

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

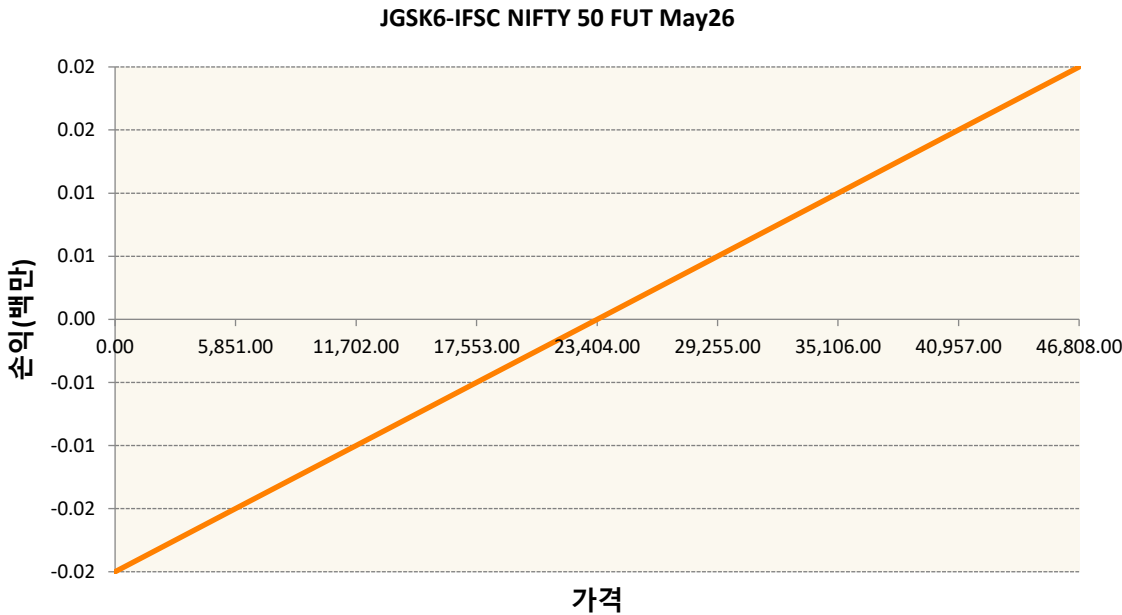
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	347	0	347	

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	2026-05-15
기준일	2026-05-14

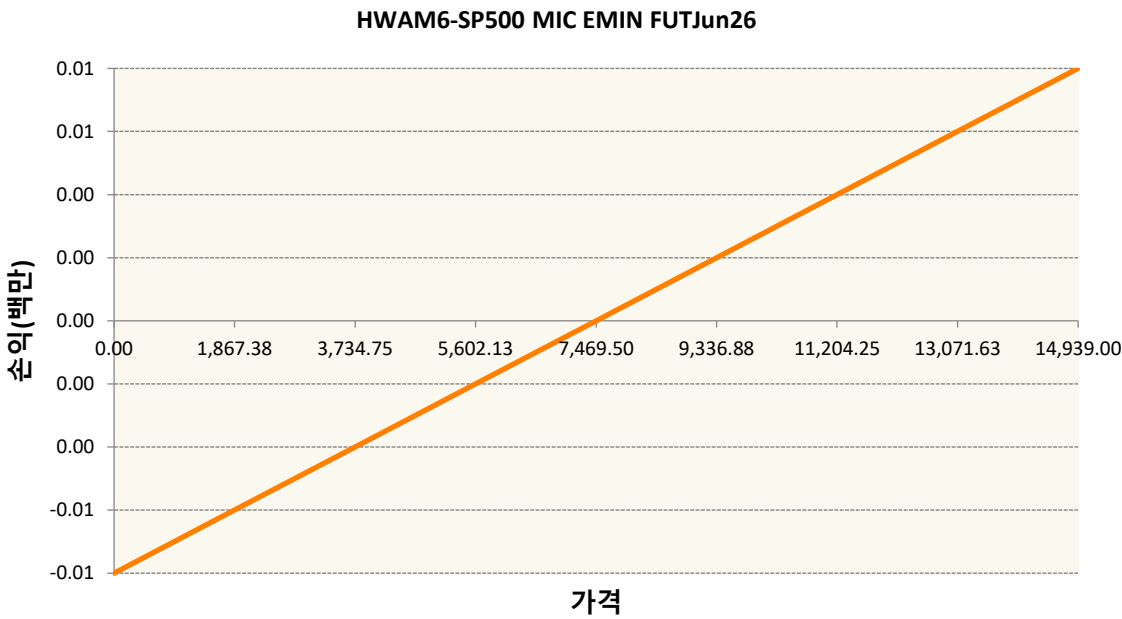
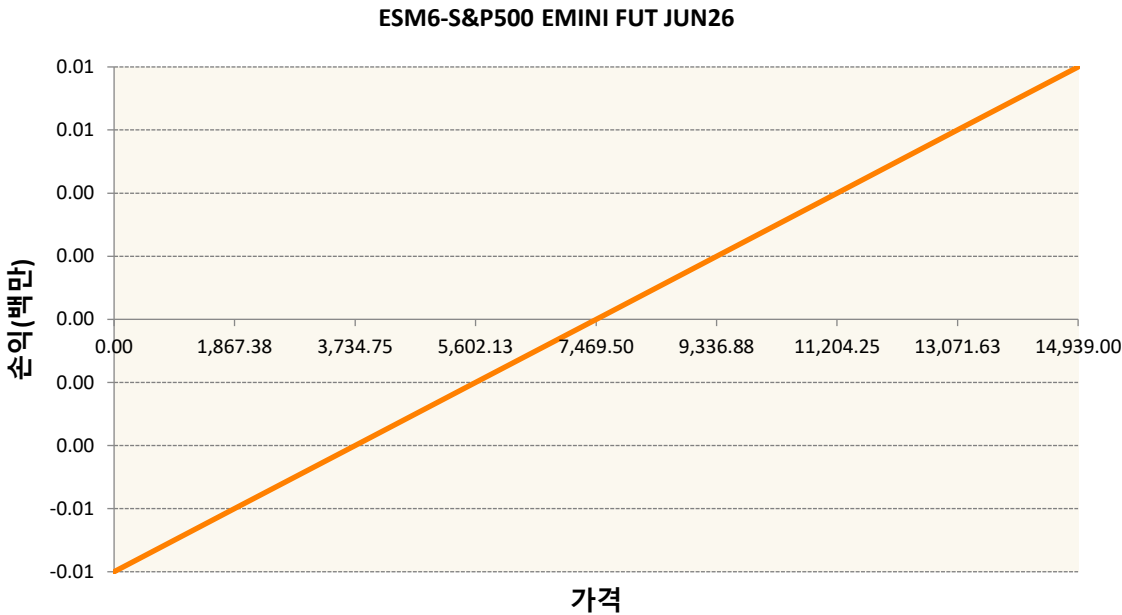
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	560	0	560	
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	2026-05-15
기준일	2026-05-14

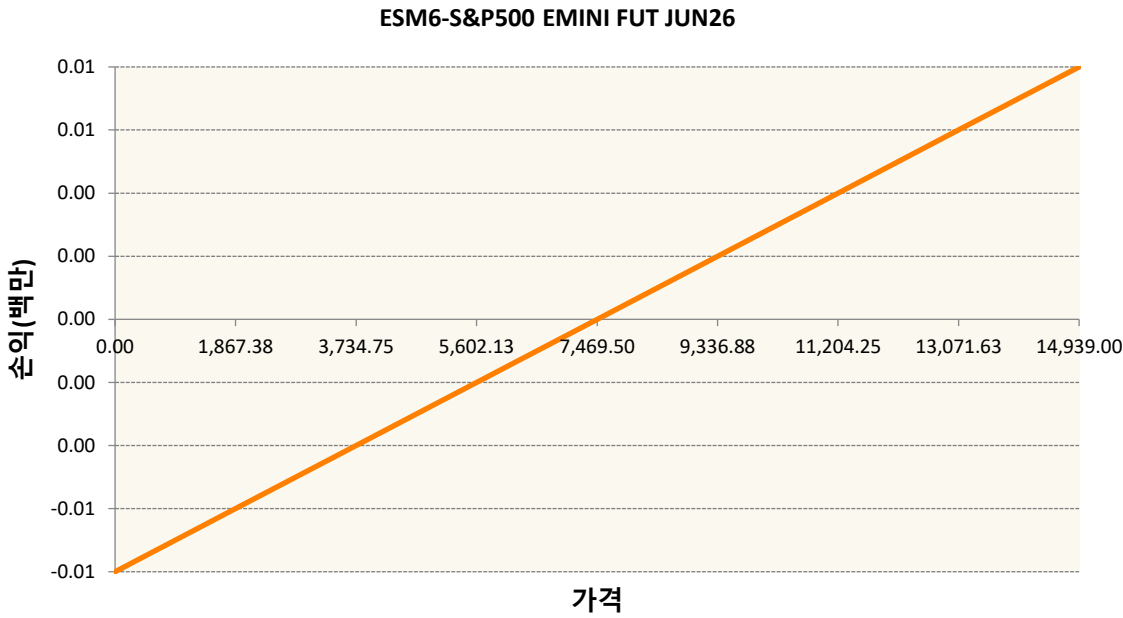
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,120	0	1,120	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	90
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

78

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

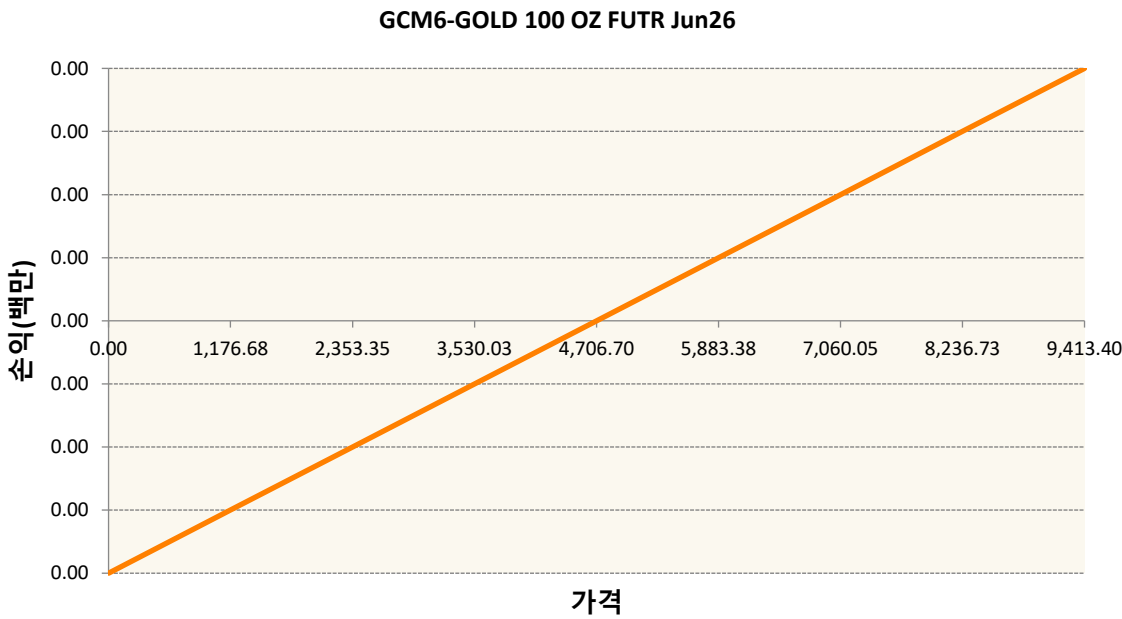
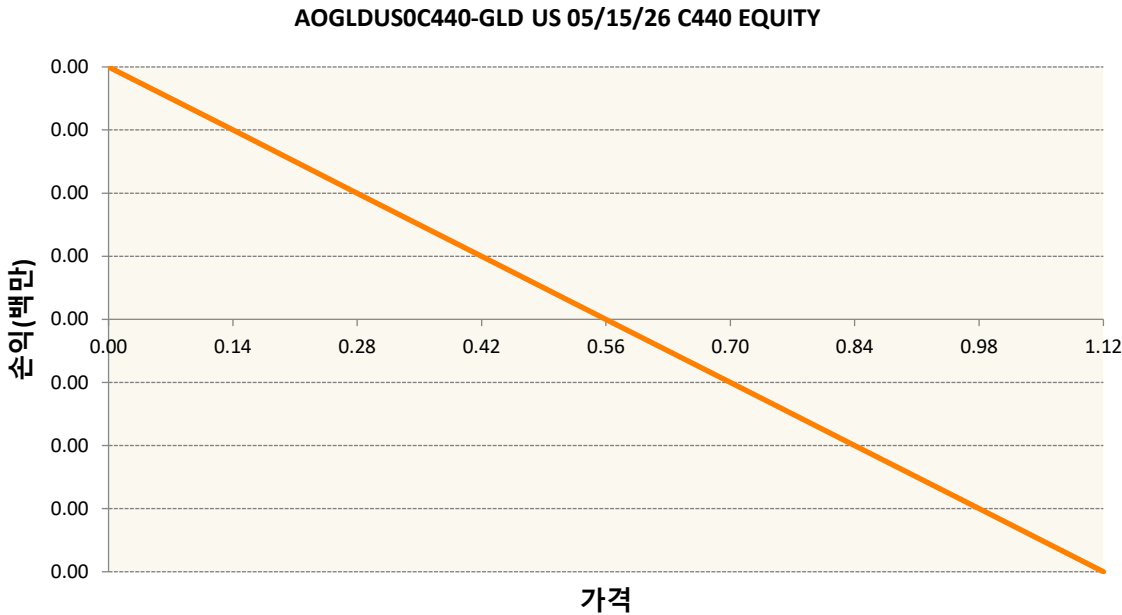
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,669	0	5,669	장내
누계	실물자산	옵션	0	130	-130	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUS0C GLD US 05/15/26 C440 EQUITY		10
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26		453

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	581

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

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	110
AOPLTRPUS`PLTR US 05/15/26 P147 EQUITY	11

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

(단위:백만원)

367

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

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	2026-05-15
기준일	2026-05-14

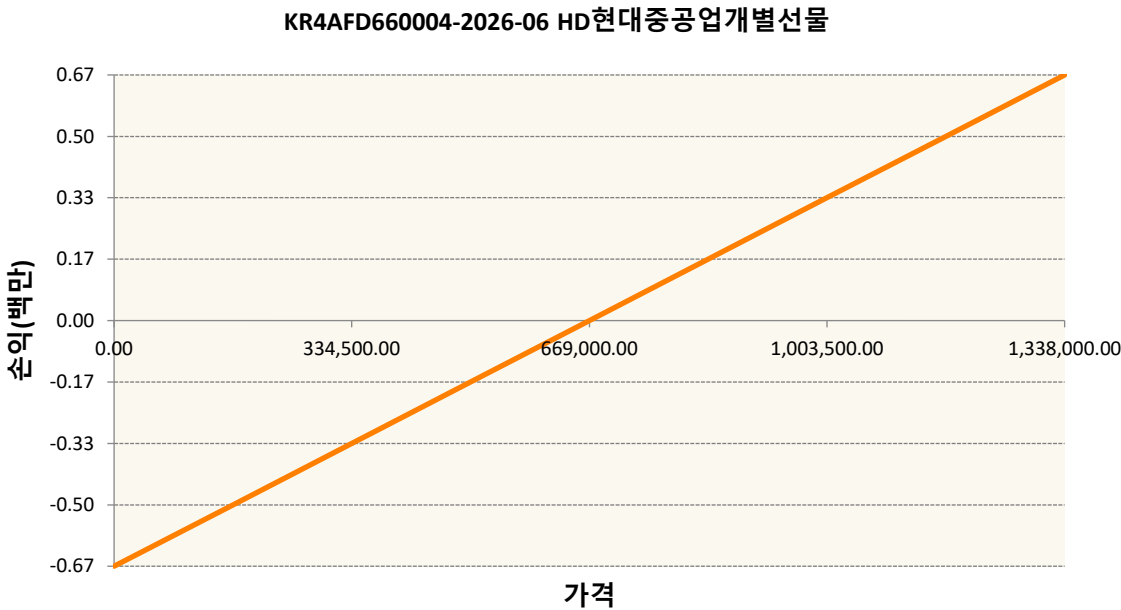
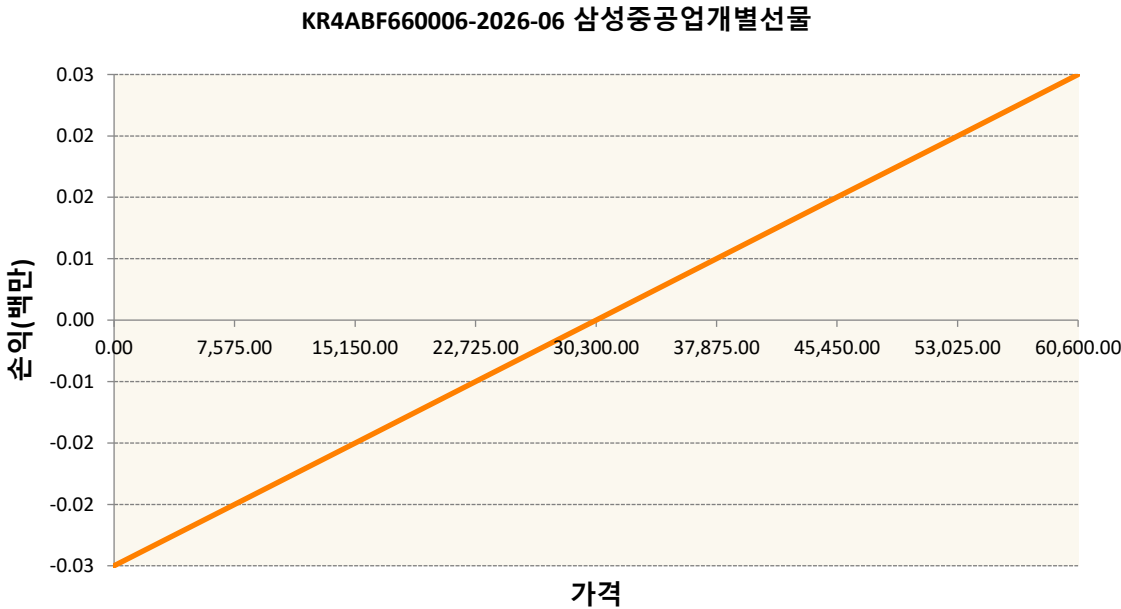
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

