

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

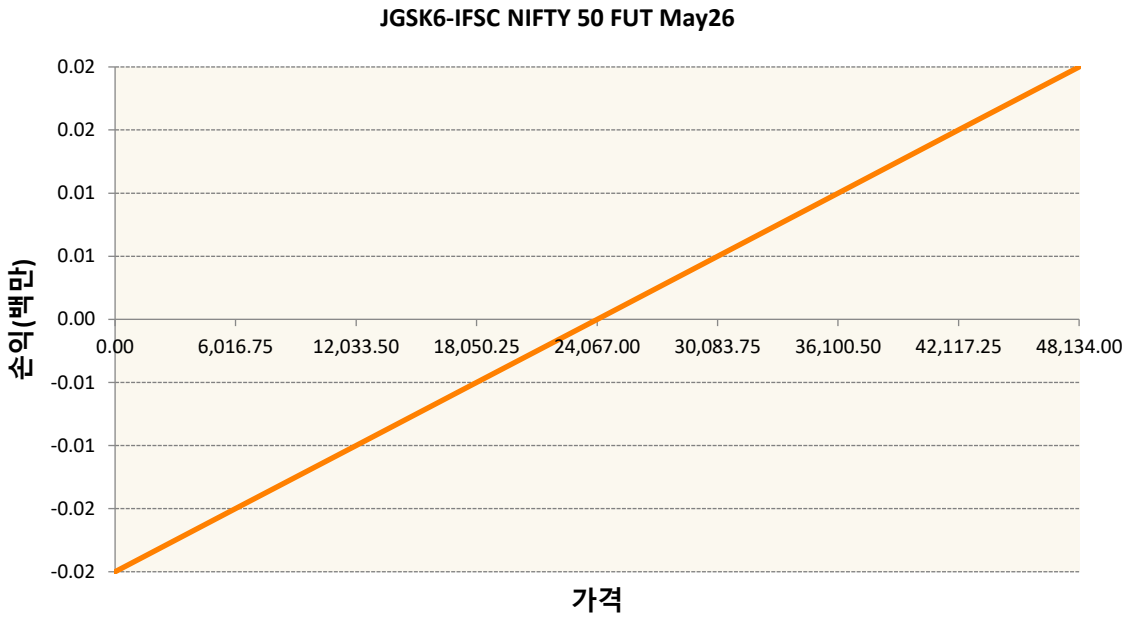
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	357	0	357	

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	2026-04-30
기준일	2026-04-29

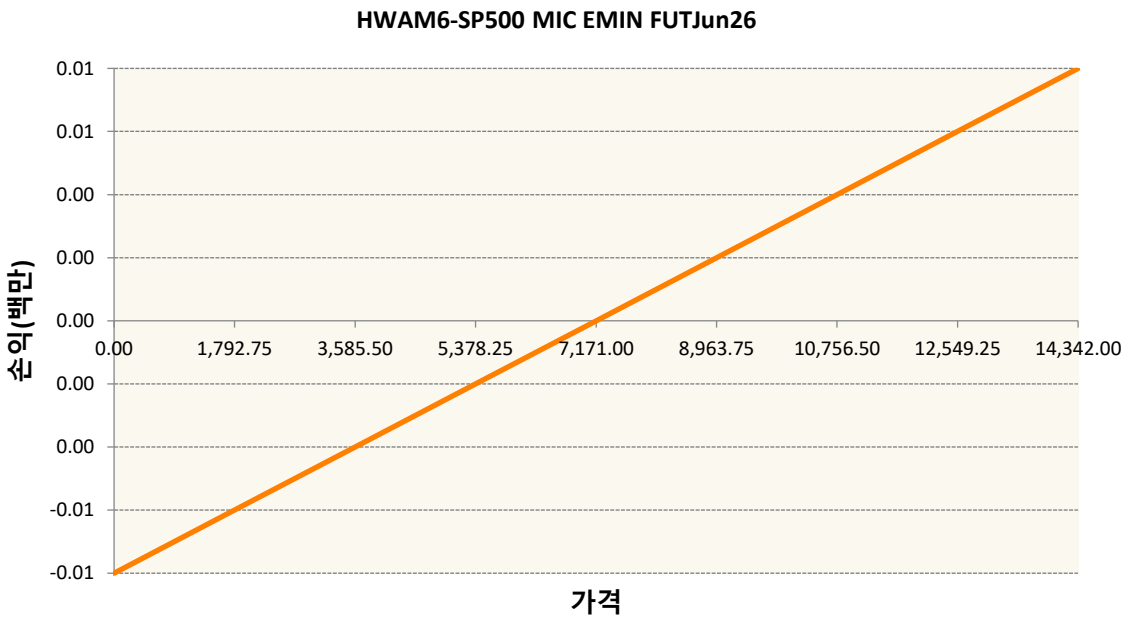
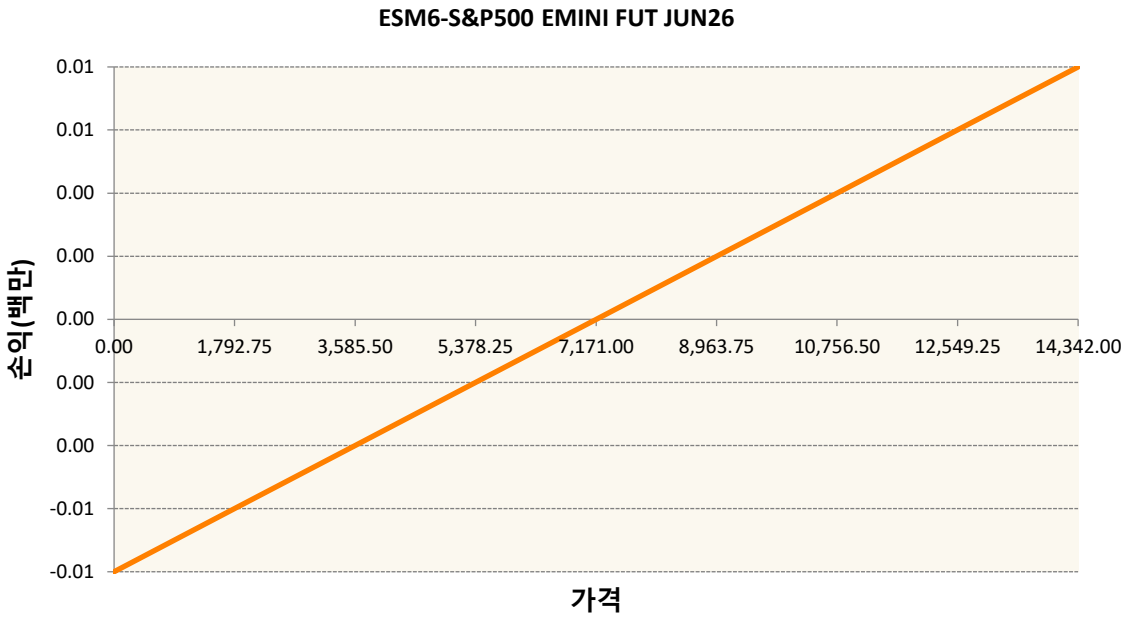
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	538	0	538	
누계	지수	선물	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	2026-04-30
기준일	2026-04-29

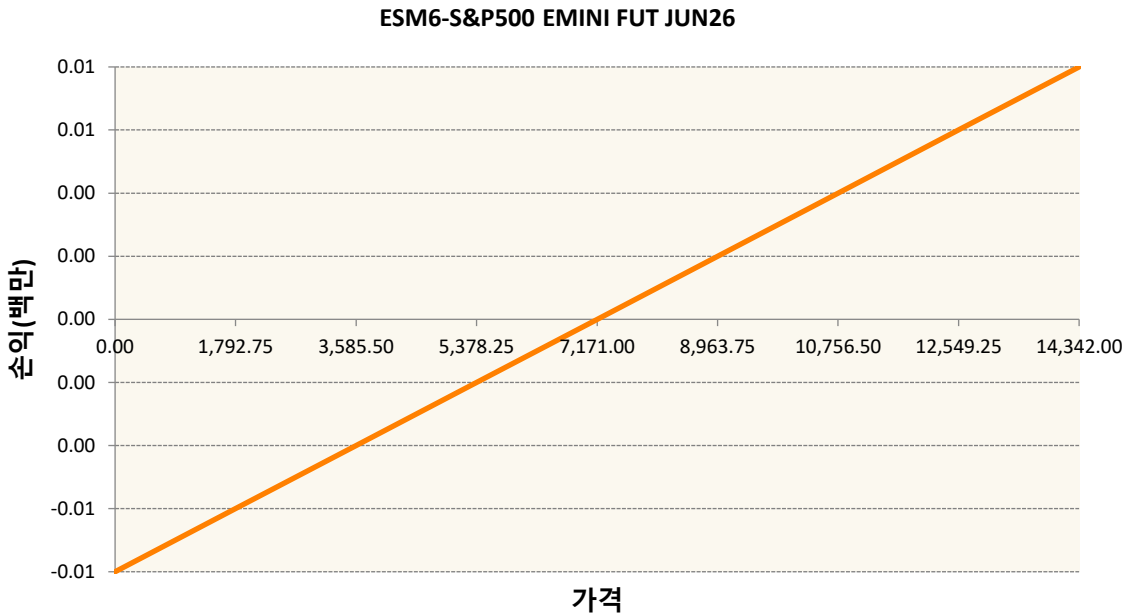
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

75

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

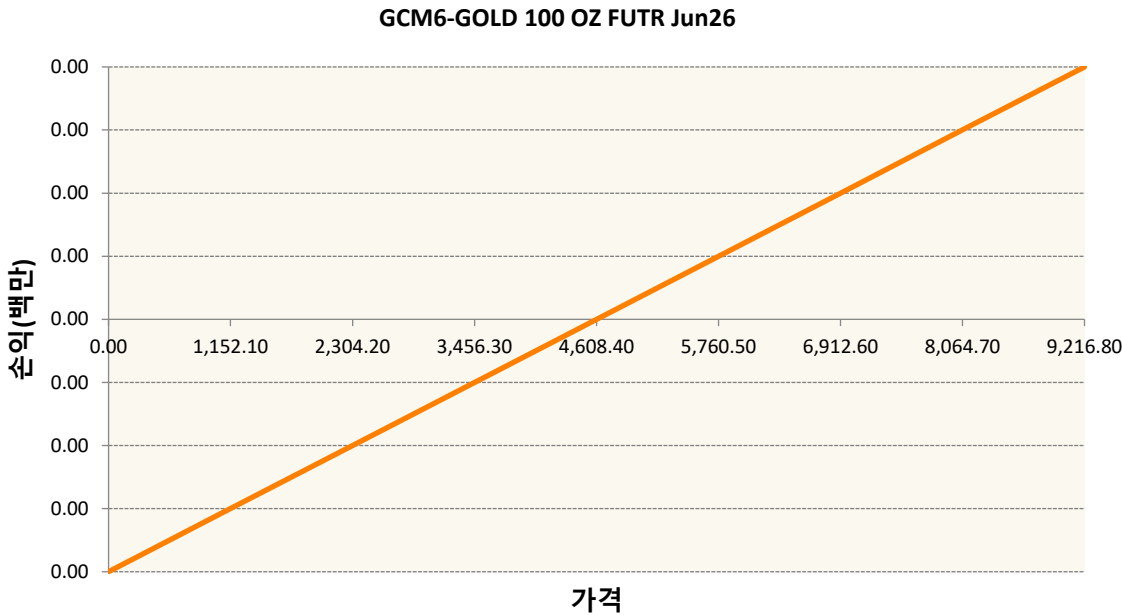
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,550	0	5,550	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUCS4 GLD US 05/08/26 C447 EQUITY	9
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	444

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

(단위:백만원)

567

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

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	302
AOPLTRSUP1 PLTR US 05/08/26 P155 EQUITY	53

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

(단위:백만원)

1,107

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

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	2026-04-30
기준일	2026-04-29

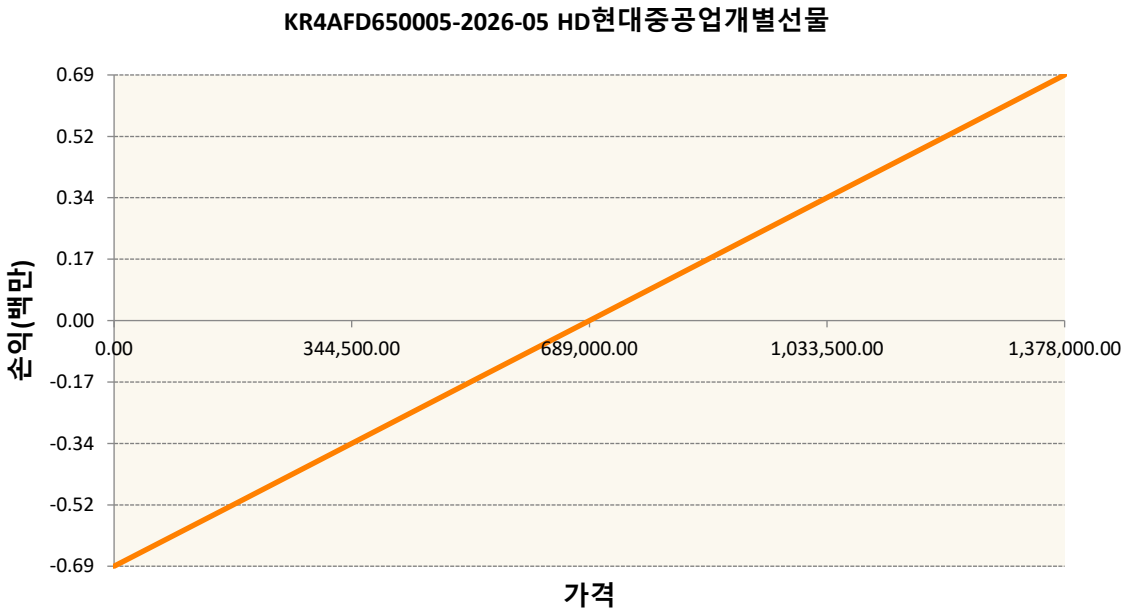
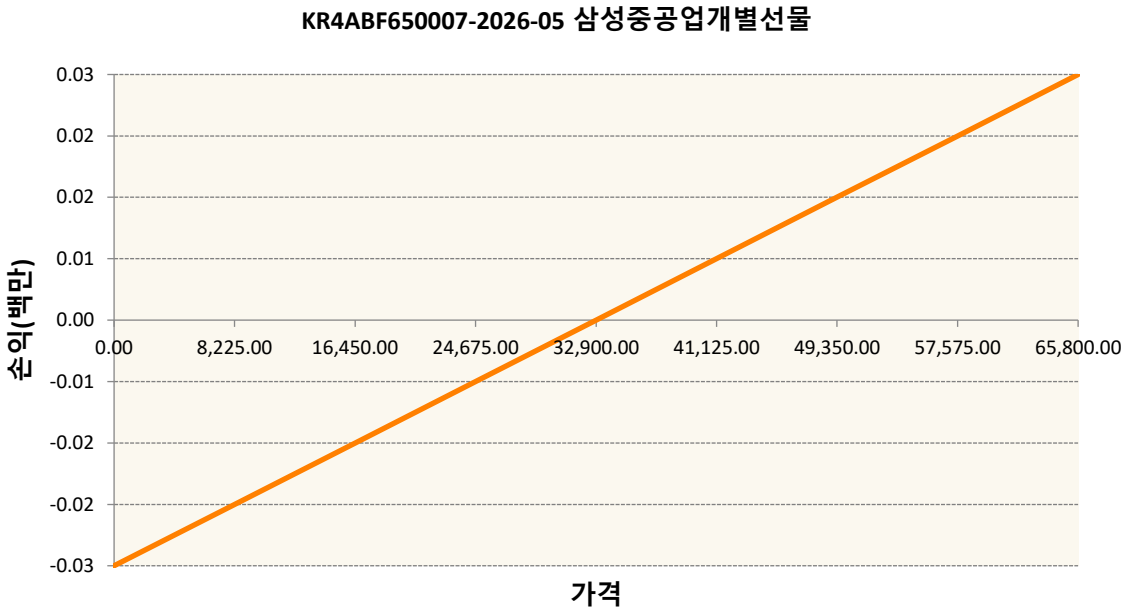
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

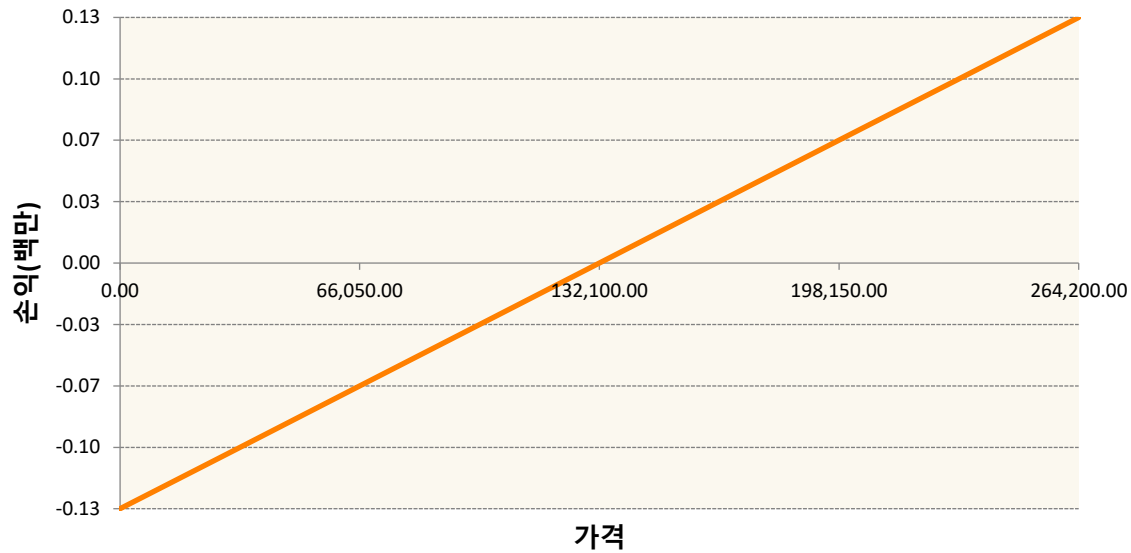
(단위:백만원)

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	35,596	0	35,596	장내
누계	유가증권	스왑	191,454	0	191,454	장외

