

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

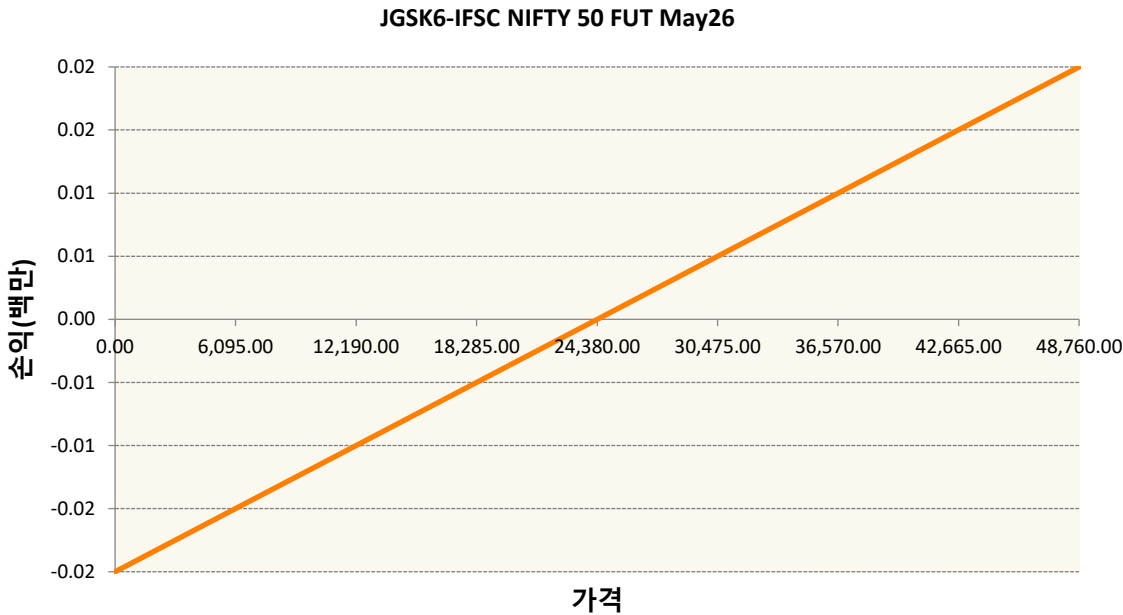
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	362	0	362	

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	2026-05-11
기준일	2026-05-08

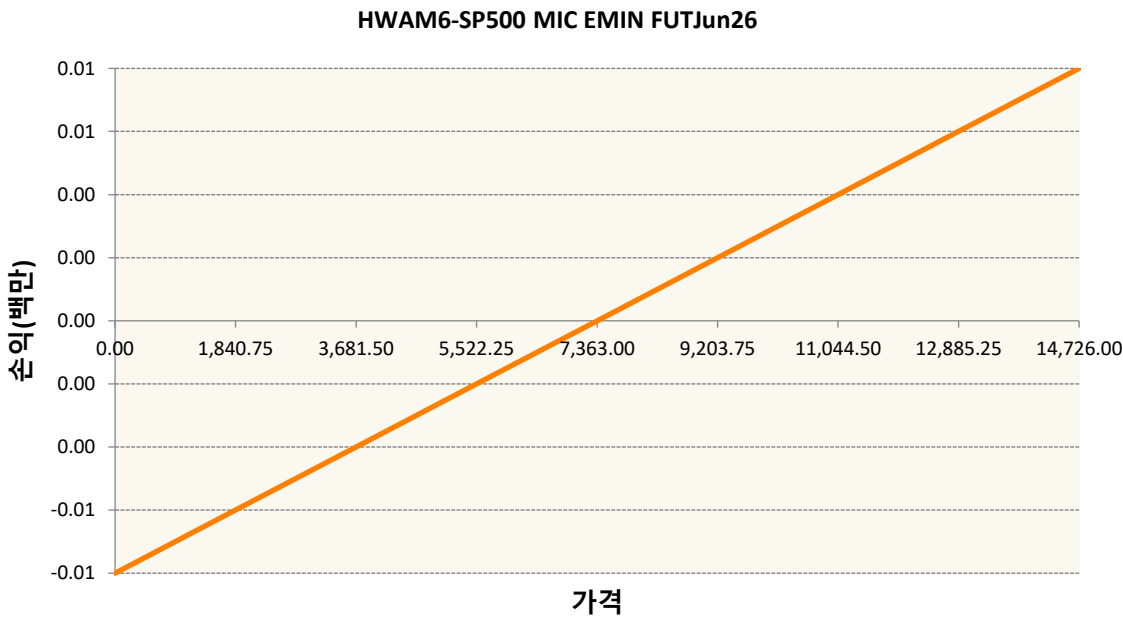
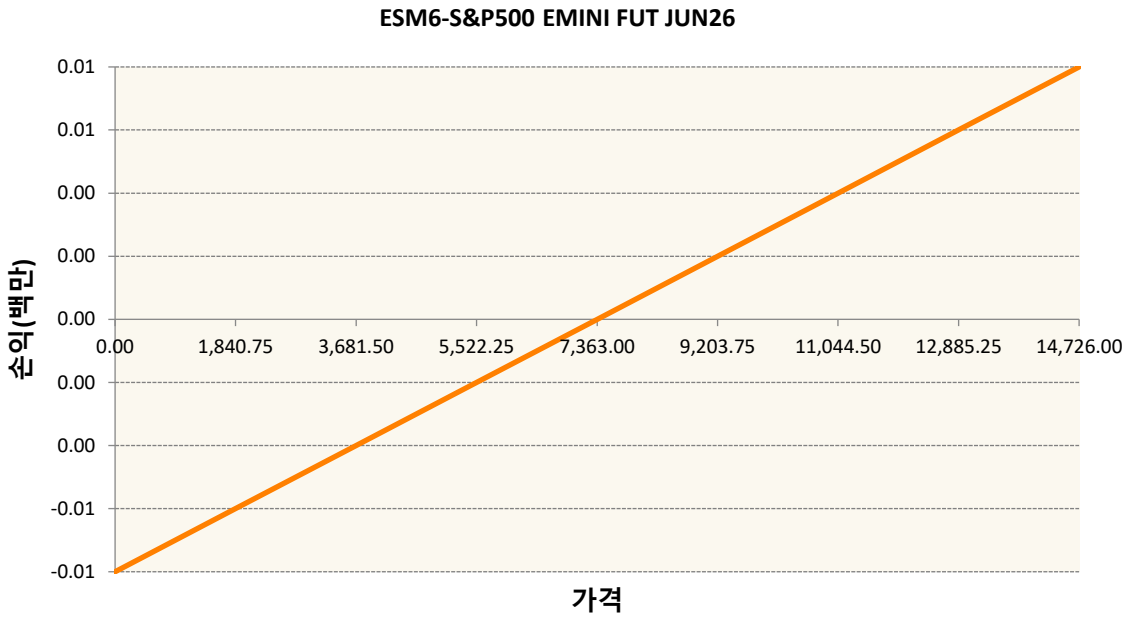
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	552	0	552	
누계	지수	선물	55	0	55	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	44
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	42

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

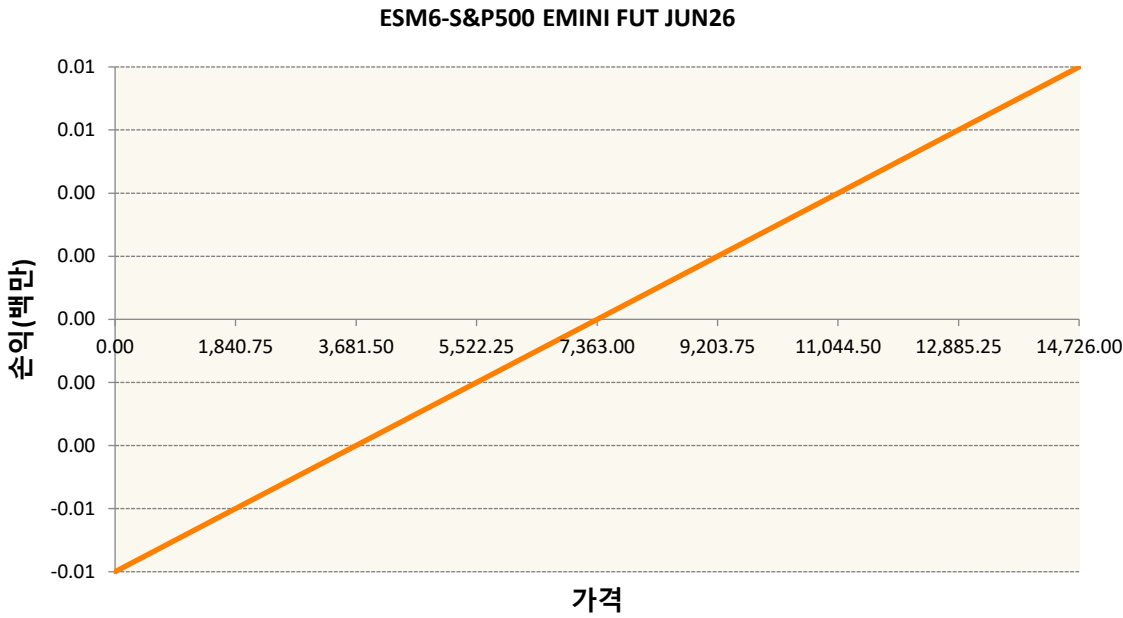
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,103	0	1,103	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	88
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

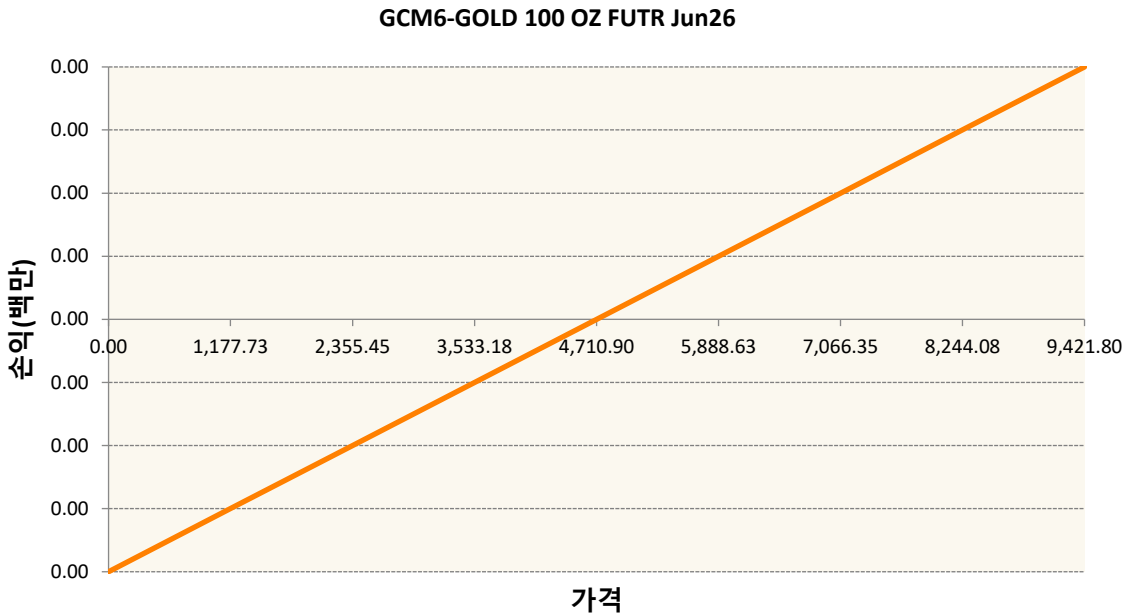
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,670	0	5,670	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	454

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

(단위:백만원)

581

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

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	491
AOPLTRSUP1 PLTR US 05/08/26 P155 EQUITY	48

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

(단위:백만원)

1,675

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

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	2026-05-11
기준일	2026-05-08

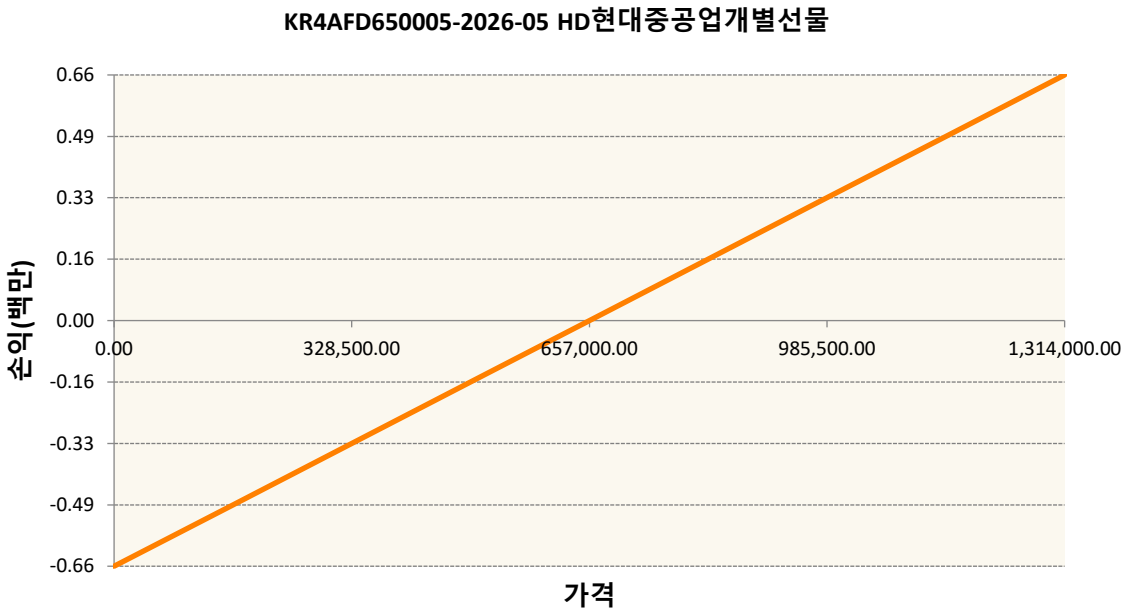
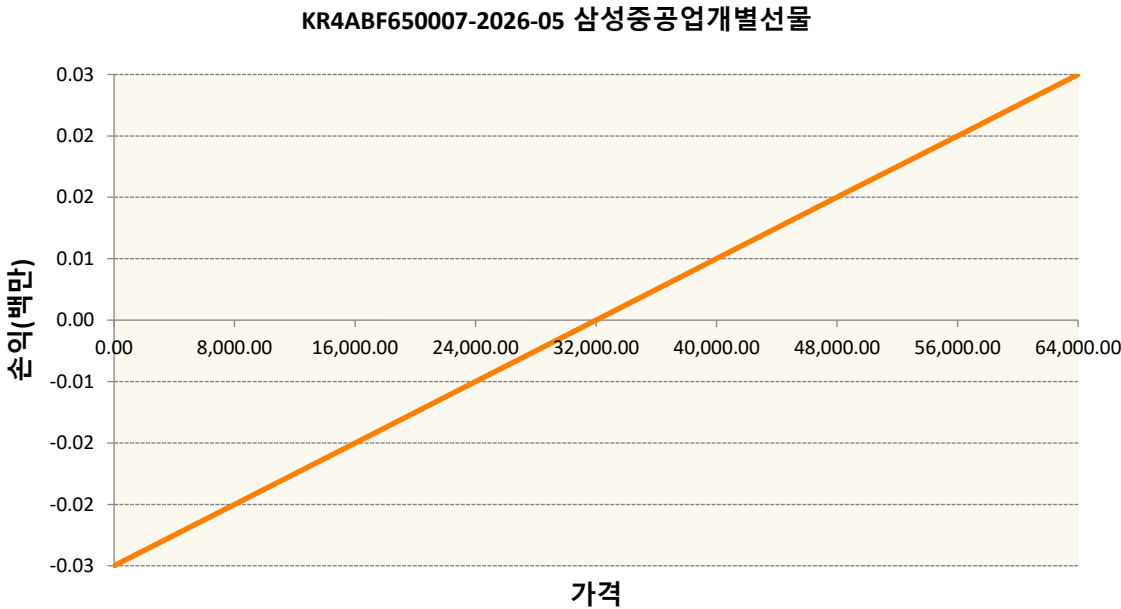
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

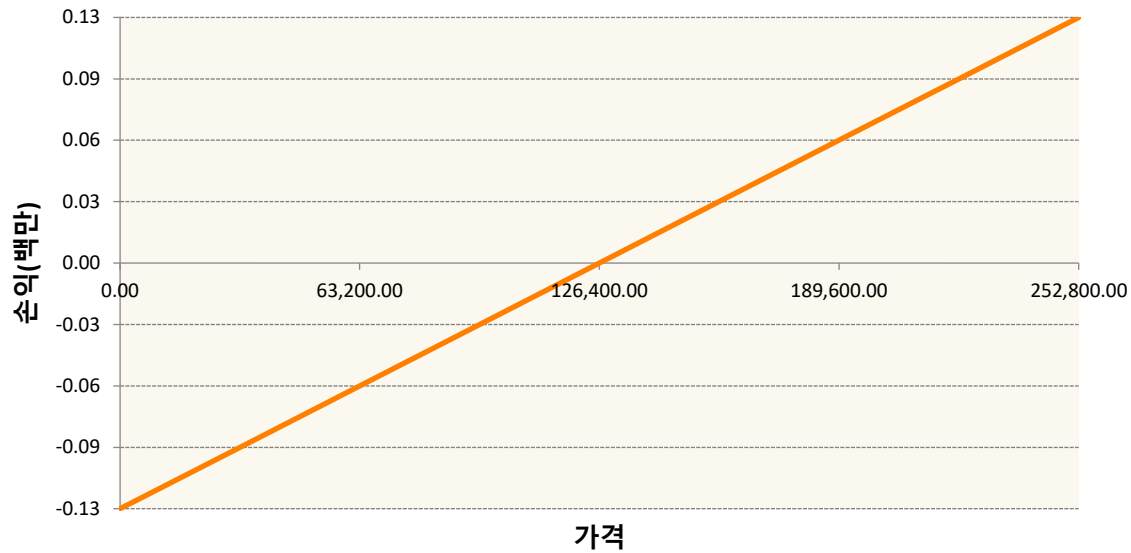
(단위:백만원)

