

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

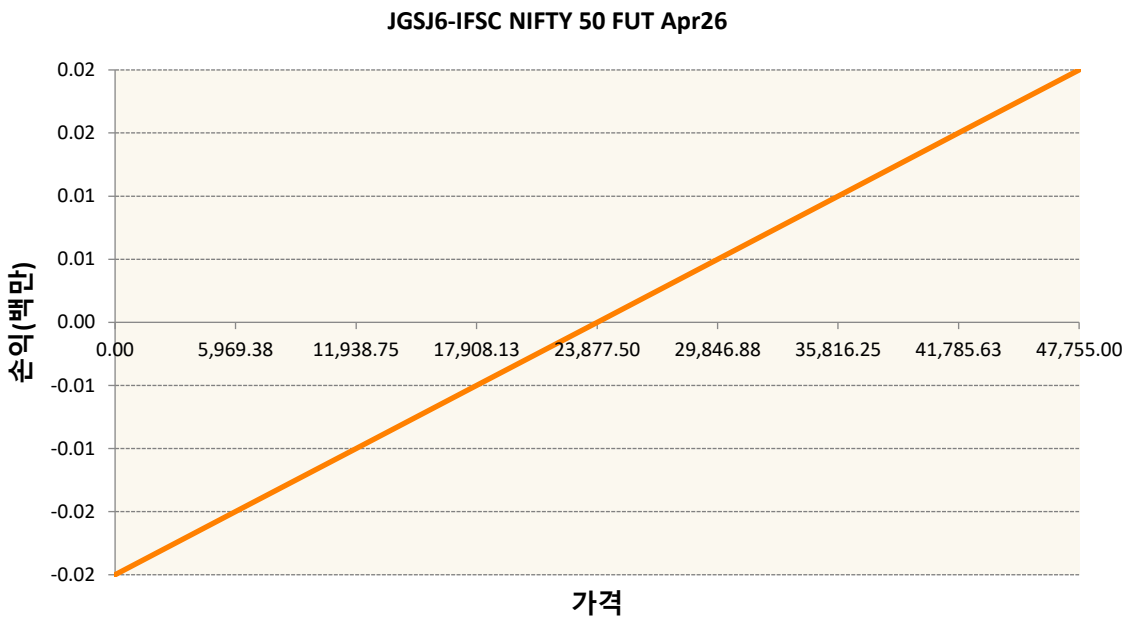
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	647	0	647	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ6	IFSC NIFTY 50 FUT Apr26	52
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

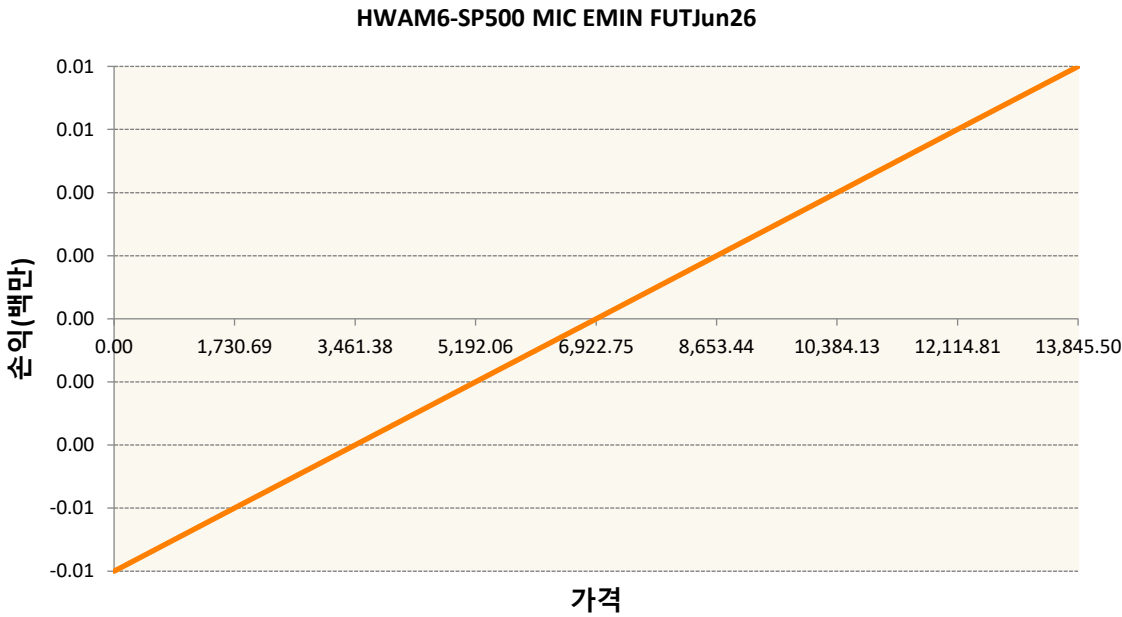
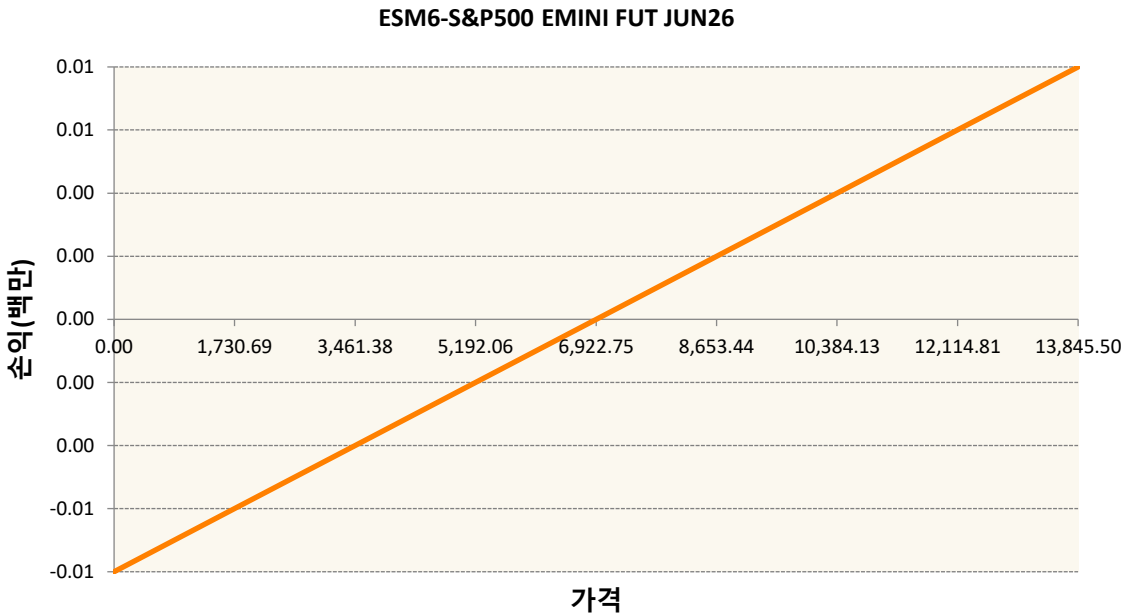
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	519	0	519	
누계	지수	선물	208	0	208	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	42
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	17

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	51

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

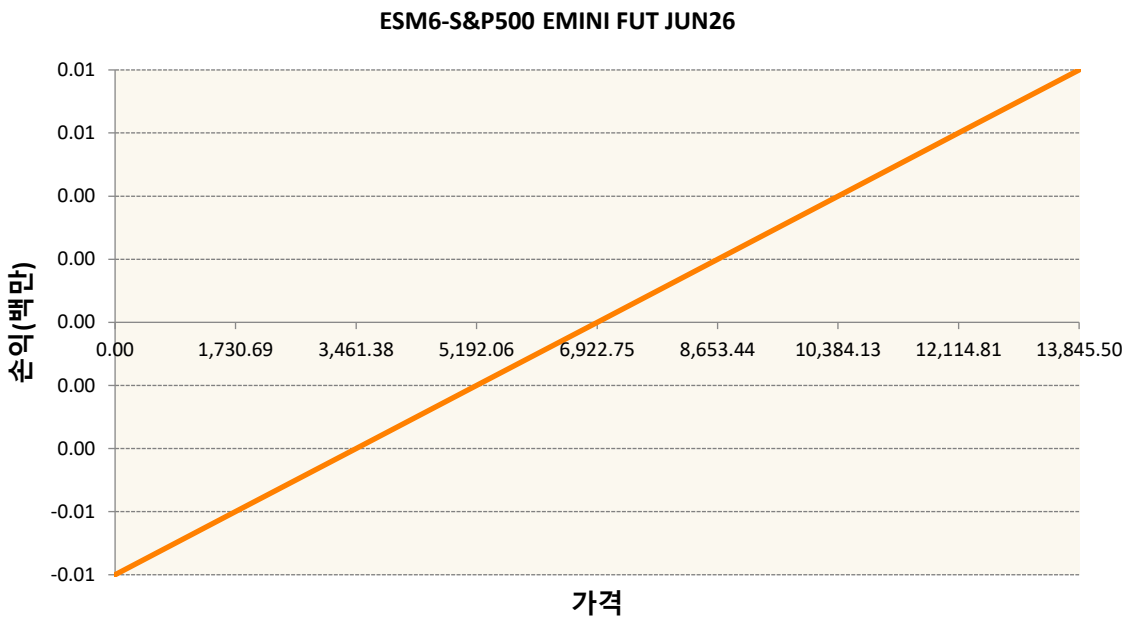
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,039	0	1,039	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	83
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

73

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

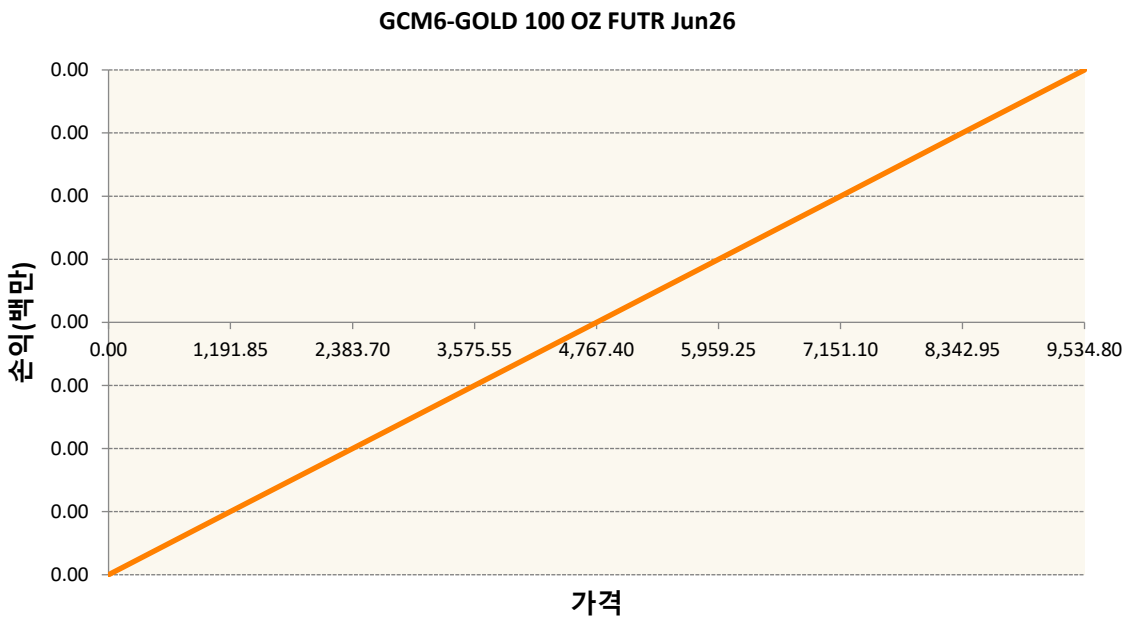
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,739	0	5,739	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 04/17/26 C440 EQUITY	14
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	459

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

(단위:백만원)

594

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

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)

AOPLTRUAP PLTR US 04/17/26 P137 EQUITY	62
AOPLTRUS1 PLTR US 04/17/26 C137 EQUITY	28

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

(단위:백만원)

298

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

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)

AOTLTUS087 TLT US 04/17/26 C87 EQUITY

4

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

(단위:백만원)

3

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

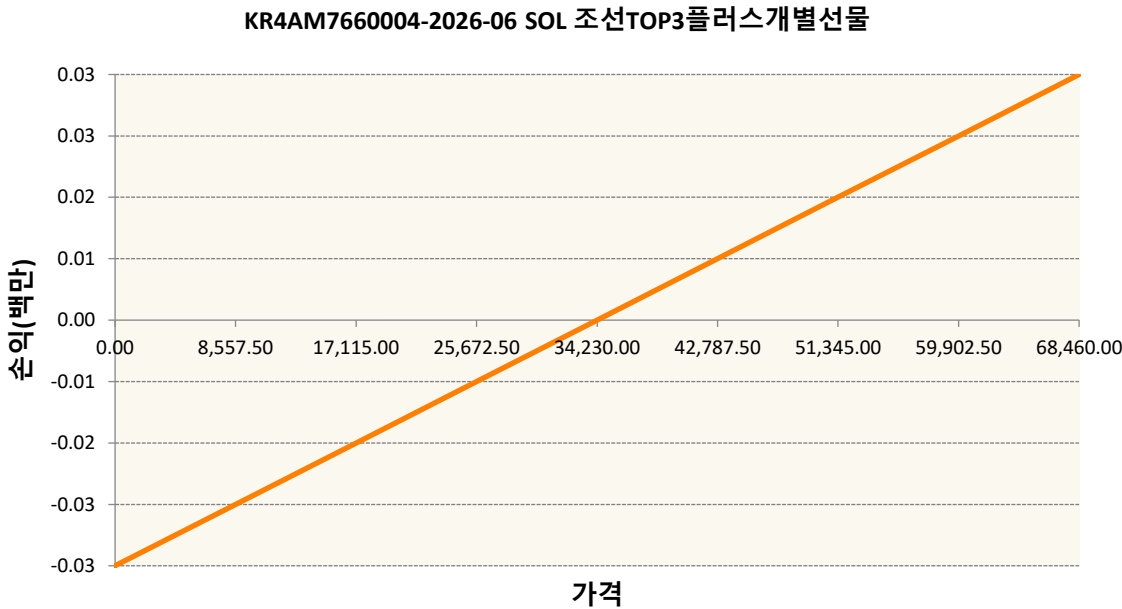
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	150,975	0	150,975	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-04-15

기준일 2026-04-14

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	2026-04-15
기준일	2026-04-14

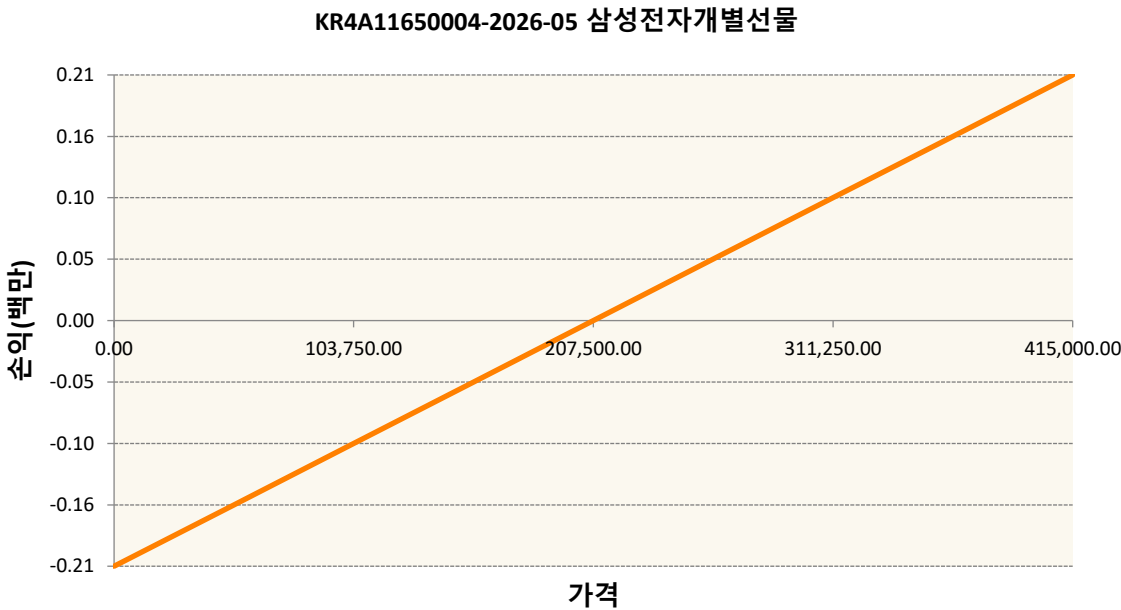
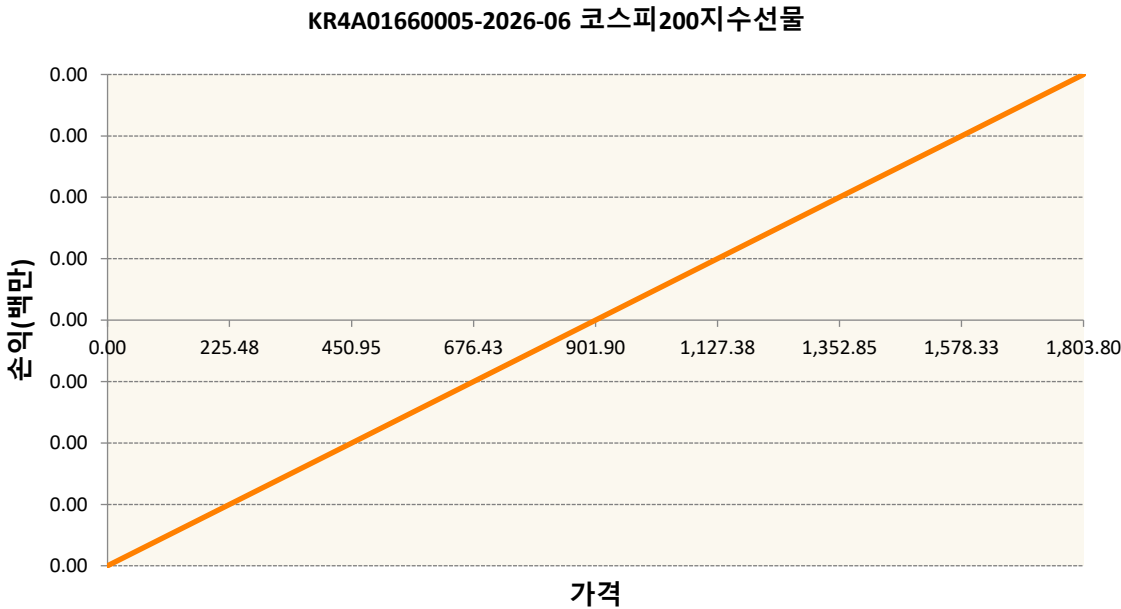
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

