

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

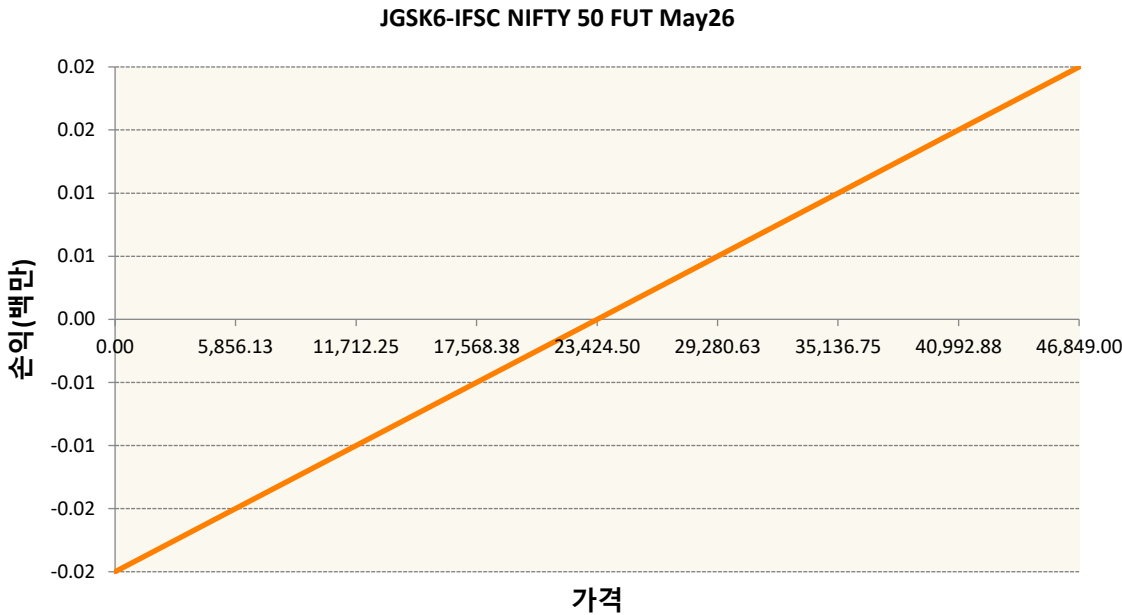
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	348	0	348	

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	2026-05-14
기준일	2026-05-13

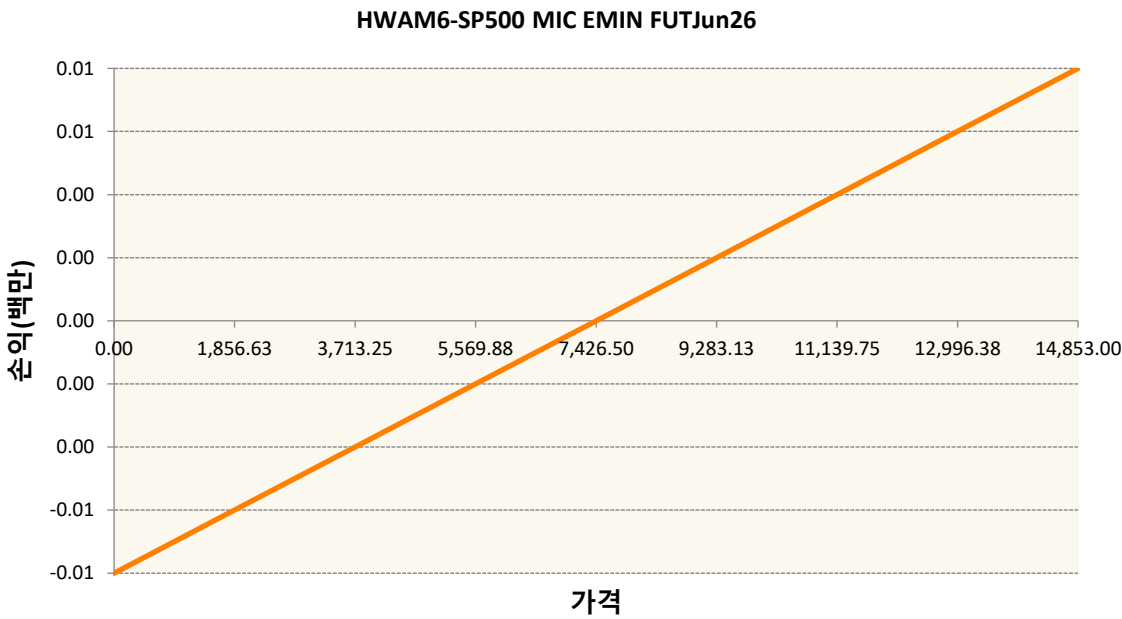
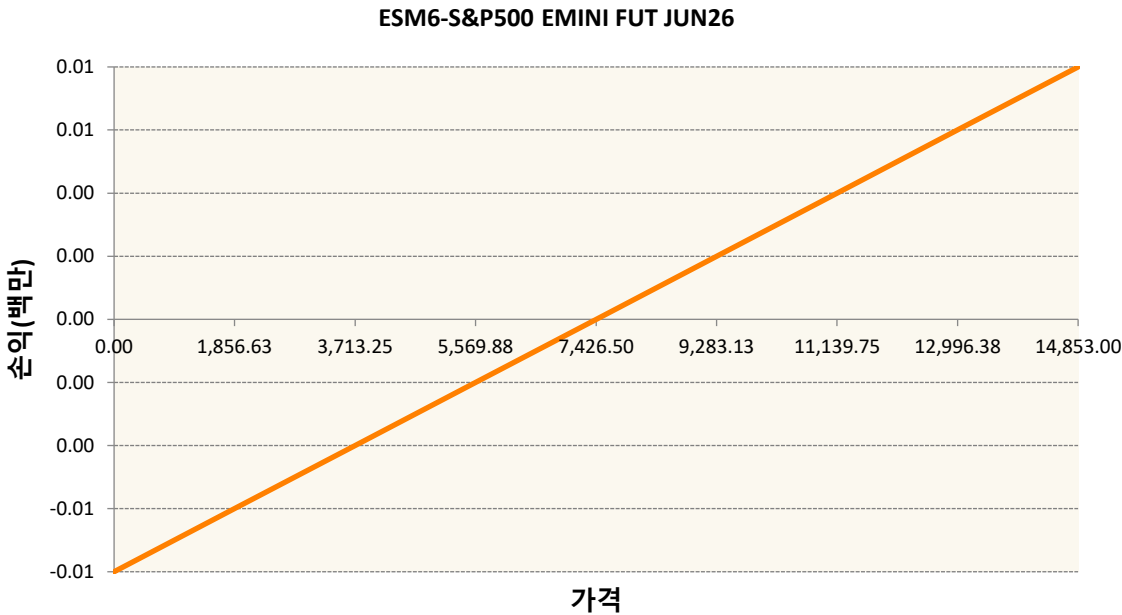
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	557	0	557	
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	2026-05-14
기준일	2026-05-13

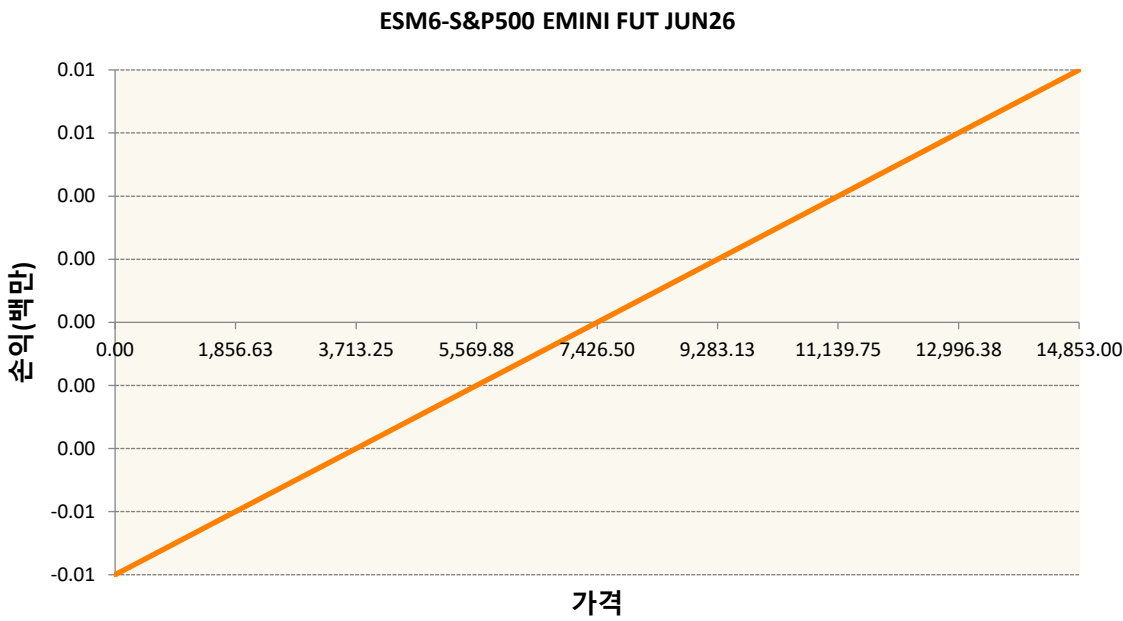
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,114	0	1,114	

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	2026-05-14
기준일	2026-05-13

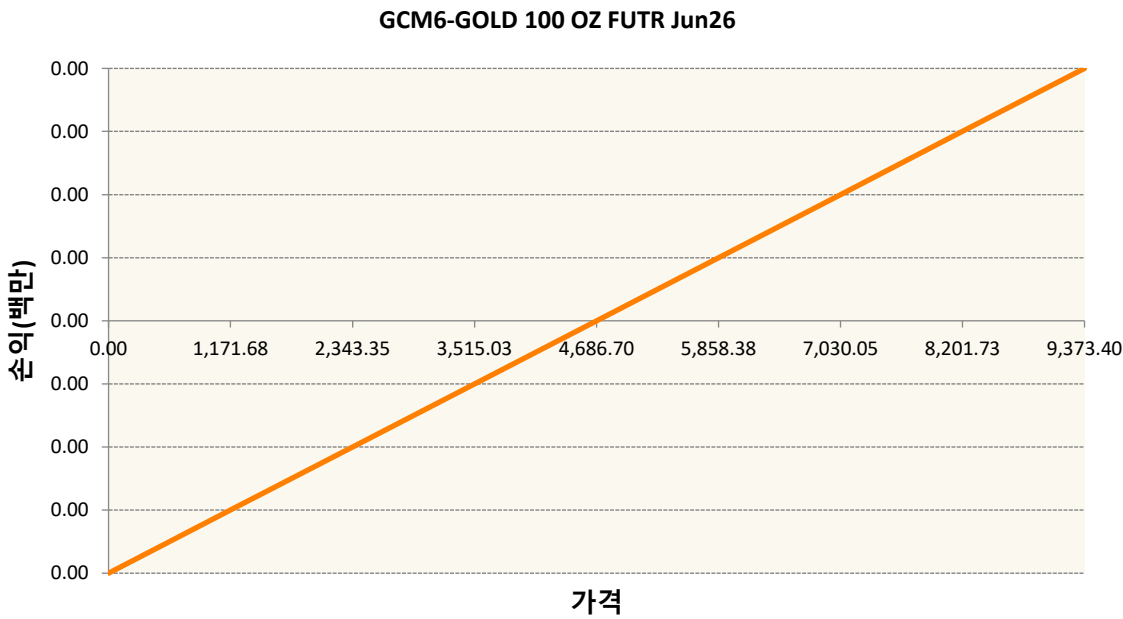
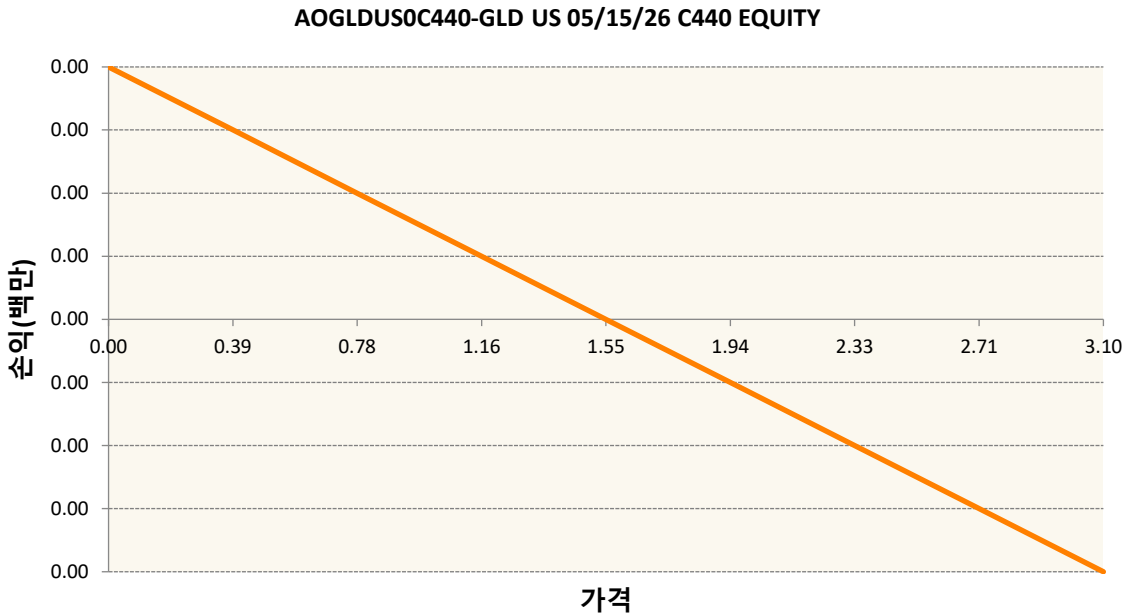
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,645	0	5,645	장내
누계	실물자산	옵션	0	105	-105	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUS0C GLD US 05/15/26 C440 EQUITY		8
GCM6	GOLD 100 OZ FUTR Jun26	452

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	576

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

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	99
AOPLTRPUS`PLTR US 05/15/26 P147 EQUITY	23

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

(단위:백만원)

379

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

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	19
--------------------------------------	----

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

(단위:백만원)

11

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

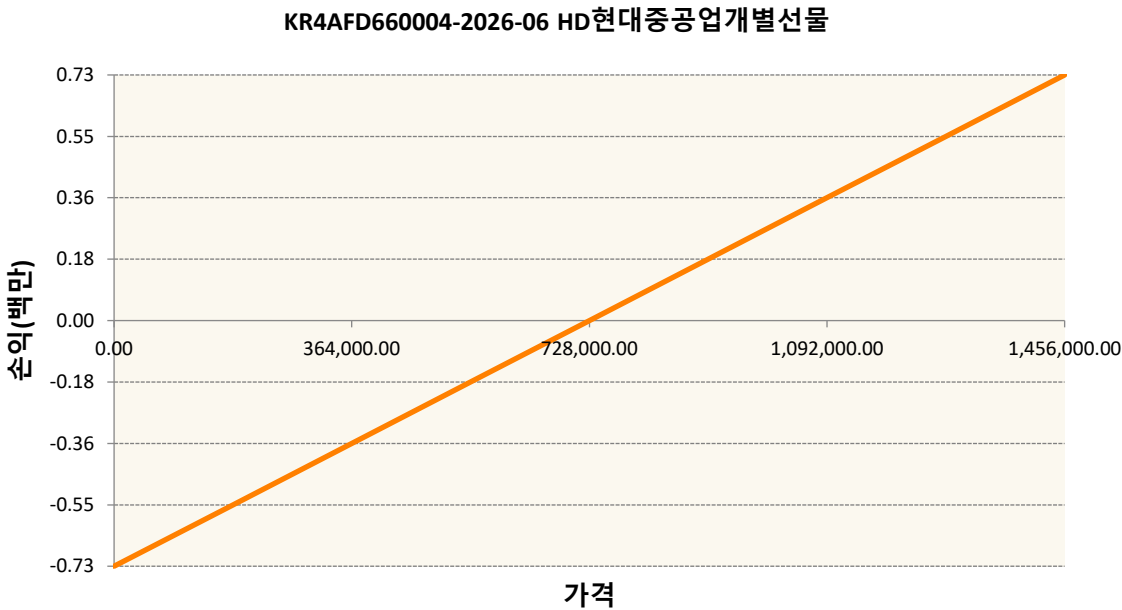
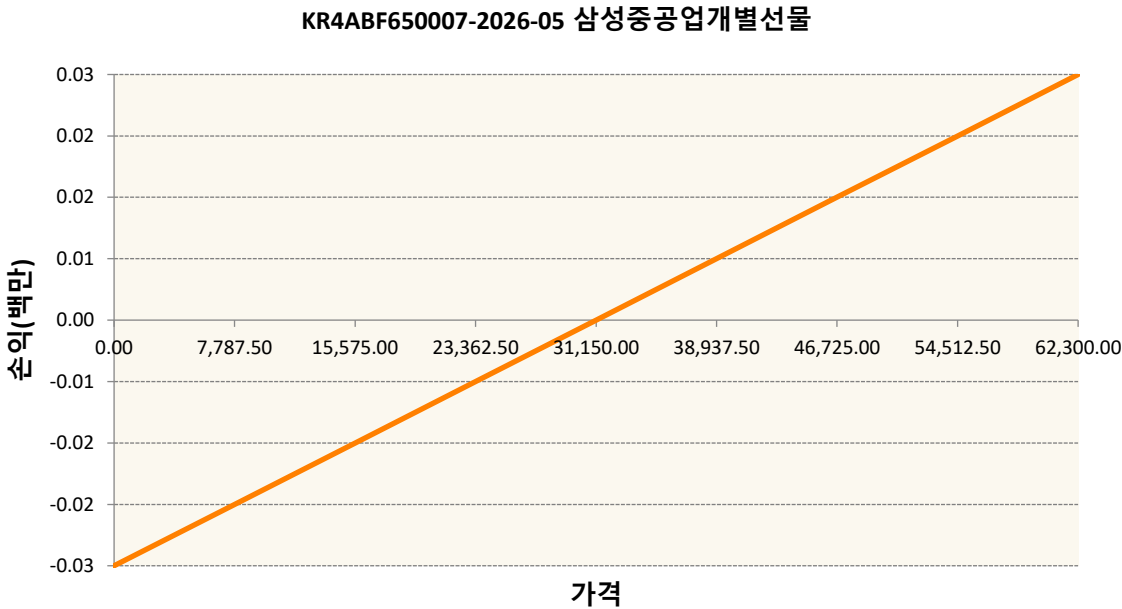
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

