

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

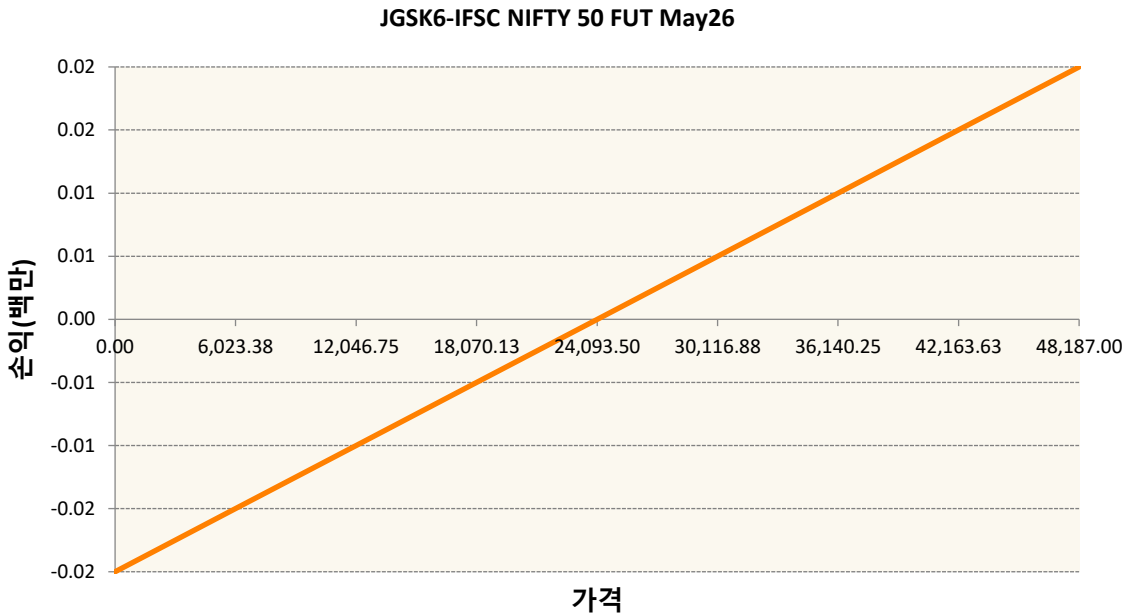
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	358	0	358	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSK6	IFSC NIFTY 50 FUT May26	29
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

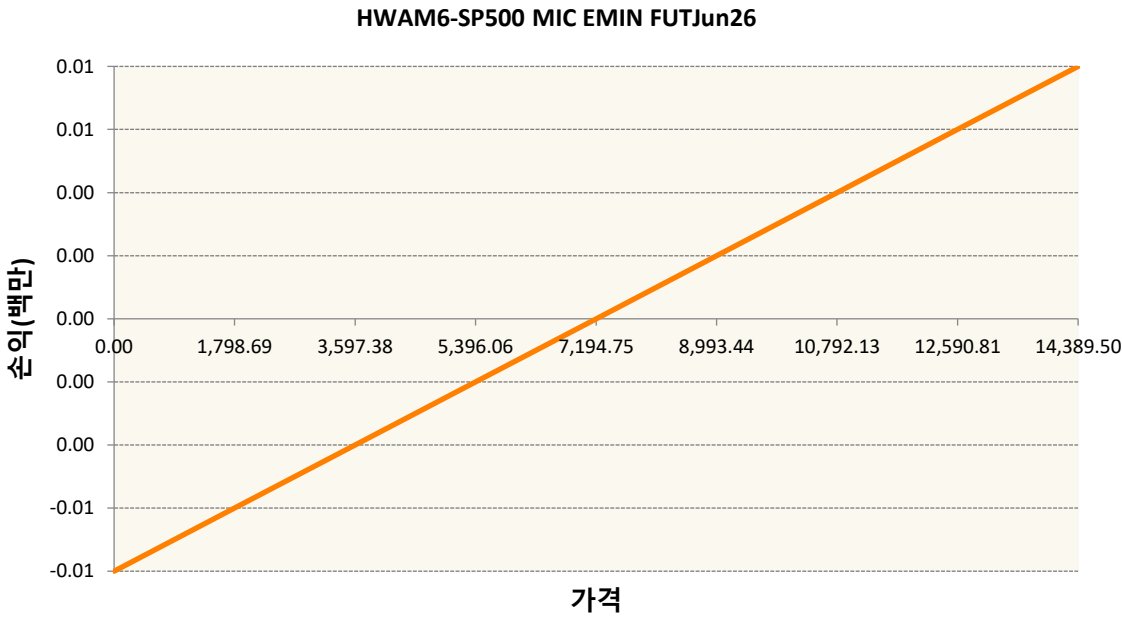
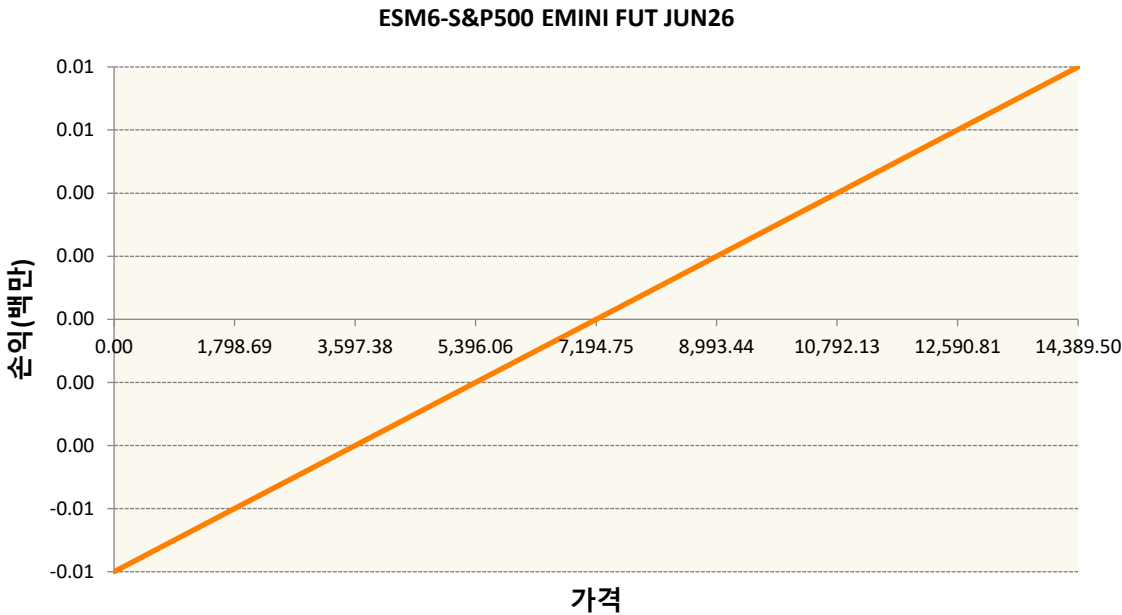
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	539	0	539	
누계	지수	선물	162	0	162	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	2026-04-28
기준일	2026-04-27

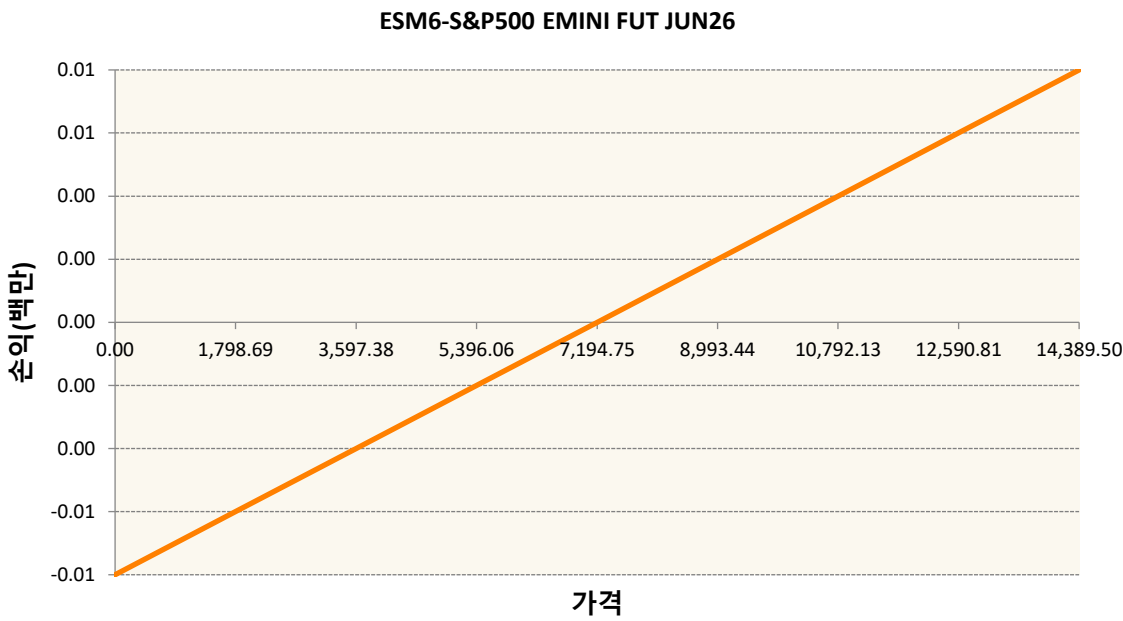
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,078	0	1,078	

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	2026-04-28
기준일	2026-04-27

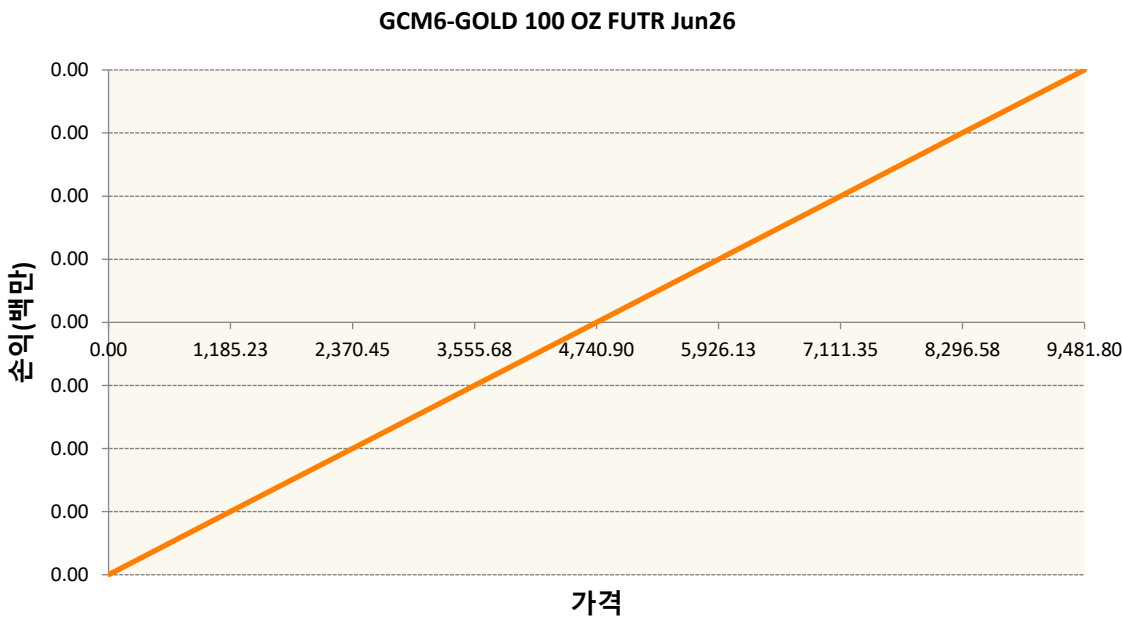
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,705	0	5,705	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUCS4 GLD US 05/08/26 C447 EQUITY	5
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	456

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

(단위:백만원)

577

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

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)

AOPLTRSUC PLTR US 05/08/26 C155 EQUITY	244
AOPLTRSUP1 PLTR US 05/08/26 P155 EQUITY	57

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

(단위:백만원)

938

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

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)

AOTLTUSC0TLT US 05/08/26 C86.5 EQUITY

15

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

(단위:백만원)

9

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

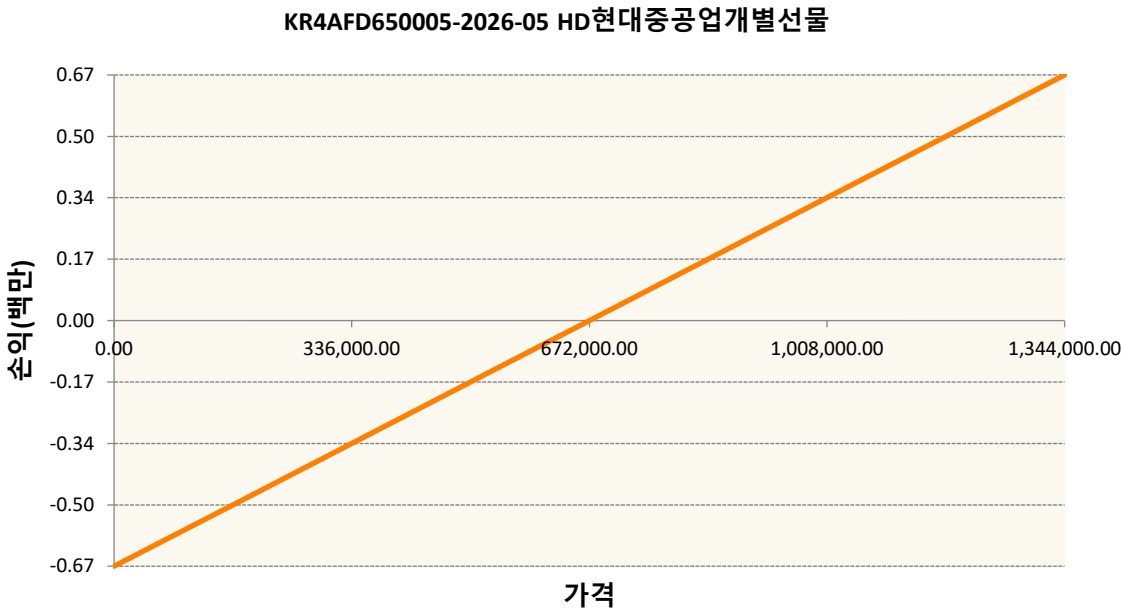
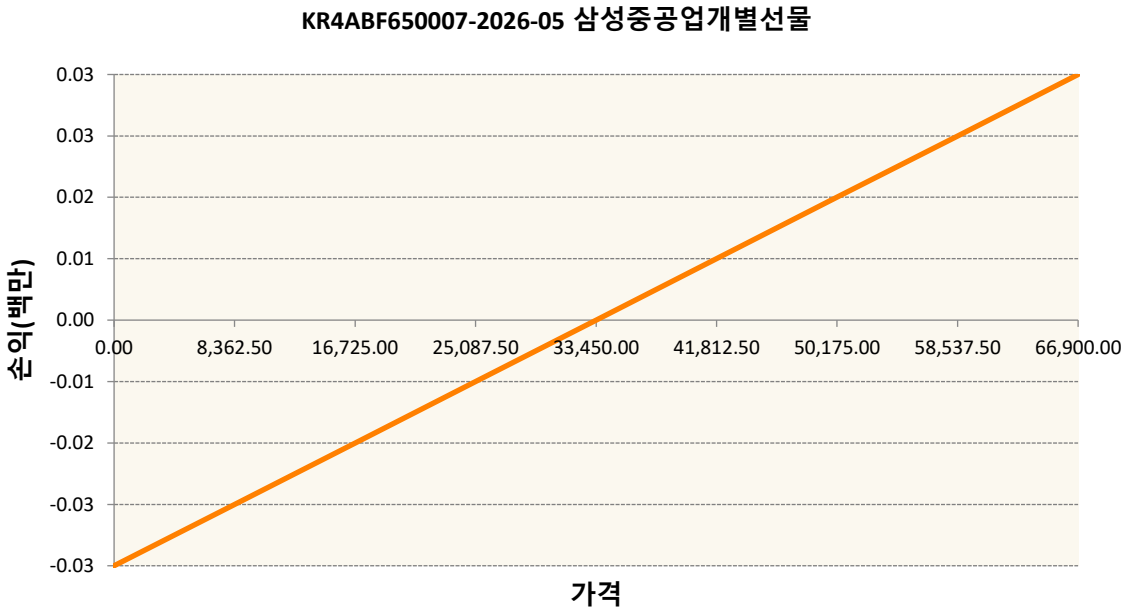
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

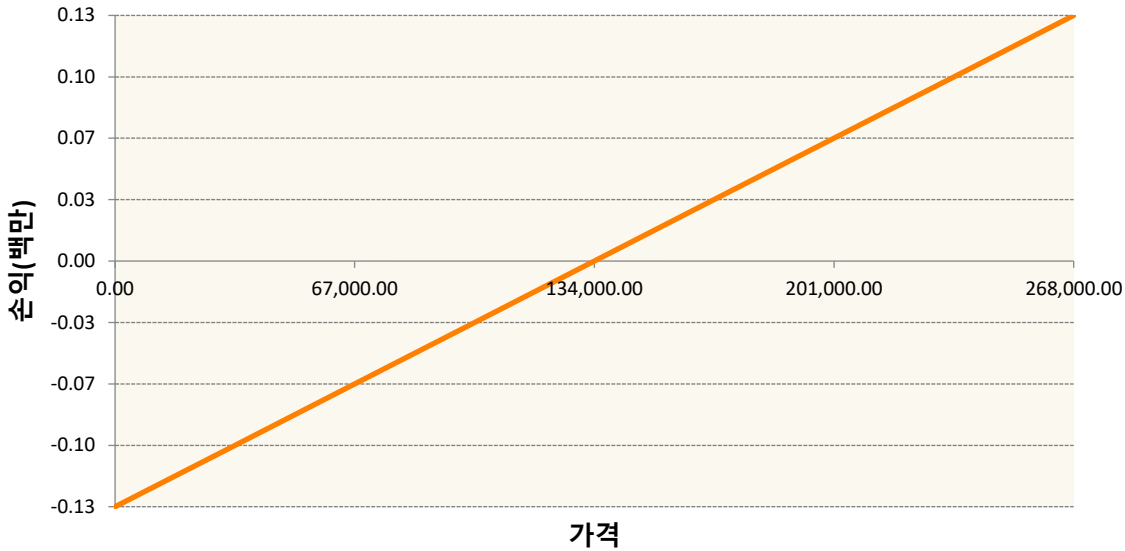
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	7,363	0	7,363	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	35,632	0	35,632	장내
누계	유가증권	스왑	191,909	0	191,909	장외