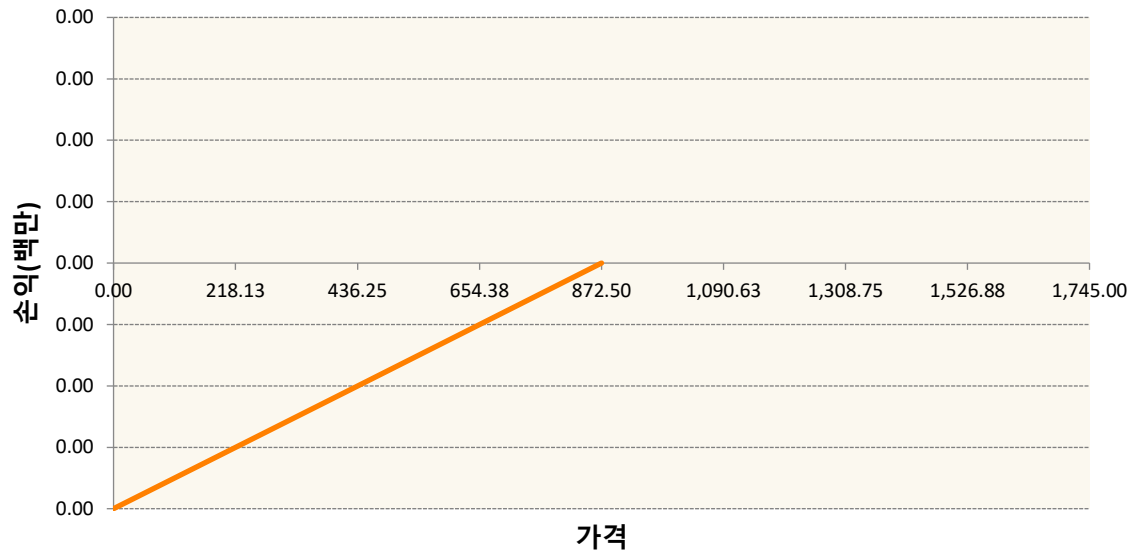
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,940	0	2,940	장내
신규	유가증권	옵션	847	0	847	장내
누계	유가증권	선물	8,767	0	8,767	장내
누계	유가증권	옵션	0	16,597	-16,597	장내

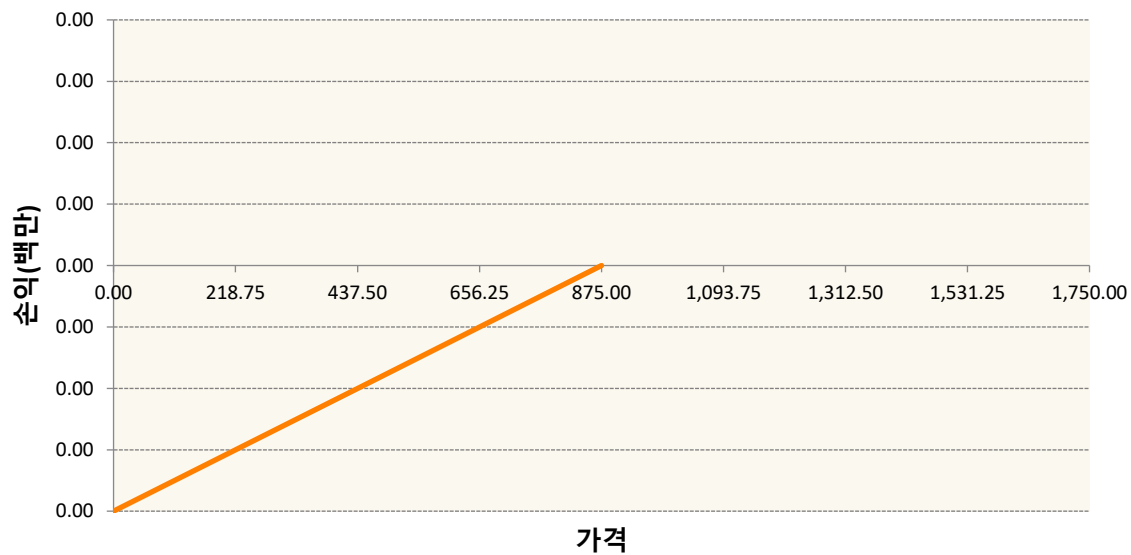
2. 만기시점의 손익구조



KR4B09EW8723-코스피위클리 C 2604W3 872.5



KR4B09EW8756-코스피위클리 C 2604W3 875.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				466
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466	
-5.33%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311	
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	155	155	155	155	155	155	155	
5.33%	311	311	311	311	311	311	311	
8.00%	466	466	466	466	466	466	466	
KR4A11650004				2026-05 삼성전자개별선물				231
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231
-5.33%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
-2.67%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	77	77	77	77	77	77	77
5.33%	154	154	154	154	154	154	154
8.00%	231	231	231	231	231	231	231
KR4B09EW8723 코스피위클리 C 2604W3 872.5							506

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-481	-483	-487	-490	-495	-500	-506
-5.33%	-235	-244	-253	-262	-272	-282	-292
-2.67%	-57	-69	-82	-94	-107	-119	-132
0%	27	19	10	0	-10	-20	-31
2.67%	49	46	43	38	33	27	21
5.33%	52	52	51	50	48	45	42
8.00%	52	52	52	52	51	51	50

KR4B09EW8756 코스피위클리 C 2604W3 875.0							361
------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-346	-347	-349	-351	-354	-357	-361
-5.33%	-174	-179	-184	-191	-197	-204	-211
-2.67%	-44	-53	-61	-70	-79	-87	-96
0%	20	14	7	0	-7	-15	-22
2.67%	38	36	33	30	26	21	17
5.33%	41	40	40	39	37	35	33
8.00%	41	41	41	41	40	40	39

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

(단위:백만원)

2,760

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

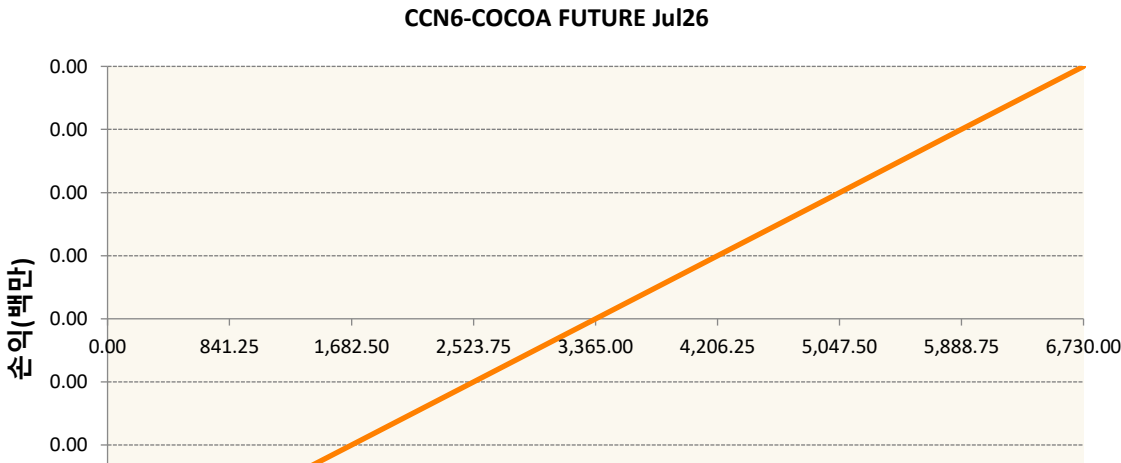
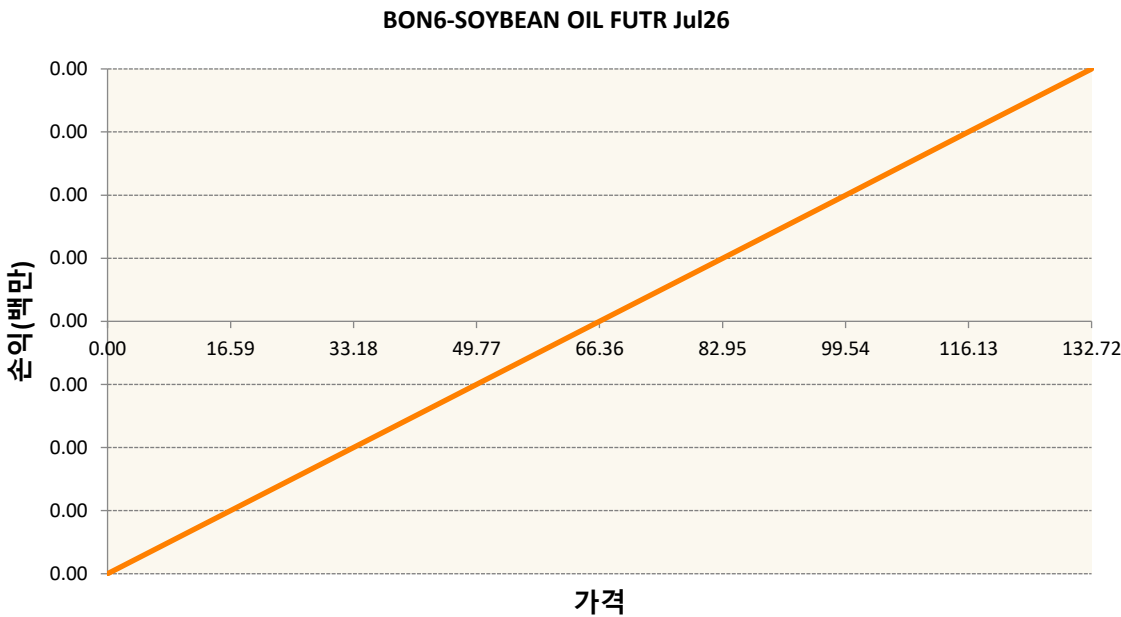
포커스농산물모(채권-파생형)

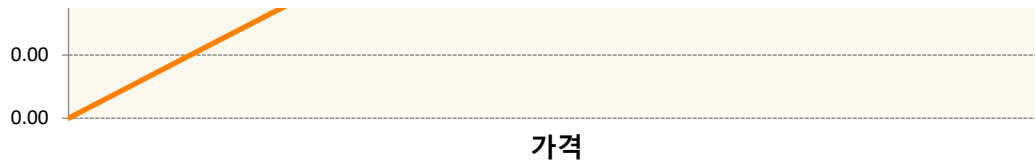
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

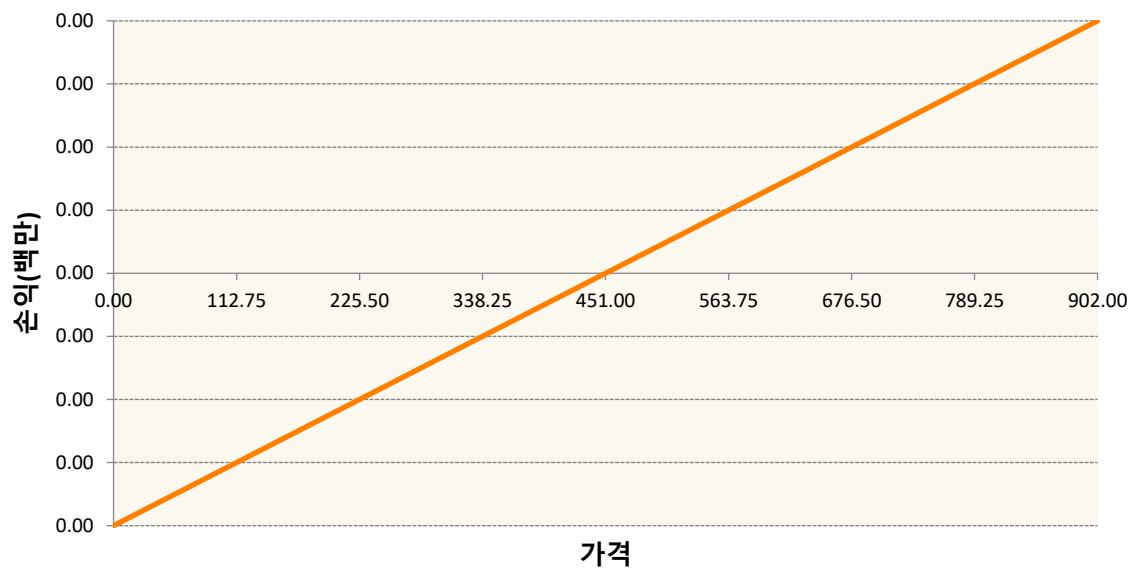
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	100	0	100	
누계	실물자산	선물	878	0	878	장내
누계	유가증권	선물	1,986	0	1,986	
누계	통화	선물	0	311	-311	장내

