

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

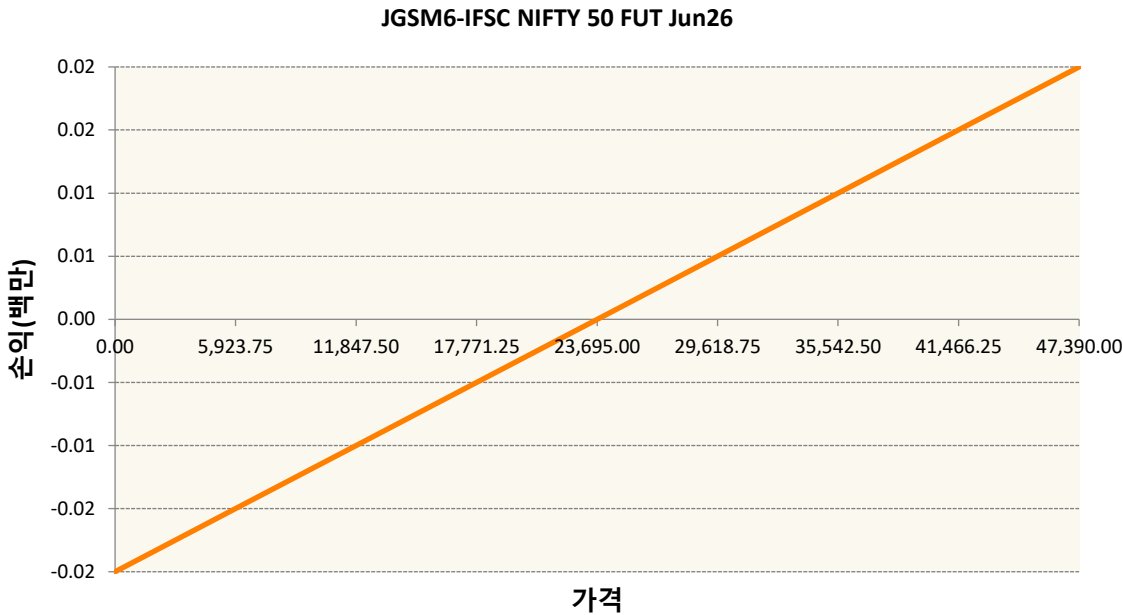
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	356	0	356	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSM6	IFSC NIFTY 50 FUT Jun26	29
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

20

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

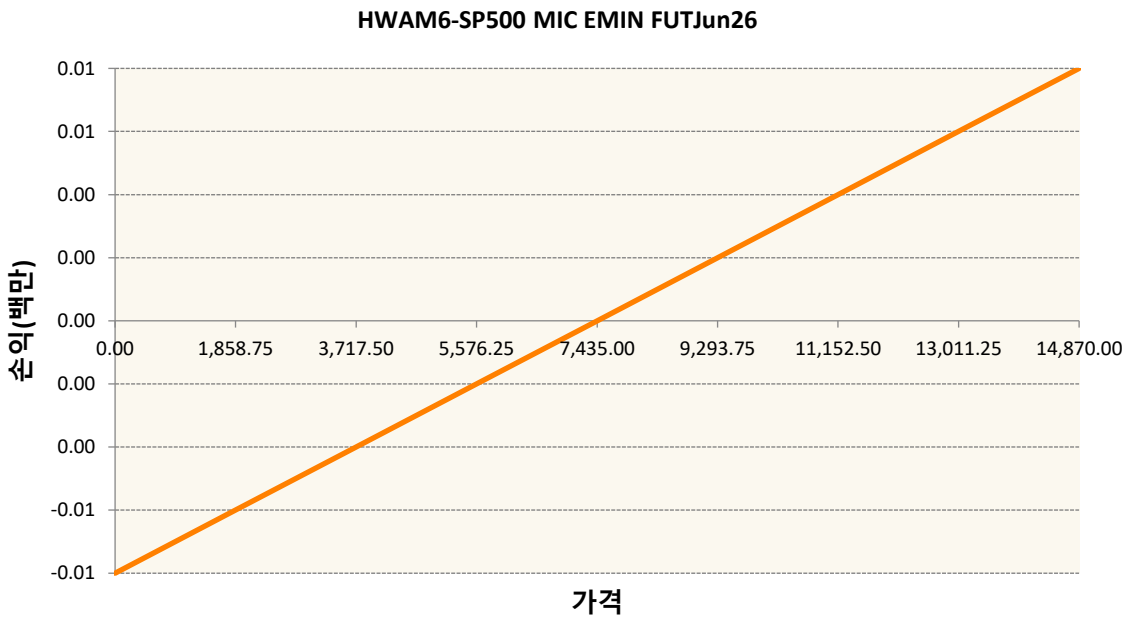
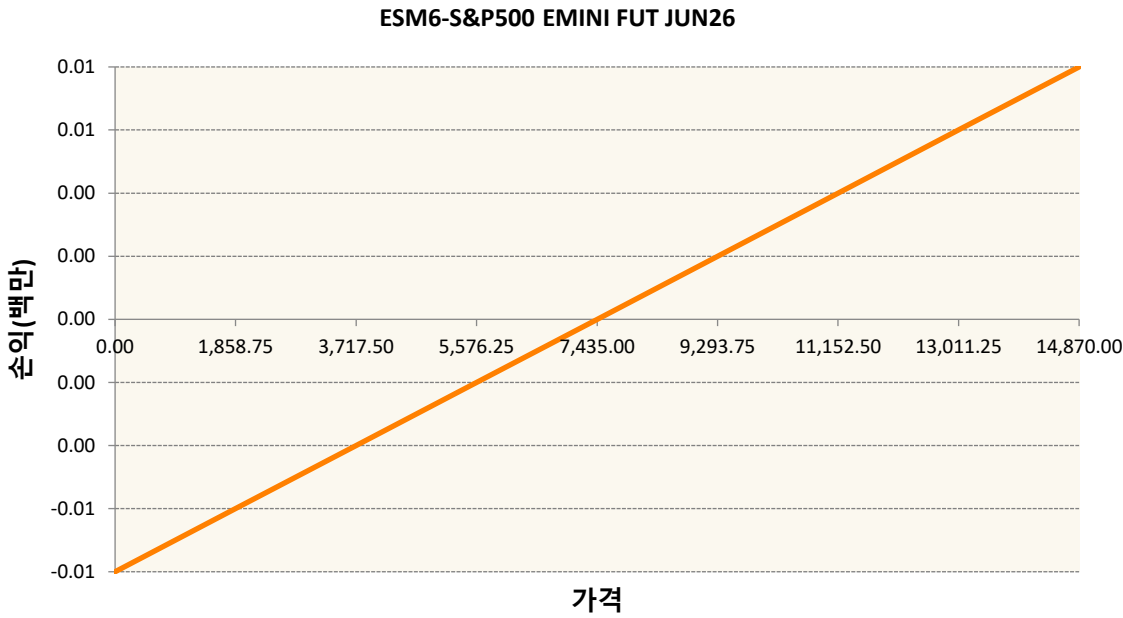
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	558	0	558	
누계	지수	선물	56	0	56	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	45
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	42

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

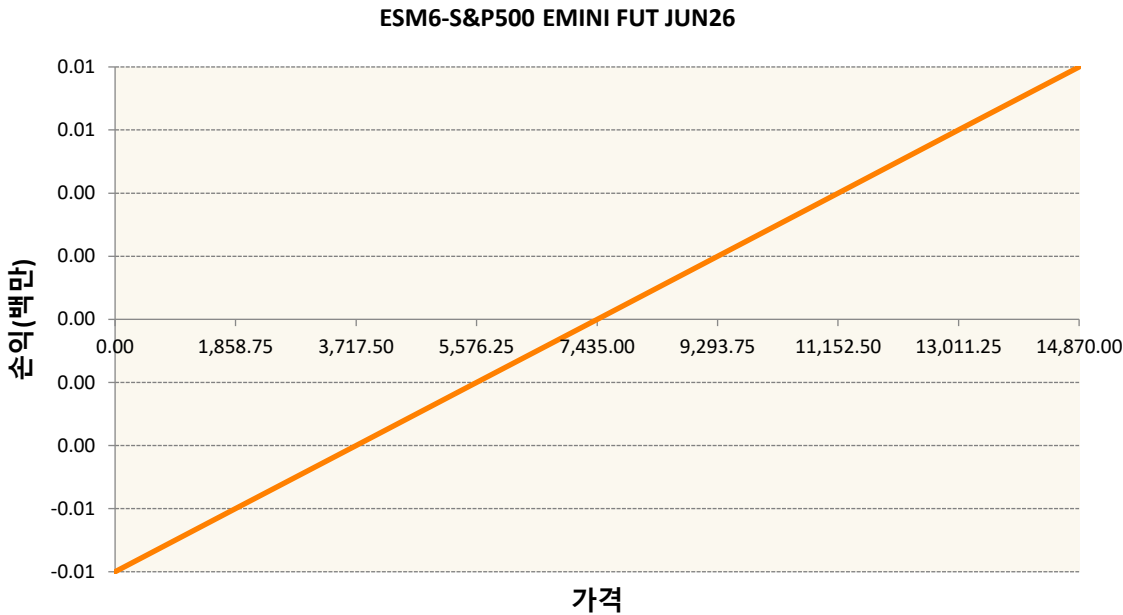
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,117	0	1,117	

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	2026-06-16
기준일	2026-06-15

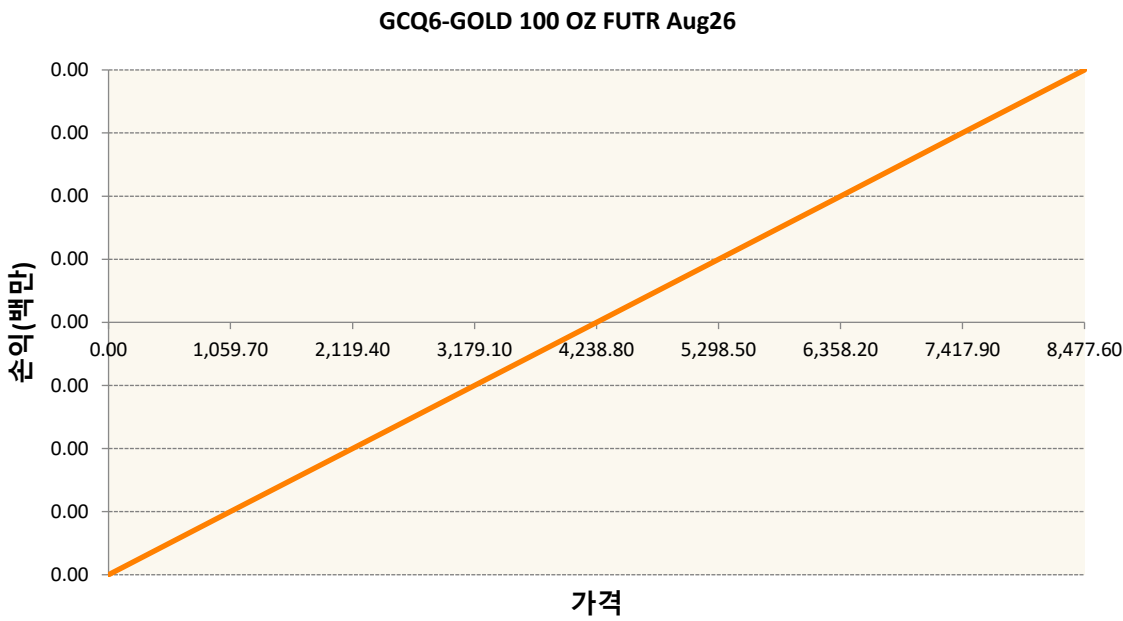
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,088	0	5,088	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 06/18/26 C390 EQUITY	11
GCQ6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	407

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

(단위:백만원)

534

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

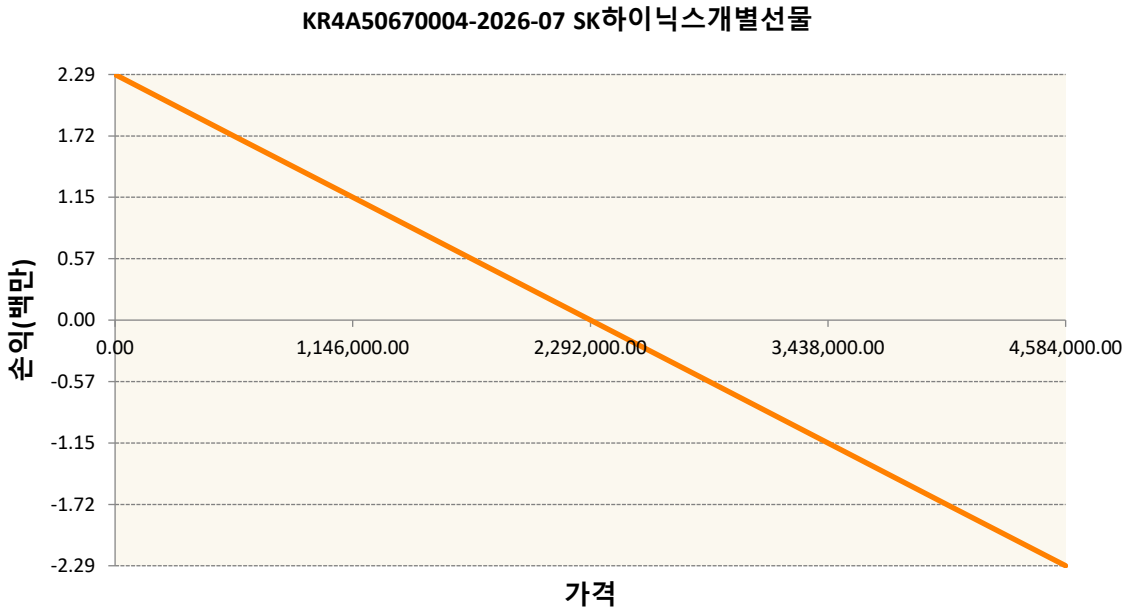
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	11,460	-11,460	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUCP' PLTR US 06/18/26 P140 EQUITY	35
AOPLTRUCS' PLTR US 06/18/26 C140 EQUITY	21
KR4A506700 2026-07 SK하이닉스개별선물	917

