

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

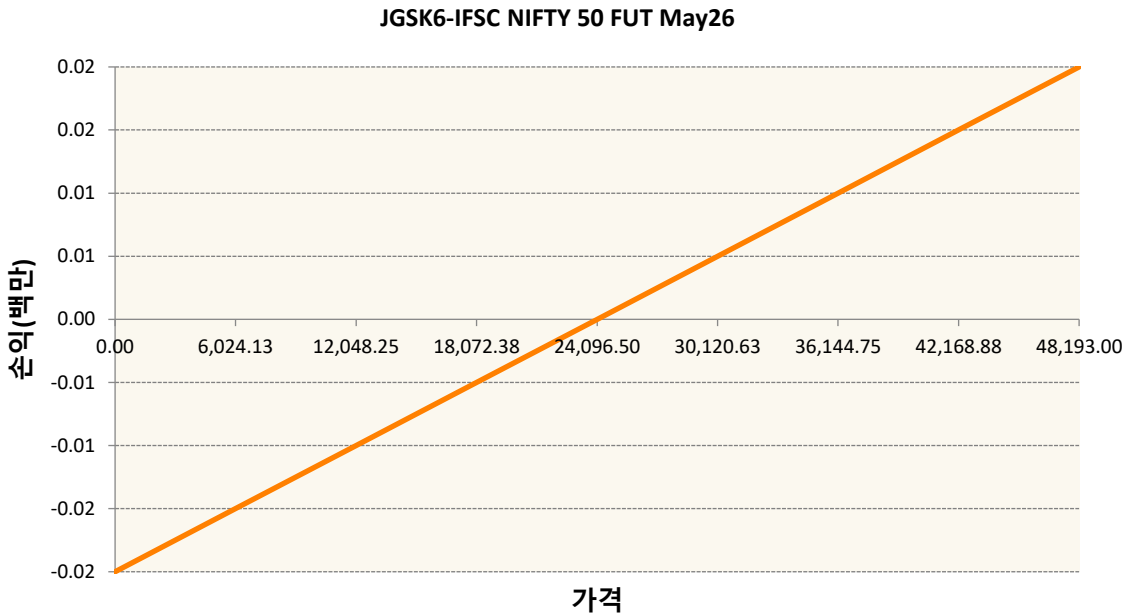
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSK6 IFSC NIFTY 50 FUT May26

29

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

(단위:백만원)

20

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

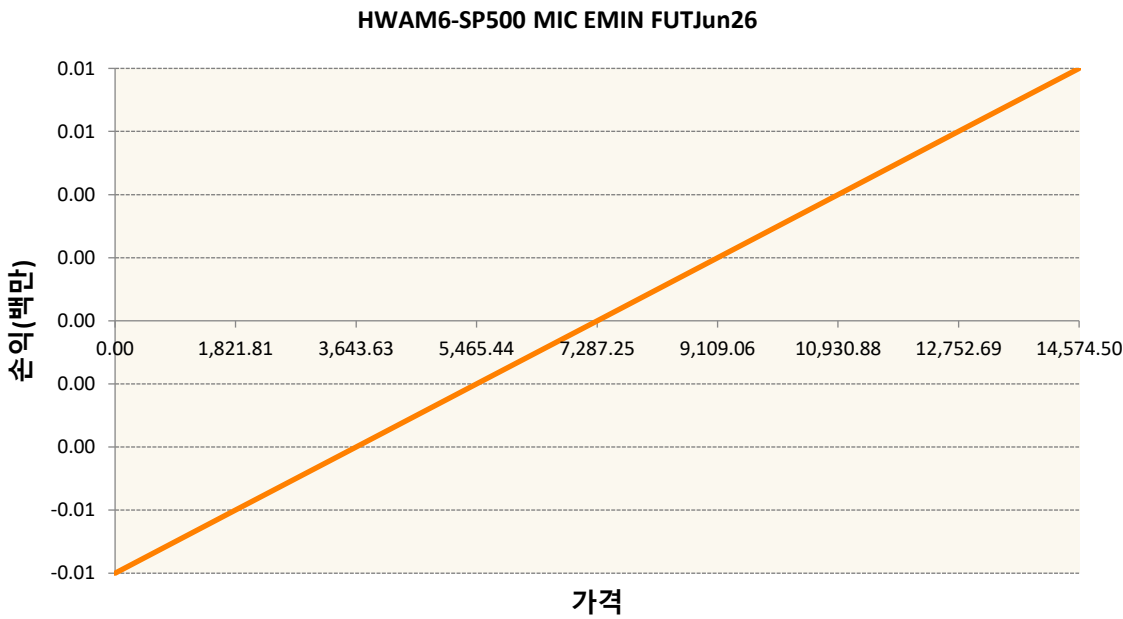
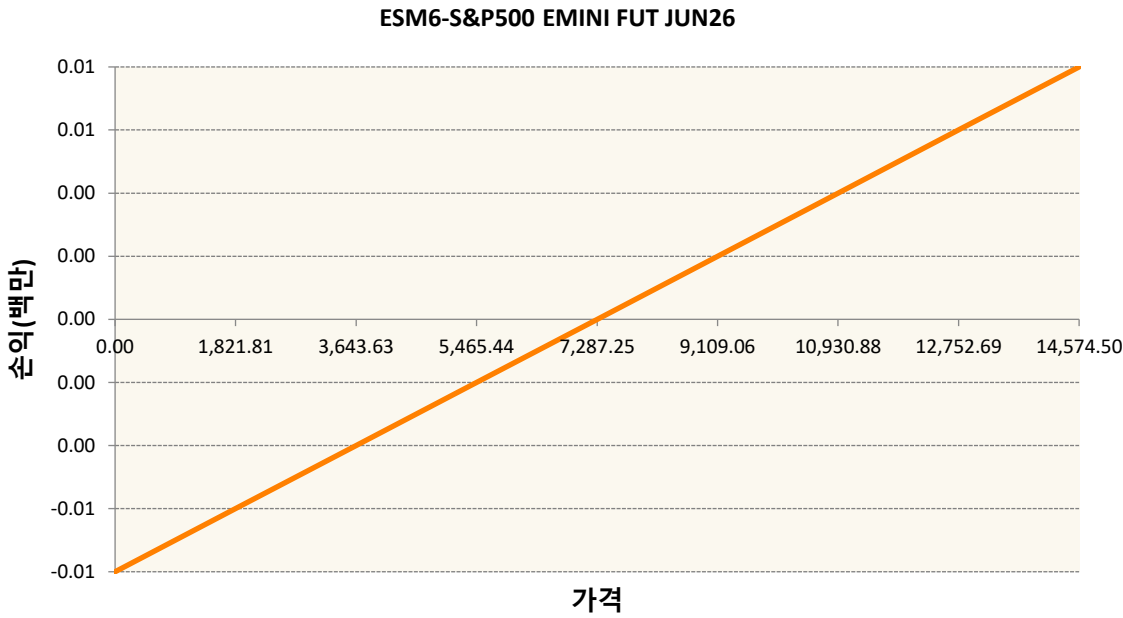
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	546	0	546	
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)
	46

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

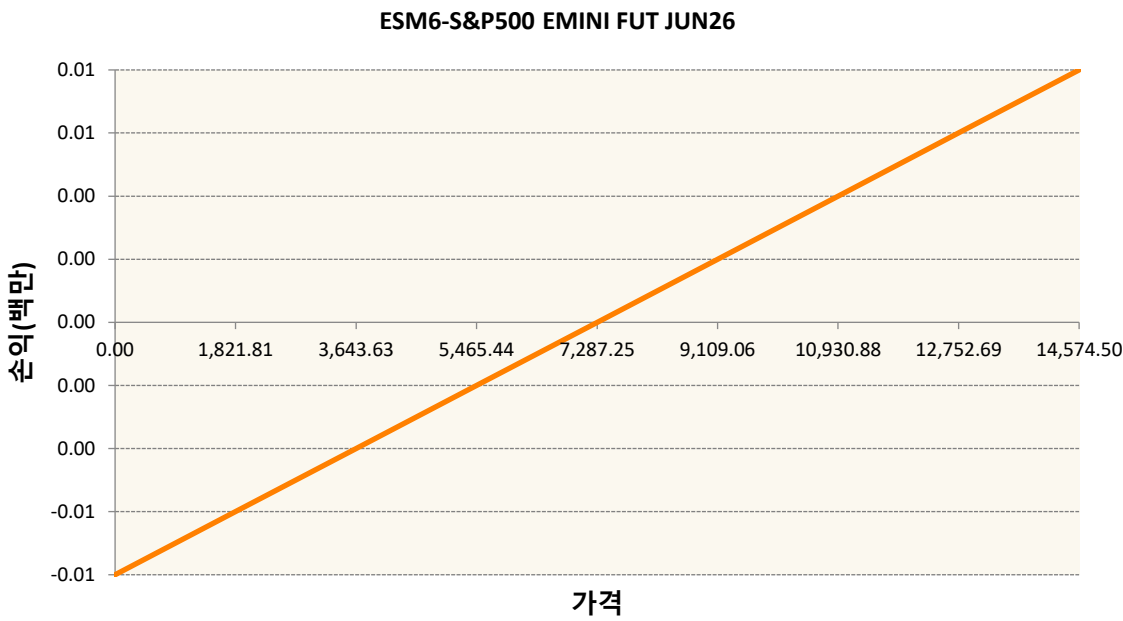
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,091	0	1,091	

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	2026-05-07
기준일	2026-05-06

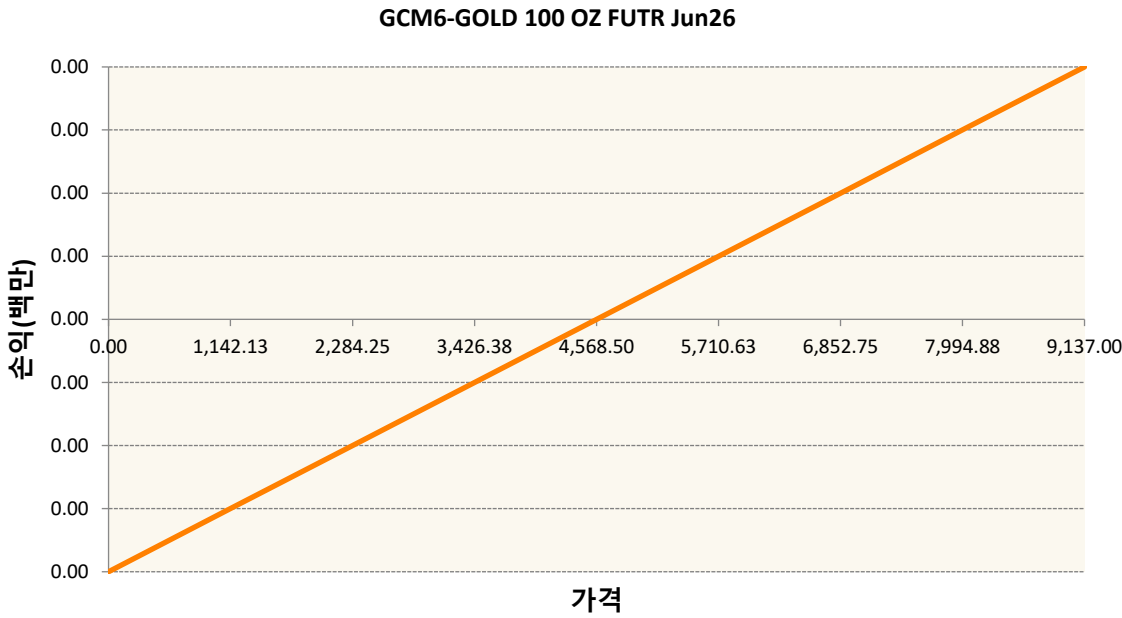
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,500	0	5,500	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	440

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

(단위:백만원)

562

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

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	478
AOPLTRSUP1 PLTR US 05/08/26 P155 EQUITY	45

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

(단위:백만원)

1,608

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

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

28

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

(단위:백만원)

17

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

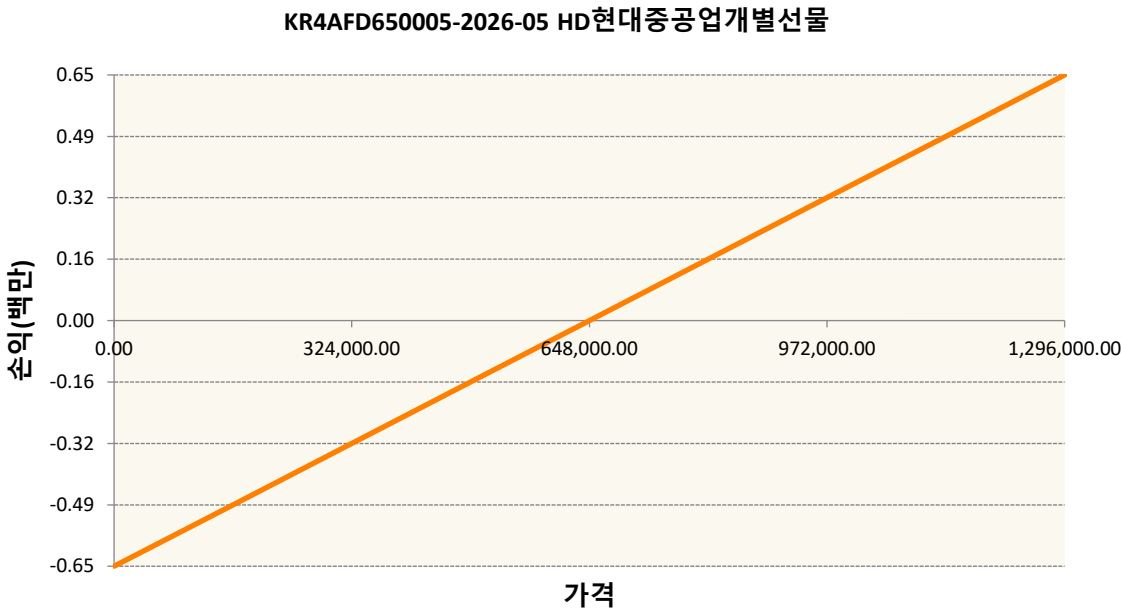
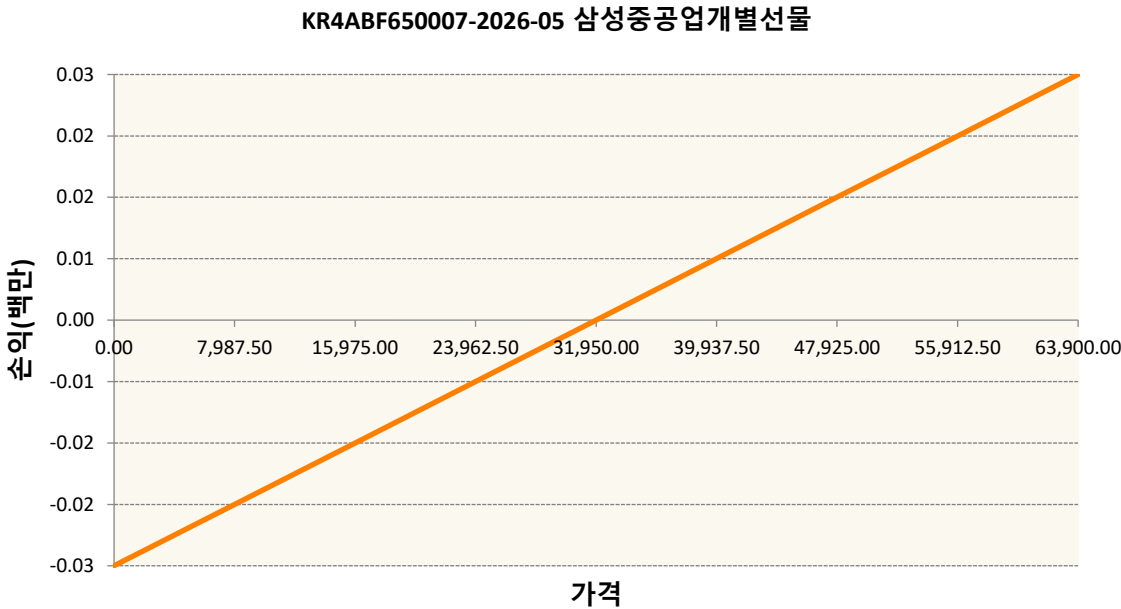
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

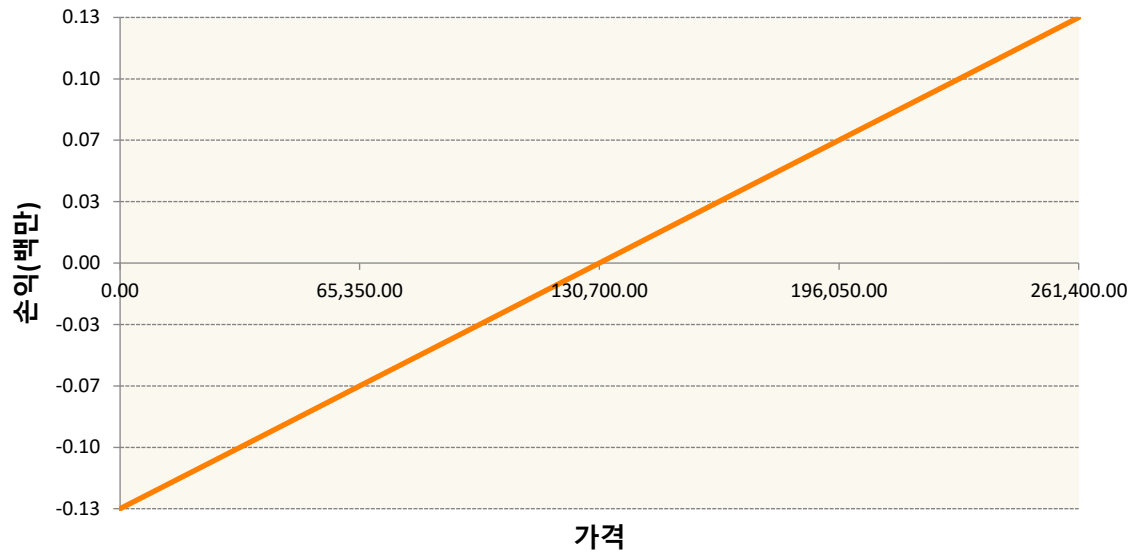
(단위:백만원)

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	34,302	0	34,302	장내
누계	유가증권	스왑	183,631	0	183,631	장외

