

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

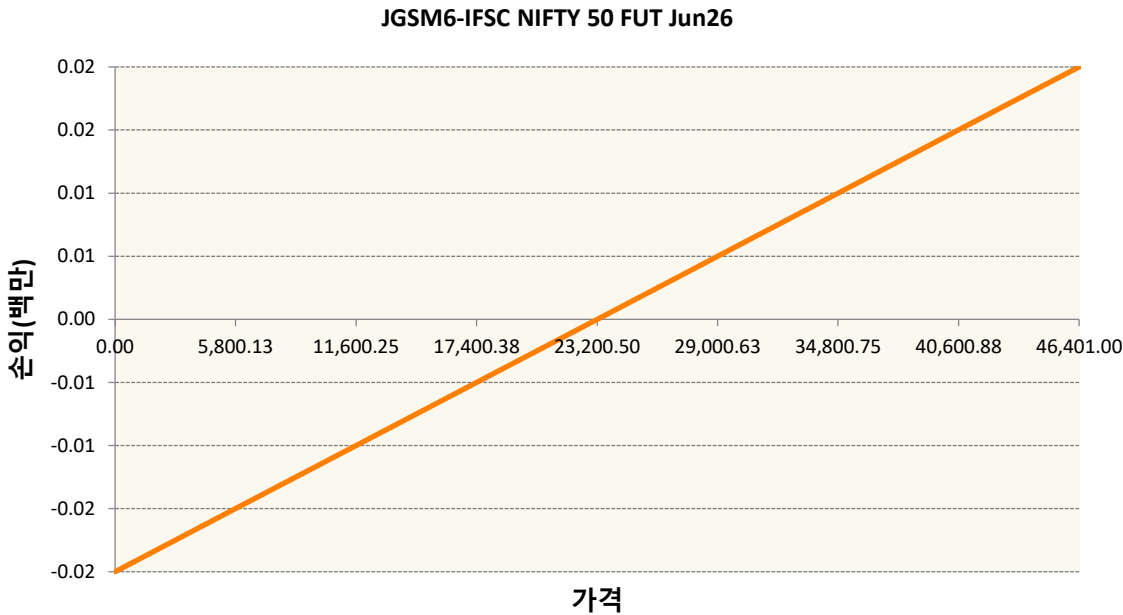
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-06-15
기준일	2026-06-12

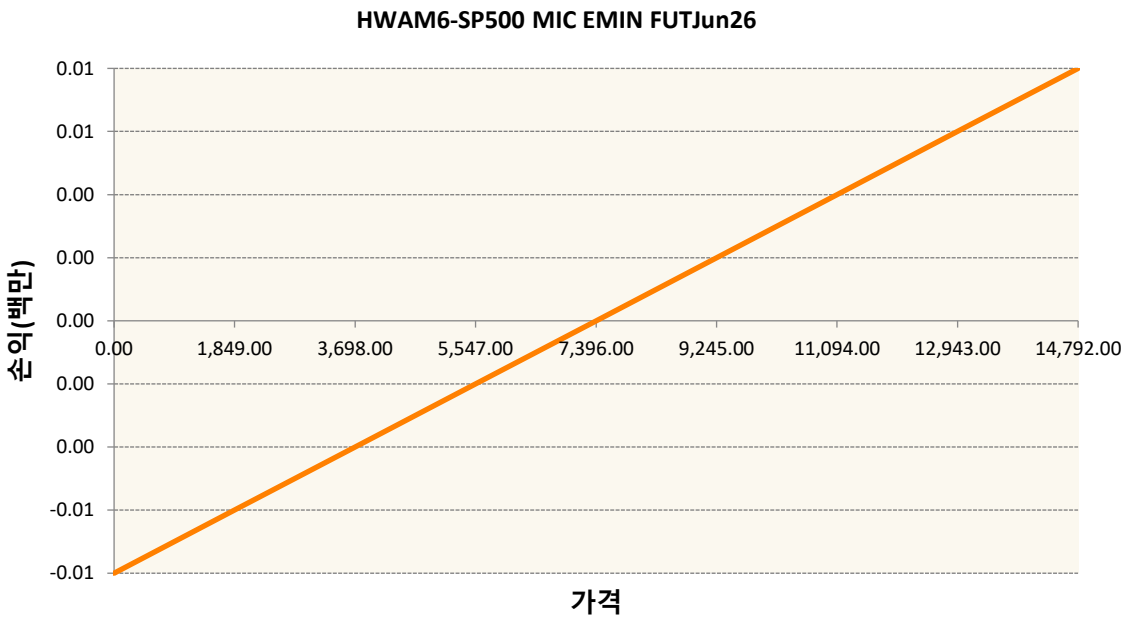
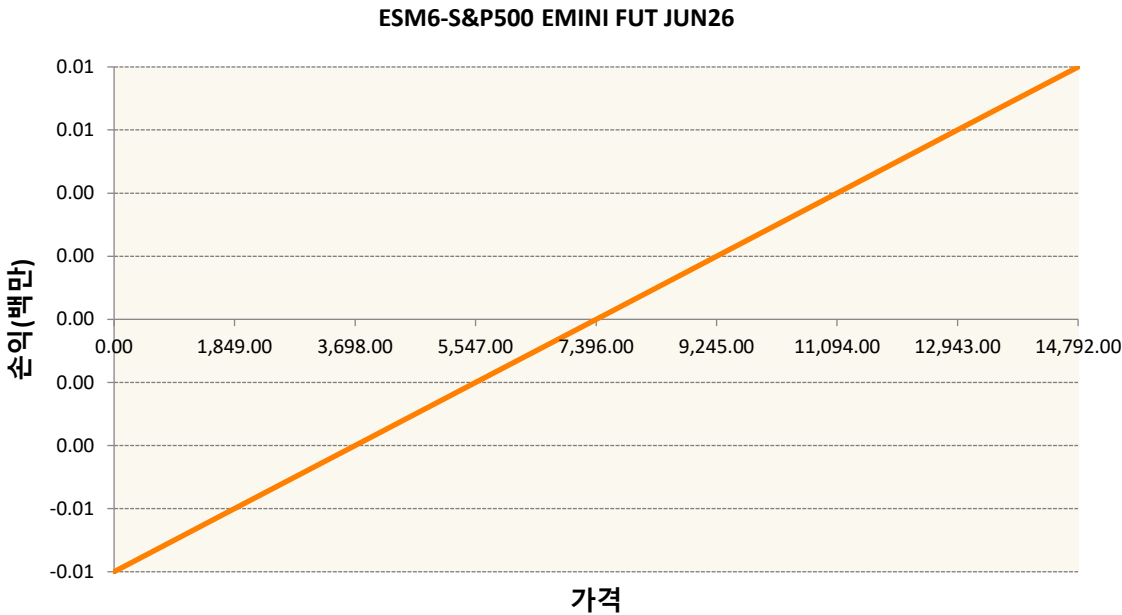
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	556	0	556	
누계	지수	선물	112	0	112	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	44
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	9

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	46

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

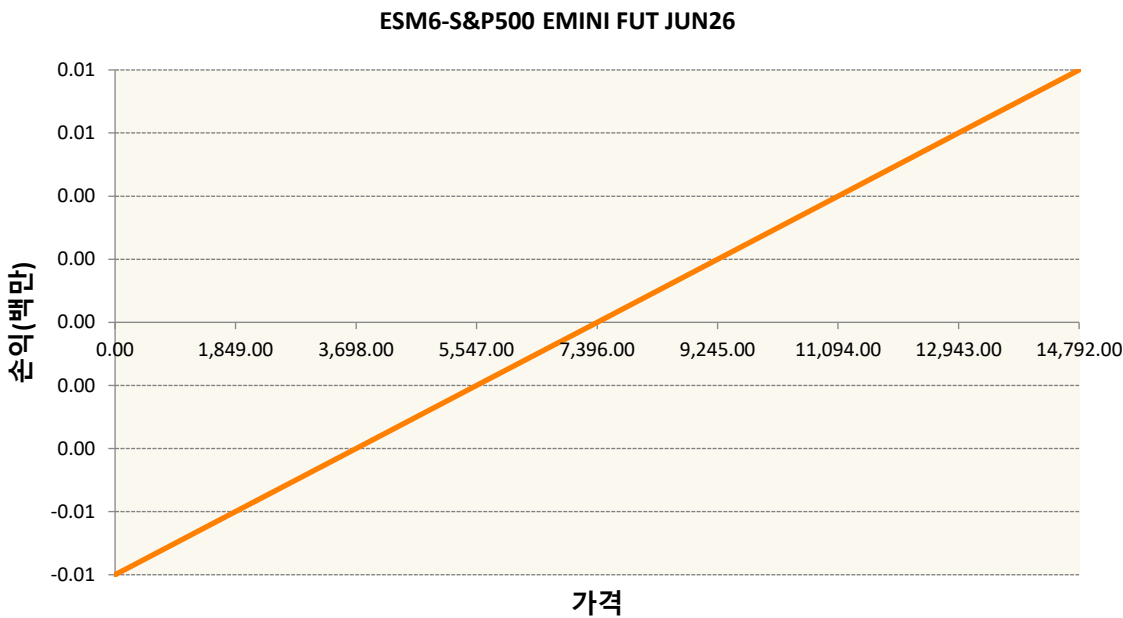
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,111	0	1,111	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	89
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

77

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

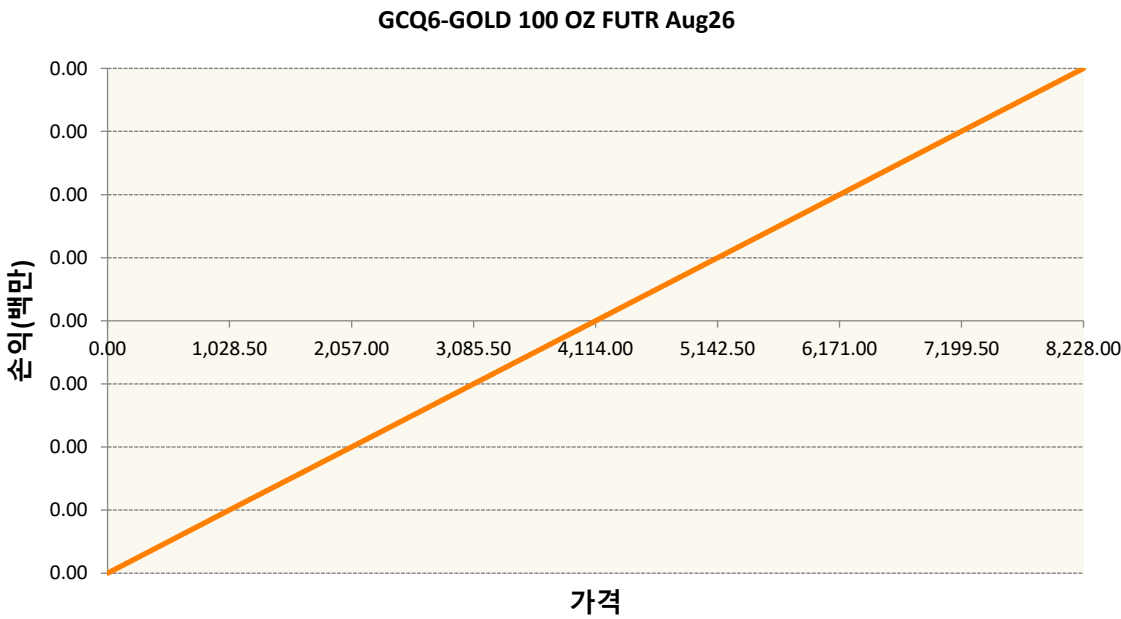
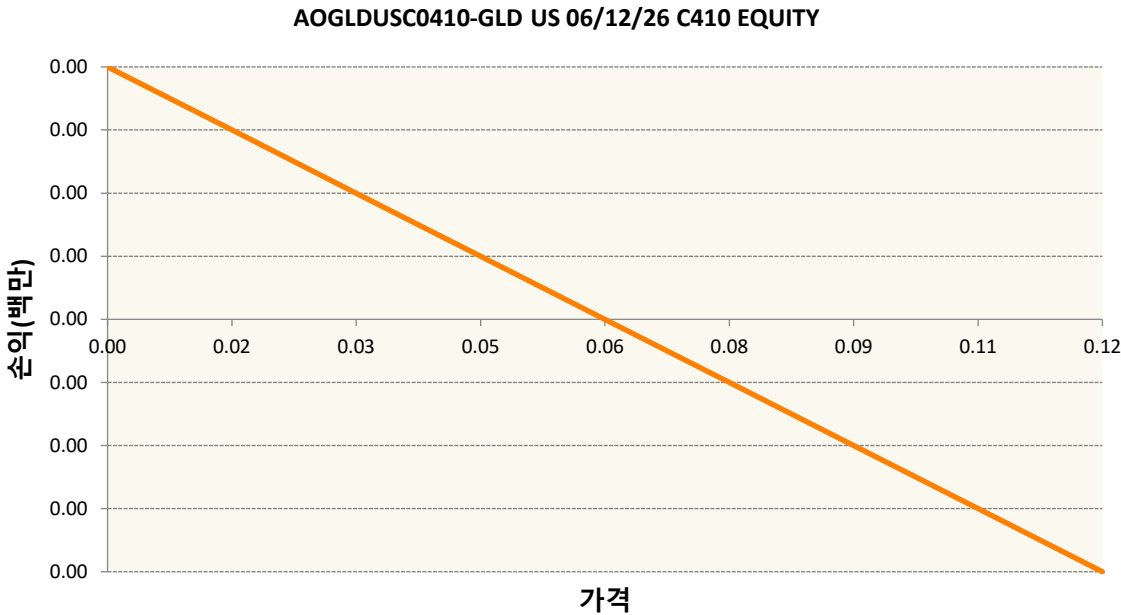
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,934	0	4,934	
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		395

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	511

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

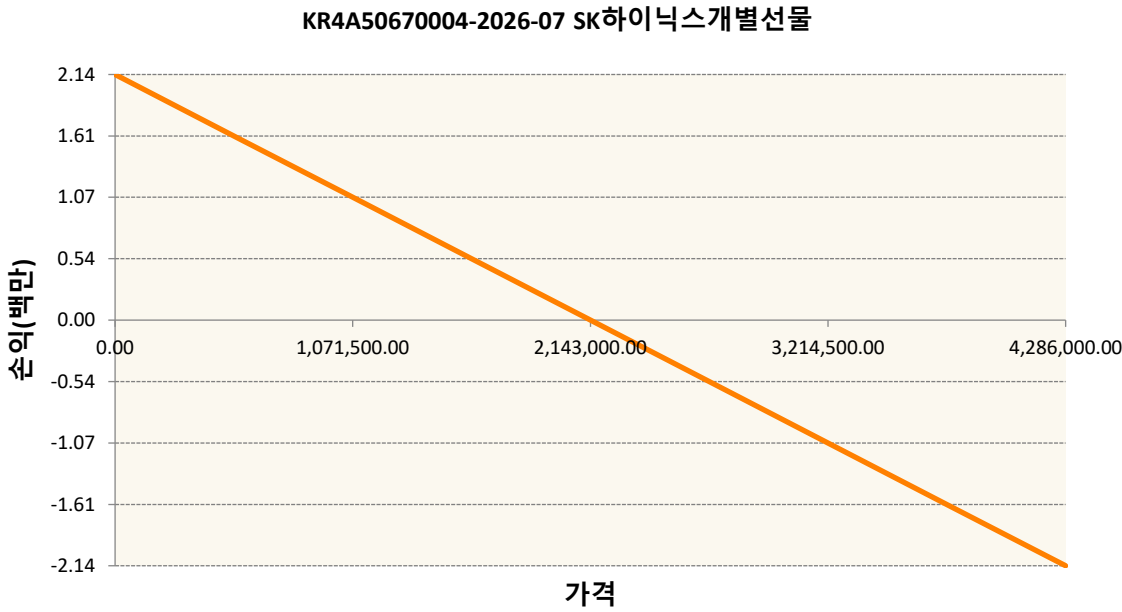
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	11,558	-11,558	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	10,715	-10,715	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUCC PLTR US 06/12/26 C140 EQUITY	0.02
AOPLTRUCP PLTR US 06/18/26 P140 EQUITY	13
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	5
KR4A506700 2026-07 SK하이닉스개별선물	857

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

(단위:백만원)

255

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

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

1

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

(단위:백만원)

1

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

(단위:백만원)