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

(단위:백만원)

170

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

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)

AOTLTUCCS(TLT US 06/18/26 C86 EQUITY

4

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

(단위:백만원)

2

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

(단위:백만원)

21,249

공시일 2026-06-16

기준일 2026-06-15

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	2026-06-16
기준일	2026-06-15

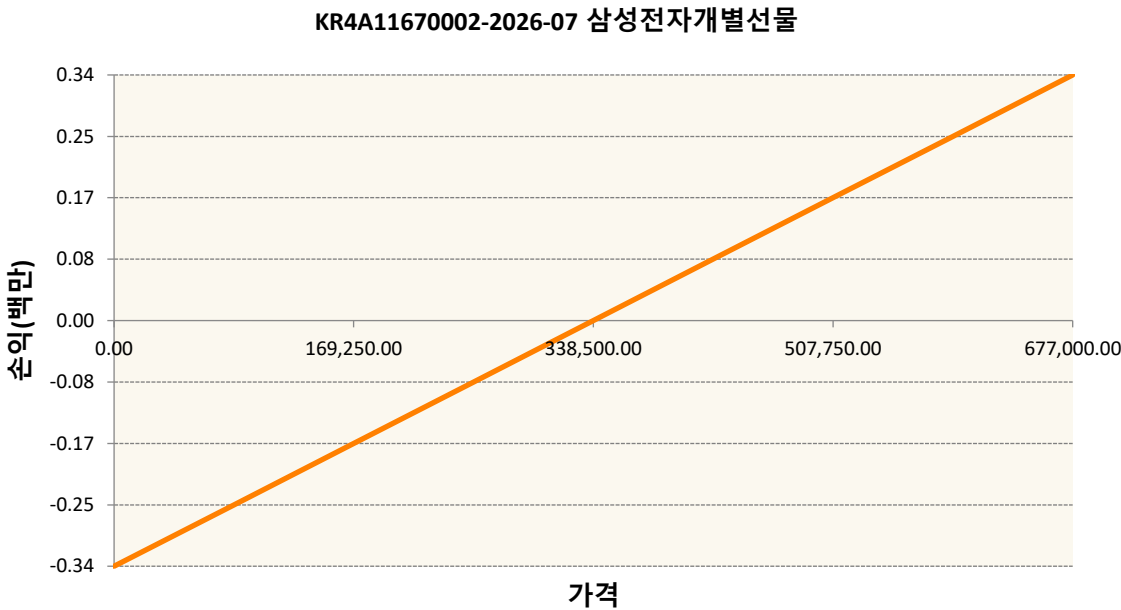
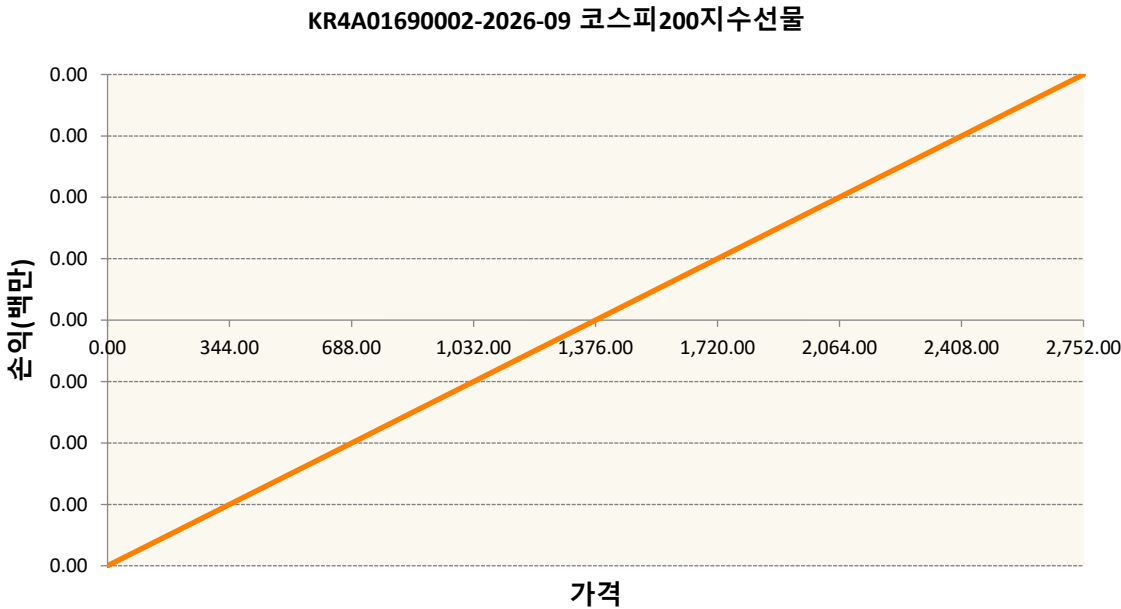
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	38,857	-38,857	장내
누계	유가증권	선물	27,223	0	27,223	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,768	-37,768	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,720.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,360, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,360.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between the amount (가액) and net income (순익). The x-axis represents the amount, ranging from 0.00 to 2,725.00. The y-axis represents net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. A single orange line starts at the origin (0, 0) and extends to the point (1,362.50, 0.00).

가액	순익 (백만)
0.00	0.00
1,362.50	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물			707
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-707	-707	-707	-707	-707	-707	-707
-5.33%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-2.67%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	236	236	236	236	236	236	236
5.33%	472	472	472	472	472	472	472
8.00%	707	707	707	707	707	707	707
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물			1,456
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456
-5.33%	-971	-971	-971	-971	-971	-971	-971
-2.67%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	485	485	485	485	485	485	485
5.33%	971	971	971	971	971	971	971
8.00%	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456
KR4B09F3B462 코스피위클리 C 2606W3 1,360.0							1,336

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,122	-1,149	-1,180	-1,215	-1,253	-1,294	-1,336
-5.33%	-602	-645	-691	-740	-790	-841	-894
-2.67%	-158	-215	-273	-332	-391	-450	-510
0%	188	126	63	0	-63	-126	-188
2.67%	433	374	315	254	194	133	71
5.33%	587	540	490	438	385	330	274
8.00%	674	641	604	564	520	474	425
KR4B09F3B470 코스피위클리 C 2606W3 1,362.5							885

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-747	-765	-785	-807	-832	-858	-885
-5.33%	-403	-431	-461	-492	-525	-558	-593
-2.67%	-108	-145	-183	-221	-260	-299	-338
0%	124	83	41	0	-41	-83	-124
2.67%	289	250	210	171	130	90	50
5.33%	394	362	329	294	259	222	185
8.00%	454	431	407	379	350	319	287

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

(단위:백만원)

9,711

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

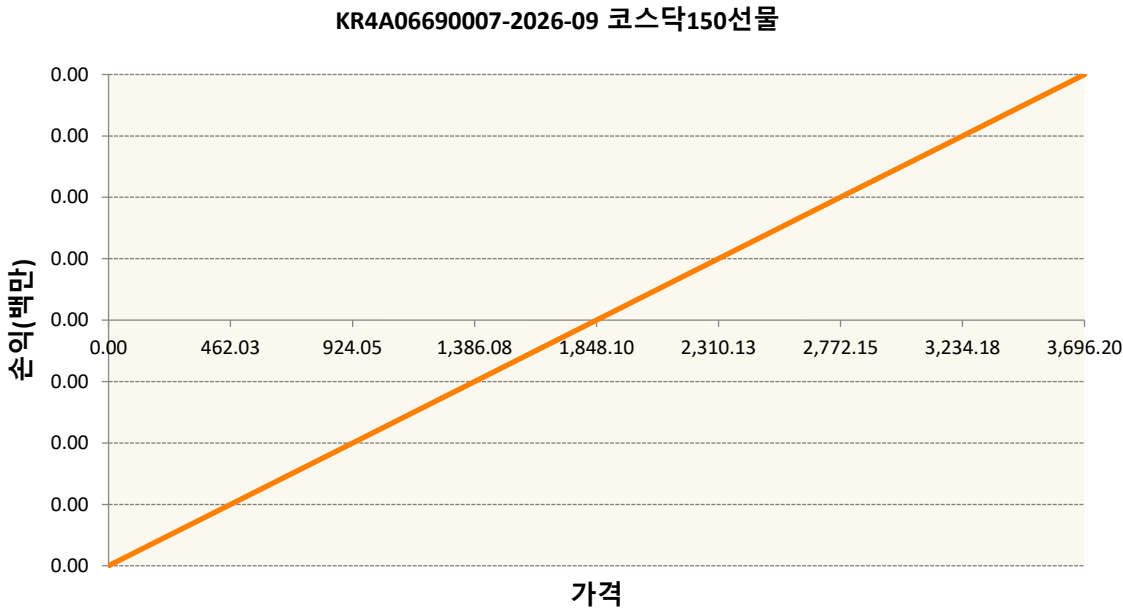
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,090	0	1,090	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)

223

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

(단위:백만원)

20,699

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

(단위:백만원)

51,994

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

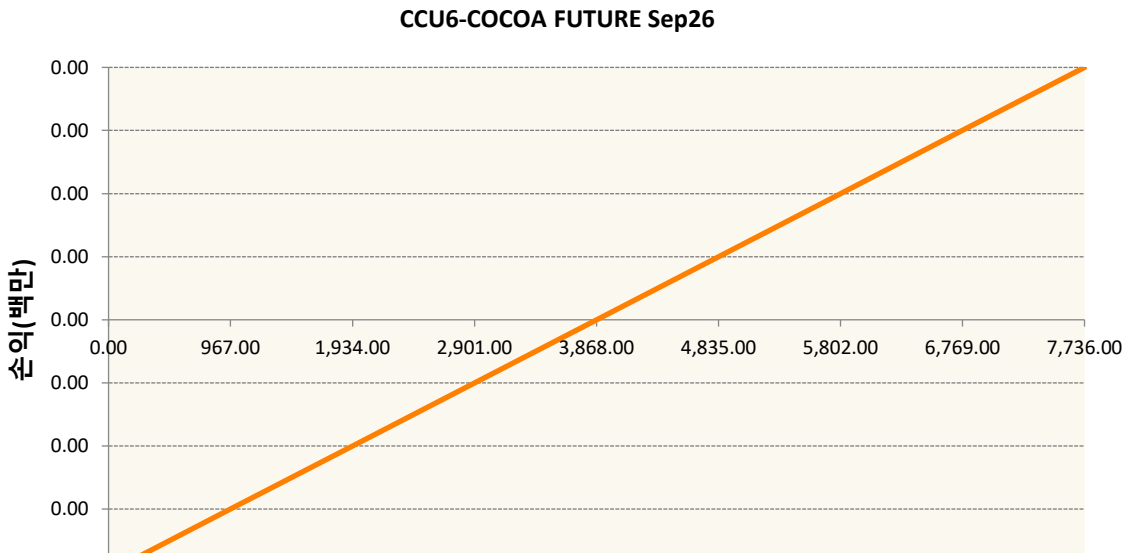
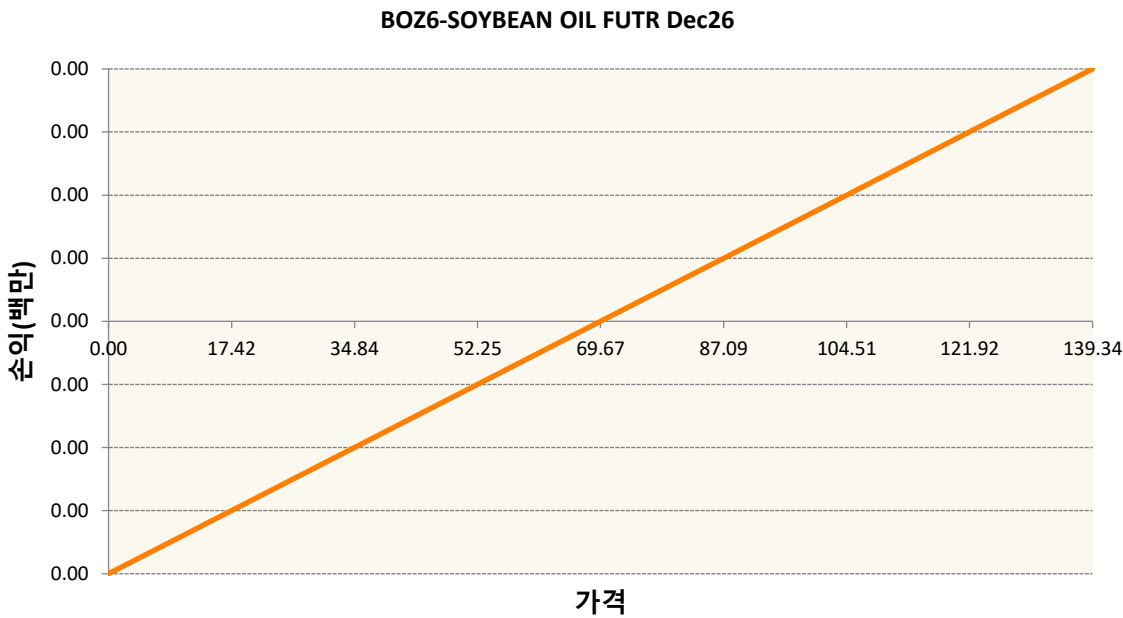
포커스농산물모(채권-파생형)

