

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

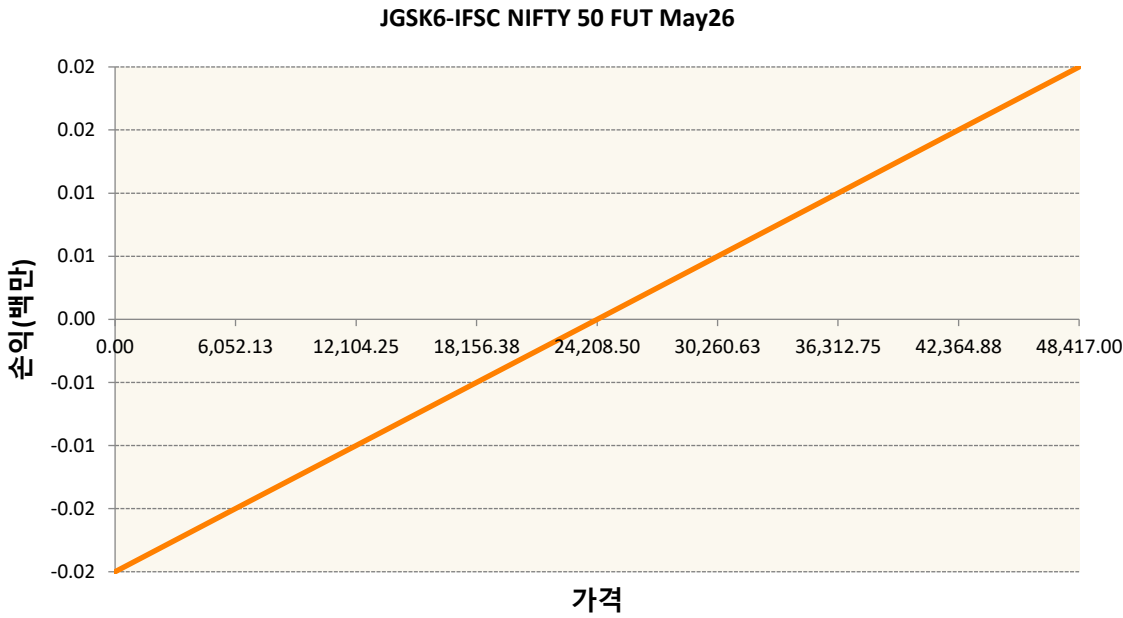
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-05-06
기준일	2026-05-04

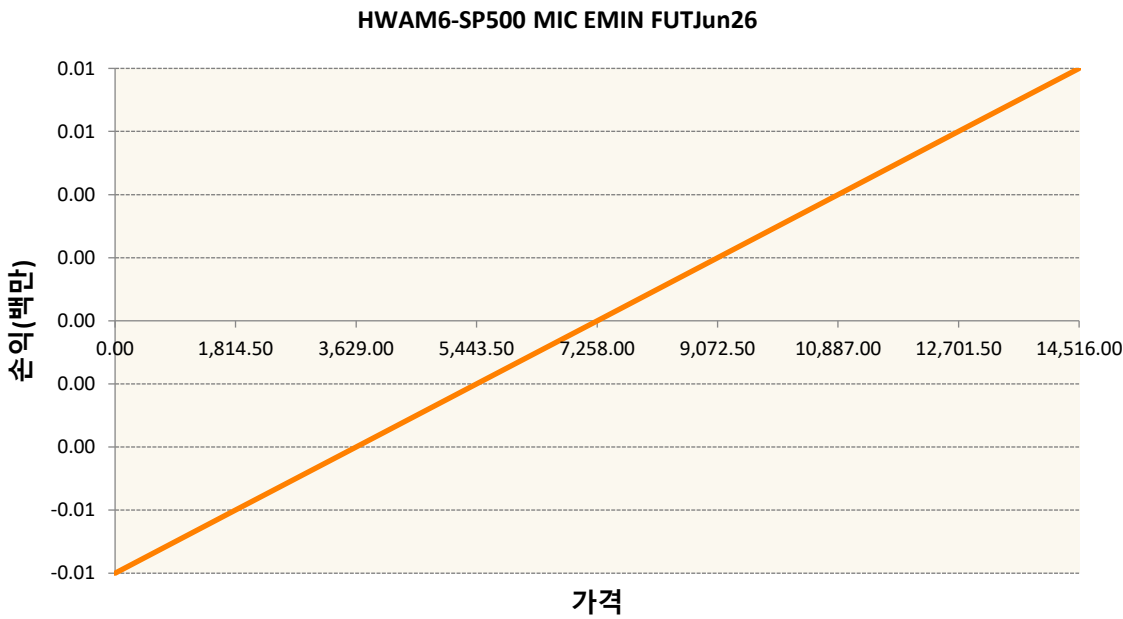
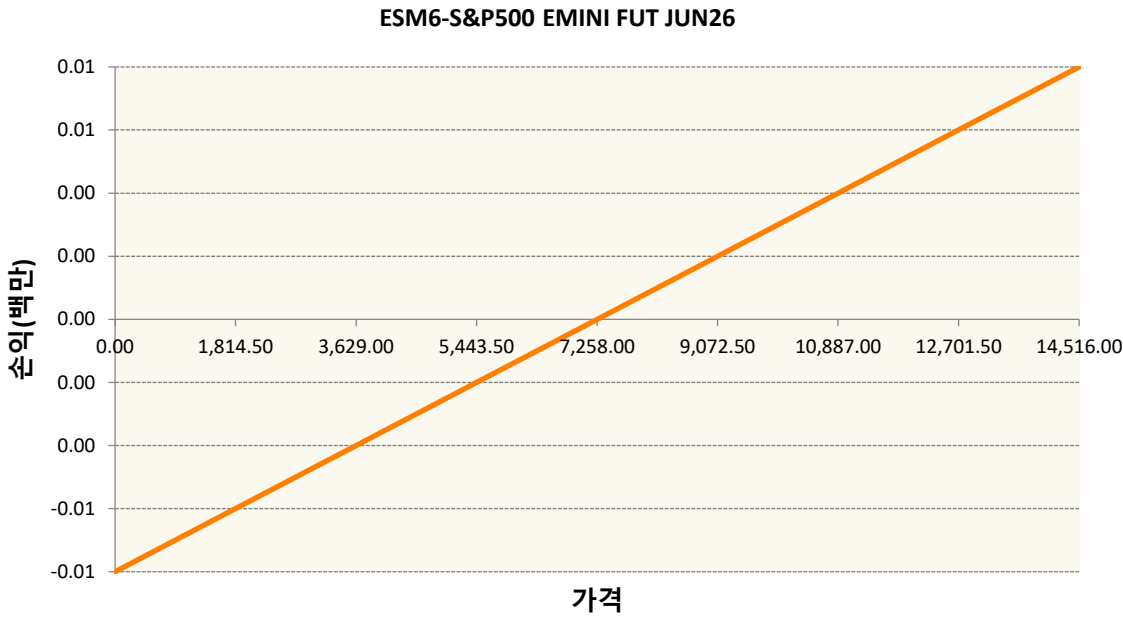
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	544	0	544	
누계	지수	선물	109	0	109	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	44
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	9

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

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

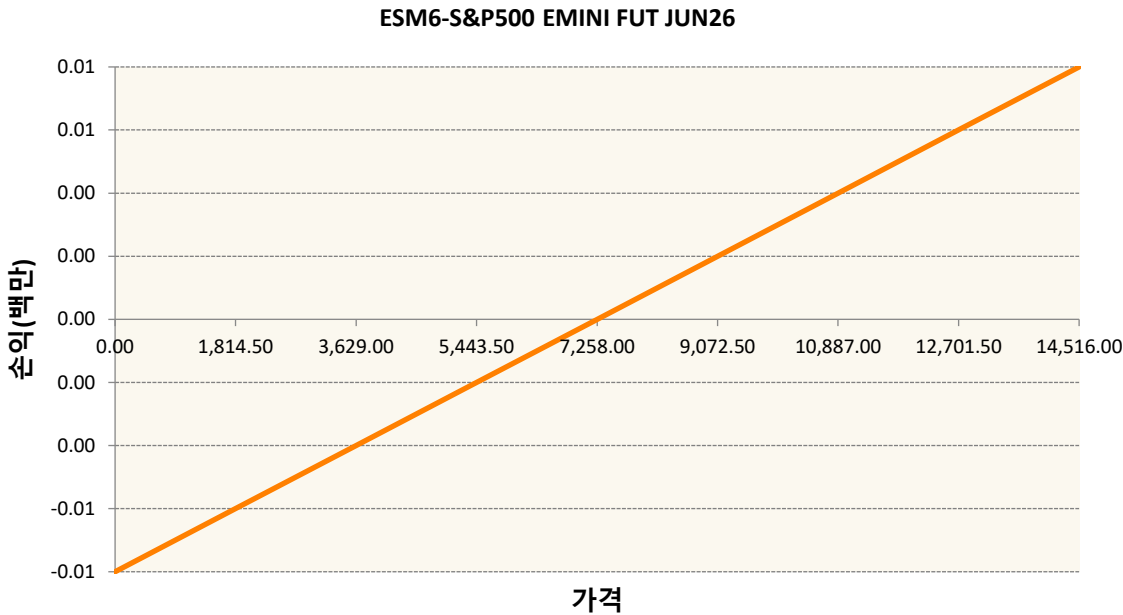
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,087	0	1,087	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	87
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

76

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

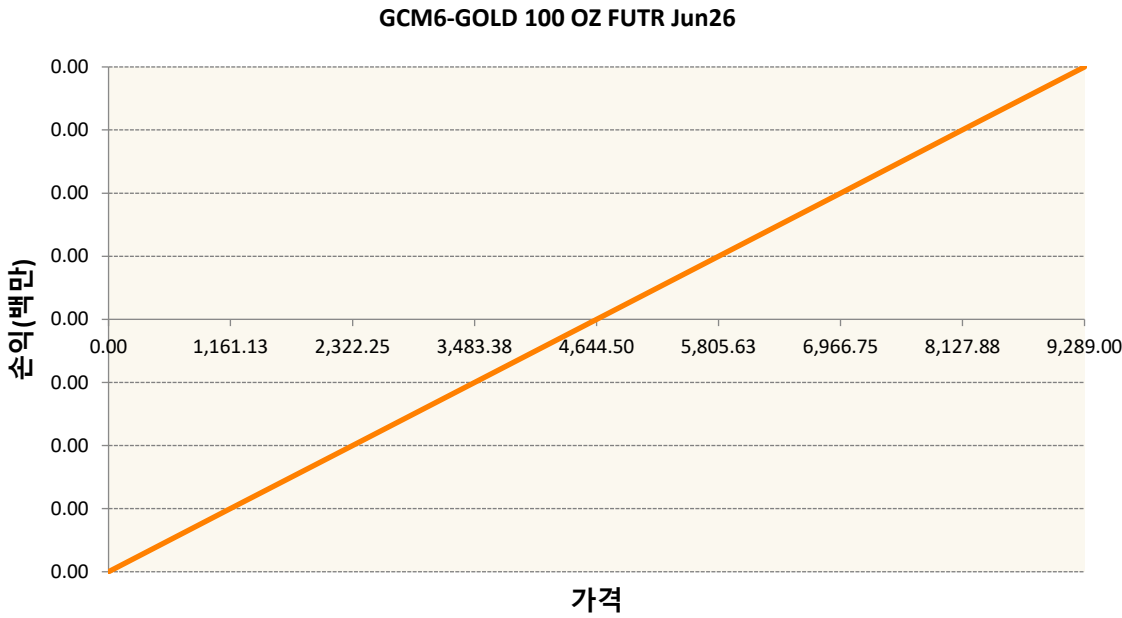
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,590	0	5,590	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUCS4 GLD US 05/08/26 C447 EQUITY	10
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	447

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

(단위:백만원)

569

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

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	293
AOPLTRSUP1 PLTR US 05/08/26 P155 EQUITY	64

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

(단위:백만원)

1,100

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

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

26

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

(단위:백만원)

16

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

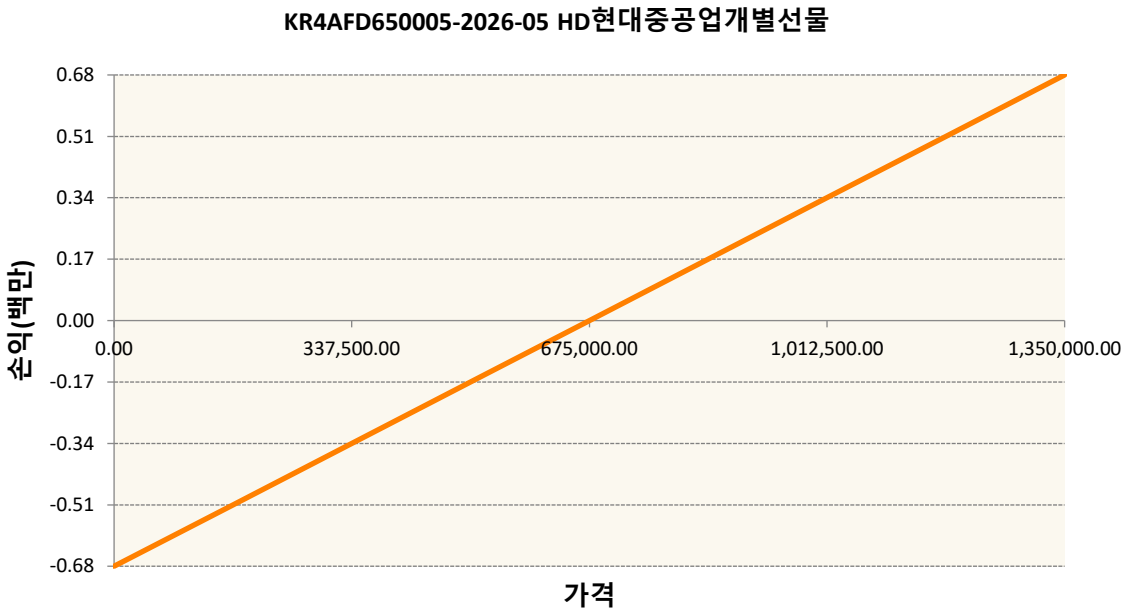
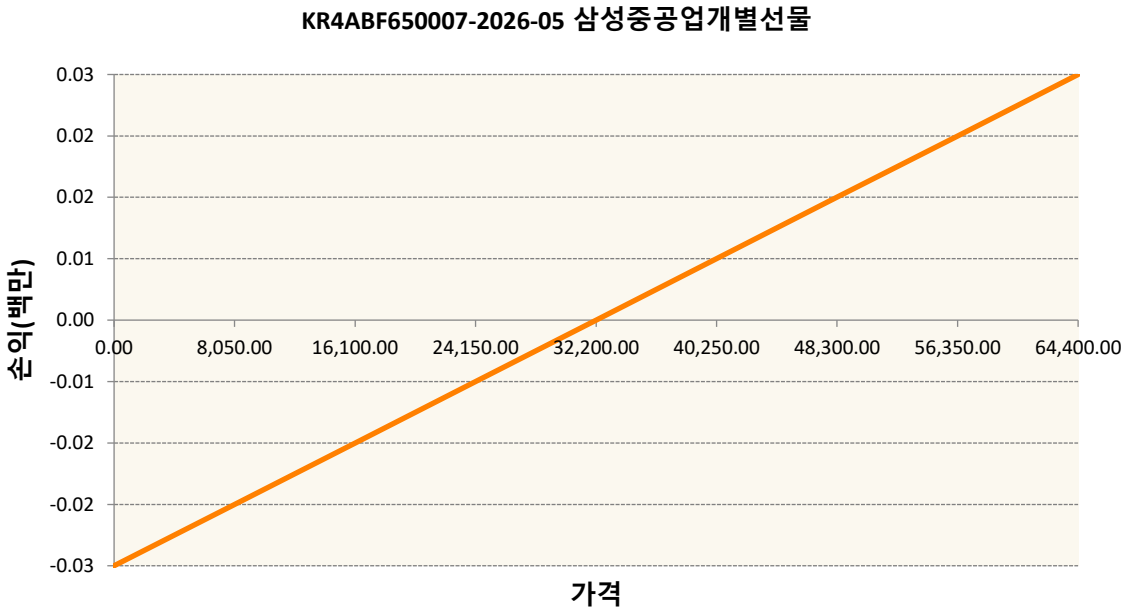
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

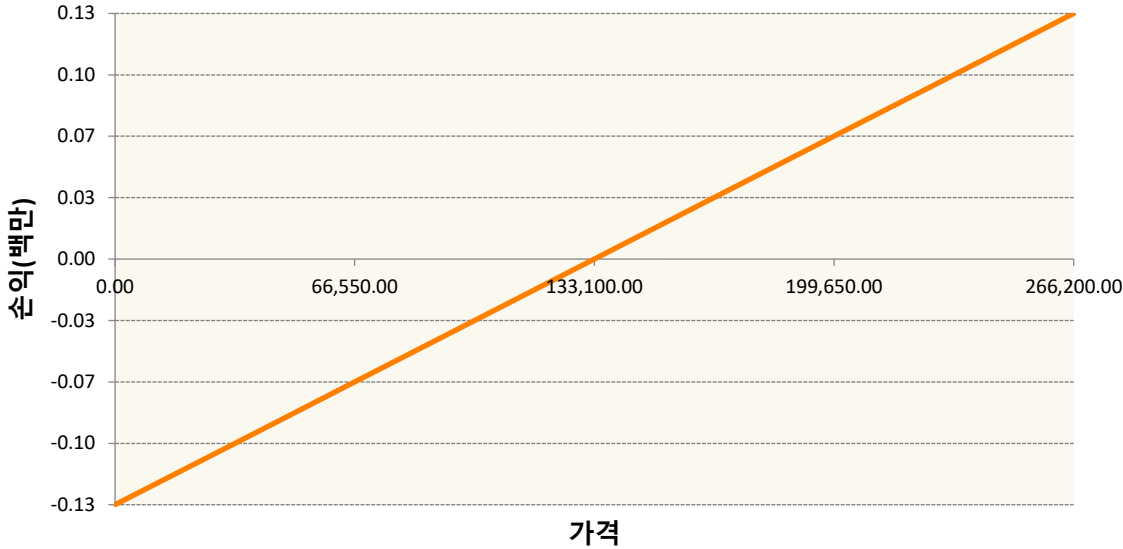
(단위:백만원)

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	35,064	0	35,064	장내
누계	유가증권	스왑	189,463	0	189,463	장외

