

공시일	2026-04-24
기준일	2026-04-23

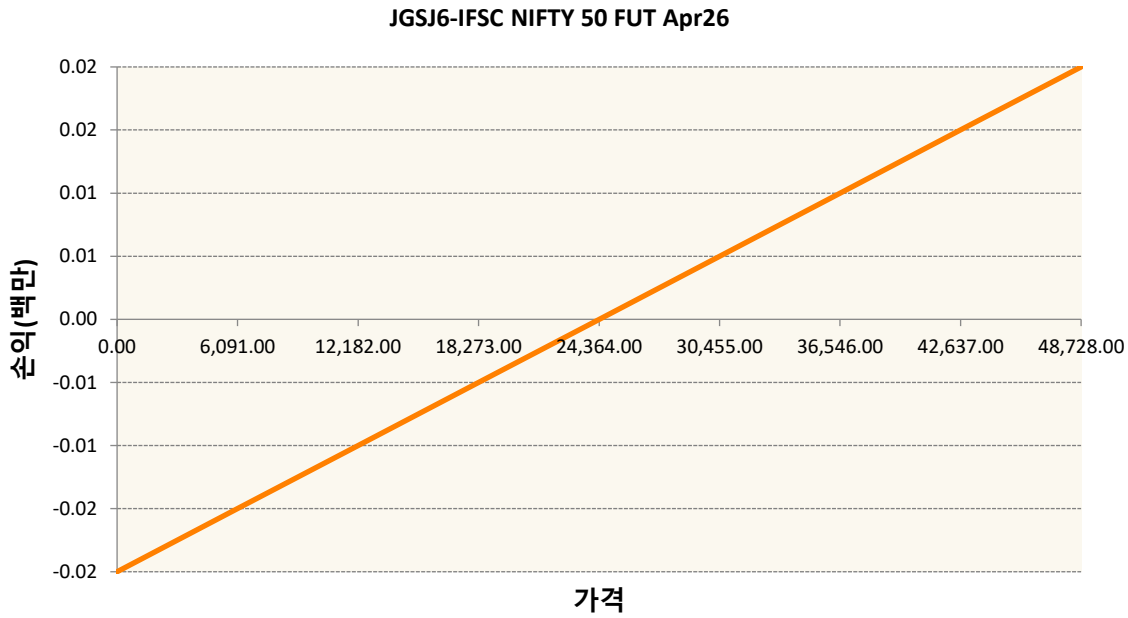
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	660	0	660	

### 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)

37

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

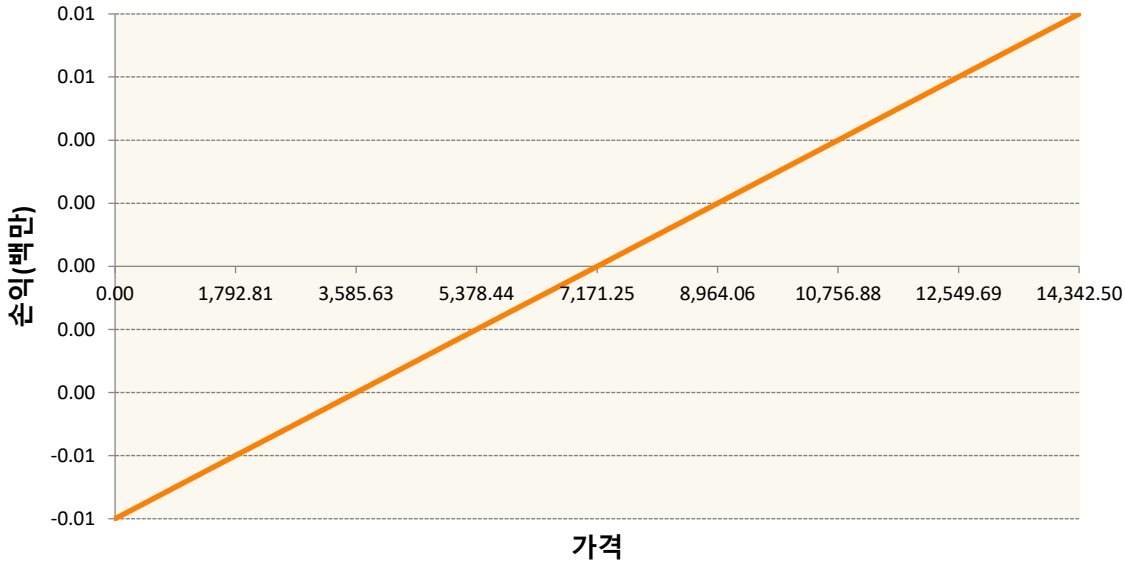
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

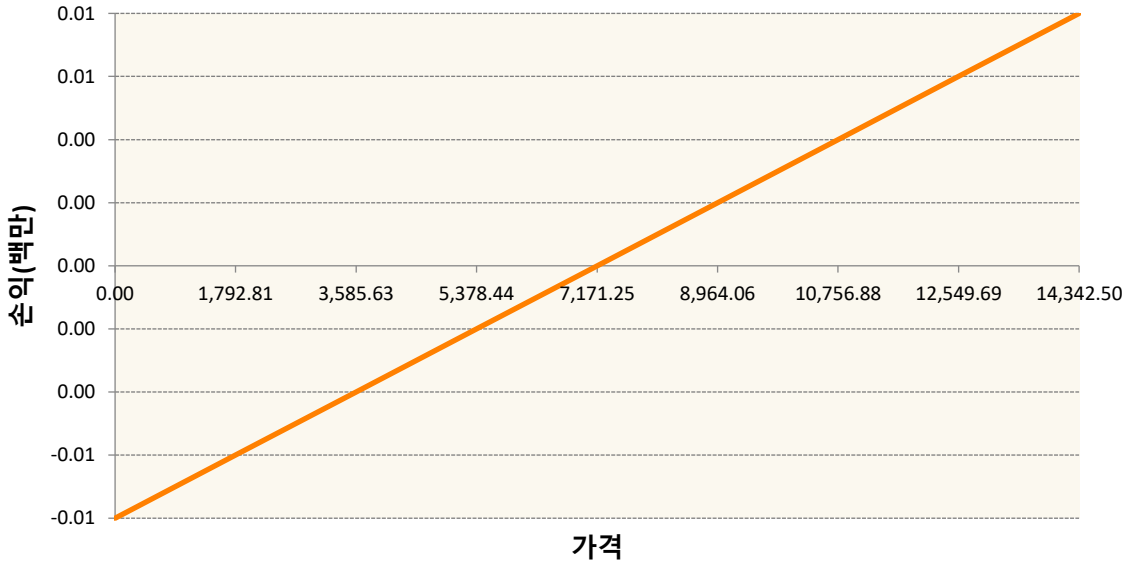
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	538	0	538	
누계	지수	선물	162	0	162	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

ESM6-S&P500 EMINI FUT JUN26



HWAM6-SP500 MIC EMIN FUTJun26



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	43
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	49

공시일	2026-04-24
기준일	2026-04-23

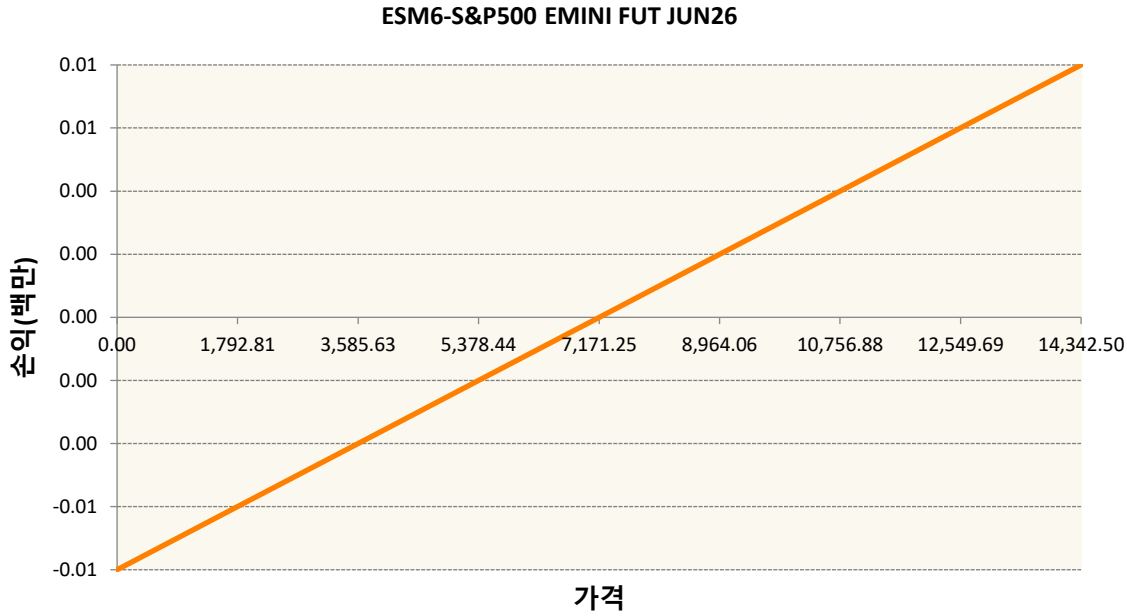
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,075	0	1,075	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	86
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

75

공시일	2026-04-24
기준일	2026-04-23

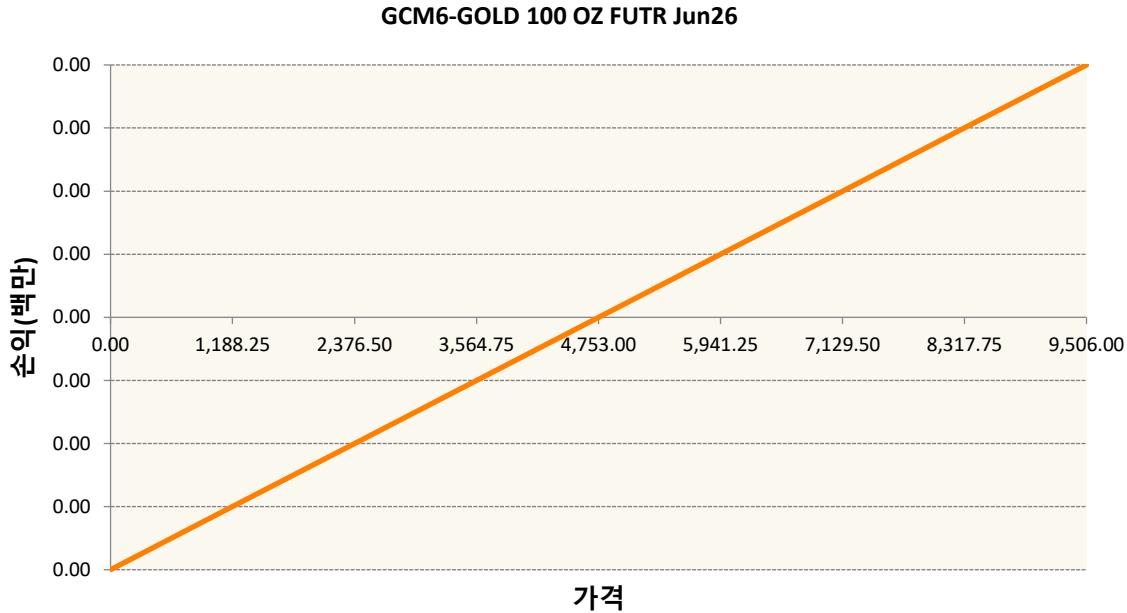
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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	5,721	0	5,721	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 04/24/26 C447 EQUITY	20
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	458

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

(단위:백만원)

<b>598</b>
------------

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 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)

AOPLTRSCC`PLTR US 04/24/26 C155 EQUITY

31

AOPLTRSCP1PLTR US 04/24/26 P155 EQUITY

84

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

(단위:백만원)

354

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 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)

AOTLTUSC6TLT US 04/24/26 C86.5 EQUITY

26

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

(단위:백만원)

16

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

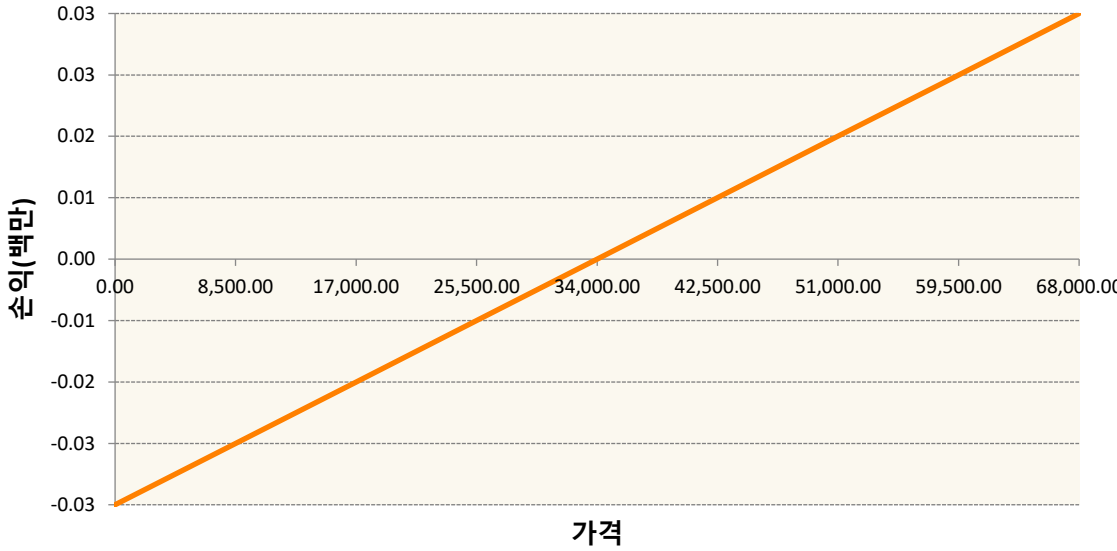
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

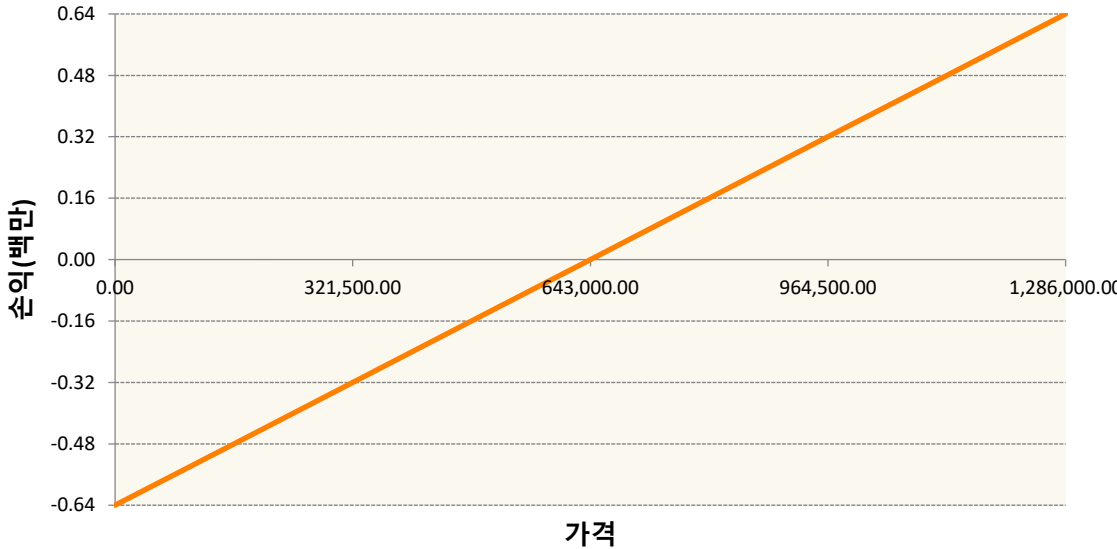
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	13,282	0	13,282	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	27,925	0	27,925	장내
누계	유가증권	스왑	186,084	0	186,084	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