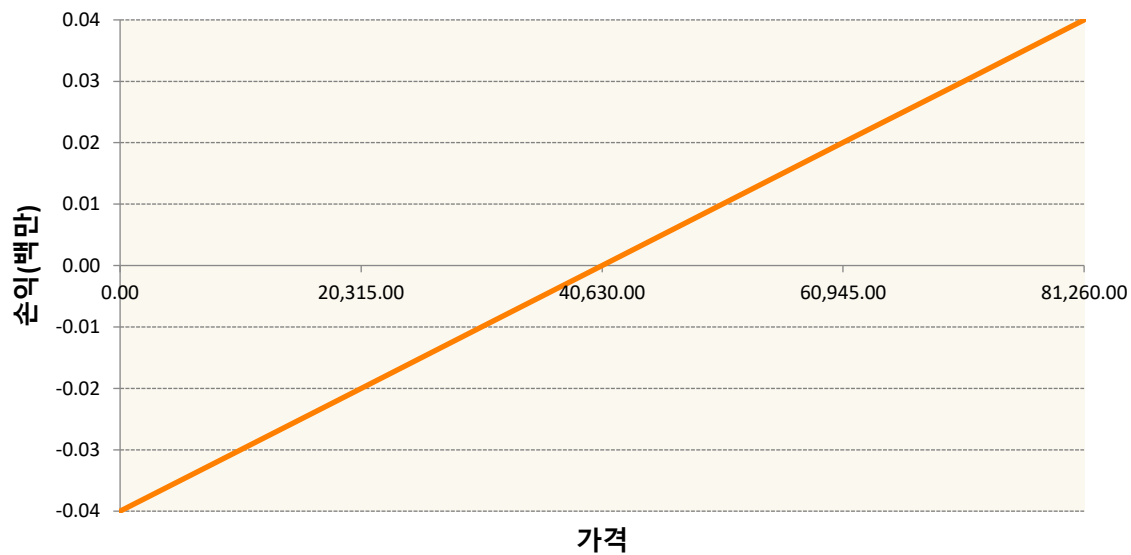
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM766004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007		2026-05 삼성중공업개별선물					1,172
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172	-1,172
-5.33%	-781	-781	-781	-781	-781	-781	-781
-2.67%	-391	-391	-391	-391	-391	-391	-391
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	391	391	391	391	391	391	391
5.33%	781	781	781	781	781	781	781
8.00%	1,172	1,172	1,172	1,172	1,172	1,172	1,172
KR4AFD650005		2026-05 HD현대중공업개별선물					985
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-985	-985	-985	-985	-985	-985	-985
-5.33%	-657	-657	-657	-657	-657	-657	-657
-2.67%	-328	-328	-328	-328	-328	-328	-328
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	328	328	328	328	328	328	328
5.33%	657	657	657	657	657	657	657
8.00%	985	985	985	985	985	985	985
KR4AFV650003 2026-05 한화오션개별선물							581
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-581	-581	-581	-581	-581	-581	-581
-5.33%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
-2.67%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	194	194	194	194	194	194	194
5.33%	387	387	387	387	387	387	387
8.00%	581	581	581	581	581	581	581

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

(단위:백만원)

4,031

공시일 2026-05-07

기준일 2026-05-06

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	2026-05-07
기준일	2026-05-06

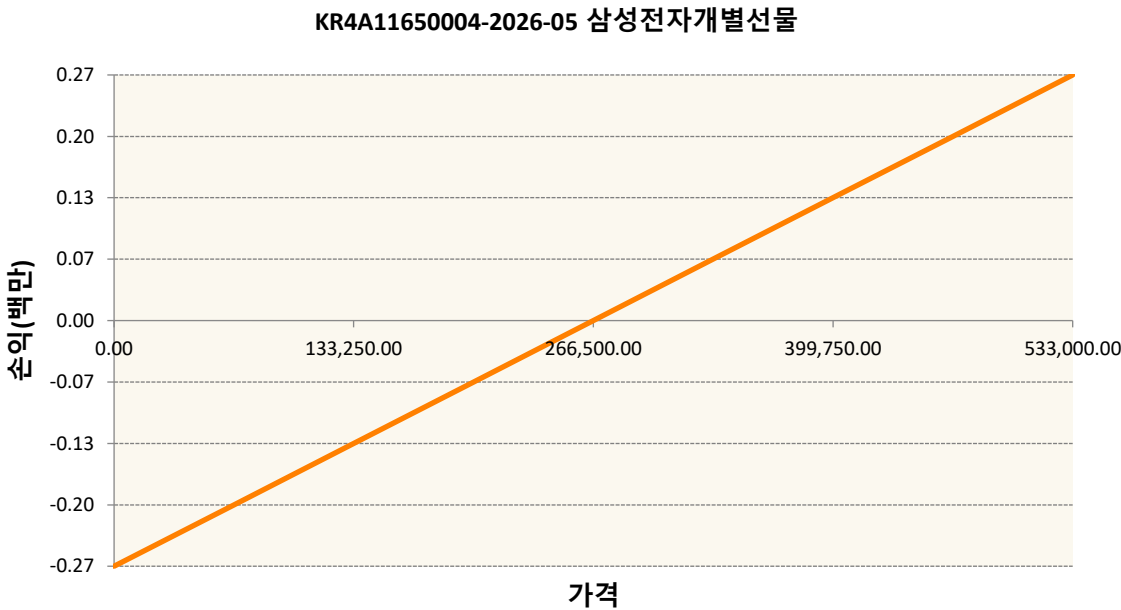
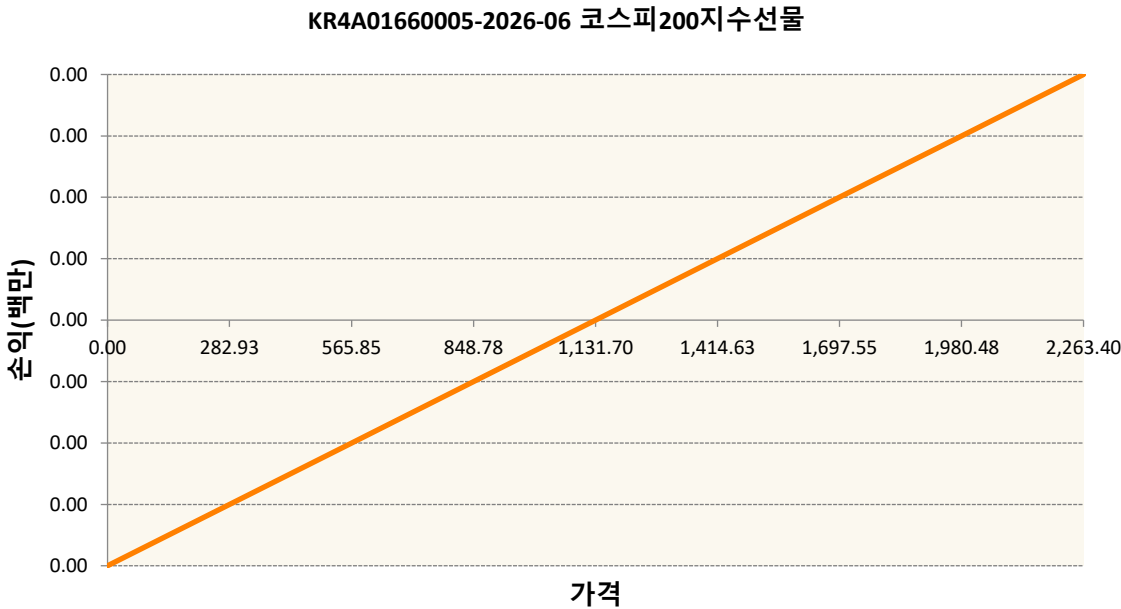
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	15,085	0	15,085	장내
누계	유가증권	옵션	0	48,871	-48,871	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph displays a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,100.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,050, 0).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,050.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,105.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. An orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,052.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,052.50	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물			587
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-587	-587	-587	-587	-587	-587	-587
-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%	587	587	587	587	587	587	587
KR4A11650004				2026-05 삼성전자개별선물			617
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-617	-617	-617	-617	-617	-617	-617
-5.33%	-411	-411	-411	-411	-411	-411	-411
-2.67%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	206	206	206	206	206	206	206
5.33%	411	411	411	411	411	411	411
8.00%	617	617	617	617	617	617	617
KR4B09EZA217 코스피위클리 C 2605W1 1,050.0							639

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-457	-486	-516	-547	-577	-608	-639
-5.33%	-92	-117	-144	-171	-199	-228	-257
-2.67%	-4	-11	-20	-31	-45	-60	-76
0%	4	4	2	0	-3	-8	-14
2.67%	5	4	4	4	4	3	1
5.33%	5	5	5	5	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	4

KR4B09EZA225 코스피위클리 C 2605W1 1,052.5							450
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-333	-351	-371	-390	-410	-430	-450
-5.33%	-72	-89	-108	-127	-146	-165	-185
-2.67%	-4	-9	-16	-24	-34	-44	-56
0%	3	3	2	0	-3	-6	-11
2.67%	4	4	4	3	3	2	1
5.33%	4	4	4	4	4	4	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

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

(단위:백만원)

3,366

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

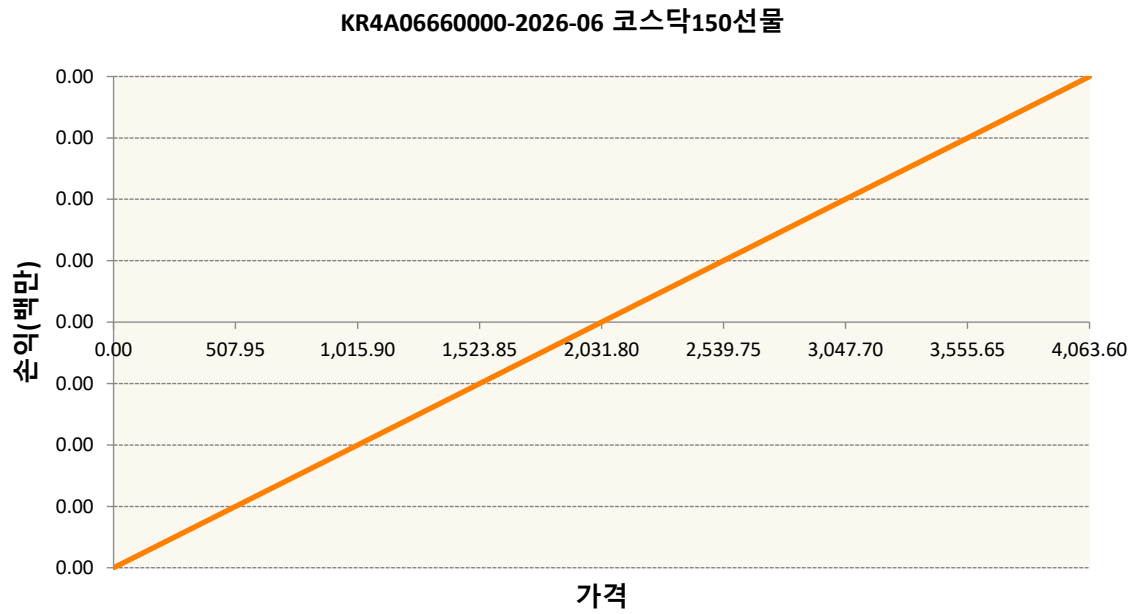
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	914	0	914	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	2026-05-07
기준일	2026-05-06

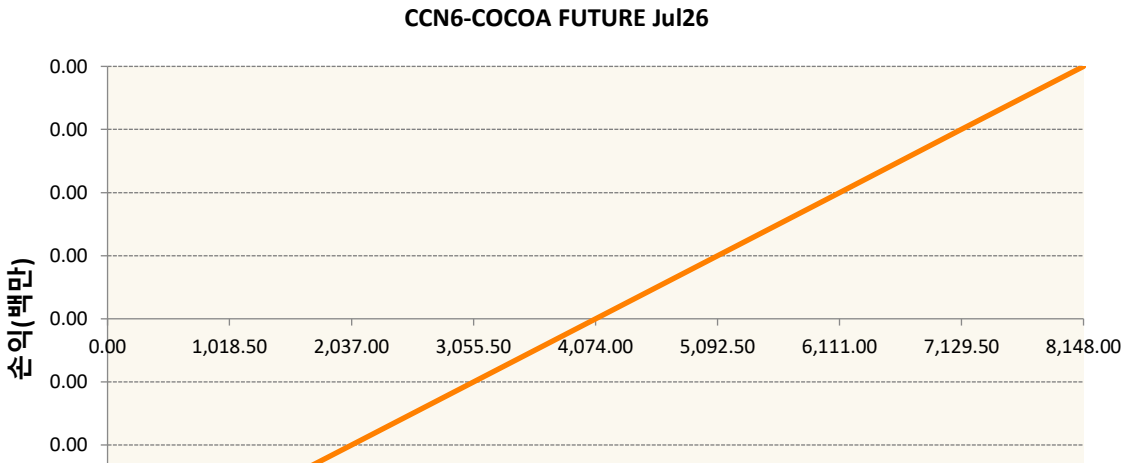
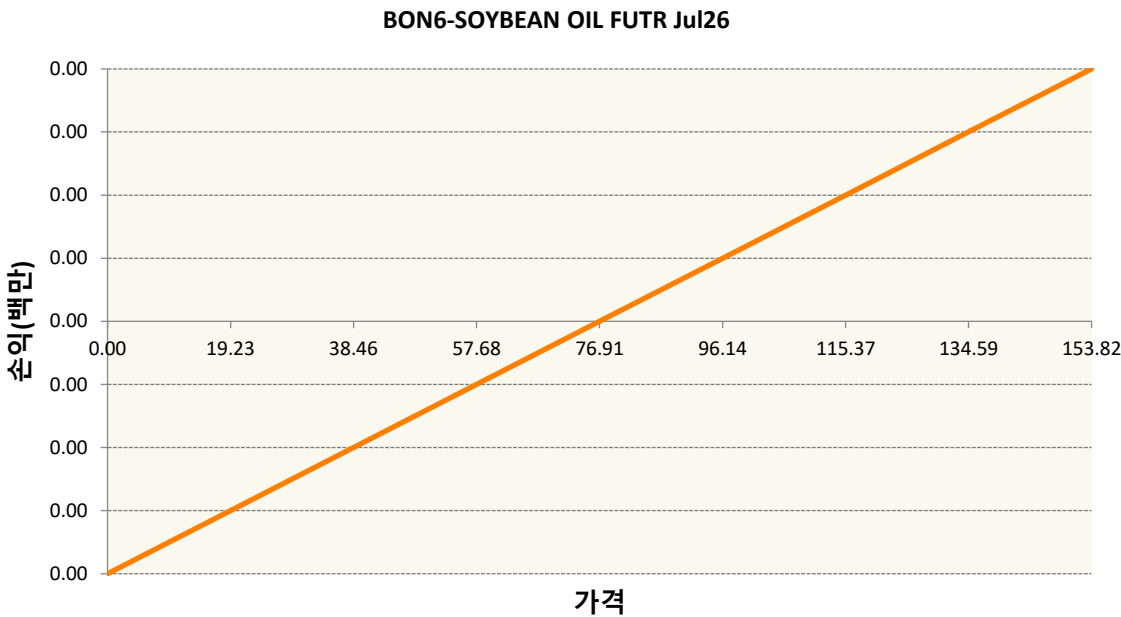
포커스농산물모(채권-파생형)

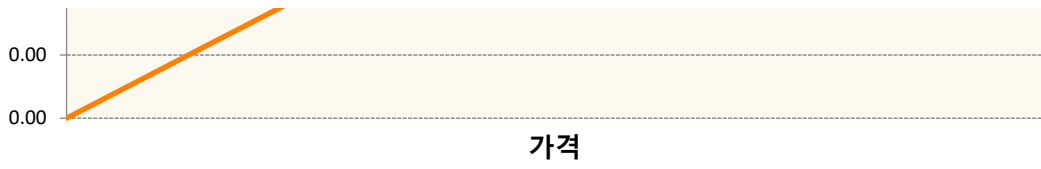
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

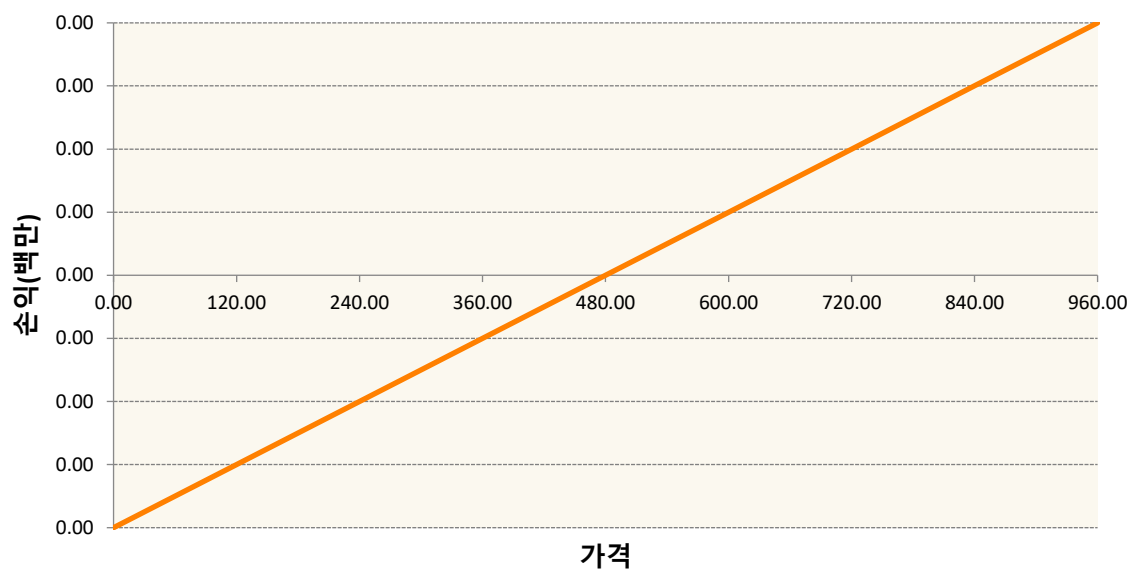
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	60	0	60	
누계	실물자산	선물	911	0	911	장내
누계	유가증권	선물	2,085	0	2,085	
누계	통화	선물	0	407	-407	장내