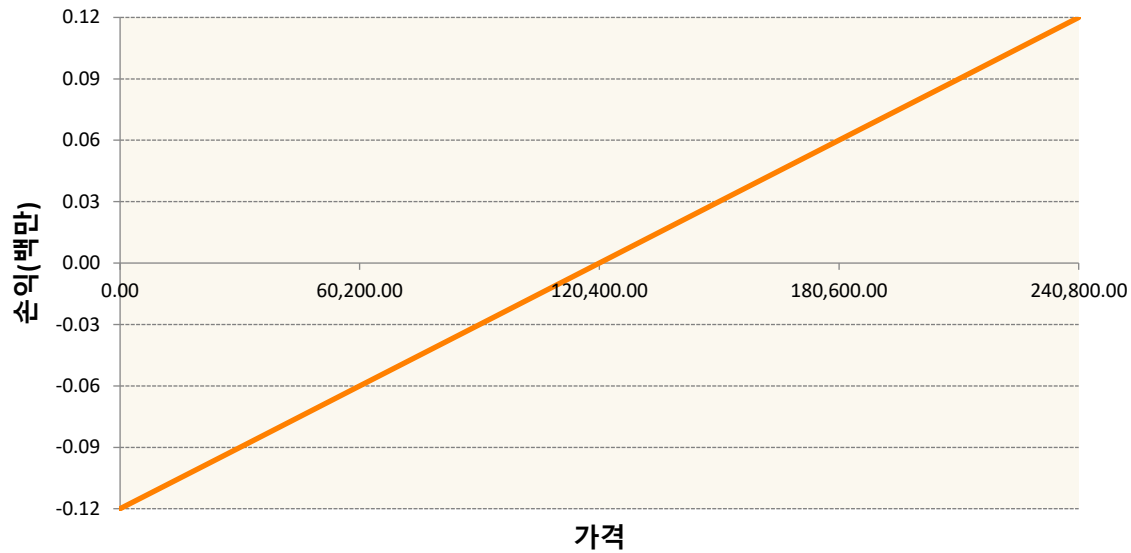
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	9,832	0	9,832	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	26,464	0	26,464	장내
누계	유가증권	스왑	160,434	0	160,434	장외

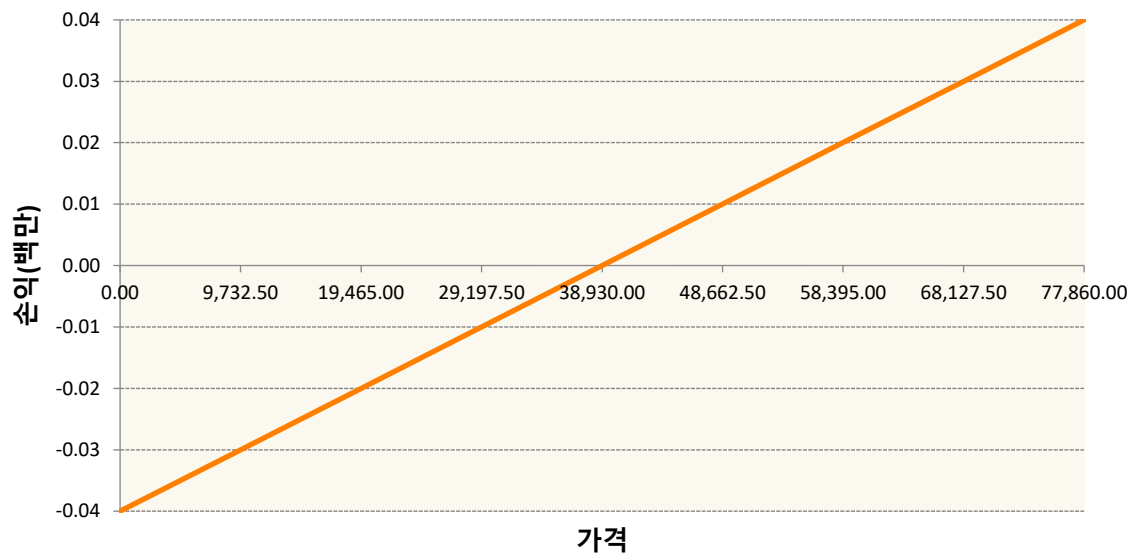
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV660002-2026-06 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF660006				2026-06 삼성중공업개별선물			664
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-664	-664	-664	-664	-664	-664	-664
-5.33%	-443	-443	-443	-443	-443	-443	-443
-2.67%	-221	-221	-221	-221	-221	-221	-221
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	221	221	221	221	221	221	221
5.33%	443	443	443	443	443	443	443
8.00%	664	664	664	664	664	664	664
KR4AFD660004				2026-06 HD현대중공업개별선물			1,020
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020
-5.33%	-680	-680	-680	-680	-680	-680	-680
-2.67%	-340	-340	-340	-340	-340	-340	-340
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	340	340	340	340	340	340	340
5.33%	680	680	680	680	680	680	680
8.00%	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020
KR4AFV660002 2026-06 한화오션개별선물							433
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-433	-433	-433	-433	-433	-433	-433
-5.33%	-289	-289	-289	-289	-289	-289	-289
-2.67%	-144	-144	-144	-144	-144	-144	-144
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	144	144	144	144	144	144	144
5.33%	289	289	289	289	289	289	289
8.00%	433	433	433	433	433	433	433

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

(단위:백만원)

3,107

공시일 2026-05-15

기준일 2026-05-14

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	2026-05-15
기준일	2026-05-14

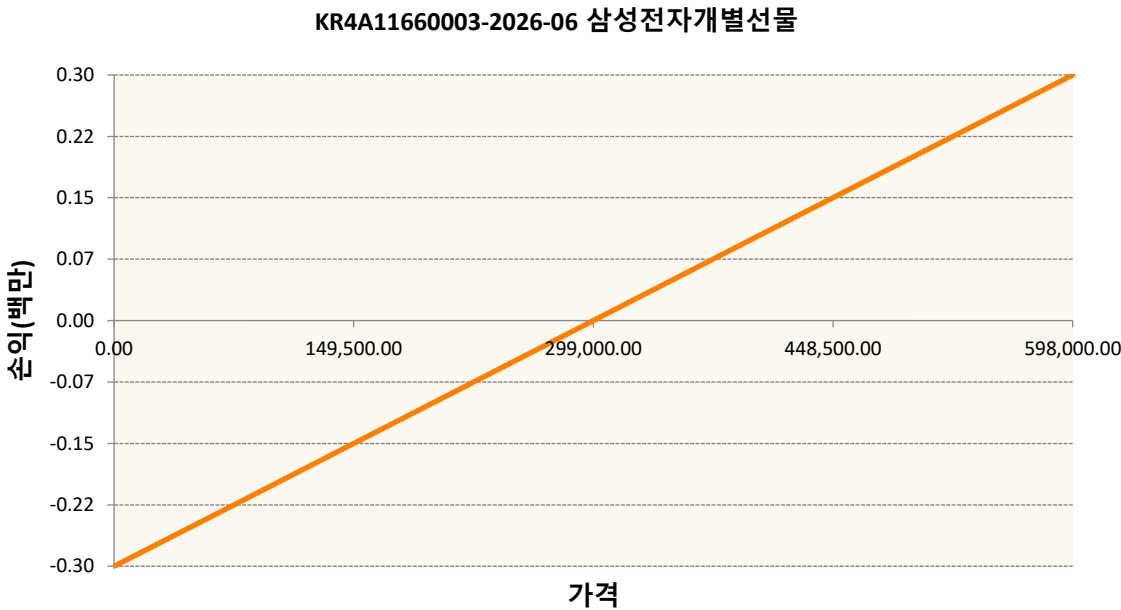
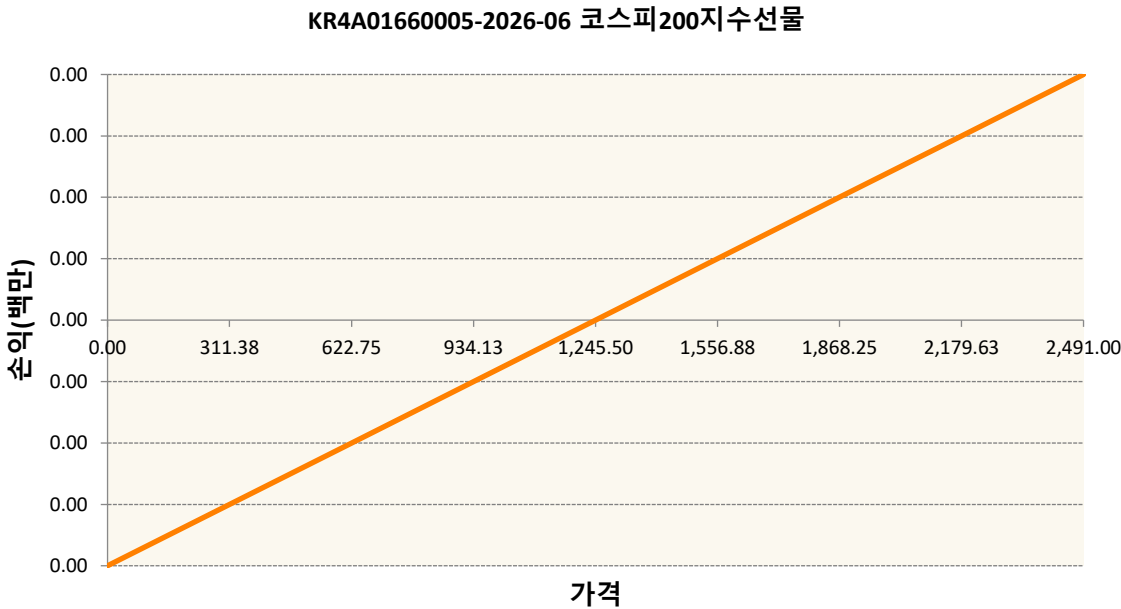
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	48,366	-48,366	장내
누계	유가증권	선물	24,242	47,659	-23,418	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the profit/loss (손익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 2,490.00 with major ticks every 311.25 units. The y-axis represents the profit/loss, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A solid blue line starts at the origin (0, 0) and slopes downward, ending at (2,490, -0.00).

가액	손익(백만)
0.00	0.00
311.25	-0.00
622.50	-0.00
933.75	-0.00
1,245.00	-0.00
1,556.25	-0.00
1,867.50	-0.00
2,178.75	-0.00
2,490.00	-0.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the residual amount (잔액). The x-axis represents the price in millions of won, ranging from 0.00 to 2,495.00. The y-axis represents the residual amount in 100 million won, ranging from 0.00 to 0.00. A solid blue line shows a constant negative slope, starting at the origin (0, 0.00) and ending at (2,495.00, 0.00).

가액 (Price)	잔액 (백만원) (Residual Amount)
0.00	0.00
311.88	0.00
623.75	0.00
935.63	0.00
1,247.50	0.00
1,559.38	0.00
1,871.25	0.00
2,183.13	0.00
2,495.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		646	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646
-5.33%	-431	-431	-431	-431	-431	-431	-431	-431	-431	-431
-2.67%	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215	-215
0%	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	215	215	215	215	215	215	215	215	215	215
5.33%	431	431	431	431	431	431	431	431	431	431
8.00%	646	646	646	646	646	646	646	646	646	646
KR4A11660003							2026-06 삼성전자개별선물		1,279	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279	-1,279
-5.33%	-852	-852	-852	-852	-852	-852	-852
-2.67%	-426	-426	-426	-426	-426	-426	-426
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	426	426	426	426	426	426	426
5.33%	852	852	852	852	852	852	852
8.00%	1,279	1,279	1,279	1,279	1,279	1,279	1,279
KR4BAFBDA992 코스피위클리M C 2605W3 1,245.0							2,287

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,287	2,287	2,287	2,287	2,287	2,287	2,287
-5.33%	1,525	1,525	1,525	1,525	1,525	1,525	1,525
-2.67%	762	762	762	762	762	762	762
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-762	-762	-762	-762	-762	-762	-762
5.33%	-1,525	-1,525	-1,525	-1,525	-1,525	-1,525	-1,525
8.00%	-2,287	-2,287	-2,287	-2,287	-2,287	-2,287	-2,287

KR4BAFBDB016 코스피위클리M C 2605W3 1,247.5							1,517
---------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-------

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,517	1,517	1,517	1,517	1,517	1,517	1,517
-5.33%	1,011	1,011	1,011	1,011	1,011	1,011	1,011
-2.67%	506	506	506	506	506	506	506
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-506	-506	-506	-506	-506	-506	-506
5.33%	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011	-1,011
8.00%	-1,517	-1,517	-1,517	-1,517	-1,517	-1,517	-1,517

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

(단위:백만원)

13,262

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

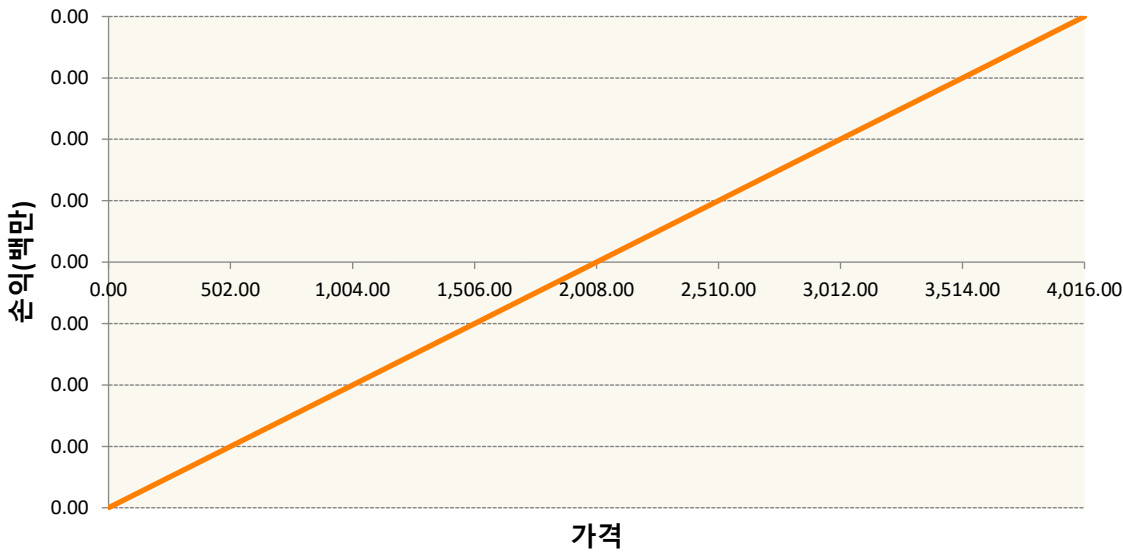
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,165	0	1,165	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A06660000-2026-06 코스닥150선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06660000			2026-06 코스닥150선물				93
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-93	-93	-93	-93	-93	-93	-93
-5.33%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62
-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%	62	62	62	62	62	62	62
8.00%	93	93	93	93	93	93	93

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

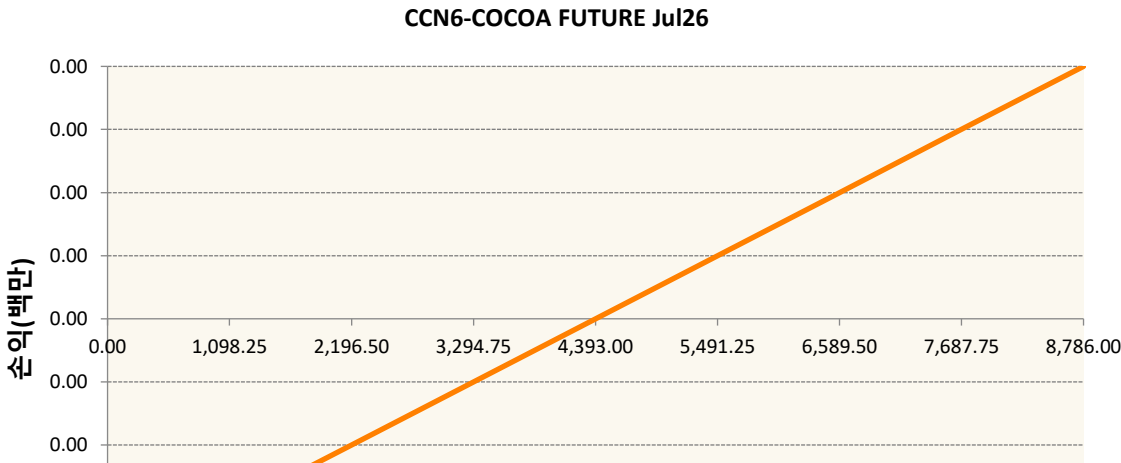
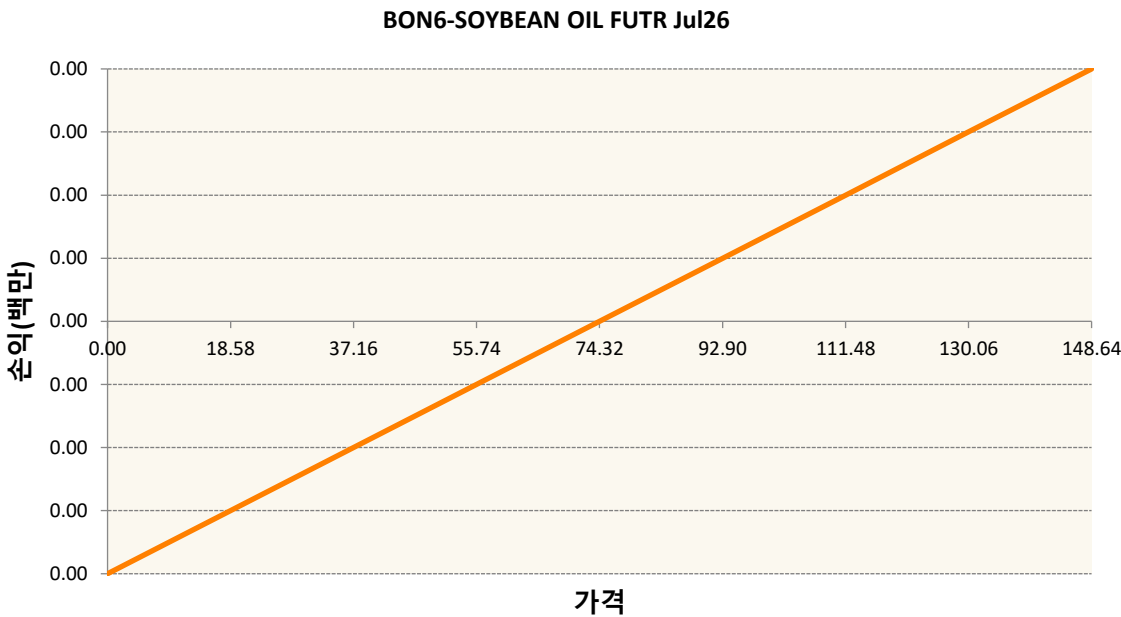
포커스농산물모(채권-파생형)

