

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

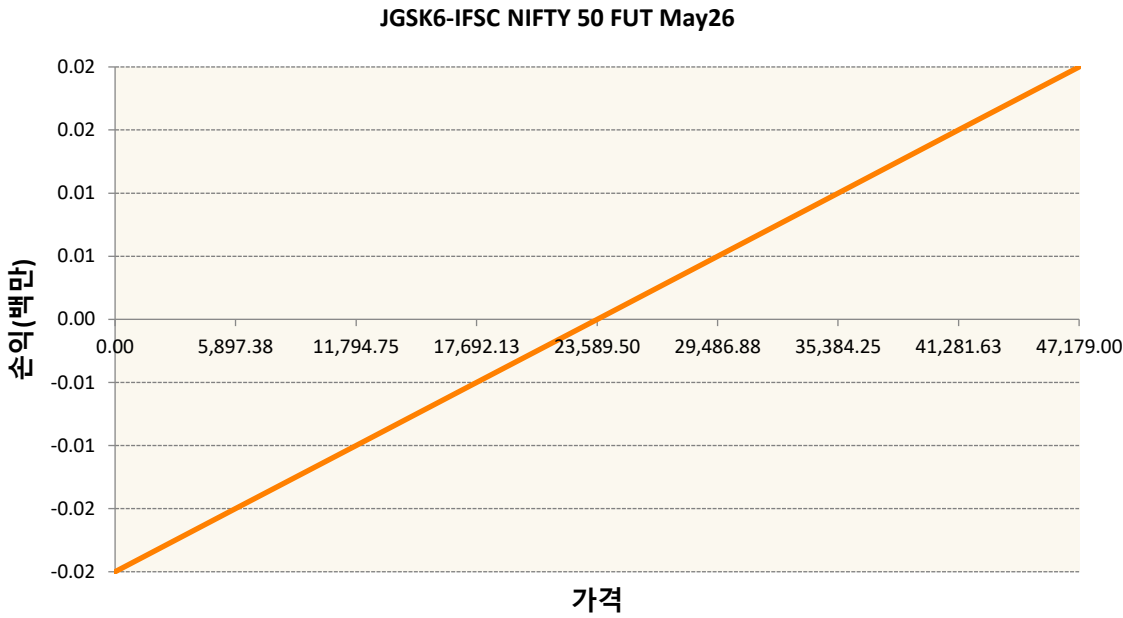
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	350	0	350	

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	2026-05-26
기준일	2026-05-22

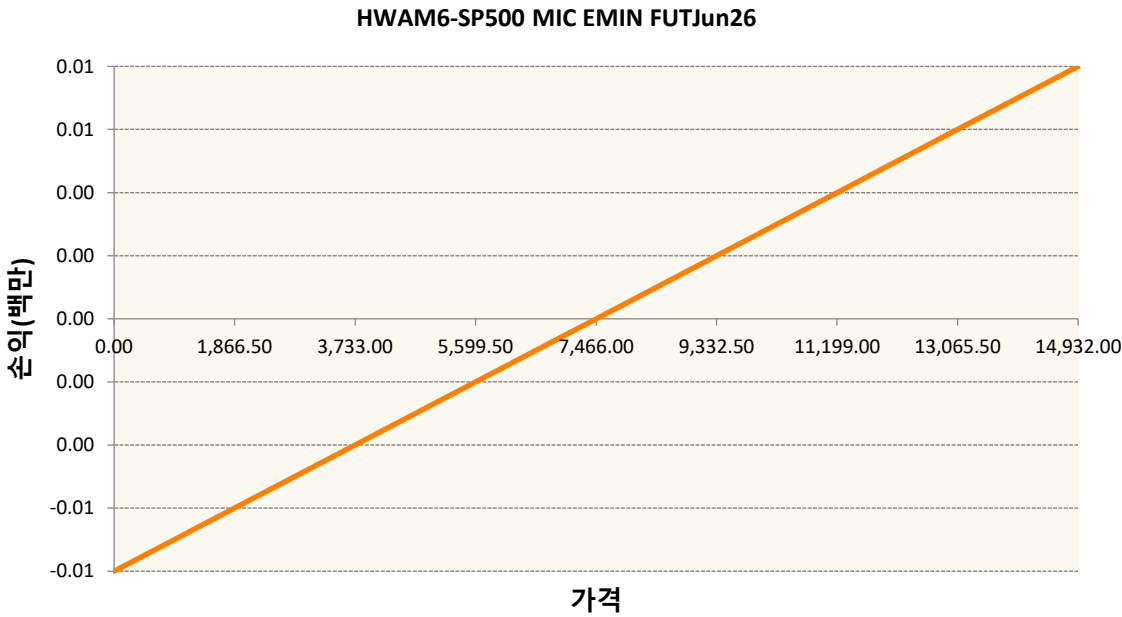
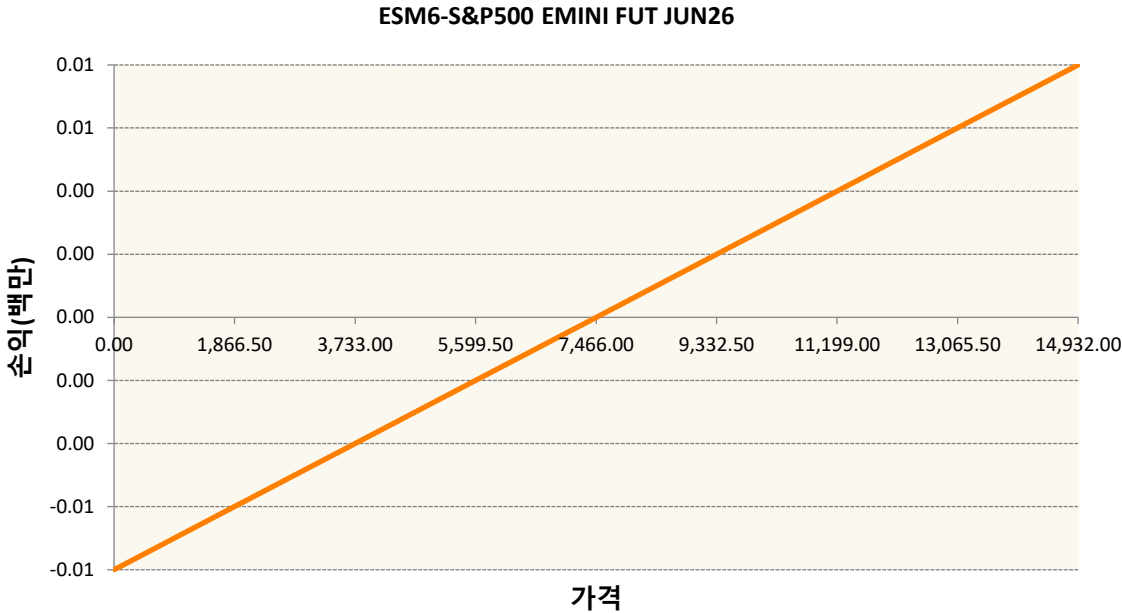
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	561	0	561	
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	2026-05-26
기준일	2026-05-22

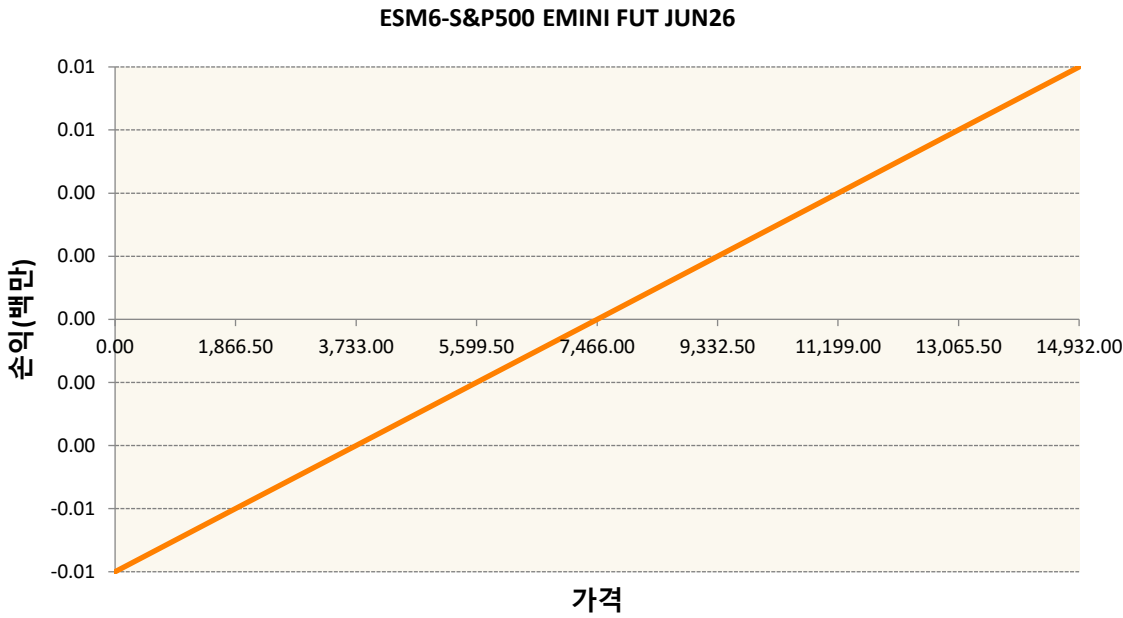
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,122	0	1,122	

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	2026-05-26
기준일	2026-05-22

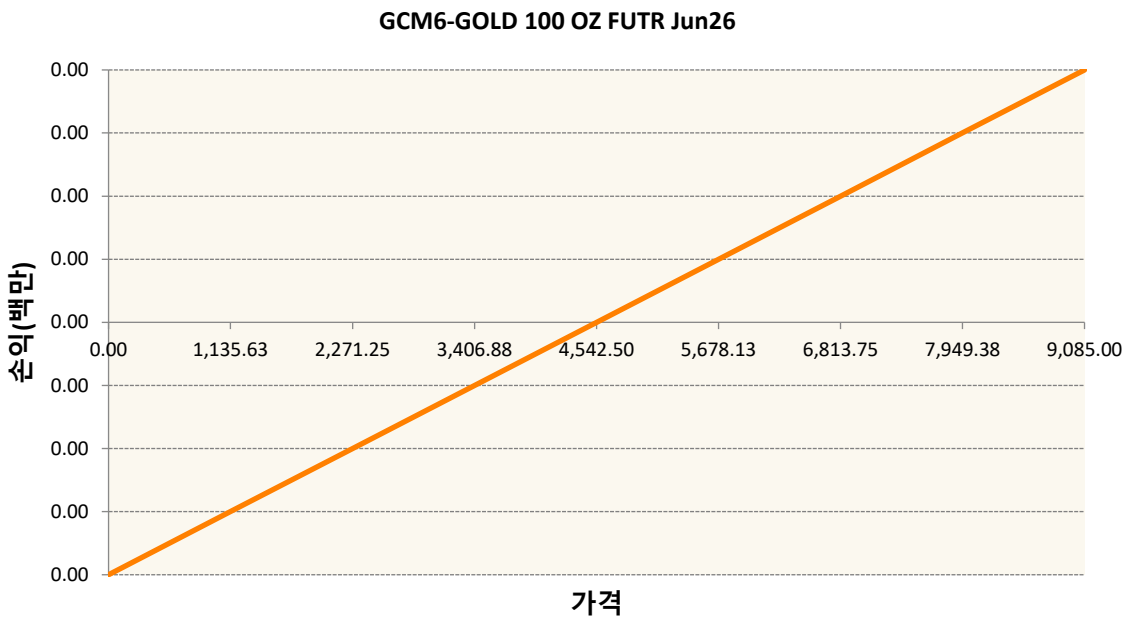
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,474	0	5,474	장내
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUC00 GLD US 05/22/26 C430 EQUITY	6
GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26	438

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

(단위:백만원)

557

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

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)

AOPLTRUSC PLTR US 05/22/26 C140 EQUITY	166
AOPLTRUSP1 PLTR US 05/22/26 P140 EQUITY	41

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

(단위:백만원)

612

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

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)

AOTLTUSC0(TLT US 05/22/26 C85 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

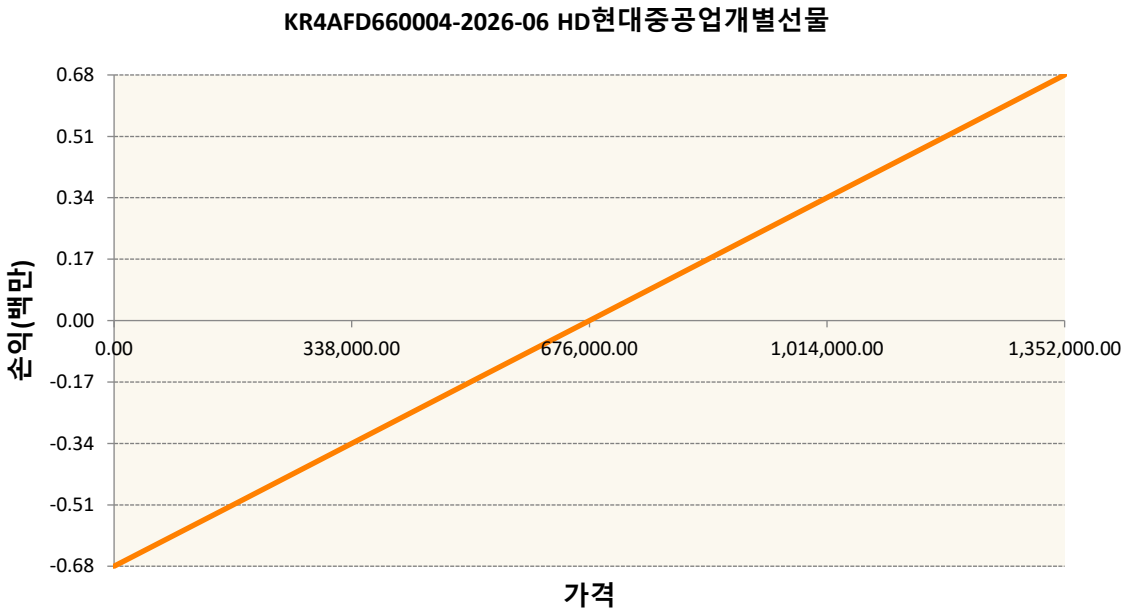
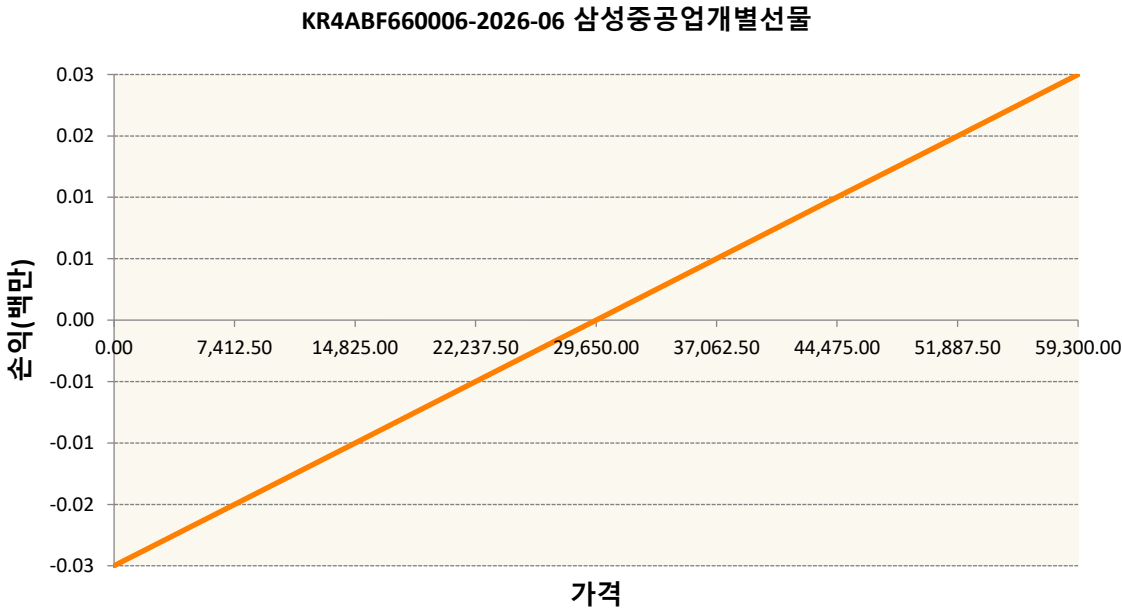
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

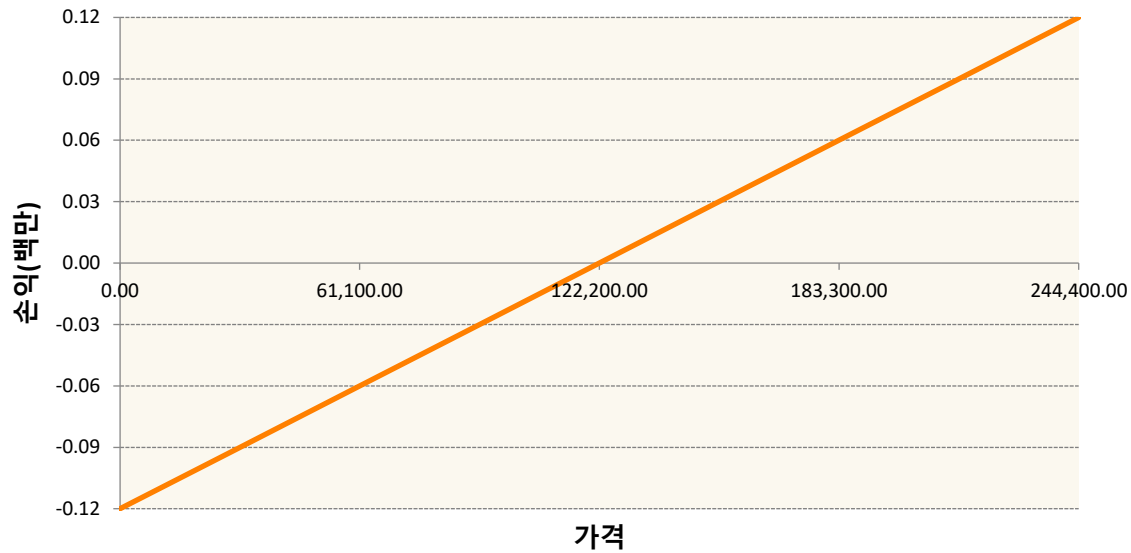
(단위:백만원)

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	18,064	0	18,064	장내
누계	유가증권	스왑	159,337	0	159,337	장외

