

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

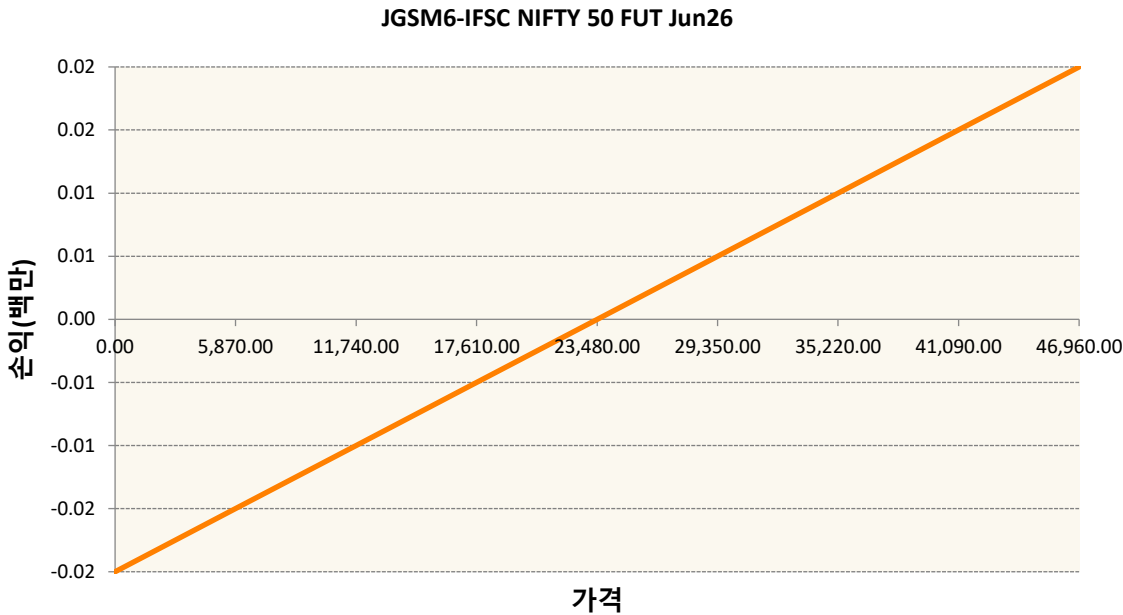
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-06-08
기준일	2026-06-05

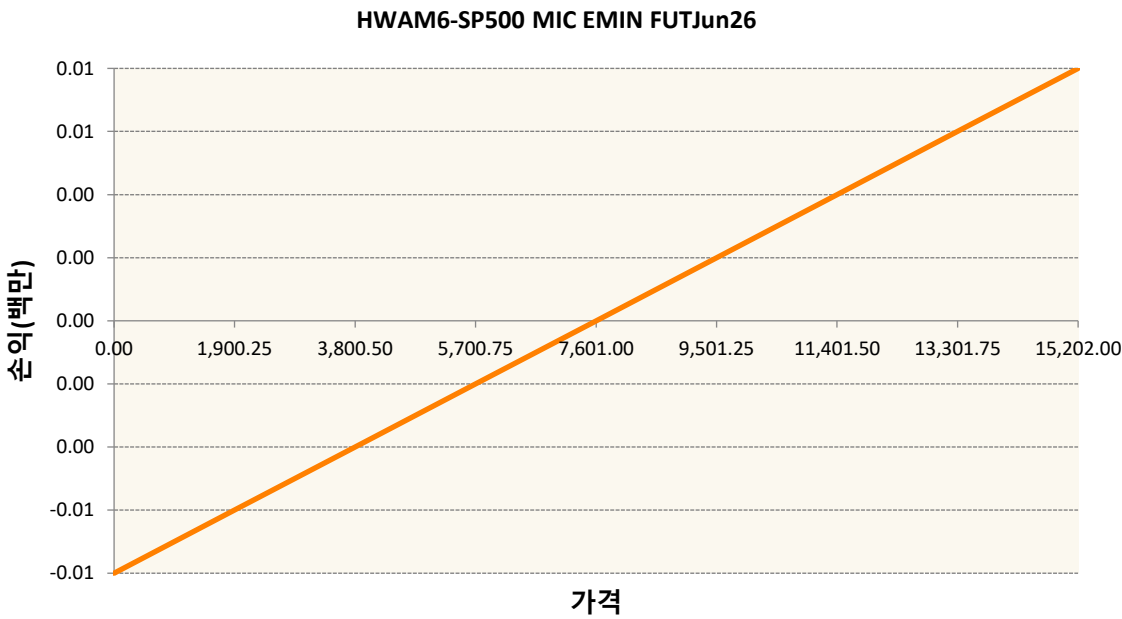
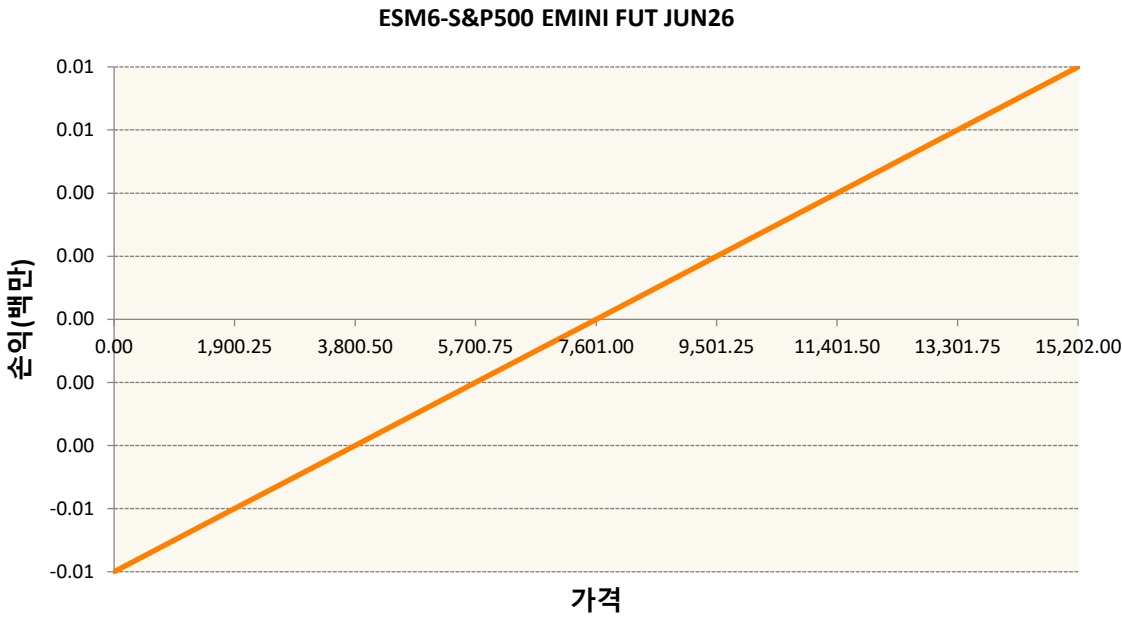
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	572	0	572	
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	2026-06-08
기준일	2026-06-05

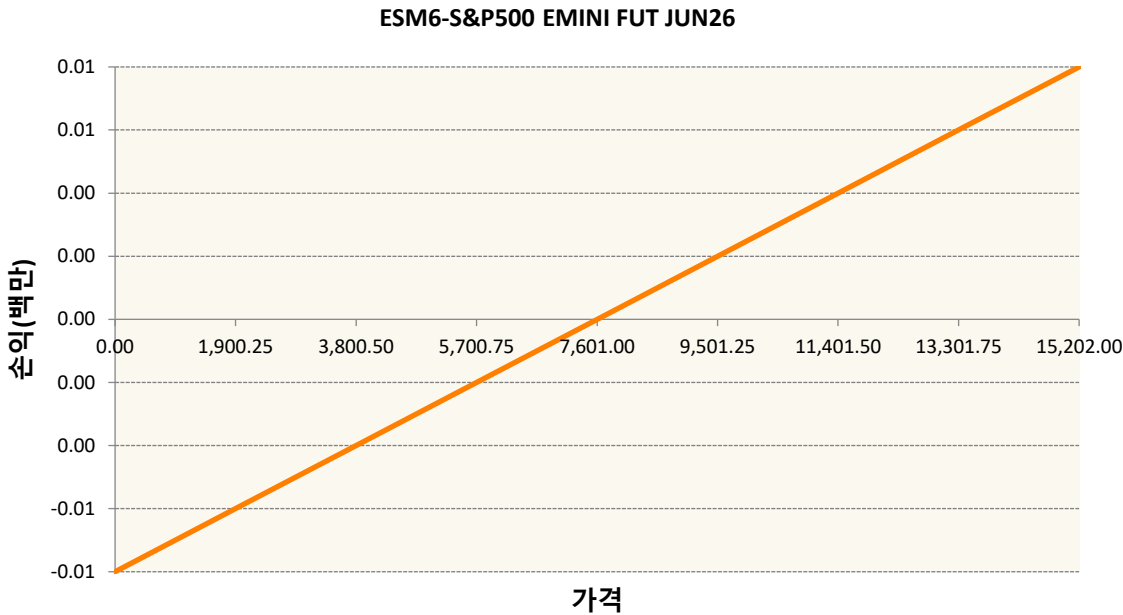
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,144	0	1,144	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	92
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

78

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

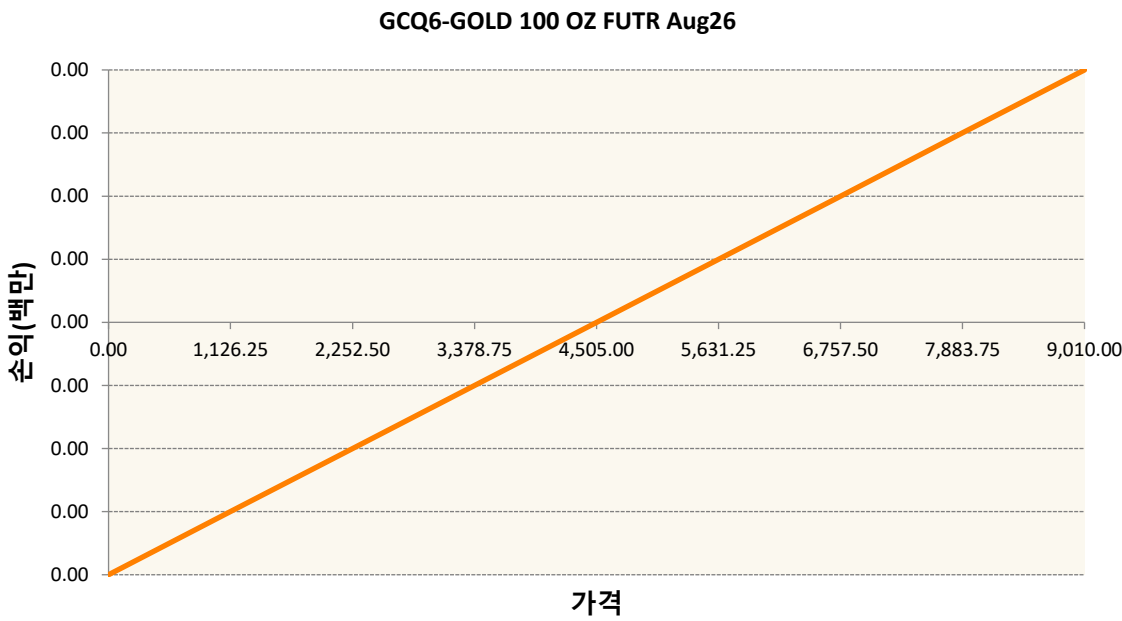
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,409	0	5,409	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 06/05/26 C415 EQUITY	37
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	433

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

(단위:백만원)

590

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

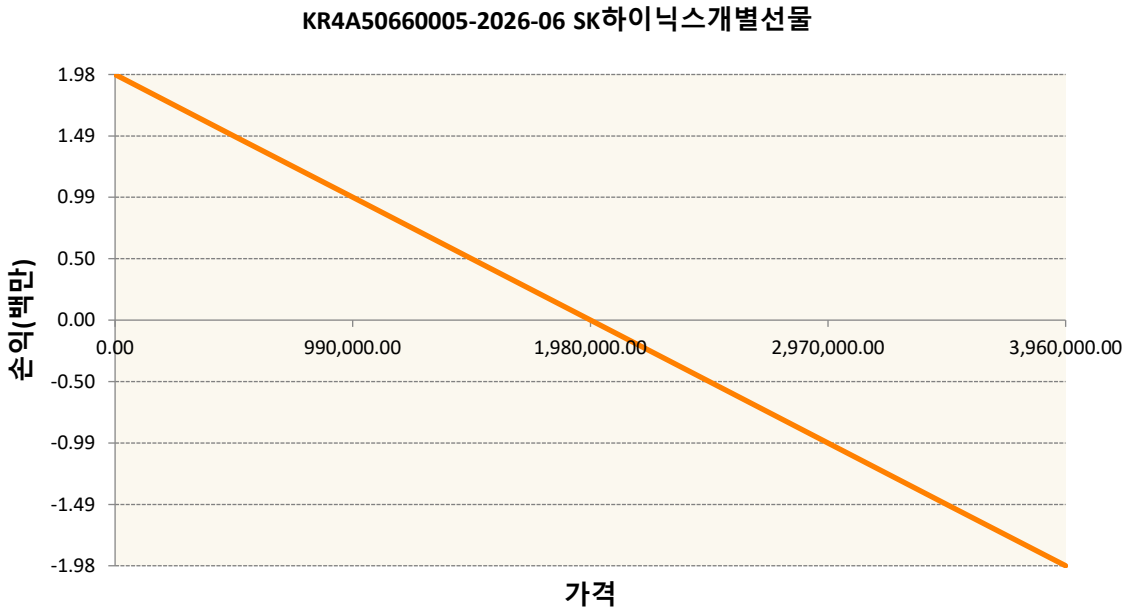
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	19,800	-19,800	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	13
AOPLTRUCC PLTR US 06/05/26 C150 EQUITY	0.46
AOPLTRUS1! PLTR US 06/05/26 C157.5 EQUITY	490
KR4A506600 2026-06 SK하이닉스개별선물	1,584

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

(단위:백만원)

7,797

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

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	2026-06-08
기준일	2026-06-05

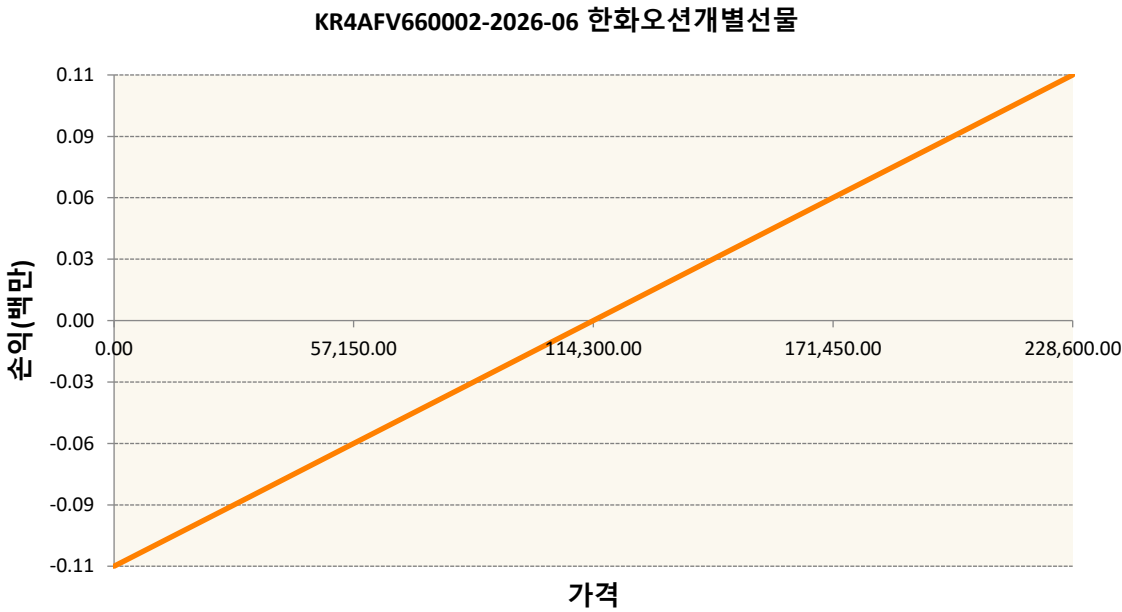
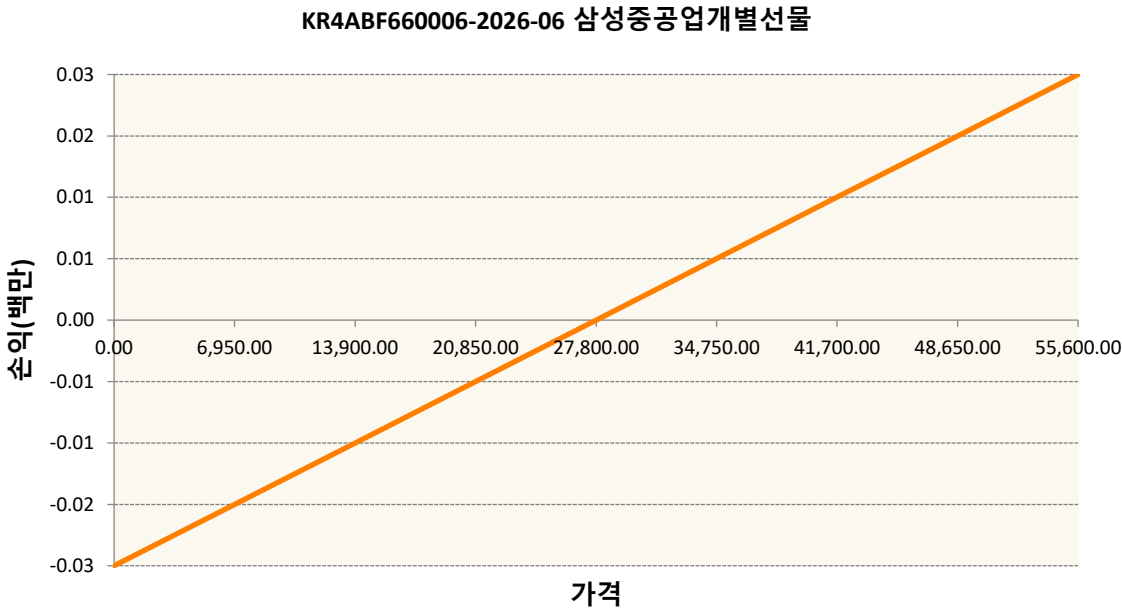
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2	0	2	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	21,896	0	21,896	장내
누계	유가증권	스왑	570	0	570	장외

2. 만기시점의 손익구조



가격	손익(백만)
0.00	-0.04
9,072.50	-0.03
18,145.00	-0.02
27,217.50	-0.01
36,290.00	0.00
45,362.50	0.01
54,435.00	0.02
63,507.50	0.03
72,580.00	0.04

가격	순이익 (백만)
0.00	-0.04
9,003.75	-0.03
18,007.50	-0.02
27,011.25	-0.01
36,015.00	0.00
45,018.75	0.01
54,022.50	0.02
63,026.25	0.03
72,030.00	0.04

(단위:백만원)

KR4ABF660006							2026-06 삼성중공업개별선물		395
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395	
-5.33%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263	
-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	132	
5.33%	263	263	263	263	263	263	263	263	
8.00%	395	395	395	395	395	395	395	395	
KR4AFV660002							2026-06 한화오션개별선물		87
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-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%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87

KR4AM7690001

2026-09 SOL 조선TOP3플러스개별선물

12,510

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12,510	-12,510	-12,510	-12,510	-12,510	-12,510	-12,510
-5.33%	-8,340	-8,340	-8,340	-8,340	-8,340	-8,340	-8,340
-2.67%	-4,170	-4,170	-4,170	-4,170	-4,170	-4,170	-4,170
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4,170	4,170	4,170	4,170	4,170	4,170	4,170
5.33%	8,340	8,340	8,340	8,340	8,340	8,340	8,340
8.00%	12,510	12,510	12,510	12,510	12,510	12,510	12,510

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

(단위:백만원)