2. 만기시점의 손익구조

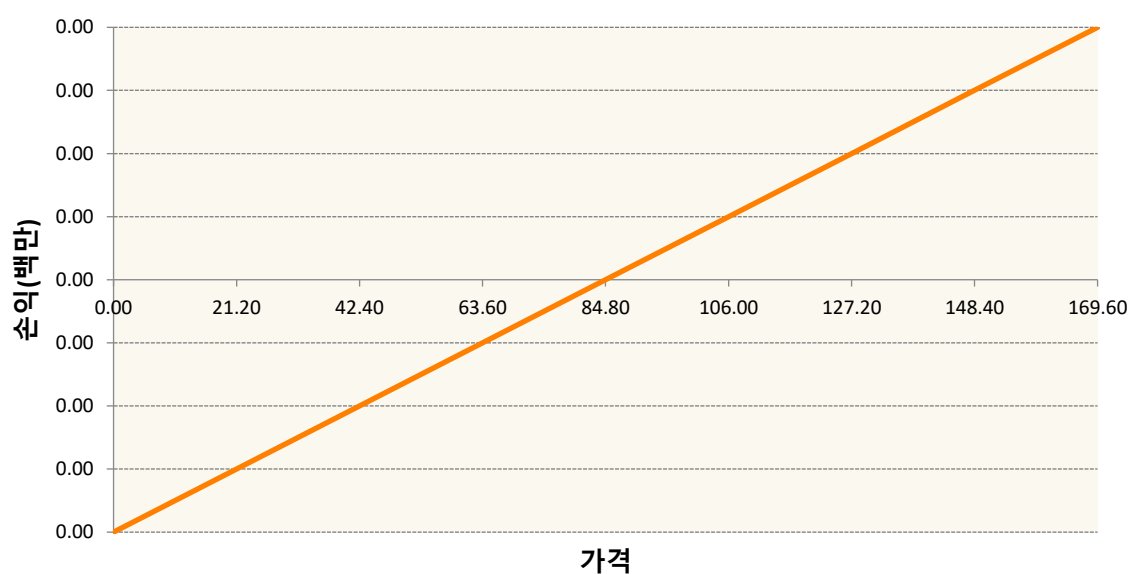




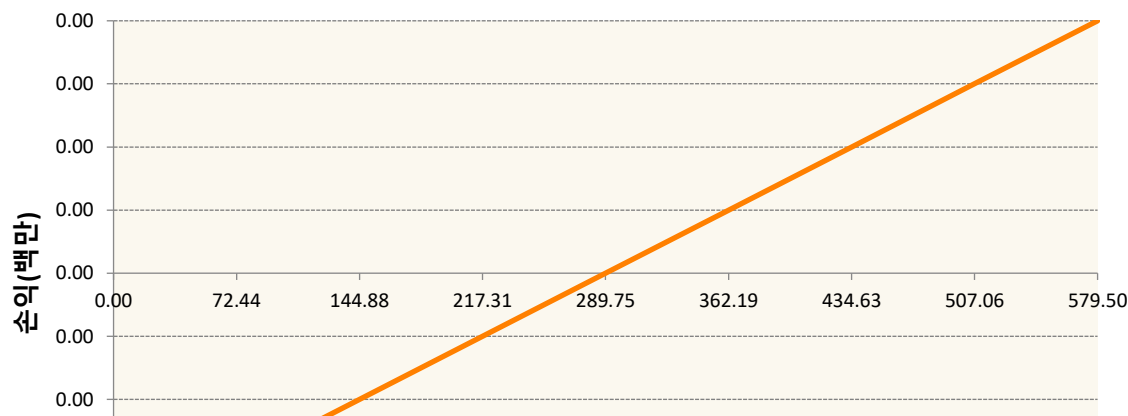
CN6-CORN FUTURE Jul26

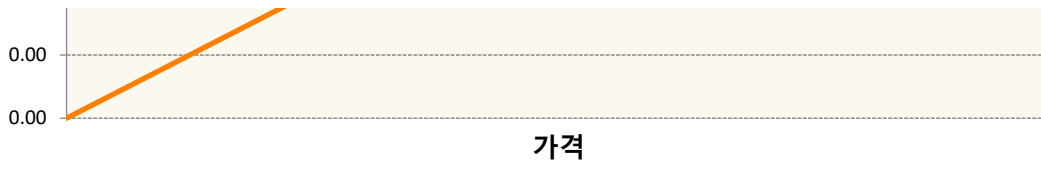


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

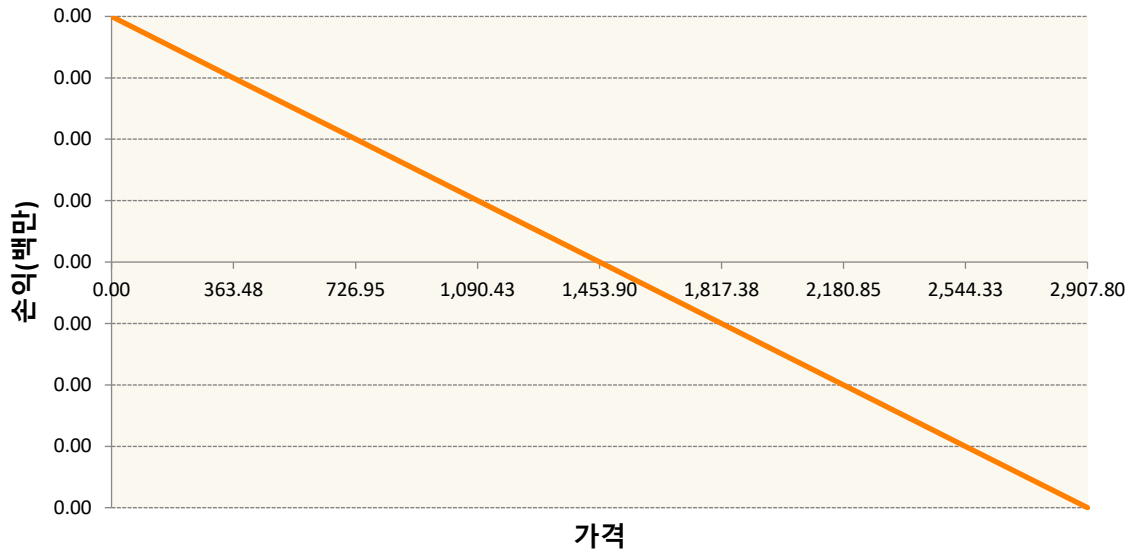


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

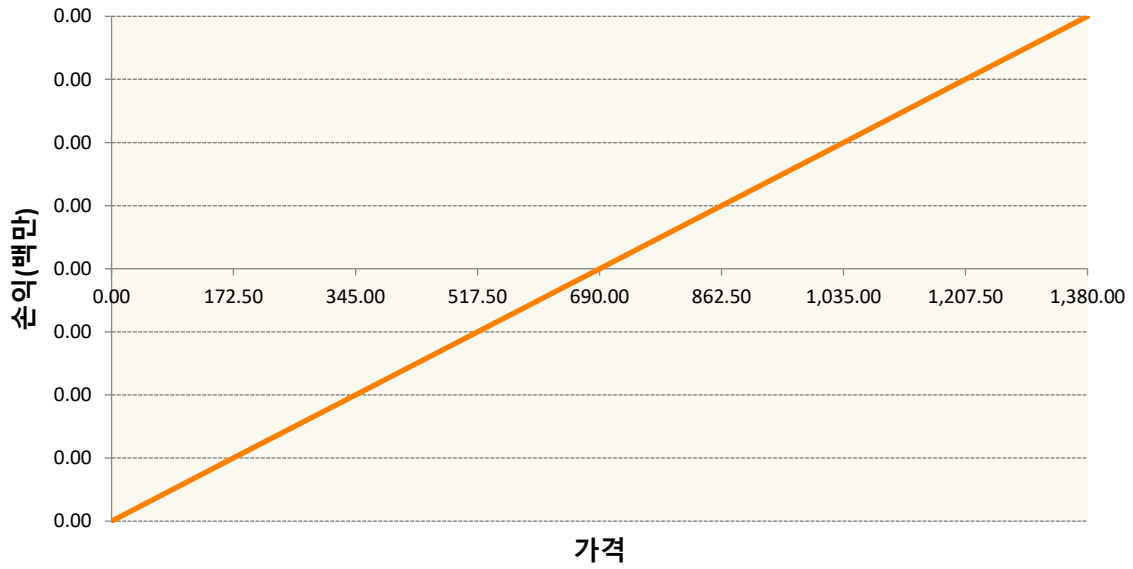




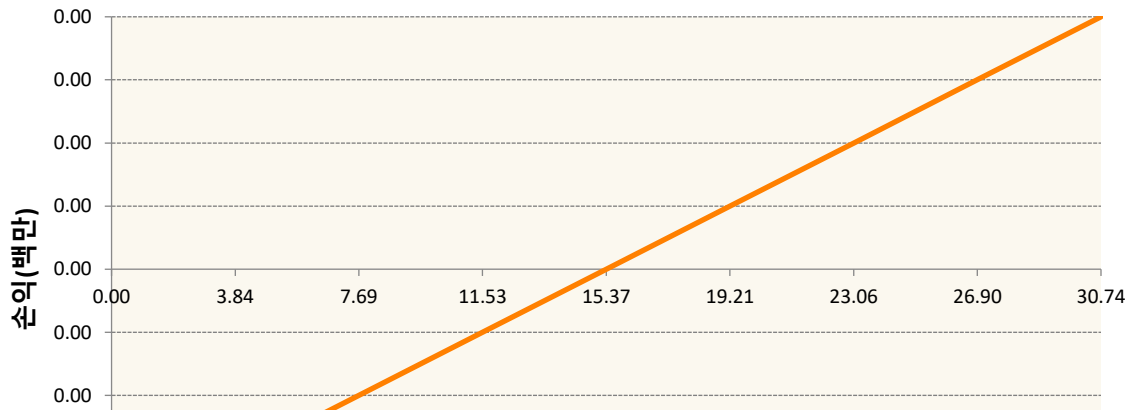
KR4A75650007-2026-05 달러선물

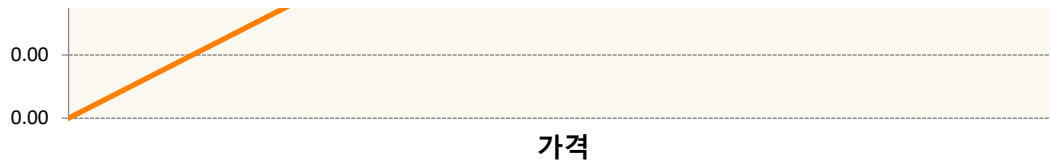


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

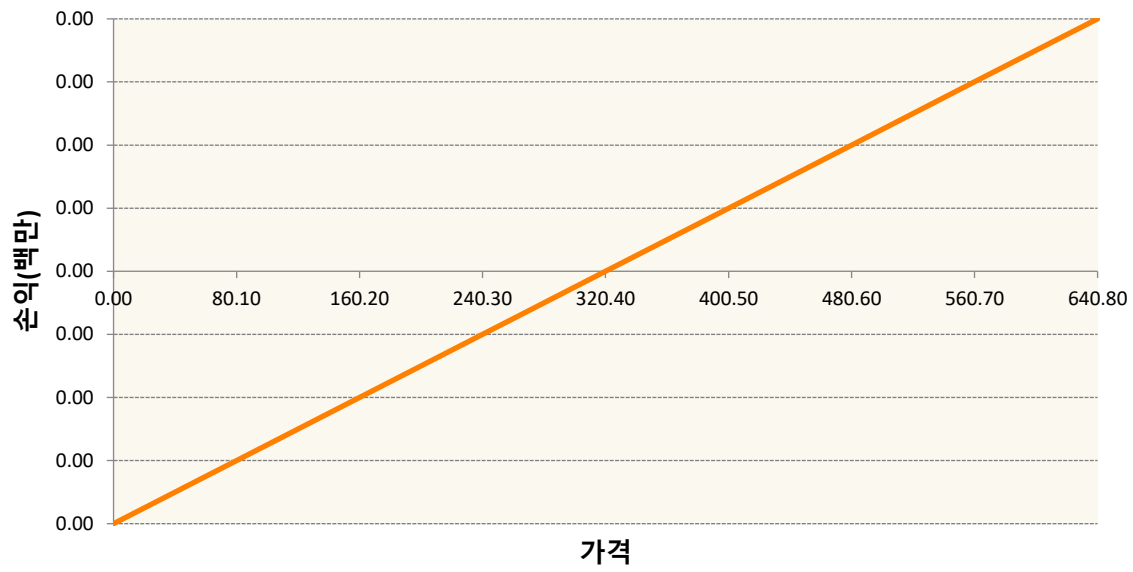


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

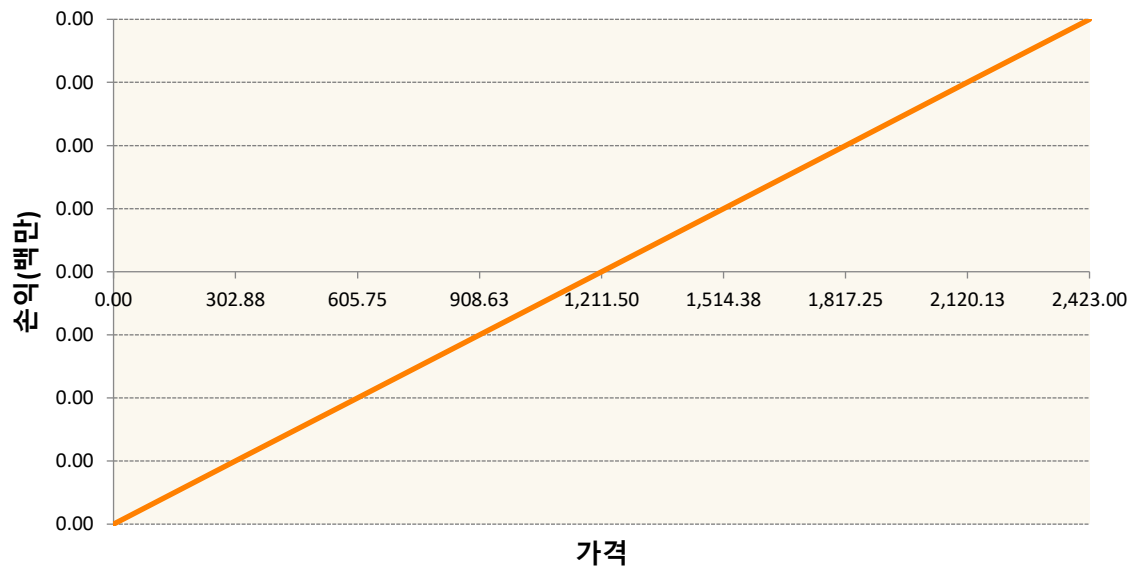




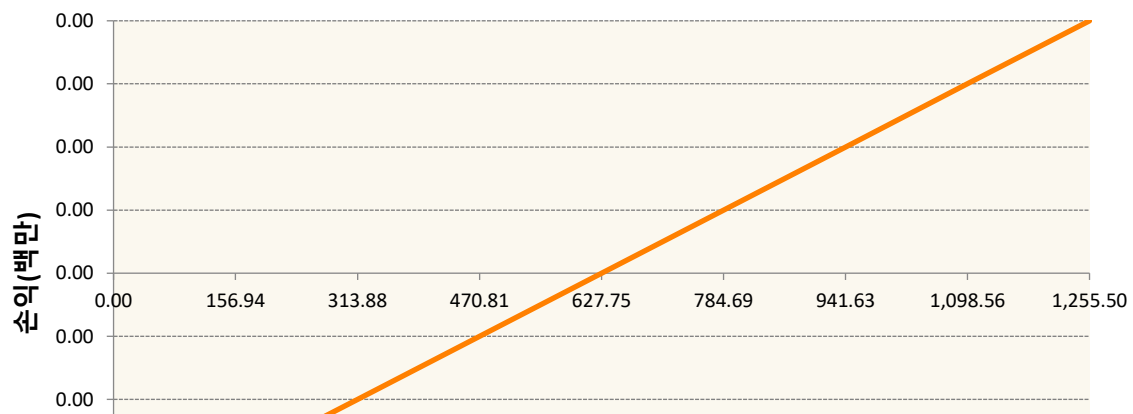
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

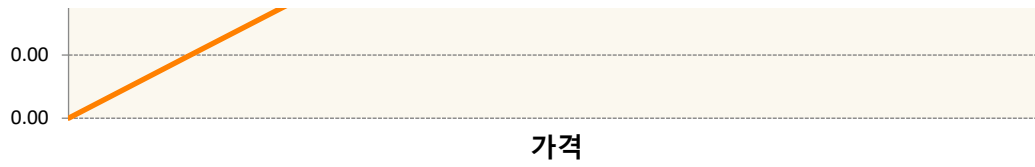


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-05-07
기준일	2026-05-06

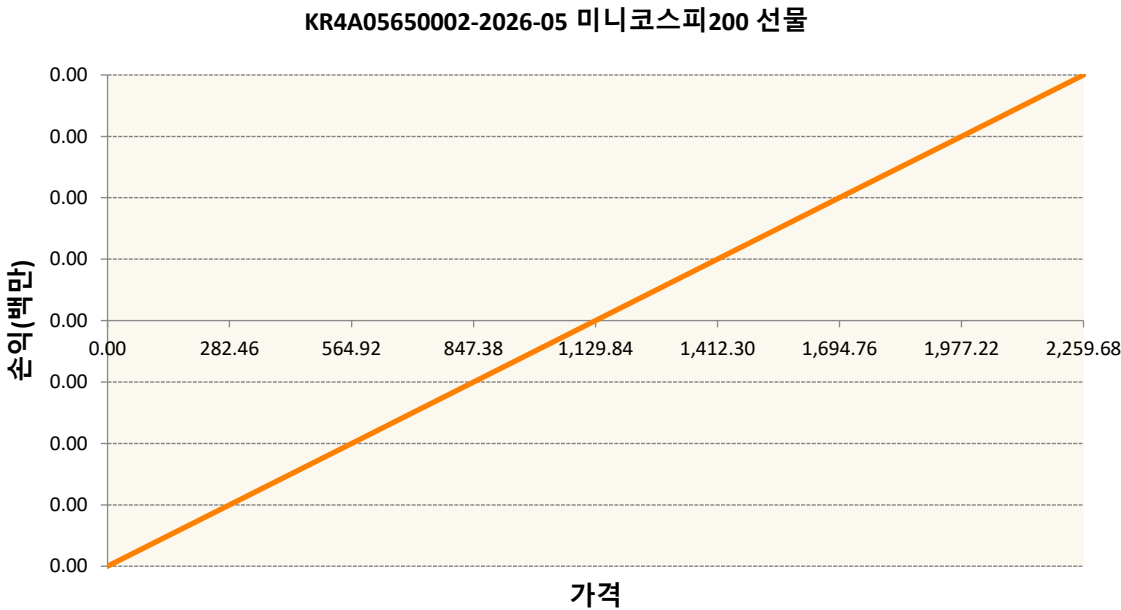
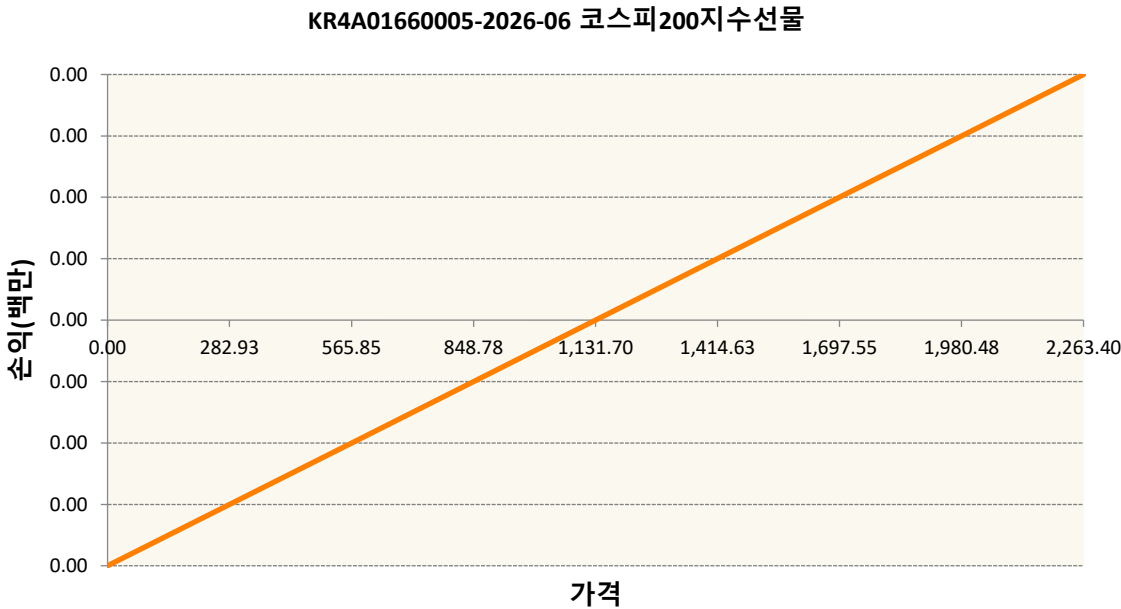
스마트인덱스모

