

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

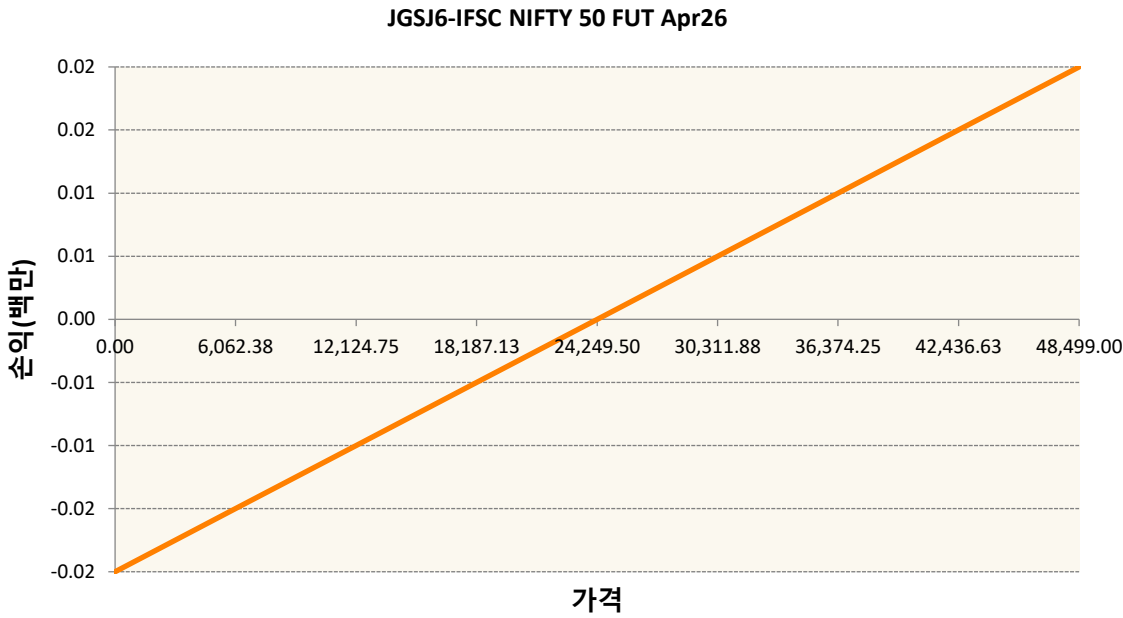
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	657	0	657	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSJ6	IFSC NIFTY 50 FUT Apr26	53
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

36

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

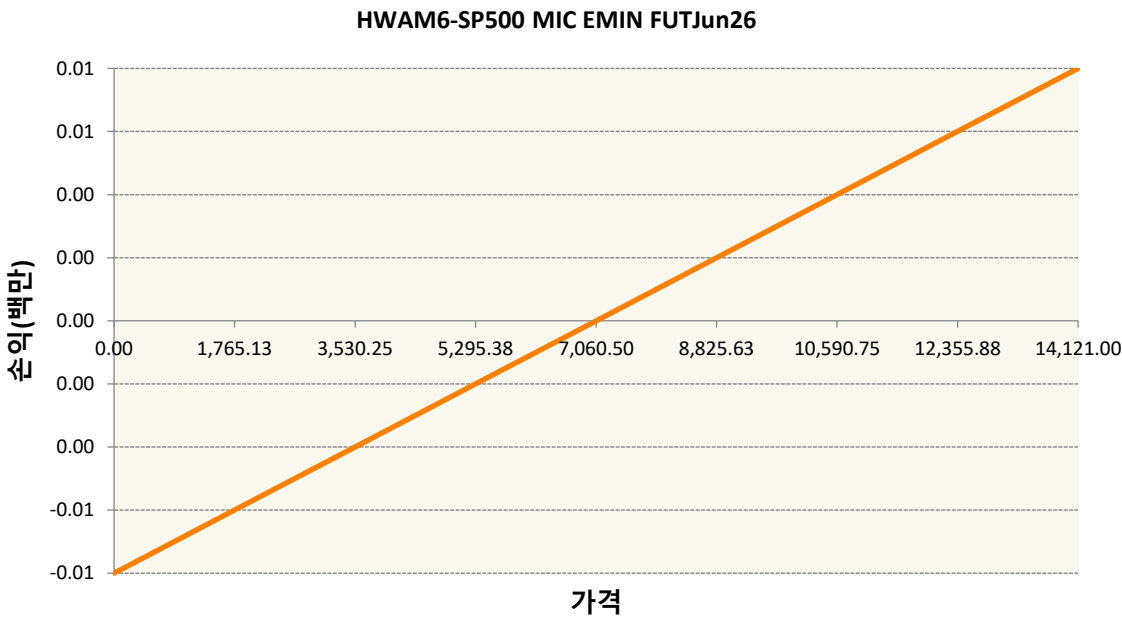
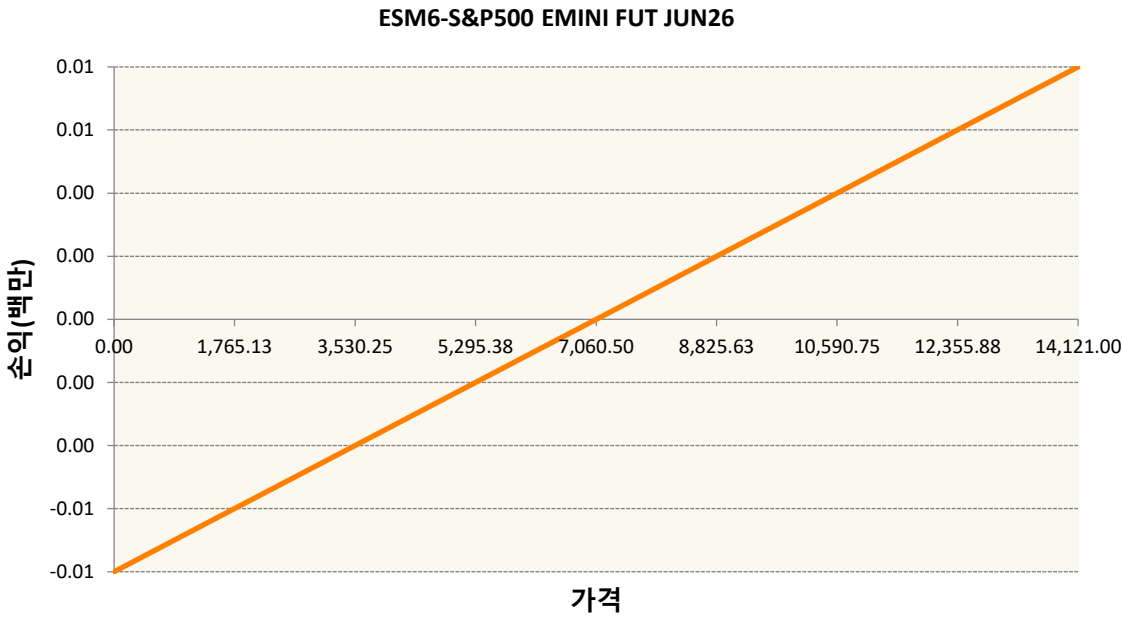
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	530	0	530	
누계	지수	선물	159	0	159	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	42
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	48

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

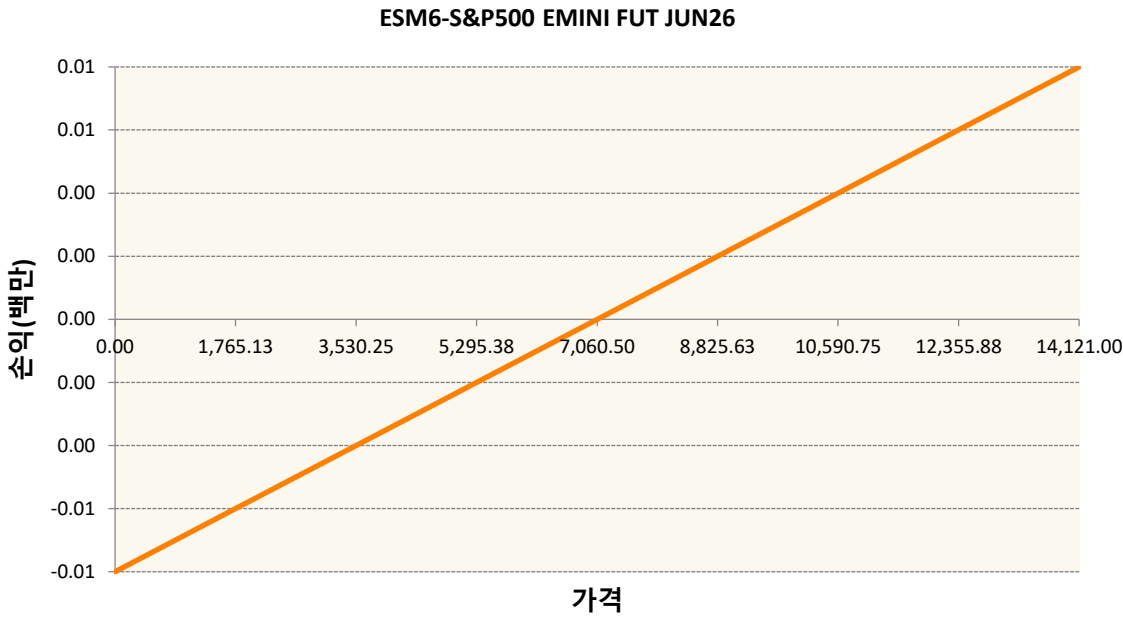
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,059	0	1,059	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6 S&P500 EMINI FUT JUN26

85

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

(단위:백만원)

74

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

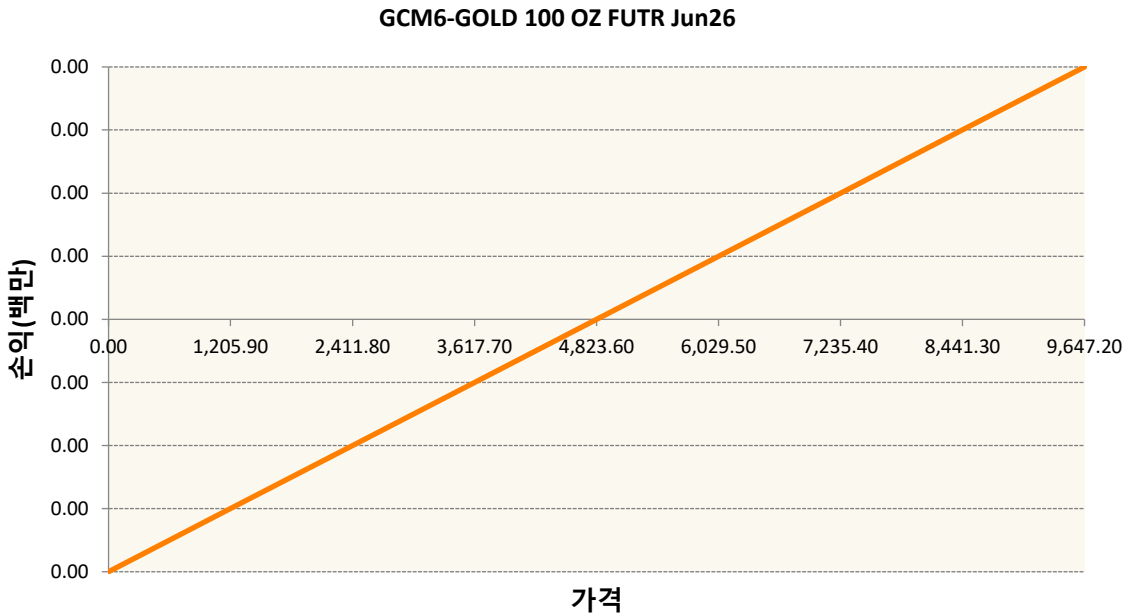
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,803	0	5,803	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 04/17/26 C440 EQUITY	12
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	464

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

(단위:백만원)

596

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

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	88
AOPLTRUS1 PLTR US 04/17/26 C137 EQUITY	113

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

(단위:백만원)

657

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

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

7

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

(단위:백만원)

4

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

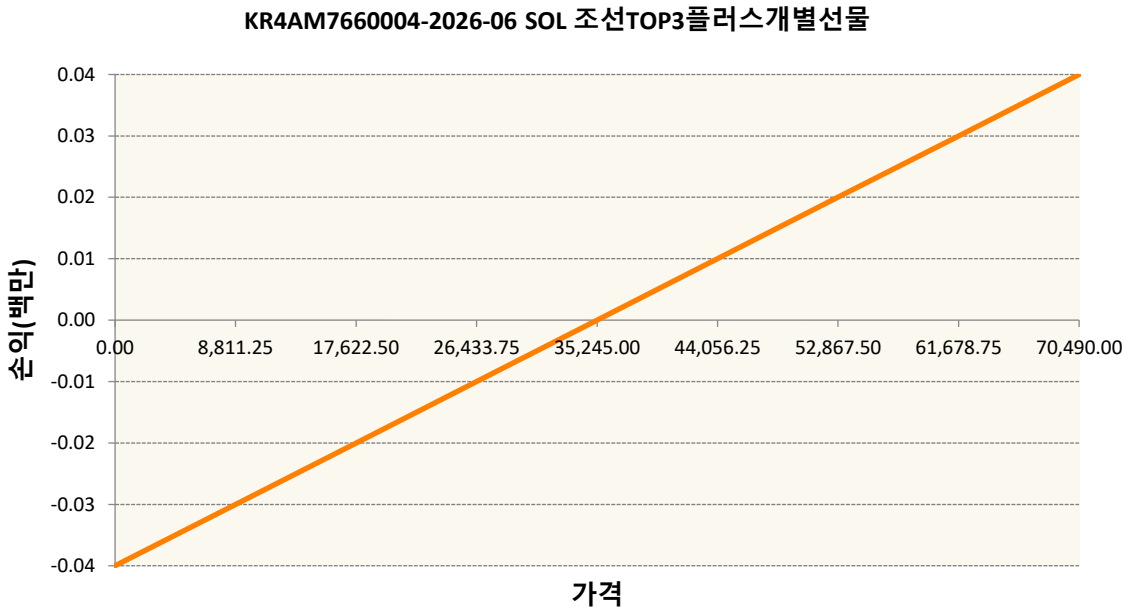
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	157,214	0	157,214	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-04-17

