

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

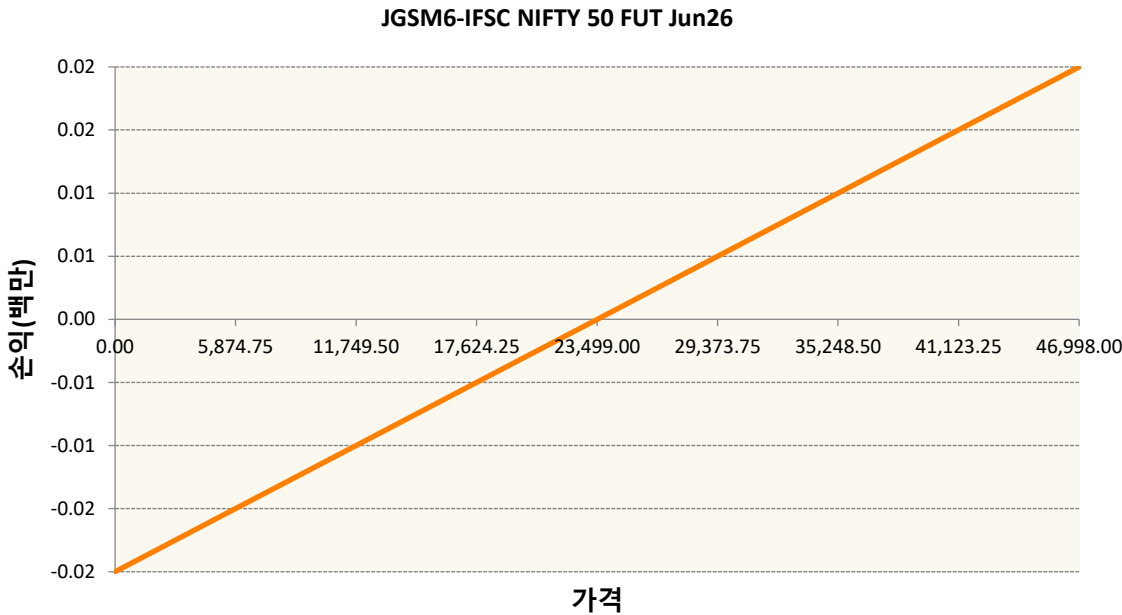
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	353	0	353	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSM6	IFSC NIFTY 50 FUT Jun26	28
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

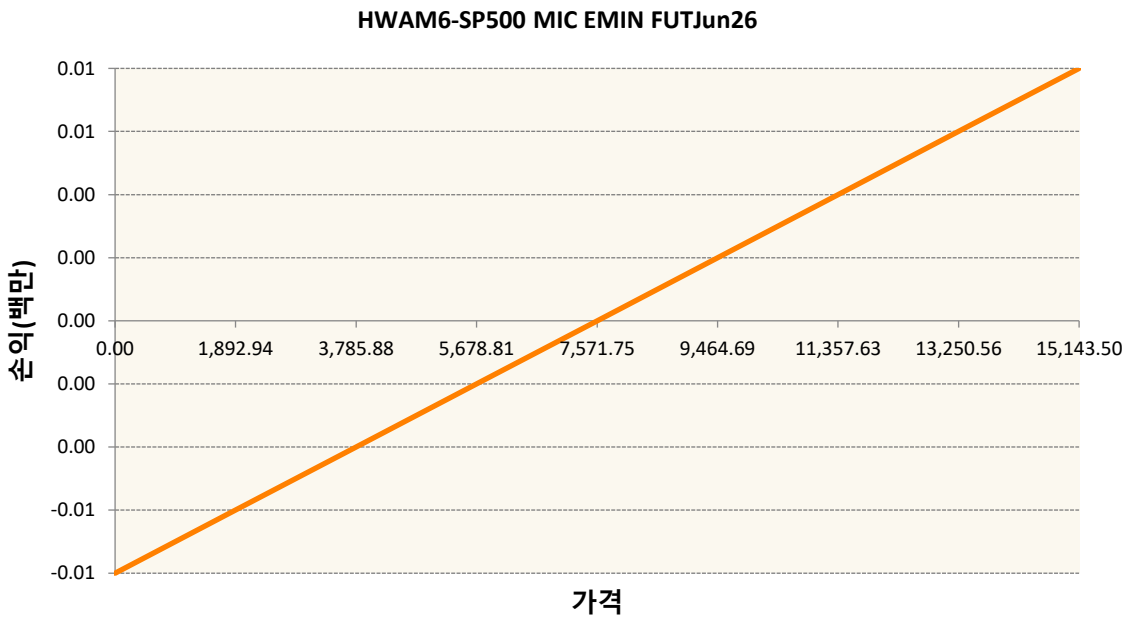
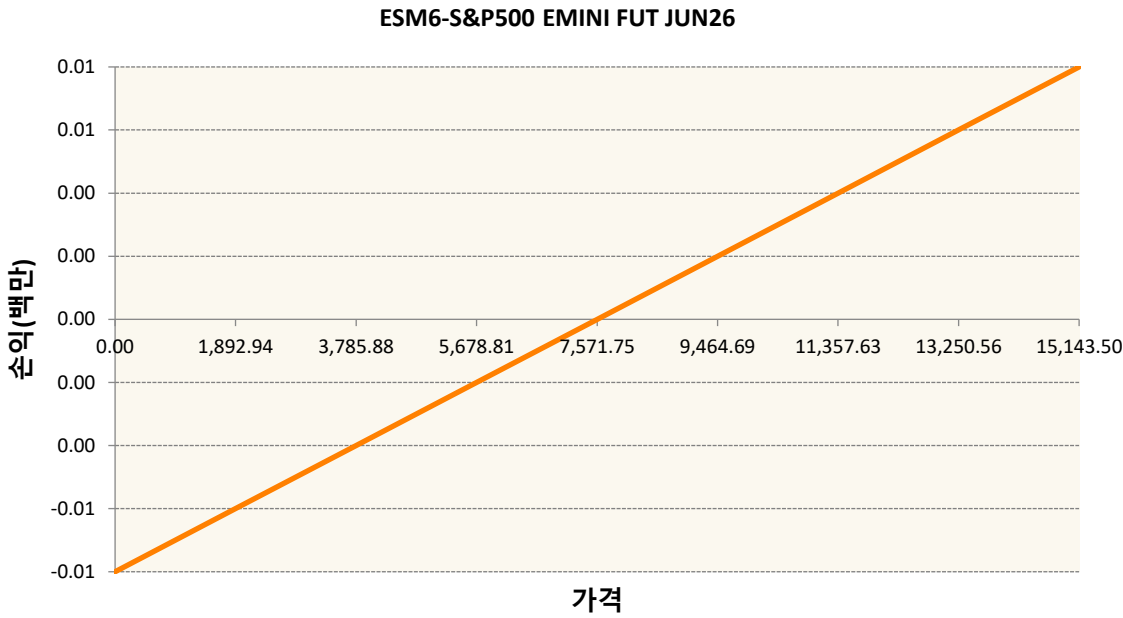
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	569	0	569	
누계	지수	선물	57	0	57	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	46
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	5

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

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

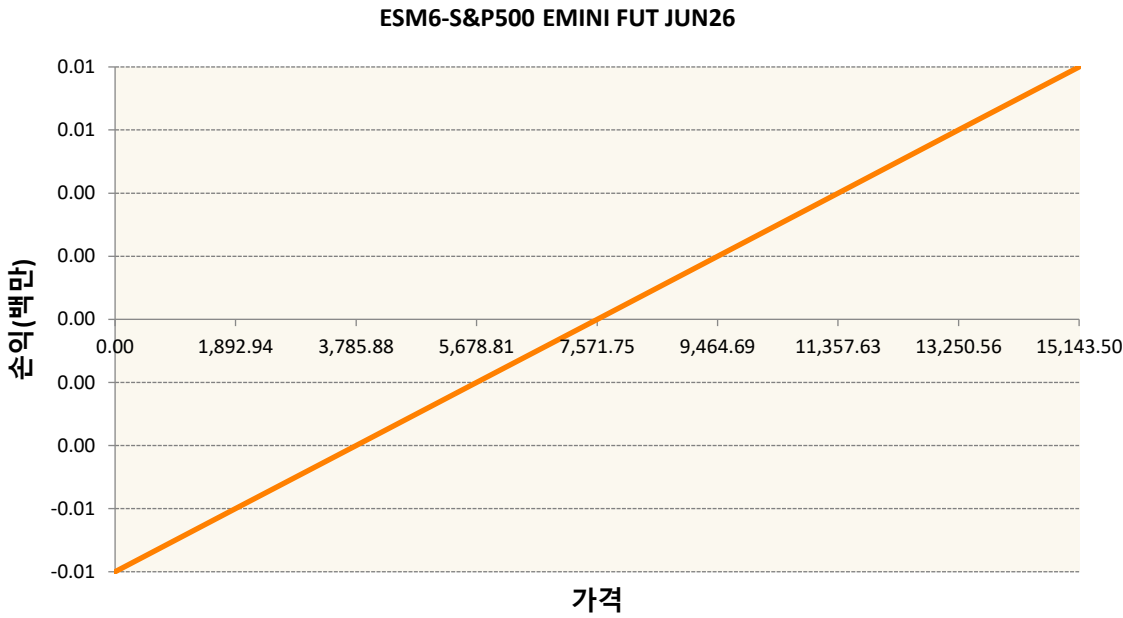
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,139	0	1,139	

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	2026-06-05
기준일	2026-06-04

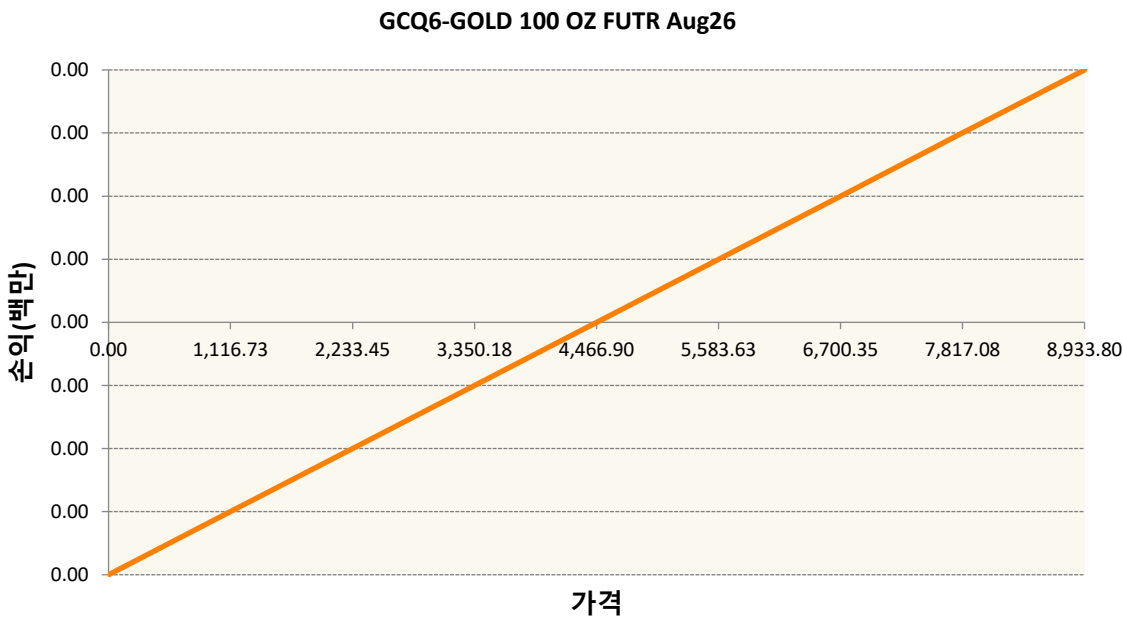
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,363	0	5,363	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 06/05/26 C415 EQUITY	37
GCQ6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	429

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

(단위:백만원)

585

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

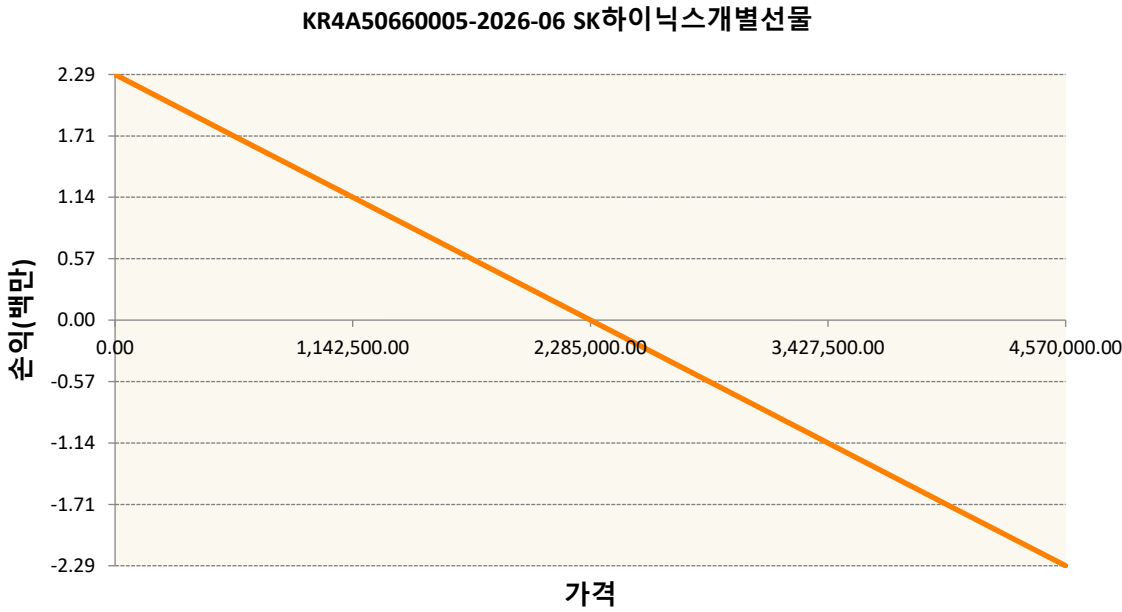
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	스왑	0	22,850	-22,850	장외
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRSP15 PLTR US 06/05/26 P157.5 EQUITY	12
AOPLTRUS15 PLTR US 06/05/26 C157.5 EQUITY	484
KR4A506600 2026-06 SK하이닉스개별선물	1,828

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

(단위:백만원)

8,622

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

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 06/05/26 C86 EQUITY

4

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

(단위:백만원)

3

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

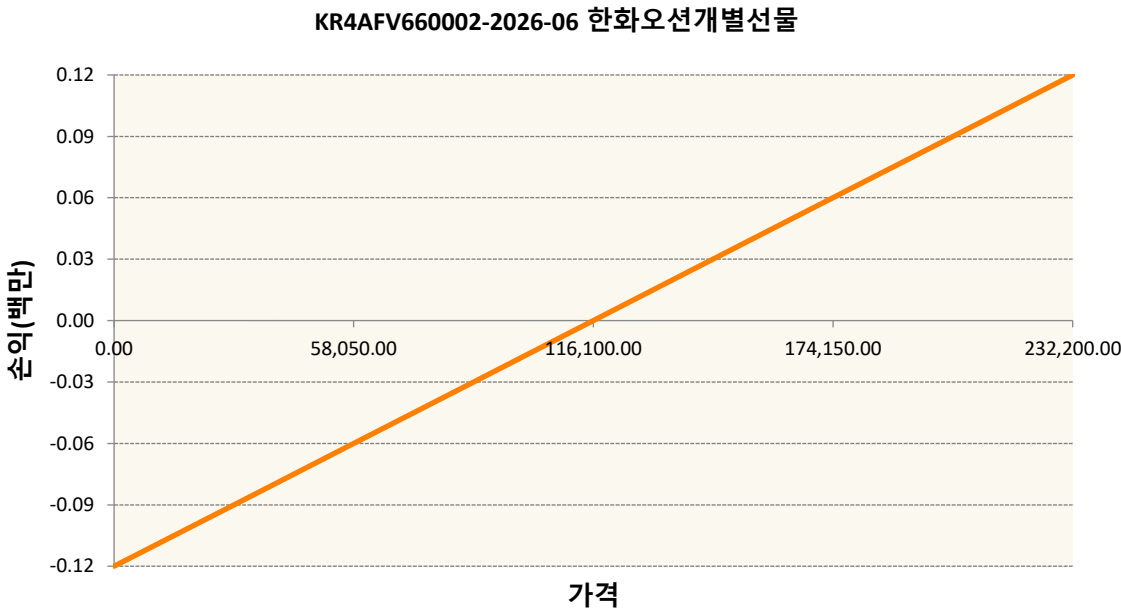
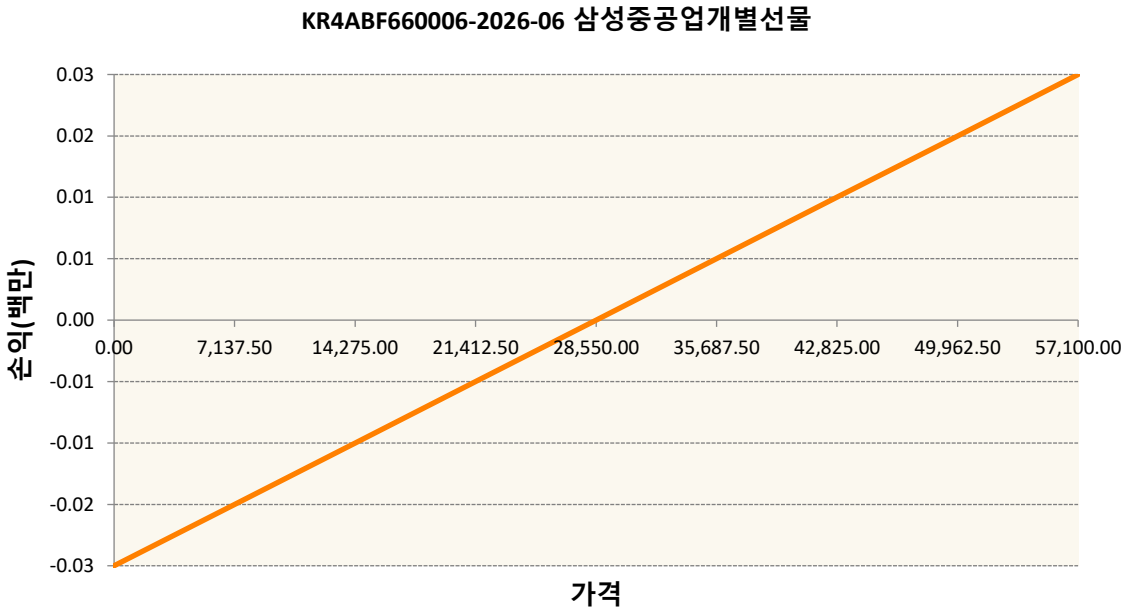
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	15,995	0	15,995	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	22,186	0	22,186	장내
누계	유가증권	스왑	564	0	564	장외

2. 만기시점의 손익구조



가격	손익(백만)
0.00	-0.04
8,980.00	-0.03
17,960.00	-0.02
26,940.00	-0.01
35,920.00	0.00
44,900.00	0.01
53,880.00	0.02
62,860.00	0.03
71,840.00	0.04

가액	순이익(백만)
0.00	-0.04
9,083.75	-0.03
18,167.50	-0.02
27,251.25	-0.01
36,335.00	0.00
45,418.75	0.01
54,502.50	0.02
63,586.25	0.03
72,670.00	0.04

(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	
KR4AFV660002				2026-06 한화오션개별선물				90
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-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%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	90	90	90	90	90	90	90

KR4AM7690001

2026-09 SOL 조선TOP3플러스개별선물

12,723

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,723	-12,723	-12,723	-12,723	-12,723	-12,723	-12,723
-5.33%	-8,482	-8,482	-8,482	-8,482	-8,482	-8,482	-8,482
-2.67%	-4,241	-4,241	-4,241	-4,241	-4,241	-4,241	-4,241
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4,241	4,241	4,241	4,241	4,241	4,241	4,241
5.33%	8,482	8,482	8,482	8,482	8,482	8,482	8,482
8.00%	12,723	12,723	12,723	12,723	12,723	12,723	12,723

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

(단위:백만원)

19,482

공시일 2026-06-05

기준일 2026-06-04

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	2026-06-05
기준일	2026-06-04

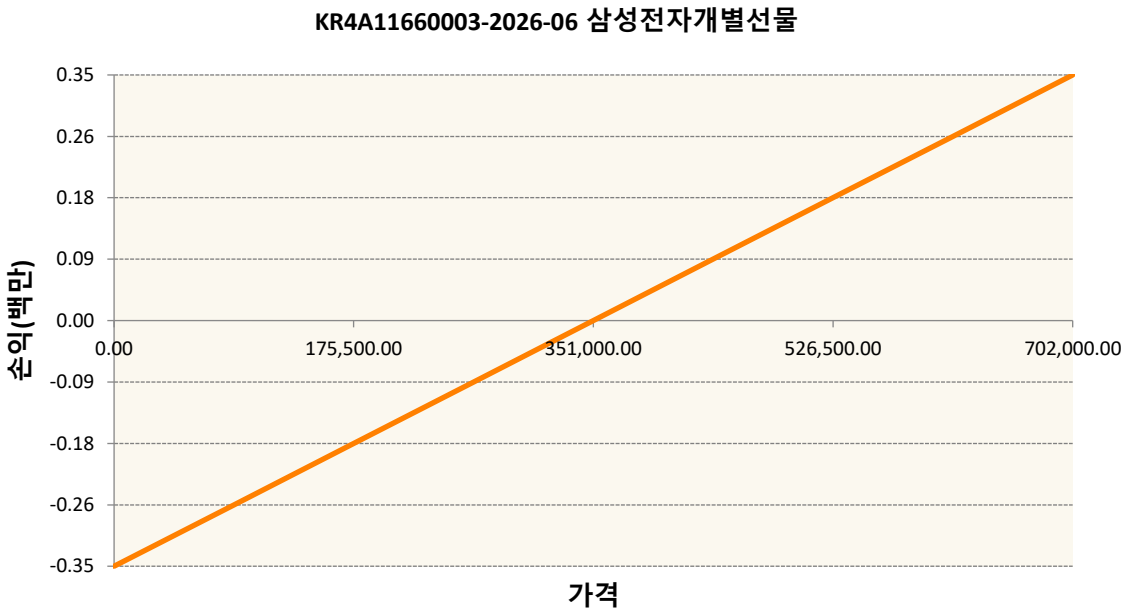
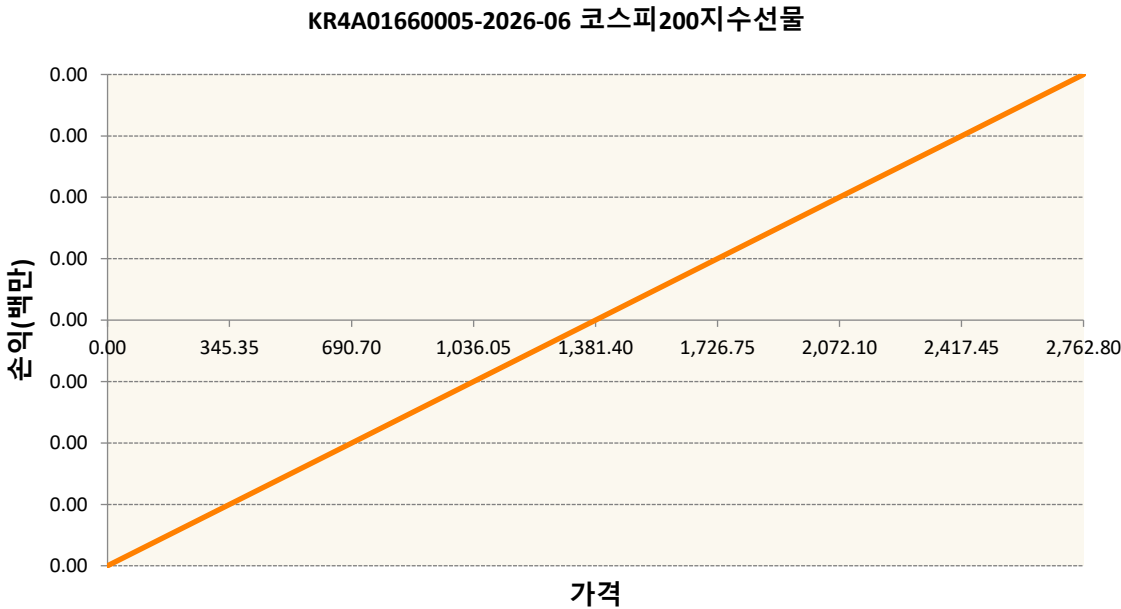
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	69,375	-69,375	장내
누계	유가증권	선물	27,933	68,014	-40,081	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,760.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A blue line starts at the origin (0, 0.00) and ends at (2,760.00, 0.00), showing that profit is zero at both the minimum and maximum price points.