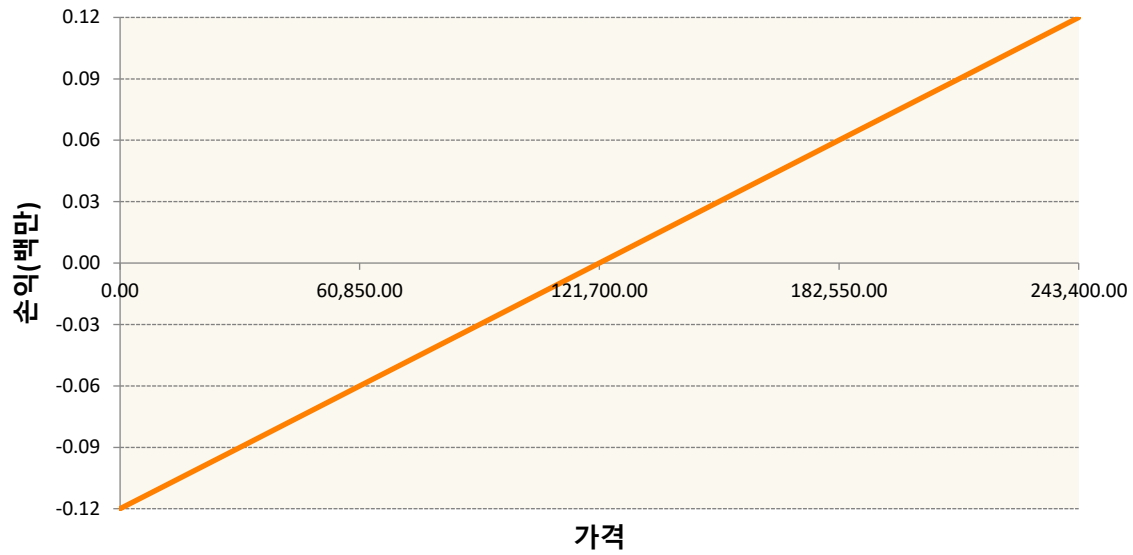
(단위:백만원)

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	34,955	0	34,955	장내
누계	유가증권	스왑	174,025	0	174,025	장외

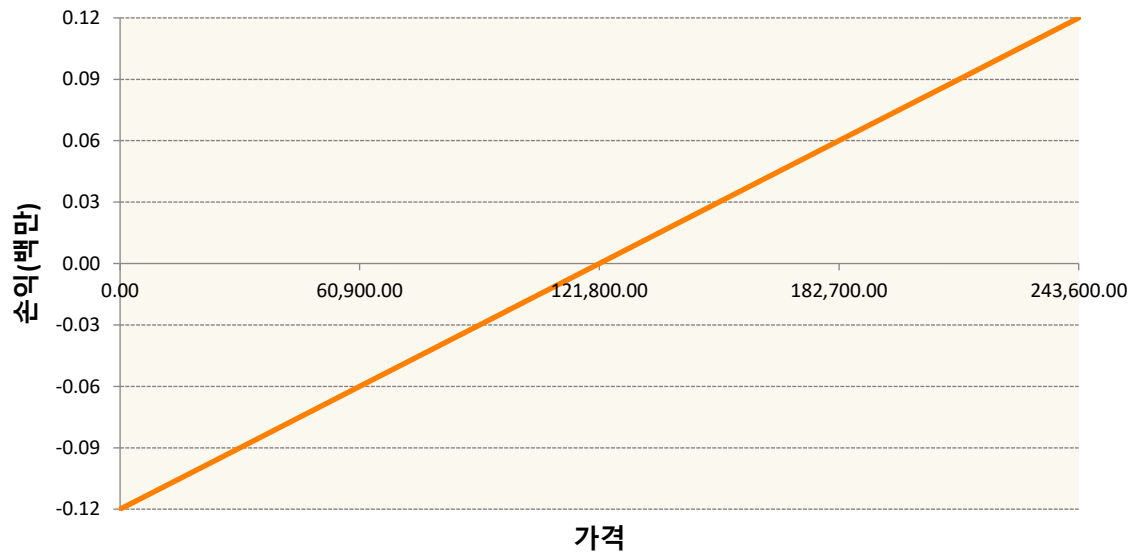
2. 만기시점의 손익구조



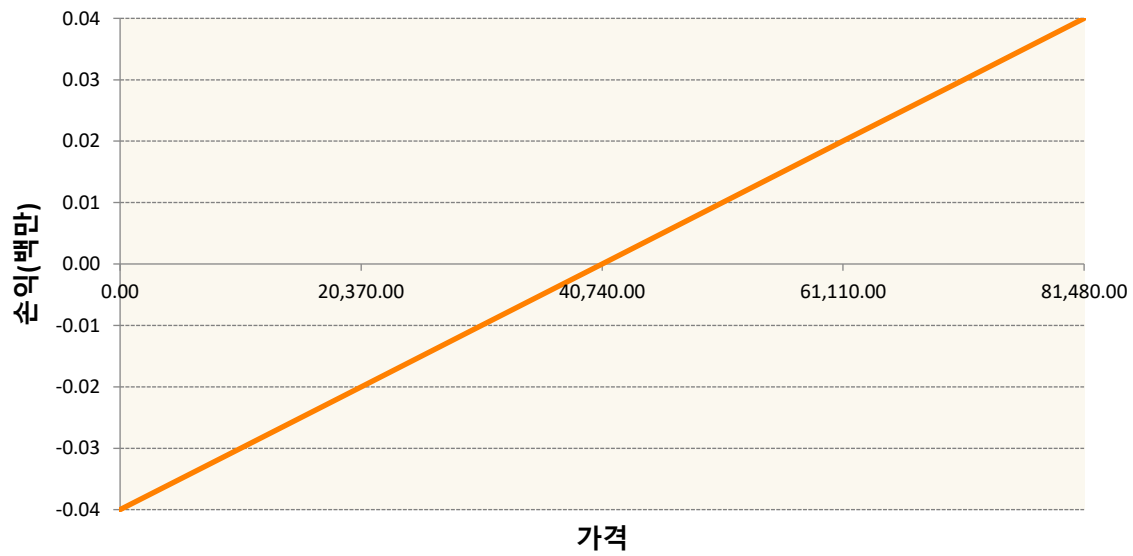
KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AFV660002-2026-06 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



(단위:백만원)

[illegible]

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

(단위:백만원)

4,190

공시일 2026-05-14

기준일 2026-05-13

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	2026-05-14
기준일	2026-05-13

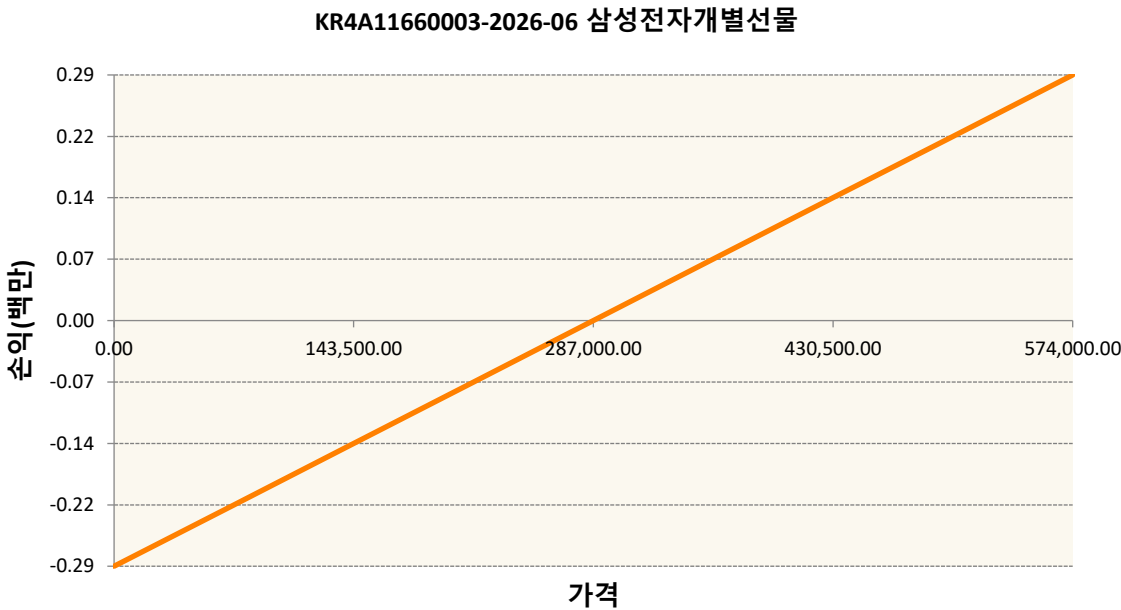
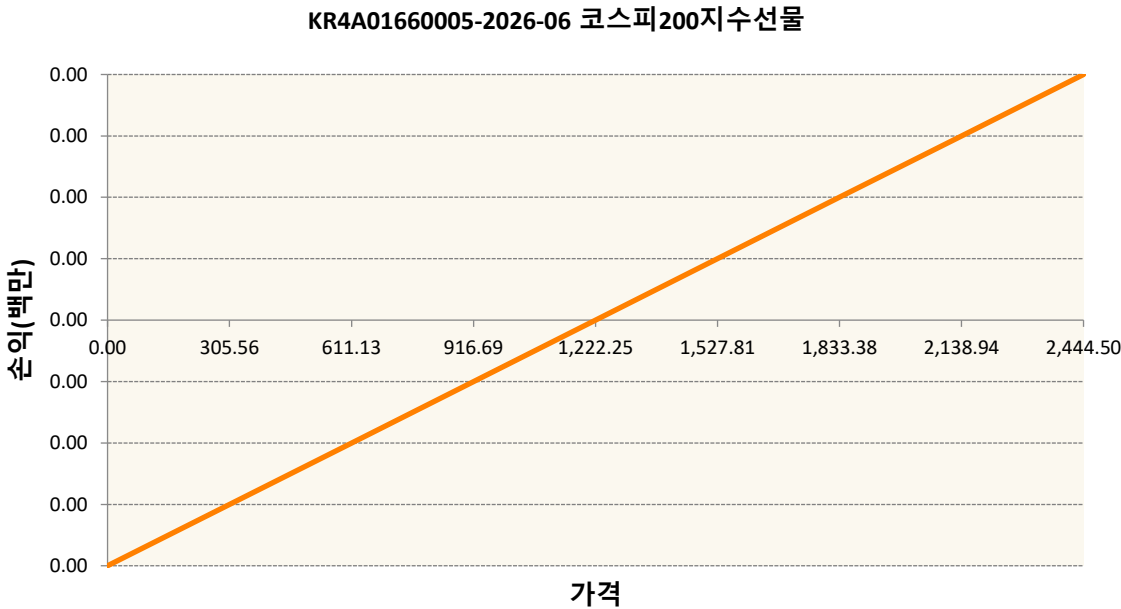
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	23,443	0	23,443	장내
누계	유가증권	옵션	0	32,461	-32,461	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,425.00. 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 ends at the point (1,212.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,212.50	0.00

The graph illustrates a linear relationship between price and net income. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,430.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Net Income in millions), ranges from 0.00 to 1,000.00. The orange line represents the profit function, starting at the origin (0,0) and reaching a net income of 1,000 million at a price of 1,215.00.

가격 (Price)	순이익 (백만) (Net Income in millions)
0.00	0.00
303.75	166.67
607.50	333.33
911.25	500.00
1,215.00	1,000.00

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물			634
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-634	-634	-634	-634	-634	-634	-634
-5.33%	-423	-423	-423	-423	-423	-423	-423
-2.67%	-211	-211	-211	-211	-211	-211	-211
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	211	211	211	211	211	211	211
5.33%	423	423	423	423	423	423	423
8.00%	634	634	634	634	634	634	634
KR4A11660003				2026-06 삼성전자개별선물			1,227
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227	-1,227
-5.33%	-818	-818	-818	-818	-818	-818	-818
-2.67%	-409	-409	-409	-409	-409	-409	-409
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	409	409	409	409	409	409	409
5.33%	818	818	818	818	818	818	818
8.00%	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227	1,227
KR4B0165A863 코스피200 C 202605 1,212.5							1,219

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,200	-1,201	-1,203	-1,205	-1,209	-1,214	-1,219
-5.33%	-689	-696	-704	-714	-725	-738	-752
-2.67%	-234	-253	-273	-294	-315	-337	-359
0%	73	49	24	0	-24	-49	-73
2.67%	203	189	173	157	139	120	101
5.33%	234	230	225	217	209	199	187
8.00%	238	237	236	234	232	228	223
KR4B0165A871 코스피200 C 202605 1,215.0							833

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-821	-821	-822	-824	-826	-829	-833
-5.33%	-477	-481	-486	-492	-499	-507	-516
-2.67%	-166	-178	-191	-205	-219	-233	-247
0%	49	33	16	0	-17	-33	-50
2.67%	145	135	124	112	99	86	73
5.33%	169	166	162	156	150	143	135
8.00%	172	172	171	169	167	164	161

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

(단위:백만원)

8,053

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

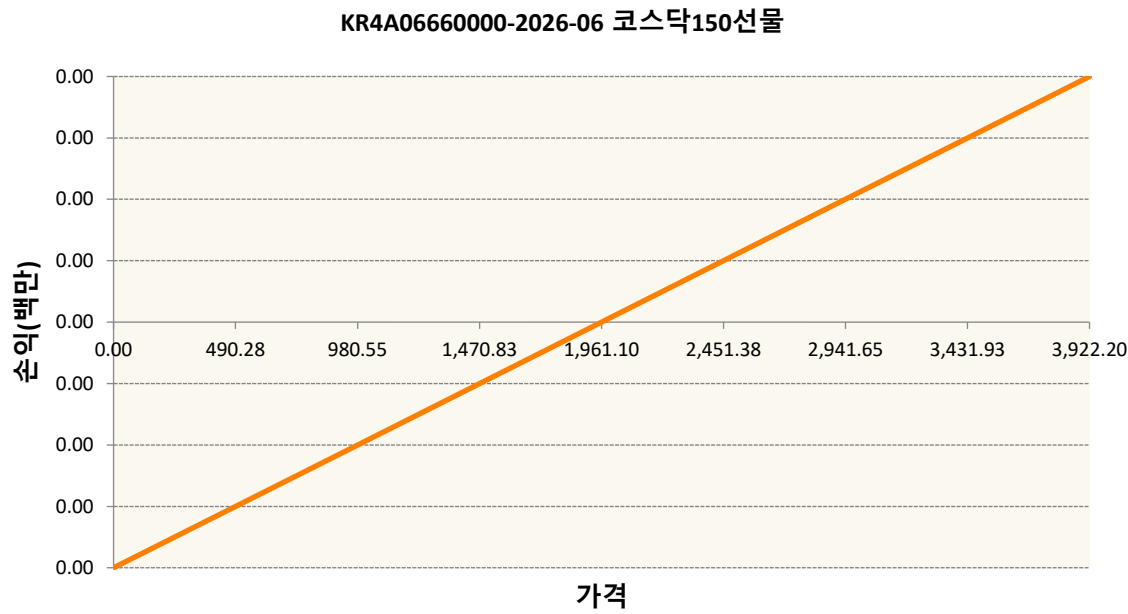
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,137	0	1,137	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06660000			2026-06 코스닥150선물				92
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	31	31	31	31	31	31	31
5.33%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	92	92	92	92	92	92	92

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

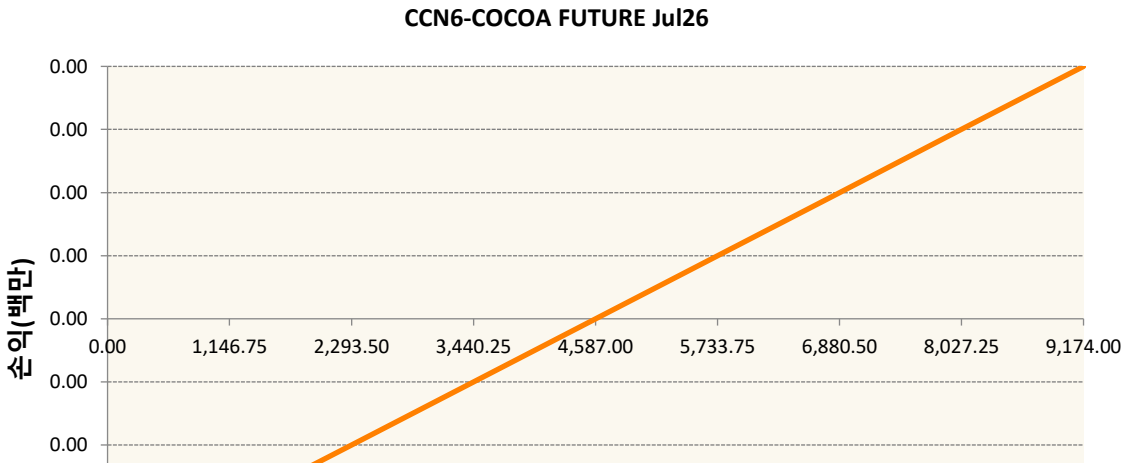
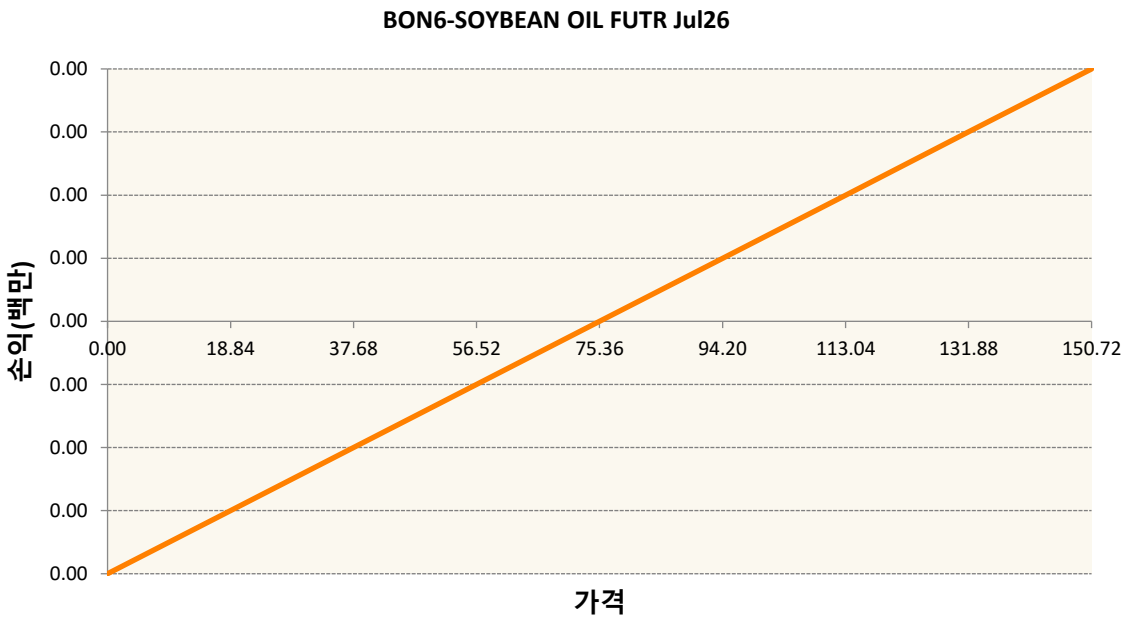
포커스농산물모(채권-파생형)

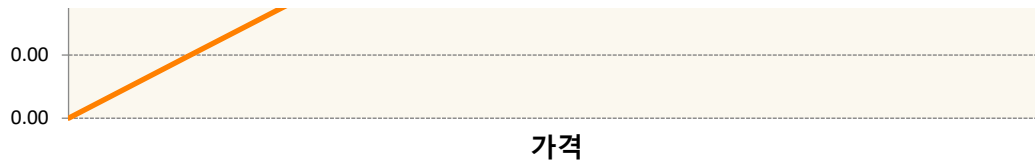
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

