

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

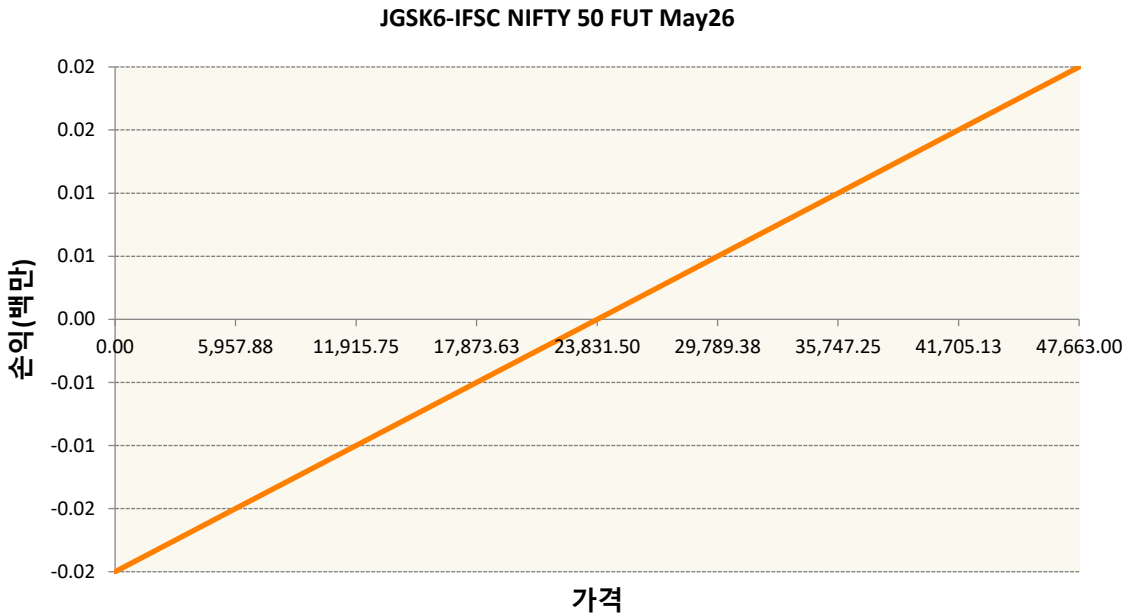
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	354	0	354	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSK6	IFSC NIFTY 50 FUT May26	28
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

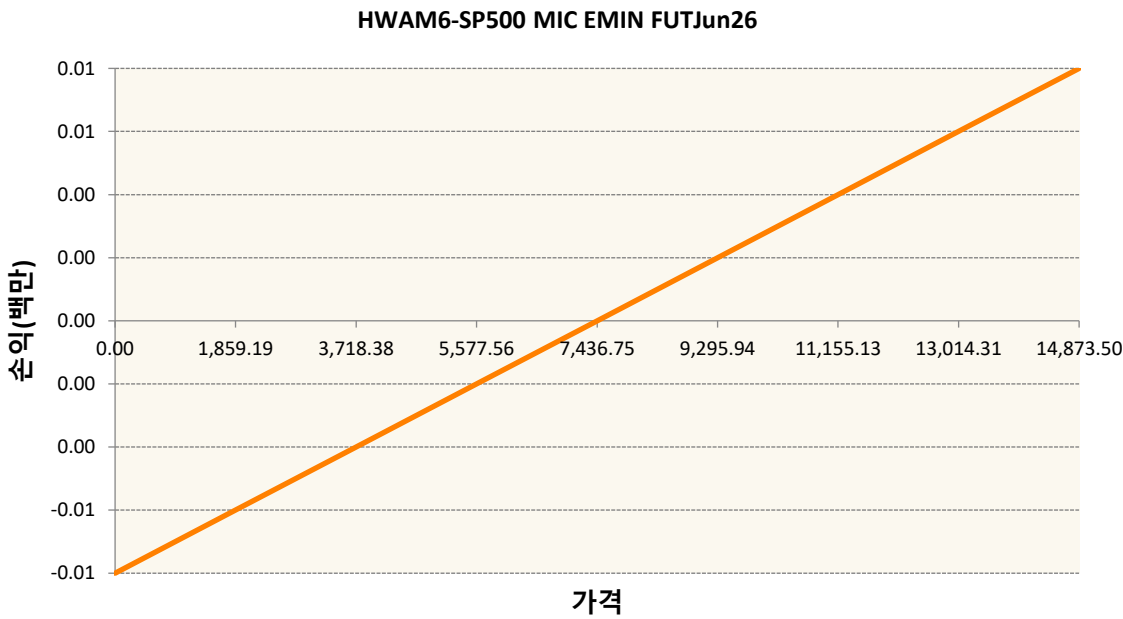
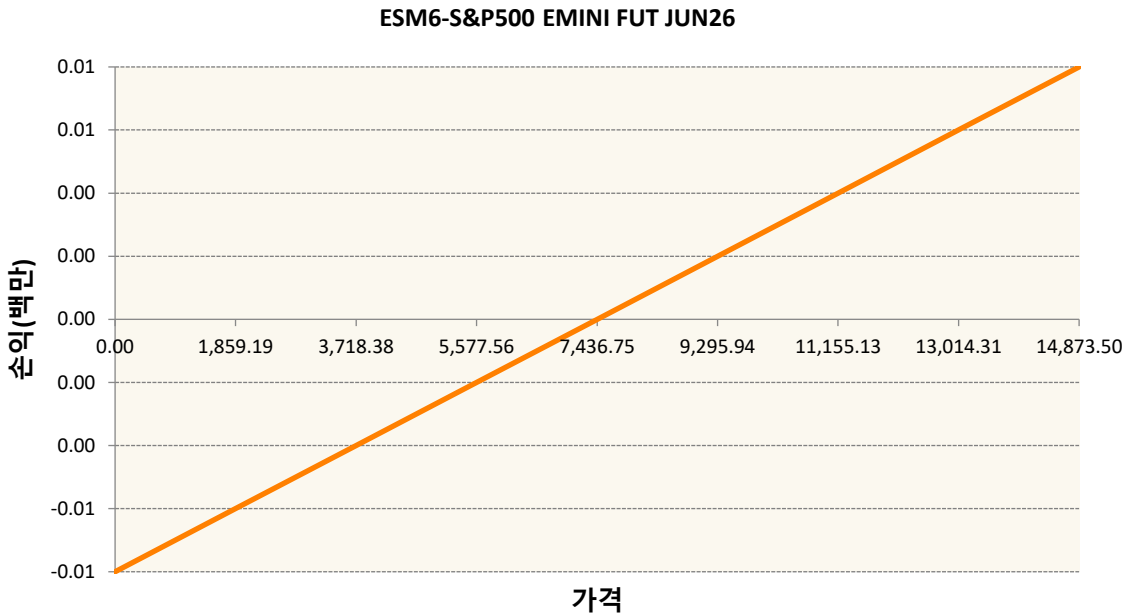
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	558	0	558	
누계	지수	선물	56	0	56	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	45
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	43

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

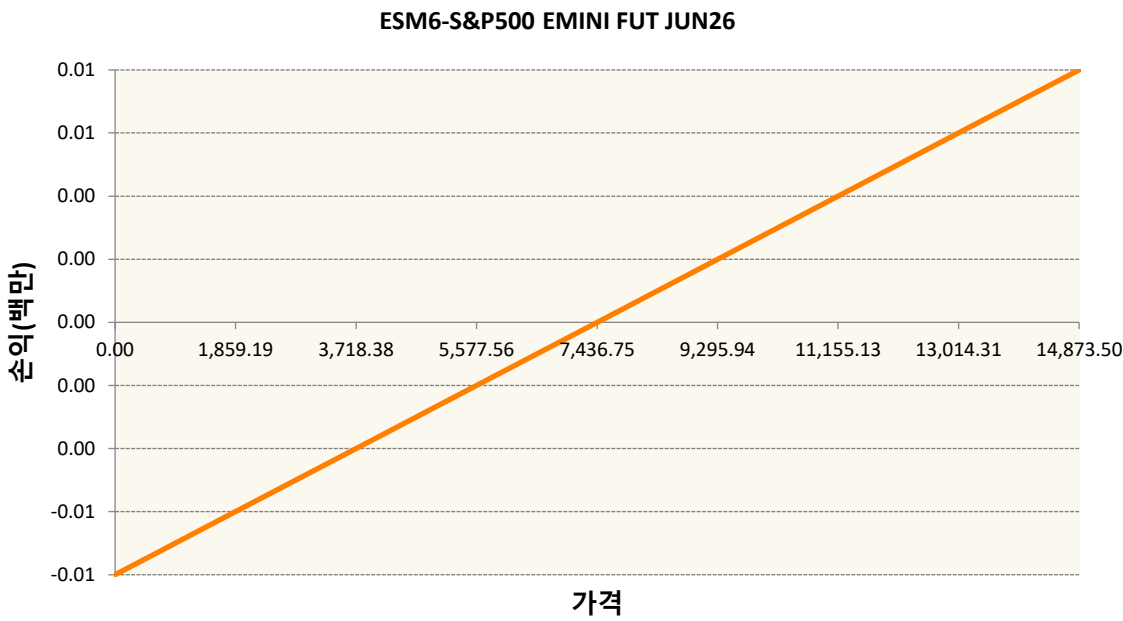
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,115	0	1,115	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	89
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

78

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

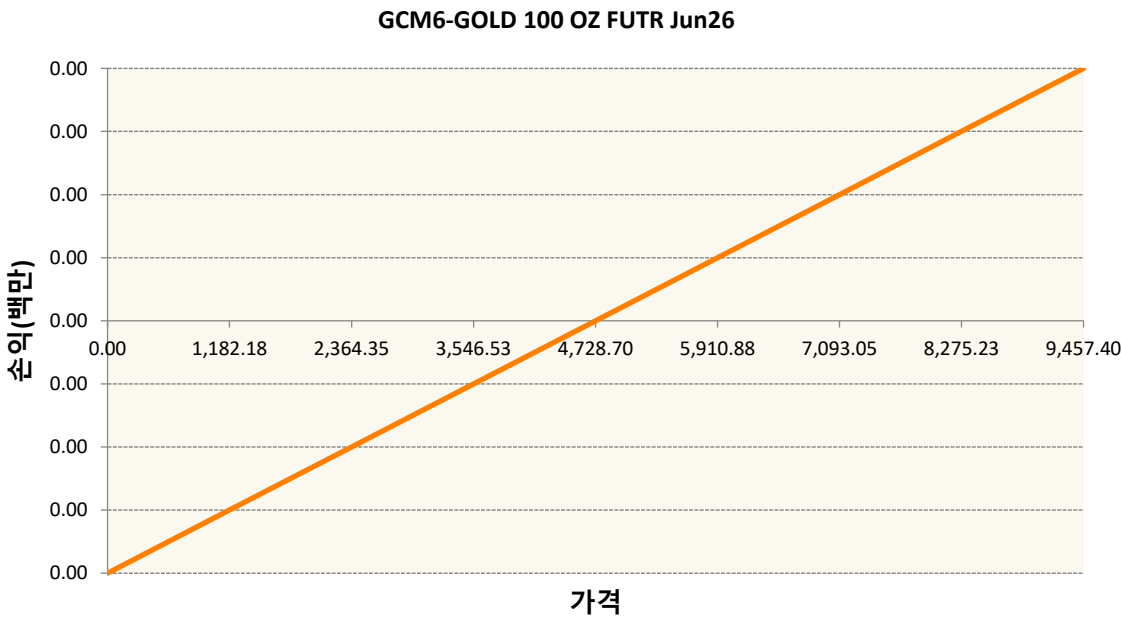
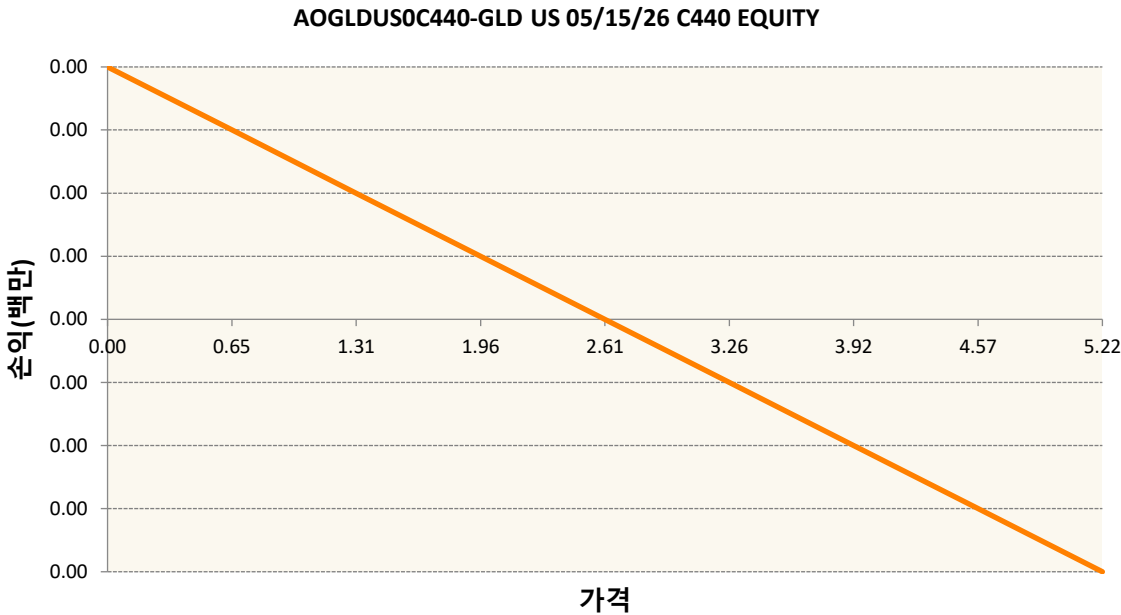
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,695	0	5,695	장내
누계	실물자산	옵션	0	78	-78	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUS0C GLD US 05/15/26 C440 EQUITY		6
GCM6	GOLD 100 OZ FUTR Jun26	456

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	578

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

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)

AOPLTRCUS' PLTR US 05/15/26 C147 EQUITY	81
AOPLTRPUS' PLTR US 05/15/26 P147 EQUITY	33

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

(단위:백만원)

353

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

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)

AOTLTUSCC(TLT US 05/15/26 C86 EQUITY

15

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

(단위:백만원)

9

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

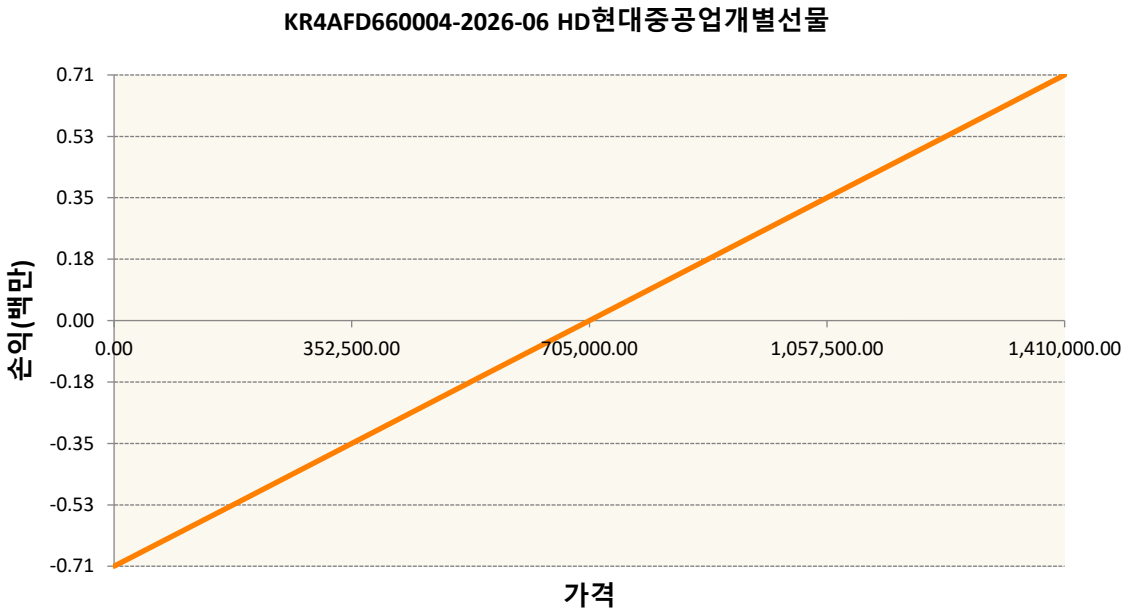
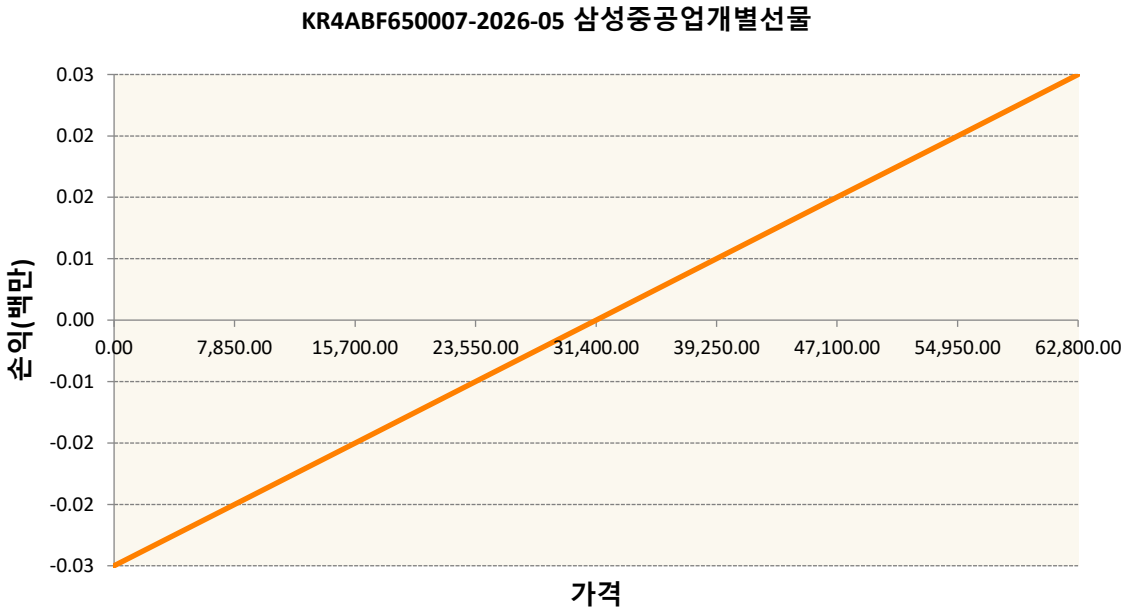
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

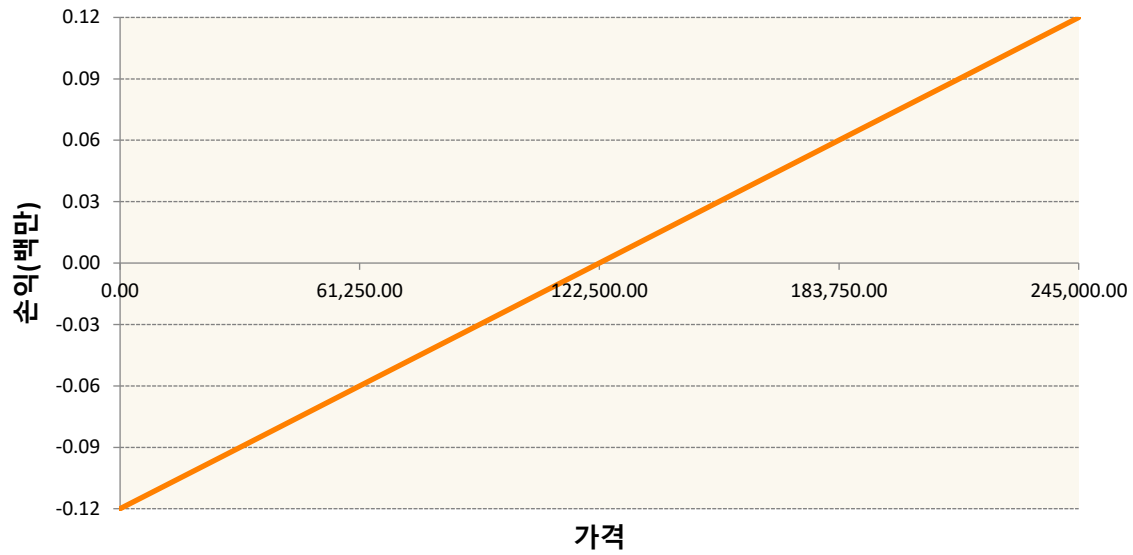
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	11,161	3,995	7,167	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	34,675	0	34,675	장내
누계	유가증권	스왑	173,492	0	173,492	장외