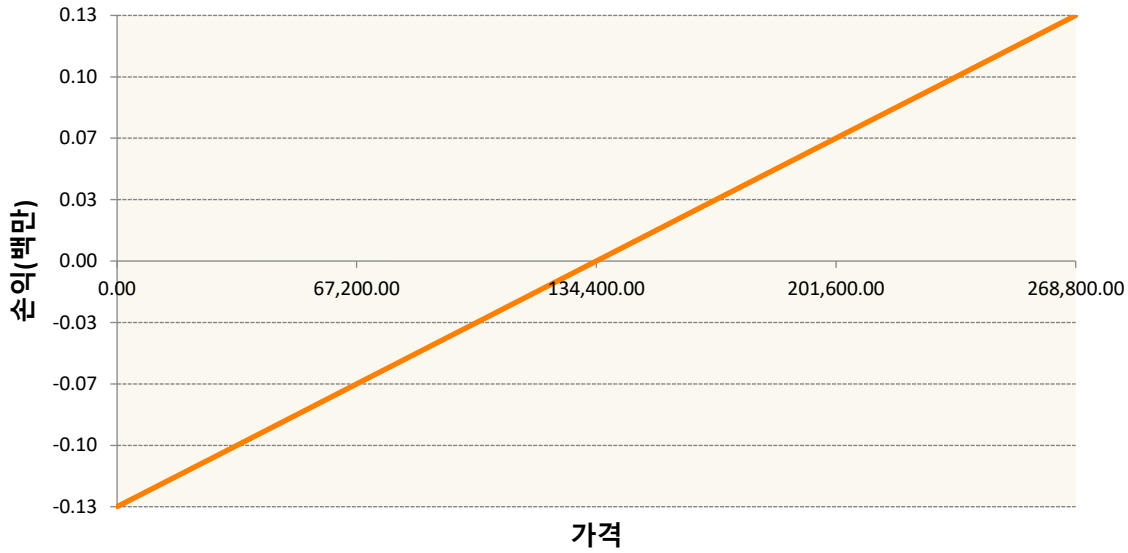
KR4ABF650007-2026-05 삼성중공업개별선물



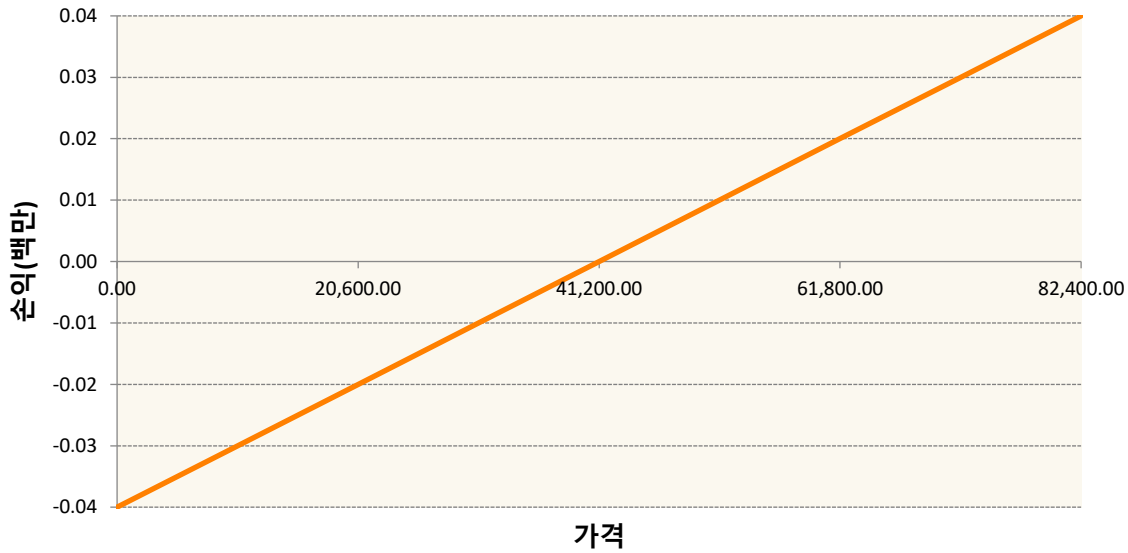
KR4AFD650005-2026-05 HD현대중공업개별선물



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007		2026-05 삼성중공업개별선물					979
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-979	-979	-979	-979	-979	-979	-979
-5.33%	-653	-653	-653	-653	-653	-653	-653
-2.67%	-326	-326	-326	-326	-326	-326	-326
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	326	326	326	326	326	326	326
5.33%	653	653	653	653	653	653	653
8.00%	979	979	979	979	979	979	979
KR4AFD650005		2026-05 HD현대중공업개별선물					974
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-974	-974	-974	-974	-974	-974	-974
-5.33%	-650	-650	-650	-650	-650	-650	-650
-2.67%	-325	-325	-325	-325	-325	-325	-325
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	325	325	325	325	325	325	325
5.33%	650	650	650	650	650	650	650
8.00%	974	974	974	974	974	974	974
KR4AFV650003                      2026-05 한화오션개별선물							277
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277
-5.33%	-185	-185	-185	-185	-185	-185	-185
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	185	185	185	185	185	185	185
8.00%	277	277	277	277	277	277	277

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

(단위:백만원)

**3,396**

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 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 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

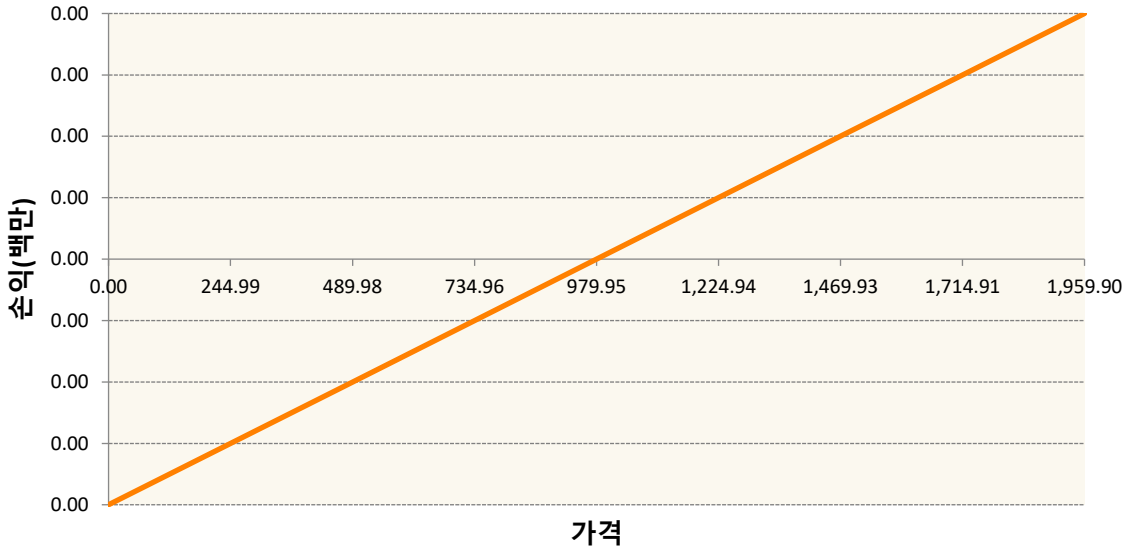
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

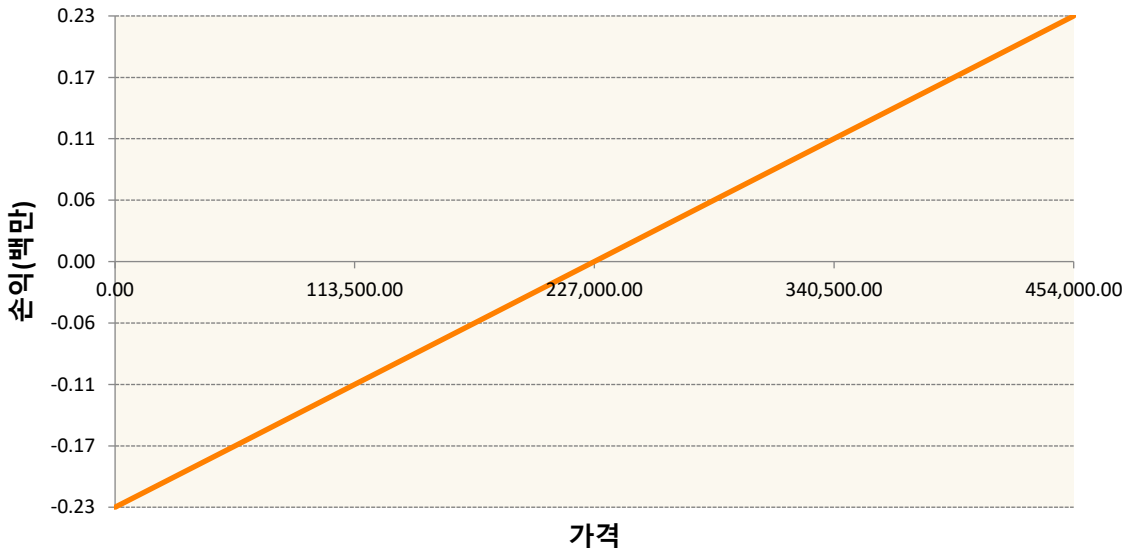
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	30,057	-30,057	장내
누계	유가증권	선물	12,953	29,599	-16,647	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

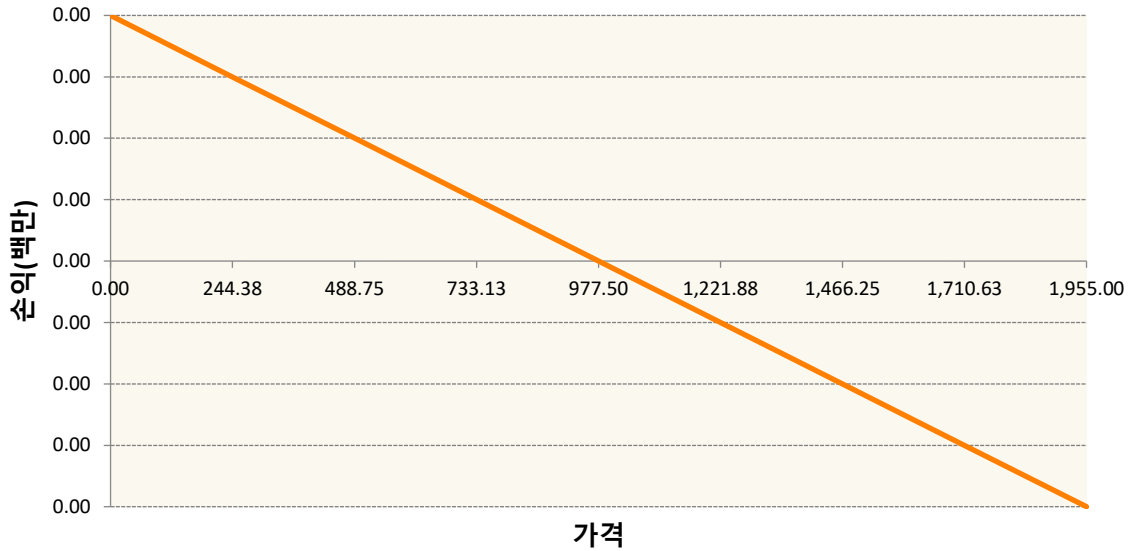
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



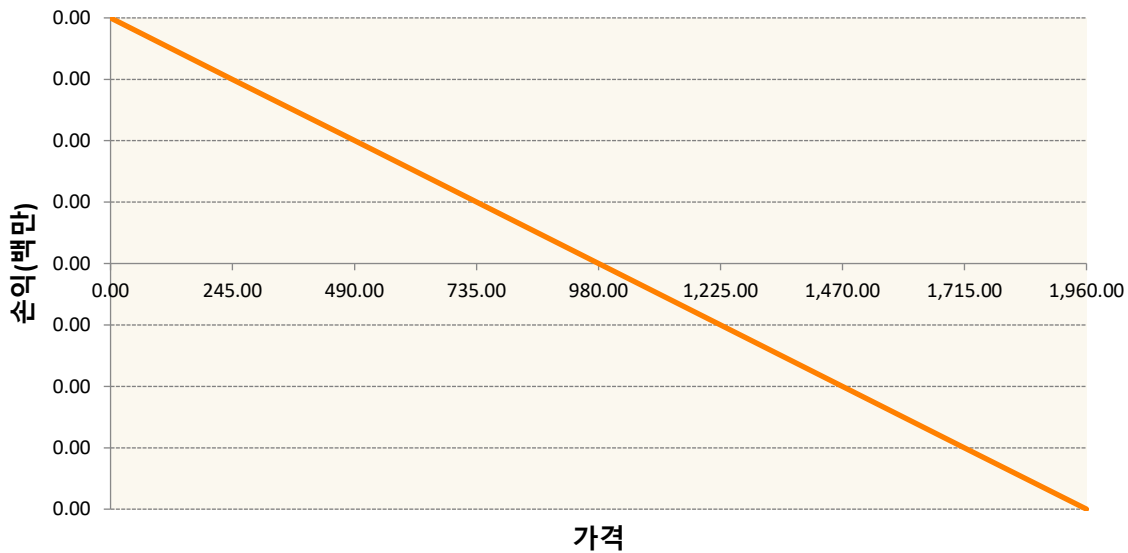
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4BAFBA9779-코스피위클리M C 2604W4 977.5



KR4BAFBA9803-코스피위클리M C 2604W4 980.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물							507
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-507	-507	-507	-507	-507	-507	-507
-5.33%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338
-2.67%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	169	169	169	169	169	169	169
5.33%	338	338	338	338	338	338	338
8.00%	507	507	507	507	507	507	507
KR4A11650004 2026-05 삼성전자개별선물							521
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-521	-521	-521	-521	-521	-521	-521
-5.33%	-347	-347	-347	-347	-347	-347	-347
-2.67%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	174	174	174	174	174	174	174
5.33%	347	347	347	347	347	347	347
8.00%	521	521	521	521	521	521	521
KR4BAFBA9779 코스피위클리M C 2604W4 977.5							1,424

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,424	1,424	1,424	1,424	1,424	1,424	1,424
-5.33%	950	950	950	950	950	950	950
-2.67%	475	475	475	475	475	475	475
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475
5.33%	-950	-950	-950	-950	-950	-950	-950
8.00%	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424	-1,424
KR4BAFBA9803 코스피위클리M C 2604W4 980.0							937

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	937	937	937	937	937	937	937
-5.33%	624	624	624	624	624	624	624
-2.67%	312	312	312	312	312	312	312
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-312	-312	-312	-312	-312	-312	-312
5.33%	-624	-624	-624	-624	-624	-624	-624
8.00%	-937	-937	-937	-937	-937	-937	-937

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

(단위:백만원)

7,386

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 포커스농산물모(채권-파생형)

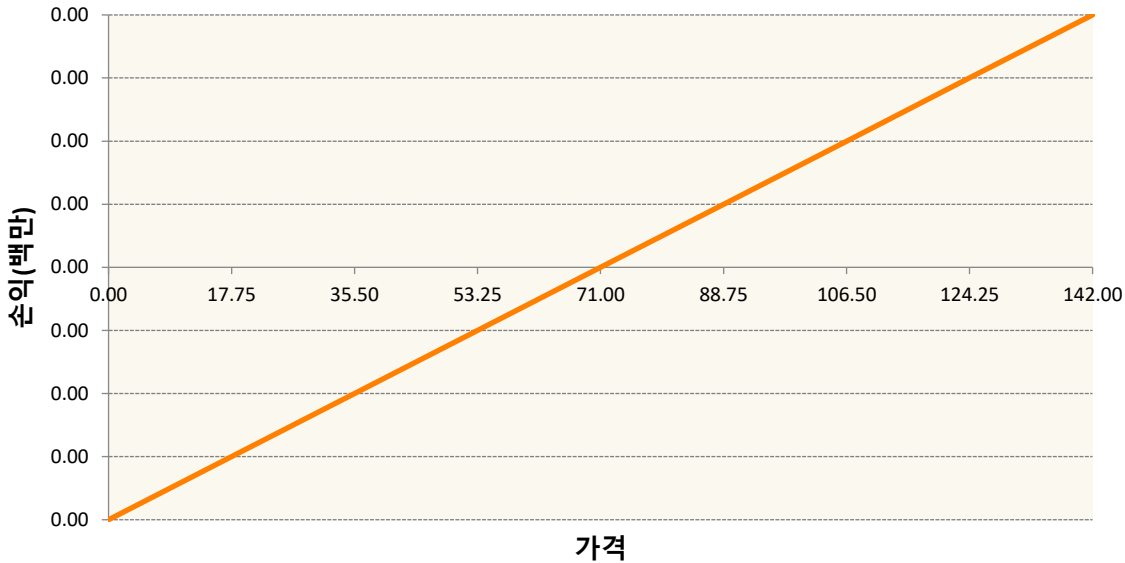
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