2. 만기시점의 손익구조

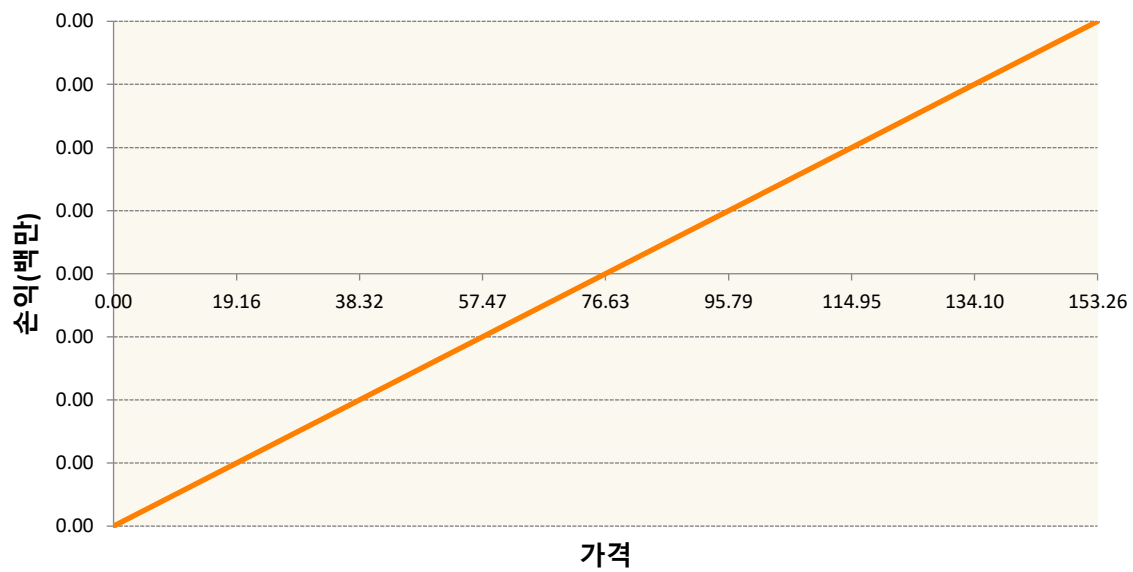




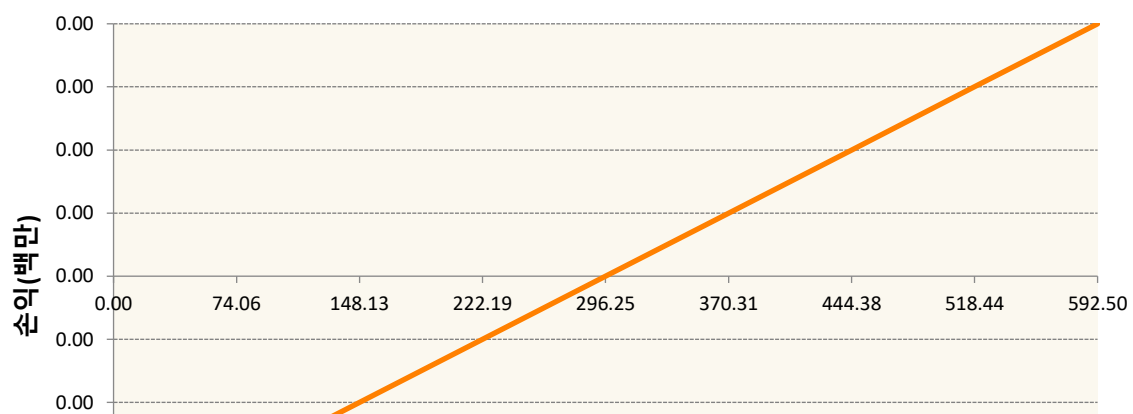
CN6-CORN FUTURE Jul26

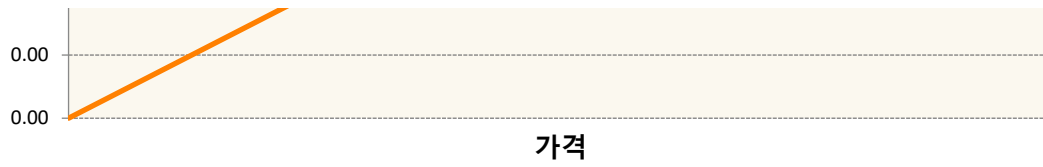


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

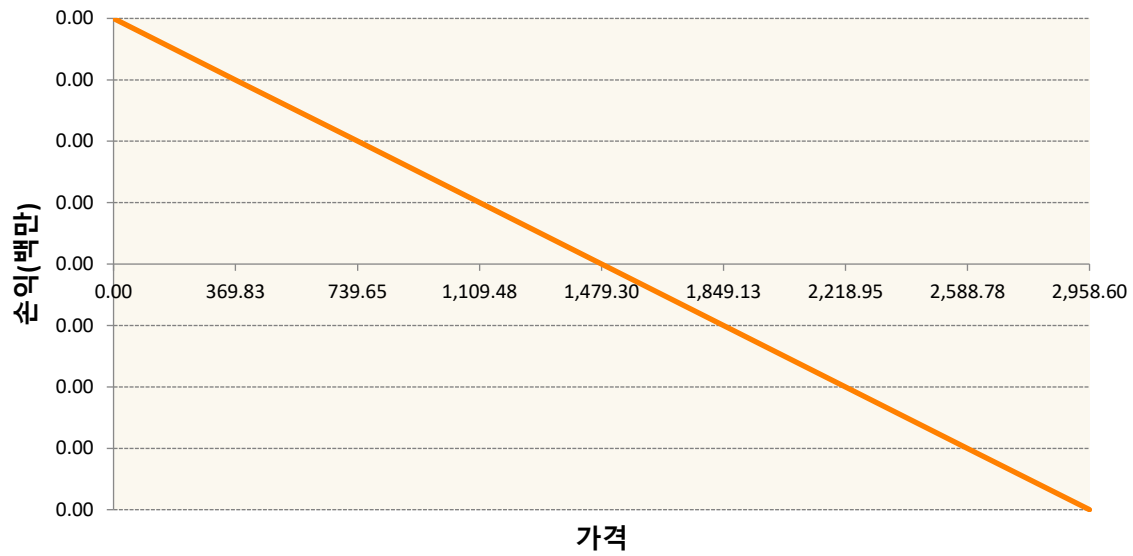


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

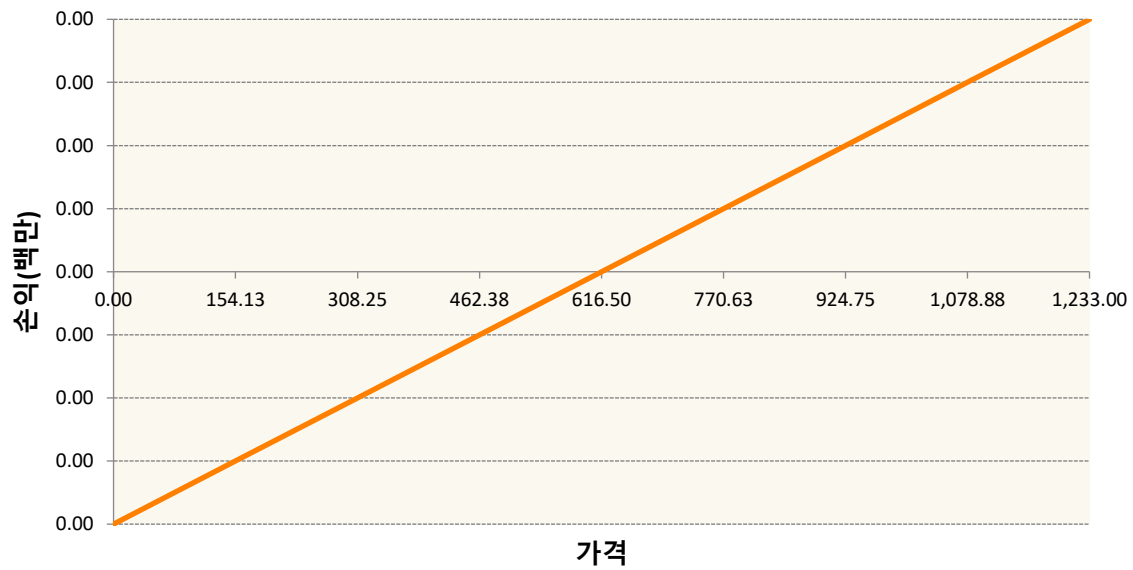




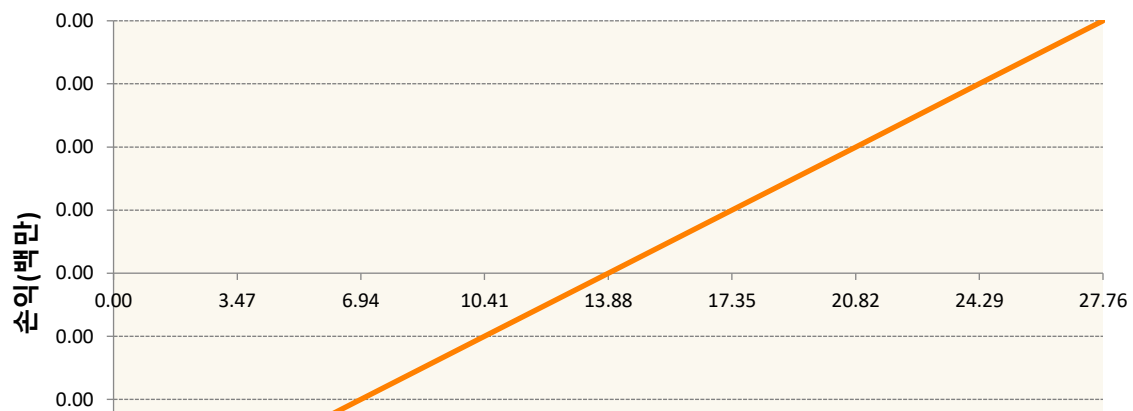
KR4A75640008-2026-04 달러선물

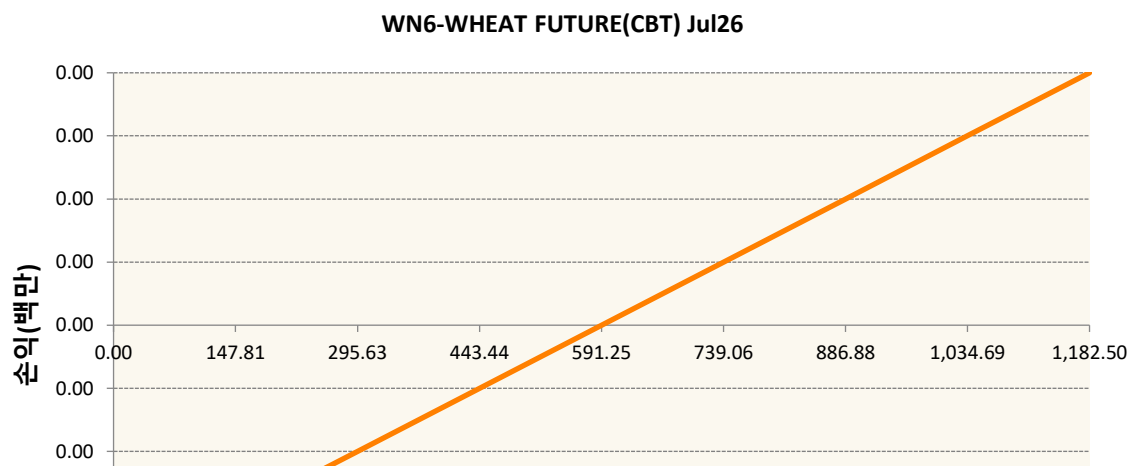
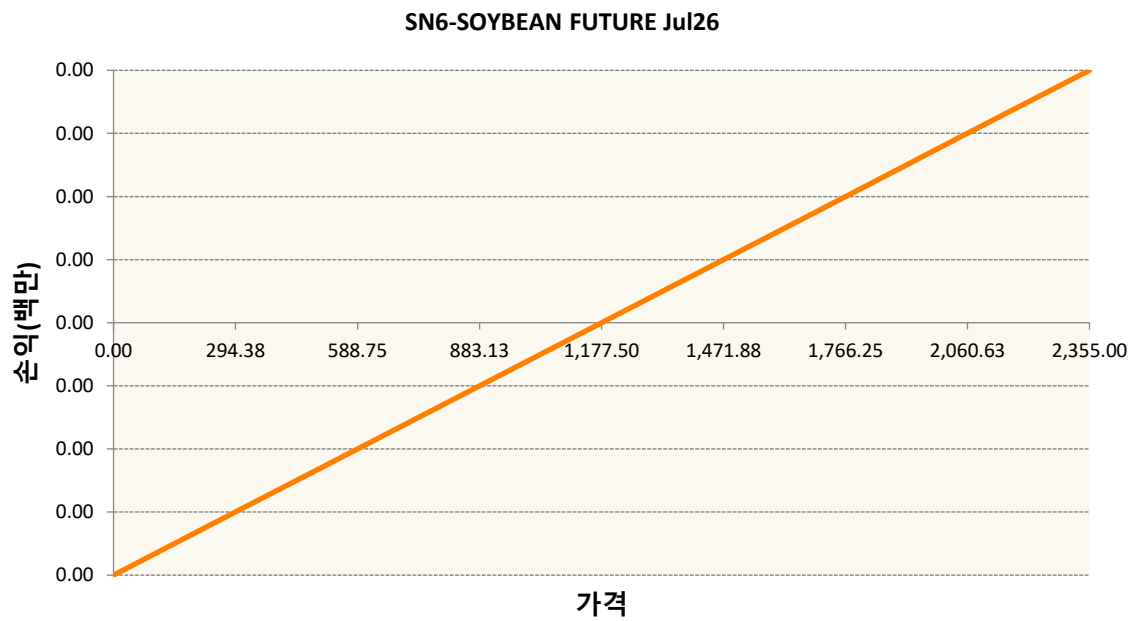
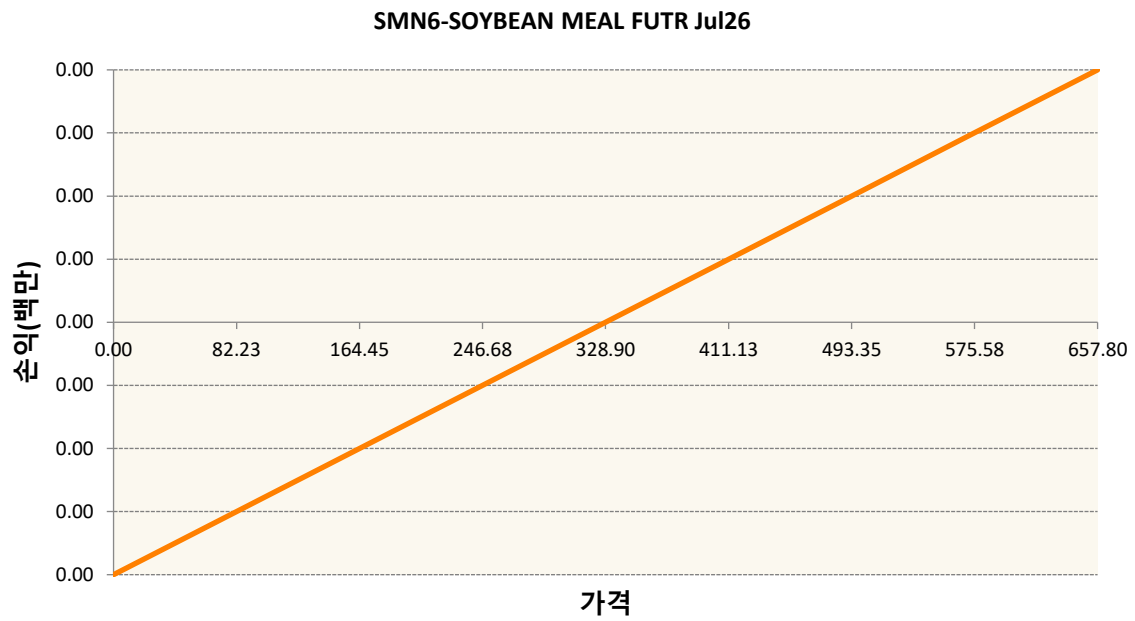
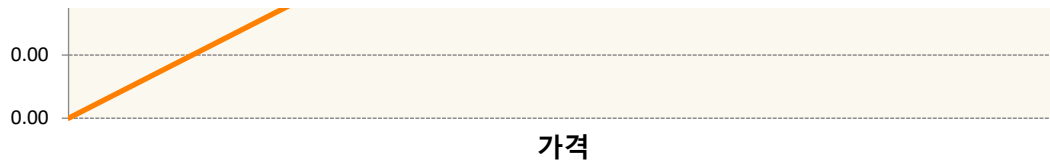


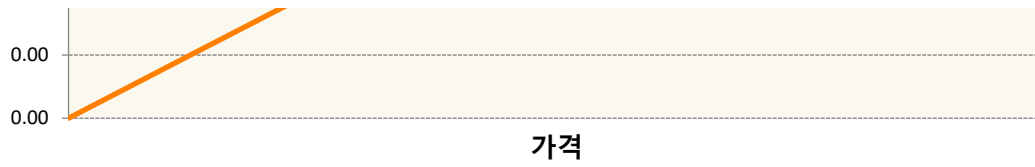
KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26



SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

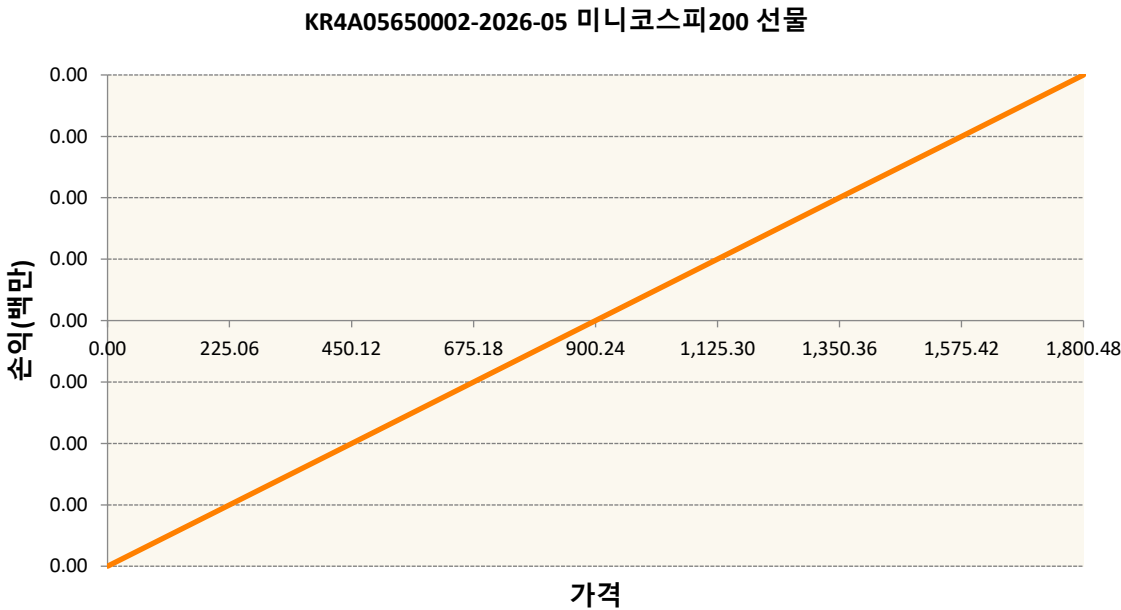
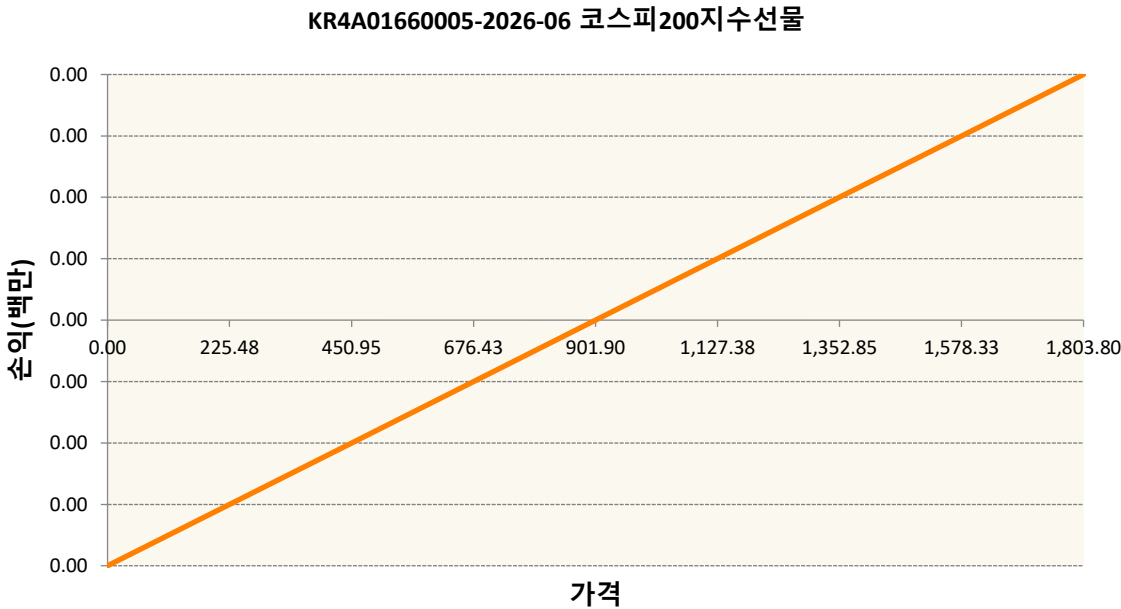
스마트인덱스모

1. 계약금액

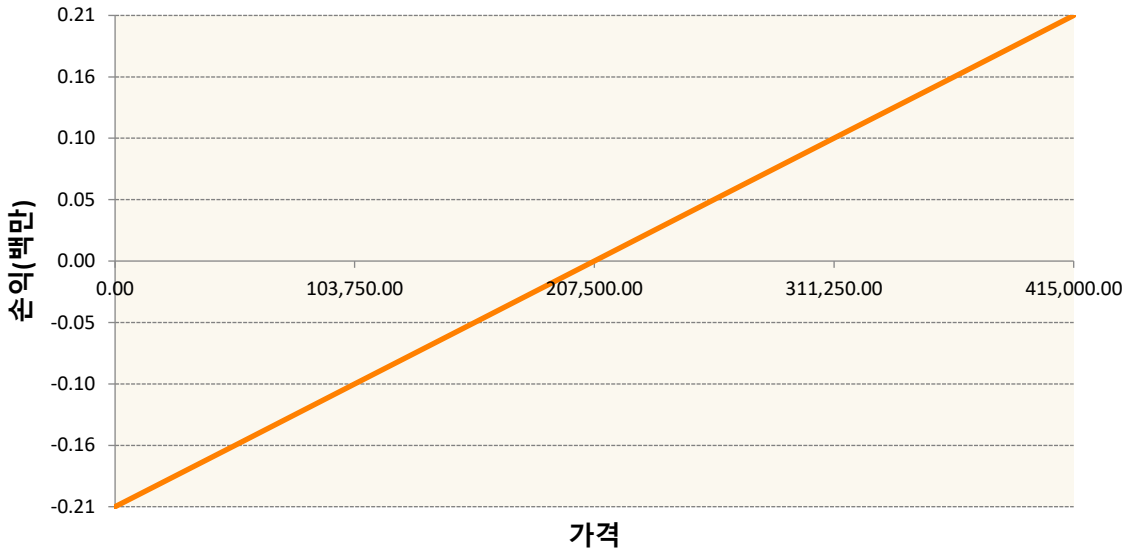
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	447	0	447	장내
누계	유가증권	선물	3,521	0	3,521	장내

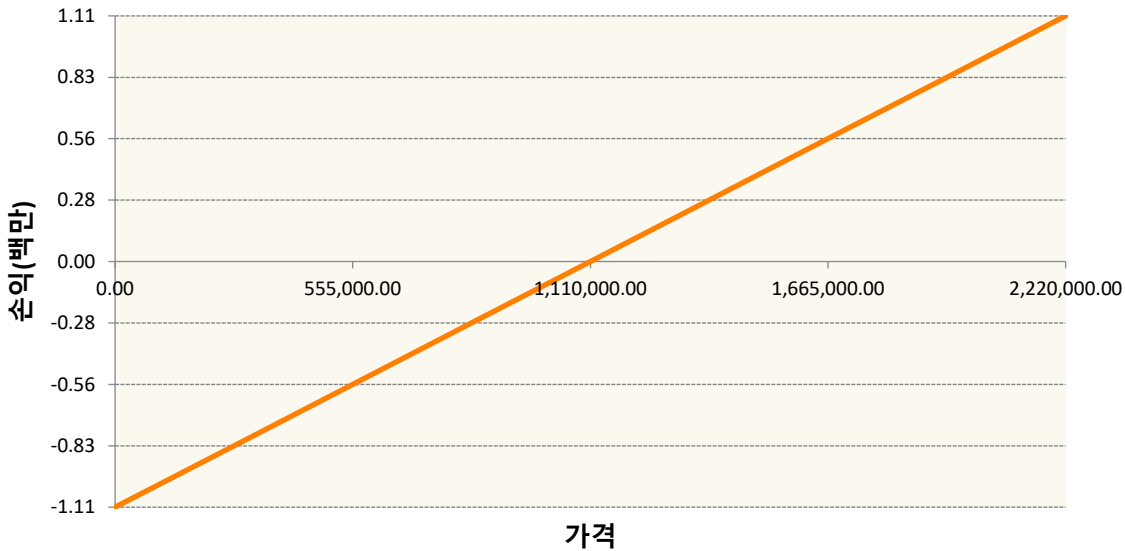
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005			2026-06 코스피200지수선물				197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	132	132	132	132	132	132	132
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
KR4A05650002			2026-05 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

KR4A11650004

2026-05 삼성전자개별선물

37

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	37	37	37	37	37	37	37

KR4A50650006

2026-05 SK하이닉스개별선물

10

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-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%	10	10	10	10	10	10	10

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

(단위:백만원)

572

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

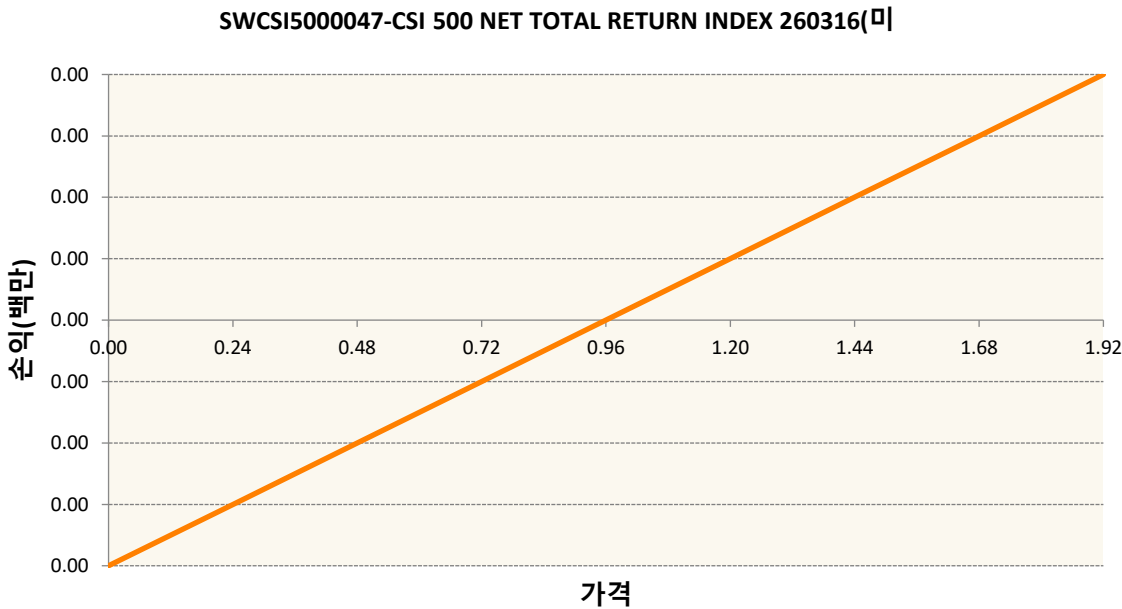
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,418	0	5,418	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

434

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

593

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

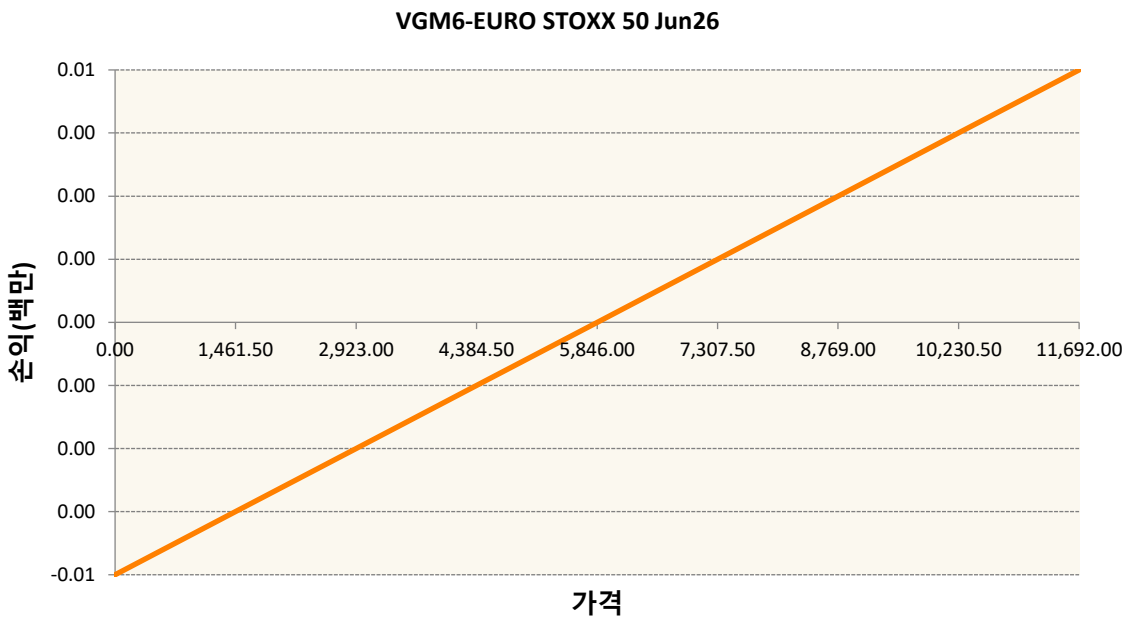
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	901	0	901	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

62

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

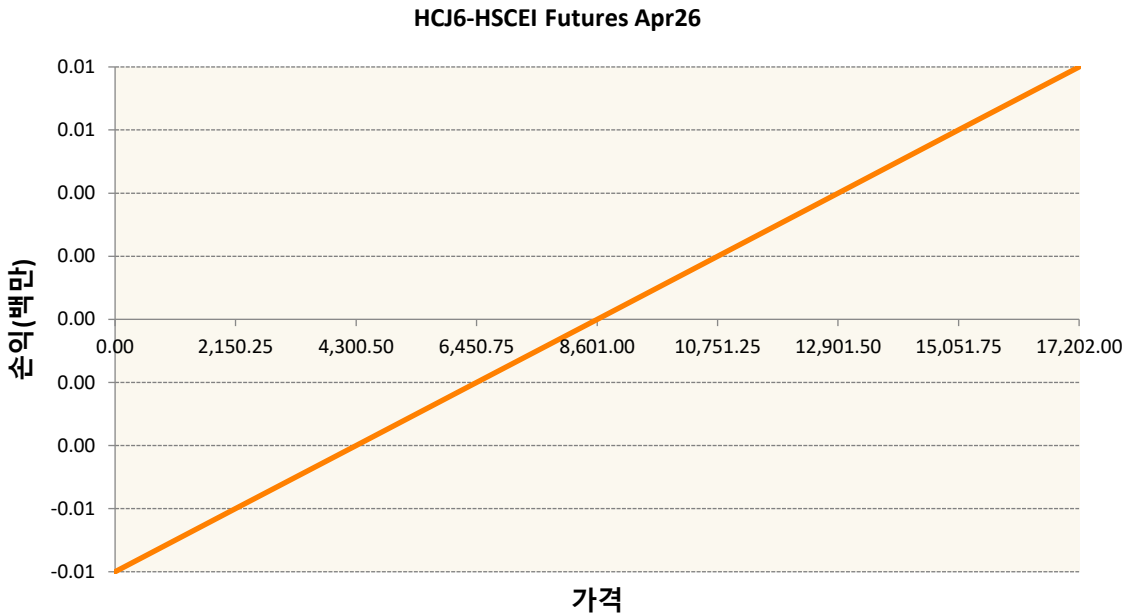
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,655	0	1,655	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI6	HSCEI Futures Apr26	132
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

161

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

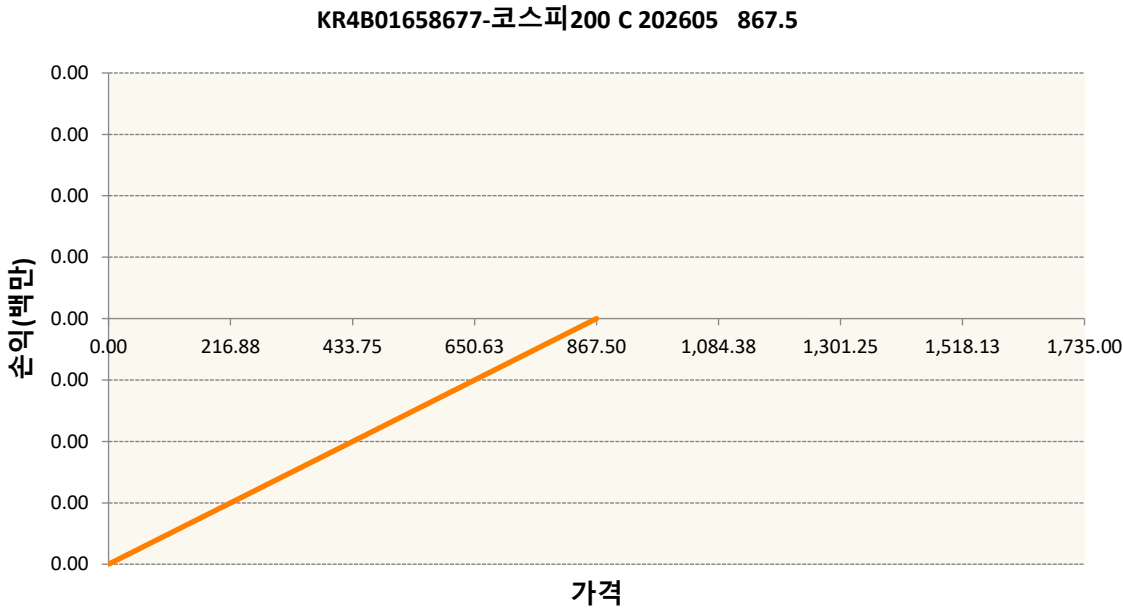
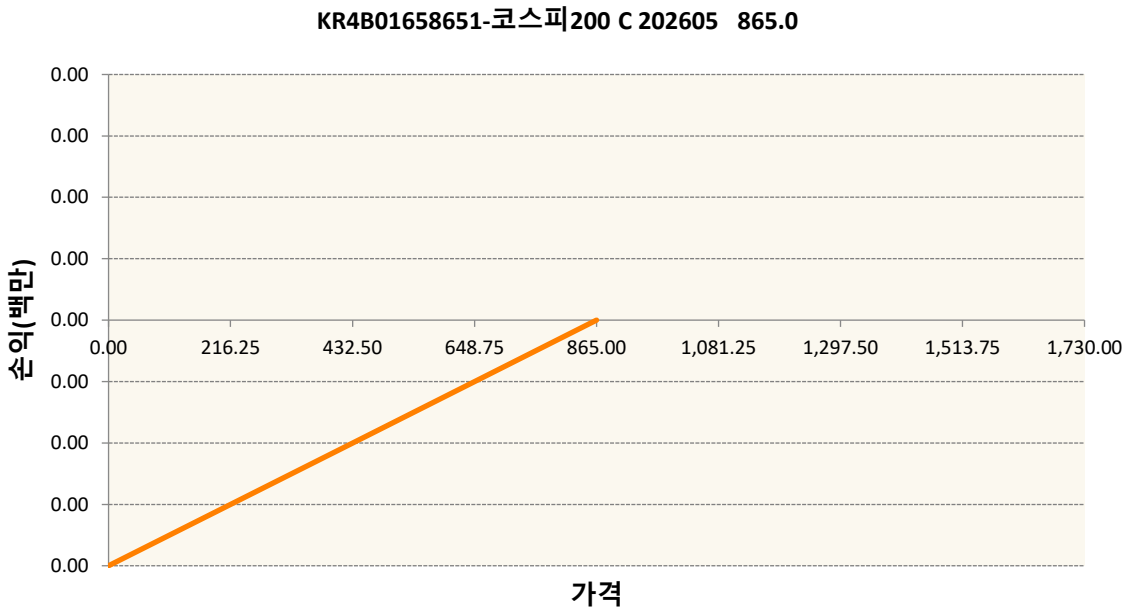
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

