

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

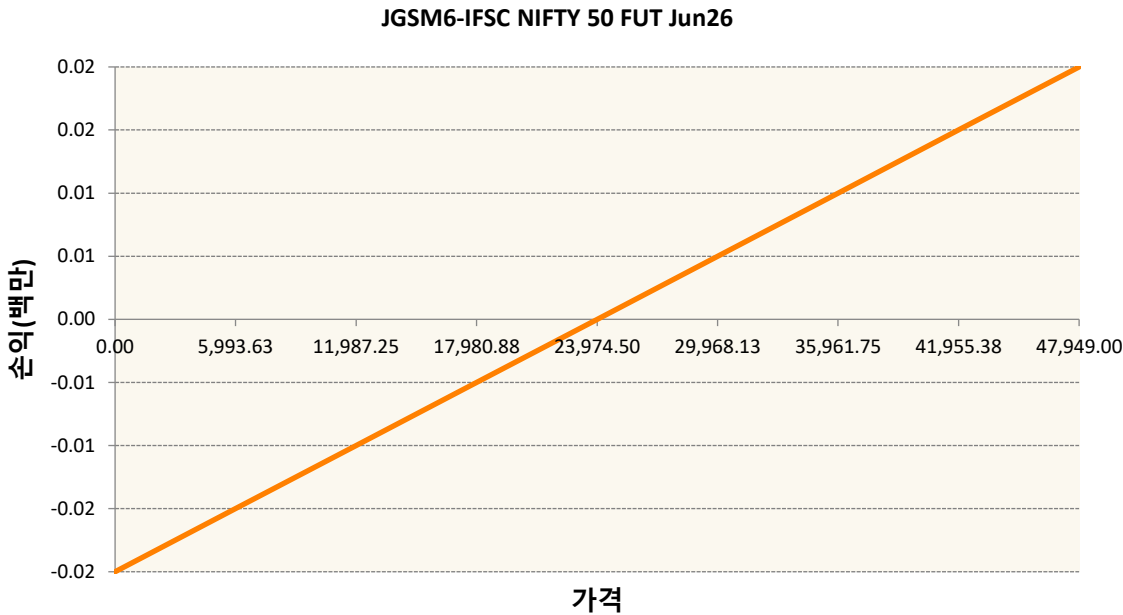
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	361	0	361	

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	2026-05-29
기준일	2026-05-28

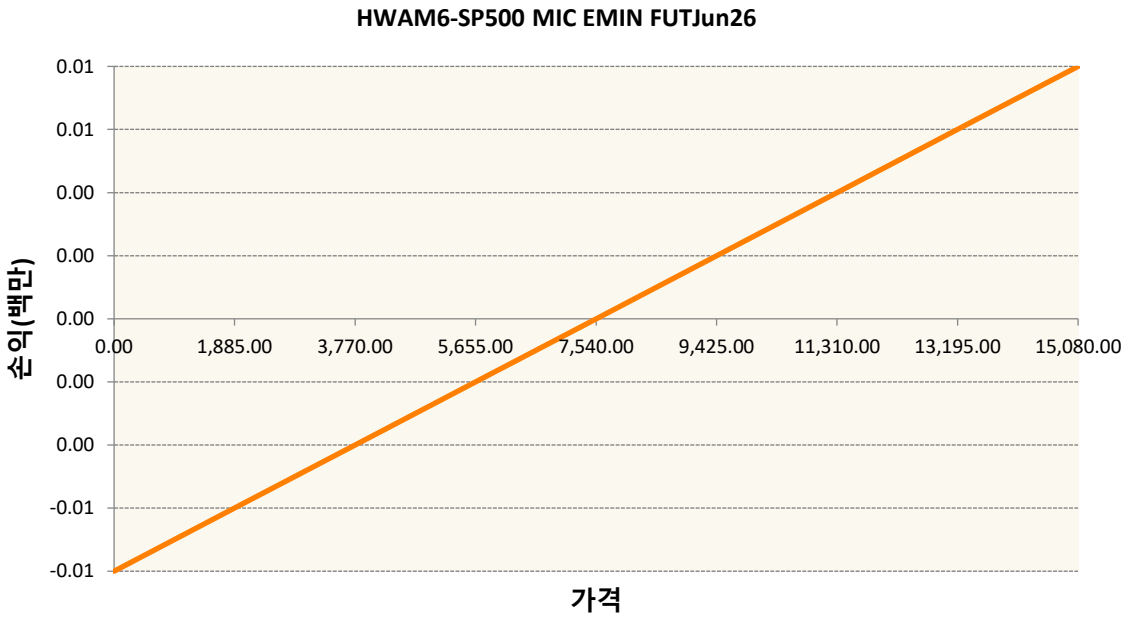
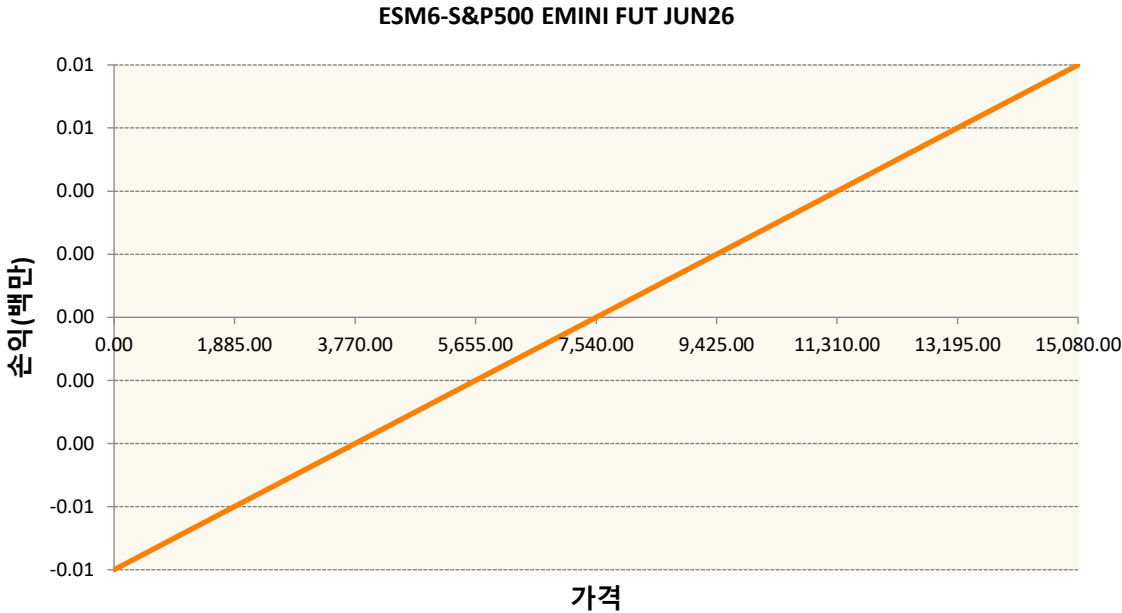
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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



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	2026-05-29
기준일	2026-05-28

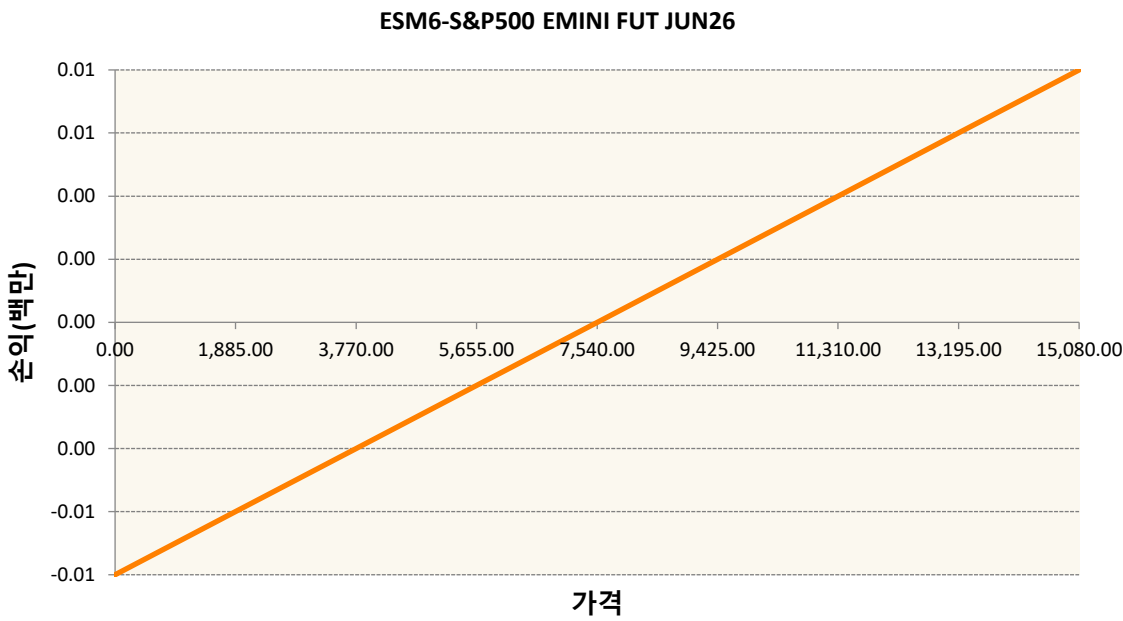
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,132	0	1,132	

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	2026-05-29
기준일	2026-05-28

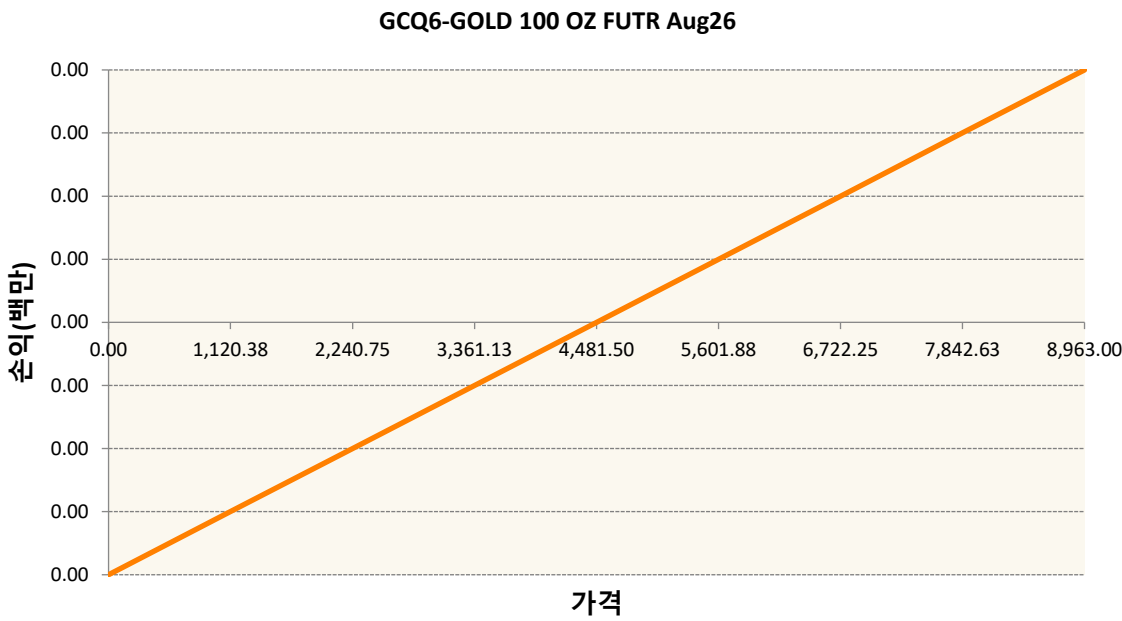
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,382	0	5,382	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC4 GLD US 05/29/26 C422 EQUITY	8
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	431

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

(단위:백만원)

550

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

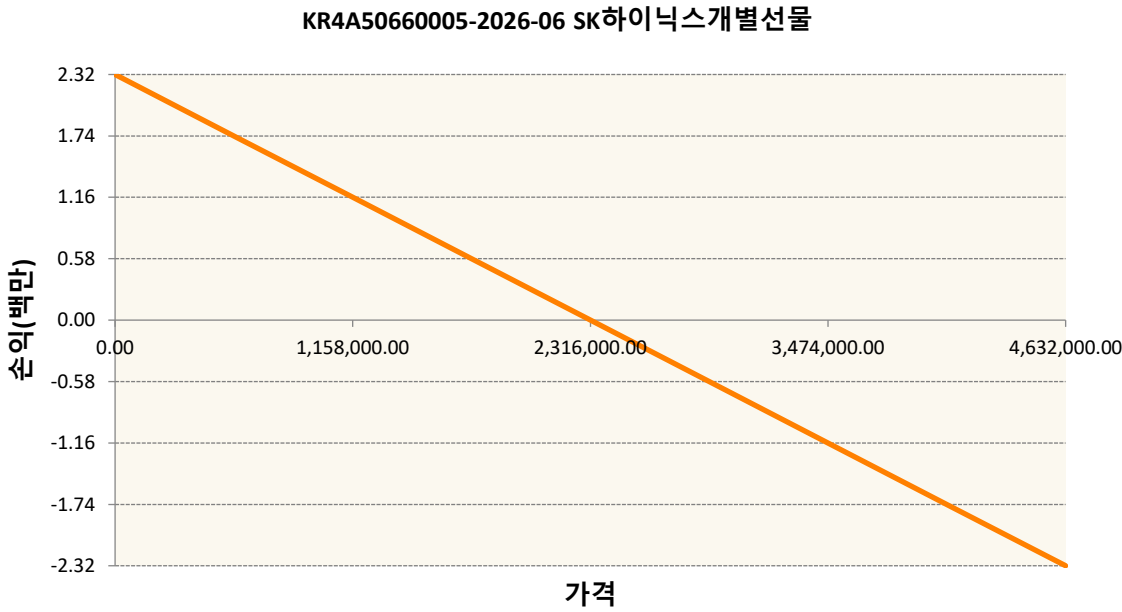
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	23,160	-23,160	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUCC PLTR US 05/29/26 C145 EQUITY	76
AOPLTRUCP PLTR US 05/29/26 P145 EQUITY	17
KR4A506600 2026-06 SK하이닉스개별선물	1,853

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

(단위:백만원)

276

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

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)

AOTLTUSC84 TLT US 05/29/26 C84.5 EQUITY

5

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

(단위:백만원)

3

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

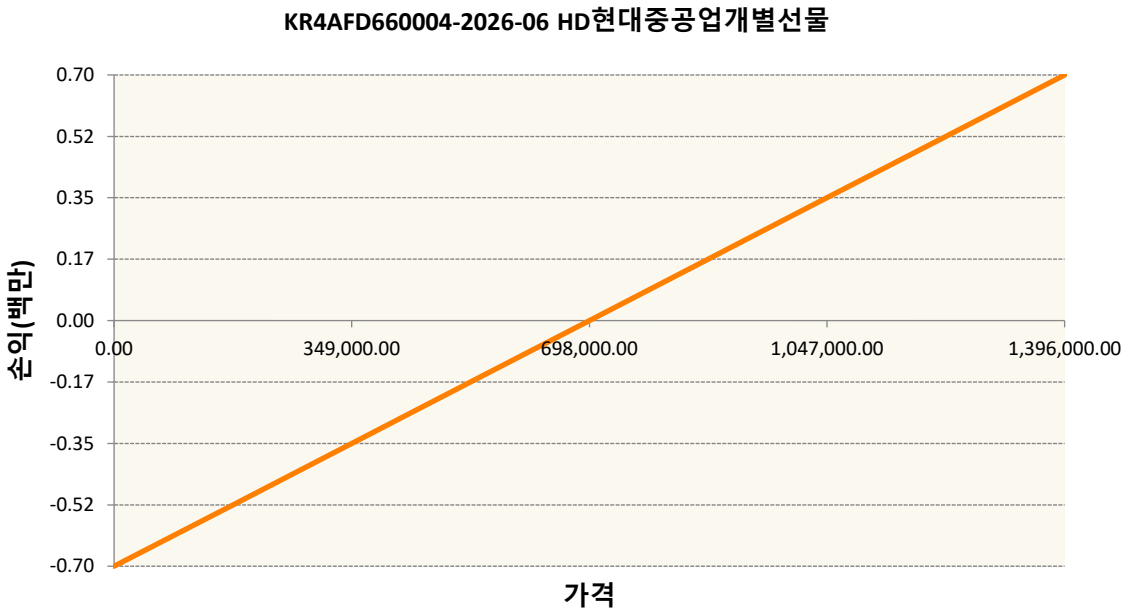
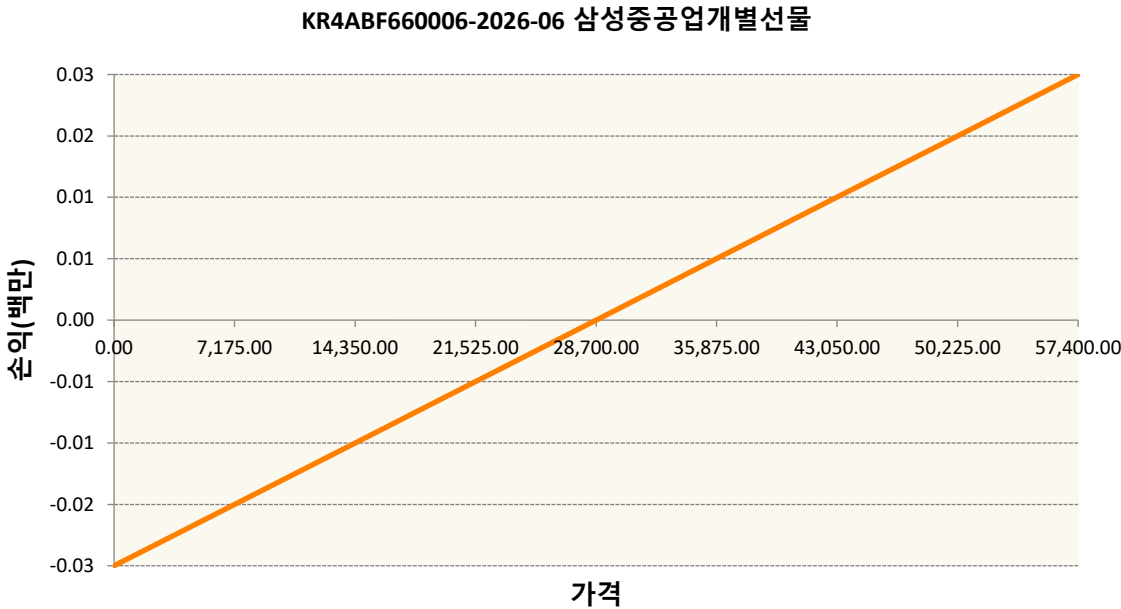
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