18,881

공시일 2026-06-08

기준일 2026-06-05

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	2026-06-08
기준일	2026-06-05

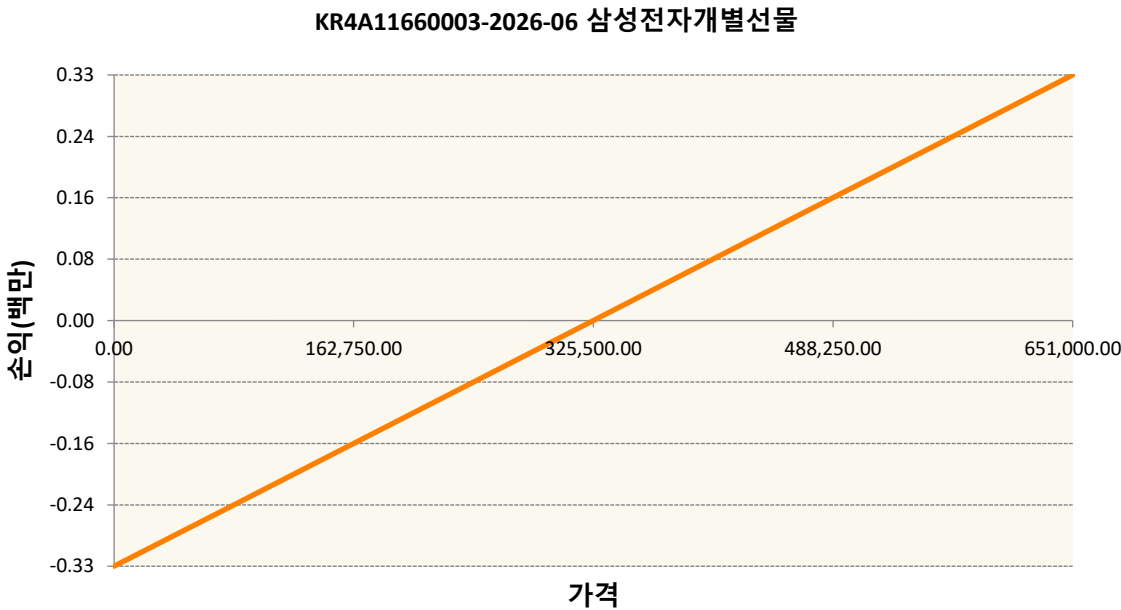
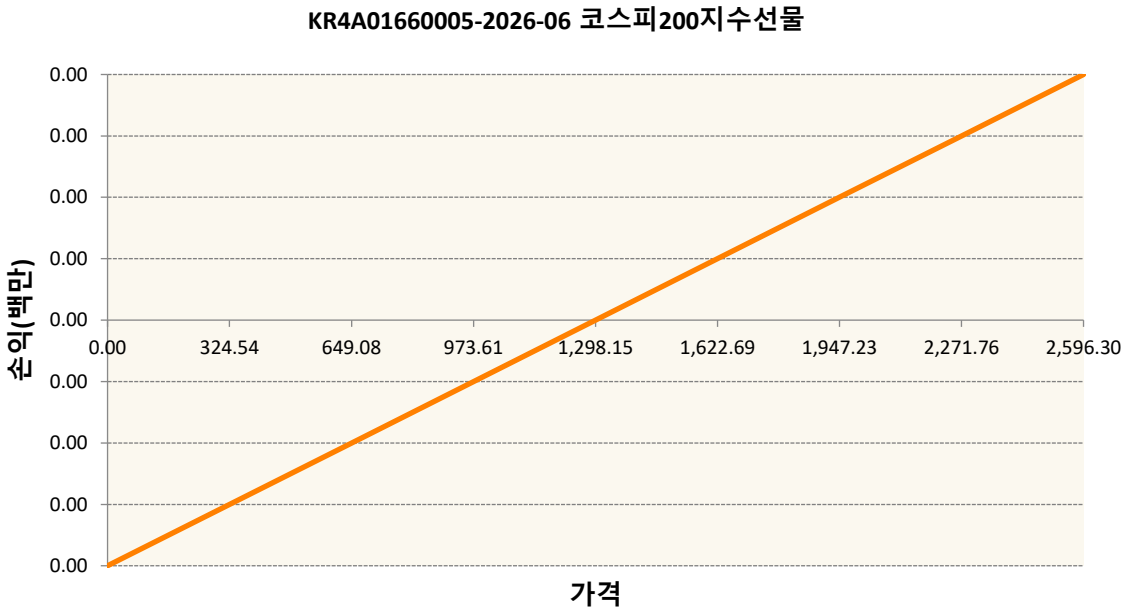
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	26,015	68,014	-41,999	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the profit/loss (손익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 2,765.00. The y-axis represents the profit/loss, ranging from 0.00 to 0.00. A solid blue line shows a constant negative slope, indicating that as the price increases, the profit/loss decreases linearly.

가액 (Price)	손익 (백만) (Profit/Loss)
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		674	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-674	-674	-674	-674	-674	-674	-674	-674		
-5.33%	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450		
-2.67%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225		
0%	0	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	225	225	225	225	225	225	225	225		
5.33%	450	450	450	450	450	450	450	450		
8.00%	674	674	674	674	674	674	674	674		
KR4A11660003							2026-06 삼성전자개별선물		1,421	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,421	-1,421	-1,421	-1,421	-1,421	-1,421	-1,421
-5.33%	-948	-948	-948	-948	-948	-948	-948
-2.67%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	474	474	474	474	474	474	474
5.33%	948	948	948	948	948	948	948
8.00%	1,421	1,421	1,421	1,421	1,421	1,421	1,421
KR4BAFBGB548 코스피위클리M C 2606W2 1,380.0							3,061

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,061	3,061	3,061	3,061	3,061	3,061	3,061
-5.33%	2,041	2,041	2,041	2,041	2,041	2,041	2,041
-2.67%	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020	1,020
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020	-1,020
5.33%	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041	-2,041
8.00%	-3,061	-3,061	-3,061	-3,061	-3,061	-3,061	-3,061
KR4BAFBGB555 코스피위클리M C 2606W2 1,382.5							2,049

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,049	2,049	2,049	2,049	2,049	2,049	2,049
-5.33%	1,366	1,366	1,366	1,366	1,366	1,366	1,366
-2.67%	683	683	683	683	683	683	683
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-683	-683	-683	-683	-683	-683	-683
5.33%	-1,366	-1,366	-1,366	-1,366	-1,366	-1,366	-1,366
8.00%	-2,049	-2,049	-2,049	-2,049	-2,049	-2,049	-2,049

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

(단위:백만원)

17,720

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

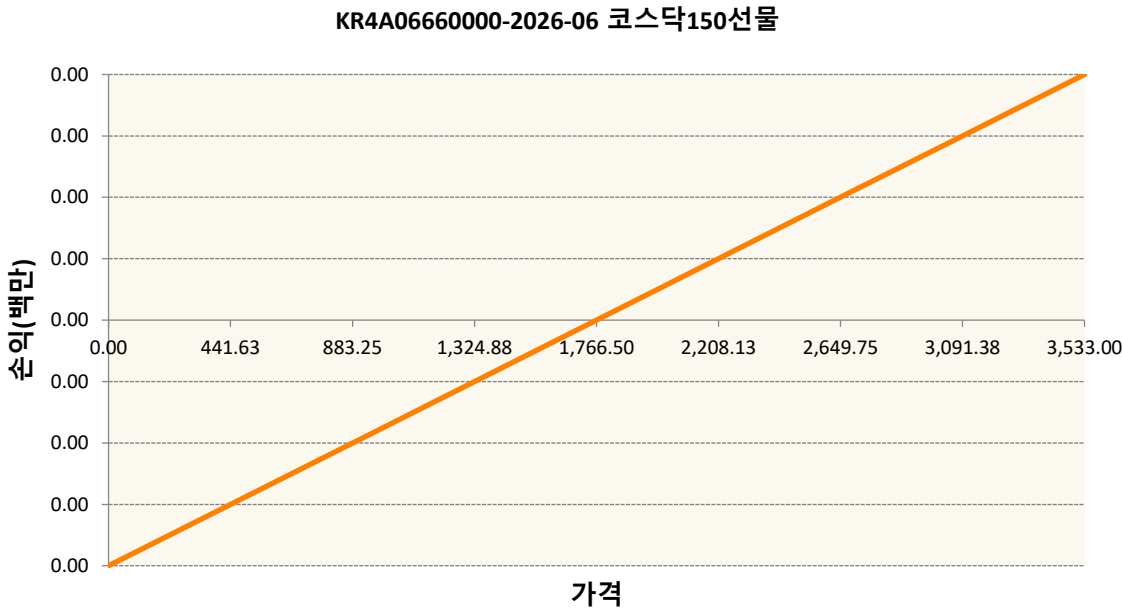
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,042	0	1,042	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06660000			2026-06 코스닥150선물				83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-2.67%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	28	28	28	28	28	28	28
5.33%	56	56	56	56	56	56	56
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

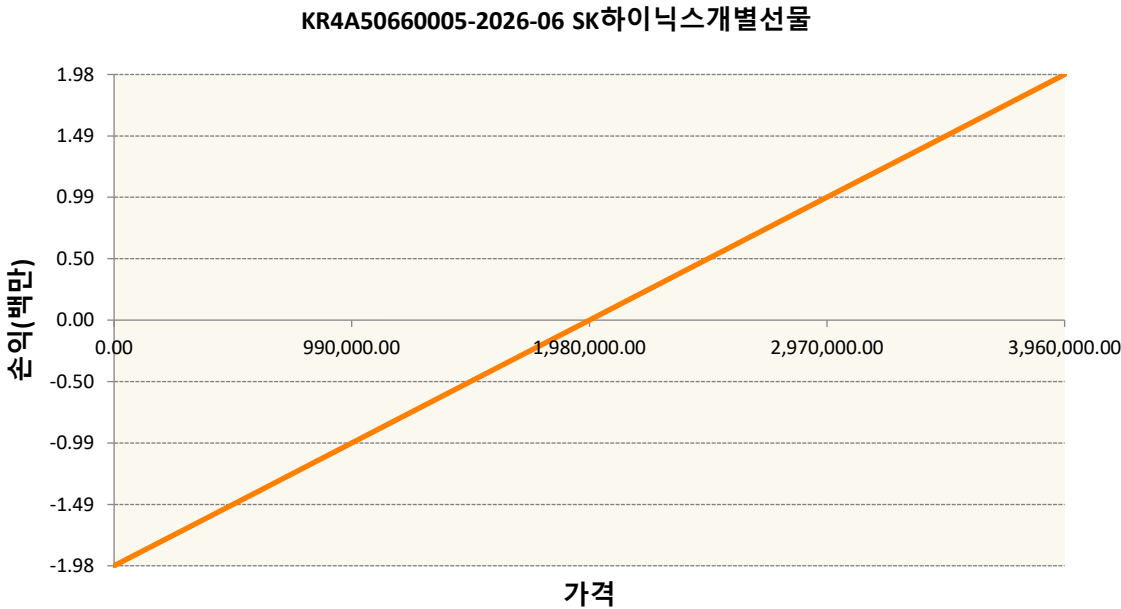
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

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	55,519	0	55,519	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

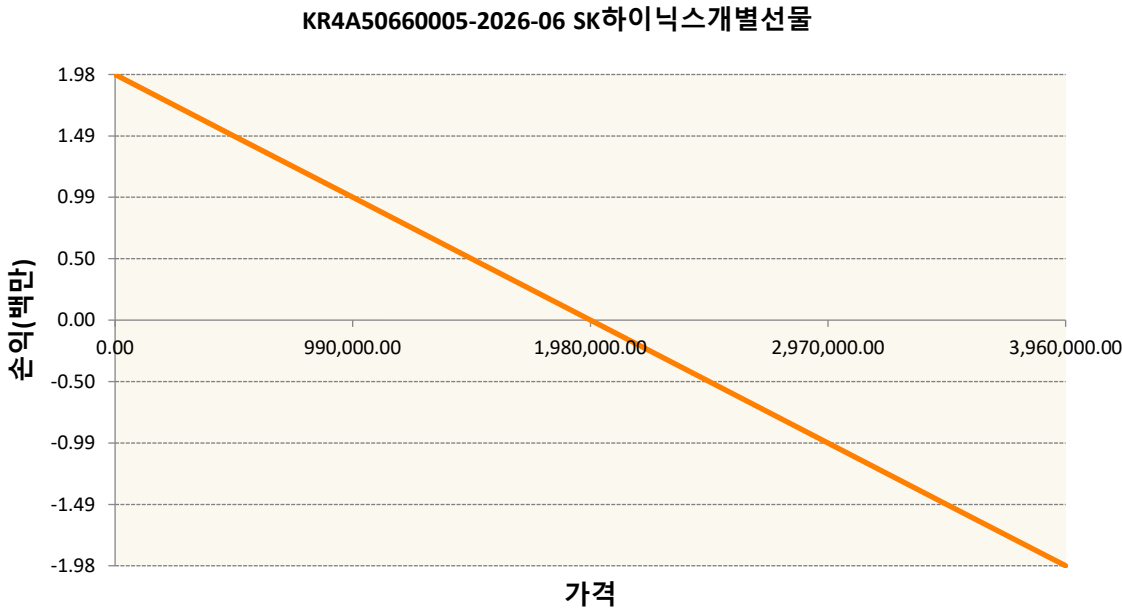
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

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	126,463	-126,463	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

(단위:백만원)

0

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

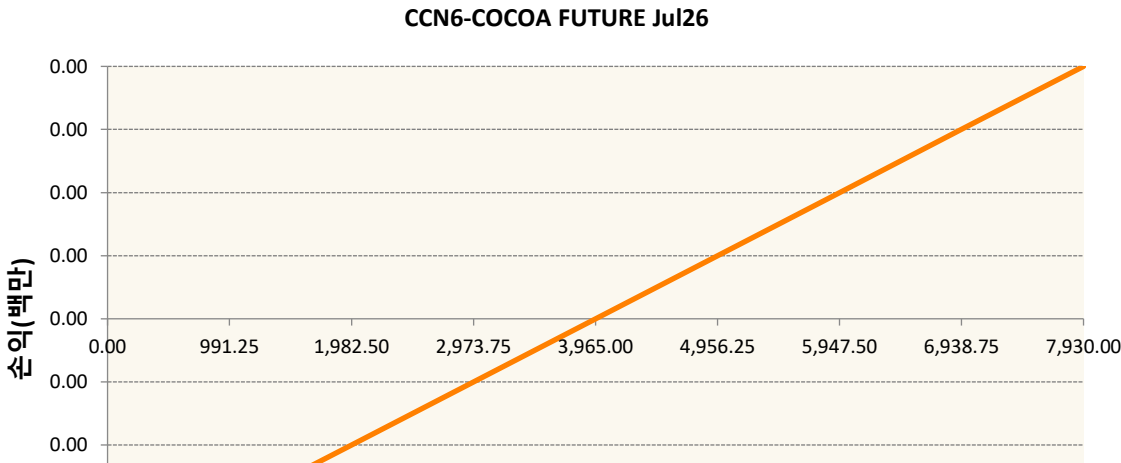
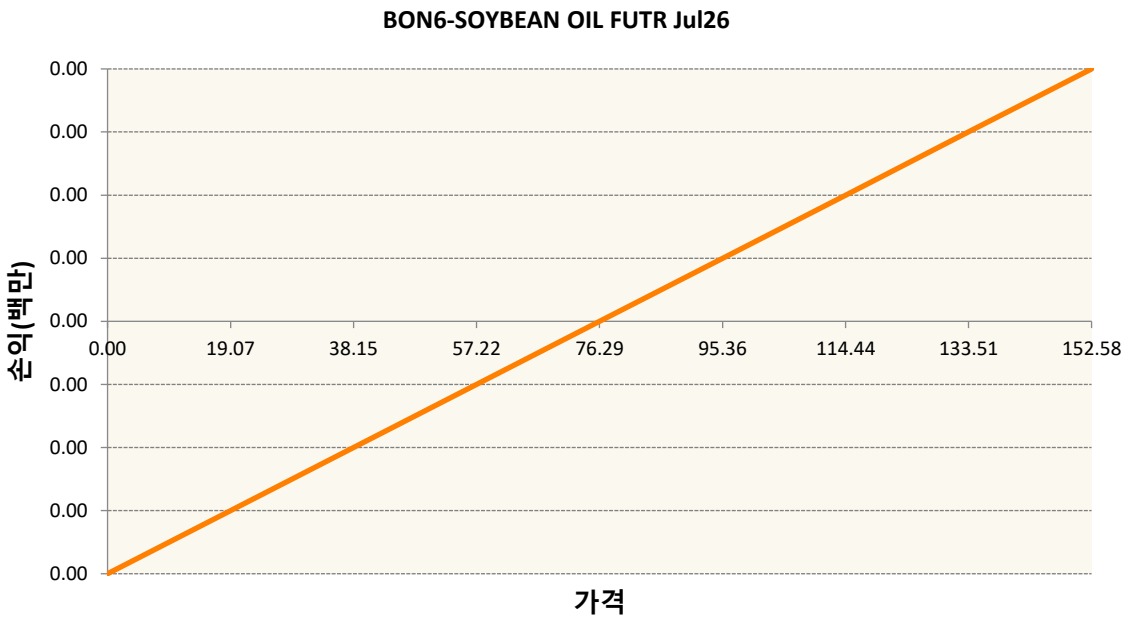
포커스농산물모(채권-파생형)

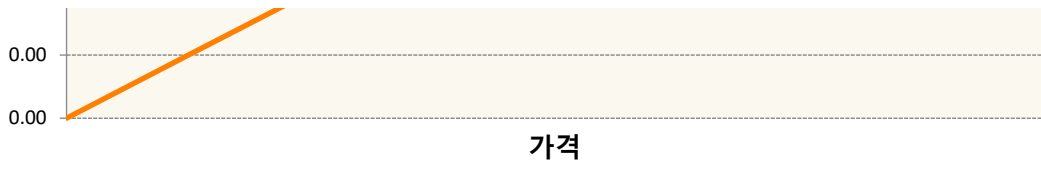
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

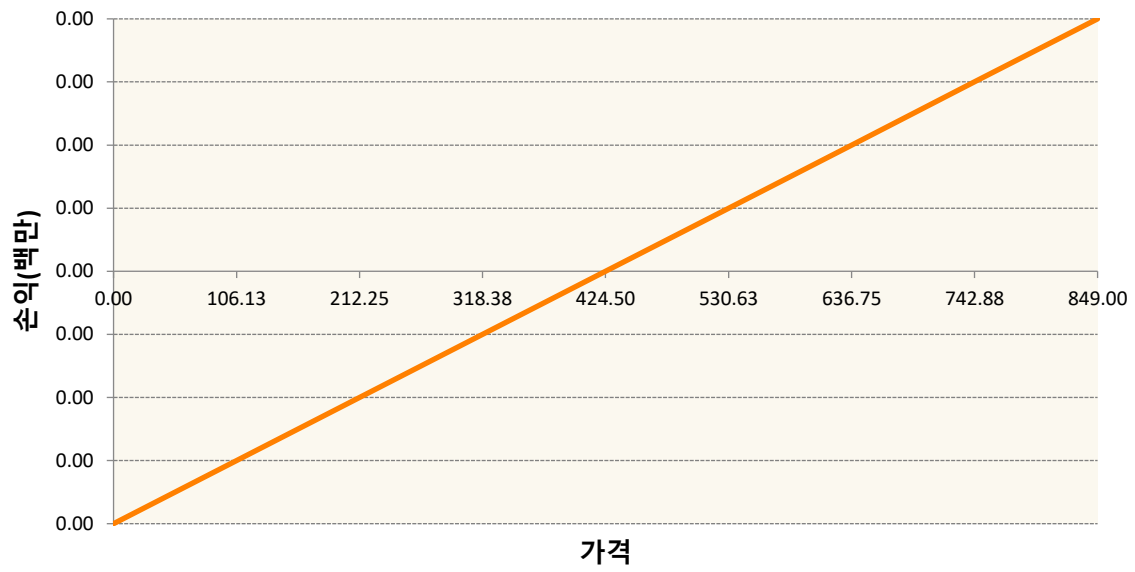
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	60	0	60	
누계	실물자산	선물	680	0	680	장내
누계	유가증권	선물	1,781	0	1,781	
누계	통화	선물	0	277	-277	장내

