

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

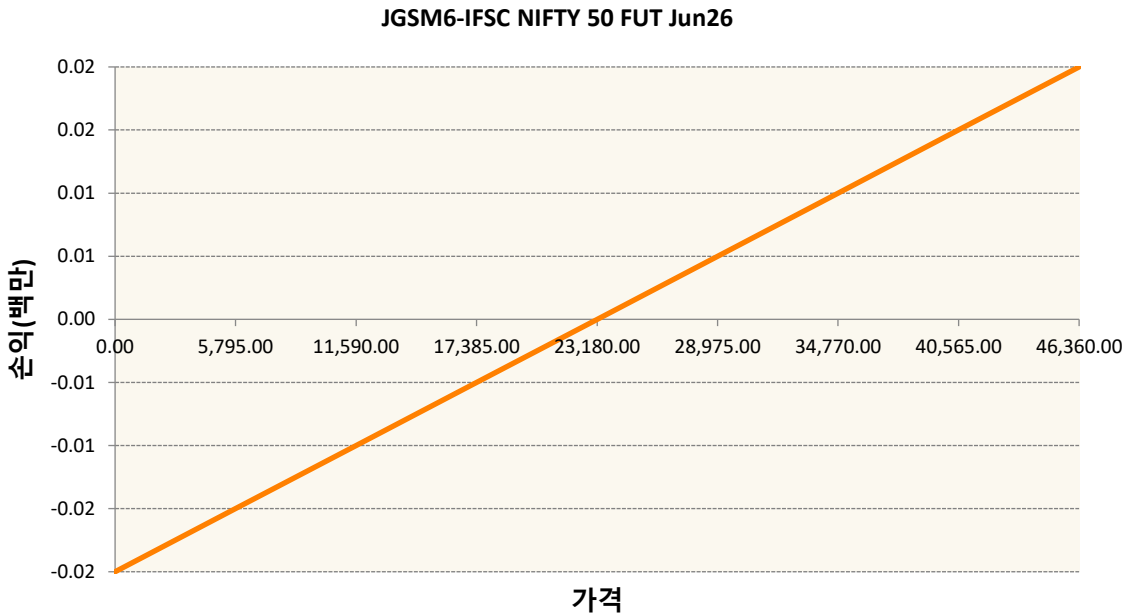
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	349	0	349	

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	2026-06-12
기준일	2026-06-11

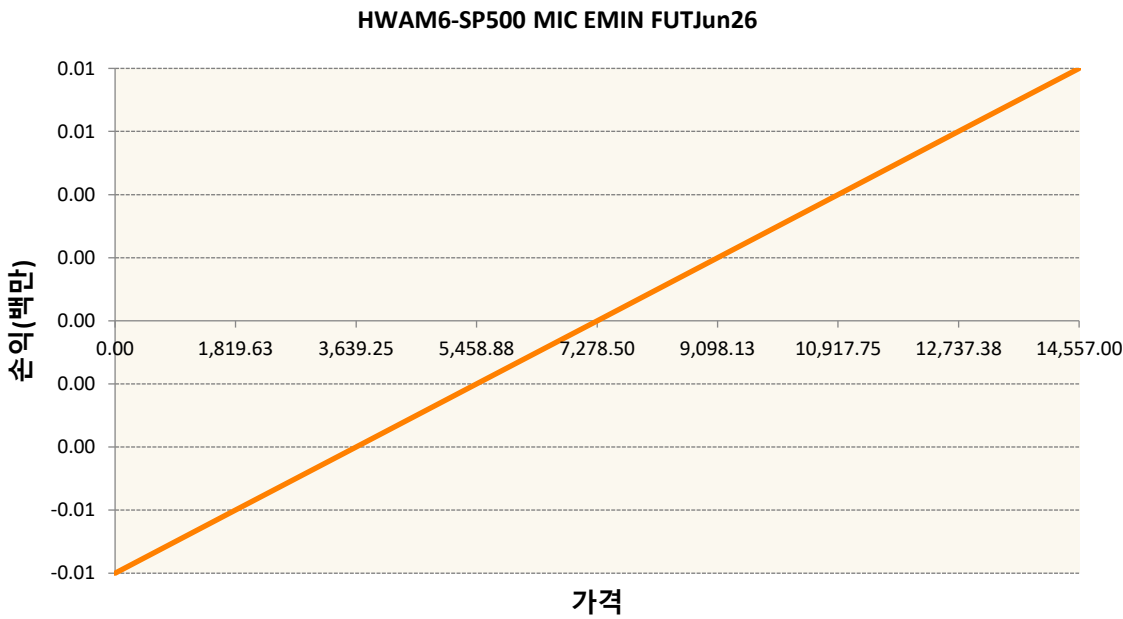
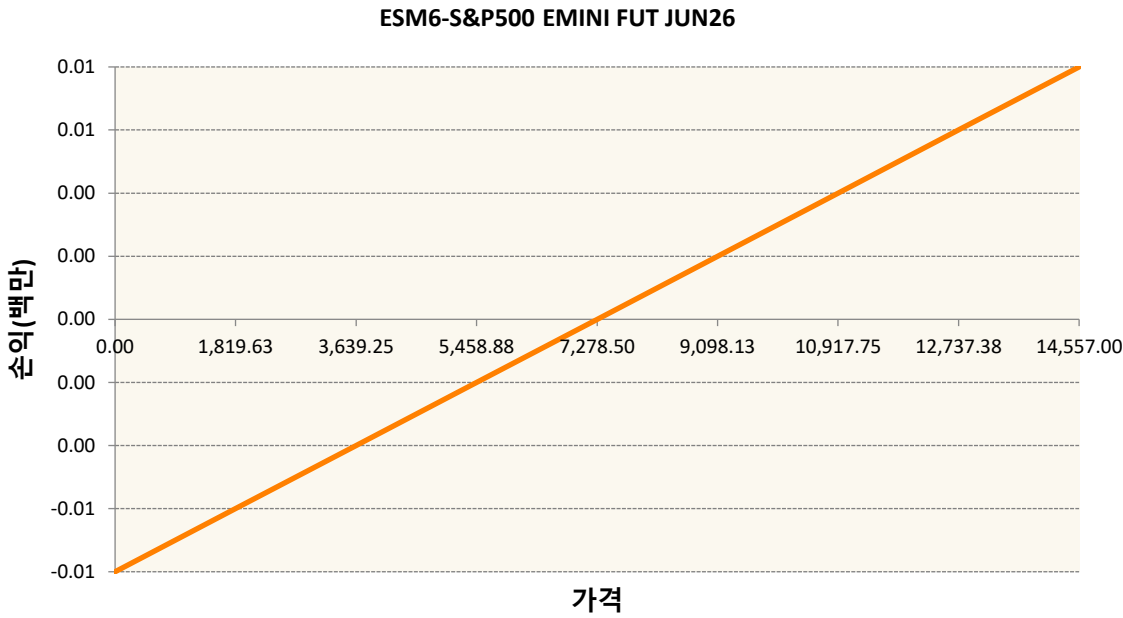
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	547	0	547	
누계	지수	선물	55	0	55	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	44
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	4

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	41

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

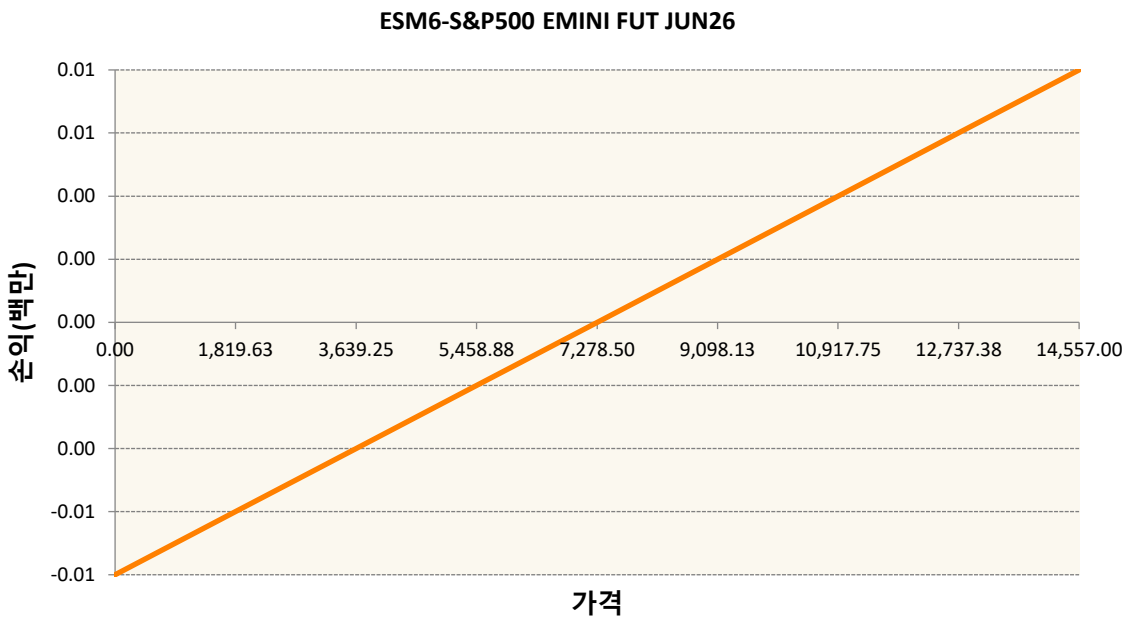
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,094	0	1,094	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	88
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

75

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

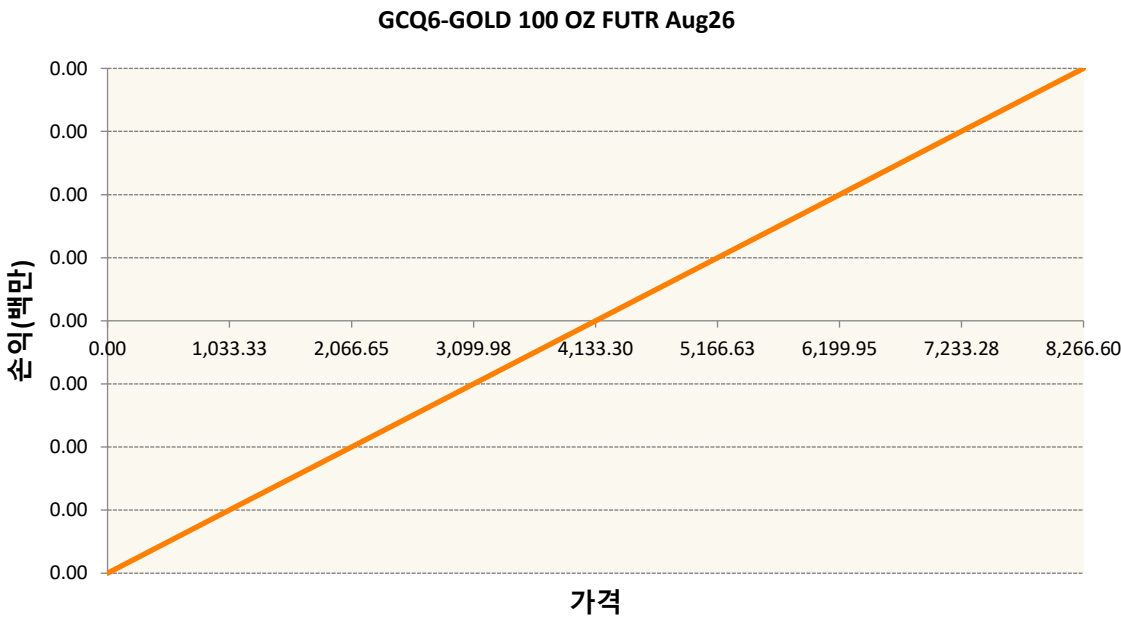
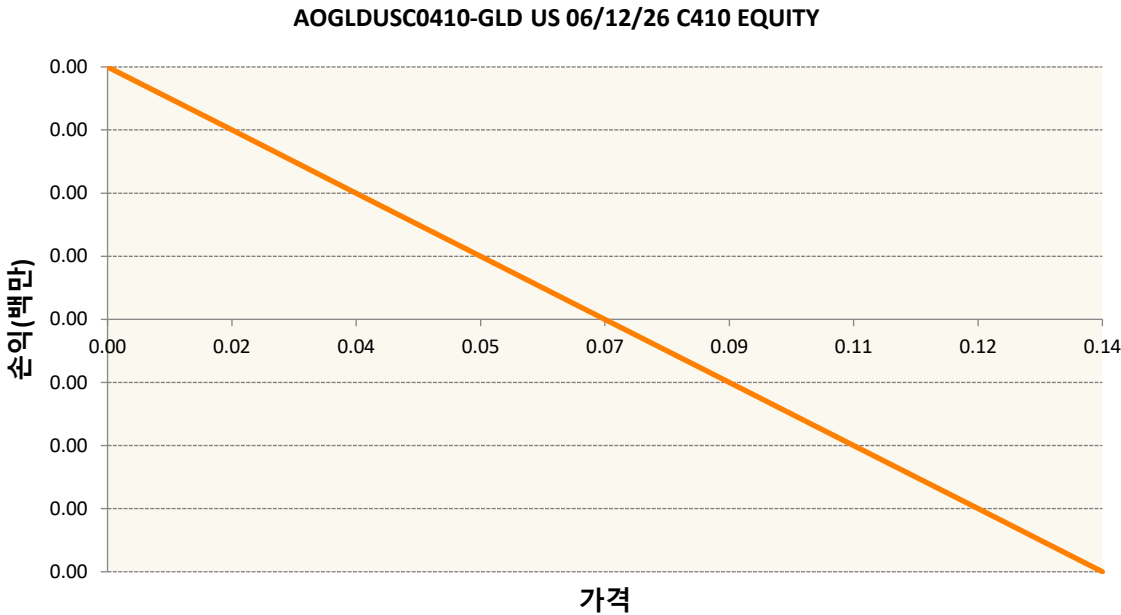
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,955	0	4,955	
누계	실물자산	옵션	0	76	-76	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
AOGLDUSC0GLD US 06/12/26 C410 EQUITY		6
GCQ6	GOLD 100 OZ FUTR Aug26	396

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	513

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUCS` PLTR US 06/12/26 C150 EQUITY	56
AOPLTRUPS` PLTR US 06/12/26 P150 EQUITY	8
AOPLTRUXC` PLTR US 06/12/26 C145 EQUITY	1
AOPLTRUXP` PLTR US 06/12/26 P145 EQUITY	4

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

(단위:백만원)

212

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

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)

AOTLTUSC8(TLT US 06/12/26 C86 EQUITY

3

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

(단위:백만원)

2

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

(단위:백만원)