기준일 2026-04-16

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	2026-04-17
기준일	2026-04-16

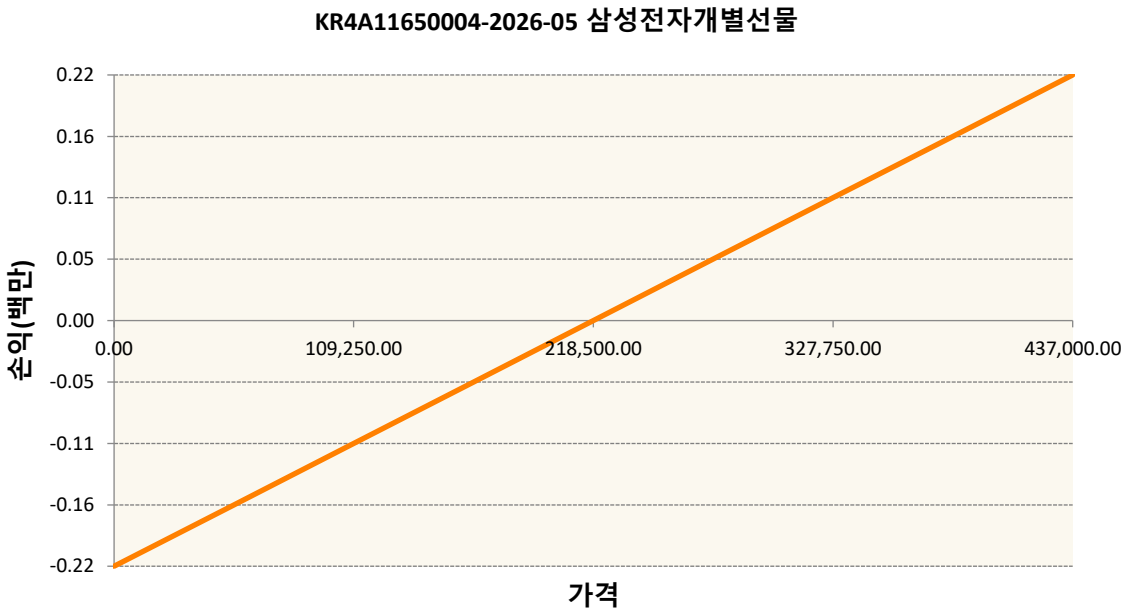
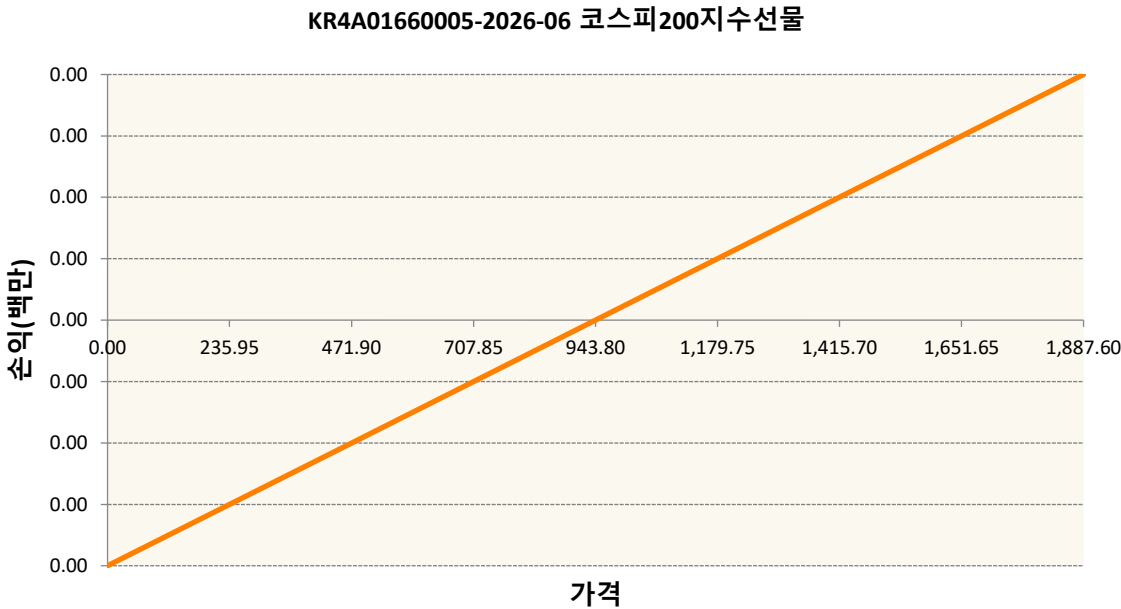
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	23,819	-23,819	장내
누계	유가증권	선물	12,471	23,525	-11,054	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between the price of a product and the profit it generates. The x-axis represents the price (가격) in thousands of won, ranging from 0.00 to 1,880.00. The y-axis represents the profit (이익) in thousands of won, ranging from 0.00 to 1,000.00. A blue line shows that as the price increases, the profit decreases linearly, starting at 1,000.00 when the price is 0.00 and reaching 0.00 when the price is 1,880.00.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	1,000.00
235.00	800.00
470.00	600.00
705.00	400.00
940.00	200.00
1,175.00	0.00
1,410.00	-200.00
1,645.00	-400.00
1,880.00	-600.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 1,885.00 with major ticks every 235.63. The y-axis represents the net income, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid blue line starts at the origin (0, 0.00) and extends to the point (1,885.00, 0.00), indicating a constant rate of change.

가액	순익 (백만)
0.00	0.00
235.63	0.00
471.25	0.00
706.88	0.00
942.50	0.00
1,178.13	0.00
1,413.75	0.00
1,649.38	0.00
1,885.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					488
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488
-5.33%	-325	-325	-325	-325	-325	-325	-325
-2.67%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	163	163	163	163	163	163	163
5.33%	325	325	325	325	325	325	325
8.00%	488	488	488	488	488	488	488
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물					505
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-505	-505	-505	-505	-505	-505	-505
-5.33%	-336	-336	-336	-336	-336	-336	-336
-2.67%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	168	168	168	168	168	168	168
5.33%	336	336	336	336	336	336	336
8.00%	505	505	505	505	505	505	505

KR4BAFB99406

코스피위클리M C 2604W3 940.0

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

KR4BAFB99422

코스피위클리M C 2604W3 942.5

750

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	750	750	750	750	750	750	750
-5.33%	500	500	500	500	500	500	500
-2.67%	250	250	250	250	250	250	250
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-250	-250	-250	-250	-250	-250	-250
5.33%	-500	-500	-500	-500	-500	-500	-500
8.00%	-750	-750	-750	-750	-750	-750	-750

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

(단위:백만원)

6,369

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

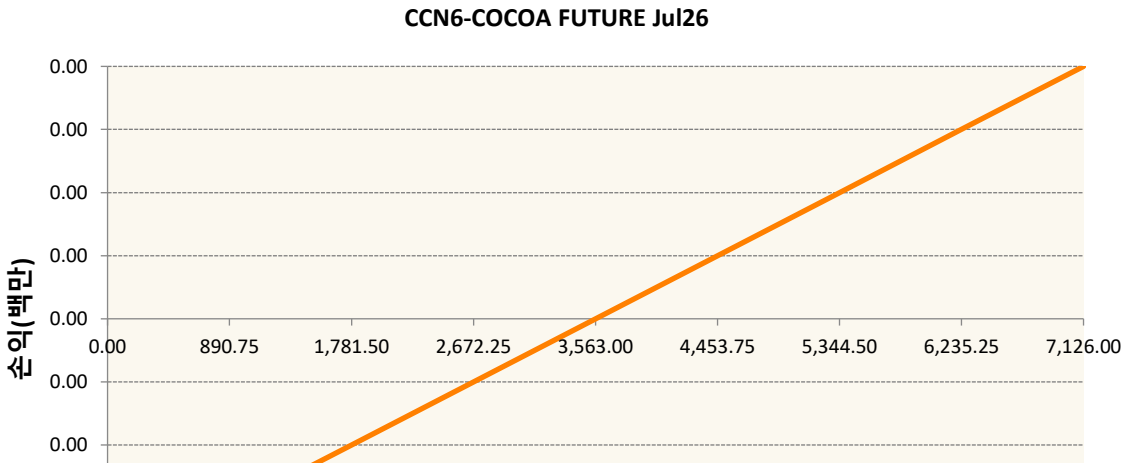
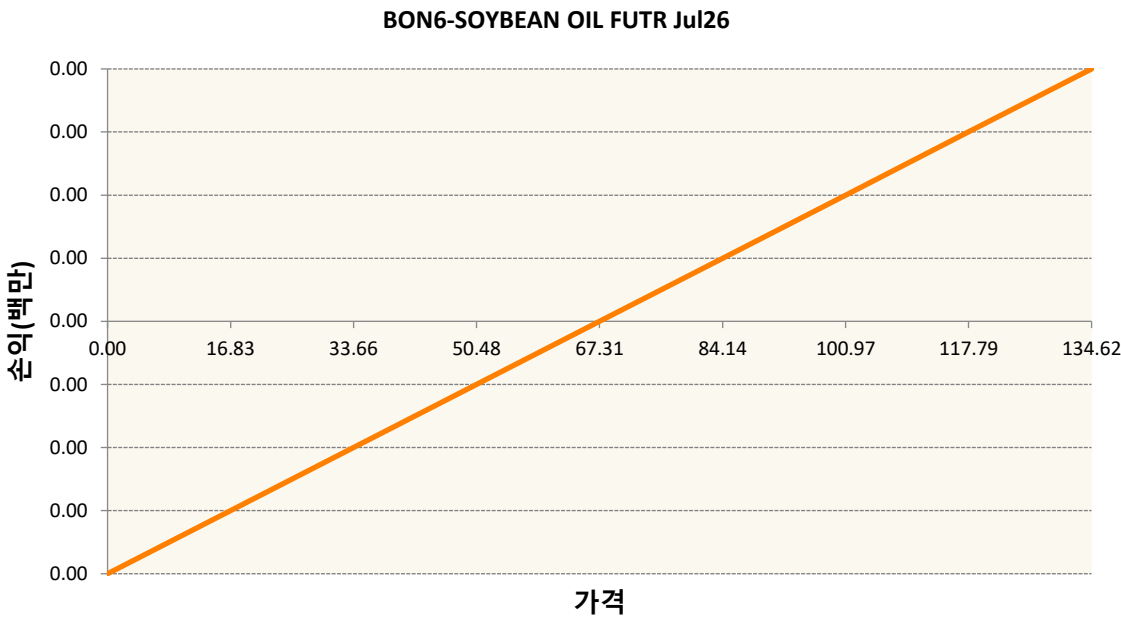
포커스농산물모(채권-파생형)

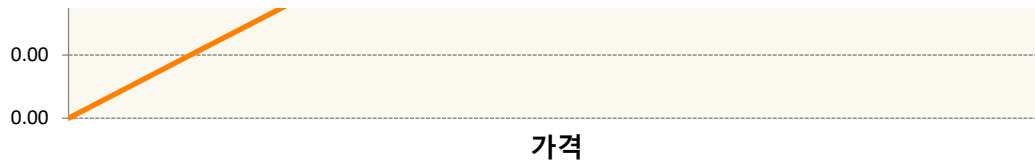
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

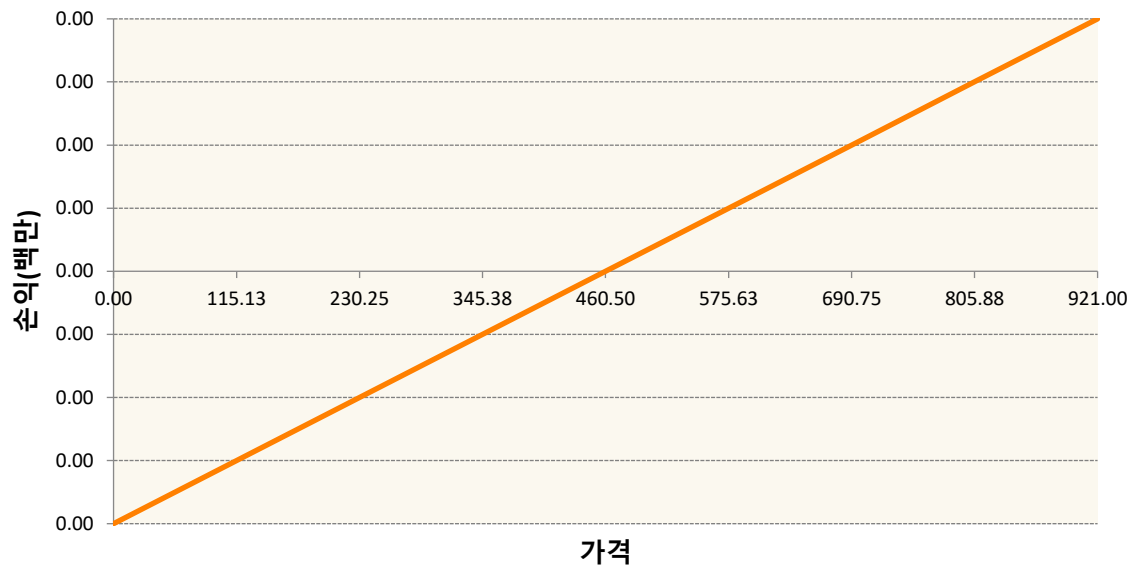
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	106	0	106	
누계	실물자산	선물	886	0	886	장내
누계	유가증권	선물	2,013	0	2,013	
누계	통화	선물	0	309	-309	장내

