

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

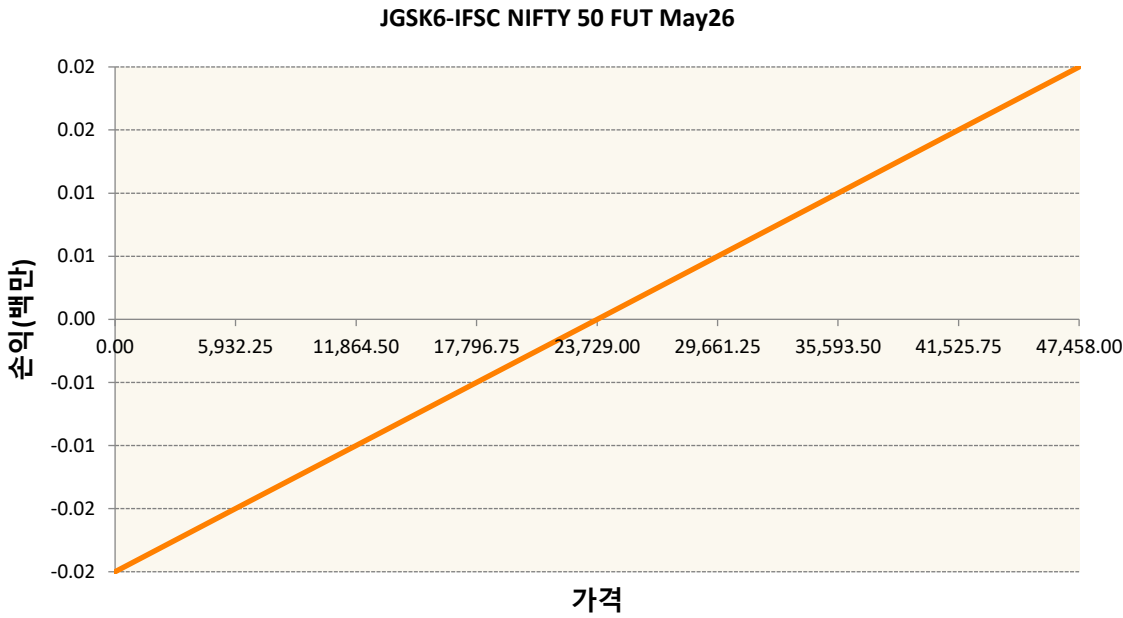
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	352	0	352	

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	2026-05-18
기준일	2026-05-15

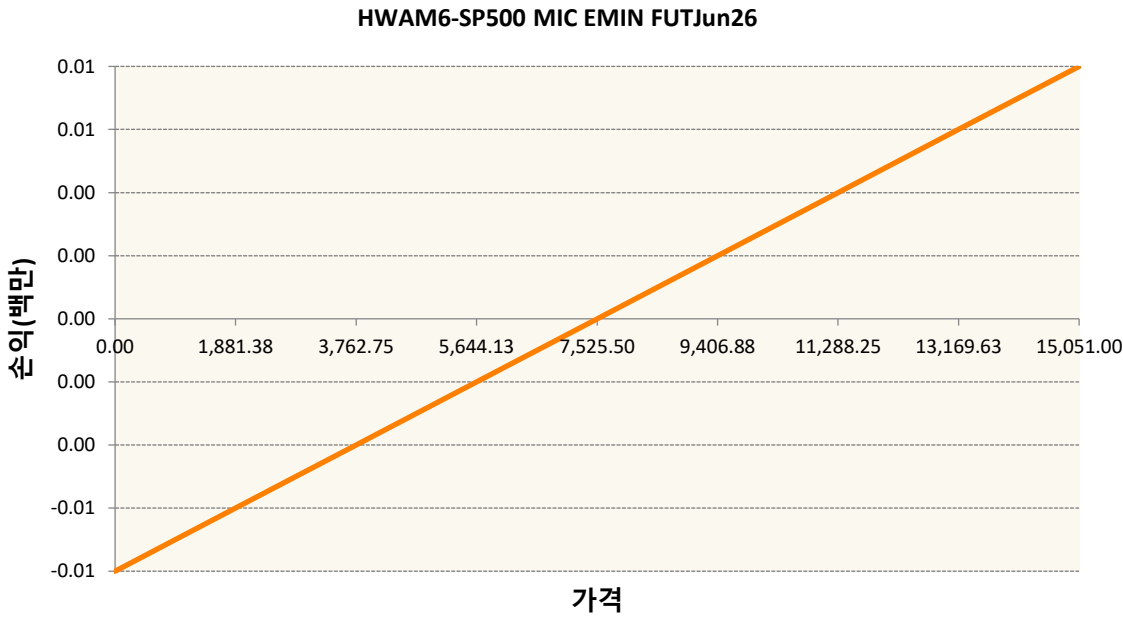
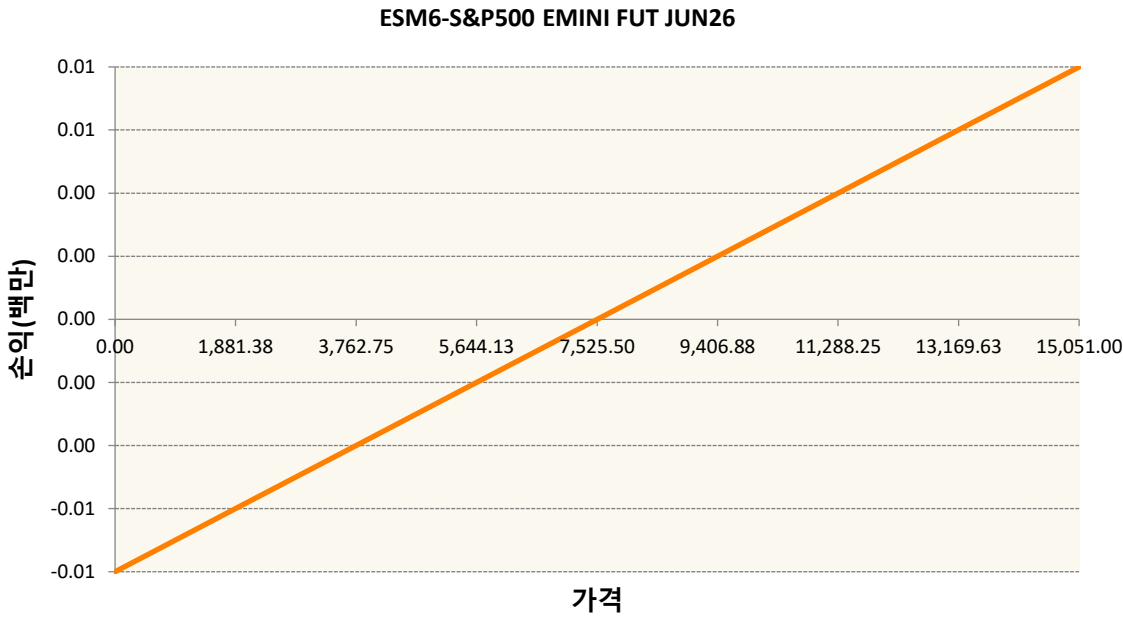
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	565	0	565	
누계	지수	선물	57	0	57	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	45
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	5

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

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

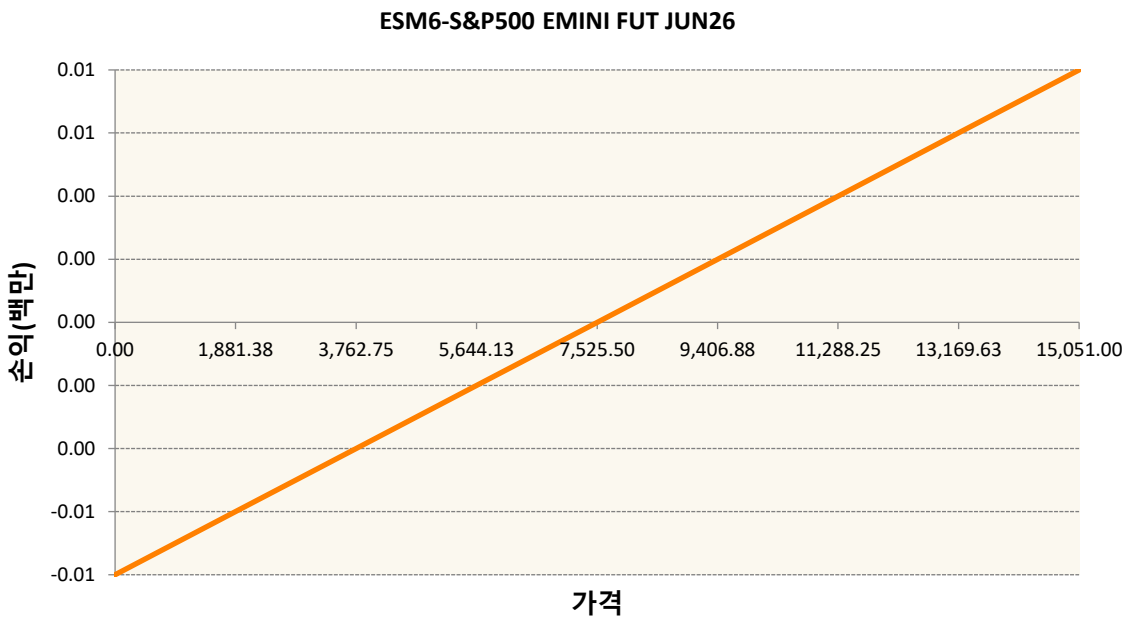
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,130	0	1,130	

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)

79

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

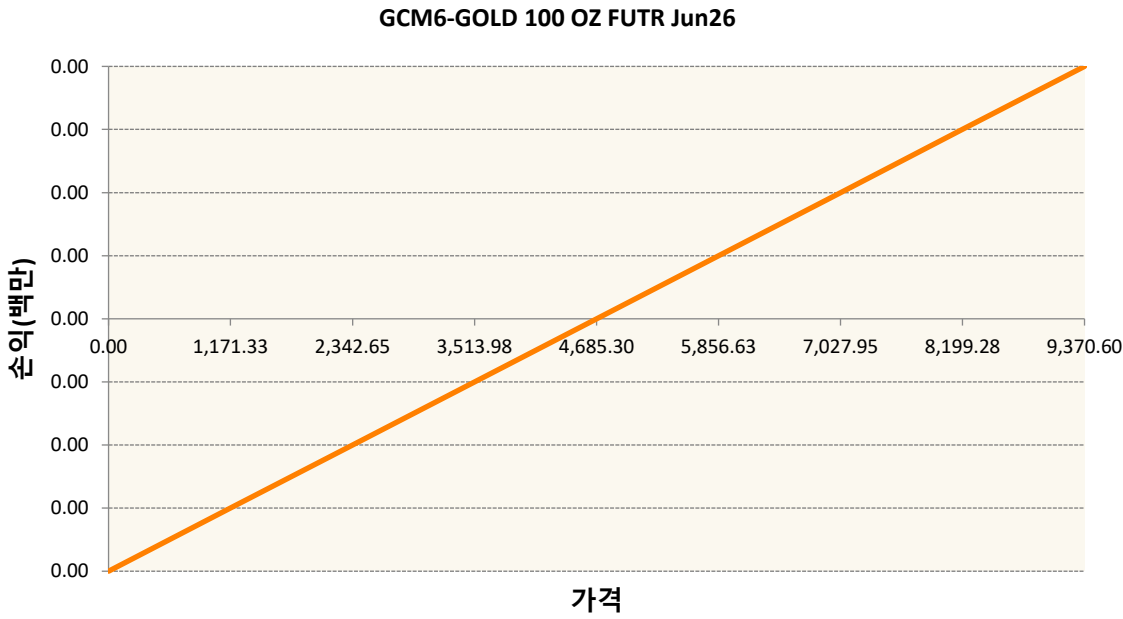
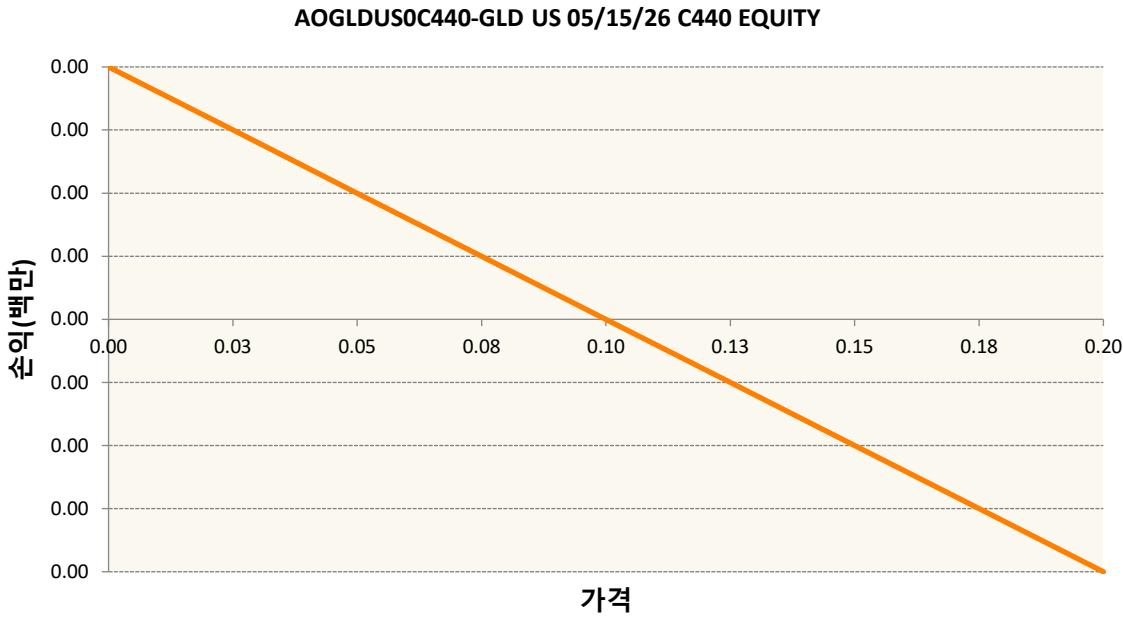
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	142	-142	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUS0C GLD US 05/15/26 C440 EQUITY		11
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26		452

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	580

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

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	116
AOPLTRPUS`PLTR US 05/15/26 P147 EQUITY	25

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

(단위:백만원)

422

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

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

20

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

(단위:백만원)

12

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

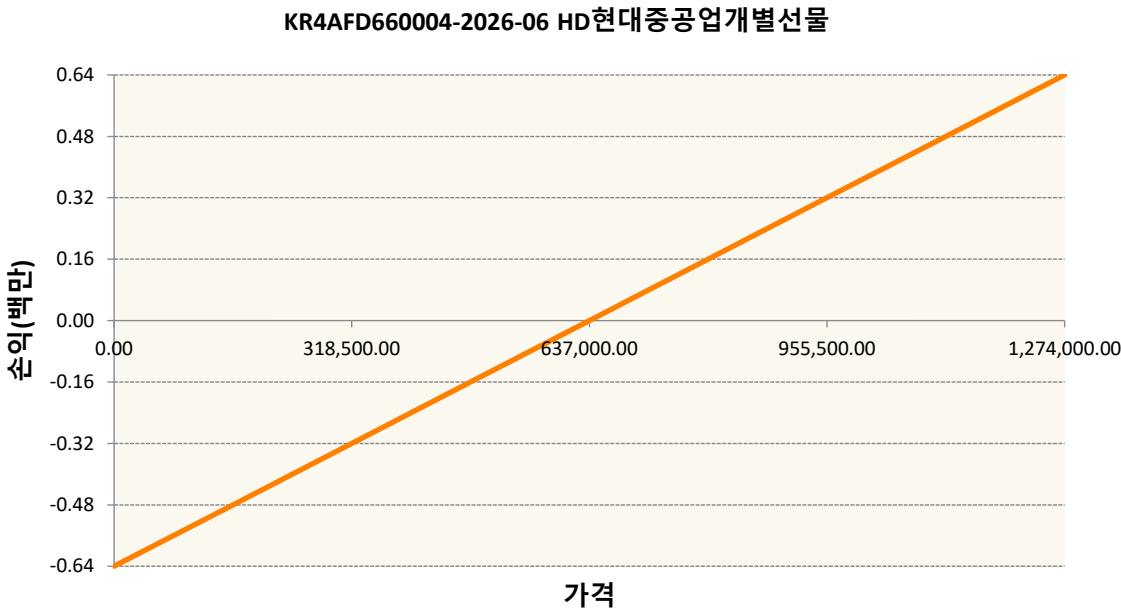
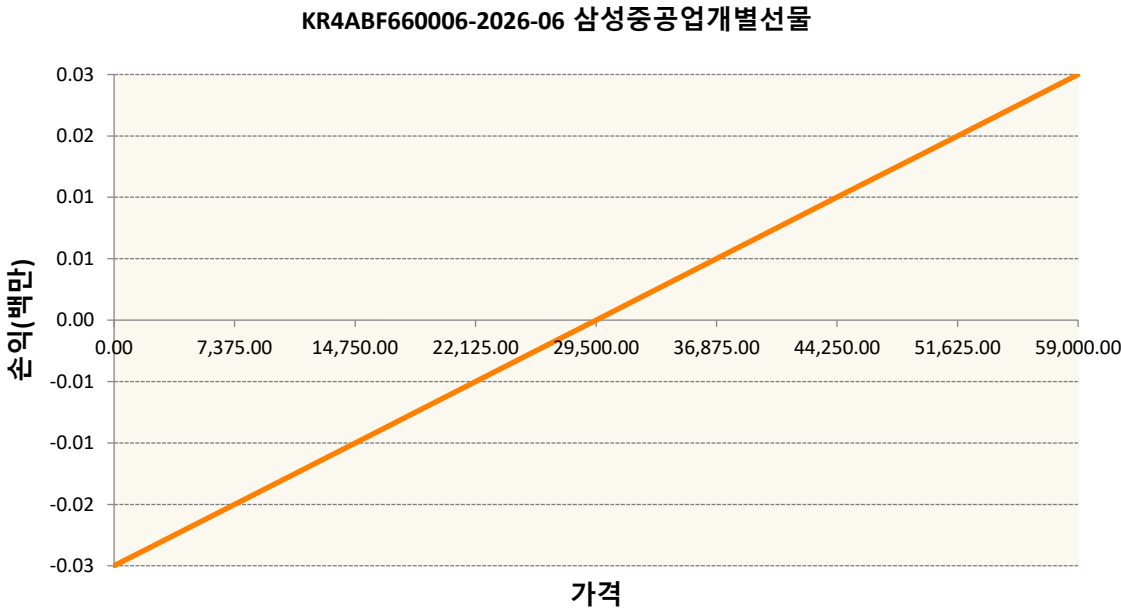
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