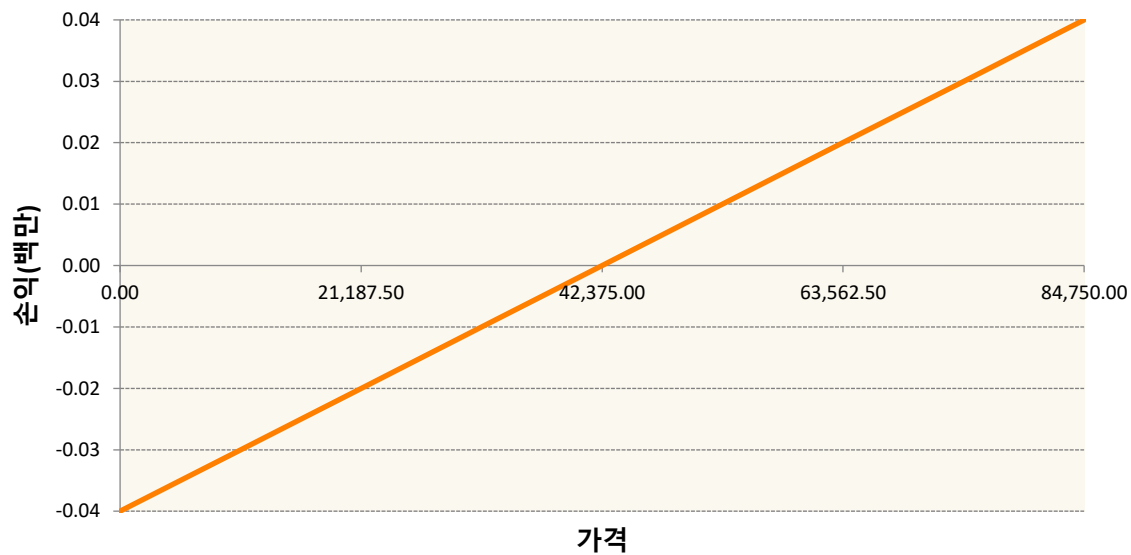
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007		2026-05 삼성중공업개별선물					1,214
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214	-1,214
-5.33%	-810	-810	-810	-810	-810	-810	-810
-2.67%	-405	-405	-405	-405	-405	-405	-405
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	405	405	405	405	405	405	405
5.33%	810	810	810	810	810	810	810
8.00%	1,214	1,214	1,214	1,214	1,214	1,214	1,214
KR4AFD650005		2026-05 HD현대중공업개별선물					1,049
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,049	-1,049	-1,049	-1,049	-1,049	-1,049	-1,049
-5.33%	-699	-699	-699	-699	-699	-699	-699
-2.67%	-350	-350	-350	-350	-350	-350	-350
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	350	350	350	350	350	350	350
5.33%	699	699	699	699	699	699	699
8.00%	1,049	1,049	1,049	1,049	1,049	1,049	1,049
KR4AFV650003 2026-05 한화오션개별선물							591
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-591	-591	-591	-591	-591	-591	-591
-5.33%	-394	-394	-394	-394	-394	-394	-394
-2.67%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	197	197	197	197	197	197	197
5.33%	394	394	394	394	394	394	394
8.00%	591	591	591	591	591	591	591

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

(단위:백만원)

4,439

공시일 2026-04-30

기준일 2026-04-29

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	2026-04-30
기준일	2026-04-29

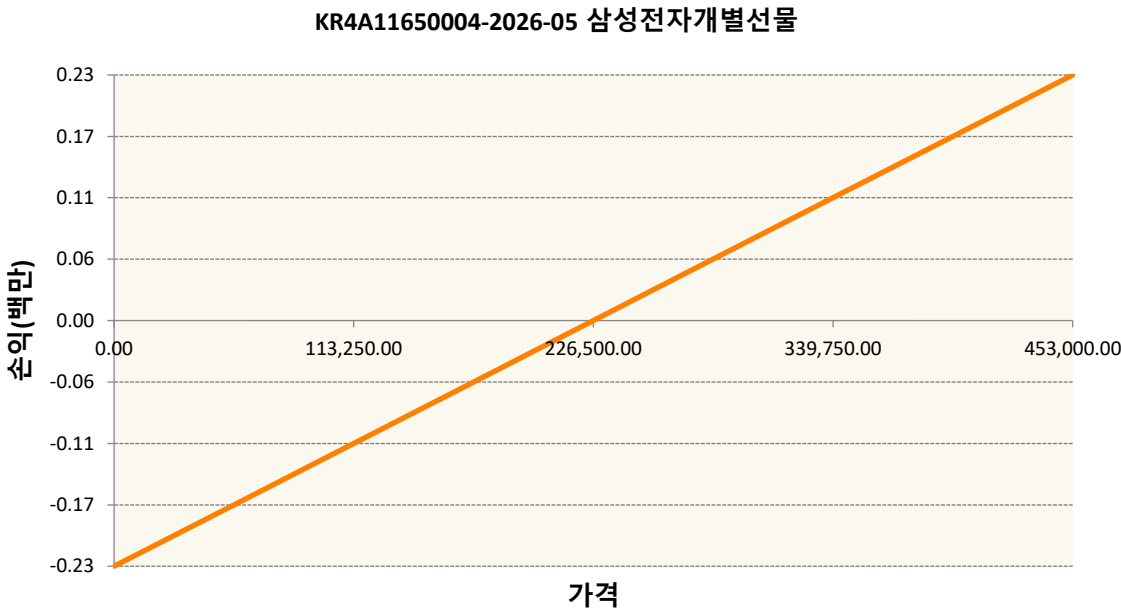
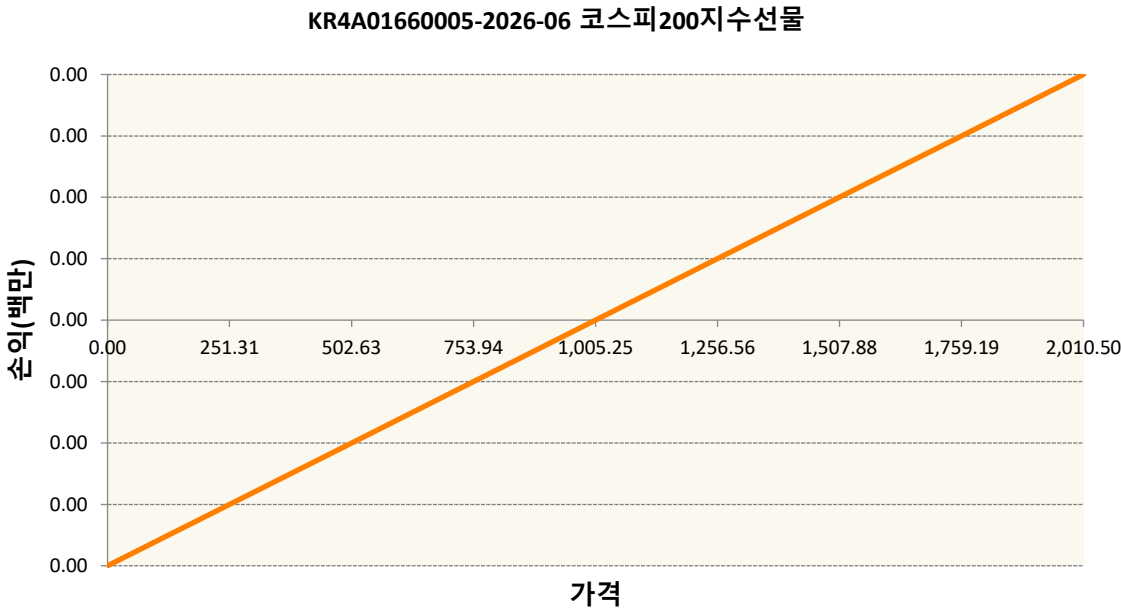
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	2,534	-2,534	장내
누계	유가증권	선물	13,103	0	13,103	장내
누계	유가증권	옵션	0	41,583	-41,583	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph displays a linear relationship between Price (가격) and Profit/Loss (손익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 1,990.00. The y-axis represents Profit/Loss, ranging from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at the origin (0, 0) and ends at (995, 0), indicating that the profit/loss is zero for prices up to 995.00.

가격	손익(백만)
0.00	0.00
995.00	0.00

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				523
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-523	-523	-523	-523	-523	-523	-523
-5.33%	-349	-349	-349	-349	-349	-349	-349
-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%	349	349	349	349	349	349	349
8.00%	523	523	523	523	523	523	523
KR4A11650004			2026-05 삼성전자개별선물				524
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-524	-524	-524	-524	-524	-524	-524
-5.33%	-350	-350	-350	-350	-350	-350	-350
-2.67%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	175	175	175	175	175	175	175
5.33%	350	350	350	350	350	350	350
8.00%	524	524	524	524	524	524	524
KR4B09EY9950 코스피위클리 C 2604W5 995.0							1,555

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,545	-1,545	-1,546	-1,547	-1,549	-1,551	-1,555
-5.33%	-880	-885	-891	-899	-908	-919	-931
-2.67%	-285	-305	-326	-347	-369	-391	-414
0%	68	46	23	0	-23	-47	-71
2.67%	166	159	150	139	127	114	99
5.33%	176	176	174	172	169	164	159
8.00%	177	177	177	176	176	175	174
KR4B09EY9976 코스피위클리 C 2604W5 997.5							1,067

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,062	-1,062	-1,062	-1,063	-1,064	-1,065	-1,067
-5.33%	-615	-617	-621	-626	-631	-638	-645
-2.67%	-208	-220	-233	-247	-261	-276	-290
0%	47	32	16	0	-16	-32	-49
2.67%	124	119	112	104	95	85	75
5.33%	134	133	132	130	127	124	120
8.00%	134	134	134	134	133	133	132

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

(단위:백만원)

6,551

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

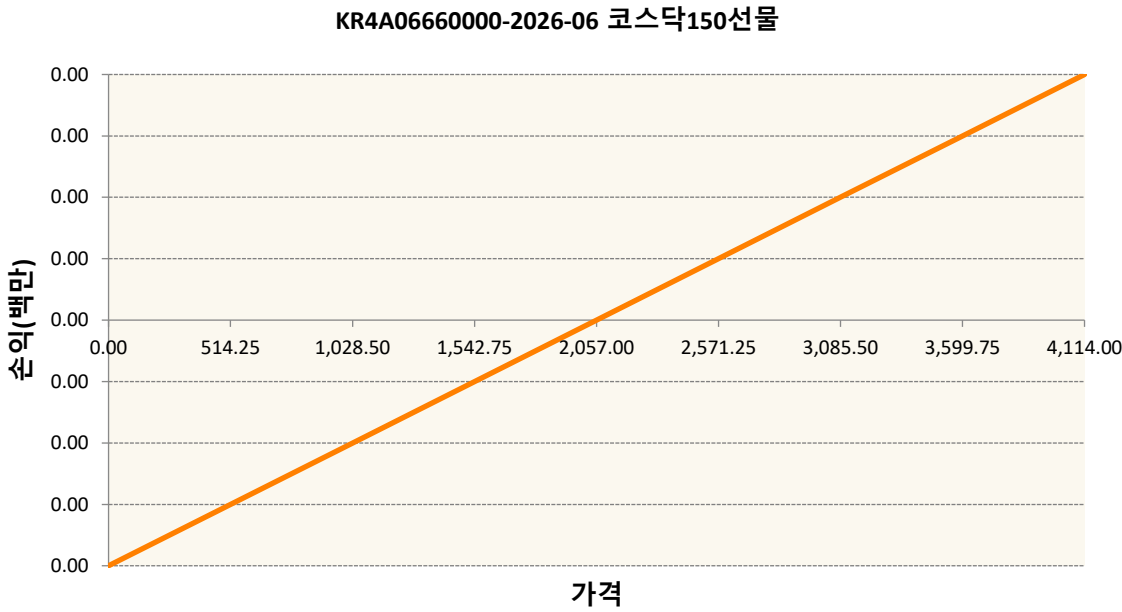
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	905	0	905	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06660000			2026-06 코스닥150선물				73
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	73	73	73	73	73	73	73

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

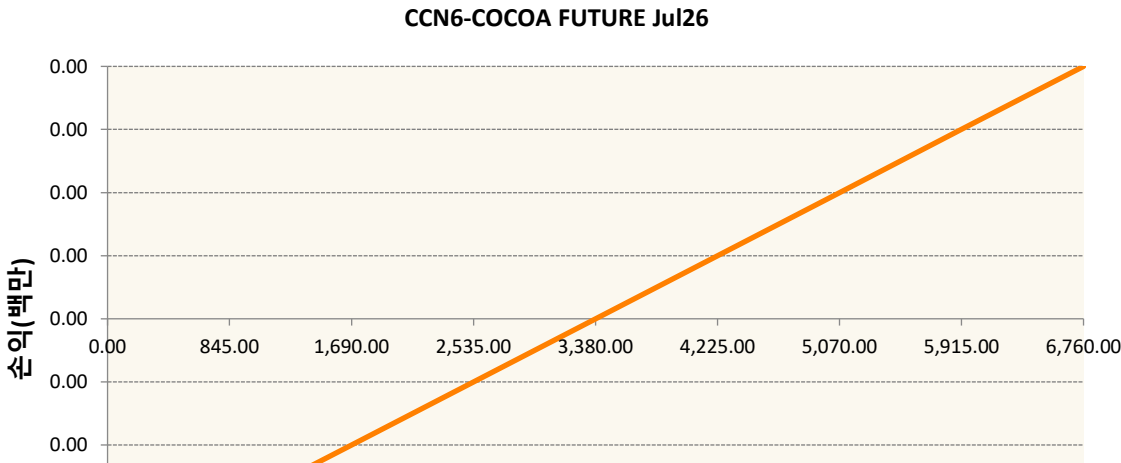
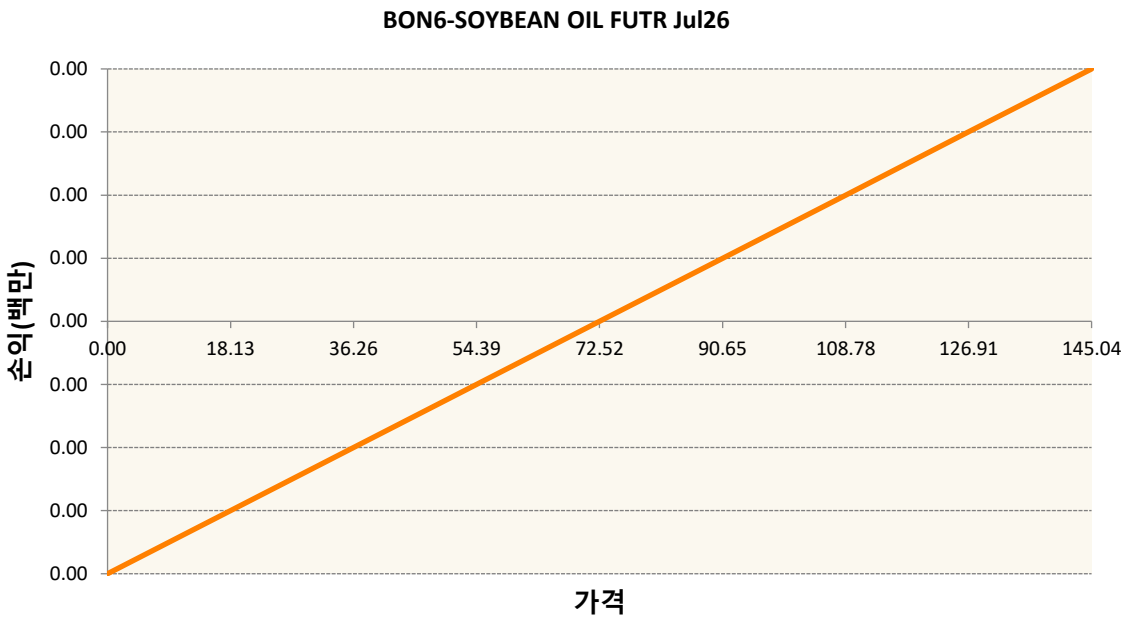
포커스농산물모(채권-파생형)

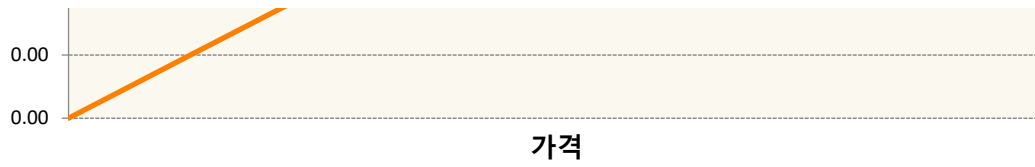
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

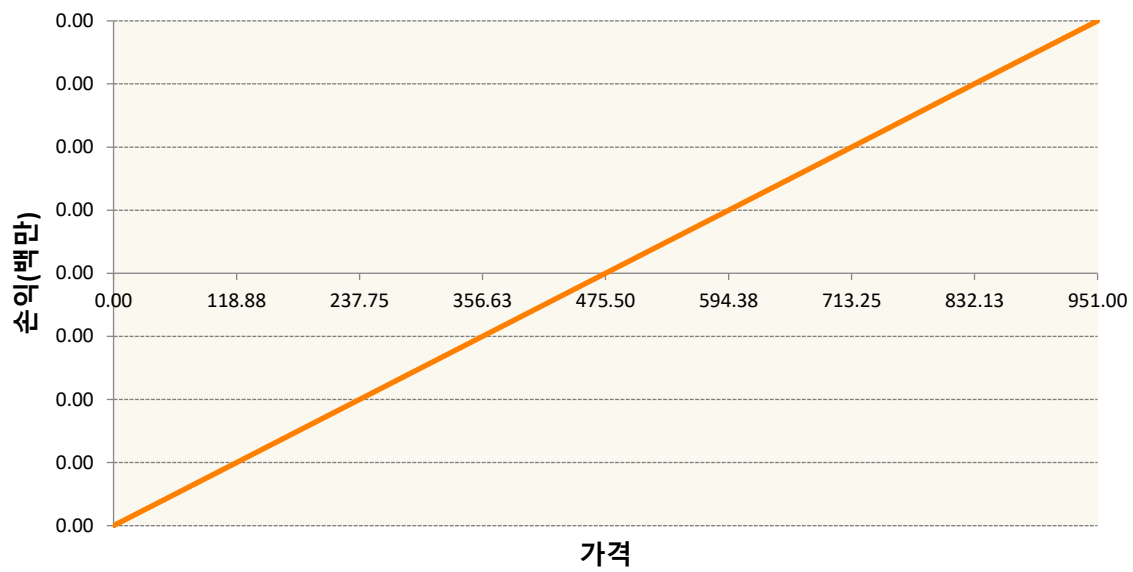
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	101	0	101	
누계	실물자산	선물	913	0	913	장내
누계	유가증권	선물	2,039	0	2,039	
누계	통화	선물	0	414	-414	장내

