

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

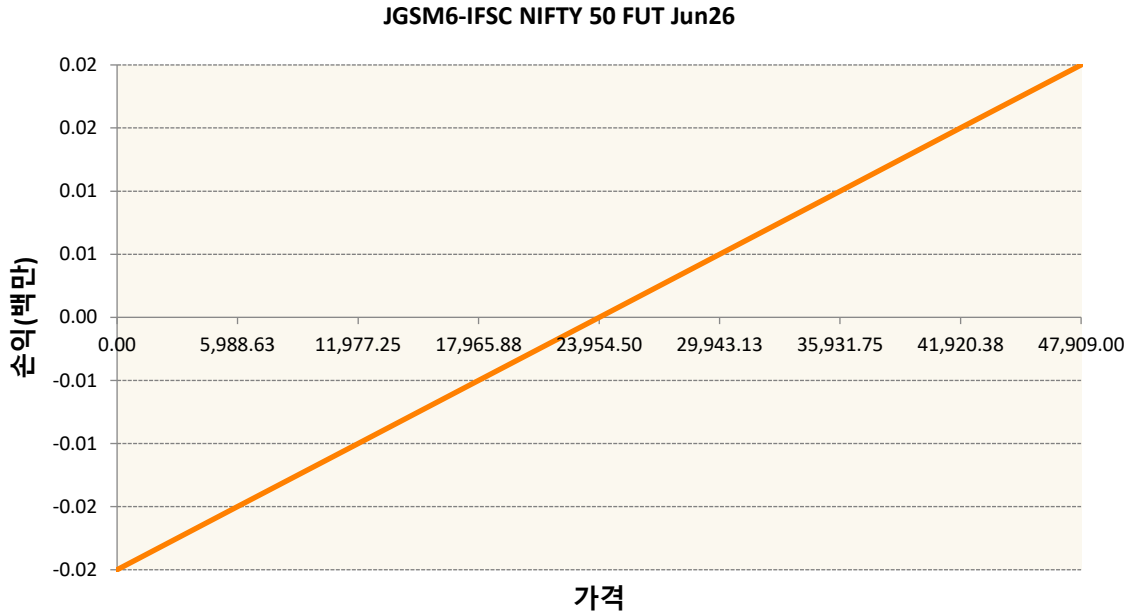
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	360	0	360	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSM6	IFSC NIFTY 50 FUT Jun26	29
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일 2026-05-28

기준일 2026-05-27

SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

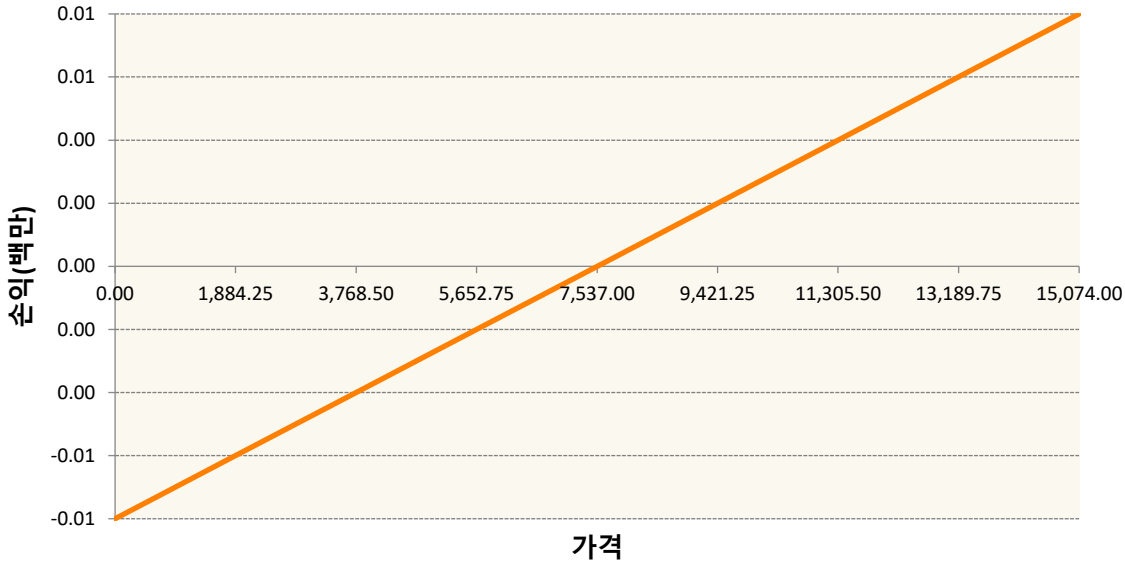
1. 계약금액

(단위:백만원)

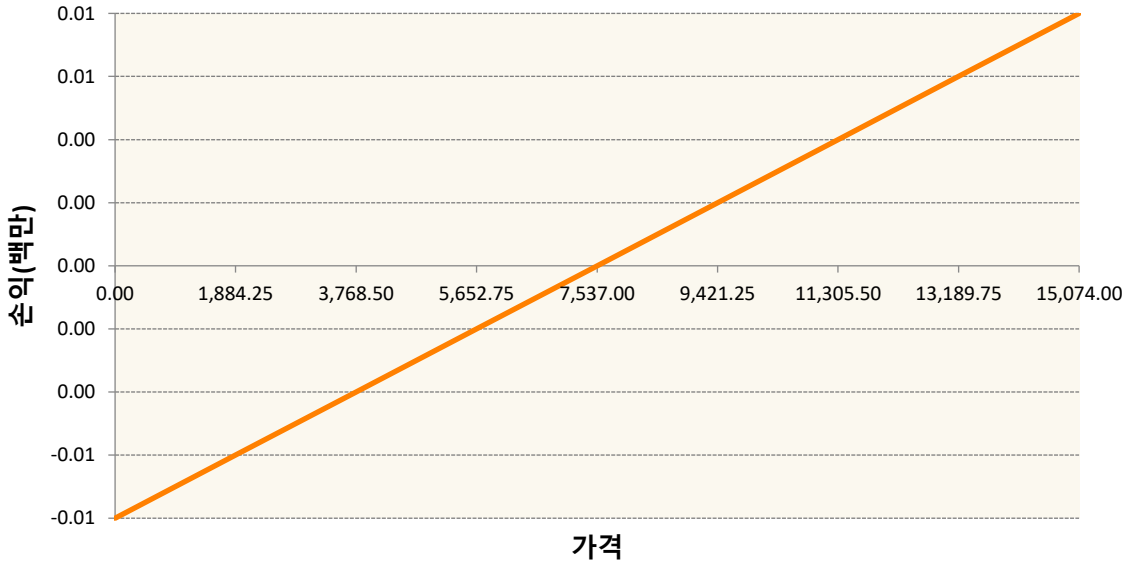
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	566	0	566	
누계	지수	선물	57	0	57	장내

2. 만기시점의 손익구조

ESM6-S&P500 EMINI FUT JUN26



HWAM6-SP500 MIC EMIN FUTJun26



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	2026-05-28
기준일	2026-05-27

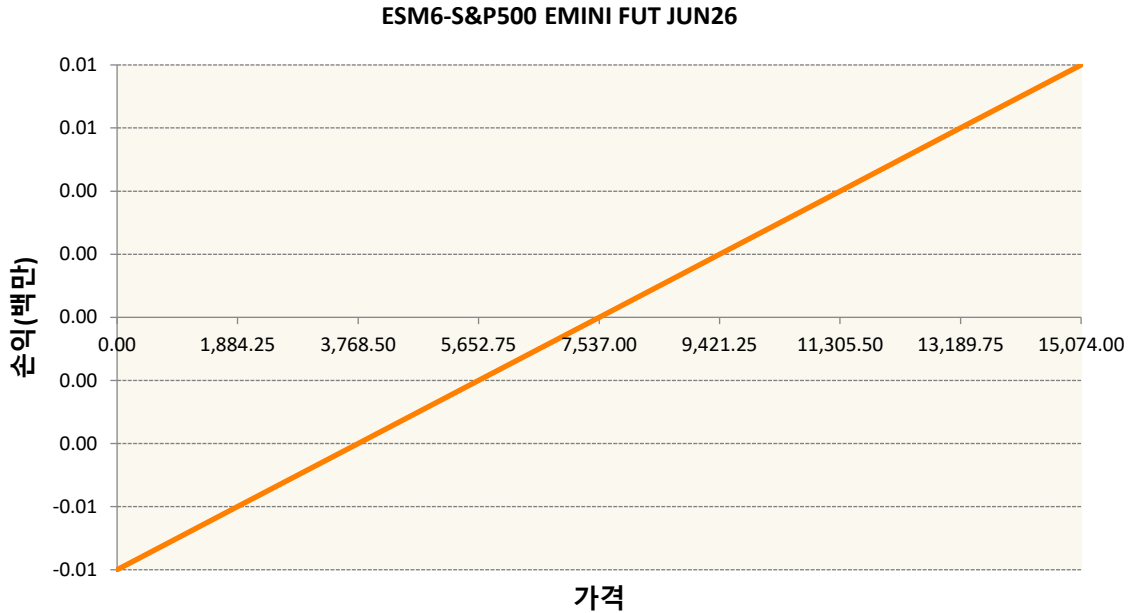
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,131	0	1,131	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	91
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

78

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

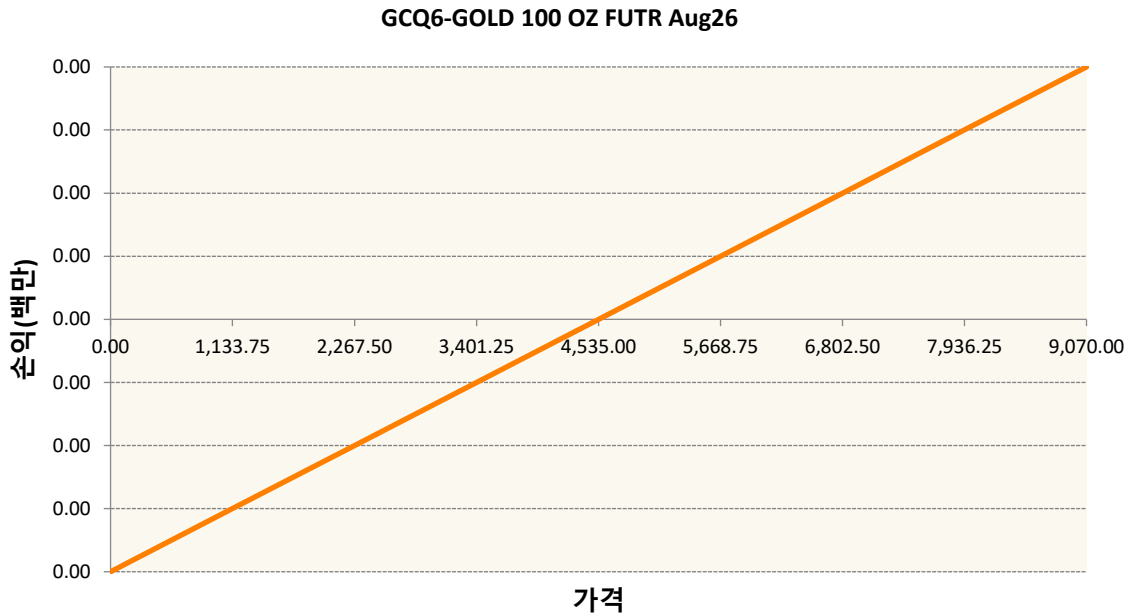
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	5,446	0	5,446	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 05/29/26 C422 EQUITY	7
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	436

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

(단위:백만원)

555

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

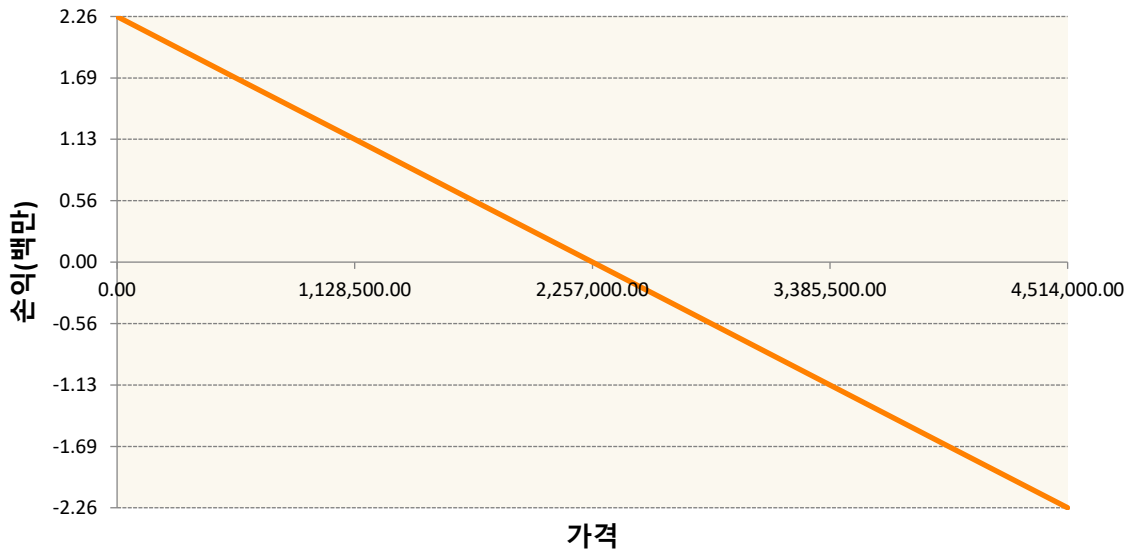
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	22,570	-22,570	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조

KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUCC PLTR US 05/29/26 C145 EQUITY	59
AOPLTRUCP PLTR US 05/29/26 P145 EQUITY	30
KR4A506600 2026-06 SK하이닉스개별선물	1,806

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

(단위:백만원)

263

공시일 2026-05-28

기준일 2026-05-27

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)

AOTLTUSC8² TLT US 05/29/26 C84.5 EQUITY

9

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

(단위:백만원)

5

공시일 2026-05-28

기준일 2026-05-27

SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

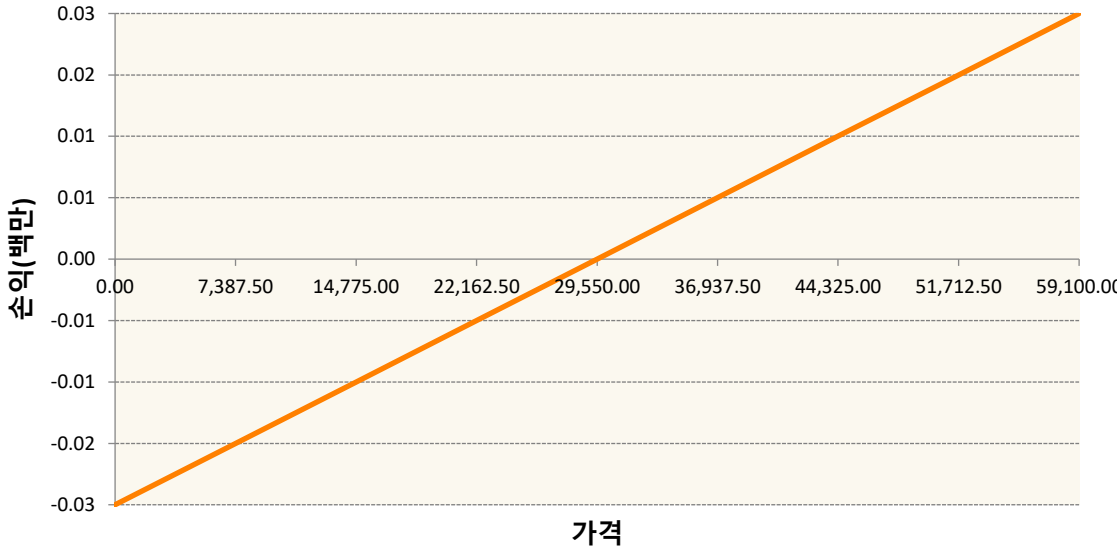
1. 계약금액

(단위:백만원)

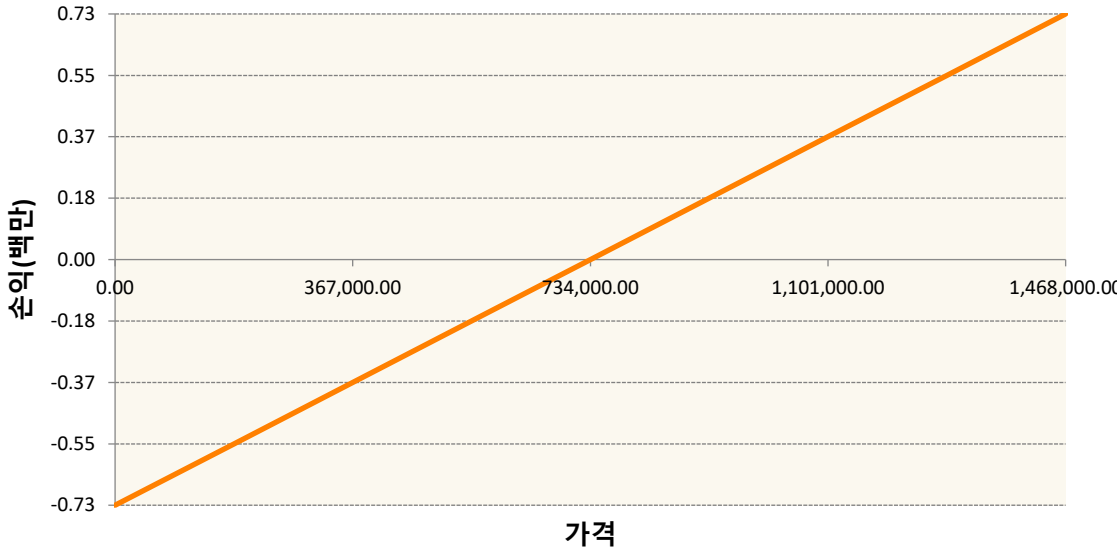
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	19,212	0	19,212	장내
누계	유가증권	스왑	167,498	0	167,498	장외