2. 만기시점의 손익구조

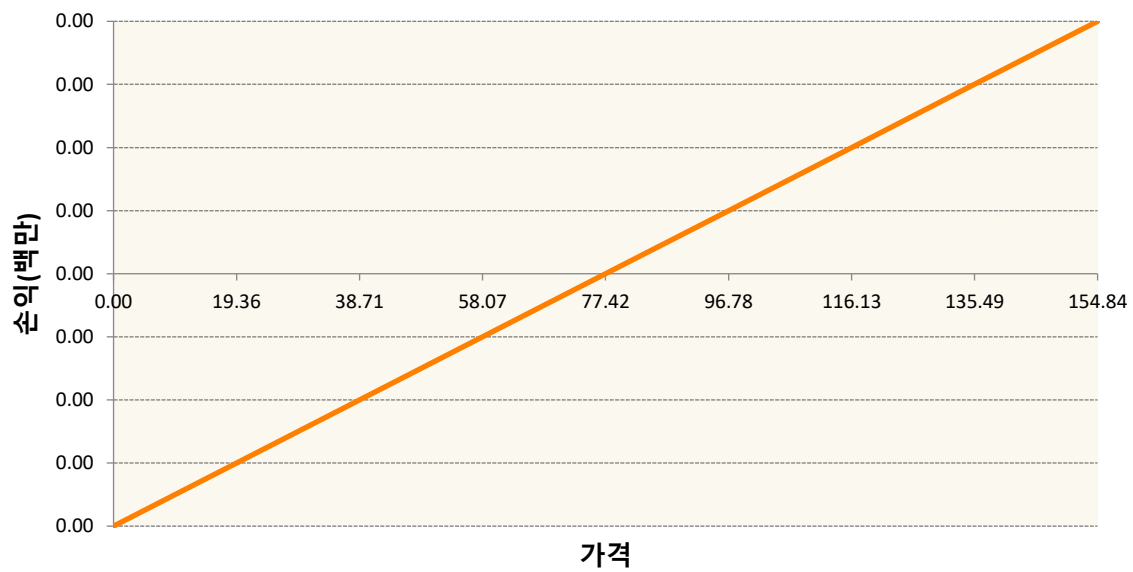




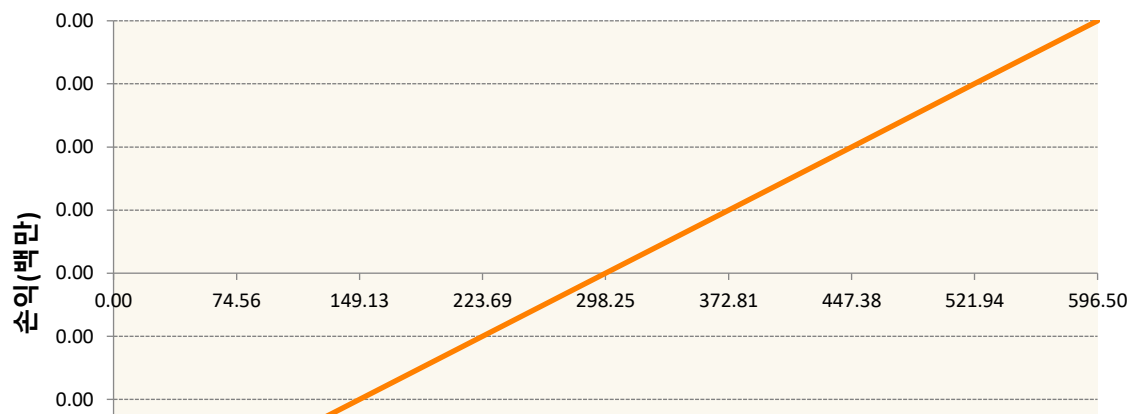
CN6-CORN FUTURE Jul26

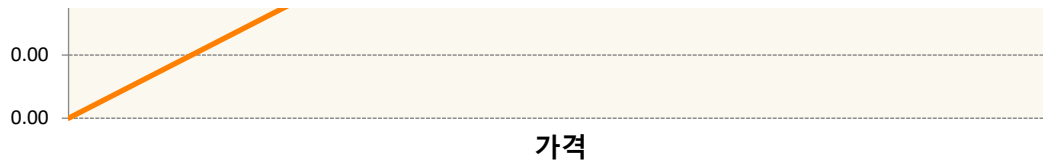


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

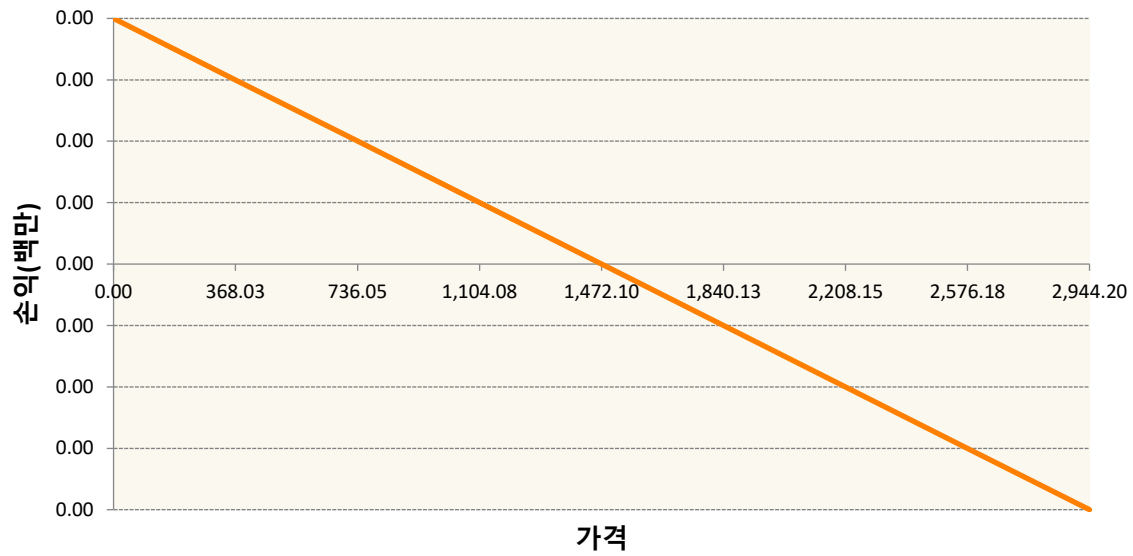


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

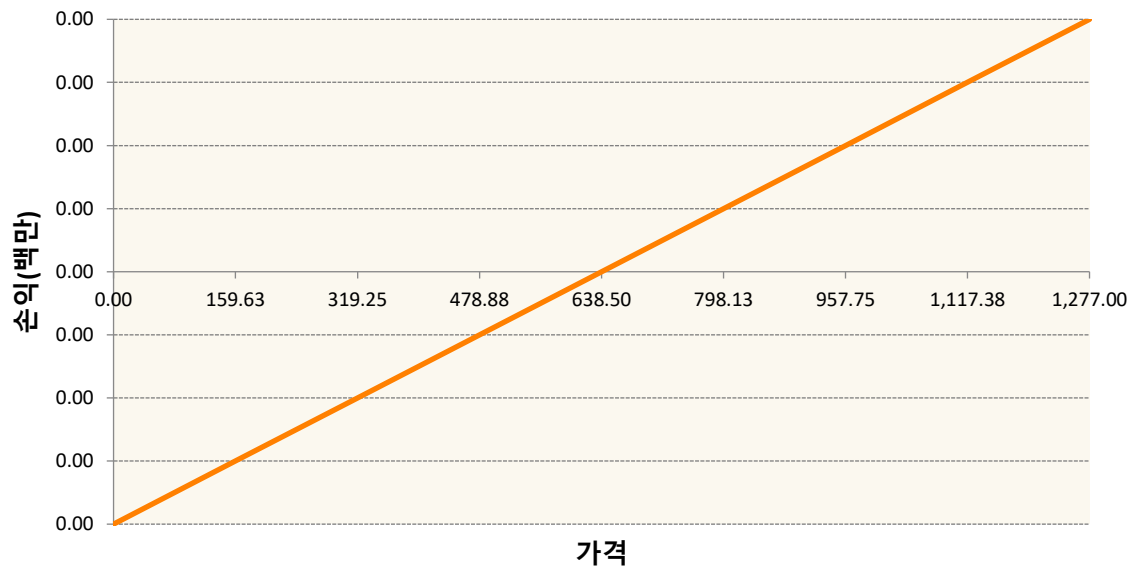




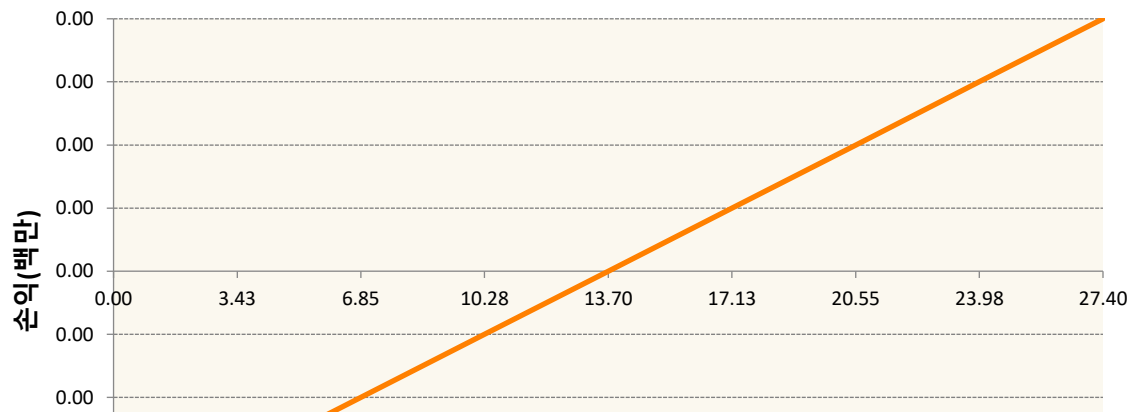
KR4A75650007-2026-05 달러선물

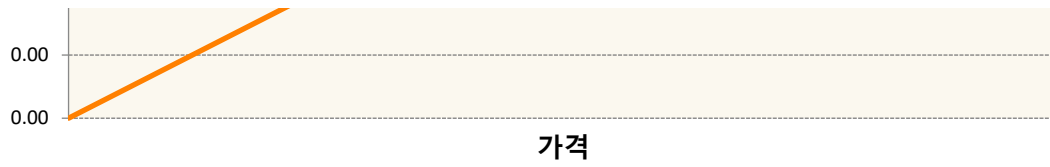


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

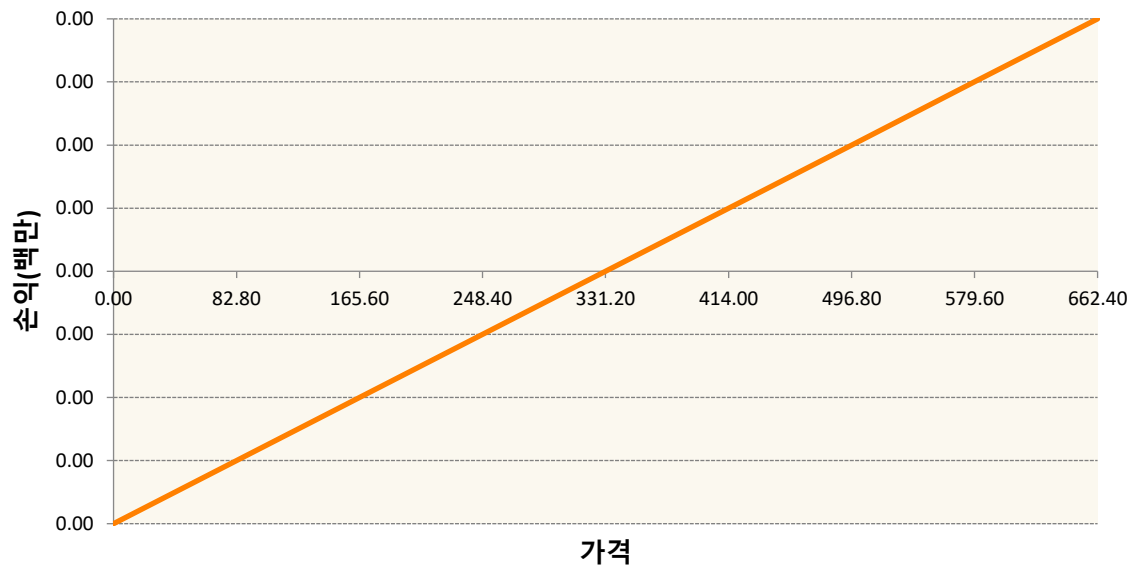


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

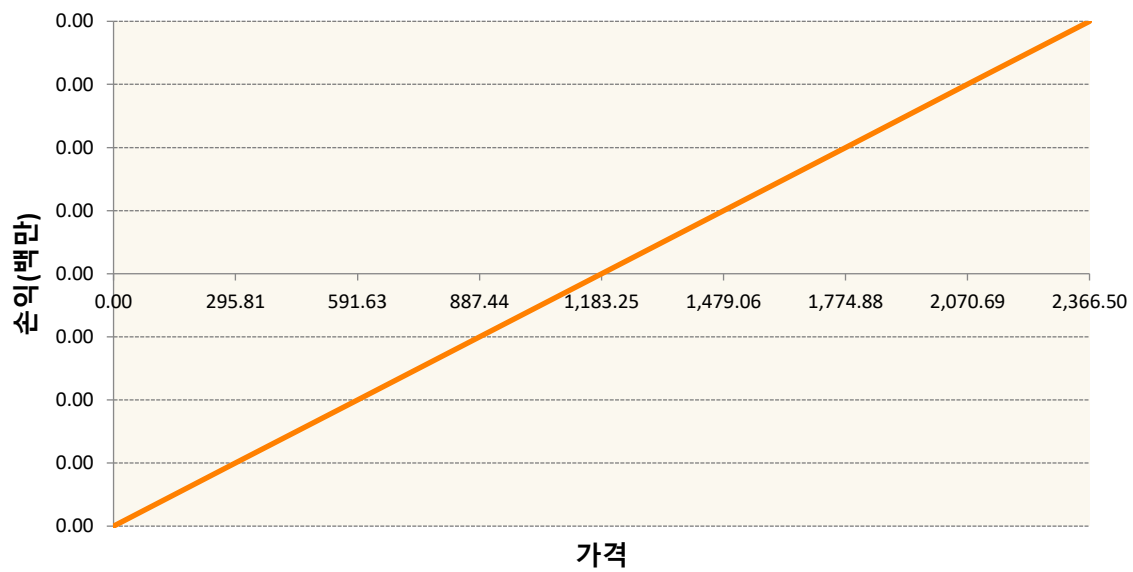




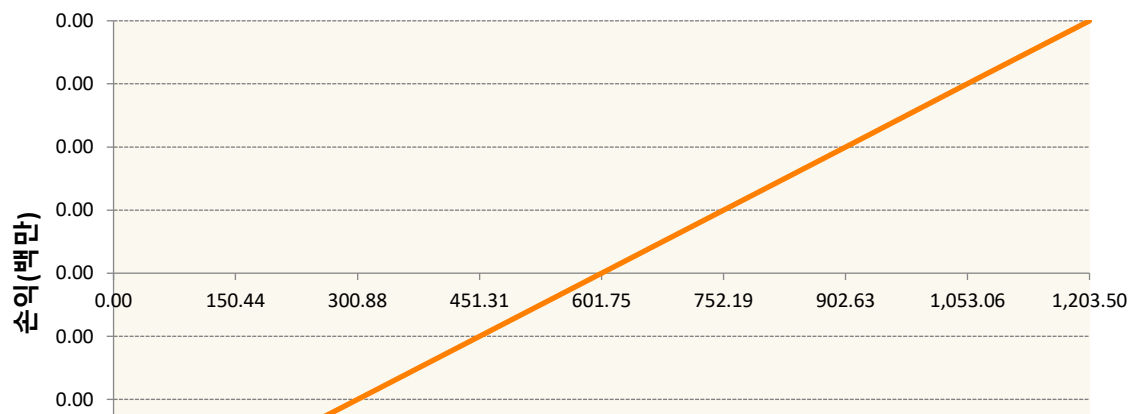
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

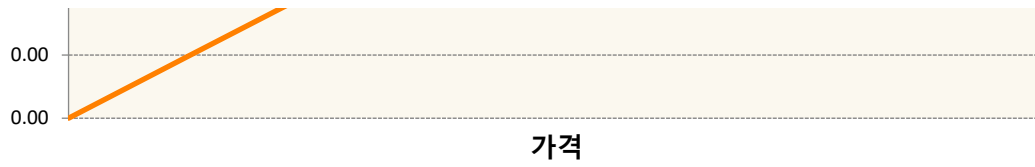


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



WN6-WHEAT FUTURE(CBT) 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	2026-04-17
기준일	2026-04-16

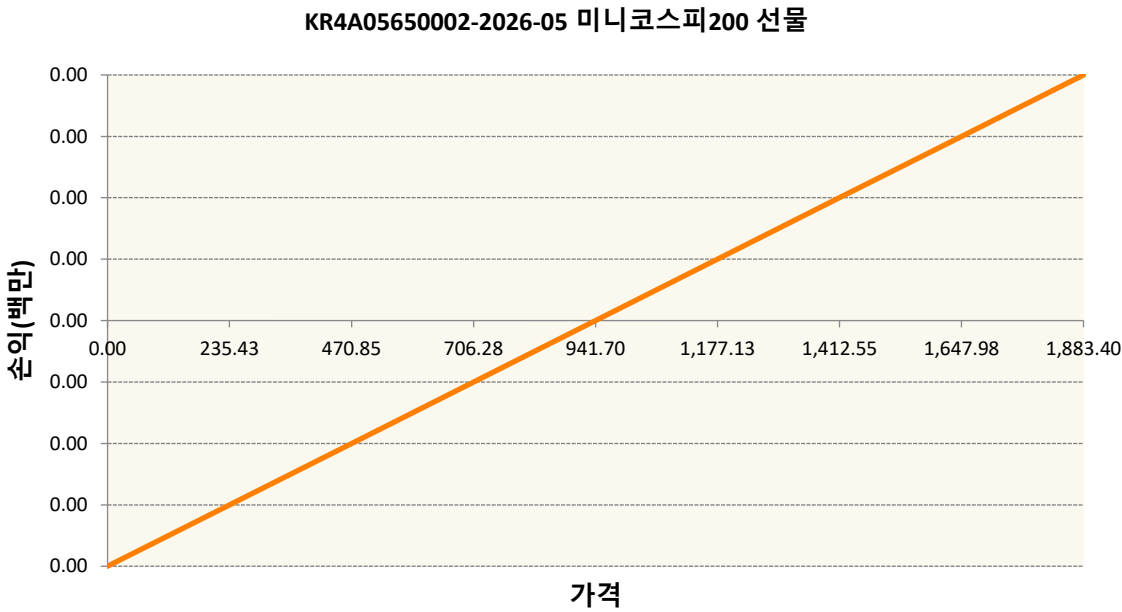
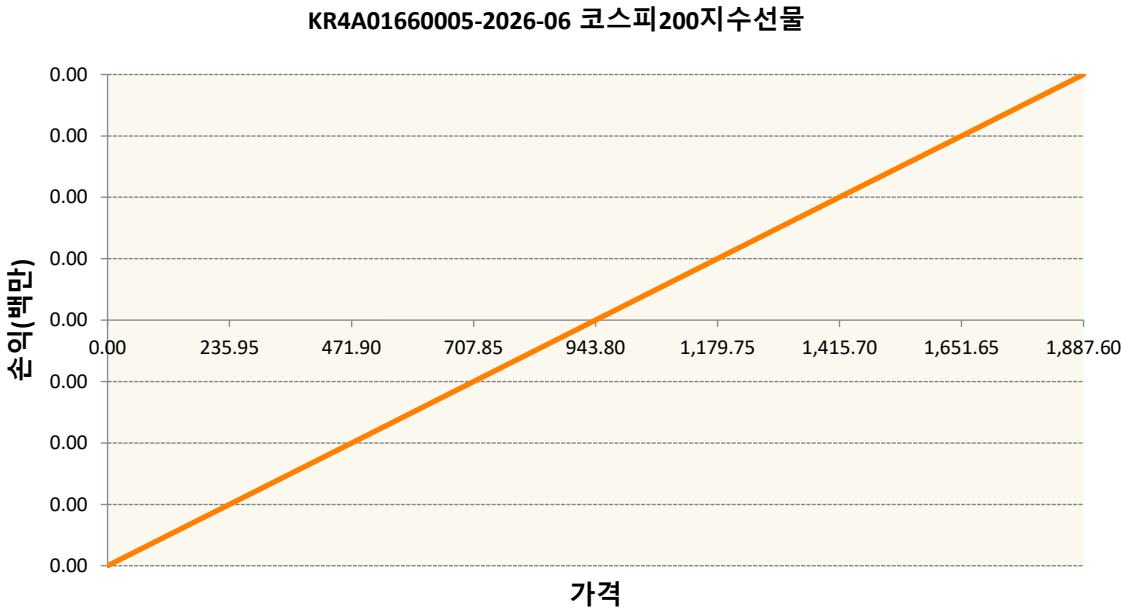
스마트인덱스모

1. 계약금액

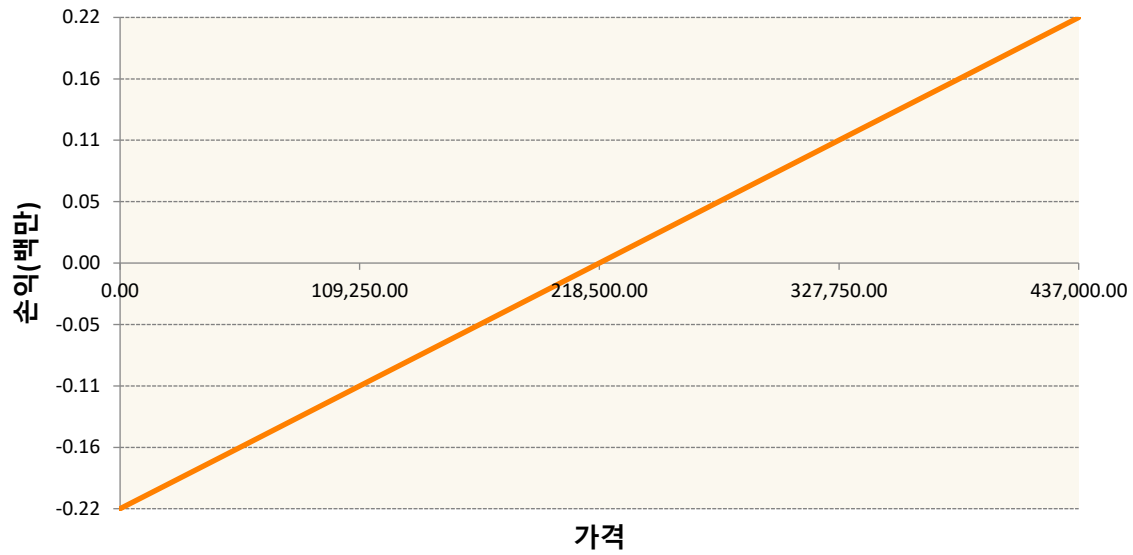
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	26	0	26	장내
누계	유가증권	선물	3,241	0	3,241	장내

