

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

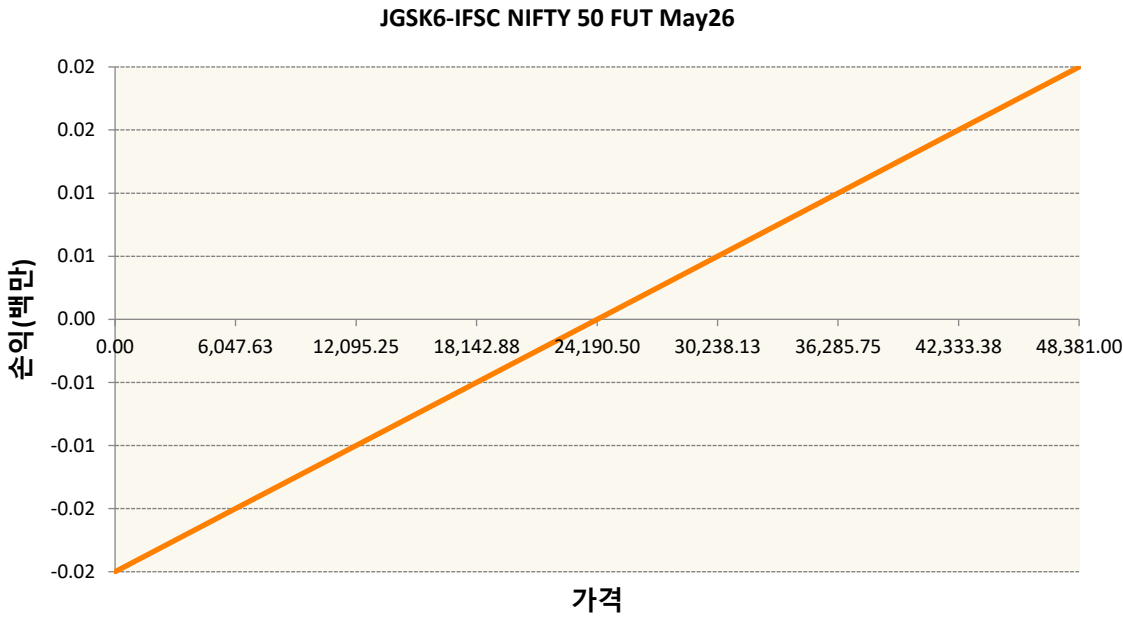
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	359	0	359	

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	2026-04-29
기준일	2026-04-28

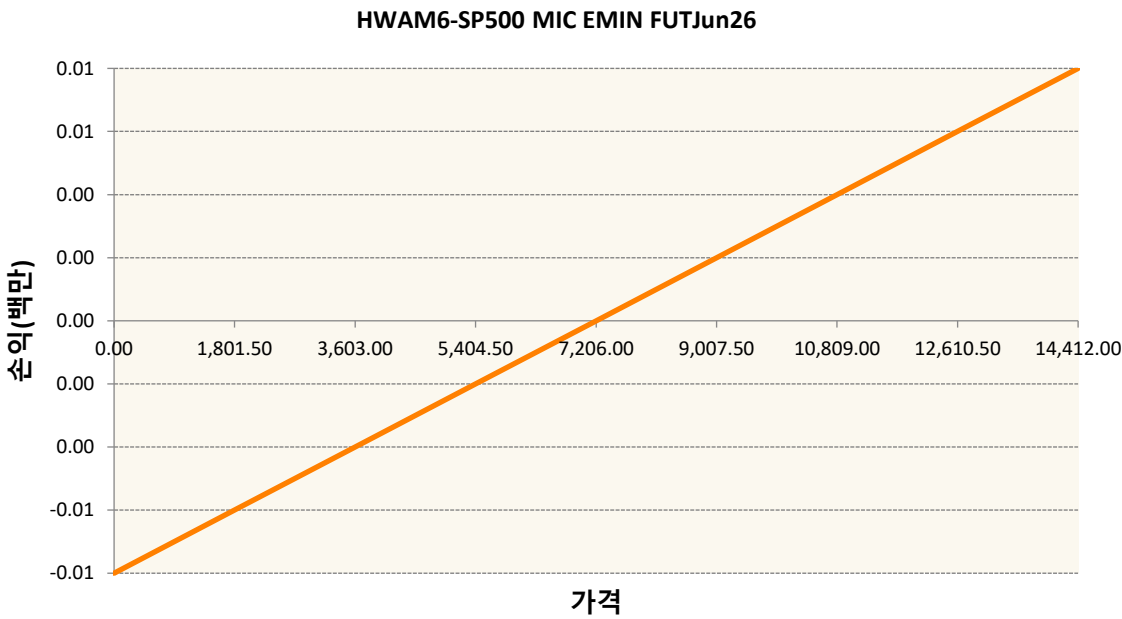
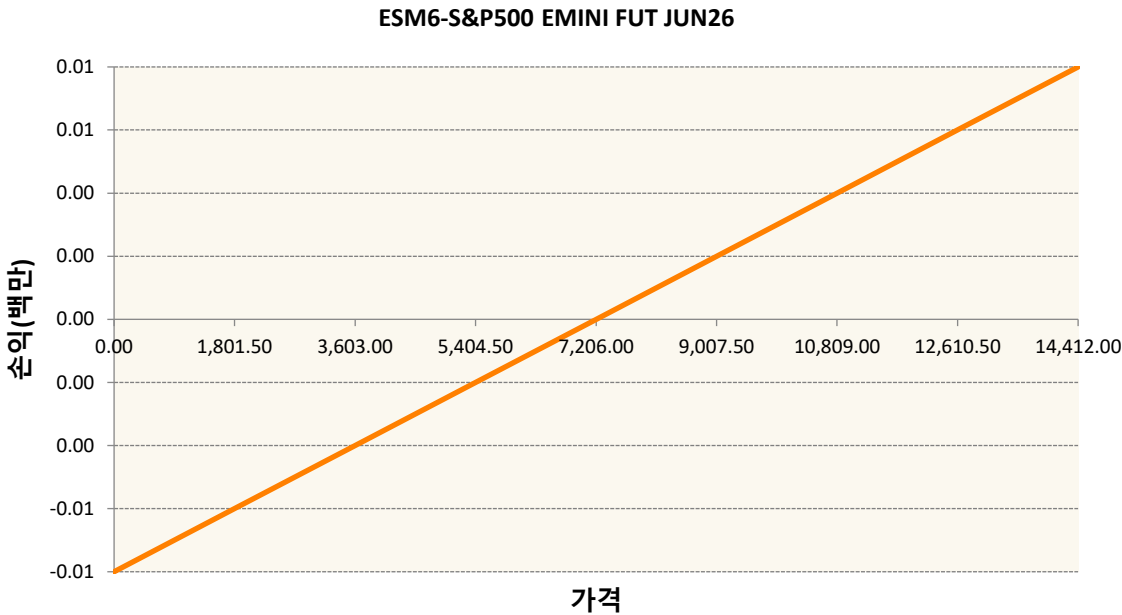
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	540	0	540	
누계	지수	선물	108	0	108	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	43
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	45

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

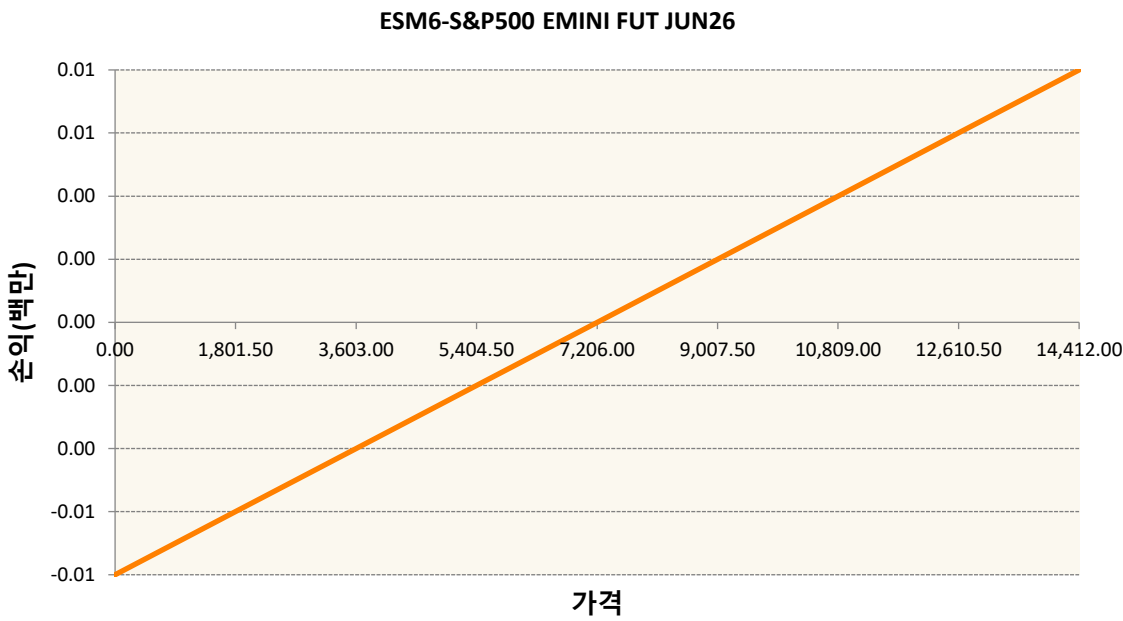
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,080	0	1,080	

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	2026-04-29
기준일	2026-04-28

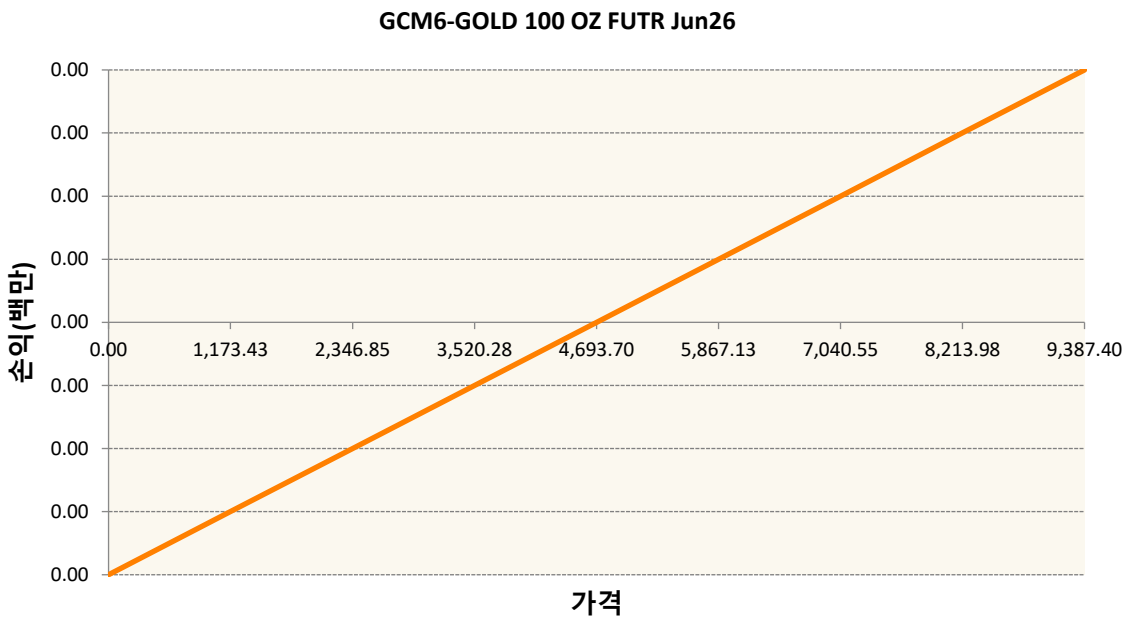
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,650	0	5,650	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUCS4 GLD US 05/08/26 C447 EQUITY	7
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	452

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

(단위:백만원)

574

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

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	255
AOPLTRSUP1 PLTR US 05/08/26 P155 EQUITY	58

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

(단위:백만원)

976

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

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

19

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

(단위:백만원)

12

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

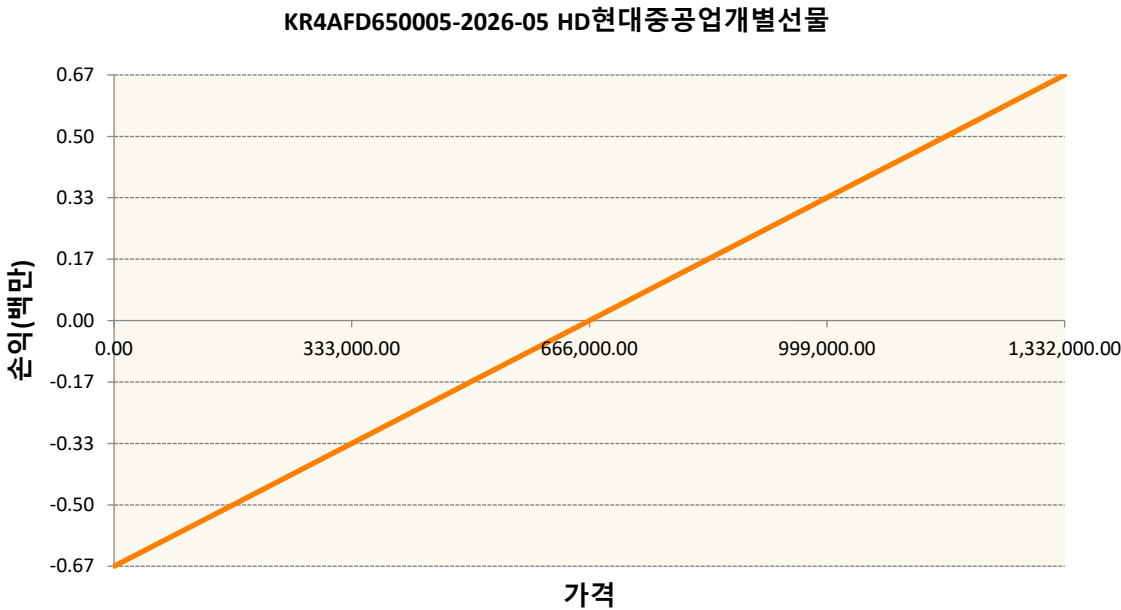
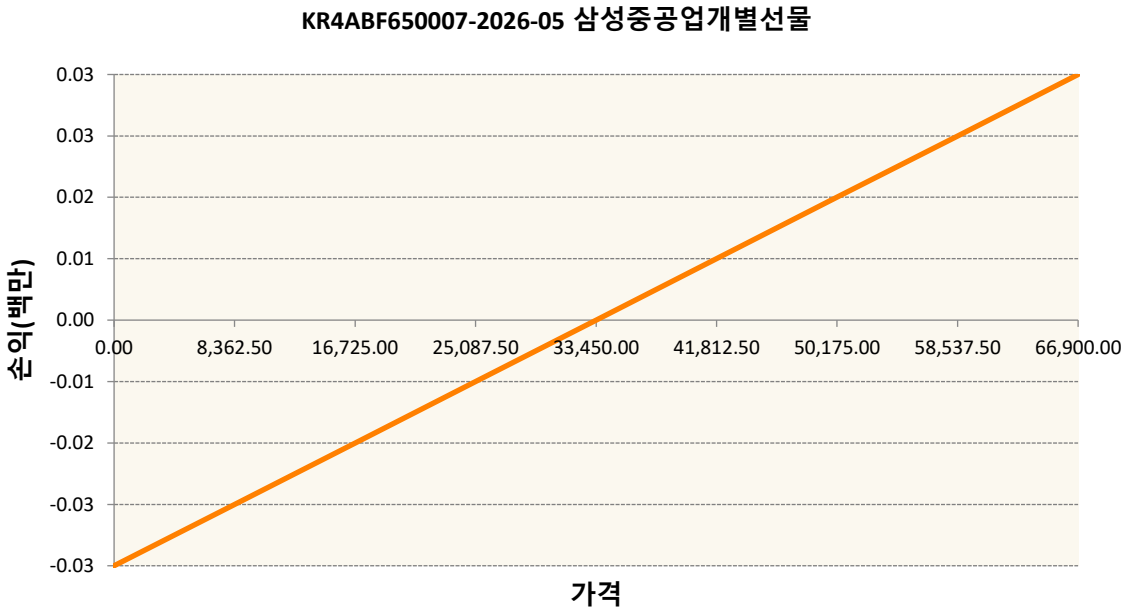
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

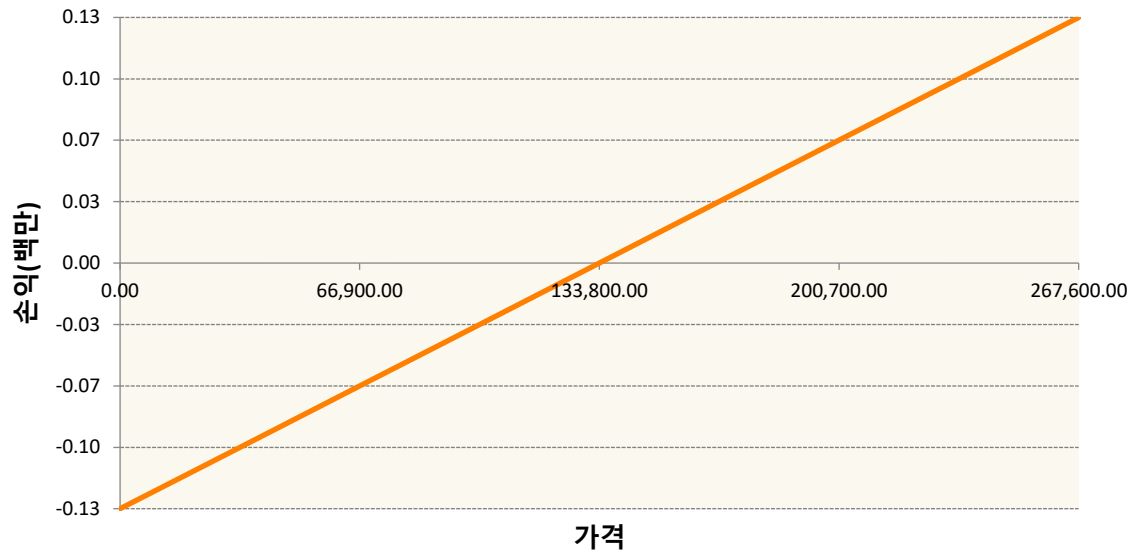
(단위:백만원)

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	35,507	0	35,507	장내
누계	유가증권	스왑	189,784	0	189,784	장외

