

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

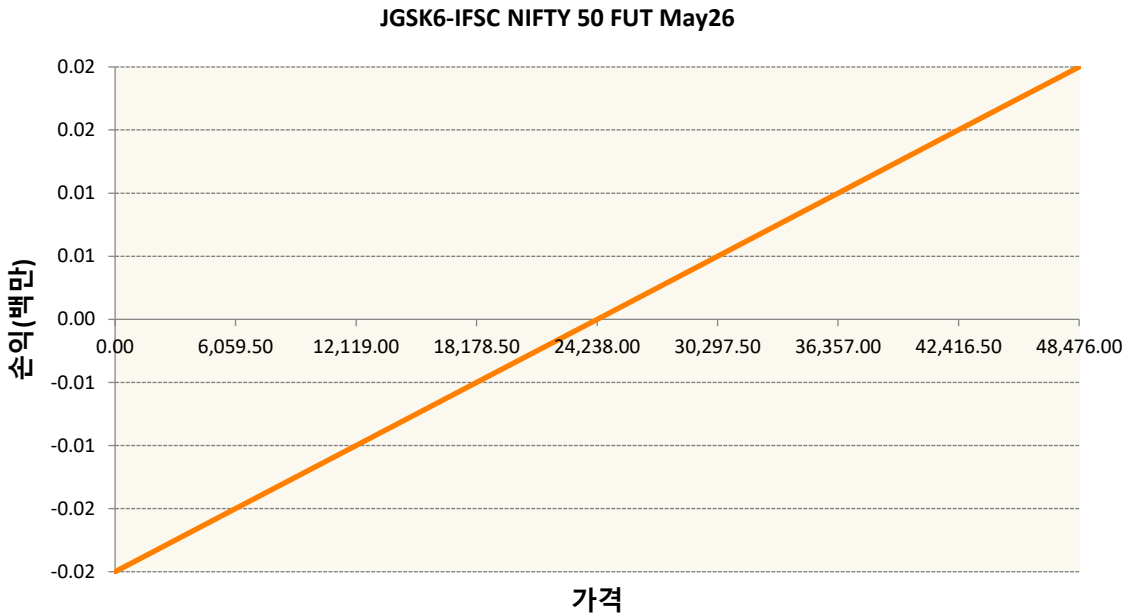
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	792	0	792	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSK6	IFSC NIFTY 50 FUT May26	63
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

44

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

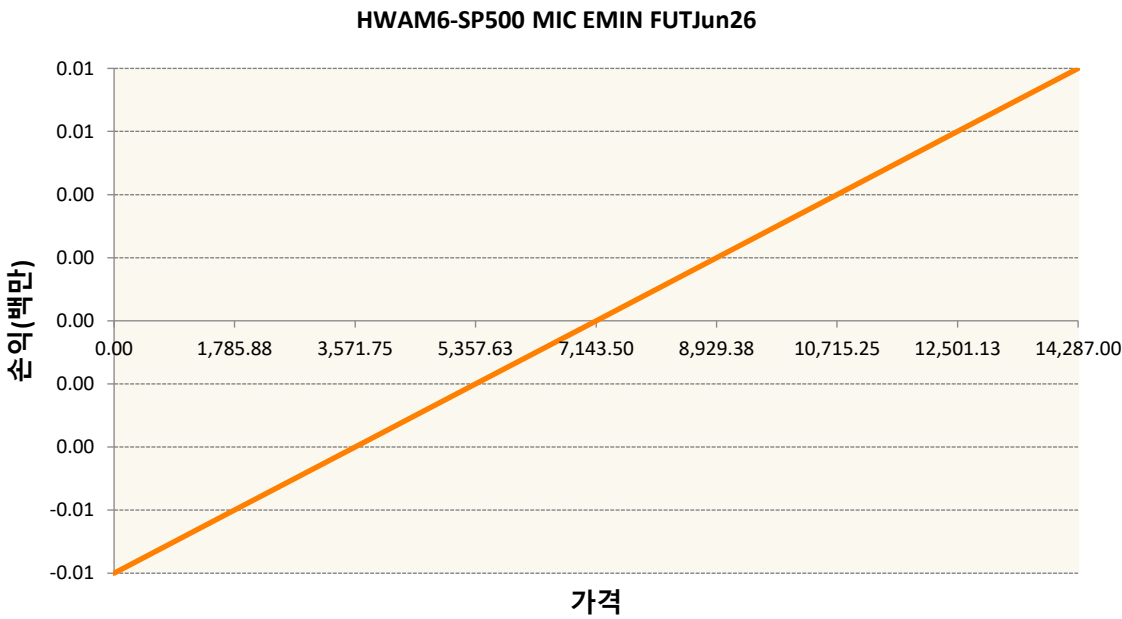
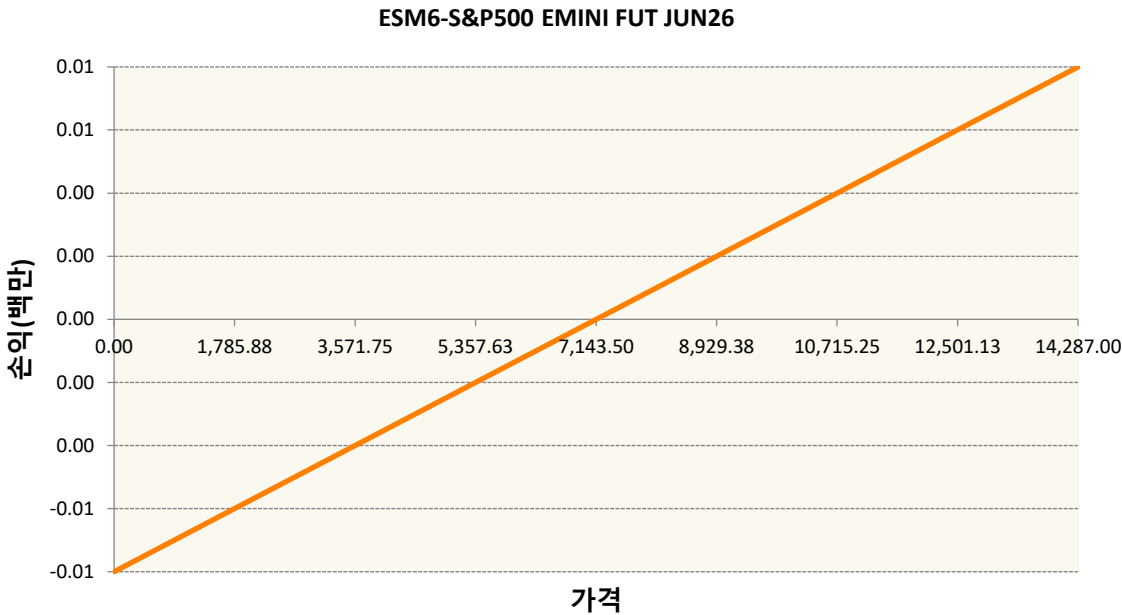
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	536	0	536	
누계	지수	선물	161	0	161	장내

2. 만기시점의 손익구조



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	2026-04-27
기준일	2026-04-24

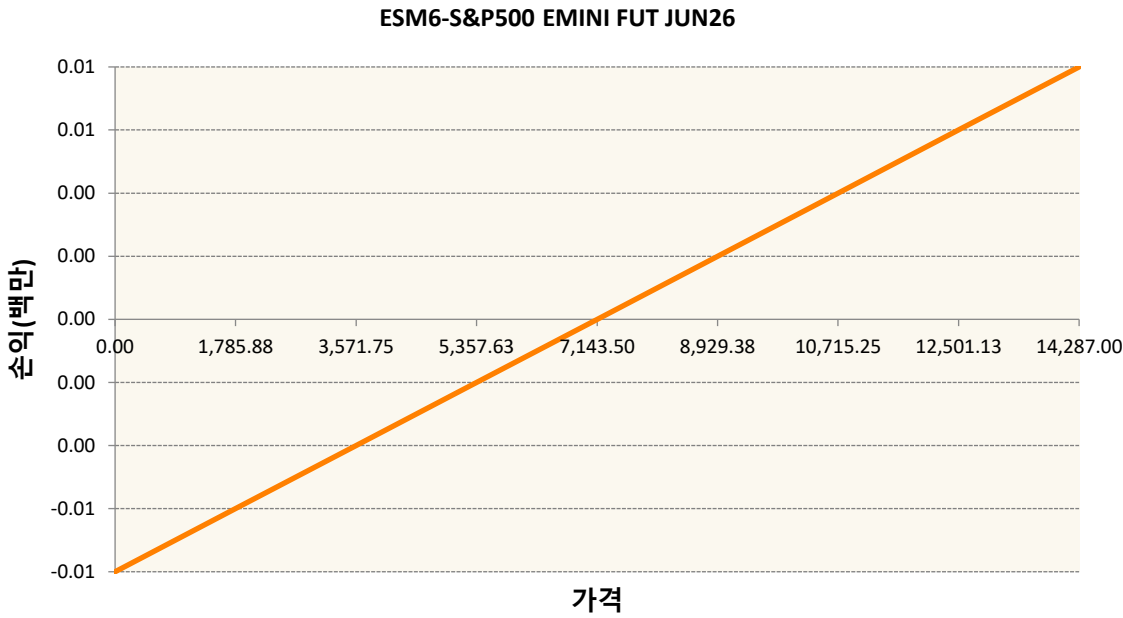
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,071	0	1,071	

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	2026-04-27
기준일	2026-04-24

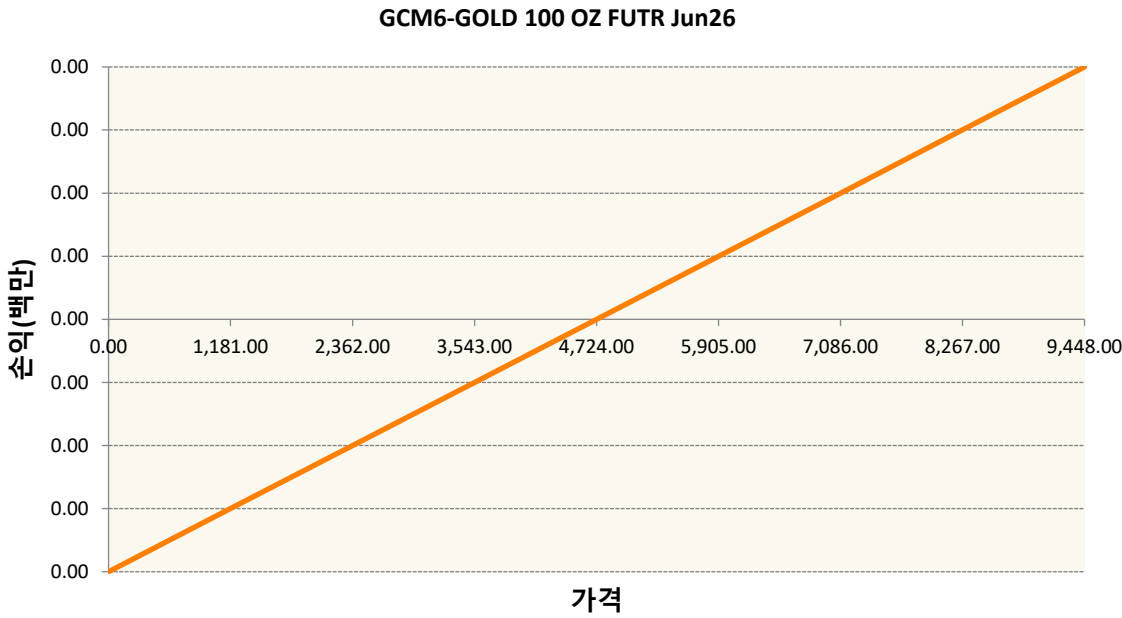
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,688	0	5,688	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	455

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

(단위:백만원)

595

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

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	118
AOPLTRSCP1PLTR US 04/24/26 P155 EQUITY	1

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

(단위:백만원)

372

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

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

28

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

(단위:백만원)

17

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

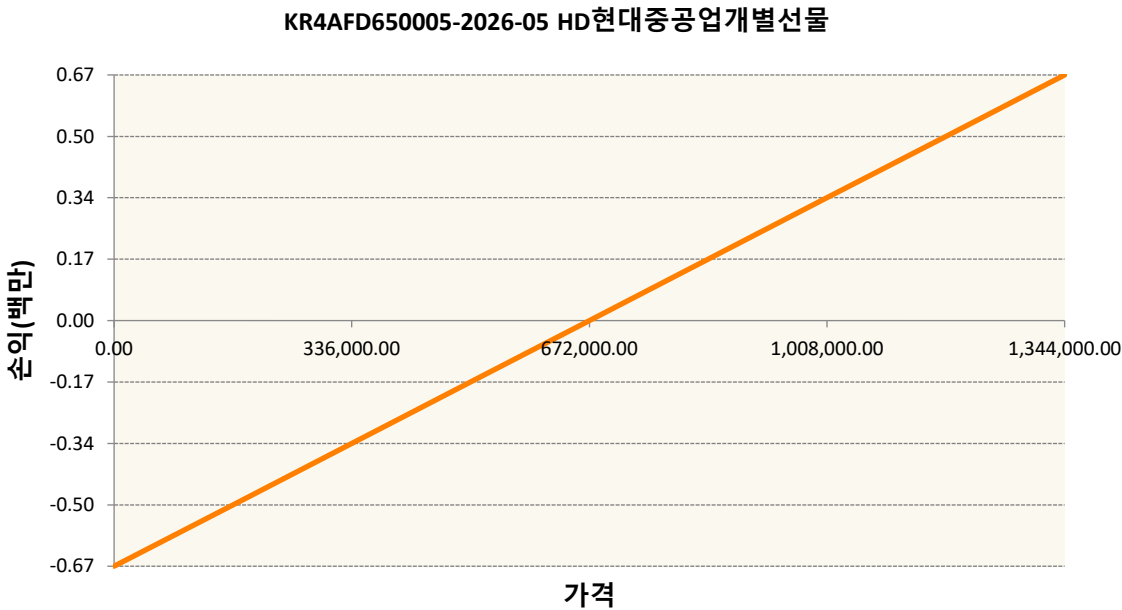
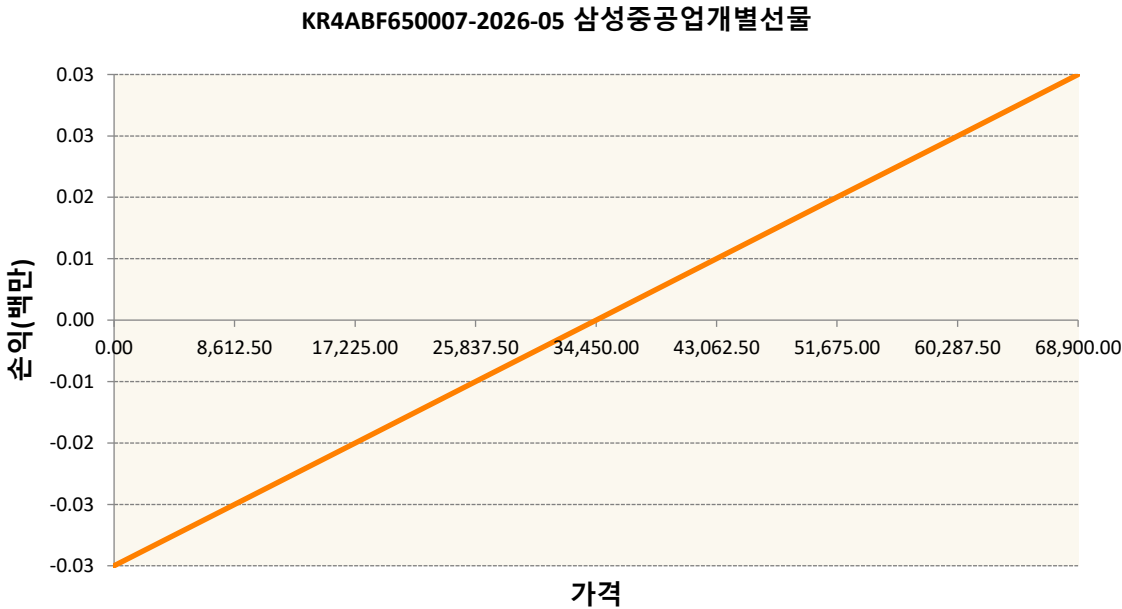
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