17,584

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

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	2026-06-15
기준일	2026-06-12

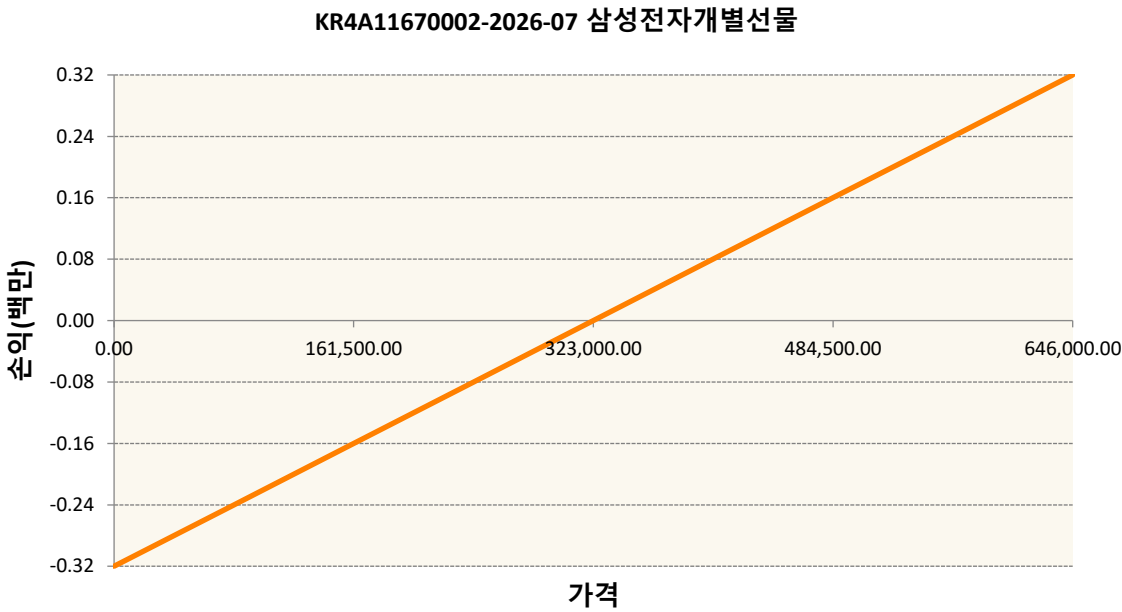
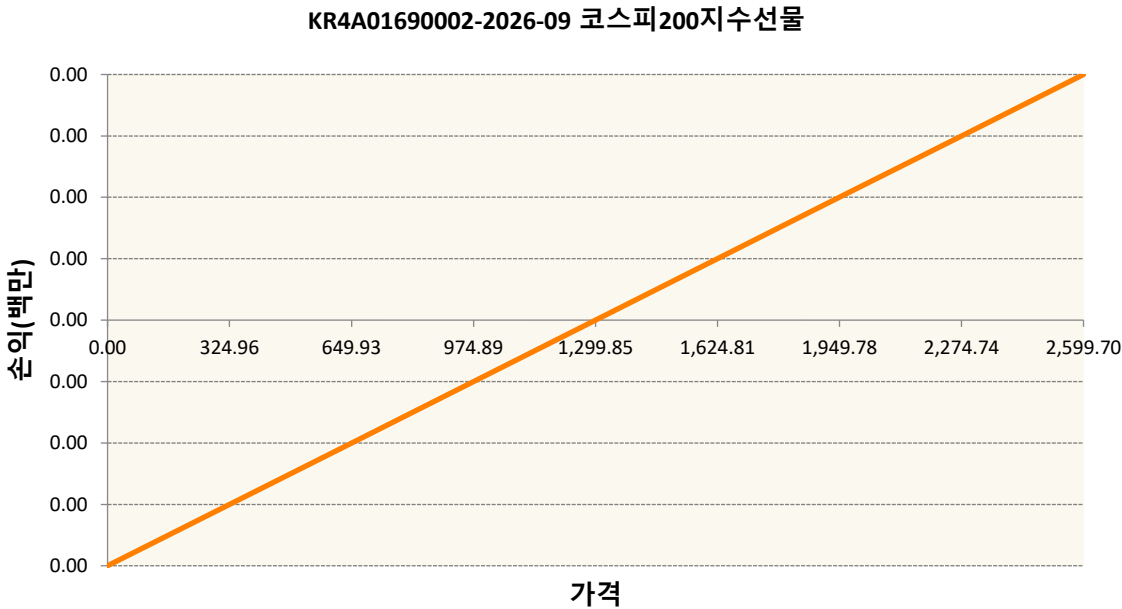
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	25,891	38,547	-12,656	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis represents price, ranging from 0.00 to 2,465.00. The y-axis represents profit/loss in millions, ranging from -1,000.00 to 1,000.00. The blue line shows that as the price increases, the profit/loss decreases linearly, starting at 0.00 when the price is 0.00 and reaching -1,000.00 when the price is 2,465.00.

가격	손익(백만)
0.00	0.00
308.13	-200.00
616.25	-400.00
924.38	-600.00
1,232.50	-800.00
1,540.63	-1,000.00
1,848.75	-1,200.00
2,156.88	-1,400.00
2,465.00	-1,600.00

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				671
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-671	-671	-671	-671	-671	-671	-671	
-5.33%	-448	-448	-448	-448	-448	-448	-448	
-2.67%	-224	-224	-224	-224	-224	-224	-224	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	224	224	224	224	224	224	224	
5.33%	448	448	448	448	448	448	448	
8.00%	671	671	671	671	671	671	671	
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물				1,393
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393	-1,393
-5.33%	-929	-929	-929	-929	-929	-929	-929
-2.67%	-464	-464	-464	-464	-464	-464	-464
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	464	464	464	464	464	464	464
5.33%	929	929	929	929	929	929	929
8.00%	1,393	1,393	1,393	1,393	1,393	1,393	1,393
KR4BAFBHA944 코스피위클리M C 2606W3 1,232.5							1,937

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,937	1,937	1,937	1,937	1,937	1,937	1,937
-5.33%	1,291	1,291	1,291	1,291	1,291	1,291	1,291
-2.67%	646	646	646	646	646	646	646
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-646	-646	-646	-646	-646	-646	-646
5.33%	-1,291	-1,291	-1,291	-1,291	-1,291	-1,291	-1,291
8.00%	-1,937	-1,937	-1,937	-1,937	-1,937	-1,937	-1,937
KR4BAFBHA951 코스피위클리M C 2606W3 1,235.0							1,291

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,291	1,291	1,291	1,291	1,291	1,291	1,291
-5.33%	861	861	861	861	861	861	861
-2.67%	430	430	430	430	430	430	430
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-430	-430	-430	-430	-430	-430	-430
5.33%	-861	-861	-861	-861	-861	-861	-861
8.00%	-1,291	-1,291	-1,291	-1,291	-1,291	-1,291	-1,291

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

(단위:백만원)

13,948

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

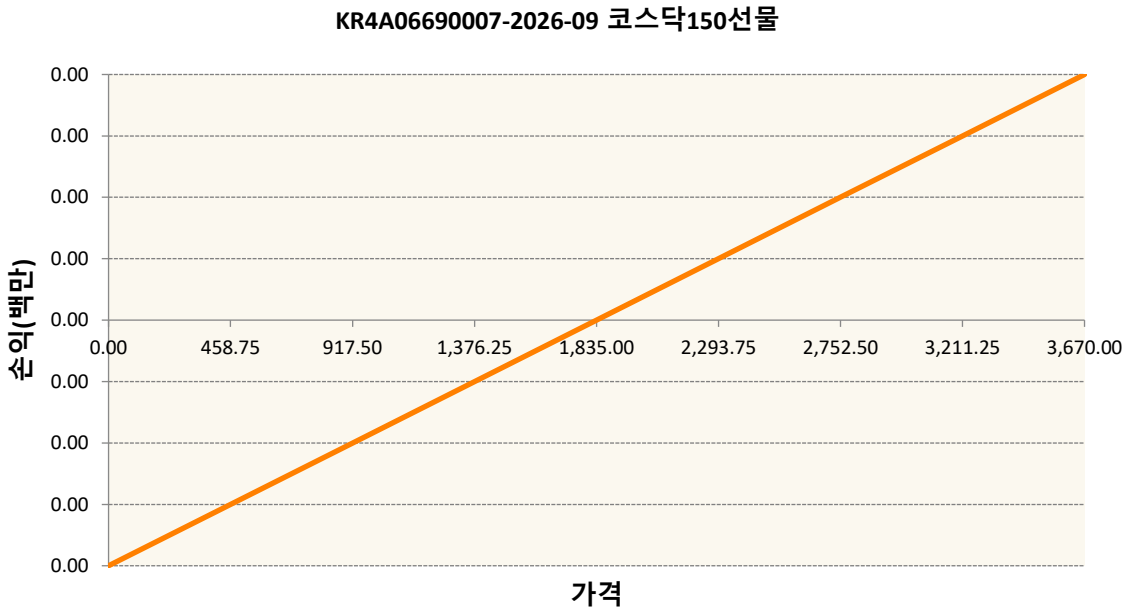
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,083	0	1,083	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				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

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

(단위:백만원)

222

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

(단위:백만원)

17,819

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

(단위:백만원)

57,608

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

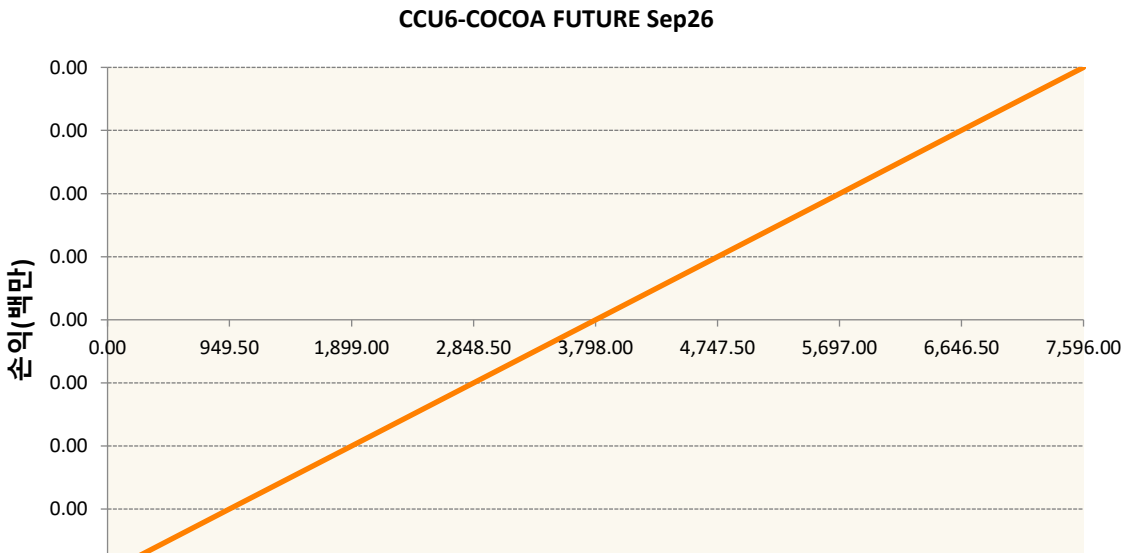
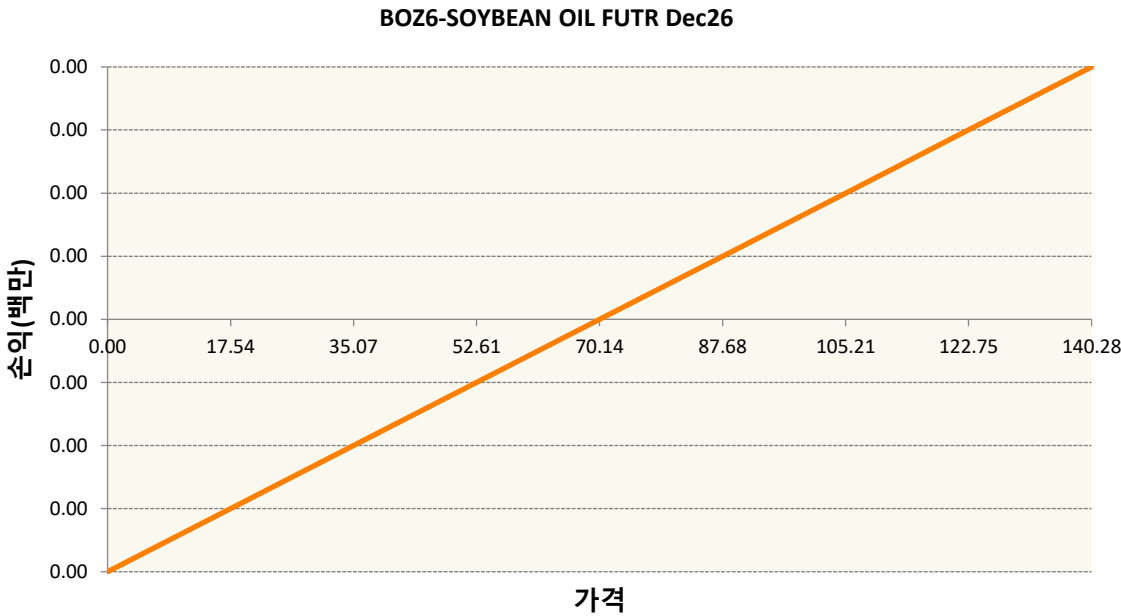
포커스농산물모(채권-파생형)

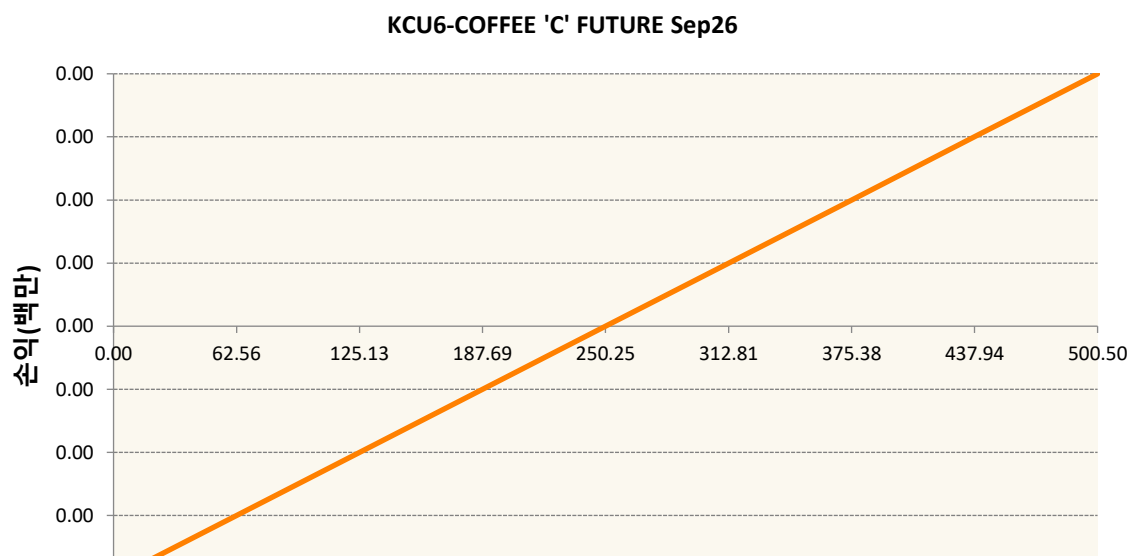
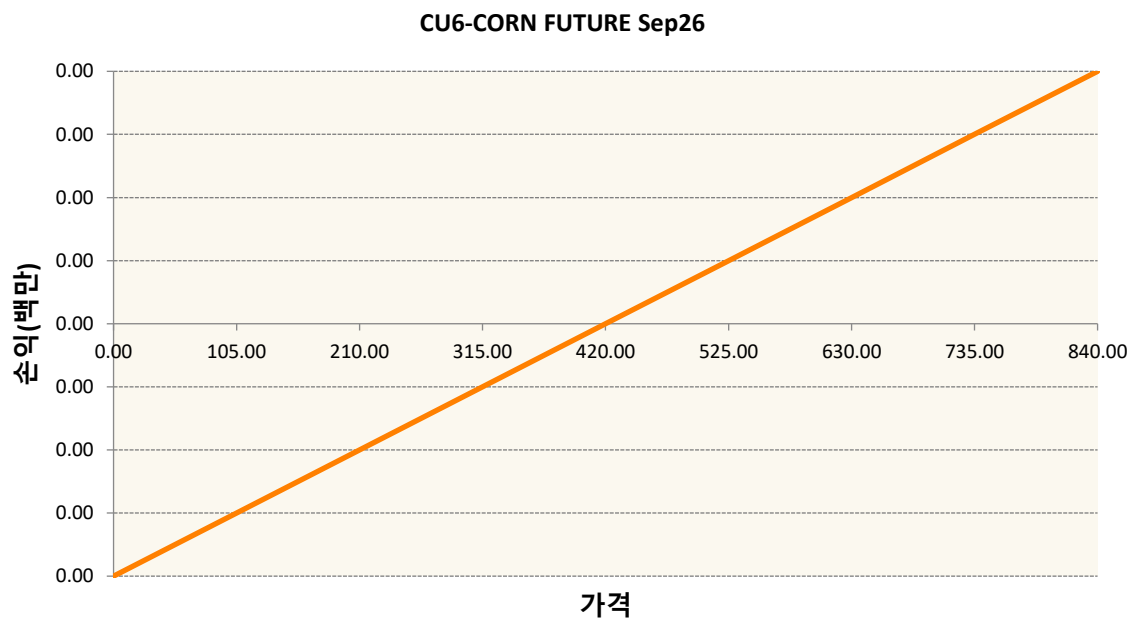
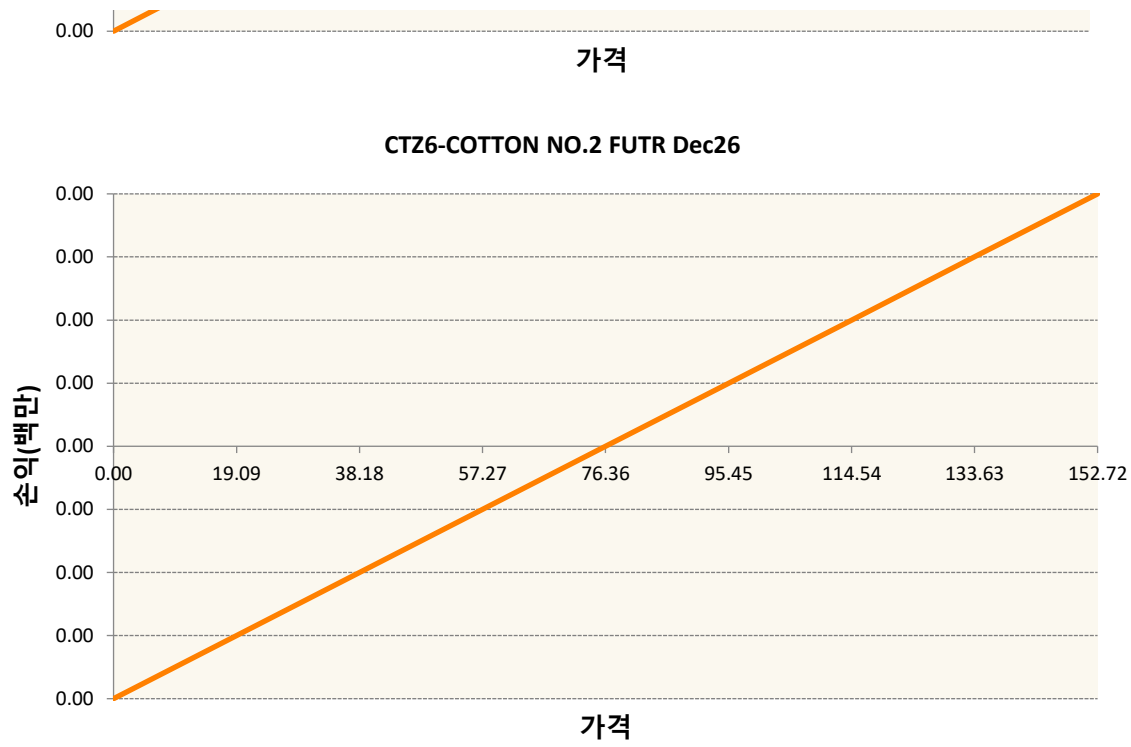
1. 계약금액