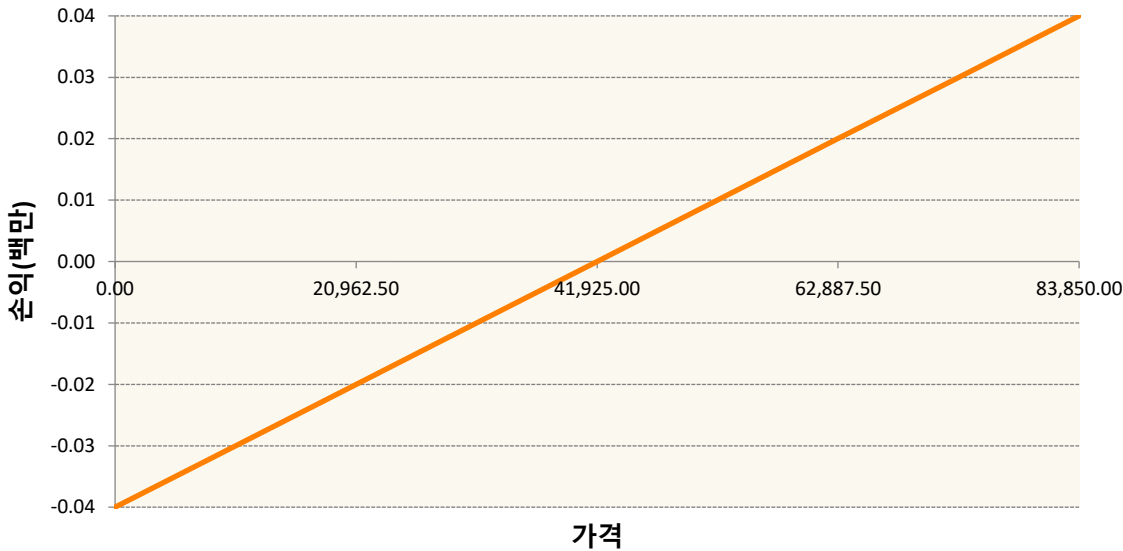
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007		2026-05 삼성중공업개별선물					1,187
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,187	-1,187	-1,187	-1,187	-1,187	-1,187	-1,187
-5.33%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791
-2.67%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	396	396	396	396	396	396	396
5.33%	791	791	791	791	791	791	791
8.00%	1,187	1,187	1,187	1,187	1,187	1,187	1,187
KR4AFD650005		2026-05 HD현대중공업개별선물					1,034
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034	-1,034
-5.33%	-689	-689	-689	-689	-689	-689	-689
-2.67%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	345	345	345	345	345	345	345
5.33%	689	689	689	689	689	689	689
8.00%	1,034	1,034	1,034	1,034	1,034	1,034	1,034
KR4AFV650003 2026-05 한화오션개별선물							594
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-594	-594	-594	-594	-594	-594	-594
-5.33%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396
-2.67%	-198	-198	-198	-198	-198	-198	-198
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	198	198	198	198	198	198	198
5.33%	396	396	396	396	396	396	396
8.00%	594	594	594	594	594	594	594

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

(단위:백만원)

4,315

공시일 2026-05-06

기준일 2026-05-04

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	2026-05-06
기준일	2026-05-04

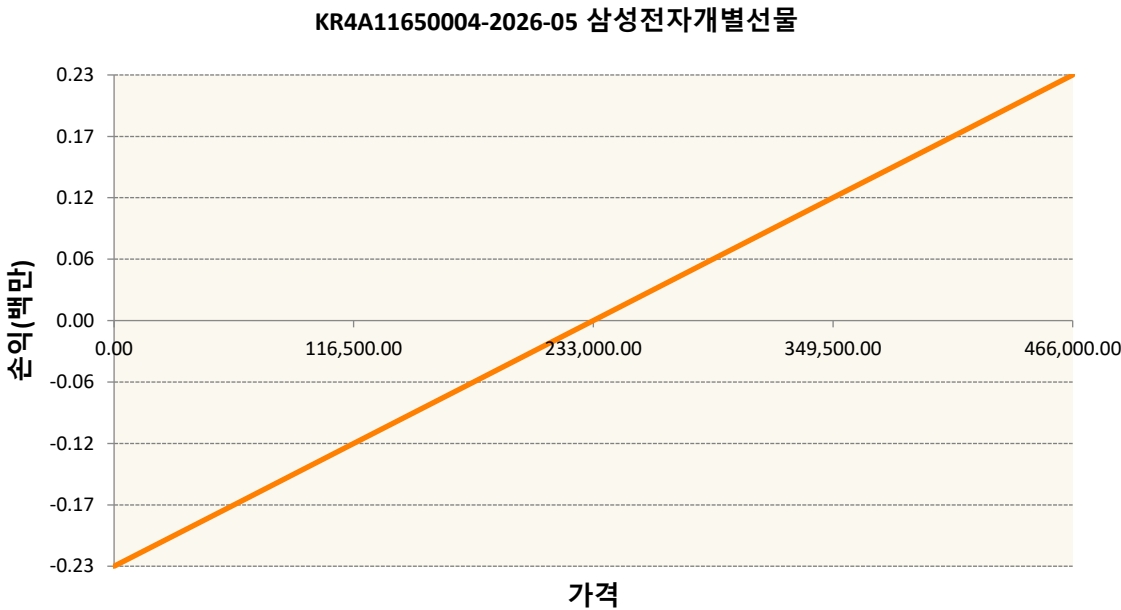
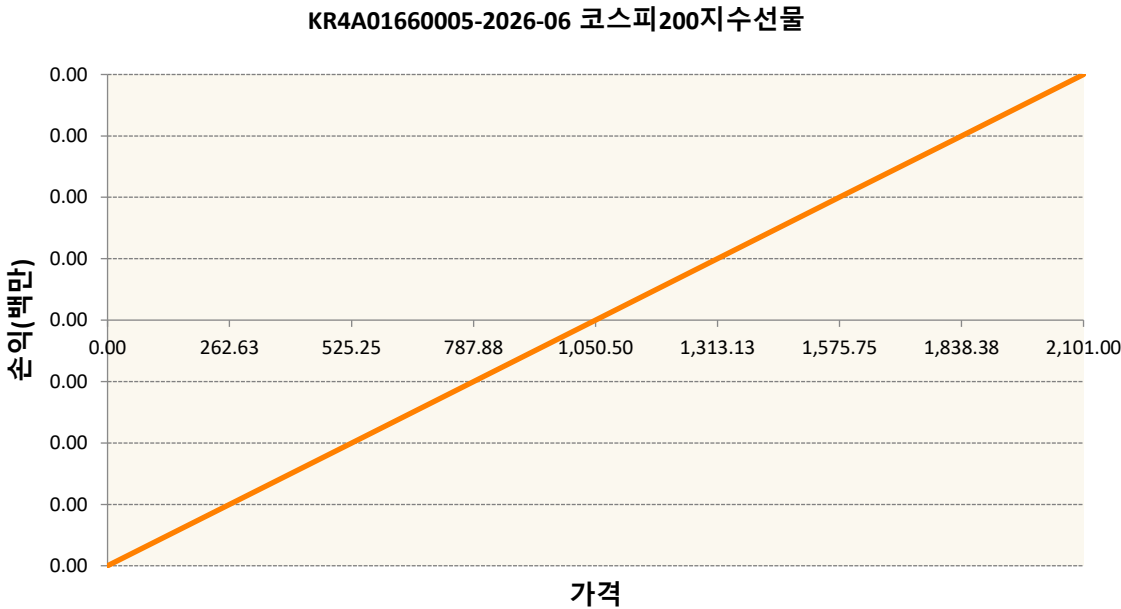
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	49,401	-49,401	장내
누계	유가증권	선물	13,585	0	13,585	장내
누계	유가증권	옵션	0	48,871	-48,871	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,100.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the relationship, starting at the origin (0, 0) and ending at (1,050, 0.00).

가격	순이익(백만)
0.00	0.00
1,050.00	0.00

The graph illustrates the relationship between price and profit/loss. The x-axis represents '가격' (Price) and the y-axis represents '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions). The line starts at the origin (0,0) and passes through the point (1,052.50, 0), indicating that the profit/loss is zero at this price point.

가격	손익 (백만)
0.00	0.00
1,052.50	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물			546
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-546	-546	-546	-546	-546	-546	-546
-5.33%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
-2.67%	-182	-182	-182	-182	-182	-182	-182
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	182	182	182	182	182	182	182
5.33%	364	364	364	364	364	364	364
8.00%	546	546	546	546	546	546	546
KR4A11650004				2026-05 삼성전자개별선물			539
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-539	-539	-539	-539	-539	-539	-539
-5.33%	-360	-360	-360	-360	-360	-360	-360
-2.67%	-180	-180	-180	-180	-180	-180	-180
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	180	180	180	180	180	180	180
5.33%	360	360	360	360	360	360	360
8.00%	539	539	539	539	539	539	539

KR4B09EZA217 코스피위클리 C 2605W1 1,050.0

1,842

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,774	-1,779	-1,786	-1,796	-1,809	-1,825	-1,842
-5.33%	-1,019	-1,037	-1,058	-1,083	-1,110	-1,139	-1,170
-2.67%	-350	-387	-427	-468	-510	-552	-596
0%	146	97	49	0	-49	-97	-146
2.67%	427	388	347	304	261	217	172
5.33%	544	523	498	470	440	407	373
8.00%	578	570	560	546	529	509	487

KR4B09EZA225 코스피위클리 C 2605W1 1,052.5

1,236

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,194	-1,197	-1,201	-1,207	-1,215	-1,224	-1,236
-5.33%	-692	-703	-717	-732	-749	-767	-787
-2.67%	-243	-267	-292	-318	-345	-373	-401
0%	96	64	32	0	-32	-64	-96
2.67%	295	267	239	210	181	151	121
5.33%	379	364	347	327	306	284	260
8.00%	405	399	391	382	370	356	340

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

(단위:백만원)

7,680

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

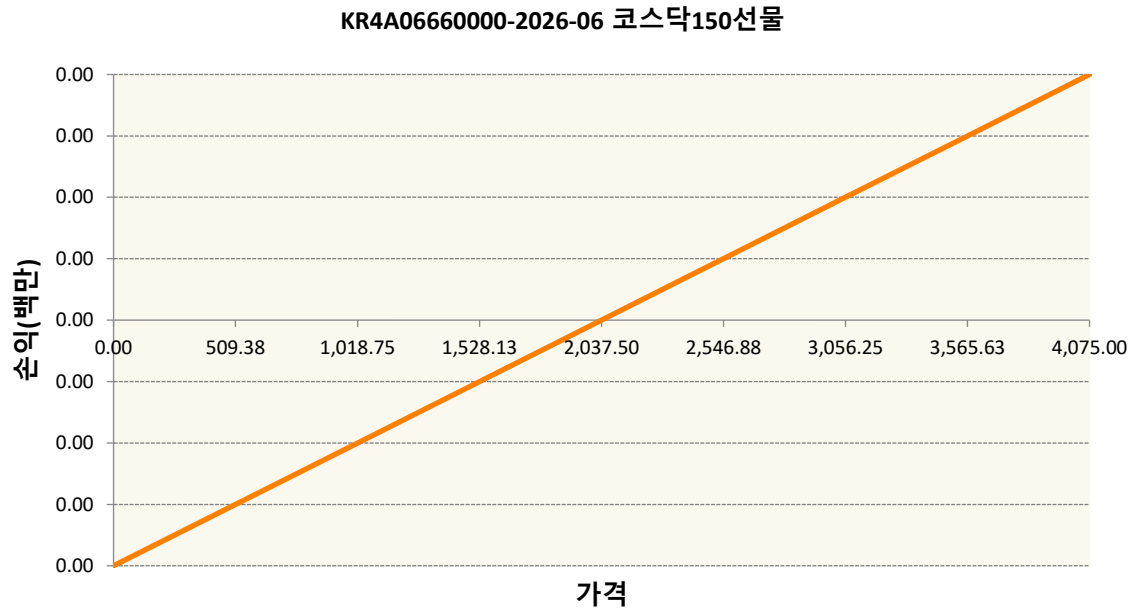
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	917	0	917	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%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-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%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	73	73	73	73	73	73	73

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

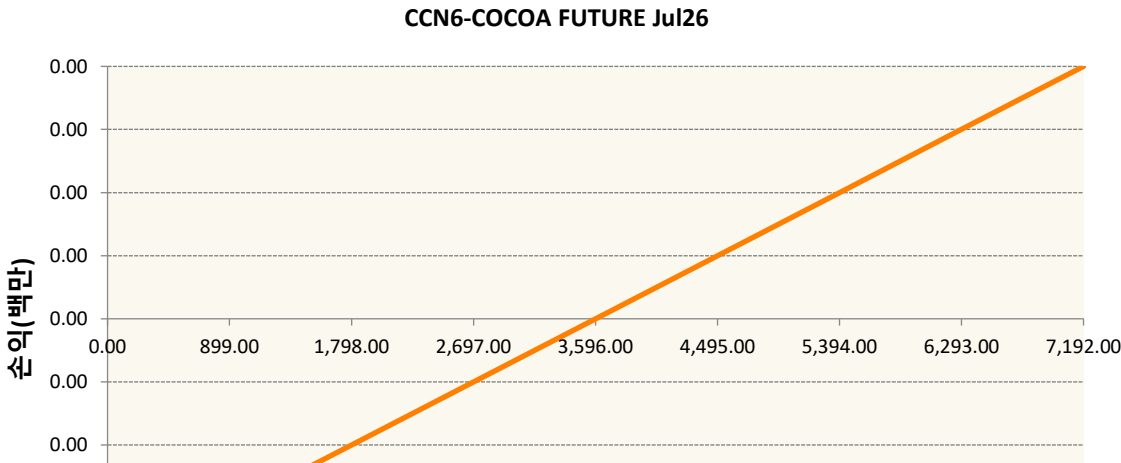
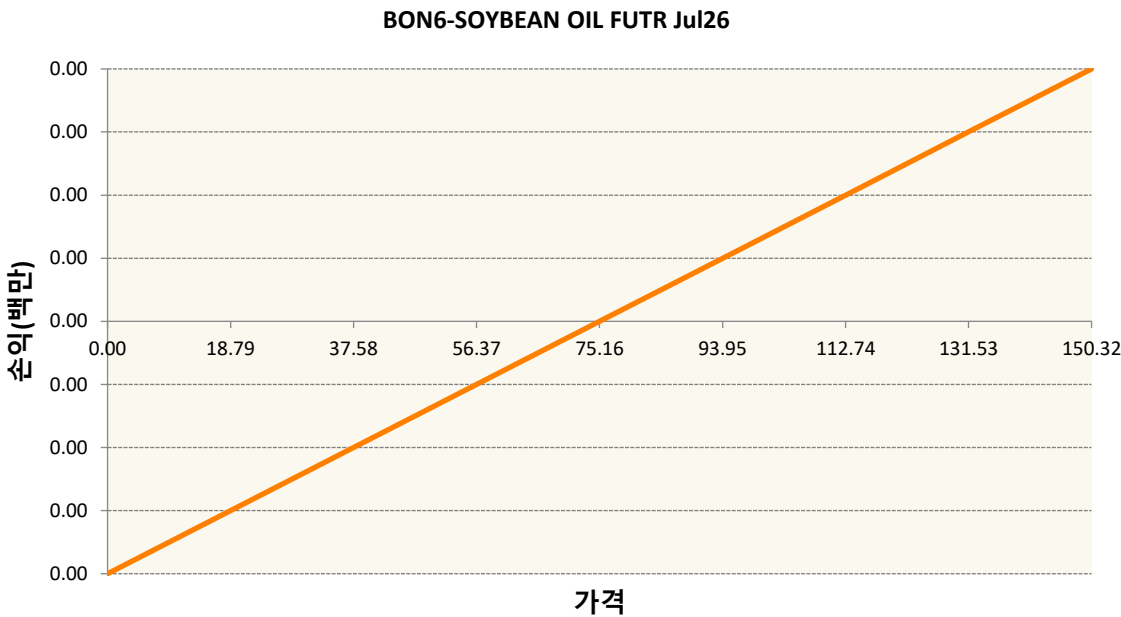
포커스농산물모(채권-파생형)

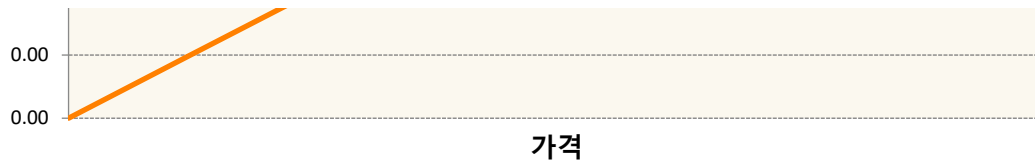
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

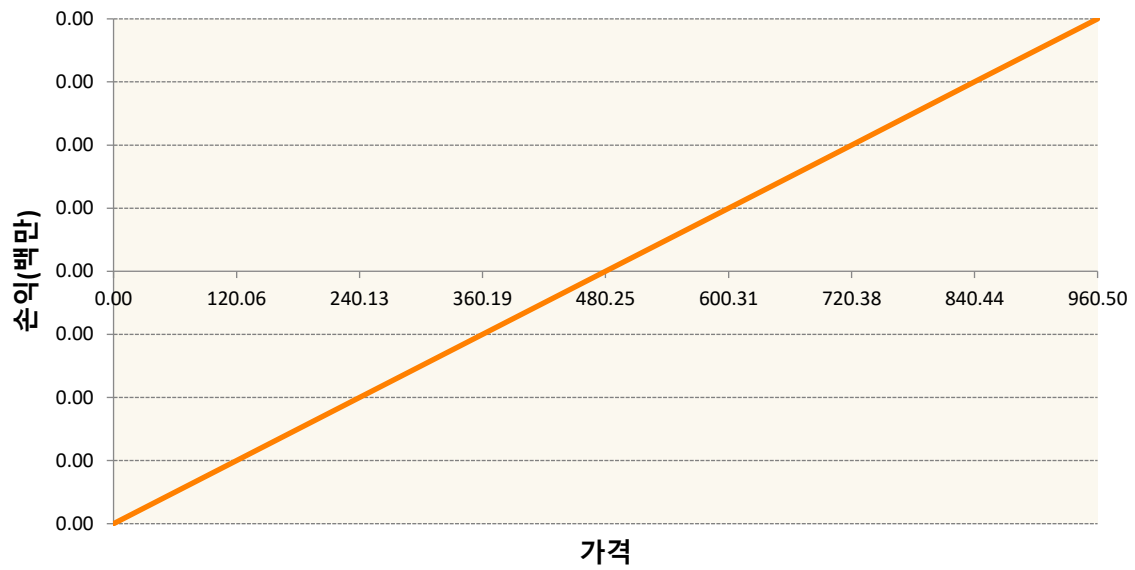
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	53	0	53	
누계	실물자산	선물	912	0	912	장내
누계	유가증권	선물	2,067	0	2,067	
누계	통화	선물	0	409	-409	장내