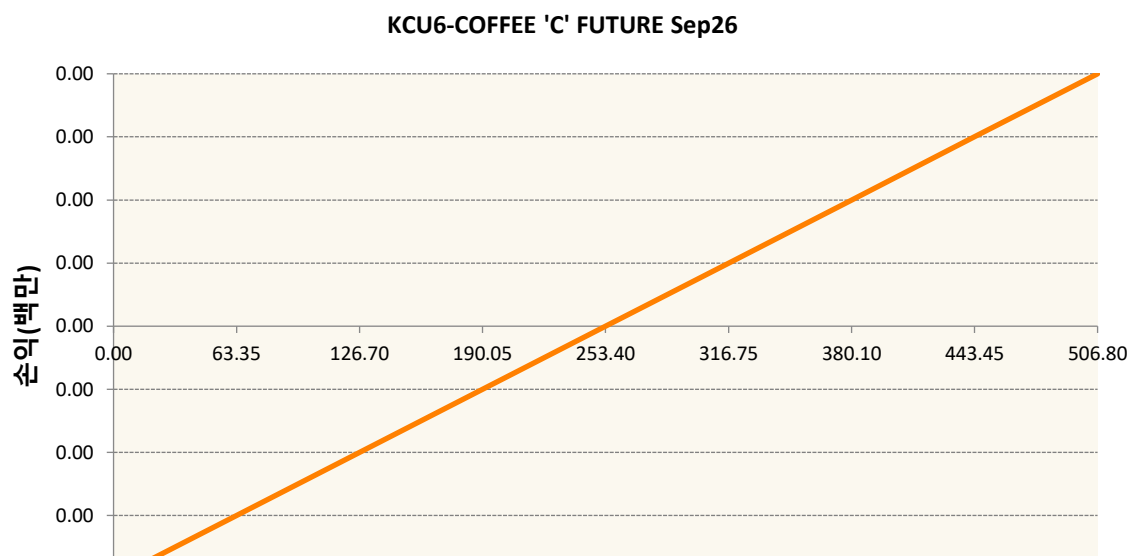
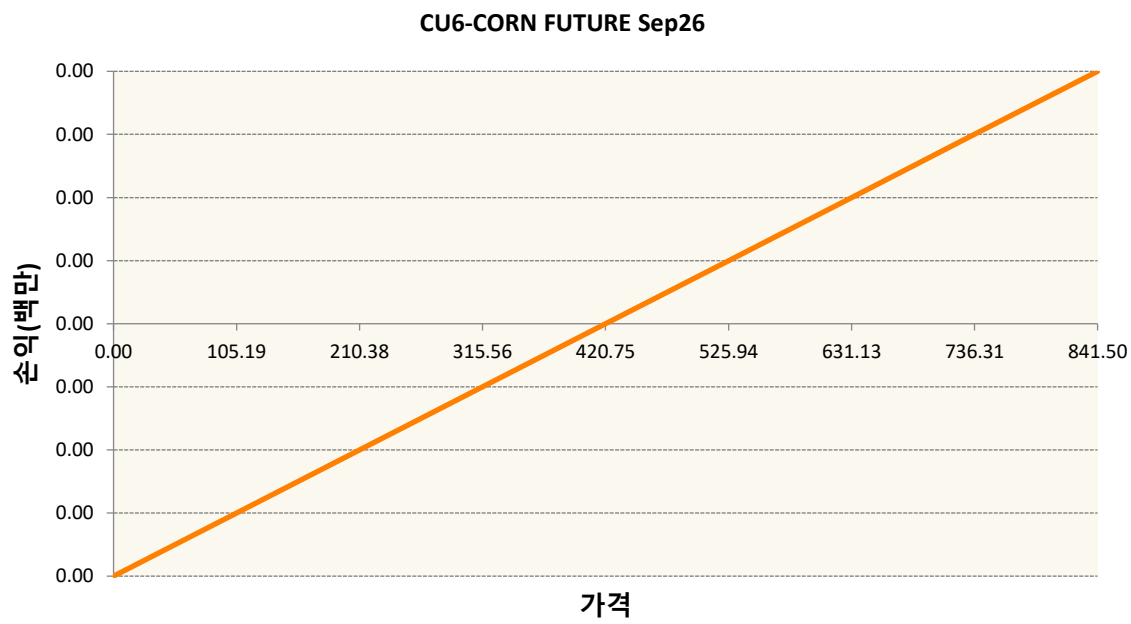
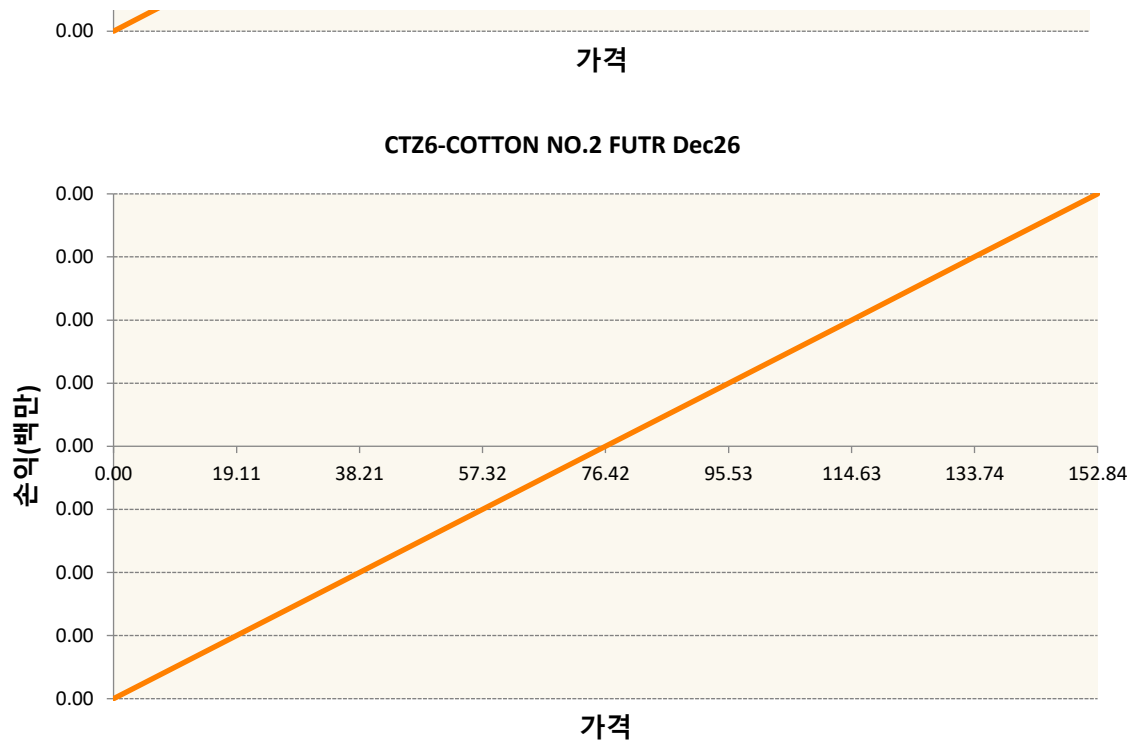
1. 계약금액

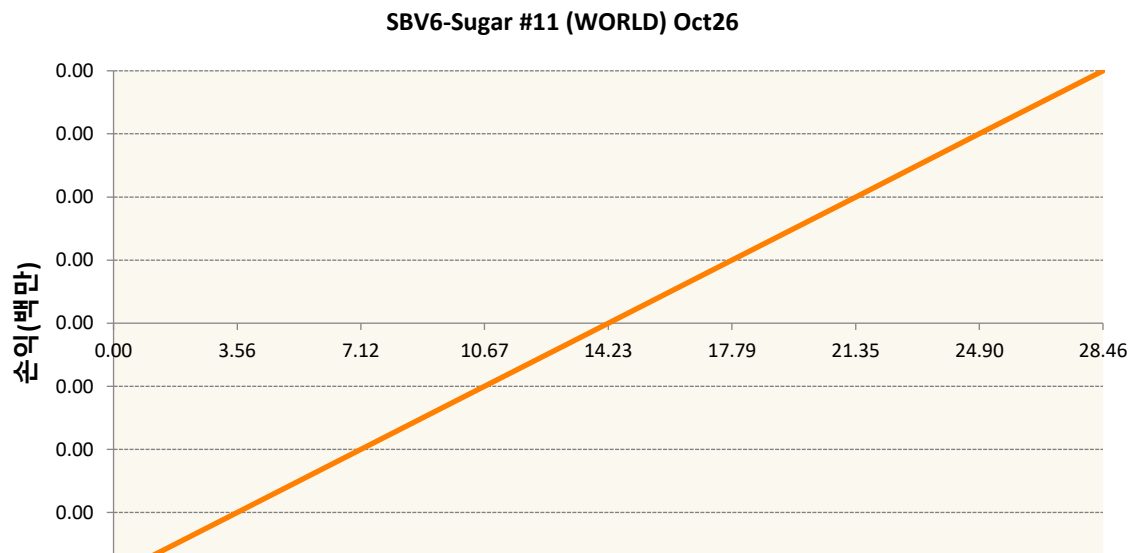
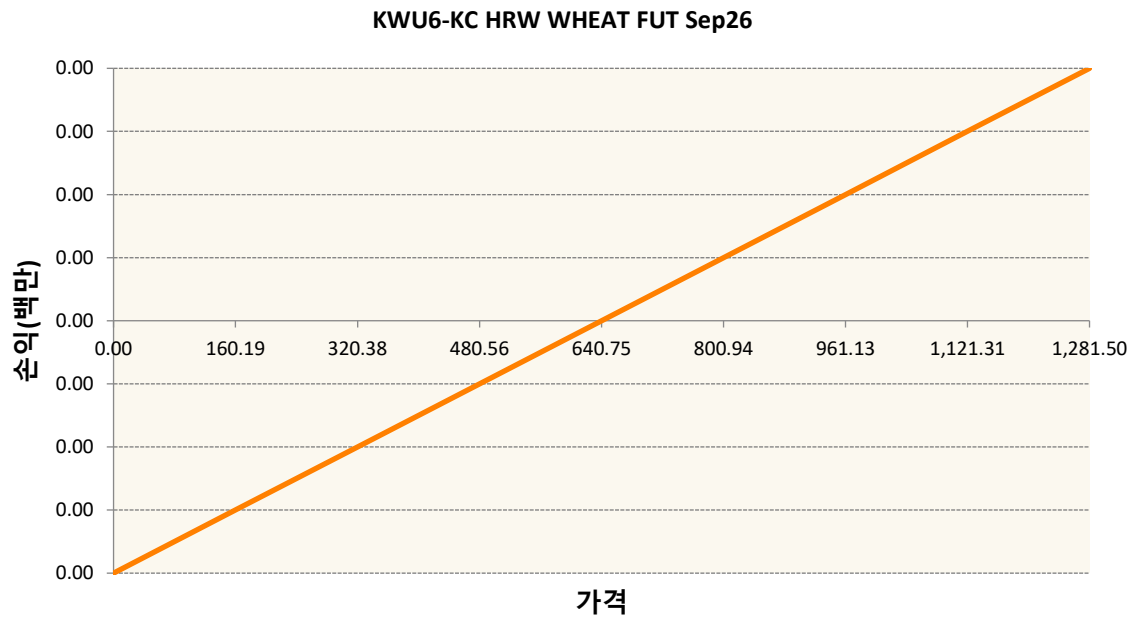
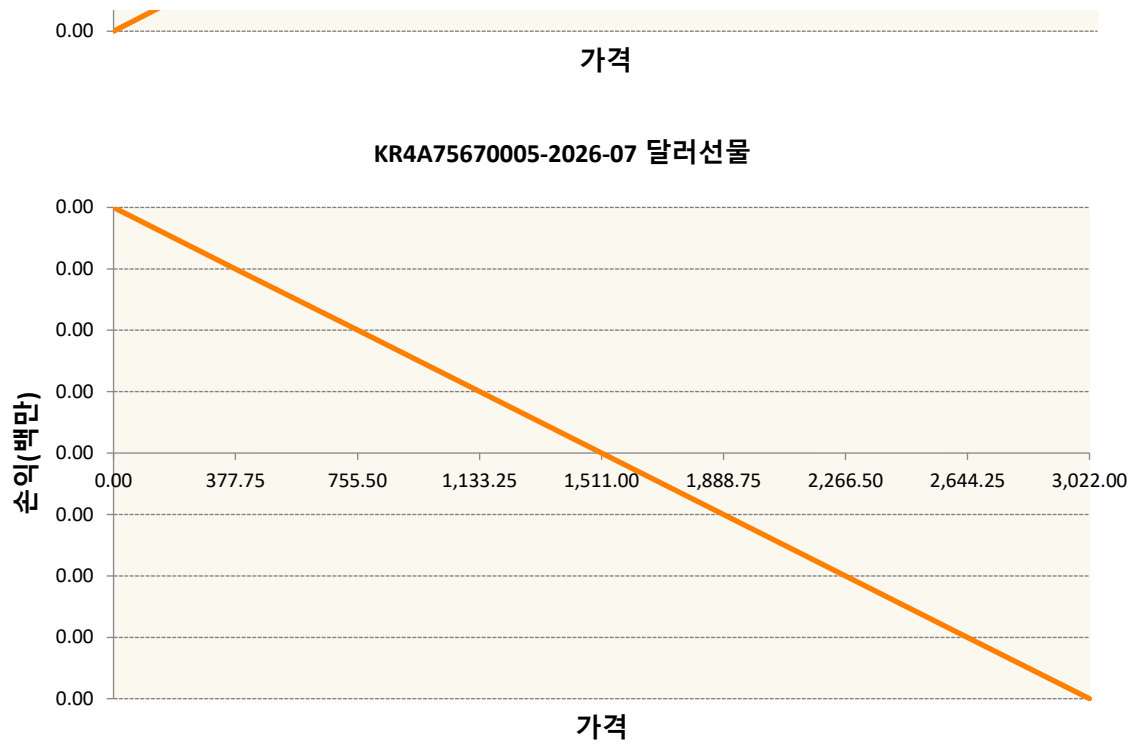
(단위:USD 백만)