가격 (Price)	이익 (백만) (Profit in millions)
0.00	0.00
345.00	0.00
690.00	0.00
1,035.00	0.00
1,380.00	0.00
1,725.00	0.00
2,070.00	0.00
2,415.00	0.00
2,760.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순이익). The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 2,765.00 with major ticks every 345.63. The y-axis represents the net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A blue line starts at the origin (0, 0.00) and extends to the point (2,765.00, 0.00), indicating a constant rate of change.

가액	순이익 (백만)
0.00	0.00
345.63	0.00
691.25	0.00
1,036.88	0.00
1,382.50	0.00
1,728.13	0.00
2,073.75	0.00
2,419.38	0.00
2,765.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01660005			2026-06 코스피200지수선물				717
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-717	-717	-717	-717	-717	-717	-717
-5.33%	-478	-478	-478	-478	-478	-478	-478
-2.67%	-239	-239	-239	-239	-239	-239	-239
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	239	239	239	239	239	239	239
5.33%	478	478	478	478	478	478	478
8.00%	717	717	717	717	717	717	717
KR4A11660003			2026-06 삼성전자개별선물				1,518
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,518	-1,518	-1,518	-1,518	-1,518	-1,518	-1,518
-5.33%	-1,012	-1,012	-1,012	-1,012	-1,012	-1,012	-1,012
-2.67%	-506	-506	-506	-506	-506	-506	-506
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	506	506	506	506	506	506	506
5.33%	1,012	1,012	1,012	1,012	1,012	1,012	1,012
8.00%	1,518	1,518	1,518	1,518	1,518	1,518	1,518
KR4BAFBGB548 코스피위클리M C 2606W2 1,380.0							3,256

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,256	3,256	3,256	3,256	3,256	3,256	3,256
-5.33%	2,171	2,171	2,171	2,171	2,171	2,171	2,171
-2.67%	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085	1,085
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085	-1,085
5.33%	-2,171	-2,171	-2,171	-2,171	-2,171	-2,171	-2,171
8.00%	-3,256	-3,256	-3,256	-3,256	-3,256	-3,256	-3,256
KR4BAFBGB555 코스피위클리M C 2606W2 1,382.5							2,180

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,180	2,180	2,180	2,180	2,180	2,180	2,180
-5.33%	1,453	1,453	1,453	1,453	1,453	1,453	1,453
-2.67%	727	727	727	727	727	727	727
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-727	-727	-727	-727	-727	-727	-727
5.33%	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453	-1,453
8.00%	-2,180	-2,180	-2,180	-2,180	-2,180	-2,180	-2,180

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

(단위:백만원)

18,624

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

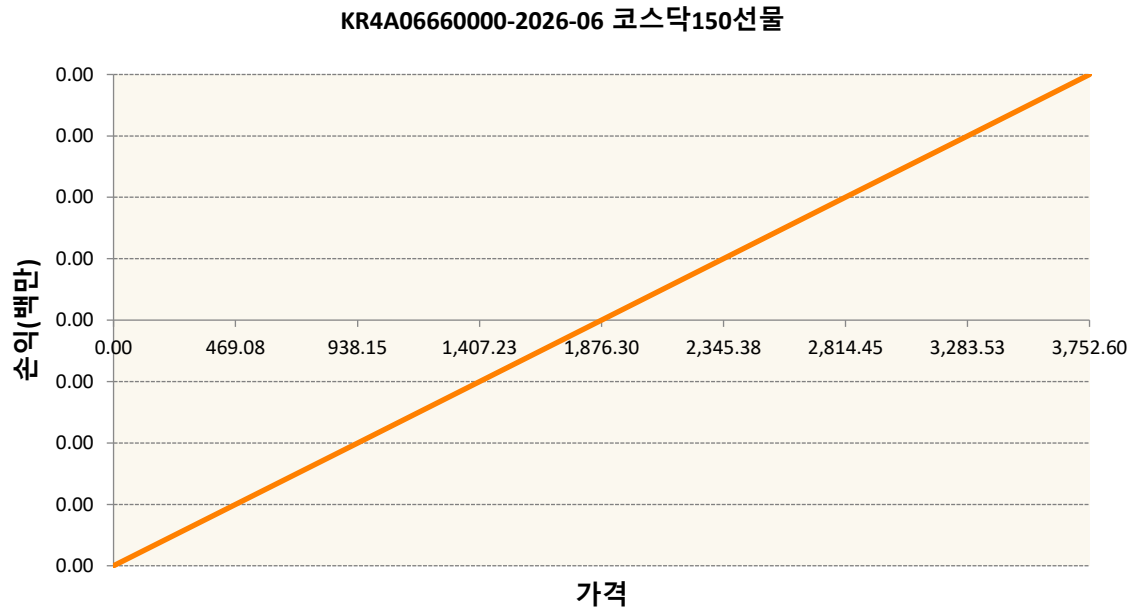
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,107	0	1,107	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

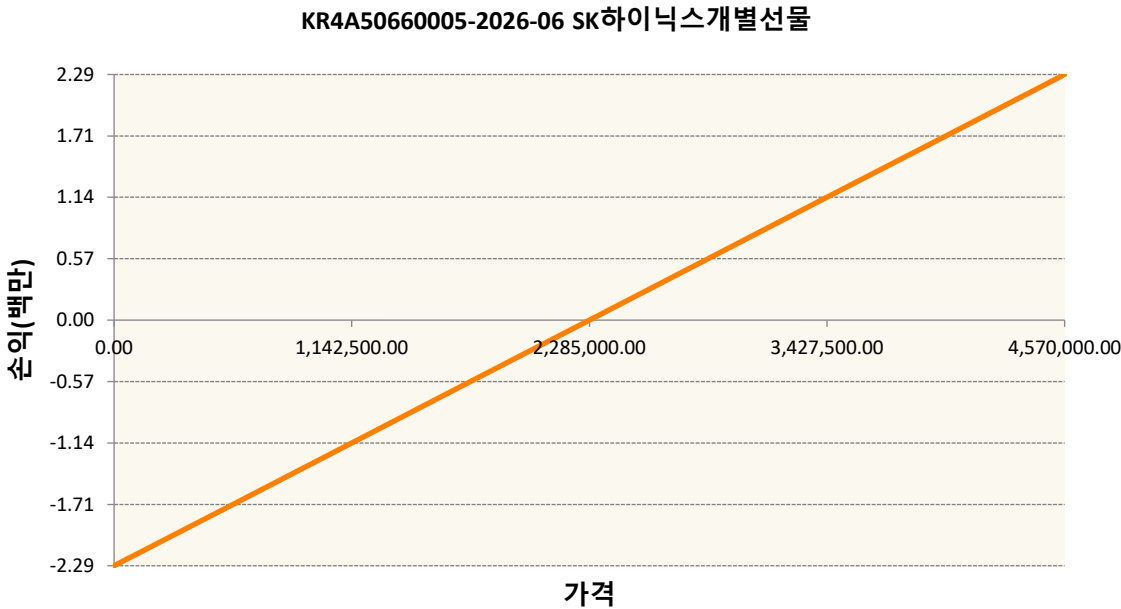
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	72,343	0	72,343	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

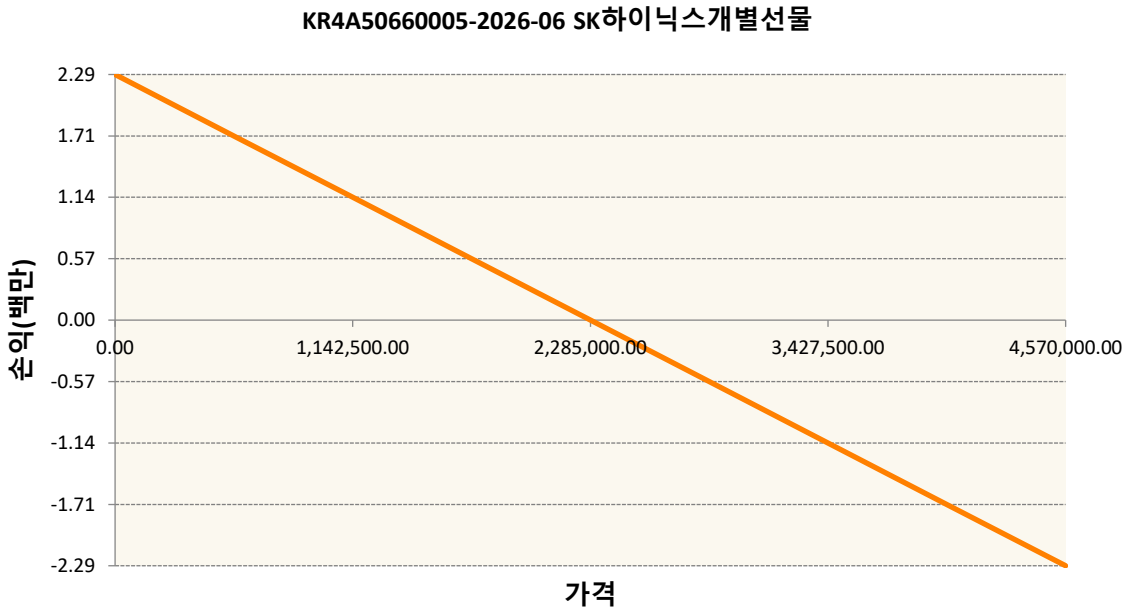
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	스왑	0	127,914	-127,914	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

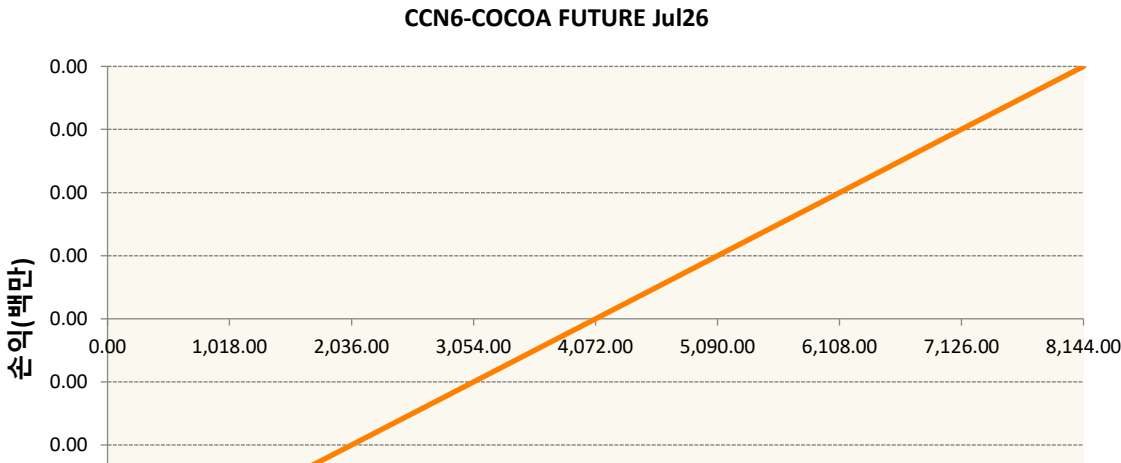
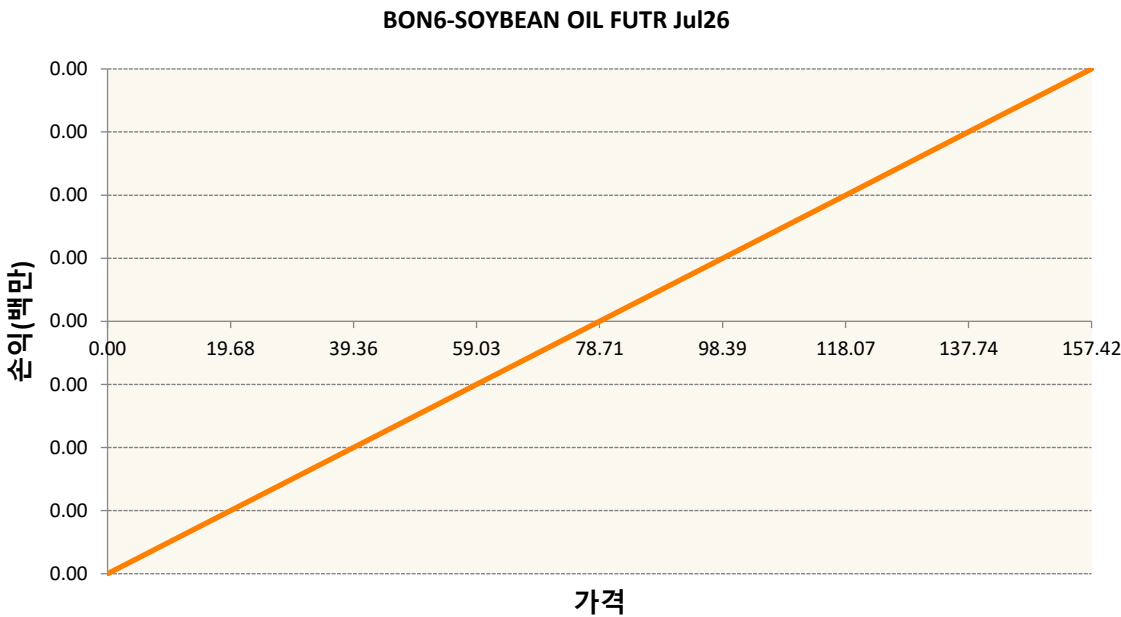
포커스농산물모(채권-파생형)

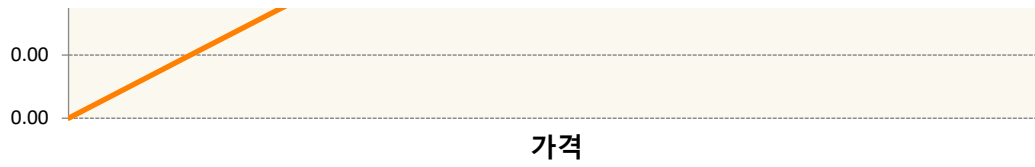
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

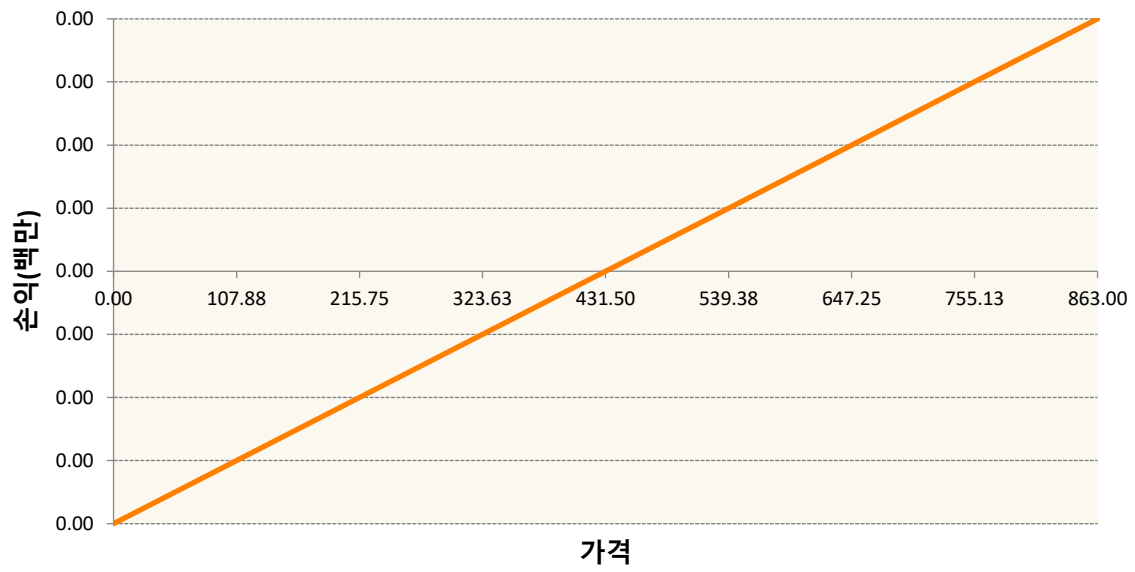
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	46	0	46	장내
누계	실물자산	선물	61	0	61	
누계	실물자산	선물	692	0	692	장내
누계	유가증권	선물	1,839	0	1,839	
누계	통화	선물	0	276	-276	장내