2. 만기시점의 손익구조

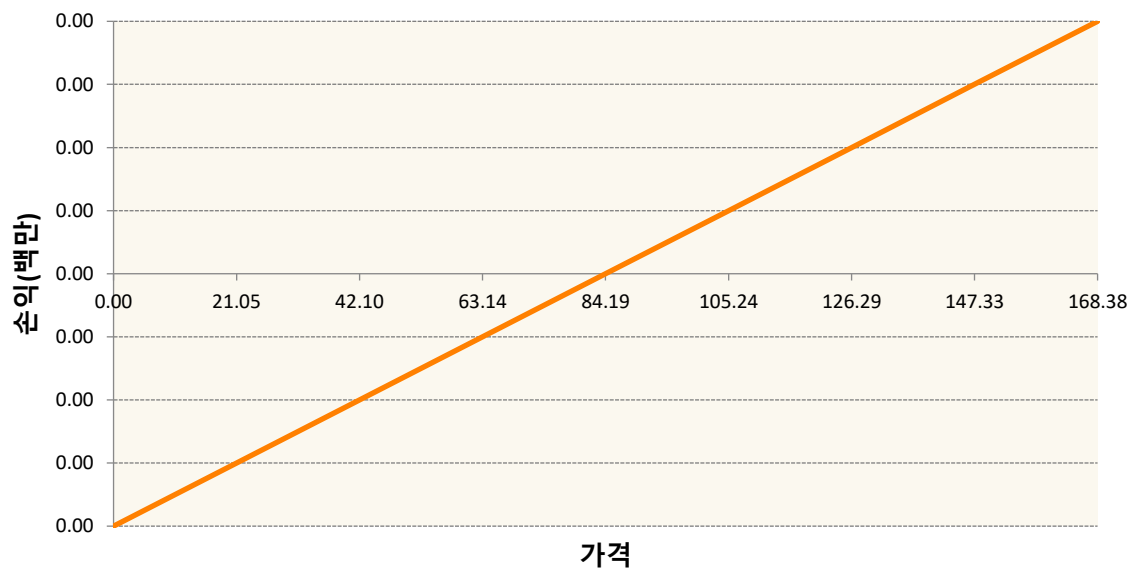




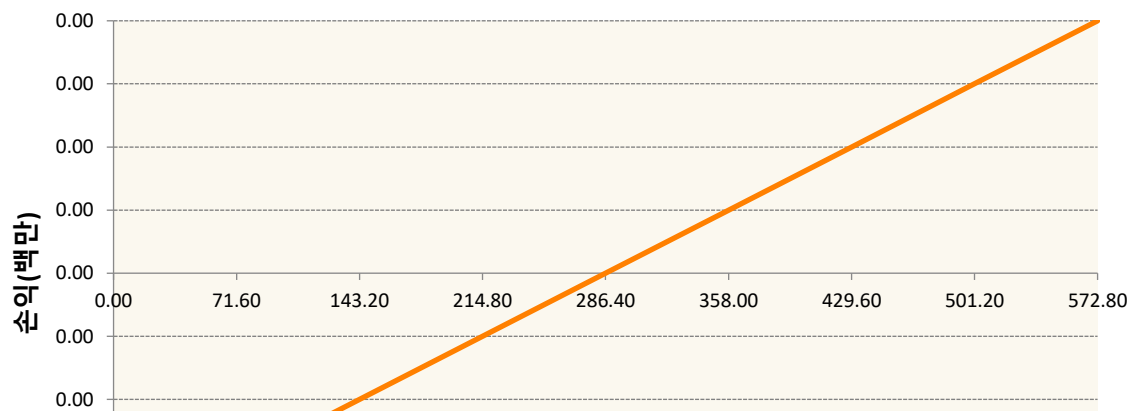
CN6-CORN FUTURE Jul26

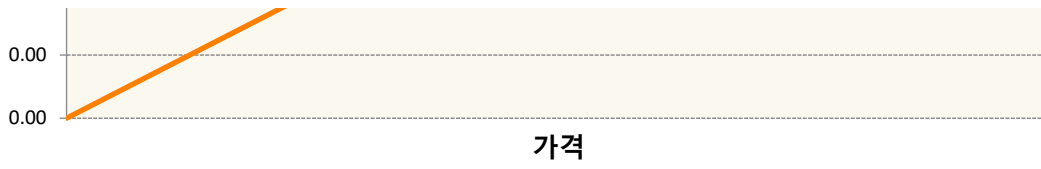


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

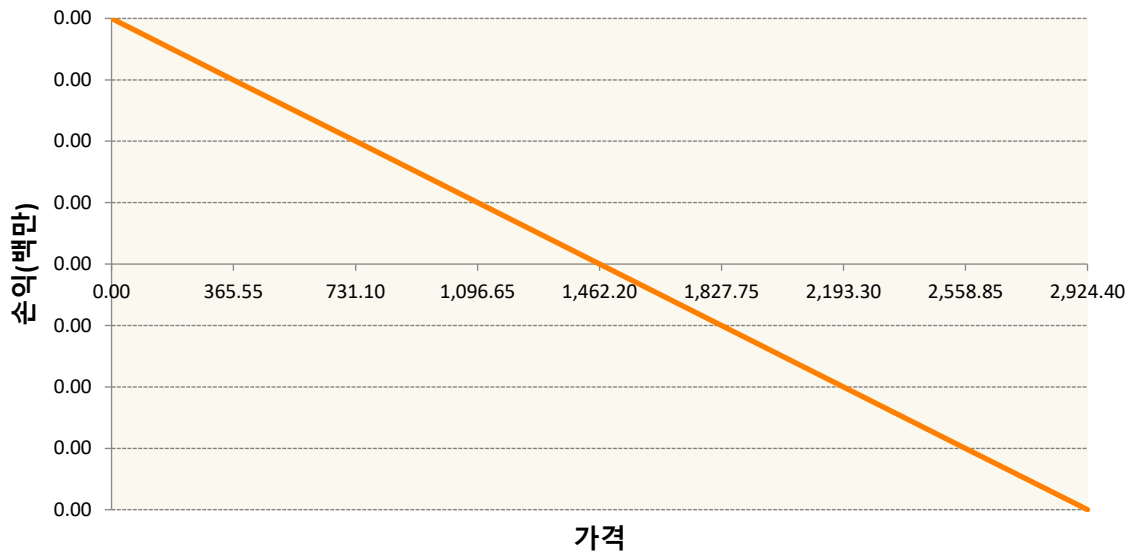


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

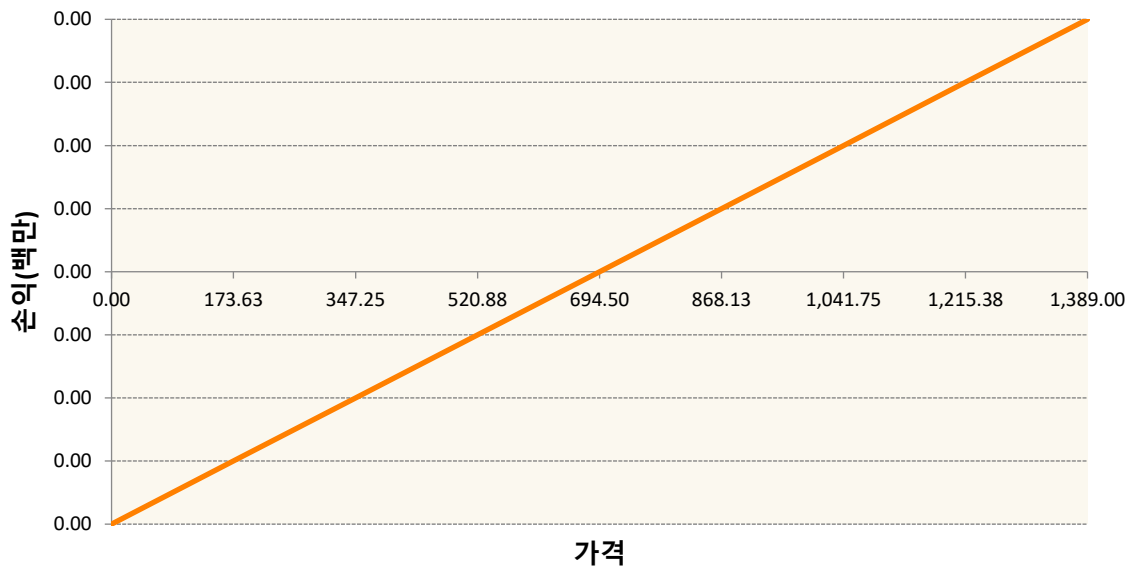




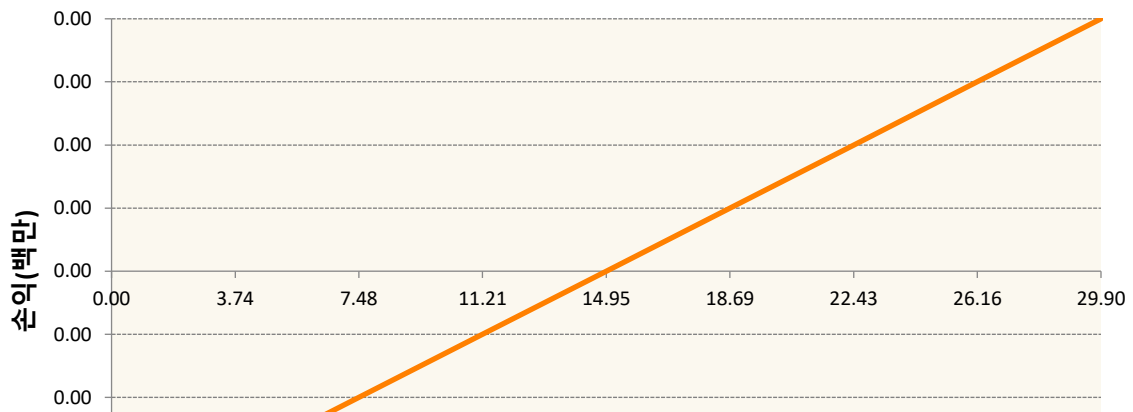
KR4A75650007-2026-05 달러선물

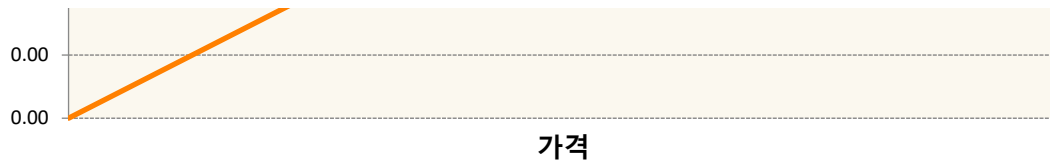


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

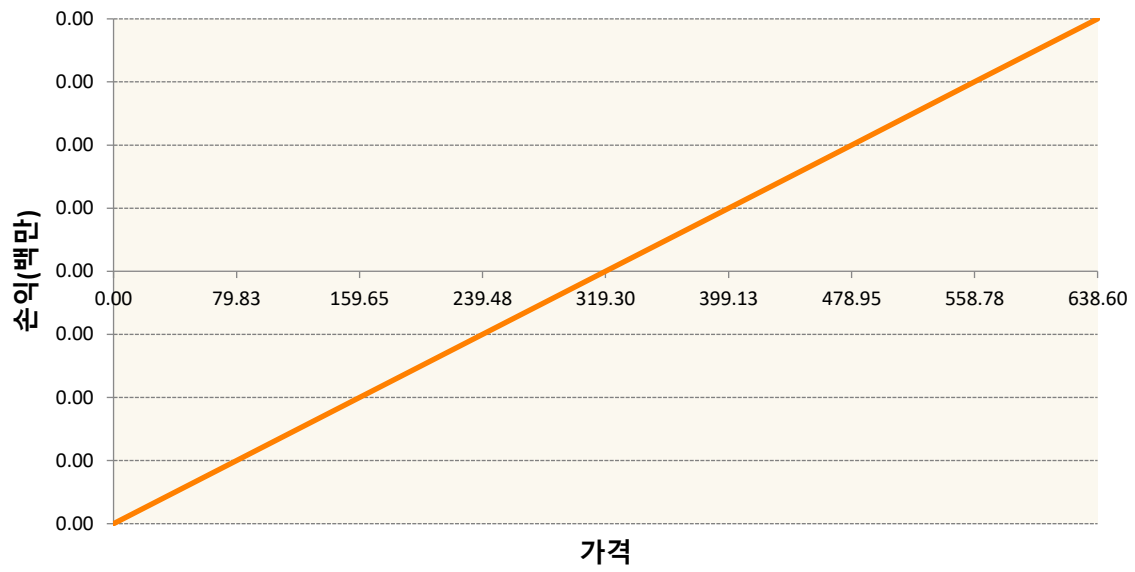


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

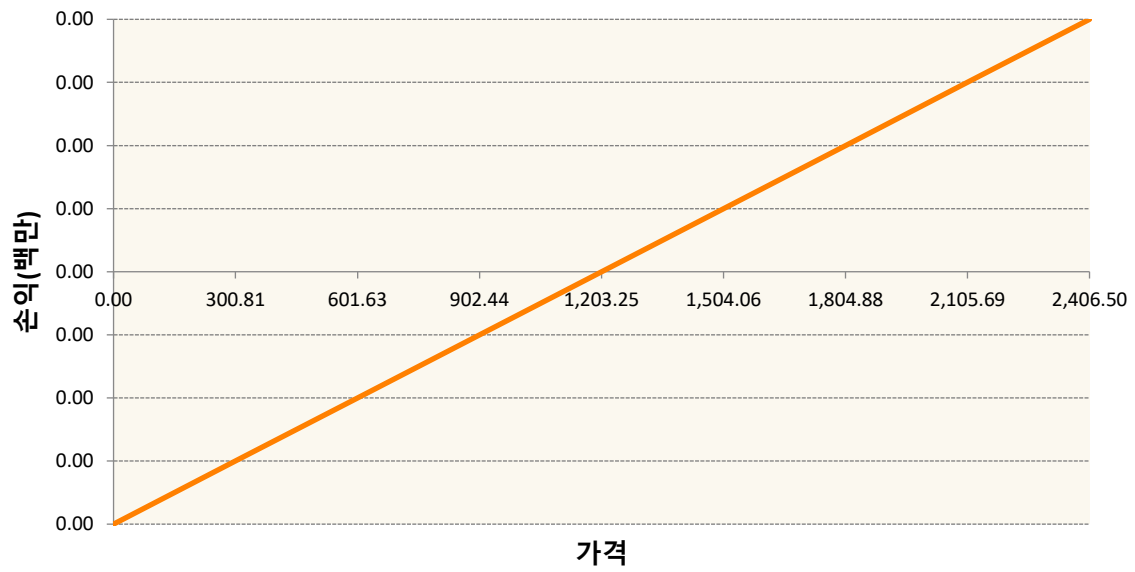




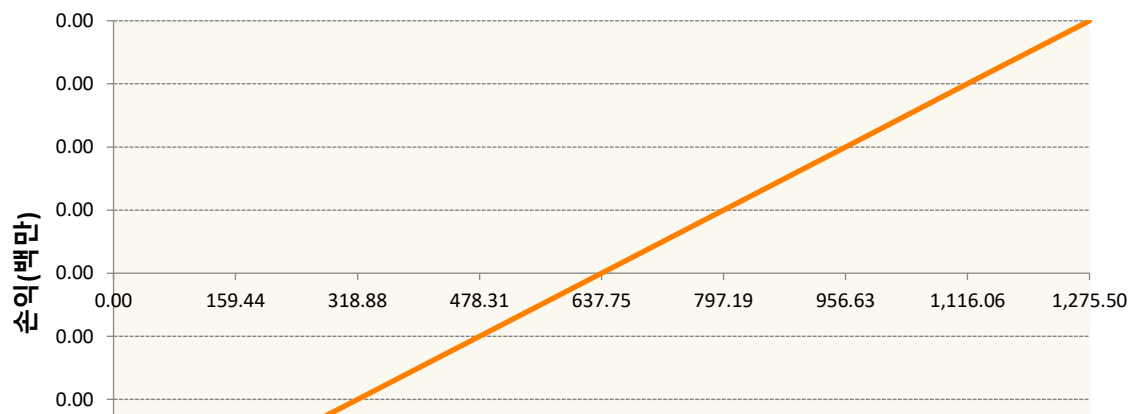
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

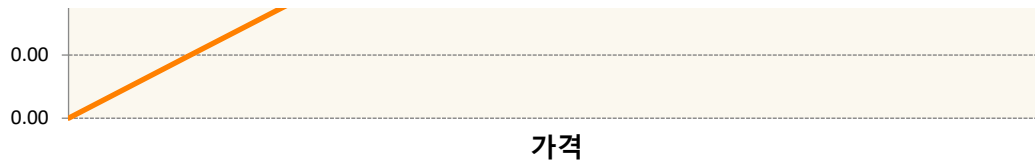


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-05-06
기준일	2026-05-04

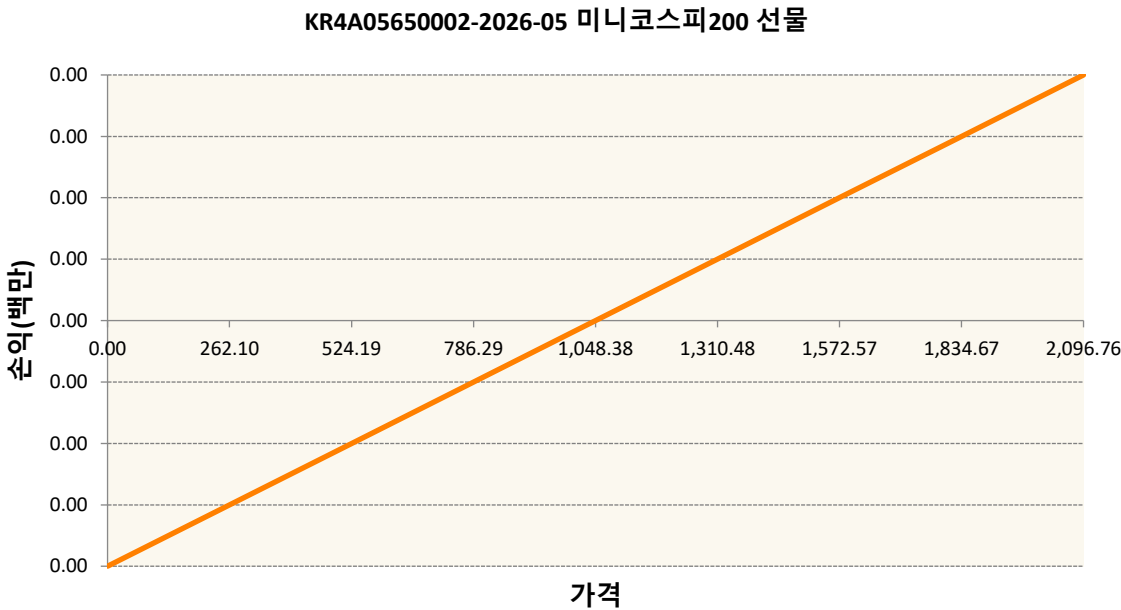
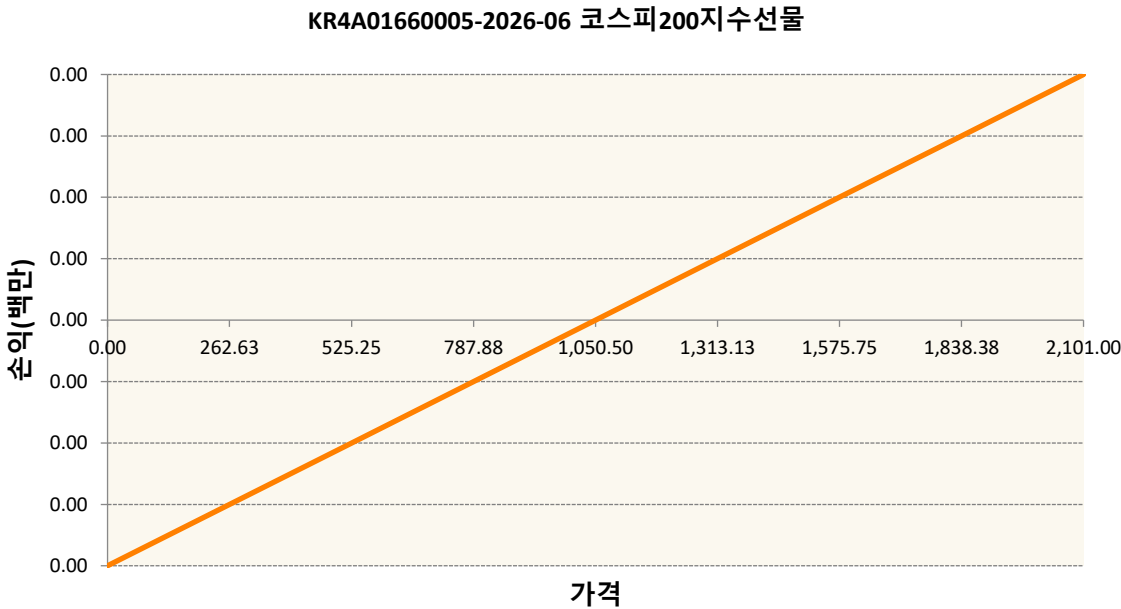
스마트인덱스모