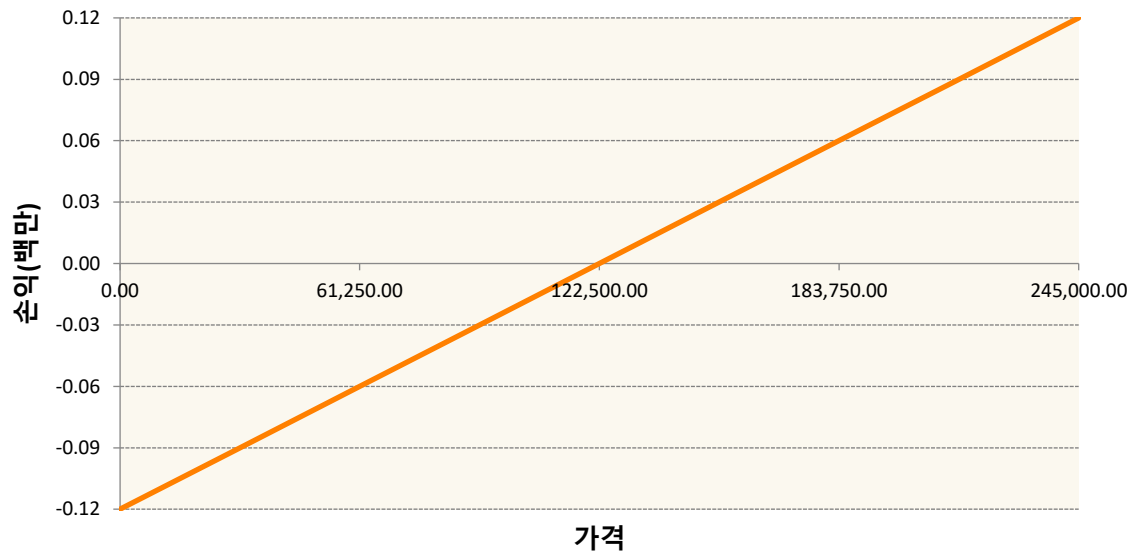
2. 만기시점의 손익구조



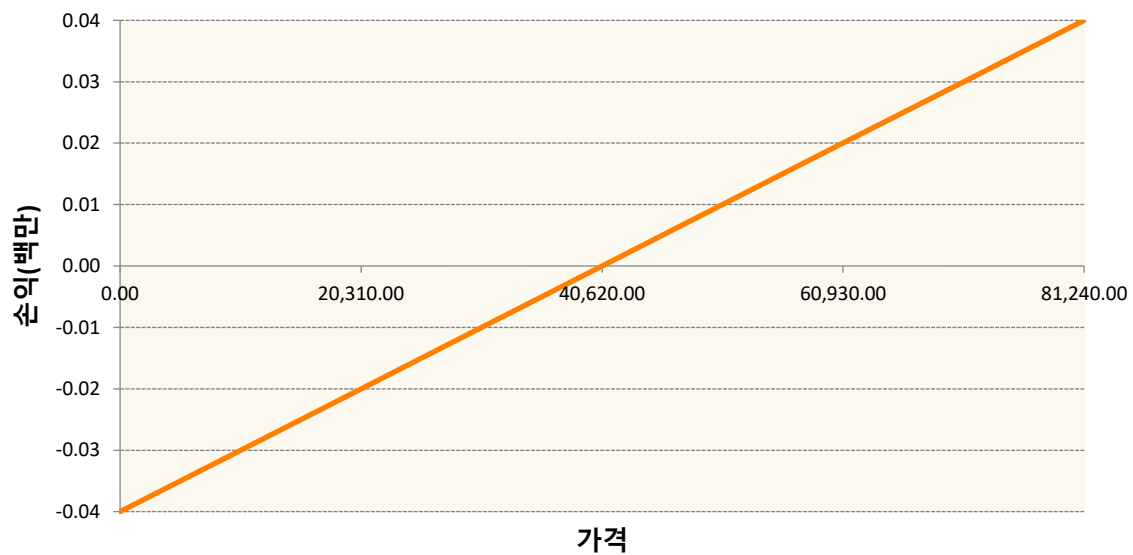
KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AFV660002-2026-06 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF650007		2026-05 삼성중공업개별선물					1,156
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,156	-1,156	-1,156	-1,156	-1,156	-1,156	-1,156
-5.33%	-770	-770	-770	-770	-770	-770	-770
-2.67%	-385	-385	-385	-385	-385	-385	-385
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	385	385	385	385	385	385	385
5.33%	770	770	770	770	770	770	770
8.00%	1,156	1,156	1,156	1,156	1,156	1,156	1,156
KR4AFD660004		2026-06 HD현대중공업개별선물					1,075
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075	-1,075
-5.33%	-716	-716	-716	-716	-716	-716	-716
-2.67%	-358	-358	-358	-358	-358	-358	-358
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	358	358	358	358	358	358	358
5.33%	716	716	716	716	716	716	716
8.00%	1,075	1,075	1,075	1,075	1,075	1,075	1,075
KR4AFV650003		2026-05 한화오션개별선물					225
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225
-5.33%	-150	-150	-150	-150	-150	-150	-150
-2.67%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	75	75	75	75	75	75	75
5.33%	150	150	150	150	150	150	150
8.00%	225	225	225	225	225	225	225
KR4AFV660002		2026-06 한화오션개별선물					319
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
-5.33%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213
-2.67%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	106	106	106	106	106	106	106
5.33%	213	213	213	213	213	213	213
8.00%	319	319	319	319	319	319	319

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

(단위:백만원)

4,165

공시일 2026-05-13

기준일 2026-05-12

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	2026-05-13
기준일	2026-05-12

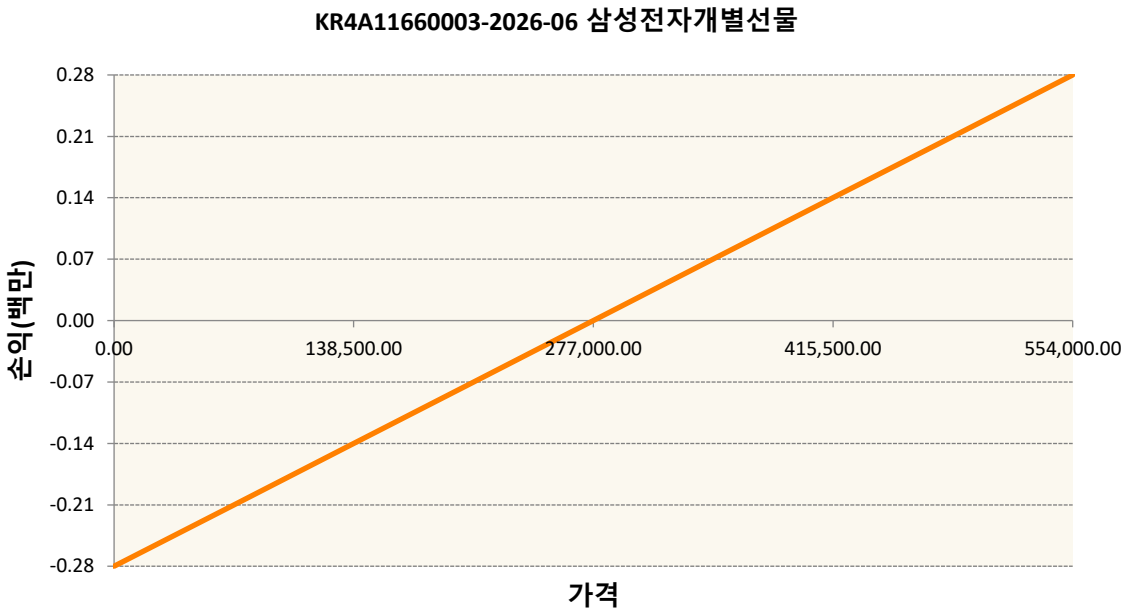
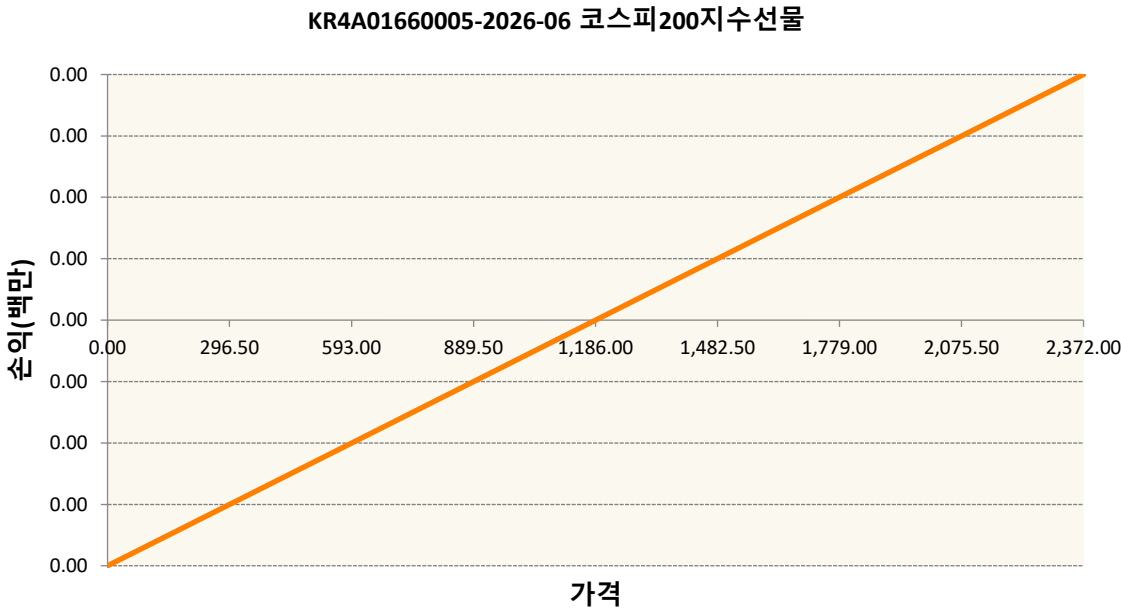
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

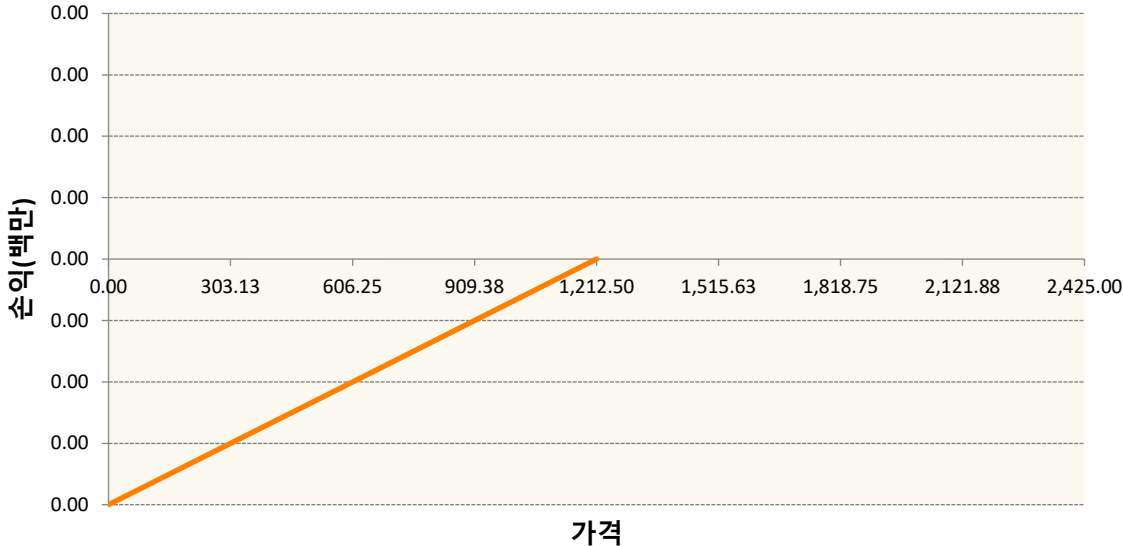
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	15,633	0	15,633	장내
신규	유가증권	옵션	0	614	-614	장내
누계	유가증권	선물	22,667	0	22,667	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,461	-32,461	장내

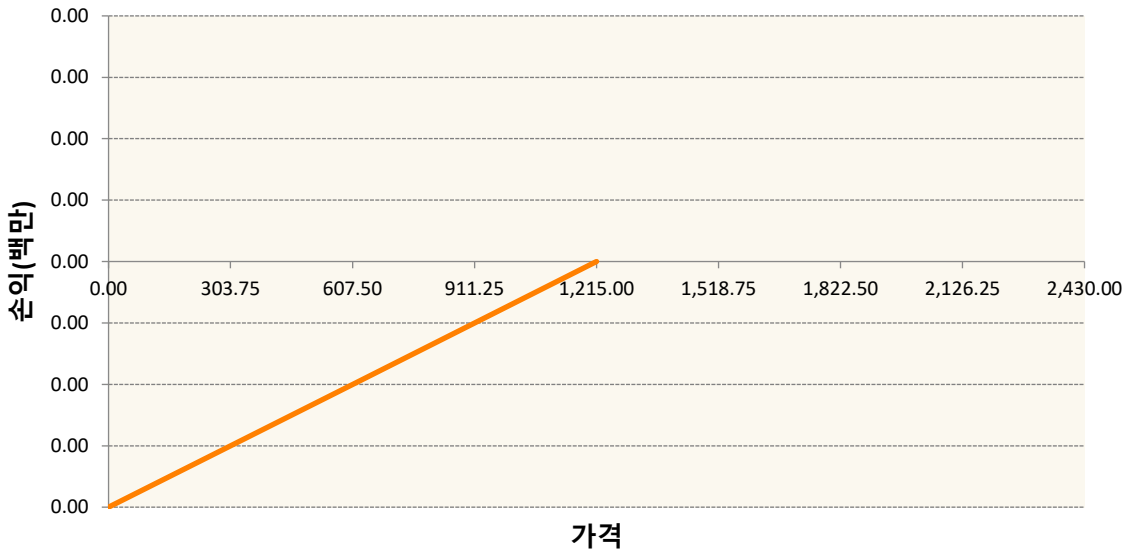
2. 만기시점의 손익구조



KR4B0165A863-코스피|200 C 202605 1,212.5



KR4B0165A871-코스피|200 C 202605 1,215.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물			615
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-615	-615	-615	-615	-615	-615	-615
-5.33%	-410	-410	-410	-410	-410	-410	-410
-2.67%	-205	-205	-205	-205	-205	-205	-205
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	205	205	205	205	205	205	205
5.33%	410	410	410	410	410	410	410
8.00%	615	615	615	615	615	615	615
KR4A11660003				2026-06 삼성전자개별선물			1,205
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205
-5.33%	-804	-804	-804	-804	-804	-804	-804
-2.67%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	402	402	402	402	402	402	402
5.33%	804	804	804	804	804	804	804
8.00%	1,205	1,205	1,205	1,205	1,205	1,205	1,205
KR4B0165A863 코스피200 C 202605 1,212.5							1,310

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,275	-1,277	-1,280	-1,285	-1,292	-1,300	-1,310
-5.33%	-778	-786	-796	-808	-822	-839	-857
-2.67%	-308	-327	-348	-371	-396	-421	-449
0%	96	65	33	0	-33	-67	-101
2.67%	395	358	322	285	248	212	175
5.33%	575	544	512	480	447	413	379
8.00%	661	642	620	597	572	545	517
KR4B0165A871 코스피200 C 202605 1,215.0							887

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-865	-866	-868	-871	-875	-881	-887
-5.33%	-531	-535	-542	-549	-559	-569	-581
-2.67%	-213	-225	-238	-253	-269	-286	-304
0%	63	43	22	0	-22	-44	-67
2.67%	270	246	221	196	172	147	122
5.33%	397	376	354	332	309	286	263
8.00%	459	446	431	414	397	378	359

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

(단위:백만원)

8,569

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

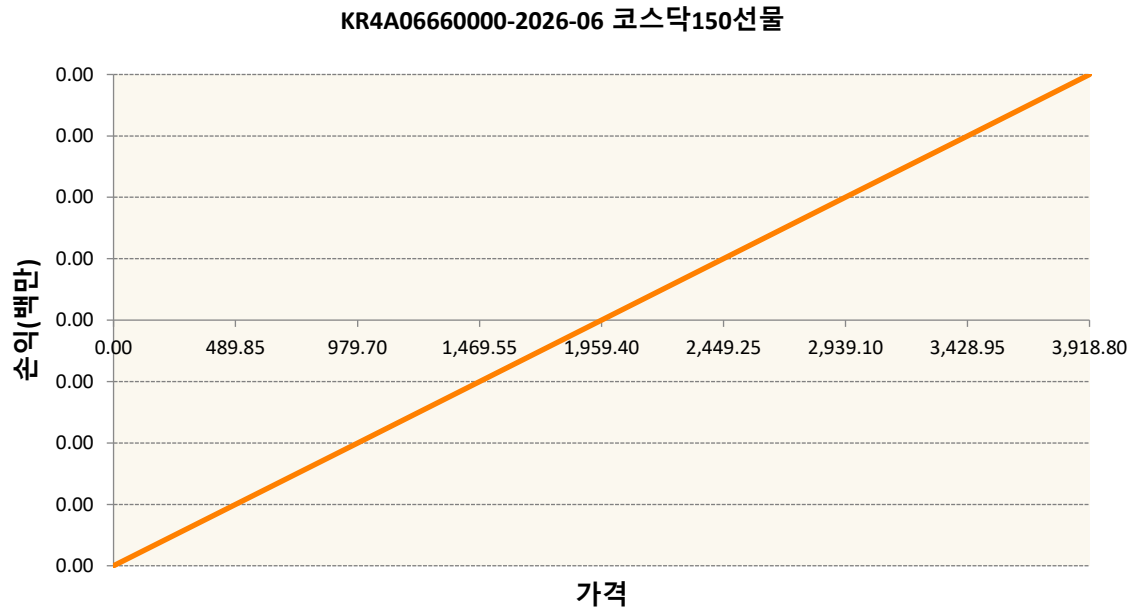
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	882	0	882	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06660000			2026-06 코스닥150선물				71
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-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%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	71	71	71	71	71	71	71

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

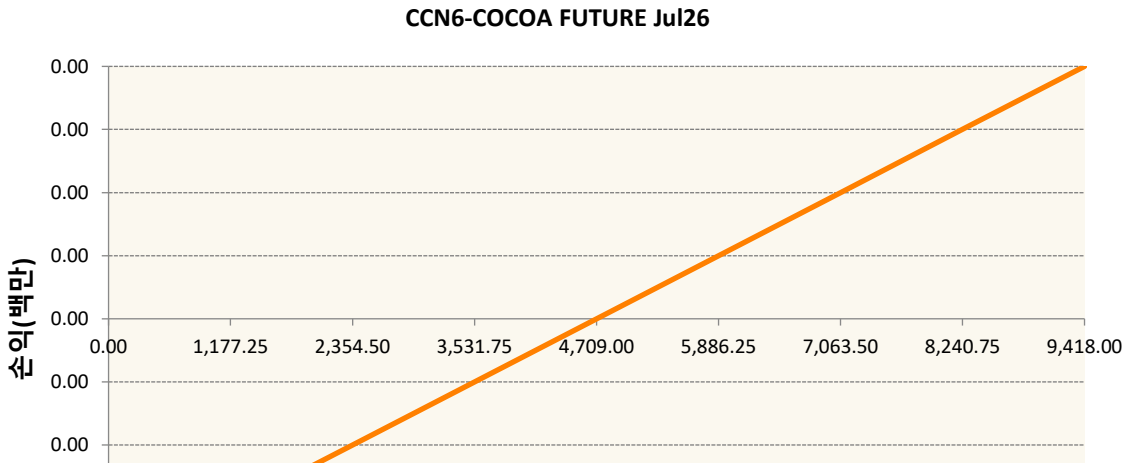
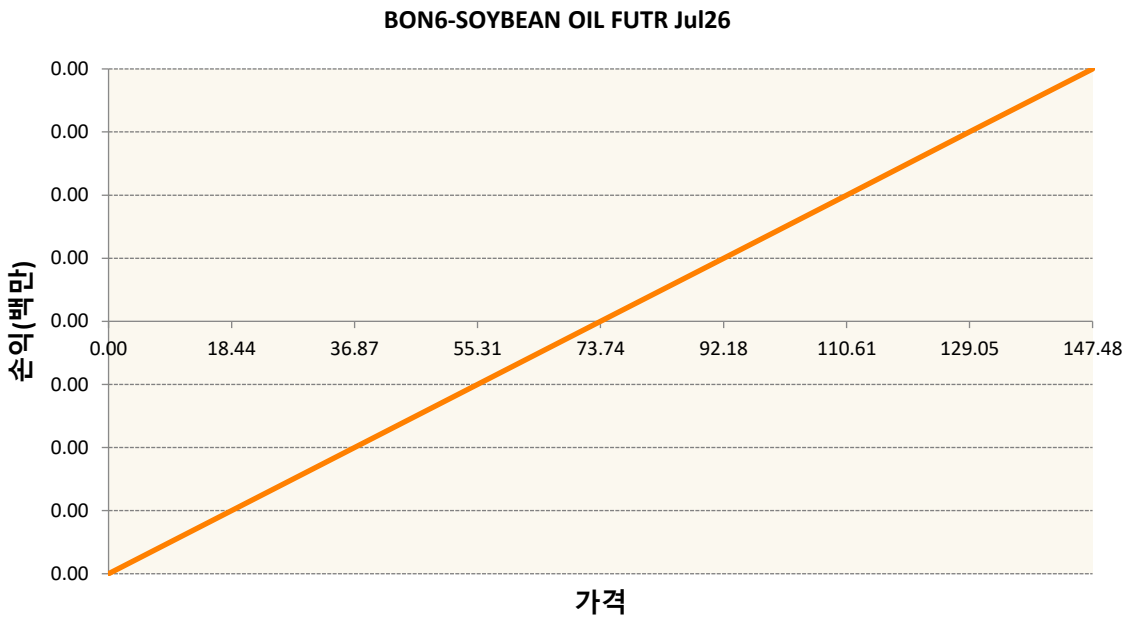
포커스농산물모(채권-파생형)