2. 만기시점의 손익구조

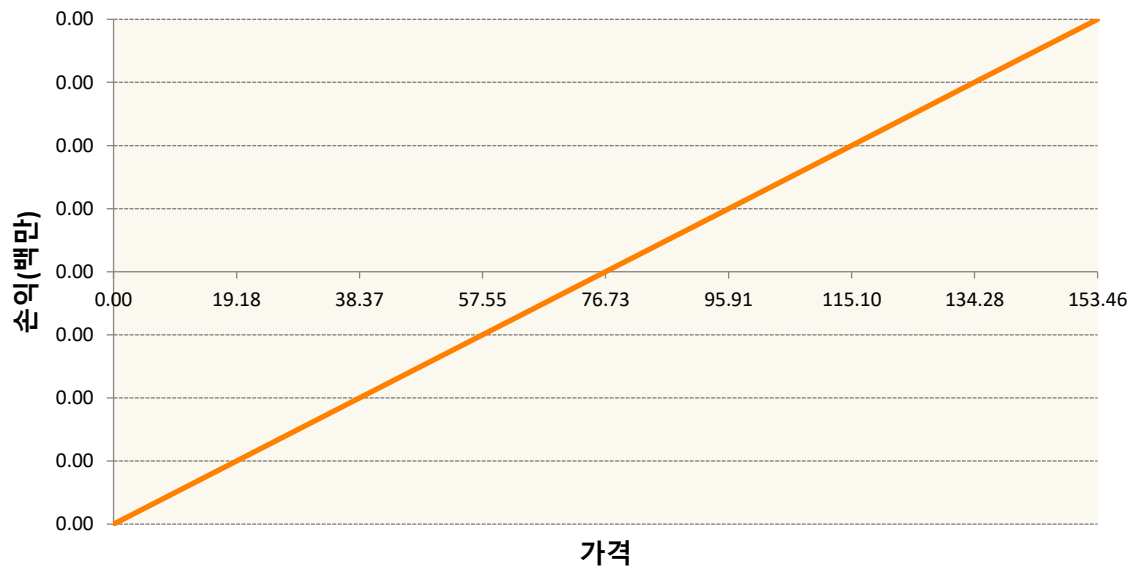




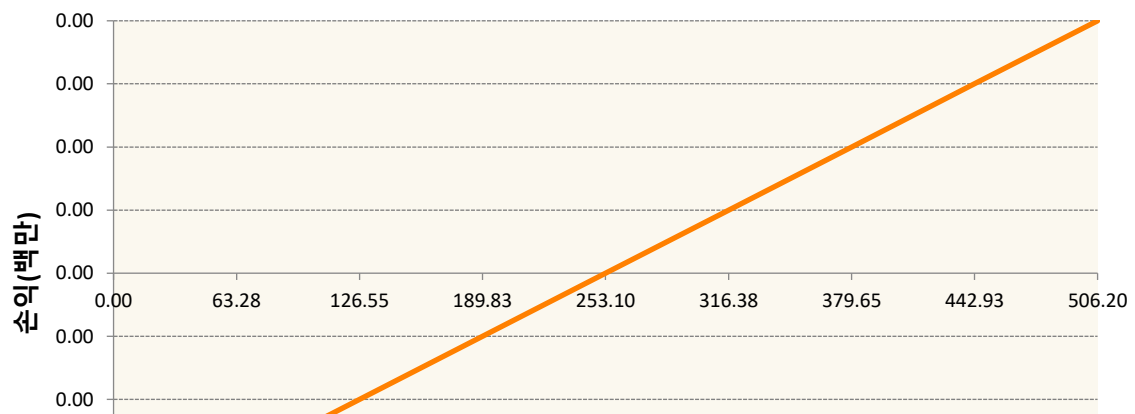
CN6-CORN FUTURE Jul26

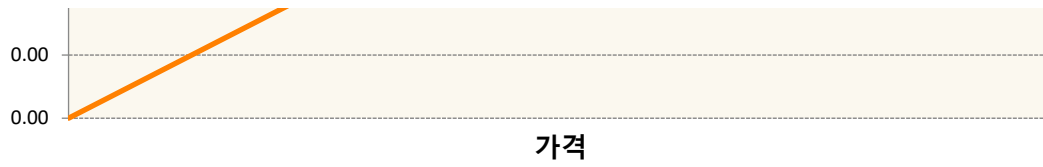


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

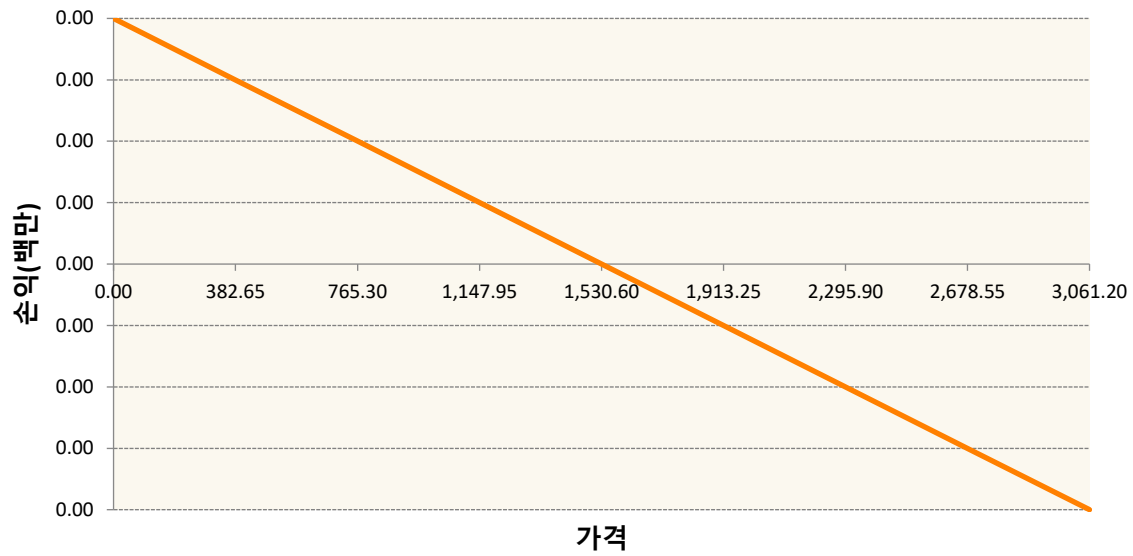


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

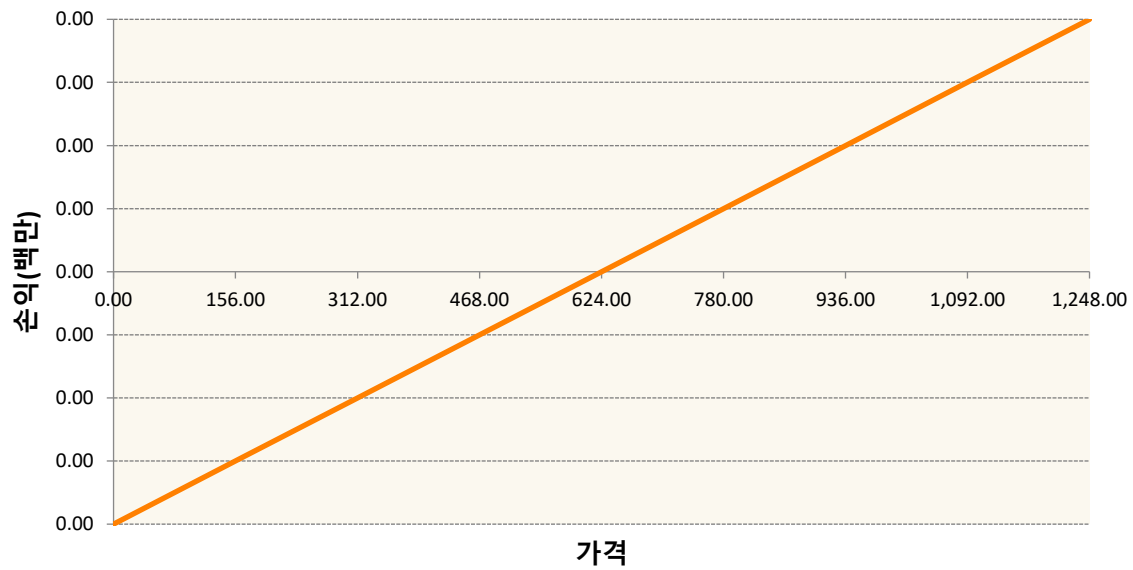




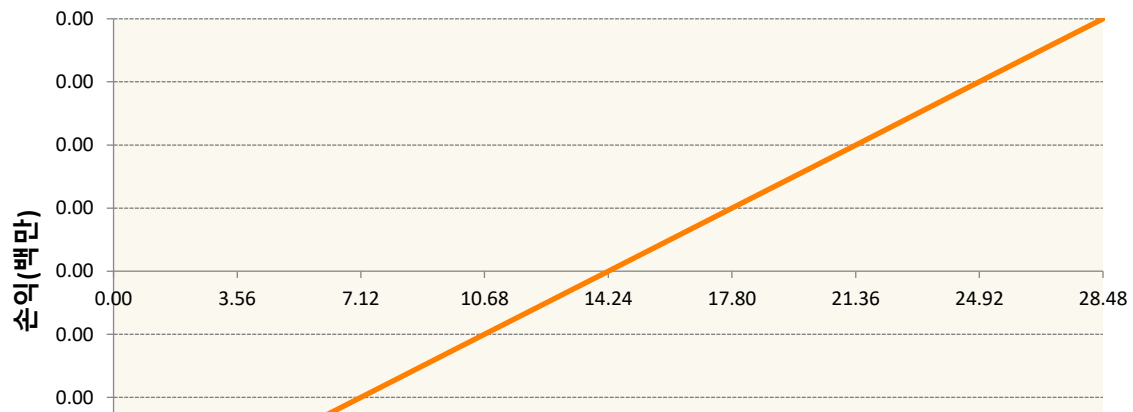
KR4A75660006-2026-06 달러선물

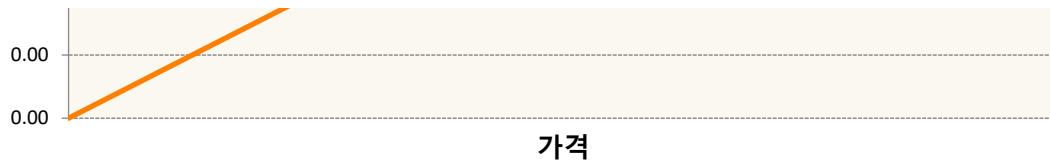


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

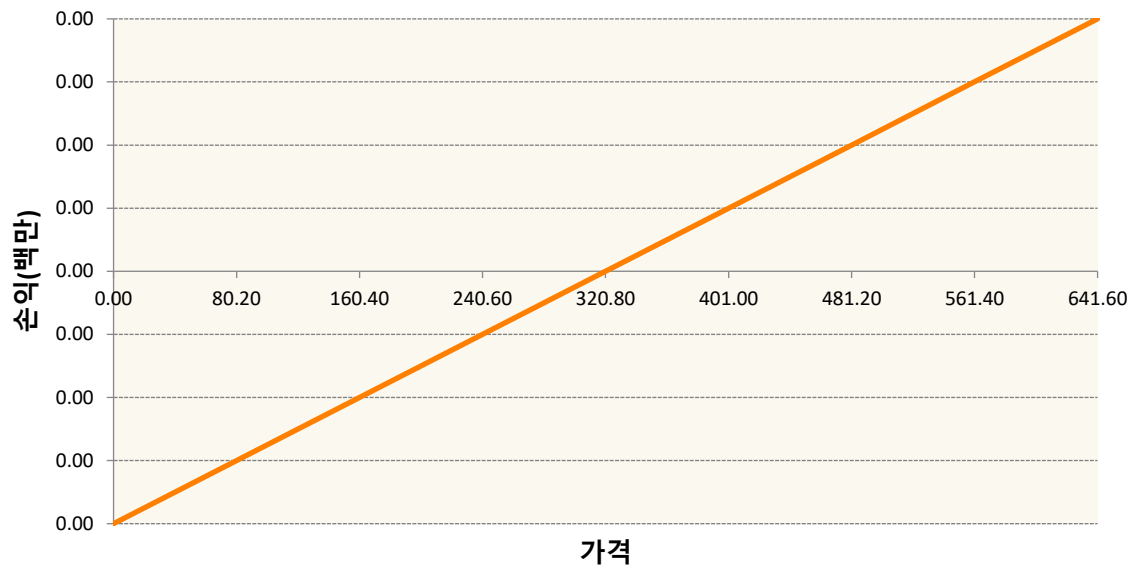


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

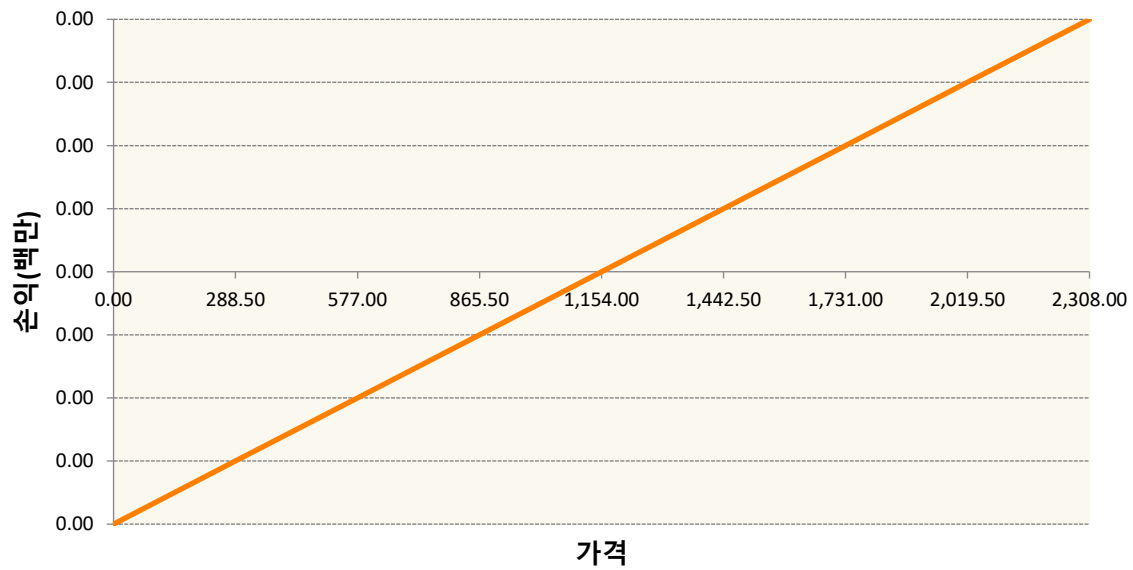




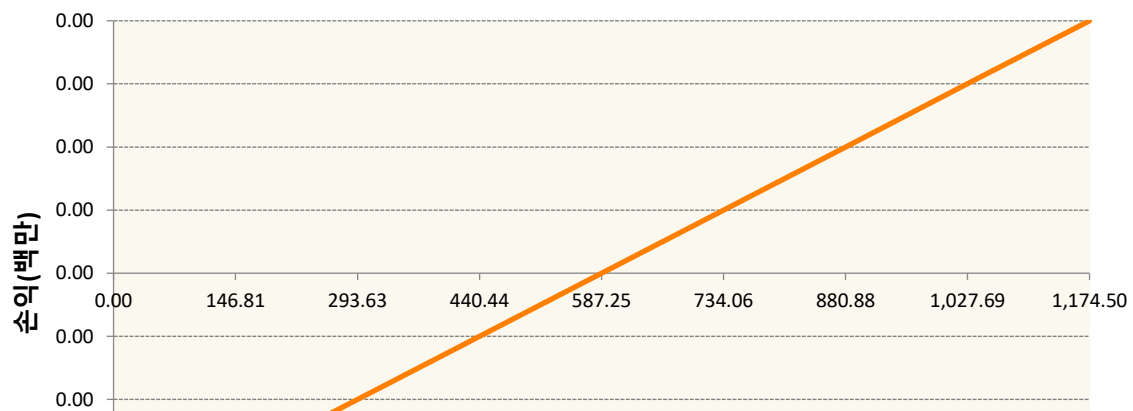
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

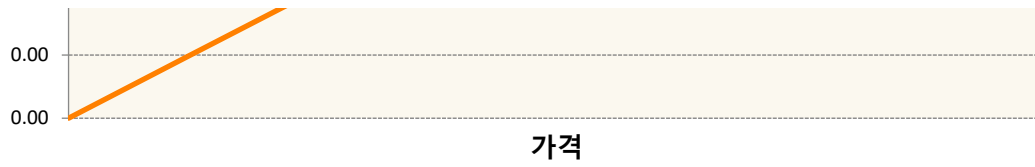


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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	2026-06-05
기준일	2026-06-04

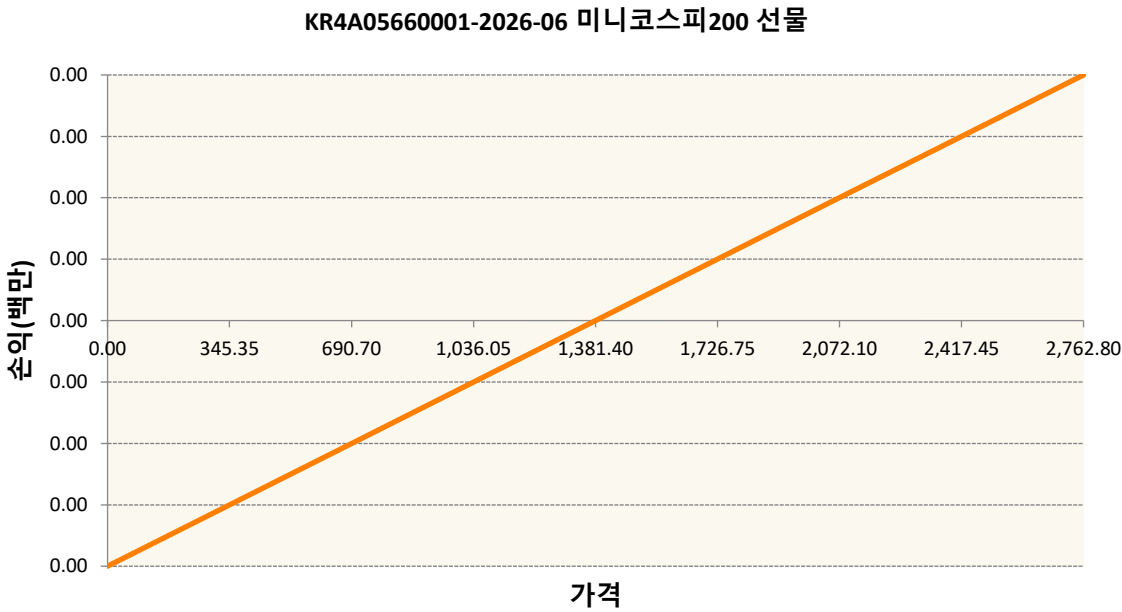
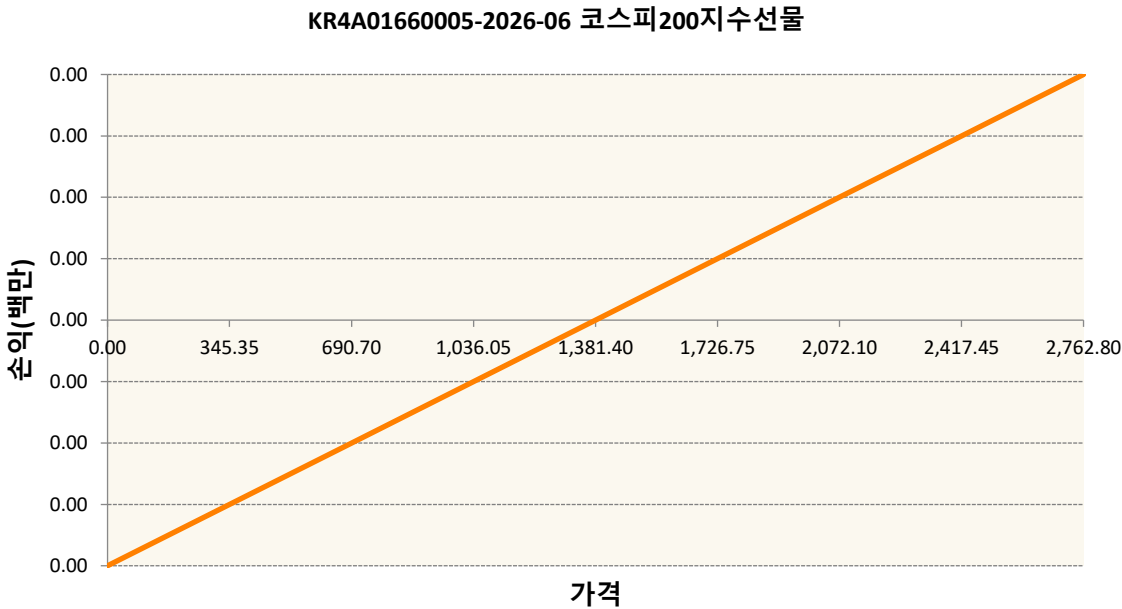
스마트인덱스모

1. 계약금액

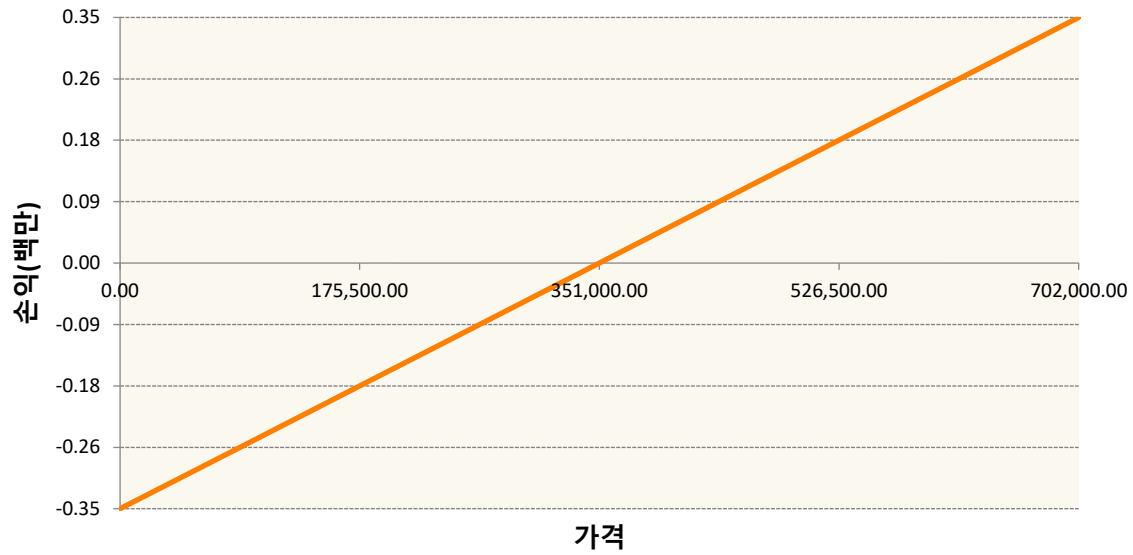
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	143	348	-206	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	4,855	0	4,855	장내
누계	유가증권	스왑	0	343	-343	장외