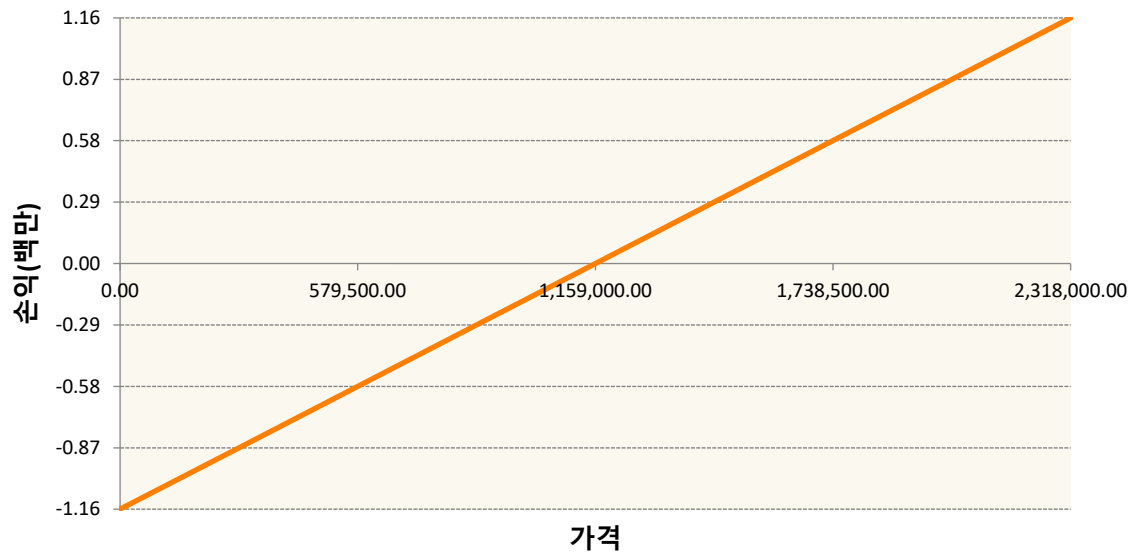
2. 만기시점의 손익구조



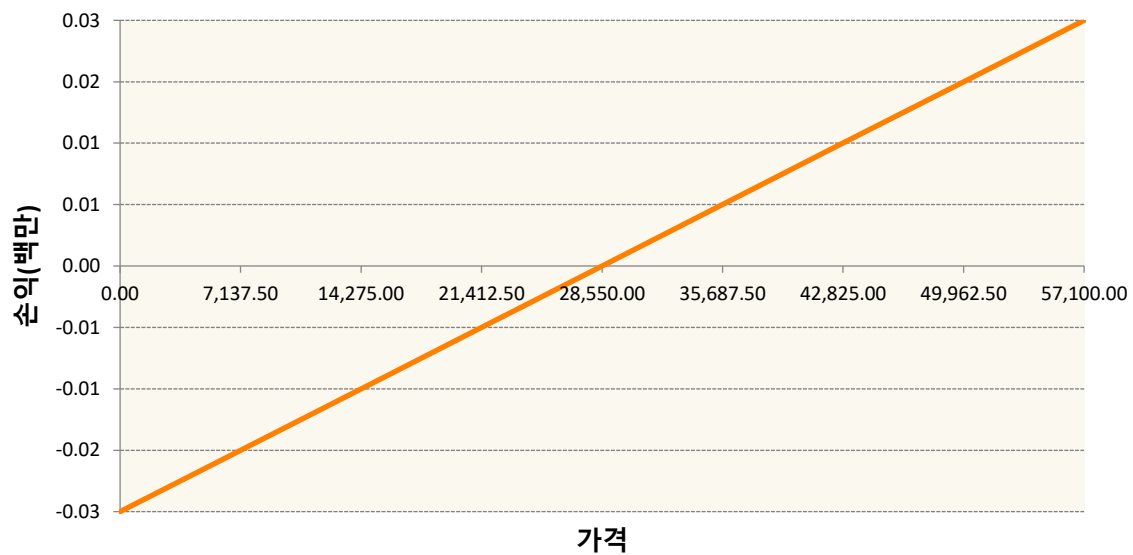
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		169		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169				
-5.33%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113				
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	56	56	56	56	56	56	56				
5.33%	113	113	113	113	113	113	113				
8.00%	169	169	169	169	169	169	169				
KR4A05650002							2026-05 미니코스피200 선물		8		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8				
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5				
-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%	5	5	5	5	5	5	5				
8.00%	8	8	8	8	8	8	8				
KR4A11650004							2026-05 삼성전자개별선물		39		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39				
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26				
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	13	13	13	13	13	13	13				
5.33%	26	26	26	26	26	26	26				
8.00%	39	39	39	39	39	39	39				
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%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7				
-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%	7	7	7	7	7	7	7				
8.00%	10	10	10	10	10	10	10				
KR4AFT650007							2026-05 대우건설개별선물		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
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-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%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

516

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

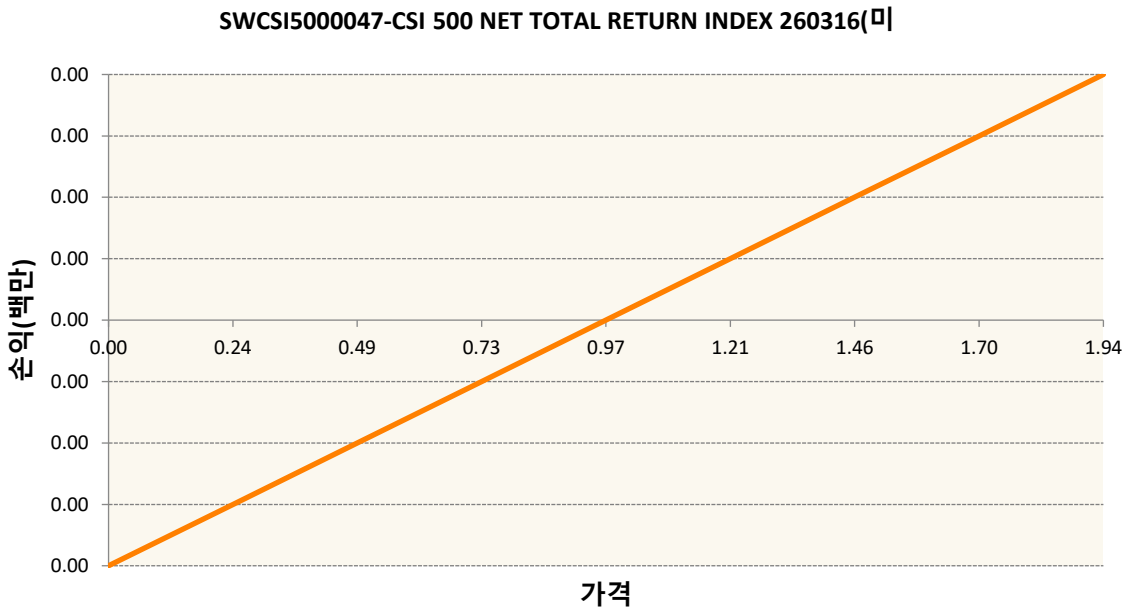
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,474	0	5,474	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

439

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

540

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

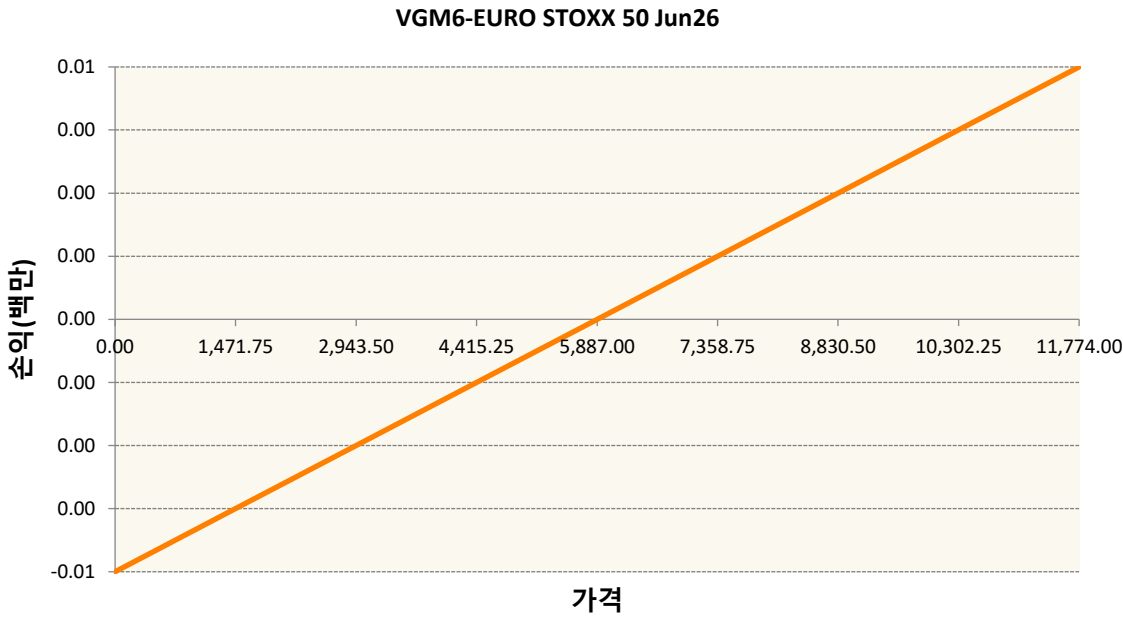
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	907	0	907	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

62

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

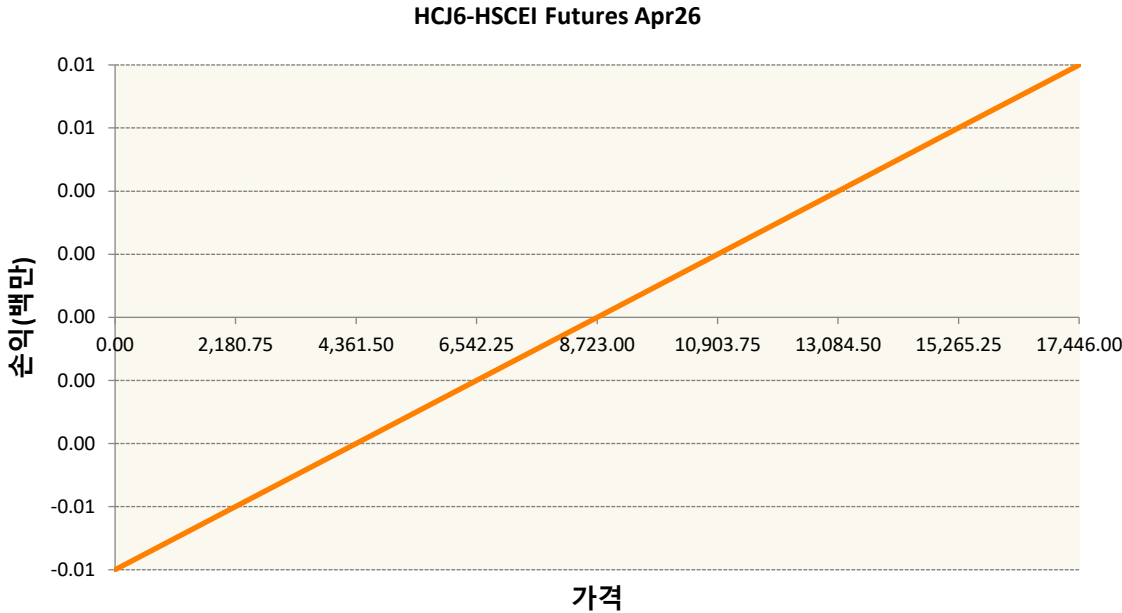
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,678	0	1,678	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ6	HSCEI Futures Apr26	134
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

164

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

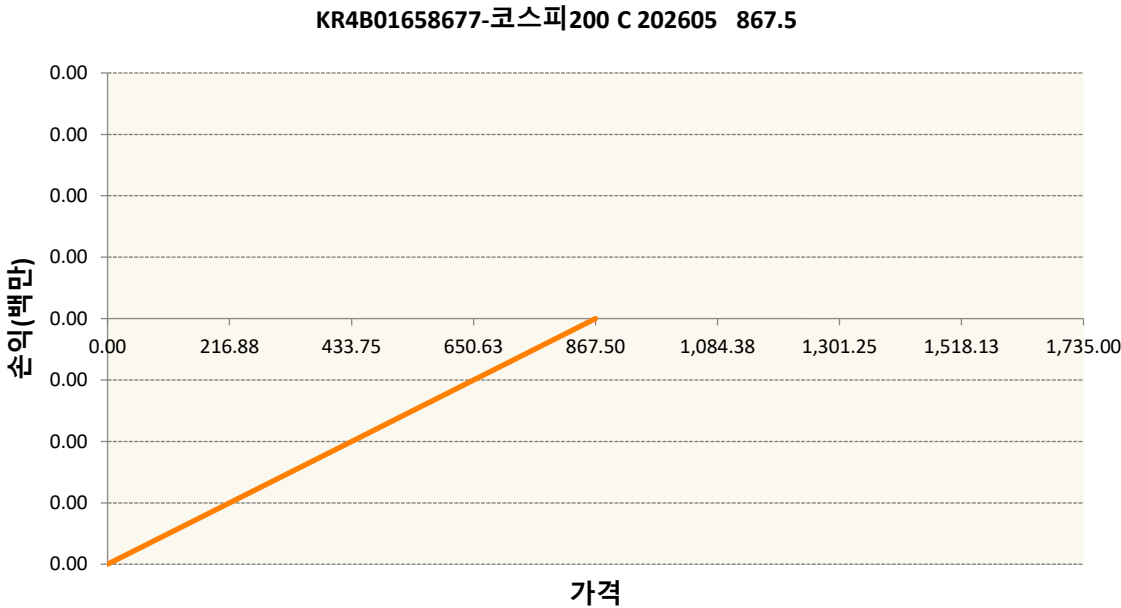
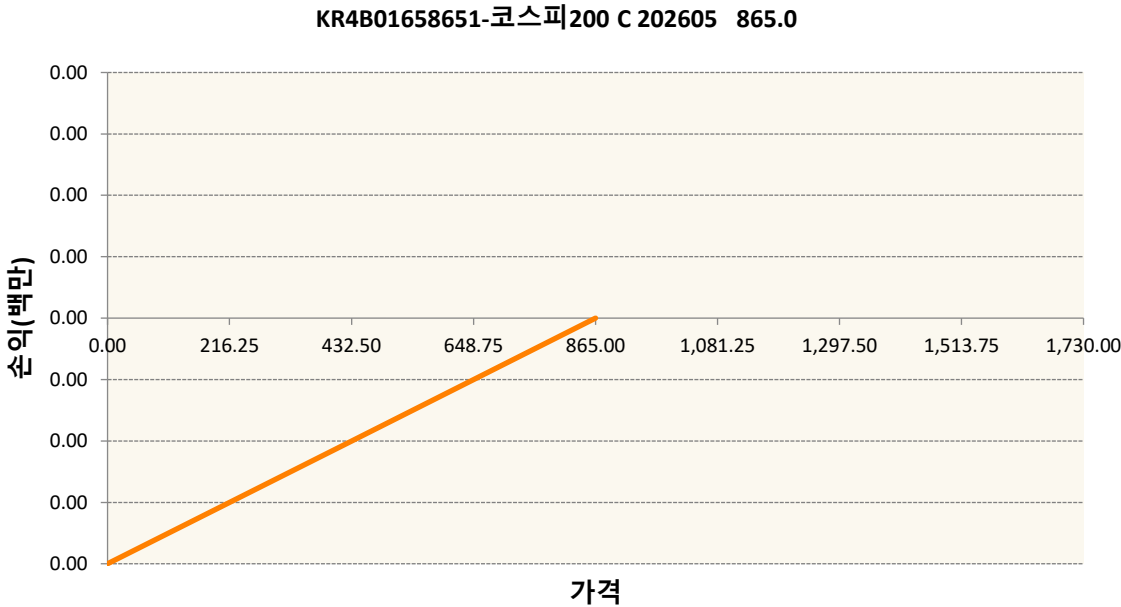
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