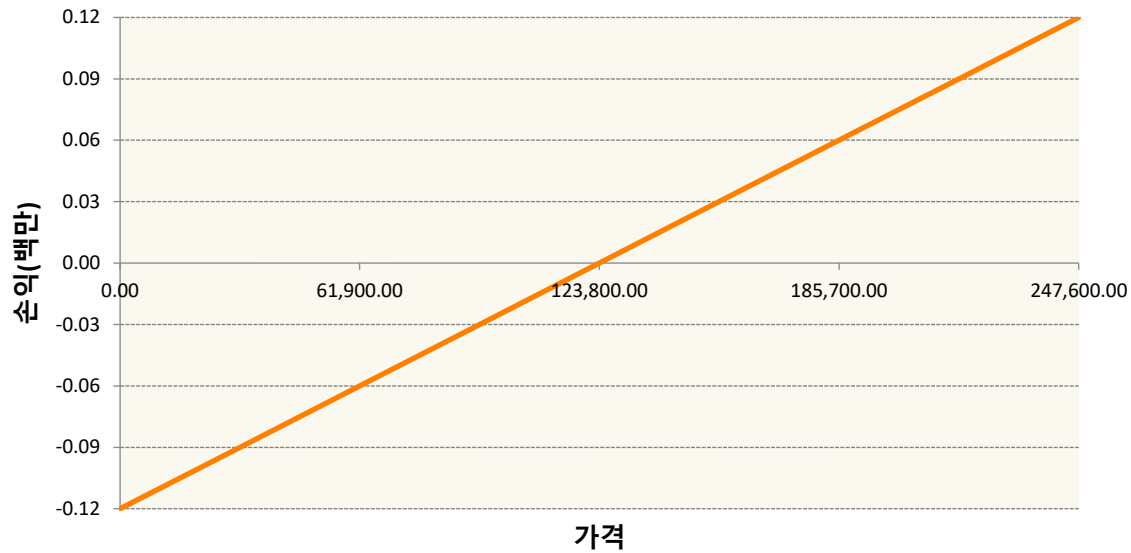
(단위:백만원)

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	18,240	0	18,240	장내
누계	유가증권	스왑	156,742	0	156,742	장외

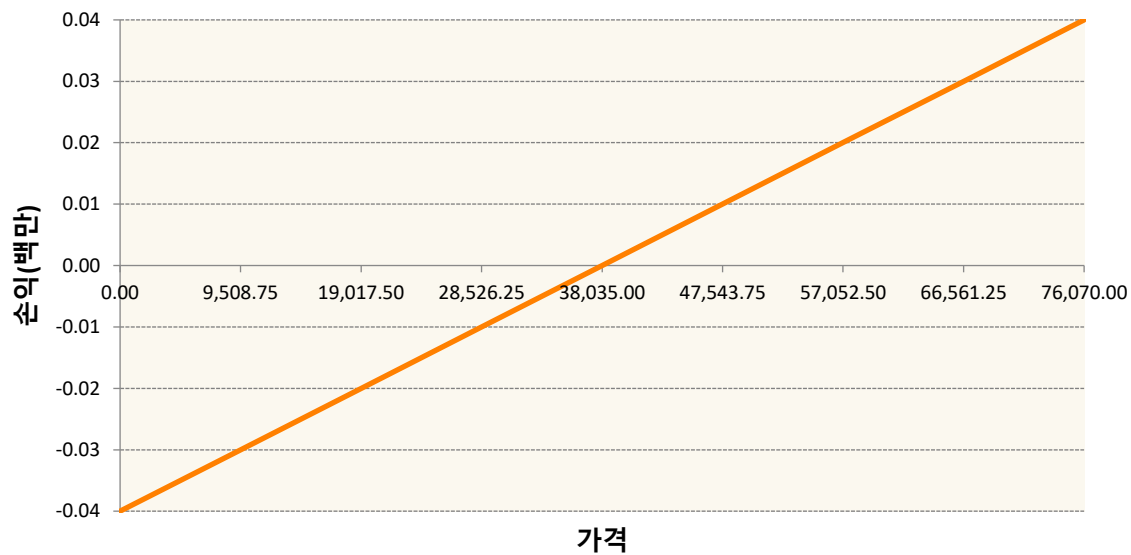
2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV660002-2026-06 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4ABF660006		2026-06 삼성중공업개별선물					404
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-404	-404	-404	-404	-404	-404	-404
-5.33%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269
-2.67%	-135	-135	-135	-135	-135	-135	-135
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	135	135	135	135	135	135	135
5.33%	269	269	269	269	269	269	269
8.00%	404	404	404	404	404	404	404
KR4AFD660004		2026-06 HD현대중공업개별선물					763
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-763	-763	-763	-763	-763	-763	-763
-5.33%	-509	-509	-509	-509	-509	-509	-509
-2.67%	-254	-254	-254	-254	-254	-254	-254
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	254	254	254	254	254	254	254
5.33%	509	509	509	509	509	509	509
8.00%	763	763	763	763	763	763	763
KR4AFV660002 2026-06 한화오션개별선물							295
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-295	-295	-295	-295	-295	-295	-295
-5.33%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-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%	197	197	197	197	197	197	197
8.00%	295	295	295	295	295	295	295

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

(단위:백만원)

2,212

공시일 2026-05-29

기준일 2026-05-28

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	2026-05-29
기준일	2026-05-28

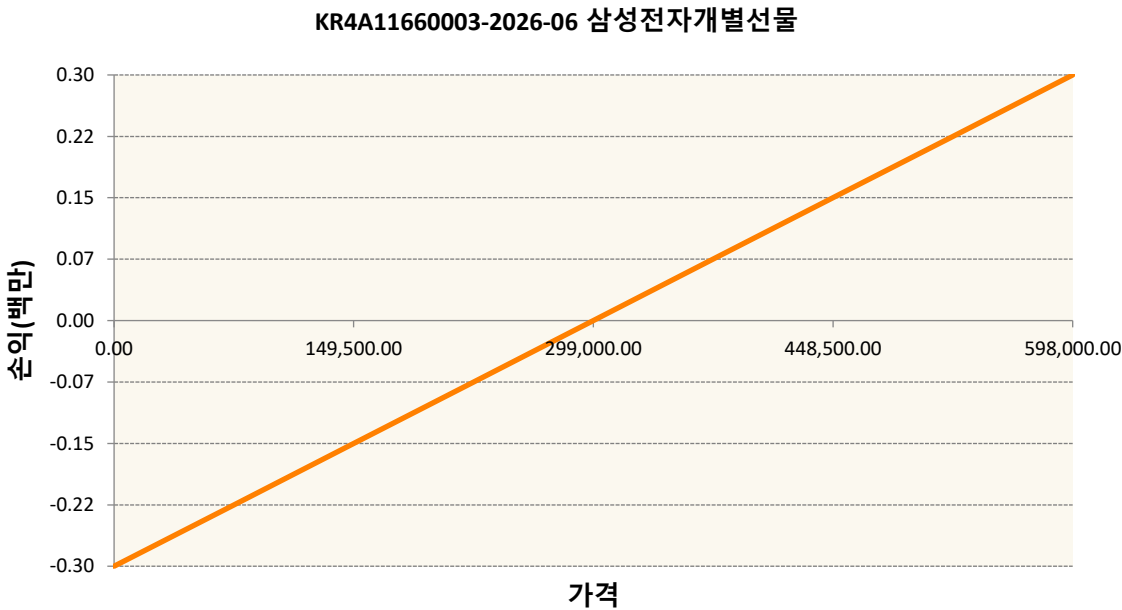
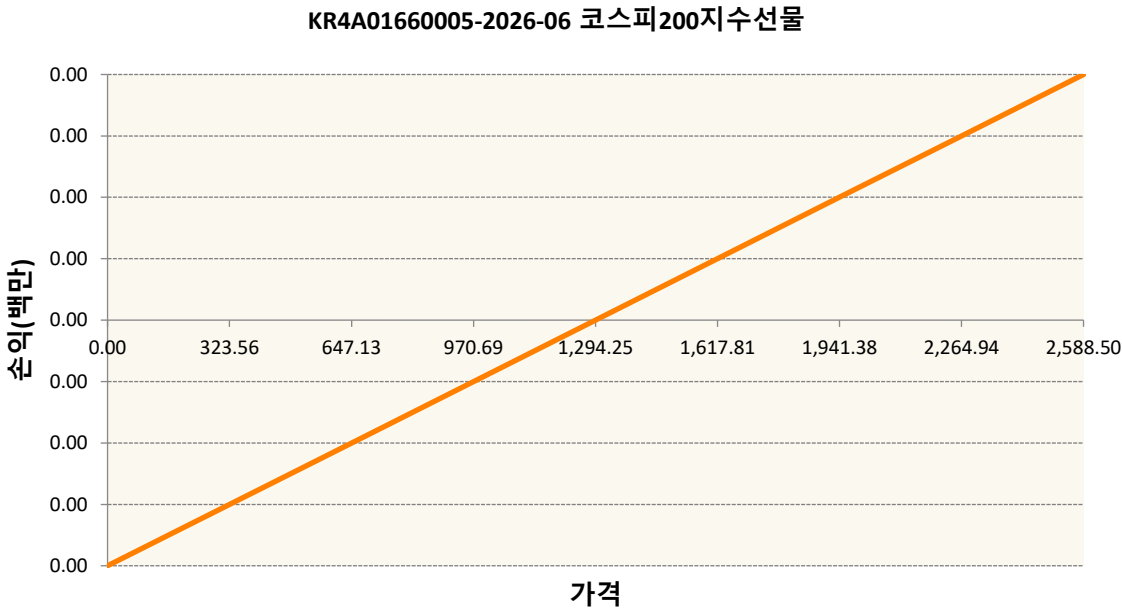
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	3	-3	장내
누계	유가증권	선물	24,559	3	24,556	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격	손익(백만)
0.00	1,000.00
323.75	800.00
647.50	600.00
971.25	400.00
1,295.00	200.00
1,618.75	0.00
1,942.50	-200.00
2,266.25	-400.00
2,590.00	-600.00

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 2,595.00. The y-axis represents Net Income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. A solid blue line shows the relationship, starting at (0, 0.00) and ending at (2,595.00, 0.00).

가격	순이익 (백만)
0.00	0.00
324.38	0.00
648.75	0.00
973.13	0.00
1,297.50	0.00
1,621.88	0.00
1,946.25	0.00
2,270.63	0.00
2,595.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물				672
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-672	-672	-672	-672	-672	-672	-672	
-5.33%	-448	-448	-448	-448	-448	-448	-448	
-2.67%	-224	-224	-224	-224	-224	-224	-224	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	224	224	224	224	224	224	224	
5.33%	448	448	448	448	448	448	448	
8.00%	672	672	672	672	672	672	672	
KR4A11660003				2026-06 삼성전자개별선물				1,294
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,294	-1,294	-1,294	-1,294	-1,294	-1,294	-1,294
-5.33%	-863	-863	-863	-863	-863	-863	-863
-2.67%	-431	-431	-431	-431	-431	-431	-431
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	431	431	431	431	431	431	431
5.33%	863	863	863	863	863	863	863
8.00%	1,294	1,294	1,294	1,294	1,294	1,294	1,294
KR4BAFBFB201 코스피위클리M C 2606W1 1,295.0							544,050

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	544,050	544,050	544,050	544,050	544,050	544,050	544,050
-5.33%	362,700	362,700	362,700	362,700	362,700	362,700	362,700
-2.67%	181,350	181,350	181,350	181,350	181,350	181,350	181,350
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-181,350	-181,350	-181,350	-181,350	-181,350	-181,350	-181,350
5.33%	-362,700	-362,700	-362,700	-362,700	-362,700	-362,700	-362,700
8.00%	-544,050	-544,050	-544,050	-544,050	-544,050	-544,050	-544,050

KR4BAFBFB219 코스피위클리M C 2606W1 1,297.5							590,850
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	590,850	590,850	590,850	590,850	590,850	590,850	590,850
-5.33%	393,900	393,900	393,900	393,900	393,900	393,900	393,900
-2.67%	196,950	196,950	196,950	196,950	196,950	196,950	196,950
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-196,950	-196,950	-196,950	-196,950	-196,950	-196,950	-196,950
5.33%	-393,900	-393,900	-393,900	-393,900	-393,900	-393,900	-393,900
8.00%	-590,850	-590,850	-590,850	-590,850	-590,850	-590,850	-590,850

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

(단위:백만원)

3,265,664

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

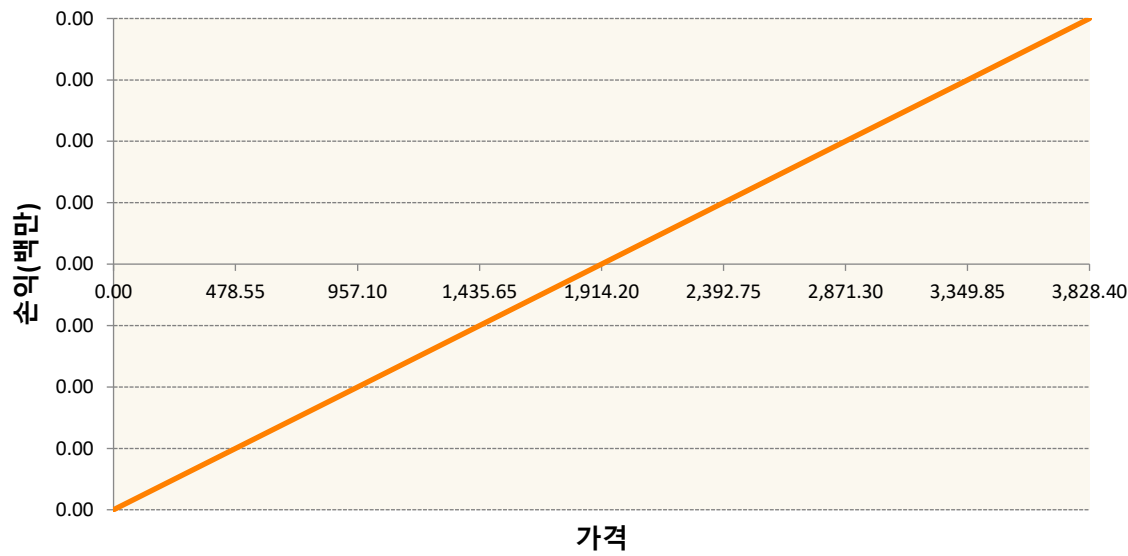
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,129	0	1,129	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A06660000-2026-06 코스닥150선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06660000			2026-06 코스닥150선물				91
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91
-5.33%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	61	61	61	61	61	61	61
8.00%	91	91	91	91	91	91	91

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

(단위:백만원)

16,807

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

(단위:백만원)

19,920

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

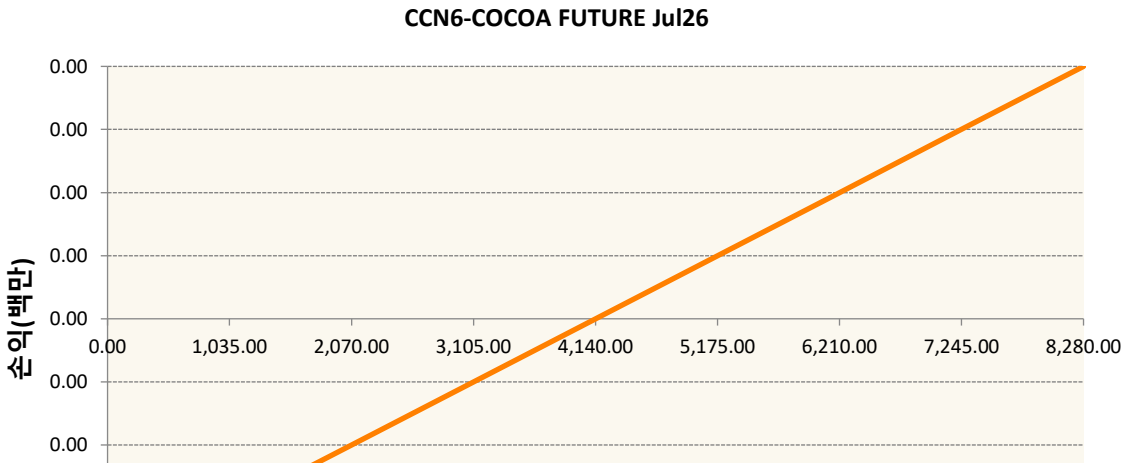
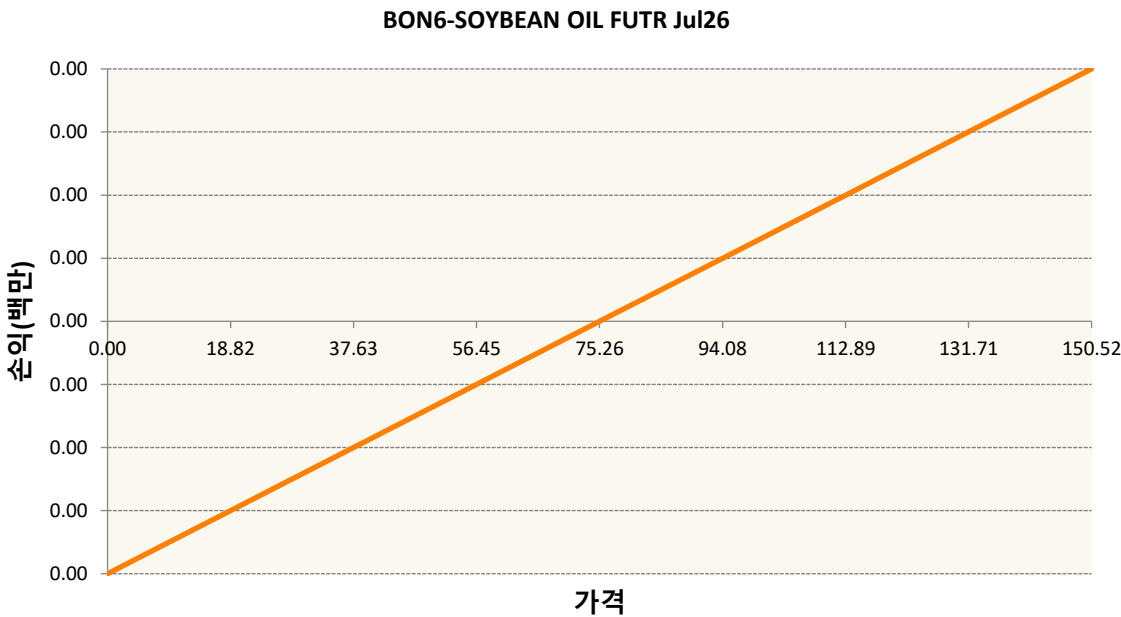
포커스농산물모(채권-파생형)

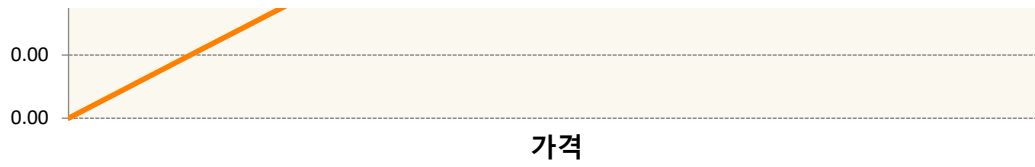
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