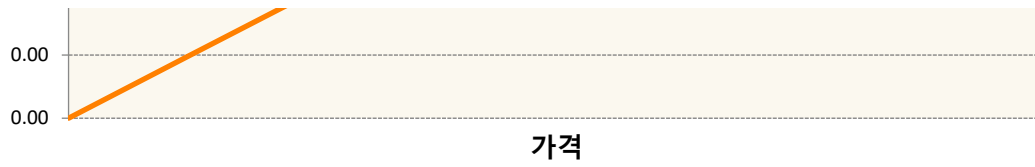
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

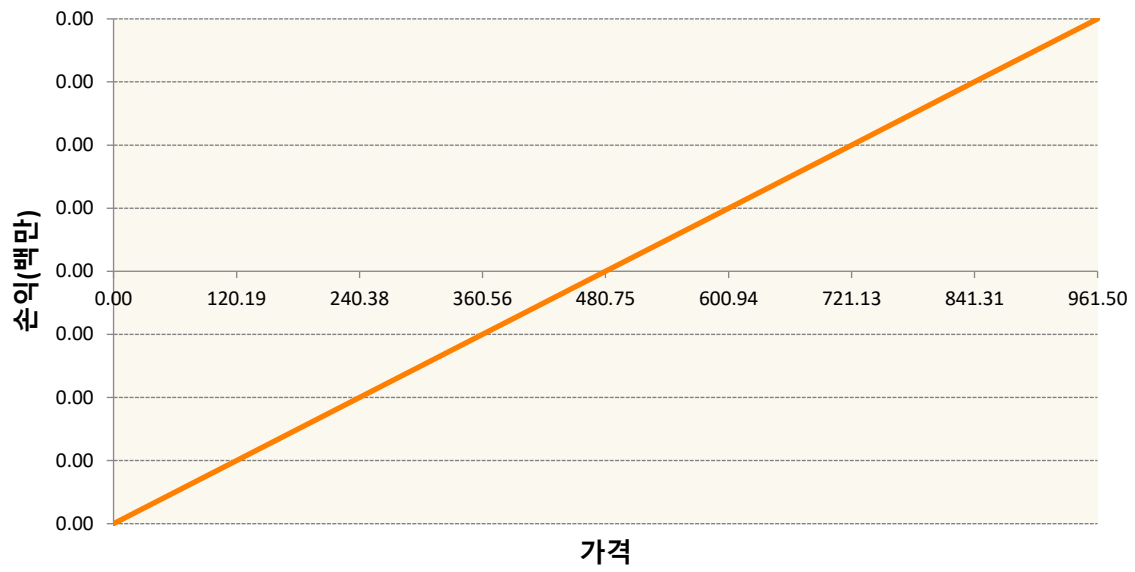
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	388	-388	장내
누계	실물자산	선물	65	0	65	
누계	실물자산	선물	942	0	942	장내
누계	유가증권	선물	2,037	0	2,037	
누계	통화	선물	0	387	-387	장내