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	34,256	0	34,256	장내
누계	유가증권	스왑	175,917	0	175,917	장외

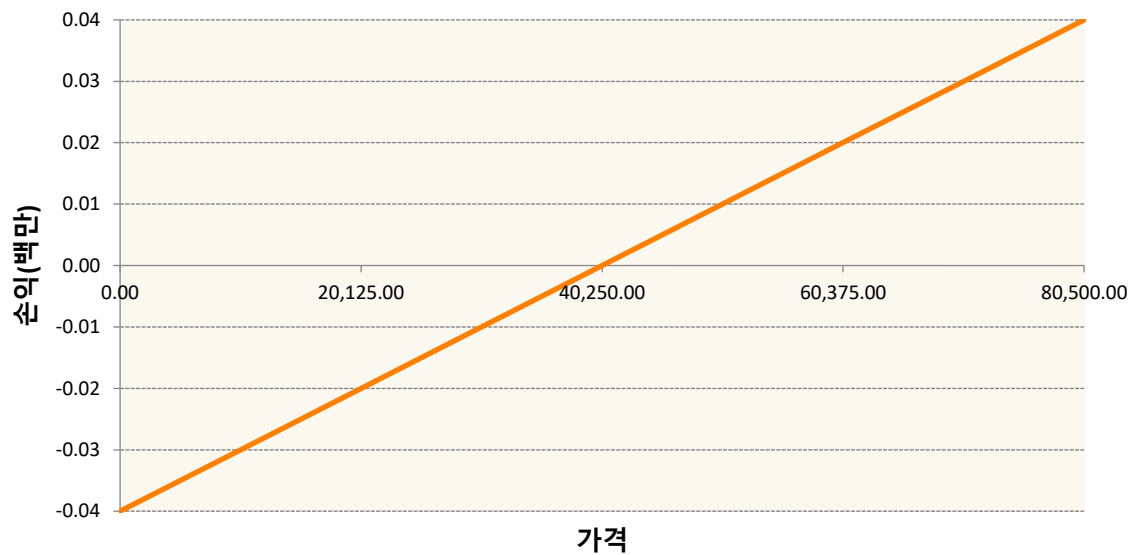
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007		2026-05 삼성중공업개별선물					1,176
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176	-1,176
-5.33%	-784	-784	-784	-784	-784	-784	-784
-2.67%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	392	392	392	392	392	392	392
5.33%	784	784	784	784	784	784	784
8.00%	1,176	1,176	1,176	1,176	1,176	1,176	1,176
KR4AFD650005		2026-05 HD현대중공업개별선물					1,000
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000	-1,000
-5.33%	-667	-667	-667	-667	-667	-667	-667
-2.67%	-333	-333	-333	-333	-333	-333	-333
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	333	333	333	333	333	333	333
5.33%	667	667	667	667	667	667	667
8.00%	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000
KR4AFV650003 2026-05 한화오션개별선물							563
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-563	-563	-563	-563	-563	-563	-563
-5.33%	-375	-375	-375	-375	-375	-375	-375
-2.67%	-188	-188	-188	-188	-188	-188	-188
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	188	188	188	188	188	188	188
5.33%	375	375	375	375	375	375	375
8.00%	563	563	563	563	563	563	563

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

(단위:백만원)

4,048

공시일 2026-05-11

기준일 2026-05-08

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	2026-05-11
기준일	2026-05-08

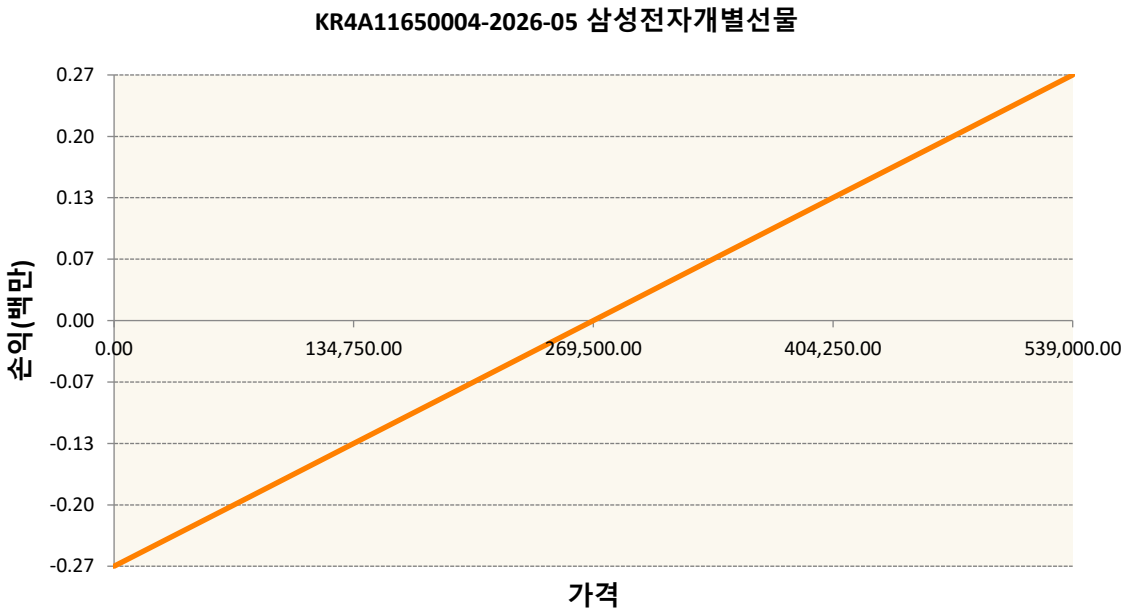
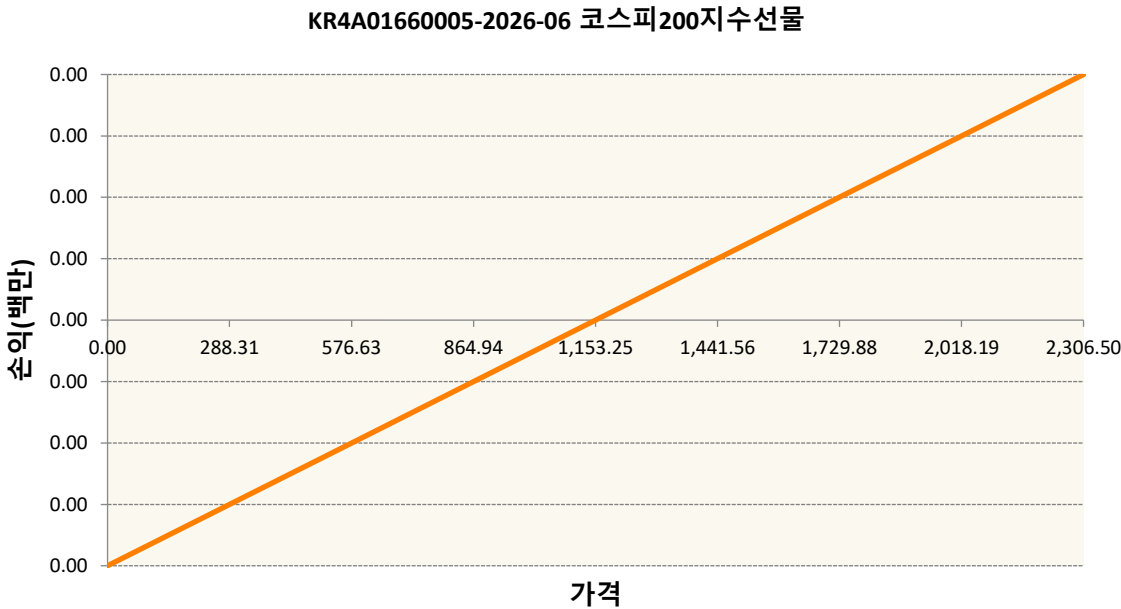
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,751	875	5,876	장내
누계	유가증권	선물	22,049	39,422	-17,373	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 2,300.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from 0.00 to 0.00. A blue line represents the profit function, starting at (0, 0.00) and ending at (2,300, 0.00). The line is straight, indicating a linear relationship between price and profit.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	0.00
287.50	-0.00
575.00	-0.00
862.50	-0.00
1,150.00	-0.00
1,437.50	-0.00
1,725.00	-0.00
2,012.50	-0.00
2,300.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 2,305.00 with major ticks every 288.13. The y-axis represents the net income, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid blue line starts at the origin (0, 0) and ends at the point (2,305, 0), indicating that the net income is zero at a price of 2,305.00.

가액	순익 (백만)
0.00	0.00
288.13	0.00
576.25	0.00
864.38	0.00
1,152.50	0.00
1,440.63	0.00
1,728.75	0.00
2,016.88	0.00
2,305.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				599
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-599	-599	-599	-599	-599	-599	-599	
-5.33%	-399	-399	-399	-399	-399	-399	-399	
-2.67%	-200	-200	-200	-200	-200	-200	-200	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	200	200	200	200	200	200	200	
5.33%	399	399	399	399	399	399	399	
8.00%	599	599	599	599	599	599	599	
KR4A11650004				2026-05 삼성전자개별선물				1,160
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160	-1,160
-5.33%	-773	-773	-773	-773	-773	-773	-773
-2.67%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	387	387	387	387	387	387	387
5.33%	773	773	773	773	773	773	773
8.00%	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160	1,160
KR4BAFBCA614 코스피위클리M C 2605W2 1,150.0							1,888

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,888	1,888	1,888	1,888	1,888	1,888	1,888
-5.33%	1,259	1,259	1,259	1,259	1,259	1,259	1,259
-2.67%	629	629	629	629	629	629	629
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-629	-629	-629	-629	-629	-629	-629
5.33%	-1,259	-1,259	-1,259	-1,259	-1,259	-1,259	-1,259
8.00%	-1,888	-1,888	-1,888	-1,888	-1,888	-1,888	-1,888

KR4BAFBCA622 코스피위클리M C 2605W2 1,152.5							1,266
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,266	1,266	1,266	1,266	1,266	1,266	1,266
-5.33%	844	844	844	844	844	844	844
-2.67%	422	422	422	422	422	422	422
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-422	-422	-422	-422	-422	-422	-422
5.33%	-844	-844	-844	-844	-844	-844	-844
8.00%	-1,266	-1,266	-1,266	-1,266	-1,266	-1,266	-1,266

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

(단위:백만원)

11,266

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

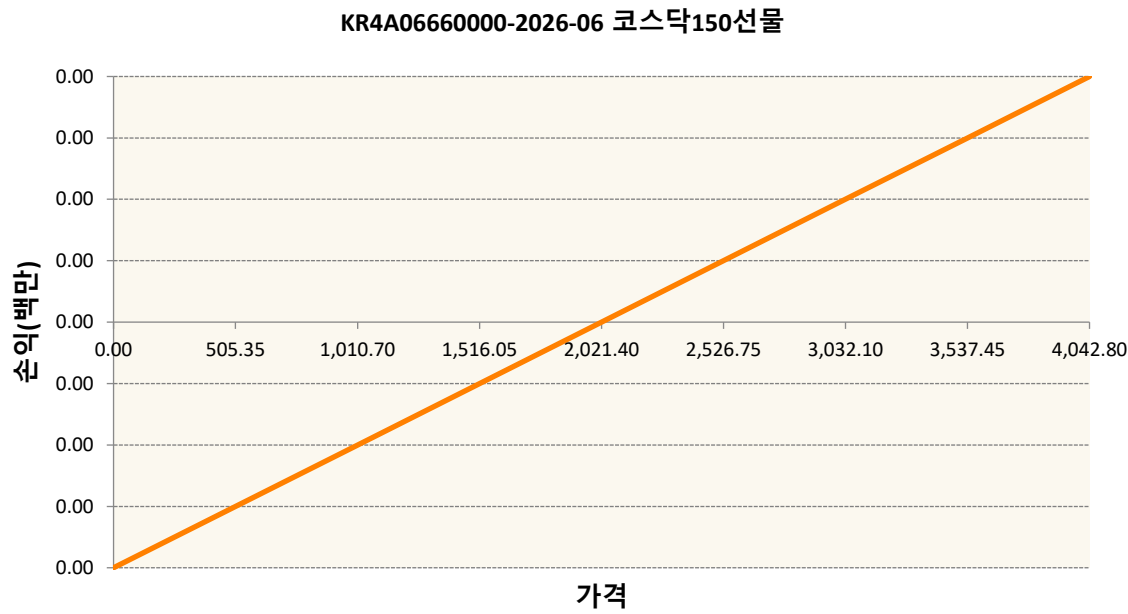
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	910	0	910	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	2026-05-11
기준일	2026-05-08

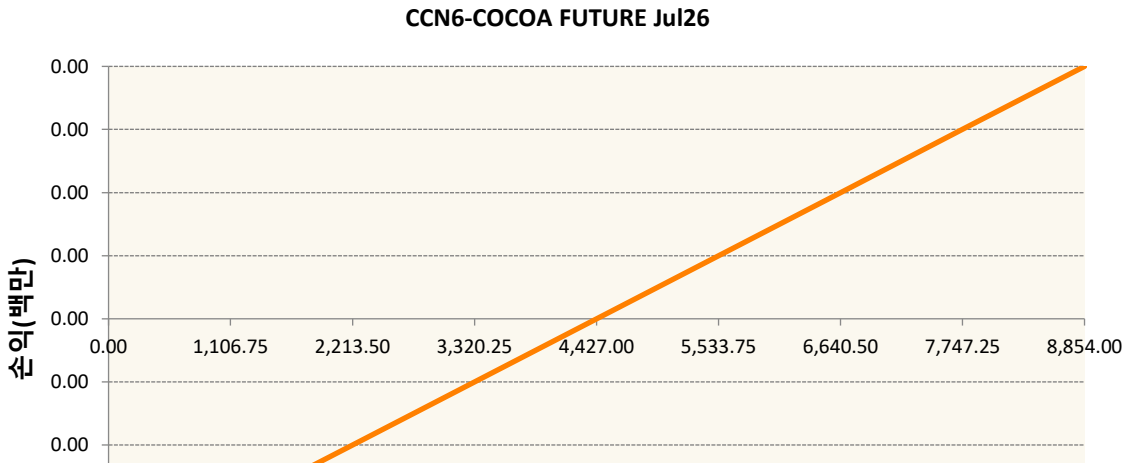
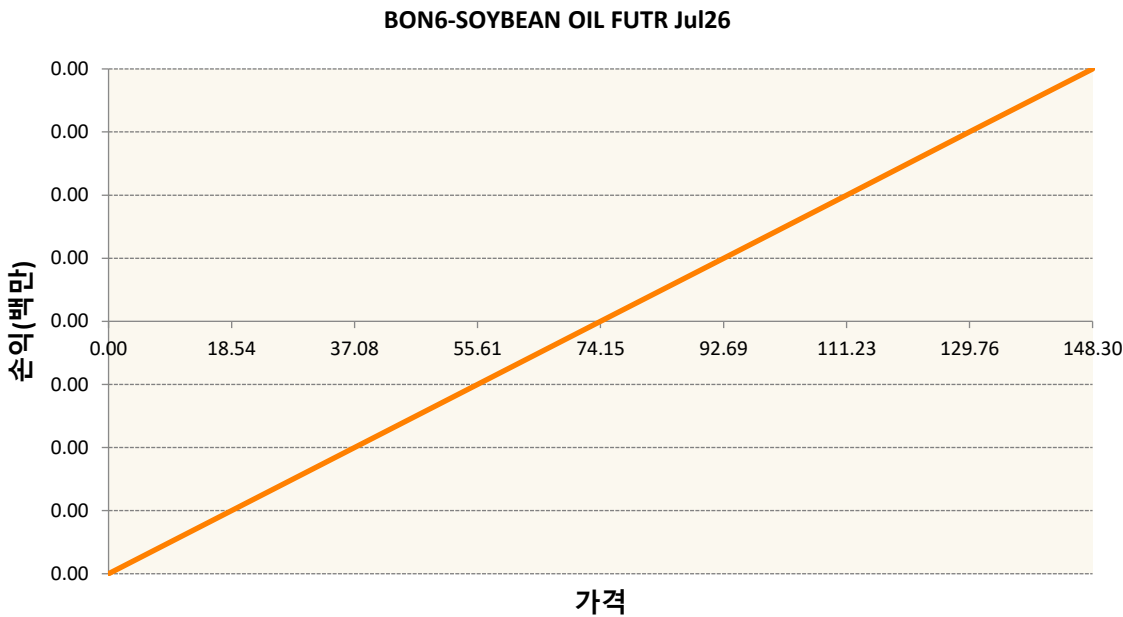
포커스농산물모(채권-파생형)

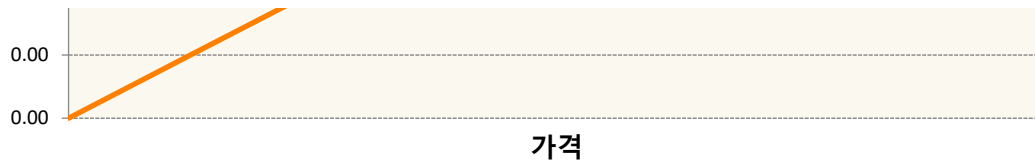
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