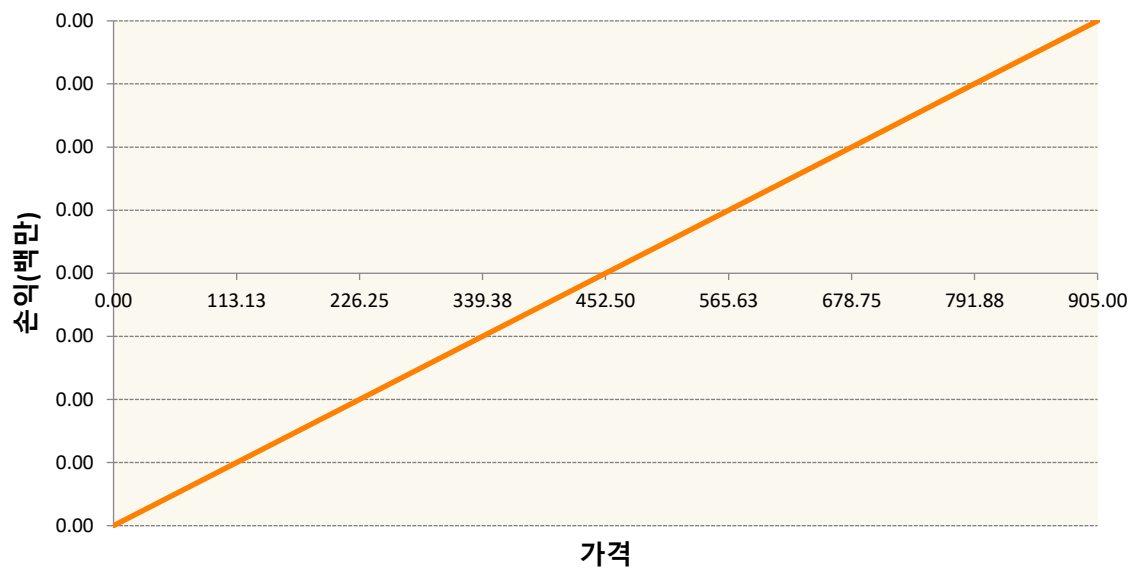
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	62	0	62	
누계	실물자산	선물	808	0	808	장내
누계	유가증권	선물	1,872	0	1,872	
누계	통화	선물	0	345	-345	장내

2. 만기시점의 손익구조

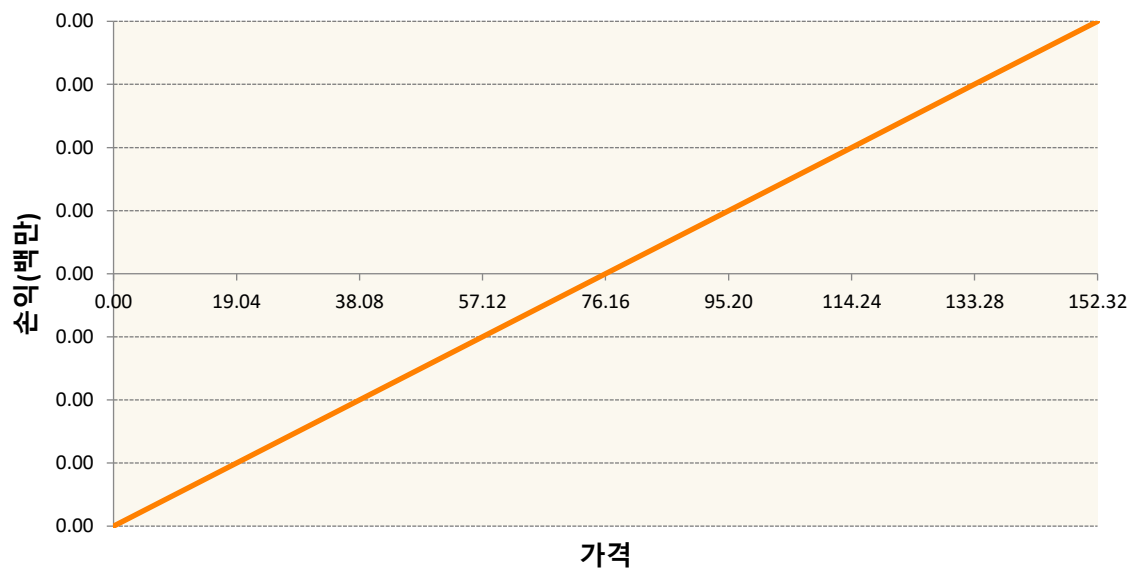




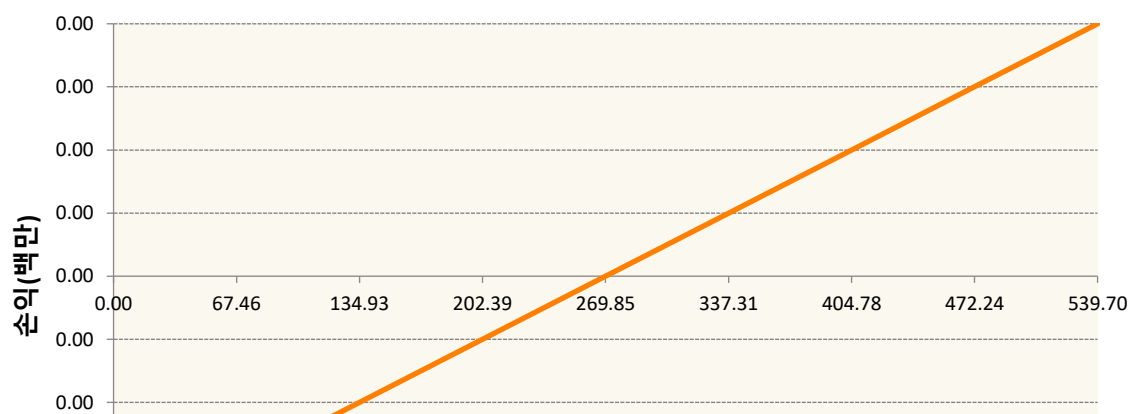
CN6-CORN FUTURE Jul26

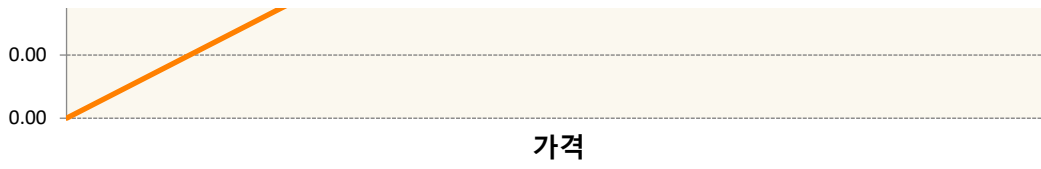


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

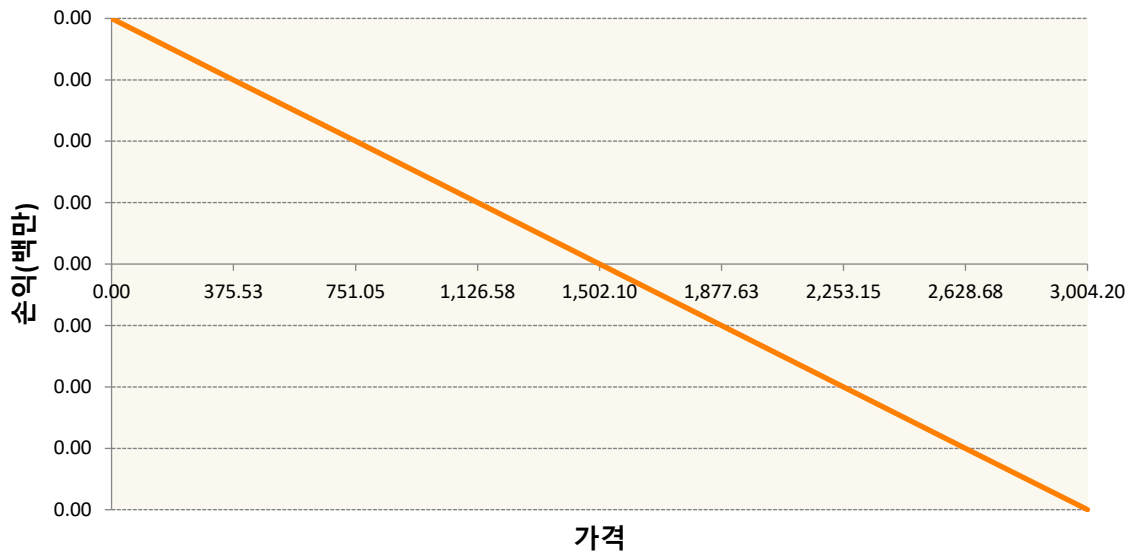


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

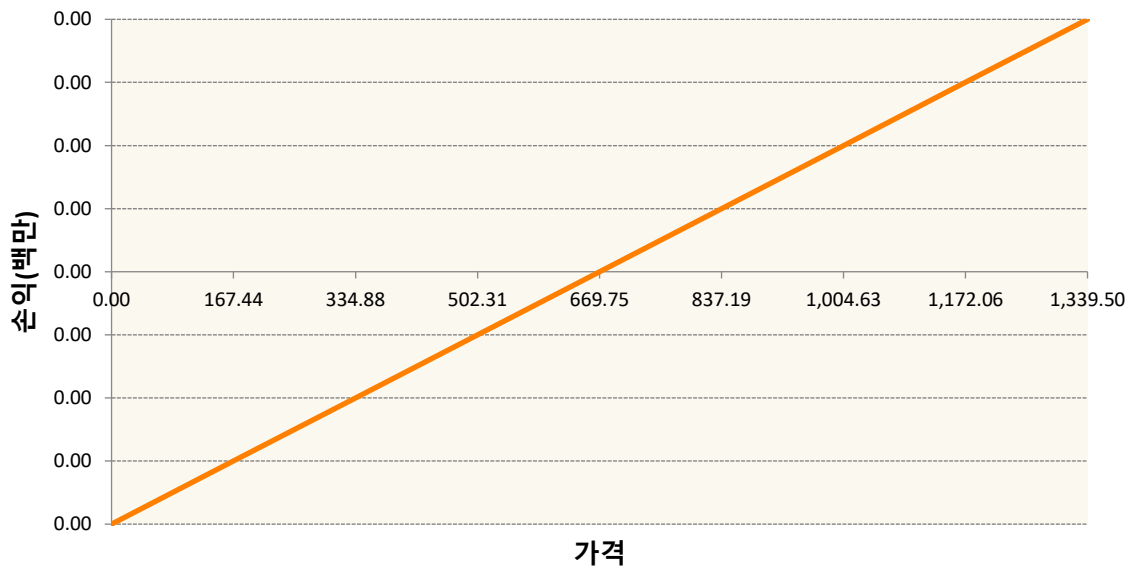




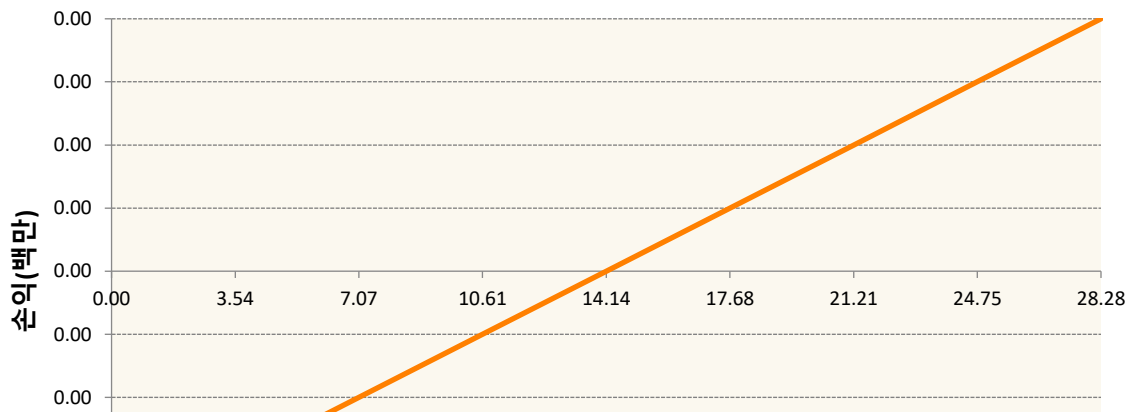
KR4A75660006-2026-06 달러선물

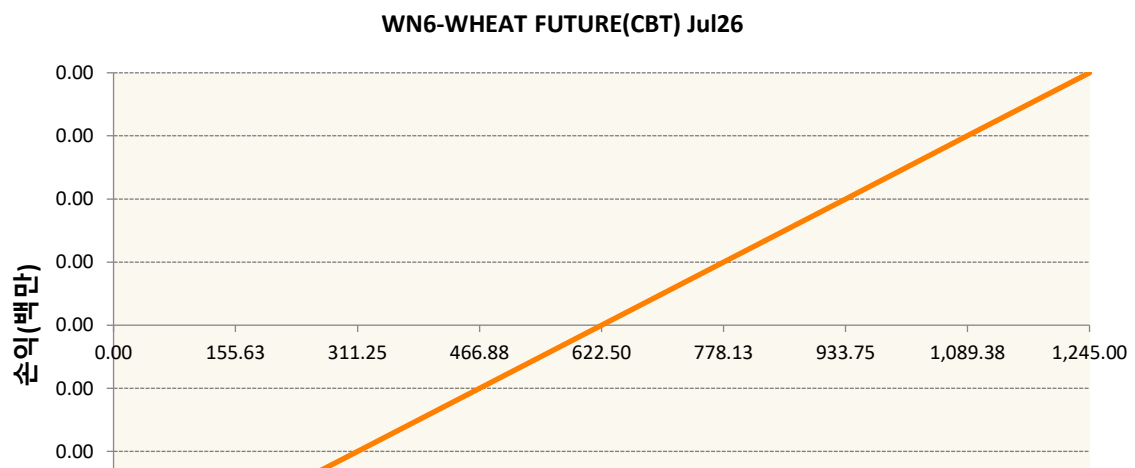
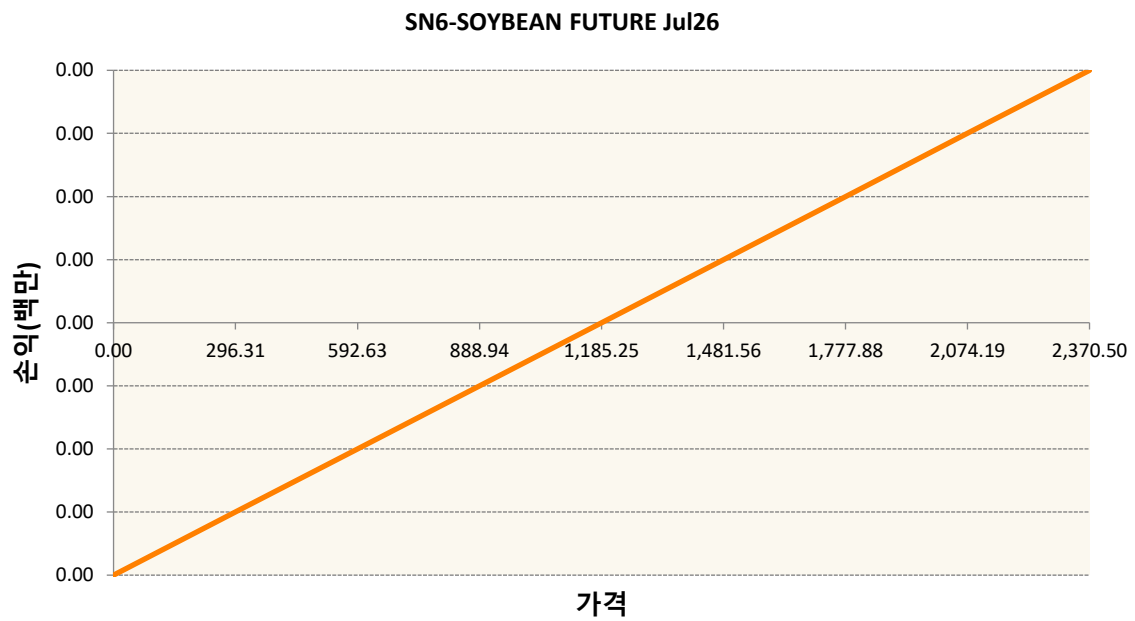
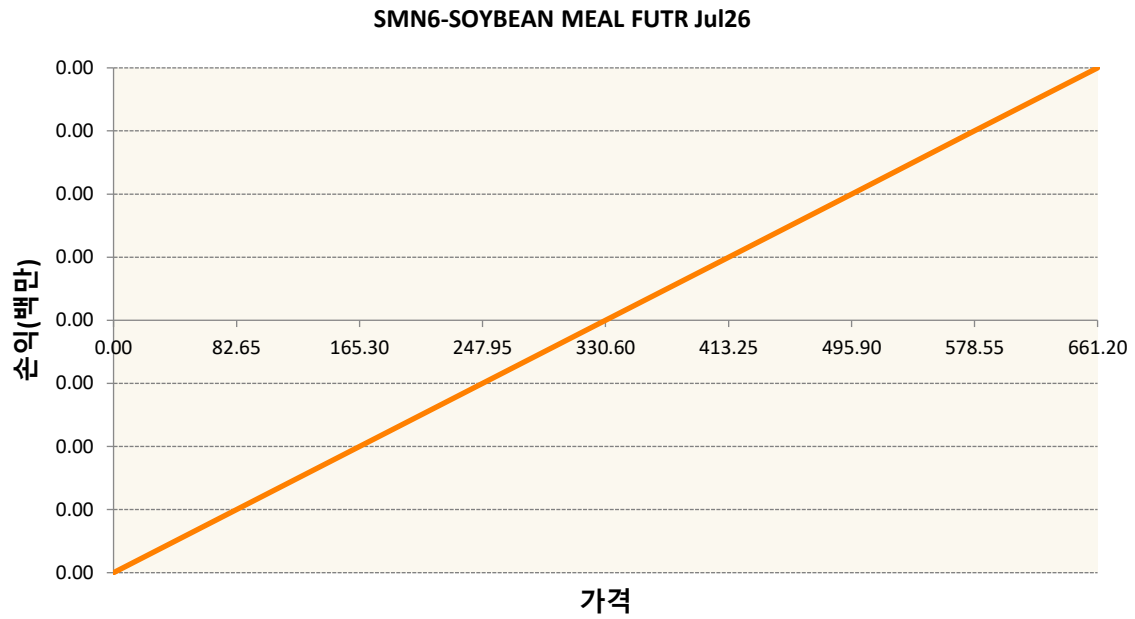
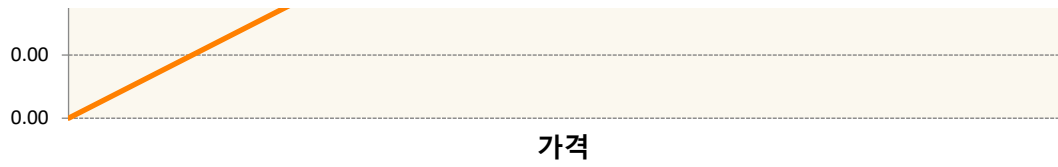


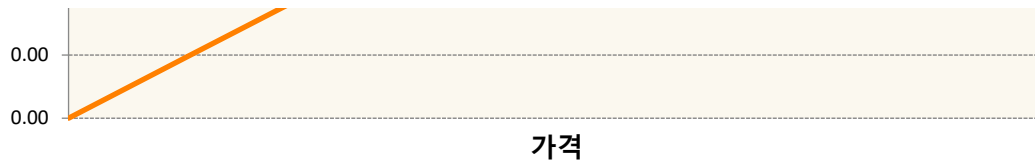
KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26



SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

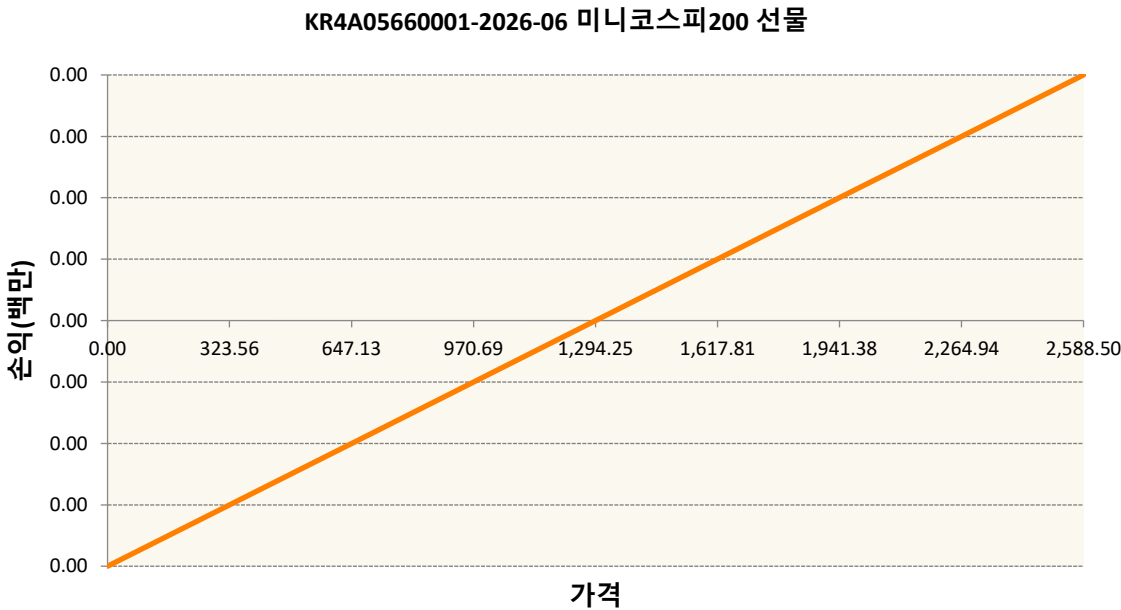
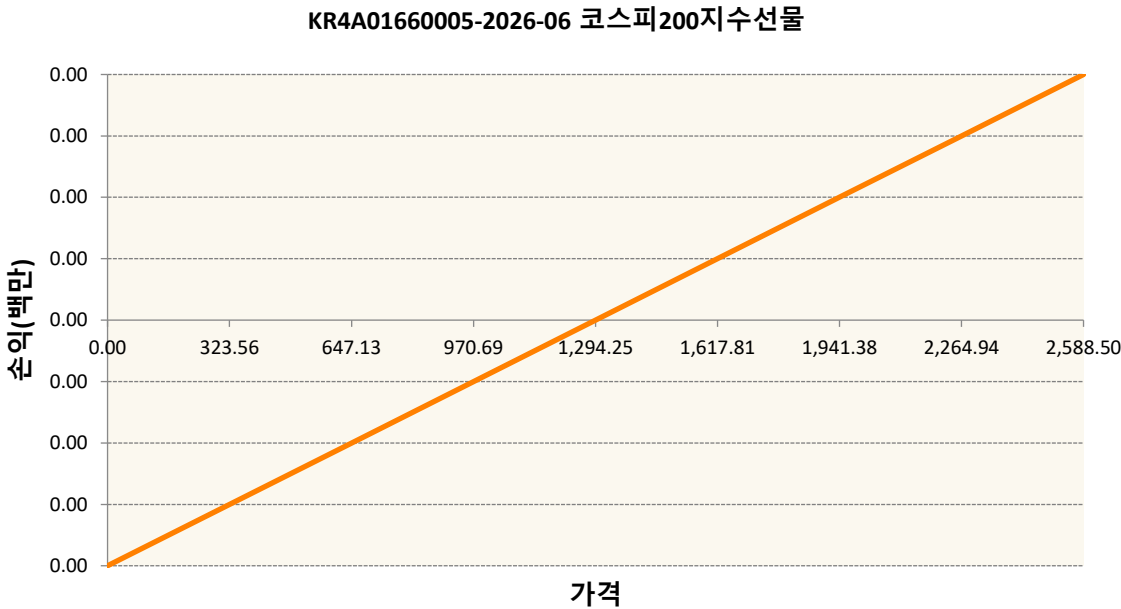
스마트인덱스모

1. 계약금액

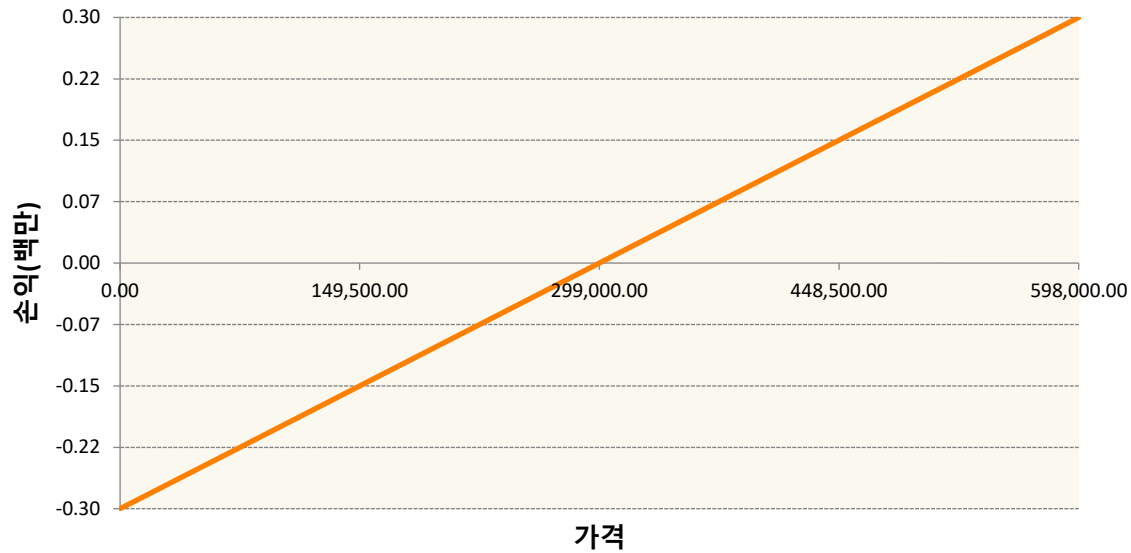
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	652	-652	장내
누계	유가증권	선물	3,535	347	3,187	장내

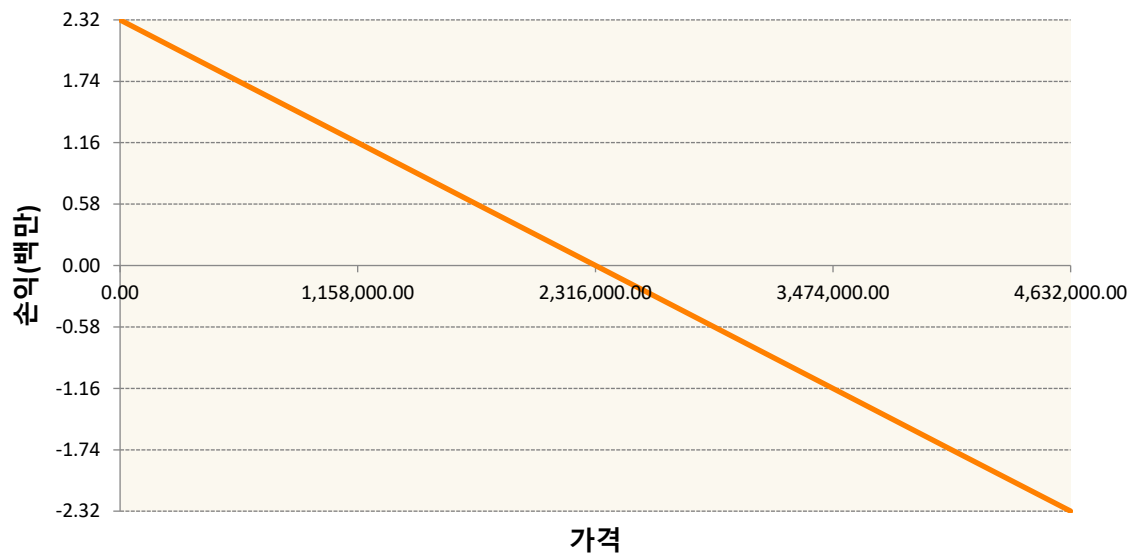
2. 만기시점의 손익구조



KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물			207
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-5.33%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	69	69	69	69	69	69	69
5.33%	138	138	138	138	138	138	138
8.00%	207	207	207	207	207	207	207
KR4A05660001				2026-06 미니코스피200 선물			10
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

KR4A11660003

2026-06 삼성전자개별선물

24

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	24	24	24	24	24	24	24

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)

660

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

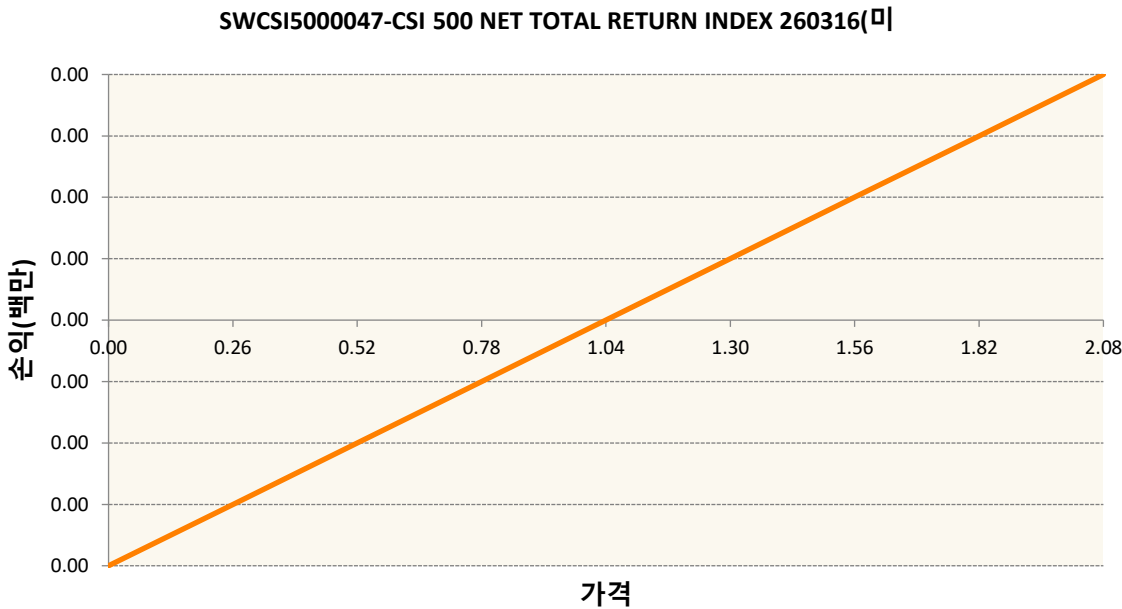
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,869	0	5,869	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

469

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

596

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

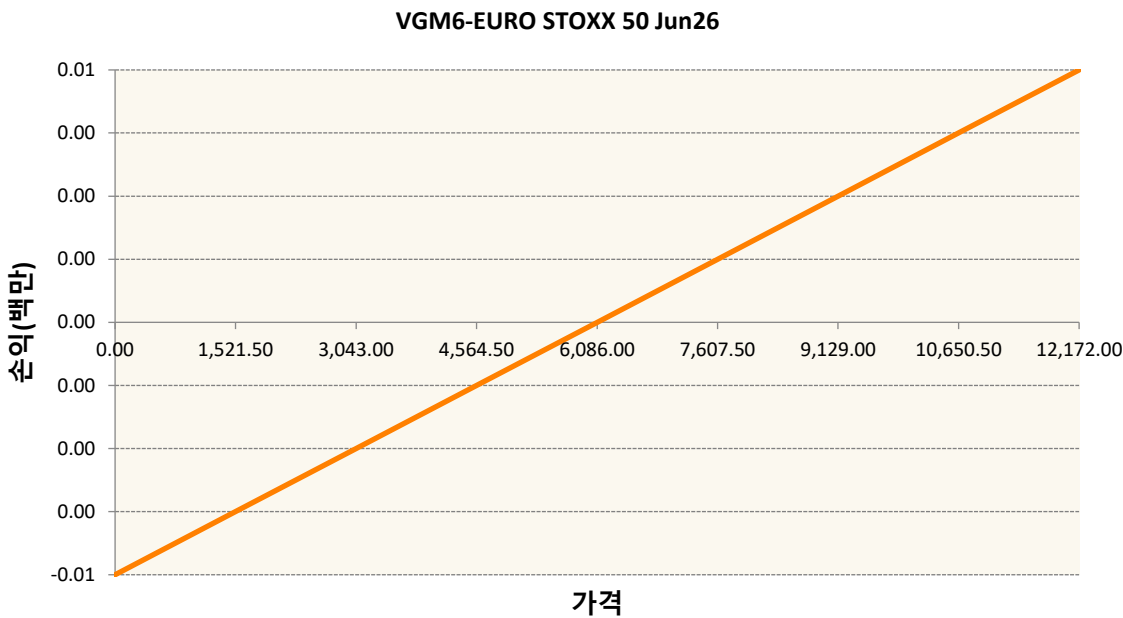
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	939	0	939	

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	2026-05-29
기준일	2026-05-28

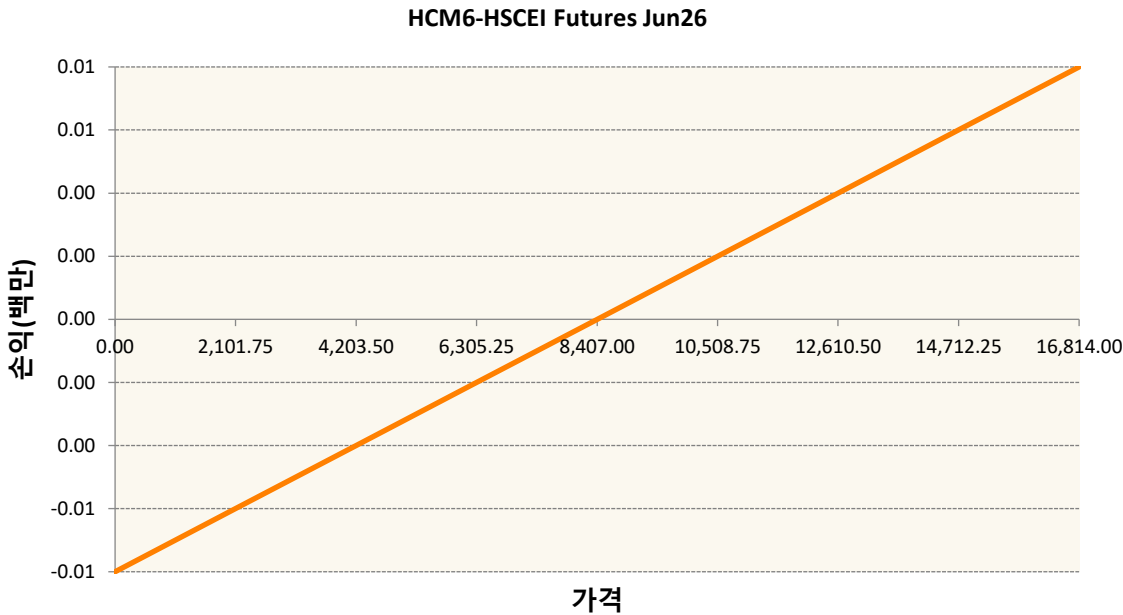
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,452	0	1,452	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	HSCEI Futures Jun26	116
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

139

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

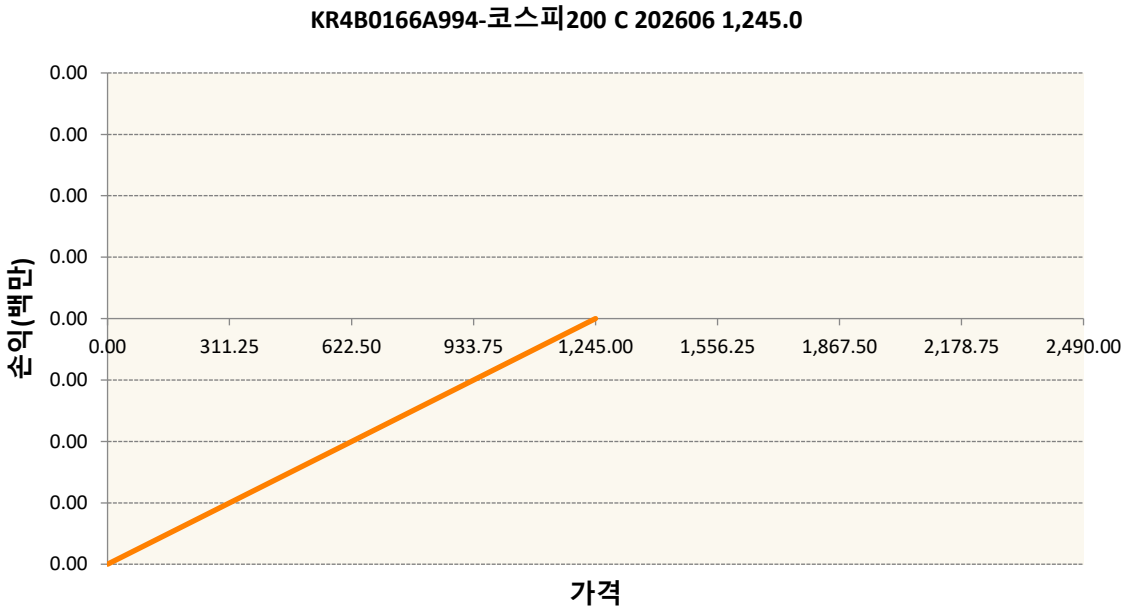
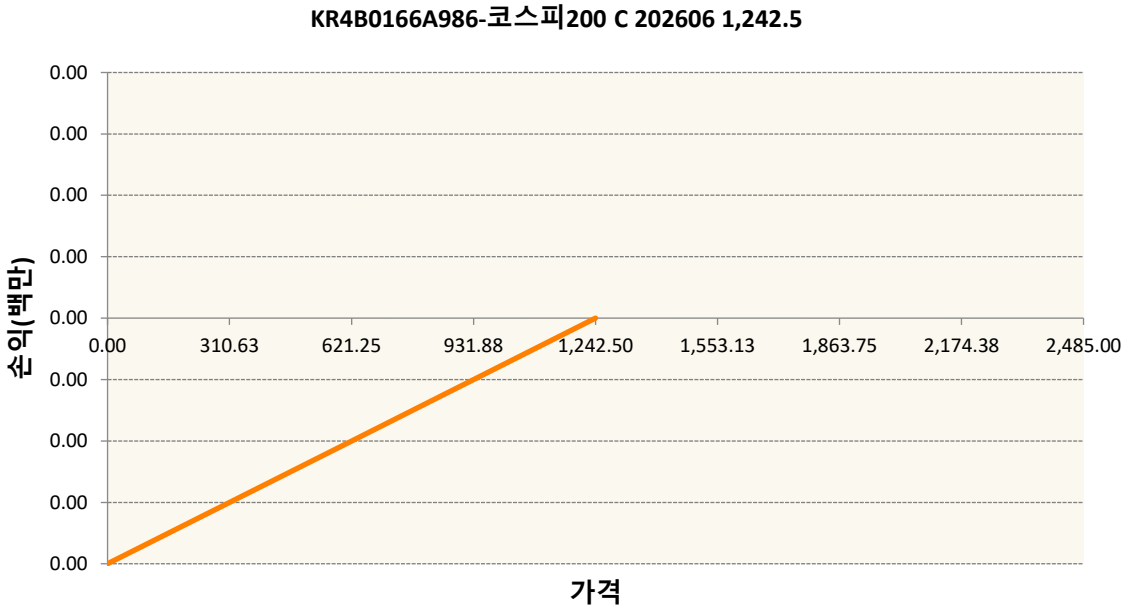
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