2. 만기시점의 손익구조

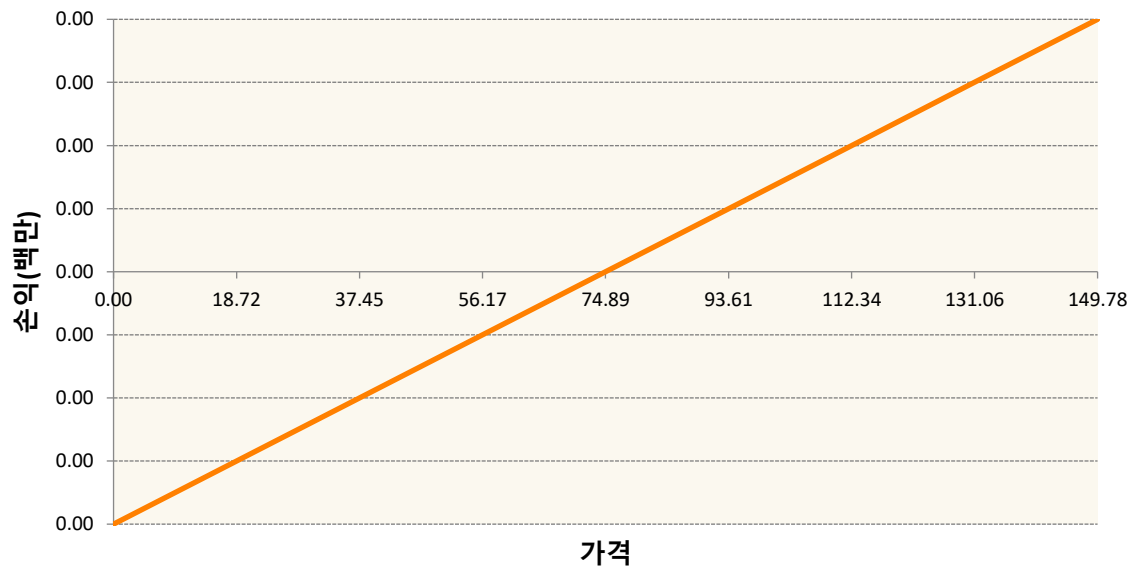




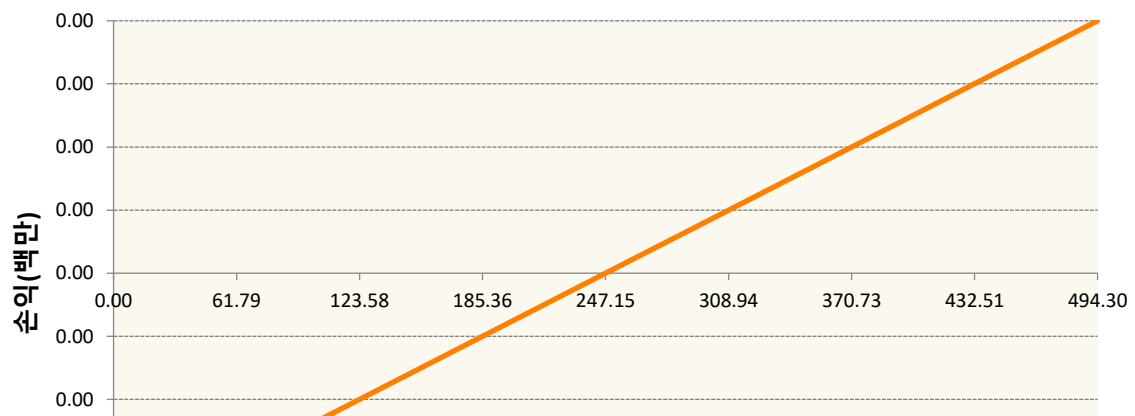
CN6-CORN FUTURE Jul26

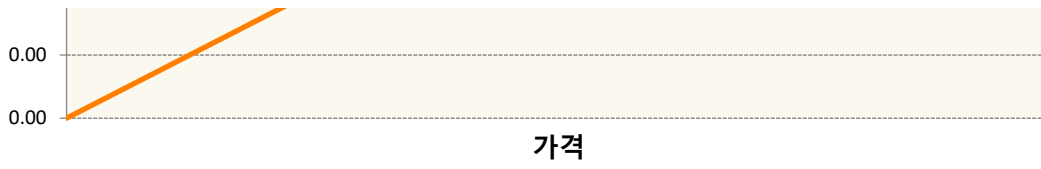


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

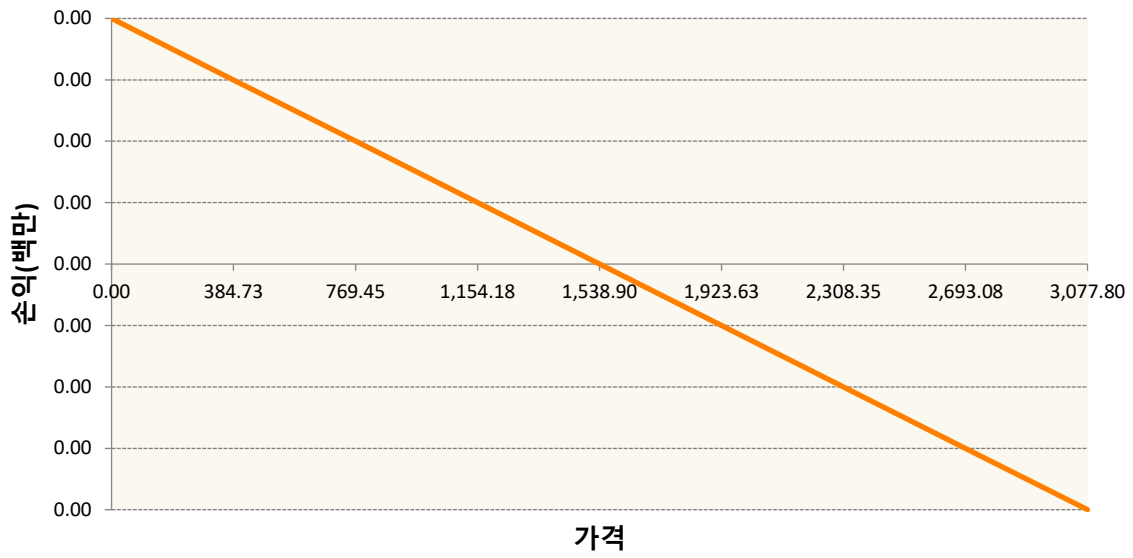


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

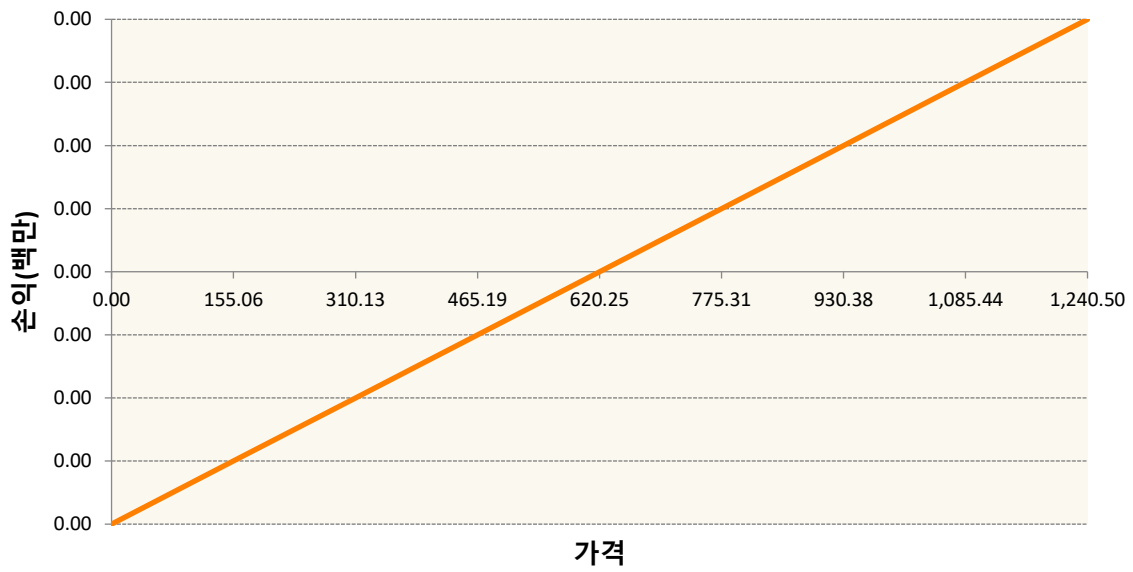




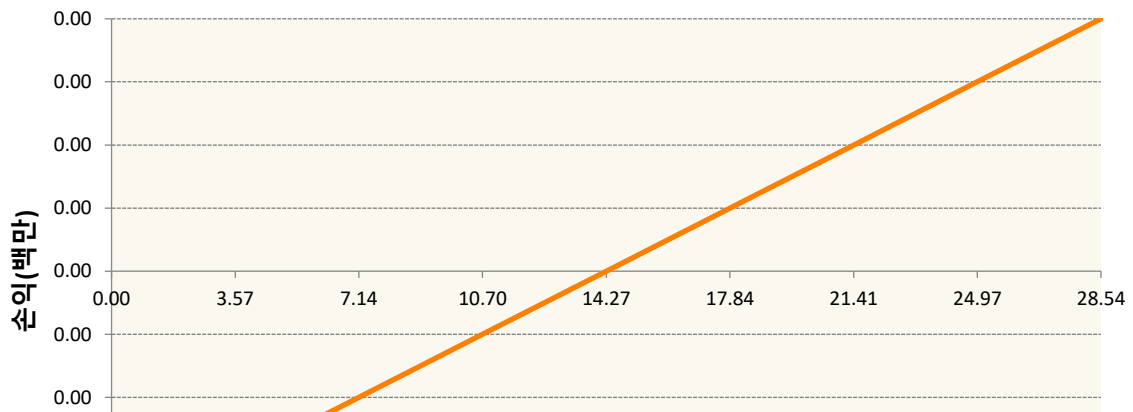
KR4A75660006-2026-06 달러선물

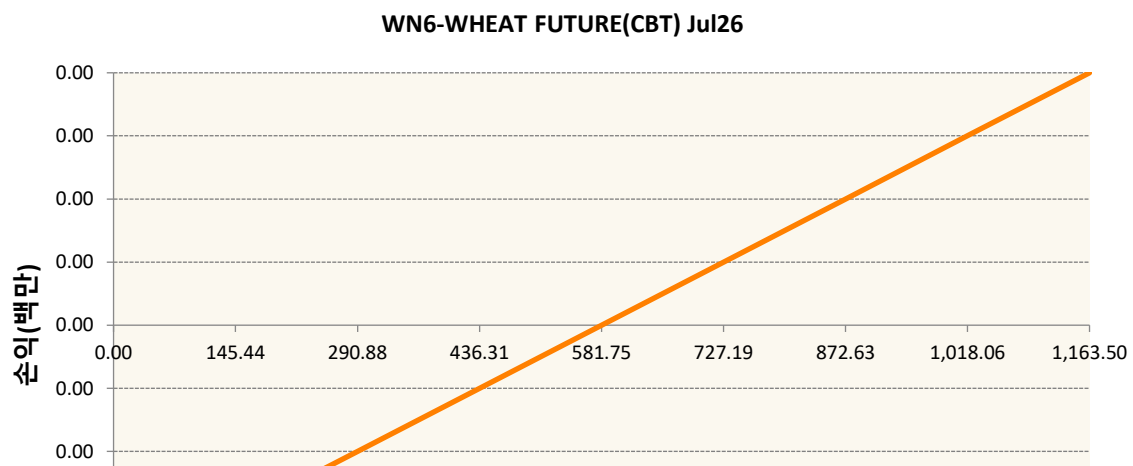
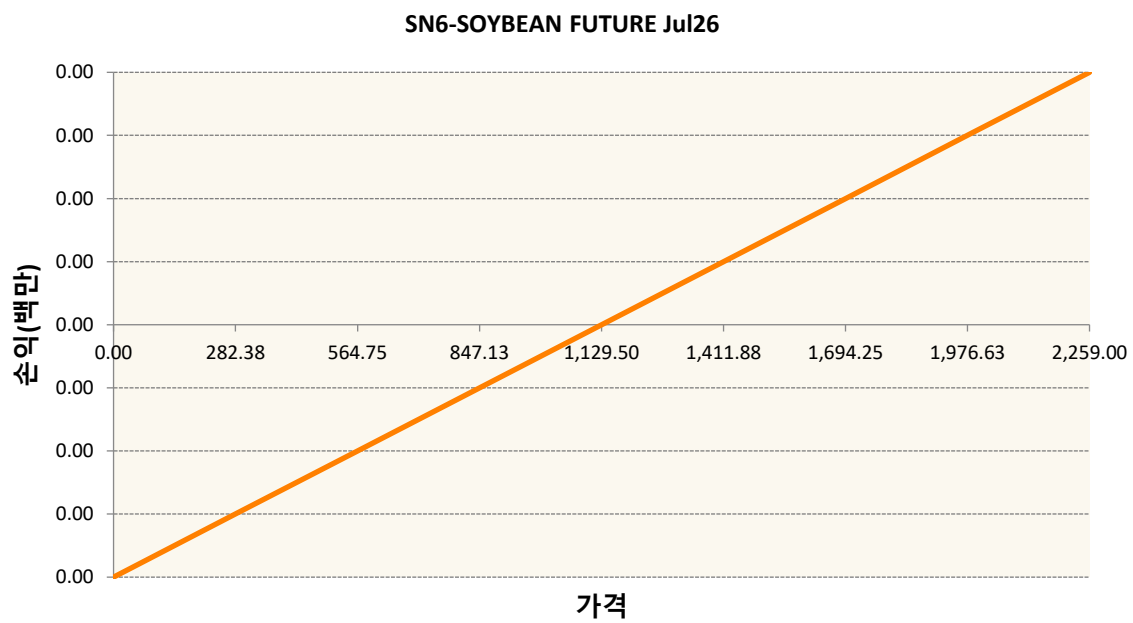
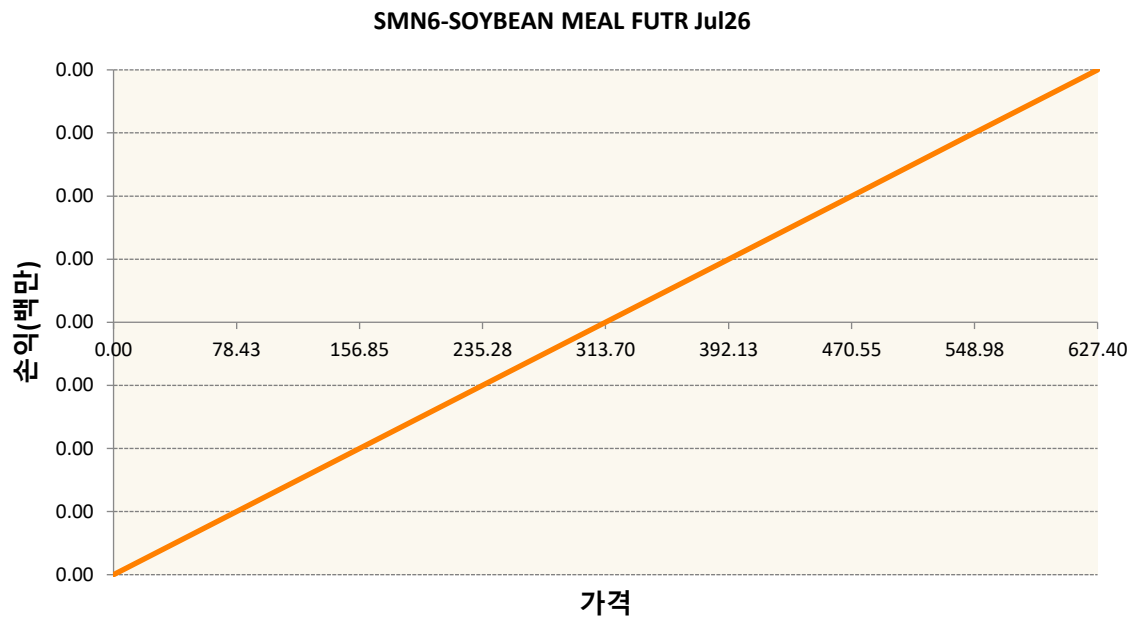
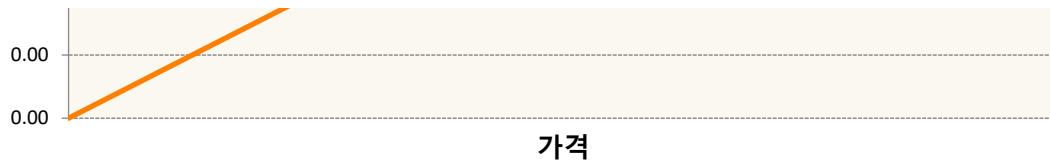


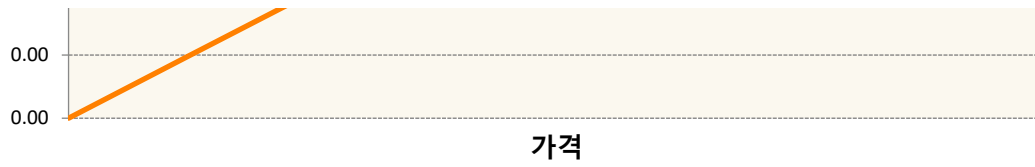
KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26



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	2026-06-08
기준일	2026-06-05

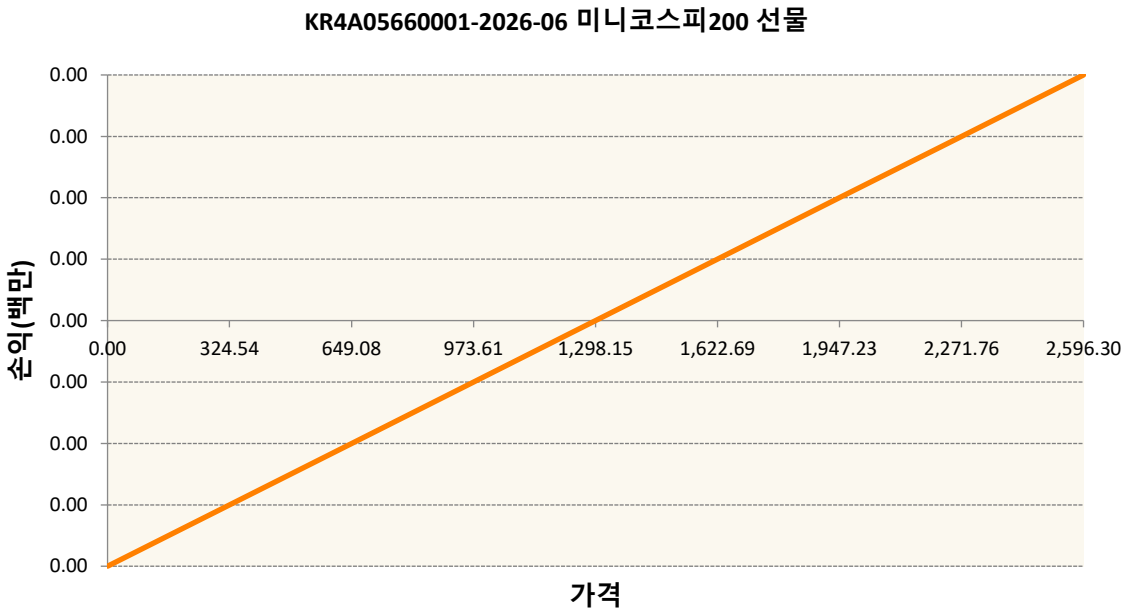
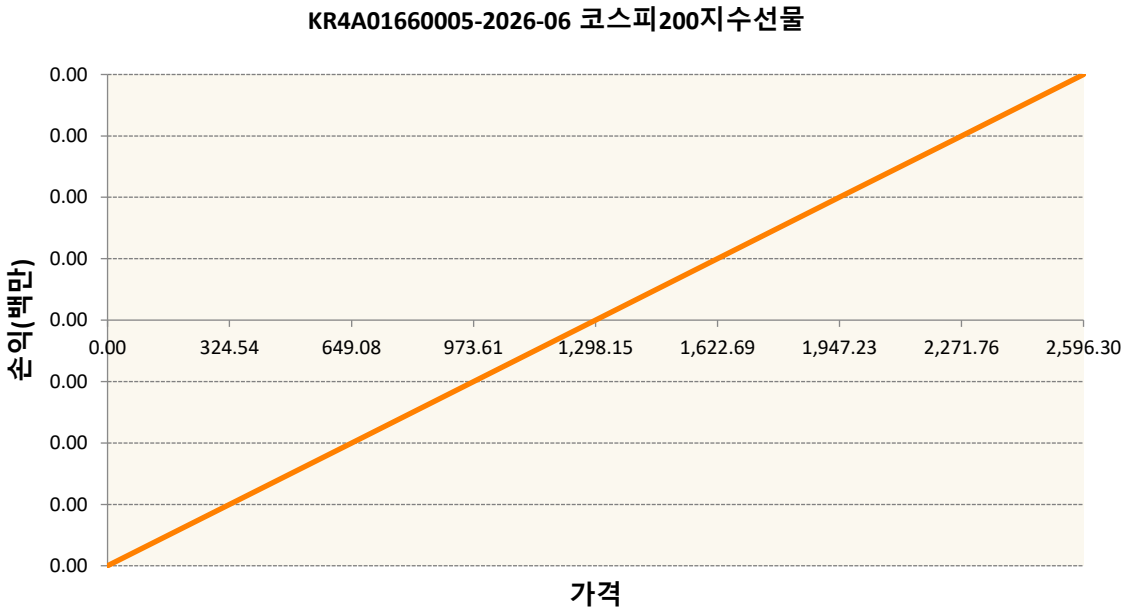
스마트인덱스모

1. 계약금액

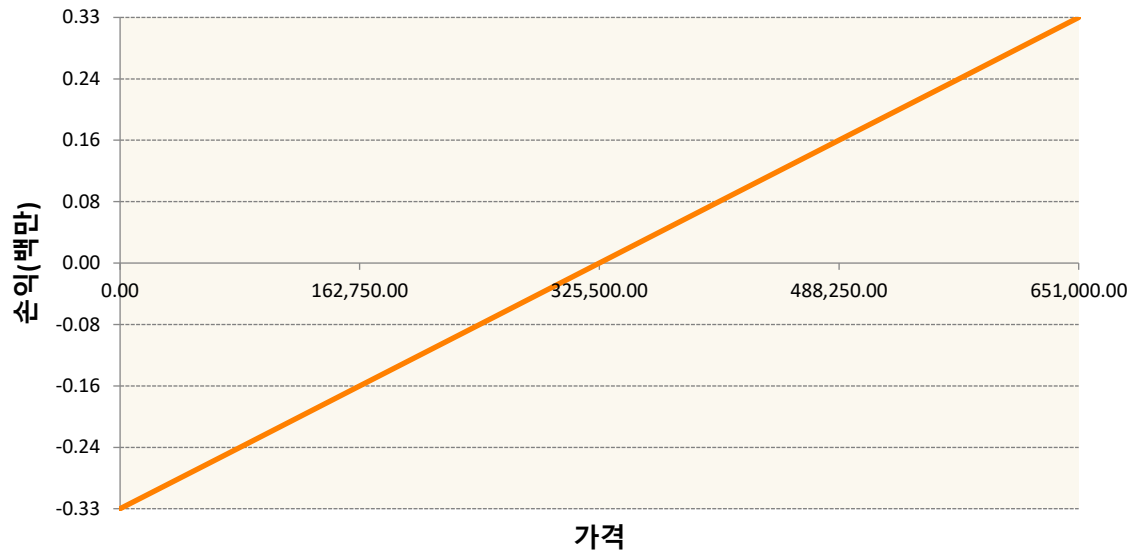
(단위:백만원)