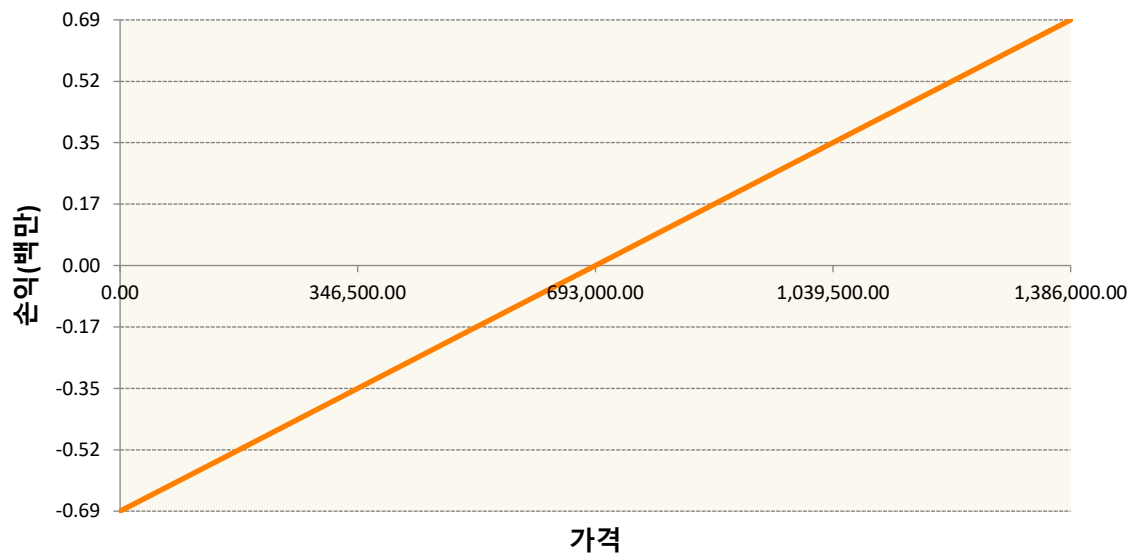
2. 만기시점의 손익구조



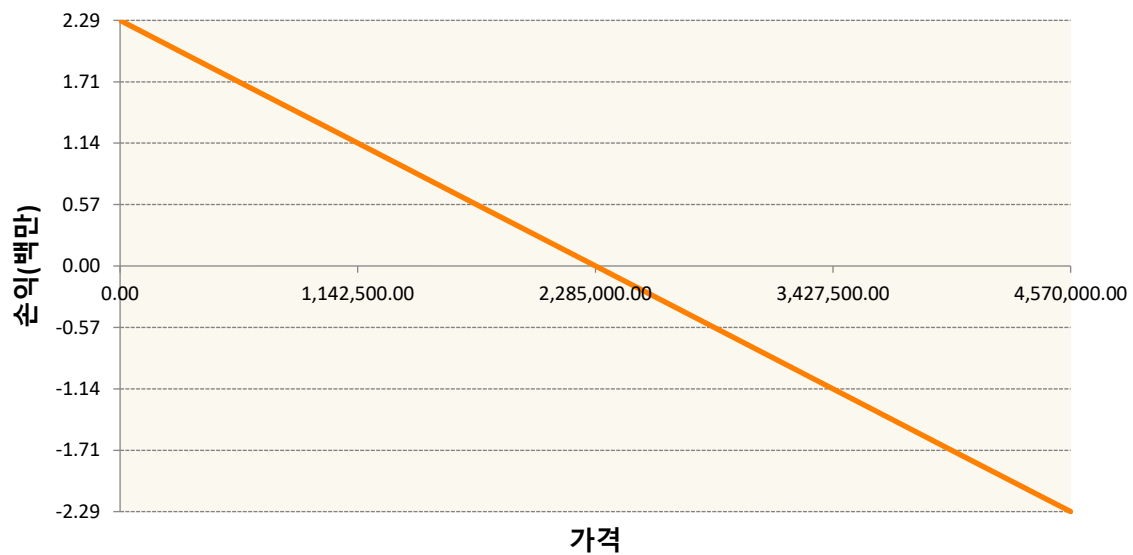
KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



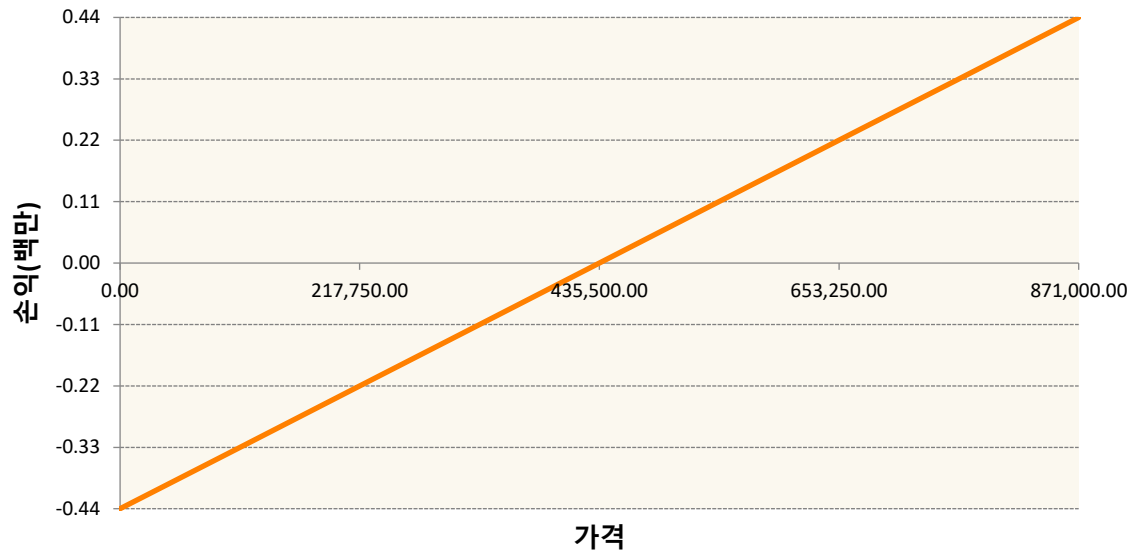
KR4A16660008-2026-06 현대차개별선물



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



KR4ABD660008-2026-06 삼성생명개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물 221

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-221	-221	-221	-221	-221	-221	-221
-5.33%	-147	-147	-147	-147	-147	-147	-147
-2.67%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	74	74	74	74	74	74	74
5.33%	147	147	147	147	147	147	147
8.00%	221	221	221	221	221	221	221

KR4A05660001 2026-06 미니코스피200 선물 11

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

KR4A11660003 2026-06 삼성전자개별선물 11

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
KR4A16660008 2026-06 현대차개별선물							90
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90
-5.33%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
-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%	60	60	60	60	60	60	60
8.00%	90	90	90	90	90	90	90
KR4ABD660008 2026-06 삼성생명개별선물							12
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

(단위:백만원)

773

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

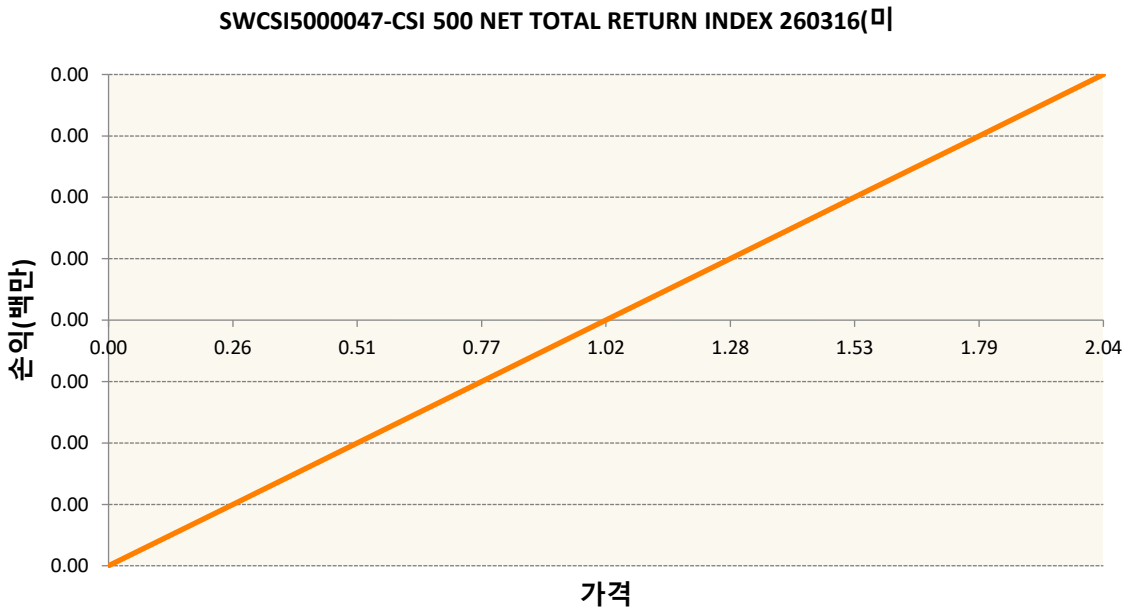
SOL차이나강소기업CSI500상장

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 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

589

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

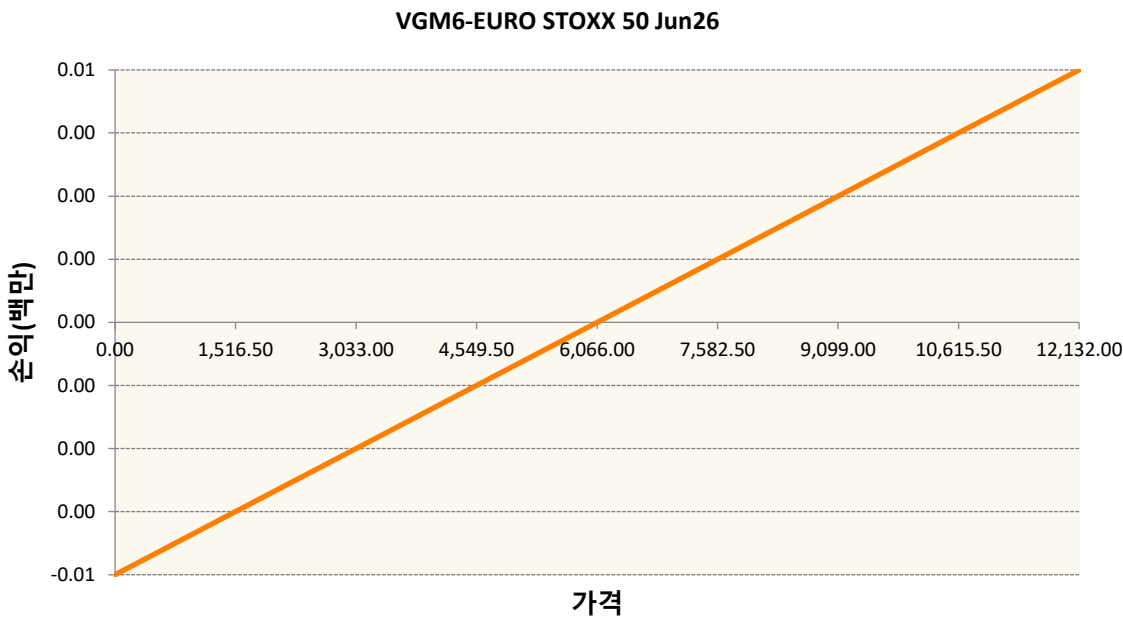
유로인덱스모(주식-파생형)

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)

66

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

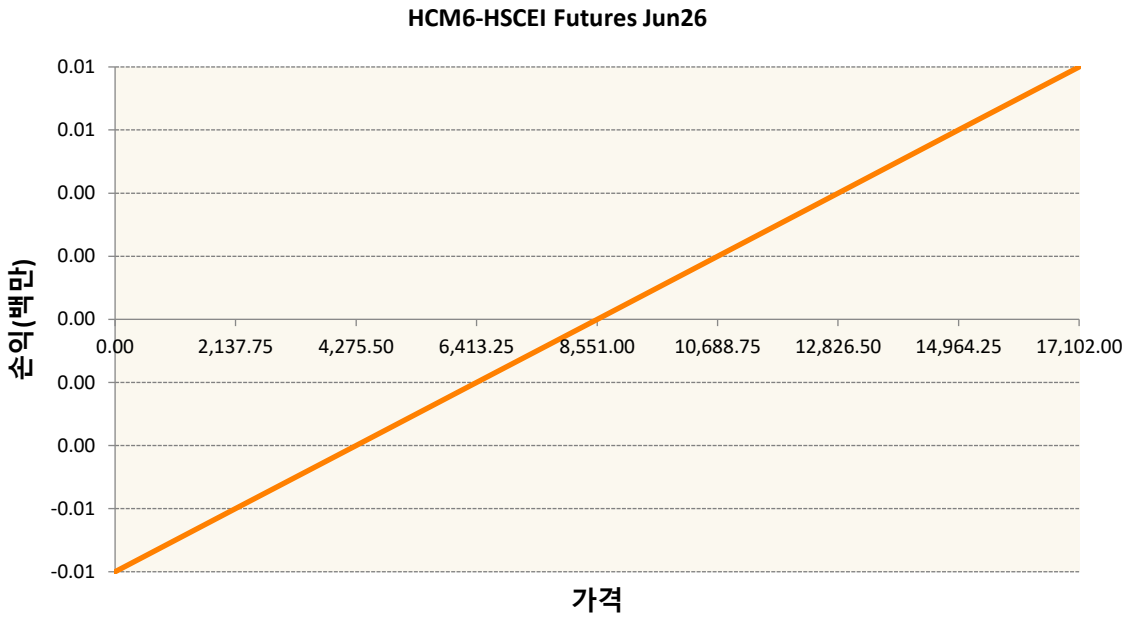
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,395	0	1,395	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	HSCEI Futures Jun26	112
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

135

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

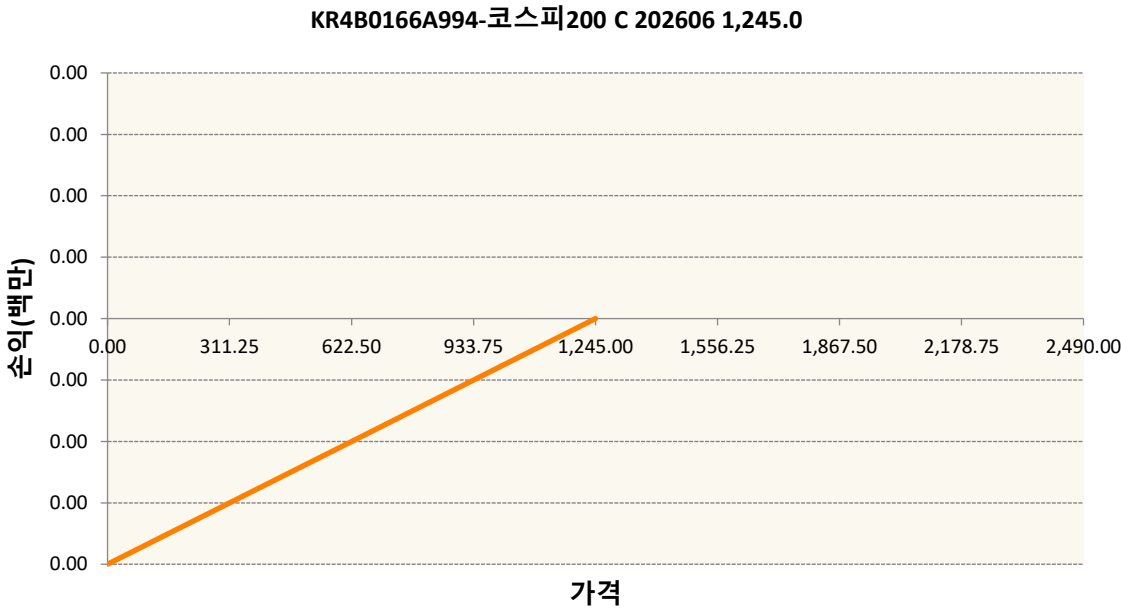
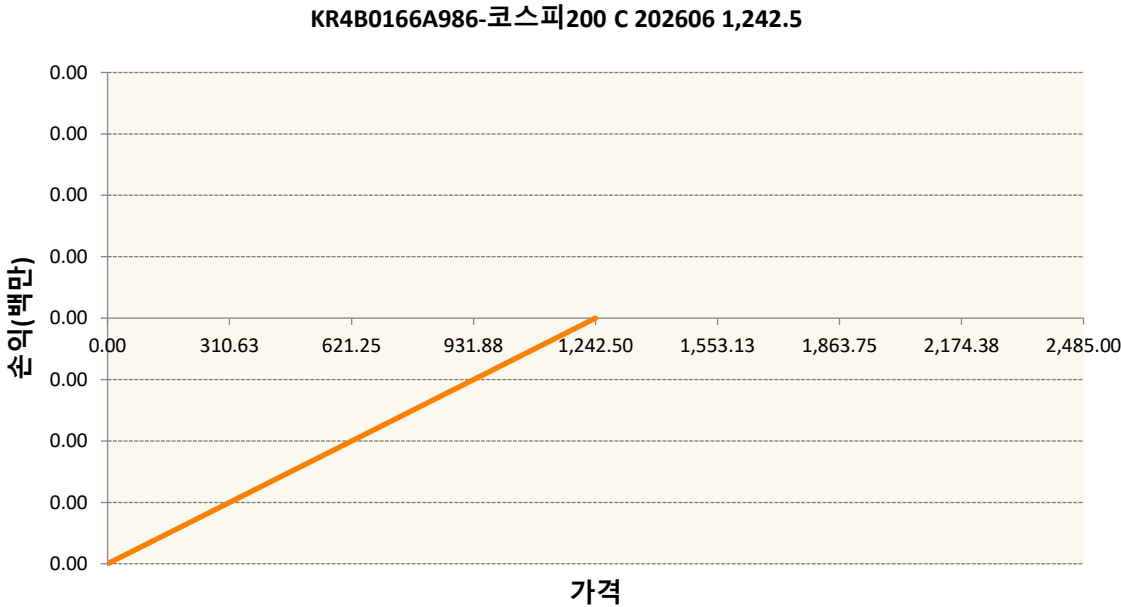
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

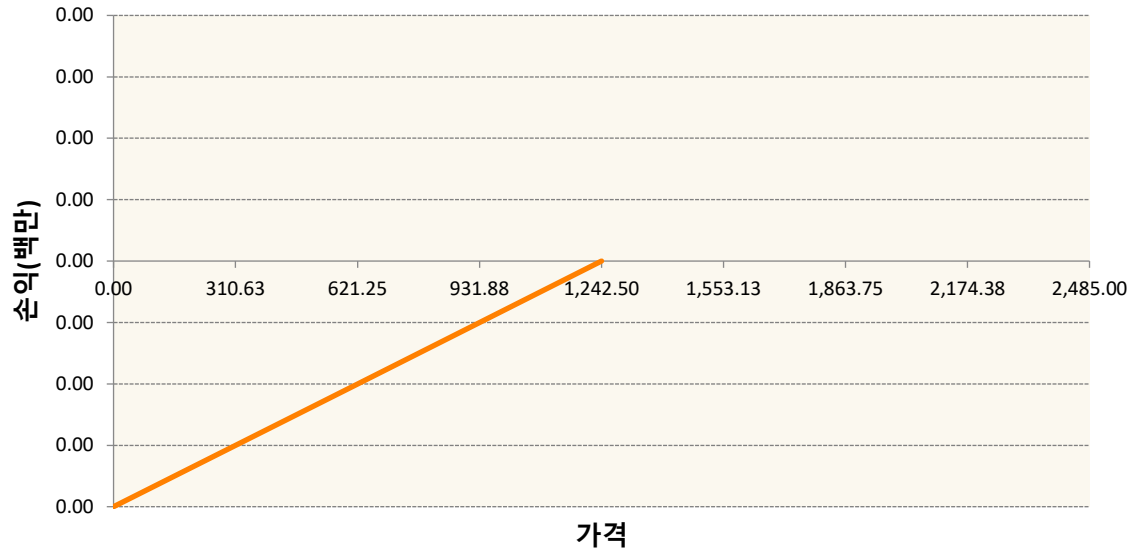
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,441	-35,441	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0166A984-코스피200 P 202606 1,242.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B0166A986 코스피200 C 202606 1,242.5							
							426
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-163	-206	-250	-294	-338	-382	-426
-5.33%	-46	-83	-123	-163	-204	-245	-288
-2.67%	29	-1	-33	-67	-103	-140	-178
0%	73	51	27	0	-29	-61	-94
2.67%	96	82	65	45	22	-3	-31
5.33%	108	100	89	74	57	37	15
8.00%	113	109	102	93	80	66	48
KR4B0166A994 코스피200 C 202606 1,245.0							
							507
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-249	-300	-352	-403	-455	-507
-5.33%	-56	-102	-148	-196	-244	-293	-343
-2.67%	34	-2	-40	-81	-123	-167	-213
0%	87	62	32	0	-35	-73	-112
2.67%	116	100	79	55	27	-3	-37
5.33%	131	121	107	90	69	46	19
8.00%	138	132	124	112	97	80	59
KR4C0166A984 코스피200 P 202606 1,242.5							
							260
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-99	-126	-152	-179	-206	-233	-260
-5.33%	-28	-51	-75	-99	-124	-150	-175
-2.67%	18	0	-20	-41	-63	-85	-109
0%	44	31	17	0	-18	-37	-57

2.67%	59	50	40	28	14	-2	-19
5.33%	66	61	54	45	35	23	9
8.00%	69	66	62	56	49	40	29

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

(단위:백만원)