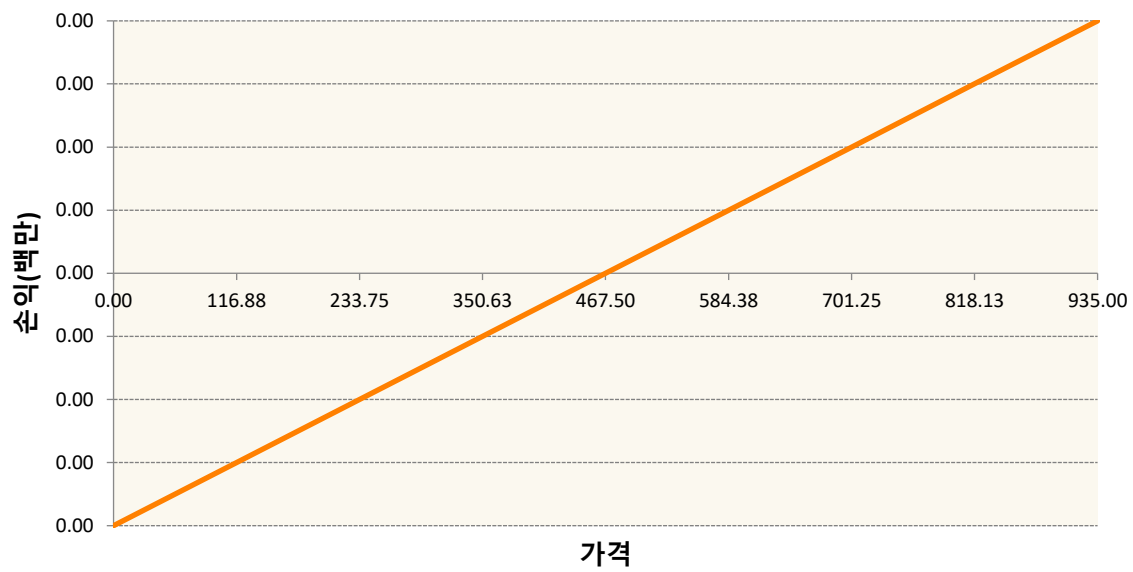
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	29	0	29	장내
누계	실물자산	선물	66	0	66	
누계	실물자산	선물	895	0	895	장내
누계	유가증권	선물	2,022	0	2,022	
누계	통화	선물	0	382	-382	장내

2. 만기시점의 손익구조

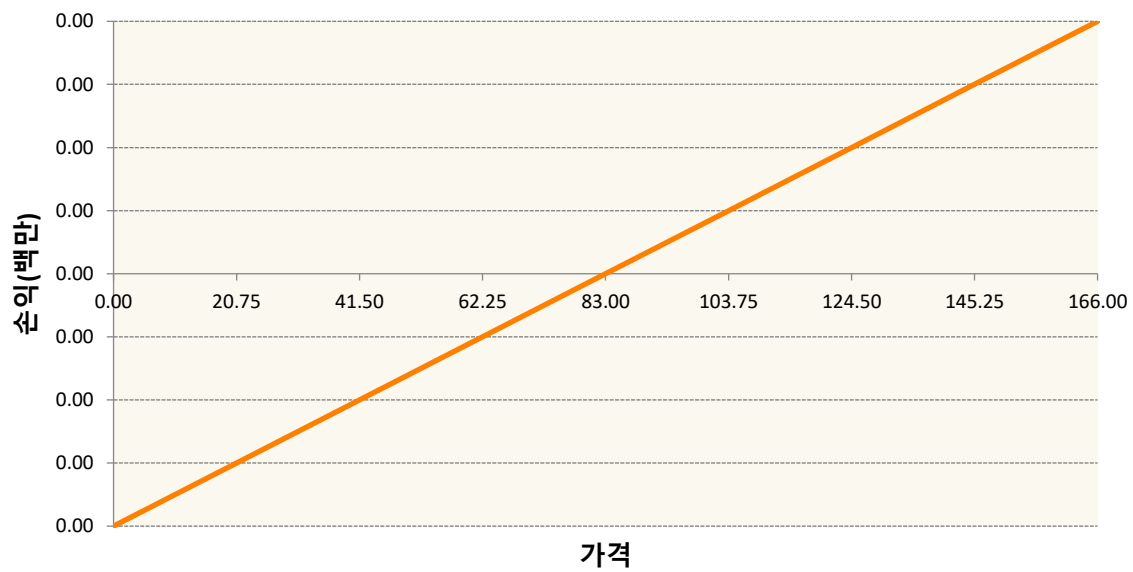




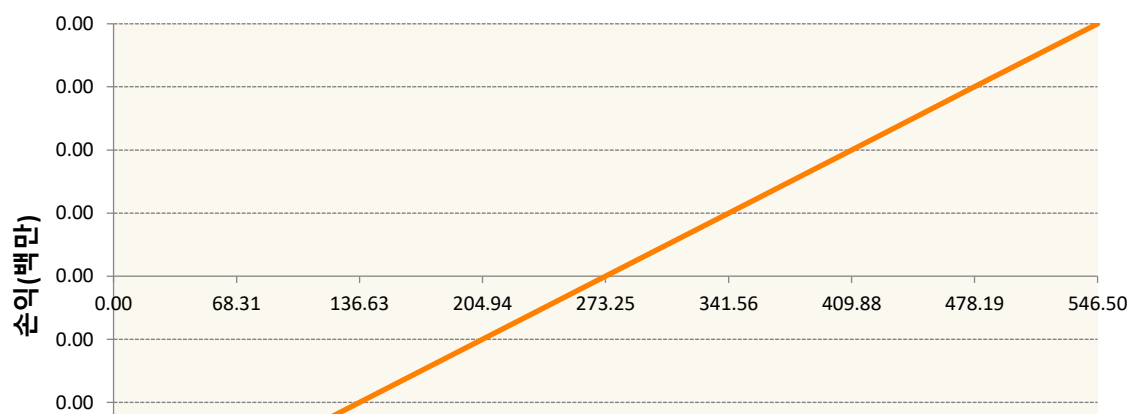
CN6-CORN FUTURE Jul26

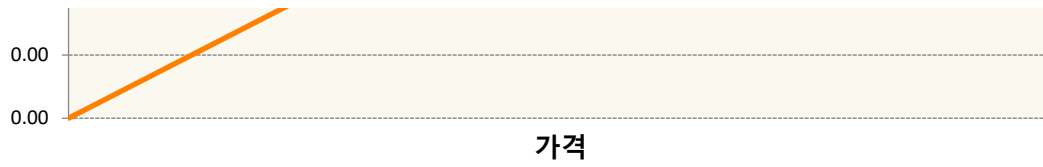


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

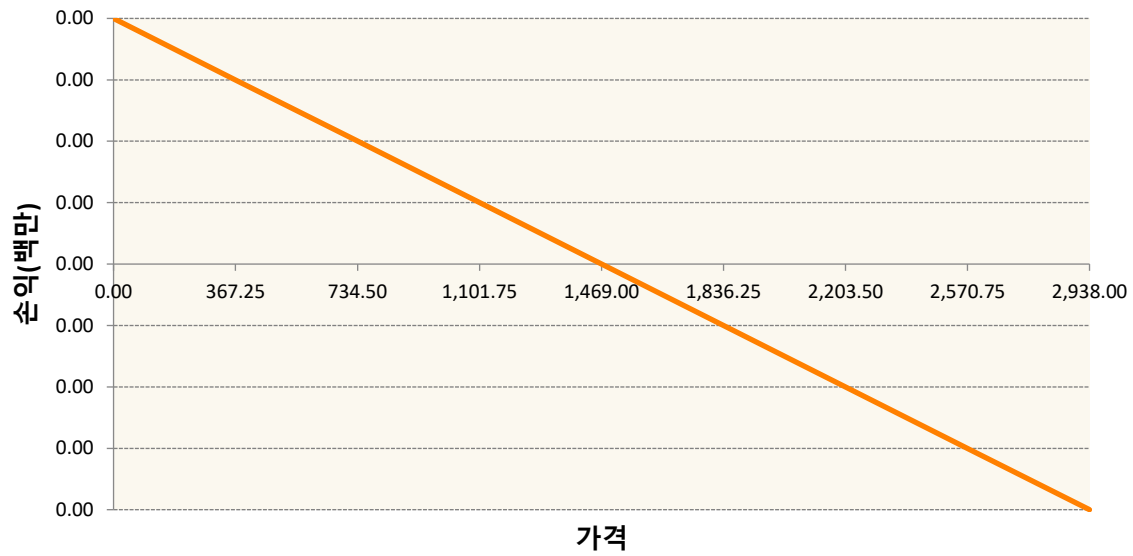


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

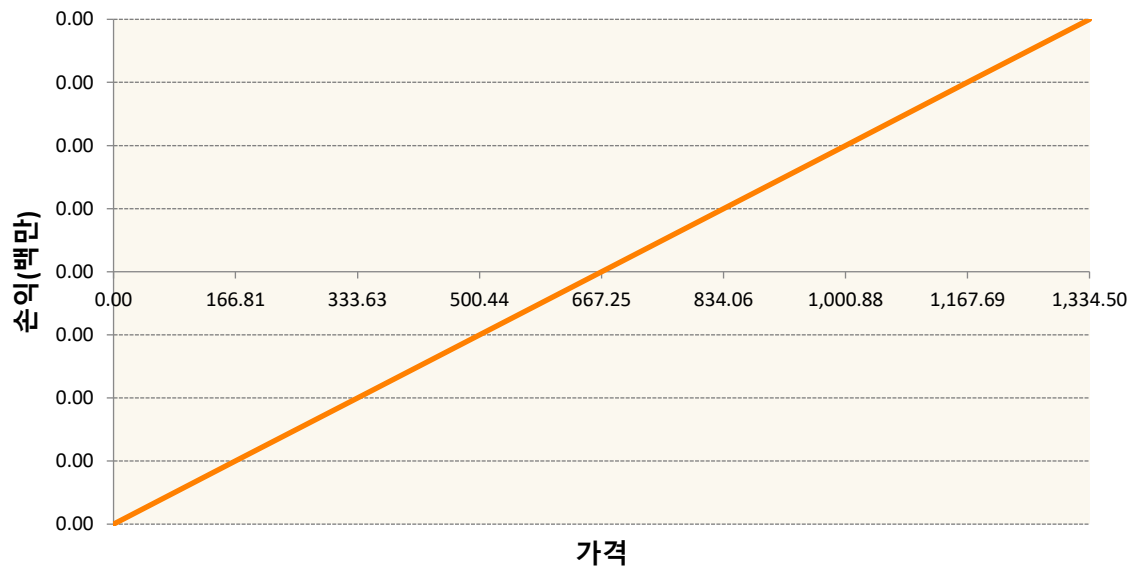




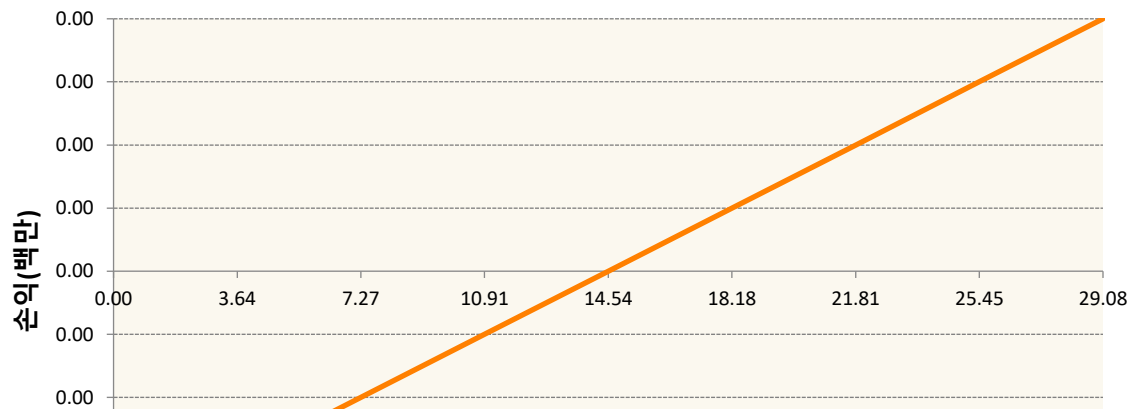
KR4A75650007-2026-05 달러선물

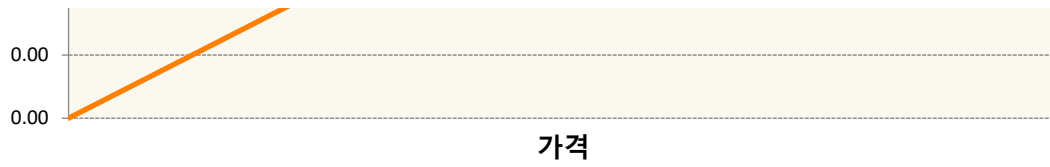


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

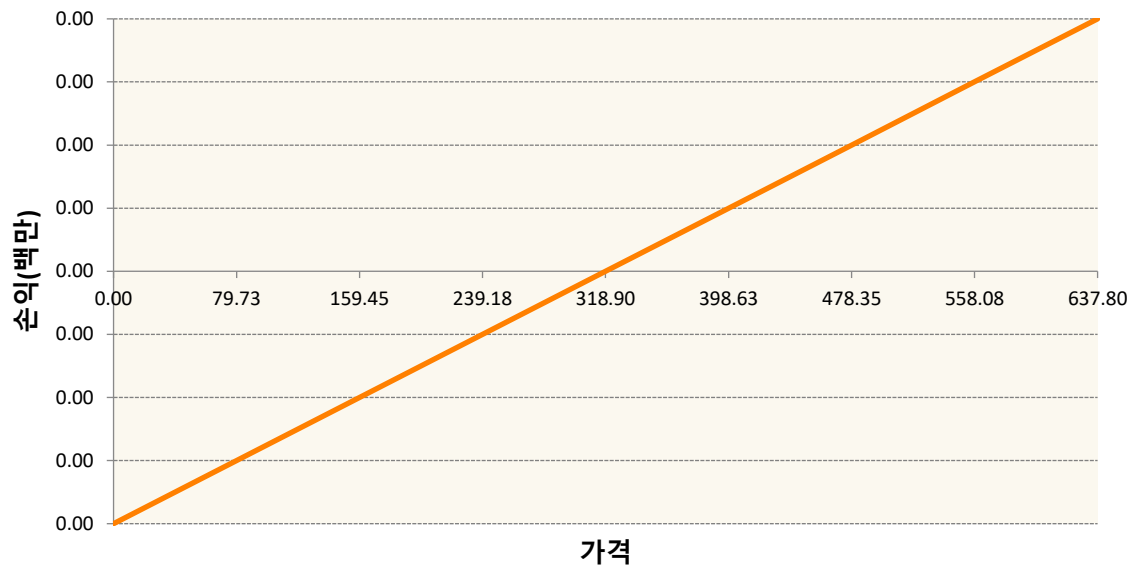


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

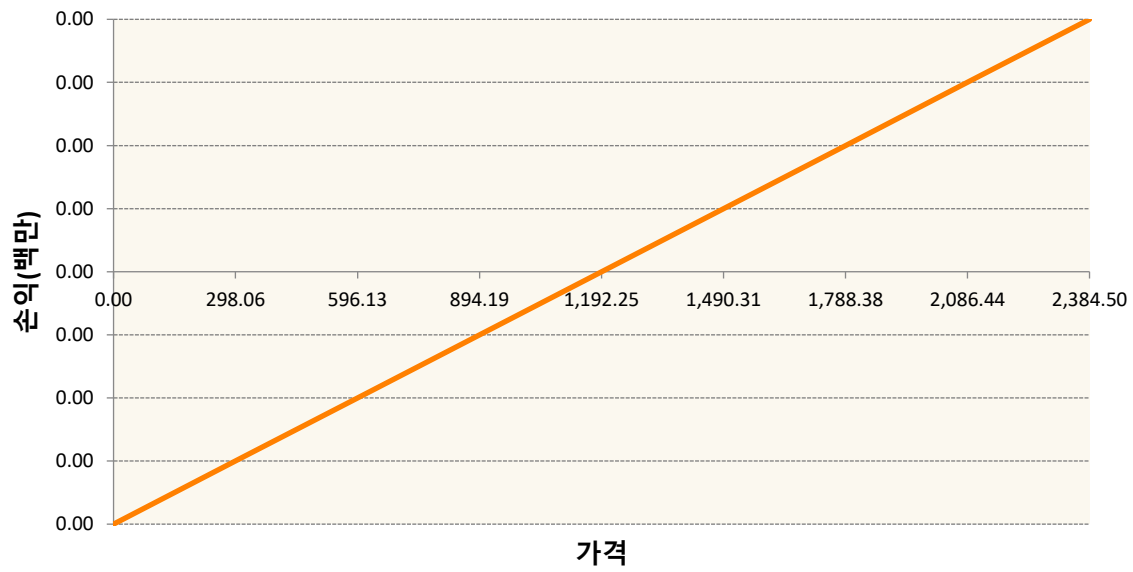




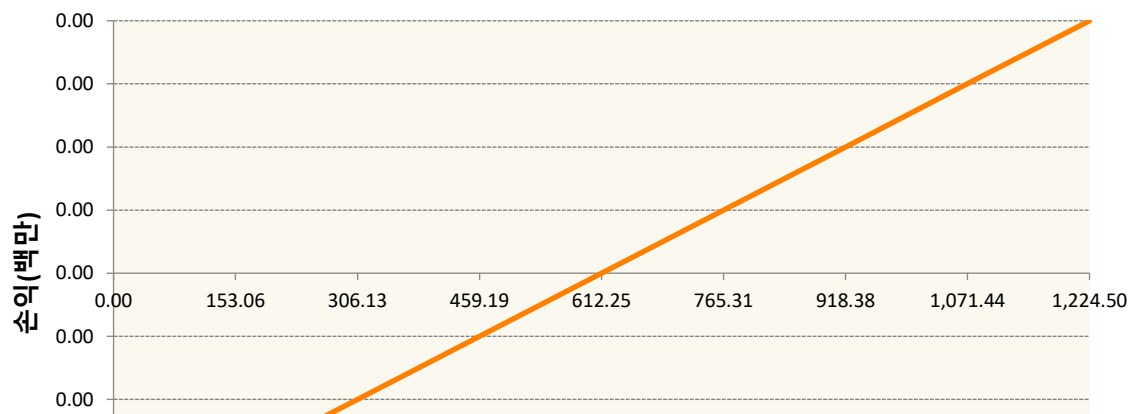
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