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	4,634	0	4,634	장내
누계	유가증권	스왑	0	297	-297	장외

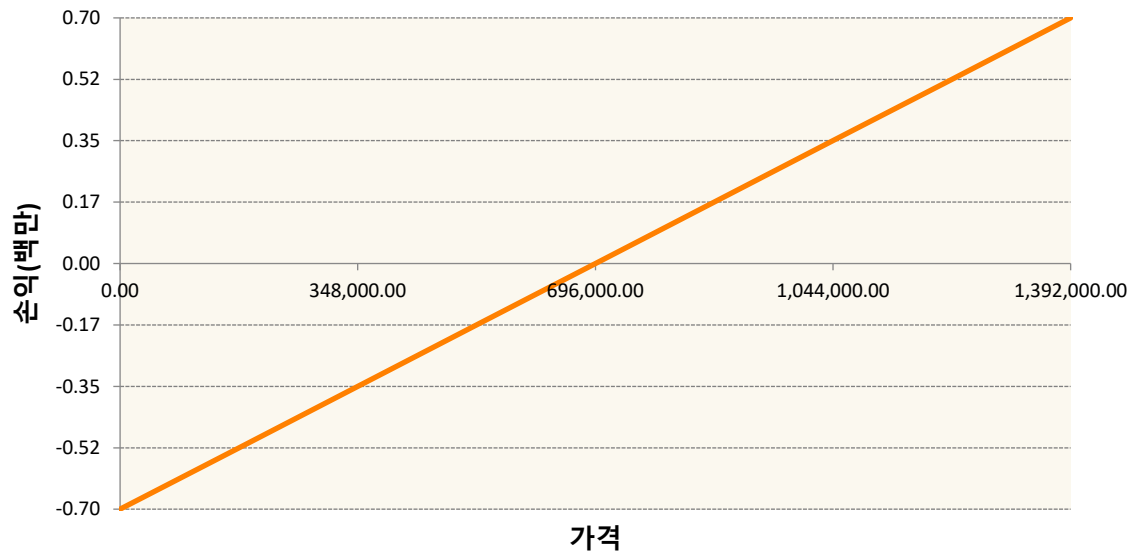
2. 만기시점의 손익구조



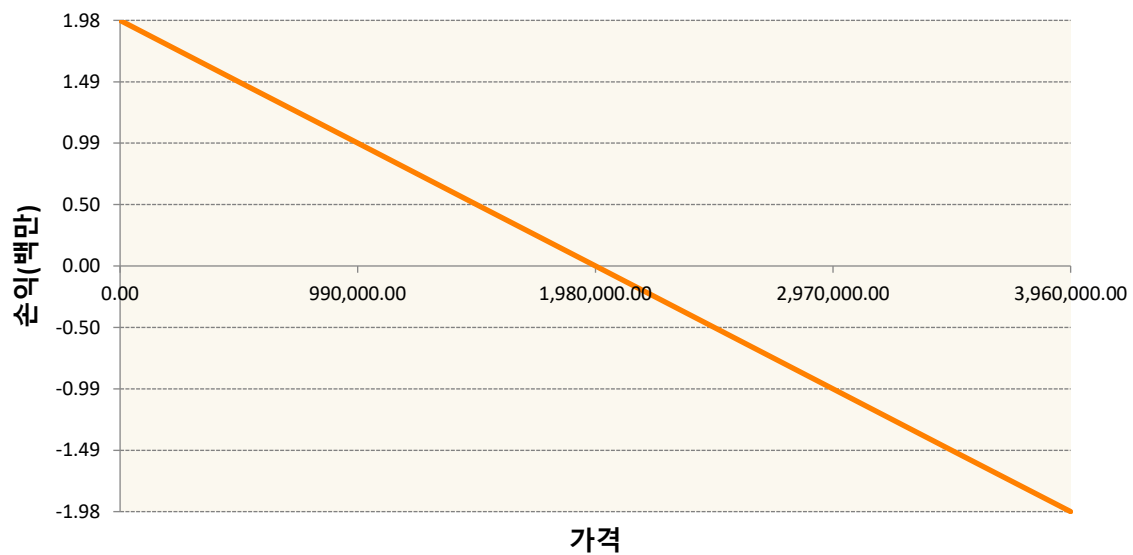
KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



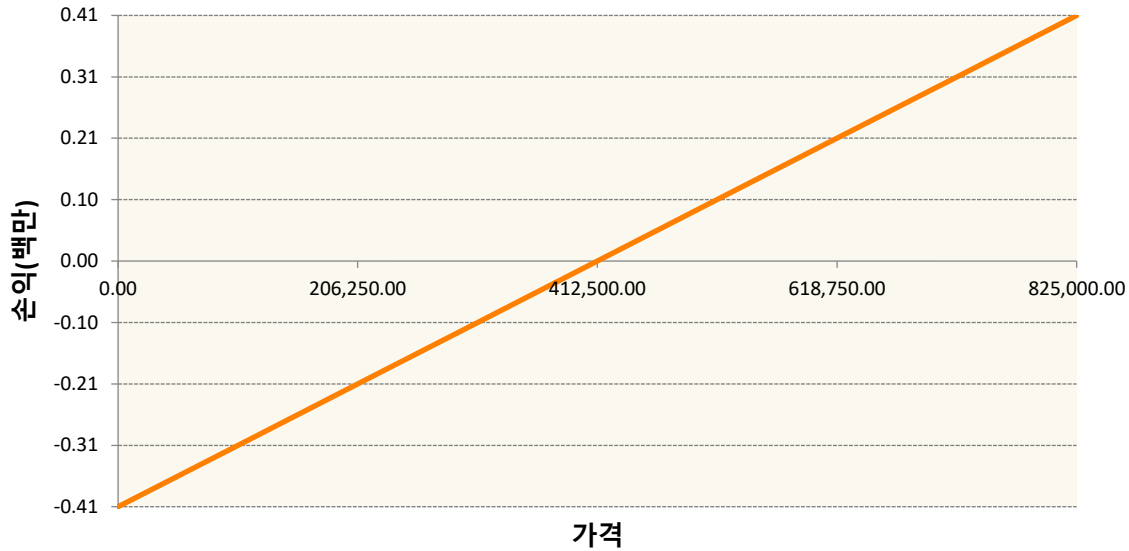
KR4A16660008-2026-06 현대차개별선물



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



KR4ABD660008-2026-06 삼성생명개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								208
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208	-208
-5.33%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	69	69	69	69	69	69	69	69
5.33%	138	138	138	138	138	138	138	138
8.00%	208	208	208	208	208	208	208	208
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	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10	10
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	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	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)

743

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

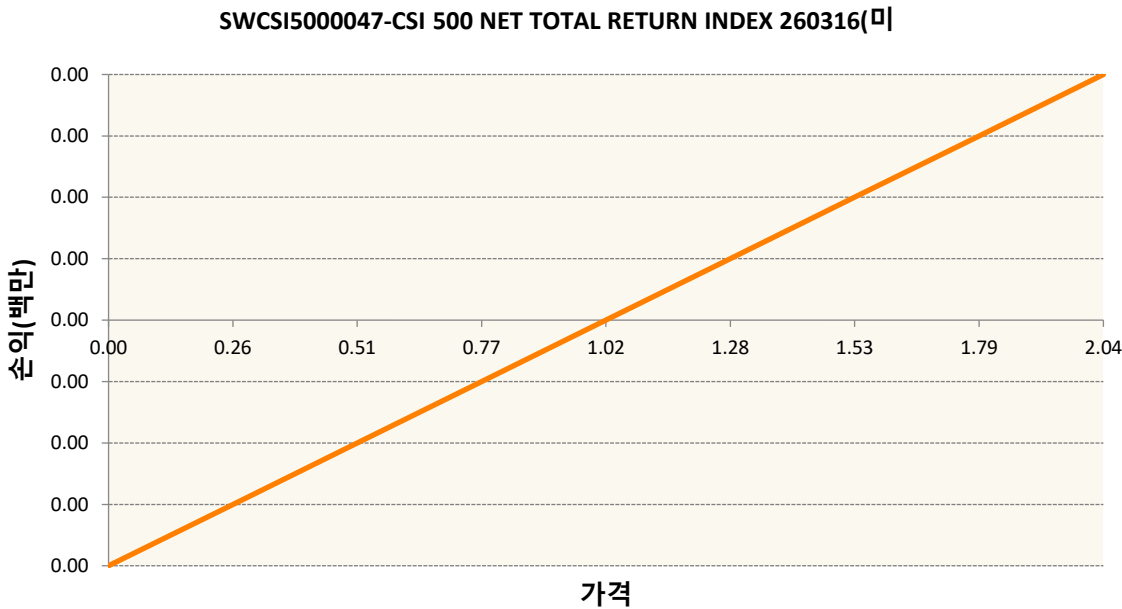
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

460

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

588

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

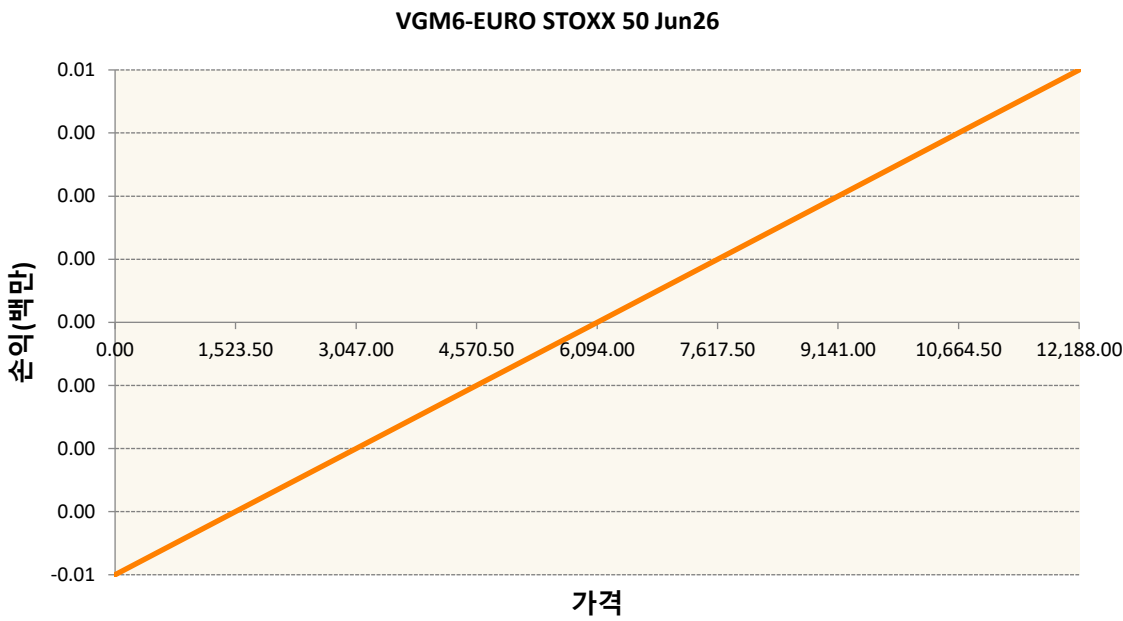
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	942	0	942	

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	2026-06-08
기준일	2026-06-05

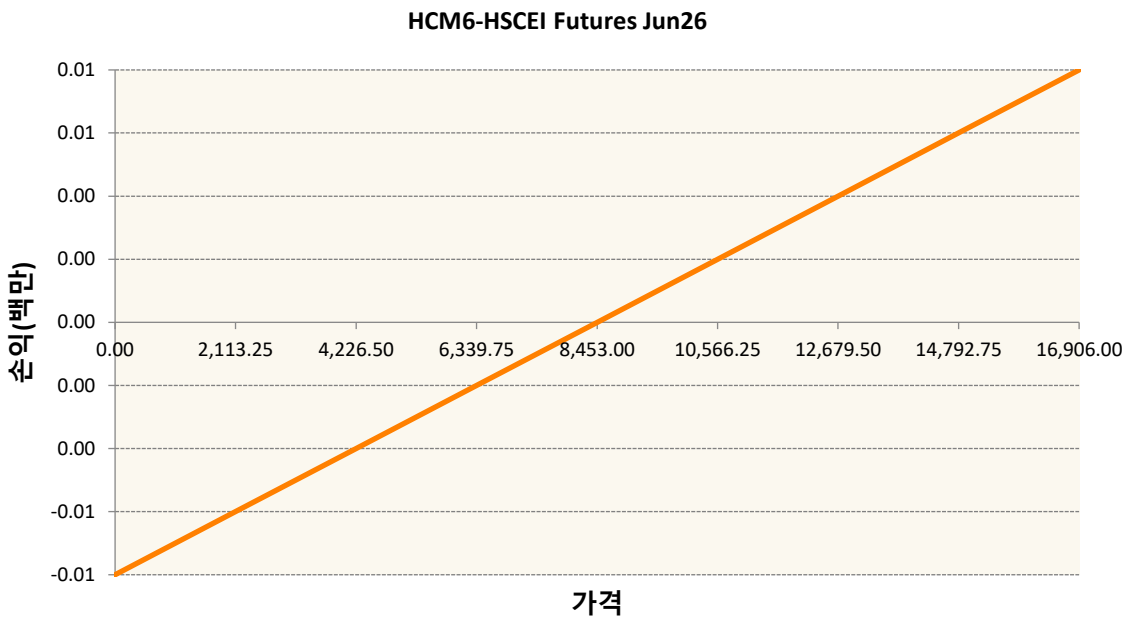
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,379	0	1,379	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	HSCEI Futures Jun26	110
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

133

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

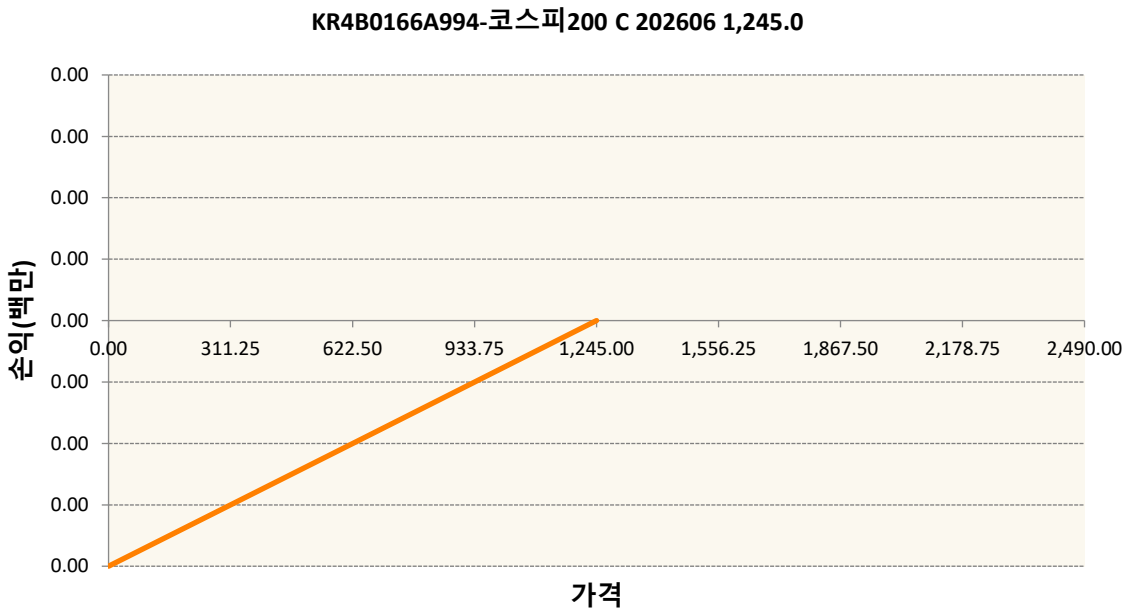
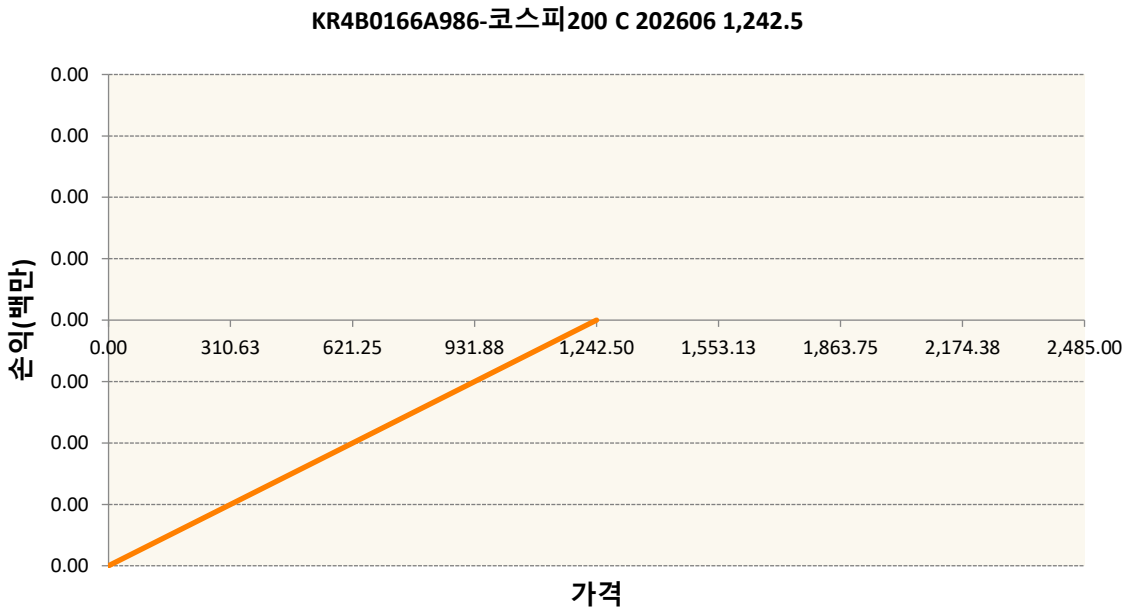
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

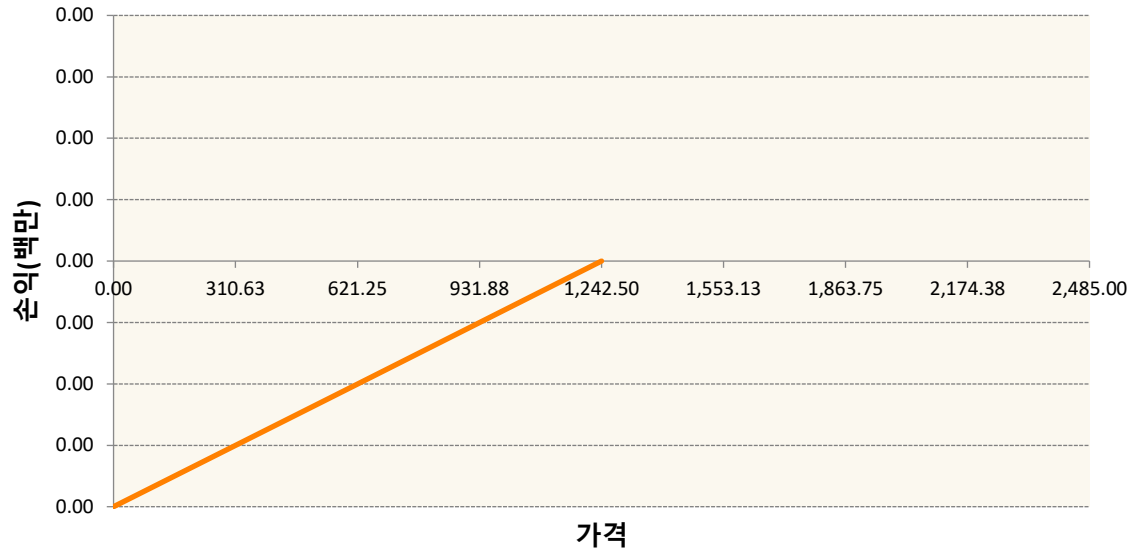
(단위:백만원)