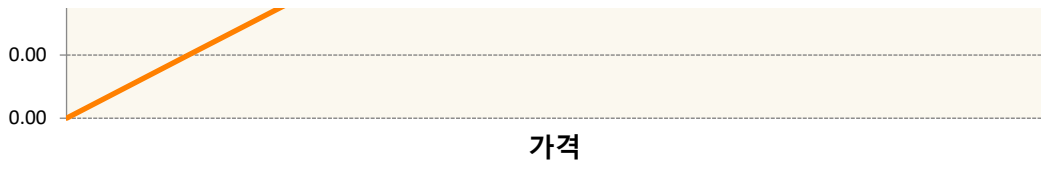
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

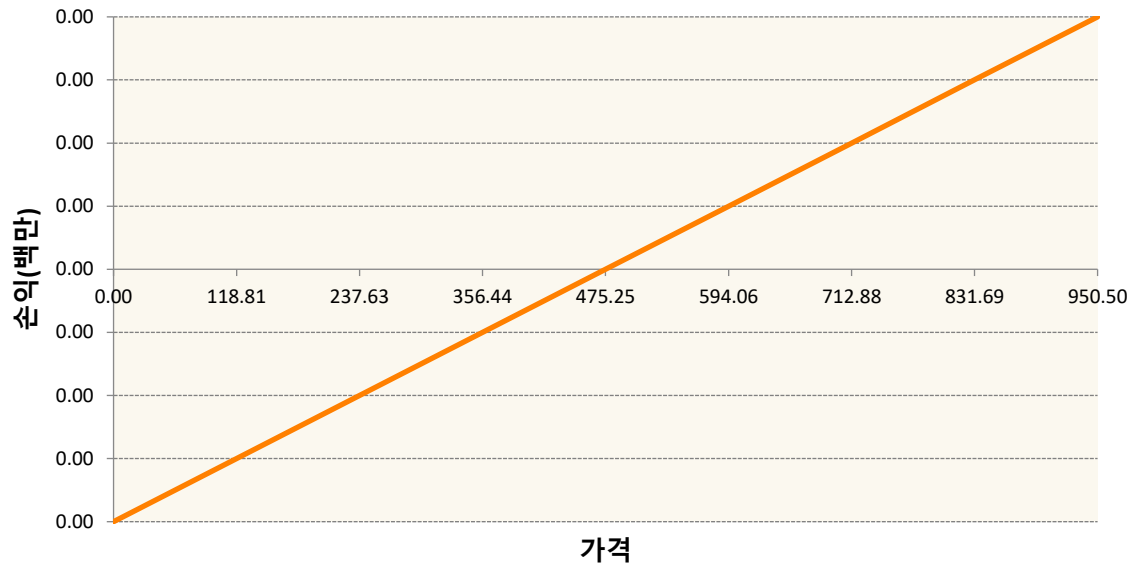
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	70	0	70	
누계	실물자산	선물	916	0	916	장내
누계	유가증권	선물	2,034	0	2,034	
누계	통화	선물	0	387	-387	장내

2. 만기시점의 손익구조

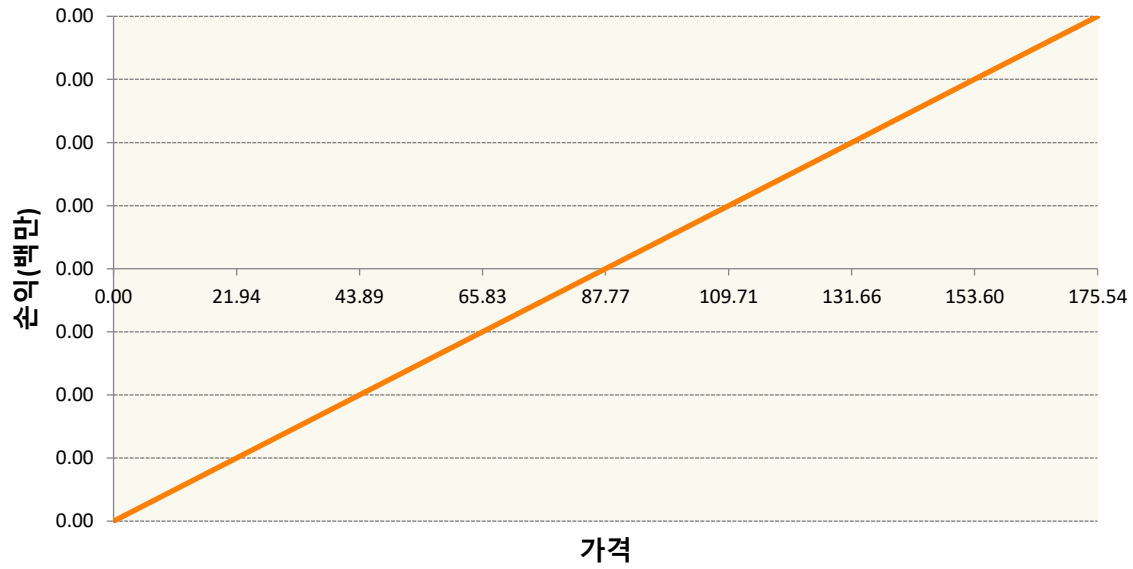




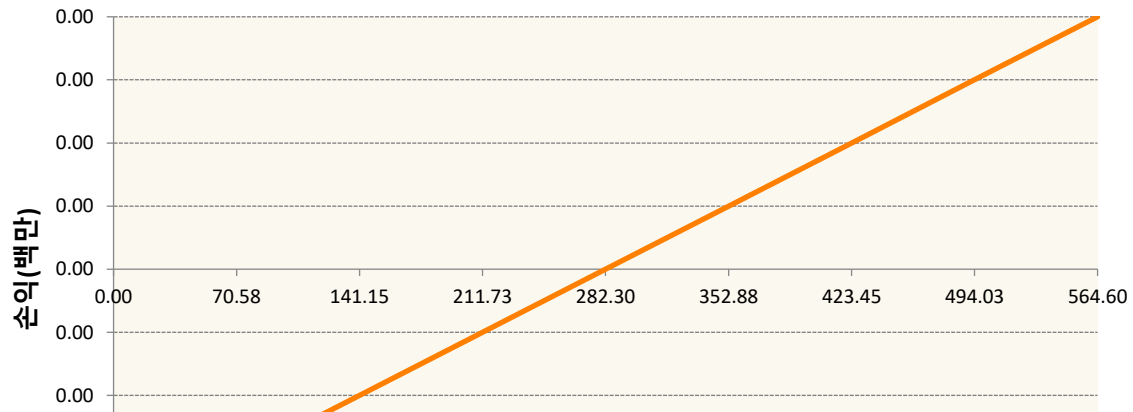
CN6-CORN FUTURE Jul26

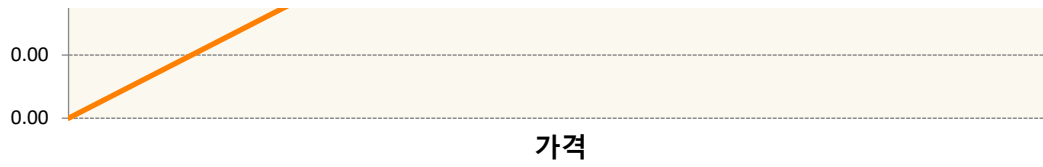


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

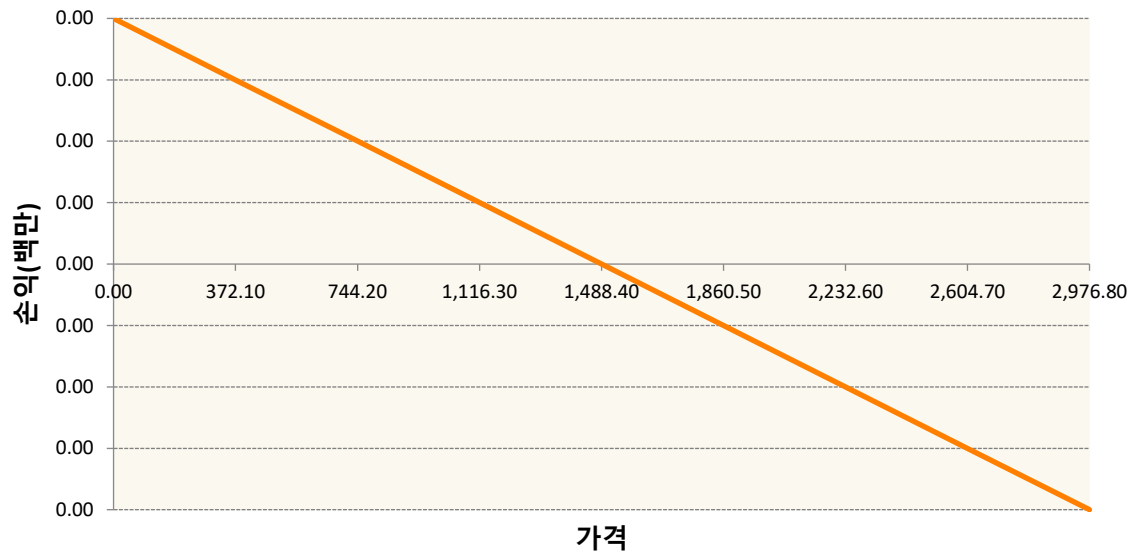


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

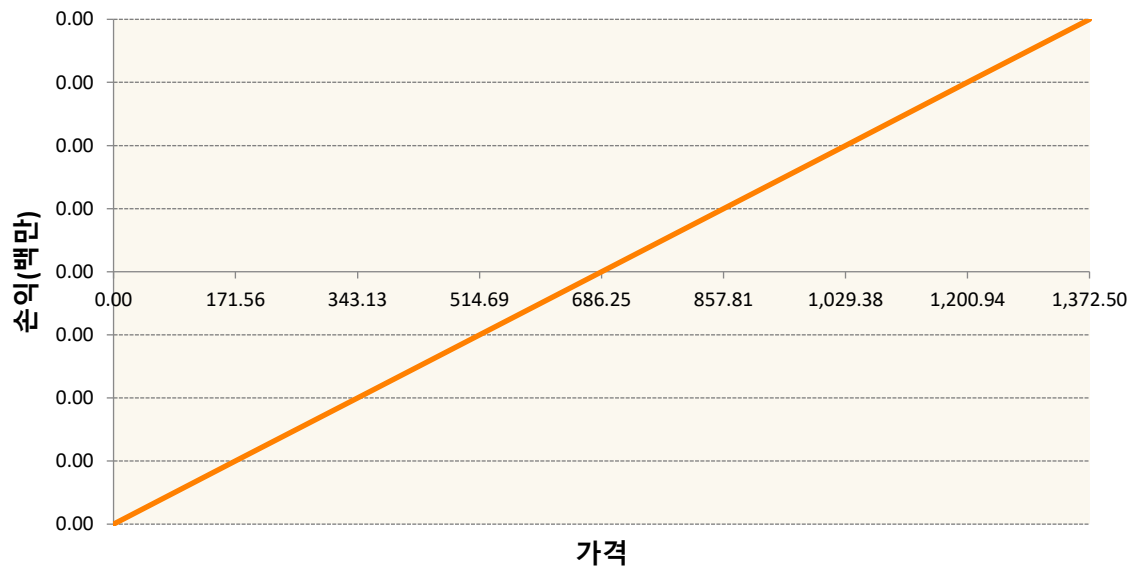




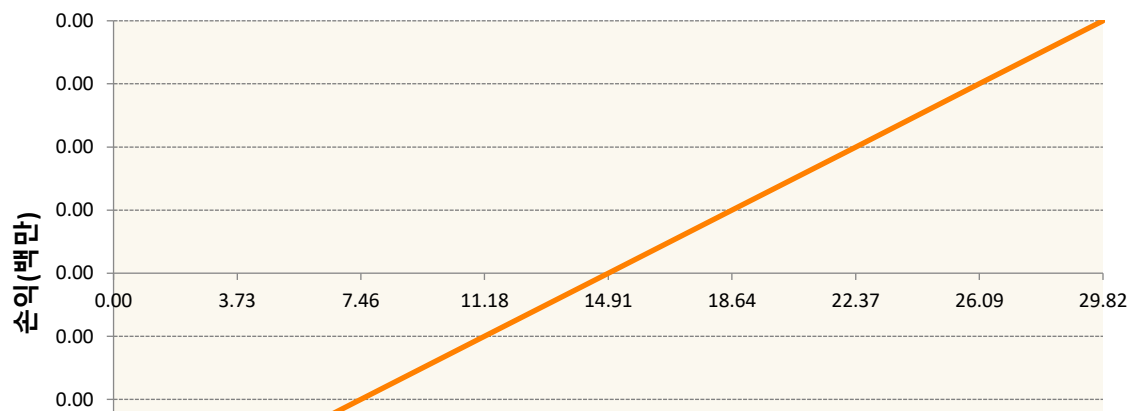
KR4A75650007-2026-05 달러선물

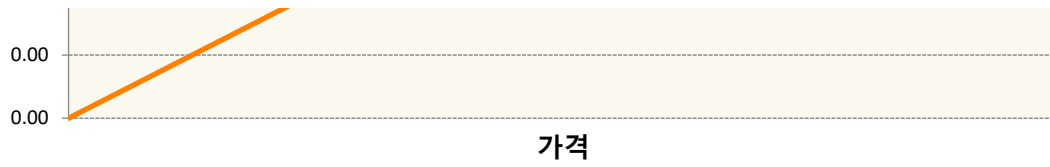


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

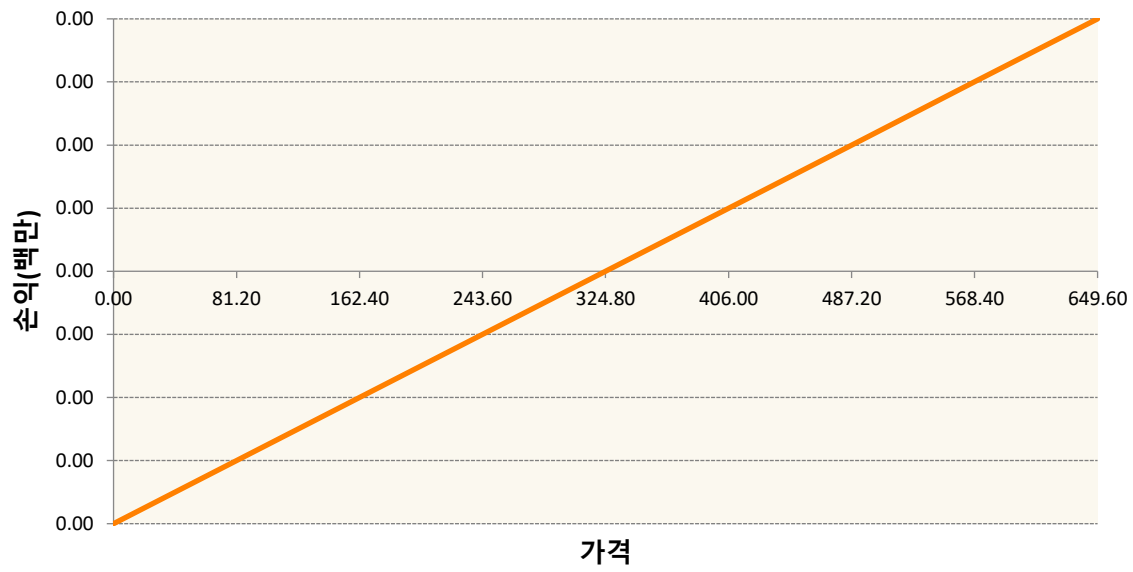


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

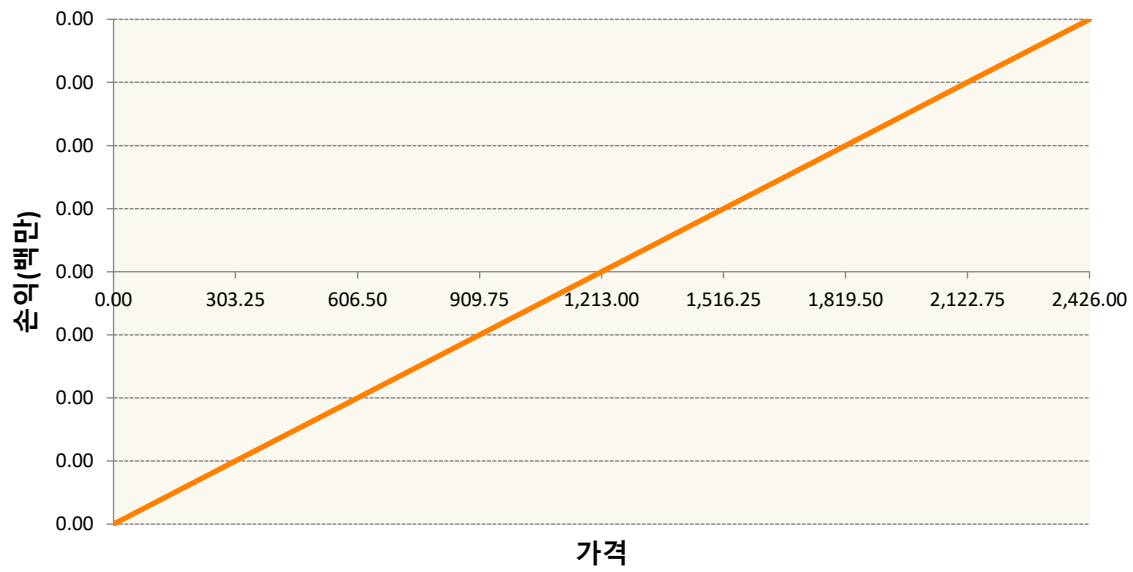




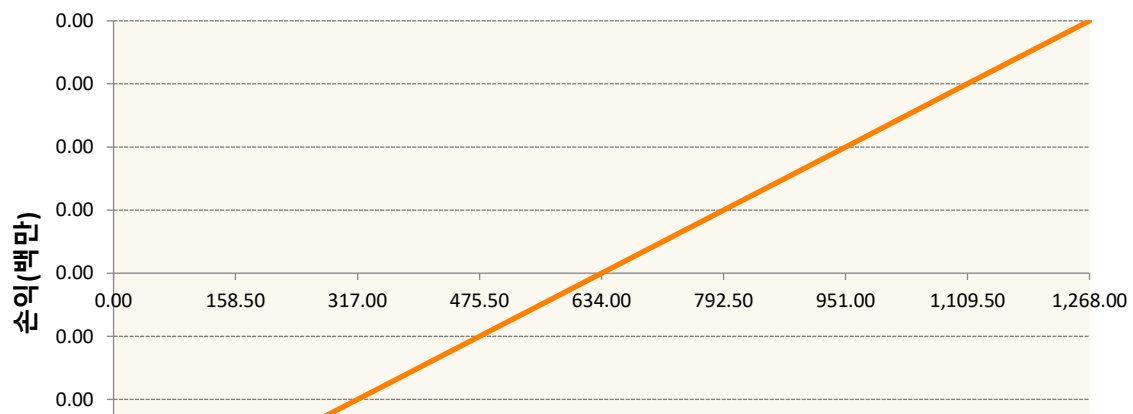
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