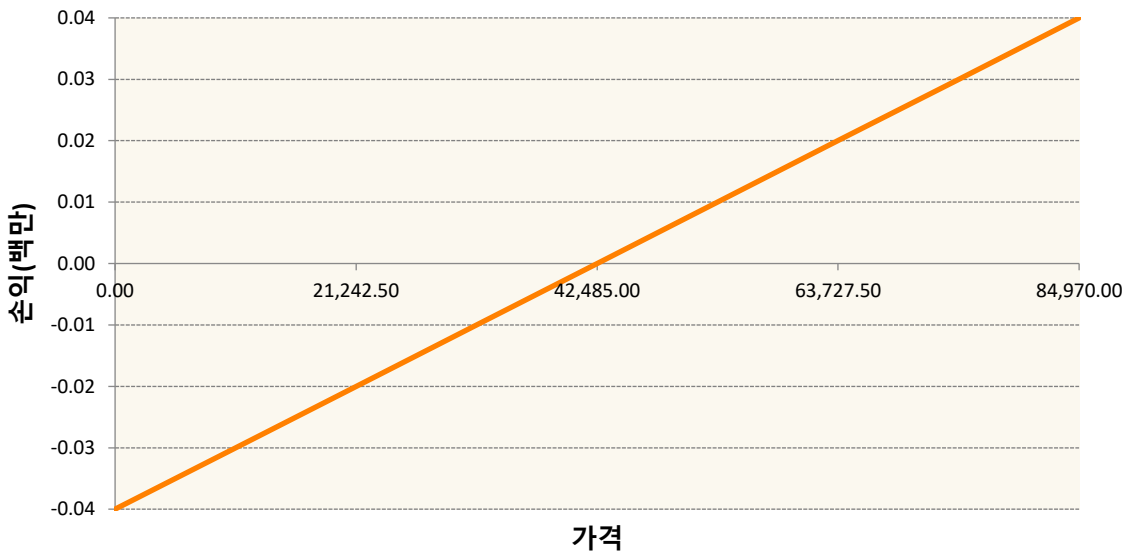
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007			2026-05 삼성중공업개별선물				1,231
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231
-5.33%	-821	-821	-821	-821	-821	-821	-821
-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%	821	821	821	821	821	821	821
8.00%	1,231	1,231	1,231	1,231	1,231	1,231	1,231
KR4AFD650005			2026-05 HD현대중공업개별선물				1,023
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023	-1,023
-5.33%	-682	-682	-682	-682	-682	-682	-682
-2.67%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	341	341	341	341	341	341	341
5.33%	682	682	682	682	682	682	682
8.00%	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023	1,023
KR4AFV650003 2026-05 한화오션개별선물							596
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-596	-596	-596	-596	-596	-596	-596
-5.33%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397
-2.67%	-199	-199	-199	-199	-199	-199	-199
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	199	199	199	199	199	199	199
5.33%	397	397	397	397	397	397	397
8.00%	596	596	596	596	596	596	596

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

(단위:백만원)

4,391

공시일 2026-04-28

기준일 2026-04-27

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	2026-04-28
기준일	2026-04-27

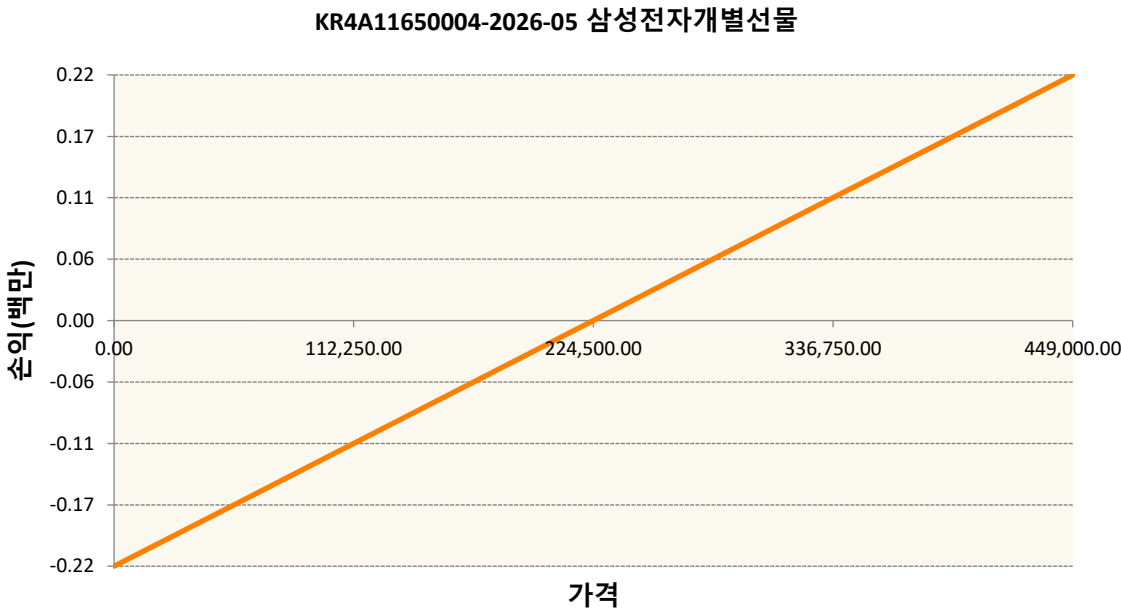
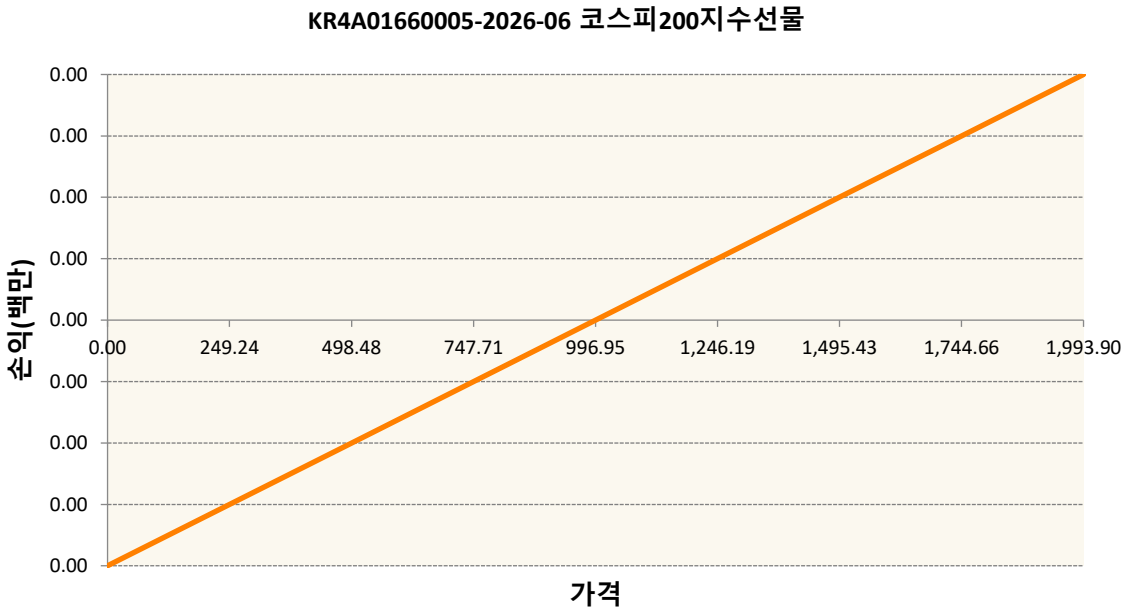
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	39,623	-39,623	장내
누계	유가증권	선물	12,991	0	12,991	장내
누계	유가증권	옵션	0	39,093	-39,093	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between the amount (가액) and net income (순익). The x-axis represents the amount, ranging from 0.00 to 1,995.00. The y-axis represents net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. The line starts at the origin (0, 0) and ends at (997.50, 0.00).

가액	순익 (백만)
0.00	0.00
249.38	0.00
498.75	0.00
748.13	0.00
997.50	0.00
1,246.88	0.00
1,496.25	0.00
1,745.63	0.00
1,995.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				518
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-518	-518	-518	-518	-518	-518	-518	
-5.33%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345	
-2.67%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	173	173	173	173	173	173	173	
5.33%	345	345	345	345	345	345	345	
8.00%	518	518	518	518	518	518	518	
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

KR4B09EY9950 코스피위클리 C 2604W5 995.0 1,450

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,386	-1,391	-1,399	-1,408	-1,420	-1,434	-1,450
-5.33%	-790	-806	-826	-847	-871	-896	-923
-2.67%	-266	-298	-332	-366	-402	-438	-474
0%	121	81	40	0	-40	-81	-121
2.67%	344	311	277	241	205	168	131
5.33%	440	422	400	377	351	323	294
8.00%	470	463	453	441	426	408	389

KR4B09EY9976 코스피위클리 C 2604W5 997.5 988

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-947	-950	-955	-961	-968	-977	-988
-5.33%	-546	-556	-568	-582	-597	-613	-631
-2.67%	-188	-209	-231	-253	-276	-300	-324
0%	81	54	27	0	-27	-54	-81
2.67%	241	218	194	169	145	120	94
5.33%	311	298	283	266	248	229	209
8.00%	334	329	322	313	302	290	276

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

(단위:백만원)

6,453

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

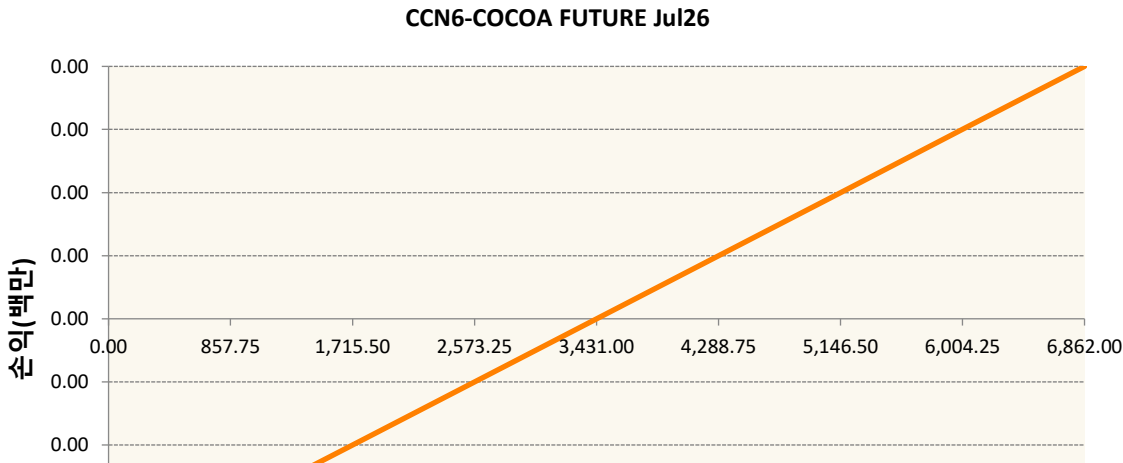
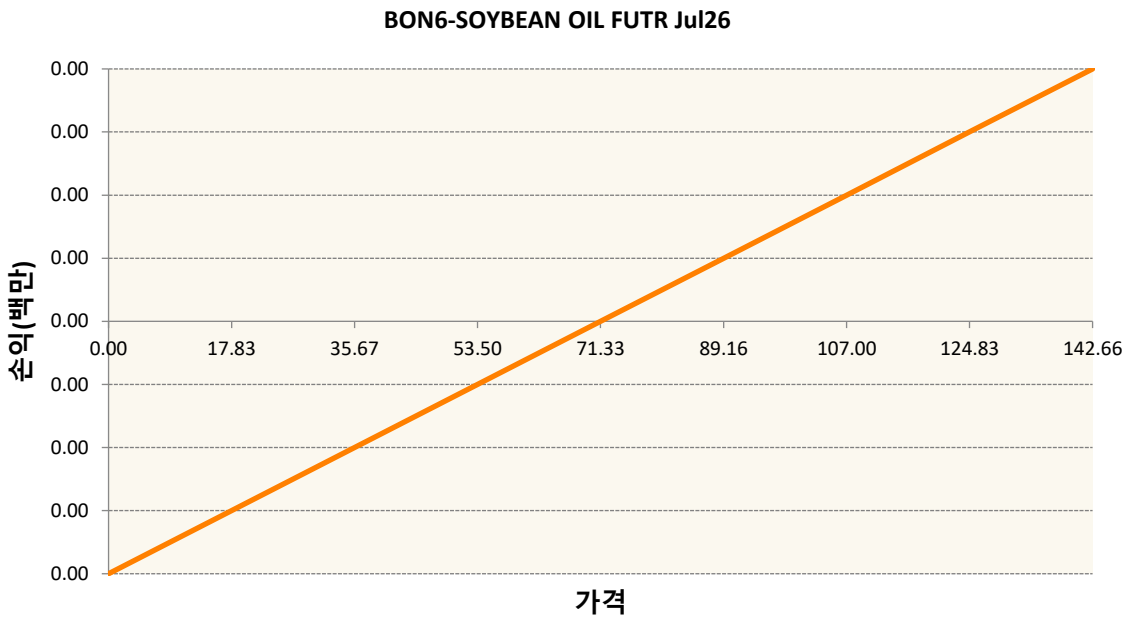
포커스농산물모(채권-파생형)

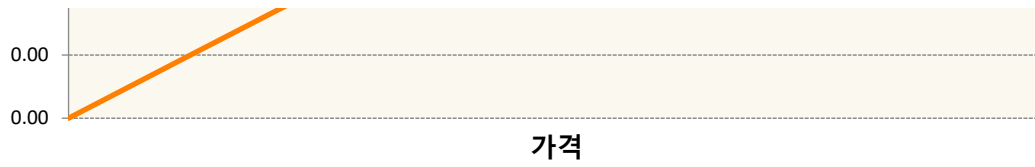
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

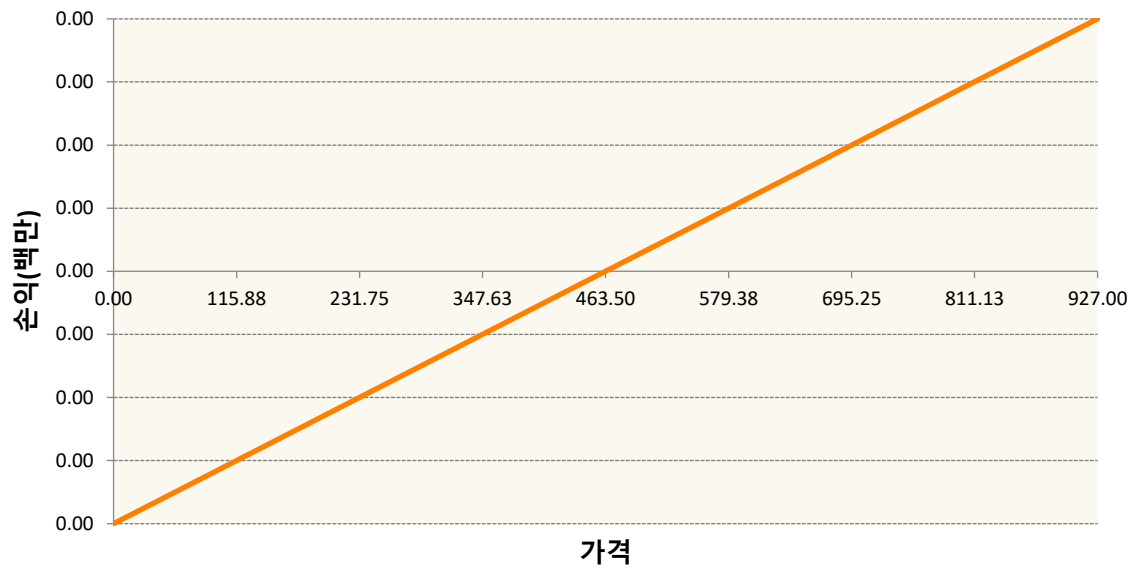
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	102	0	102	
누계	실물자산	선물	890	0	890	장내
누계	유가증권	선물	2,000	0	2,000	
누계	통화	선물	0	353	-353	장내