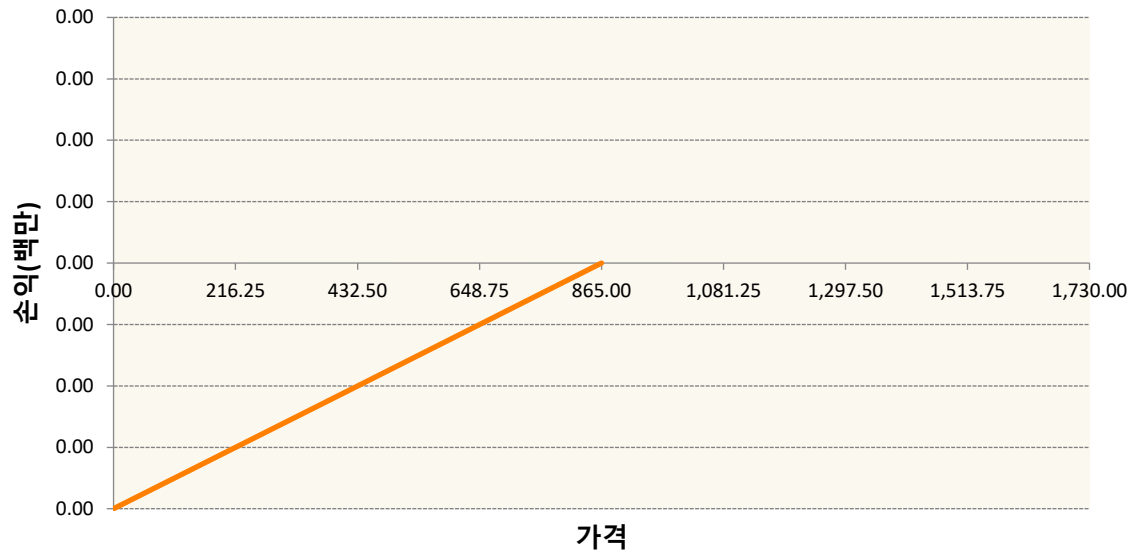
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,444	-37,444	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0							1,020
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-498	-583	-669	-756	-843	-931	-1,020
-5.33%	-189	-281	-373	-465	-557	-649	-741
-2.67%	68	-26	-120	-213	-307	-401	-494
0%	274	183	92	0	-92	-185	-278
2.67%	434	350	265	178	89	0	-91
5.33%	553	480	403	323	241	156	70
8.00%	640	579	512	440	365	287	207
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							609
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-303	-352	-403	-454	-505	-557	-609
-5.33%	-117	-171	-225	-279	-334	-388	-443
-2.67%	38	-17	-73	-128	-184	-239	-295
0%	163	109	55	0	-55	-110	-165
2.67%	260	210	159	107	54	1	-53
5.33%	333	289	243	195	146	95	44
8.00%	387	350	309	266	221	174	126
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							382
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-187	-219	-251	-283	-316	-349	-382
-5.33%	-71	-105	-140	-174	-209	-243	-278
-2.67%	25	-10	-45	-80	-115	-150	-185
0%	103	69	34	0	-35	-69	-104

2.67%	163	131	99	67	33	0	-34
5.33%	207	180	151	121	90	59	26
8.00%	240	217	192	165	137	108	77

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

(단위:백만원)

2,642

공시일 2026-04-15

기준일 2026-04-14

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	2026-04-15
기준일	2026-04-14

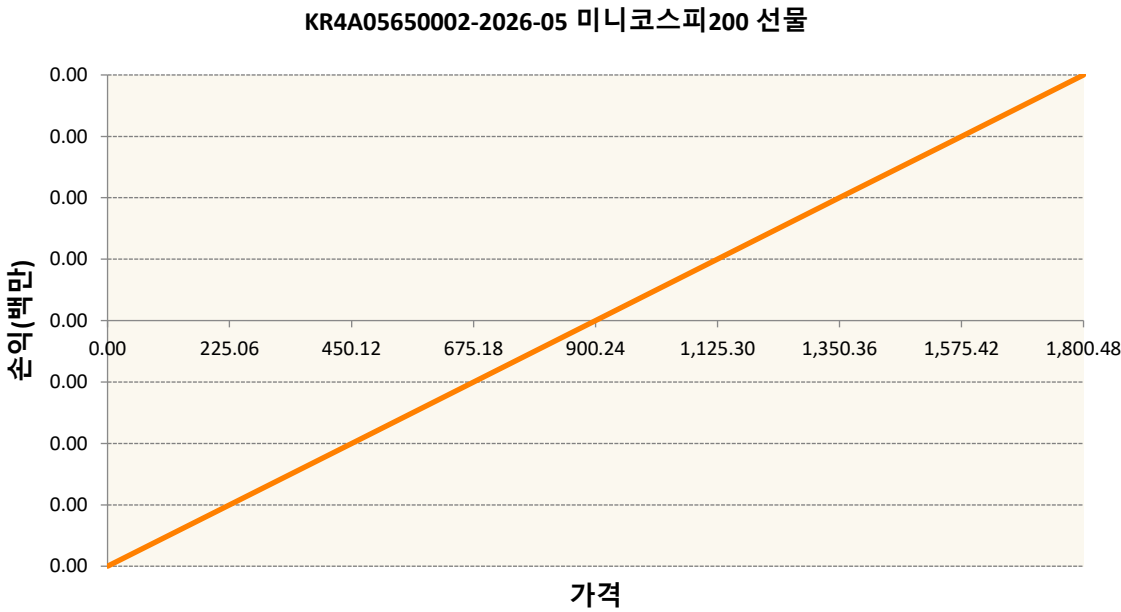
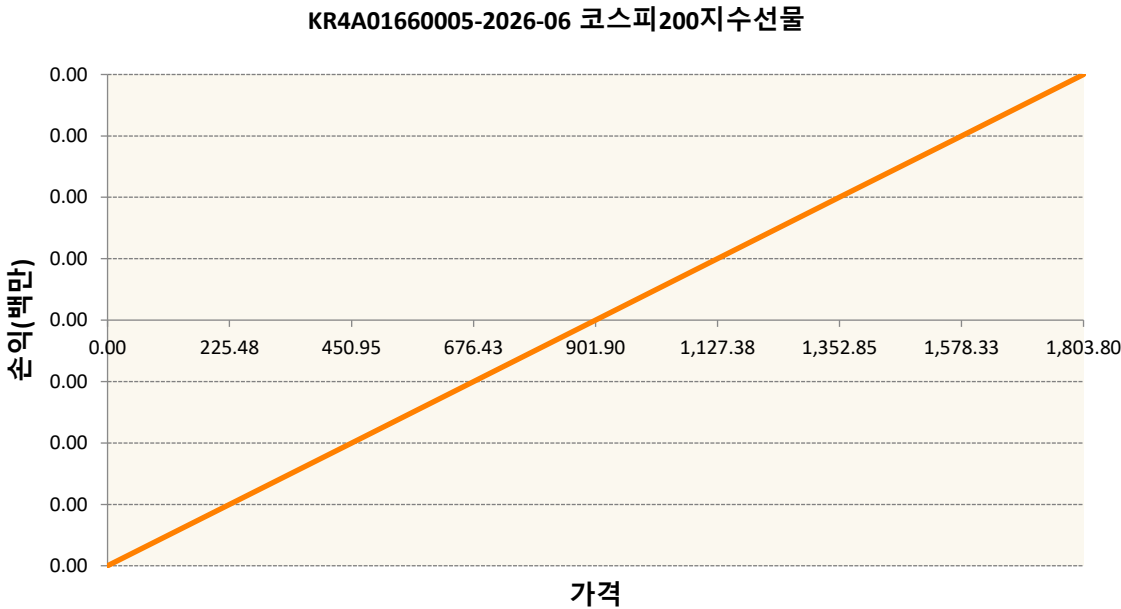
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

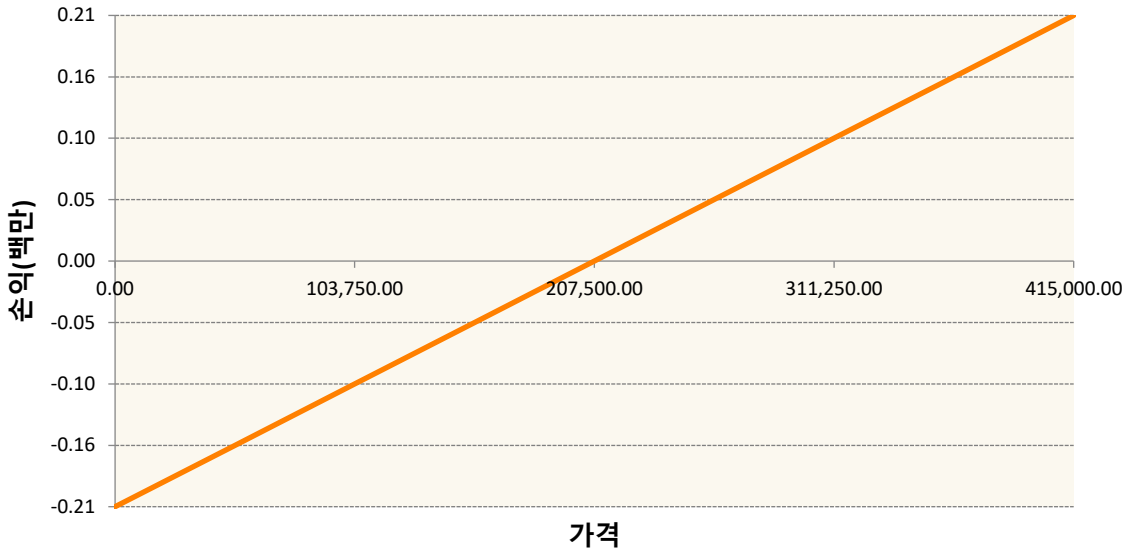
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	224	-224	장내
누계	유가증권	선물	3,260	0	3,260	장내

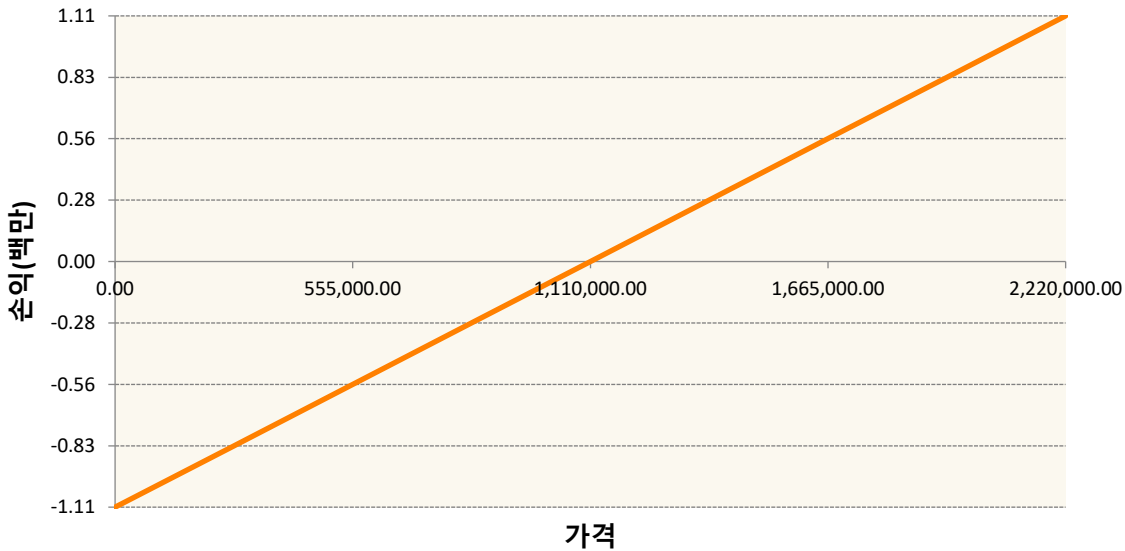
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				90
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90	
-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%	90	90	90	90	90	90	90	
KR4A05650002				2026-05 미니코스피200 선물				32
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-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%	22	22	22	22	22	22	22
8.00%	32	32	32	32	32	32	32

KR4A11650004

2026-05 삼성전자개별선물

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

KR4A50650006

2026-05 SK하이닉스개별선물

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

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

(단위:백만원)

290

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

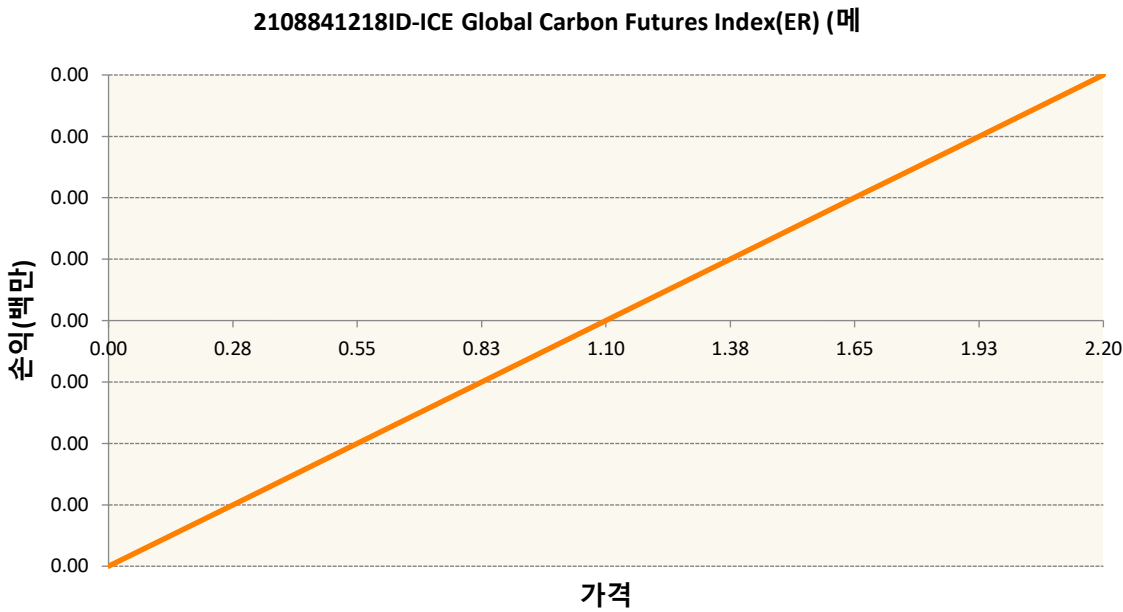
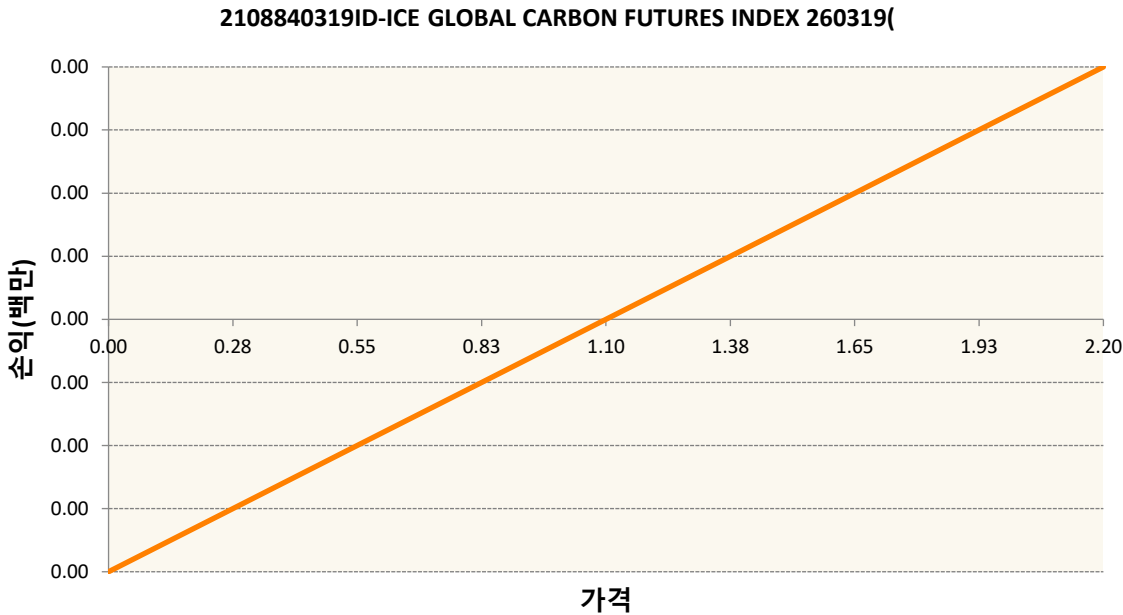
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,321	0	6,321	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		403
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		101