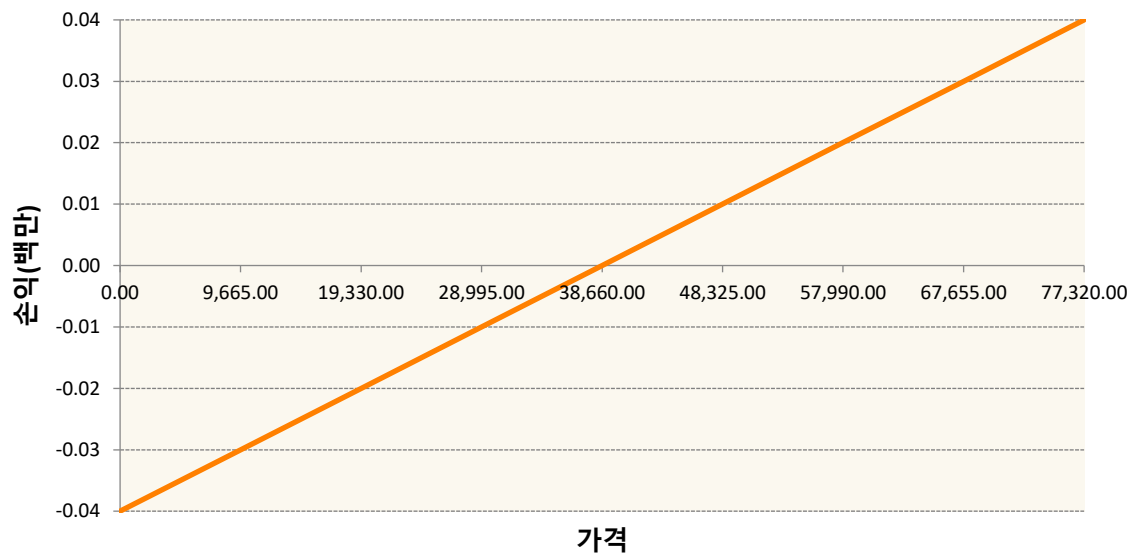
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV660002-2026-06 한화오션개별선물



KR4AM766004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF660006		2026-06 삼성중공업개별선물					420
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-420	-420	-420	-420	-420	-420	-420
-5.33%	-280	-280	-280	-280	-280	-280	-280
-2.67%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	140	140	140	140	140	140	140
5.33%	280	280	280	280	280	280	280
8.00%	420	420	420	420	420	420	420
KR4AFD660004		2026-06 HD현대중공업개별선물					737
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-737	-737	-737	-737	-737	-737	-737
-5.33%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
-2.67%	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-246
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	246	246	246	246	246	246	246
5.33%	491	491	491	491	491	491	491
8.00%	737	737	737	737	737	737	737
KR4AFV660002 2026-06 한화오션개별선물							291
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-291	-291	-291	-291	-291	-291	-291
-5.33%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
-2.67%	-97	-97	-97	-97	-97	-97	-97
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	97	97	97	97	97	97	97
5.33%	194	194	194	194	194	194	194
8.00%	291	291	291	291	291	291	291

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

(단위:백만원)

2,150

공시일 2026-05-26

기준일 2026-05-22

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	2026-05-26
기준일	2026-05-22

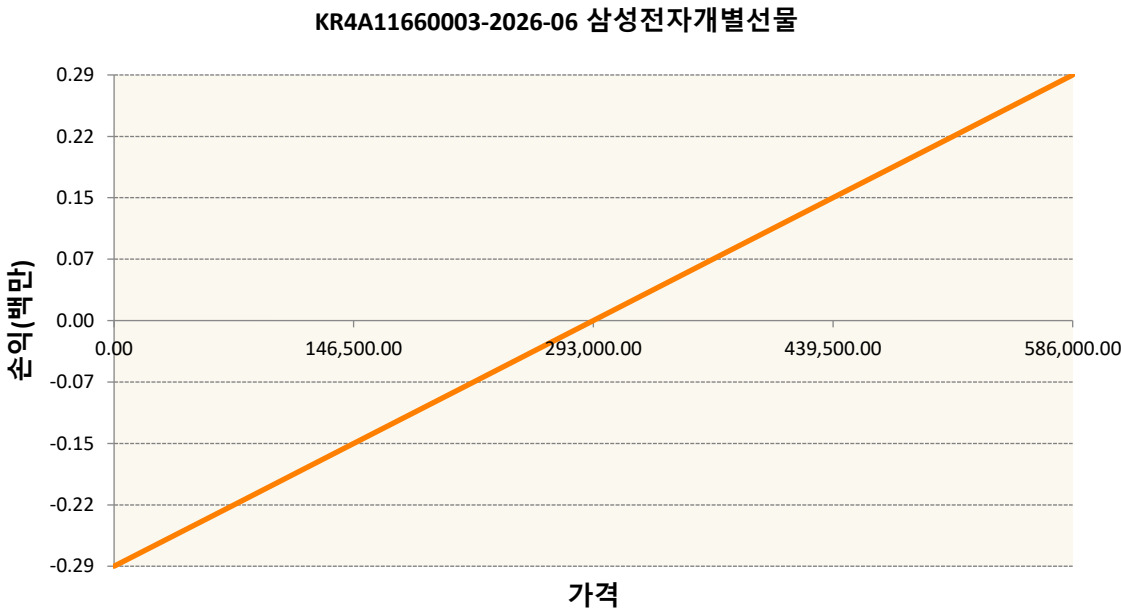
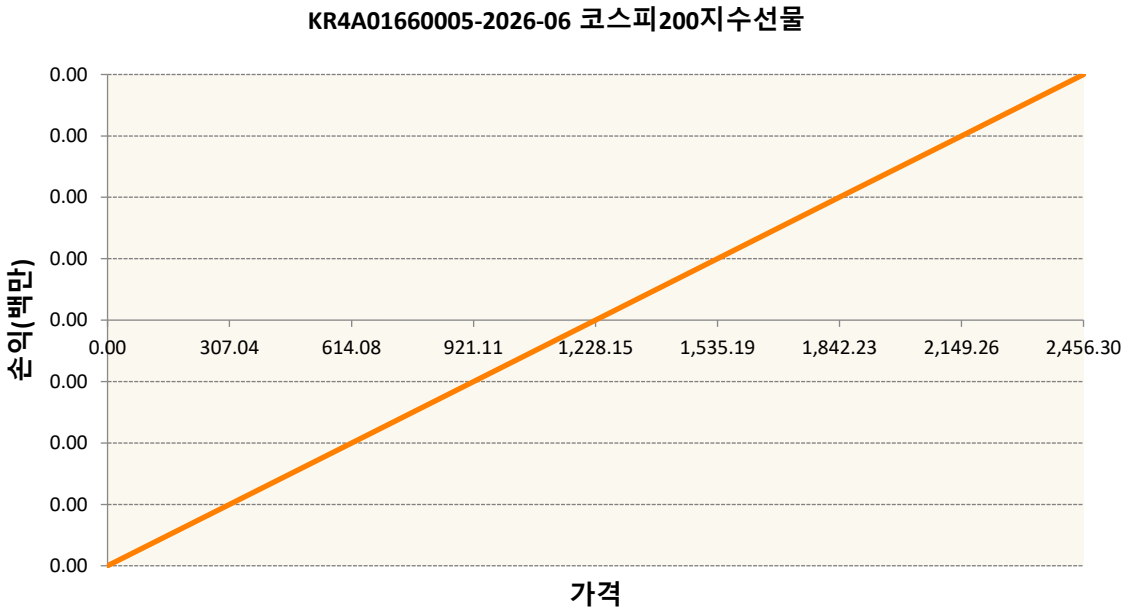
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	5,927	-5,927	장내
누계	유가증권	선물	23,805	50,983	-27,178	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 2,455.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from -1,000.00 to 1,000.00. A solid blue line represents the relationship, starting at the origin (0, 0) and ending at (2,455, -1,000). The line has a negative slope, indicating that as the price increases, the profit/loss decreases linearly.

가격	손익(백만)
0.00	0.00
306.88	-166.67
613.75	-333.33
920.63	-500.00
1,227.50	-666.67
1,534.38	-833.33
1,841.25	-1,000.00
2,148.13	-1,166.67
2,455.00	-1,333.33

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 2,460.00 with major ticks every 307.50. The y-axis represents the profit/loss, ranging from -1,000.00 to 1,000.00 with major ticks every 200.00. A blue line starts at the origin (0, 0) and slopes downward, ending at (2,460, -1,000). This indicates that as the price increases, the profit/loss decreases linearly.

가액	손익(백만)
0.00	0.00
307.50	-166.67
615.00	-333.33
922.50	-500.00
1,230.00	-666.67
1,537.50	-833.33
1,845.00	-1,000.00
2,152.50	-1,166.67
2,460.00	-1,333.33

(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		638	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-638	-638	-638	-638	-638	-638	-638			
-5.33%	-425	-425	-425	-425	-425	-425	-425			
-2.67%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	213	213	213	213	213	213	213			
5.33%	425	425	425	425	425	425	425			
8.00%	638	638	638	638	638	638	638			
KR4A11660003							2026-06 삼성전자개별선물		1,264	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264	-1,264
-5.33%	-842	-842	-842	-842	-842	-842	-842
-2.67%	-421	-421	-421	-421	-421	-421	-421
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	421	421	421	421	421	421	421
5.33%	842	842	842	842	842	842	842
8.00%	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264	1,264
KR4BAFBEA925 코스피위클리M C 2605W4 1,227.5							2,428

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,428	2,428	2,428	2,428	2,428	2,428	2,428
-5.33%	1,618	1,618	1,618	1,618	1,618	1,618	1,618
-2.67%	809	809	809	809	809	809	809
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-809	-809	-809	-809	-809	-809	-809
5.33%	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618	-1,618
8.00%	-2,428	-2,428	-2,428	-2,428	-2,428	-2,428	-2,428

KR4BAFBEA933 코스피위클리M C 2605W4 1,230.0							1,643
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,643	1,643	1,643	1,643	1,643	1,643	1,643
-5.33%	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095	1,095
-2.67%	548	548	548	548	548	548	548
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-548	-548	-548	-548	-548	-548	-548
5.33%	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095	-1,095
8.00%	-1,643	-1,643	-1,643	-1,643	-1,643	-1,643	-1,643

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

(단위:백만원)

14,359

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

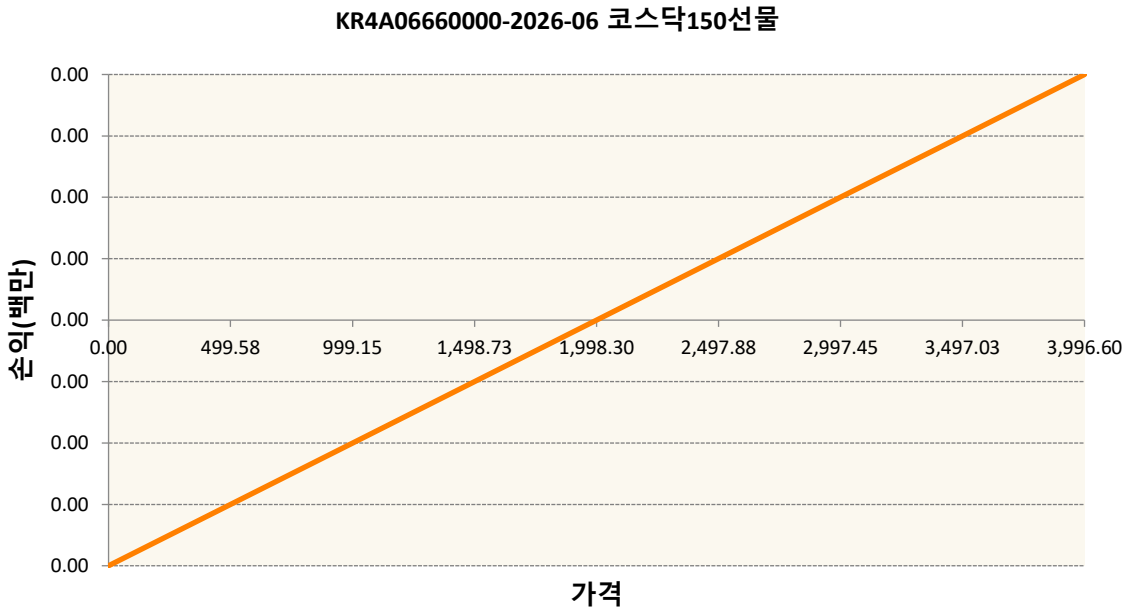
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,179	0	1,179	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06660000			2026-06 코스닥150선물				94
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
-5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-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%	63	63	63	63	63	63	63
8.00%	94	94	94	94	94	94	94

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

(단위:백만원)

224

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

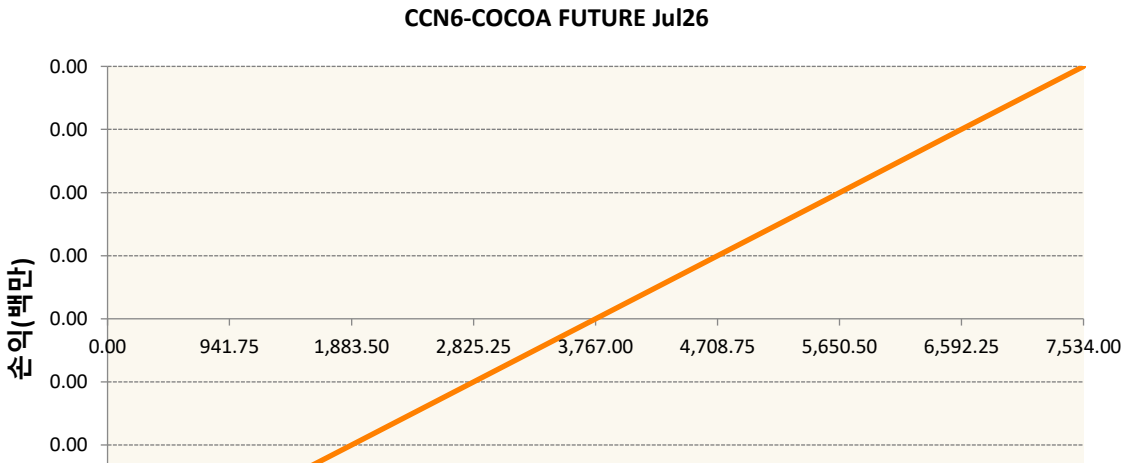
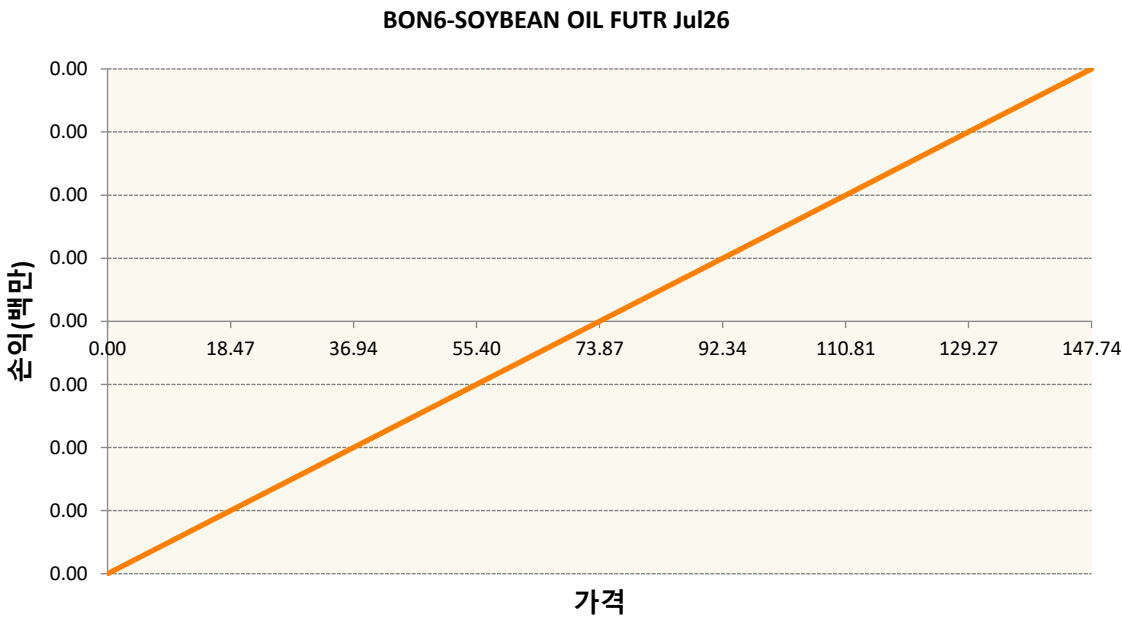
포커스농산물모(채권-파생형)

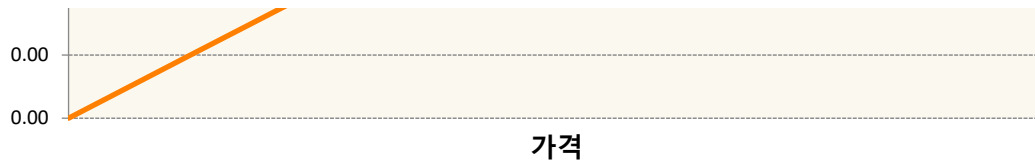
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

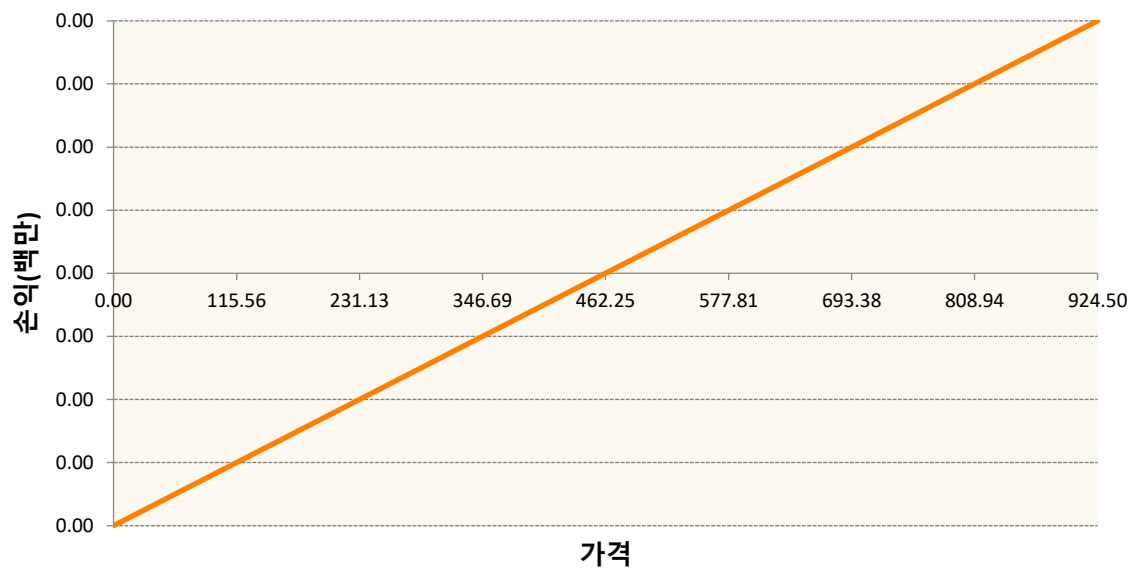
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	45	0	45	장내
누계	실물자산	선물	57	0	57	
누계	실물자산	선물	823	0	823	장내
누계	유가증권	선물	1,954	0	1,954	
누계	통화	선물	0	349	-349	장내