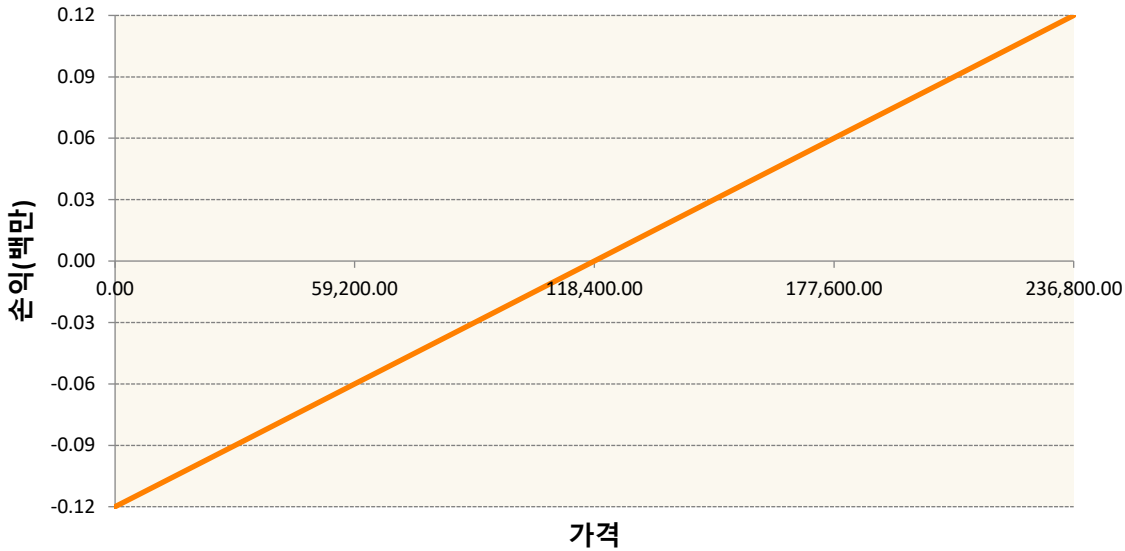
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	4,230	-4,230	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	21,283	0	21,283	장내
누계	유가증권	스왑	154,461	0	154,461	장외

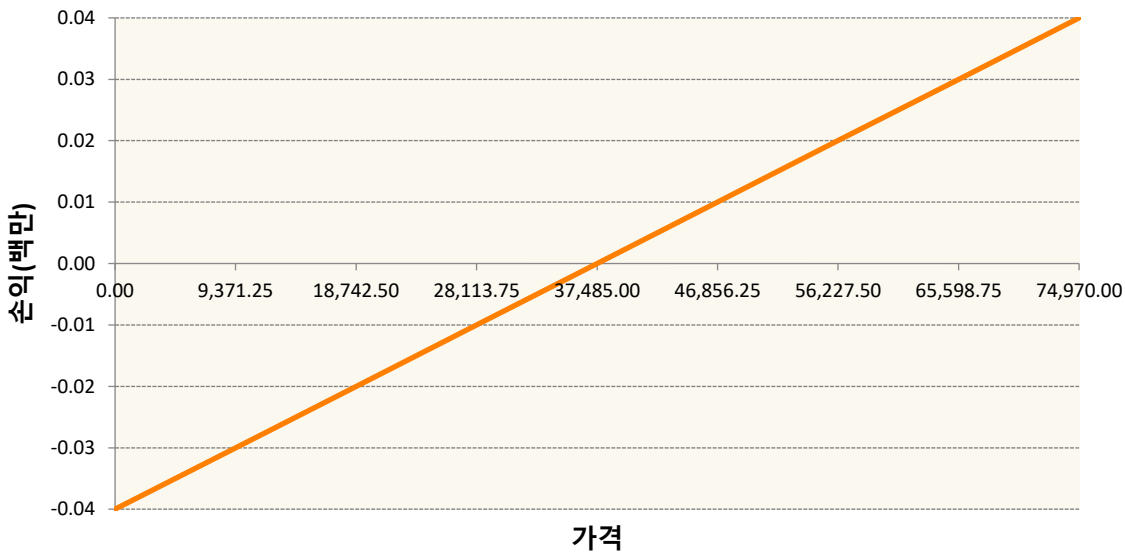
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV660002-2026-06 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF660006		2026-06 삼성중공업개별선물					522
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-522	-522	-522	-522	-522	-522	-522
-5.33%	-348	-348	-348	-348	-348	-348	-348
-2.67%	-174	-174	-174	-174	-174	-174	-174
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	174	174	174	174	174	174	174
5.33%	348	348	348	348	348	348	348
8.00%	522	522	522	522	522	522	522
KR4AFD660004		2026-06 HD현대중공업개별선물					791
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-791	-791	-791	-791	-791	-791	-791
-5.33%	-527	-527	-527	-527	-527	-527	-527
-2.67%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	264	264	264	264	264	264	264
5.33%	527	527	527	527	527	527	527
8.00%	791	791	791	791	791	791	791
KR4AFV660002 2026-06 한화오션개별선물							389
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-389	-389	-389	-389	-389	-389	-389
-5.33%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
-2.67%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	130	130	130	130	130	130	130
5.33%	259	259	259	259	259	259	259
8.00%	389	389	389	389	389	389	389

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

(단위:백만원)

2,520

공시일 2026-05-18

기준일 2026-05-15

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	2026-05-18
기준일	2026-05-15

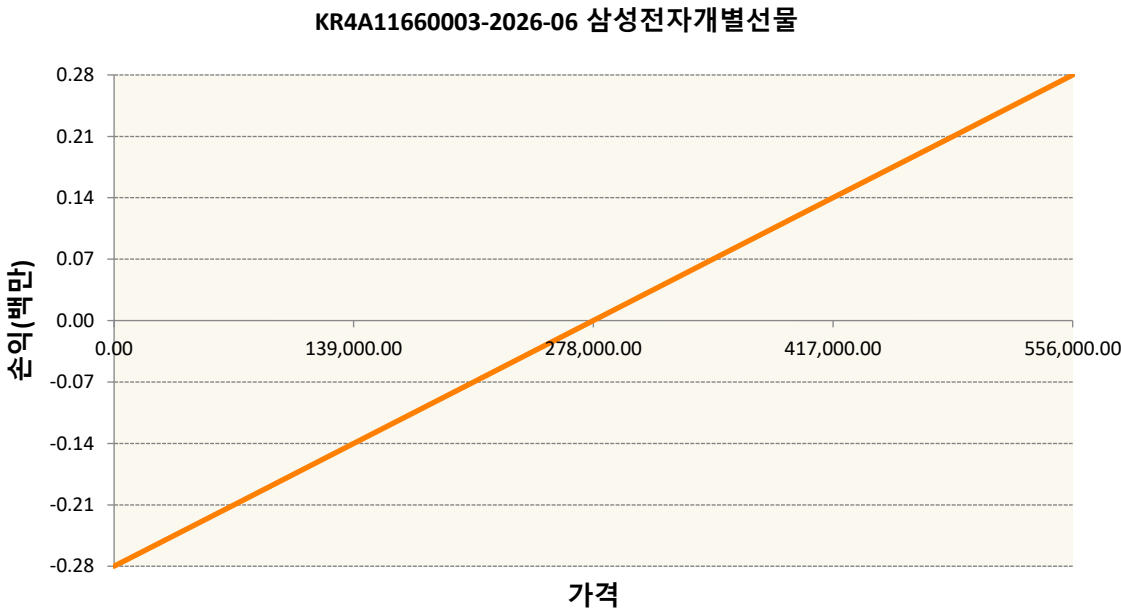
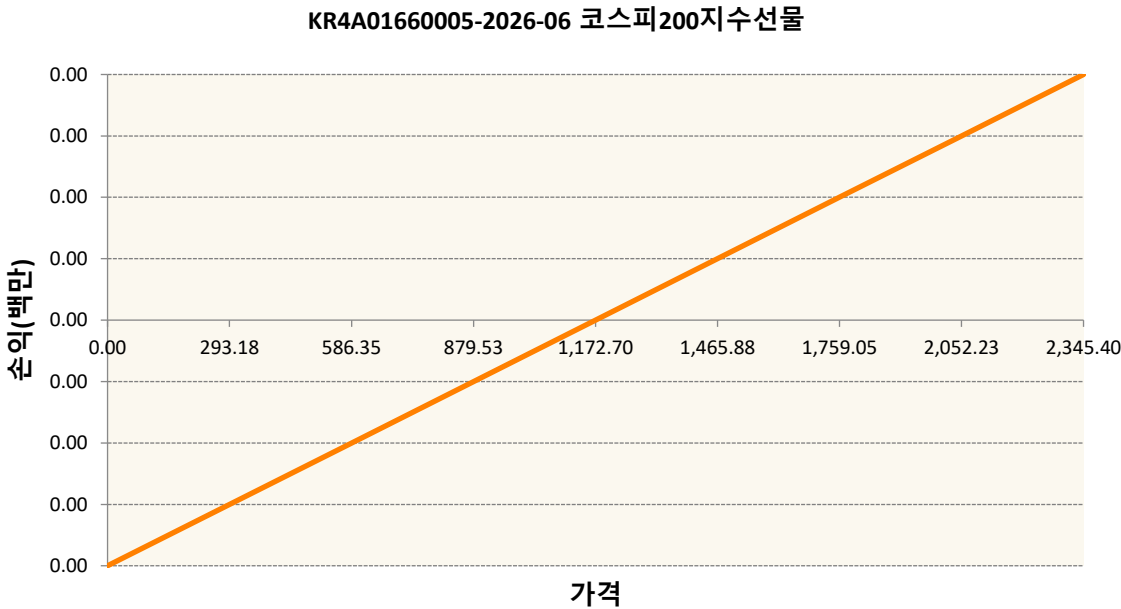
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	4,679	-4,679	장내
누계	유가증권	선물	22,635	52,332	-29,697	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순이익) 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 net income, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A solid blue line starts at the origin (0, 0.00) and extends to the point (2,490.00, 0.00), indicating a constant rate of change.

가액	순이익(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 blue line starts at the origin (0, 0.00) and ends at (2,495.00, 0.00), indicating a constant rate of decrease.

가액	잔액(백만원)
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		604	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-604	-604	-604	-604	-604	-604	-604			
-5.33%	-403	-403	-403	-403	-403	-403	-403			
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	201	201	201	201	201	201	201			
5.33%	403	403	403	403	403	403	403			
8.00%	604	604	604	604	604	604	604			
KR4A11660003							2026-06 삼성전자개별선물		1,169	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,169	-1,169	-1,169	-1,169	-1,169	-1,169	-1,169
-5.33%	-779	-779	-779	-779	-779	-779	-779
-2.67%	-390	-390	-390	-390	-390	-390	-390
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	390	390	390	390	390	390	390
5.33%	779	779	779	779	779	779	779
8.00%	1,169	1,169	1,169	1,169	1,169	1,169	1,169
KR4BAFBDA992 코스피위클리M C 2605W3 1,245.0							2,348

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,348	2,348	2,348	2,348	2,348	2,348	2,348
-5.33%	1,565	1,565	1,565	1,565	1,565	1,565	1,565
-2.67%	783	783	783	783	783	783	783
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-783	-783	-783	-783	-783	-783	-783
5.33%	-1,565	-1,565	-1,565	-1,565	-1,565	-1,565	-1,565
8.00%	-2,348	-2,348	-2,348	-2,348	-2,348	-2,348	-2,348

KR4BAFBDB016 코스피위클리M C 2605W3 1,247.5							1,558
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,558	1,558	1,558	1,558	1,558	1,558	1,558
-5.33%	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038	1,038
-2.67%	519	519	519	519	519	519	519
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-519	-519	-519	-519	-519	-519	-519
5.33%	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038	-1,038
8.00%	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558	-1,558

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

(단위:백만원)

13,344

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

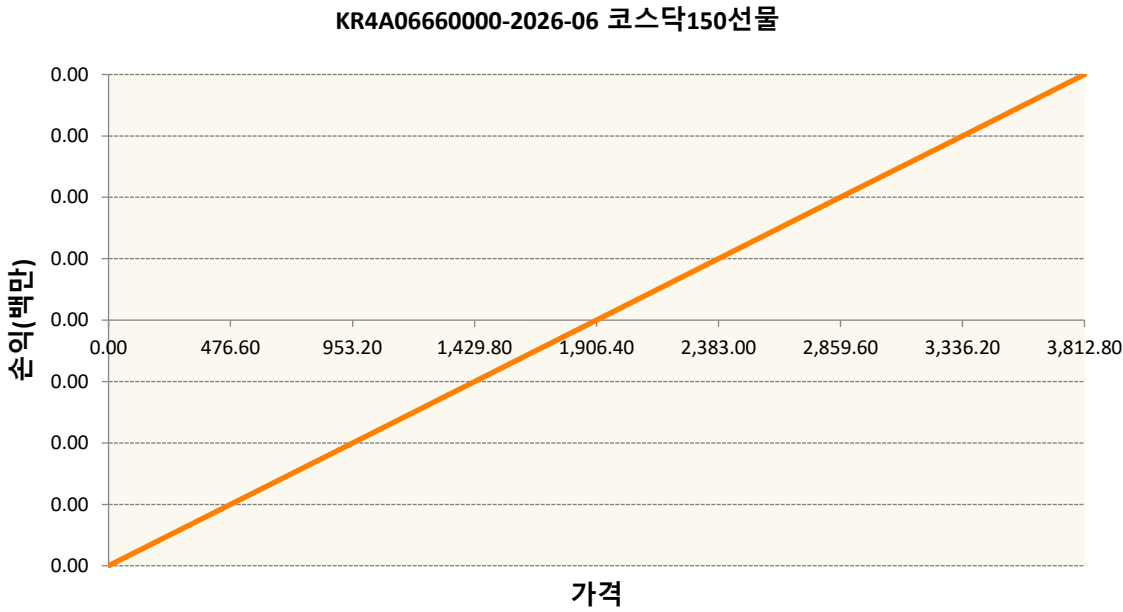
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,106	0	1,106	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06660000			2026-06 코스닥150선물				88
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	88	88	88	88	88	88	88

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

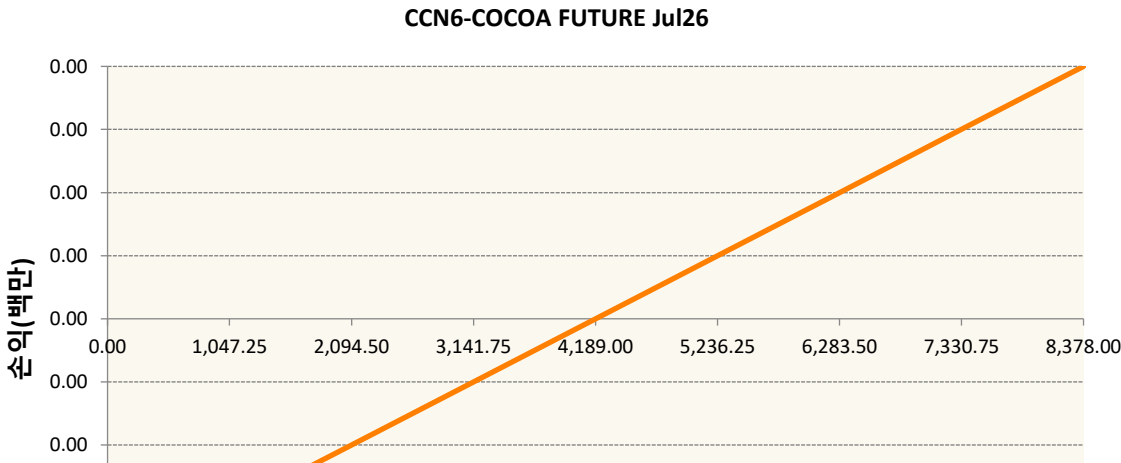
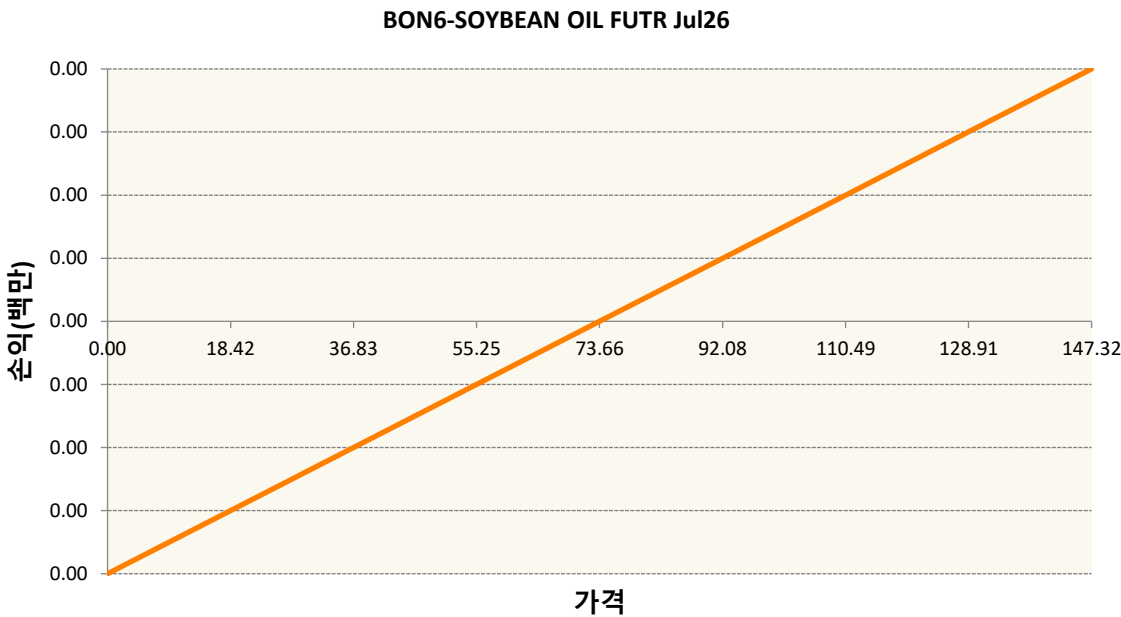
포커스농산물모(채권-파생형)

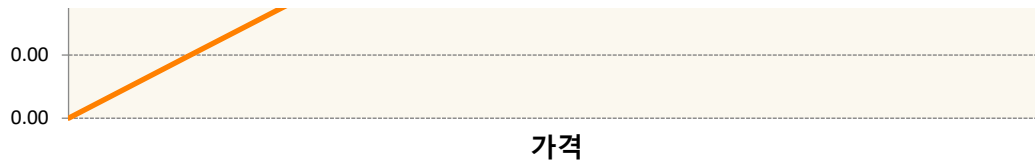
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

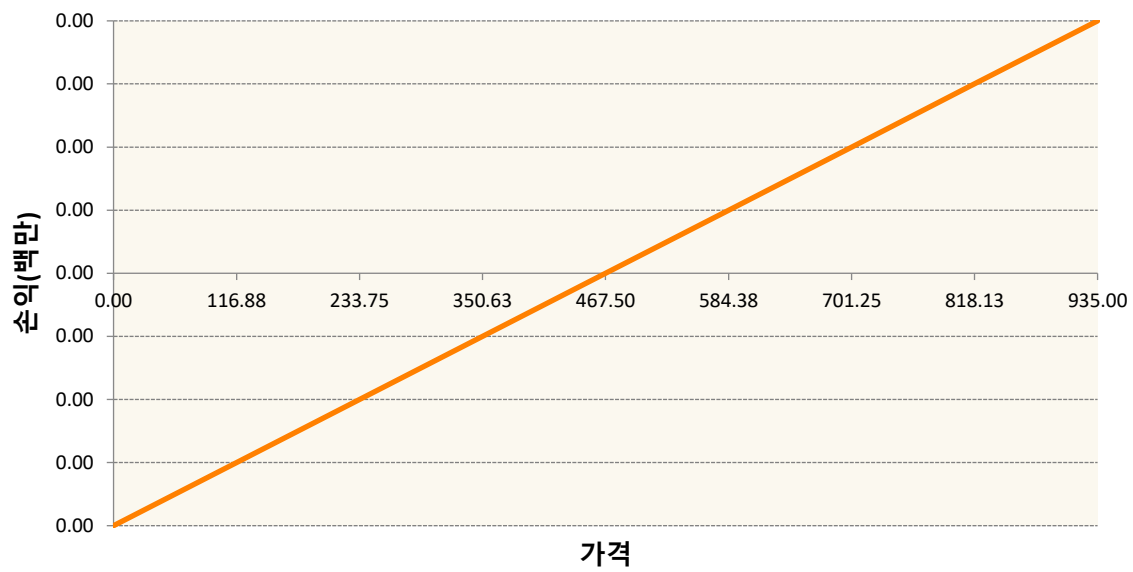
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	62	0	62	
누계	실물자산	선물	916	0	916	장내
누계	유가증권	선물	1,929	0	1,929	
누계	통화	선물	0	390	-390	장내