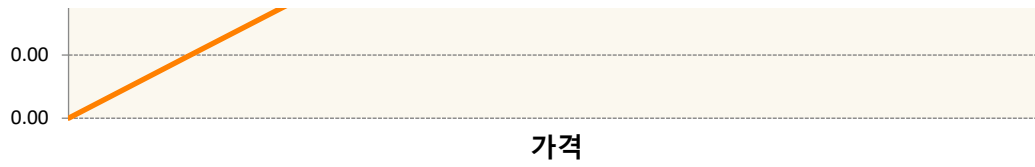


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-05-13
기준일	2026-05-12

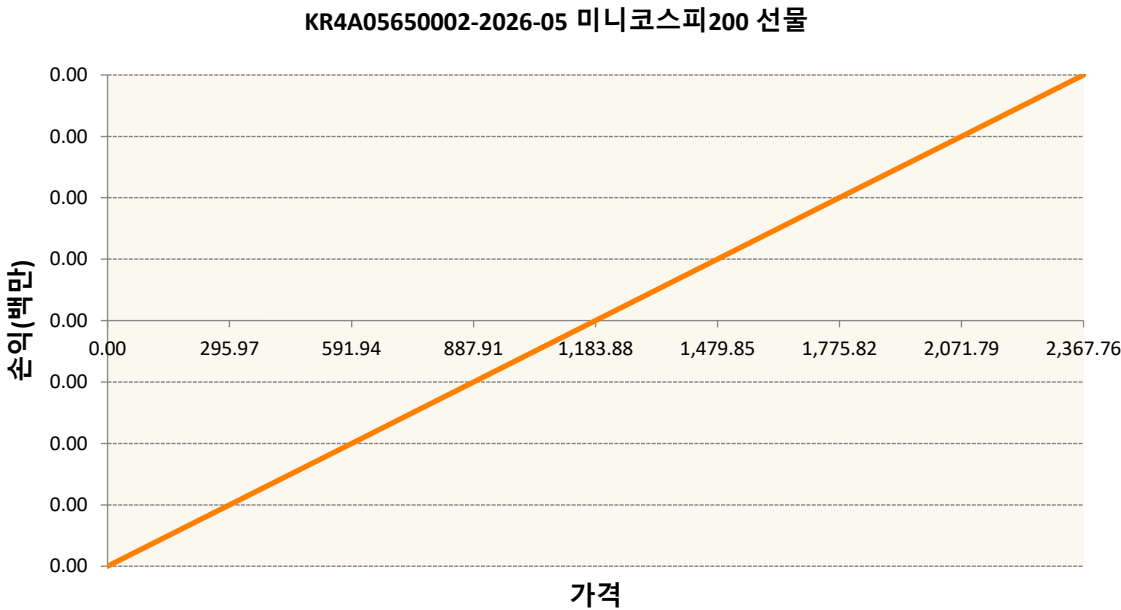
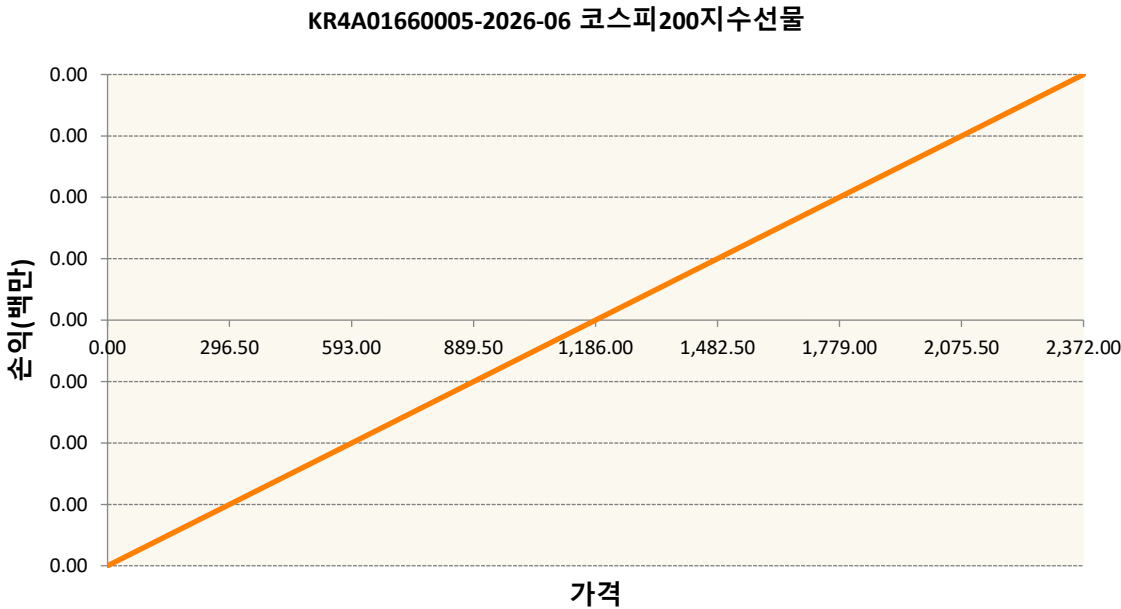
스마트인덱스모

1. 계약금액

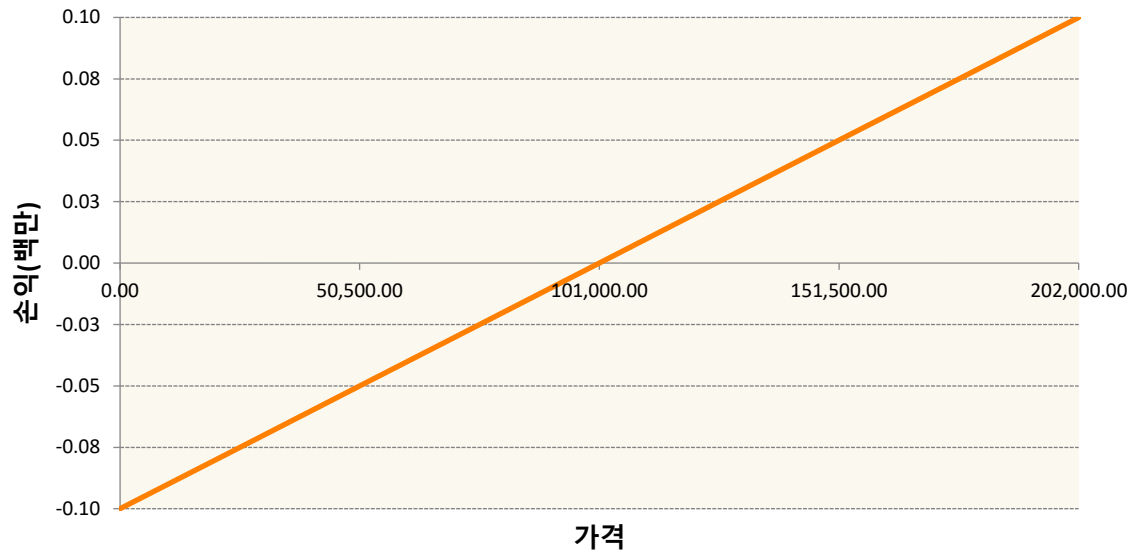
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,236	0	3,236	장내

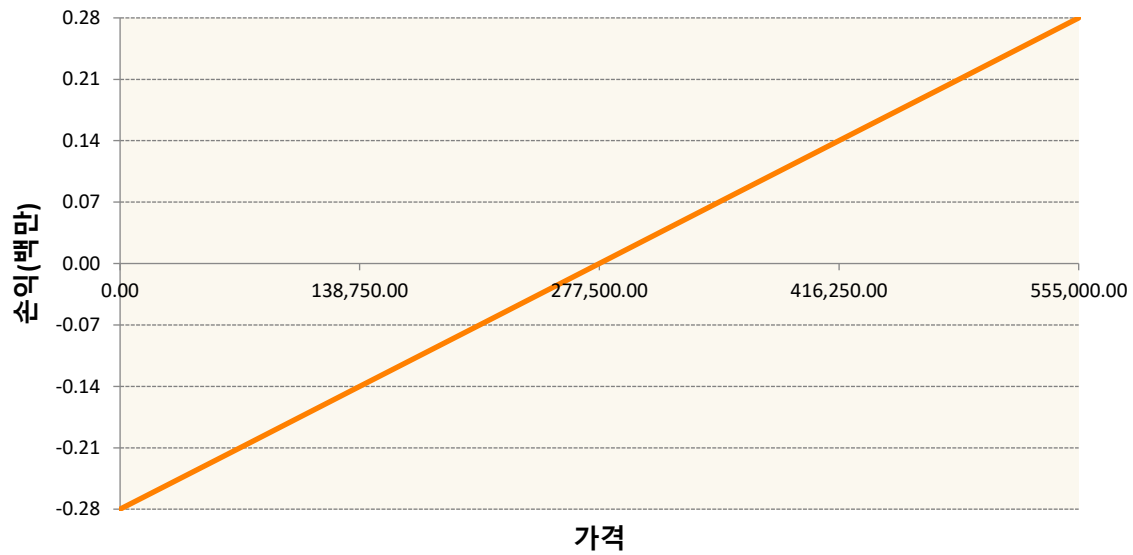
2. 만기시점의 손익구조



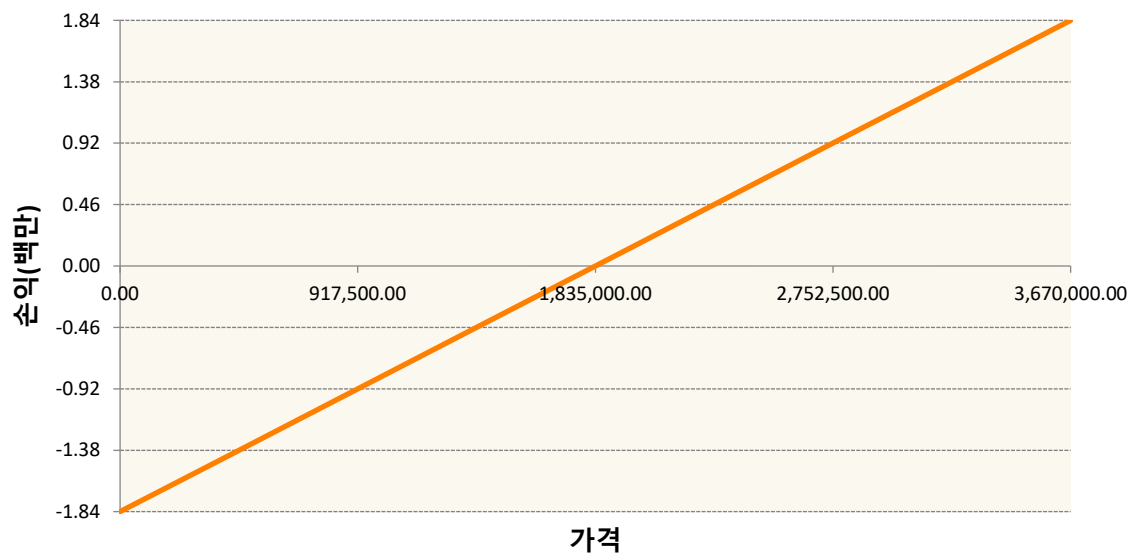
KR4A0F650001-2026-05 두산로보틱스개별선물



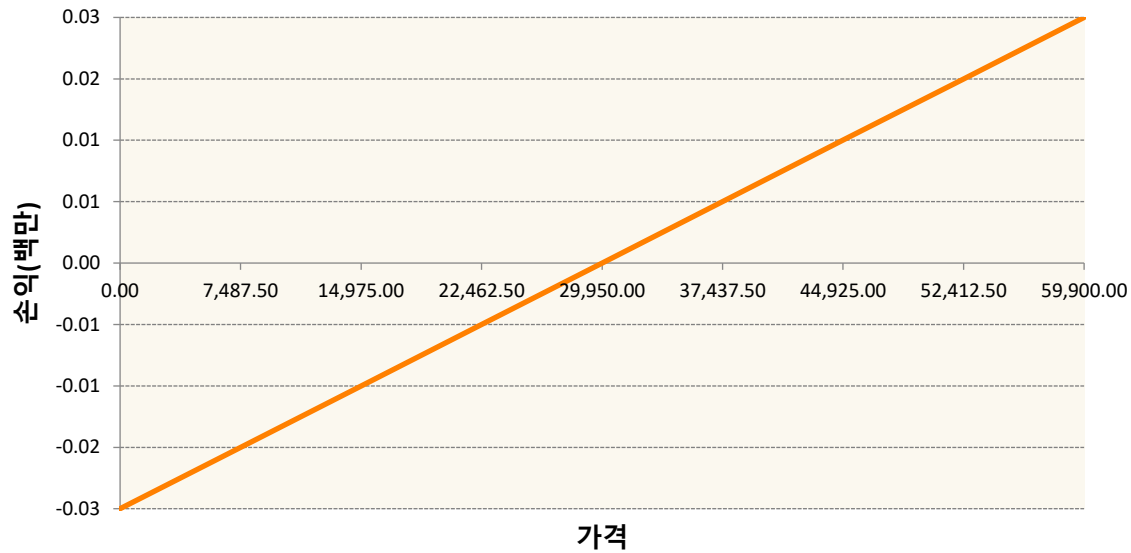
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								166
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166	-166
-5.33%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-2.67%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	55	55	55	55	55	55	55	55
5.33%	110	110	110	110	110	110	110	110
8.00%	166	166	166	166	166	166	166	166
KR4A05650002 2026-05 미니코스피200 선물								5
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	3	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5	5
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							50
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-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%	50	50	50	50	50	50	50
KR4A50650006 2026-05 SK하이닉스개별선물							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%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-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%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	16	16	16	16	16	16	16
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%	-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

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

(단위:백만원)

568

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

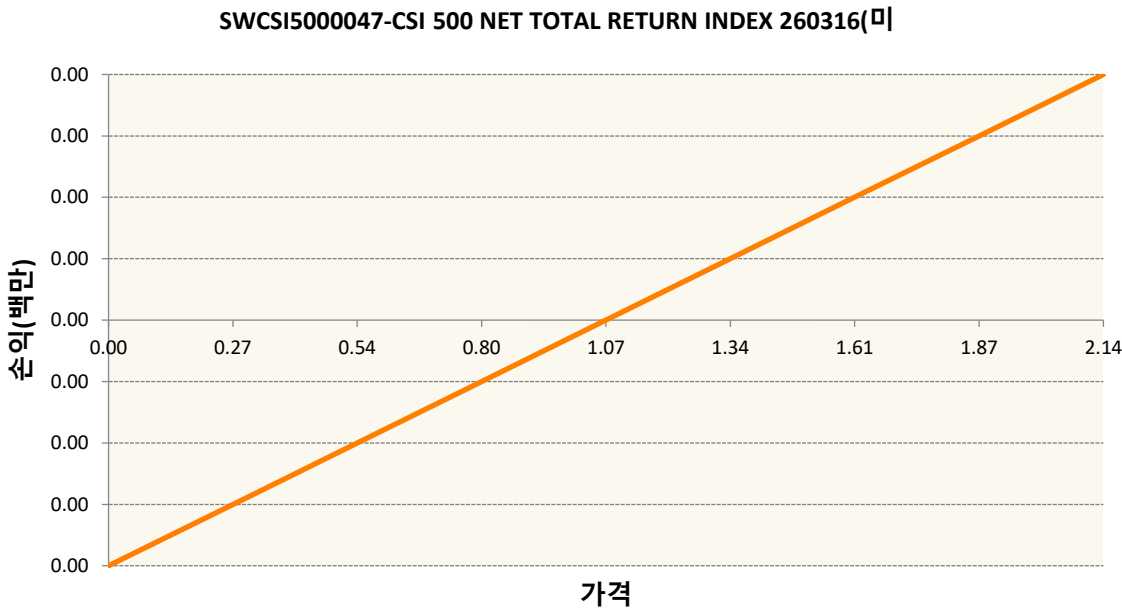
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	6,039	0	6,039	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

484

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

603

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

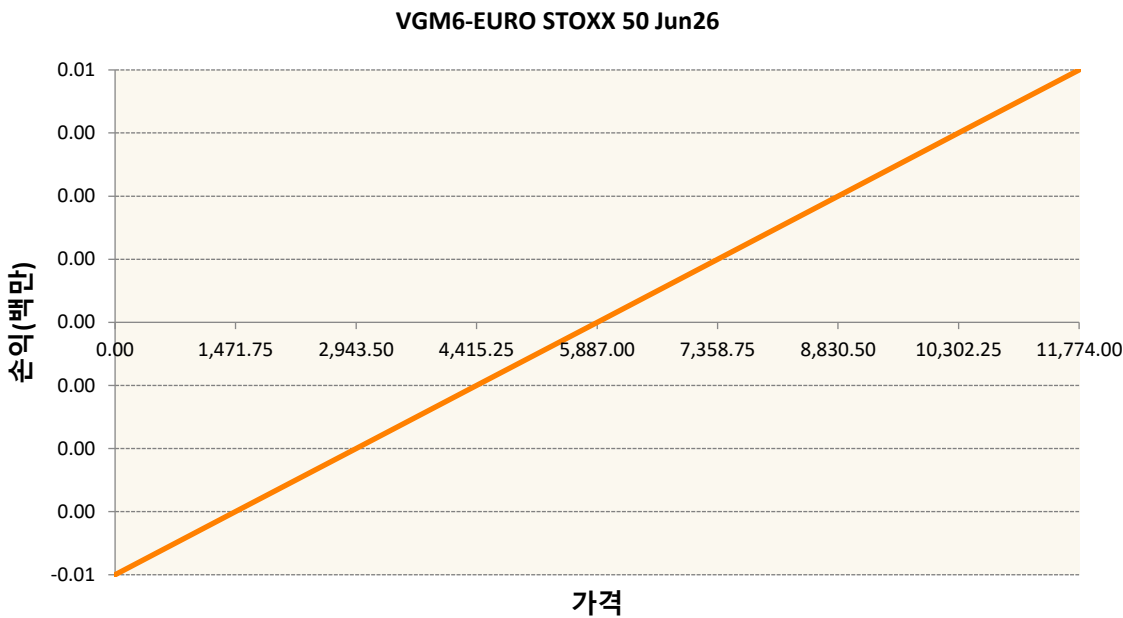
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	908	0	908	

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	2026-05-13
기준일	2026-05-12

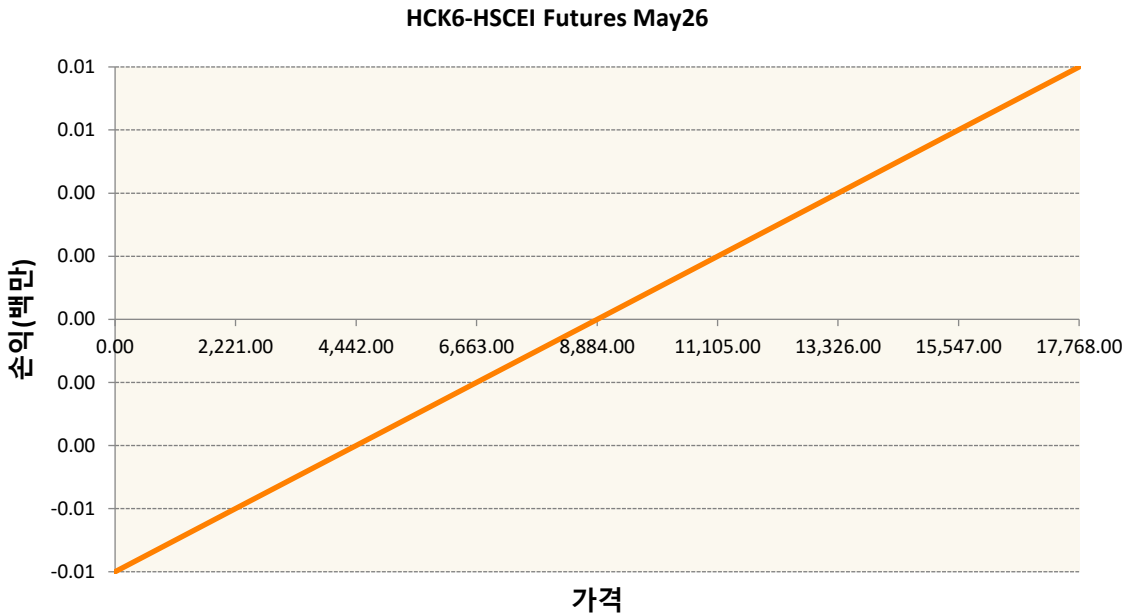
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,671	0	1,671	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