2. 만기시점의 손익구조

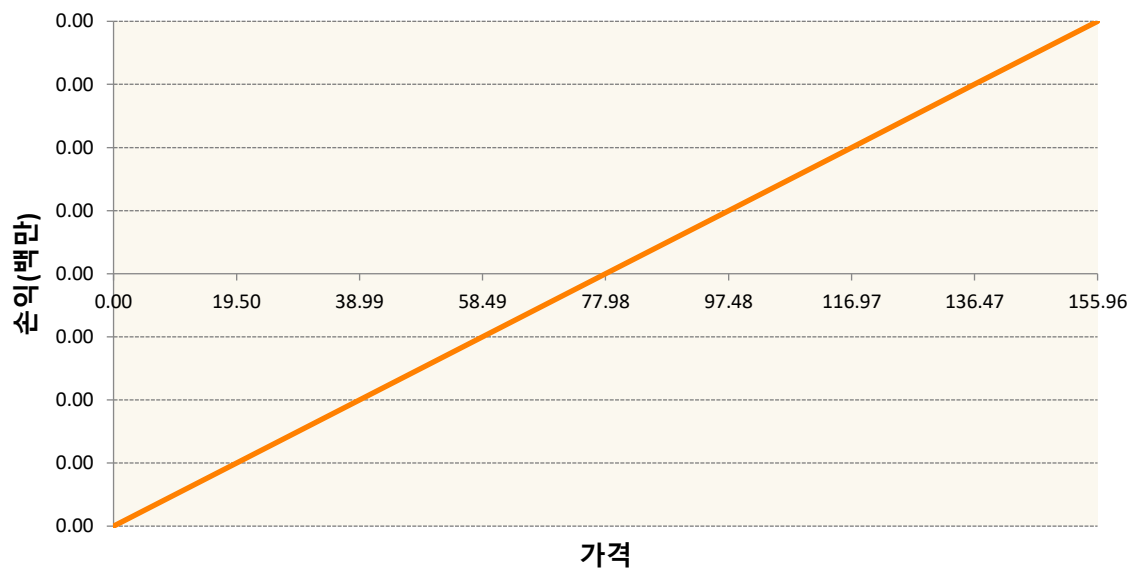




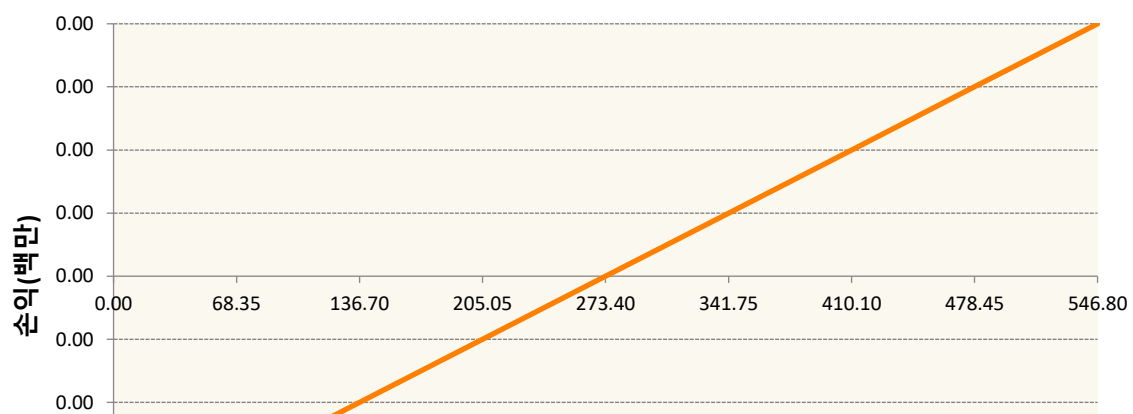
CN6-CORN FUTURE Jul26

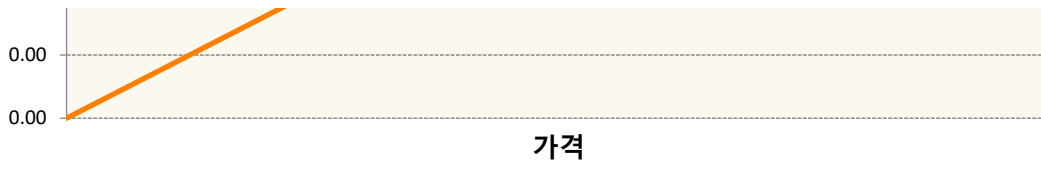


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

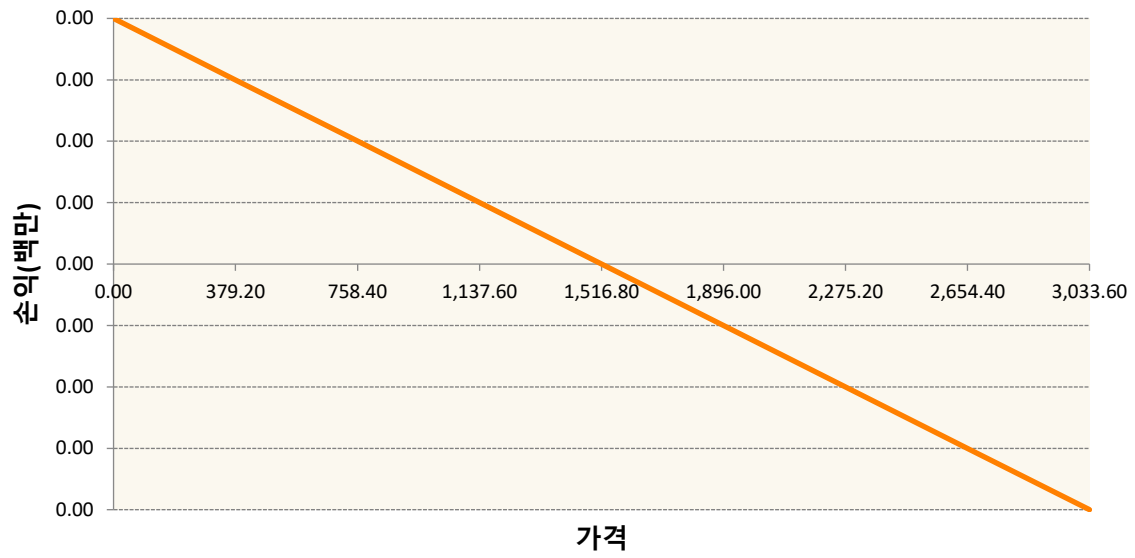


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

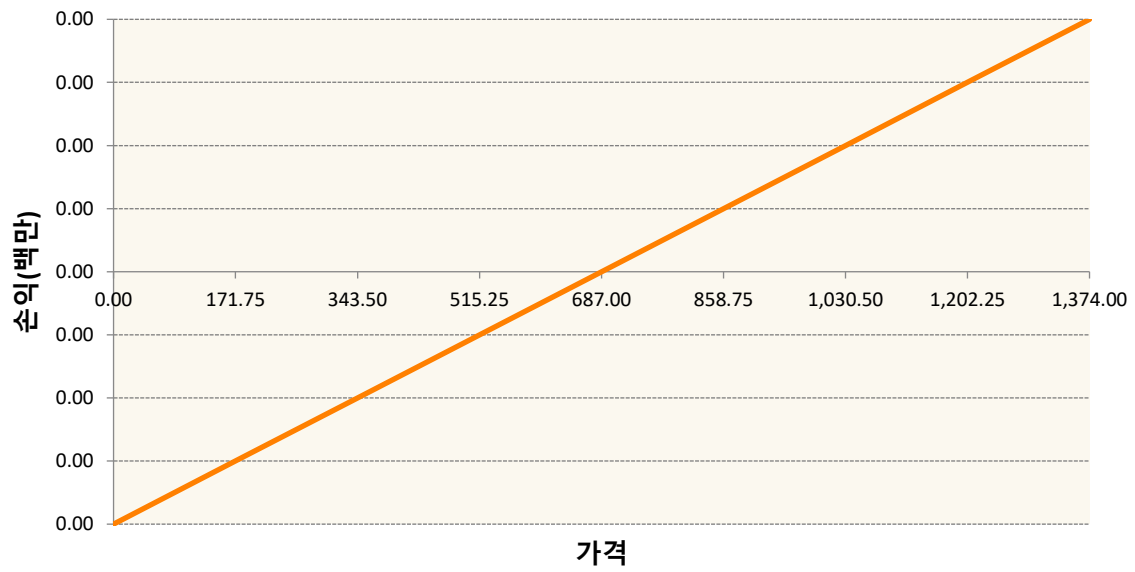




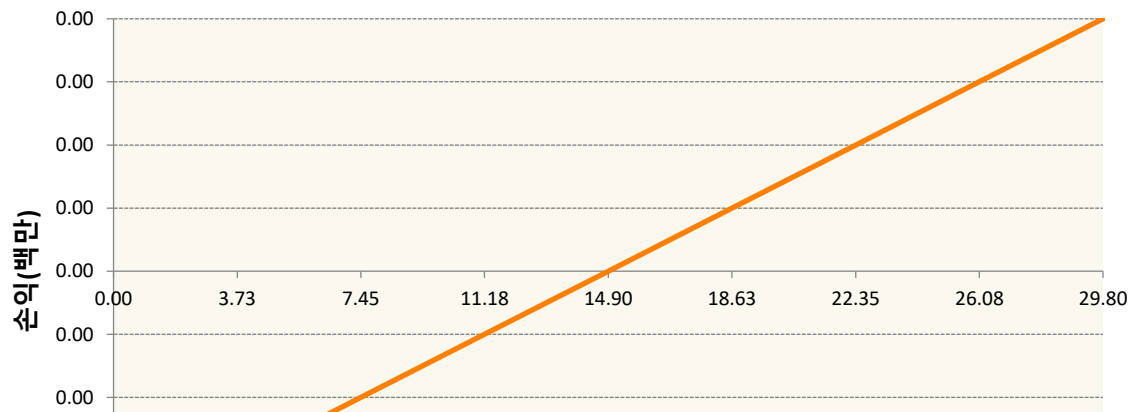
KR4A75660006-2026-06 달러선물

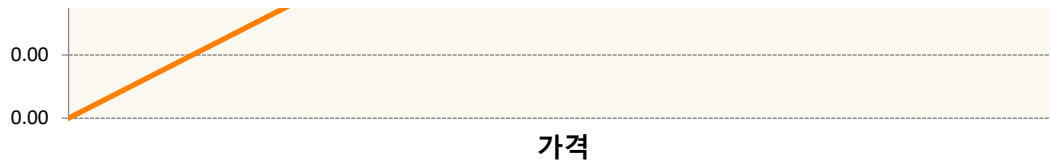


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

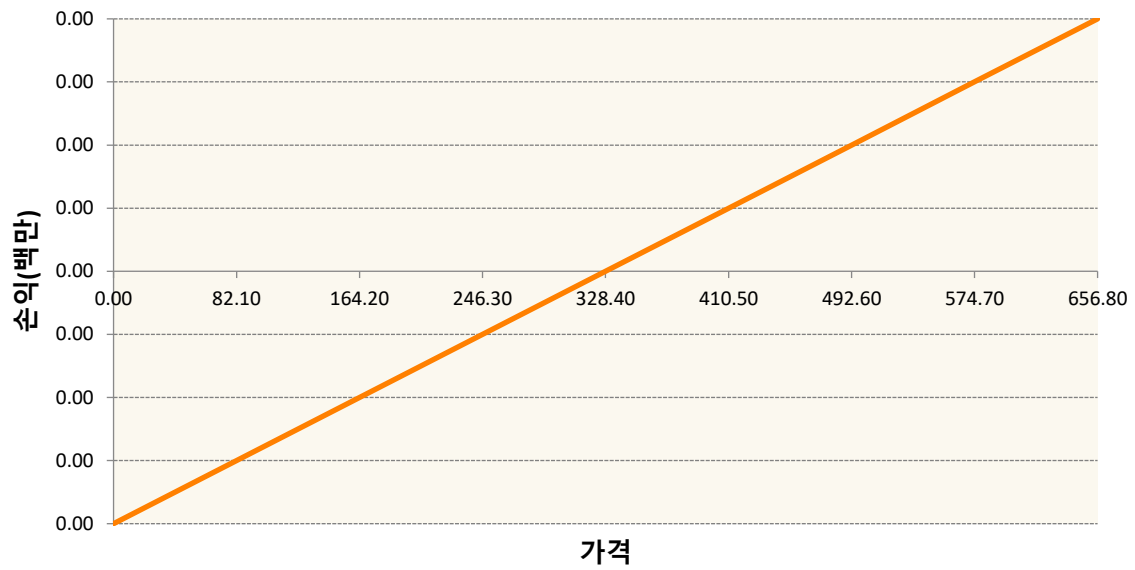


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

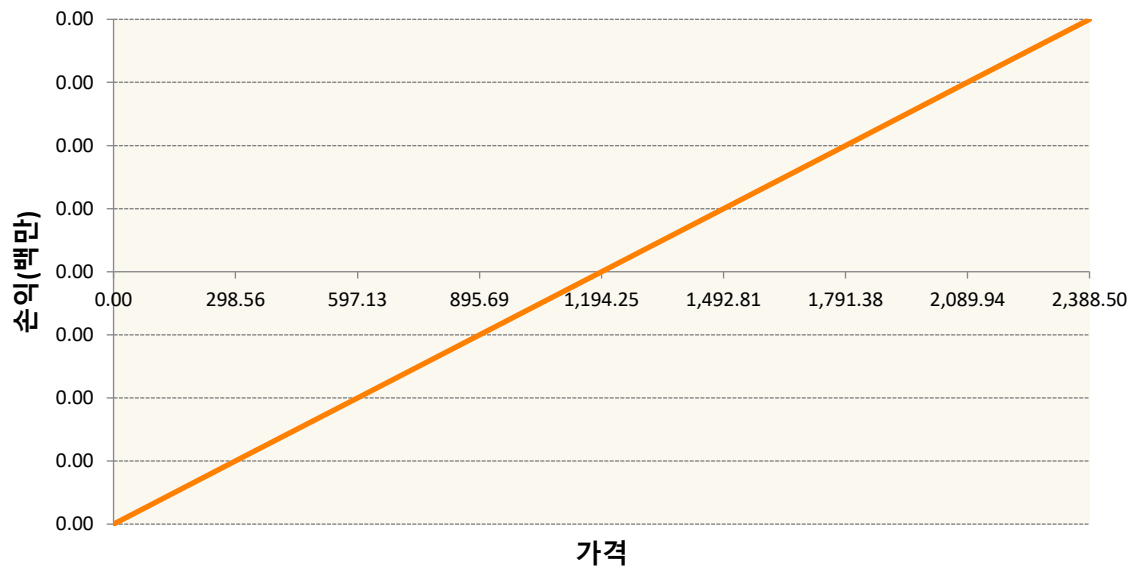




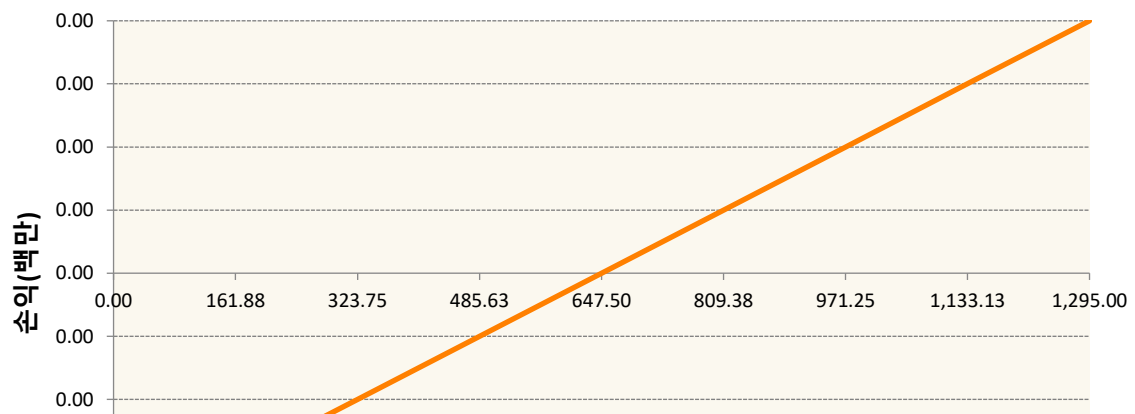
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

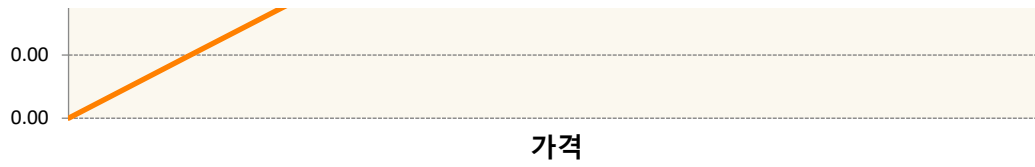


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-05-26
기준일	2026-05-22

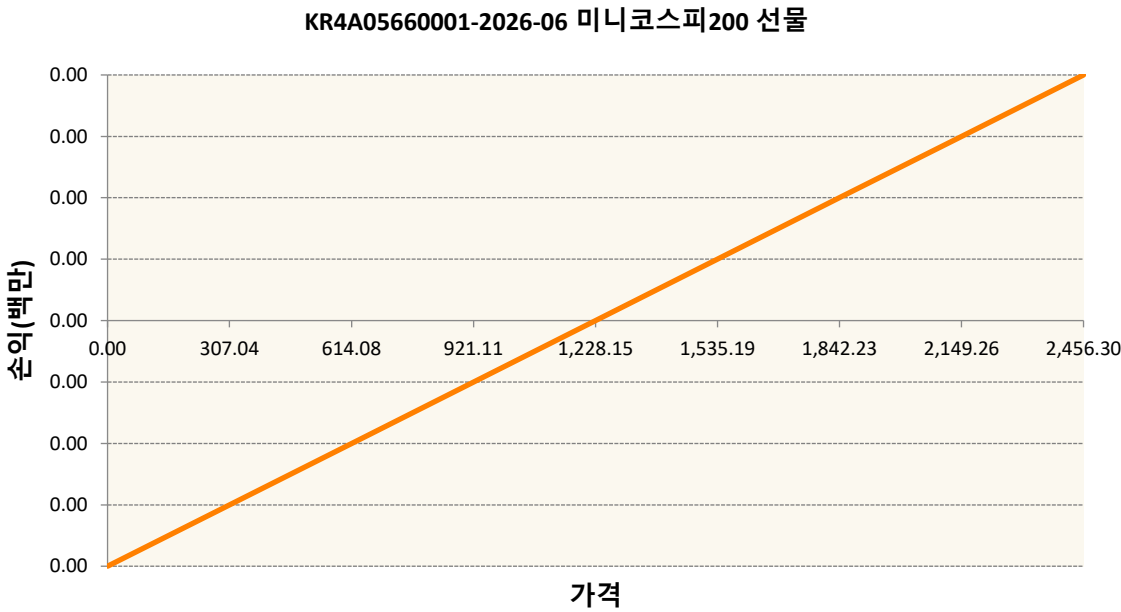
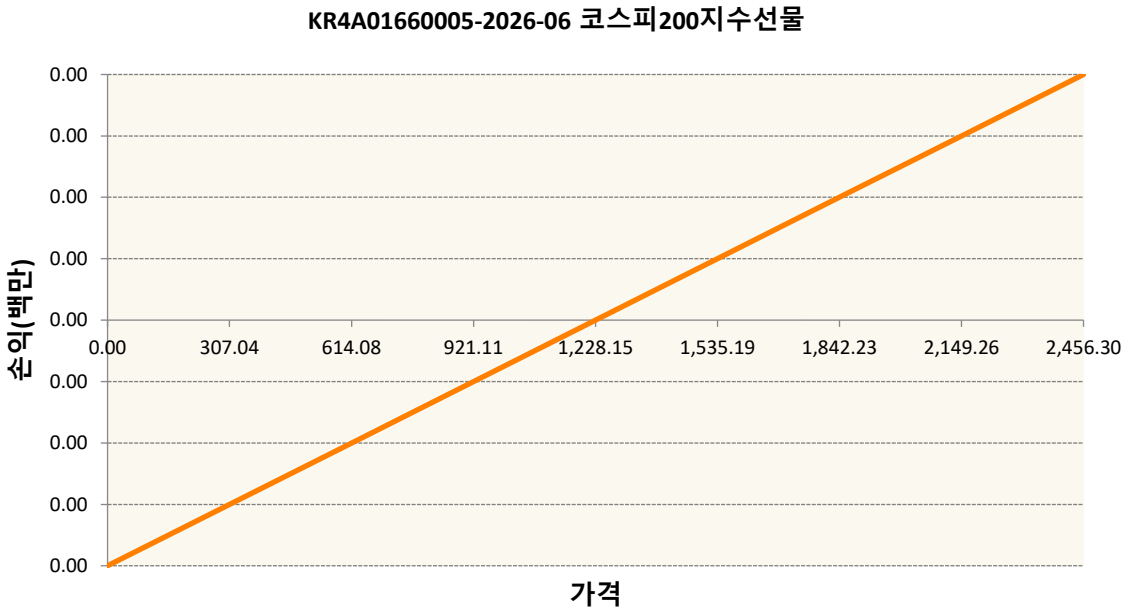
스마트인덱스모

