

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

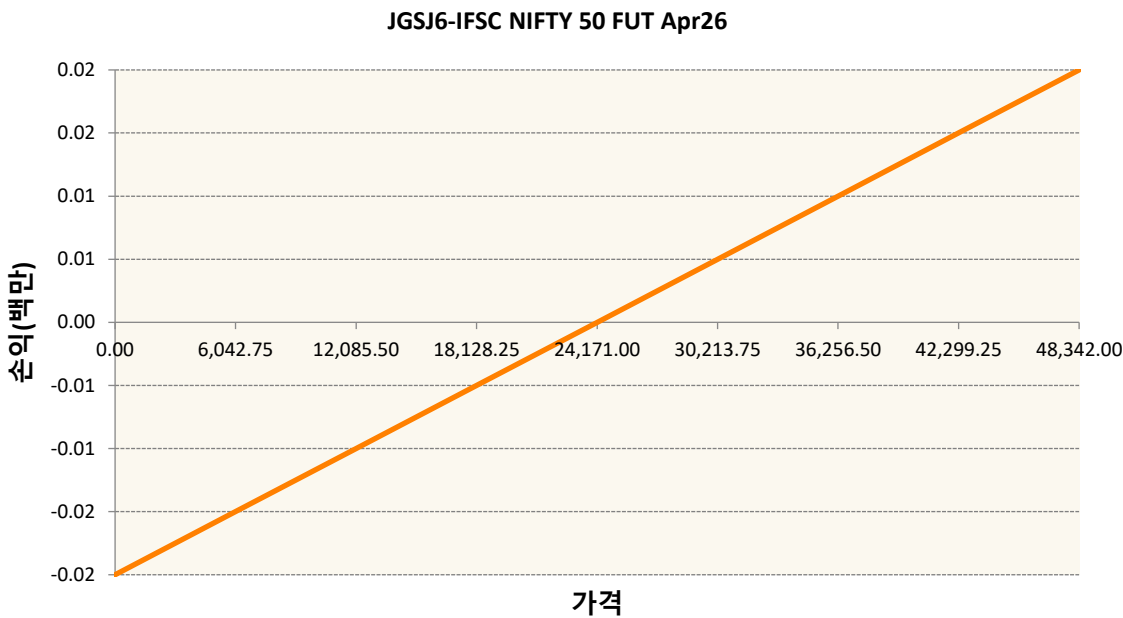
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	655	0	655	

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	2026-04-20
기준일	2026-04-17

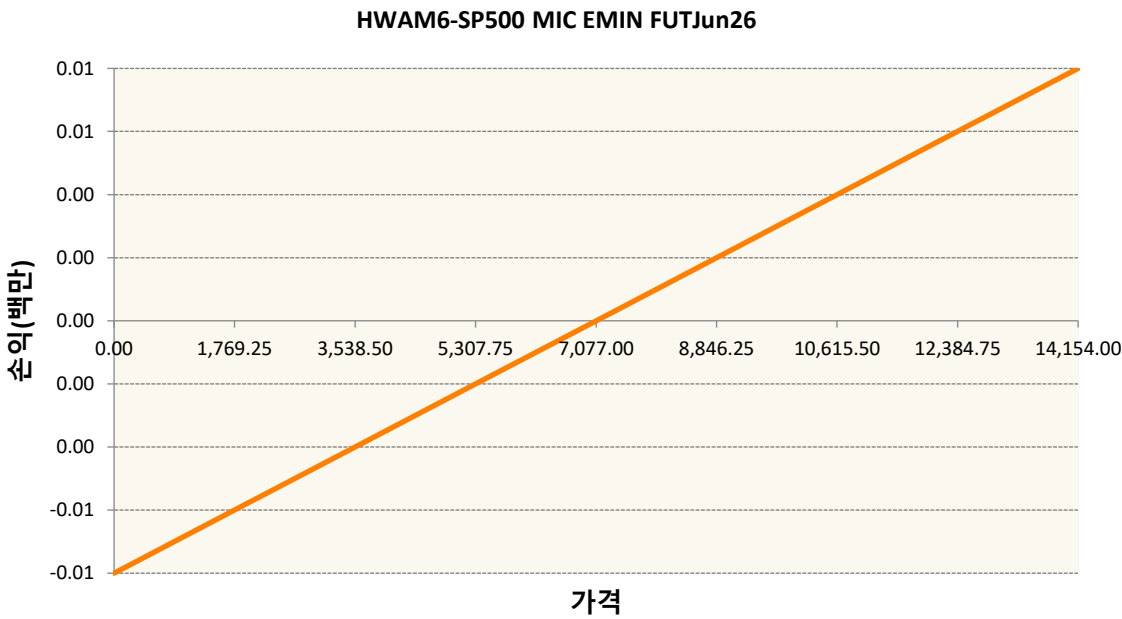
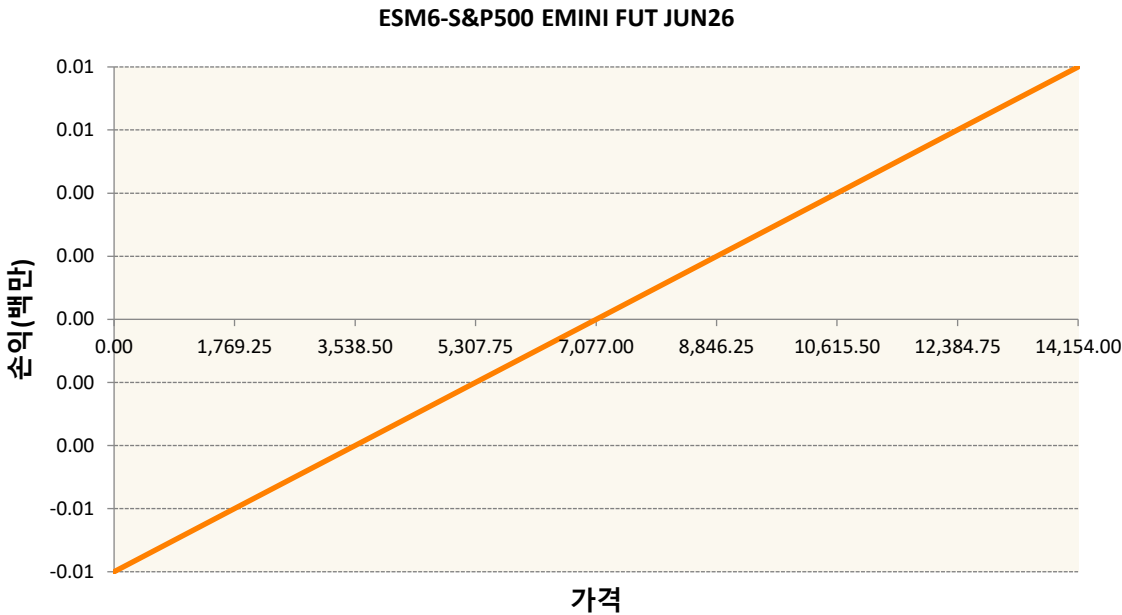
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	531	0	531	
누계	지수	선물	160	0	160	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	2026-04-20
기준일	2026-04-17

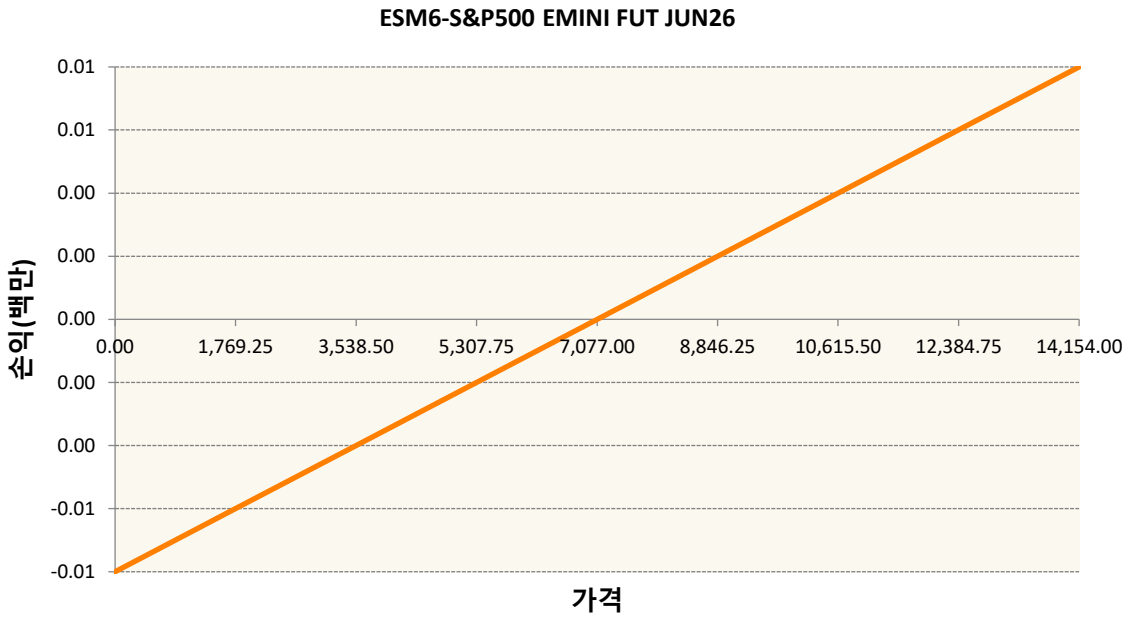
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,062	0	1,062	

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	2026-04-20
기준일	2026-04-17

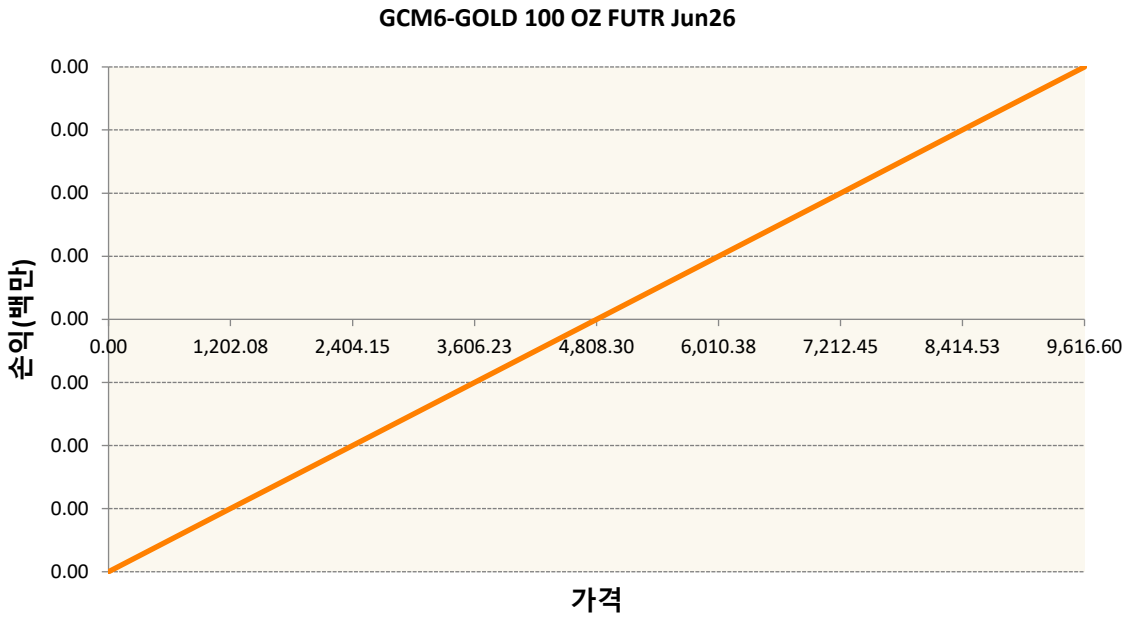
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,788	0	5,788	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 04/17/26 C440 EQUITY	15
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	463

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

(단위:백만원)

599

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

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	90
AOPLTRUS1 PLTR US 04/17/26 C137 EQUITY	114

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

(단위:백만원)

641

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

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

9

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

(단위:백만원)

6

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

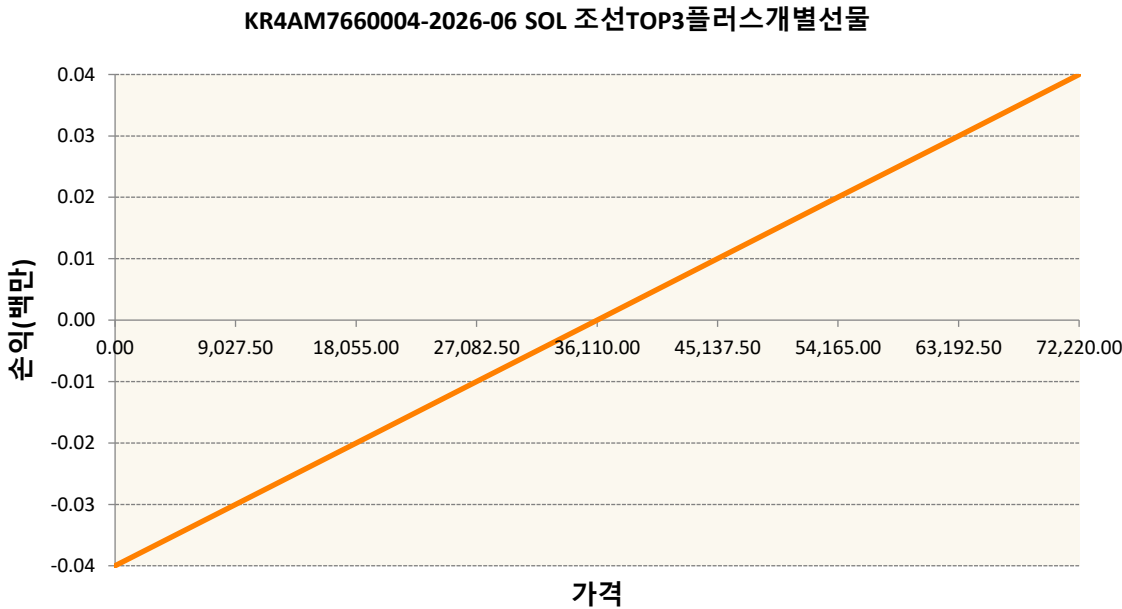
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

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	161,072	0	161,072	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-04-20