2. 만기시점의 손익구조

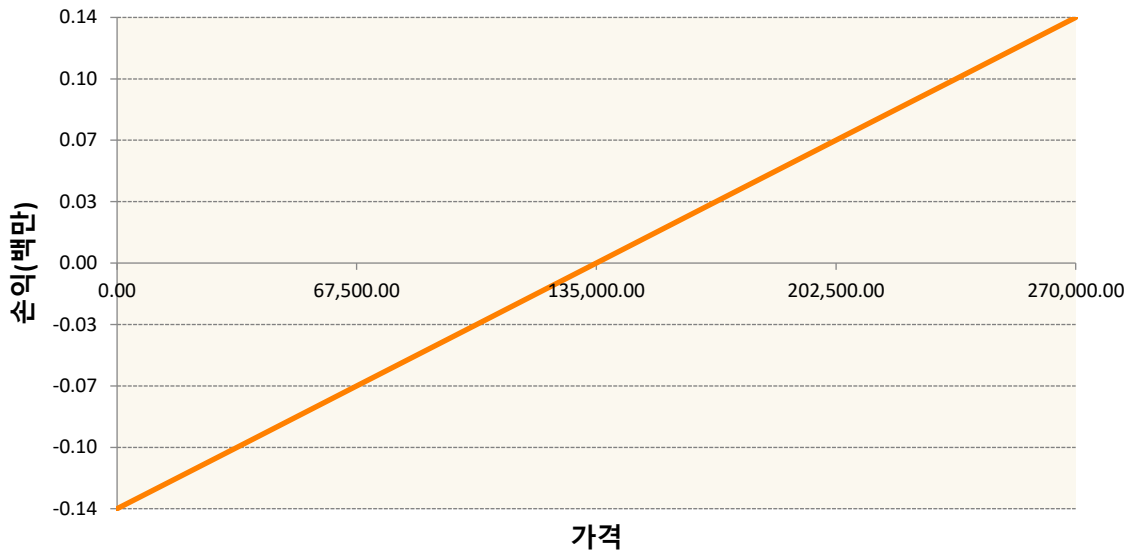
KR4ABF660006-2026-06 삼성중공업개별선물



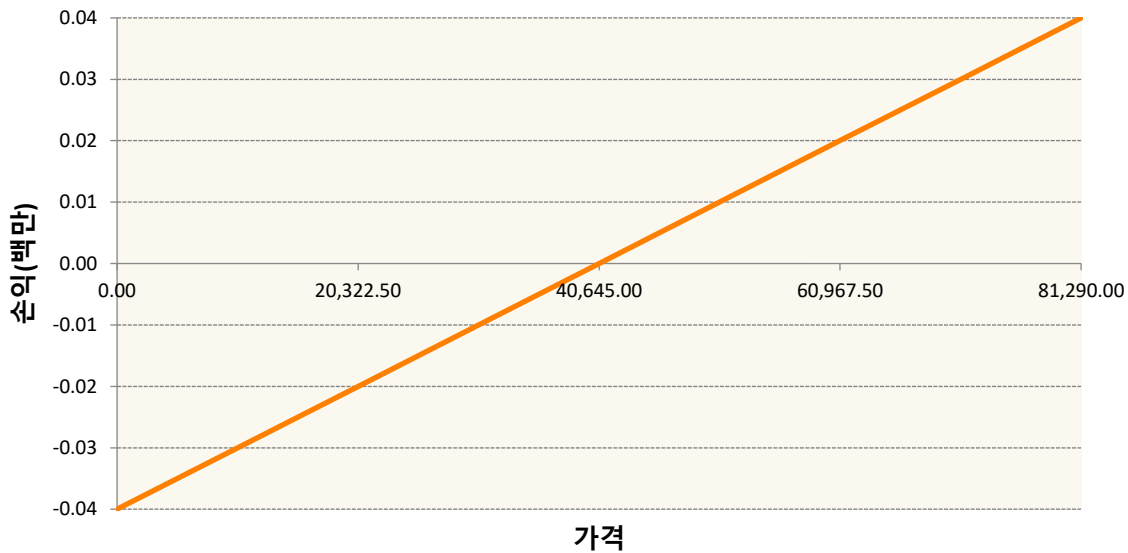
KR4AFD660004-2026-06 HD현대중공업개별선물



KR4AFV660002-2026-06 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4ABF660006		2026-06 삼성중공업개별선물						419
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419	
-5.33%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279	
-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%	279	279	279	279	279	279	279	
8.00%	419	419	419	419	419	419	419	
KR4AFD660004		2026-06 HD현대중공업개별선물						806
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-806	-806	-806	-806	-806	-806	-806
-5.33%	-538	-538	-538	-538	-538	-538	-538
-2.67%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	269	269	269	269	269	269	269
5.33%	538	538	538	538	538	538	538
8.00%	806	806	806	806	806	806	806
KR4AFV660002 2026-06 한화오션개별선물							321
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-321	-321	-321	-321	-321	-321	-321
-5.33%	-214	-214	-214	-214	-214	-214	-214
-2.67%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	107	107	107	107	107	107	107
5.33%	214	214	214	214	214	214	214
8.00%	321	321	321	321	321	321	321

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

(단위:백만원)

2,320

공시일 2026-05-28

기준일 2026-05-27

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	2026-05-28
기준일	2026-05-27

SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

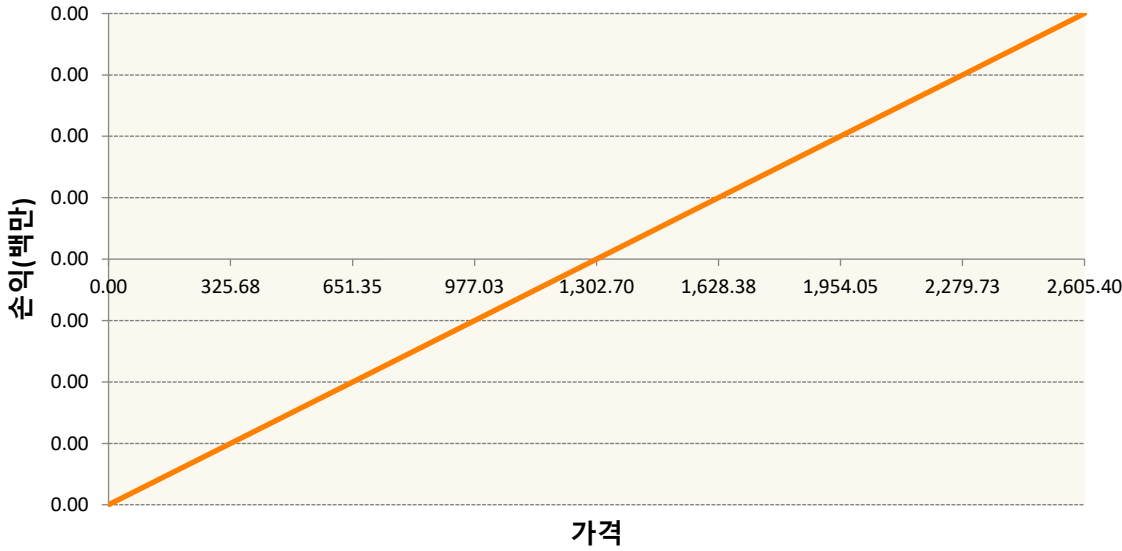
1. 계약금액

(단위:백만원)

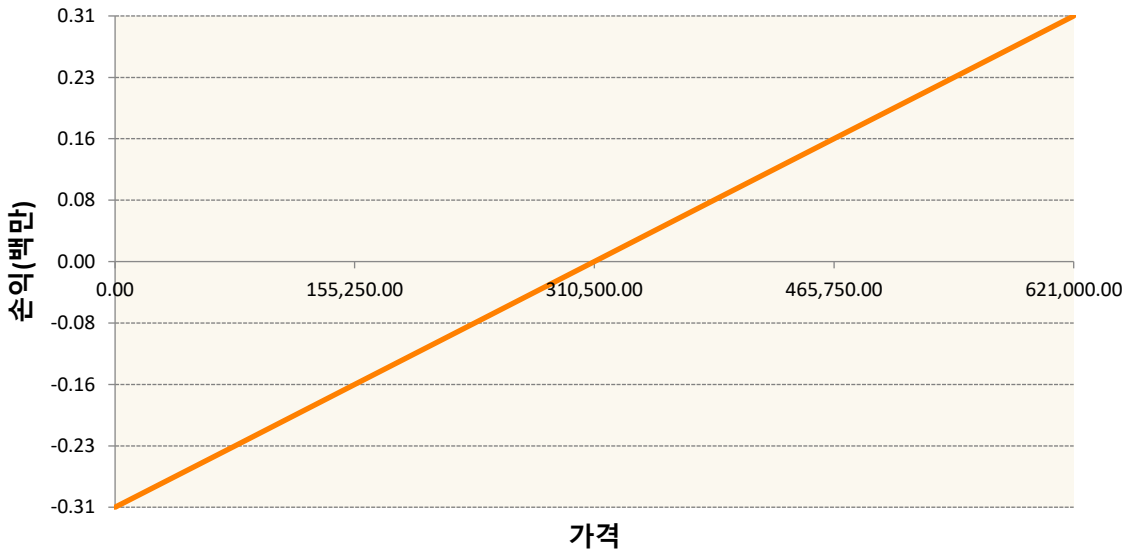
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	25,235	0	25,235	장내
누계	유가증권	옵션	0	63,175	-63,175	장내

2. 만기시점의 손익구조

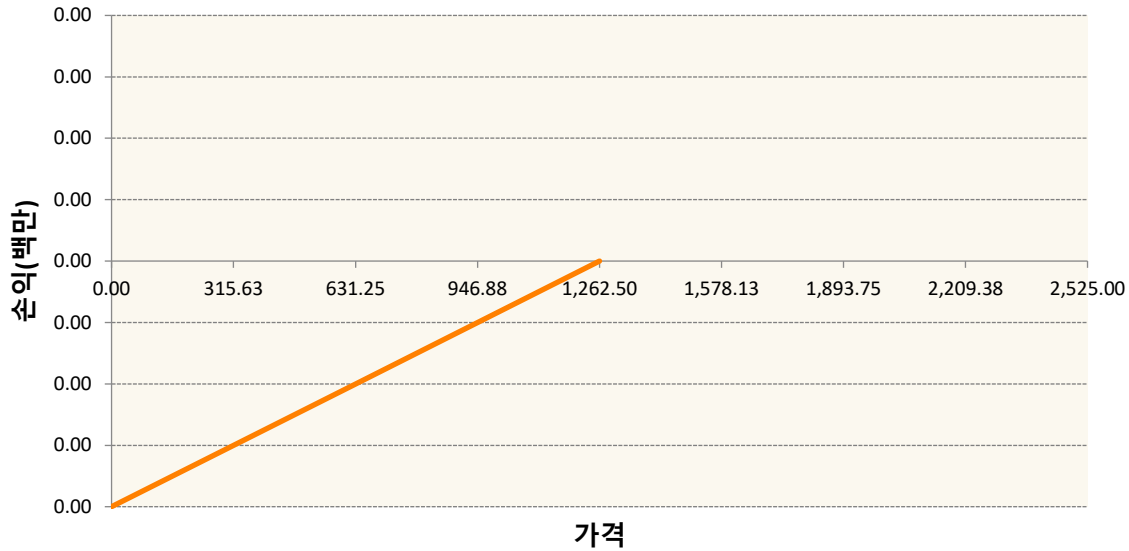
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



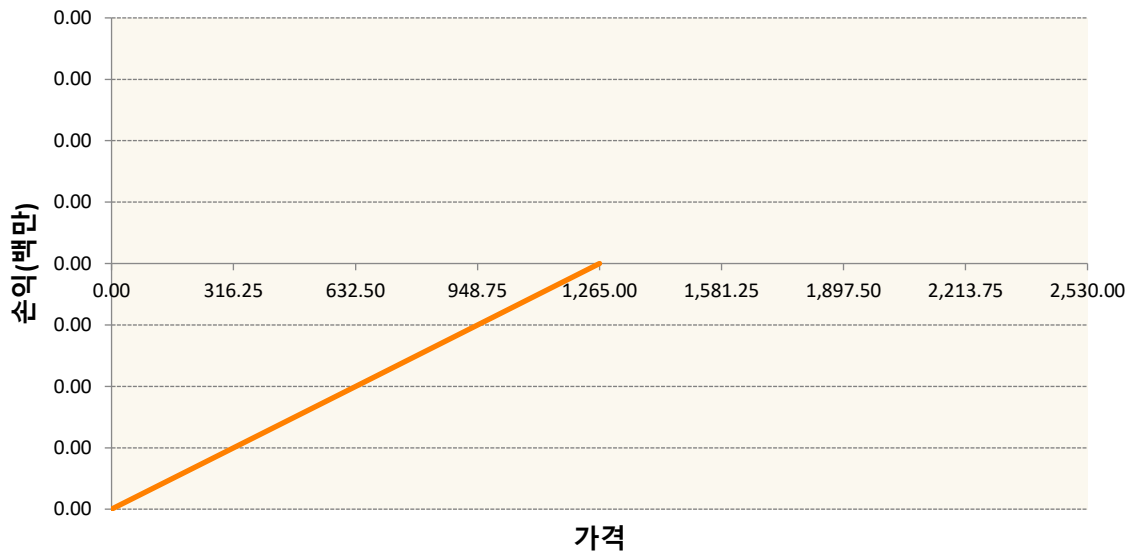
KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



KR4B09F1B078-코스피위클리 C 2605W4 1,262.5



KR4B09F1B086-코스피위클리 C 2605W4 1,265.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물					675	
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-675	-675	-675	-675	-675	-675	-675	
-5.33%	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450	
-2.67%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	225	225	225	225	225	225	225	
5.33%	450	450	450	450	450	450	450	
8.00%	675	675	675	675	675	675	675	
KR4A11660003		2026-06 삼성전자개별선물					1,326	
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326	-1,326
-5.33%	-884	-884	-884	-884	-884	-884	-884
-2.67%	-442	-442	-442	-442	-442	-442	-442
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	442	442	442	442	442	442	442
5.33%	884	884	884	884	884	884	884
8.00%	1,326	1,326	1,326	1,326	1,326	1,326	1,326
KR4B09F1B078 코스피위클리 C 2605W4 1,262.5							1,935

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,820	-1,831	-1,846	-1,864	-1,885	-1,909	-1,935
-5.33%	-885	-921	-959	-998	-1,040	-1,082	-1,125
-2.67%	-211	-262	-313	-364	-415	-465	-516
0%	111	76	39	0	-41	-83	-127
2.67%	203	191	175	156	134	109	81
5.33%	218	216	212	206	197	186	173
8.00%	219	219	218	217	215	211	206
KR4B09F1B086 코스피위클리 C 2605W4 1,265.0							1,321

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,249	-1,256	-1,265	-1,276	-1,289	-1,304	-1,321
-5.33%	-618	-641	-665	-691	-717	-745	-773
-2.67%	-153	-187	-221	-255	-289	-323	-357
0%	77	53	27	0	-28	-57	-87
2.67%	146	137	126	112	96	79	59
5.33%	158	156	153	148	142	134	125
8.00%	159	159	158	157	155	153	149

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

(단위:백만원)

9,546

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

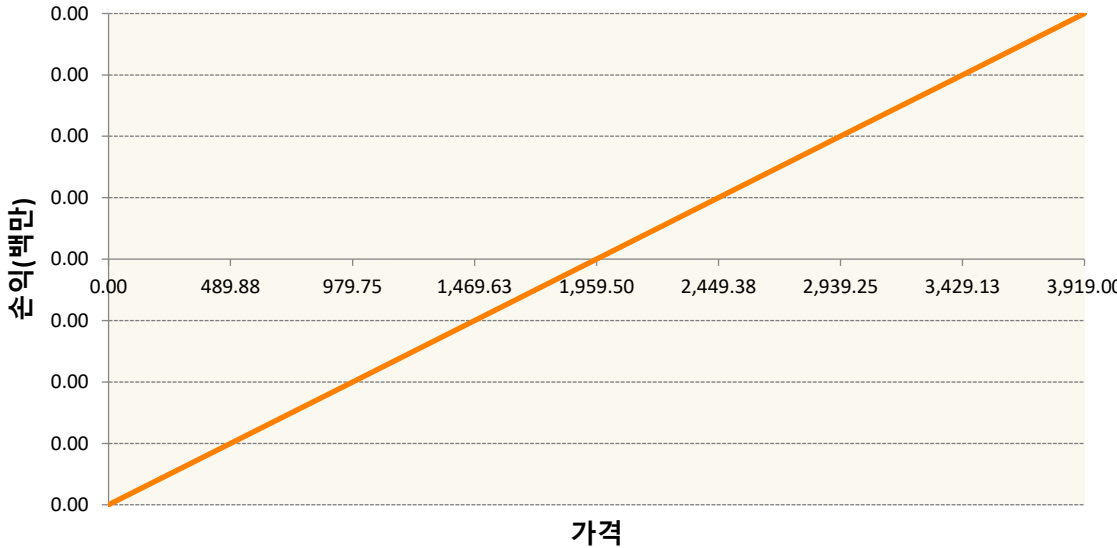
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,156	0	1,156	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

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

(단위:백만원)

16,295

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

(단위:백만원)

22,937

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

포커스농산물모(채권-파생형)

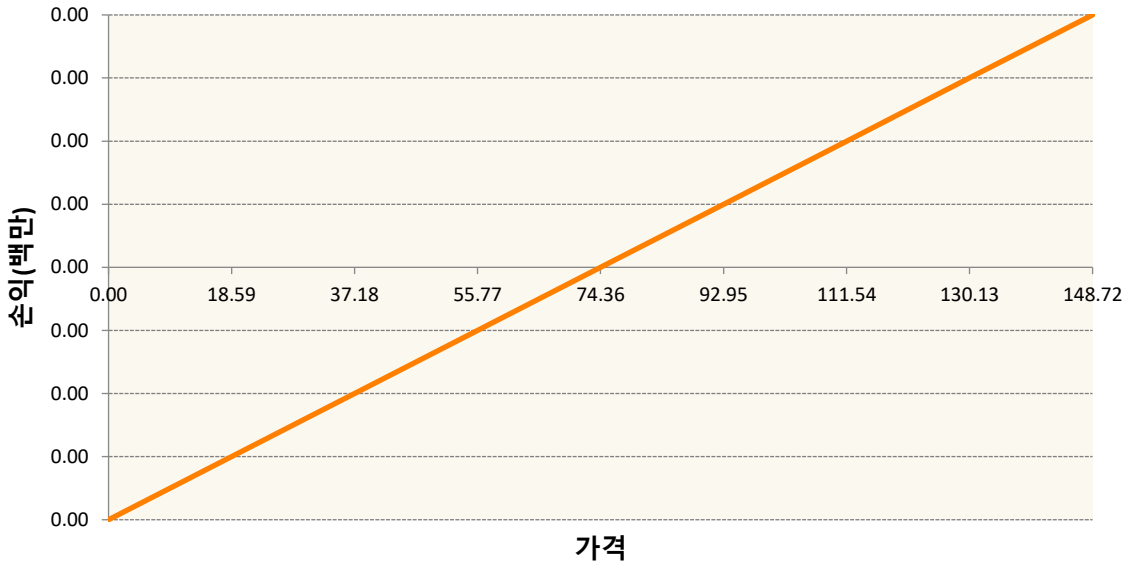
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

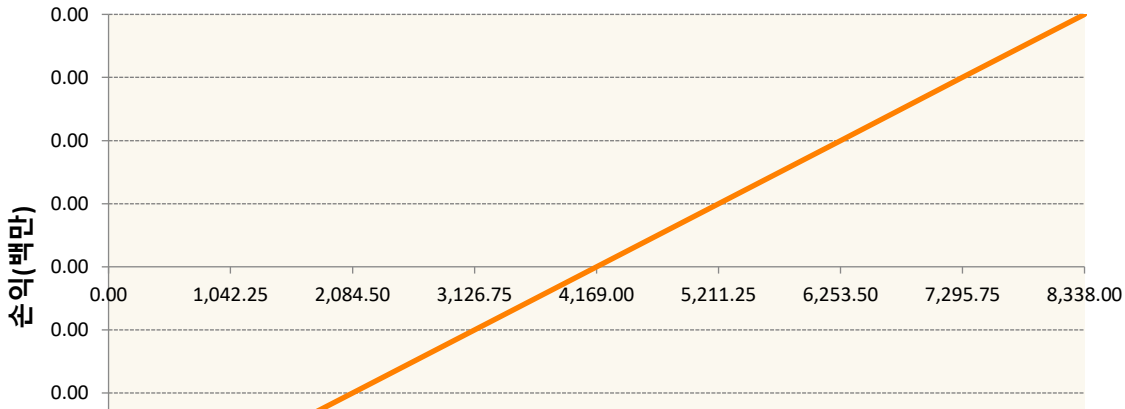
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	63	0	63	
누계	실물자산	선물	814	0	814	장내
누계	유가증권	선물	1,883	0	1,883	
누계	통화	선물	0	345	-345	장내