2. 만기시점의 손익구조

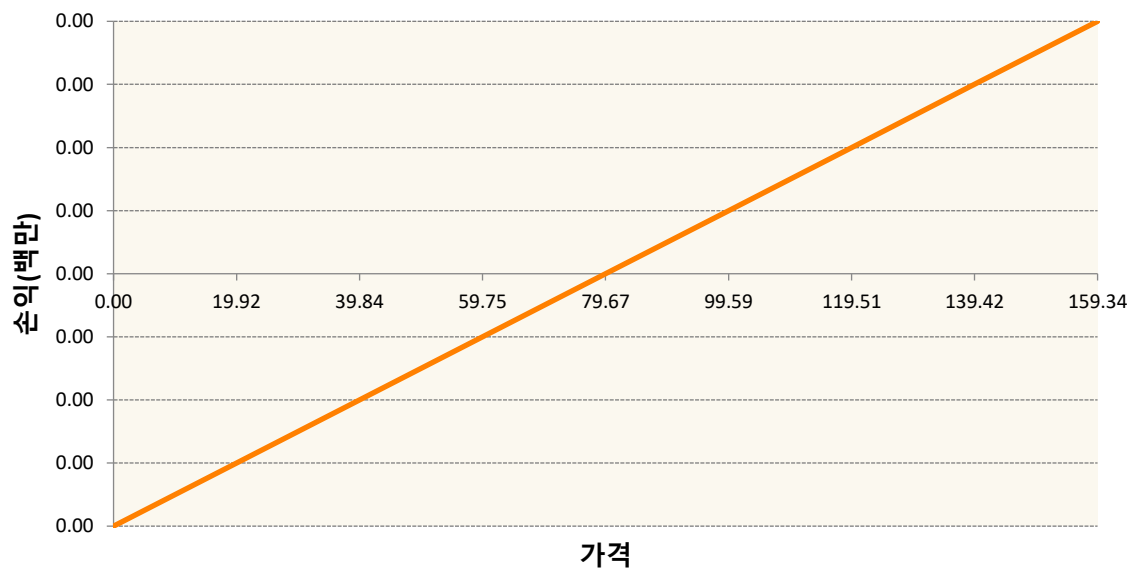




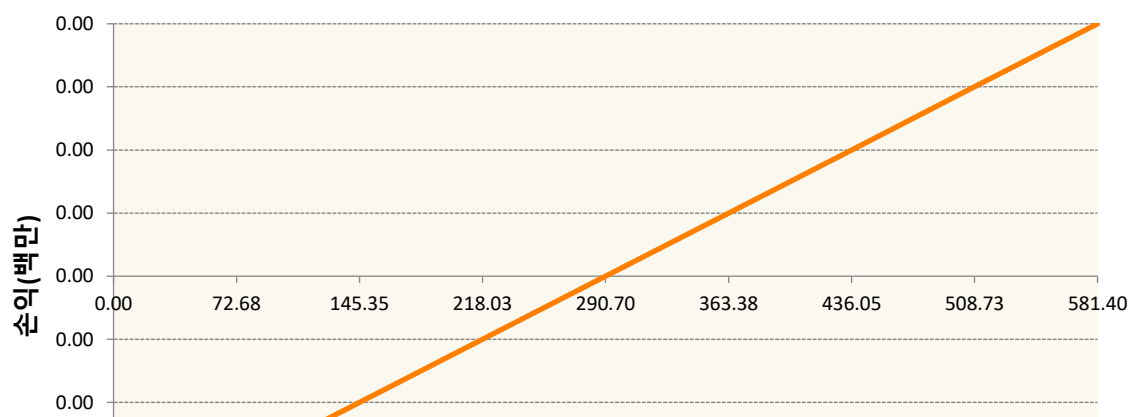
CN6-CORN FUTURE Jul26

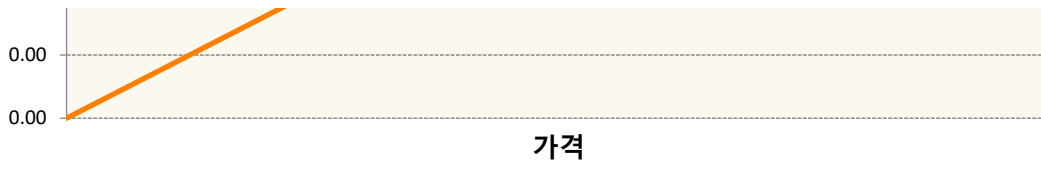


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

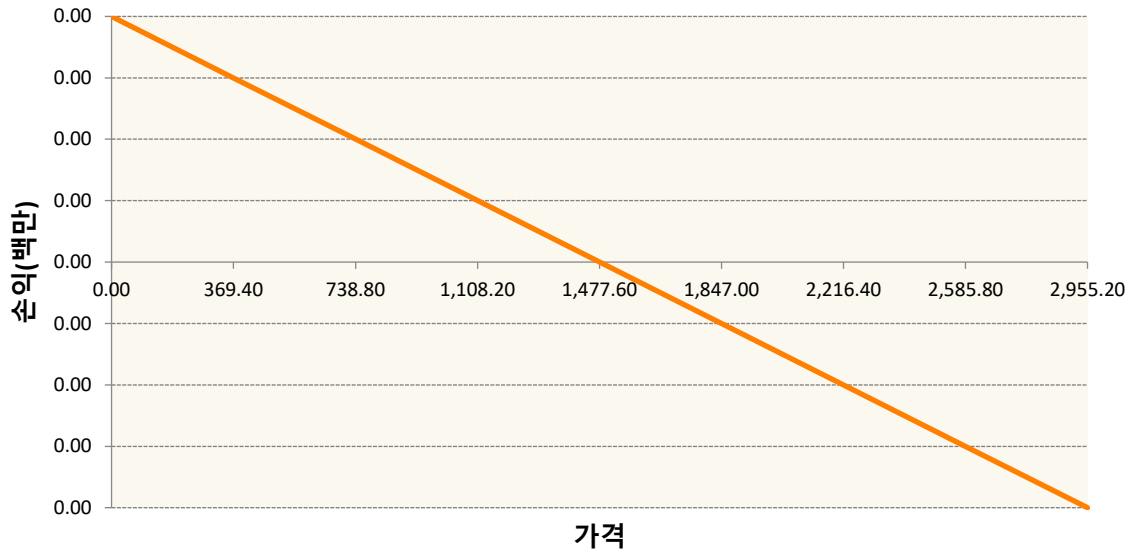


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

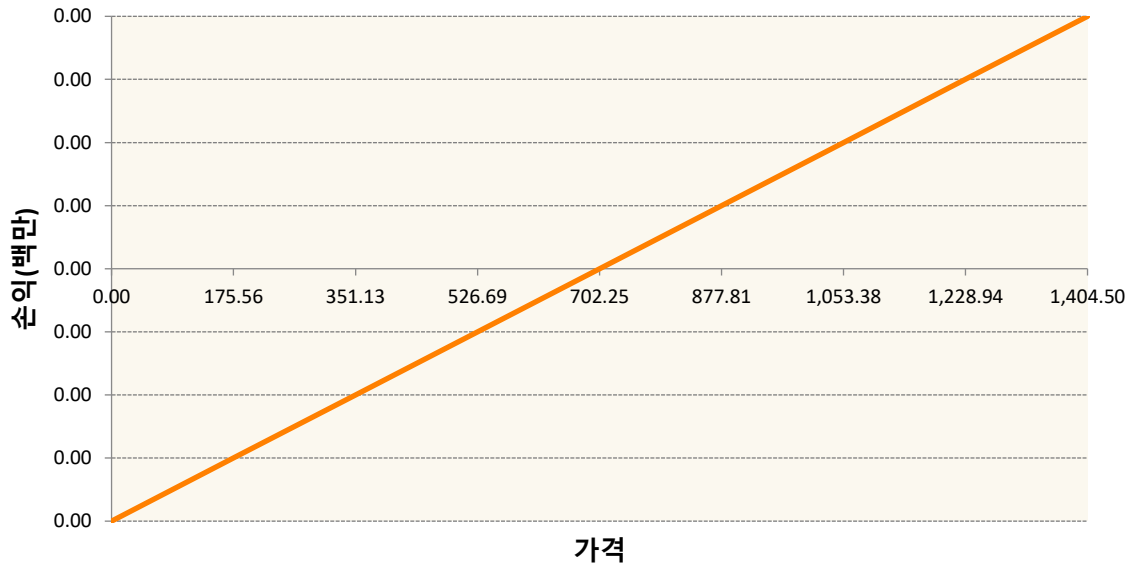




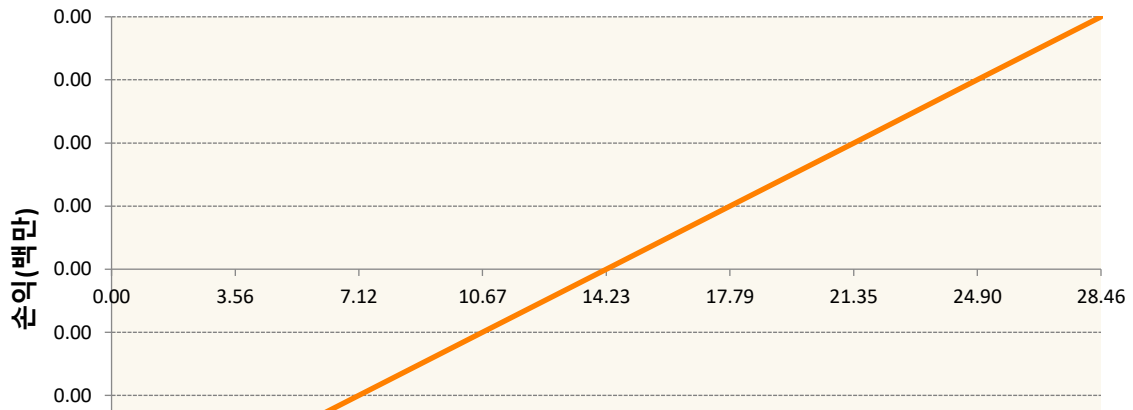
KR4A75650007-2026-05 달러선물

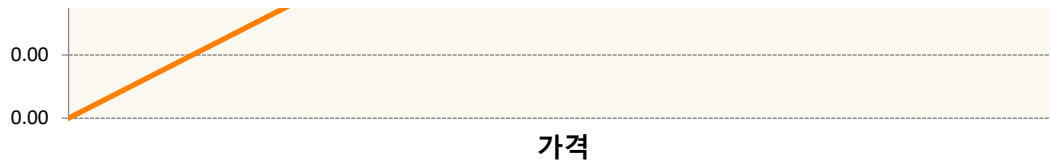


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

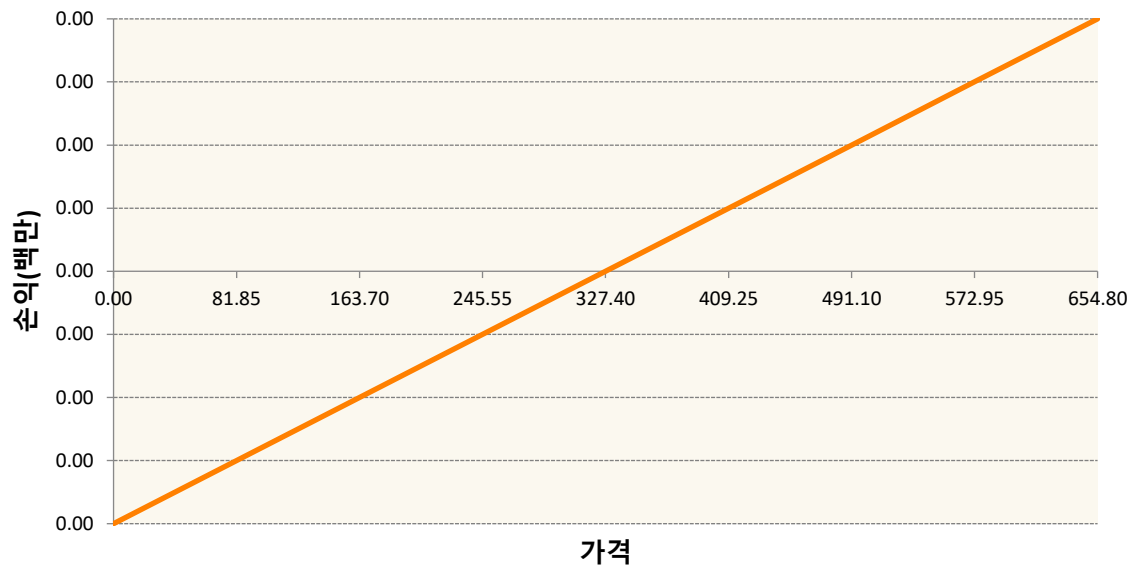


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

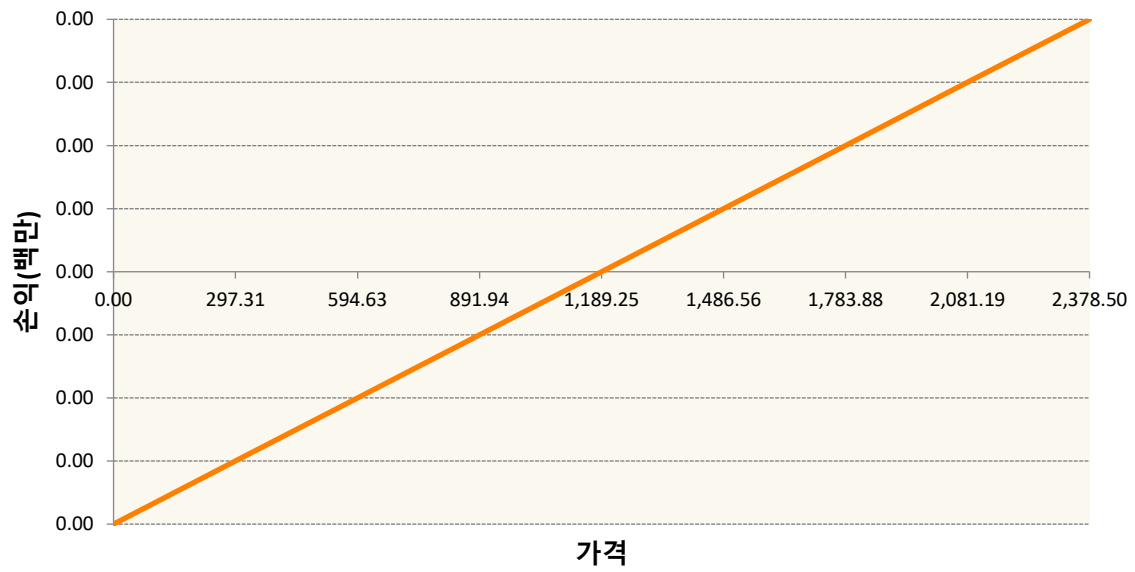




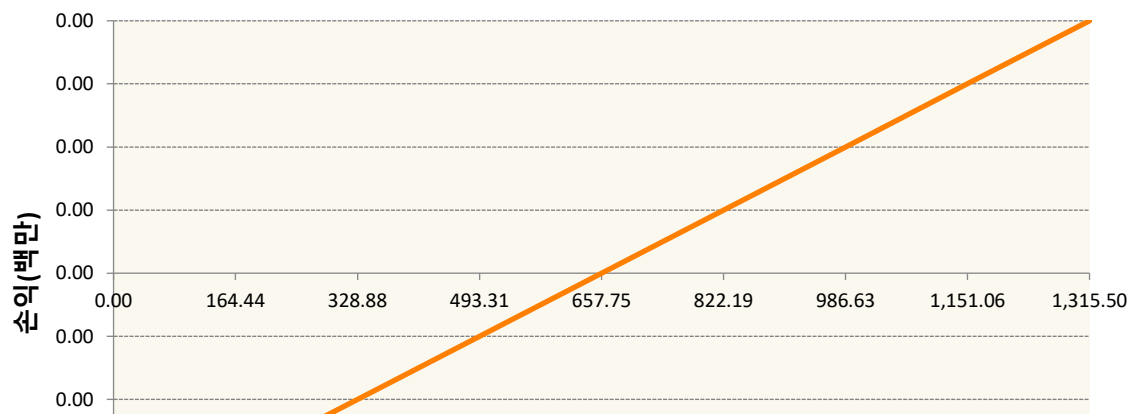
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

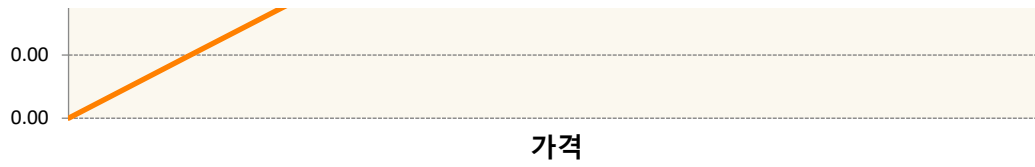


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-04-30
기준일	2026-04-29

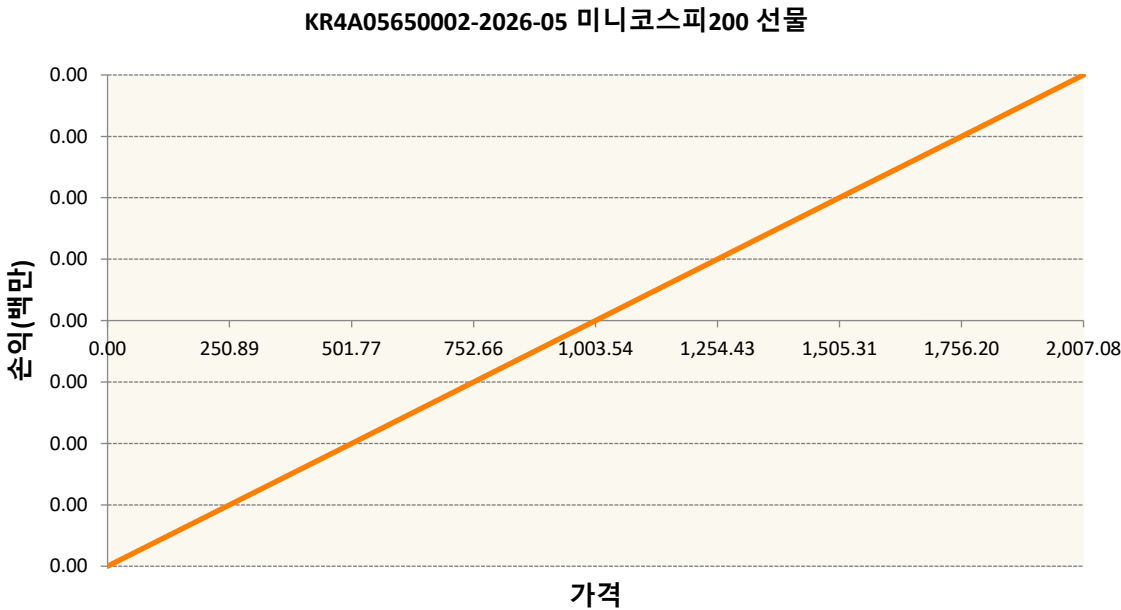
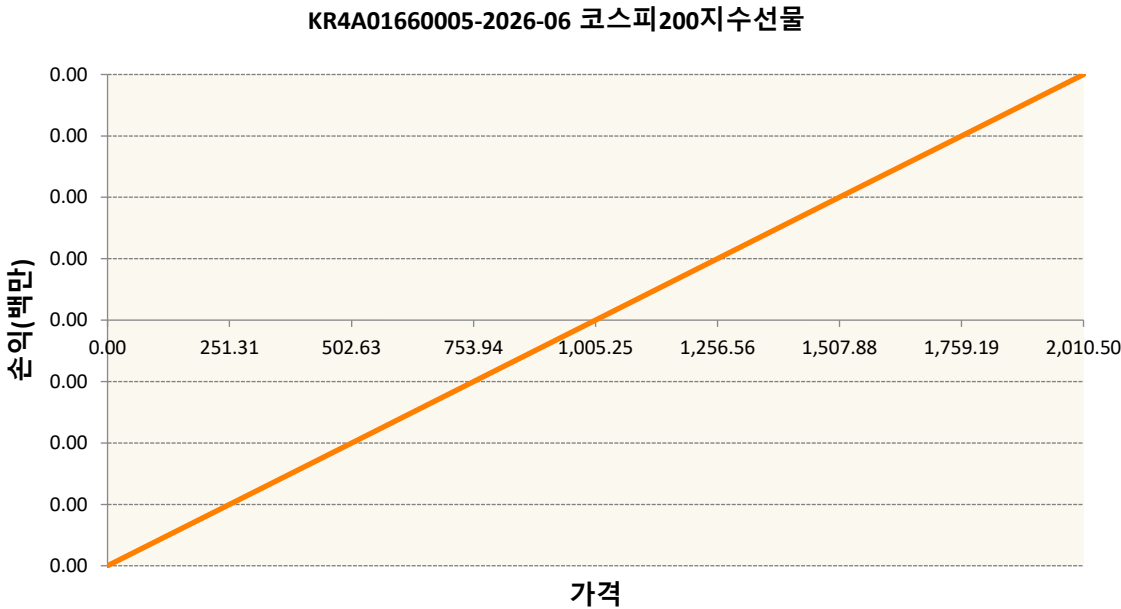
스마트인덱스모

