

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

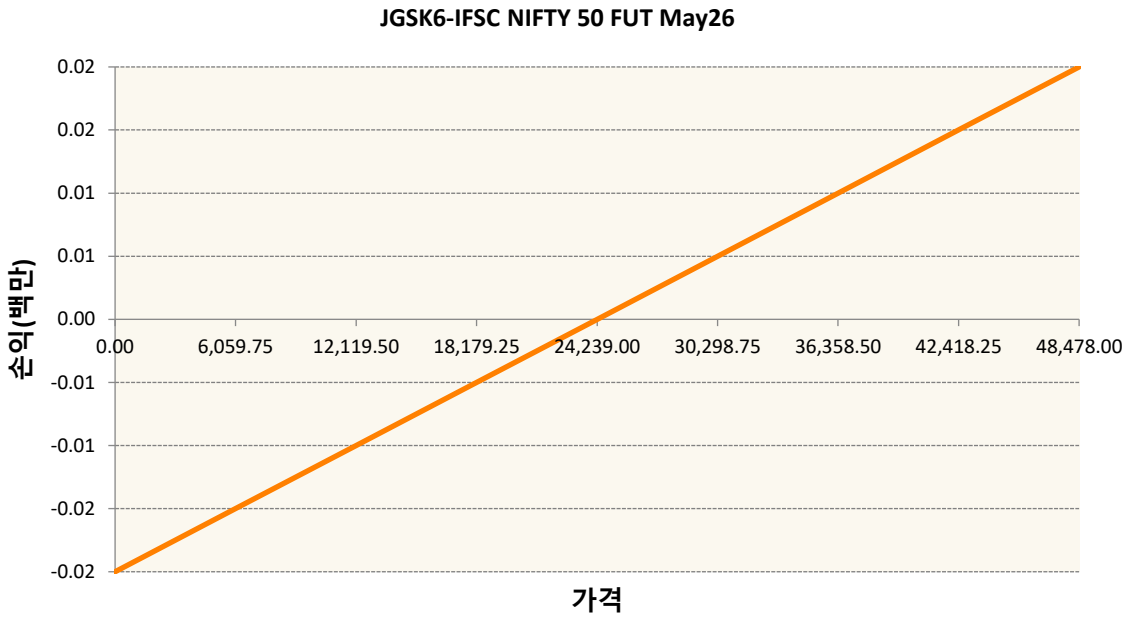
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	360	0	360	

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	2026-05-04
기준일	2026-04-30

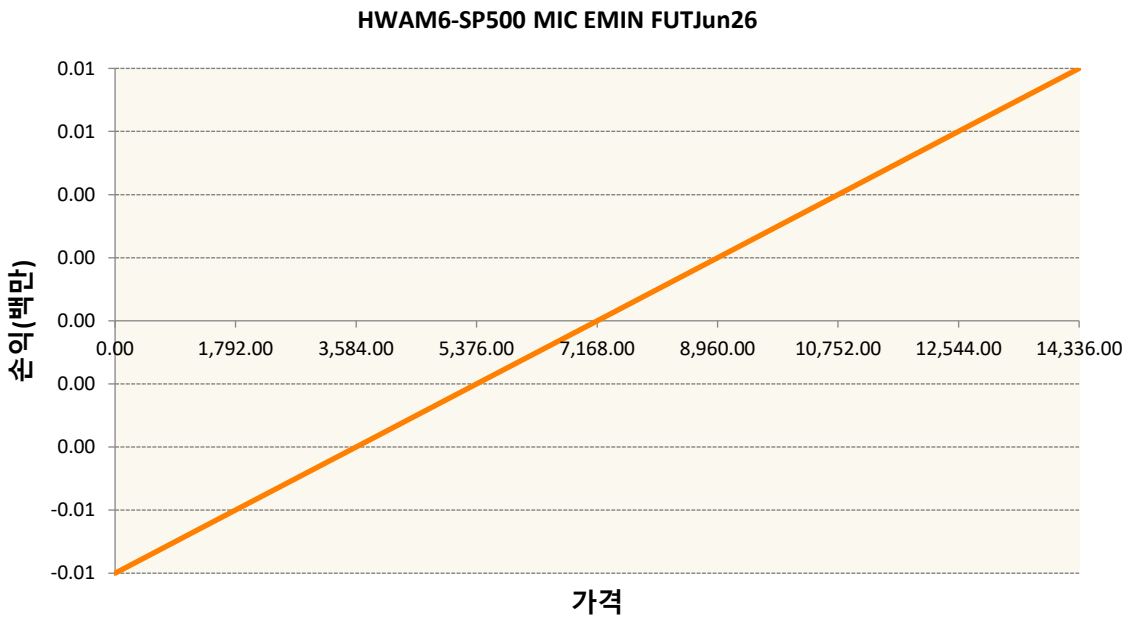
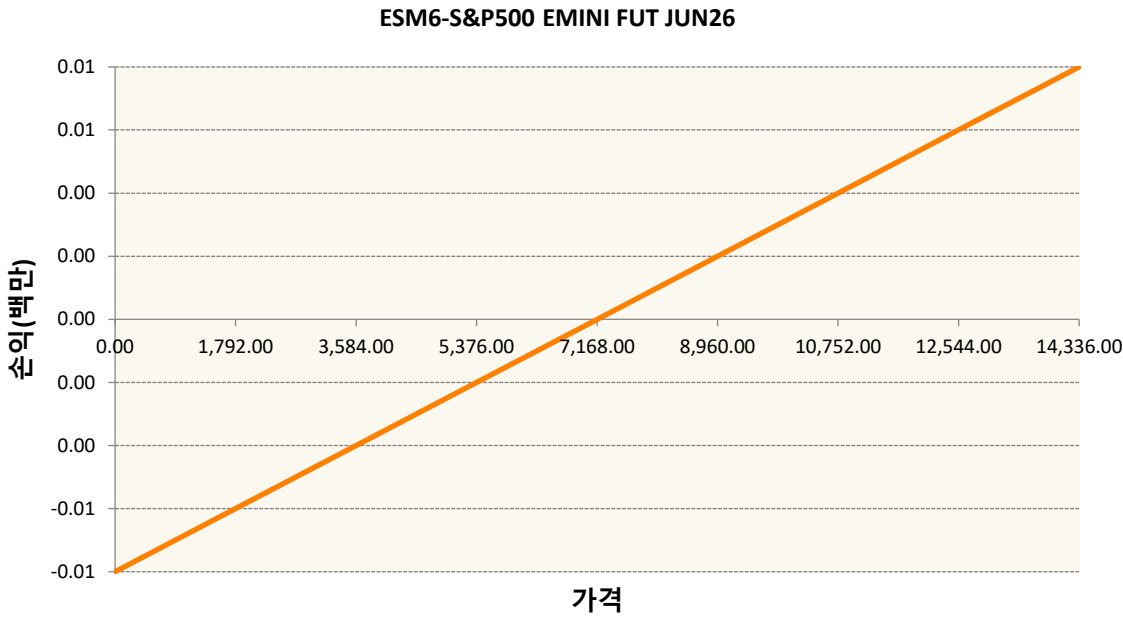
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-05-04
기준일	2026-04-30

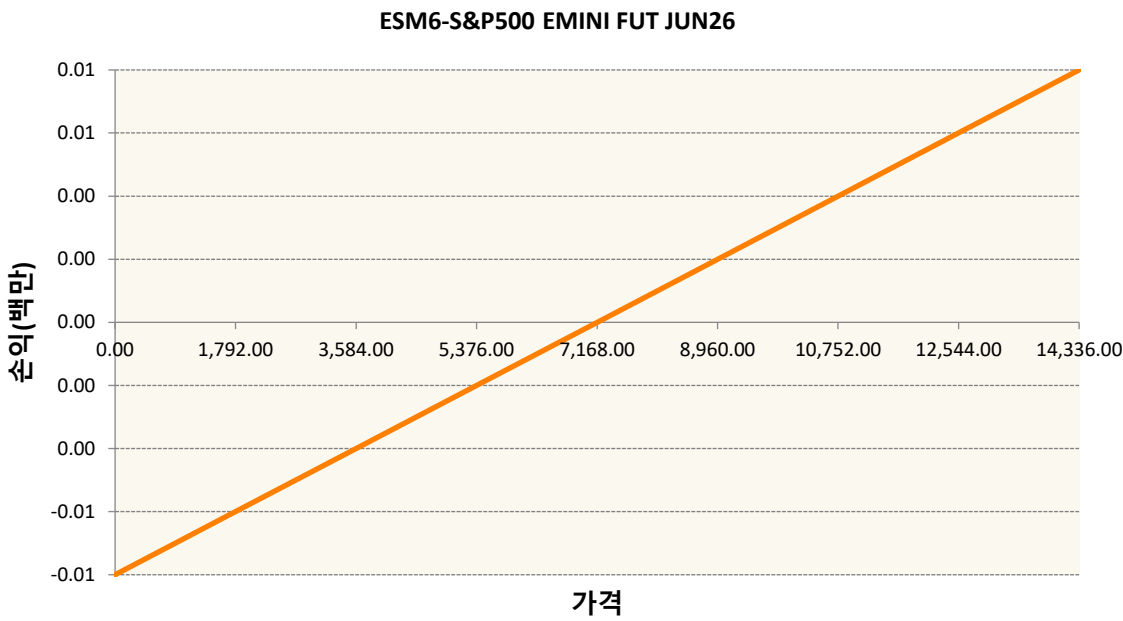
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

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	2026-05-04
기준일	2026-04-30

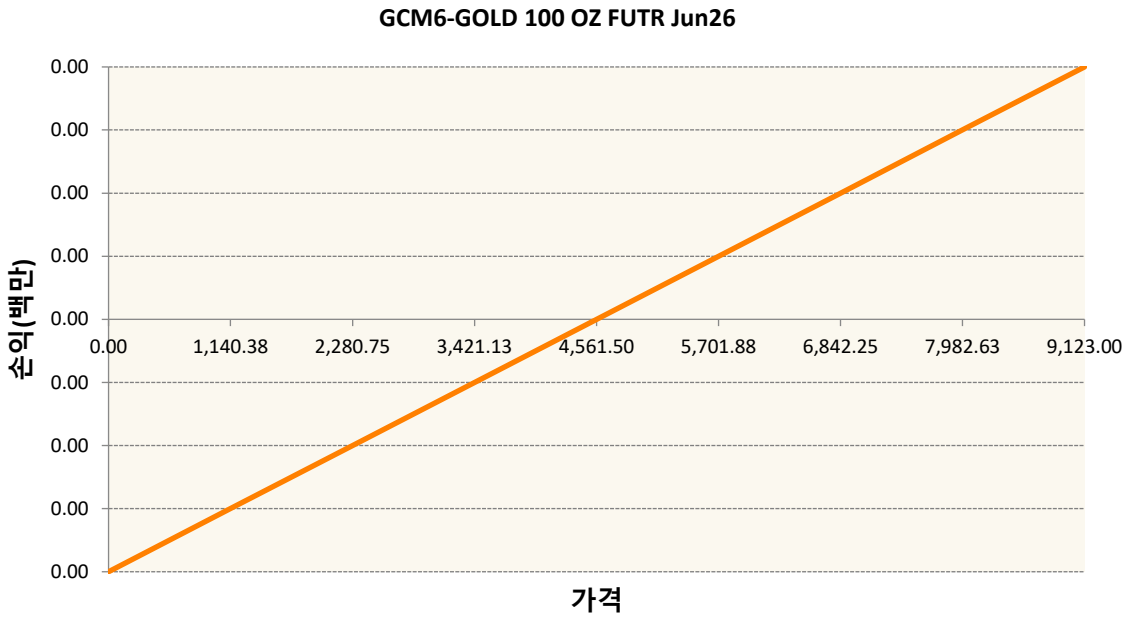
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,495	0	5,495	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	440

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

(단위:백만원)

563

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

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	373
AOPLTRSUP1 PLTR US 05/08/26 P155 EQUITY	44

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

(단위:백만원)

1,295

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

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

25

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

(단위:백만원)

15

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

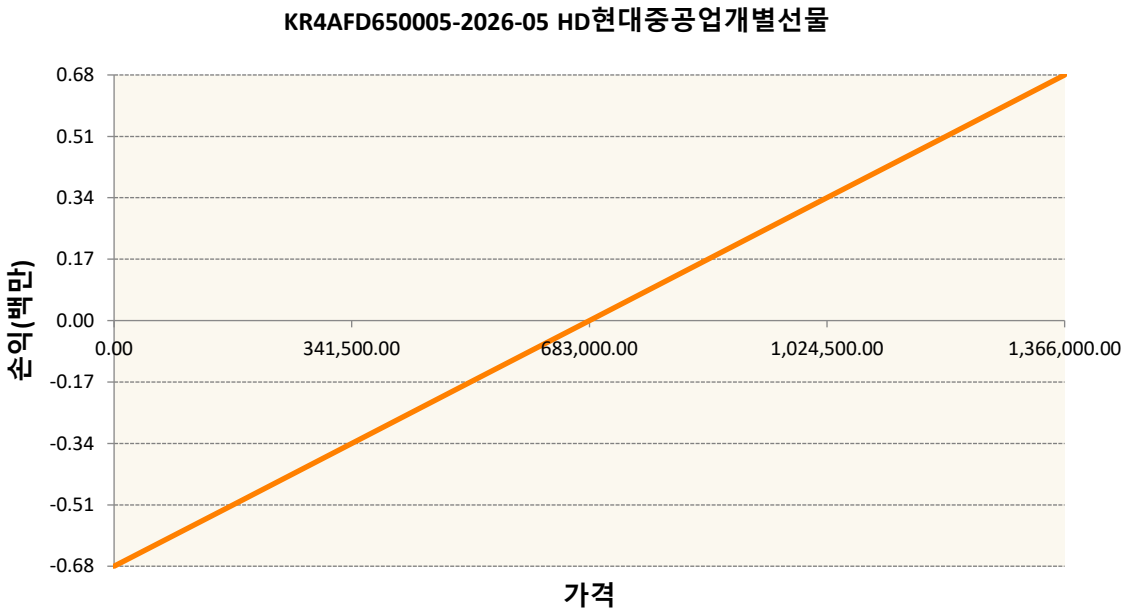
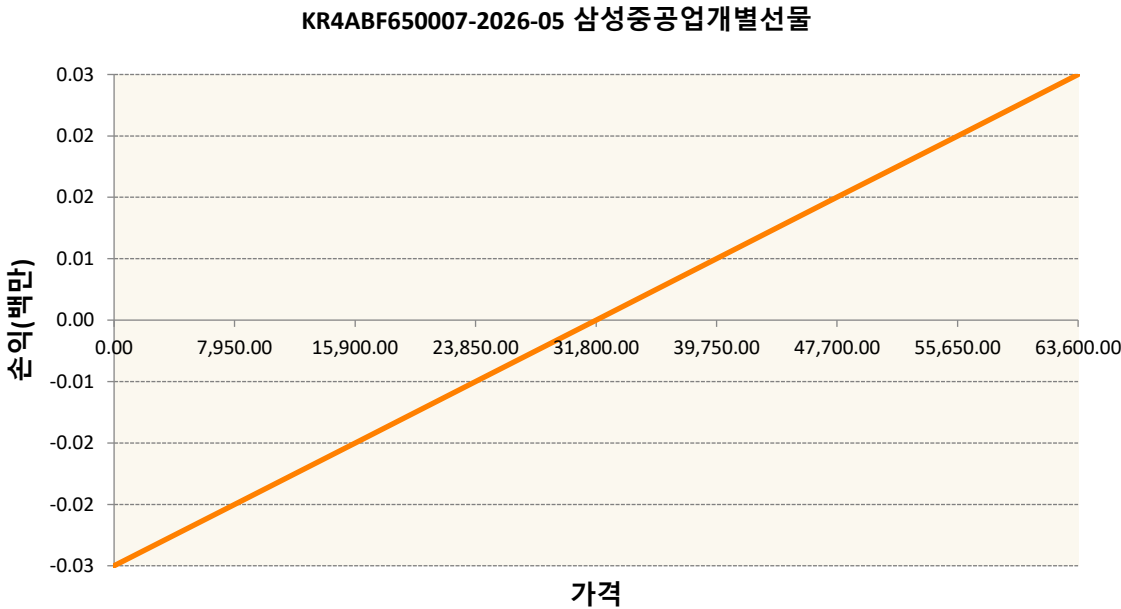
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

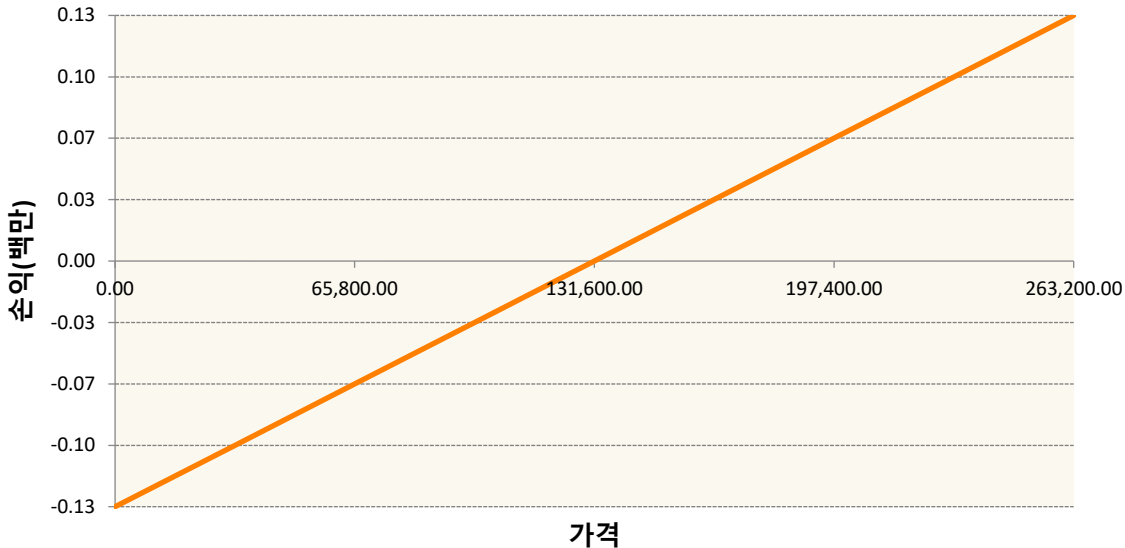
(단위:백만원)

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	34,948	0	34,948	장내
누계	유가증권	스왑	189,013	0	189,013	장외