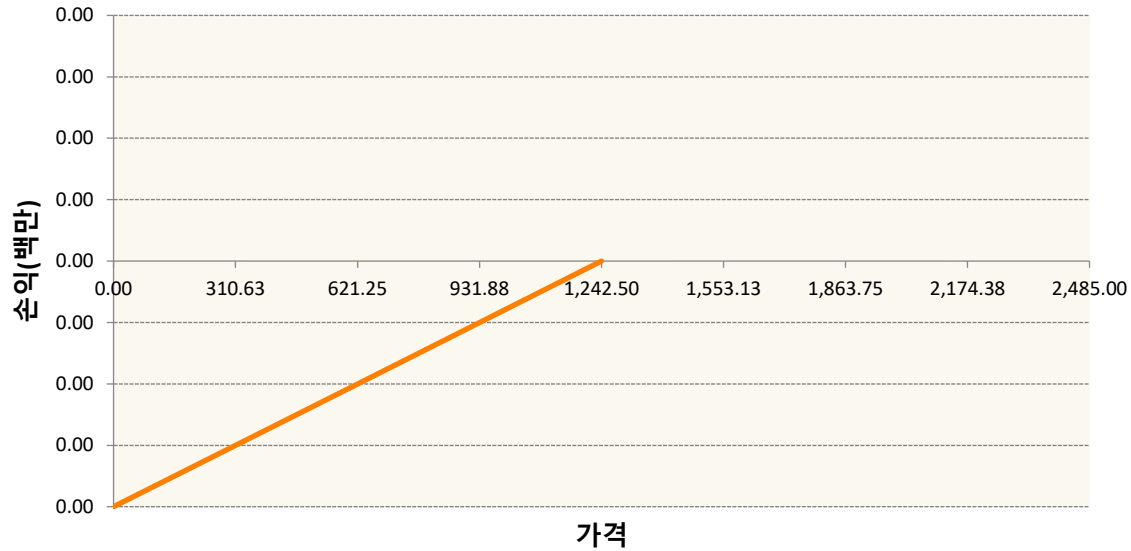
(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0166A984-코스피200 P 202606 1,242.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B0166A986 코스피200 C 202606 1,242.5							683
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-320	-379	-439	-500	-560	-622	-683
-5.33%	-116	-180	-244	-308	-371	-435	-499
-2.67%	53	-12	-77	-141	-206	-271	-335
0%	189	126	63	0	-64	-128	-192
2.67%	295	237	178	118	57	-5	-67
5.33%	375	324	271	215	158	100	41
8.00%	433	390	344	294	242	188	132
KR4B0166A994 코스피200 C 202606 1,245.0							906
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-429	-507	-586	-665	-745	-826	-906
-5.33%	-158	-242	-326	-410	-494	-578	-662
-2.67%	67	-18	-103	-189	-274	-359	-445
0%	250	167	84	0	-84	-169	-254
2.67%	392	316	238	158	77	-5	-87
5.33%	500	433	362	288	212	135	56
8.00%	579	522	460	394	324	252	178
KR4C0166A984 코스피200 P 202606 1,242.5							416
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-231	-268	-305	-342	-379	-416
-5.33%	-71	-110	-149	-188	-226	-265	-304
-2.67%	32	-7	-47	-86	-126	-165	-204
0%	115	77	39	0	-39	-78	-117

2.67%	180	145	109	72	35	-3	-41
5.33%	228	198	165	131	97	61	25
8.00%	264	238	210	179	148	115	81

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,605

공시일 2026-05-29

기준일 2026-05-28

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	2026-05-29
기준일	2026-05-28

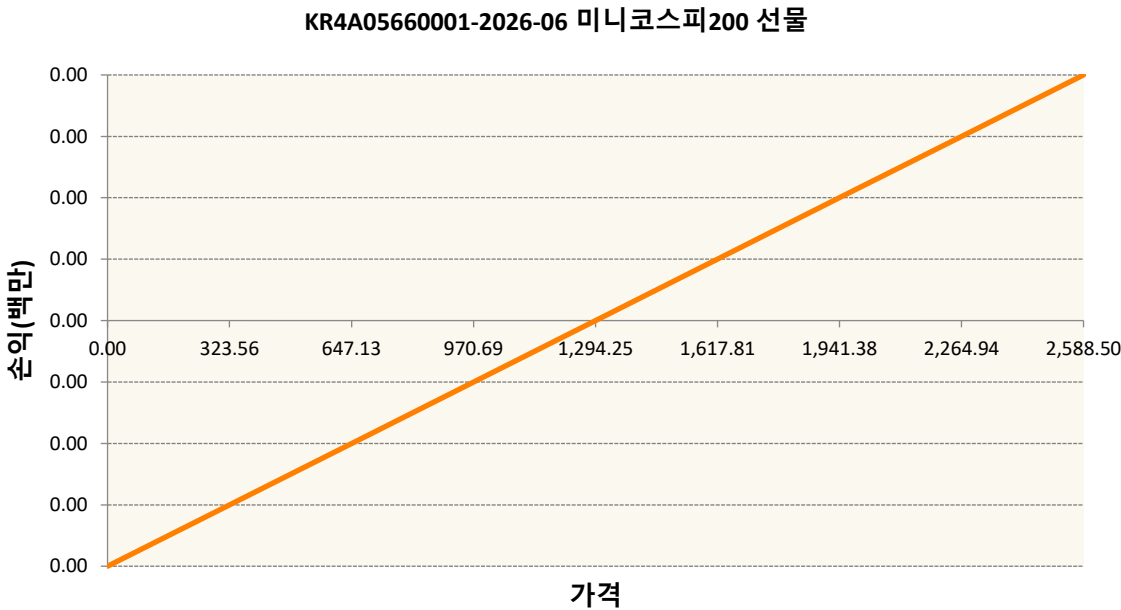
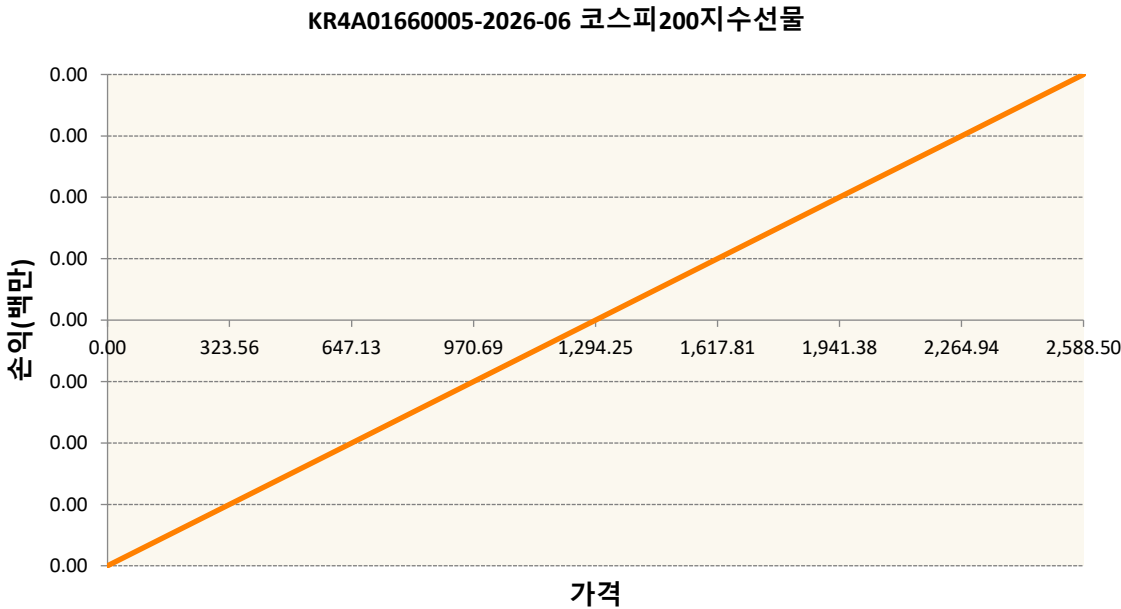
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

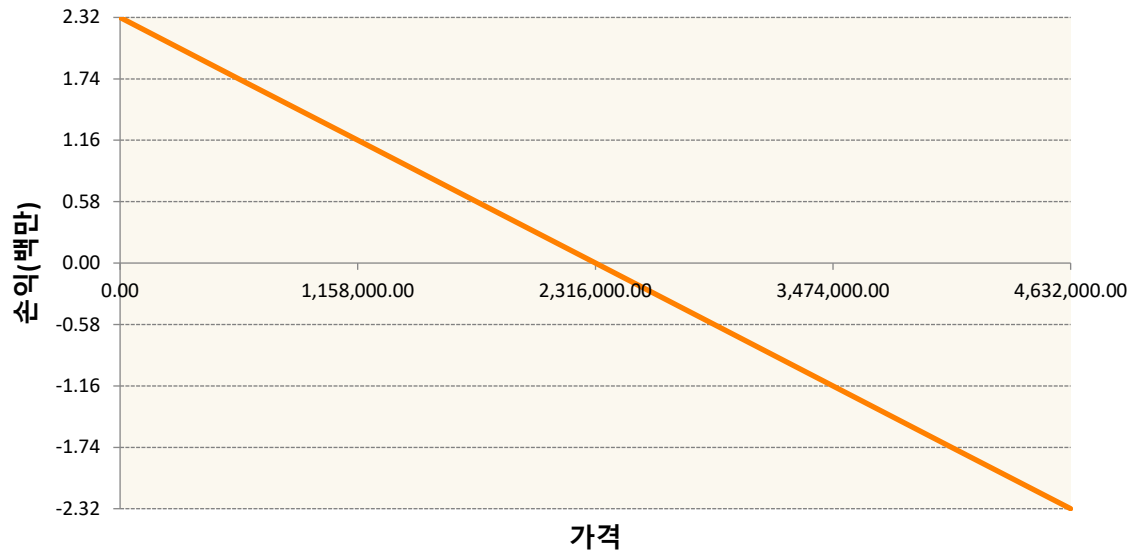
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,290	966	323	장내
누계	유가증권	선물	2,912	93	2,819	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								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	-103
-5.33%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-2.67%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	34	34	34	34	34	34	34	34
5.33%	69	69	69	69	69	69	69	69
8.00%	103	103	103	103	103	103	103	103
KR4A05660001 2026-06 미니코스피200 선물								26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	9
5.33%	17	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	26	26	26	26	26	26	26	26
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	7
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5	5
-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%	-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)

323

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

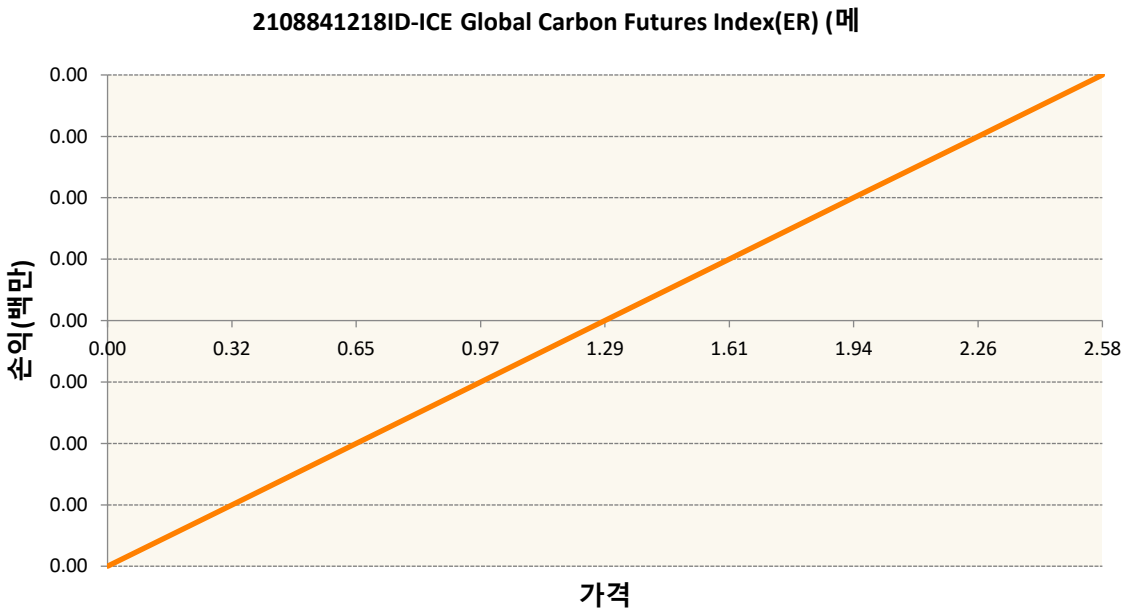
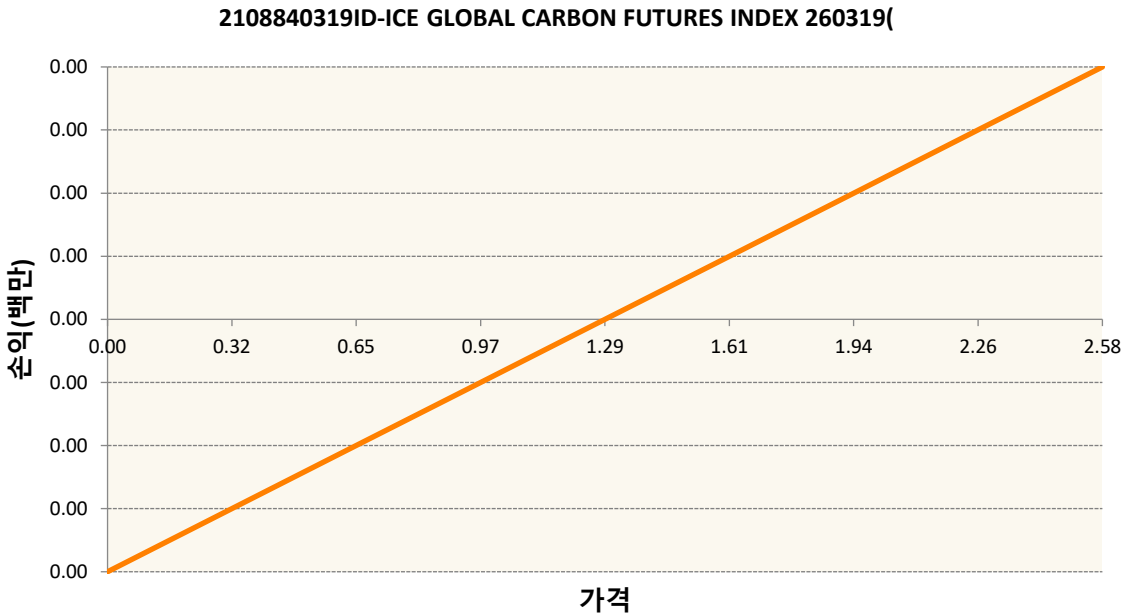
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,413	0	7,413	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		475
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		120

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)		(단위:백만원)
		686

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

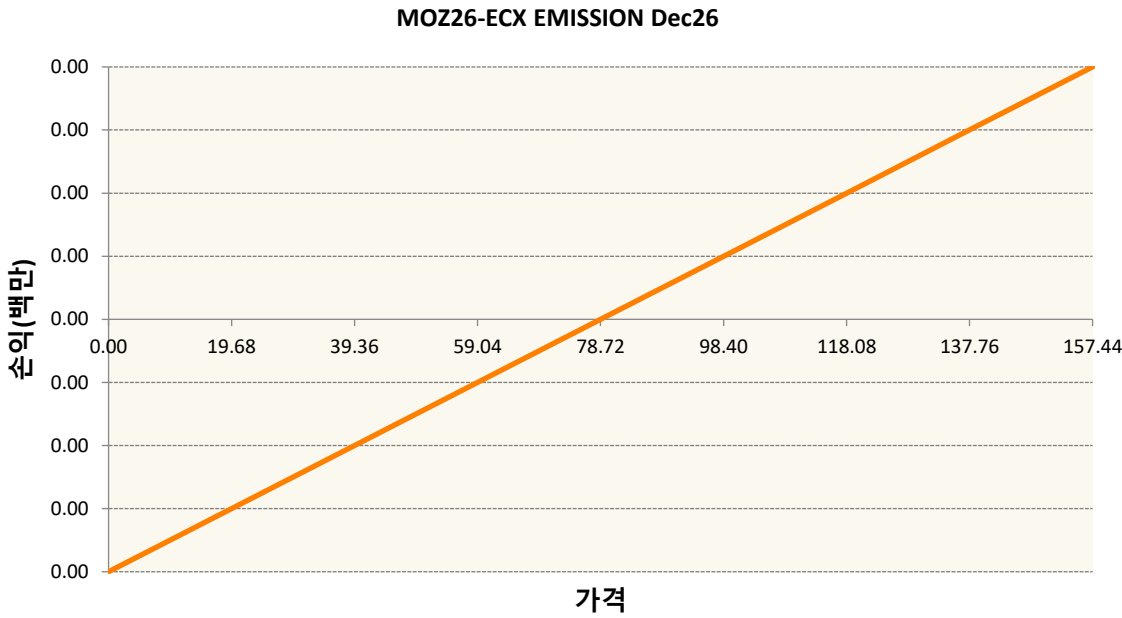
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,081	0	5,081	
누계	통화	선도	0	5,003	-5,003	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E	190
FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	210
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	406

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

(단위:백만원)

819

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

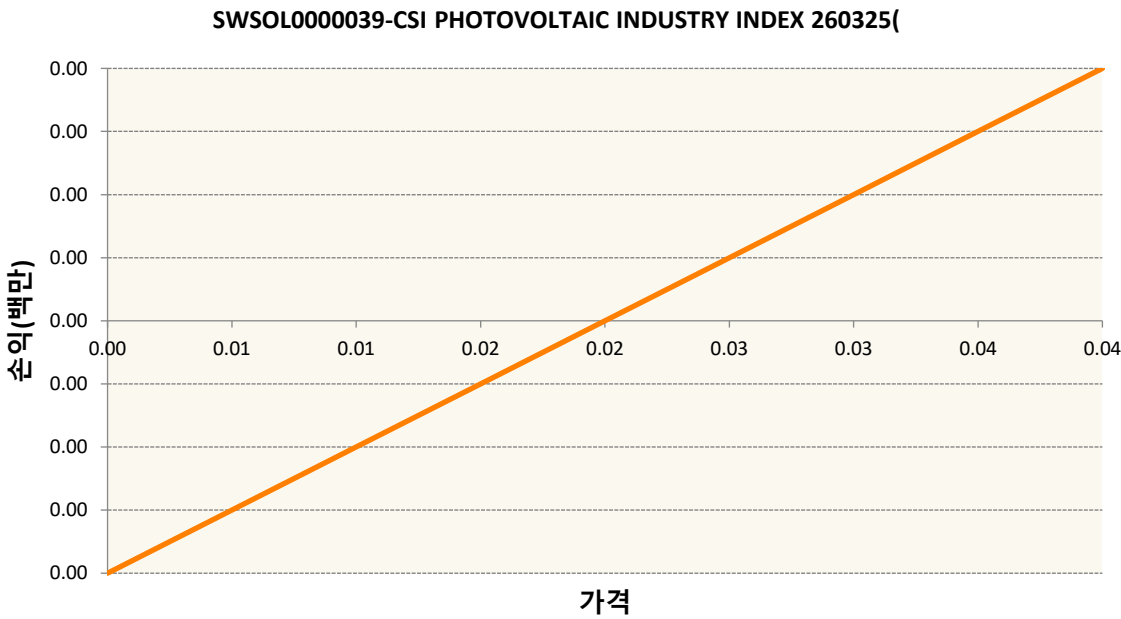
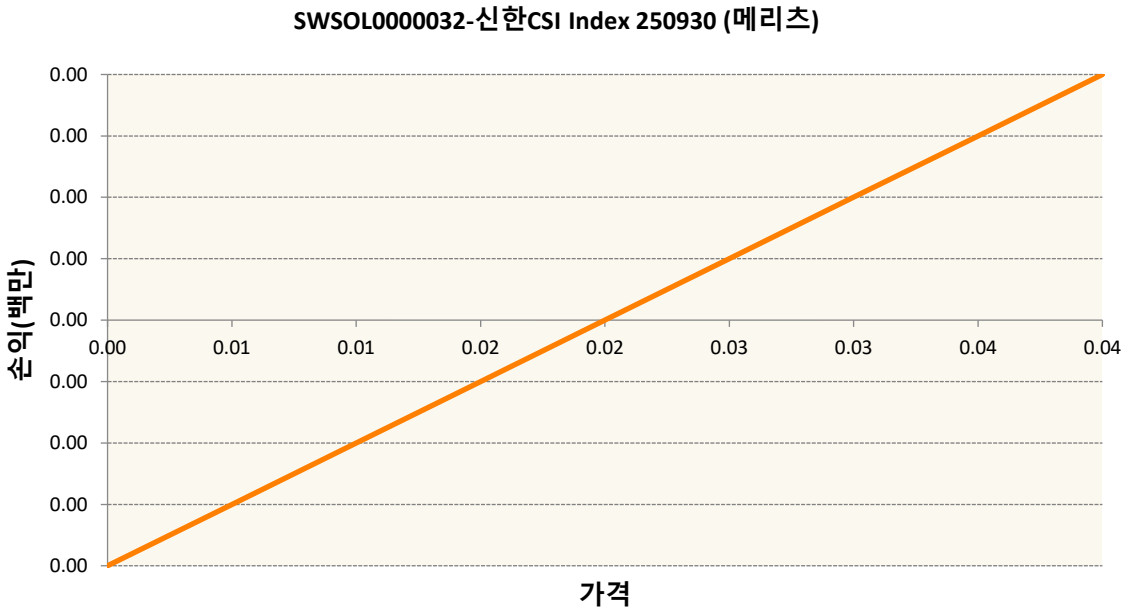
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