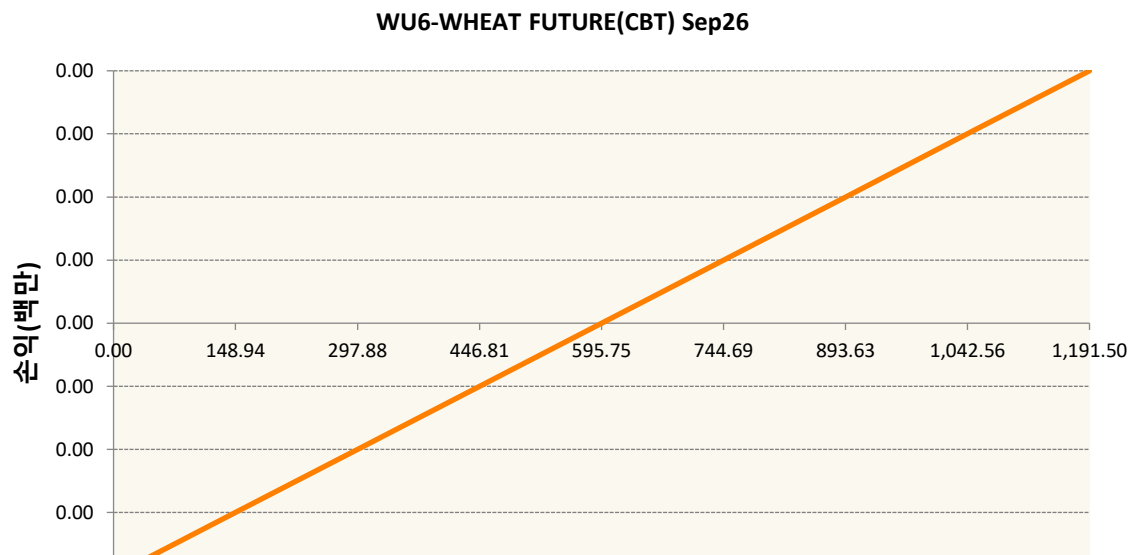
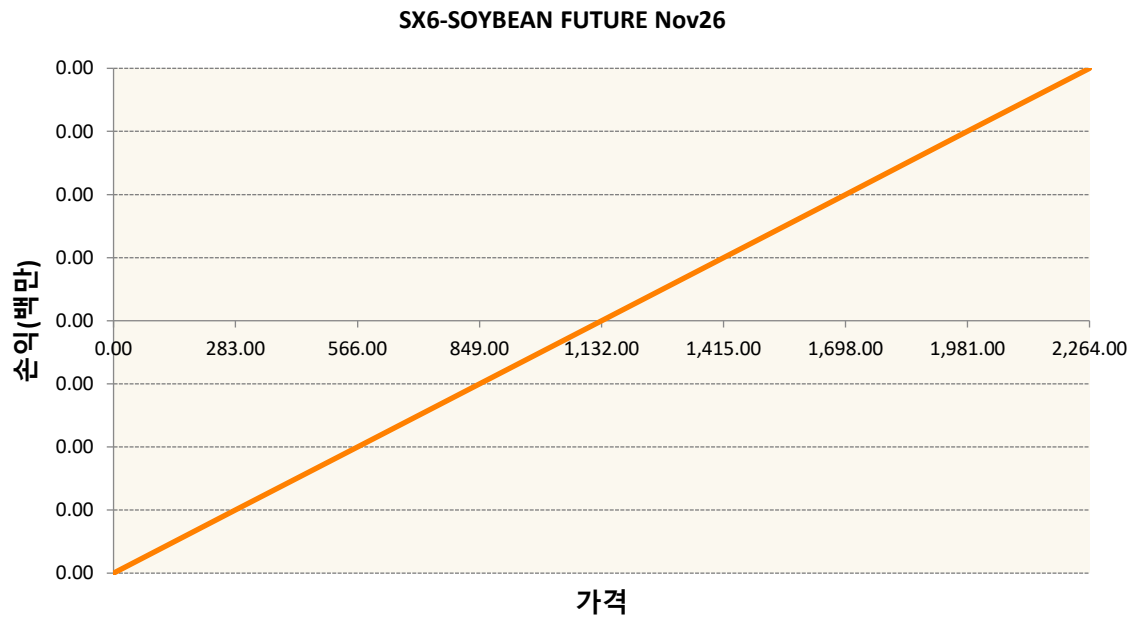
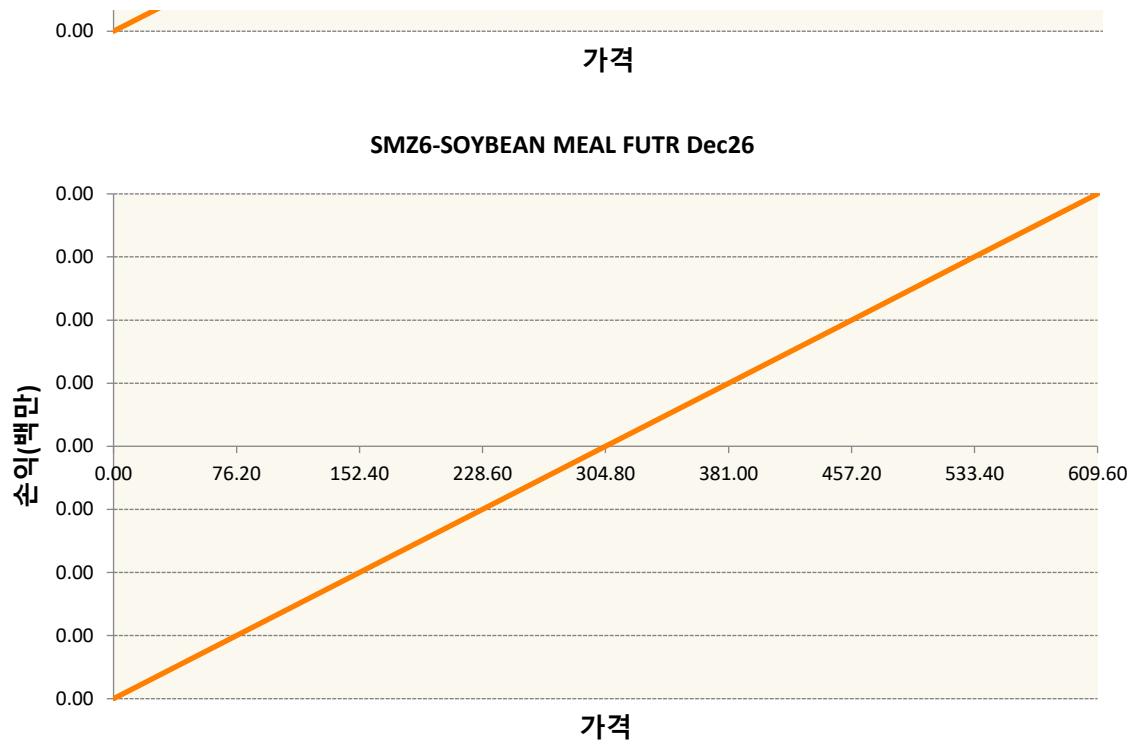
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	441	0	441	
누계	유가증권	선물	2,107	0	2,107	
누계	통화	선물	0	166	-166	장내

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	2026-06-16
기준일	2026-06-15

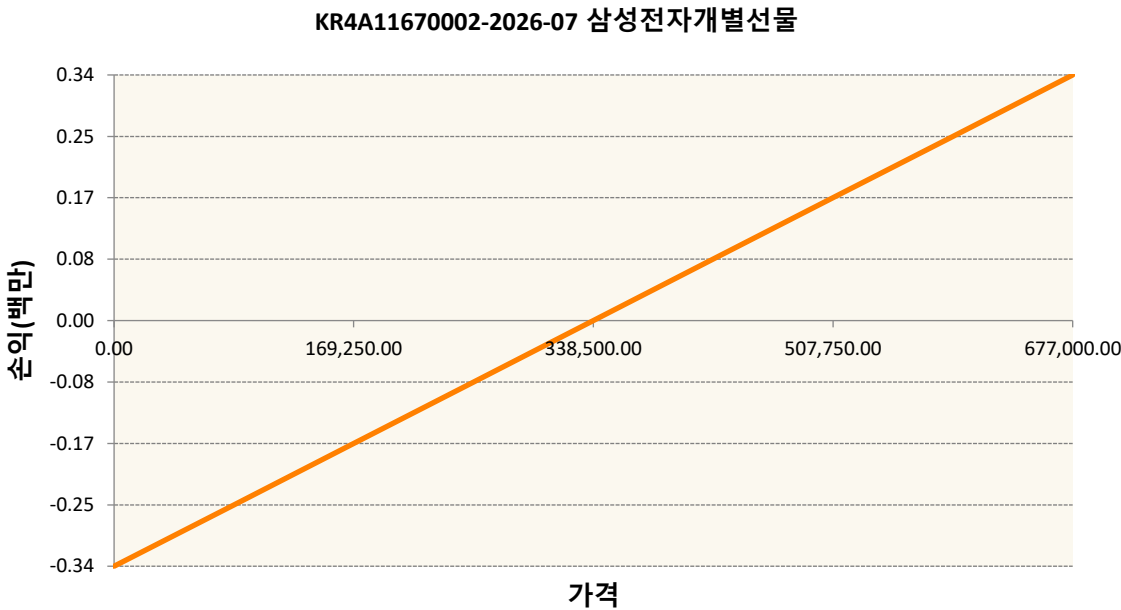
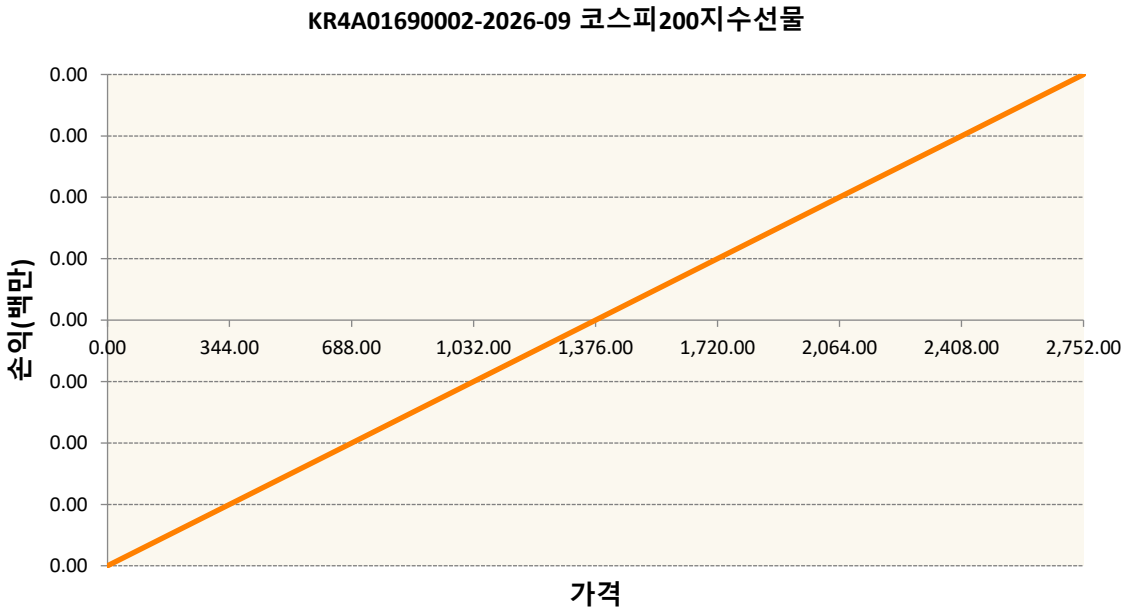
스마트인덱스모

1. 계약금액

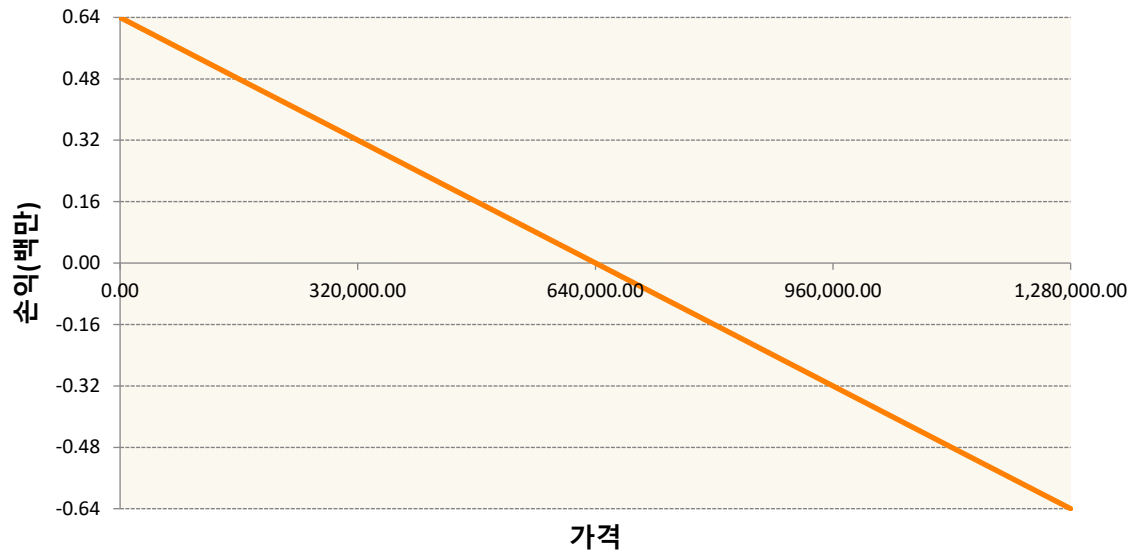
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	681	686	-5	장내
누계	유가증권	선물	3,575	171	3,405	장내

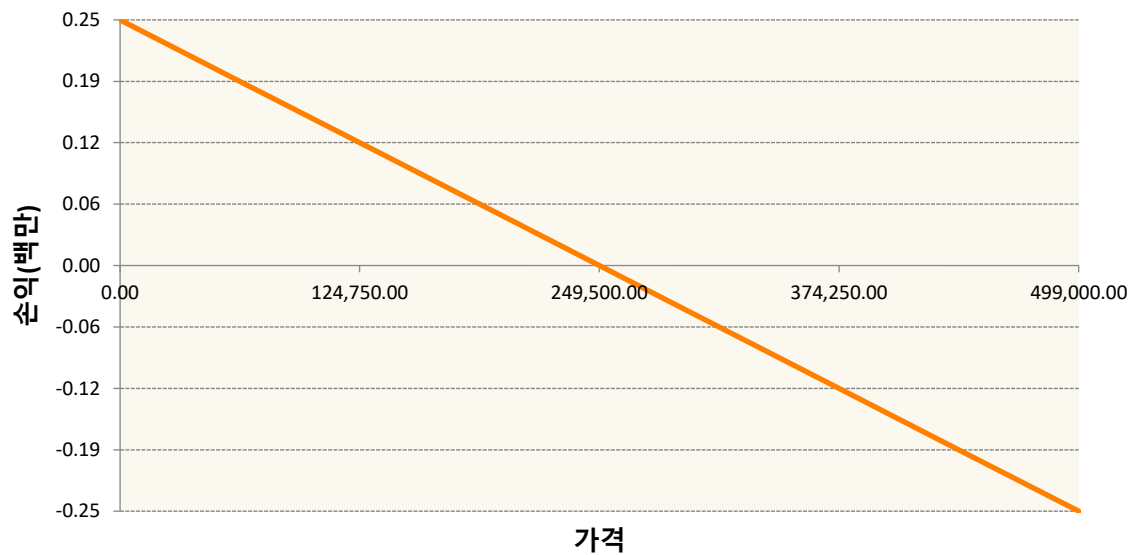
2. 만기시점의 손익구조



KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



KR4A56670008-2026-07 NAVER개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				272
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-272	-272	-272	-272	-272	-272	-272	
-5.33%	-181	-181	-181	-181	-181	-181	-181	
-2.67%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	91	91	91	91	91	91	91	
5.33%	181	181	181	181	181	181	181	
8.00%	272	272	272	272	272	272	272	
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물				11
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11
KR4A20670001 2026-07 현대모비스개별선물							8