1,234

공시일 2026-06-05

기준일 2026-06-04

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	2026-06-05
기준일	2026-06-04

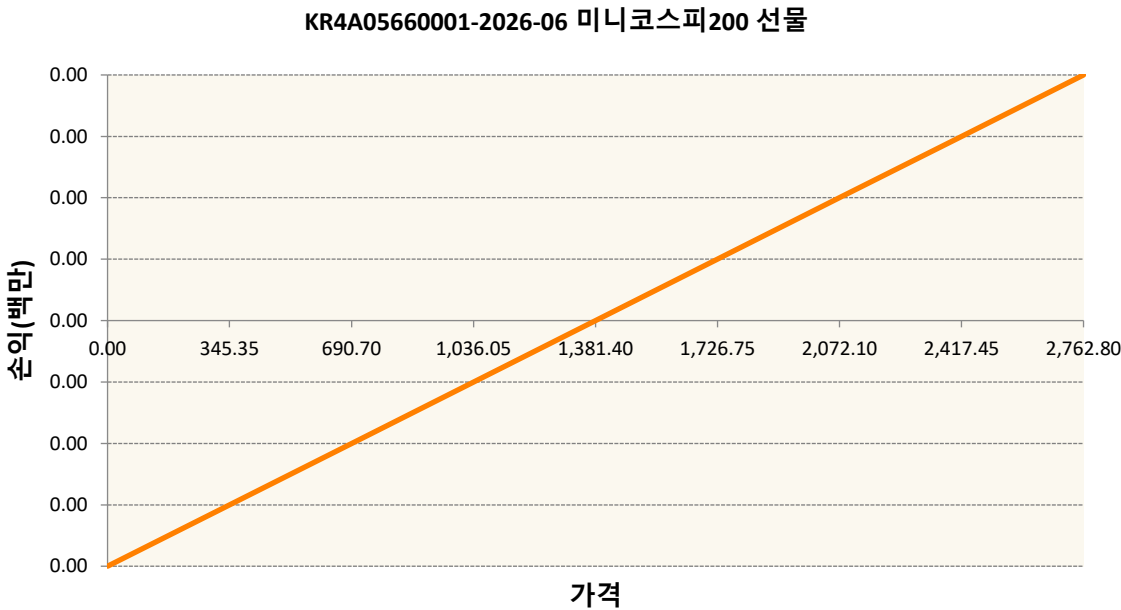
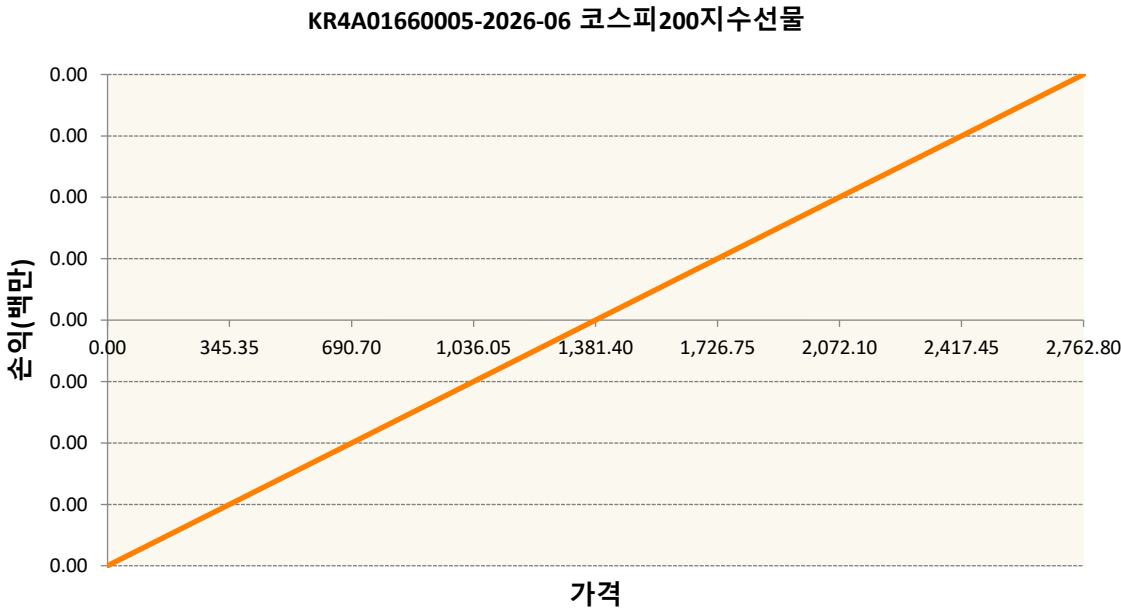
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

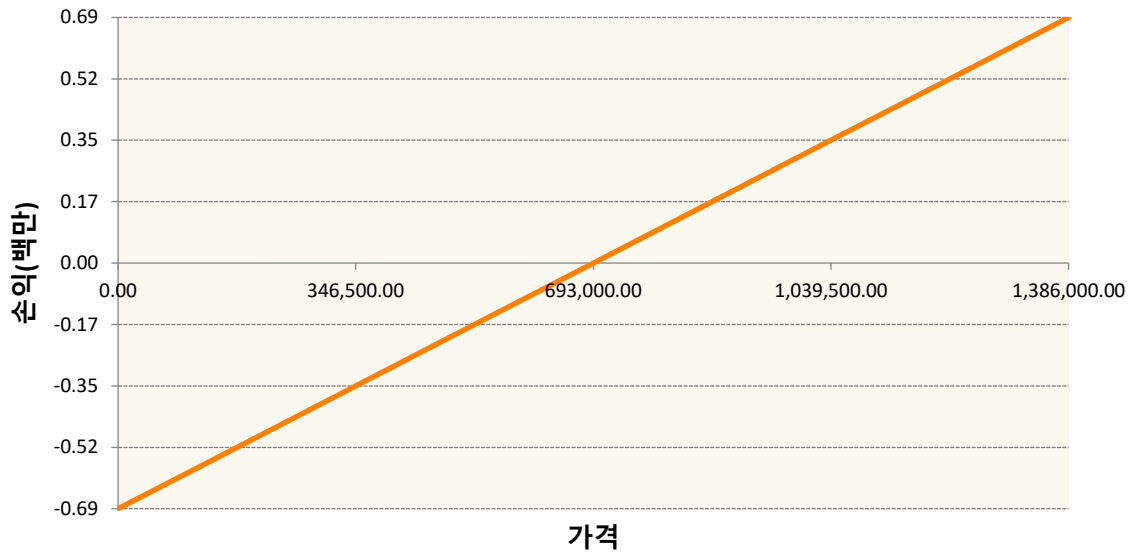
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	347	348	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	2,448	0	2,448	장내
누계	유가증권	스왑	0	91	-91	장외

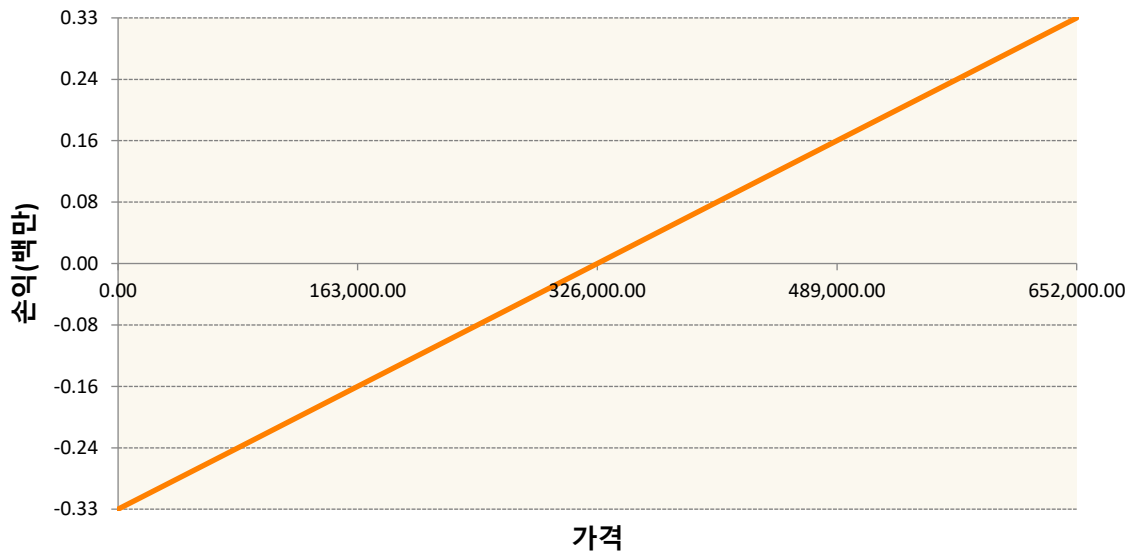
2. 만기시점의 손익구조



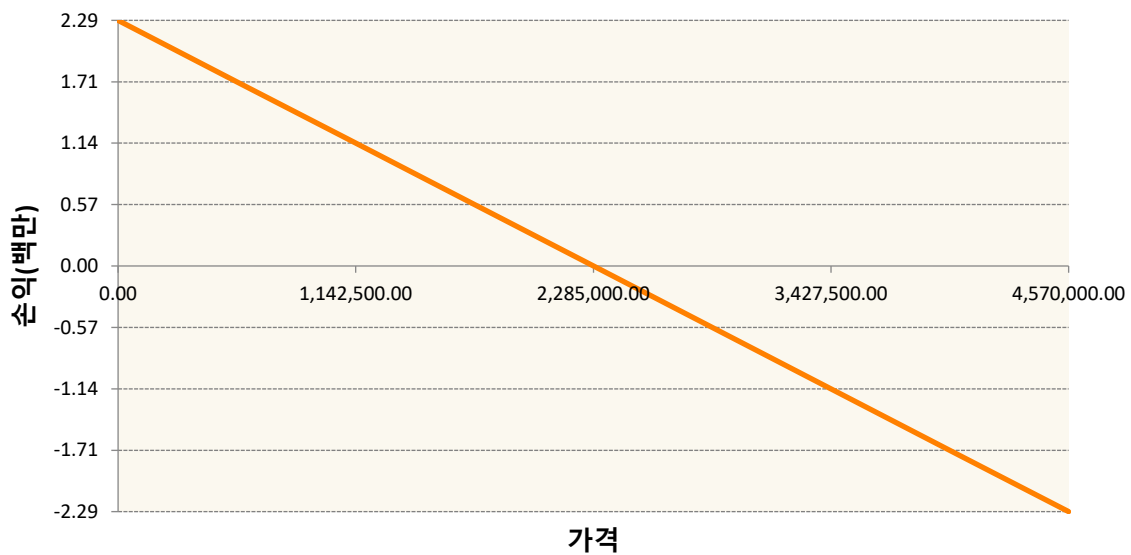
KR4A16660008-2026-06 현대차개별선물



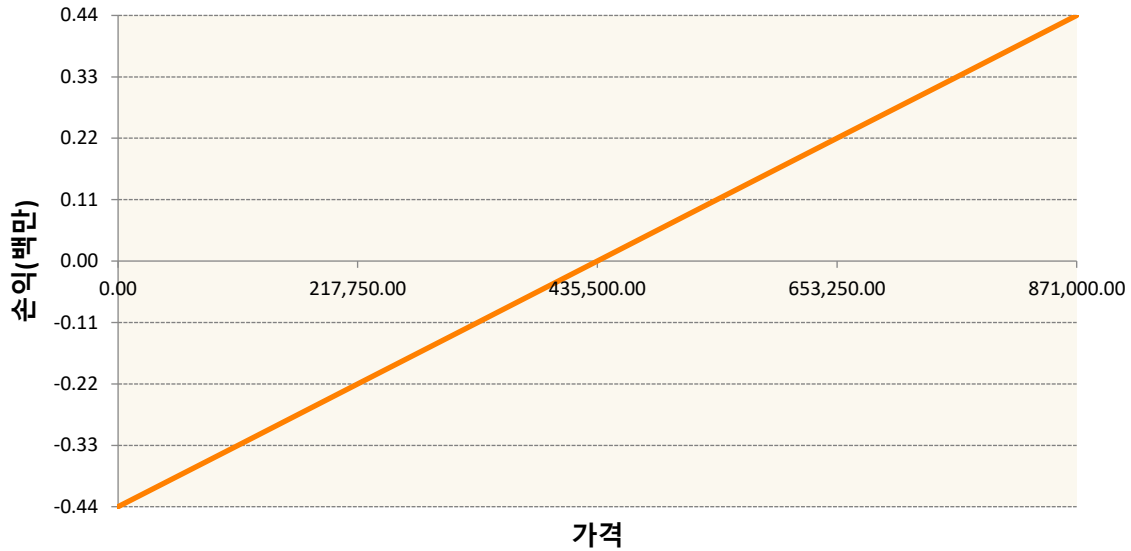
KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



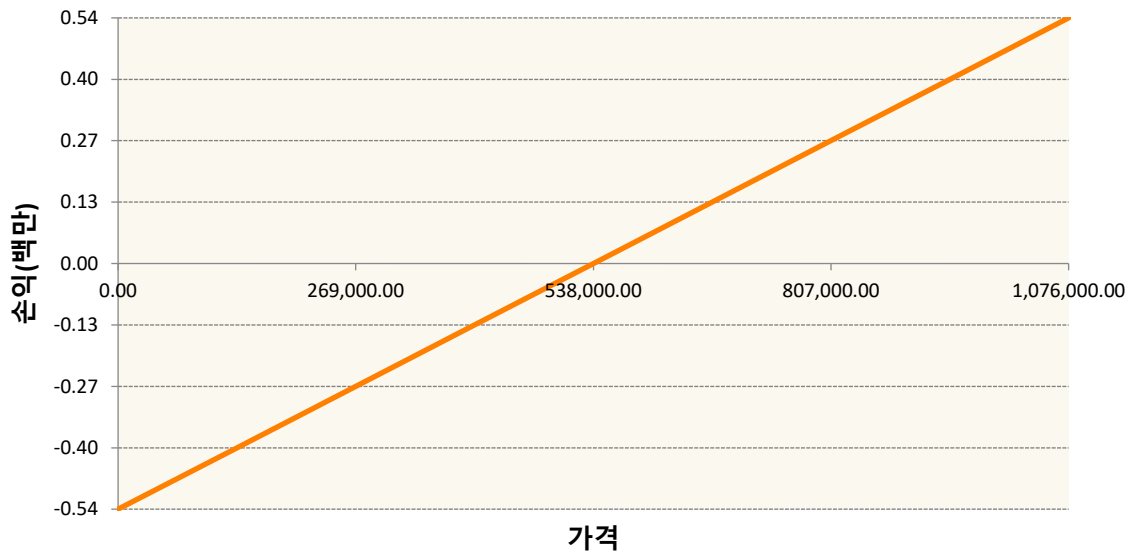
KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



KR4ABD660008-2026-06 삼성생명개별선물



KR4AC8660004-2026-06 삼성물산개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물			110
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
-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%	110	110	110	110	110	110	110
KR4A05660001				2026-06 미니코스피200 선물			11
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

KR4A16660008 2026-06 현대차개별선물 5

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-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%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

KR4A24660008 2026-06 LG전자개별선물 1

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

KR4ABD660008 2026-06 삼성생명개별선물 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%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-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%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	16	16	16	16	16	16	16

KR4AC8660004 2026-06 삼성물산개별선물 9

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

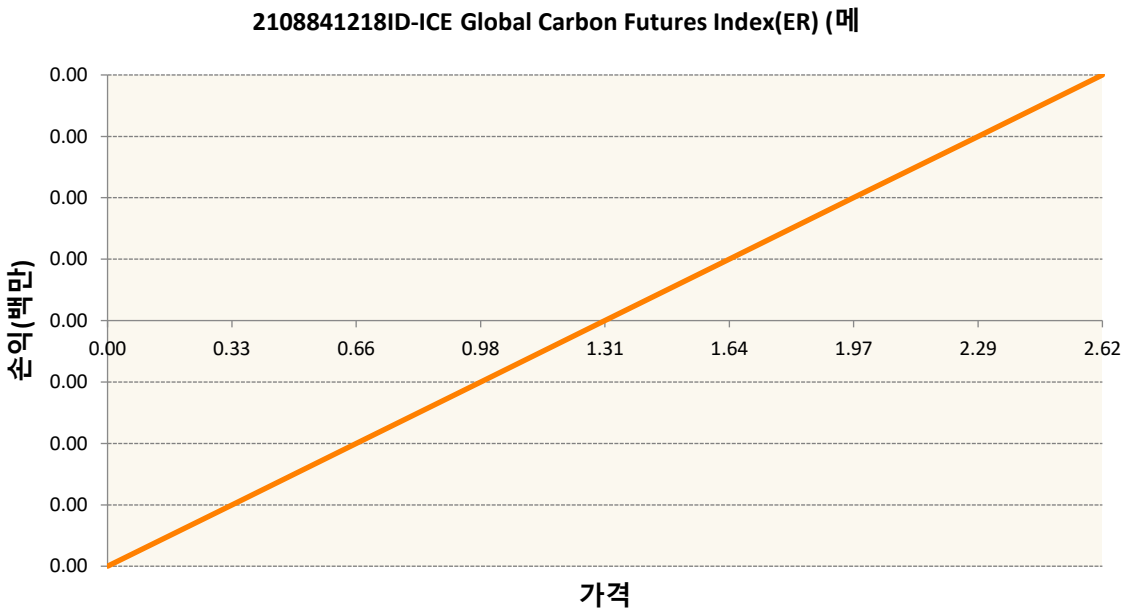
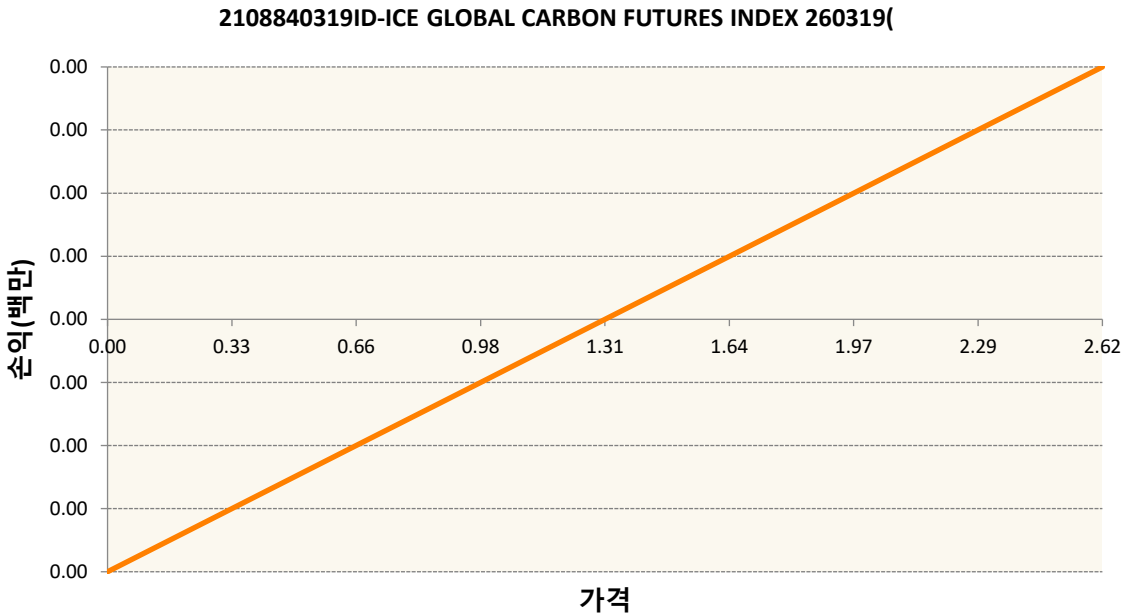
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,528	0	7,528	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		480
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		121

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	691

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

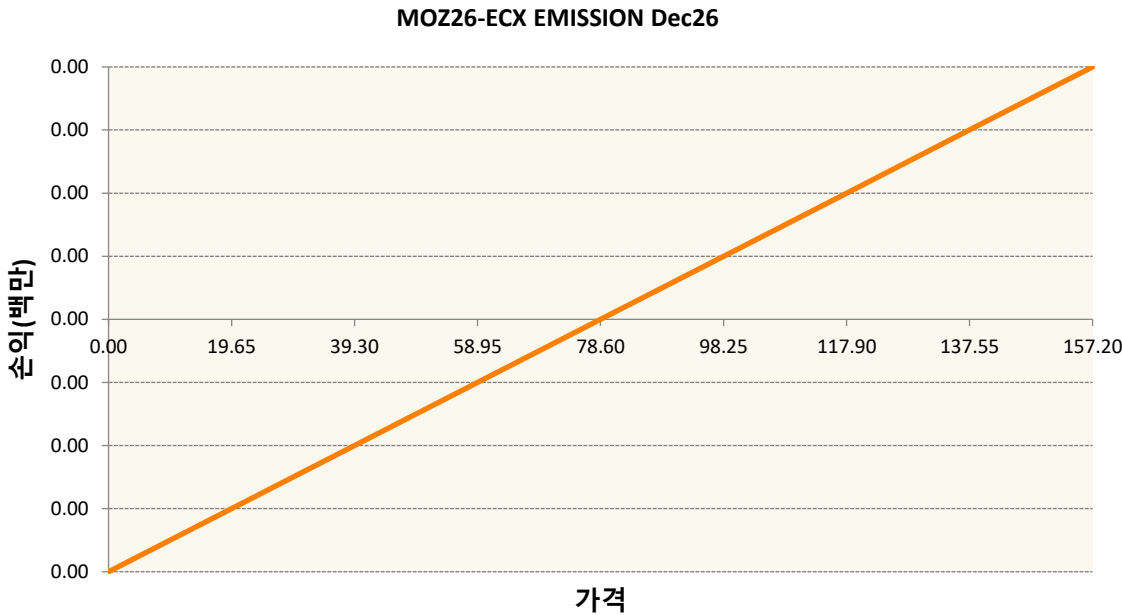
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,067	0	5,067	
누계	통화	선도	0	2,671	-2,671	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	214
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	405

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

(단위:백만원)

694

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

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	1,879	0	1,879	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)		3
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)		2
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)		5
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(		2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	19