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)		4
SWSOL00000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	15

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

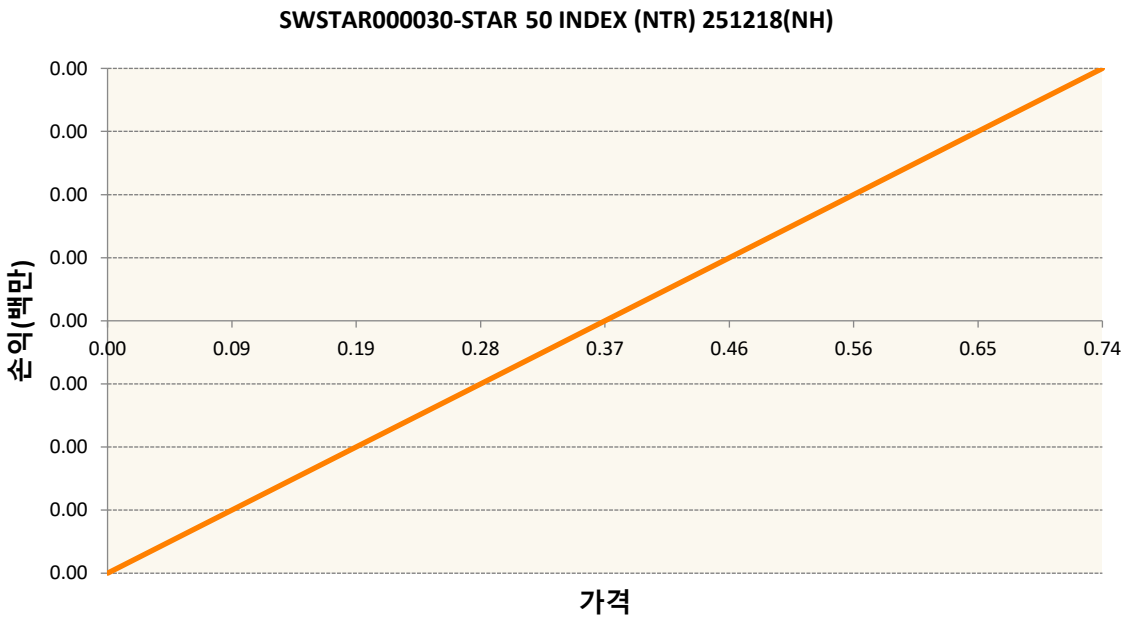
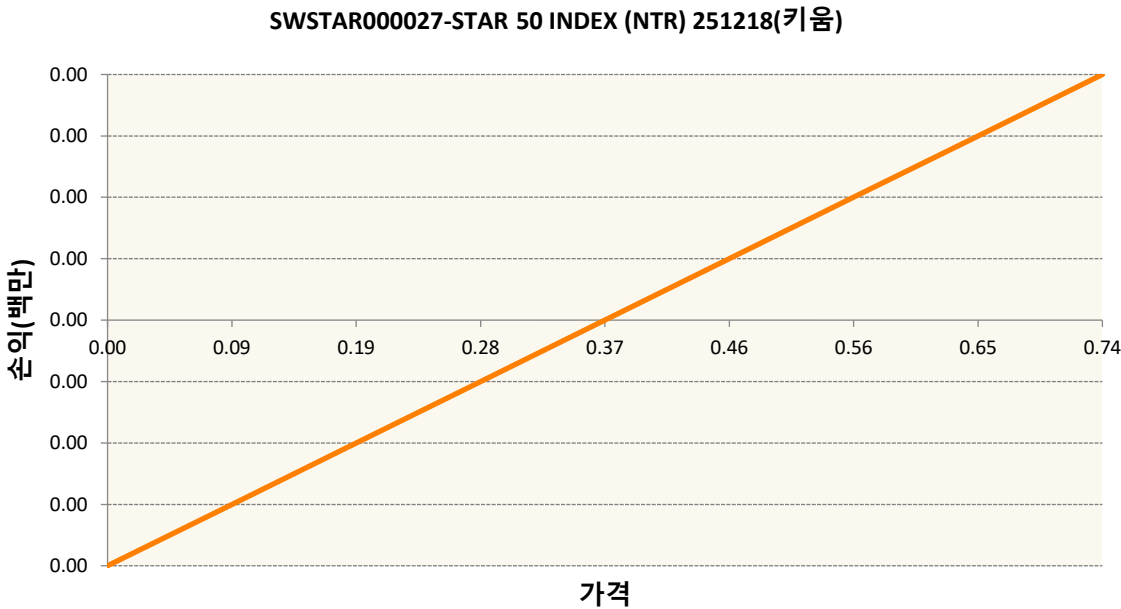
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

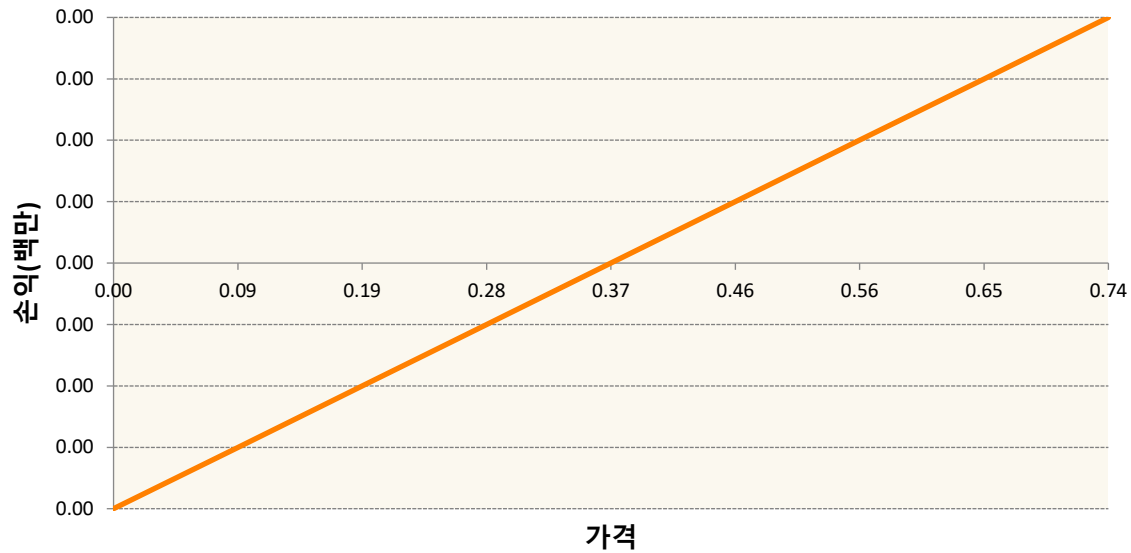
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	9,359	0	9,359	장외

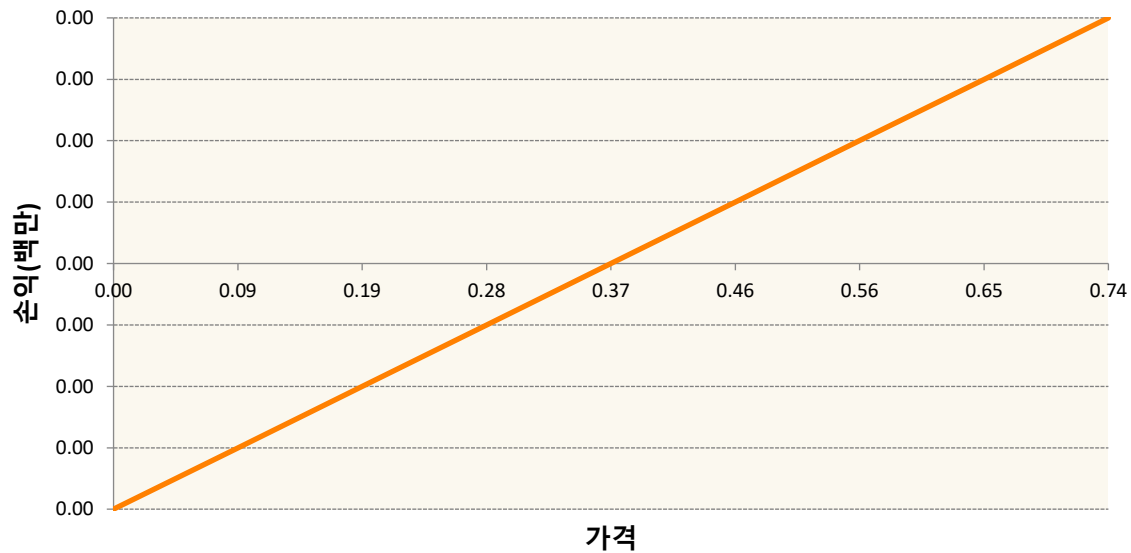
2. 만기시점의 손익구조



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)	27
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	91
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	462
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	172

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

(단위:백만원)

1,153

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

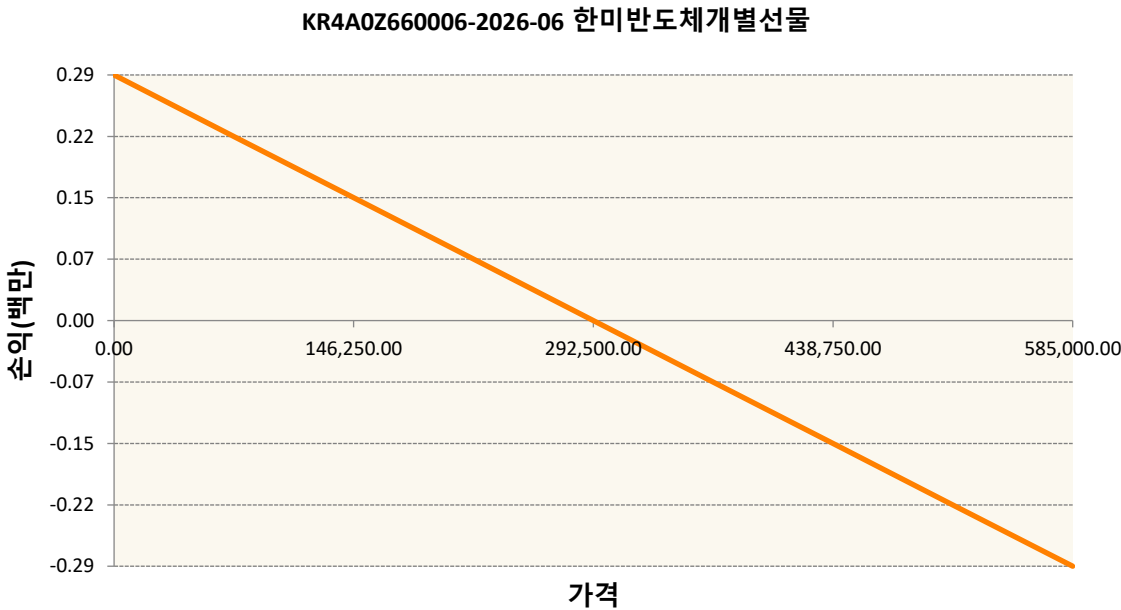
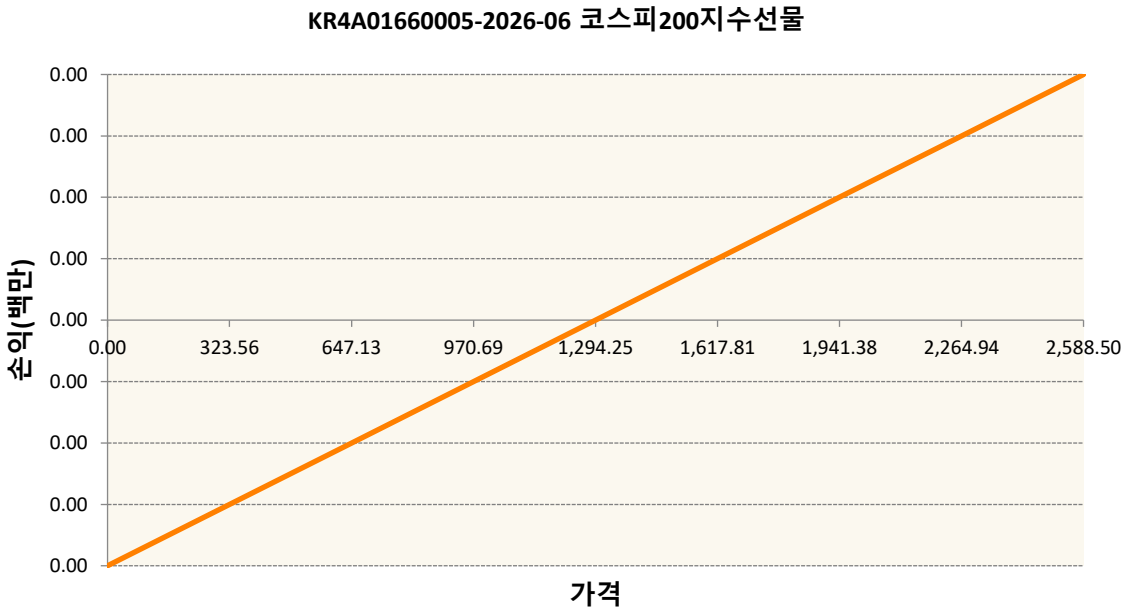
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

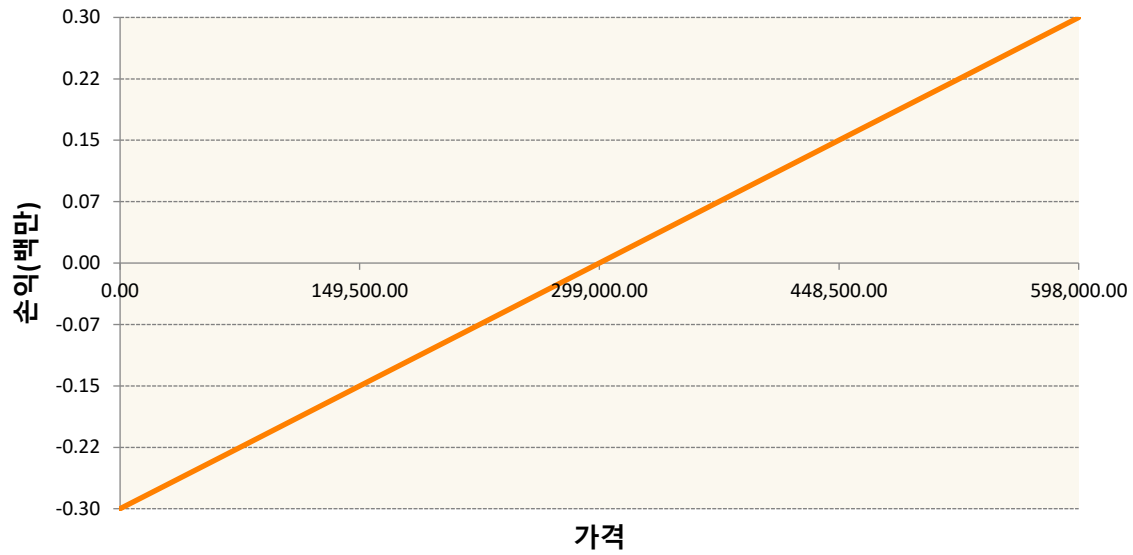
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,820	4,120	1,700	장내
누계	유가증권	선물	17,463	4,081	13,382	장내

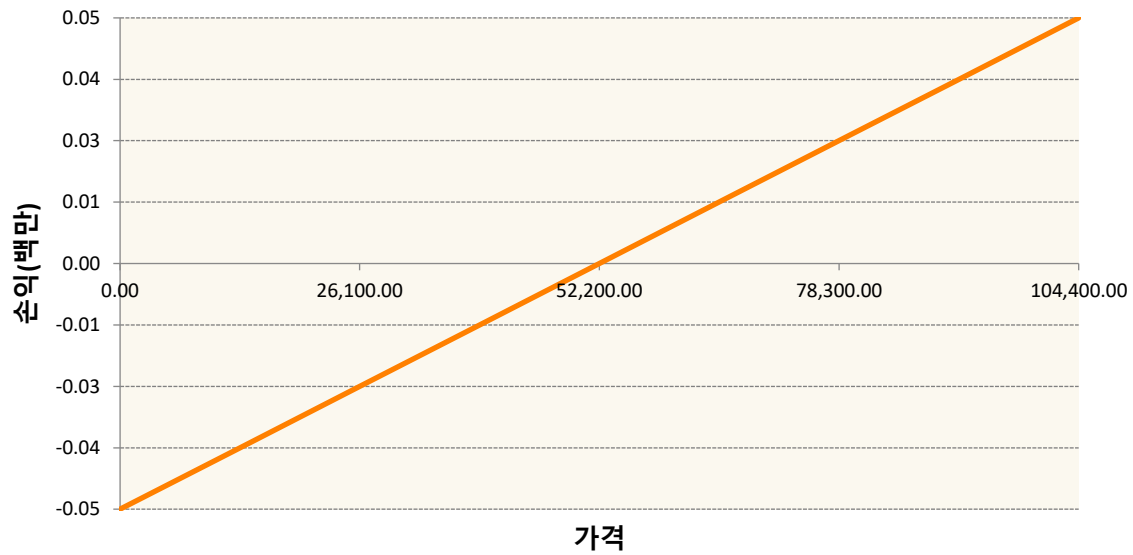
2. 만기시점의 손익구조



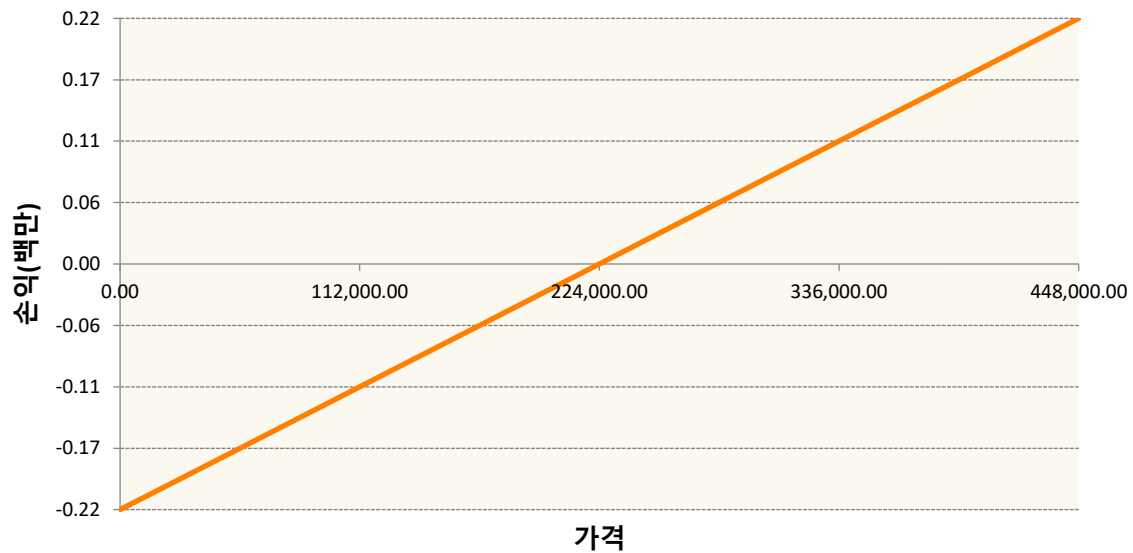
KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