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8	8	8	8	8	8	8
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-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%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
8.00%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8

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)

739

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

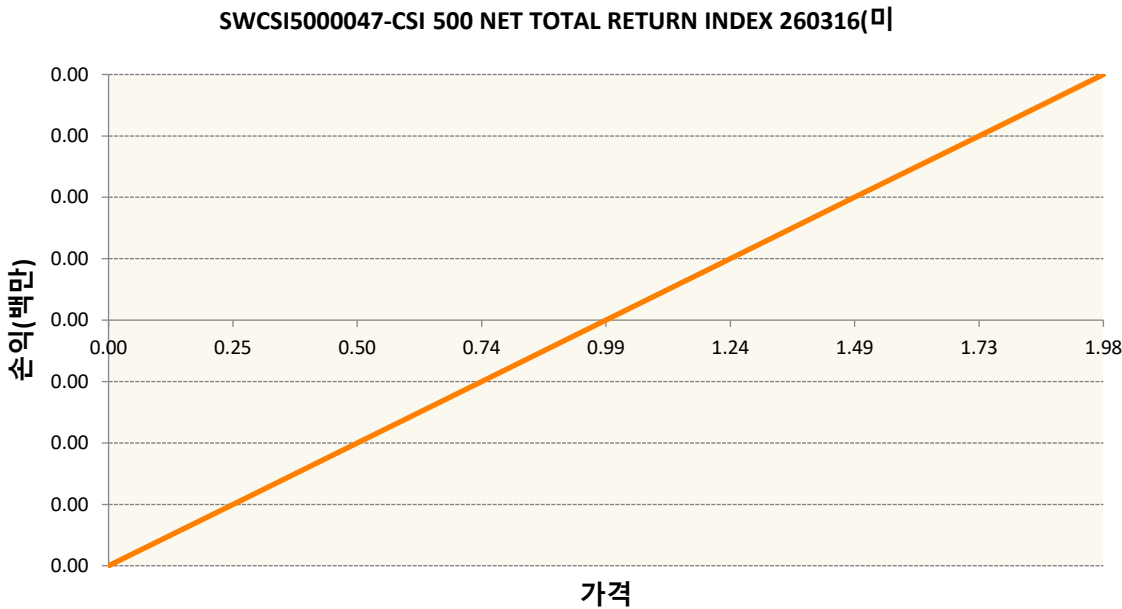
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,587	0	5,587	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

448

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

586

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

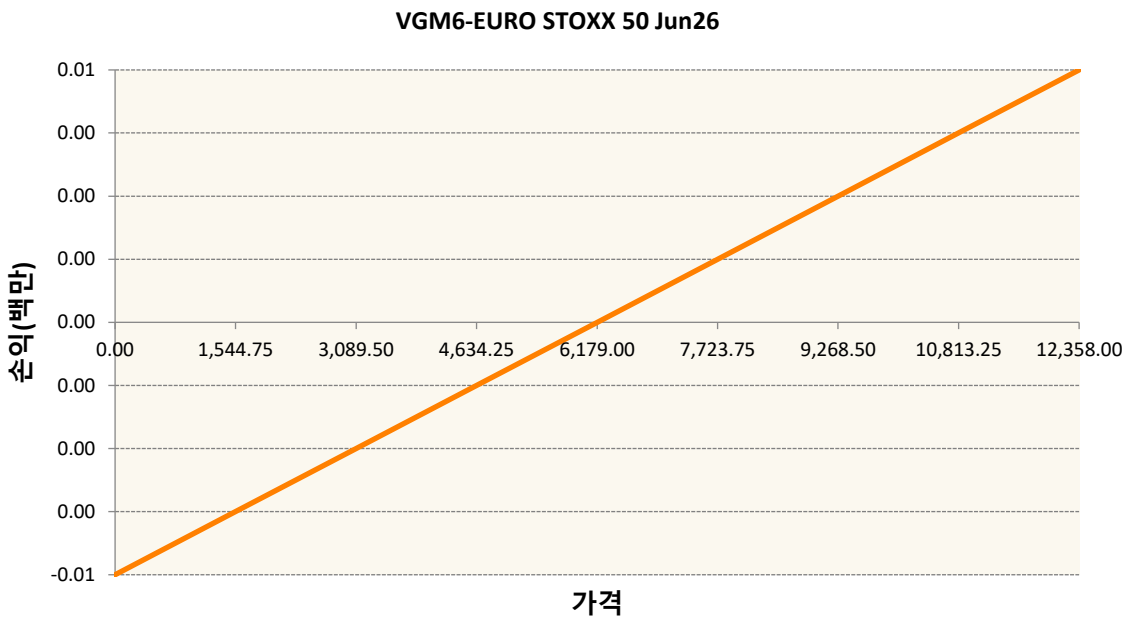
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	954	0	954	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGM6	EURO STOXX 50 Jun26	76
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

67

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

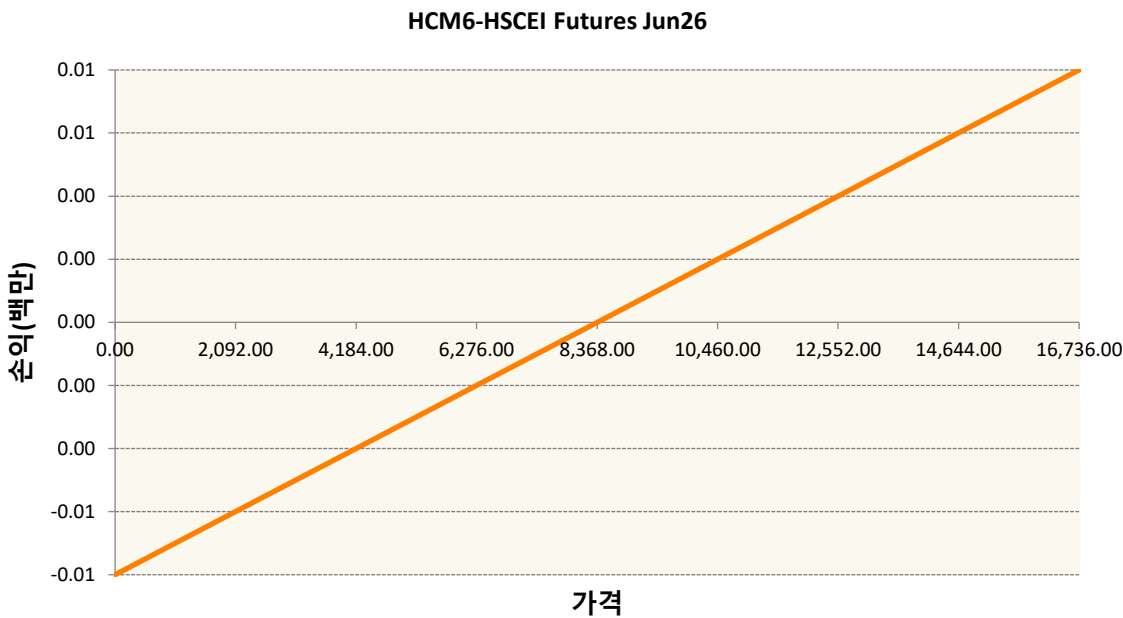
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,365	0	1,365	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	HSCEI Futures Jun26	109
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

131

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

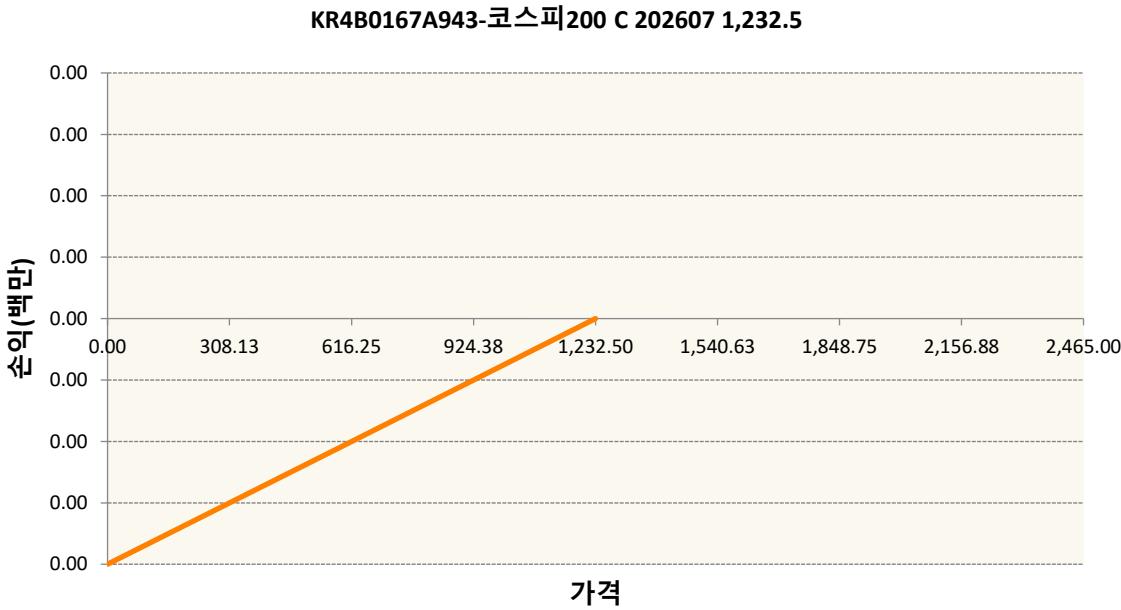
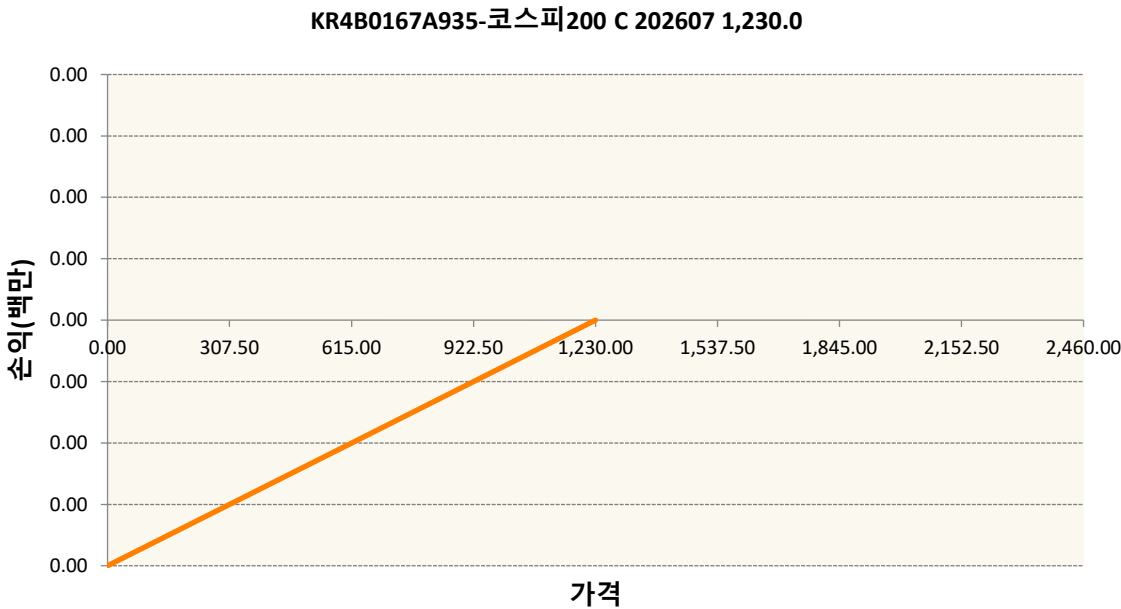
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