1. 계약금액

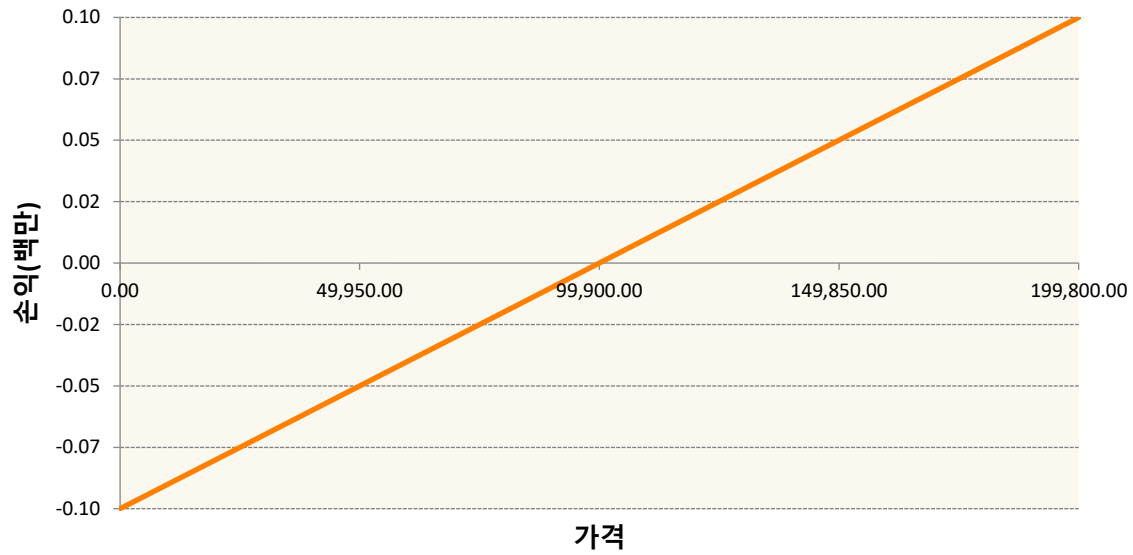
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	562	836	-273	장내
누계	유가증권	선물	4,209	0	4,209	장내

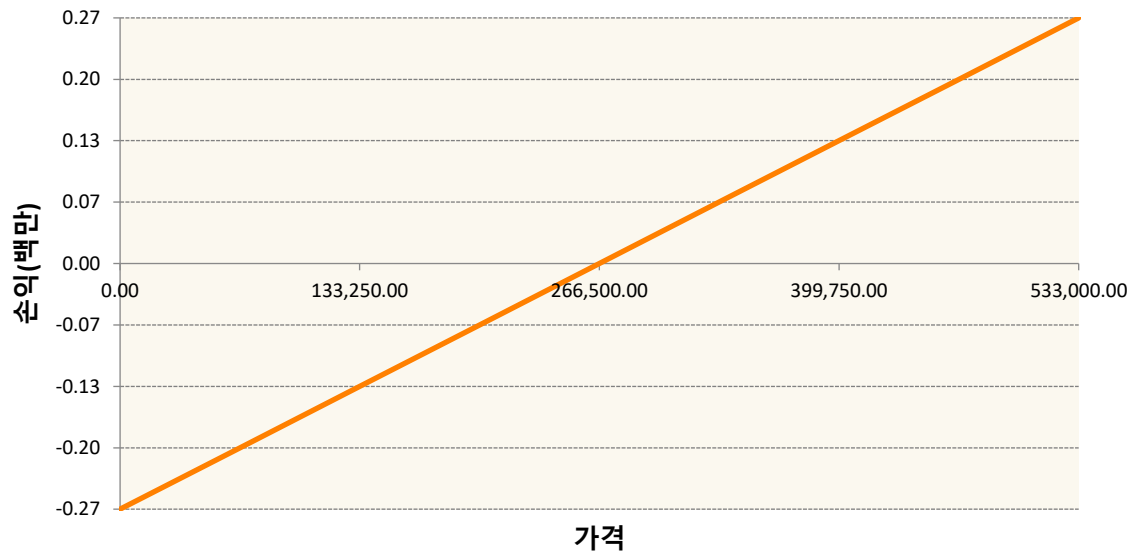
2. 만기시점의 손익구조



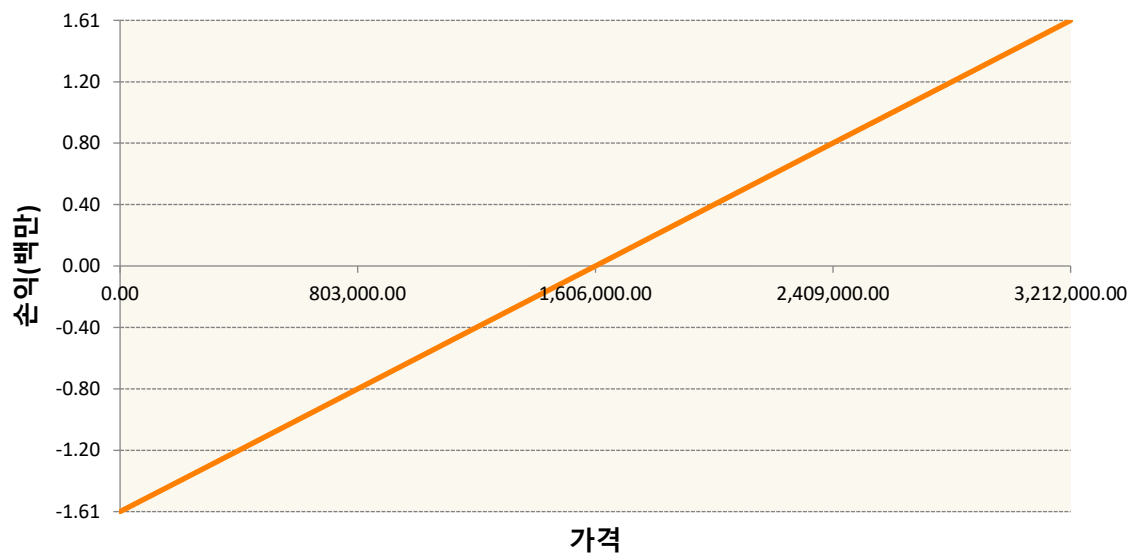
KR4A0F650001-2026-05 두산로보틱스개별선물



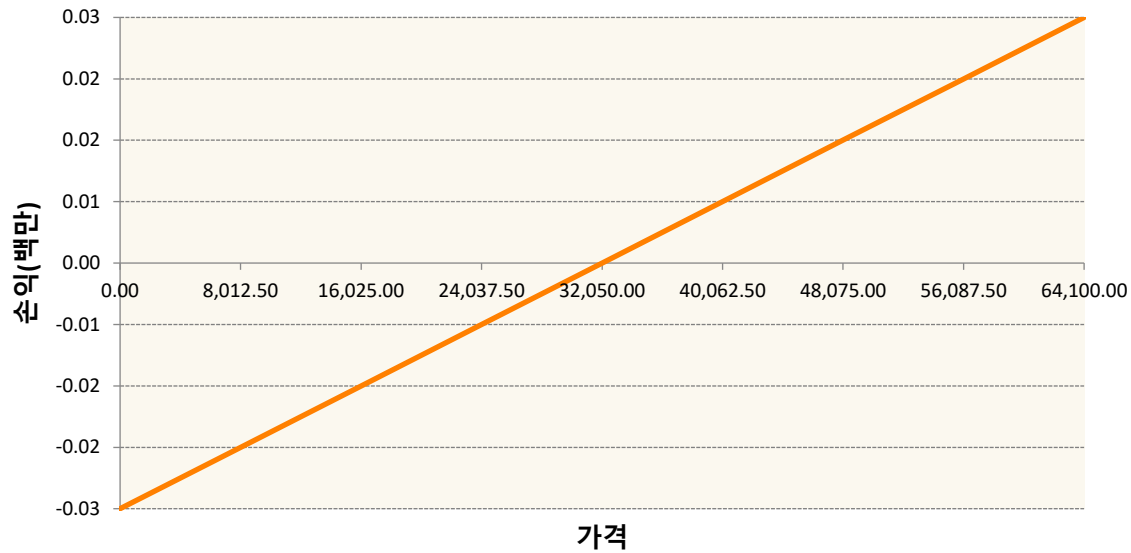
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								158
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158	-158
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	105	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	158	158	158	158	158	158	158	158
KR4A05650002 2026-05 미니코스피200 선물								23
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-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	8
5.33%	15	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	23	23	23	23	23	23	23	23
KR4A0F650001 2026-05 두산로보틱스개별선물								1
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1
KR4A11650004 2026-05 삼성전자개별선물							48
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	48	48	48	48	48	48	48
KR4A50650006 2026-05 SK하이닉스개별선물							14
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	9	9	9	9	9	9	9
8.00%	14	14	14	14	14	14	14
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)

572

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

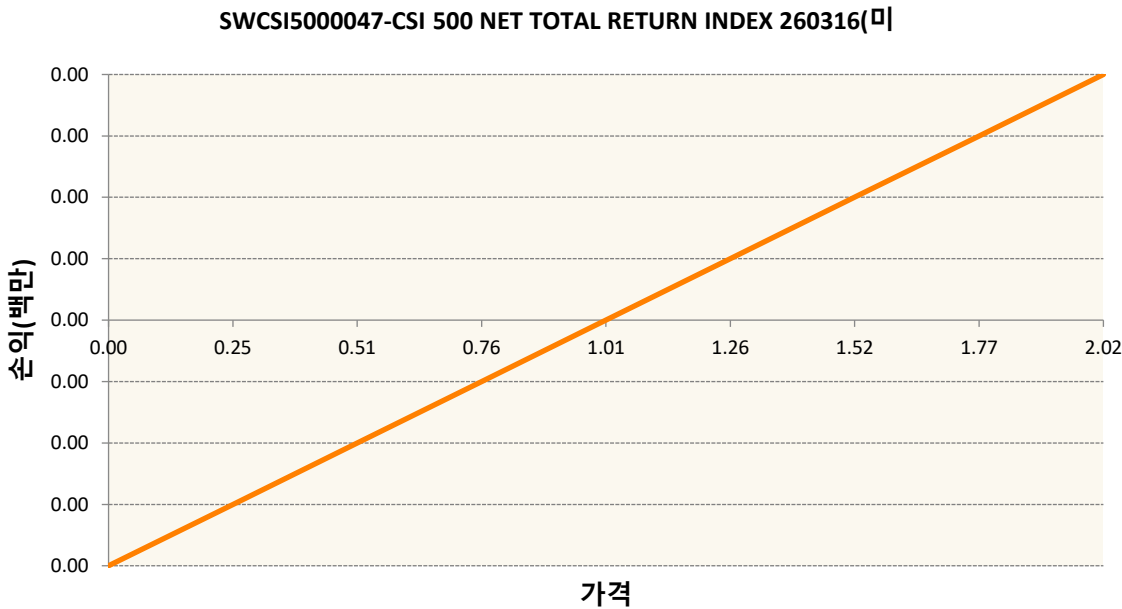
SOL차이나강소기업CSI500상장

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)

558

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

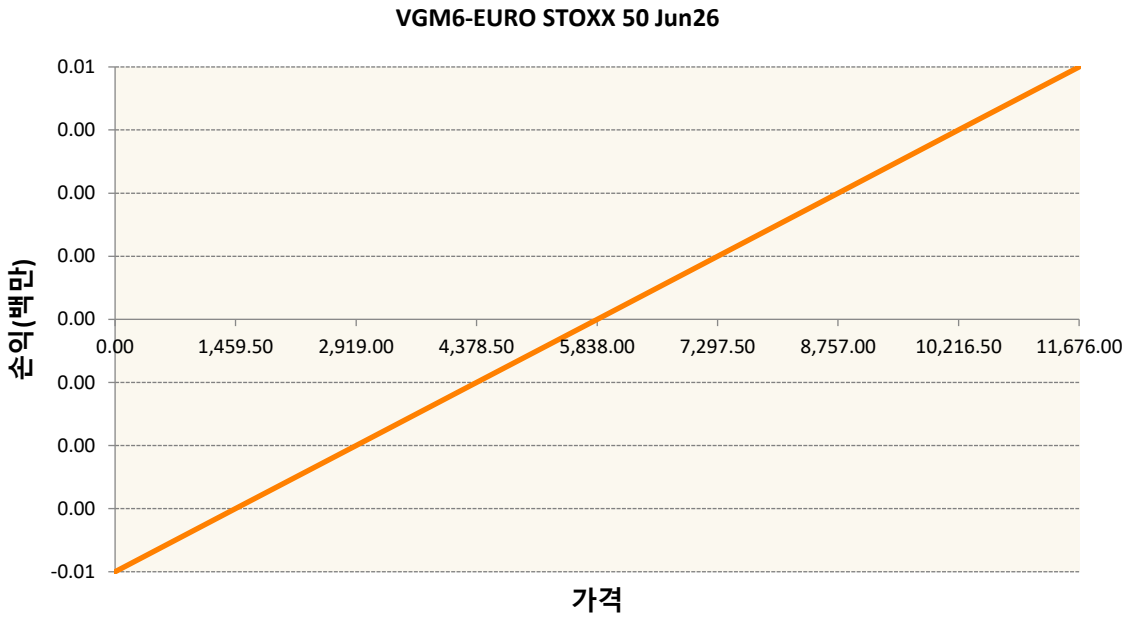
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	72
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

62

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

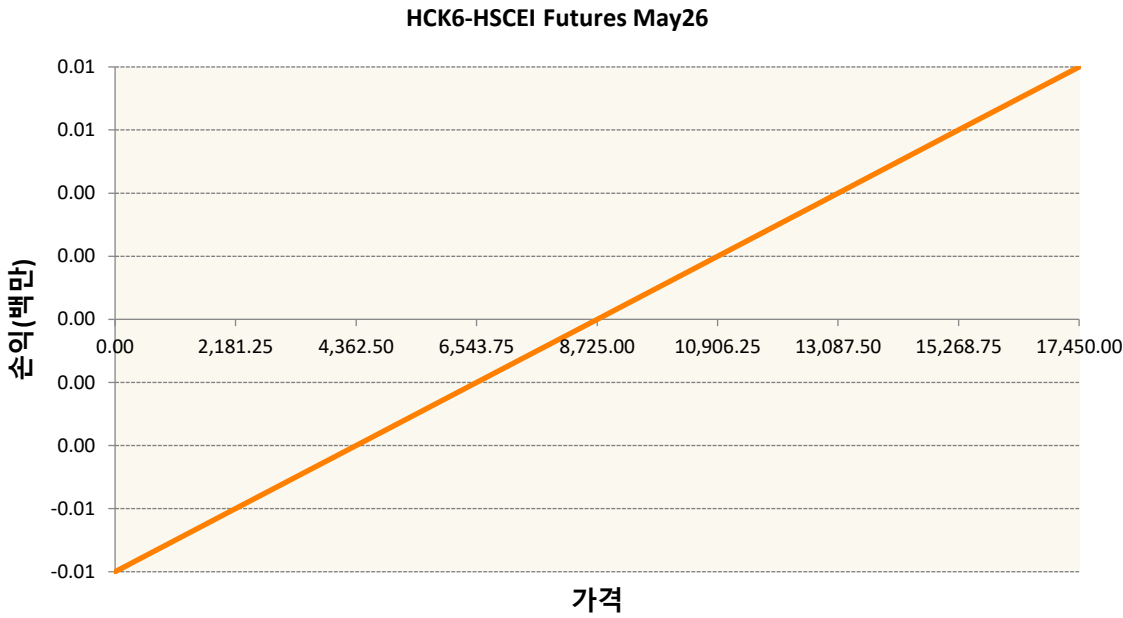
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,641	0	1,641	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

157

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

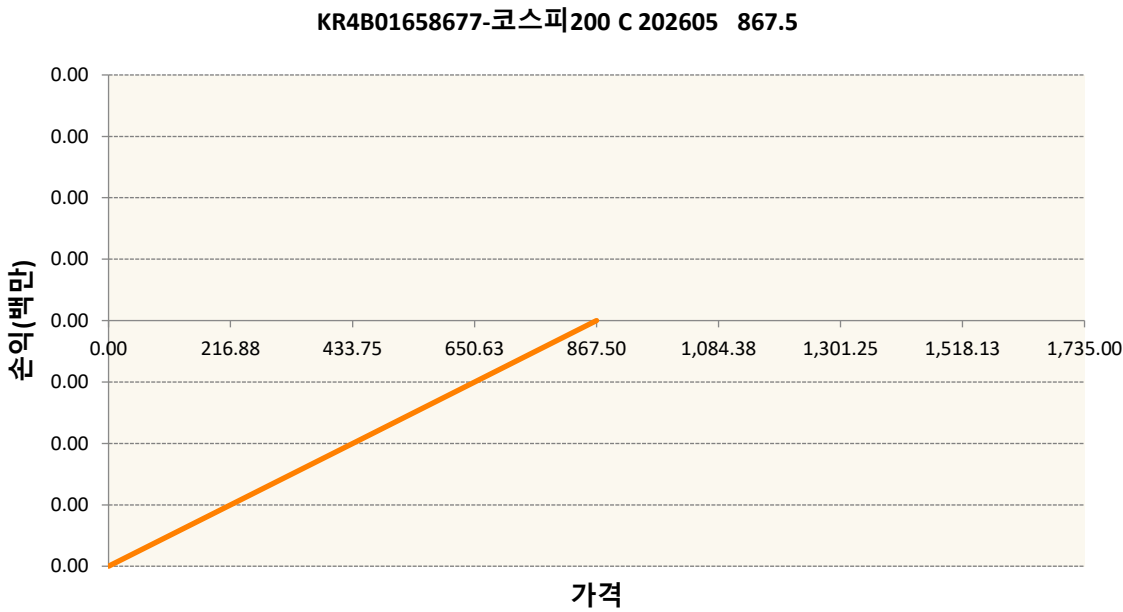
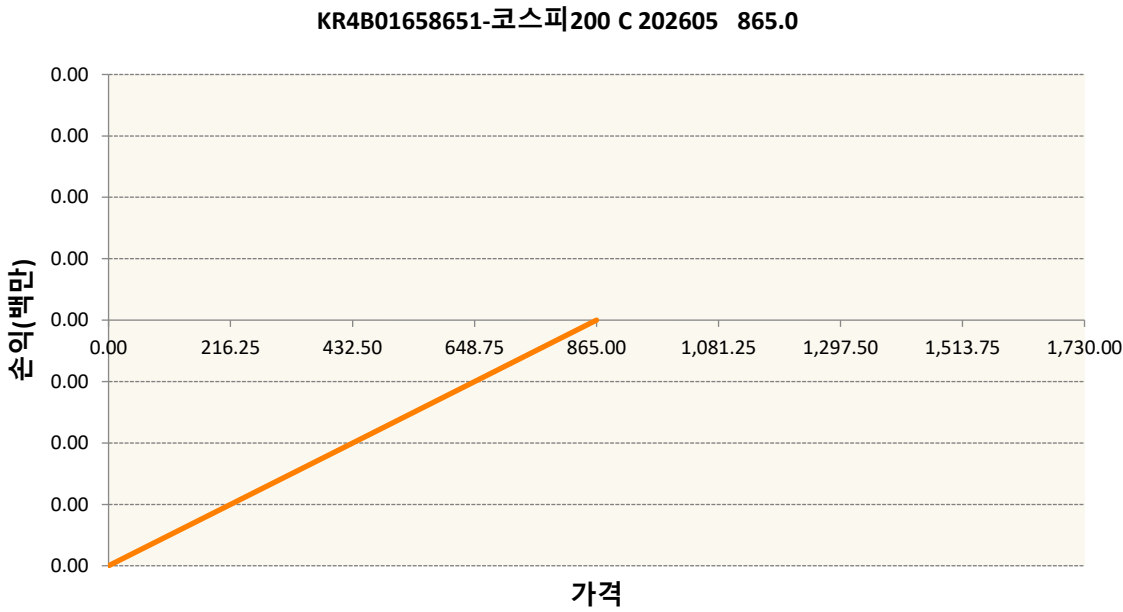
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