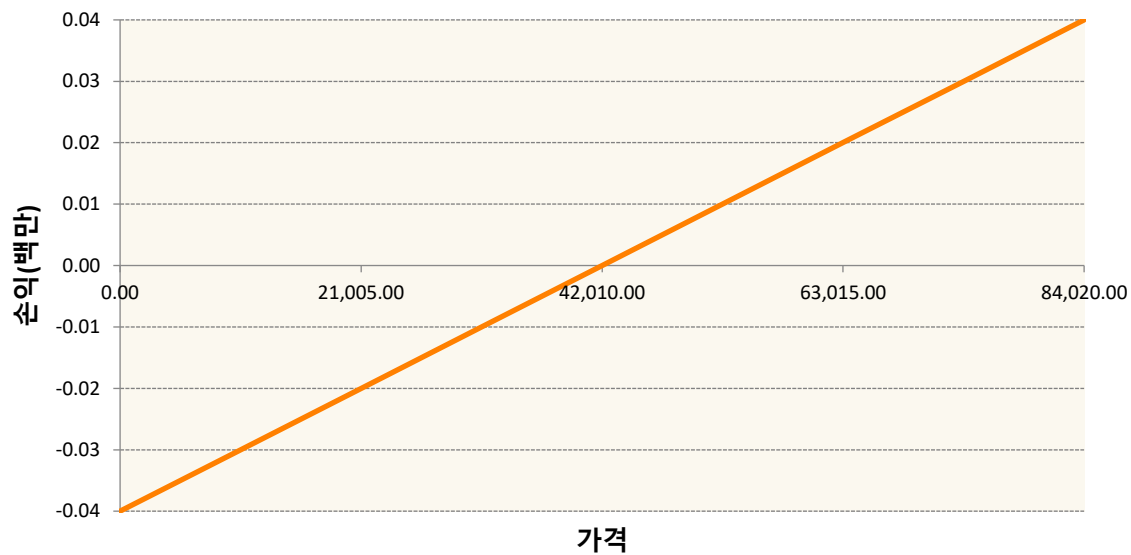
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM766004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007		2026-05 삼성중공업개별선물					1,227
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227
-5.33%	-818	-818	-818	-818	-818	-818	-818
-2.67%	-409	-409	-409	-409	-409	-409	-409
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	409	409	409	409	409	409	409
5.33%	818	818	818	818	818	818	818
8.00%	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227
KR4AFD650005		2026-05 HD현대중공업개별선물					1,014
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014
-5.33%	-676	-676	-676	-676	-676	-676	-676
-2.67%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	338	338	338	338	338	338	338
5.33%	676	676	676	676	676	676	676
8.00%	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014	1,014
KR4AFV650003 2026-05 한화오션개별선물							598

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-598	-598	-598	-598	-598	-598	-598
-5.33%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
-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%	398	398	398	398	398	398	398
8.00%	598	598	598	598	598	598	598

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

(단위:백만원)

4,421

공시일 2026-04-29

기준일 2026-04-28

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	2026-04-29
기준일	2026-04-28

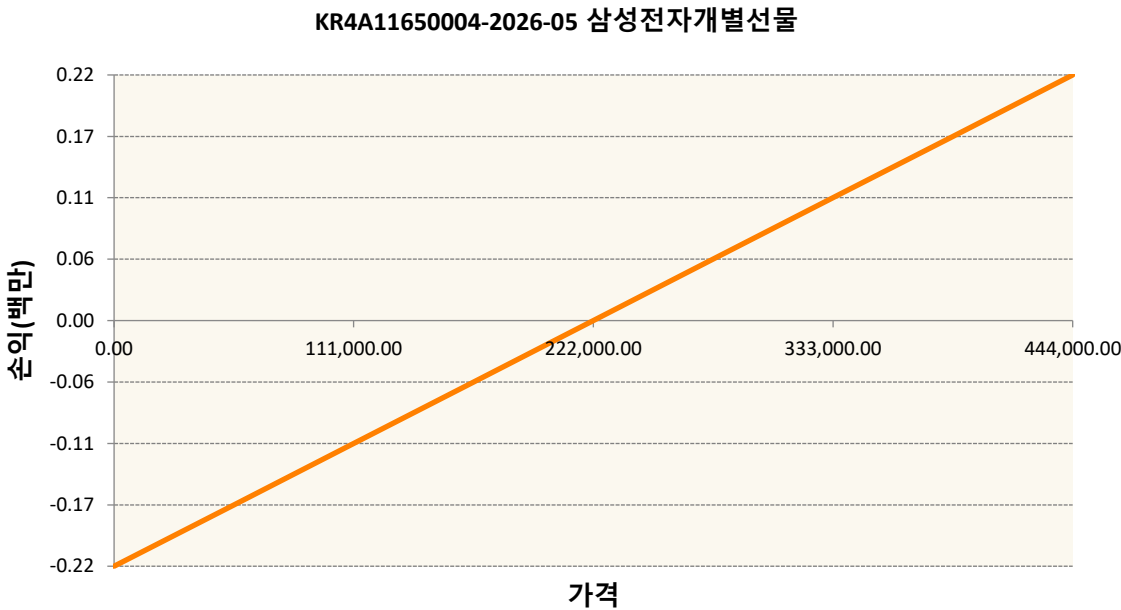
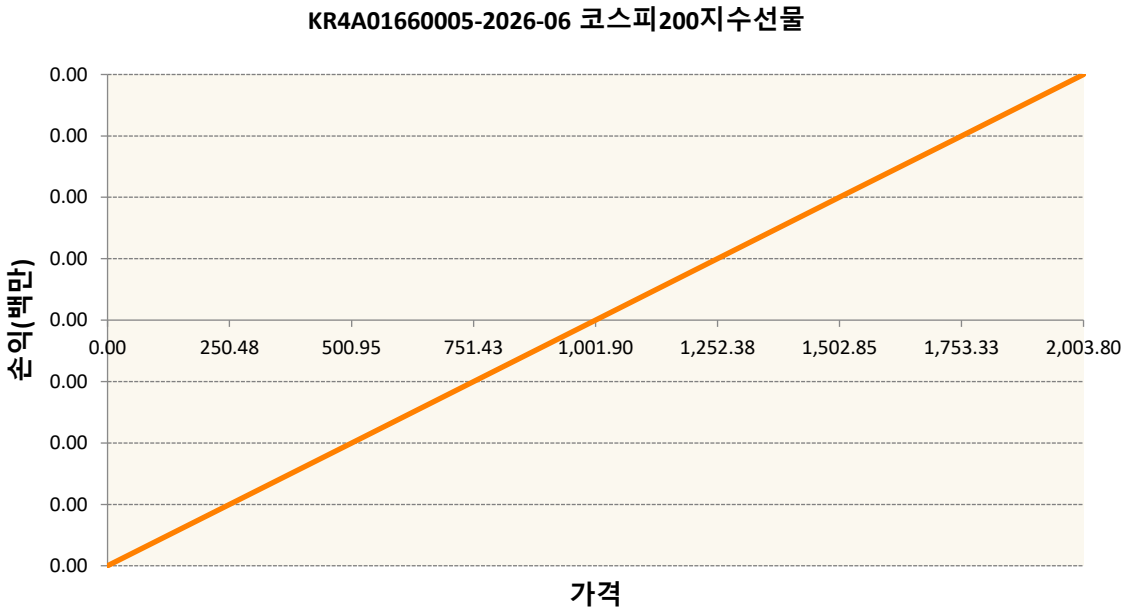
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,950	0	12,950	장내
누계	유가증권	옵션	0	39,093	-39,093	장내

2. 만기시점의 손익구조



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					519
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519
-5.33%	-346	-346	-346	-346	-346	-346	-346
-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%	346	346	346	346	346	346	346
8.00%	519	519	519	519	519	519	519
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물					515
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-515	-515	-515	-515	-515	-515	-515
-5.33%	-343	-343	-343	-343	-343	-343	-343
-2.67%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	172	172	172	172	172	172	172
5.33%	343	343	343	343	343	343	343
8.00%	515	515	515	515	515	515	515
KR4B09EY9950 코스피위클리 C 2604W5 995.0							1,464

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,429	-1,431	-1,434	-1,439	-1,446	-1,454	-1,464
-5.33%	-819	-830	-843	-858	-875	-894	-914
-2.67%	-279	-305	-333	-361	-390	-419	-449
0%	99	66	33	0	-33	-66	-100
2.67%	284	261	237	211	184	157	128
5.33%	341	332	321	308	292	275	256
8.00%	352	350	347	342	335	327	317
KR4B09EY9976 코스피위클리 C 2604W5 997.5							999

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-978	-979	-981	-984	-988	-993	-999
-5.33%	-567	-574	-582	-591	-602	-614	-626
-2.67%	-199	-215	-233	-251	-270	-289	-309
0%	67	45	22	0	-22	-45	-67
2.67%	202	186	168	150	132	113	93
5.33%	246	239	231	221	210	198	184
8.00%	255	253	250	247	242	236	228

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

(단위:백만원)

6,464

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

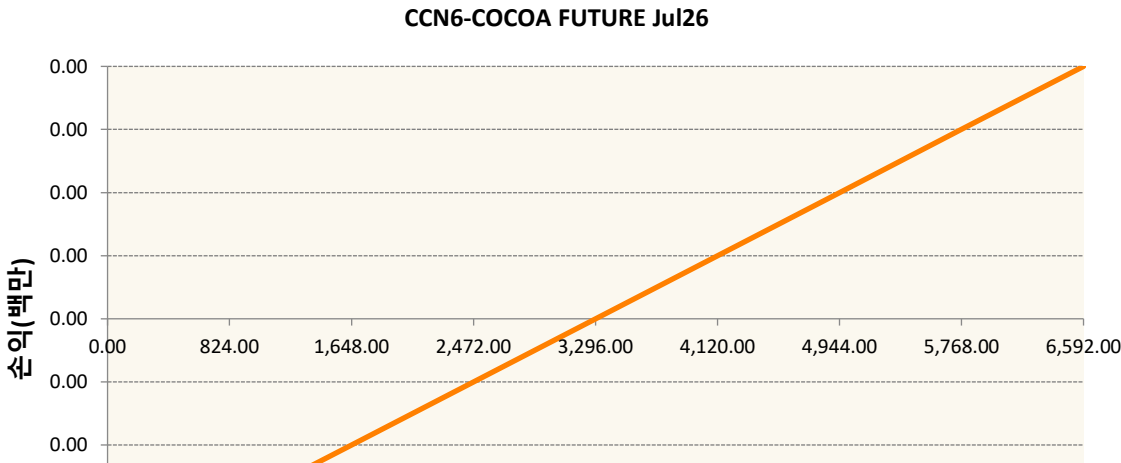
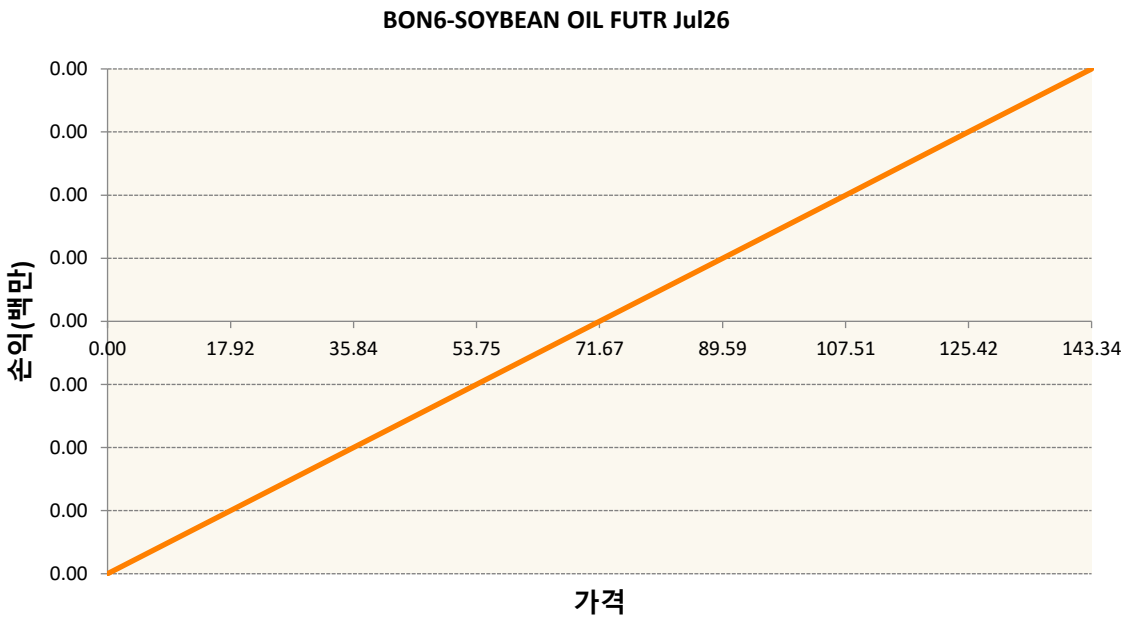
포커스농산물모(채권-파생형)

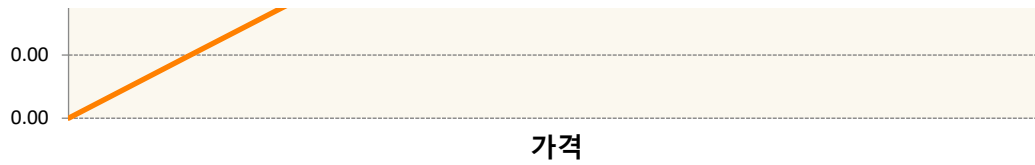
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

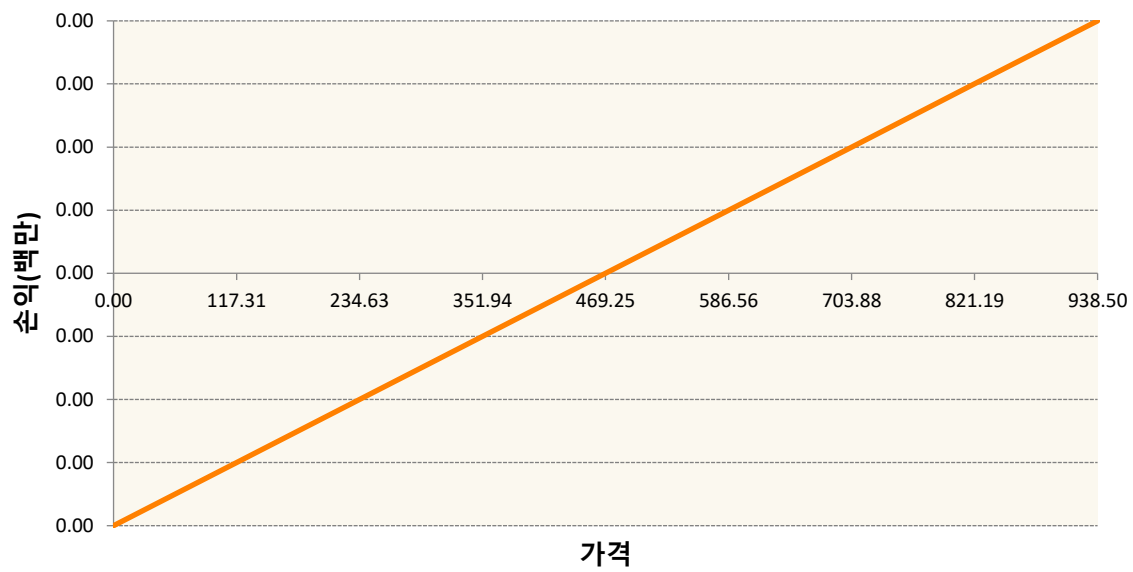
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	59	-59	장내
누계	실물자산	선물	98	0	98	
누계	실물자산	선물	902	0	902	장내
누계	유가증권	선물	2,013	0	2,013	
누계	통화	선물	0	413	-413	장내