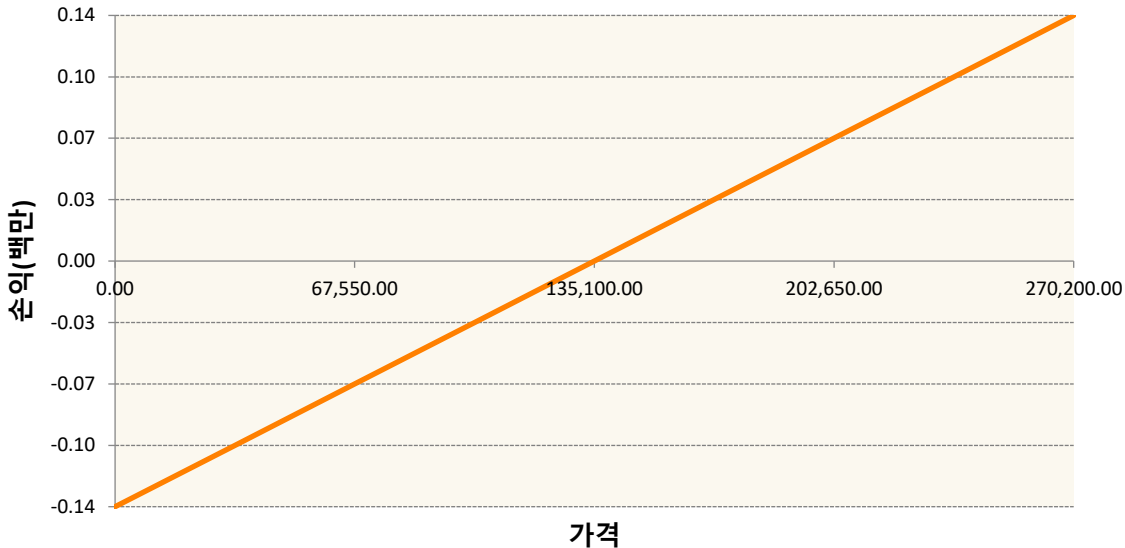
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	28,656	0	28,656	장내
누계	유가증권	스왑	190,126	0	190,126	장외

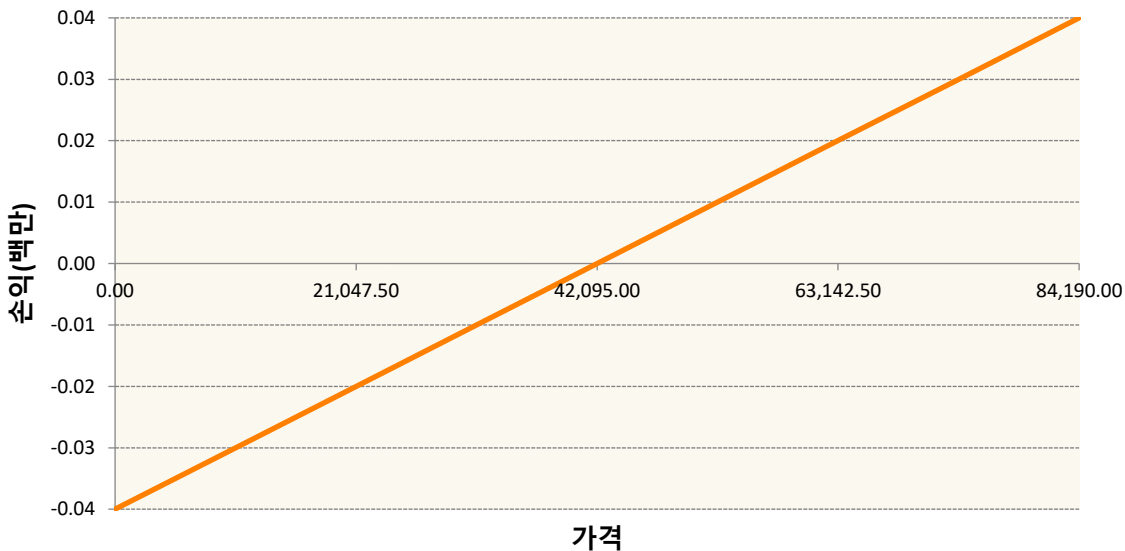
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007			2026-05 삼성중공업개별선물				991
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-991	-991	-991	-991	-991	-991	-991
-5.33%	-660	-660	-660	-660	-660	-660	-660
-2.67%	-330	-330	-330	-330	-330	-330	-330
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	330	330	330	330	330	330	330
5.33%	660	660	660	660	660	660	660
8.00%	991	991	991	991	991	991	991
KR4AFD650005			2026-05 HD현대중공업개별선물				1,020
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020
-5.33%	-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680
-2.67%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	340	340	340	340	340	340	340
5.33%	680	680	680	680	680	680	680
8.00%	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020
KR4AFV650003 2026-05 한화오션개별선물							278
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-278	-278	-278	-278	-278	-278	-278
-5.33%	-186	-186	-186	-186	-186	-186	-186
-2.67%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	93	93	93	93	93	93	93
5.33%	186	186	186	186	186	186	186
8.00%	278	278	278	278	278	278	278

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

(단위:백만원)

3,466

공시일 2026-04-27

기준일 2026-04-24

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	2026-04-27
기준일	2026-04-24

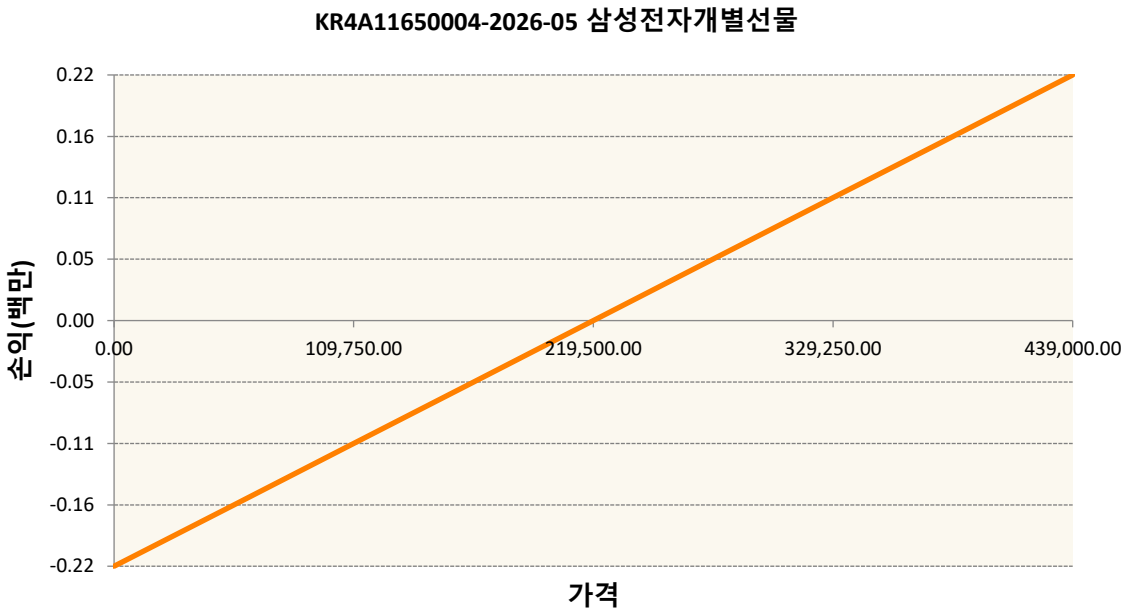
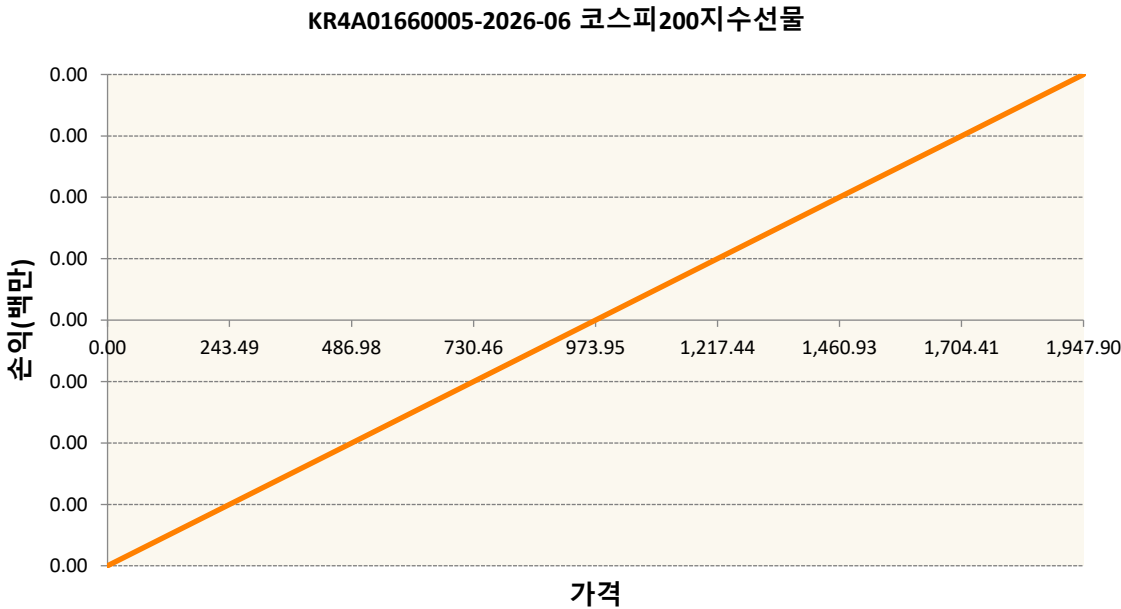
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,696	29,599	-16,903	장내

2. 만기시점의 손익구조



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 1,955.00 with major ticks every 244.38 units. The y-axis represents the net income, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A solid blue line starts at the origin (0, 0.00) and extends to the point (1,955.00, 0.00), indicating a constant rate of change.

가액	순익(백만)
0.00	0.00
244.38	0.00
488.75	0.00
733.13	0.00
977.50	0.00
1,221.88	0.00
1,466.25	0.00
1,710.63	0.00
1,955.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between the amount (가액) and the profit/loss (손익) in millions. The x-axis represents the amount, ranging from 0.00 to 1,960.00 with major ticks every 245.00. The y-axis represents the profit/loss, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid blue line starts at the origin (0, 0) and ends at (1,960, 0), indicating that the profit/loss is zero for all amounts shown on the x-axis.

가액	손익 (백만)
0.00	0.00
245.00	0.00
490.00	0.00
735.00	0.00
980.00	0.00
1,225.00	0.00
1,470.00	0.00
1,715.00	0.00
1,960.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					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%	-337	-337	-337	-337	-337	-337	-337
-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%	337	337	337	337	337	337	337
8.00%	505	505	505	505	505	505	505
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물					509
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-509	-509	-509	-509	-509	-509	-509
-5.33%	-339	-339	-339	-339	-339	-339	-339
-2.67%	-170	-170	-170	-170	-170	-170	-170
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	170	170	170	170	170	170	170
5.33%	339	339	339	339	339	339	339
8.00%	509	509	509	509	509	509	509
KR4BAFBA9779 코스피위클리M C 2604W4 977.5							1,419

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,419	1,419	1,419	1,419	1,419	1,419	1,419
-5.33%	946	946	946	946	946	946	946
-2.67%	473	473	473	473	473	473	473
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-473	-473	-473	-473	-473	-473	-473
5.33%	-946	-946	-946	-946	-946	-946	-946
8.00%	-1,419	-1,419	-1,419	-1,419	-1,419	-1,419	-1,419

KR4BAFBA9803 코스피위클리M C 2604W4 980.0							933
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	933	933	933	933	933	933	933
-5.33%	622	622	622	622	622	622	622
-2.67%	311	311	311	311	311	311	311
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-311	-311	-311	-311	-311	-311	-311
5.33%	-622	-622	-622	-622	-622	-622	-622
8.00%	-933	-933	-933	-933	-933	-933	-933

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

(단위:백만원)

7,326

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

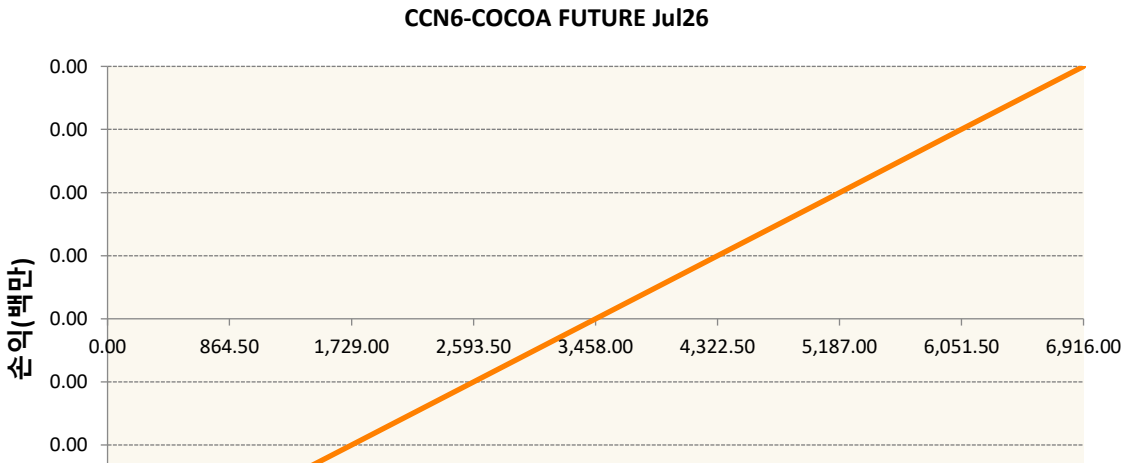
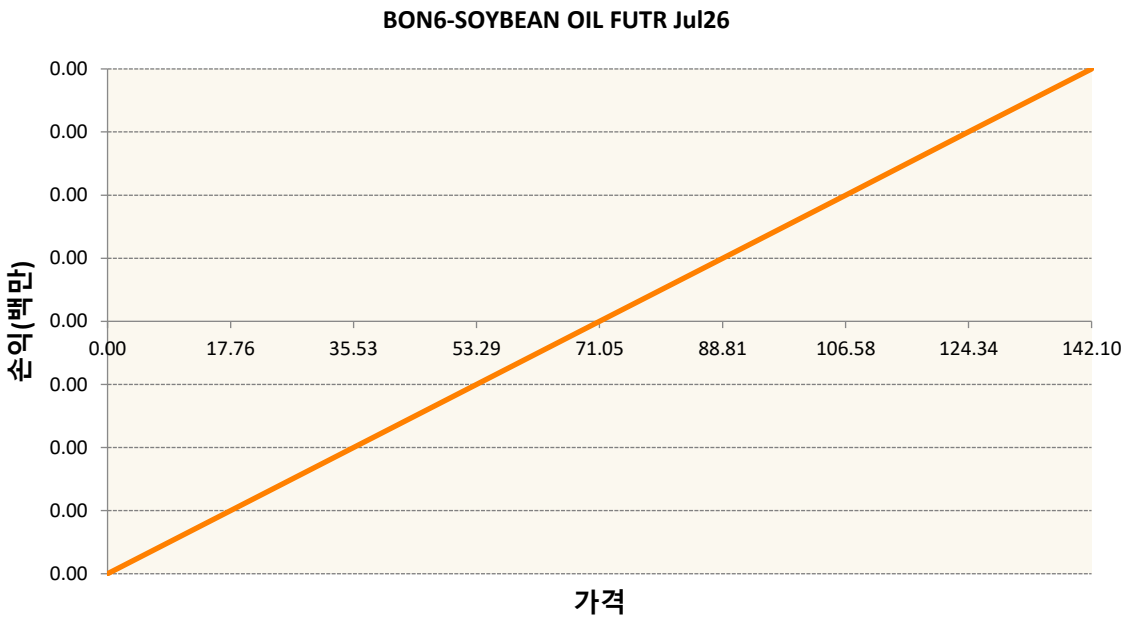
포커스농산물모(채권-파생형)

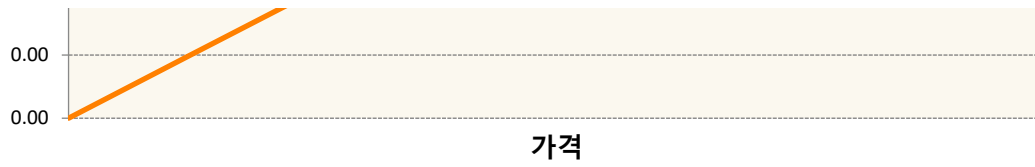
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