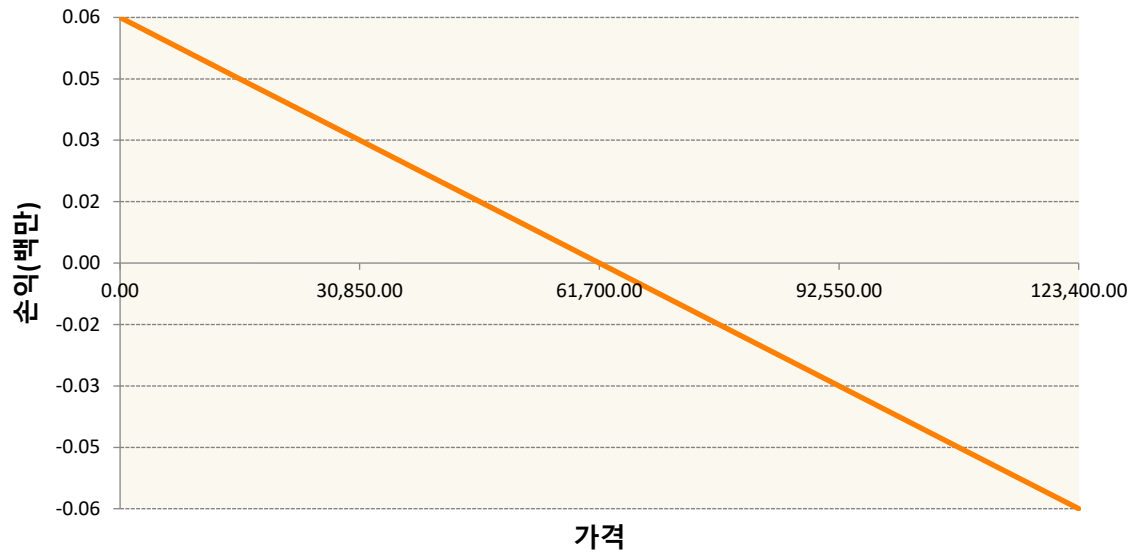
KR4A14660000-2026-06 KT개별선물



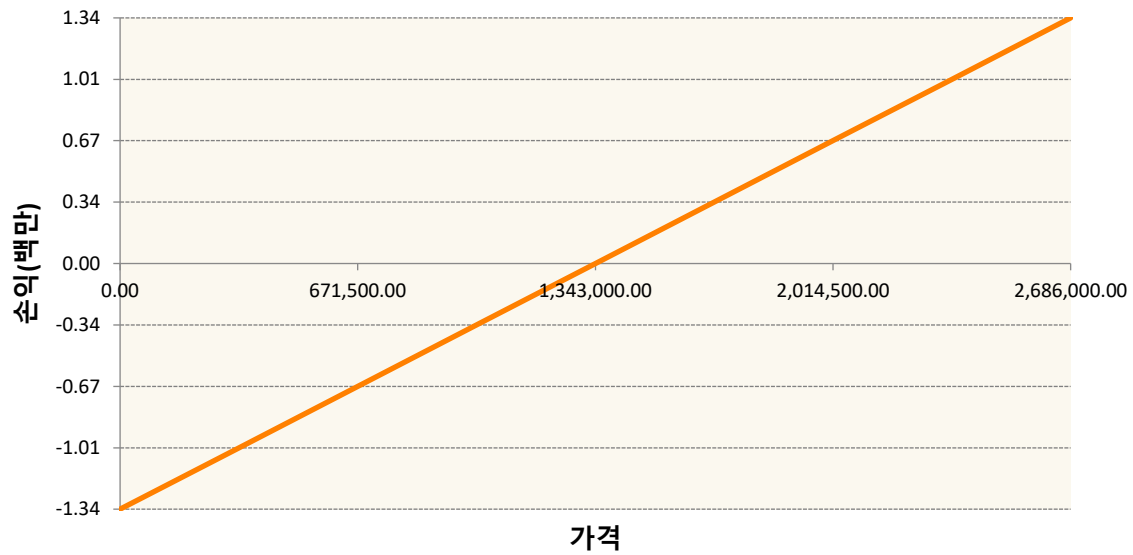
KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



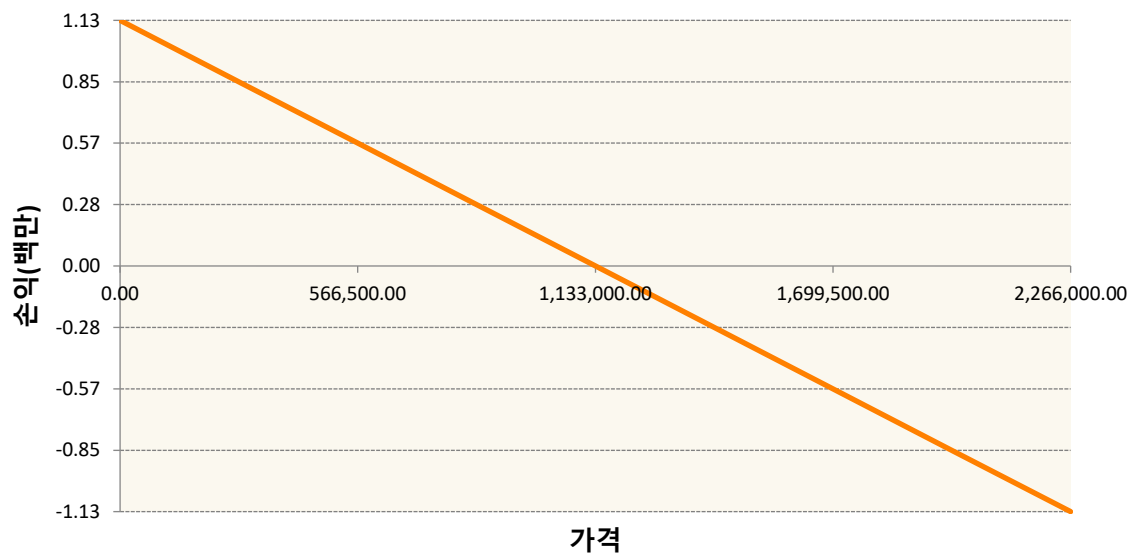
KR4A48660000-2026-06 미래에셋증권개별선물



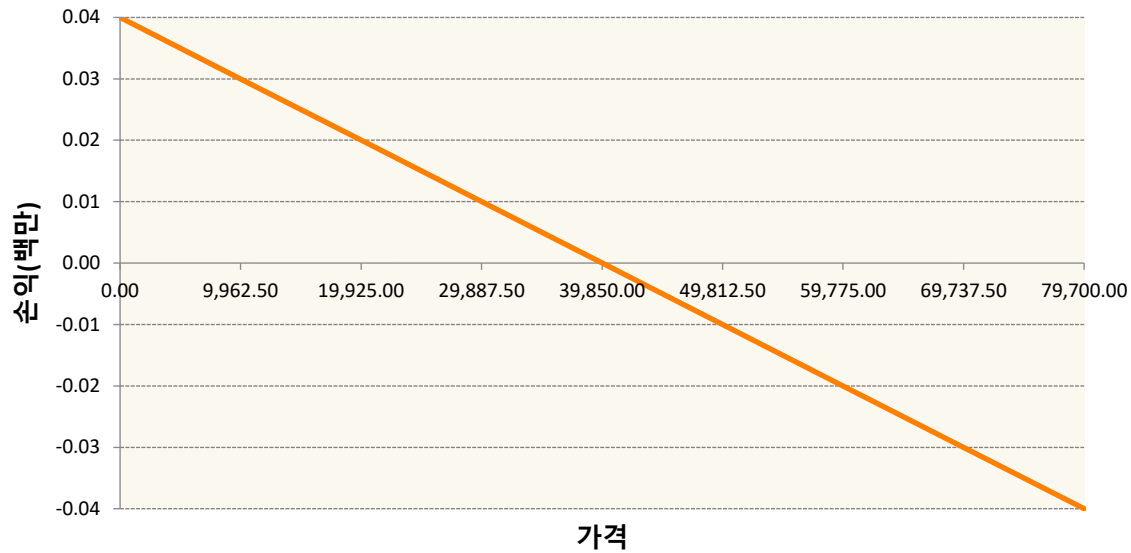
KR4AB3660001-2026-06 고려아연개별선물



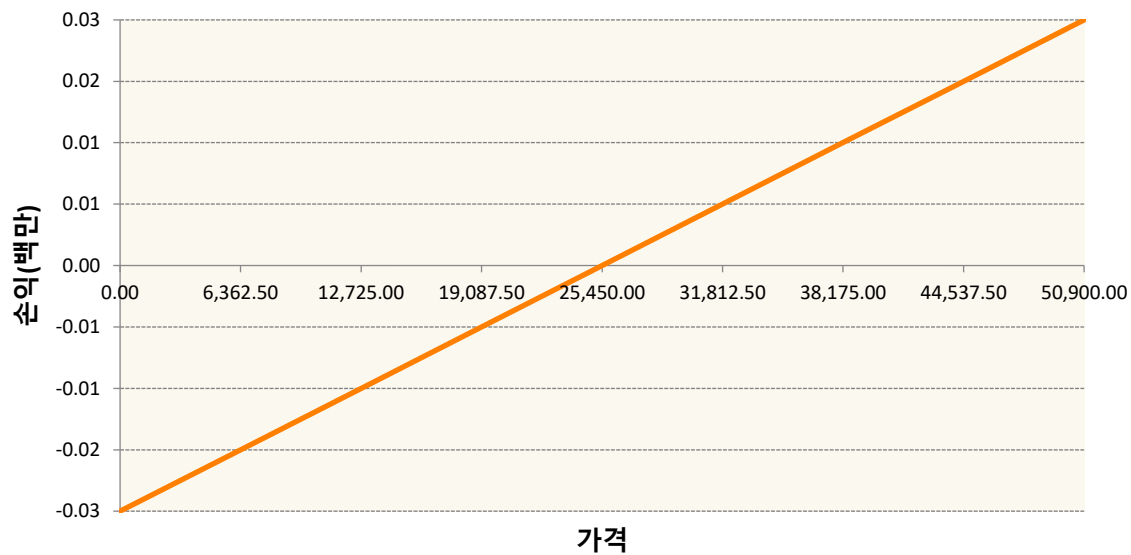
KR4ABY660003-2026-06 LG이노텍개별선물



KR4ACF660005-2026-06 카카오개별선물



KR4AFT660006-2026-06 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005			2026-06 코스피200지수선물				1,060
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,060	-1,060	-1,060	-1,060	-1,060	-1,060	-1,060
-5.33%	-707	-707	-707	-707	-707	-707	-707
-2.67%	-353	-353	-353	-353	-353	-353	-353
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	353	353	353	353	353	353	353
5.33%	707	707	707	707	707	707	707
8.00%	1,060	1,060	1,060	1,060	1,060	1,060	1,060
KR4A0Z660006			2026-06 한미반도체개별선물				57
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57
-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%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57

KR4A11660003 2026-06 삼성전자개별선물 248

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
-5.33%	-165	-165	-165	-165	-165	-165	-165
-2.67%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	83	83	83	83	83	83	83
5.33%	165	165	165	165	165	165	165
8.00%	248	248	248	248	248	248	248

KR4A14660000 2026-06 KT개별선물 32

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	11	11	11	11	11	11	11
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	32	32	32	32	32	32	32

KR4A24660008 2026-06 LG전자개별선물 18

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-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%	18	18	18	18	18	18	18

KR4A48660000 2026-06 미래에셋증권개별선물 57

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57
-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%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57

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

KR4ABY660003 2026-06 LG이노텍개별선물 111

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	111	111	111	111	111	111	111
-5.33%	74	74	74	74	74	74	74
-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%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111

KR4ACF660005 2026-06 카카오개별선물 102

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

KR4AFT660006 2026-06 대우건설개별선물 37

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-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%	37	37	37	37	37	37	37

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

(단위:백만원)

3,988

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

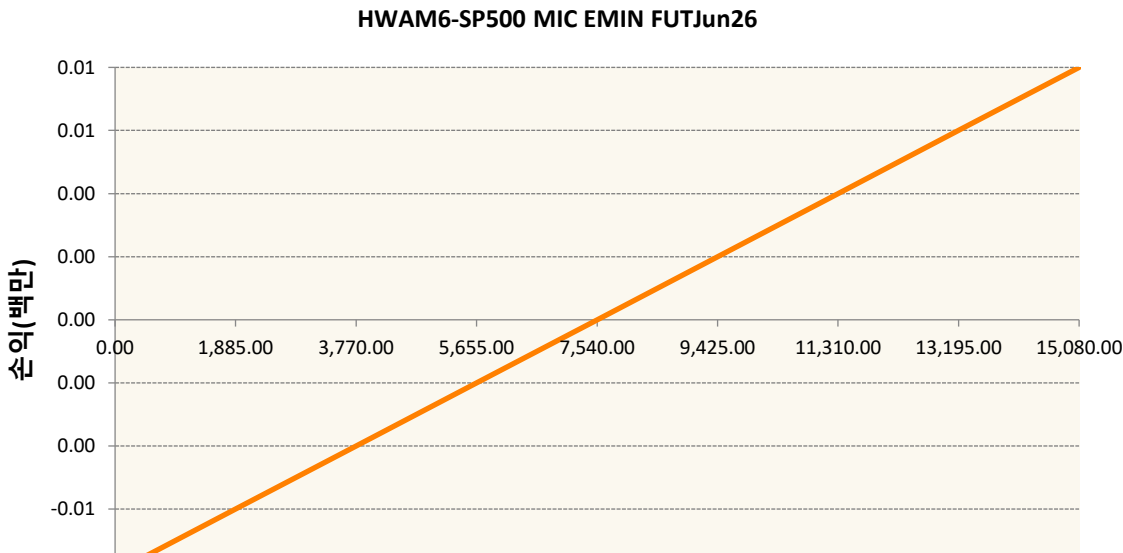
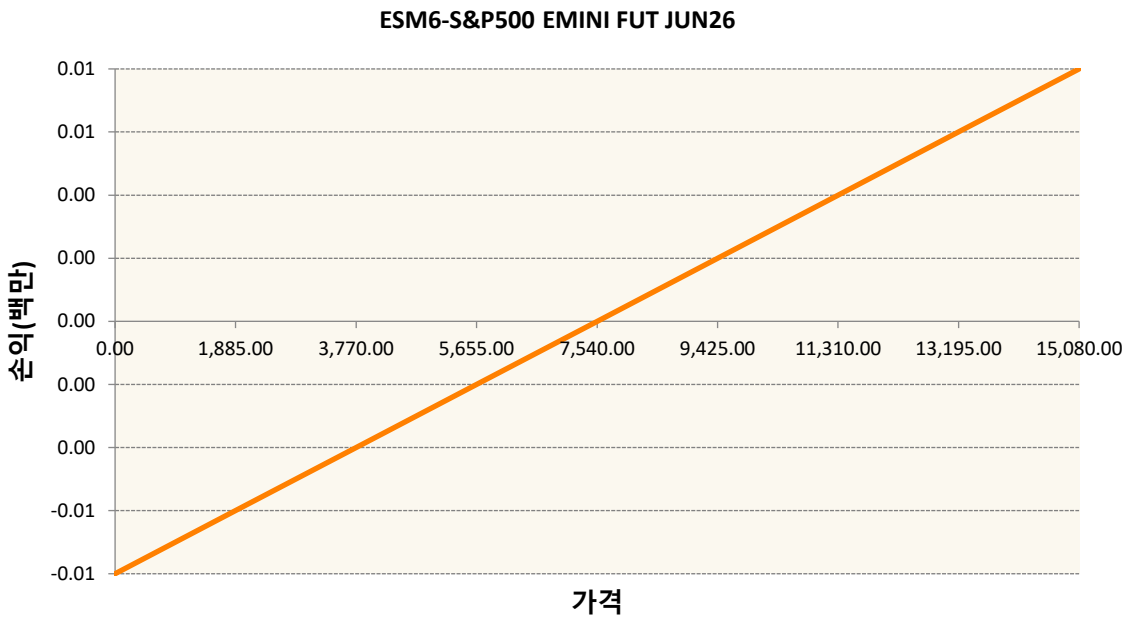
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

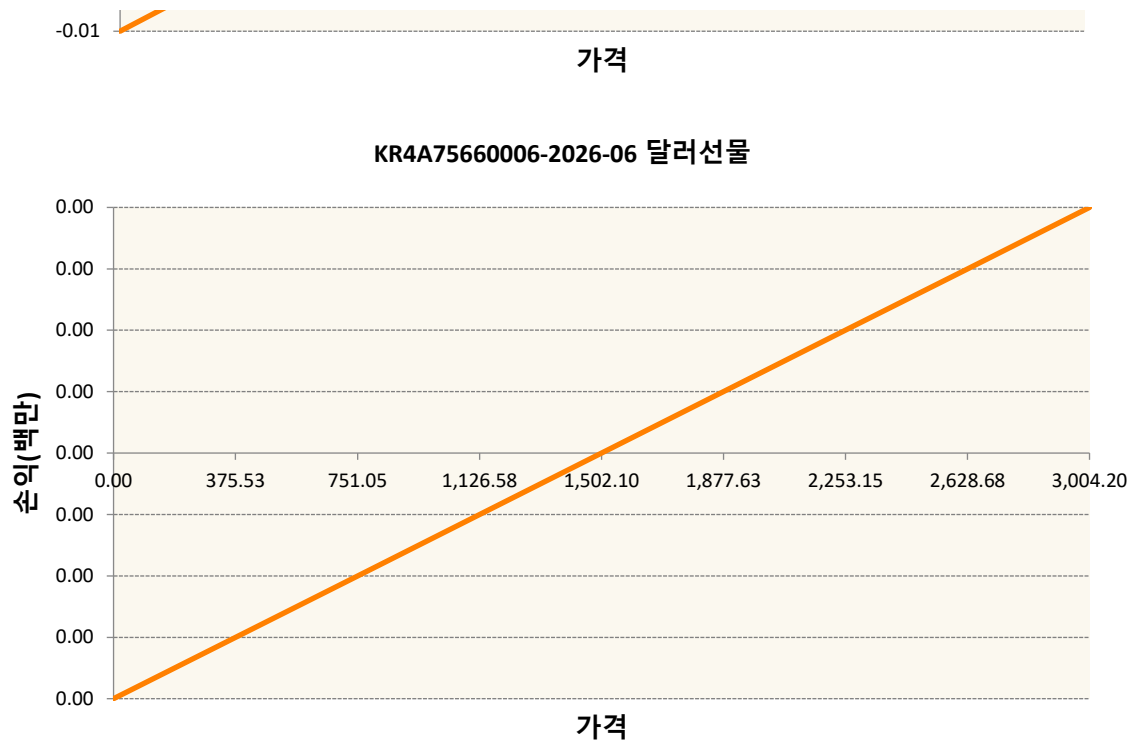
1. 계약금액

(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	61,032	0	61,032	
누계	지수	선물	281	0	281	장내
누계	통화	선물	10,665	0	10,665	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,883
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		22
KR4A756600 2026-06 달러선물			853