16,824

공시일 2026-06-12

기준일 2026-06-11

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	2026-06-12
기준일	2026-06-11

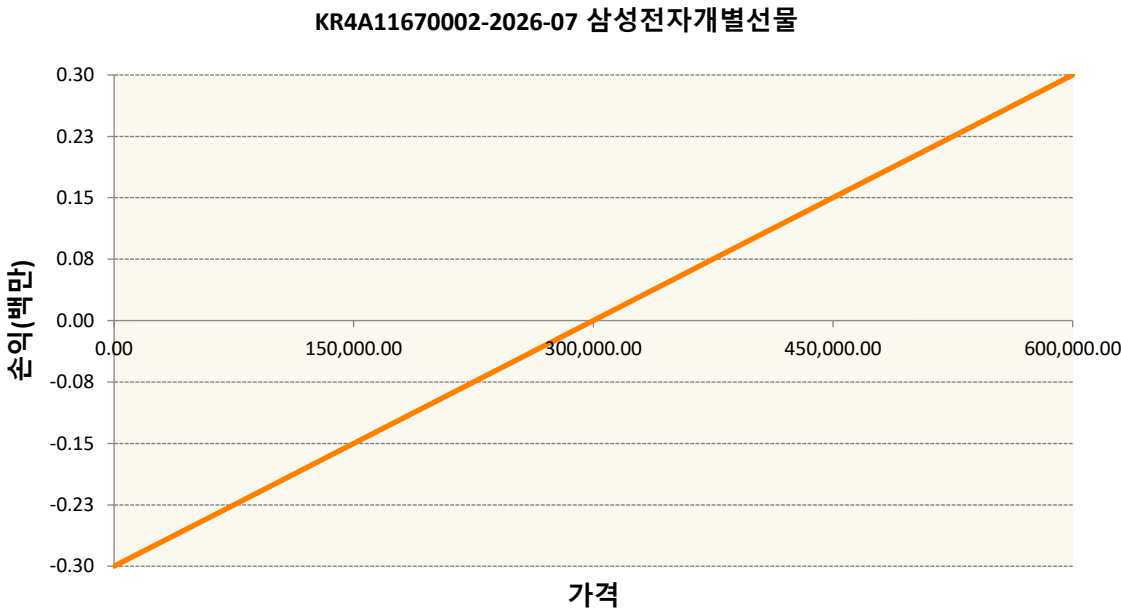
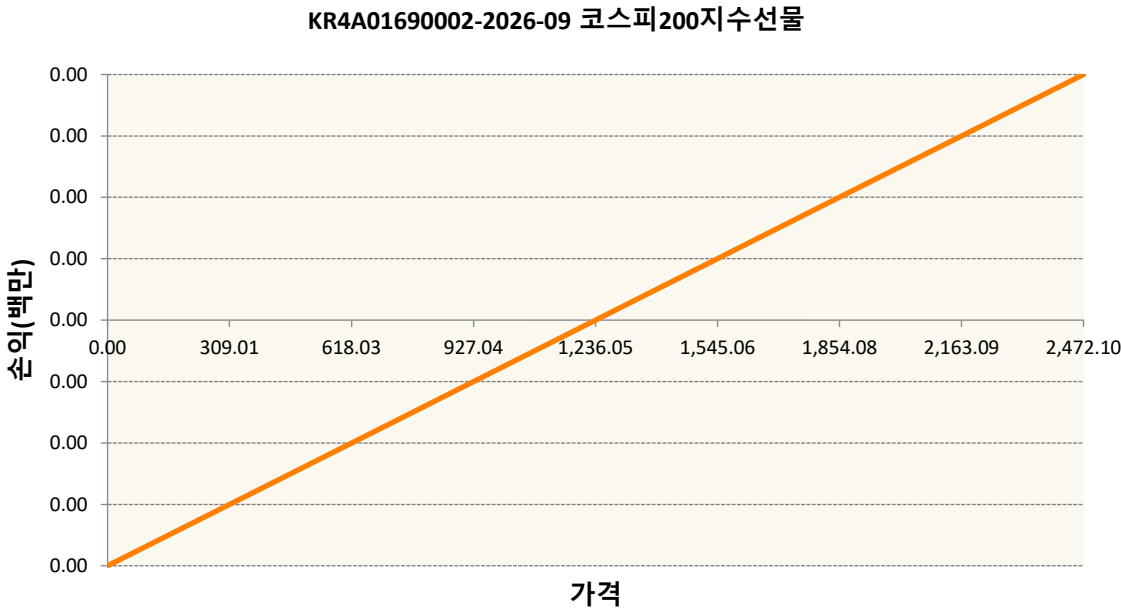
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	39,554	-39,554	장내
누계	유가증권	선물	24,234	38,547	-14,313	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 2,465.00 with major ticks every 308.13. The y-axis represents Net Income, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A single orange line starts at (0, 0.00) and ends at (2,465.00, 0.00).

가격	순이익(백만)
0.00	0.00
308.13	0.00
616.25	0.00
924.38	0.00
1,232.50	0.00
1,540.63	0.00
1,848.75	0.00
2,156.88	0.00
2,465.00	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 2,470.00 with major ticks every 308.75. The y-axis represents the net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid blue line starts at the origin (0, 0.00) and extends to the point (2,470.00, 0.00), indicating a constant rate of change.

가액	순이익 (백만)
0.00	0.00
308.75	0.00
617.50	0.00
926.25	0.00
1,235.00	0.00
1,543.75	0.00
1,852.50	0.00
2,161.25	0.00
2,470.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				640
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-640	-640	-640	-640	-640	-640	-640	
-5.33%	-427	-427	-427	-427	-427	-427	-427	
-2.67%	-213	-213	-213	-213	-213	-213	-213	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	213	213	213	213	213	213	213	
5.33%	427	427	427	427	427	427	427	
8.00%	640	640	640	640	640	640	640	
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물				1,292
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,292	-1,292	-1,292	-1,292	-1,292	-1,292	-1,292
-5.33%	-861	-861	-861	-861	-861	-861	-861
-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%	861	861	861	861	861	861	861
8.00%	1,292	1,292	1,292	1,292	1,292	1,292	1,292
KR4BAFBHA944 코스피위클리M C 2606W3 1,232.5							1,847

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,847	1,847	1,847	1,847	1,847	1,847	1,847
-5.33%	1,232	1,232	1,232	1,232	1,232	1,232	1,232
-2.67%	616	616	616	616	616	616	616
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-616	-616	-616	-616	-616	-616	-616
5.33%	-1,232	-1,232	-1,232	-1,232	-1,232	-1,232	-1,232
8.00%	-1,847	-1,847	-1,847	-1,847	-1,847	-1,847	-1,847

KR4BAFBHA951 코스피위클리M C 2606W3 1,235.0							1,232
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,232	1,232	1,232	1,232	1,232	1,232	1,232
-5.33%	821	821	821	821	821	821	821
-2.67%	411	411	411	411	411	411	411
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-411	-411	-411	-411	-411	-411	-411
5.33%	-821	-821	-821	-821	-821	-821	-821
8.00%	-1,232	-1,232	-1,232	-1,232	-1,232	-1,232	-1,232

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

(단위:백만원)

13,131

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

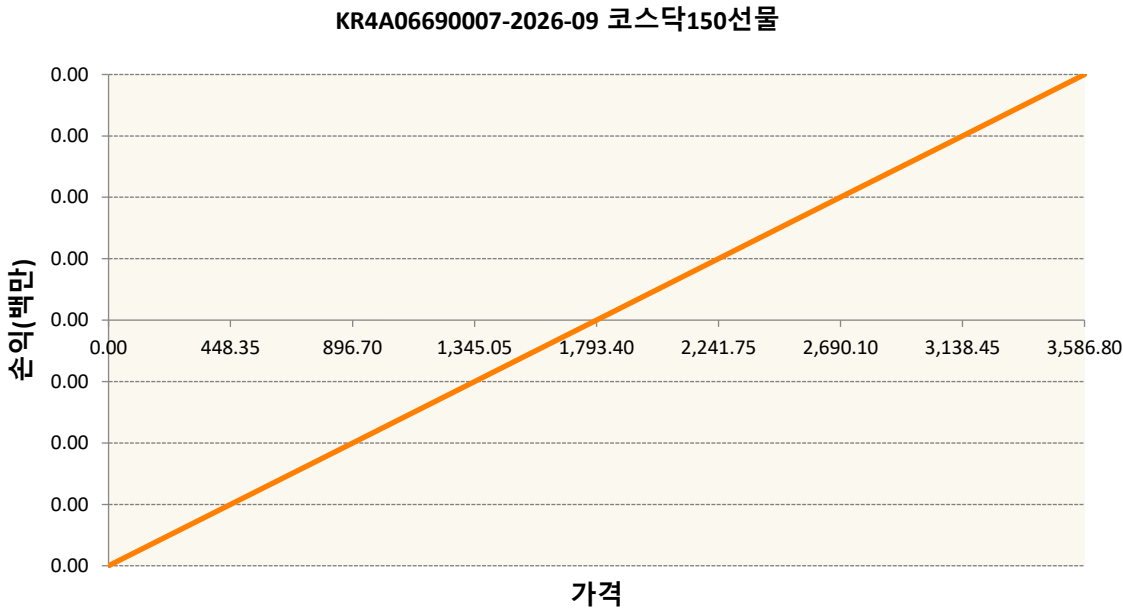
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,058	0	1,058	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				84
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
-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%	84	84	84	84	84	84	84

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

(단위:백만원)

17,528

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

(단위:백만원)

68,391

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

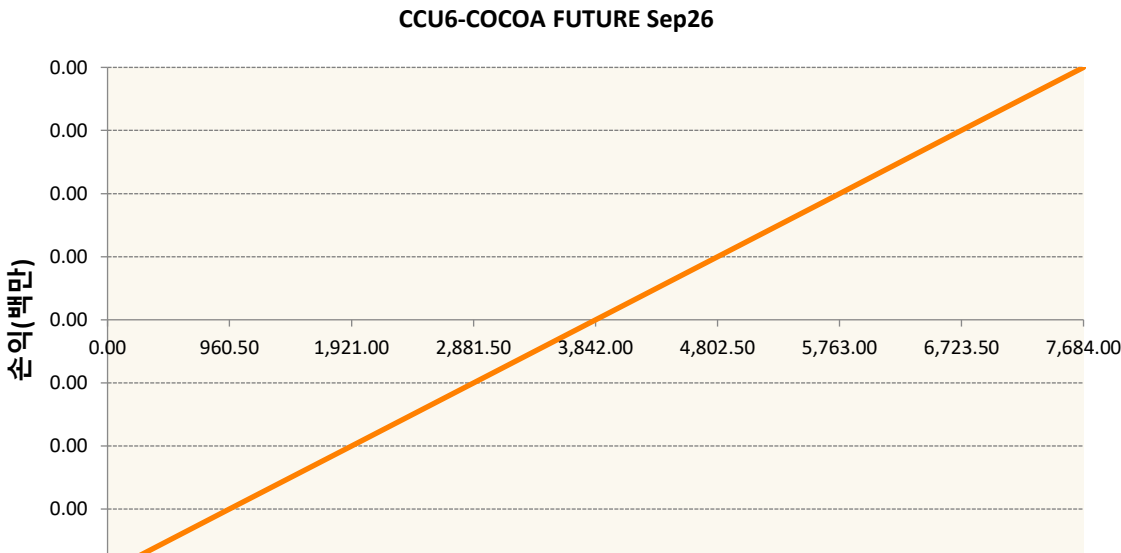
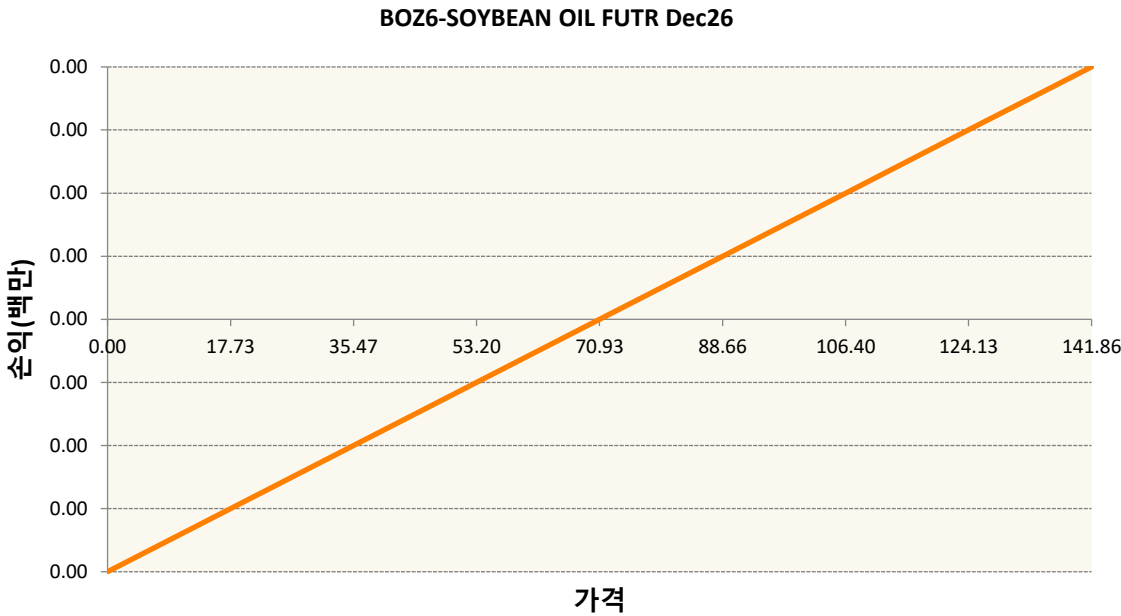
포커스농산물모(채권-파생형)

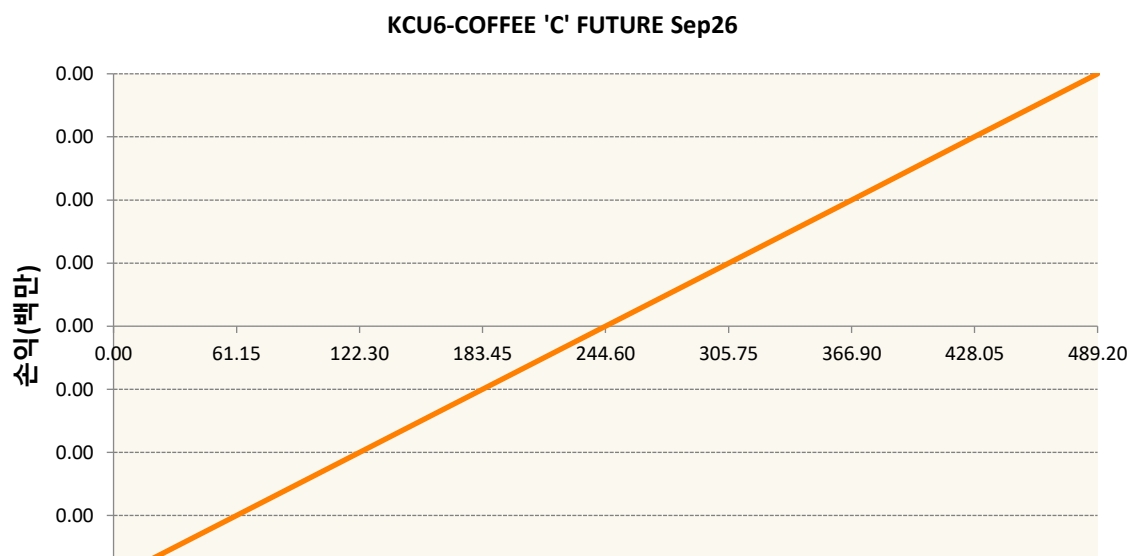
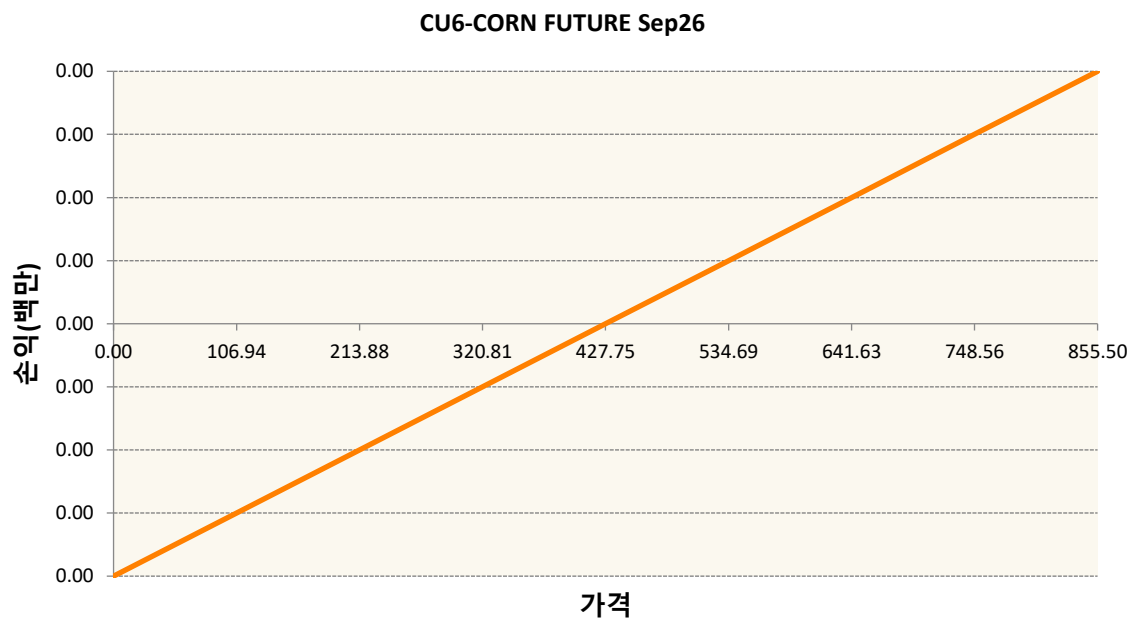
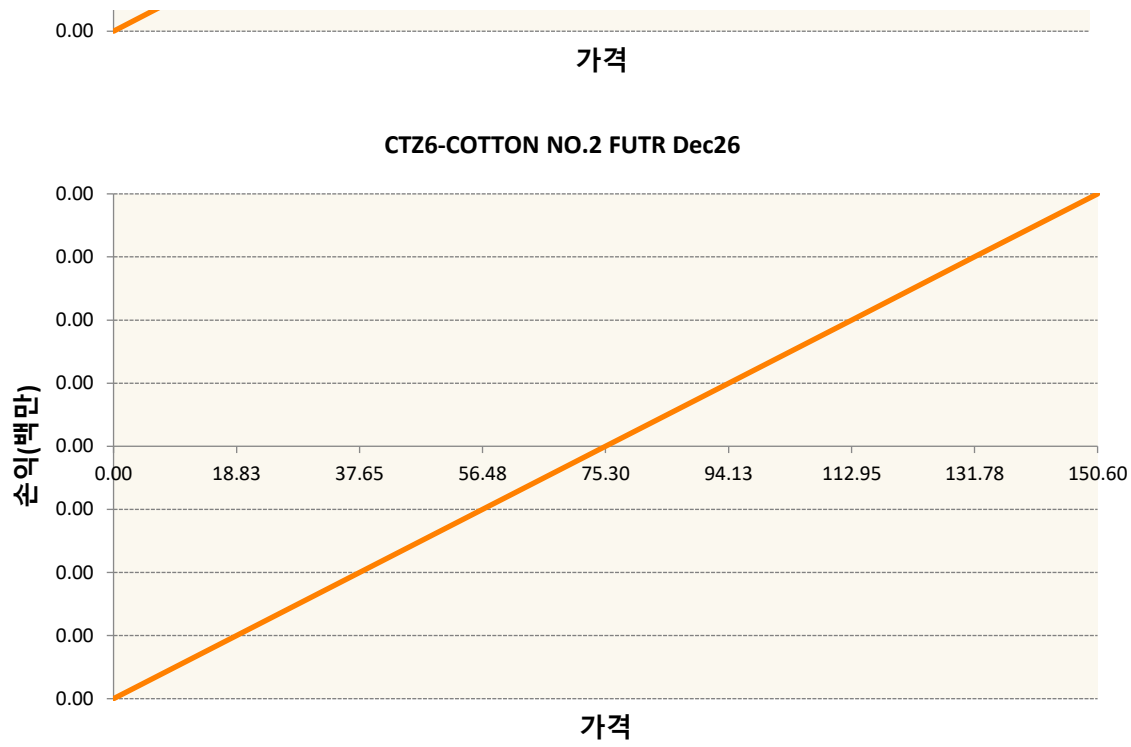
1. 계약금액