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							622
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-386	-423	-462	-501	-541	-581	-622
-5.33%	-168	-211	-253	-296	-339	-382	-425
-2.67%	0	-43	-87	-130	-173	-217	-260
0%	119	80	40	0	-41	-82	-124
2.67%	197	166	132	97	61	23	-15
5.33%	245	222	196	167	136	104	70
8.00%	272	256	237	215	191	164	135
KR4B0166A994 코스피200 C 202606 1,245.0							737
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-462	-506	-551	-596	-643	-689	-737
-5.33%	-203	-253	-303	-353	-404	-454	-504
-2.67%	-3	-54	-104	-155	-206	-257	-308
0%	140	95	48	0	-48	-97	-146
2.67%	235	198	158	117	73	29	-17
5.33%	294	266	235	201	164	125	85
8.00%	327	308	285	259	230	198	163
KR4C0166A984 코스피200 P 202606 1,242.5							379
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-235	-258	-282	-306	-330	-354	-379
-5.33%	-102	-128	-155	-181	-207	-233	-259
-2.67%	0	-27	-53	-79	-106	-132	-159
0%	72	49	25	0	-25	-50	-76

2.67%	120	101	81	59	37	14	-9
5.33%	149	135	119	102	83	63	43
8.00%	166	156	145	131	116	100	82

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

(단위:백만원)

2,329

공시일 2026-06-08

기준일 2026-06-05

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	2026-06-08
기준일	2026-06-05

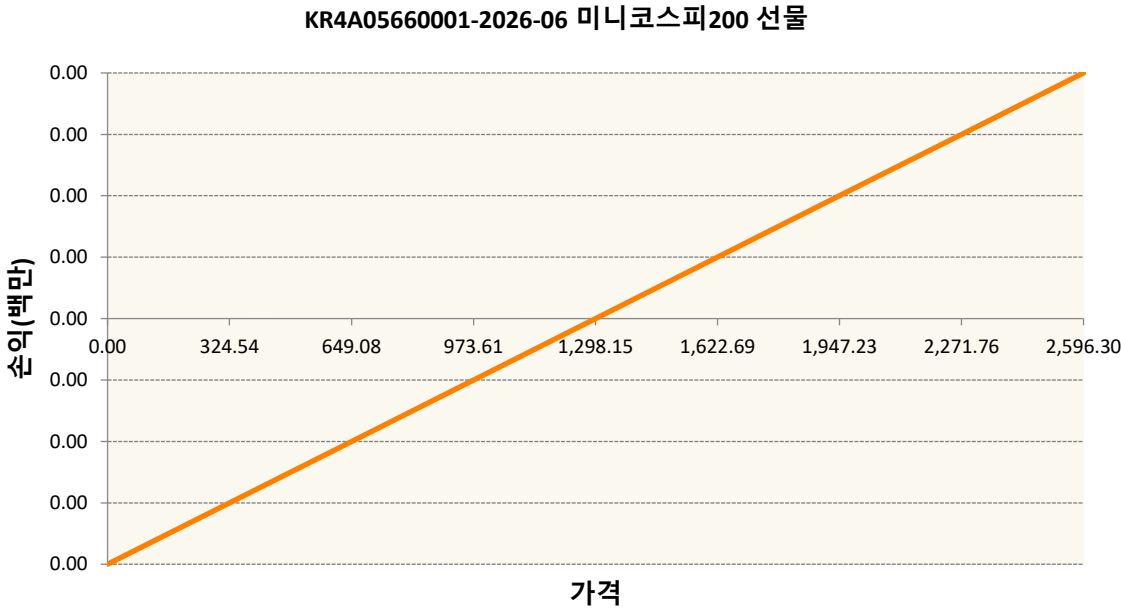
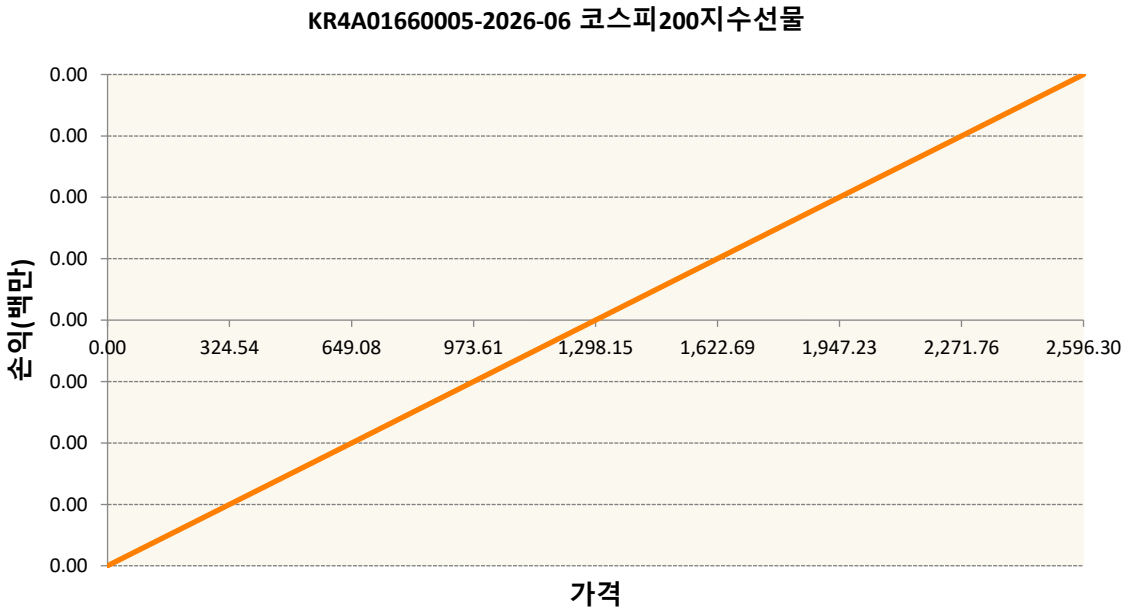
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

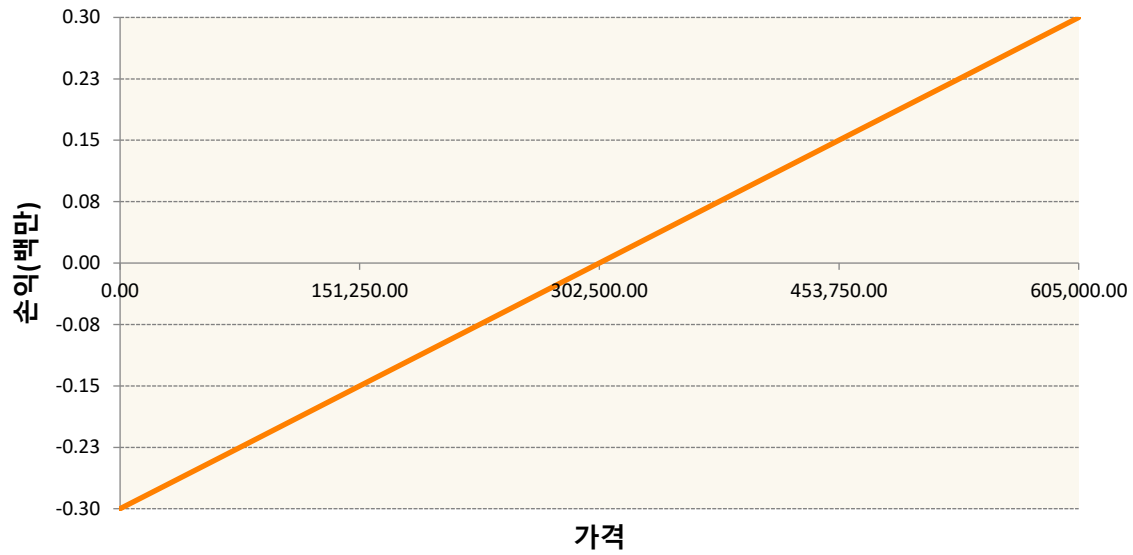
(단위:백만원)

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	2,142	0	2,142	장내
누계	유가증권	스왑	0	79	-79	장외

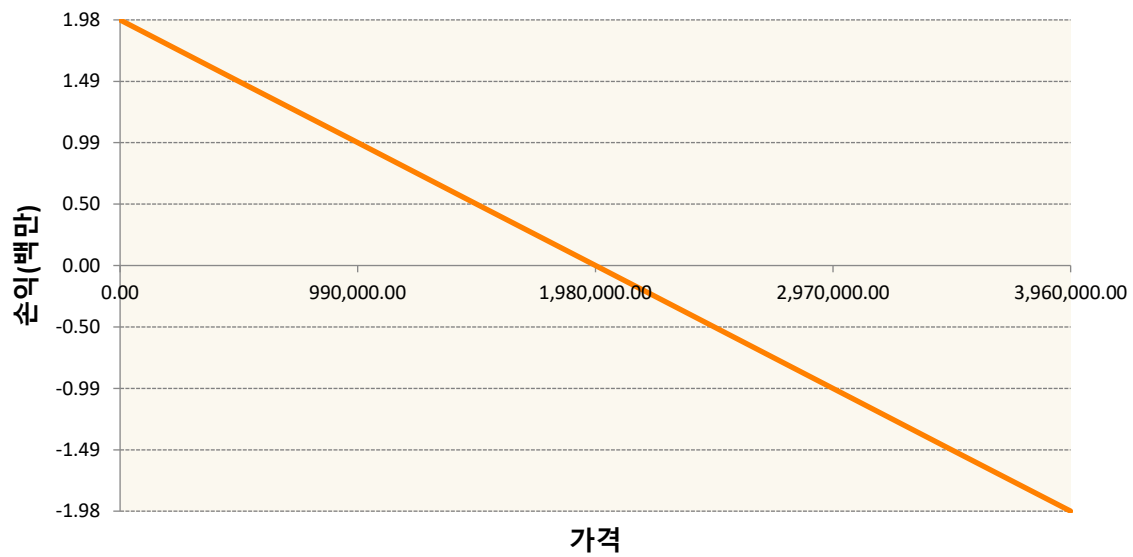
2. 만기시점의 손익구조



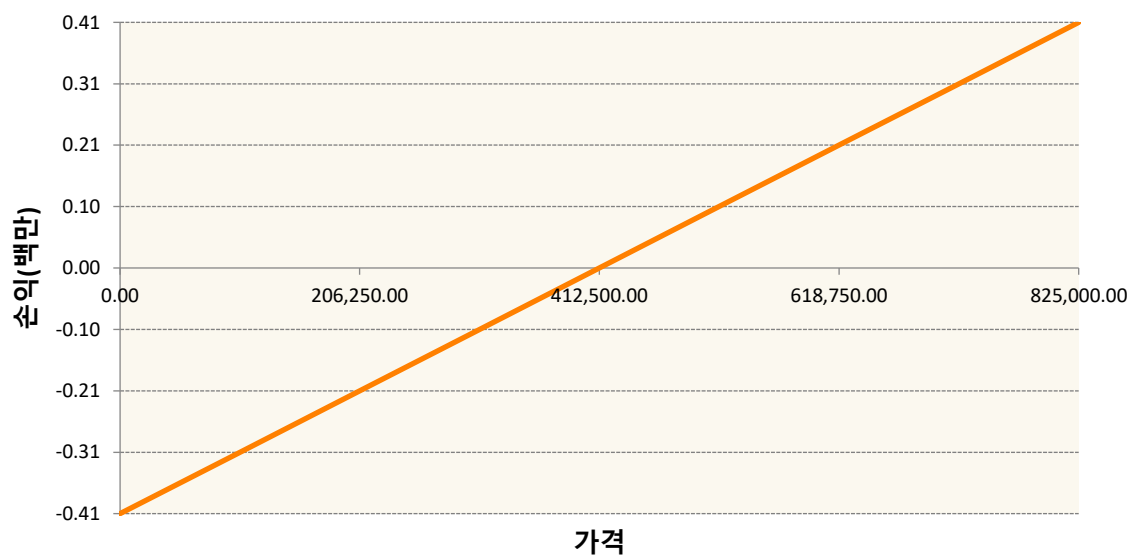
KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



KR4ABD660008-2026-06 삼성생명개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01660005 2026-06 코스피200지수선물								104
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
-5.33%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	35	35	35	35	35	35	35	35
5.33%	69	69	69	69	69	69	69	69
8.00%	104	104	104	104	104	104	104	104
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	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10	10
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	-1
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	1	1	1	1	1	1	1	1
KR4ABD660008 2026-06 삼성생명개별선물								15
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	5	5	5	5	5	5	5	5
5.33%	10	10	10	10	10	10	10	10
8.00%	15	15	15	15	15	15	15	15

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

(단위:백만원)

274

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

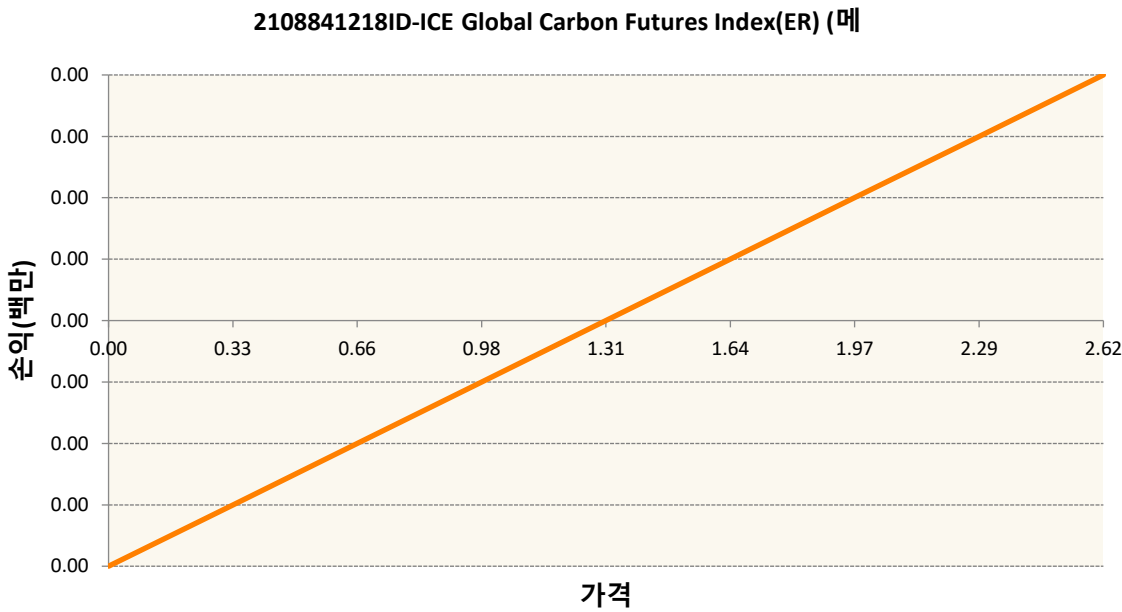
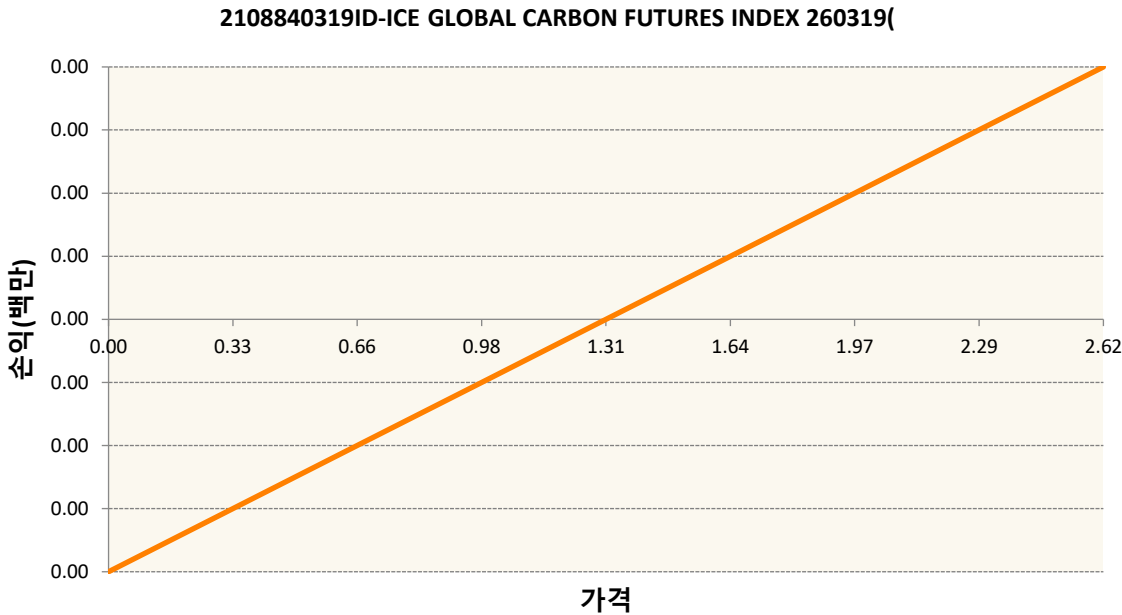
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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(		481
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		121

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	692

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

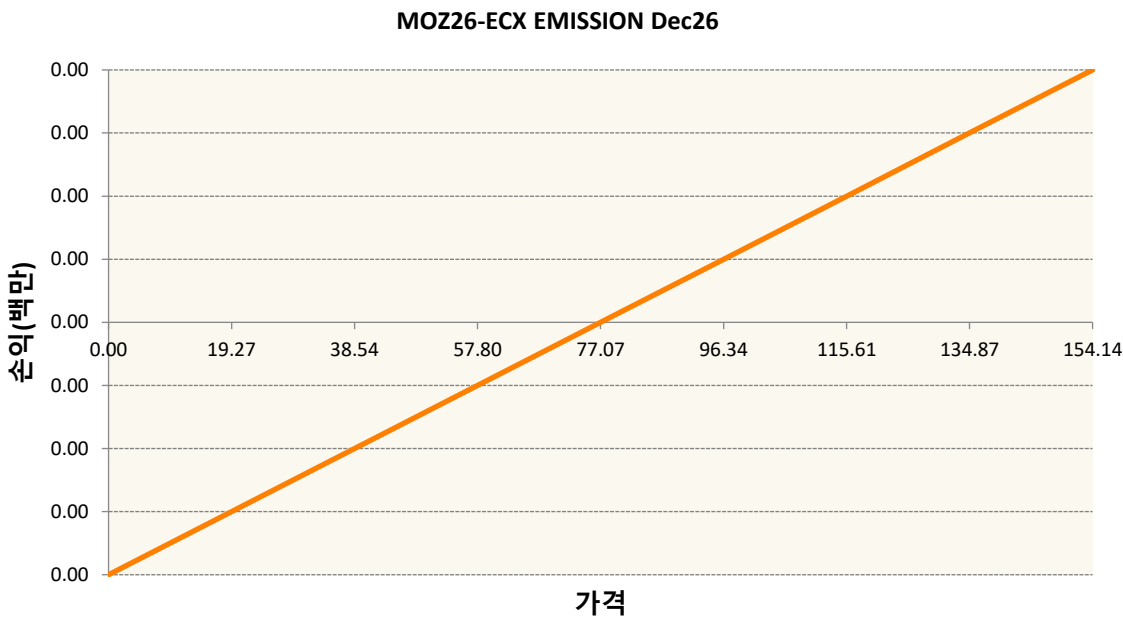
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			4,961	0	4,961	
누계	통화	선도	0	2,690	-2,690	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	215
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	397

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

(단위:백만원)

682

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

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	1,925	0	1,925	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	2
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	1
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	3
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	1

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

(단위:백만원)