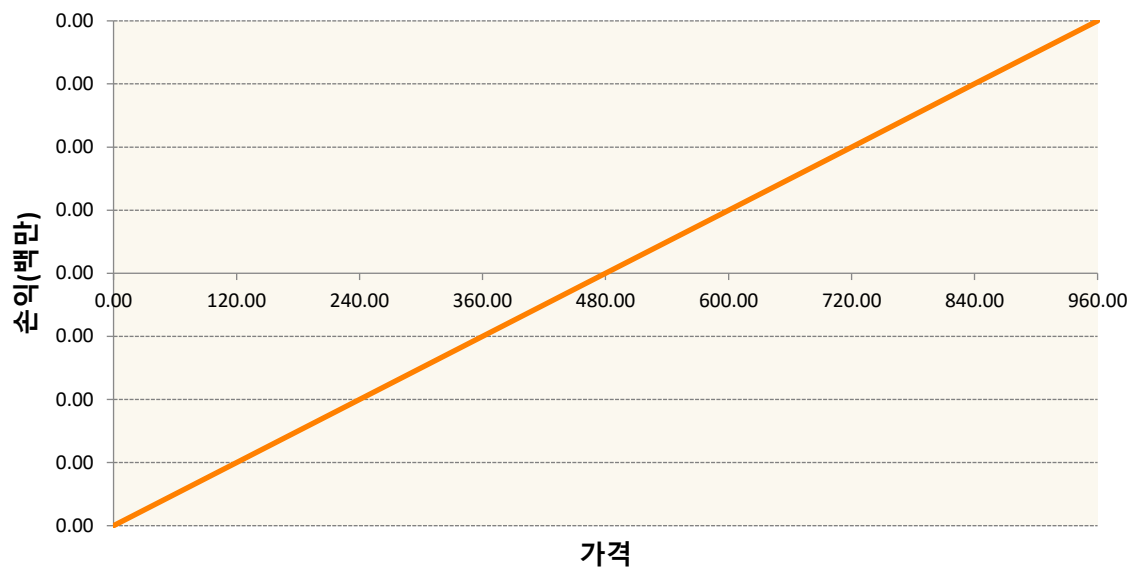
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	68	0	68	
누계	실물자산	선물	943	0	943	장내
누계	유가증권	선물	2,029	0	2,029	
누계	통화	선물	0	387	-387	장내

2. 만기시점의 손익구조

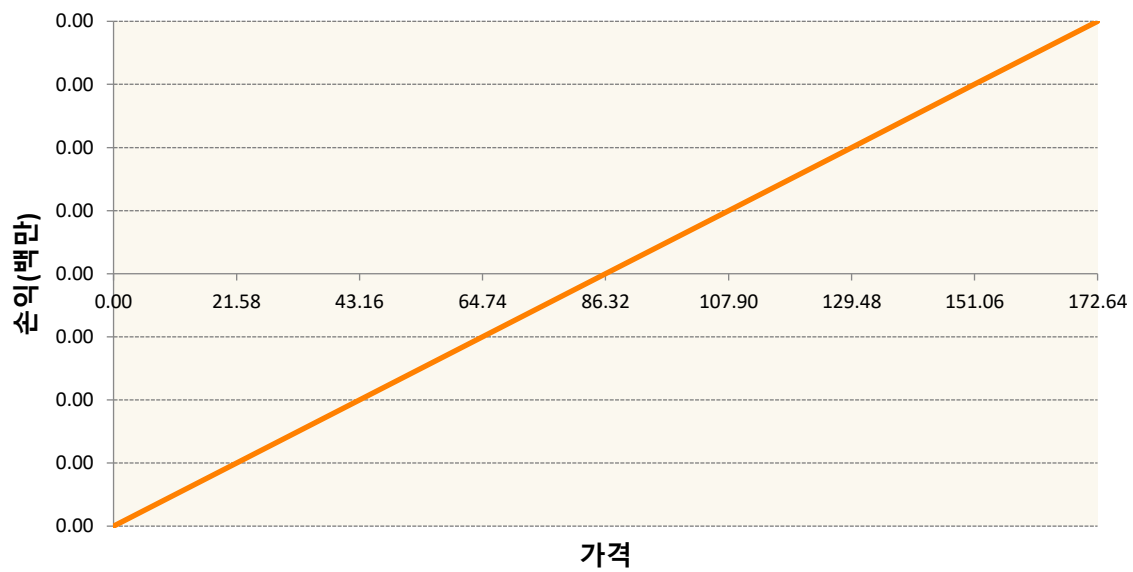




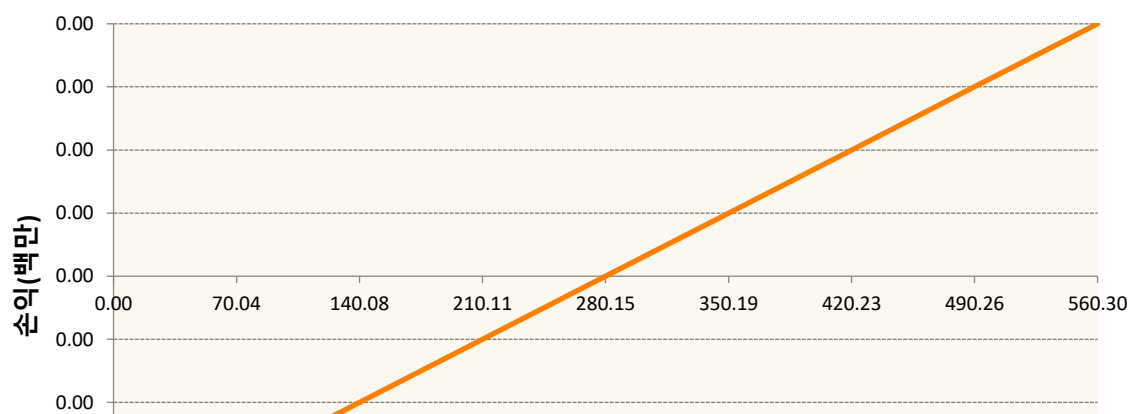
CN6-CORN FUTURE Jul26

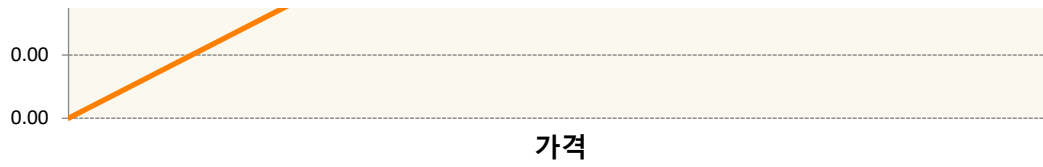


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

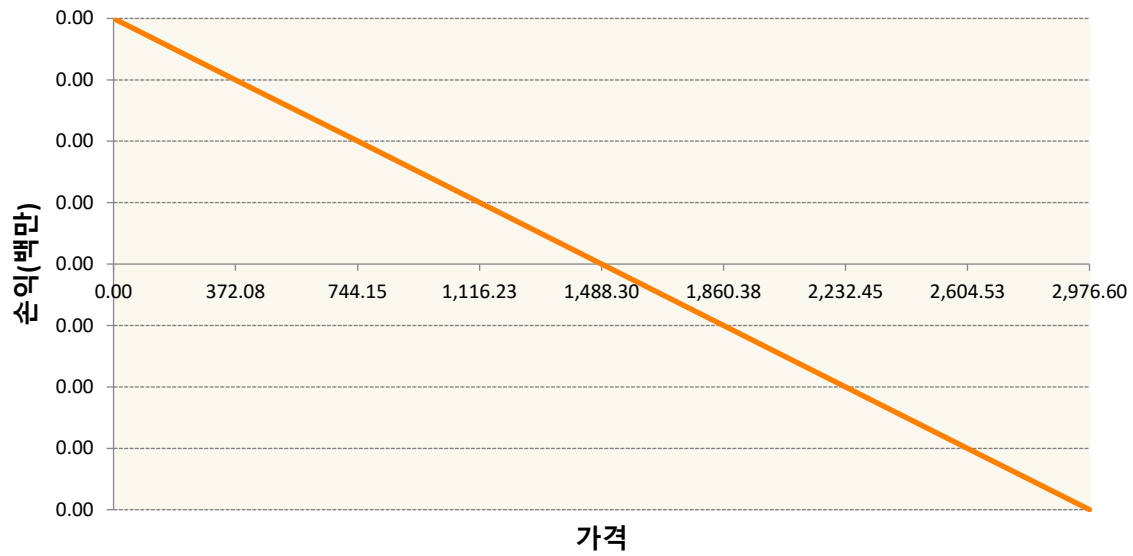


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

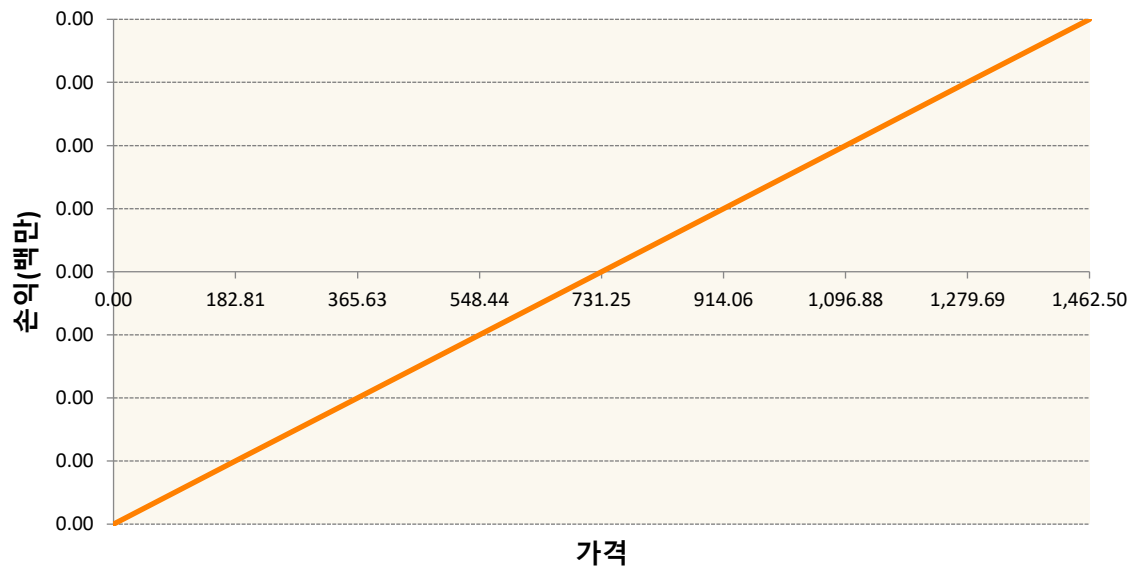




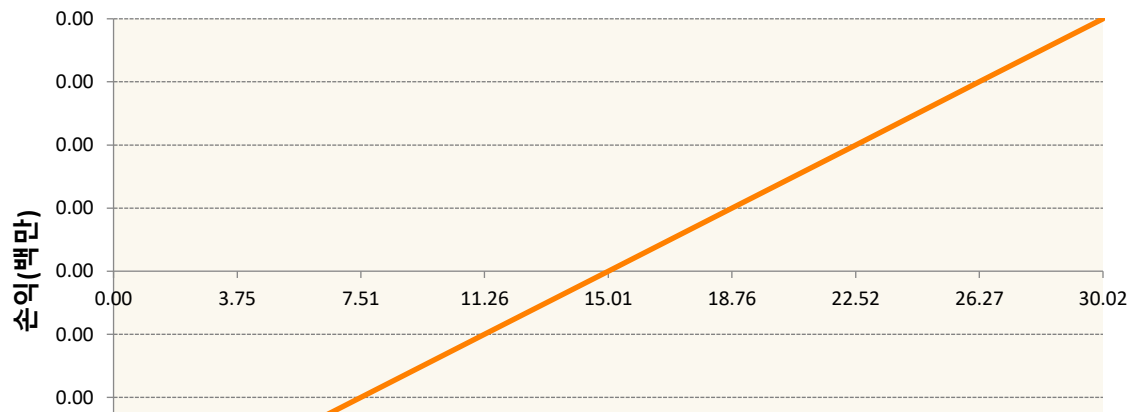
KR4A75650007-2026-05 달러선물

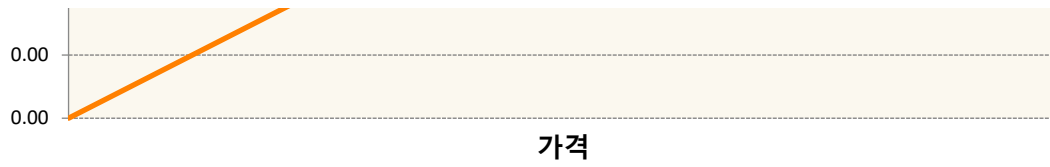


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

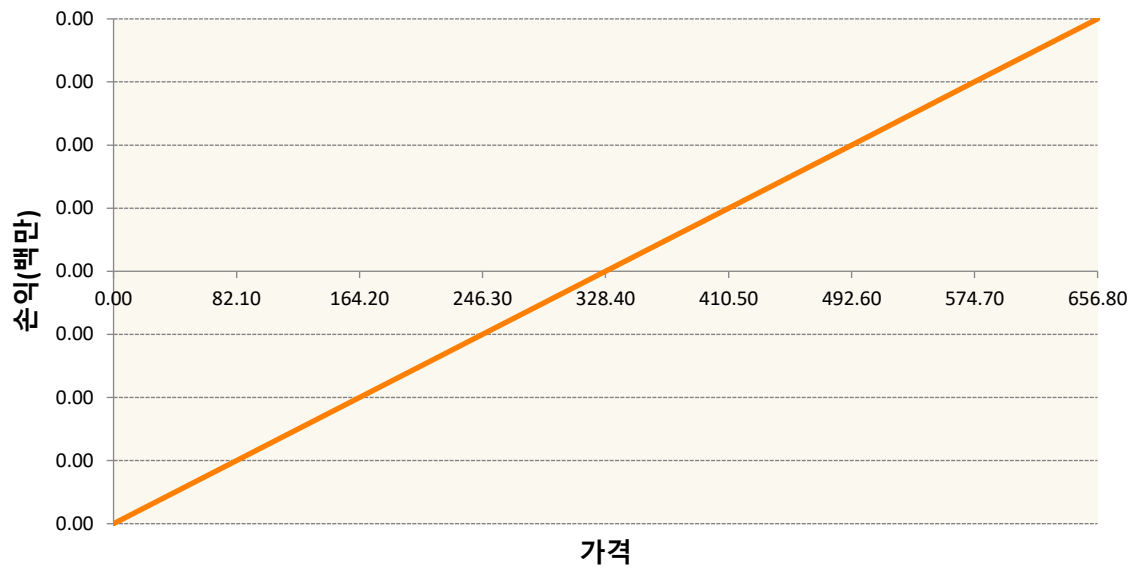


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

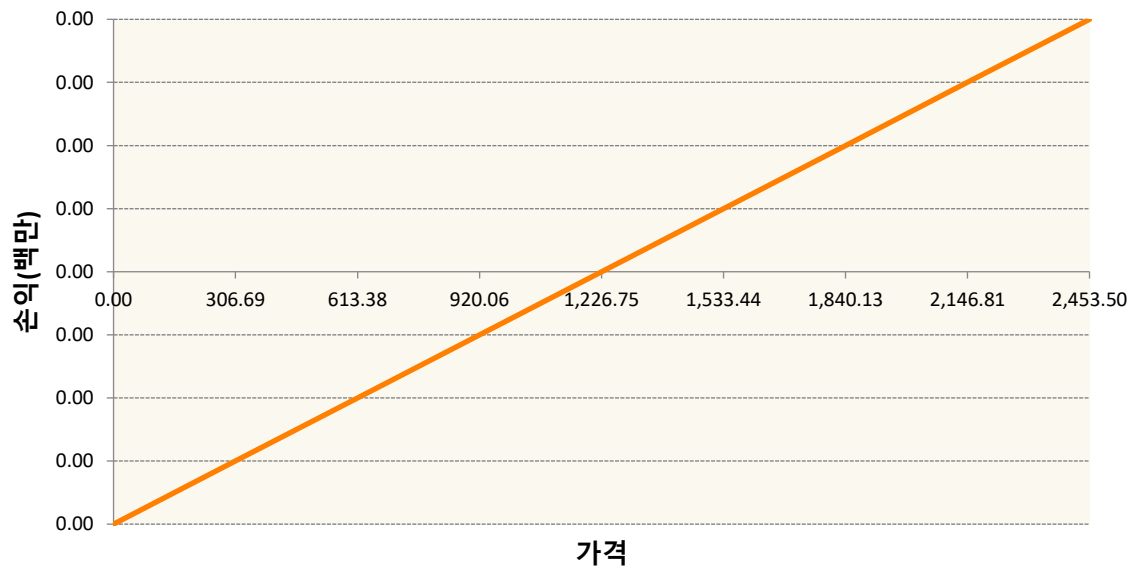




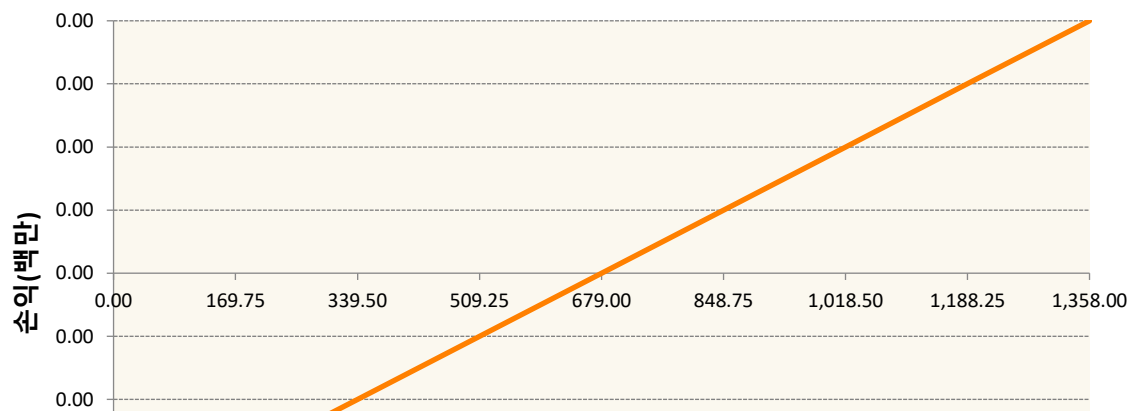
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