기준일 2026-04-17

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	2026-04-20
기준일	2026-04-17

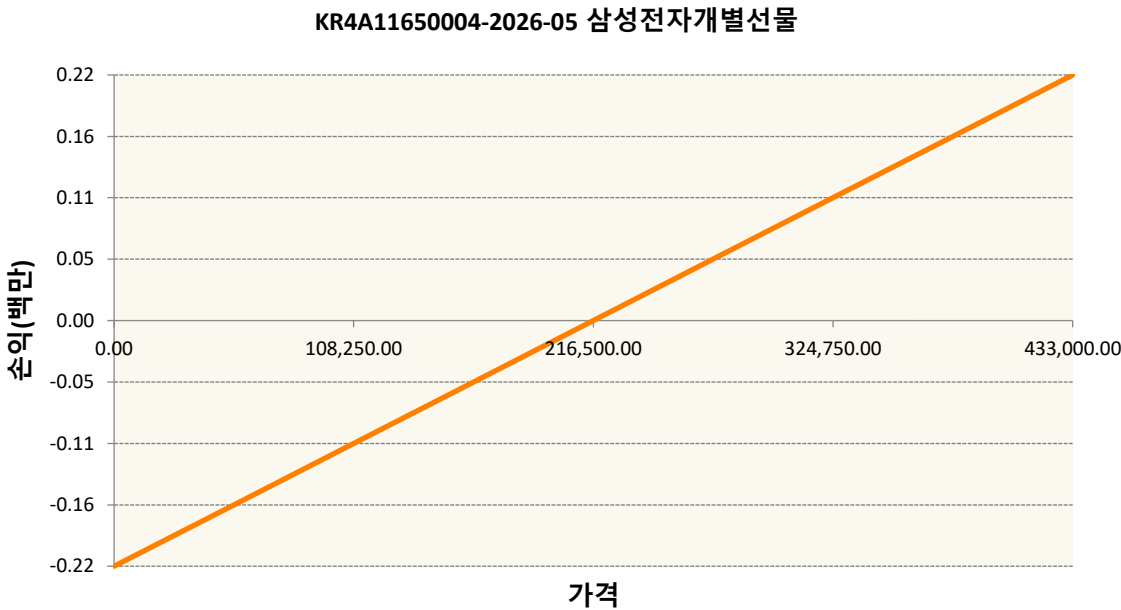
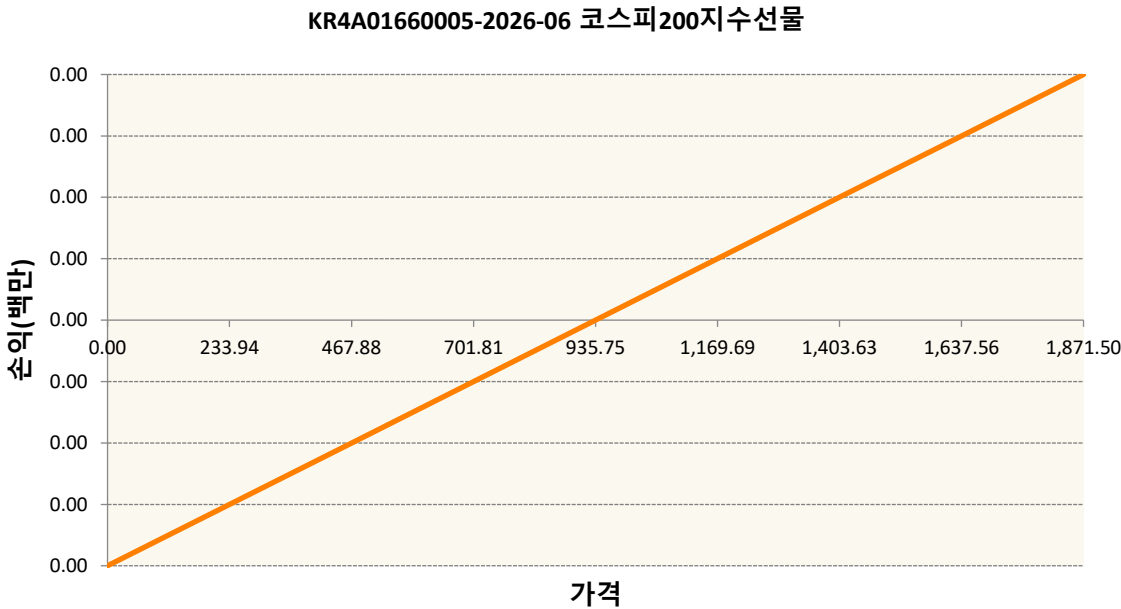
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,364	-2,364	장내
누계	유가증권	선물	12,361	25,878	-13,517	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The line starts at (0, 0) and ends at (1,880, 0), showing that profit is zero at both zero price and the maximum price of 1,880. The line is labeled '가격' (Price) and '이익(백만)' (Profit in millions).

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.00
235.00	-0.00
470.00	-0.00
705.00	-0.00
940.00	-0.00
1,175.00	-0.00
1,410.00	-0.00
1,645.00	-0.00
1,880.00	0.00

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 9.00 with major ticks every 3.00. A solid blue line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,885, 9), indicating a constant positive slope.

가액 (Price)	순익 (백만) (Net Income)
0.00	0.00
235.63	1.00
471.25	2.00
706.88	3.00
942.50	4.00
1,178.13	5.00
1,413.75	6.00
1,649.38	7.00
1,885.00	8.00

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					484
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-484	-484	-484	-484	-484	-484	-484
-5.33%	-323	-323	-323	-323	-323	-323	-323
-2.67%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	161	161	161	161	161	161	161
5.33%	323	323	323	323	323	323	323
8.00%	484	484	484	484	484	484	484
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물					501
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-501	-501	-501	-501	-501	-501	-501
-5.33%	-334	-334	-334	-334	-334	-334	-334
-2.67%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	167	167	167	167	167	167	167
5.33%	334	334	334	334	334	334	334
8.00%	501	501	501	501	501	501	501

KR4BAFB99406

코스피위클리M C 2604W3 940.0

1,229

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229
-5.33%	820	820	820	820	820	820	820
-2.67%	410	410	410	410	410	410	410
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-410	-410	-410	-410	-410	-410	-410
5.33%	-820	-820	-820	-820	-820	-820	-820
8.00%	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229

KR4BAFB99422

코스피위클리M C 2604W3 942.5

820

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	820	820	820	820	820	820	820
-5.33%	546	546	546	546	546	546	546
-2.67%	273	273	273	273	273	273	273
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-273	-273	-273	-273	-273	-273	-273
5.33%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
8.00%	-820	-820	-820	-820	-820	-820	-820

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

(단위:백만원)

6,715

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

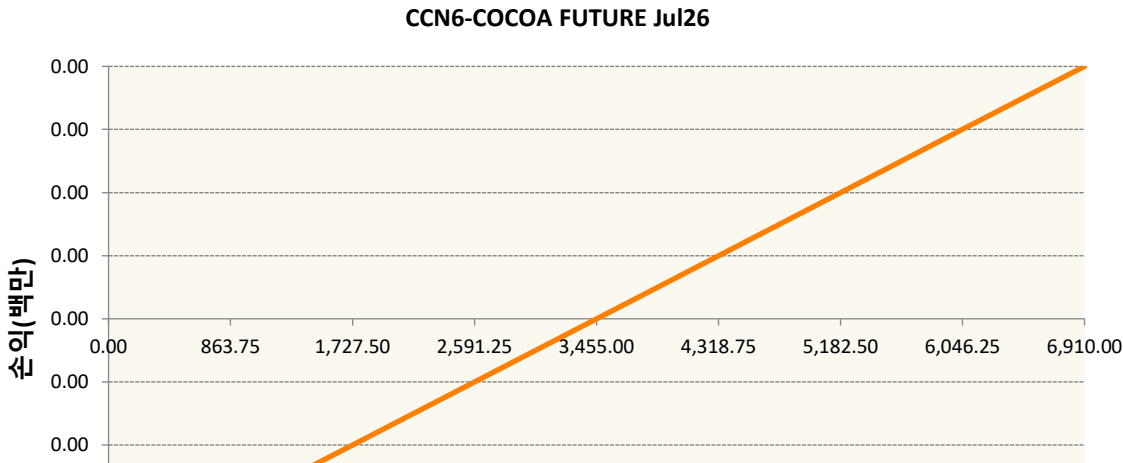
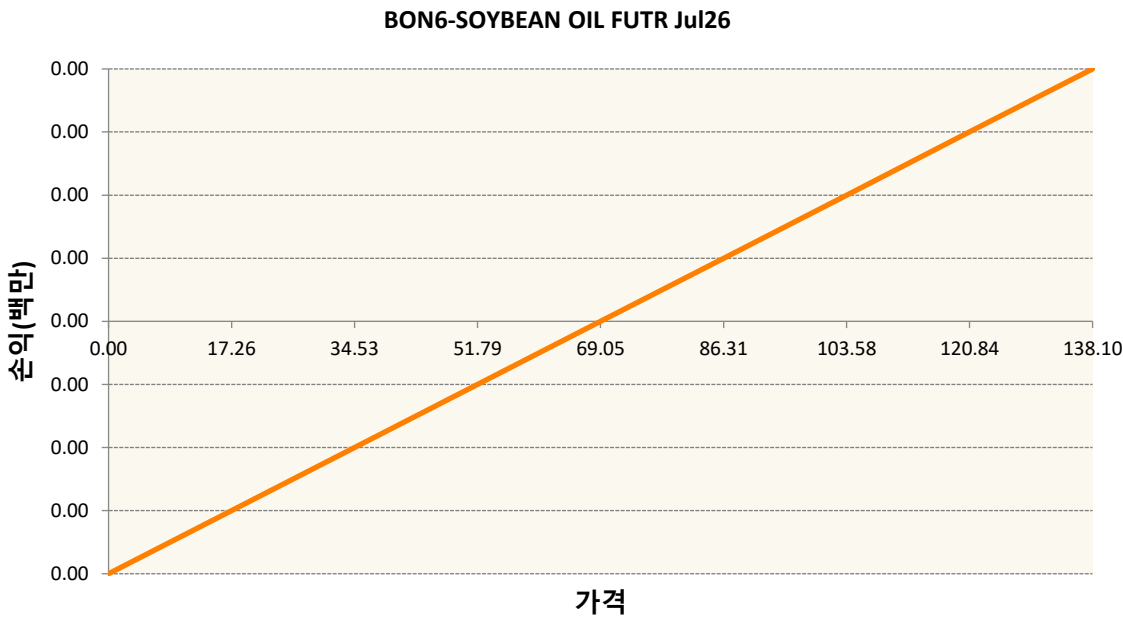
포커스농산물모(채권-파생형)

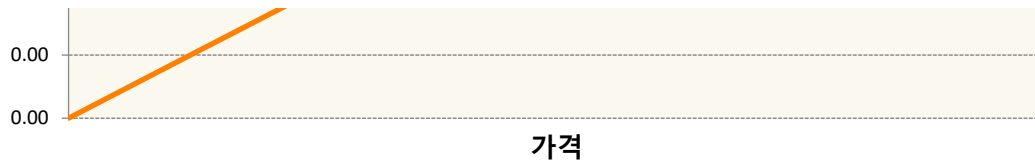
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

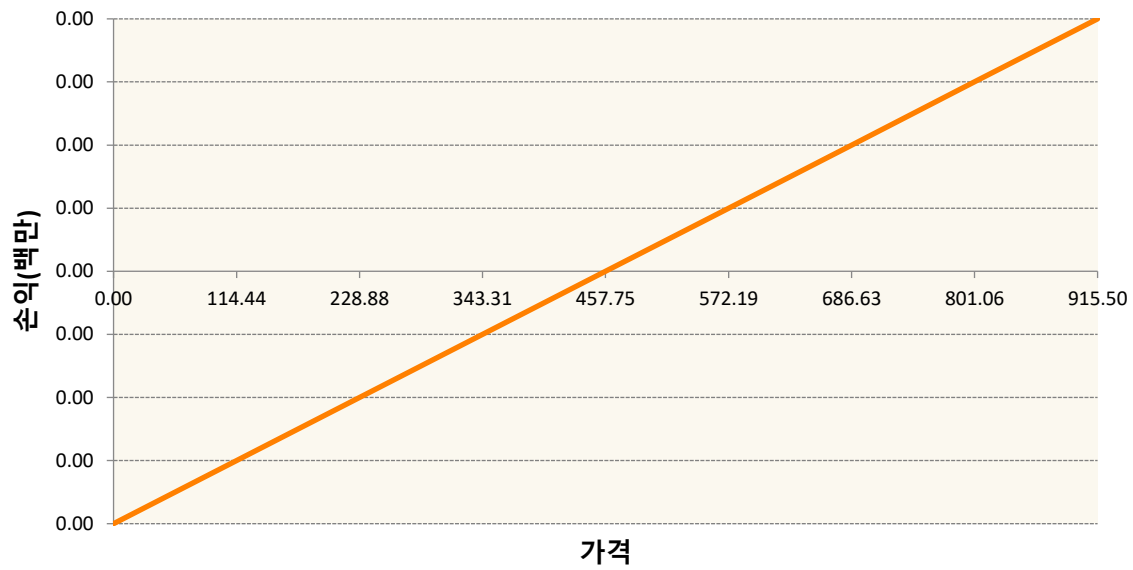
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	103	0	103	
누계	실물자산	선물	886	0	886	장내
누계	유가증권	선물	2,022	0	2,022	
누계	통화	선물	0	311	-311	장내