160

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

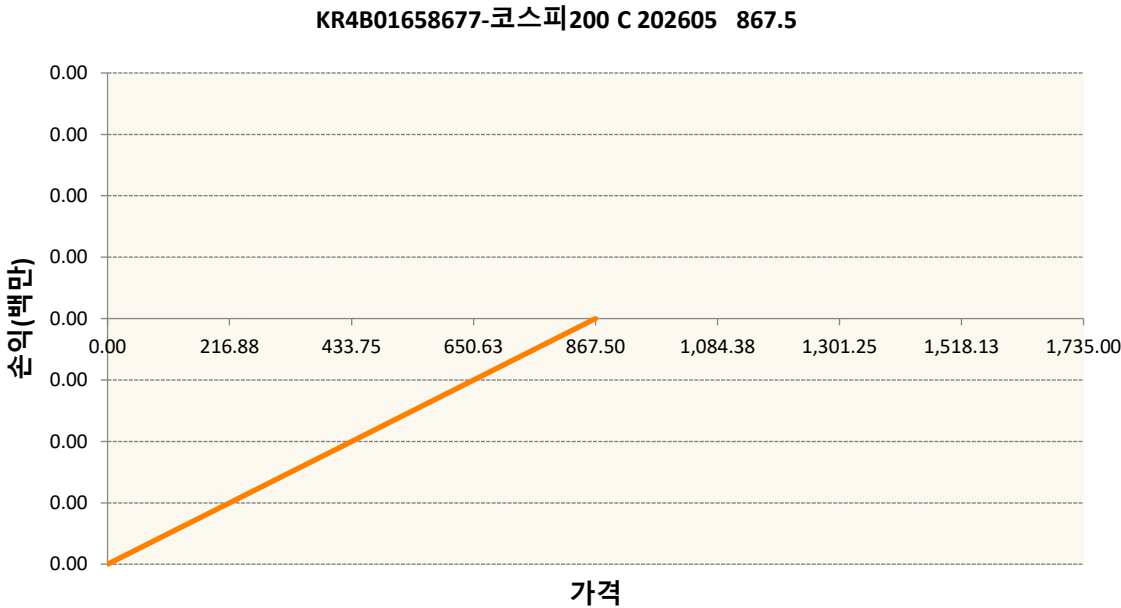
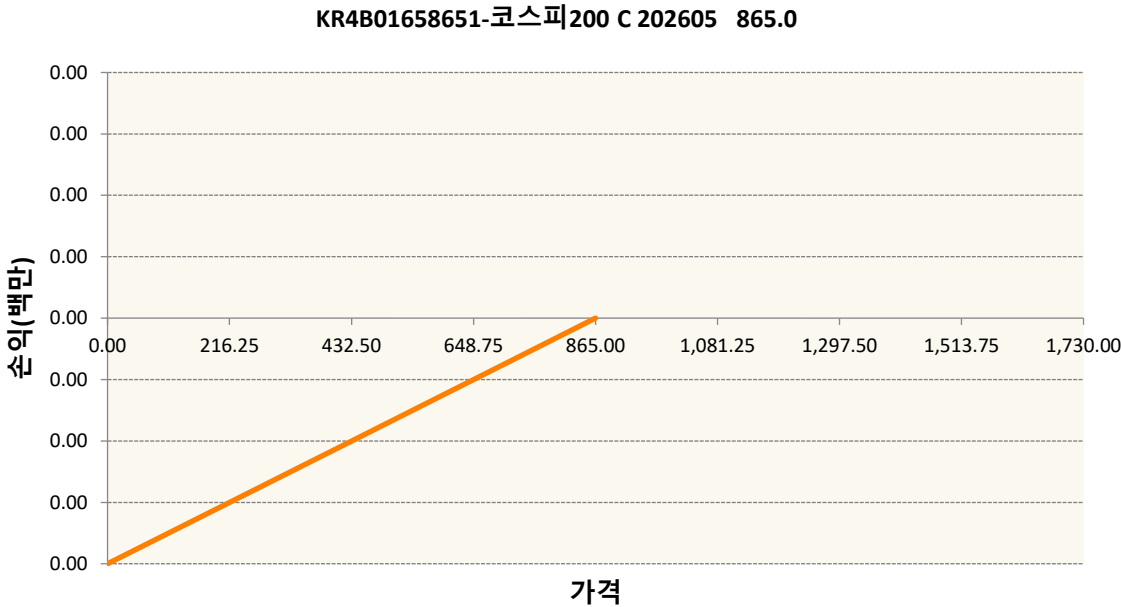
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

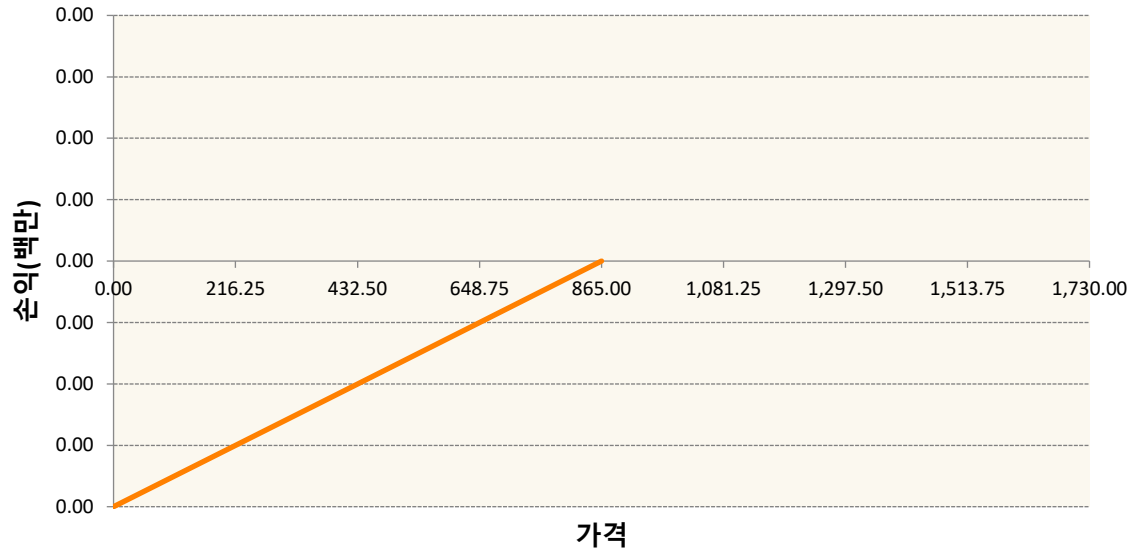
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	27,710	-27,710	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B01658651 코스피200 C 202605 865.0							0
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	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%	0	0	0	0	0	0	0
KR4B01658677 코스피200 C 202605 867.5							0
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	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%	0	0	0	0	0	0	0
KR4C01658650 코스피200 P 202605 865.0							0
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	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%	0	0	0	0	0	0	0

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-05-13

기준일 2026-05-12

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	2026-05-13
기준일	2026-05-12

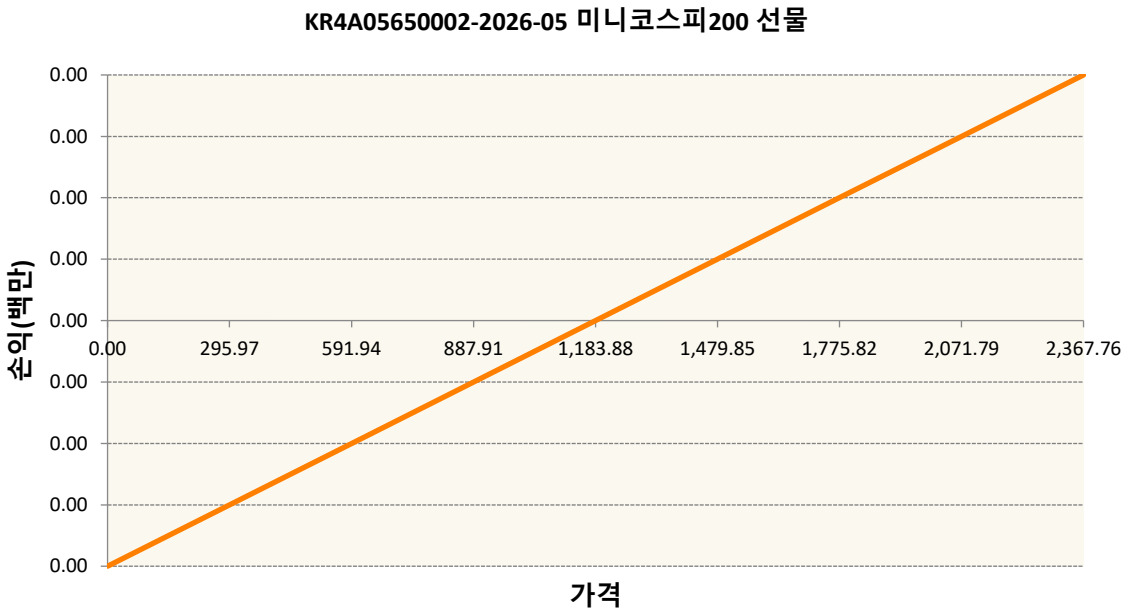
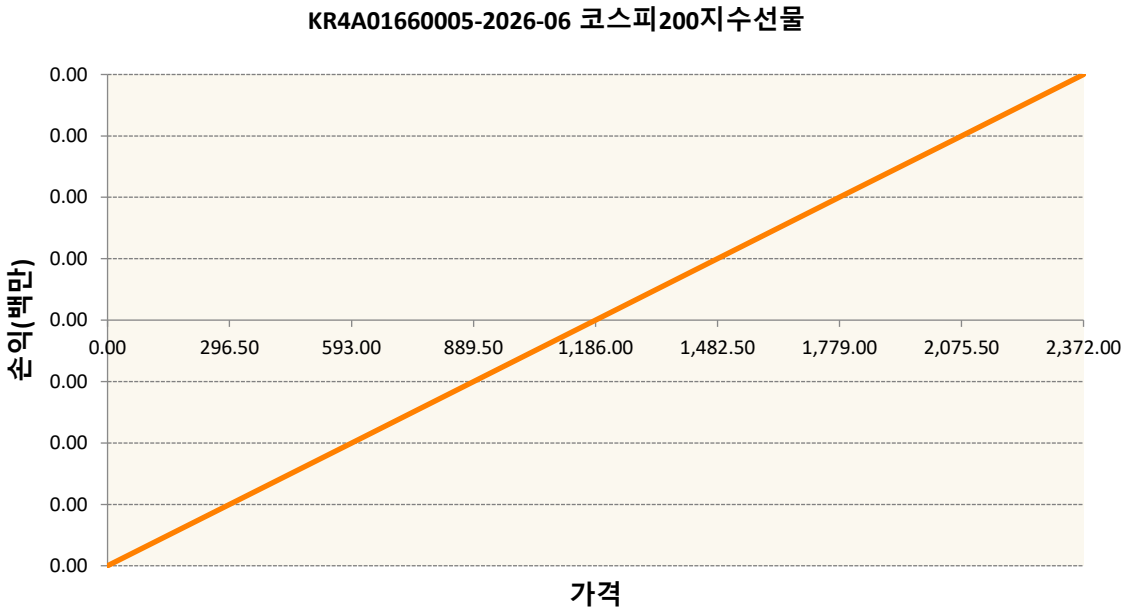
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

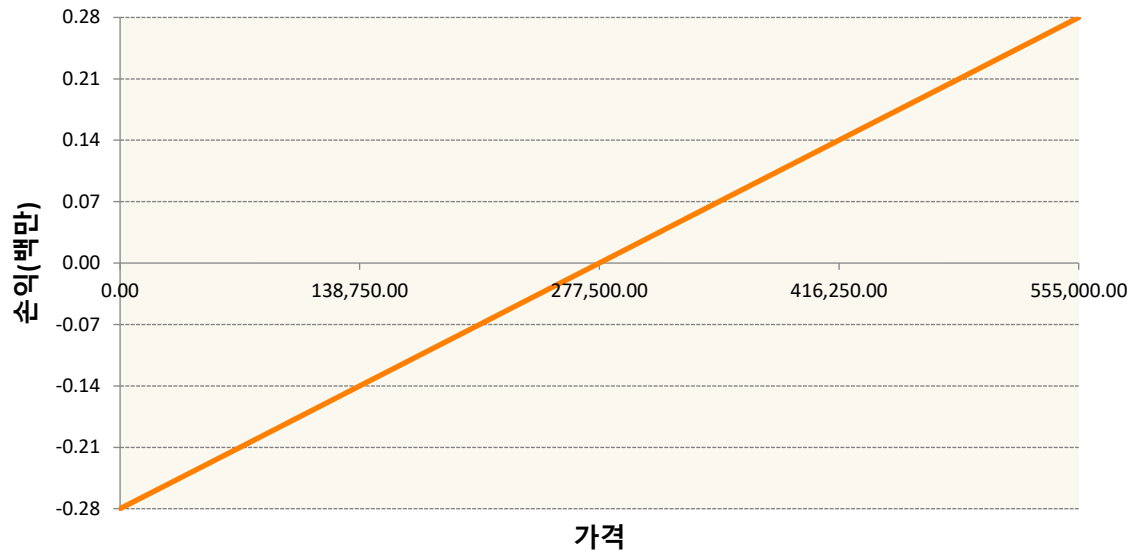
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	105	-105	장내
누계	유가증권	선물	2,246	107	2,139	장내

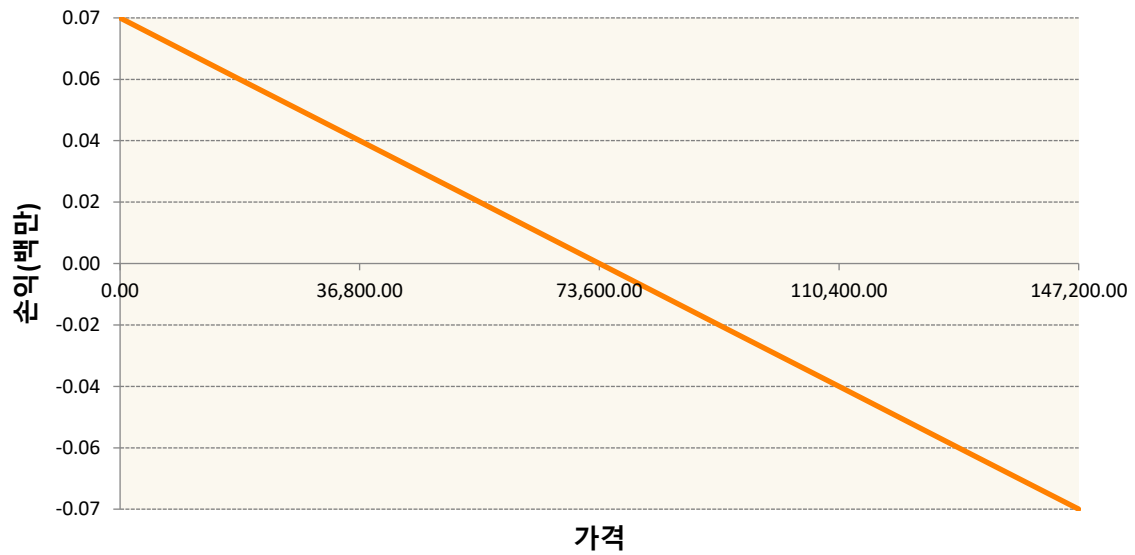
2. 만기시점의 손익구조



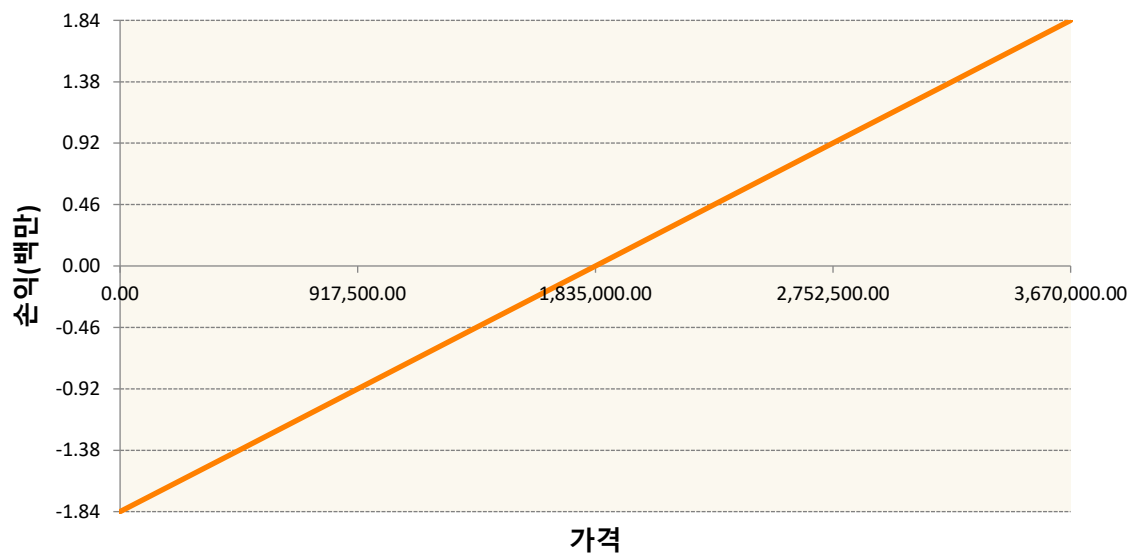
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A48660000-2026-06 미래에셋증권개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		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				
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				
KR4A48660000							2026-06 미래에셋증권개별선물		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				
KR4A50650006							2026-05 SK하이닉스개별선물		12		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-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%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

347

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

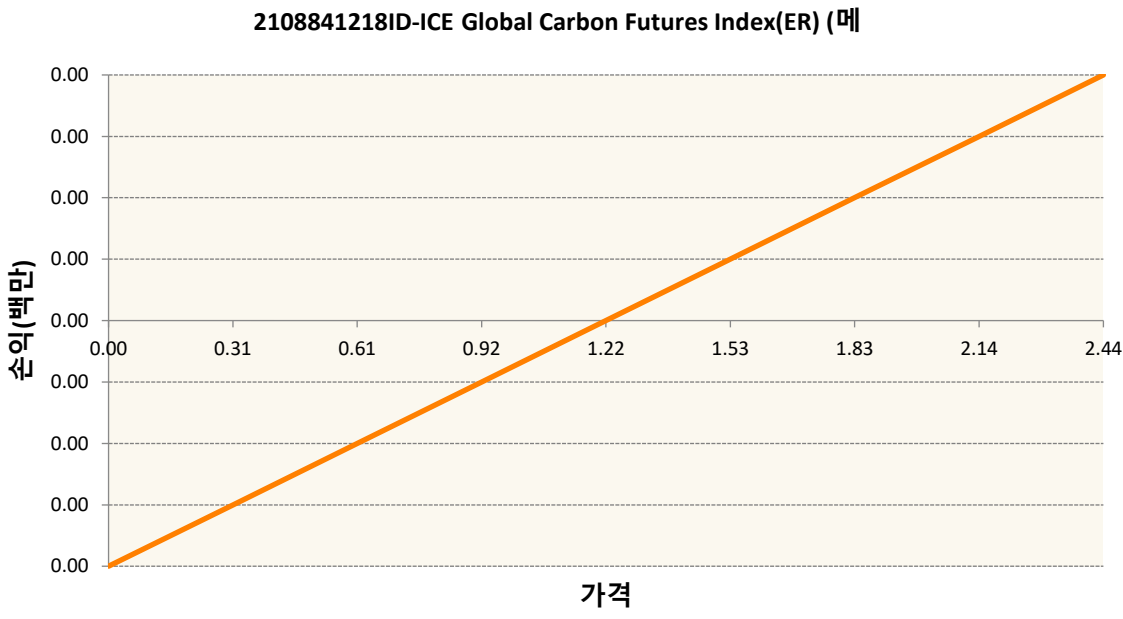
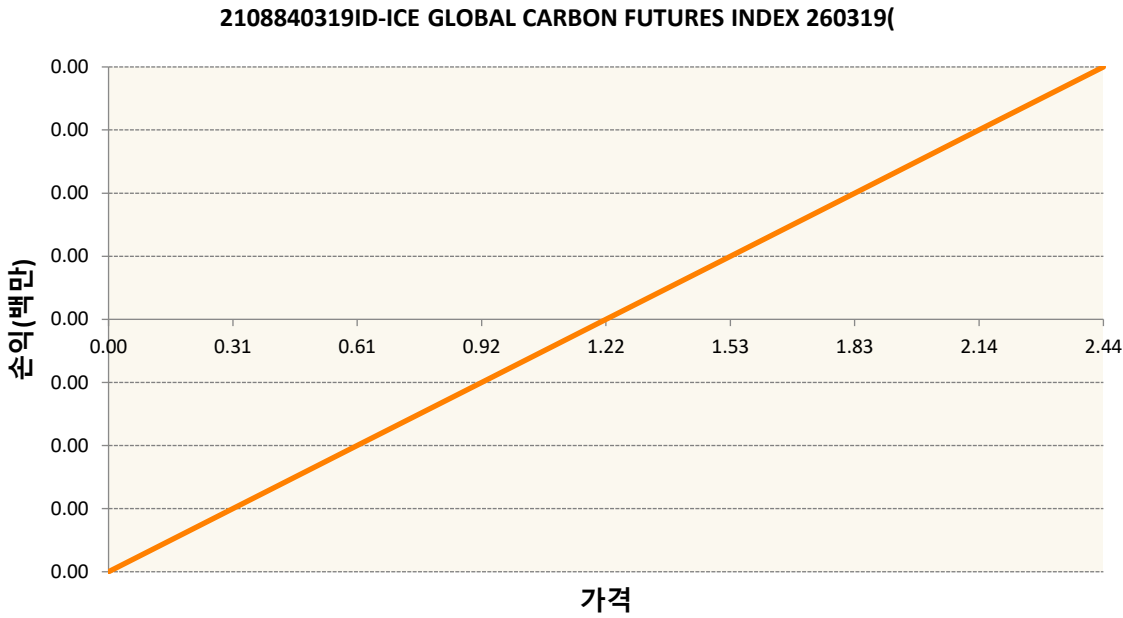
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,010	0	7,010	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		450
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		113