2. 만기시점의 손익구조

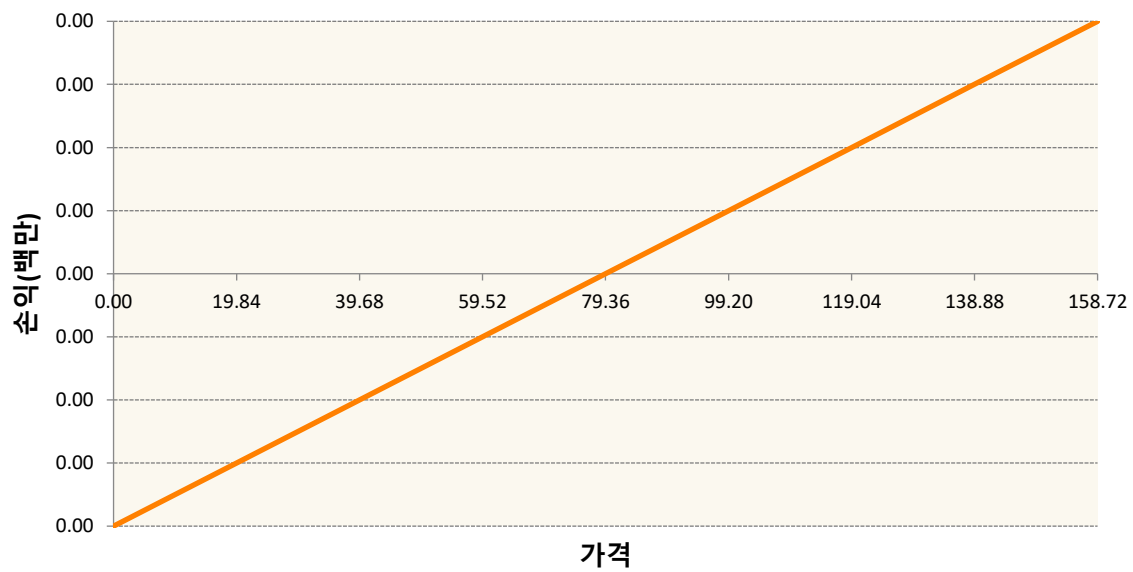




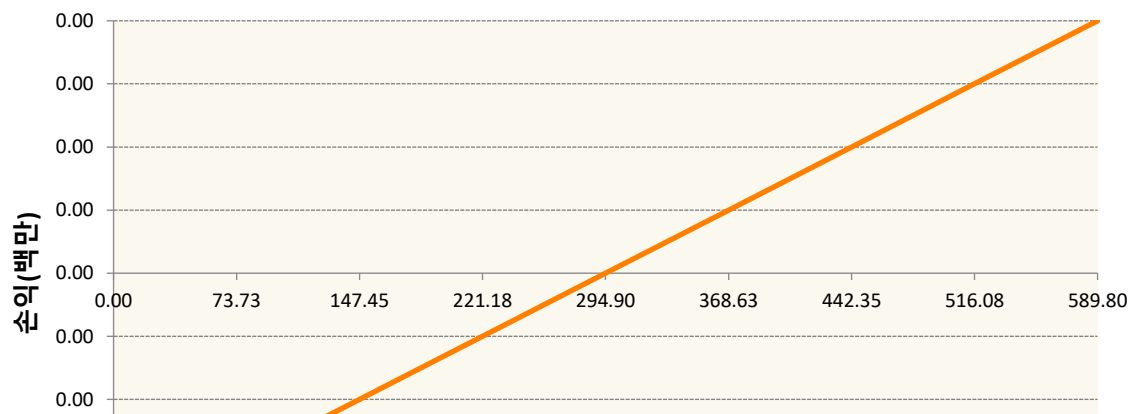
CN6-CORN FUTURE Jul26

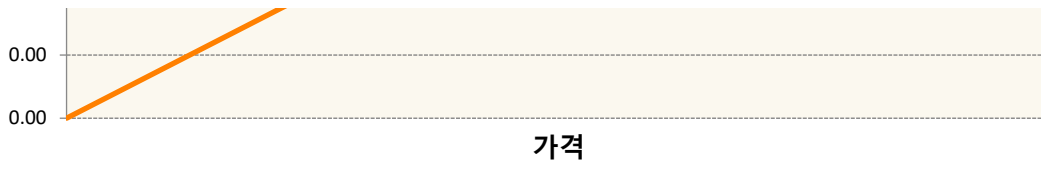


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

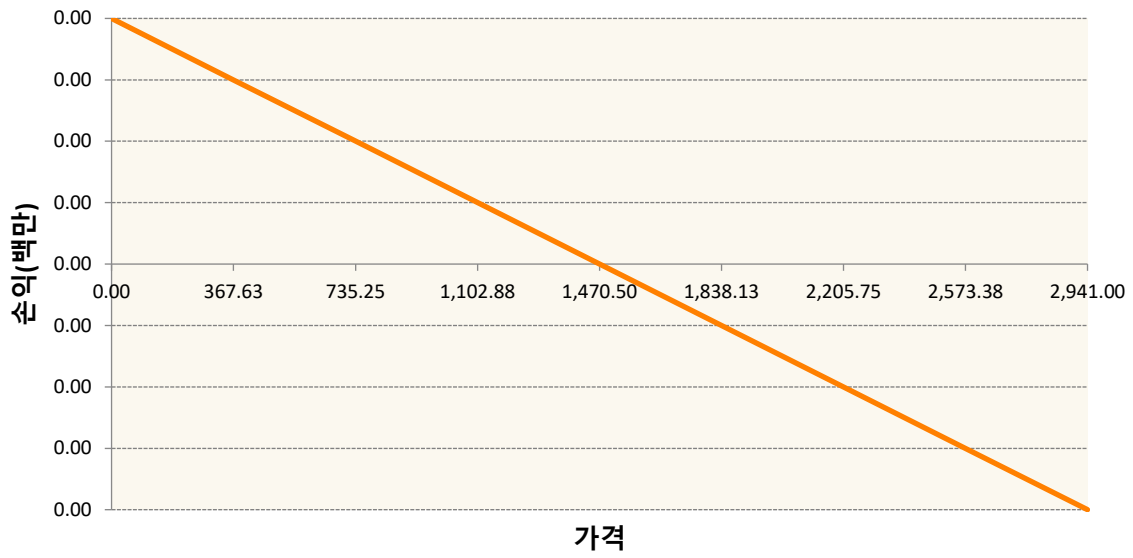


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

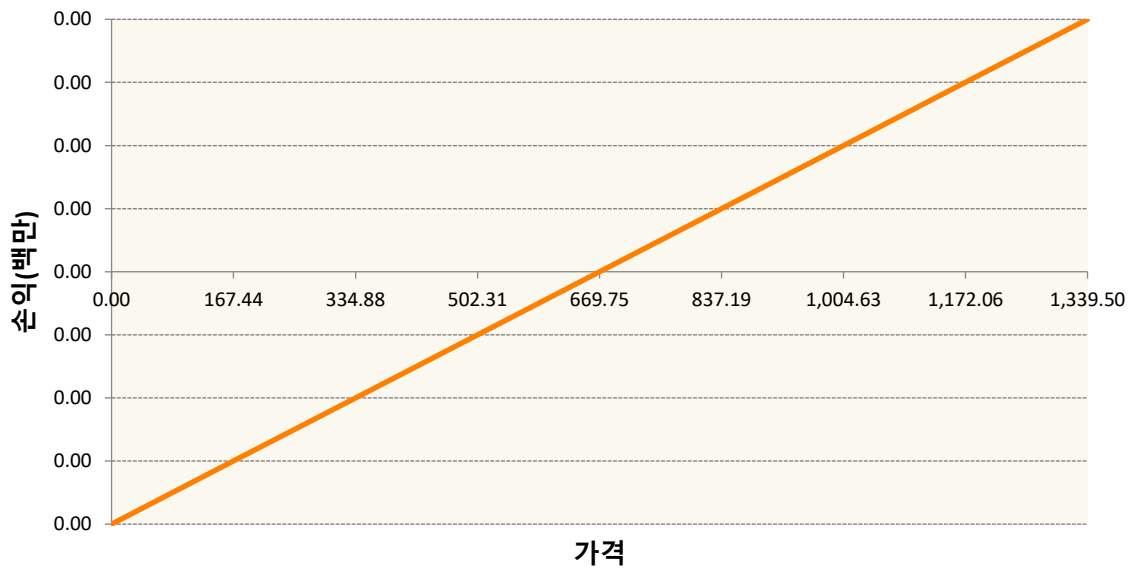




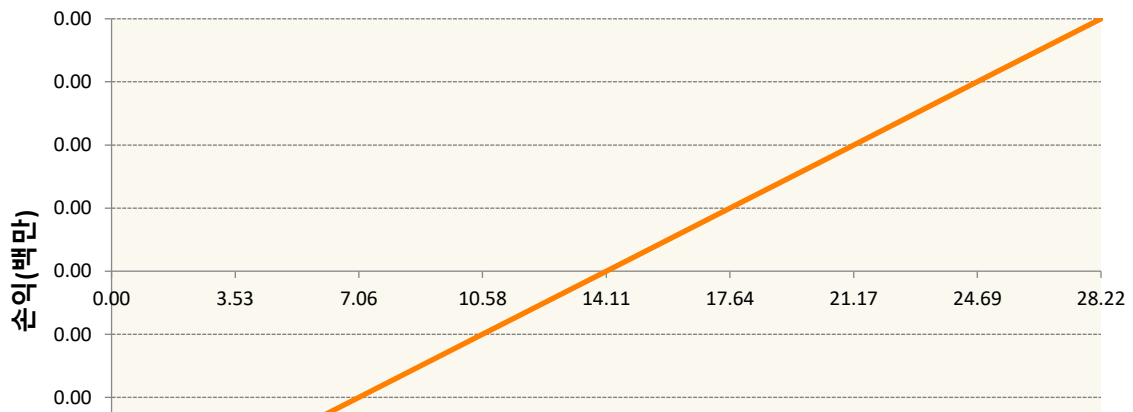
KR4A75650007-2026-05 달러선물

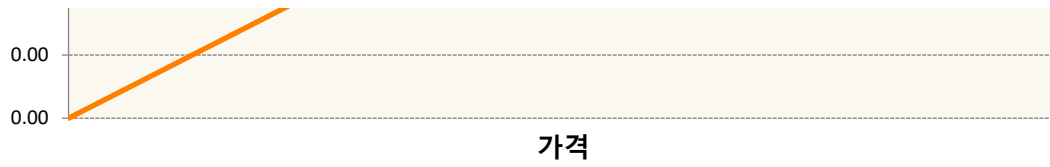


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

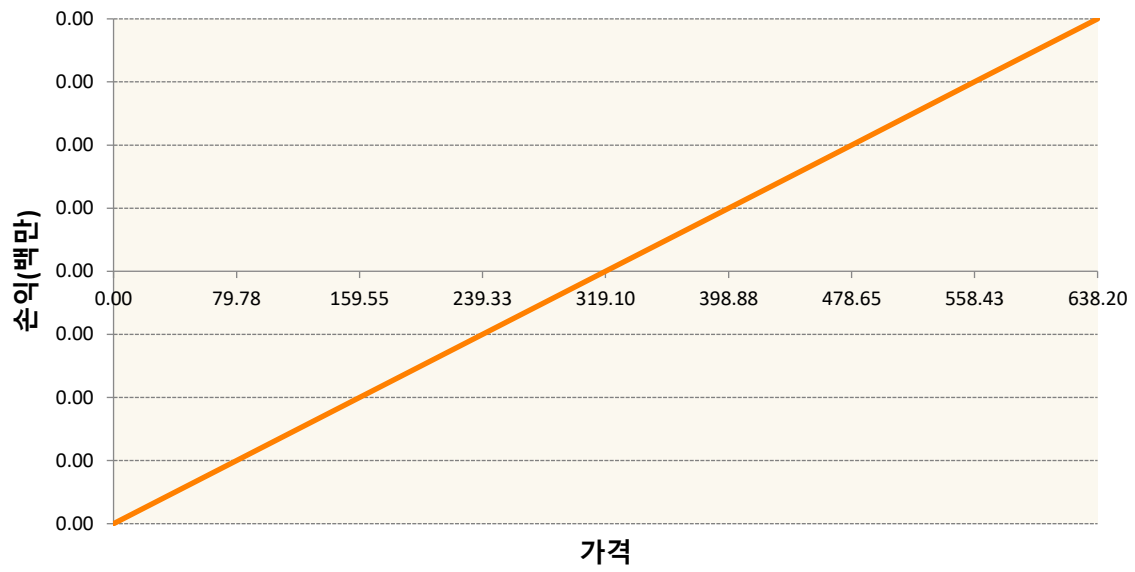


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

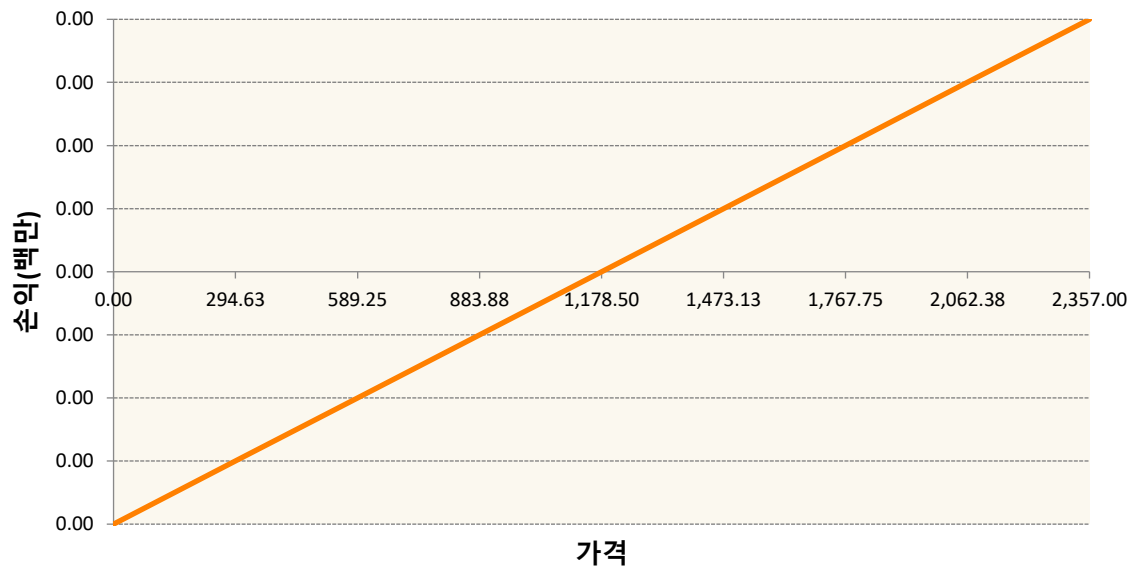




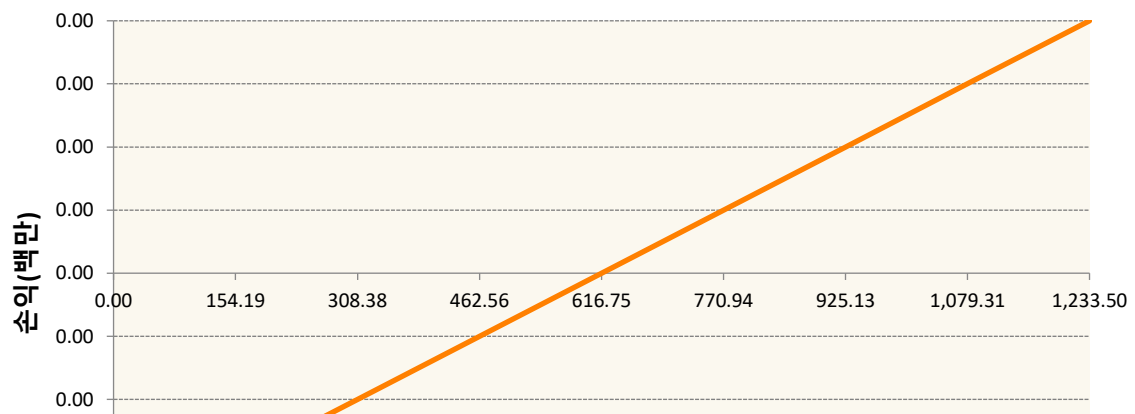
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

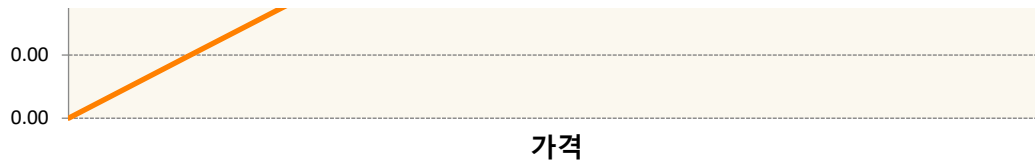


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-04-28
기준일	2026-04-27

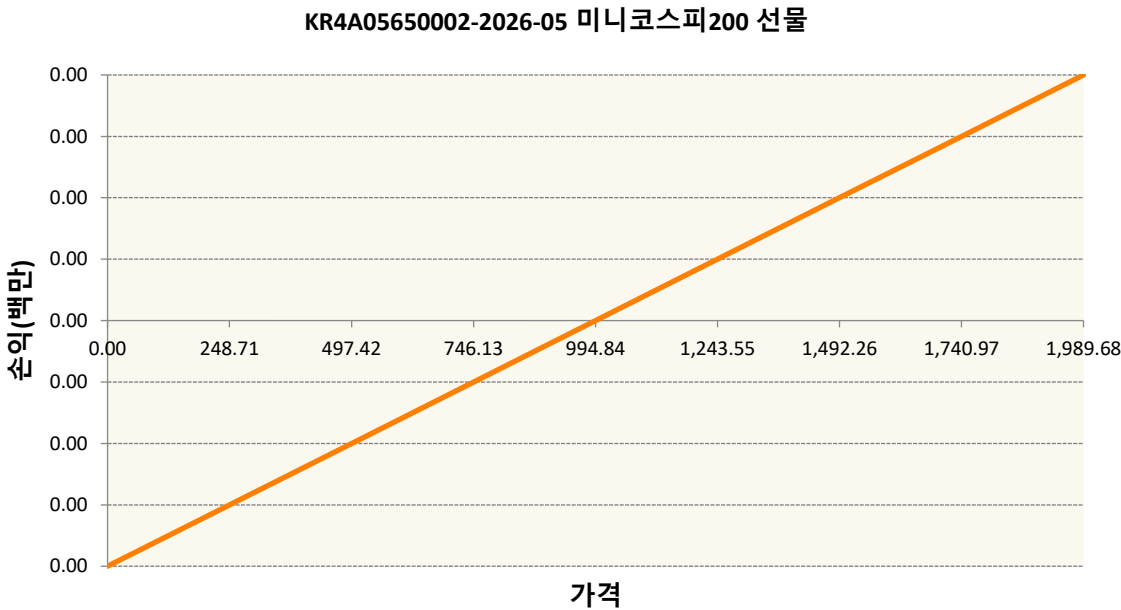
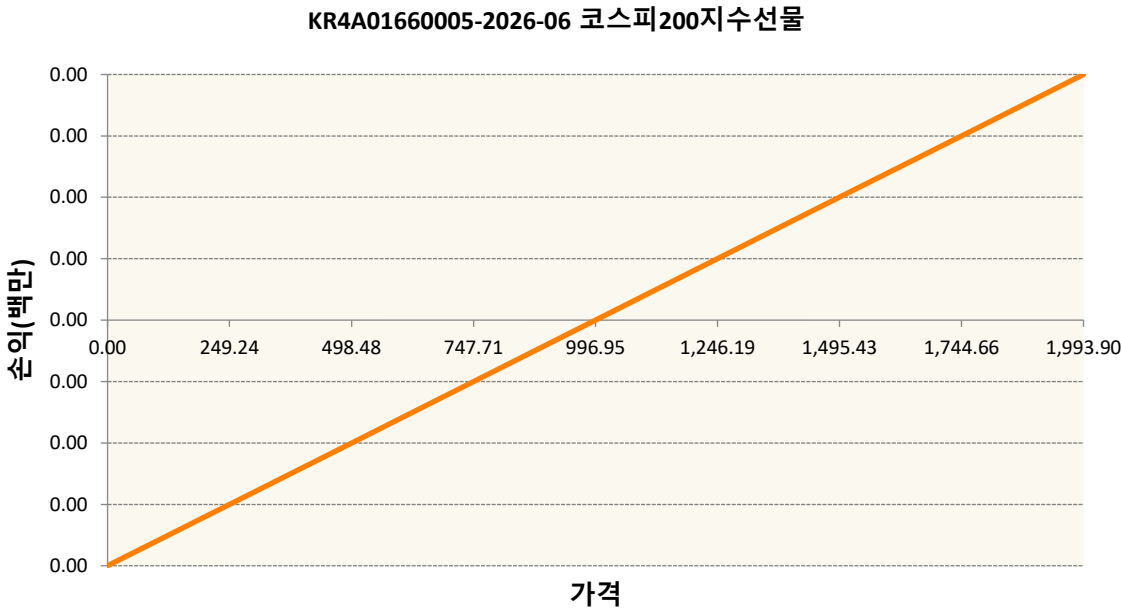
스마트인덱스모

1. 계약금액

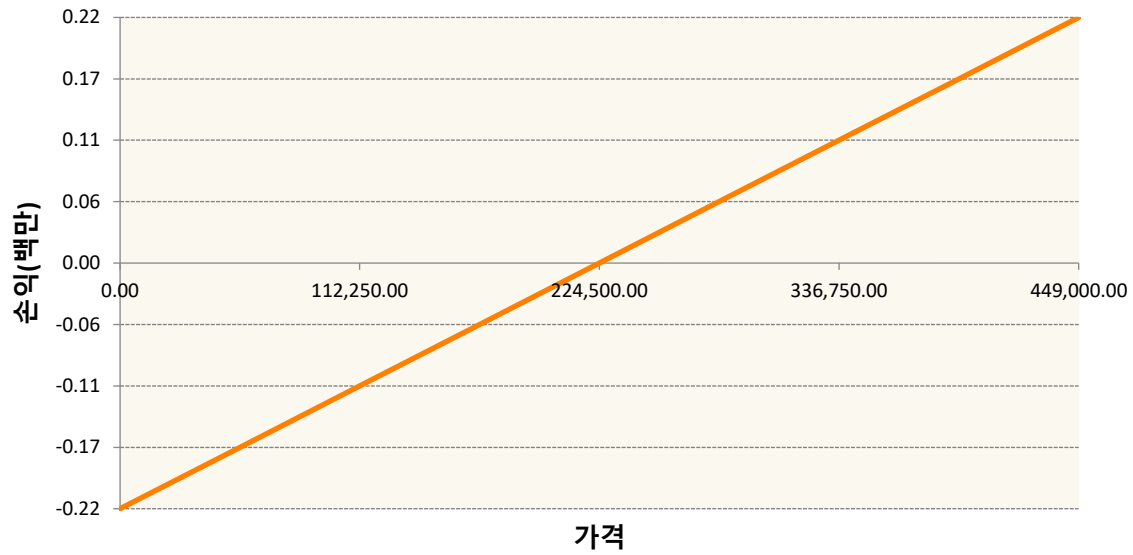
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	491	0	491	장내
누계	유가증권	선물	3,171	0	3,171	장내