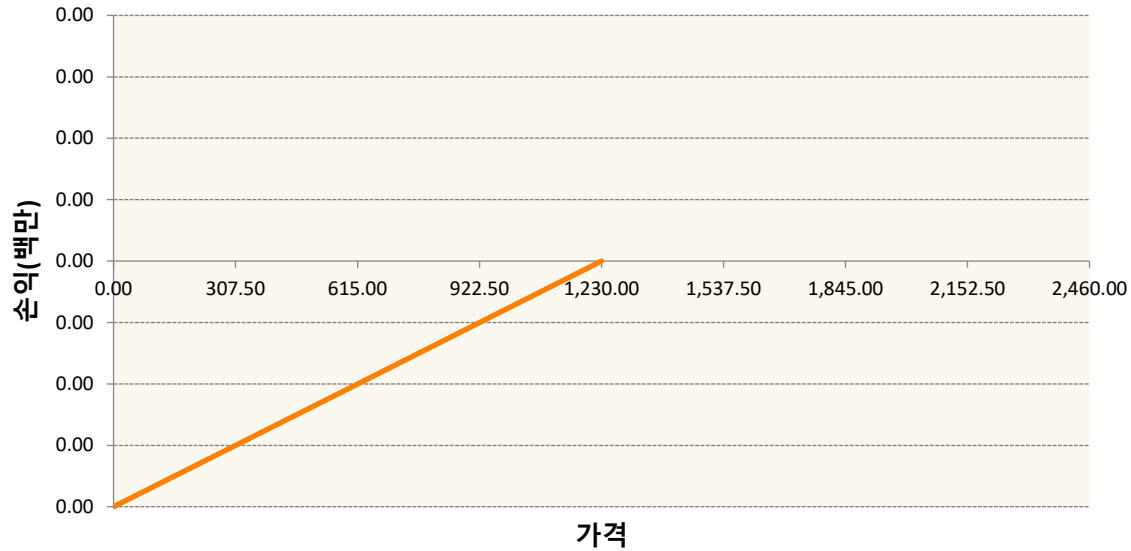
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	355	-355	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,563	-37,563	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0167A933-코스피200 P 202607 1,230.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4B0167A935 코스피200 C 202607 1,230.0							403
기초자산의 변동성							
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-116	-173	-231	-288	-345	-403
-5.33%	27	-30	-87	-144	-201	-259	-316
-2.67%	99	44	-11	-67	-124	-181	-238
0%	159	107	54	0	-55	-111	-167
2.67%	209	161	111	59	6	-48	-103
5.33%	249	206	159	110	60	8	-45
8.00%	282	243	200	155	107	57	6
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5							1,283
기초자산의 변동성							
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-190	-372	-555	-737	-919	-1,101	-1,283
-5.33%	83	-98	-279	-461	-643	-825	-1,007
-2.67%	313	139	-37	-216	-395	-576	-757
0%	507	342	173	0	-175	-352	-530
2.67%	667	513	354	189	20	-152	-326
5.33%	797	657	509	353	192	27	-142
8.00%	903	777	640	495	343	185	23
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0							369
기초자산의 변동성							
가액	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-106	-159	-211	-264	-317	-369
-5.33%	25	-27	-80	-132	-185	-237	-290
-2.67%	91	40	-10	-62	-114	-166	-218
0%	146	98	50	0	-50	-101	-153

2.67%	191	147	101	54	6	-44	-94
5.33%	229	188	146	101	55	7	-41
8.00%	259	223	183	142	98	53	6

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

2,143

공시일 2026-06-16

기준일 2026-06-15

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	2026-06-16
기준일	2026-06-15

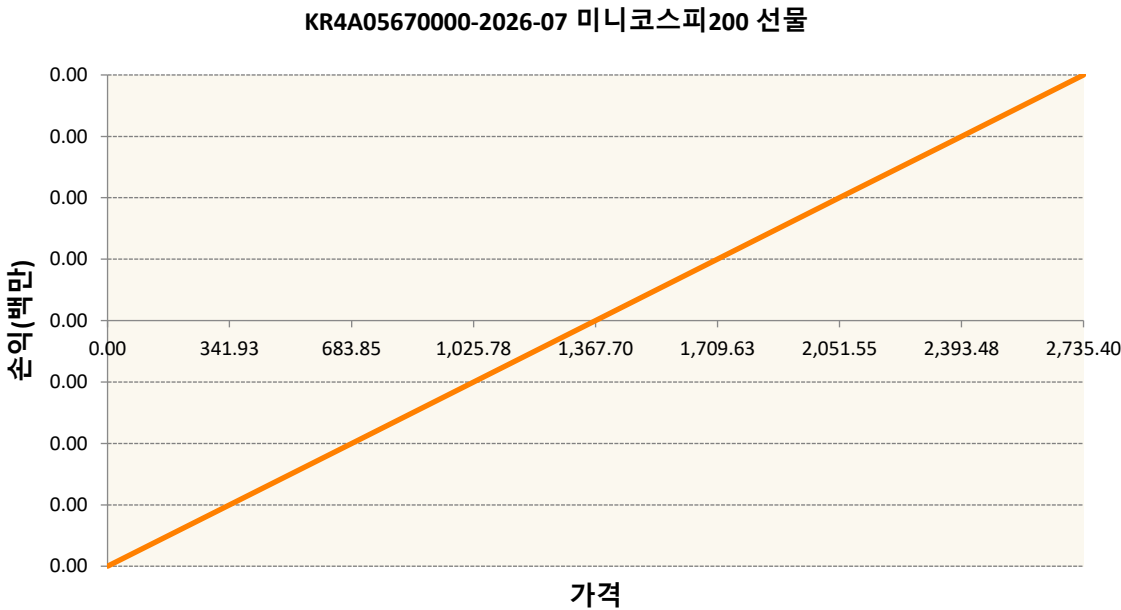
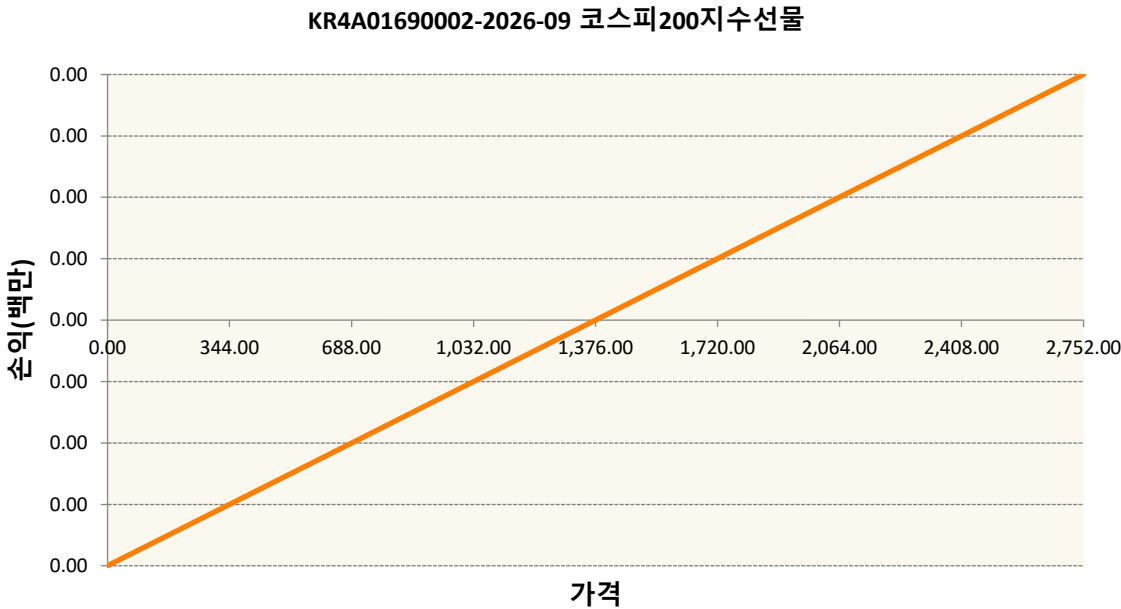
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	343	343	0	장내
누계	유가증권	선물	2,813	69	2,744	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates the profit function for a product. The x-axis is labeled '가격' (Price) and the y-axis is labeled '이익(백만)' (Profit in millions). The line shows that profit is positive for prices below 2,292,000.00 and negative for prices above this point. The maximum profit is 2.29 million won when the price is 0, and the minimum profit is -2.29 million won when the price is 4,584,000.00.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	2.29
1,146,000.00	1.15
2,292,000.00	0.00
3,438,000.00	-1.15
4,584,000.00	-2.29

The graph illustrates a linear relationship between price and profit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 1,422,000.00 with major ticks every 355,500.00. The y-axis, labeled '이익 (백만)' (Profit in millions), ranges from -0.71 to 0.71 with major ticks every 0.18. A solid blue line represents the profit function, starting at (0, -0.71) and ending at (1,422,000, 0.71). The line intersects the x-axis at 711,000.00, which is the break-even point.

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
0.00	-0.71
355,500.00	-0.36
711,000.00	0.00
1,066,500.00	0.36
1,422,000.00	0.71

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-2.67%	-27	-27	-27	-27	-27	-27	-27
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	27	27	27	27	27	27	27
5.33%	54	54	54	54	54	54	54
8.00%	82	82	82	82	82	82	82
KR4A05670000		2026-07 미니코스피200 선물					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
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%	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

KR4AFD670003 2026-07 HD현대중공업개별선물							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)

300

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

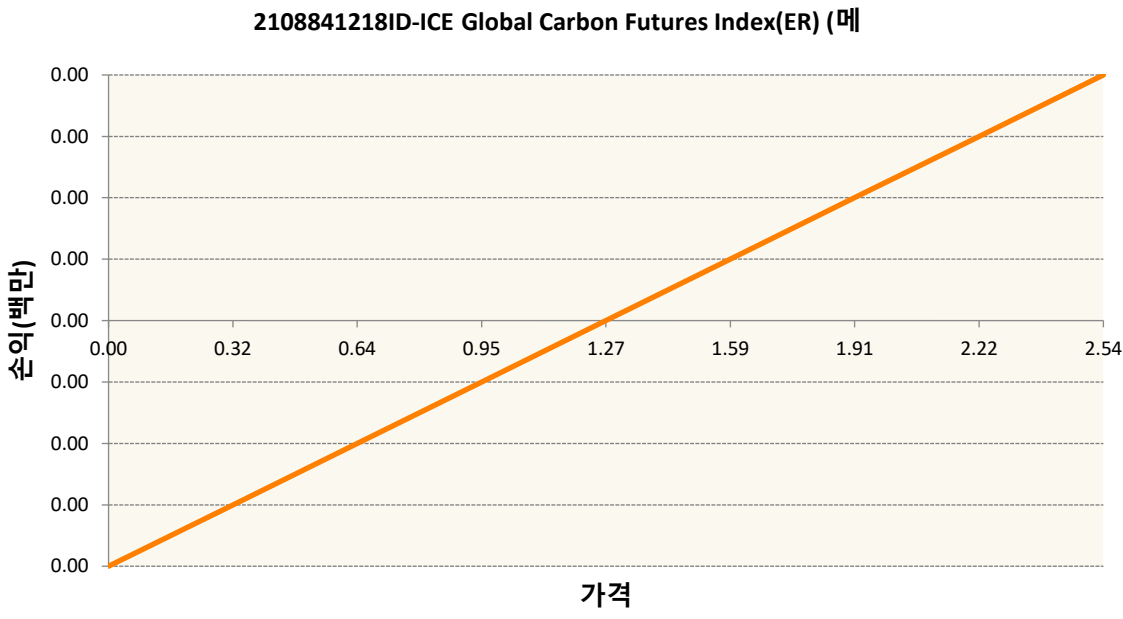
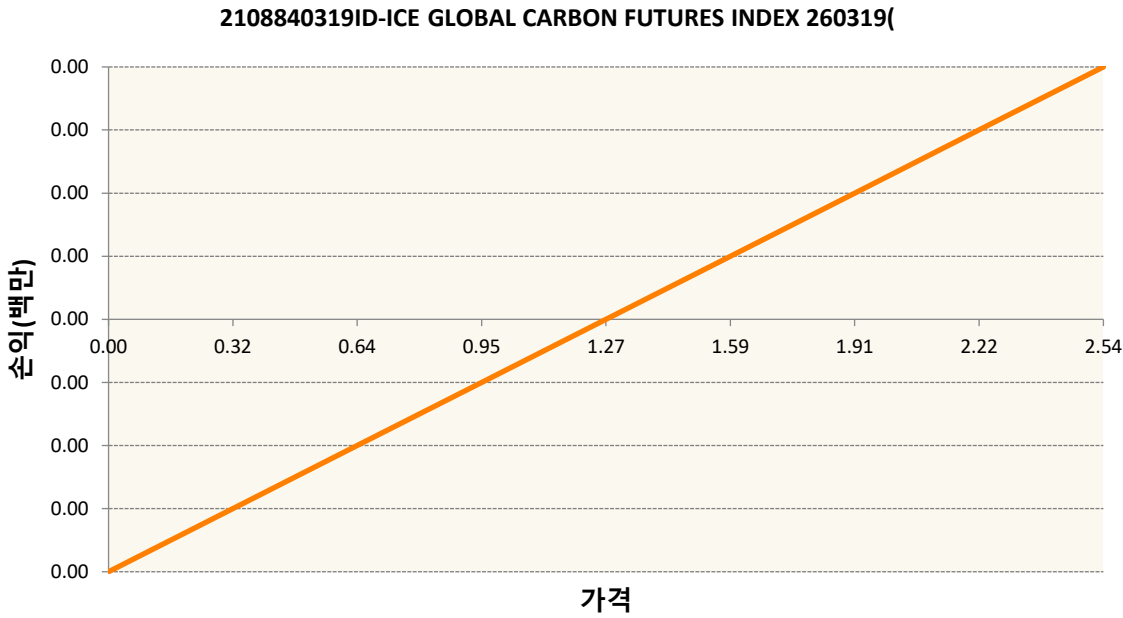
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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

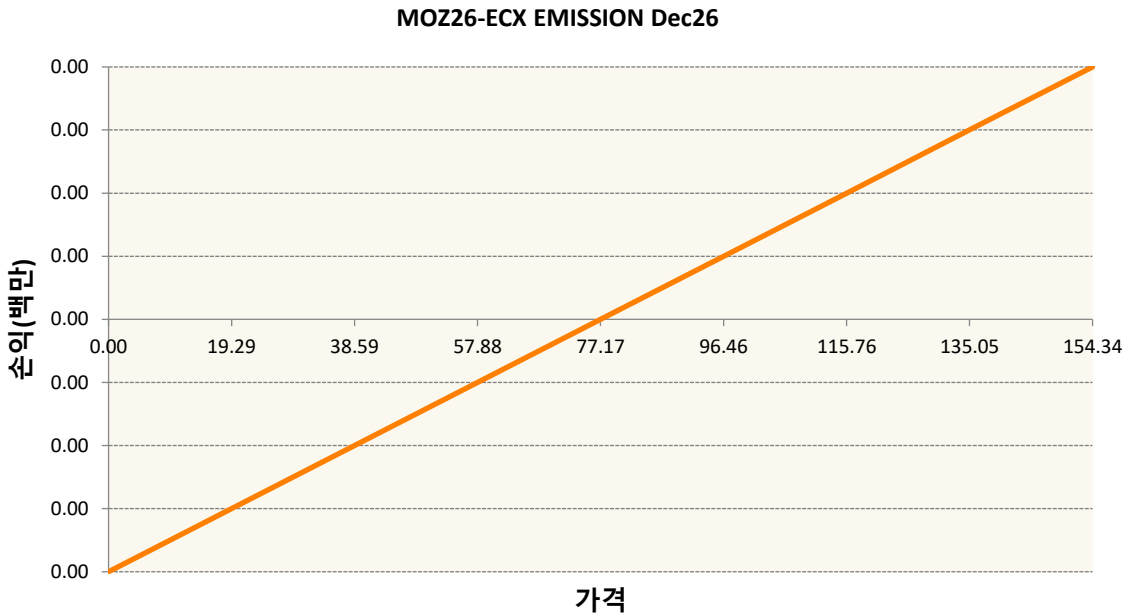
공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