2. 만기시점의 손익구조

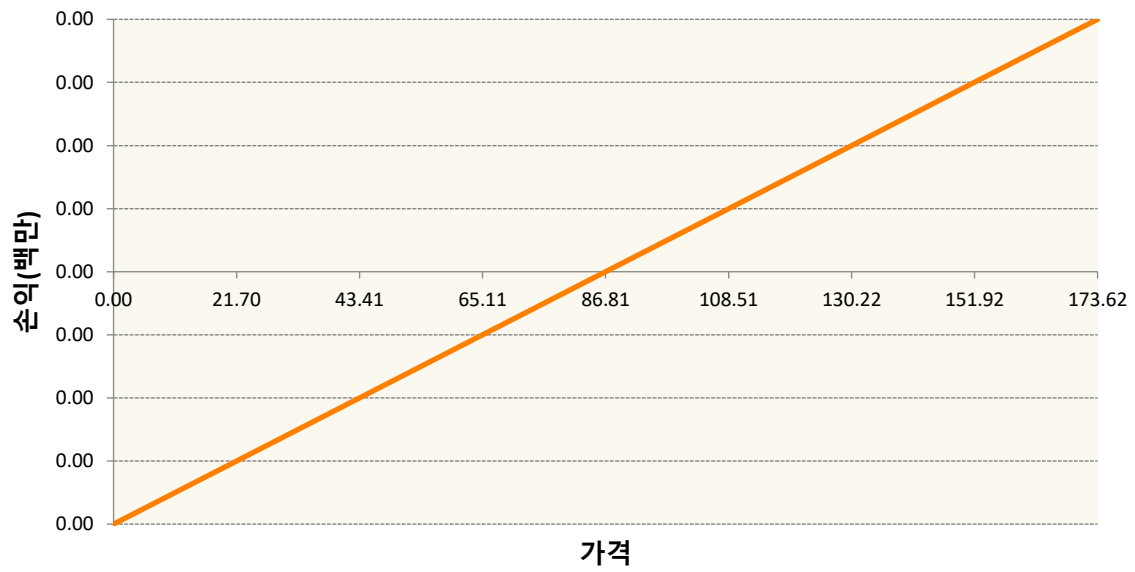




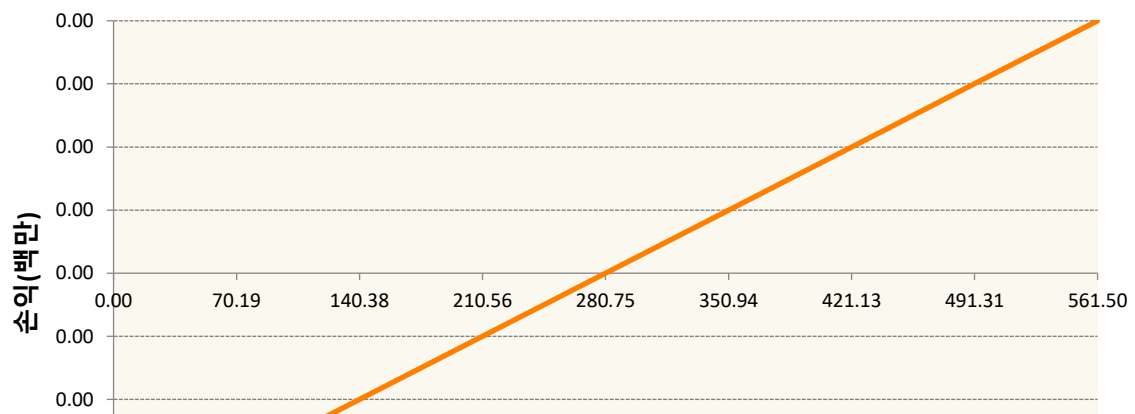
CN6-CORN FUTURE Jul26

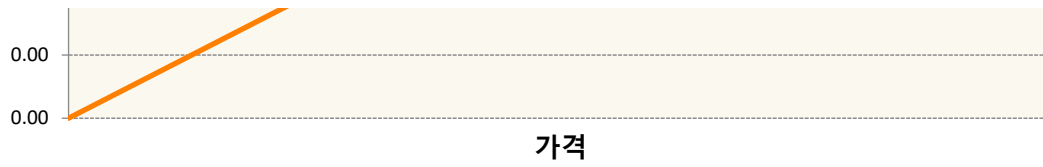


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

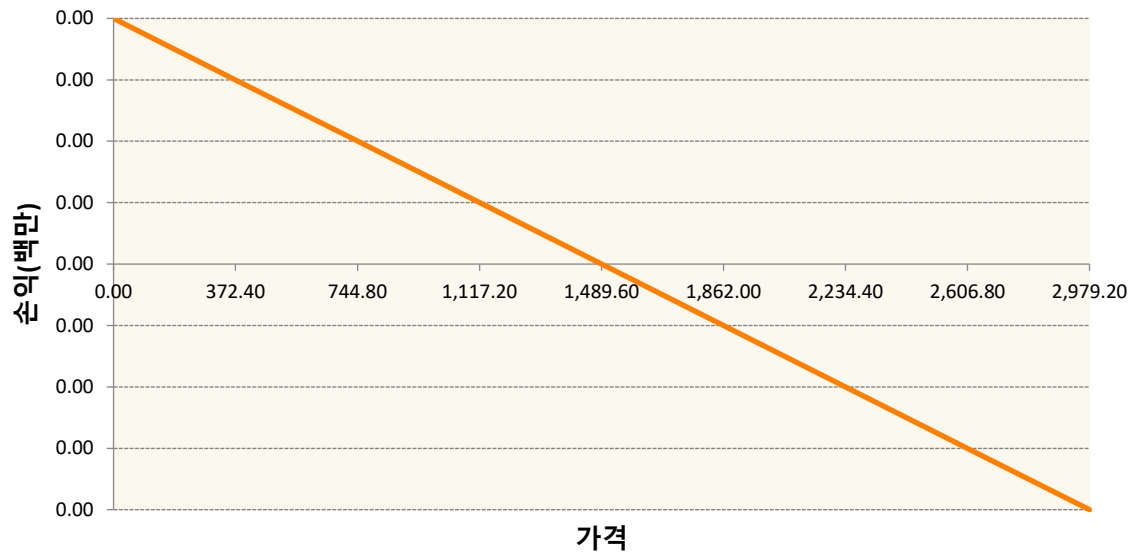


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

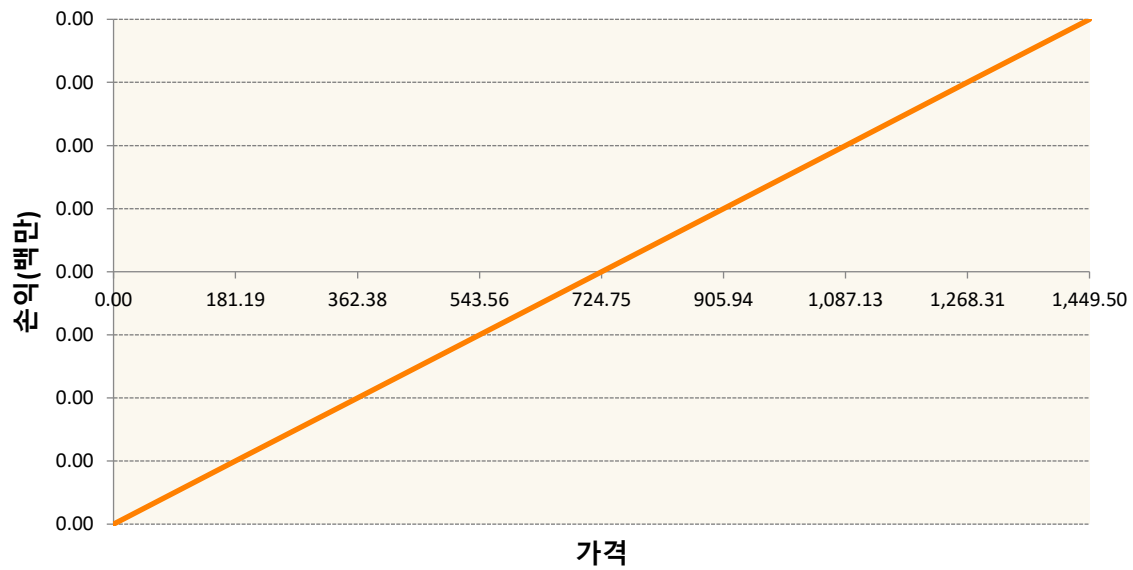




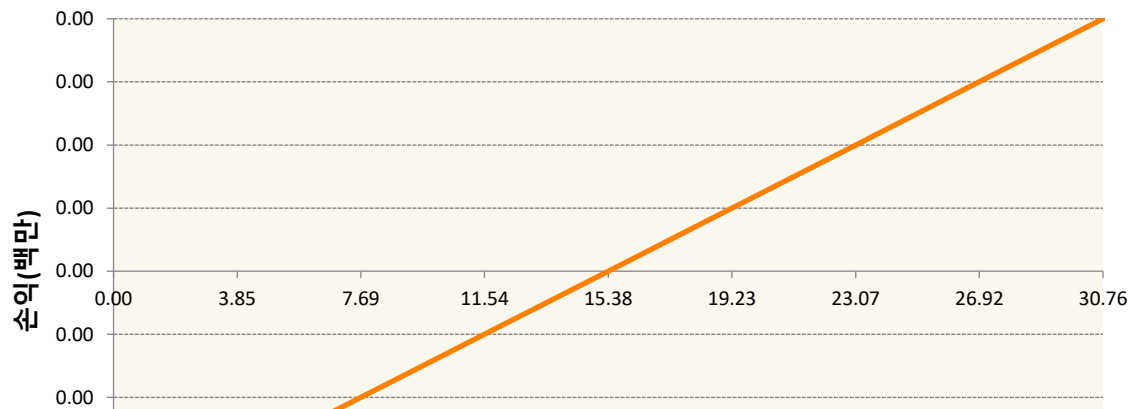
KR4A75660006-2026-06 달러선물

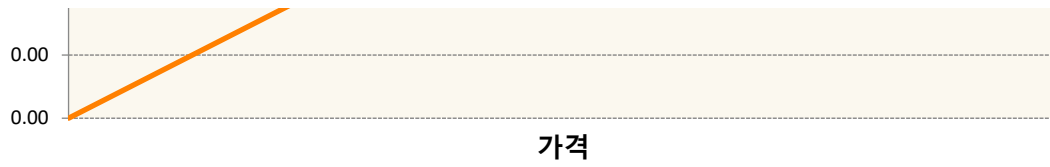


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

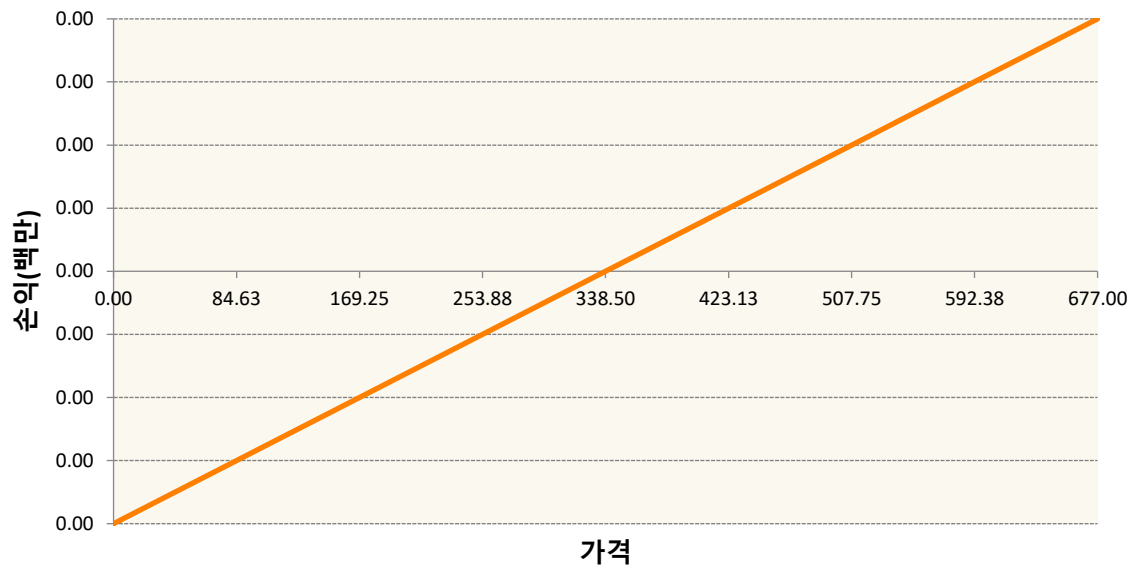


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

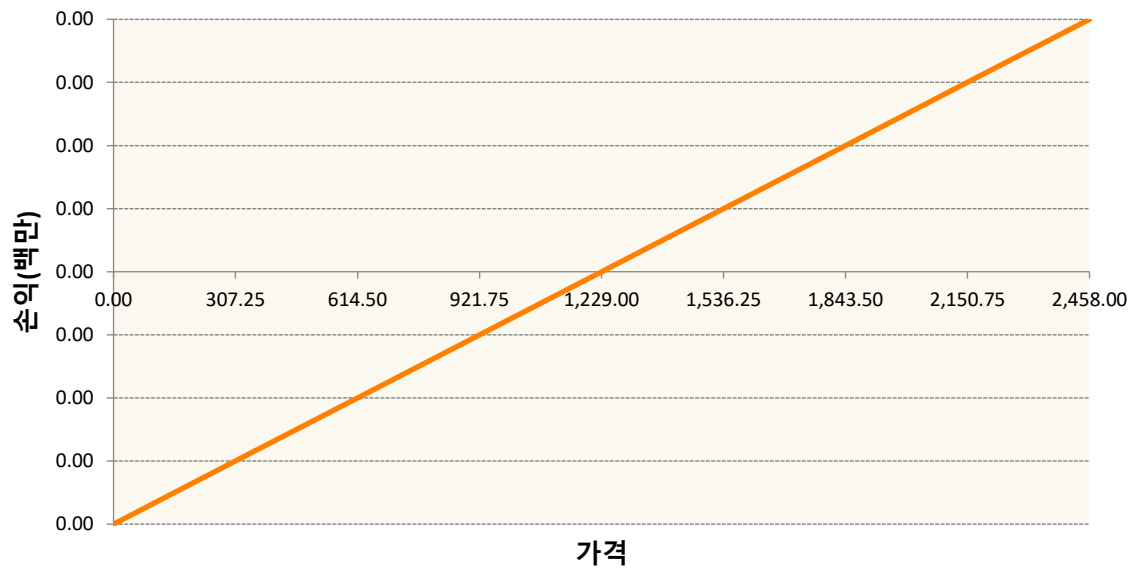




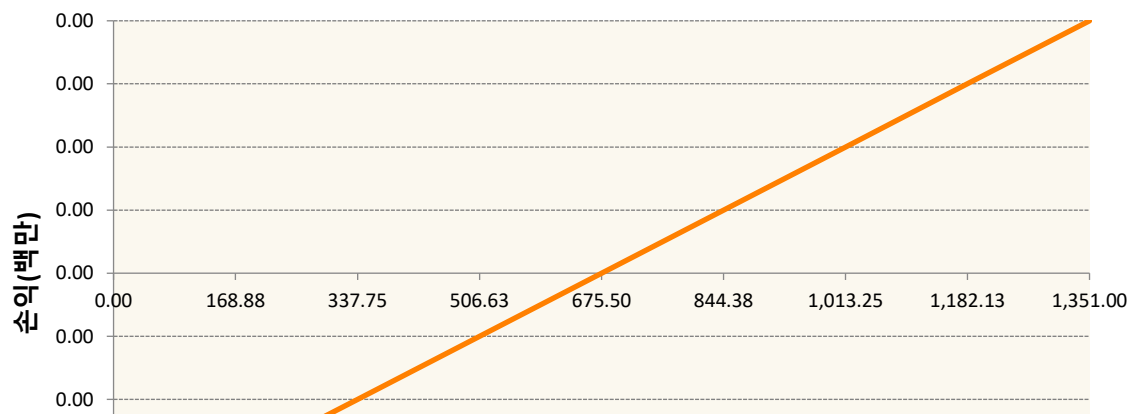
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

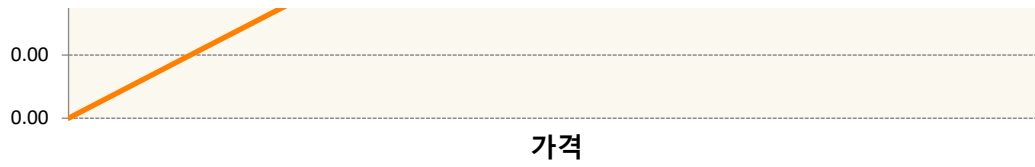


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-05-15
기준일	2026-05-14

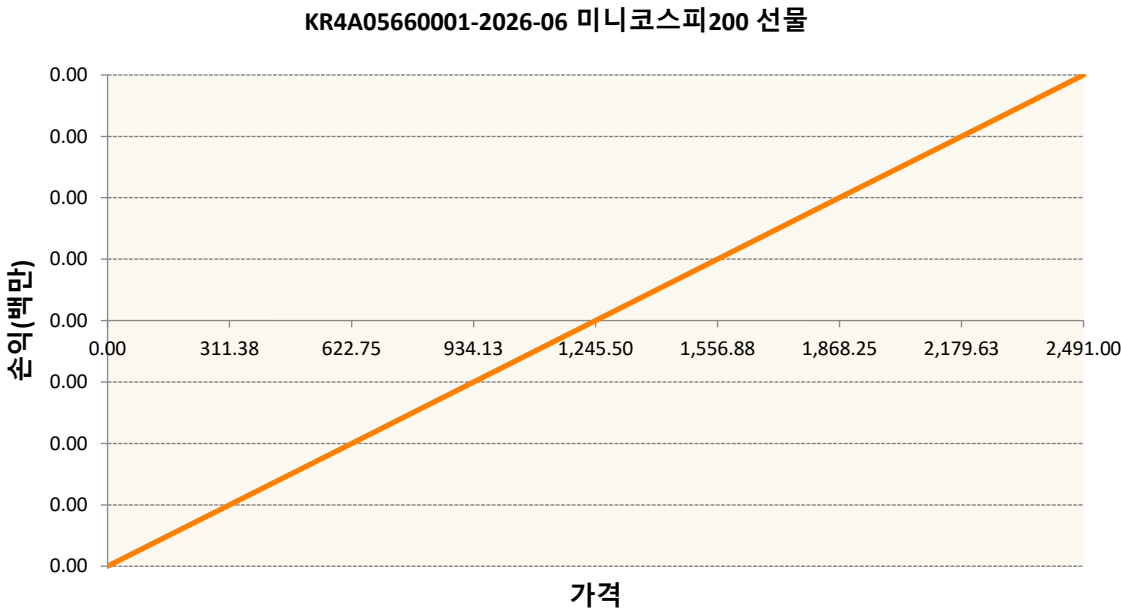
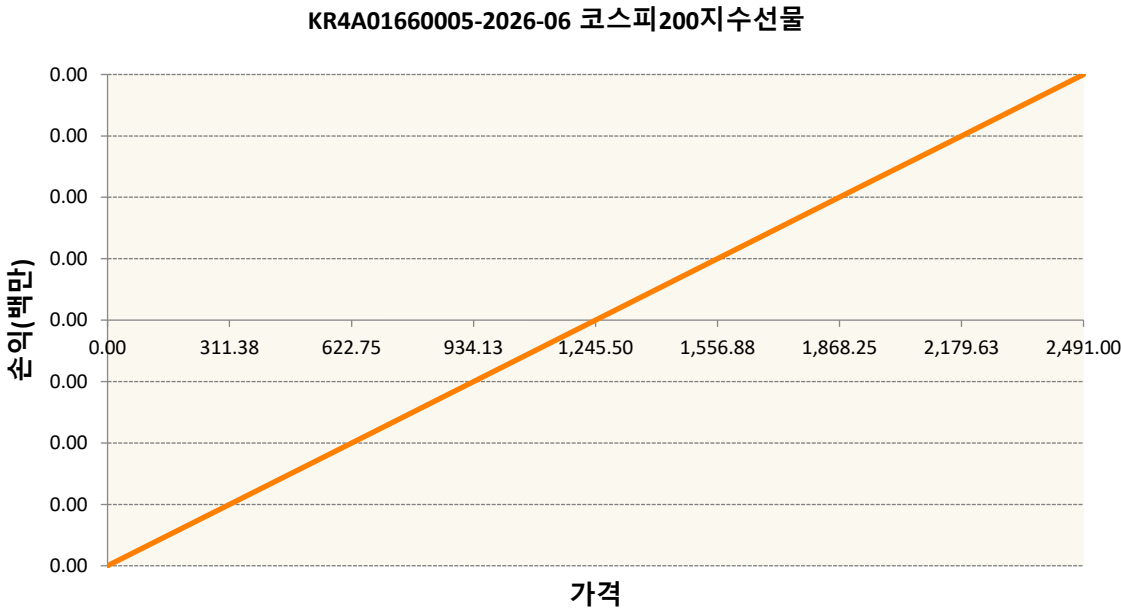
스마트인덱스모

1. 계약금액

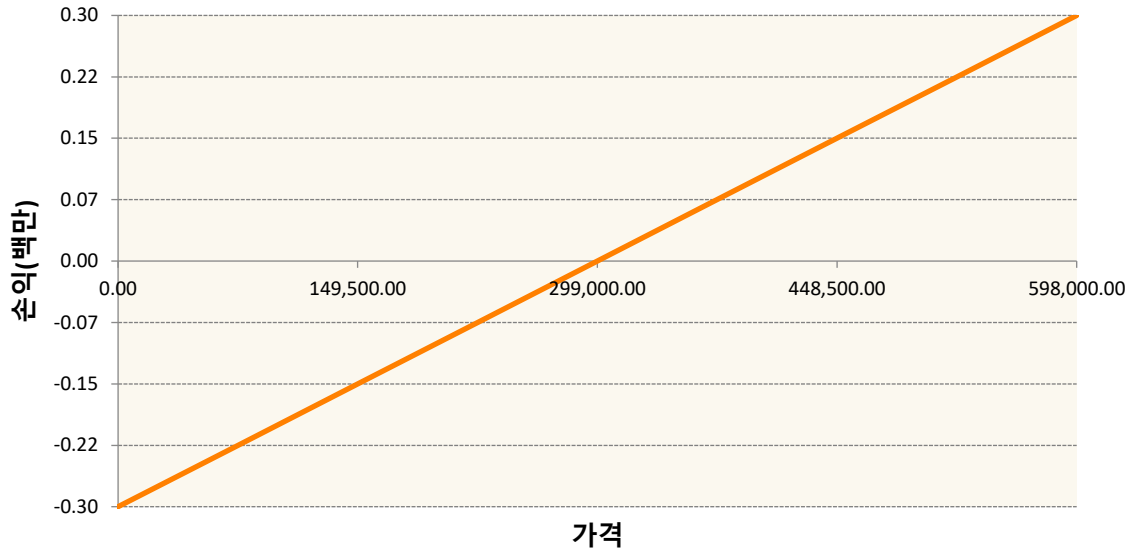
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	3,101	0	3,101	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					174
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
-5.33%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-2.67%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	58	58	58	58	58	58	58
5.33%	116	116	116	116	116	116	116
8.00%	174	174	174	174	174	174	174
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
KR4A11660003		2026-06 삼성전자개별선물					24
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	24	24	24	24	24	24	24

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	469

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

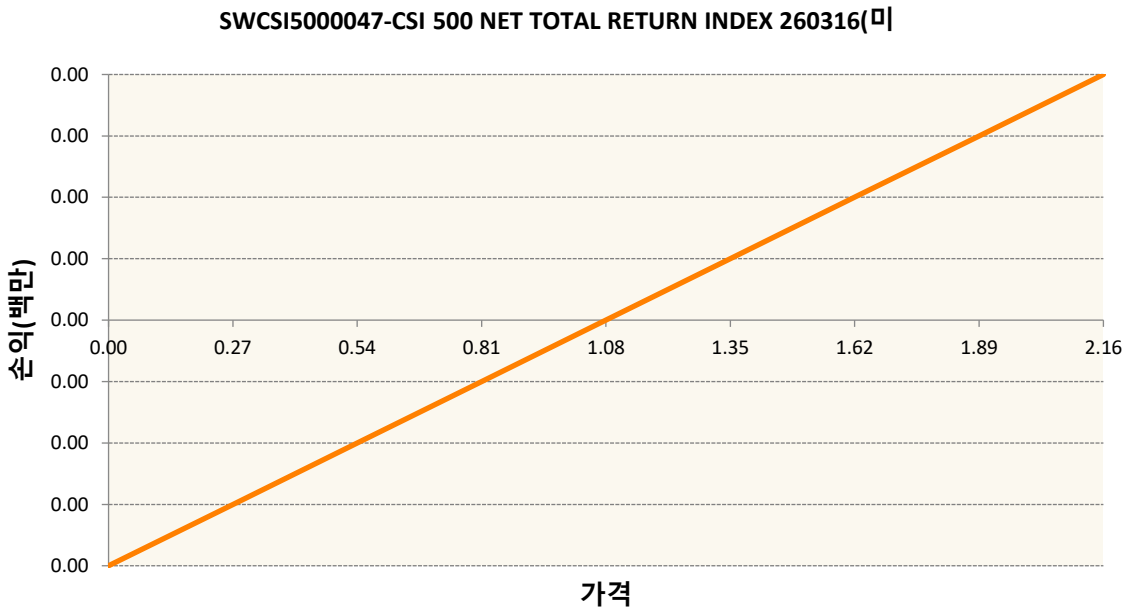
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	6,095	0	6,095	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

488

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

606

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

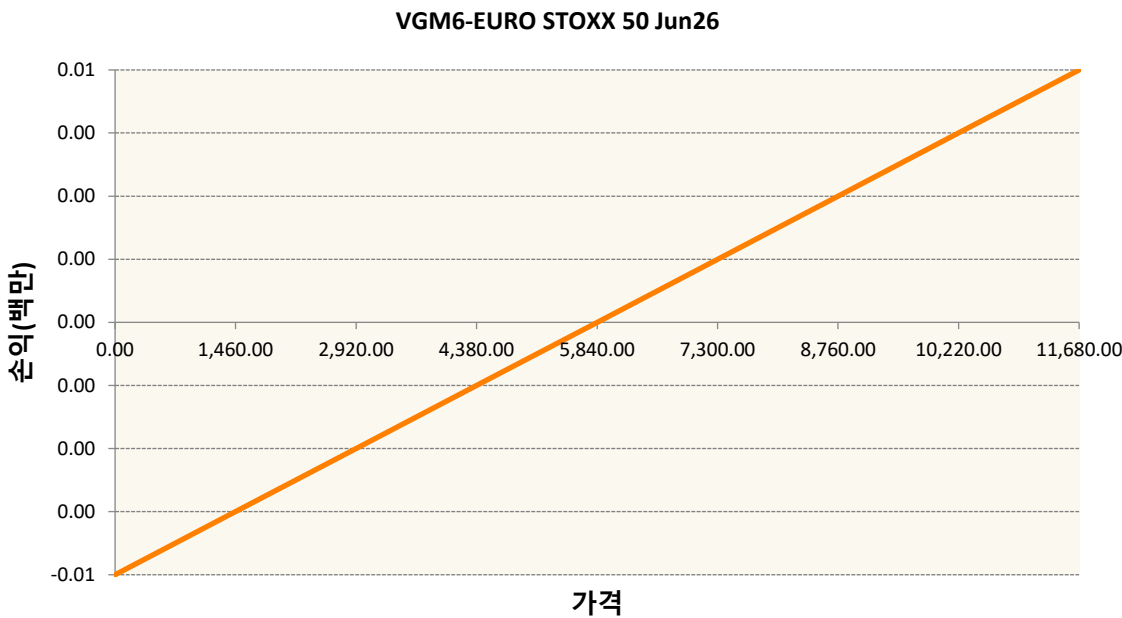
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

63

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

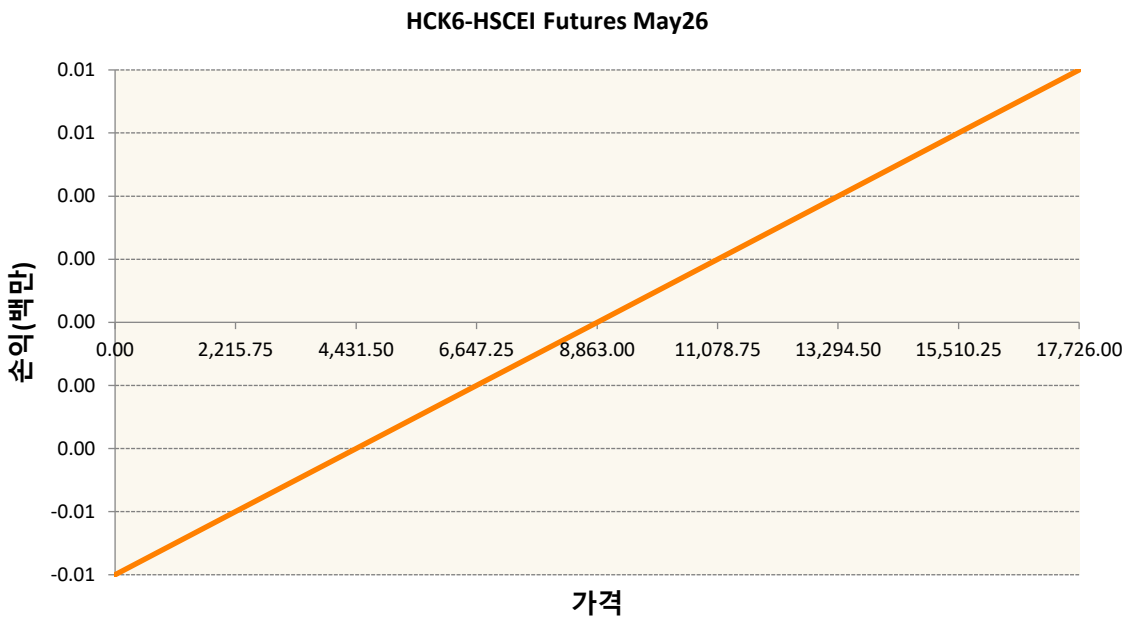
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,667	0	1,667	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK6	HSCEI Futures May26	133
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

160

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

(단위:백만원)