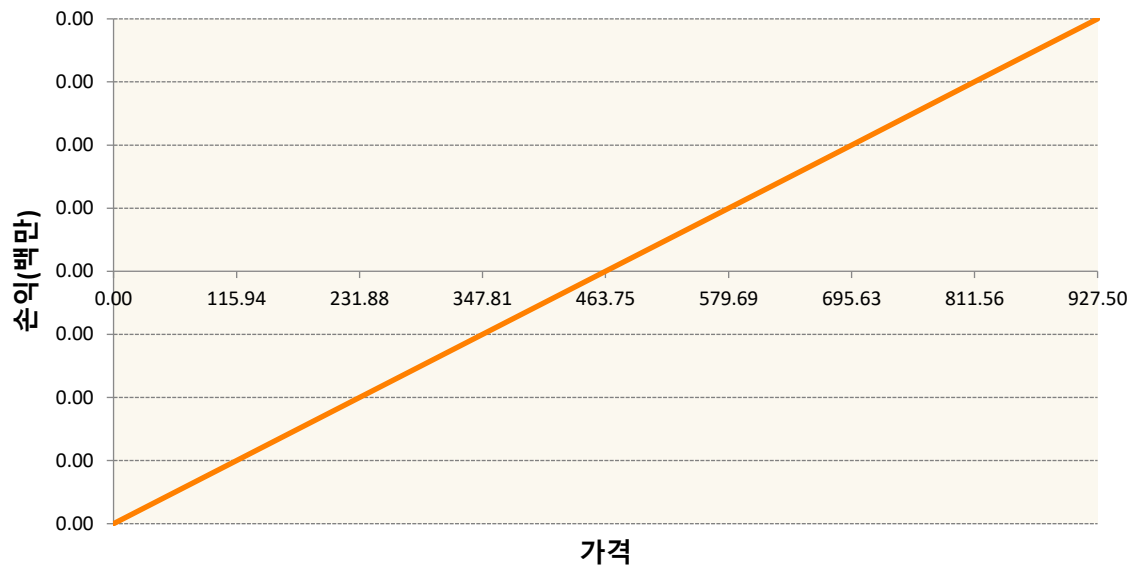
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	103	0	103	
누계	실물자산	선물	889	0	889	장내
누계	유가증권	선물	2,050	0	2,050	
누계	통화	선물	0	356	-356	장내

2. 만기시점의 손익구조

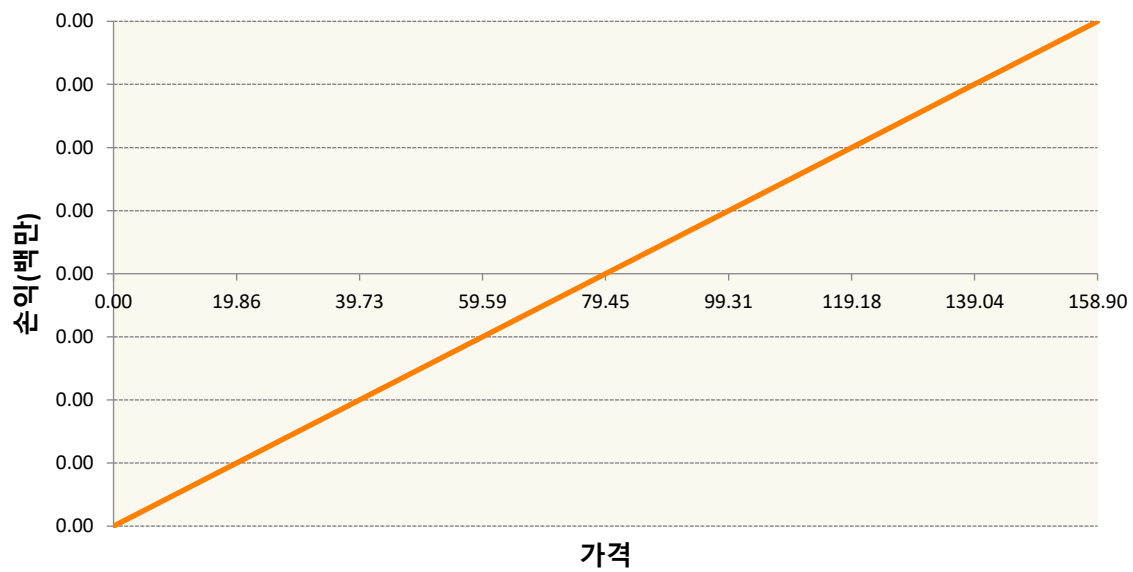




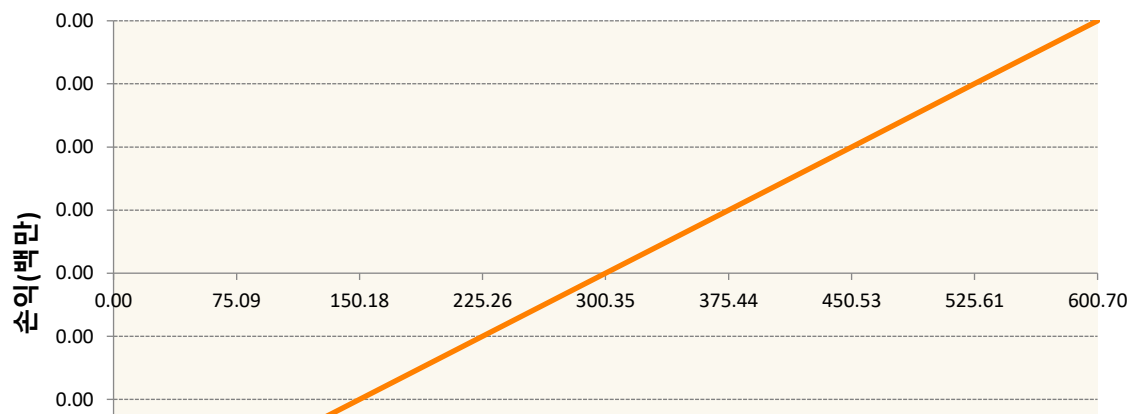
CN6-CORN FUTURE Jul26

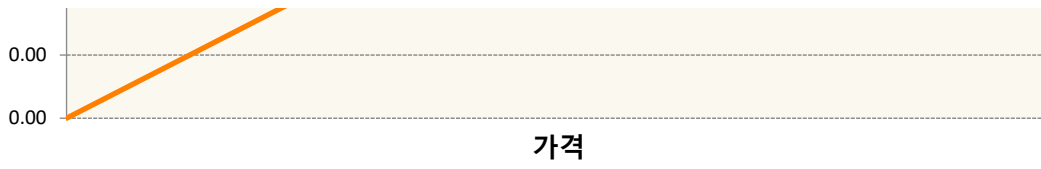


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

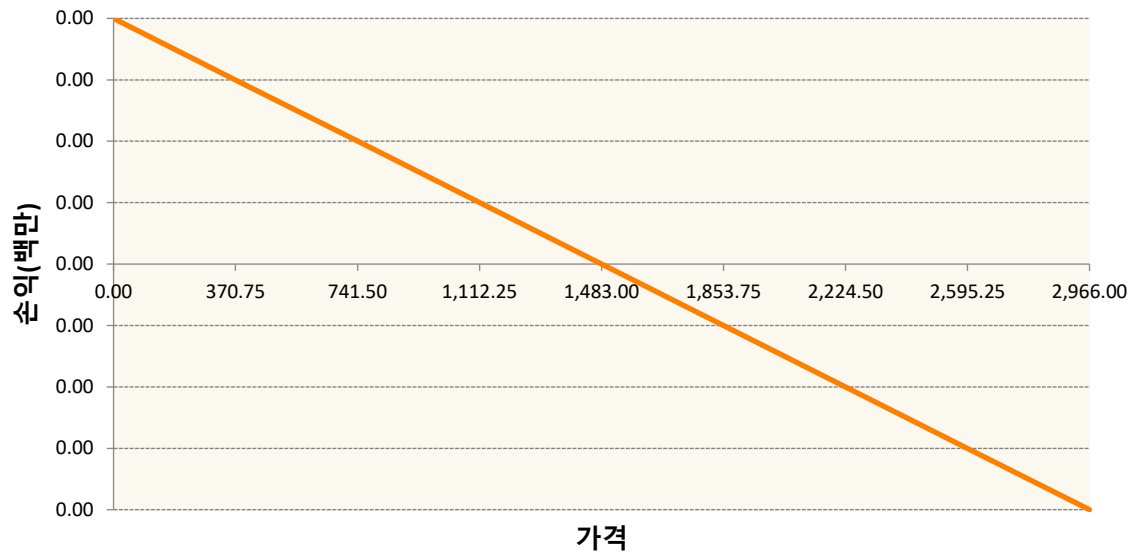


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

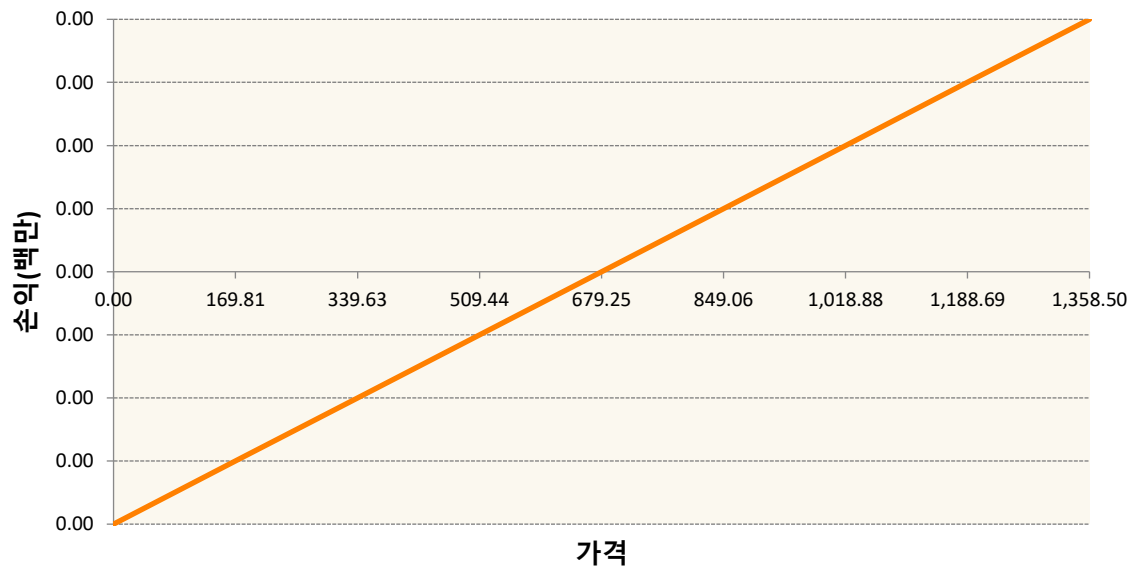




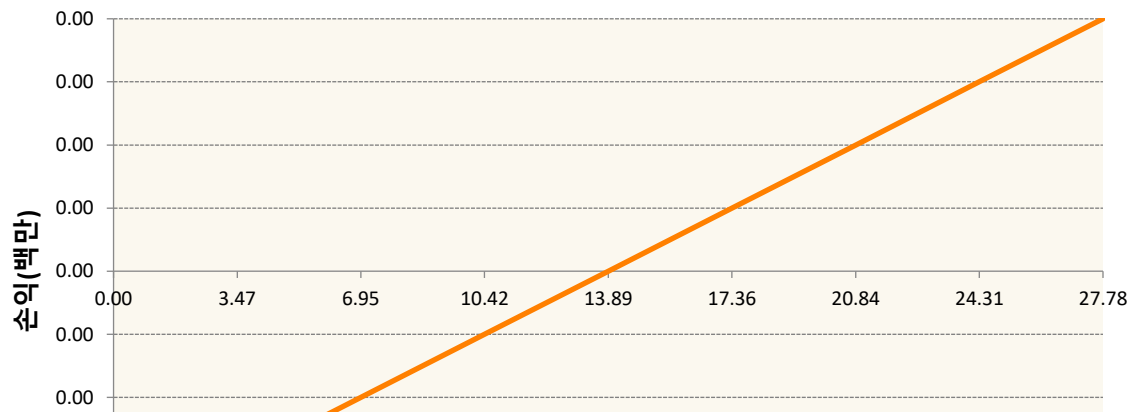
KR4A75650007-2026-05 달러선물

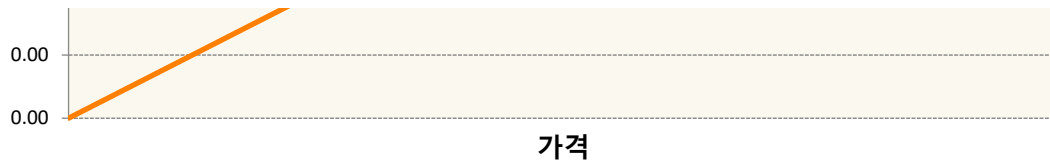


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

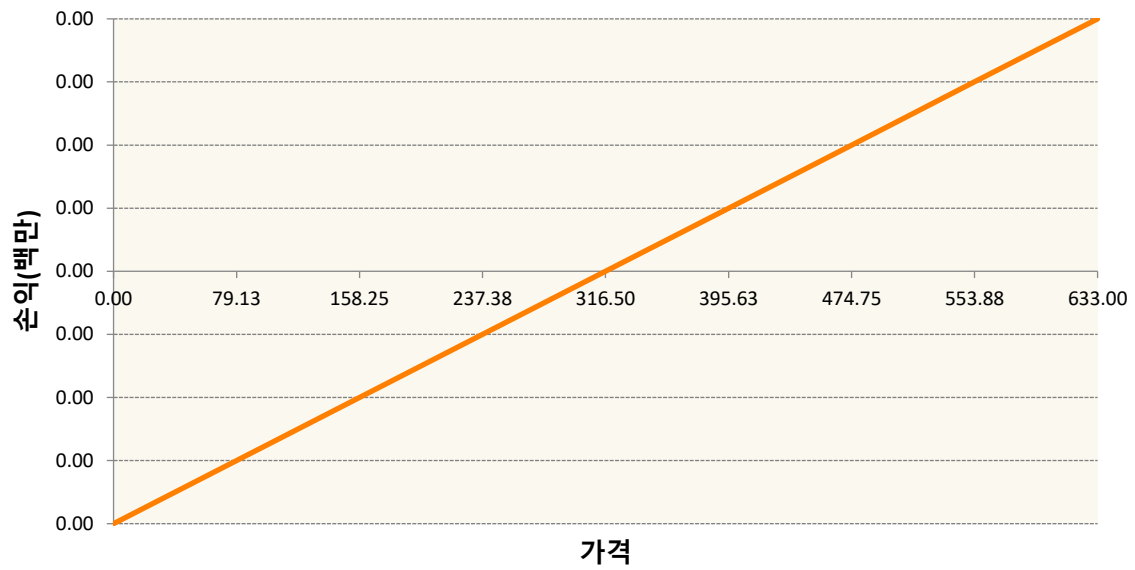


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

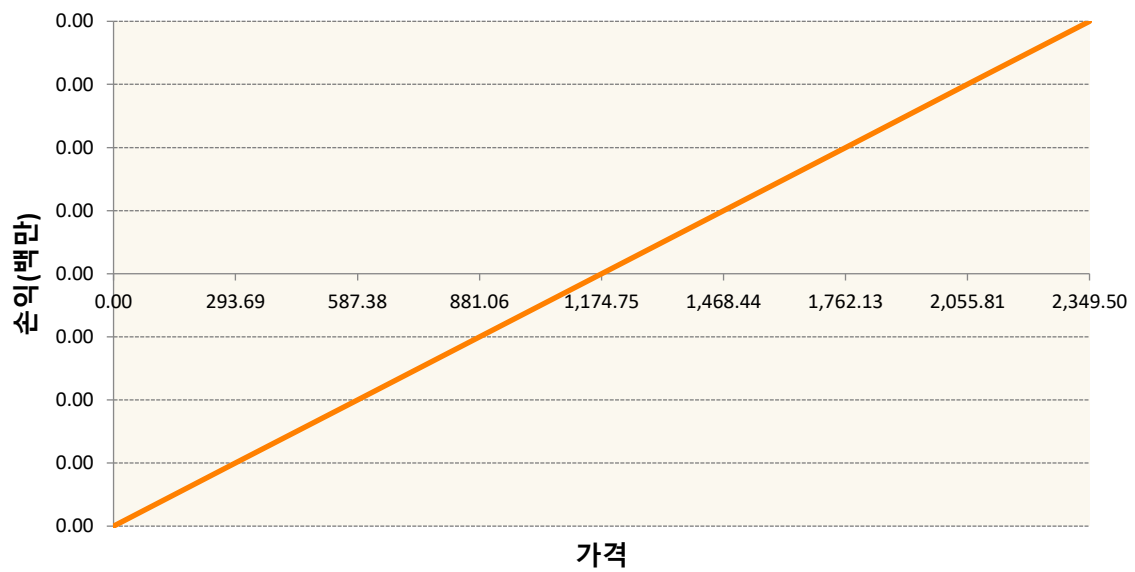




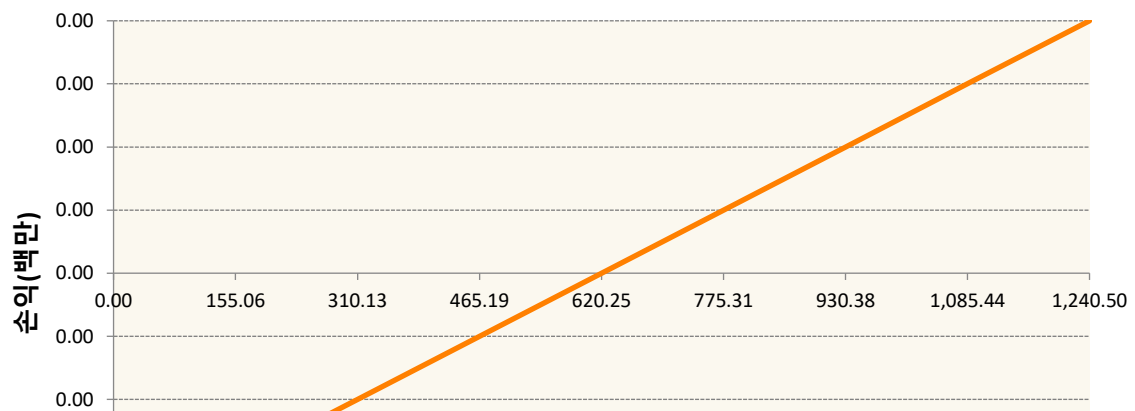
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