2. 만기시점의 손익구조

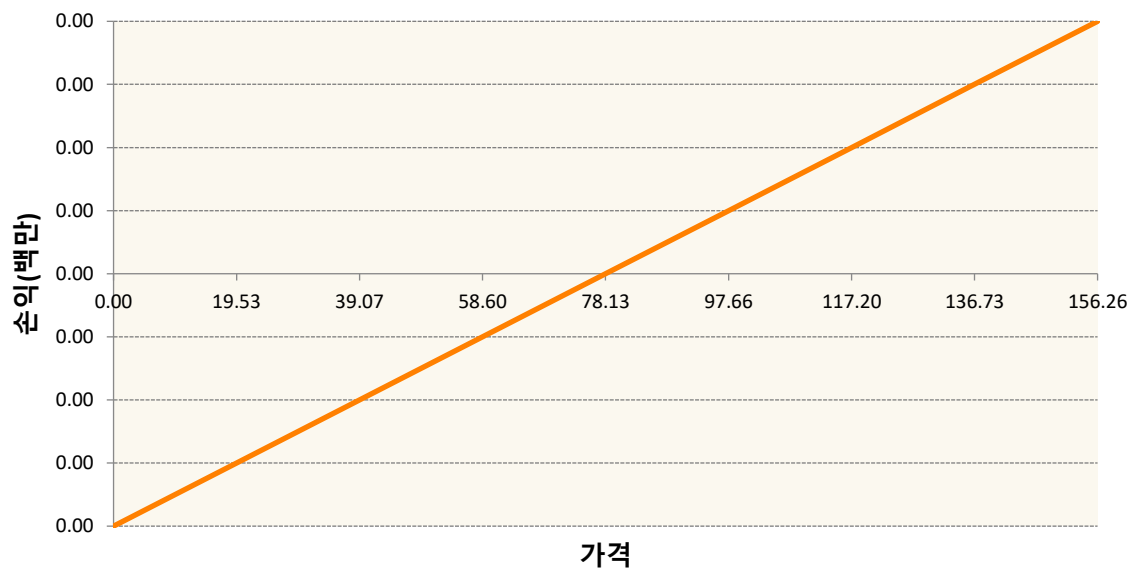




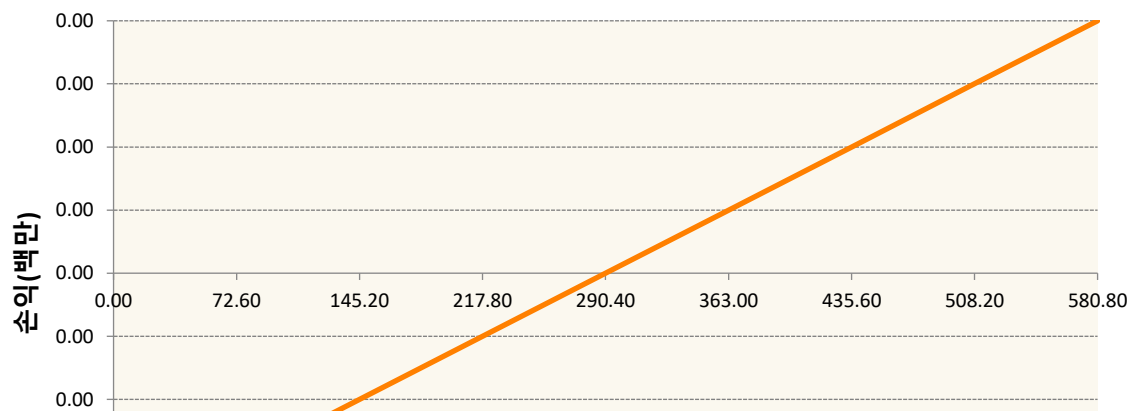
CN6-CORN FUTURE Jul26

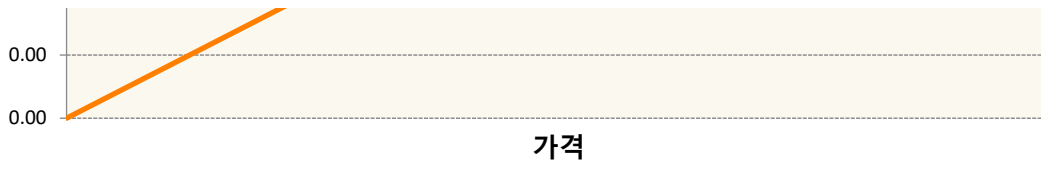


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

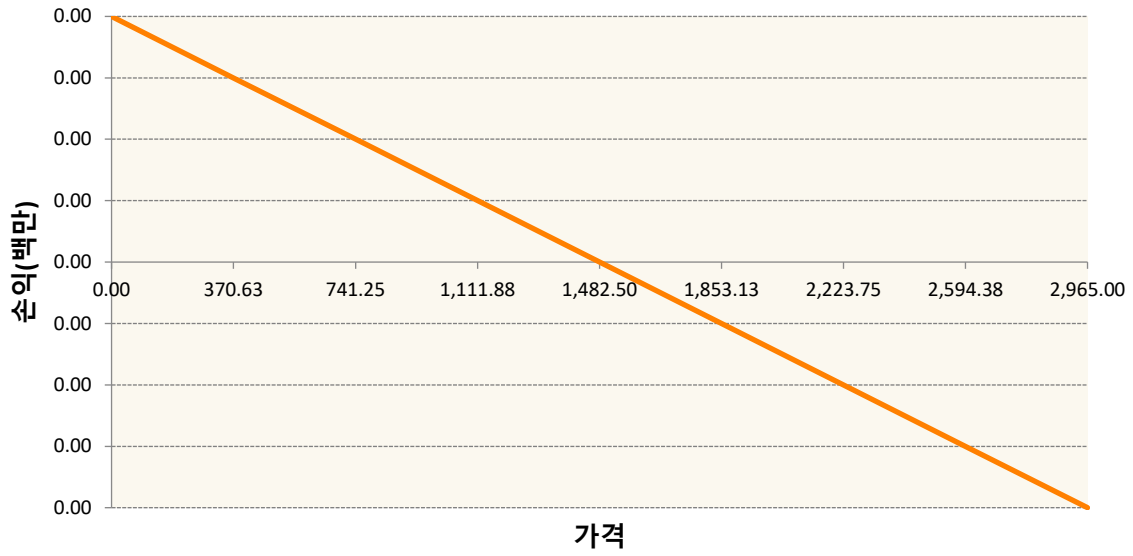


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

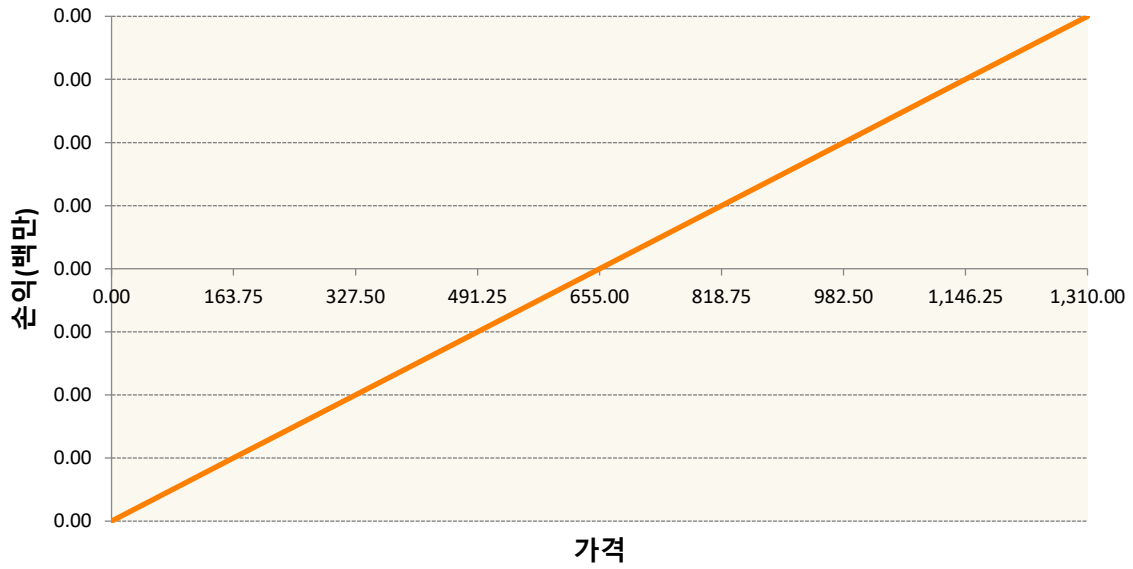




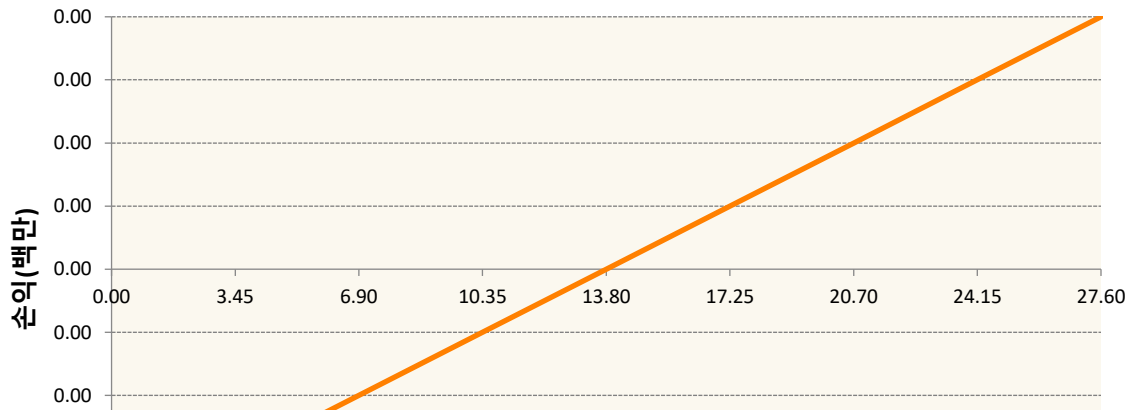
KR4A75650007-2026-05 달러선물

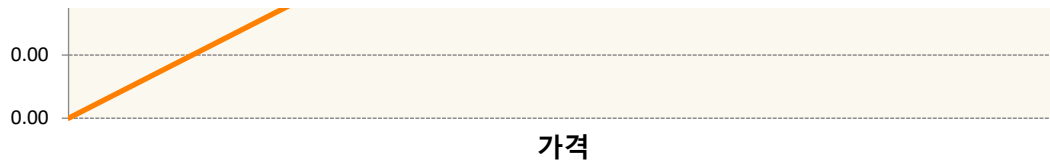


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

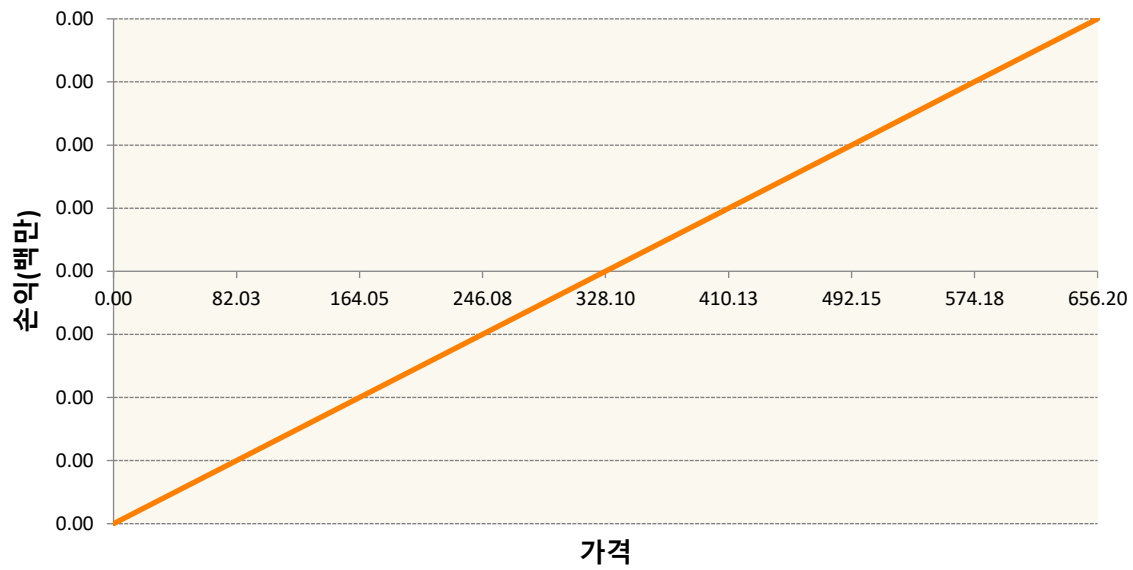


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

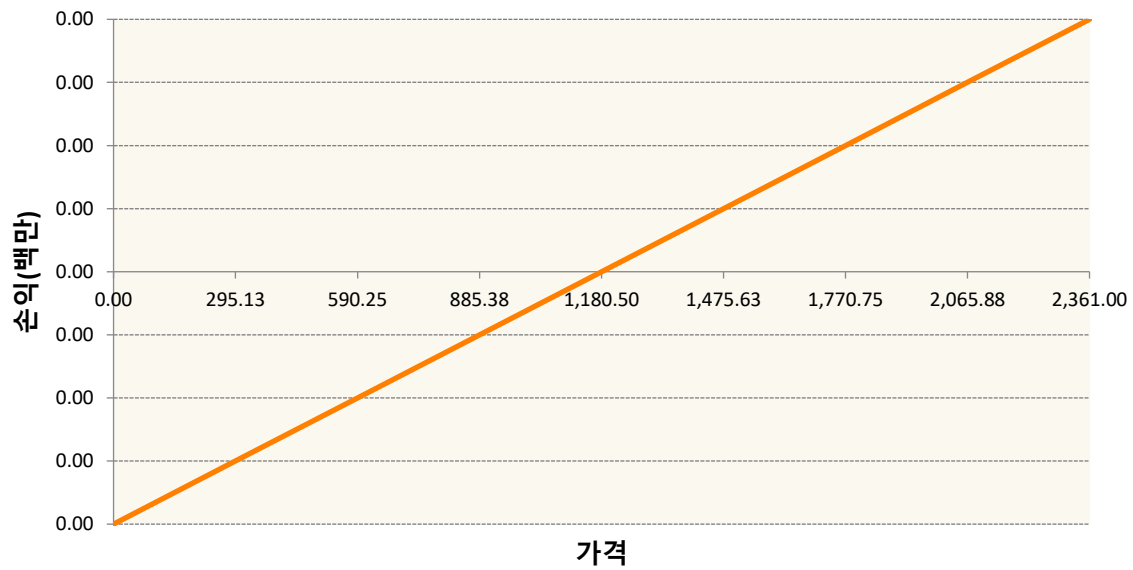




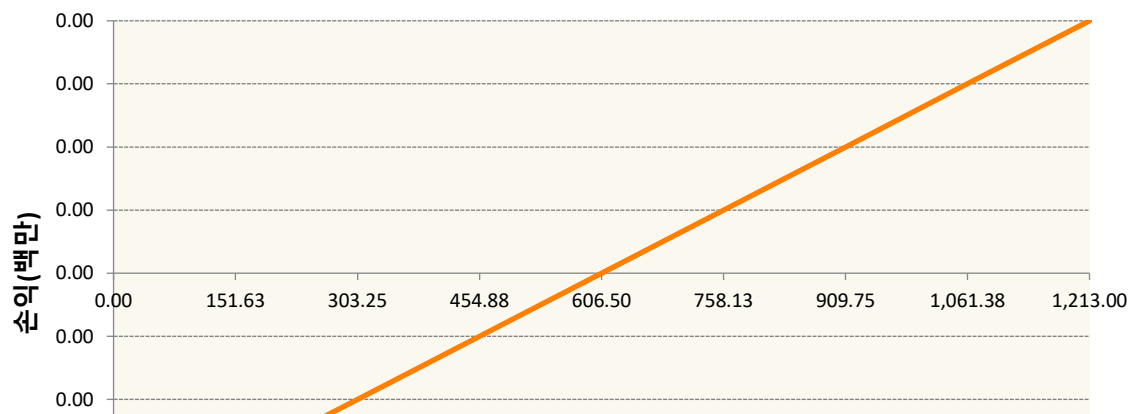
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

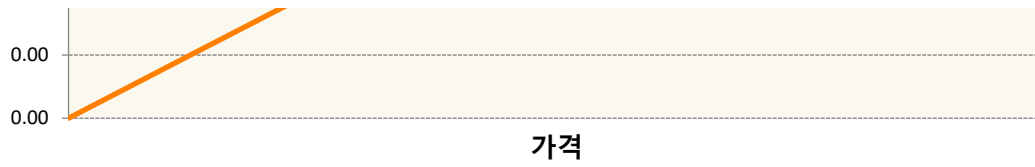


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-04-20
기준일	2026-04-17

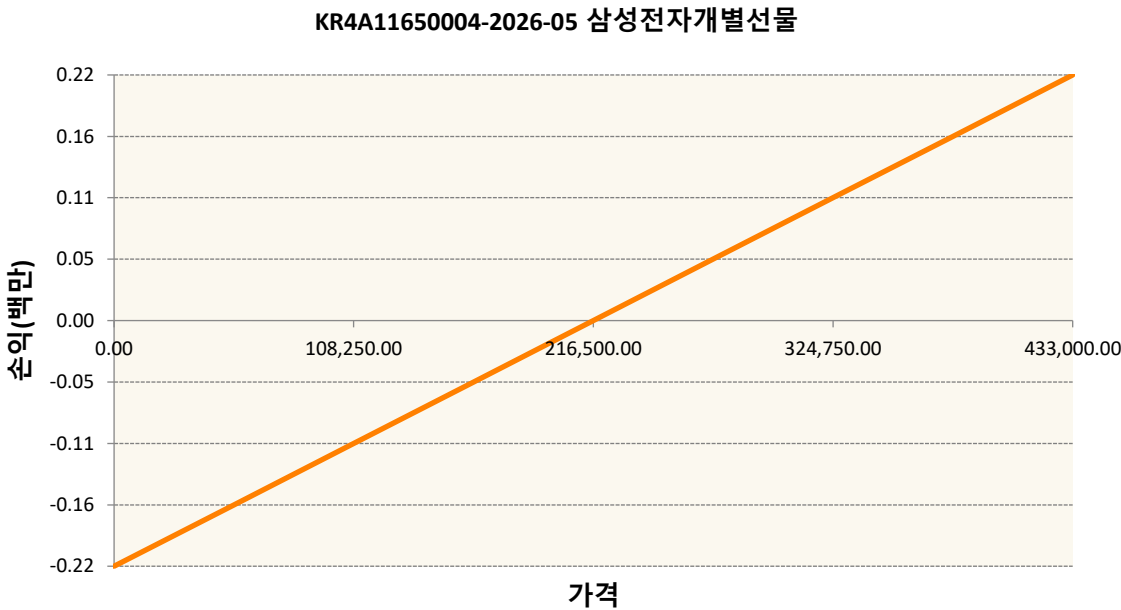
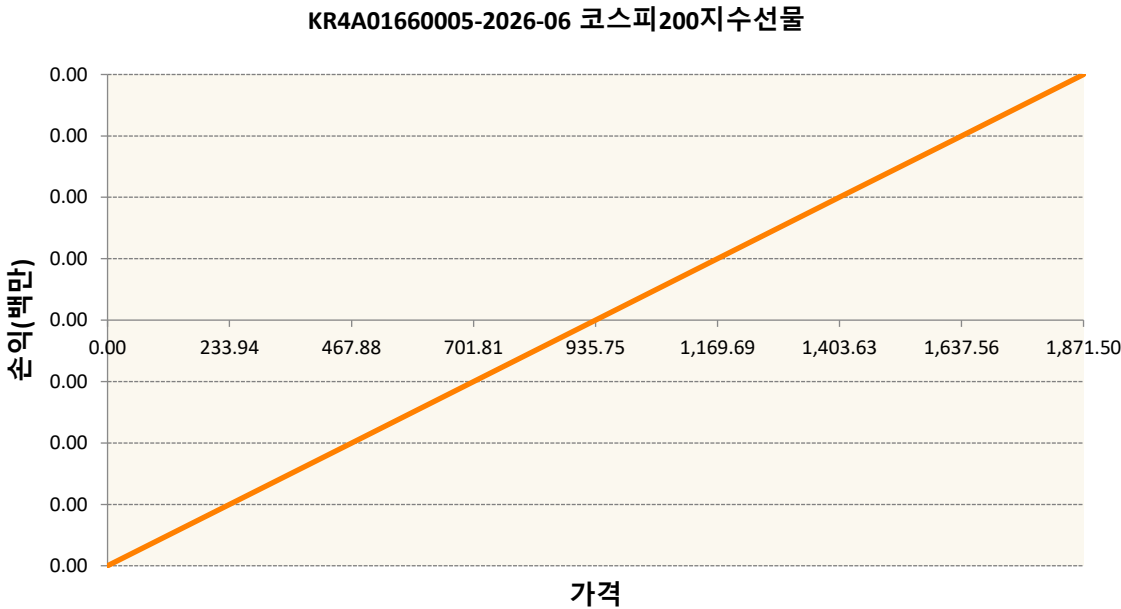
스마트인덱스모