2. 만기시점의 손익구조

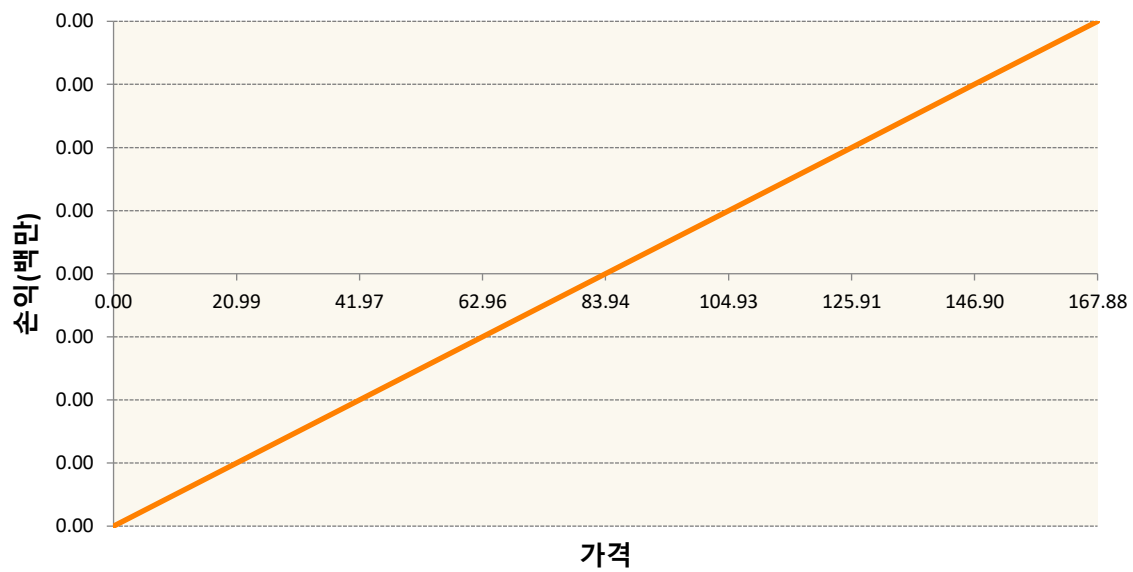




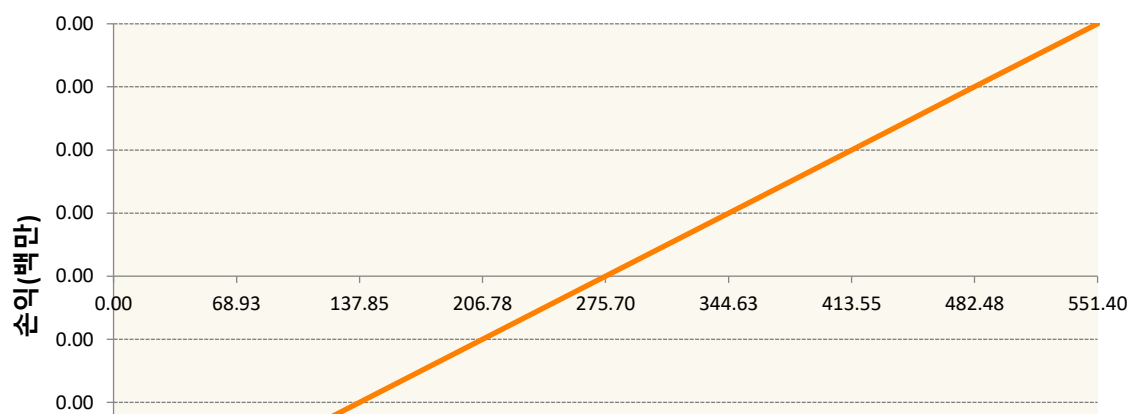
CN6-CORN FUTURE Jul26

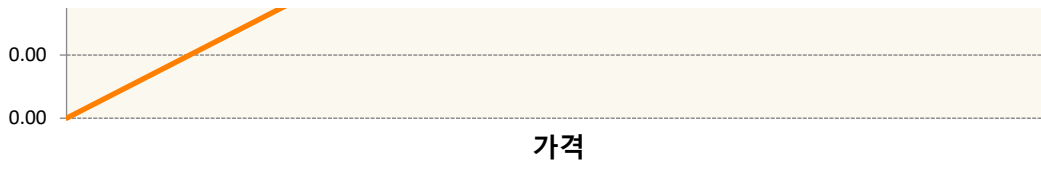


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

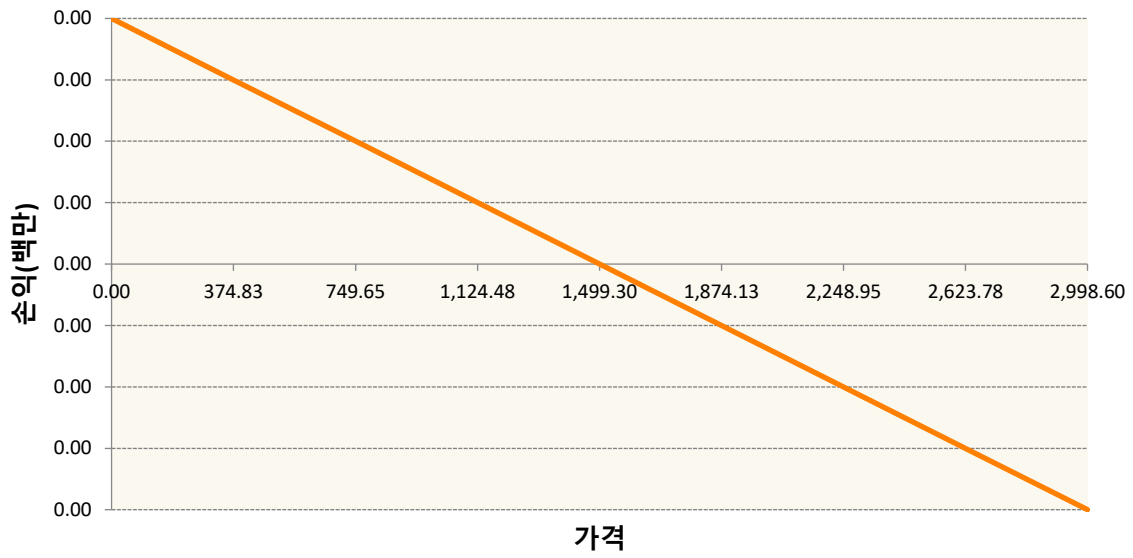


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

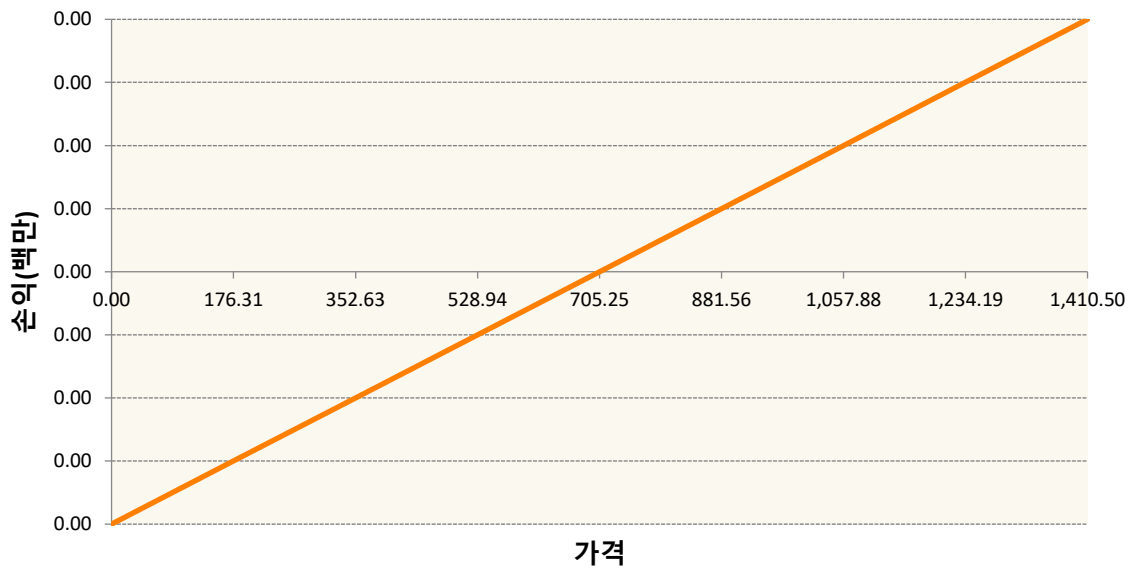




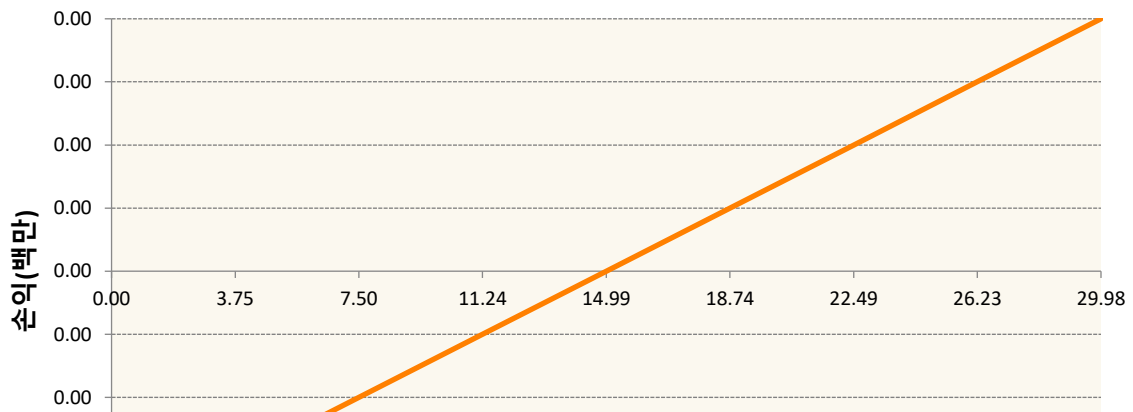
KR4A75660006-2026-06 달러선물

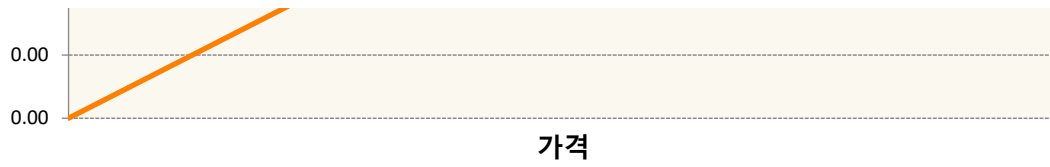


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

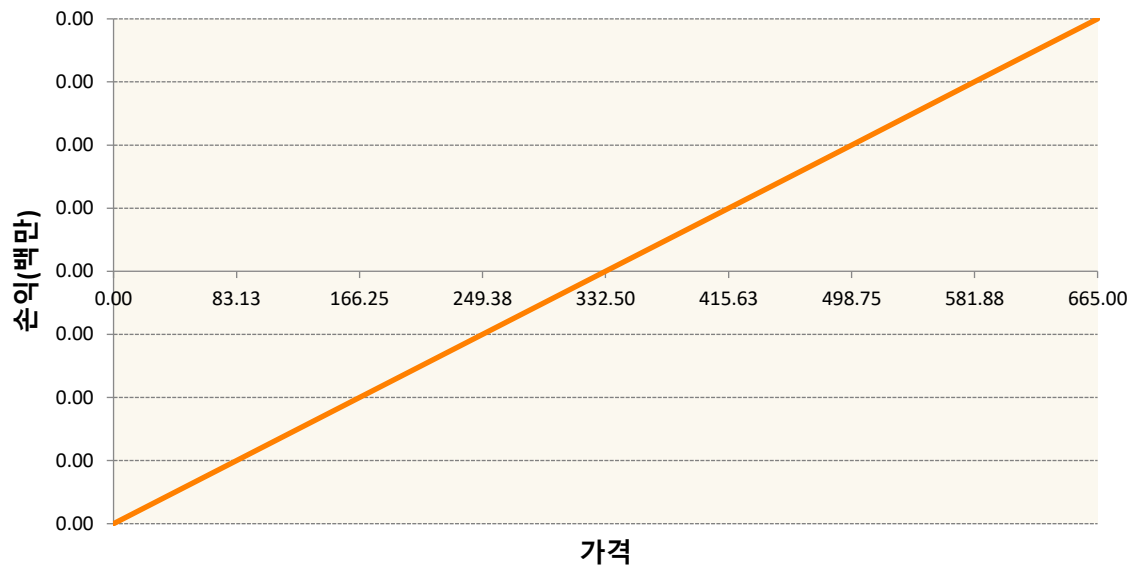


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

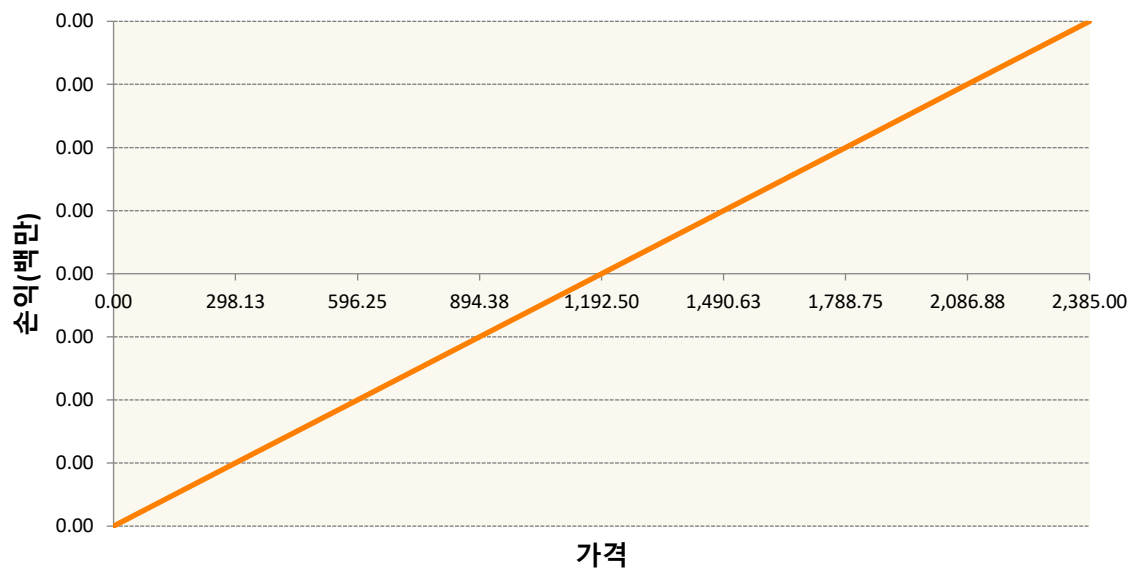




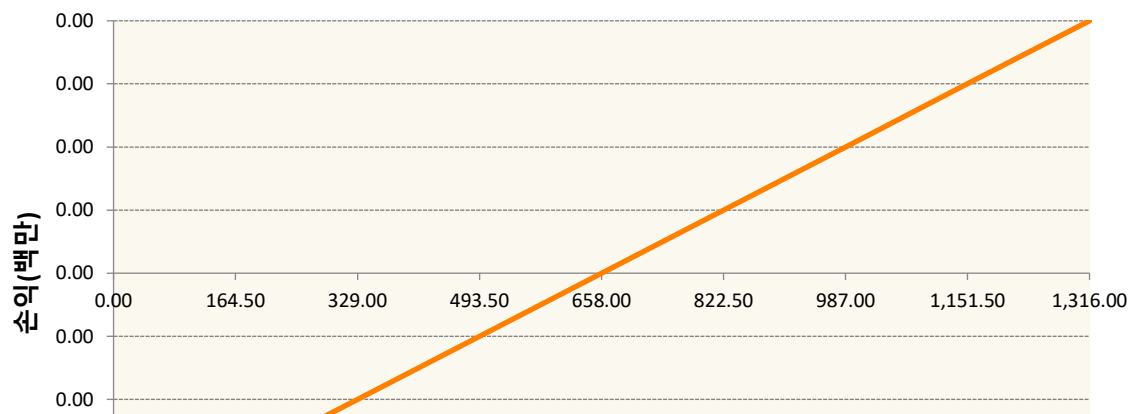
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