1,751

공시일 2026-05-15

기준일 2026-05-14

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	2026-05-15
기준일	2026-05-14

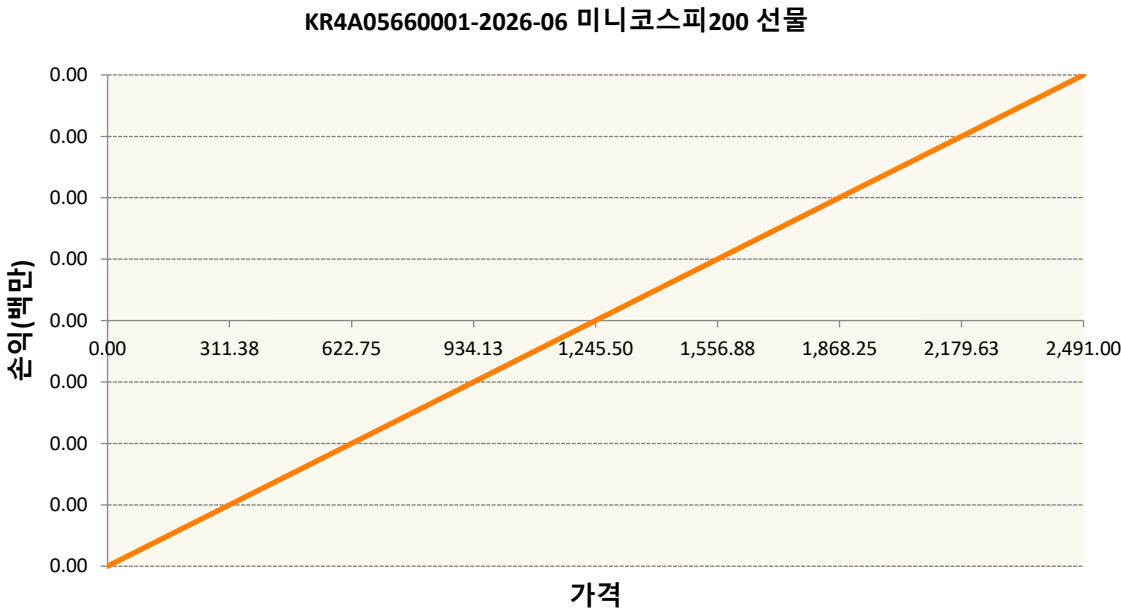
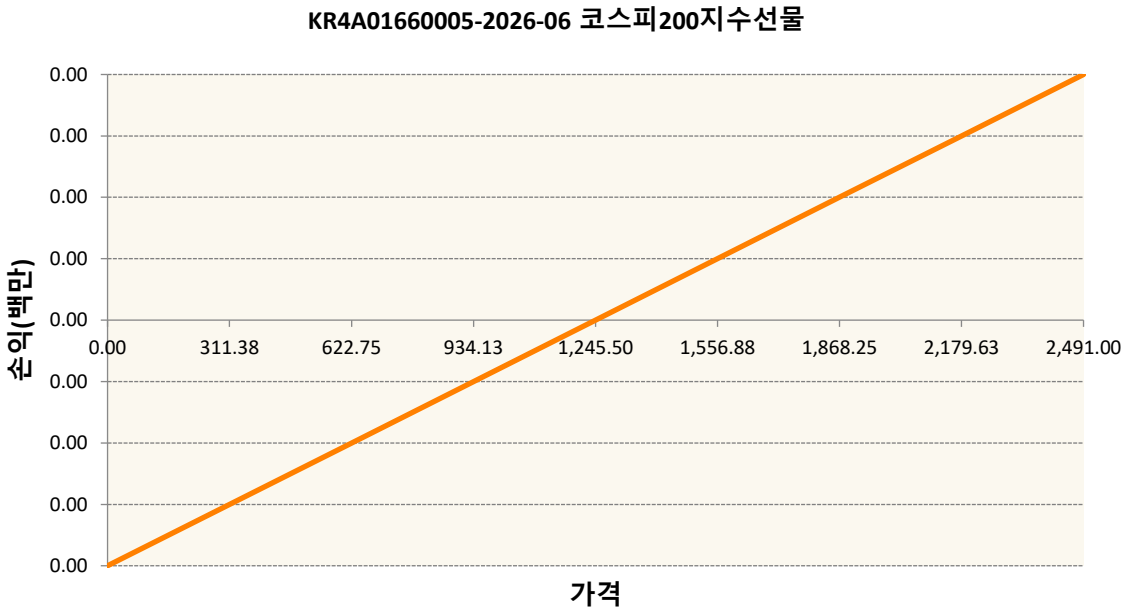
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

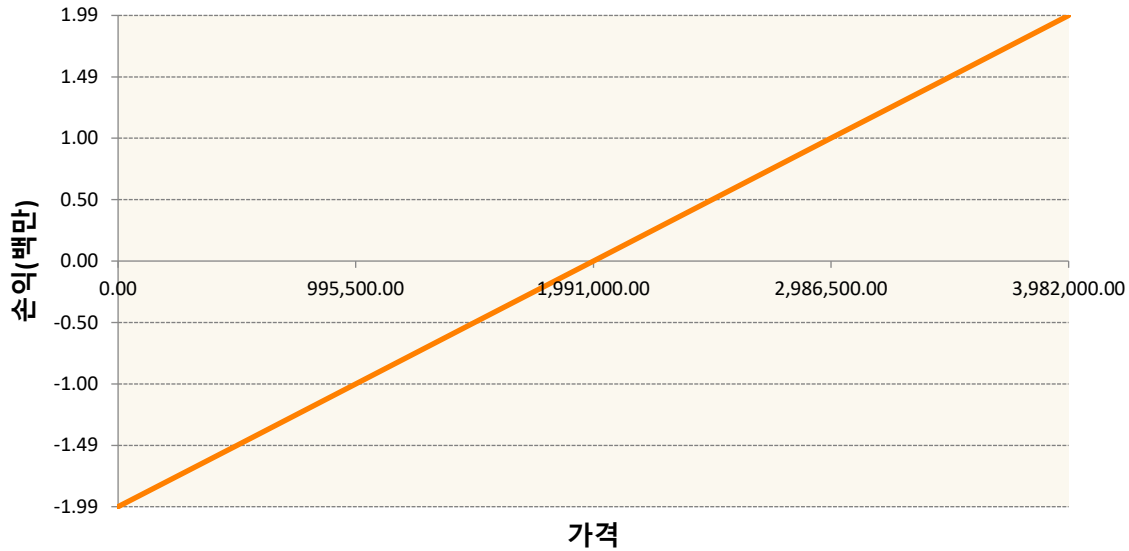
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,339	0	2,339	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						124
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124	
-5.33%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83	
-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%	83	83	83	83	83	83	83	
8.00%	124	124	124	124	124	124	124	
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)
	336

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

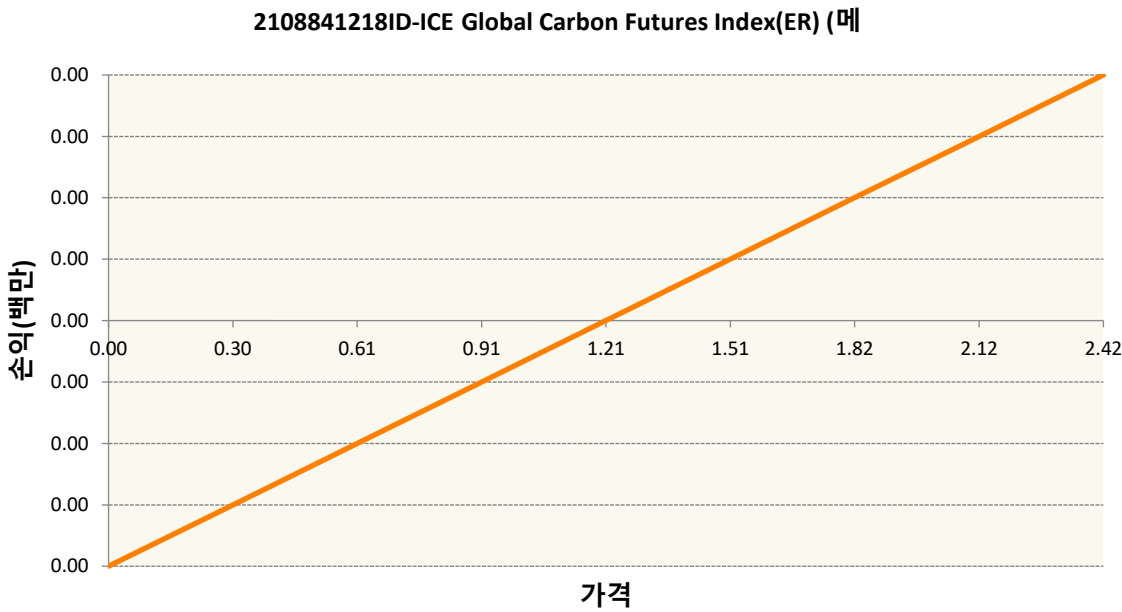
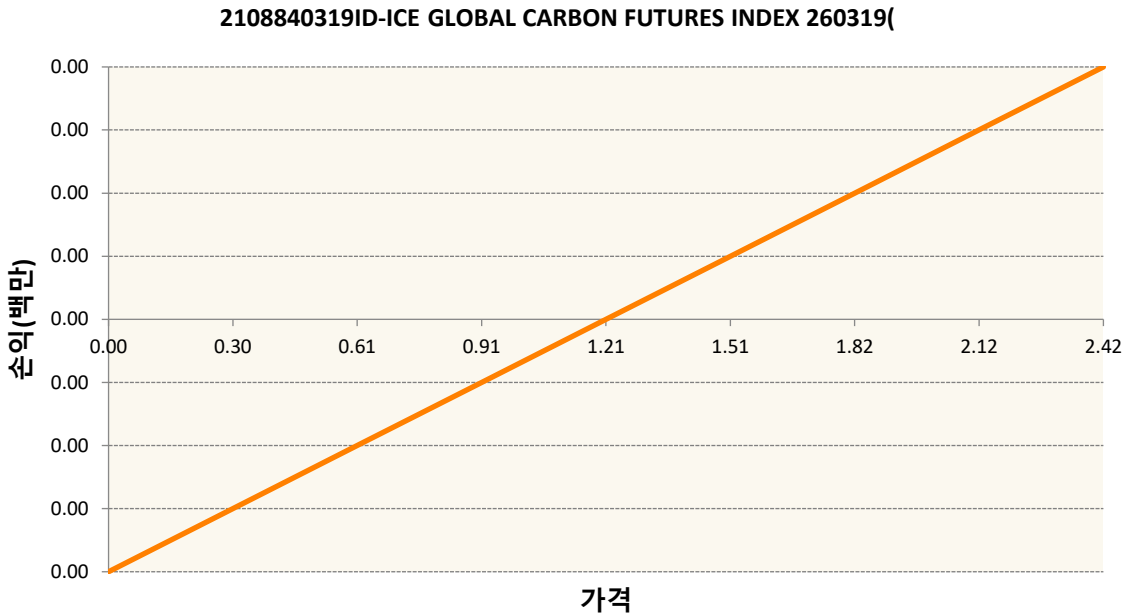
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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(		445
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		112

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	639

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

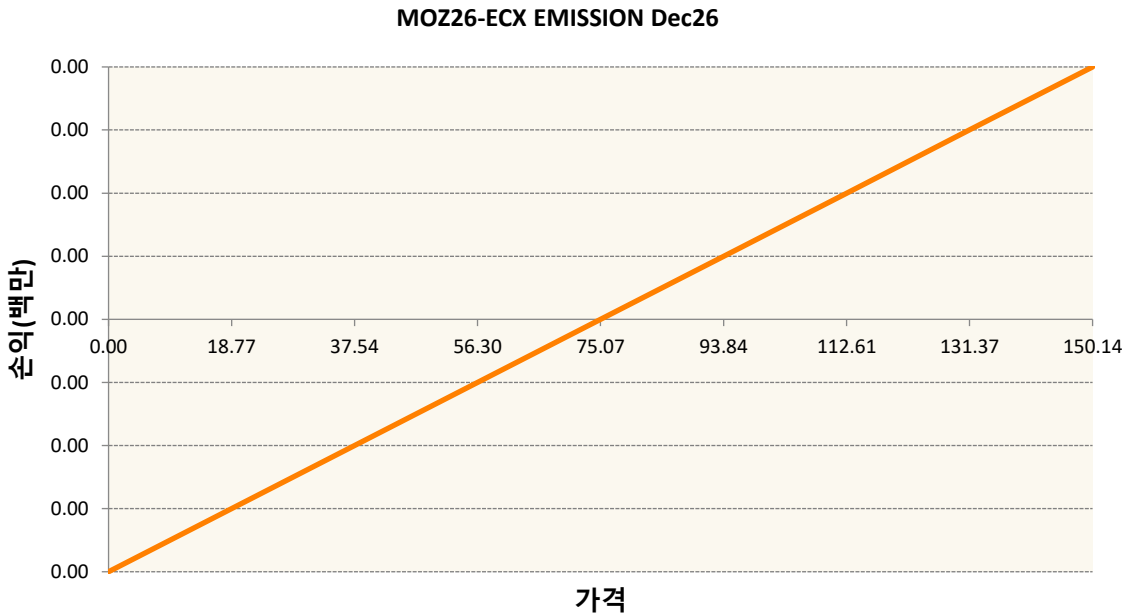
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,838	0	4,838	
누계	통화	선도	0	2,383	-2,383	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	191
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	387

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

(단위:백만원)

670

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

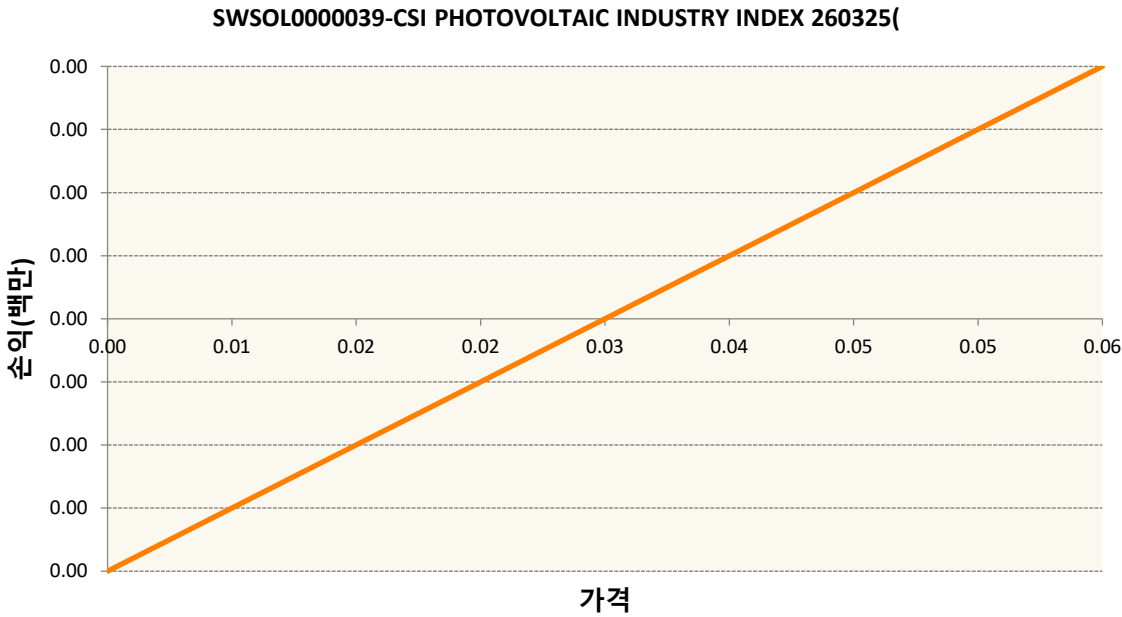
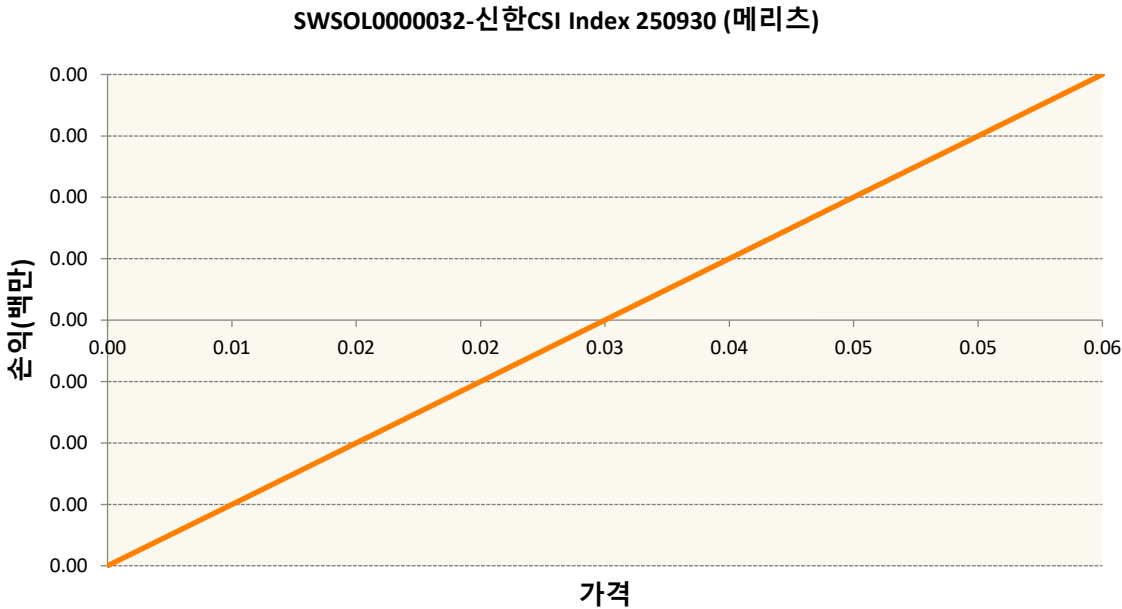
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,110	0	2,110	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)		5
SWSOL00000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)		4
SWSOL00000(신한CSI Index 250930 (메리츠)		9
SWSOL00000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(		4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	32