10

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

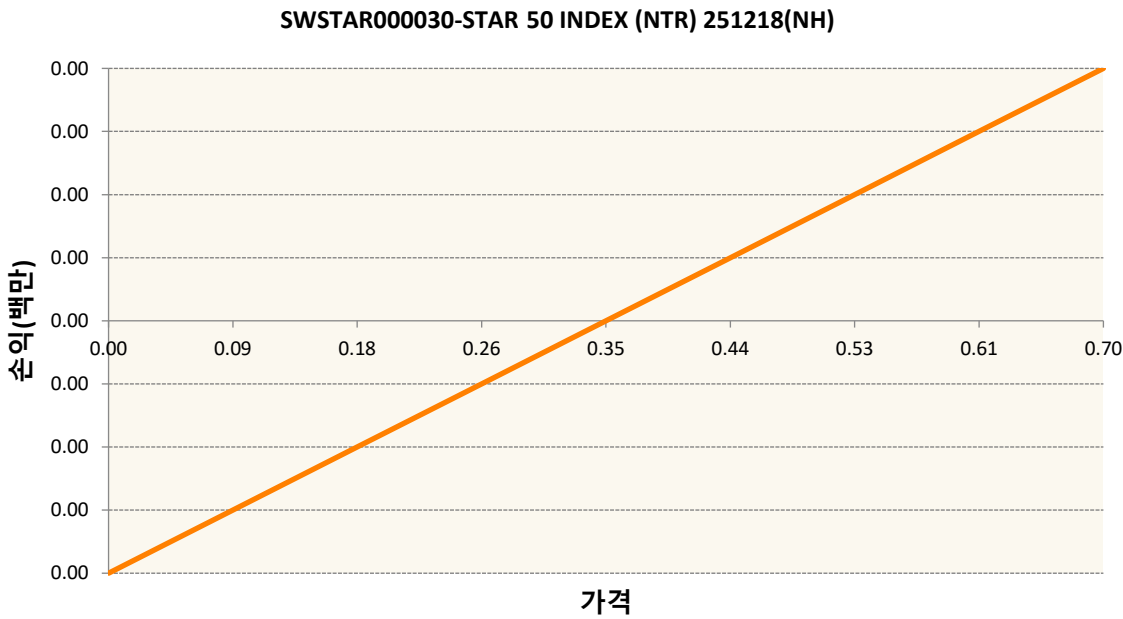
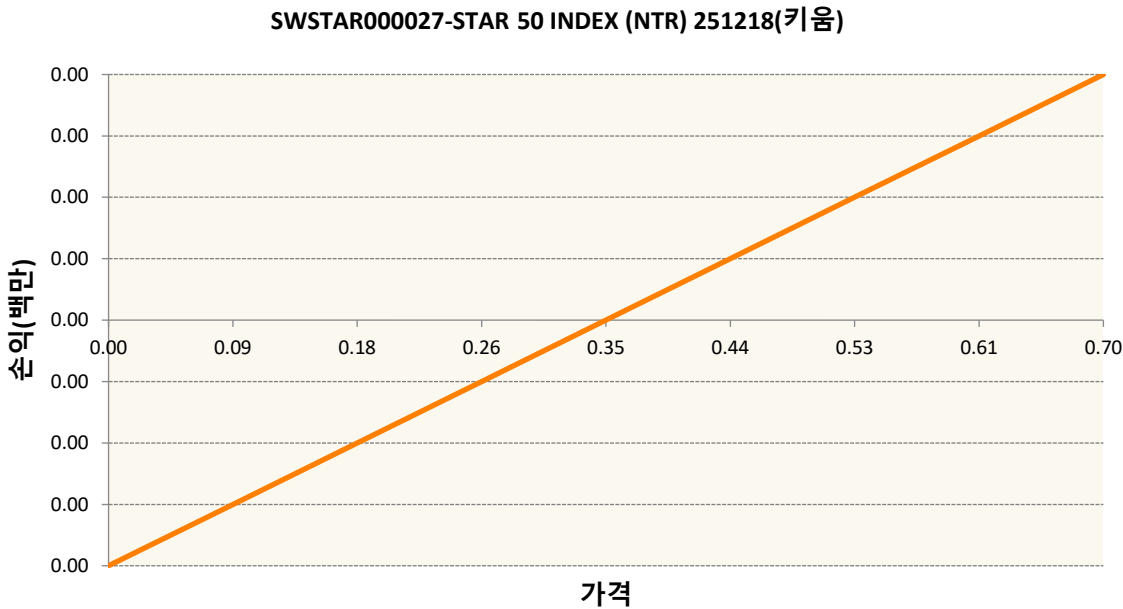
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

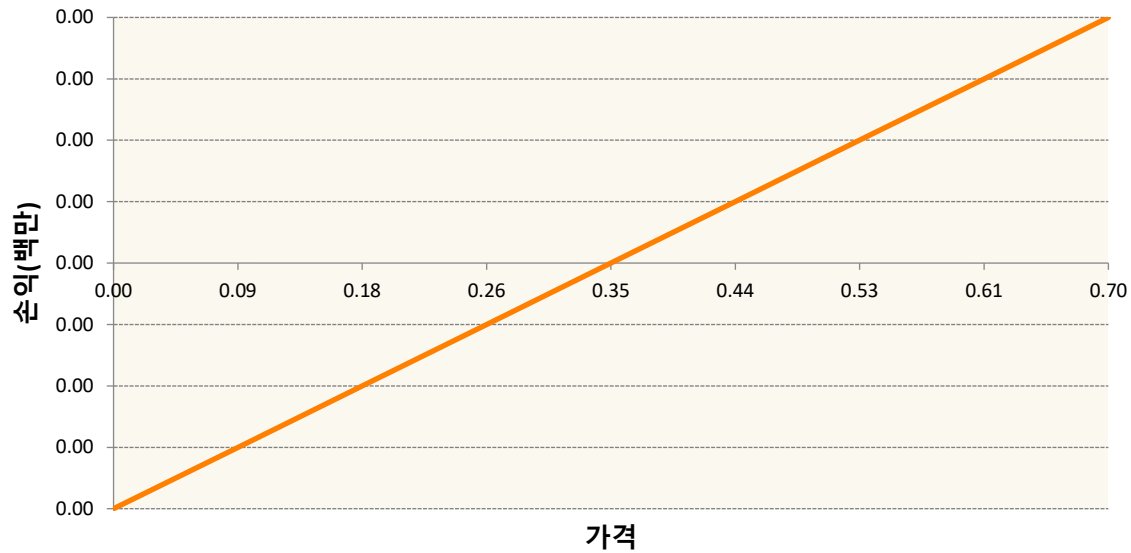
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8,853	0	8,853	장외

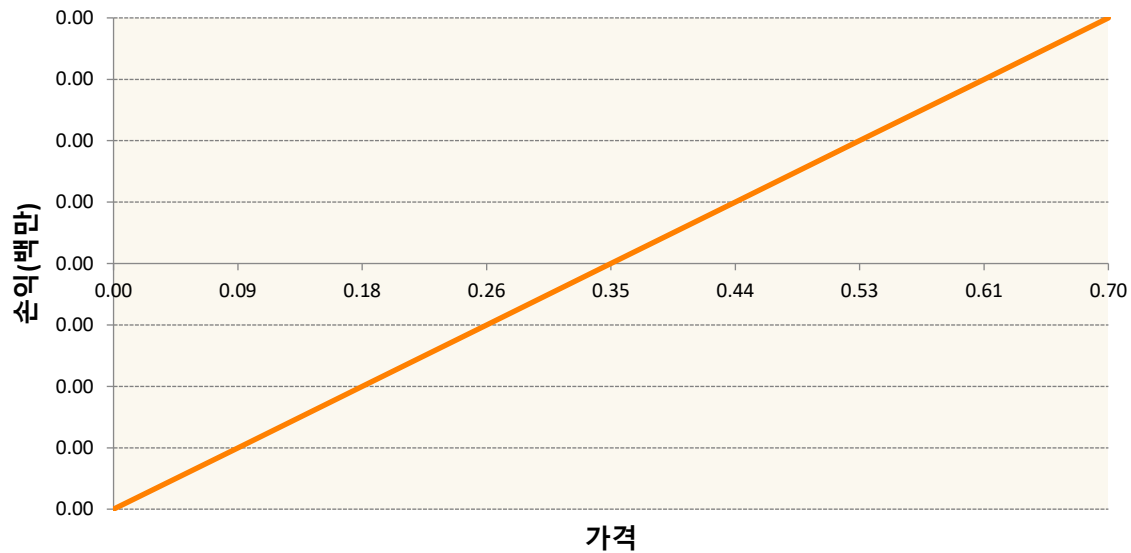
2. 만기시점의 손익구조



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



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)	25
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	84
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	430
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	160

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

(단위:백만원)

1,094

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

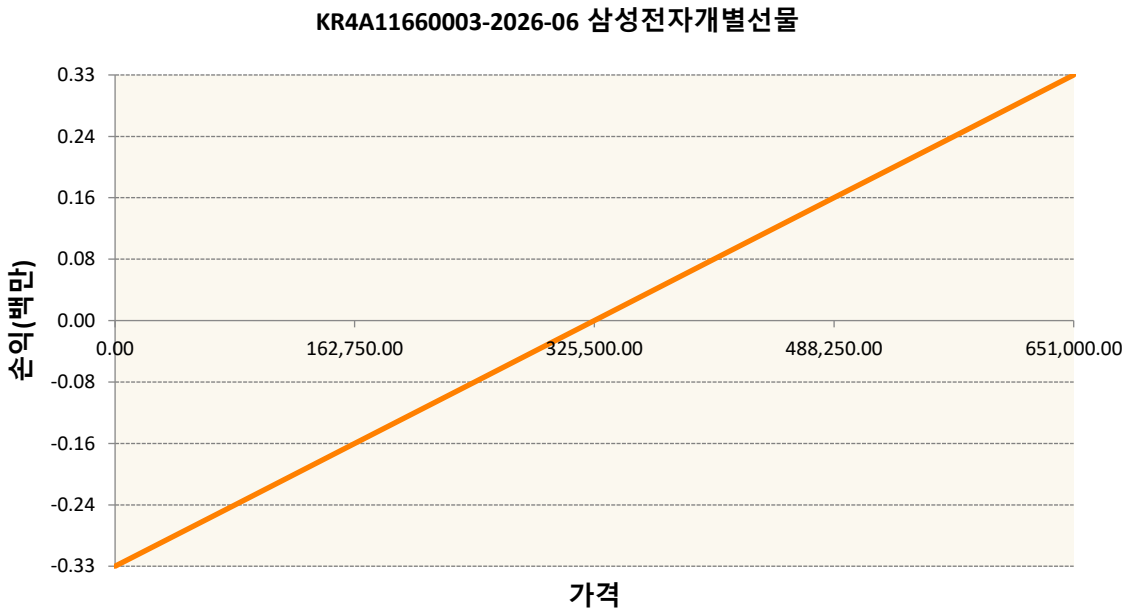
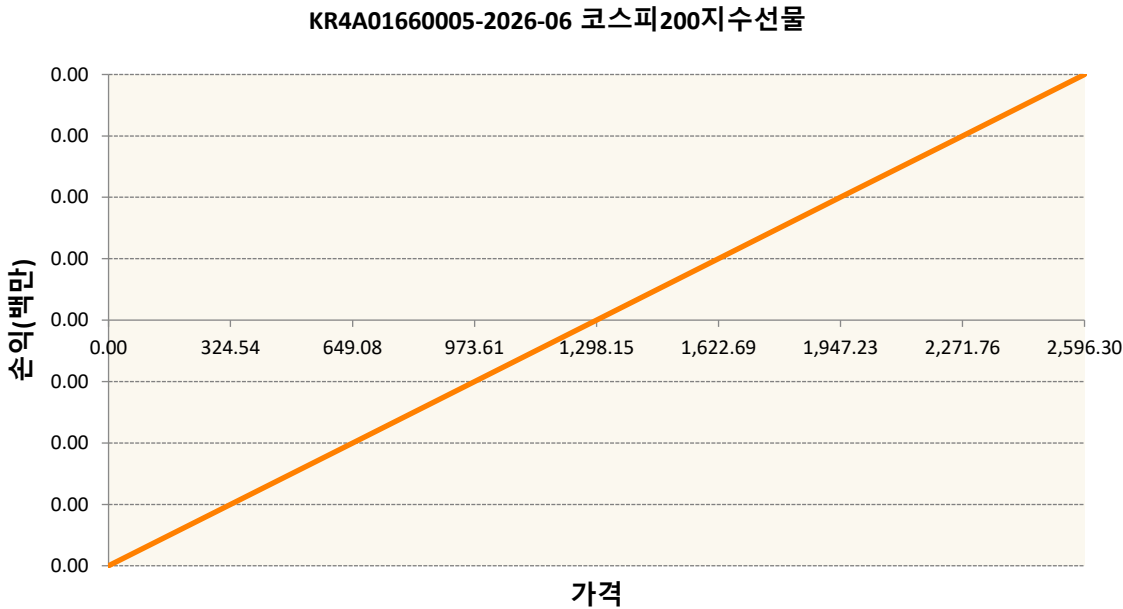
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

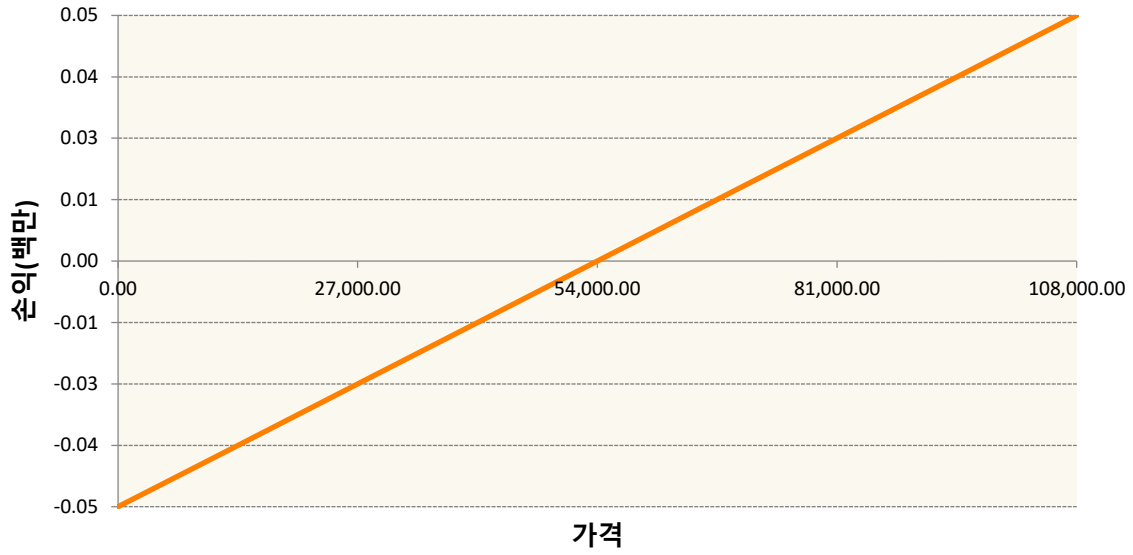
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,471	2,300	170	장내
누계	유가증권	선물	23,257	2,859	20,398	장내

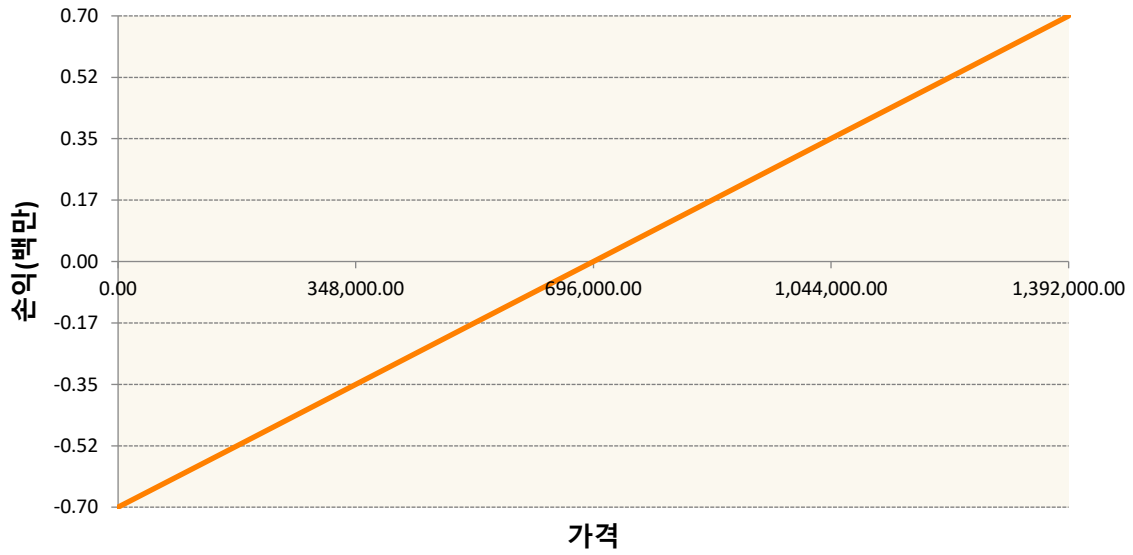
2. 만기시점의 손익구조



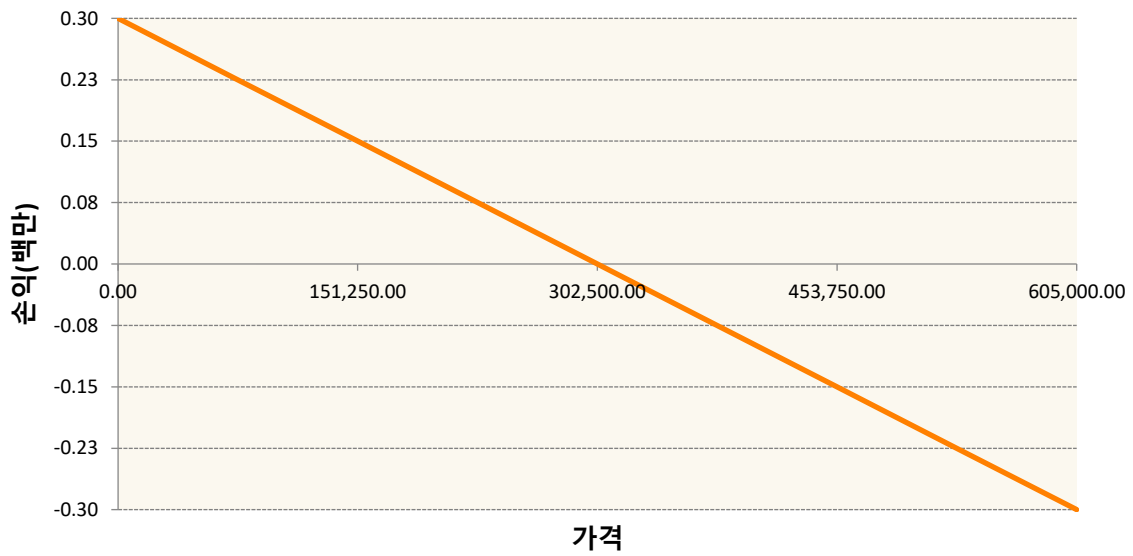
KR4A14660000-2026-06 KT개별선물



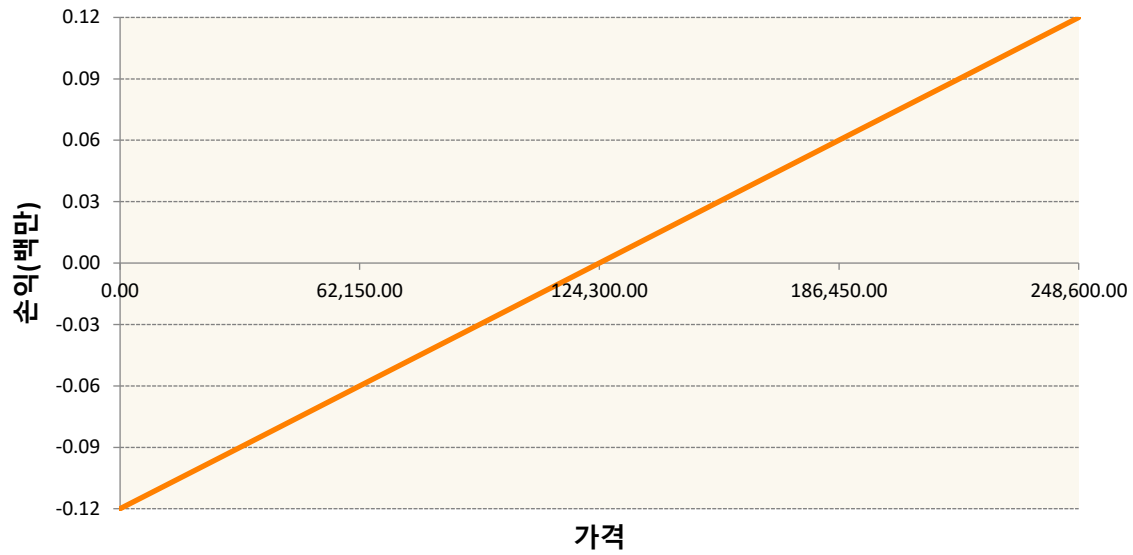
KR4A16660008-2026-06 현대차개별선물



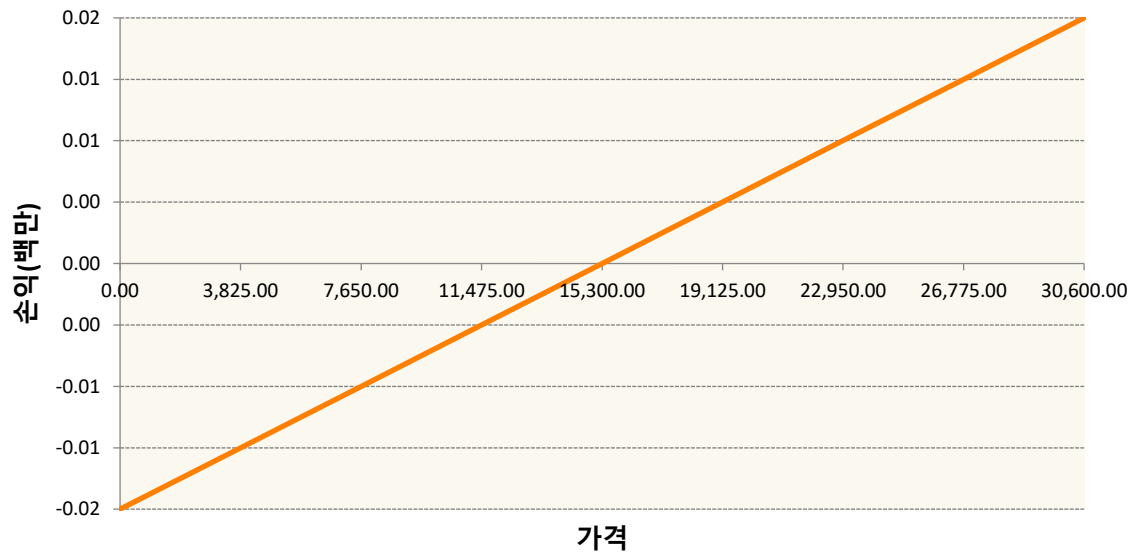
KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