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	2,745	0	2,745	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격	순이익(백만)
0.00	-1.13
566,000.00	-0.57
1,132,000.00	0.00
1,698,000.00	0.57
2,264,000.00	1.13

가격	순이익 (백만)
0.00	-0.03
7,150.00	-0.02
14,300.00	-0.01
21,450.00	0.00
28,600.00	0.01
35,750.00	0.02
42,900.00	0.03
50,050.00	0.04
57,200.00	0.05

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				168
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168	
-5.33%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112	
-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%	112	112	112	112	112	112	112	
8.00%	168	168	168	168	168	168	168	
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)

496

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

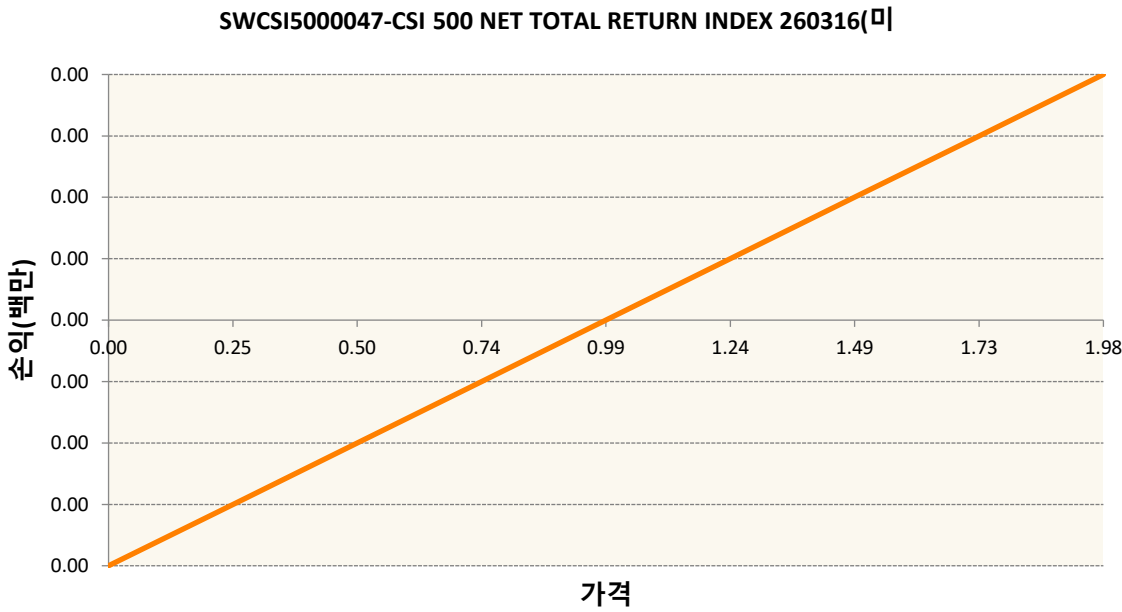
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,587	0	5,587	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

446

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

549

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

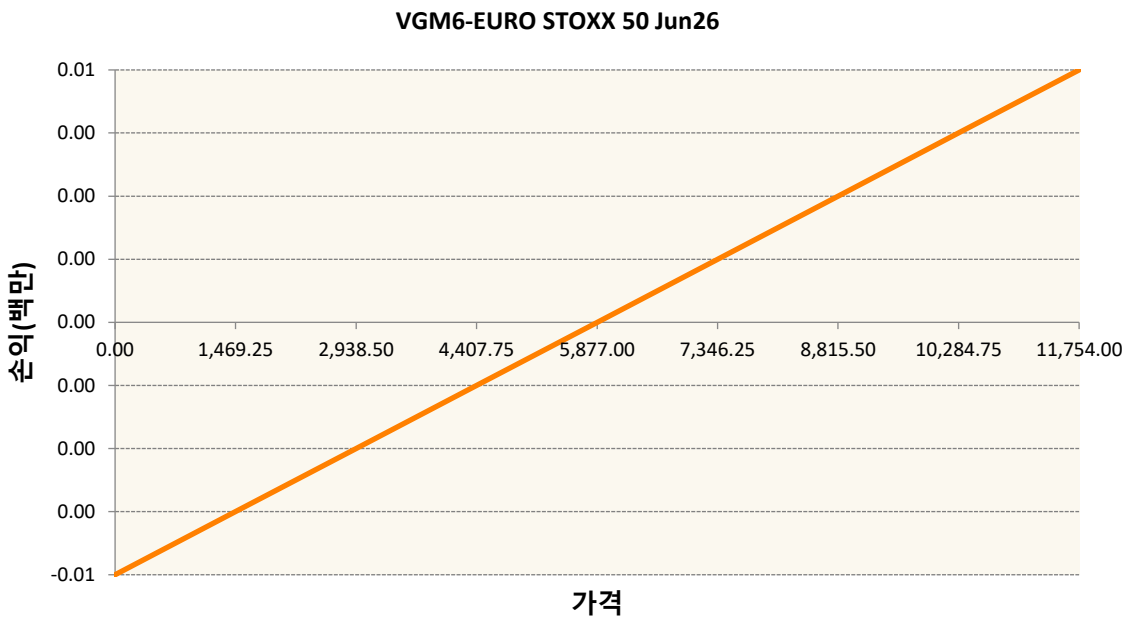
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	906	0	906	

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	2026-04-20
기준일	2026-04-17

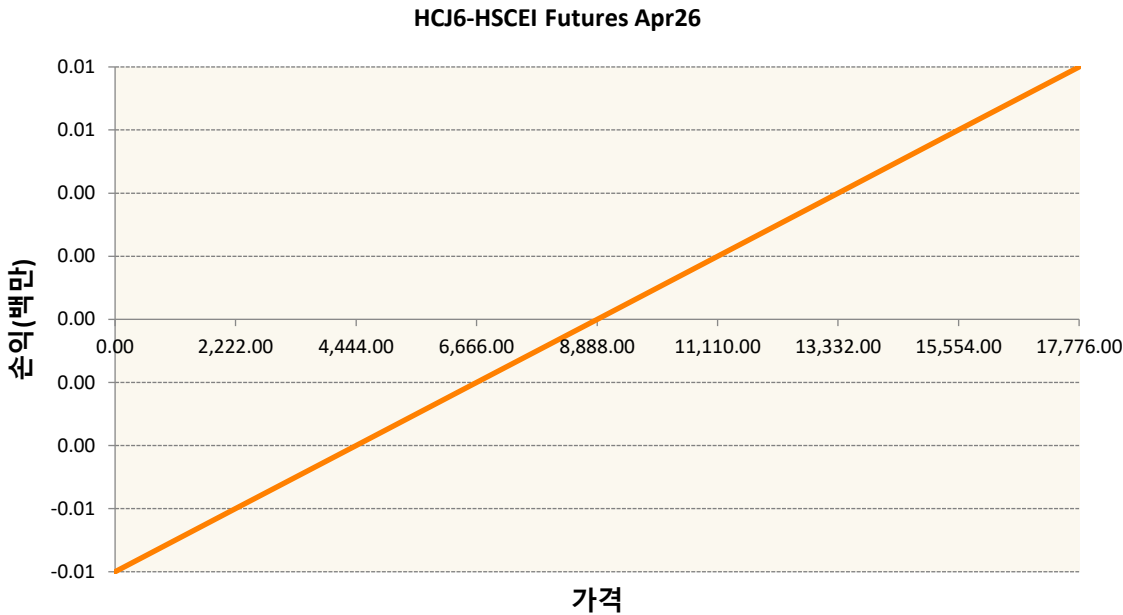
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,710	0	1,710	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI6	HSCEI Futures Apr26	137
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

166

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

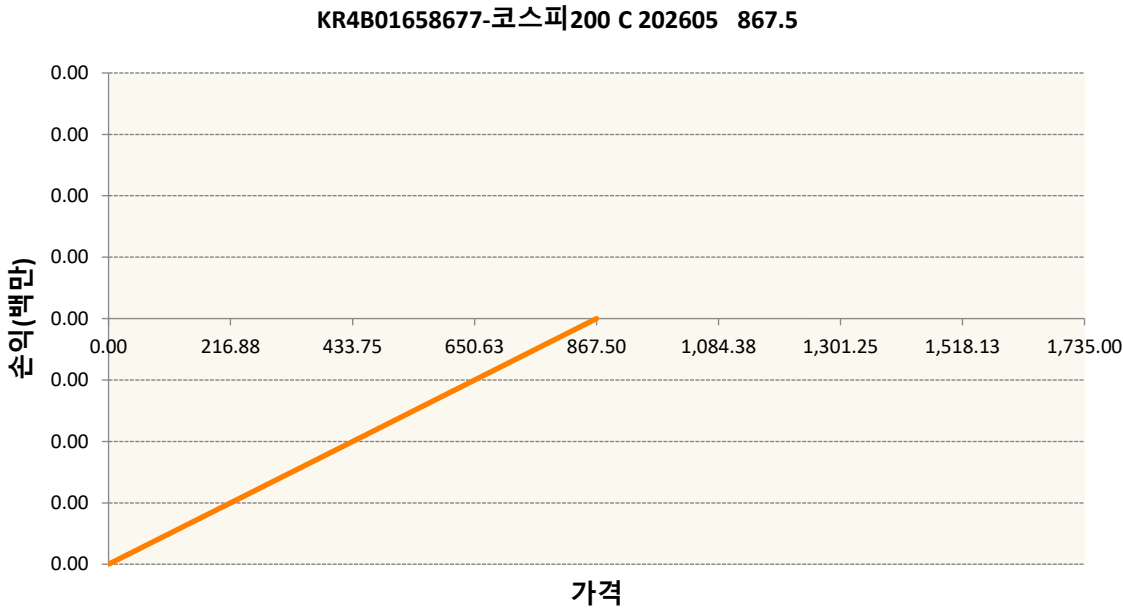
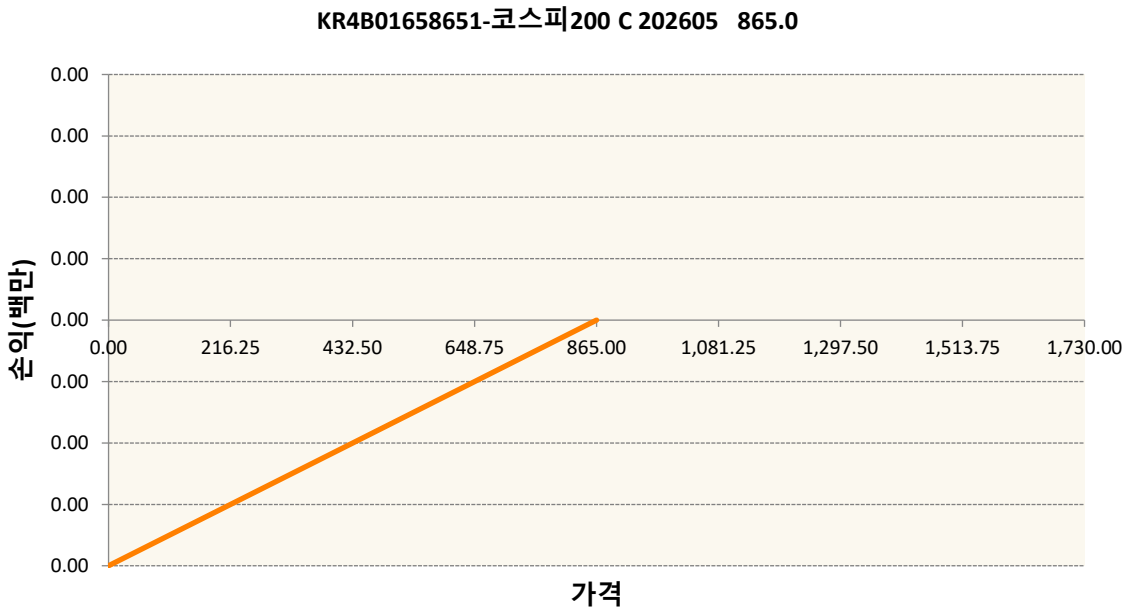
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

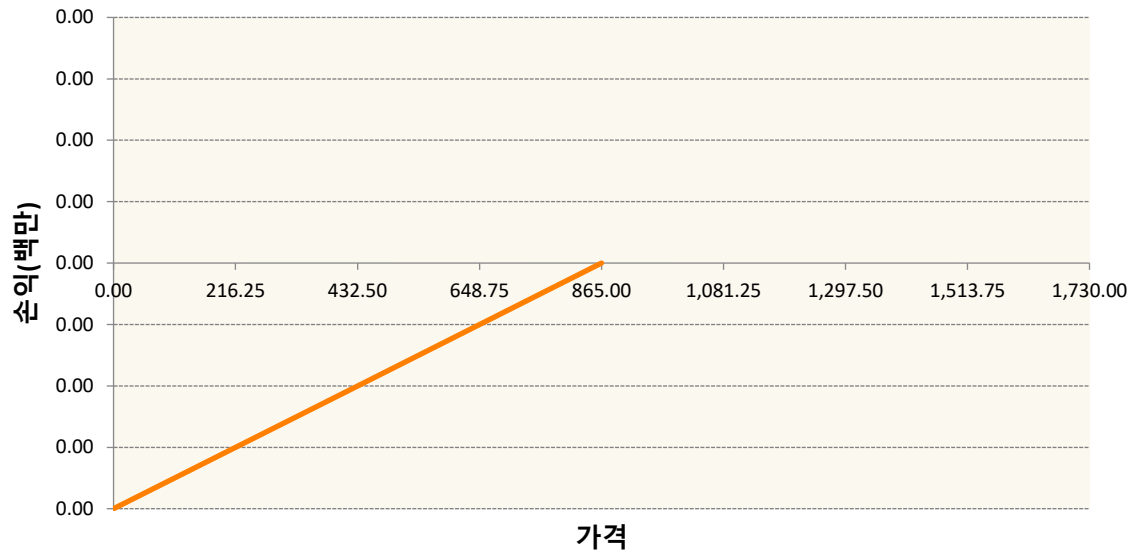
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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							818
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-342	-421	-501	-580	-659	-739	-818
-5.33%	-108	-187	-266	-346	-426	-506	-586
-2.67%	71	-2	-78	-154	-231	-309	-387
0%	202	137	70	0	-72	-145	-219
2.67%	293	240	182	121	56	-11	-80
5.33%	354	312	265	213	157	97	34
8.00%	393	362	325	282	234	182	127
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							520
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-272	-321	-371	-421	-471	-520
-5.33%	-72	-122	-172	-222	-272	-322	-373
-2.67%	44	-3	-51	-99	-148	-197	-246
0%	129	87	44	0	-45	-92	-139
2.67%	188	154	117	78	37	-6	-50
5.33%	228	201	171	137	101	63	24
8.00%	254	234	210	182	152	118	83
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							325
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-136	-167	-199	-231	-262	-294	-325
-5.33%	-43	-74	-106	-138	-169	-201	-233
-2.67%	28	-1	-31	-61	-92	-123	-154
0%	80	55	28	0	-29	-58	-87