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

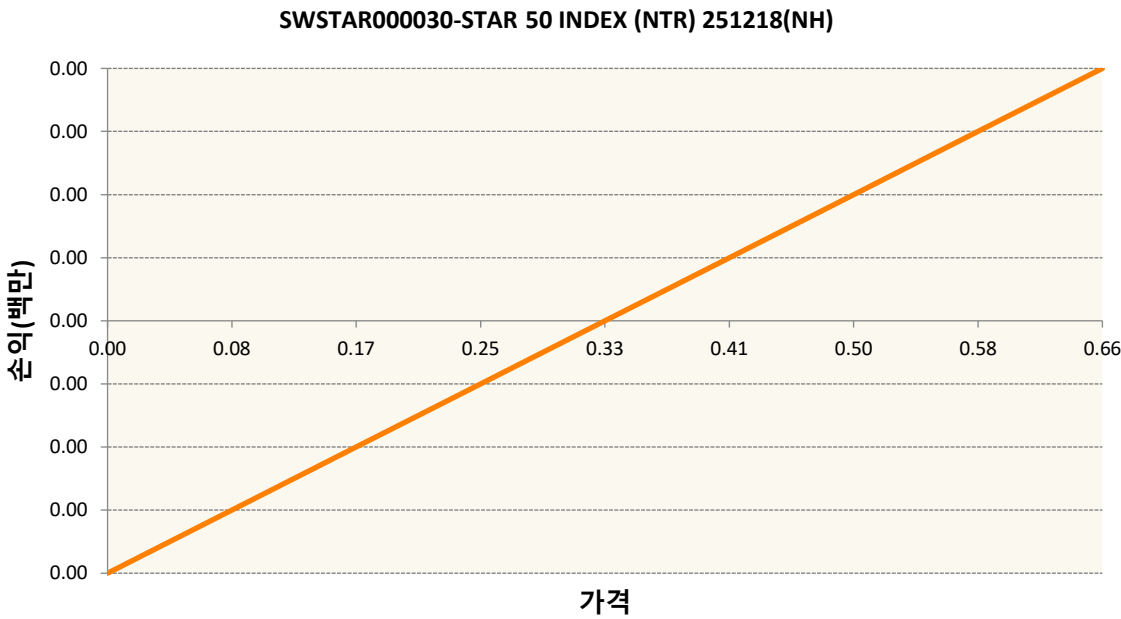
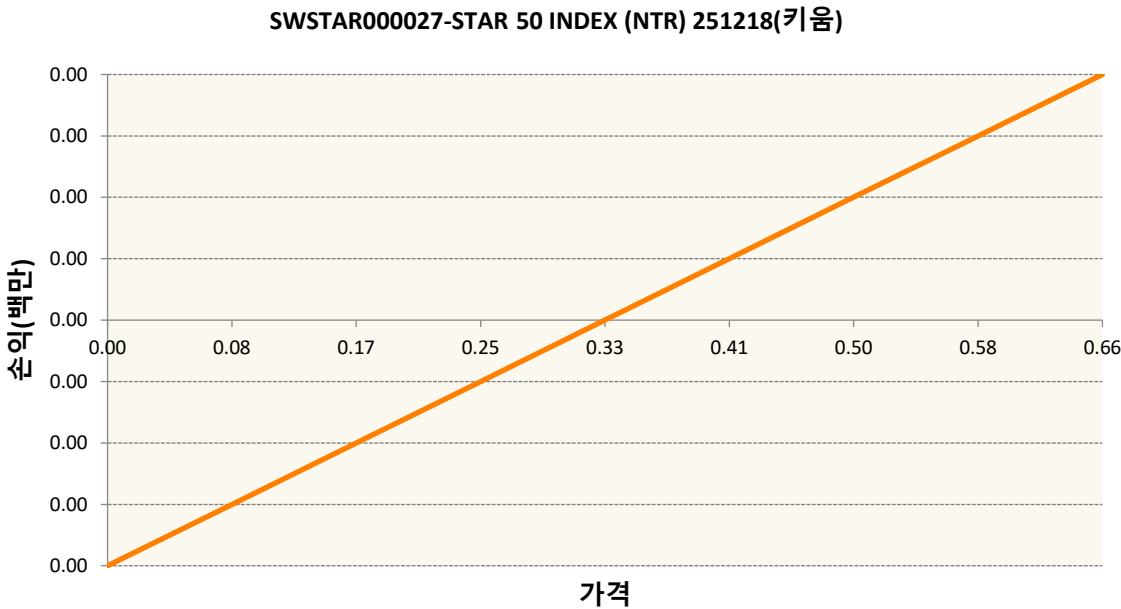
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

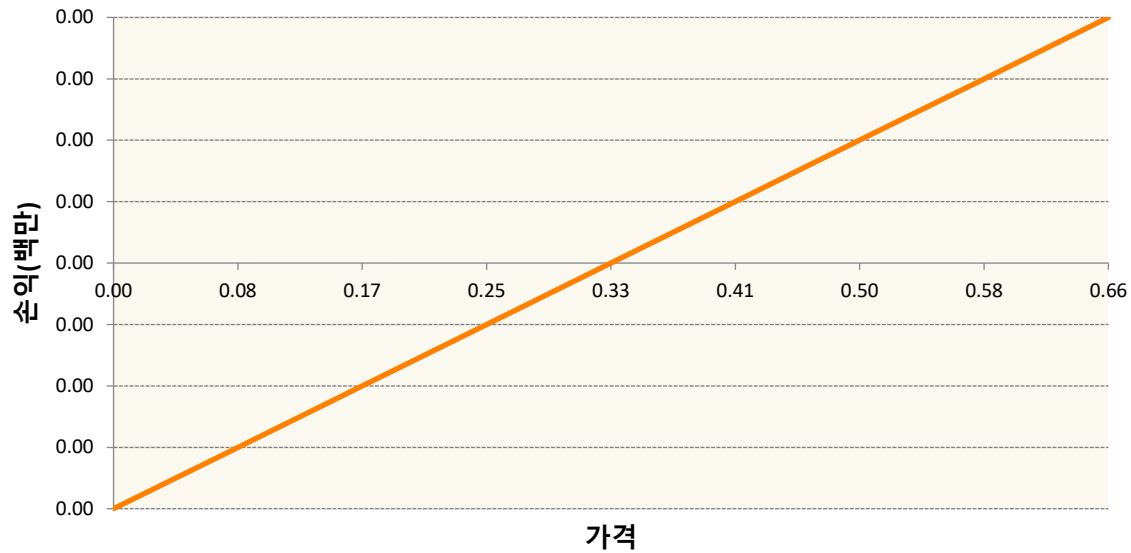
(단위:백만원)

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

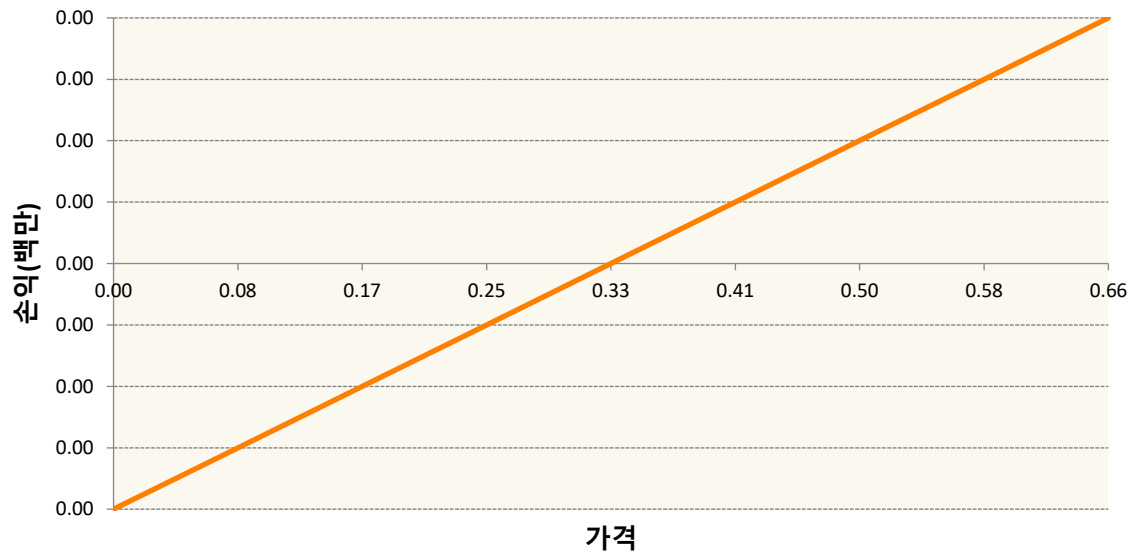
2. 만기시점의 손익구조



SWSTAR000031-STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)



SWSTAR000032-STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)	24
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	80
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	408
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	152

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

(단위:백만원)

1,040

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

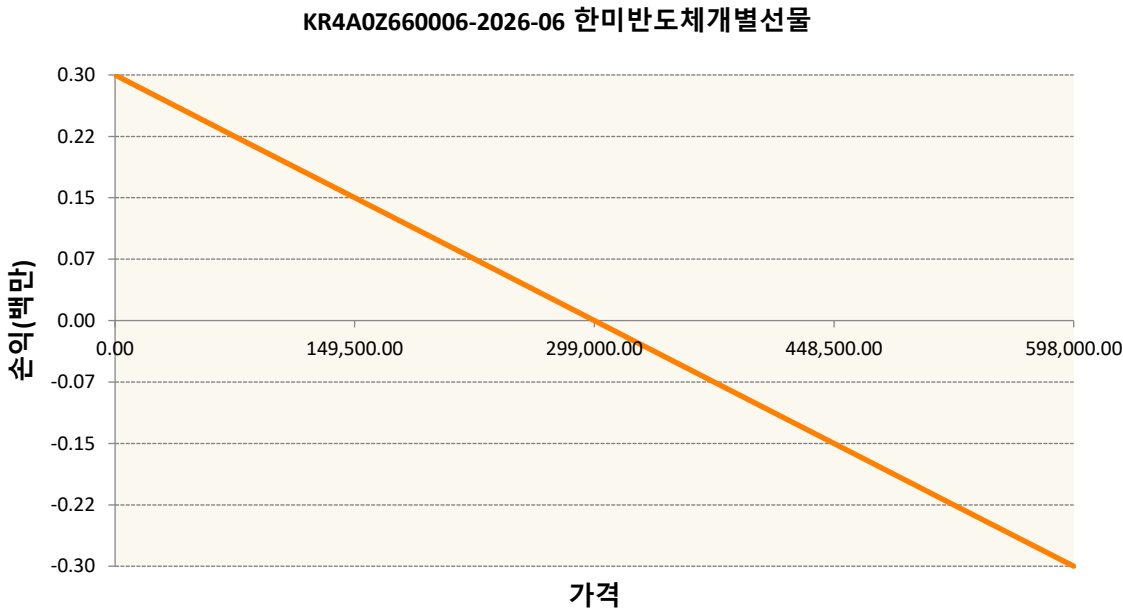
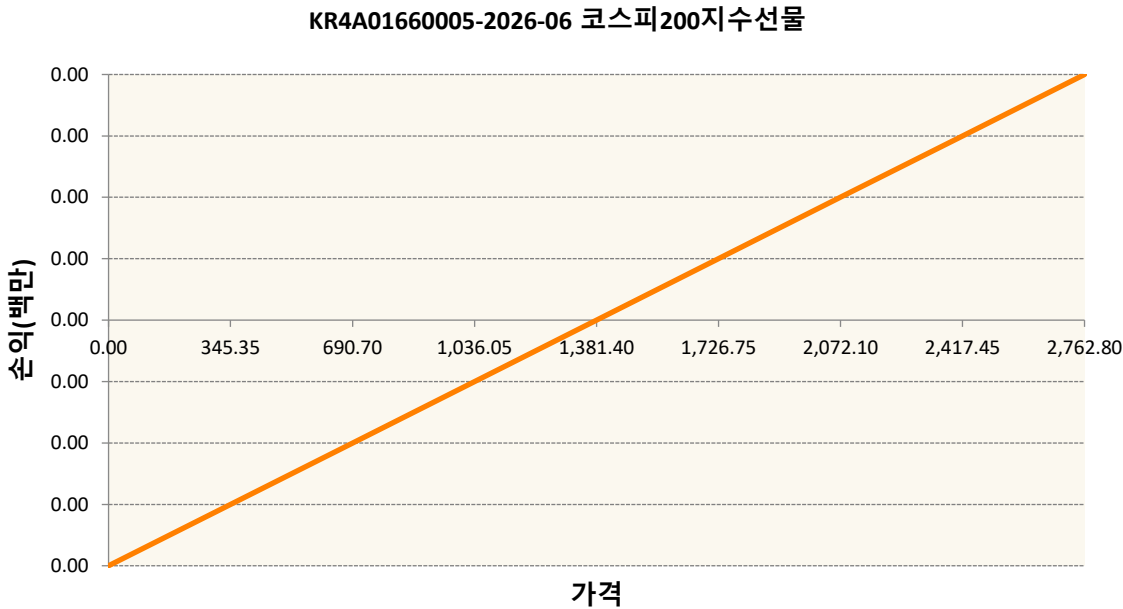
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

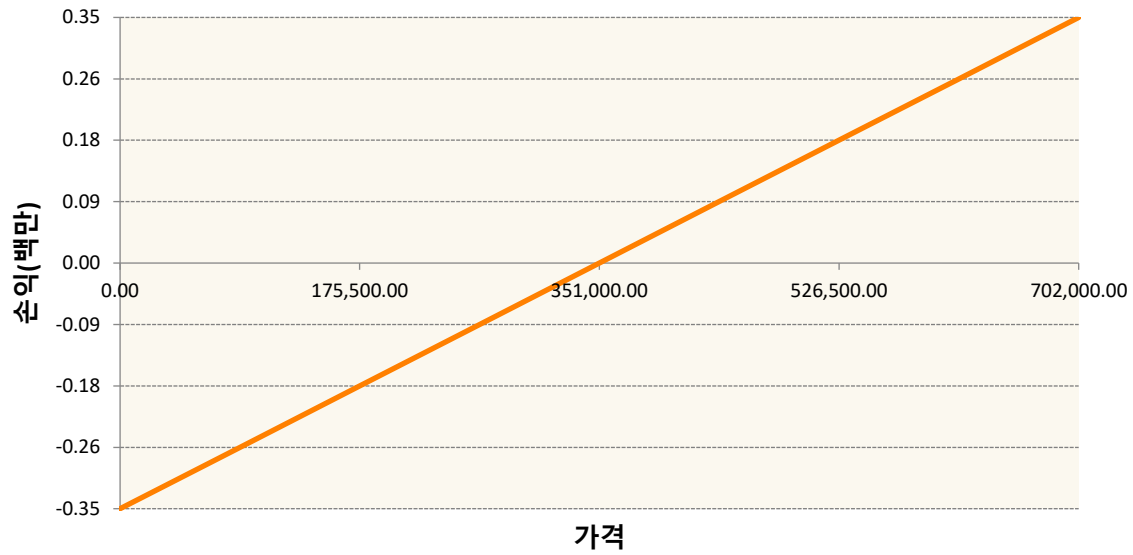
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,756	3,462	-706	장내
누계	유가증권	선물	24,168	3,360	20,808	장내

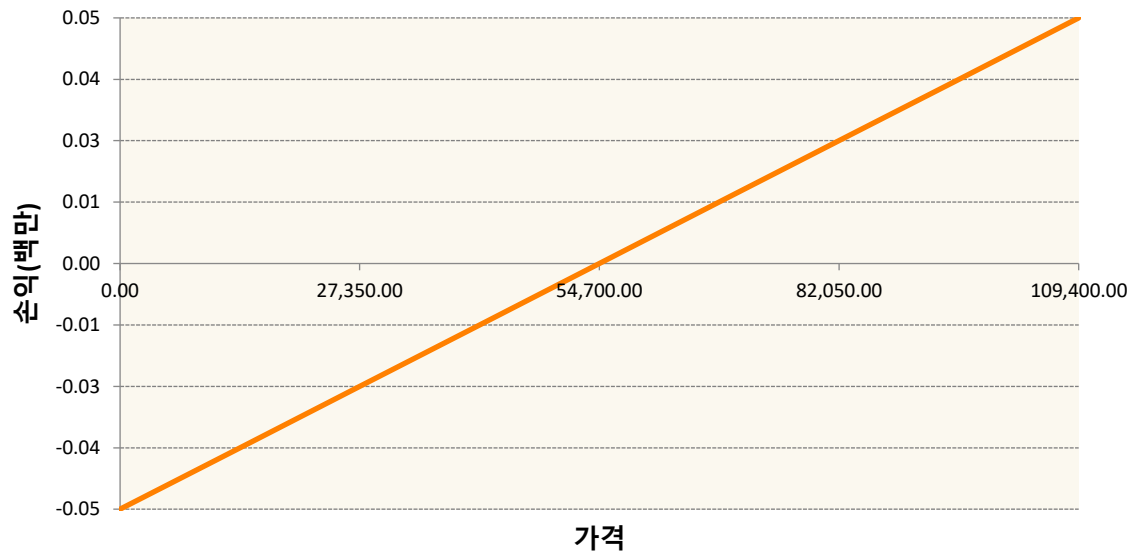
2. 만기시점의 손익구조



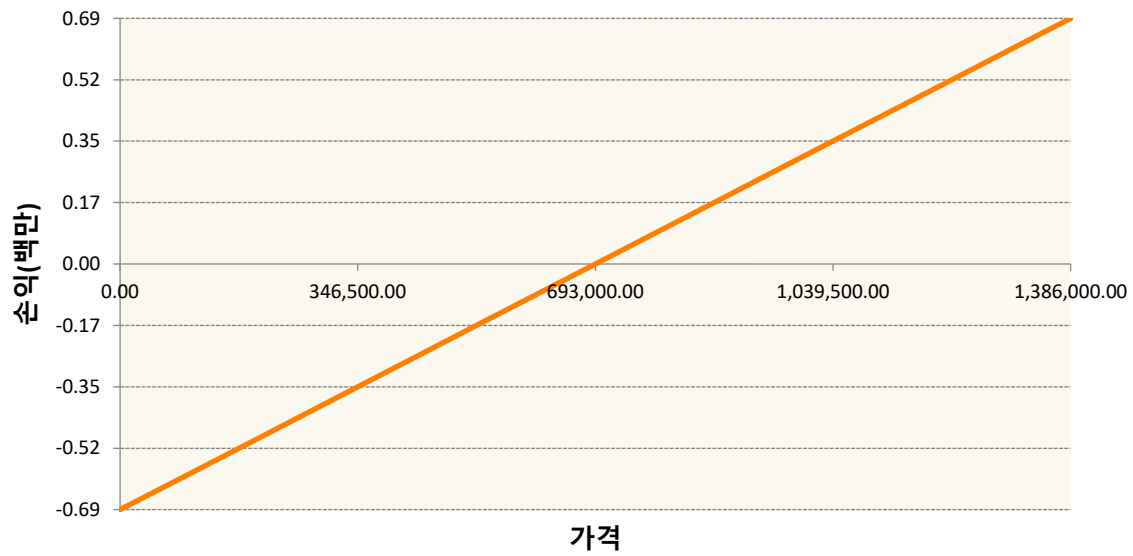
KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



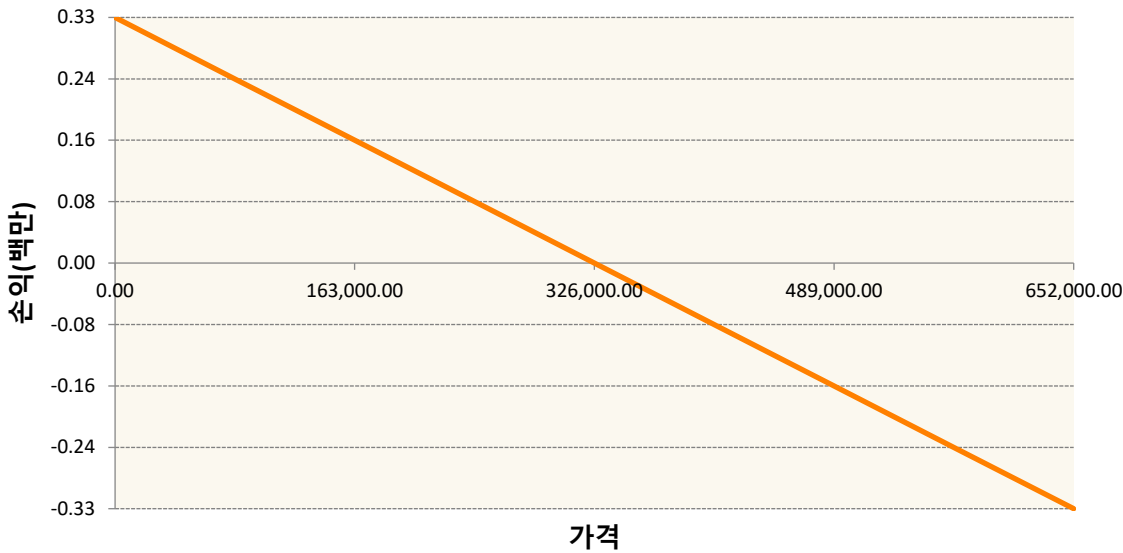
KR4A14660000-2026-06 KT개별선물



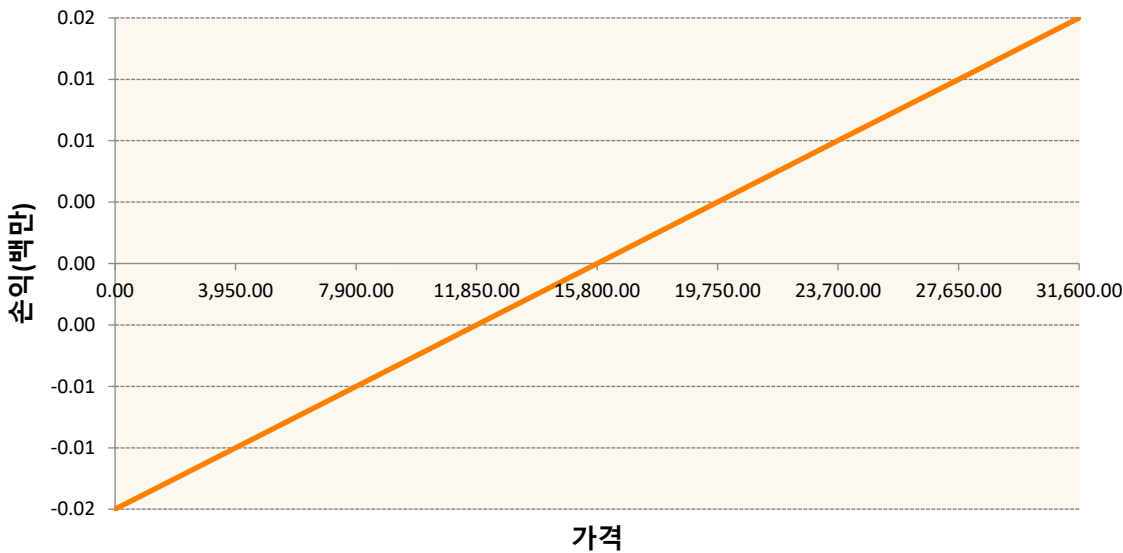
KR4A16660008-2026-06 현대차개별선물



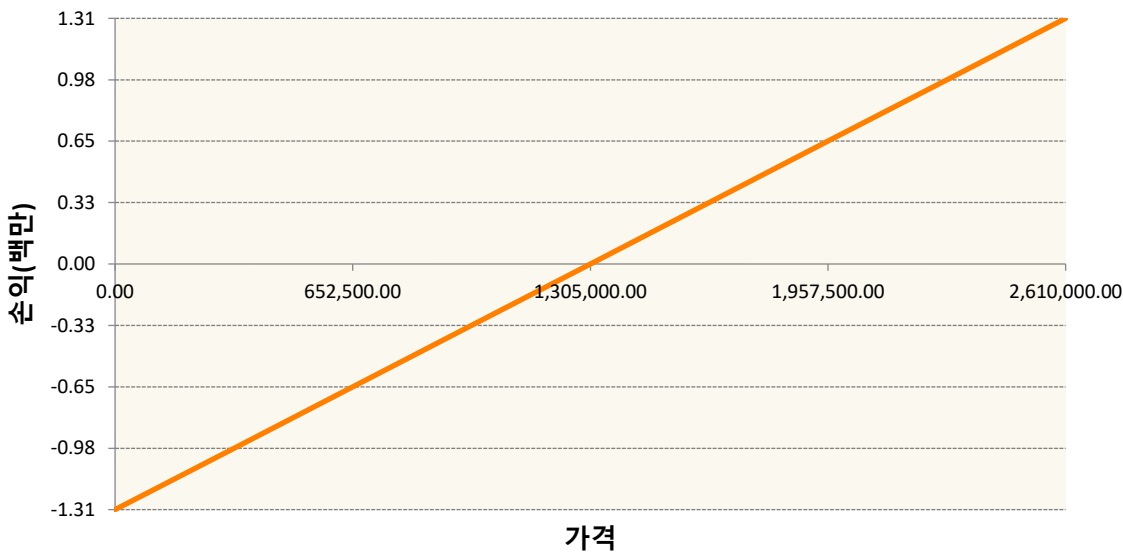
KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