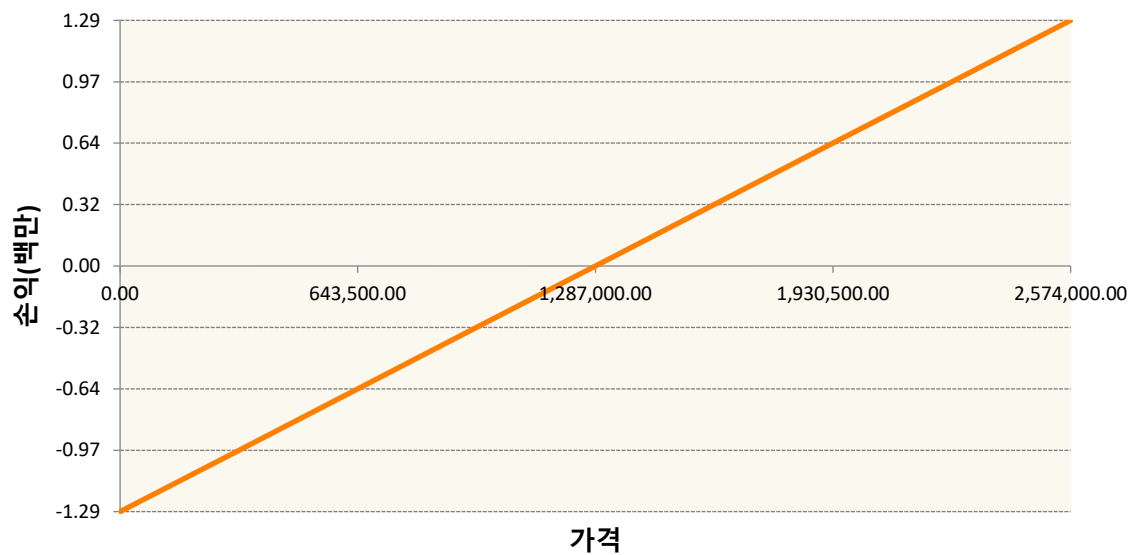
KR4A34660006-2026-06 LG개별선물



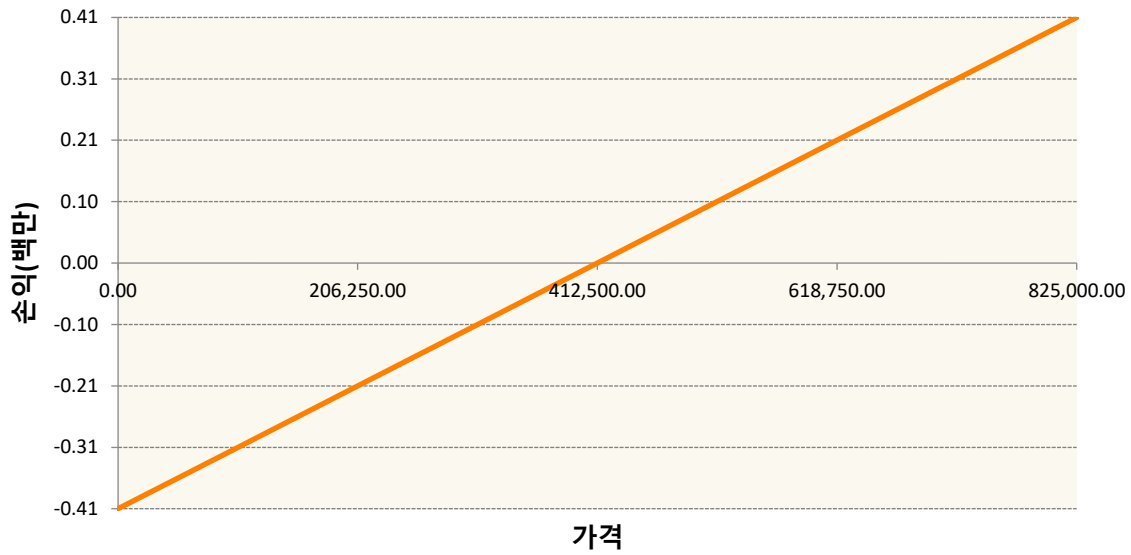
KR4AB0660004-2026-06 LG유플러스개별선물



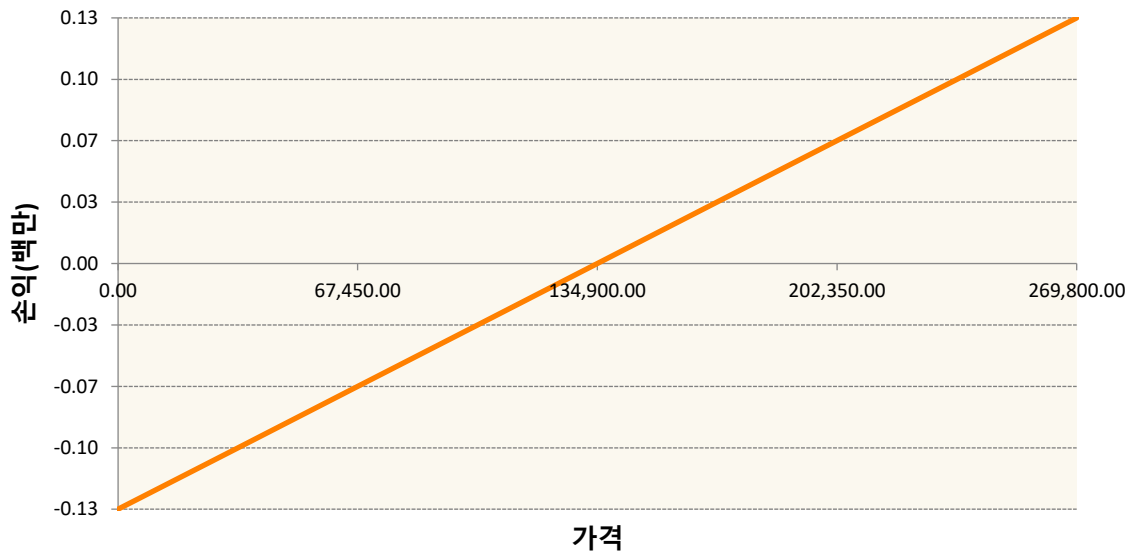
KR4AB3660001-2026-06 고려아연개별선물



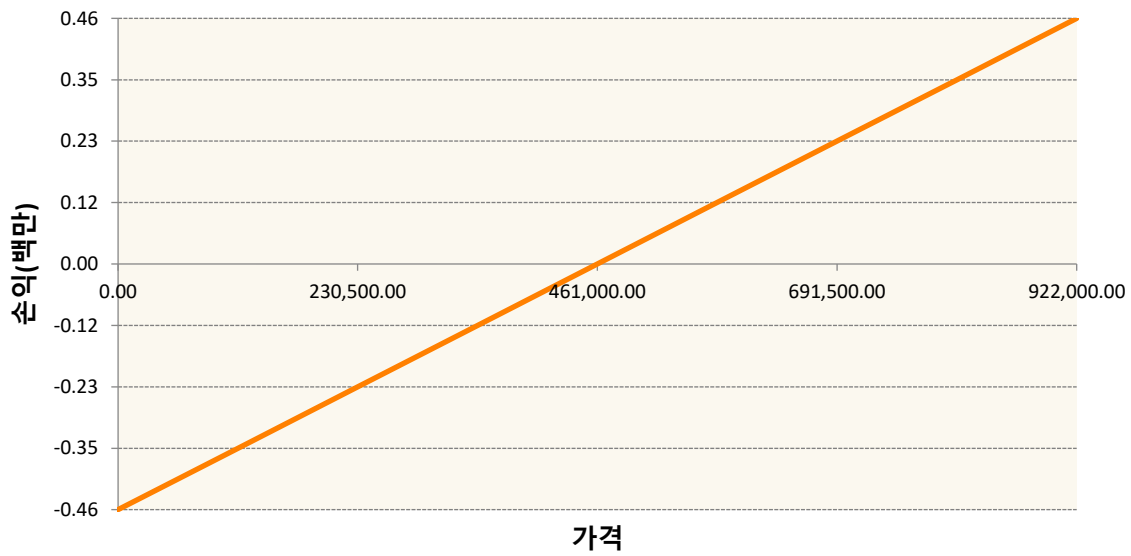
KR4ABD660008-2026-06 삼성생명개별선물



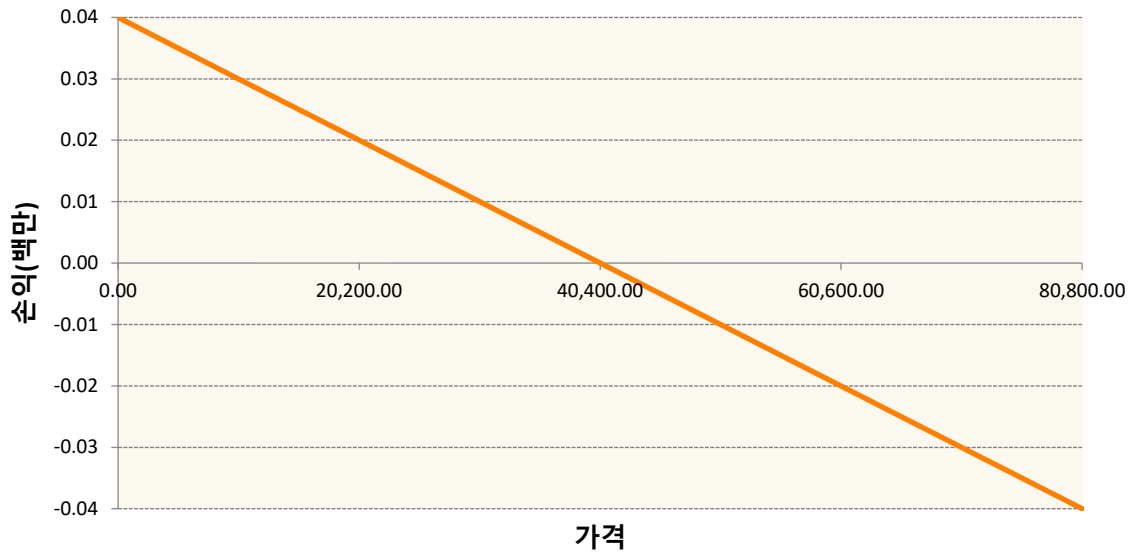
KR4ABM660007-2026-06 한국항공우주개별선물



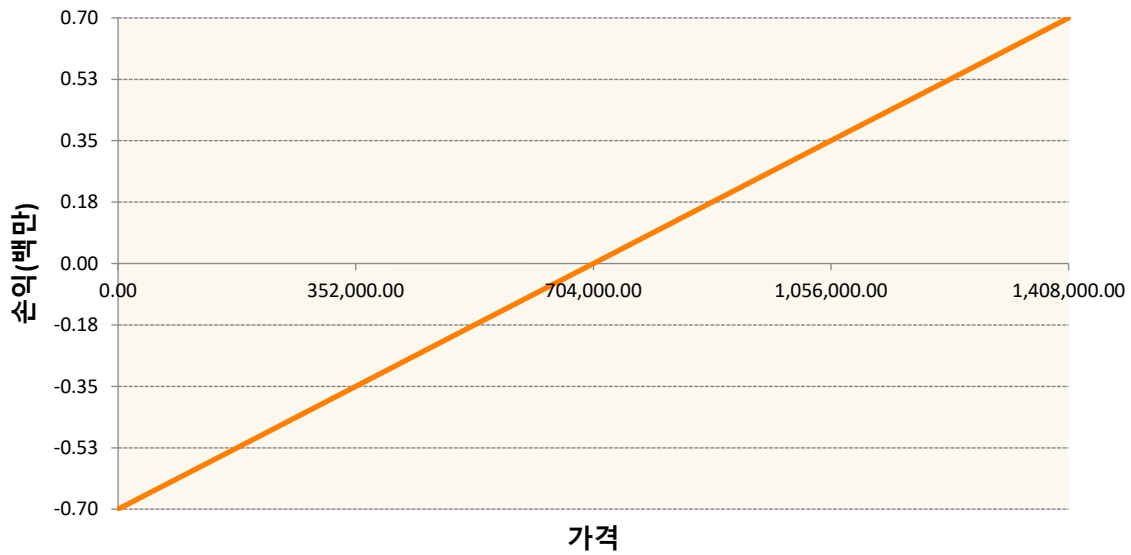
KR4AC8660004-2026-06 삼성물산개별선물



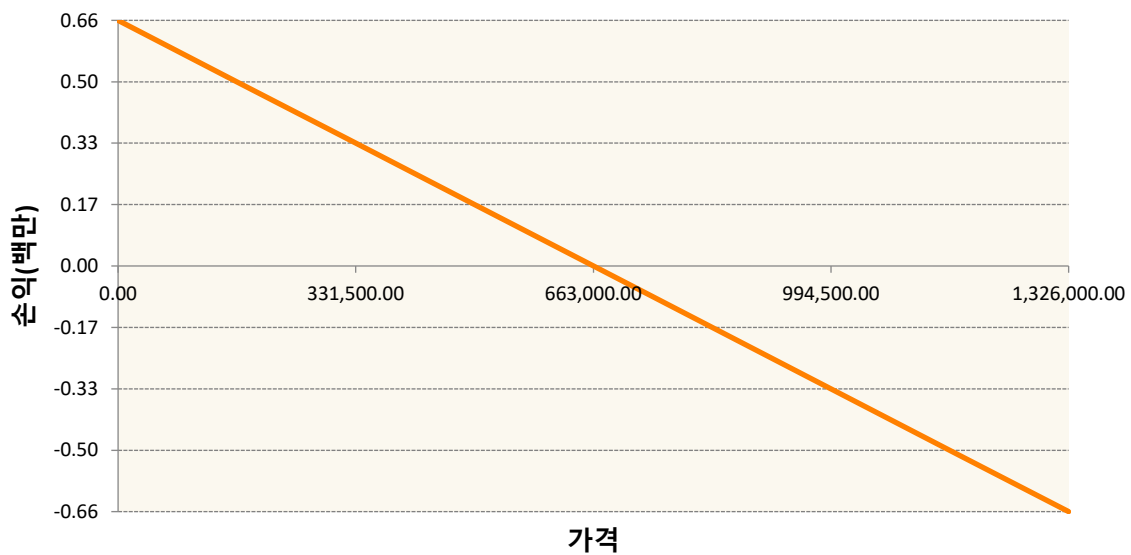
KR4ACF660005-2026-06 카카오개별선물



KR4ACT660009-2026-06 삼성화재개별선물



KR4ADD660006-2026-06 신세계개별선물



The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 285,000.00 with major ticks every 71,250.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -0.14 to 0.14 with major ticks every 0.03. A solid orange line represents the profit function, starting at (0, 0.14) and ending at (285,000, -0.14). The line crosses the x-axis at 142,500.00, indicating the break-even point.

가격 (Price)	이익 (Profit)
0.00	0.14
71,250.00	0.07
142,500.00	0.00
213,750.00	-0.07
285,000.00	-0.14

가격 (Price)	손익 (백만) (Profit/Loss in millions)
0.00	-0.02
5,575.00	-0.015
11,150.00	-0.01
16,725.00	-0.005
22,300.00	0.00
27,875.00	0.005
33,450.00	0.01
39,025.00	0.015
44,600.00	0.02

(단위:백만원)

KR4A01660005				2026-06 코스피200지수선물			908
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-908	-908	-908	-908	-908	-908	-908
-5.33%	-605	-605	-605	-605	-605	-605	-605
-2.67%	-303	-303	-303	-303	-303	-303	-303
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	303	303	303	303	303	303	303
5.33%	605	605	605	605	605	605	605
8.00%	908	908	908	908	908	908	908
KR4A11660003				2026-06 삼성전자개별선물			371
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-371	-371	-371	-371	-371	-371	-371
-5.33%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247
-2.67%	-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	124	124	124	124	124	124	124
5.33%	247	247	247	247	247	247	247
8.00%	371	371	371	371	371	371	371

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

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 76

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	76	76	76	76	76	76	76
-5.33%	50	50	50	50	50	50	50
-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%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76

KR4A34660006 2026-06 LG개별선물 67

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-5.33%	-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%	64	64	64	64	64	64	64

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%	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%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103

KR4ACT660009 2026-06 삼성화재개별선물 43

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-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%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	43	43	43	43	43	43	43

KR4ADD660006 2026-06 신세계개별선물 30

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	30	30	30	30	30	30	30
-5.33%	20	20	20	20	20	20	20
-2.67%	10	10	10	10	10	10	10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
5.33%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30

KR4AEJ660009 2026-06 SKC개별선물 20

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

2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
KR4AFT660006 2026-06 대우건설개별선물							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	10	10	10	10	10	10	10
5.33%	21	21	21	21	21	21	21
8.00%	31	31	31	31	31	31	31

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,307

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

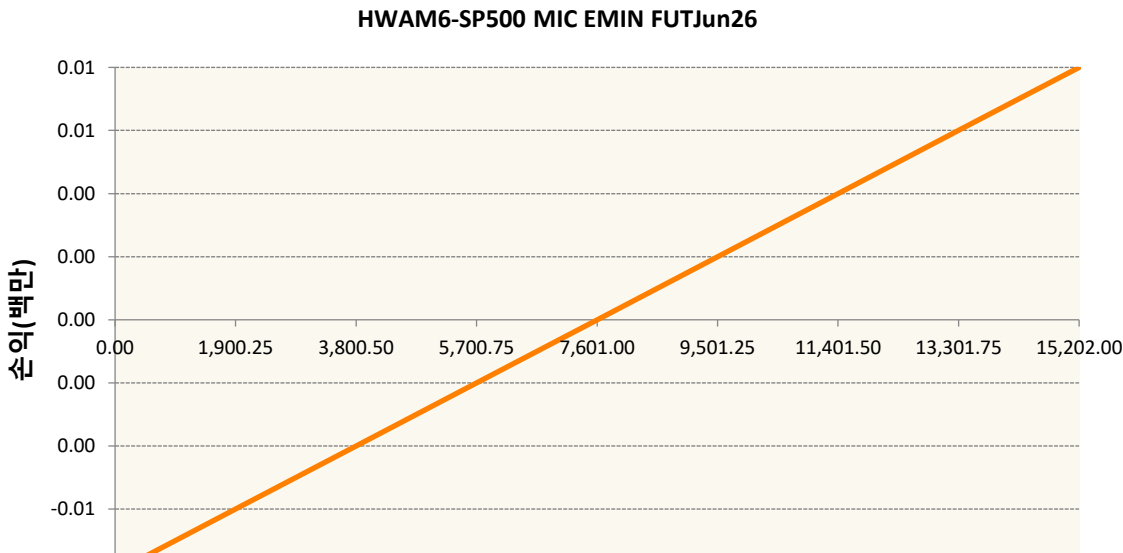
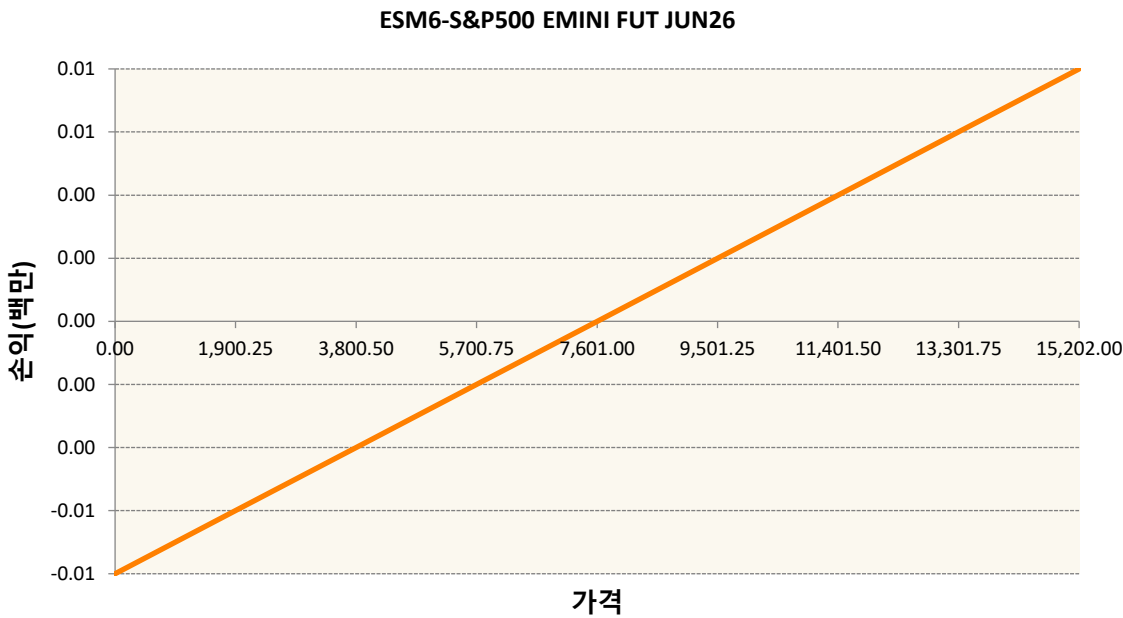
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