1. 계약금액

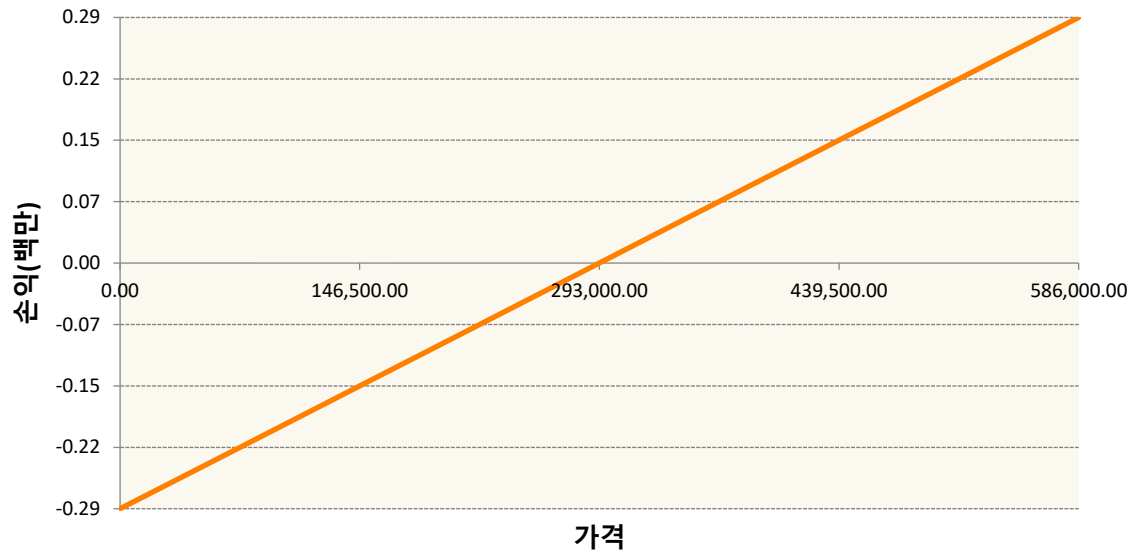
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,592	292	4,300	장내

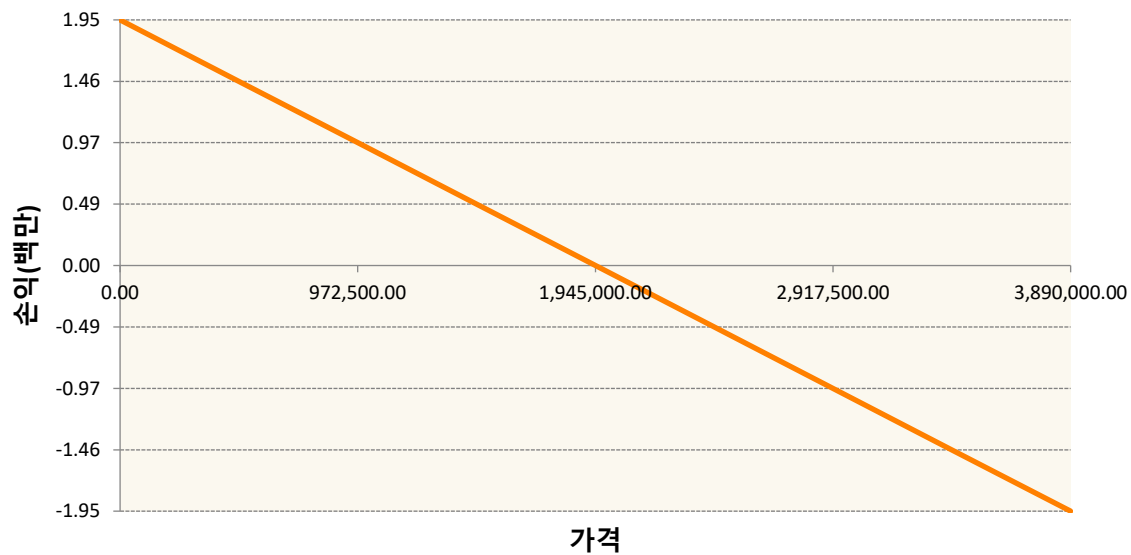
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				294
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-294	-294	-294	-294	-294	-294	-294	
-5.33%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196	
-2.67%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	98	98	98	98	98	98	98	
5.33%	196	196	196	196	196	196	196	
8.00%	294	294	294	294	294	294	294	
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

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%	-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%	23	23	23	23	23	23	23

KR4A50660005

2026-06 SK하이닉스개별선물

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%	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%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23

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

(단위:백만원)

842

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

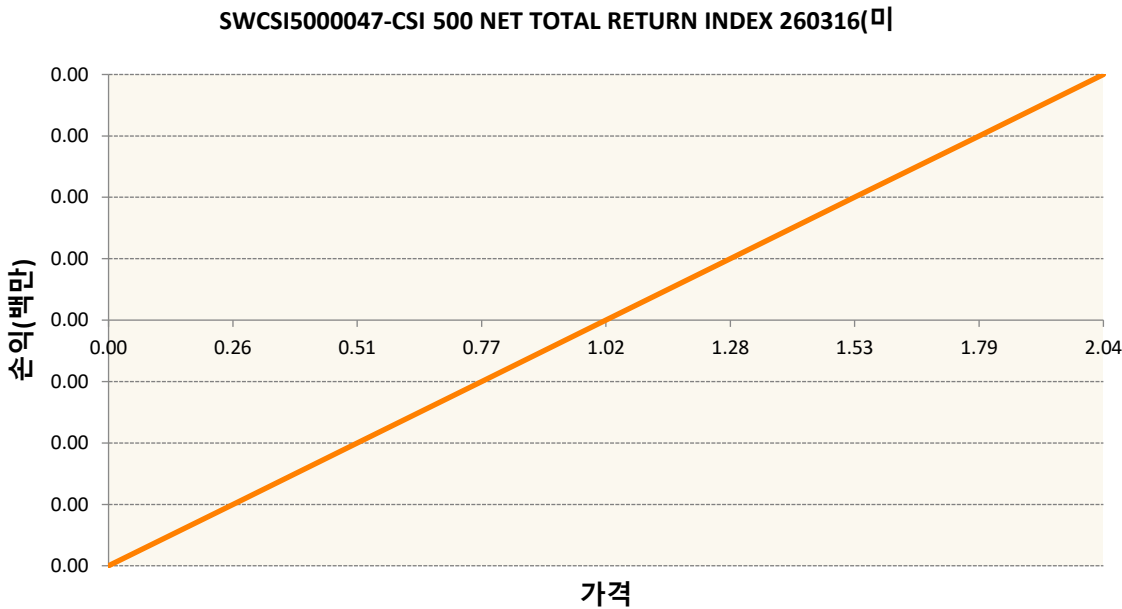
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,756	0	5,756	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

461

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

582

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

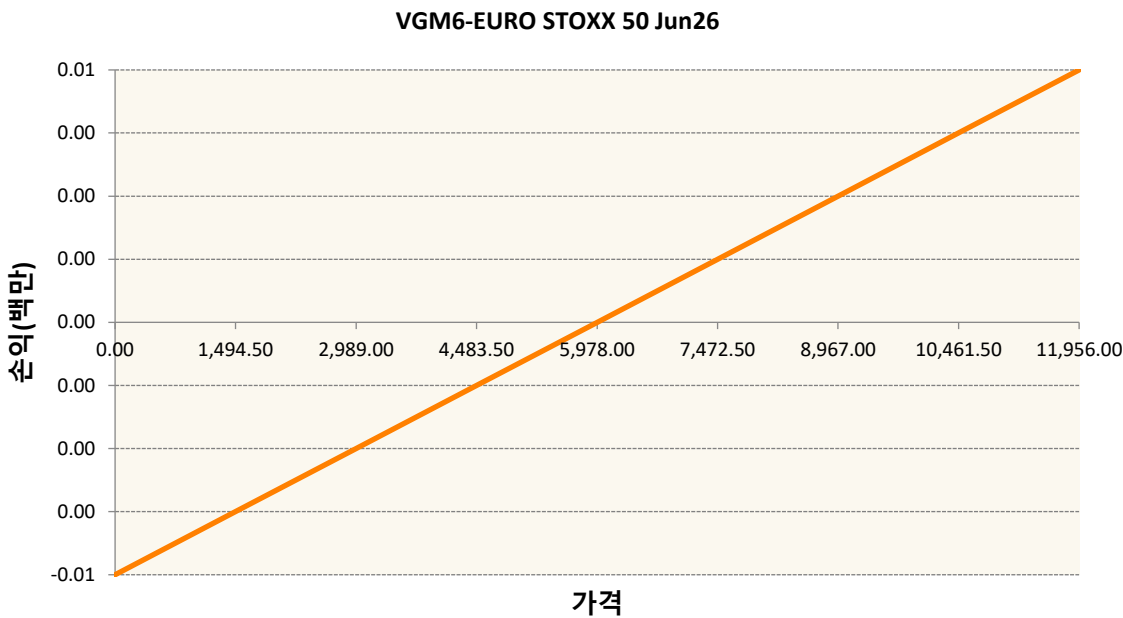
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	922	0	922	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	74
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

66

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

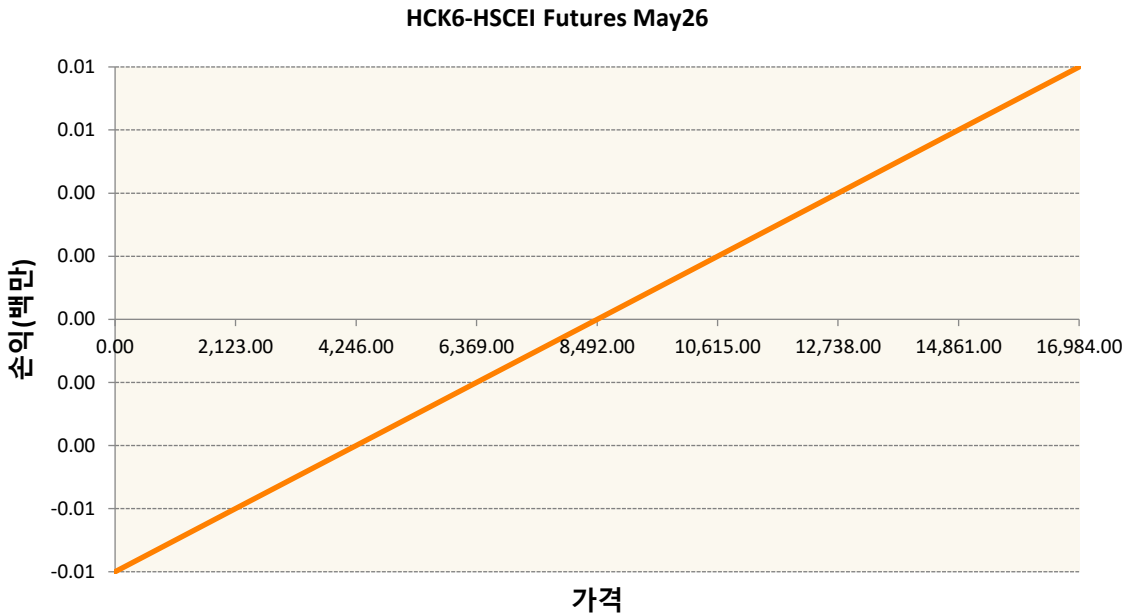
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,436	0	1,436	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK6	HSCEI Futures May26	115
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

138

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

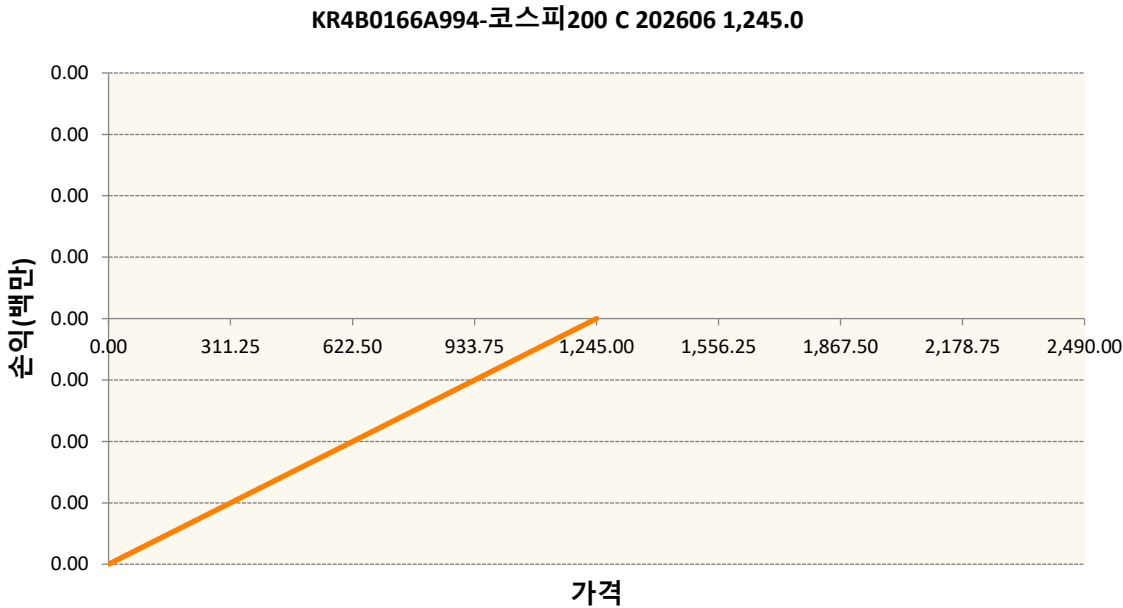
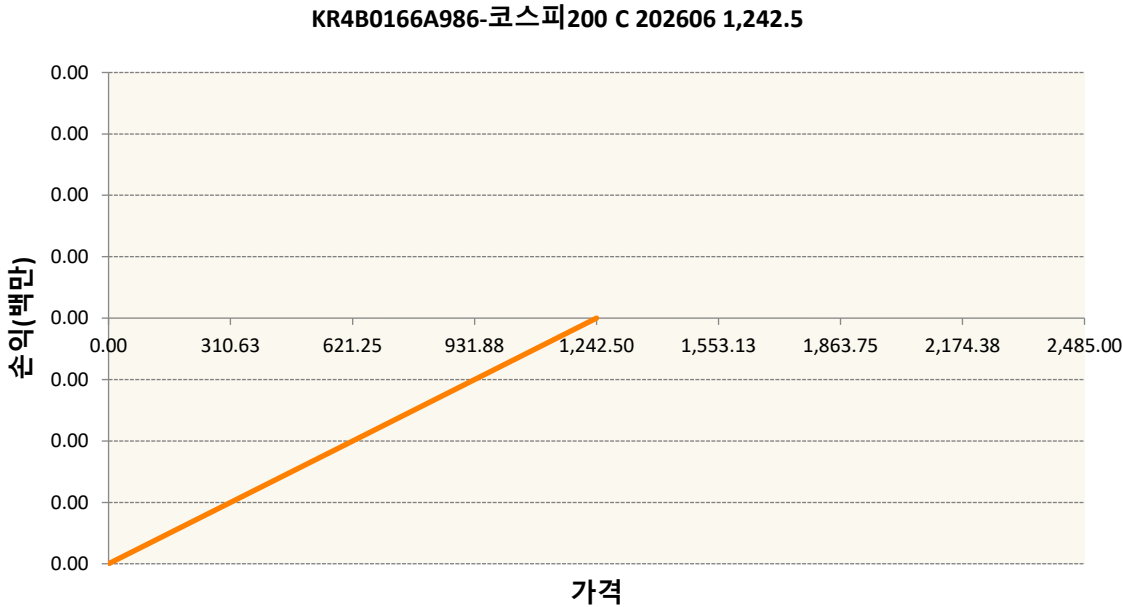
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

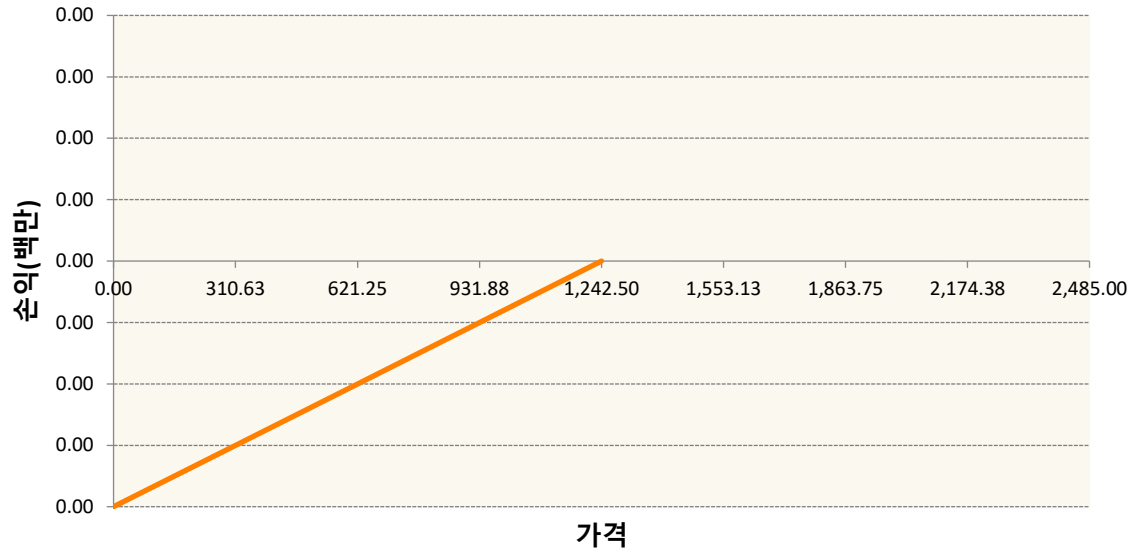
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	39,176	-39,176	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0166A984-코스피200 P 202606 1,242.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B0166A986 코스피200 C 202606 1,242.5								770
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-442	-492	-544	-599	-654	-711	-770	
-5.33%	-199	-257	-317	-377	-438	-501	-563	
-2.67%	17	-47	-112	-177	-243	-309	-375	
0%	204	136	68	0	-68	-136	-204	
2.67%	362	293	224	156	87	18	-51	
5.33%	492	425	358	290	222	154	86	
8.00%	597	534	470	405	339	273	206	
KR4B0166A994 코스피200 C 202606 1,245.0								1,132
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-656	-728	-804	-883	-964	-1,047	-1,132	
-5.33%	-297	-382	-468	-557	-646	-737	-828	
-2.67%	22	-72	-167	-262	-358	-454	-550	
0%	298	199	100	0	-100	-199	-299	
2.67%	533	432	331	230	129	28	-73	
5.33%	726	628	529	430	330	229	129	
8.00%	882	790	696	600	503	405	307	
KR4C0166A984 코스피200 P 202606 1,242.5								469
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-270	-300	-332	-365	-399	-434	-469	
-5.33%	-121	-157	-193	-230	-267	-305	-343	
-2.67%	10	-29	-68	-108	-148	-188	-228	
0%	124	83	41	0	-41	-83	-124	