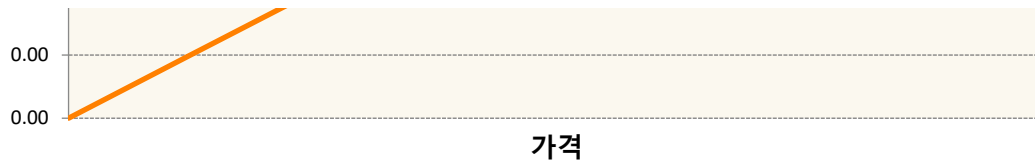


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-05-18
기준일	2026-05-15

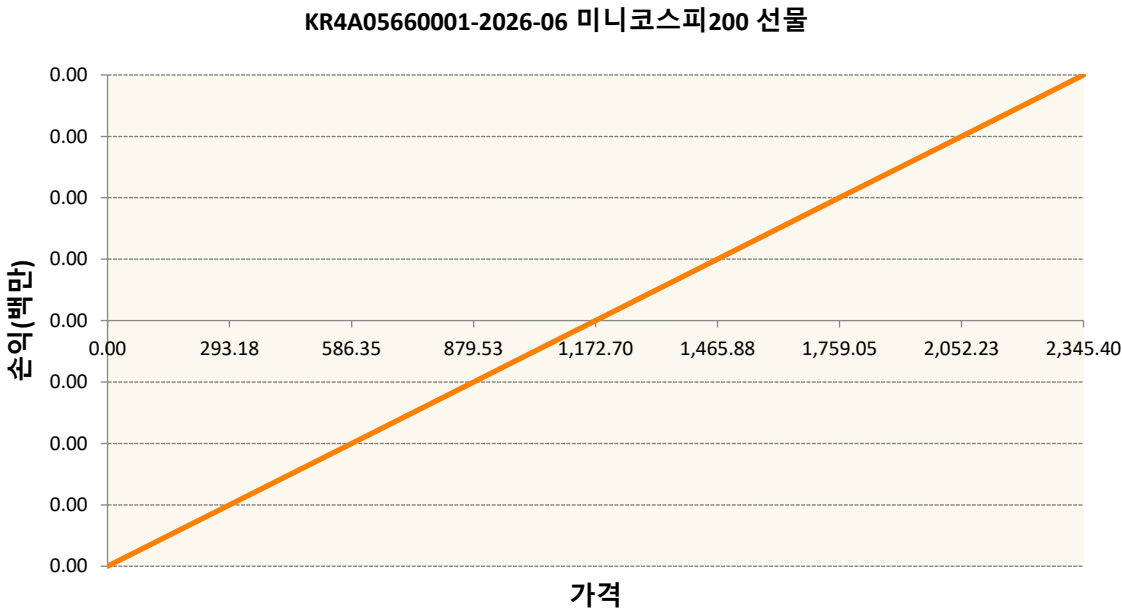
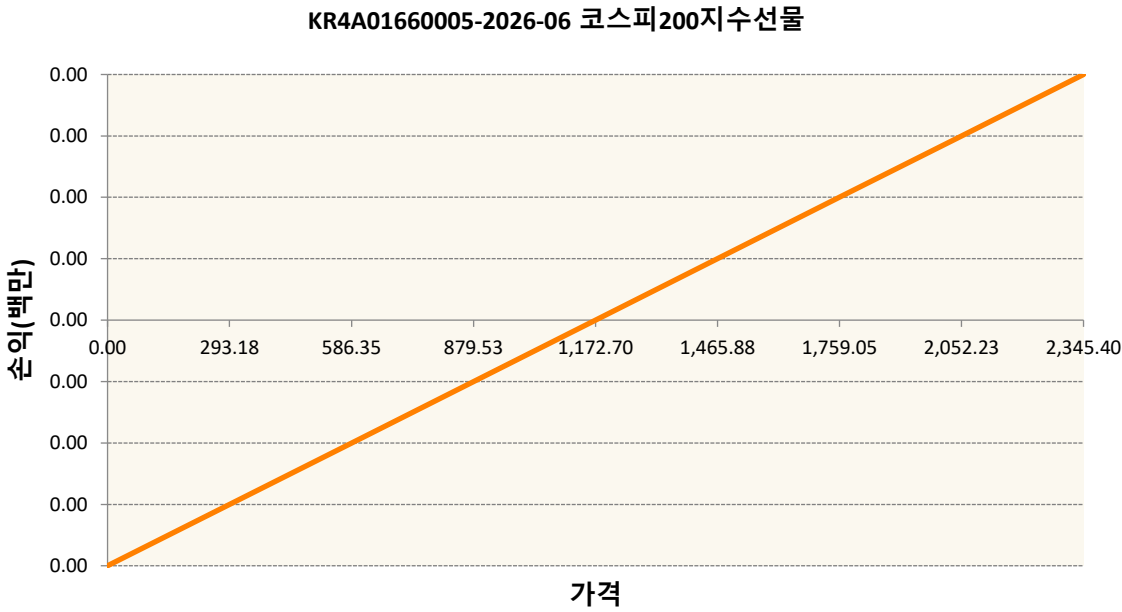
스마트인덱스모

1. 계약금액

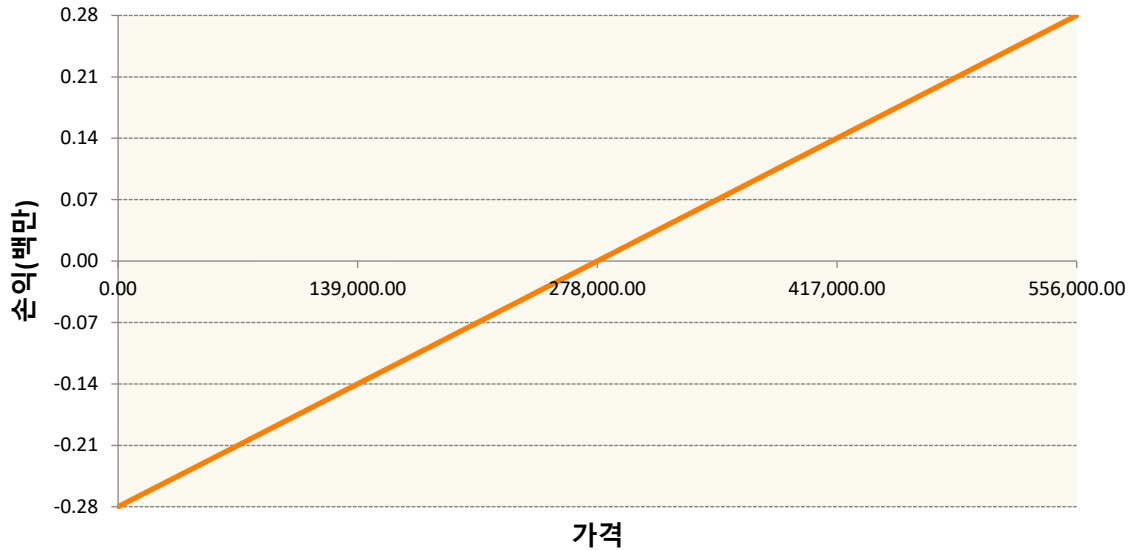
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,214	592	622	장내
누계	유가증권	선물	3,503	0	3,503	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005			2026-06 코스피200지수선물				209
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
-5.33%	-139	-139	-139	-139	-139	-139	-139
-2.67%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	70	70	70	70	70	70	70
5.33%	139	139	139	139	139	139	139
8.00%	209	209	209	209	209	209	209
KR4A05660001			2026-06 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
KR4A11660003			2026-06 삼성전자개별선물				22
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	22	22	22	22	22	22	22

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)						(단위:백만원)
						550

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

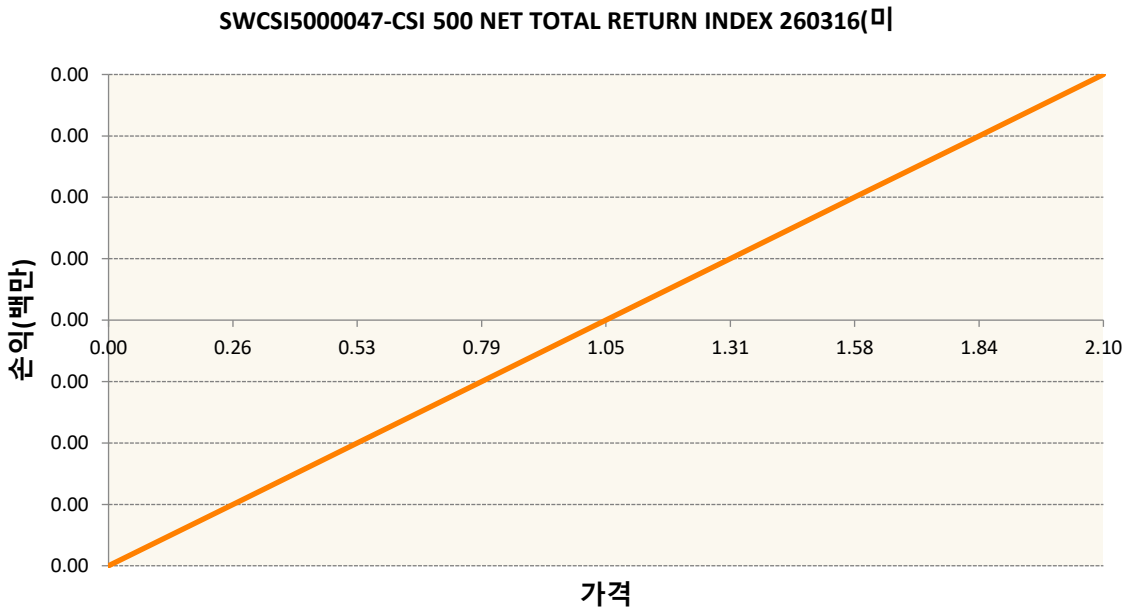
SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,926	0	5,926	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

475

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

596

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

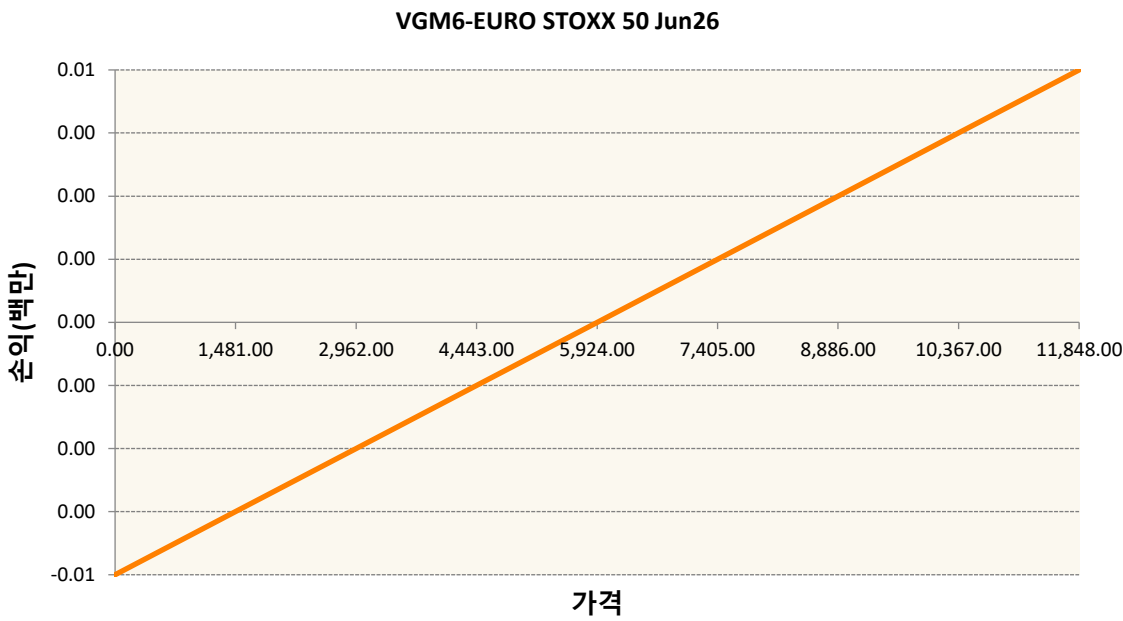
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	913	0	913	

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	2026-05-18
기준일	2026-05-15

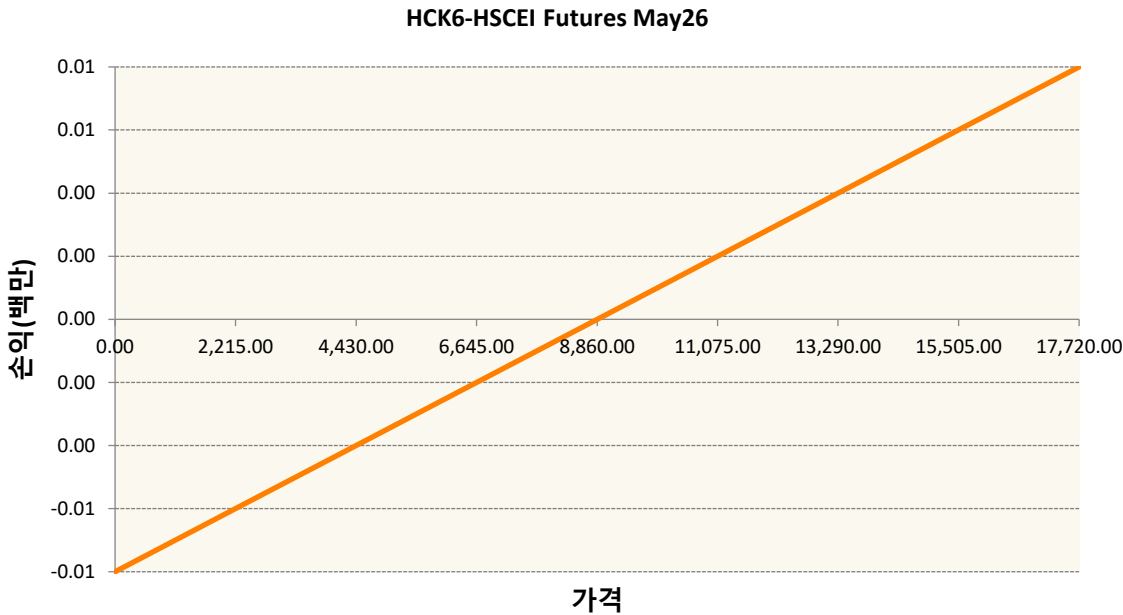
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,666	0	1,666	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

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

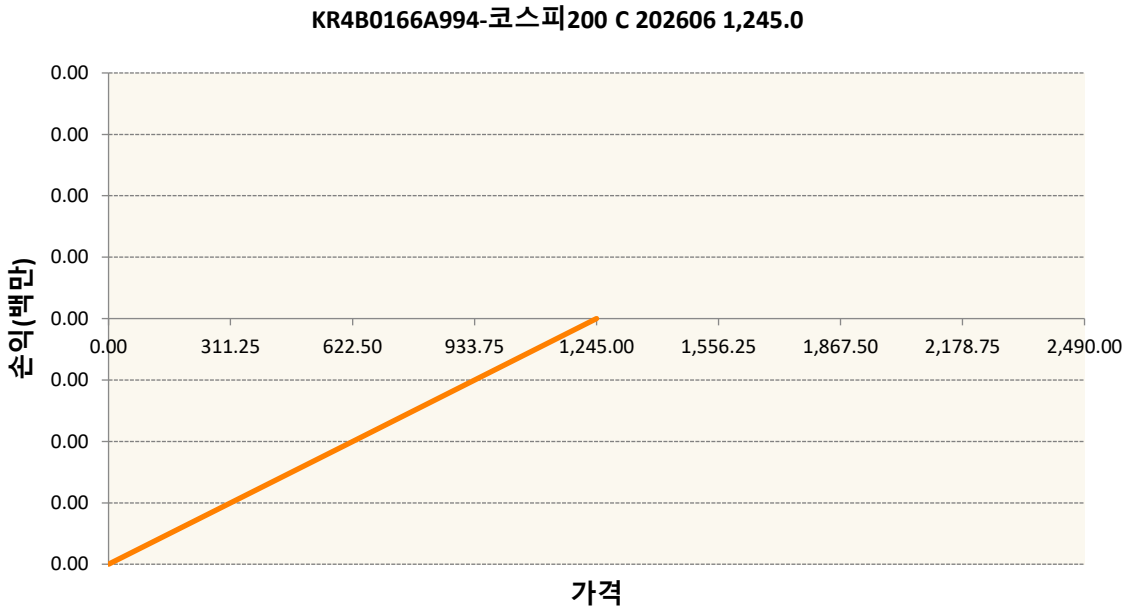
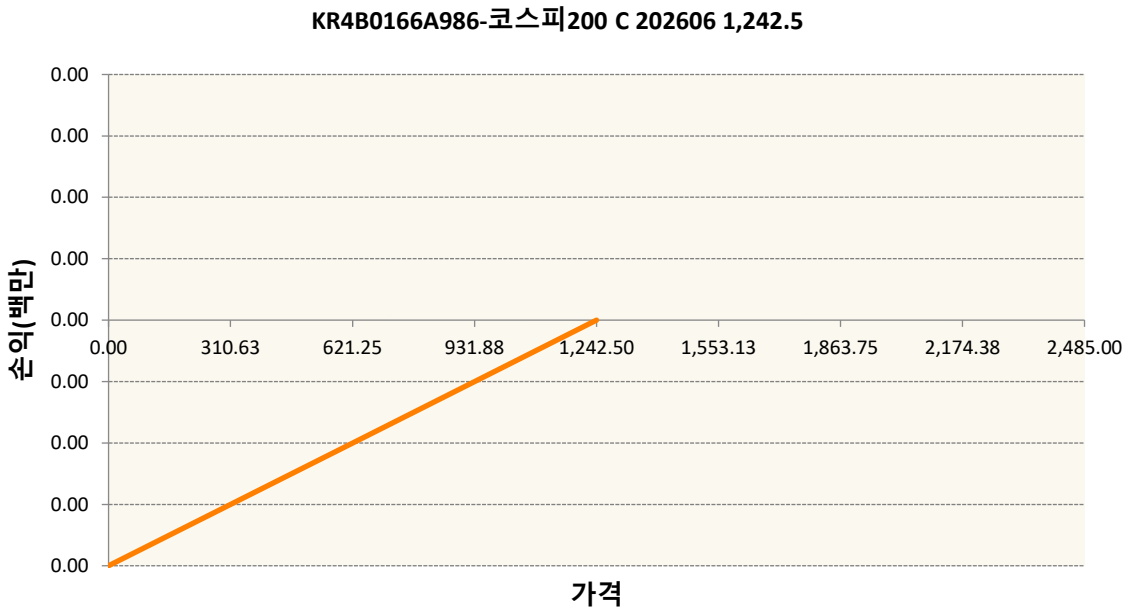
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

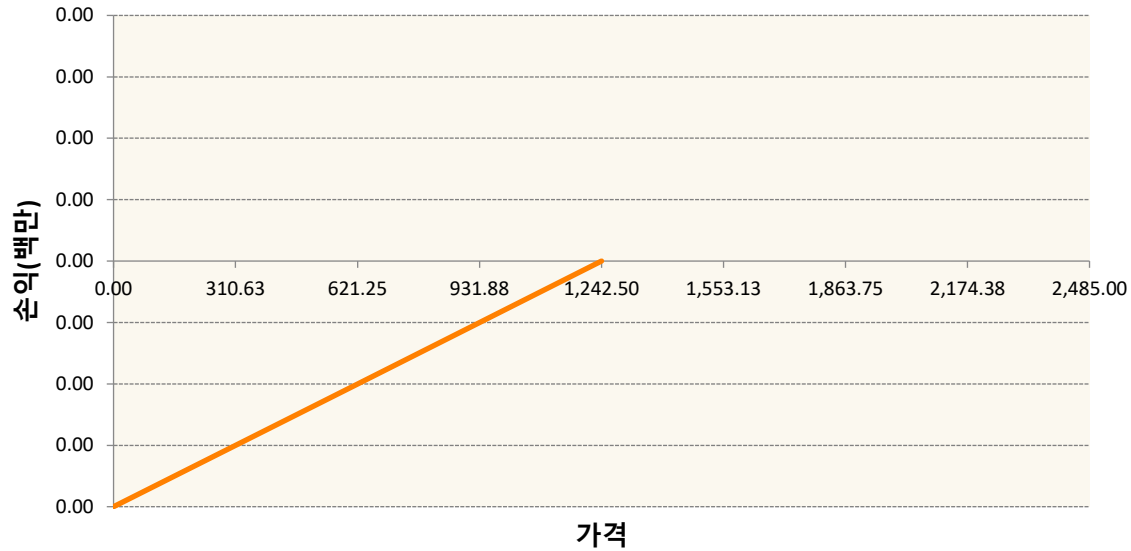
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	40,892	-40,892	장내
누계	유가증권	옵션	0	38,866	-38,866	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0166A984-코스피200 P 202606 1,242.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0166A986 코스피200 C 202606 1,242.5							802
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-456	-506	-560	-617	-677	-738	-802
-5.33%	-211	-270	-332	-396	-462	-529	-598
-2.67%	16	-51	-120	-190	-262	-334	-407
0%	224	150	76	0	-76	-153	-230
2.67%	411	333	253	174	95	15	-65
5.33%	578	496	414	332	251	169	87
8.00%	724	641	558	475	392	309	227
KR4B0166A994 코스피200 C 202606 1,245.0							1,206
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-692	-766	-846	-931	-1,019	-1,112	-1,206
-5.33%	-322	-410	-502	-597	-696	-797	-899
-2.67%	21	-79	-182	-287	-394	-502	-612
0%	335	225	113	0	-114	-229	-344
2.67%	618	500	382	263	144	24	-95
5.33%	871	748	625	502	379	257	134
8.00%	1,092	967	843	718	594	469	345
KR4C0166A984 코스피200 P 202606 1,242.5							501
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-285	-316	-350	-386	-423	-461	-501
-5.33%	-132	-169	-207	-247	-289	-331	-374
-2.67%	10	-32	-75	-119	-164	-209	-255
0%	140	94	47	0	-48	-95	-143