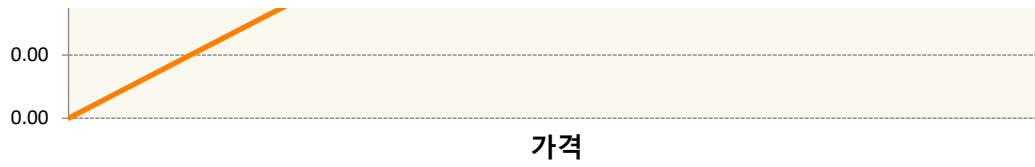


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-05-11
기준일	2026-05-08

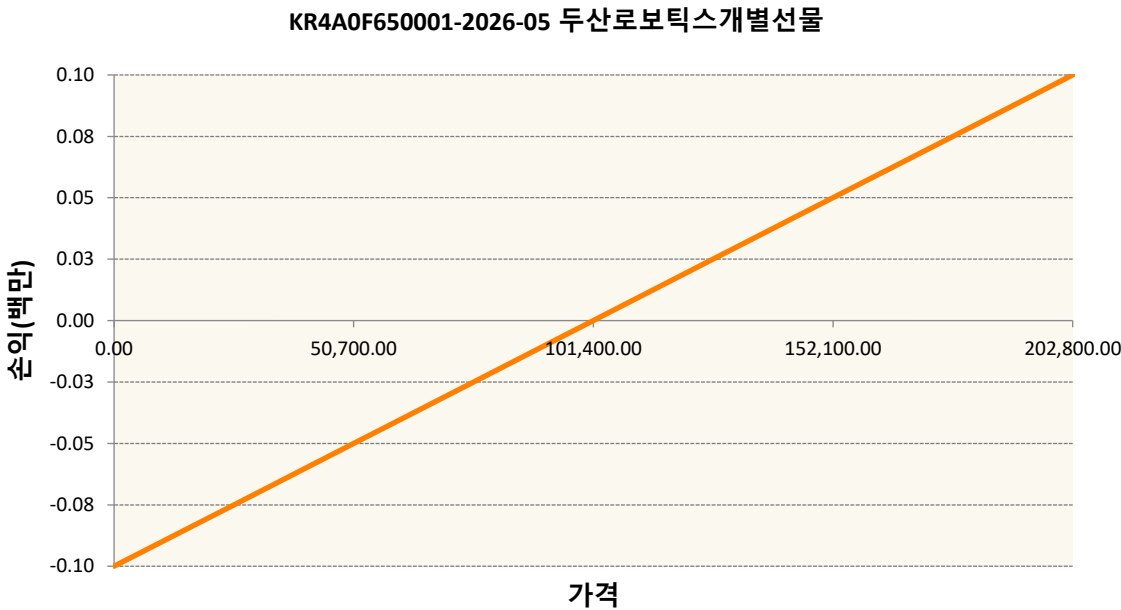
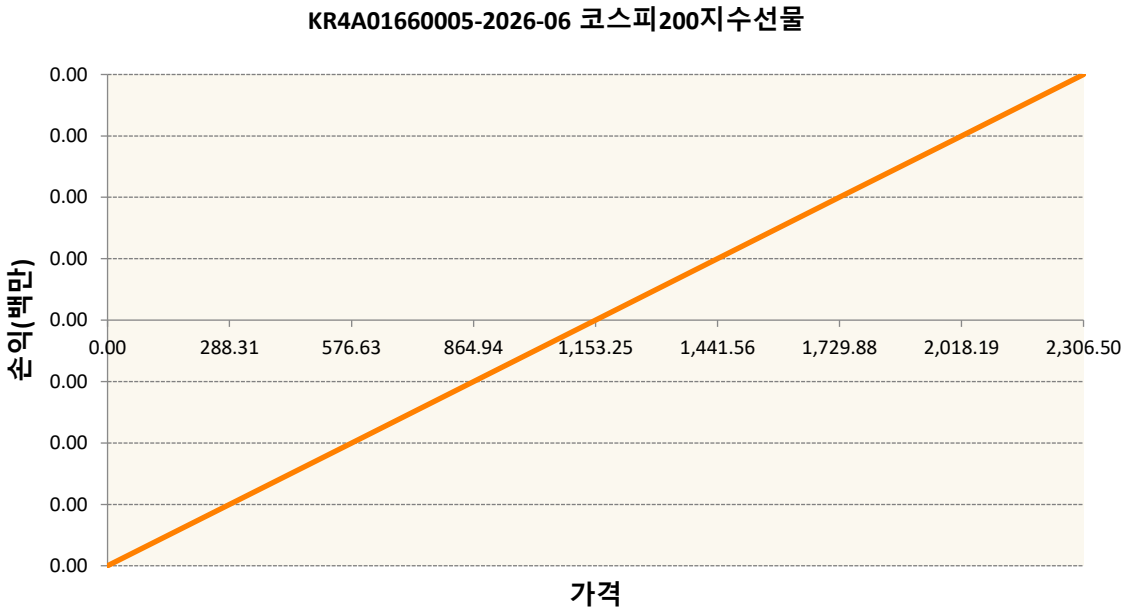
스마트인덱스모

1. 계약금액

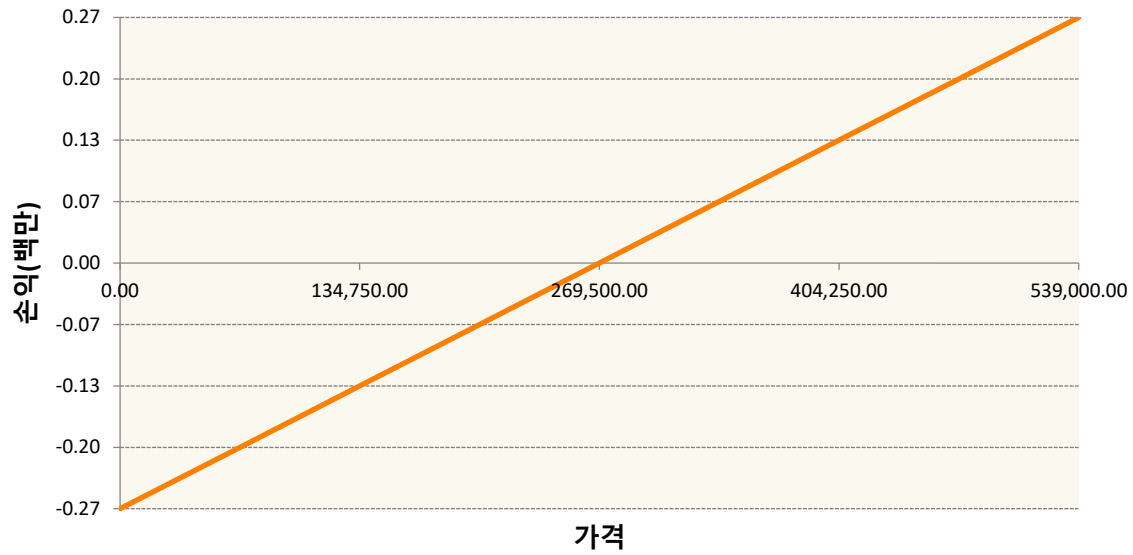
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,563	0	2,563	장내

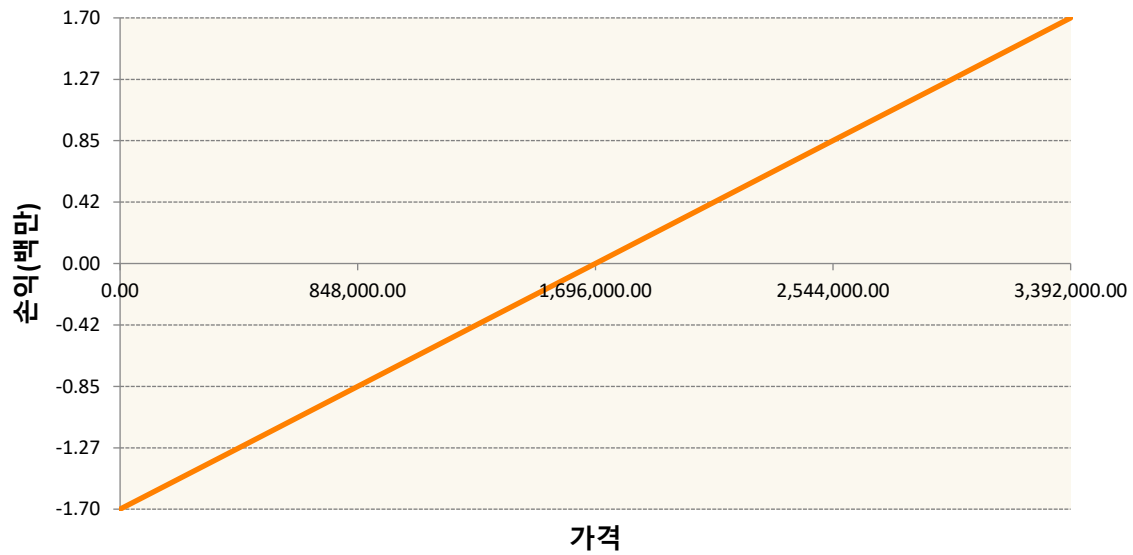
2. 만기시점의 손익구조



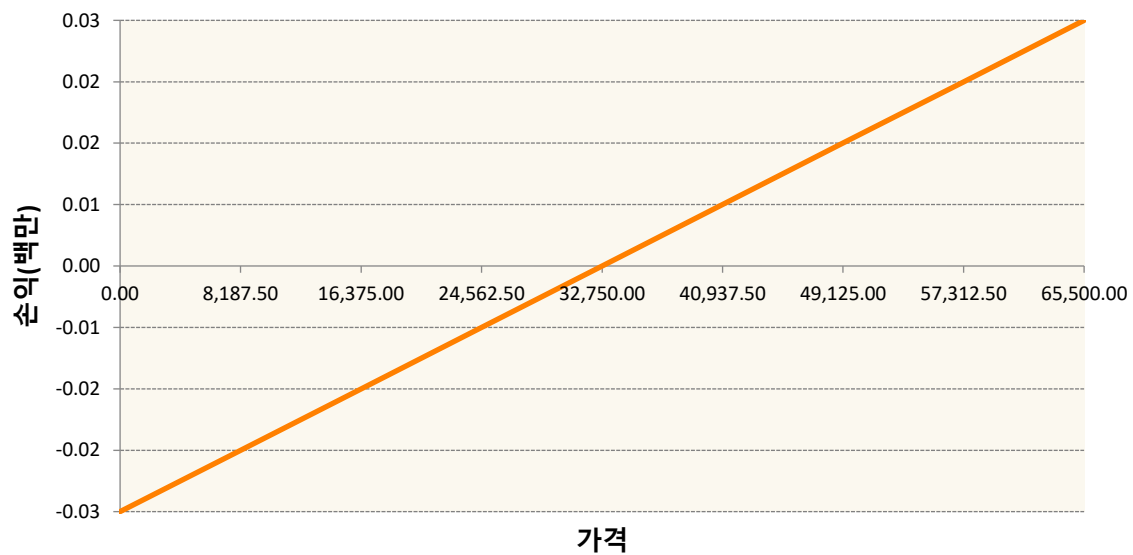
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		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	-138	
-5.33%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92	
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	46	46	46	46	46	46	46	46	
5.33%	92	92	92	92	92	92	92	92	
8.00%	138	138	138	138	138	138	138	138	
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	0	
5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0	
8.00%	1	1	1	1	1	1	1	1	
KR4A11650004							2026-05 삼성전자개별선물		49
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	32	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	49	49	49	49	49	49	49	49	
KR4A50650006							2026-05 SK하이닉스개별선물		15
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	
-5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	5	5	5	5	5	5	5	5	
5.33%	10	10	10	10	10	10	10	10	
8.00%	15	15	15	15	15	15	15	15	
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)

484

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

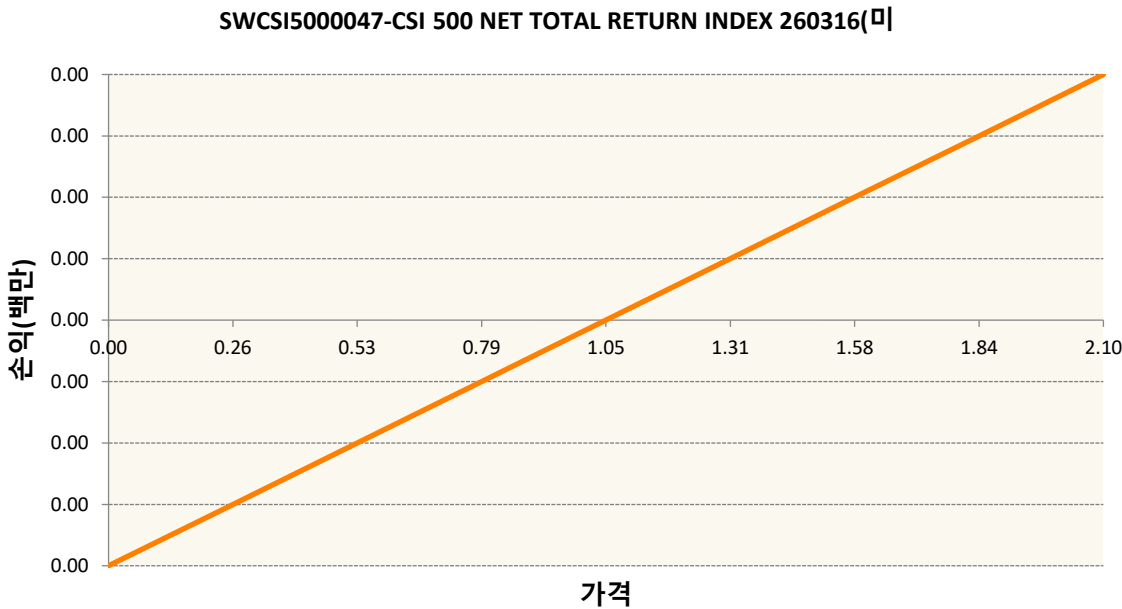
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,926	0	5,926	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

475

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

590

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

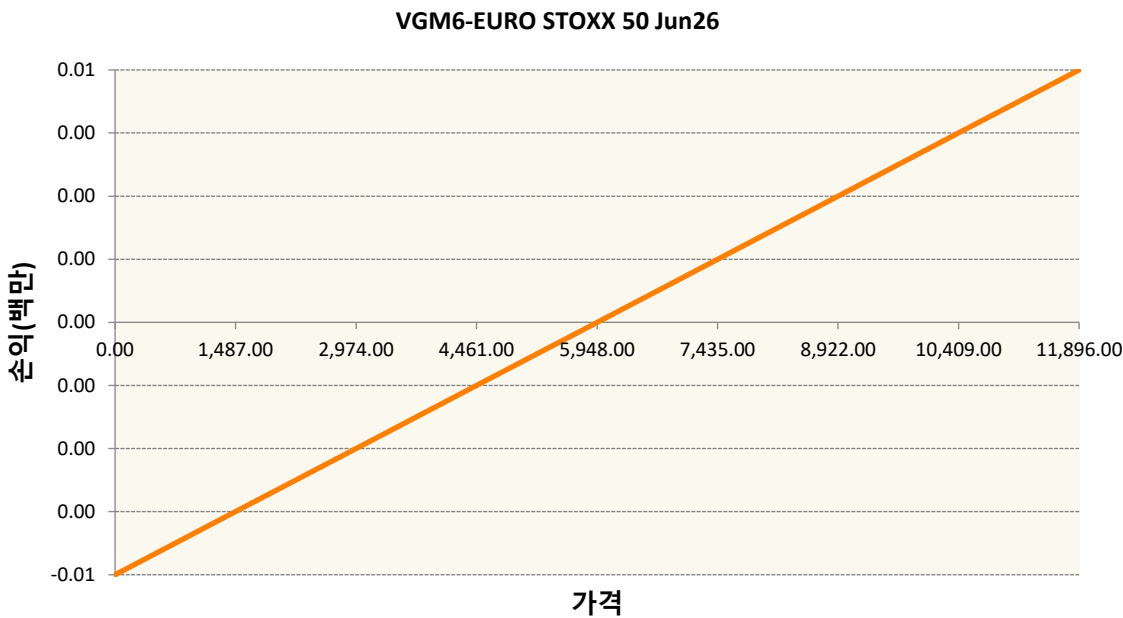
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	917	0	917	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	73
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

64

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

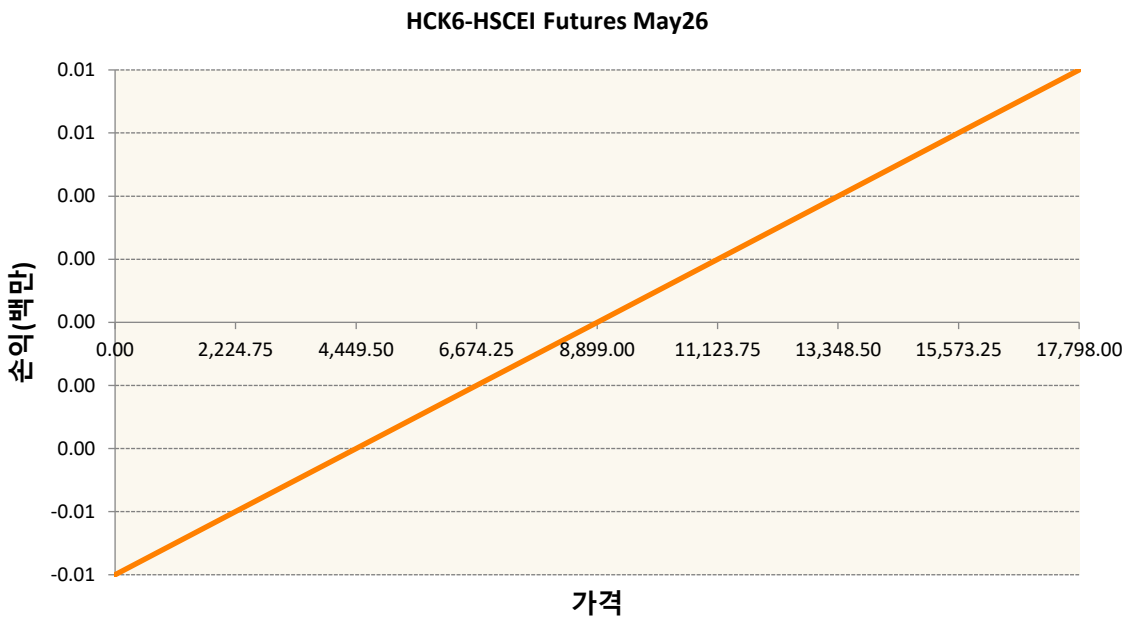
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,673	0	1,673	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK6	HSCEI Futures May26	134
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