1. 계약금액

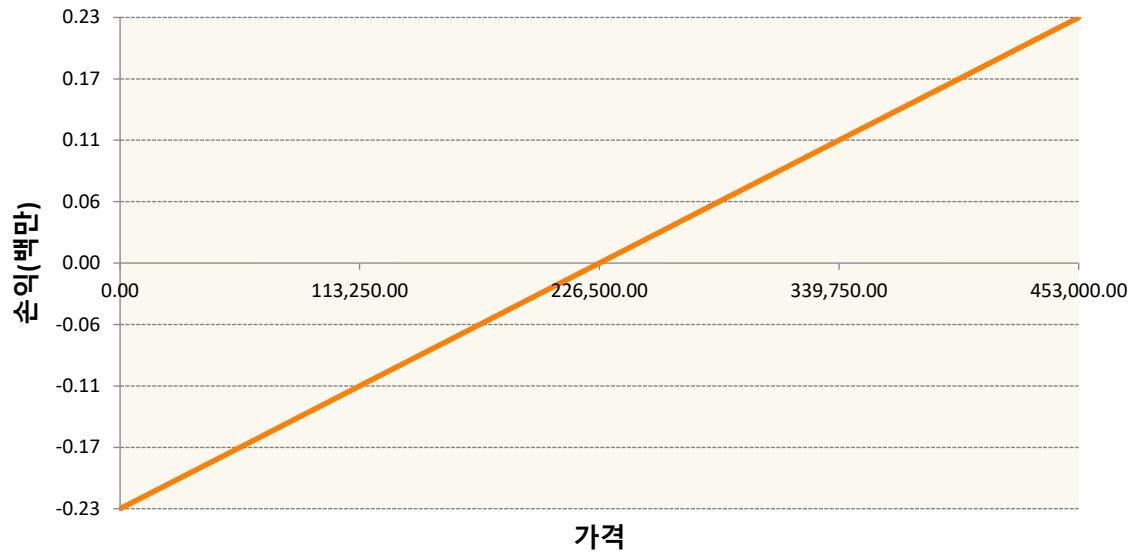
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,952	0	3,952	장내

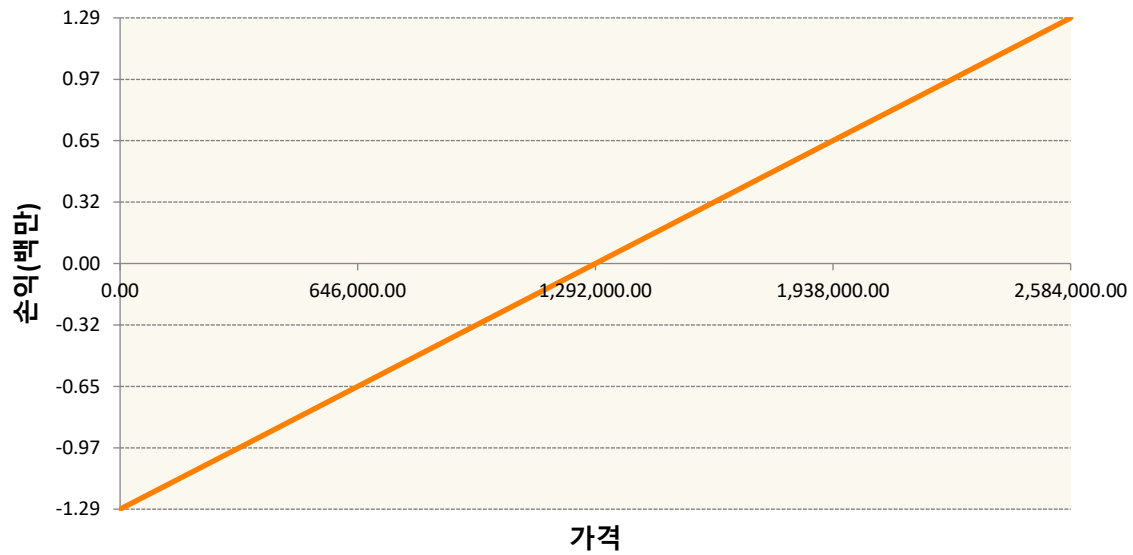
2. 만기시점의 손익구조



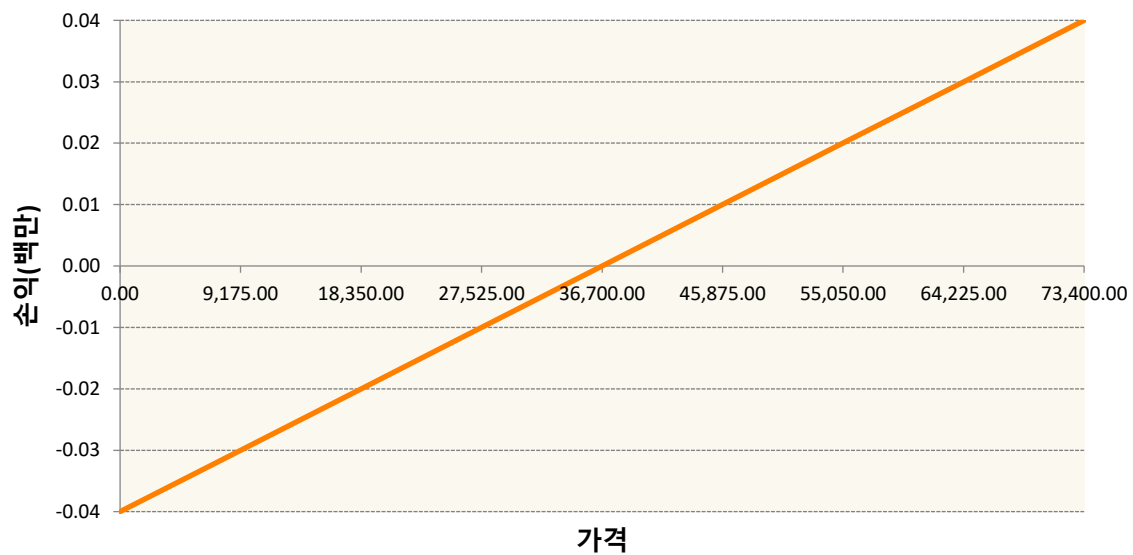
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		161	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161			
-5.33%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107			
-2.67%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	54	54	54	54	54	54	54			
5.33%	107	107	107	107	107	107	107			
8.00%	161	161	161	161	161	161	161			
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		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		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)

529

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

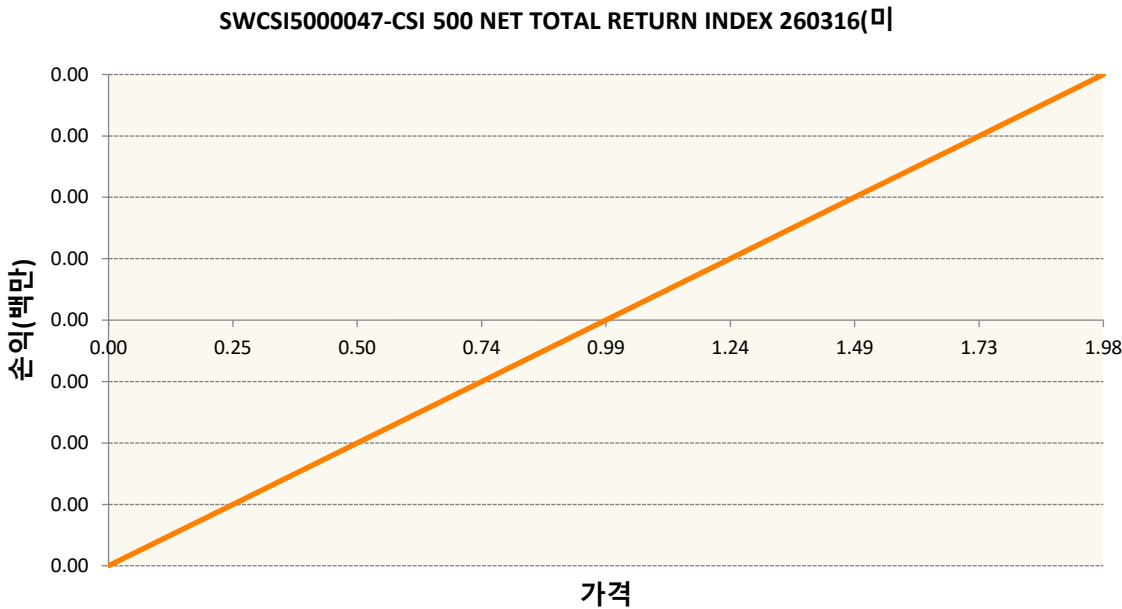
SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,587	0	5,587	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

446

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

548

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

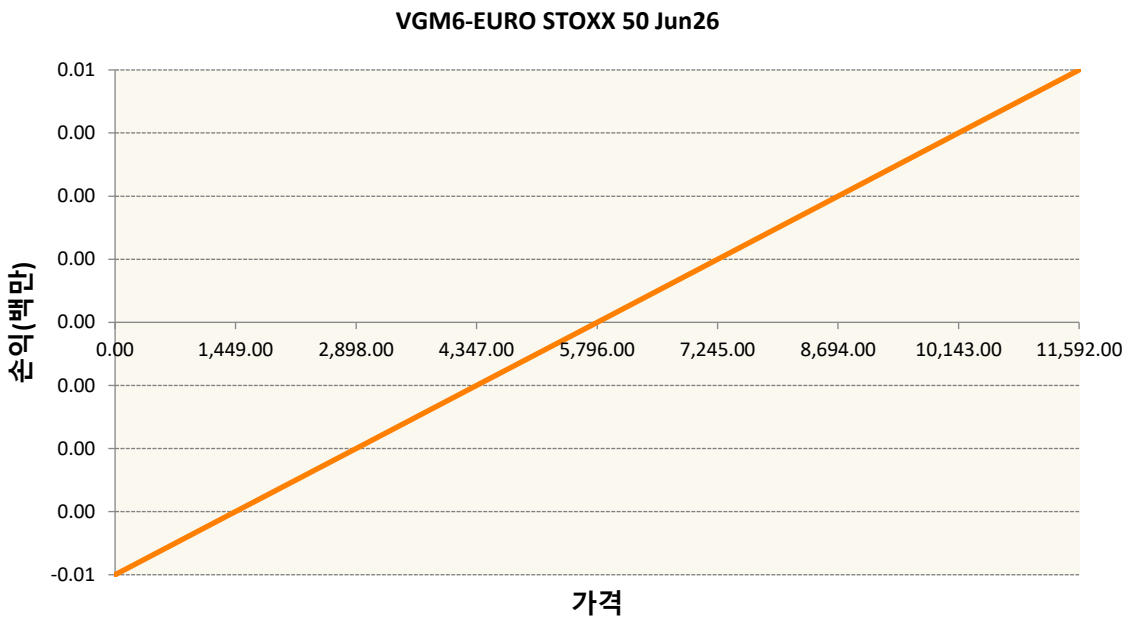
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	893	0	893	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	71
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

61

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

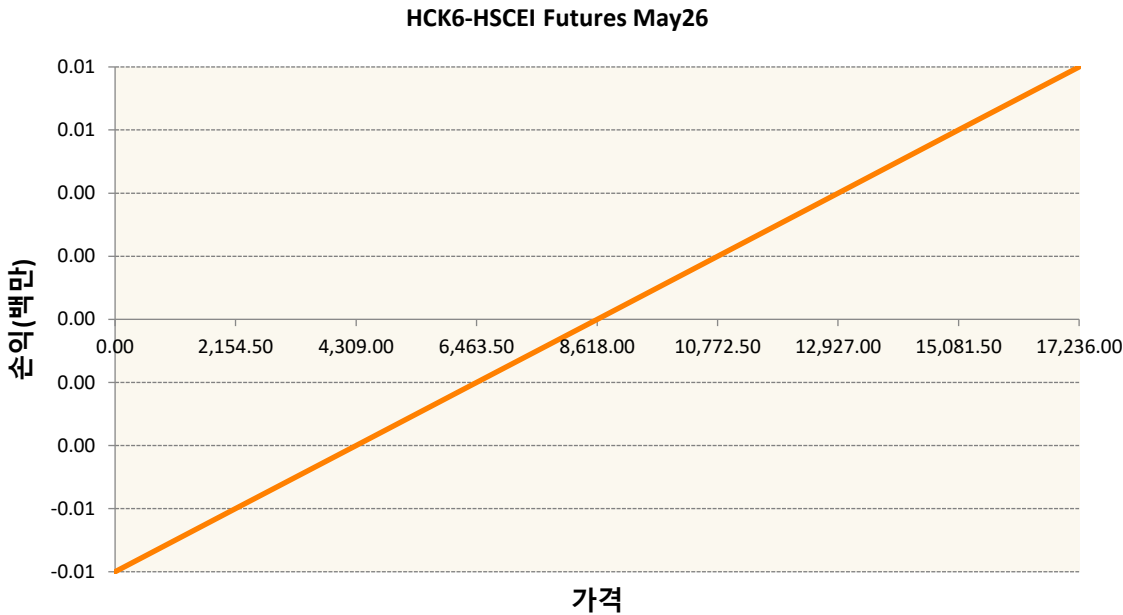
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,621	0	1,621	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK6	HSCEI Futures May26	130
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

156

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

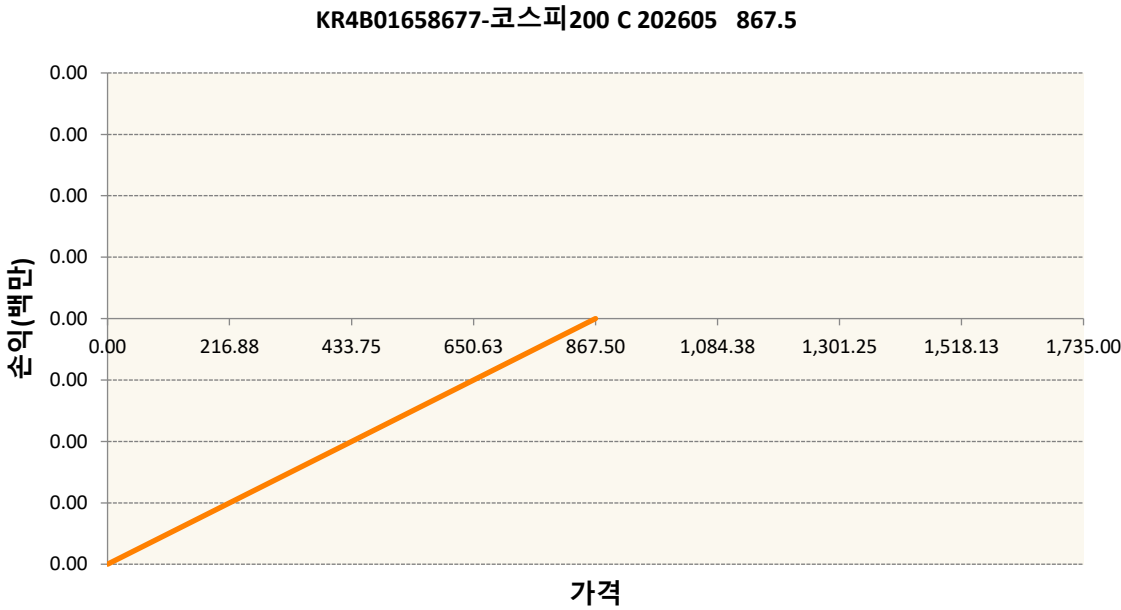
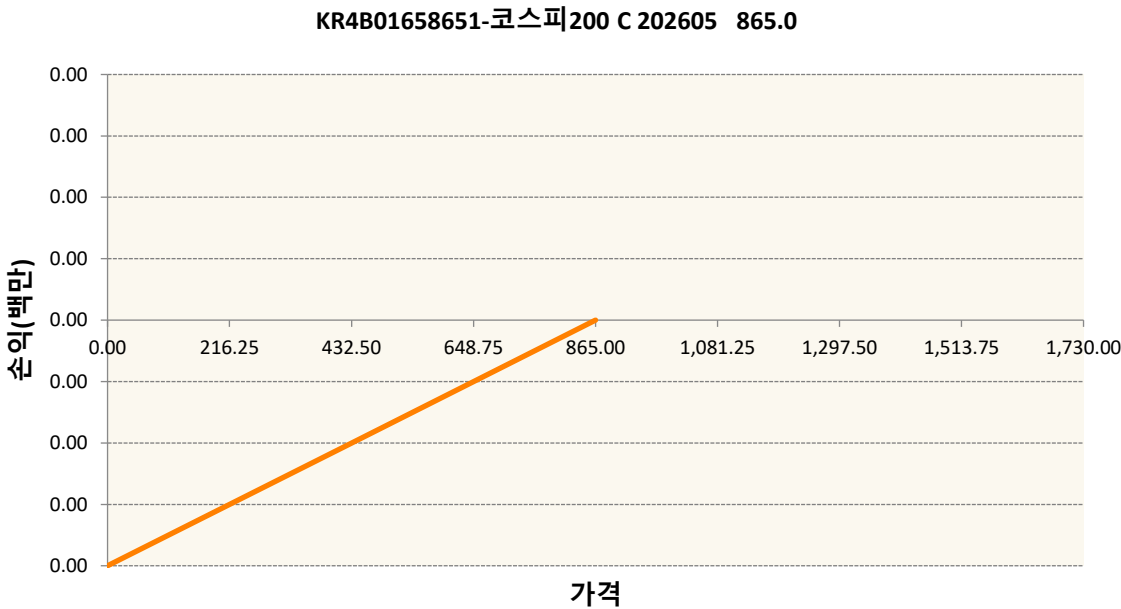
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