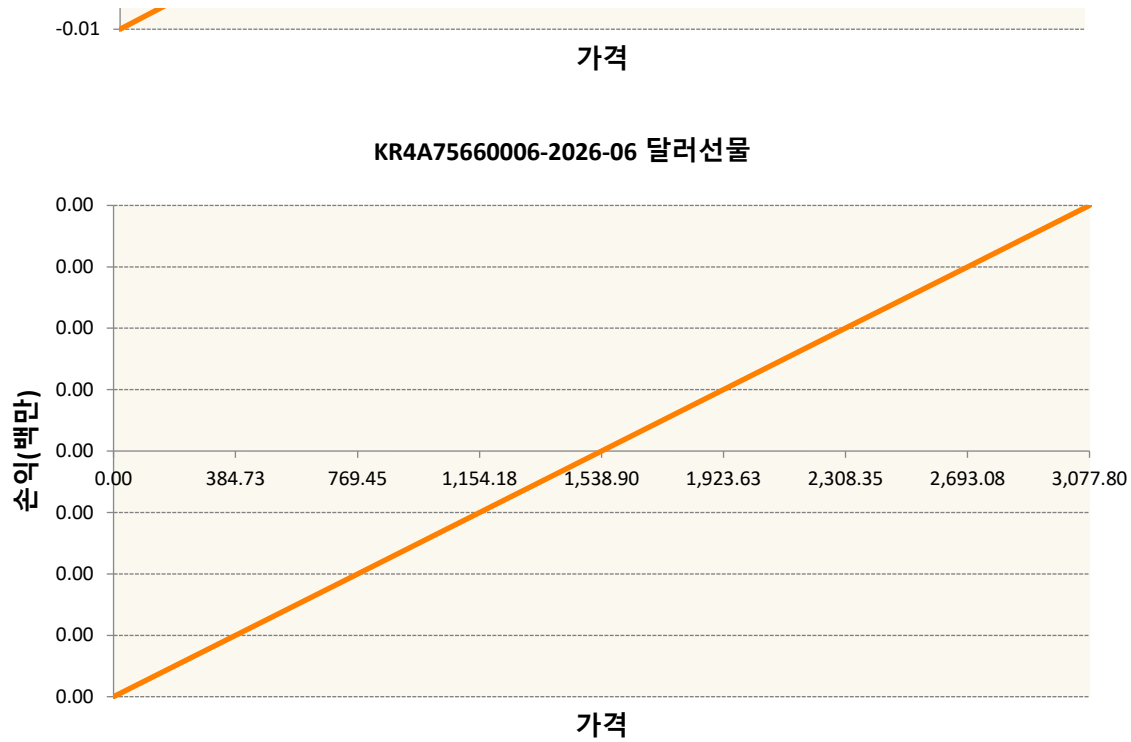
1. 계약금액

(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	61,692	0	61,692	
누계	지수	선물	284	0	284	장내
누계	통화	선물	10,926	0	10,926	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,935
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	23
KR4A756600 2026-06 달러선물		874

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

(단위:백만원)

4,226

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

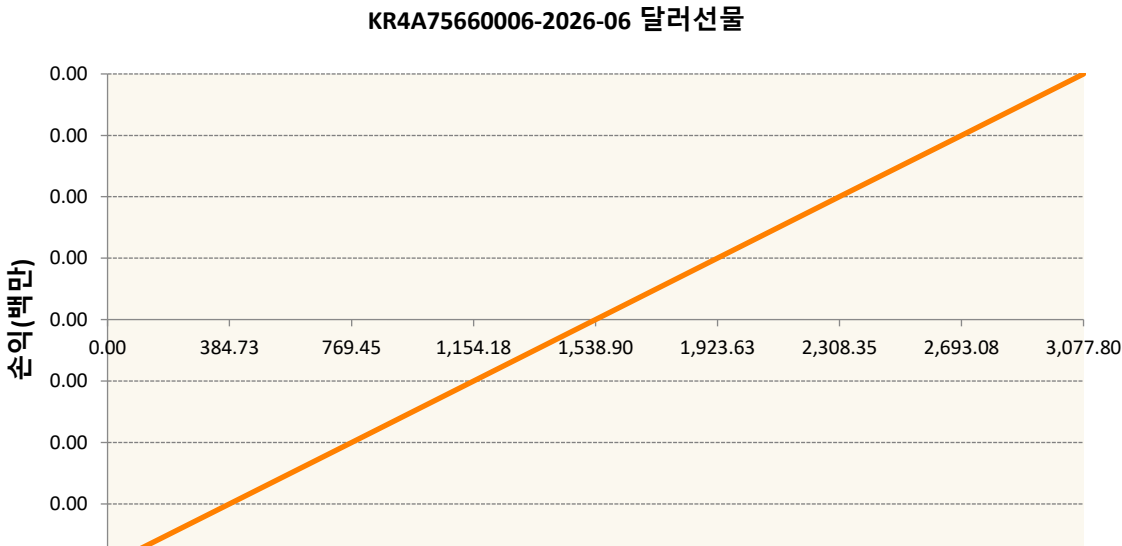
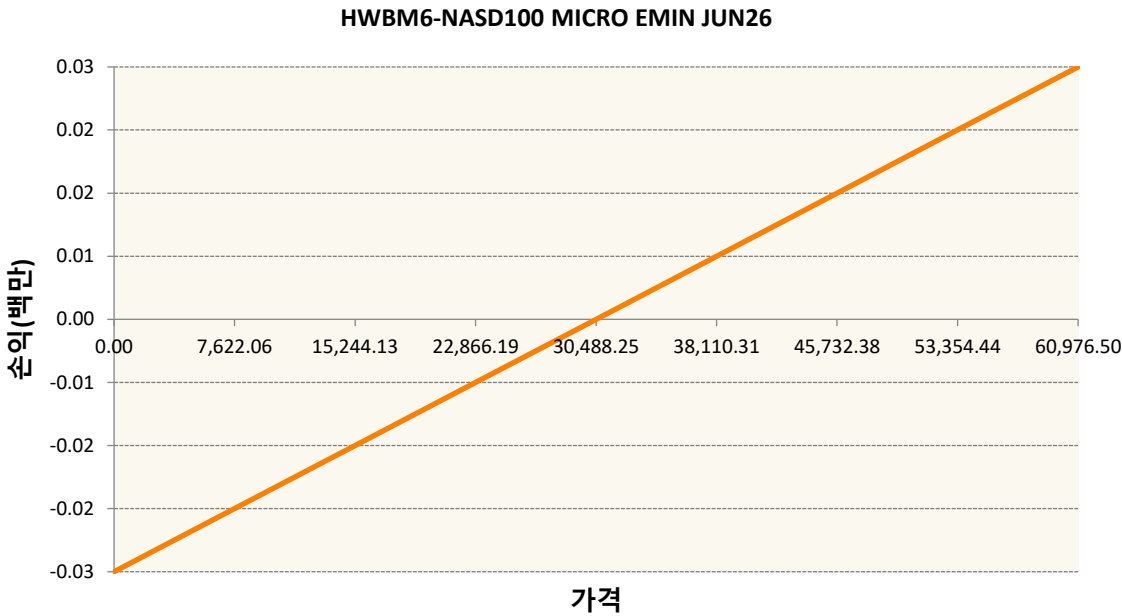
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

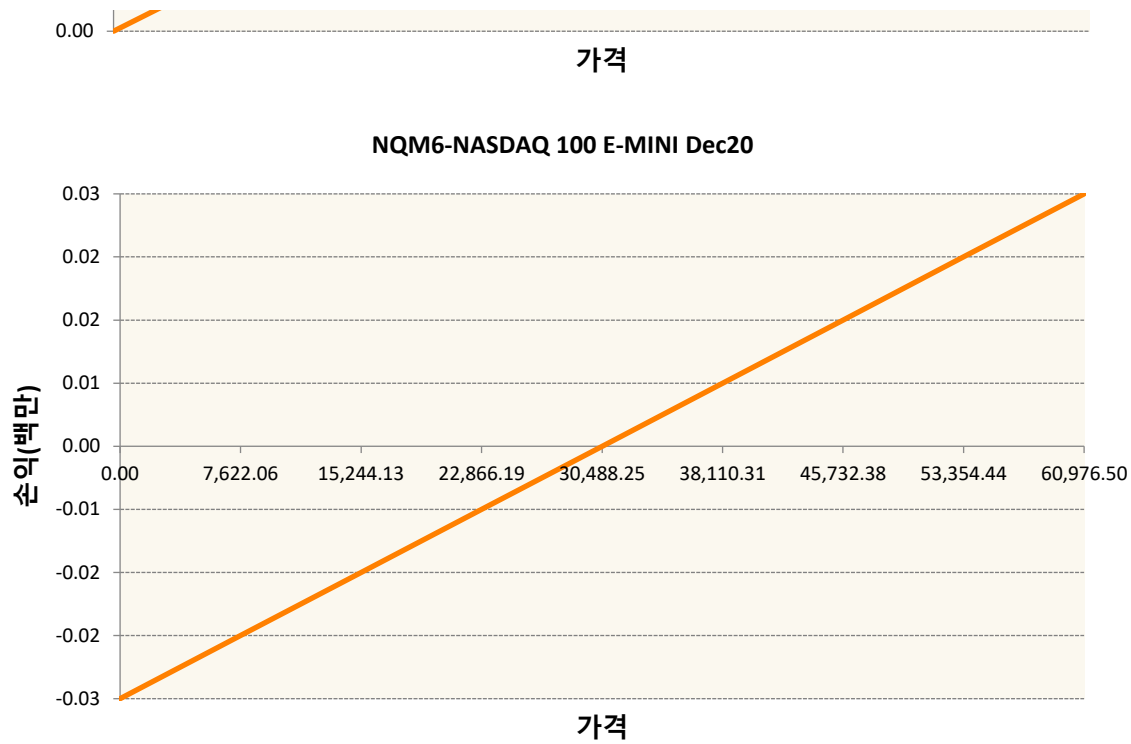
1. 계약금액

(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	31,182	0	31,182	
누계	유가증권	선물	267	0	267	장내
누계	통화	선물	4,017	0	4,017	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	21
KR4A756600	2026-06 달러선물	321
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,495

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

2,726

공시일	2026-06-08
기준일	2026-06-05

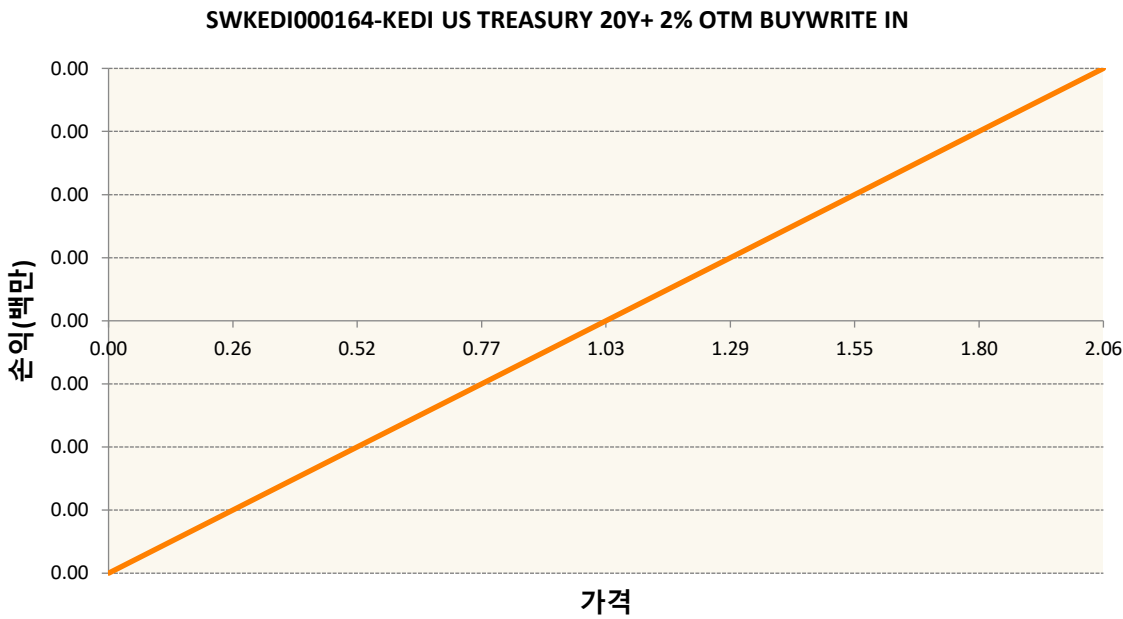
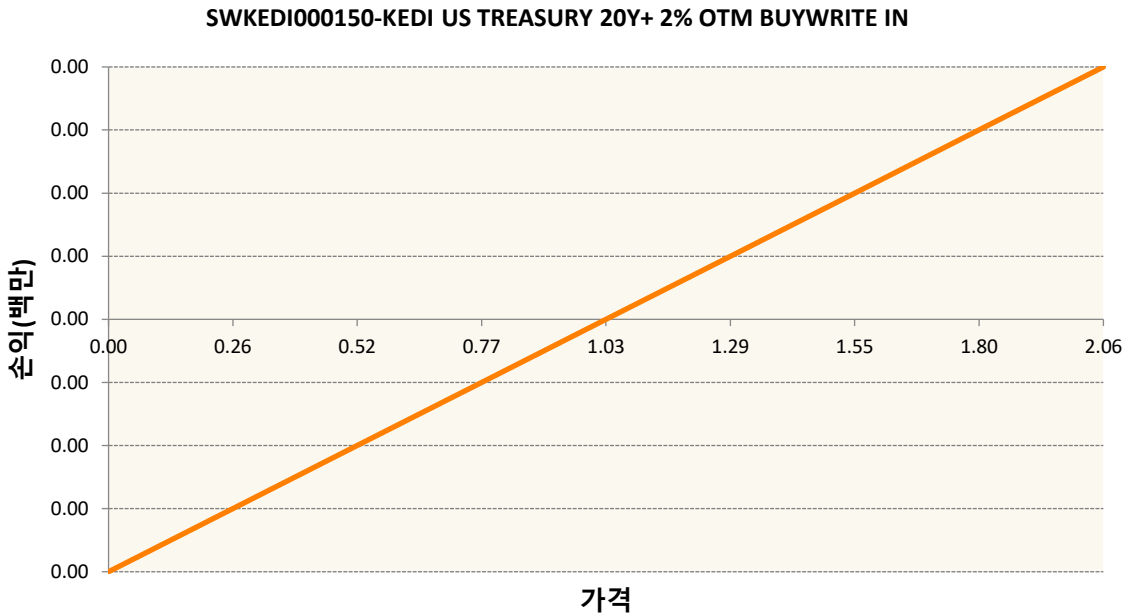
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

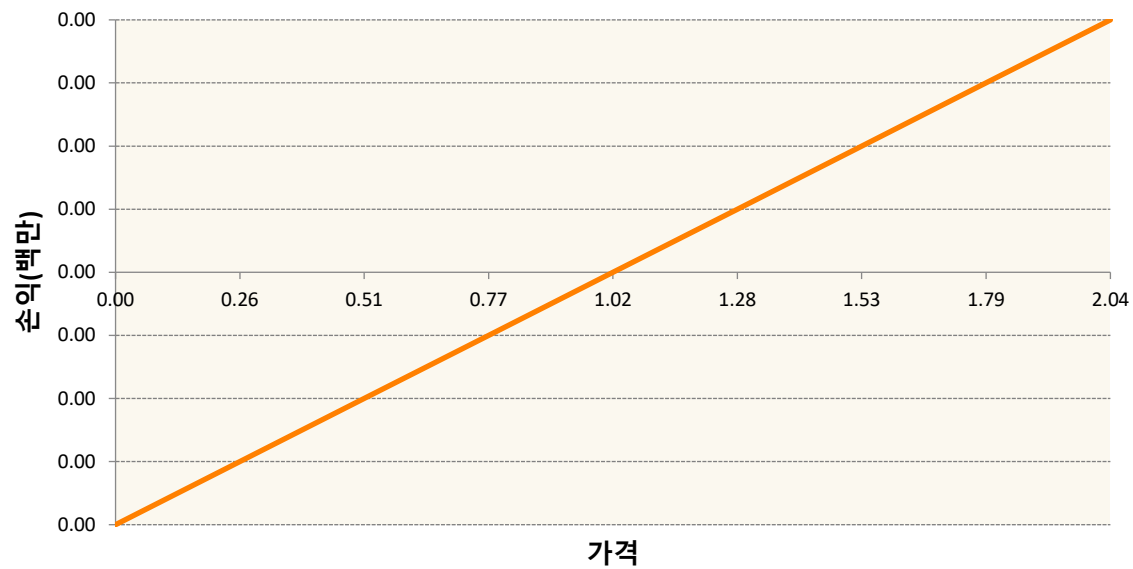
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	359,809	0	359,809	장외

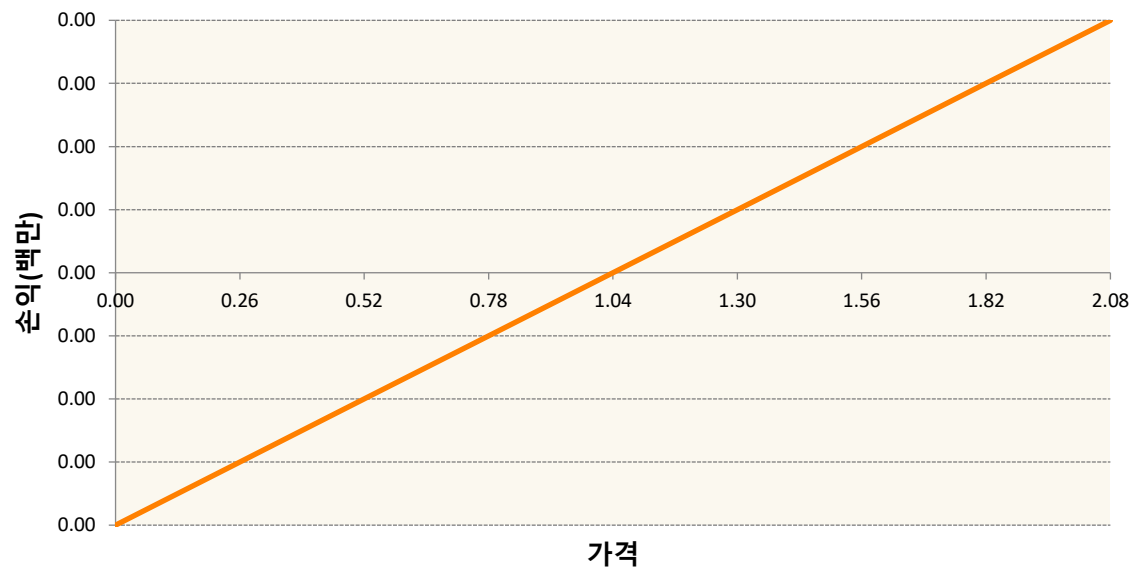
2. 만기시점의 손익구조



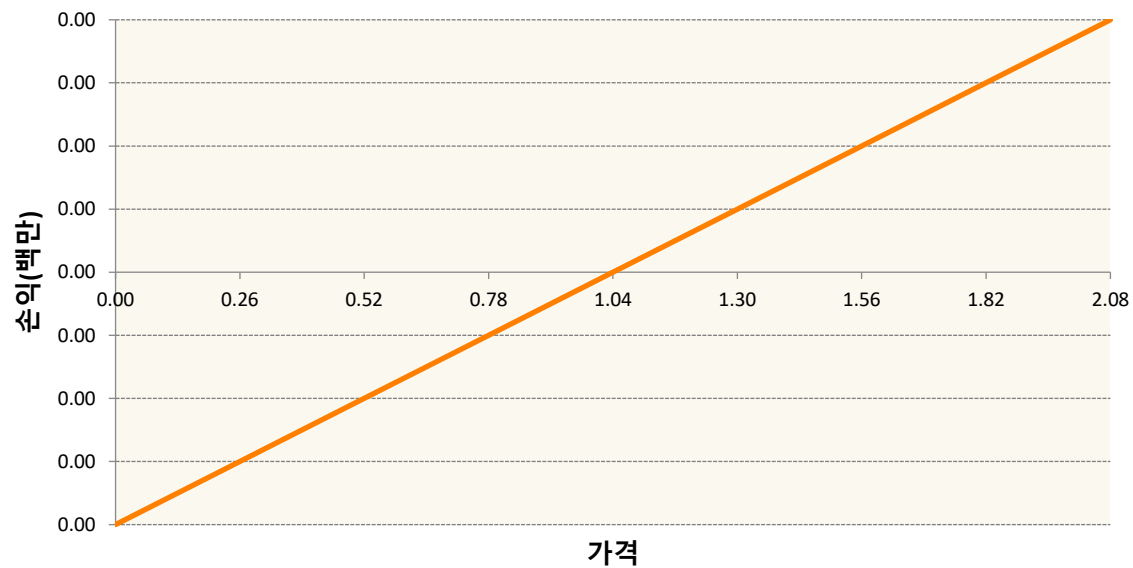
SWKEDI000172-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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		8,609
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		157
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		3,534
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		9,246
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN		7,215

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	12,090