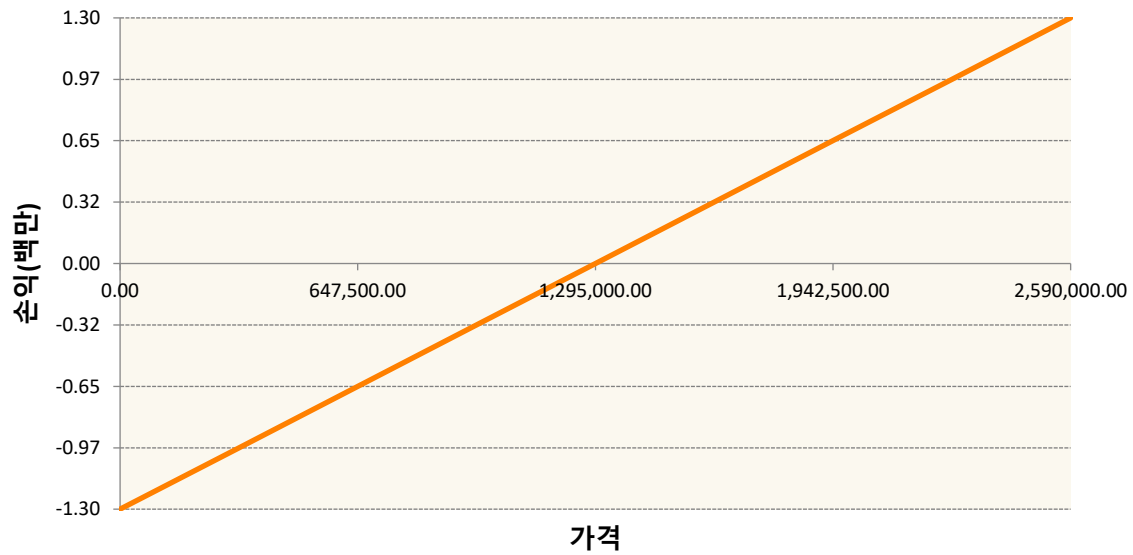
2. 만기시점의 손익구조



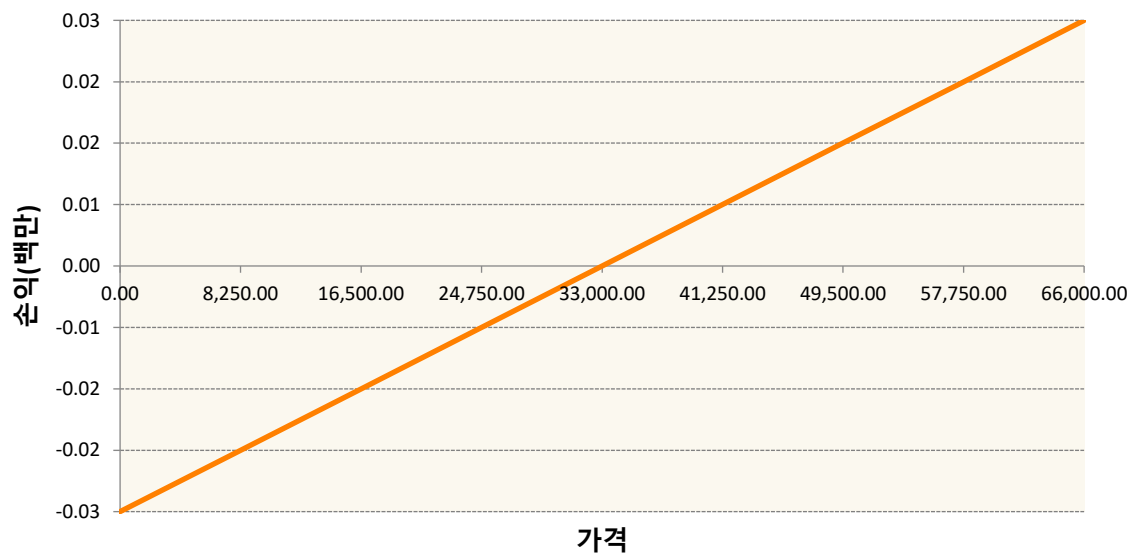
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		159					
기초자산의 변동성														
가격	-25.00%		-16.67%		-8.33%		0%		8.33%		16.67%		25.00%	
-8.00%	-159		-159		-159		-159		-159		-159		-159	
-5.33%	-106		-106		-106		-106		-106		-106		-106	
-2.67%	-53		-53		-53		-53		-53		-53		-53	
0%	0		0		0		0		0		0		0	
2.67%	53		53		53		53		53		53		53	
5.33%	106		106		106		106		106		106		106	
8.00%	159		159		159		159		159		159		159	
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					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%	-8		-8		-8		-8		-8		-8		-8	
-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%	8		8		8		8		8		8		8	
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)

498

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

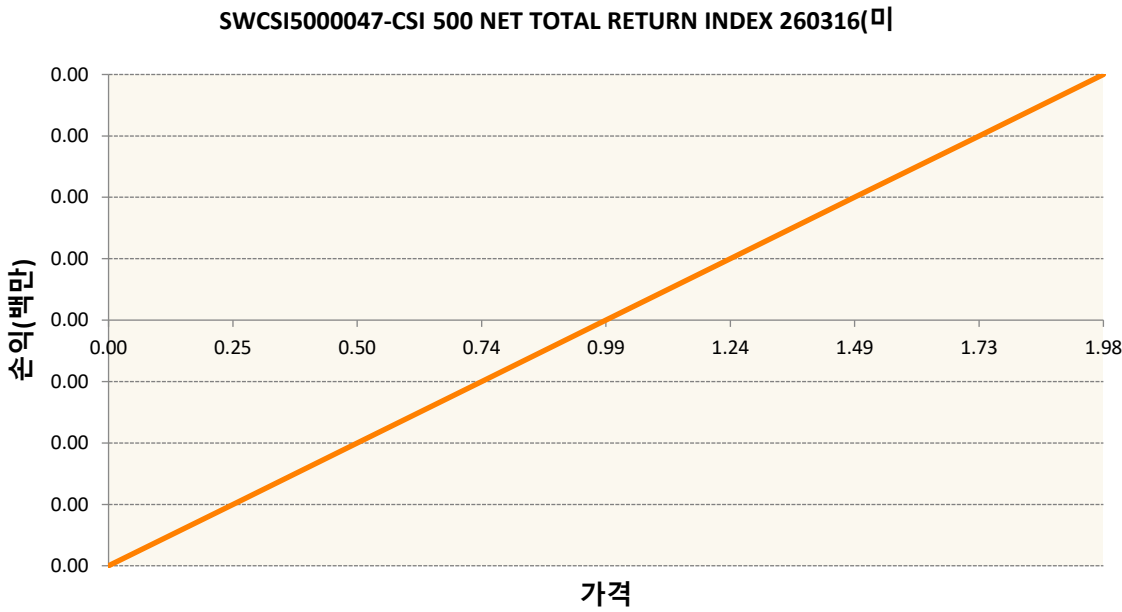
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

448

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

551

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

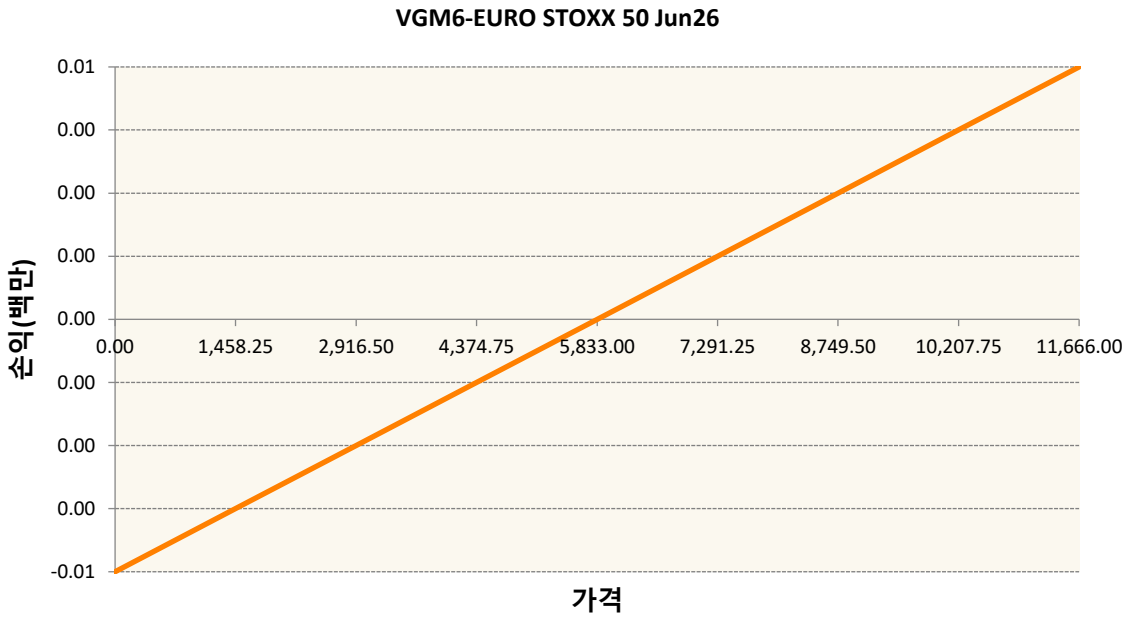
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	899	0	899	

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	2026-04-28
기준일	2026-04-27

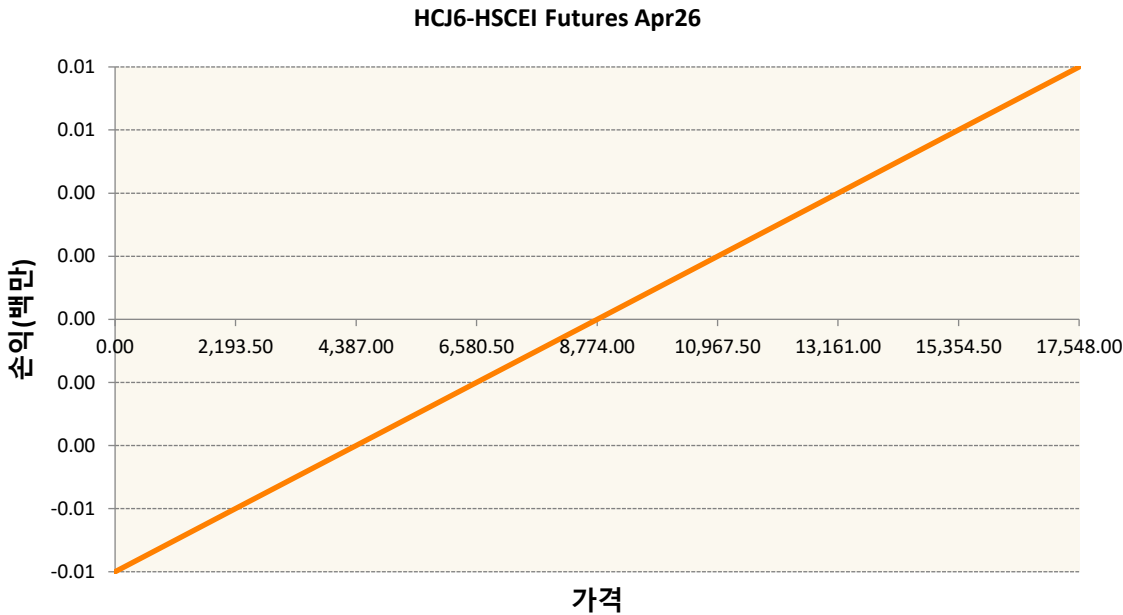
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,688	0	1,688	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCI6	HSCEI Futures Apr26	135
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

164

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

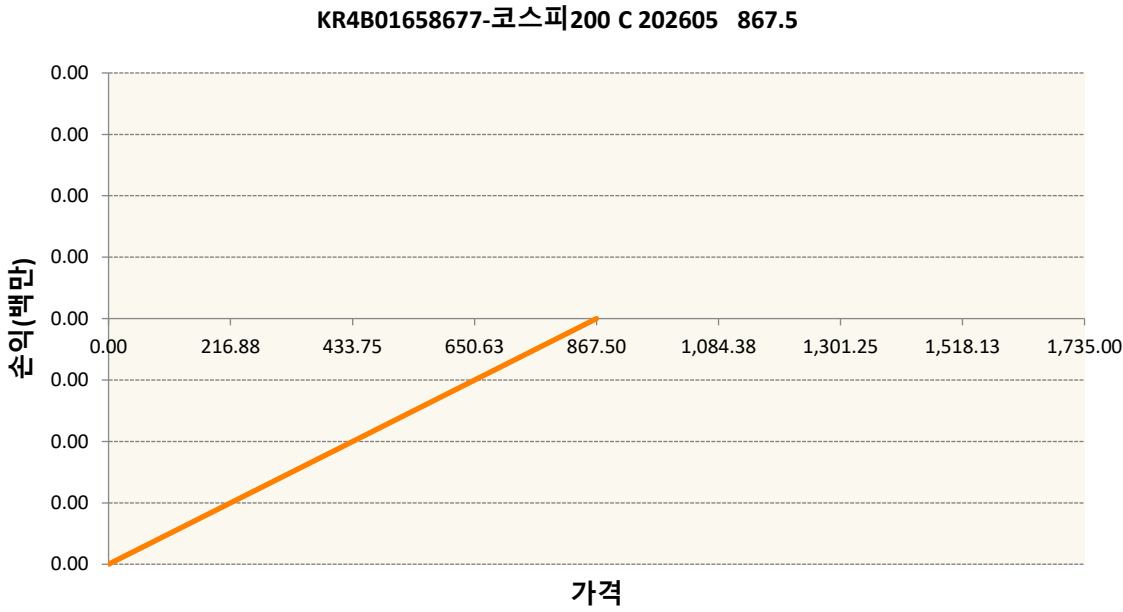
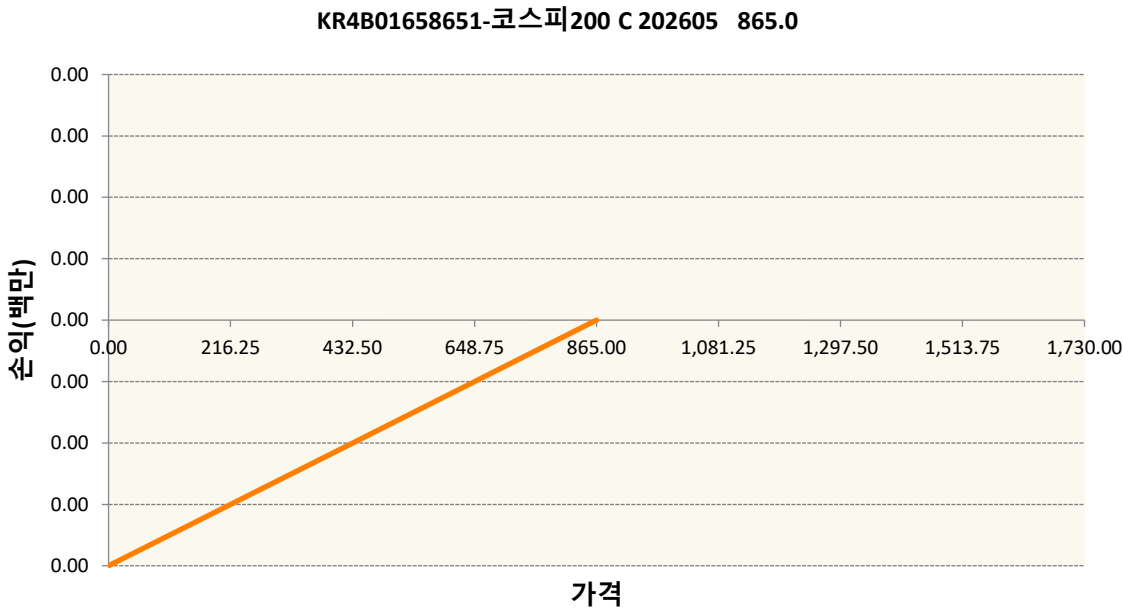
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

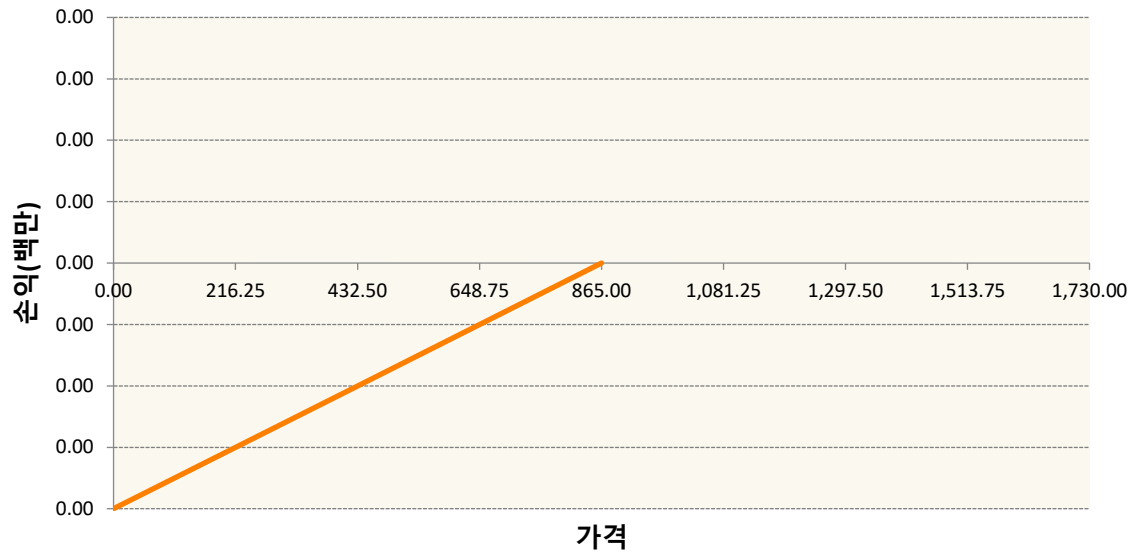
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	545	0	545	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,849	-34,849	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0							499
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-120	-179	-241	-304	-368	-433	-499
-5.33%	-13	-62	-115	-170	-227	-287	-348
-2.67%	54	17	-25	-71	-120	-172	-227
0%	94	68	36	0	-41	-85	-132
2.67%	117	99	77	49	17	-19	-59
5.33%	129	118	103	82	58	29	-4
8.00%	135	129	118	104	86	64	37
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							341
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-125	-167	-209	-253	-296	-341
-5.33%	-11	-44	-80	-117	-156	-196	-237
-2.67%	37	11	-18	-49	-83	-118	-155
0%	65	47	25	0	-28	-58	-90
2.67%	81	69	53	34	12	-13	-40
5.33%	90	82	71	57	40	21	-2
8.00%	94	90	83	73	60	45	26
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							198
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-71	-96	-121	-146	-172	-198
-5.33%	-5	-25	-46	-67	-90	-114	-138
-2.67%	21	7	-10	-28	-48	-68	-90
0%	37	27	14	0	-16	-34	-52

2.67%	46	39	31	20	7	-8	-24
5.33%	51	47	41	33	23	11	-2
8.00%	54	51	47	41	34	25	15

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

(단위:백만원)