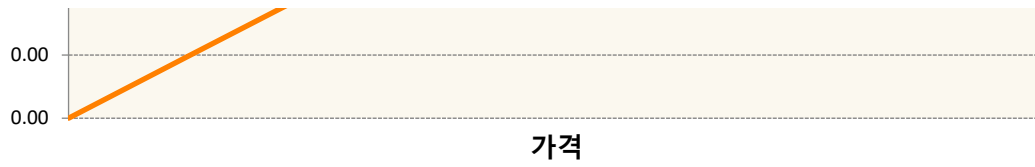


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-05-14
기준일	2026-05-13

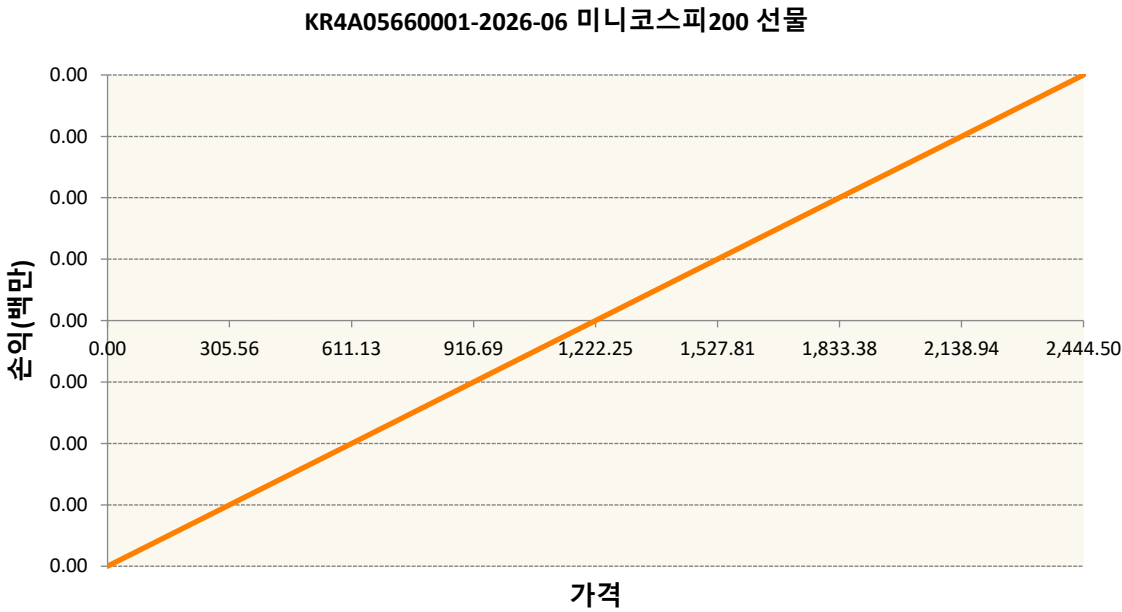
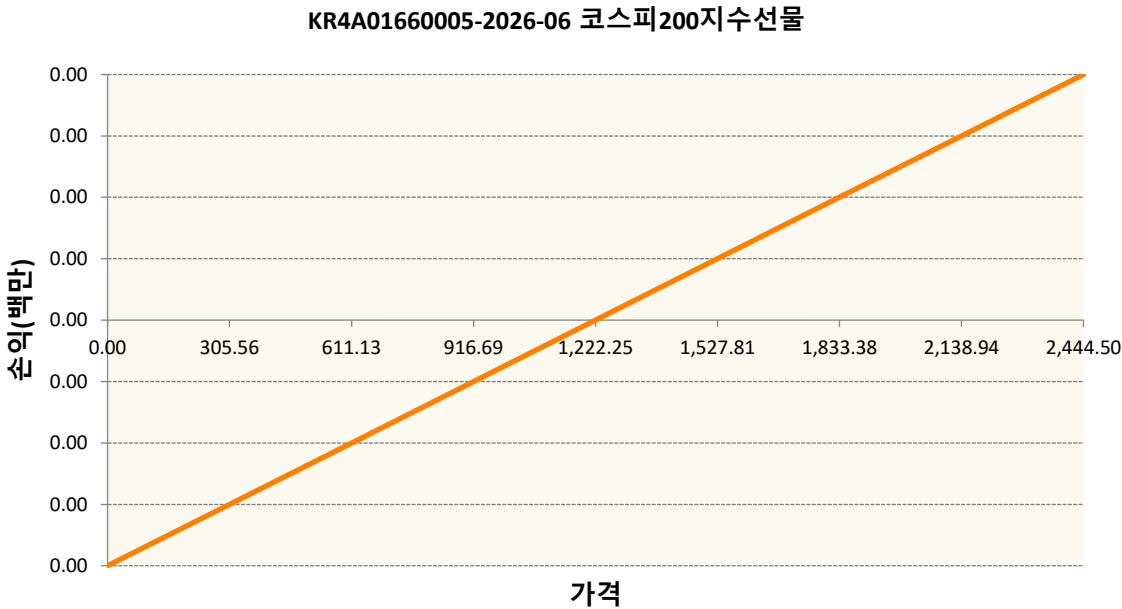
스마트인덱스모

1. 계약금액

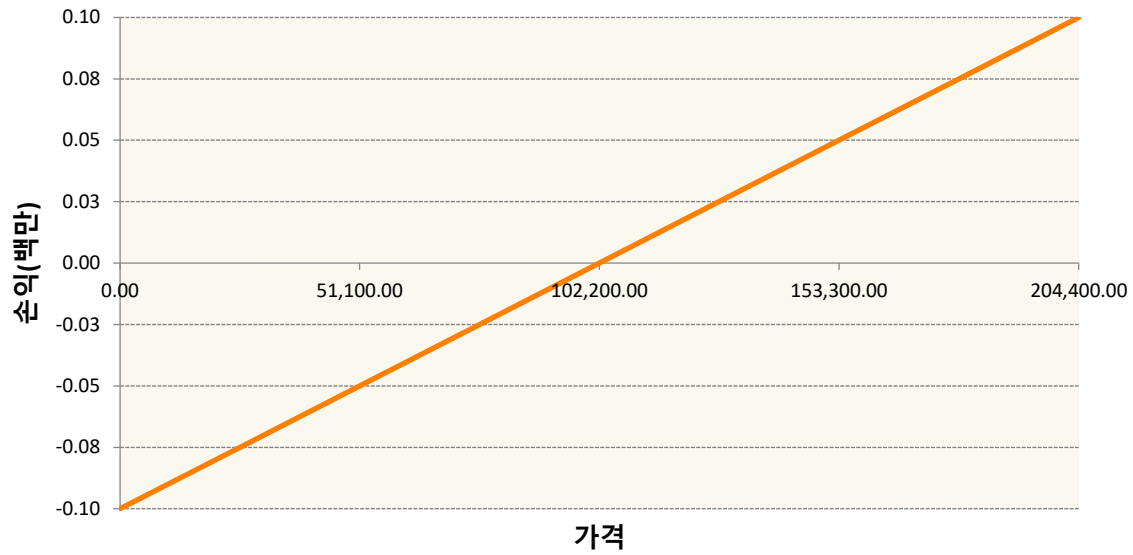
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	880	0	880	장내
누계	유가증권	선물	3,072	0	3,072	장내

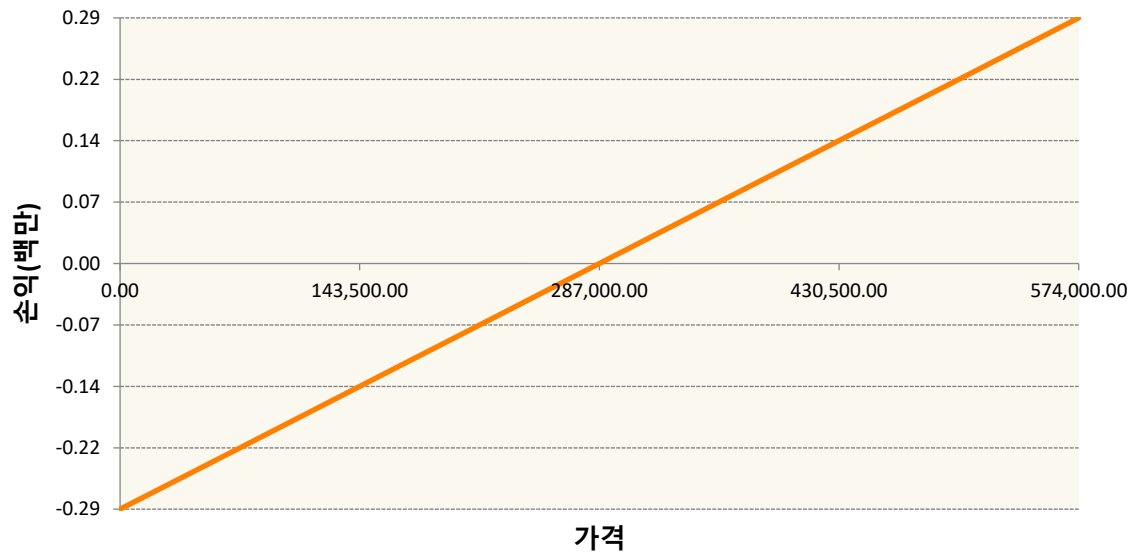
2. 만기시점의 손익구조



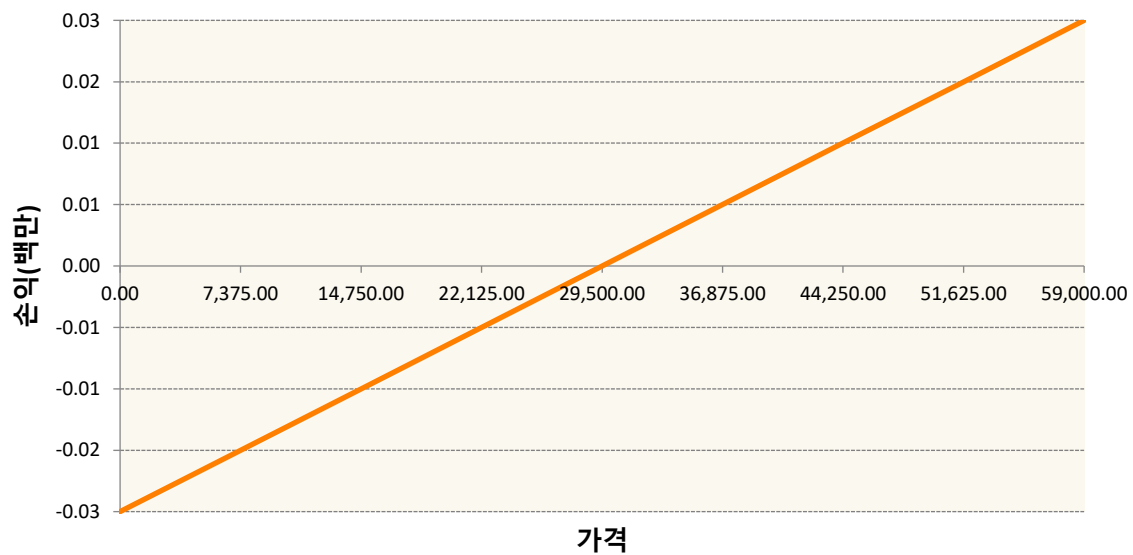
KR4A0F650001-2026-05 두산로보틱스개별선물



KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		171		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171				
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114				
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	57	57	57	57	57	57	57				
5.33%	114	114	114	114	114	114	114				
8.00%	171	171	171	171	171	171	171				
KR4A05660001							2026-06 미니코스피200 선물		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				
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				
-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%	1	1	1	1	1	1	1				
KR4A11660003							2026-06 삼성전자개별선물		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				
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)

464

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

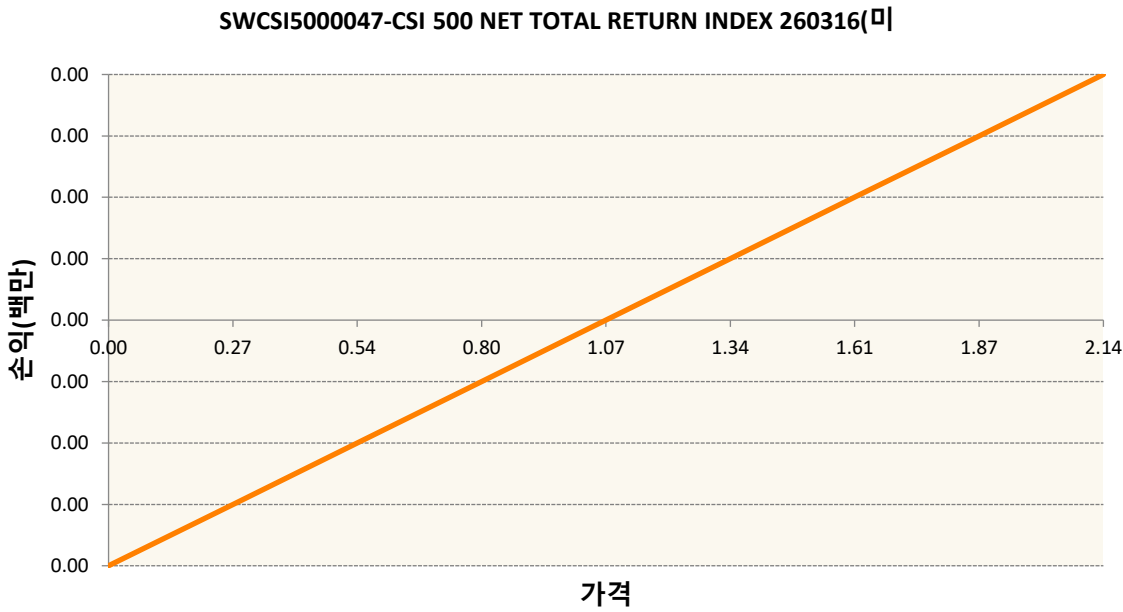
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	481
--	-----

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

600

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

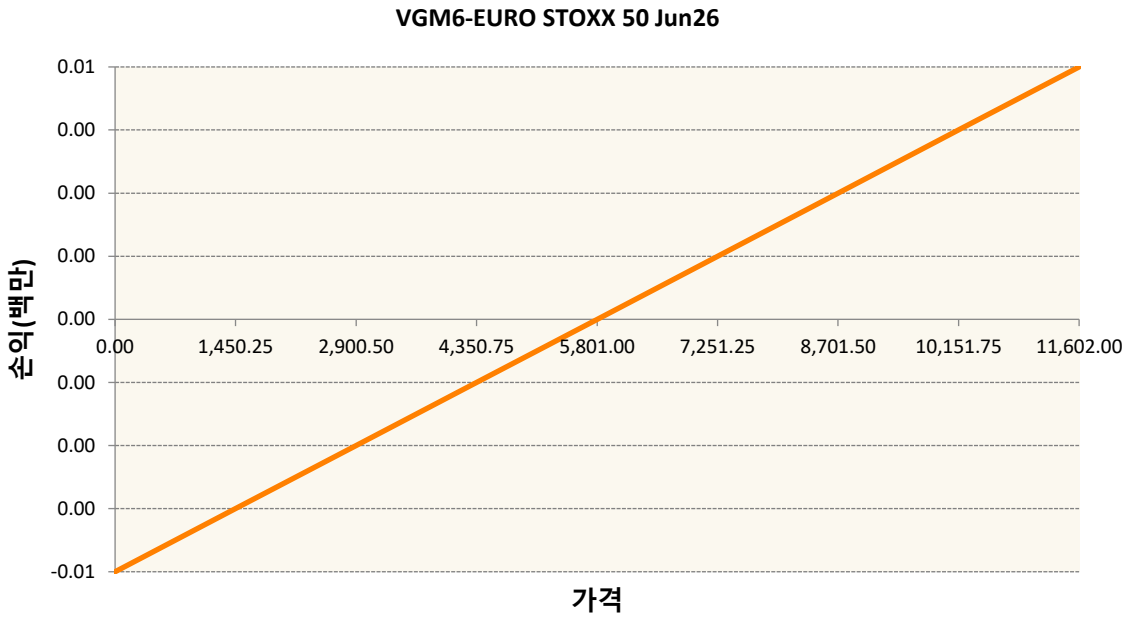
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	894	0	894	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

63

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

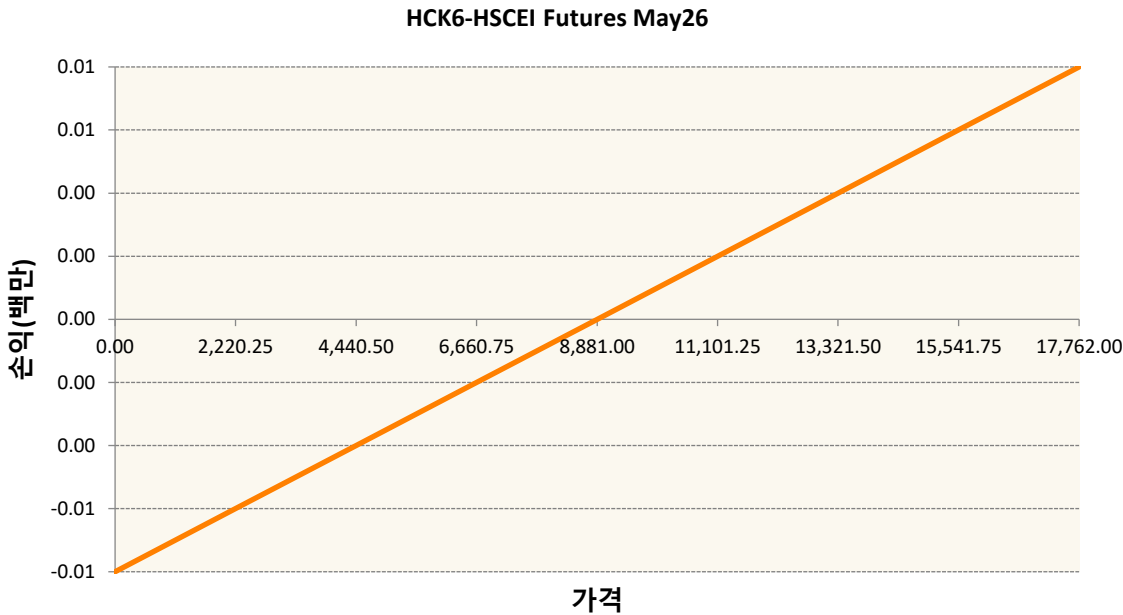
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,670	0	1,670	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	2026-05-14
기준일	2026-05-13