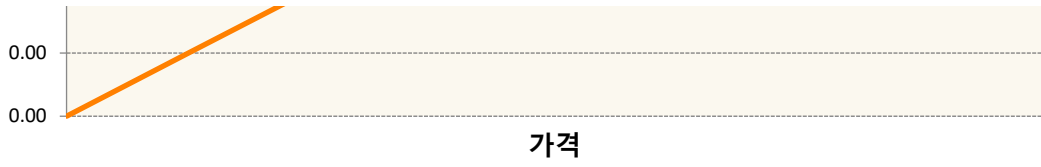
2. 만기시점의 손익구조

BON6-SOYBEAN OIL FUTR Jul26



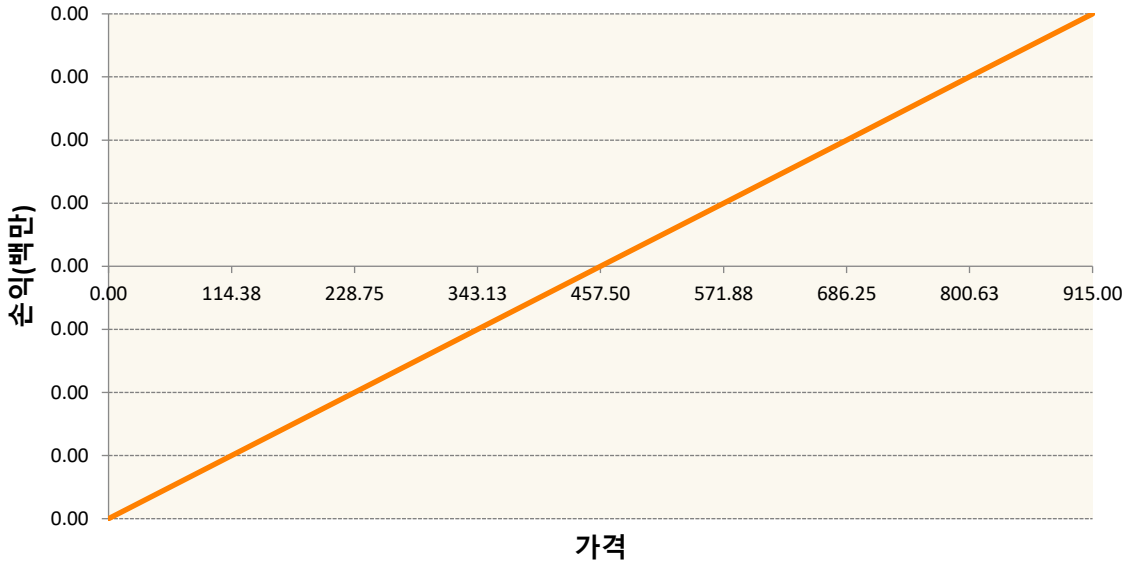
CCN6-COCOA FUTURE Jul26





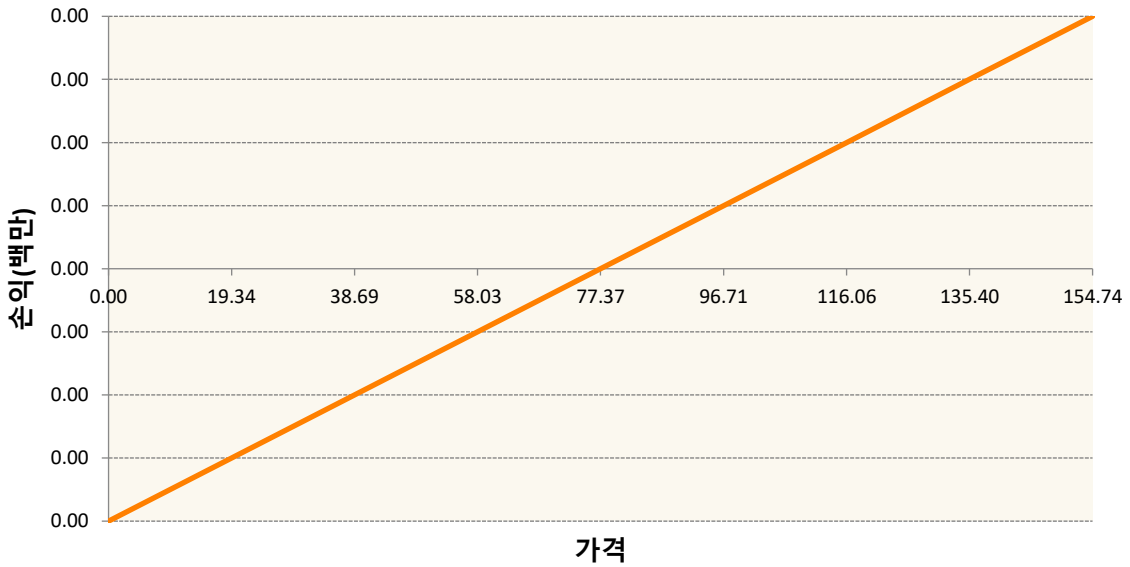
가격

CN6-CORN FUTURE Jul26



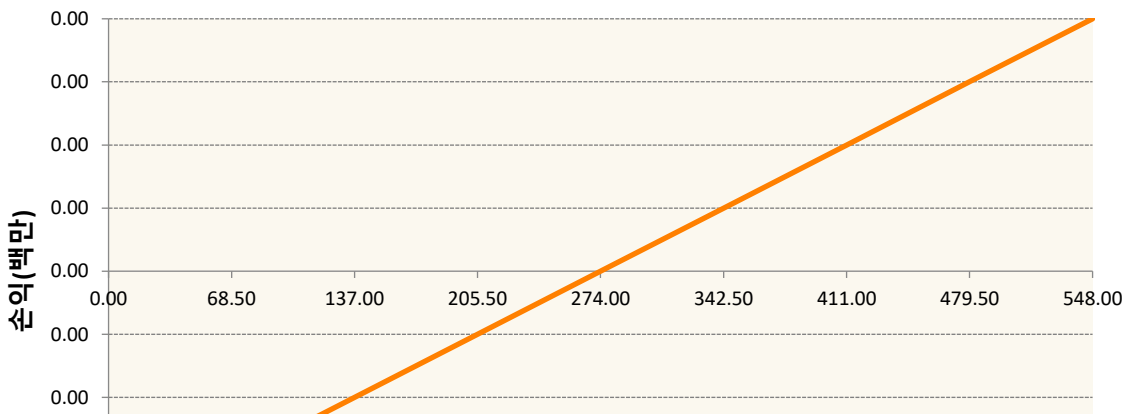
가격

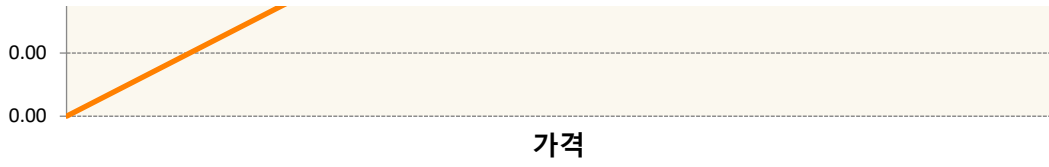
CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26



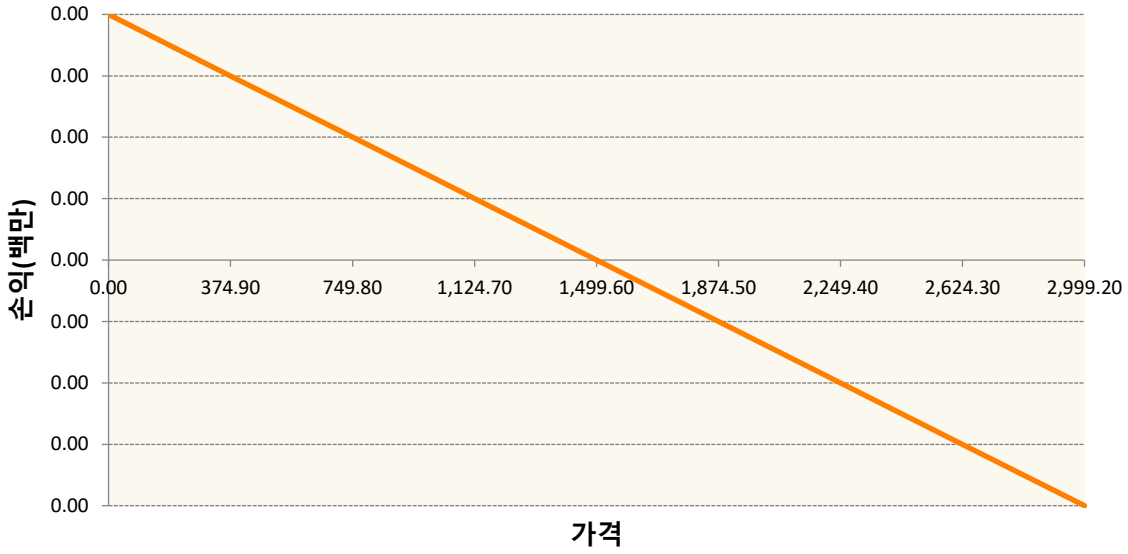
가격

KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

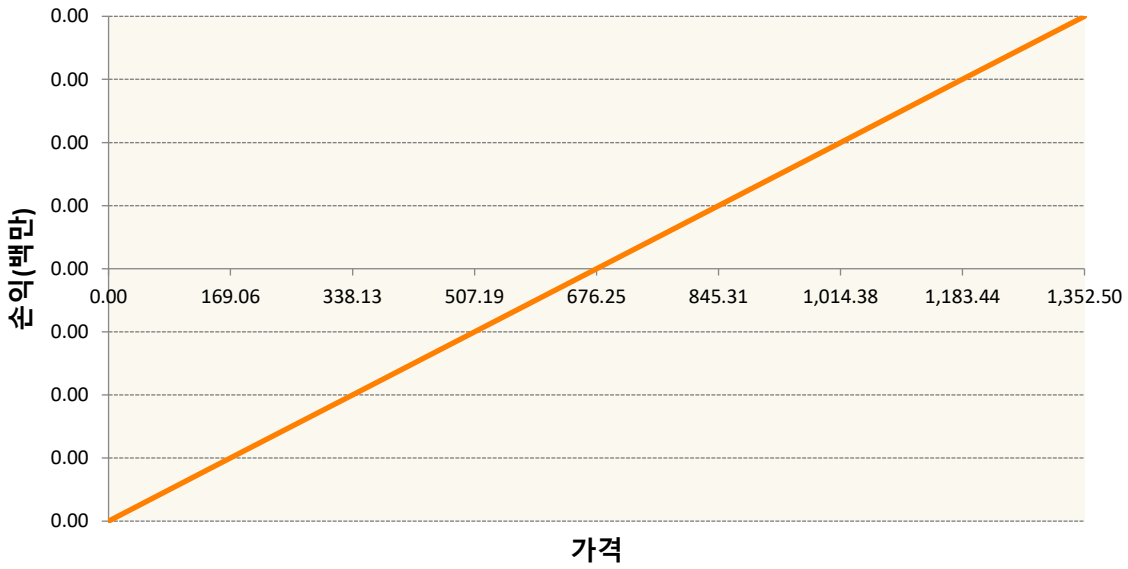




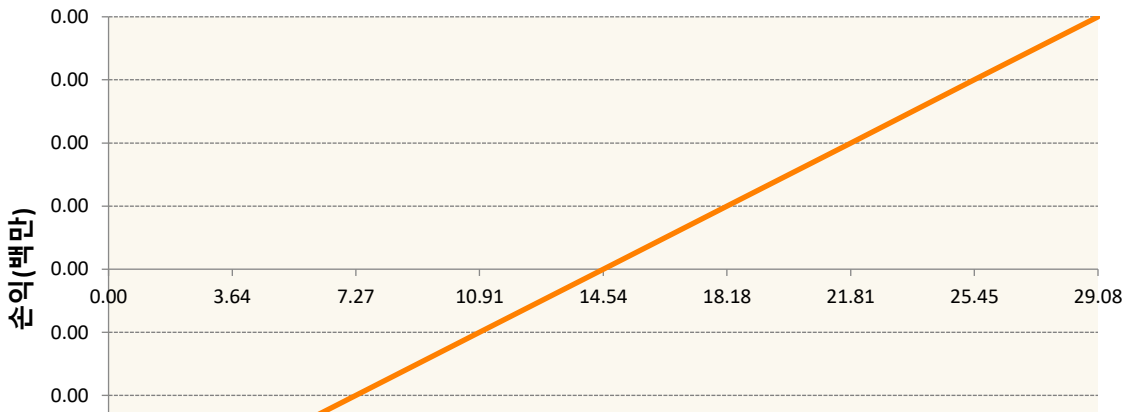
KR4A75660006-2026-06 달러선물

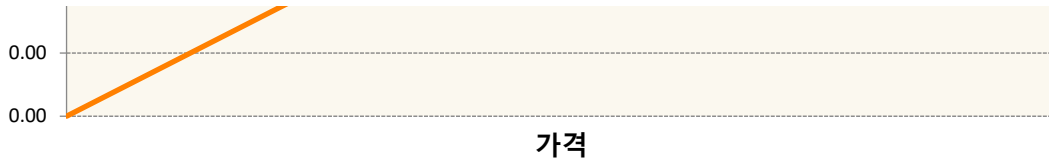


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

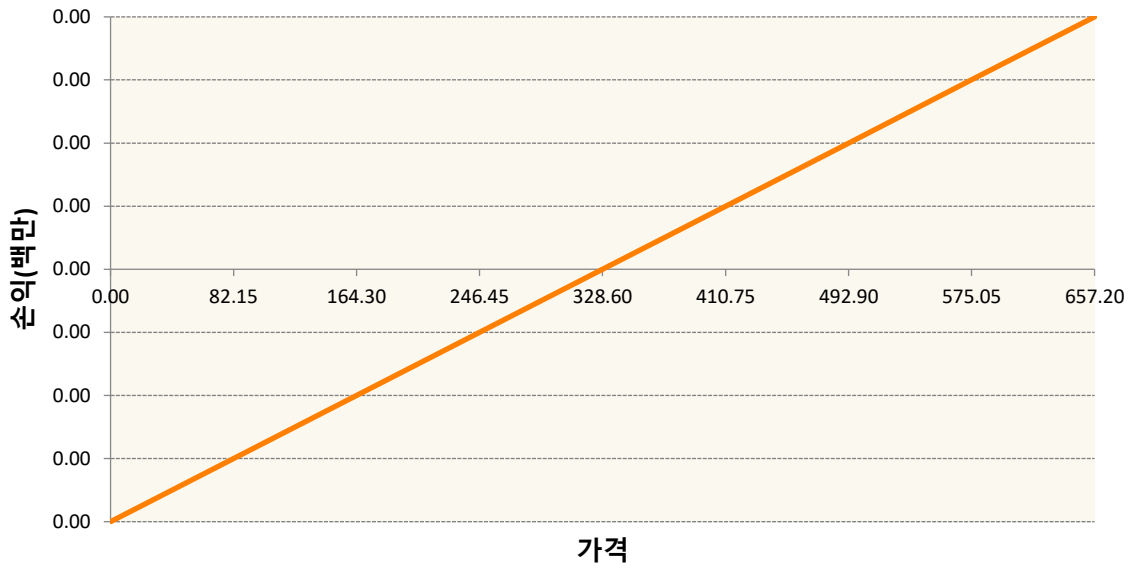


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

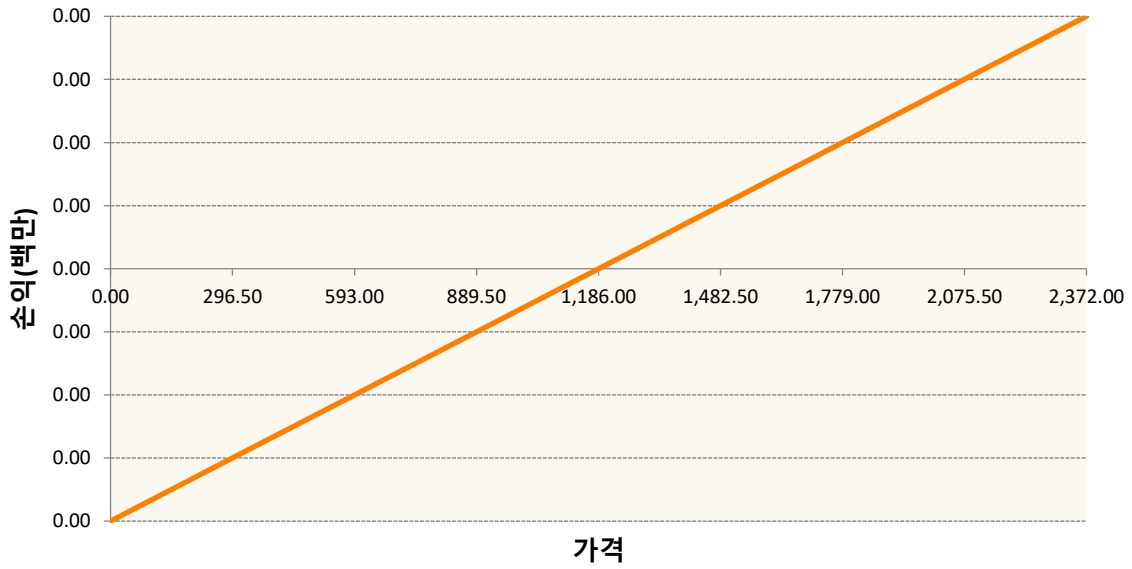




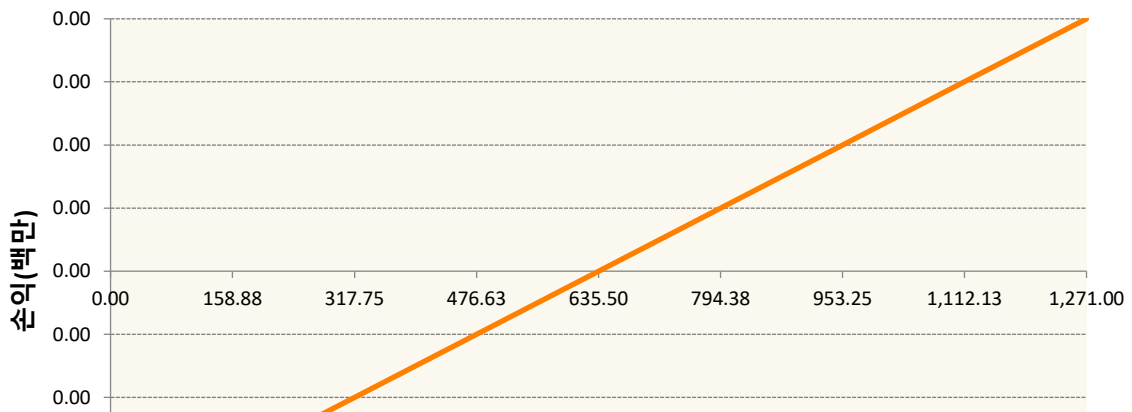
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

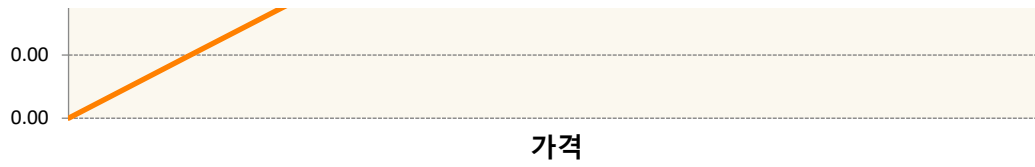


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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 2026-05-28