2. 만기시점의 손익구조

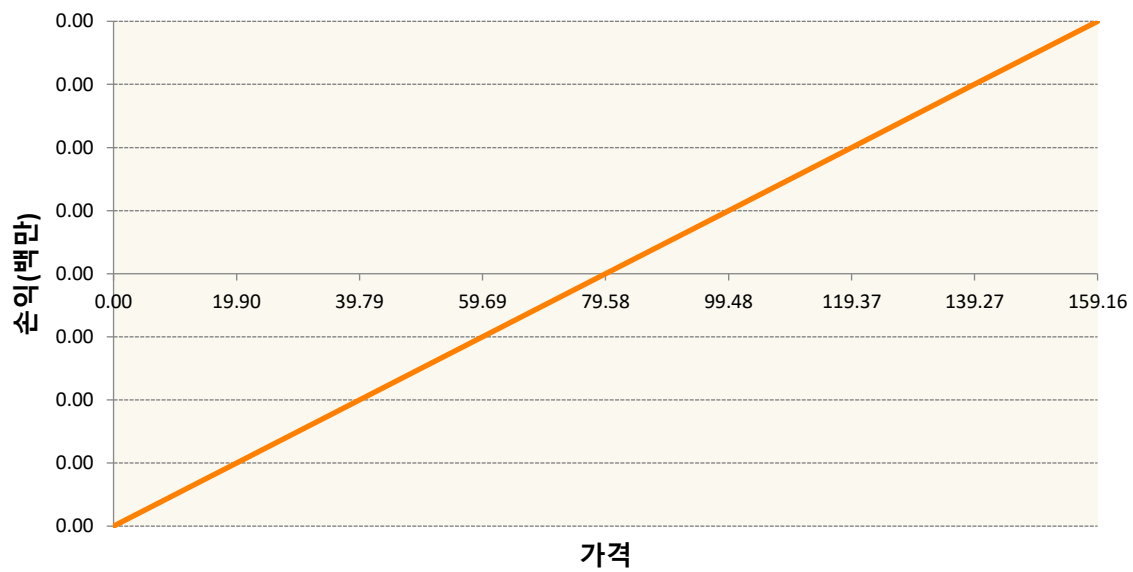




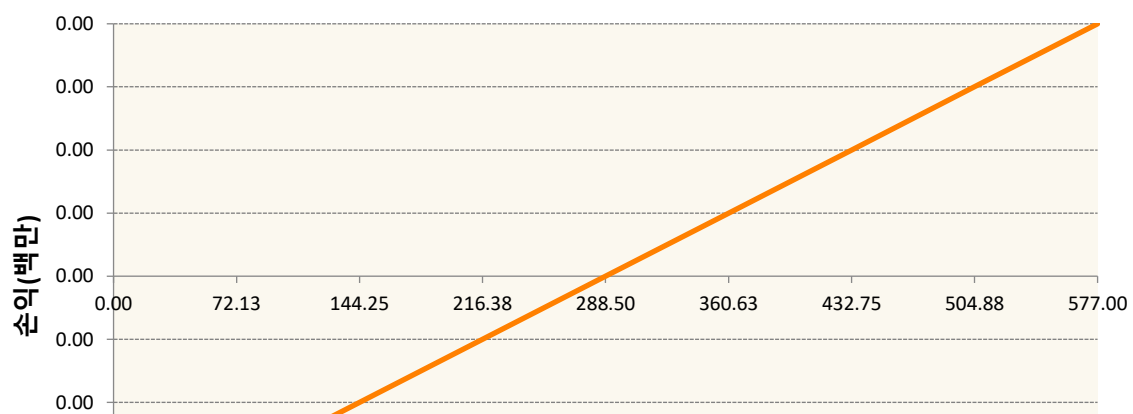
CN6-CORN FUTURE Jul26

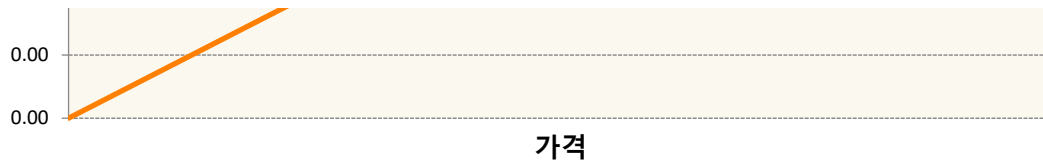


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

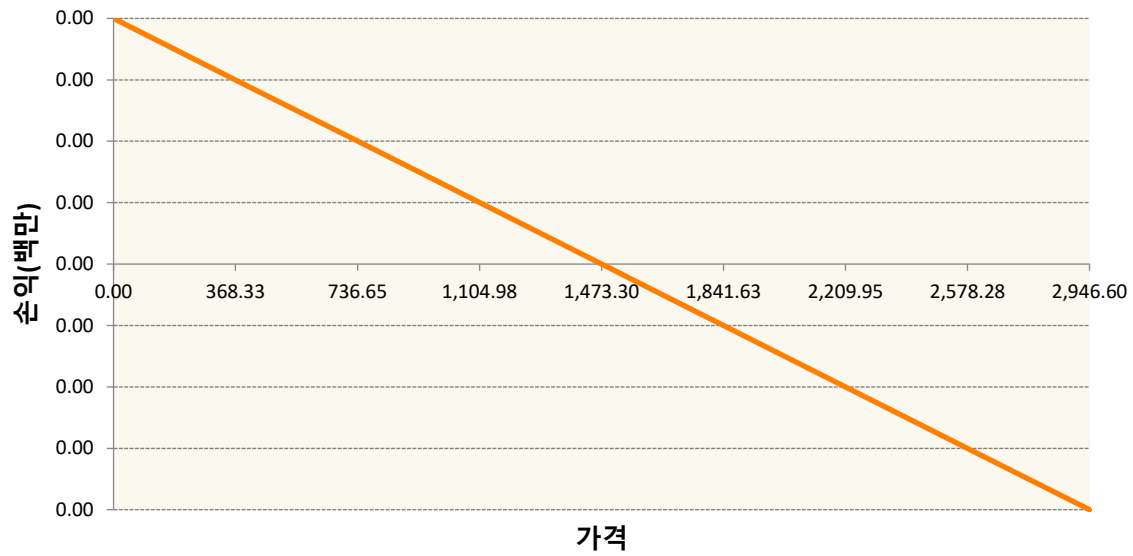


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

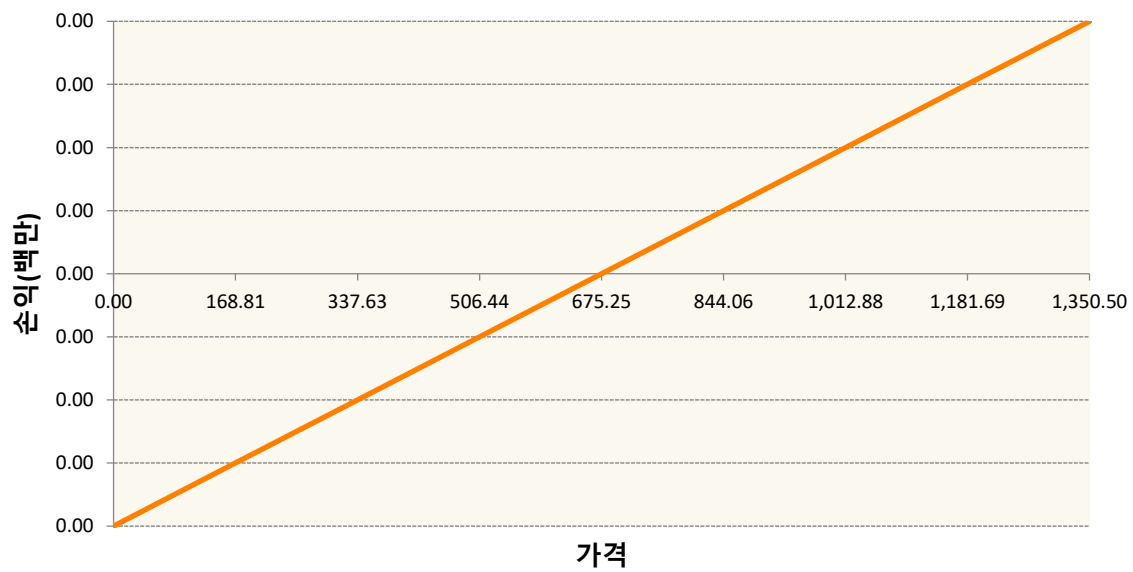




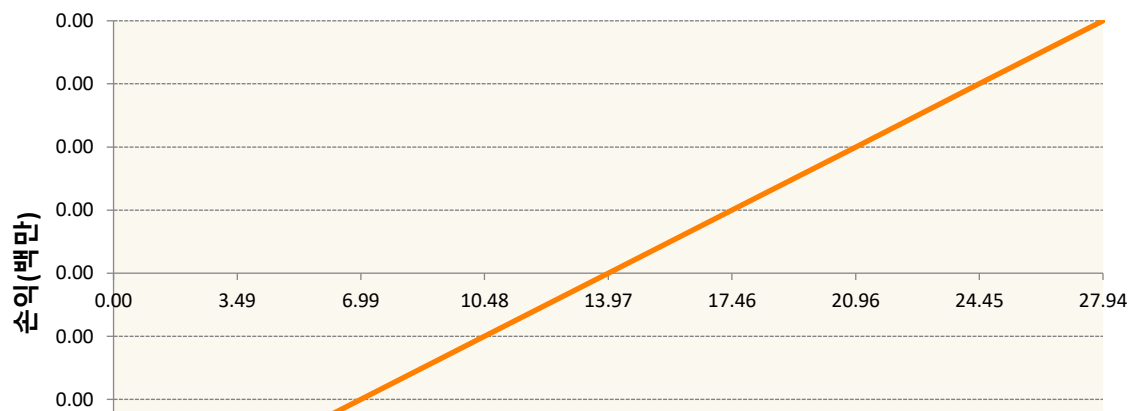
KR4A75650007-2026-05 달러선물

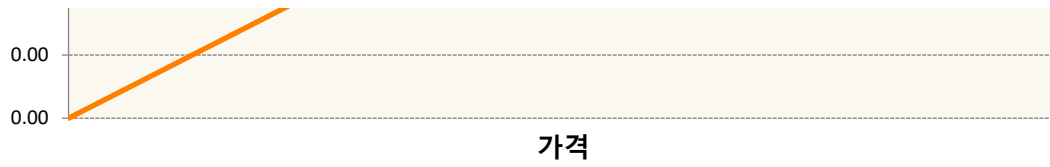


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

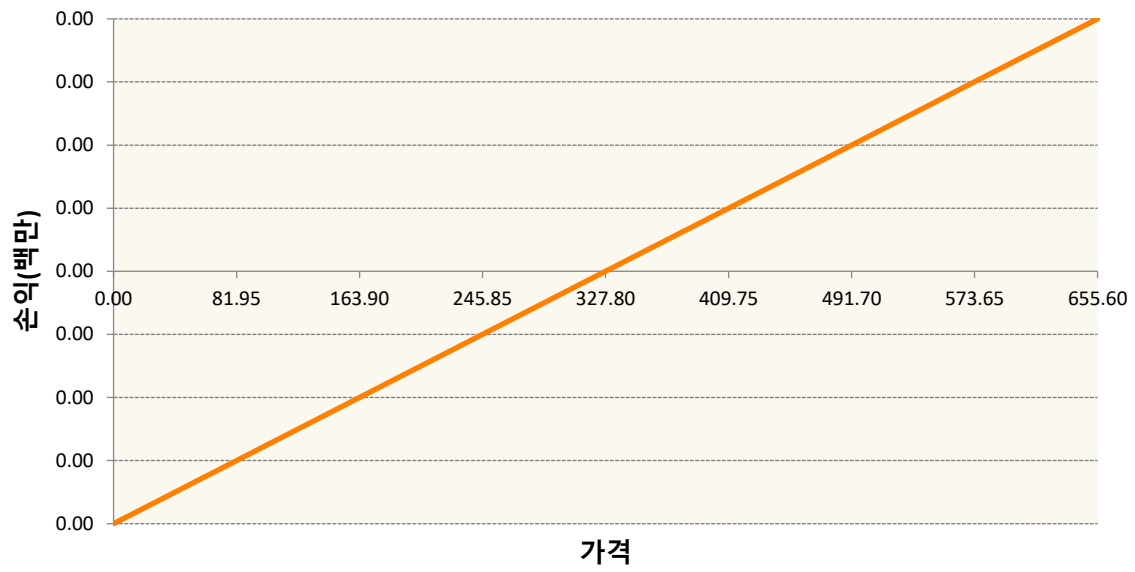


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

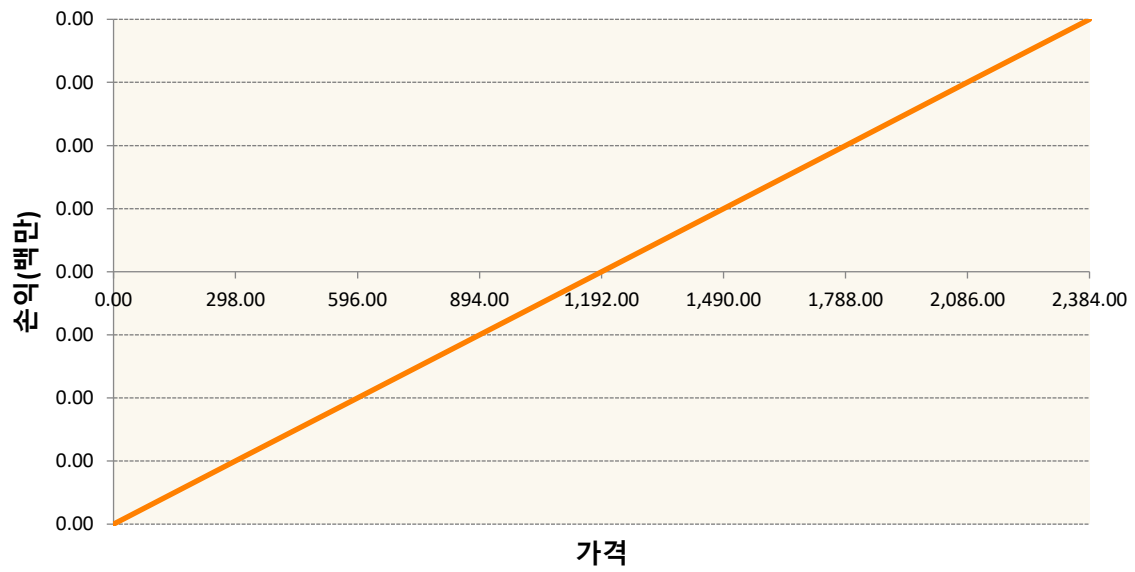




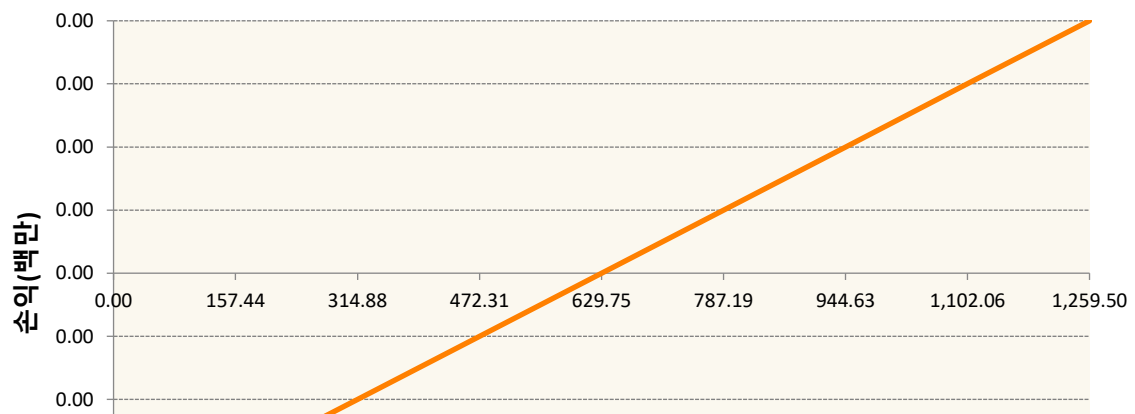
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

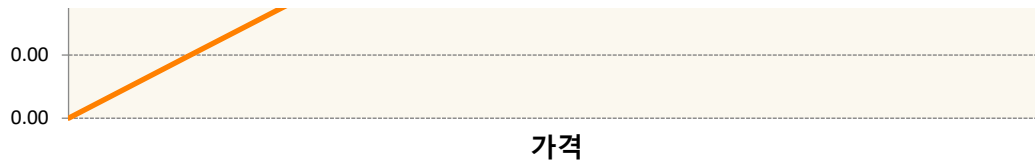


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-04-29
기준일	2026-04-28

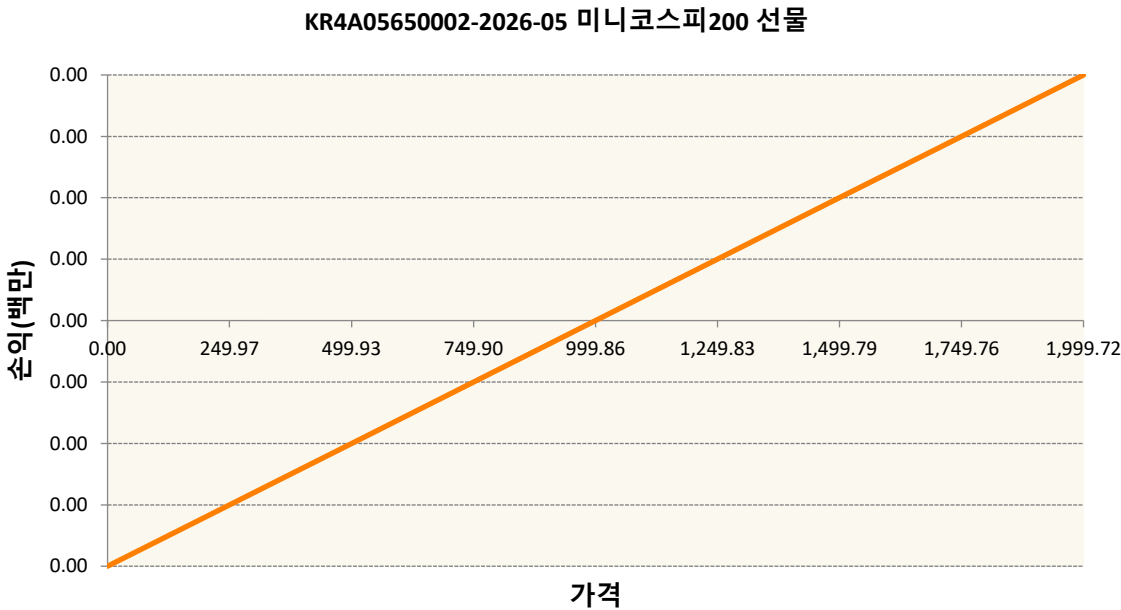
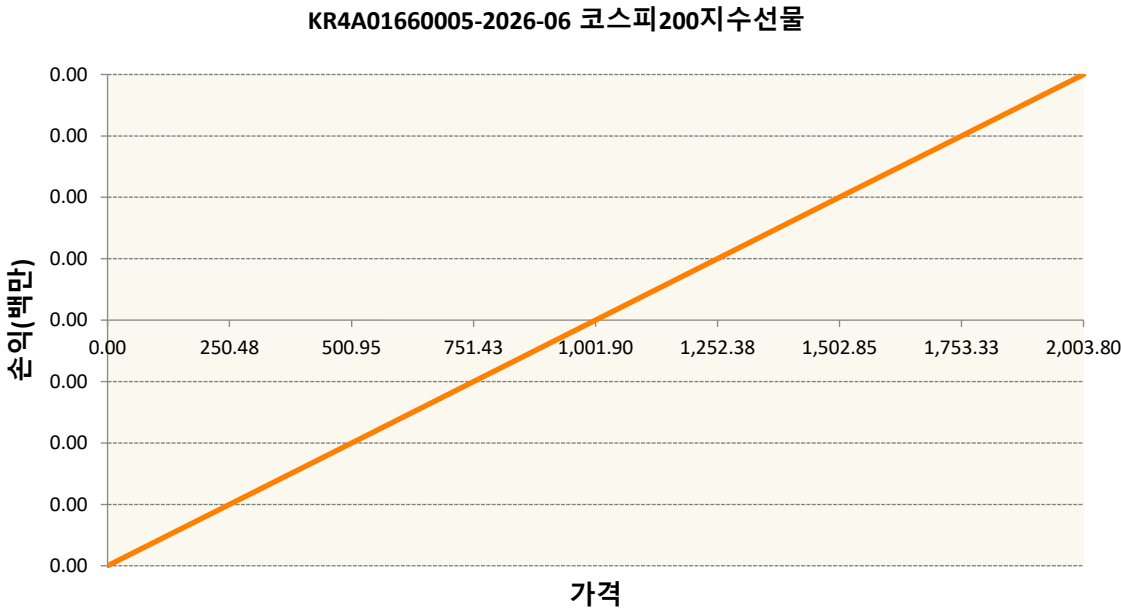
스마트인덱스모

1. 계약금액

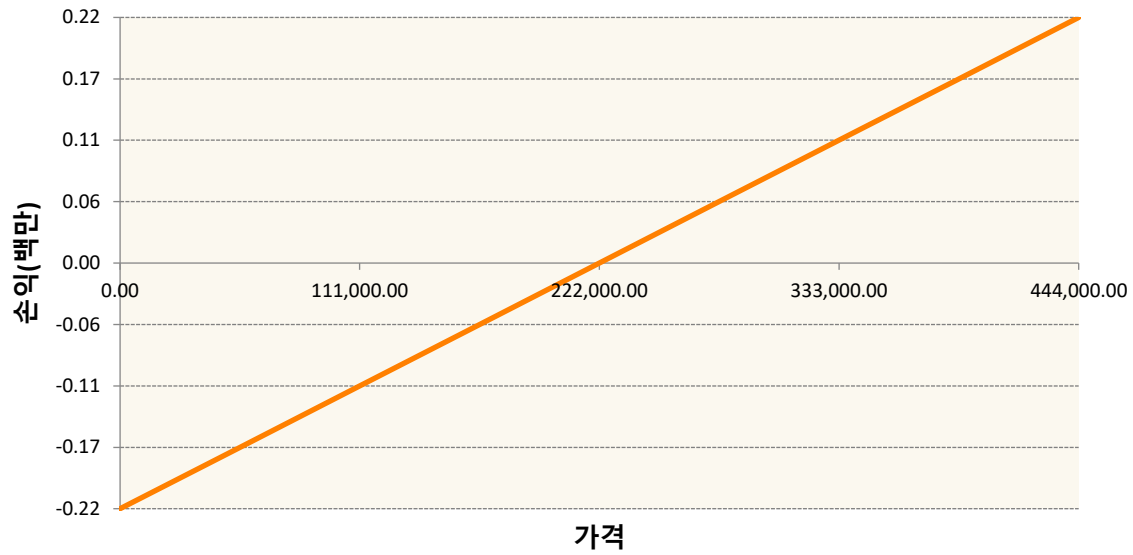
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	753	0	753	장내
누계	유가증권	선물	3,932	0	3,932	장내