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	563

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

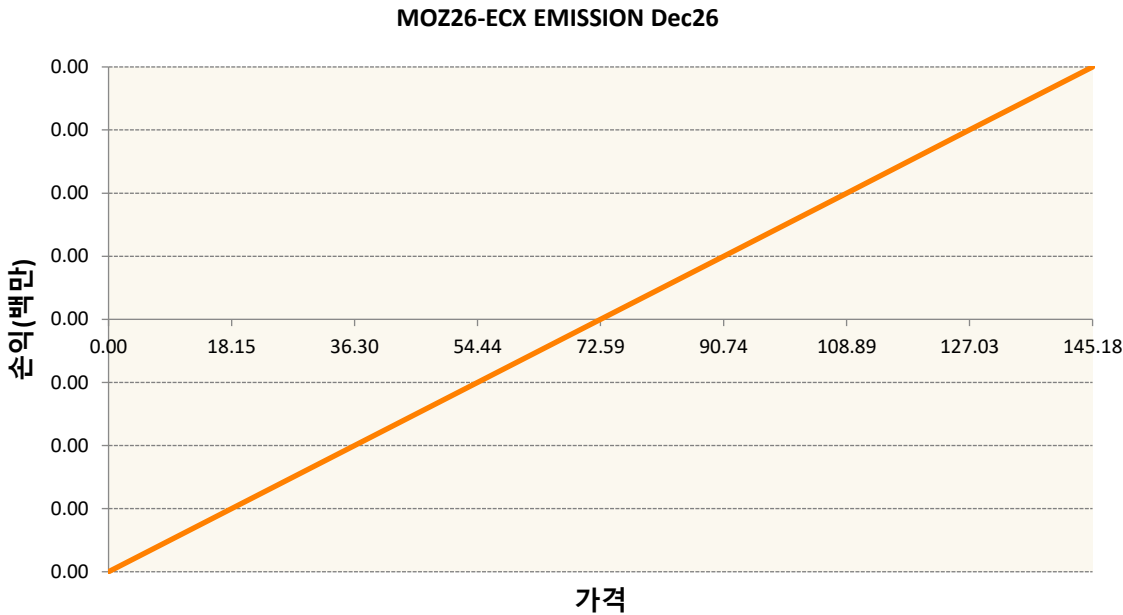
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,675	0	4,675	
누계	통화	선도	0	2,209	-2,209	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E)	177
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	374

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

(단위:백만원)

648

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

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	1,694	0	1,694	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	9
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	6
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	15
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	6

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

(단위:백만원)

57

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

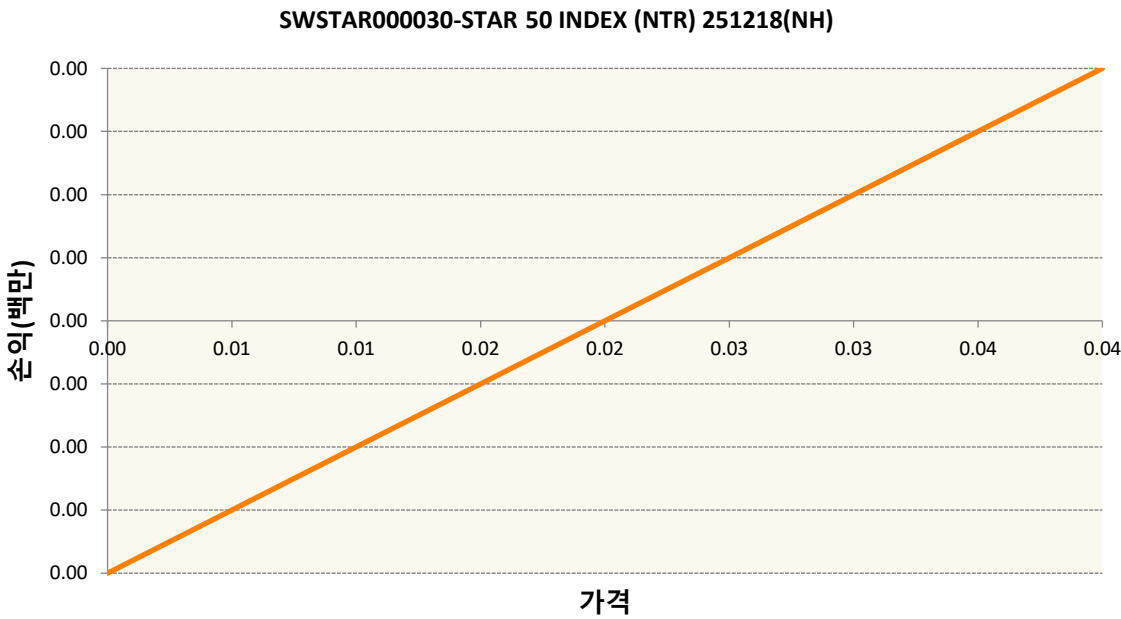
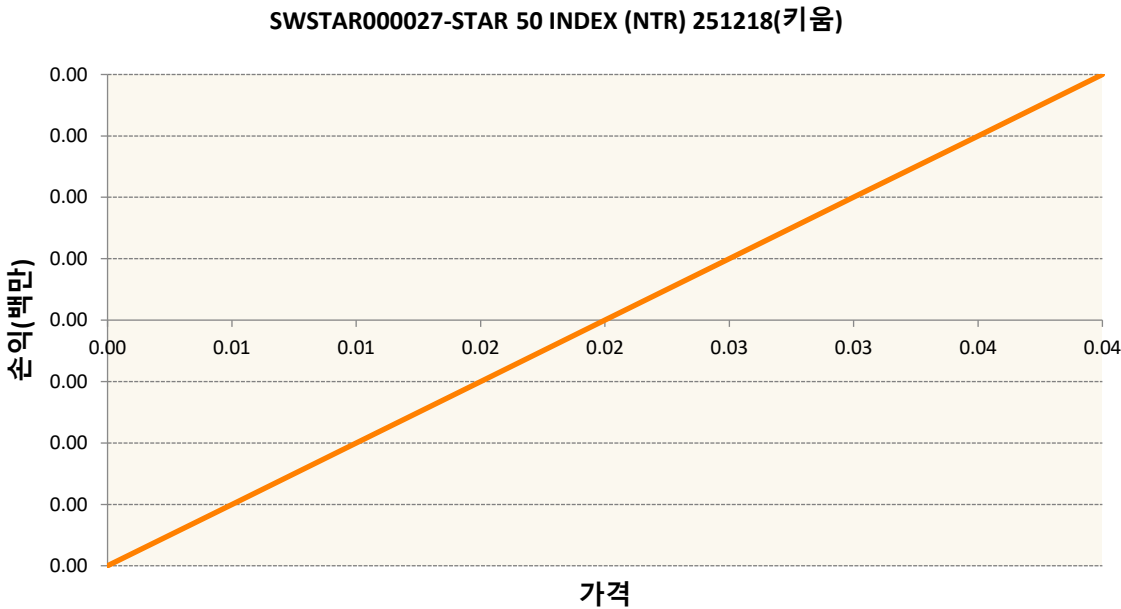
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

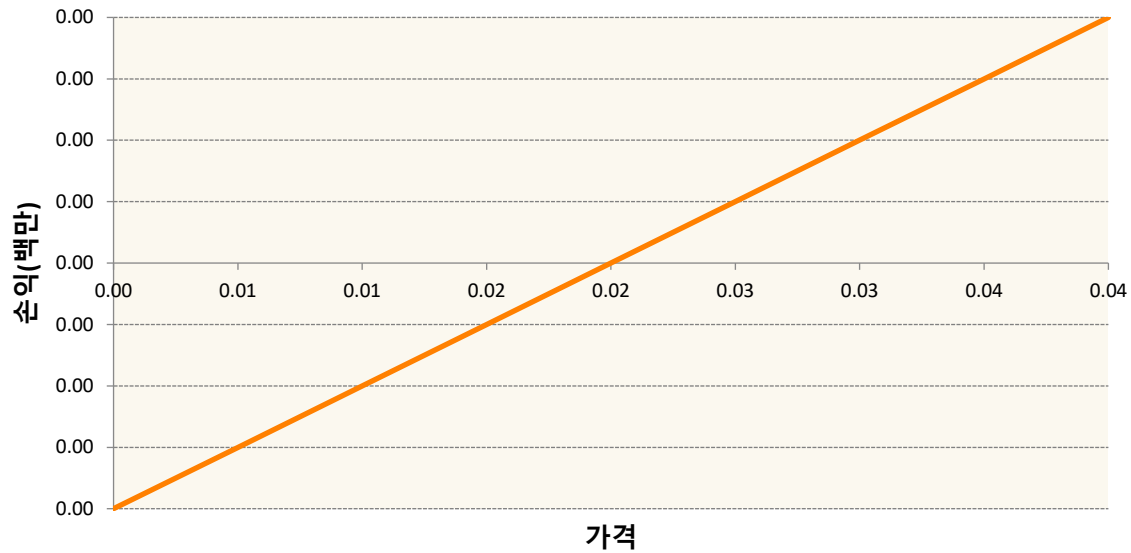
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	506	0	506	장외

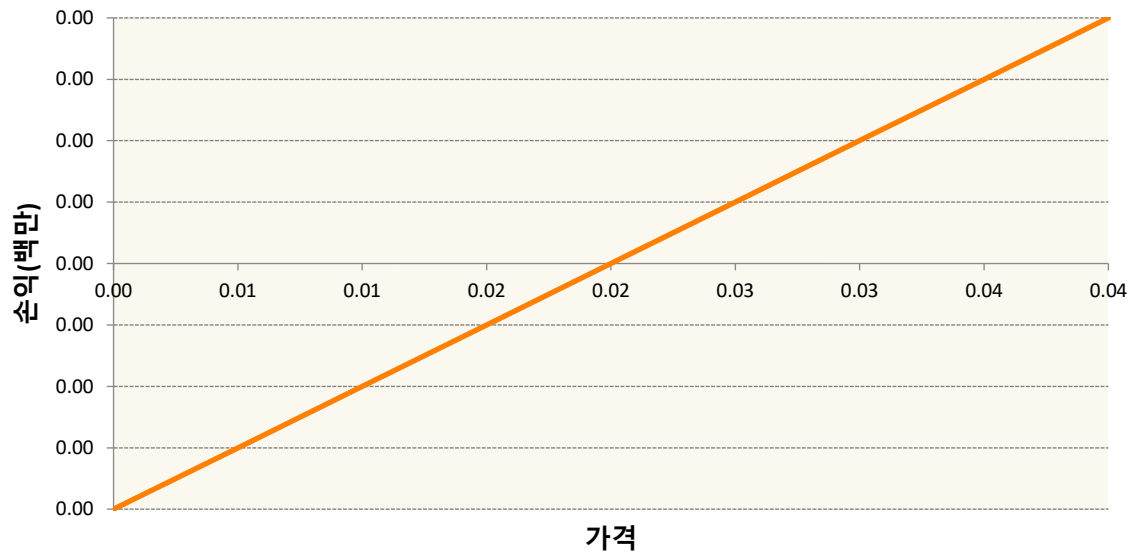
2. 만기시점의 손익구조



SWSTAR000031-STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)



SWSTAR000032-STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)

1
5
25
9

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

(단위:백만원)

62

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

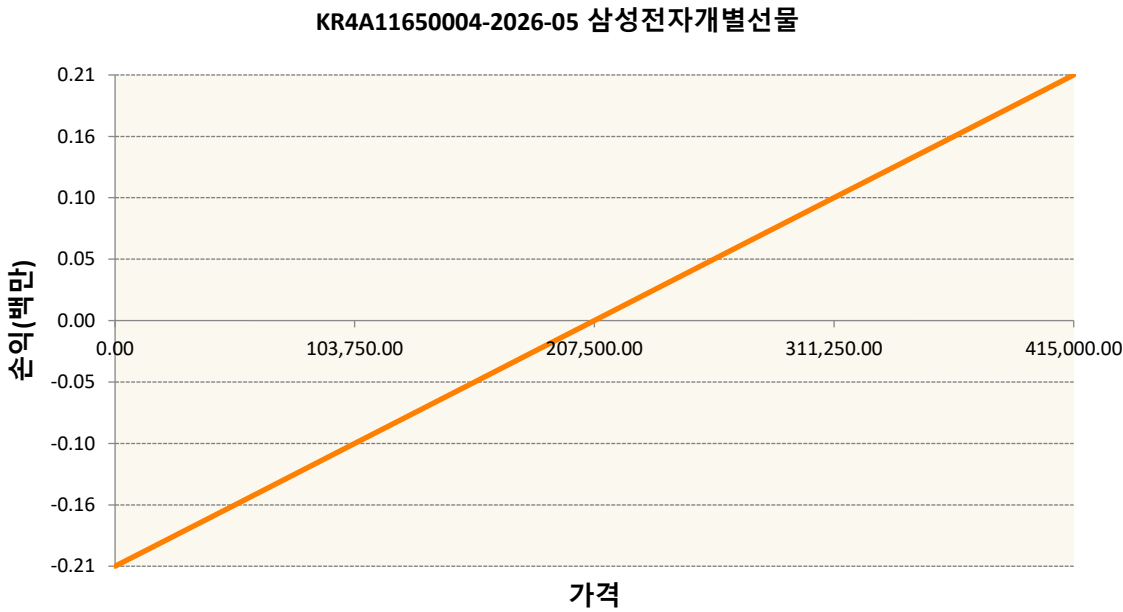
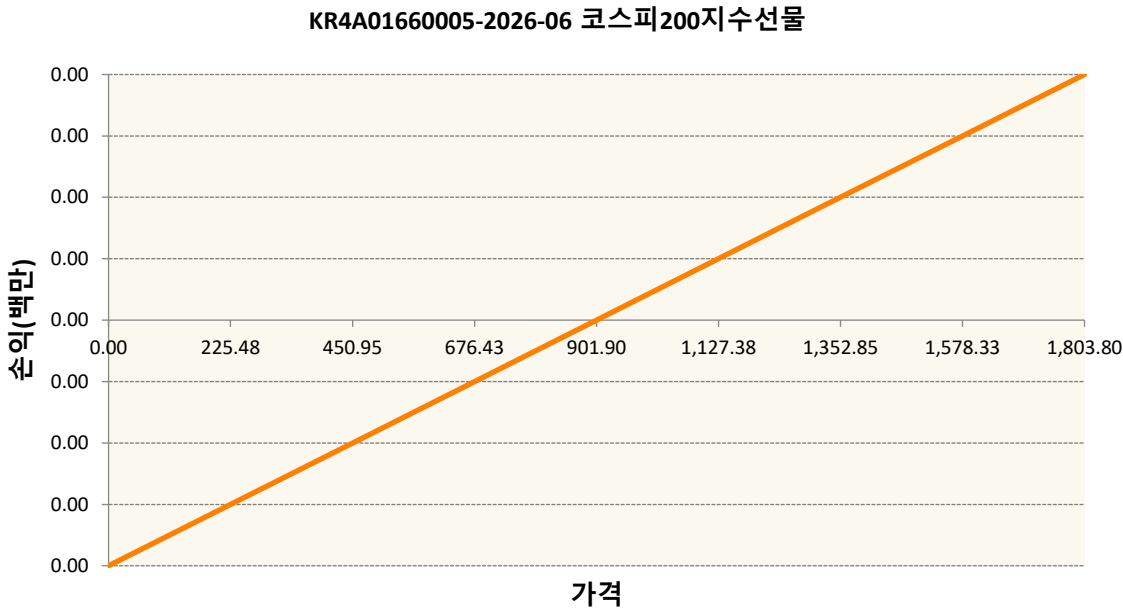
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