기준일 2026-05-27

스마트인덱스모

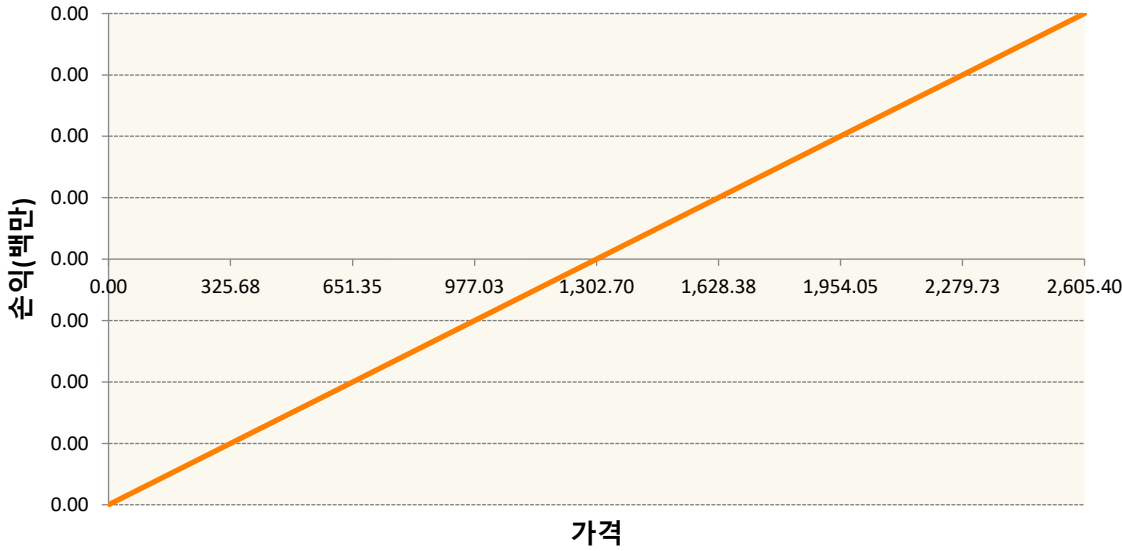
1. 계약금액

(단위:백만원)

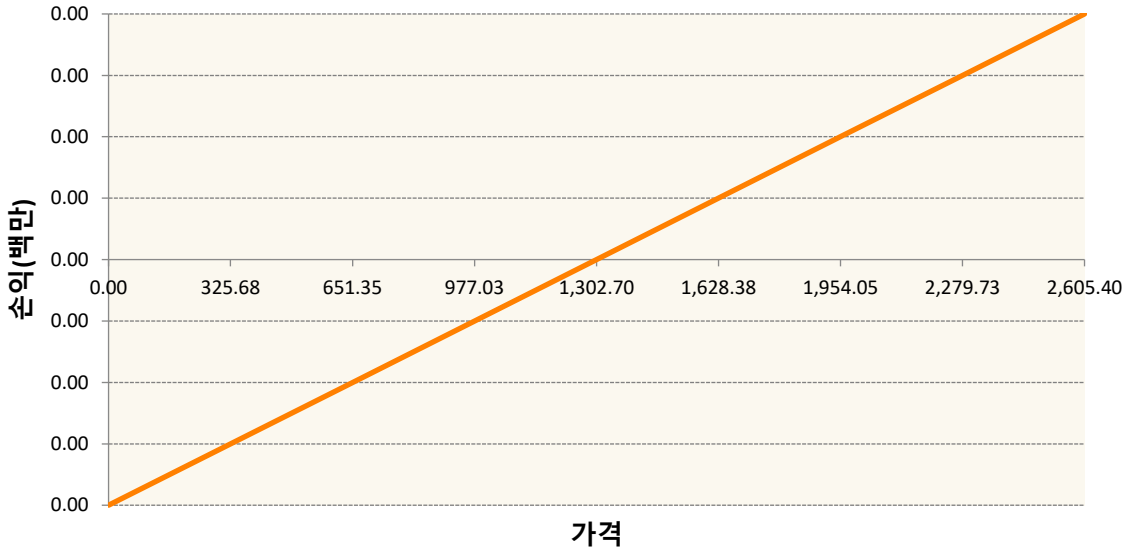
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	668	667	1	장내
누계	유가증권	선물	4,219	339	3,880	장내

2. 만기시점의 손익구조

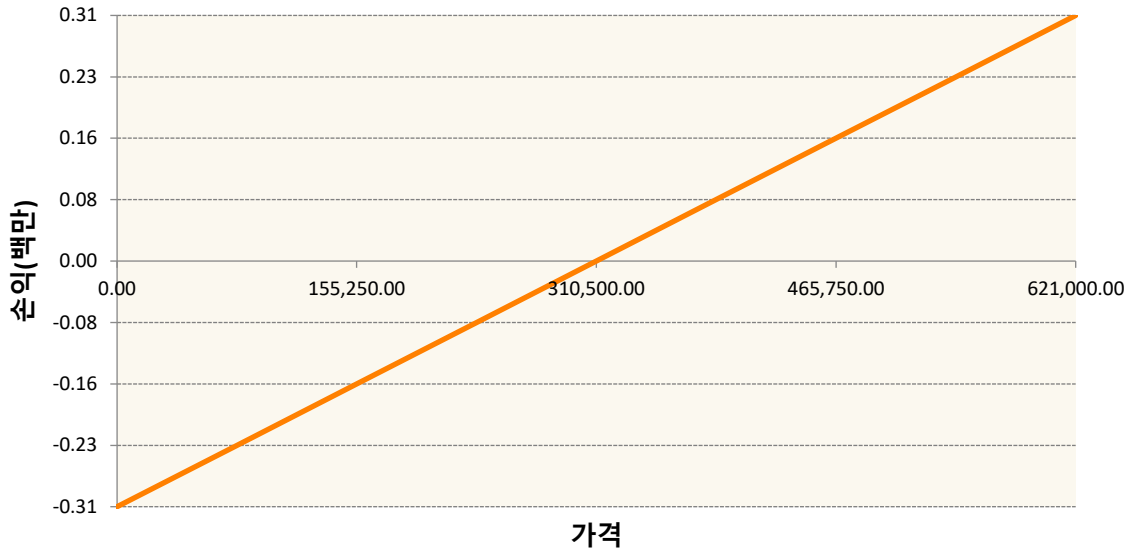
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



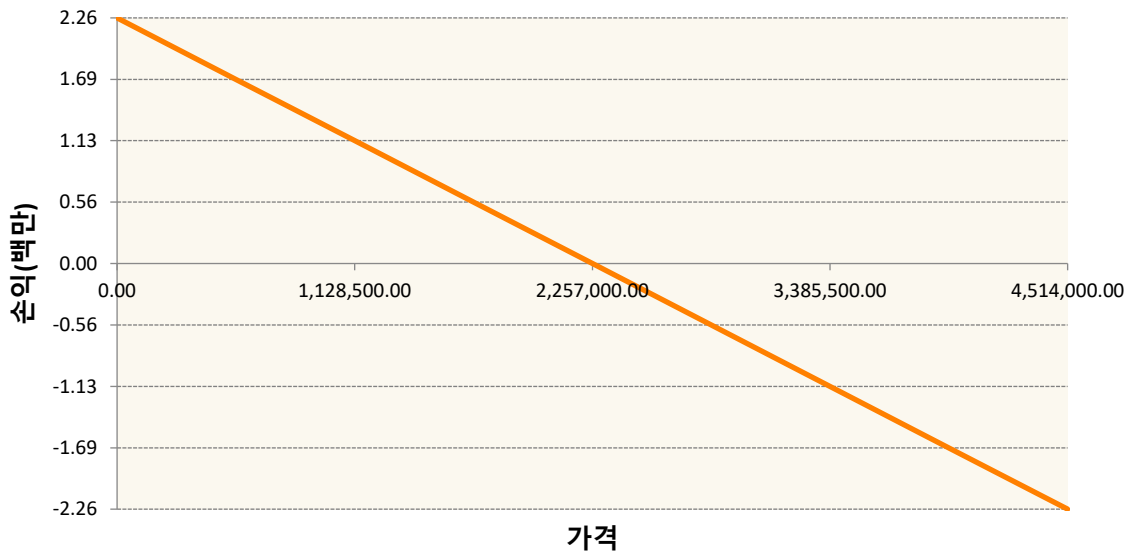
KR4A05660001-2026-06 미니코스피200 선물



KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						260
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-260	-260	-260	-260	-260	-260	-260	
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173	
-2.67%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	87	87	87	87	87	87	87	
5.33%	173	173	173	173	173	173	173	
8.00%	260	260	260	260	260	260	260	
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							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
-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%	25	25	25	25	25	25	25
KR4A50660005 2026-06 SK하이닉스개별선물							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)

782

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

SOL차이나강소기업CSI500상장

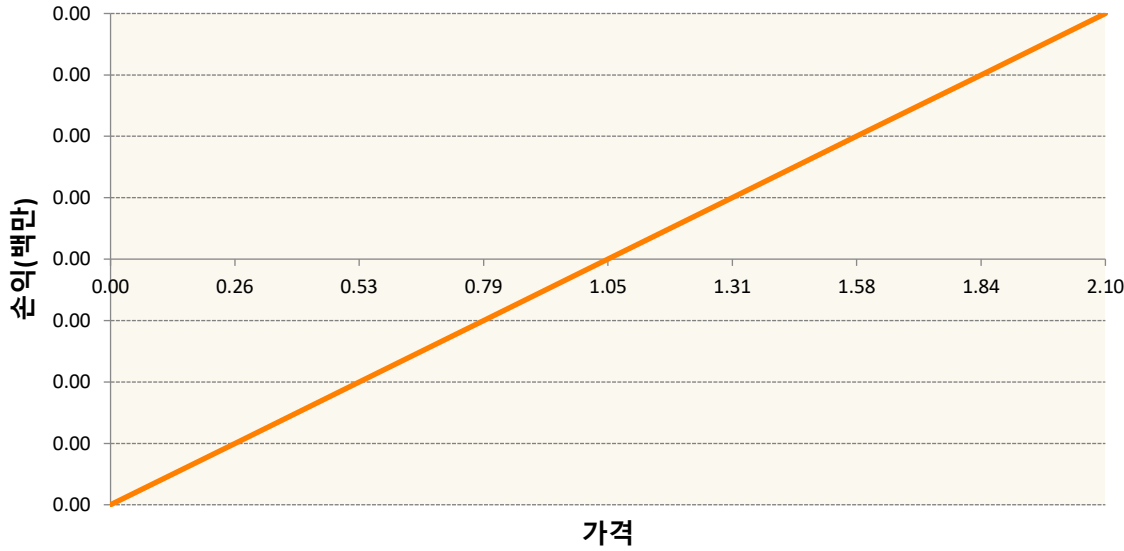
1. 계약금액

(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

SWCSI5000047-CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미)



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)

603

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

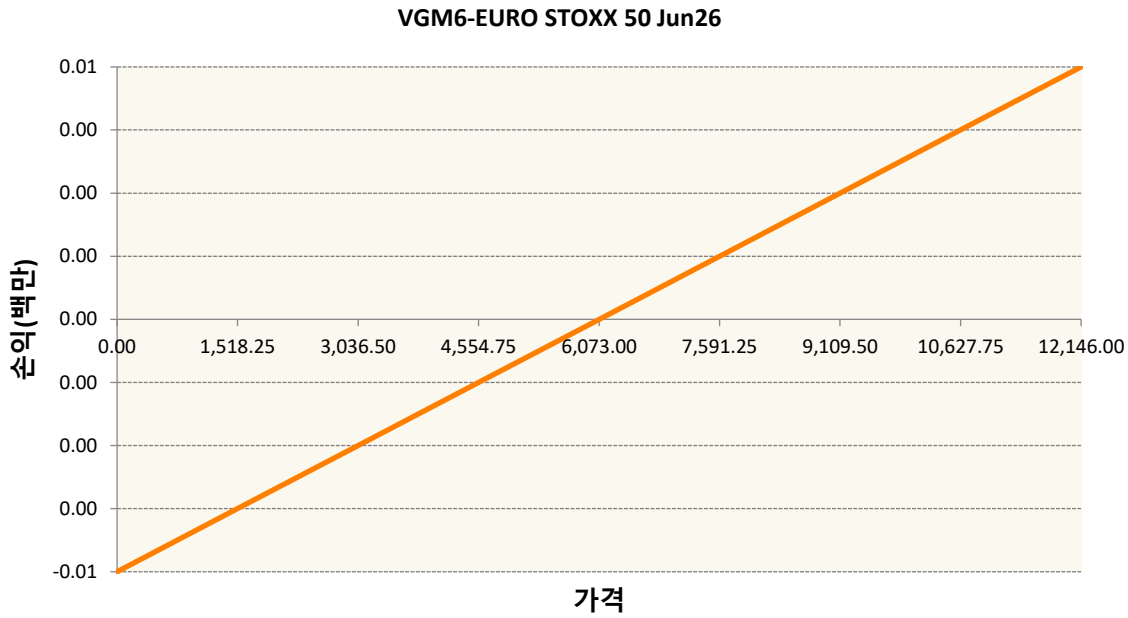
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	937	0	937	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	75
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

67

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

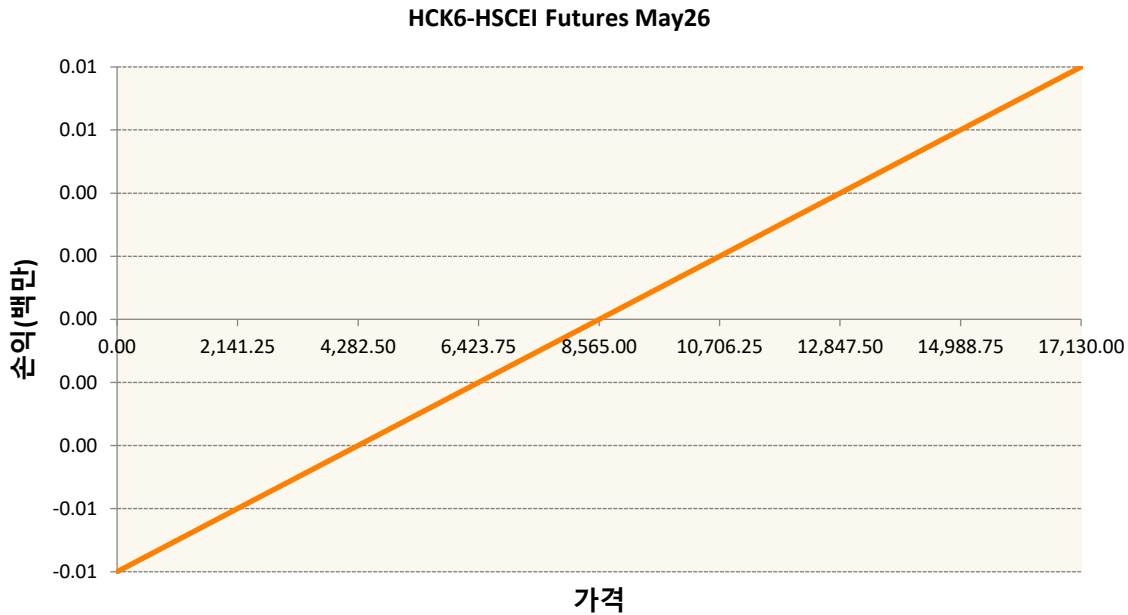
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,449	0	1,449	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCK6	HSCEI Futures May26	116
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

139

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

커버드콜모(주식혼합-파생형)

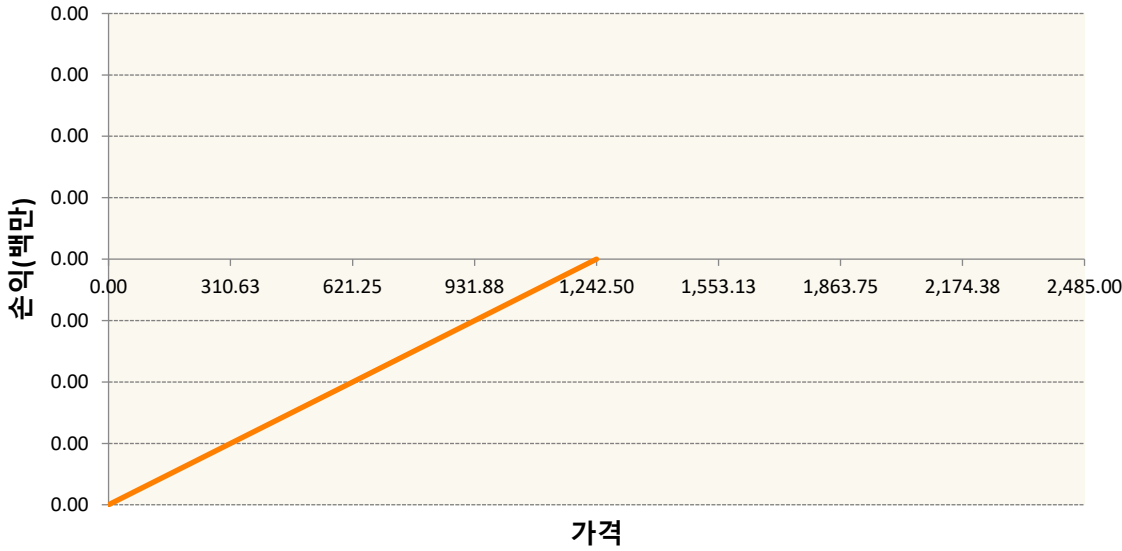
1. 계약금액

(단위:백만원)

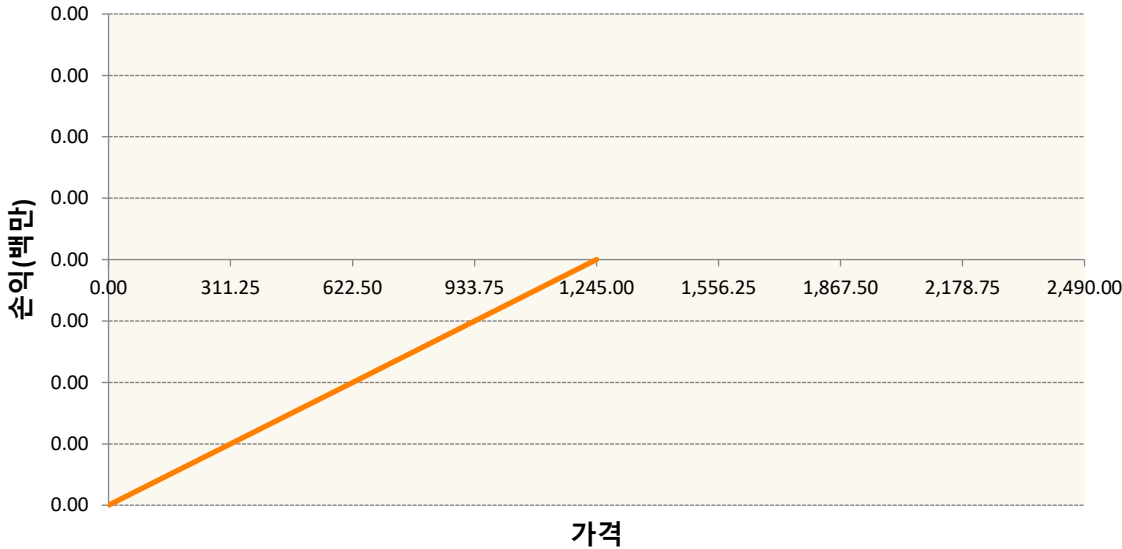
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	1,689	0	1,689	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,309	-37,309	장내