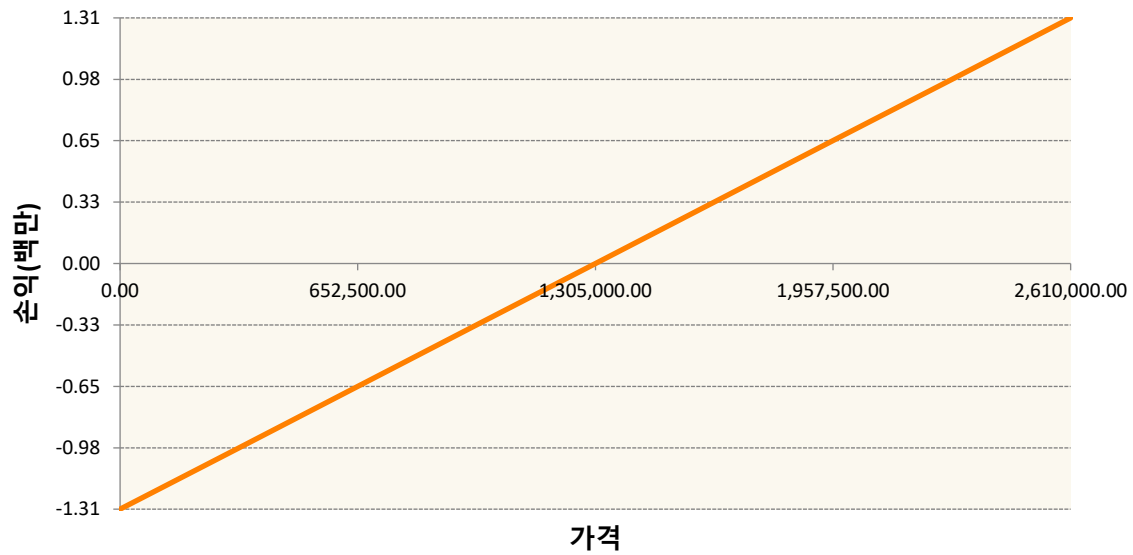
2. 만기시점의 손익구조



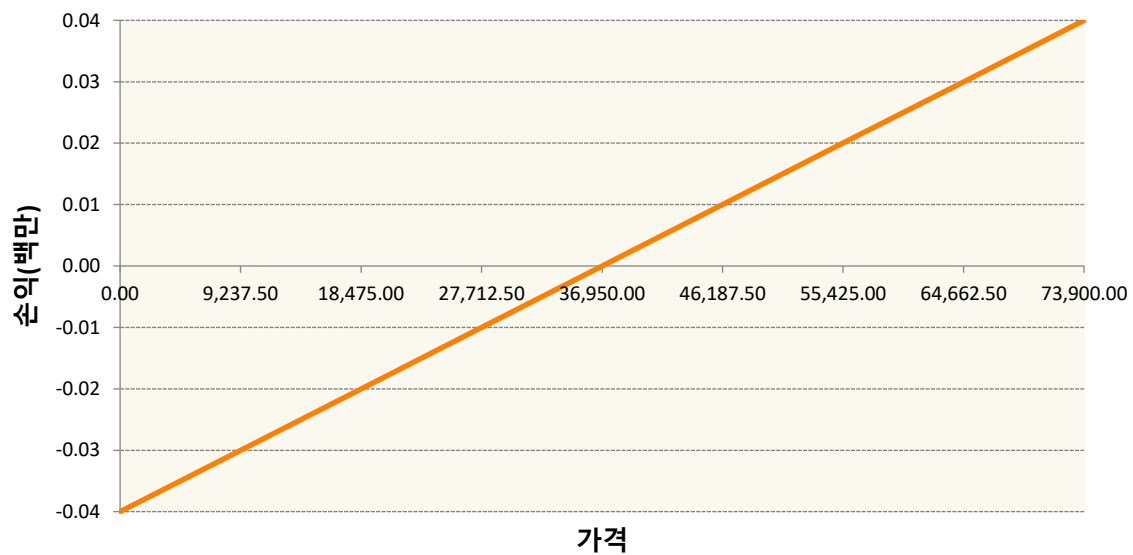
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		160	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160			
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107			
-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%	107	107	107	107	107	107	107			
8.00%	160	160	160	160	160	160	160			
KR4A05650002							2026-05 미니코스피200 선물		20	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20			
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13			
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	7	7	7	7	7	7	7			
5.33%	13	13	13	13	13	13	13			
8.00%	20	20	20	20	20	20	20			
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%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27			
-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%	27	27	27	27	27	27	27			
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%	-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		3	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-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%	3	3	3	3	3	3	3

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

(단위:백만원)

525

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

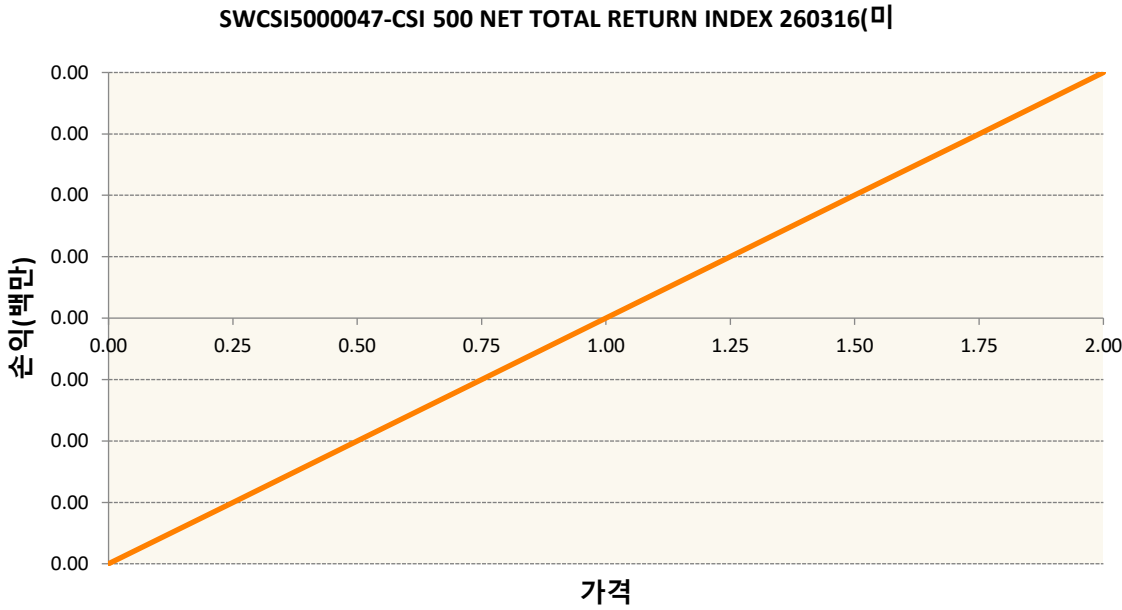
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

452

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

555

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

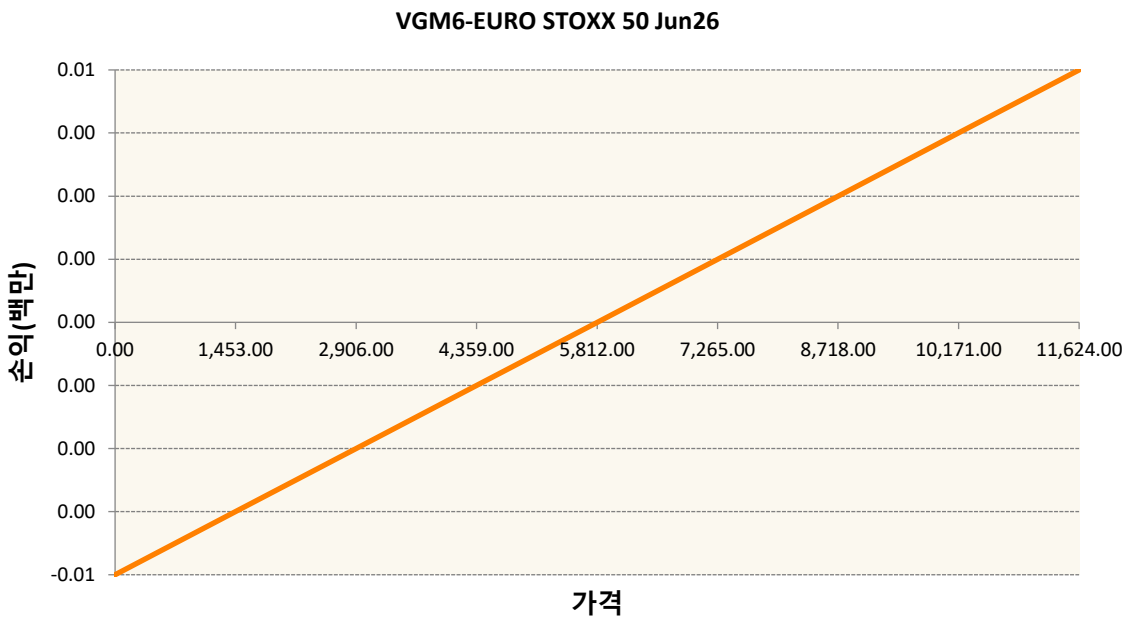
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	896	0	896	

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	2026-04-29
기준일	2026-04-28

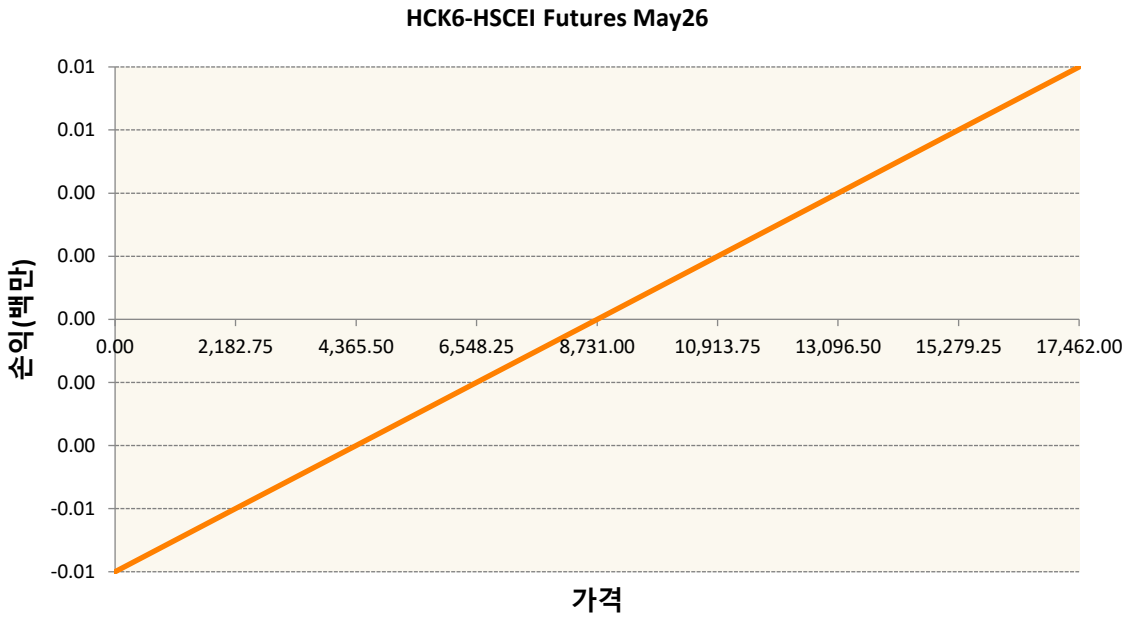
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,642	0	1,642	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK6	HSCEI Futures May26	131
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

159

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

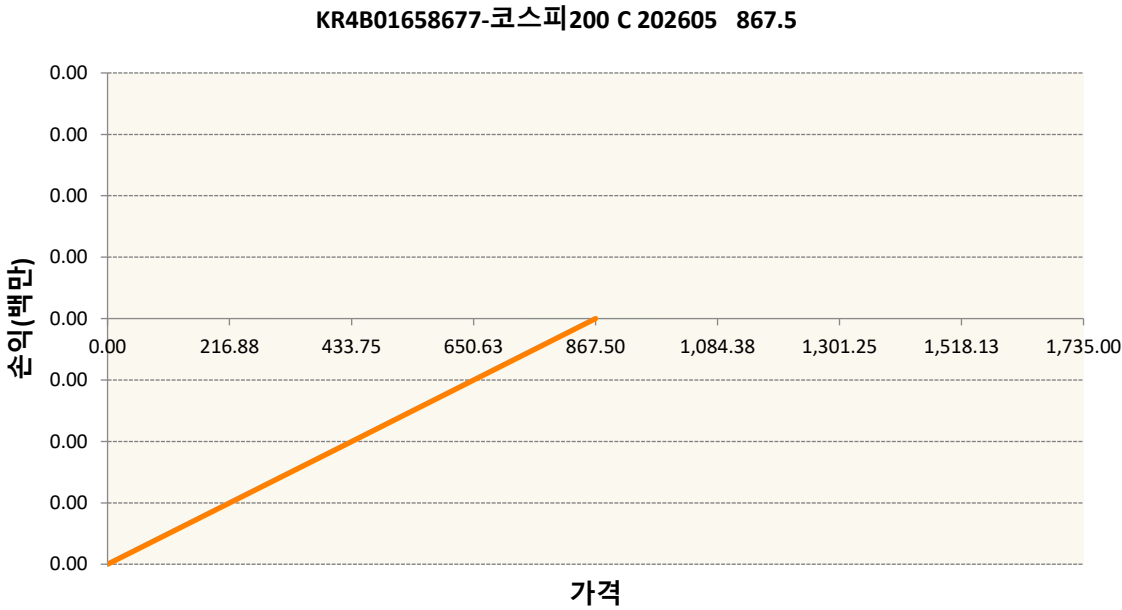
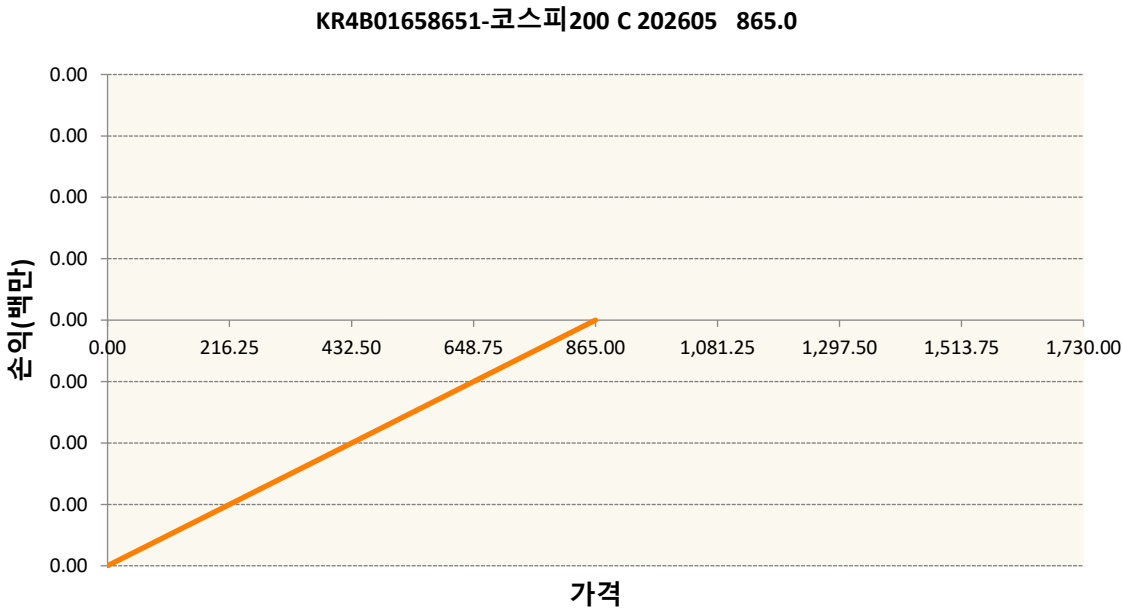
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

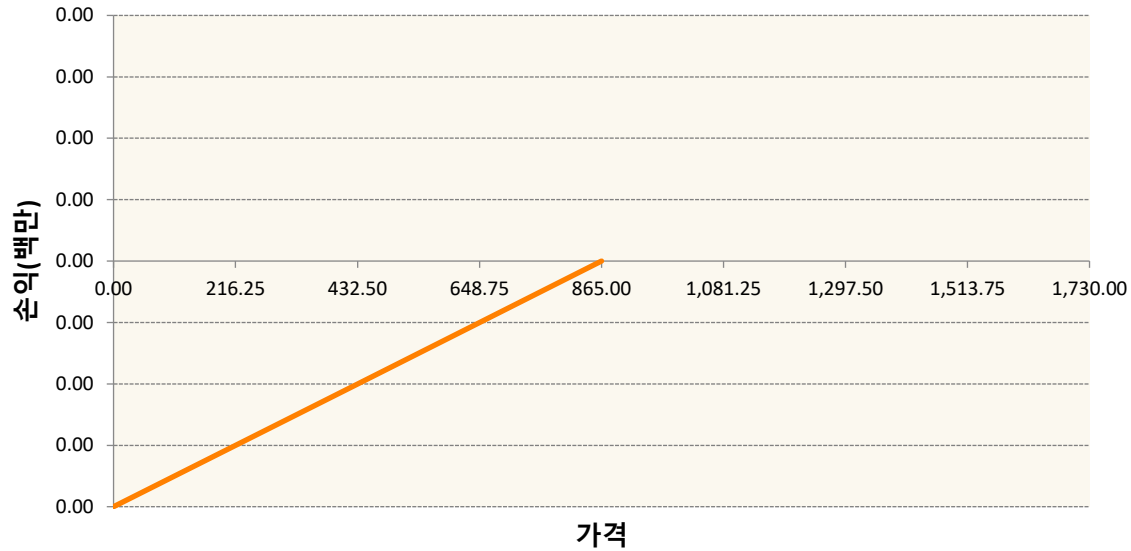
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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							476
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-167	-226	-287	-349	-412	-476
-5.33%	-11	-57	-106	-159	-214	-271	-329
-2.67%	50	16	-23	-66	-112	-161	-213
0%	85	62	33	0	-38	-79	-124
2.67%	105	90	70	45	15	-18	-55
5.33%	115	106	92	75	53	26	-4
8.00%	120	115	106	94	78	58	34
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							325
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-117	-157	-198	-239	-282	-325
-5.33%	-9	-40	-74	-110	-147	-185	-225
-2.67%	34	10	-16	-45	-77	-111	-146
0%	59	43	23	0	-26	-54	-84
2.67%	73	62	48	31	11	-12	-37
5.33%	80	74	64	52	37	19	-2
8.00%	84	80	74	66	54	40	24
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							189
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-44	-66	-90	-114	-139	-164	-189
-5.33%	-5	-23	-42	-63	-85	-108	-131
-2.67%	20	6	-9	-26	-45	-64	-85
0%	34	25	13	0	-15	-31	-49