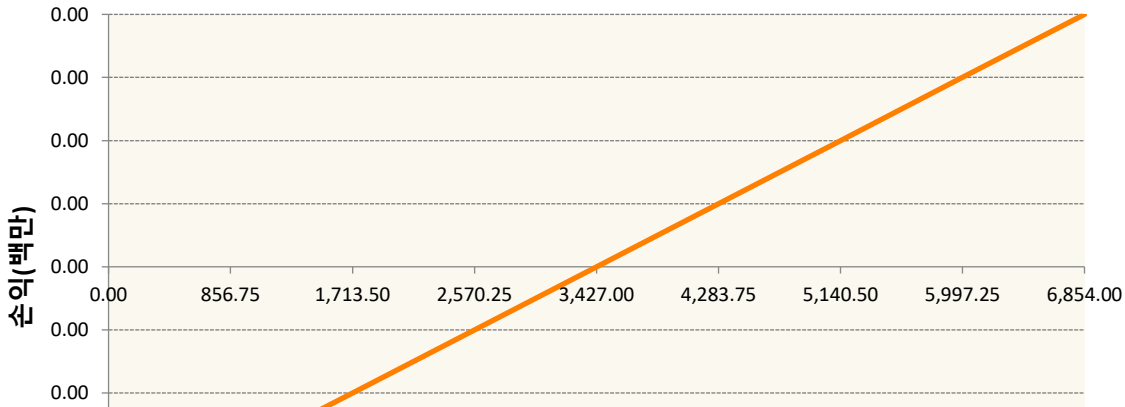
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	102	0	102	
누계	실물자산	선물	886	0	886	장내
누계	유가증권	선물	2,028	0	2,028	
누계	통화	선물	0	355	-355	장내