1. 계약금액

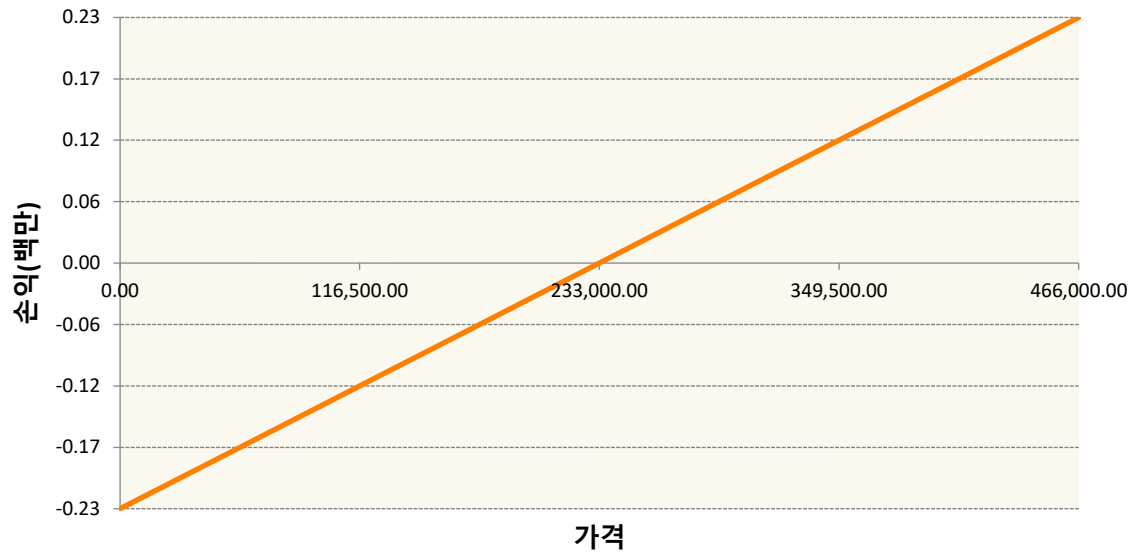
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	256	-256	장내
누계	유가증권	선물	4,126	0	4,126	장내

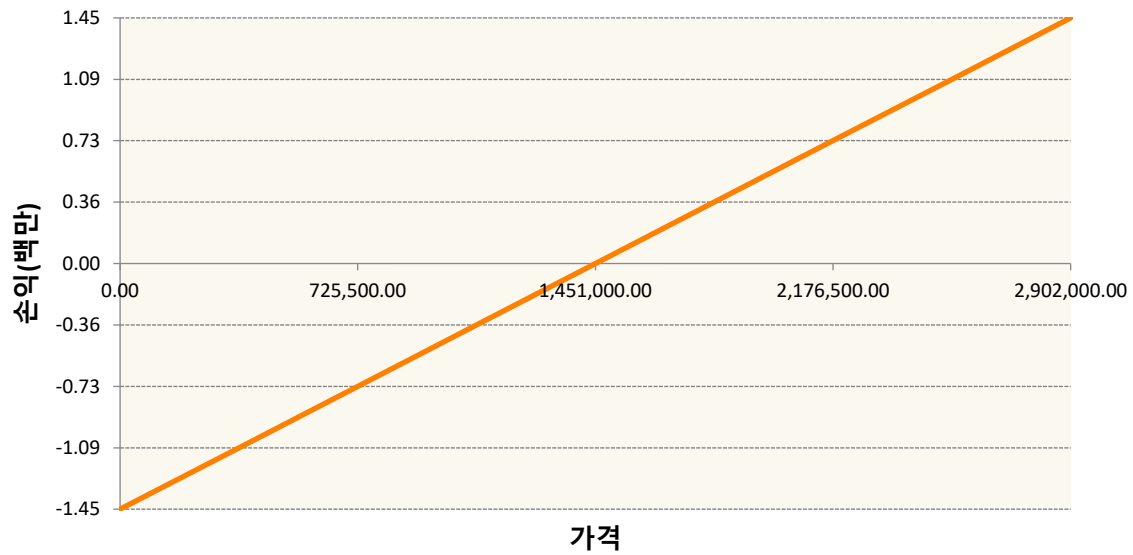
2. 만기시점의 손익구조



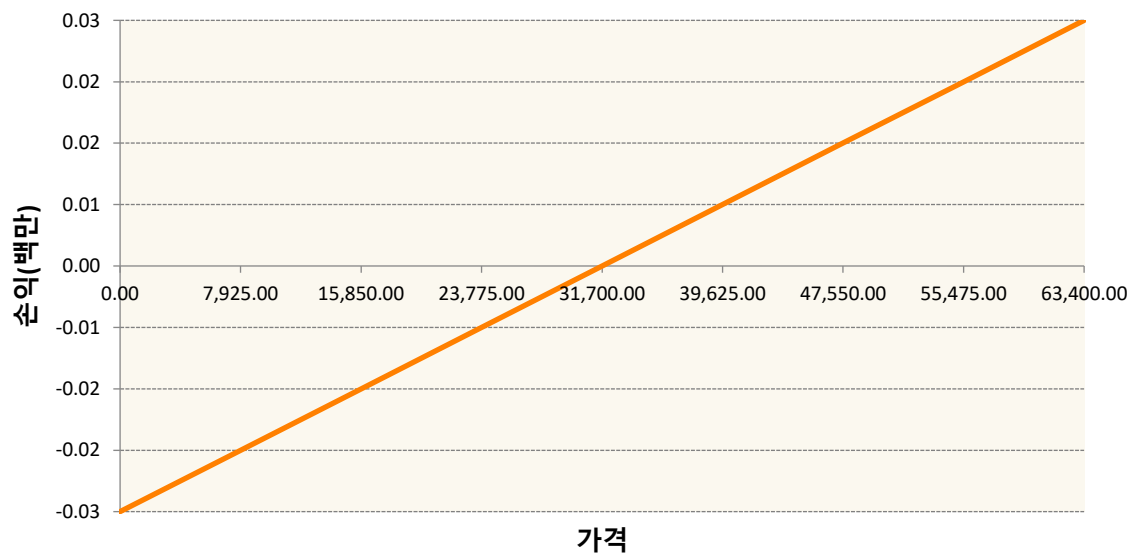
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					168
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-5.33%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	56	56	56	56	56	56	56
5.33%	112	112	112	112	112	112	112
8.00%	168	168	168	168	168	168	168
KR4A05650002		2026-05 미니코스피200 선물					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
KR4A11650004		2026-05 삼성전자개별선물					42
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-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%	28	28	28	28	28	28	28
8.00%	42	42	42	42	42	42	42
KR4A50650006		2026-05 SK하이닉스개별선물					13
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-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%	13	13	13	13	13	13	13
KR4AFT650007		2026-05 대우건설개별선물					2
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-5.33%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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

(단위:백만원)

558

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

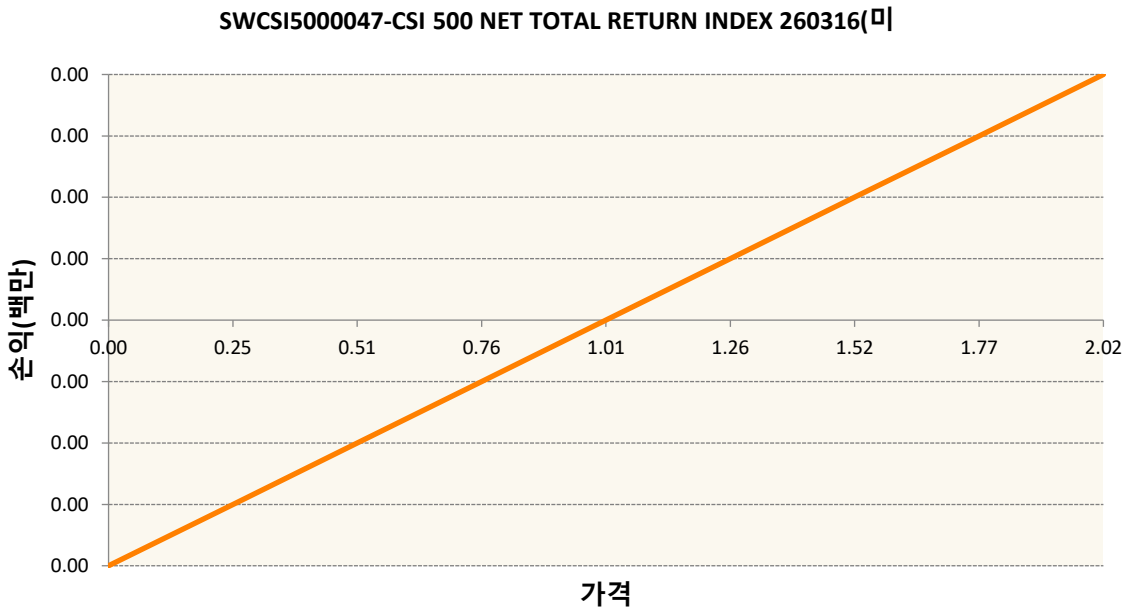
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	2026-05-06
기준일	2026-05-04

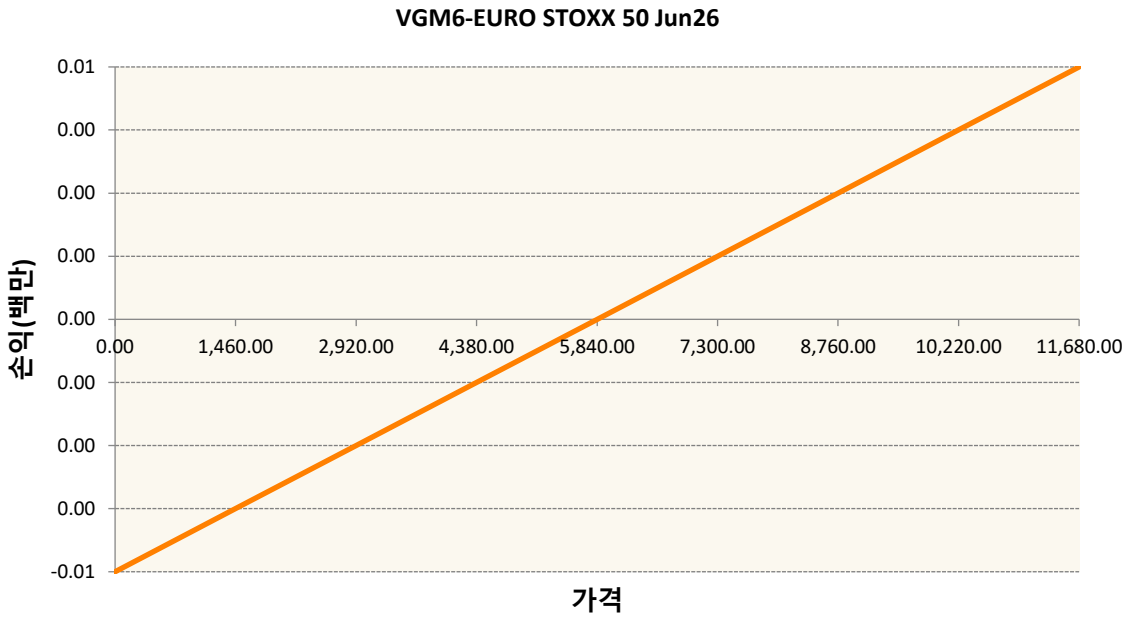
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	900	0	900	

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	2026-05-06
기준일	2026-05-04

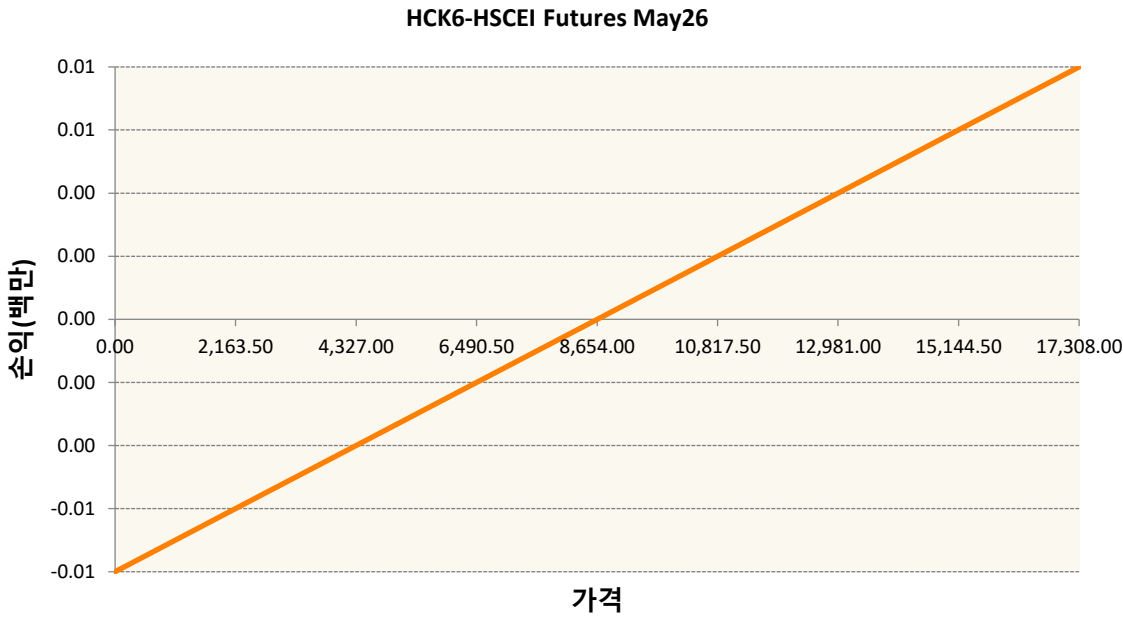
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,627	0	1,627	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

157

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

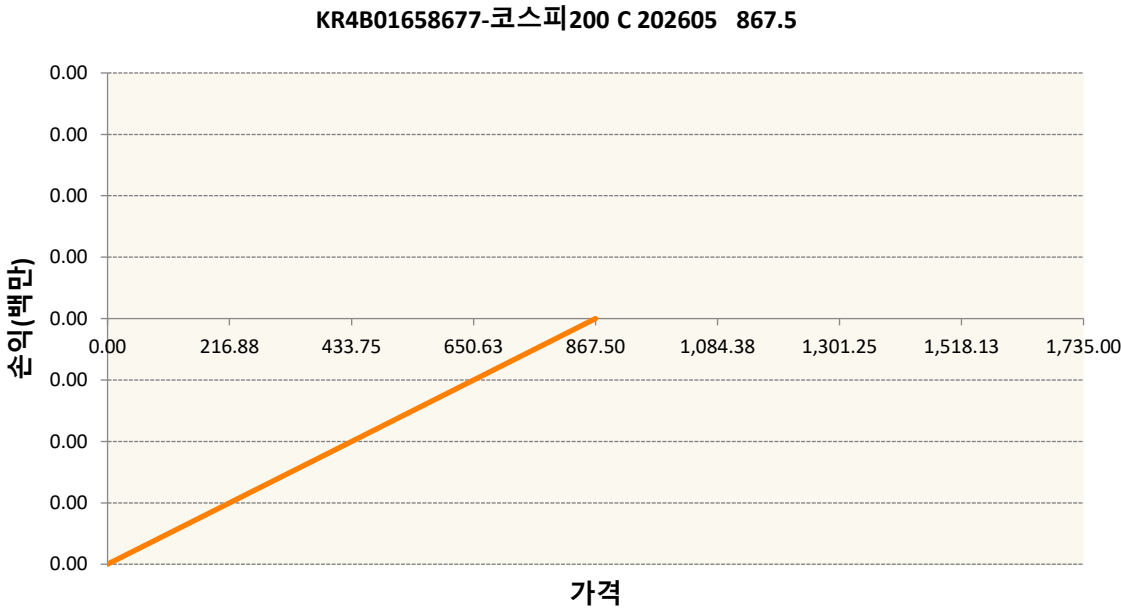
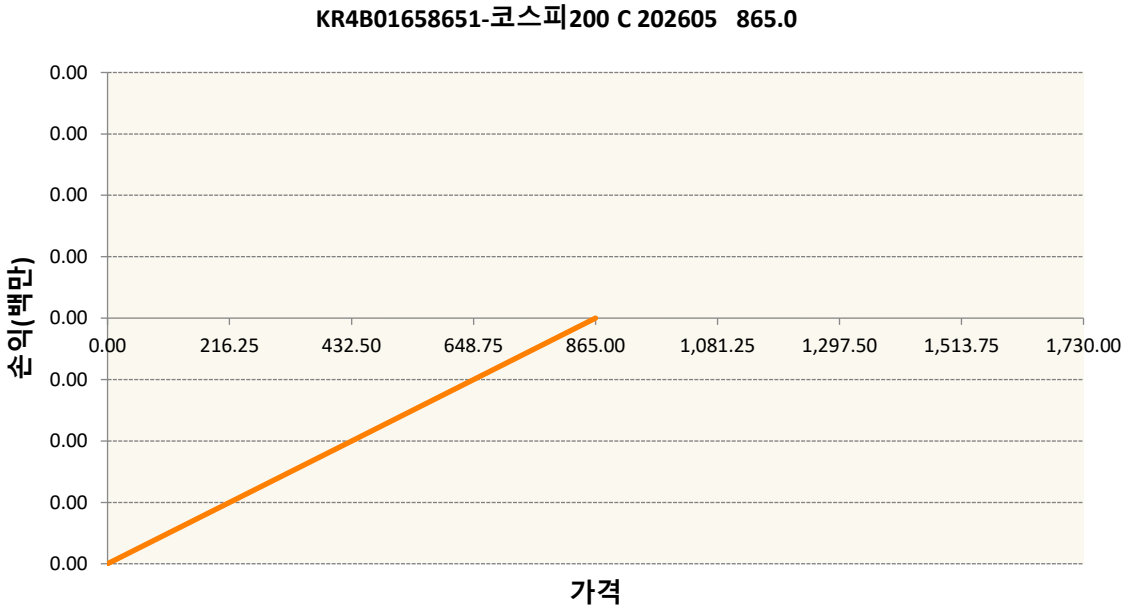
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