2.67%	257	208	158	109	59	9	-41
5.33%	361	310	259	208	157	106	54
8.00%	452	401	349	297	245	193	142

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

(단위:백만원)

3,656

공시일 2026-05-18

기준일 2026-05-15

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	2026-05-18
기준일	2026-05-15

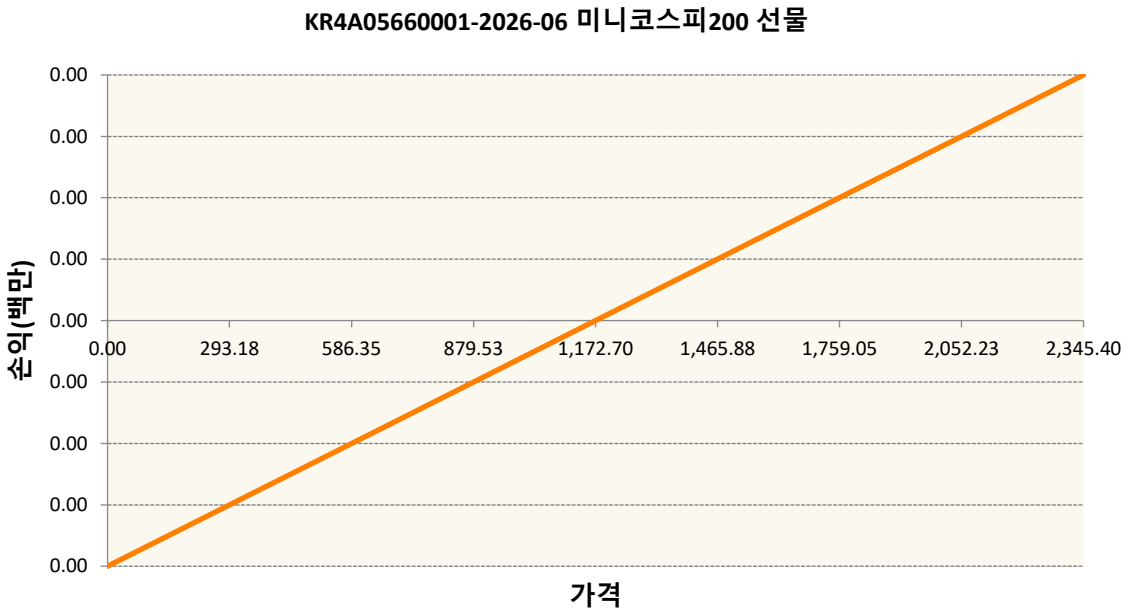
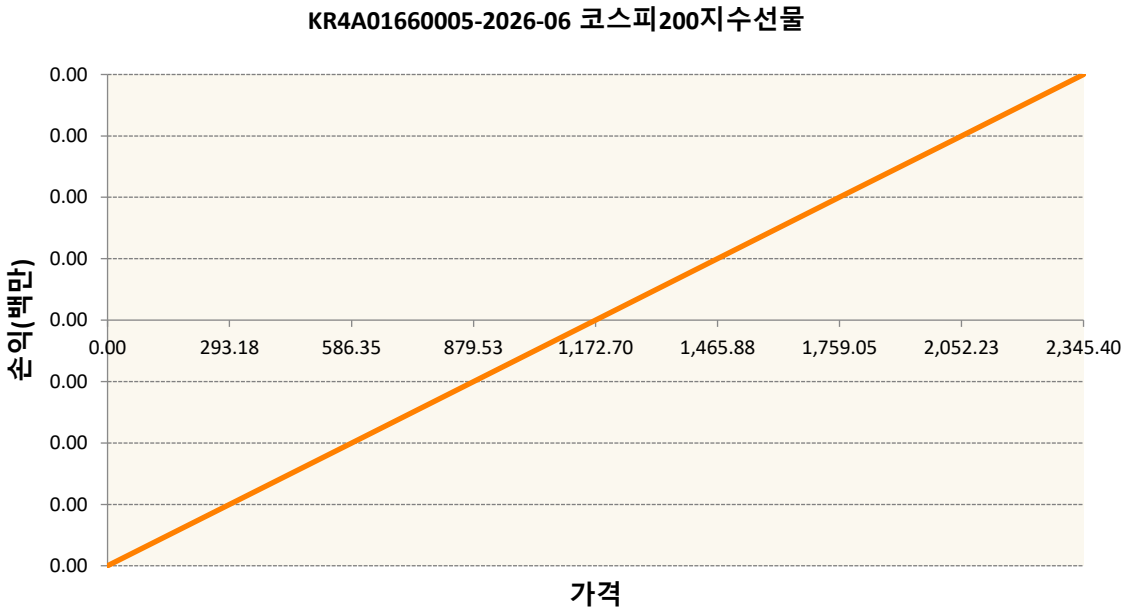
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

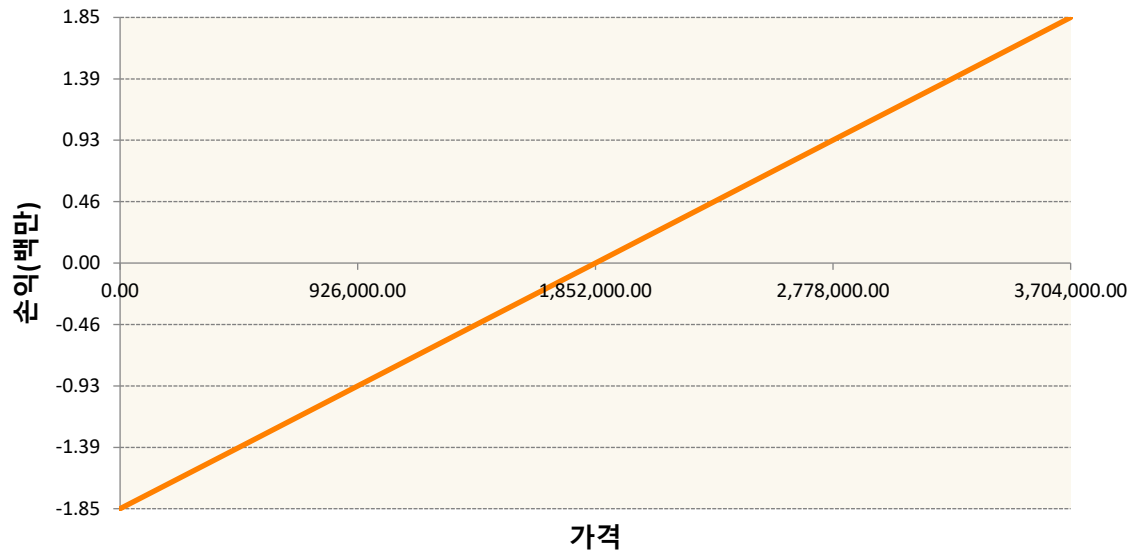
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	608	296	312	장내
누계	유가증권	선물	2,494	0	2,494	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						116
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116	
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77	
-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%	77	77	77	77	77	77	77	
8.00%	116	116	116	116	116	116	116	
KR4A05660001		2026-06 미니코스피200 선물						14
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14	
-5.33%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	5	5	5	5	5	5	5	
5.33%	9	9	9	9	9	9	9	
8.00%	14	14	14	14	14	14	14	
KR4A50660005		2026-06 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)
	330

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

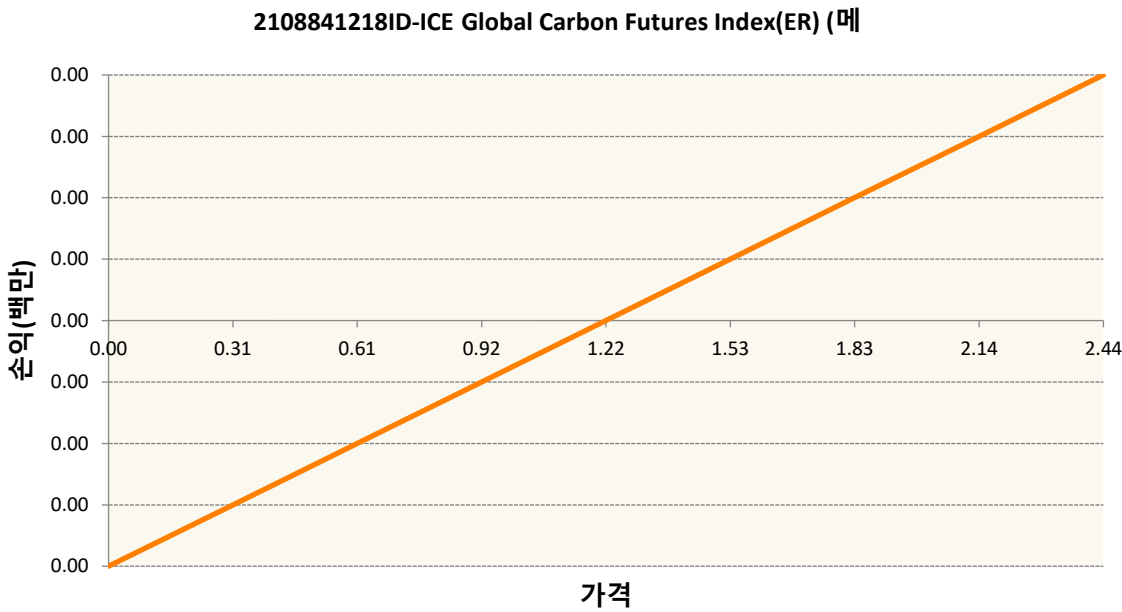
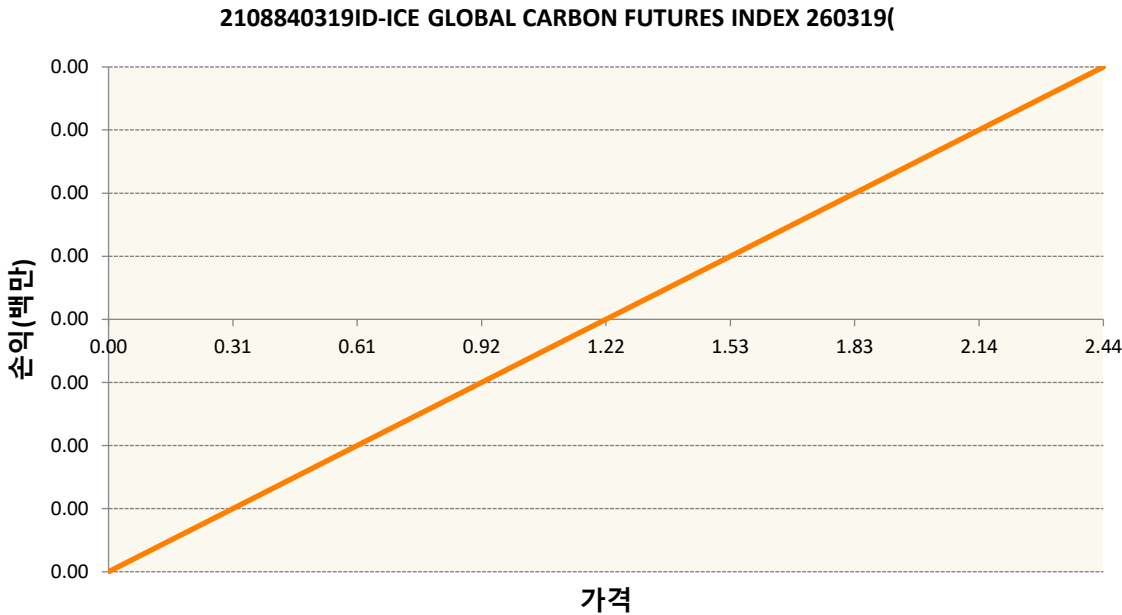
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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(		448
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		113

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	644

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

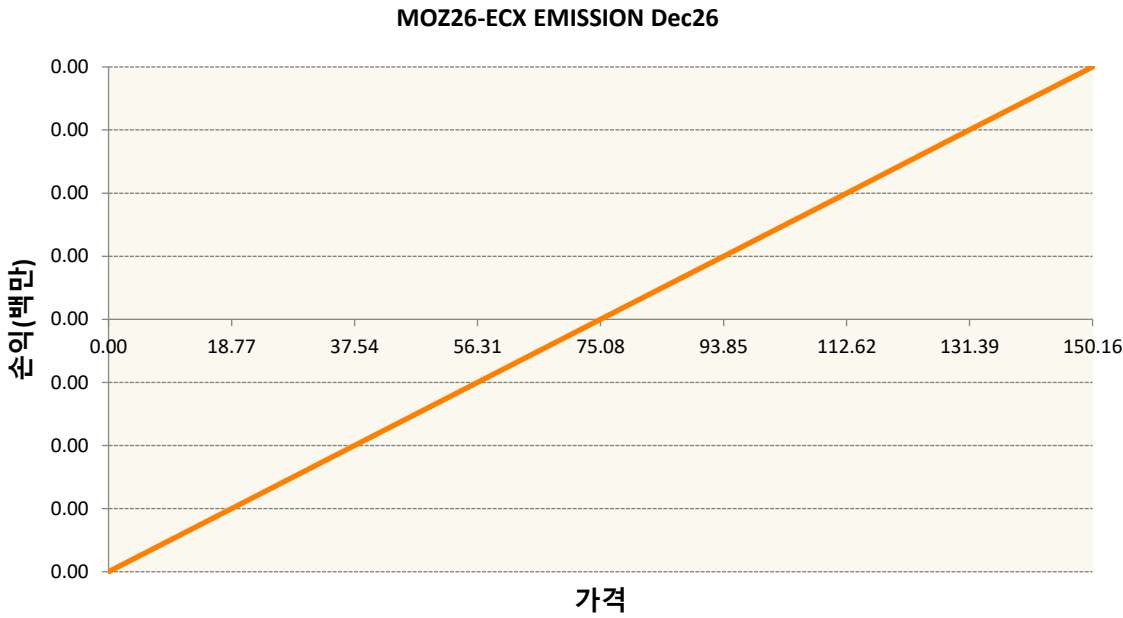
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,839	0	4,839	
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)

663

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

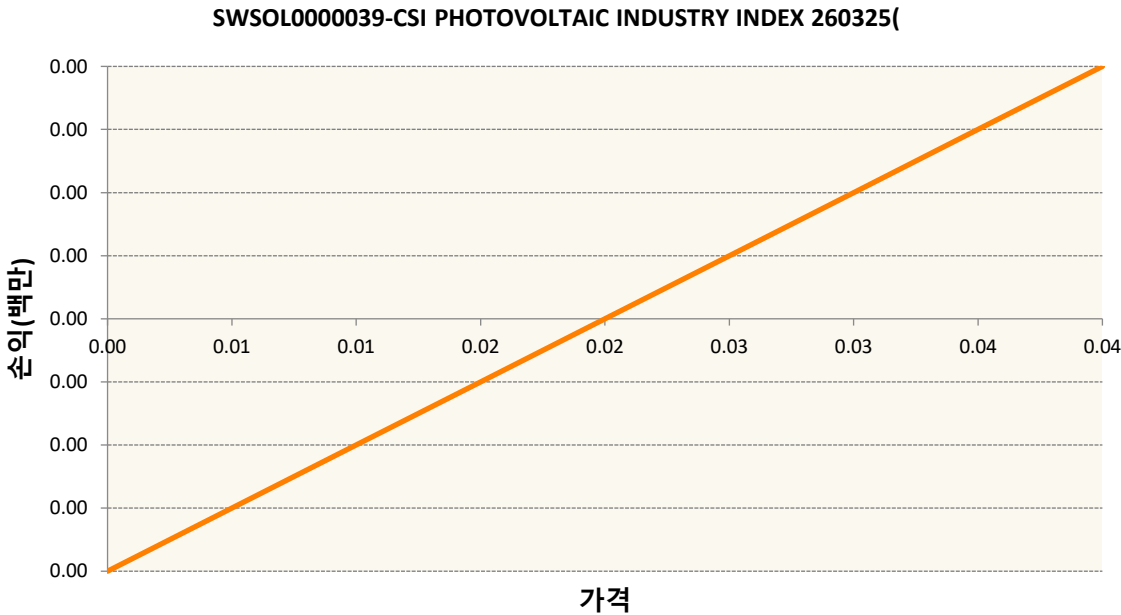
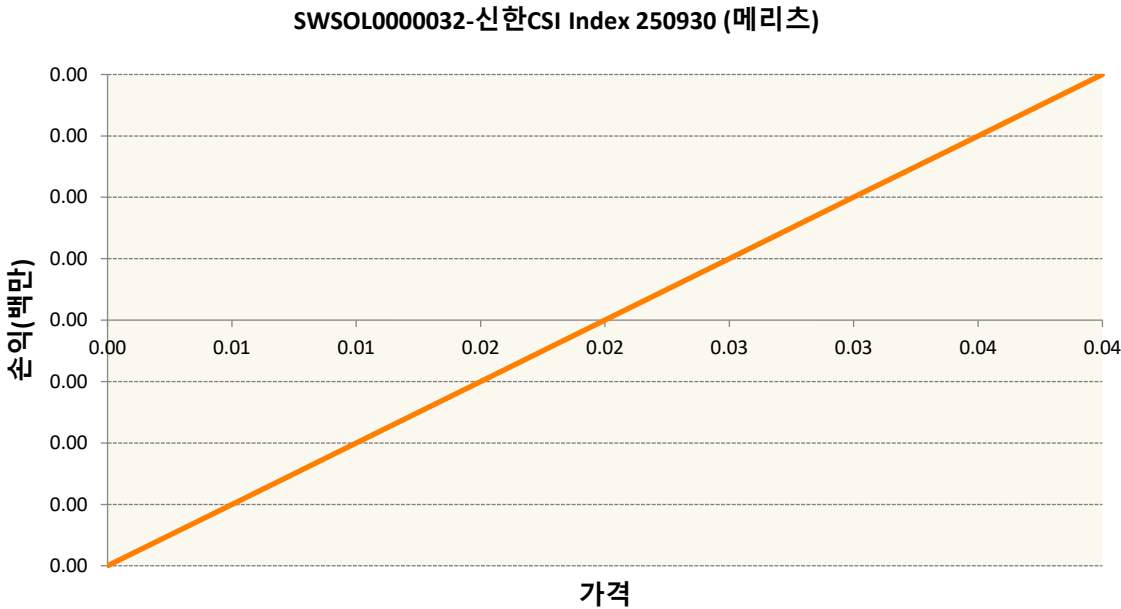
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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	2,064	0	2,064	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)		3
SWSOL00000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)		2
SWSOL00000(신한CSI Index 250930 (메리츠)		5
SWSOL00000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	20