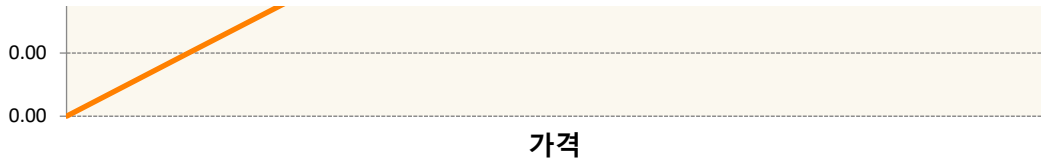
### 2. 만기시점의 손익구조

BON6-SOYBEAN OIL FUTR Jul26

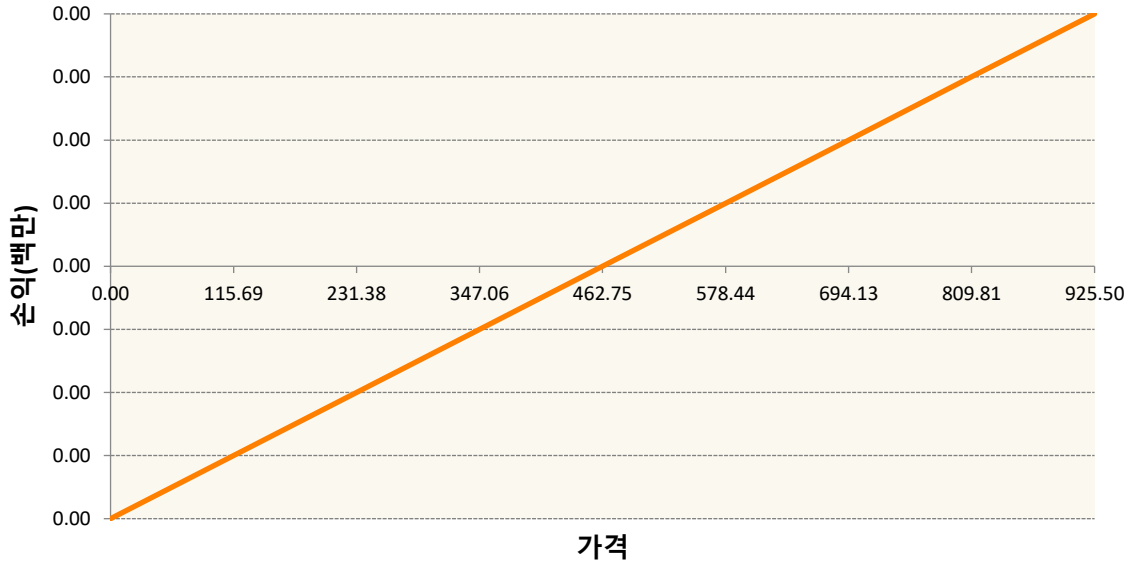


CCN6-COCOA FUTURE Jul26

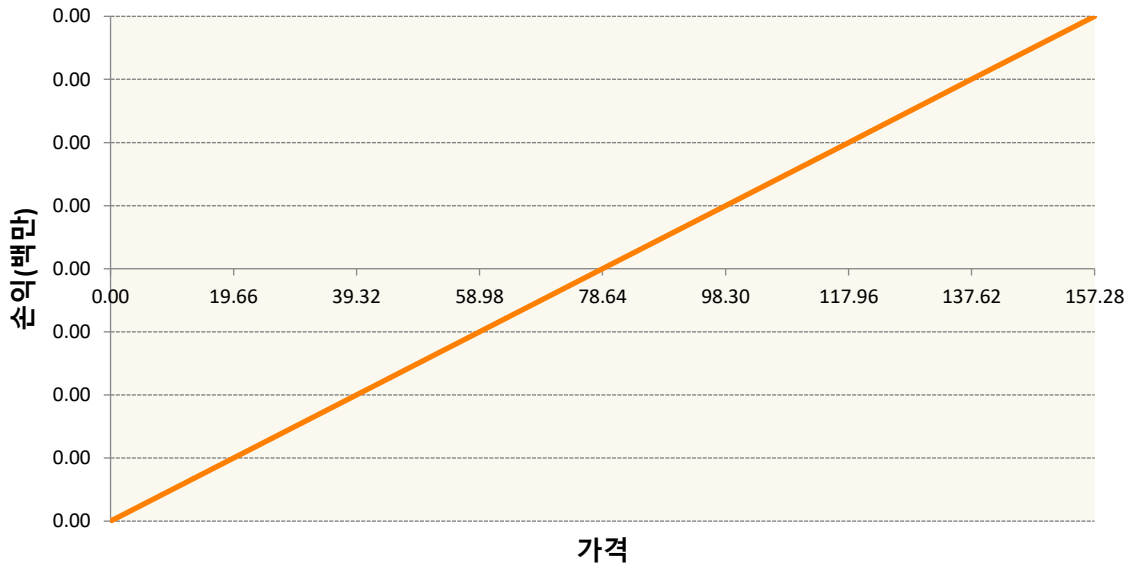




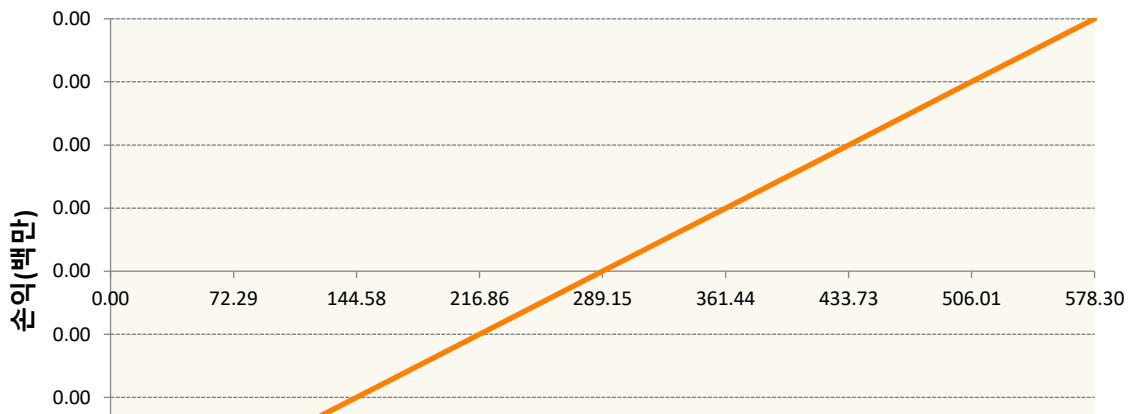
**CN6-CORN FUTURE Jul26**

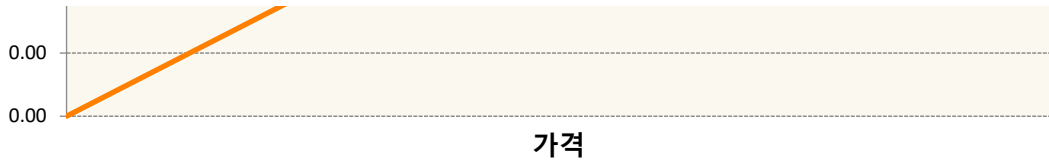


**CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26**

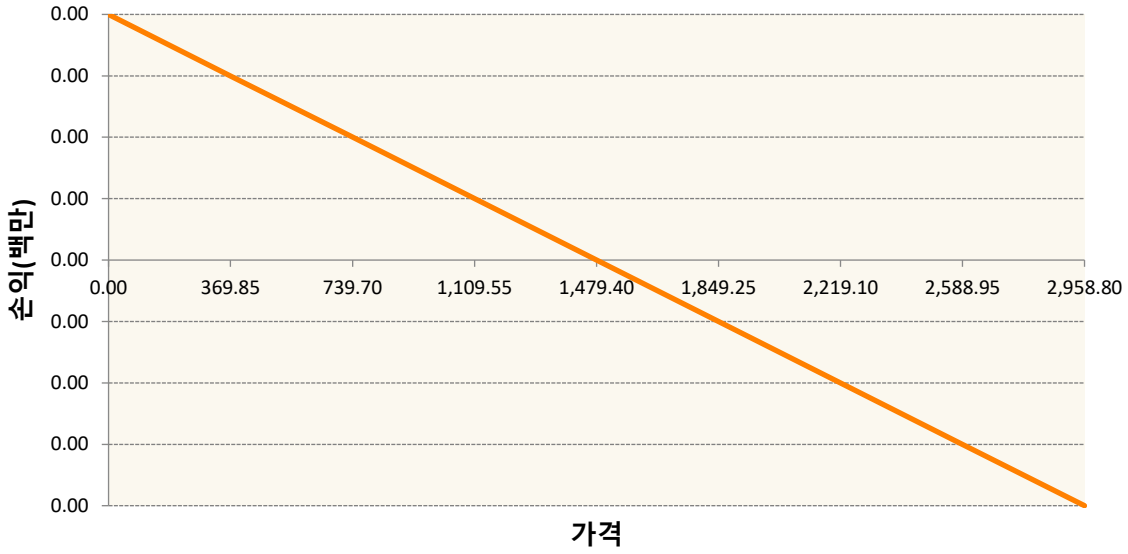


**KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26**

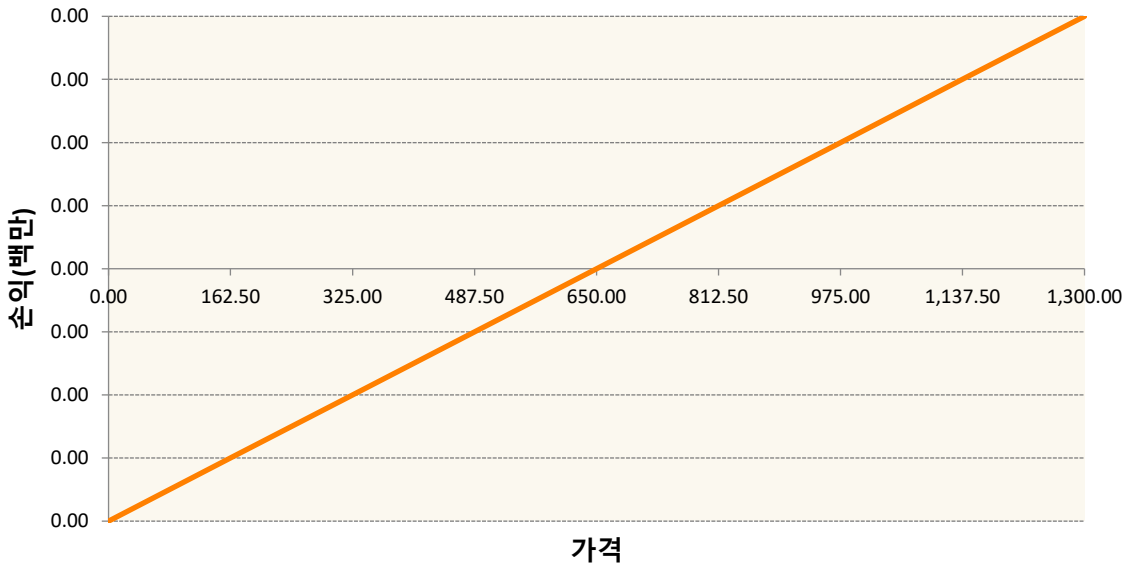




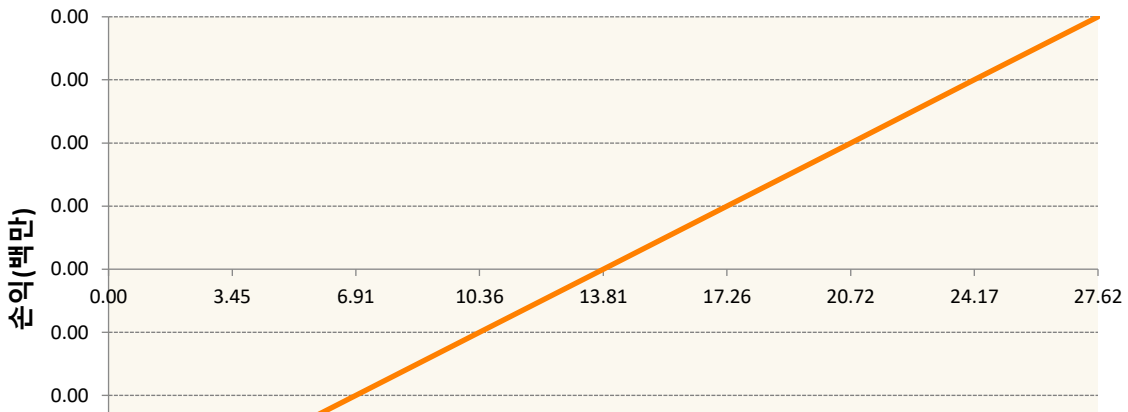
**KR4A75650007-2026-05 달러선물**

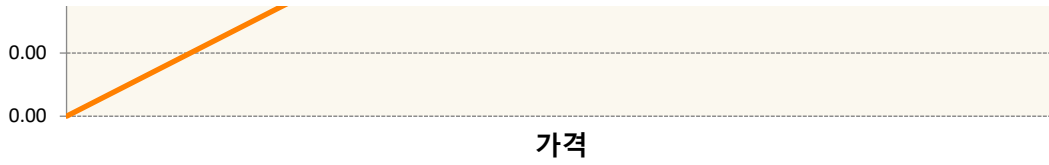


**KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26**

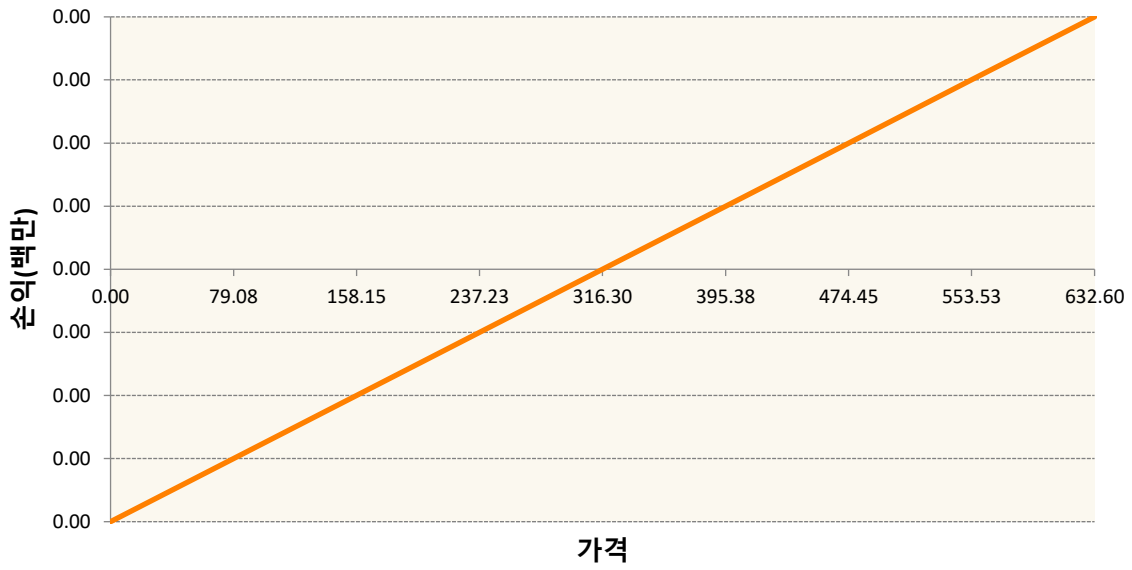


**SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26**

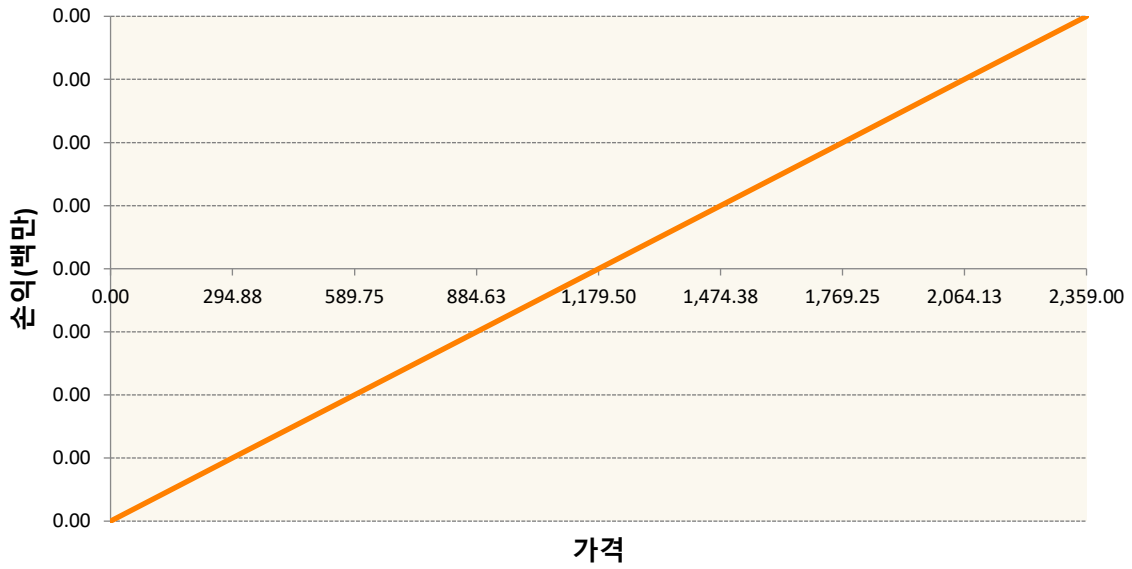




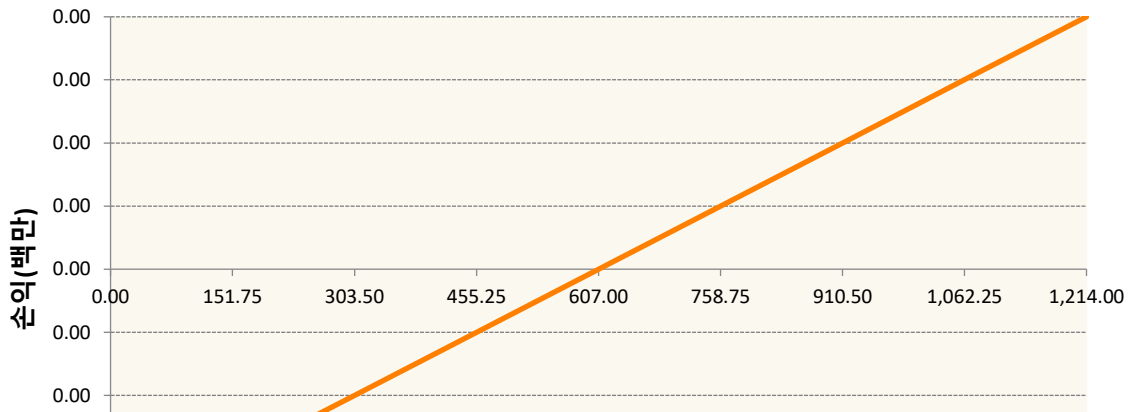
**SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26**

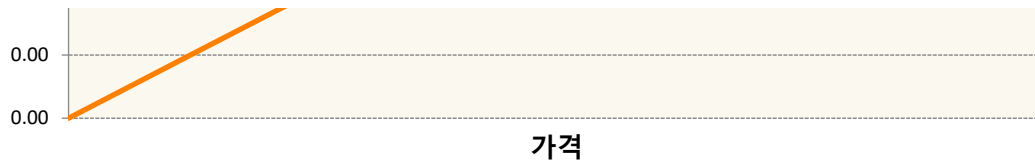


**SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26**



**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 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 스마트인덱스모

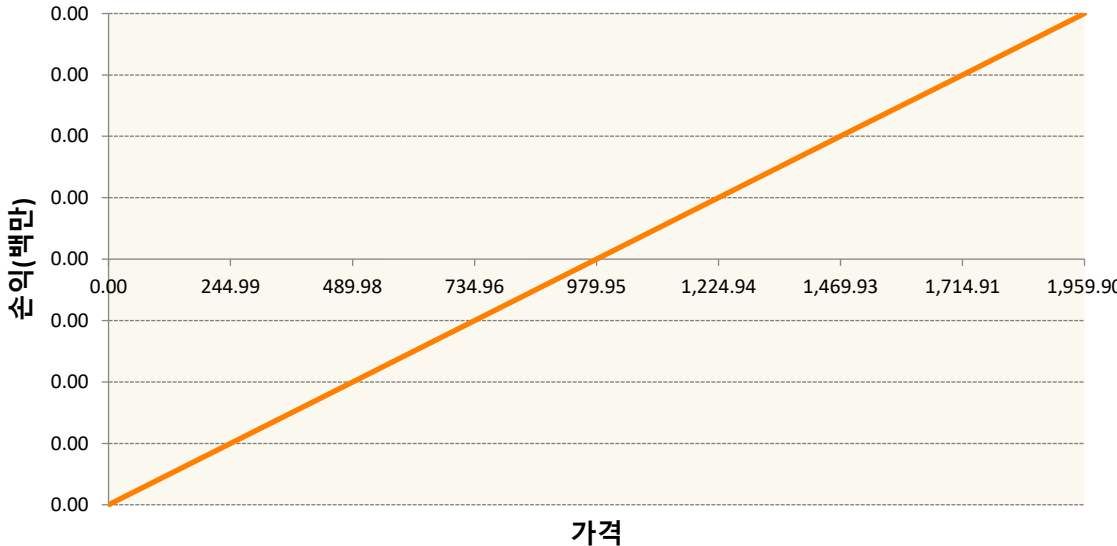
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

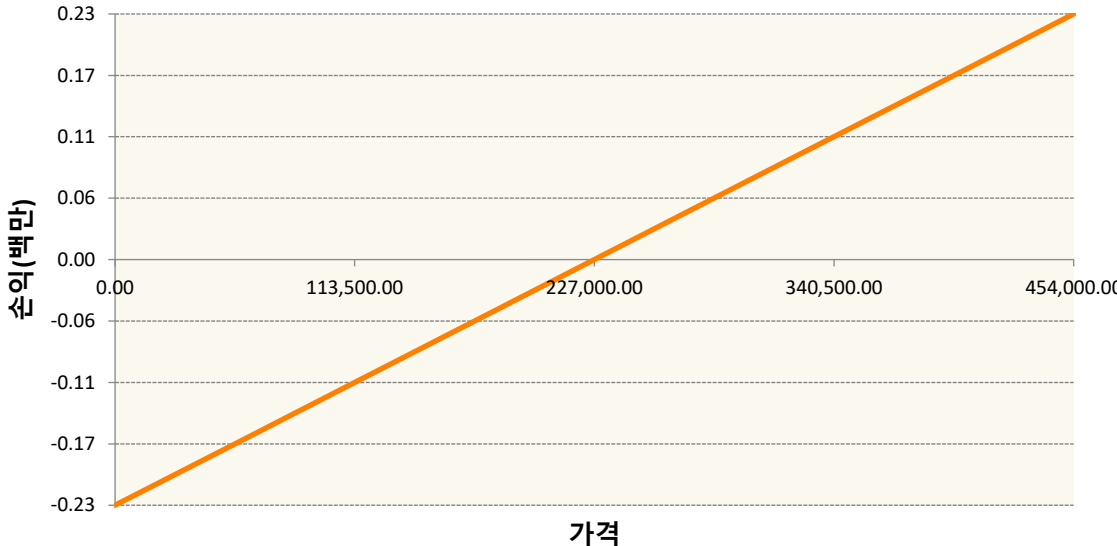
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,882	0	2,882	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

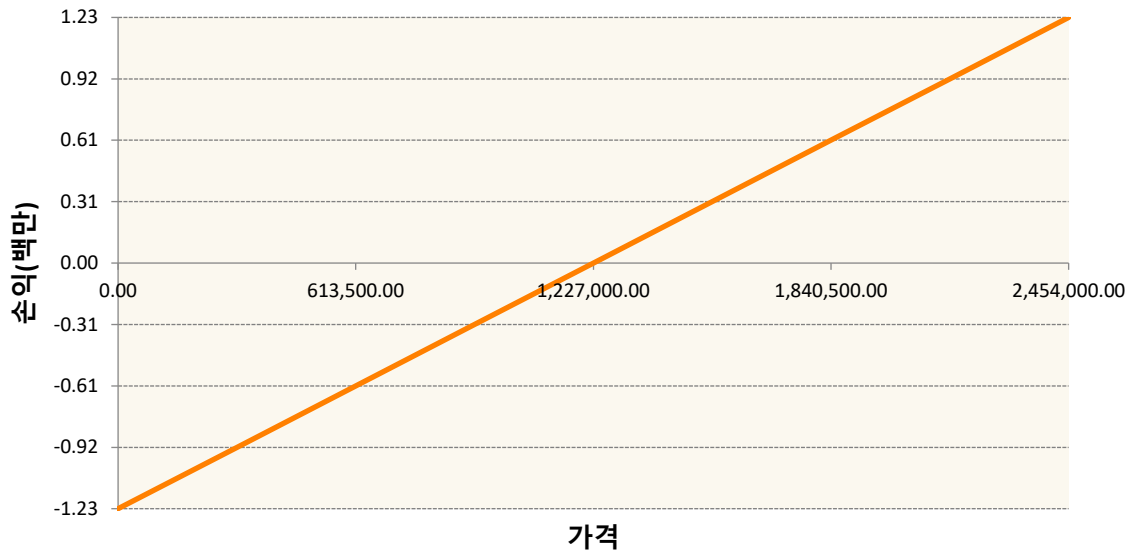
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



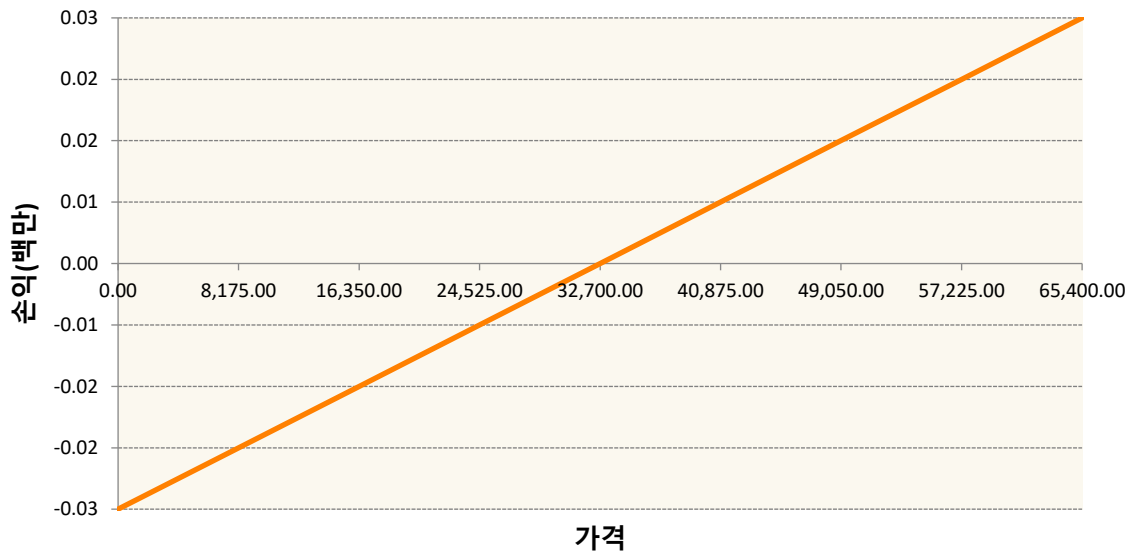
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					176
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
-5.33%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	117	117	117	117	117	117	117
8.00%	176	176	176	176	176	176	176
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물					41
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	41	41	41	41	41	41	41
KR4A50650006                      2026-05 SK하이닉스개별선물							11

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
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%	-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%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

514

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## SOL차이나강소기업CSI500상장

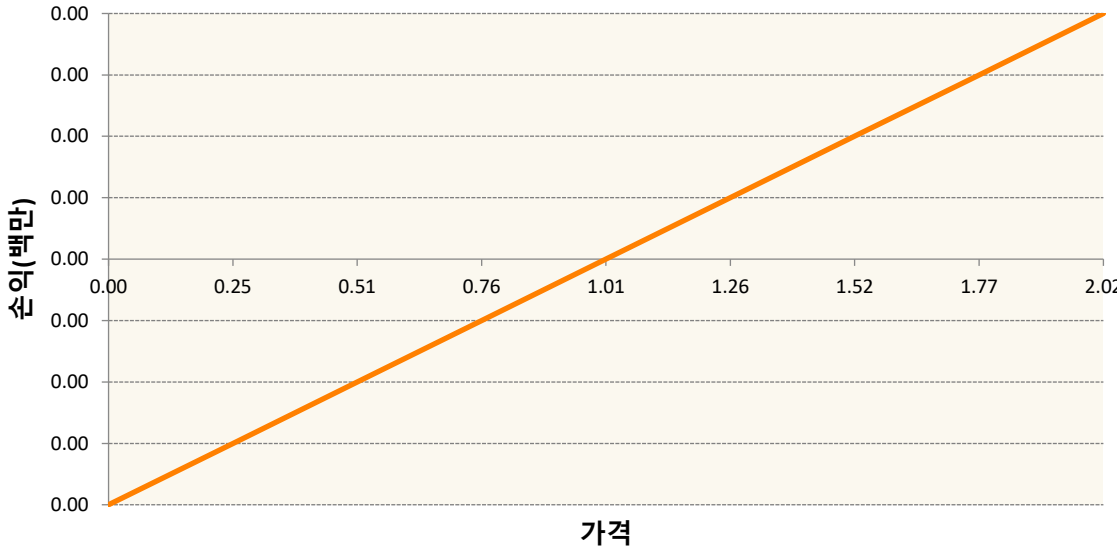
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,700	0	5,700	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

SWCSI5000047-CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미)



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미)

456

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

560

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-04-24
기준일	2026-04-23

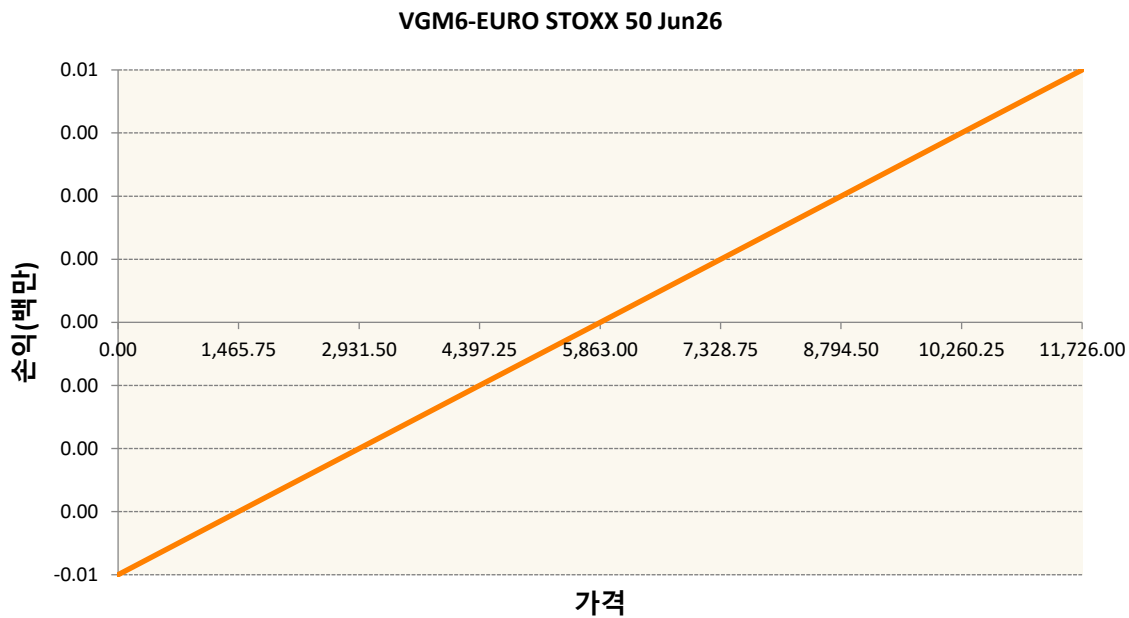
## 유로인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	904	0	904	