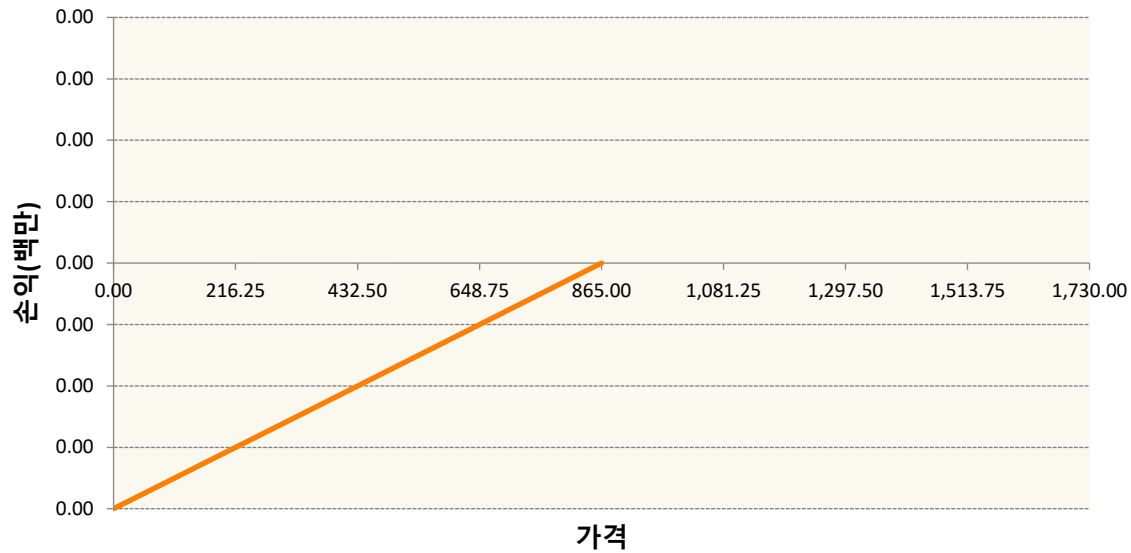
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	358	0	358	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,416	-34,416	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0							417
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-139	-191	-245	-301	-358	-417
-5.33%	-8	-46	-88	-133	-181	-232	-284
-2.67%	40	14	-18	-54	-94	-136	-182
0%	67	49	27	0	-31	-66	-104
2.67%	80	70	55	36	12	-15	-46
5.33%	87	81	71	58	41	20	-4
8.00%	90	87	81	72	60	45	26
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							293
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-100	-136	-174	-213	-252	-293
-5.33%	-6	-33	-63	-95	-128	-164	-200
-2.67%	28	9	-13	-39	-66	-96	-128
0%	48	35	19	0	-22	-46	-73
2.67%	58	50	39	26	9	-10	-32
5.33%	63	58	51	42	30	15	-2
8.00%	65	62	58	52	44	33	19
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							170
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-57	-78	-100	-123	-146	-170
-5.33%	-3	-19	-36	-54	-74	-95	-116
-2.67%	16	6	-7	-22	-38	-56	-74
0%	27	20	11	0	-13	-27	-42

2.67%	33	28	22	15	5	-6	-19
5.33%	35	33	29	24	17	8	-2
8.00%	37	35	33	30	25	18	11

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

(단위:백만원)

751

공시일 2026-04-30

기준일 2026-04-29

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	2026-04-30
기준일	2026-04-29

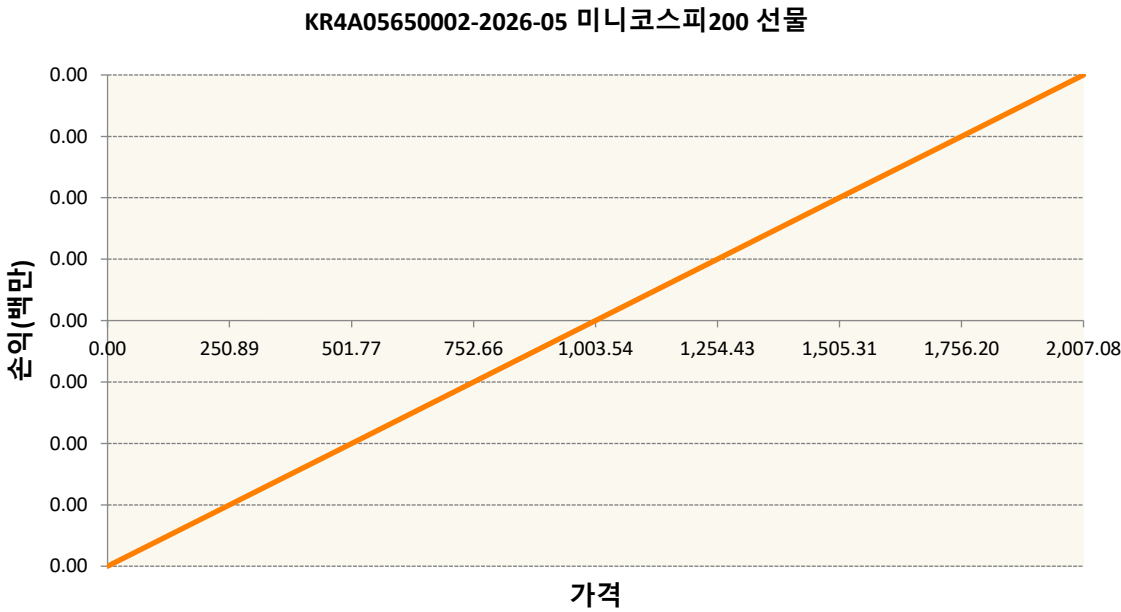
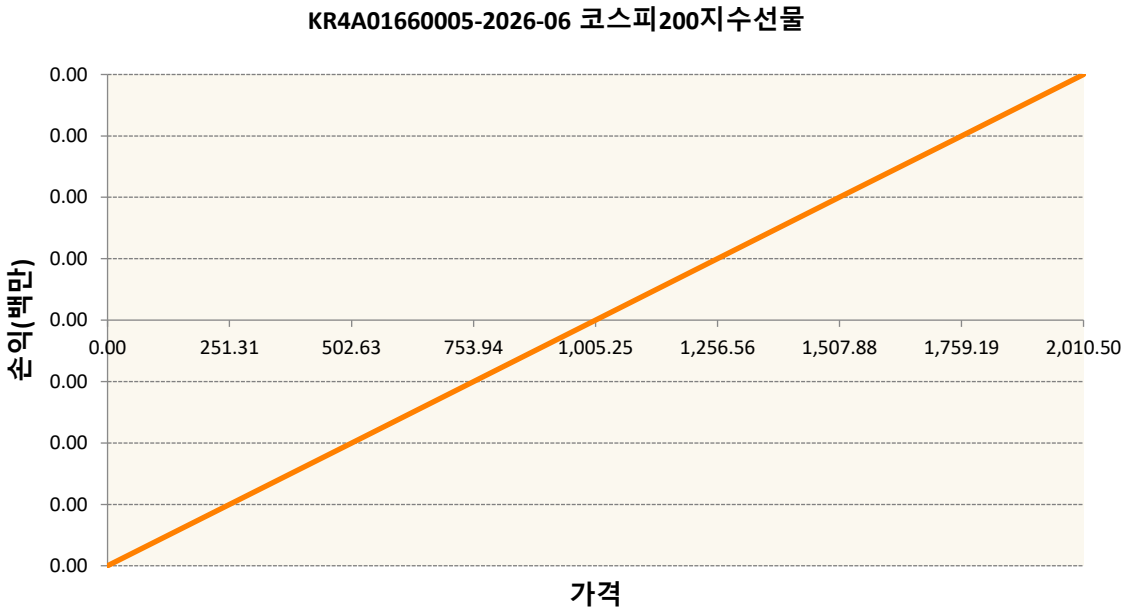
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

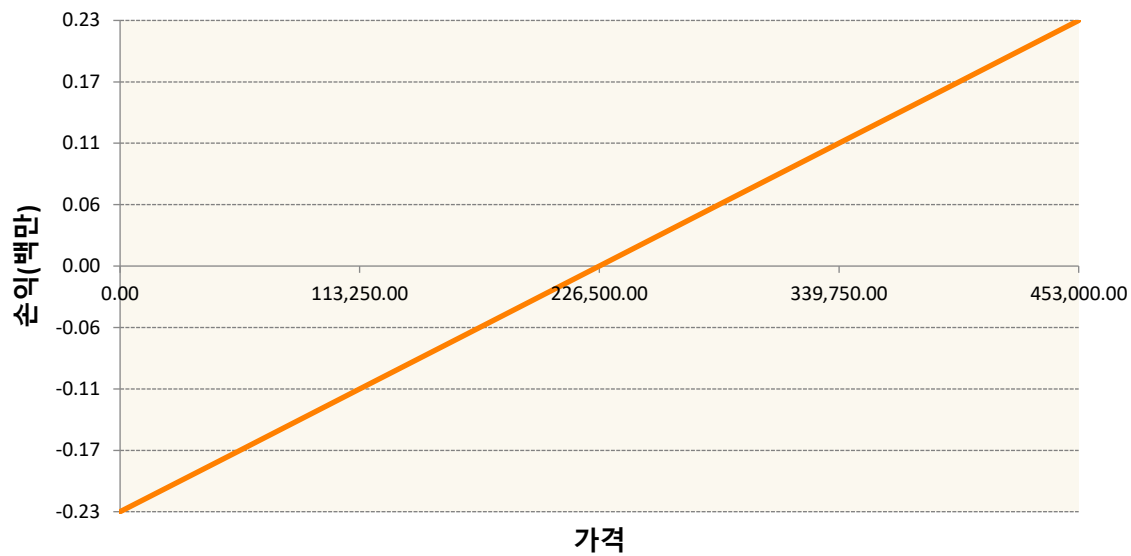
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	249	-249	장내
누계	유가증권	선물	4,140	66	4,074	장내

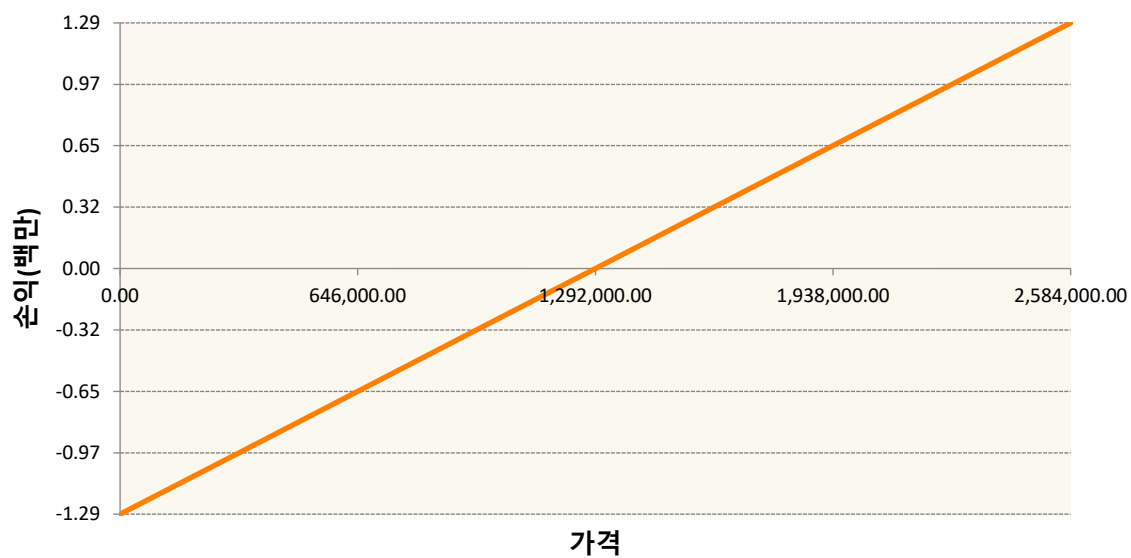
2. 만기시점의 손익구조



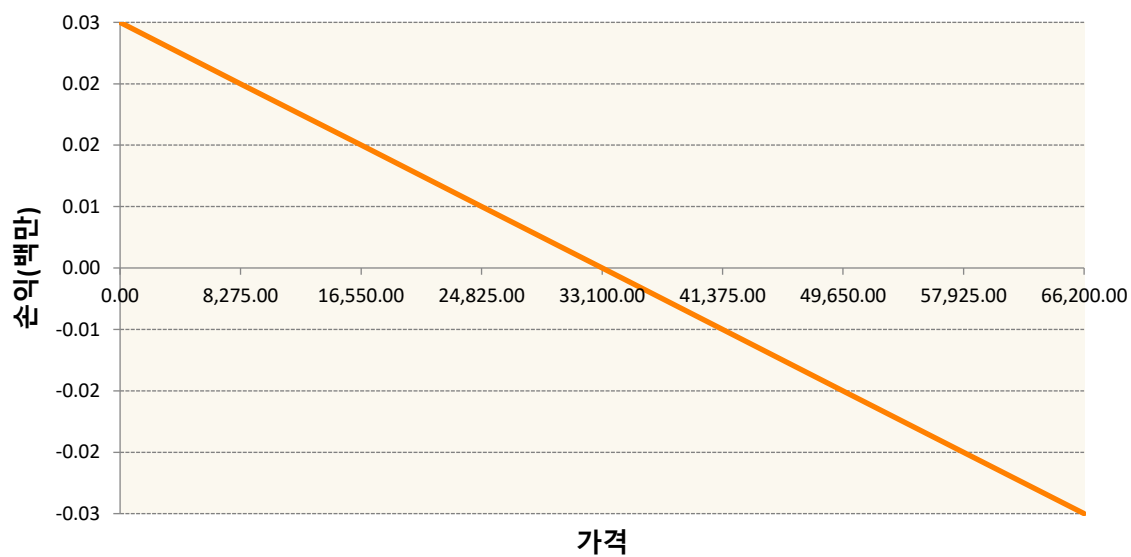
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AEB650008-2026-05 우리금융지주개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		101		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101				
-5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67				
-2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	34	34	34	34	34	34	34				
5.33%	67	67	67	67	67	67	67				
8.00%	101	101	101	101	101	101	101				
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%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30				
-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%	30	30	30	30	30	30	30				
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				
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)

341

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

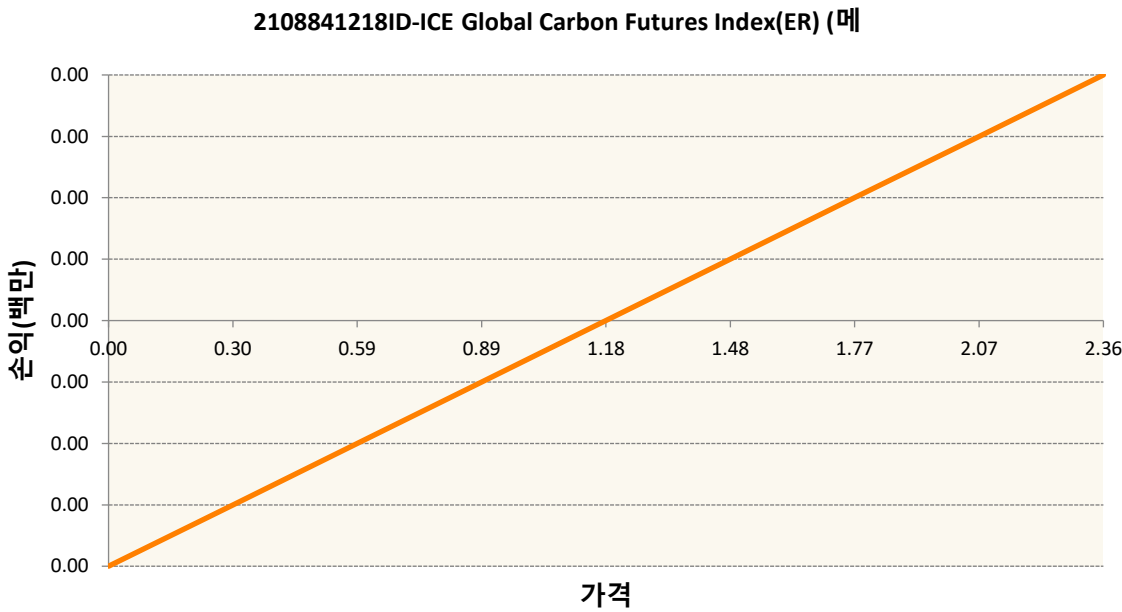
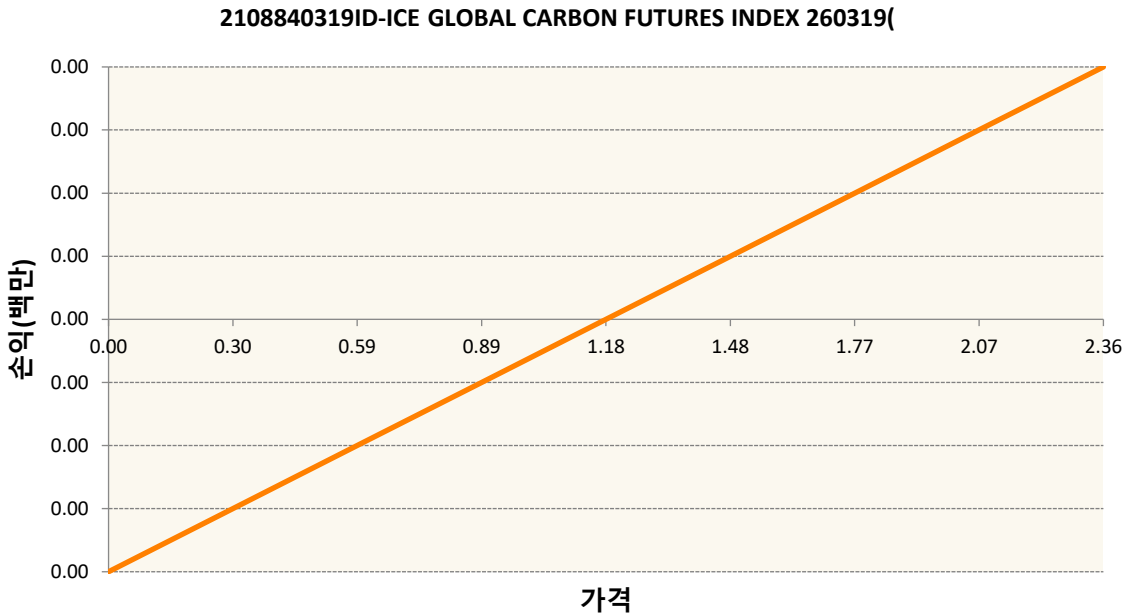
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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(		433
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		109