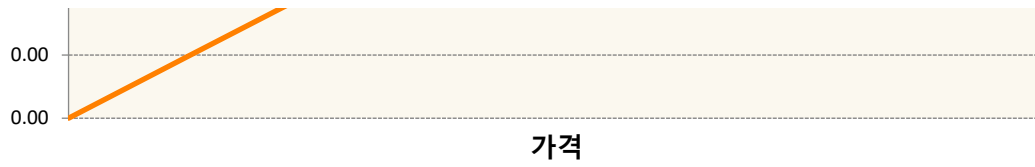


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-04-27
기준일	2026-04-24

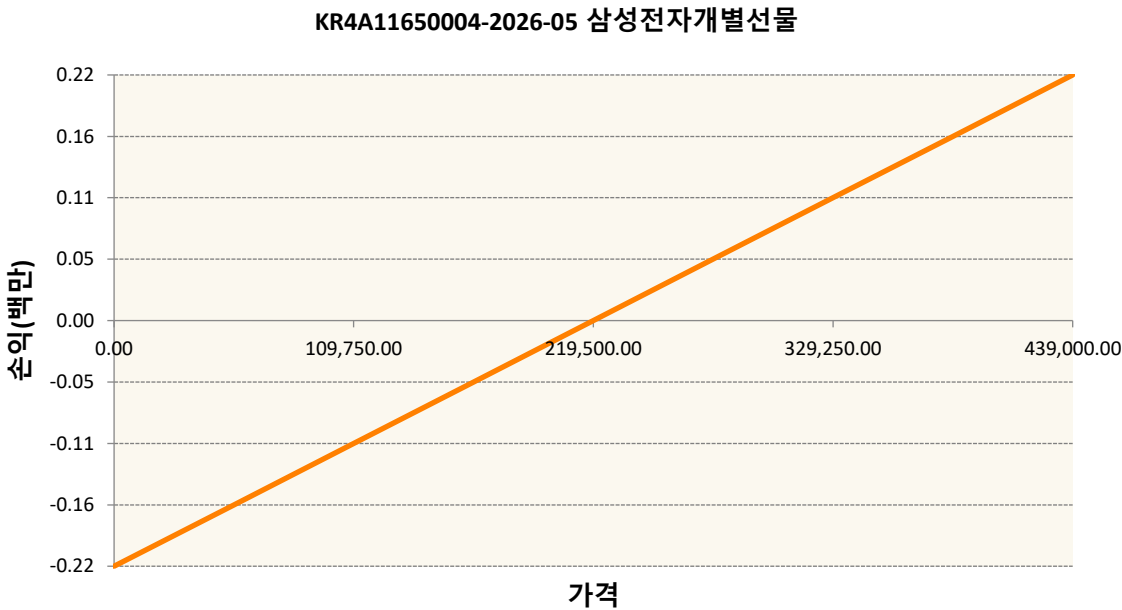
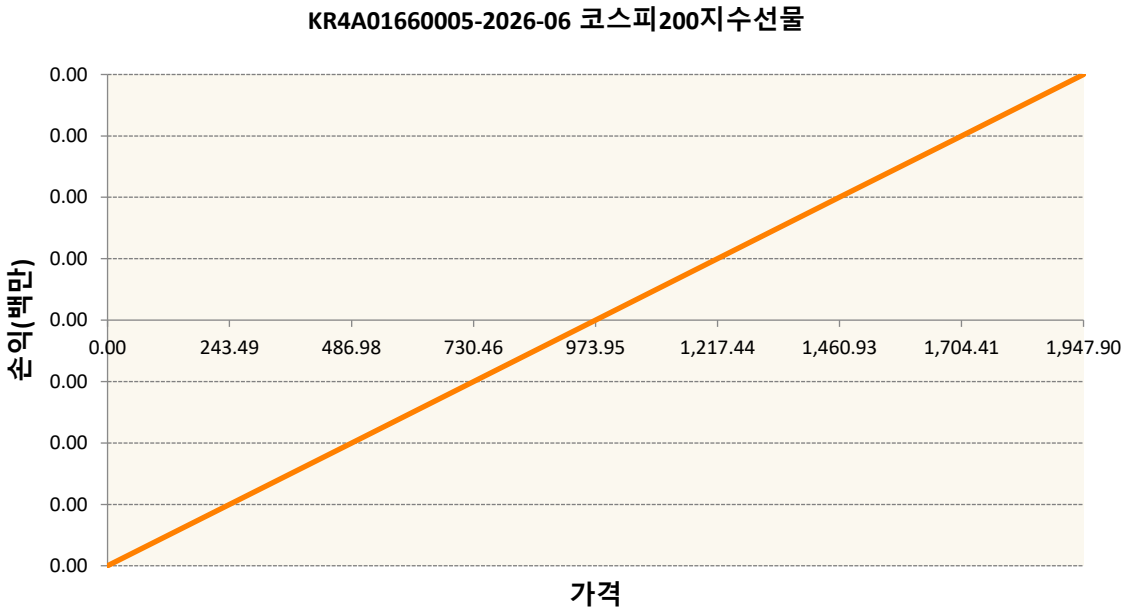
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	244	-244	장내
누계	유가증권	선물	2,608	0	2,608	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The line shows that profit is negative for prices below 1,227,000.00 and positive for prices above 1,227,000.00.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-1.23
613,500.00	-0.61
1,227,000.00	0.00
1,840,500.00	0.61
2,454,000.00	1.23

가격	순이익 (백만)
0.00	-0.03
8,175.00	-0.02
16,350.00	-0.01
24,525.00	0.00
32,700.00	0.01
40,875.00	0.02
49,050.00	0.03
57,225.00	0.04
65,400.00	0.05

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					155
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
-5.33%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	104	104	104	104	104	104	104
8.00%	155	155	155	155	155	155	155
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물					40
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
-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%	40	40	40	40	40	40	40
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)

468

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

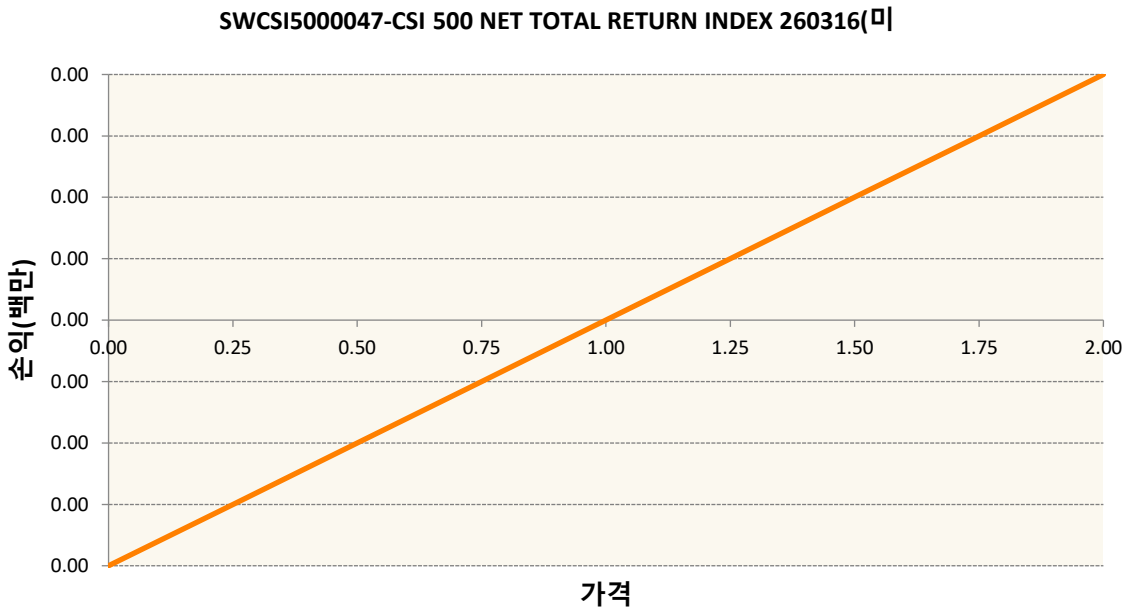
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,644	0	5,644	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

451

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

554

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

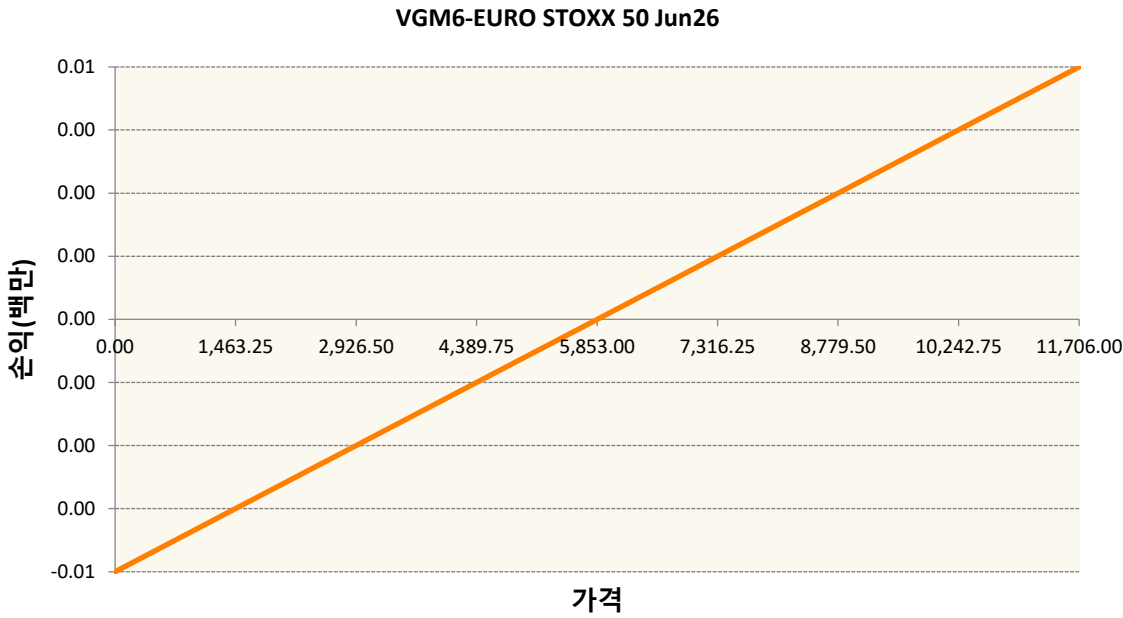
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	902	0	902	

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	2026-04-27
기준일	2026-04-24

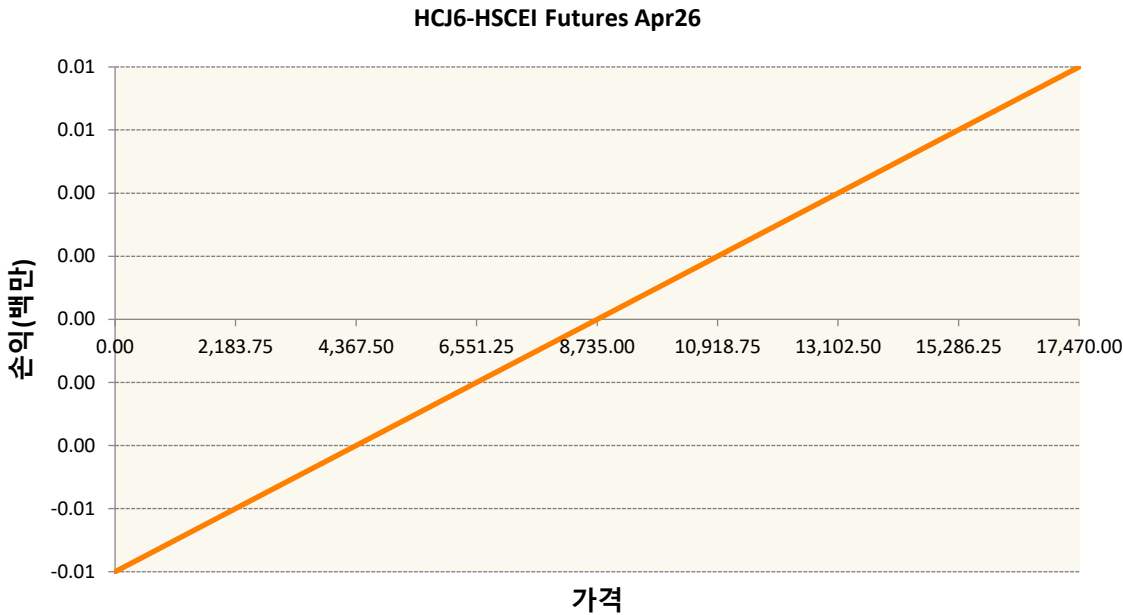
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,681	0	1,681	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI6	HSCEI Futures Apr26	134
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

164

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

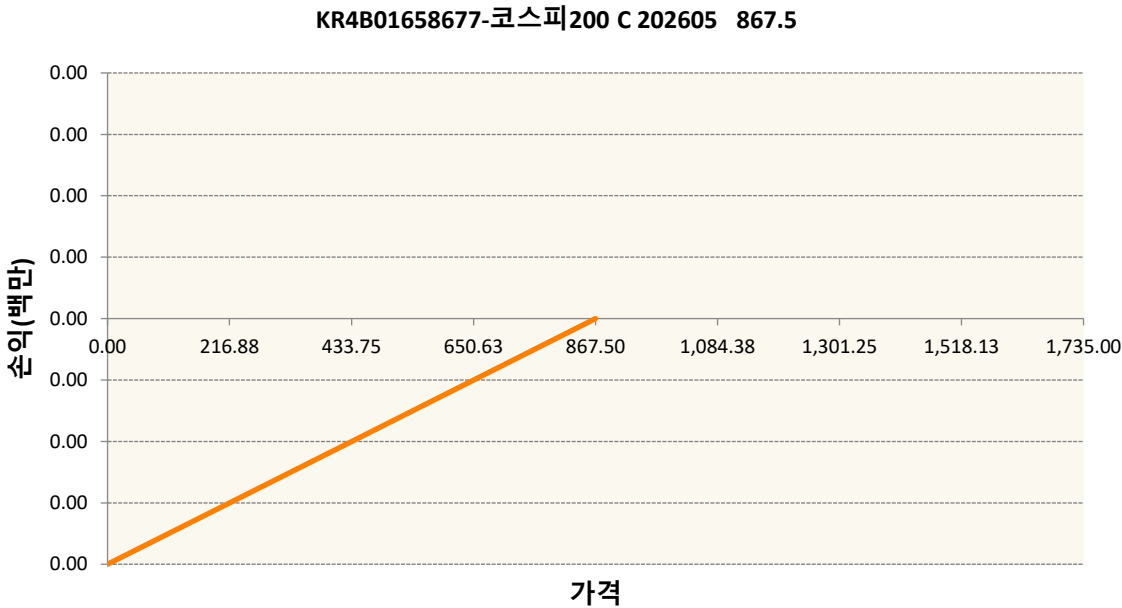
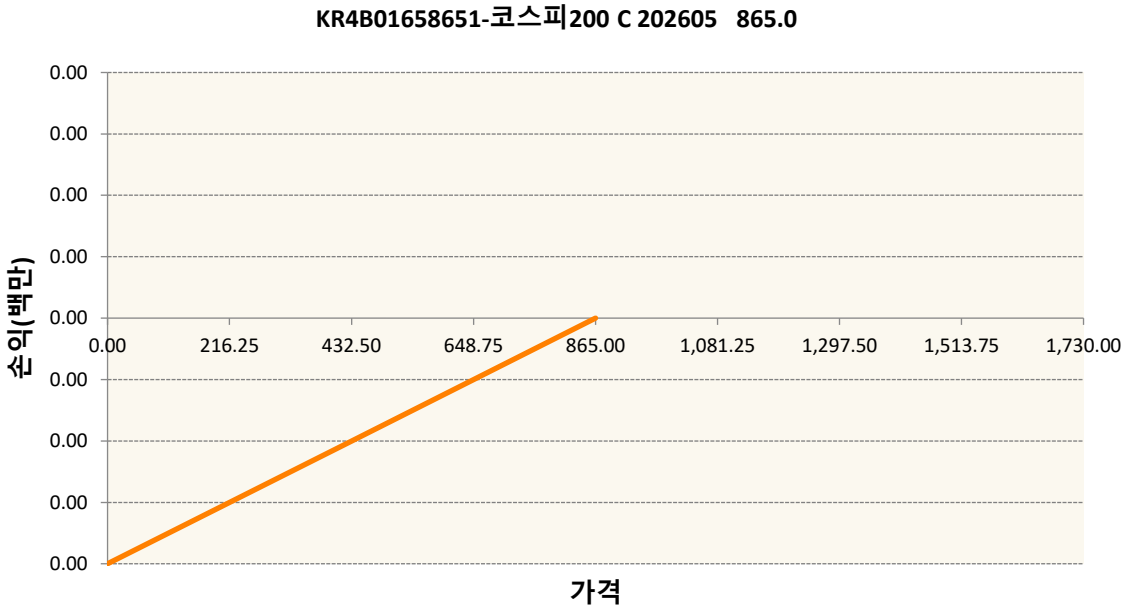
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