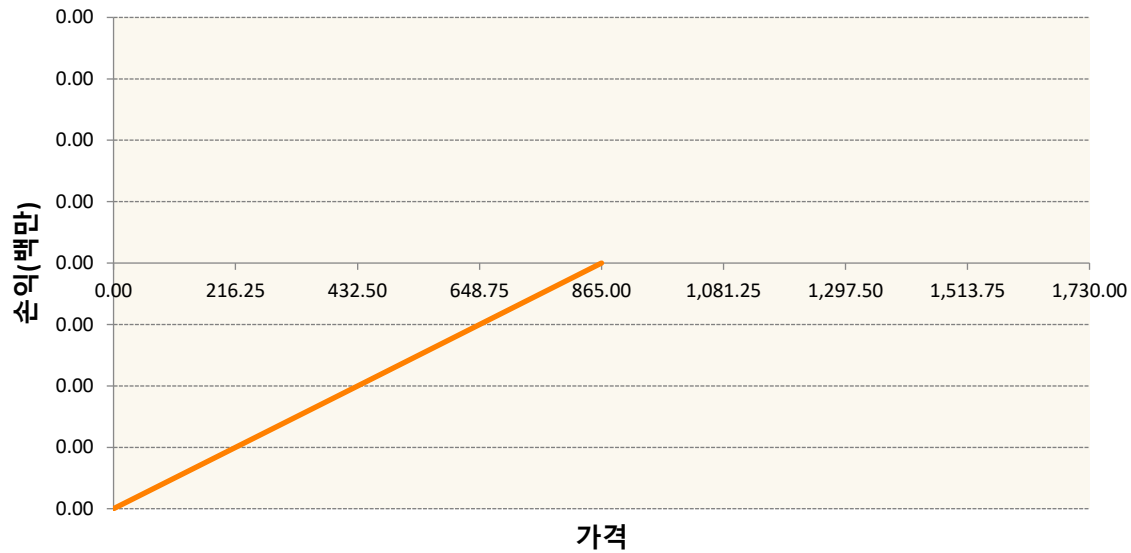
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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							159
기초자산의 변동성							
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-32	-51	-74	-100	-128	-159
-5.33%	1	-7	-19	-33	-51	-71	-94
-2.67%	7	3	-3	-11	-22	-36	-53
0%	9	7	4	0	-7	-15	-27
2.67%	9	9	8	5	2	-4	-11
5.33%	9	9	9	8	6	3	-2
8.00%	9	9	9	9	8	6	3
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							117
기초자산의 변동성							
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12	-24	-39	-55	-74	-95	-117
-5.33%	0	-6	-14	-25	-38	-53	-70
-2.67%	5	2	-2	-8	-17	-27	-39
0%	7	5	3	0	-5	-11	-20
2.67%	7	7	6	4	1	-3	-8
5.33%	7	7	7	6	4	2	-1
8.00%	7	7	7	7	6	5	3
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							66
기초자산의 변동성							
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7	-13	-21	-31	-42	-54	-66
-5.33%	0	-3	-8	-14	-21	-30	-40
-2.67%	3	1	-1	-5	-9	-15	-22
0%	4	3	2	0	-3	-6	-11

2.67%	4	4	3	2	1	-2	-5
5.33%	4	4	4	3	2	1	-1
8.00%	4	4	4	4	3	3	1

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

(단위:백만원)

167

공시일 2026-05-06

기준일 2026-05-04

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	2026-05-06
기준일	2026-05-04

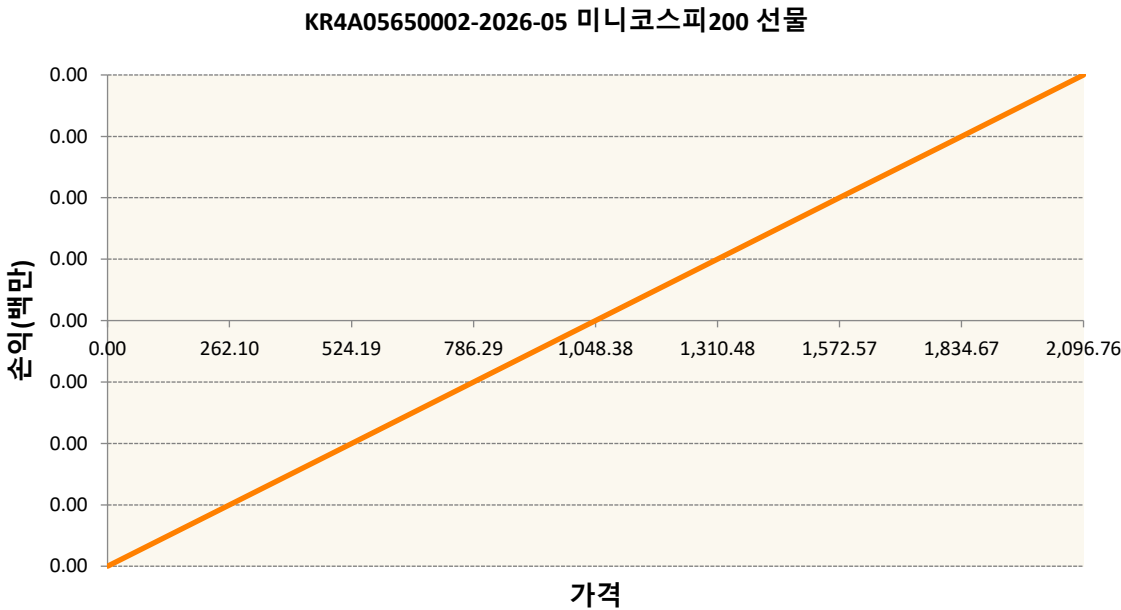
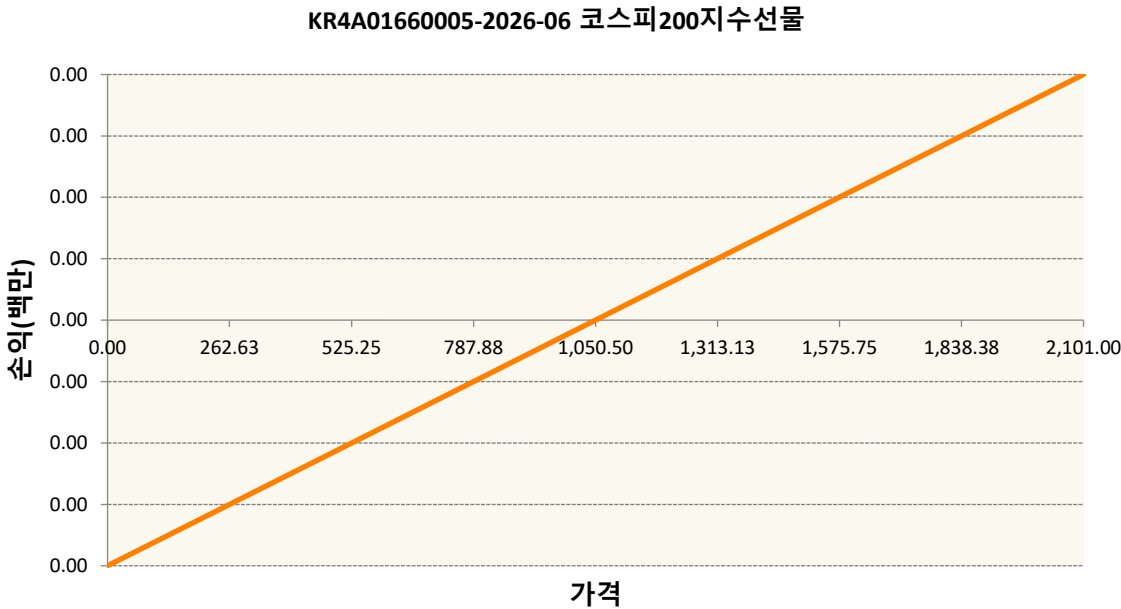
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

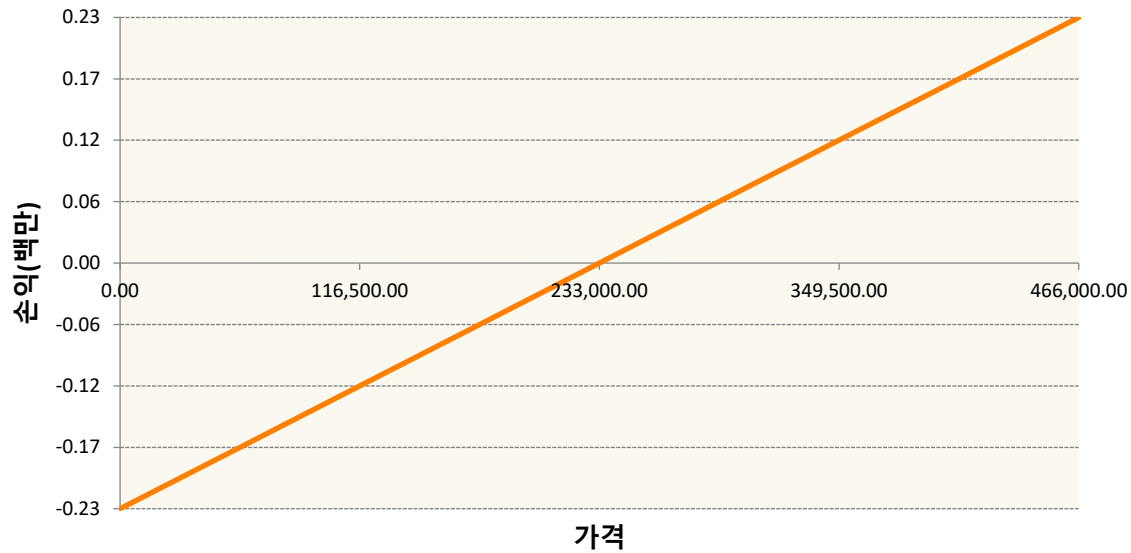
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,344	-2,344	장내
누계	유가증권	선물	2,761	0	2,761	장내

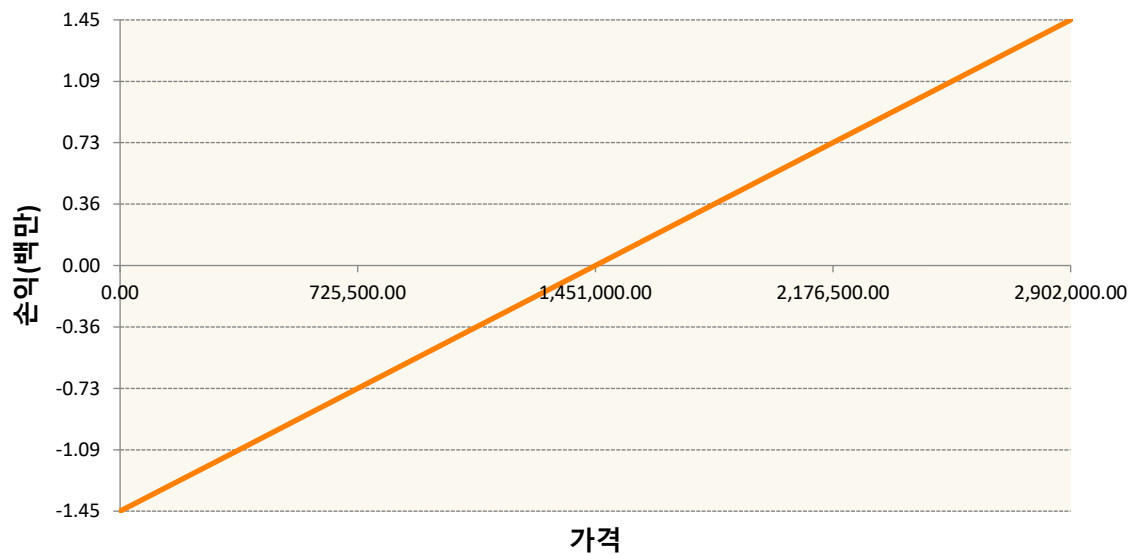
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물			105
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	70	70	70	70	70	70	70
8.00%	105	105	105	105	105	105	105
KR4A05650002				2026-05 미니코스피200 선물			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

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

9

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-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%	9	9	9	9	9	9	9

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

(단위:백만원)

302

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

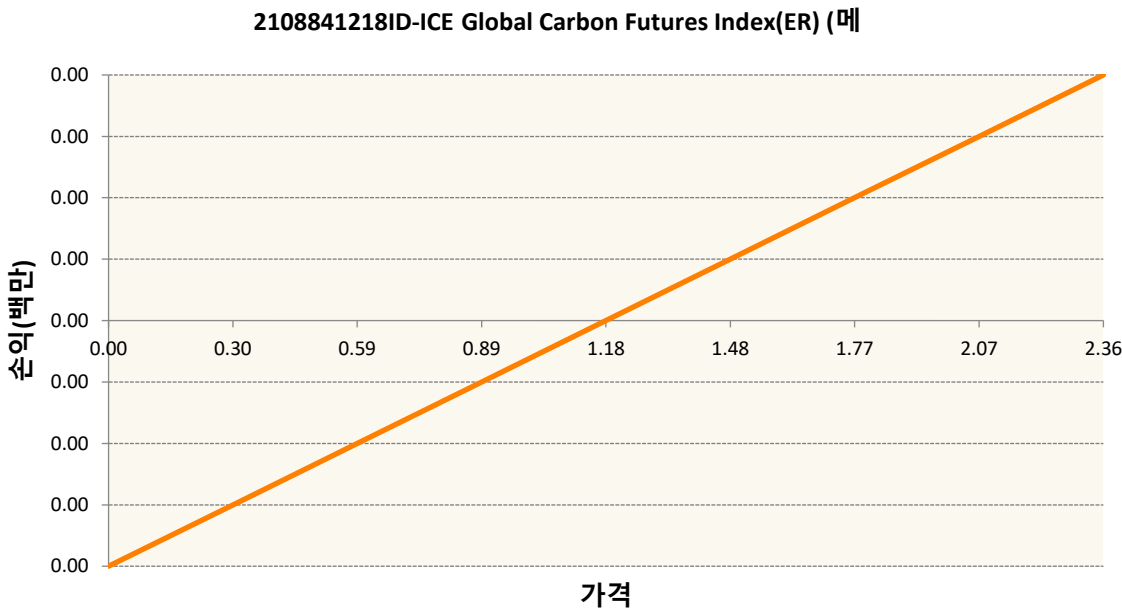
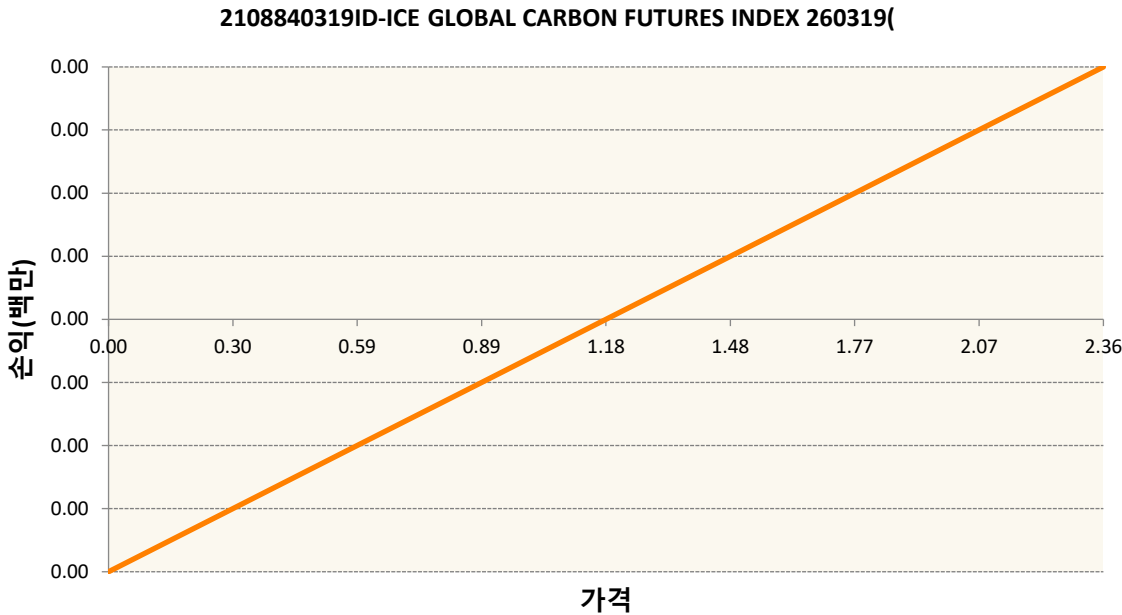
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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)
	620