961

공시일 2026-04-28

기준일 2026-04-27

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	2026-04-28
기준일	2026-04-27

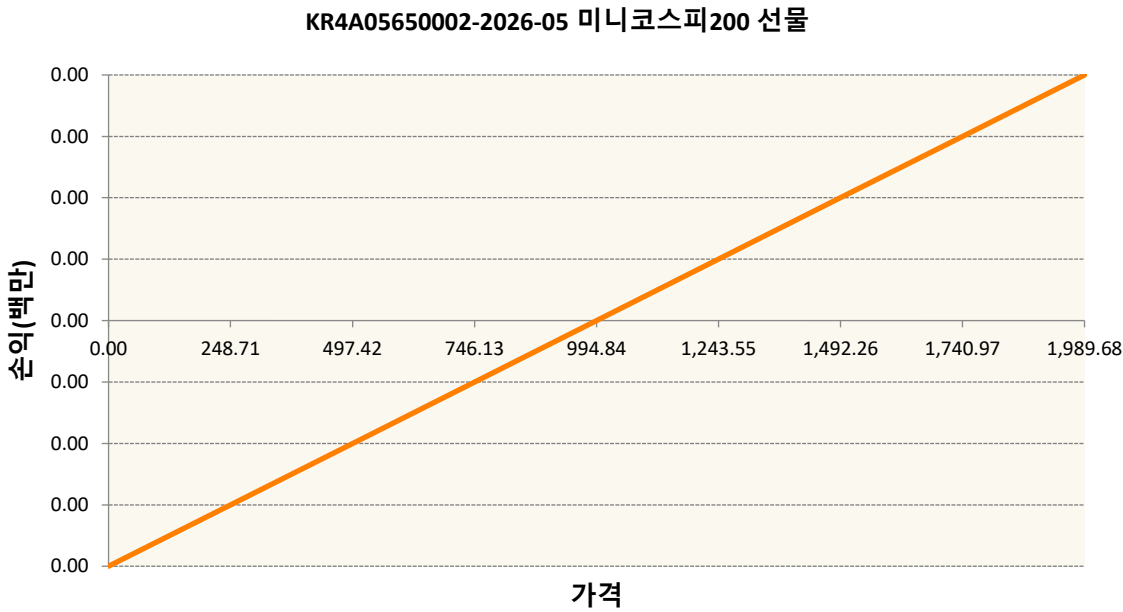
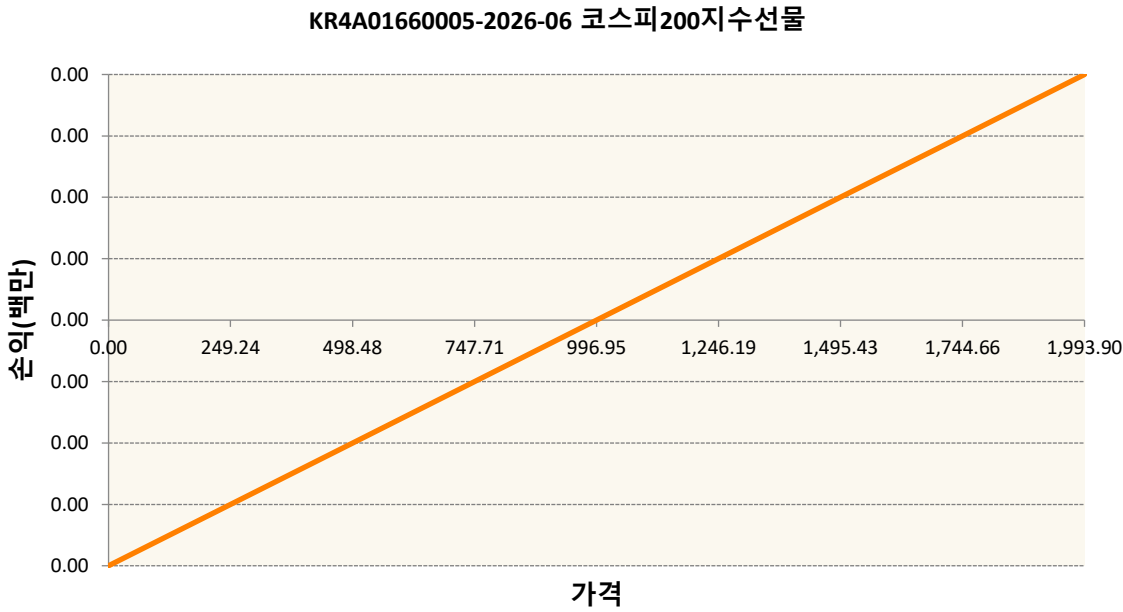
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

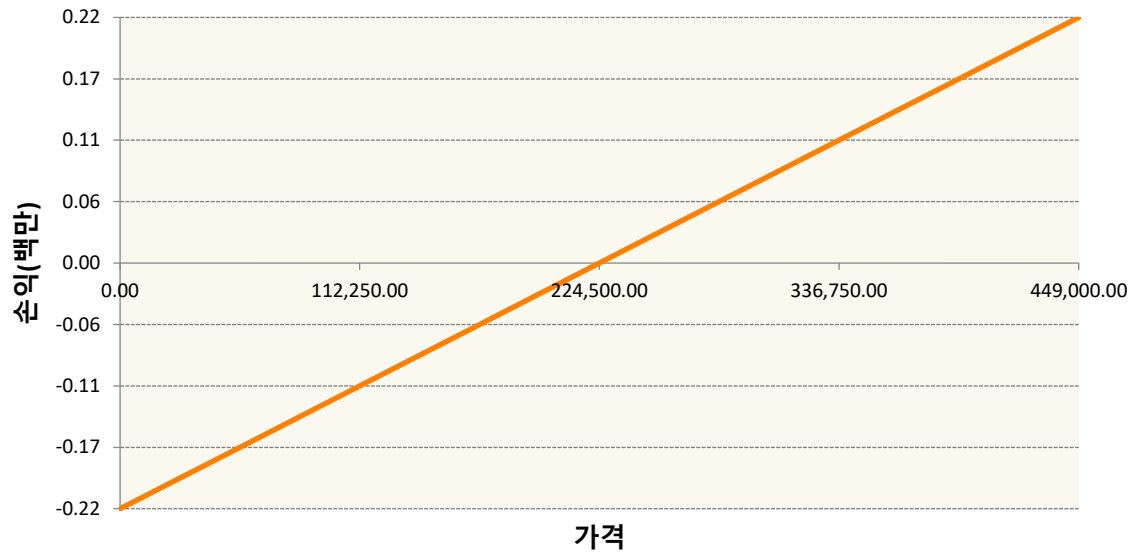
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	245	-245	장내
누계	유가증권	선물	4,106	79	4,027	장내

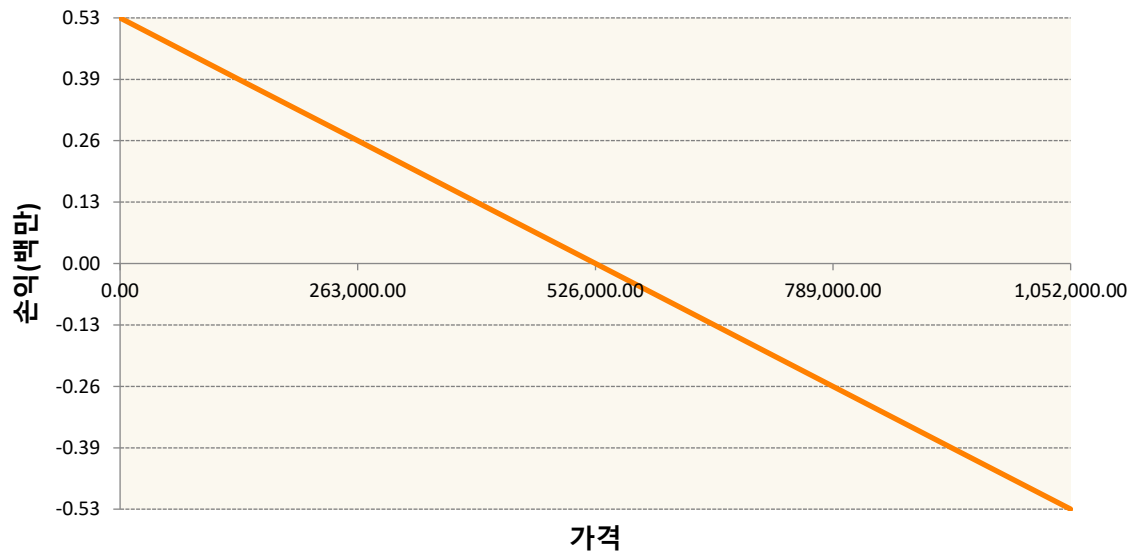
2. 만기시점의 손익구조



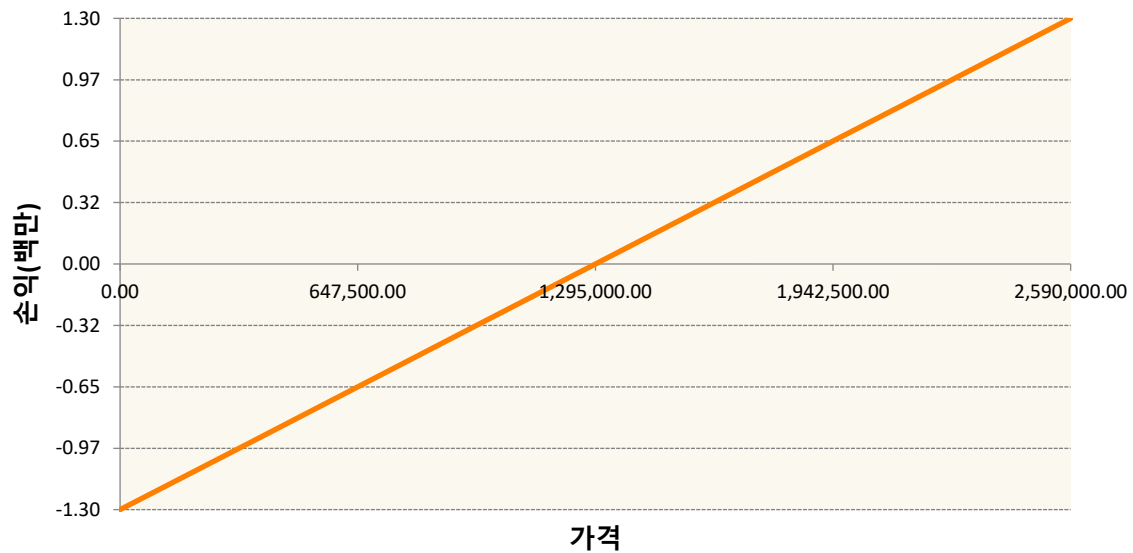
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A16650009-2026-05 현대차개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		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				
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66				
-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%	66	66	66	66	66	66	66				
8.00%	100	100	100	100	100	100	100				
KR4A05650002							2026-05 미니코스피200 선물		44		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44				
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29				
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	15	15	15	15	15	15	15				
5.33%	29	29	29	29	29	29	29				
8.00%	44	44	44	44	44	44	44				
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%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	8	8	8	8	8	8	8

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

(단위:백만원)

345

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

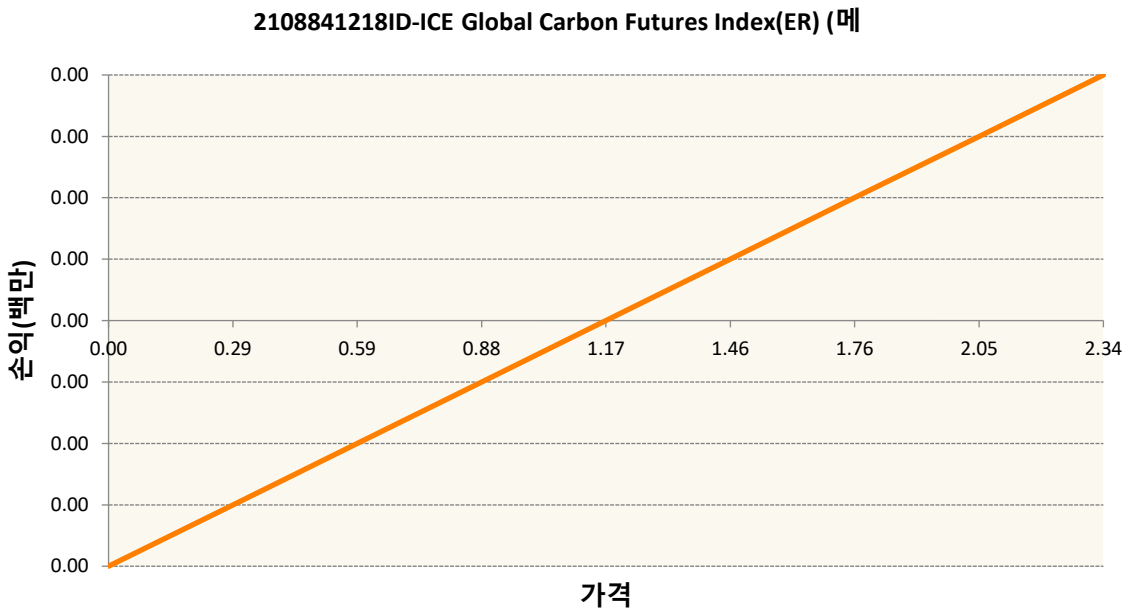
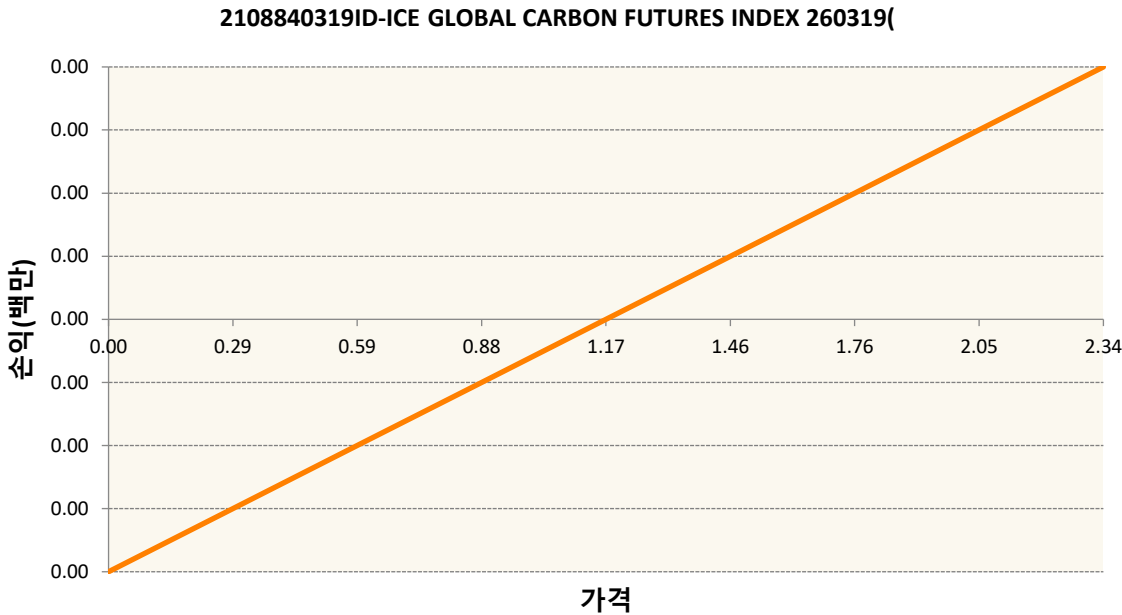
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,723	0	6,723	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		429
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		108

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	611

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

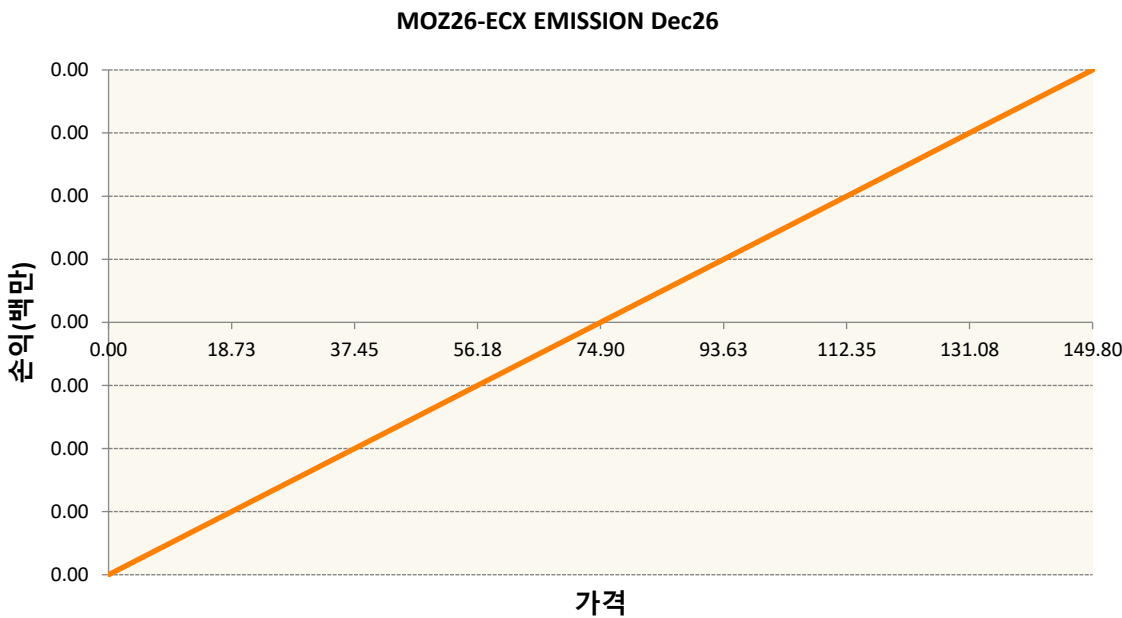
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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	2,187	-2,187	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E	175
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	387

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

(단위:백만원)

662

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

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)

57

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

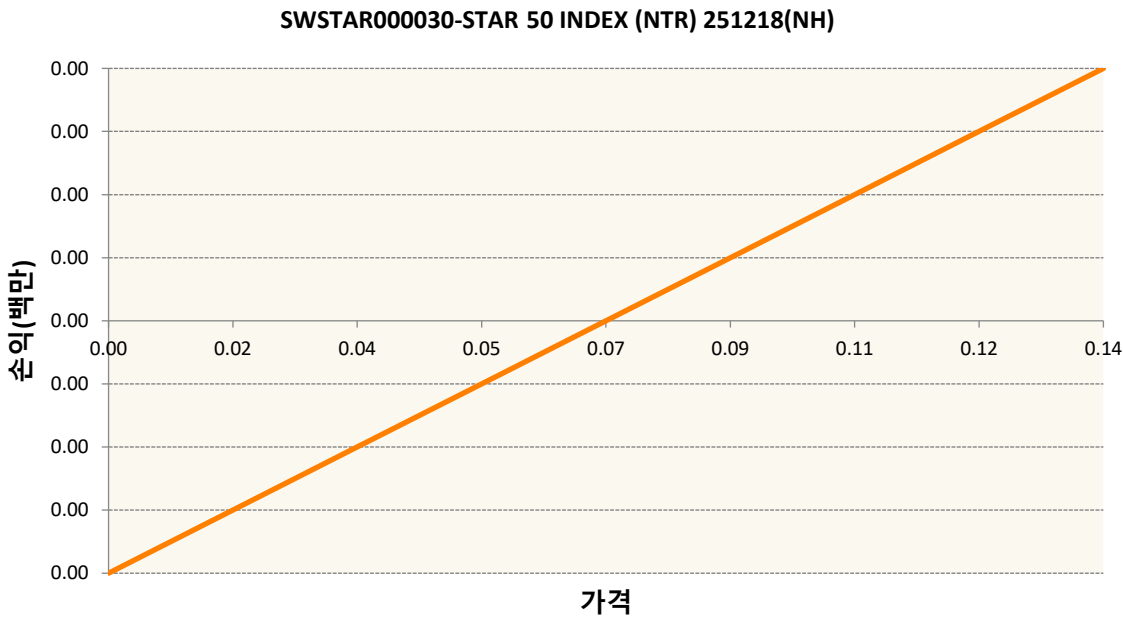
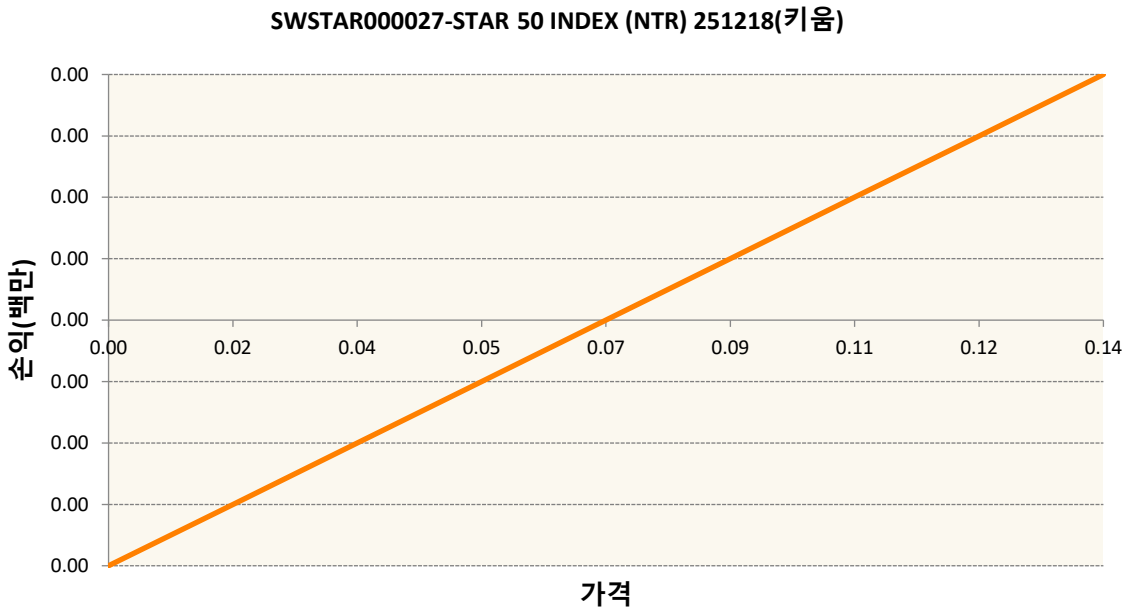
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