### 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	2026-04-24
기준일	2026-04-23

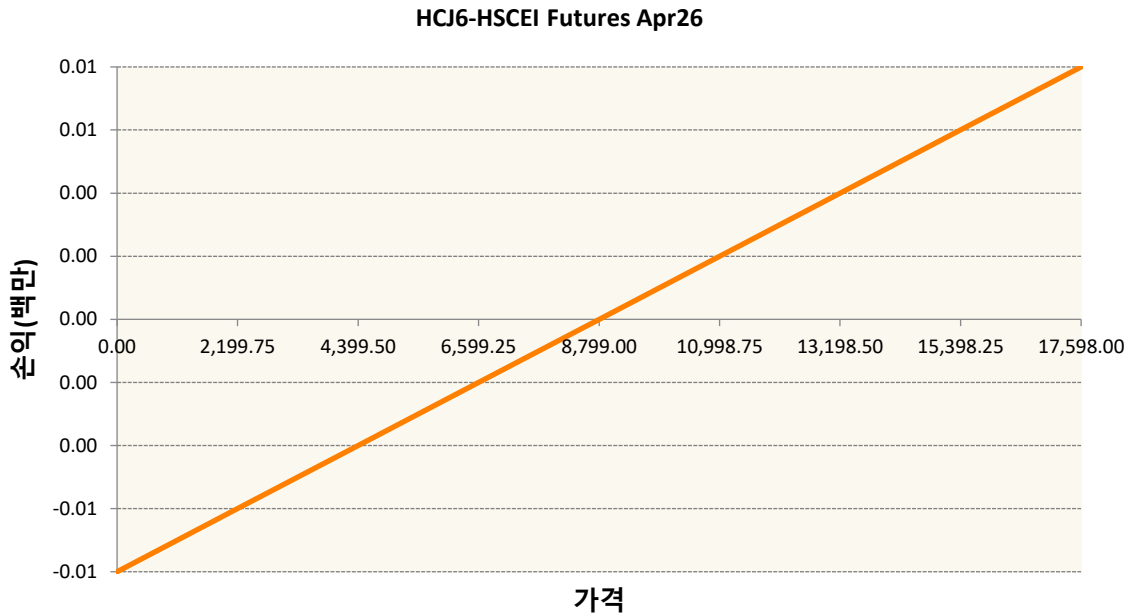
## 차이나인덱스모(주식-파생형)

### 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	1,693	0	1,693	장내

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCJ6	HSCEI Futures Apr26	135
------	---------------------	-----

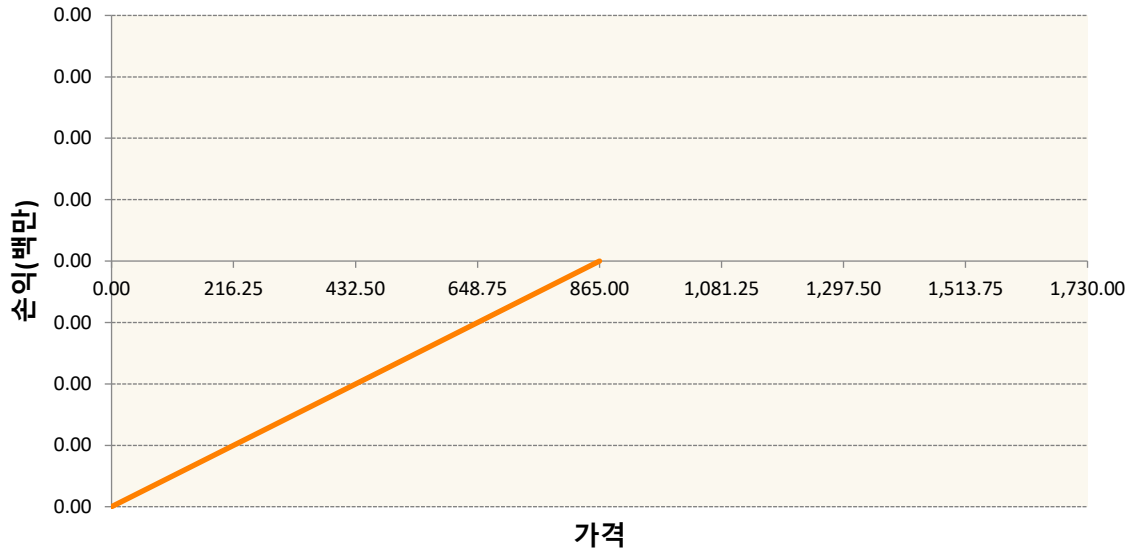
### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

165



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0								649
기초자산의 변동성								
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-179	-255	-333	-411	-490	-569	-649	
-5.33%	-27	-95	-166	-239	-314	-389	-465	
-2.67%	81	23	-39	-104	-172	-241	-313	
0%	153	107	56	0	-59	-122	-187	
2.67%	199	165	124	78	27	-27	-85	
5.33%	228	203	172	135	93	47	-4	
8.00%	245	228	205	177	143	104	60	
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5								424
기초자산의 변동성								
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-120	-170	-220	-271	-322	-373	-424	
-5.33%	-19	-64	-111	-158	-206	-255	-304	
-2.67%	52	14	-26	-69	-113	-158	-204	
0%	101	70	37	0	-39	-80	-122	
2.67%	132	109	82	52	18	-17	-55	
5.33%	152	135	114	90	62	32	-2	
8.00%	163	152	137	118	95	69	41	
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0								248
기초자산의 변동성								
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-68	-98	-127	-157	-188	-218	-248	
-5.33%	-10	-37	-64	-92	-120	-149	-178	
-2.67%	31	9	-15	-40	-66	-92	-120	
0%	58	41	21	0	-23	-47	-72	

2.67%	76	63	48	30	10	-10	-33
5.33%	87	78	66	52	36	18	-2
8.00%	94	87	79	68	55	40	23

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

(단위:백만원)

**1,360**

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 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 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

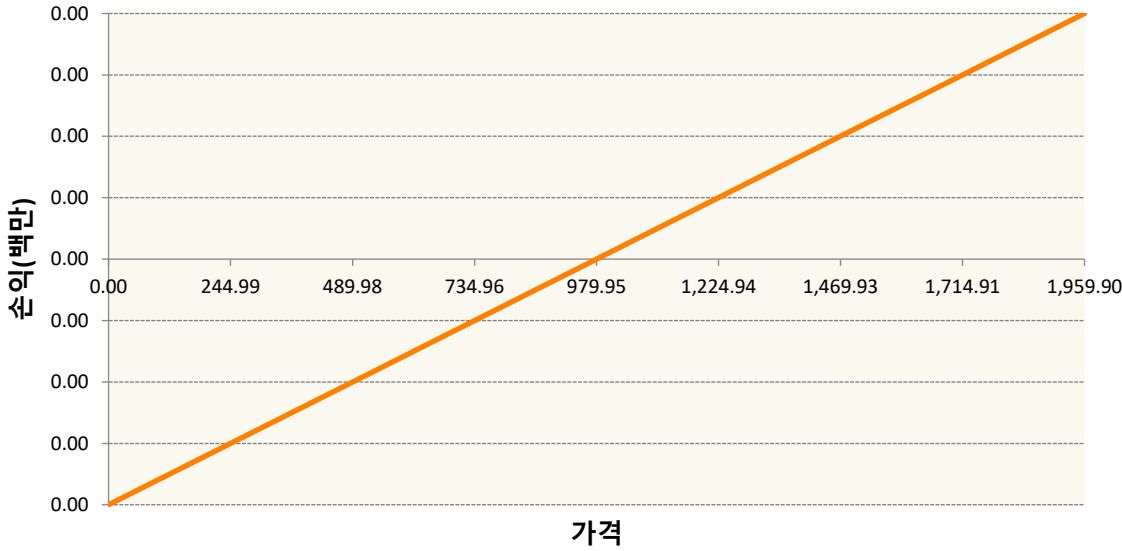
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

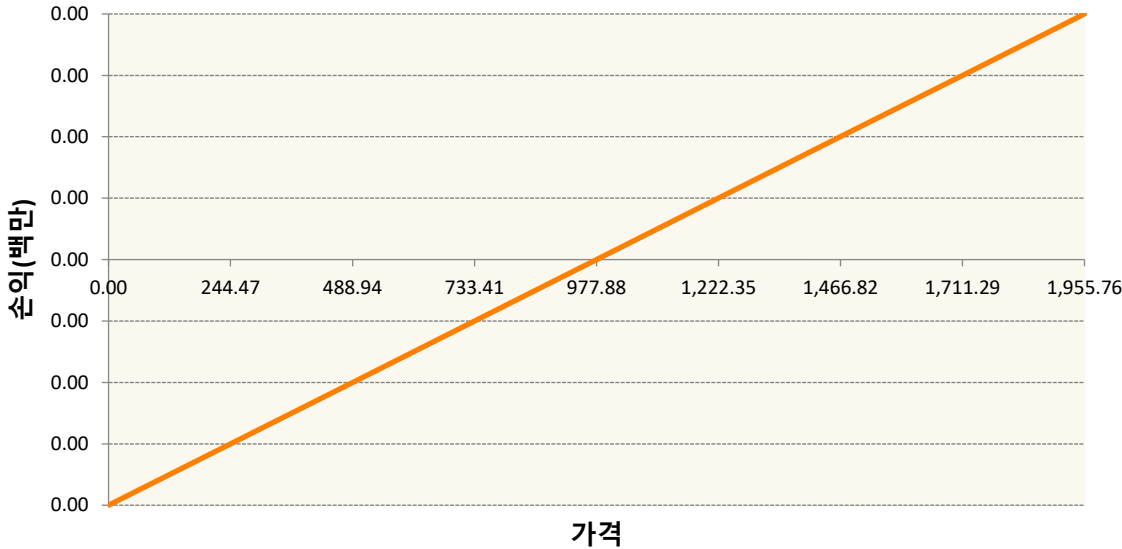
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,788	0	3,788	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

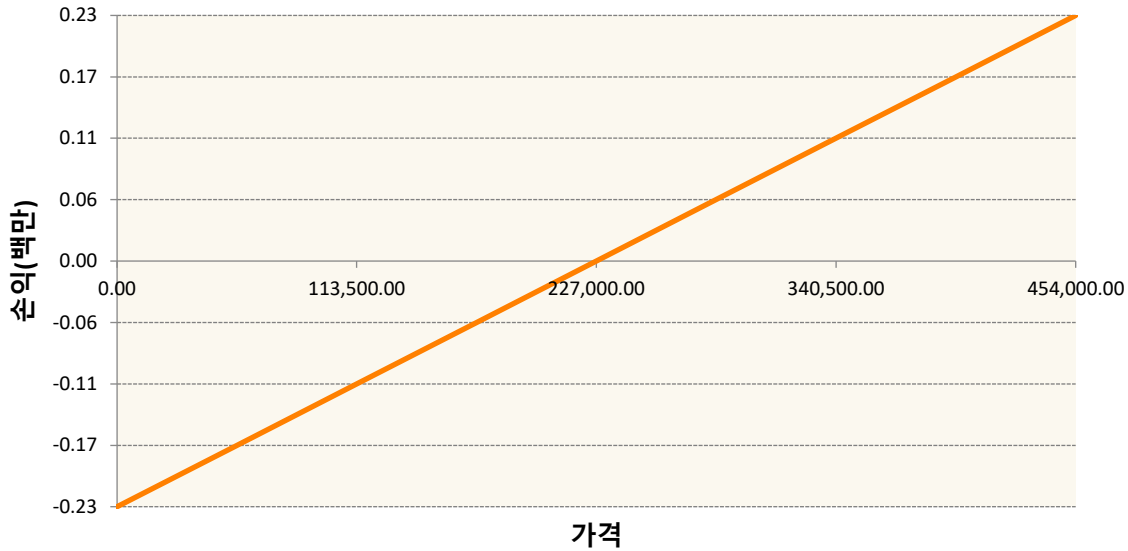
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



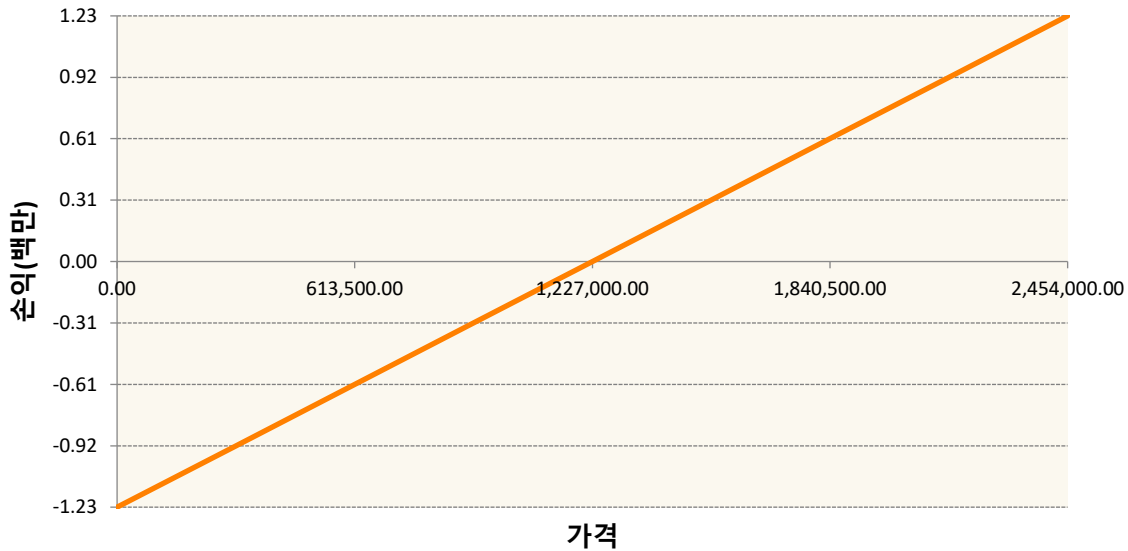
KR4A05650002-2026-05 미니코스피200 선물



**KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물**



**KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물**



**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)**

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						98
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
-5.33%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65	
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	33	33	33	33	33	33	33	
5.33%	65	65	65	65	65	65	65	
8.00%	98	98	98	98	98	98	98	
KR4A05650002		2026-05 미니코스피200 선물						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

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                      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

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

(단위:백만원)

**316**

공시일	2026-04-24
기준일	2026-04-23

## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

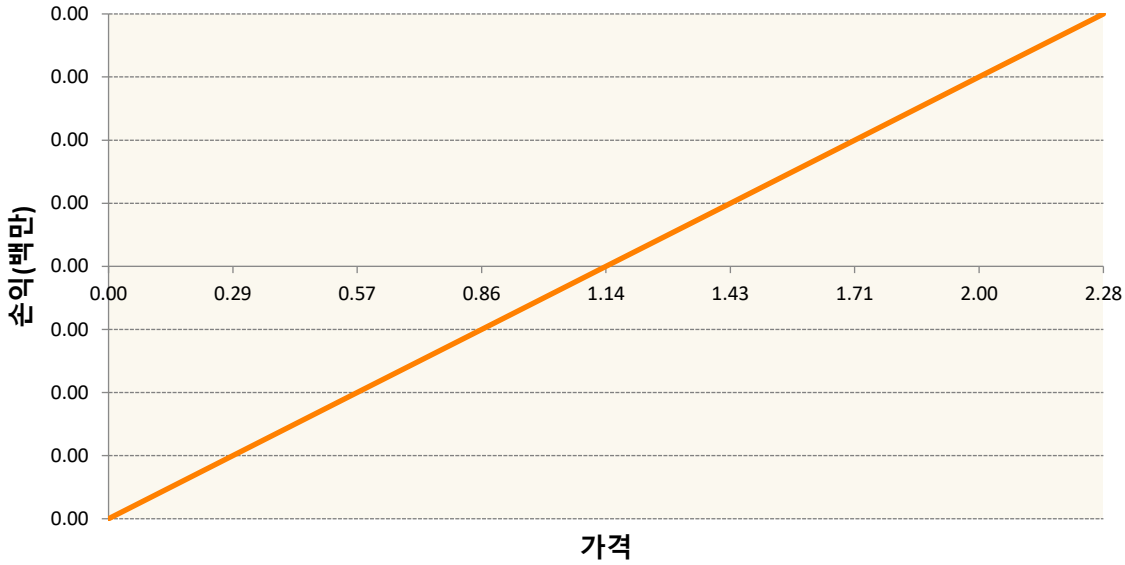
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