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	647

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

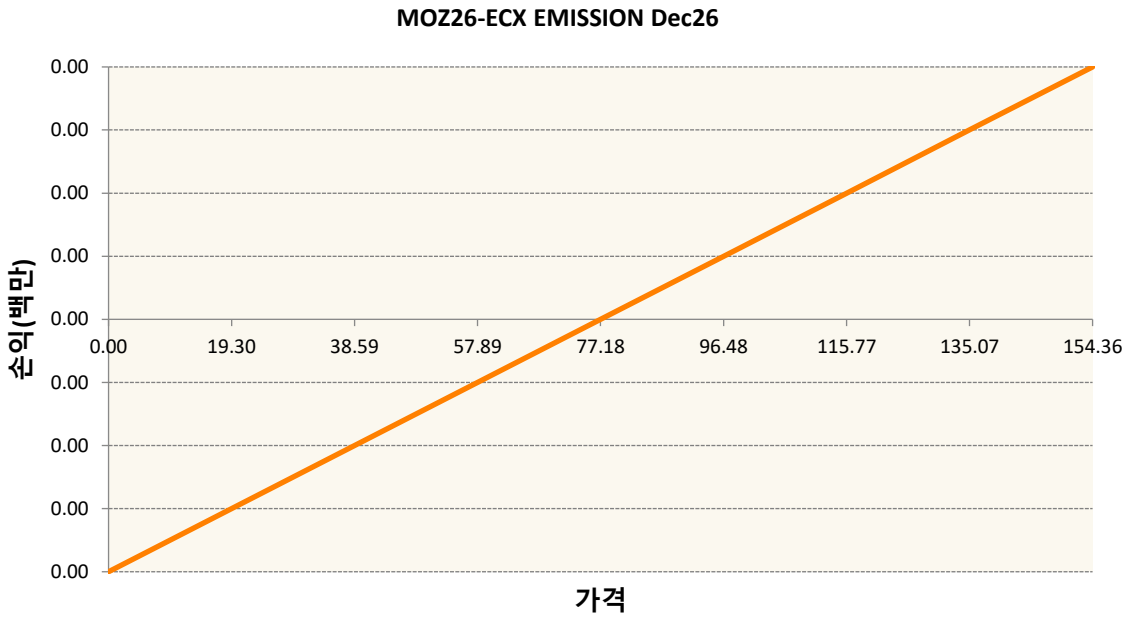
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,977	0	4,977	
누계	통화	선도	0	2,389	-2,389	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	191
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	398

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

(단위:백만원)

687

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

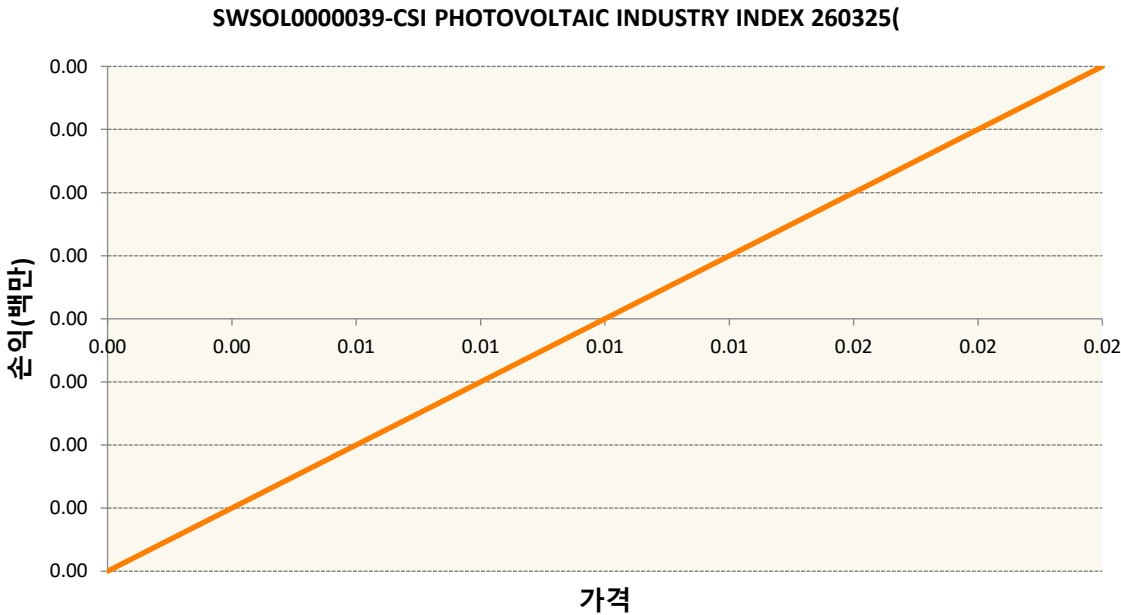
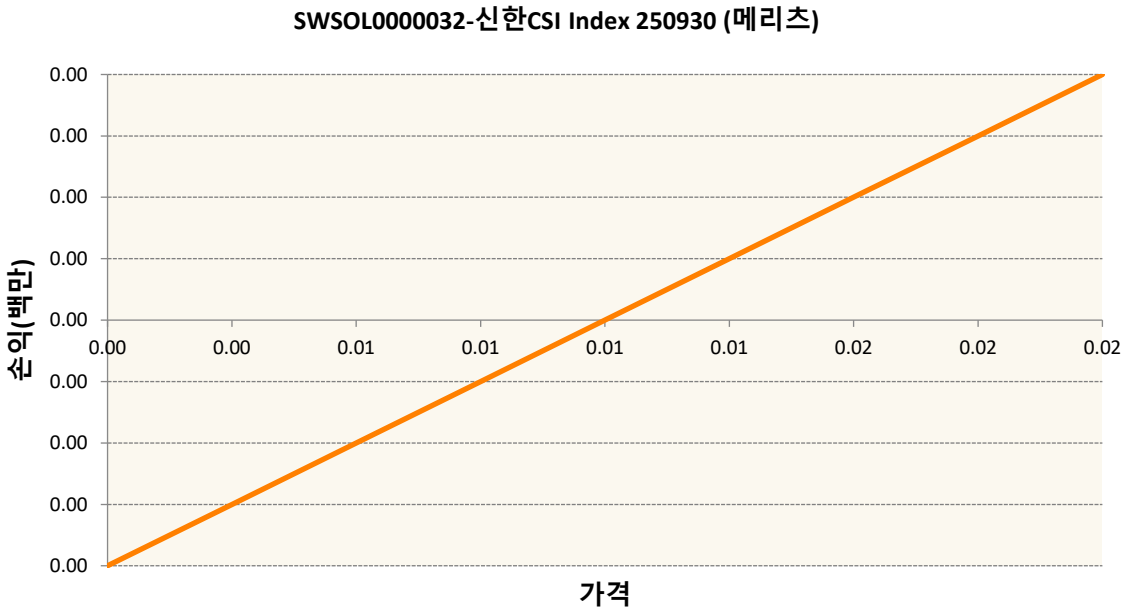
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,018	0	2,018	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)		1
SWSOL00000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)		1
SWSOL00000(신한CSI Index 250930 (메리츠)		2
SWSOL00000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	8

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

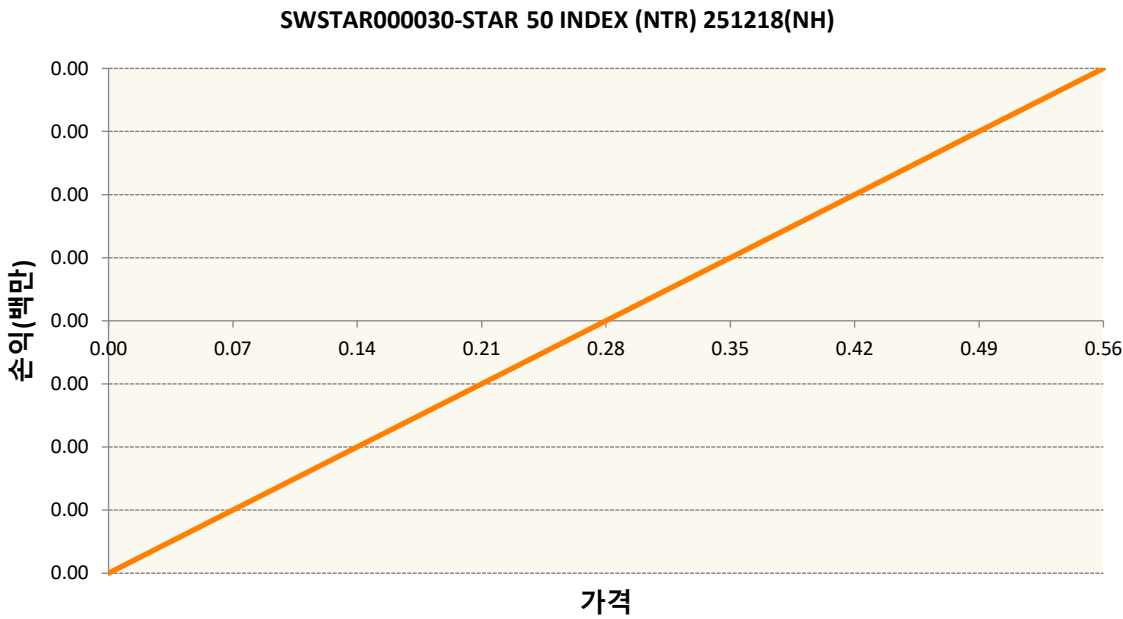
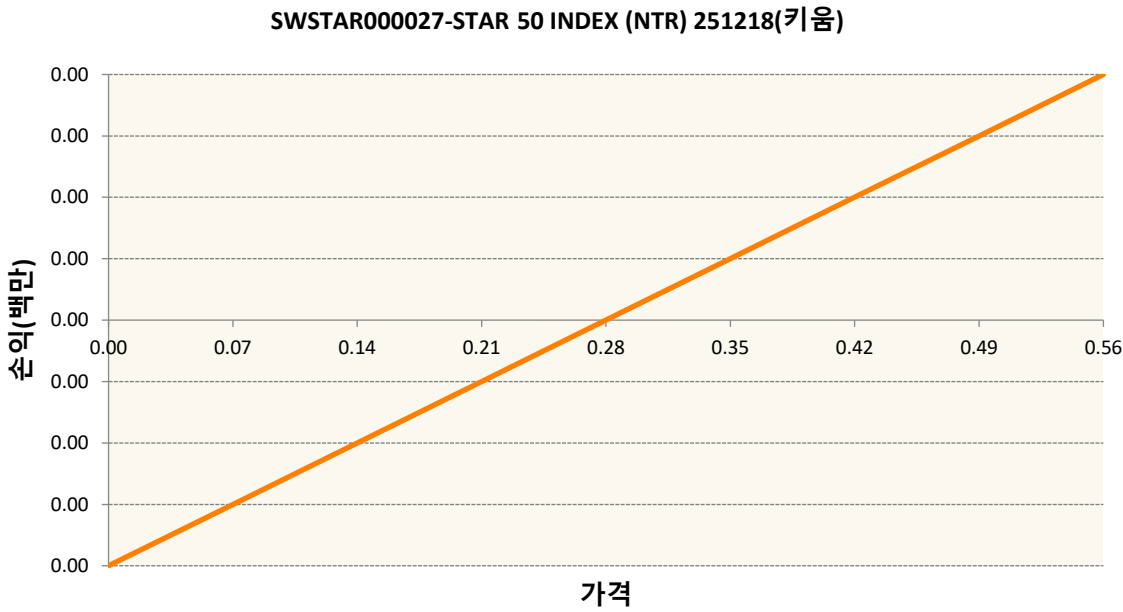
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

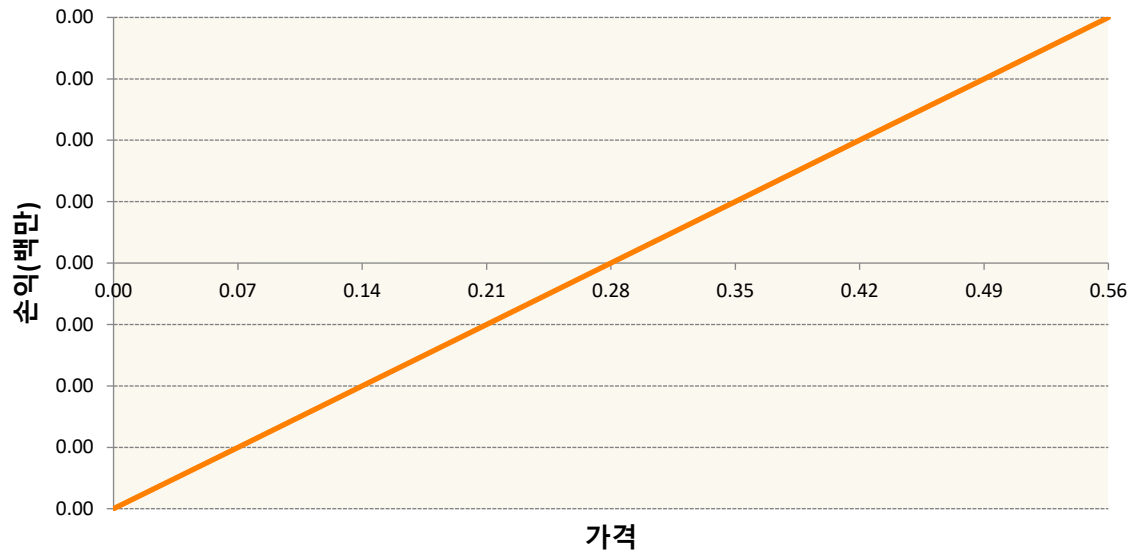
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,082	0	7,082	장외

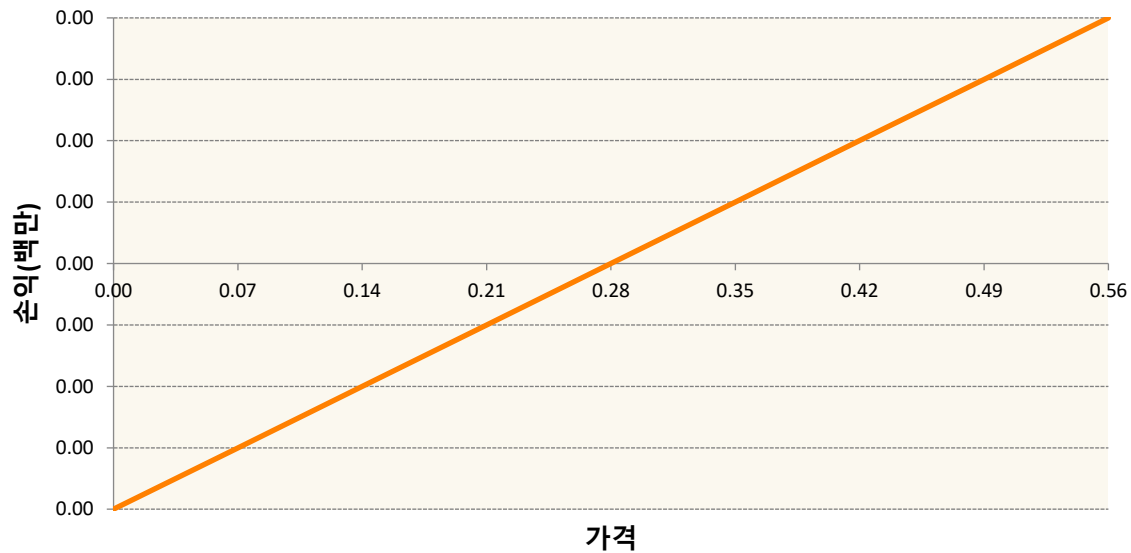
2. 만기시점의 손익구조



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)	20
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	69
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	353
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	131

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

(단위:백만원)

874

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

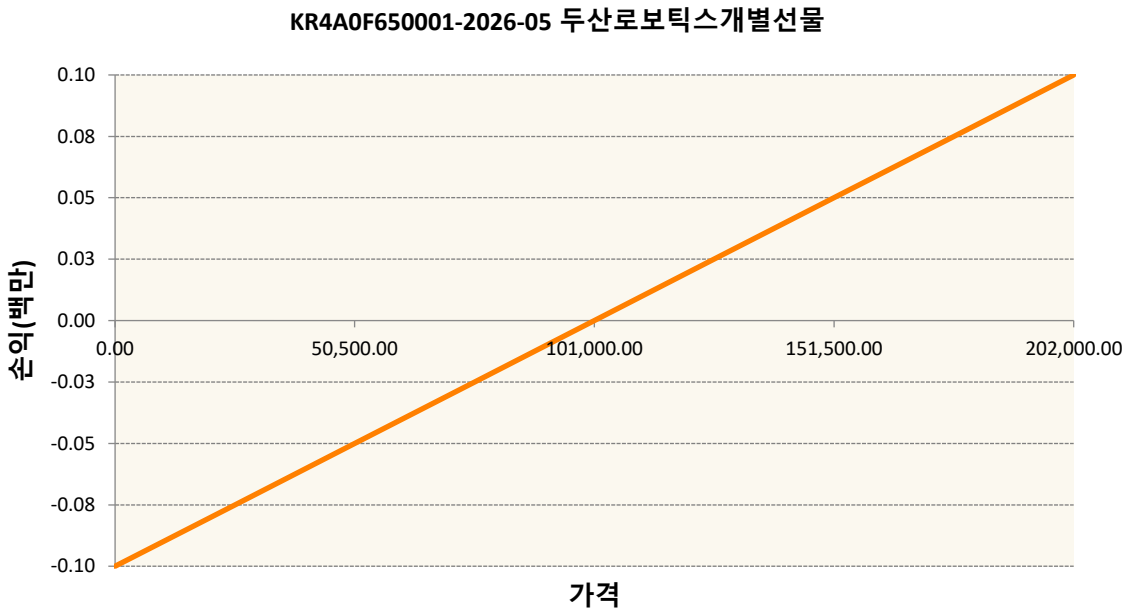
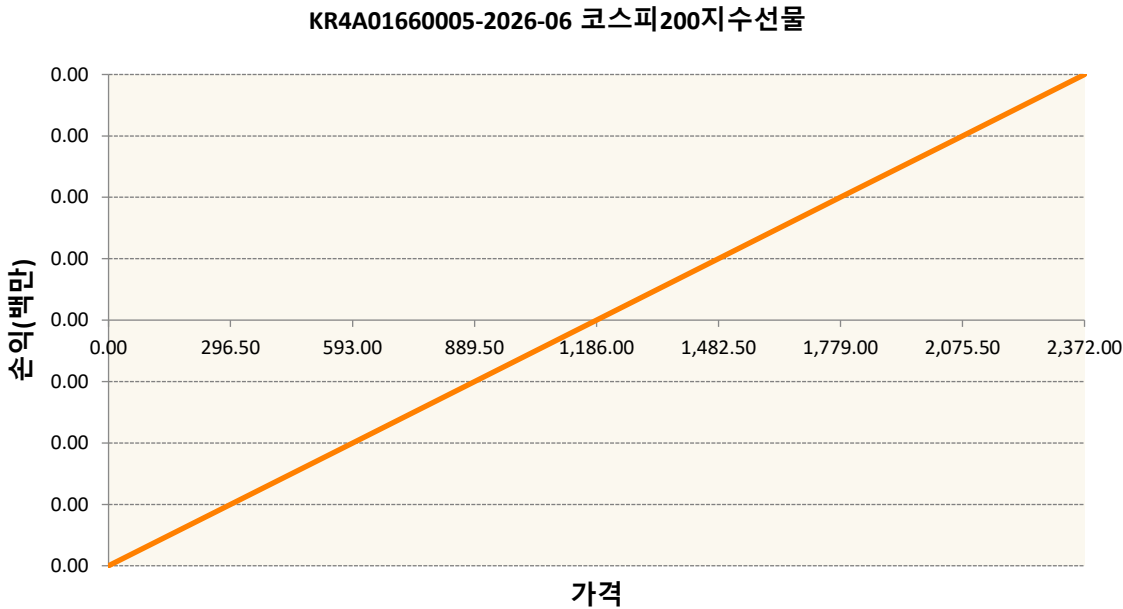
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