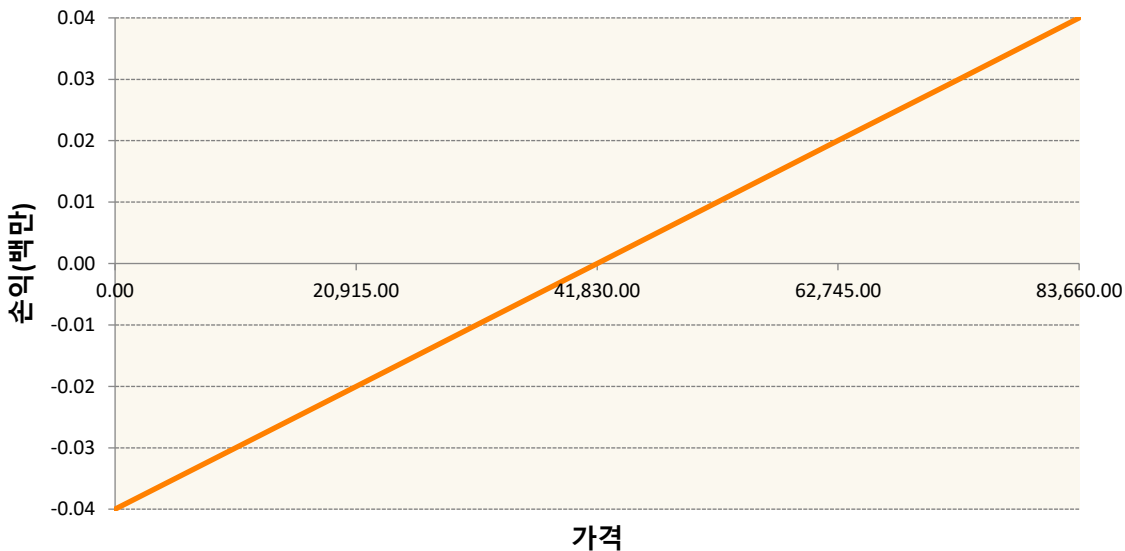
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007		2026-05 삼성중공업개별선물					1,190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	397	397	397	397	397	397	397
5.33%	794	794	794	794	794	794	794
8.00%	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190
KR4AFD650005		2026-05 HD현대중공업개별선물					1,041
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041	-1,041
-5.33%	-694	-694	-694	-694	-694	-694	-694
-2.67%	-347	-347	-347	-347	-347	-347	-347
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	347	347	347	347	347	347	347
5.33%	694	694	694	694	694	694	694
8.00%	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041	1,041
KR4AFV650003 2026-05 한화오션개별선물							588
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-588	-588	-588	-588	-588	-588	-588
-5.33%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
-2.67%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	196	196	196	196	196	196	196
5.33%	392	392	392	392	392	392	392
8.00%	588	588	588	588	588	588	588

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

(단위:백만원)

4,384

공시일 2026-05-04

기준일 2026-04-30

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	2026-05-04
기준일	2026-04-30

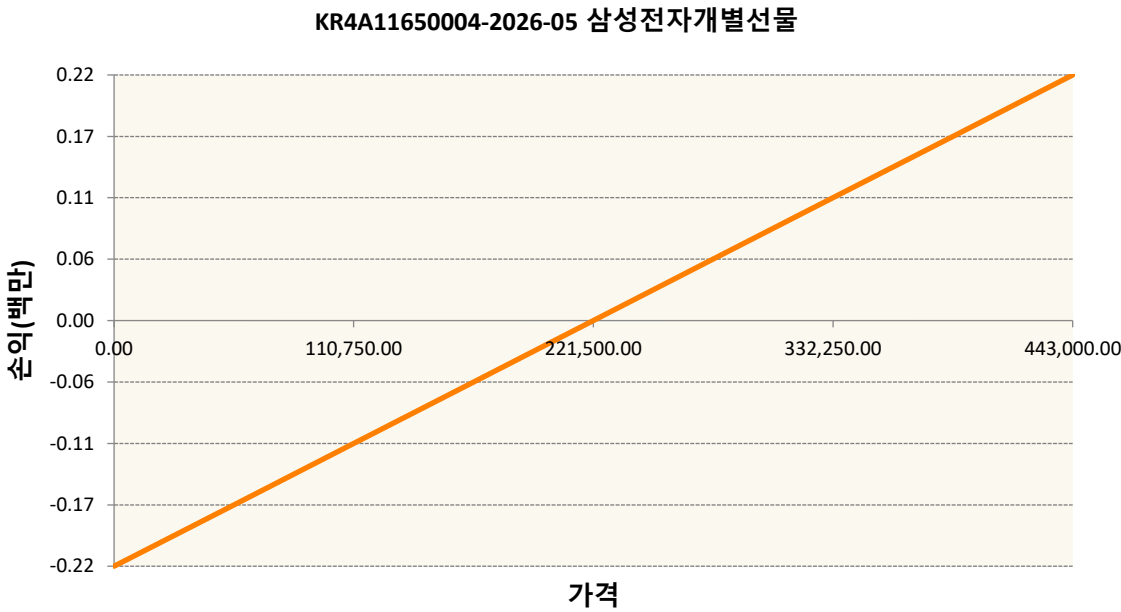
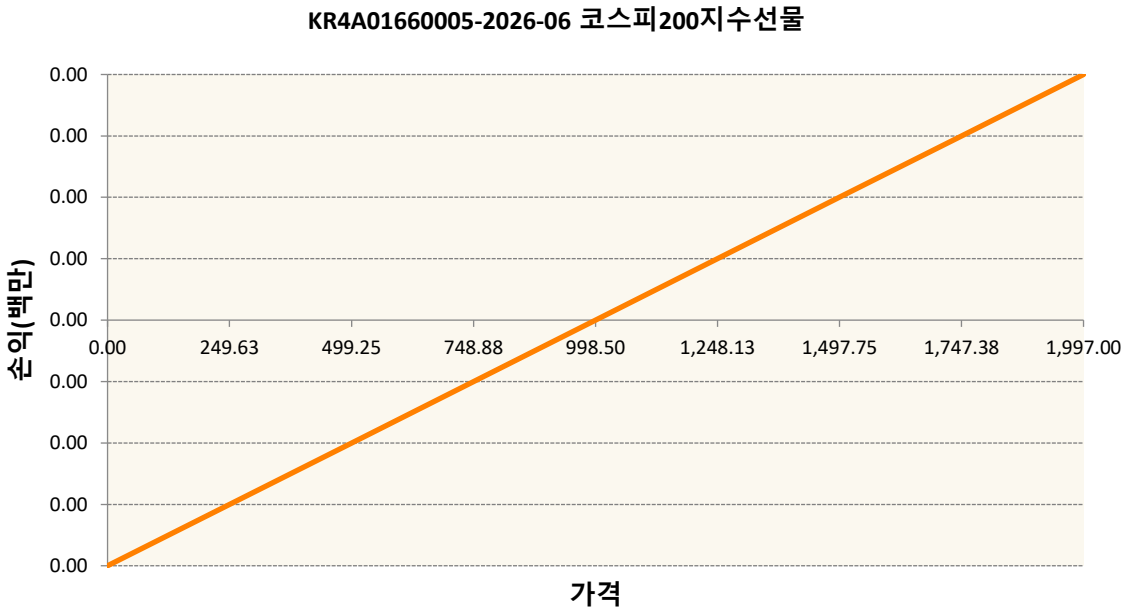
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	44,040	-44,040	장내
누계	유가증권	선물	12,914	43,488	-30,574	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 1,985.00 with major ticks every 248.13. The y-axis represents Net Income, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A blue line starts at (0, 0.00) and ends at (1,985.00, 0.00).

가격	순이익(백만)
0.00	0.00
248.13	0.00
496.25	0.00
744.38	0.00
992.50	0.00
1,240.63	0.00
1,488.75	0.00
1,736.88	0.00
1,985.00	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 1,990.00 with major ticks every 248.75. The y-axis represents net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid blue line starts at the origin (0, 0.00) and extends to the point (1,990.00, 0.00), indicating a constant rate of change.

가액	순익 (백만)
0.00	0.00
248.75	0.00
497.50	0.00
746.25	0.00
995.00	0.00
1,243.75	0.00
1,492.50	0.00
1,741.25	0.00
1,990.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					516
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-516	-516	-516	-516	-516	-516	-516
-5.33%	-344	-344	-344	-344	-344	-344	-344
-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%	344	344	344	344	344	344	344
8.00%	516	516	516	516	516	516	516
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물					512
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-512	-512	-512	-512	-512	-512	-512
-5.33%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341
-2.67%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	171	171	171	171	171	171	171
5.33%	341	341	341	341	341	341	341
8.00%	512	512	512	512	512	512	512
KR4BAFBB9927 코스피위클리M C 2605W1 992.5							1,389

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,389	1,389	1,389	1,389	1,389	1,389	1,389
-5.33%	926	926	926	926	926	926	926
-2.67%	463	463	463	463	463	463	463
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
5.33%	-926	-926	-926	-926	-926	-926	-926
8.00%	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389

KR4BAFBB9950 코스피위클리M C 2605W1 995.0							2,084
-------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-------

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,084	2,084	2,084	2,084	2,084	2,084	2,084
-5.33%	1,389	1,389	1,389	1,389	1,389	1,389	1,389
-2.67%	695	695	695	695	695	695	695
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-695	-695	-695	-695	-695	-695	-695
5.33%	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389
8.00%	-2,084	-2,084	-2,084	-2,084	-2,084	-2,084	-2,084

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

(단위:백만원)

9,749

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

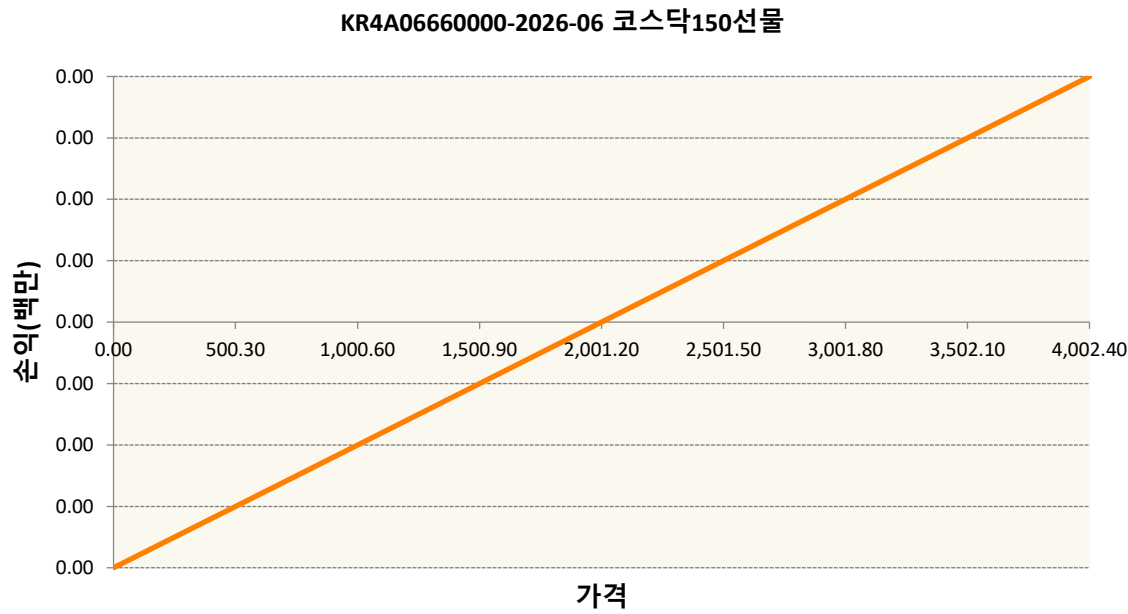
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	901	0	901	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06660000				2026-06 코스닥150선물			72
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-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%	72	72	72	72	72	72	72

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

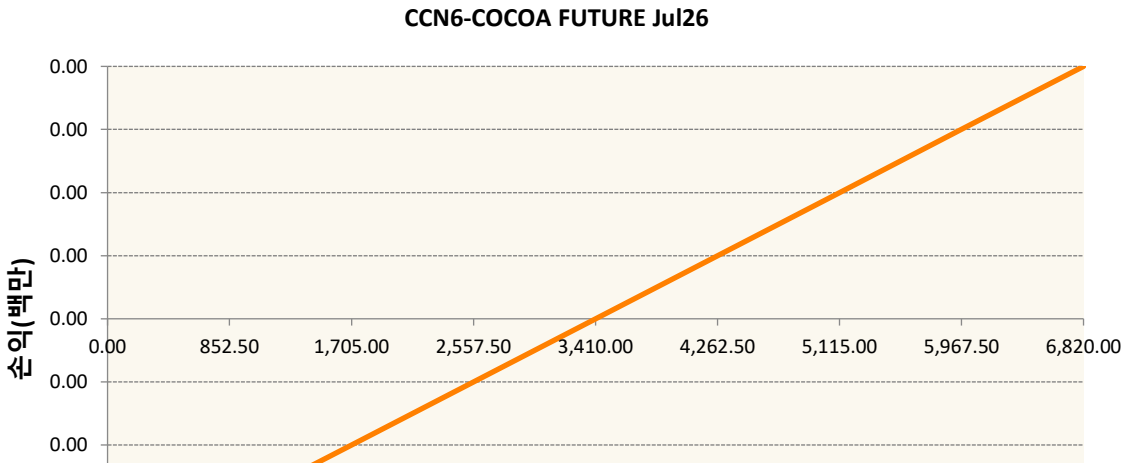
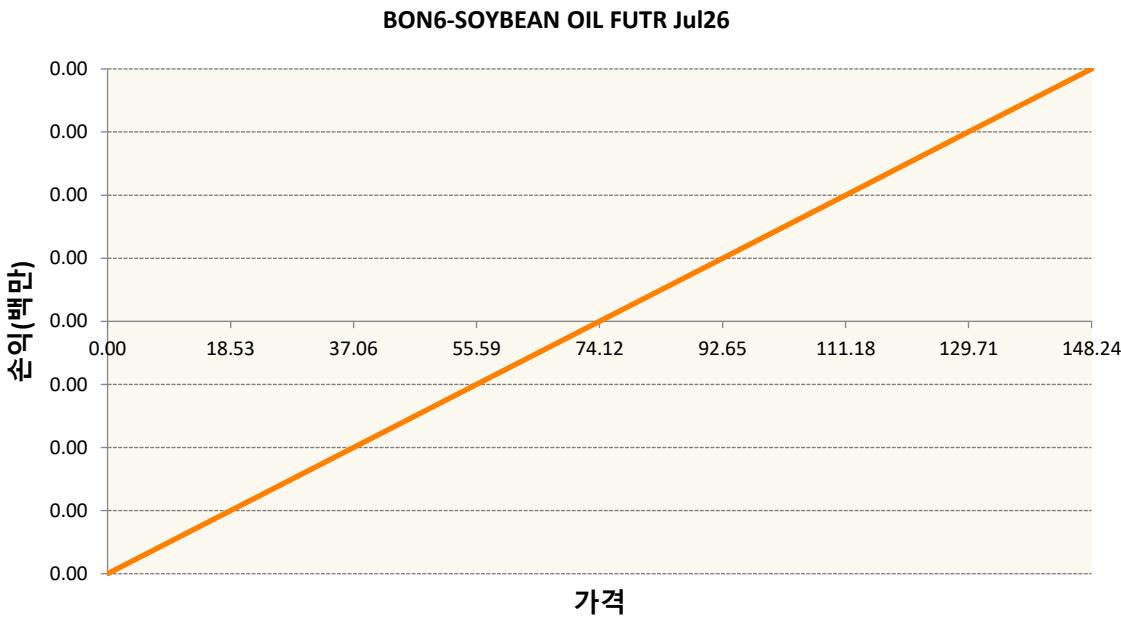
포커스농산물모(채권-파생형)

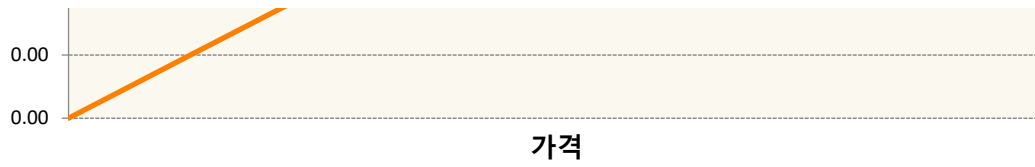
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

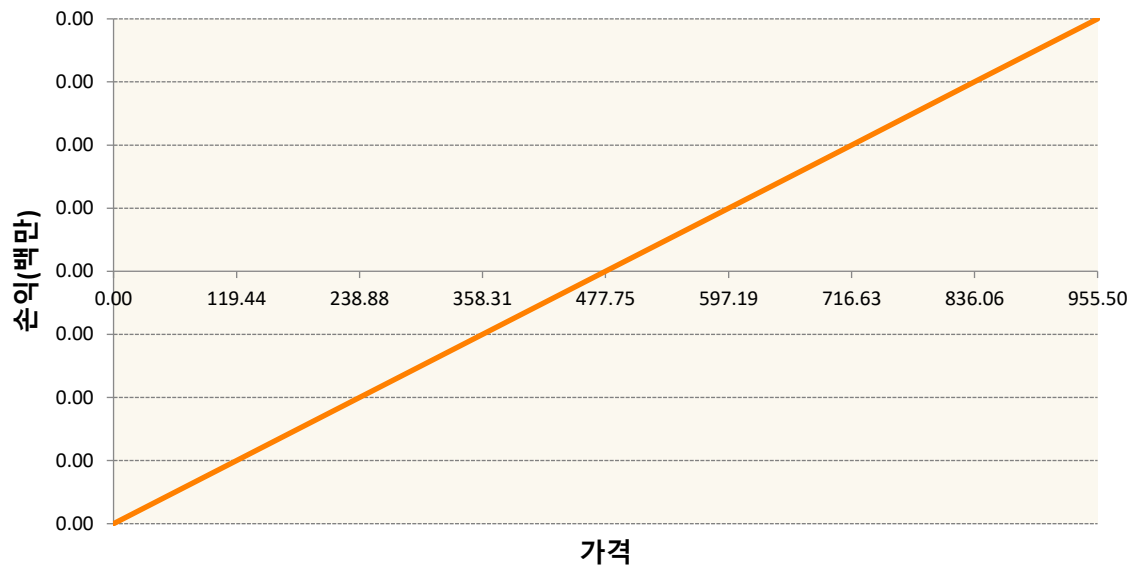
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	102	0	102	
누계	실물자산	선물	915	0	915	장내
누계	유가증권	선물	2,058	0	2,058	
누계	통화	선물	0	415	-415	장내