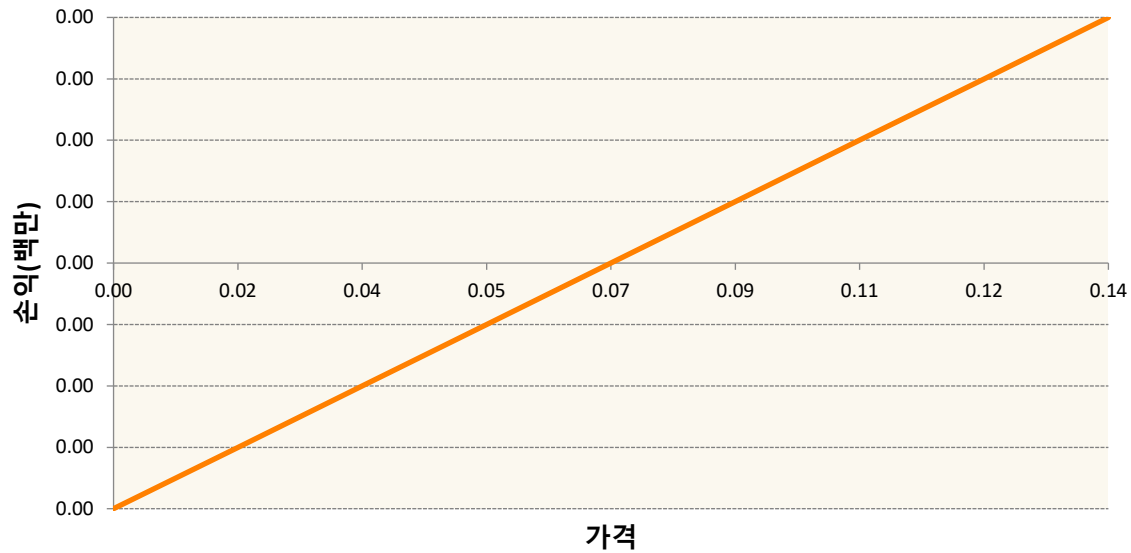
(단위:백만원)

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

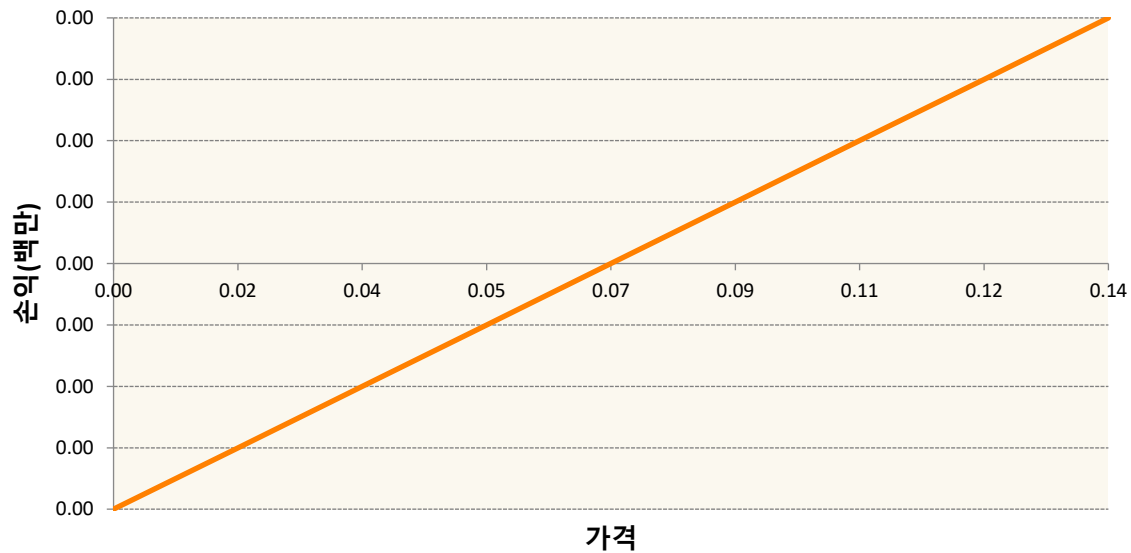
2. 만기시점의 손익구조



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)	17
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	86
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	32

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

(단위:백만원)

211

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

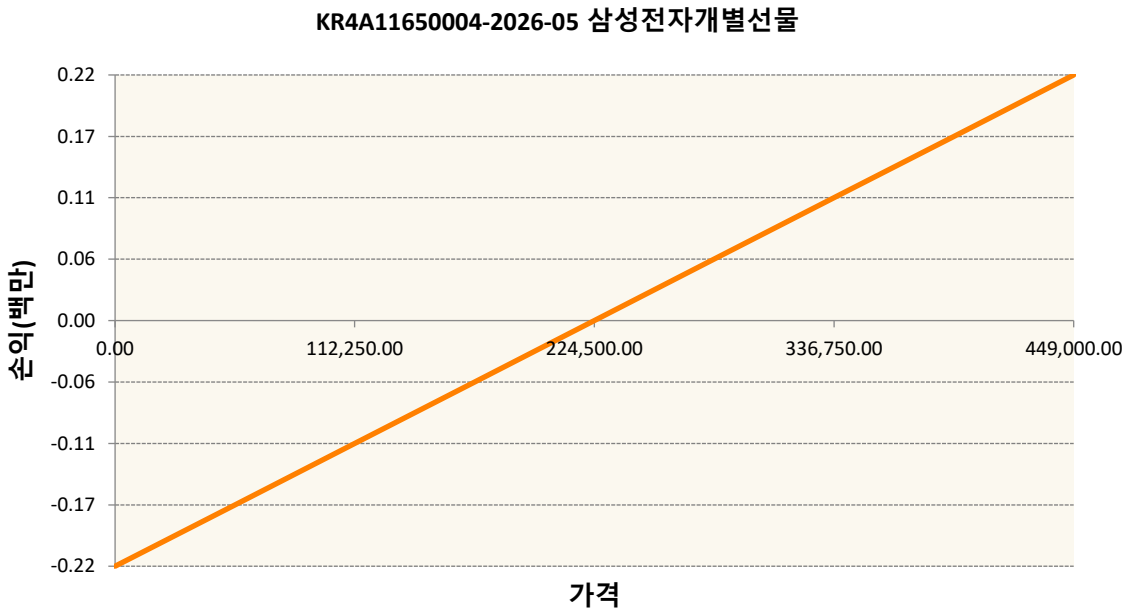
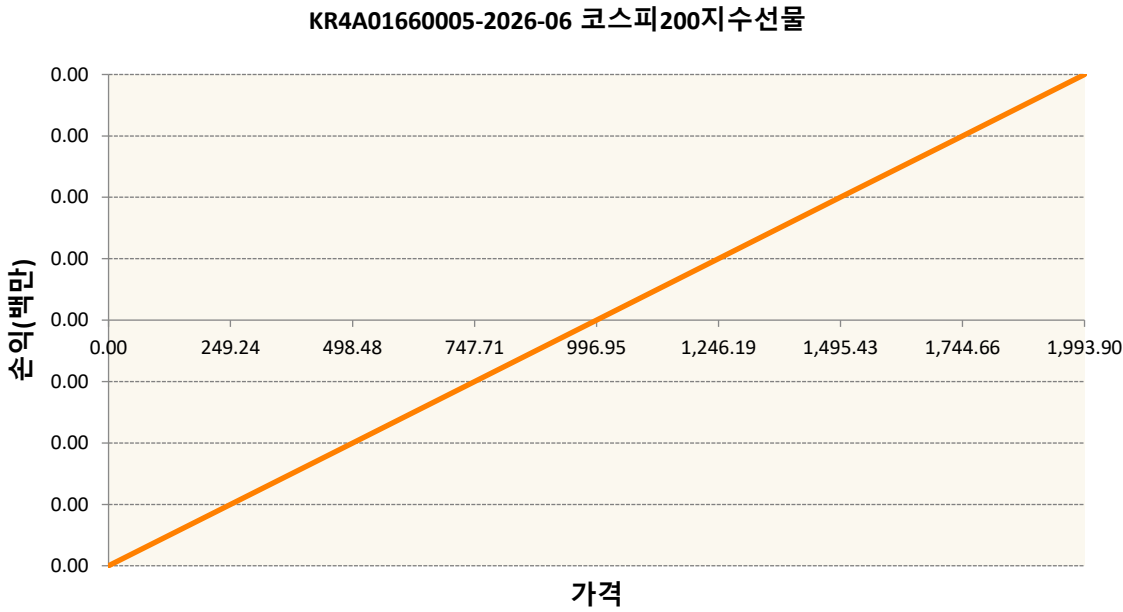
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

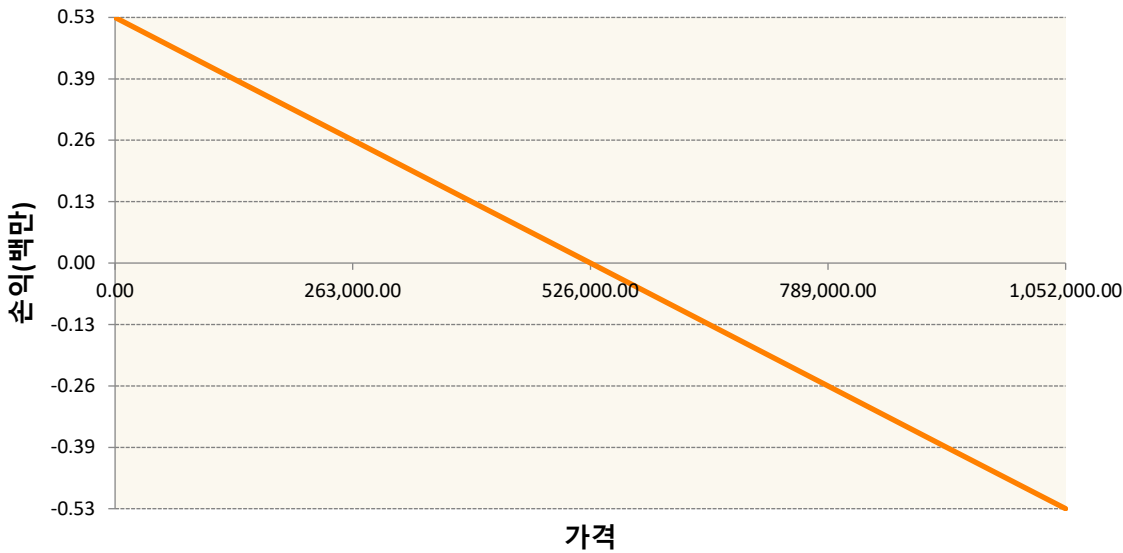
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,476	4,965	-1,490	장내
누계	유가증권	선물	32,517	6,775	25,742	장내