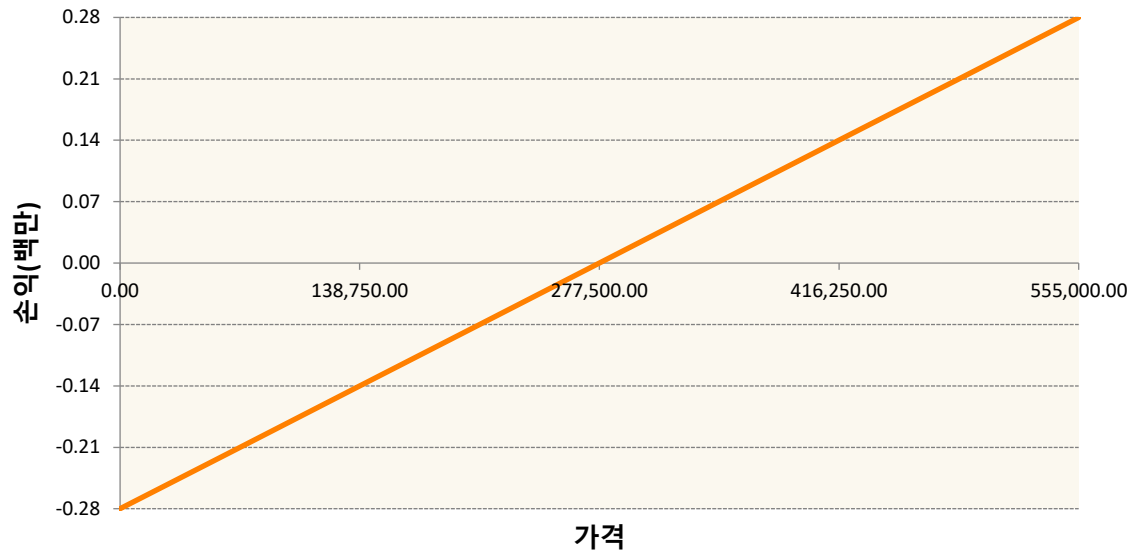
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,848	3,660	-1,813	장내
누계	유가증권	선물	24,904	4,275	20,628	장내

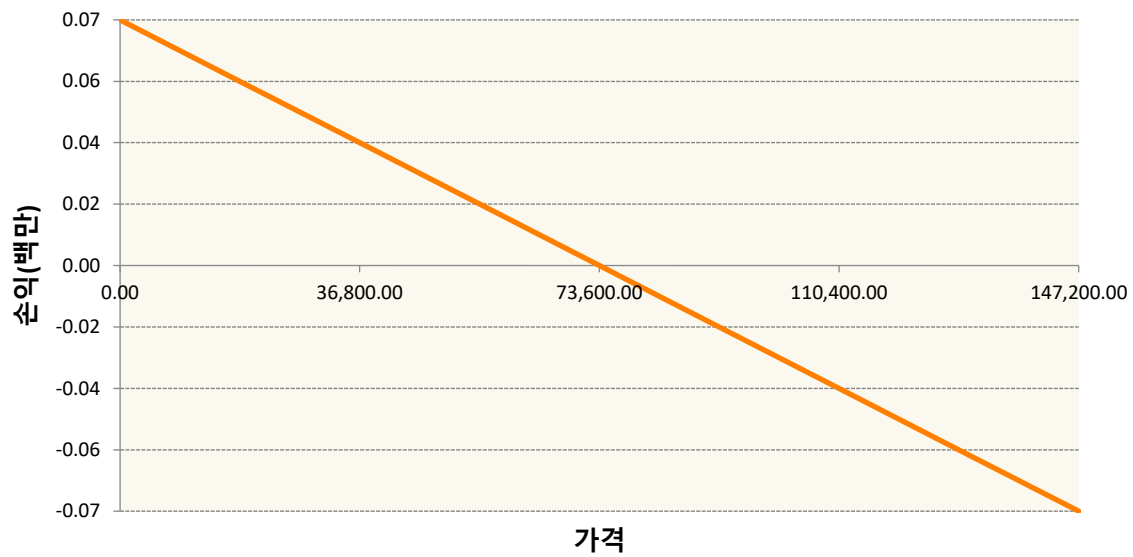
2. 만기시점의 손익구조



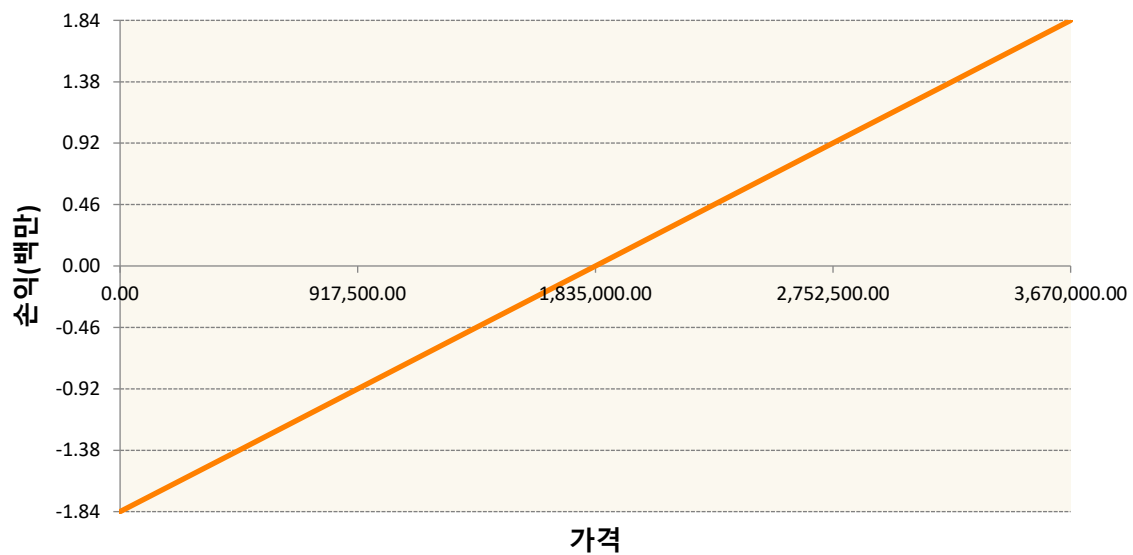
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



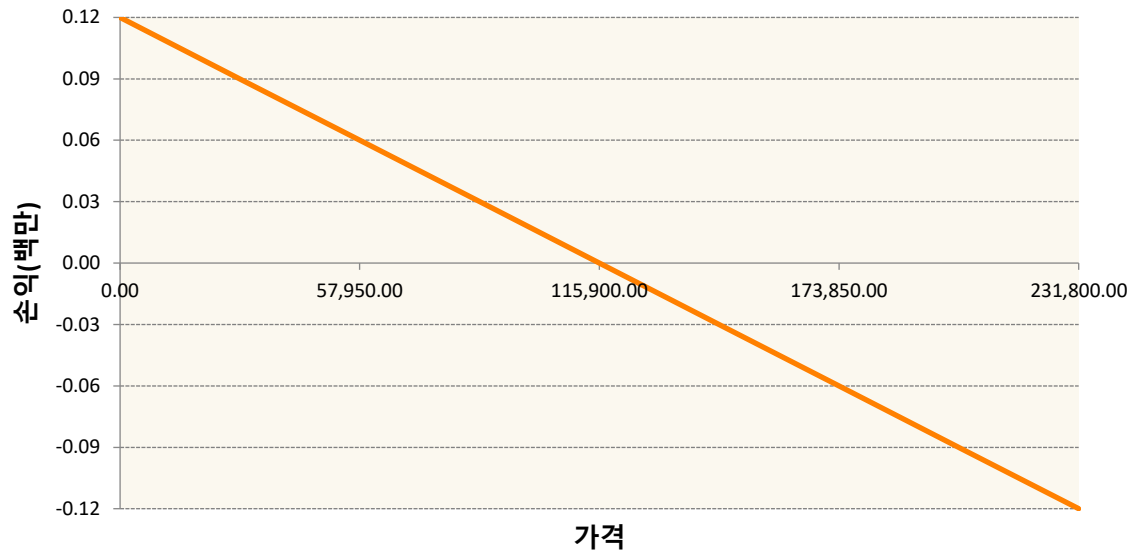
KR4A48660000-2026-06 미래에셋증권개별선물



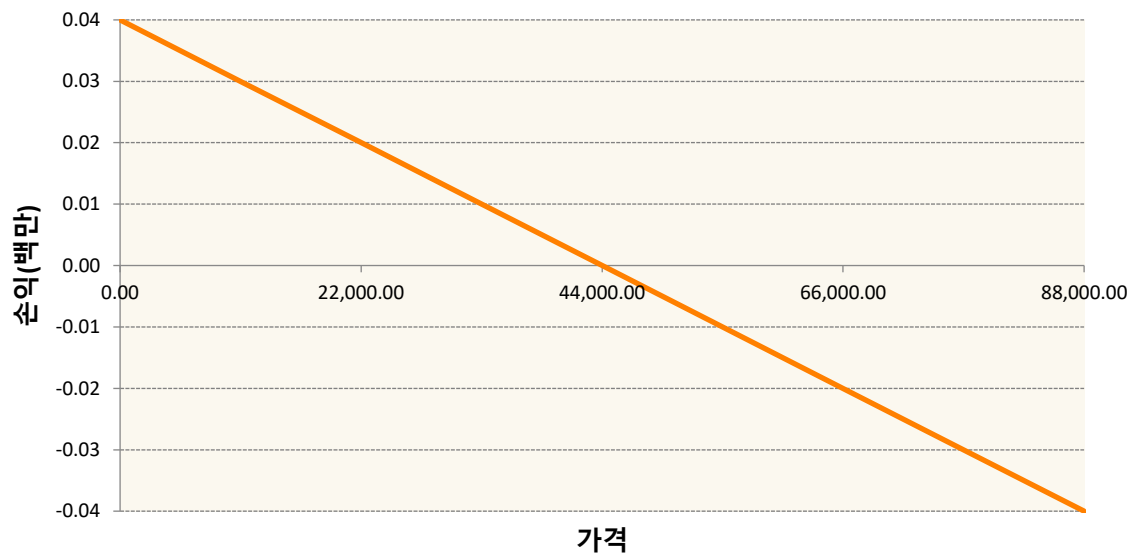
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



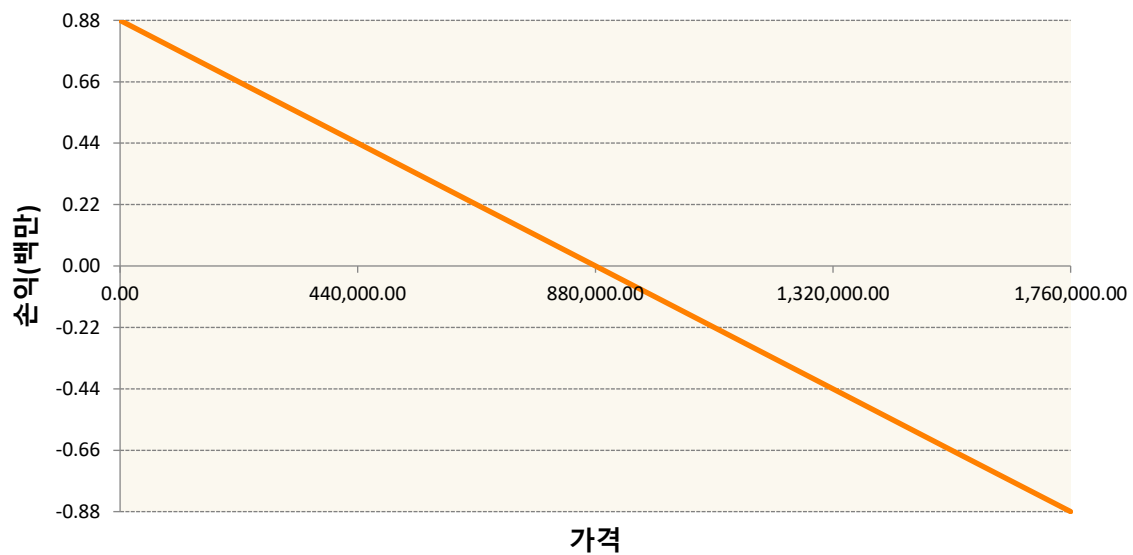
KR4AB2650003-2026-05 S-Oil개별선물



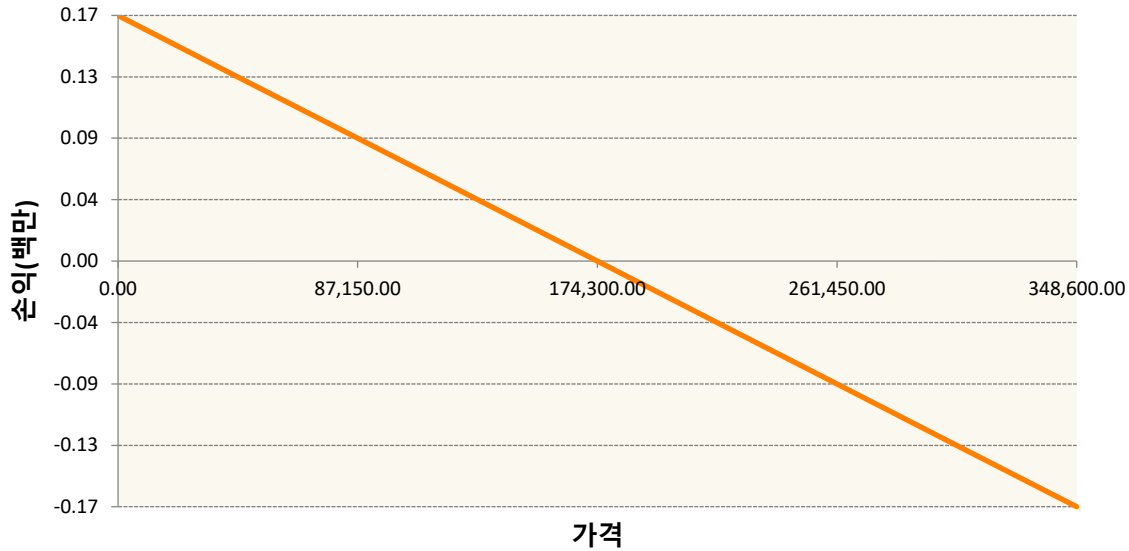
KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



KR4ADB650009-2026-05 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선



KR4AFM650004-2026-05 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						1,586
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,586	-1,586	-1,586	-1,586	-1,586	-1,586	-1,586	
-5.33%	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	
-2.67%	-529	-529	-529	-529	-529	-529	-529	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	529	529	529	529	529	529	529	
5.33%	1,057	1,057	1,057	1,057	1,057	1,057	1,057	
8.00%	1,586	1,586	1,586	1,586	1,586	1,586	1,586	
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						231
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231	
-5.33%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154	
-2.67%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
0%	0	0	0	0	0	0	0	

2.67%	77	77	77	77	77	77	77
5.33%	154	154	154	154	154	154	154
8.00%	231	231	231	231	231	231	231

KR4A48660000	2026-06 미래에셋증권개별선물	104
--------------	--------------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	104	104	104	104	104	104	104
-5.33%	69	69	69	69	69	69	69
-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%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104

KR4A50650006	2026-05 SK하이닉스개별선물	159
--------------	--------------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-159	-159	-159	-159	-159	-159	-159
-5.33%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106
-2.67%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	53	53	53	53	53	53	53
5.33%	106	106	106	106	106	106	106
8.00%	159	159	159	159	159	159	159

KR4AB2650003	2026-05 S-Oil개별선물	32
--------------	-------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	32	32	32	32	32	32	32
-5.33%	21	21	21	21	21	21	21
-2.67%	11	11	11	11	11	11	11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32

KR4ACF650006	2026-05 카카오개별선물	111
--------------	-----------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	111	111	111	111	111	111	111
-5.33%	74	74	74	74	74	74	74
-2.67%	37	37	37	37	37	37	37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111

KR4ADB650009	2026-05 LG디펜스앤에어로스페이스개별선	66
--------------	--------------------------	----

	기초자산의 변동성
--	-----------

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	66	66	66	66	66	66	66
-5.33%	44	44	44	44	44	44	44
-2.67%	22	22	22	22	22	22	22
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66

KR4AFM650004

2026-05 엘앤에프개별선물

29

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29
-5.33%	19	19	19	19	19	19	19
-2.67%	10	10	10	10	10	10	10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29

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

(단위:백만원)

5,115

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

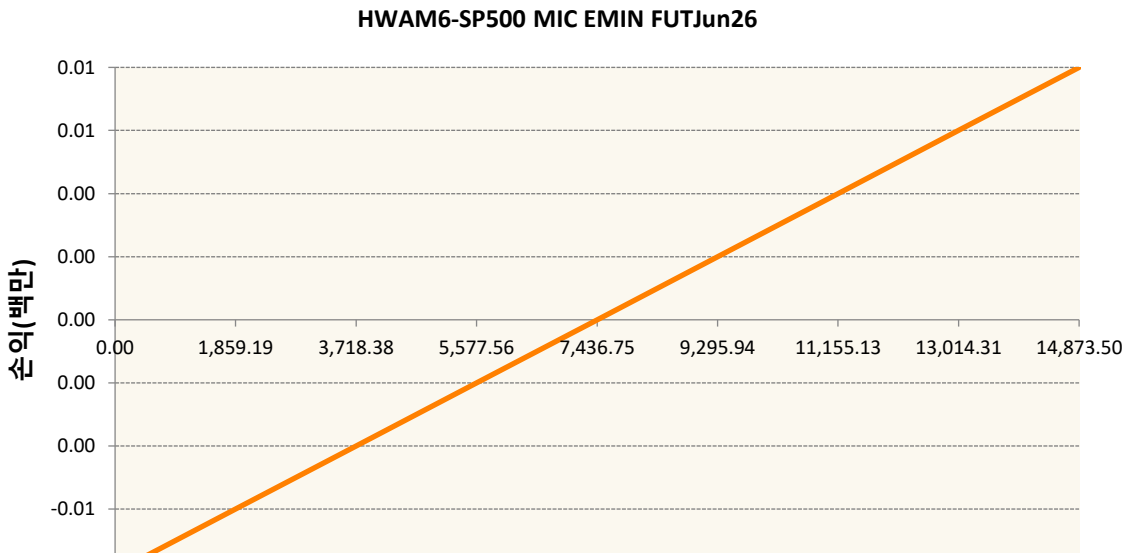
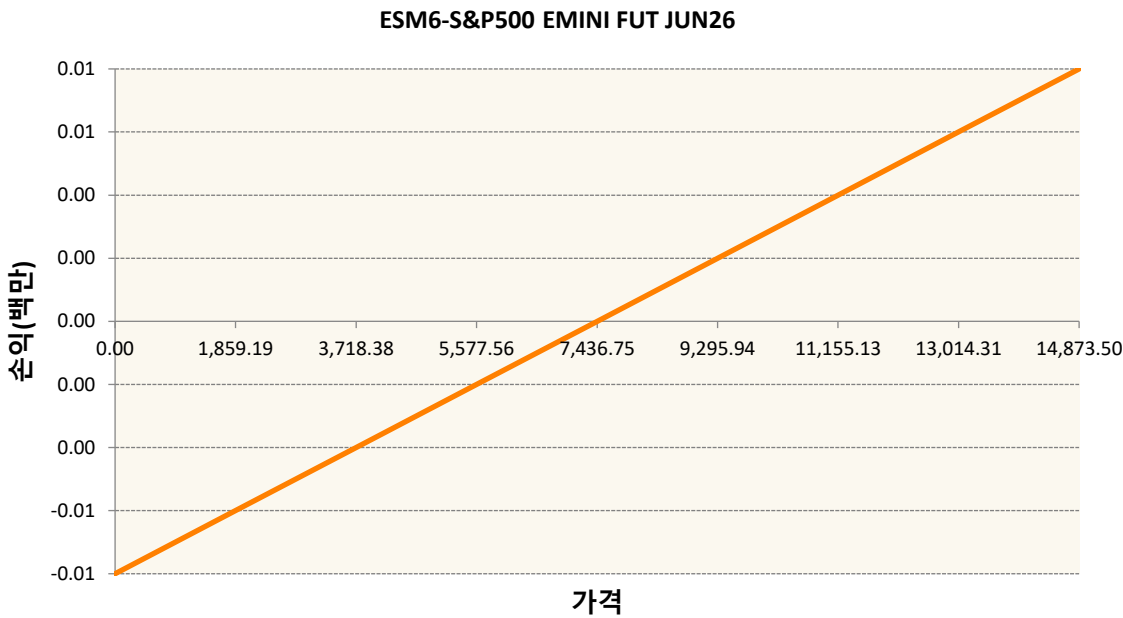
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