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

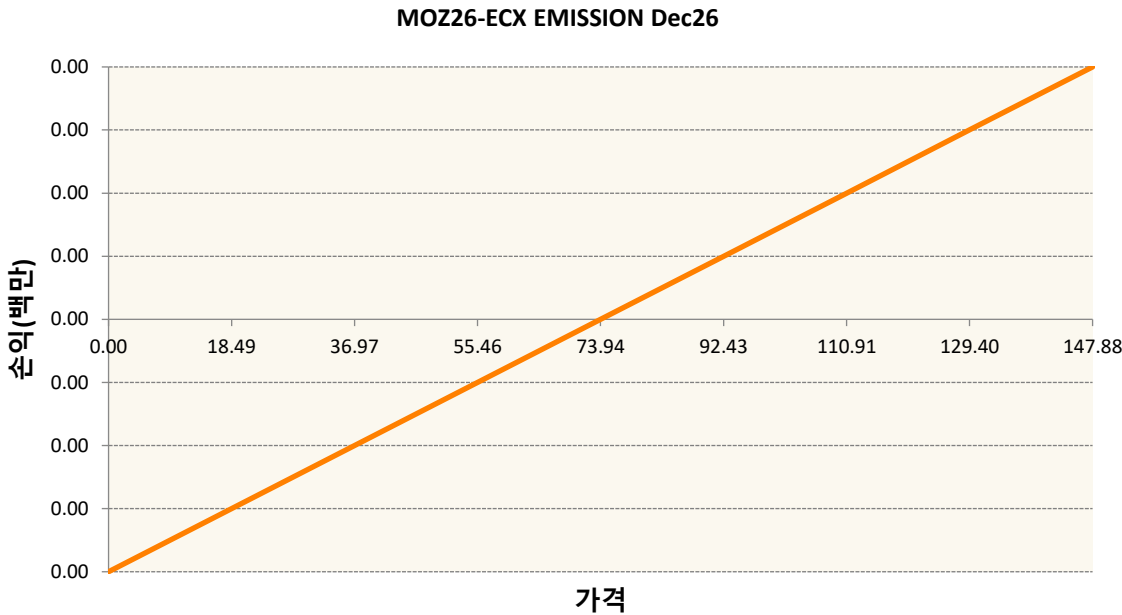
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,774	0	4,774	
누계	통화	선도	0	2,339	-2,339	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	187
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	382

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

(단위:백만원)

664

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

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	2026-05-06
기준일	2026-05-04

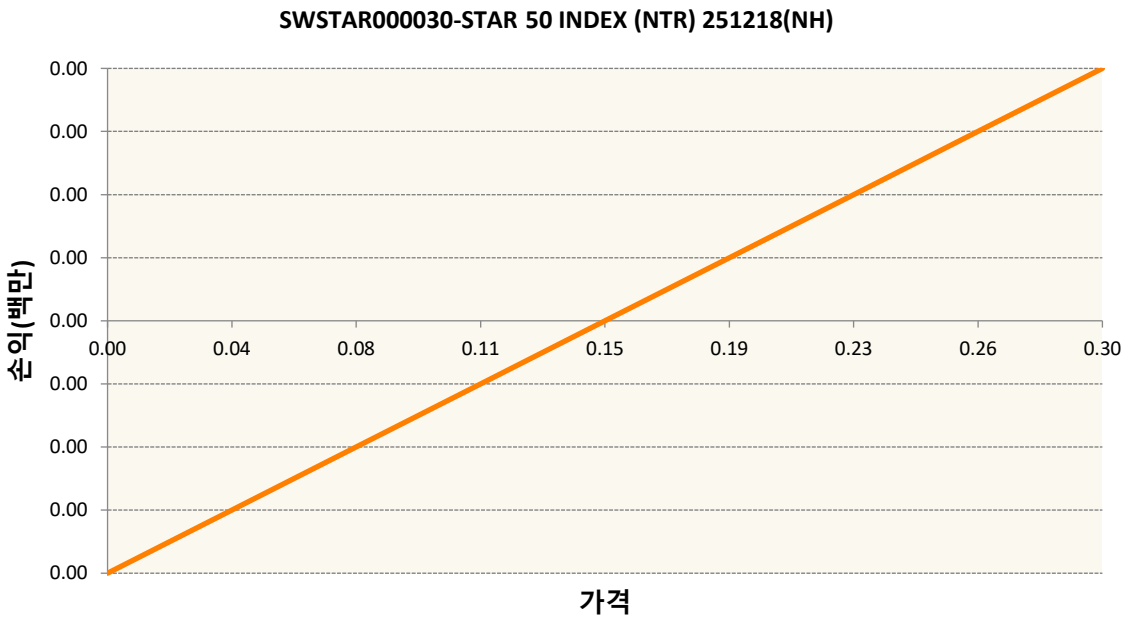
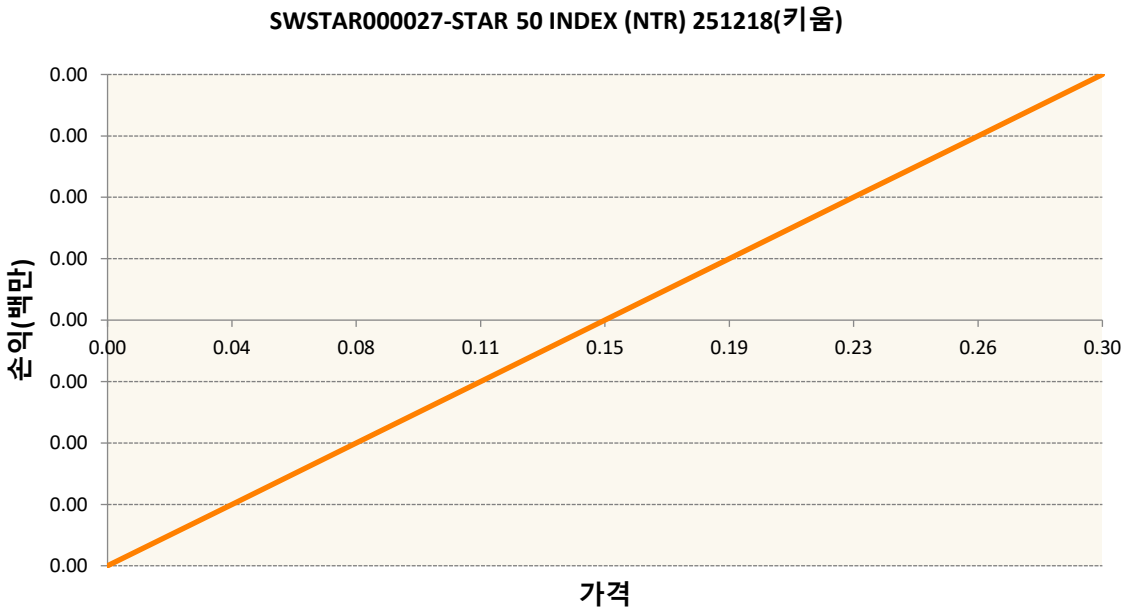
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

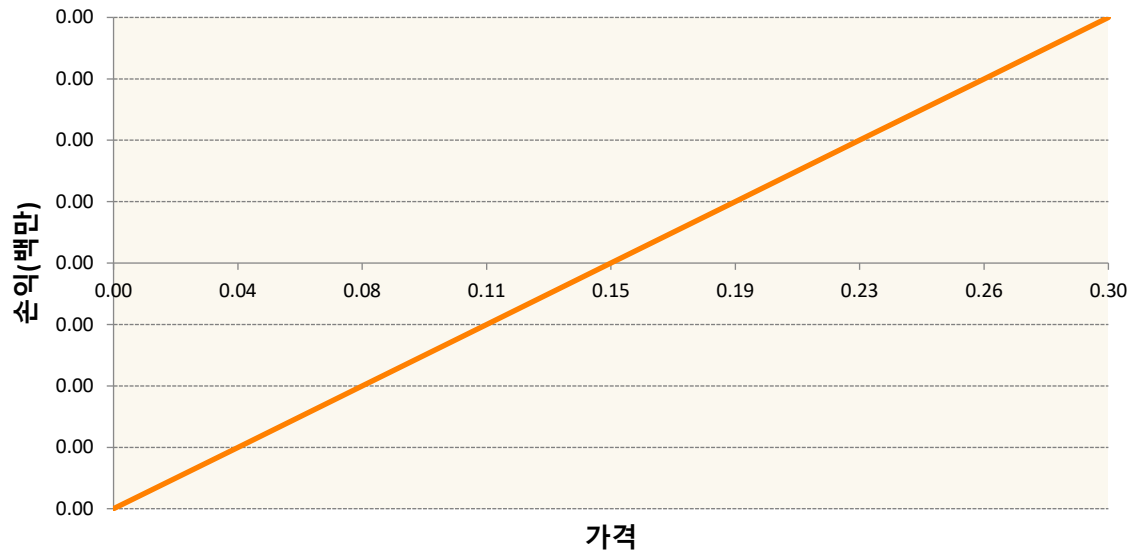
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,794	0	3,794	장외

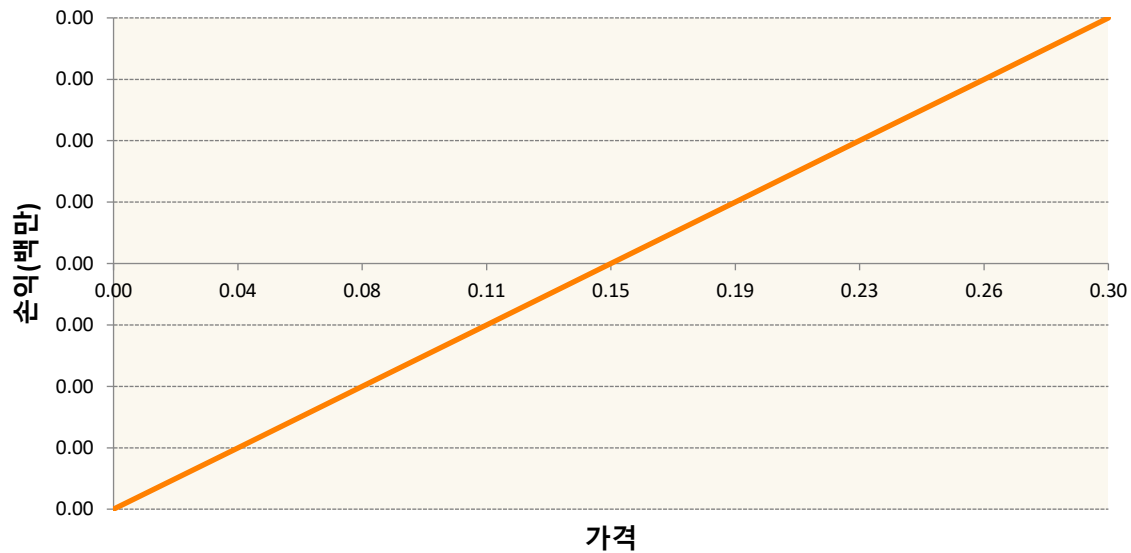
2. 만기시점의 손익구조



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)	11
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	36
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	184
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	68

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

(단위:백만원)

447

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

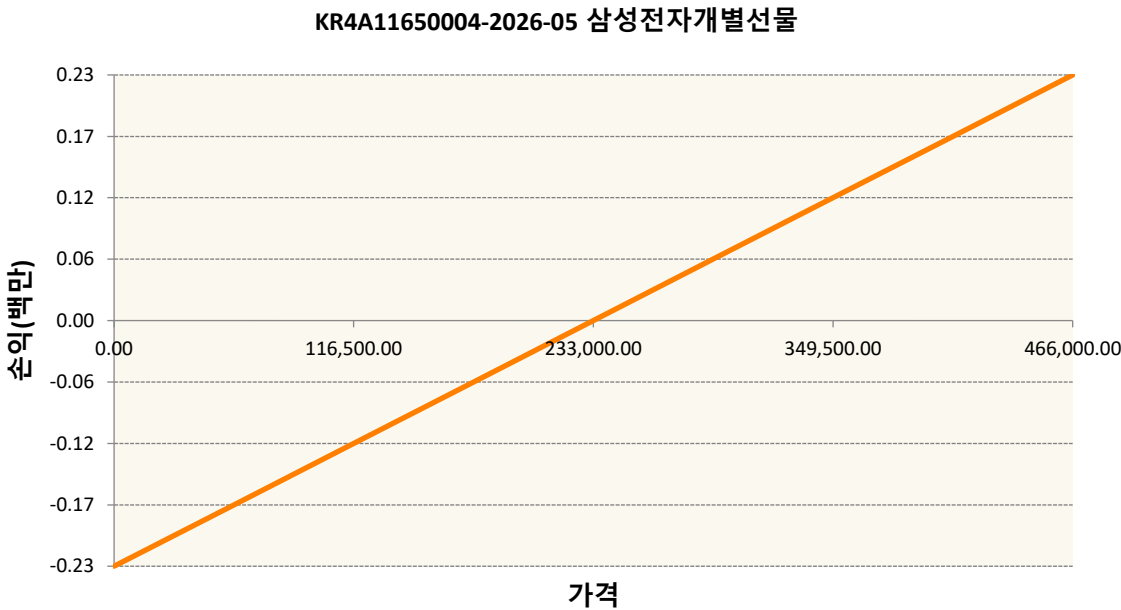
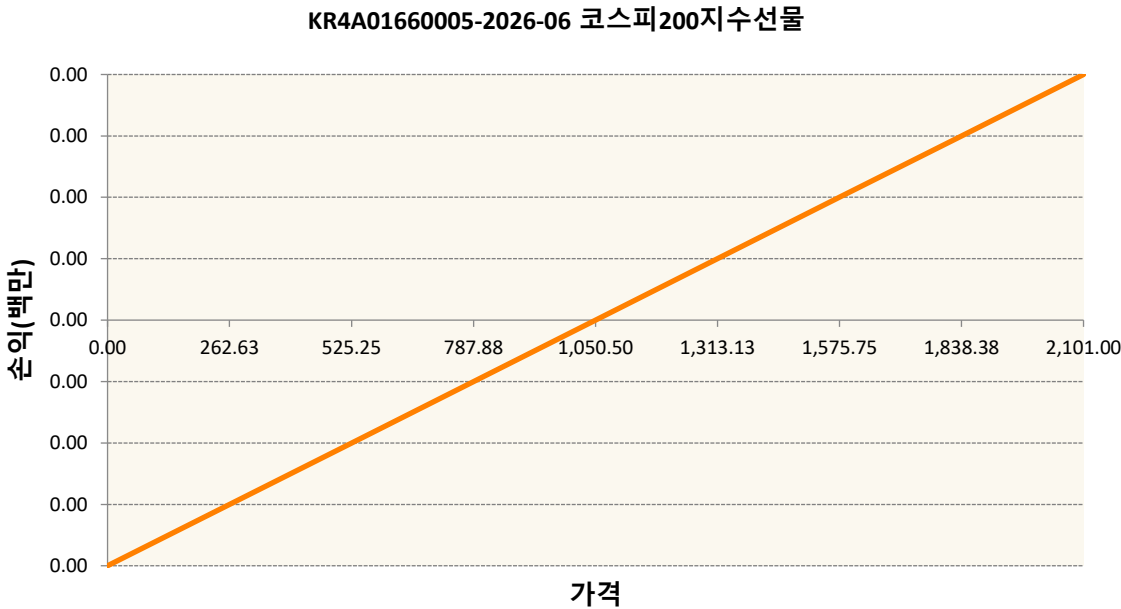
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

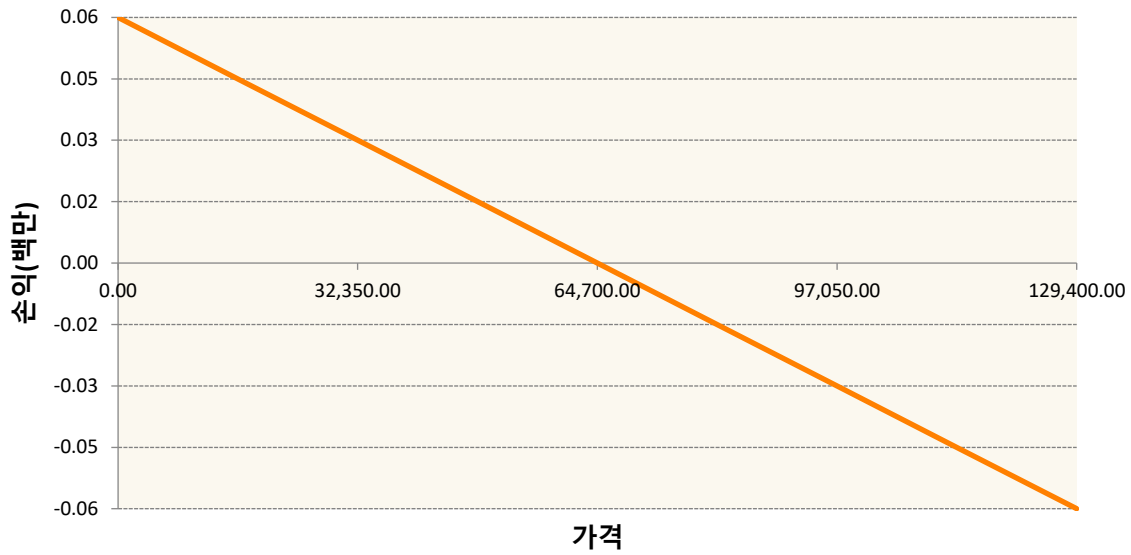
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	259	3,639	-3,379	장내
누계	유가증권	선물	25,871	3,652	22,219	장내