161

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

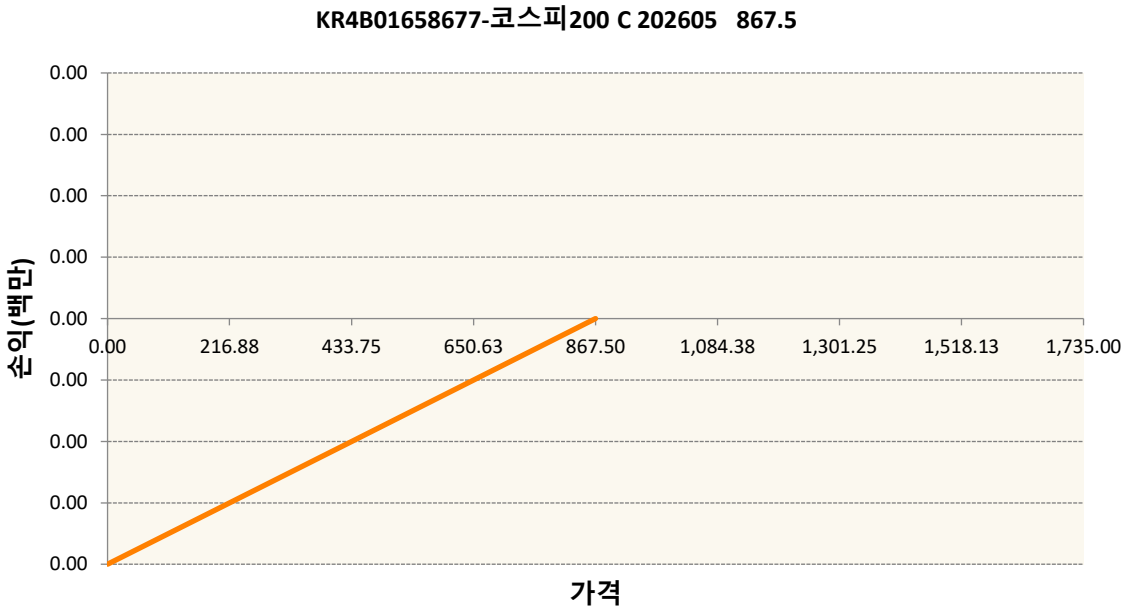
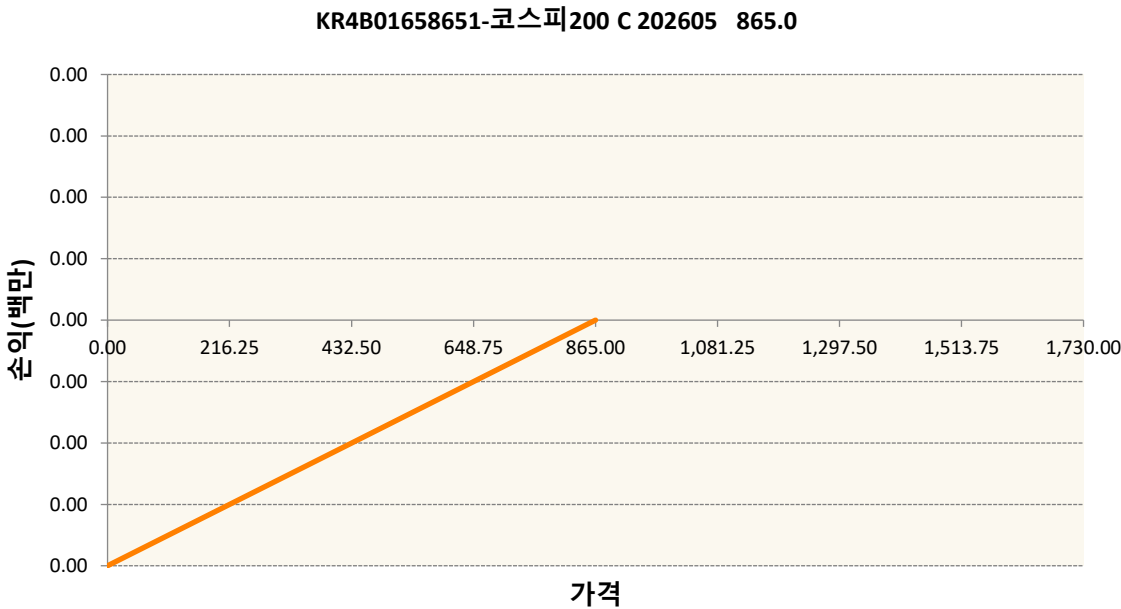
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

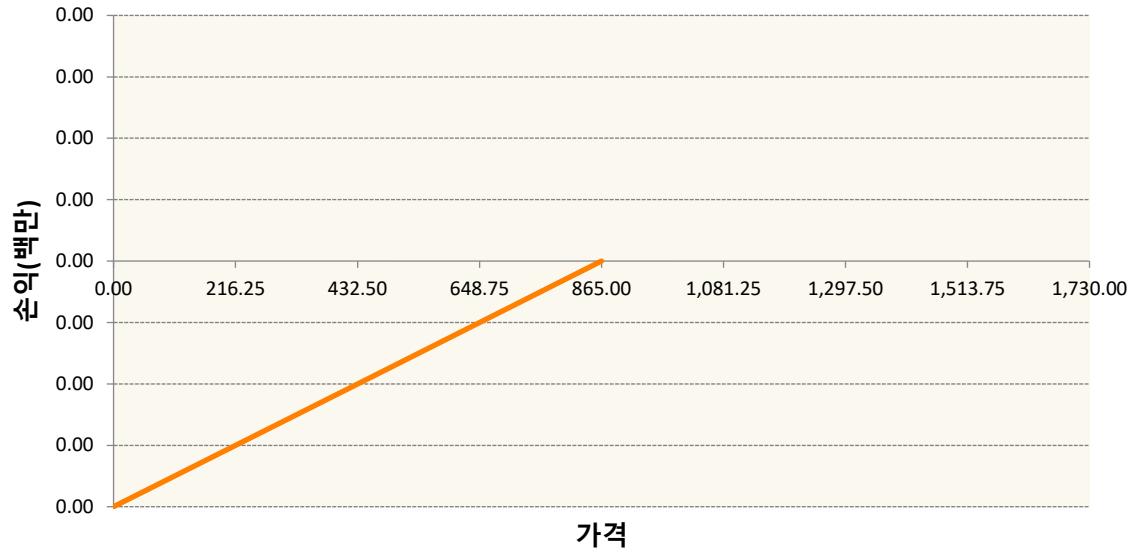
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	30,091	-30,091	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0 9

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	-1	-2	-3	-6	-9
-5.33%	0	0	0	0	-1	-2	-4
-2.67%	0	0	0	0	0	-1	-2
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5 9

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	-1	-2	-3	-6	-9
-5.33%	0	0	0	0	-1	-2	-4
-2.67%	0	0	0	0	0	-1	-2
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0

KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0 4

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	-1	-2	-3	-4
-5.33%	0	0	0	0	-1	-1	-2
-2.67%	0	0	0	0	0	0	-1
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%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

2

공시일 2026-05-11

기준일 2026-05-08

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	2026-05-11
기준일	2026-05-08

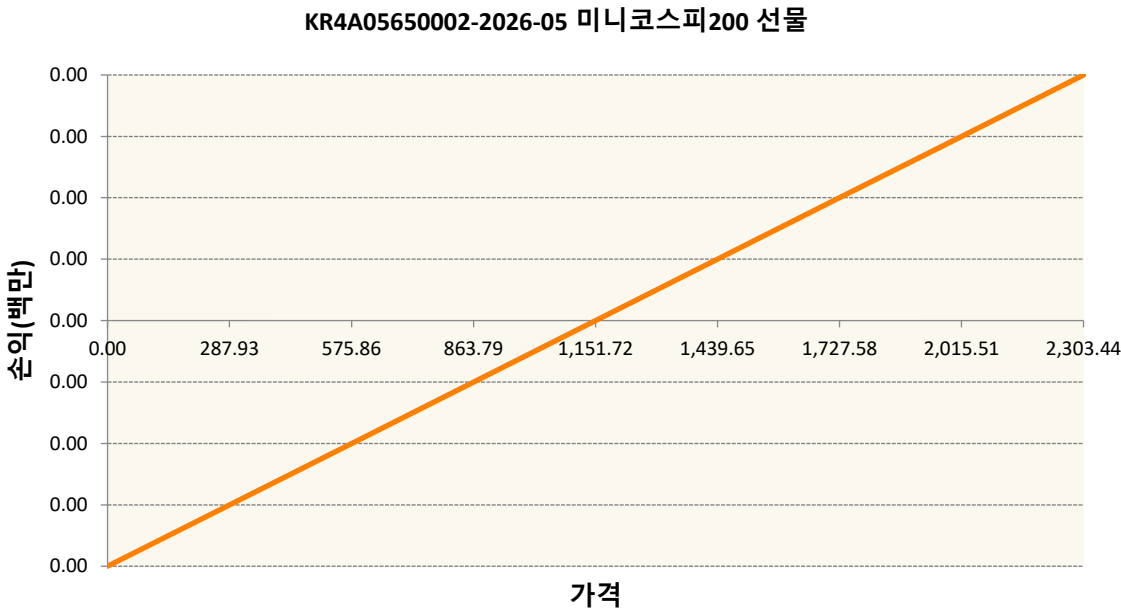
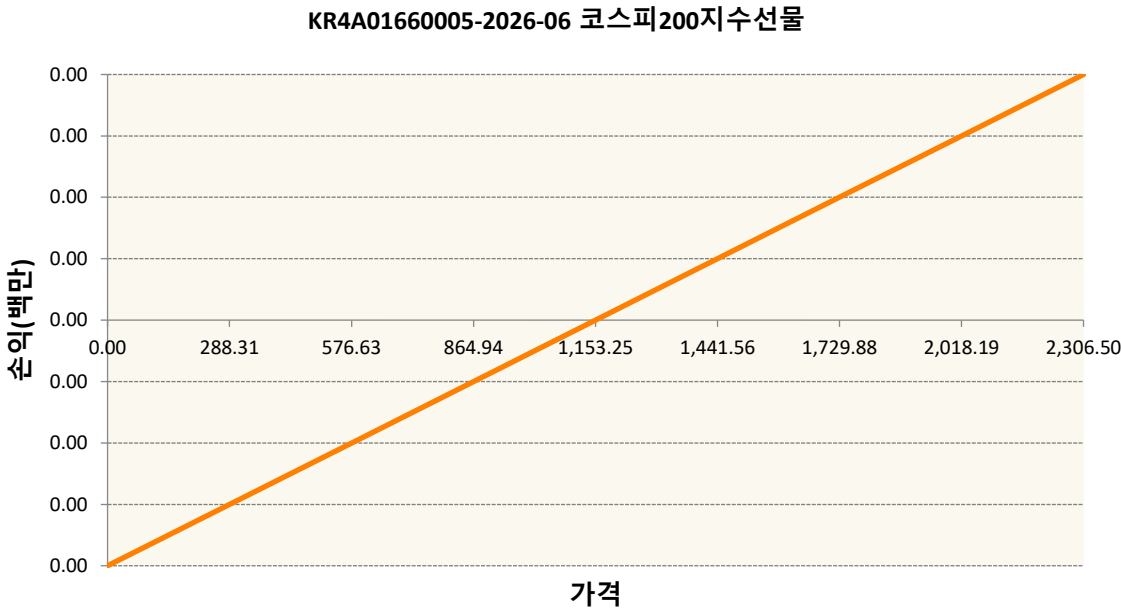
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

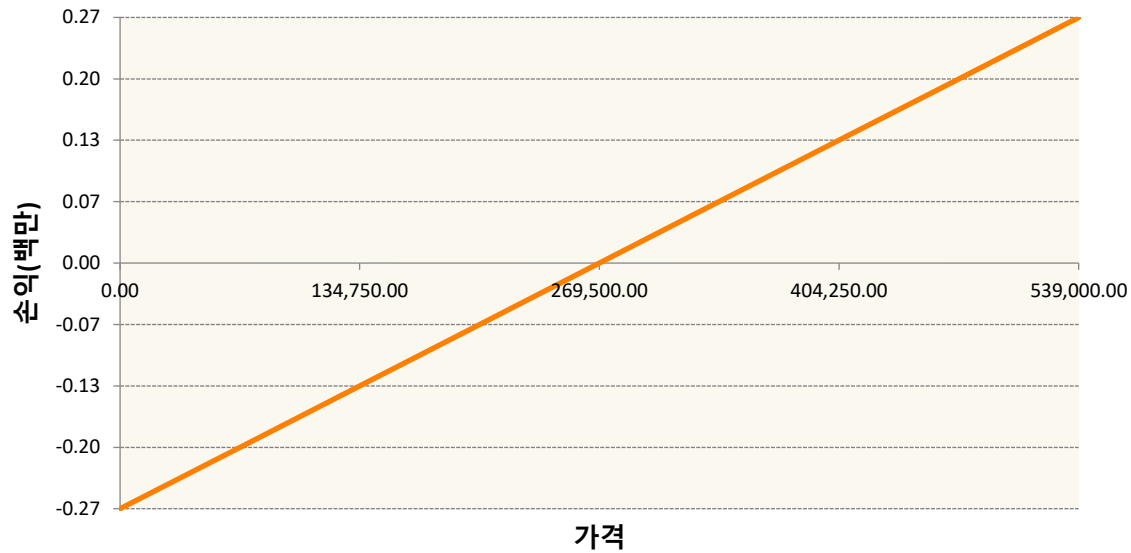
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	288	-288	장내
누계	유가증권	선물	2,177	0	2,177	장내

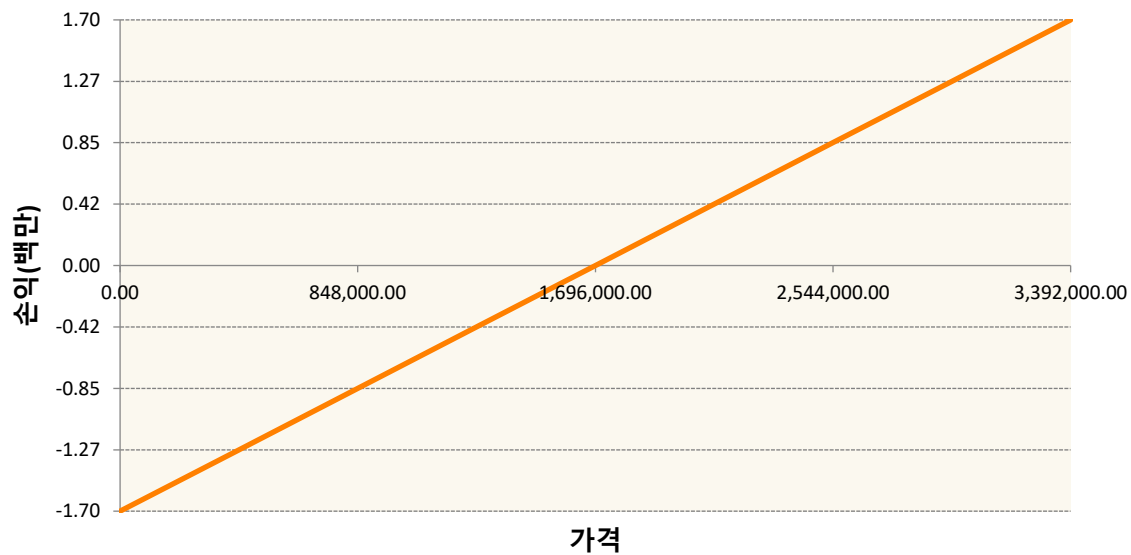
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					115
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-115	-115	-115	-115	-115	-115	-115
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-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%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	115	115	115	115	115	115	115
KR4A05650002		2026-05 미니코스피200 선물					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

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

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%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-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%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

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

(단위:백만원)