2. 만기시점의 손익구조

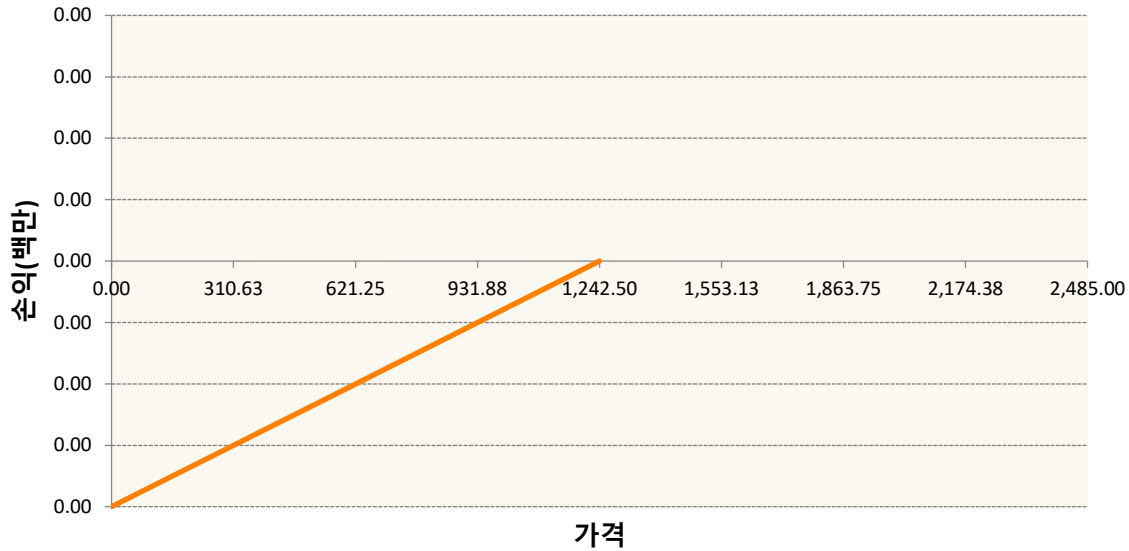
KR4B0166A986-코스피200 C 202606 1,242.5



KR4B0166A994-코스피200 C 202606 1,245.0



KR4C0166A984-코스피200 P 202606 1,242.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0166A986		코스피200 C 202606 1,242.5						677
기초자산의 변동성								
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-302	-363	-426	-488	-551	-614	-677	
-5.33%	-104	-170	-235	-300	-366	-431	-497	
-2.67%	60	-6	-72	-138	-204	-270	-336	
0%	191	128	64	0	-65	-130	-195	
2.67%	294	236	176	115	54	-9	-73	
5.33%	371	320	267	211	153	94	33	
8.00%	428	385	338	288	235	180	124	
KR4B0166A994		코스피200 C 202606 1,245.0						899
기초자산의 변동성								
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-405	-486	-568	-650	-733	-816	-899	
-5.33%	-142	-228	-314	-400	-487	-573	-659	
-2.67%	77	-10	-97	-184	-271	-358	-446	
0%	253	170	85	0	-86	-172	-258	
2.67%	391	314	235	154	72	-11	-95	
5.33%	495	428	356	282	205	126	46	
8.00%	572	515	452	385	315	242	167	
KR4C0166A984		코스피200 P 202606 1,242.5						413
기초자산의 변동성								
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-184	-222	-260	-298	-336	-374	-413	
-5.33%	-63	-103	-143	-183	-223	-263	-303	
-2.67%	36	-4	-44	-84	-124	-165	-205	
0%	117	78	39	0	-40	-79	-119	

2.67%	179	144	108	70	33	-6	-44
5.33%	226	195	163	128	93	57	20
8.00%	261	235	206	176	143	110	75

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

(단위:백만원)

2,544

공시일 2026-05-28

기준일 2026-05-27

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 2026-05-28

기준일 2026-05-27

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

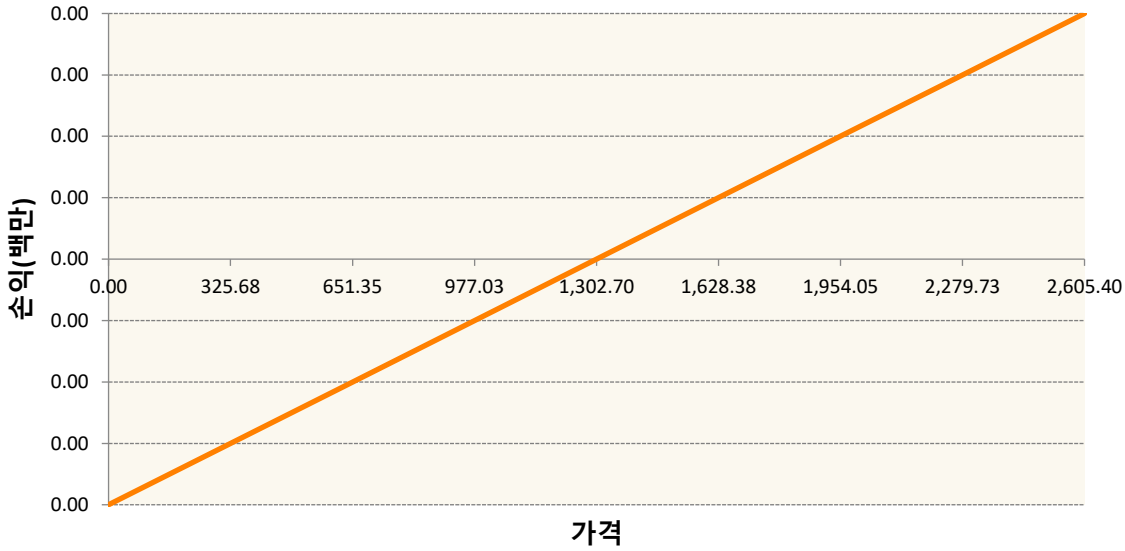
1. 계약금액

(단위:백만원)

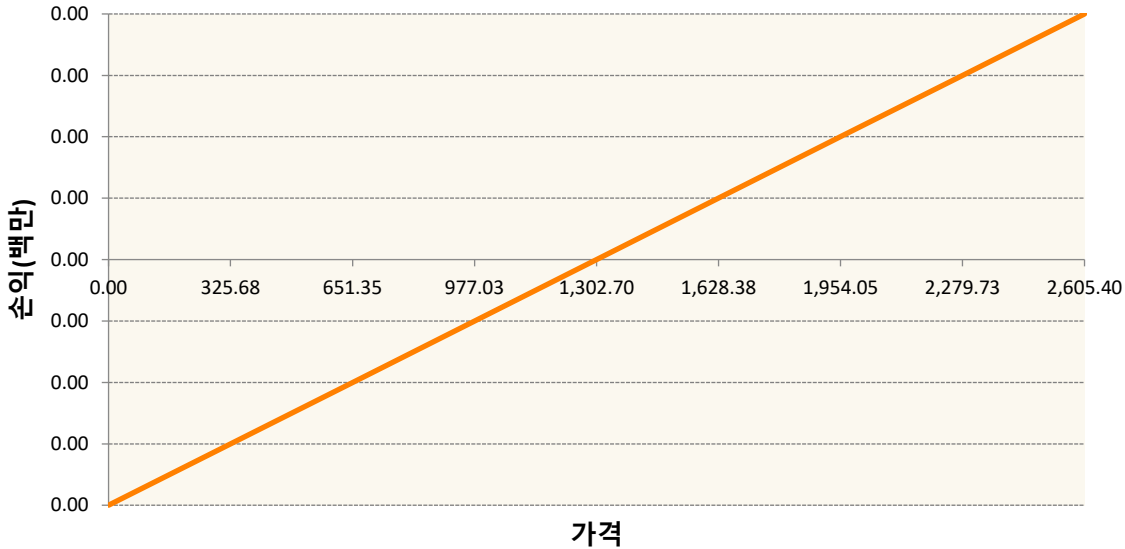
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	333	662	-329	장내
누계	유가증권	선물	2,605	90	2,515	장내

2. 만기시점의 손익구조

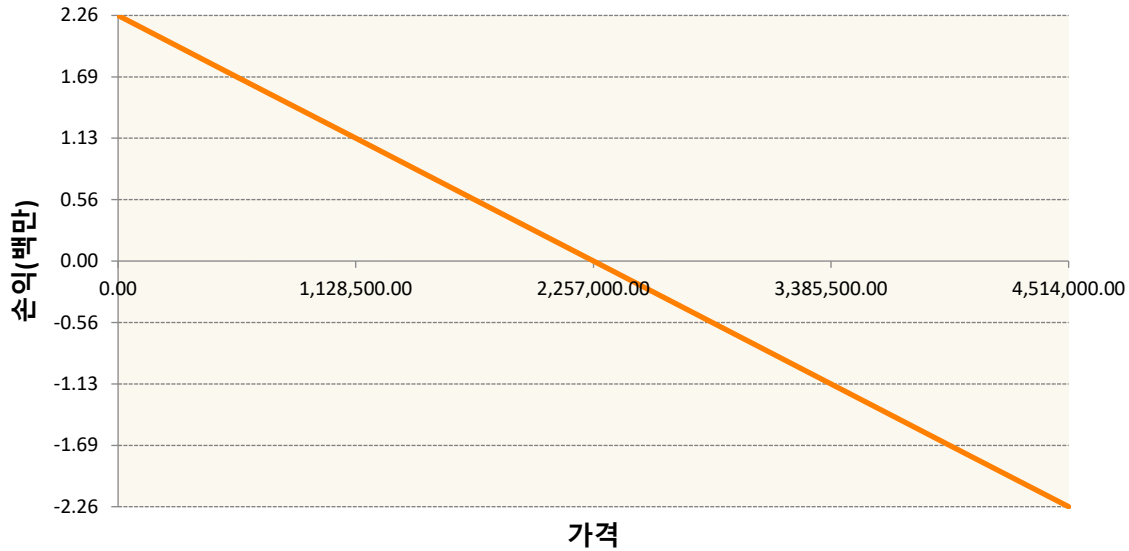
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



KR4A05660001-2026-06 미니코스피200 선물



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						130
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130	
-5.33%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87	
-2.67%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	43	43	43	43	43	43	43	
5.33%	87	87	87	87	87	87	87	
8.00%	130	130	130	130	130	130	130	
KR4A05660001		2026-06 미니코스피200 선물						16
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
-5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	5	5	5	5	5	5	5	
5.33%	10	10	10	10	10	10	10	
8.00%	16	16	16	16	16	16	16	
KR4A50660005		2026-06 SK하이닉스개별선물						7
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7	
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5	
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2	
0%	0	0	0	0	0	0	0	

2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

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

(단위:백만원)

359

공시일 2026-05-28

기준일 2026-05-27

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

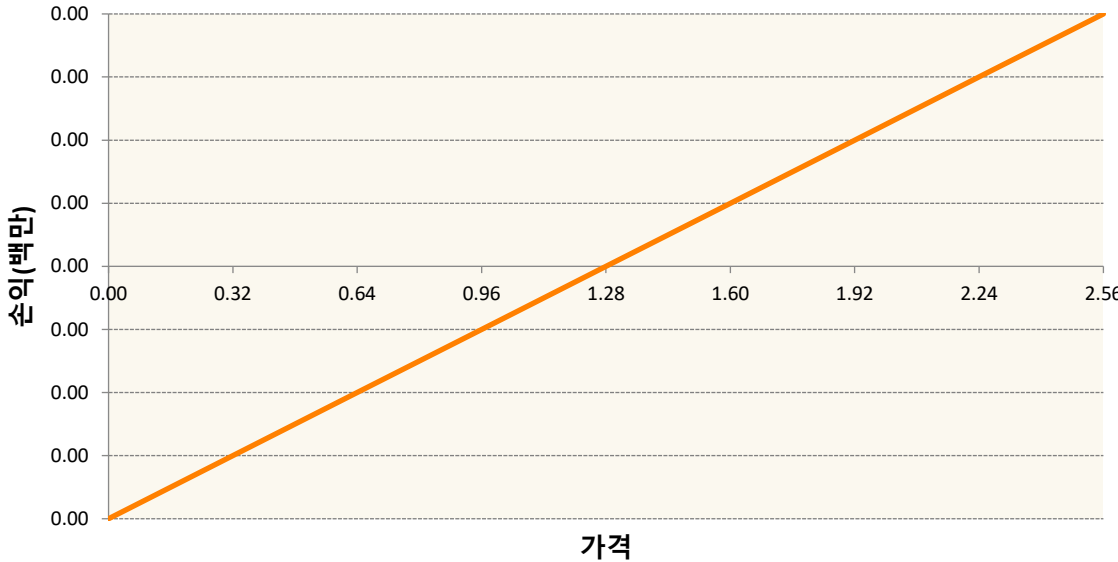
1. 계약금액

(단위:백만원)

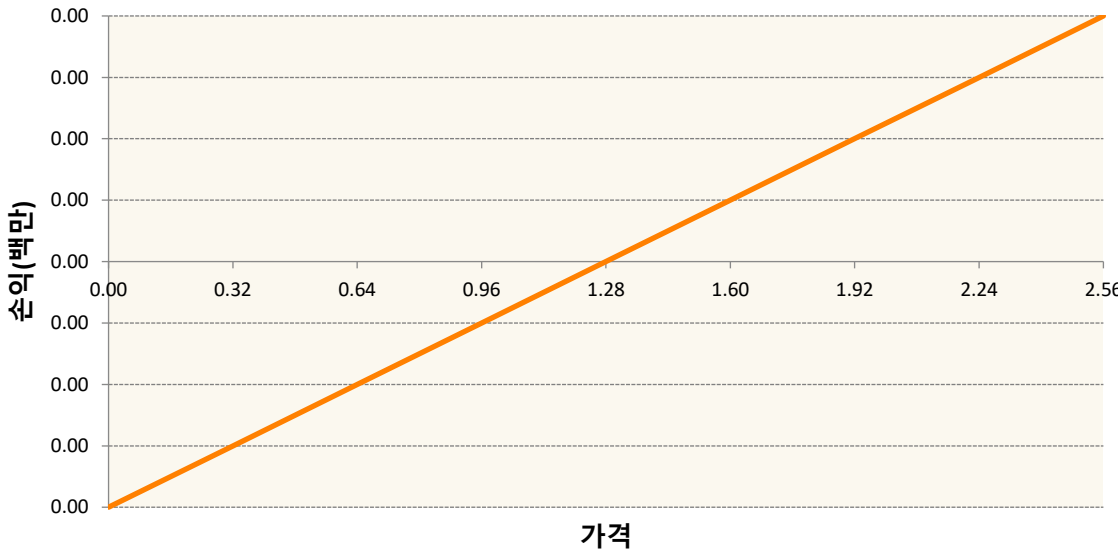
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,355	0	7,355	장외

2. 만기시점의 손익구조

2108840319ID-ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(



2108841218ID-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319	ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(471
2108841218	ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	118

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

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

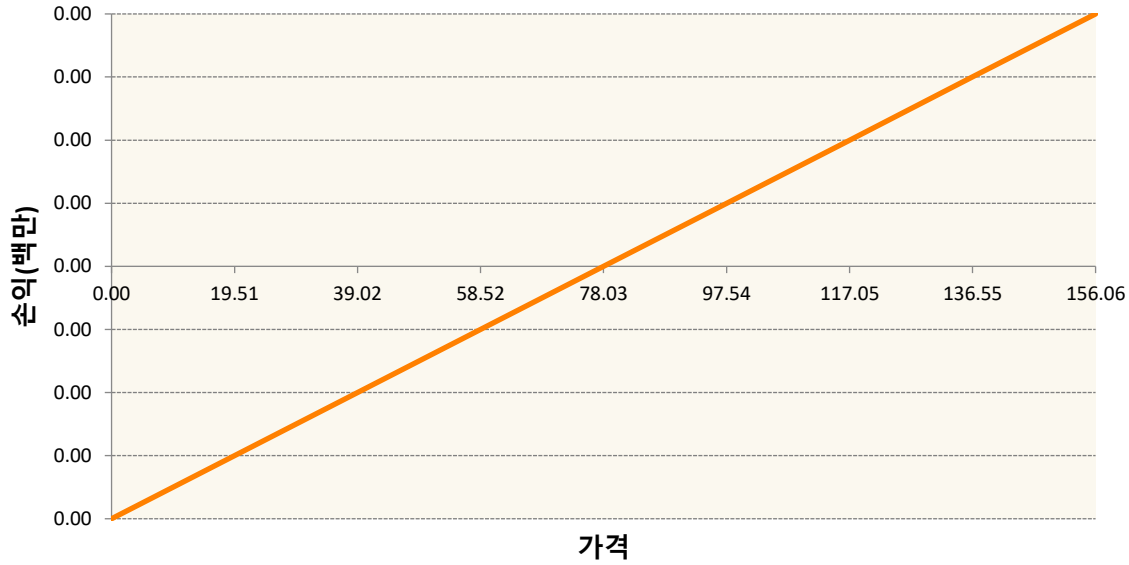
1. 계약금액

(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			5,034	0	5,034	
누계	통화	선도	0	5,015	-5,015	장외

2. 만기시점의 손익구조

MOZ26-ECX EMISSION Dec26



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	191
FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	210
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	403

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

(단위:백만원)

814

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

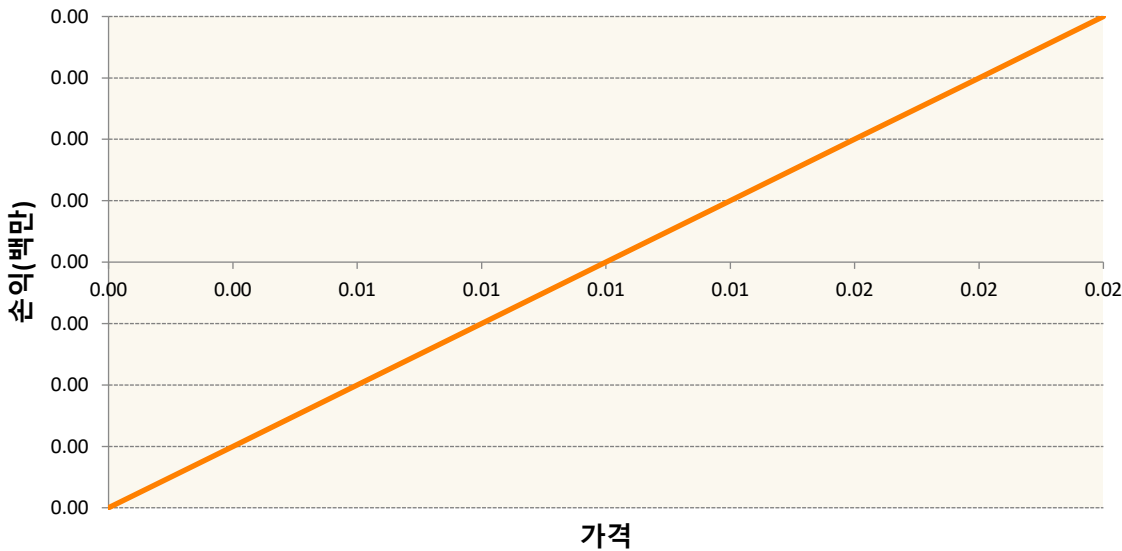
1. 계약금액

(단위:백만원)