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

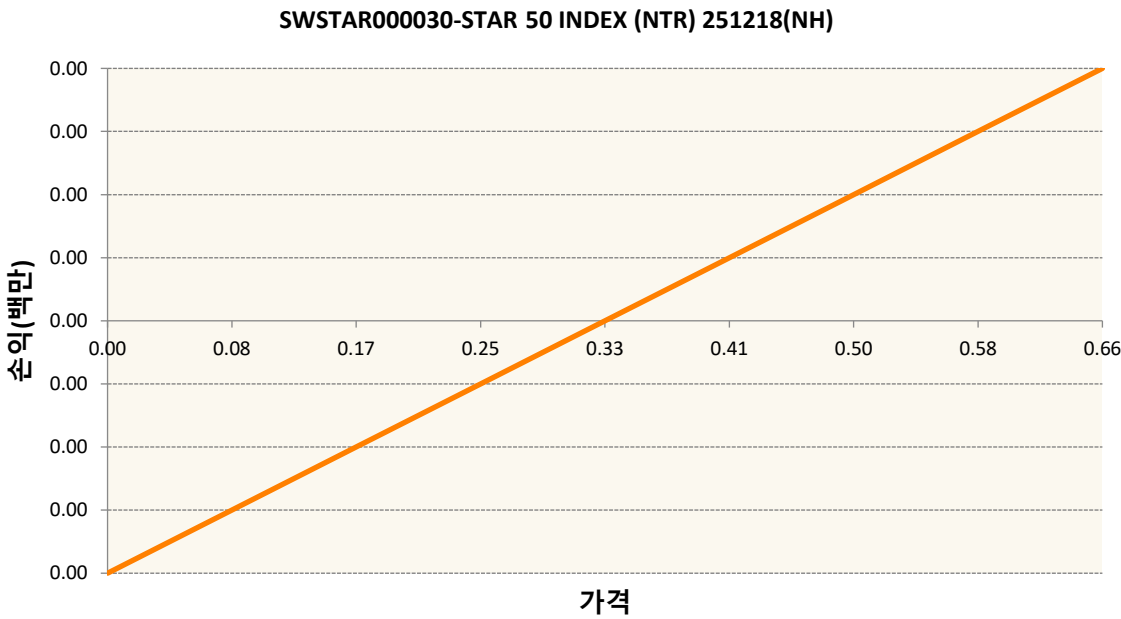
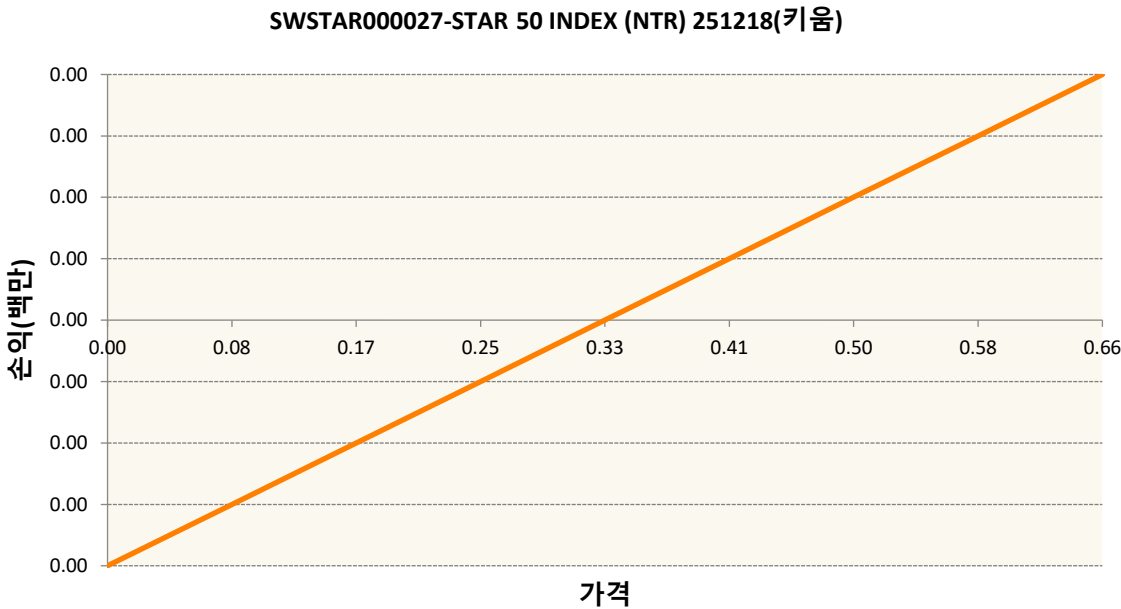
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

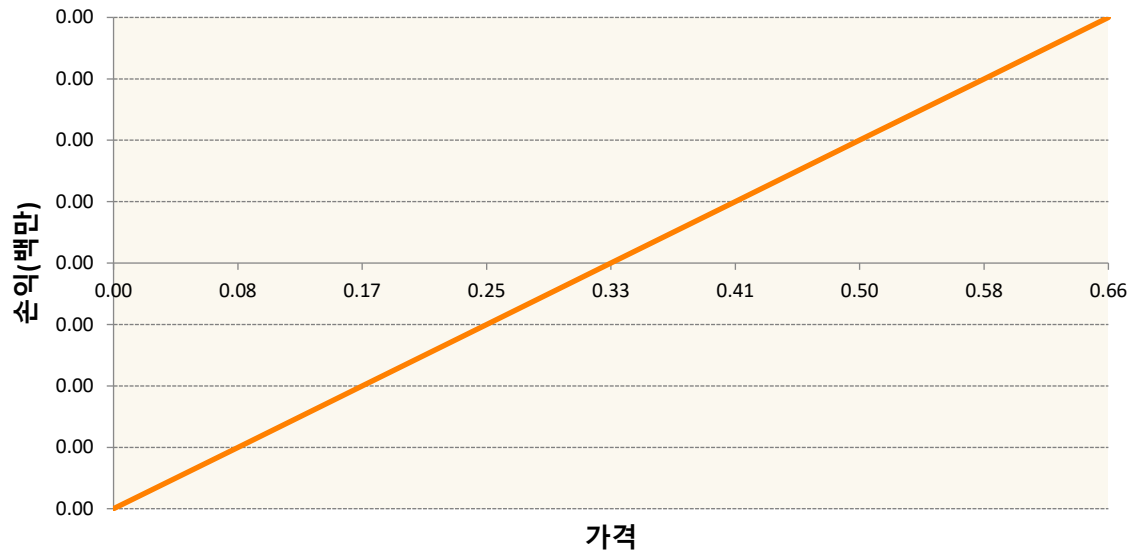
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8,347	0	8,347	장외

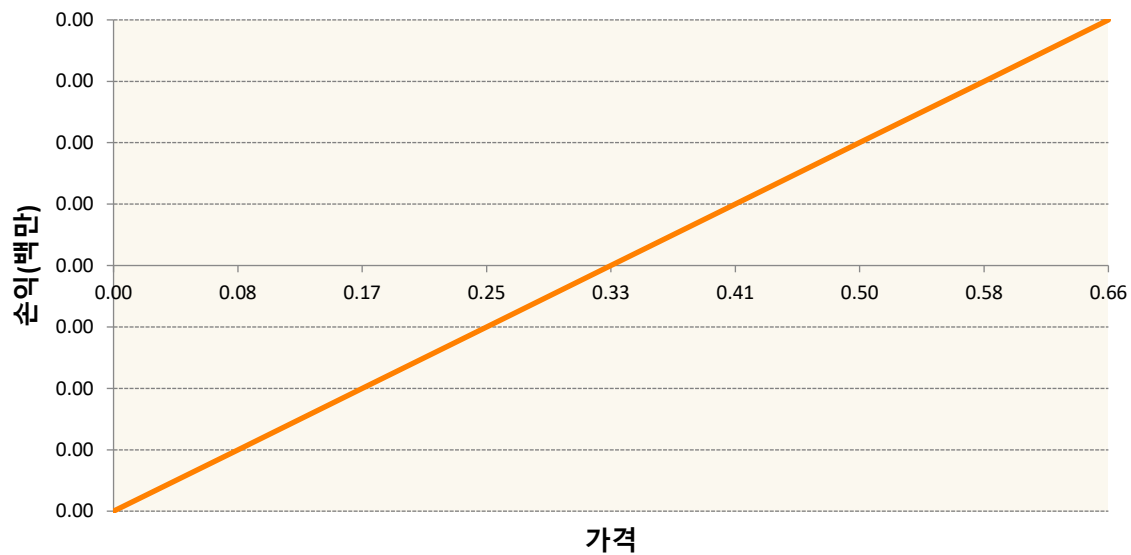
2. 만기시점의 손익구조



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)

23
80
406
151

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

(단위:백만원)

1,003

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

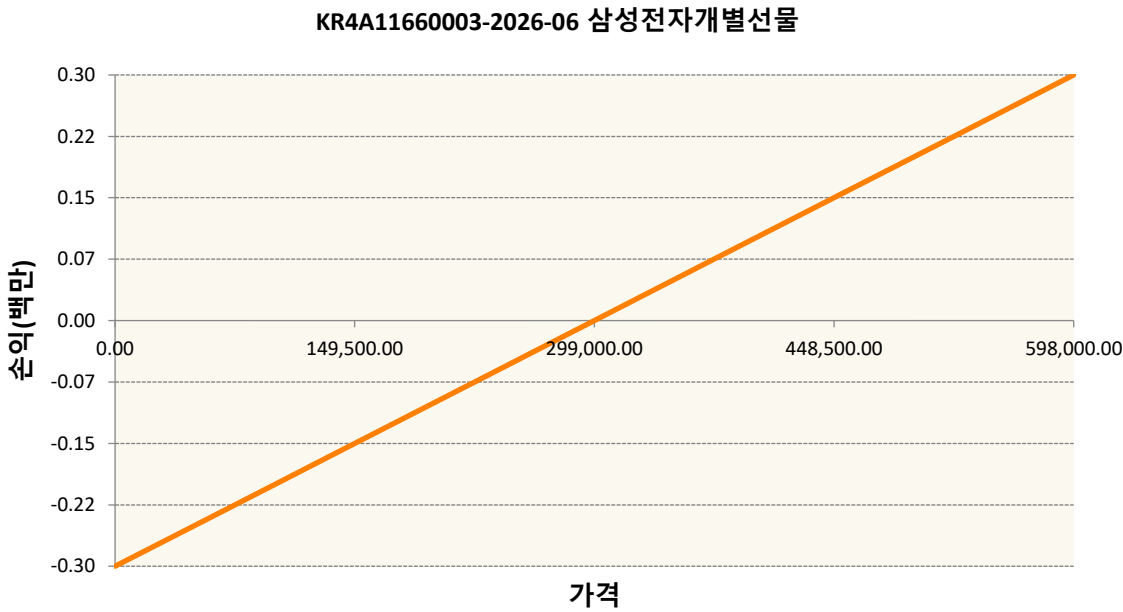
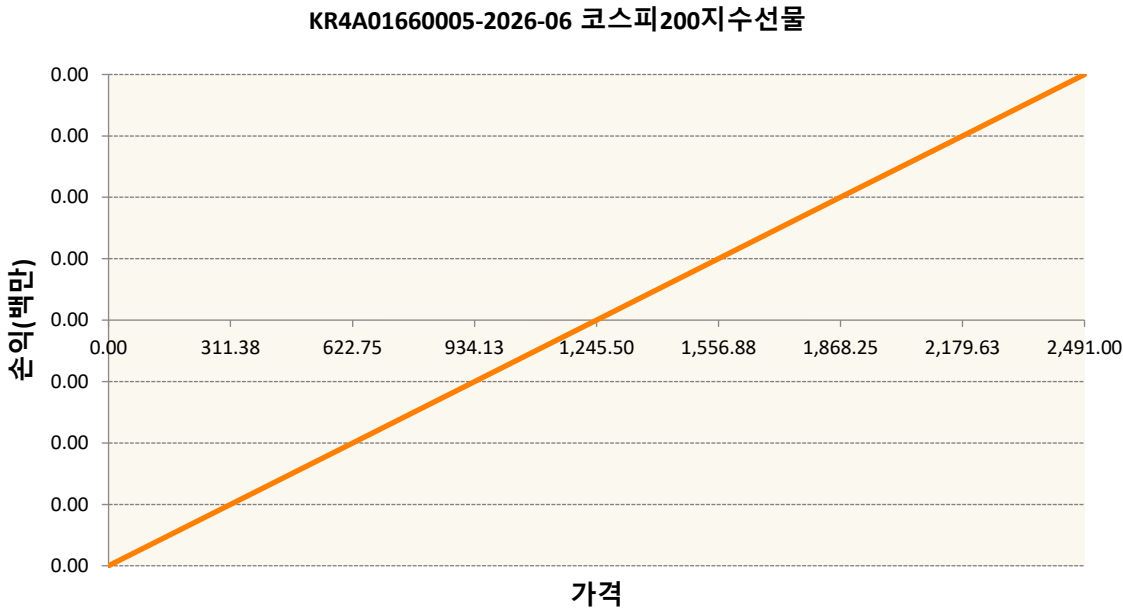
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

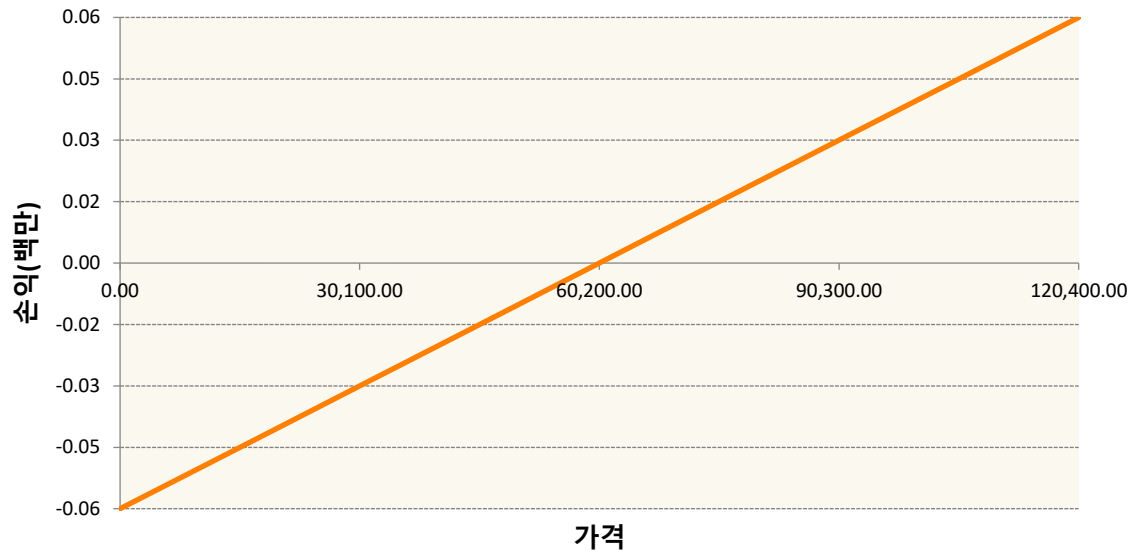
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,612	619	1,994	장내
누계	유가증권	선물	21,613	3,901	17,712	장내