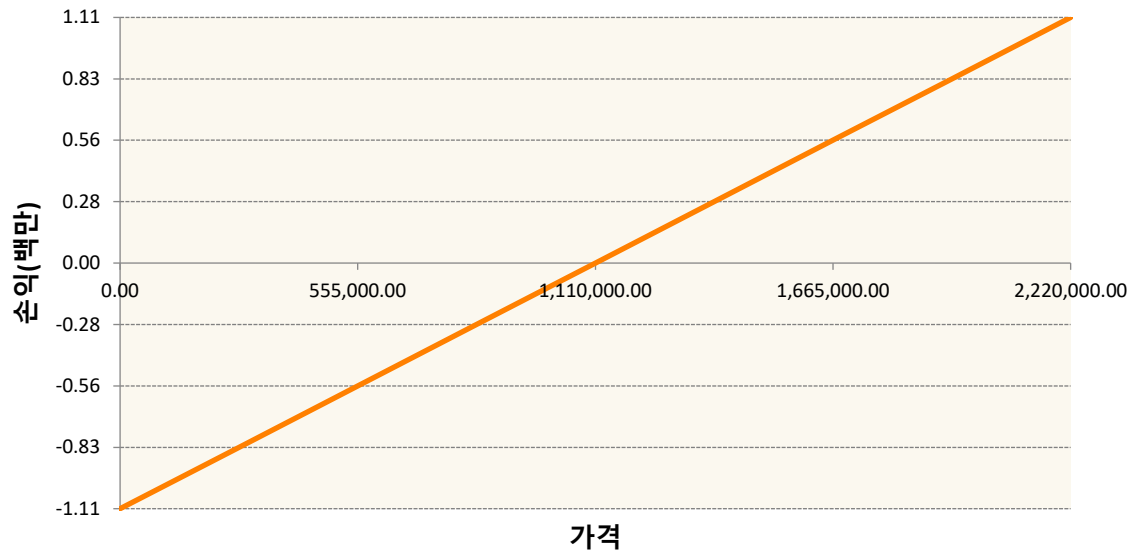
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,126	-1,126	장내
누계	유가증권	선물	20,478	1,769	18,710	장내

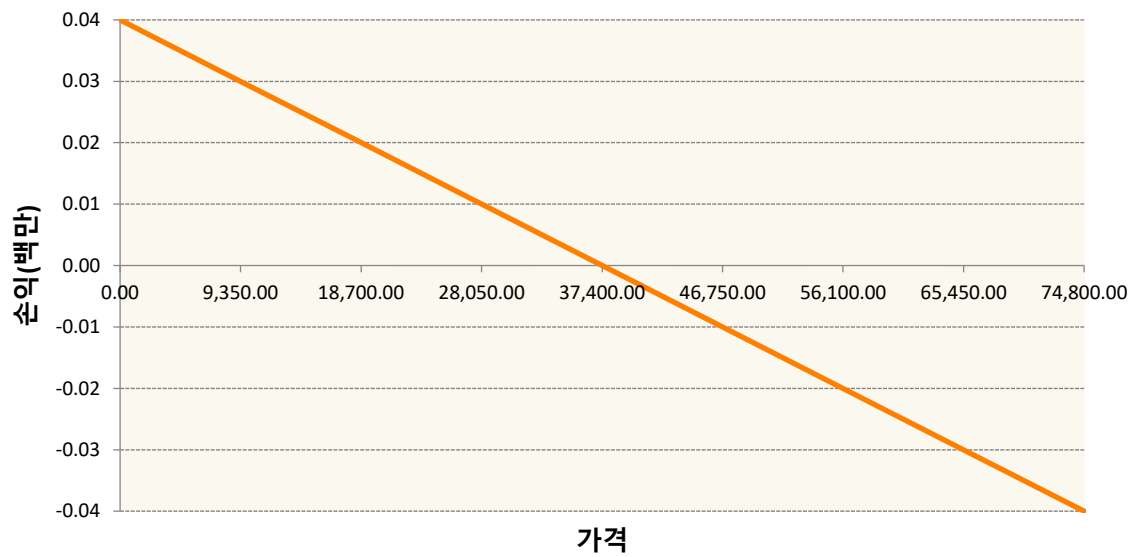
2. 만기시점의 손익구조



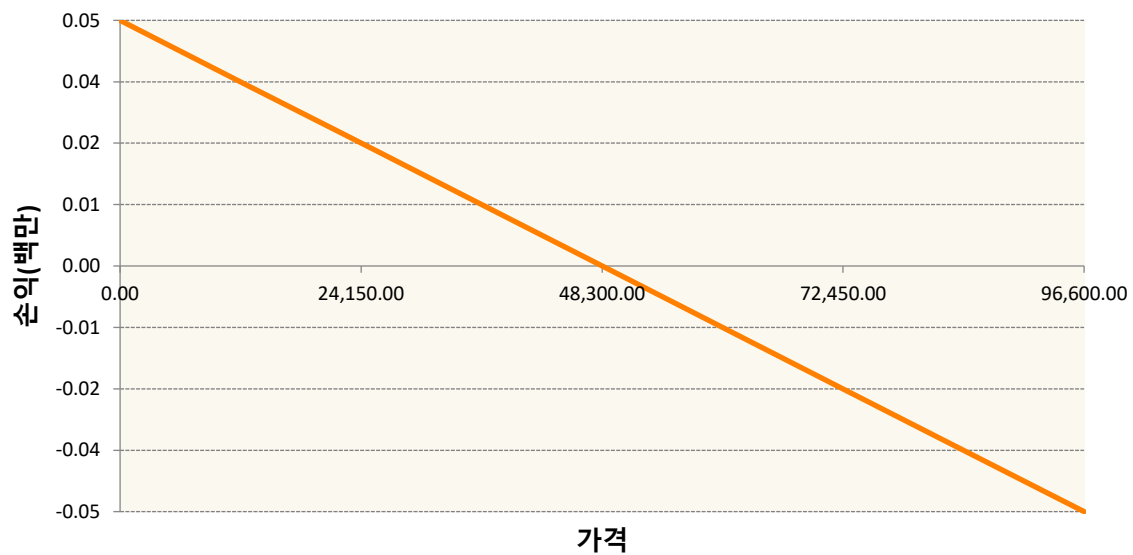
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4A51650005-2026-05 GS건설개별선물



KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		1,363		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-1,363	-1,363	-1,363	-1,363	-1,363	-1,363	-1,363				
-5.33%	-909	-909	-909	-909	-909	-909	-909				
-2.67%	-454	-454	-454	-454	-454	-454	-454				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	454	454	454	454	454	454	454				
5.33%	909	909	909	909	909	909	909				
8.00%	1,363	1,363	1,363	1,363	1,363	1,363	1,363				
KR4A11650004							2026-05 삼성전자개별선물		171		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171				
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114				
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	57	57	57	57	57	57	57				
5.33%	114	114	114	114	114	114	114				
8.00%	171	171	171	171	171	171	171				
KR4A50650006							2026-05 SK하이닉스개별선물		95		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-95	-95	-95	-95	-95	-95	-95				
-5.33%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64				
-2.67%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	32	32	32	32	32	32	32				
5.33%	64	64	64	64	64	64	64				
8.00%	95	95	95	95	95	95	95				
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		123		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	123	123	123	123	123	123	123
-5.33%	82	82	82	82	82	82	82
-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%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123

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

(단위:백만원)

3,925

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

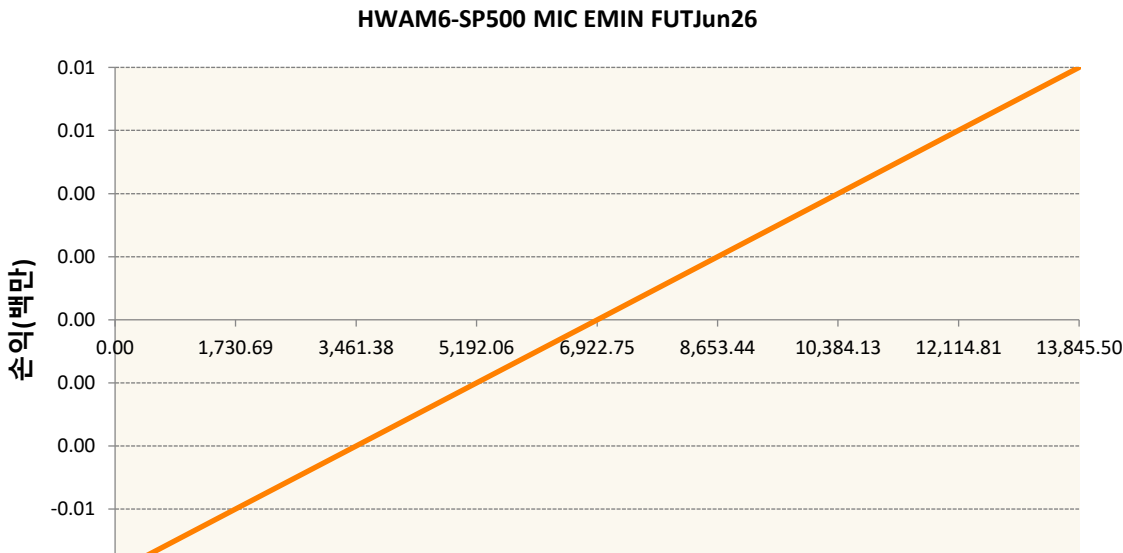
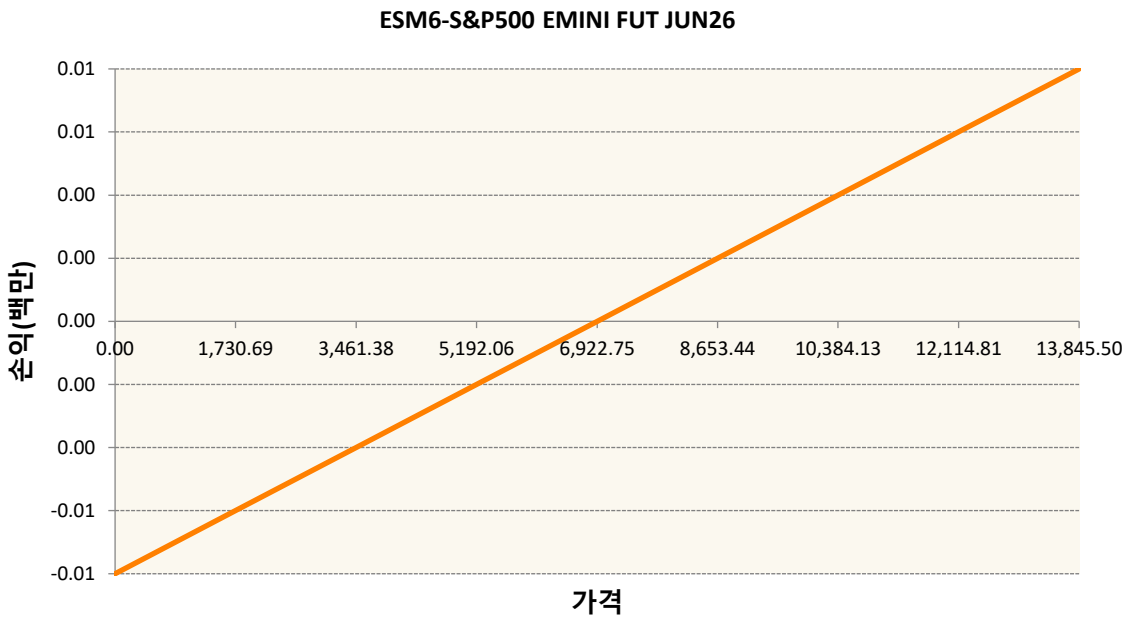
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

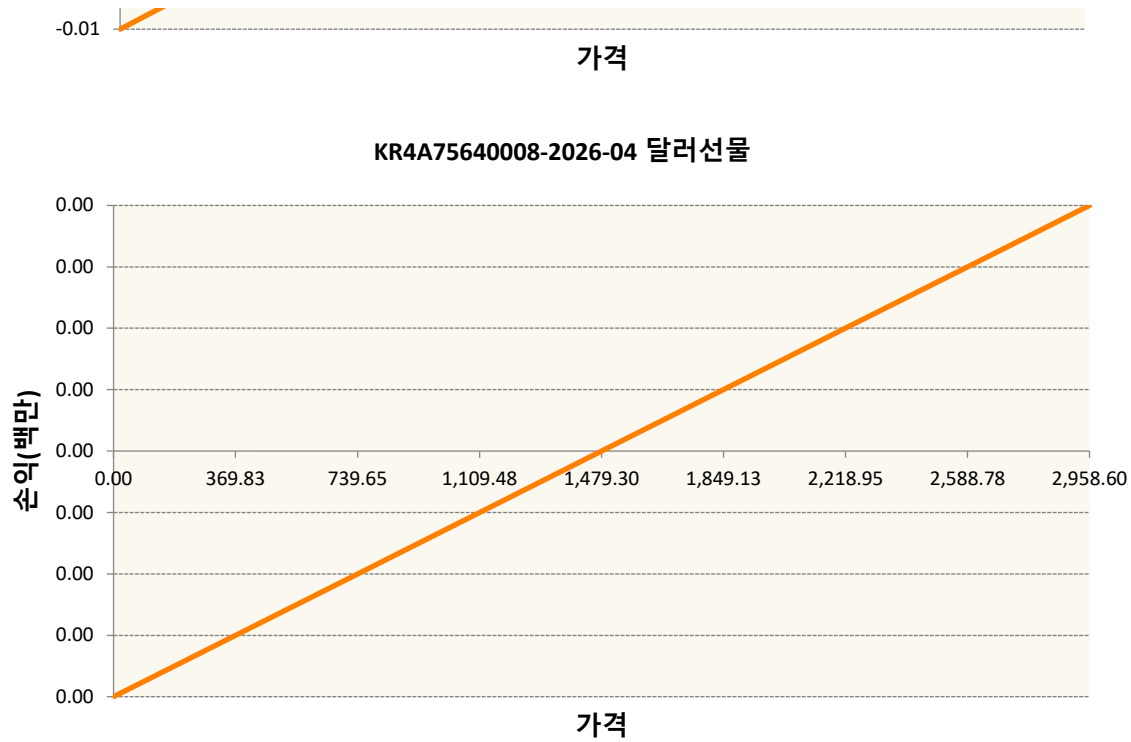
1. 계약금액

(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	56,102	0	56,102	
누계	지수	선물	157	0	157	장내
누계	통화	선물	10,503	0	10,503	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,488
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		13
KR4A756400 2026-04 달러선물			840