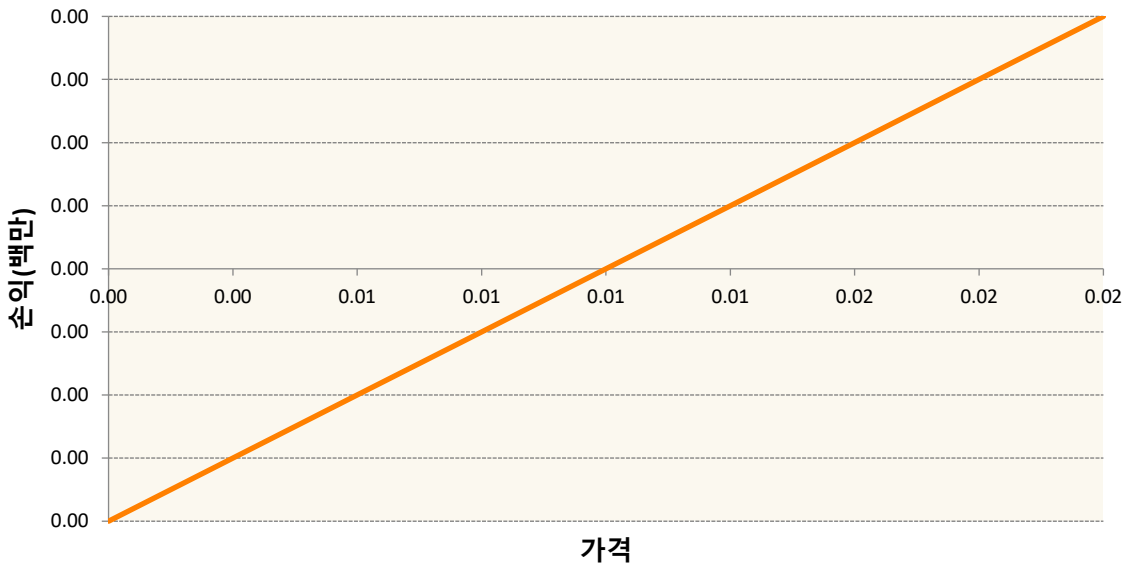
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	1,333	0	1,333	장외
누계	지수	스왑	2,018	0	2,018	장외

2. 만기시점의 손익구조

SWSOL0000032-신한CSI Index 250930 (메리츠)



SWSOL0000039-CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)		1
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)		1
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)		2
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(1

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

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

SOL차이나육성산업액티브상장지

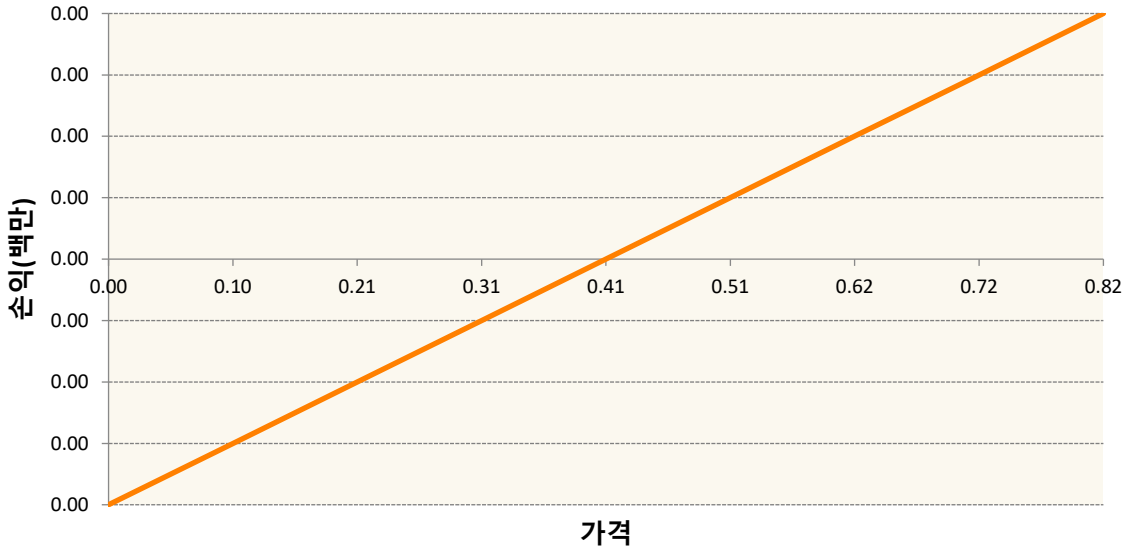
1. 계약금액

(단위:백만원)

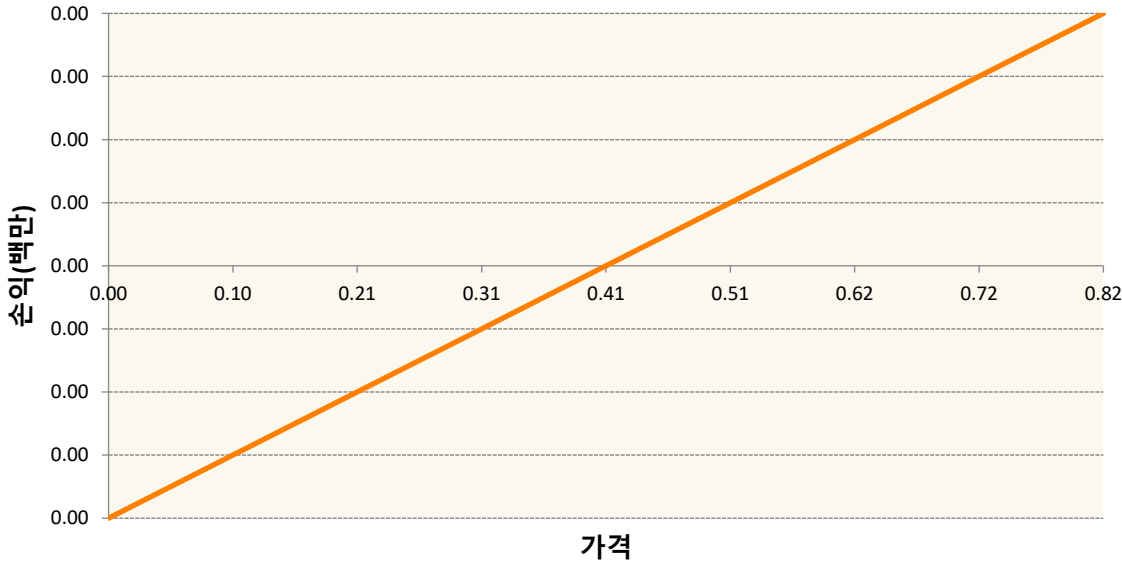
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	10,371	0	10,371	장외

2. 만기시점의 손익구조

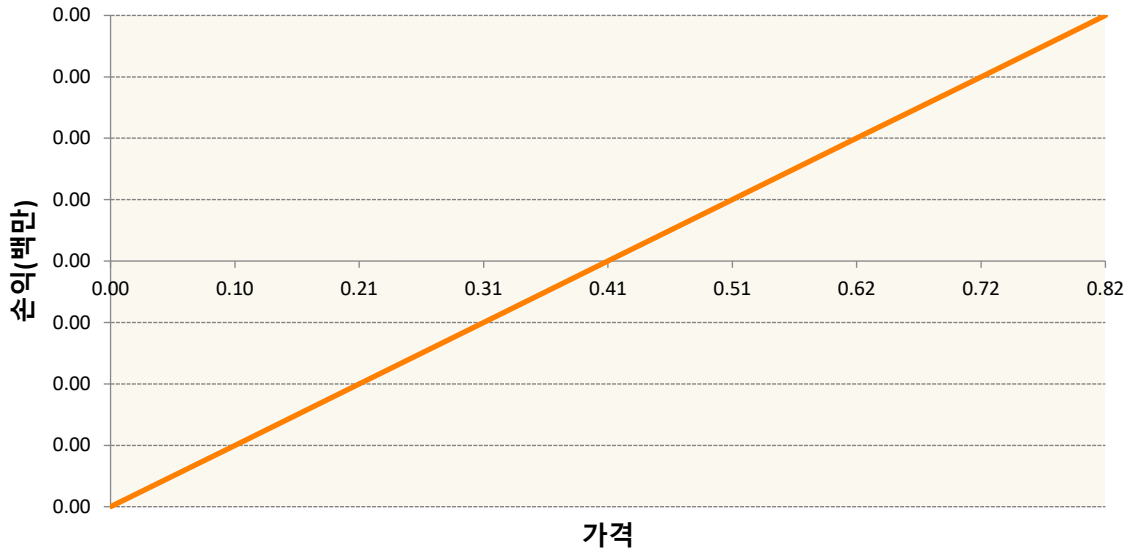
SWSTAR000027-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)



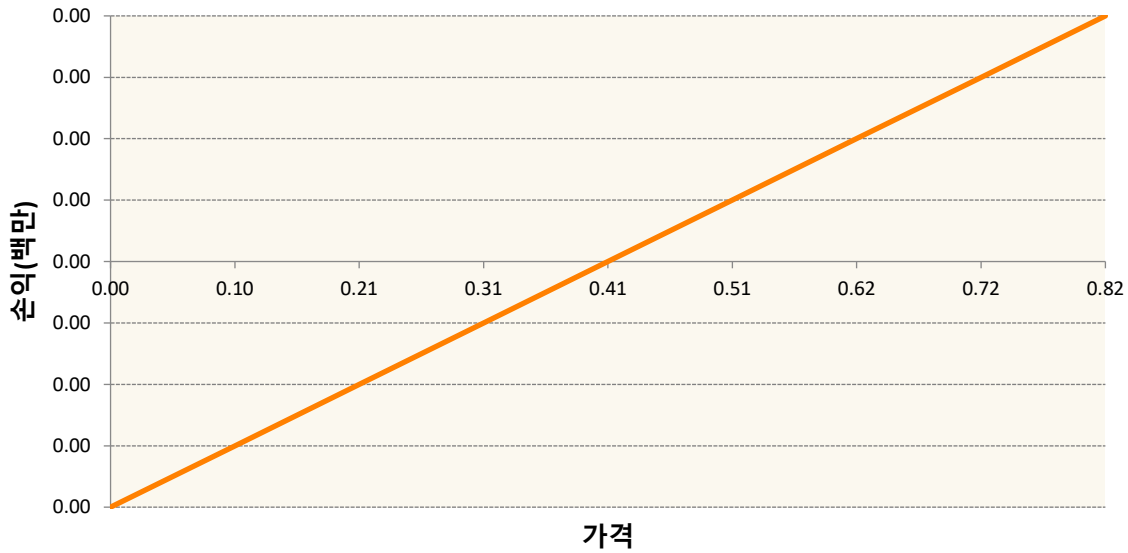
SWSTAR000030-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)



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)	29
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	100
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	510
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	189

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

(단위:백만원)

1,268

공시일 2026-05-28

기준일 2026-05-27

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

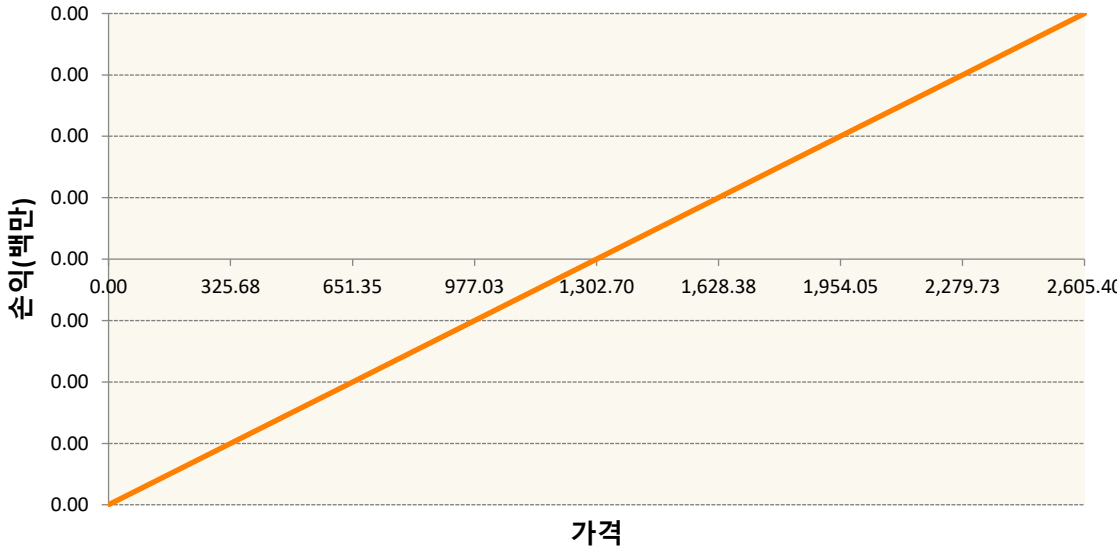
1. 계약금액

(단위:백만원)

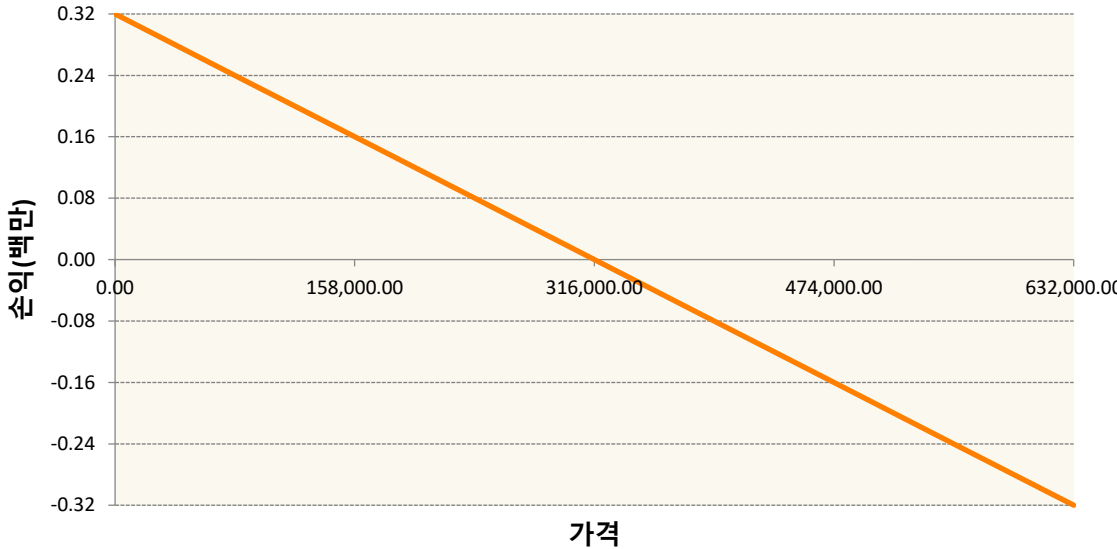
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,335	4,317	1,018	장내
누계	유가증권	선물	17,222	3,671	13,551	장내

2. 만기시점의 손익구조

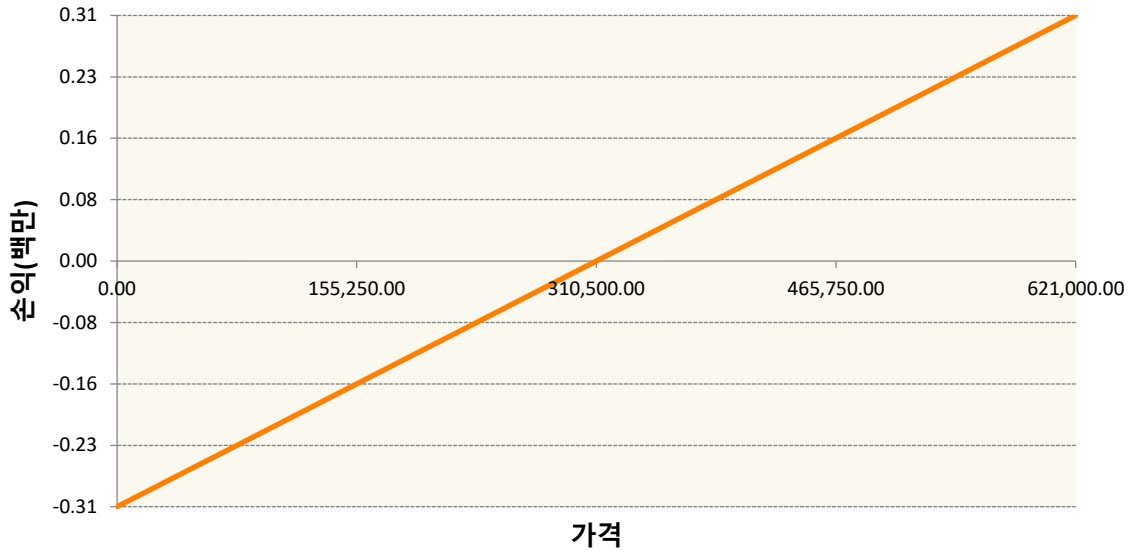
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



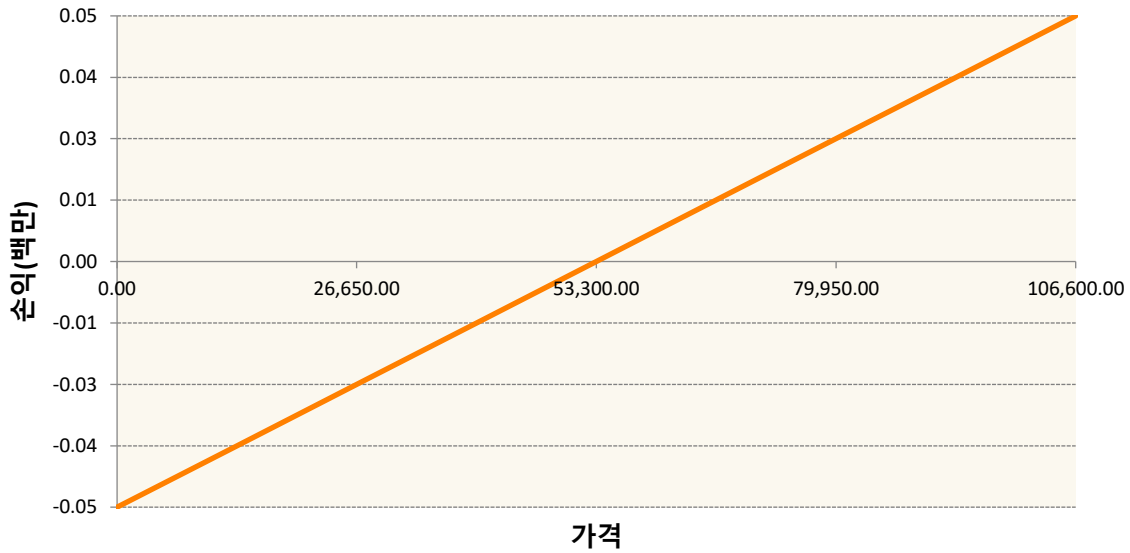
KR4A0Z660006-2026-06 한미반도체개별선물



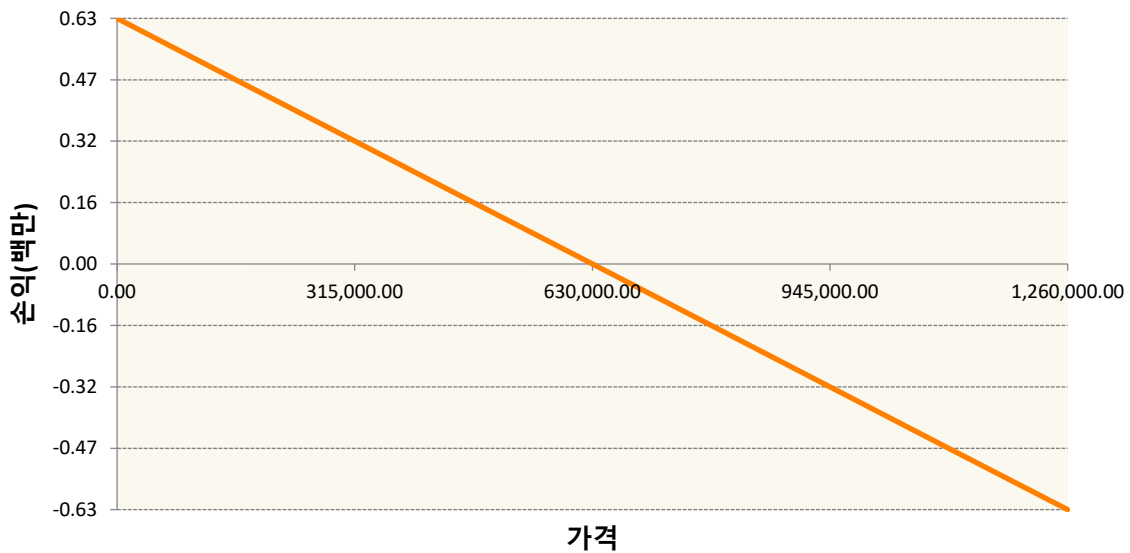
KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