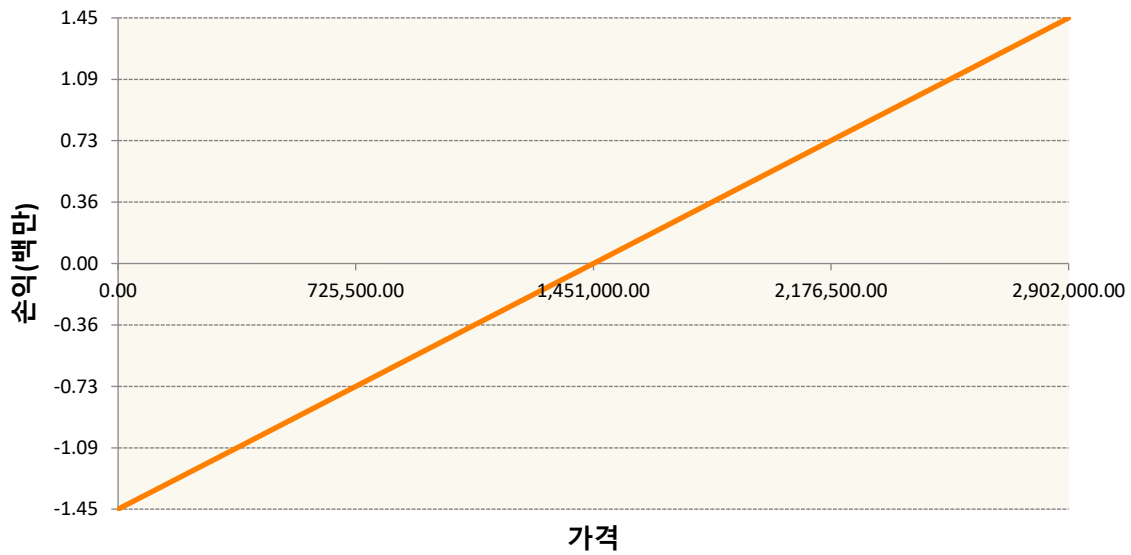
2. 만기시점의 손익구조



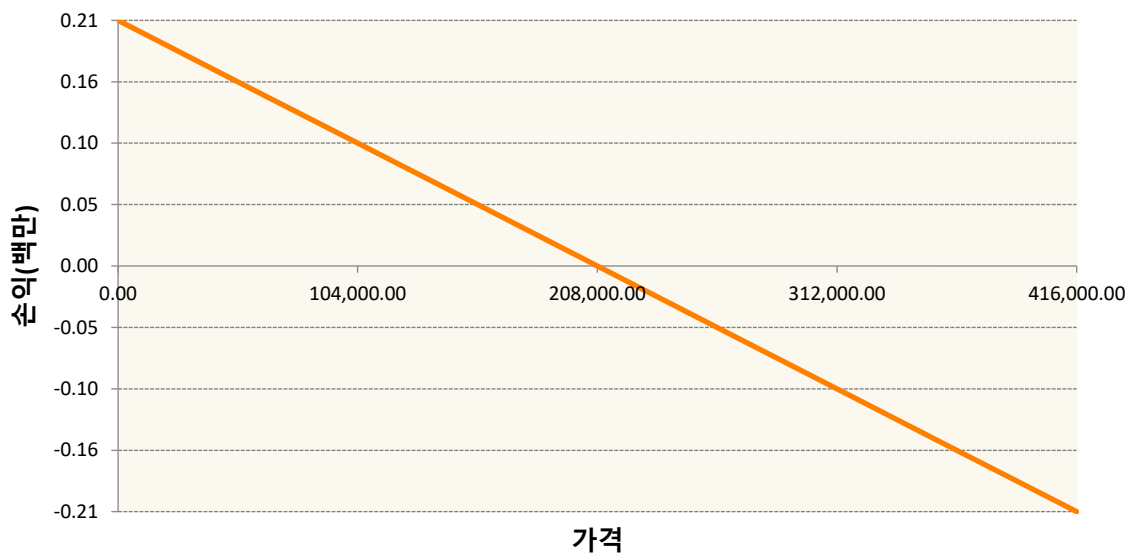
KR4A2K650002-2026-05 LG씨엔에스개별선물



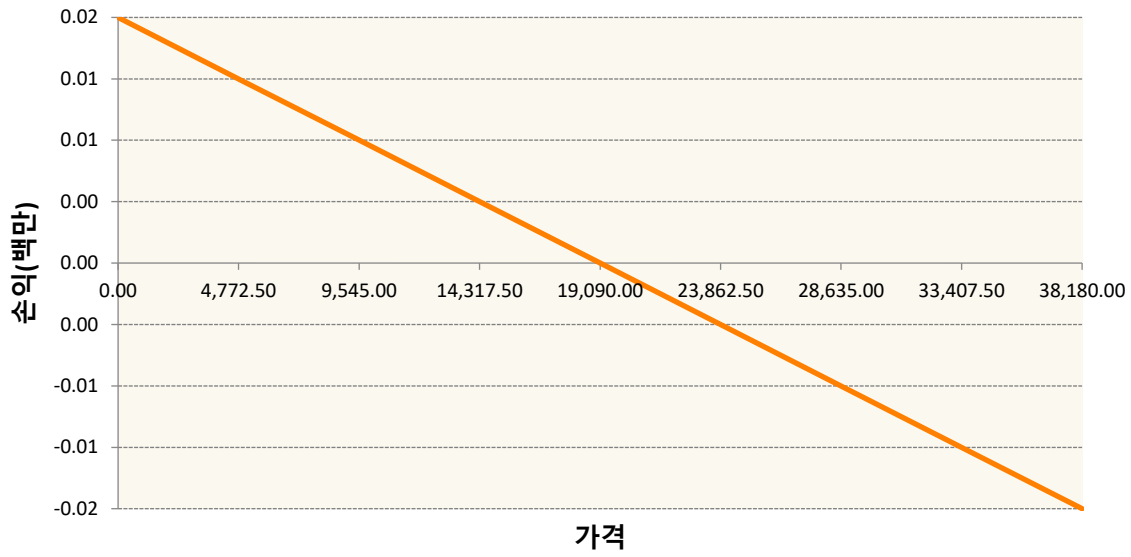
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



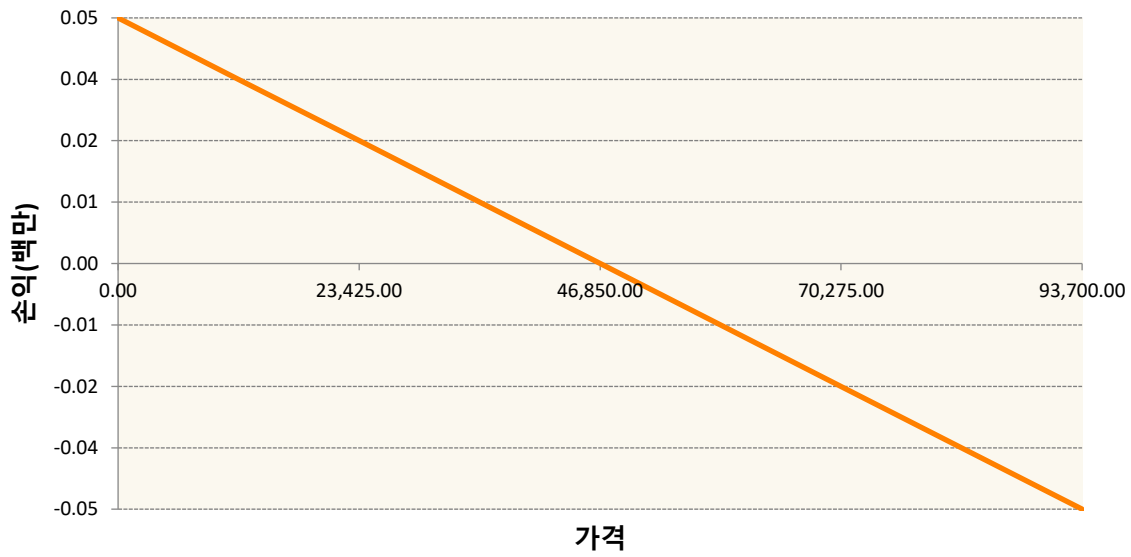
KR4A56650000-2026-05 NAVER개별선물



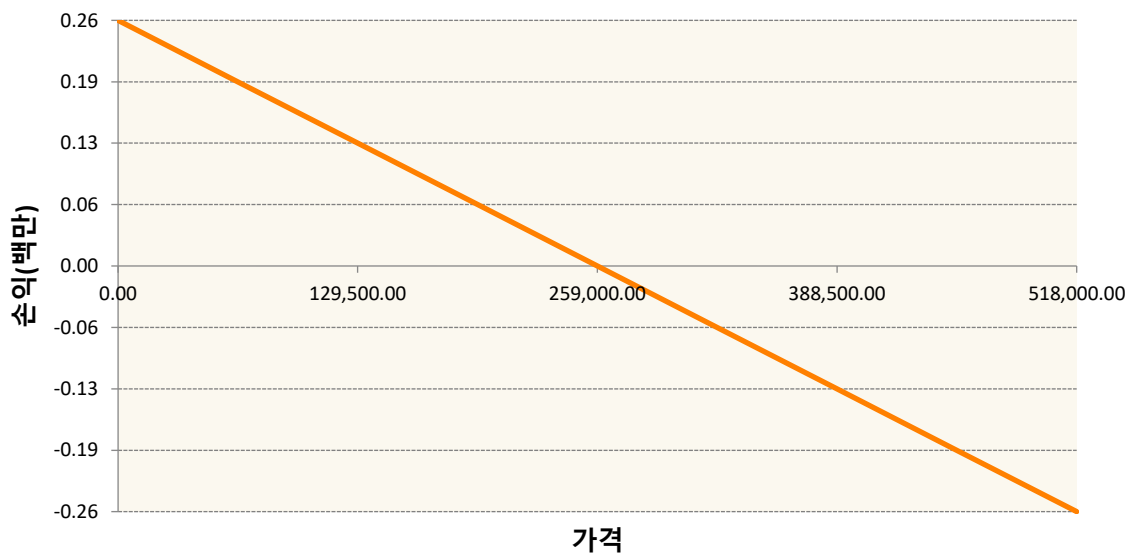
KR4ABV650007-2026-05 iM금융지주개별선물



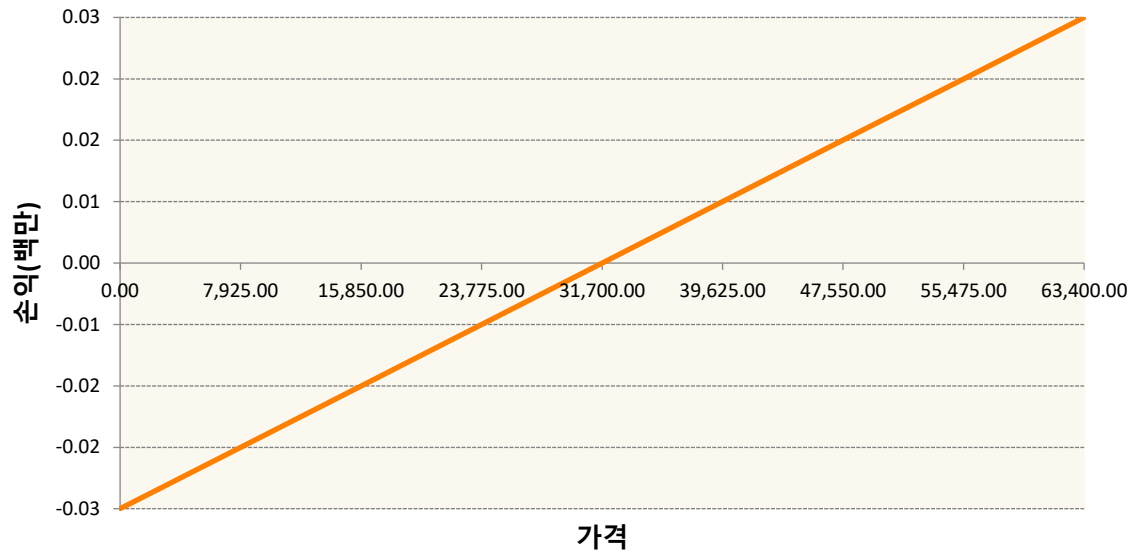
KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



KR4AFC650006-2026-05 하이브개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물 1,700

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,700	-1,700	-1,700	-1,700	-1,700	-1,700	-1,700
-5.33%	-1,134	-1,134	-1,134	-1,134	-1,134	-1,134	-1,134
-2.67%	-567	-567	-567	-567	-567	-567	-567
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	567	567	567	567	567	567	567
5.33%	1,134	1,134	1,134	1,134	1,134	1,134	1,134
8.00%	1,700	1,700	1,700	1,700	1,700	1,700	1,700

KR4A11650004 2026-05 삼성전자개별선물 192

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-192	-192	-192	-192	-192	-192	-192
-5.33%	-128	-128	-128	-128	-128	-128	-128
-2.67%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	64	64	64	64	64	64	64
5.33%	128	128	128	128	128	128	128
8.00%	192	192	192	192	192	192	192

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
-5.33%	16	16	16	16	16	16	16
-2.67%	8	8	8	8	8	8	8
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	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

KR4A56650000	2026-05 NAVER개별선물	85
--------------	-------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	85	85	85	85	85	85	85
-5.33%	57	57	57	57	57	57	57
-2.67%	28	28	28	28	28	28	28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
8.00%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85

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	120
--------------	-----------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	120	120	120	120	120	120	120
-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%	-120	-120	-120	-120	-120	-120	-120

KR4AFC650006	2026-05 하이브개별선물	43
--------------	-----------------	----

	기초자산의 변동성
--	-----------

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	43	43	43	43	43	43	43
-5.33%	29	29	29	29	29	29	29
-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%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
KR4AFT650007 2026-05 대우건설개별선물							51

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
-2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	17	17	17	17	17	17	17
5.33%	34	34	34	34	34	34	34
8.00%	51	51	51	51	51	51	51

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

(단위:백만원)

5,009

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

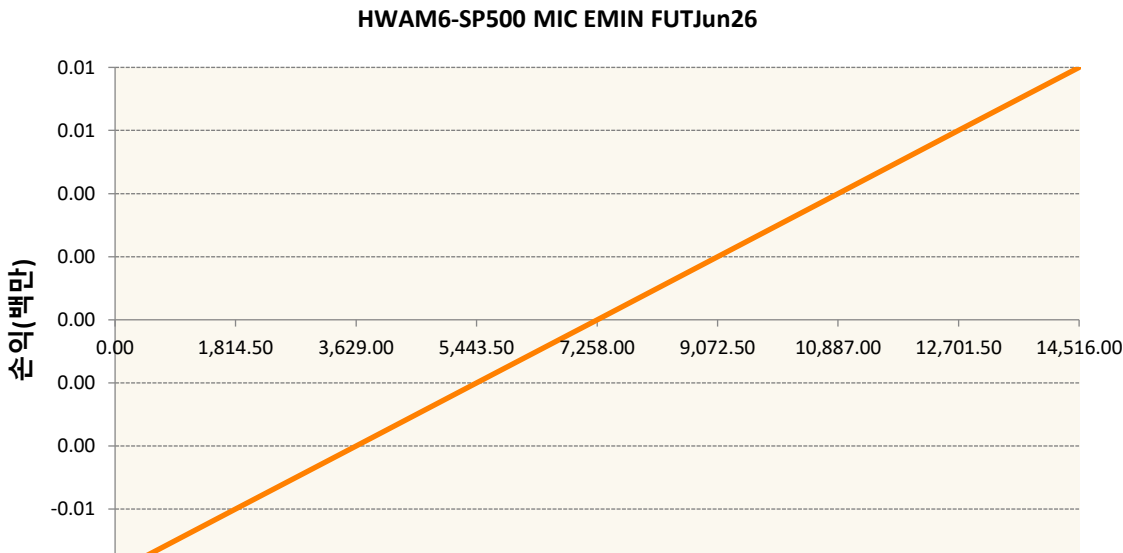
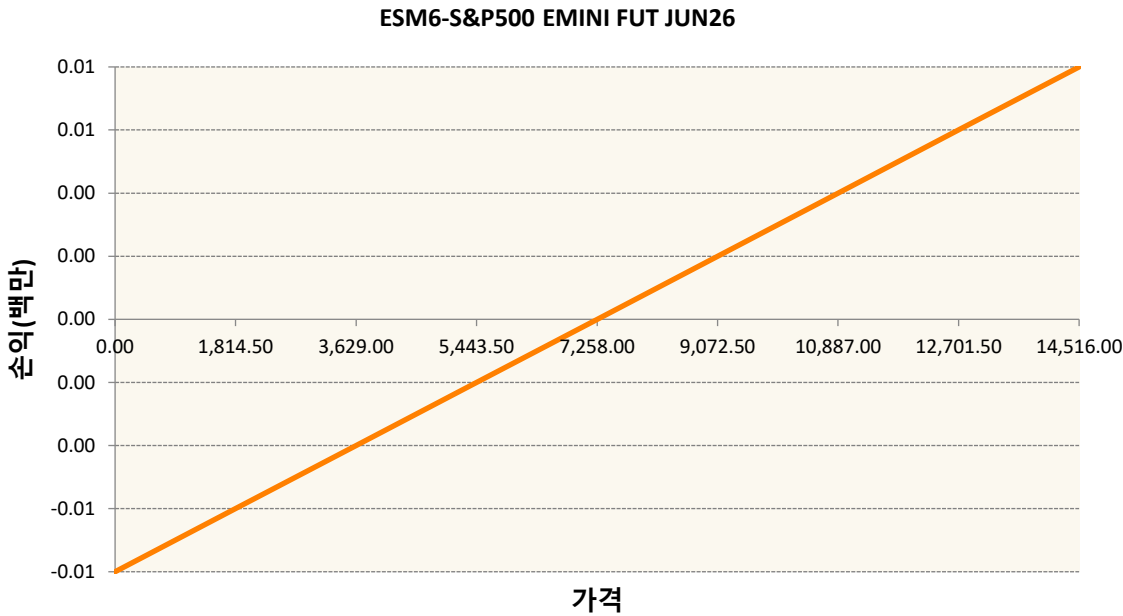
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

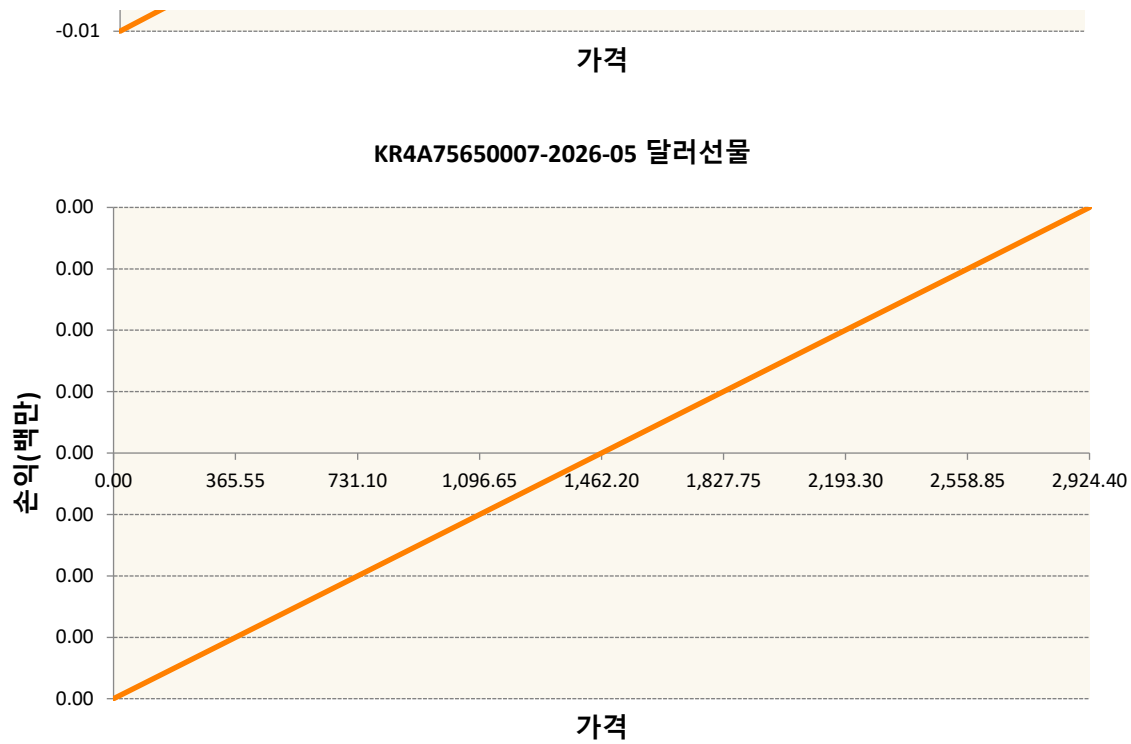
1. 계약금액

(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	57,643	0	57,643	
누계	지수	선물	270	0	270	장내
누계	통화	선물	10,382	0	10,382	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,611
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		22
KR4A756500 2026-05 달러선물			831