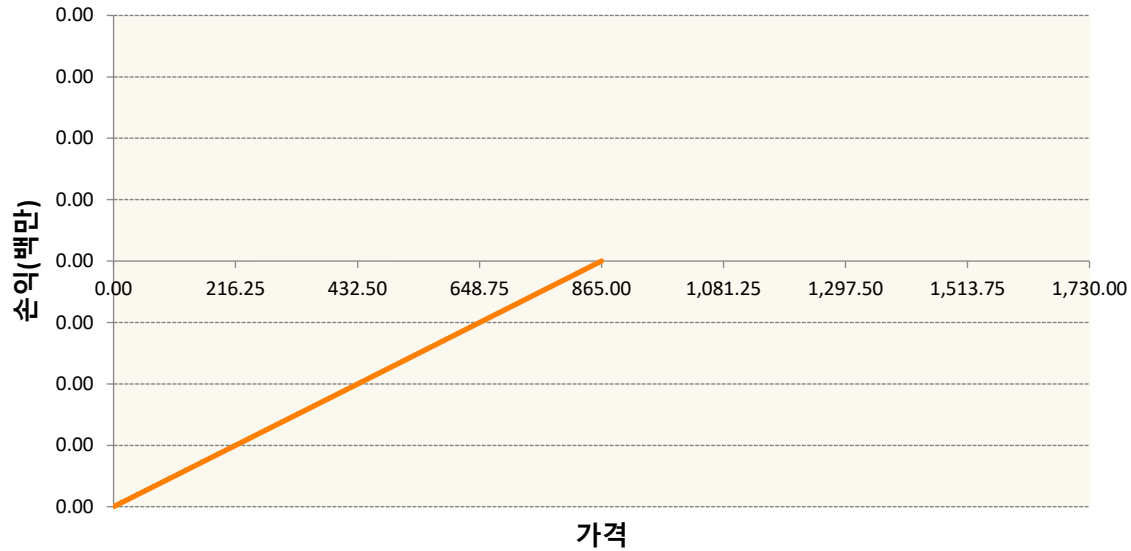
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,498	-35,498	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0							642
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-190	-264	-339	-414	-490	-566	-642
-5.33%	-35	-101	-169	-240	-311	-383	-457
-2.67%	73	18	-41	-103	-168	-235	-303
0%	145	102	53	0	-57	-116	-178
2.67%	190	158	120	77	29	-23	-78
5.33%	218	195	166	132	93	49	2
8.00%	234	218	198	172	140	104	64
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							420
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-176	-224	-273	-322	-371	-420
-5.33%	-25	-68	-113	-158	-205	-252	-299
-2.67%	47	11	-28	-68	-111	-154	-199
0%	96	67	35	0	-37	-76	-116
2.67%	126	105	80	51	20	-14	-50
5.33%	145	130	111	88	62	33	2
8.00%	156	146	132	114	94	70	43
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							246
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-73	-101	-130	-158	-187	-217	-246
-5.33%	-13	-39	-65	-92	-119	-147	-175
-2.67%	28	7	-16	-40	-64	-90	-116
0%	56	39	20	0	-22	-44	-68

2.67%	73	61	46	29	11	-9	-30
5.33%	83	75	64	51	36	19	1
8.00%	89	84	76	66	54	40	24

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

(단위:백만원)

1,357

공시일 2026-04-27

기준일 2026-04-24

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	2026-04-27
기준일	2026-04-24

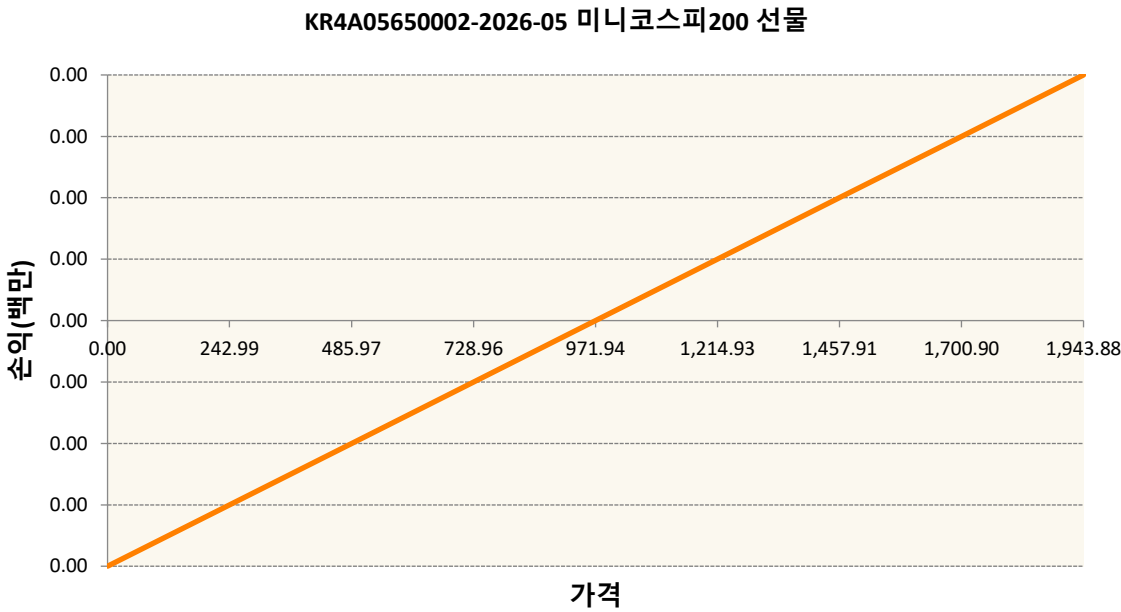
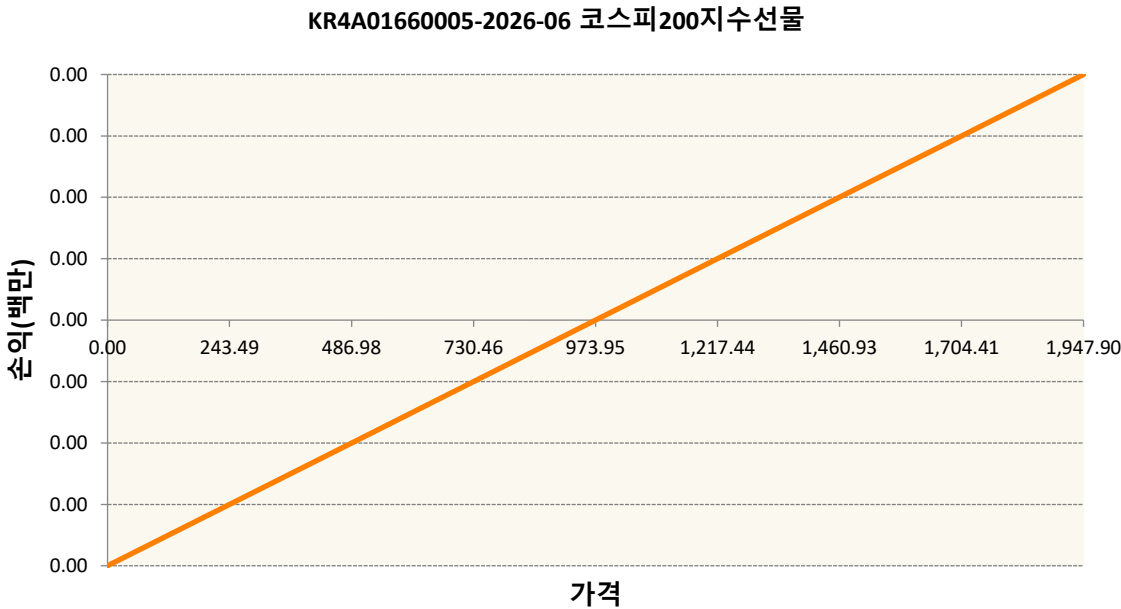
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

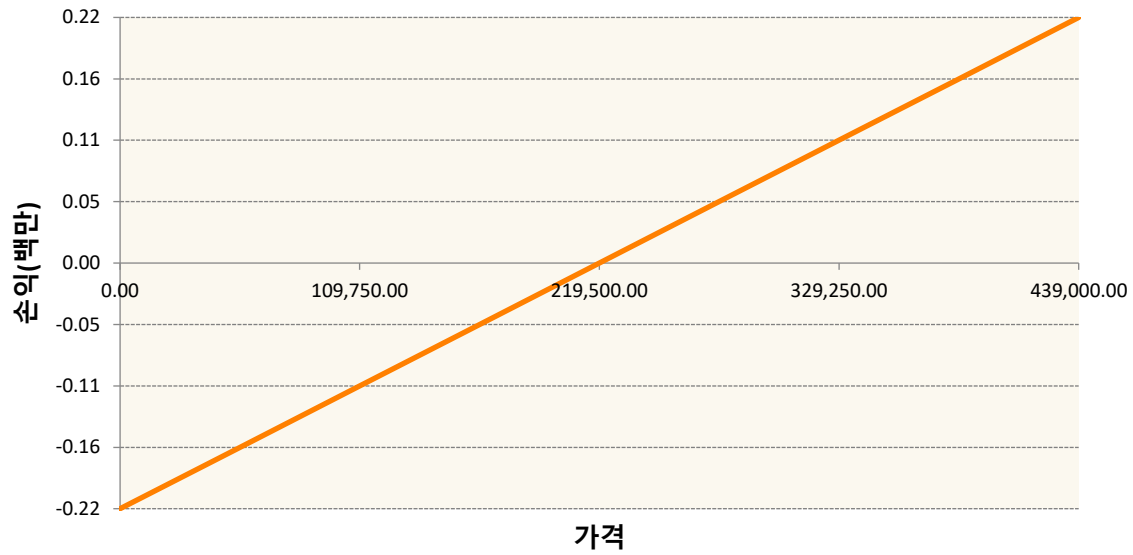
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	488	77	411	장내
누계	유가증권	선물	4,251	77	4,174	장내

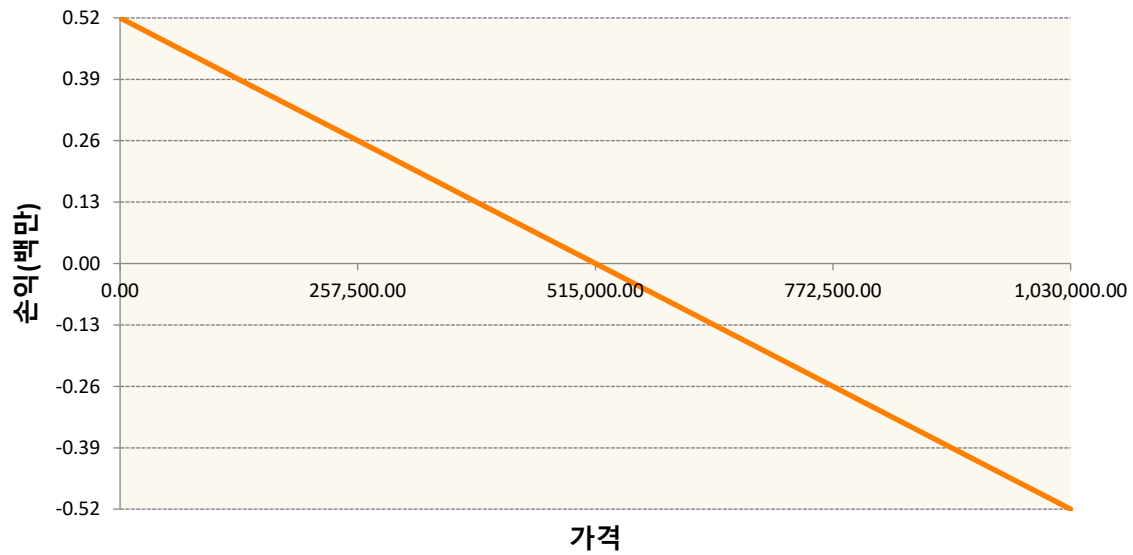
2. 만기시점의 손익구조



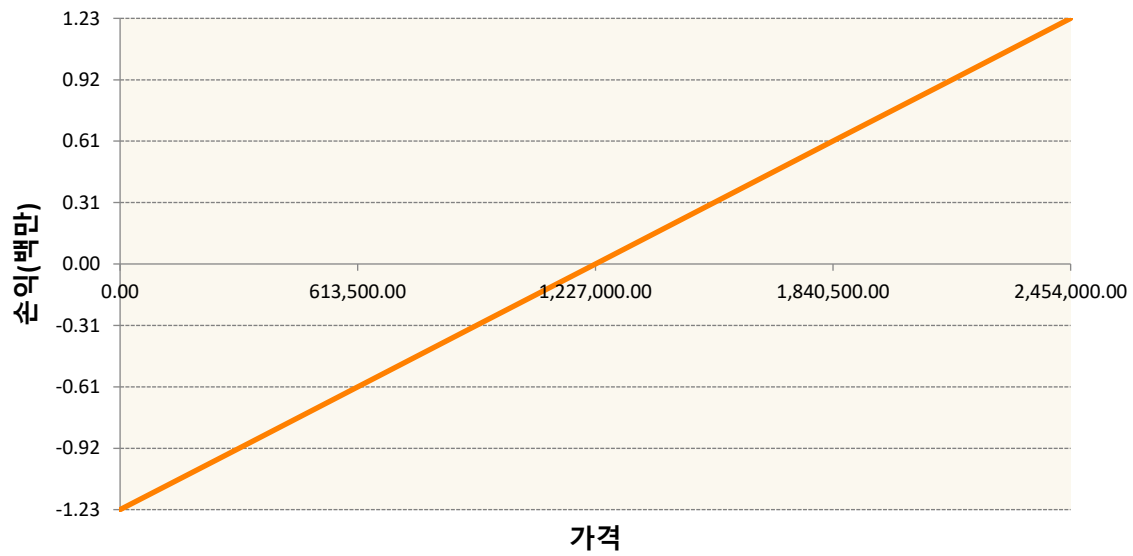
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A16650009-2026-05 현대차개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		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			
KR4A05650002							2026-05 미니코스피200 선물		47	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47			
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31			
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	16	16	16	16	16	16	16			
5.33%	31	31	31	31	31	31	31			
8.00%	47	47	47	47	47	47	47			
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			
KR4A16650009							2026-05 현대차개별선물		6	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6			
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4			
-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%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4			
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6			
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)