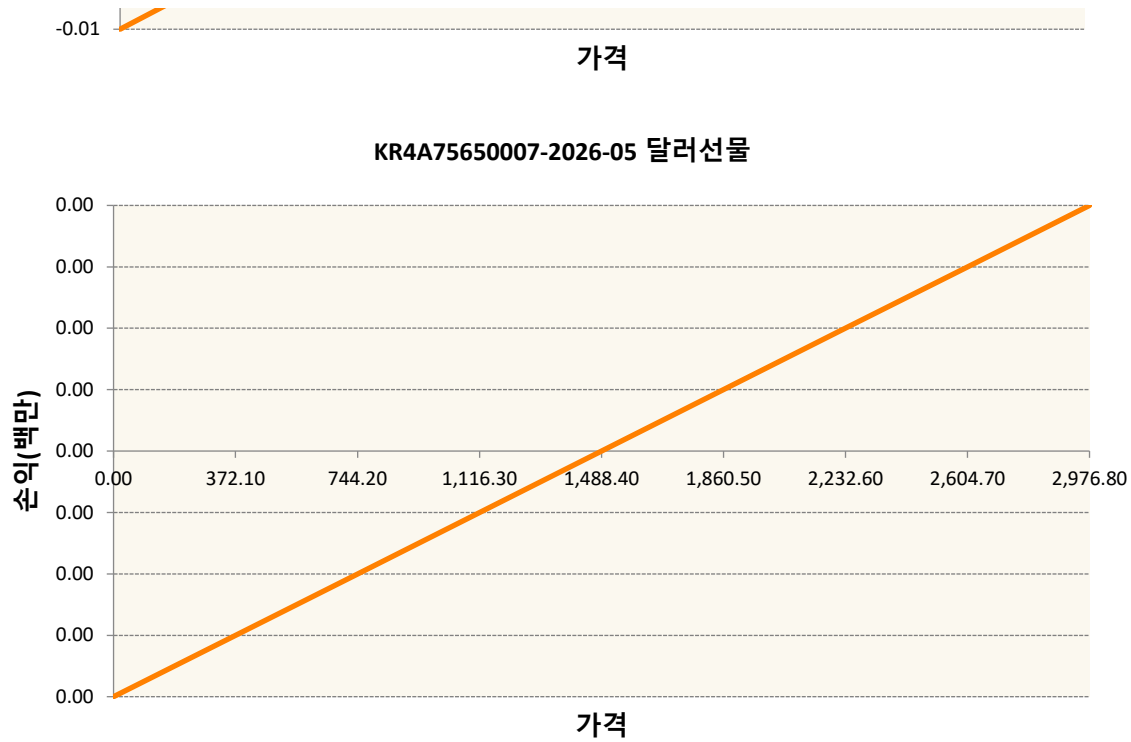
1. 계약금액

(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	60,148	0	60,148	
누계	지수	선물	277	0	277	장내
누계	통화	선물	10,568	0	10,568	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,812
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		22
KR4A756500 2026-05 달러선물			845

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,221

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

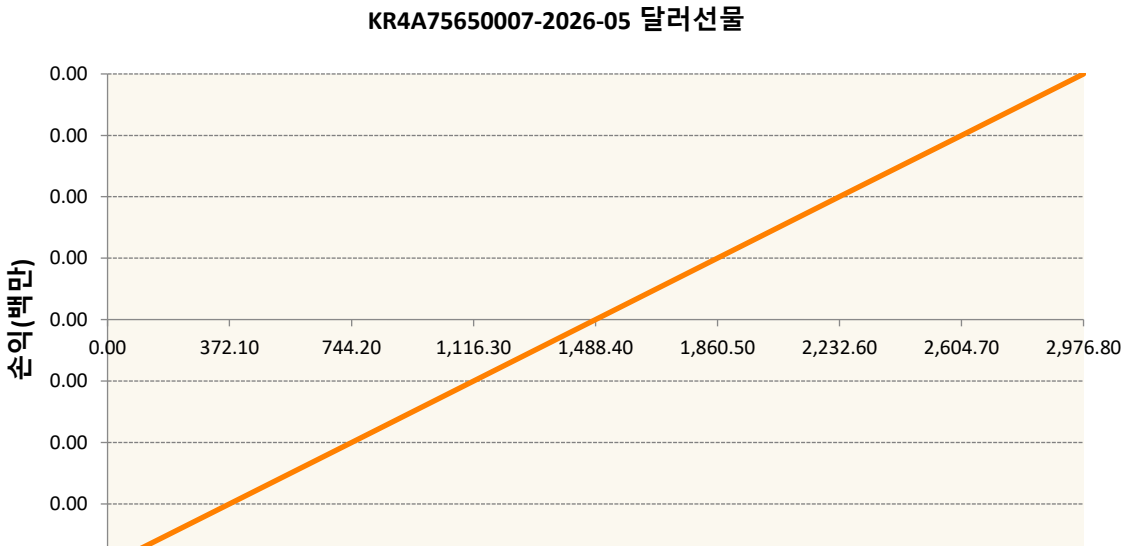
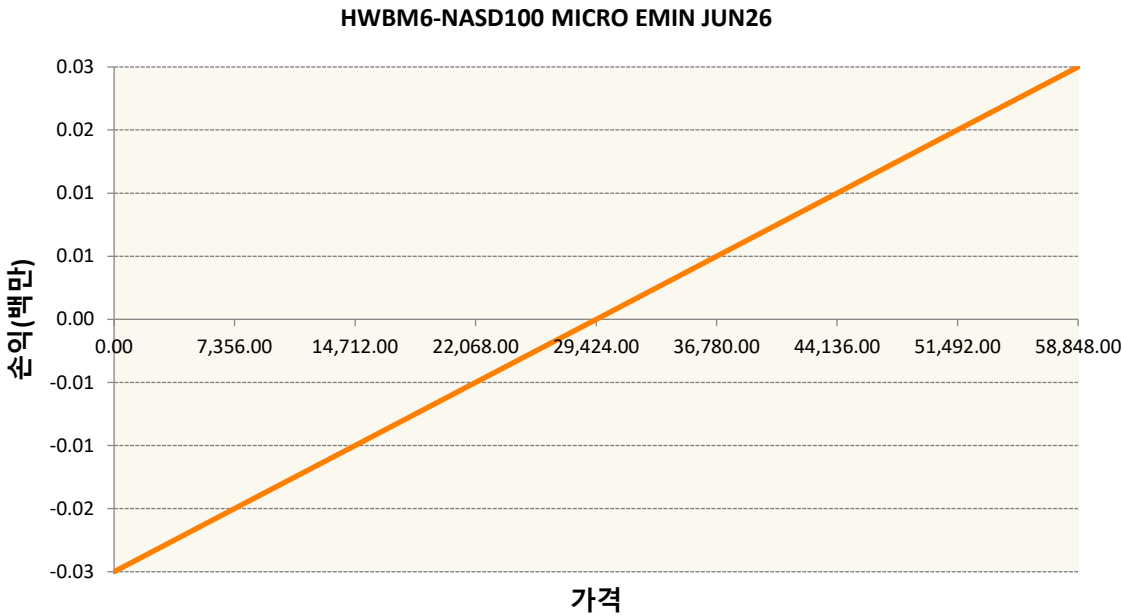
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

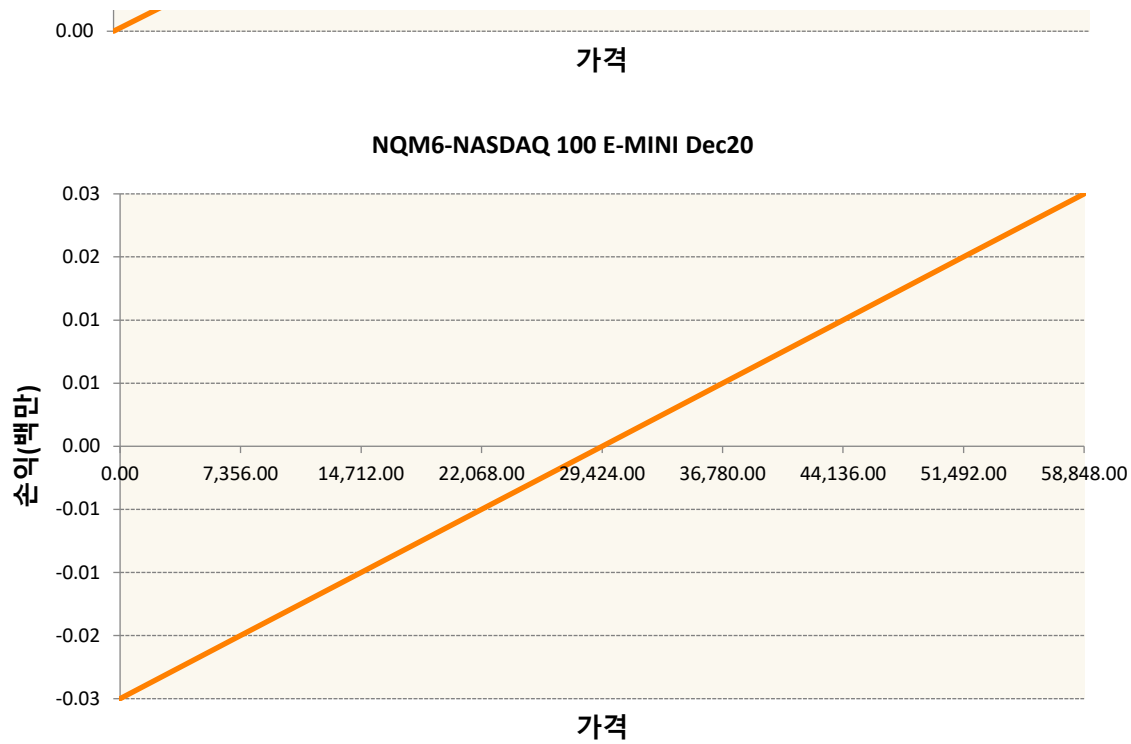
1. 계약금액

(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	29,925	0	29,925	
누계	유가증권	선물	257	0	257	장내
누계	통화	선물	3,885	0	3,885	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	21
KR4A756500	2026-05 달러선물	311
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,394

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

2,672

공시일	2026-05-13
기준일	2026-05-12

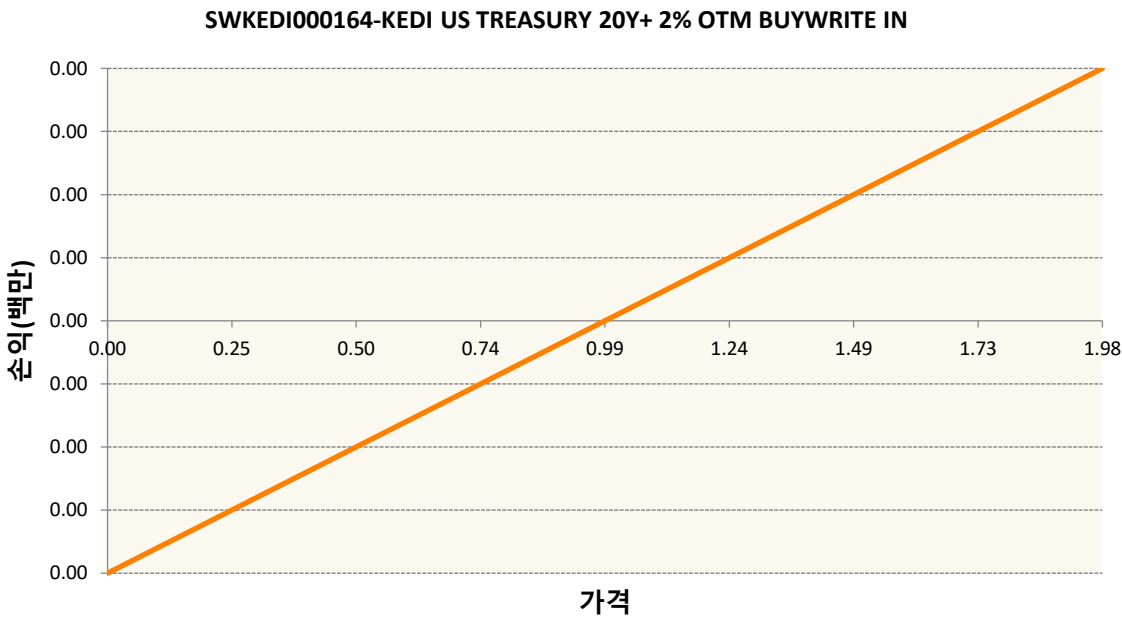
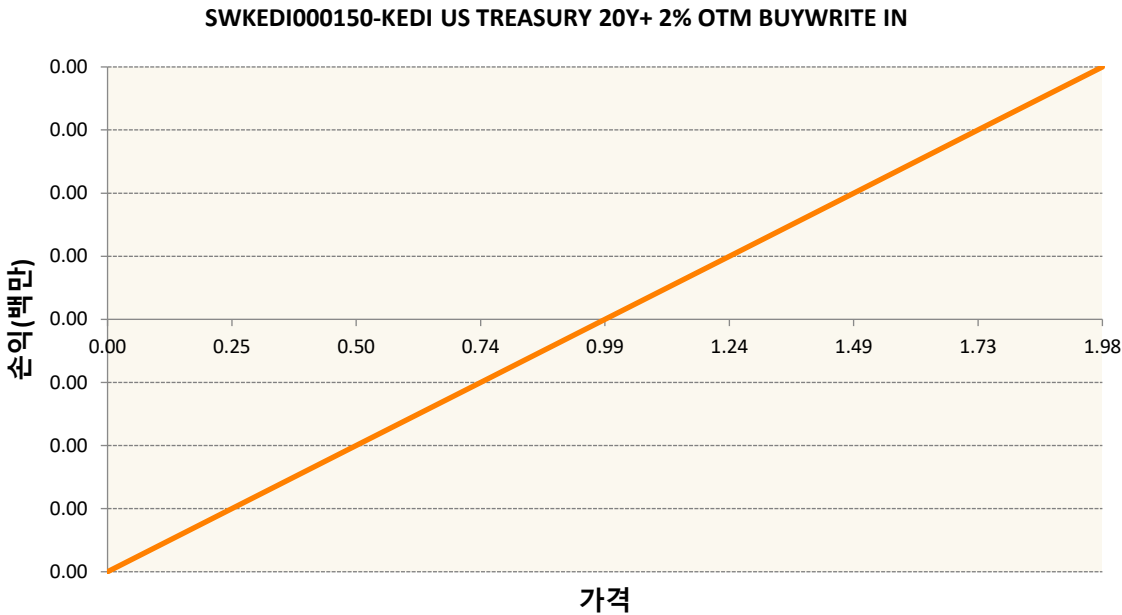
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

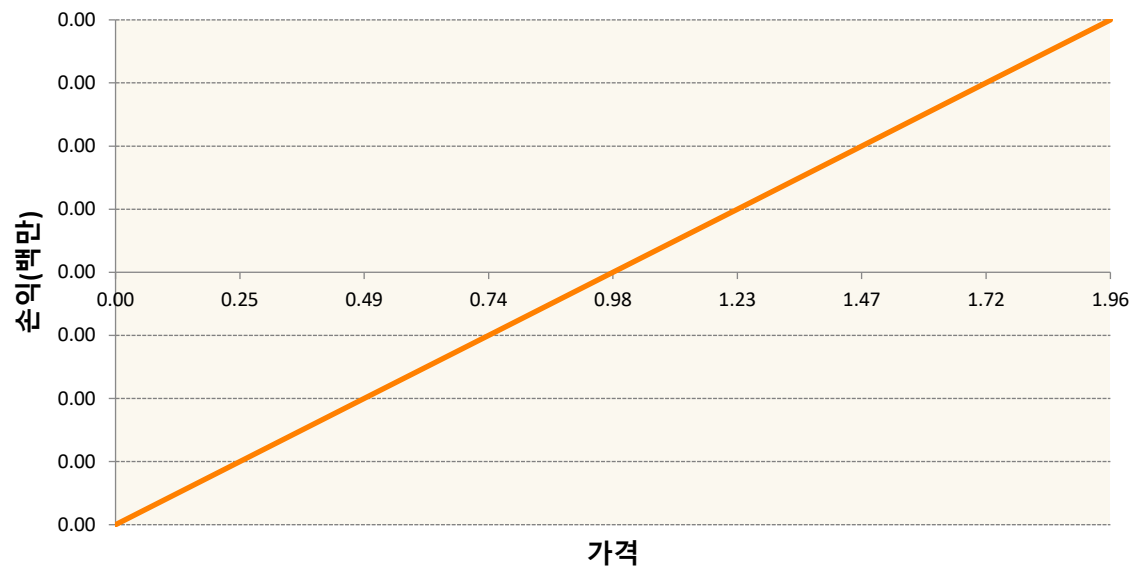
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	356,522	0	356,522	장외

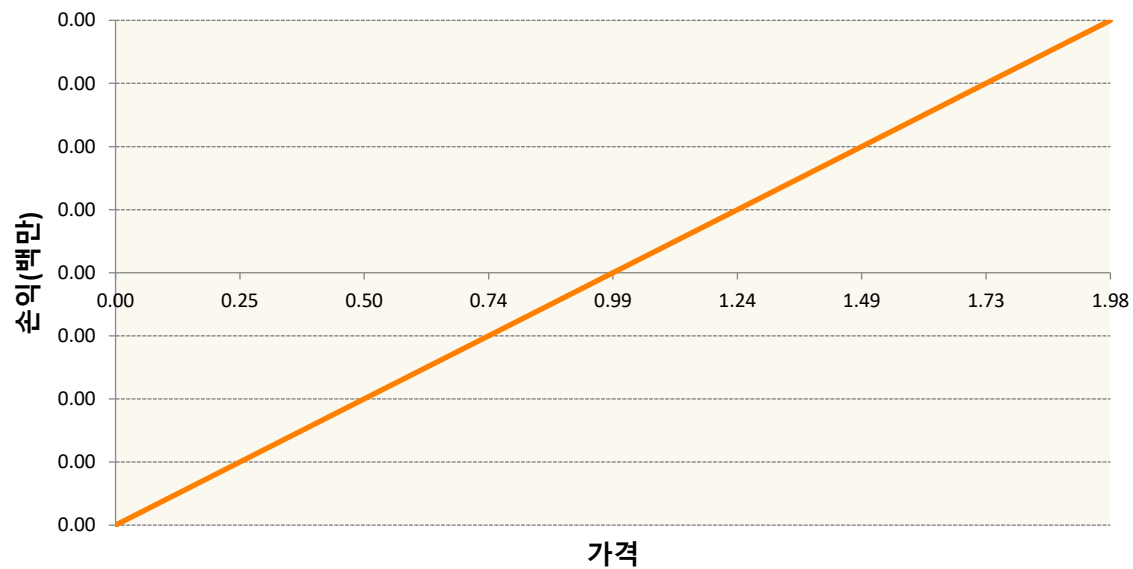
2. 만기시점의 손익구조



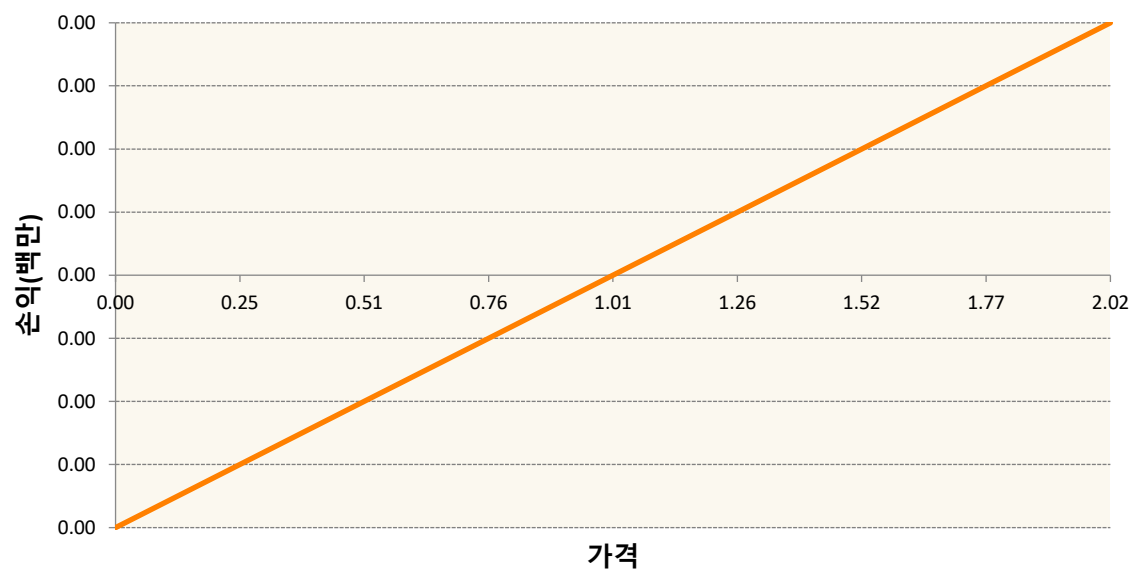
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,310
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		152
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,711
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,412
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,925

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,095