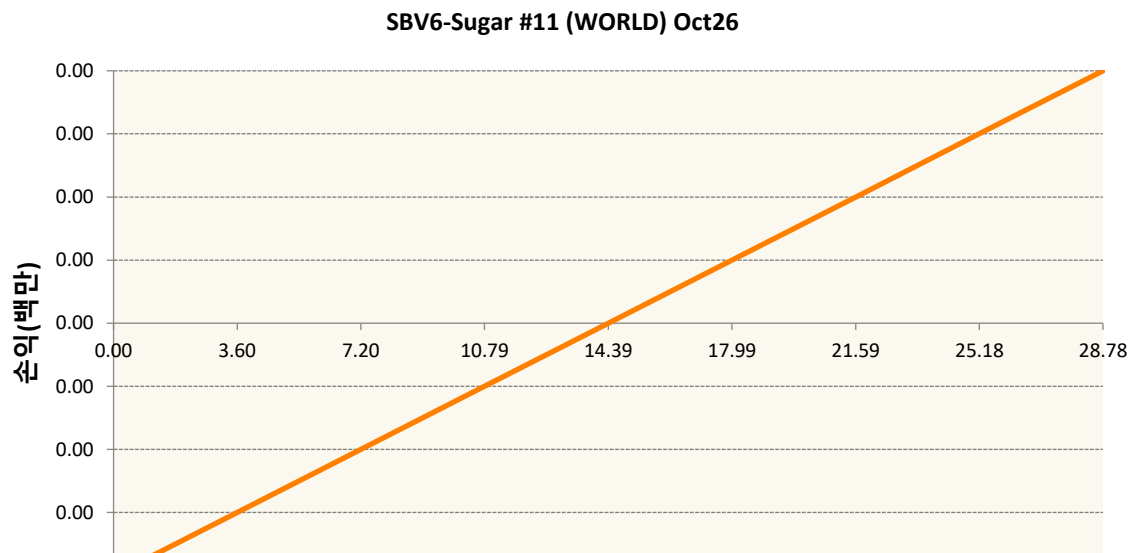
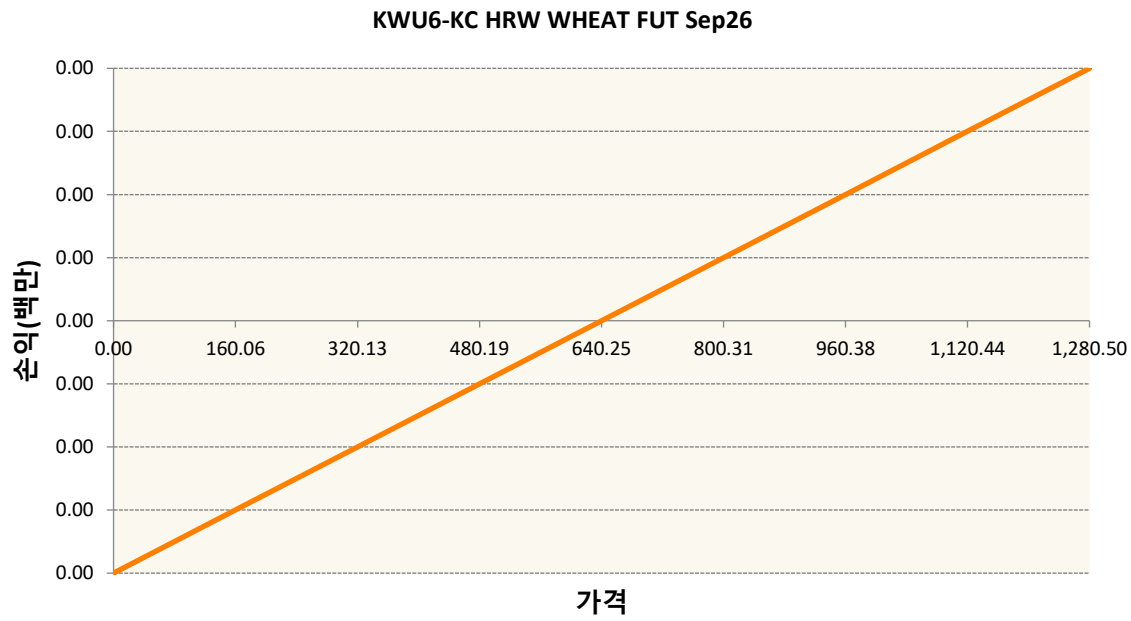
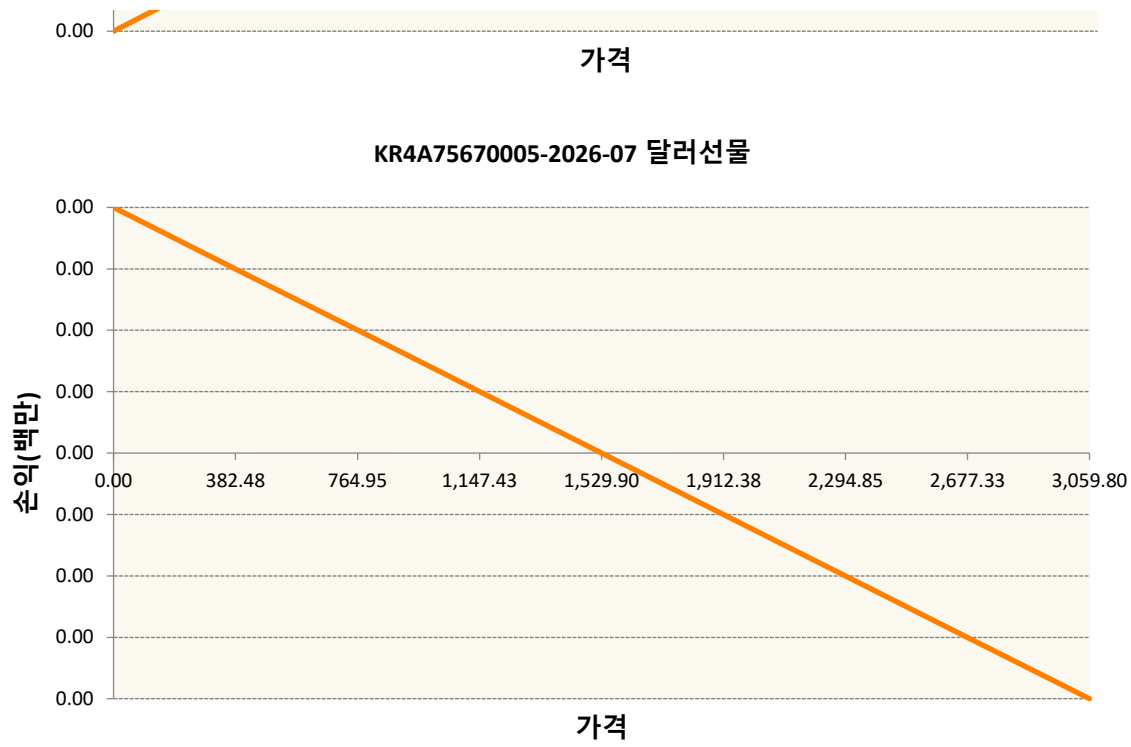
(단위:USD 백만)

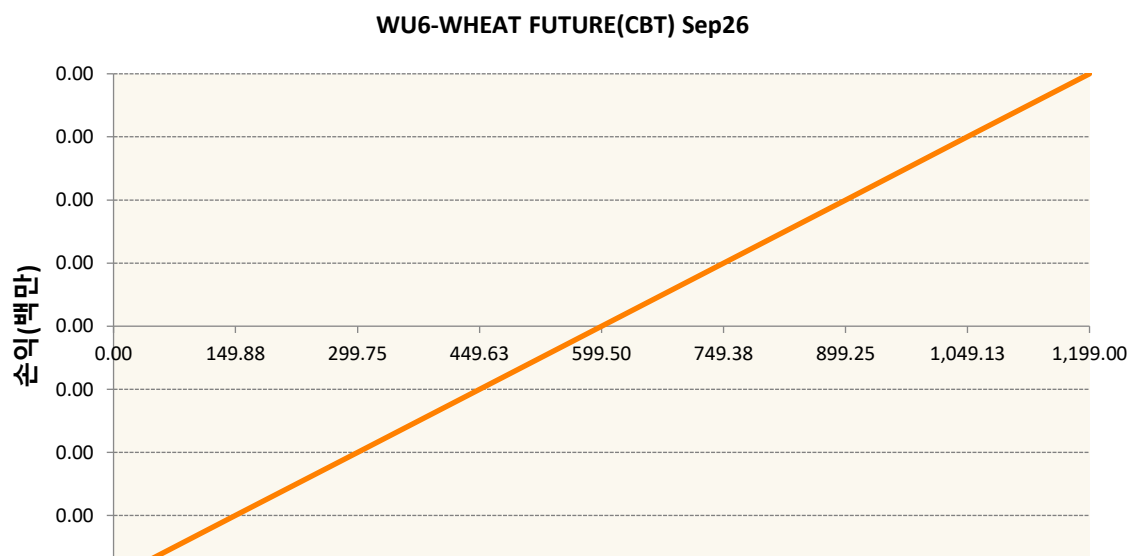
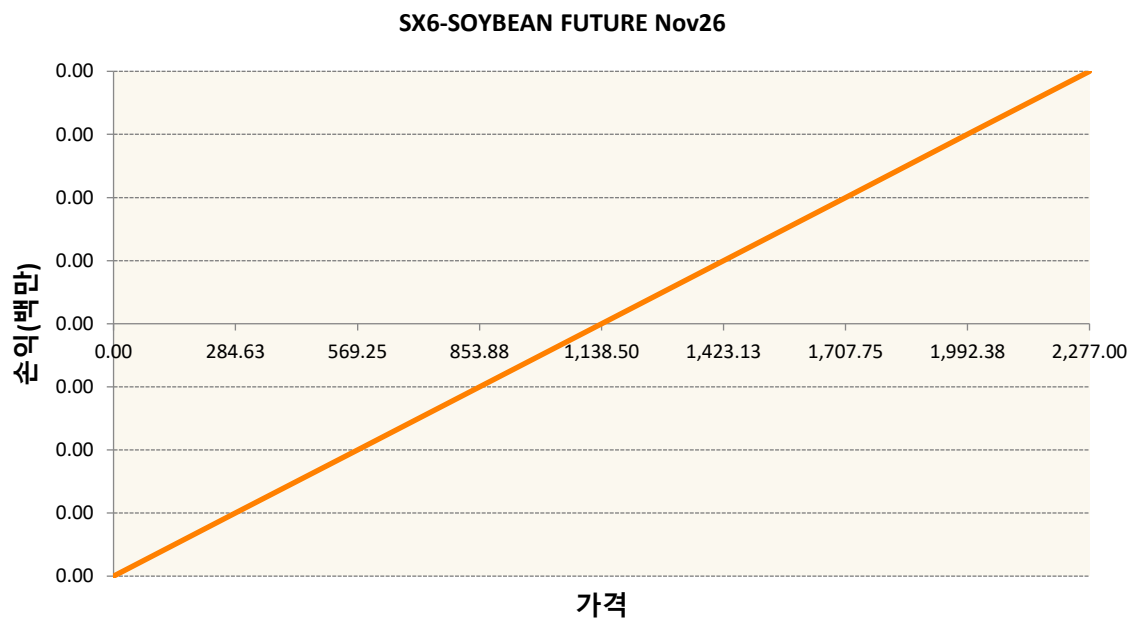
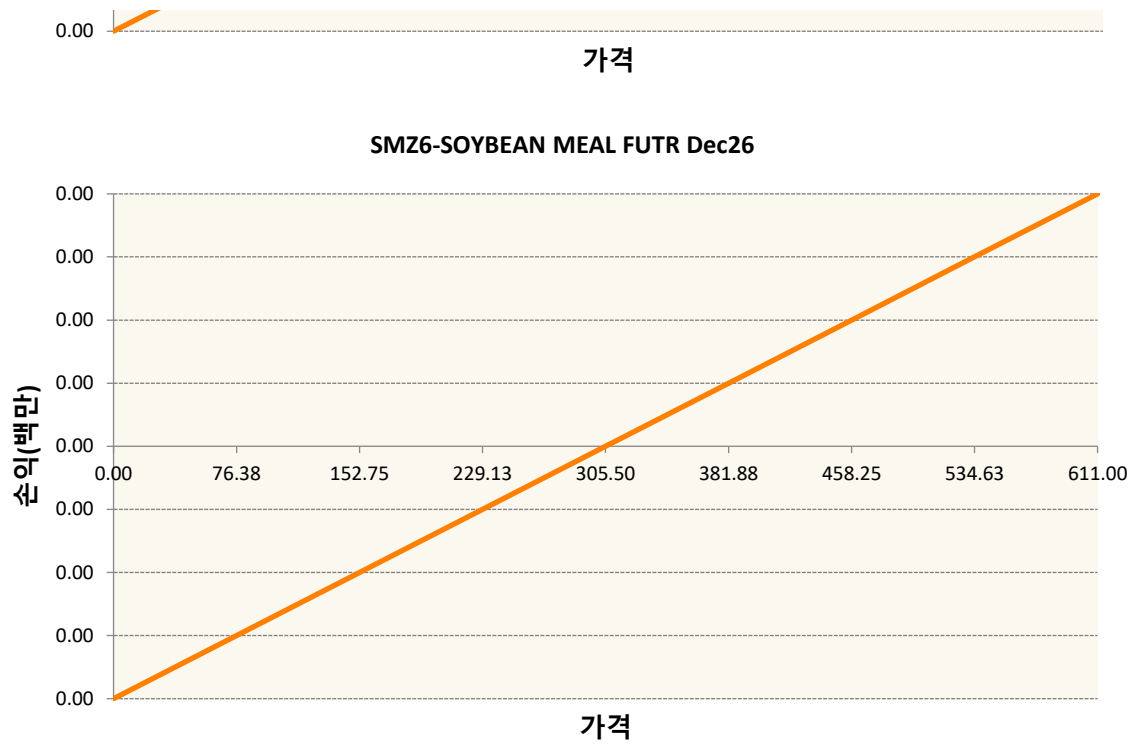
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	448	0	448	
누계	유가증권	선물	2,115	0	2,115	
누계	통화	선물	0	168	-168	장내