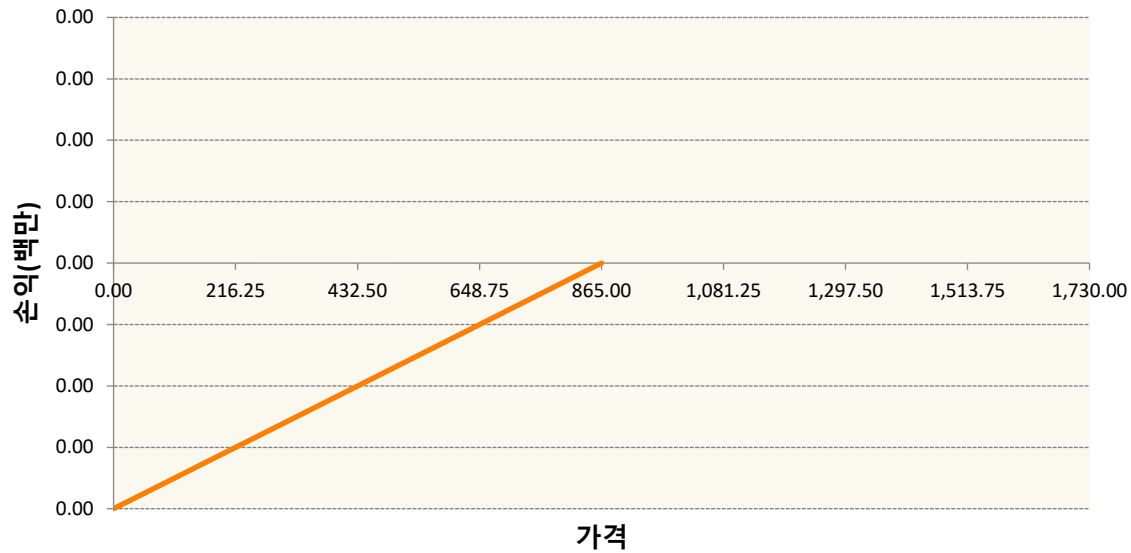
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,040	0	1,040	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,470	-32,470	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0							43
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-3	-6	-12	-20	-31	-43
-5.33%	1	0	-2	-5	-9	-16	-24
-2.67%	1	1	0	-1	-4	-7	-12
0%	1	1	1	0	-1	-3	-6
2.67%	1	1	1	1	0	-1	-3
5.33%	1	1	1	1	1	0	-1
8.00%	1	1	1	1	1	1	0
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							36
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	-2	-6	-10	-17	-25	-36
-5.33%	0	0	-2	-4	-8	-13	-20
-2.67%	1	0	0	-1	-3	-6	-10
0%	1	1	0	0	-1	-3	-5
2.67%	1	1	1	0	0	-1	-2
5.33%	1	1	1	1	0	0	-1
8.00%	1	1	1	1	1	0	0
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							20
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	-1	-3	-6	-9	-14	-20
-5.33%	0	0	-1	-2	-4	-7	-11
-2.67%	0	0	0	-1	-2	-3	-6
0%	0	0	0	0	-1	-1	-3

2.67%	0	0	0	0	0	0	-1
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

23

공시일 2026-05-07

기준일 2026-05-06

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	2026-05-07
기준일	2026-05-06

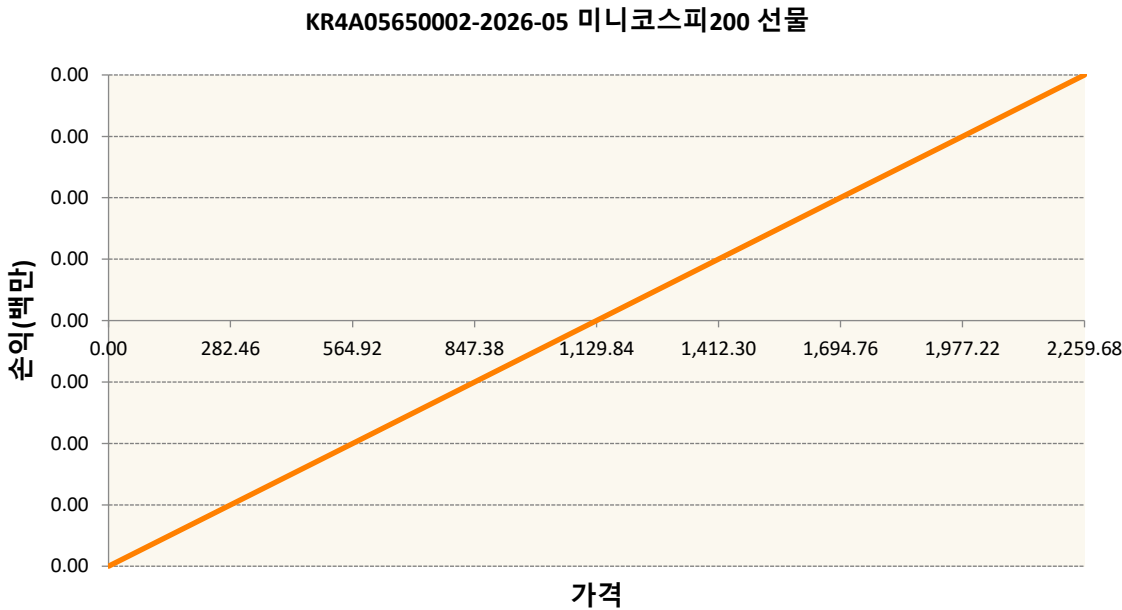
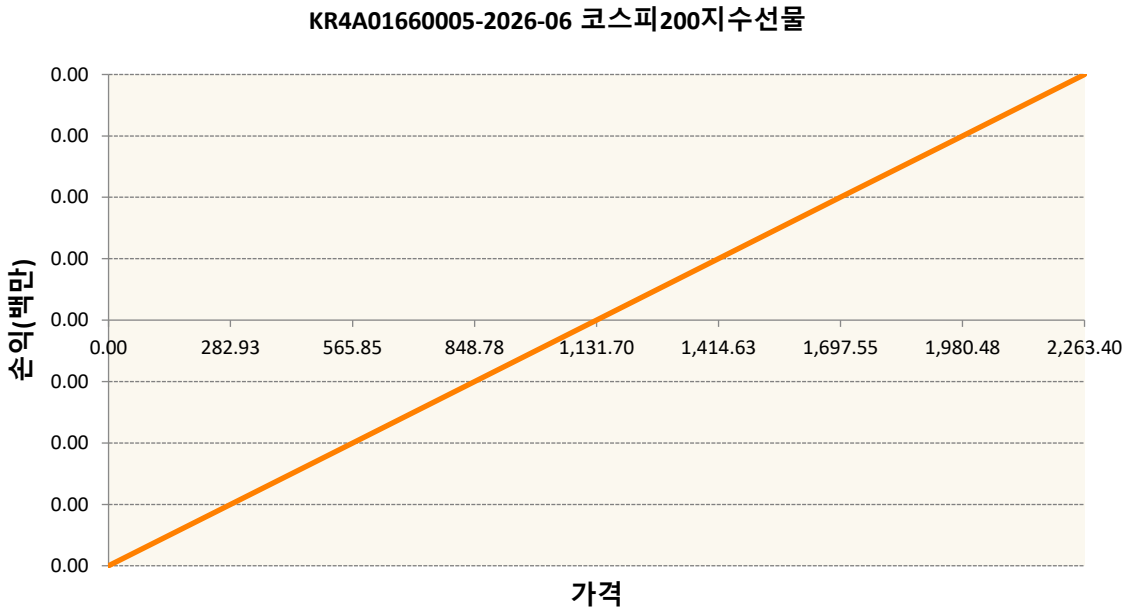
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

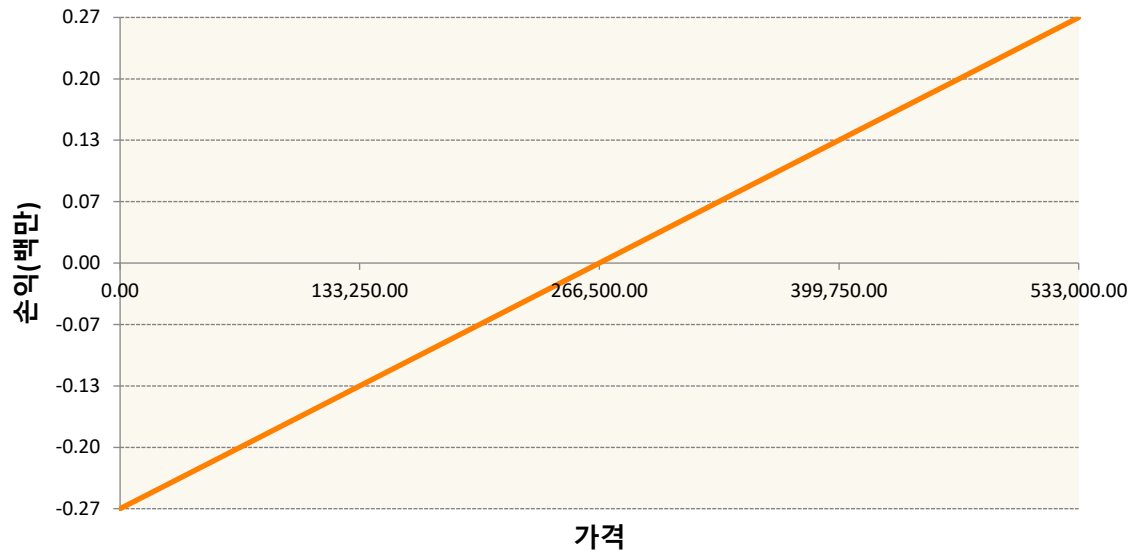
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,979	0	2,979	장내

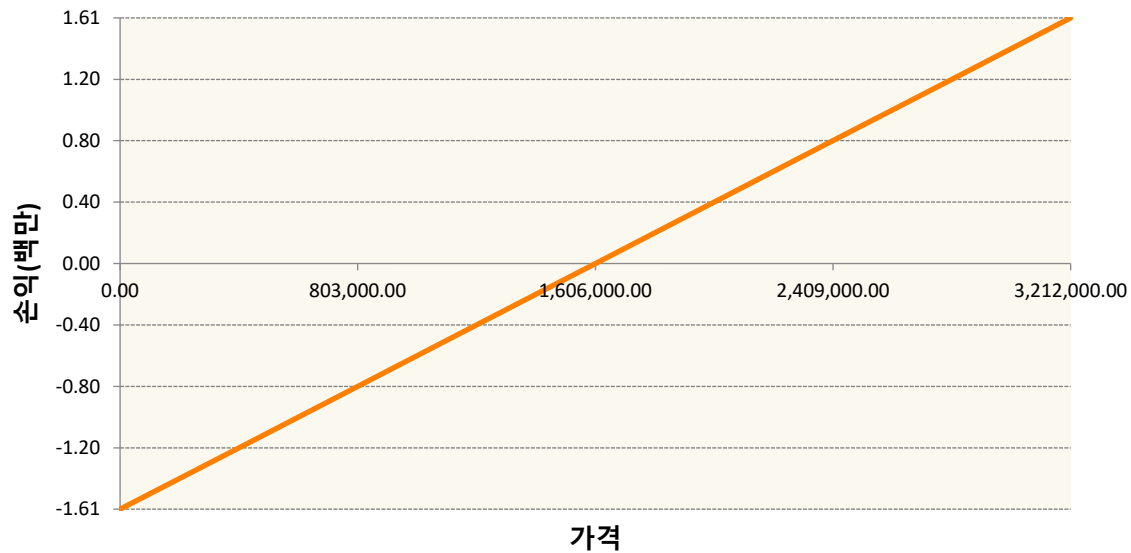
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	75	75	75	75	75	75	75
8.00%	113	113	113	113	113	113	113
KR4A05650002		2026-05 미니코스피200 선물					23
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-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%	15	15	15	15	15	15	15
8.00%	23	23	23	23	23	23	23
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							10
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-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%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

(단위:백만원)

332

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

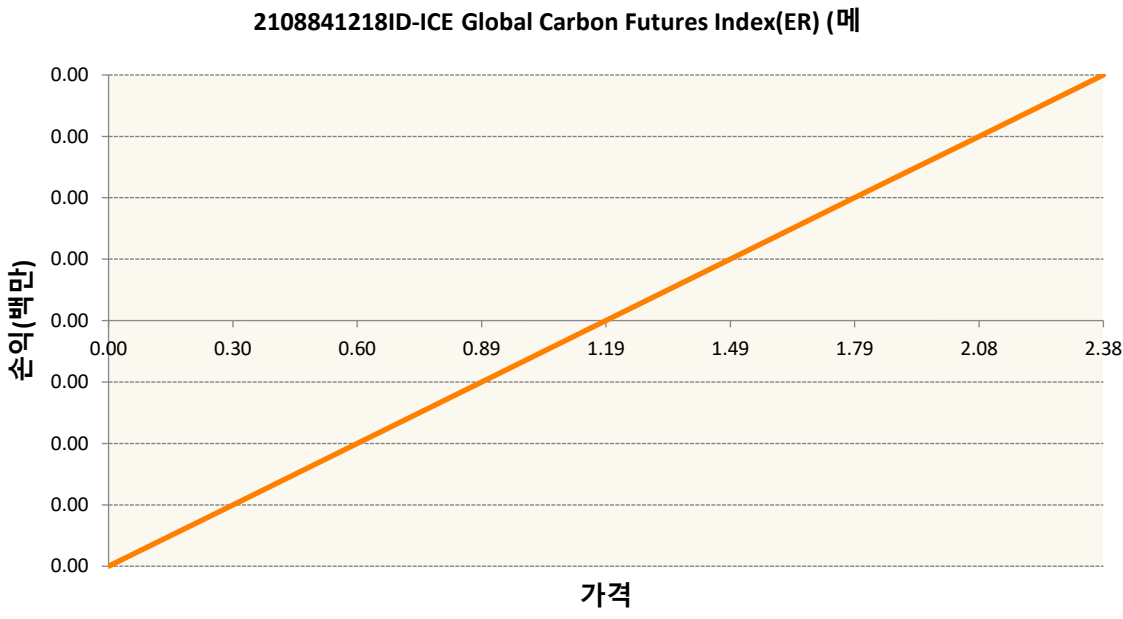
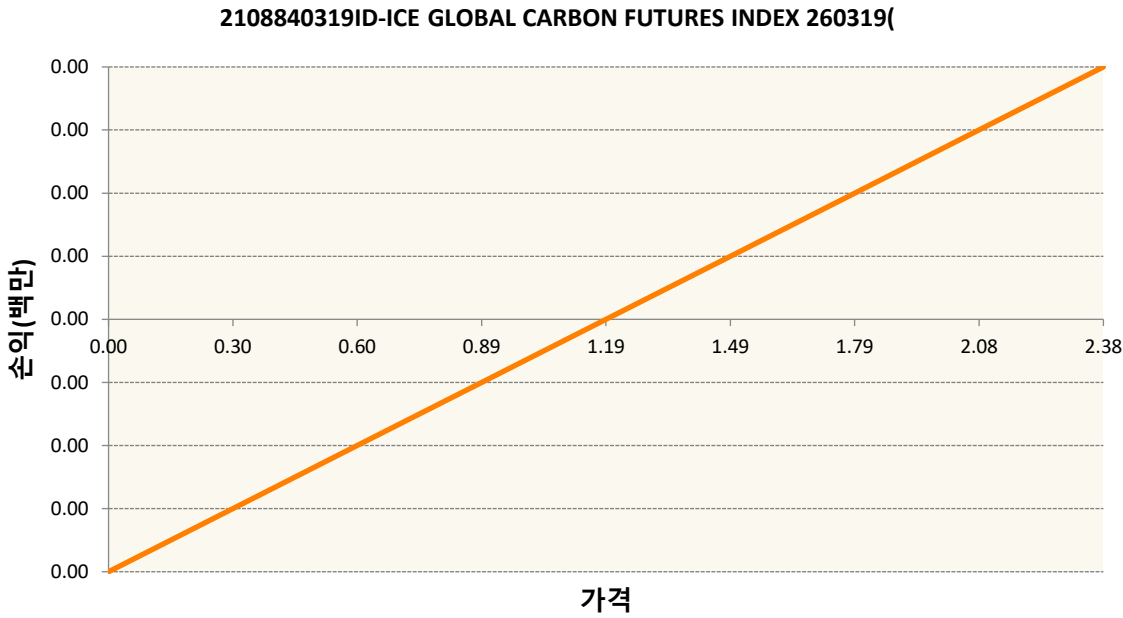
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,838	0	6,838	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		437
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		110