2. 만기시점의 손익구조

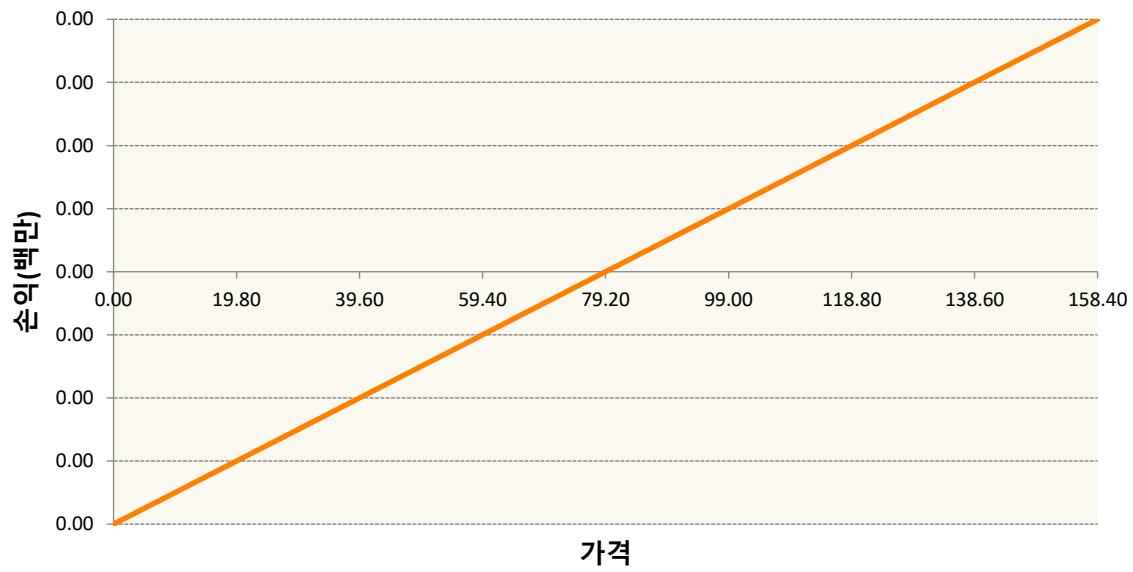




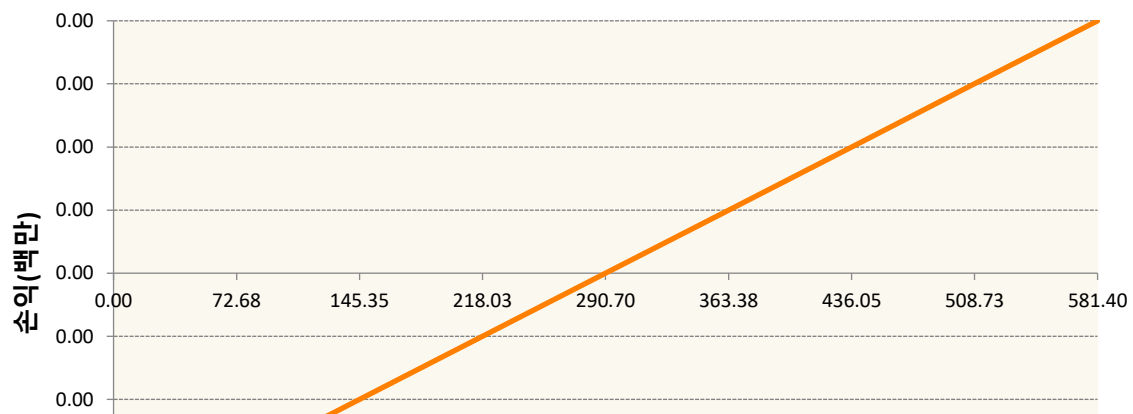
CN6-CORN FUTURE Jul26

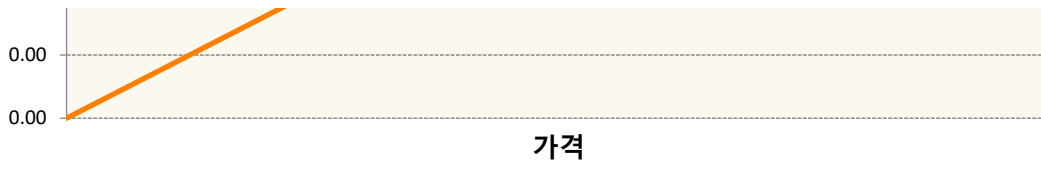


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

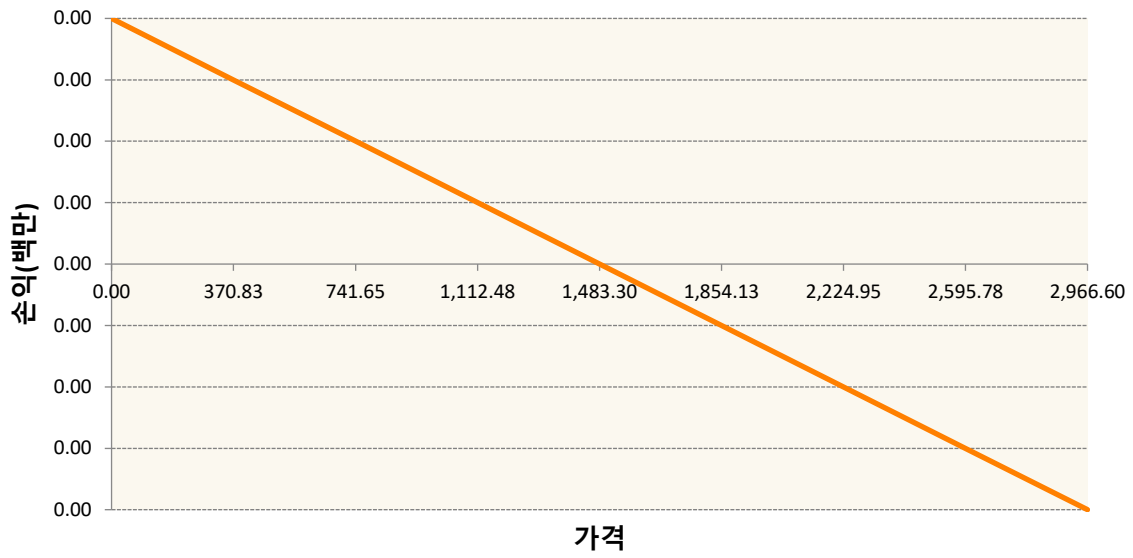


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

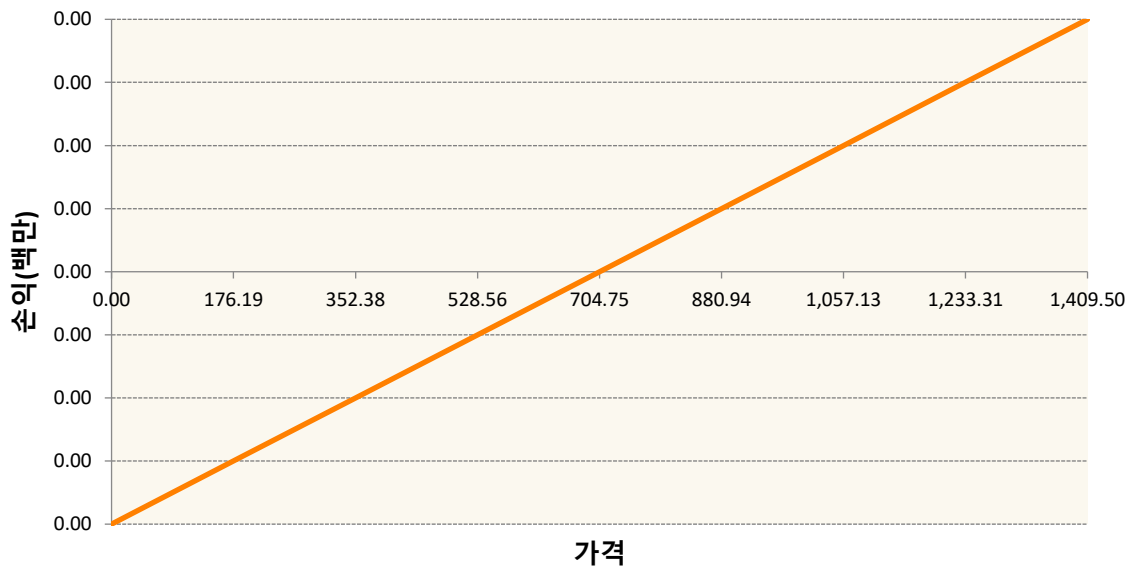




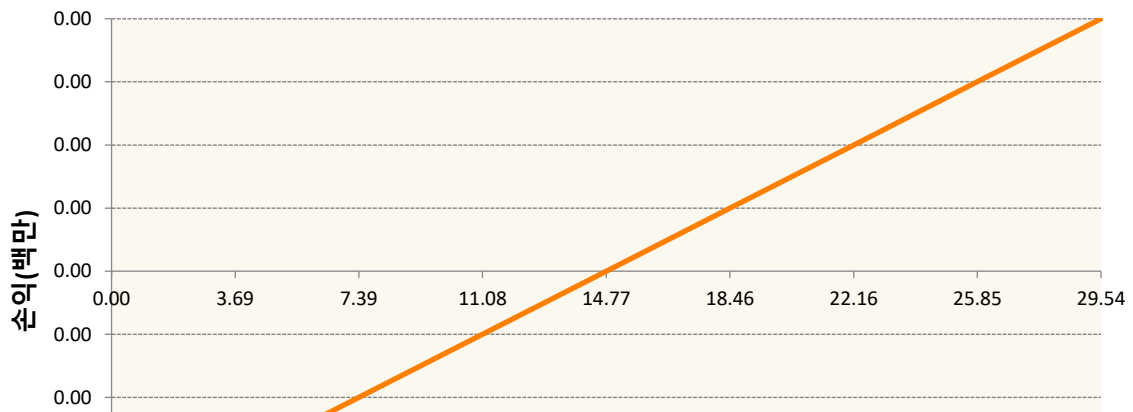
KR4A75650007-2026-05 달러선물

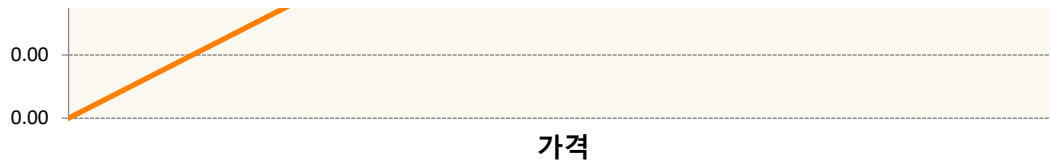


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

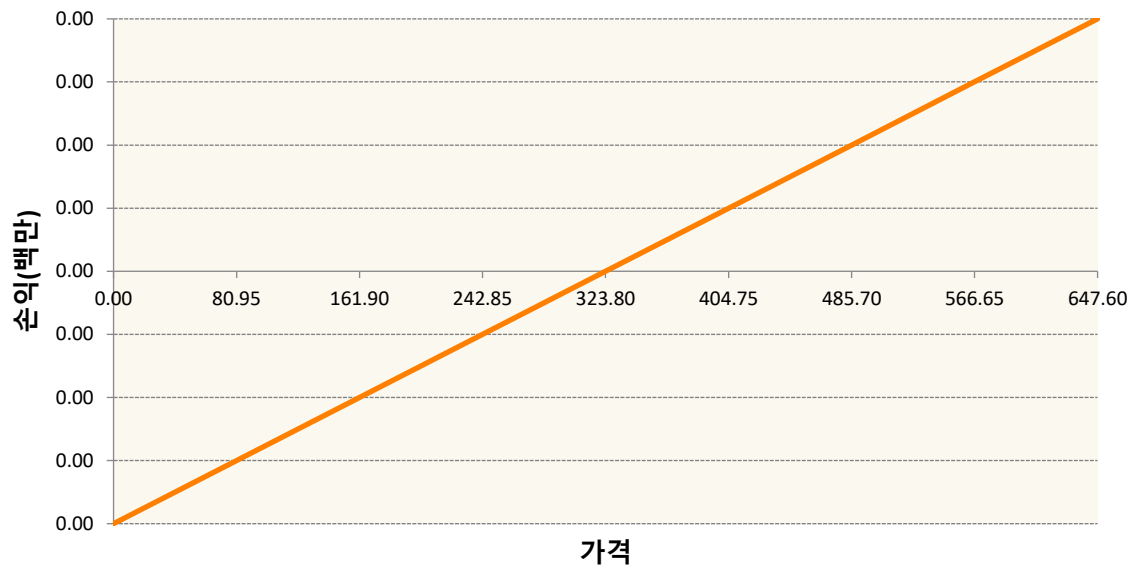


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

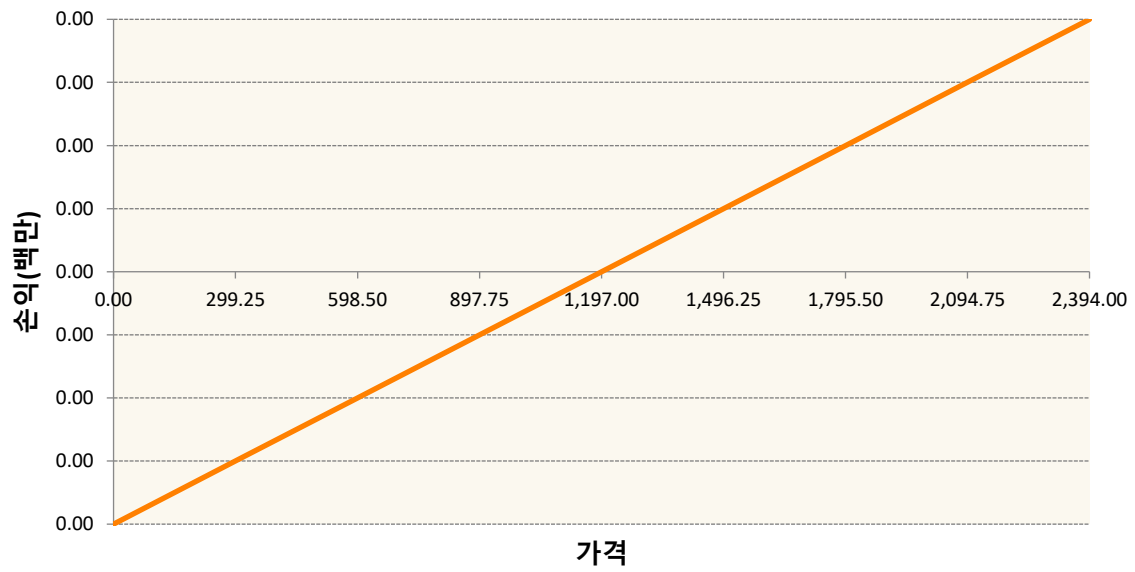




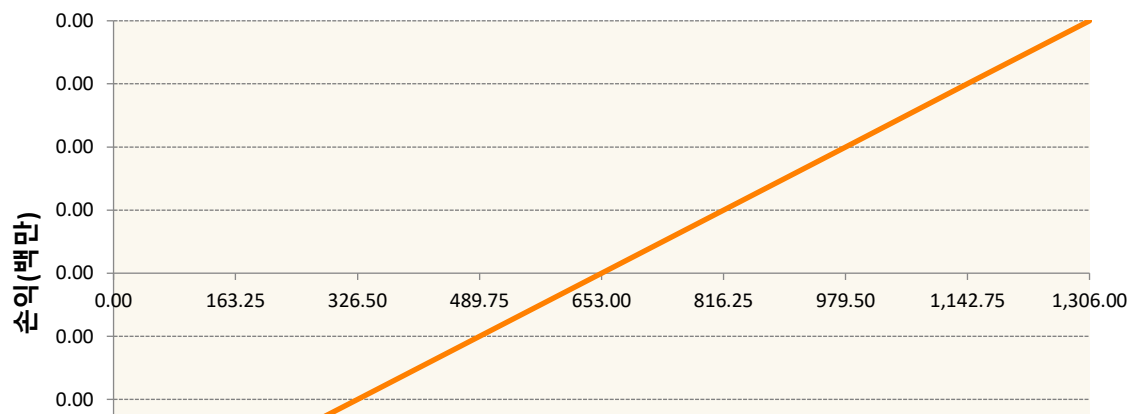
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

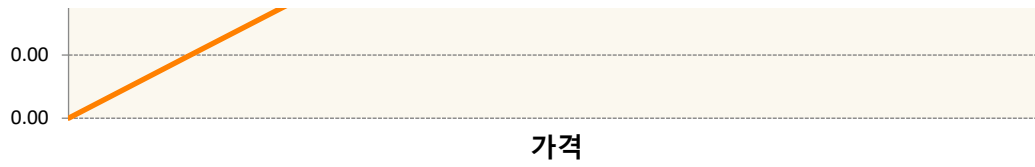


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-05-04
기준일	2026-04-30

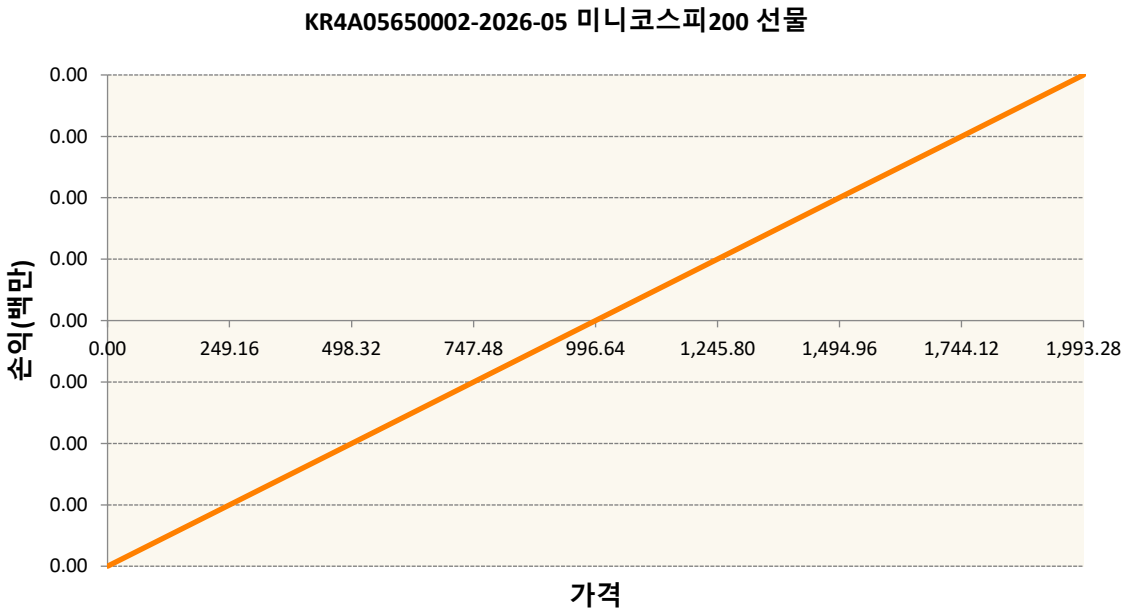
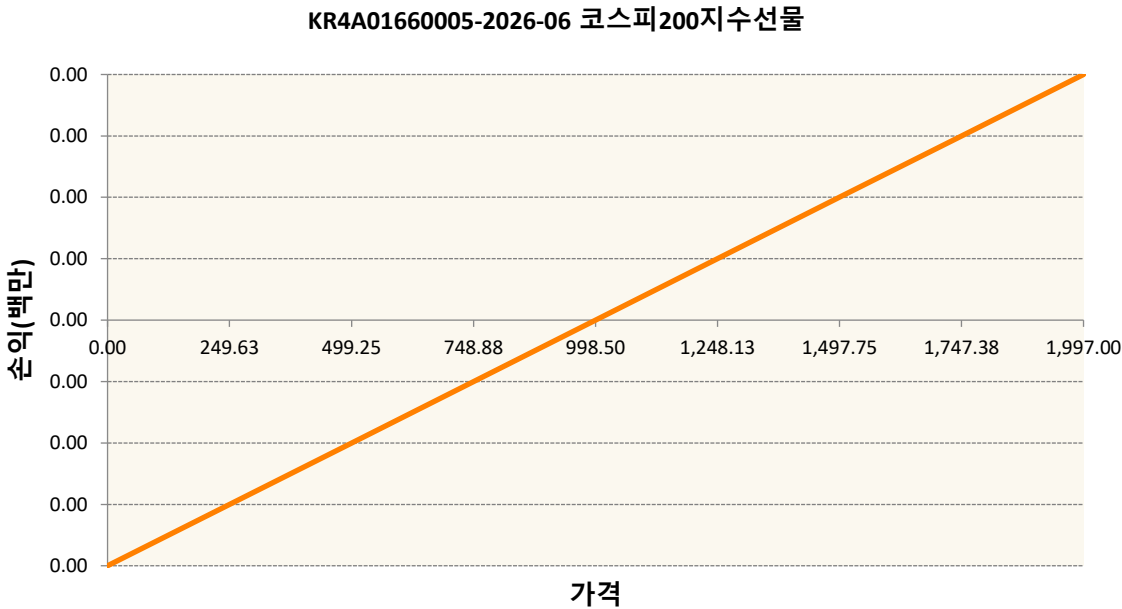
스마트인덱스모