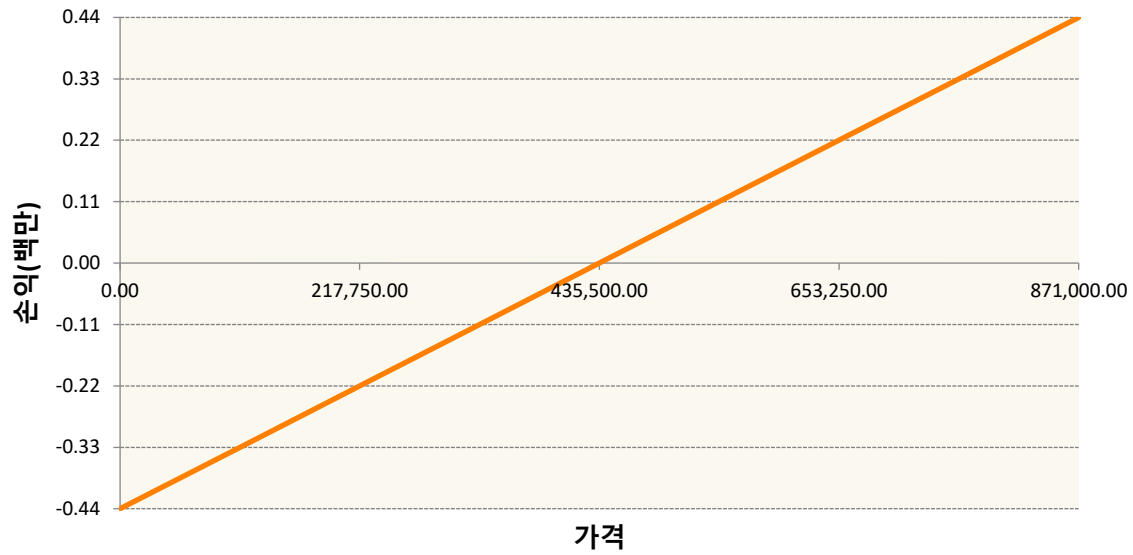
KR4AB0660004-2026-06 LG유플러스개별선물



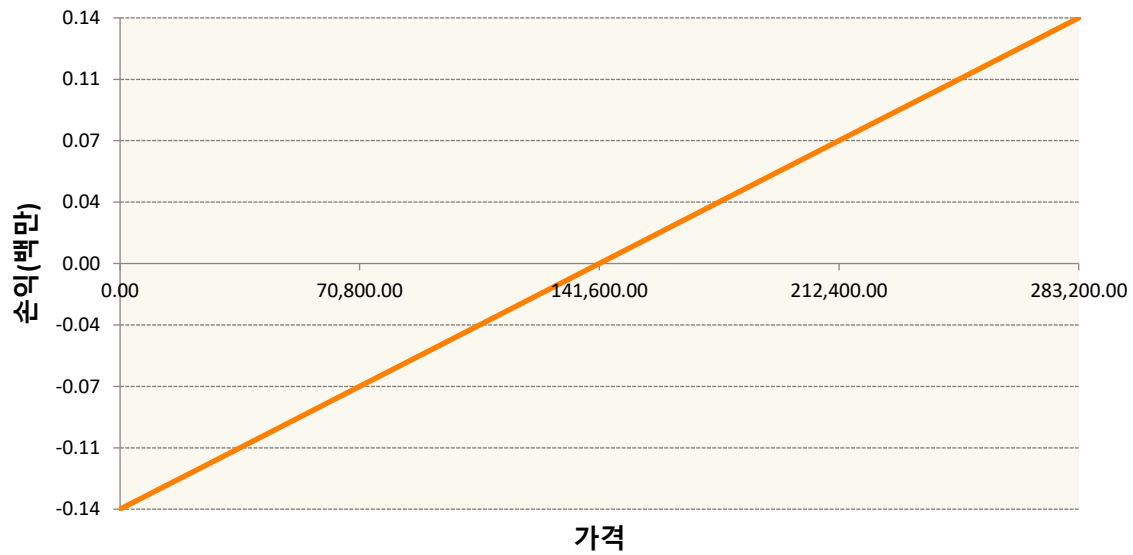
KR4AB3660001-2026-06 고려아연개별선물



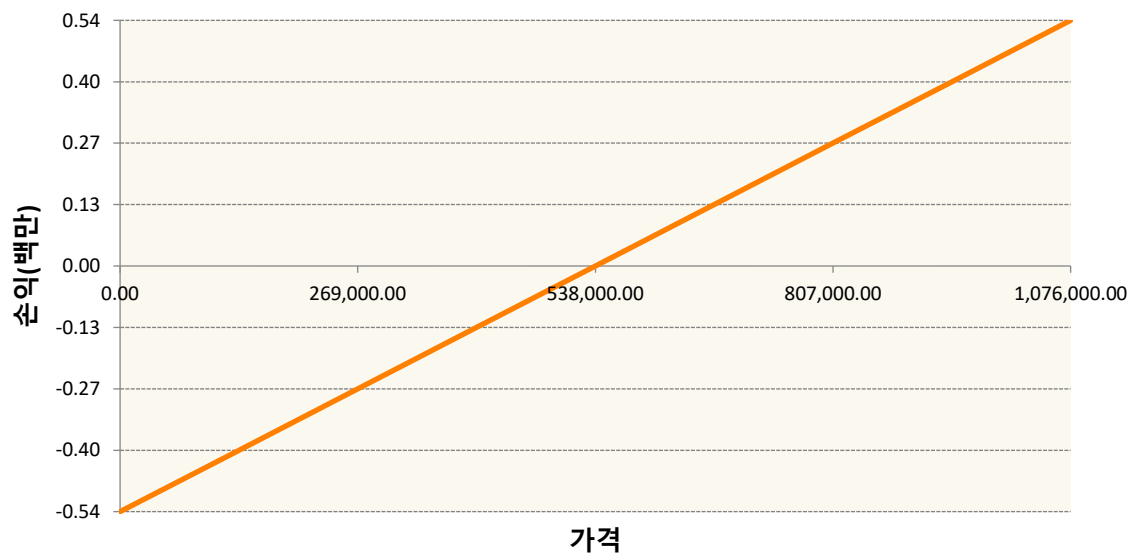
KR4ABD660008-2026-06 삼성생명개별선물



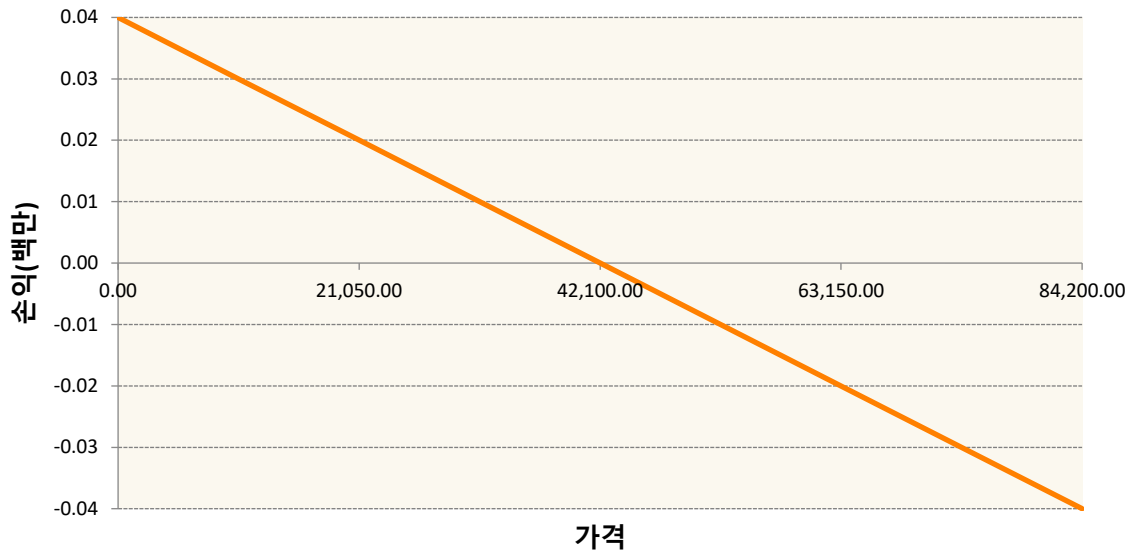
KR4ABM660007-2026-06 한국항공우주개별선물



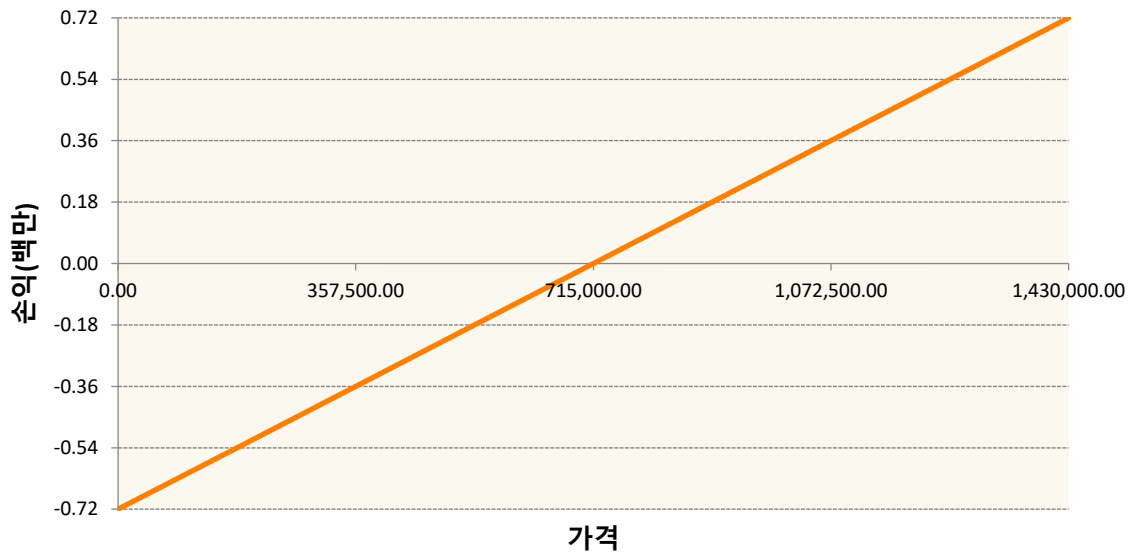
KR4AC8660004-2026-06 삼성물산개별선물



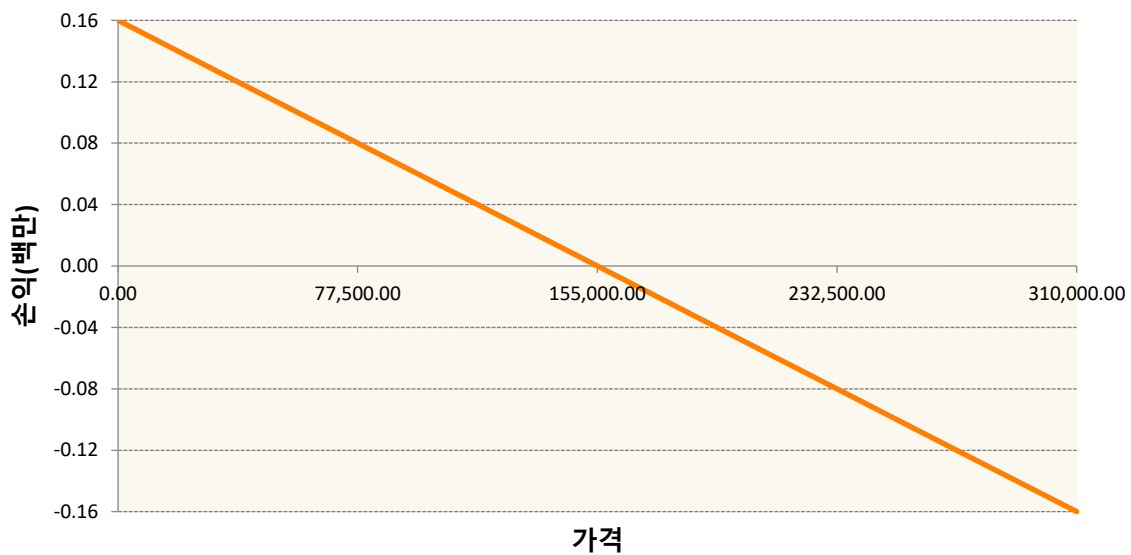
KR4ACF660005-2026-06 카카오개별선물



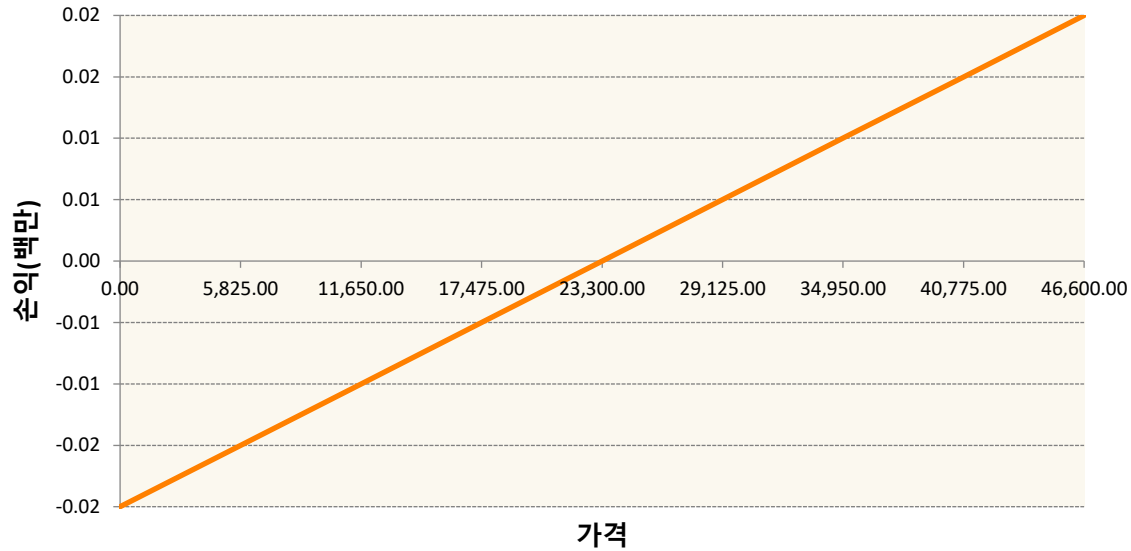
KR4ACT660009-2026-06 삼성화재개별선물



KR4AEJ660009-2026-06 SKC개별선물



KR4AFT660006-2026-06 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005		2026-06 코스피200지수선물						993
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-993	-993	-993	-993	-993	-993	-993	-993
-5.33%	-662	-662	-662	-662	-662	-662	-662	-662
-2.67%	-331	-331	-331	-331	-331	-331	-331	-331
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	331	331	331	331	331	331	331	331
5.33%	662	662	662	662	662	662	662	662
8.00%	993	993	993	993	993	993	993	993
KR4A0Z660006		2026-06 한미반도체개별선물						59
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59	59
-5.33%	40	40	40	40	40	40	40	40
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20	20
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
KR4A11660003		2026-06 삼성전자개별선물						396
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396	-396
-5.33%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
-2.67%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	132	132	132	132	132	132	132
5.33%	264	264	264	264	264	264	264
8.00%	396	396	396	396	396	396	396

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%	-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%	34	34	34	34	34	34	34

KR4A16660008	2026-06 현대차개별선물	101
--------------	-----------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-101	-101	-101	-101	-101	-101	-101
-5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-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%	67	67	67	67	67	67	67
8.00%	101	101	101	101	101	101	101

KR4A24660008	2026-06 LG전자개별선물	82
--------------	------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	82	82	82	82	82	82	82
-5.33%	55	55	55	55	55	55	55
-2.67%	27	27	27	27	27	27	27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82

KR4AB0660004	2026-06 LG유플러스개별선물	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%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-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%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	25	25	25	25	25	25	25

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

KR4ABD660008

2026-06 삼성생명개별선물

190

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
-5.33%	-127	-127	-127	-127	-127	-127	-127
-2.67%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	63	63	63	63	63	63	63
5.33%	127	127	127	127	127	127	127
8.00%	190	190	190	190	190	190	190

KR4ABM660007

2026-06 한국항공우주개별선물

41

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
-5.33%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	27	27	27	27	27	27	27
8.00%	41	41	41	41	41	41	41

KR4AC8660004

2026-06 삼성물산개별선물

74

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-49	-49	-49	-49	-49	-49	-49
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	49	49	49	49	49	49	49
8.00%	74	74	74	74	74	74	74

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
KR4ACT660009 2026-06 삼성화재개별선물							45
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45
KR4AEJ660009 2026-06 SKC개별선물							22
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22
-5.33%	15	15	15	15	15	15	15
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
KR4AFT660006 2026-06 대우건설개별선물							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

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

(단위:백만원)

4,634

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

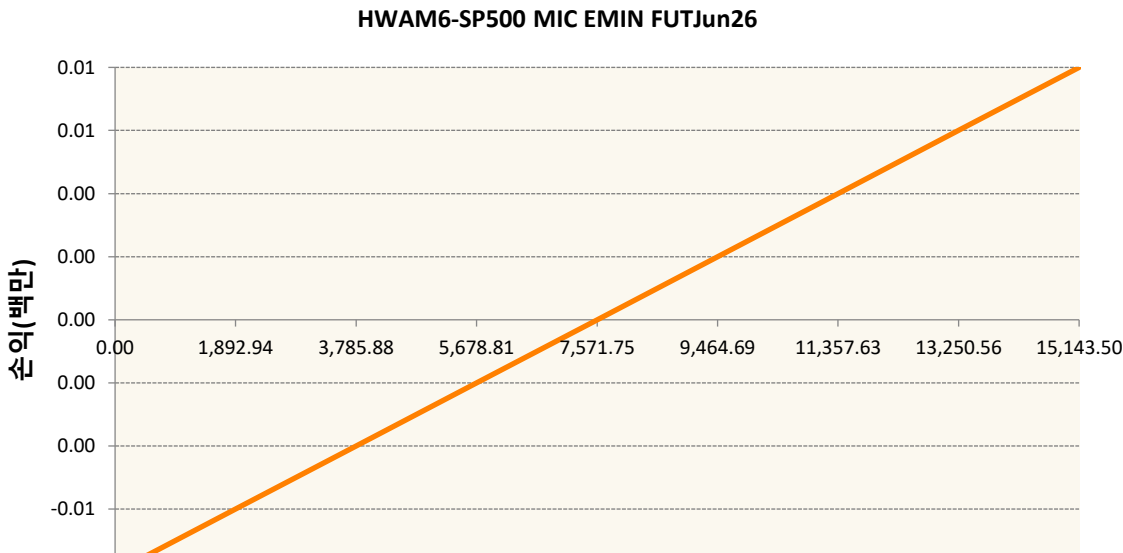
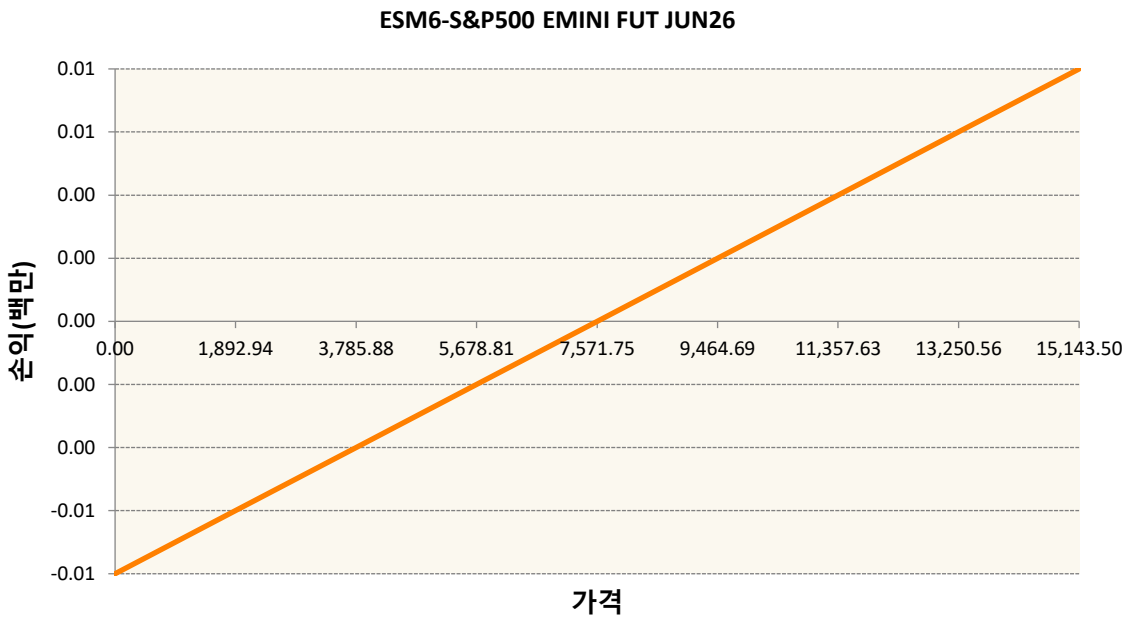
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