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

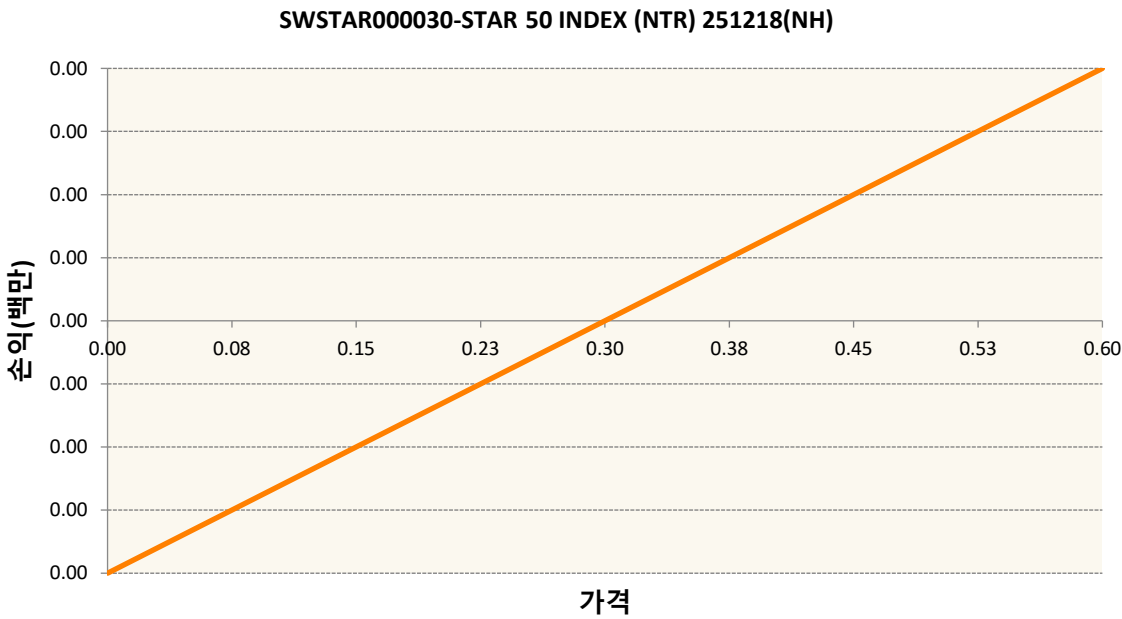
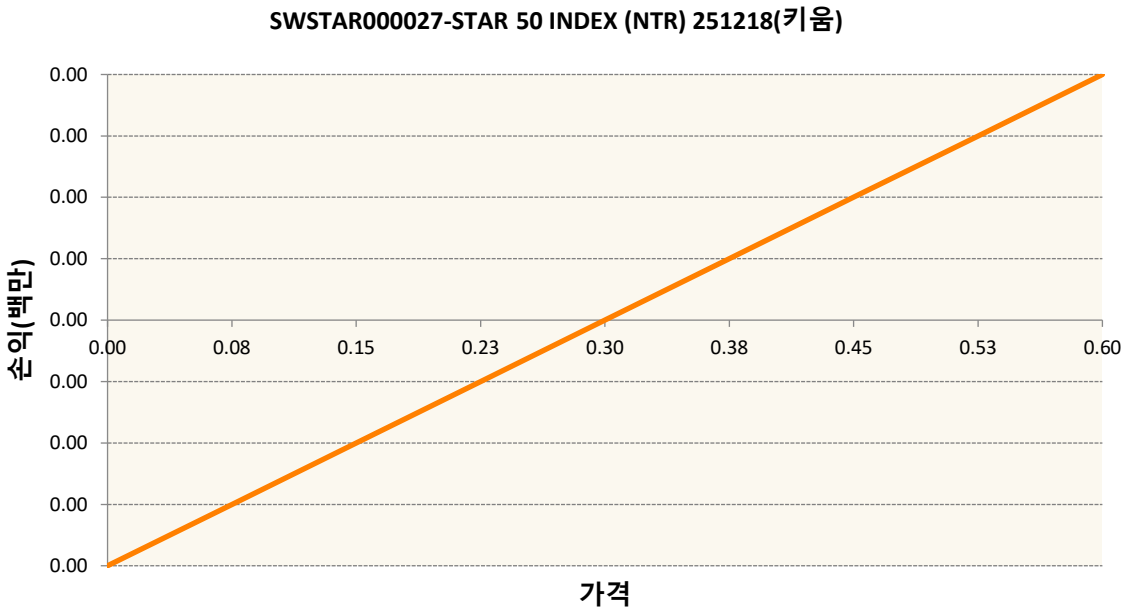
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

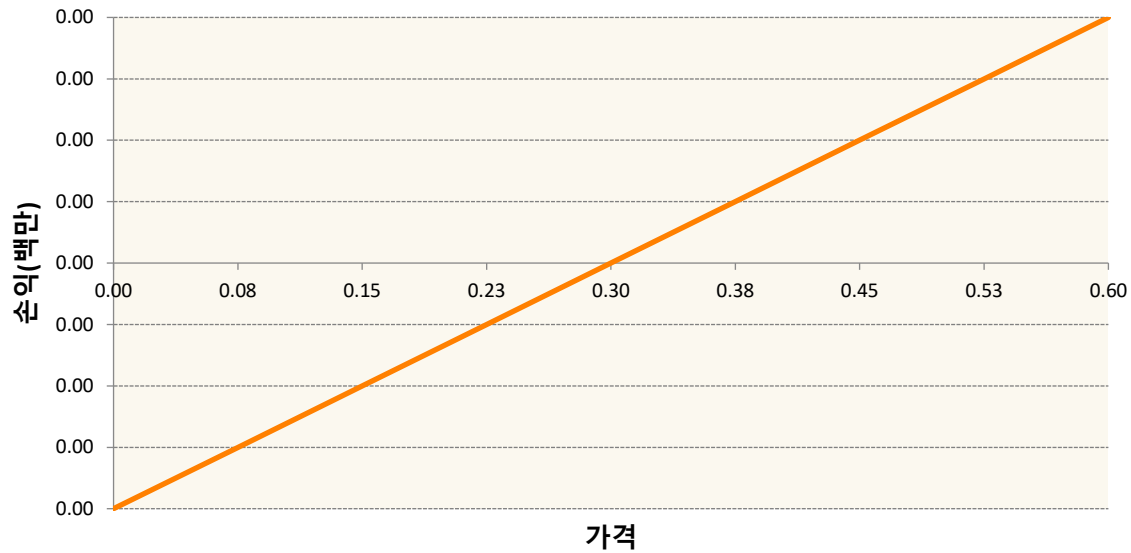
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,588	0	7,588	장외

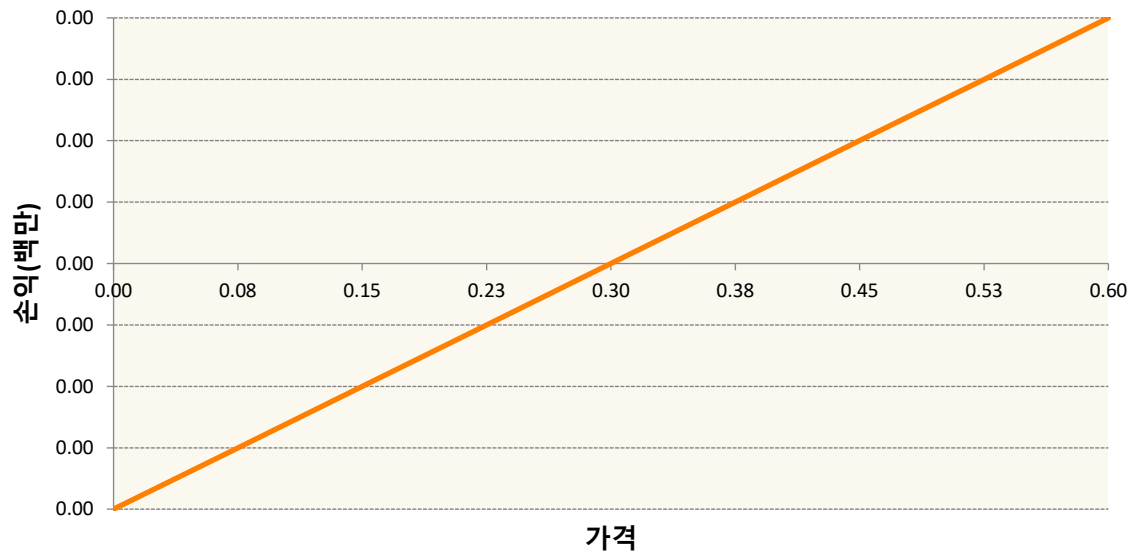
2. 만기시점의 손익구조



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)	73
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	371
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	138

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

(단위:백만원)

911

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

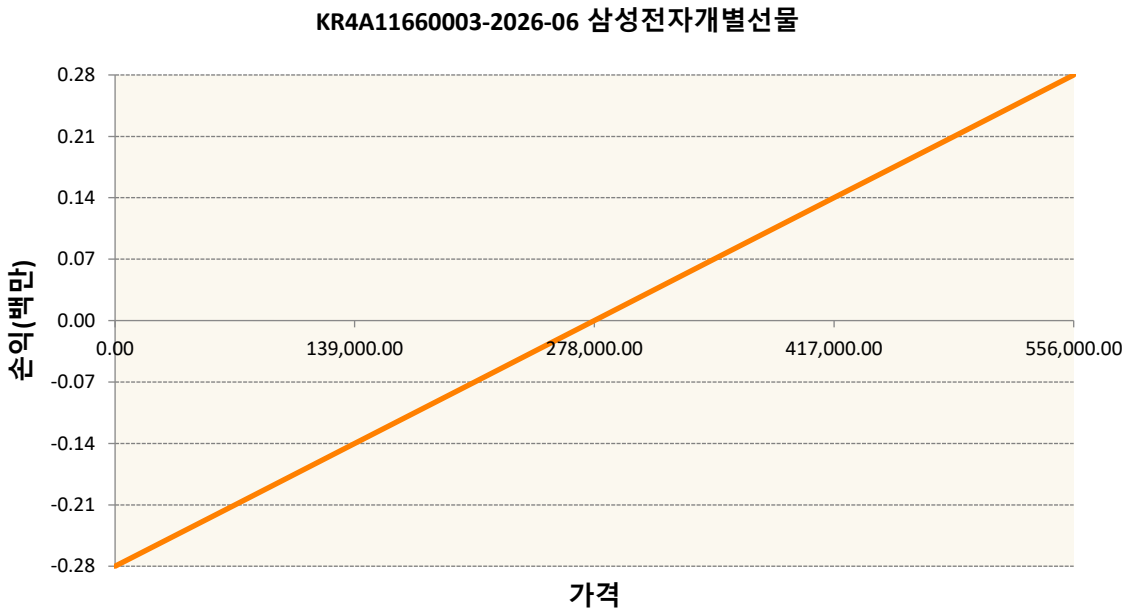
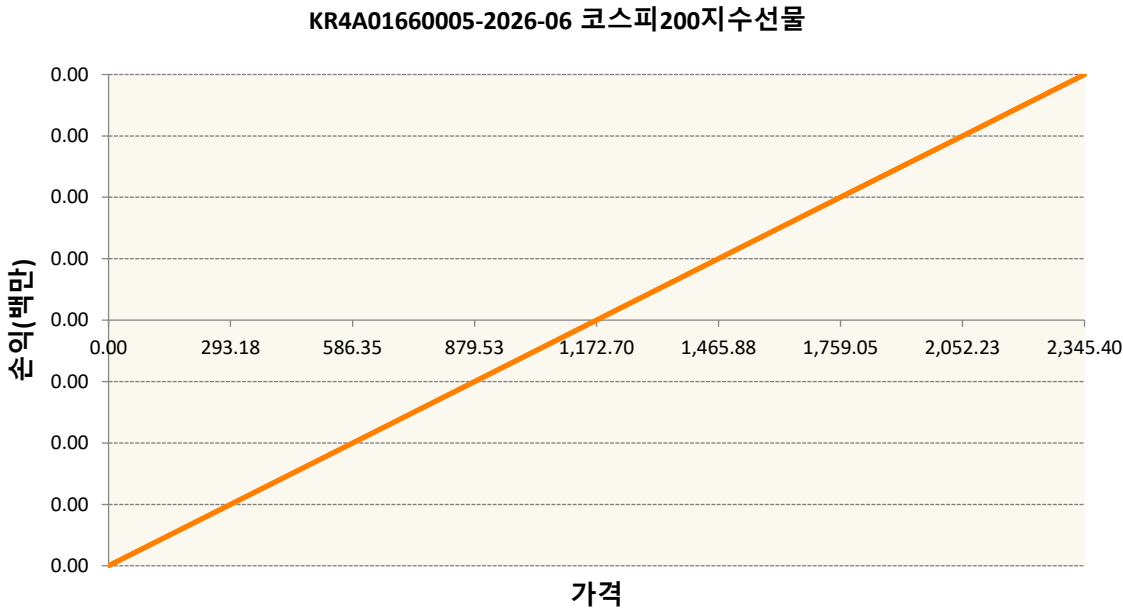
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

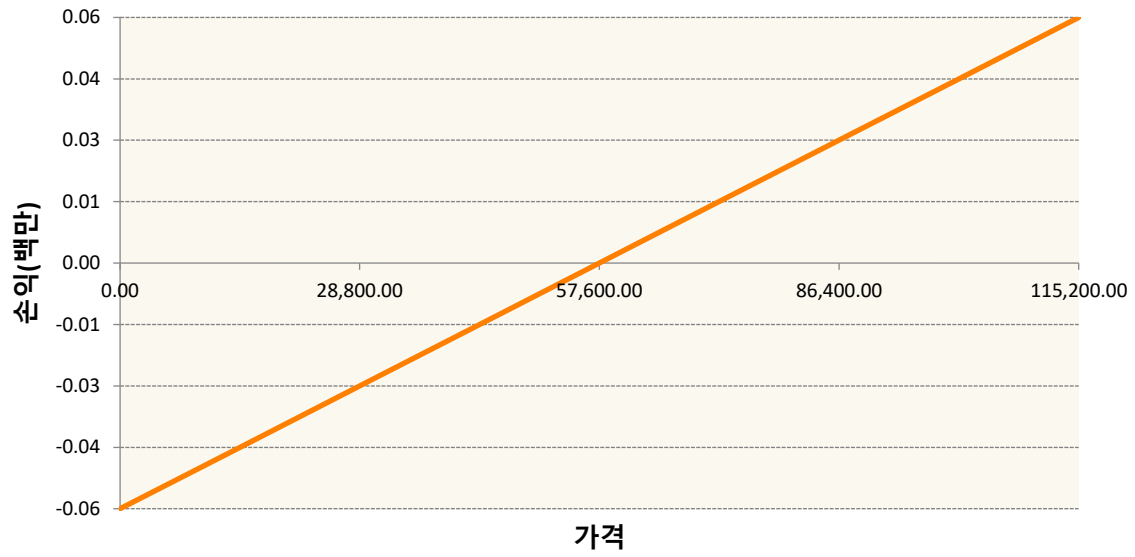
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,756	5,672	-916	장내
누계	유가증권	선물	20,257	3,514	16,743	장내