2. 만기시점의 손익구조









0.00

가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

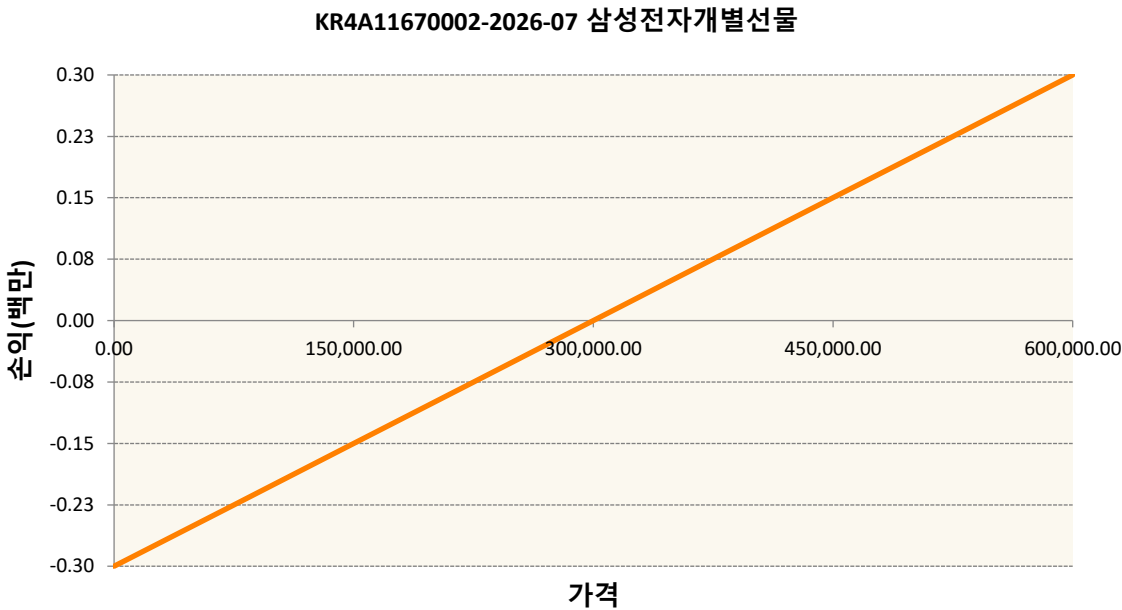
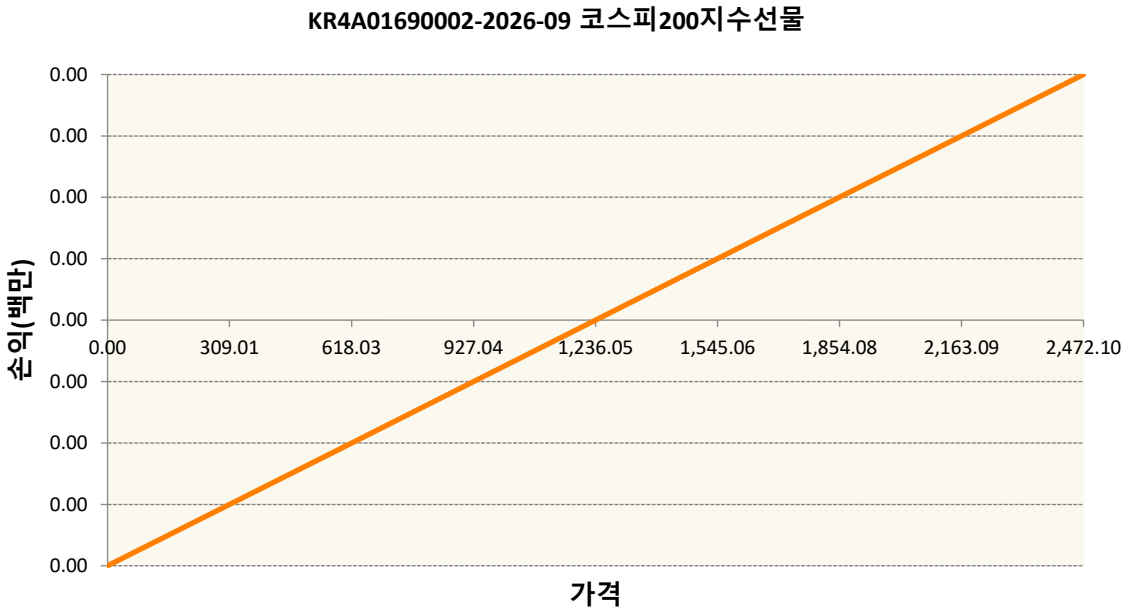
스마트인덱스모

1. 계약금액

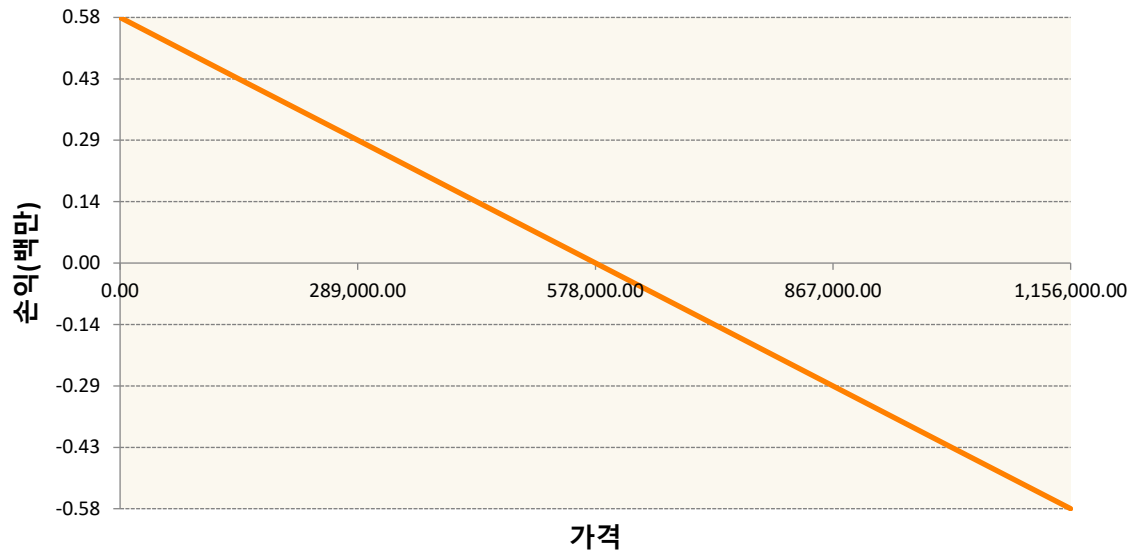
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	121	0	121	장내
누계	유가증권	선물	3,210	153	3,057	장내

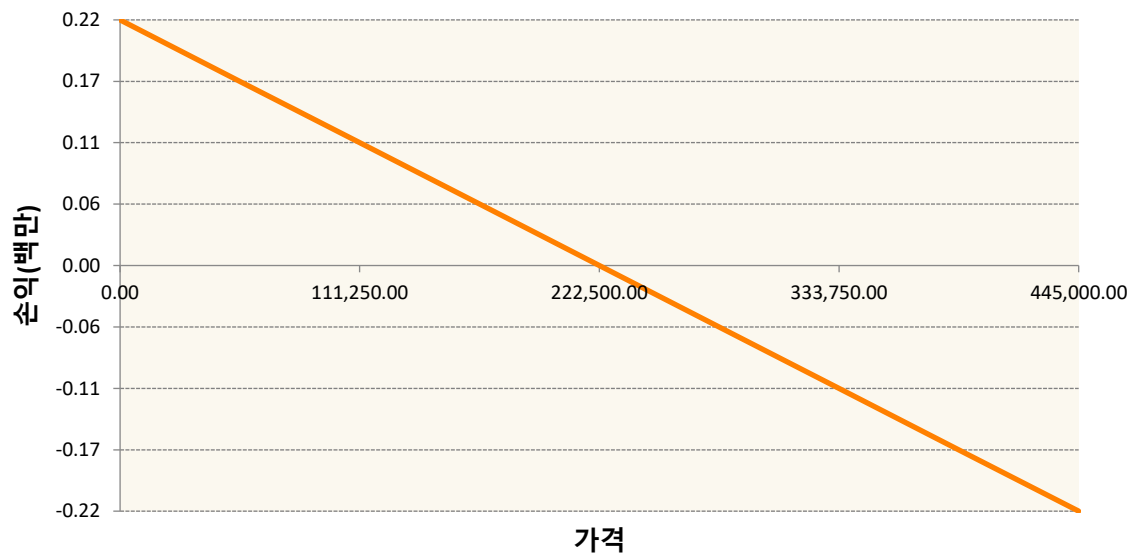
2. 만기시점의 손익구조



KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



KR4A56670008-2026-07 NAVER개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002						2026-09 코스피200지수선물		246
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-246
-5.33%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	82	82	82	82	82	82	82	82
5.33%	164	164	164	164	164	164	164	164
8.00%	246	246	246	246	246	246	246	246
KR4A11670002						2026-07 삼성전자개별선물		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%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-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%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
KR4A20670001 2026-07 현대모비스개별선물							7

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7	7	7	7	7	7	7
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-2.67%	2	2	2	2	2	2	2
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
5.33%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7

KR4A56670008 2026-07 NAVER개별선물							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%	4	4	4	4	4	4	4
-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%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5

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

(단위:백만원)

662

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

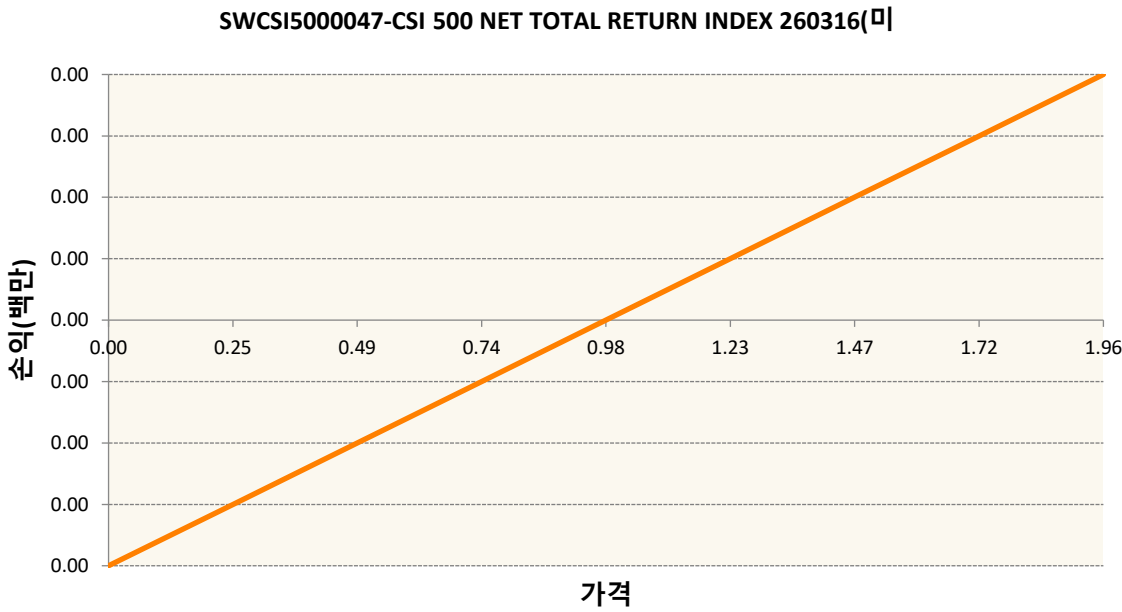
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,531	0	5,531	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

444

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

581

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

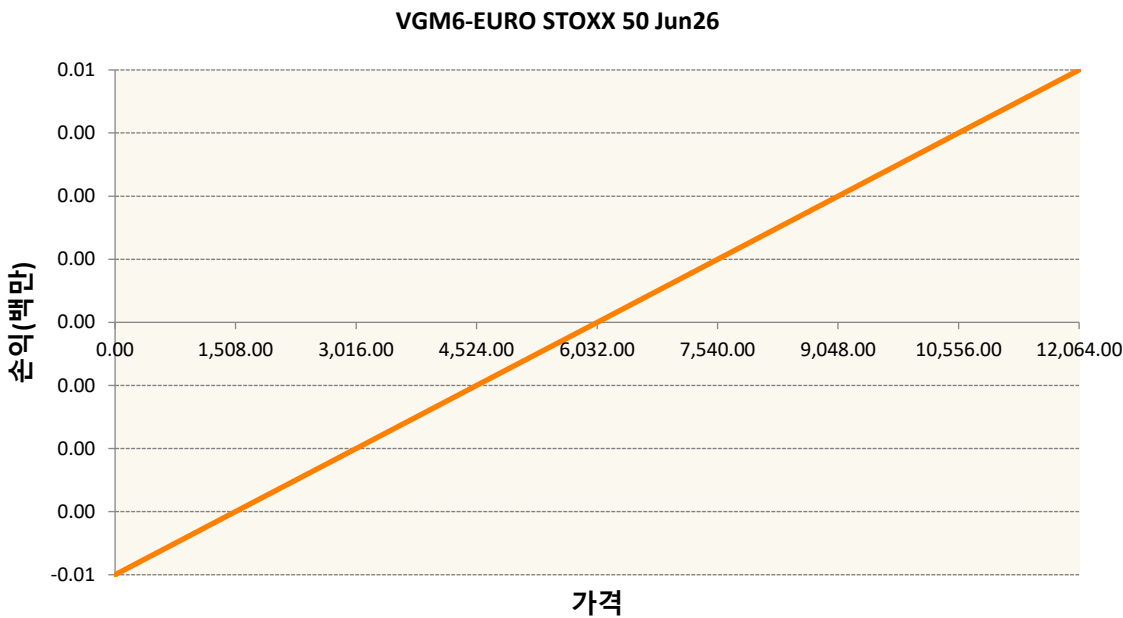
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	931	0	931	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

65

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

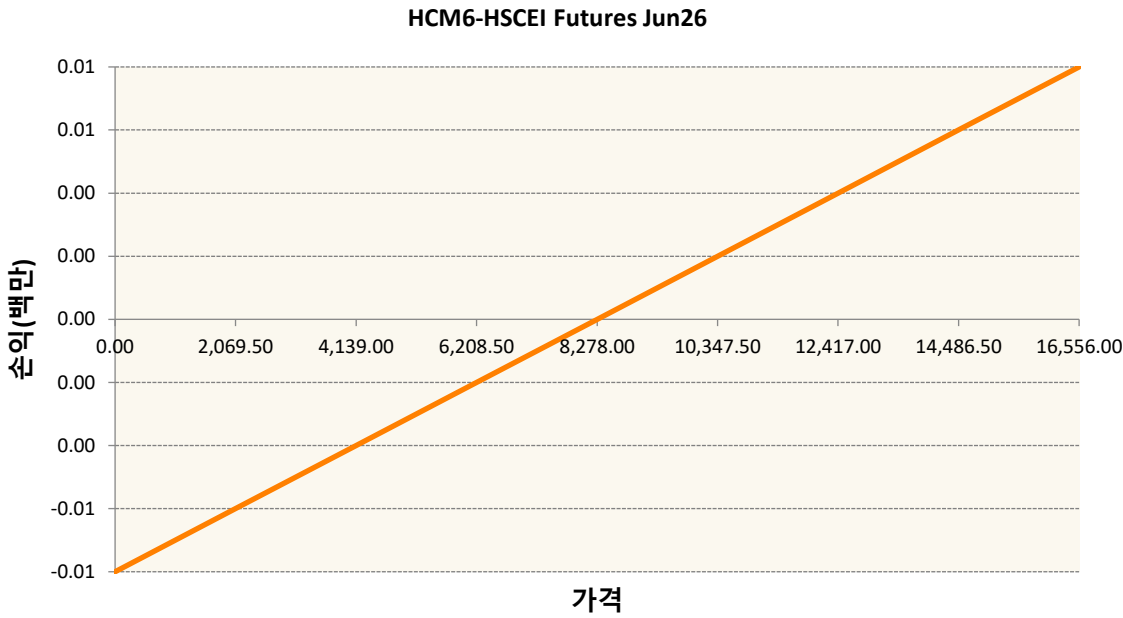
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,350	0	1,350	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	HSCEI Futures Jun26	108
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

130

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

(단위:백만원)