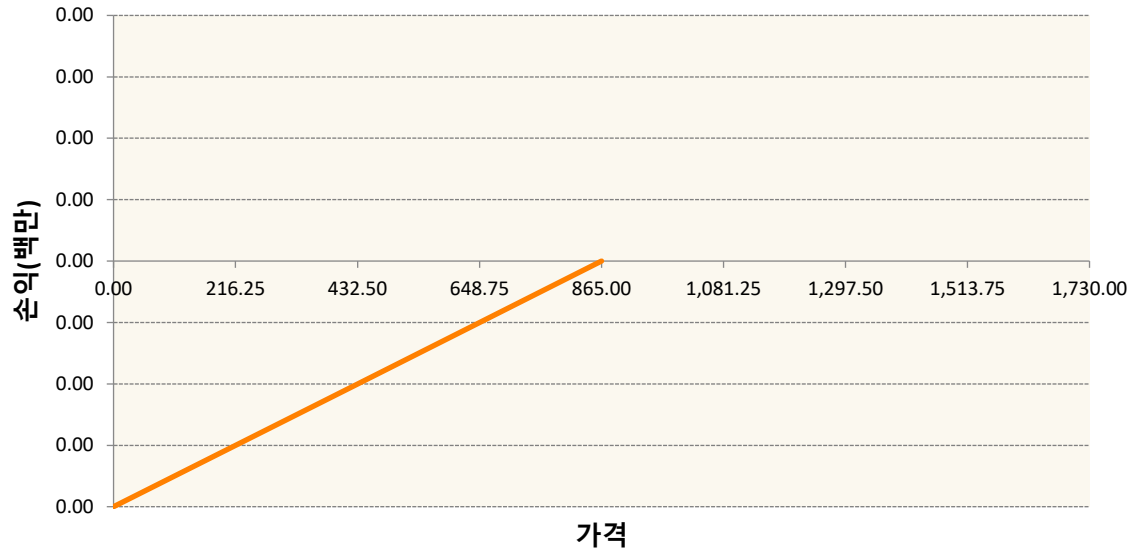
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	385	0	385	장내
누계	유가증권	옵션	0	36,363	-36,363	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0							812
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-309	-393	-477	-560	-644	-728	-812
-5.33%	-86	-169	-252	-335	-419	-502	-586
-2.67%	84	8	-70	-150	-230	-311	-392
0%	209	142	73	0	-75	-151	-229
2.67%	297	242	182	118	51	-19	-91
5.33%	357	314	264	209	150	88	22
8.00%	396	363	324	279	228	173	115
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							516
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-201	-253	-306	-358	-411	-464	-516
-5.33%	-58	-110	-162	-215	-267	-320	-373
-2.67%	52	4	-46	-96	-147	-198	-249
0%	133	91	46	0	-47	-96	-145
2.67%	191	155	117	76	33	-11	-57
5.33%	230	202	170	135	97	57	16
8.00%	256	234	209	180	147	112	75
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							323
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-123	-156	-189	-223	-256	-289	-323
-5.33%	-34	-67	-100	-133	-166	-200	-233
-2.67%	33	3	-28	-59	-91	-124	-156
0%	83	57	29	0	-30	-60	-91

2.67%	118	96	72	47	20	-8	-36
5.33%	142	125	105	83	60	35	9
8.00%	158	144	129	111	91	69	46

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

(단위:백만원)

1,933

공시일 2026-04-17

기준일 2026-04-16

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	2026-04-17
기준일	2026-04-16

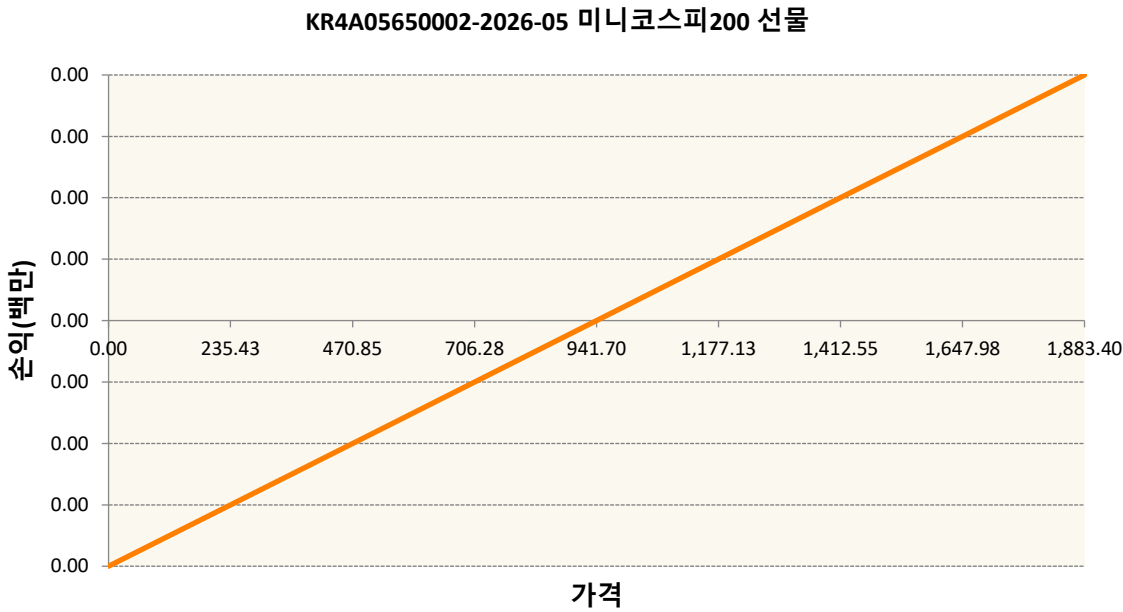
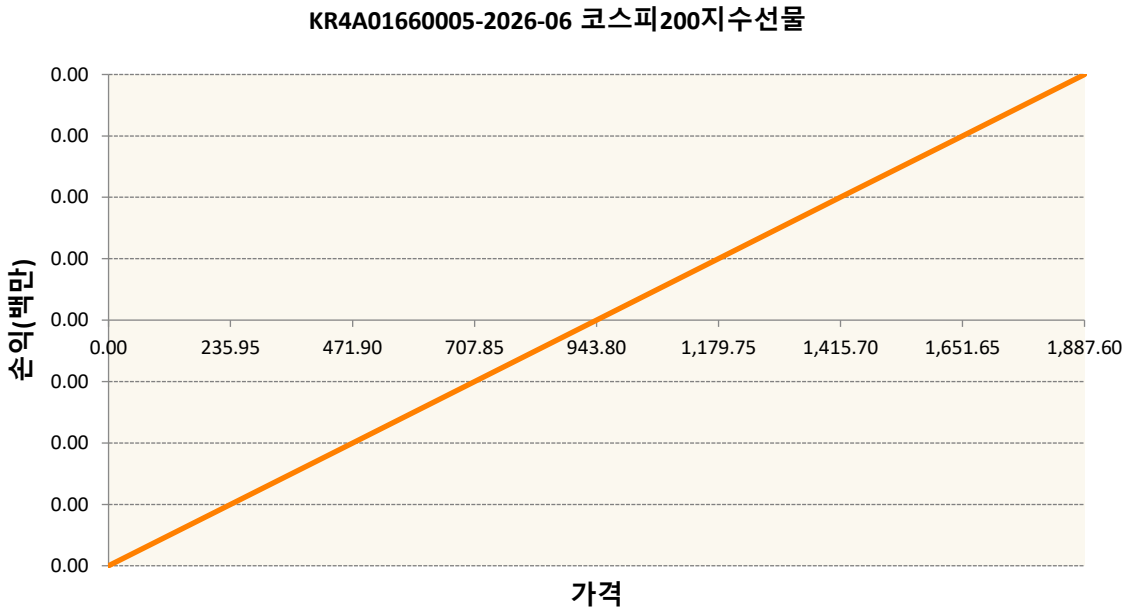
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

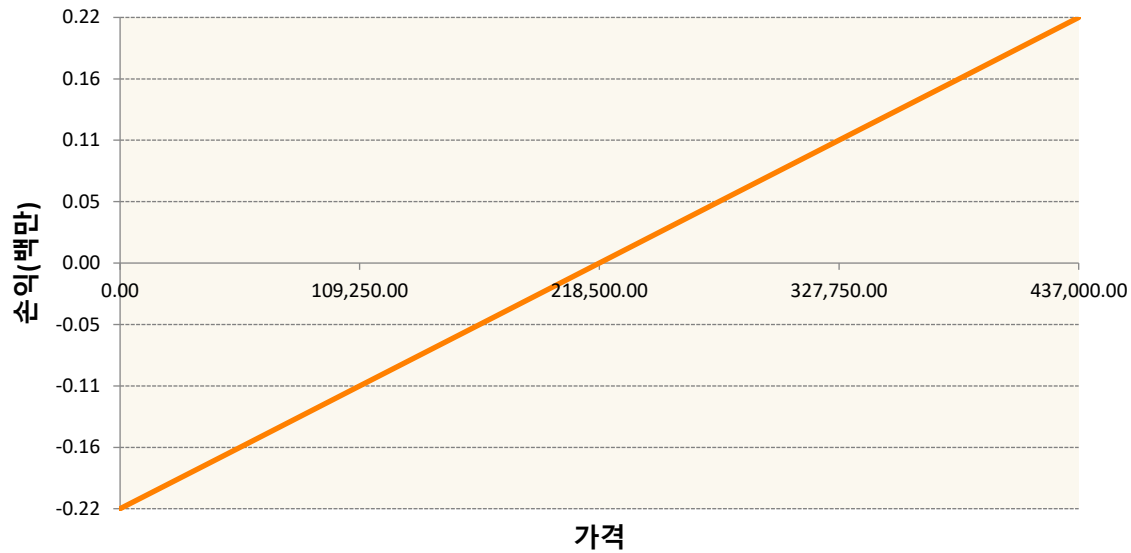
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,176	0	3,176	장내

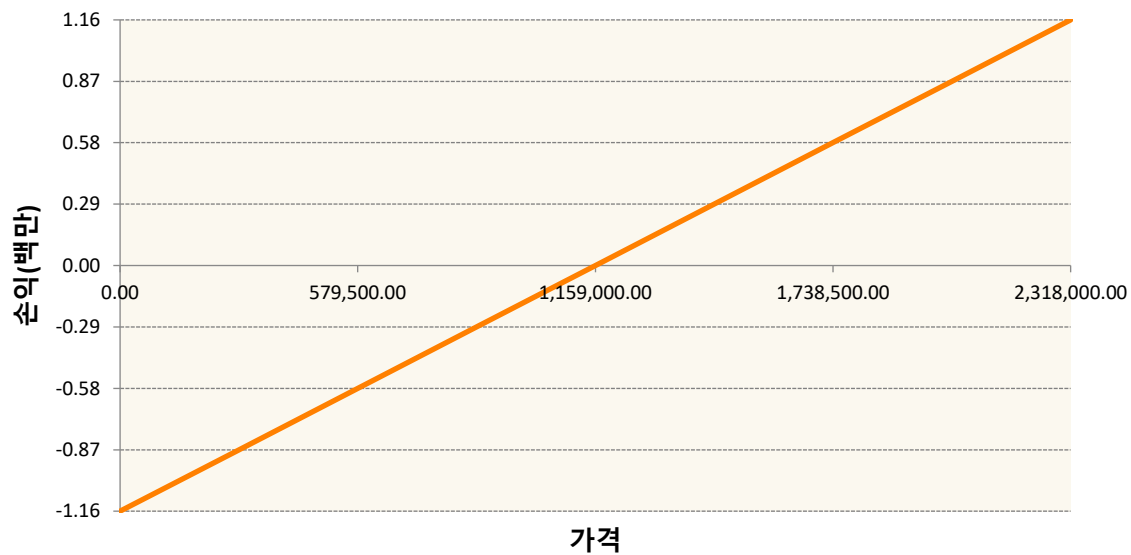
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				94
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94	
-5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63	
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	31	31	31	31	31	31	31	
5.33%	63	63	63	63	63	63	63	
8.00%	94	94	94	94	94	94	94	
KR4A05650002				2026-05 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
-5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	20	20	20	20	20	20	20
8.00%	30	30	30	30	30	30	30

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
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-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%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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)

292

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

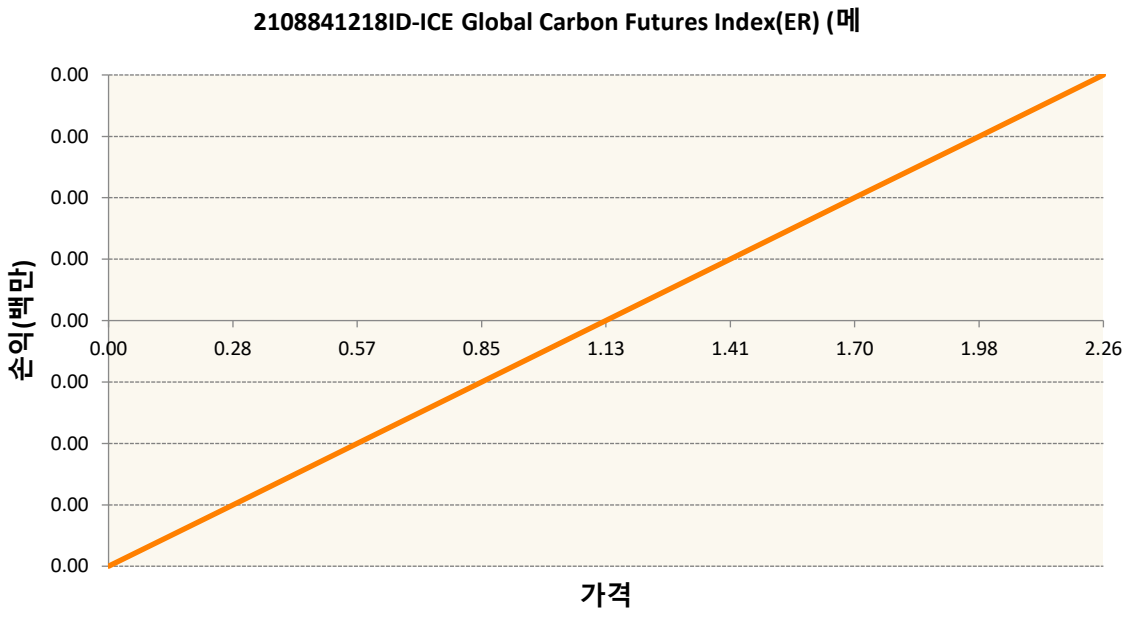
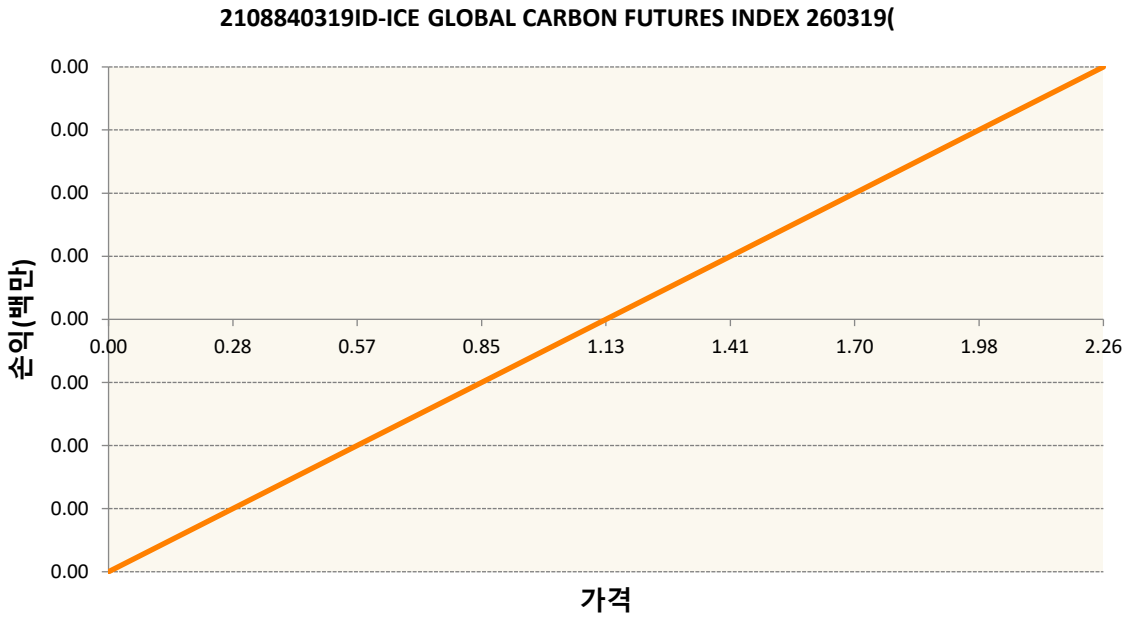
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,493	0	6,493	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		415
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		104