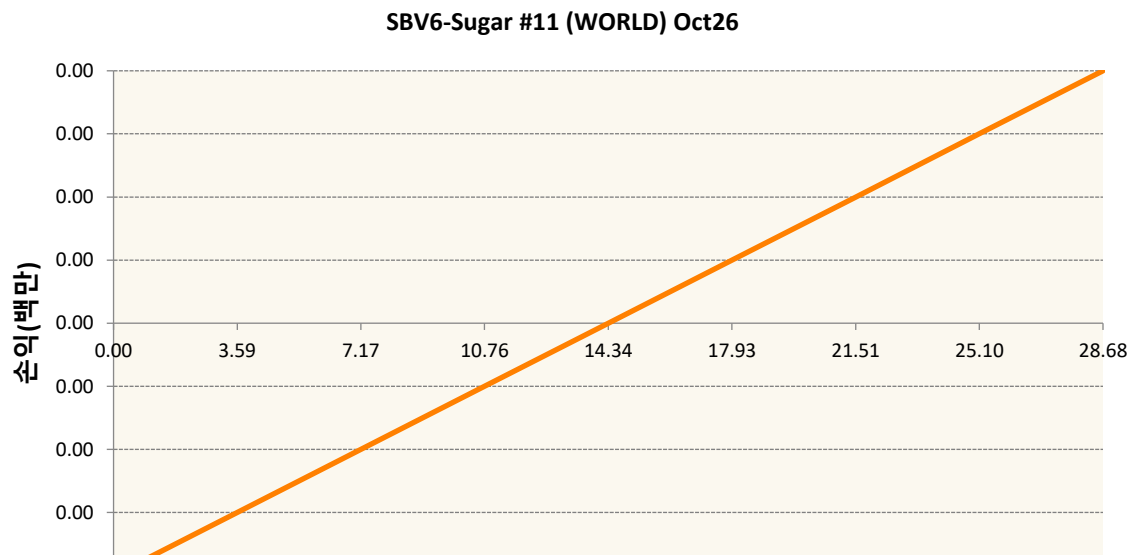
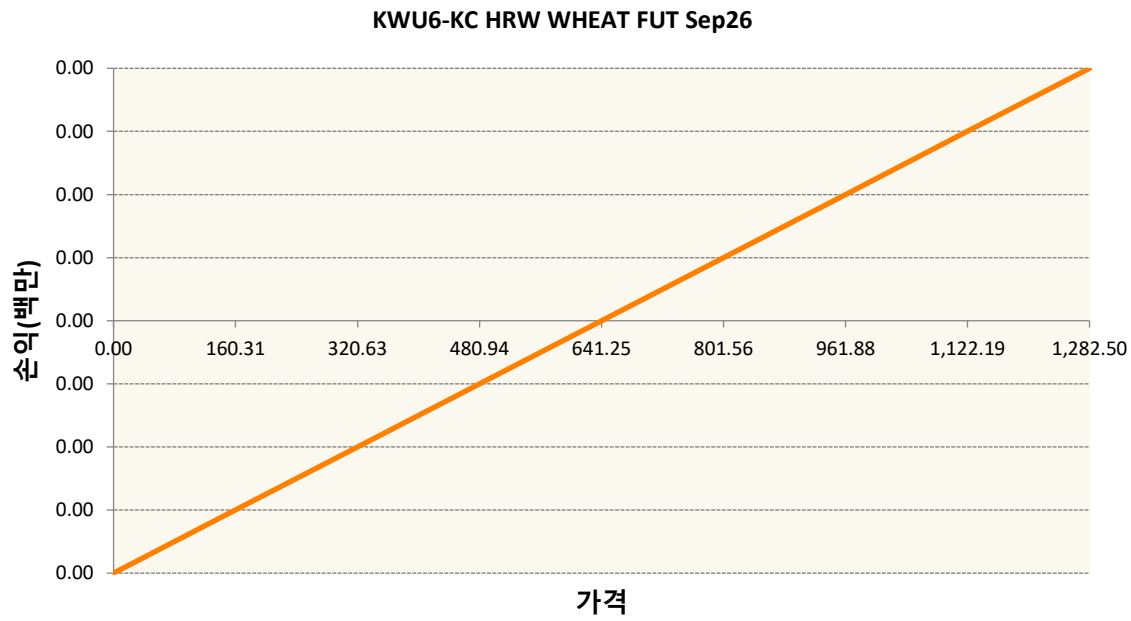
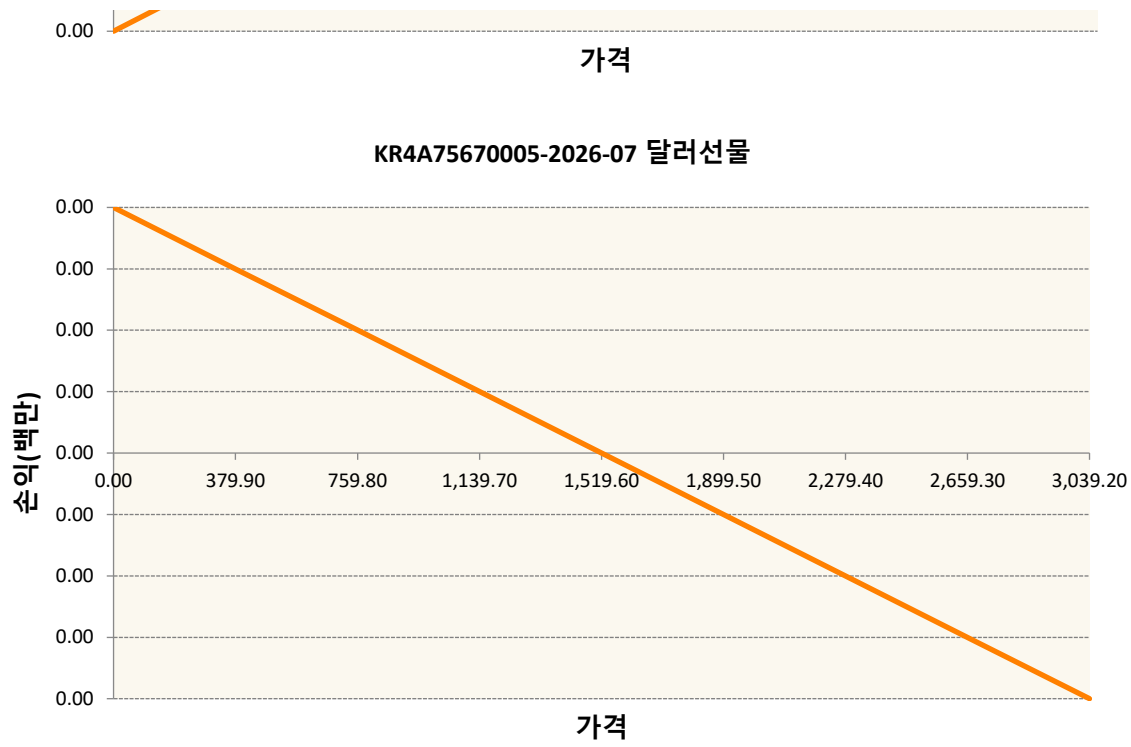
(단위:USD 백만)

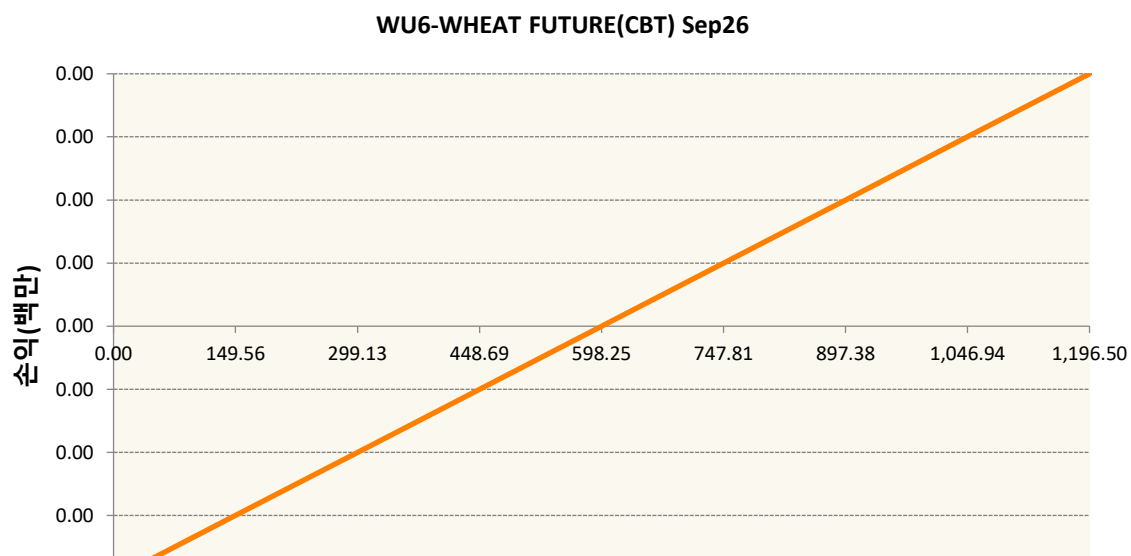
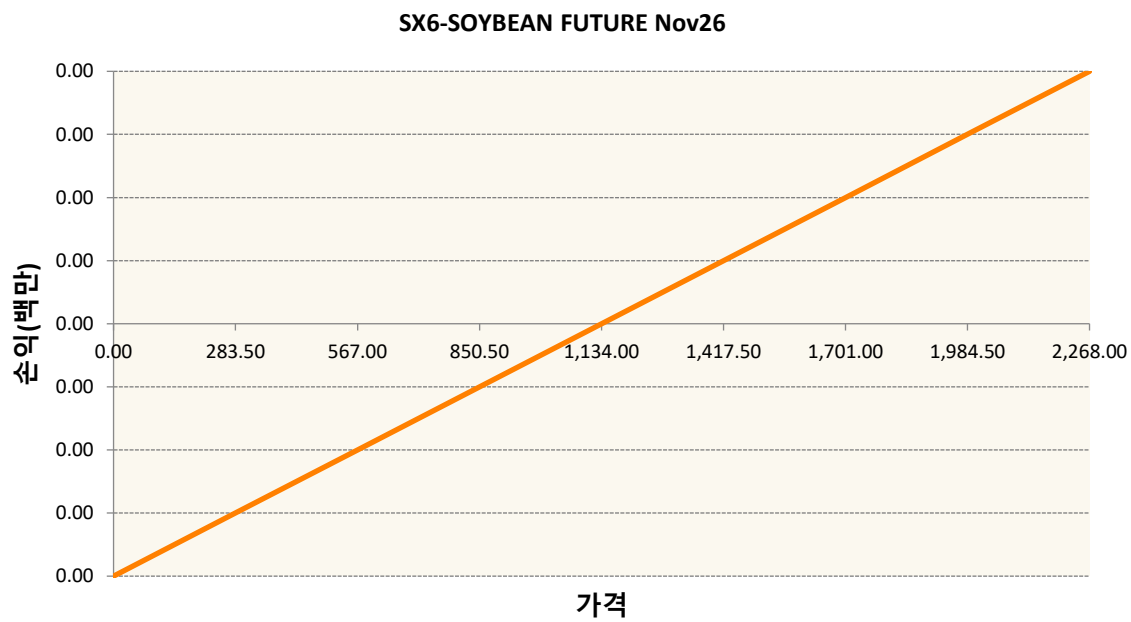
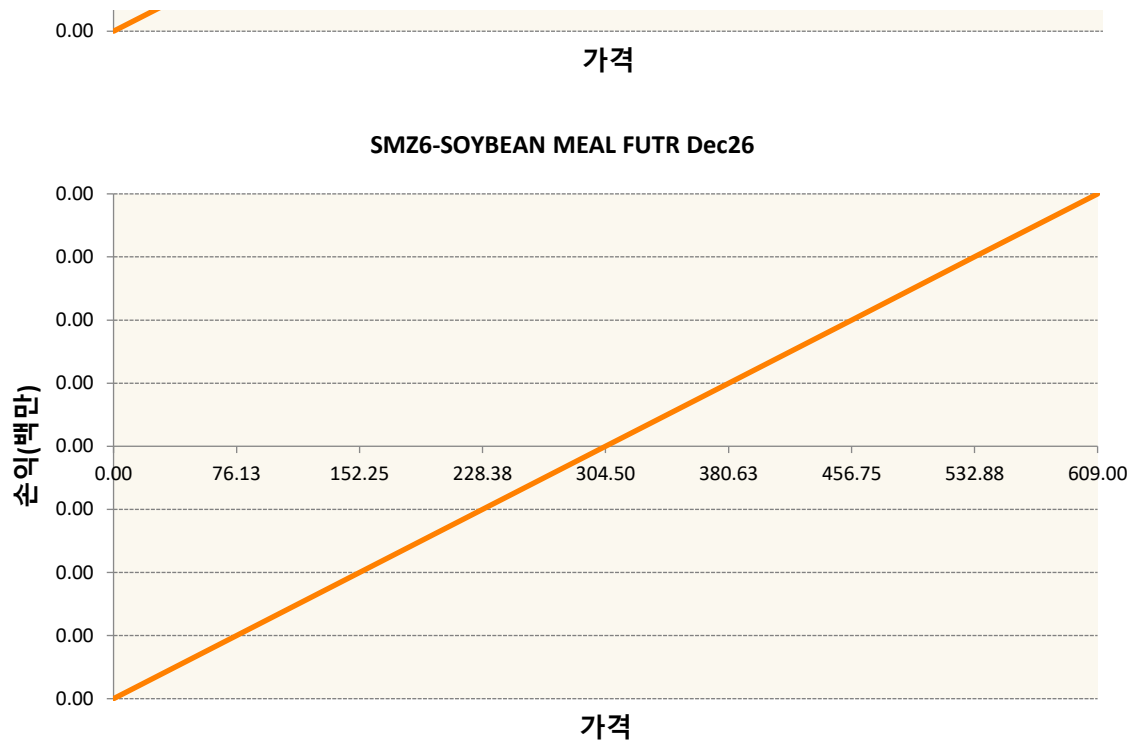
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	443	0	443	
누계	유가증권	선물	2,107	0	2,107	
누계	통화	선물	0	167	-167	장내