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

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

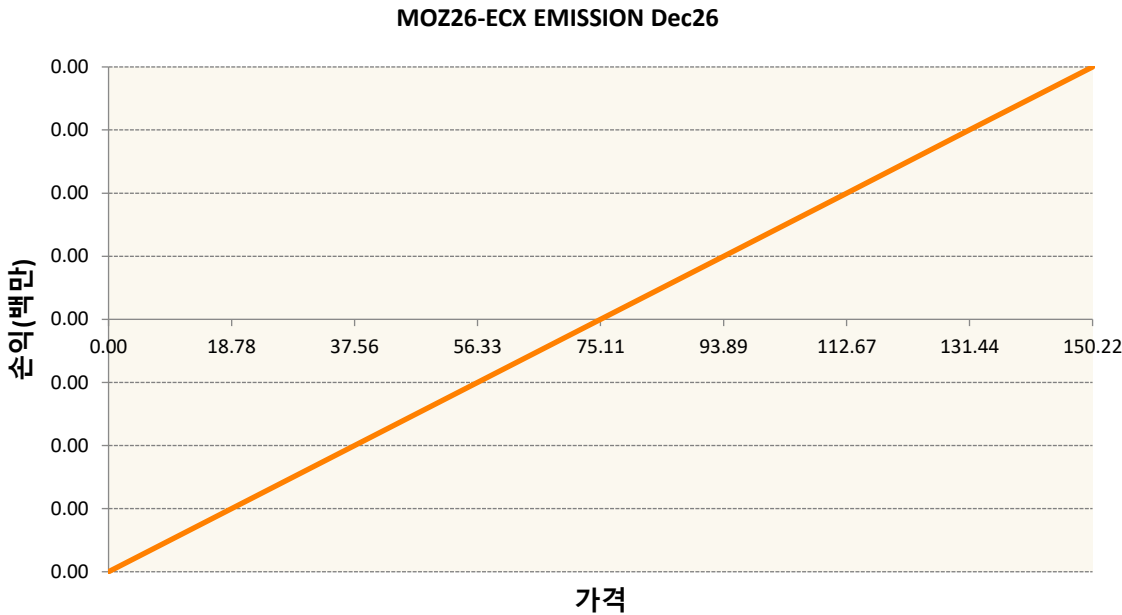
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,846	0	4,846	
누계	통화	선도	0	4,553	-4,553	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G3T(KRW/EUR 30-04-26E	175
FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	189
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	388

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

(단위:백만원)

791

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

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	1,602	0	1,602	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	12
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	8
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	20
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	8

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

(단위:백만원)

73

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

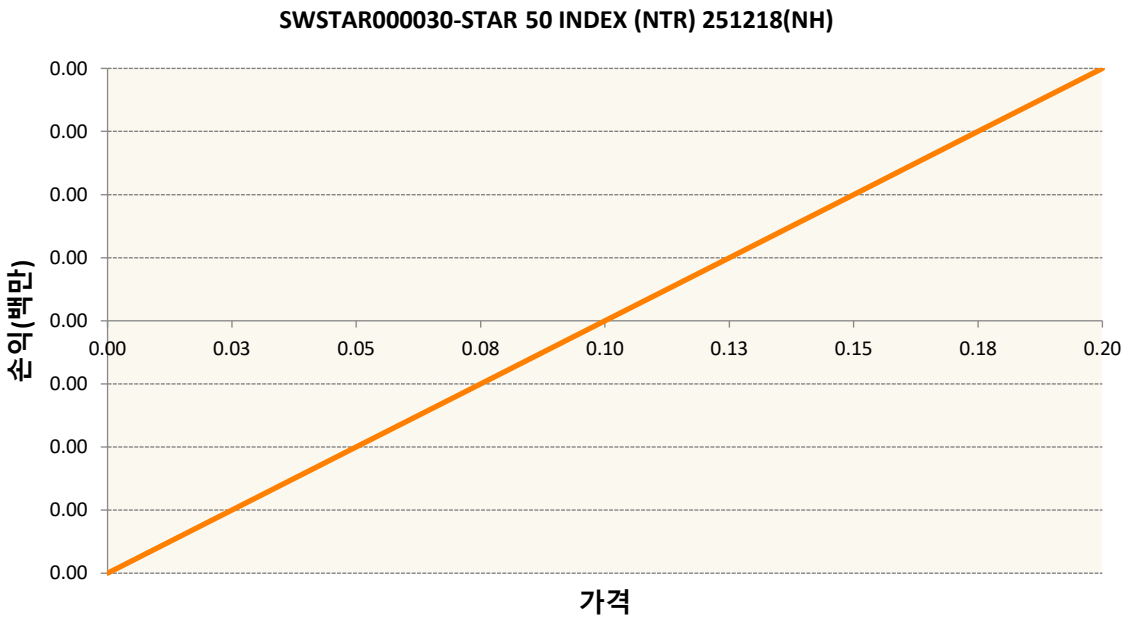
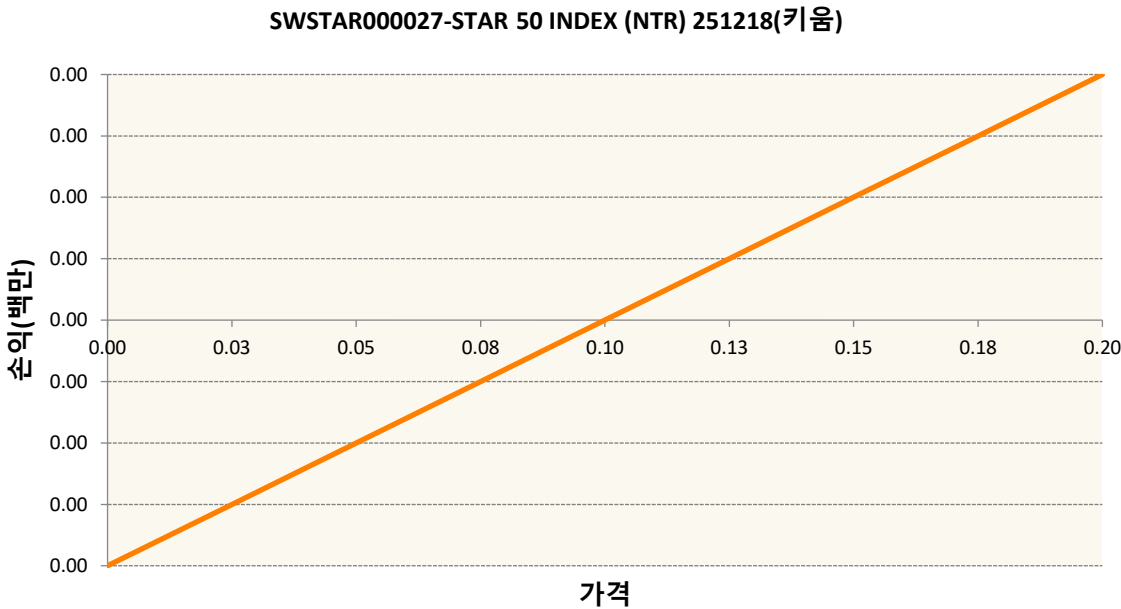
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

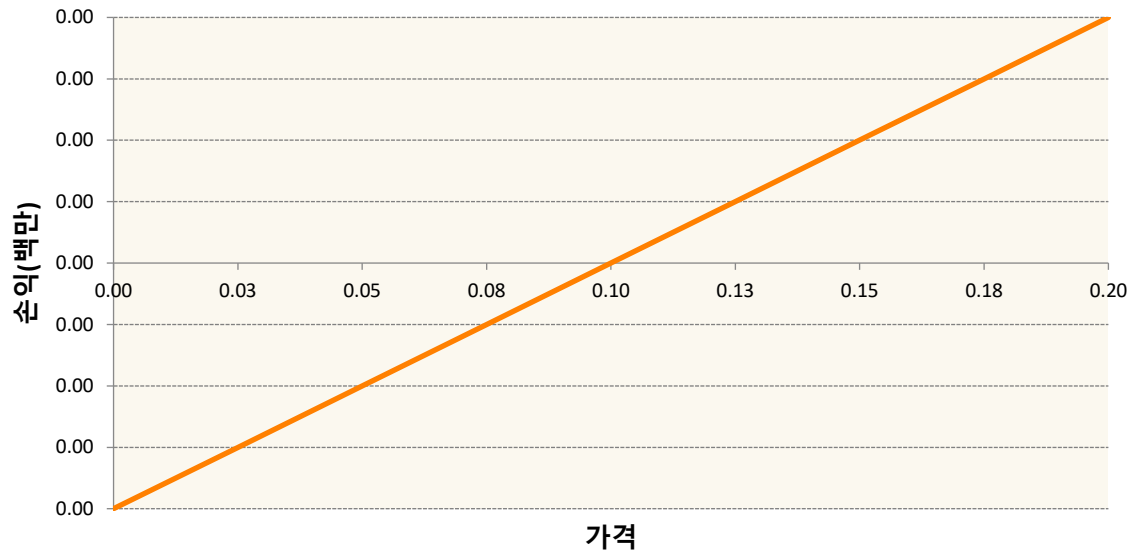
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,529	0	2,529	장외

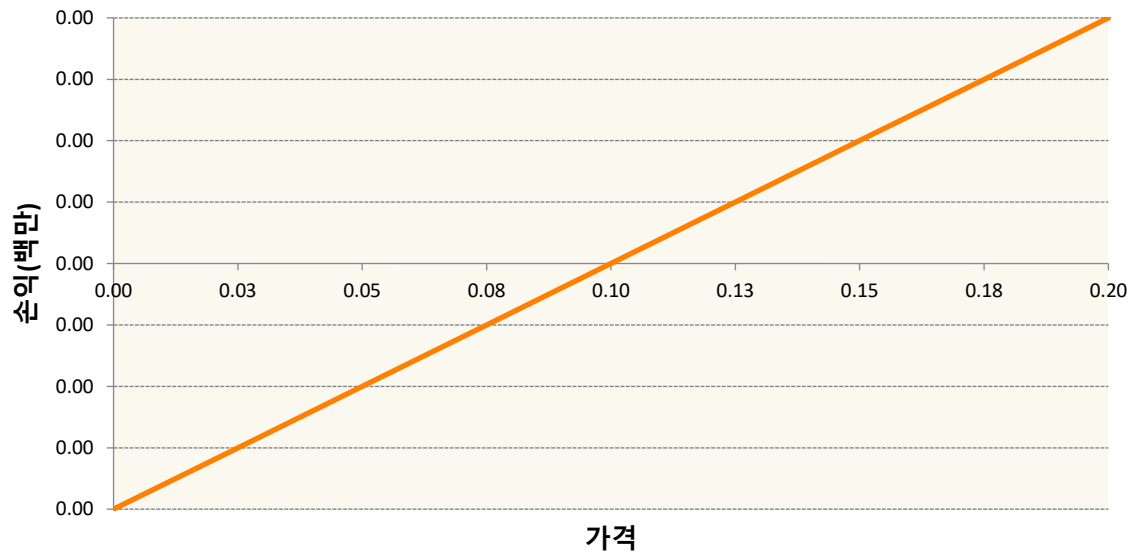
2. 만기시점의 손익구조



SWSTAR000031-STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)



SWSTAR000032-STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)

7
24
123
46

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

(단위:백만원)

302

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

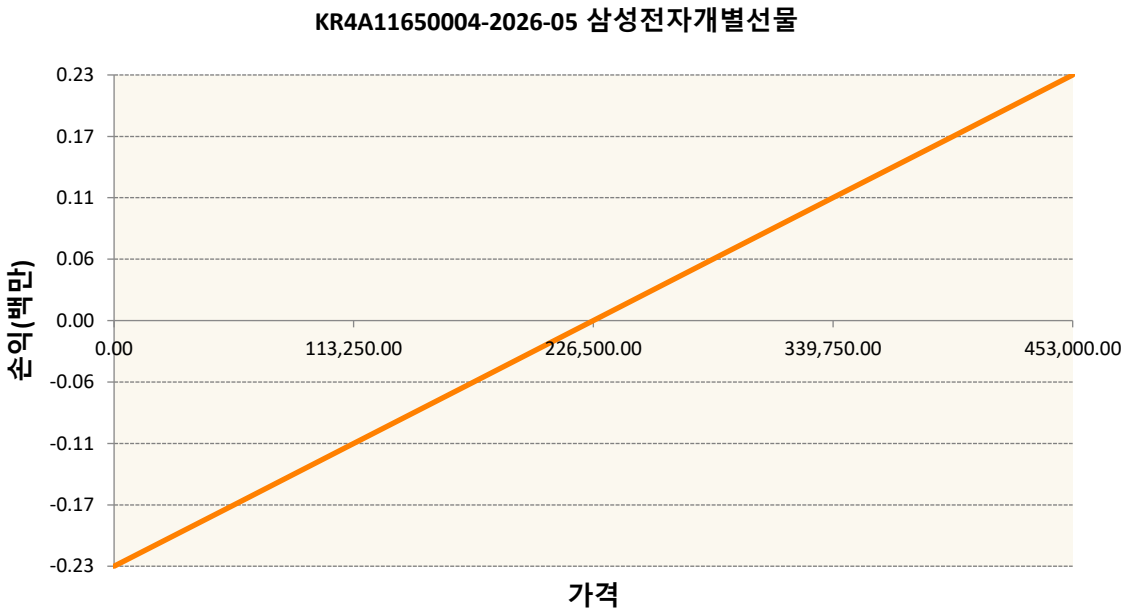
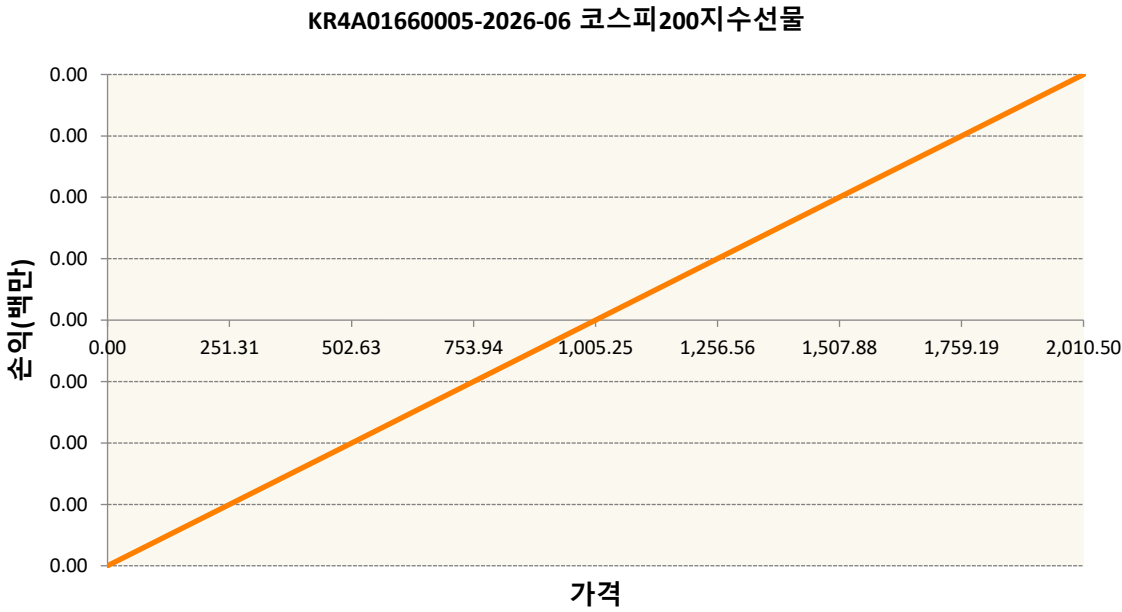
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

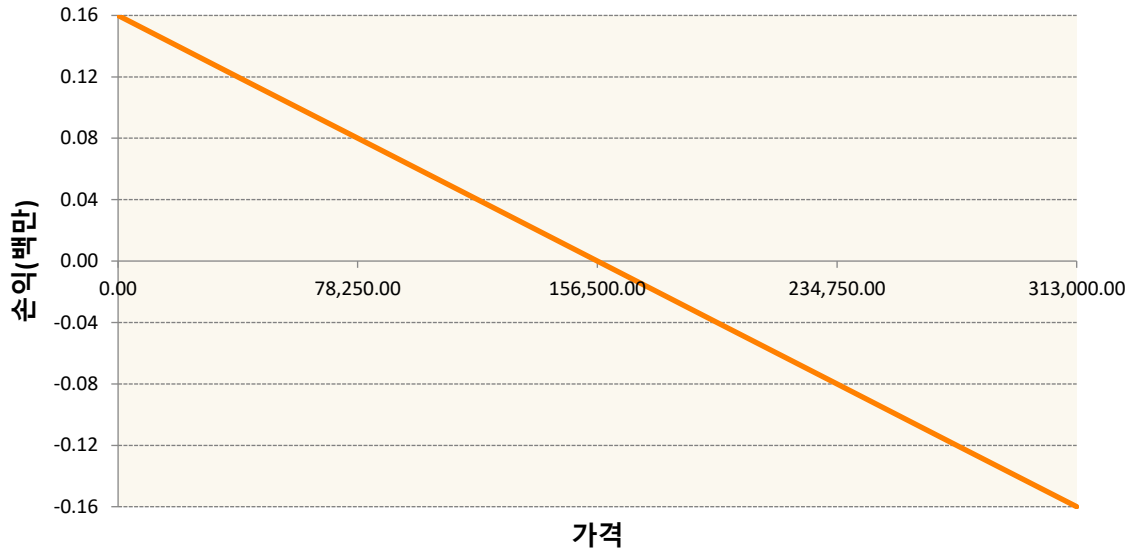
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,007	-1,007	장내
누계	유가증권	선물	29,599	4,790	24,808	장내