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,932

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

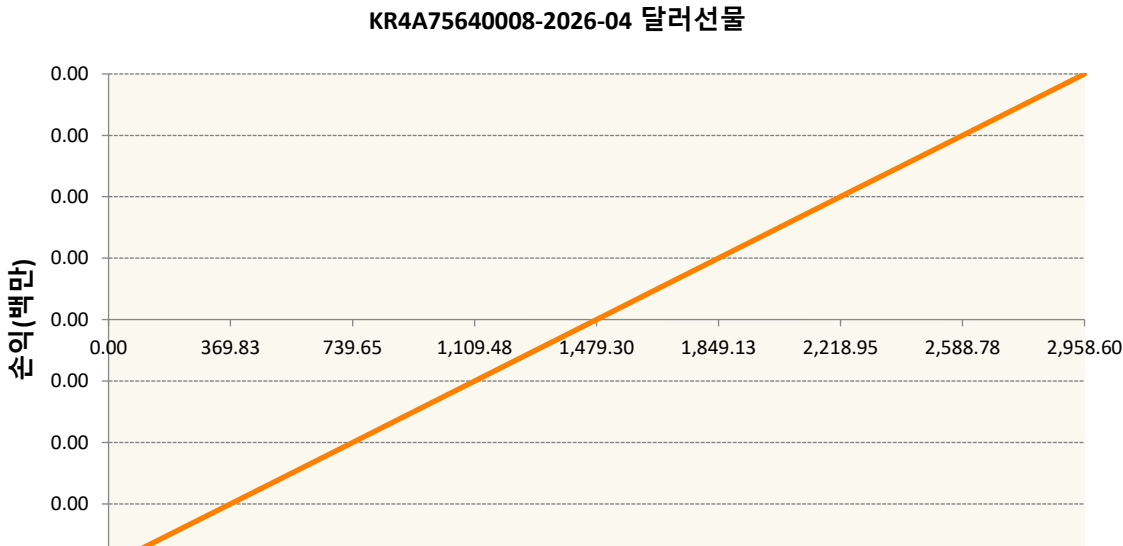
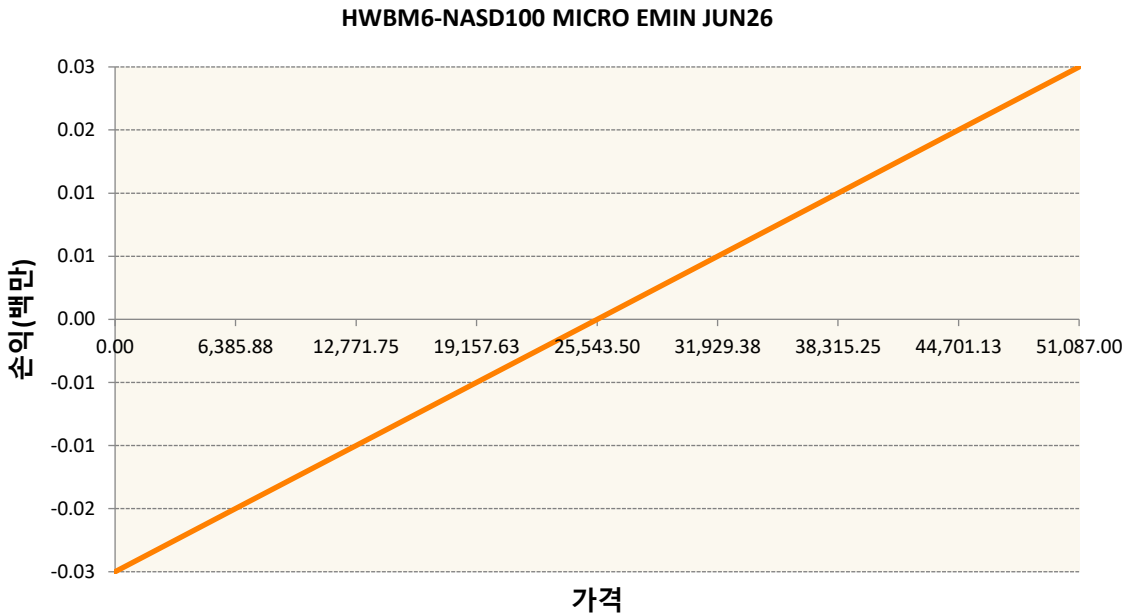
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

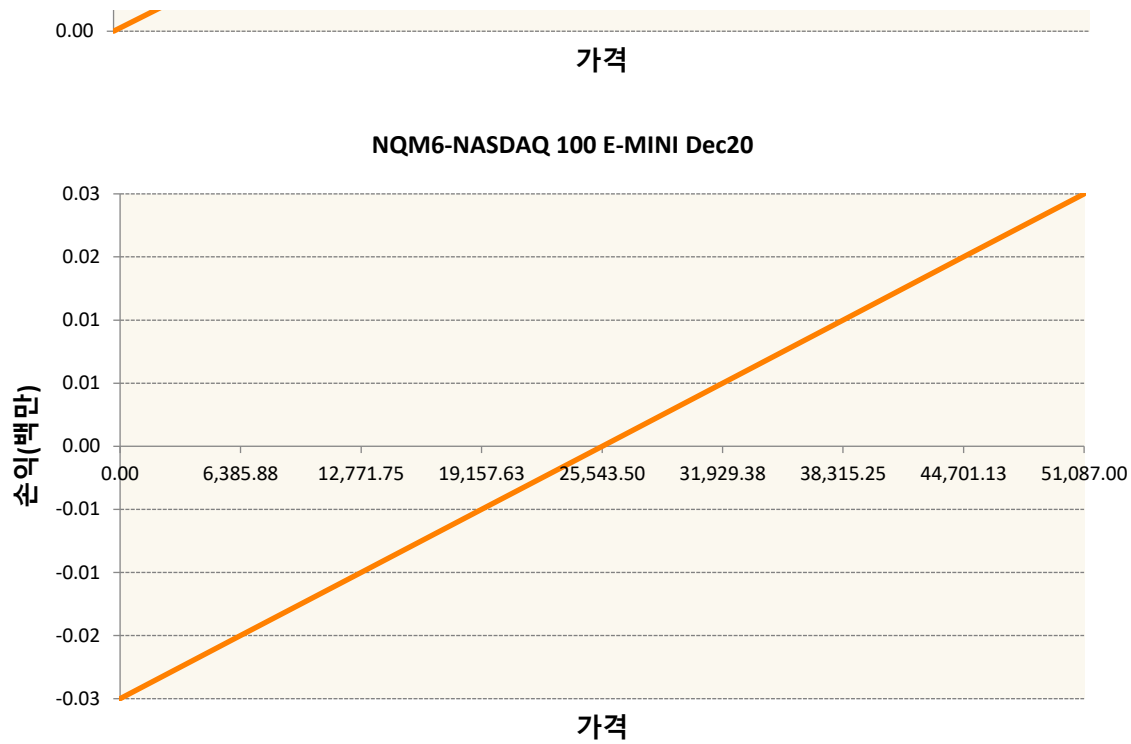
1. 계약금액

(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	0	0	장내
누계	유가증권	선물	23,766	0	23,766	
누계	유가증권	선물	304	0	304	장내
누계	통화	선물	3,861	0	3,861	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	24
KR4A756400	2026-04 달러선물	309
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	1,901

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

(단위:백만원)

2,122

공시일	2026-04-15
기준일	2026-04-14

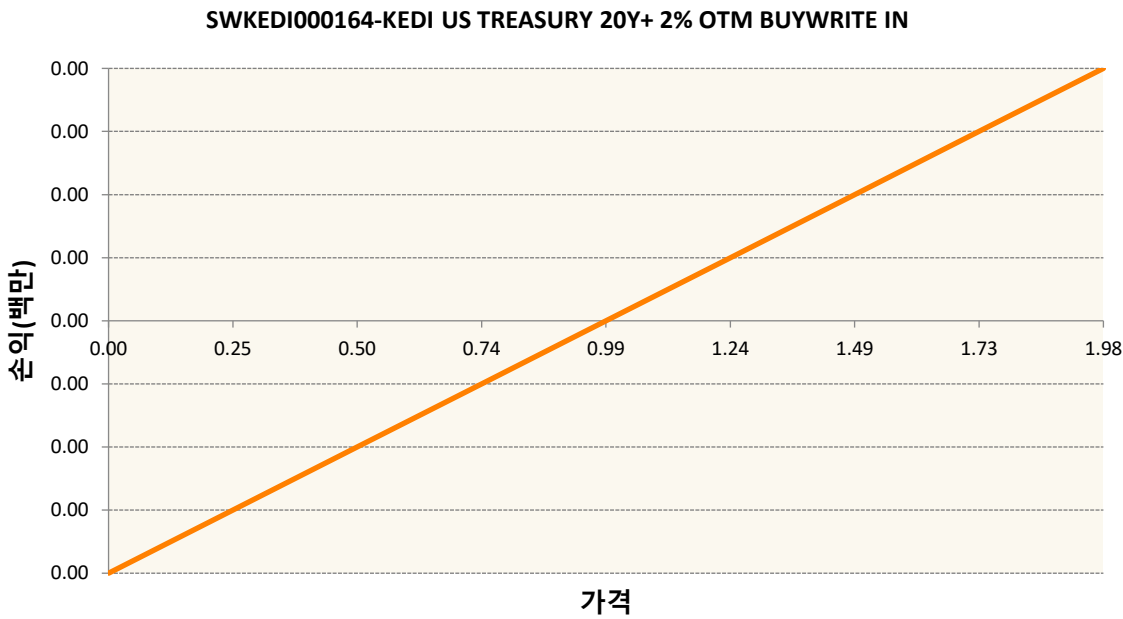
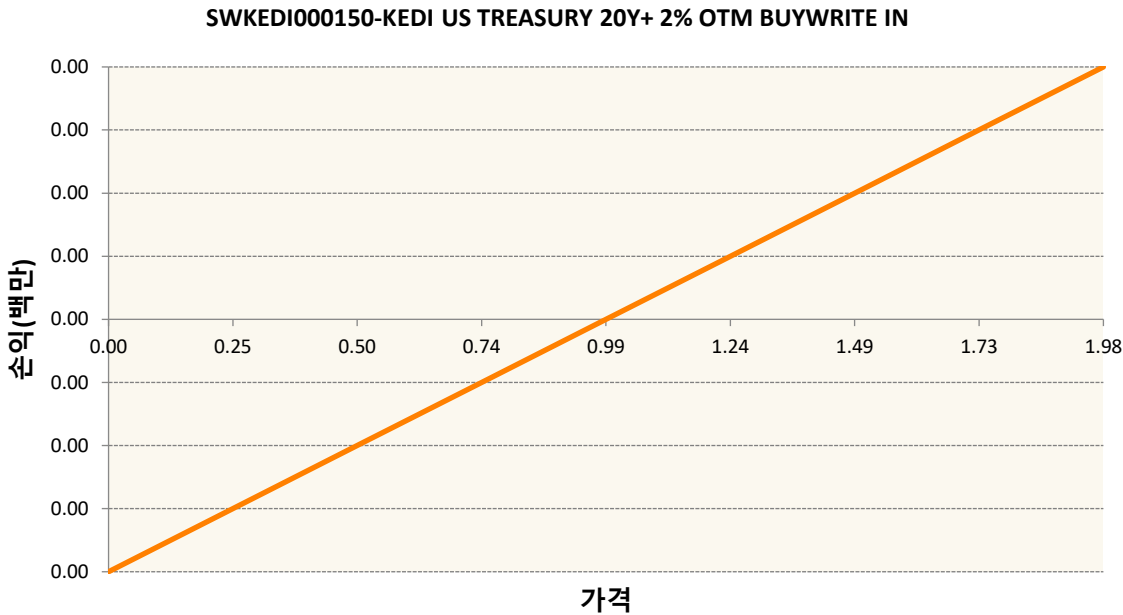
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

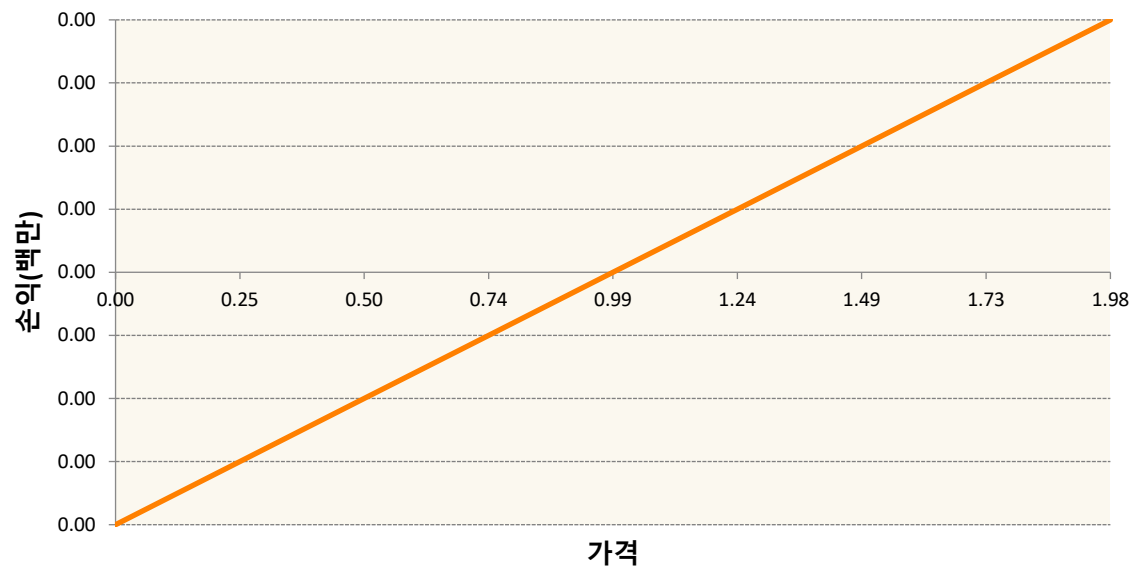
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	357,503	0	357,503	장외

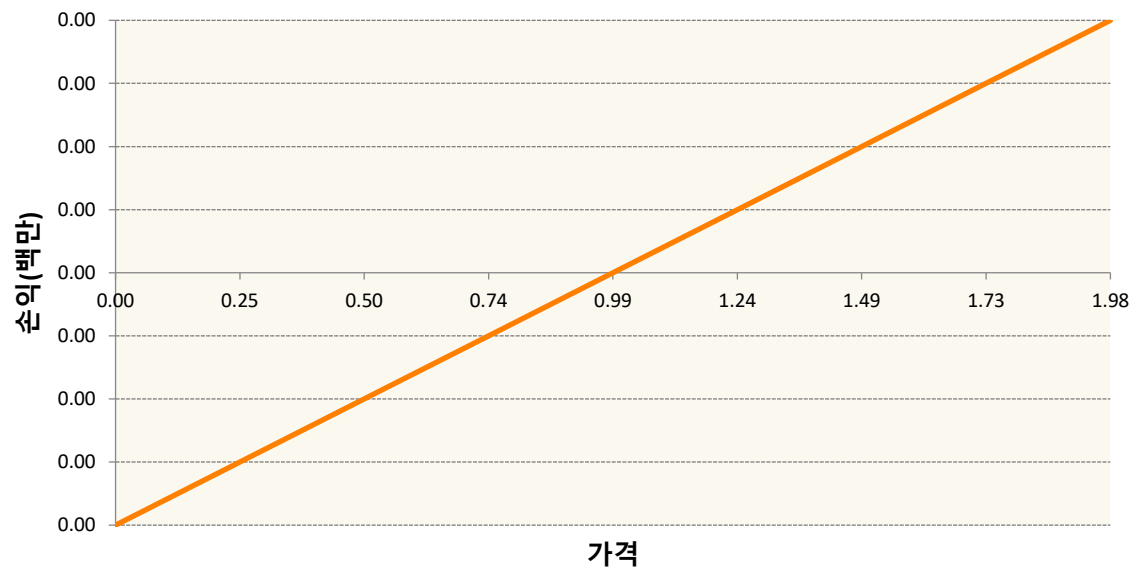
2. 만기시점의 손익구조



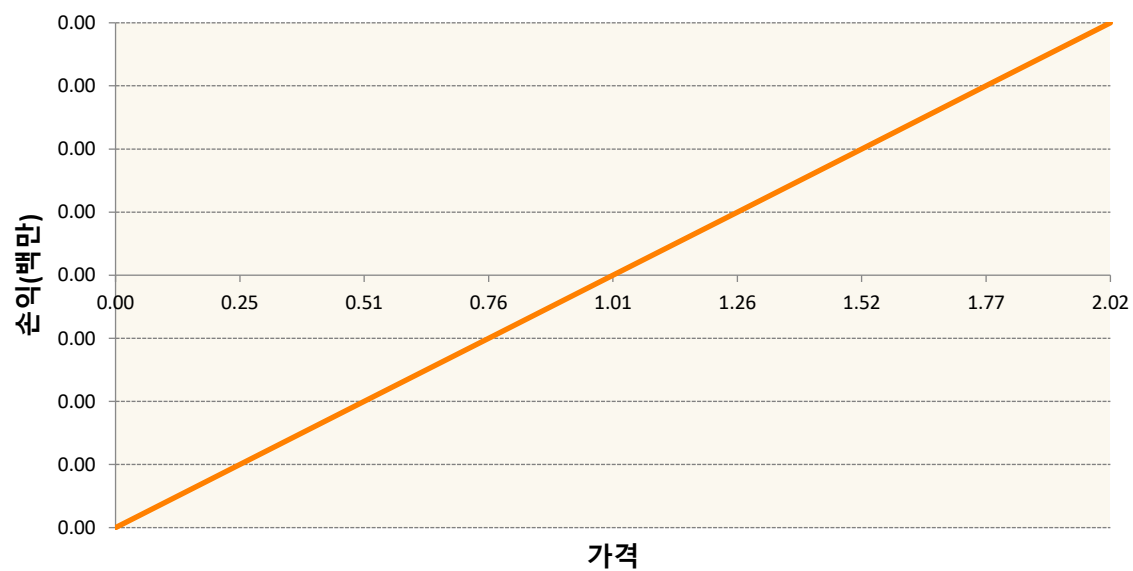
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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



SWKEDI000173-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,341
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		153
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,739
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,424
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,958

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,196

공시일 2026-04-15

기준일 2026-04-14

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