2.67%	221	179	137	95	53	11	-31
5.33%	300	259	218	177	136	94	52
8.00%	364	326	287	247	207	166	126

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

(단위:백만원)

3,394

공시일 2026-05-26

기준일 2026-05-22

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	2026-05-26
기준일	2026-05-22

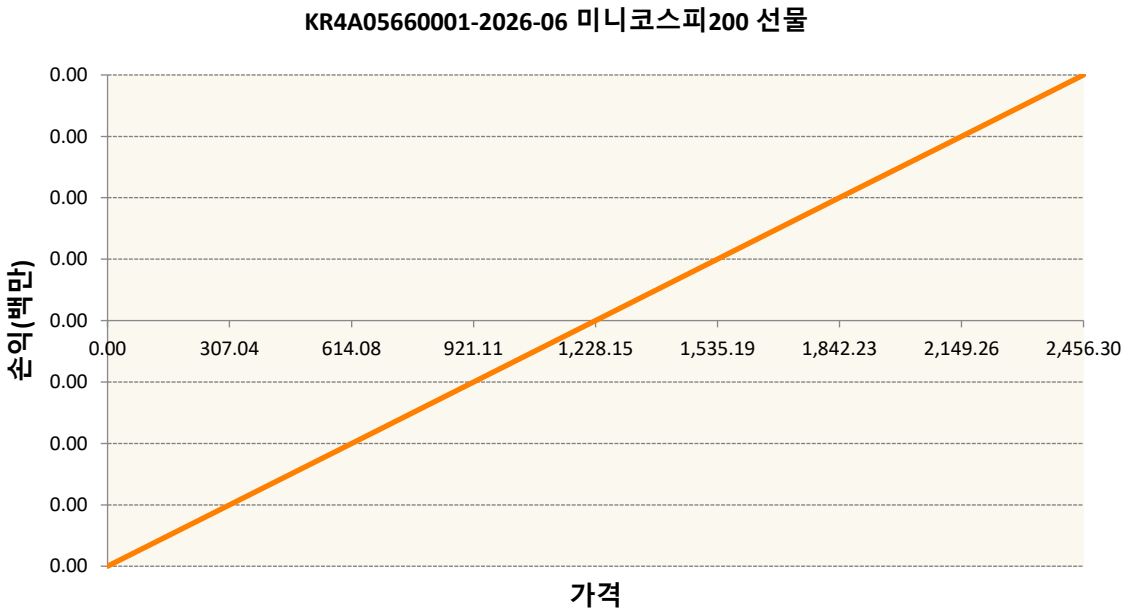
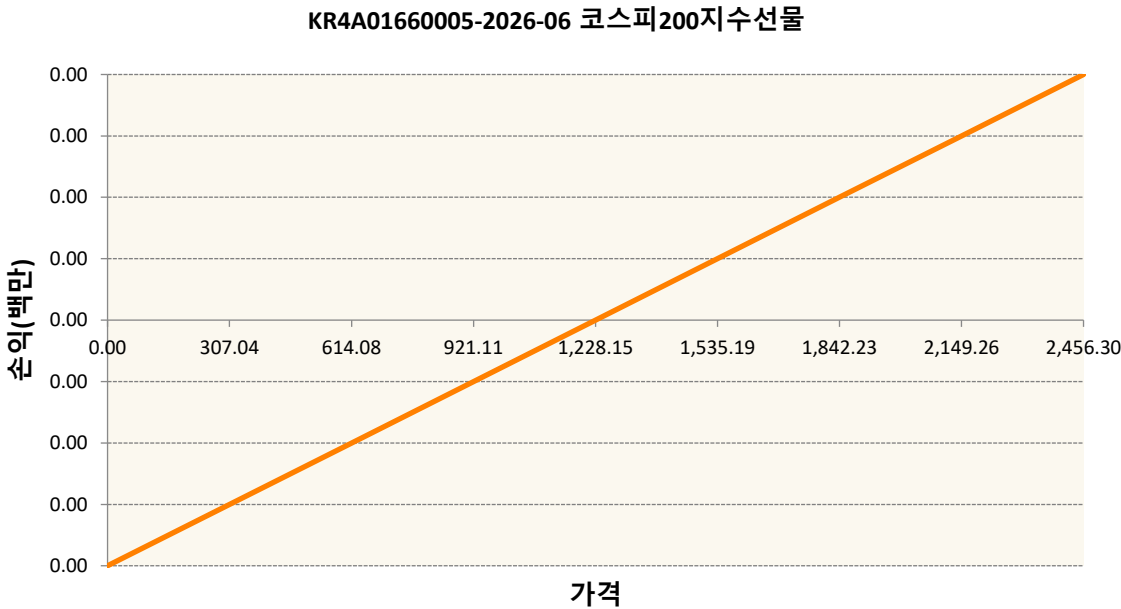
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

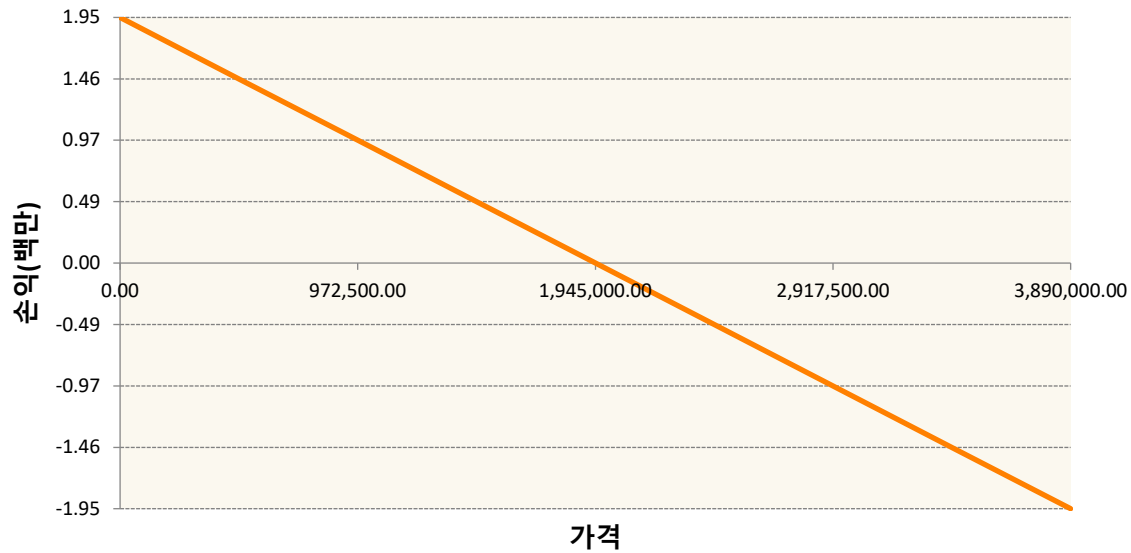
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	616	0	616	장내
누계	유가증권	선물	3,070	78	2,993	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						123
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123	-123
-5.33%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-2.67%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	41	41	41	41	41	41	41	41
5.33%	82	82	82	82	82	82	82	82
8.00%	123	123	123	123	123	123	123	123
KR4A05660001		2026-06 미니코스피200 선물						25
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	16	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	25	25	25	25	25	25	25	25
KR4A50660005		2026-06 SK하이닉스개별선물						6
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6	6
-5.33%	4	4	4	4	4	4	4	4
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	359

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

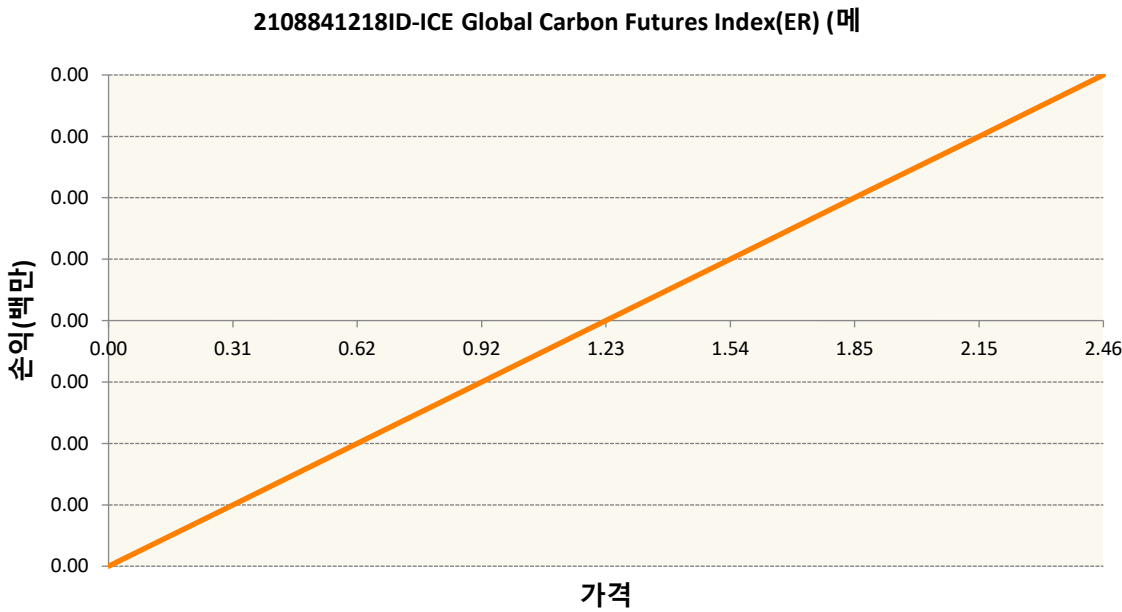
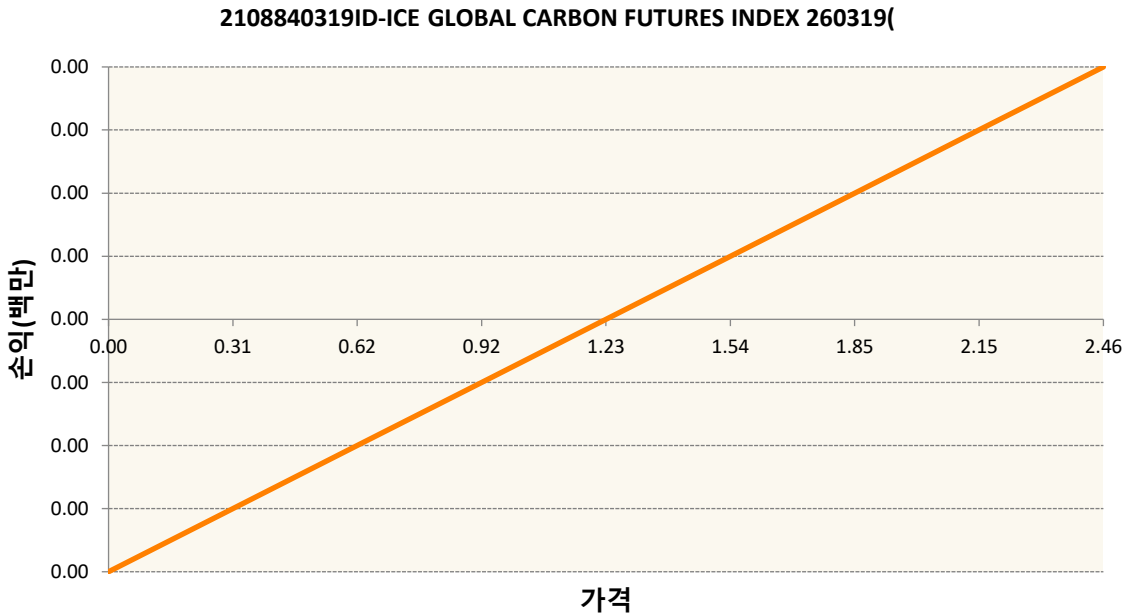
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,068	0	7,068	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		451
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		113

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	646

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

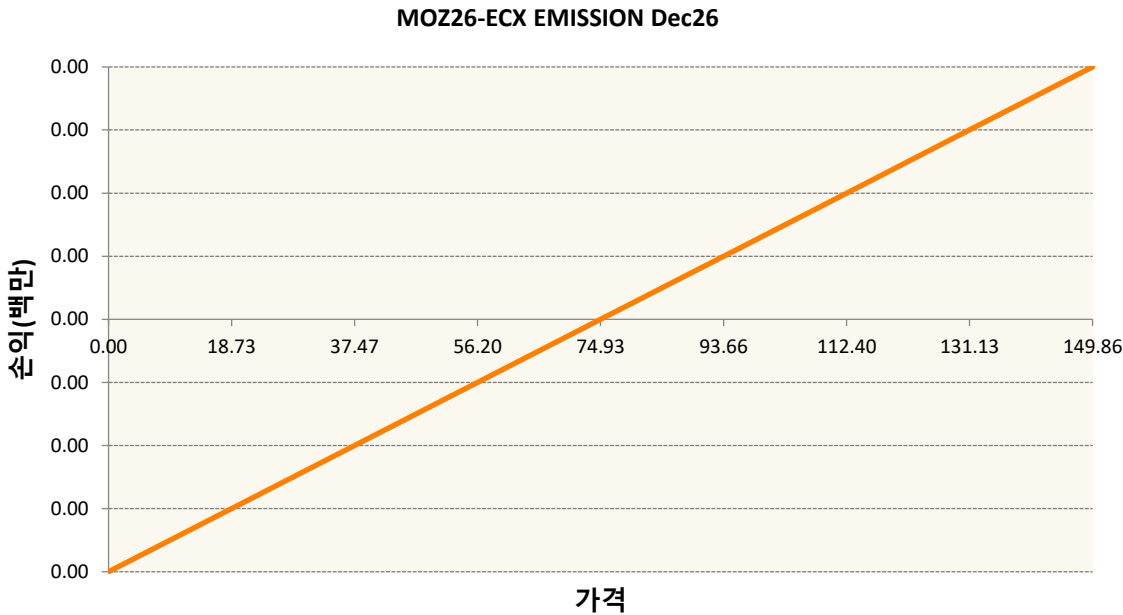
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,824	0	4,824	
누계	통화	선도	0	2,402	-2,402	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	192
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	386

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

(단위:백만원)

657

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

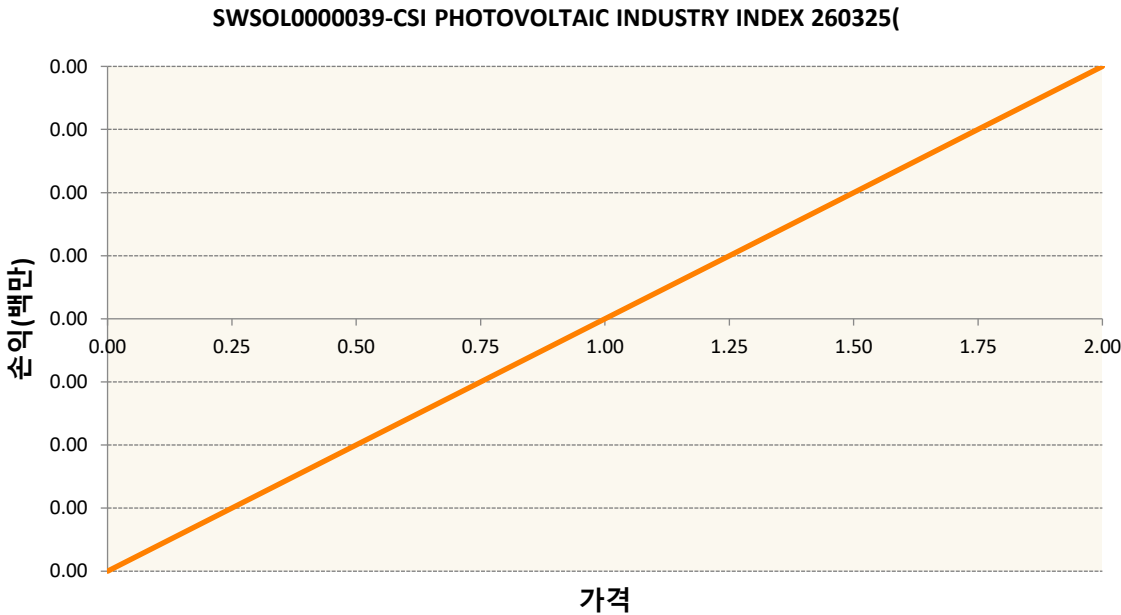
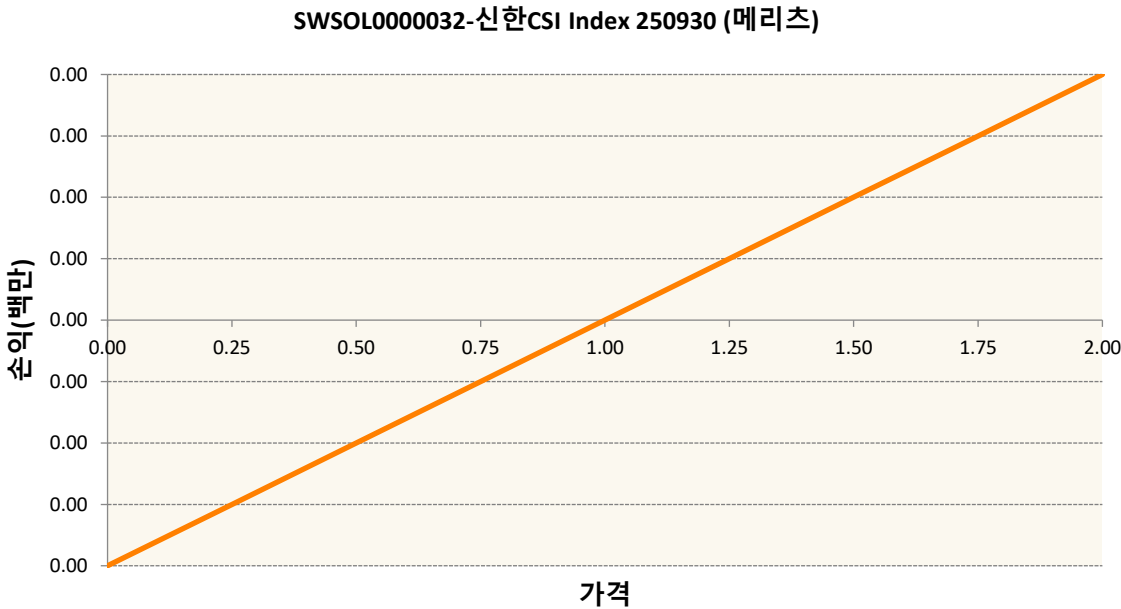
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	1,333	0	1,333	장외
누계	지수	스왑	1,971	0	1,971	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)		0.44
SWSOL00000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)		0.3
SWSOL00000(신한CSI Index 250930 (메리츠)		1
SWSOL00000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(		0.26