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,035

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

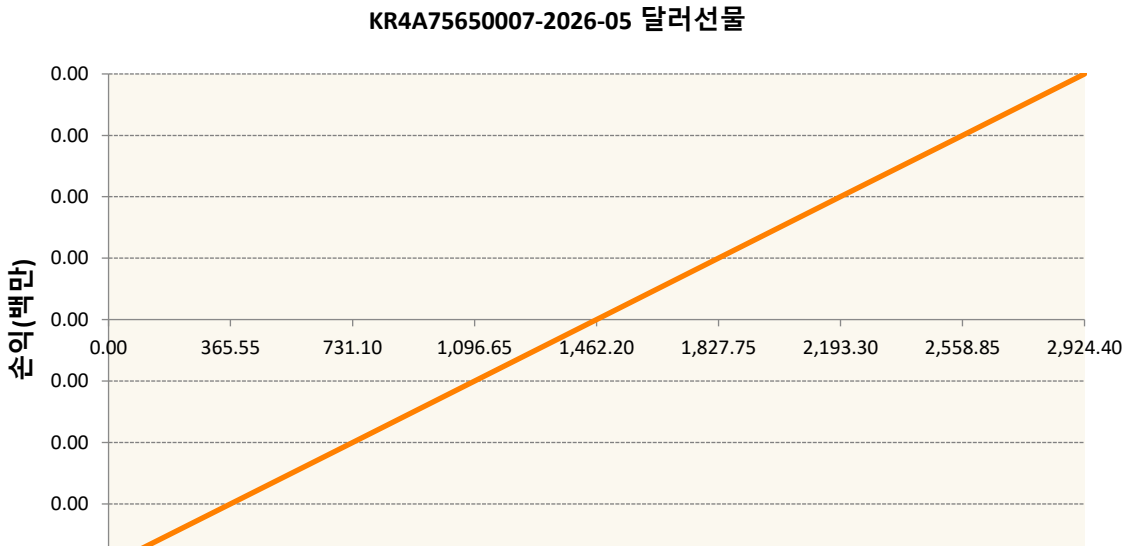
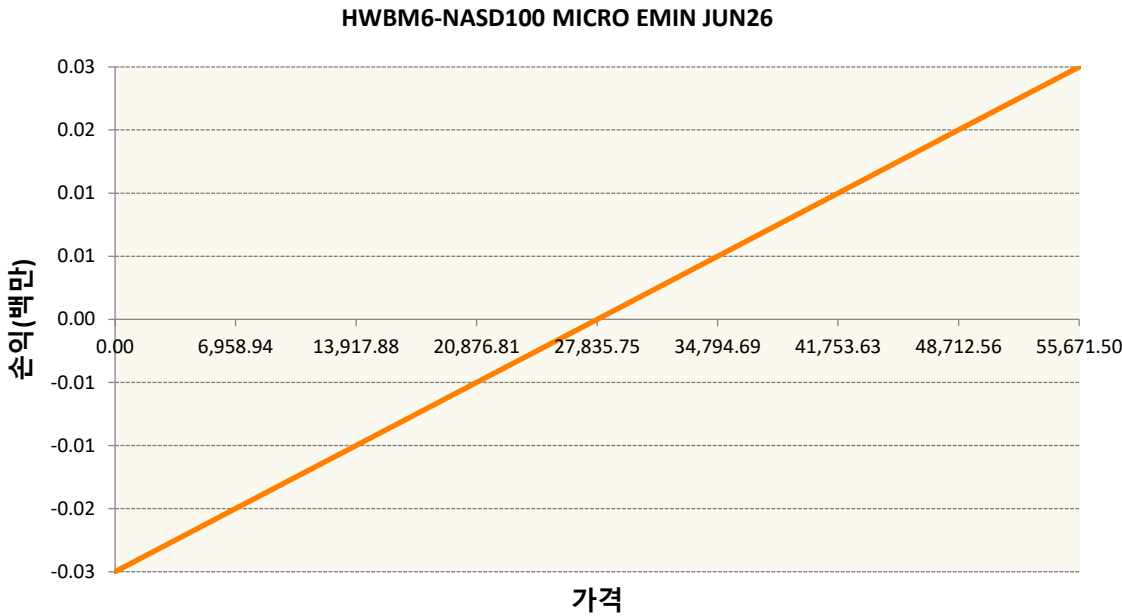
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

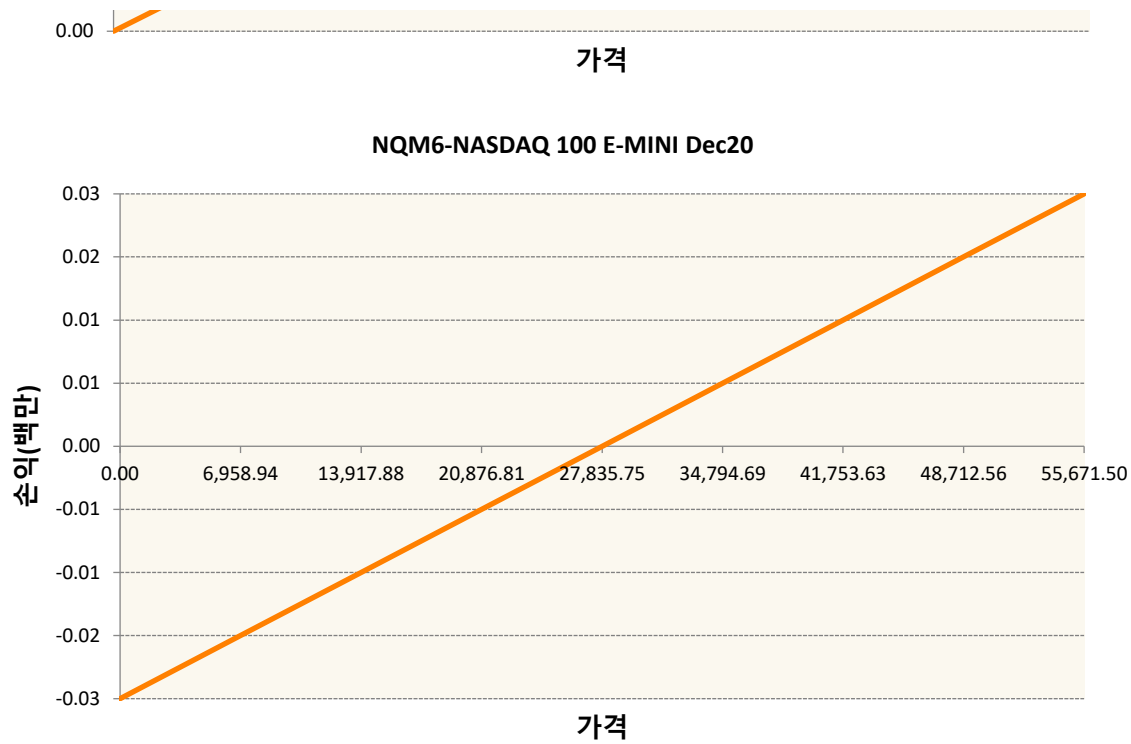
1. 계약금액

(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	25,836	0	25,836	
누계	유가증권	선물	414	0	414	장내
누계	통화	선물	3,816	0	3,816	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	33
KR4A756500	2026-05 달러선물	305
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,067

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

2,310

공시일	2026-05-06
기준일	2026-05-04

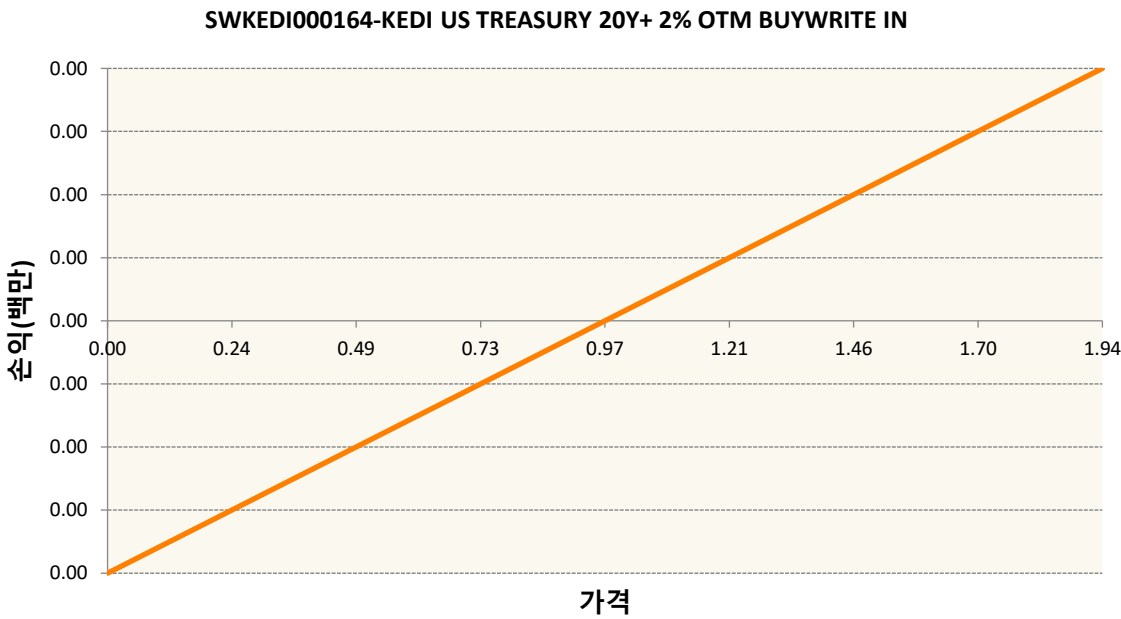
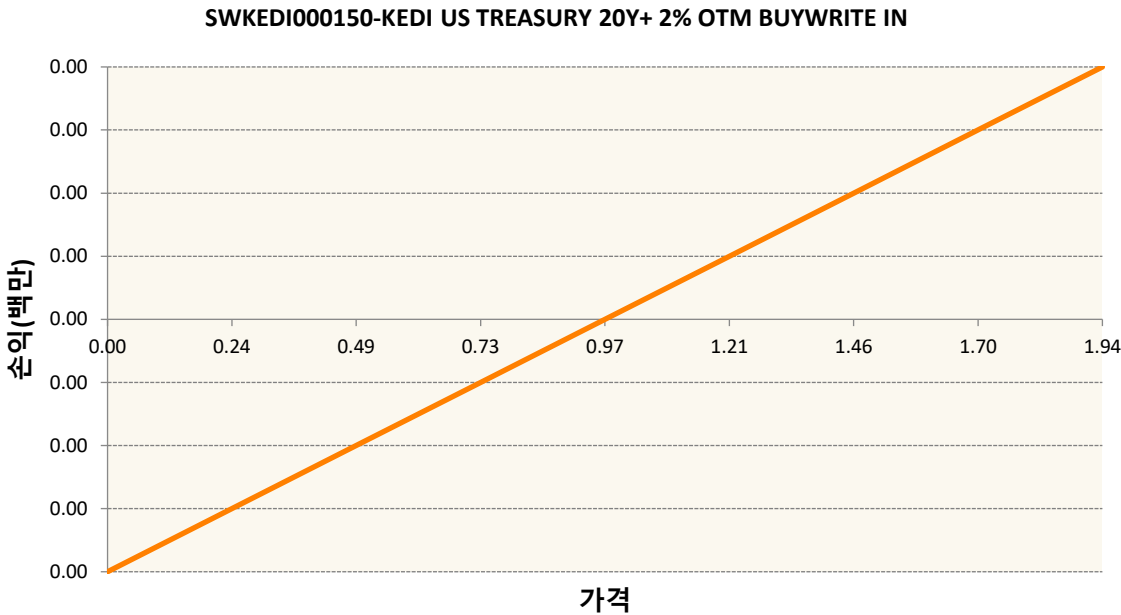
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

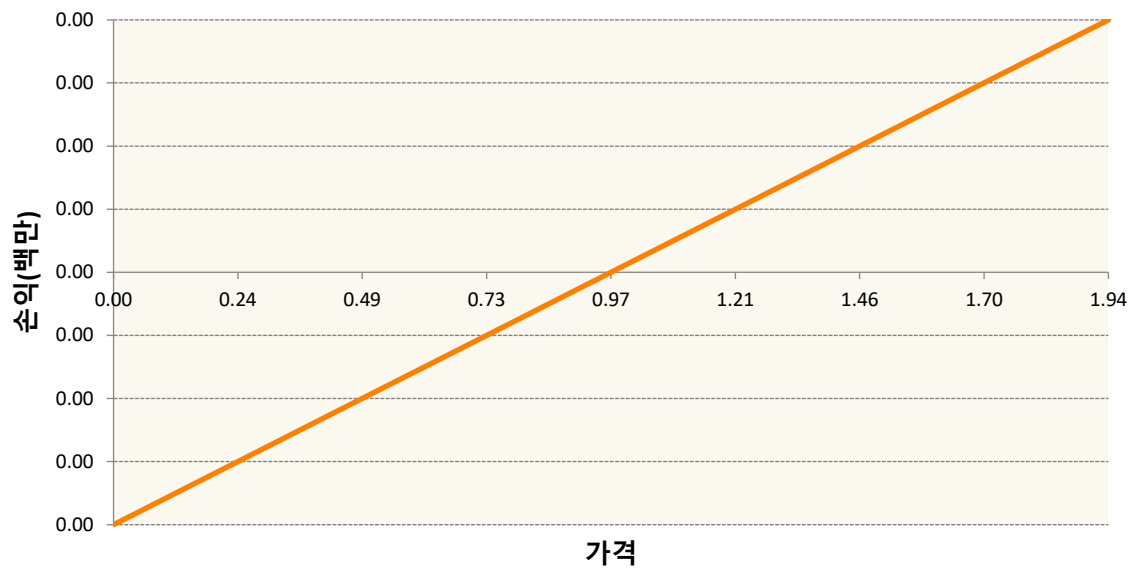
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	350,325	0	350,325	장외

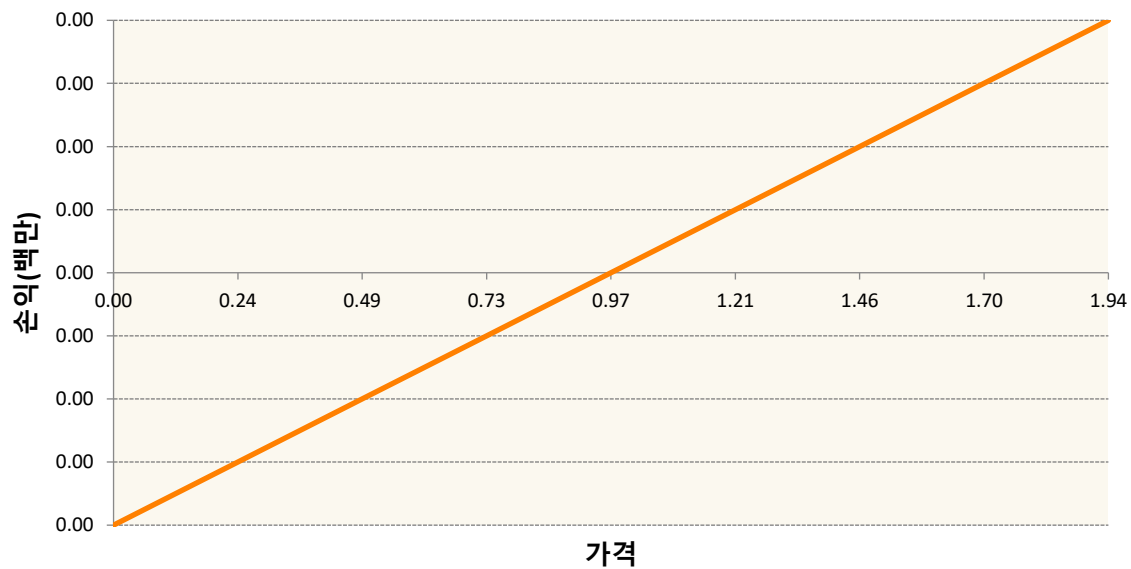
2. 만기시점의 손익구조



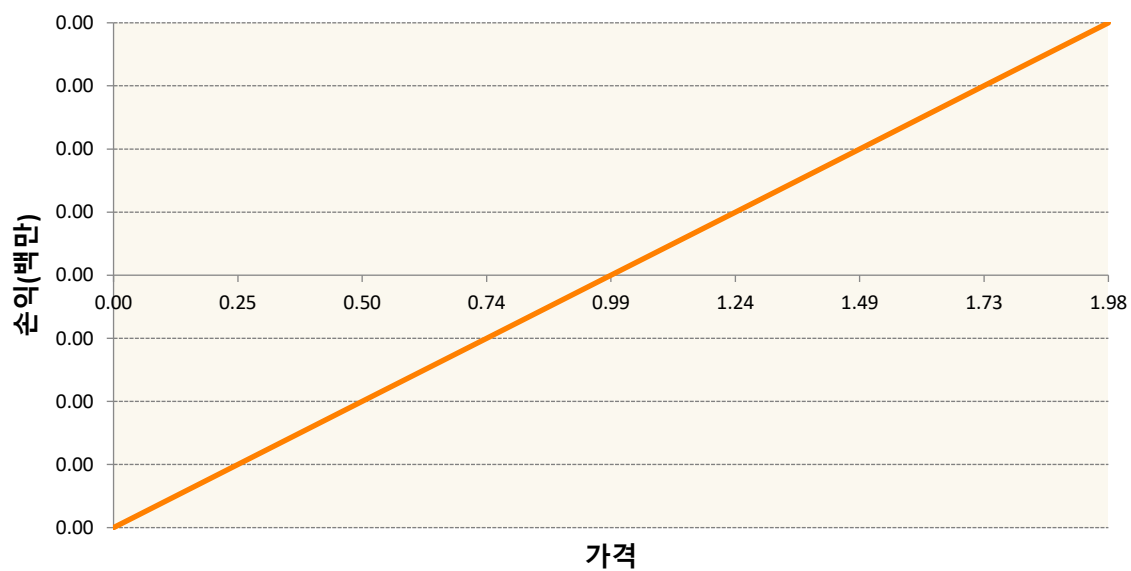
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,164
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		149
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,575
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,352
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,768

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,018