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			4,976	0	4,976	
누계	통화	선도	0	2,638	-2,638	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E)			211
MOZ26	ECX EMISSION Dec26		398

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	682

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

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	1,510	0	1,510	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)		15
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)		10
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)		25
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(		10

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	93

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

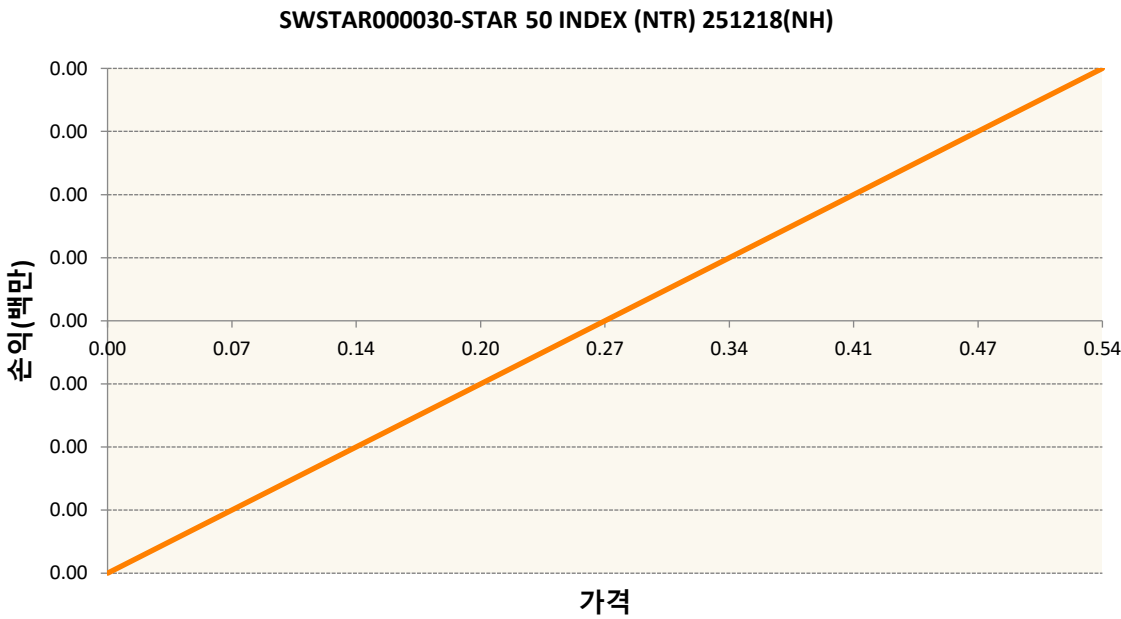
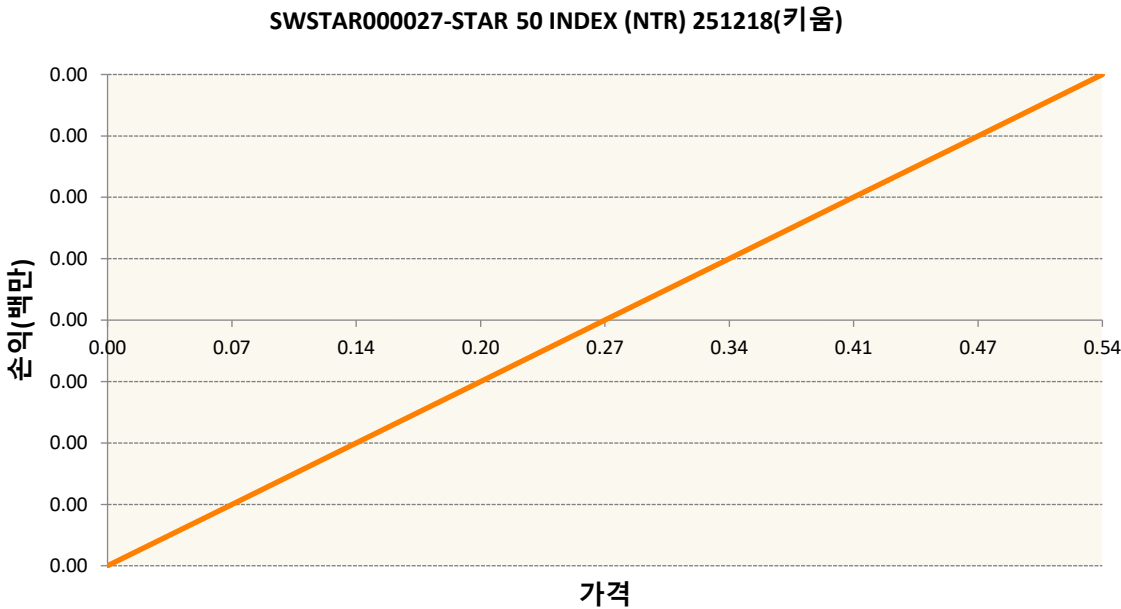
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

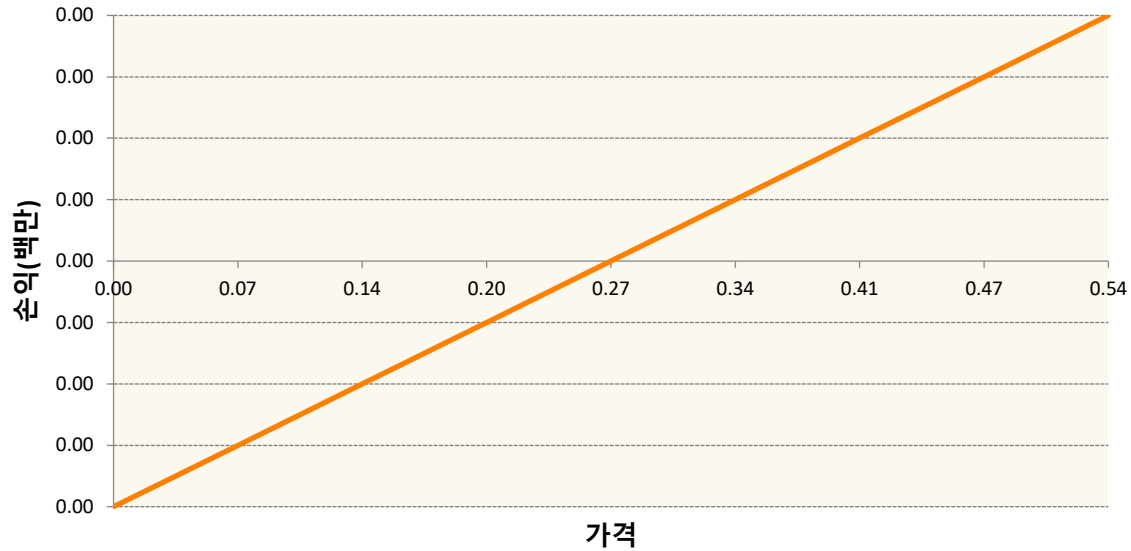
(단위:백만원)

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

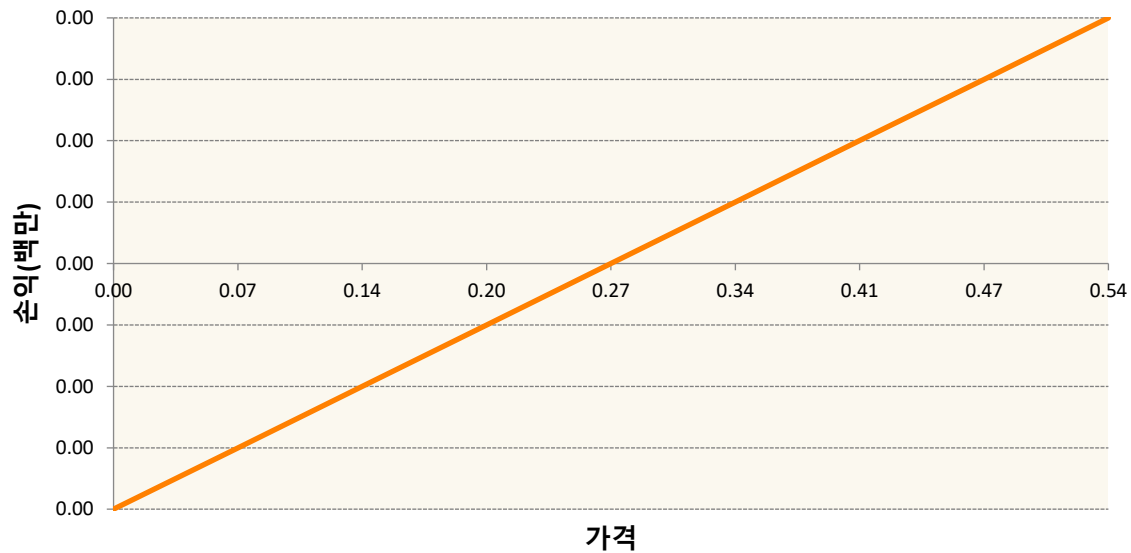
2. 만기시점의 손익구조



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)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)

19
65
331
123

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

(단위:백만원)

855

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

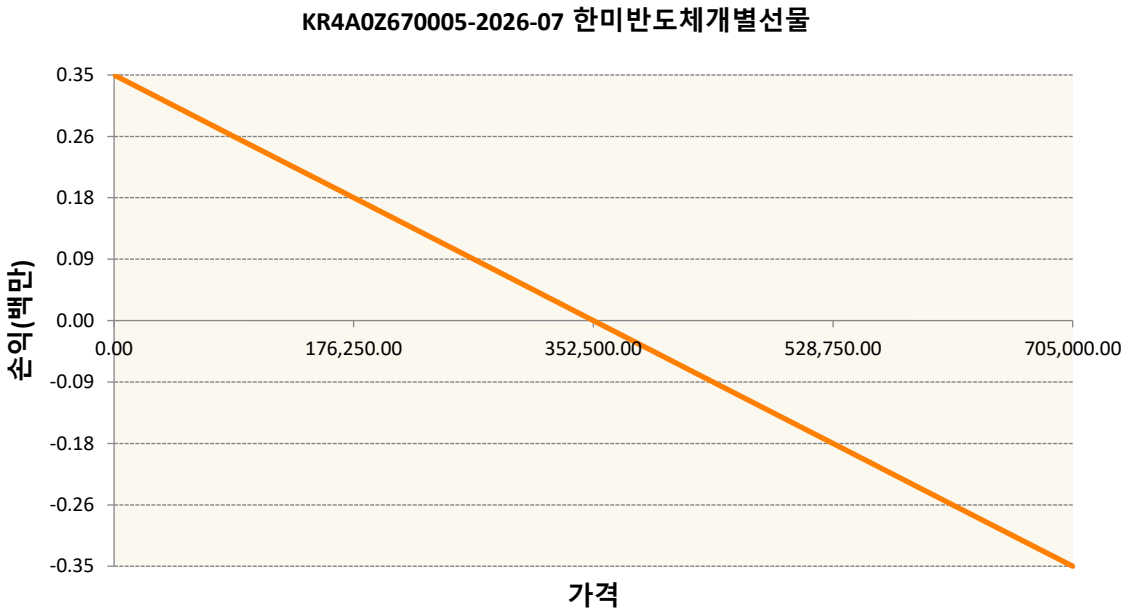
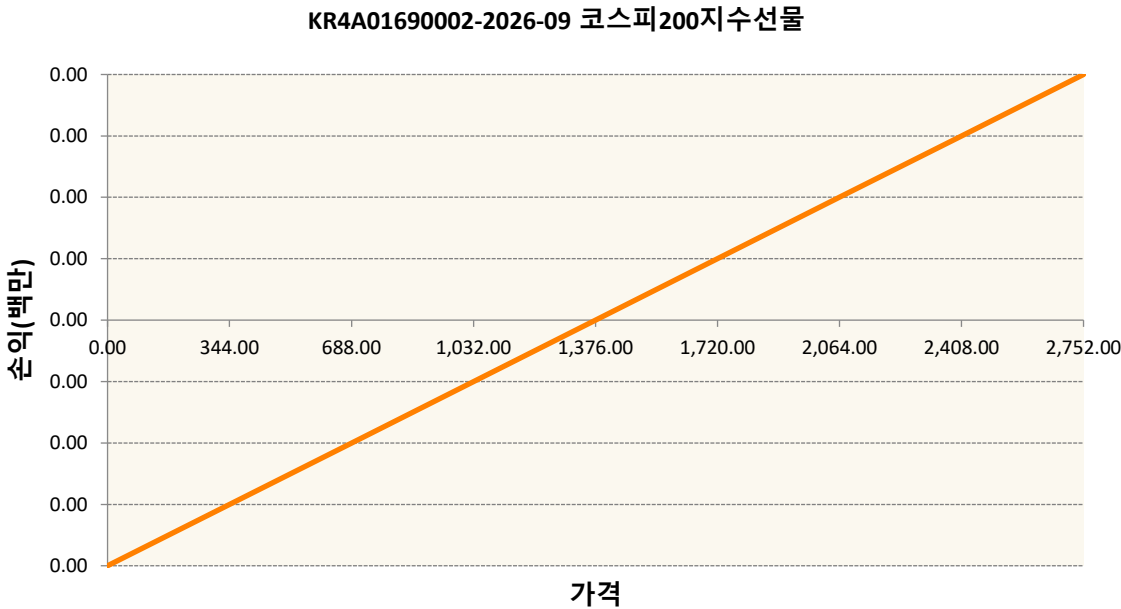
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