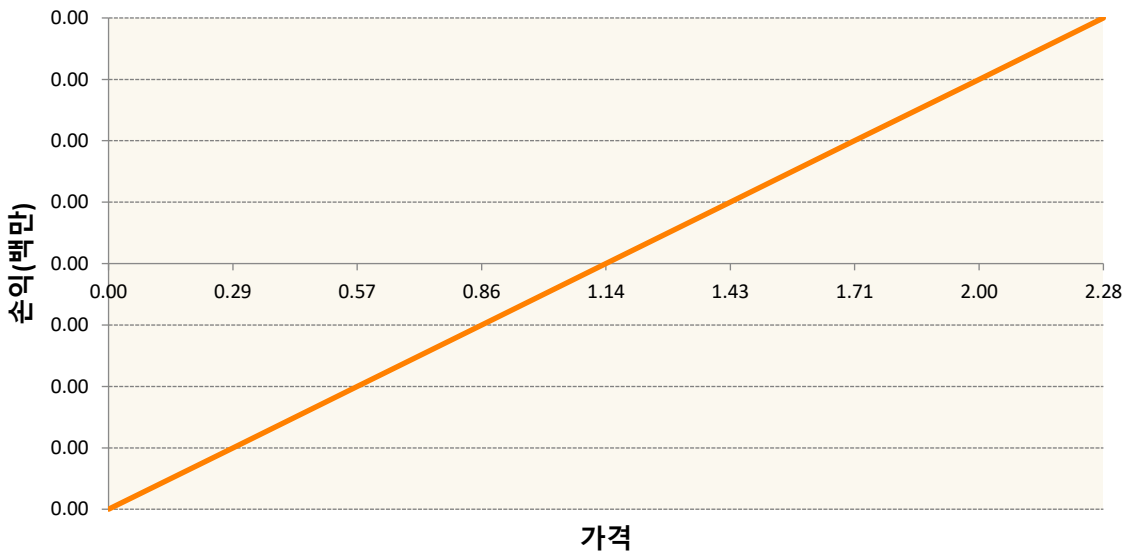
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,551	0	6,551	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

2108840319ID-ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(



2108841218ID-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319	ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(	418
2108841218	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	105

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		595

공시일	2026-04-24
기준일	2026-04-23

## SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

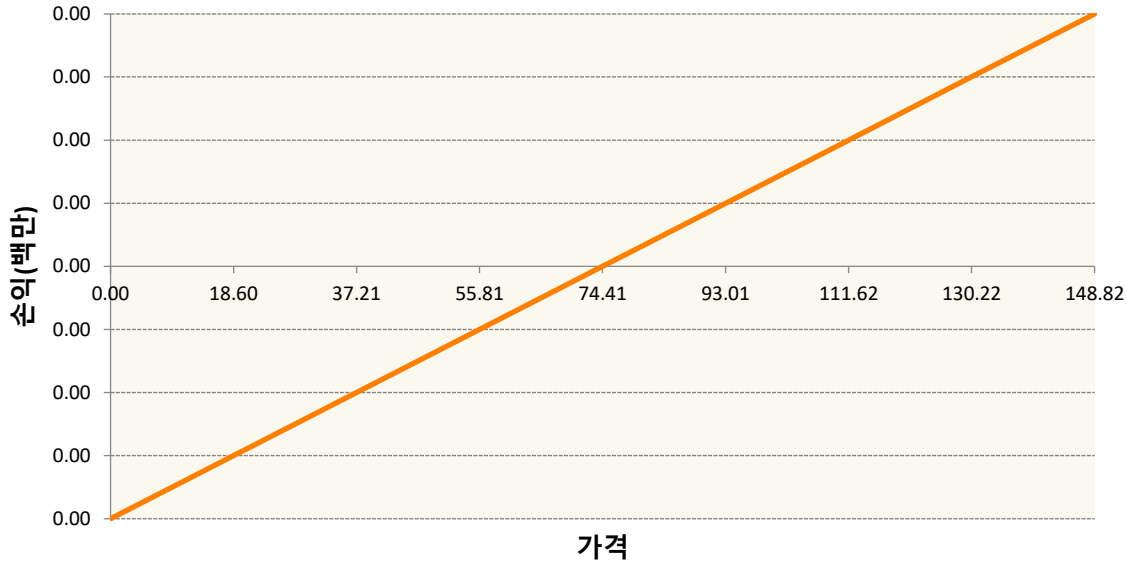
### 1. 계약금액

(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			4,799	0	4,799	
누계	통화	선도	0	2,197	-2,197	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

MOZ26-ECX EMISSION Dec26



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E)

176

MOZ26 ECX EMISSION Dec26

384

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

(단위:백만원)

660

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 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	1,833	0	1,833	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	5
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	4
SWSOL0000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)	9
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	4

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

(단위:백만원)

33

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## SOL차이나육성산업액티브상장지

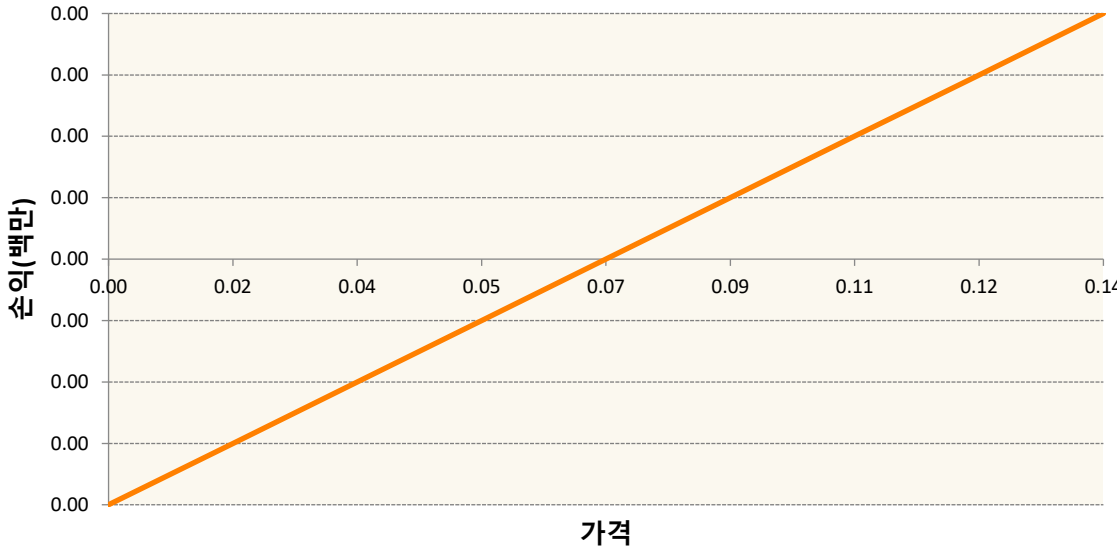
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

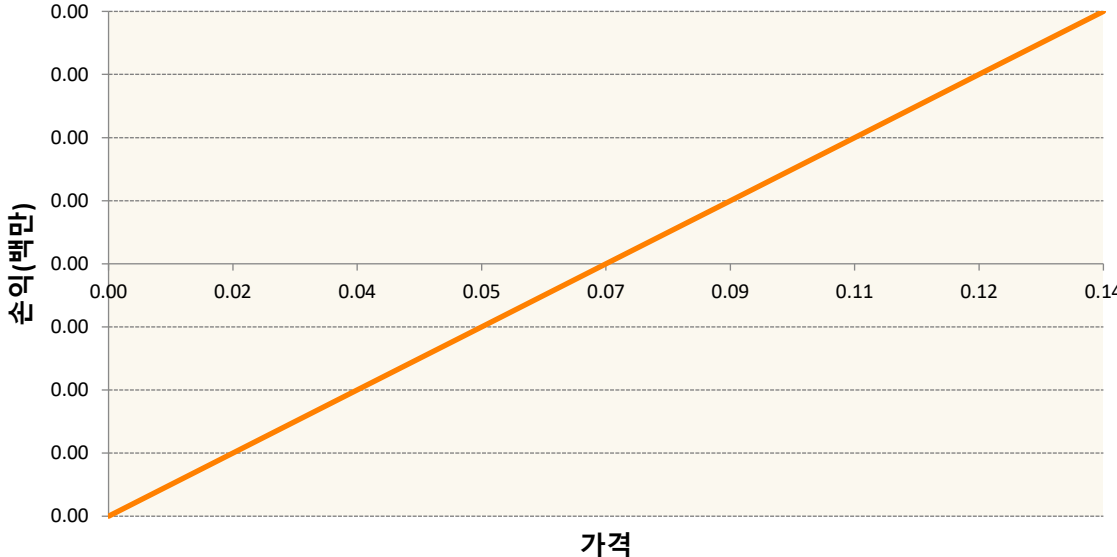
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	1,771	0	1,771	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

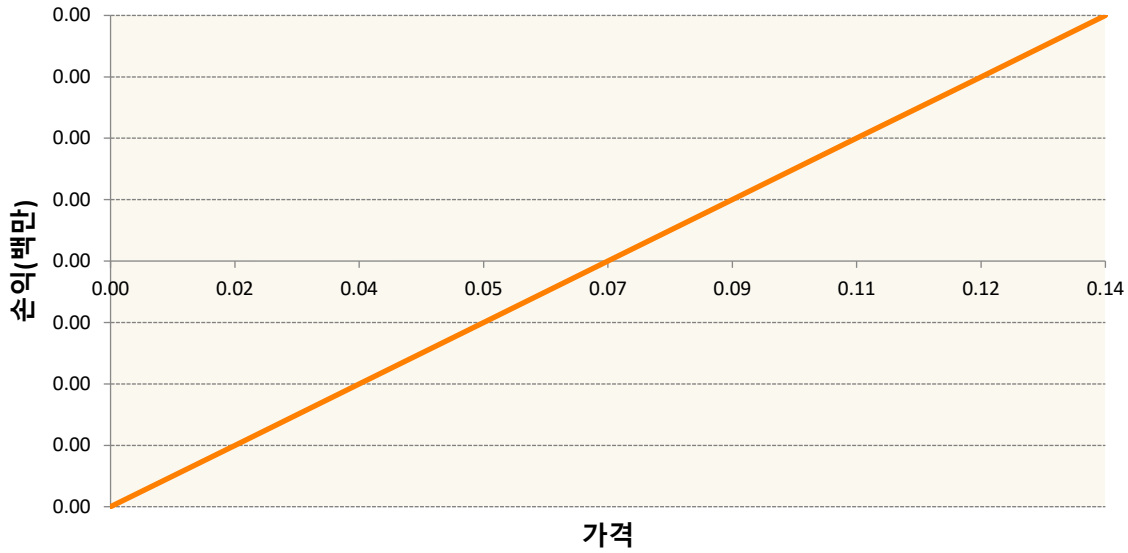
SWSTAR000027-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)



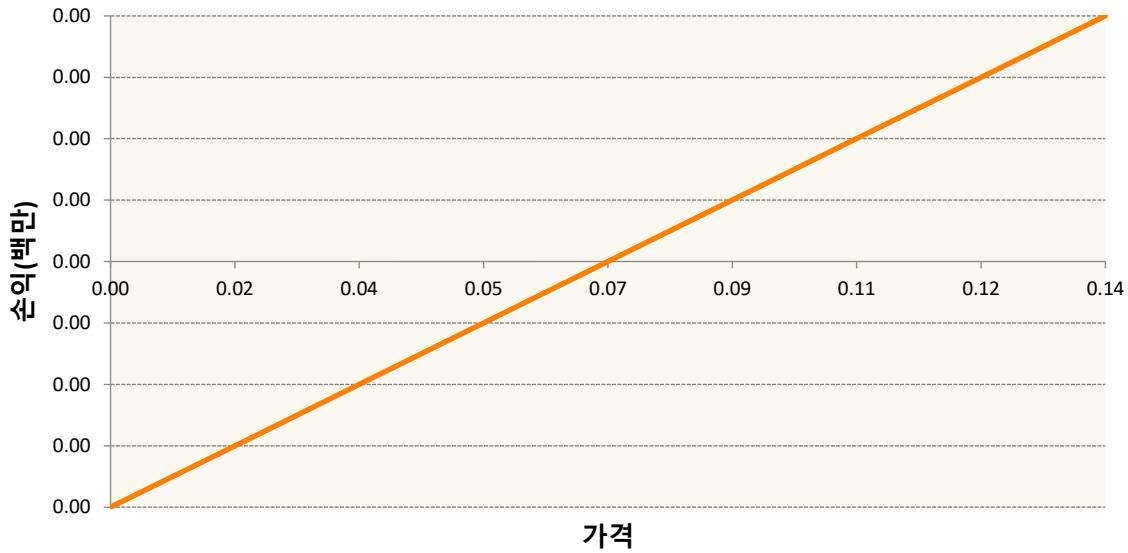
SWSTAR000030-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)



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)	5
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	18
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	92
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	34

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

(단위:백만원)

225
-----

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 코리아인덱스(주식-파생형)(종)

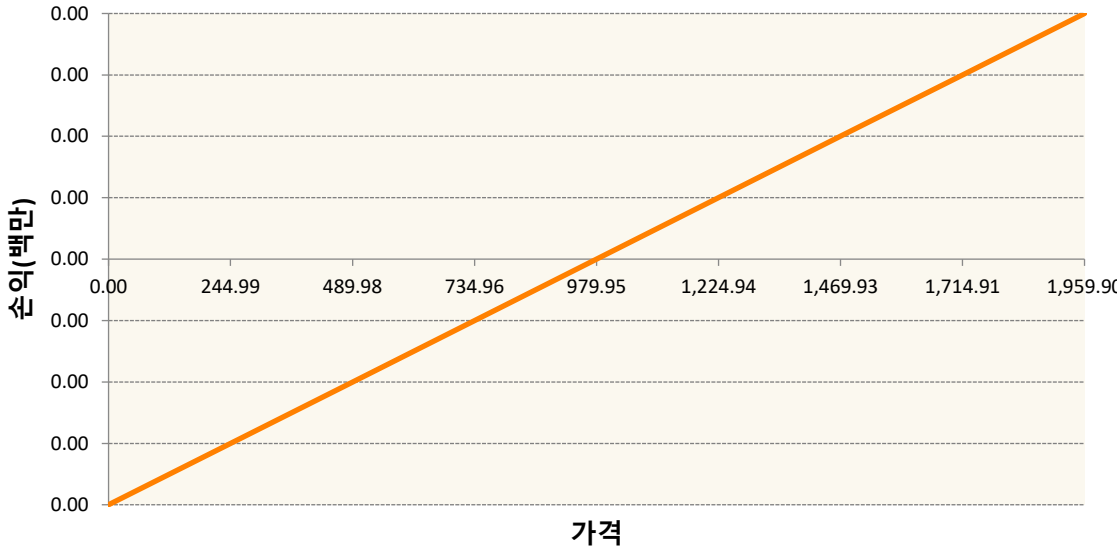
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

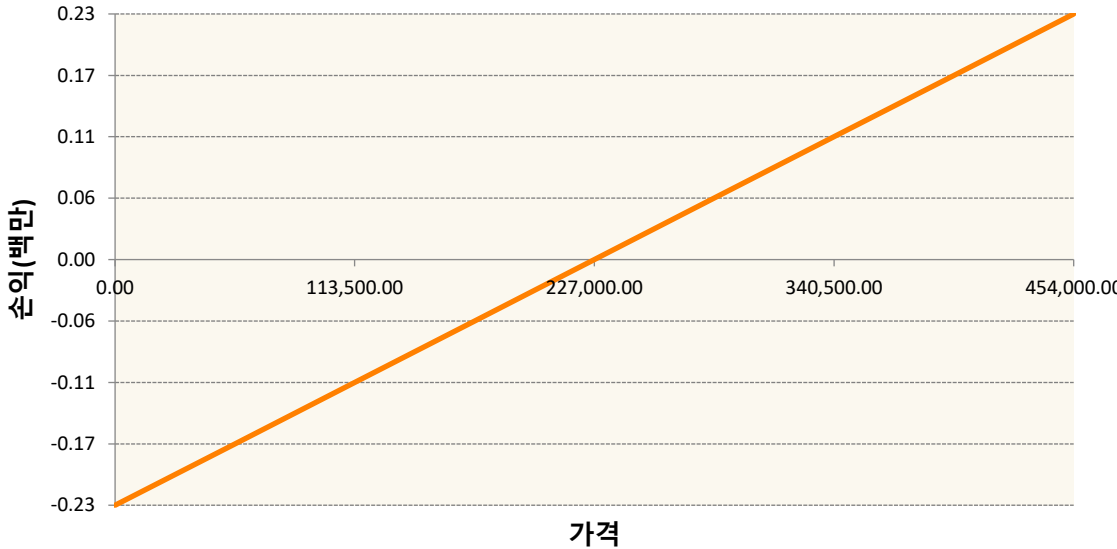
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,230	2,014	-784	장내
누계	유가증권	선물	20,226	2,538	17,687	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