1. 계약금액

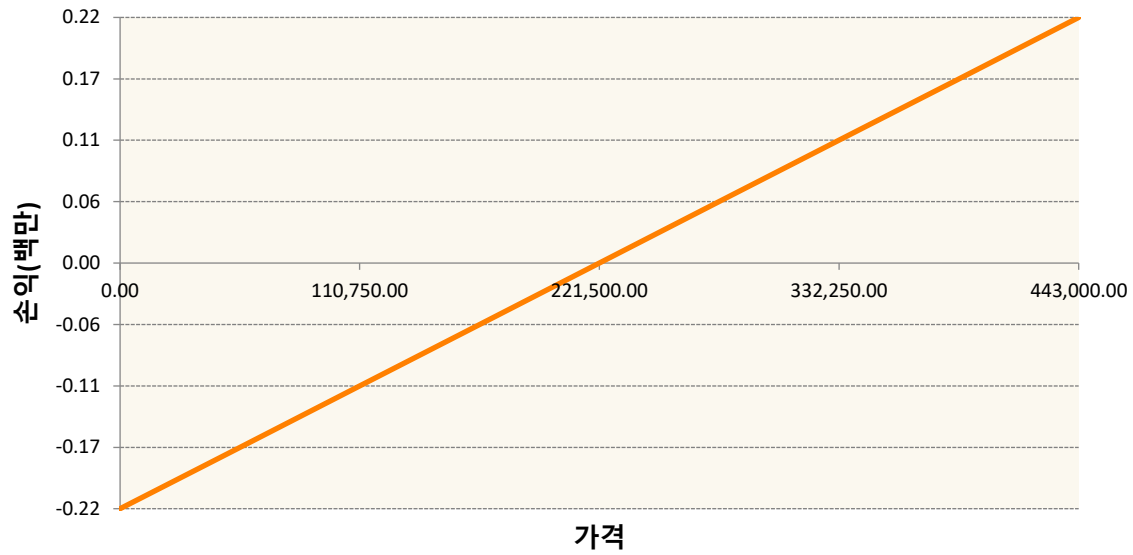
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	252	0	252	장내
누계	유가증권	선물	4,166	0	4,166	장내

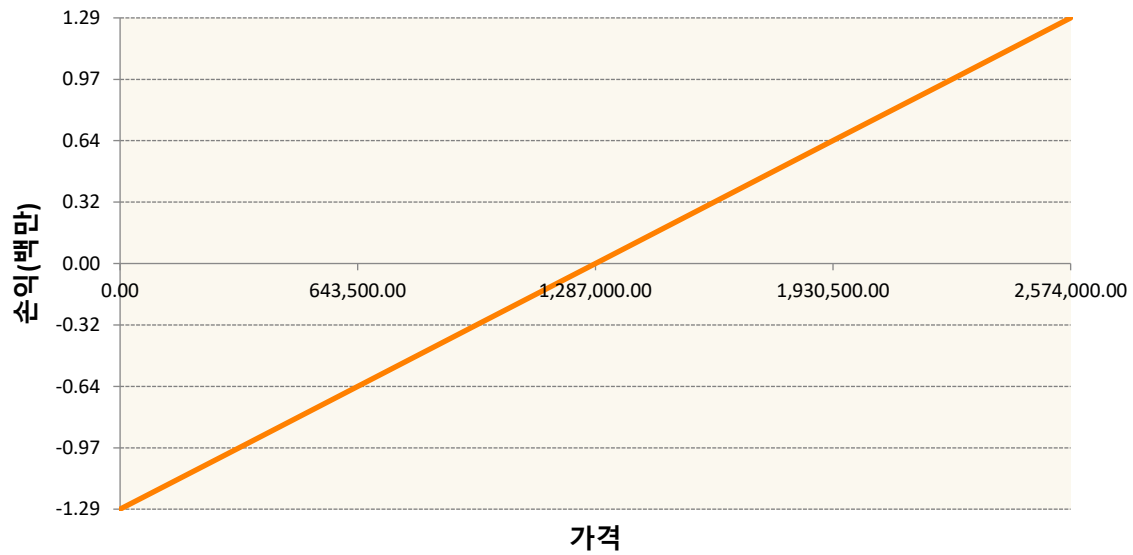
2. 만기시점의 손익구조



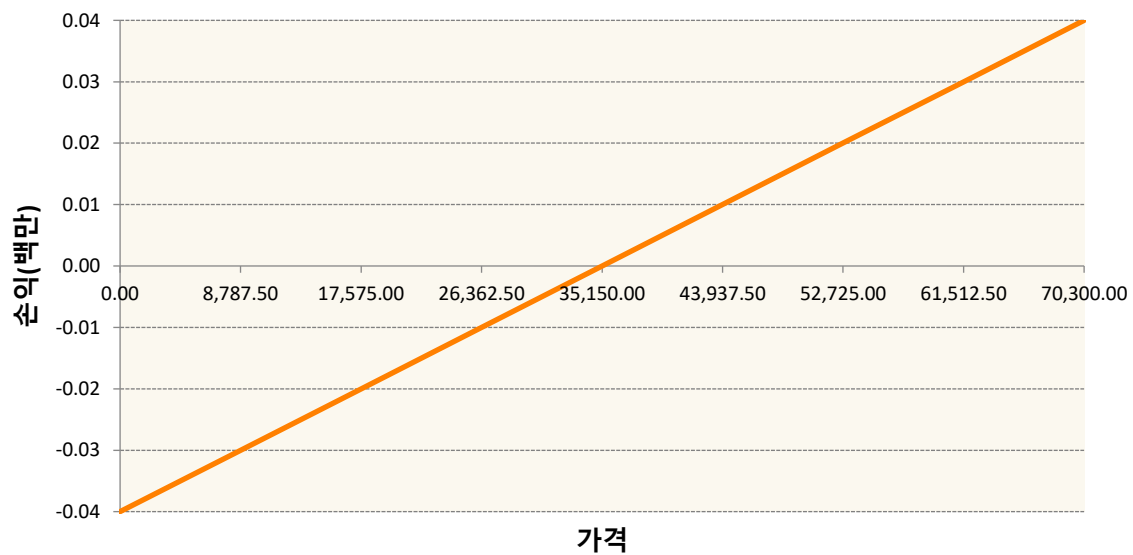
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		179		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179				
-5.33%	-119	-119	-119	-119	-119	-119	-119				
-2.67%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	60	60	60	60	60	60	60				
5.33%	119	119	119	119	119	119	119				
8.00%	179	179	179	179	179	179	179				
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)

563

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

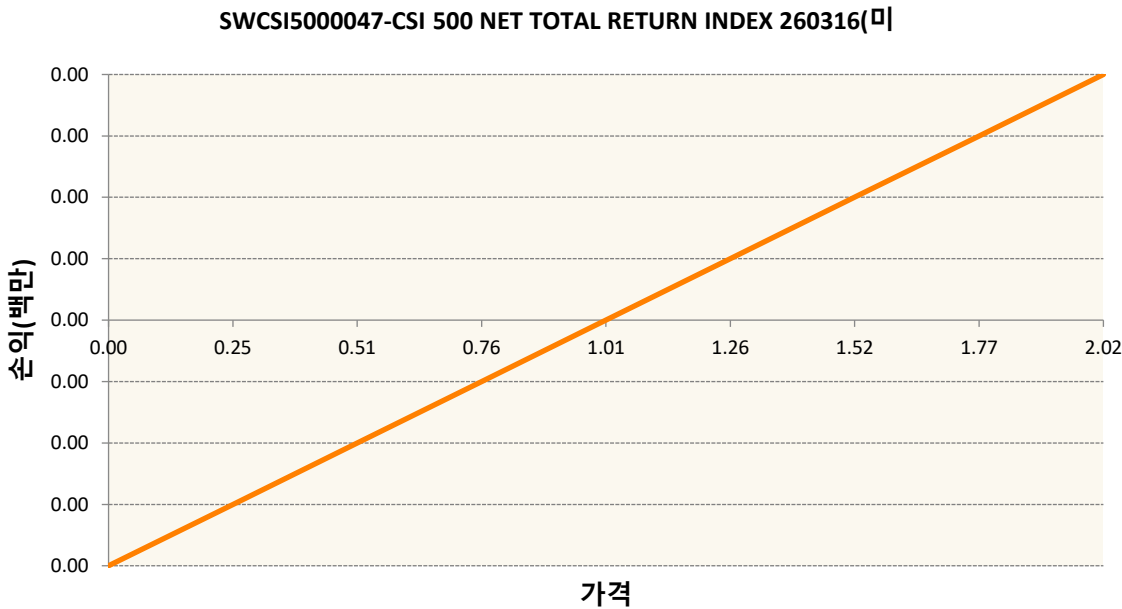
SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미	454
--	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

559

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

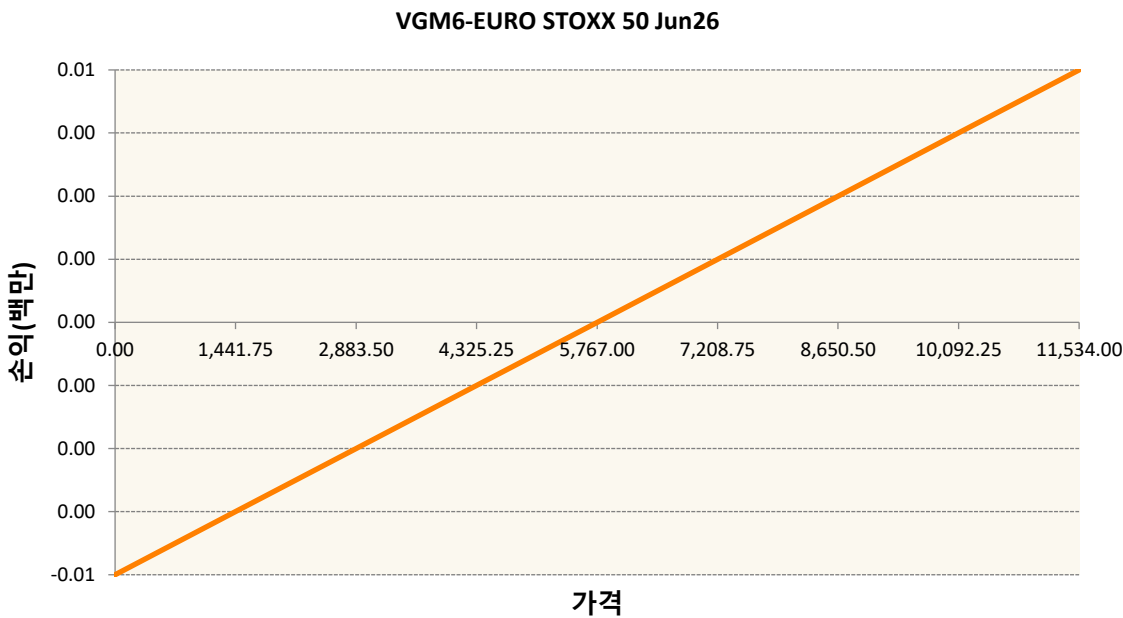
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	889	0	889	

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	2026-05-04
기준일	2026-04-30

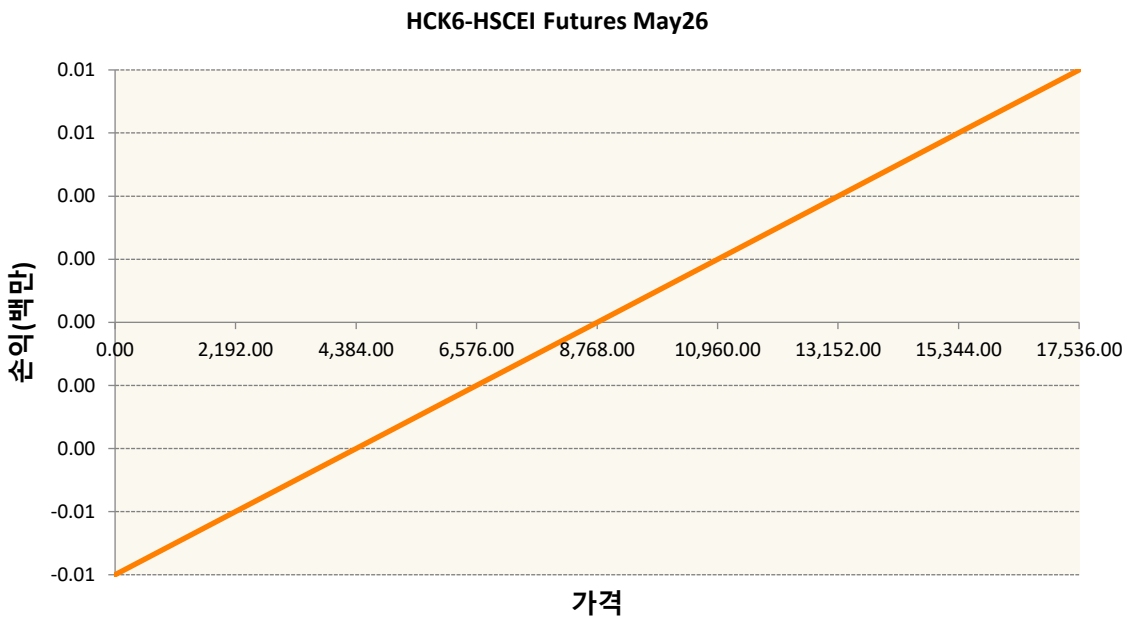
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,649	0	1,649	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK6	HSCEI Futures May26	132
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

159

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

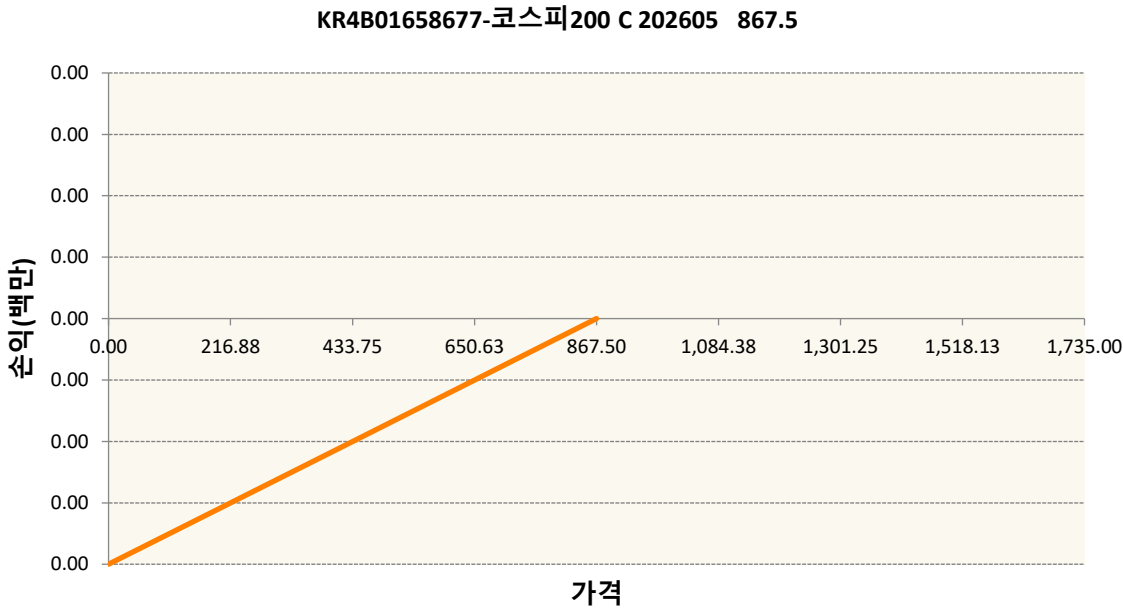
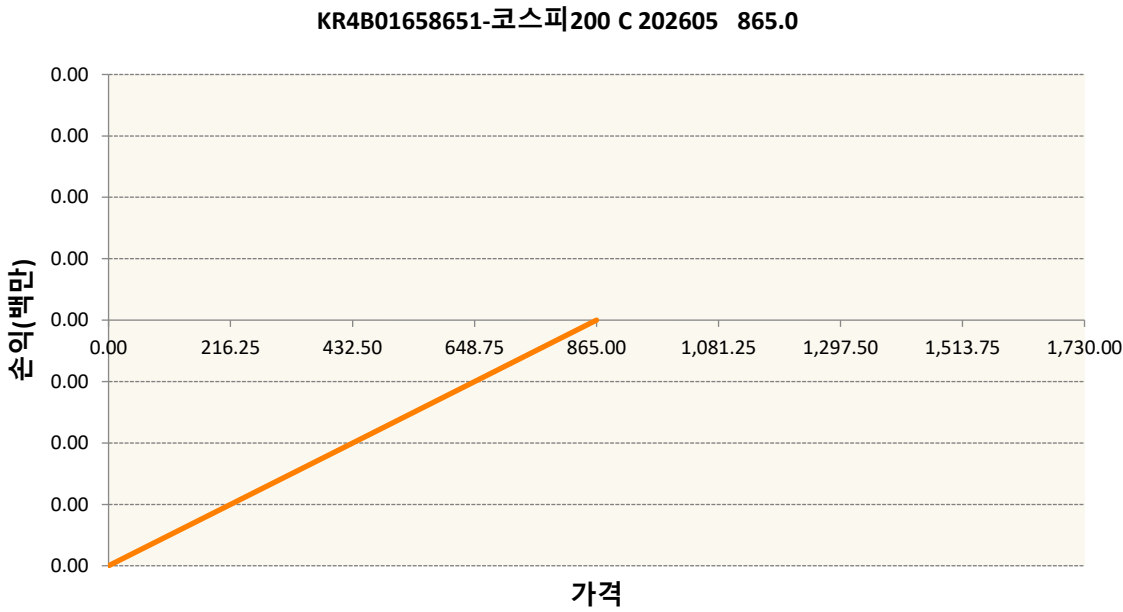
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