1,712

공시일 2026-06-12

기준일 2026-06-11

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	2026-06-12
기준일	2026-06-11

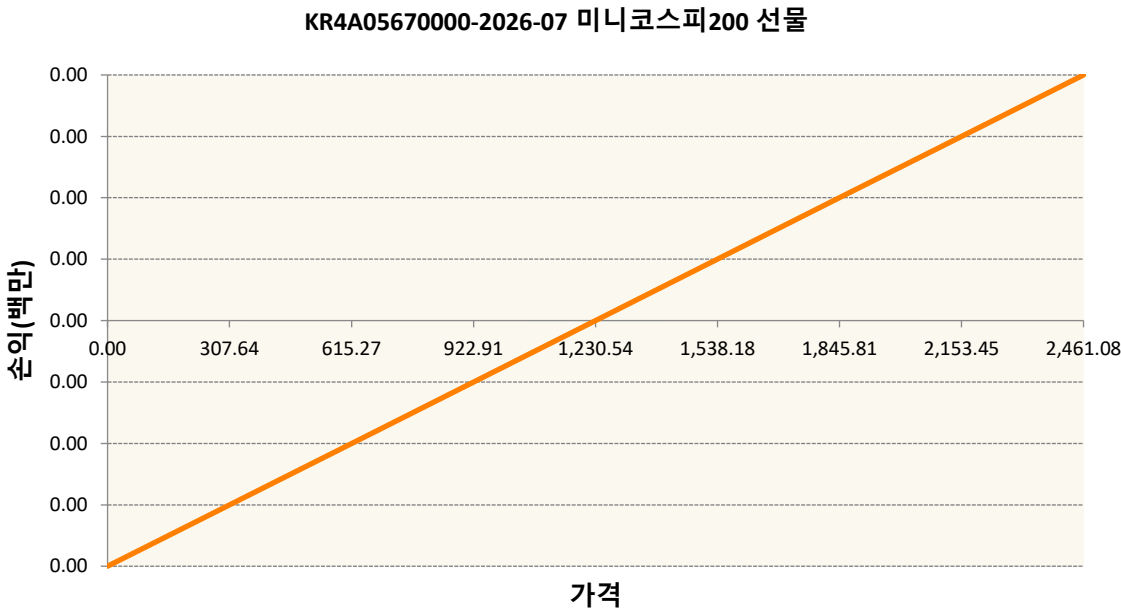
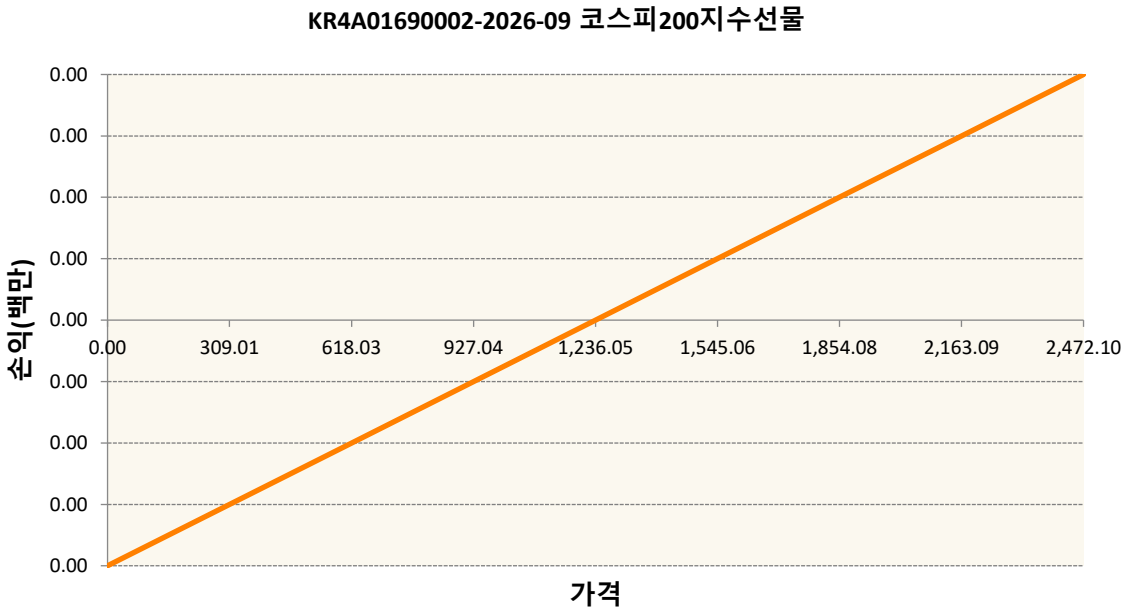
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	32	0	32	장내
누계	유가증권	선물	2,529	64	2,466	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the relationship between price and profit. The x-axis is labeled '가격' (Price) and ranges from 0.00 to 4,242,000.00. The y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions) and ranges from -2.12 to 2.12. A solid orange line represents the profit function, starting at a profit of 2.12 when the price is 0.00 and decreasing linearly to a profit of -2.12 at a price of 4,242,000.00. The line crosses the x-axis at a price of 2,121,000.00, which is the break-even point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	2.12
1,060,500.00	1.06
2,121,000.00	0.00
3,181,500.00	-1.06
4,242,000.00	-2.12

The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 1,280,000.00 with major ticks every 320,000.00. The y-axis, labeled '이익 (백만)' (Profit in millions), ranges from -0.64 to 0.64 with major ticks every 0.16. A solid orange line represents the profit function, starting at (0, -0.64), crossing the x-axis at (640,000, 0), and ending at (1,280,000, 0.64). Horizontal dashed grid lines are present at each major y-axis tick.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-0.64
320,000.00	-0.32
640,000.00	0.00
960,000.00	0.32
1,280,000.00	0.64

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					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
KR4A05670000		2026-07 미니코스피200 선물					25
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	25	25	25	25	25	25	25
KR4A50670004 2026-07 SK하이닉스개별선물							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

KR4AFD670003 2026-07 HD현대중공업개별선물							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

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

(단위:백만원)

269

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

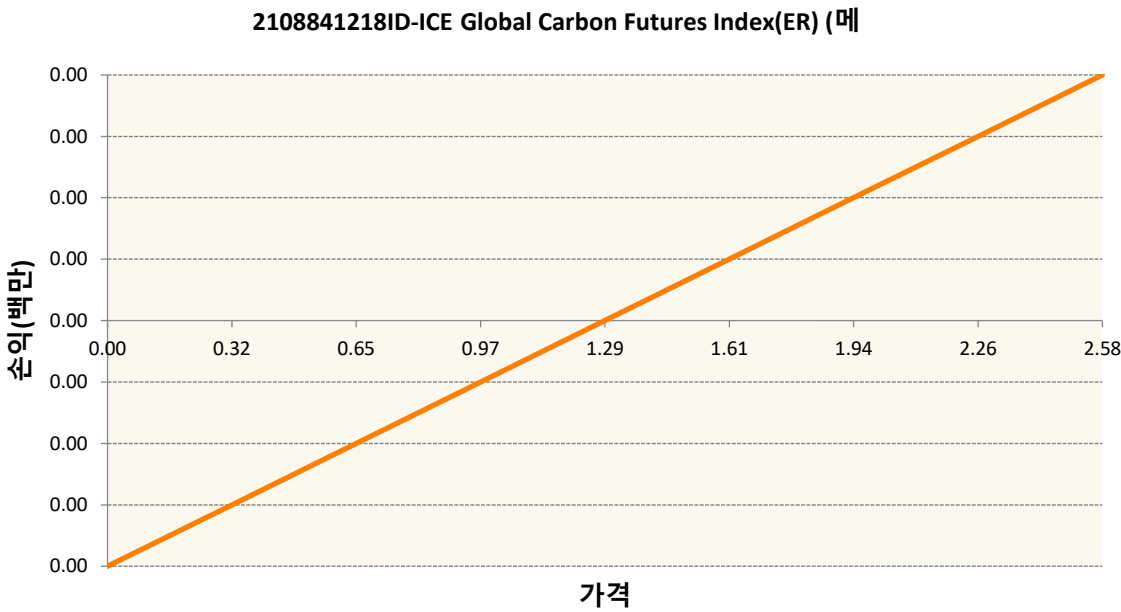
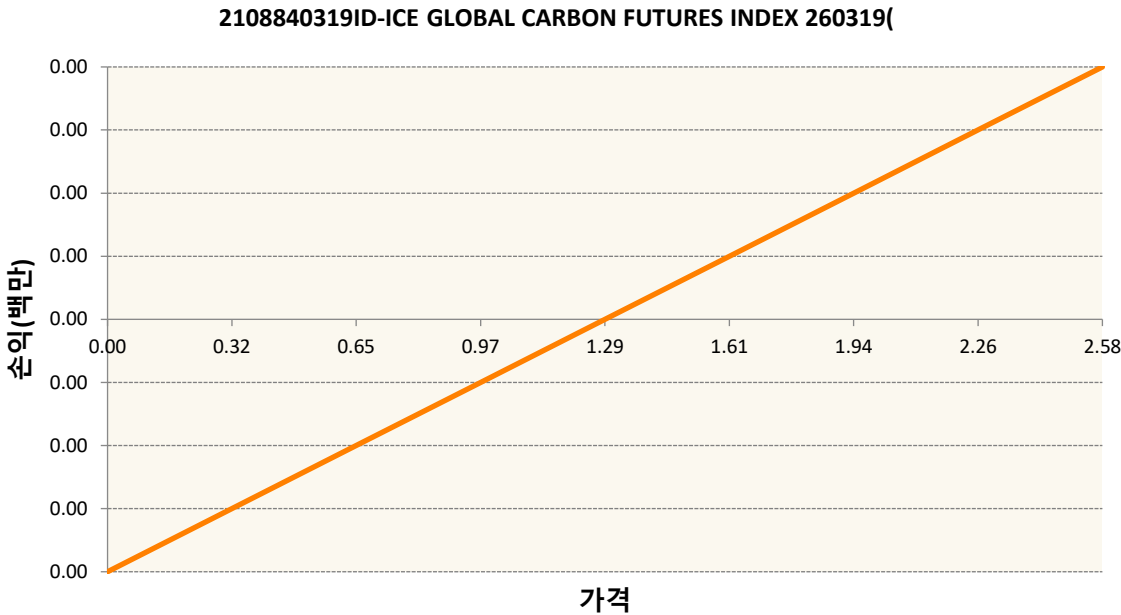
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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(		472
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		119

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

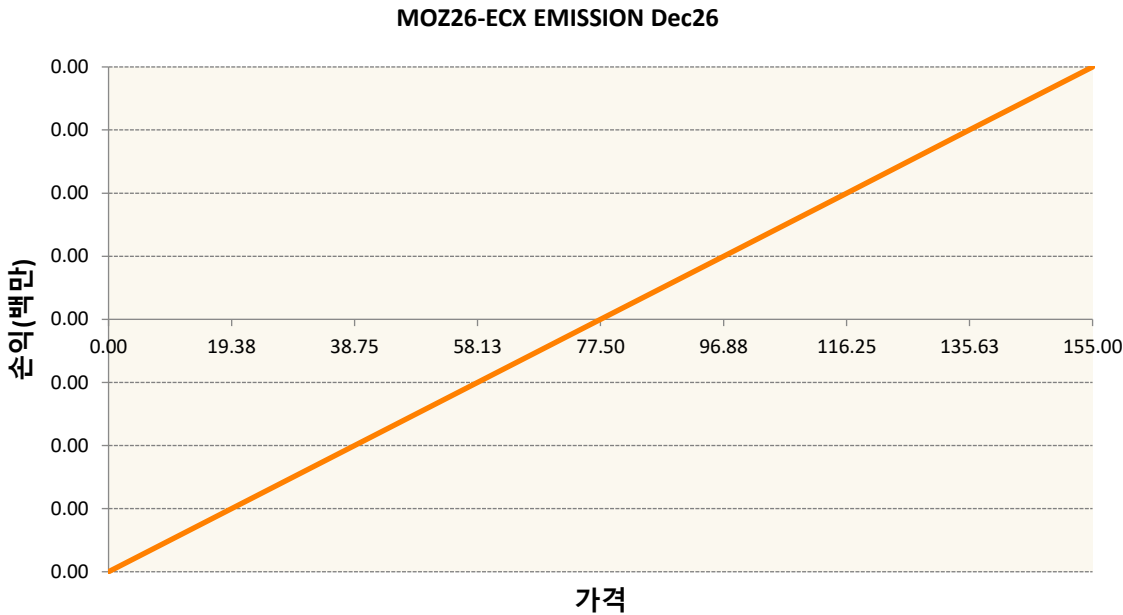
공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

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			4,995	0	4,995	
누계	통화	선도	0	2,654	-2,654	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	212
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	400

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

685

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

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	1,602	0	1,602	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	13
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	9
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	21
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	8

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

(단위:백만원)

78

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

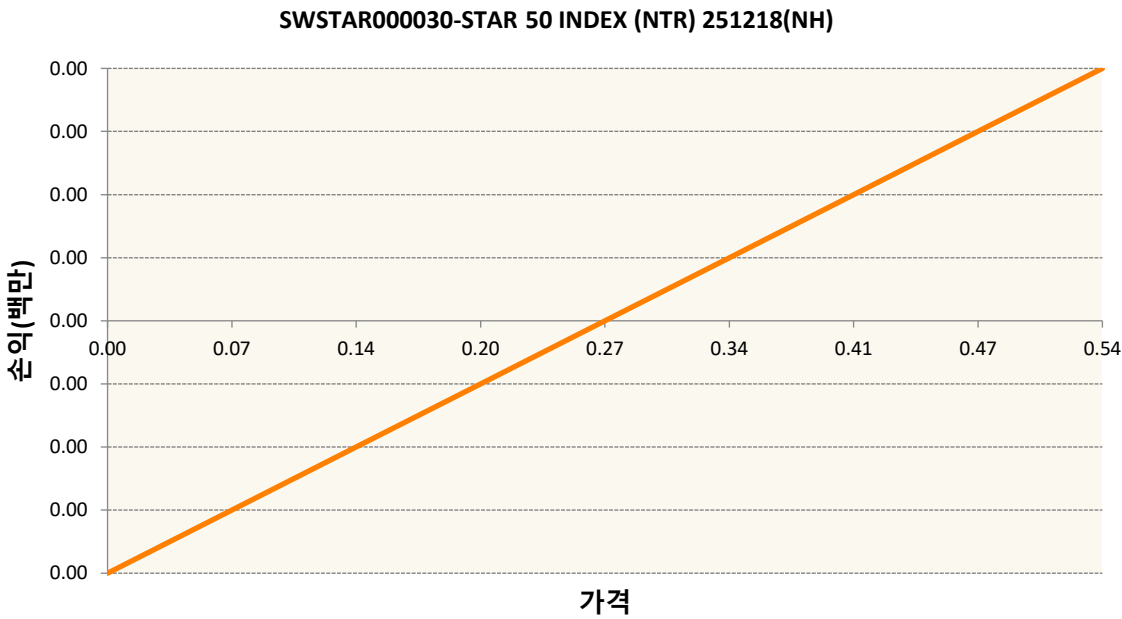
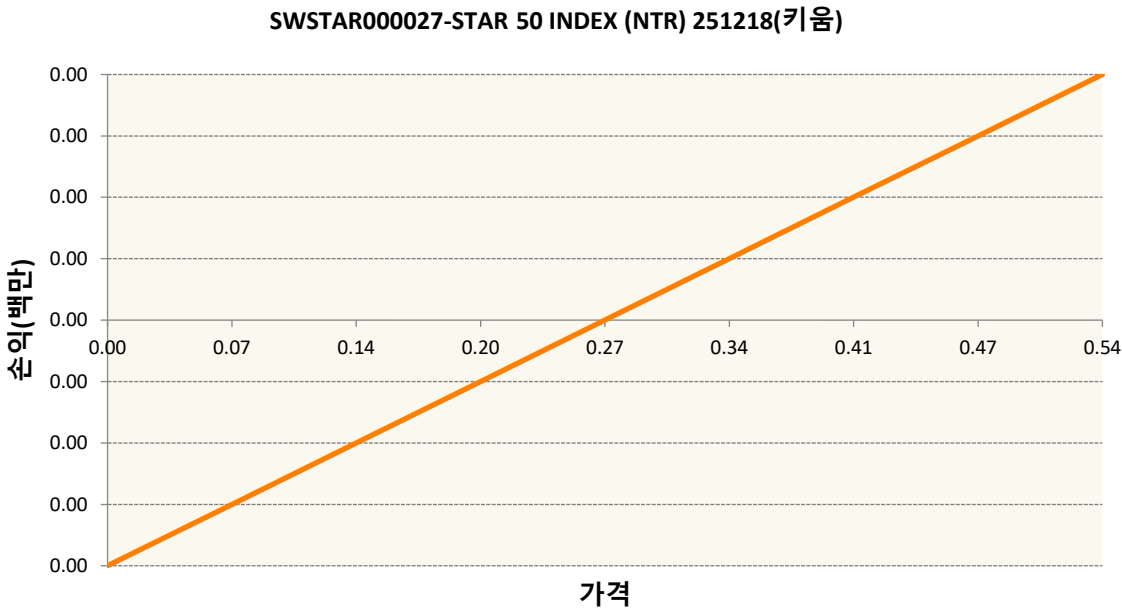
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