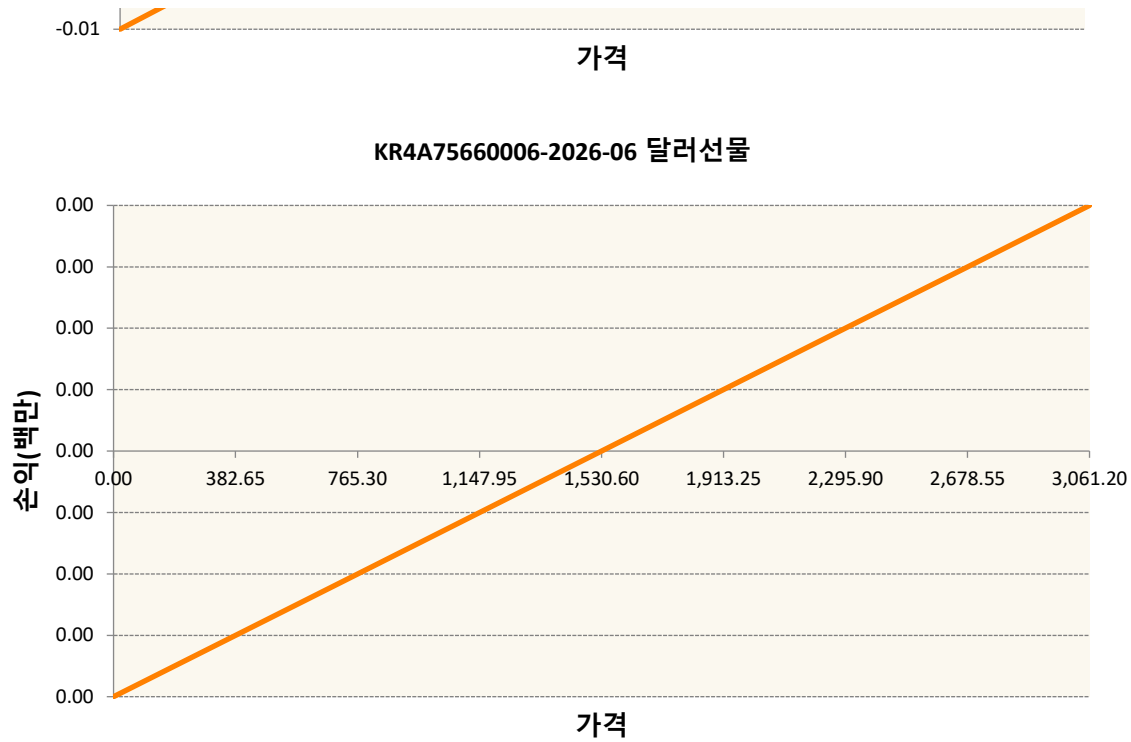
1. 계약금액

(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	61,407	0	61,407	
누계	지수	선물	283	0	283	장내
누계	통화	선물	10,867	0	10,867	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26		4,913
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26		23
KR4A756600 2026-06 달러선물			869

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,214

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

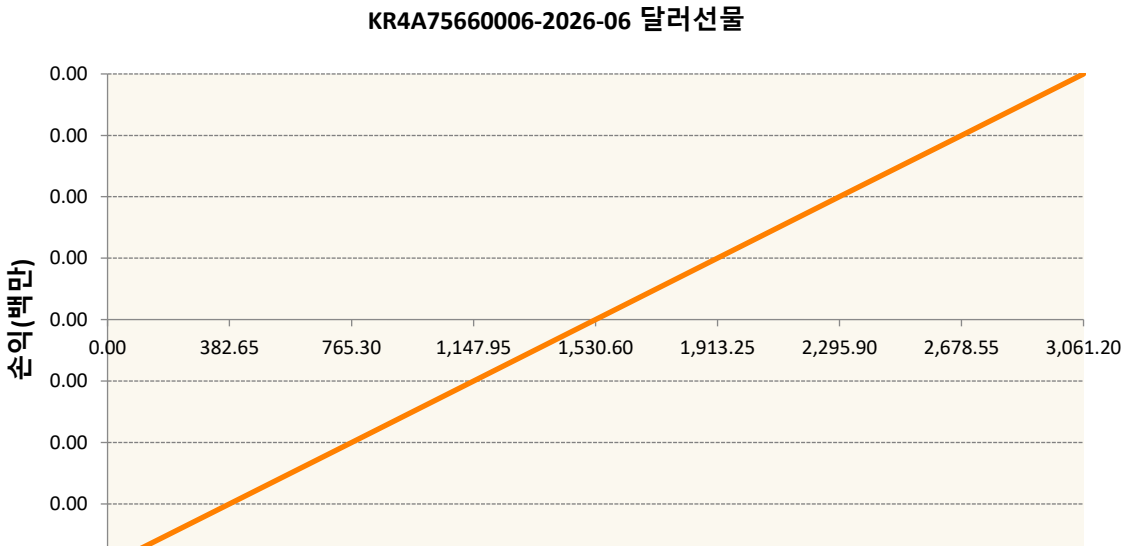
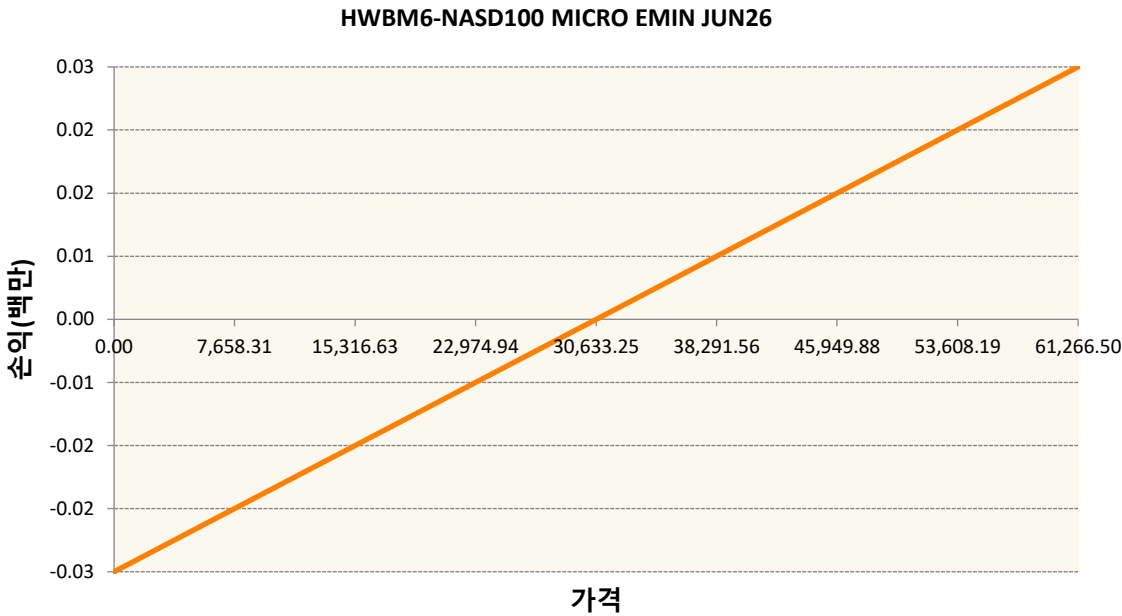
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

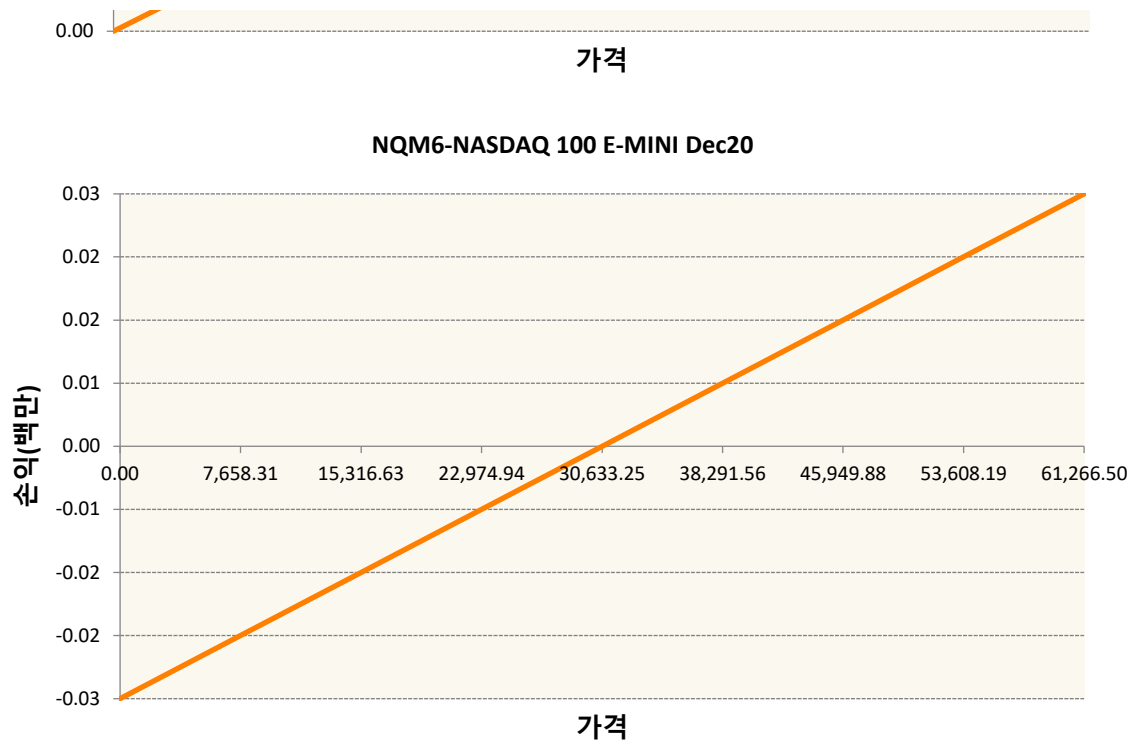
1. 계약금액

(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	31,299	0	31,299	
누계	유가증권	선물	269	0	269	장내
누계	통화	선물	3,995	0	3,995	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	21
KR4A756600	2026-06 달러선물	320
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,504

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

2,739

공시일	2026-06-05
기준일	2026-06-04

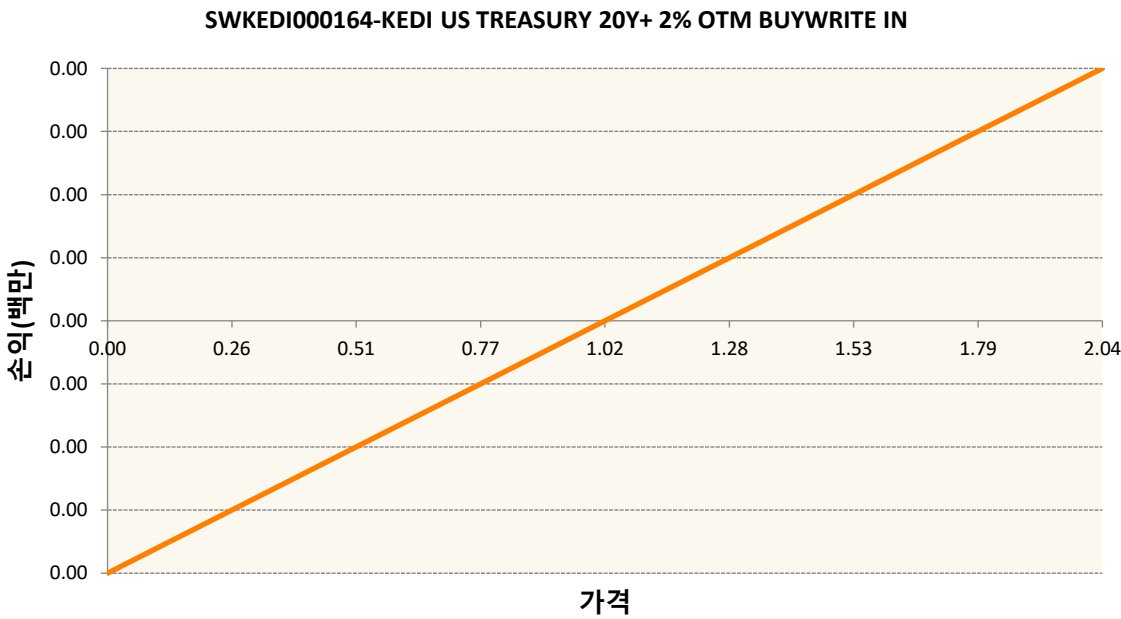
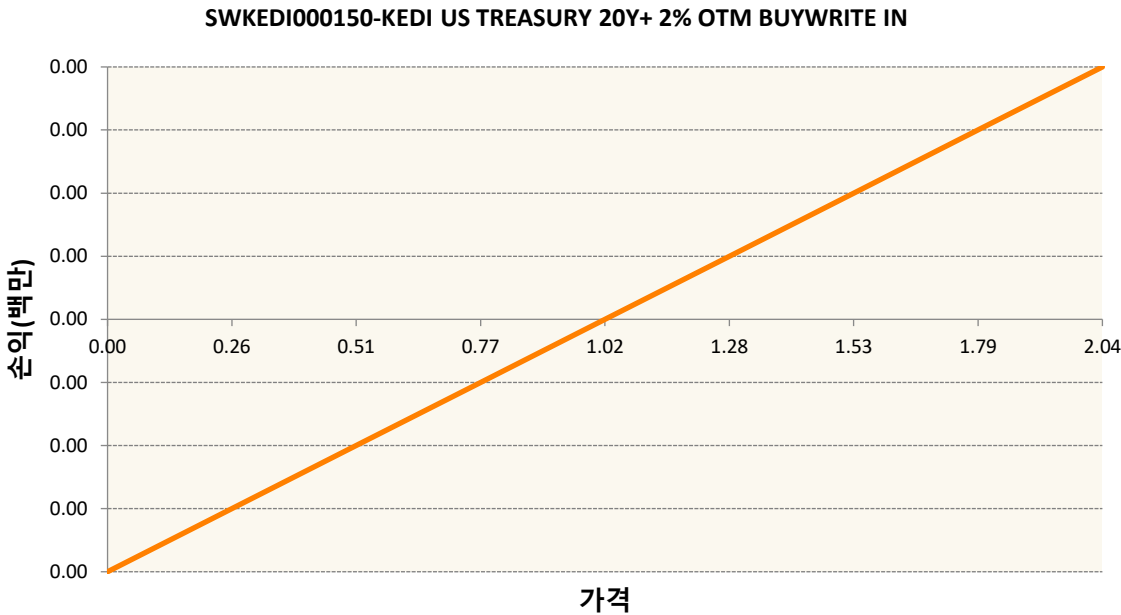
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

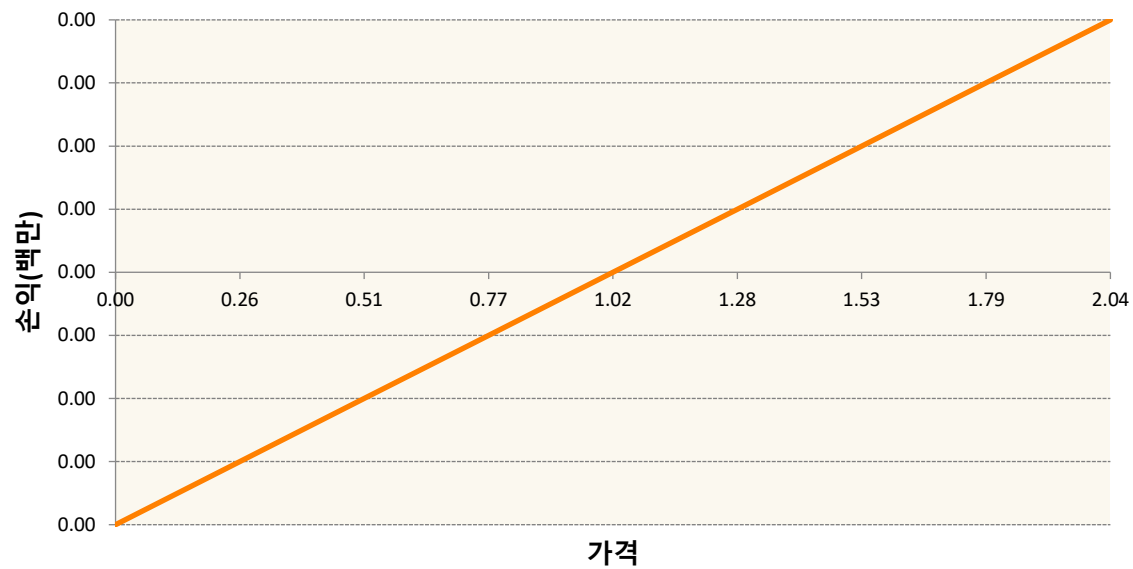
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	356,762	0	356,762	장외

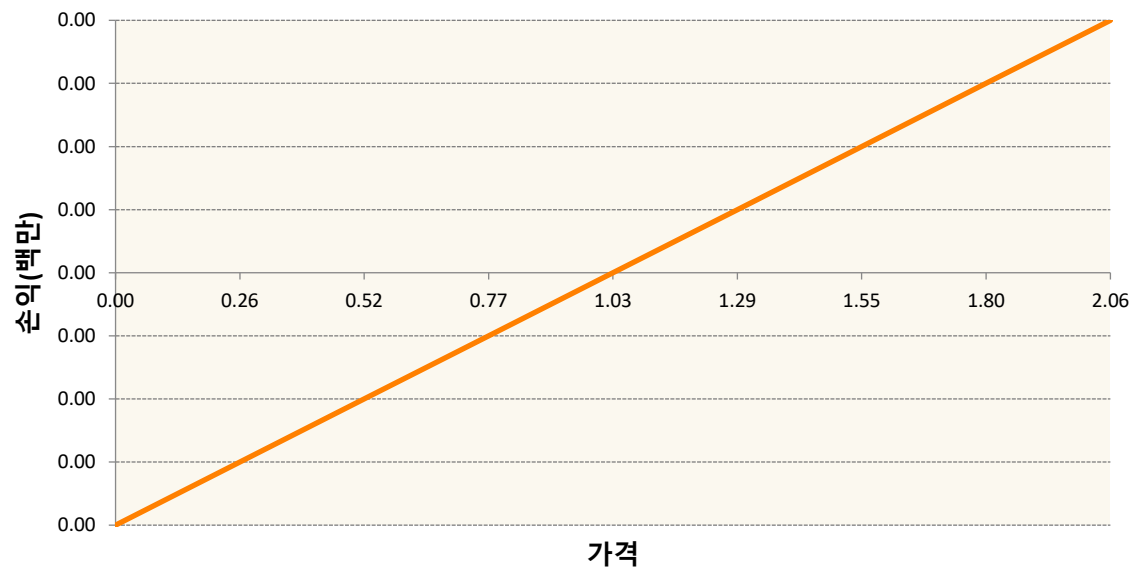
2. 만기시점의 손익구조



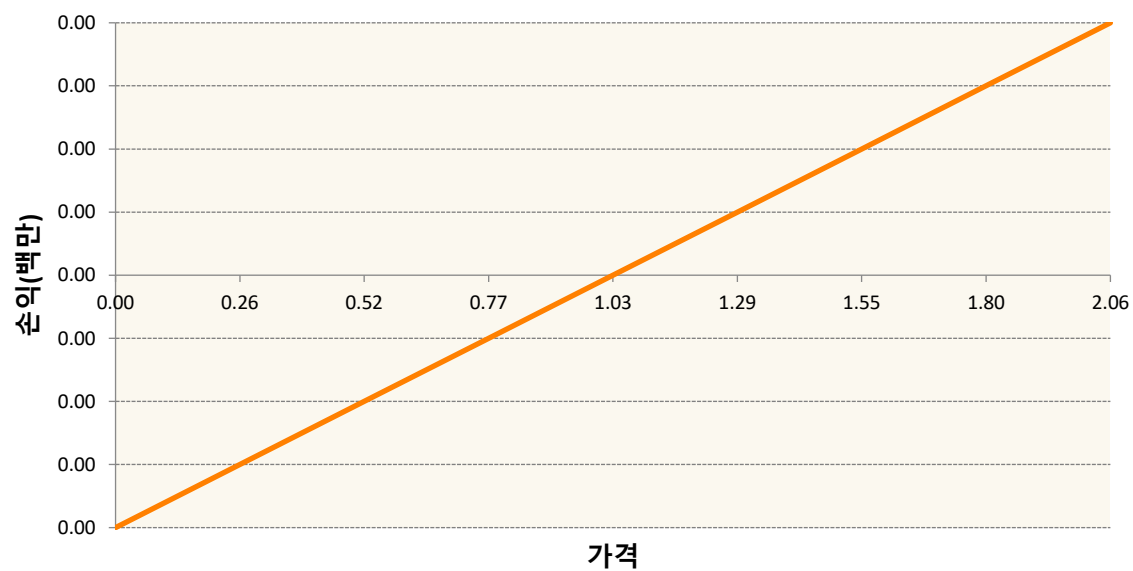
SWKEDI000172-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,539
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		156
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,506
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,171
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,156

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	11,993