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	586

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

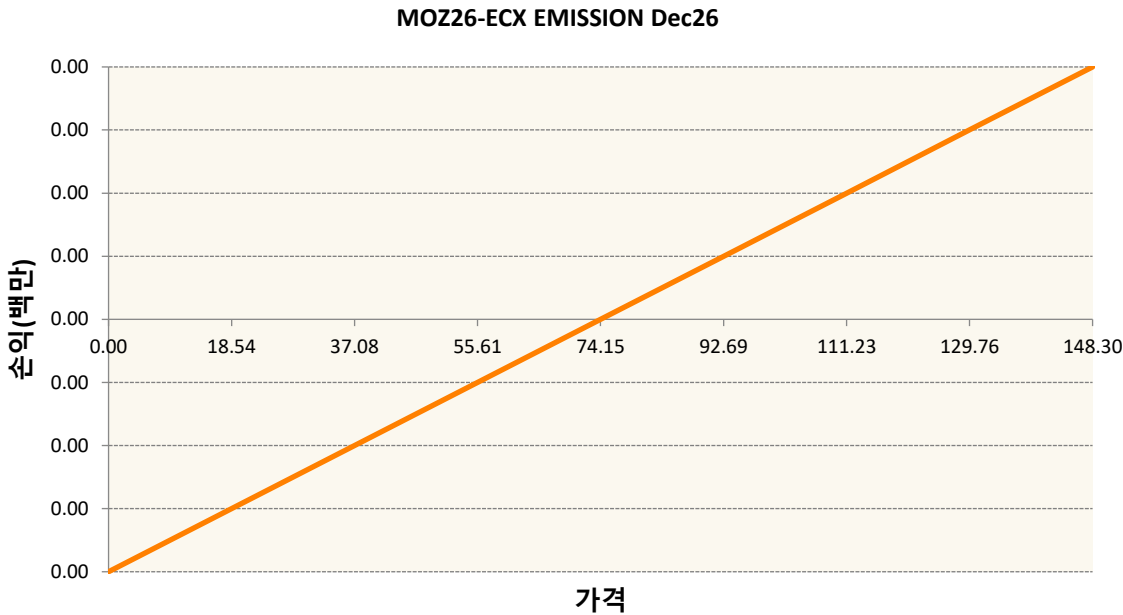
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,779	0	4,779	
누계	통화	선도	0	2,205	-2,205	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E	176
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	382

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

(단위:백만원)

658

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

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)	16
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	6

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

(단위:백만원)

59

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

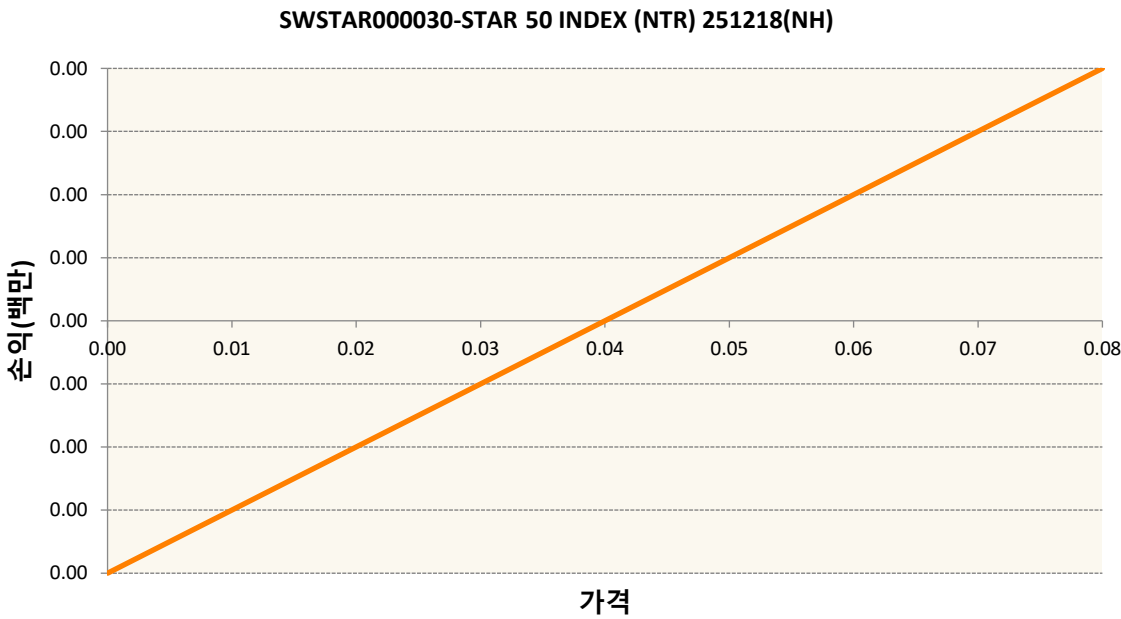
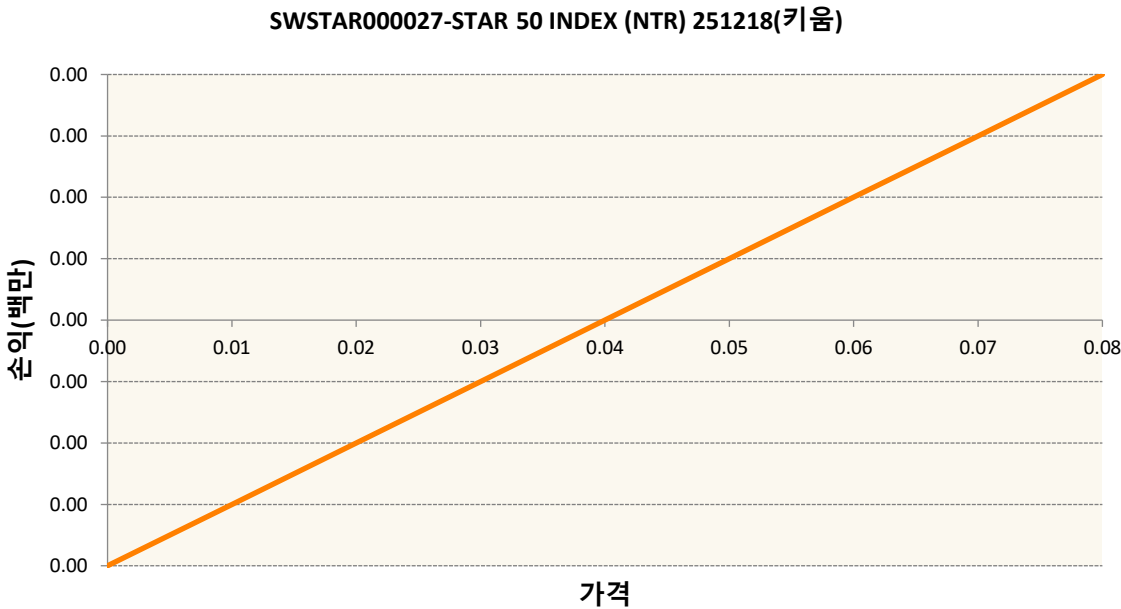
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

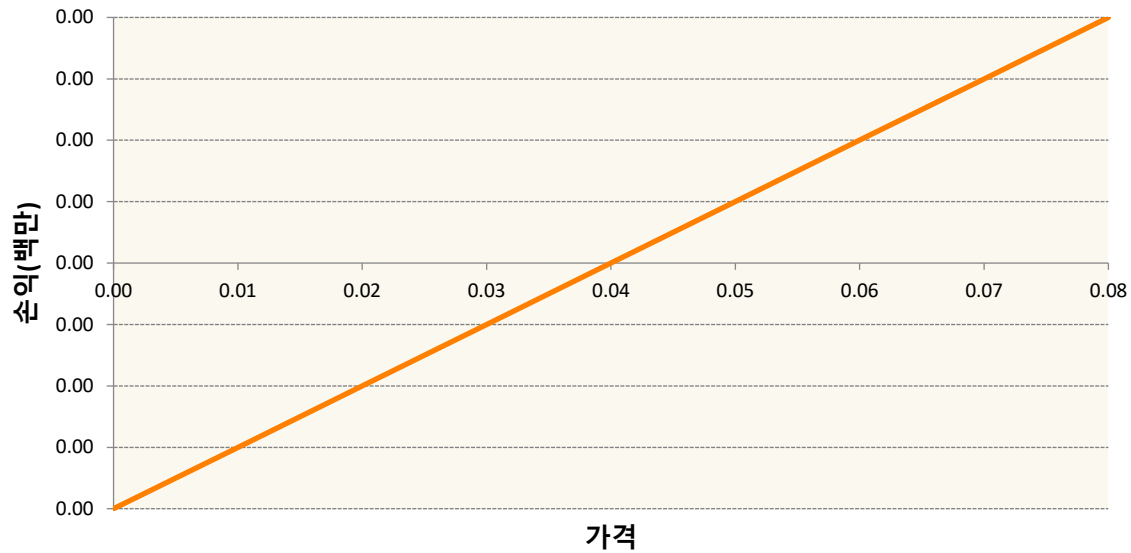
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	1,012	0	1,012	장외

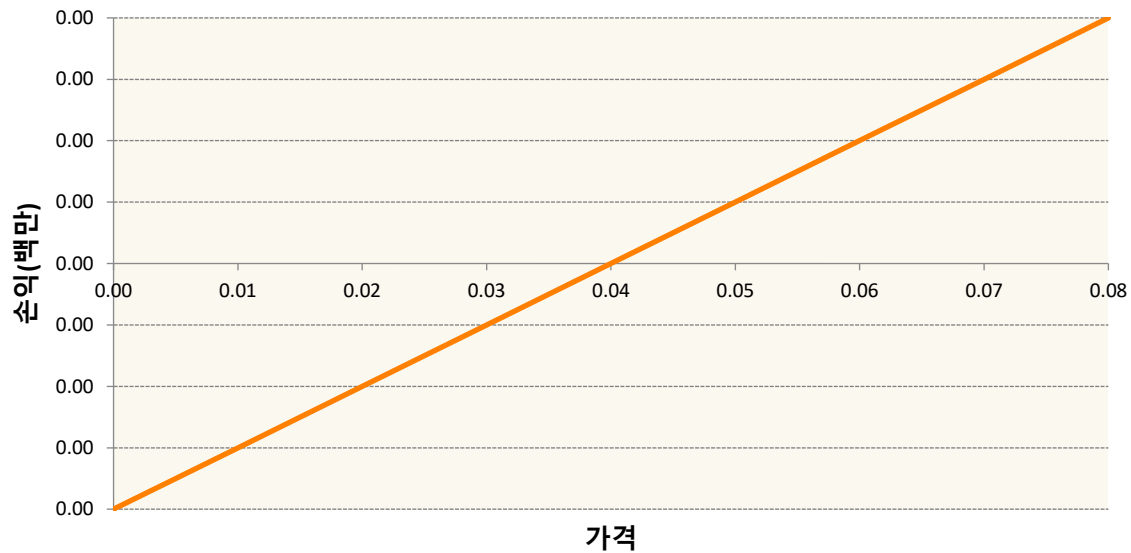
2. 만기시점의 손익구조



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)

3
9
48
18

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

(단위:백만원)

117

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

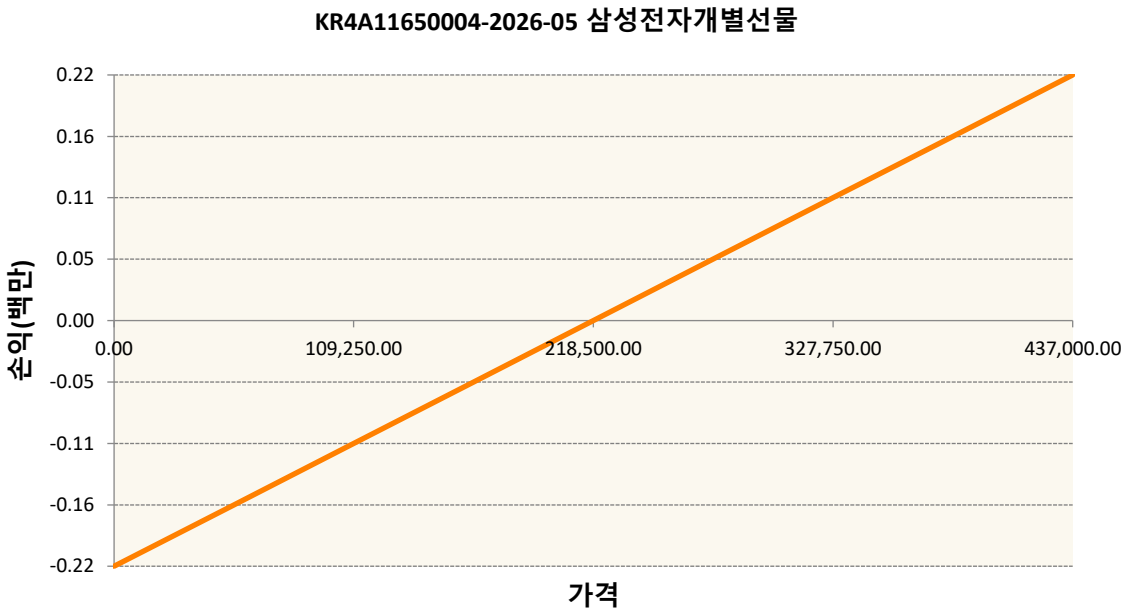
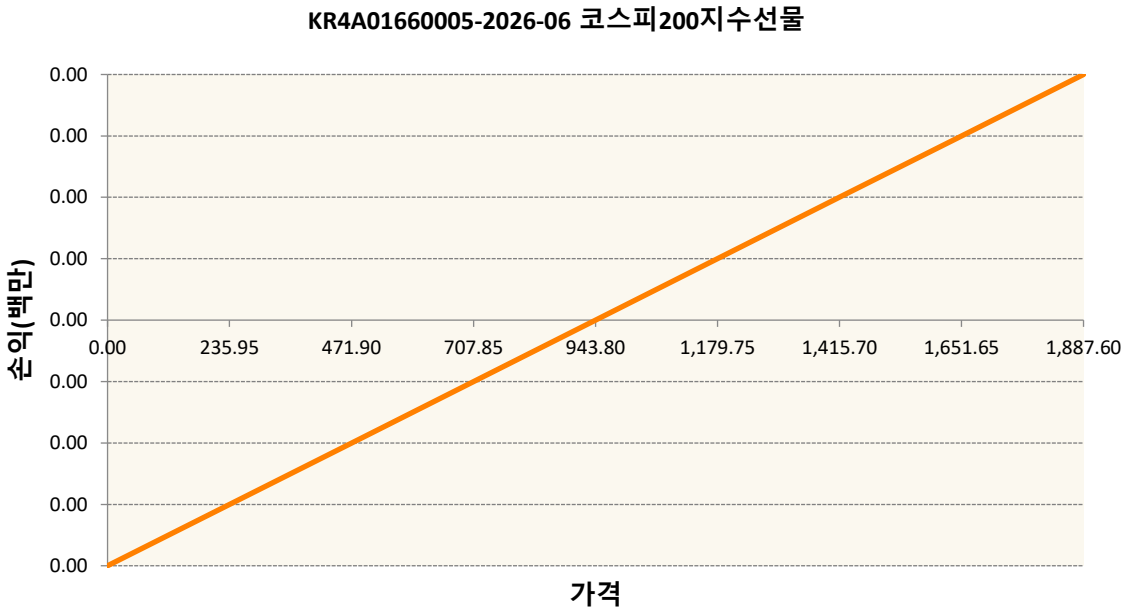
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

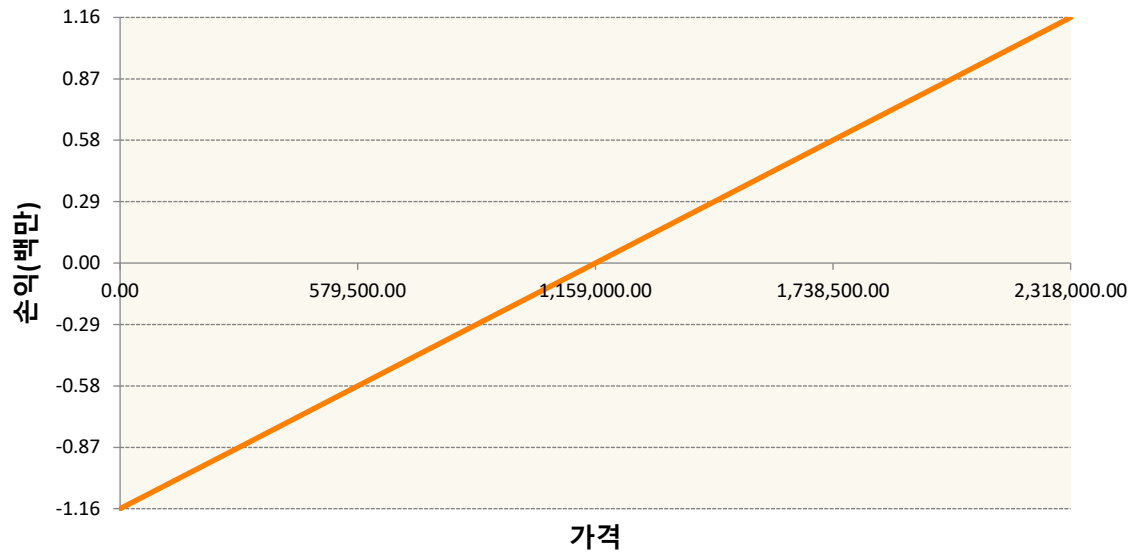
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	760	470	290	장내
누계	유가증권	선물	19,847	1,861	17,985	장내