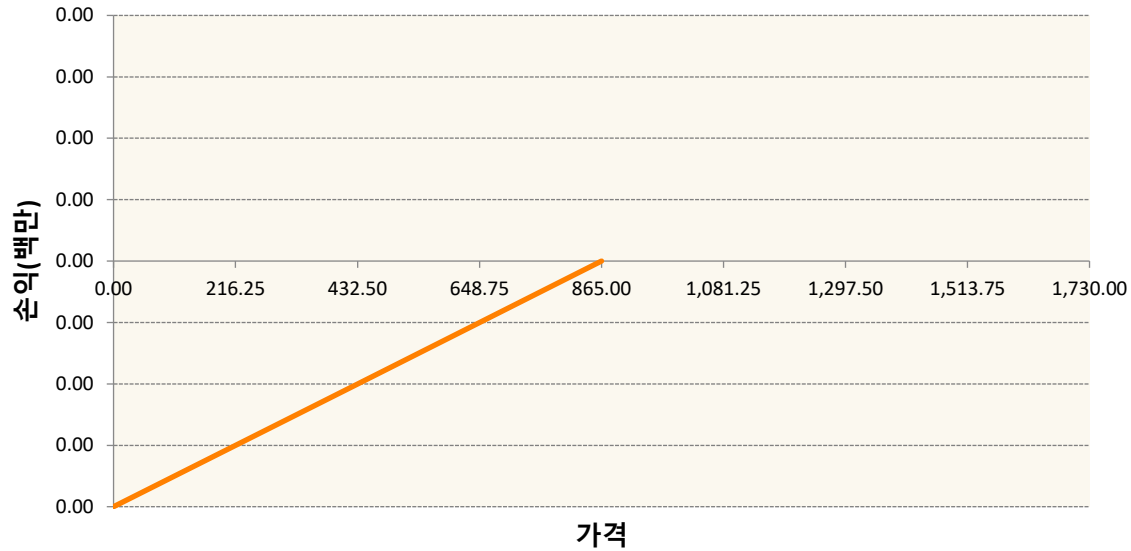
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	364	0	364	장내
누계	유가증권	옵션	0	33,984	-33,984	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0							428
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-112	-161	-212	-265	-318	-372	-428
-5.33%	-18	-57	-99	-143	-190	-238	-288
-2.67%	37	9	-22	-58	-96	-137	-181
0%	67	49	26	0	-30	-64	-100
2.67%	82	71	56	38	15	-11	-41
5.33%	89	83	74	61	45	25	2
8.00%	92	89	84	75	64	50	32
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							309
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-119	-156	-193	-231	-270	-309
-5.33%	-15	-43	-73	-105	-138	-173	-208
-2.67%	26	6	-17	-42	-70	-100	-131
0%	49	36	19	0	-22	-46	-72
2.67%	60	52	42	28	11	-8	-29
5.33%	66	61	55	45	33	19	2
8.00%	68	66	62	56	48	37	24
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							179
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-68	-89	-111	-133	-156	-179
-5.33%	-8	-24	-41	-60	-80	-100	-121
-2.67%	15	4	-9	-24	-40	-58	-76
0%	28	20	11	0	-13	-27	-42

2.67%	34	30	24	16	6	-5	-17
5.33%	37	35	31	26	19	11	1
8.00%	39	37	35	32	27	21	14

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

(단위:백만원)

817

공시일 2026-05-04

기준일 2026-04-30

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	2026-05-04
기준일	2026-04-30

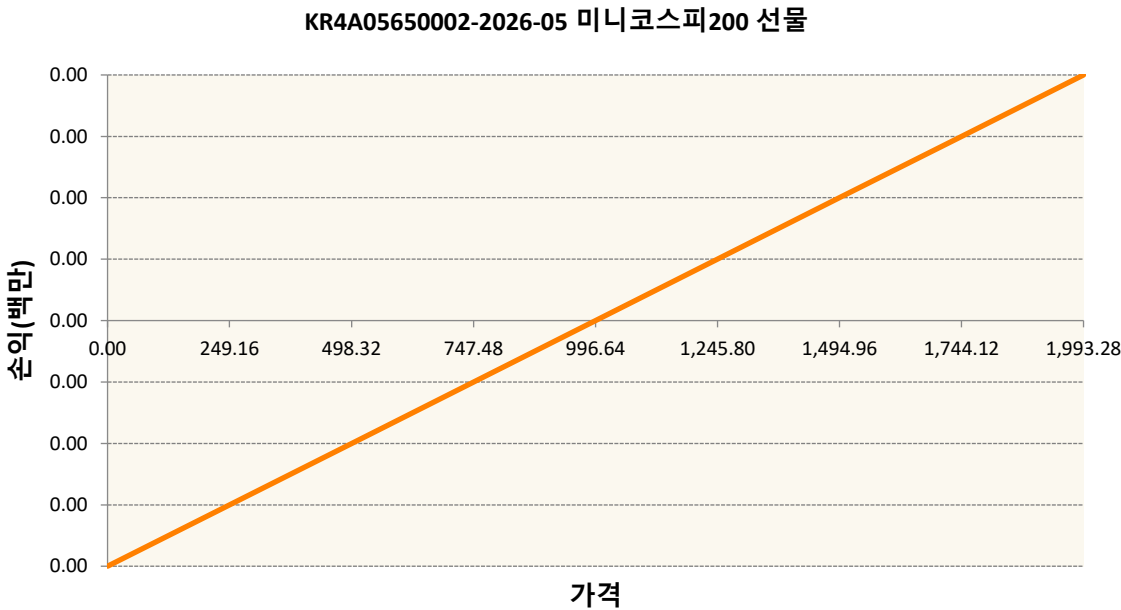
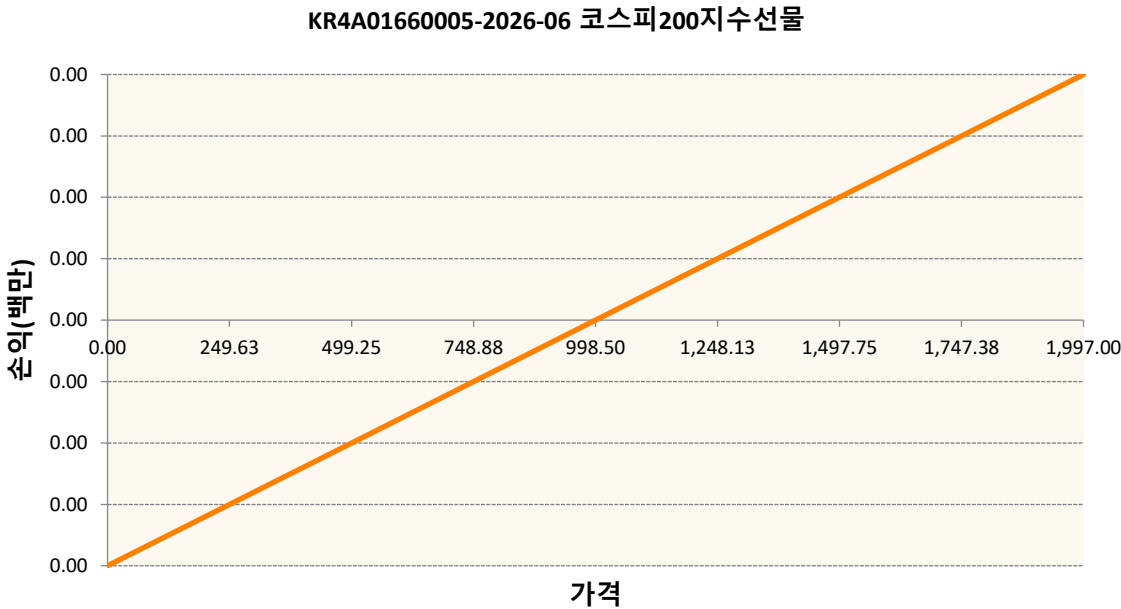
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

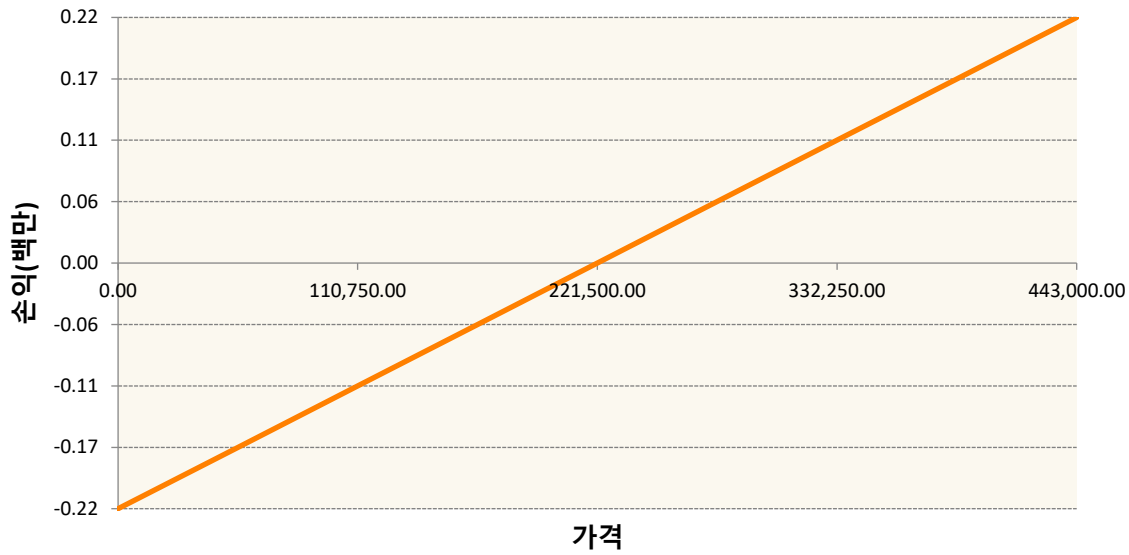
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	754	0	754	장내
누계	유가증권	선물	4,859	67	4,792	장내

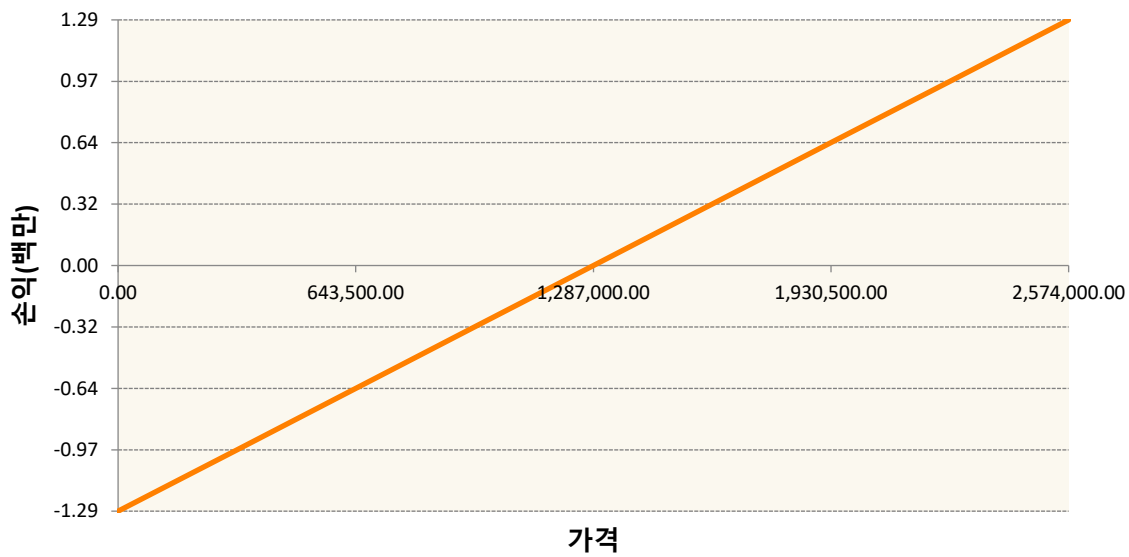
2. 만기시점의 손익구조



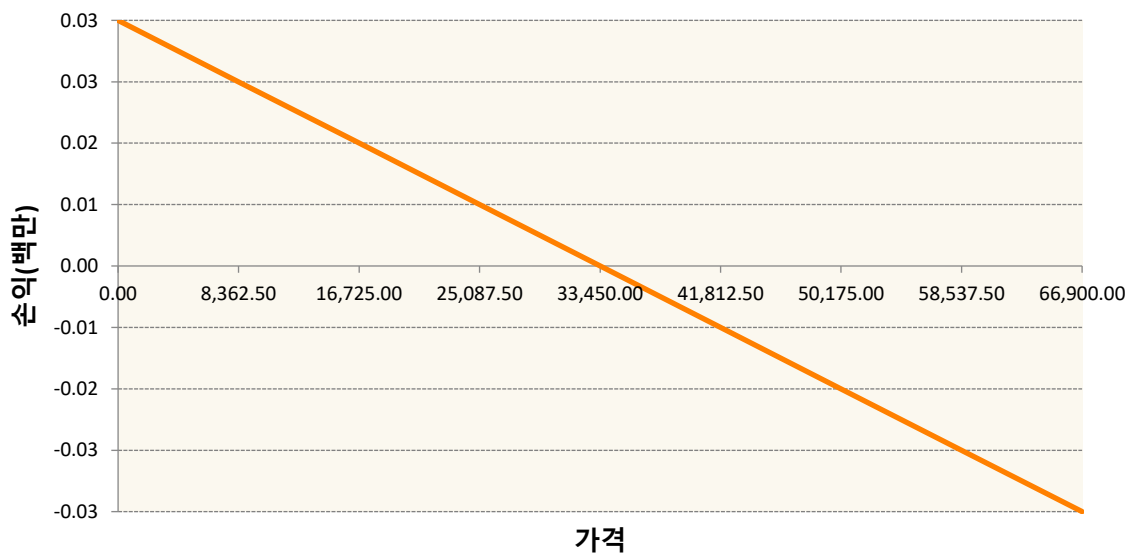
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AEB650008-2026-05 우리금융지주개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					99
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-99	-99	-99	-99	-99	-99	-99
-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%	99	99	99	99	99	99	99
KR4A05650002		2026-05 미니코스피200 선물					56
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-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%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	56	56	56	56	56	56	56
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물					2
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2
KR4A50650006		2026-05 SK하이닉스개별선물					8
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	5	5	5	5	5	5	5
8.00%	8	8	8	8	8	8	8
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)

362

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

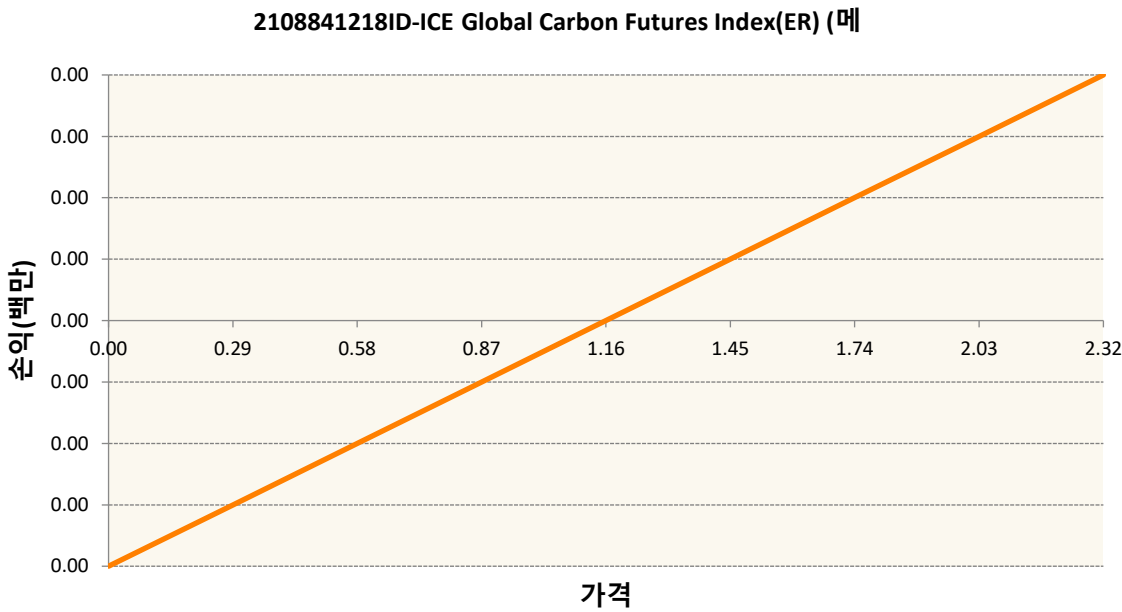
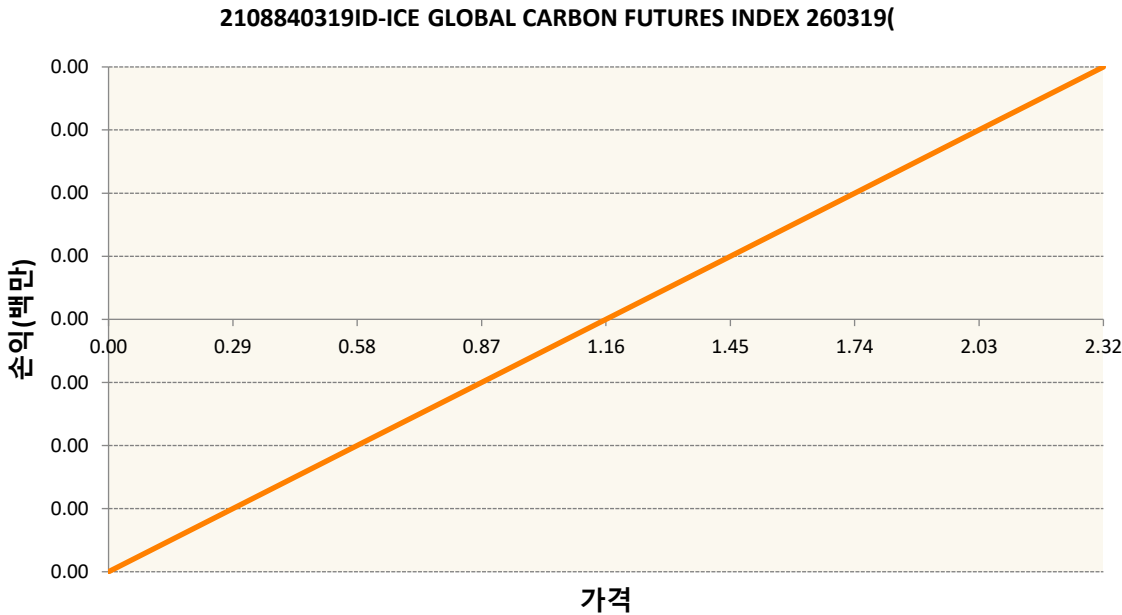
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,666	0	6,666	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		426
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	609