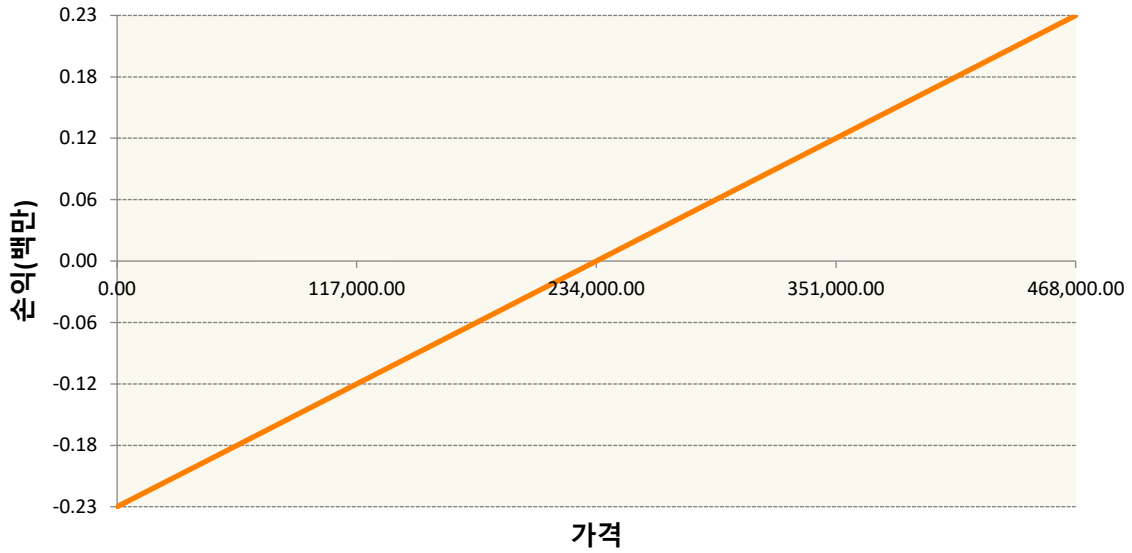
KR4A14660000-2026-06 KT개별선물



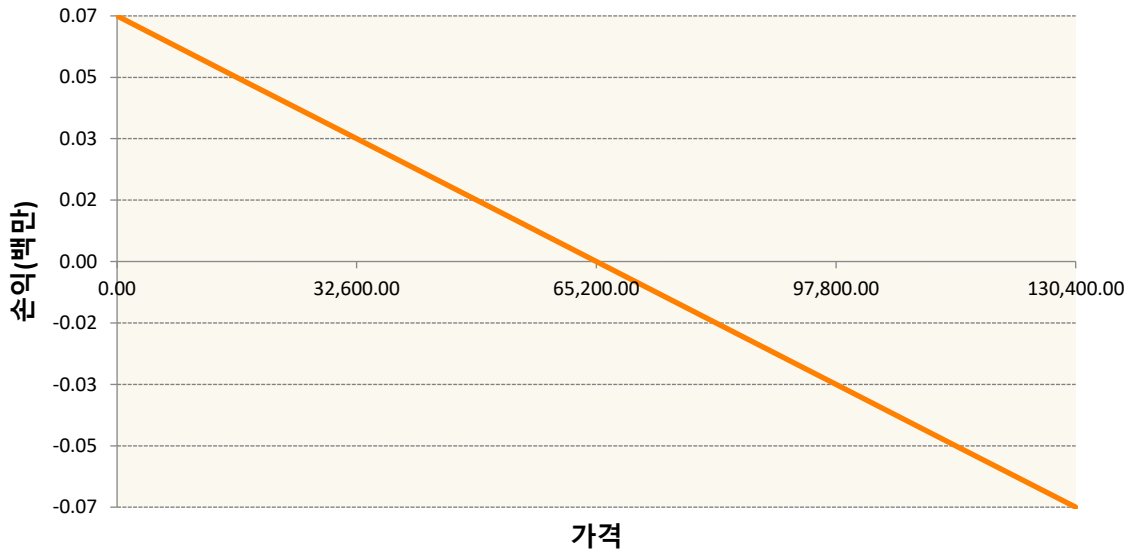
KR4A22660000-2026-06 삼성SDI개별선물



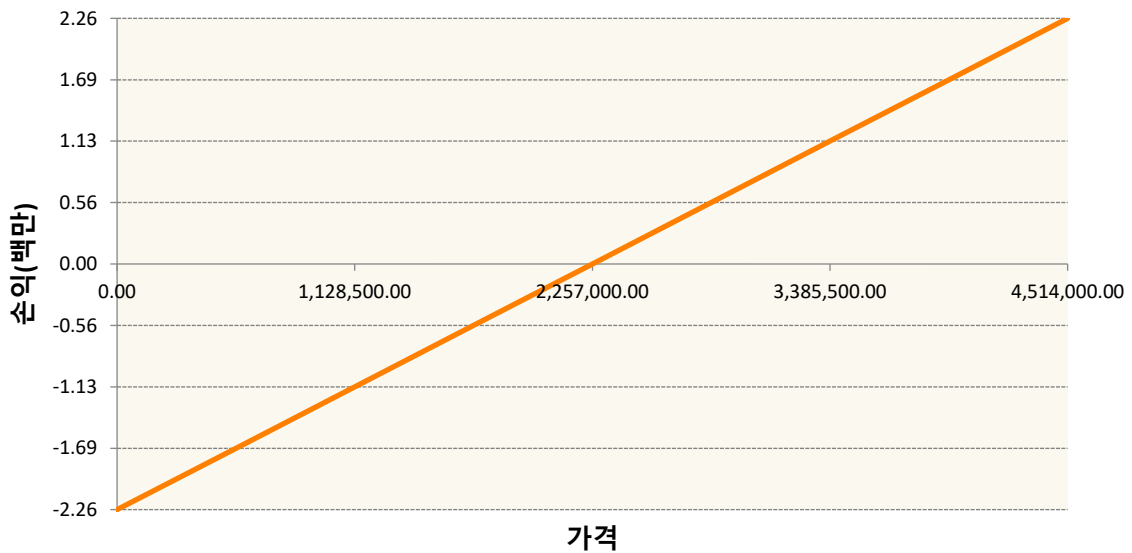
KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



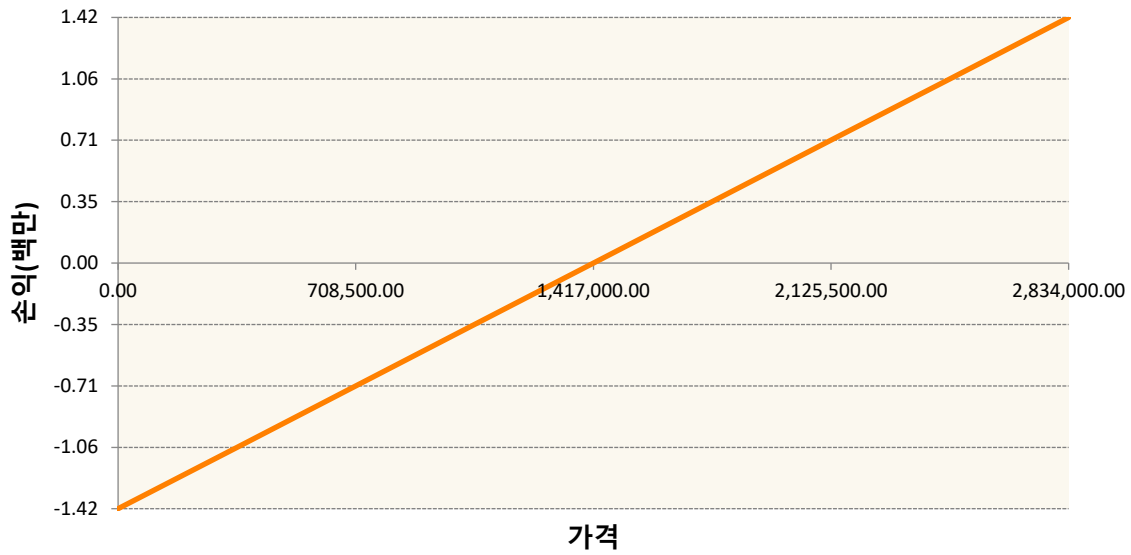
KR4A48660000-2026-06 미래에셋증권개별선물



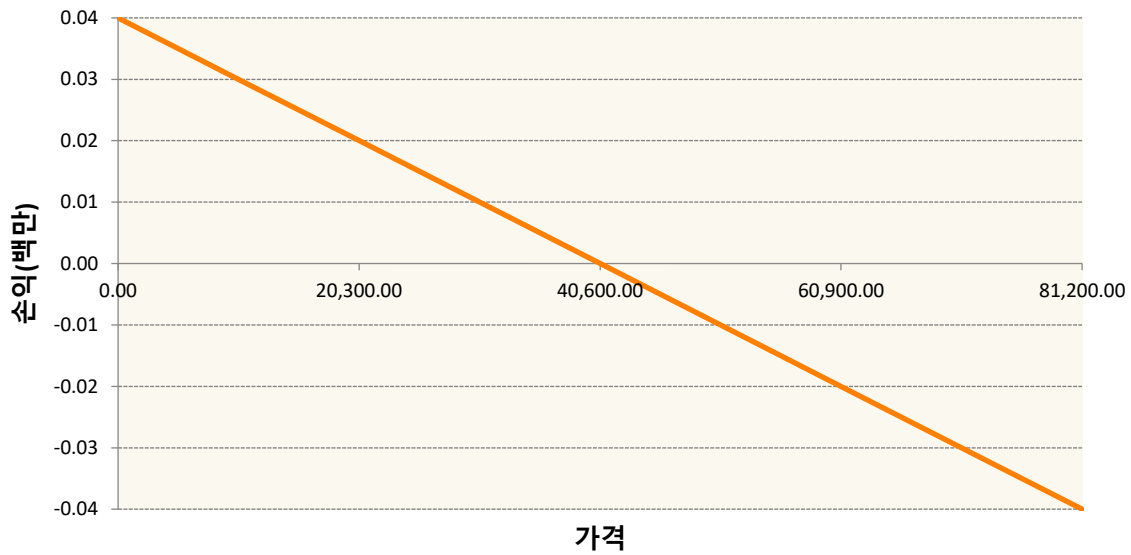
KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



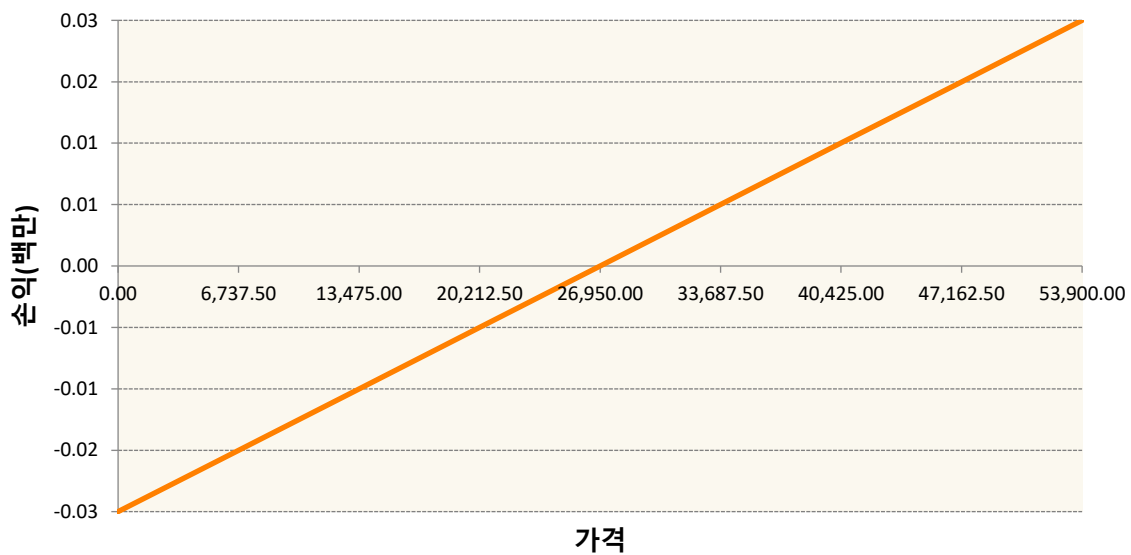
KR4AB3660001-2026-06 고려아연개별선물



KR4ACF660005-2026-06 카카오개별선물



KR4AFT660006-2026-06 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						831
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-831	-831	-831	-831	-831	-831	-831	
-5.33%	-554	-554	-554	-554	-554	-554	-554	
-2.67%	-277	-277	-277	-277	-277	-277	-277	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	277	277	277	277	277	277	277	
5.33%	554	554	554	554	554	554	554	
8.00%	831	831	831	831	831	831	831	
KR4A0Z660006		2026-06 한미반도체개별선물						62
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	62	62	62	62	62	62	62	
-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%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62	
KR4A11660003		2026-06 삼성전자개별선물						254
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254	
-5.33%	-169	-169	-169	-169	-169	-169	-169	
-2.67%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	85	85	85	85	85	85	85	
5.33%	169	169	169	169	169	169	169	
8.00%	254	254	254	254	254	254	254	
KR4A14660000		2026-06 KT개별선물						33
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33	
-5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22	
-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%	22	22	22	22	22	22	22	
8.00%	33	33	33	33	33	33	33	
KR4A22660000		2026-06 삼성SDI개별선물						68
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	68	68	68	68	68	68	68
-5.33%	45	45	45	45	45	45	45
-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%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68

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%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-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%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

KR4A48660000 2026-06 미래에셋증권개별선물 60

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	60	60	60	60	60	60	60
-5.33%	40	40	40	40	40	40	40
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
8.00%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60

KR4A50660005 2026-06 SK하이닉스개별선물 194

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-194	-194	-194	-194	-194	-194	-194
-5.33%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	129	129	129	129	129	129	129
8.00%	194	194	194	194	194	194	194

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%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2
KR4ACF660005 2026-06 카카오개별선물							103
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	103	103	103	103	103	103	103
-5.33%	69	69	69	69	69	69	69
-2.67%	34	34	34	34	34	34	34
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
5.33%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
8.00%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
KR4AFT660006 2026-06 대우건설개별선물							39
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-5.33%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	26	26	26	26	26	26	26
8.00%	39	39	39	39	39	39	39

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

(단위:백만원)

4,063

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

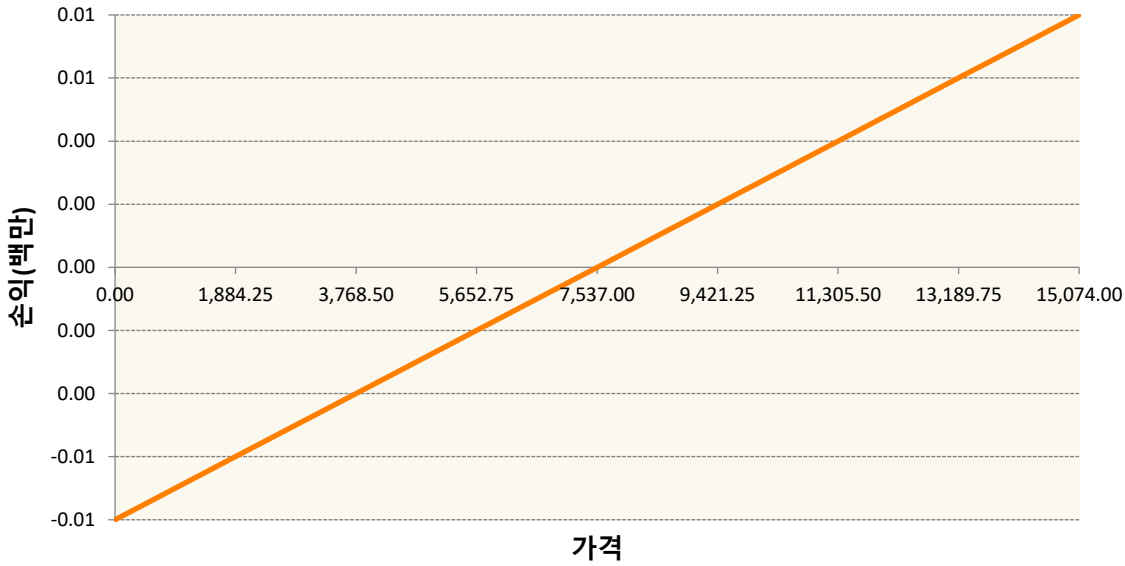
1. 계약금액

(단위:백만원)

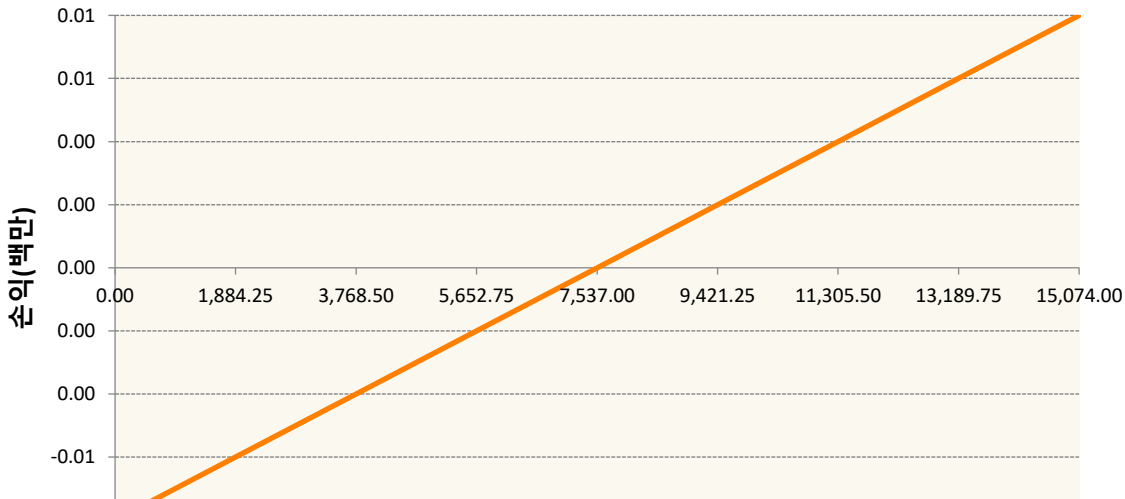
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	61,002	0	61,002	
누계	지수	선물	281	0	281	장내
누계	통화	선물	10,647	0	10,647	장내