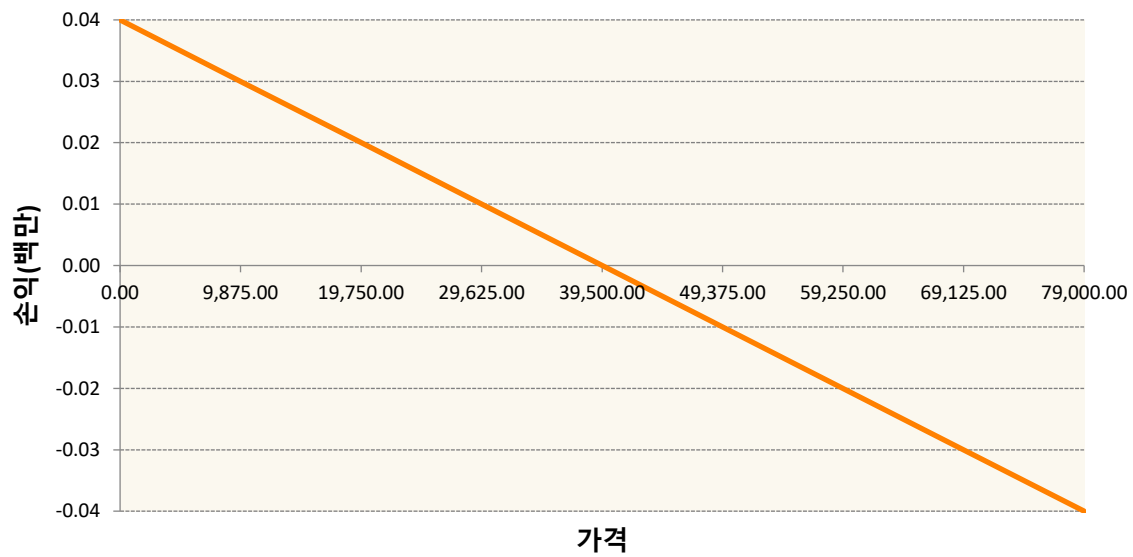
2. 만기시점의 손익구조



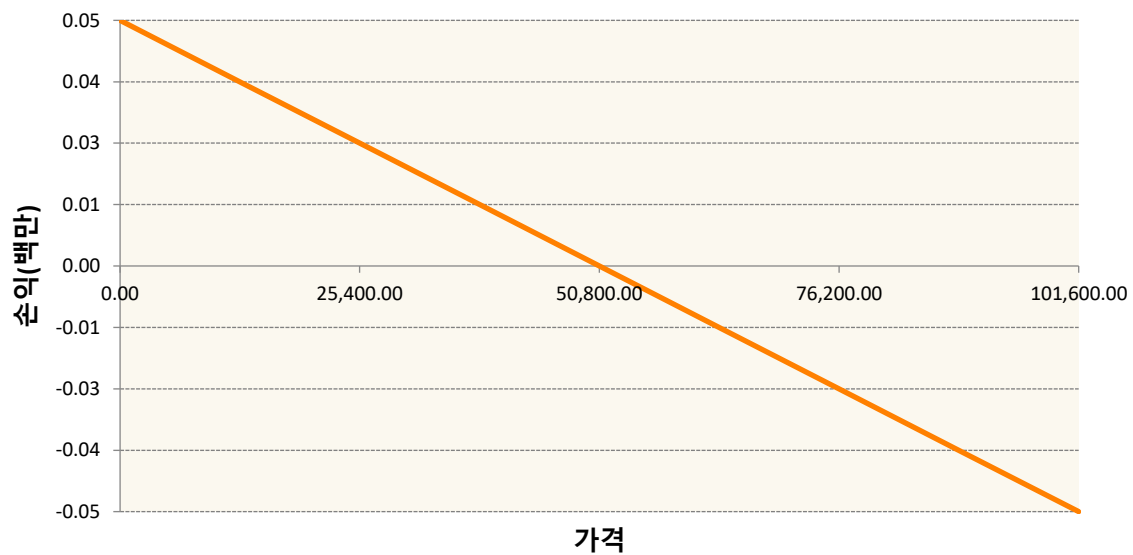
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



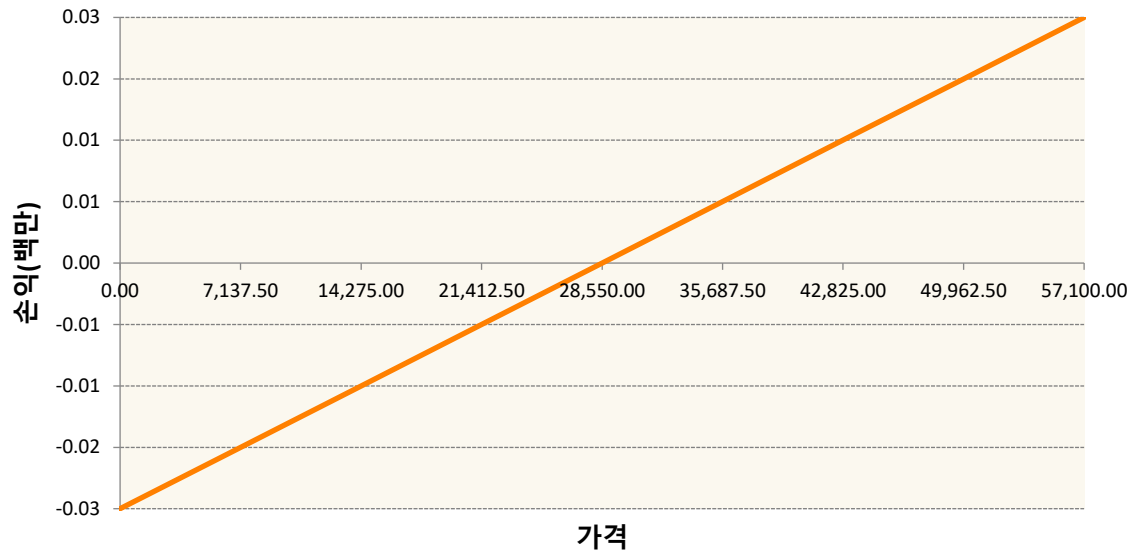
KR4A51650005-2026-05 GS건설개별선물



KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								1,238
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,238	-1,238	-1,238	-1,238	-1,238	-1,238	-1,238	-1,238
-5.33%	-825	-825	-825	-825	-825	-825	-825	-825
-2.67%	-413	-413	-413	-413	-413	-413	-413	-413
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	413	413	413	413	413	413	413	413
5.33%	825	825	825	825	825	825	825	825
8.00%	1,238	1,238	1,238	1,238	1,238	1,238	1,238	1,238
KR4A11650004 2026-05 삼성전자개별선물								180
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
-5.33%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	120	120	120	120	120	120	120	120
8.00%	180	180	180	180	180	180	180	180
KR4A50650006 2026-05 SK하이닉스개별선물								100
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100
-5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	67	67	67	67	67	67	67
8.00%	100	100	100	100	100	100	100
KR4A51650005 2026-05 GS건설개별선물							19
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19	19	19	19	19	19	19
-5.33%	13	13	13	13	13	13	13
-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%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
KR4ACF650006 2026-05 카카오개별선물							129
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	129	129	129	129	129	129	129
-5.33%	86	86	86	86	86	86	86
-2.67%	43	43	43	43	43	43	43
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
5.33%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
8.00%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
KR4AFT650007 2026-05 대우건설개별선물							61
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	20	20	20	20	20	20	20
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	61	61	61	61	61	61	61

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

(단위:백만원)

3,814

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

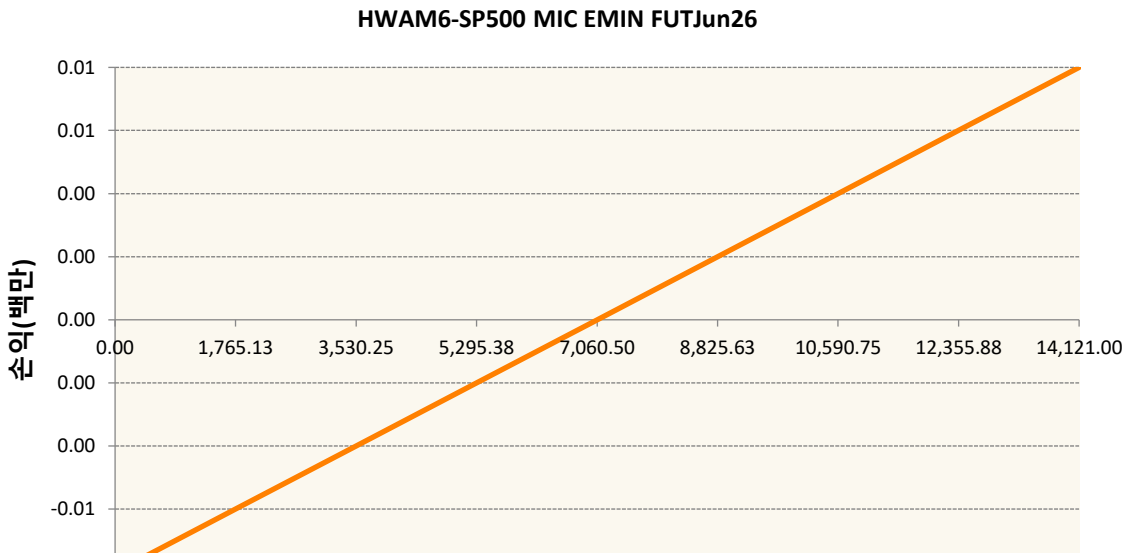
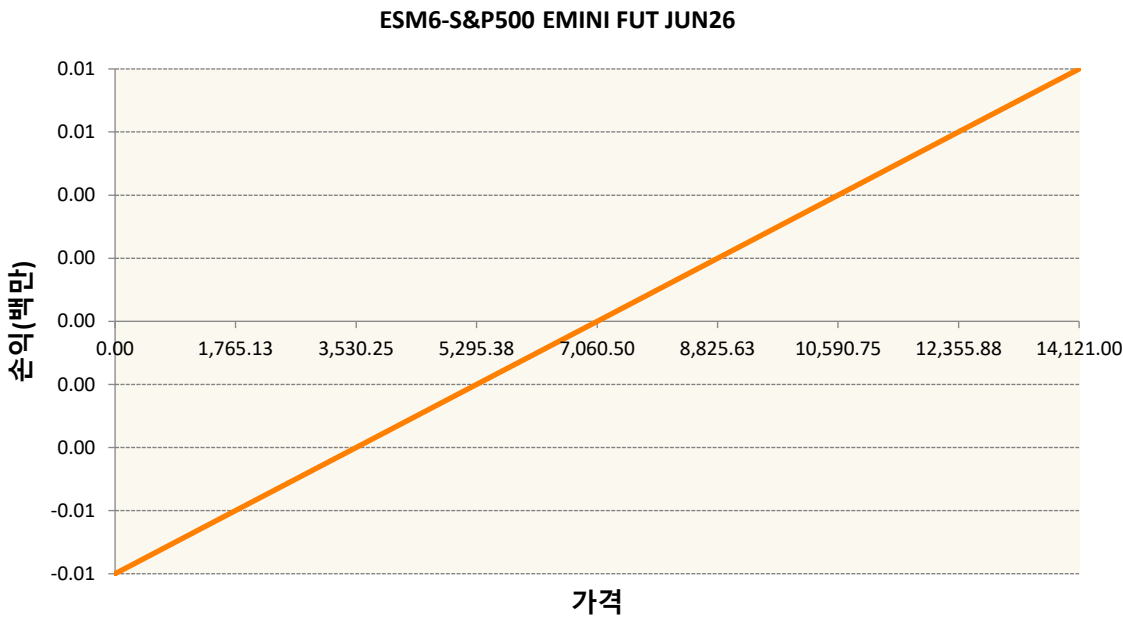
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

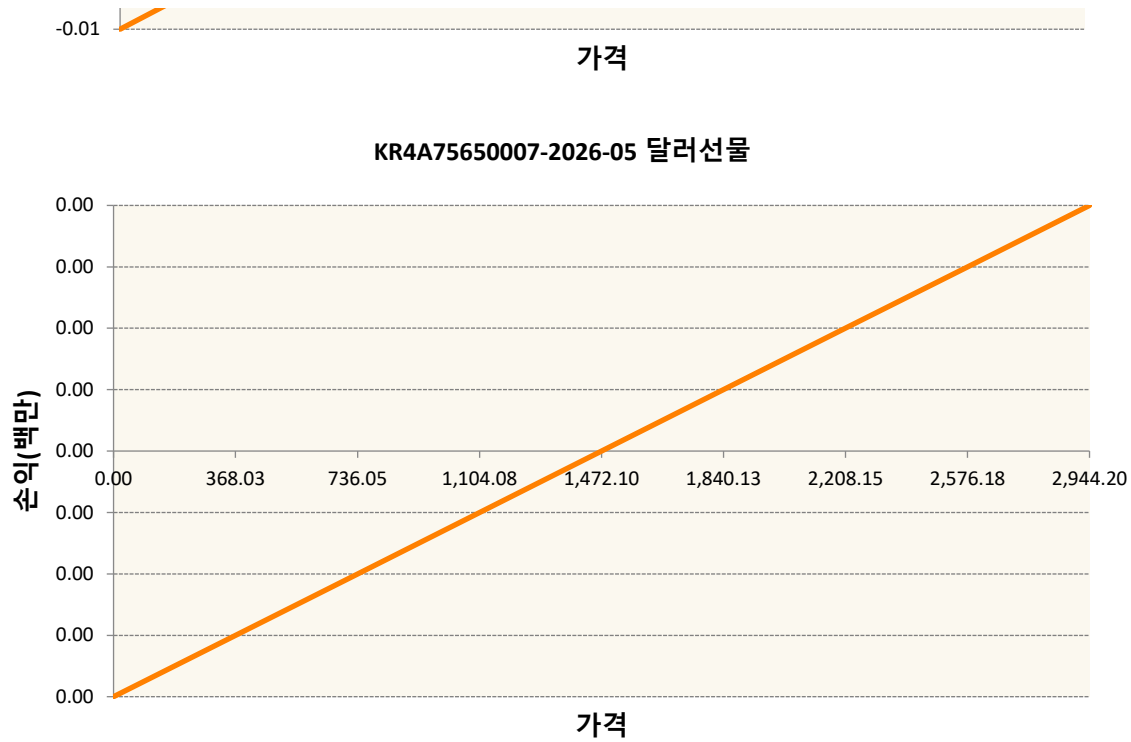
1. 계약금액

(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	57,192	0	57,192	
누계	지수	선물	160	0	160	장내
누계	통화	선물	10,452	0	10,452	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,575
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		13
KR4A756500 2026-05 달러선물			836