2.67%	117	95	72	48	22	-4	-32
5.33%	141	124	105	85	62	39	14
8.00%	156	144	129	112	93	73	51

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

(단위:백만원)

1,993

공시일 2026-04-20

기준일 2026-04-17

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	2026-04-20
기준일	2026-04-17

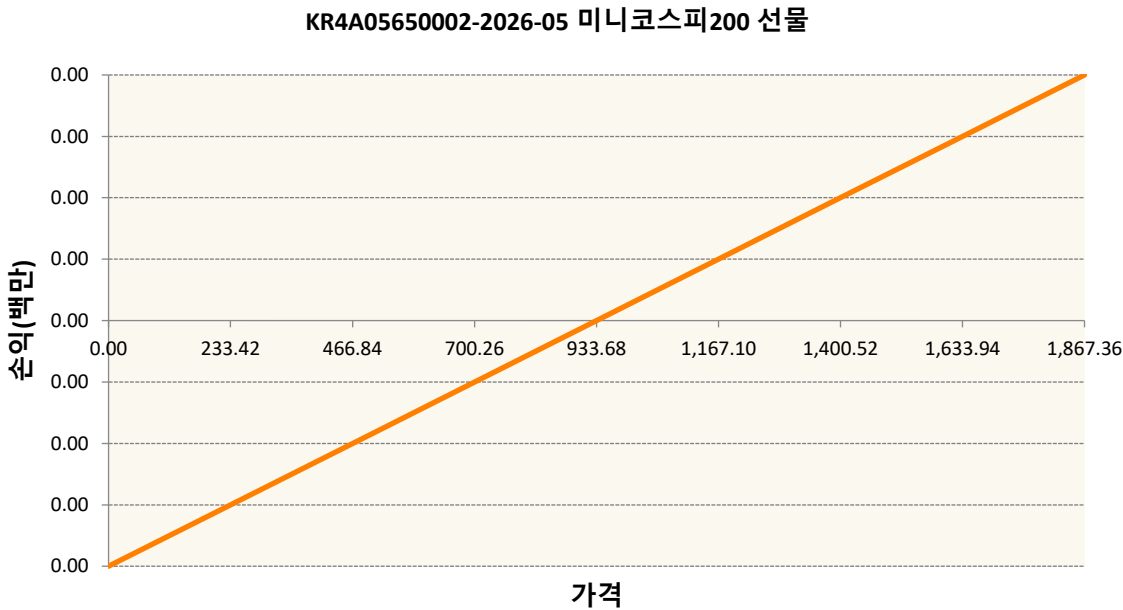
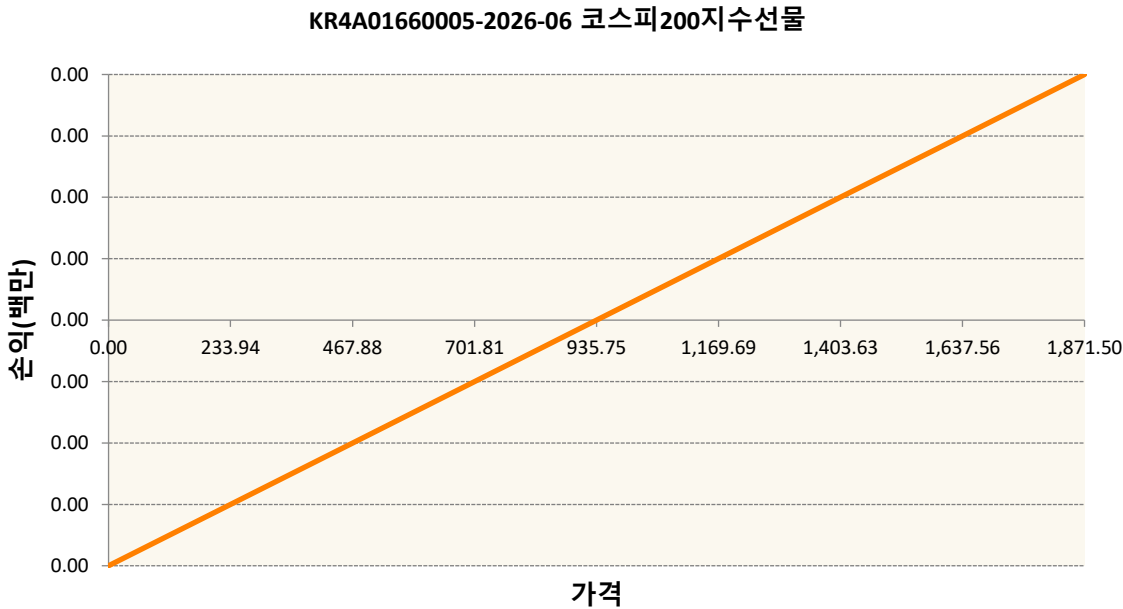
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

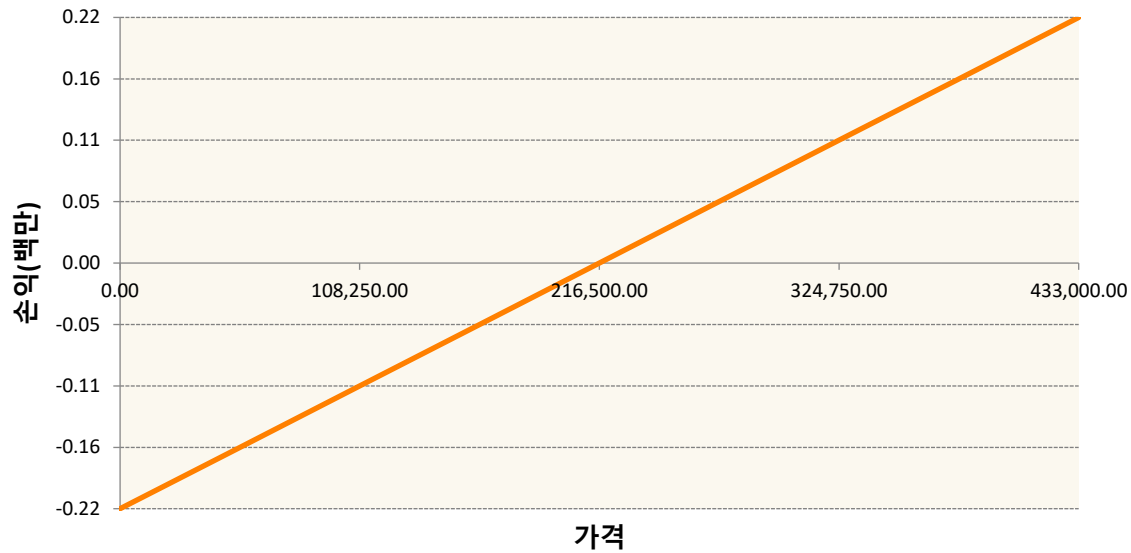
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,147	0	3,147	장내

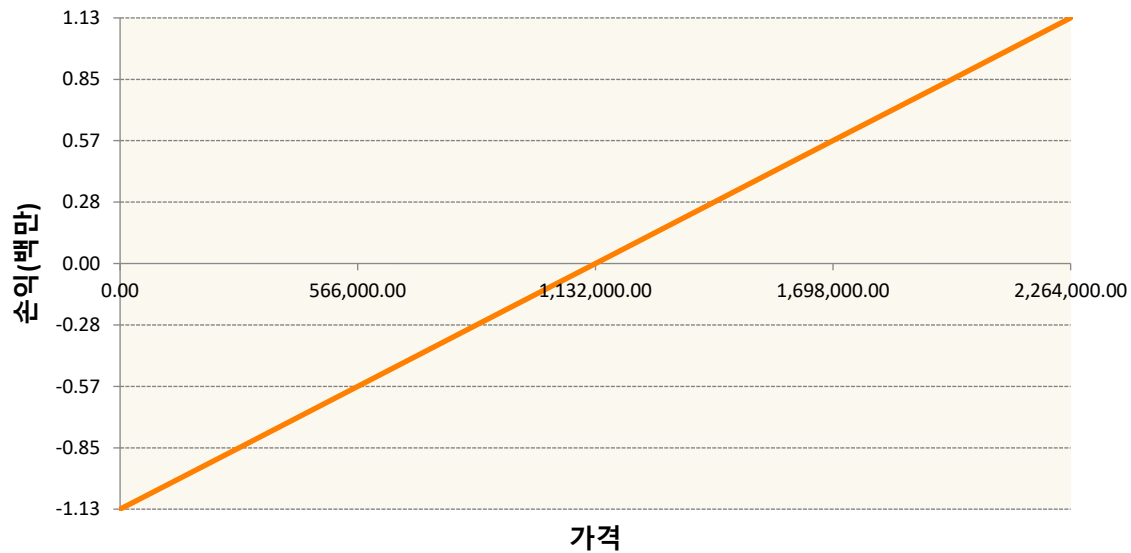
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				93
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93	
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	
-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%	62	62	62	62	62	62	62	
8.00%	93	93	93	93	93	93	93	
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)

289

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

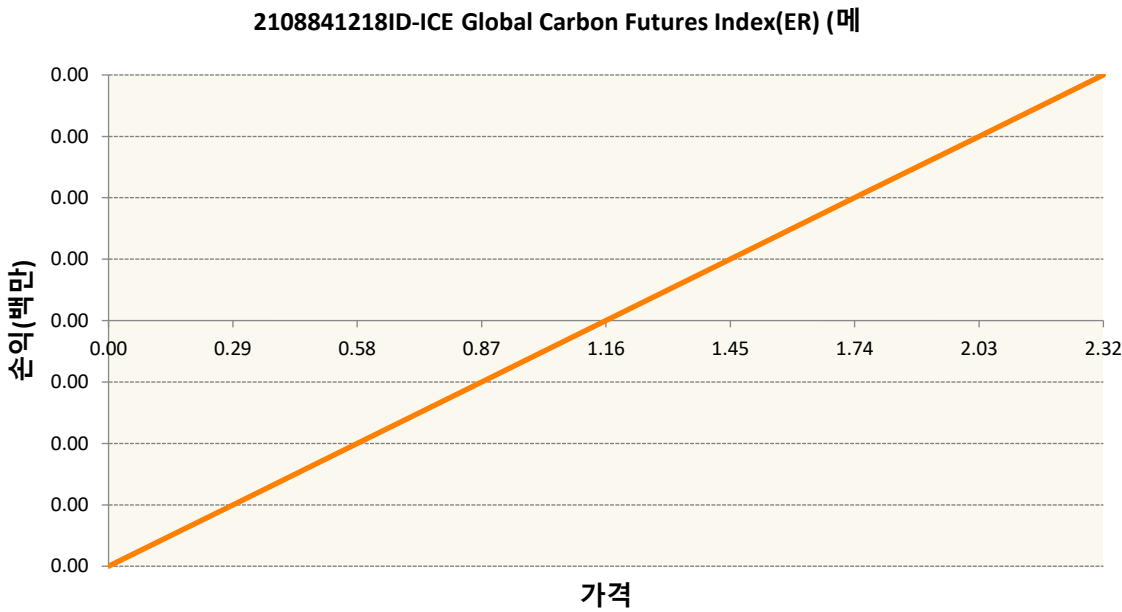
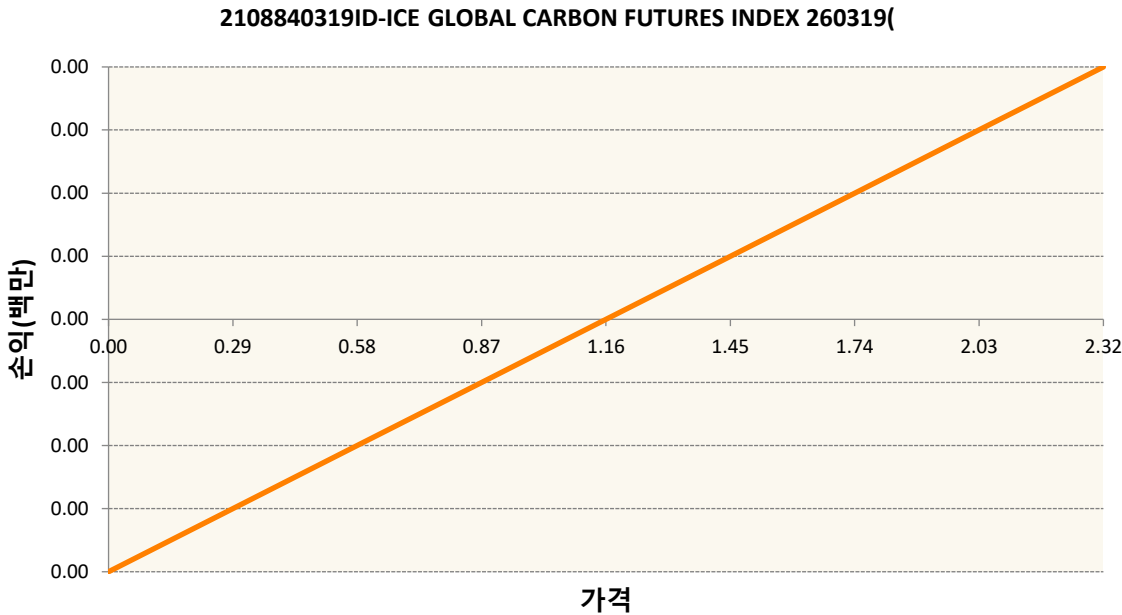
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,666	0	6,666	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		426
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	603

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

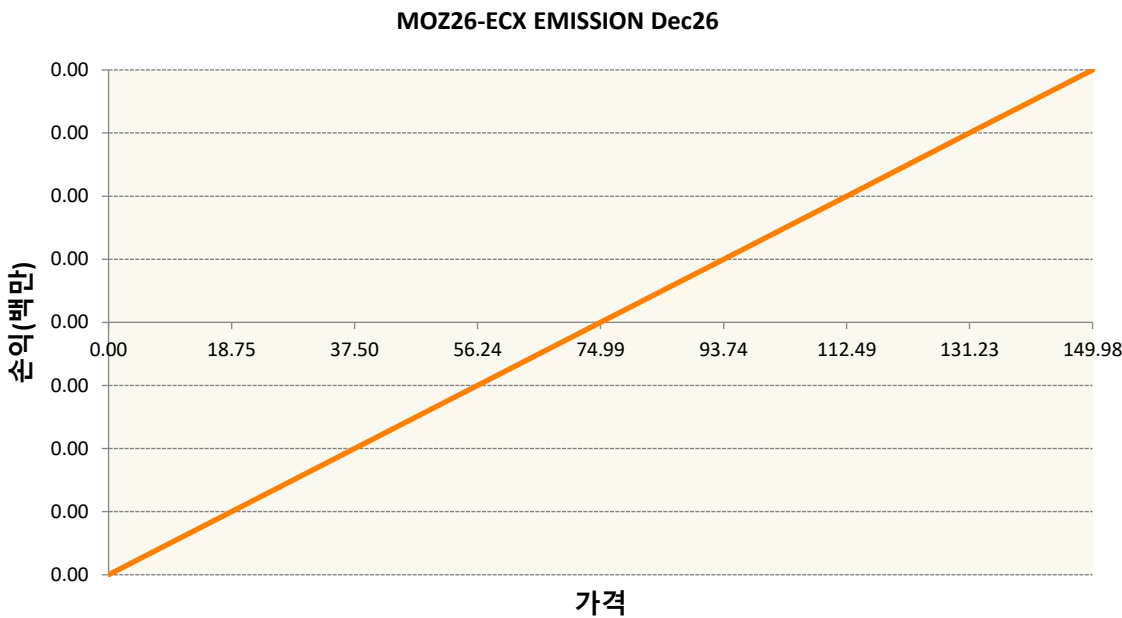
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,833	0	4,833	
누계	통화	선도	0	2,213	-2,213	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E	177
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	387

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

(단위:백만원)

663

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

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	1,787	0	1,787	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	7
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	5
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	12
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	5

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

(단위:백만원)