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	627

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

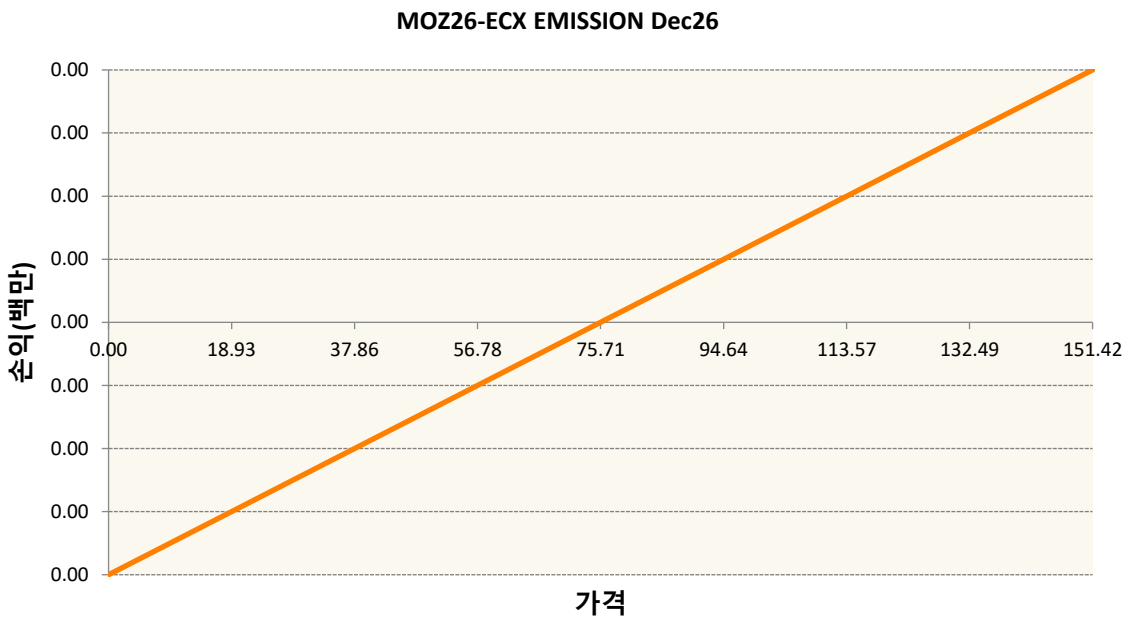
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,892	0	4,892	
누계	통화	선도	0	2,329	-2,329	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	186
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	391

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

(단위:백만원)

677

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

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)	8
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	19
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	7

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

(단위:백만원)

68

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

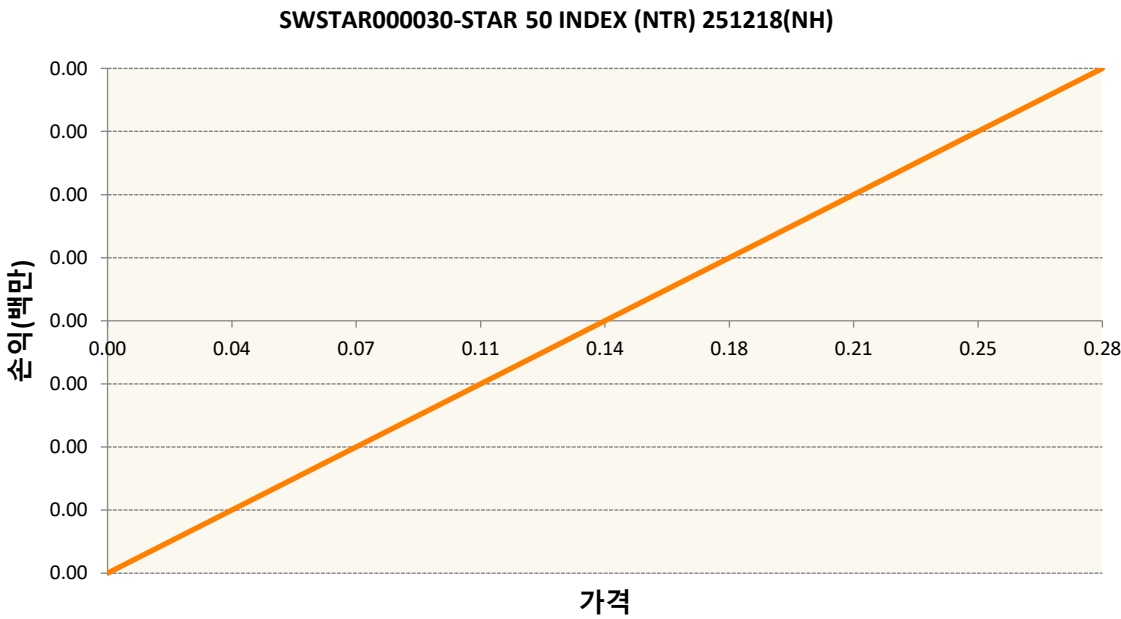
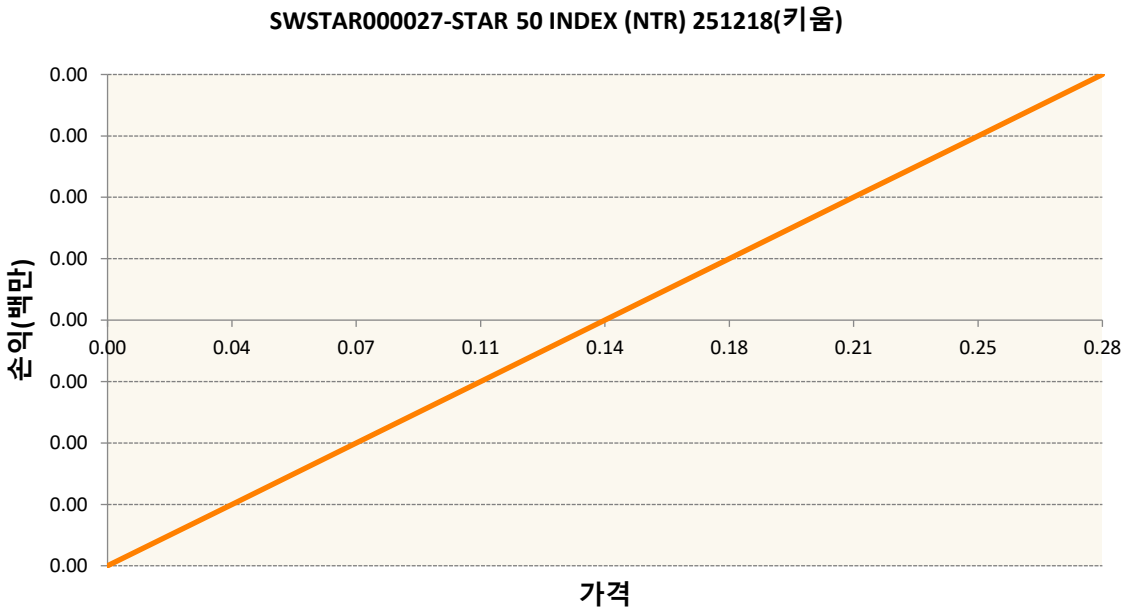
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

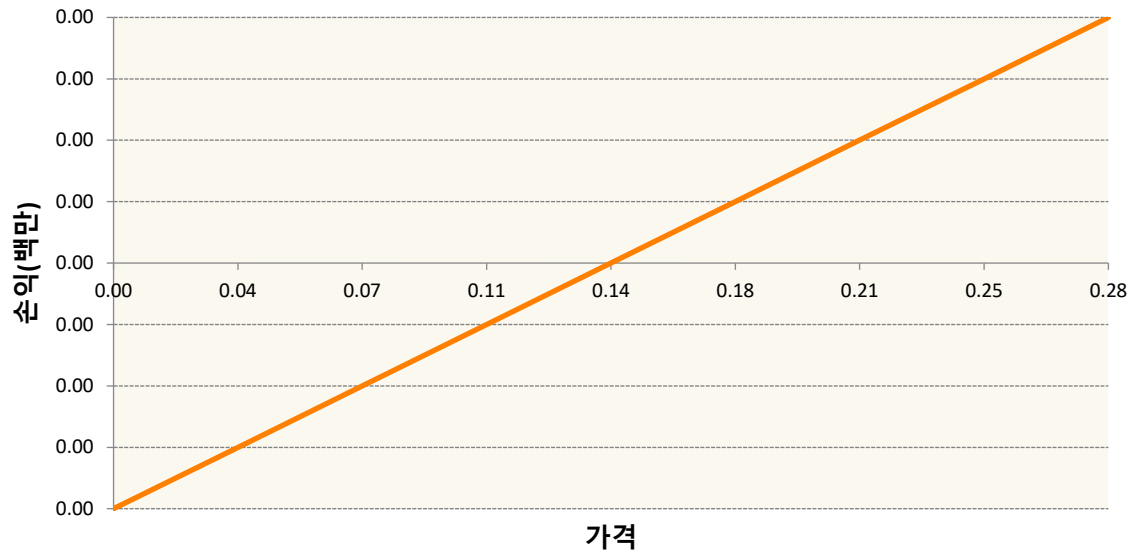
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,541	0	3,541	장외

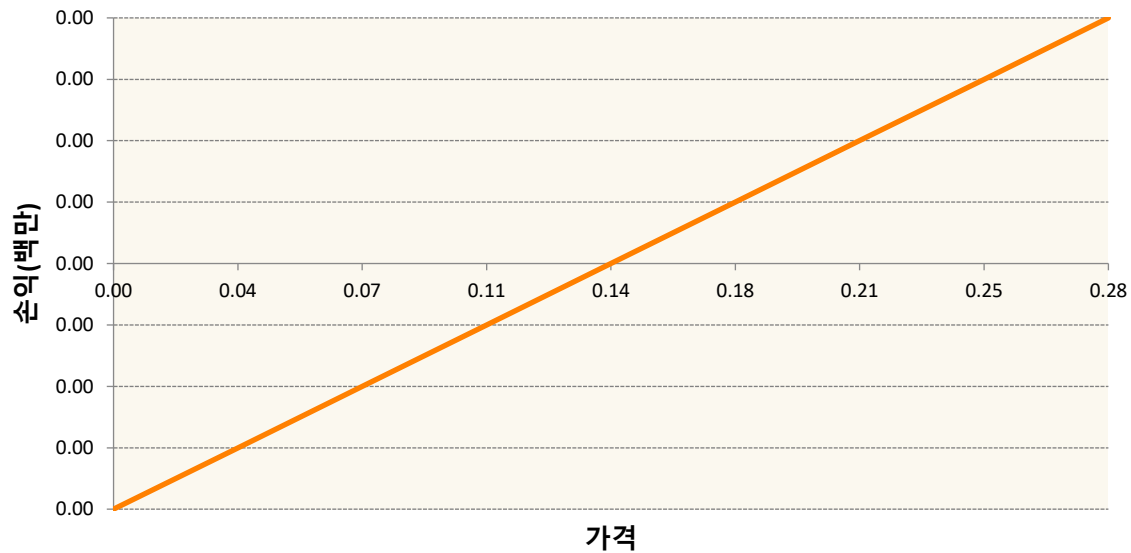
2. 만기시점의 손익구조



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)	10
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	35
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	178
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	66

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

(단위:백만원)

433

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

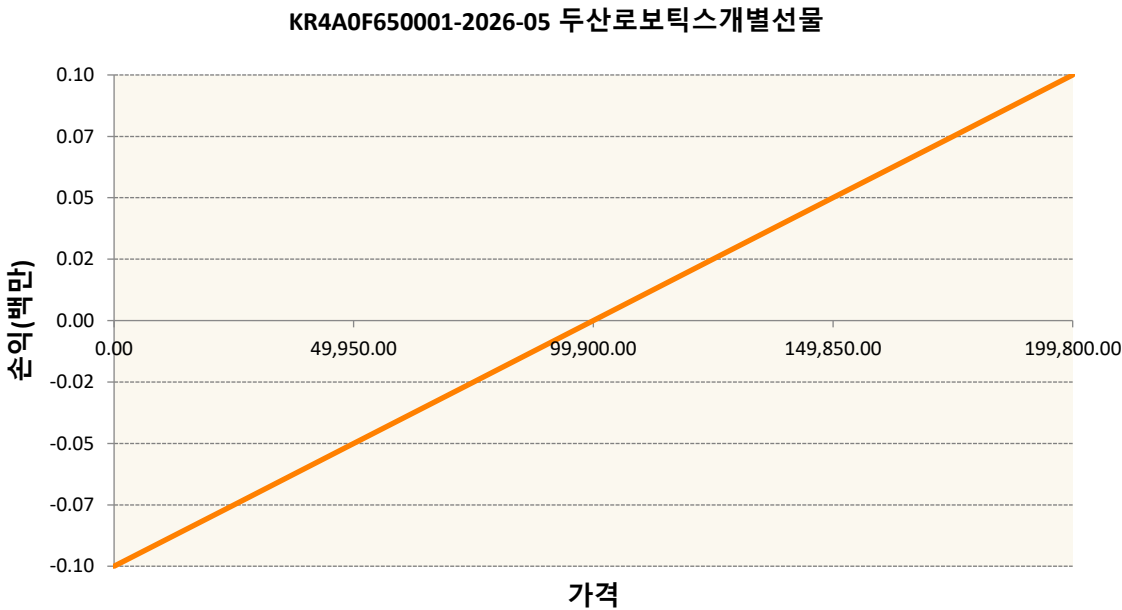
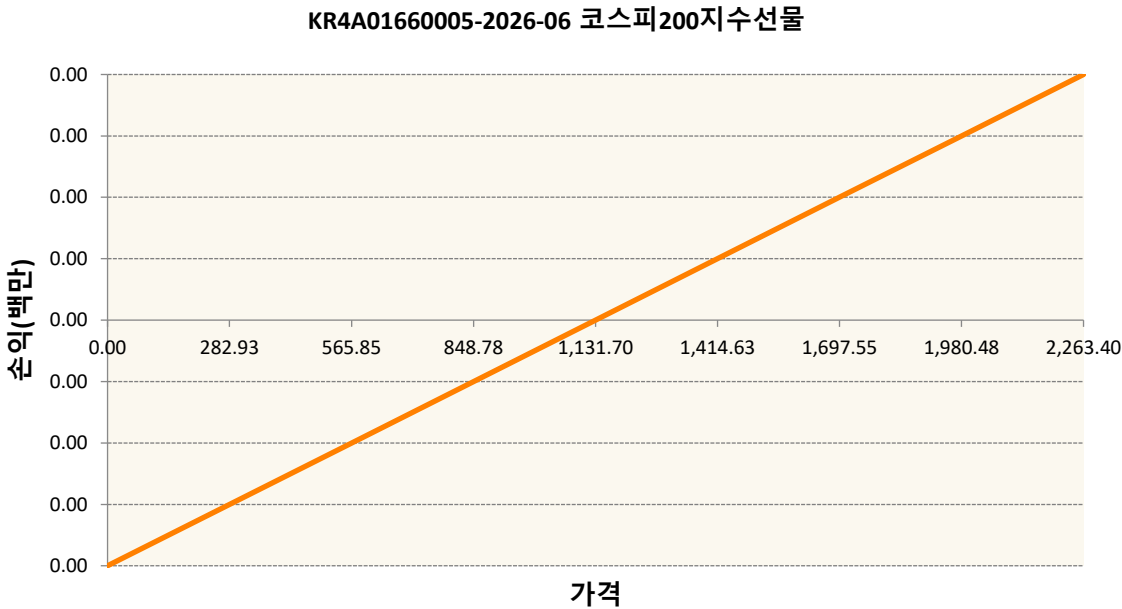
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

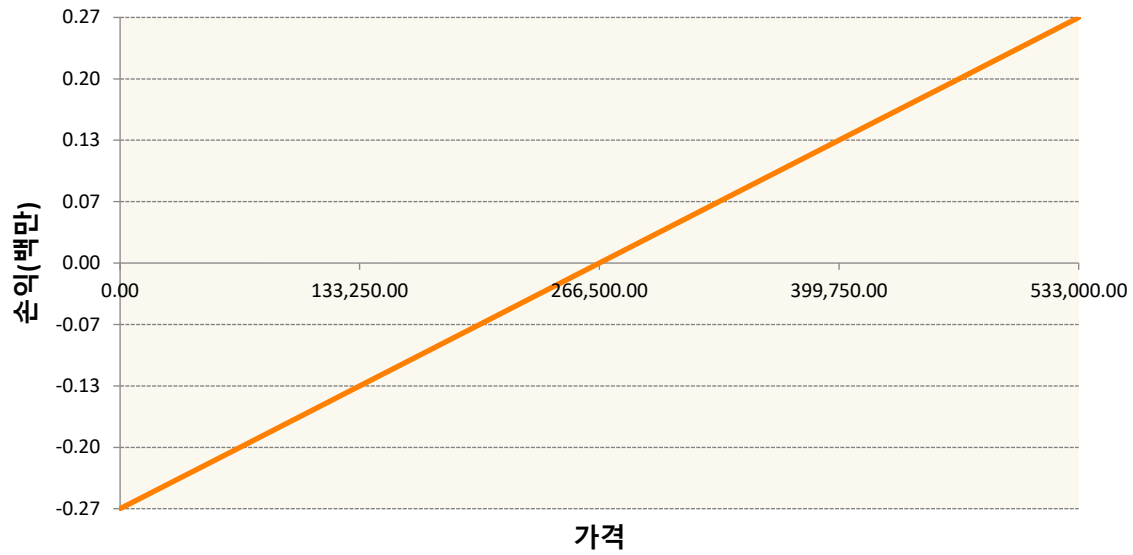
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	469	2,828	-2,358	장내
누계	유가증권	선물	25,677	3,591	22,086	장내

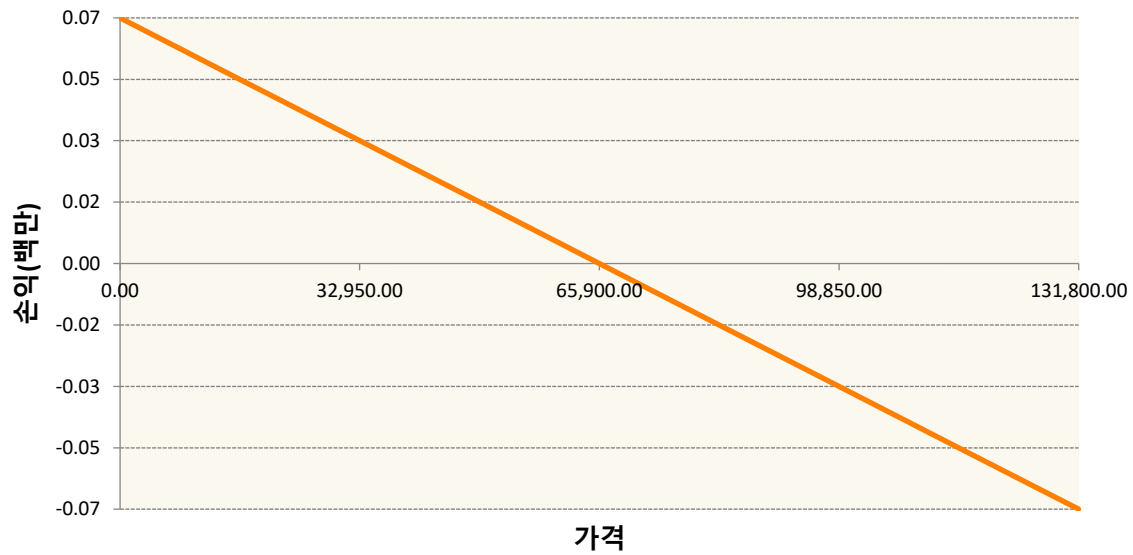
2. 만기시점의 손익구조



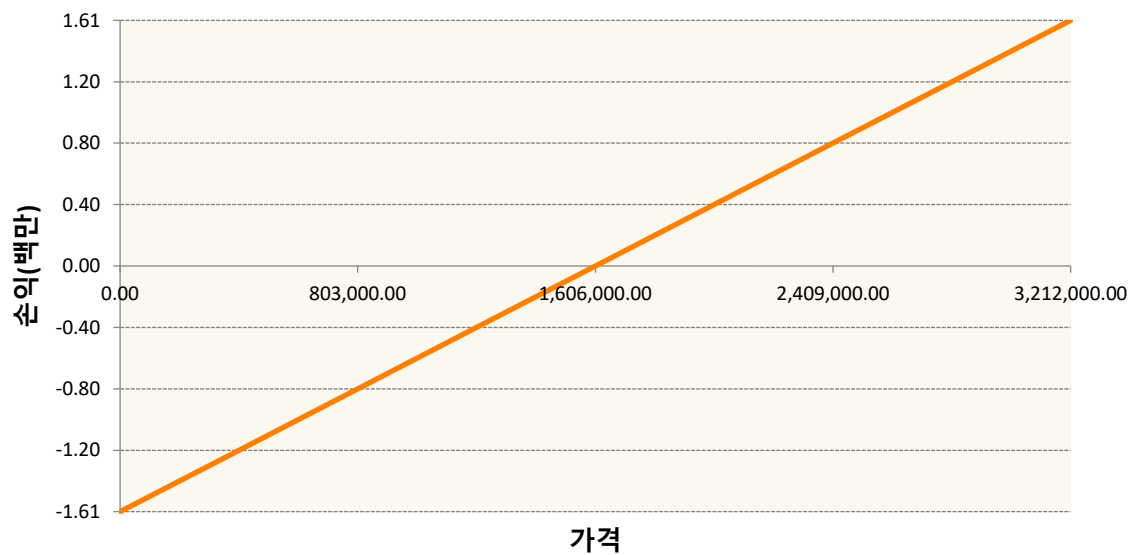
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