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,989

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

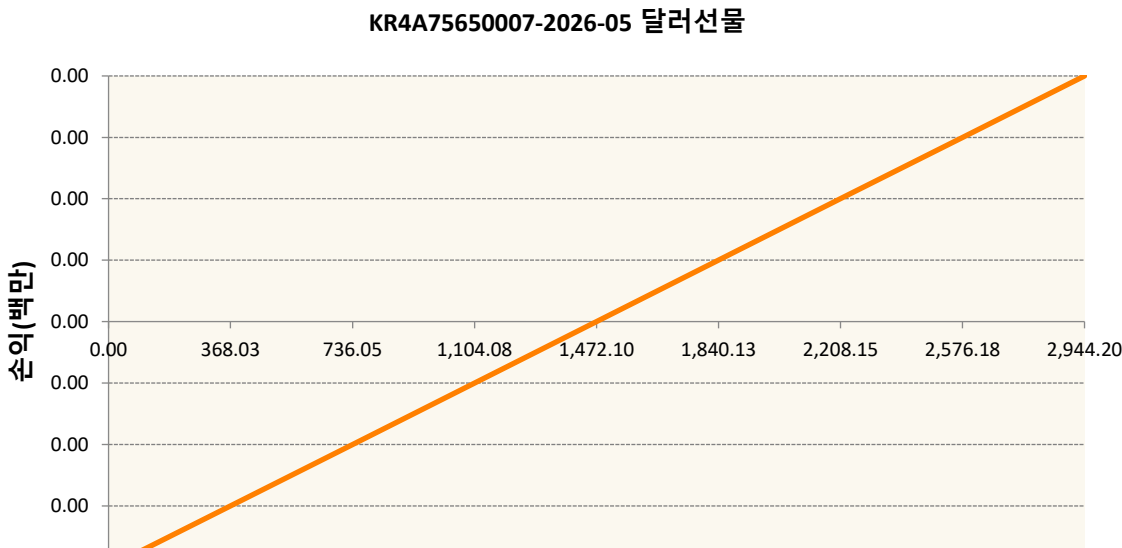
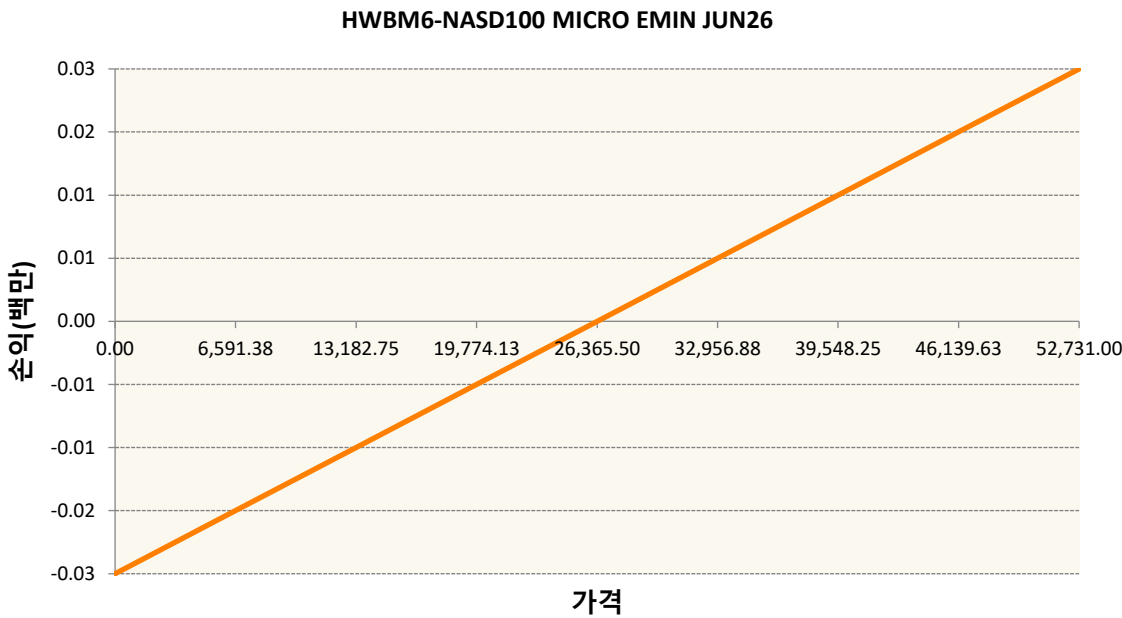
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

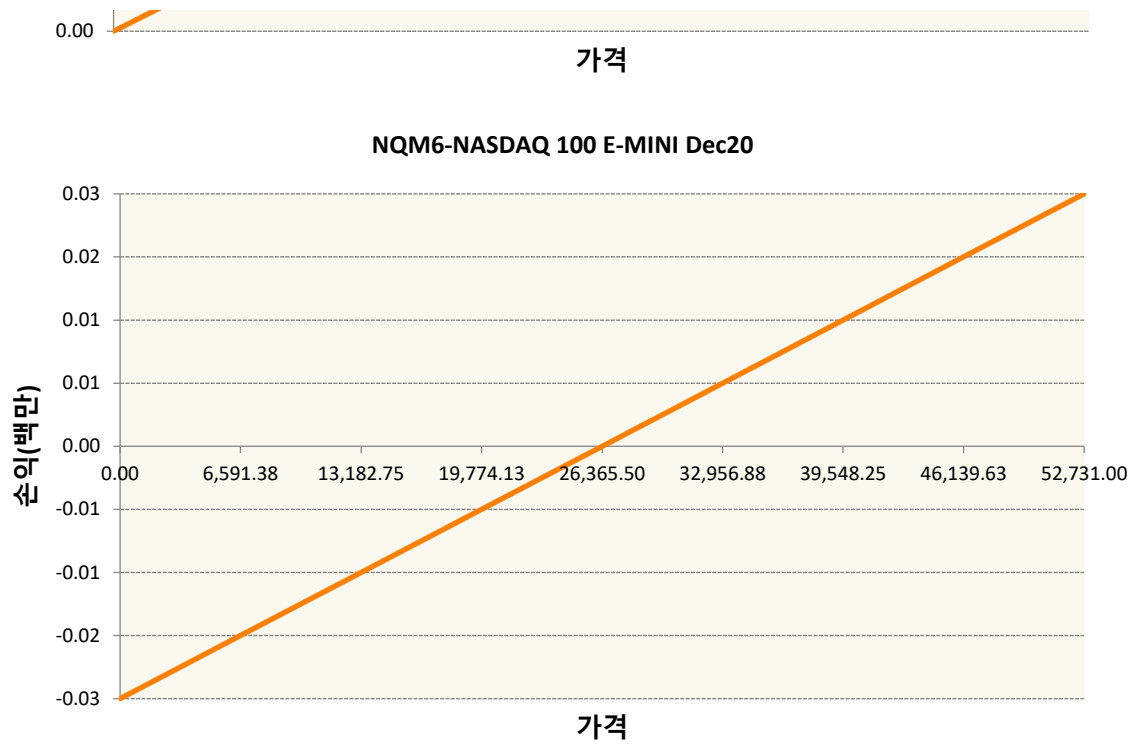
1. 계약금액

(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	24,514	0	24,514	
누계	유가증권	선물	314	0	314	장내
누계	통화	선물	3,842	0	3,842	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26		25
KR4A756500	2026-05 달러선물		307
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		1,961

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,182

공시일	2026-04-17
기준일	2026-04-16

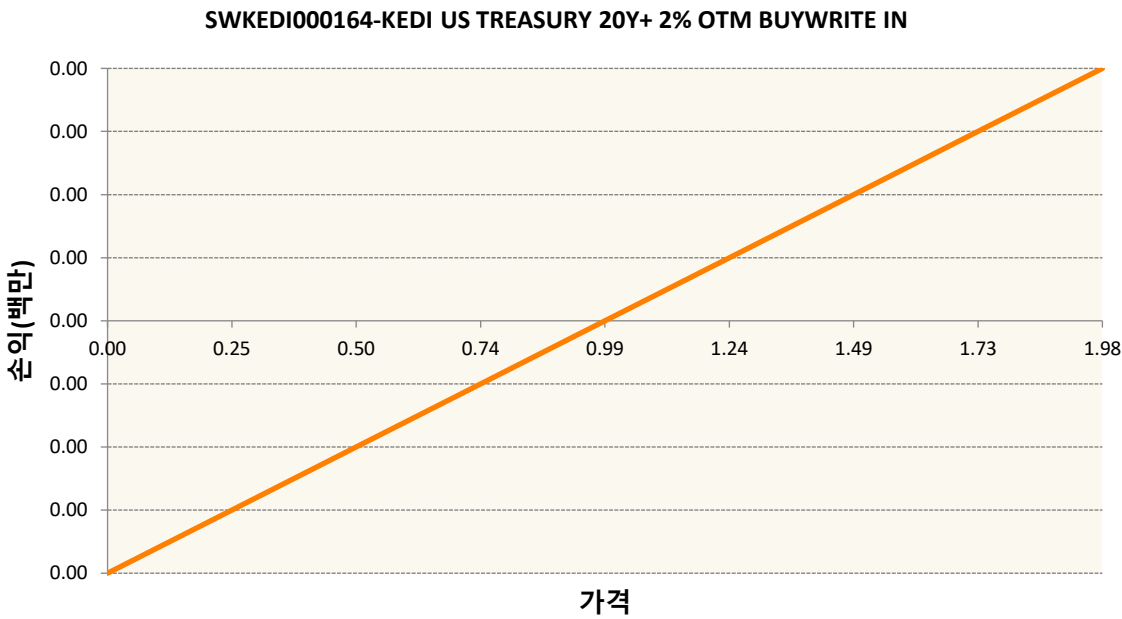
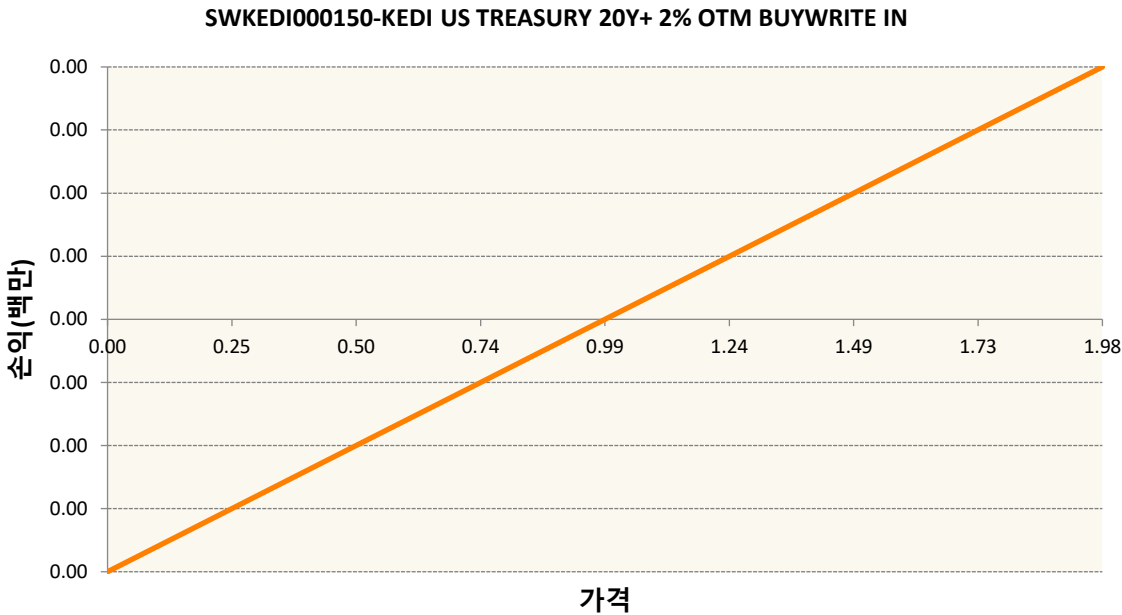
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

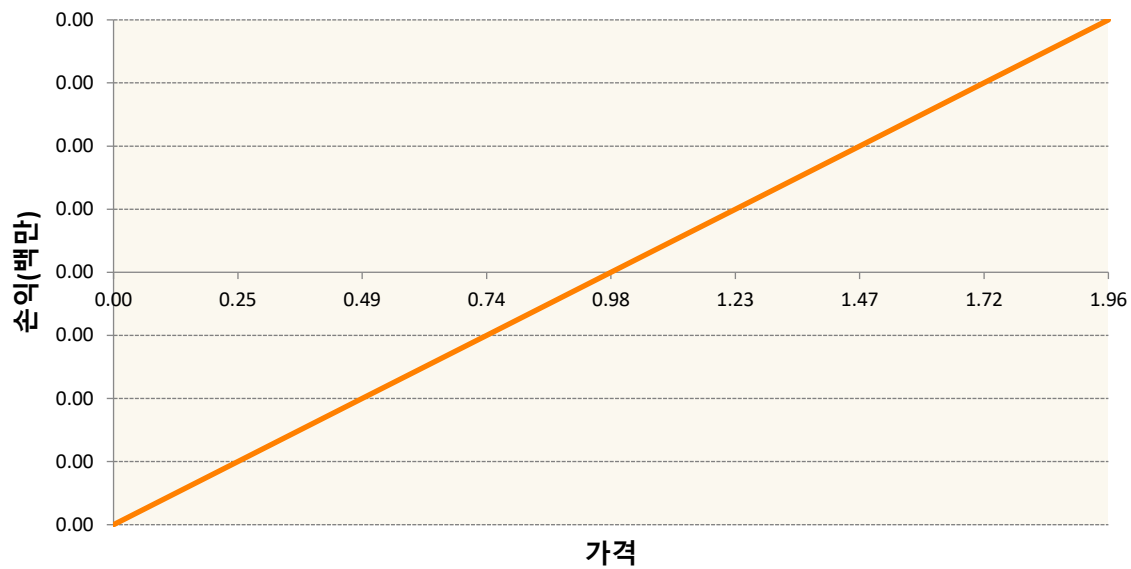
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	356,522	0	356,522	장외

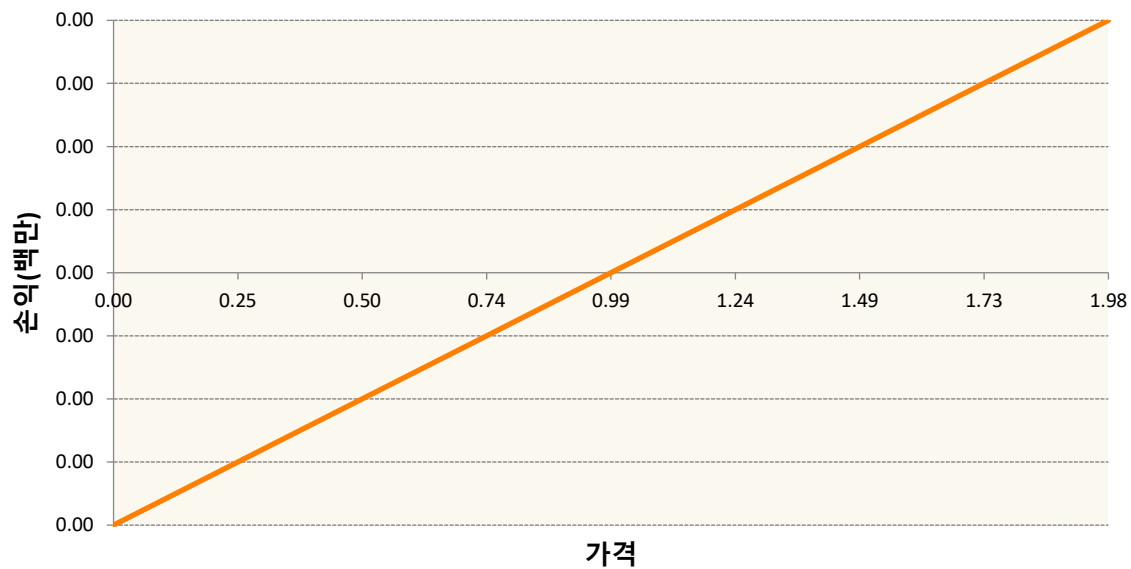
2. 만기시점의 손익구조



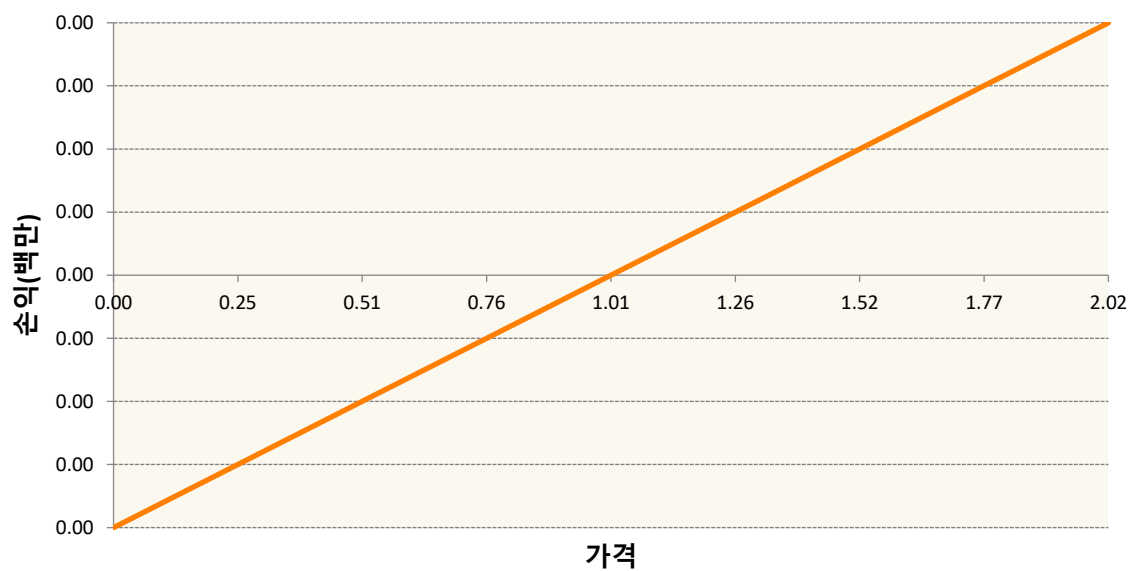
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,311
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		152
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,711
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,412
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,925

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,165