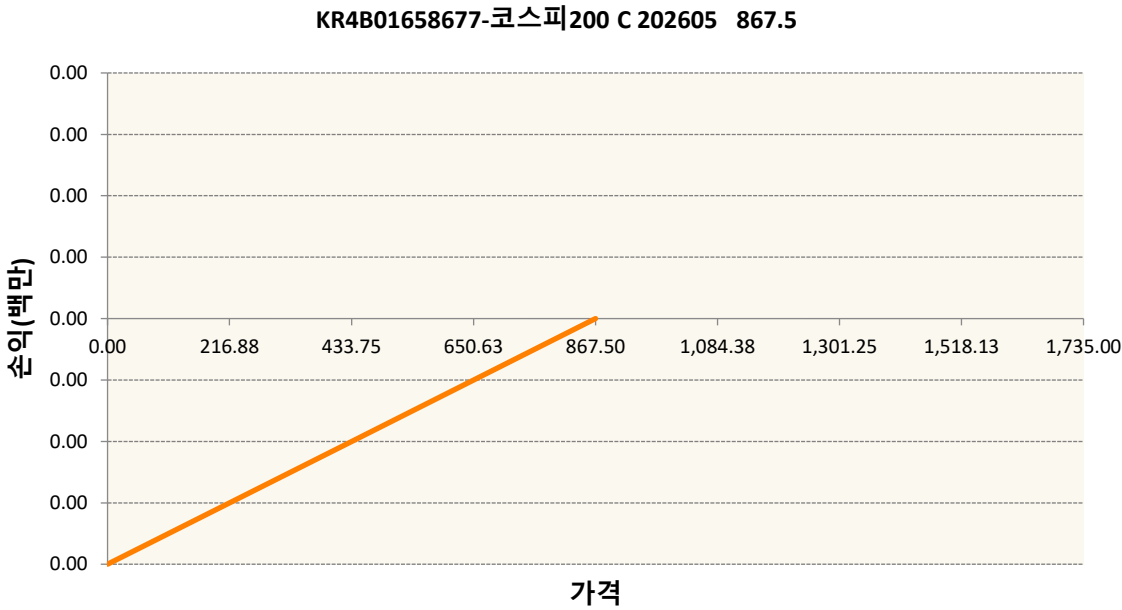
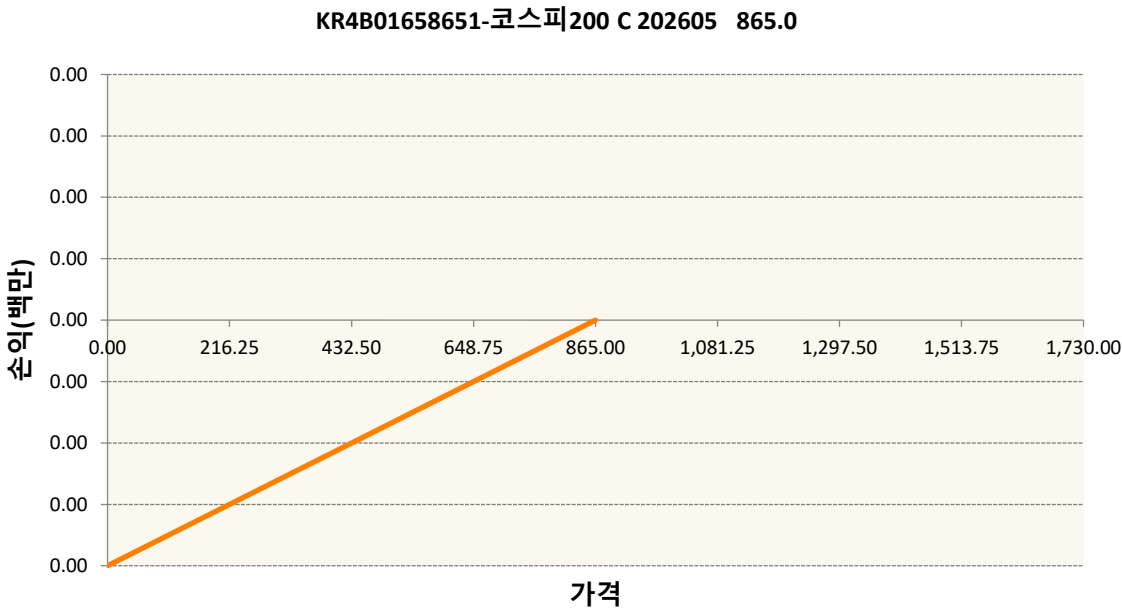
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

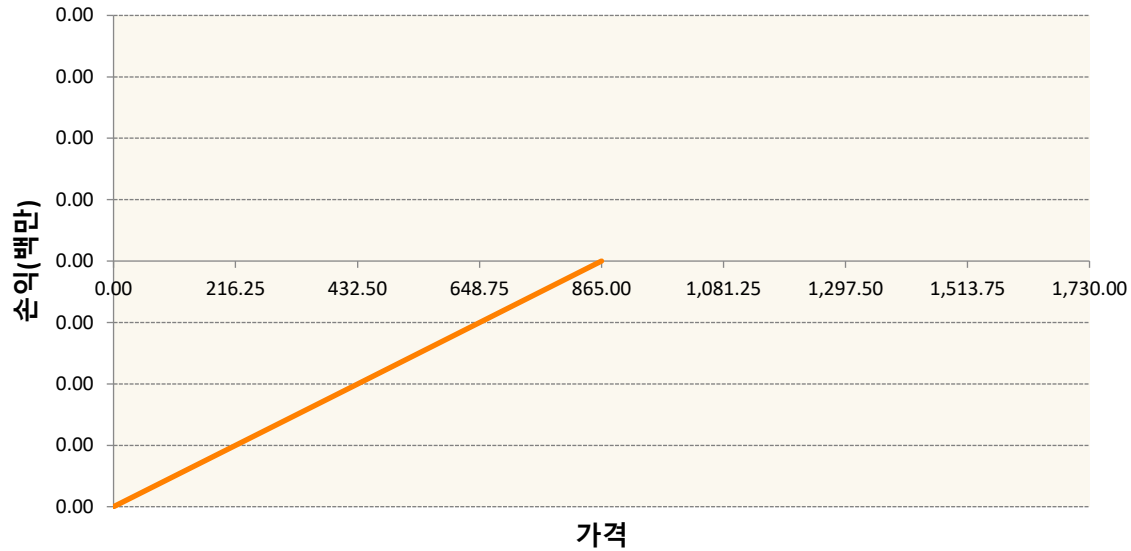
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	432	0	432	장내
누계	유가증권	옵션	0	27,278	-27,278	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 2026-05-14

기준일 2026-05-13

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	2026-05-14
기준일	2026-05-13

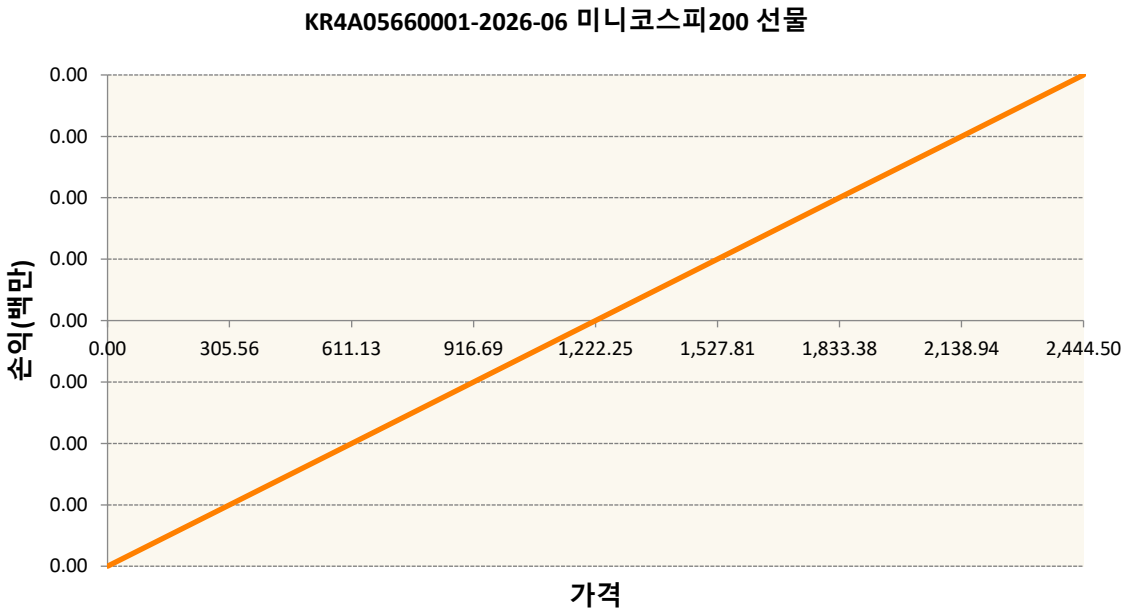
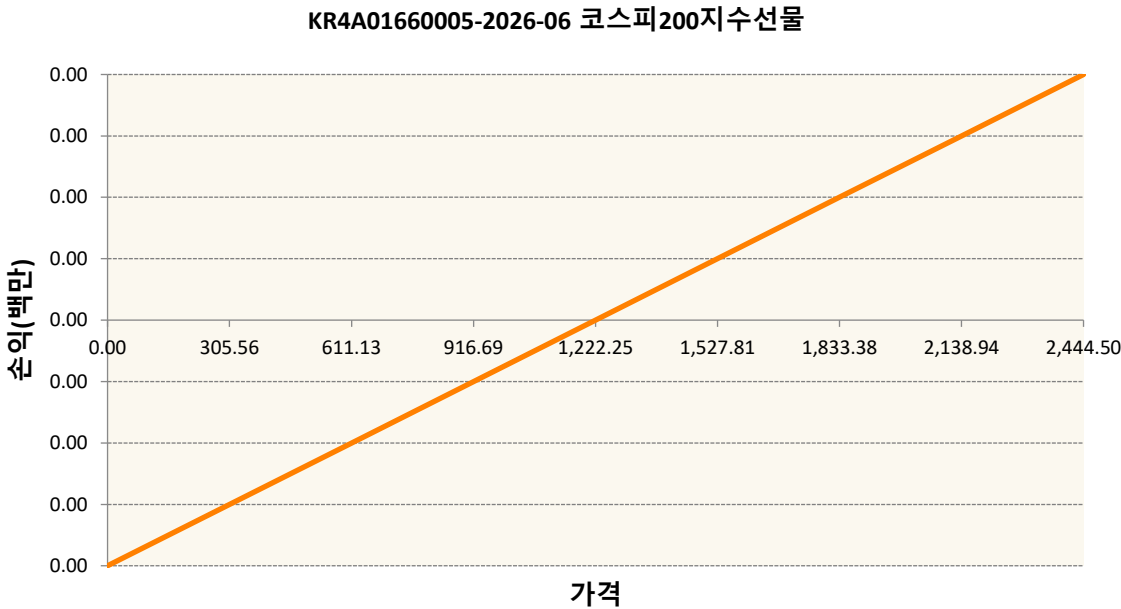
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

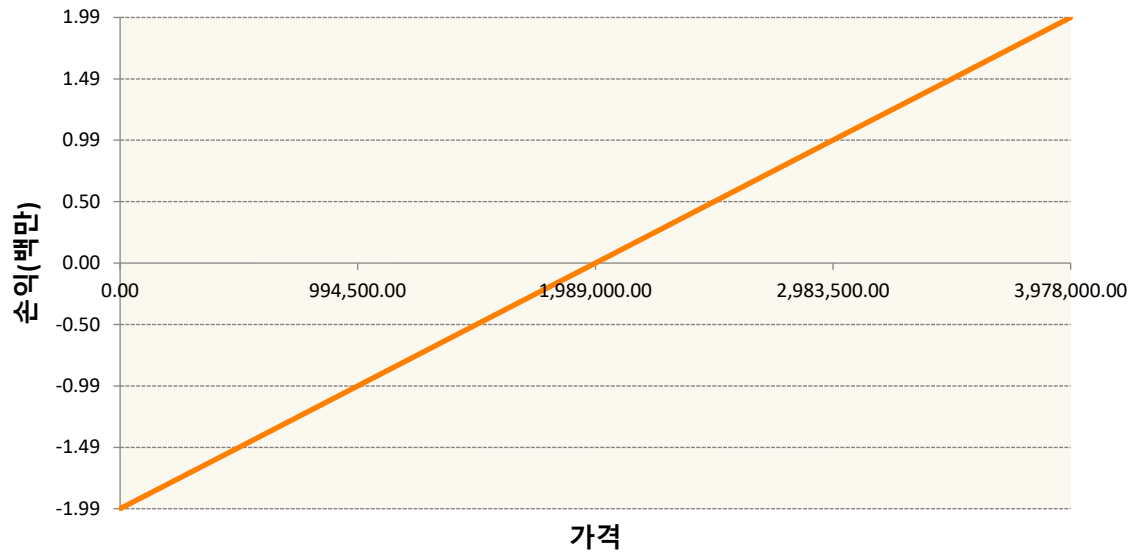
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	765	0	765	장내
누계	유가증권	선물	2,298	0	2,298	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						122
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
-5.33%		-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-2.67%		-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%		0	0	0	0	0	0	0
2.67%		41	41	41	41	41	41	41
5.33%		81	81	81	81	81	81	81
8.00%		122	122	122	122	122	122	122
KR4A05660001		2026-06 미니코스피200 선물						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
KR4A50660005		2026-06 SK하이닉스개별선물						13
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-5.33%		-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-2.67%		-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%		0	0	0	0	0	0	0

2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	13	13	13	13	13	13	13

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	331

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

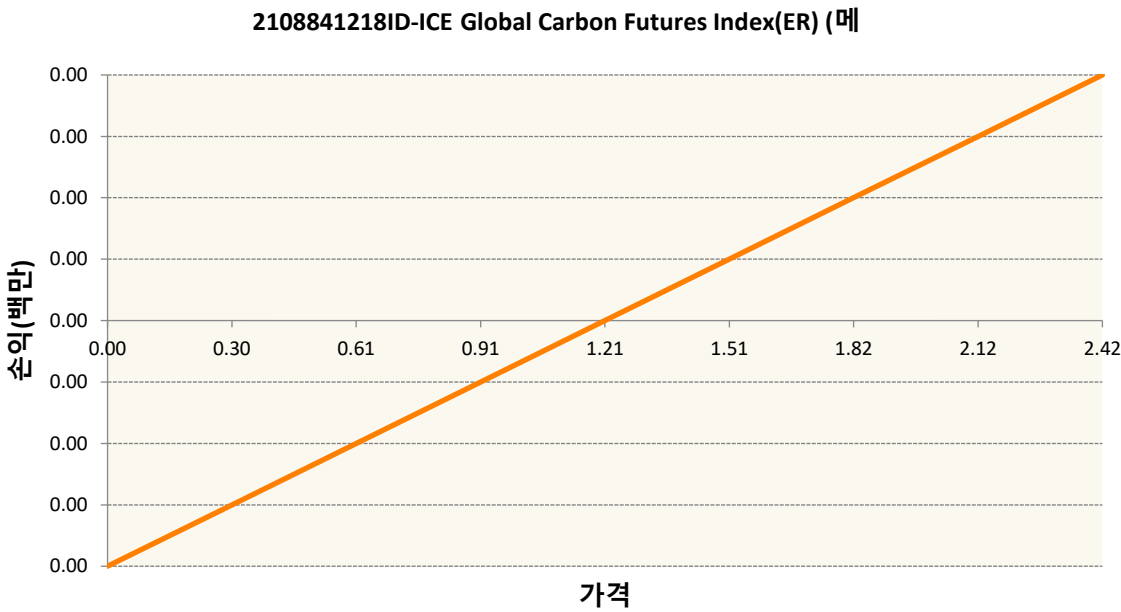
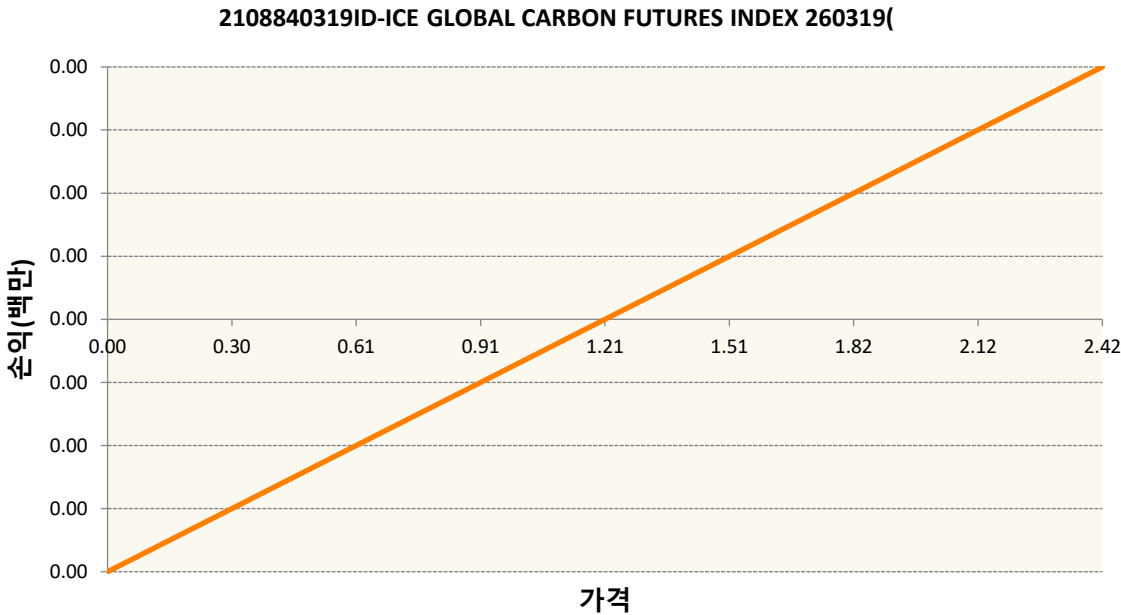
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	6,953	0	6,953	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		443
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		112

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	638

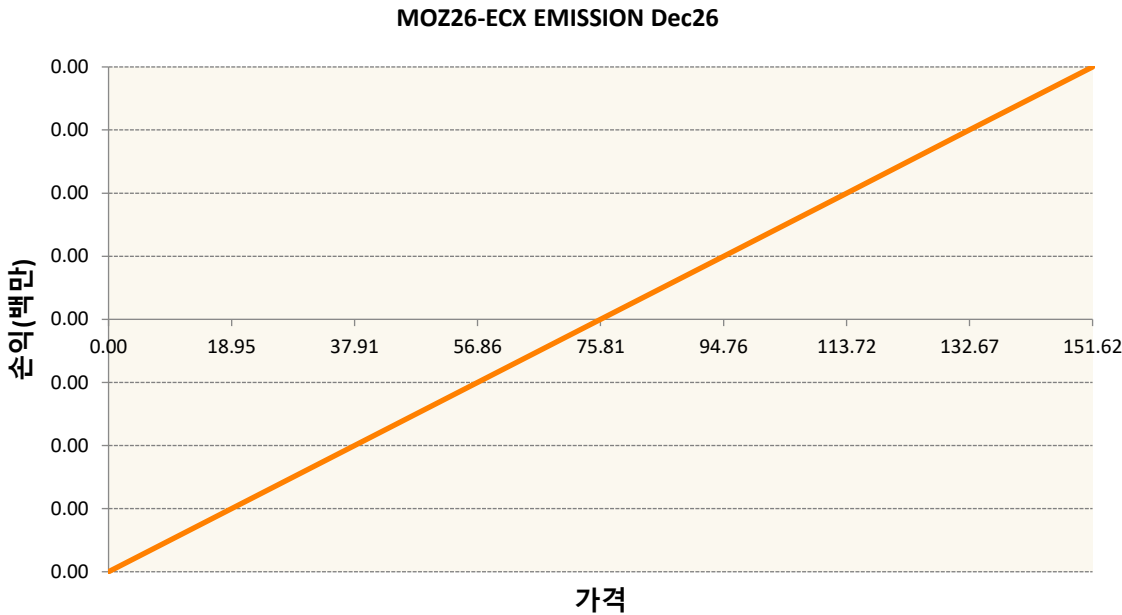
공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

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			4,887	0	4,887	
누계	통화	선도	0	2,384	-2,384	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)		
FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E		191
MOZ26 ECX EMISSION Dec26		391