44

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

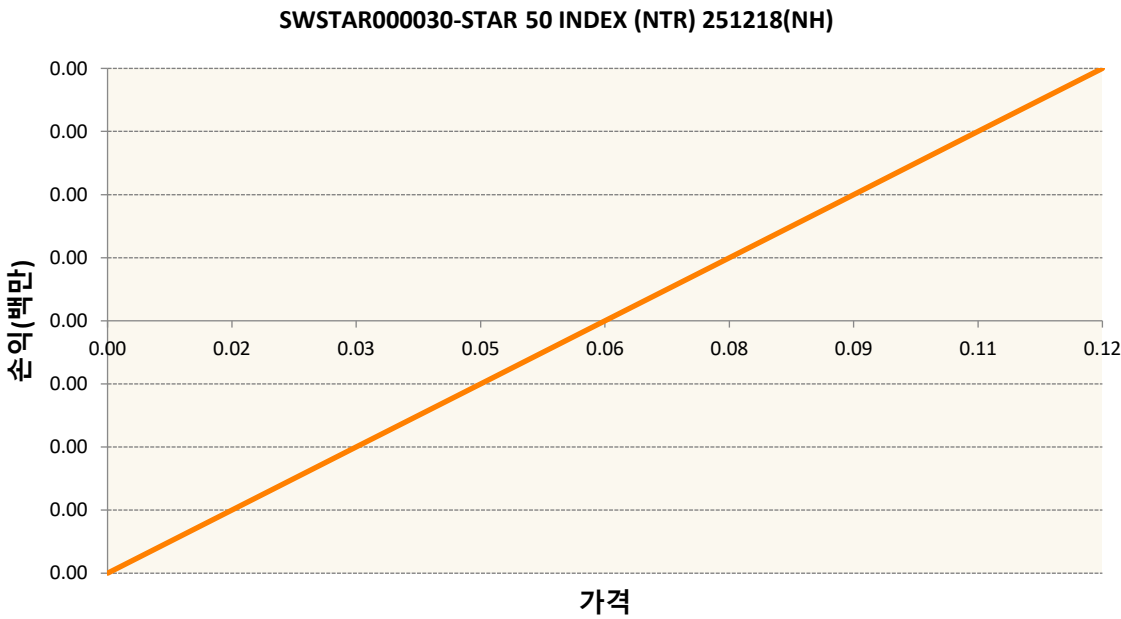
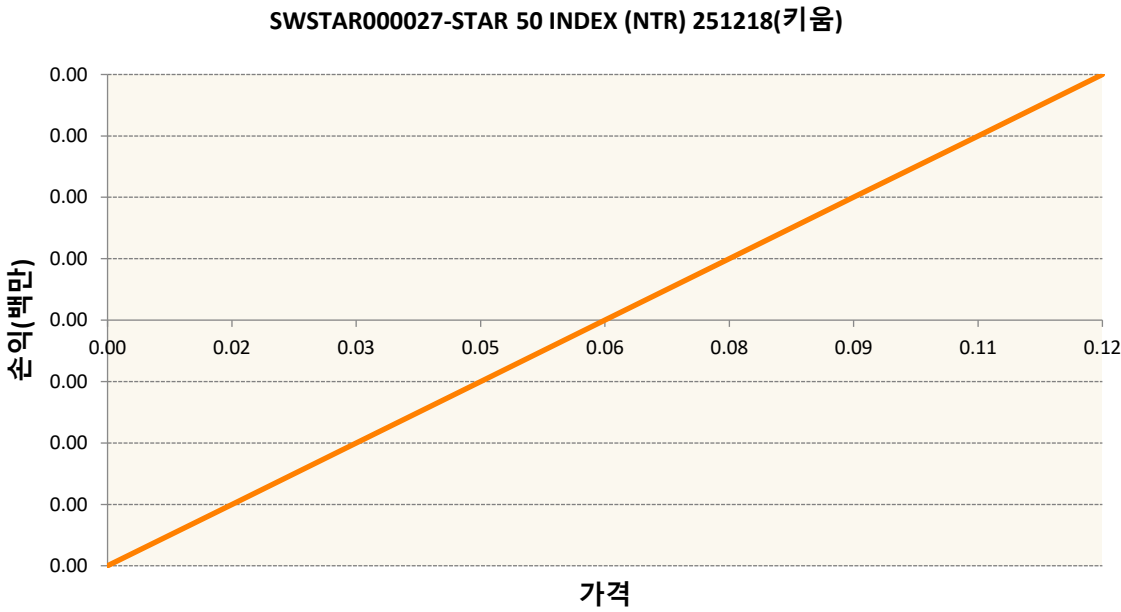
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

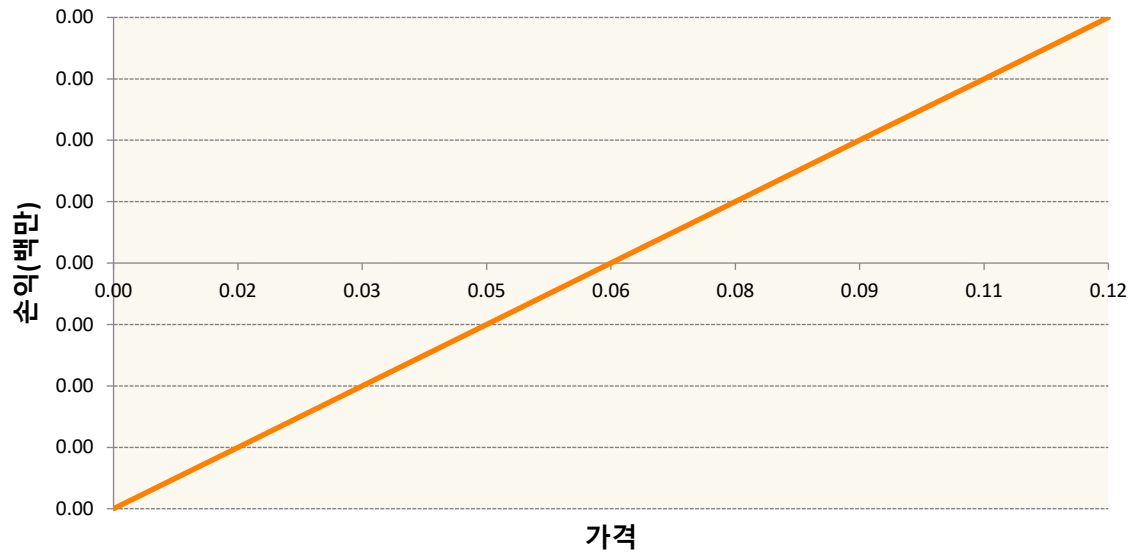
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	1,518	0	1,518	장외

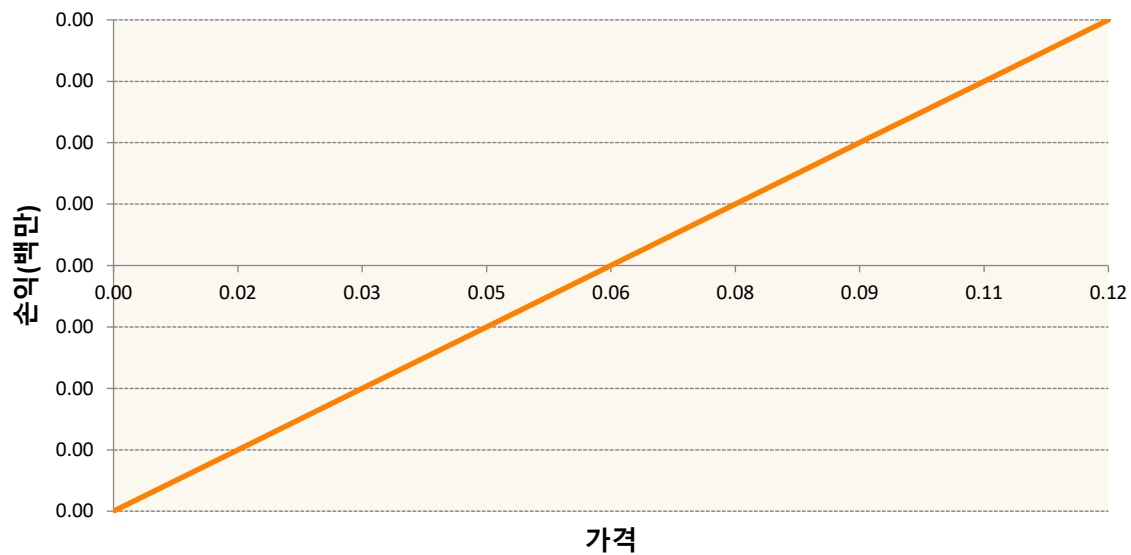
2. 만기시점의 손익구조



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)

4
14
69
26

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

(단위:백만원)

169

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

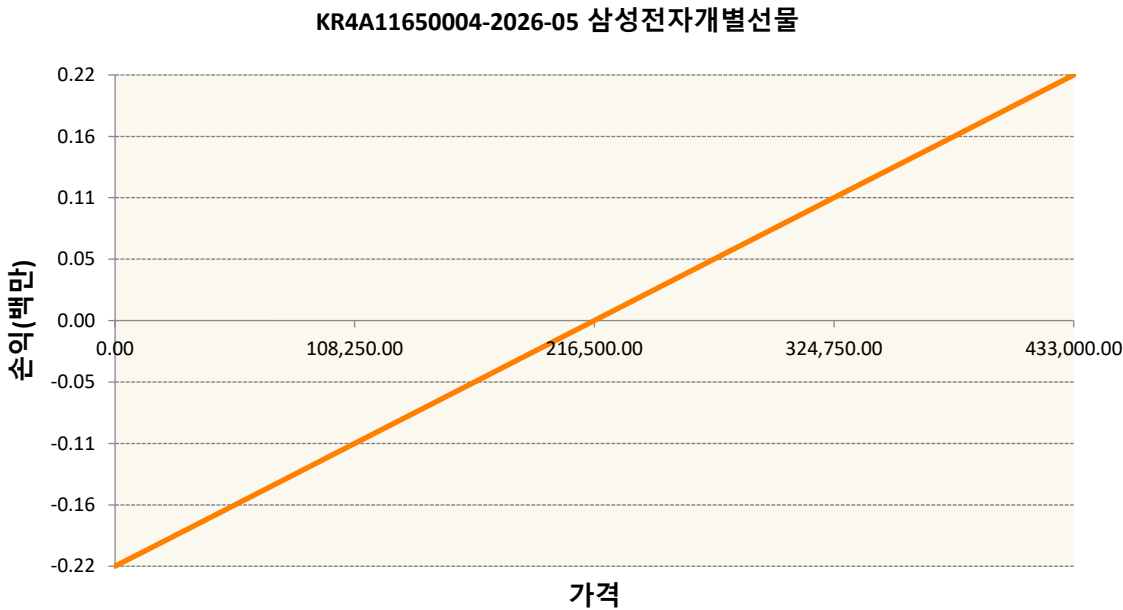
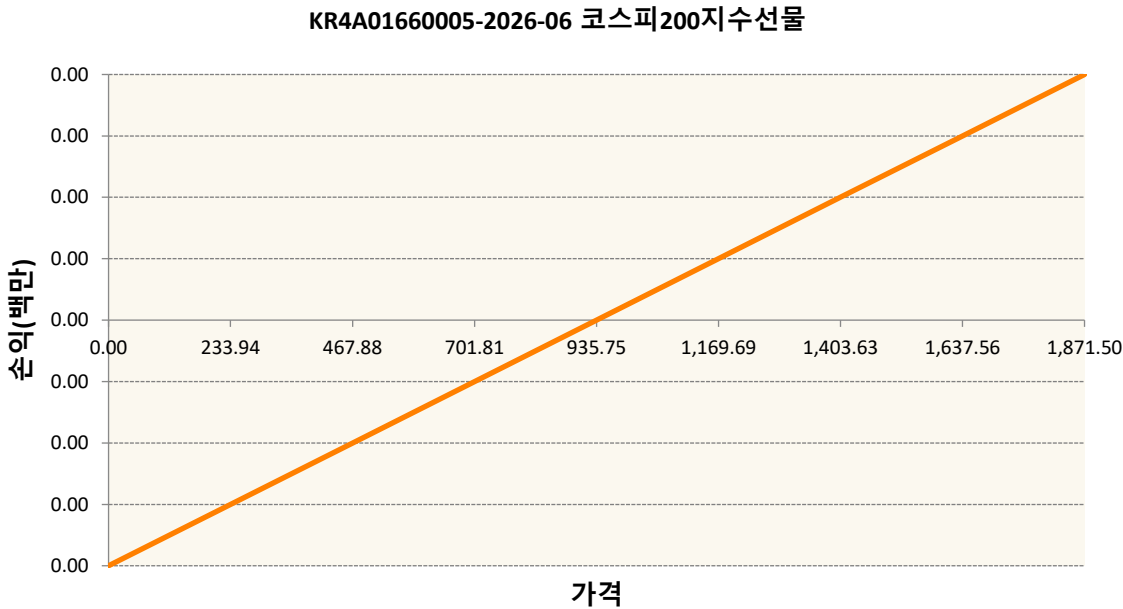
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

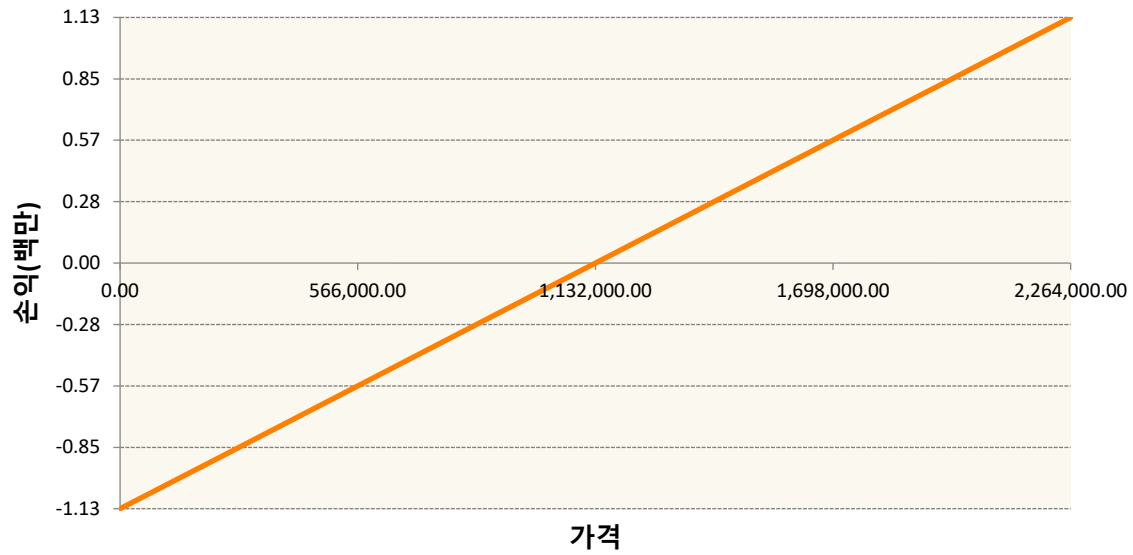
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	234	-234	장내
누계	유가증권	선물	19,431	1,838	17,594	장내