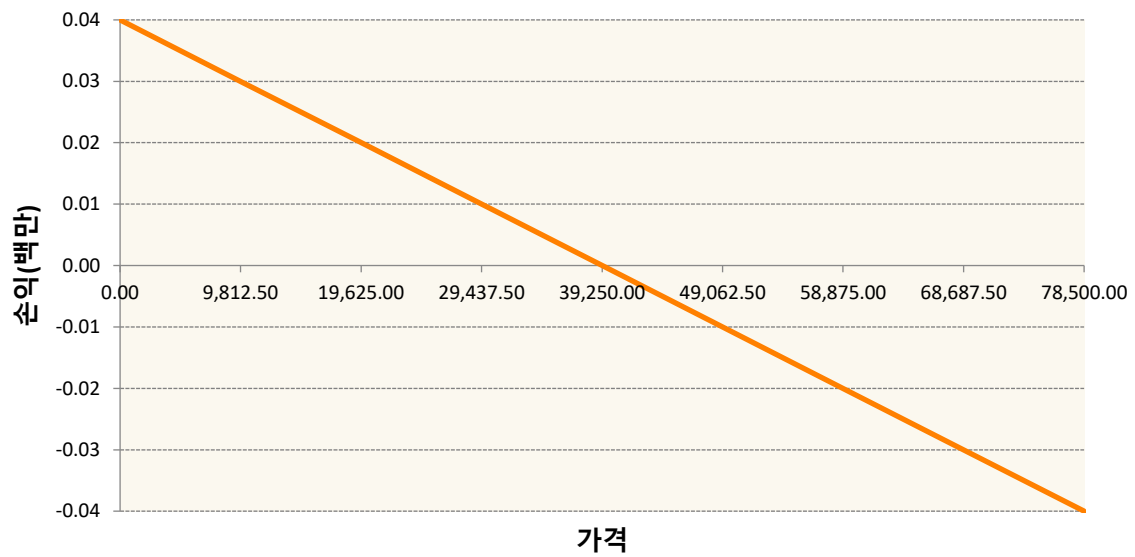
2. 만기시점의 손익구조



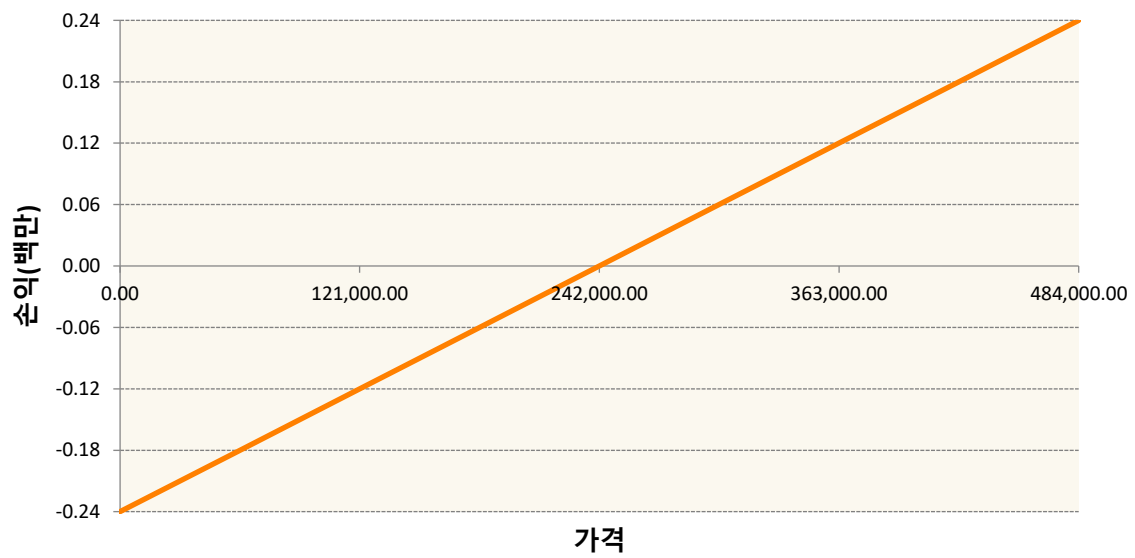
KR4A14660000-2026-06 KT개별선물



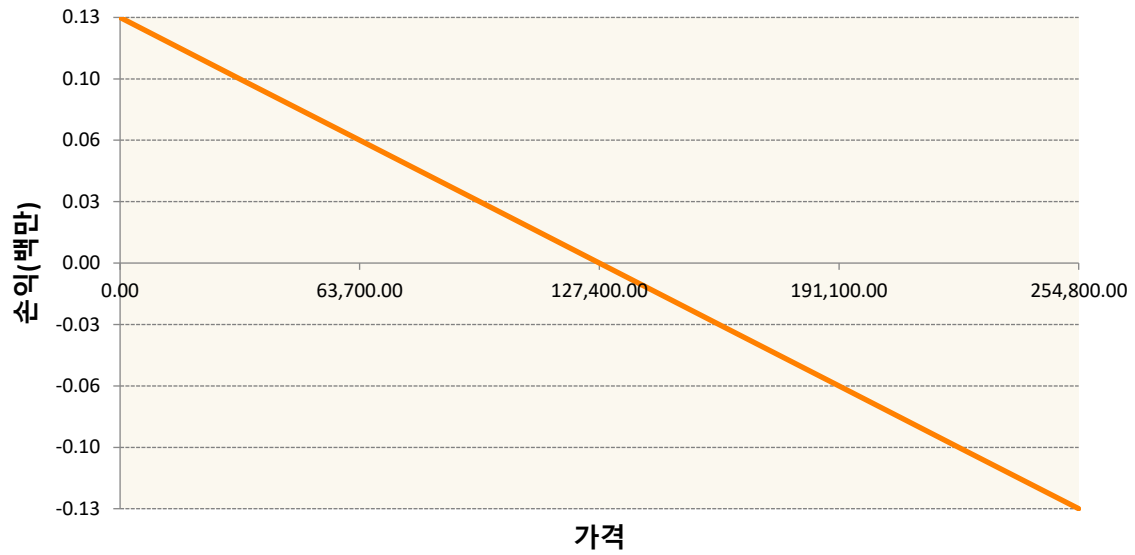
KR4A15660009-2026-06 한국전력개별선물



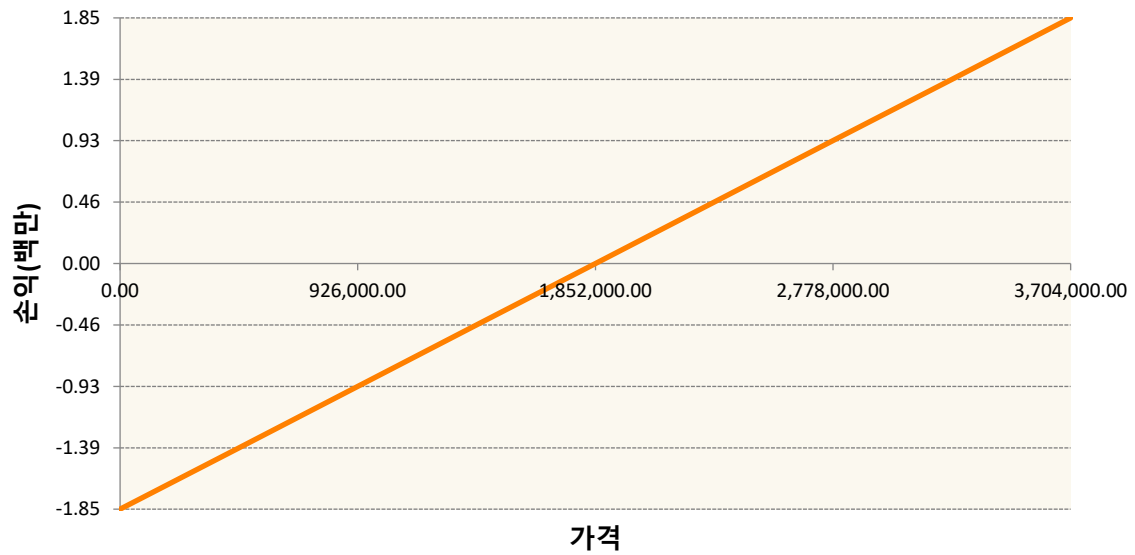
KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



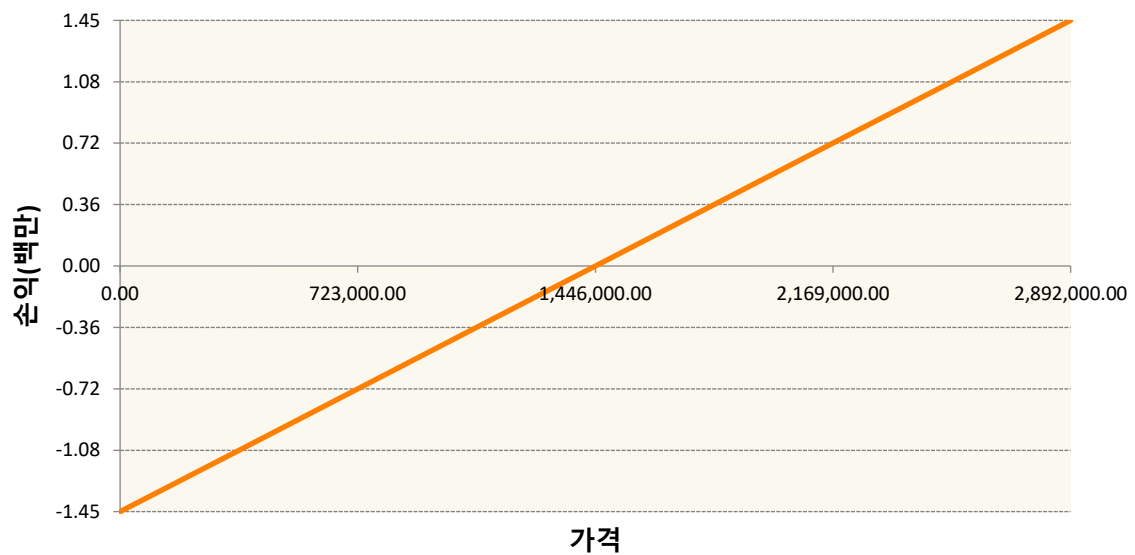
KR4A34660006-2026-06 LG개별선물



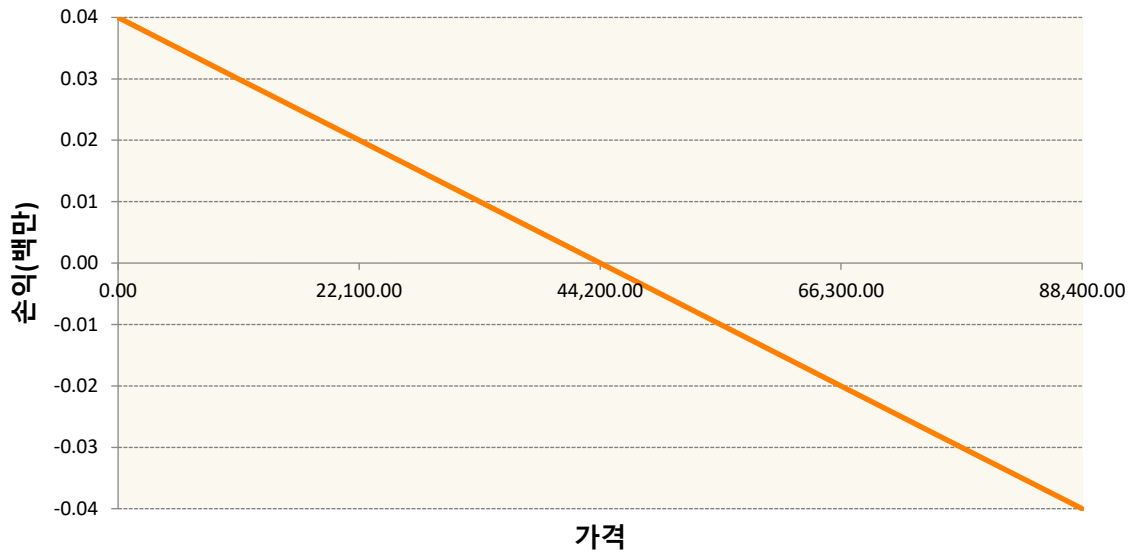
KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



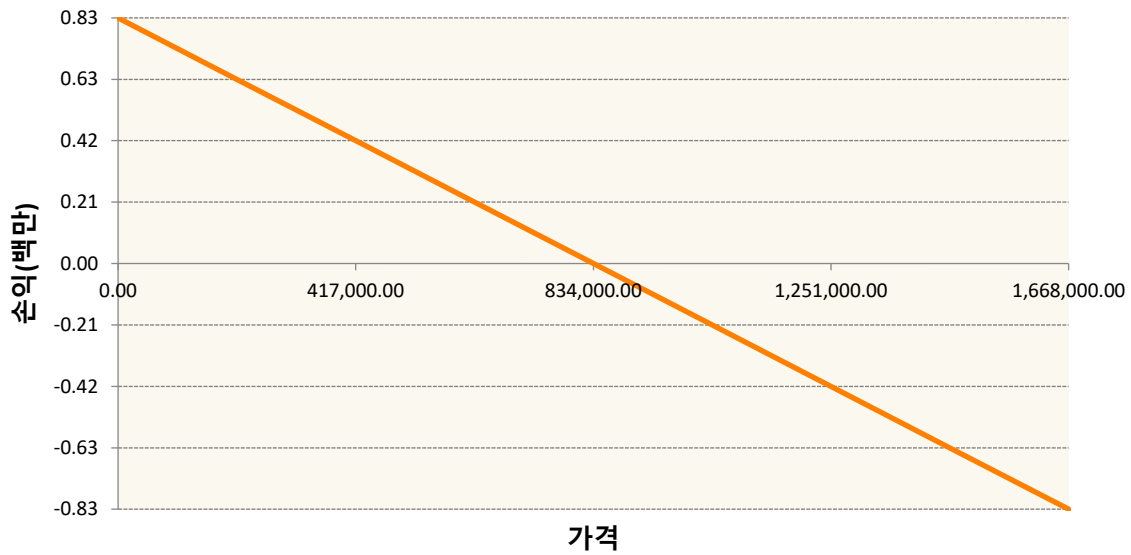
KR4AB3660001-2026-06 고려아연개별선물



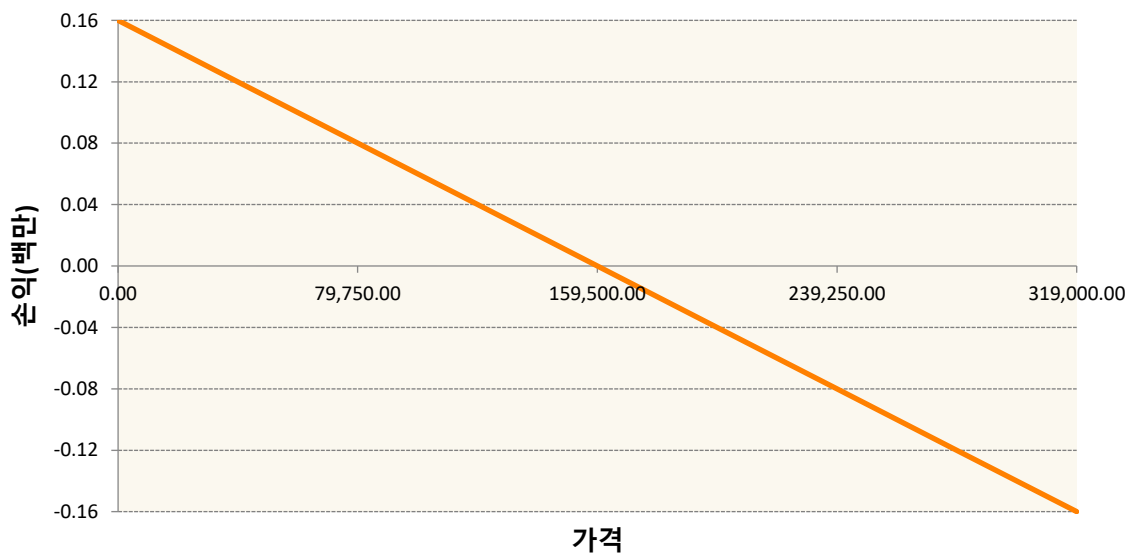
KR4ACF660005-2026-06 카카오개별선물



KR4ADB660008-2026-06 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선



KR4AFM660003-2026-06 엘앤에프개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		1,162	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162	-1,162			
-5.33%	-775	-775	-775	-775	-775	-775	-775			
-2.67%	-387	-387	-387	-387	-387	-387	-387			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	387	387	387	387	387	387	387			
5.33%	775	775	775	775	775	775	775			
8.00%	1,162	1,162	1,162	1,162	1,162	1,162	1,162			
KR4A11660003							2026-06 삼성전자개별선물		224	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-224	-224	-224	-224	-224	-224	-224			
-5.33%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149			
-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%	149	149	149	149	149	149	149			
8.00%	224	224	224	224	224	224	224			
KR4A14660000							2026-06 KT개별선물		36	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36			
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24			
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	12	12	12	12	12	12	12			
5.33%	24	24	24	24	24	24	24			
8.00%	36	36	36	36	36	36	36			
KR4A15660009							2026-06 한국전력개별선물		58	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58			
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38			
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19			
5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38			
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58			
KR4A24660008							2026-06 LG전자개별선물		20	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	20	20	20	20	20	20	20

KR4A34660006

2026-06 LG개별선물

21

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	14	14	14	14	14	14	14
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21

KR4A50660005

2026-06 SK하이닉스개별선물

157

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	157	157	157	157	157	157	157

KR4AB3660001

2026-06 고려아연개별선물

2

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

KR4ACF660005

2026-06 카카오개별선물

112

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	112	112	112	112	112	112	112
-5.33%	75	75	75	75	75	75	75
-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%	-75	-75	-75	-75	-75	-75	-75
8.00%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
KR4ADB660008 2026-06 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선							63
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	63	63	63	63
-5.33%	42	42	42	42	42	42	42
-2.67%	21	21	21	21	21	21	21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
KR4AFM660003 2026-06 엘앤에프개별선물							27
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	27	27	27	27	27	27	27
-5.33%	18	18	18	18	18	18	18
-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%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
8.00%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27

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

(단위:백만원)

4,096

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

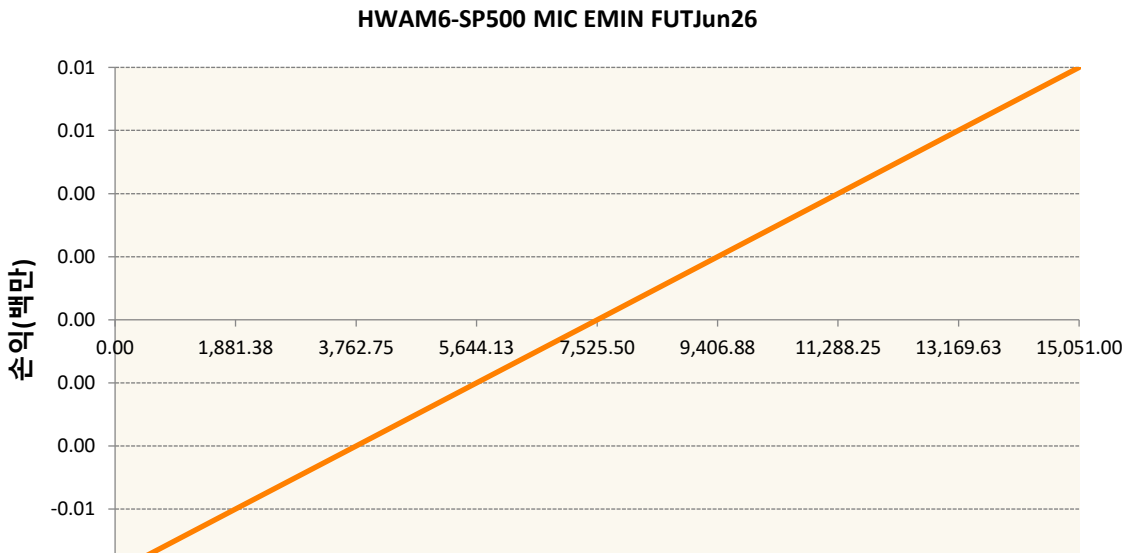
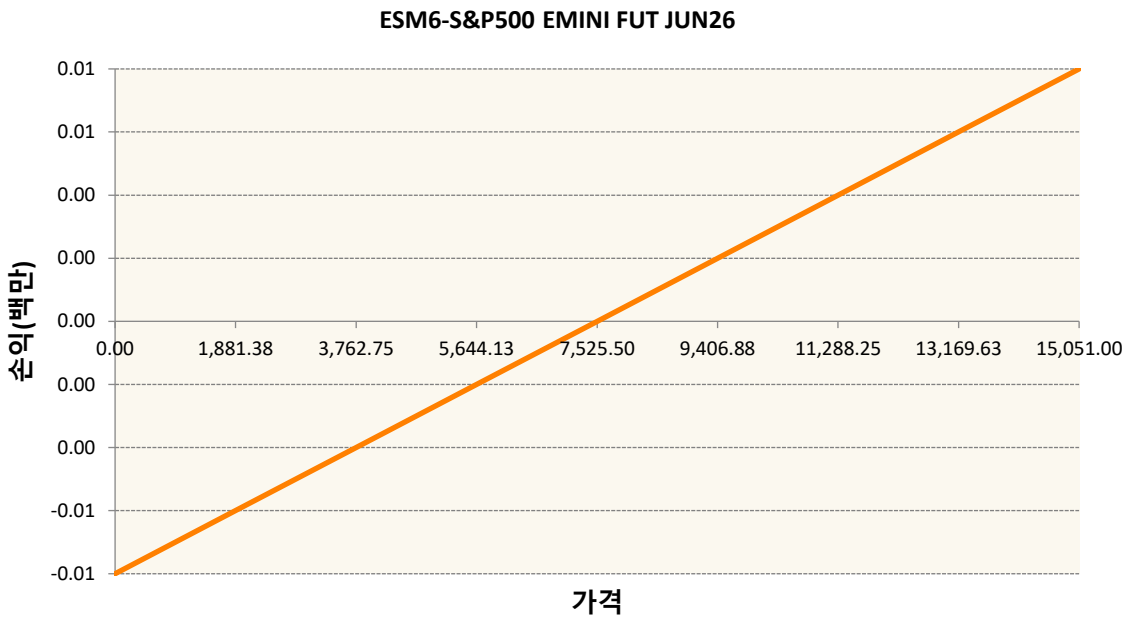
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

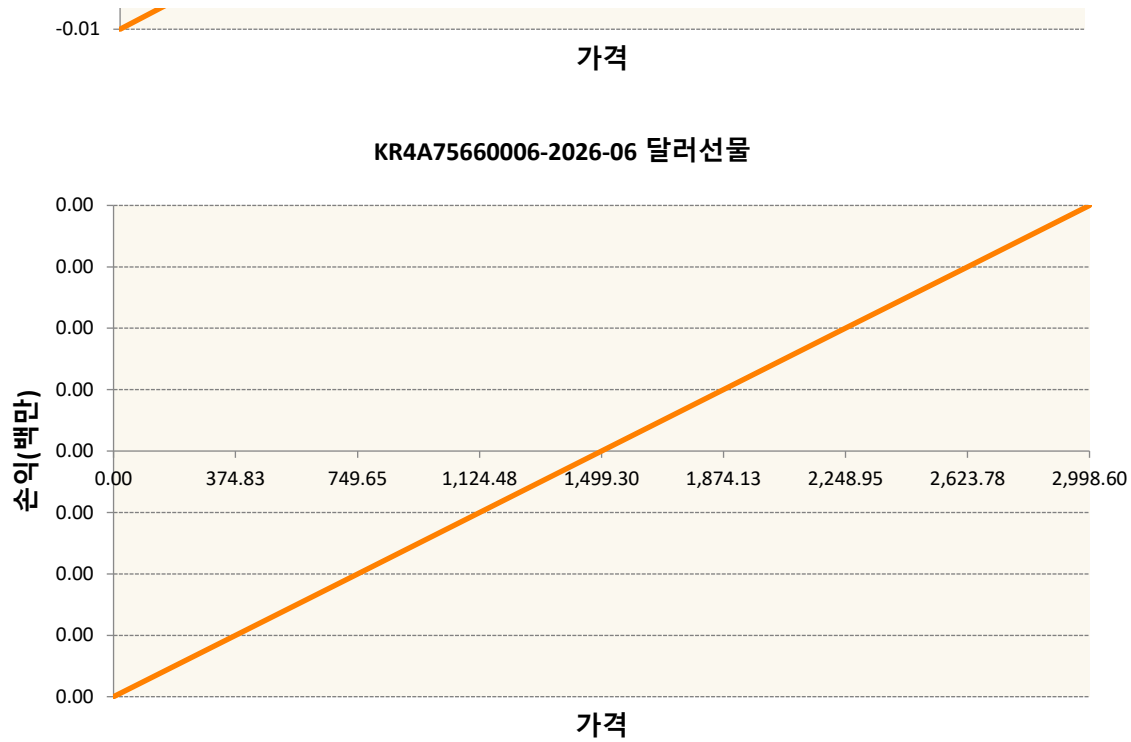
1. 계약금액

(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	60,906	0	60,906	
누계	지수	선물	281	0	281	장내
누계	통화	선물	10,645	0	10,645	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,873
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	22
KR4A756600 2026-06 달러선물		852