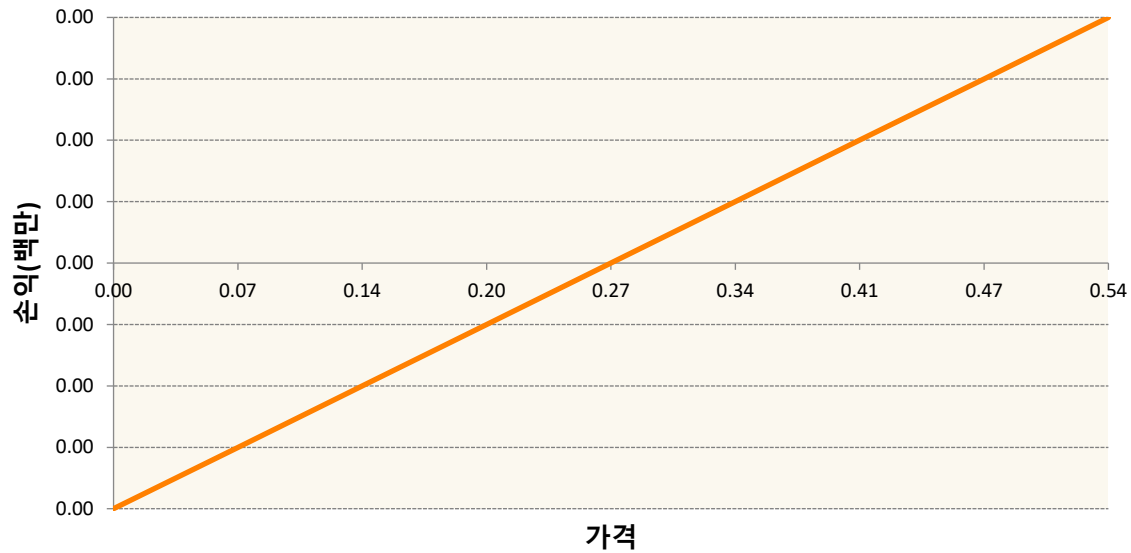
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,829	0	6,829	장외

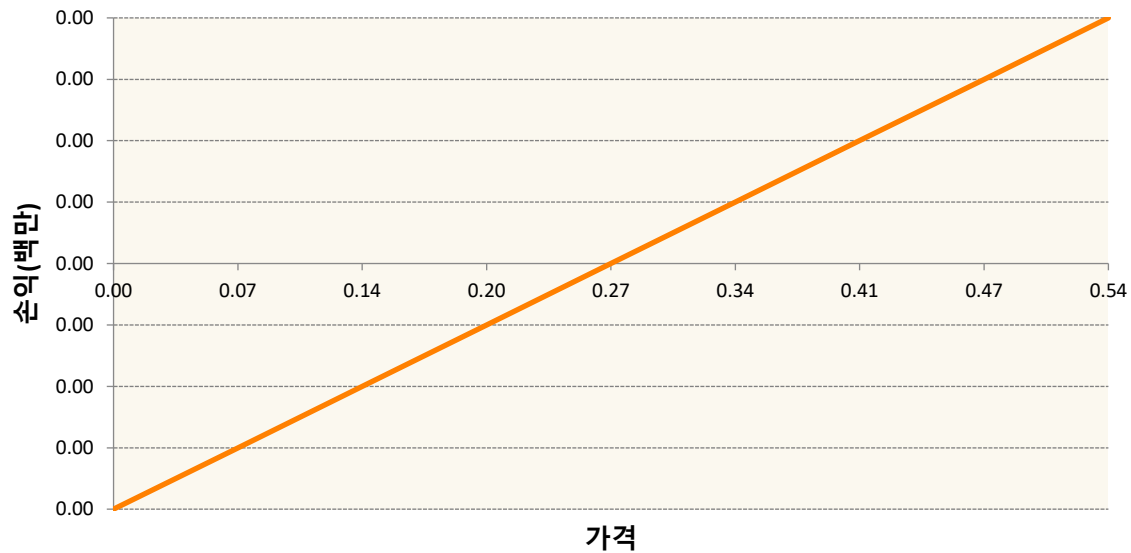
2. 만기시점의 손익구조



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)	19
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	66
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	335
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	124

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

(단위:백만원)

868

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

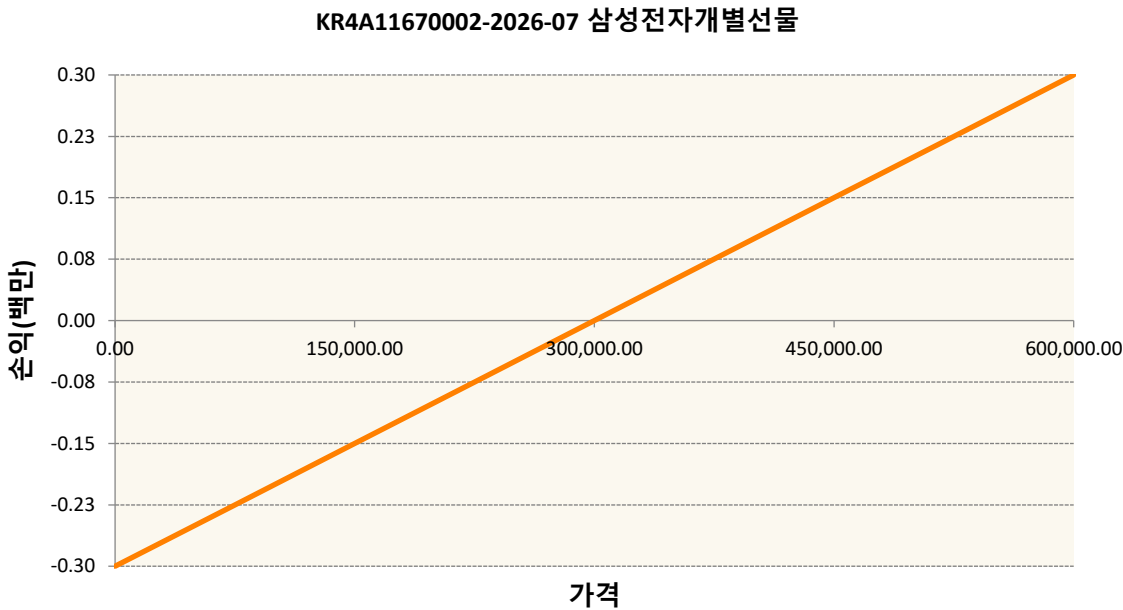
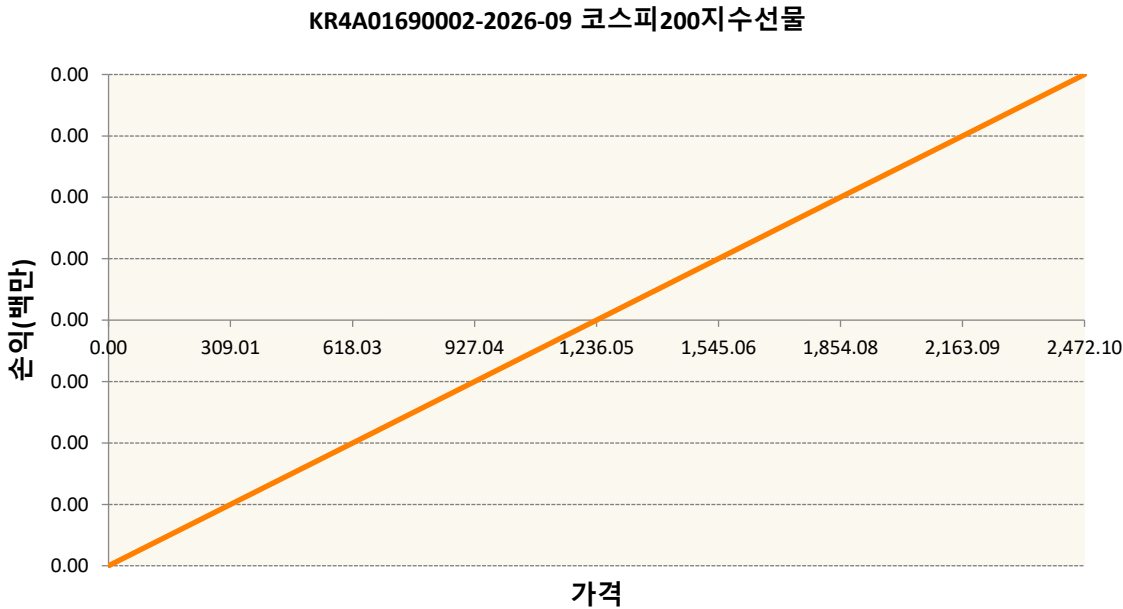
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

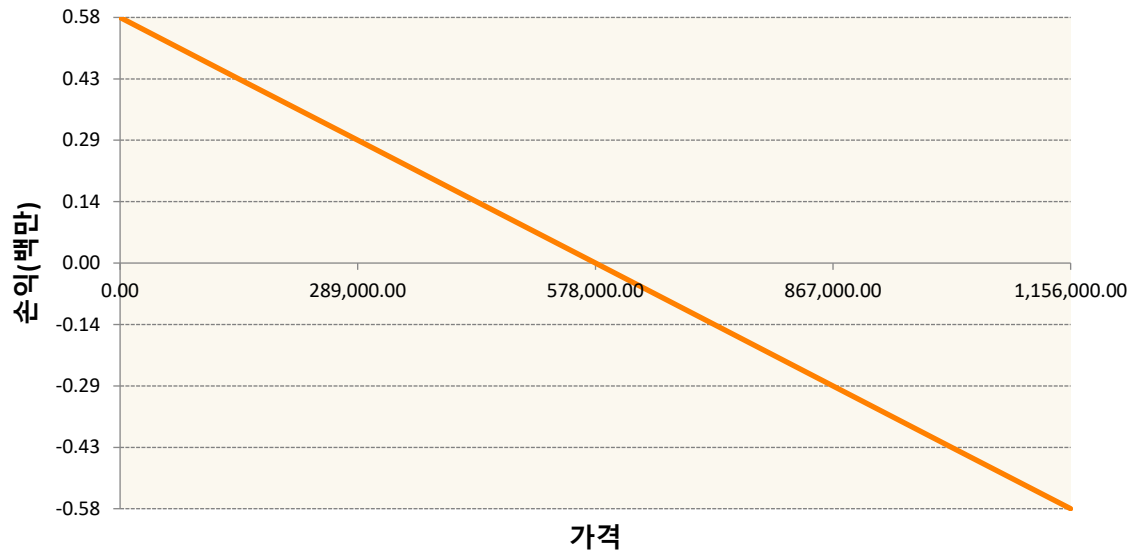
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	798	2,468	-1,669	장내
누계	유가증권	선물	15,698	4,758	10,940	장내

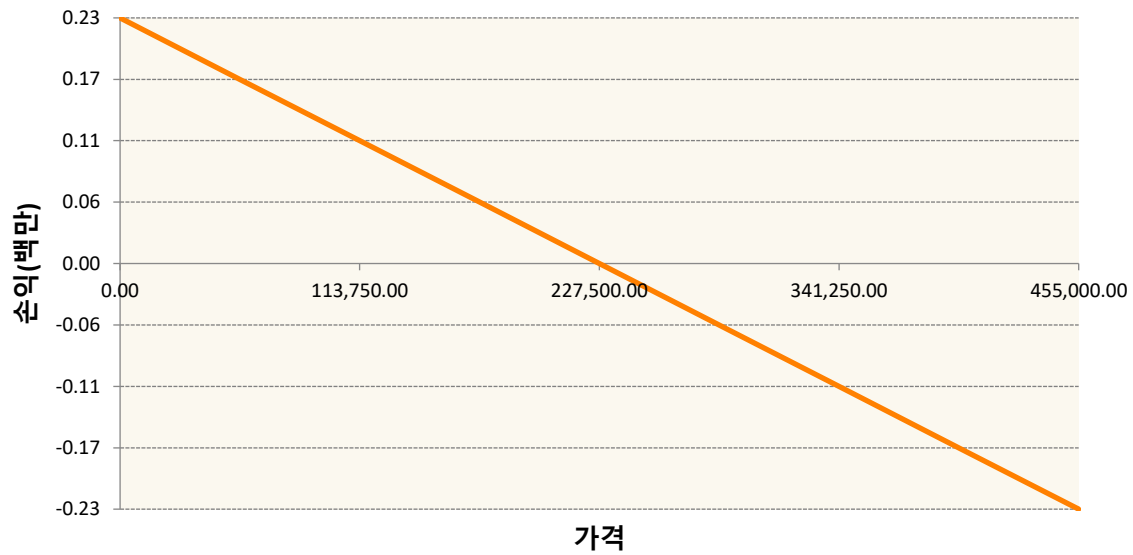
2. 만기시점의 손익구조



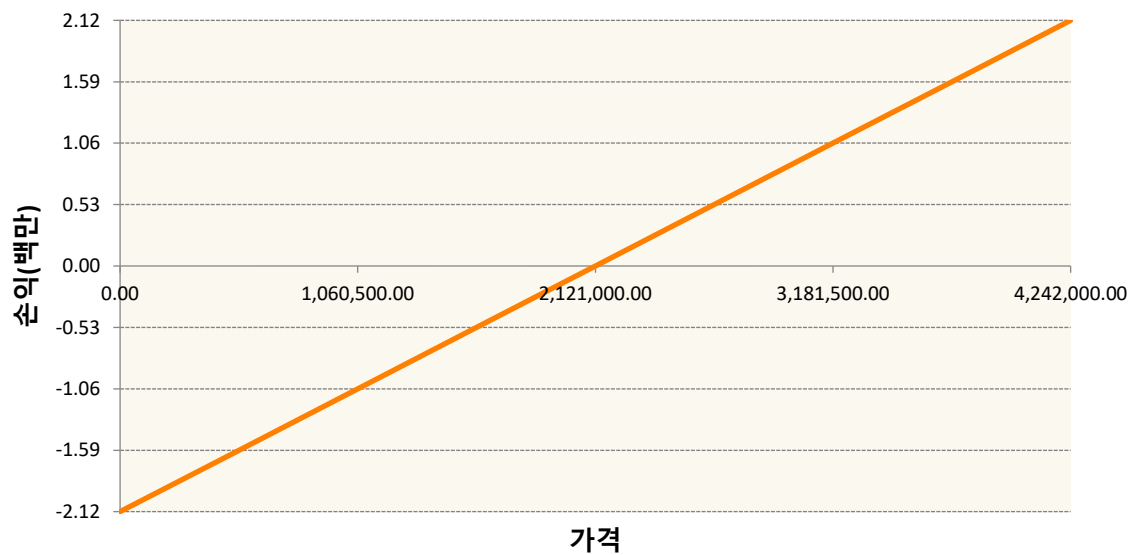
KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



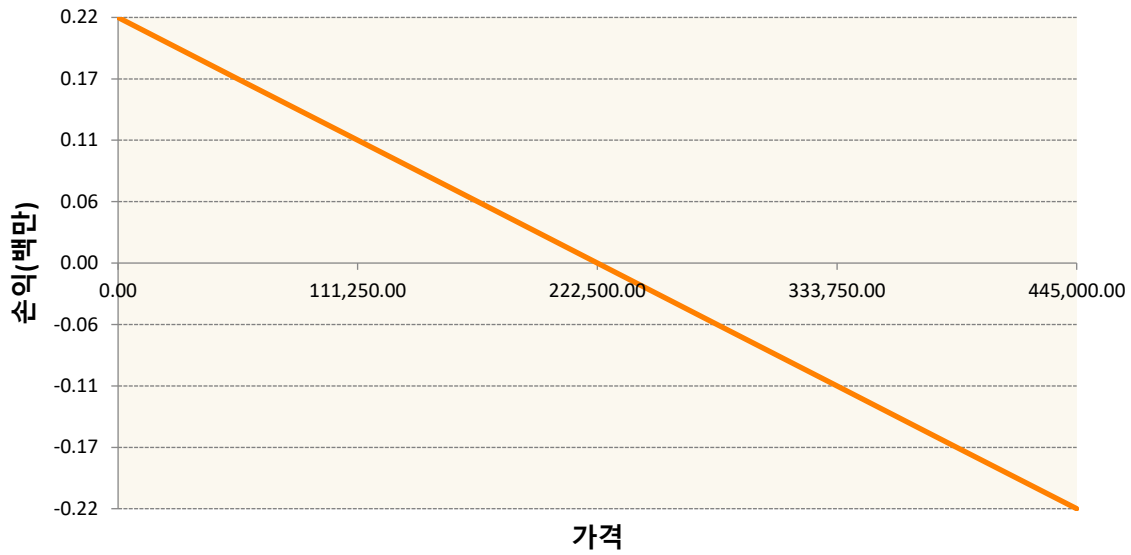
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