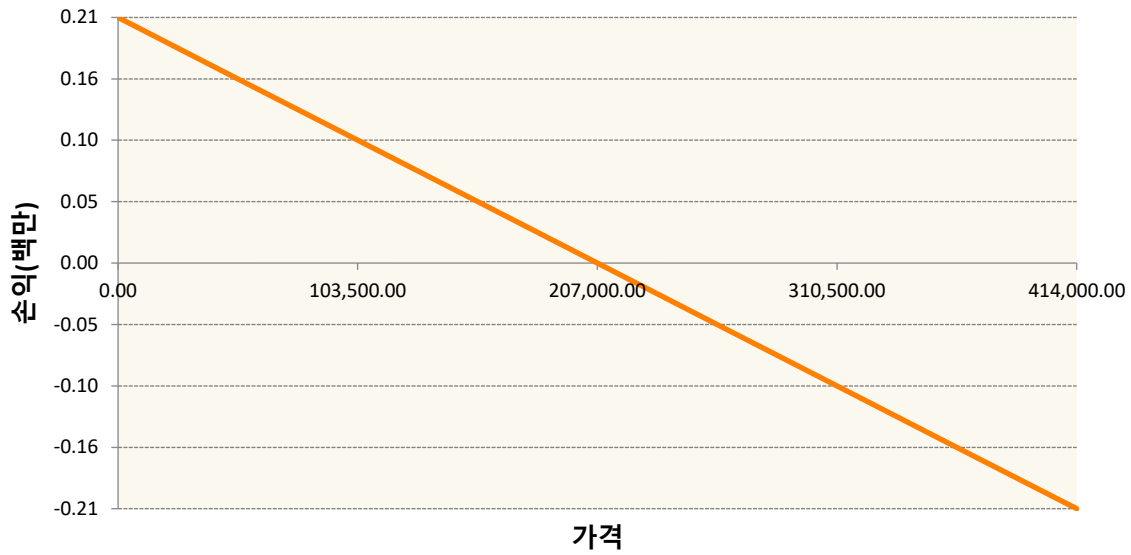
KR4A2K650002-2026-05 LG씨엔에스개별선물



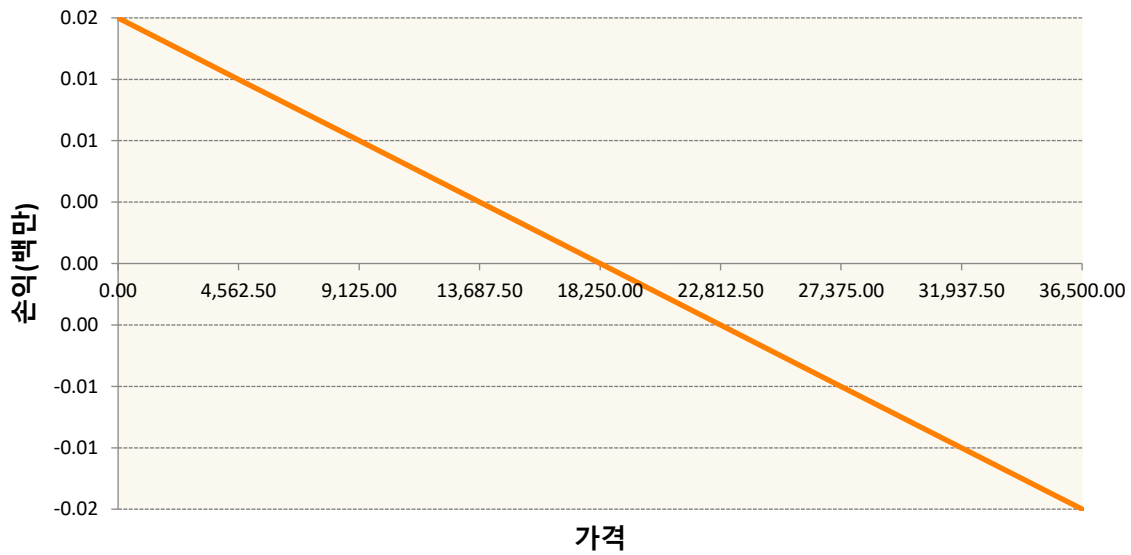
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



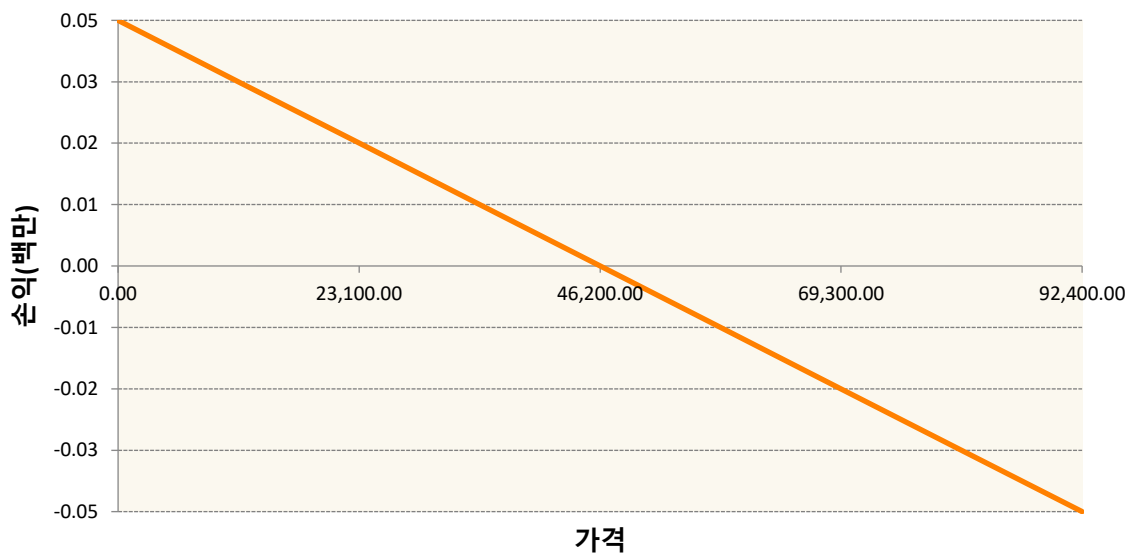
KR4A56650000-2026-05 NAVER개별선물



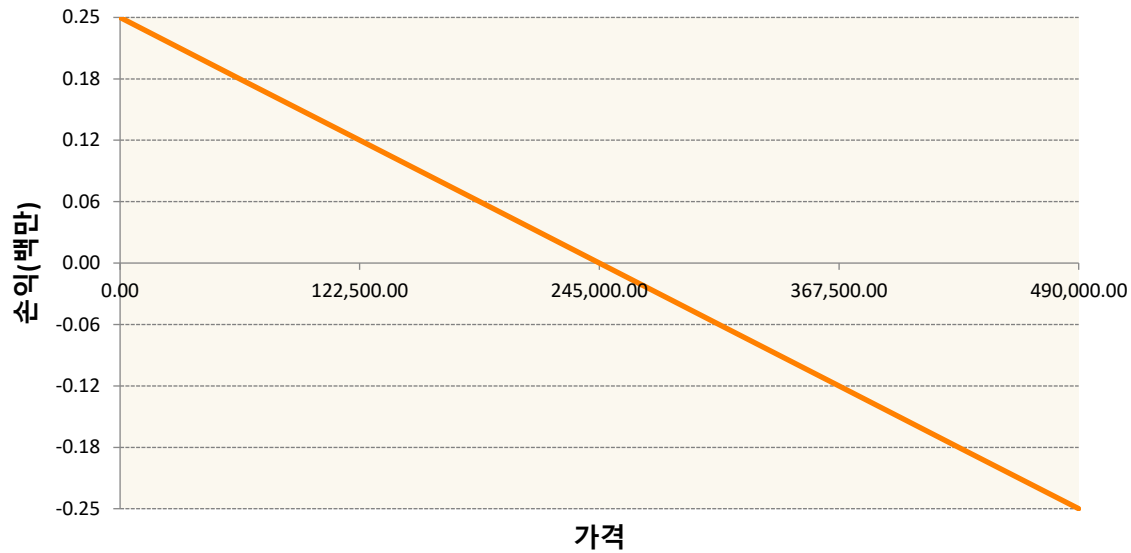
KR4ABV650007-2026-05 iM금융지주개별선물



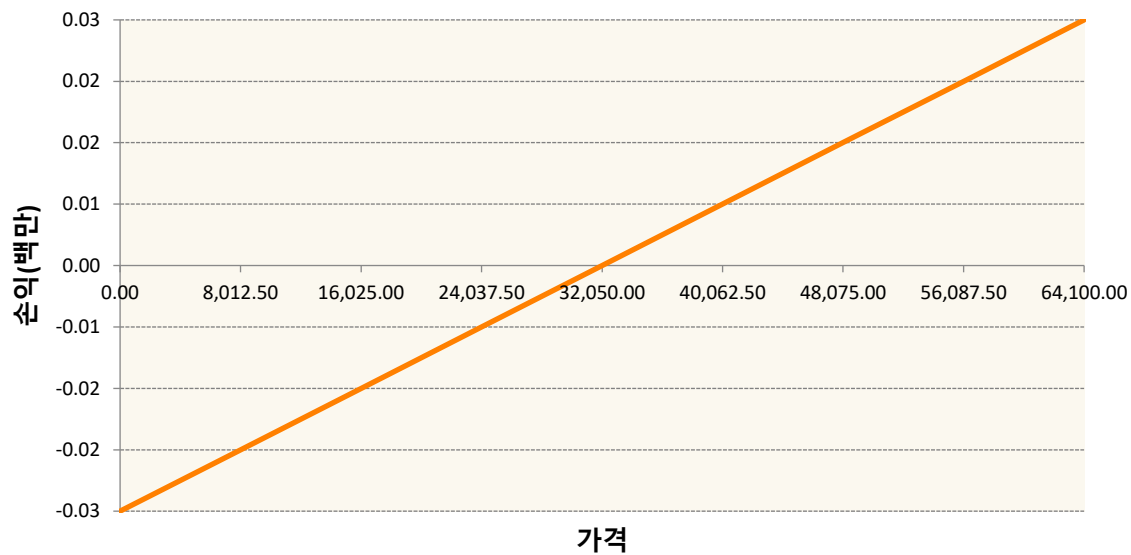
KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



KR4AFC650006-2026-05 하이브개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005			2026-06 코스피200지수선물				1,627
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627	-1,627
-5.33%	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084	-1,084
-2.67%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	542	542	542	542	542	542	542
5.33%	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084	1,084
8.00%	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627	1,627
KR4A0F650001			2026-05 두산로보틱스개별선물				16
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	10	10	10	10	10	10	10
8.00%	16	16	16	16	16	16	16

KR4A11650004

2026-05 삼성전자개별선물

220

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-220	-220	-220	-220	-220	-220	-220
-5.33%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
-2.67%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	73	73	73	73	73	73	73
5.33%	147	147	147	147	147	147	147
8.00%	220	220	220	220	220	220	220

KR4A2K650002

2026-05 LG씨엔에스개별선물

25

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	25	25	25	25	25	25
-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%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25

KR4A50650006

2026-05 SK하이닉스개별선물

138

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	46	46	46	46	46	46	46
5.33%	92	92	92	92	92	92	92
8.00%	138	138	138	138	138	138	138

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%	56	56	56	56	56	56	56
-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%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
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 118

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	118	118	118	118	118	118	118
-5.33%	79	79	79	79	79	79	79
-2.67%	39	39	39	39	39	39	39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
5.33%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
8.00%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118

KR4AFC650006 2026-05 하이브개별선물 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%	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%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41

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)

5,032

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

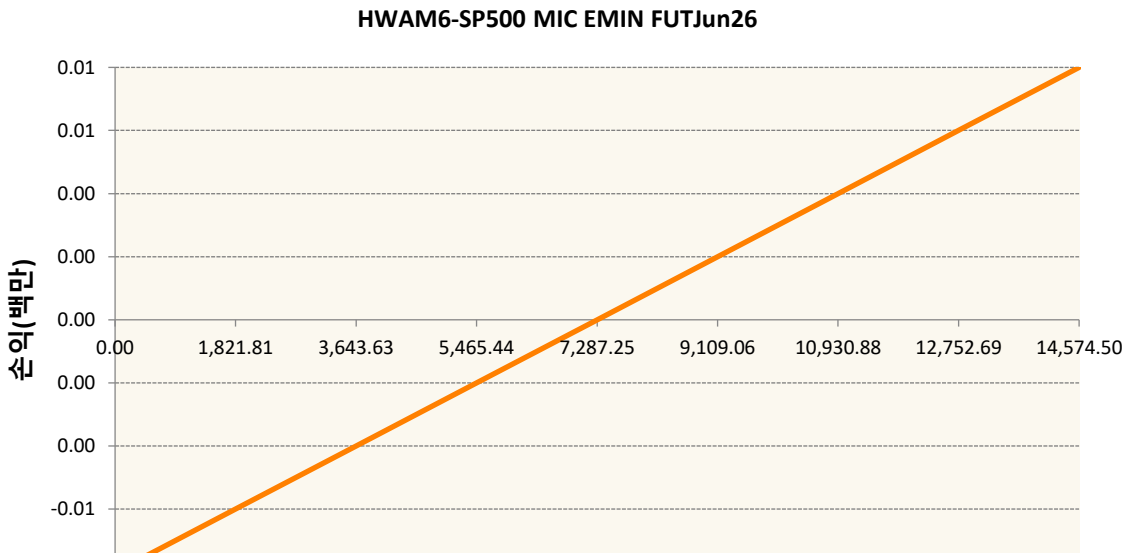
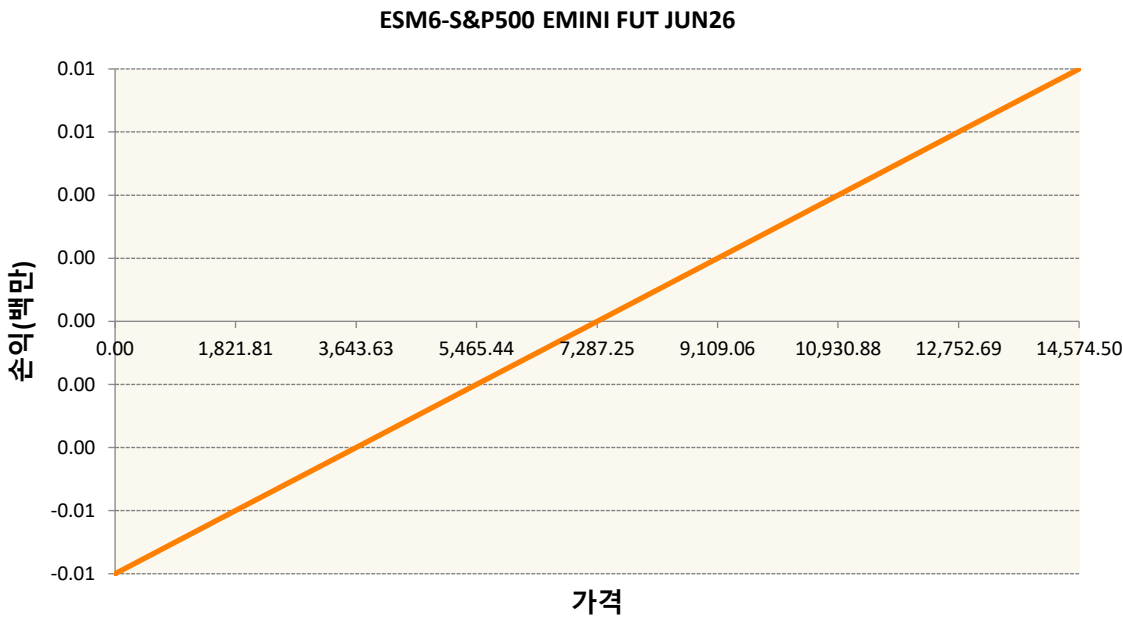
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

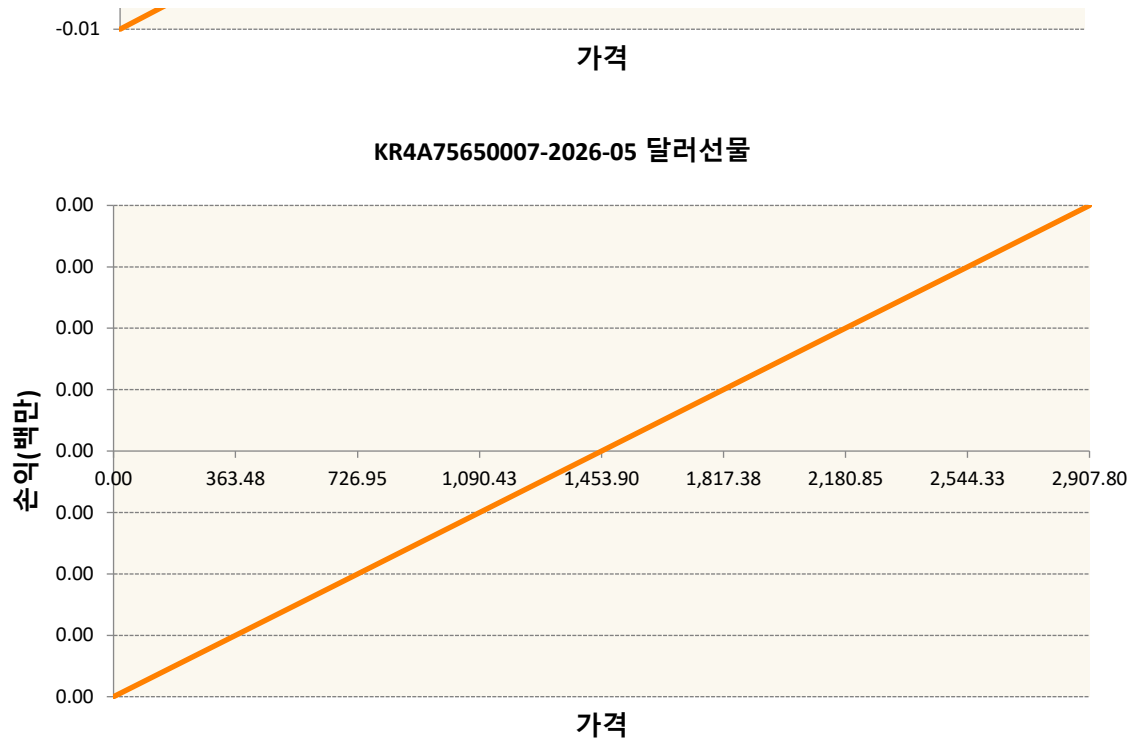
1. 계약금액

(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	61,028	0	61,028	
누계	지수	선물	271	0	271	장내
누계	통화	선물	10,323	0	10,323	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,882
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		22
KR4A756500 2026-05 달러선물			826