310

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

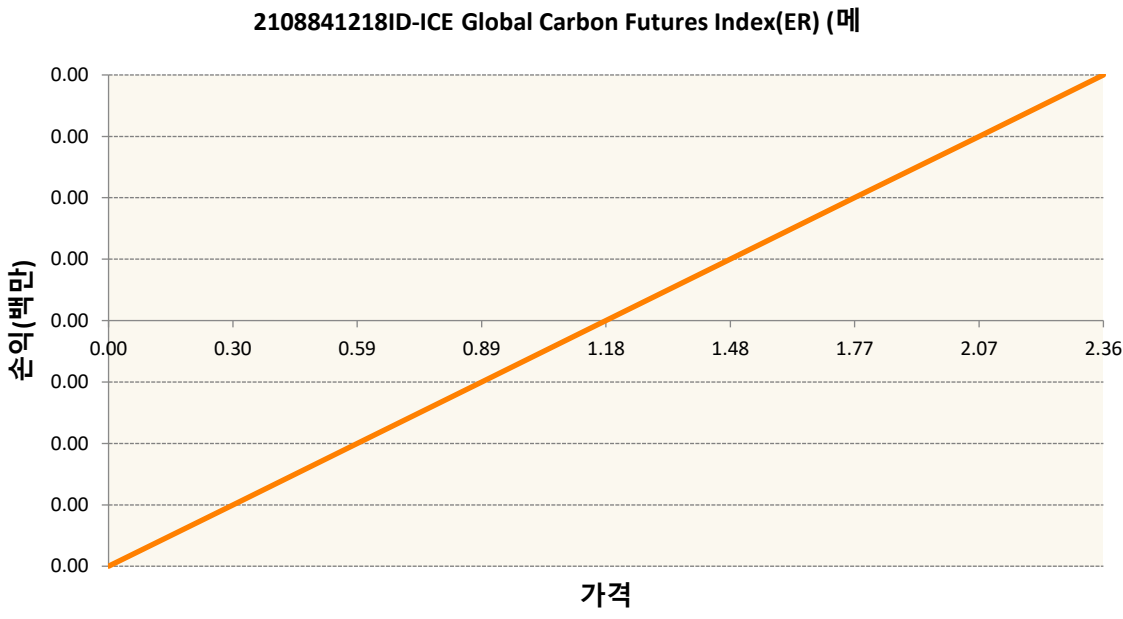
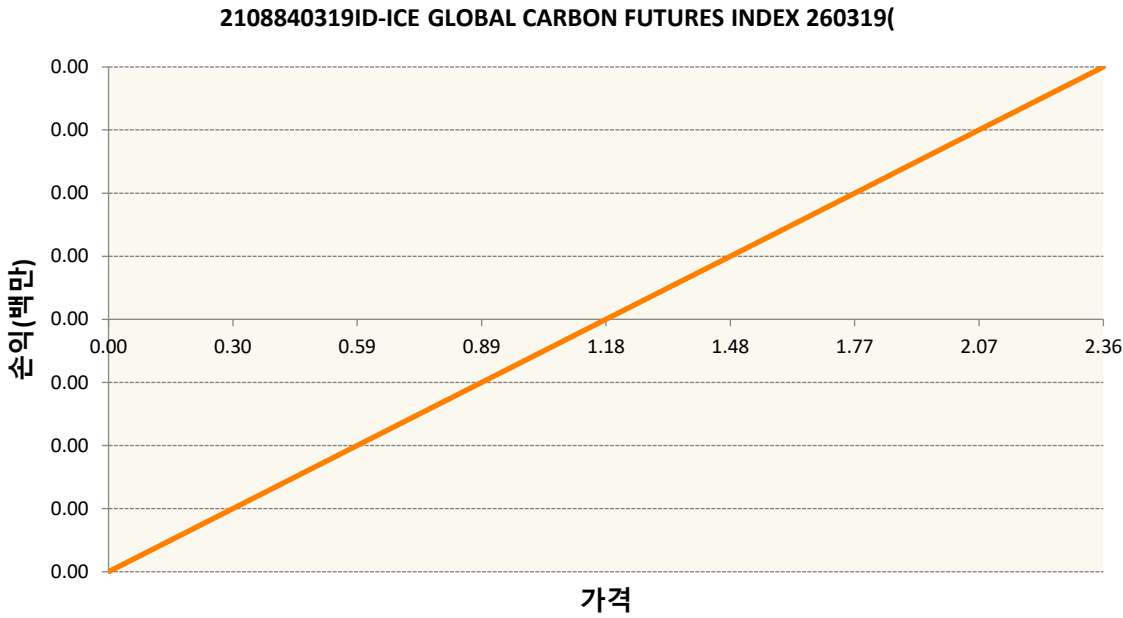
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,781	0	6,781	장외

2. 만기시점의 손익구조



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

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		622

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

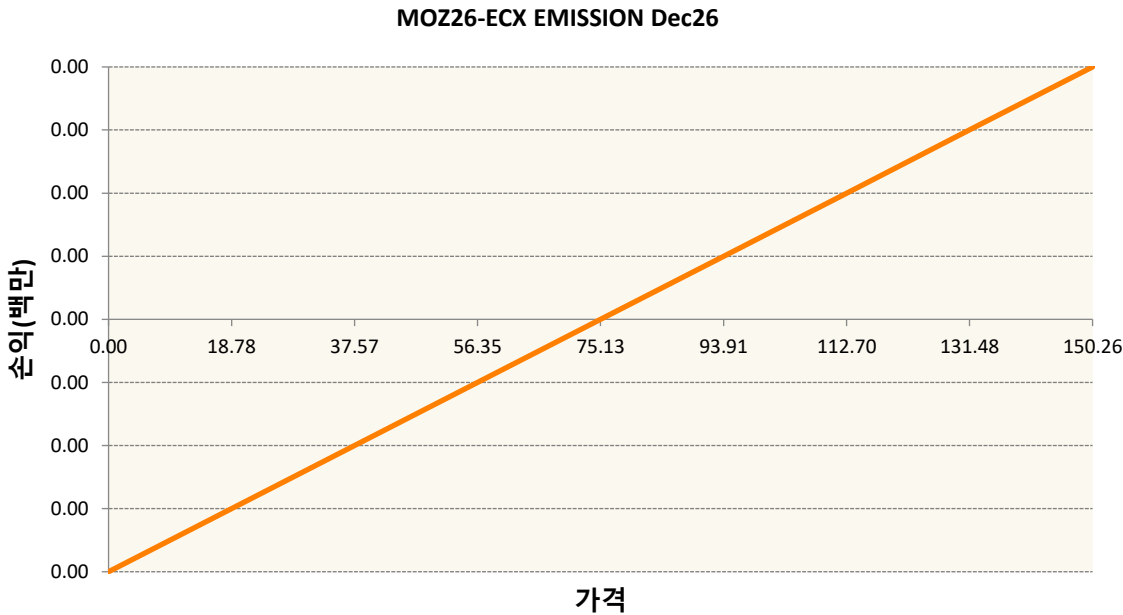
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,848	0	4,848	
누계	통화	선도	0	2,358	-2,358	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	189
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	388

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

(단위:백만원)

671

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

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	1,879	0	1,879	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	4
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	3
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	6
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	3

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

(단위:백만원)

23

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

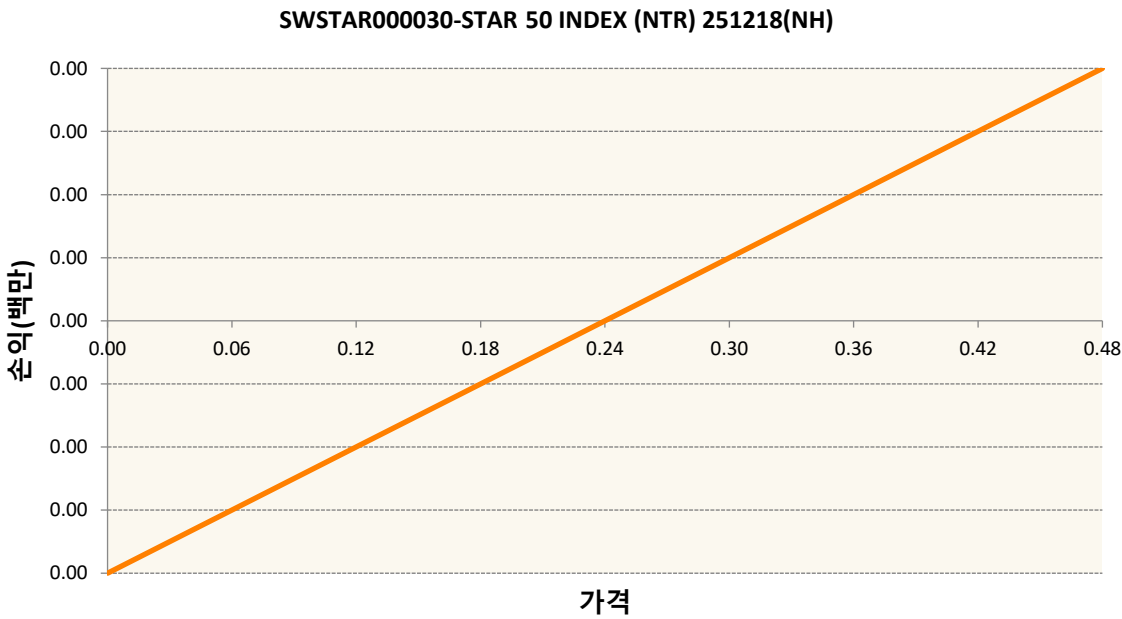
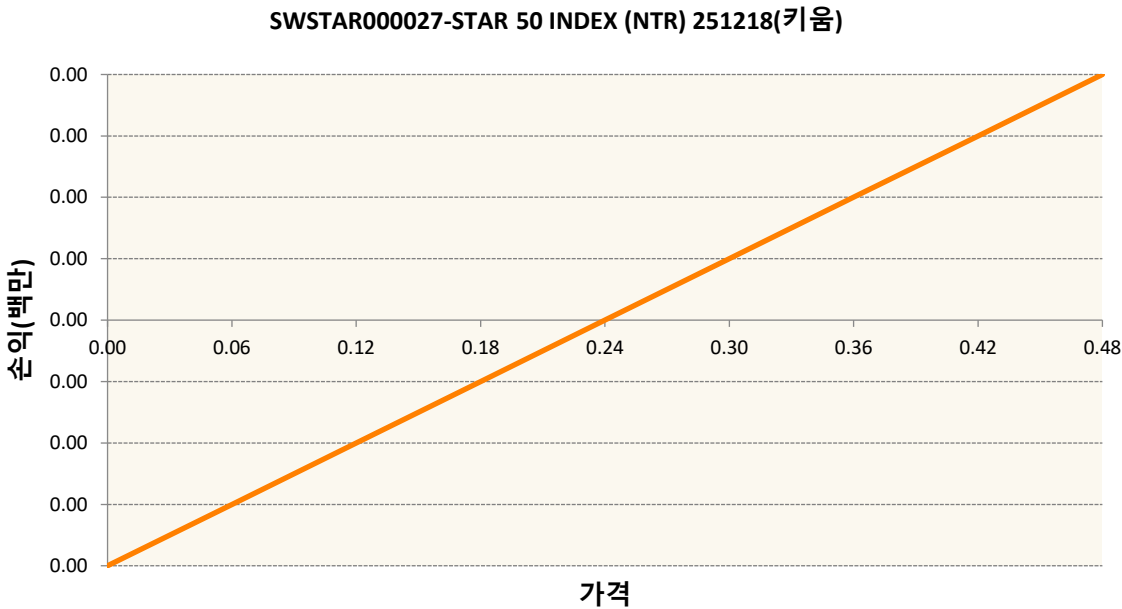
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

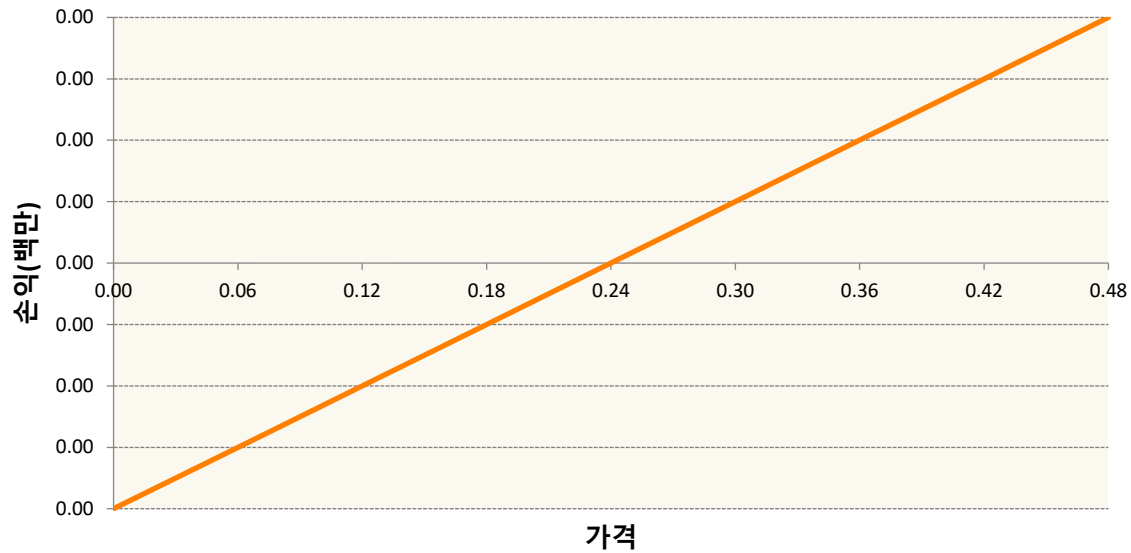
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,071	0	6,071	장외

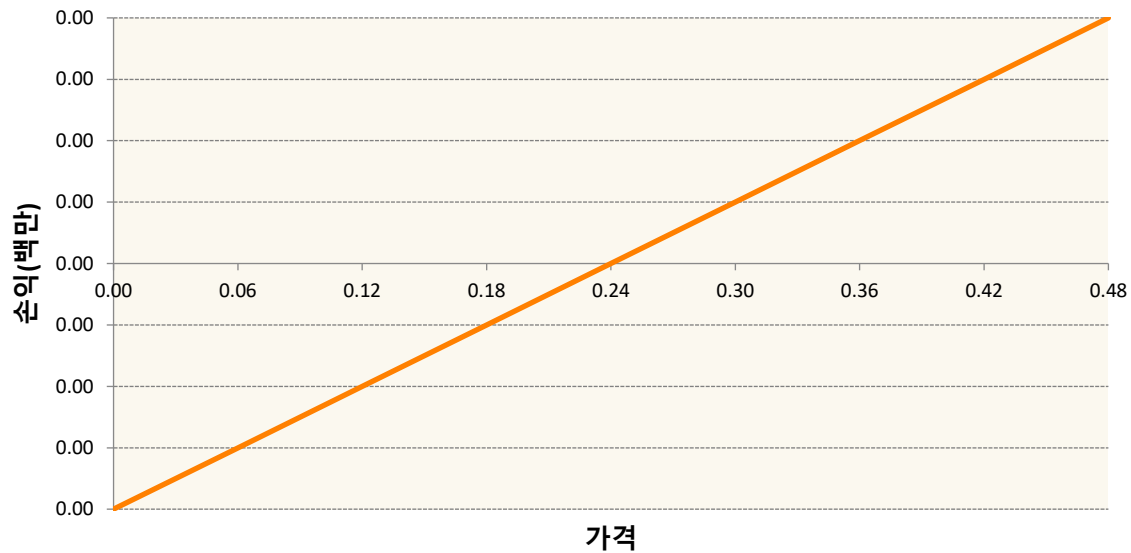
2. 만기시점의 손익구조



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



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

17
 58
 297
 111

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

(단위:백만원)

736

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

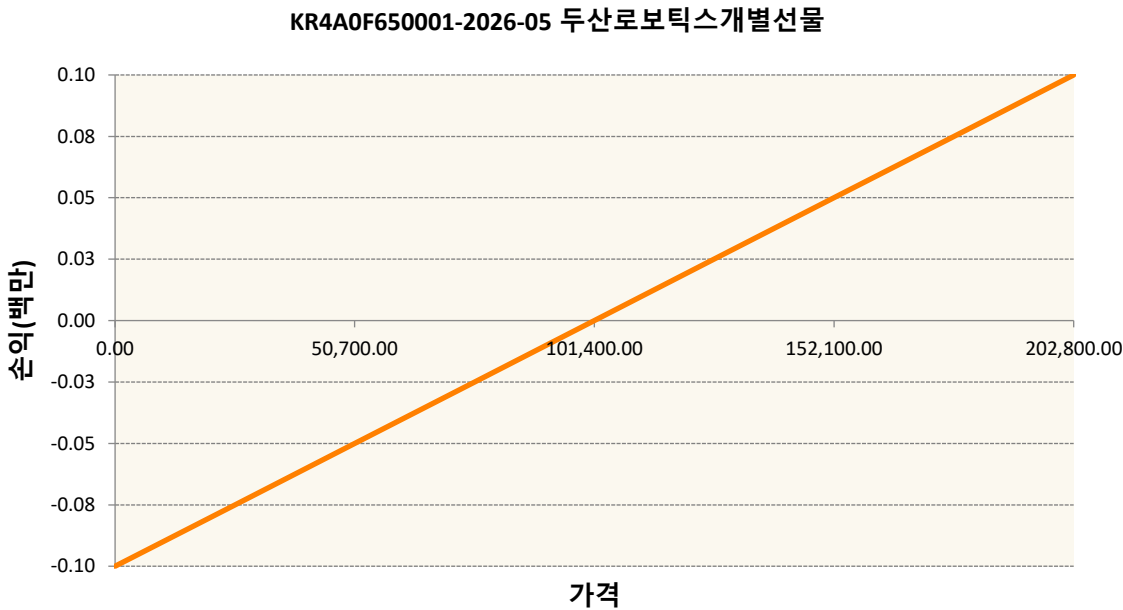
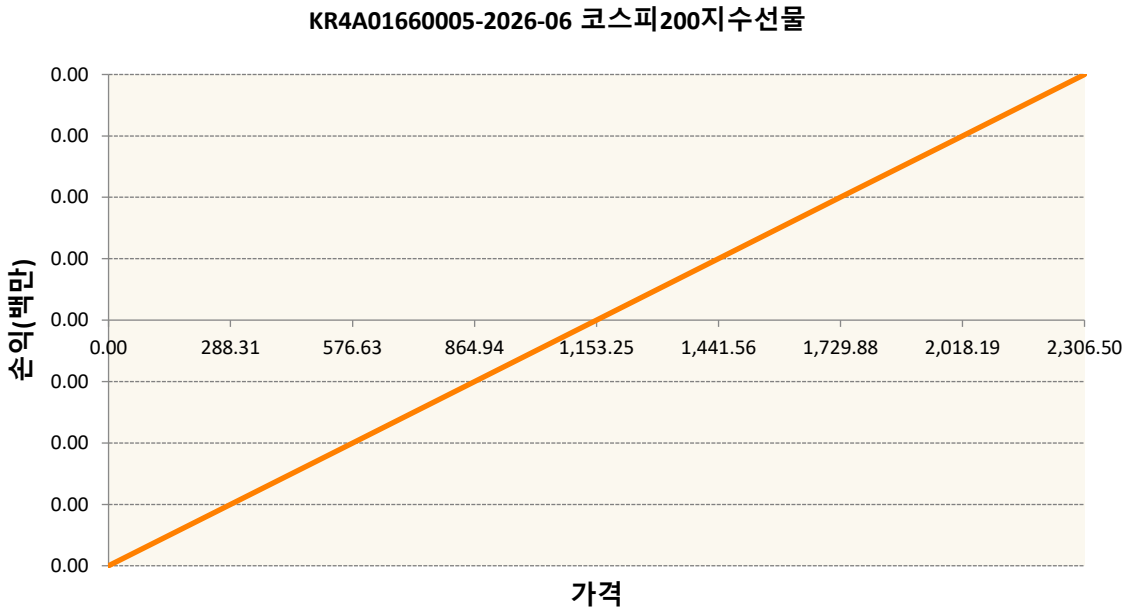
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