344

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

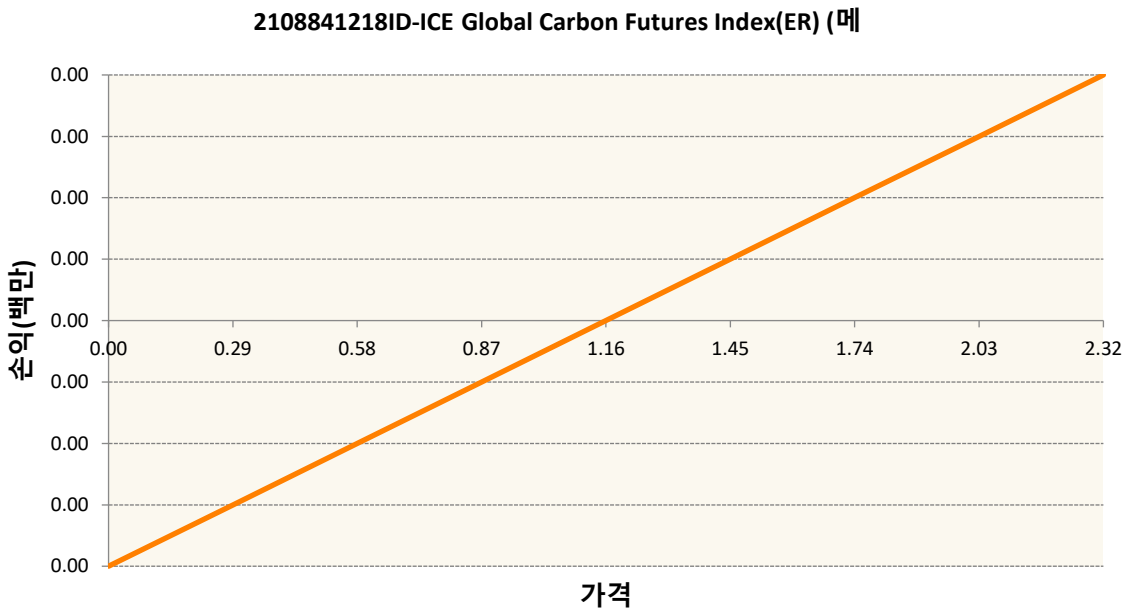
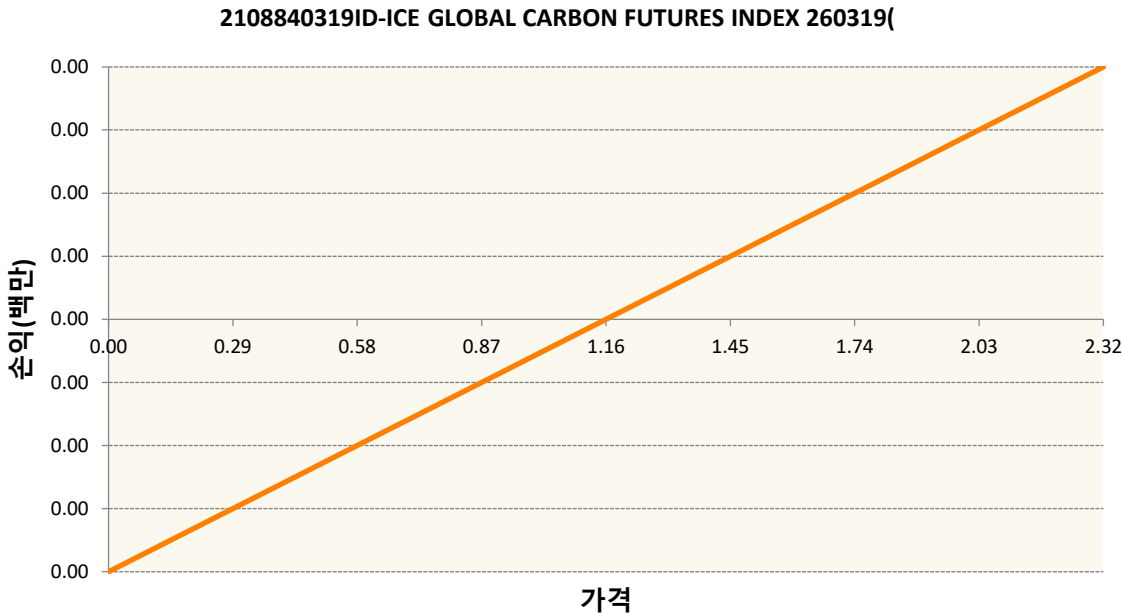
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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(		424
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	604

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

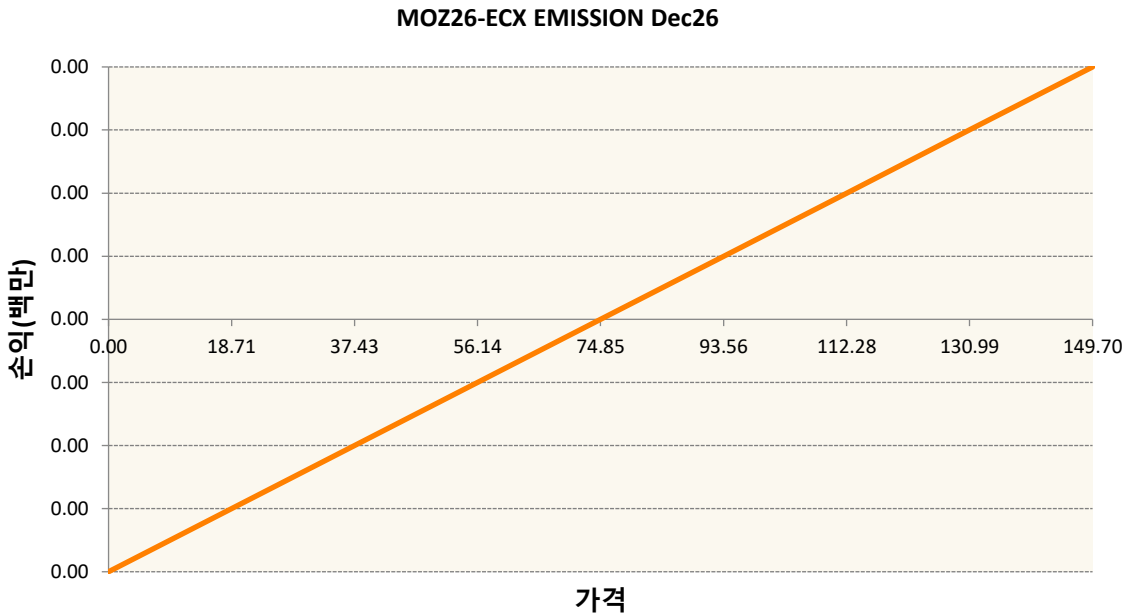
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,828	0	4,828	
누계	통화	선도	0	2,197	-2,197	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E)	176
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	386

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

(단위:백만원)

663

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

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)	6
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	4
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	10
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	4

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

(단위:백만원)

36

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

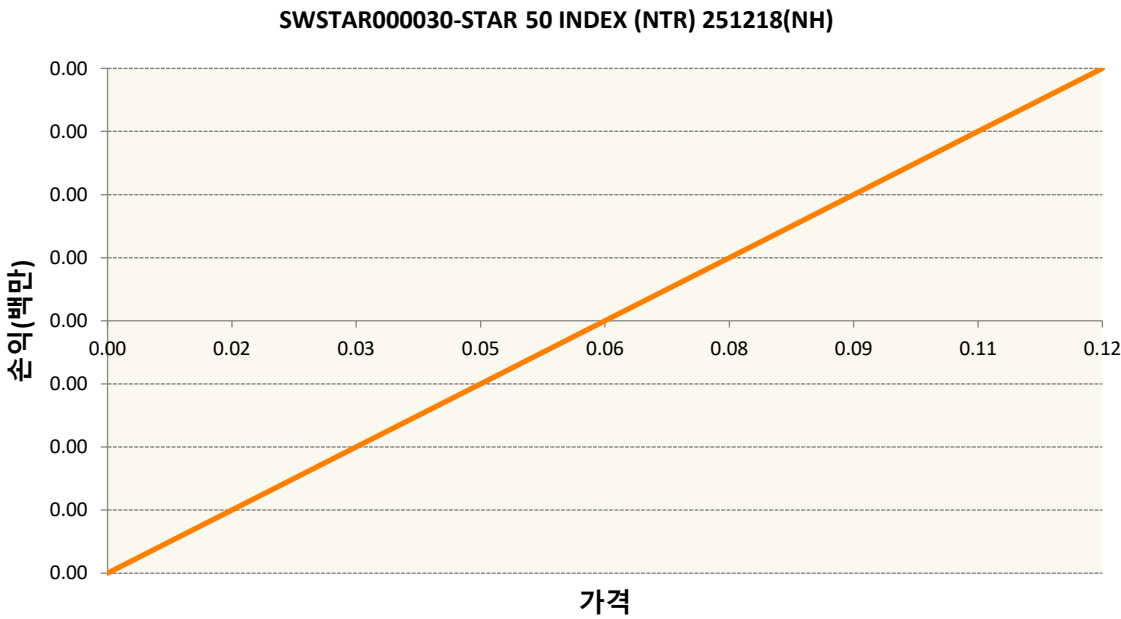
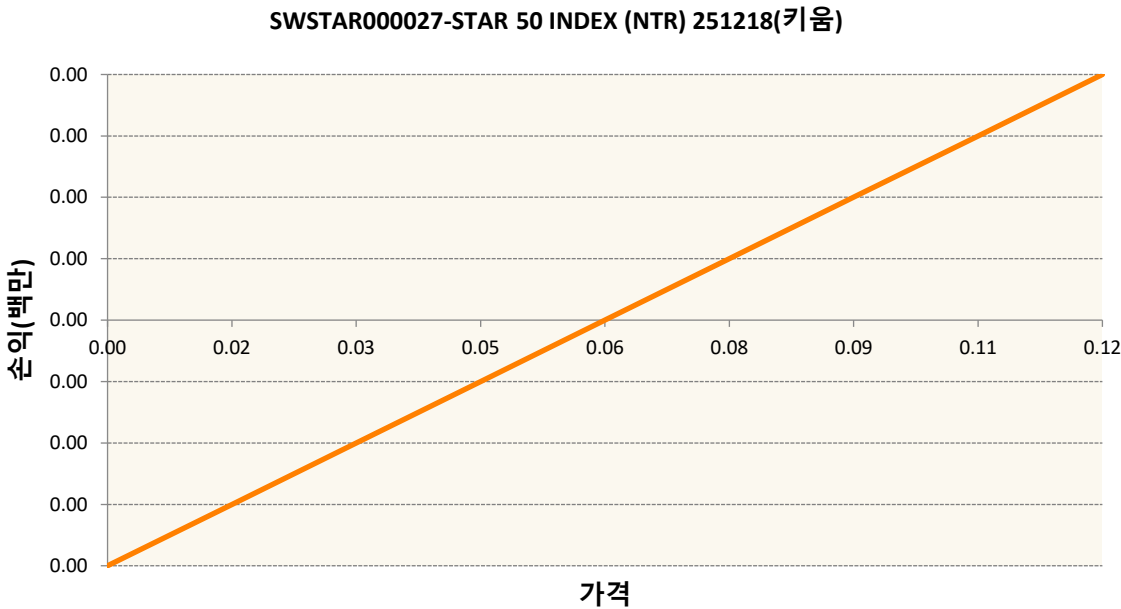
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

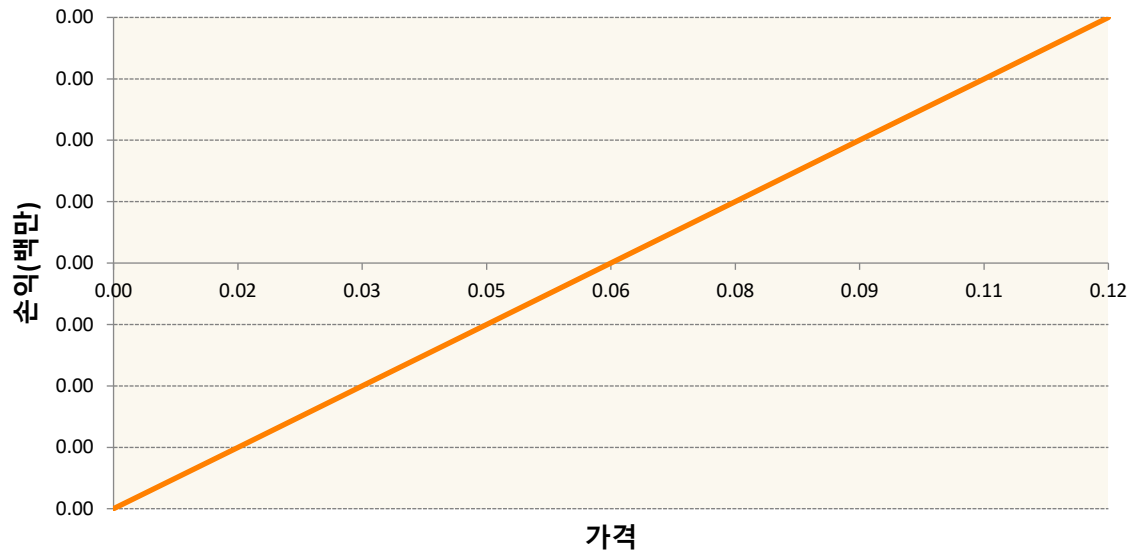
(단위:백만원)

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

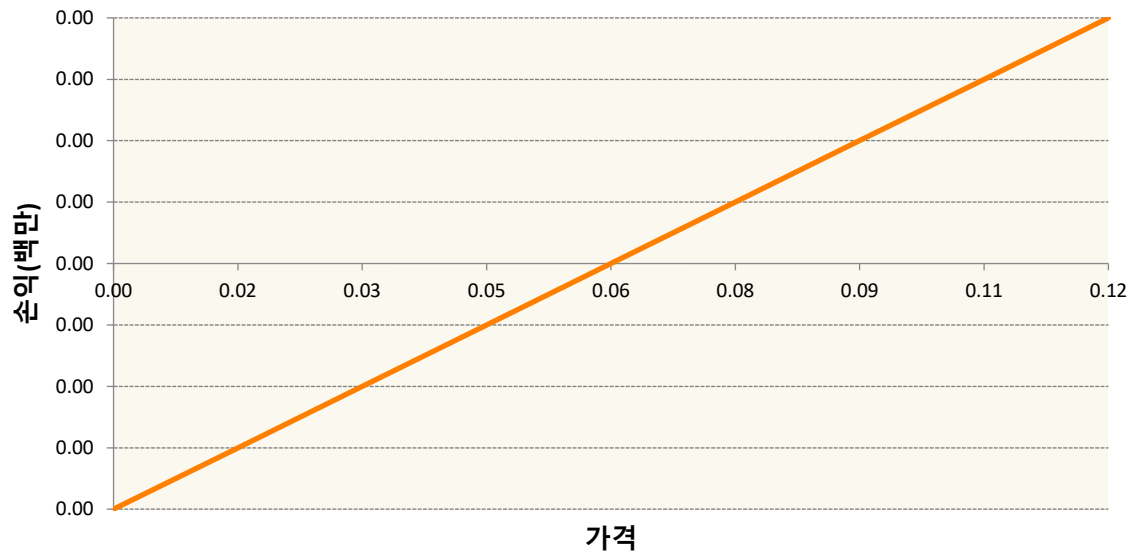
2. 만기시점의 손익구조



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)

4

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)

15

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)

77

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)

29

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

(단위:백만원)

188

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

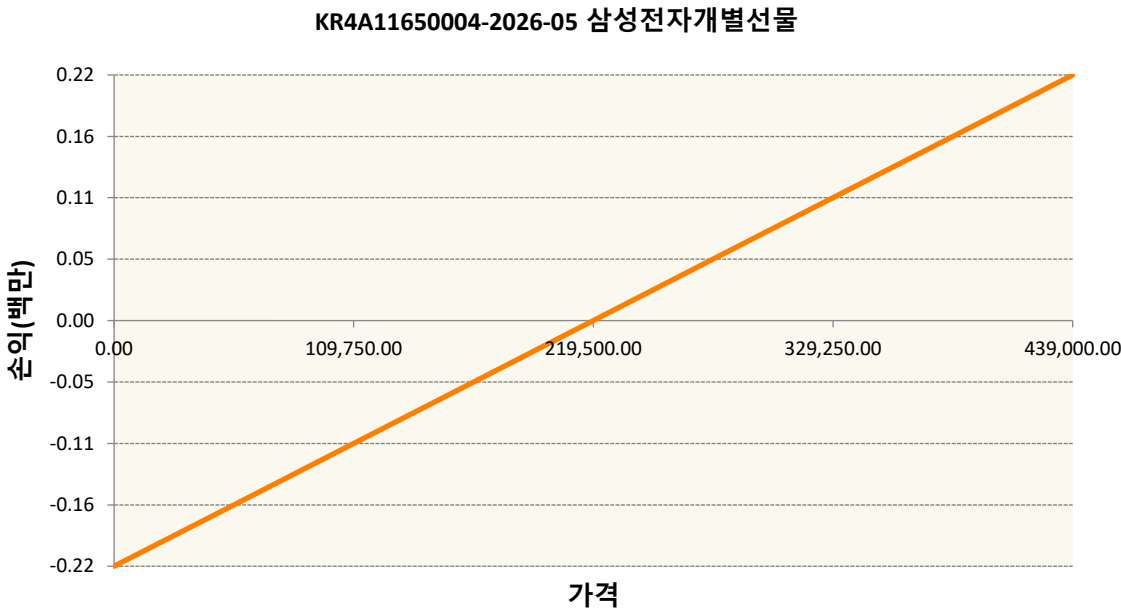
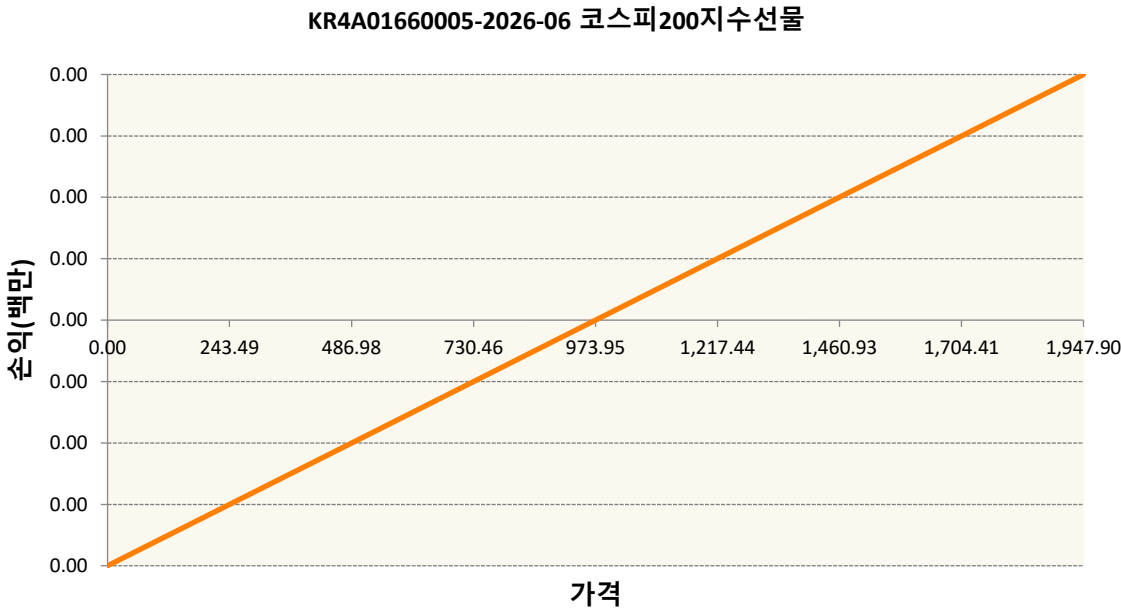
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