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

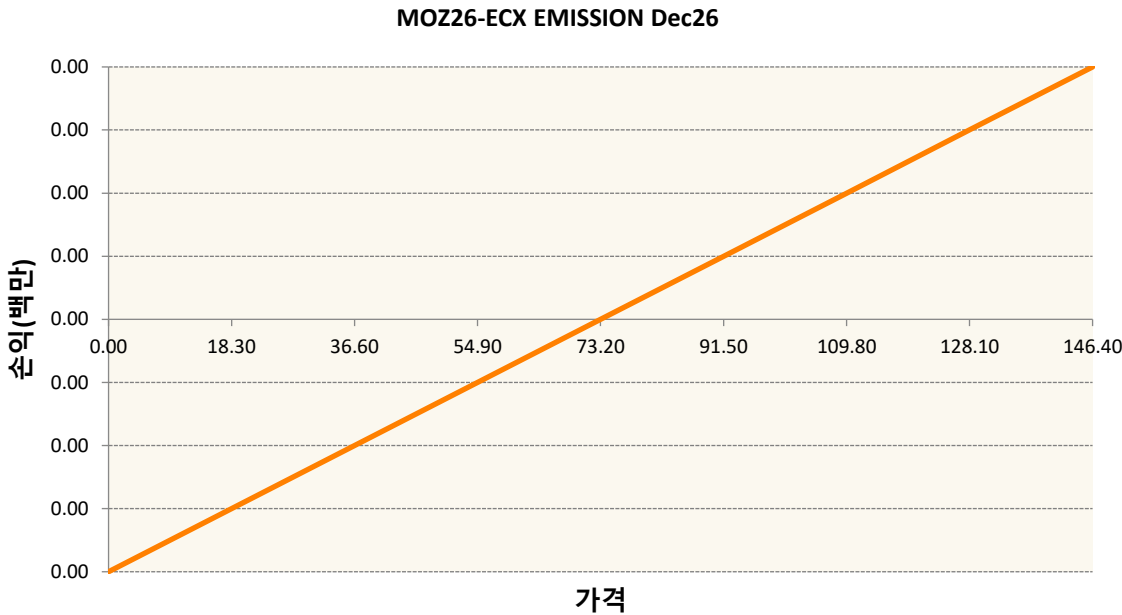
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,720	0	4,720	
누계	통화	선도	0	2,361	-2,361	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	189
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	378

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

(단위:백만원)

660

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

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)	15
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	6

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

(단위:백만원)

54

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

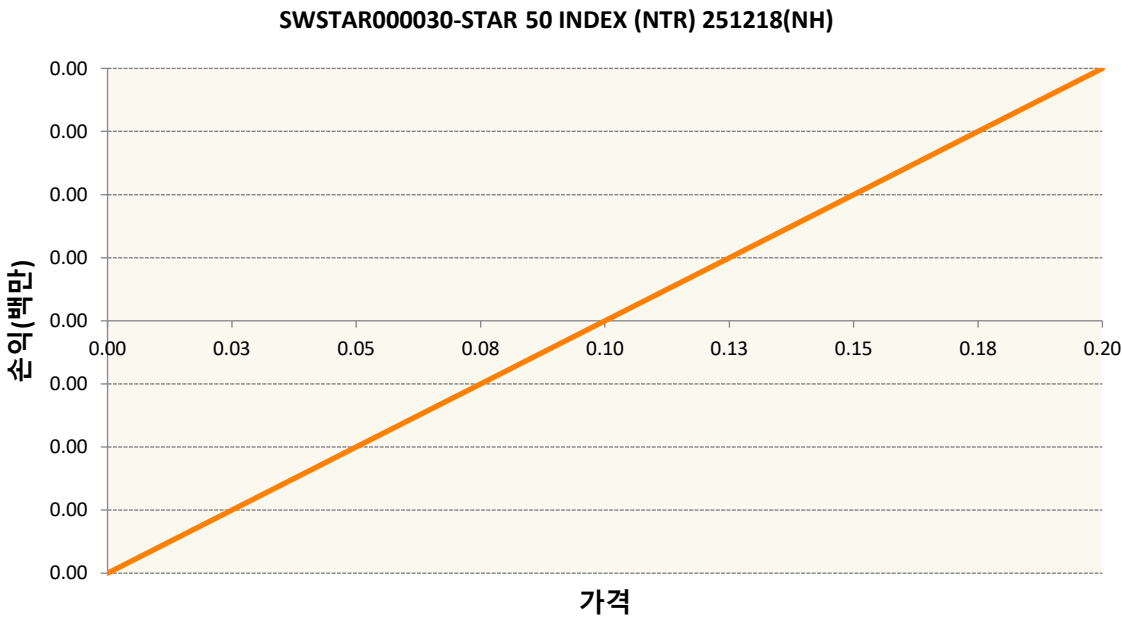
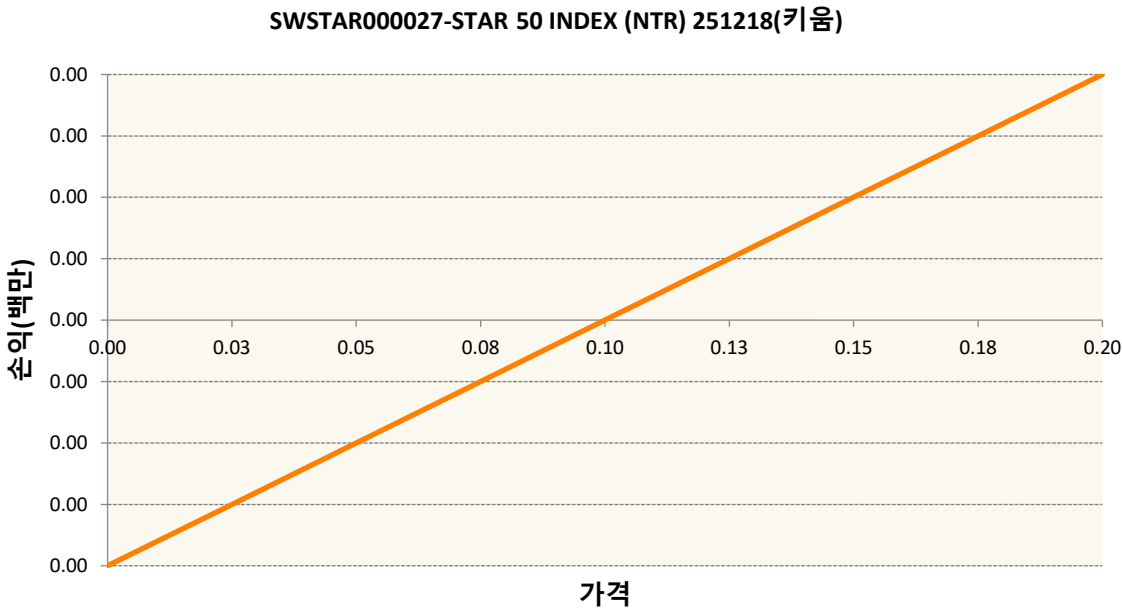
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

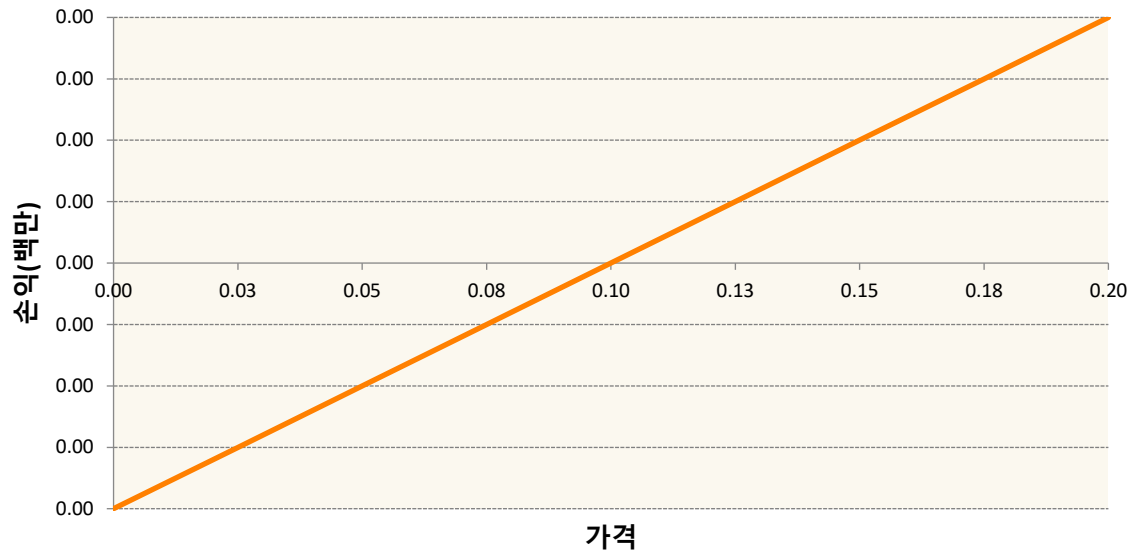
(단위:백만원)

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

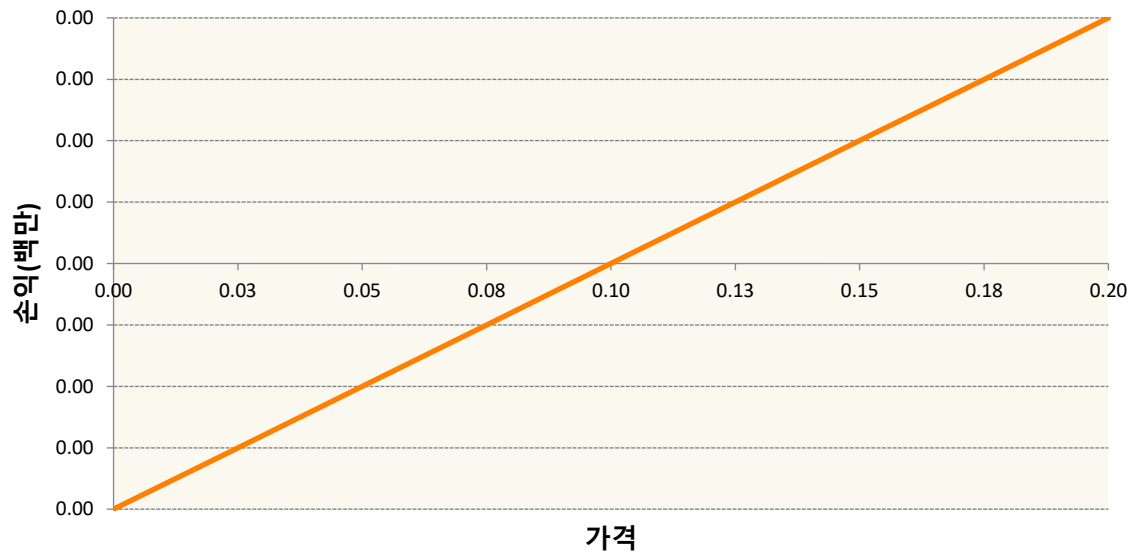
2. 만기시점의 손익구조



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)	8
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	26
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	130
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	48

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

(단위:백만원)

317

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

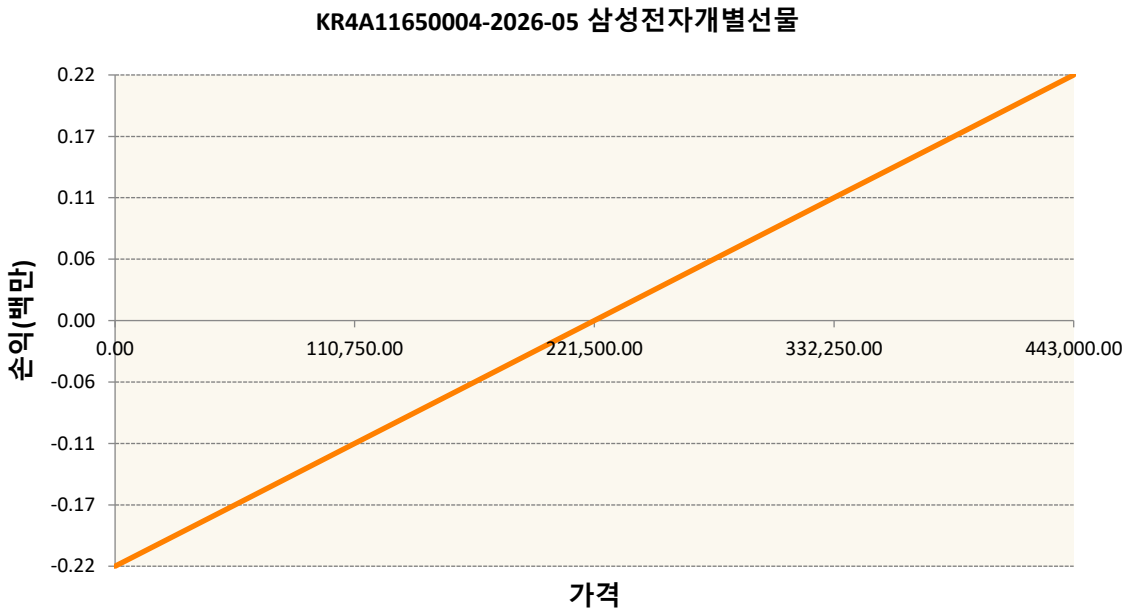
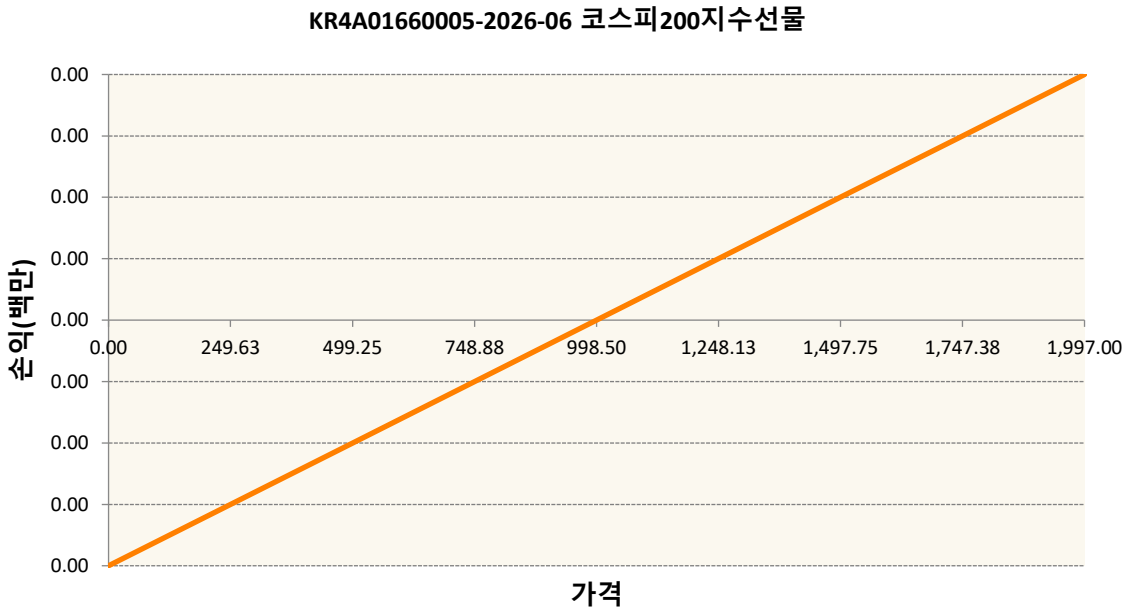
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

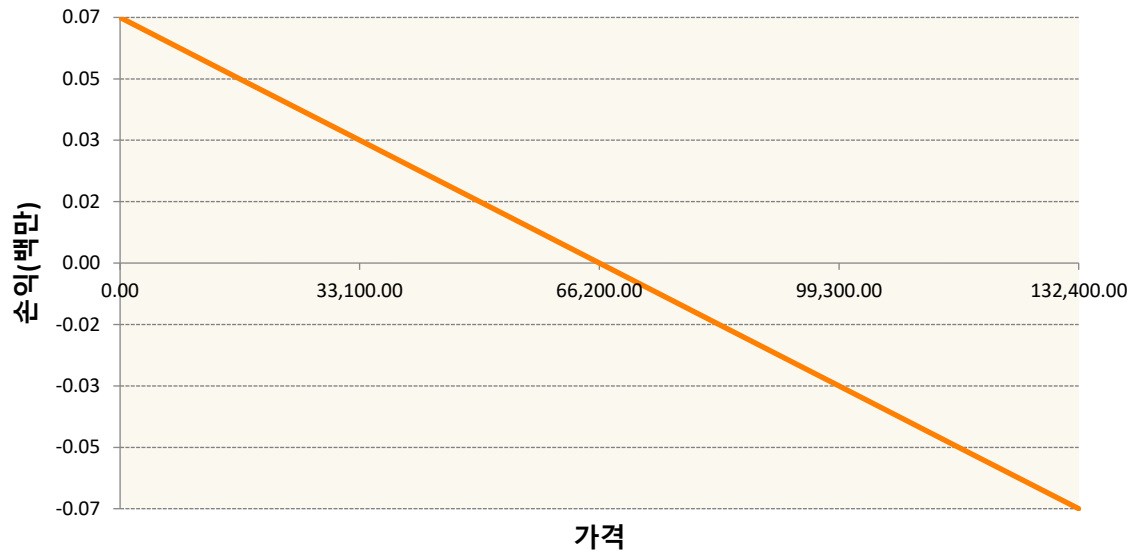
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,536	6,180	-3,644	장내
누계	유가증권	선물	27,835	3,671	24,164	장내