2.67%	42	36	28	18	6	-7	-22
5.33%	46	42	37	30	21	10	-2
8.00%	48	46	42	37	31	23	13

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

(단위:백만원)

894

공시일 2026-04-29

기준일 2026-04-28

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	2026-04-29
기준일	2026-04-28

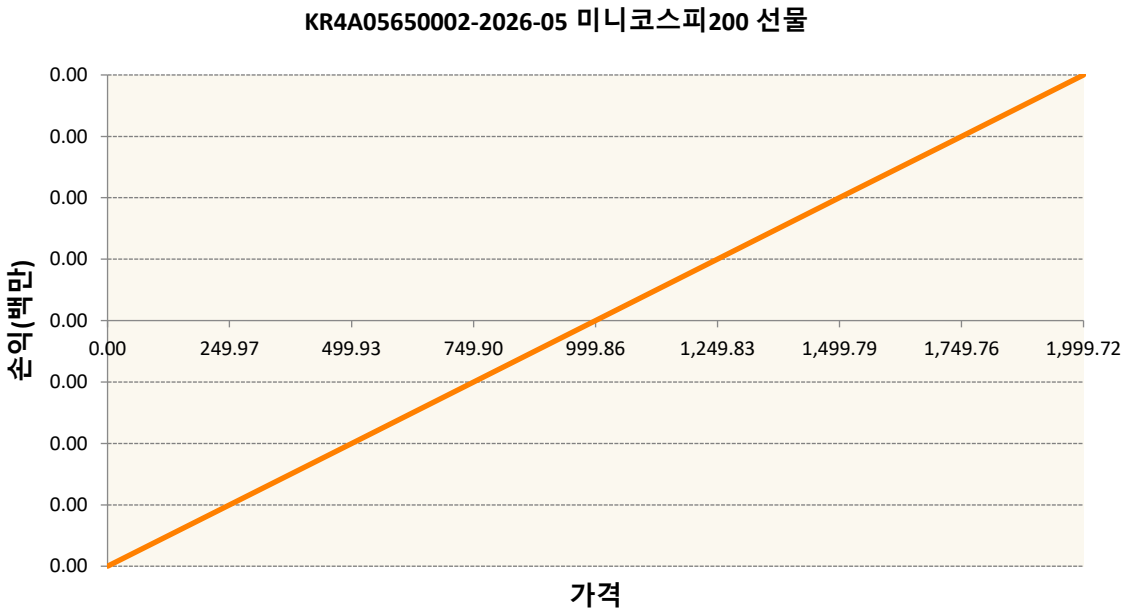
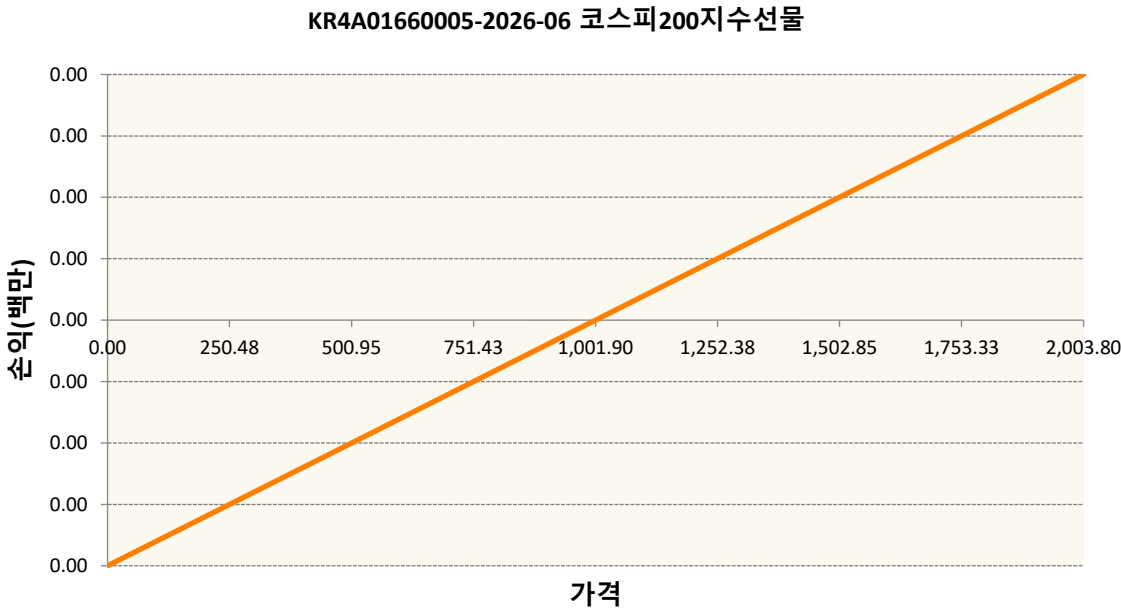
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

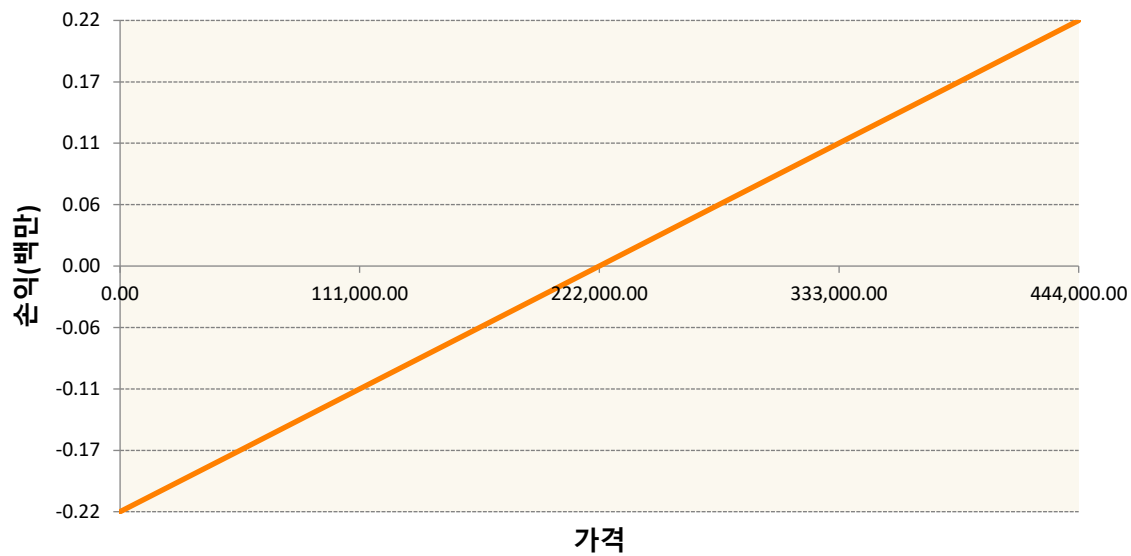
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	756	566	190	장내
누계	유가증권	선물	4,376	67	4,310	장내

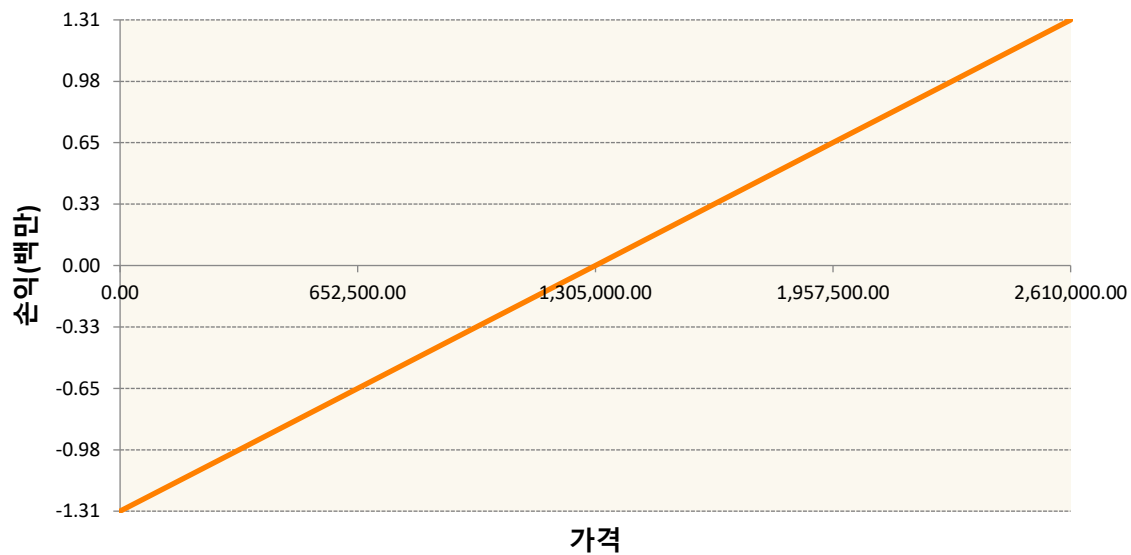
2. 만기시점의 손익구조



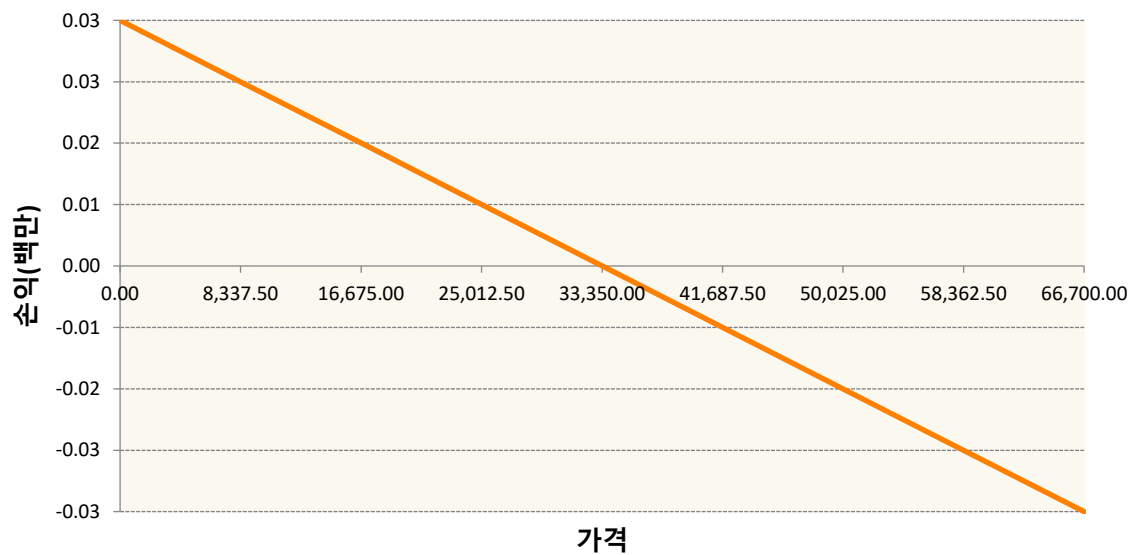
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AEB650008-2026-05 우리금융지주개별선물



(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%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67				
-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%	67	67	67	67	67	67	67				
8.00%	100	100	100	100	100	100	100				
KR4A05650002							2026-05 미니코스피200 선물		48		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48				
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32				
-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%	32	32	32	32	32	32	32				
8.00%	48	48	48	48	48	48	48				
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%	-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				
KR4AEB650008							2026-05 우리금융지주개별선물		5		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-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%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

347

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

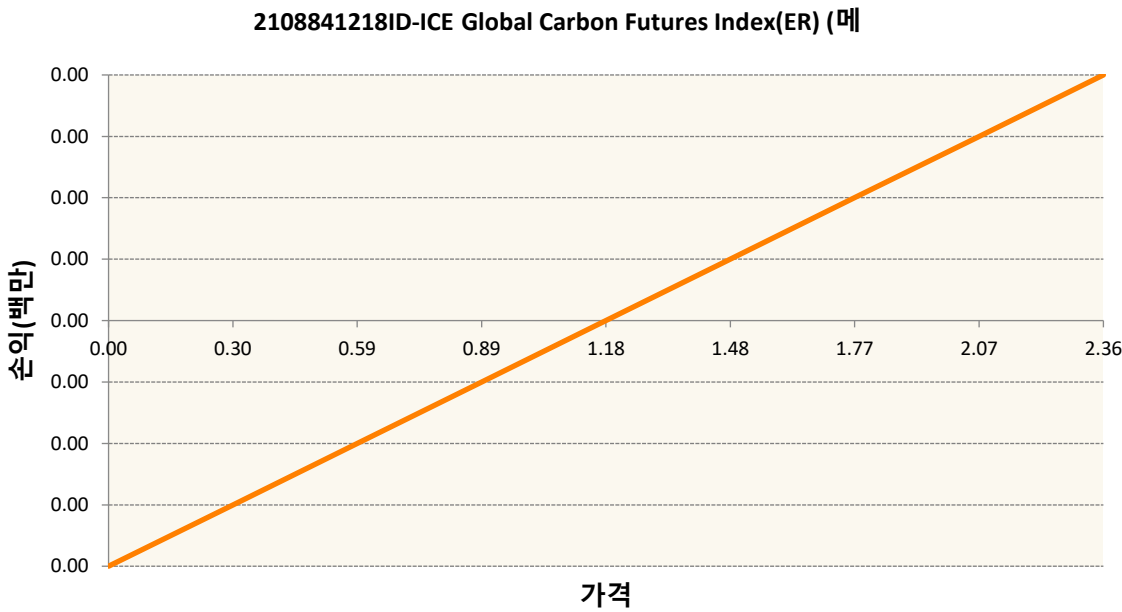
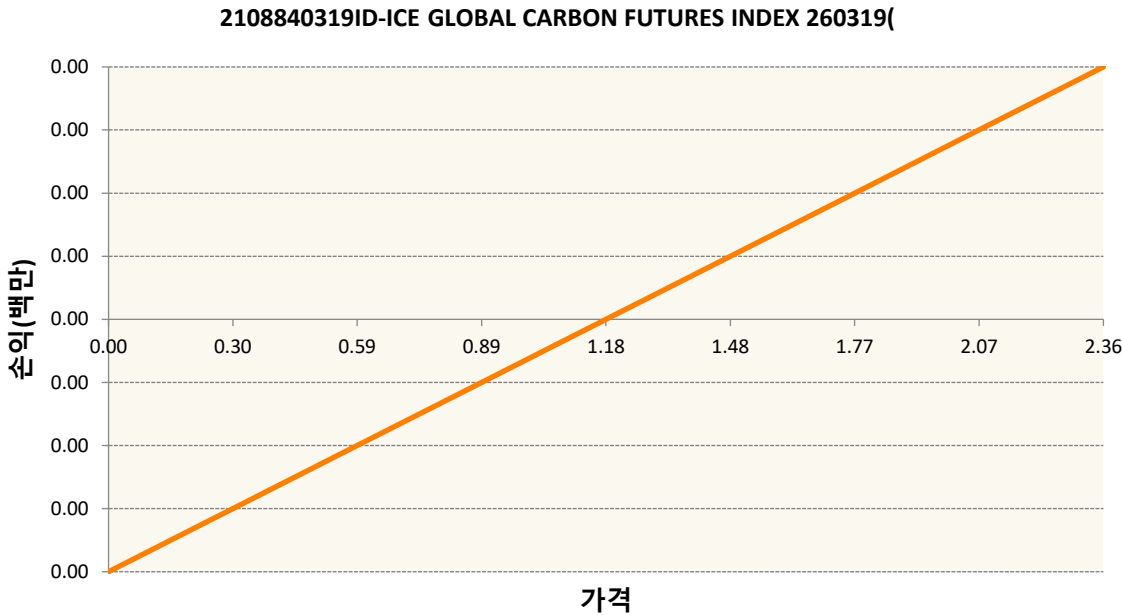
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,781	0	6,781	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		434
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		109

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	618

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

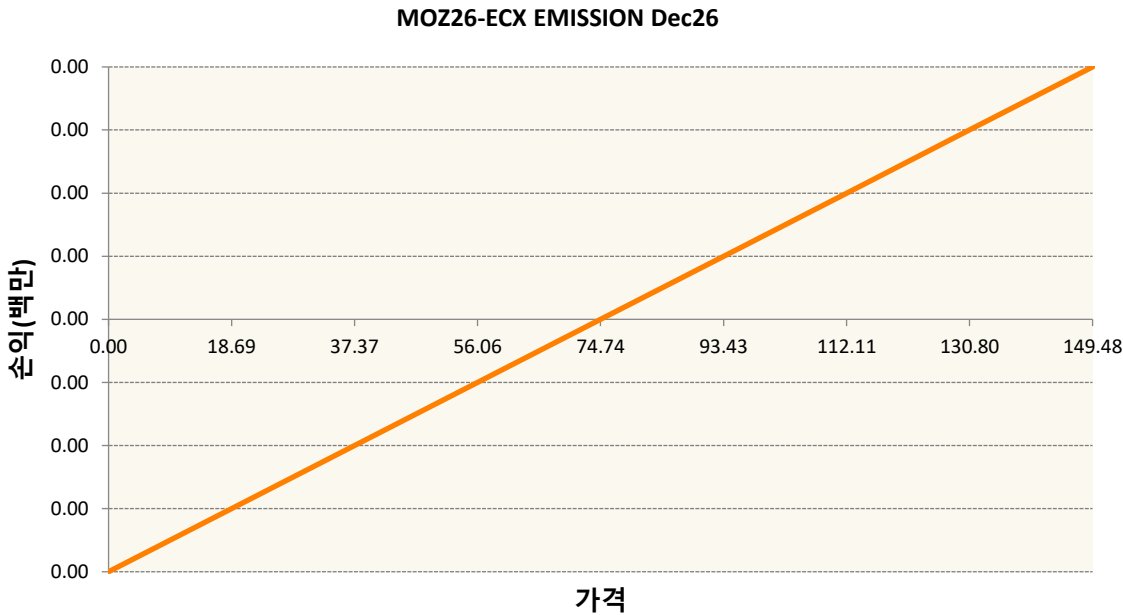
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,824	0	4,824	
누계	통화	선도	0	2,184	-2,184	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E)	175
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	386