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	2026-06-15
기준일	2026-06-12

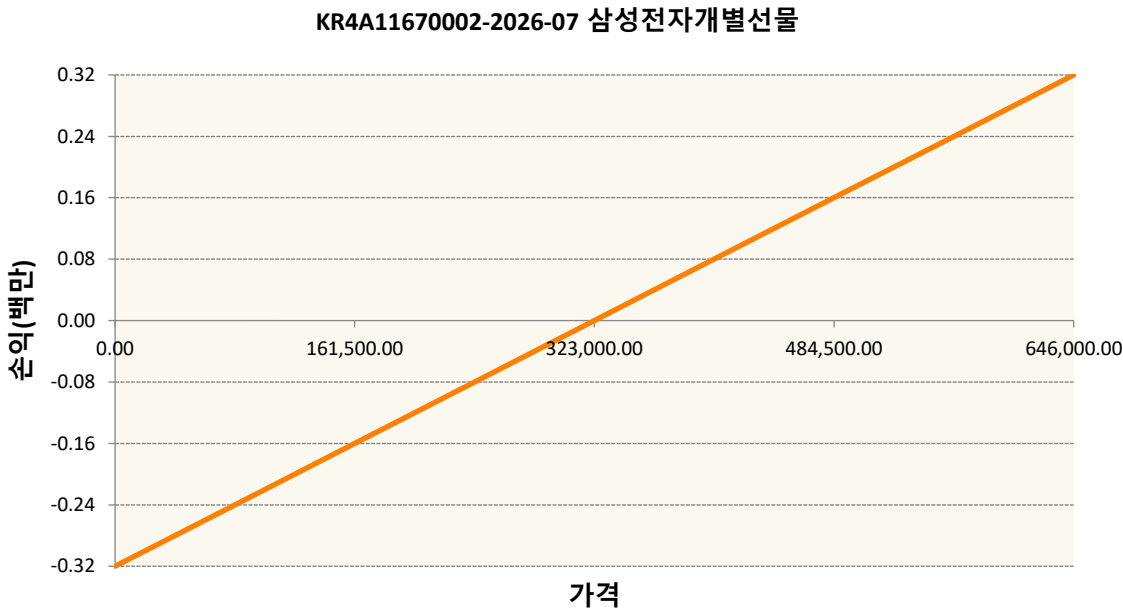
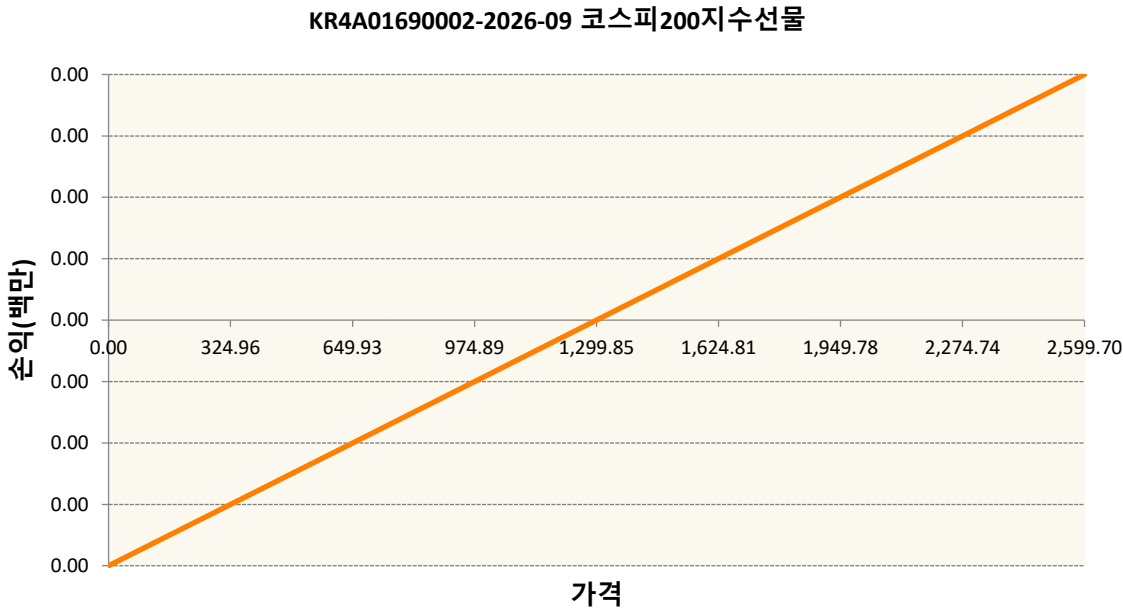
스마트인덱스모

1. 계약금액

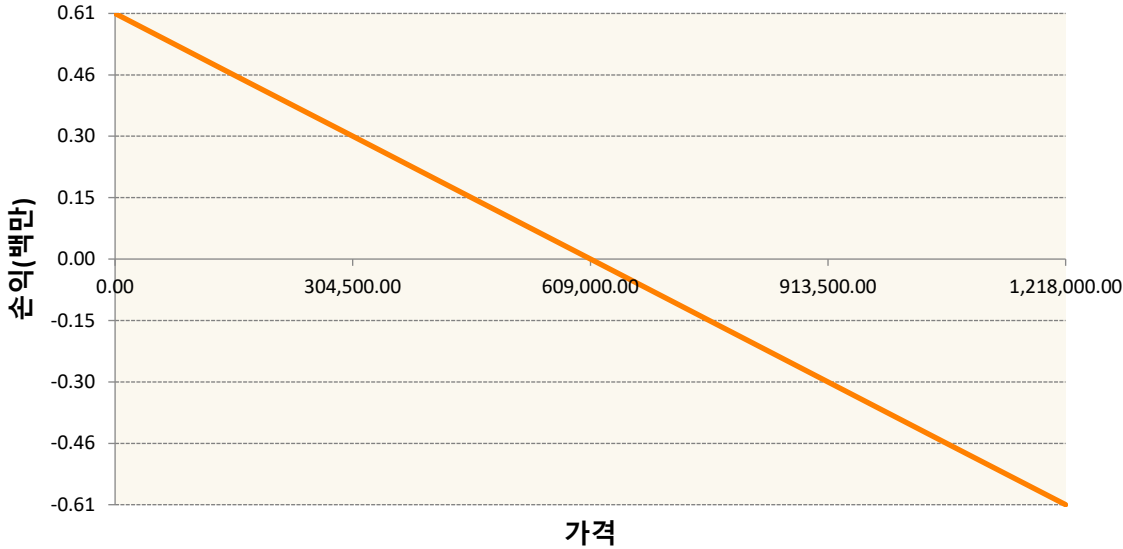
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	666	671	-5	장내
누계	유가증권	선물	3,379	166	3,213	장내

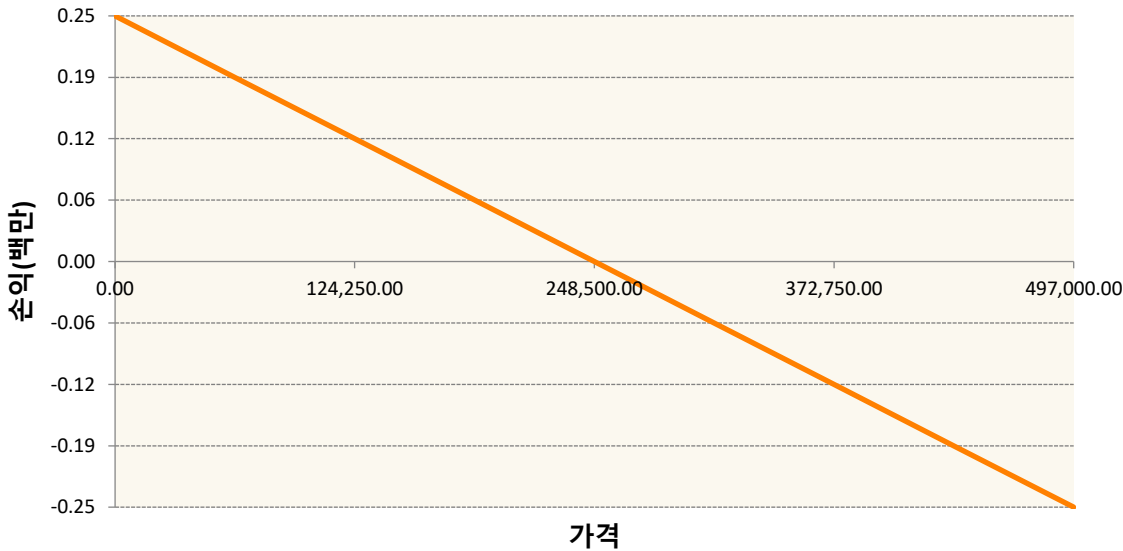
2. 만기시점의 손익구조



KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



KR4A56670008-2026-07 NAVER개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					258
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-5.33%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	172	172	172	172	172	172	172
8.00%	258	258	258	258	258	258	258
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%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10
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							6
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-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%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

698

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

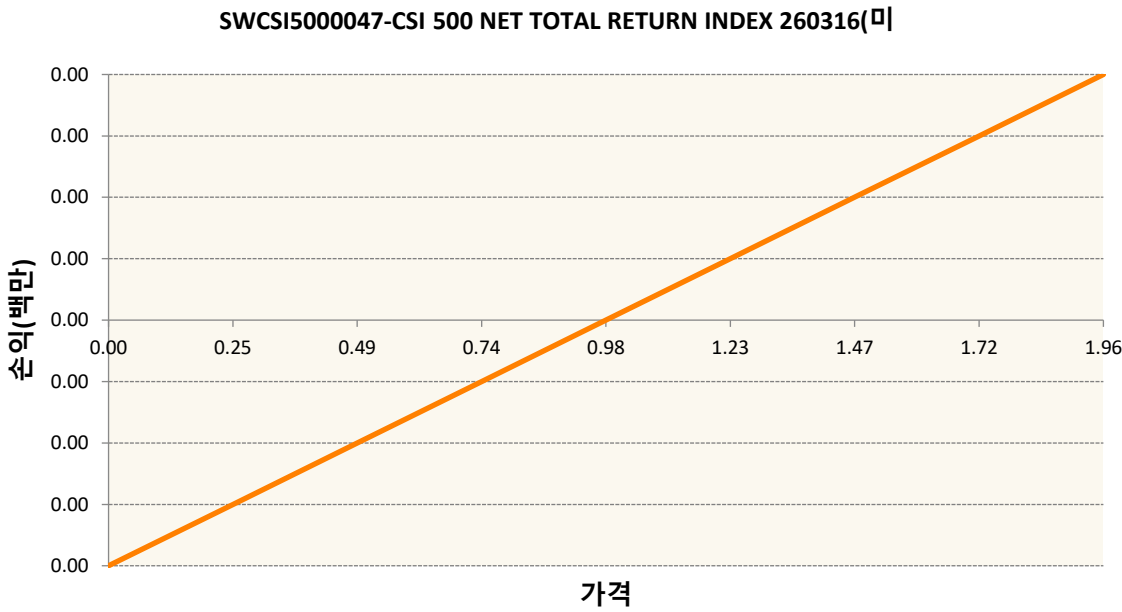
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

442

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

579

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

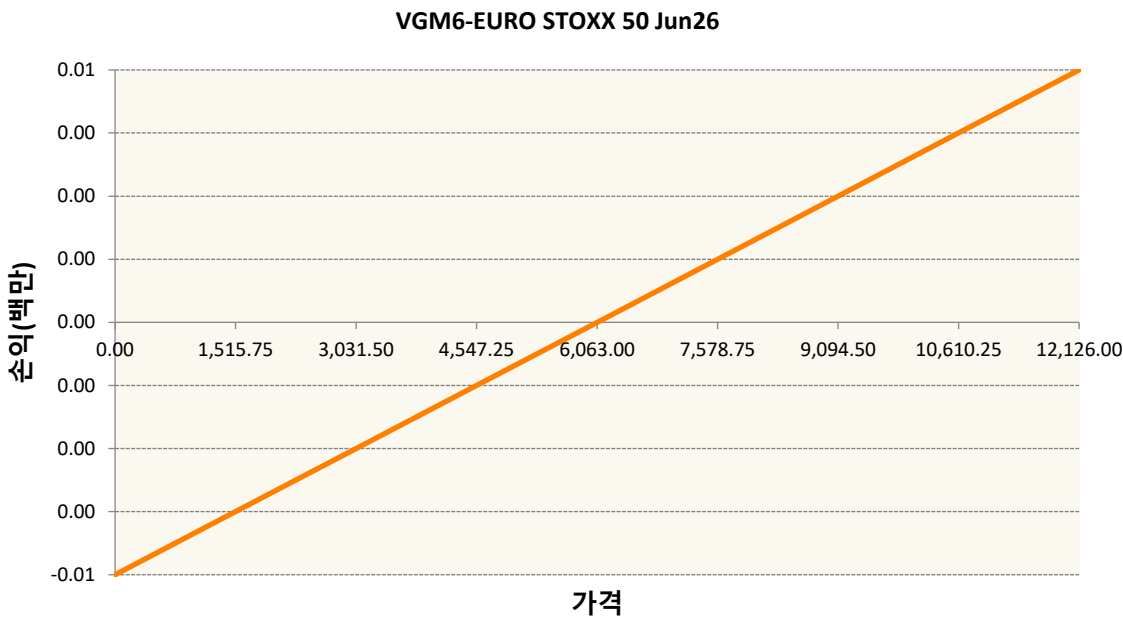
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	936	0	936	

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	2026-06-15
기준일	2026-06-12

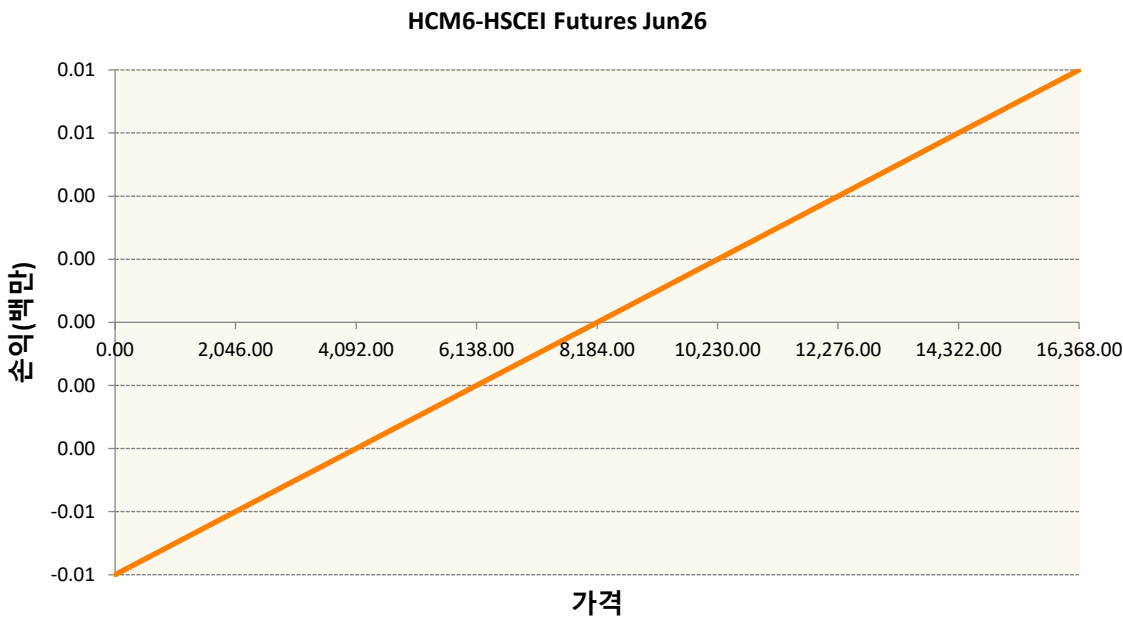
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,334	0	1,334	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	HSCEI Futures Jun26	107
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

128

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

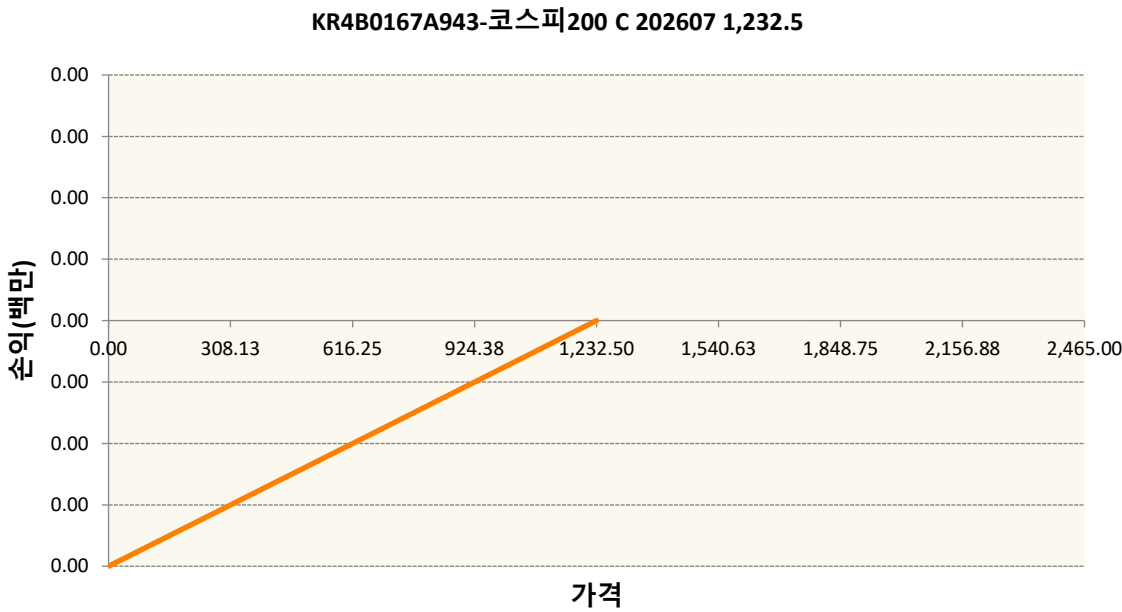
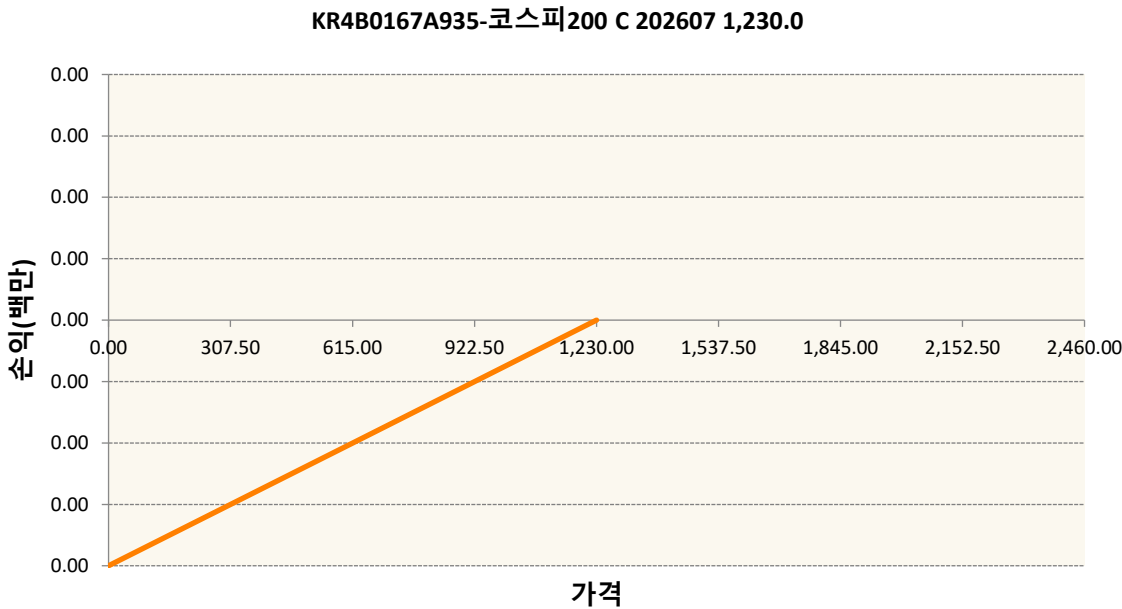
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