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

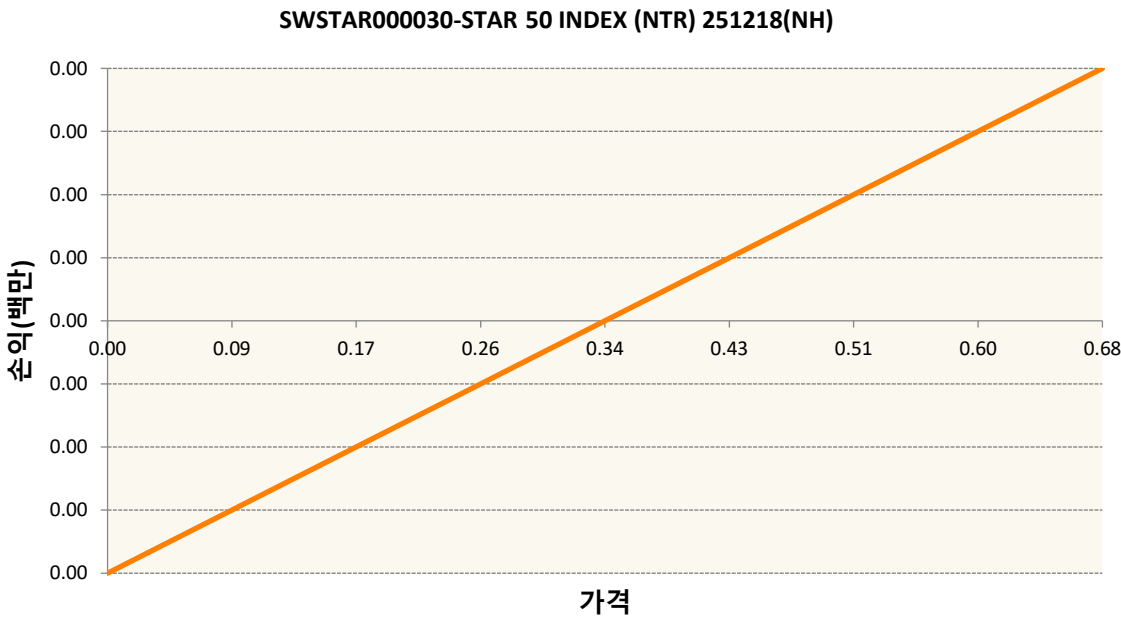
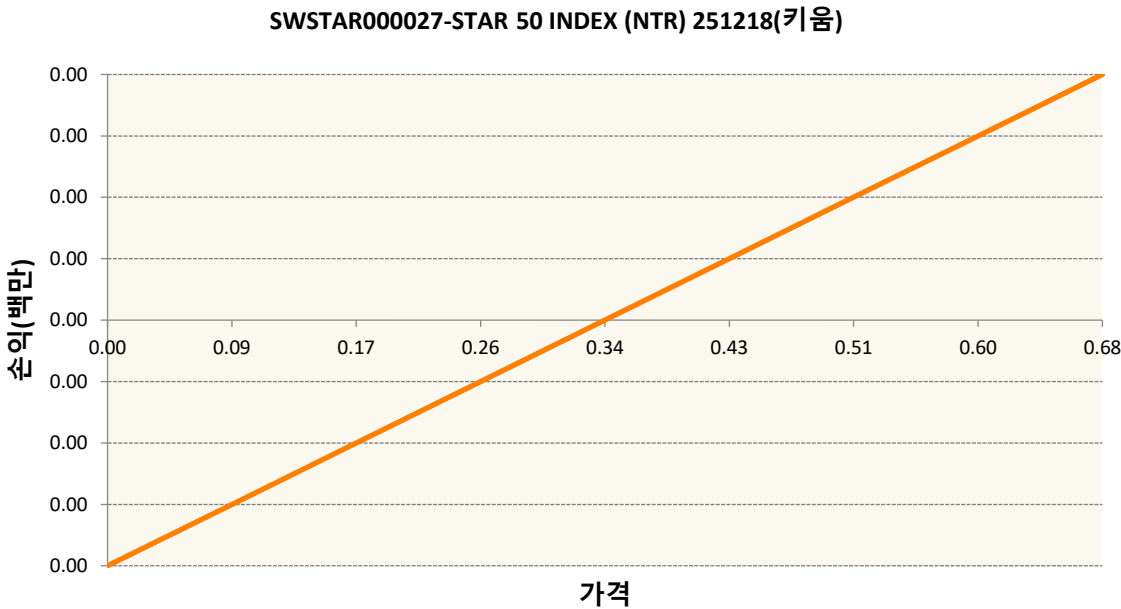
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

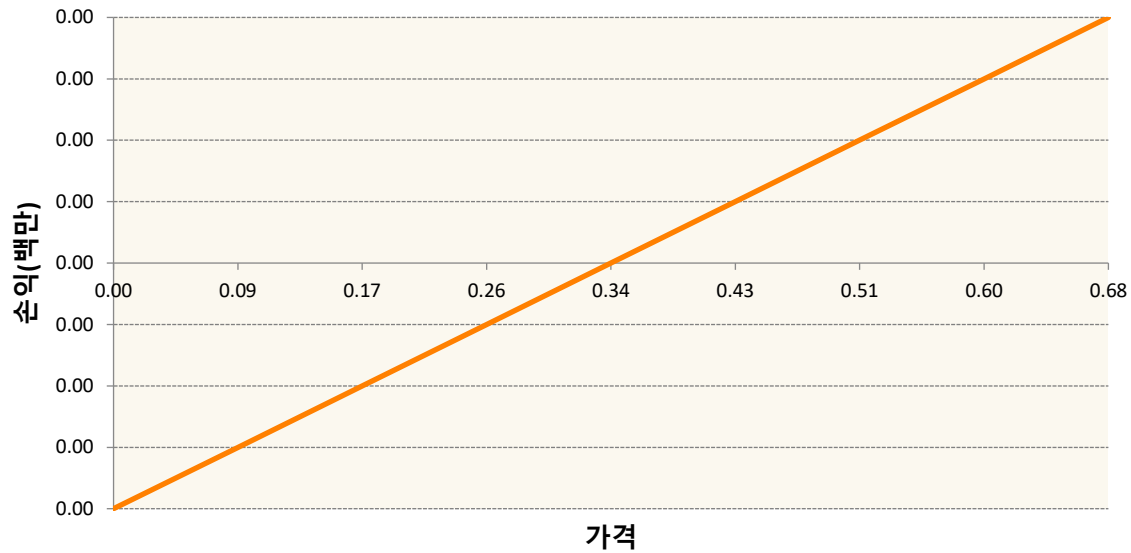
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8,600	0	8,600	장외

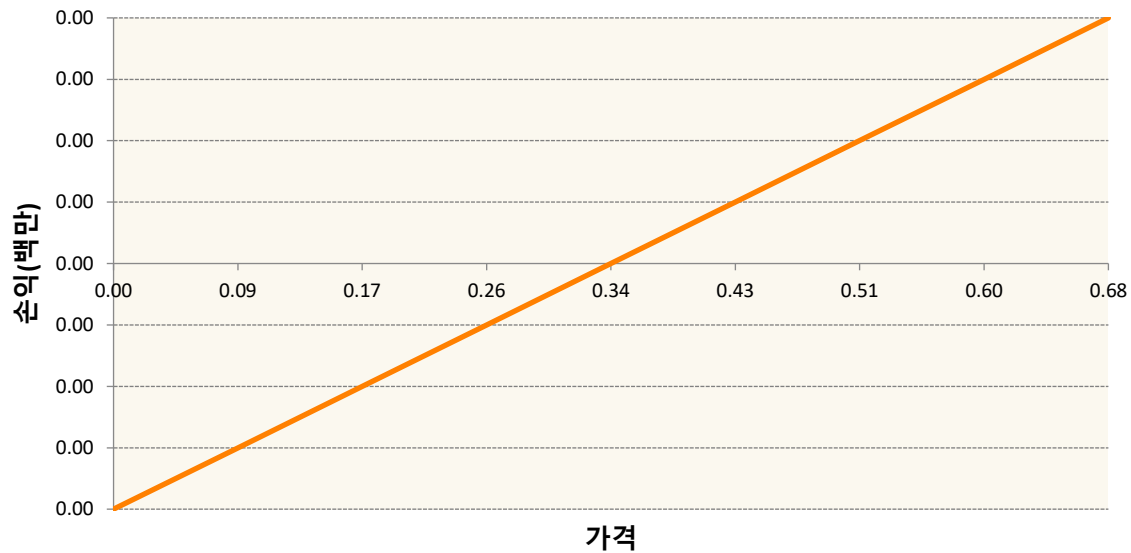
2. 만기시점의 손익구조



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)	25
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	84
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	426
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	158

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

(단위:백만원)

1,052

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

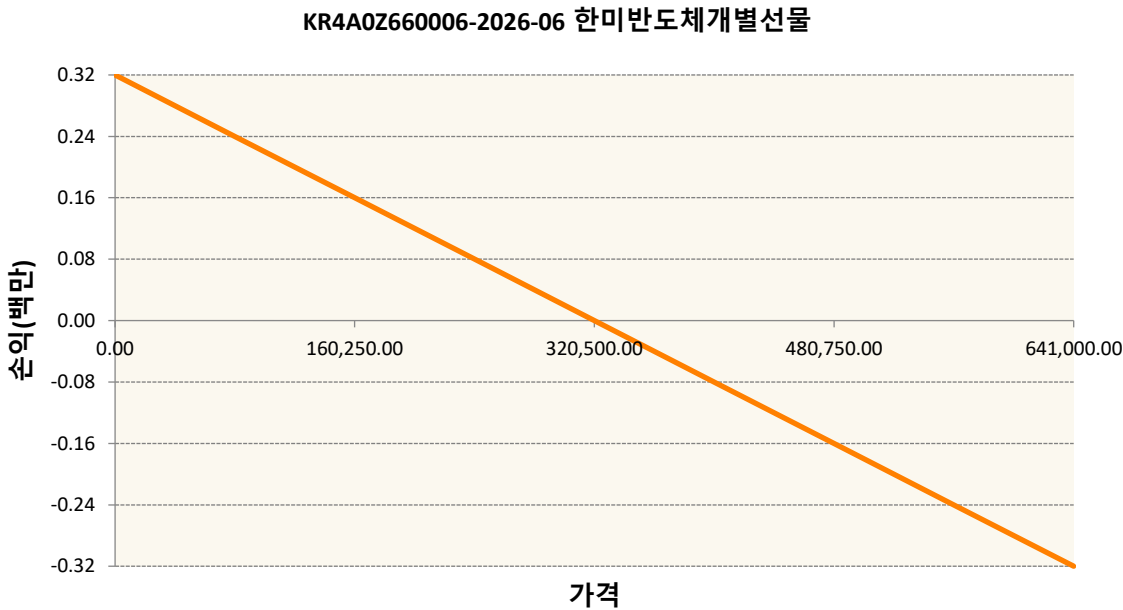
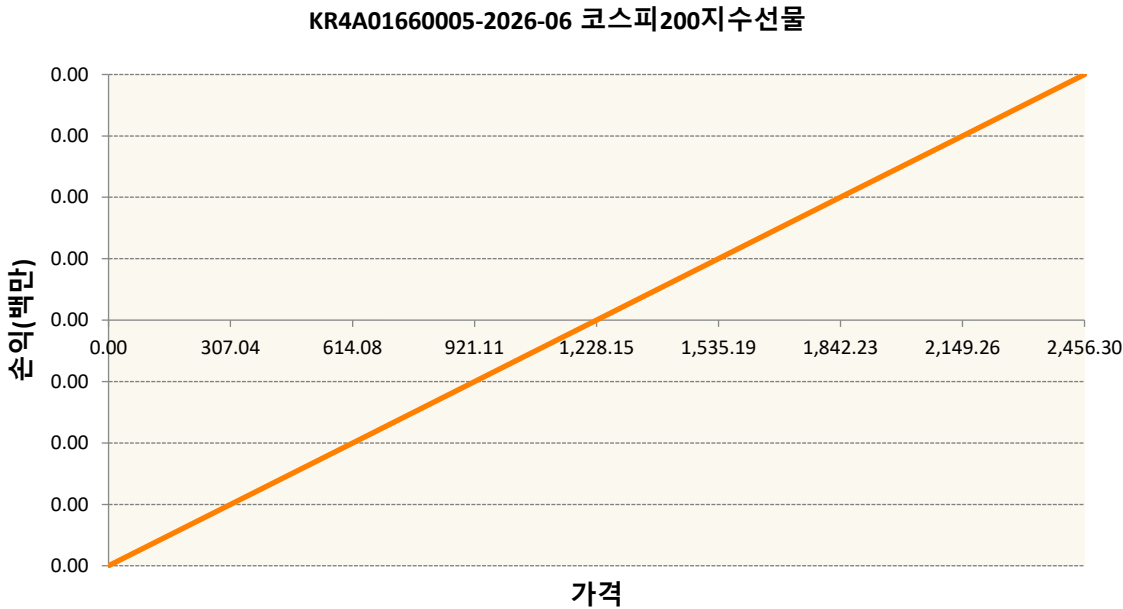
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

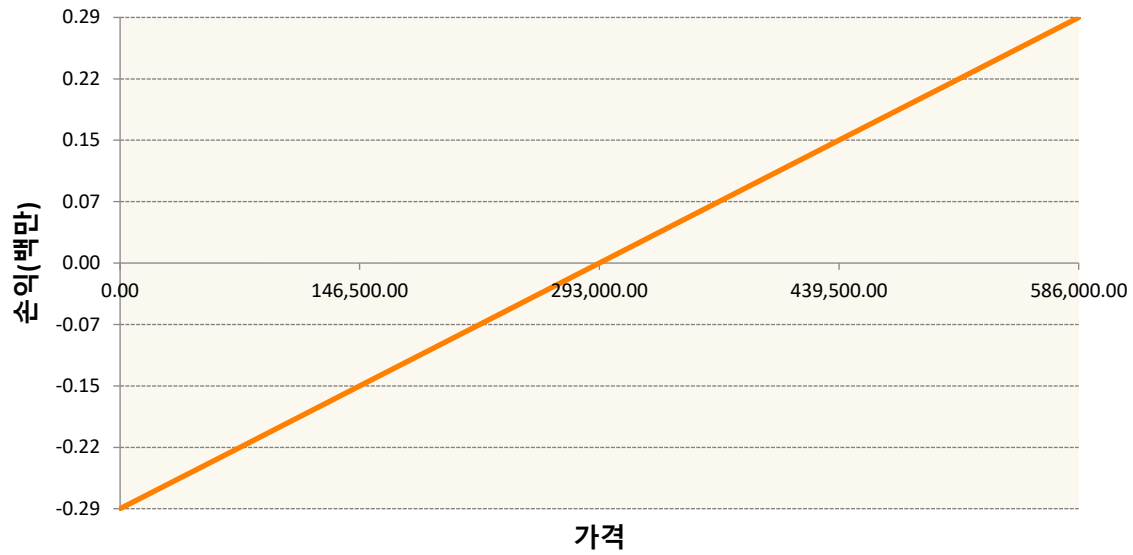
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,962	779	2,183	장내
누계	유가증권	선물	16,135	3,777	12,358	장내

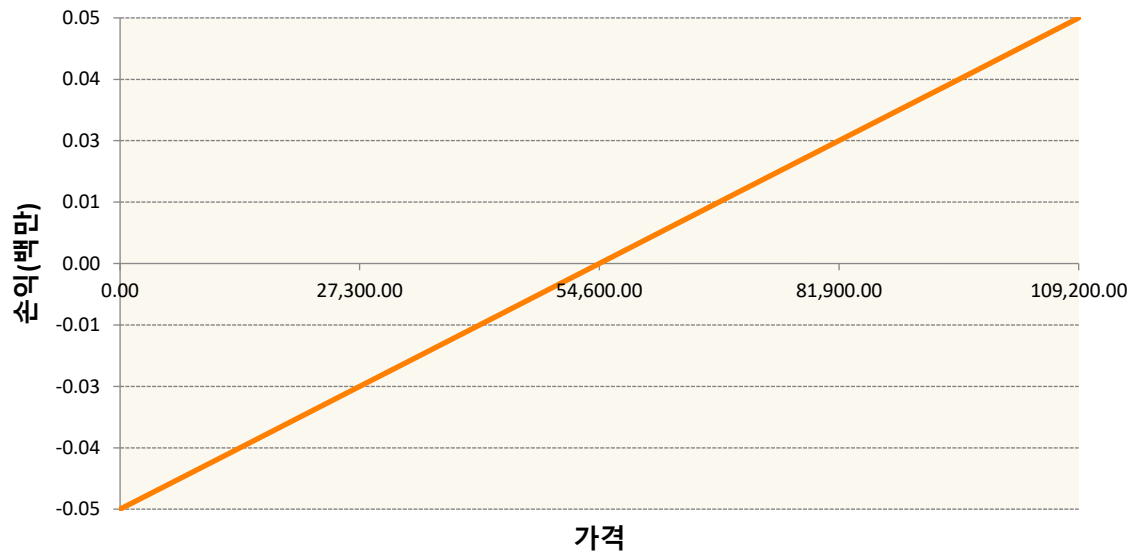
2. 만기시점의 손익구조



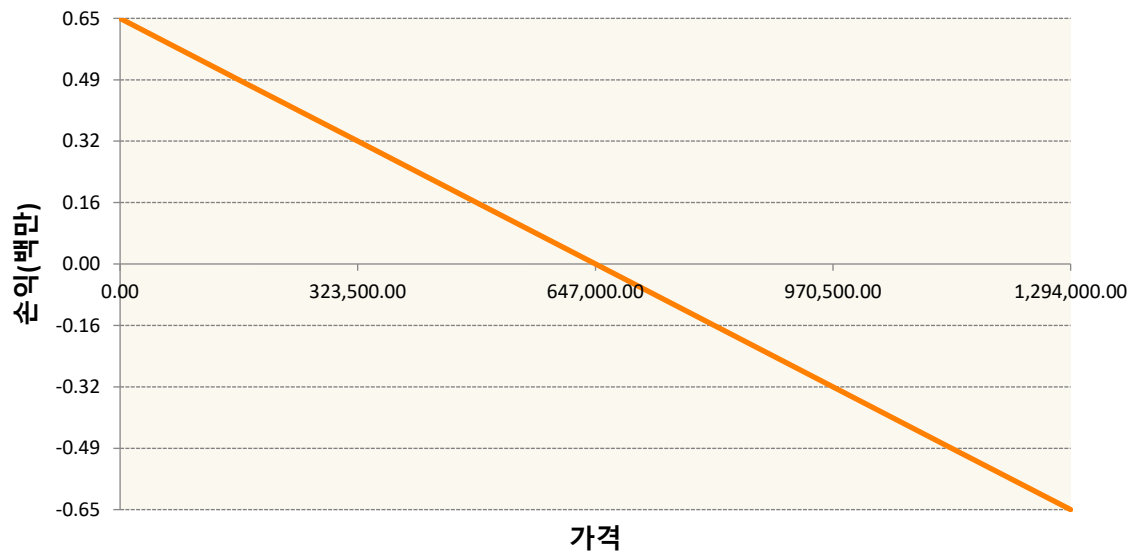
KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