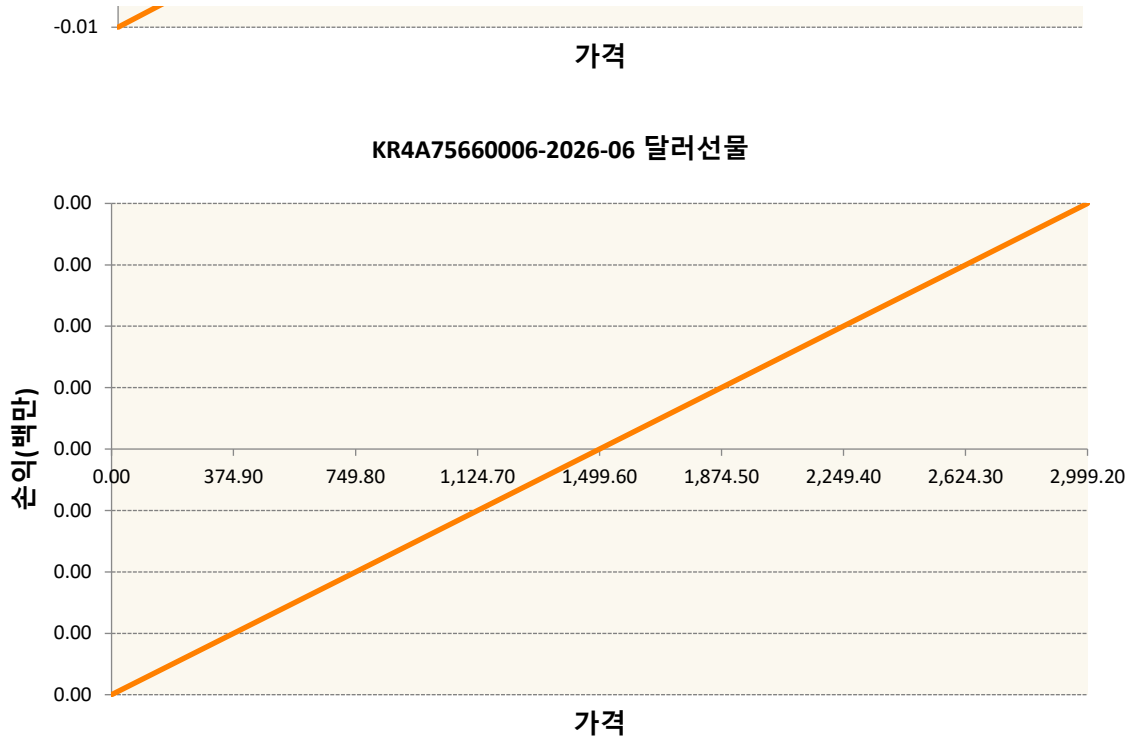
2. 만기시점의 손익구조

ESM6-S&P500 EMINI FUT JUN26



HWAM6-SP500 MIC EMIN FUTJun26





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,880
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	22
	KR4A756600 2026-06 달러선물	852

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,246

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

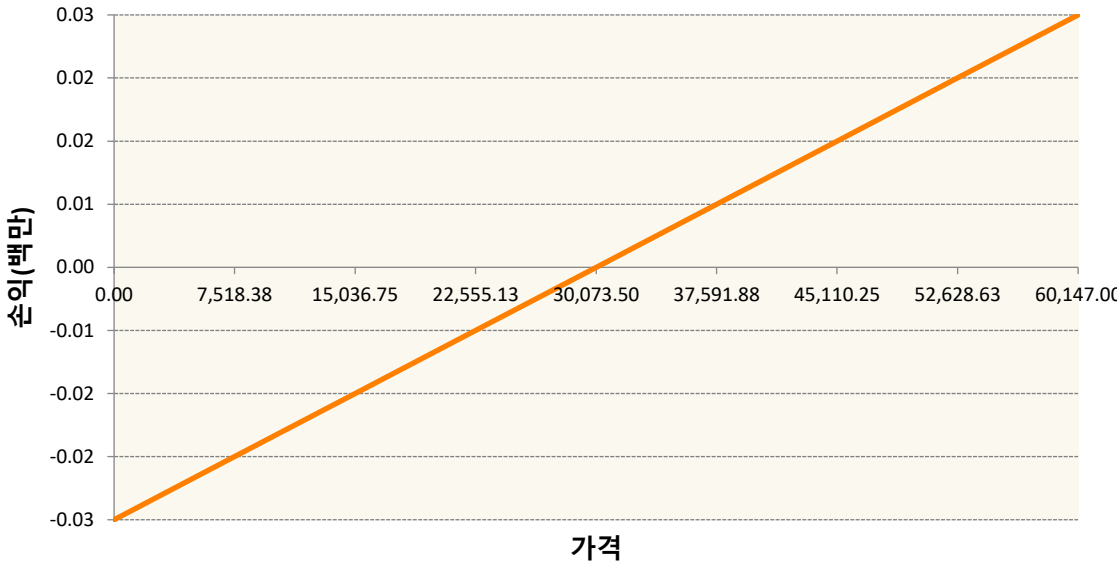
1. 계약금액

(단위:백만원)

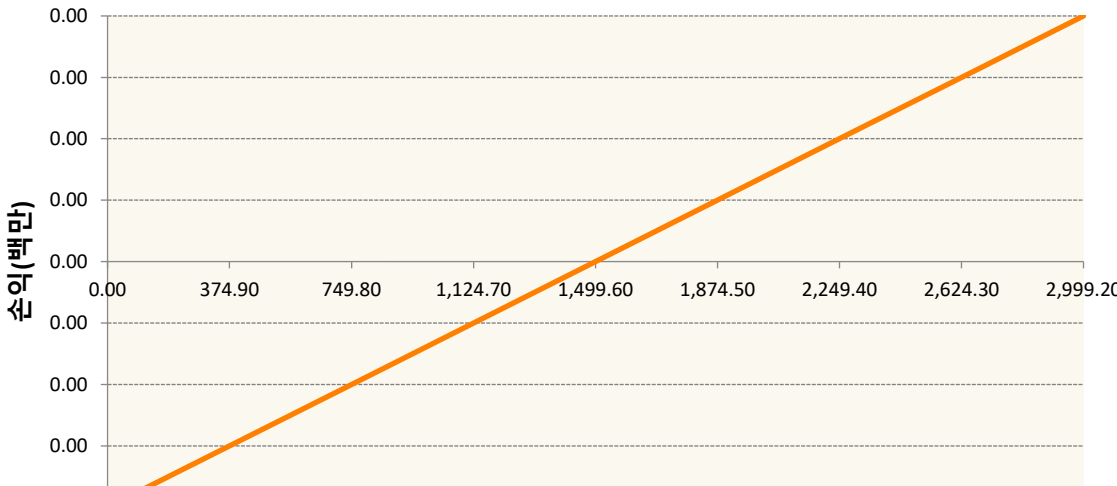
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,621	0	30,621	
누계	유가증권	선물	263	0	263	장내
누계	통화	선물	3,914	0	3,914	장내

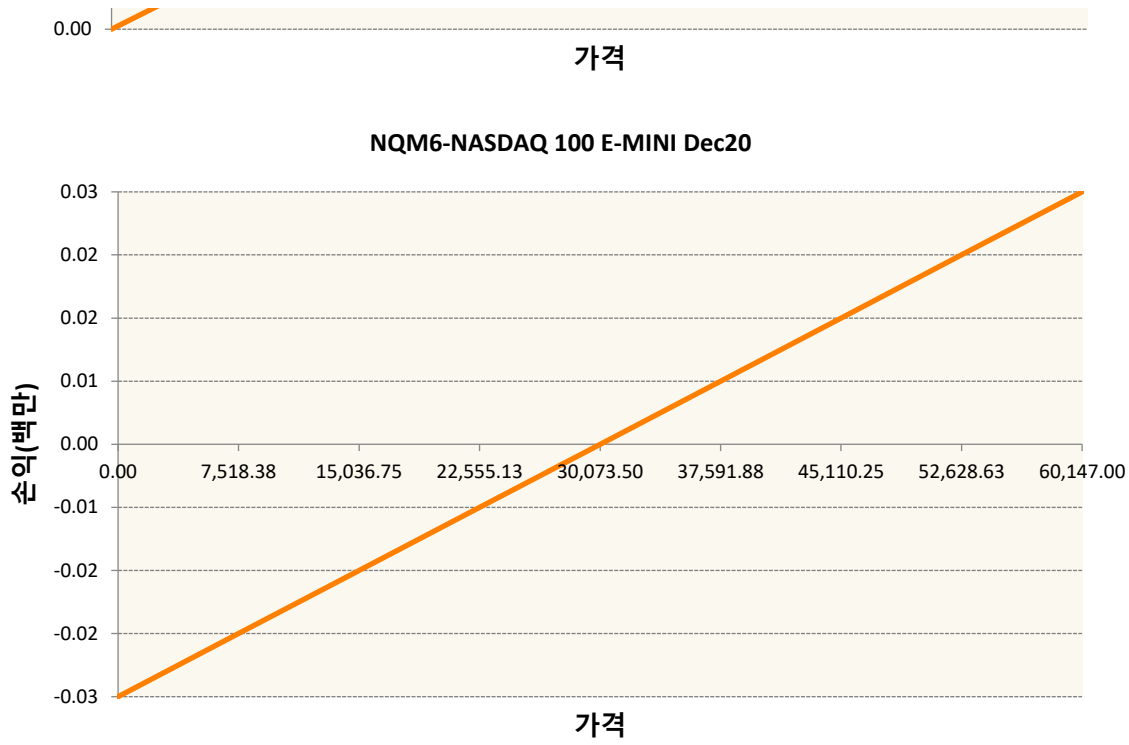
2. 만기시점의 손익구조

HWBM6-NASD100 MICRO EMIN JUN26



KR4A75660006-2026-06 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	21
KR4A756600	2026-06 달러선물	313
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,450

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

2,713

공시일	2026-05-28
기준일	2026-05-27

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

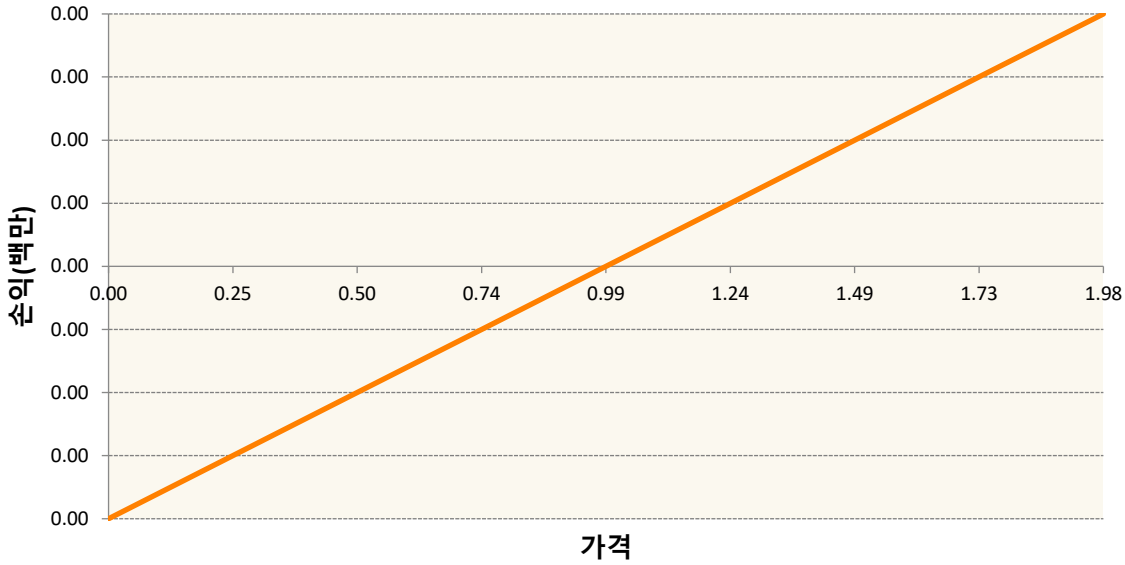
1. 계약금액

(단위:백만원)

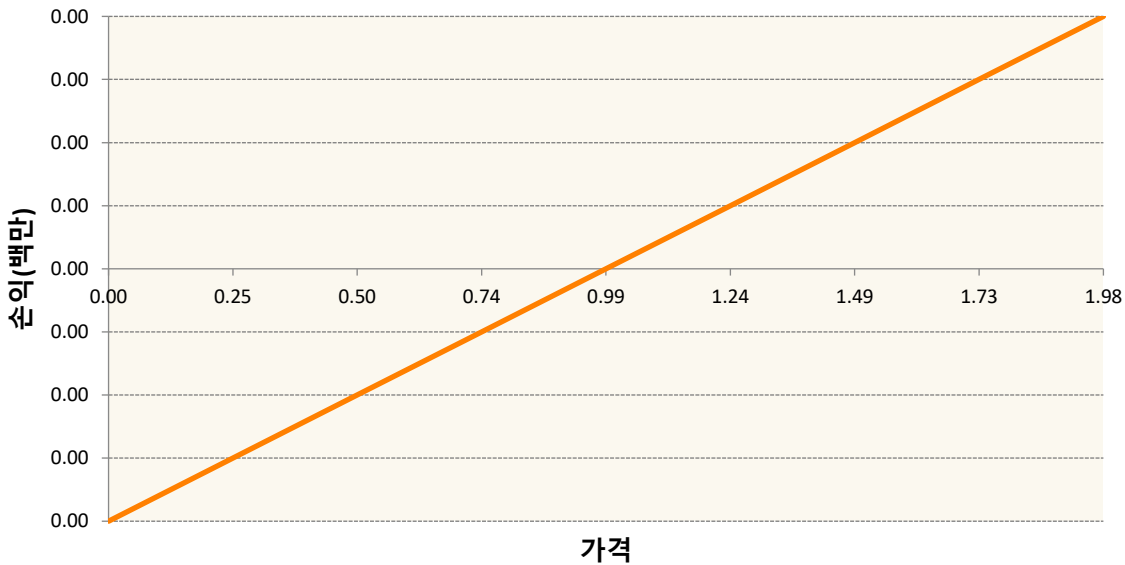
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	347,437	0	347,437	장외

2. 만기시점의 손익구조

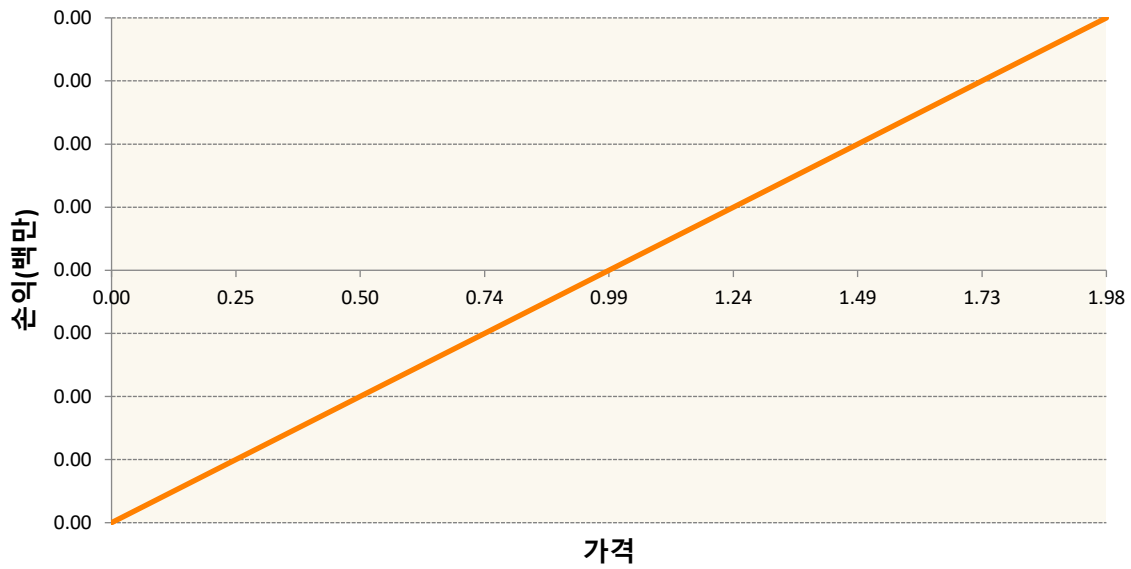
SWKEDI000150-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



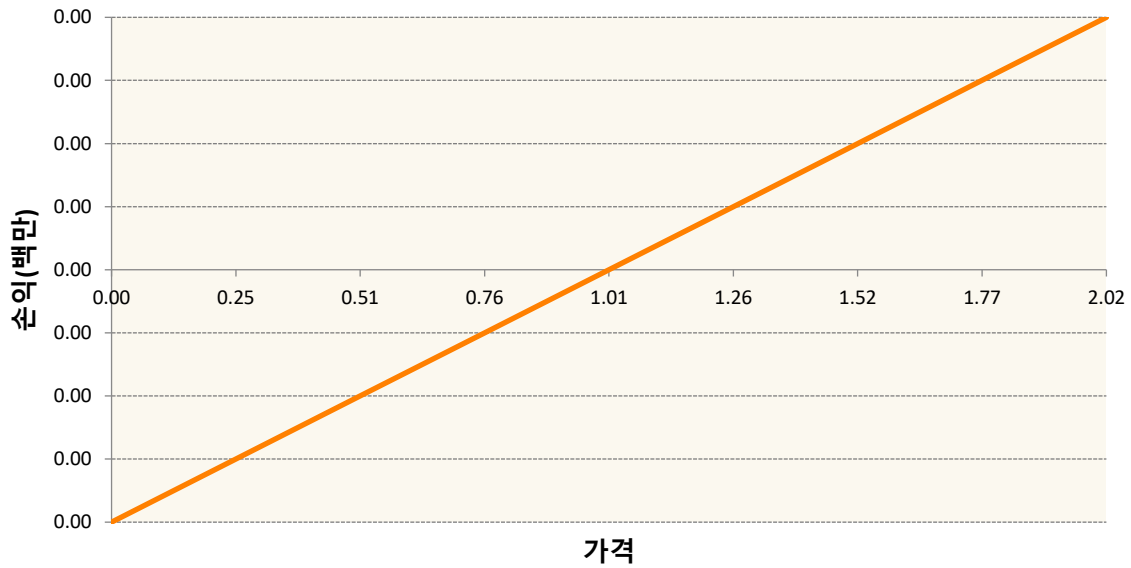
SWKEDI000164-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



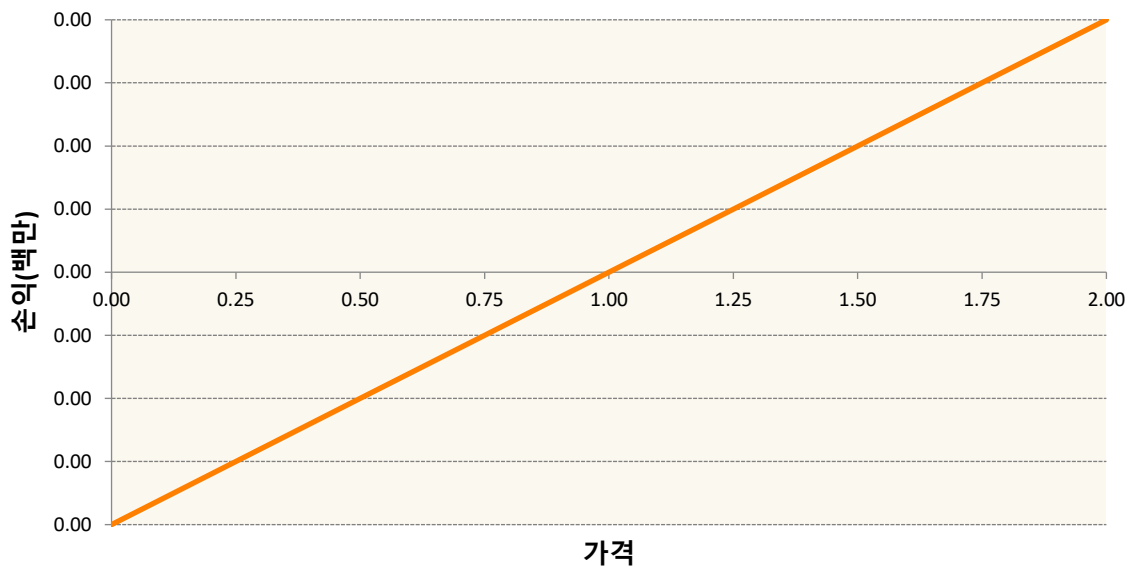
SWKEDI000172-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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



SWKEDI000174-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,330
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		152
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,420
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,947
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		6,982

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	11,875