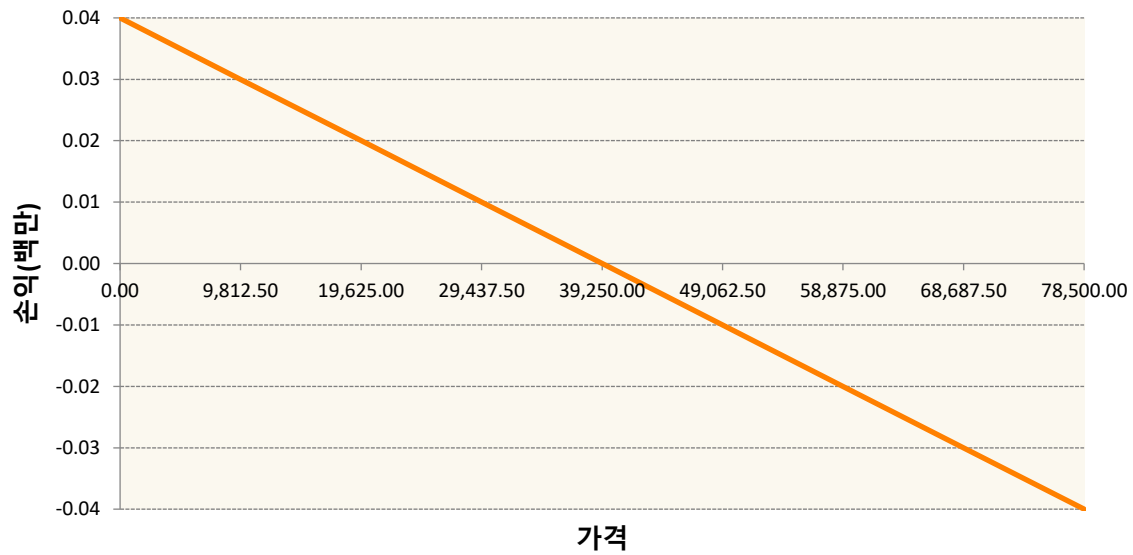
2. 만기시점의 손익구조



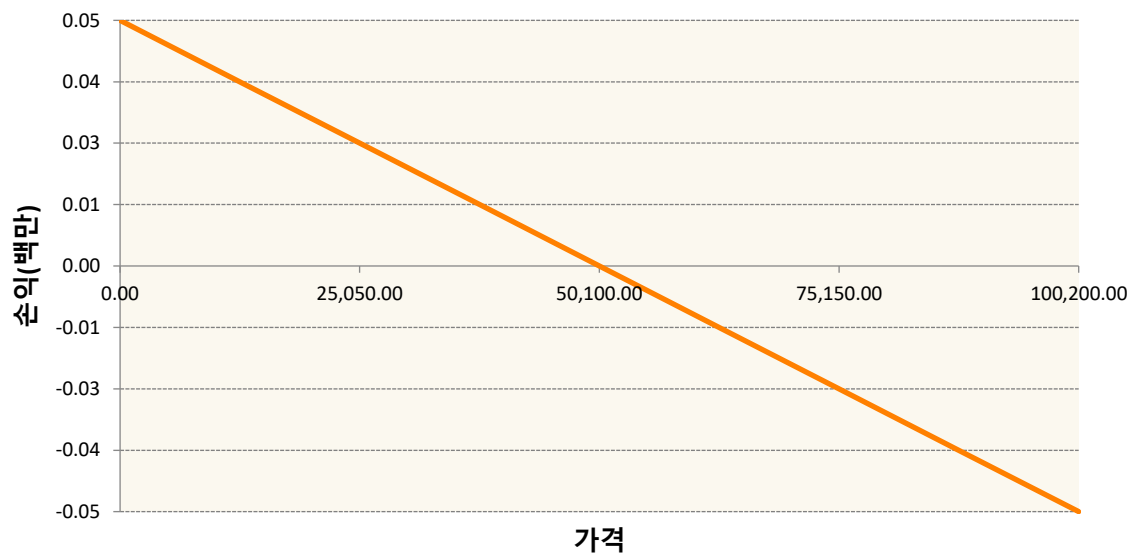
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



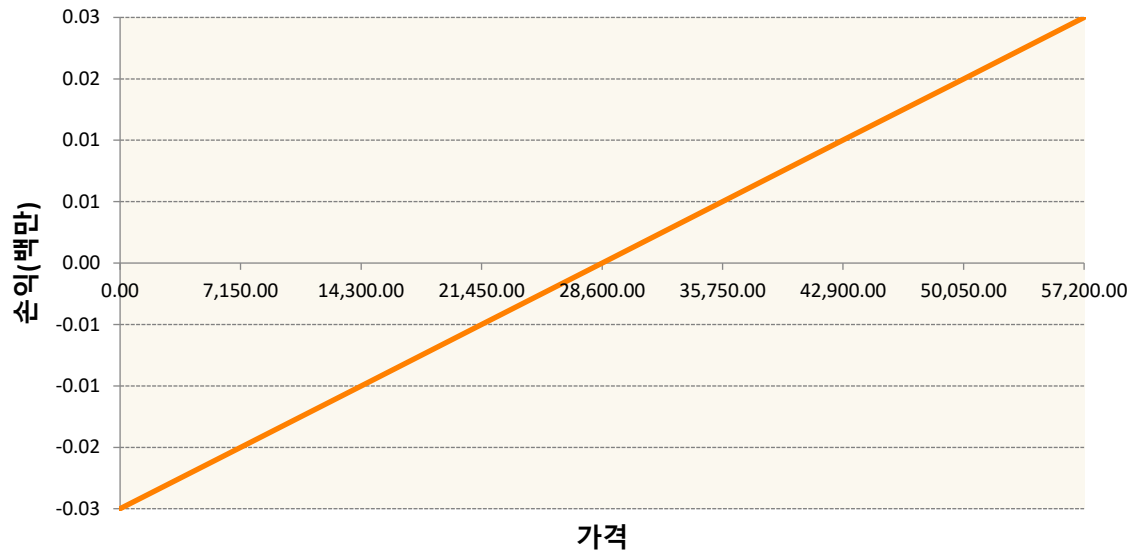
KR4A51650005-2026-05 GS건설개별선물



KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005			2026-06 코스피200지수선물				1,211
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,211	-1,211	-1,211	-1,211	-1,211	-1,211	-1,211
-5.33%	-807	-807	-807	-807	-807	-807	-807
-2.67%	-404	-404	-404	-404	-404	-404	-404
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	404	404	404	404	404	404	404
5.33%	807	807	807	807	807	807	807
8.00%	1,211	1,211	1,211	1,211	1,211	1,211	1,211
KR4A11650004			2026-05 삼성전자개별선물				179
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179
-5.33%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	60	60	60	60	60	60	60
5.33%	119	119	119	119	119	119	119
8.00%	179	179	179	179	179	179	179
KR4A50650006			2026-05 SK하이닉스개별선물				97
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-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%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	97	97	97	97	97	97	97
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							128
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	128	128	128	128	128	128	128
-5.33%	85	85	85	85	85	85	85
-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%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
8.00%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
KR4AFT650007 2026-05 대우건설개별선물							62
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	41	41	41	41	41	41	41
8.00%	62	62	62	62	62	62	62

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

(단위:백만원)

3,738

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

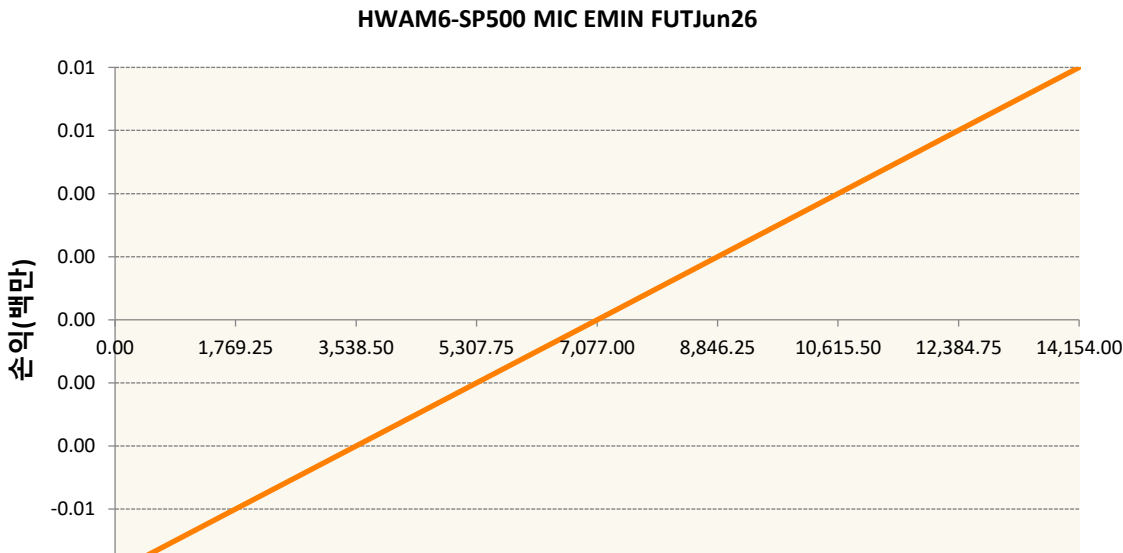
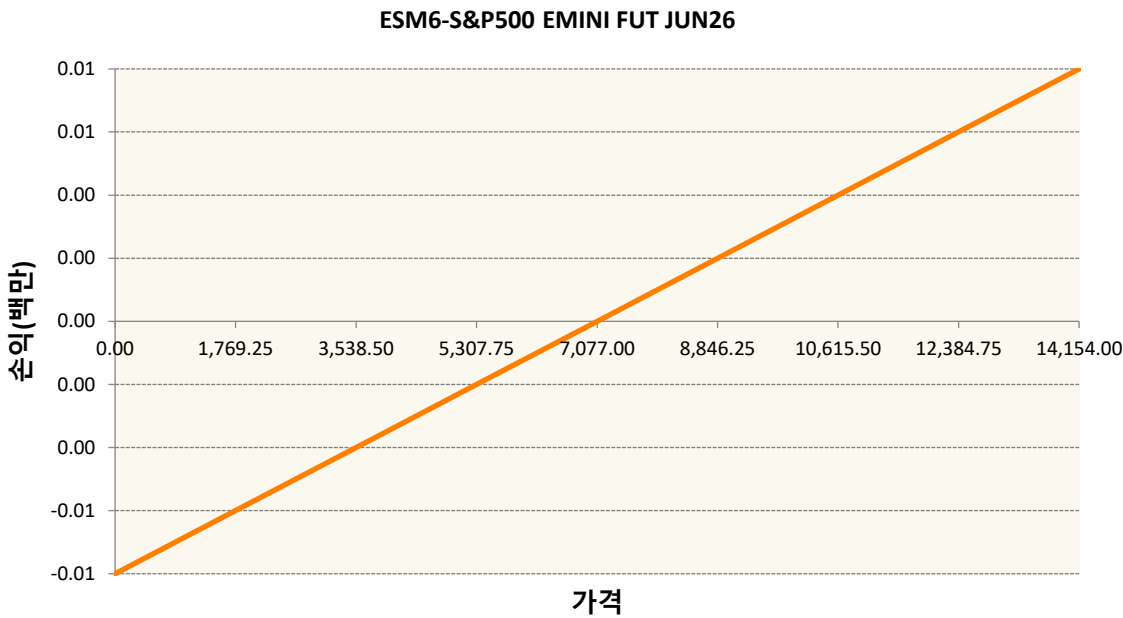
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

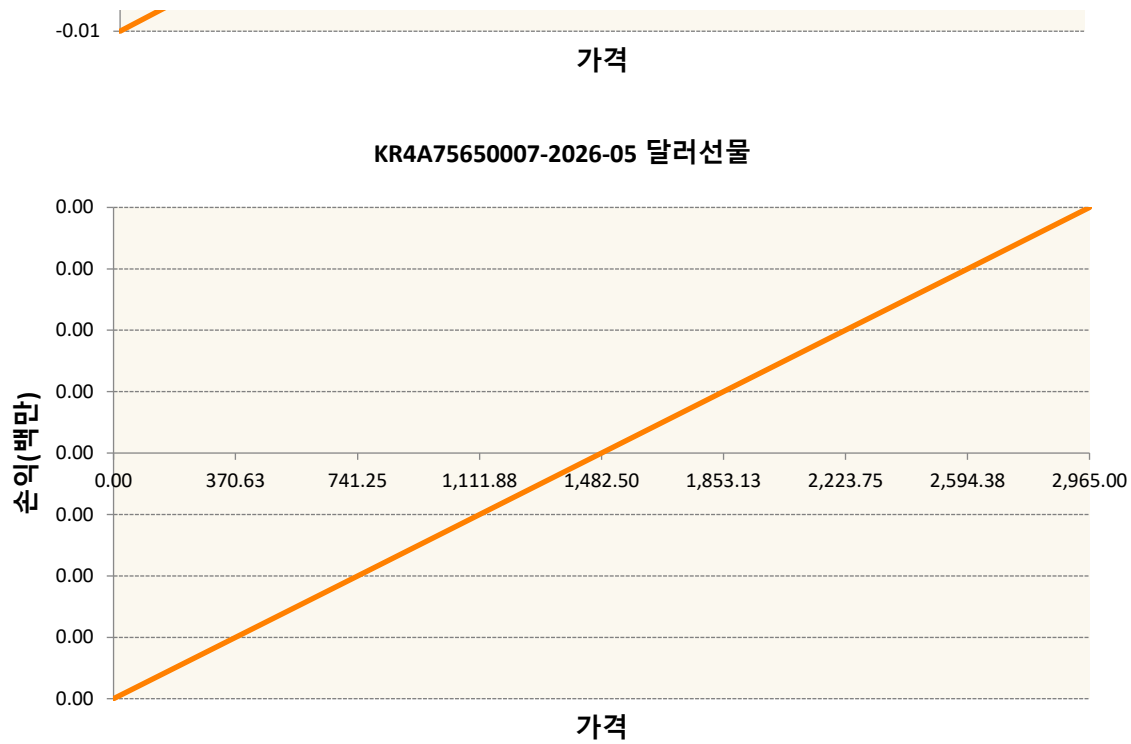
1. 계약금액

(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	57,340	0	57,340	
누계	지수	선물	161	0	161	장내
누계	통화	선물	10,526	0	10,526	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,587
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	13
KR4A756500 2026-05 달러선물		842

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

(단위:백만원)

3,999

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

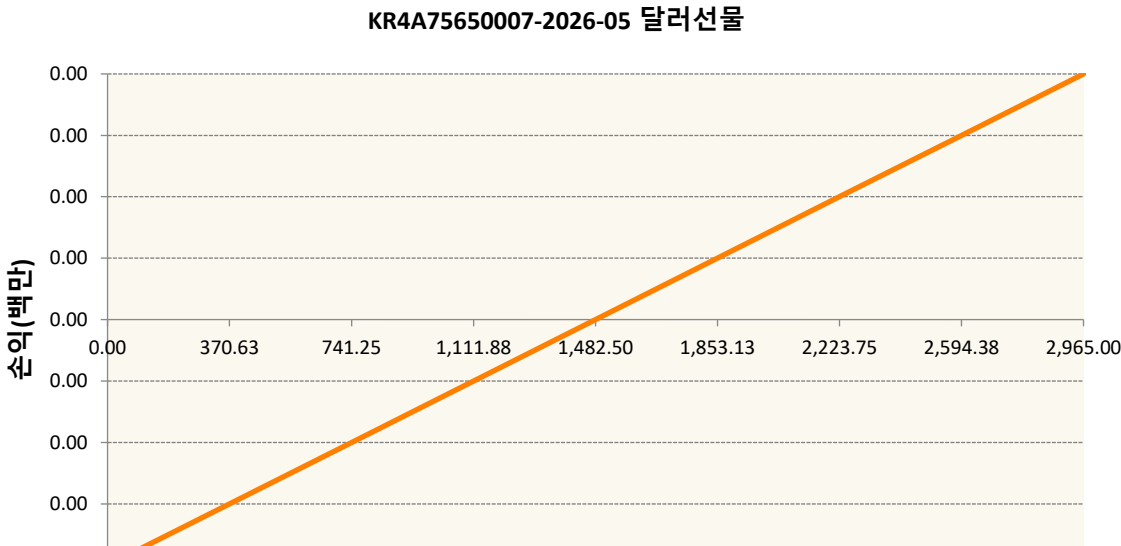
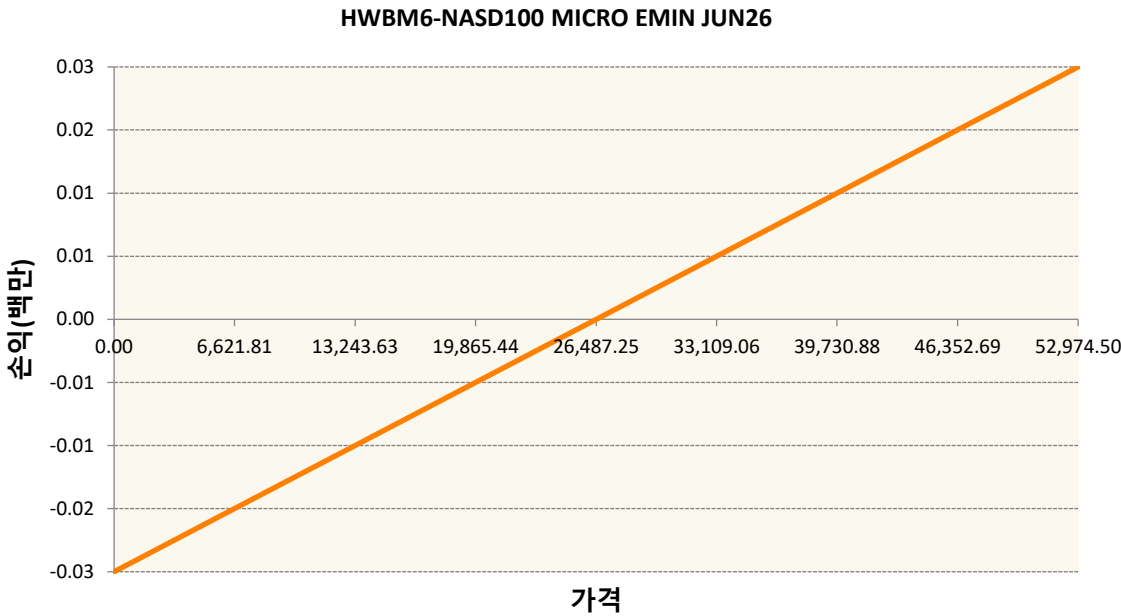
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