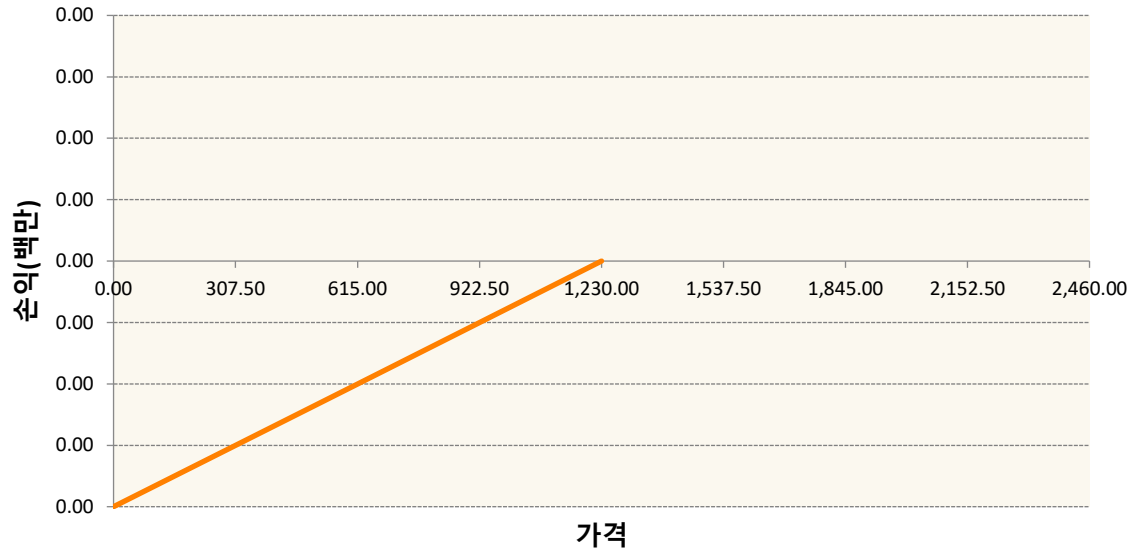
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	42,019	-42,019	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,254	-37,254	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0167A933-코스피200 P 202607 1,230.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0167A935 코스피200 C 202607 1,230.0							446
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-94	-153	-211	-270	-329	-387	-446
-5.33%	10	-51	-111	-171	-231	-291	-351
-2.67%	101	40	-20	-81	-142	-202	-263
0%	180	121	60	0	-60	-121	-182
2.67%	249	191	132	73	13	-47	-108
5.33%	307	252	195	137	79	20	-40
8.00%	356	304	250	195	138	80	22
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5							1,400
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-301	-484	-667	-850	-1,034	-1,217	-1,400
-5.33%	26	-162	-350	-538	-726	-913	-1,100
-2.67%	314	125	-65	-255	-445	-634	-824
0%	565	378	189	0	-190	-379	-569
2.67%	782	600	415	229	41	-147	-336
5.33%	967	792	614	433	249	64	-122
8.00%	1,123	959	789	614	436	255	72
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0							409
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-86	-140	-194	-248	-301	-355	-409
-5.33%	9	-46	-102	-157	-212	-267	-321
-2.67%	92	37	-19	-74	-130	-185	-241
0%	165	110	55	0	-55	-111	-167

2.67%	228	175	121	67	12	-43	-99
5.33%	282	231	179	126	72	18	-36
8.00%	327	279	229	179	127	74	20

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

(단위:백만원)

2,536

공시일 2026-06-15

기준일 2026-06-12

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	2026-06-15
기준일	2026-06-12

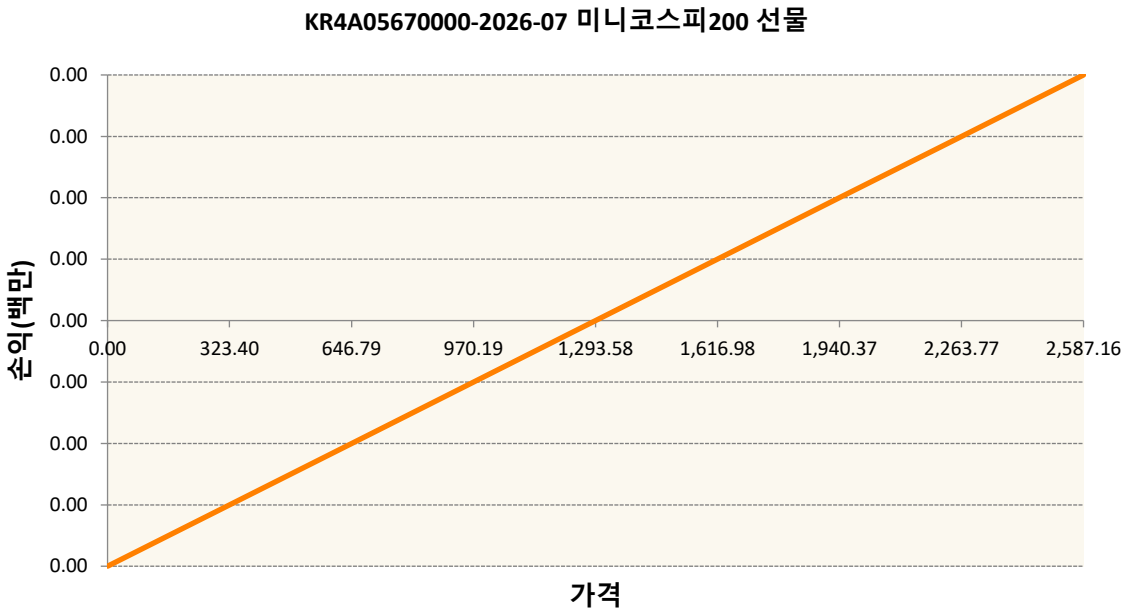
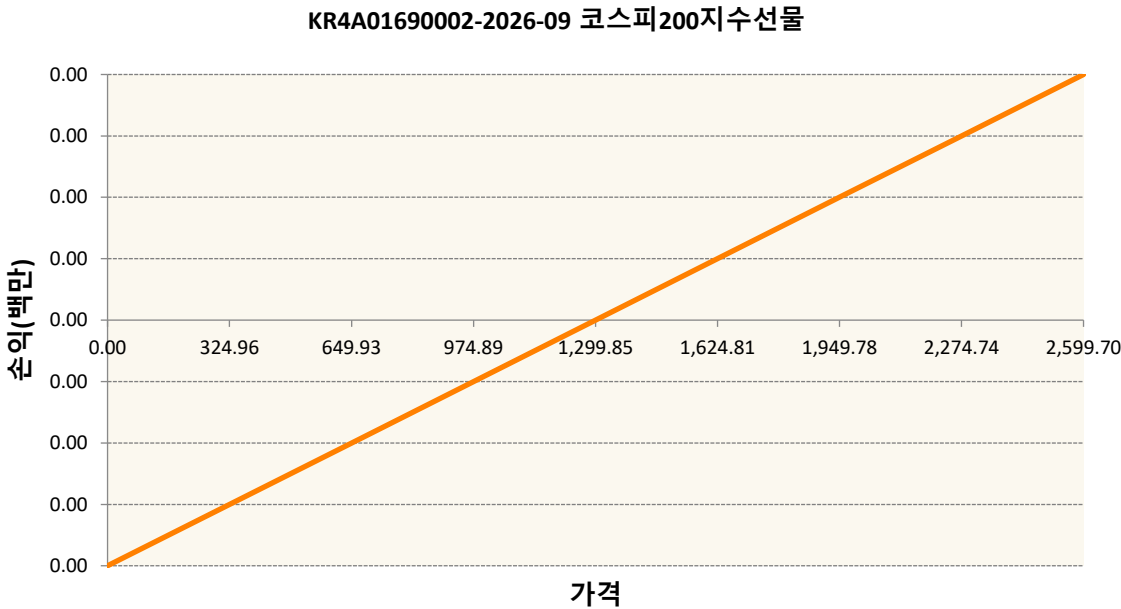
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	333	335	-2	장내
누계	유가증권	선물	2,656	64	2,592	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 4,286,000.00. The y-axis, labeled '이익(백만)' (Profit in millions), ranges from -2.14 to 2.14. A solid orange line represents the profit function, starting at a profit of 2.14 million when the price is 0 and decreasing linearly to a profit of -2.14 million at a price of 4,286,000. The line crosses the x-axis at a price of 2,143,000.00, indicating the break-even point.

가격 (Price)	이익 (백만) (Profit in millions)
0.00	2.14
1,071,500.00	1.07
2,143,000.00	0.00
3,214,500.00	-1.07
4,286,000.00	-2.14

The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 1,292,000.00 with major ticks every 323,000.00. The y-axis, labeled '이익 (백만)' (Profit in millions), ranges from -0.65 to 0.65 with major ticks every 0.16. A solid orange line represents the profit function, starting at (0, -0.65) and ending at (1,292,000, 0.65). The line crosses the x-axis at 646,000.00, indicating the break-even point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-0.65
323,000.00	-0.32
646,000.00	0.00
969,000.00	0.32
1,292,000.00	0.65

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					77
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	77	77	77	77	77	77	77
KR4A05670000		2026-07 미니코스피200 선물					26
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-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%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	26	26	26	26	26	26	26
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)

282

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

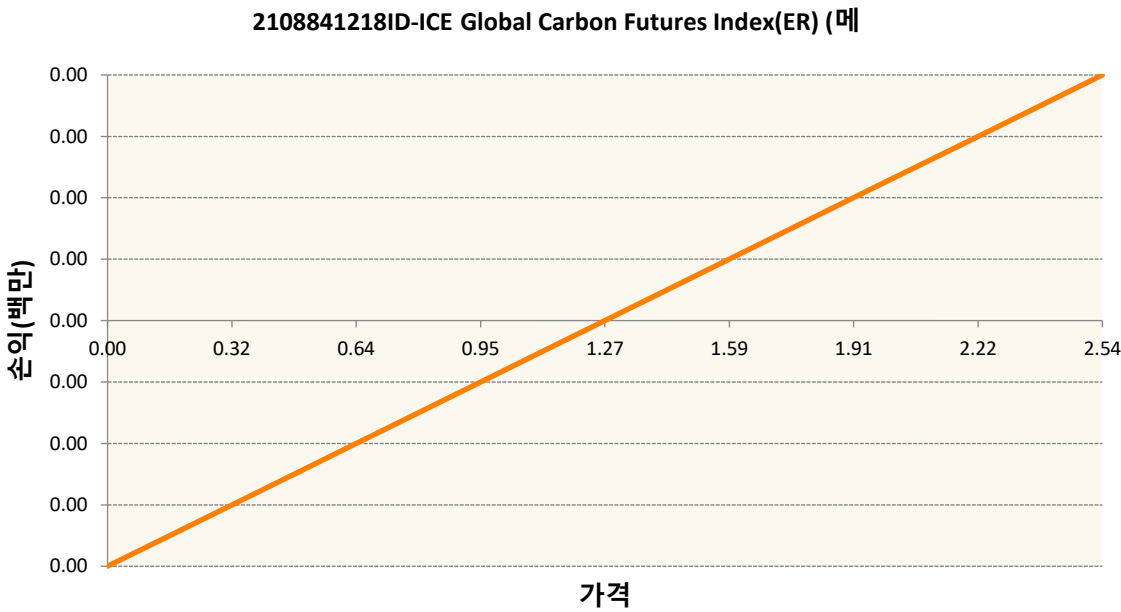
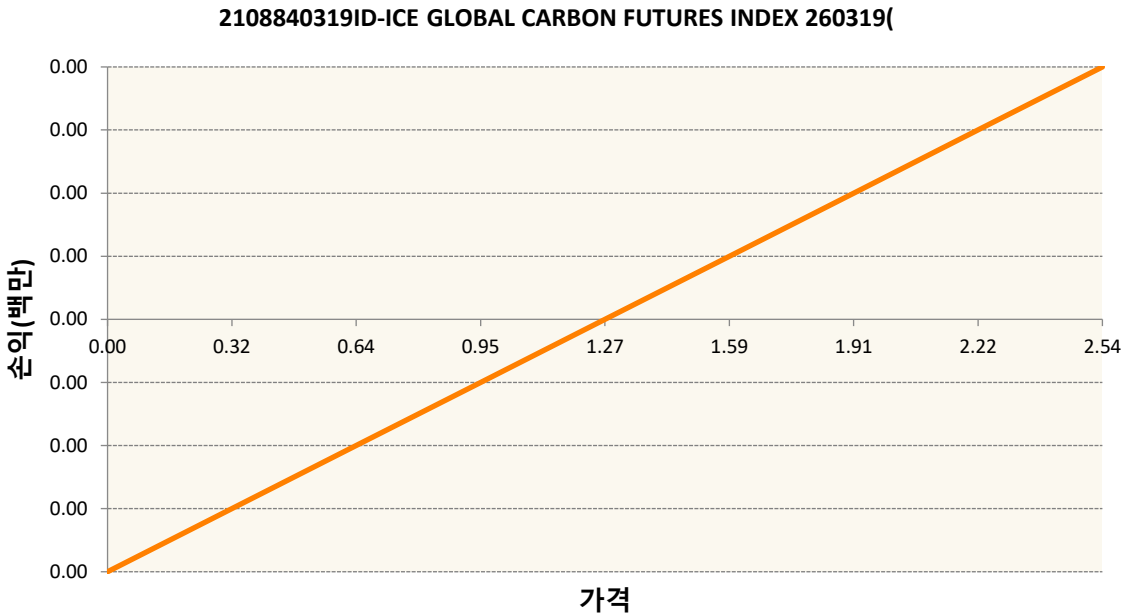
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,298	0	7,298	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(		466
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		117

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	670

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

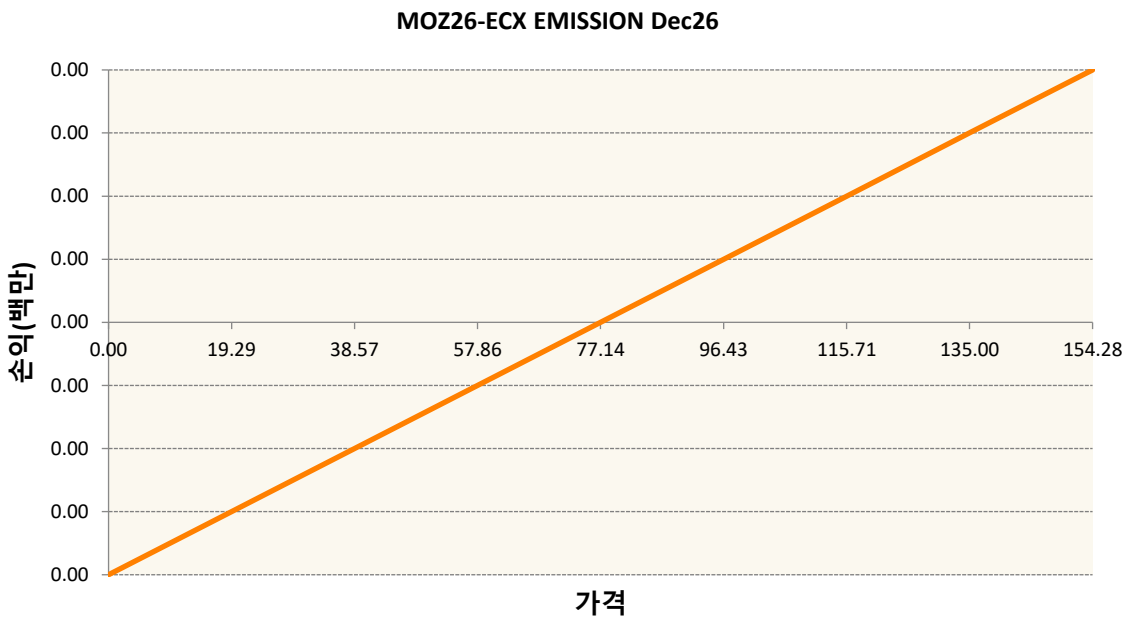
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			4,973	0	4,973	
누계	통화	선도	0	2,644	-2,644	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	212
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	398

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

(단위:백만원)

682

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

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	1,556	0	1,556	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	14
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	10
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	24
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	9