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)
676

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

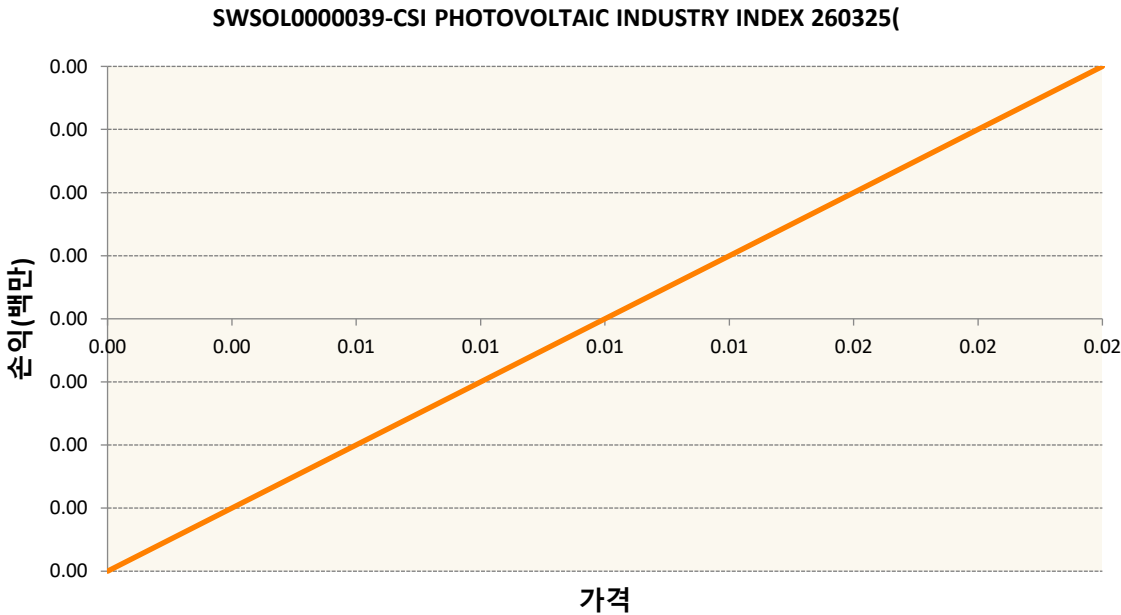
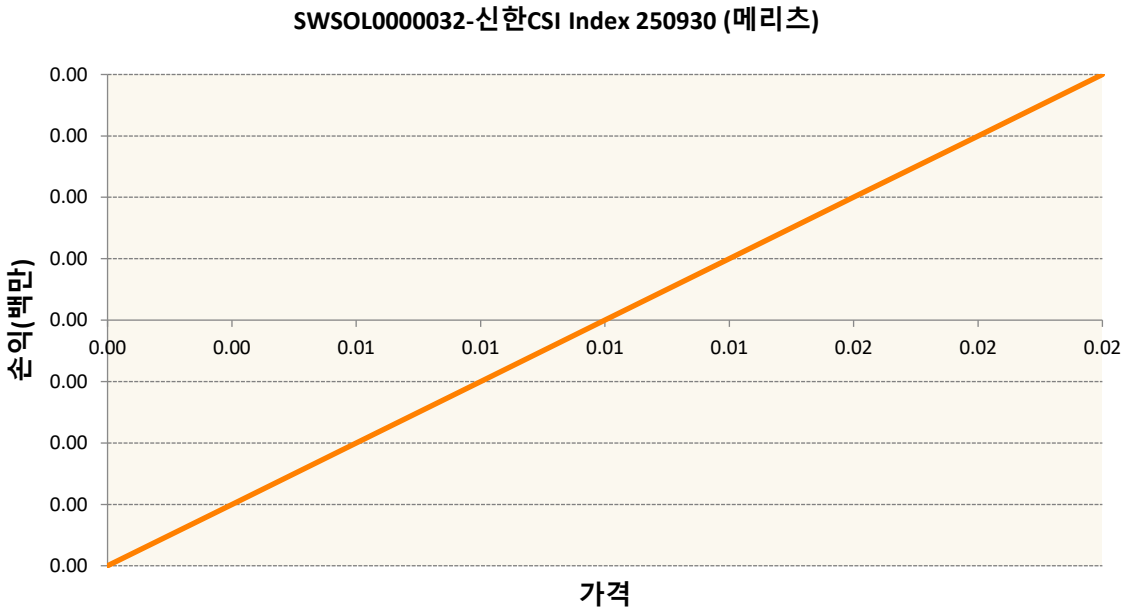
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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)		3
SWSOL00000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(		1

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	9

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

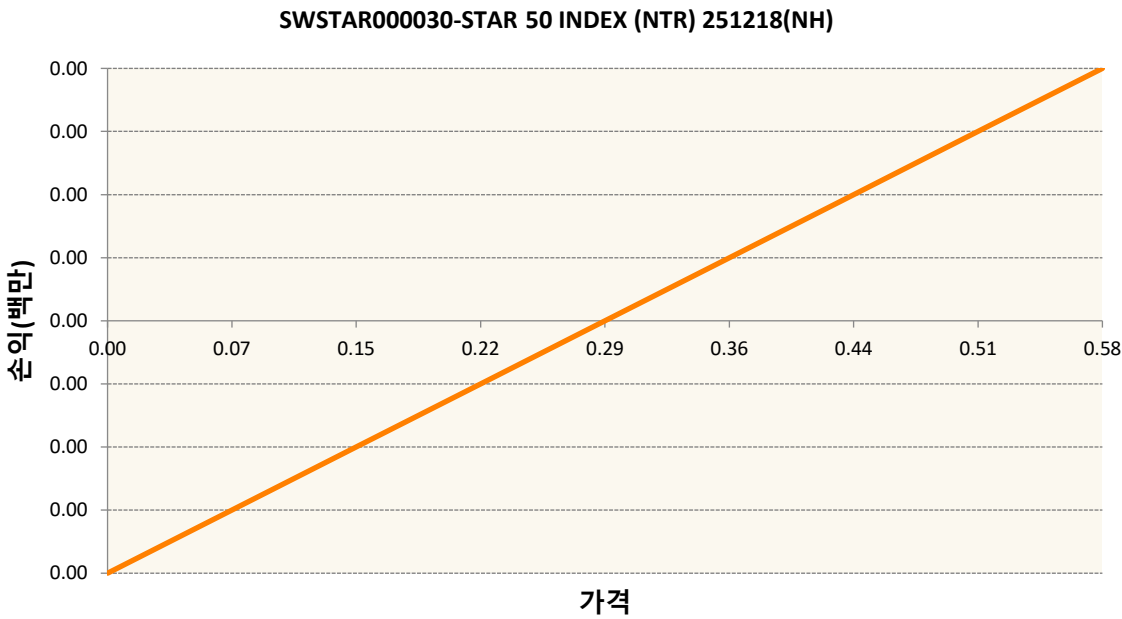
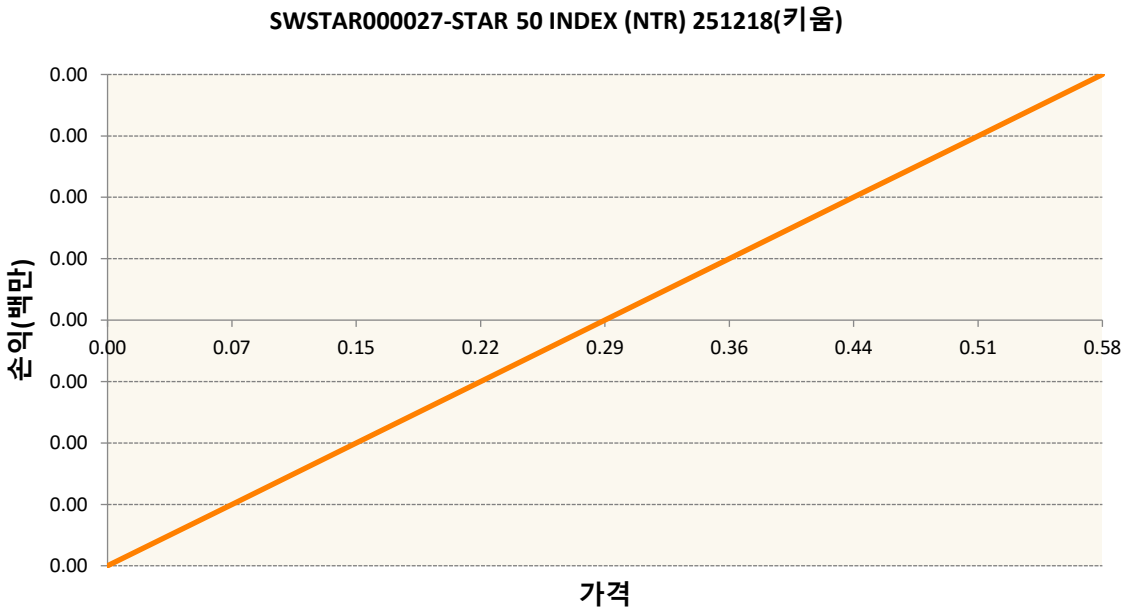
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

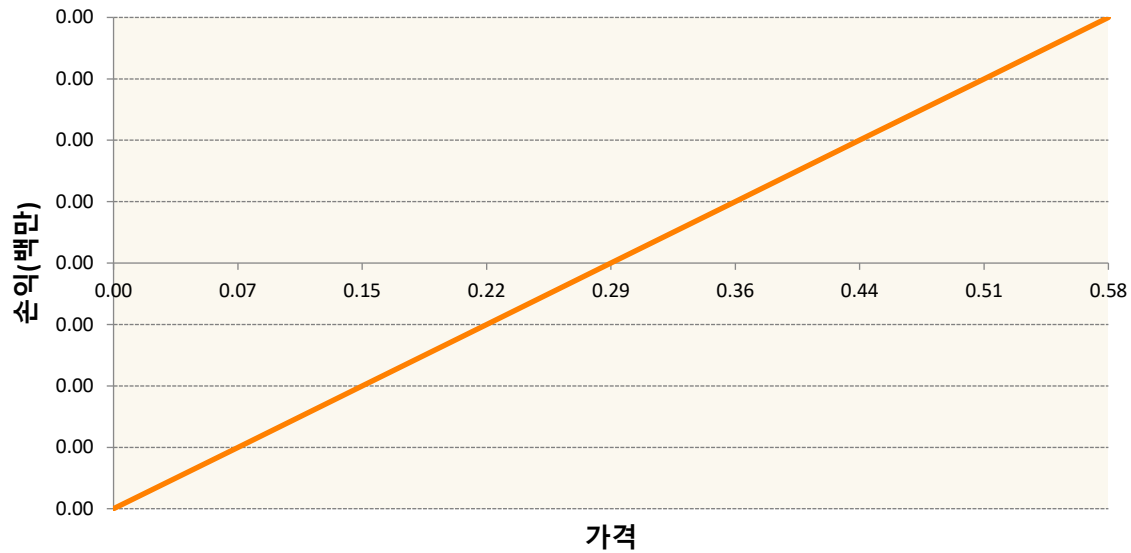
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,335	0	7,335	장외

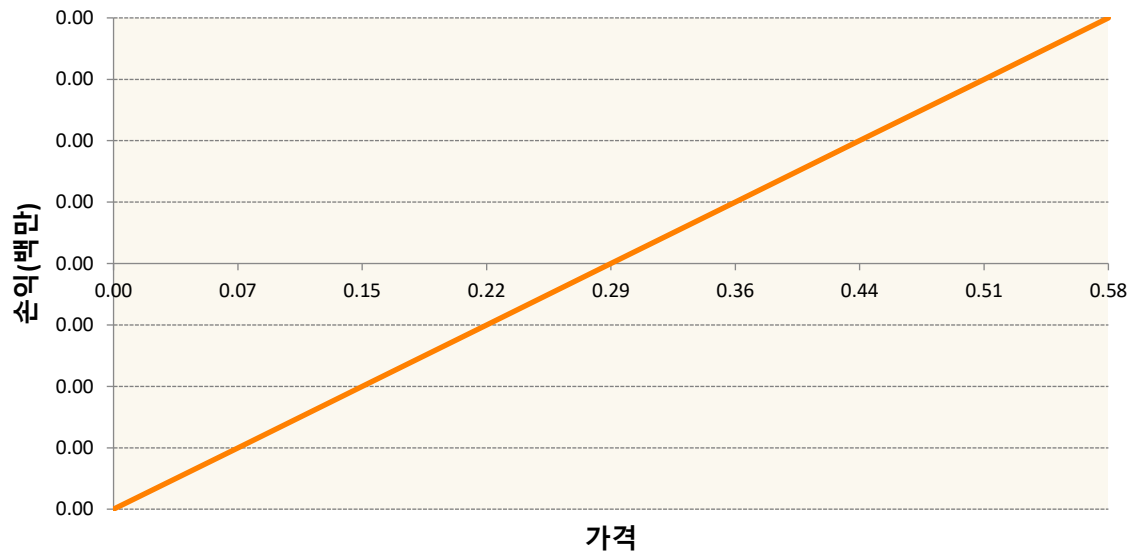
2. 만기시점의 손익구조



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)

21

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)

71

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)

361

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)

134

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

(단위:백만원)

893

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

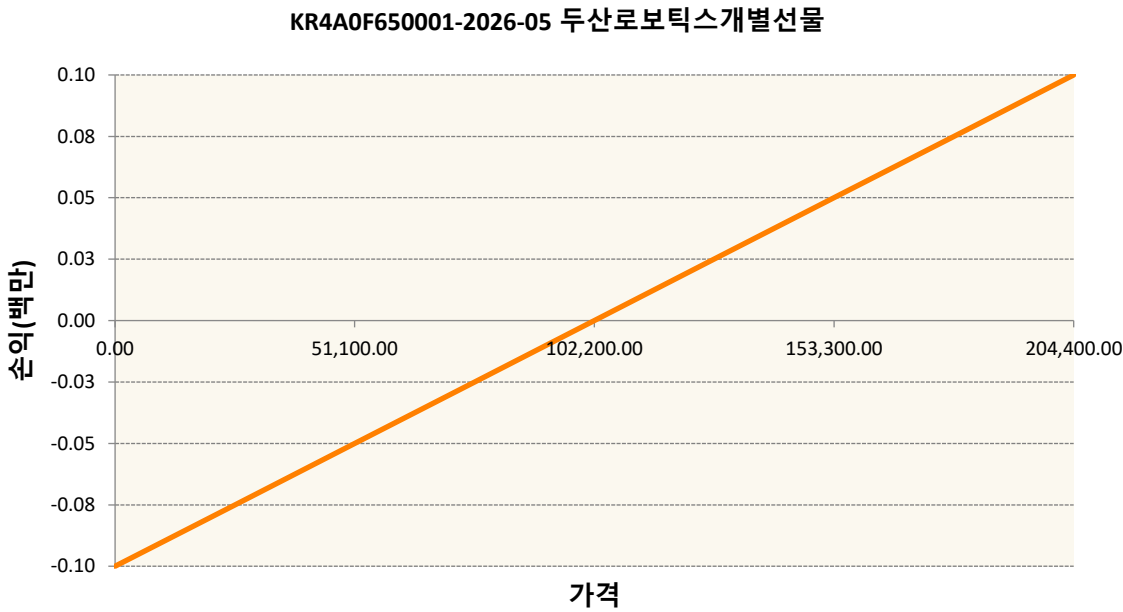
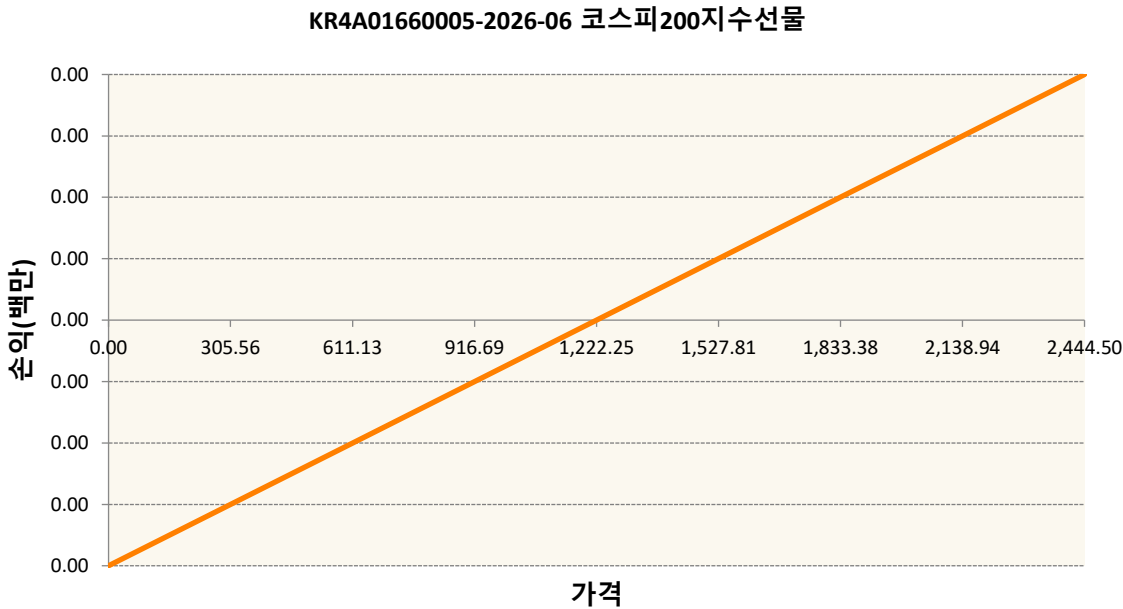
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

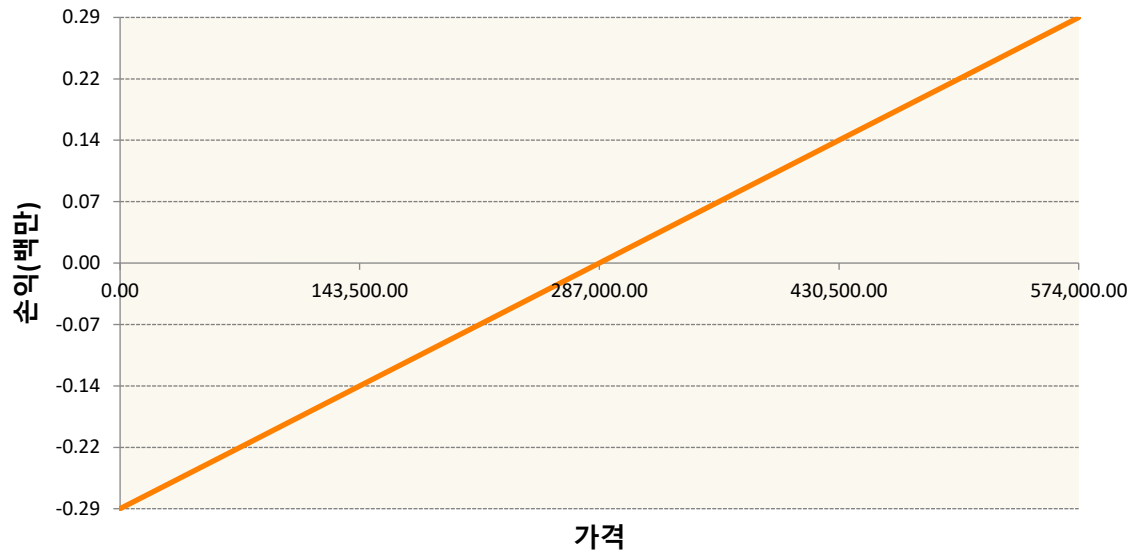
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,753	7,227	-4,474	장내
누계	유가증권	선물	21,490	4,203	17,287	장내