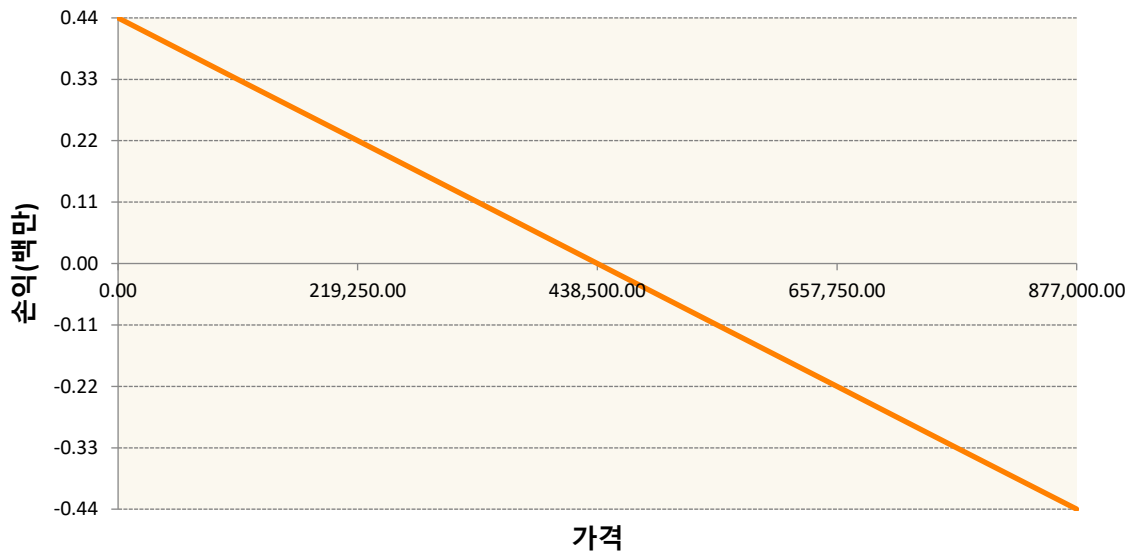
2. 만기시점의 손익구조



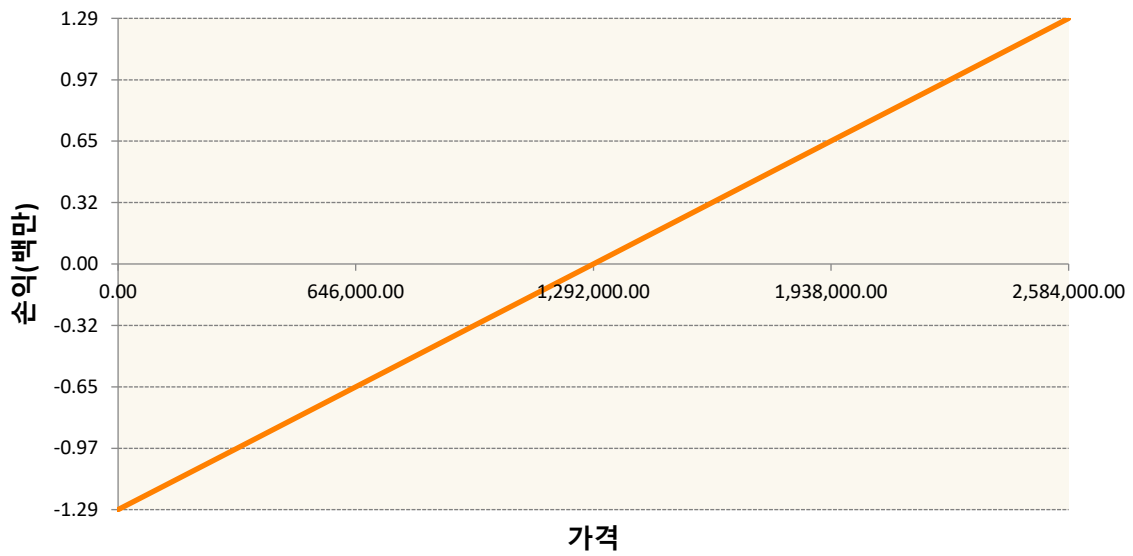
KR4A19650006-2026-05 기아개별선물



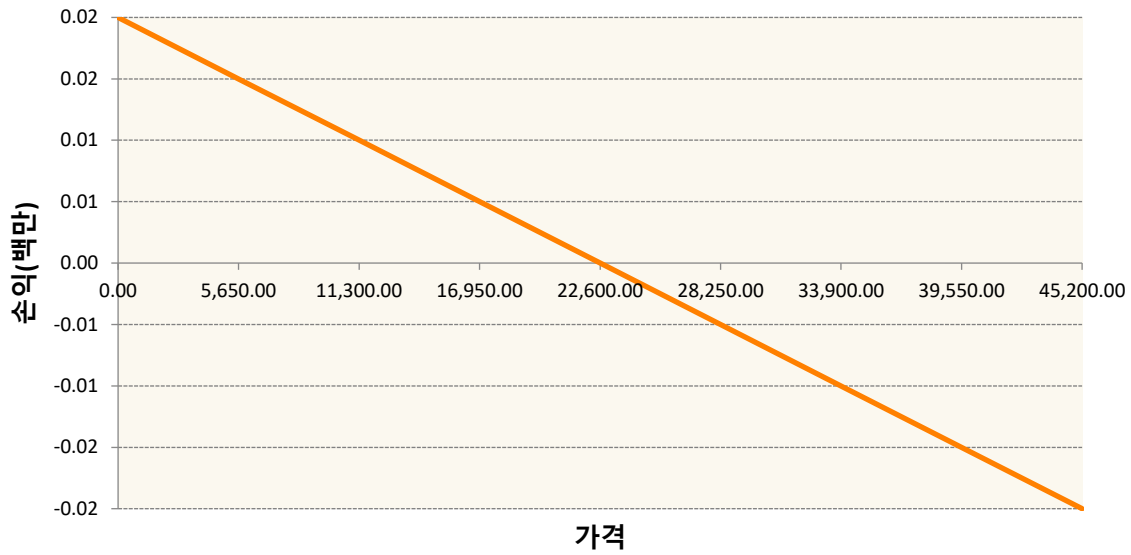
KR4A20650003-2026-05 현대모비스개별선물



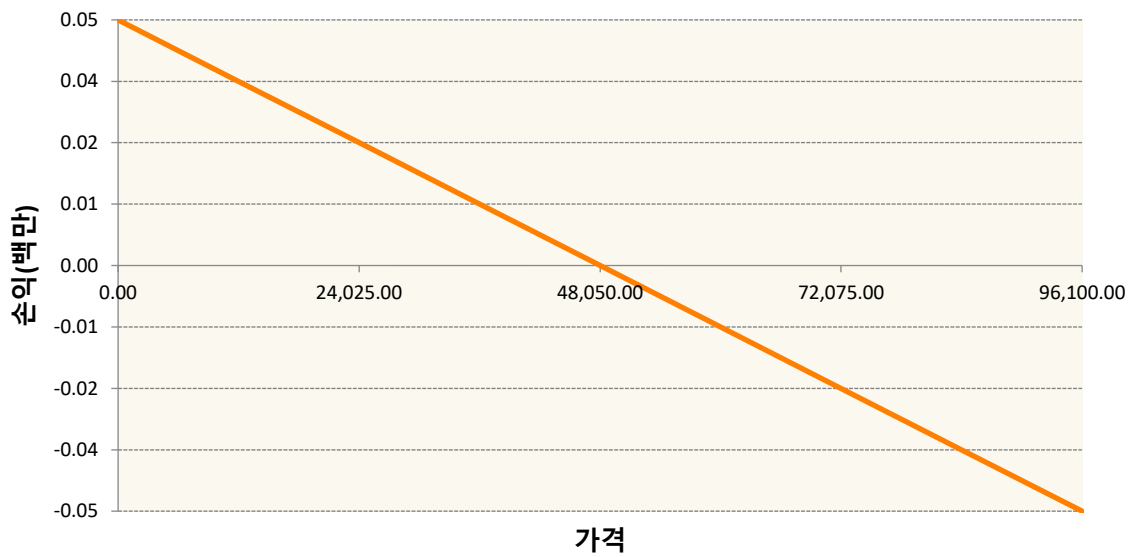
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



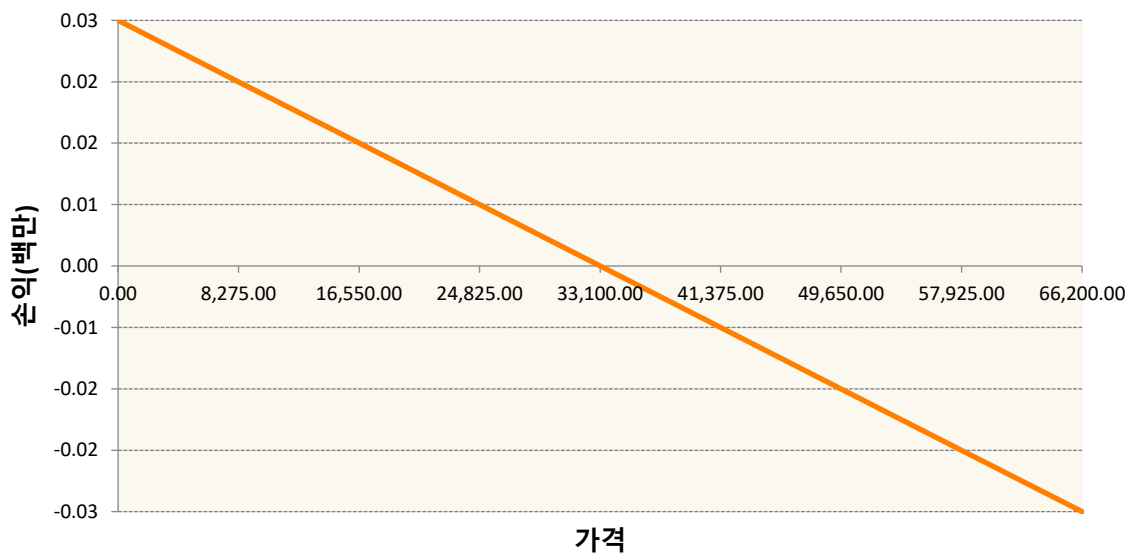
KR4AB4650001-2026-05 기업은행개별선물



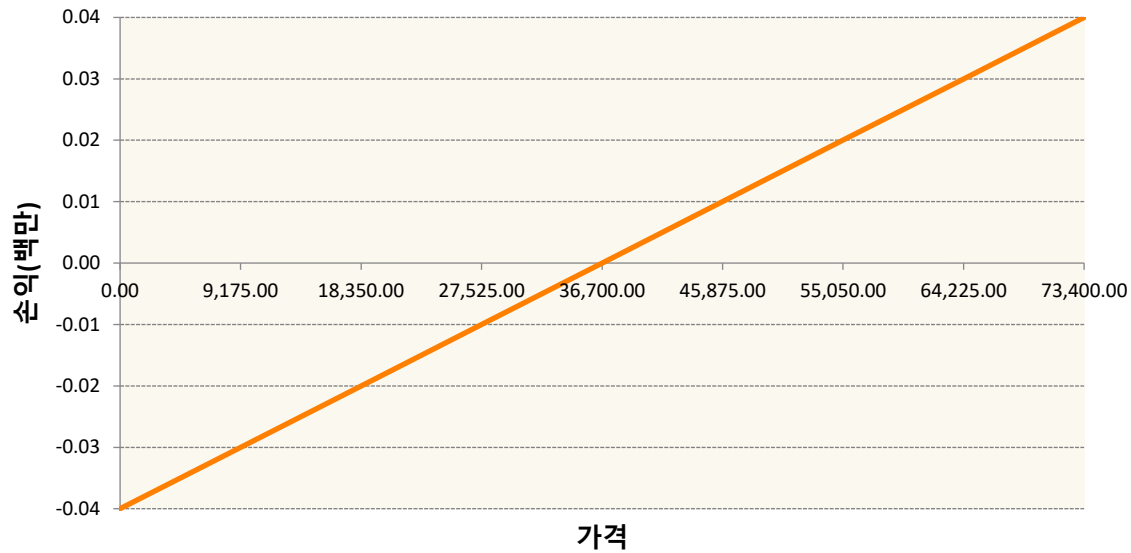
KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



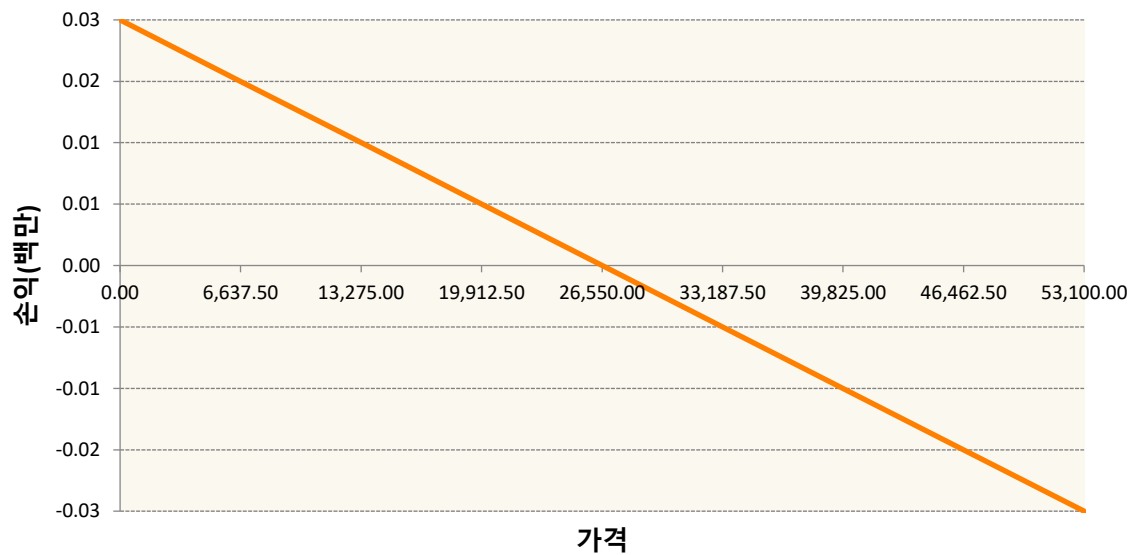
KR4AEB650008-2026-05 우리금융지주개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



KR4AGJ650008-2026-05 JB금융지주개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				1,993
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,993	-1,993	-1,993	-1,993	-1,993	-1,993	-1,993	
-5.33%	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	-1,329	
-2.67%	-664	-664	-664	-664	-664	-664	-664	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	664	664	664	664	664	664	664	
5.33%	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	1,329	
8.00%	1,993	1,993	1,993	1,993	1,993	1,993	1,993	
KR4A11650004				2026-05 삼성전자개별선물				187
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-187	-187	-187	-187	-187	-187	-187
-5.33%	-125	-125	-125	-125	-125	-125	-125
-2.67%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	62	62	62	62	62	62	62
5.33%	125	125	125	125	125	125	125
8.00%	187	187	187	187	187	187	187
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							60
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	60	60	60	60	60	60
-5.33%	40	40	40	40	40	40	40
-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%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
8.00%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60

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%	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 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

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 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
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	79	79	79	79	79	79	79

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)

5,741

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

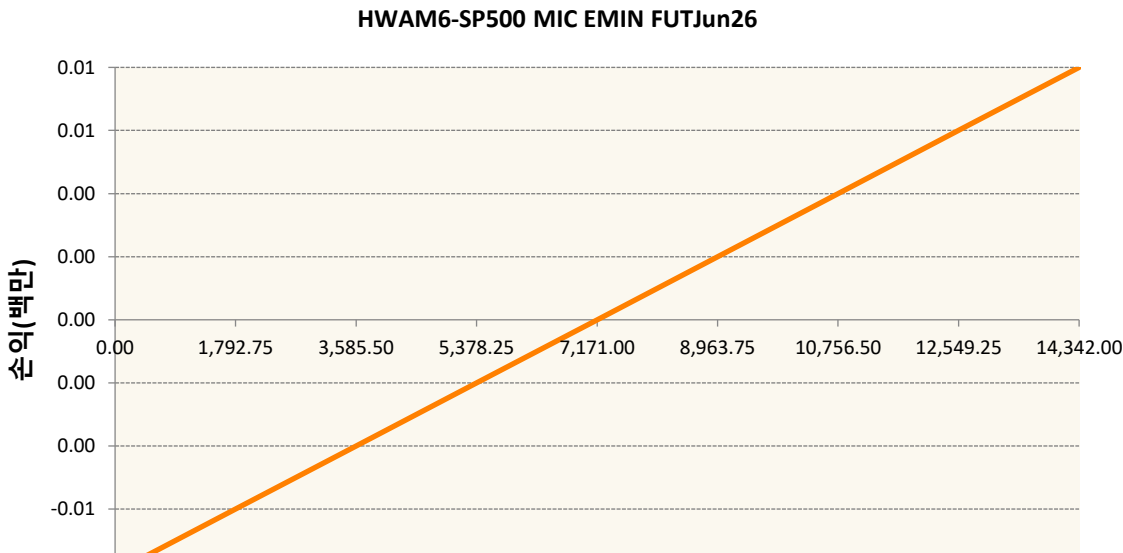
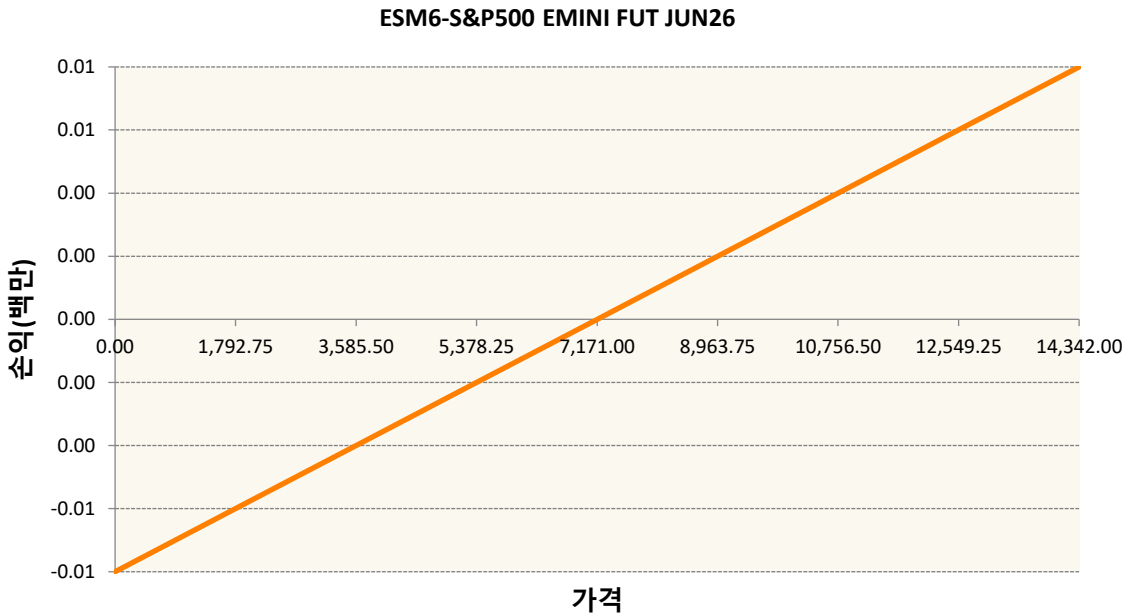
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

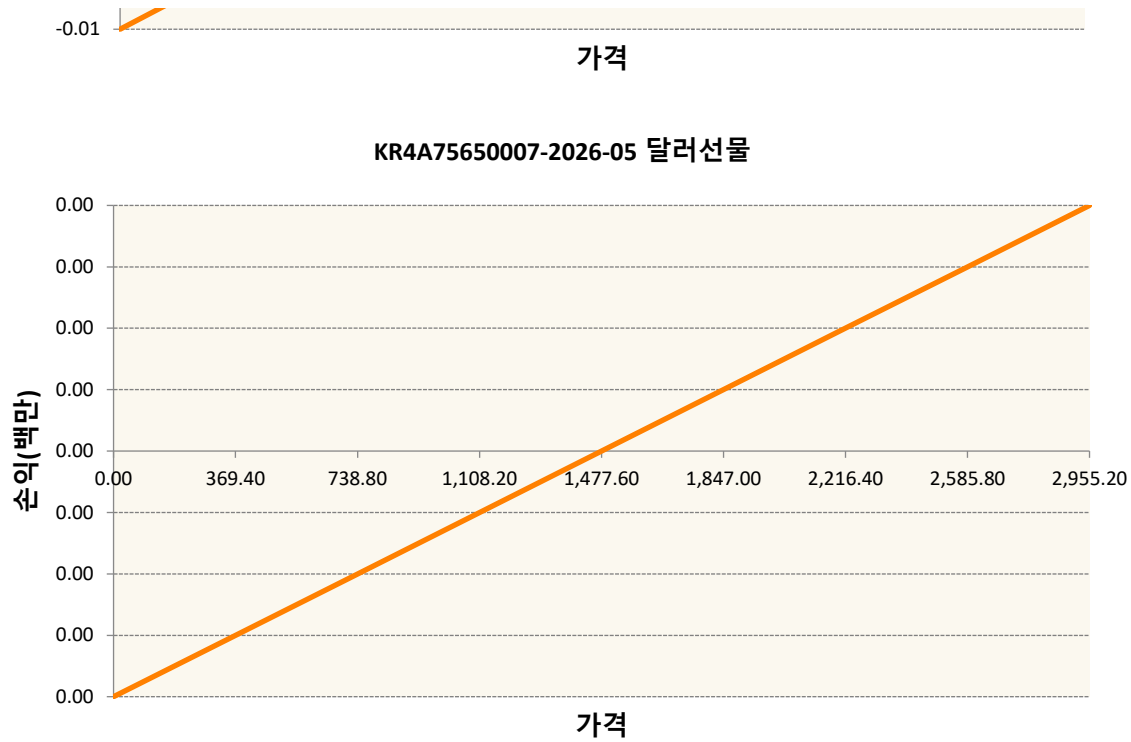
1. 계약금액

(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	57,006	0	57,006	
누계	지수	선물	267	0	267	장내
누계	통화	선물	10,491	0	10,491	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,561
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	21
KR4A756500 2026-05 달러선물		839