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

(단위:백만원)

87

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

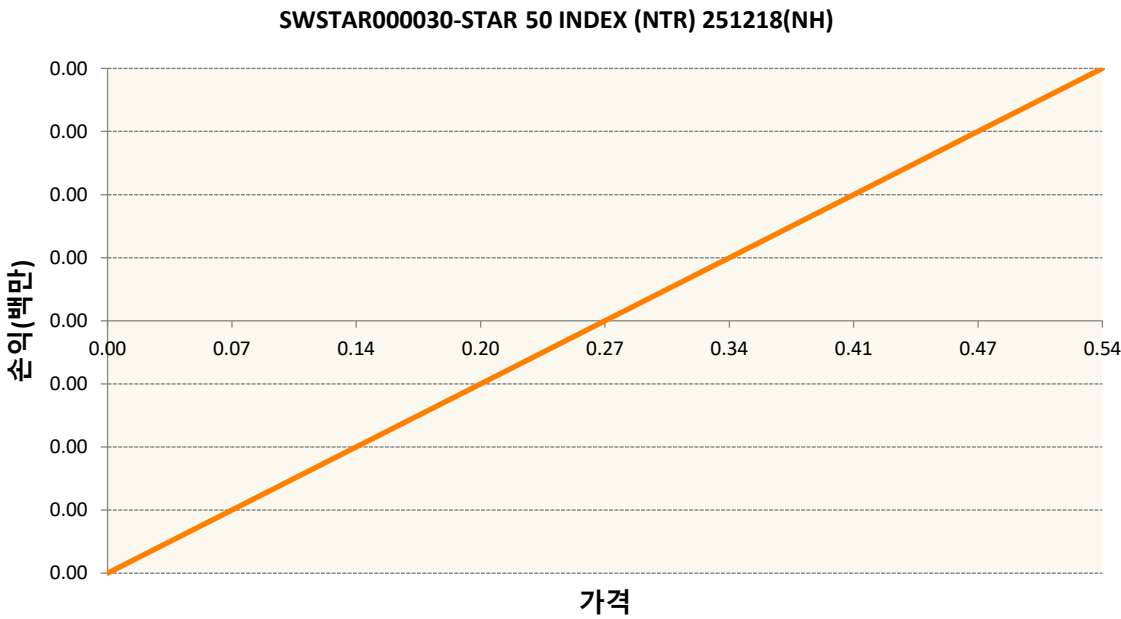
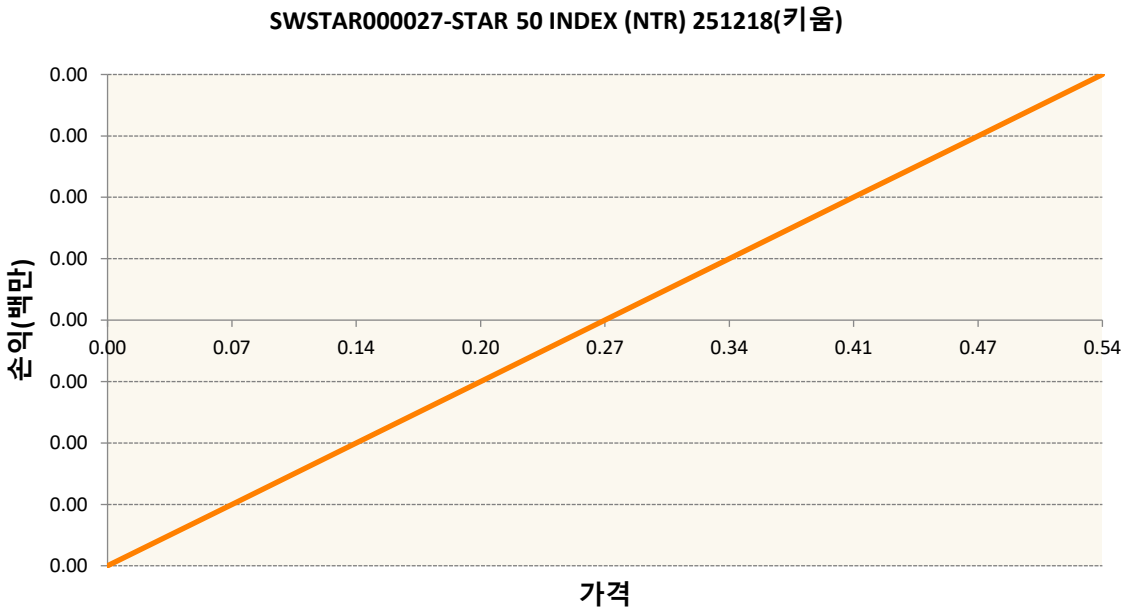
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

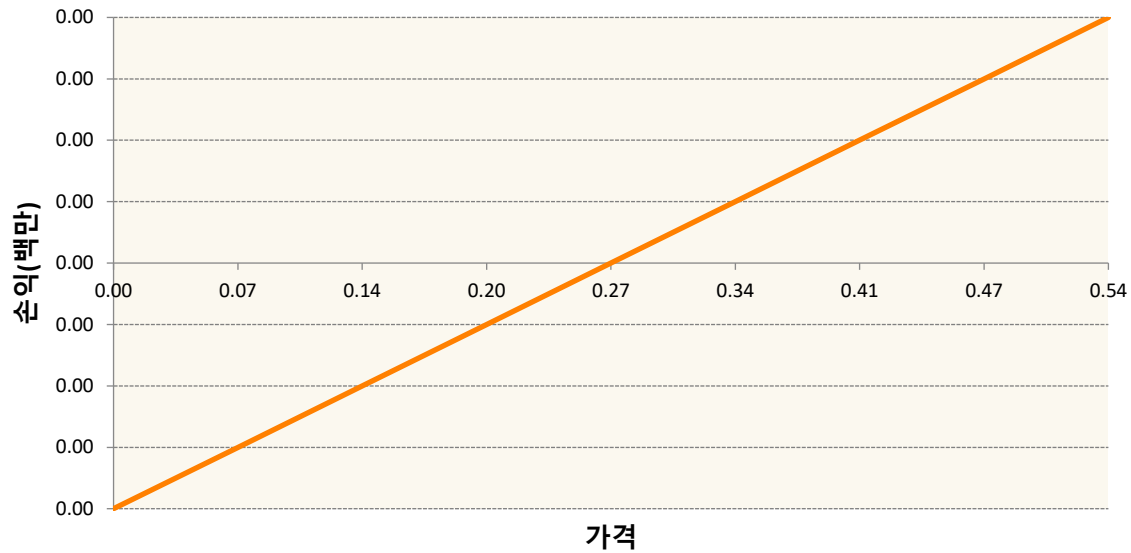
(단위:백만원)

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

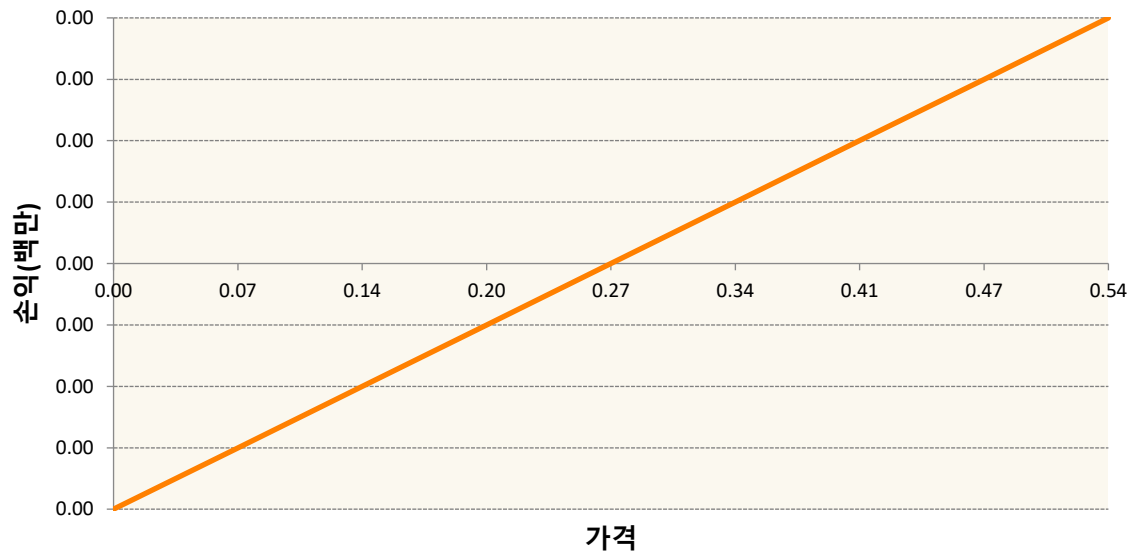
2. 만기시점의 손익구조



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)	20
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	66
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	339
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)	126

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

(단위:백만원)

876

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

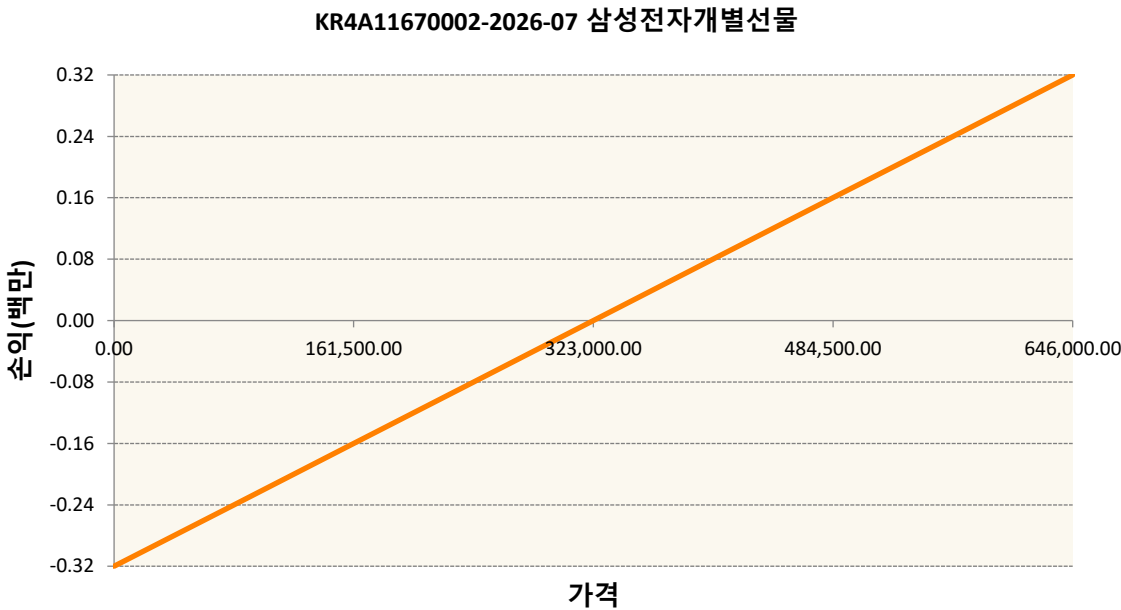
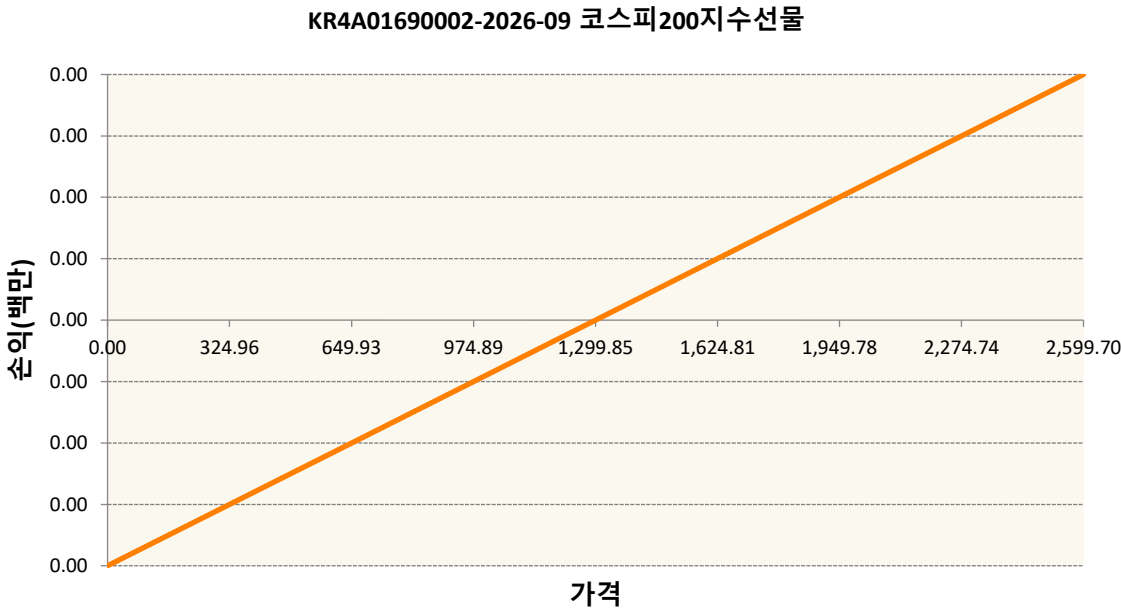
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

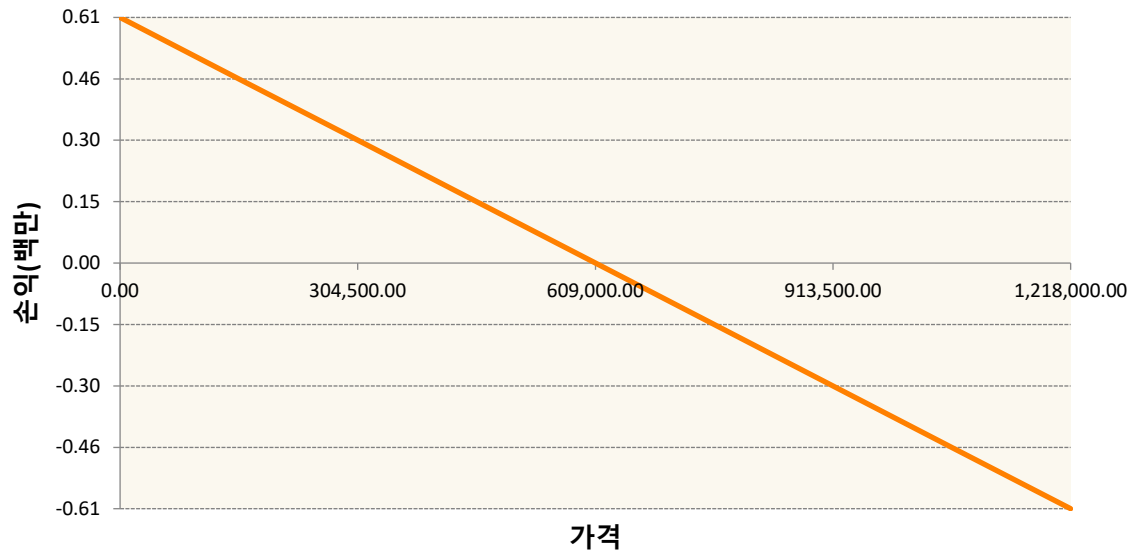
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	5,343	9,811	-4,468	장내
누계	유가증권	선물	12,011	4,183	7,828	장내

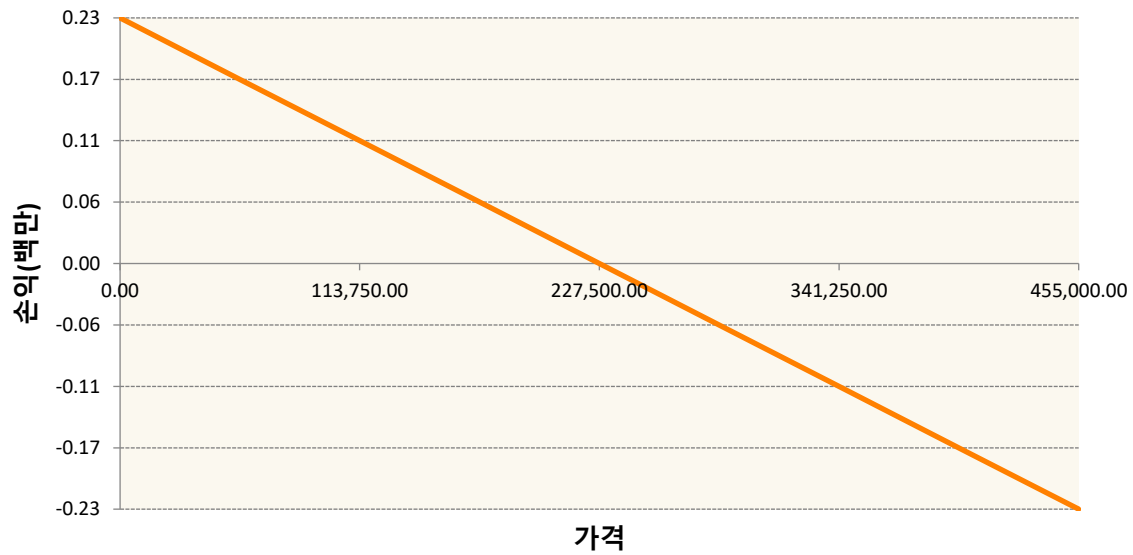
2. 만기시점의 손익구조



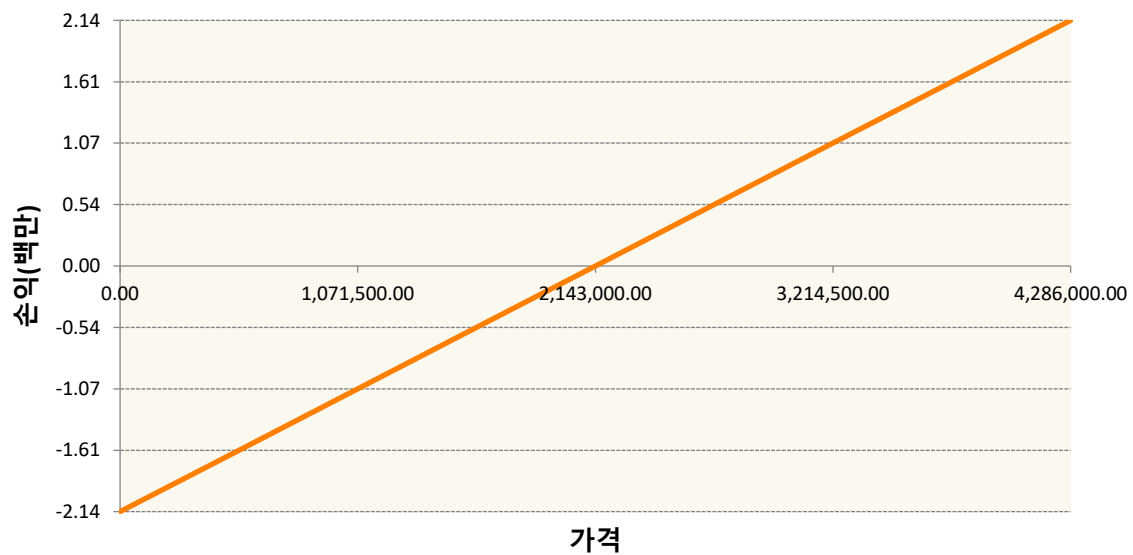
KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