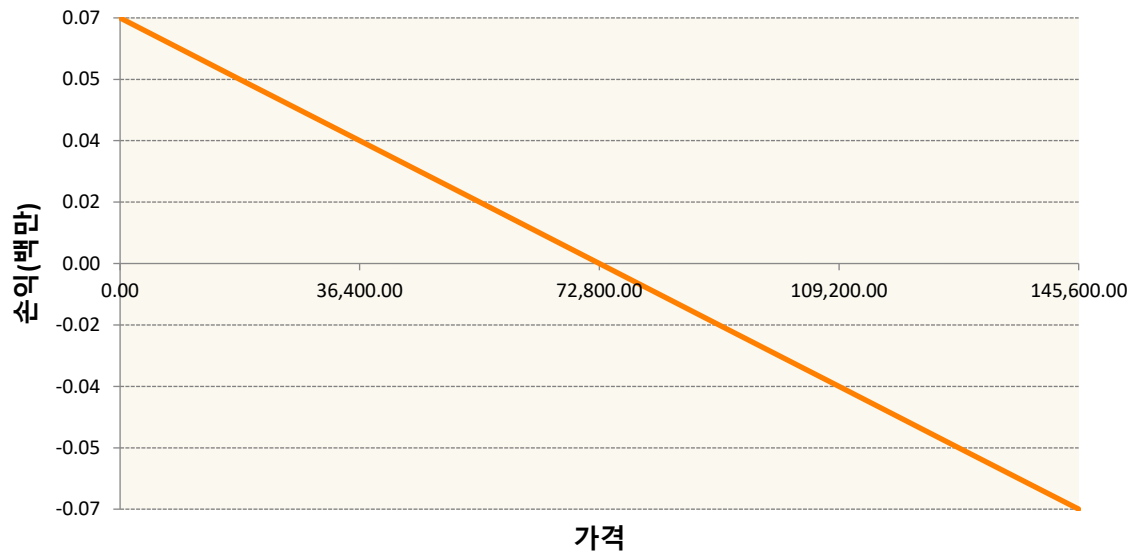
2. 만기시점의 손익구조



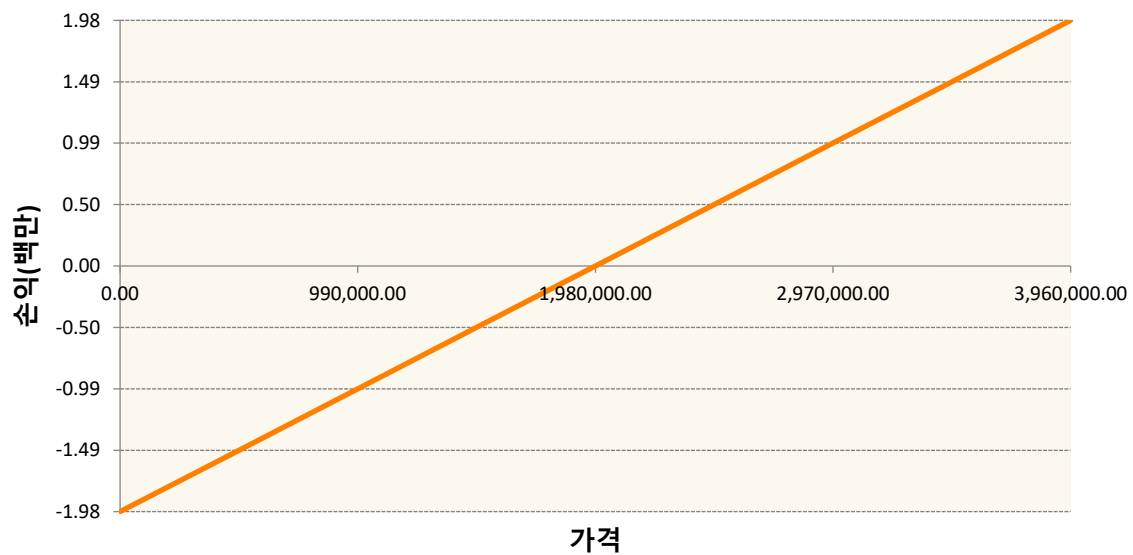
KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



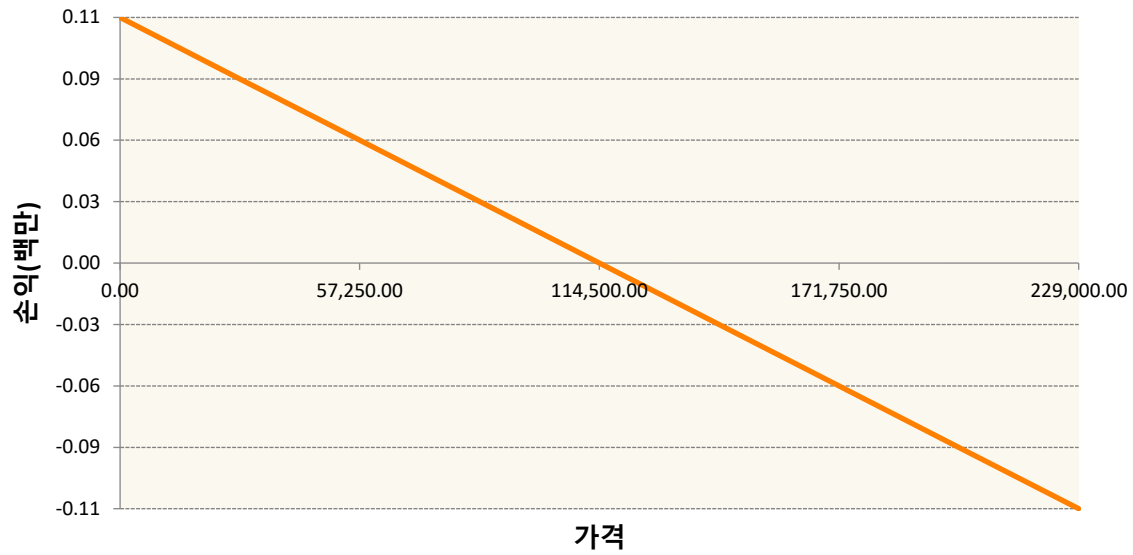
KR4A48660000-2026-06 미래에셋증권개별선물



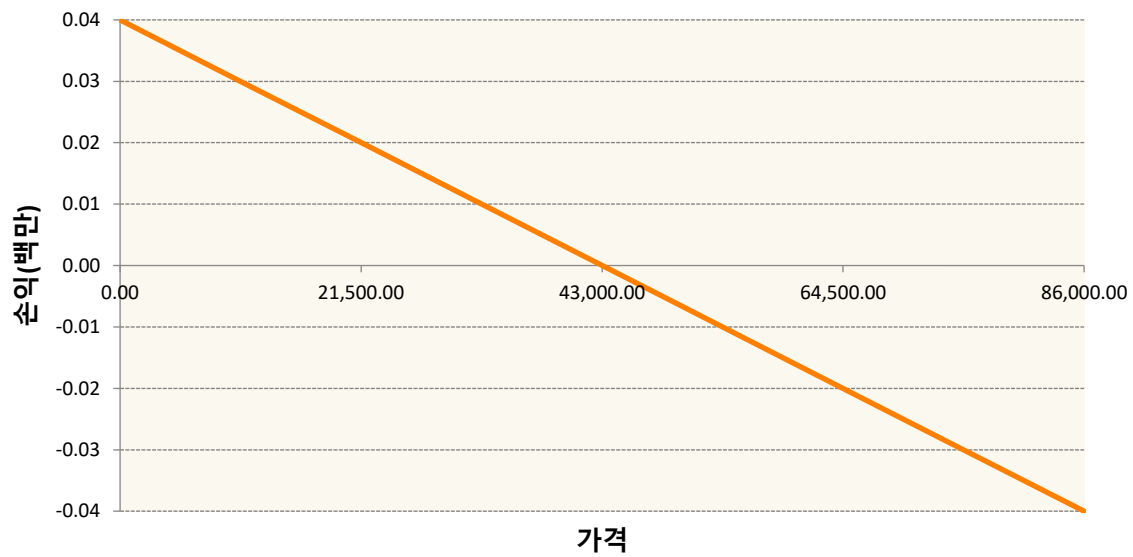
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



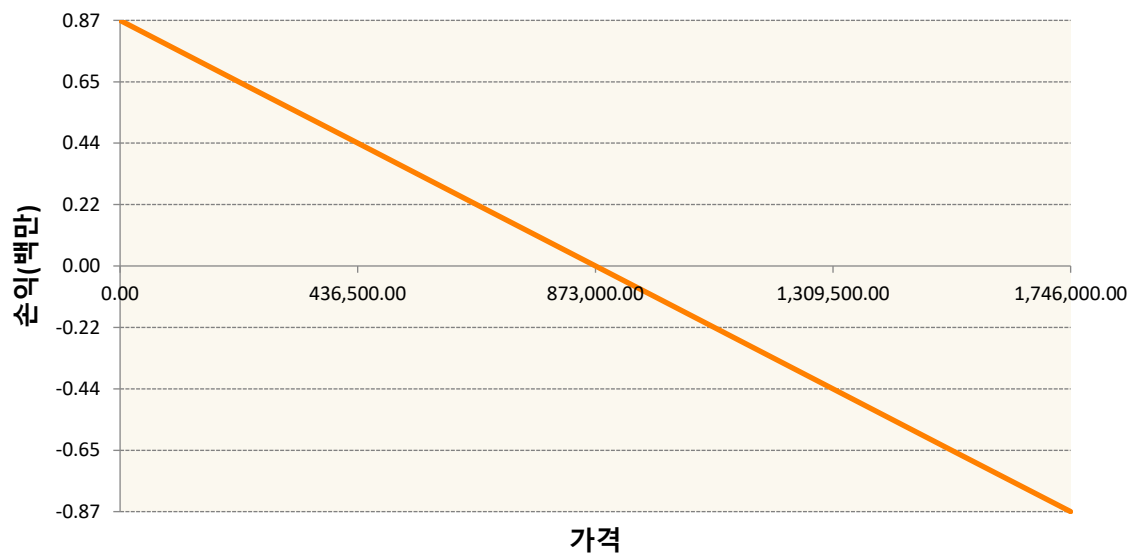
KR4AB2660002-2026-06 S-Oil개별선물



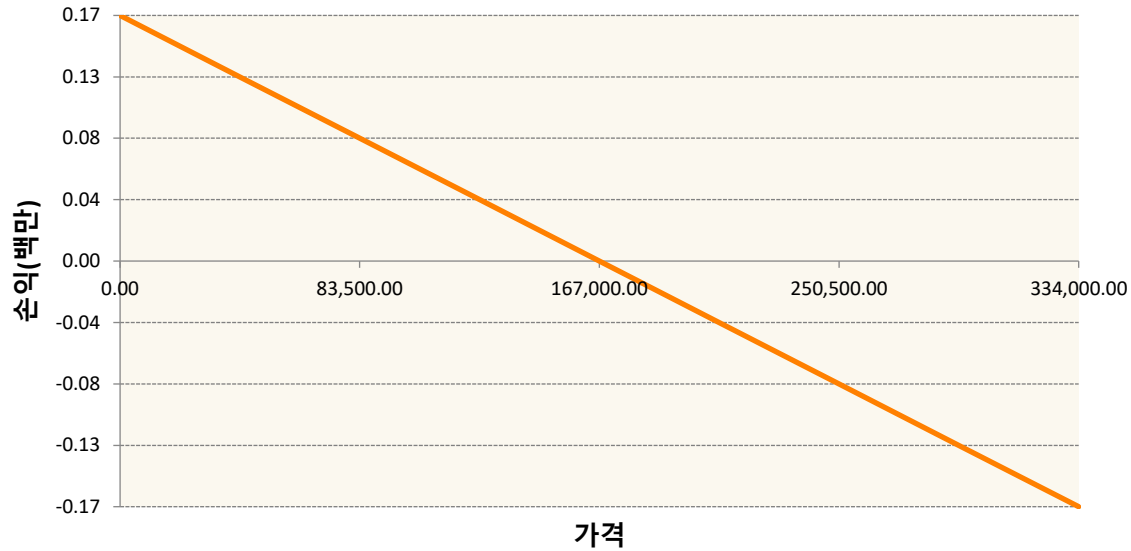
KR4ACF660005-2026-06 카카오개별선물



KR4ADB660008-2026-06 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선



KR4AFM660003-2026-06 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						1,293
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	-1,293	
-5.33%	-862	-862	-862	-862	-862	-862	-862	
-2.67%	-431	-431	-431	-431	-431	-431	-431	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	431	431	431	431	431	431	431	
5.33%	862	862	862	862	862	862	862	
8.00%	1,293	1,293	1,293	1,293	1,293	1,293	1,293	
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	
KR4A11660003		2026-06 삼성전자개별선물						235
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235	
-5.33%	-156	-156	-156	-156	-156	-156	-156	
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78	
0%	0	0	0	0	0	0	0	

2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	156	156	156	156	156	156	156
8.00%	235	235	235	235	235	235	235

KR4A48660000	2026-06 미래에셋증권개별선물	102
--------------	--------------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	102	102	102	102	102	102	102
-5.33%	68	68	68	68	68	68	68
-2.67%	34	34	34	34	34	34	34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
5.33%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
8.00%	-102	-102	-102	-102	-102	-102	-102

KR4A50650006	2026-05 SK하이닉스개별선물	171
--------------	--------------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171
-5.33%	-114	-114	-114	-114	-114	-114	-114
-2.67%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	57	57	57	57	57	57	57
5.33%	114	114	114	114	114	114	114
8.00%	171	171	171	171	171	171	171

KR4AB2660002	2026-06 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

KR4ACF660005	2026-06 카카오개별선물	110
--------------	-----------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	110	110	110	110	110	110	110
-5.33%	73	73	73	73	73	73	73
-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%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73
8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110

KR4ADB660008	2026-06 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

KR4AFM660003

2026-06 엘앤에프개별선물

28

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	28	28	28	28
-5.33%	19	19	19	19	19	19	19
-2.67%	9	9	9	9	9	9	9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28

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

(단위:백만원)

4,522

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

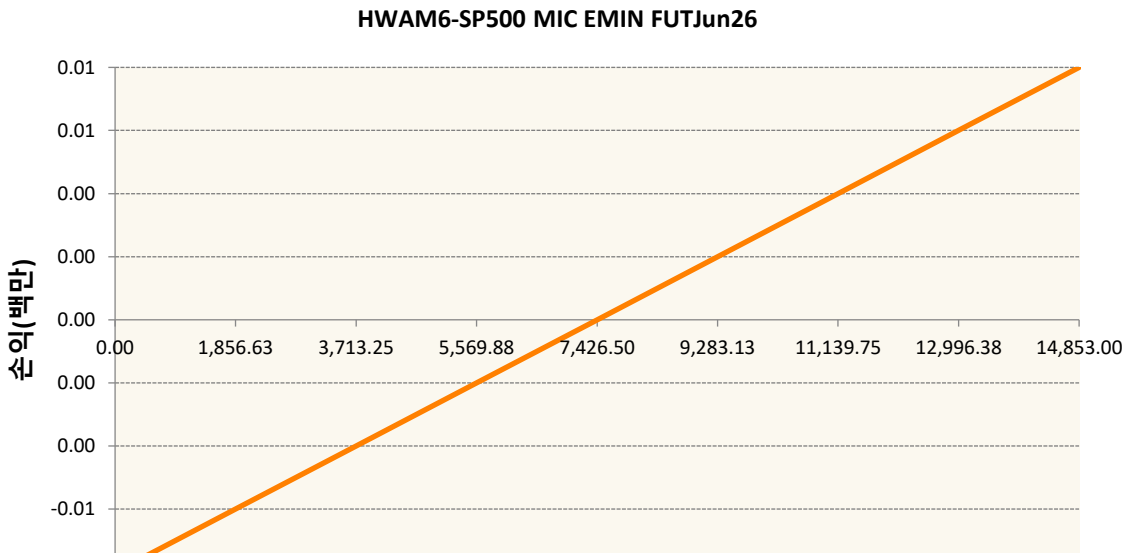
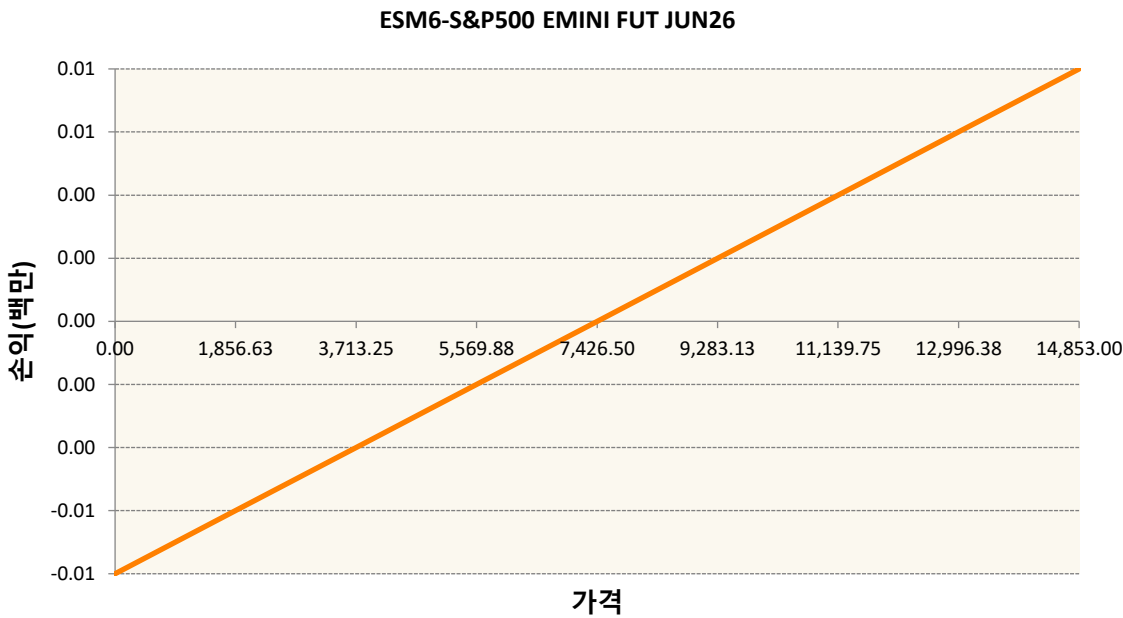
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

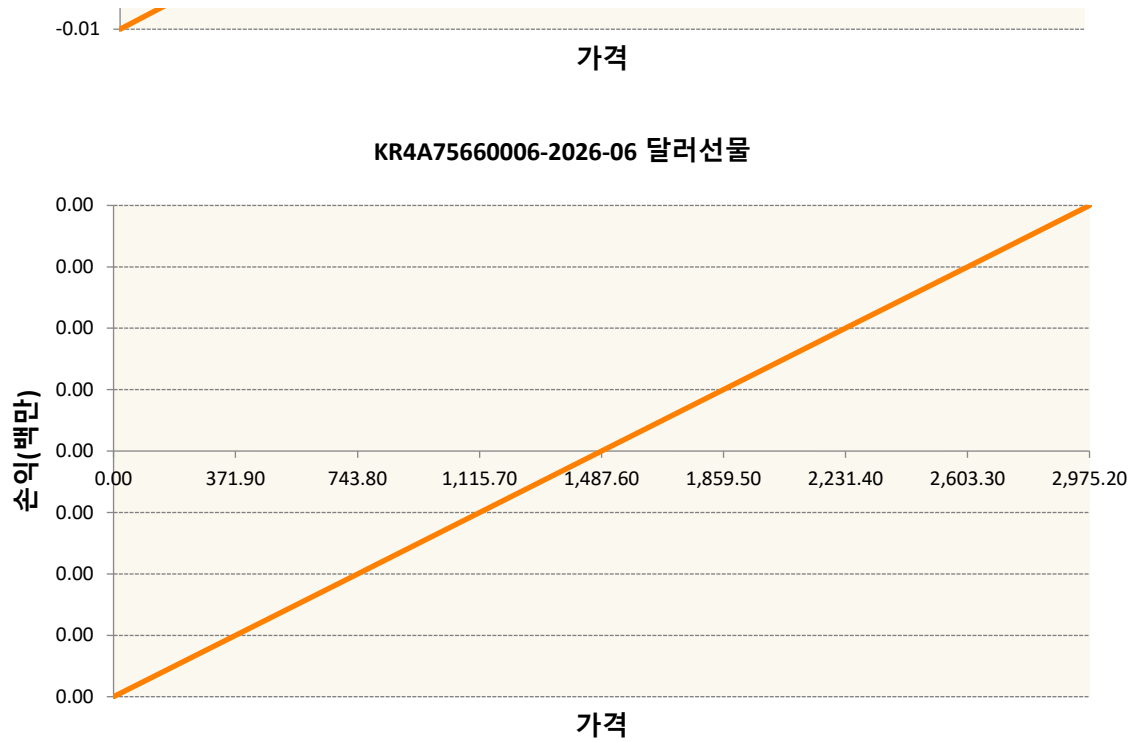
1. 계약금액

(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	10,612	0	10,612	장내
누계	지수	선물	60,067	0	60,067	
누계	지수	선물	277	0	277	장내
누계	통화	선물	10,562	0	10,562	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,805
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		22
KR4A756600 2026-06 달러선물			845