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

(단위:백만원)

661

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

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	1,648	0	1,648	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	11
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	7
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	18
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	7

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

(단위:백만원)

65

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

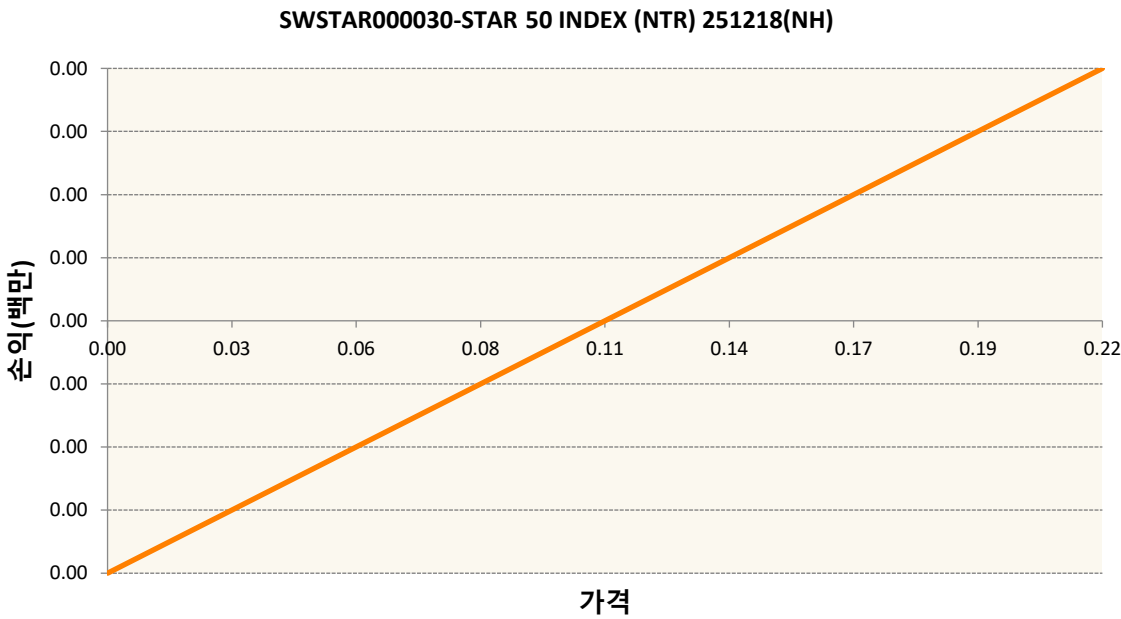
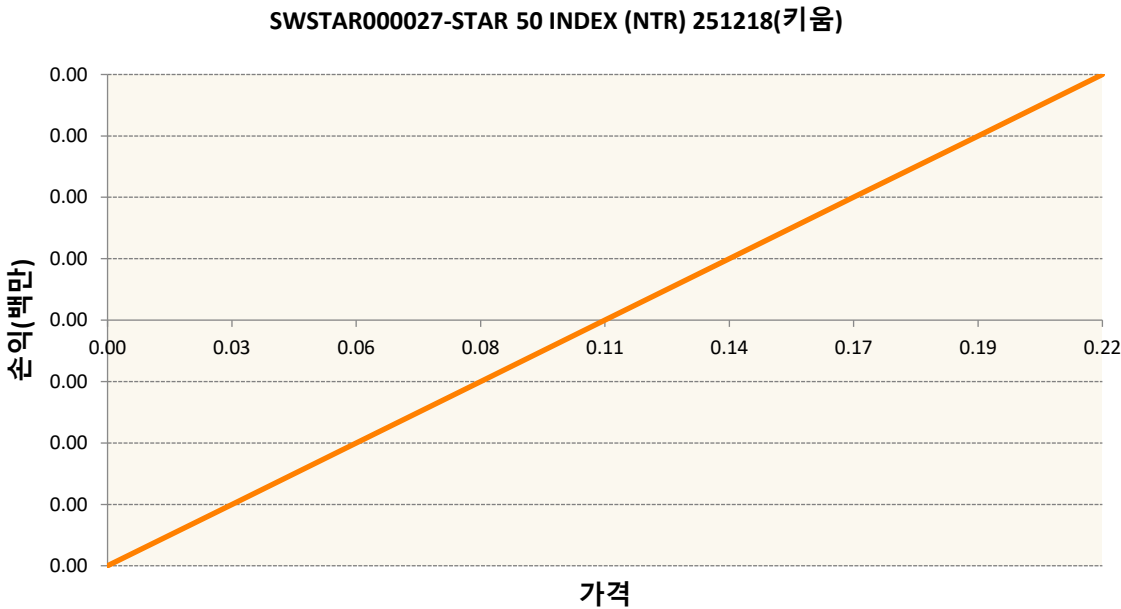
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

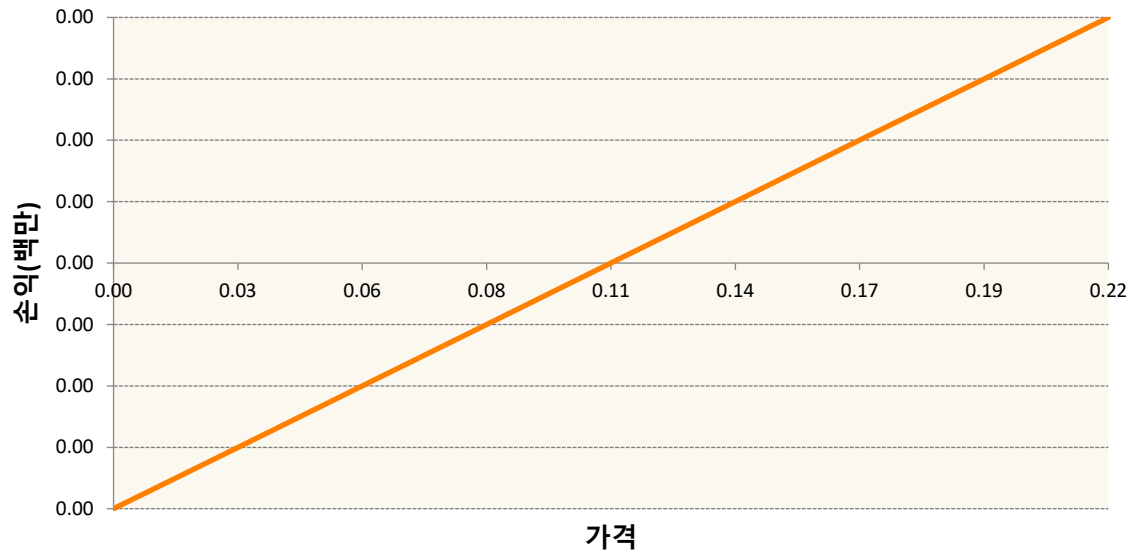
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,782	0	2,782	장외

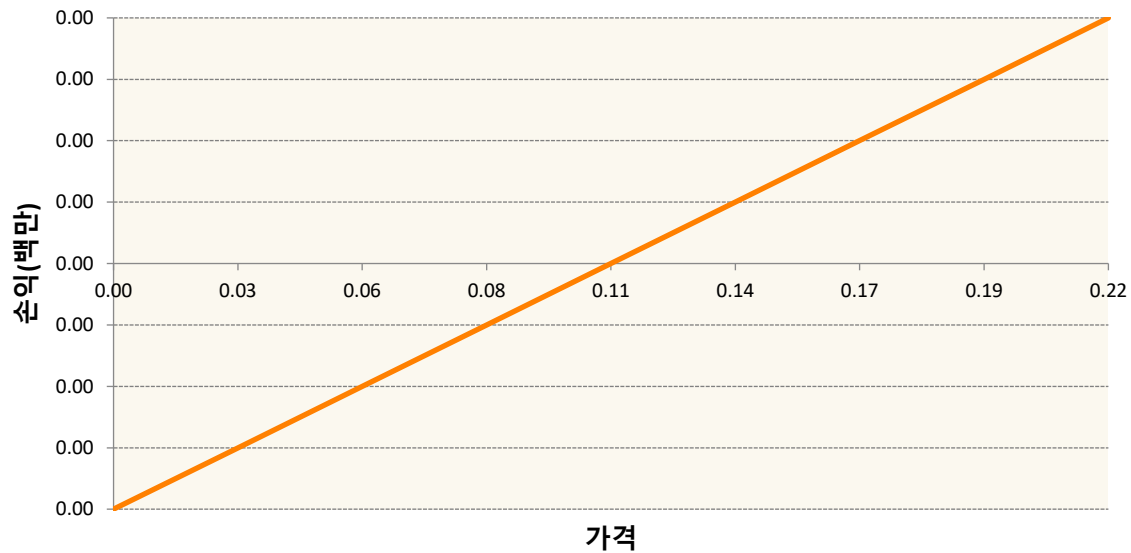
2. 만기시점의 손익구조



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)	8
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	27
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	137
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	51

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

(단위:백만원)

334

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

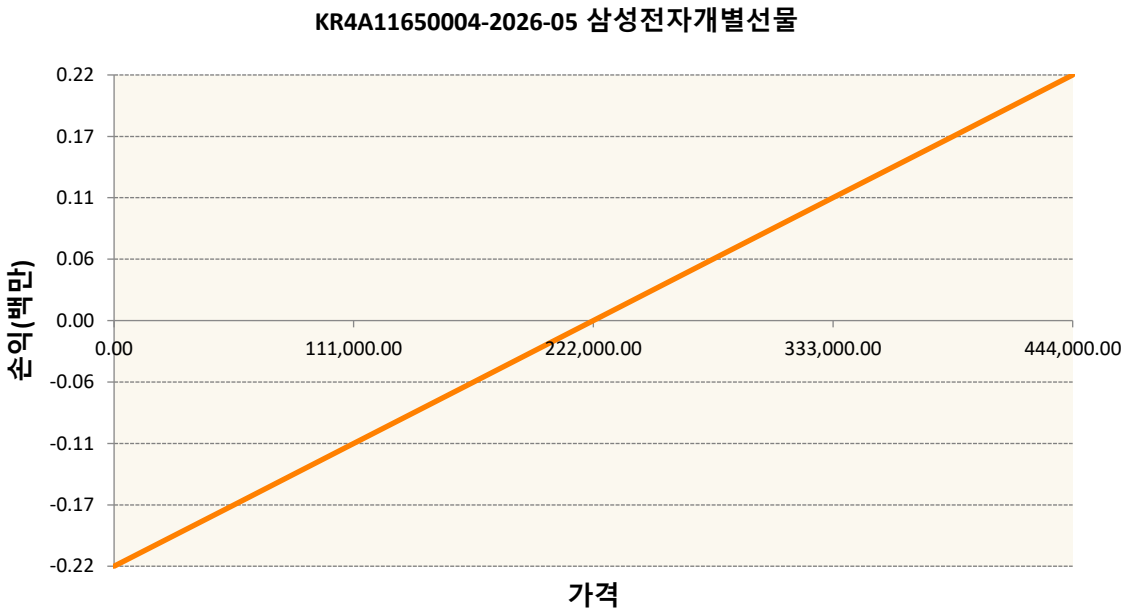
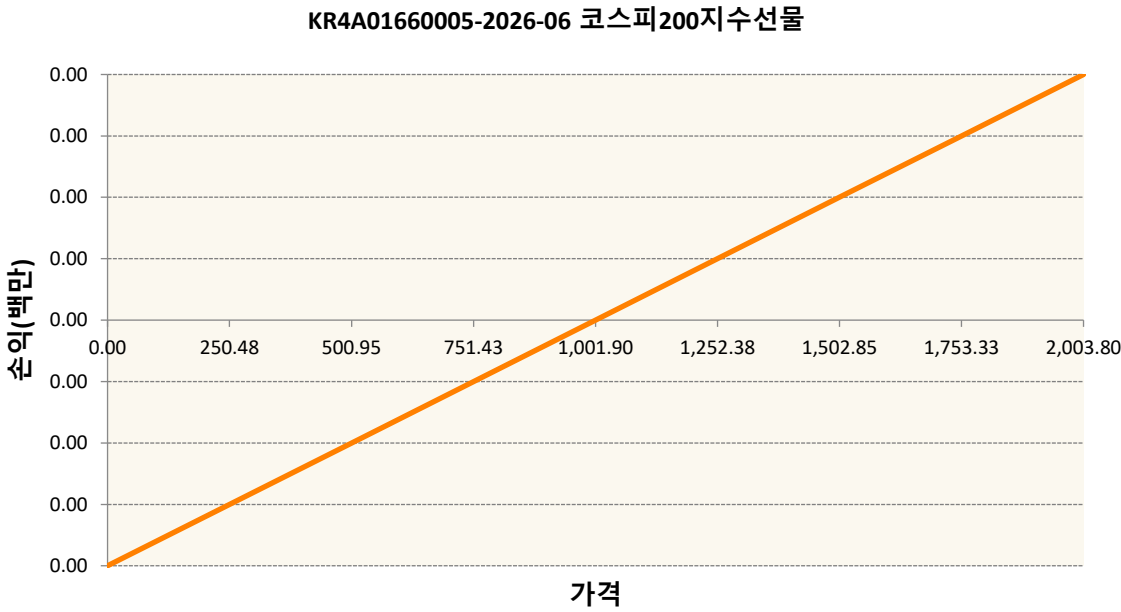
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

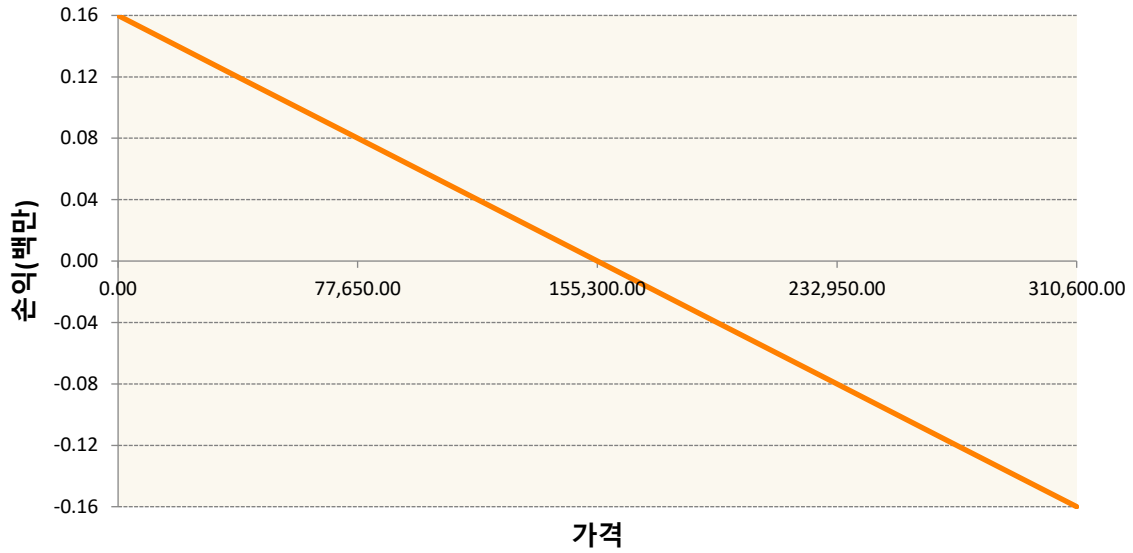
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,263	-2,263	장내
누계	유가증권	선물	30,492	4,839	25,653	장내