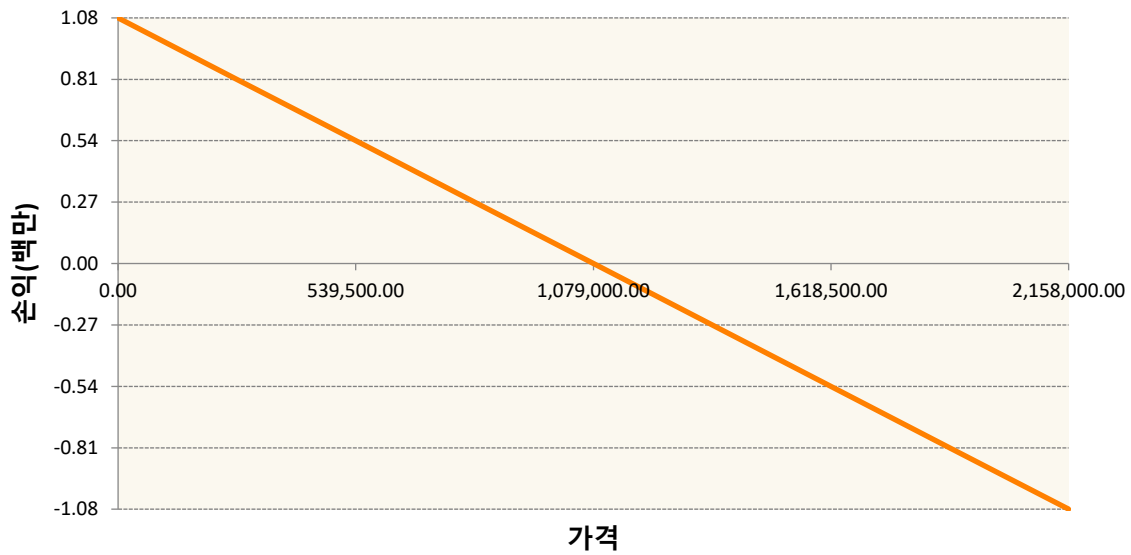
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



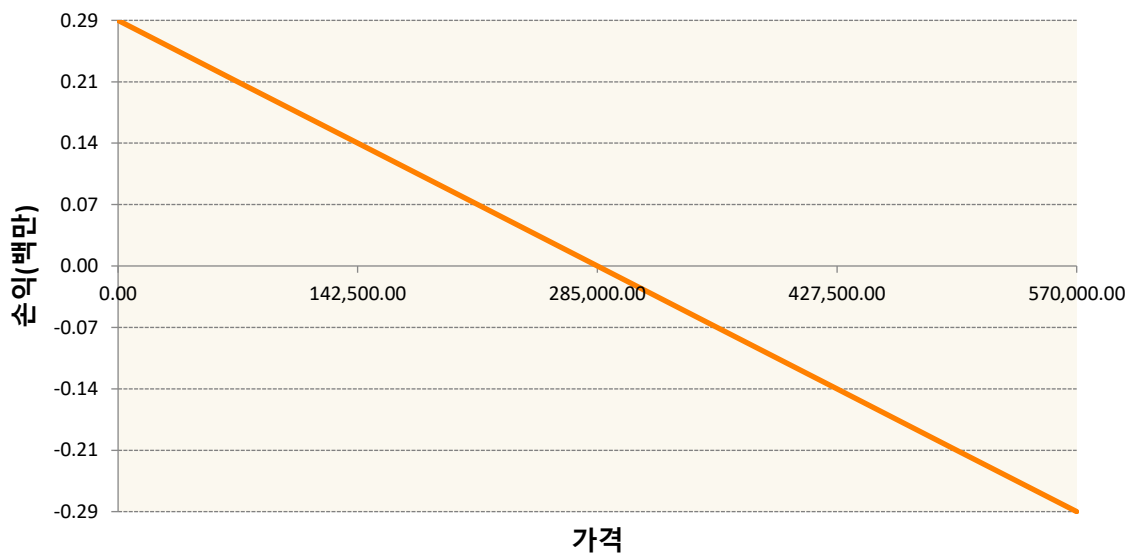
KR4A56670008-2026-07 NAVER개별선물



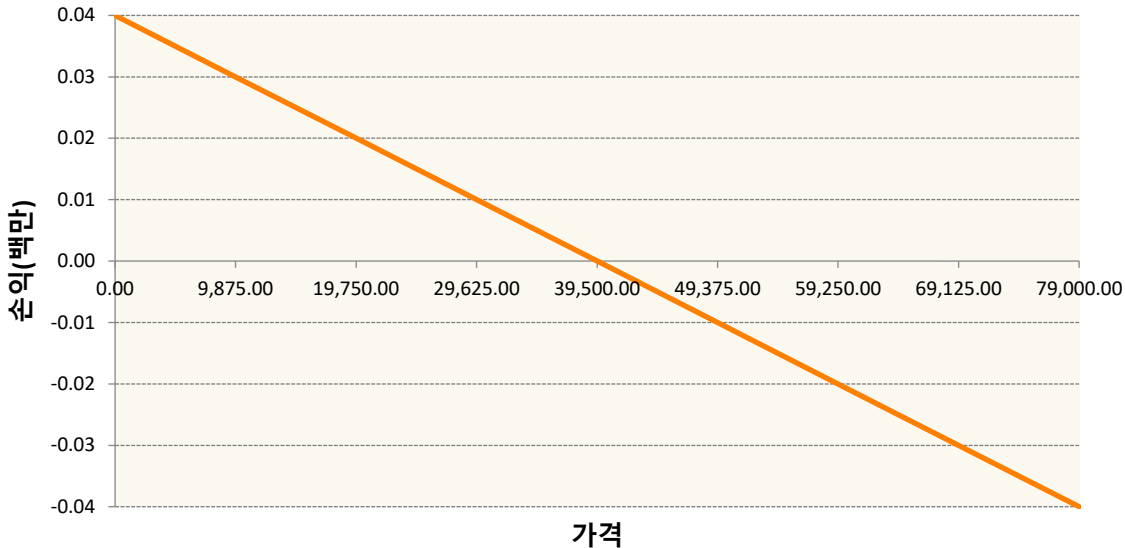
KR4ABY670002-2026-07 LG이노텍개별선물



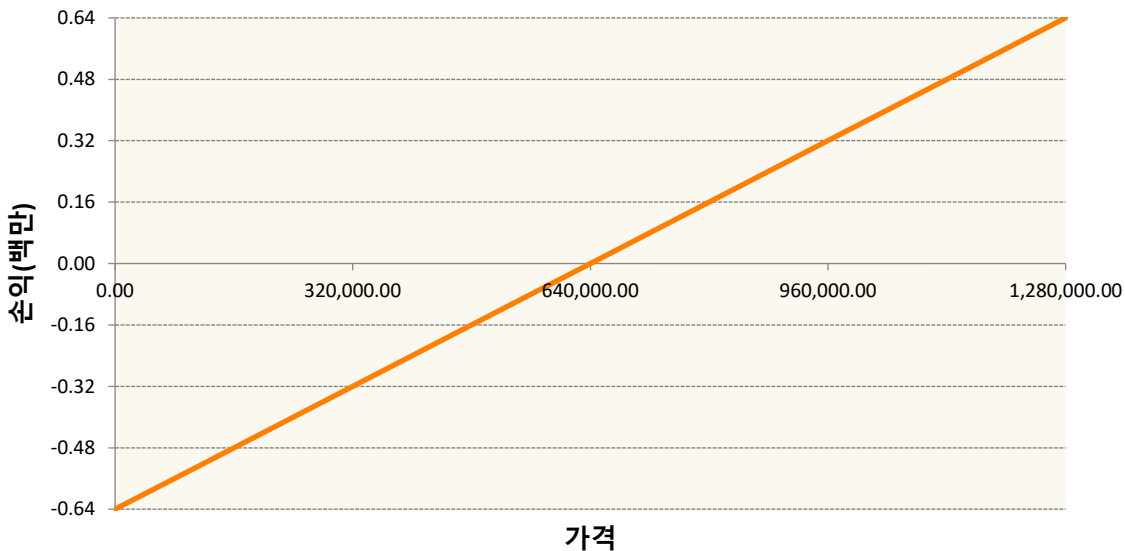
KR4AC0670001-2026-07 OCI홀딩스개별선물



KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					813
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-813	-813	-813	-813	-813	-813	-813
-5.33%	-542	-542	-542	-542	-542	-542	-542
-2.67%	-271	-271	-271	-271	-271	-271	-271
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	271	271	271	271	271	271	271
5.33%	542	542	542	542	542	542	542
8.00%	813	813	813	813	813	813	813
KR4A11670002		2026-07 삼성전자개별선물					337
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-337	-337	-337	-337	-337	-337	-337
-5.33%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225
-2.67%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	112	112	112	112	112	112	112
5.33%	225	225	225	225	225	225	225
8.00%	337	337	337	337	337	337	337
KR4A20670001 2026-07 현대모비스개별선물							69

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	69	69	69	69	69	69	69
-5.33%	46	46	46	46	46	46	46
-2.67%	23	23	23	23	23	23	23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
5.33%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
8.00%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69

KR4A24670007 2026-07 LG전자개별선물							53
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53

KR4A50670004 2026-07 SK하이닉스개별선물							64
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64
-5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	21	21	21	21	21	21	21
5.33%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	64	64	64	64	64	64	64

KR4A56670008 2026-07 NAVER개별선물							66
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	66	66	66	66	66	66	66
-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

2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
8.00%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66

KR4ABY670002 2026-07 LG이노텍개별선물 64

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	64	64	64	64	64	64	64
-5.33%	43	43	43	43	43	43	43
-2.67%	21	21	21	21	21	21	21
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
5.33%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64

KR4AC0670001 2026-07 OCI홀딩스개별선물 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

KR4ACF670004 2026-07 카카오개별선물 100

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	100	100	100	100	100	100
-5.33%	67	67	67	67	67	67	67
-2.67%	33	33	33	33	33	33	33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67
8.00%	-100	-100	-100	-100	-100	-100	-100

KR4AFD670003 2026-07 HD현대중공업개별선물 38

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
-5.33%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-2.67%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	13	13	13	13	13	13	13
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	38	38	38	38	38	38	38

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

(단위:백만원)

3,967

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

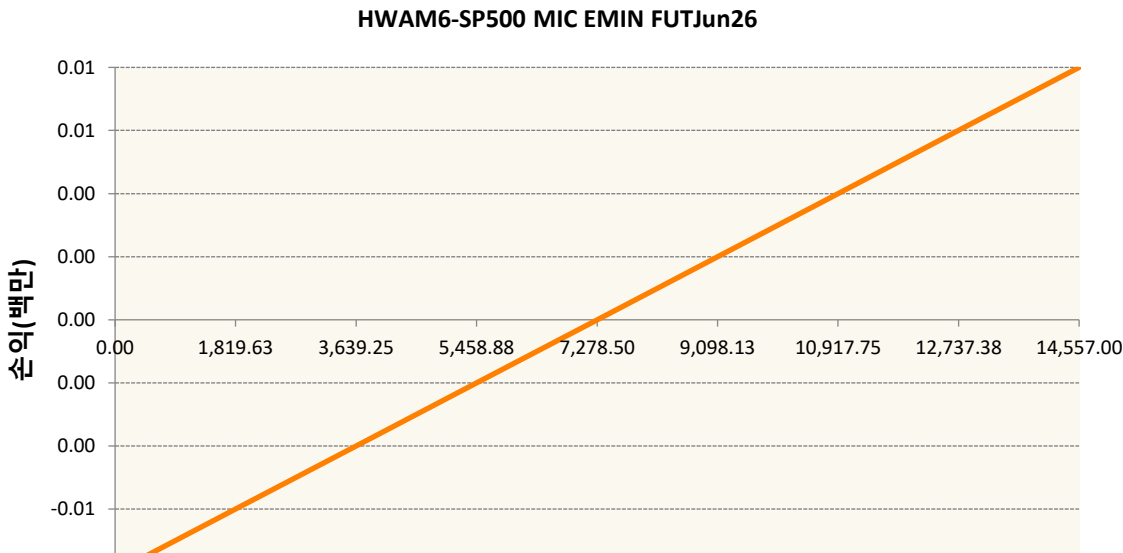
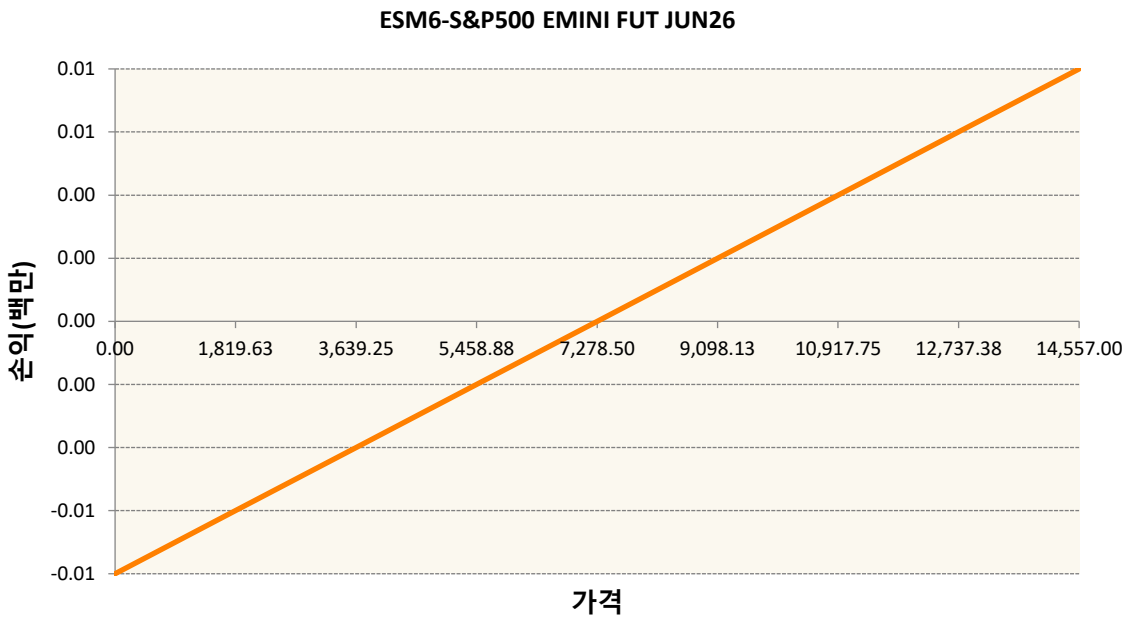
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

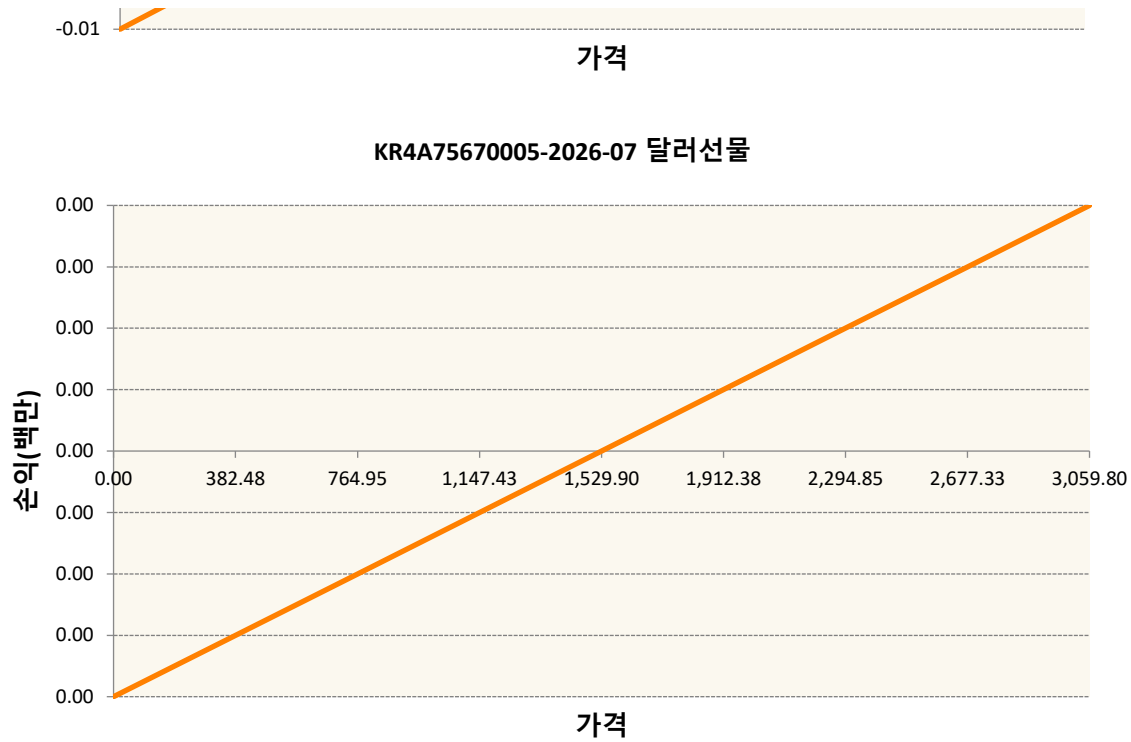
1. 계약금액

(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	58,983	0	58,983	
누계	지수	선물	271	0	271	장내
누계	통화	선물	10,862	0	10,862	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,719
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	22
KR4A756700	2026-07 달러선물	869