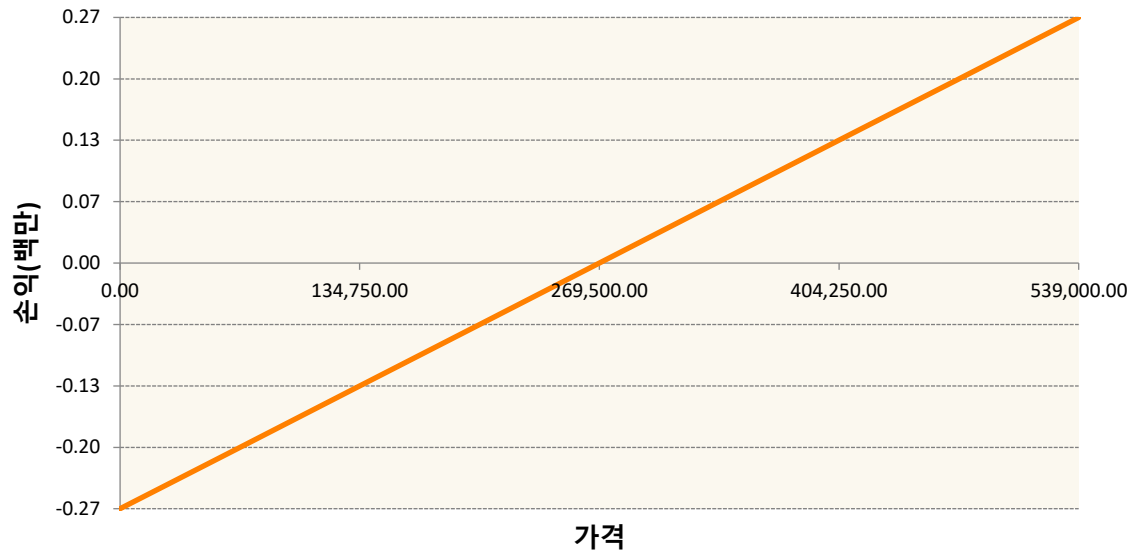
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,595	2,515	2,080	장내
누계	유가증권	선물	28,805	2,249	26,556	장내

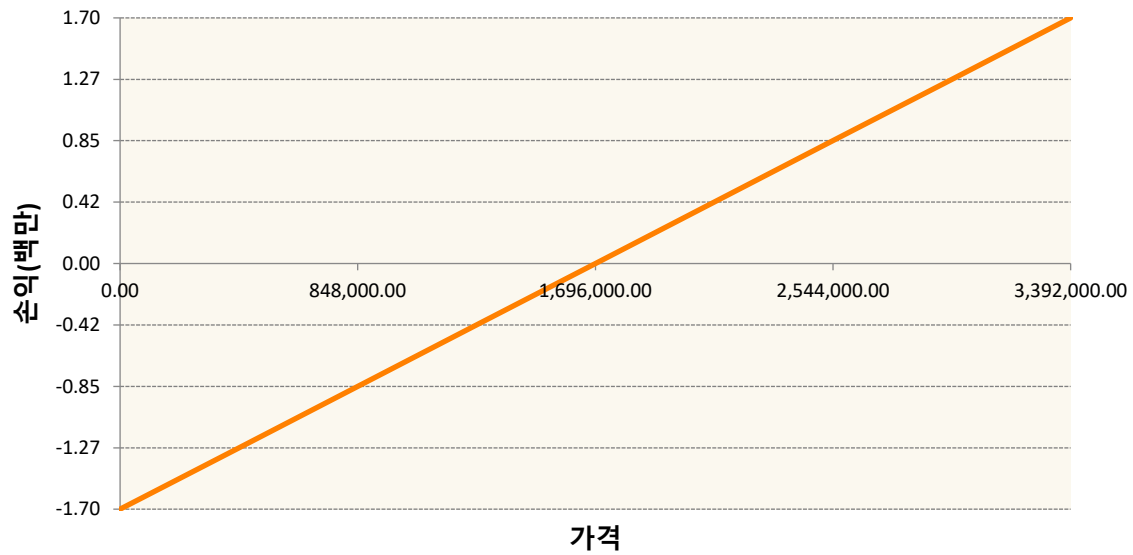
2. 만기시점의 손익구조



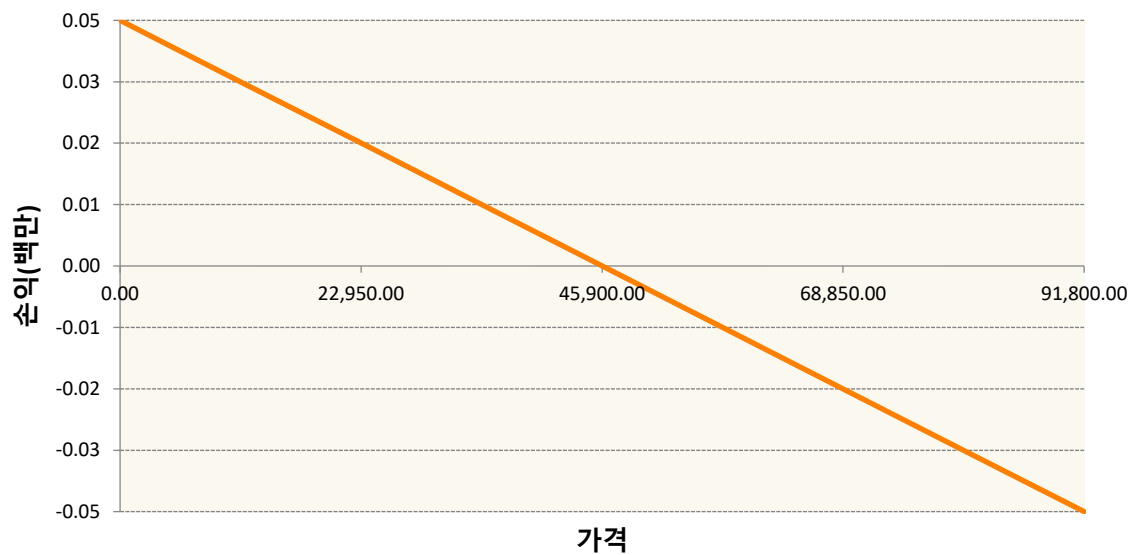
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 1,670,000.00 with major ticks every 417,500.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -0.84 to 0.84 with major ticks every 0.21. A solid orange line represents the profit function, starting at a profit of 0.84 when the price is 0.00 and decreasing linearly to a profit of -0.84 at a price of 1,670,000.00. The line intersects the x-axis at a price of 835,000.00, indicating the break-even point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	0.84
417,500.00	0.42
835,000.00	0.00
1,252,500.00	-0.42
1,670,000.00	-0.84

The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), has major ticks at 0.00, 8,187.50, 16,375.00, 24,562.50, 32,750.00, 40,937.50, 49,125.00, 57,312.50, and 65,500.00. The y-axis, labeled '손익 (백만)' (Profit/Loss in millions), has major ticks at -0.03, -0.02, -0.01, 0.00, 0.01, 0.02, and 0.03. A solid blue line represents the function, starting at (0, -0.03) and ending at (65,500, 0.03), with a break in the y-axis between -0.01 and 0.01.

가격 (Price)	손익 (백만) (Profit/Loss in millions)
0.00	-0.03
8,187.50	-0.02
16,375.00	-0.01
24,562.50	0.00
32,750.00	0.01
40,937.50	0.02
49,125.00	0.03
57,312.50	0.04
65,500.00	0.05

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				1,865
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,865	-1,865	-1,865	-1,865	-1,865	-1,865	-1,865	
-5.33%	-1,243	-1,243	-1,243	-1,243	-1,243	-1,243	-1,243	
-2.67%	-622	-622	-622	-622	-622	-622	-622	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	622	622	622	622	622	622	622	
5.33%	1,243	1,243	1,243	1,243	1,243	1,243	1,243	
8.00%	1,865	1,865	1,865	1,865	1,865	1,865	1,865	
KR4A0F650001				2026-05 두산로보틱스개별선물				15
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-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%	15	15	15	15	15	15	15

KR4A11650004

2026-05 삼성전자개별선물

222

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-222	-222	-222	-222	-222	-222	-222
-5.33%	-148	-148	-148	-148	-148	-148	-148
-2.67%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	74	74	74	74	74	74	74
5.33%	148	148	148	148	148	148	148
8.00%	222	222	222	222	222	222	222

KR4A50650006

2026-05 SK하이닉스개별선물

146

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-146	-146	-146	-146	-146	-146	-146
-5.33%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
-2.67%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	49	49	49	49	49	49	49
5.33%	97	97	97	97	97	97	97
8.00%	146	146	146	146	146	146	146

KR4ACF650006

2026-05 카카오개별선물

117

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	117	117	117	117	117	117	117
-5.33%	78	78	78	78	78	78	78
-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%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117

KR4ADB650009

2026-05 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선

63

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	63	63	63	63
-5.33%	42	42	42	42	42	42	42
-2.67%	21	21	21	21	21	21	21
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
KR4AFT650007 2026-05 대우건설개별선물							52
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-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%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	52	52	52	52	52	52	52

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	5,447

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

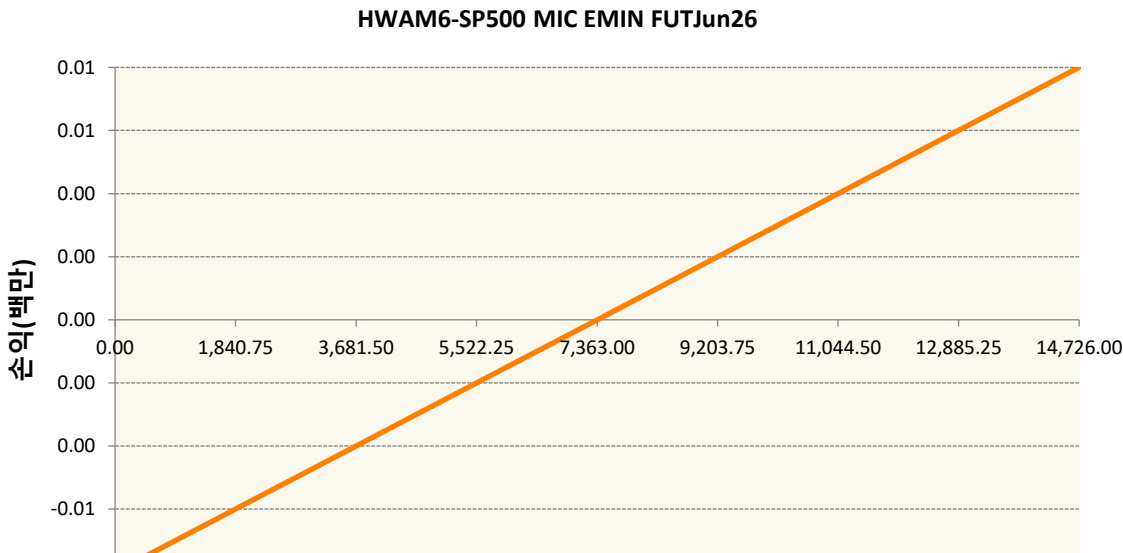
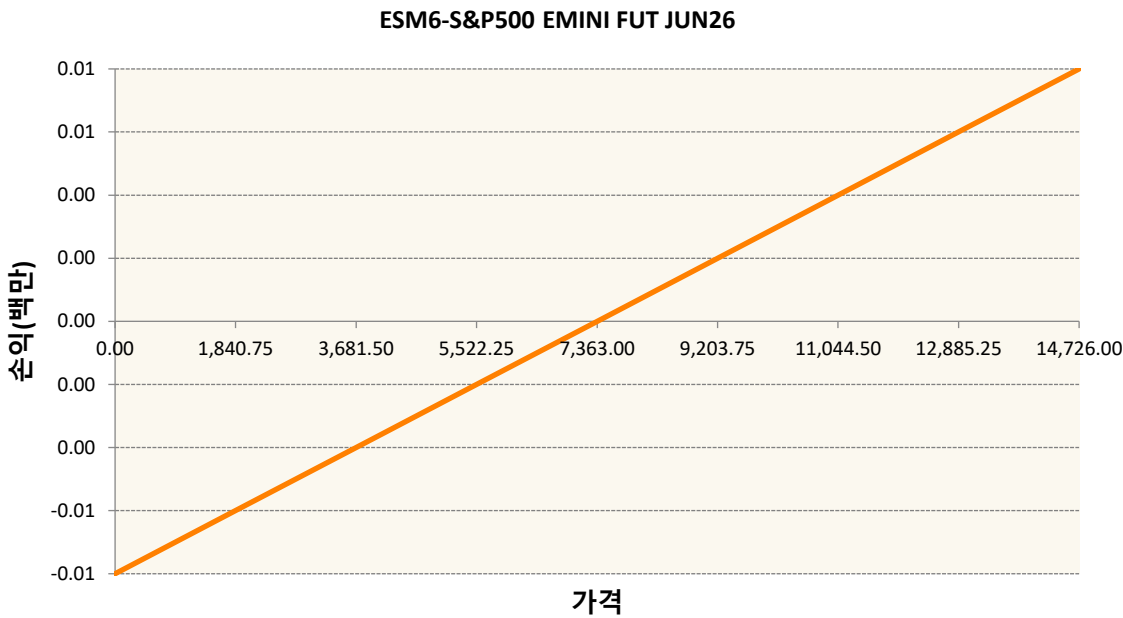
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

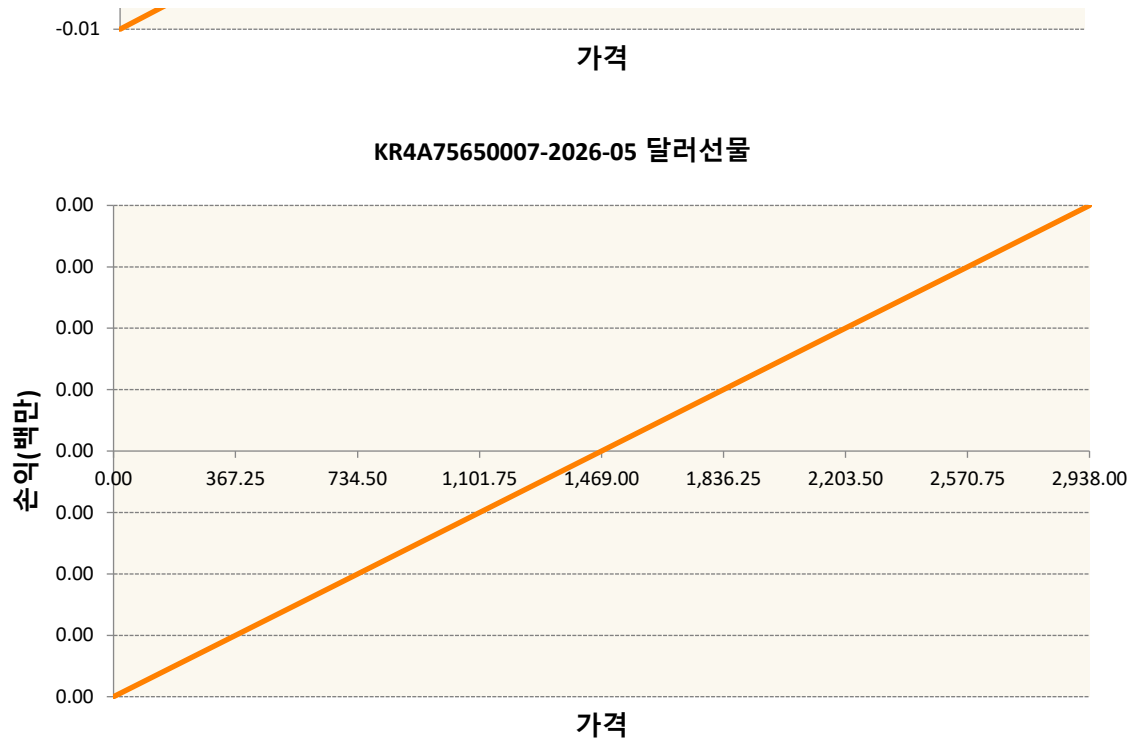
1. 계약금액

(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	61,702	0	61,702	
누계	지수	선물	274	0	274	장내
누계	통화	선물	10,430	0	10,430	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,936
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	22
KR4A756500 2026-05 달러선물		834

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

(단위:백만원)