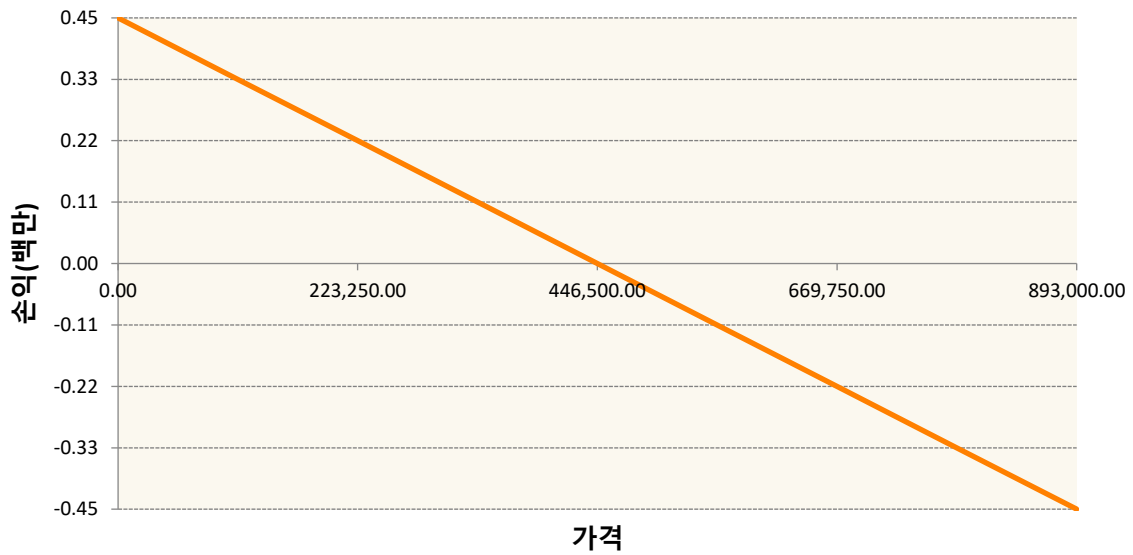
2. 만기시점의 손익구조



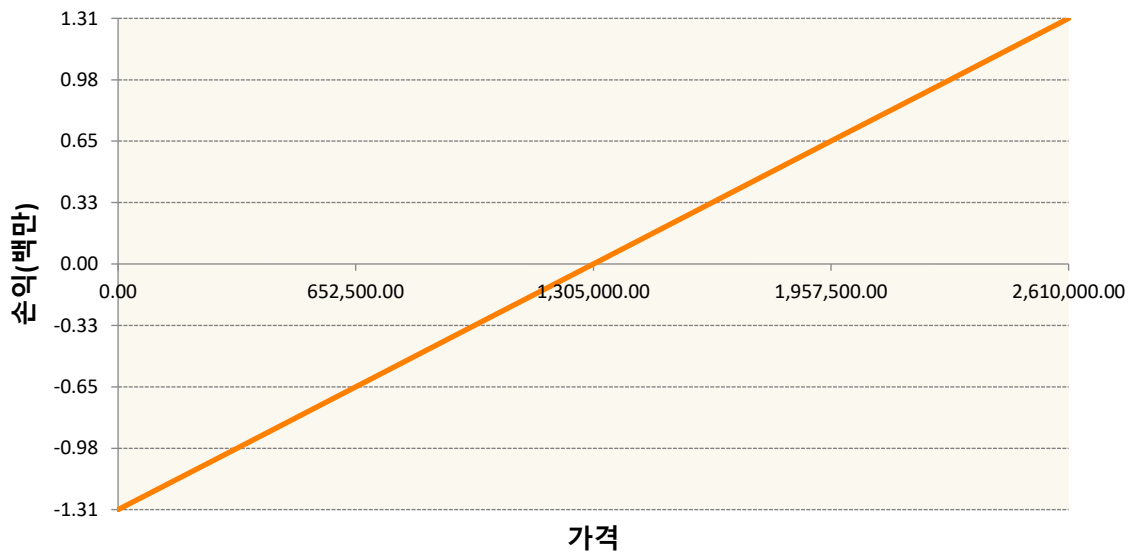
KR4A19650006-2026-05 기아개별선물



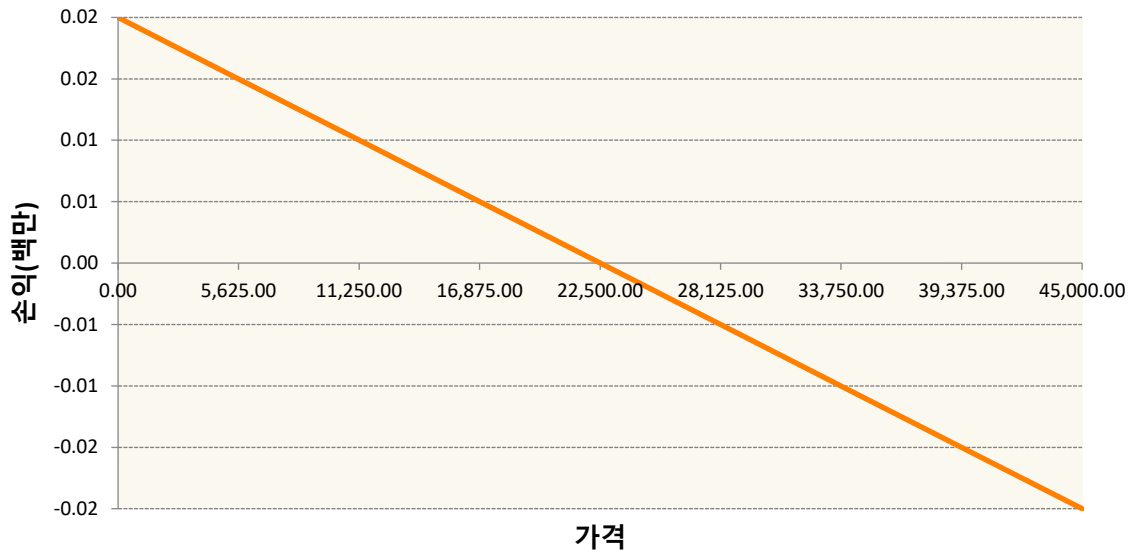
KR4A20650003-2026-05 현대모비스개별선물



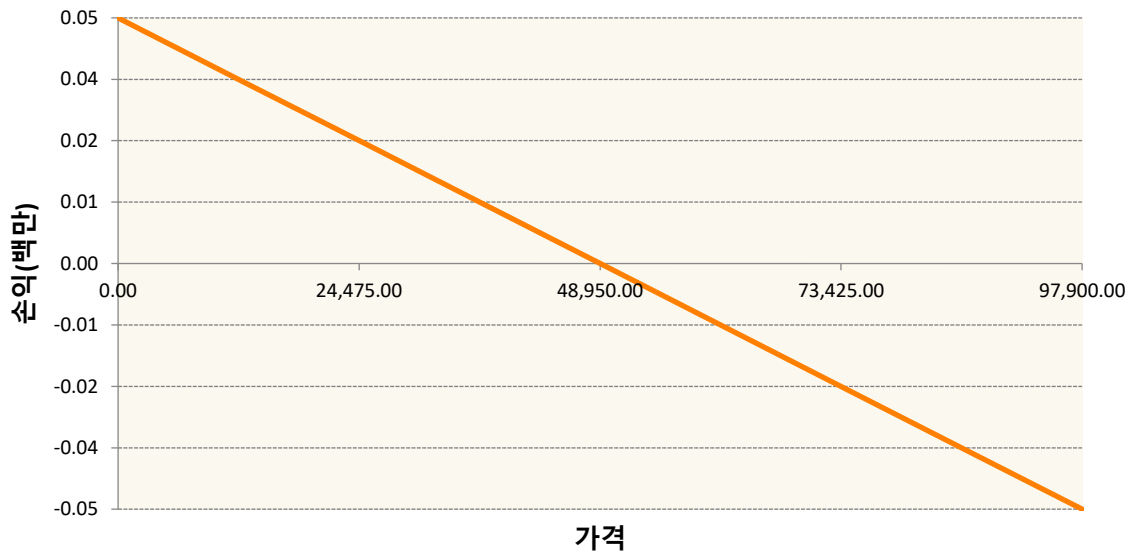
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



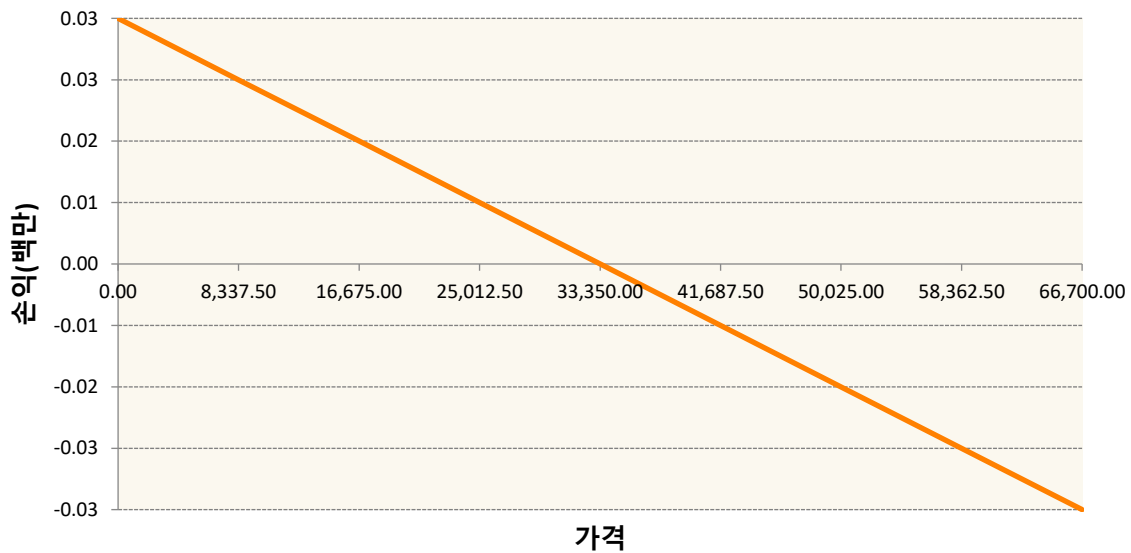
KR4AB4650001-2026-05 기업은행개별선물



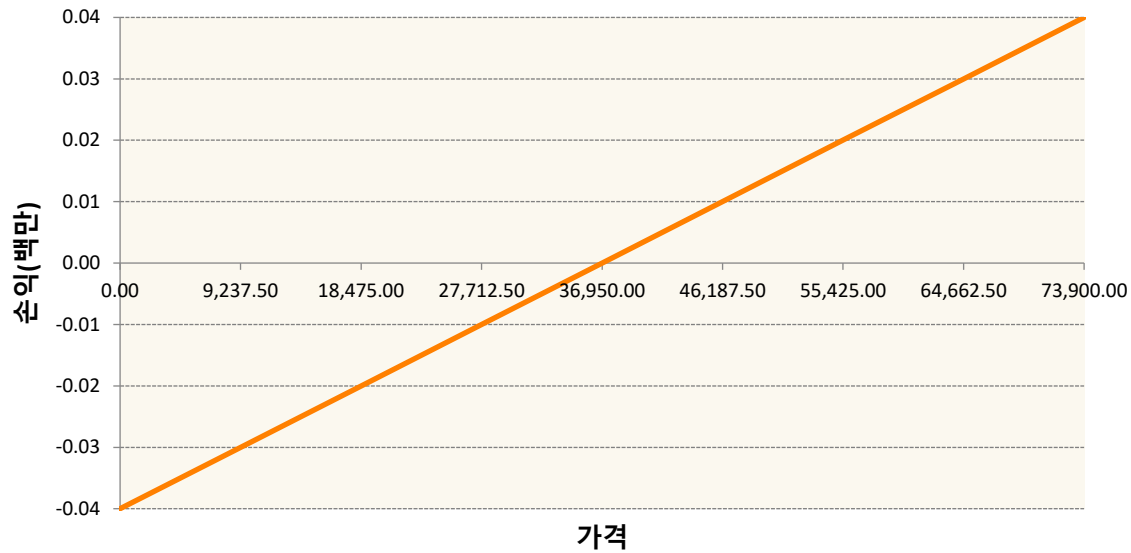
KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



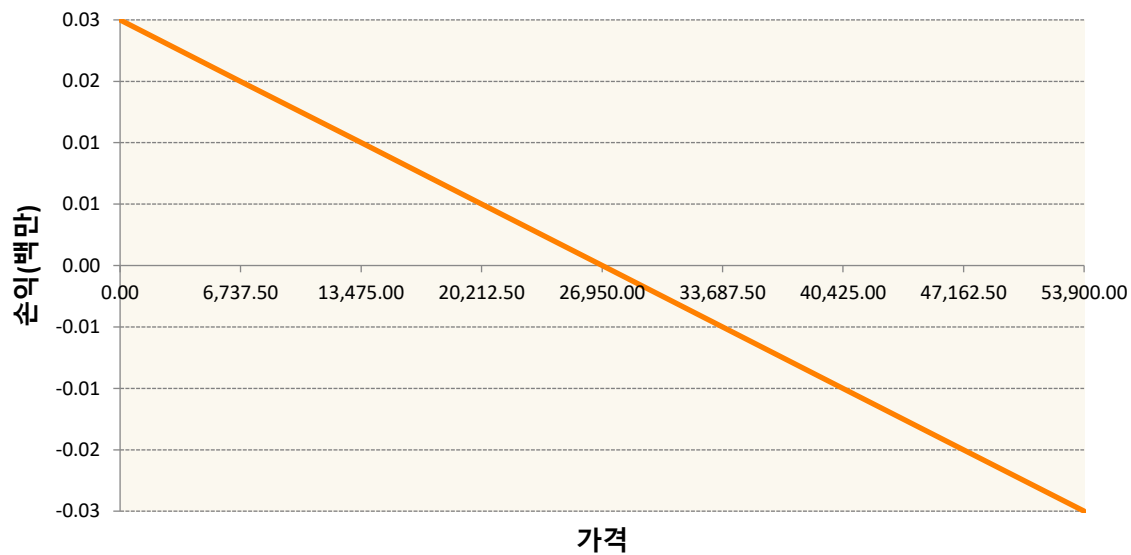
KR4AEB650008-2026-05 우리금융지주개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



KR4AGJ650008-2026-05 JB금융지주개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				2,058
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-2,058	-2,058	-2,058	-2,058	-2,058	-2,058	-2,058	
-5.33%	-1,372	-1,372	-1,372	-1,372	-1,372	-1,372	-1,372	
-2.67%	-686	-686	-686	-686	-686	-686	-686	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	686	686	686	686	686	686	686	
5.33%	1,372	1,372	1,372	1,372	1,372	1,372	1,372	
8.00%	2,058	2,058	2,058	2,058	2,058	2,058	2,058	
KR4A11650004				2026-05 삼성전자개별선물				183
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-5.33%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-2.67%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	61	61	61	61	61	61	61
5.33%	122	122	122	122	122	122	122
8.00%	183	183	183	183	183	183	183
KR4A19650006 2026-05 기아개별선물							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

KR4A20650003 2026-05 현대모비스개별선물							61
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	61	61	61	61	61	61
-5.33%	41	41	41	41	41	41	41
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
5.33%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61

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%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-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%	75	75	75	75	75	75	75
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%	19	19	19	19	19	19	19
-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%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28

KR4ACF650006 2026-05 카카오개별선물 125

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	125	125	125	125	125	125	125
-5.33%	83	83	83	83	83	83	83
-2.67%	42	42	42	42	42	42	42
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
8.00%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125

KR4AEB650008 2026-05 우리금융지주개별선물 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 80

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80

KR4AGJ650008 2026-05 JB금융지주개별선물 33

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	33	33	33	33	33	33	33
-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%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33

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

(단위:백만원)

5,876

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

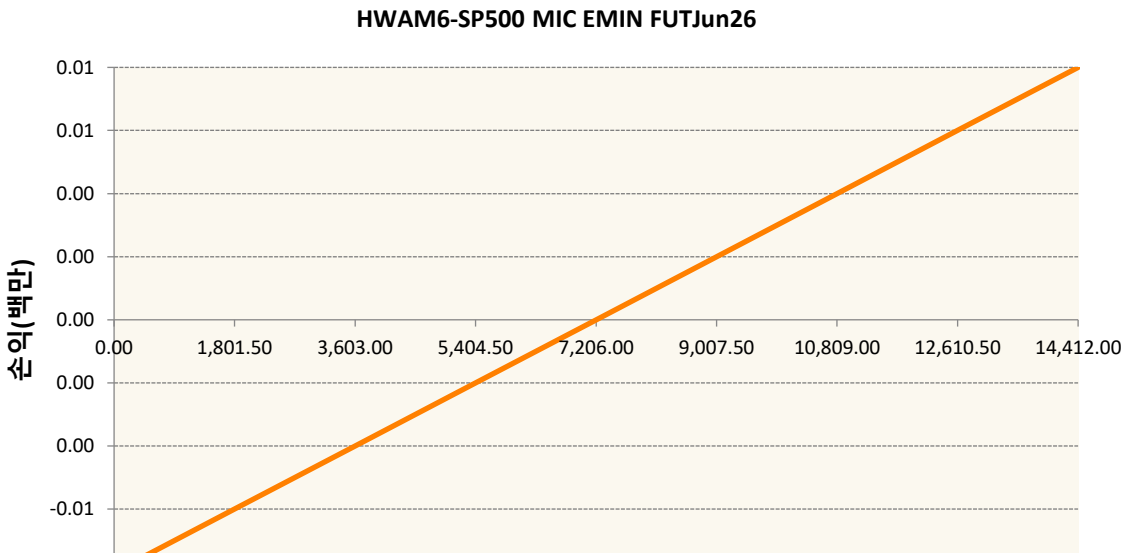
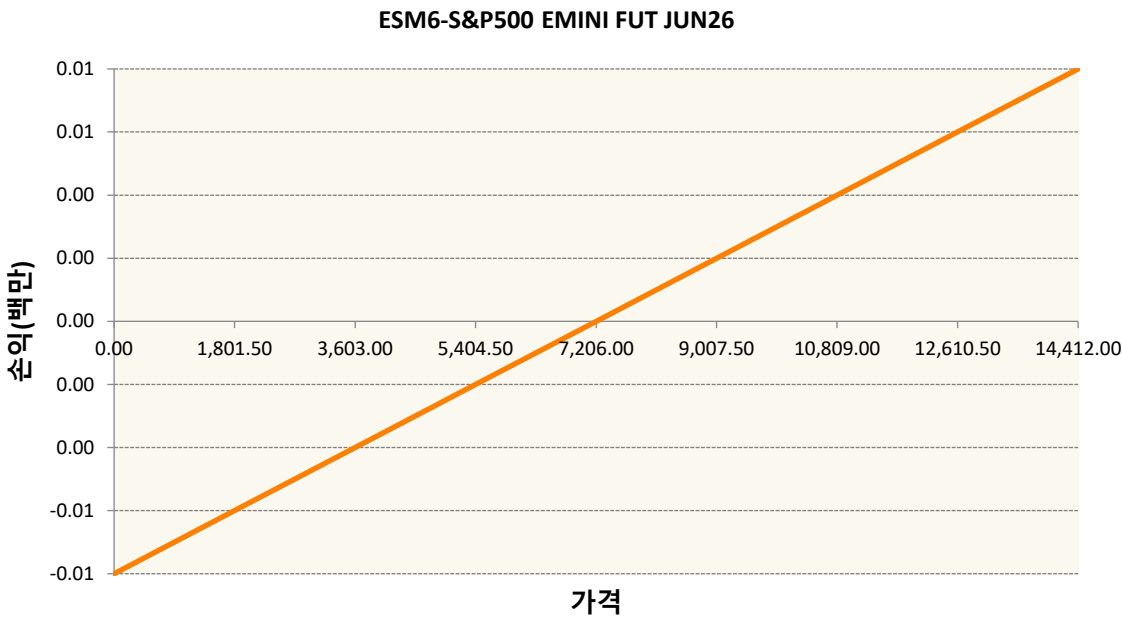
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

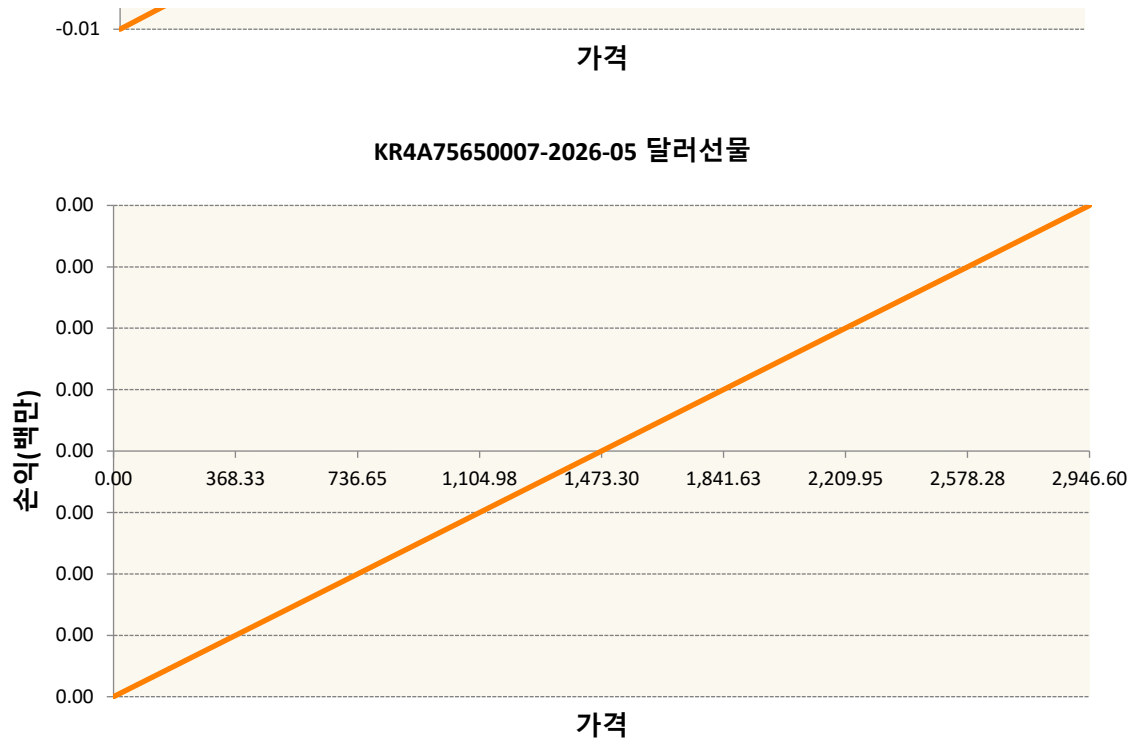
1. 계약금액

(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	57,267	0	57,267	
누계	지수	선물	268	0	268	장내
누계	통화	선물	10,460	0	10,460	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,581
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		21
KR4A756500 2026-05 달러선물			837