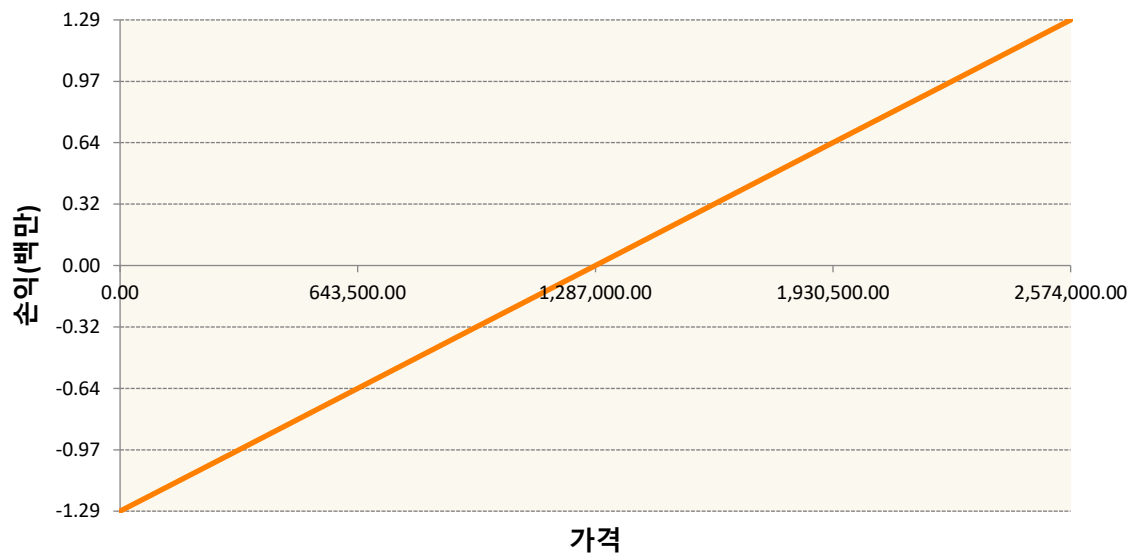
2. 만기시점의 손익구조



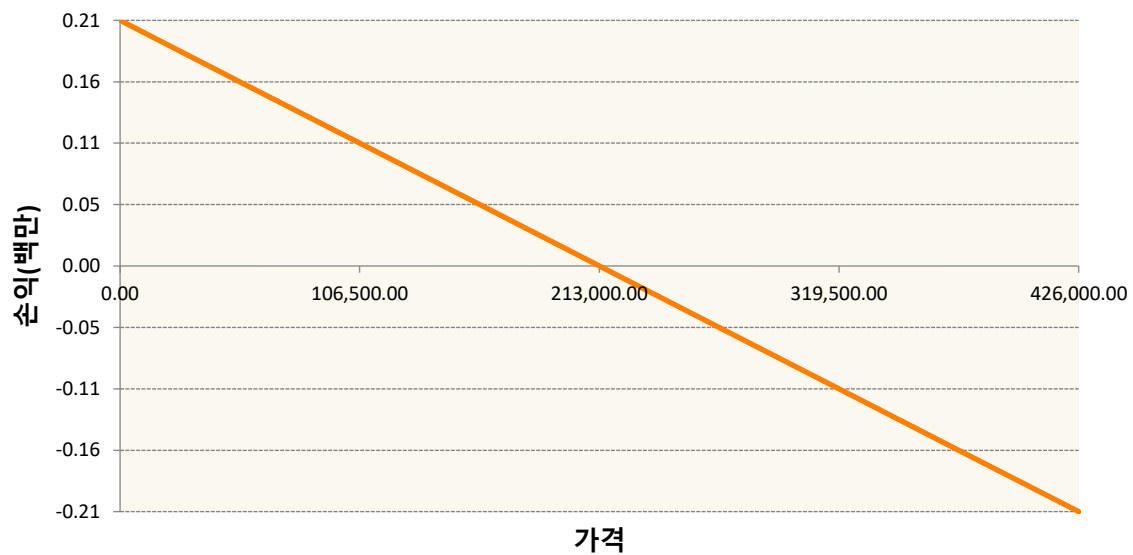
KR4A2K650002-2026-05 LG씨엔에스개별선물



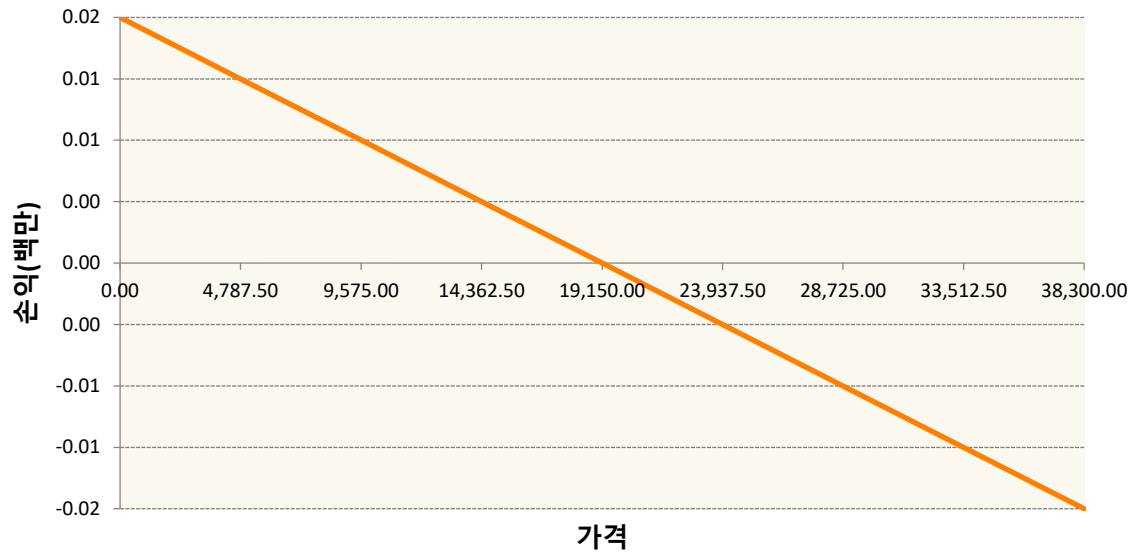
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



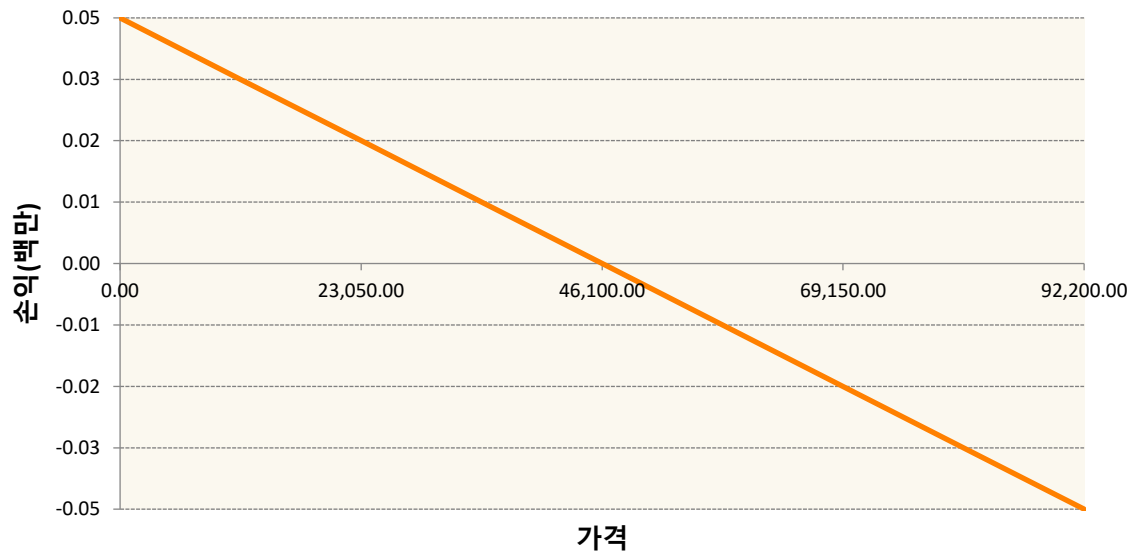
KR4A56650000-2026-05 NAVER개별선물



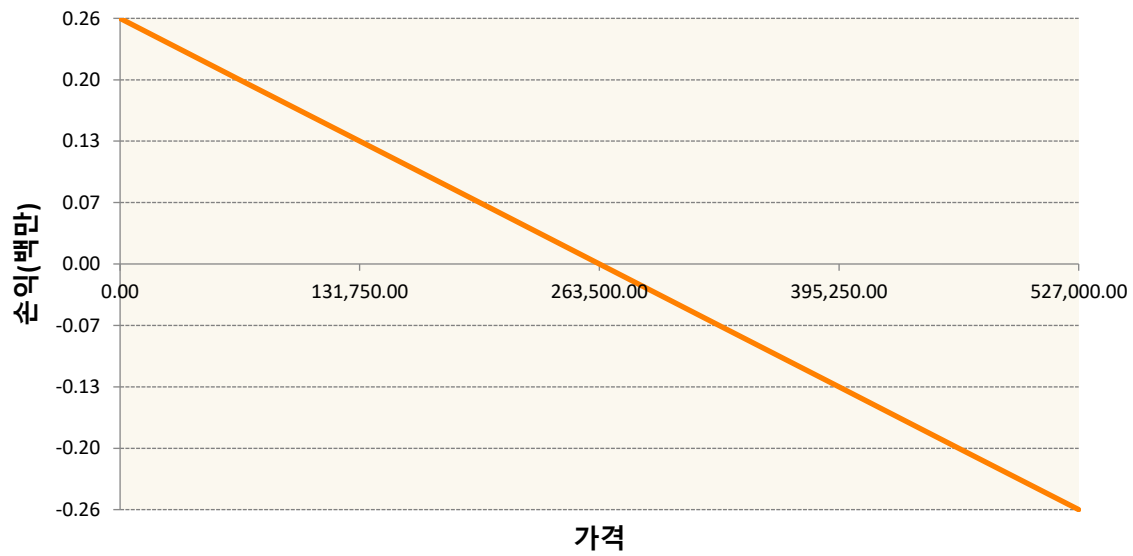
KR4ABV650007-2026-05 iM금융지주개별선물



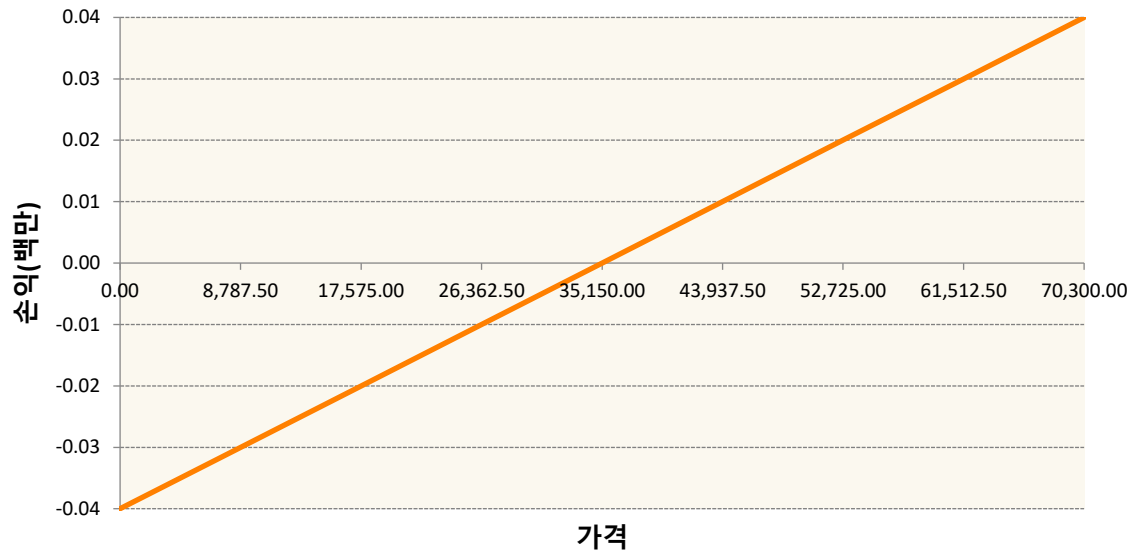
KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



KR4AFC650006-2026-05 하이브개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								1,845
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,845	-1,845	-1,845	-1,845	-1,845	-1,845	-1,845	-1,845
-5.33%	-1,230	-1,230	-1,230	-1,230	-1,230	-1,230	-1,230	-1,230
-2.67%	-615	-615	-615	-615	-615	-615	-615	-615
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	615	615	615	615	615	615	615	615
5.33%	1,230	1,230	1,230	1,230	1,230	1,230	1,230	1,230
8.00%	1,845	1,845	1,845	1,845	1,845	1,845	1,845	1,845
KR4A11650004 2026-05 삼성전자개별선물								182
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
-5.33%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
-2.67%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	61	61	61	61	61	61	61	61
5.33%	121	121	121	121	121	121	121	121
8.00%	182	182	182	182	182	182	182	182
KR4A2K650002 2026-05 LG씨엔에스개별선물								24
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	24	24	24	24	24	24	24	24
-5.33%	16	16	16	16	16	16	16	16
-2.67%	8	8	8	8	8	8	8	8
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24

KR4A50650006	2026-05 SK하이닉스개별선물	111
--------------	--------------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-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%	111	111	111	111	111	111	111

KR4A56650000	2026-05 NAVER개별선물	86
--------------	-------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	86	86	86	86	86	86	86
-5.33%	57	57	57	57	57	57	57
-2.67%	29	29	29	29	29	29	29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
8.00%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86

KR4ABV650007	2026-05 iM금융지주개별선물	21
--------------	--------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	14	14	14	14	14	14	14
-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%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21

KR4ACF650006	2026-05 카카오개별선물	121
--------------	-----------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	121	121	121	121	121	121	121
-5.33%	80	80	80	80	80	80	80
-2.67%	40	40	40	40	40	40	40
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
5.33%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
8.00%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121

KR4AFC650006	2026-05 하이브개별선물	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
KR4AFT650007 2026-05 대우건설개별선물							75

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	75	75	75	75	75	75	75

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		5,283

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

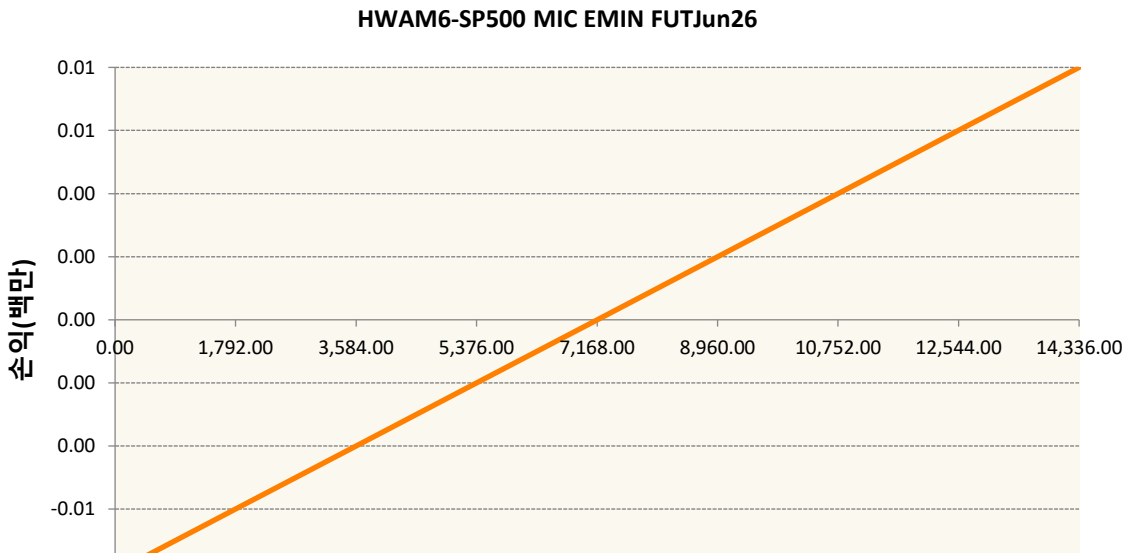
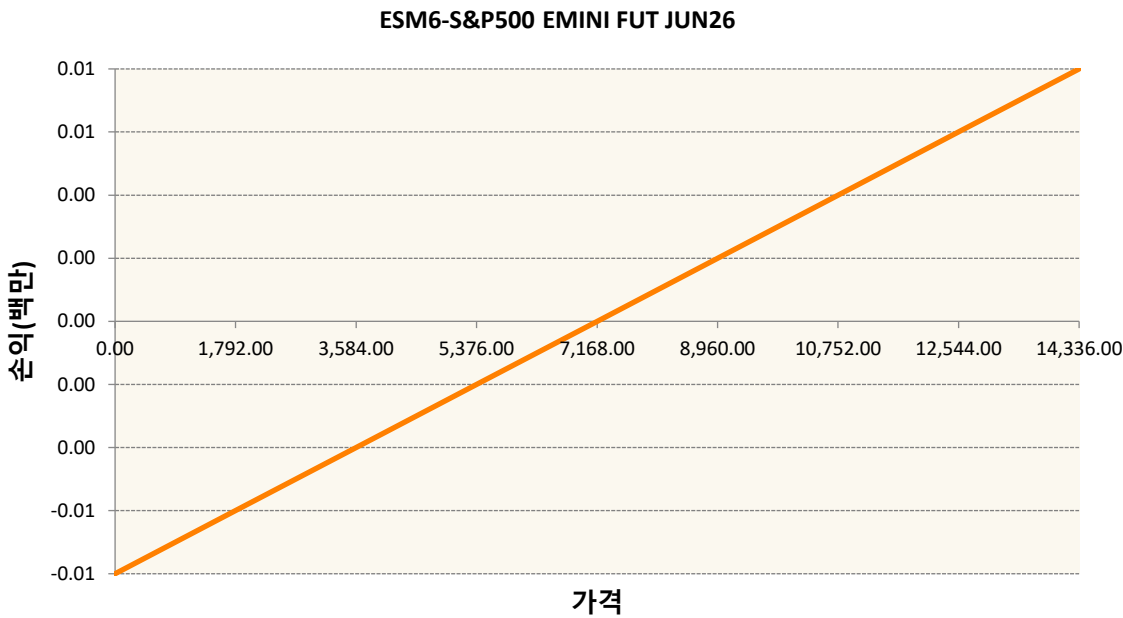
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

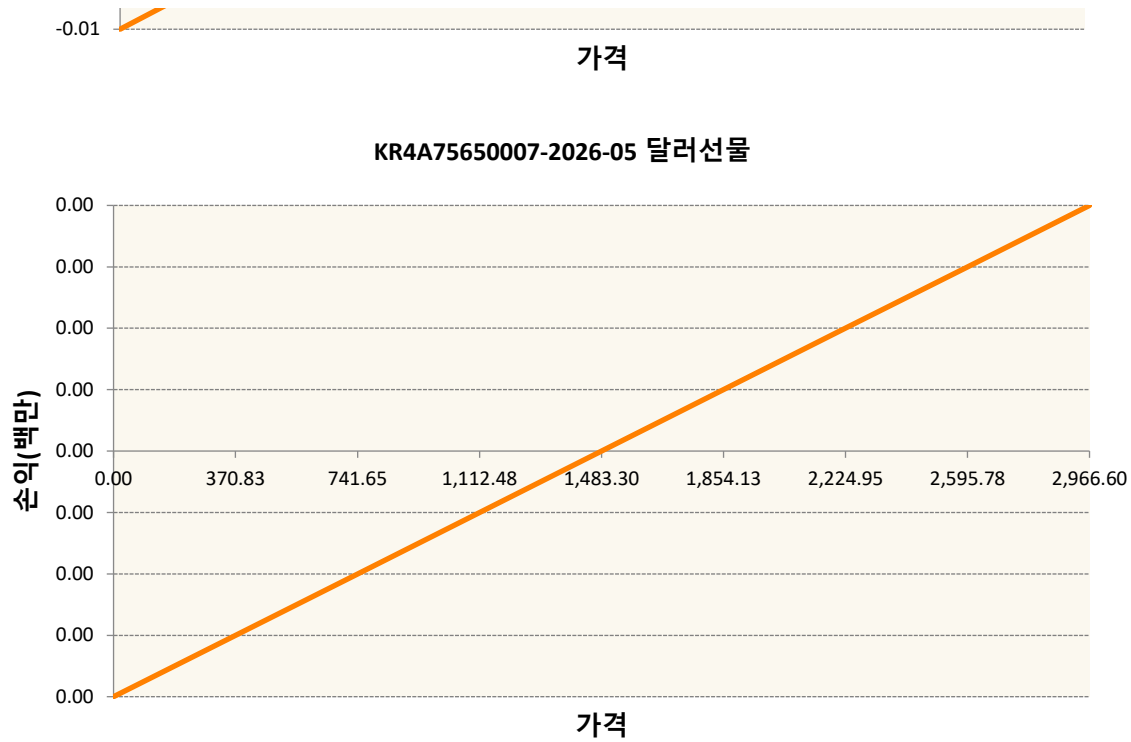
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	56,993	0	56,993	
누계	지수	선물	267	0	267	장내
누계	통화	선물	10,531	0	10,531	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,559
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		21
KR4A756500 2026-05 달러선물			843