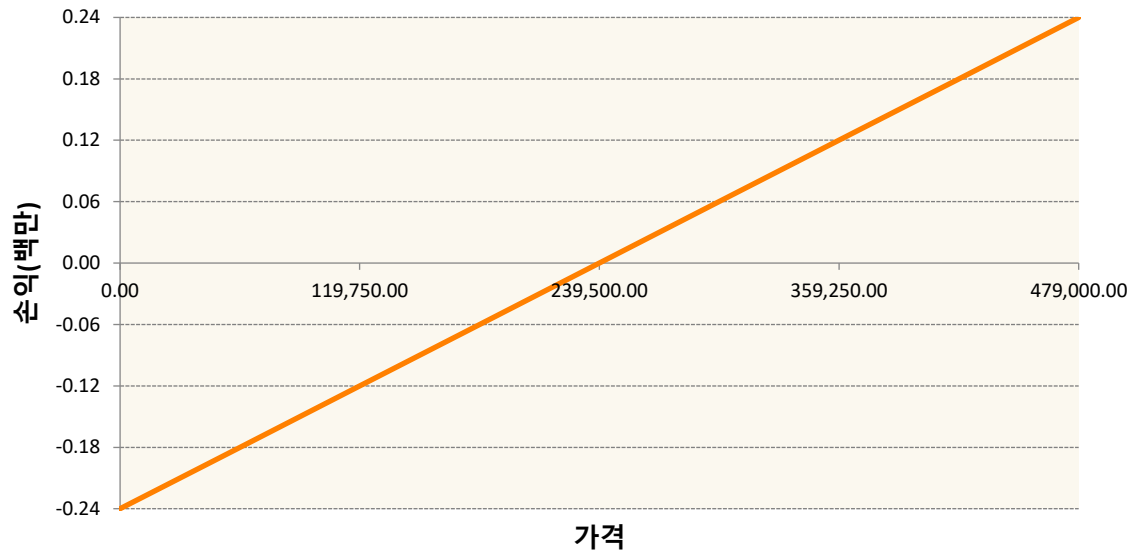
KR4A14660000-2026-06 KT개별선물



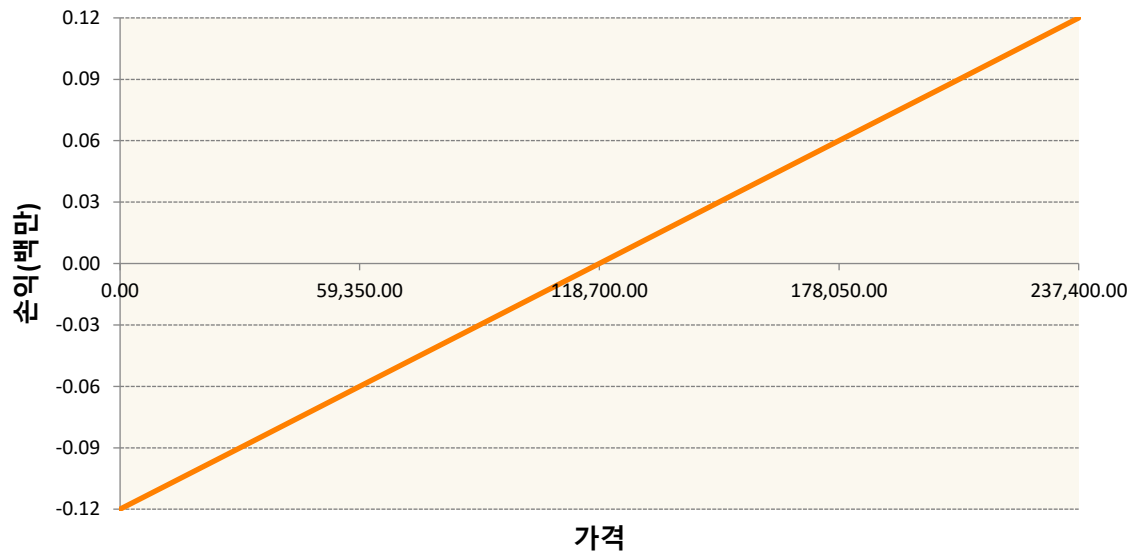
KR4A22660000-2026-06 삼성SDI개별선물



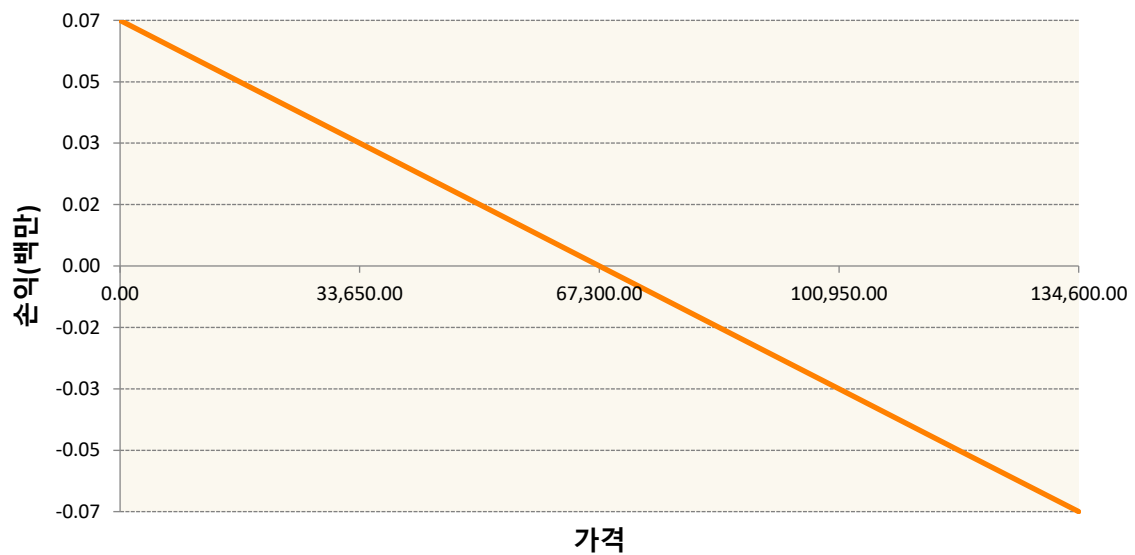
KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



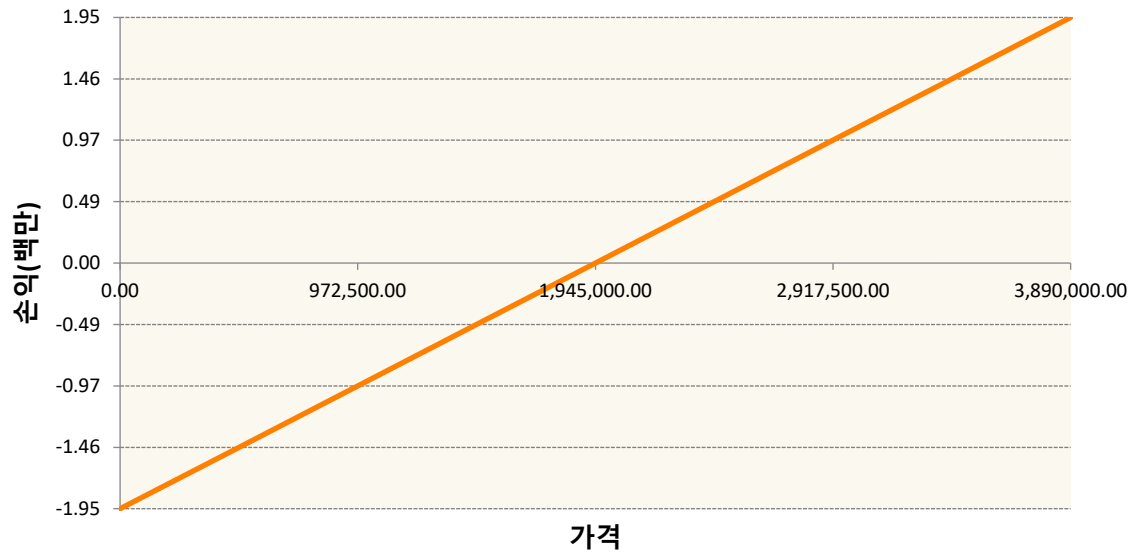
KR4A34660006-2026-06 LG개별선물



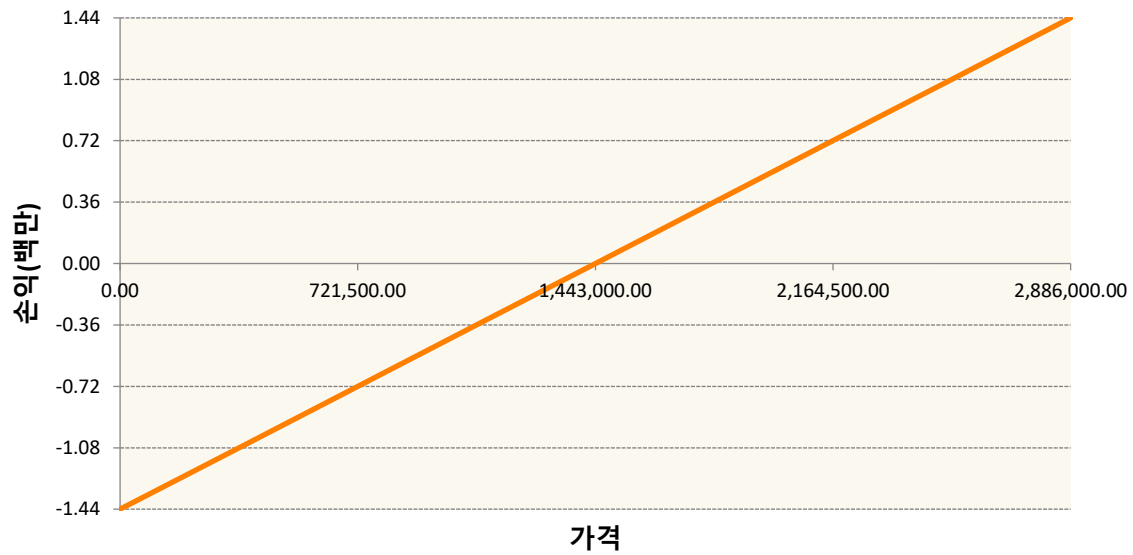
KR4A48660000-2026-06 미래에셋증권개별선물



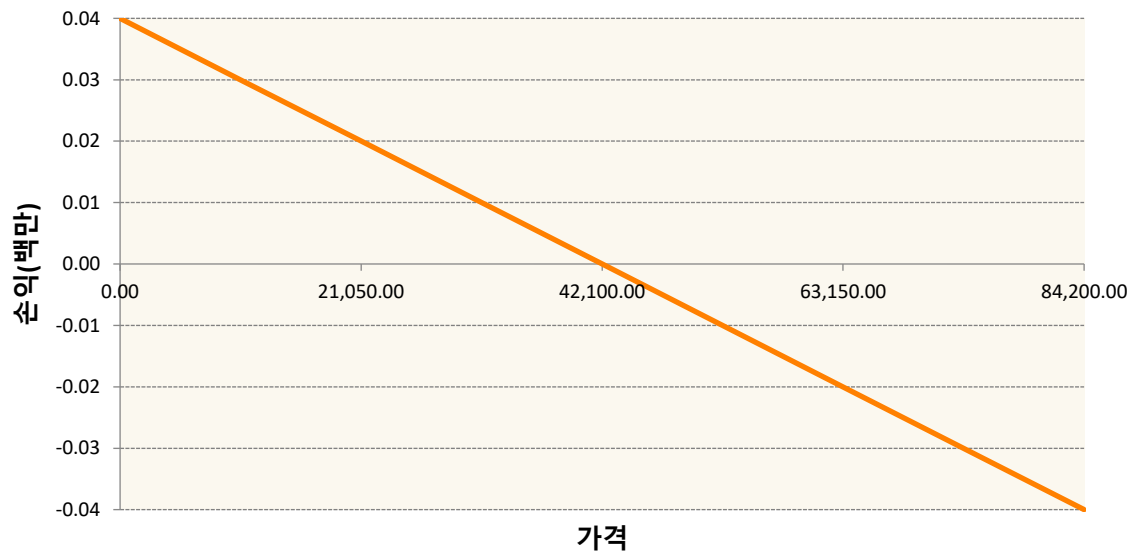
KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



KR4AB3660001-2026-06 고려아연개별선물



KR4ACF660005-2026-06 카카오개별선물



(단위:백만원)

KR4A01660005							2026-06 코스피200지수선물		760		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-760	-760	-760	-760	-760	-760	-760				
-5.33%	-507	-507	-507	-507	-507	-507	-507				
-2.67%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	253	253	253	253	253	253	253				
5.33%	507	507	507	507	507	507	507				
8.00%	760	760	760	760	760	760	760				
KR4A0Z660006							2026-06 한미반도체개별선물		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				
KR4A11660003							2026-06 삼성전자개별선물		242		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242				
-5.33%	-161	-161	-161	-161	-161	-161	-161				
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81				
0%	0	0	0	0	0	0	0				
2.67%	81	81	81	81	81	81	81				
5.33%	161	161	161	161	161	161	161				
8.00%	242	242	242	242	242	242	242				
KR4A14660000							2026-06 KT개별선물		34		
기초자산의 변동성											
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%				
-8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34				
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23				
-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%	23	23	23	23	23	23	23				
8.00%	34	34	34	34	34	34	34				
KR4A22660000							2026-06 삼성SDI개별선물		70		
기초자산의 변동성											

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	70	70	70	70	70	70	70
-5.33%	47	47	47	47	47	47	47
-2.67%	23	23	23	23	23	23	23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70

KR4A24660008 2026-06 LG전자개별선물 19

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	6	6	6	6	6	6	6
5.33%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

KR4A34660006 2026-06 LG개별선물 64

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-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%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	64	64	64	64	64	64	64

KR4A48660000 2026-06 미래에셋증권개별선물 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

KR4A50660005 2026-06 SK하이닉스개별선물 168

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-5.33%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
-2.67%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	56	56	56	56	56	56	56
5.33%	112	112	112	112	112	112	112
8.00%	168	168	168	168	168	168	168
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							107
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	107	107	107	107	107	107	107
-5.33%	71	71	71	71	71	71	71
-2.67%	36	36	36	36	36	36	36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107

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

(단위:백만원)

3,790

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

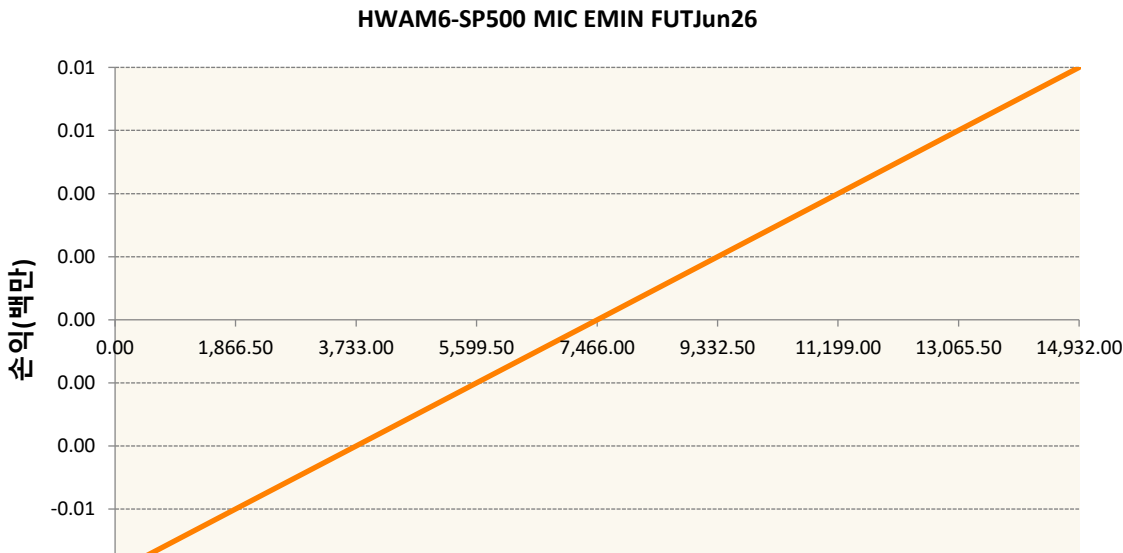
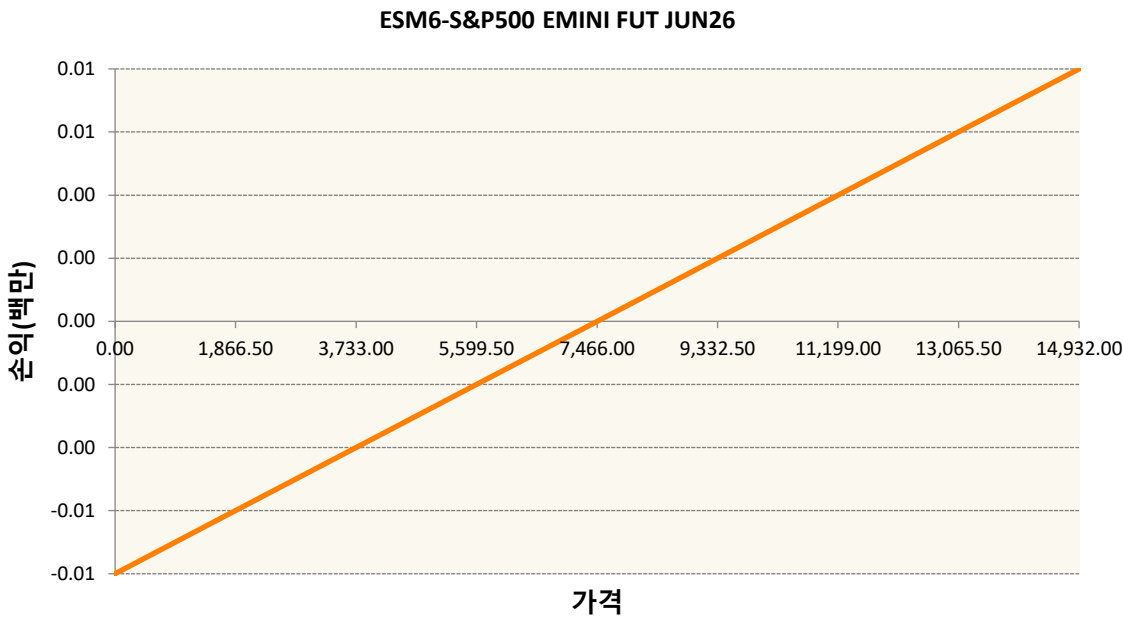
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

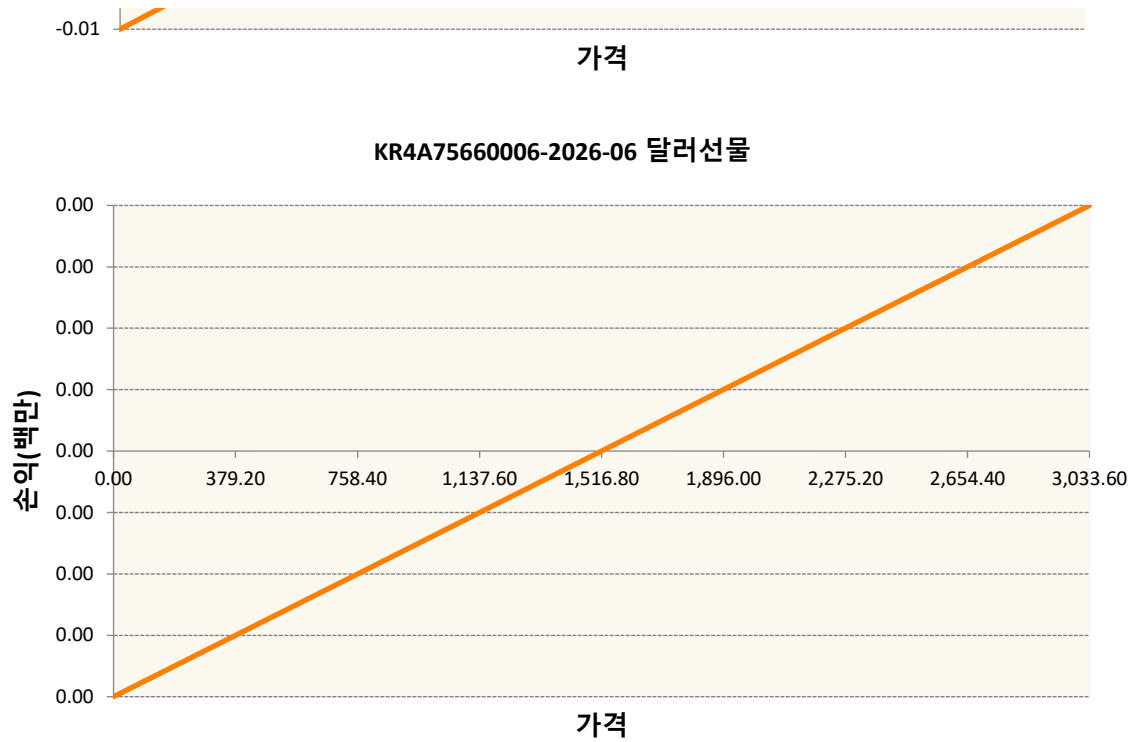
1. 계약금액

(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	60,487	0	60,487	
누계	지수	선물	278	0	278	장내
누계	통화	선물	10,769	0	10,769	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,839
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		22
KR4A756600 2026-06 달러선물			862