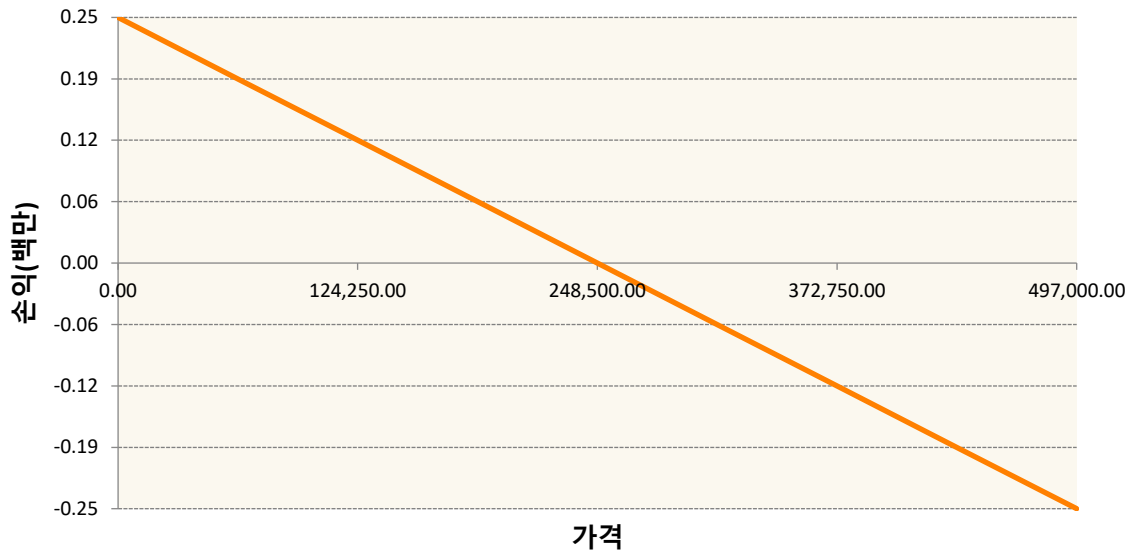
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



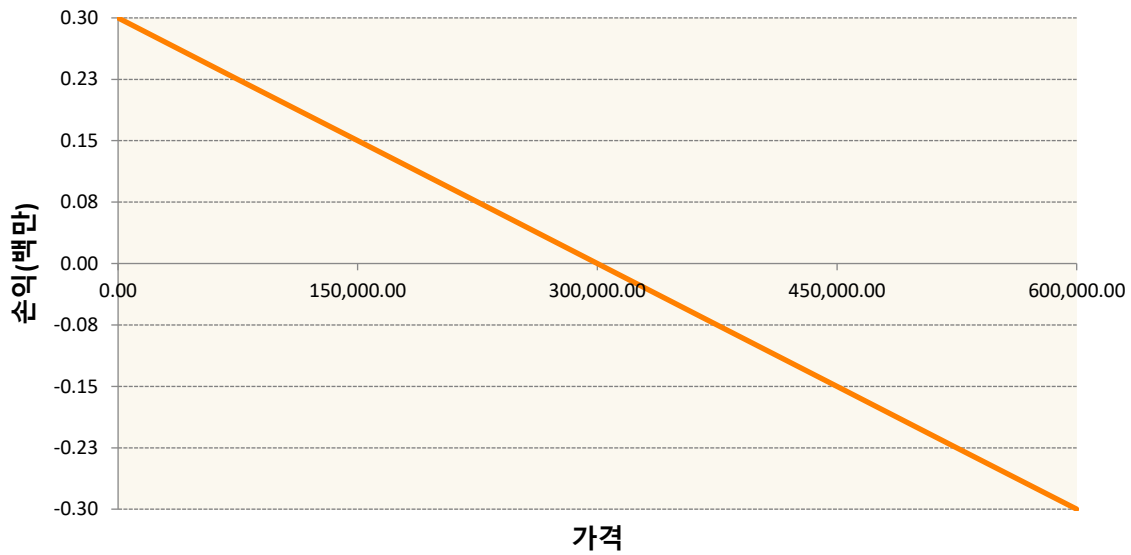
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



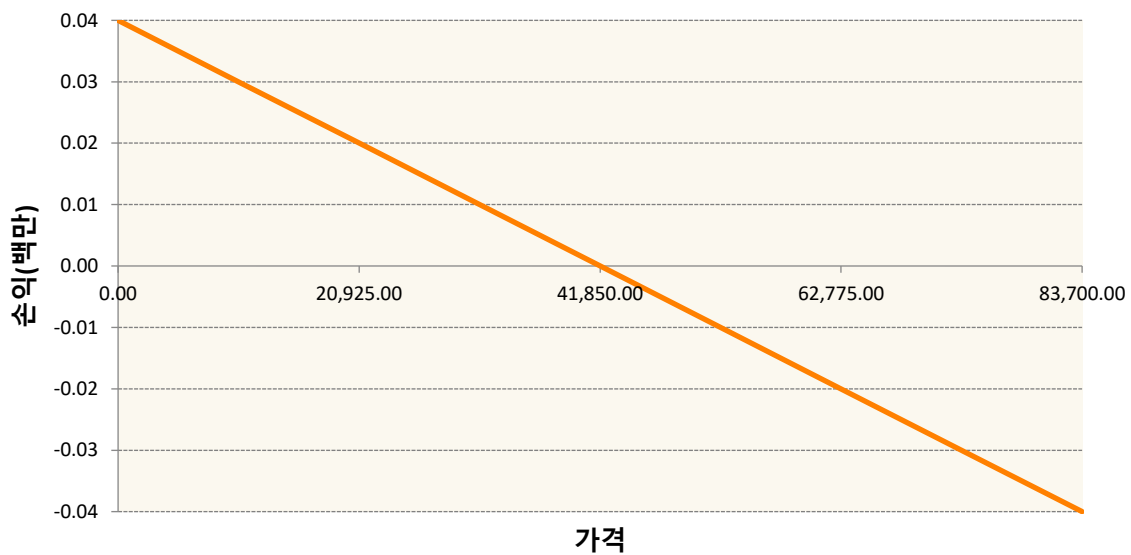
KR4A56670008-2026-07 NAVER개별선물



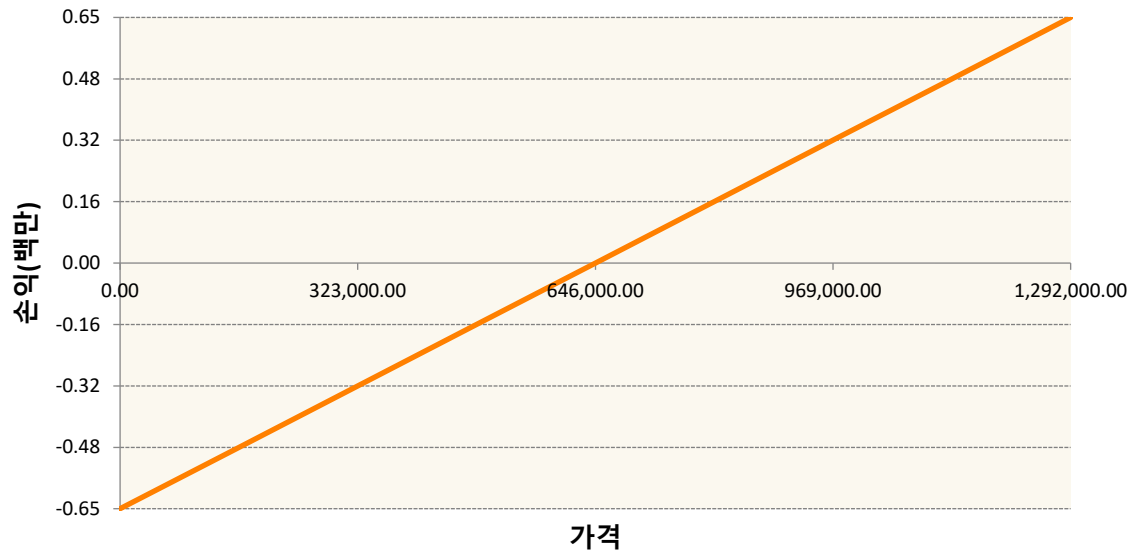
KR4AC0670001-2026-07 OCI홀딩스개별선물



KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002 2026-09 코스피200지수선물								491
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
-5.33%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
-2.67%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	164	164	164	164	164	164	164	164
5.33%	327	327	327	327	327	327	327	327
8.00%	491	491	491	491	491	491	491	491
KR4A11670002 2026-07 삼성전자개별선물								364
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364	-364
-5.33%	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242	-242
-2.67%	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121	-121
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	121	121	121	121	121	121	121	121
5.33%	242	242	242	242	242	242	242	242
8.00%	364	364	364	364	364	364	364	364
KR4A20670001 2026-07 현대모비스개별선물								72
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	72	72	72	72	72	72	72	72
-5.33%	48	48	48	48	48	48	48	48
-2.67%	24	24	24	24	24	24	24	24
0%	0	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
8.00%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72

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	65
--------------	--------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-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%	65	65	65	65	65	65	65

KR4A56670008	2026-07 NAVER개별선물	73
--------------	-------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	73	73	73	73	73	73	73
-5.33%	48	48	48	48	48	48	48
-2.67%	24	24	24	24	24	24	24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
8.00%	-73	-73	-73	-73	-73	-73	-73

KR4AC0670001	2026-07 OCI홀딩스개별선물	29
--------------	--------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29
-5.33%	19	19	19	19	19	19	19
-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%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29

KR4ACF670004	2026-07 카카오개별선물	106
--------------	-----------------	-----

	기초자산의 변동성
--	-----------

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	106	106	106	106	106	106	106
-5.33%	71	71	71	71	71	71	71
-2.67%	35	35	35	35	35	35	35
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
8.00%	-106	-106	-106	-106	-106	-106	-106

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)

3,153

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

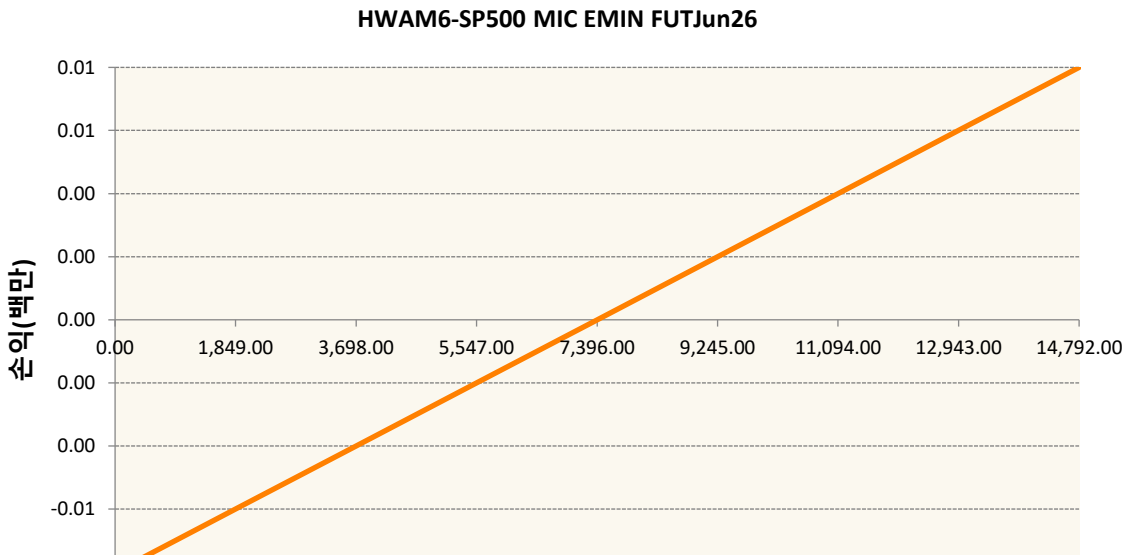
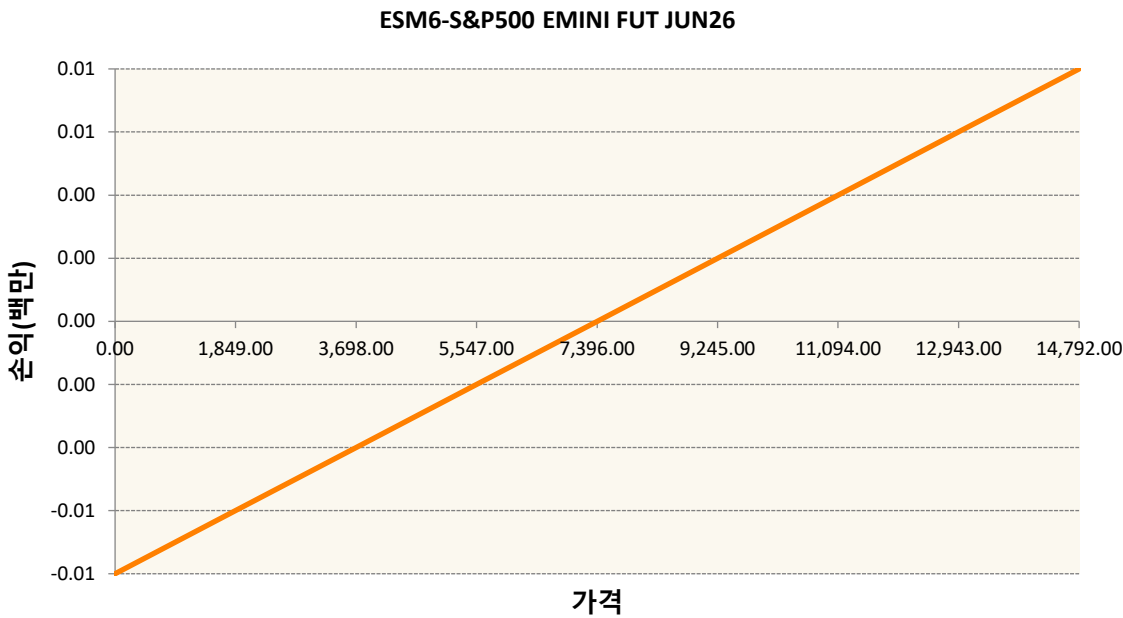
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

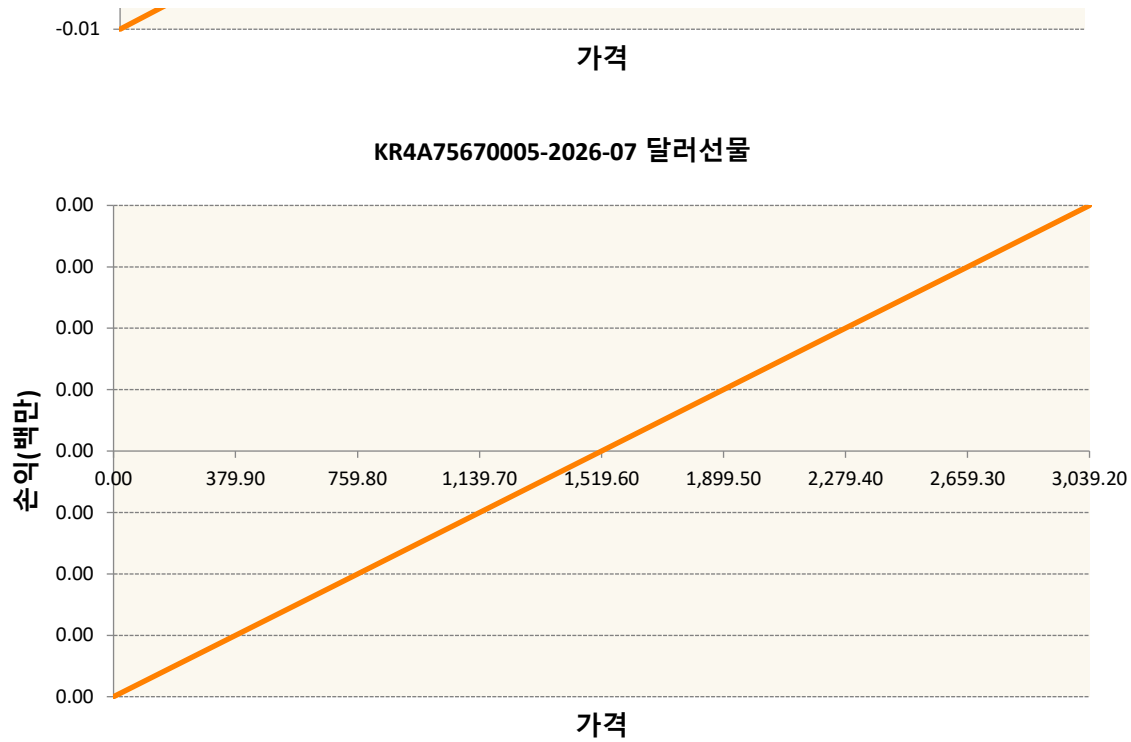
1. 계약금액

(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	60,484	0	60,484	
누계	지수	선물	276	0	276	장내
누계	통화	선물	10,789	0	10,789	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,839
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	22
KR4A756700 2026-07 달러선물		863