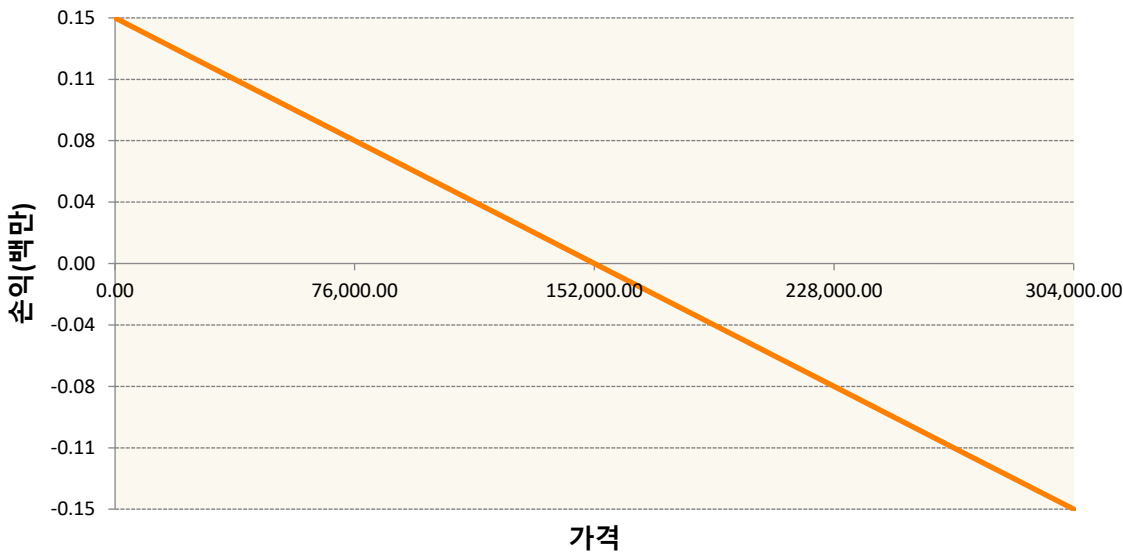
2. 만기시점의 손익구조



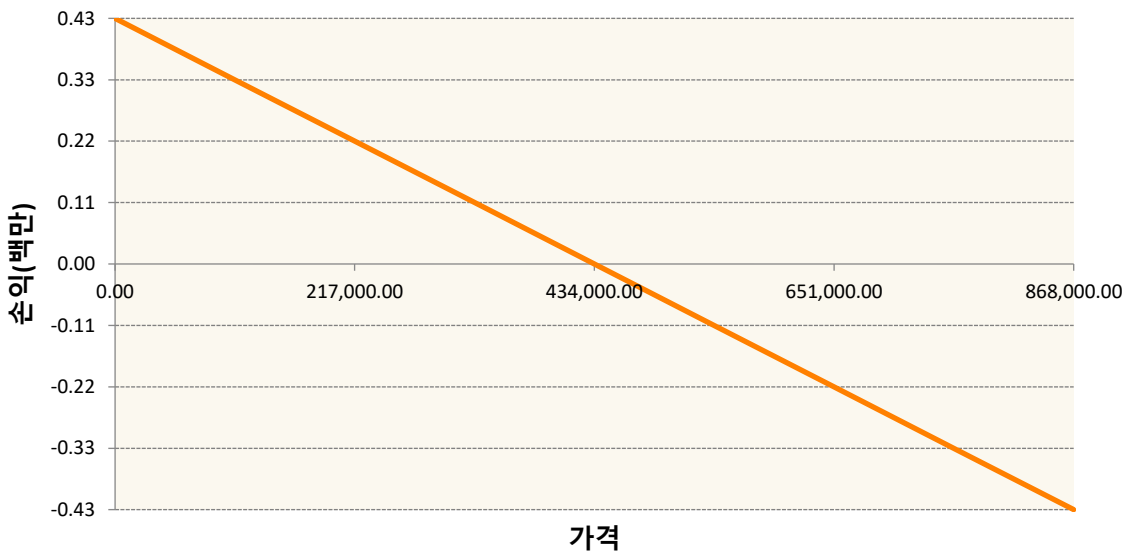
KR4A16650009-2026-05 현대차개별선물



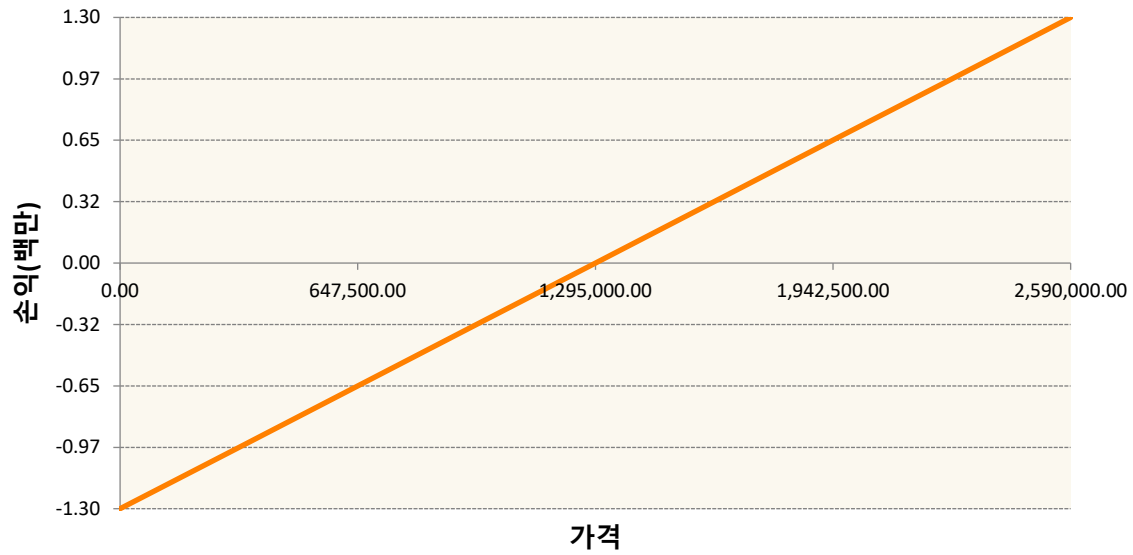
KR4A19650006-2026-05 기아개별선물



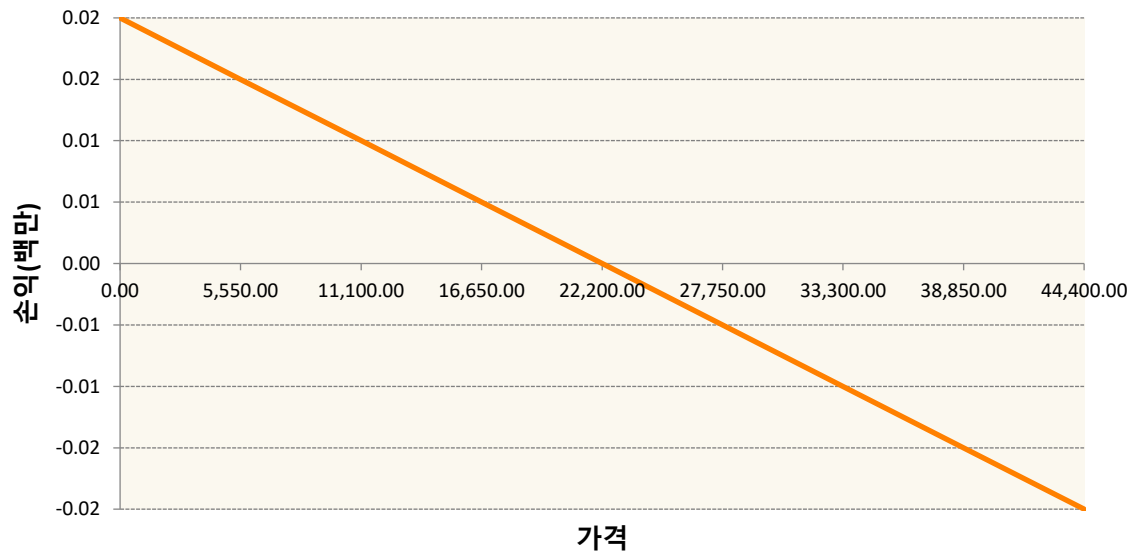
KR4A20650003-2026-05 현대모비스개별선물



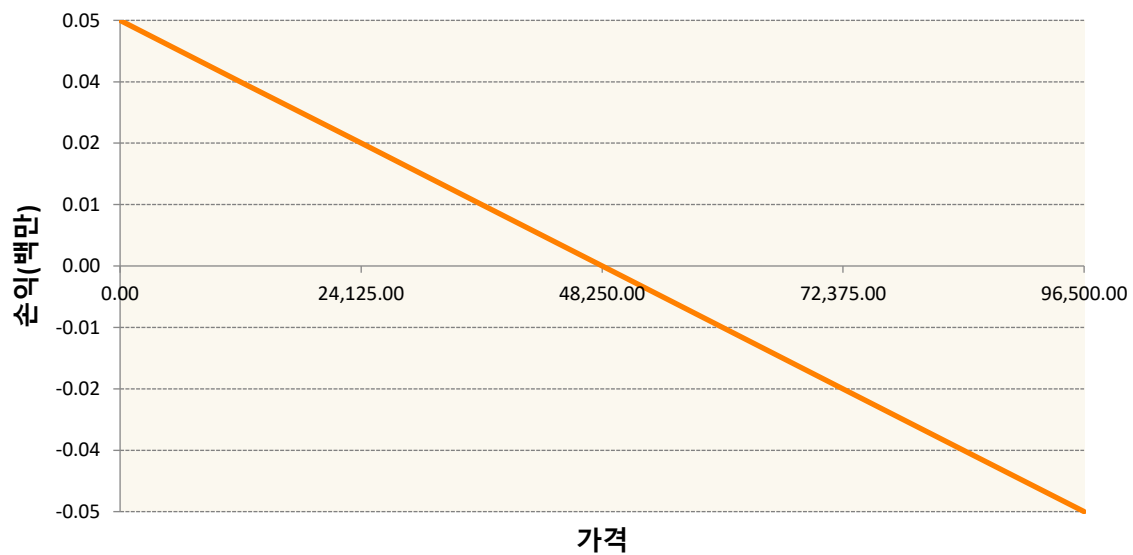
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



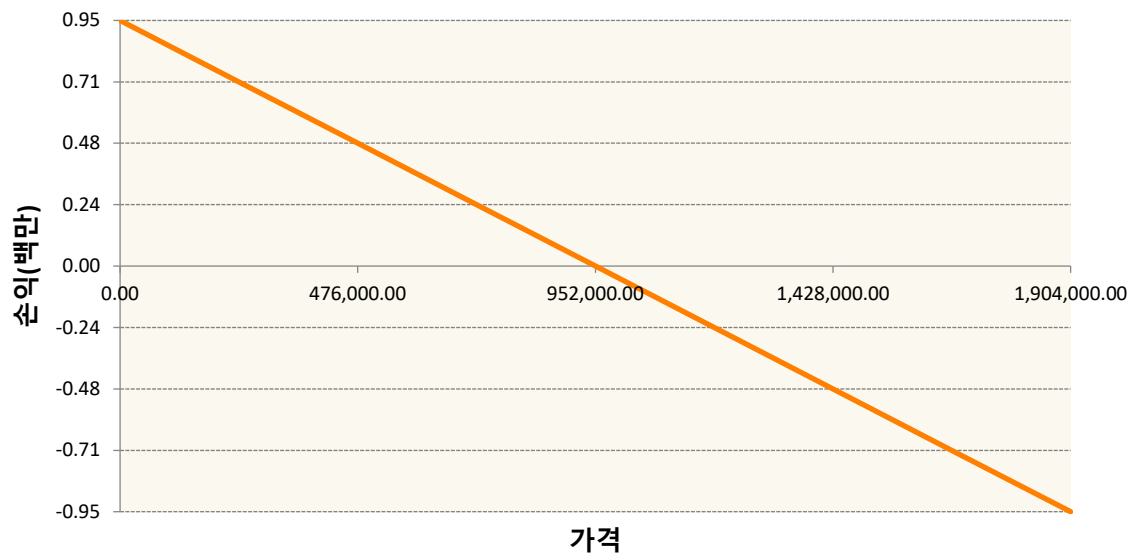
KR4AB4650001-2026-05 기업은행개별선물



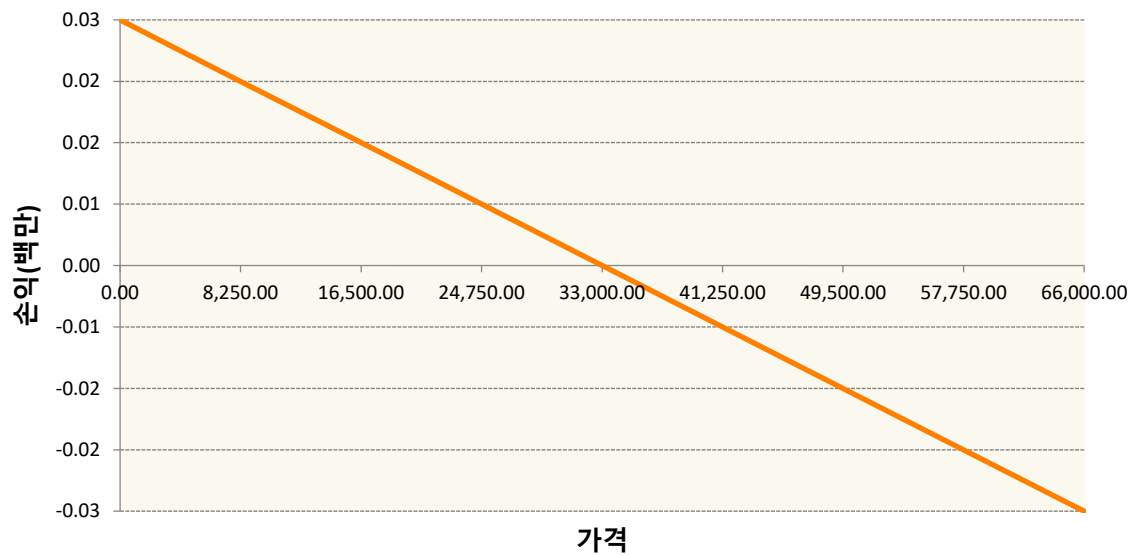
KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



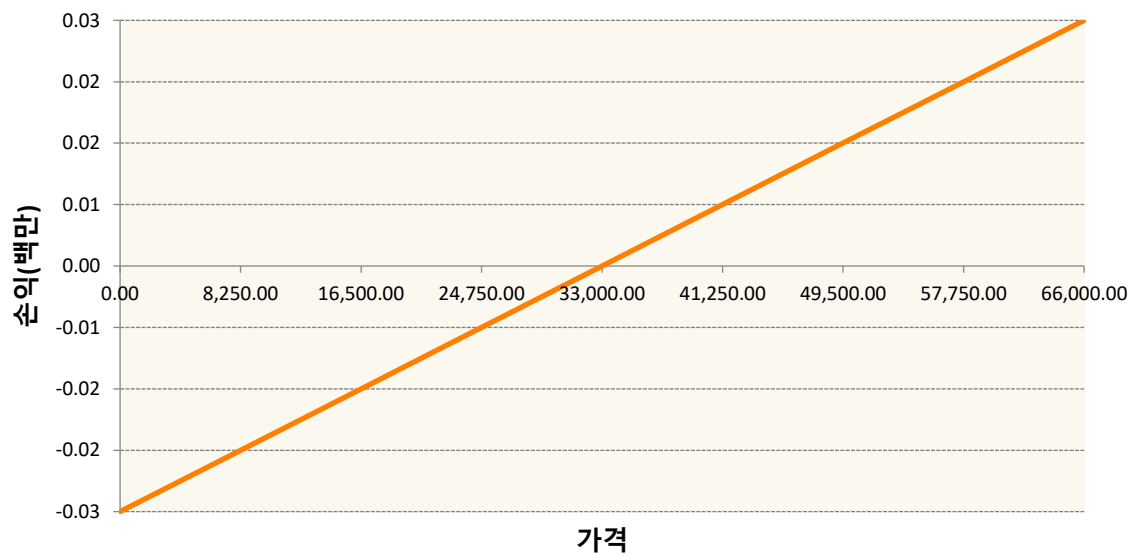
KR4ADB650009-2026-05 LIG디펜스엔에어로스페이스개별선



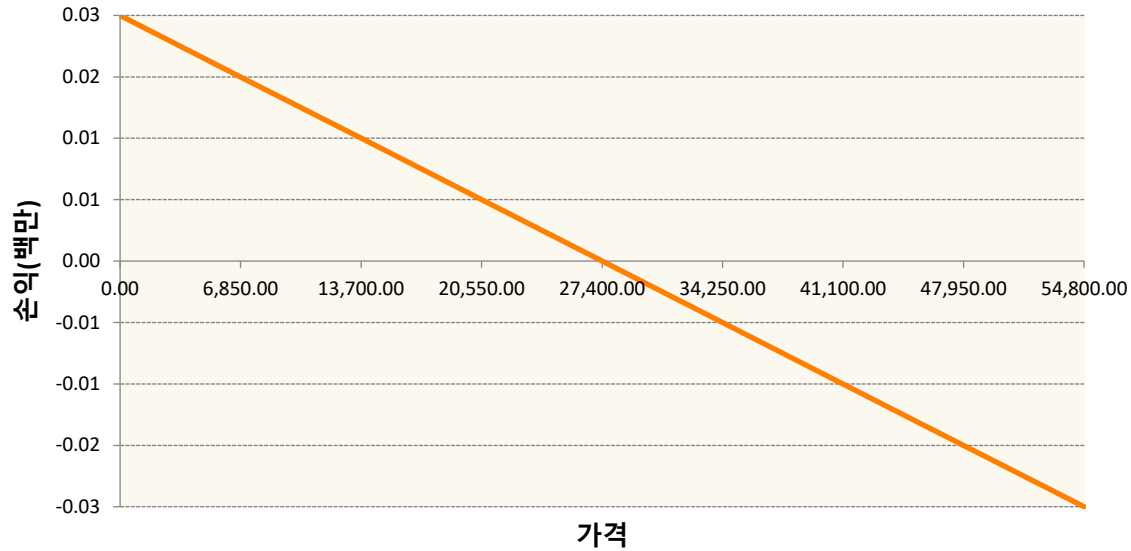
KR4AEB650008-2026-05 우리금융지주개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



KR4AGJ650008-2026-05 JB금융지주개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								2,230
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,230	-2,230	-2,230	-2,230	-2,230	-2,230	-2,230	-2,230
-5.33%	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486	-1,486
-2.67%	-743	-743	-743	-743	-743	-743	-743	-743
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	743	743	743	743	743	743	743	743
5.33%	1,486	1,486	1,486	1,486	1,486	1,486	1,486	1,486
8.00%	2,230	2,230	2,230	2,230	2,230	2,230	2,230	2,230
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	-186
-5.33%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	62	62	62	62	62	62	62	62
5.33%	124	124	124	124	124	124	124	124
8.00%	186	186	186	186	186	186	186	186
KR4A16650009 2026-05 현대차개별선물								79
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	79	79	79	79	79	79	79	79
-5.33%	53	53	53	53	53	53	53	53
-2.67%	26	26	26	26	26	26	26	26
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
8.00%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79

KR4A19650006	2026-05 기아개별선물	58
--------------	----------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58

KR4A20650003	2026-05 현대모비스개별선물	59
--------------	-------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39
-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%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59

KR4A50650006	2026-05 SK하이닉스개별선물	112
--------------	--------------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	112	112	112	112	112	112	112

KR4AB4650001	2026-05 기업은행개별선물	28
--------------	------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	28	28	28	28
-5.33%	18	18	18	18	18	18	18
-2.67%	9	9	9	9	9	9	9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28

KR4ACF650006	2026-05 카카오개별선물	124
--------------	-----------------	-----

	기초자산의 변동성
--	-----------

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	124	124	124	124	124	124	124
-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%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124

KR4ADB650009 2026-05 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선 81

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	81	81	81	81	81	81
-5.33%	54	54	54	54	54	54	54
-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%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81

KR4AEB650008 2026-05 우리금융지주개별선물 81

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	81	81	81	81	81	81	81
-5.33%	54	54	54	54	54	54	54
-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%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81

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%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-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%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	71	71	71	71	71	71	71

KR4AGJ650008 2026-05 JB금융지주개별선물 34

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34
-5.33%	22	22	22	22	22	22	22
-2.67%	11	11	11	11	11	11	11
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34

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

(단위:백만원)

6,398

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

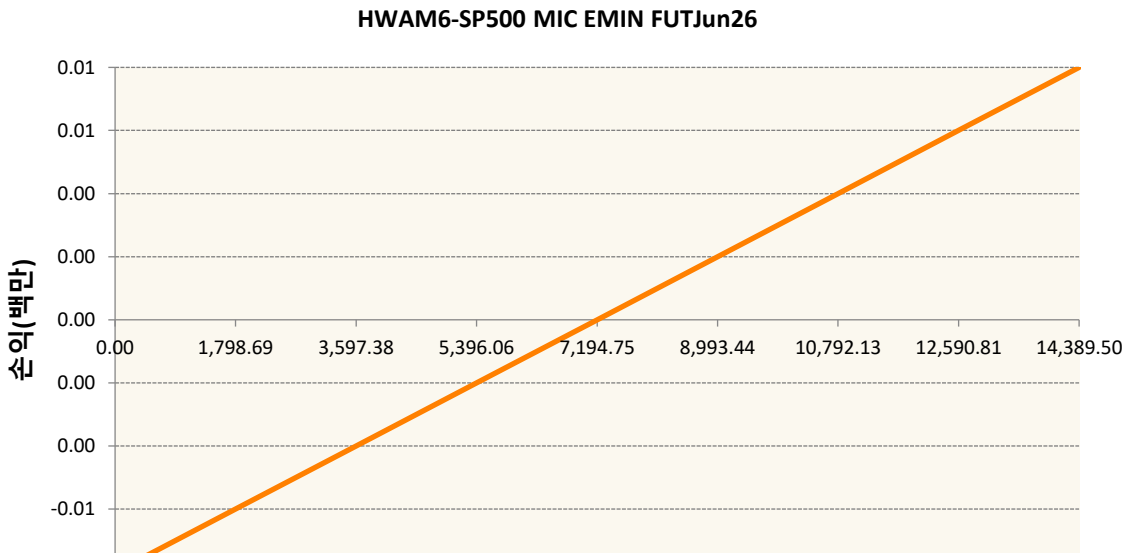
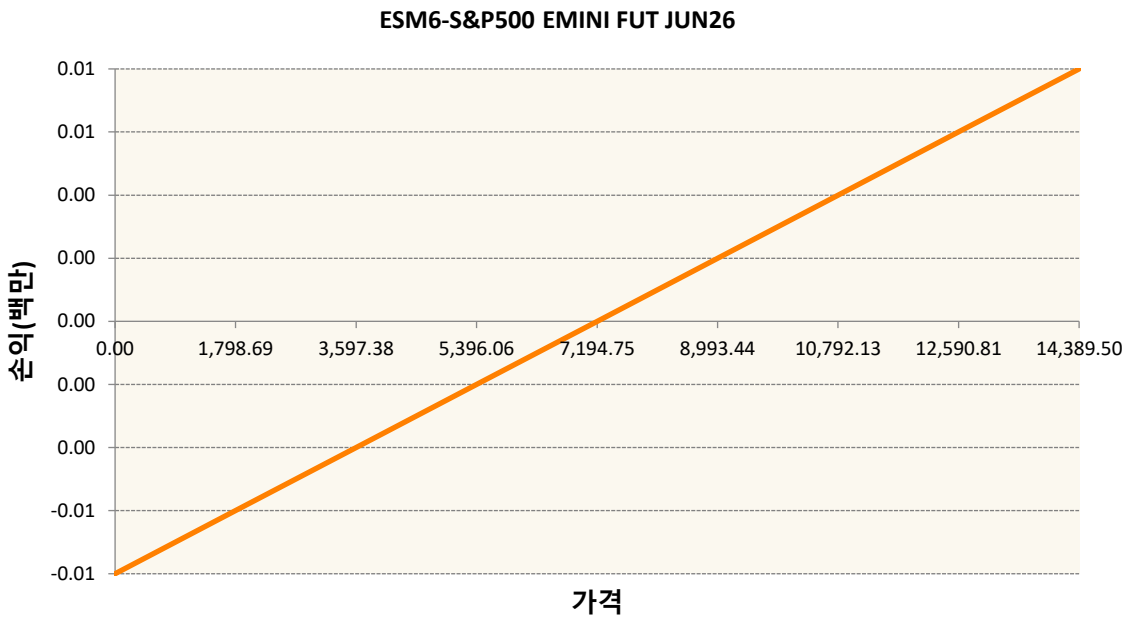
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

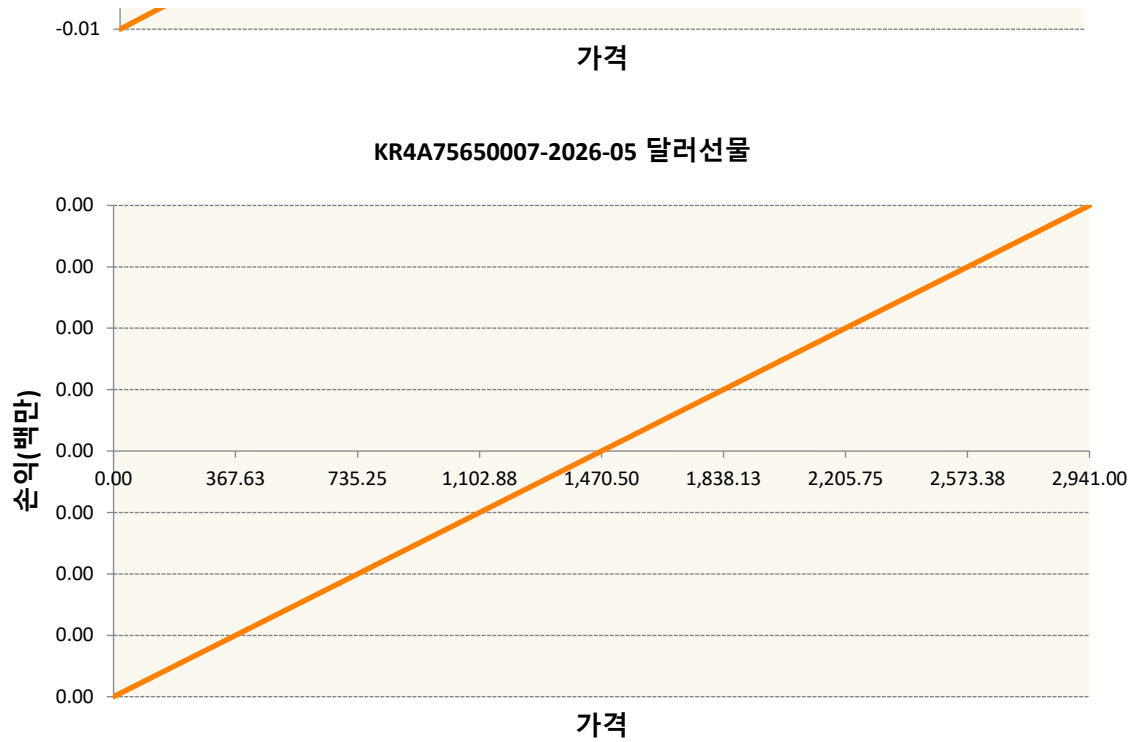
1. 계약금액

(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	57,177	0	57,177	
누계	지수	선물	268	0	268	장내
누계	통화	선물	10,441	0	10,441	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,574
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		21
KR4A756500 2026-05 달러선물			835