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,985

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

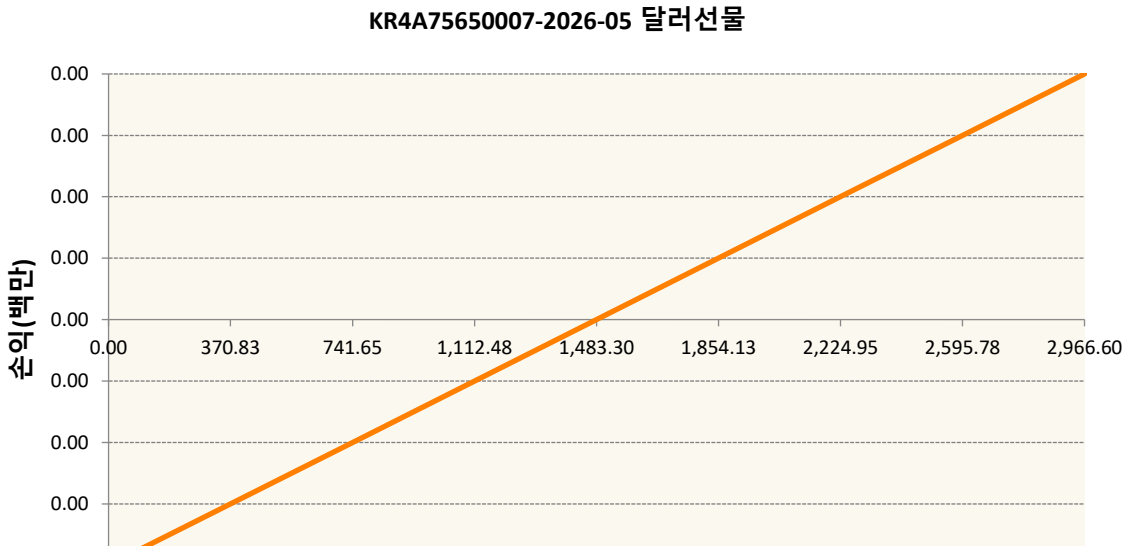
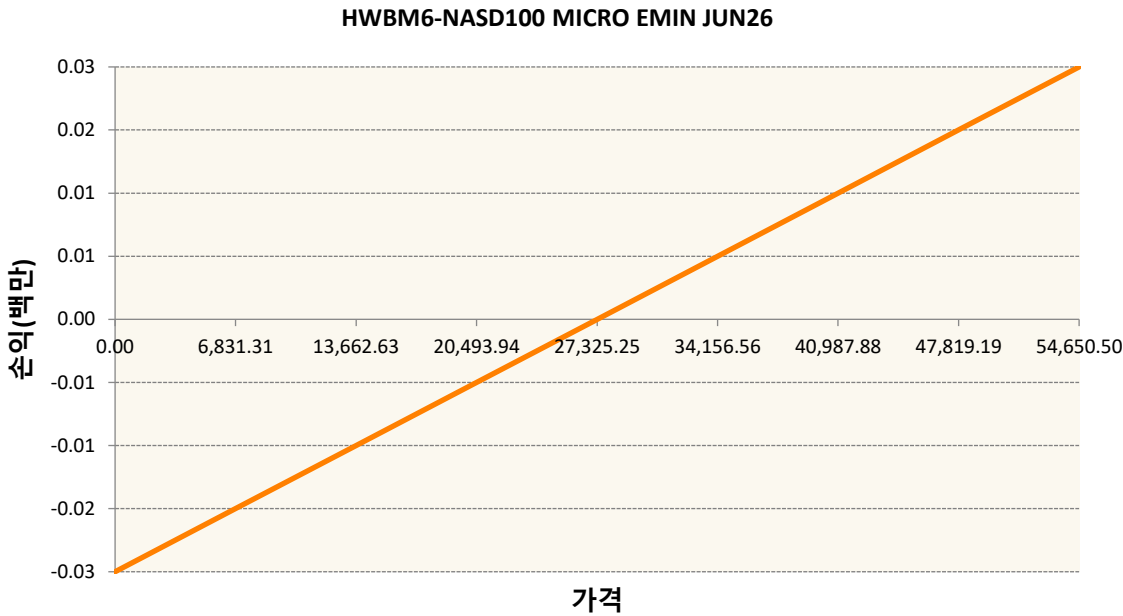
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

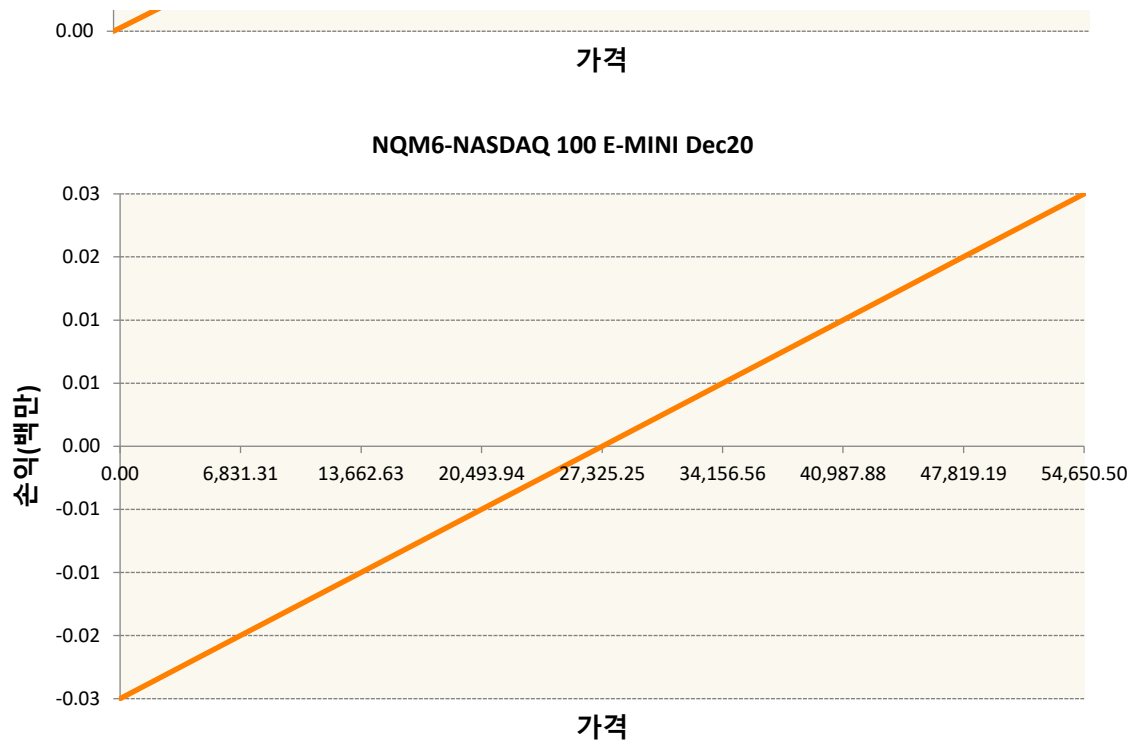
1. 계약금액

(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	25,405	0	25,405	
누계	유가증권	선물	406	0	406	장내
누계	통화	선물	3,871	0	3,871	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBM6 NASD100 MICRO EMIN JUN26

33

KR4A756500 2026-05 달러선물

310

NQM6 NASDAQ 100 E-MINI Dec20

2,032

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

(단위:백만원)

2,270

공시일	2026-05-04
기준일	2026-04-30

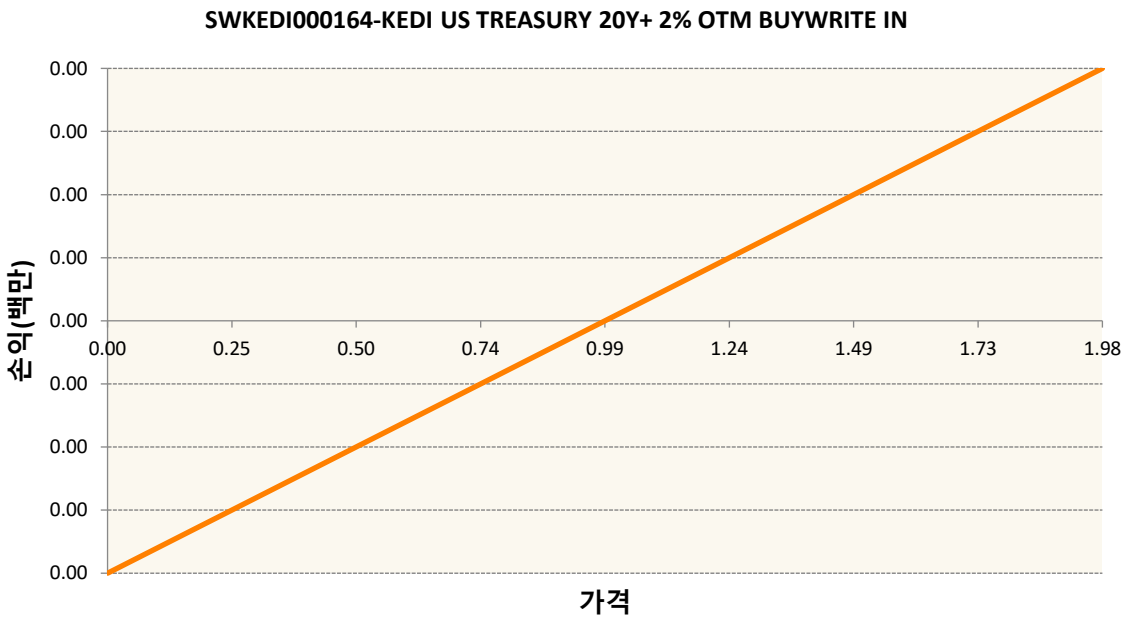
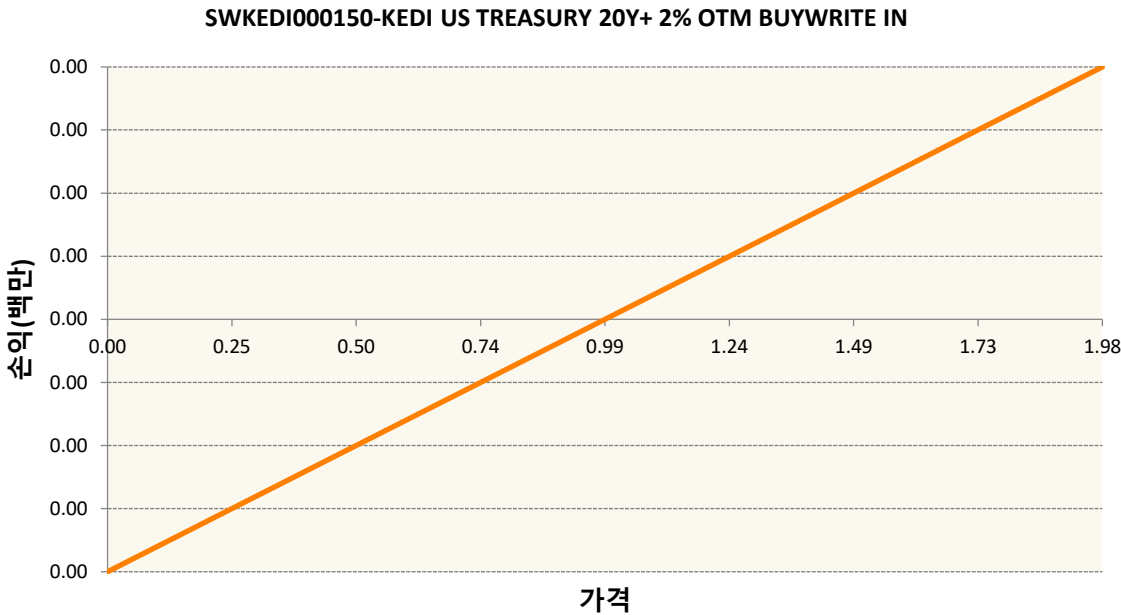
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

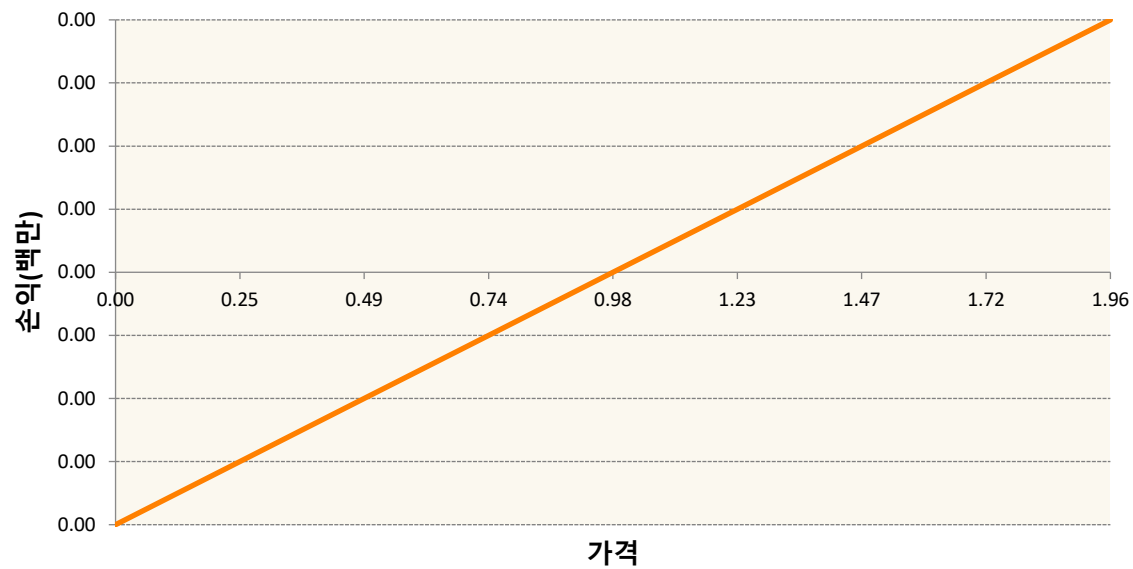
(단위:백만원)

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

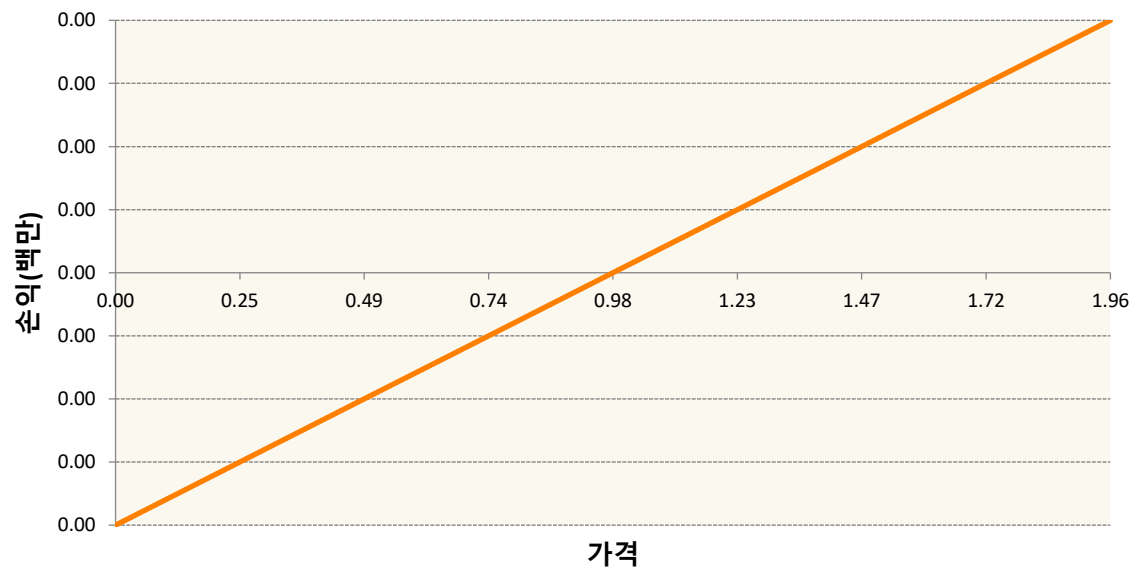
2. 만기시점의 손익구조



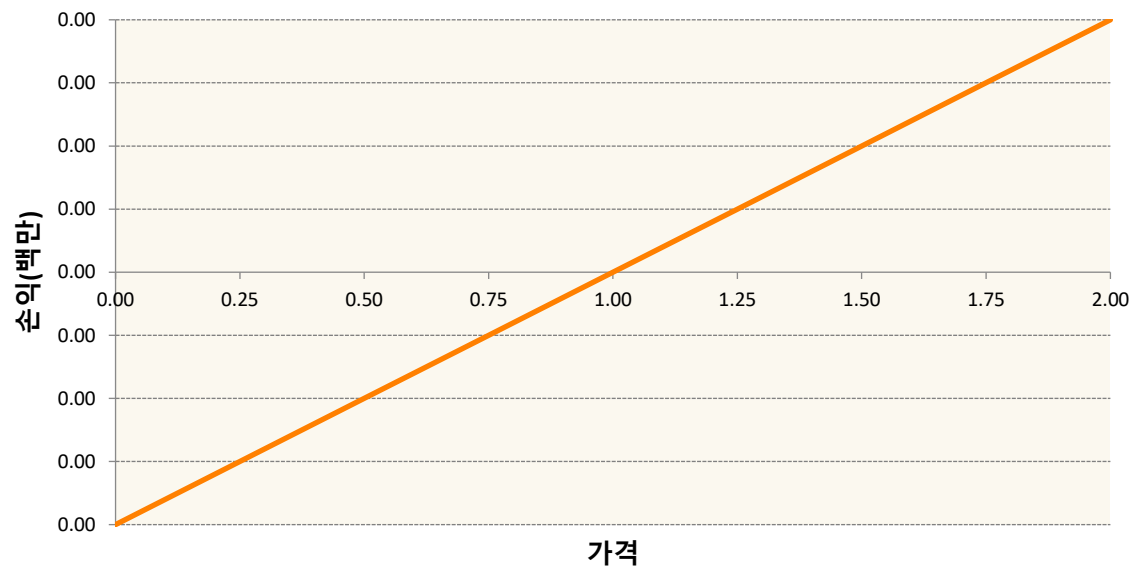
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,259
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		151
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,664
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,391
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,870

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,159