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,273

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

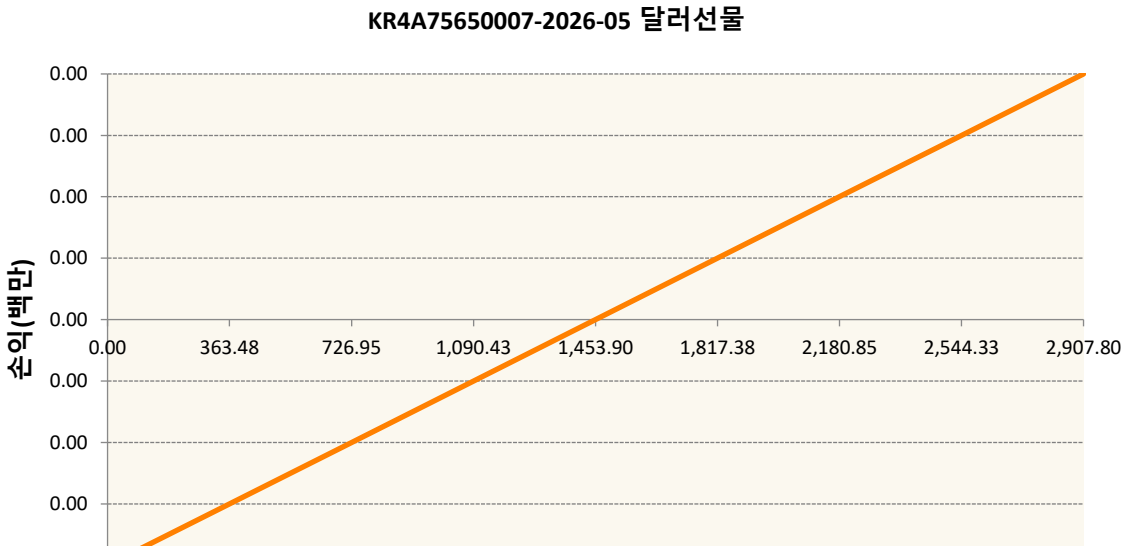
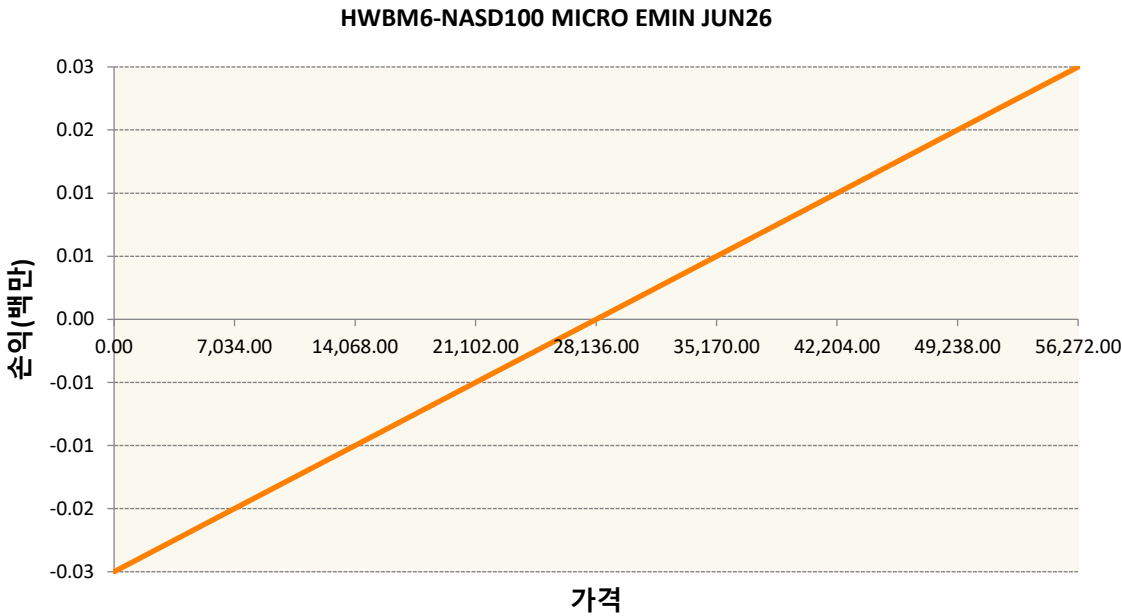
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

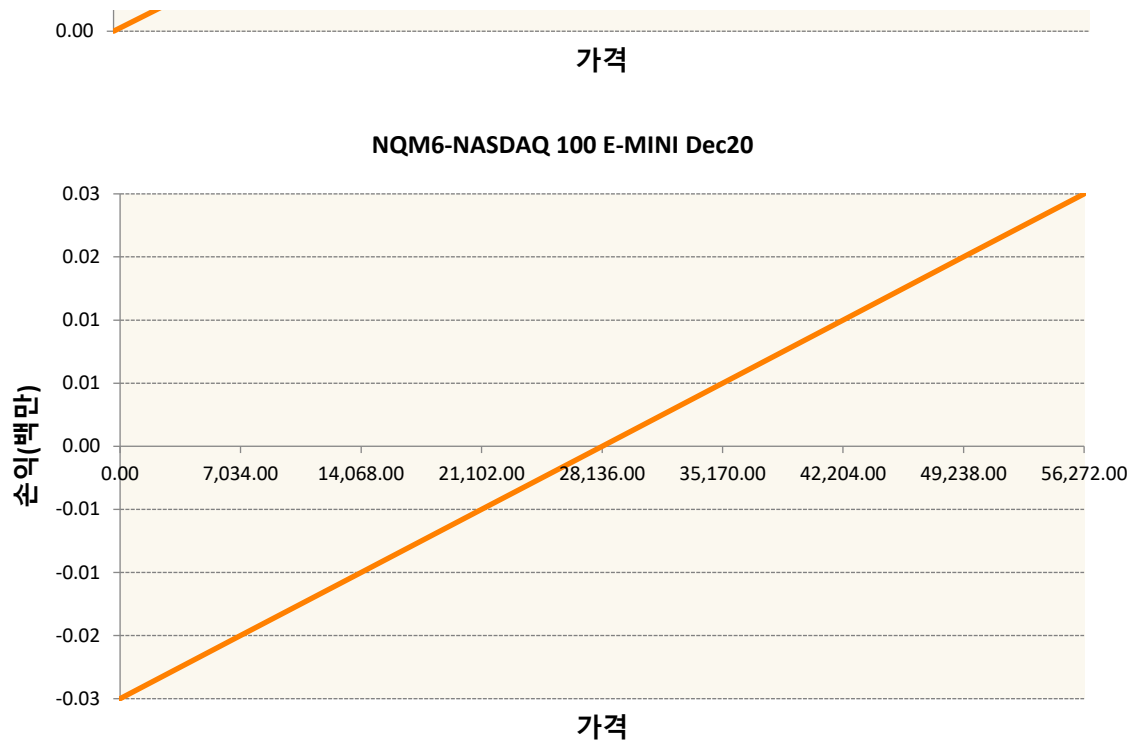
1. 계약금액

(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	28,549	0	28,549	
누계	유가증권	선물	745	0	745	장내
누계	통화	선물	3,795	0	3,795	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	60
KR4A756500	2026-05 달러선물	304
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,284

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

2,574

공시일	2026-05-07
기준일	2026-05-06

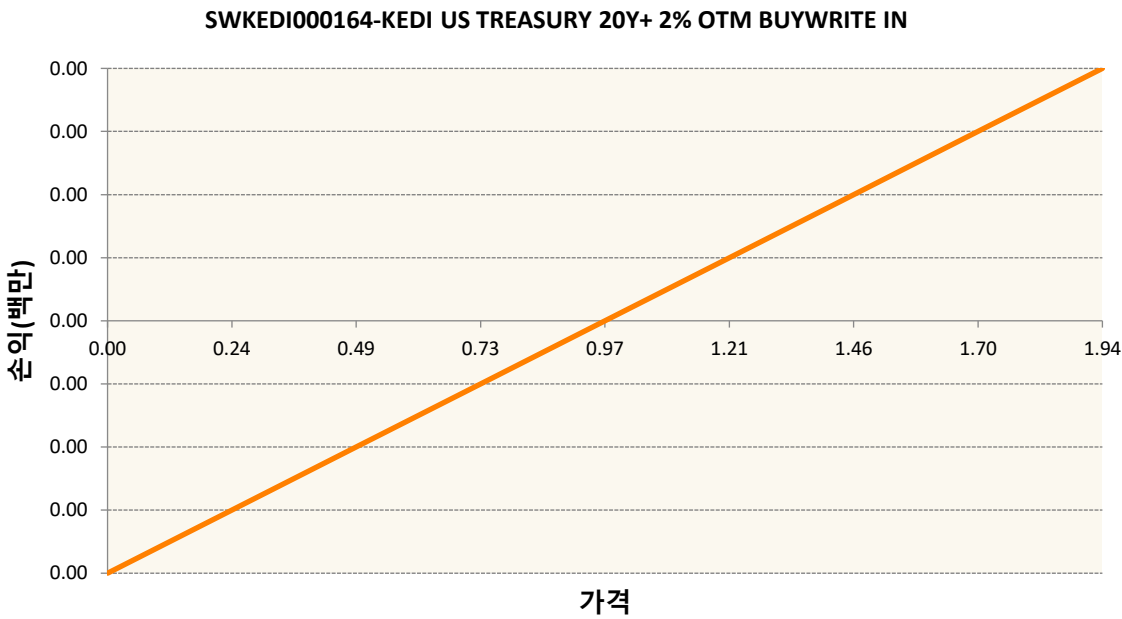
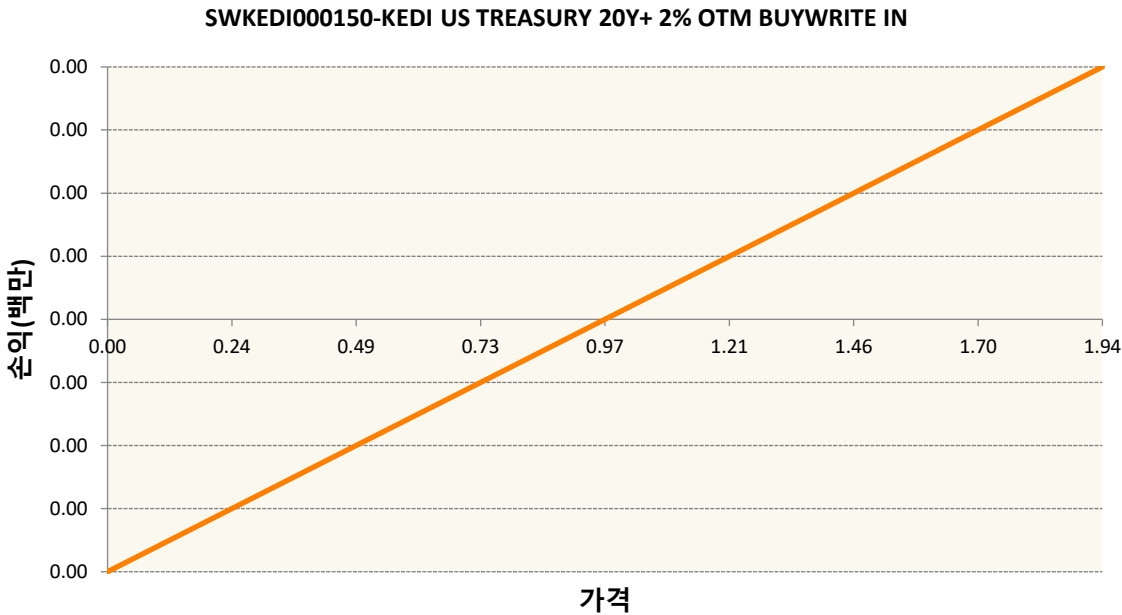
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

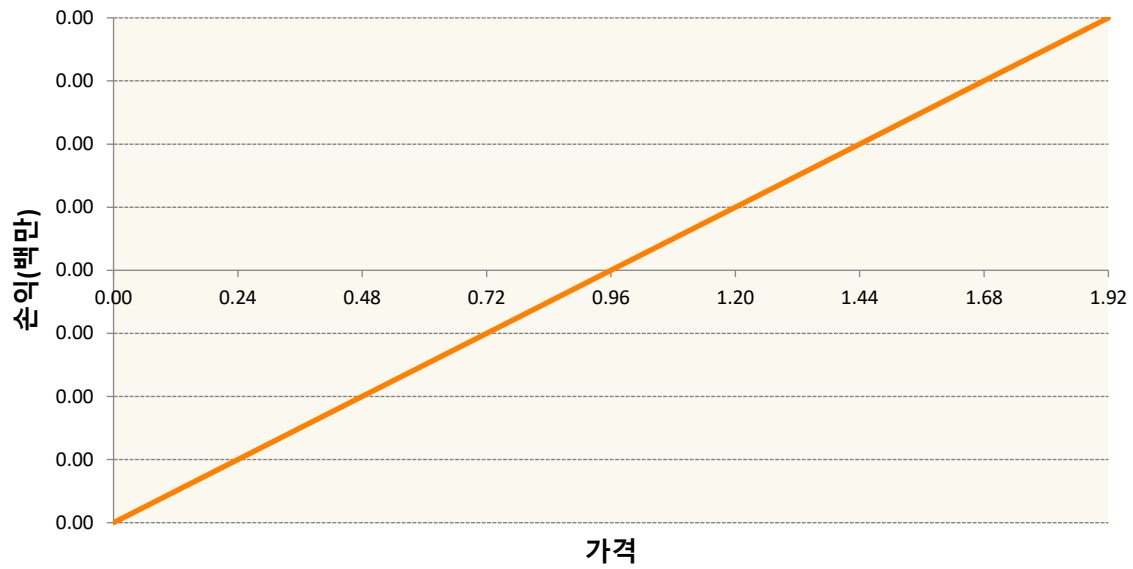
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	347,804	0	347,804	장외

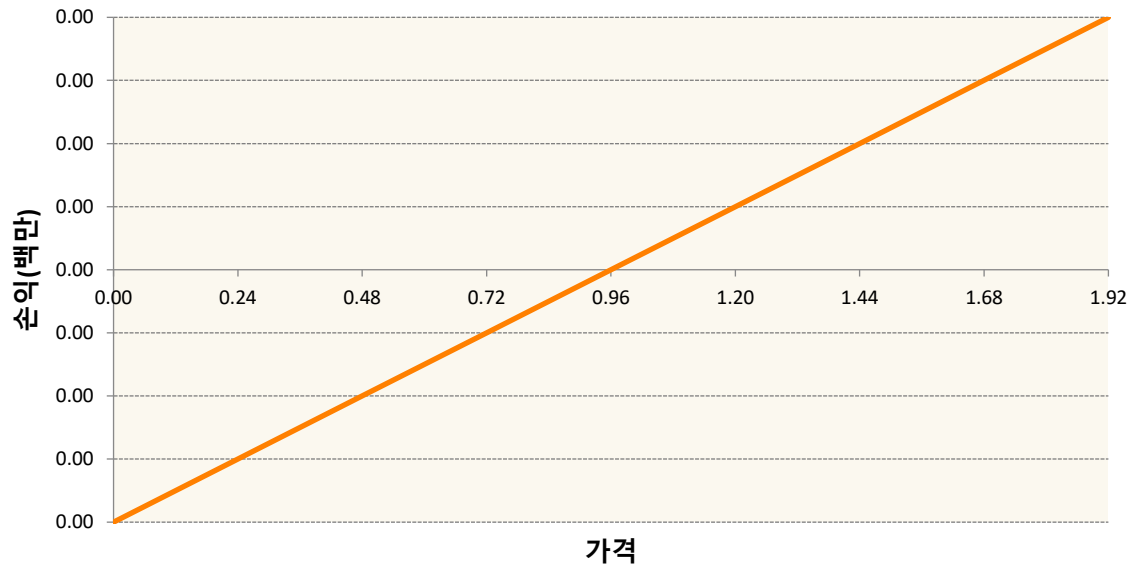
2. 만기시점의 손익구조



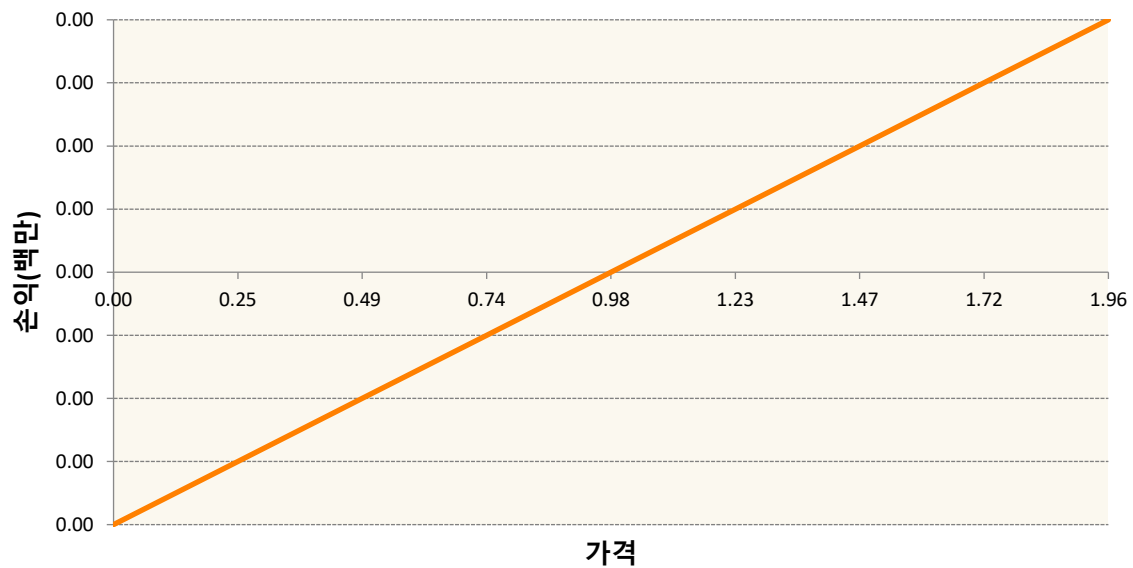
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,103
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		148
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,519
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,327
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,703

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	11,889