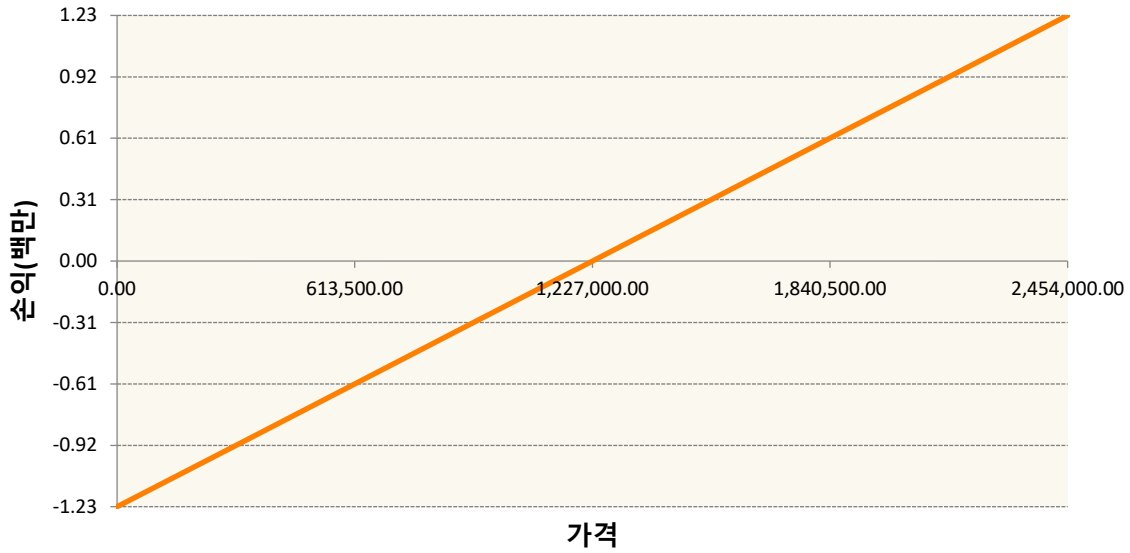
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



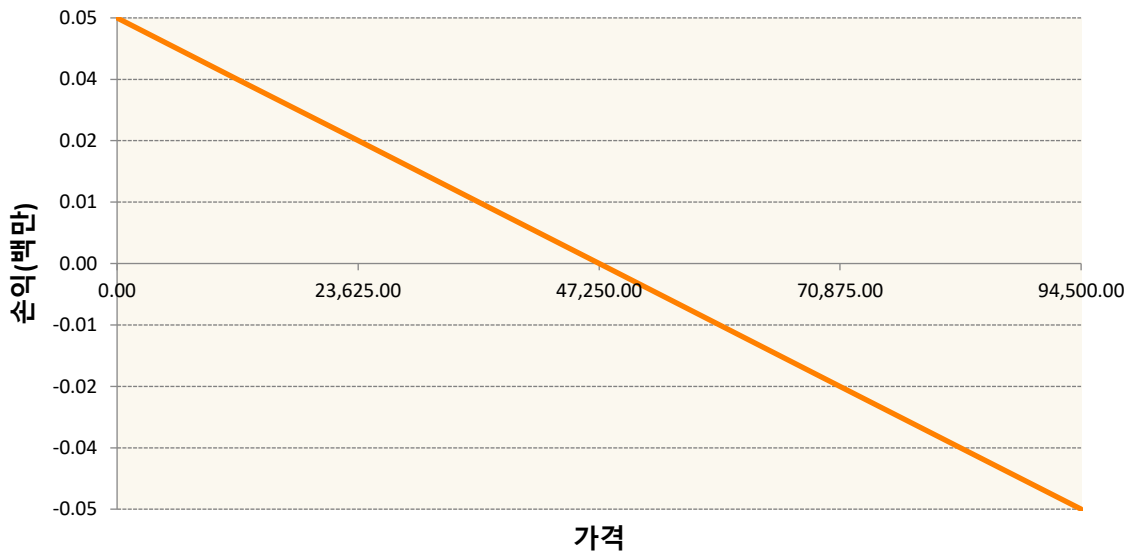
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



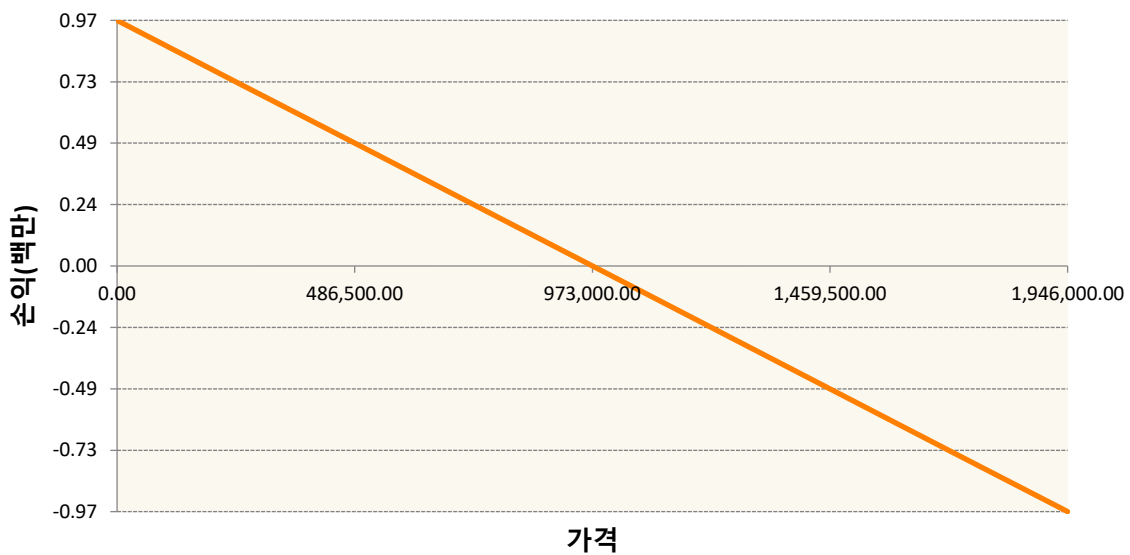
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



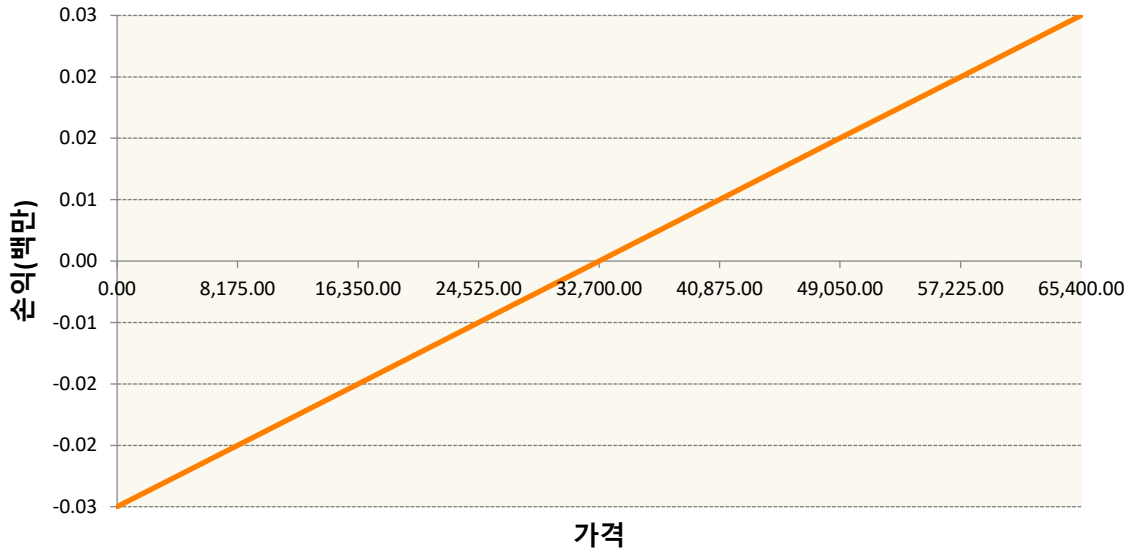
KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



KR4ADB650009-2026-05 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						1,249
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,249	-1,249	-1,249	-1,249	-1,249	-1,249	-1,249	
-5.33%	-833	-833	-833	-833	-833	-833	-833	
-2.67%	-416	-416	-416	-416	-416	-416	-416	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	416	416	416	416	416	416	416	
5.33%	833	833	833	833	833	833	833	
8.00%	1,249	1,249	1,249	1,249	1,249	1,249	1,249	
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물						186
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186	
-5.33%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	62	62	62	62	62	62	62	
5.33%	124	124	124	124	124	124	124	
8.00%	186	186	186	186	186	186	186	
KR4A50650006		2026-05 SK하이닉스개별선물						106
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106	
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71	
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
0%	0	0	0	0	0	0	0	

2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	106	106	106	106	106	106	106

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

KR4ADB650009                      2026-05 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선                      82

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	82	82	82	82	82	82	82
-5.33%	55	55	55	55	55	55	55
-2.67%	27	27	27	27	27	27	27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82

KR4AFT650007                      2026-05 대우건설개별선물                      71

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	71	71	71	71	71	71	71

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

(단위:백만원)

**3,858**

공시일	2026-04-24
기준일	2026-04-23

## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

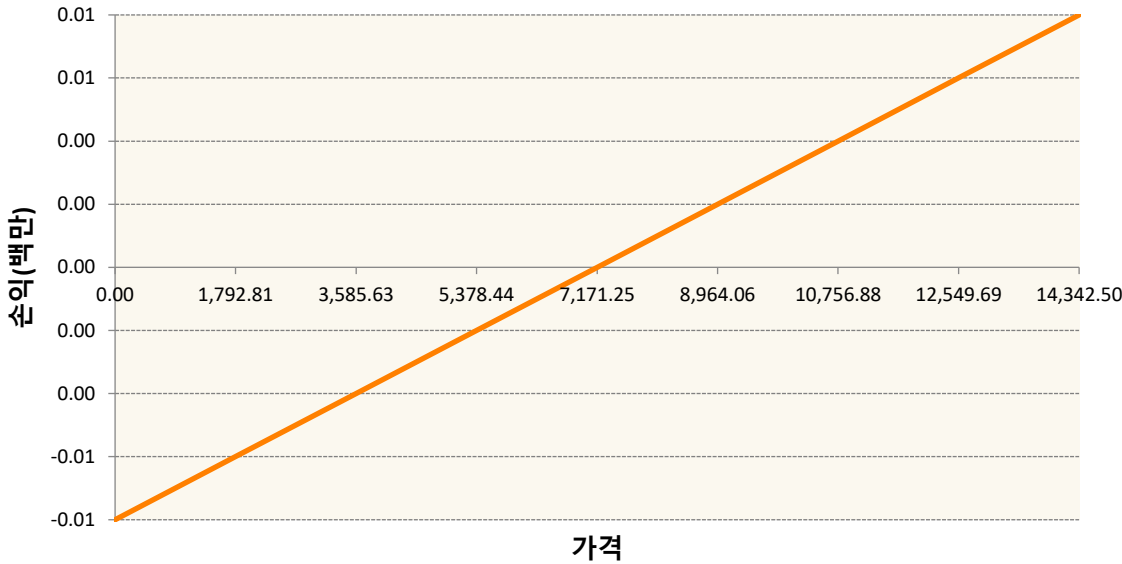
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

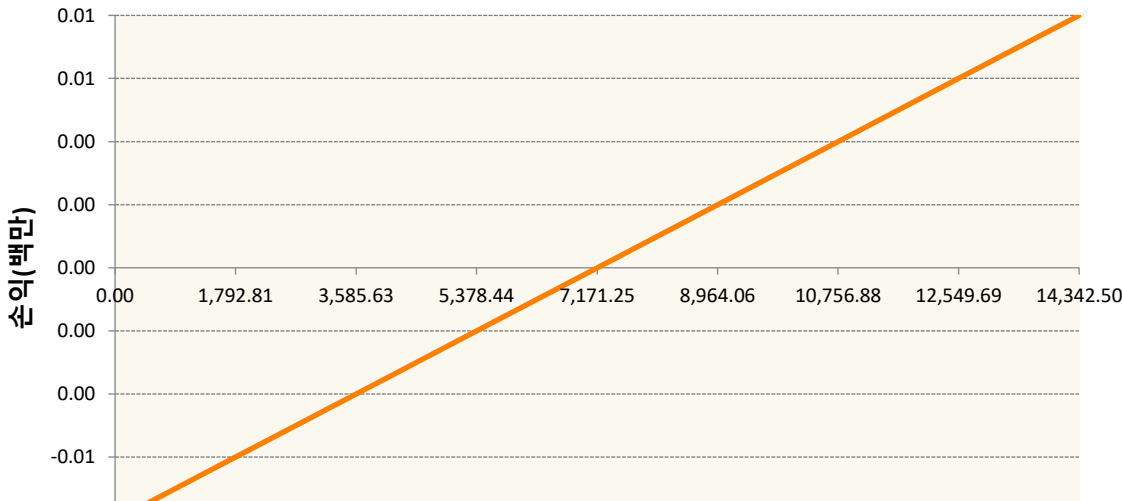
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	57,013	0	57,013	
누계	지수	선물	54	0	54	장내
누계	통화	선물	10,504	0	10,504	장내

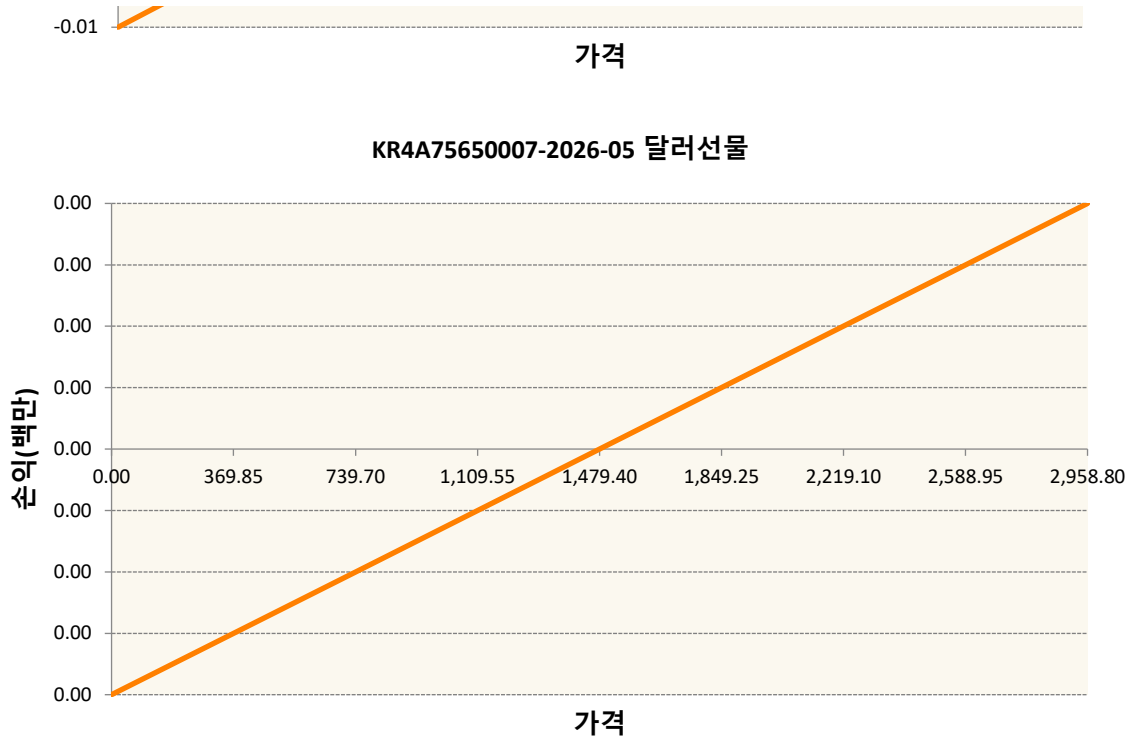
### 2. 만기시점의 손익구조

ESM6-S&P500 EMINI FUT JUN26



HWAM6-SP500 MIC EMIN FUTJun26





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,561
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	4
	KR4A756500 2026-05 달러선물	840

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	<b>3,978</b>

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## 미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