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,248

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

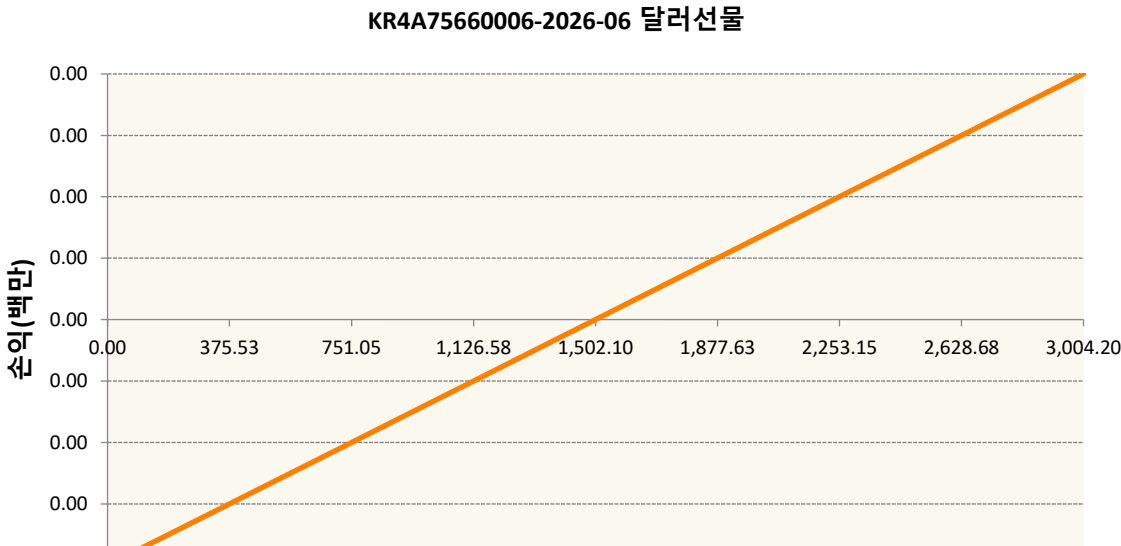
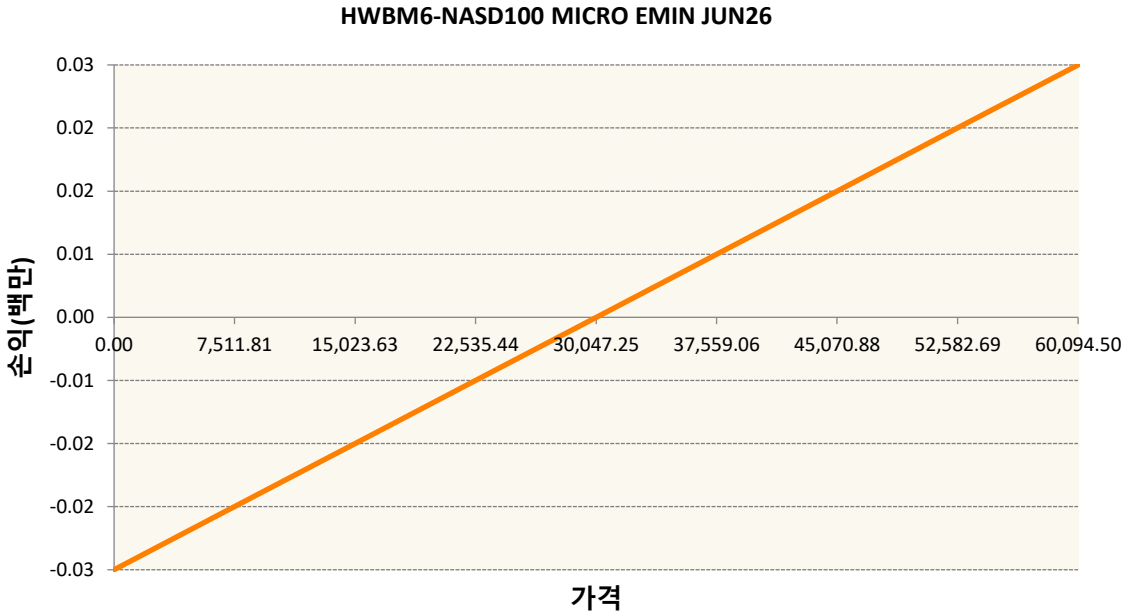
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

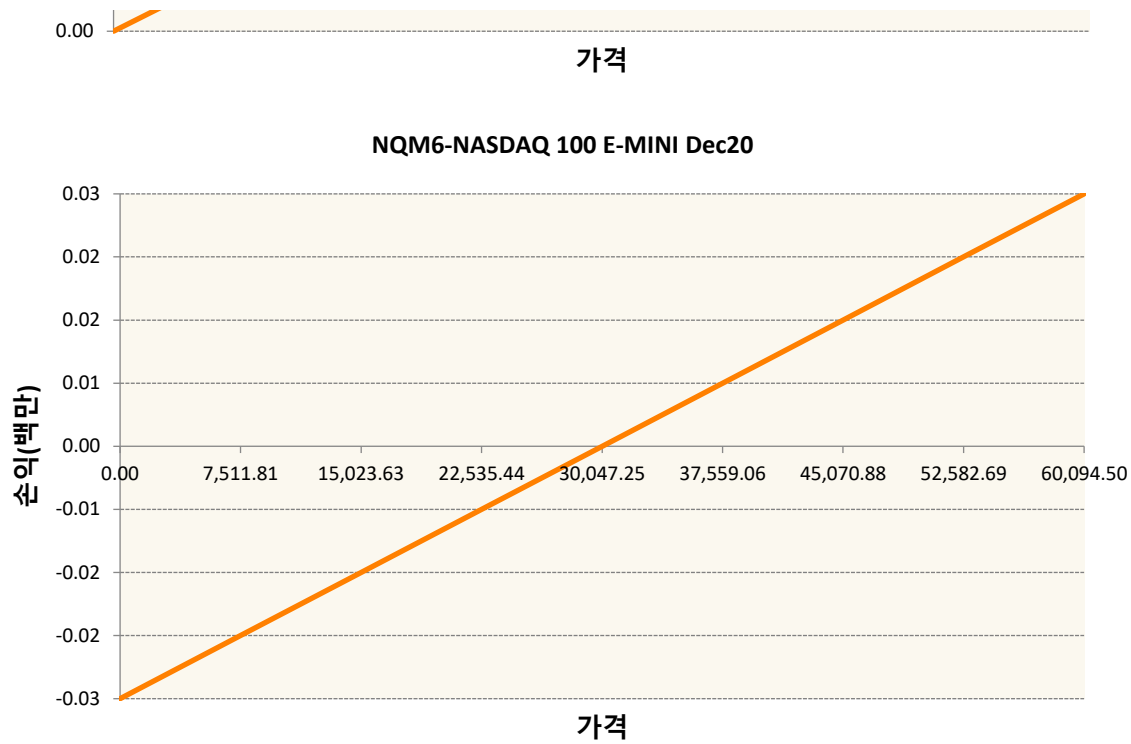
1. 계약금액

(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	30,600	0	30,600	
누계	유가증권	선물	263	0	263	장내
누계	통화	선물	3,920	0	3,920	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	21
KR4A756600	2026-06 달러선물	314
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,448

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

2,710

공시일	2026-05-29
기준일	2026-05-28

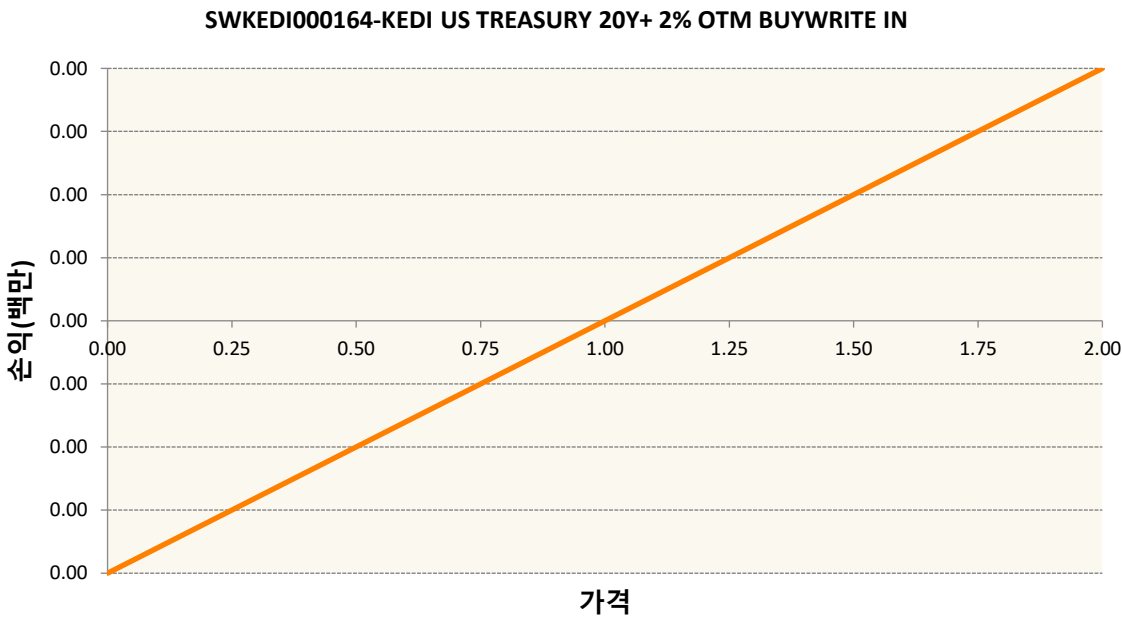
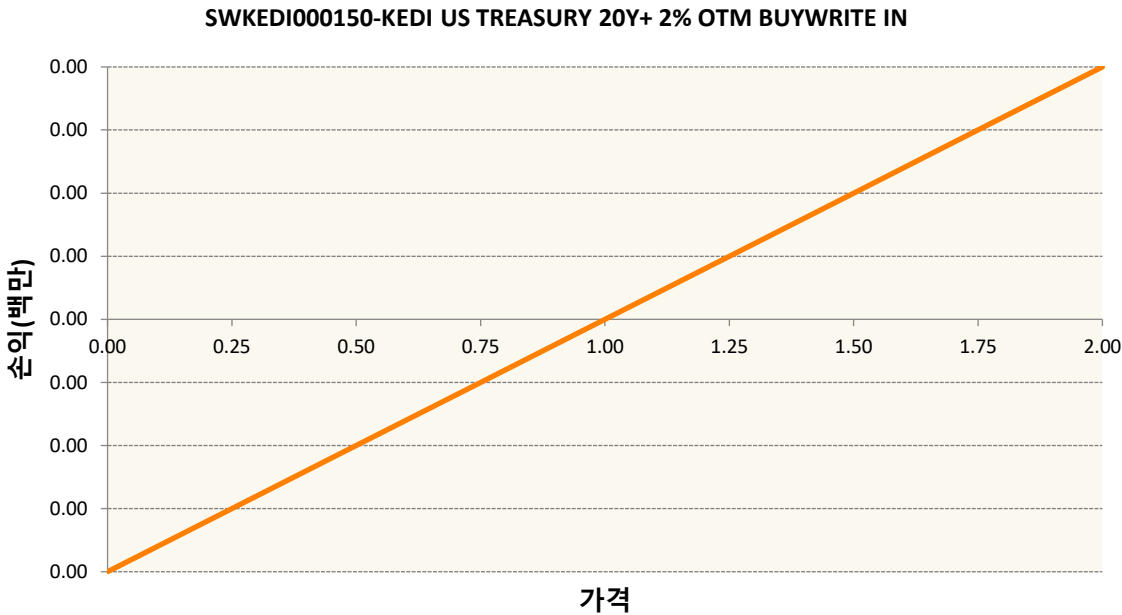
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

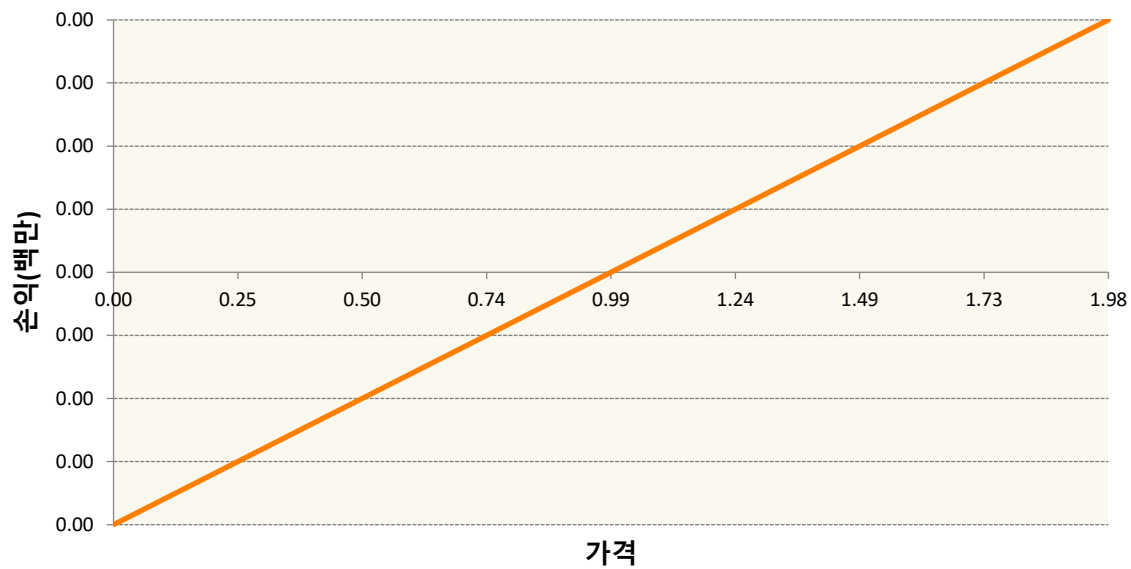
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	349,374	0	349,374	장외

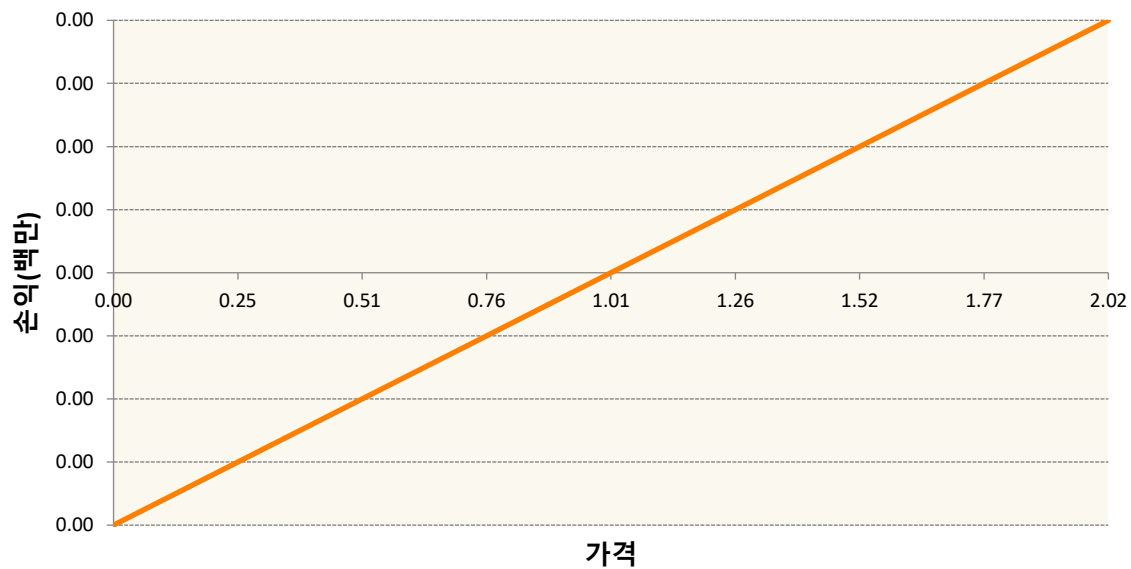
2. 만기시점의 손익구조



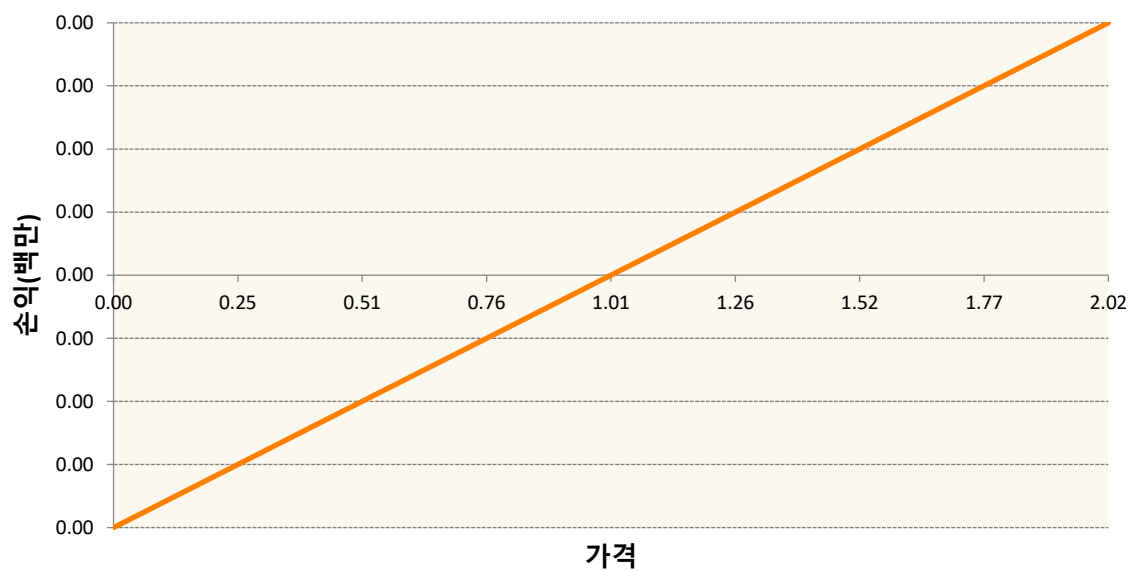
SWKEDI000172-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,356
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		153
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,430
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		8,974
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,003

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	11,911