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,216

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

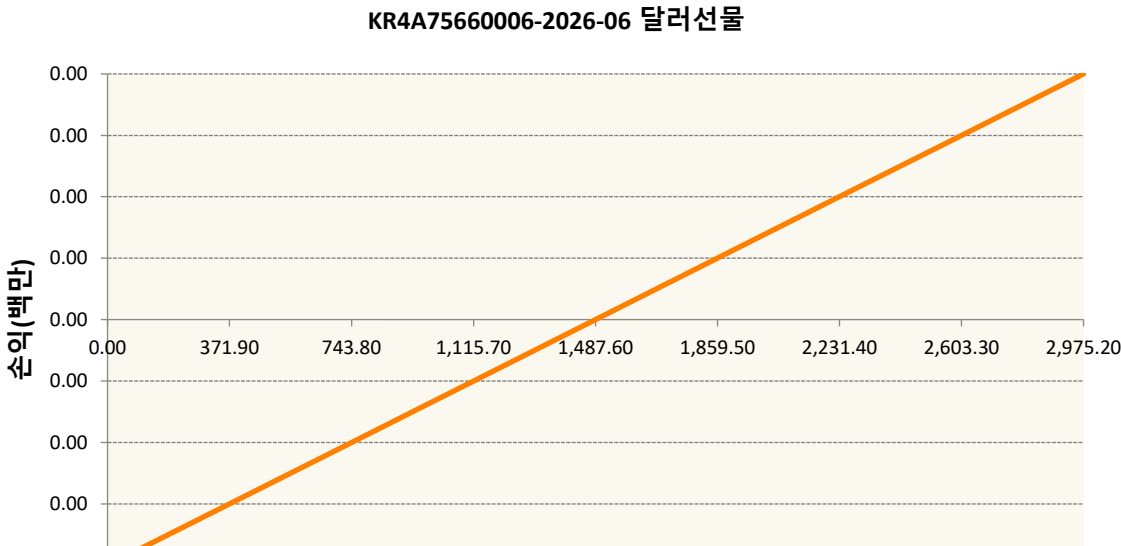
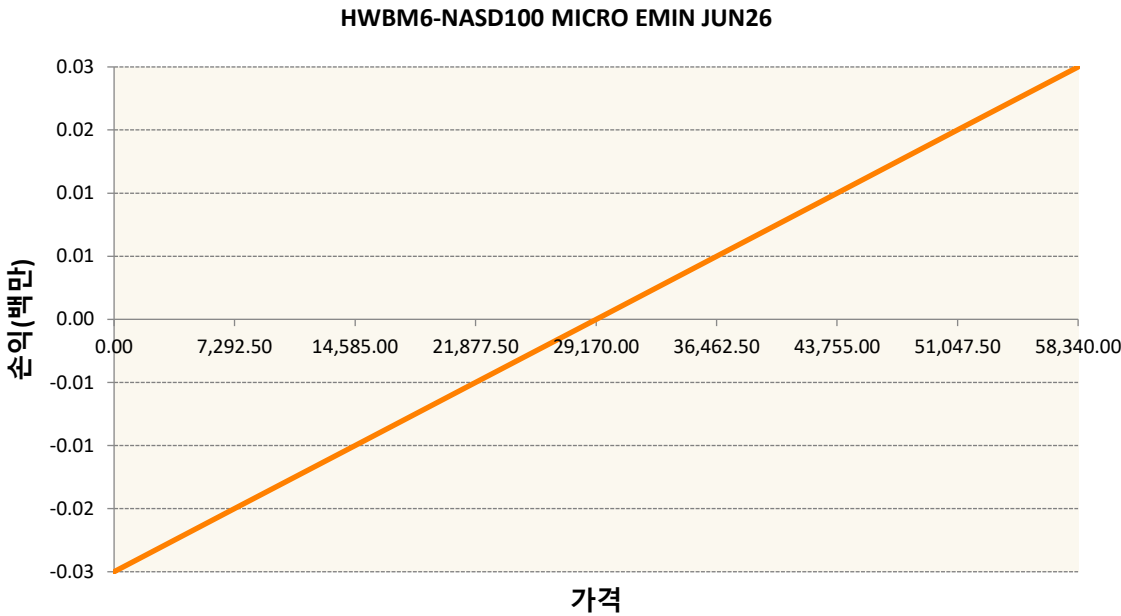
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

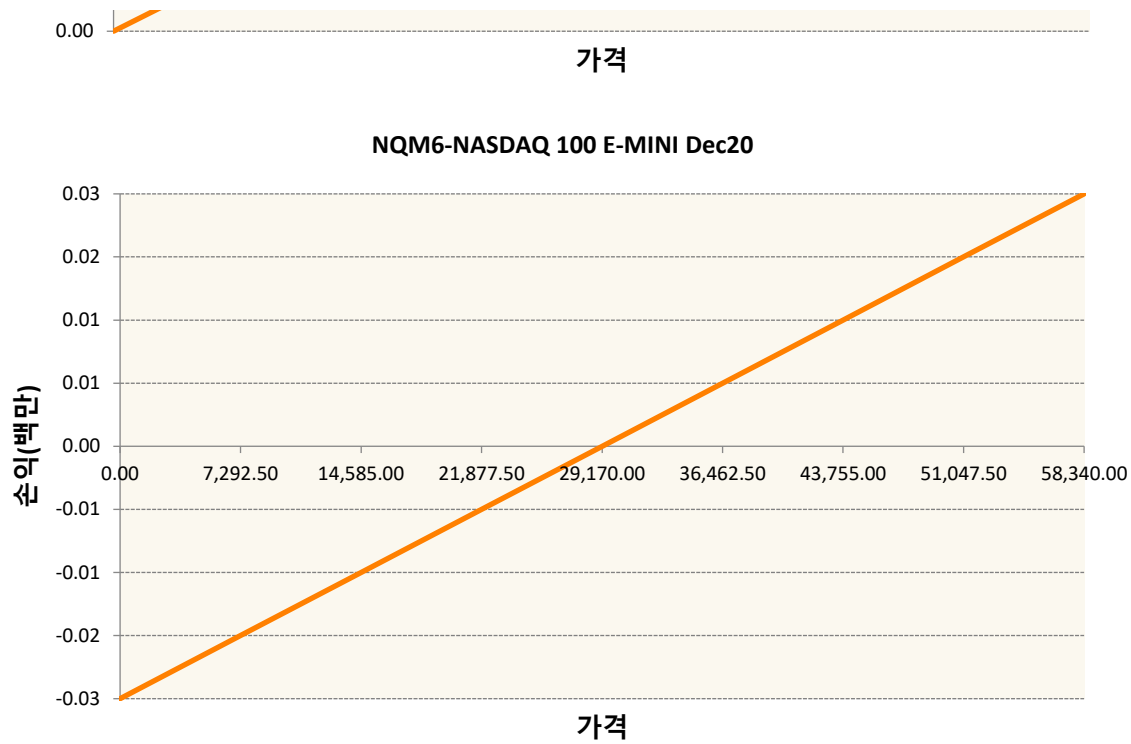
1. 계약금액

(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	3,901	0	3,901	장내
누계	유가증권	선물	29,670	0	29,670	
누계	유가증권	선물	255	0	255	장내
누계	통화	선물	3,883	0	3,883	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26		20
KR4A756600	2026-06 달러선물		311
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		2,374

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,651

공시일	2026-05-14
기준일	2026-05-13

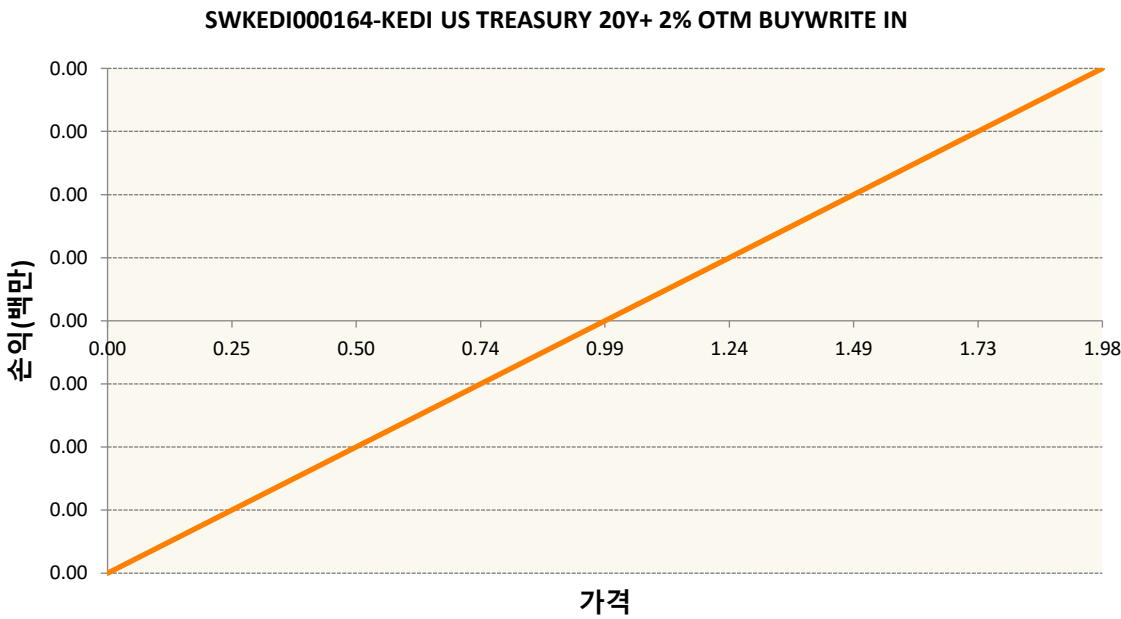
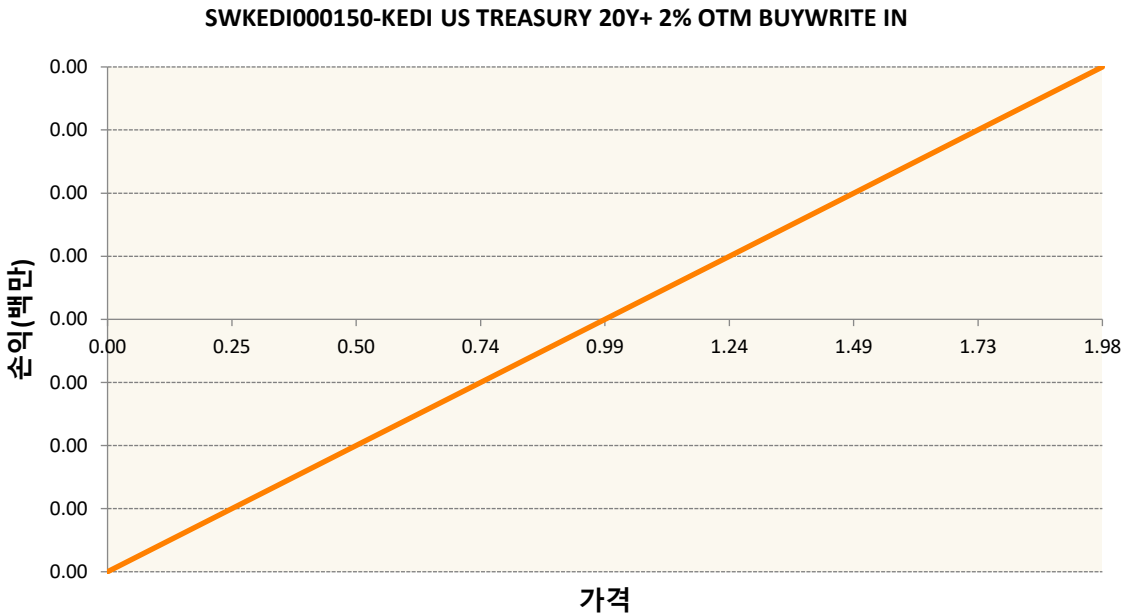
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

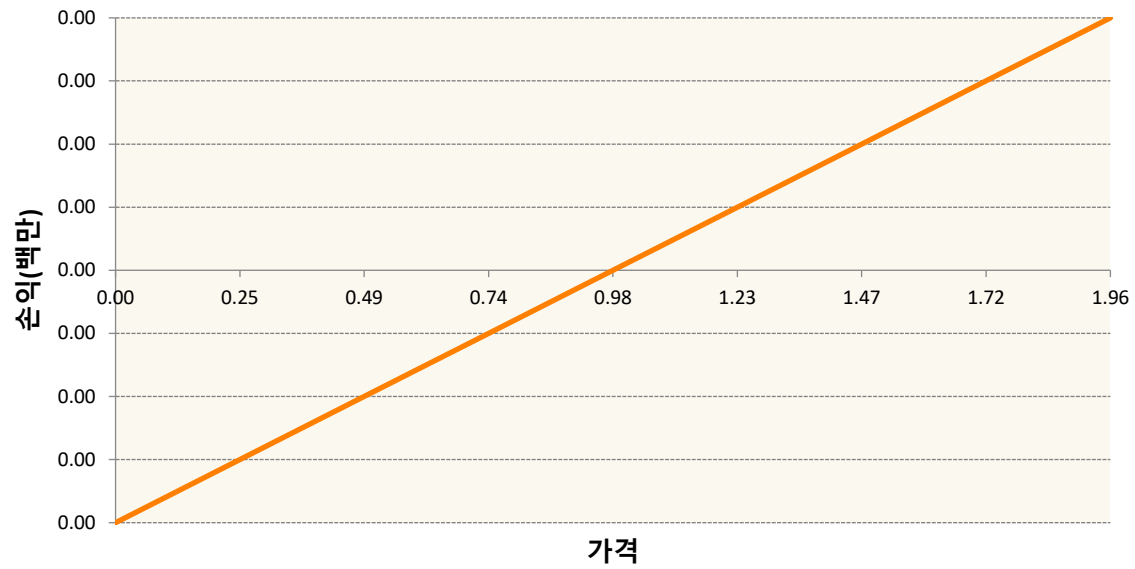
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	354,981	0	354,981	장외

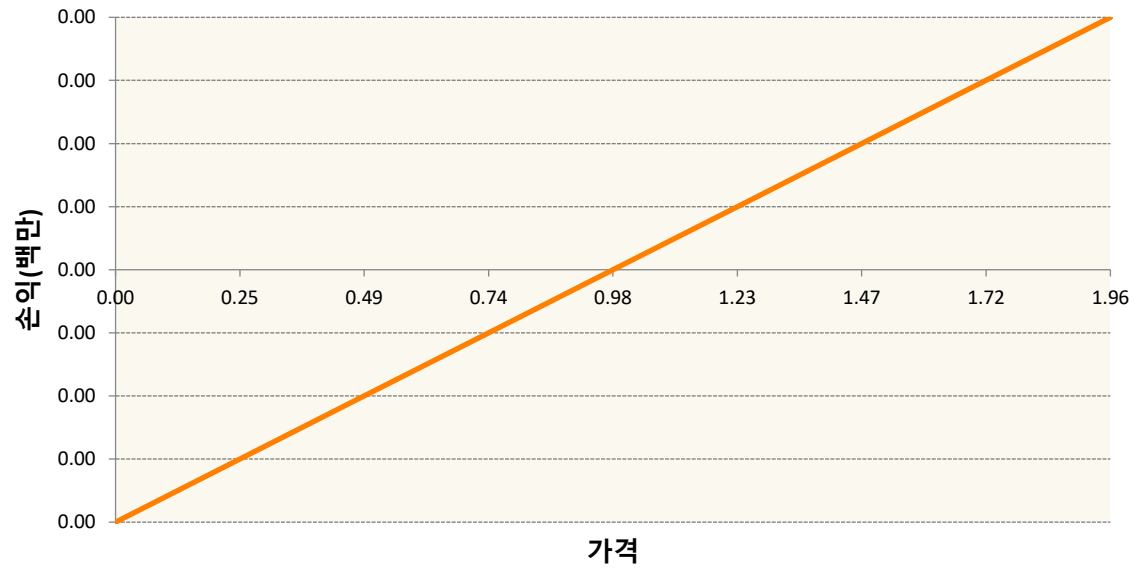
2. 만기시점의 손익구조



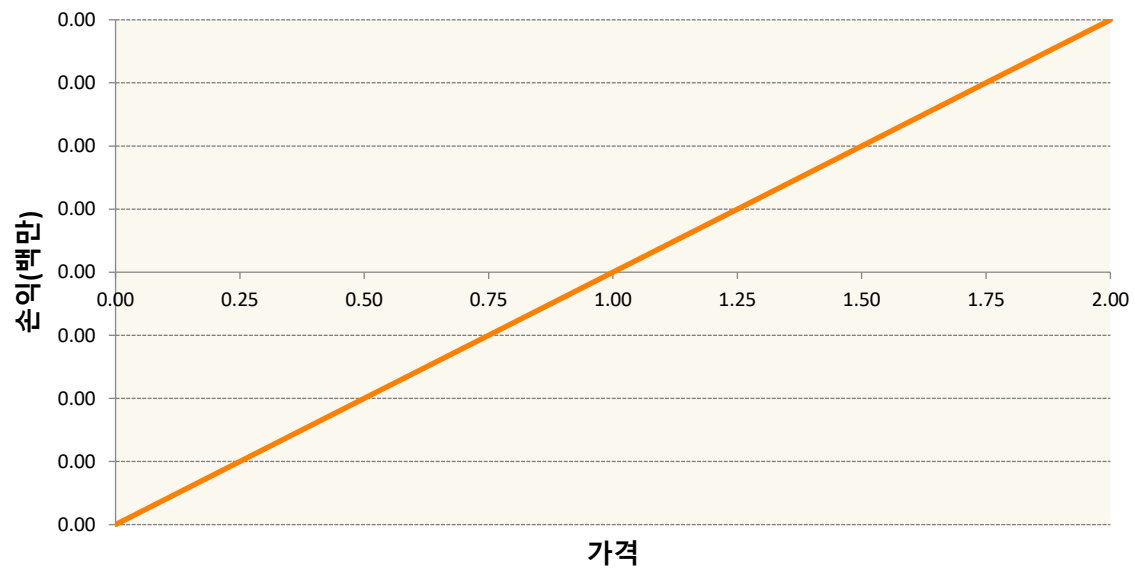
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000172-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000173-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,259
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		151
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,664
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,391
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,870

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,049