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,998

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

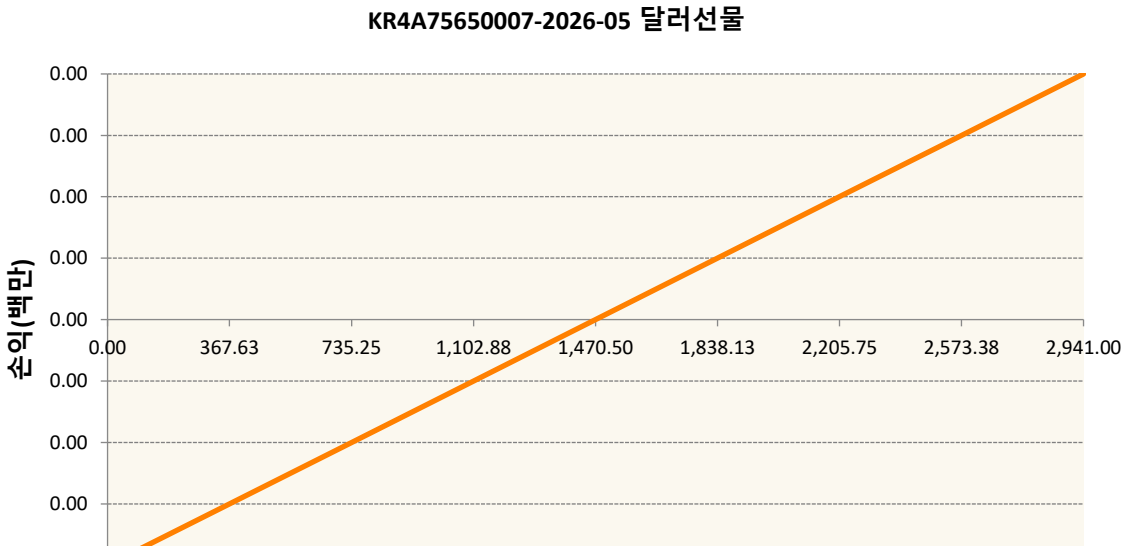
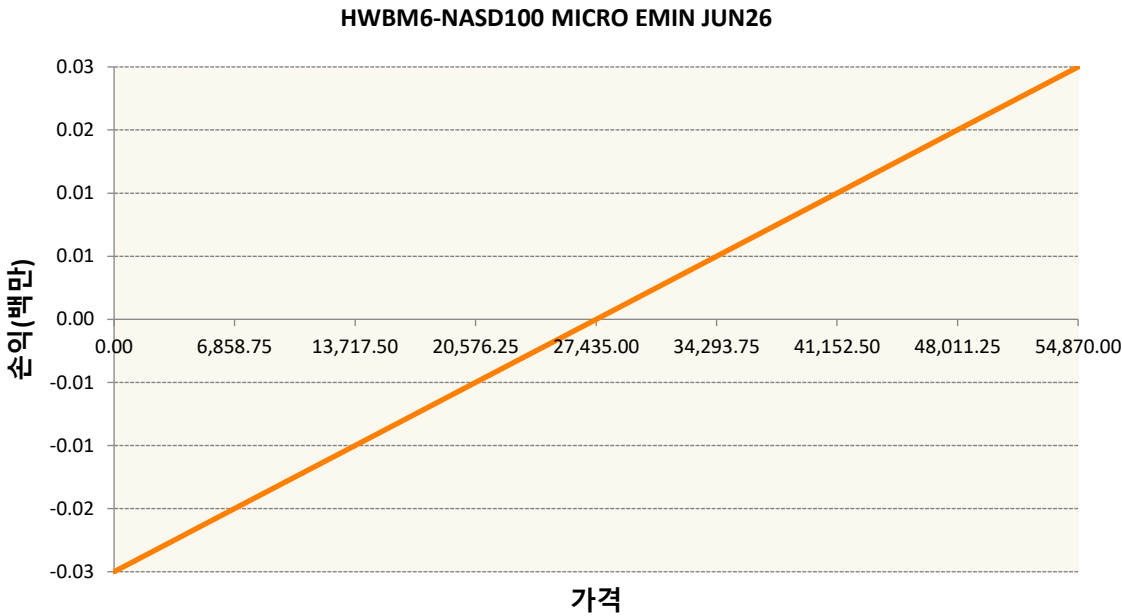
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

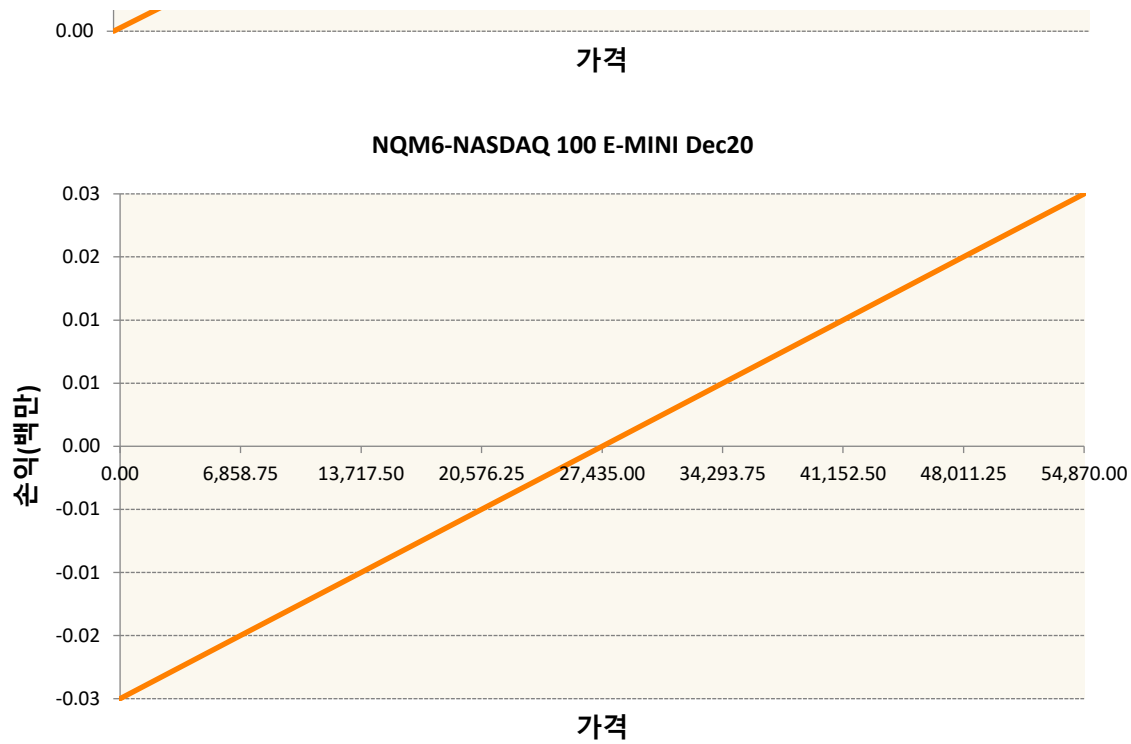
1. 계약금액

(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	25,488	0	25,488	
누계	유가증권	선물	408	0	408	장내
누계	통화	선물	3,838	0	3,838	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBM6 NASD100 MICRO EMIN JUN26

33

KR4A756500 2026-05 달러선물

307

NQM6 NASDAQ 100 E-MINI Dec20

2,039

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

(단위:백만원)

2,275

공시일	2026-04-28
기준일	2026-04-27

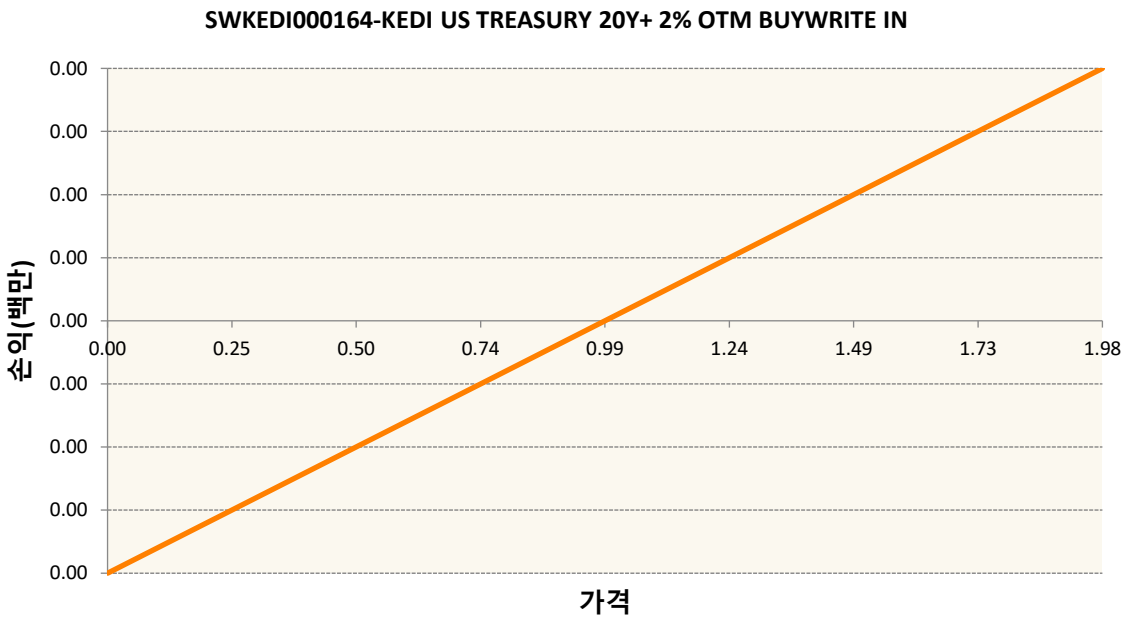
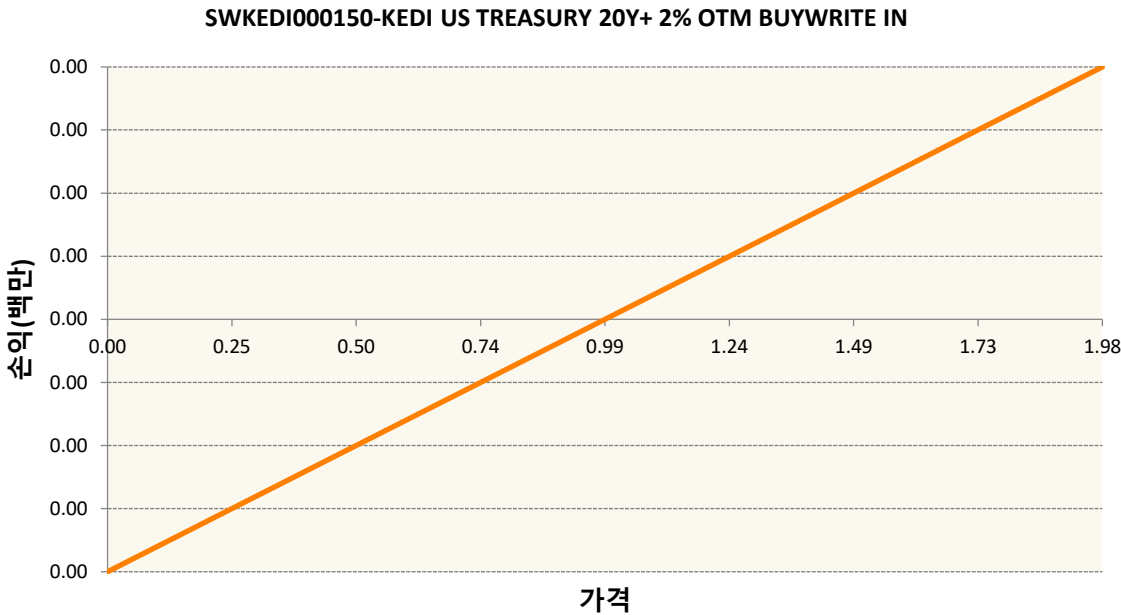
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

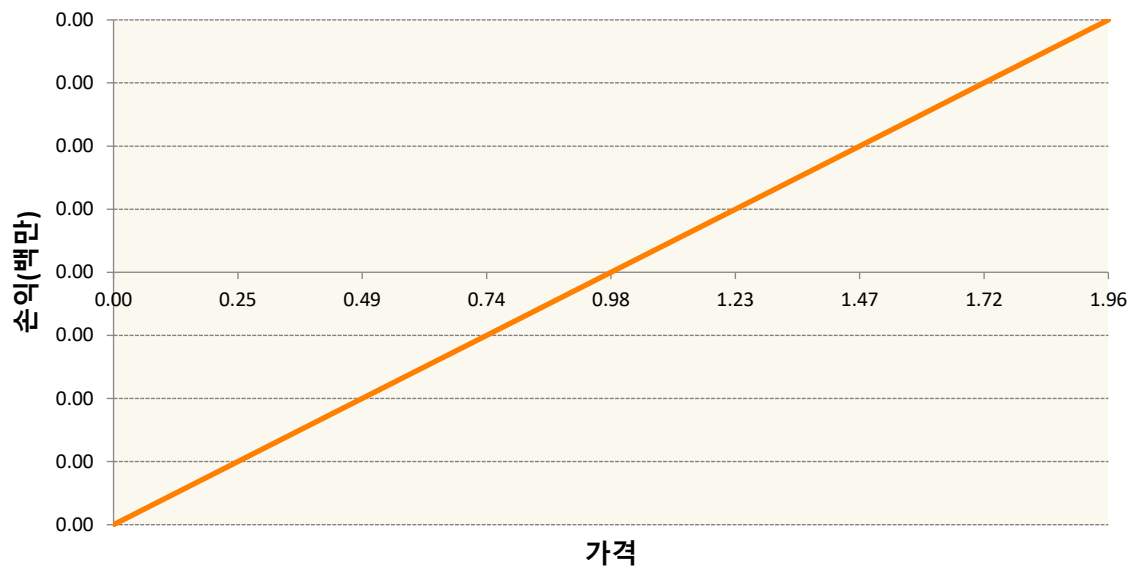
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	355,413	0	355,413	장외

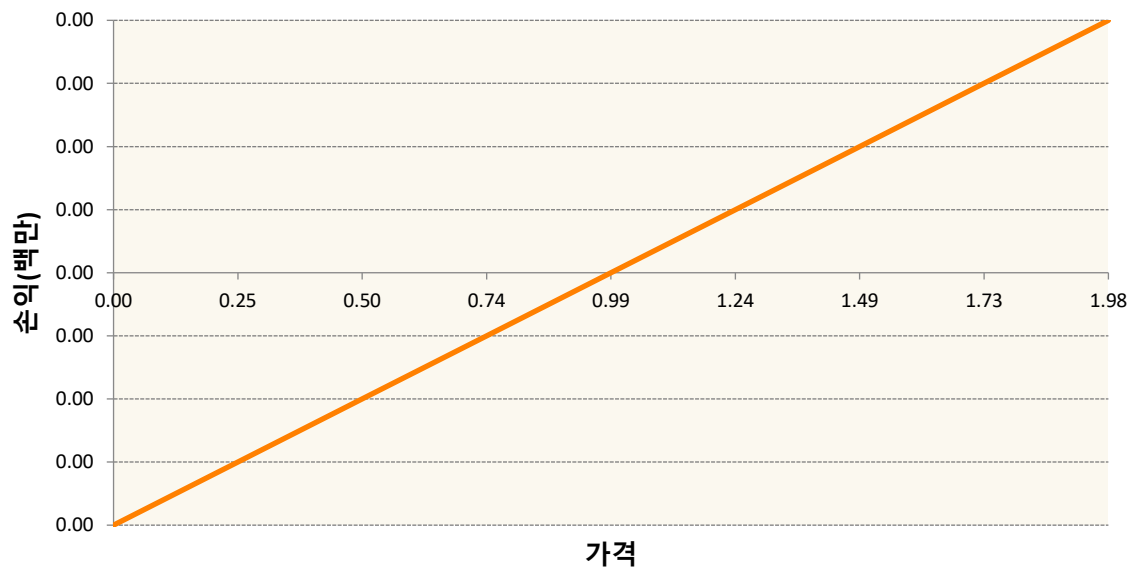
2. 만기시점의 손익구조



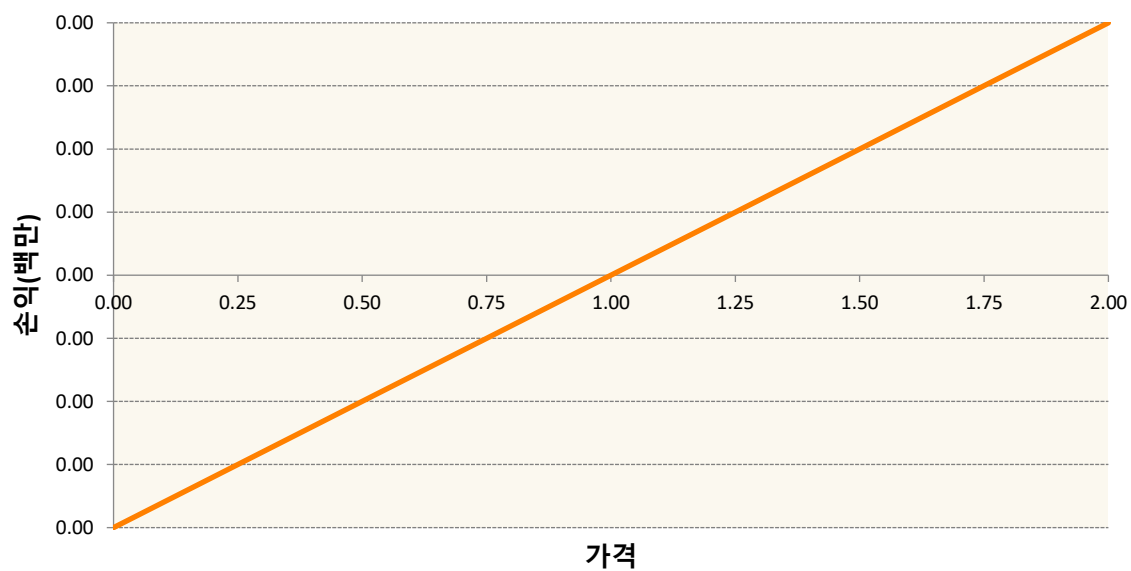
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,294
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		152
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,696
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,405
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,908

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