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

(단위:백만원)

3,988

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

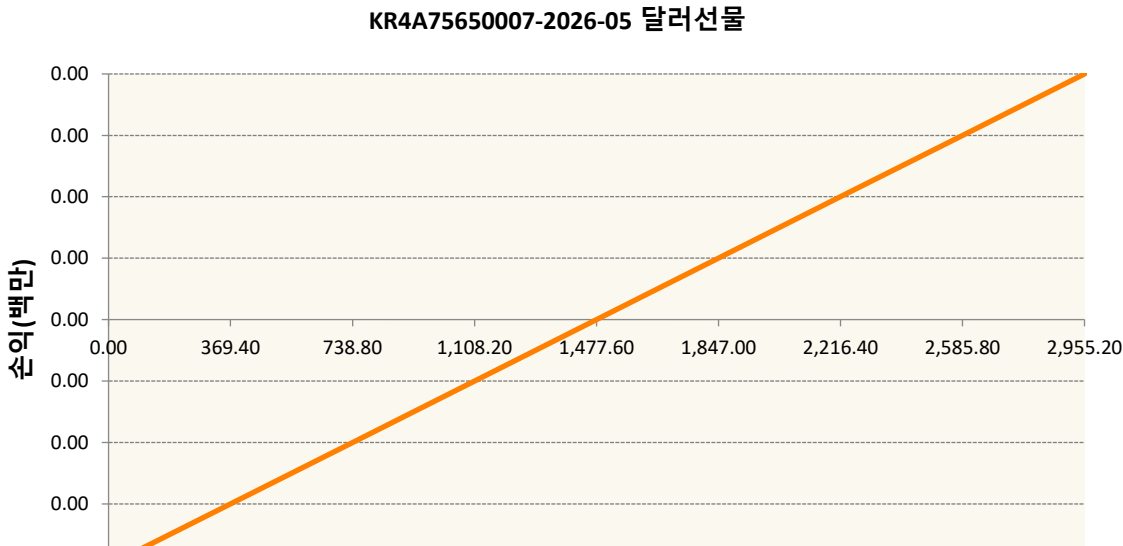
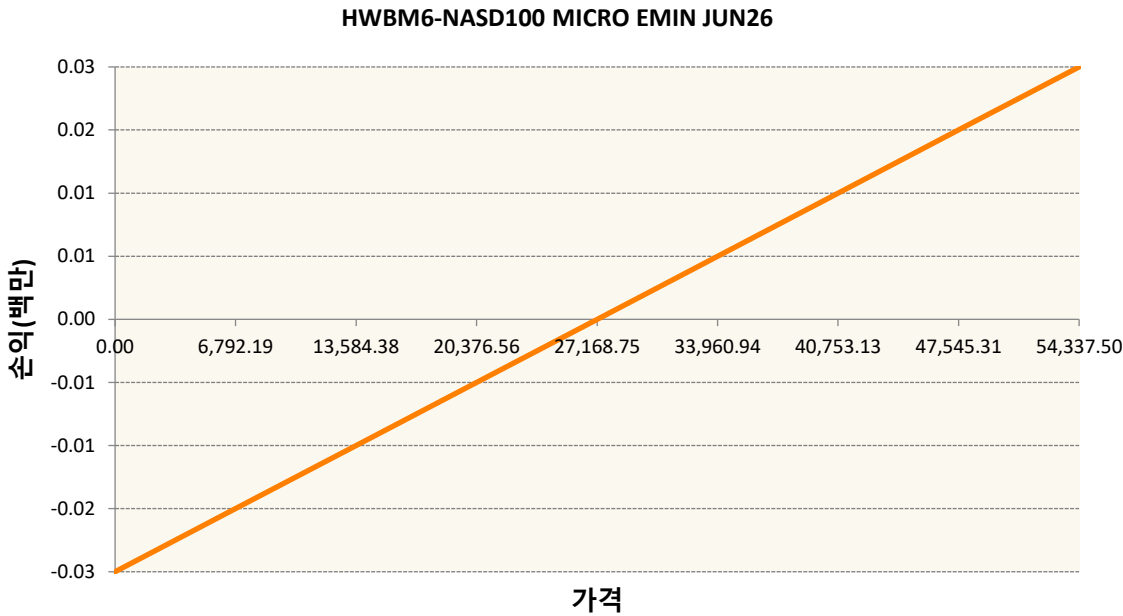
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

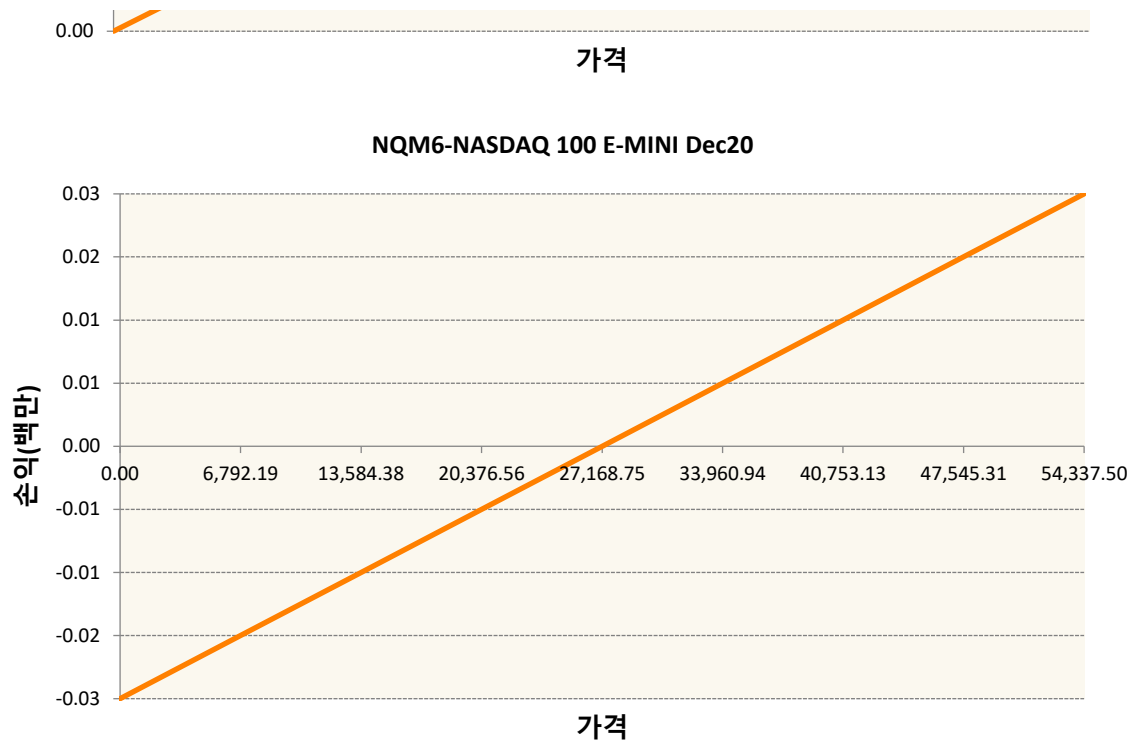
1. 계약금액

(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	25,255	0	25,255	
누계	유가증권	선물	404	0	404	장내
누계	통화	선물	3,857	0	3,857	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26		32
KR4A756500	2026-05 달러선물		309
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		2,020

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,255

공시일	2026-04-30
기준일	2026-04-29

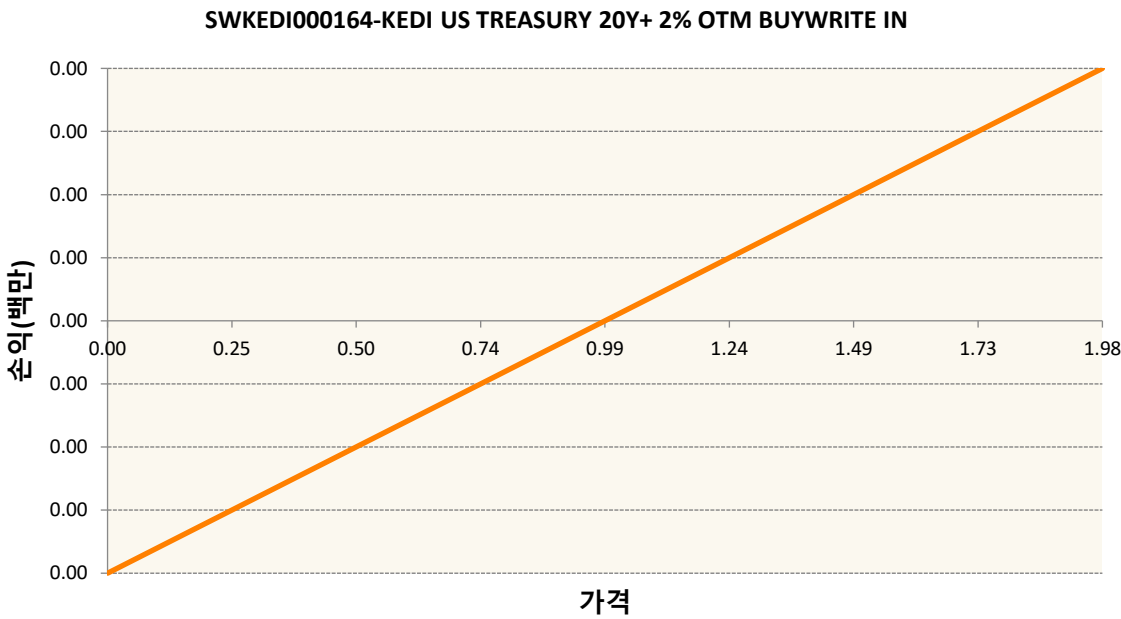
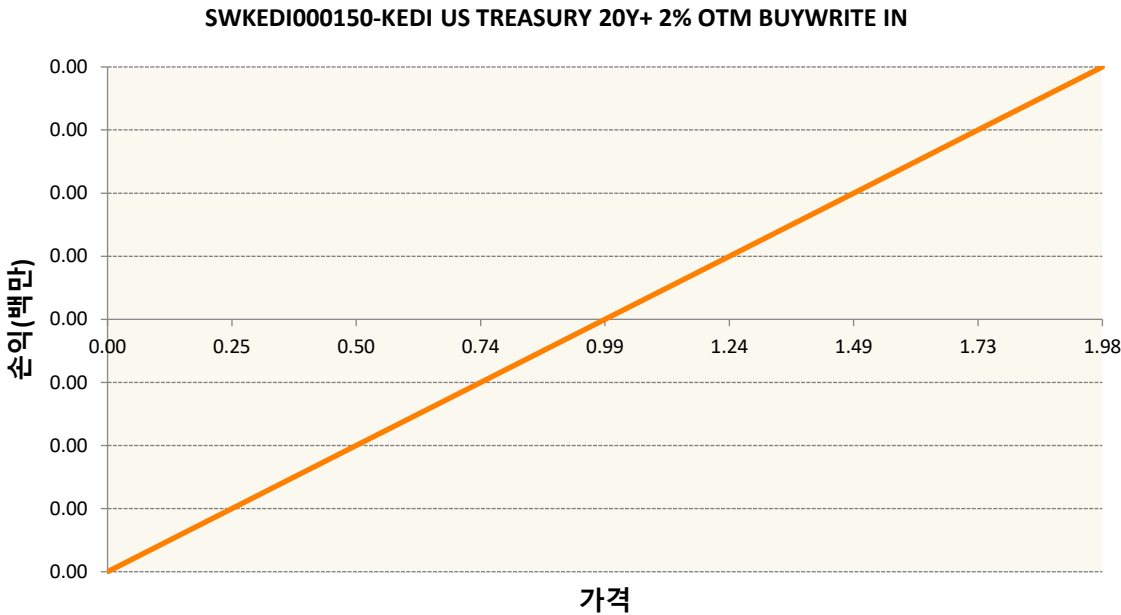
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

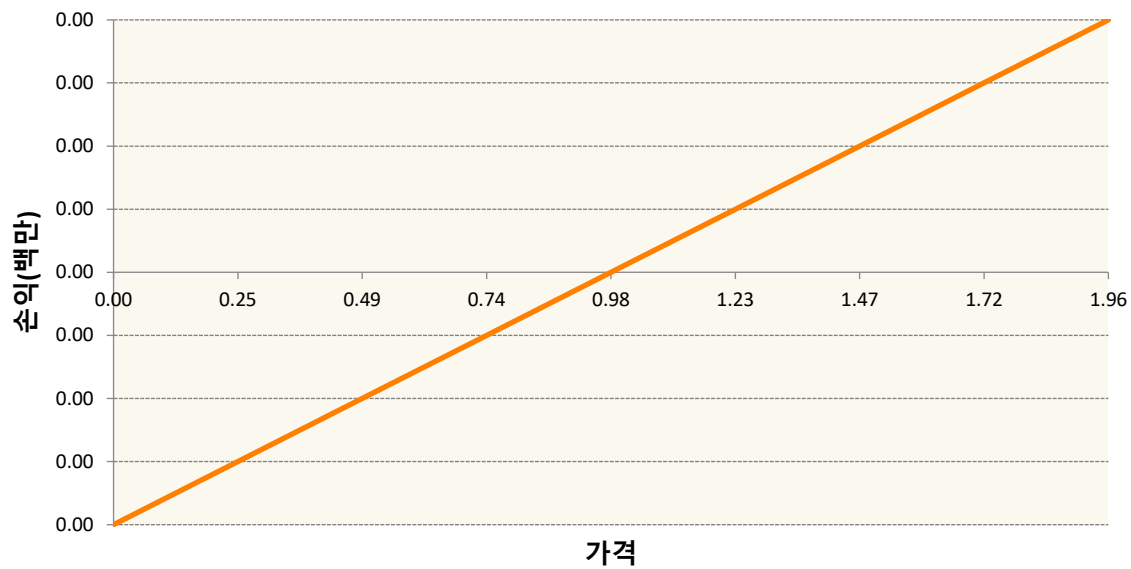
(단위:백만원)

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

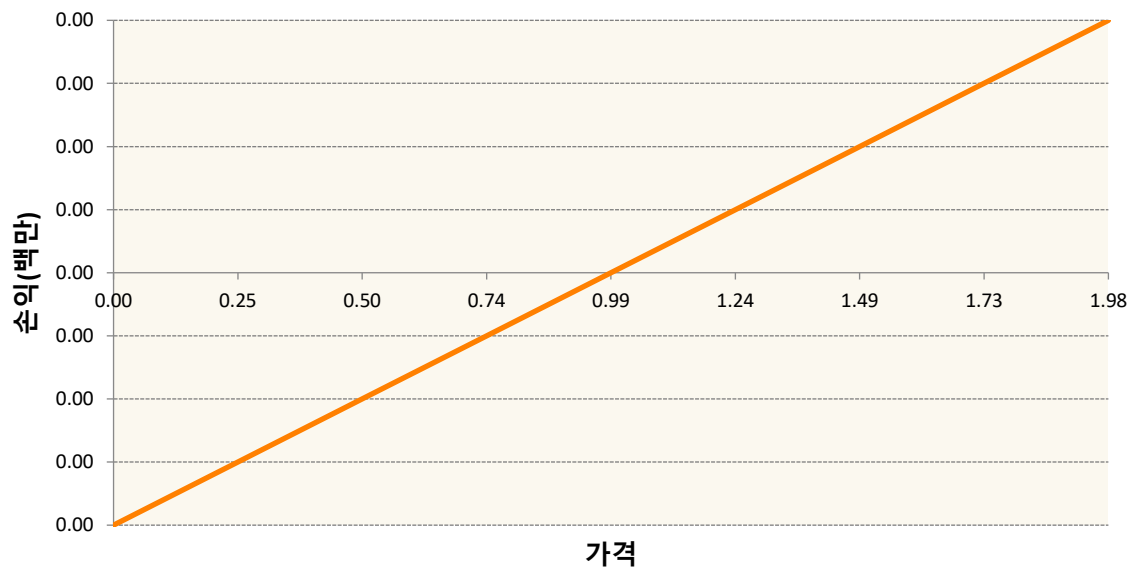
2. 만기시점의 손익구조



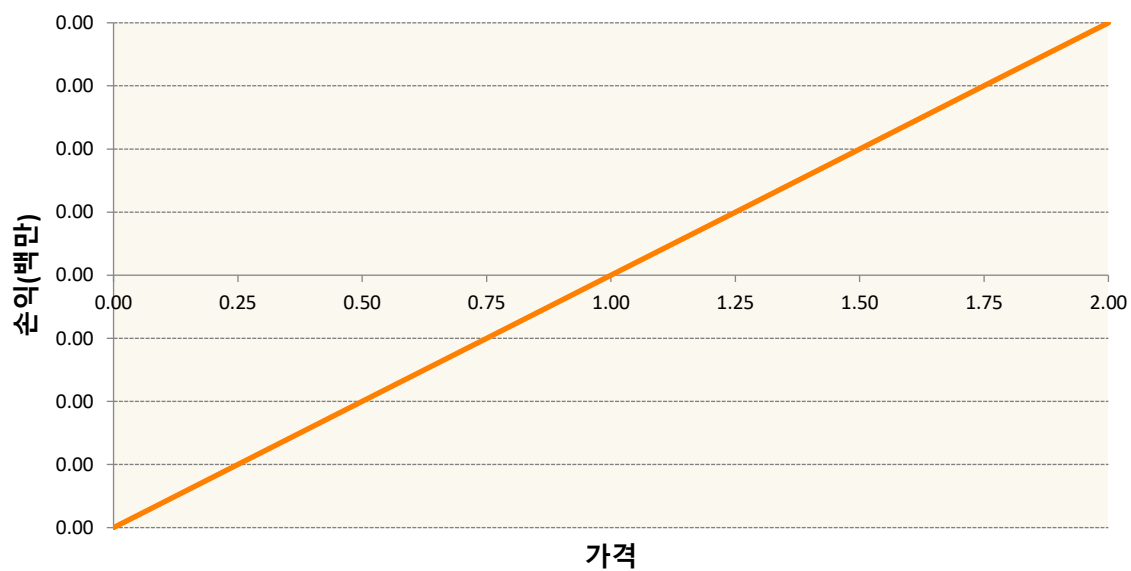
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,301
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		152
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,702
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,408
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,915

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,220