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,004

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

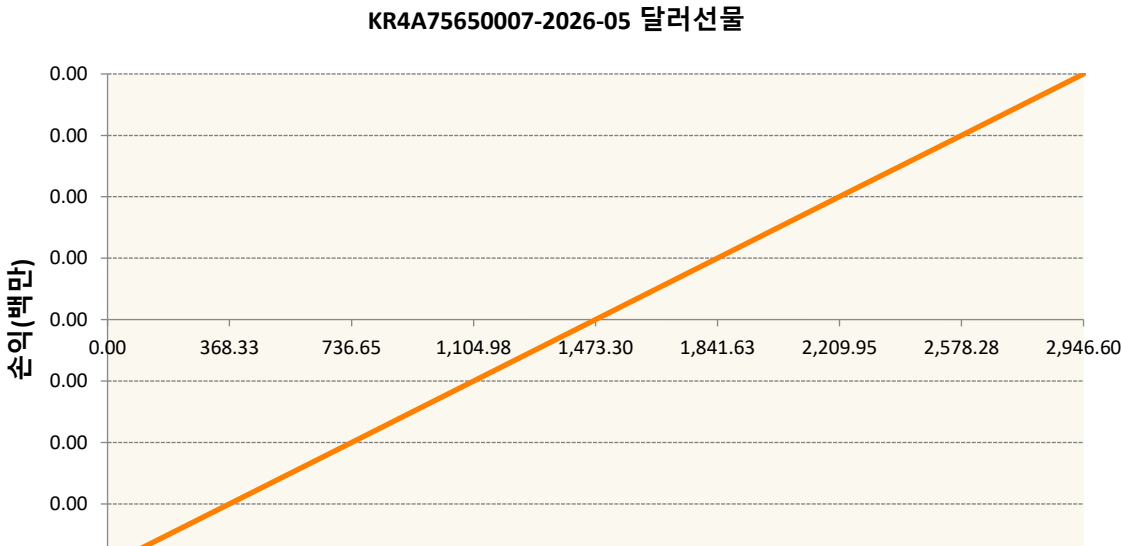
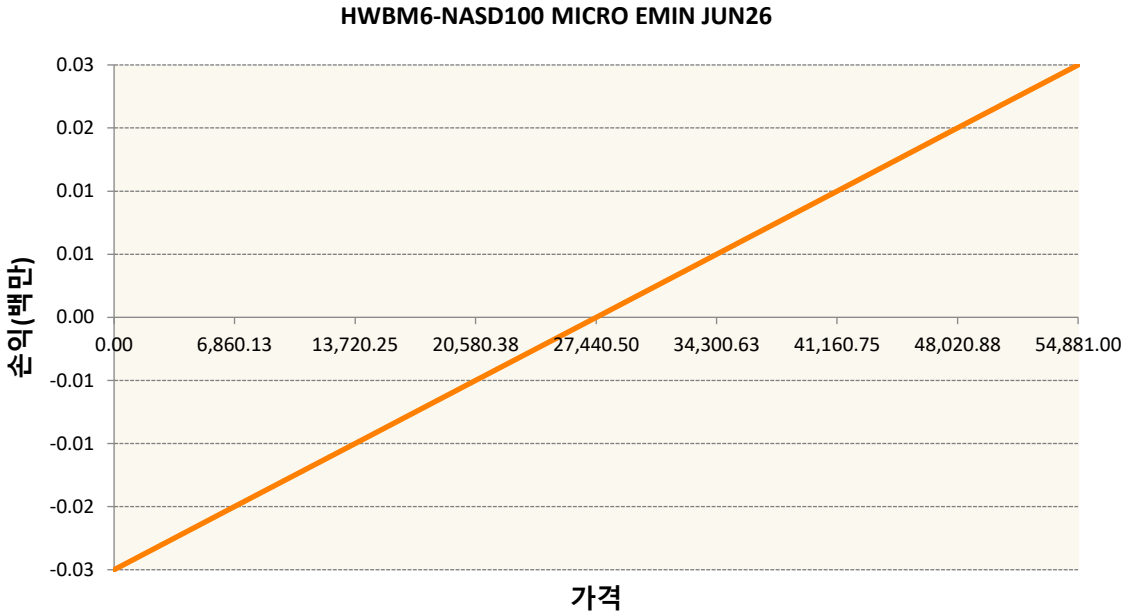
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

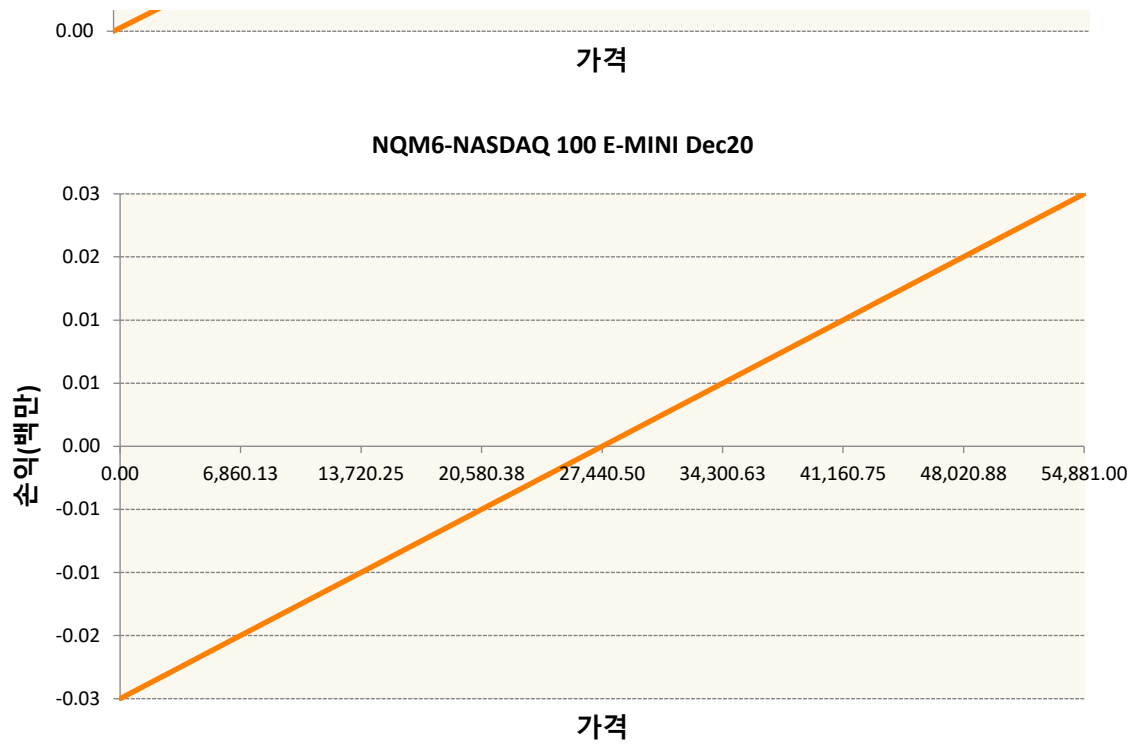
1. 계약금액

(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	25,495	0	25,495	
누계	유가증권	선물	408	0	408	장내
누계	통화	선물	3,845	0	3,845	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26		33
KR4A756500	2026-05 달러선물		308
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		2,040

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,275

공시일	2026-04-29
기준일	2026-04-28

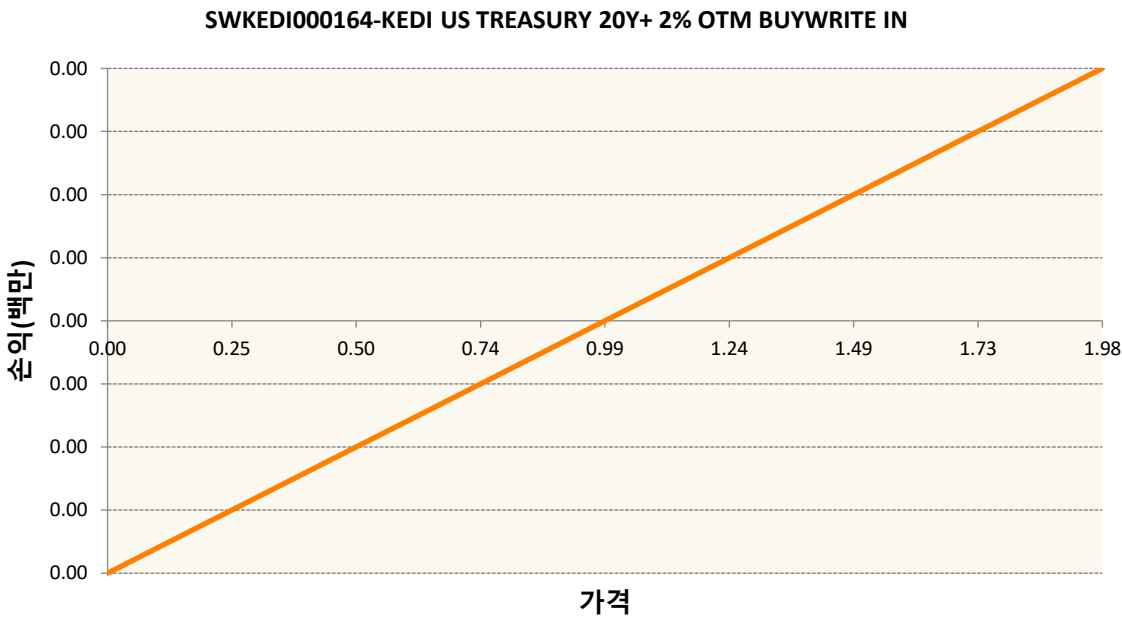
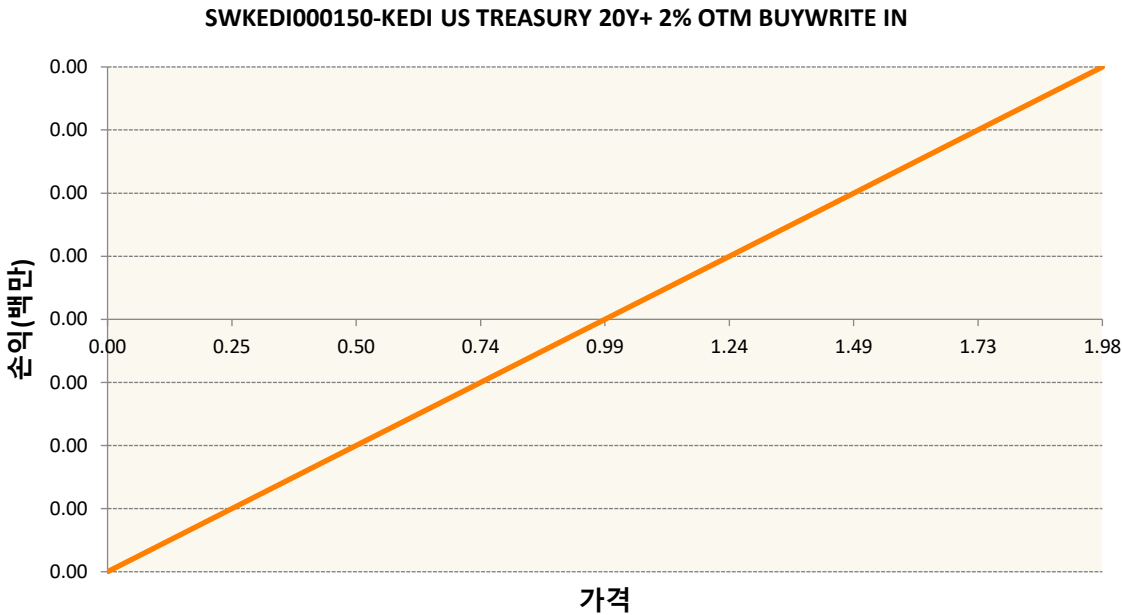
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

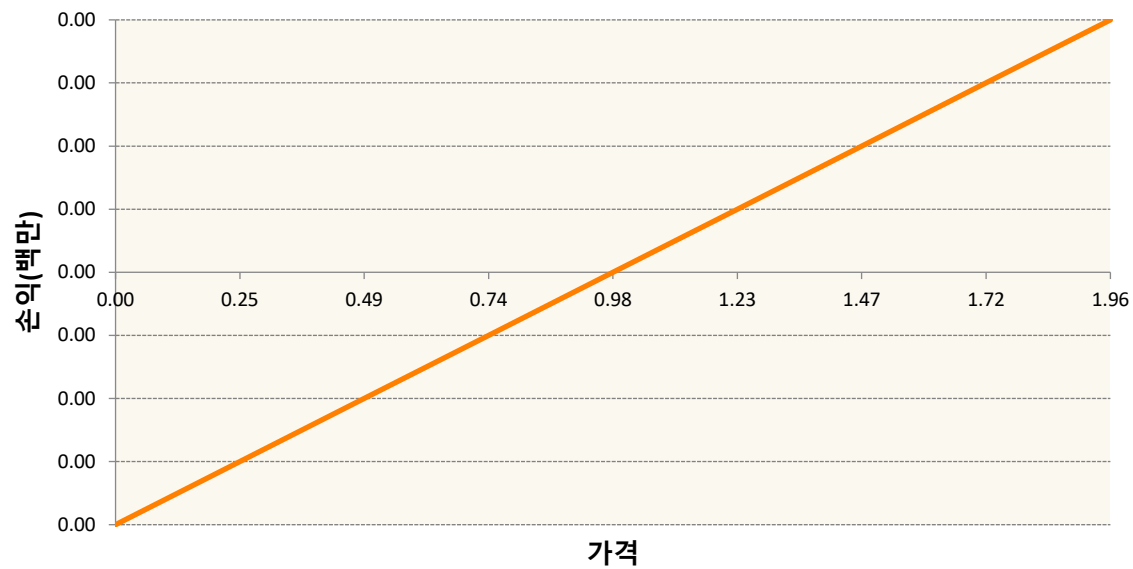
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	354,981	0	354,981	장외

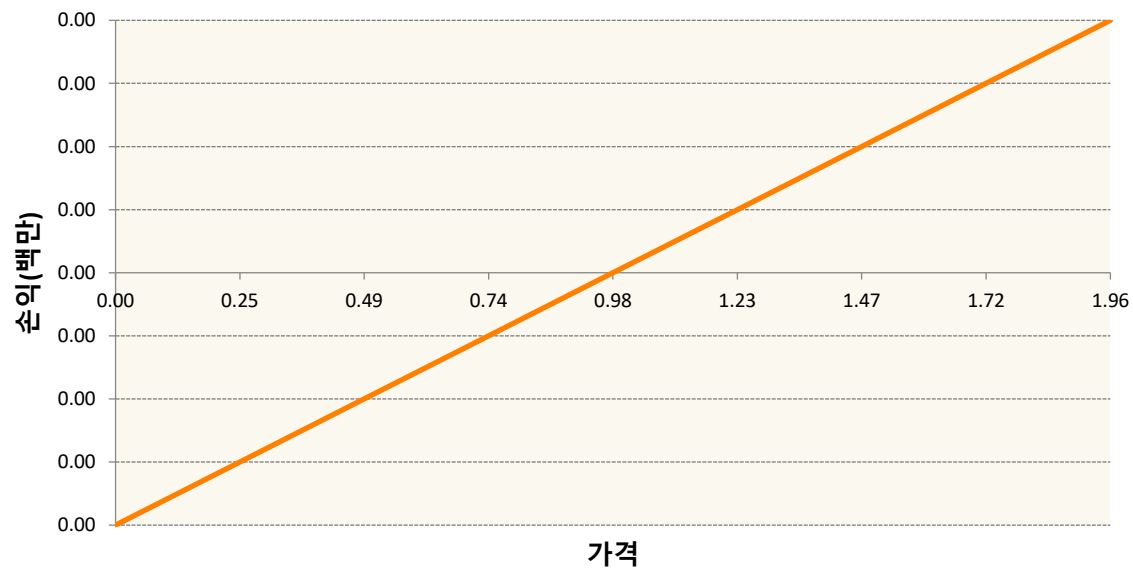
2. 만기시점의 손익구조



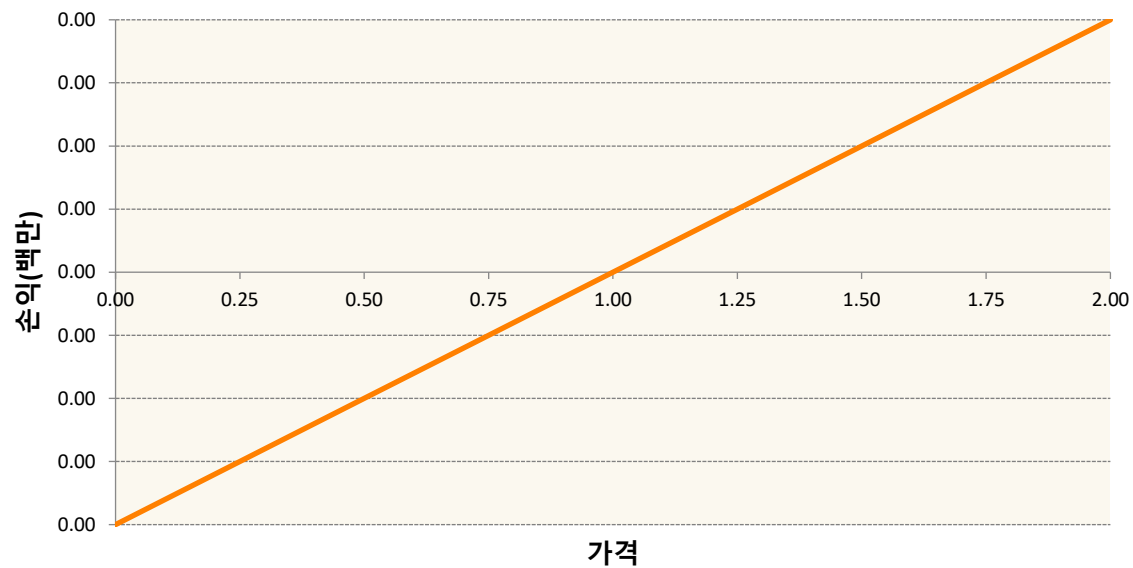
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,262
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		151
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,667
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,392
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,874

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,163