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,255

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

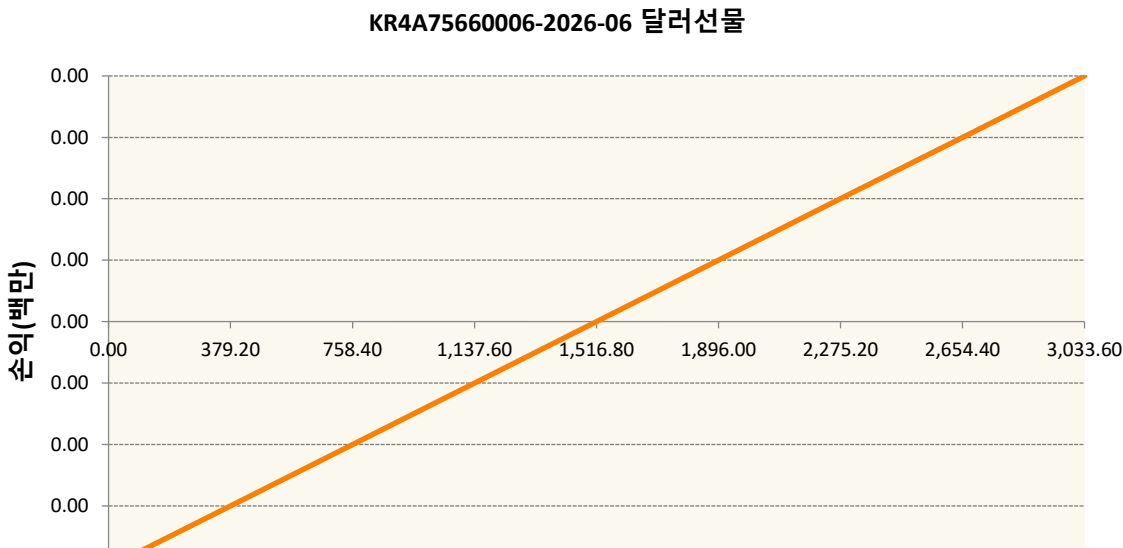
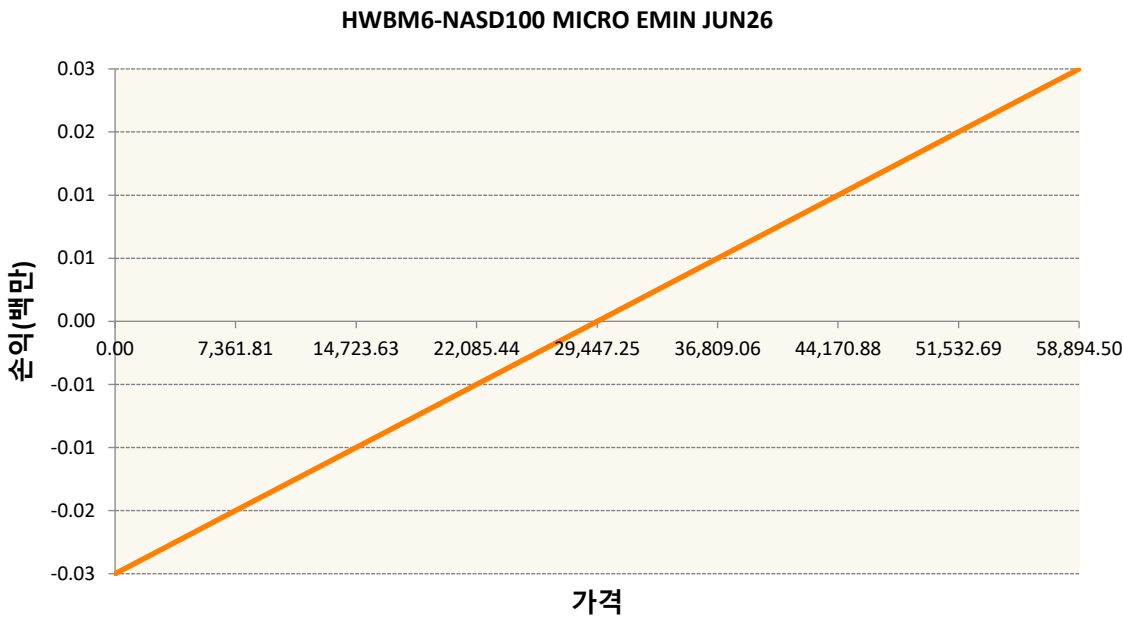
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

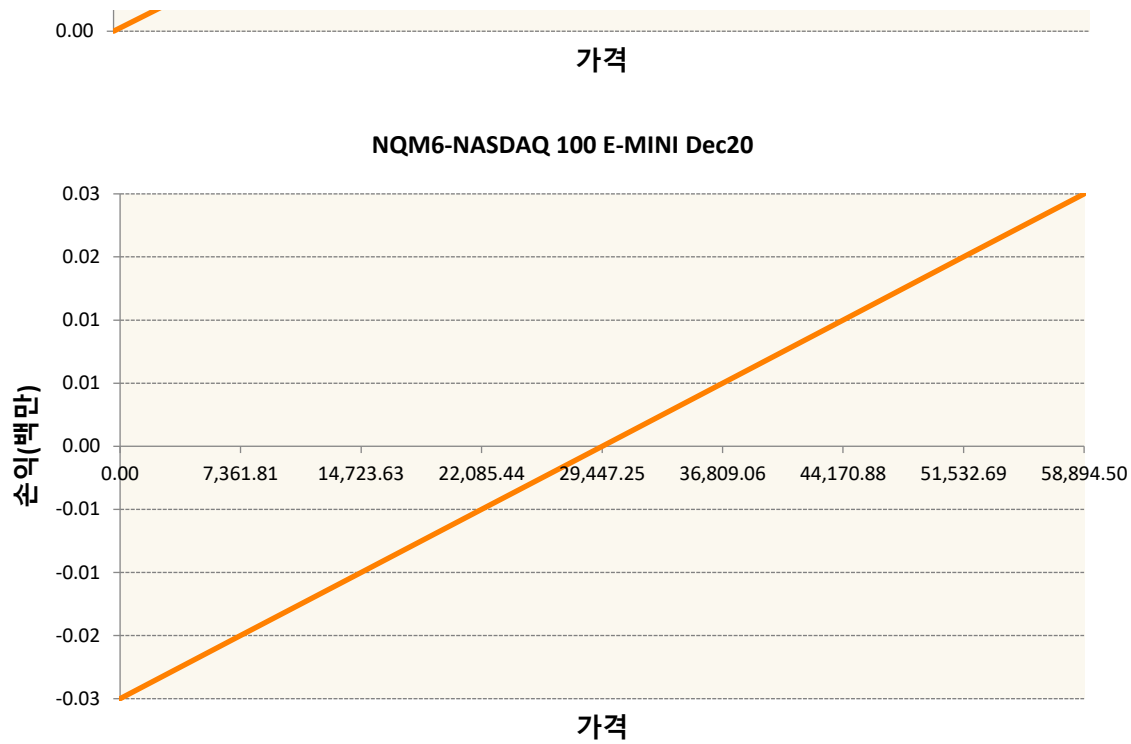
1. 계약금액

(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	30,028	0	30,028	
누계	유가증권	선물	258	0	258	장내
누계	통화	선물	3,959	0	3,959	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26		21
KR4A756600	2026-06 달러선물		317
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		2,402

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,683

공시일	2026-05-26
기준일	2026-05-22

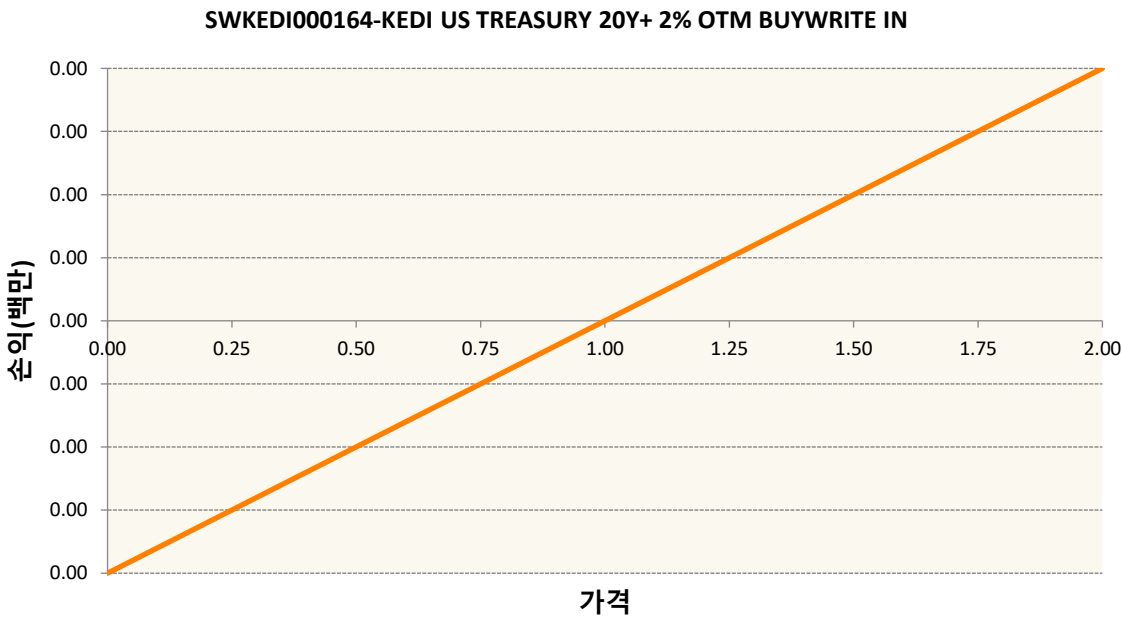
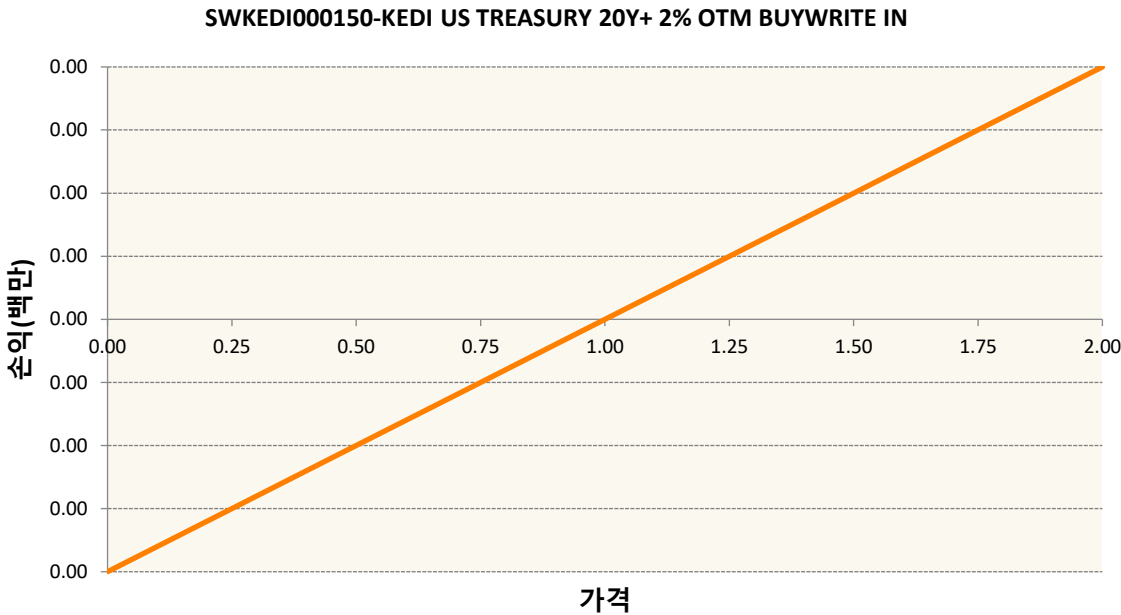
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

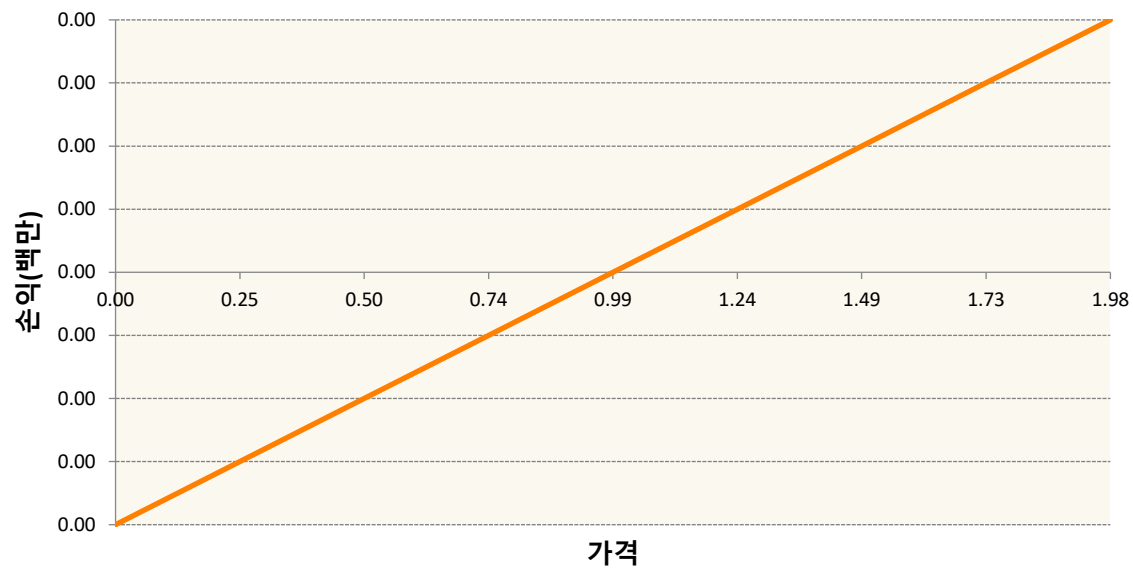
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	358,570	0	358,570	장외

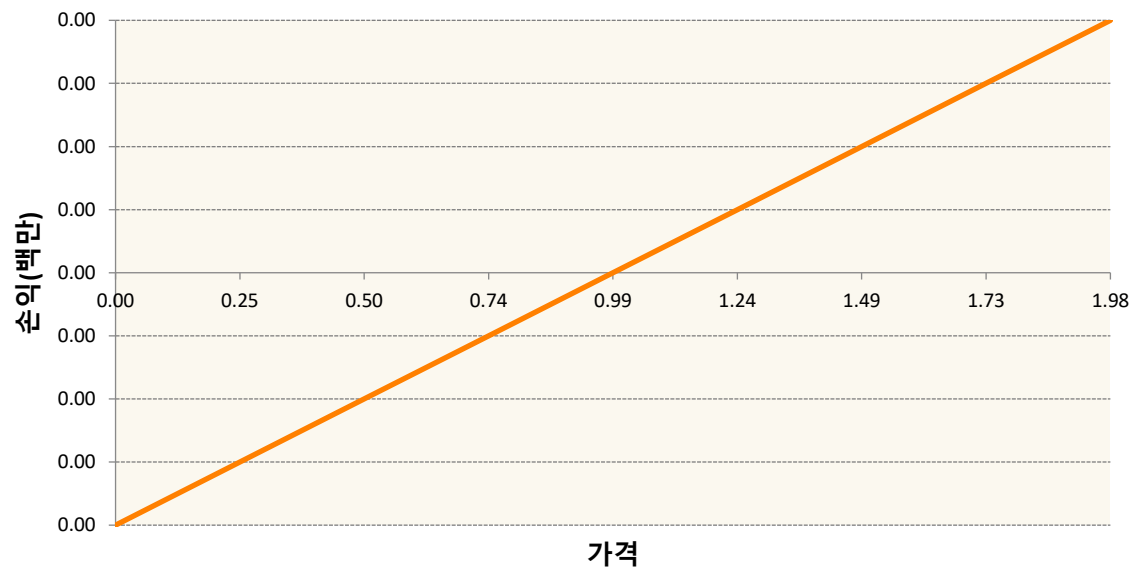
2. 만기시점의 손익구조



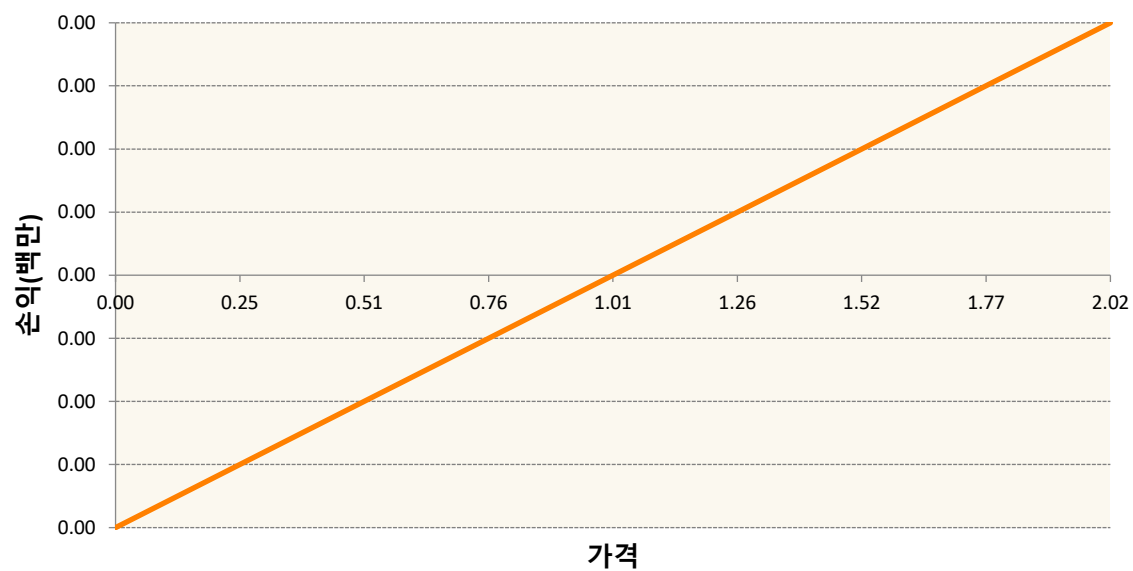
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,344
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		153
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,743
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,426
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,962

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,284