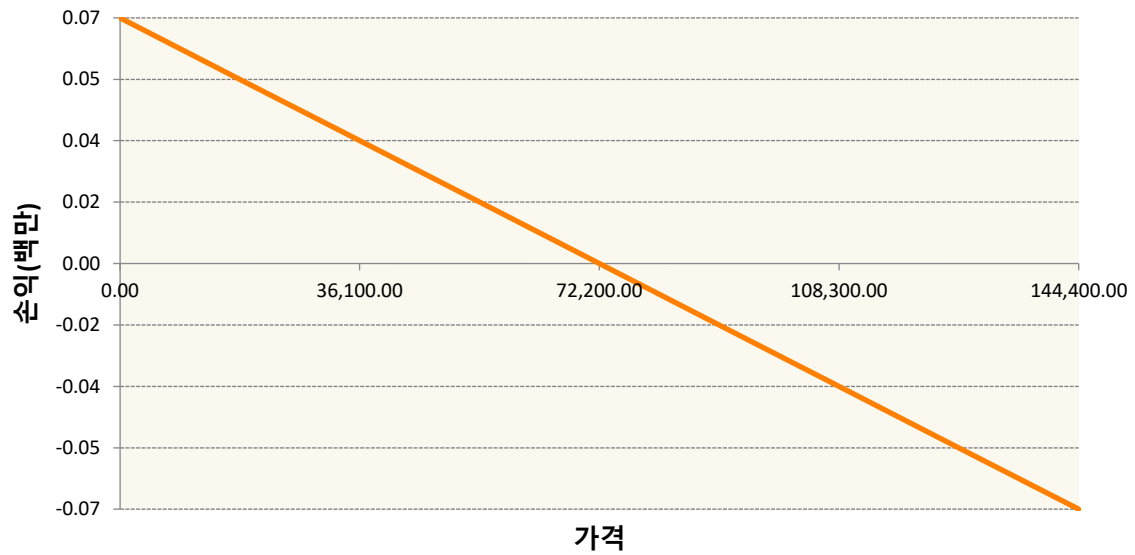
2. 만기시점의 손익구조



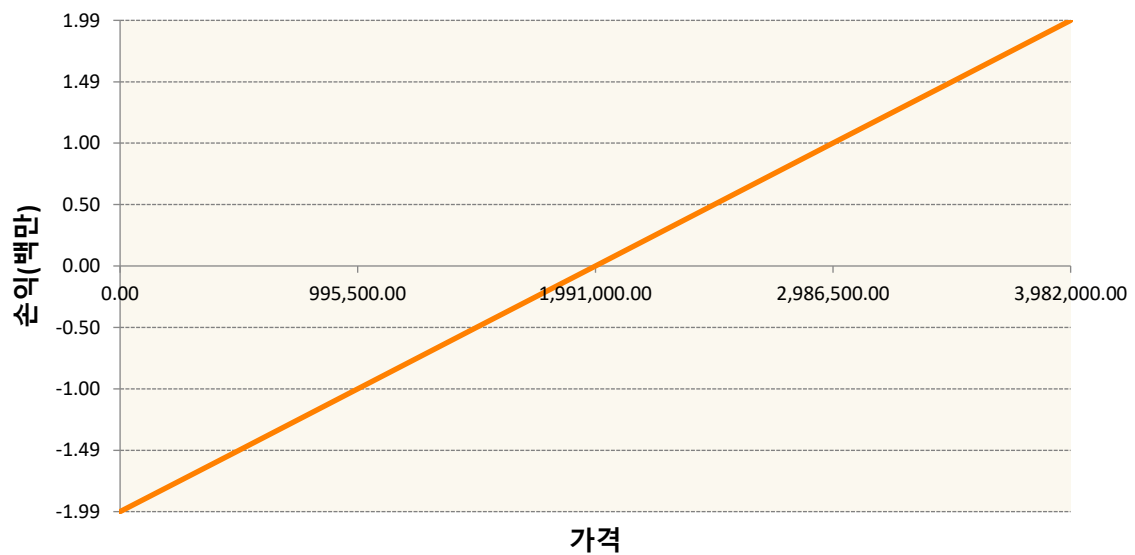
KR4A14660000-2026-06 KT개별선물



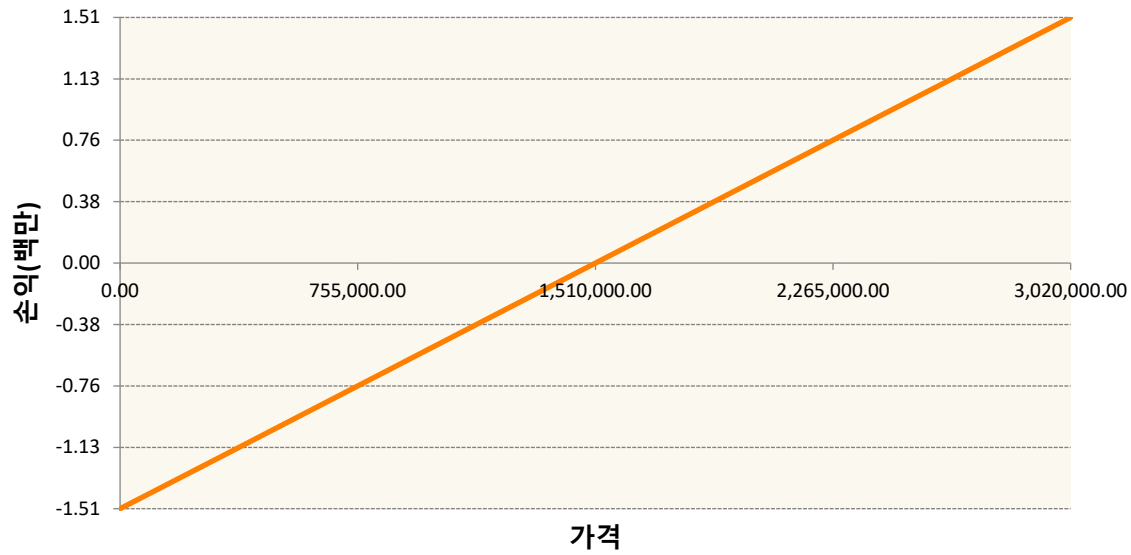
KR4A48660000-2026-06 미래에셋증권개별선물



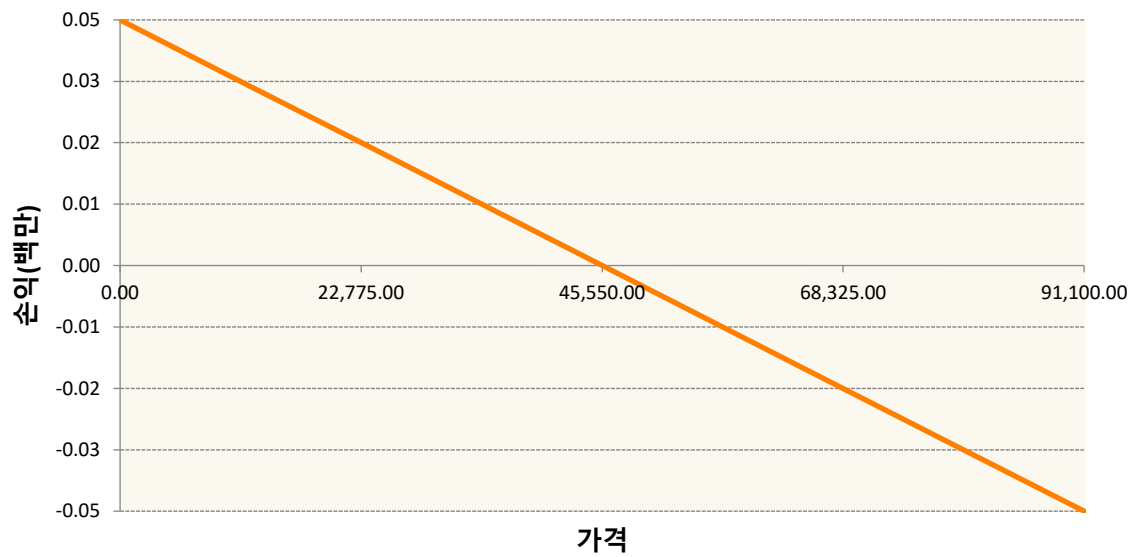
KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



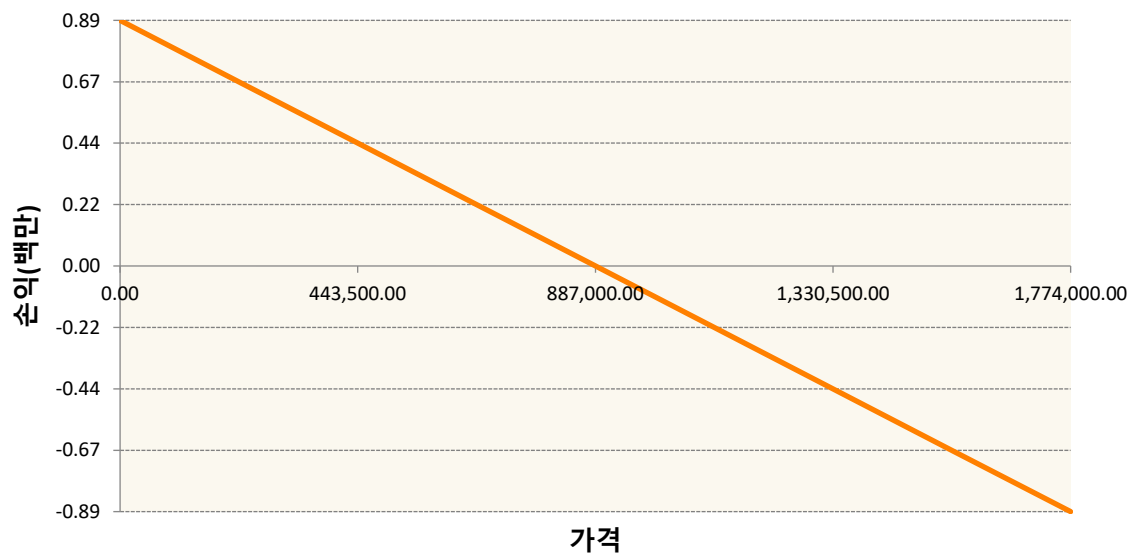
KR4AB3660001-2026-06 고려아연개별선물



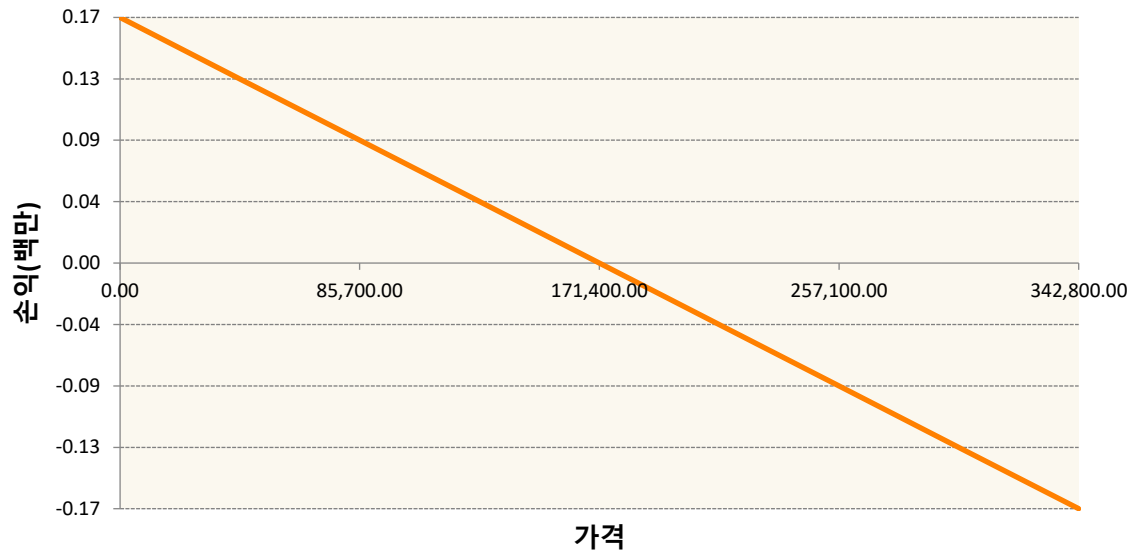
KR4ACF660005-2026-06 카카오개별선물



KR4ADB660008-2026-06 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선물



KR4AFM660003-2026-06 엘앤에프개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						1,268
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,268	-1,268	-1,268	-1,268	-1,268	-1,268	-1,268	
-5.33%	-845	-845	-845	-845	-845	-845	-845	
-2.67%	-423	-423	-423	-423	-423	-423	-423	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	423	423	423	423	423	423	423	
5.33%	845	845	845	845	845	845	845	
8.00%	1,268	1,268	1,268	1,268	1,268	1,268	1,268	
KR4A11660003		2026-06 삼성전자개별선물						245
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-245	-245	-245	-245	-245	-245	-245	
-5.33%	-163	-163	-163	-163	-163	-163	-163	
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	82	82	82	82	82	82	82	
5.33%	163	163	163	163	163	163	163	
8.00%	245	245	245	245	245	245	245	
KR4A14660000		2026-06 KT개별선물						38
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38	
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13	
0%	0	0	0	0	0	0	0	

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)

4,516

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

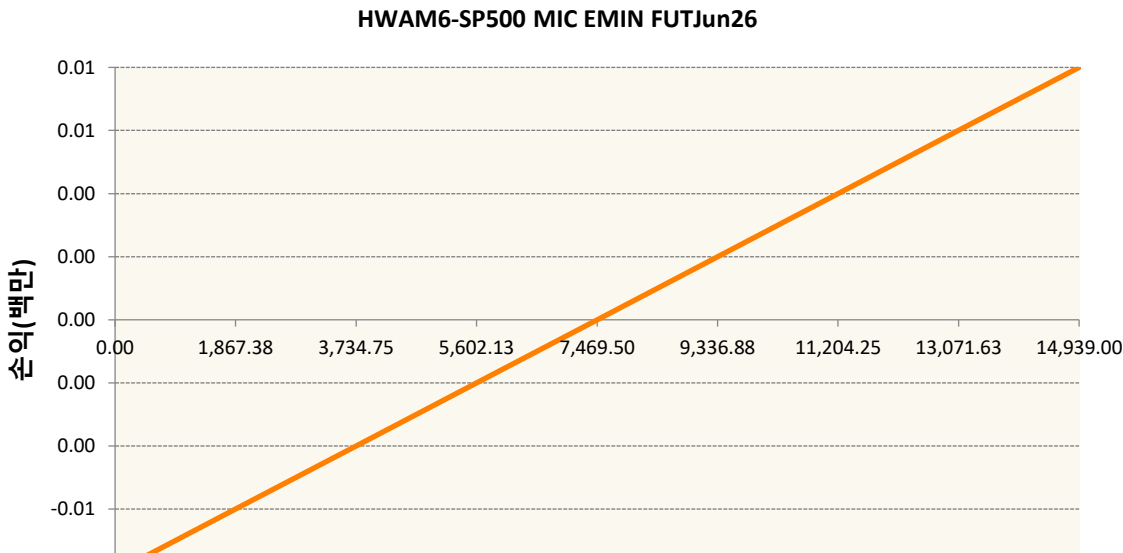
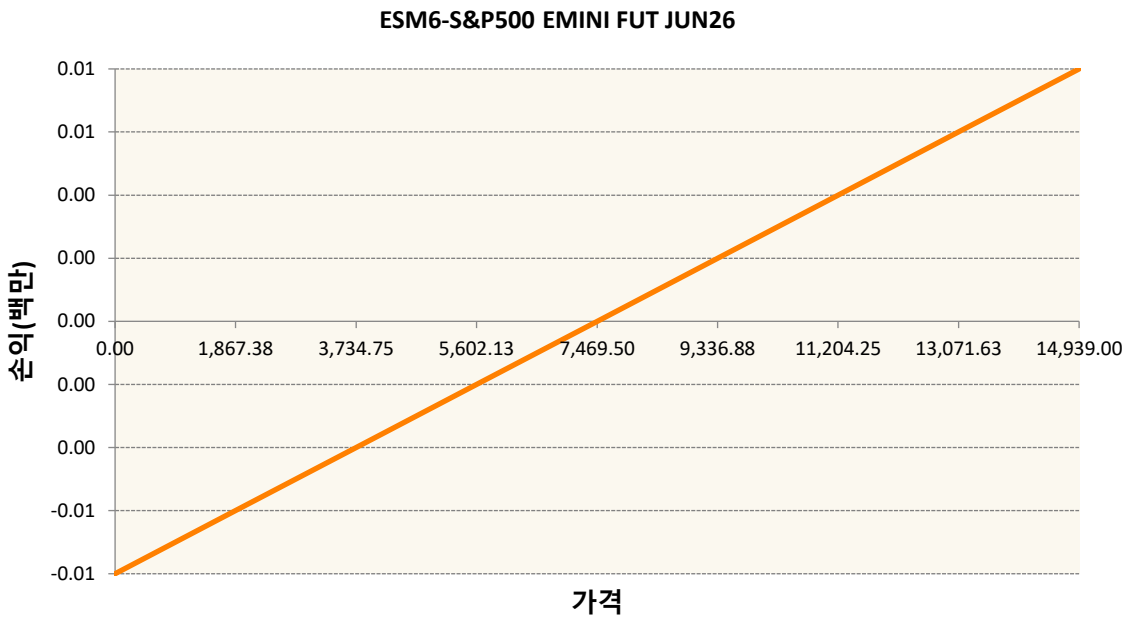
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

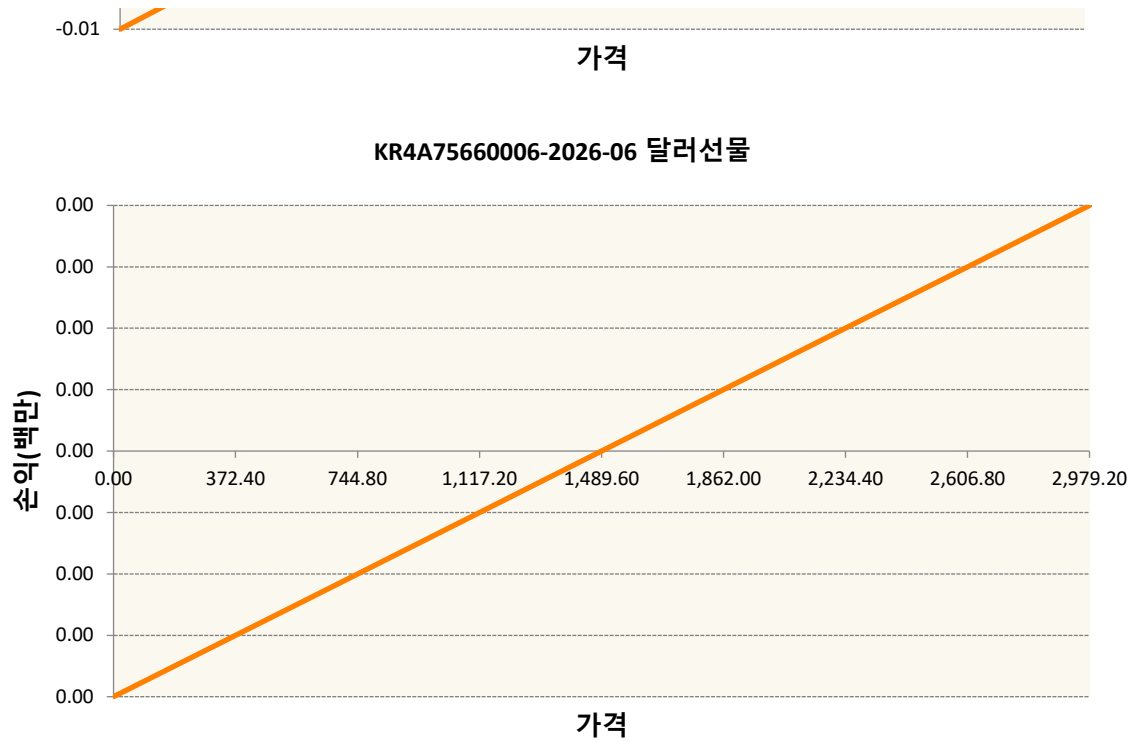
1. 계약금액

(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	60,415	0	60,415	
누계	지수	선물	278	0	278	장내
누계	통화	선물	10,576	0	10,576	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,833
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		22
KR4A756600 2026-06 달러선물			846