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

(단위:백만원)

4,080

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

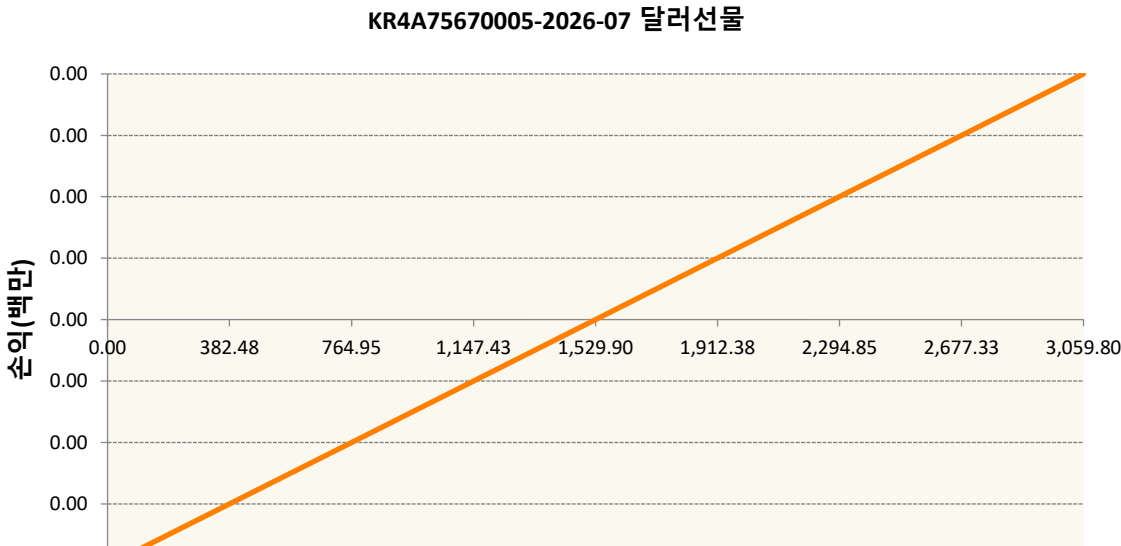
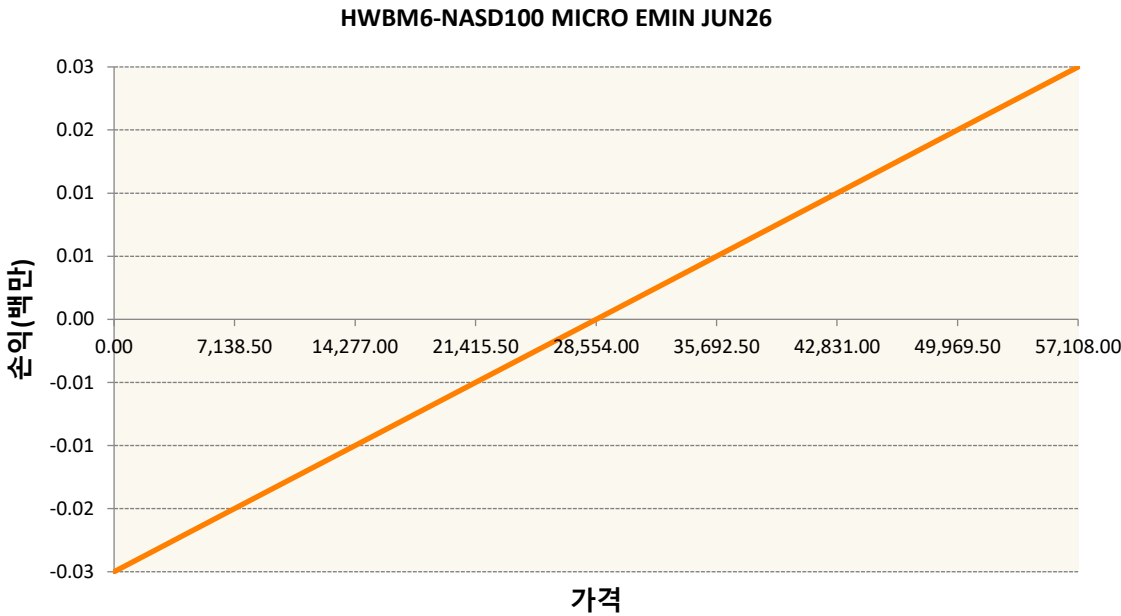
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

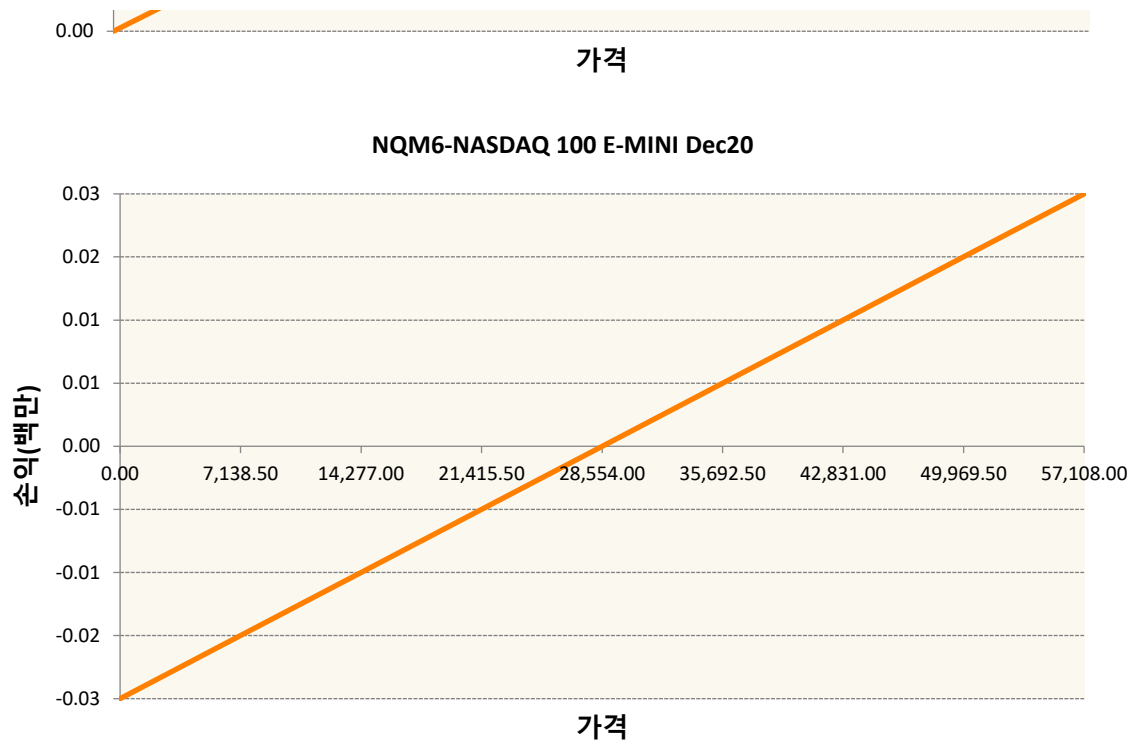
1. 계약금액

(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	29,134	0	29,134	
누계	유가증권	선물	249	0	249	장내
누계	통화	선물	3,993	0	3,993	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	20
KR4A756700	2026-07 달러선물	319
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,331

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

(단위:백만원)

2,598

공시일	2026-06-12
기준일	2026-06-11

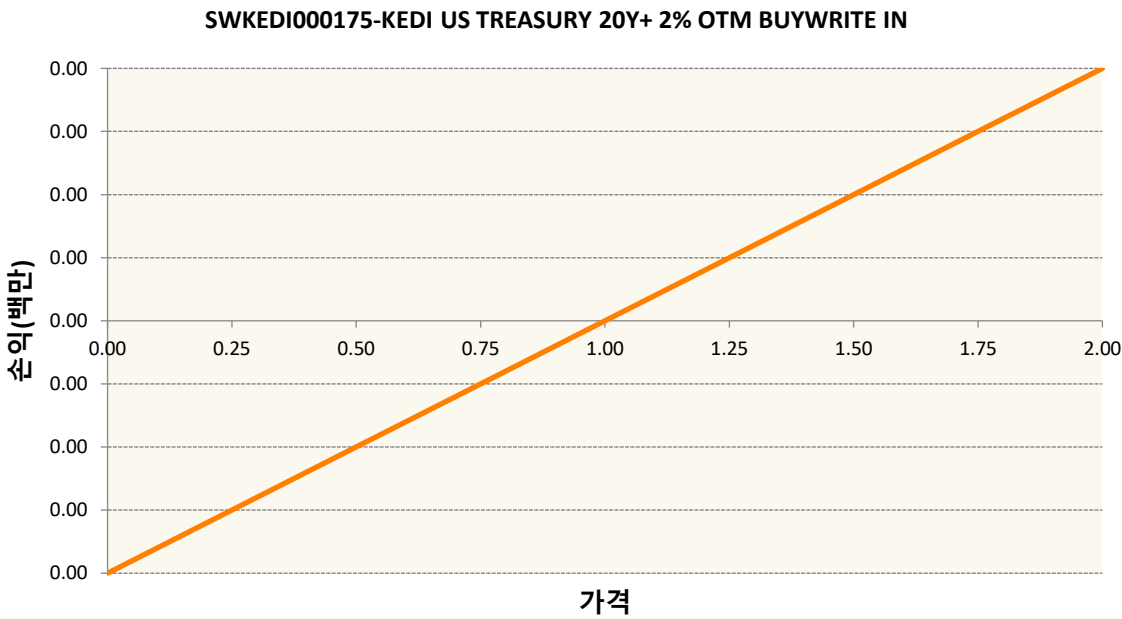
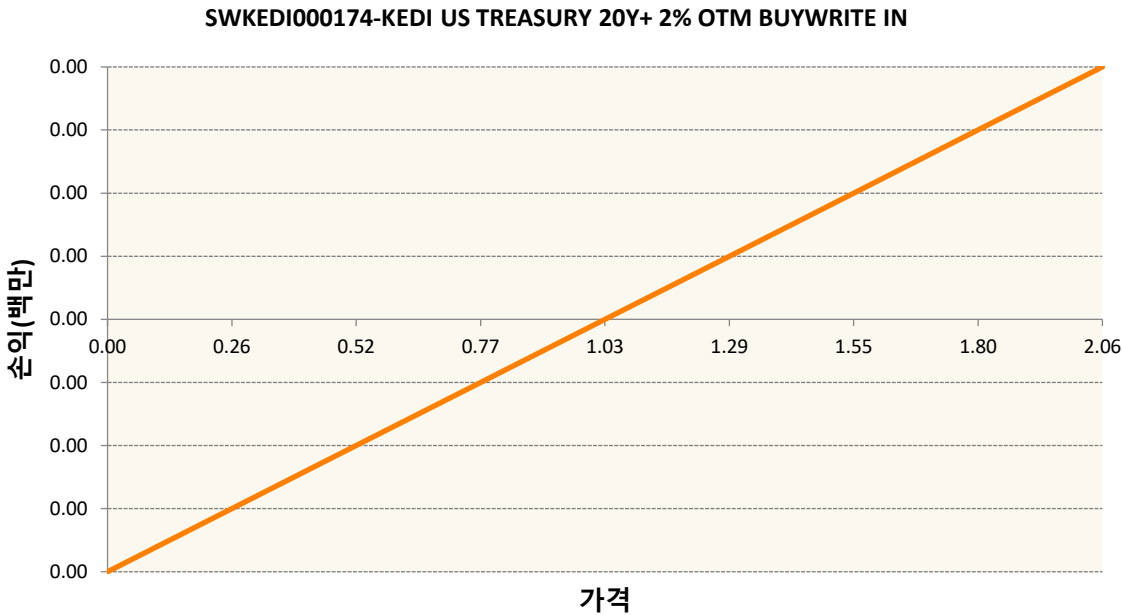
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

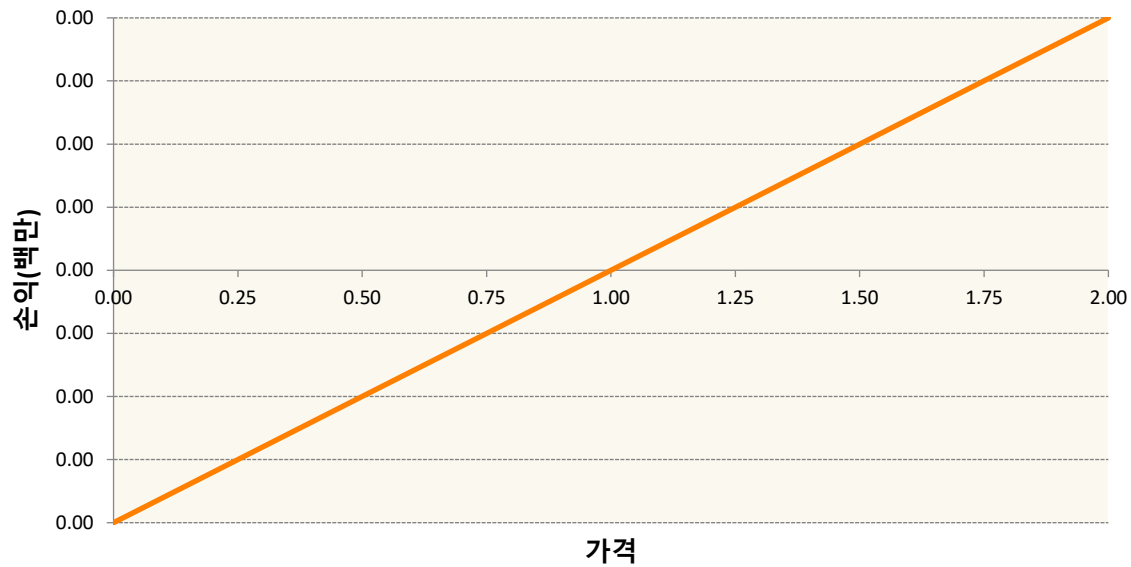
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	336,265	0	336,265	장외

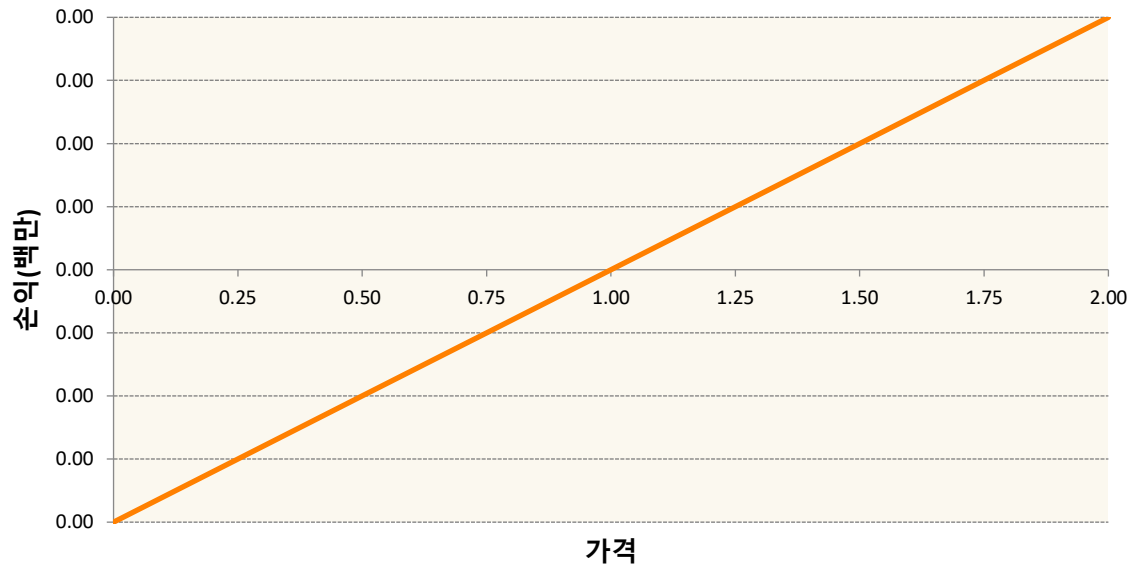
2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000176-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000181-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,138
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,405
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,153
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,200

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

(단위:백만원)

11,293