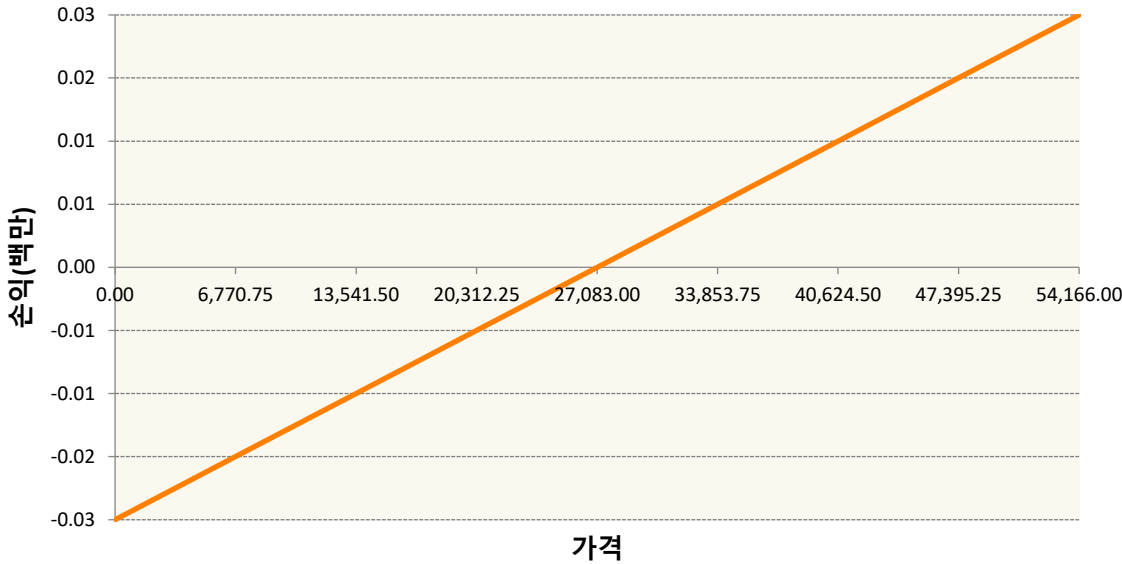
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

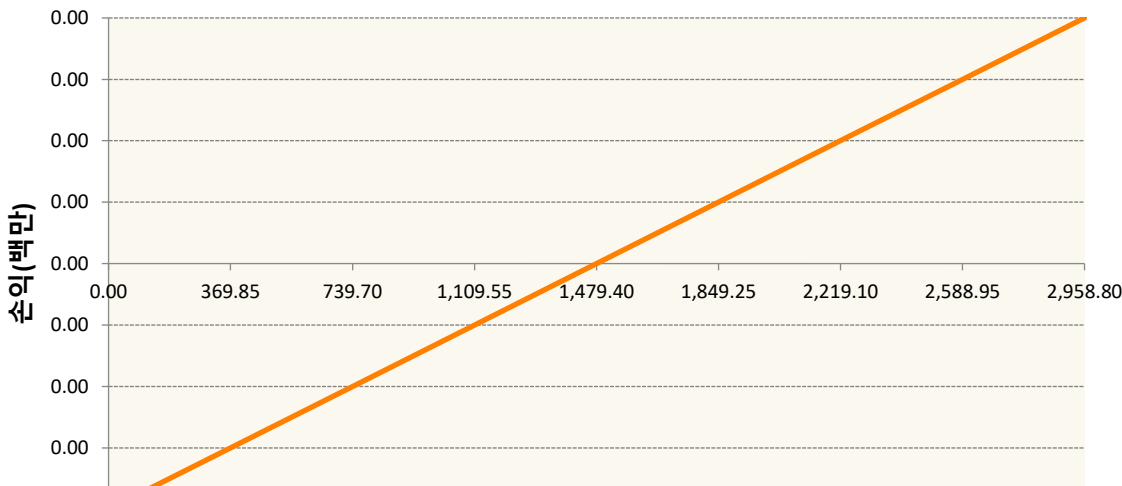
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	25,179	0	25,179	
누계	유가증권	선물	403	0	403	장내
누계	통화	선물	3,861	0	3,861	장내

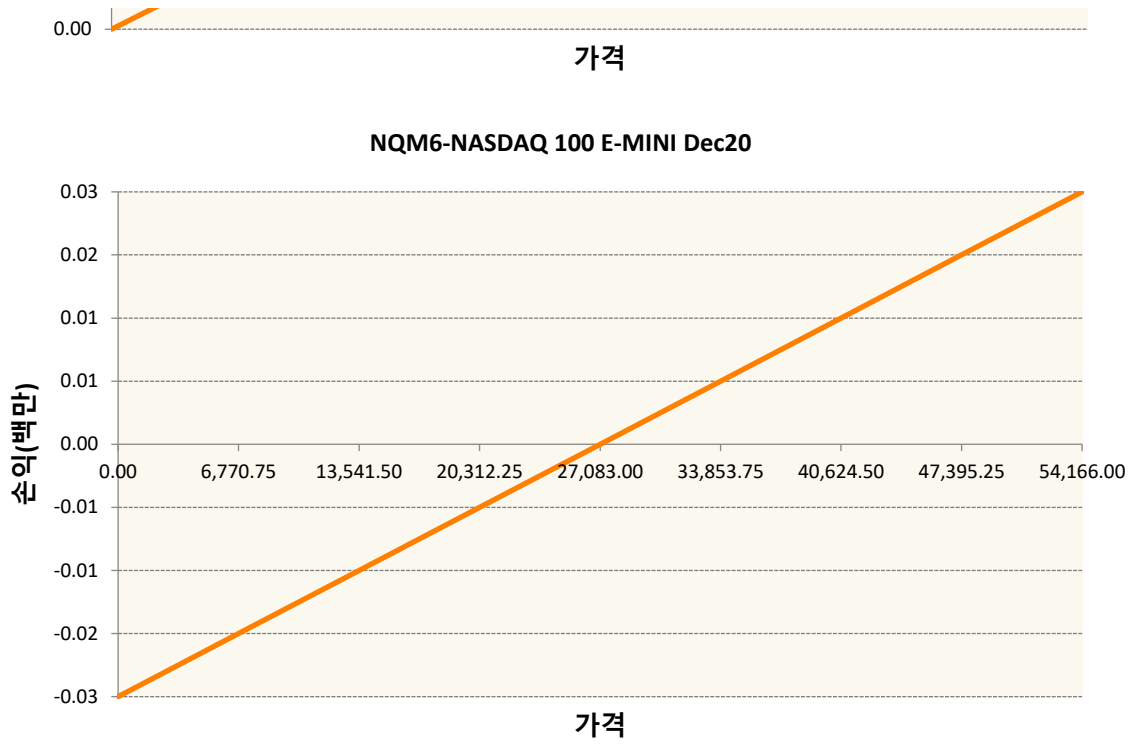
### 2. 만기시점의 손익구조

HWBM6-NASD100 MICRO EMIN JUN26



KR4A75650007-2026-05 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	32
KR4A756500	2026-05 달러선물	309
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,014

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,254

공시일 2026-04-24

기준일 2026-04-23

## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

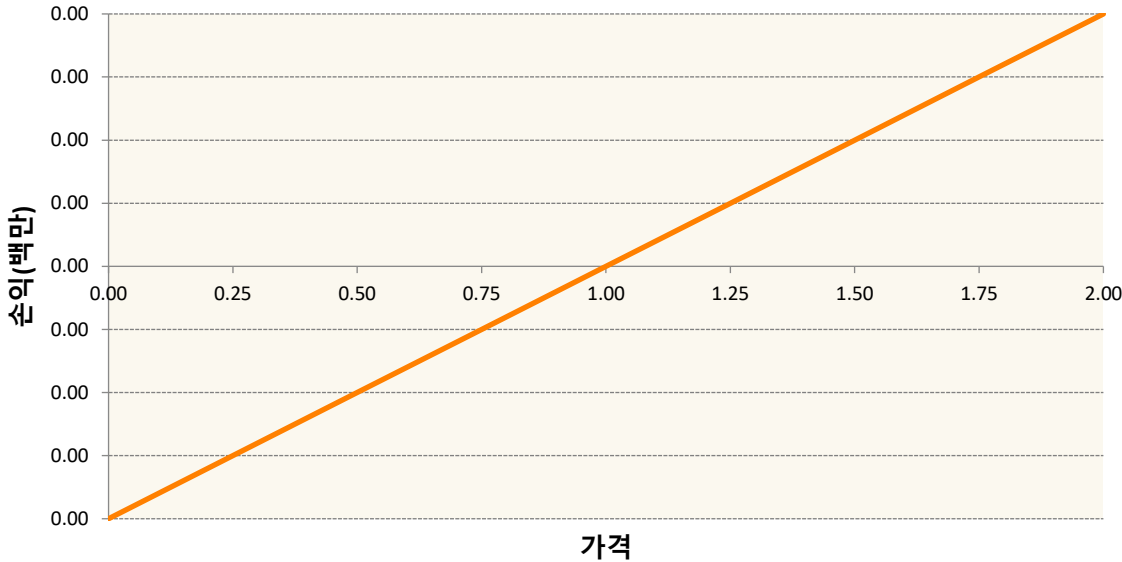
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

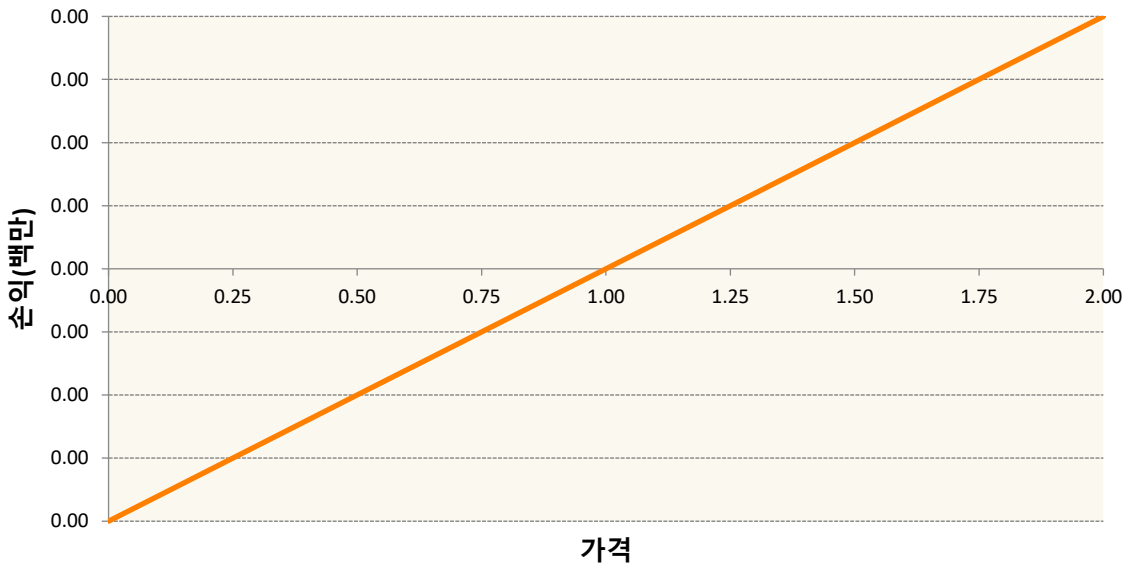
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	358,570	0	358,570	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

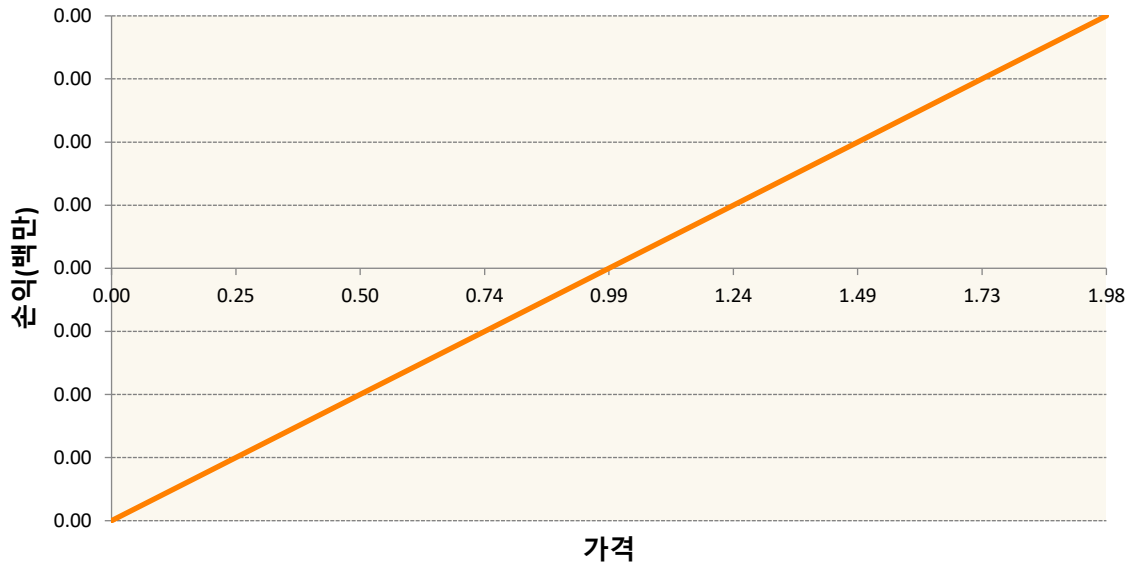
SWKEDI000150-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



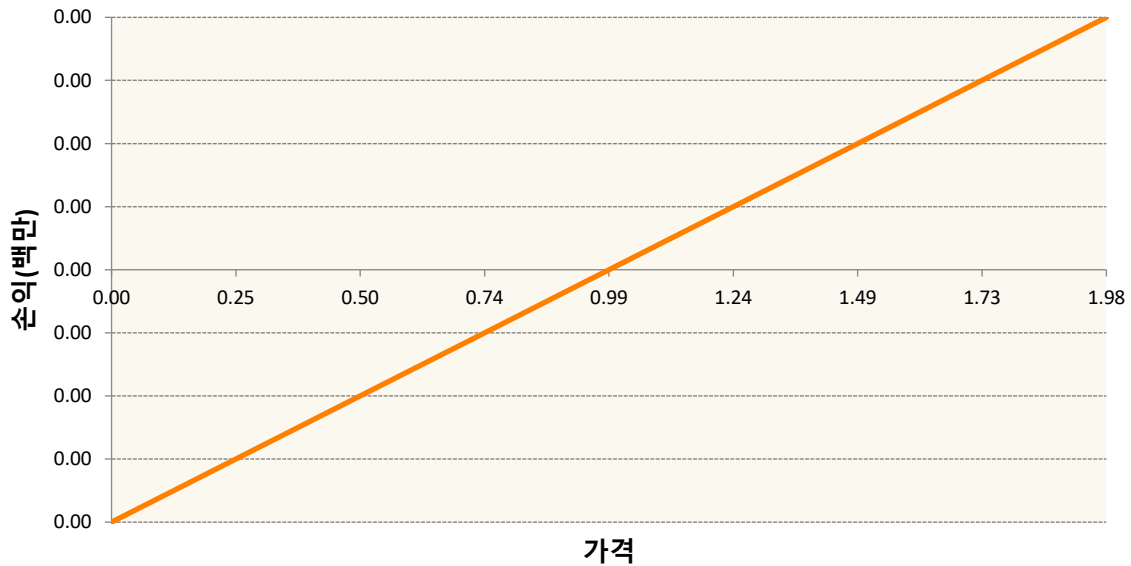
SWKEDI000164-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



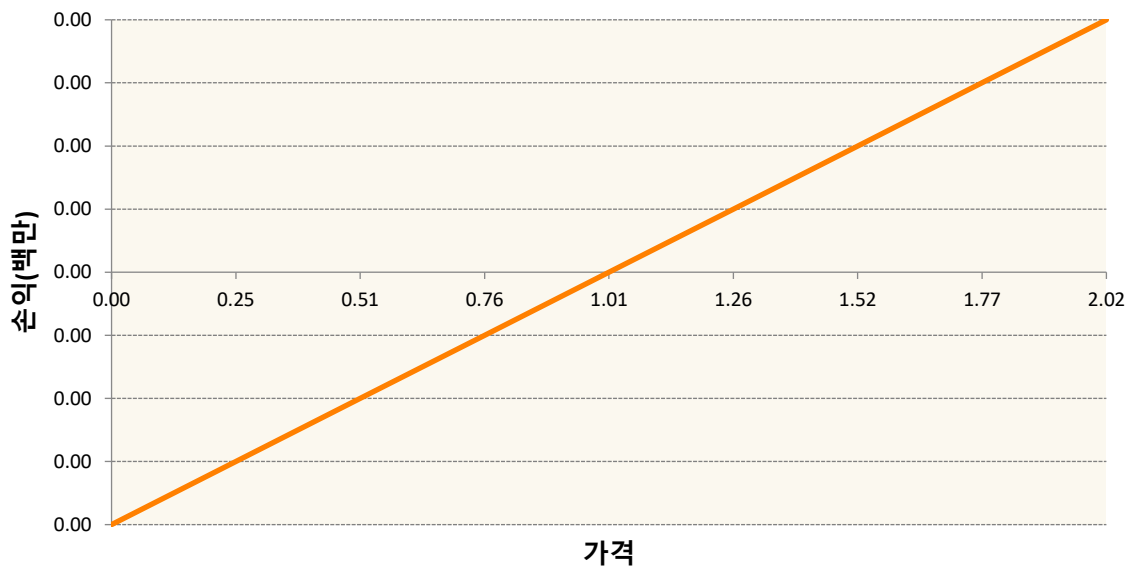
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,343
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		153
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,741
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,425
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,960

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,268