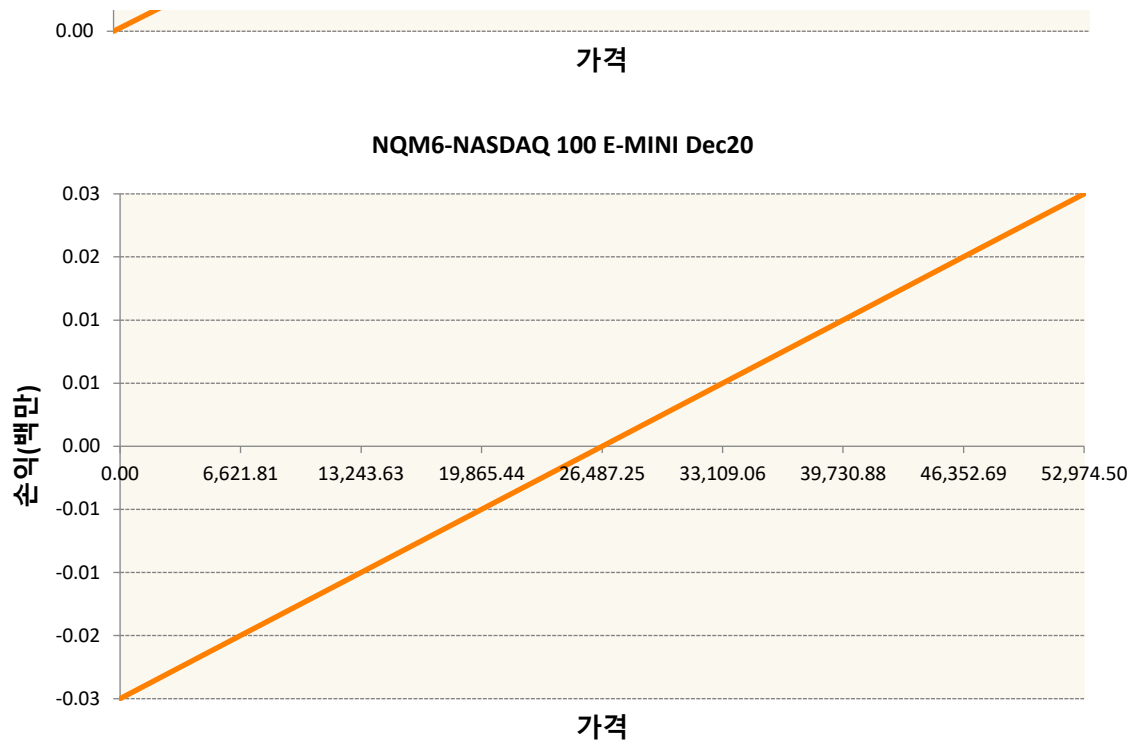
1. 계약금액

(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	24,635	0	24,635	
누계	유가증권	선물	394	0	394	장내
누계	통화	선물	3,869	0	3,869	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBM6 NASD100 MICRO EMIN JUN26

32

KR4A756500 2026-05 달러선물

310

NQM6 NASDAQ 100 E-MINI Dec20

1,971

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

(단위:백만원)

2,199

공시일	2026-04-20
기준일	2026-04-17

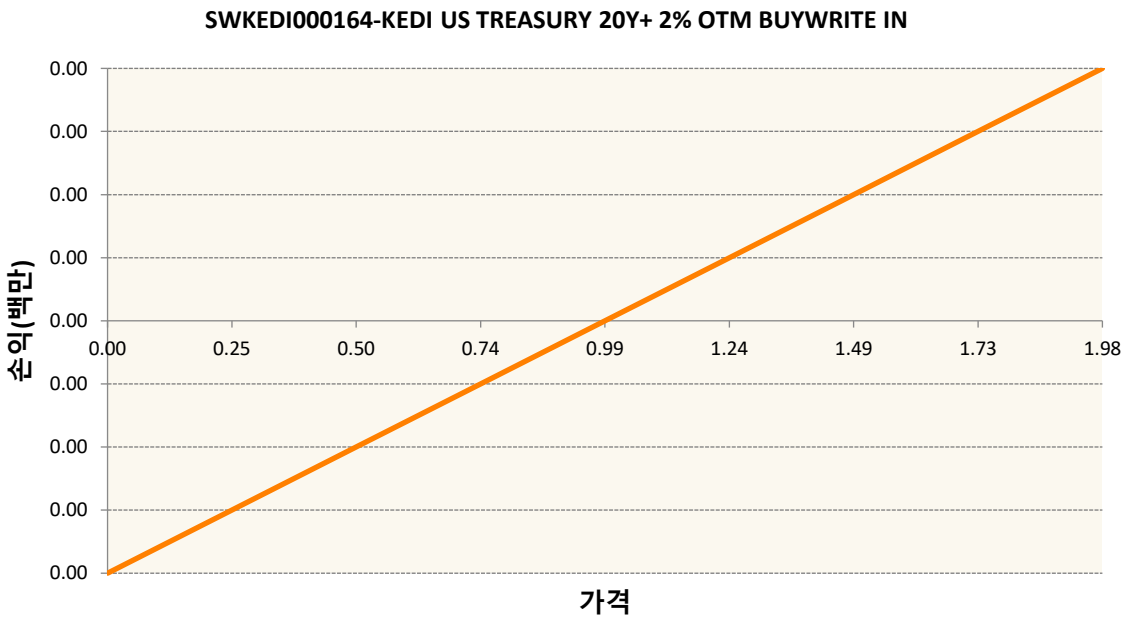
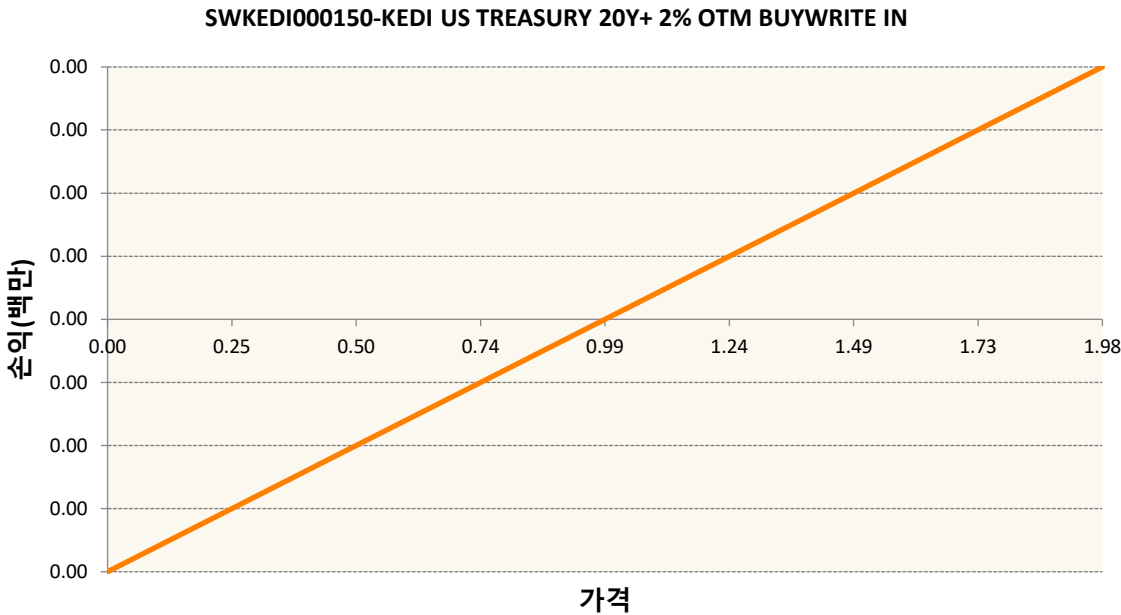
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

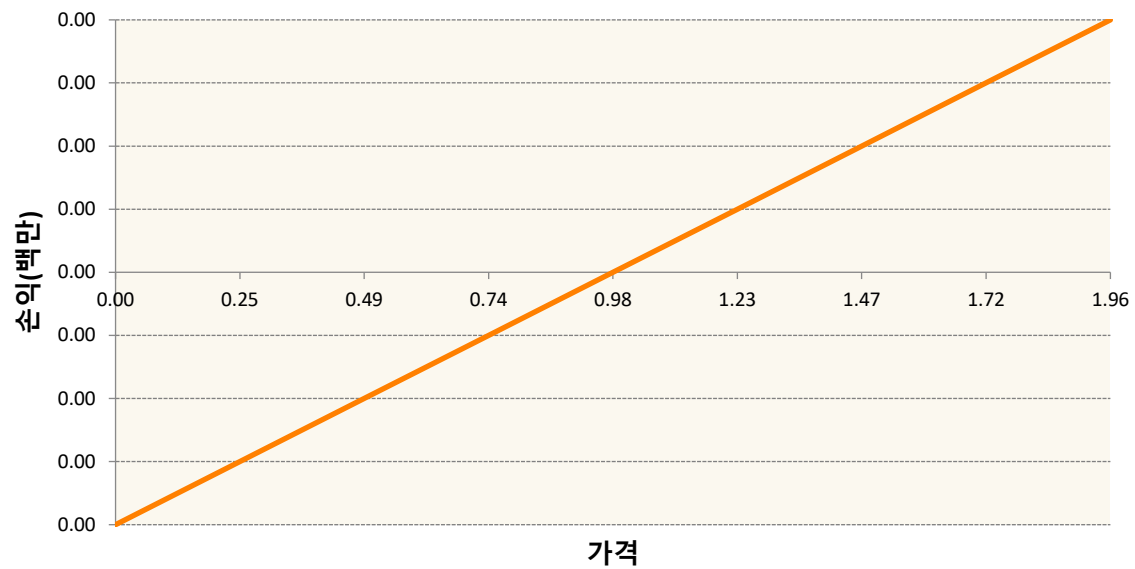
(단위:백만원)

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

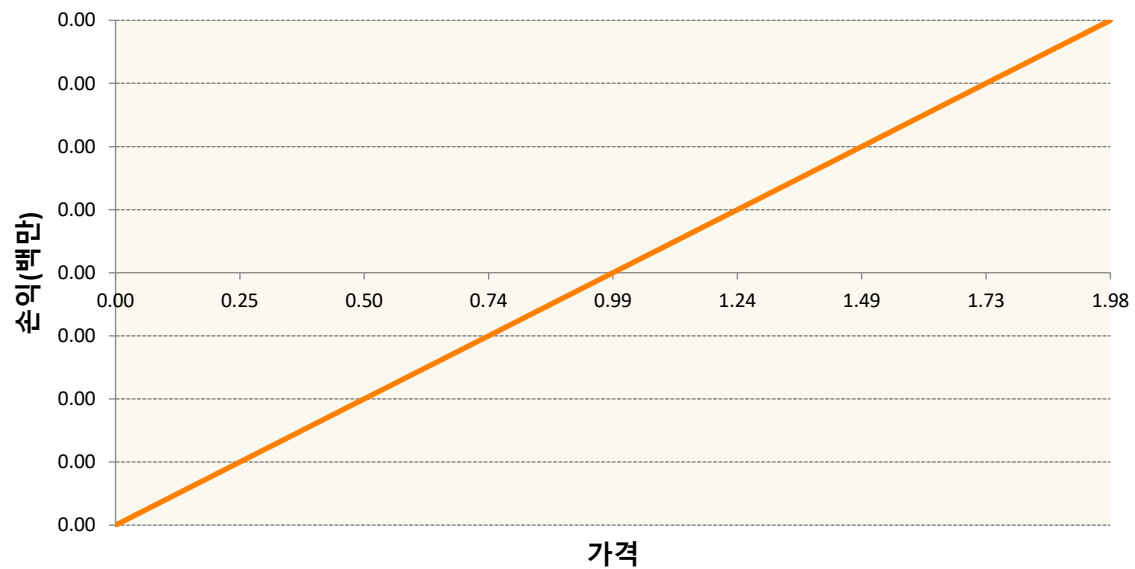
2. 만기시점의 손익구조



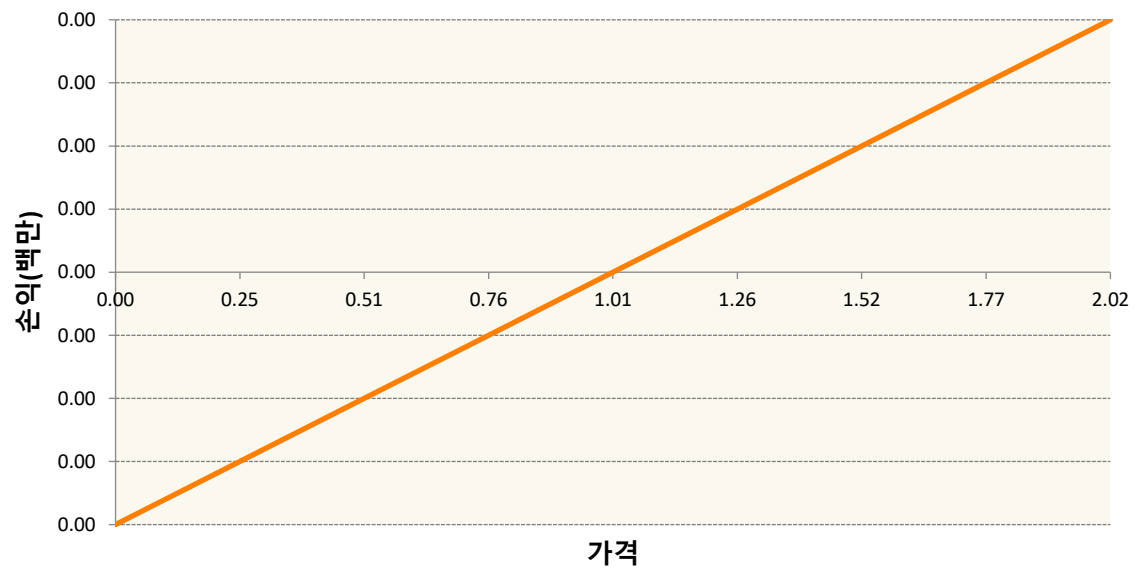
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,310
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		152
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,710
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,411
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,924

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,177