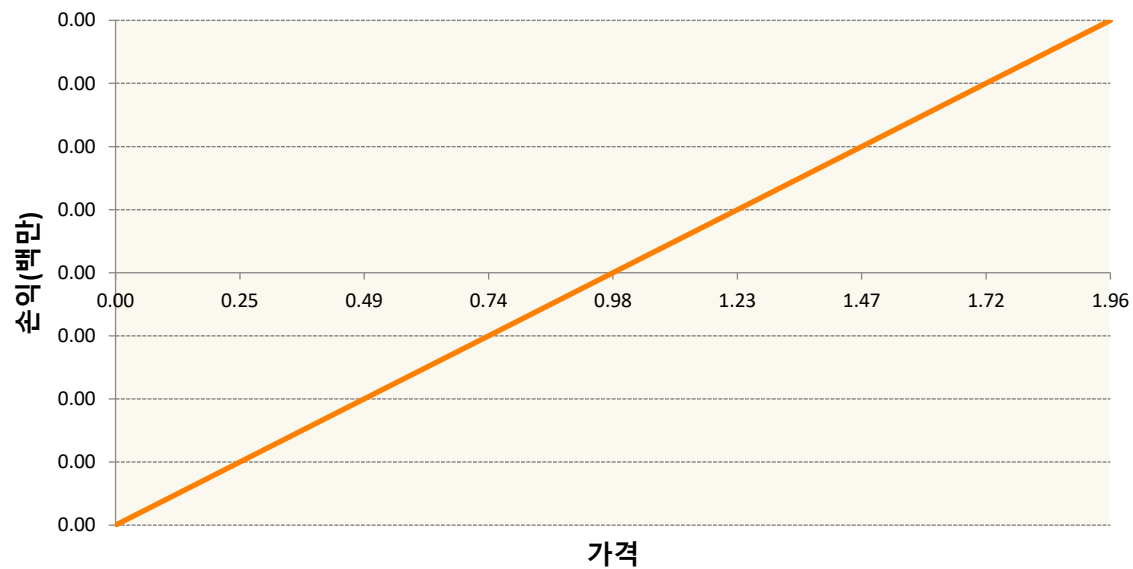
2. 만기시점의 손익구조



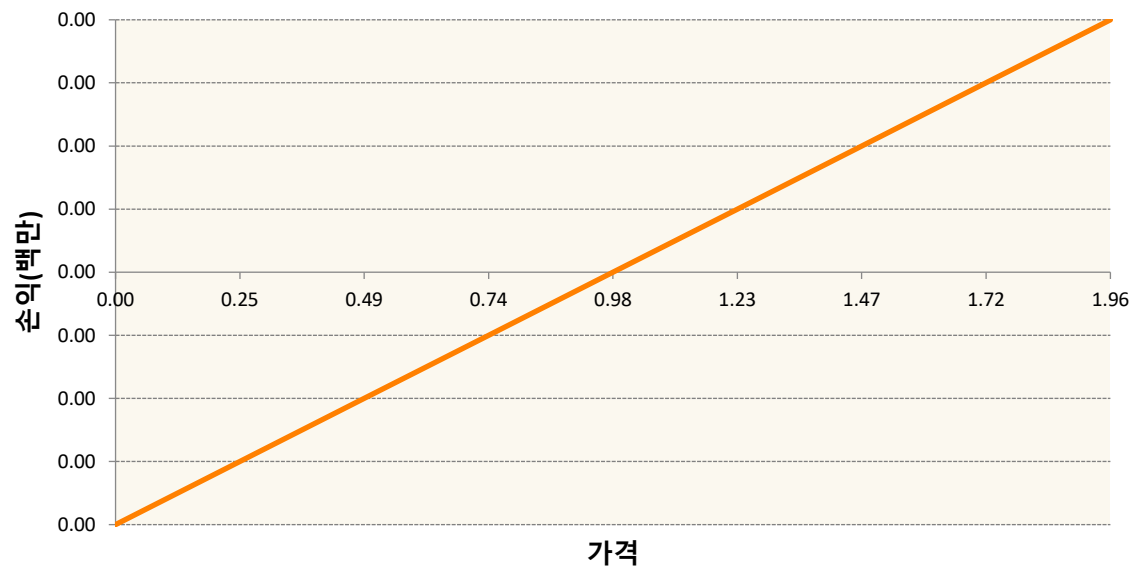
SWKEDI000169-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000172-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,263
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		151
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,204
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,667
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,392

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,334

공시일 2026-04-09

기준일 2026-04-08

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

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