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

(단위:백만원)

4,275

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

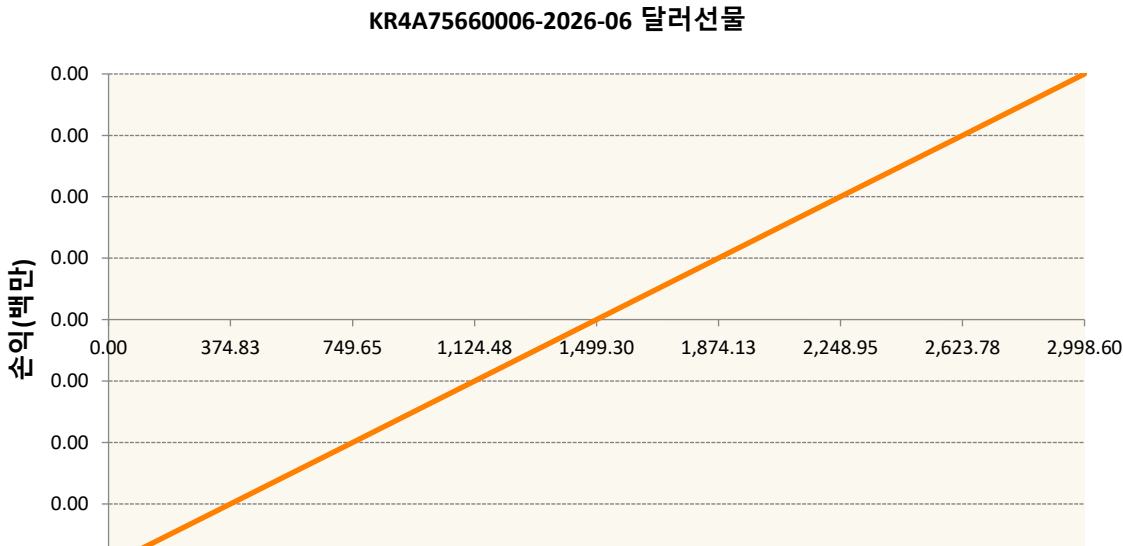
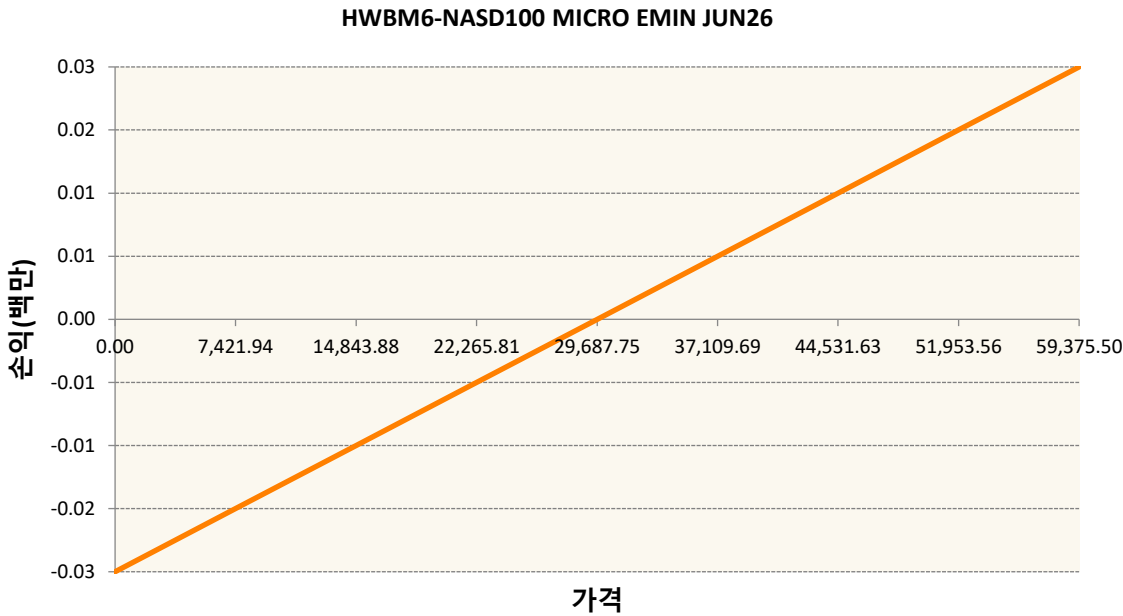
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

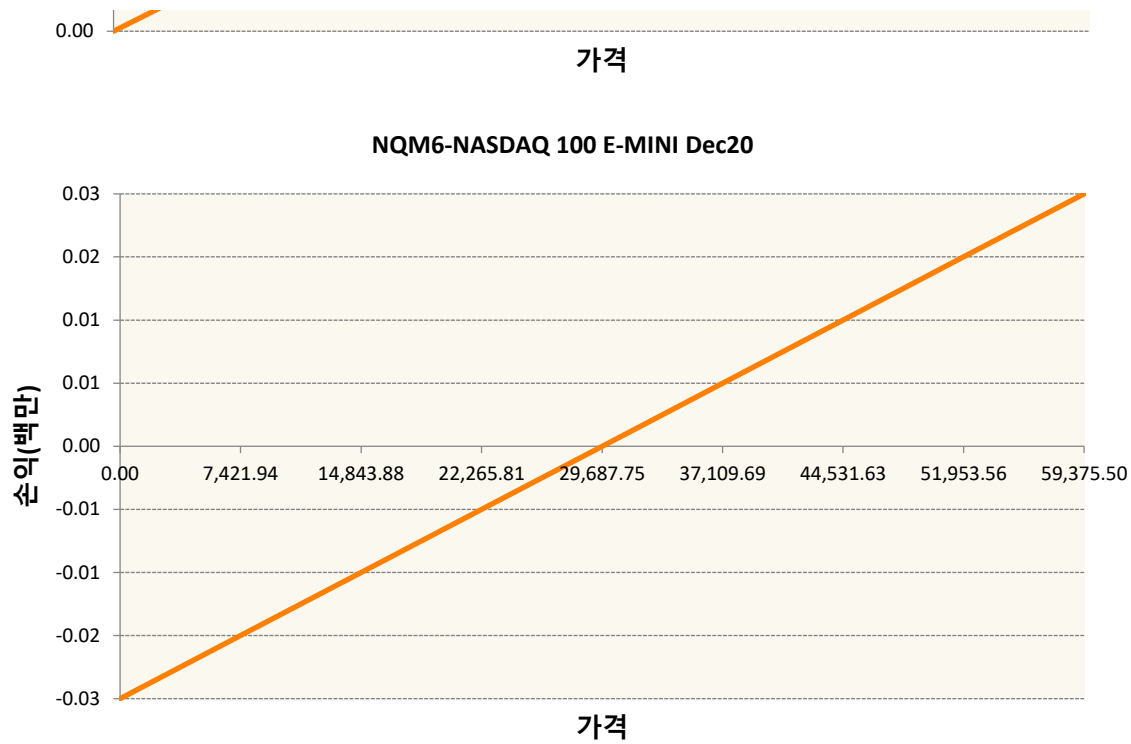
1. 계약금액

(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	30,226	0	30,226	
누계	유가증권	선물	260	0	260	장내
누계	통화	선물	3,913	0	3,913	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	21
KR4A756600	2026-06 달러선물	313
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,418

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

2,700

공시일	2026-05-18
기준일	2026-05-15

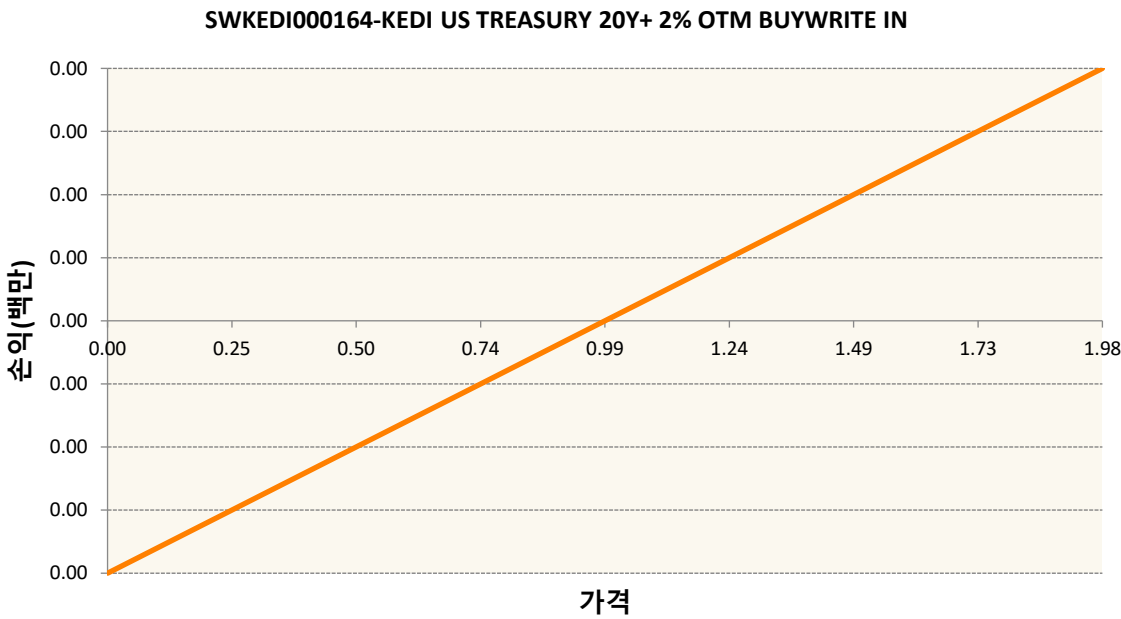
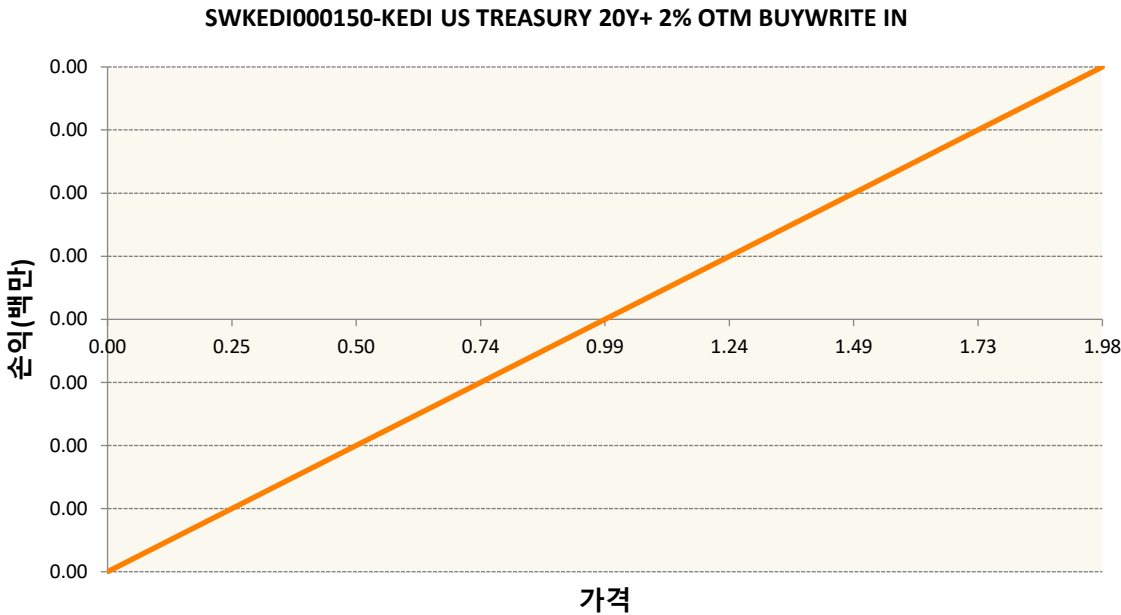
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

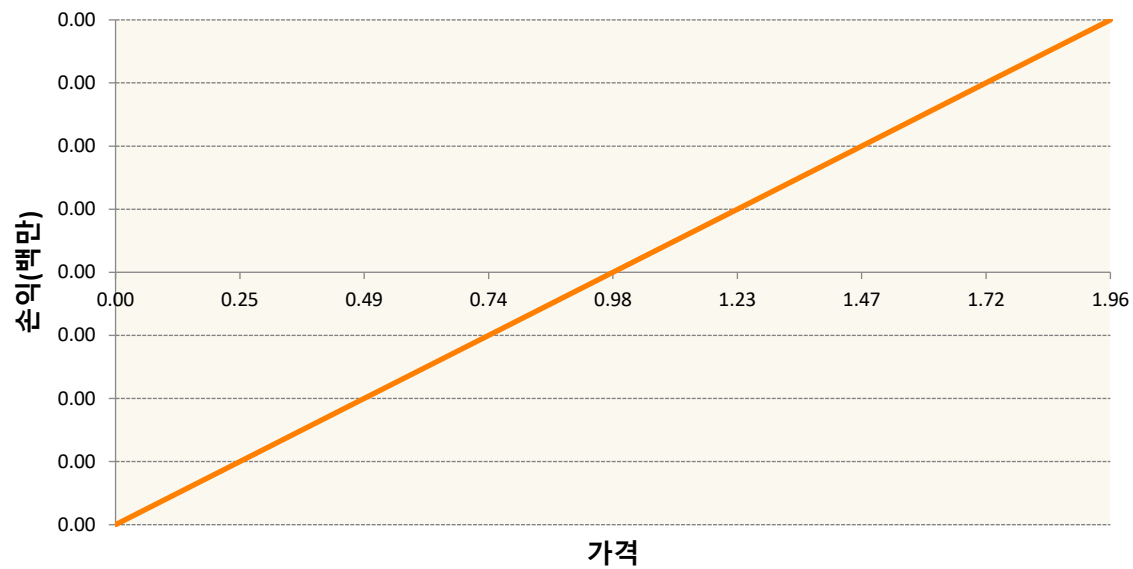
(단위:백만원)

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

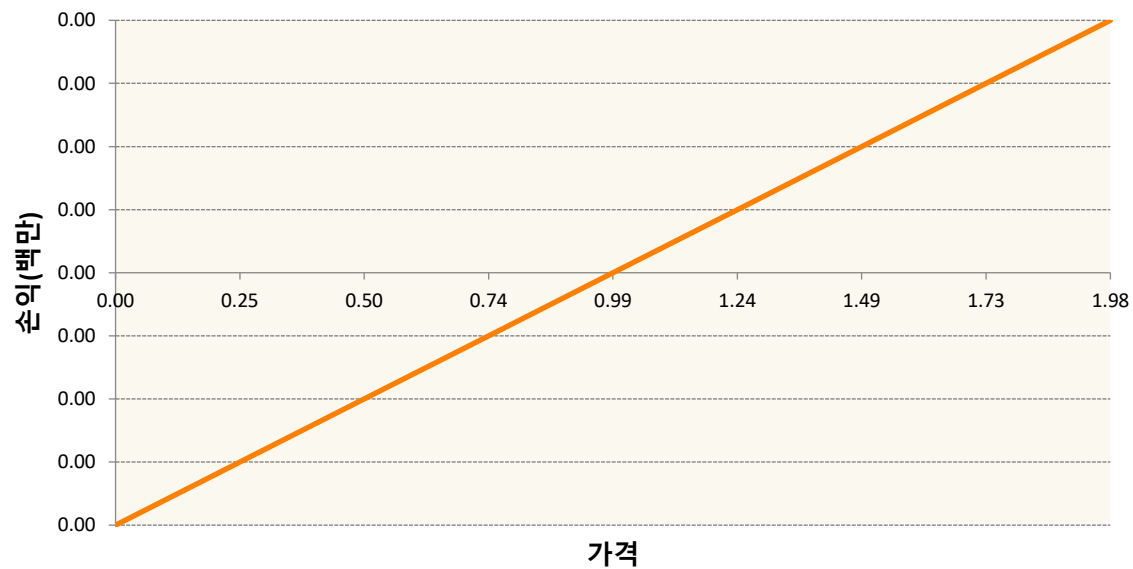
2. 만기시점의 손익구조



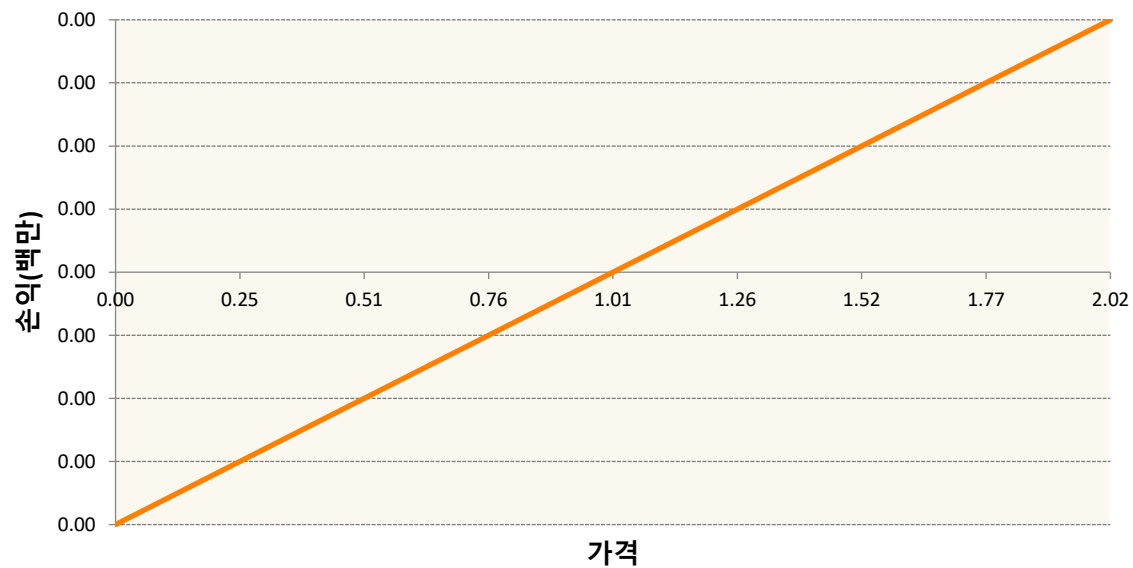
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,308
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		152
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,709
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,411
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,923

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,106