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

(단위:백만원)

4,188

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

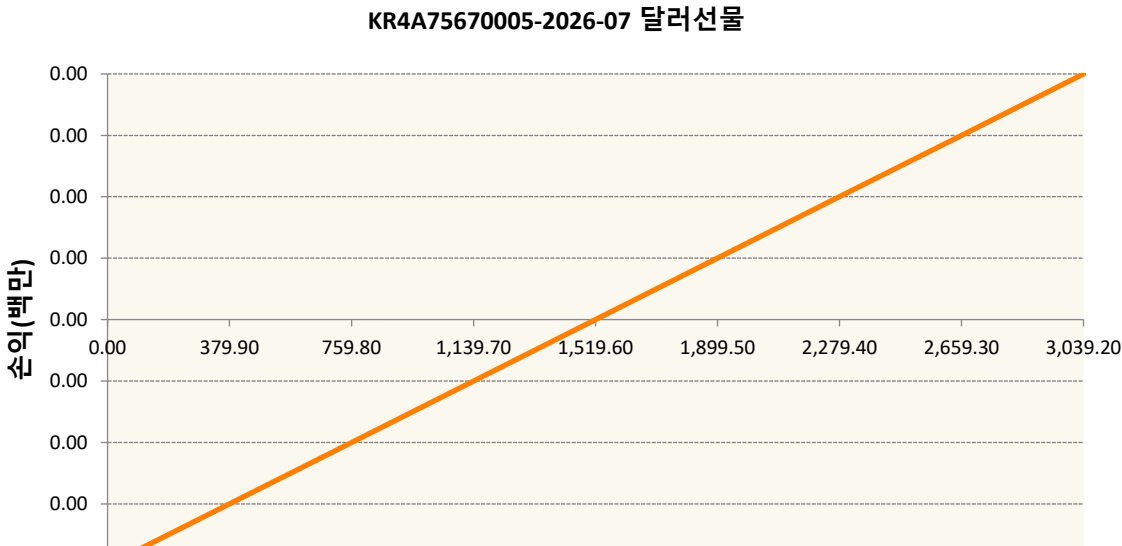
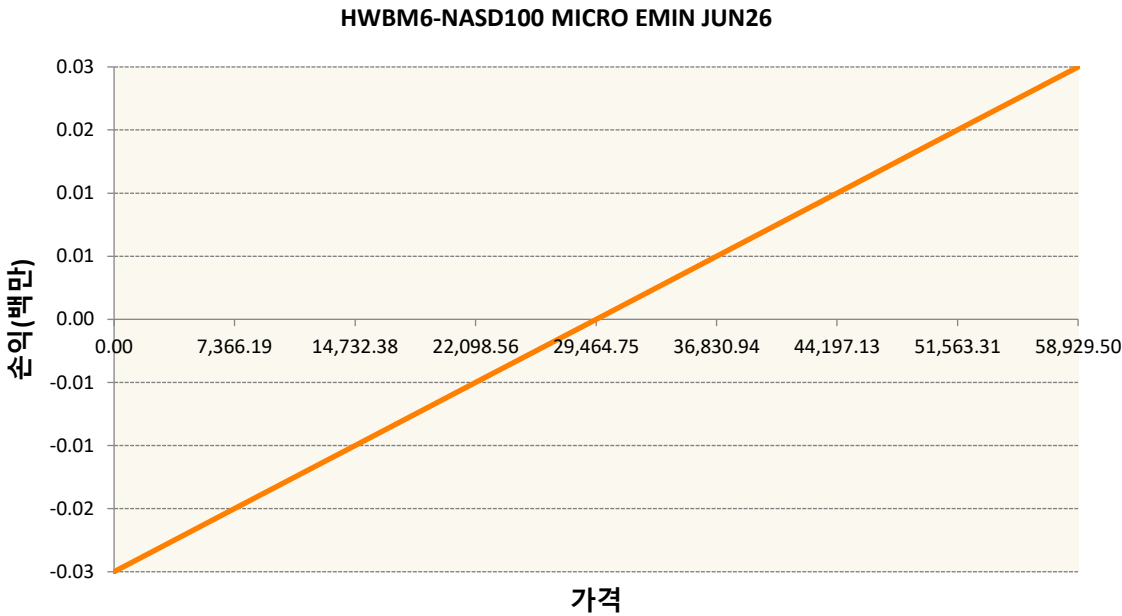
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

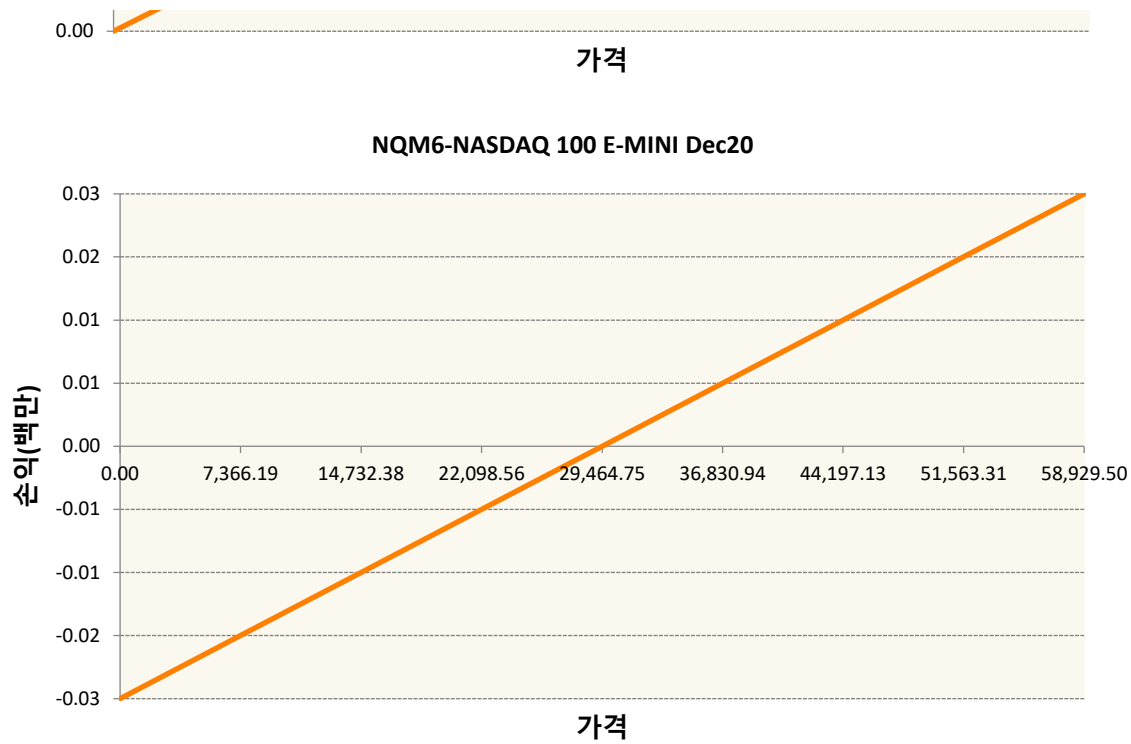
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30,054	0	30,054	
누계	유가증권	선물	258	0	258	장내
누계	통화	선물	3,966	0	3,966	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26		21
KR4A756700	2026-07 달러선물		317
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20		2,404

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,690

공시일	2026-06-15
기준일	2026-06-12

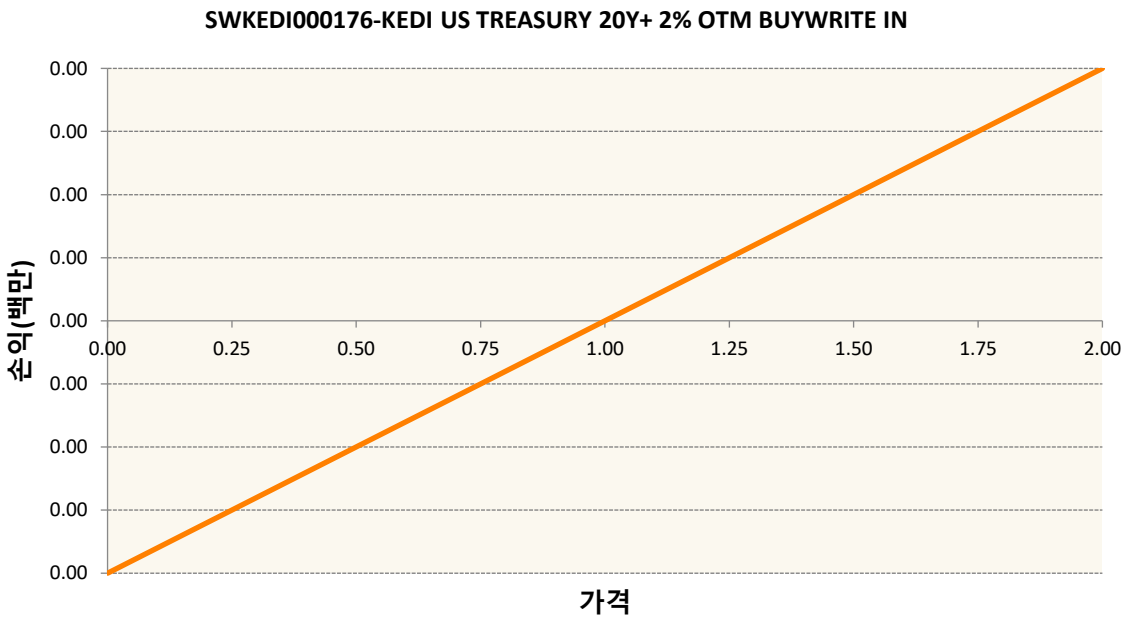
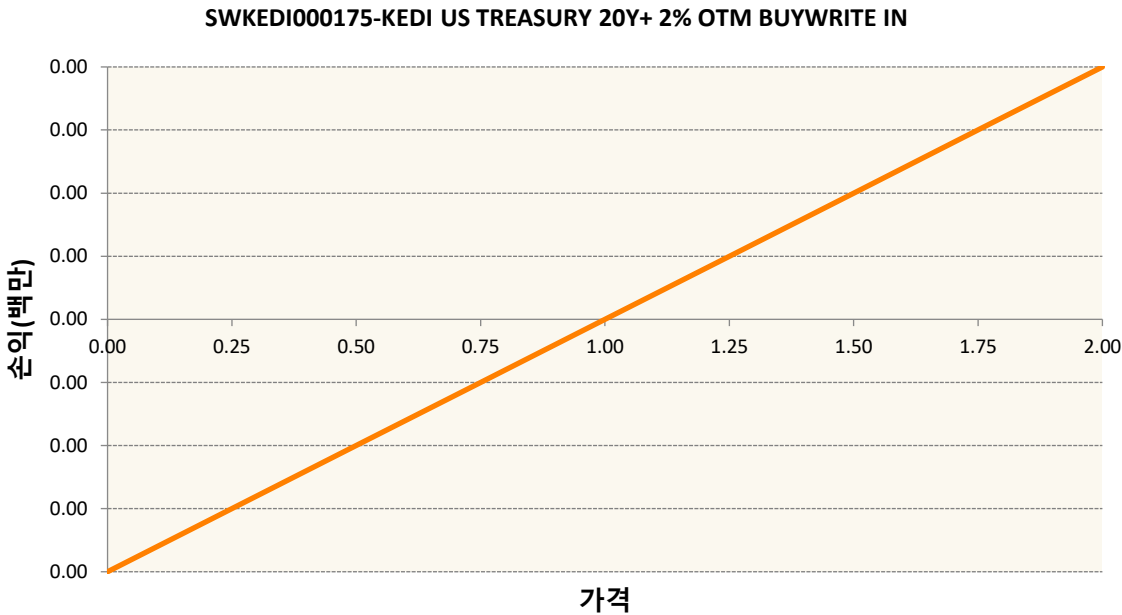
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

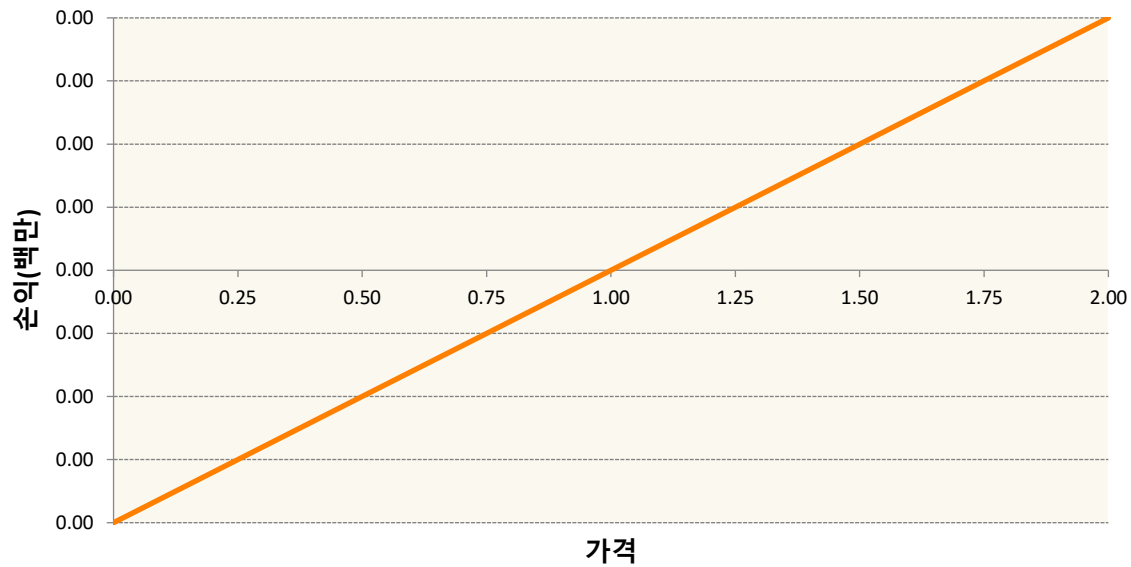
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	321,010	0	321,010	장외

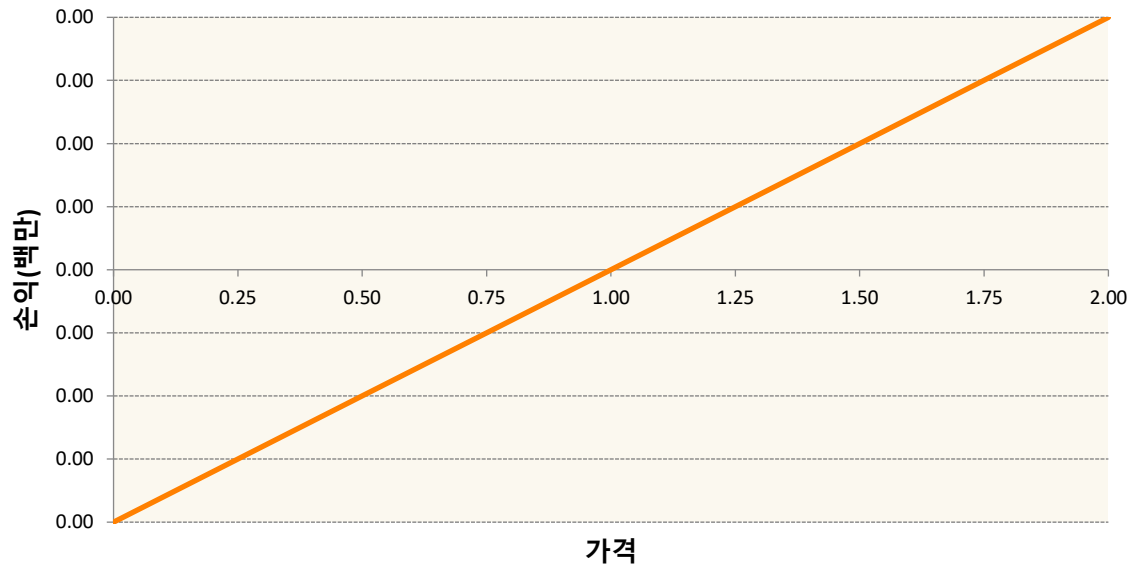
2. 만기시점의 손익구조



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



SWKEDI000182-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,434
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,182
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,211
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,971

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

(단위:백만원)

10,870