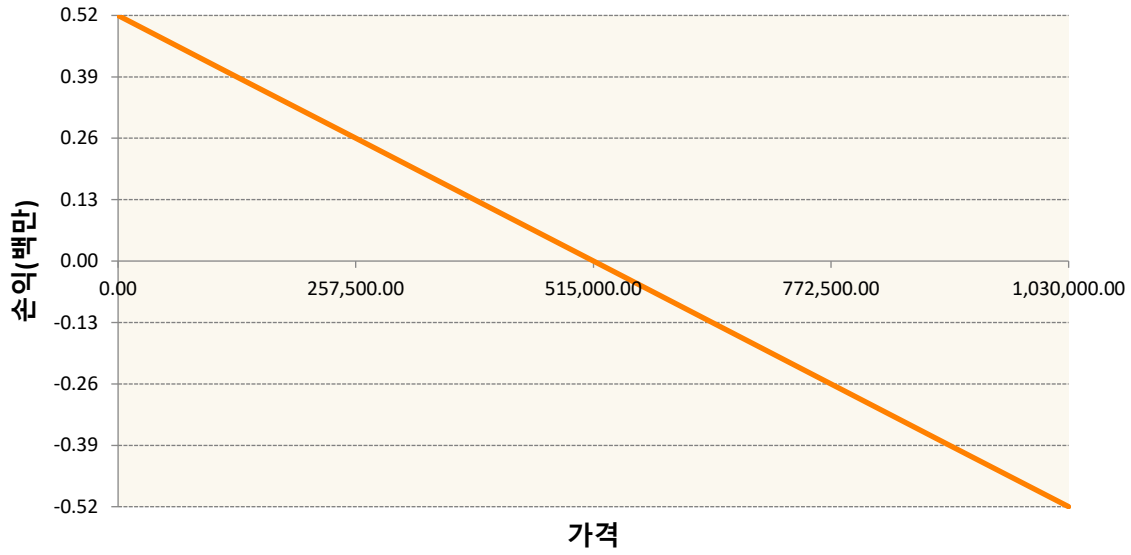
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	10,763	1,697	9,066	장내
누계	유가증권	선물	30,035	3,543	26,492	장내

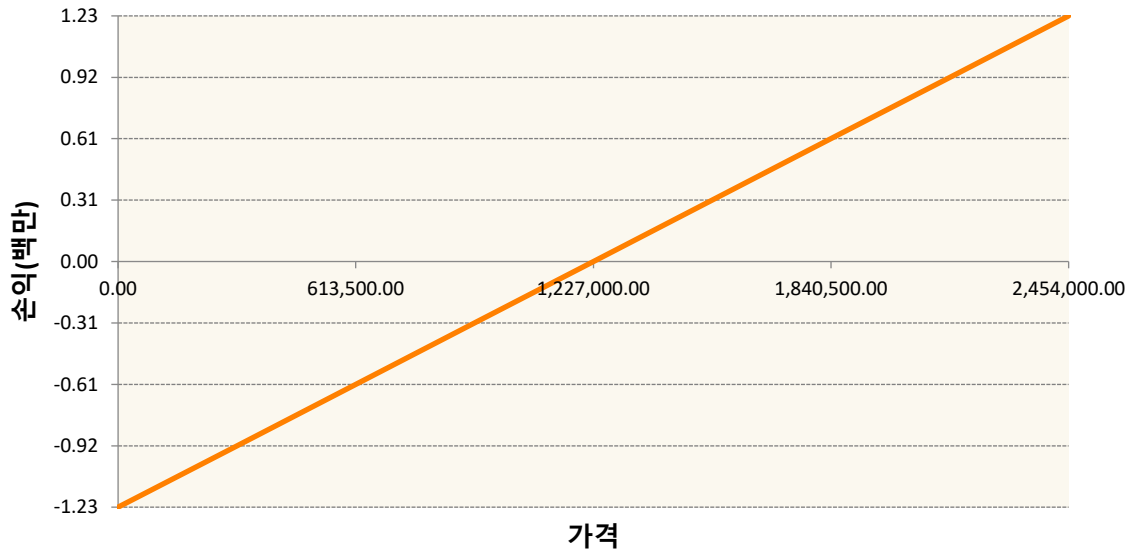
2. 만기시점의 손익구조



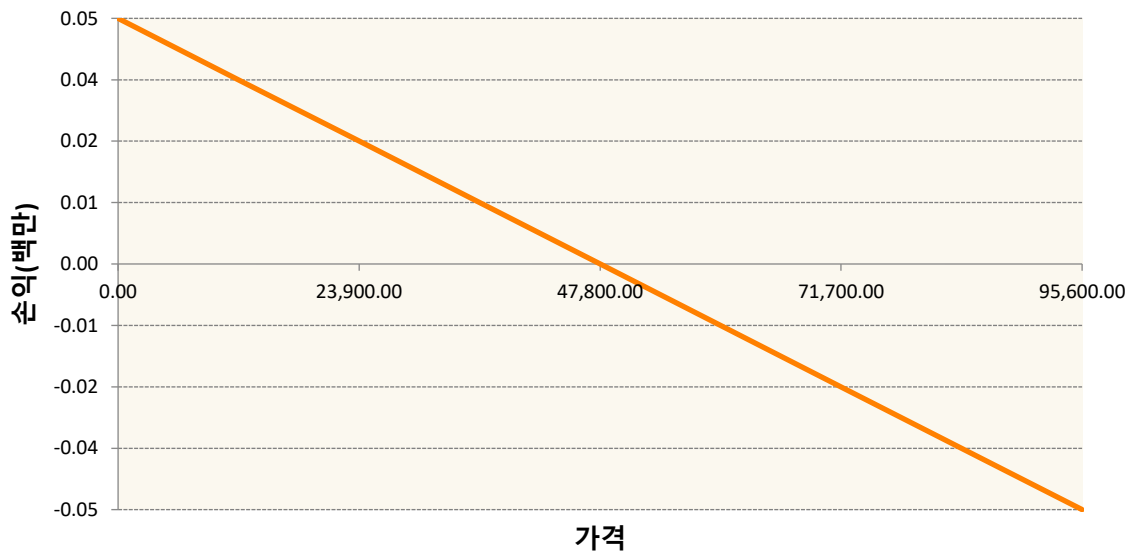
KR4A16650009-2026-05 현대차개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



가격 (Price)	이익 (백만) (Profit in millions)
0.00	0.99
493,000.00	0.49
986,000.00	0.00
1,479,000.00	-0.49
1,972,000.00	-0.99

가격	순의 (백만)
0.00	-0.03
8,175.00	-0.02
16,350.00	-0.01
24,525.00	0.00
32,700.00	0.01
40,875.00	0.02
49,050.00	0.03
57,225.00	0.04
65,400.00	0.05

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				2,041
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	
-5.33%	-1,361	-1,361	-1,361	-1,361	-1,361	-1,361	-1,361	
-2.67%	-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	680	680	680	680	680	680	680	
5.33%	1,361	1,361	1,361	1,361	1,361	1,361	1,361	
8.00%	2,041	2,041	2,041	2,041	2,041	2,041	2,041	
KR4A11650004				2026-05 삼성전자개별선물				181
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181
-5.33%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-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%	121	121	121	121	121	121	121
8.00%	181	181	181	181	181	181	181

KR4A16650009 2026-05 현대차개별선물 78

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	78	78	78	78	78	78	78
-5.33%	52	52	52	52	52	52	52
-2.67%	26	26	26	26	26	26	26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78

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%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-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%	70	70	70	70	70	70	70
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 84

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	84	84	84	84	84	84	84
-5.33%	56	56	56	56	56	56	56
-2.67%	28	28	28	28	28	28	28
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
KR4AFT650007 2026-05 대우건설개별선물							70
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	70	70	70	70	70	70	70

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

(단위:백만원)

5,665

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

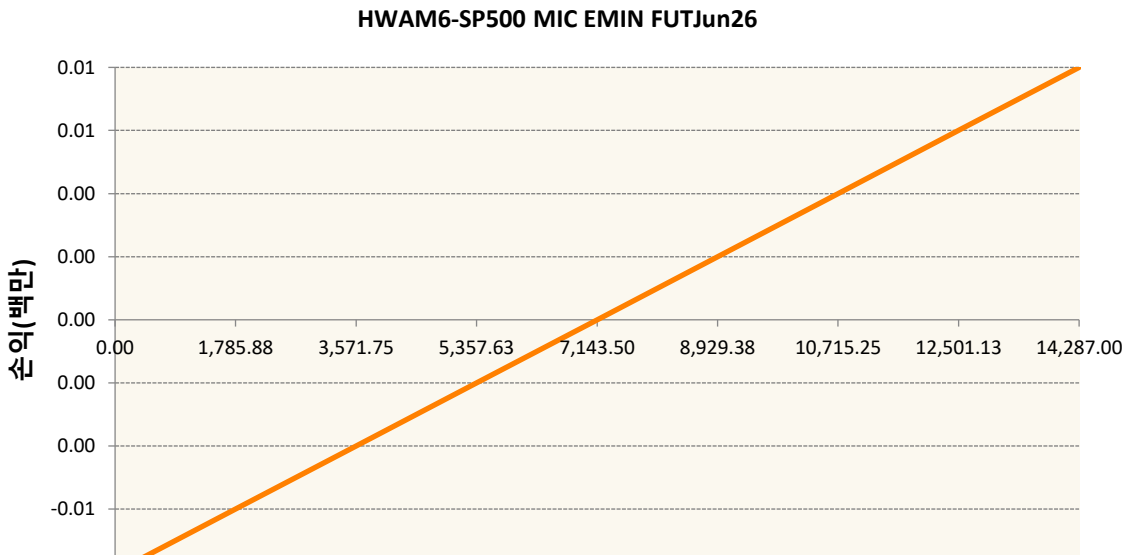
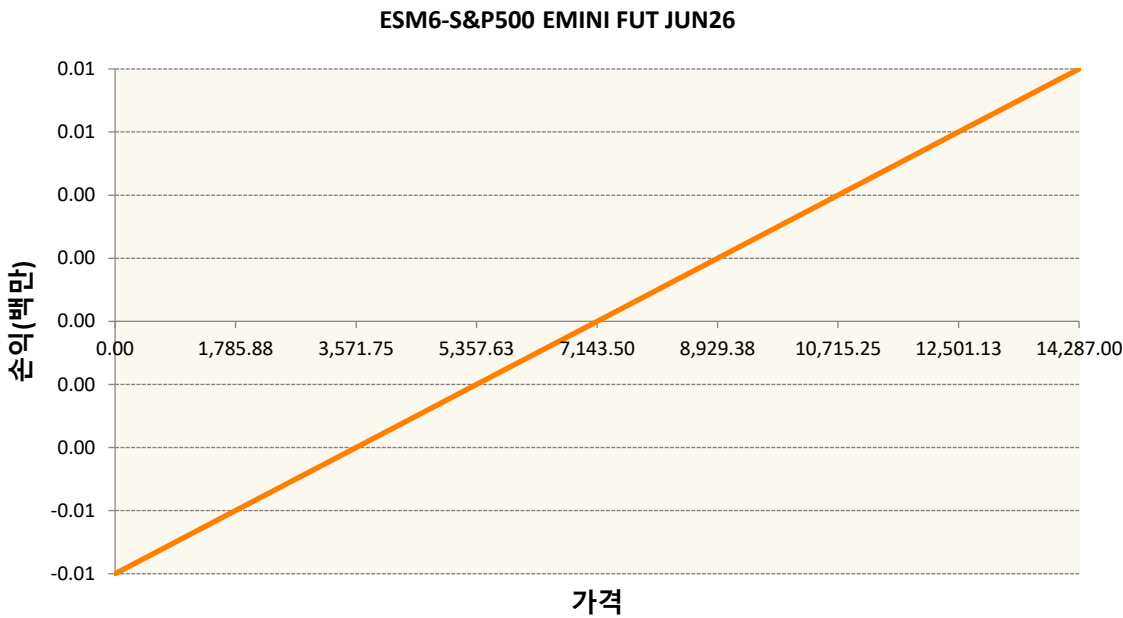
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

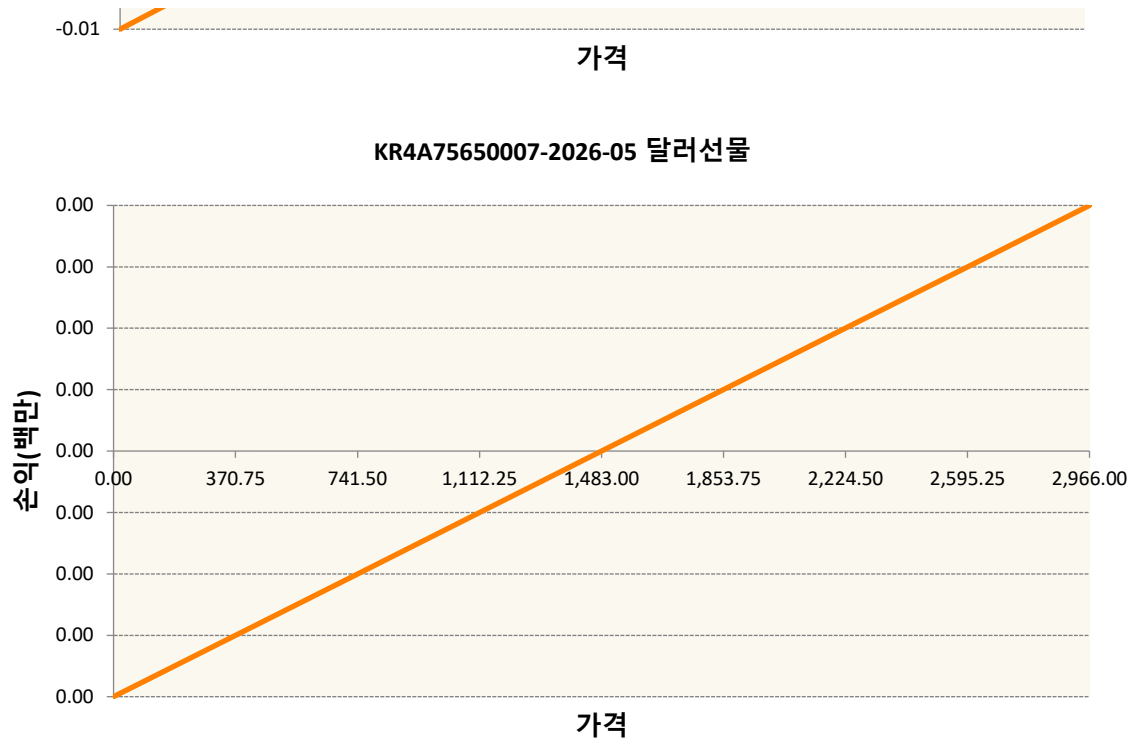
1. 계약금액

(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	56,803	0	56,803	
누계	지수	선물	266	0	266	장내
누계	통화	선물	10,529	0	10,529	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,544
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		21
KR4A756500 2026-05 달러선물			842