4,327

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

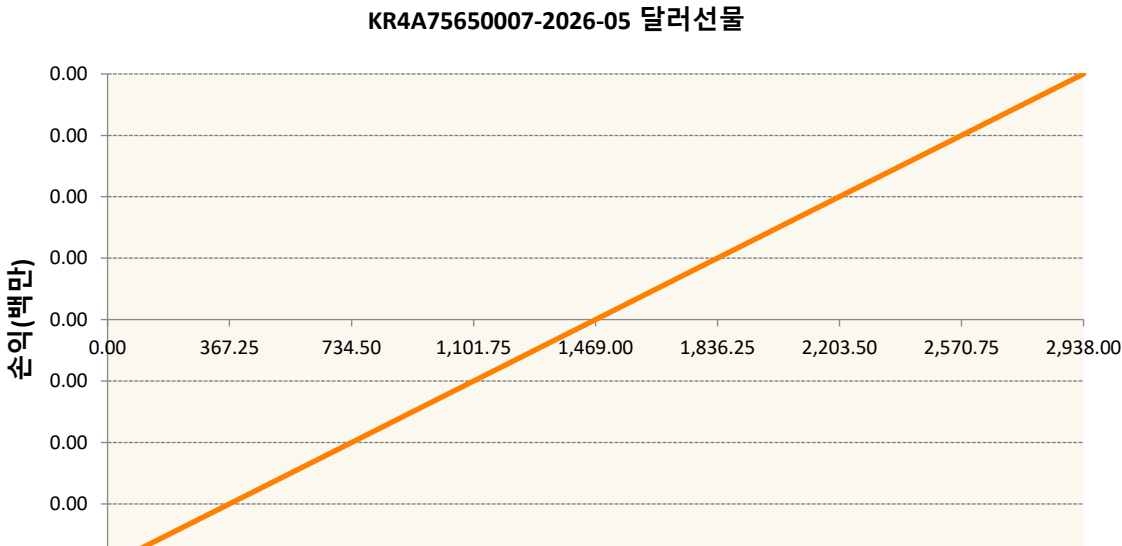
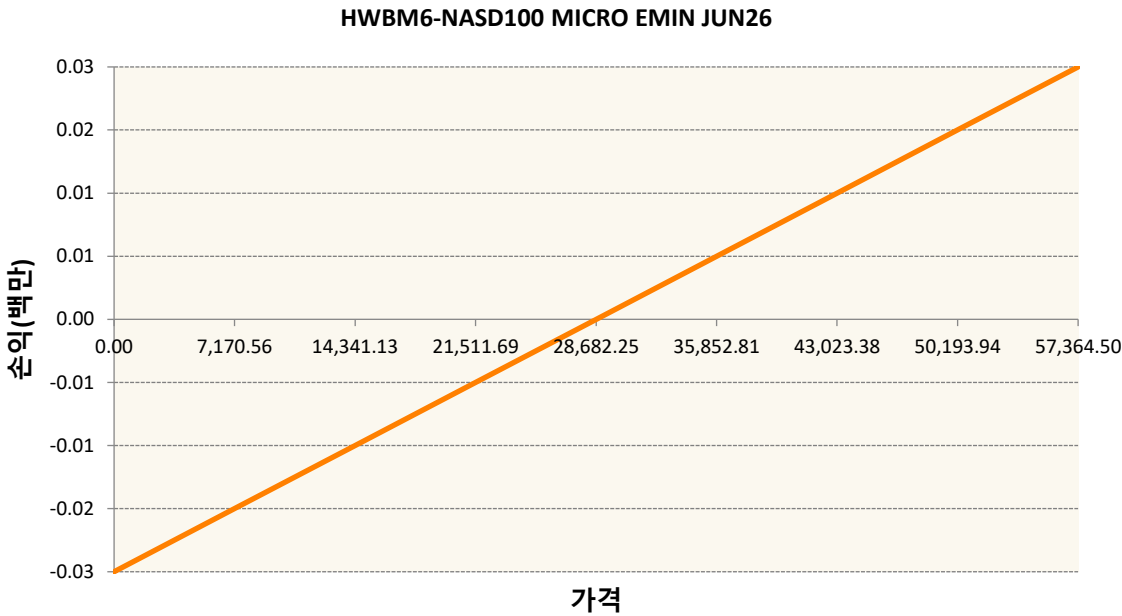
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

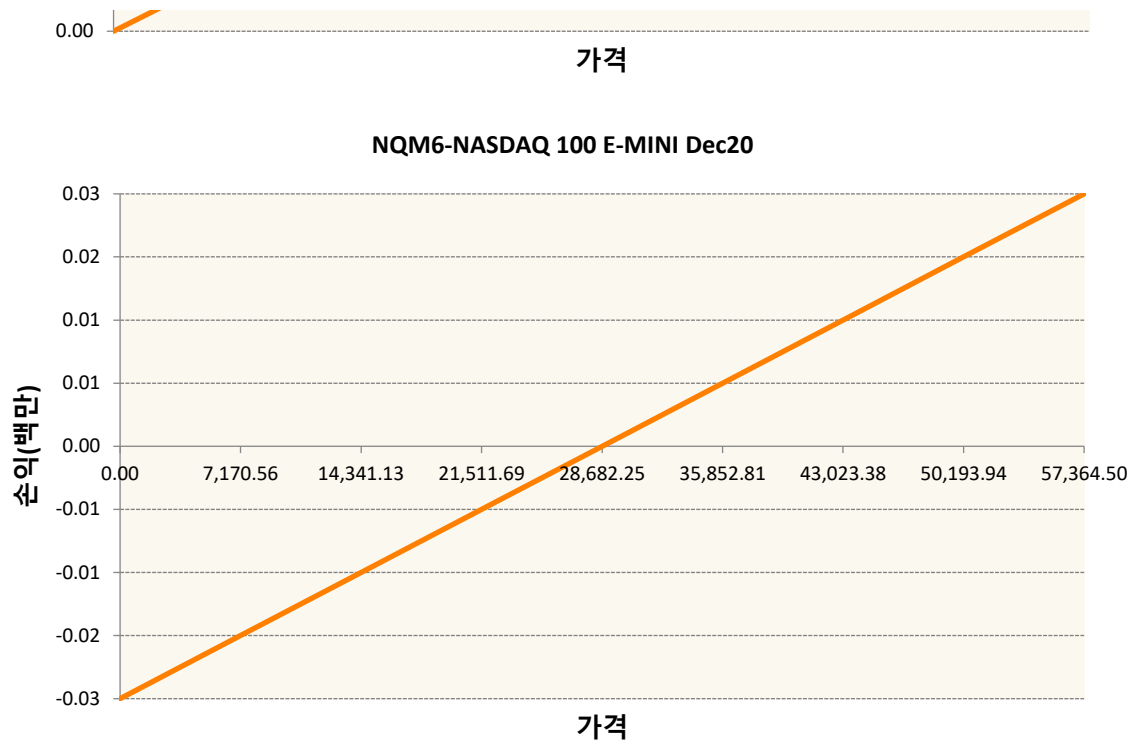
1. 계약금액

(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	29,130	0	29,130	
누계	유가증권	선물	760	0	760	장내
누계	통화	선물	3,834	0	3,834	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	61
KR4A756500	2026-05 달러선물	307
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,330

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

(단위:백만원)

2,630

공시일	2026-05-11
기준일	2026-05-08

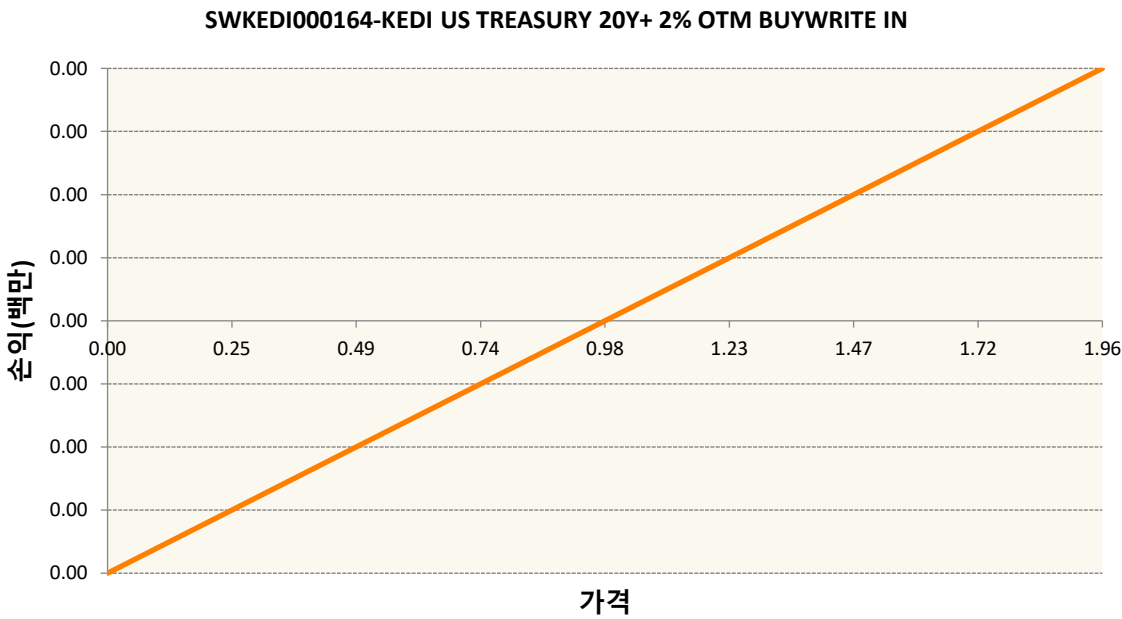
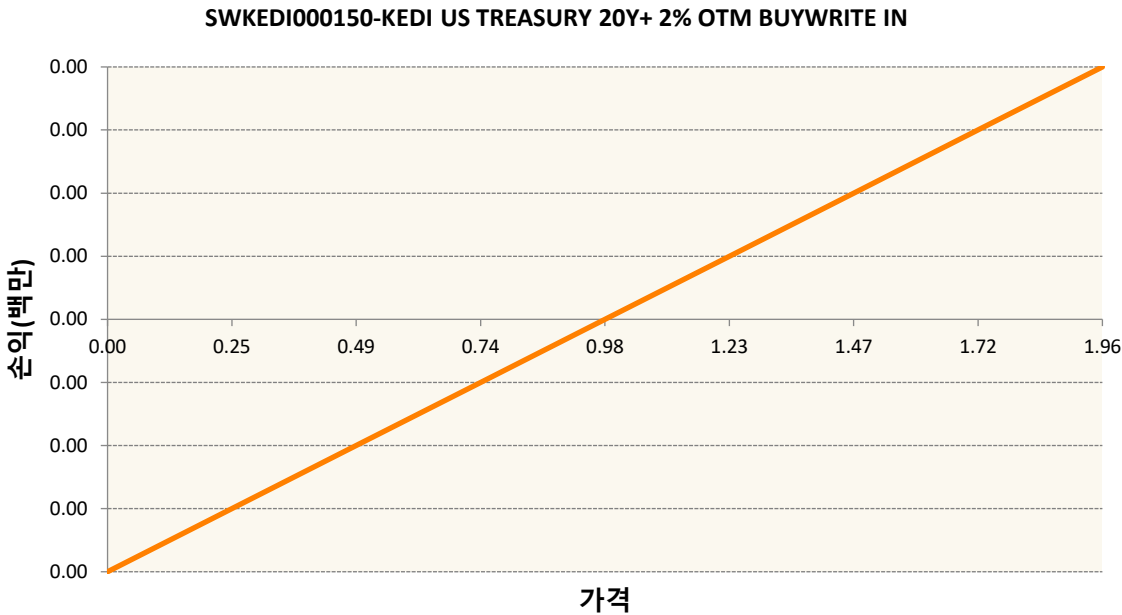
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

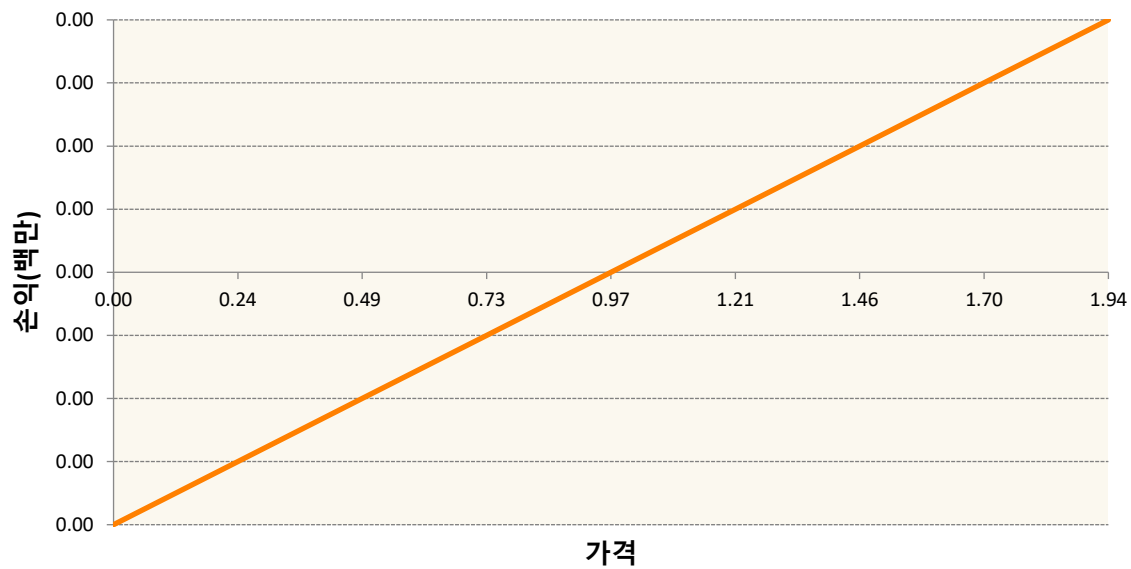
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	351,824	0	351,824	장외

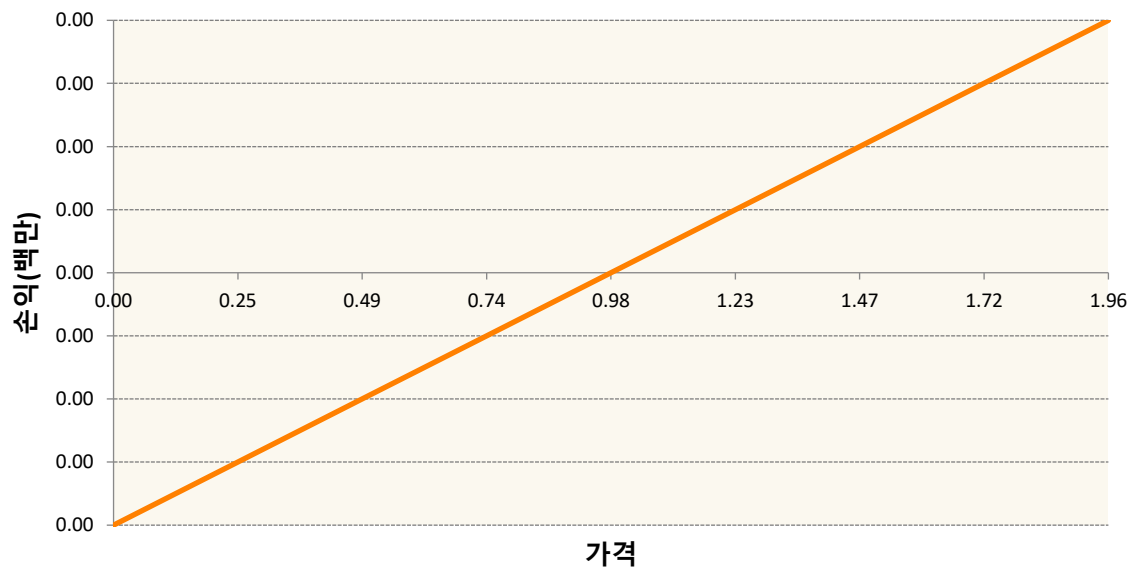
2. 만기시점의 손익구조



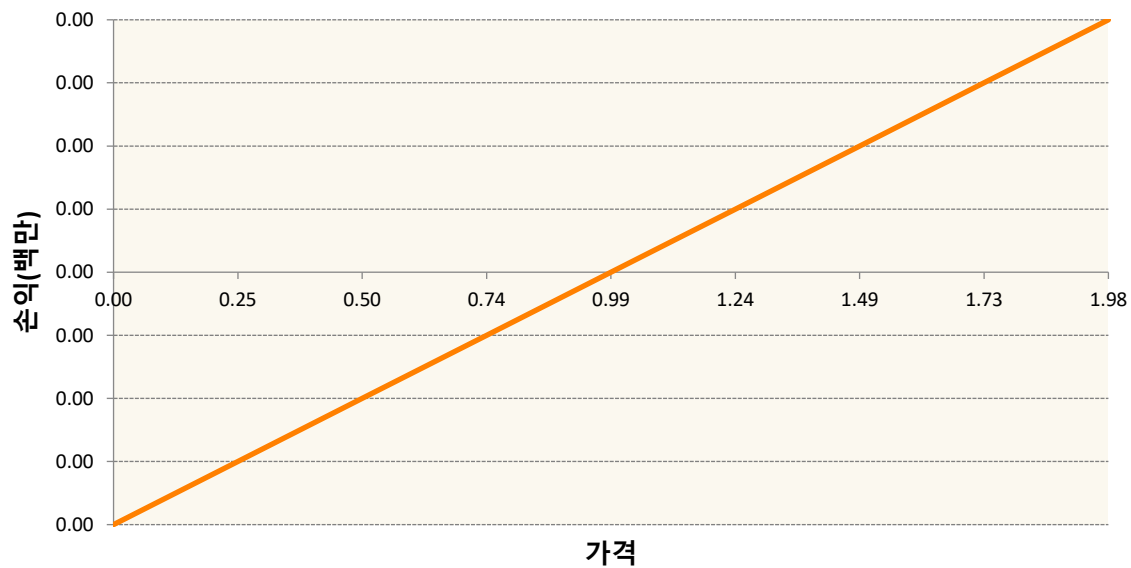
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,218
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		150
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,626
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,374
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,826

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	11,962