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,240

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

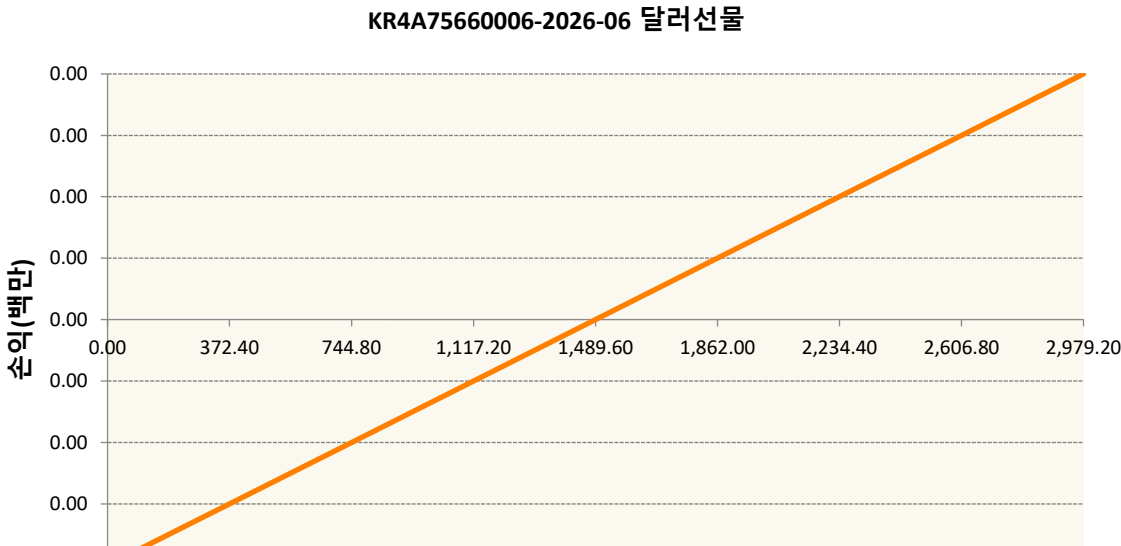
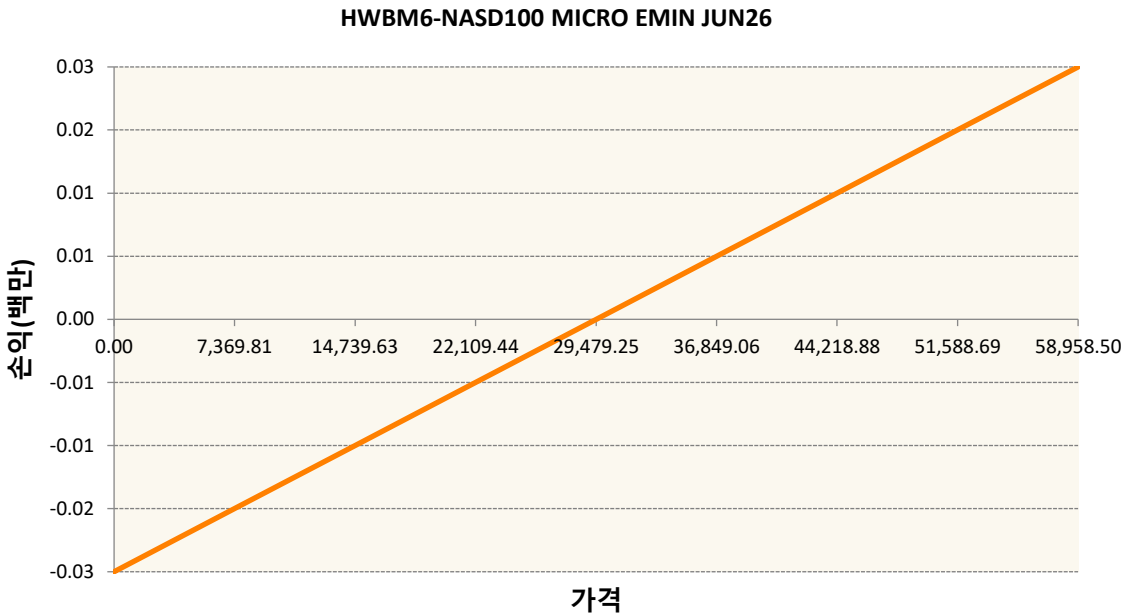
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

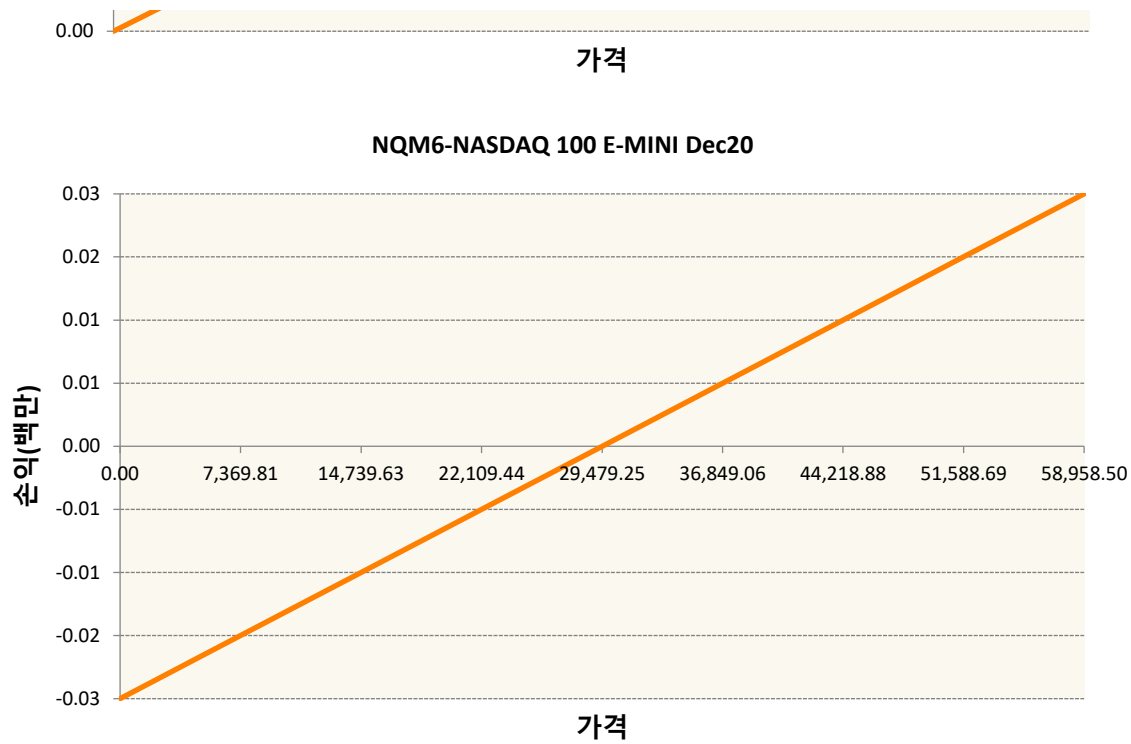
1. 계약금액

(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	29,985	0	29,985	
누계	유가증권	선물	258	0	258	장내
누계	통화	선물	3,888	0	3,888	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26		21
KR4A756600	2026-06 달러선물		311
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		2,399

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,679

공시일	2026-05-15
기준일	2026-05-14

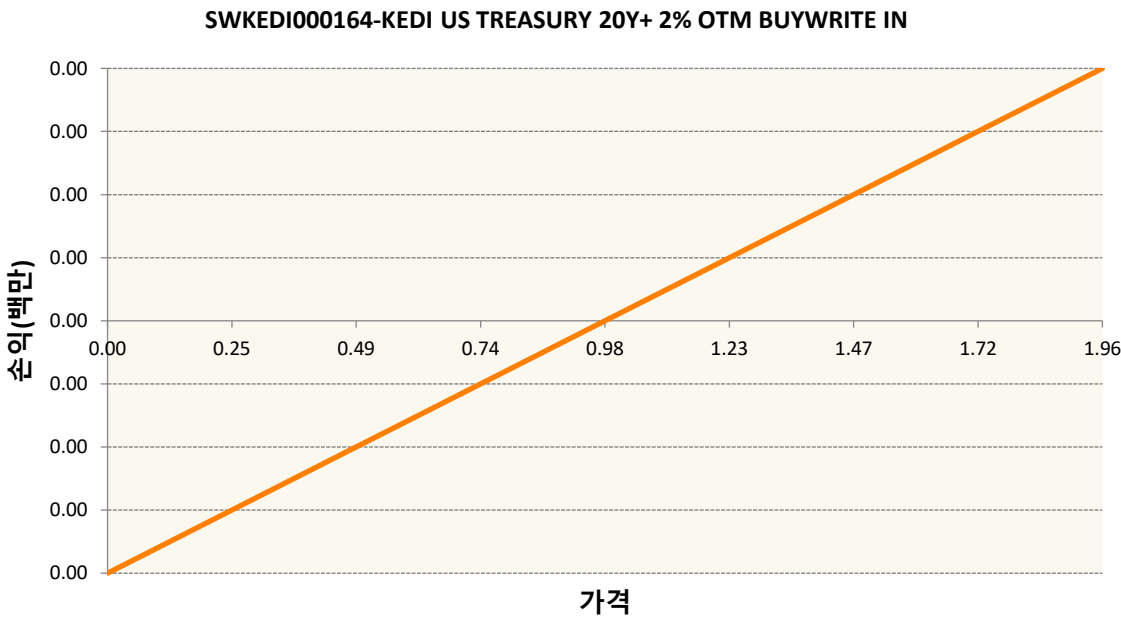
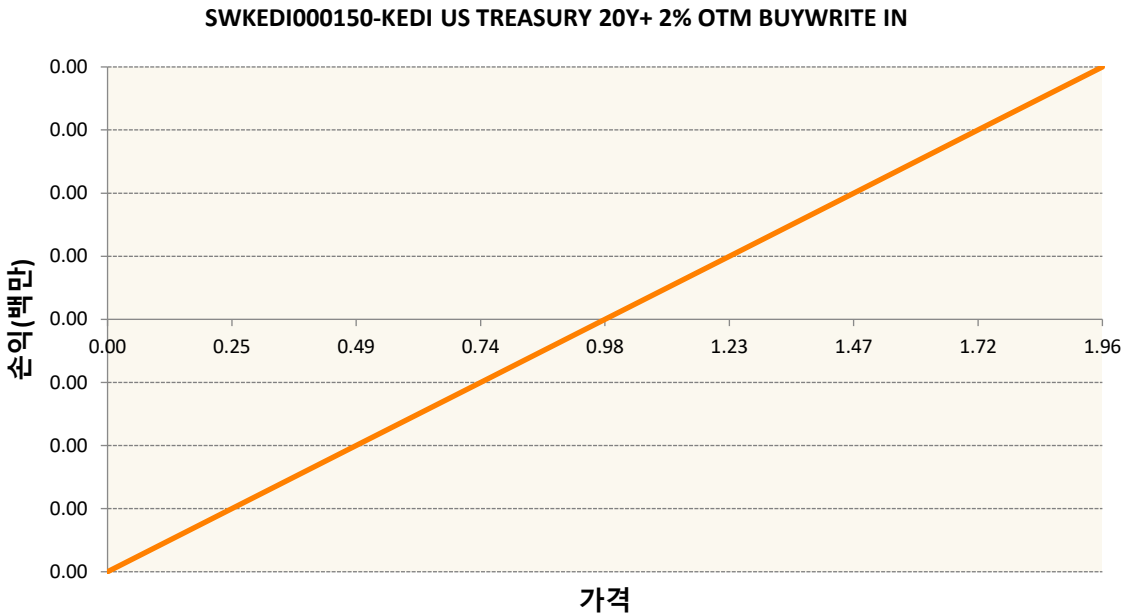
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

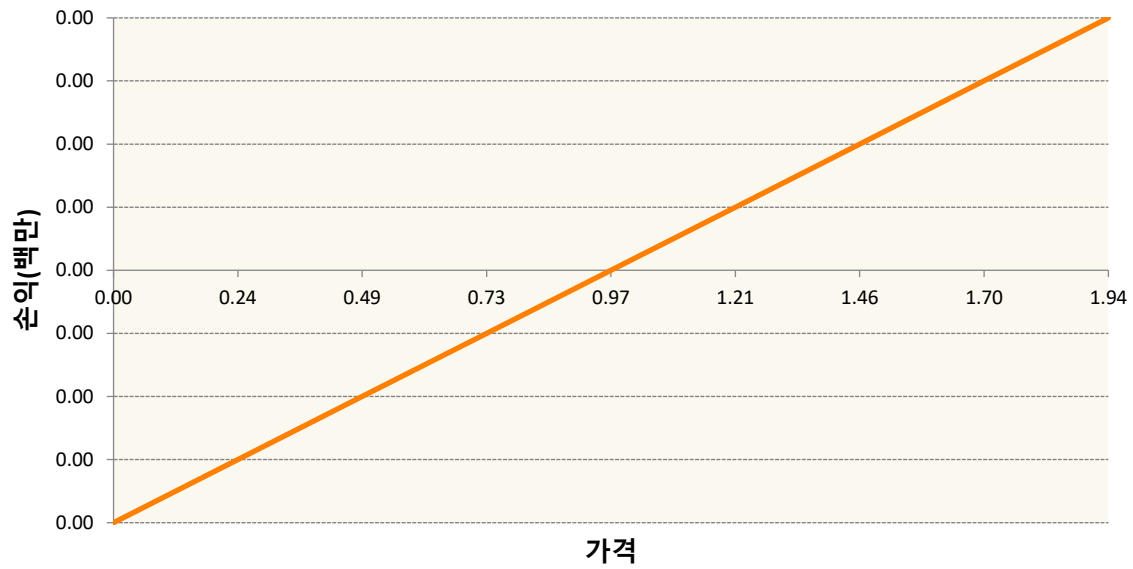
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	352,933	0	352,933	장외

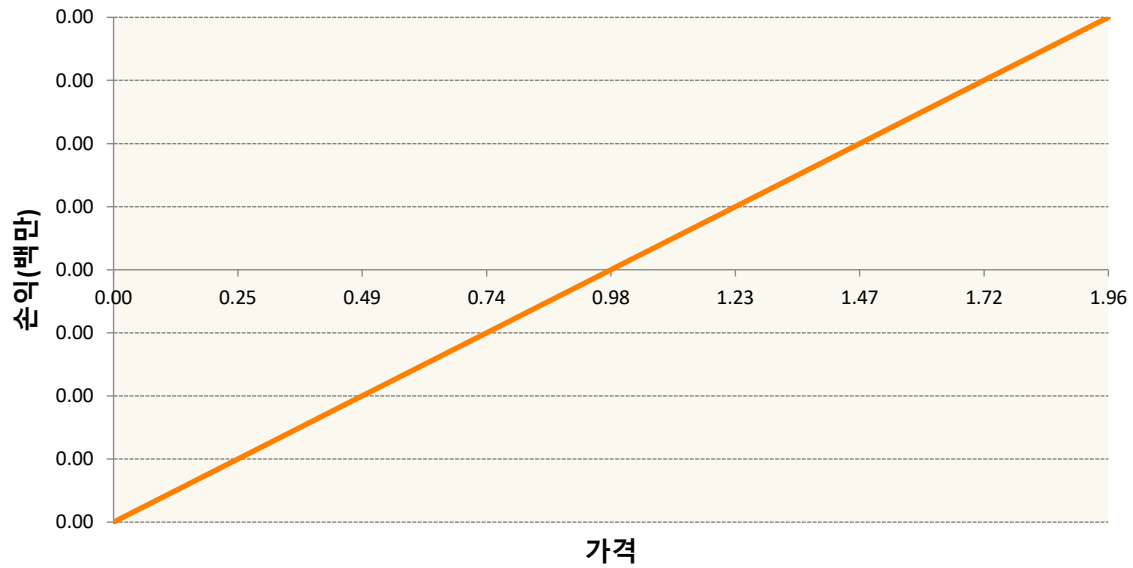
2. 만기시점의 손익구조



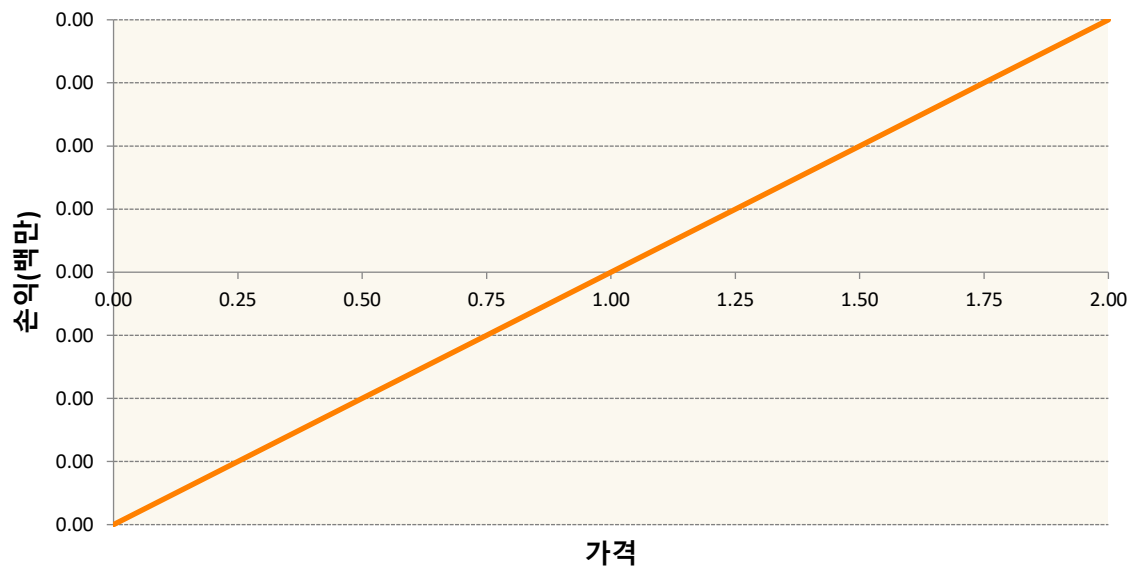
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,241
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		151
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,647
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,383
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,851

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,036