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,971

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

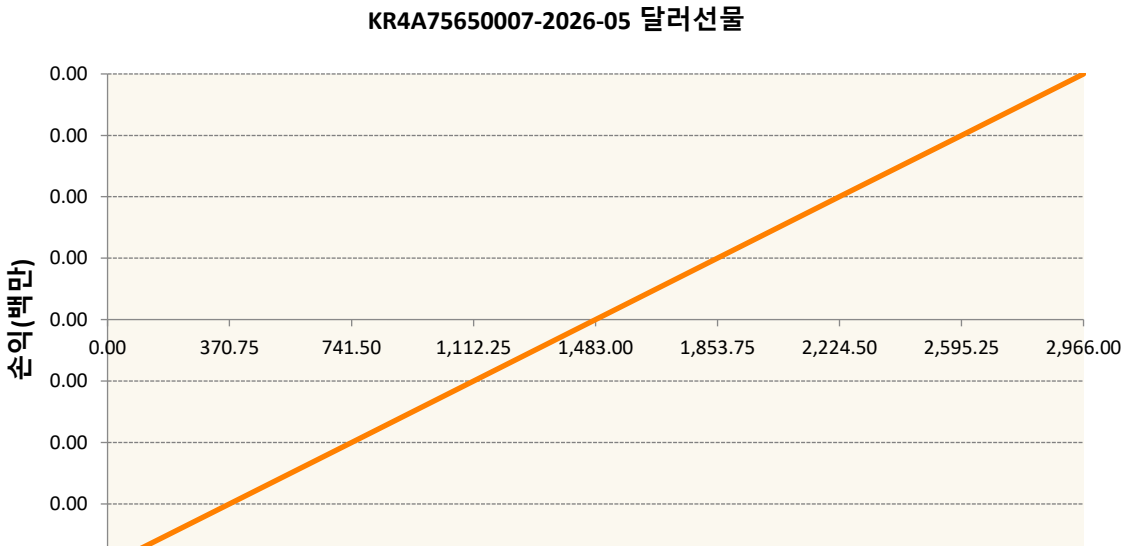
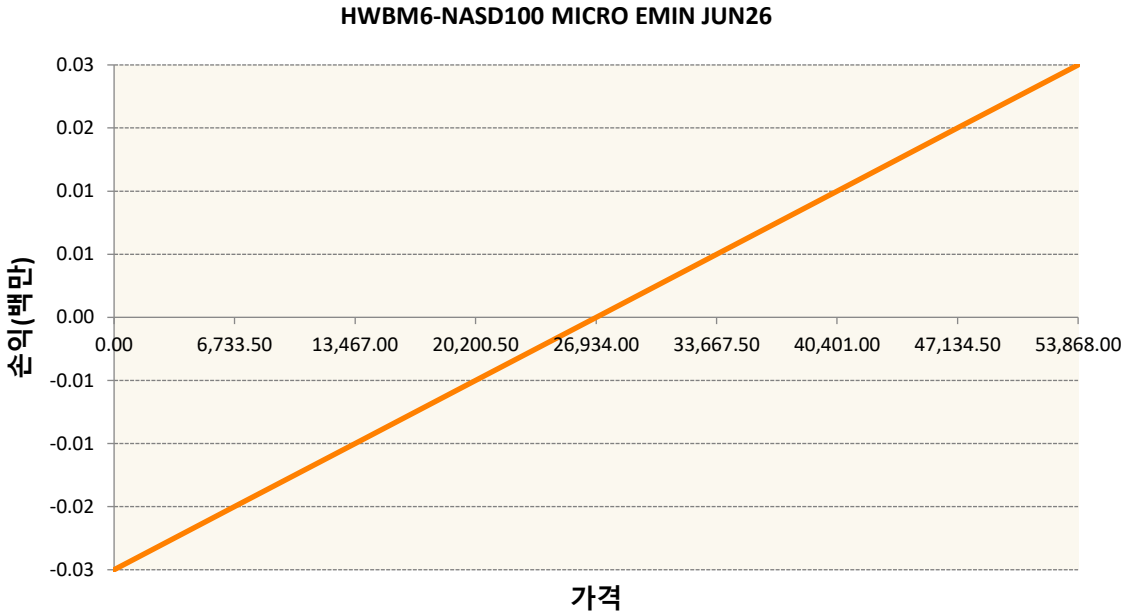
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

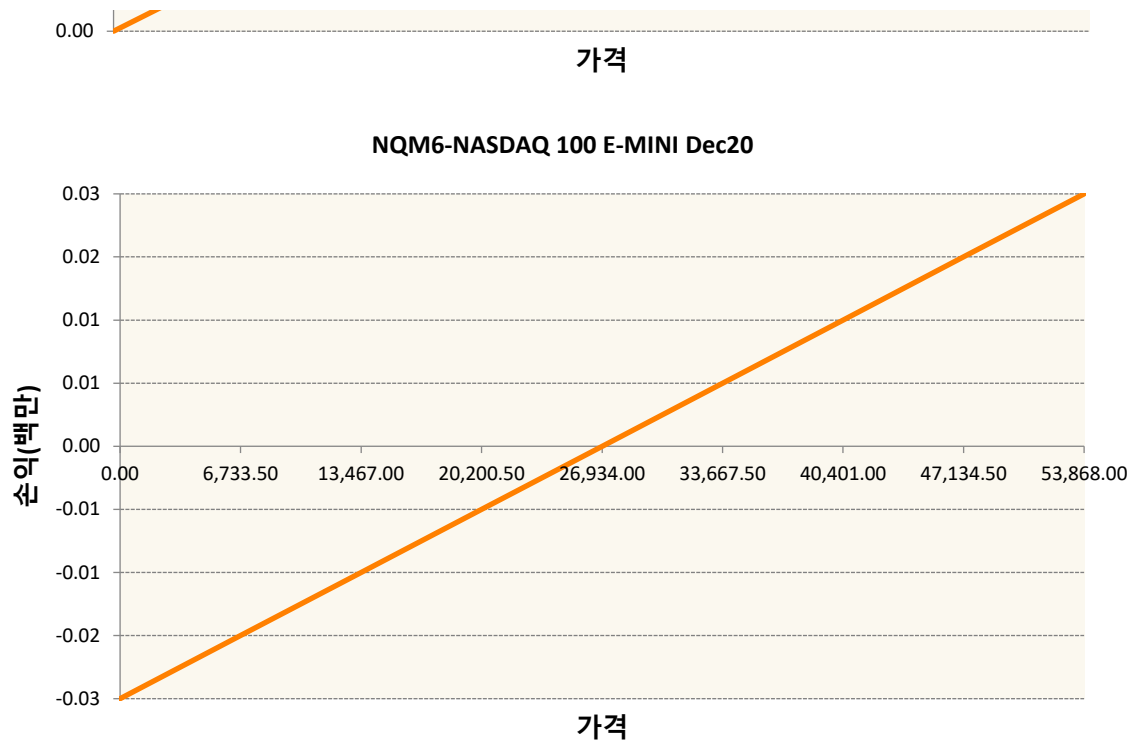
1. 계약금액

(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	25,047	0	25,047	
누계	유가증권	선물	401	0	401	장내
누계	통화	선물	3,871	0	3,871	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		2,004

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,232

공시일	2026-04-27
기준일	2026-04-24

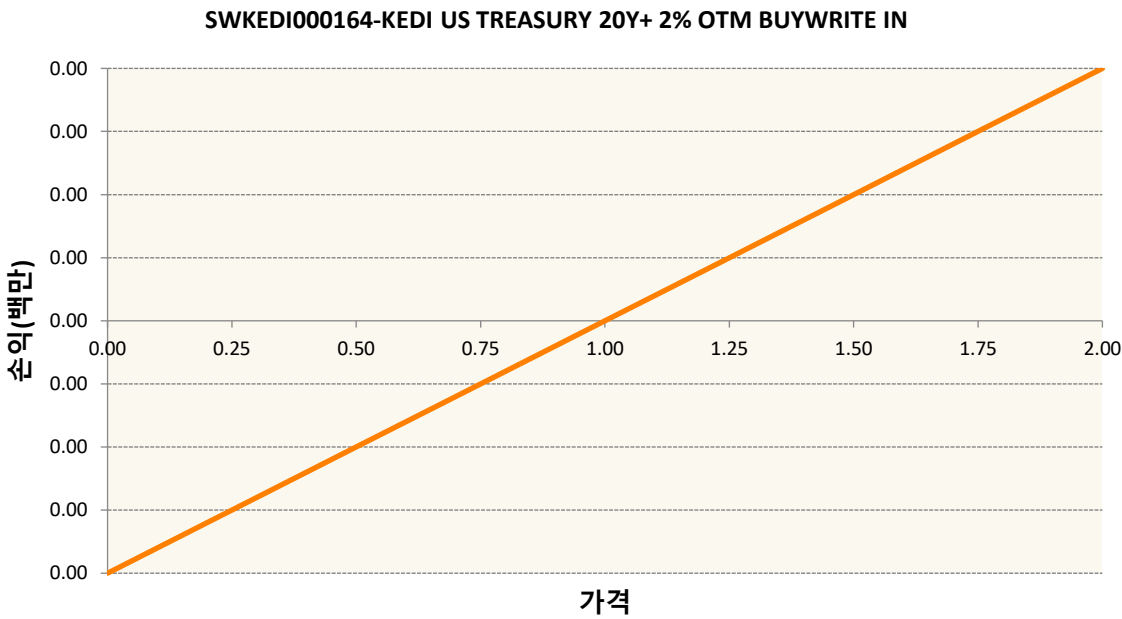
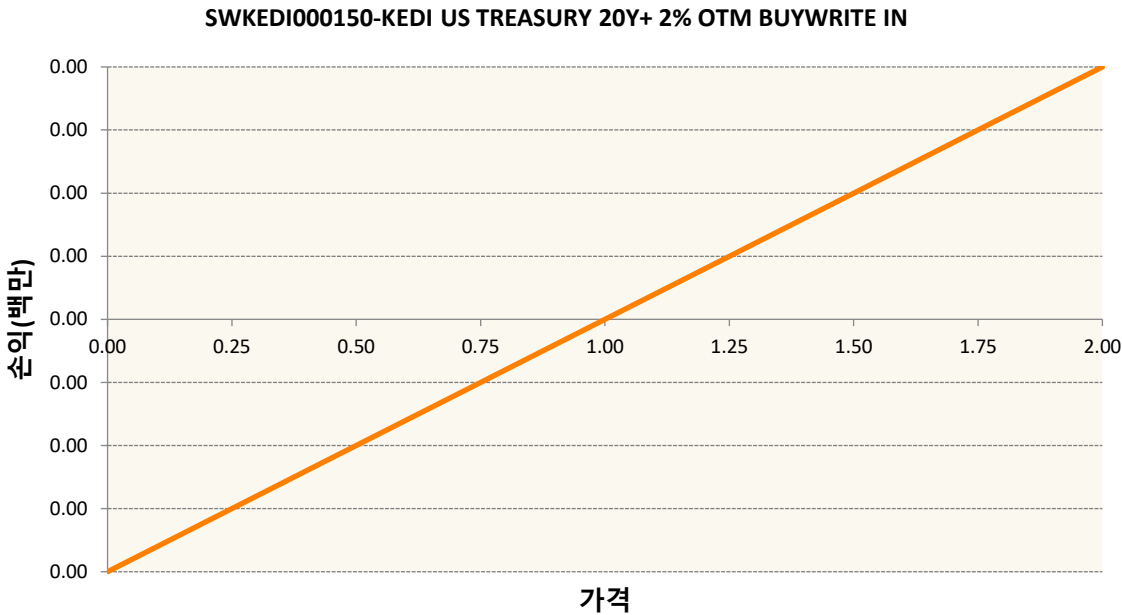
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

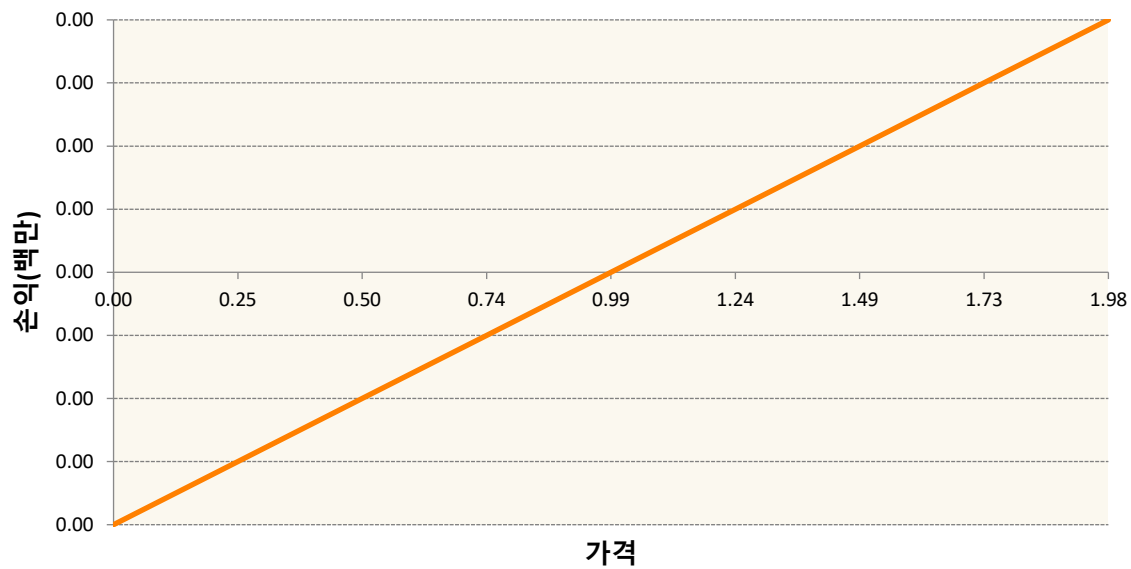
(단위:백만원)

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

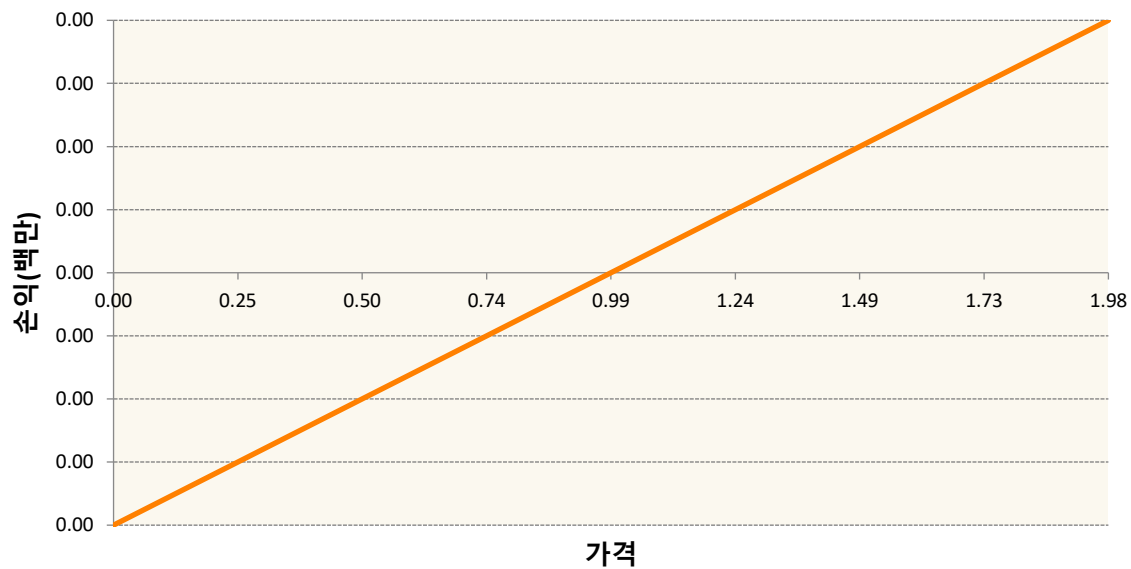
2. 만기시점의 손익구조



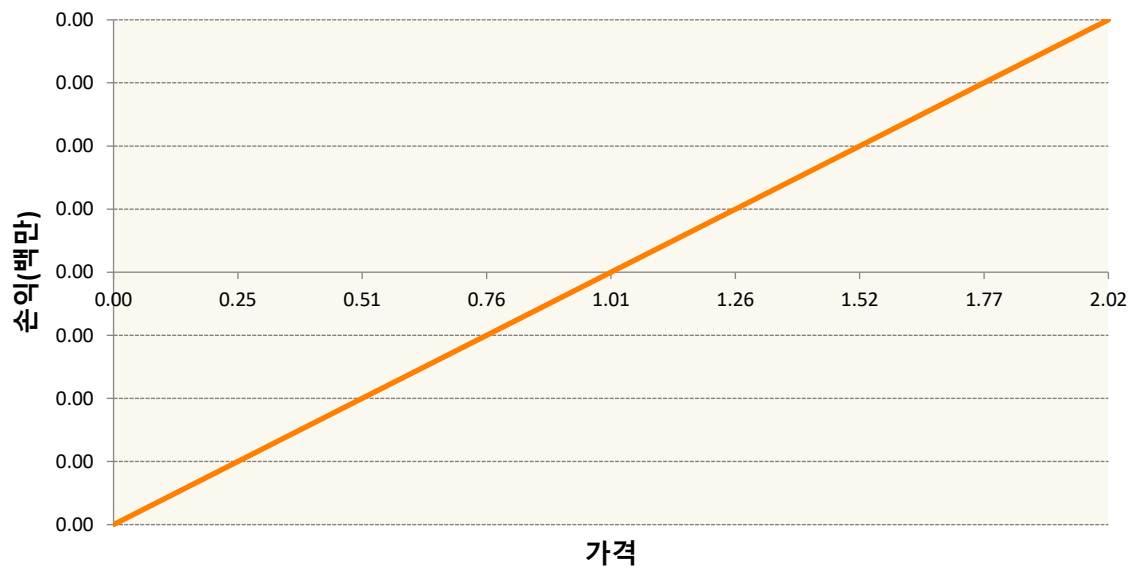
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,346
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		153
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,744
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,426
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,963

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,273