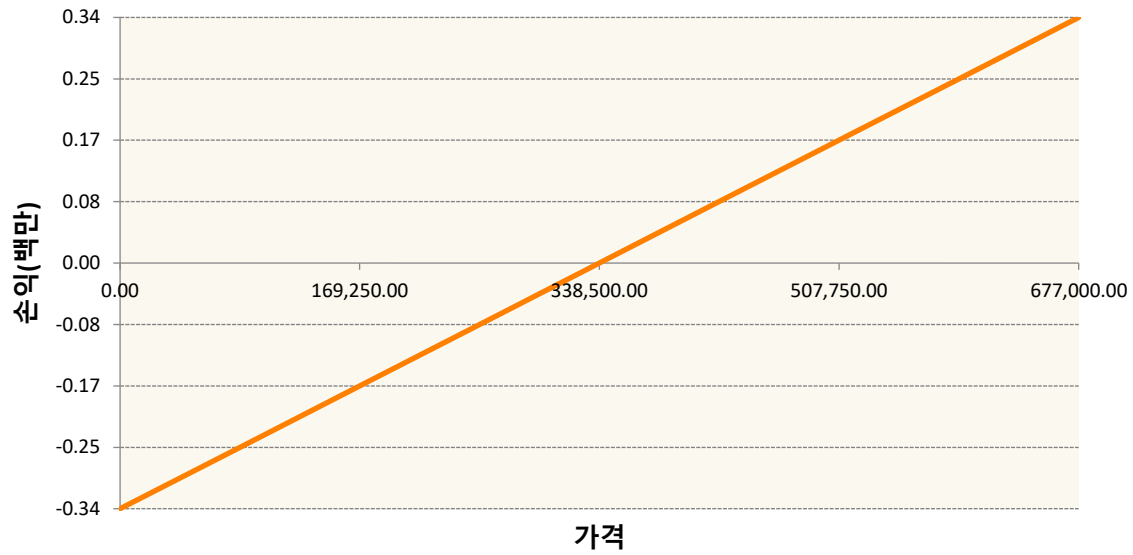
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,665	2,671	-1,006	장내
누계	유가증권	선물	14,144	5,799	8,345	장내

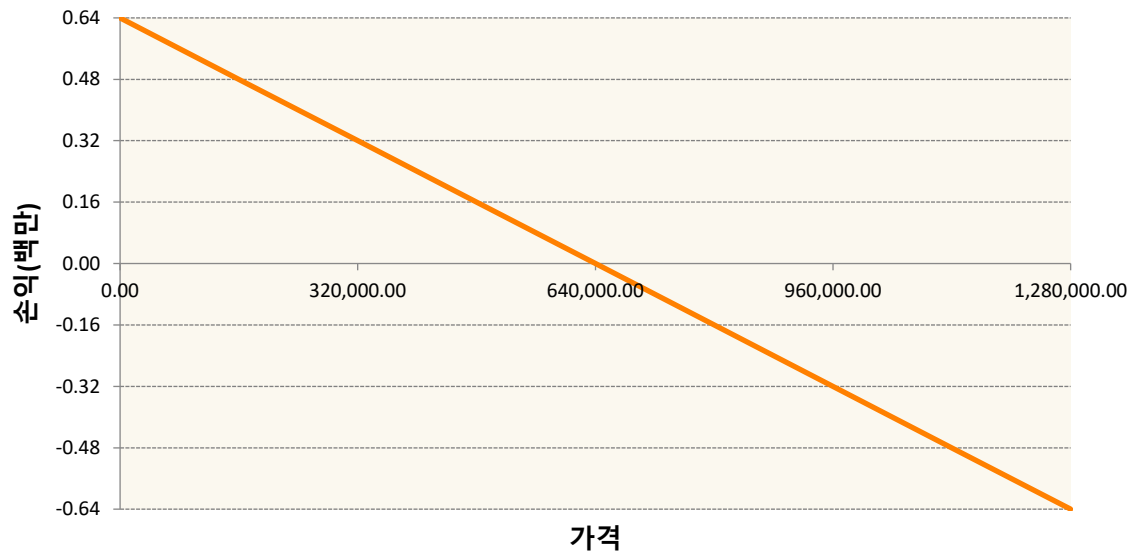
2. 만기시점의 손익구조



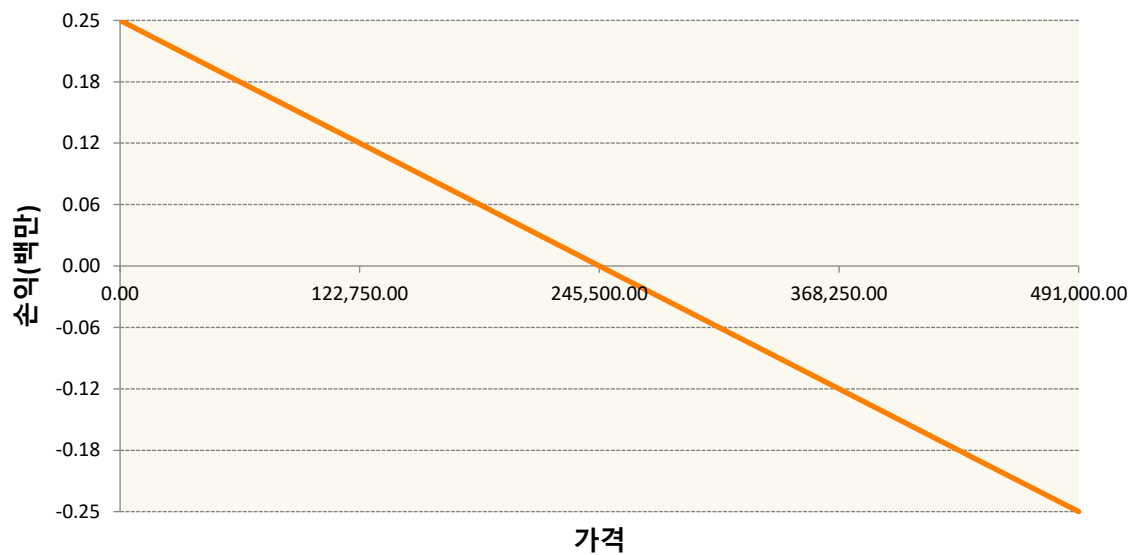
KR4A11670002-2026-07 삼성전자개별선물



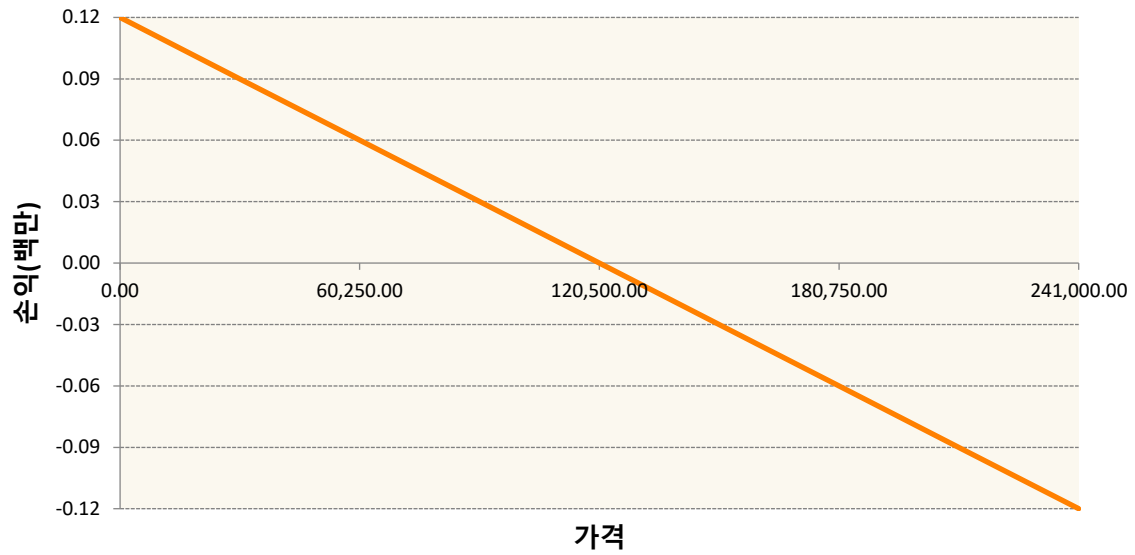
KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



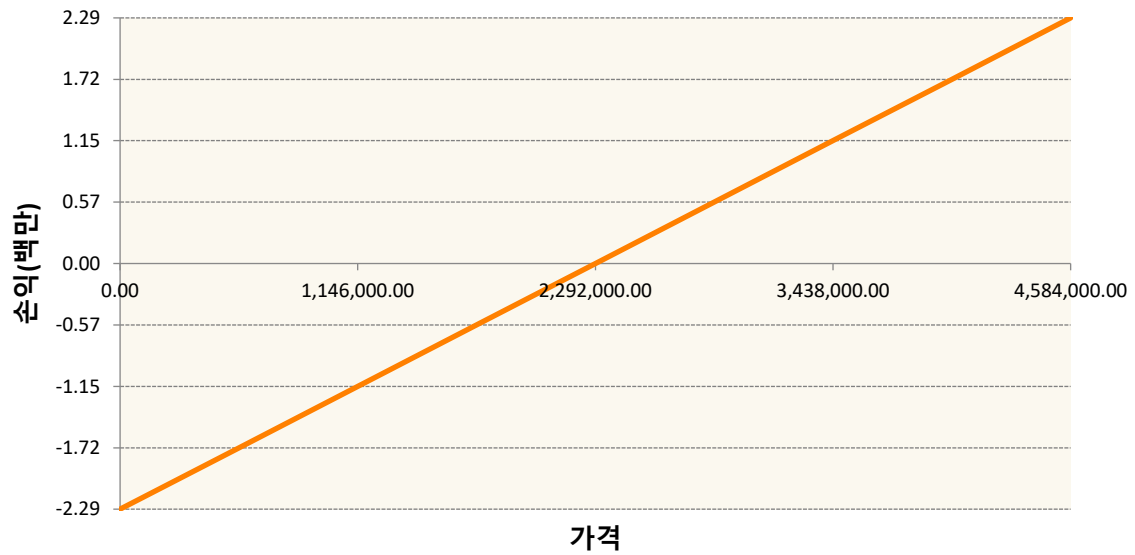
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



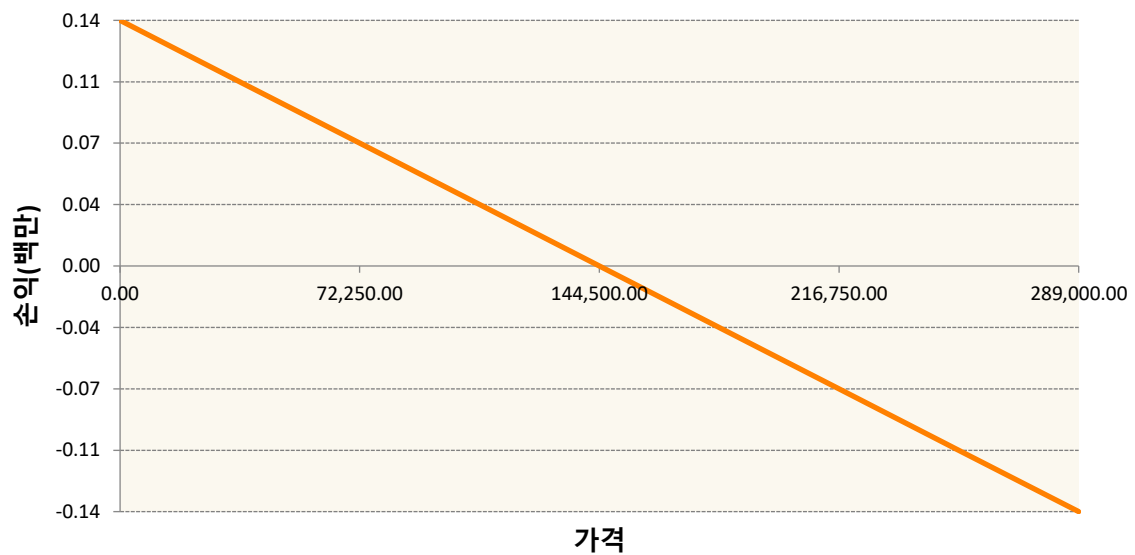
KR4A2P670005-2026-07 이수페타시스개별선물



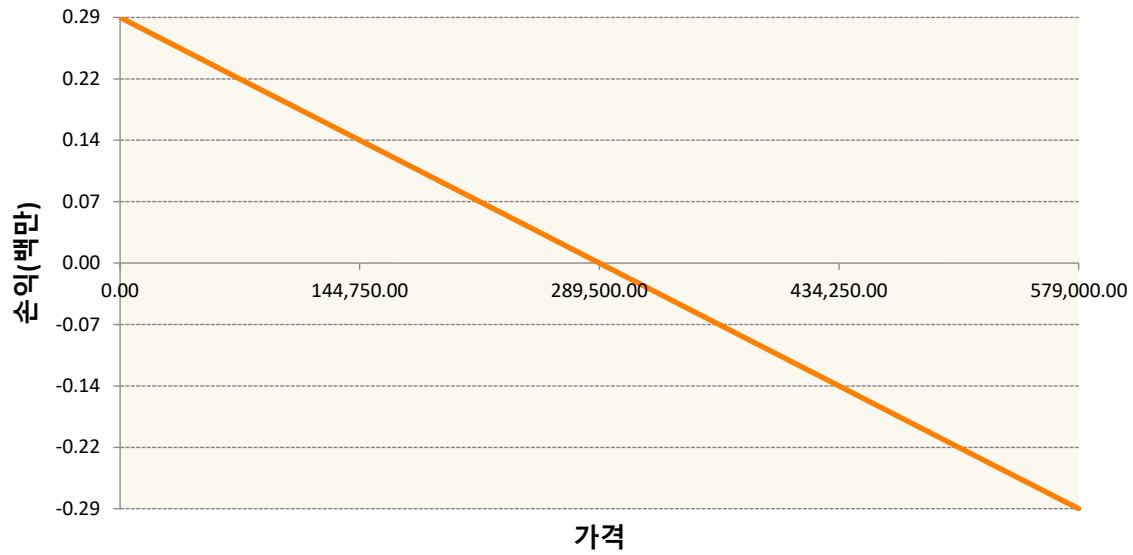
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



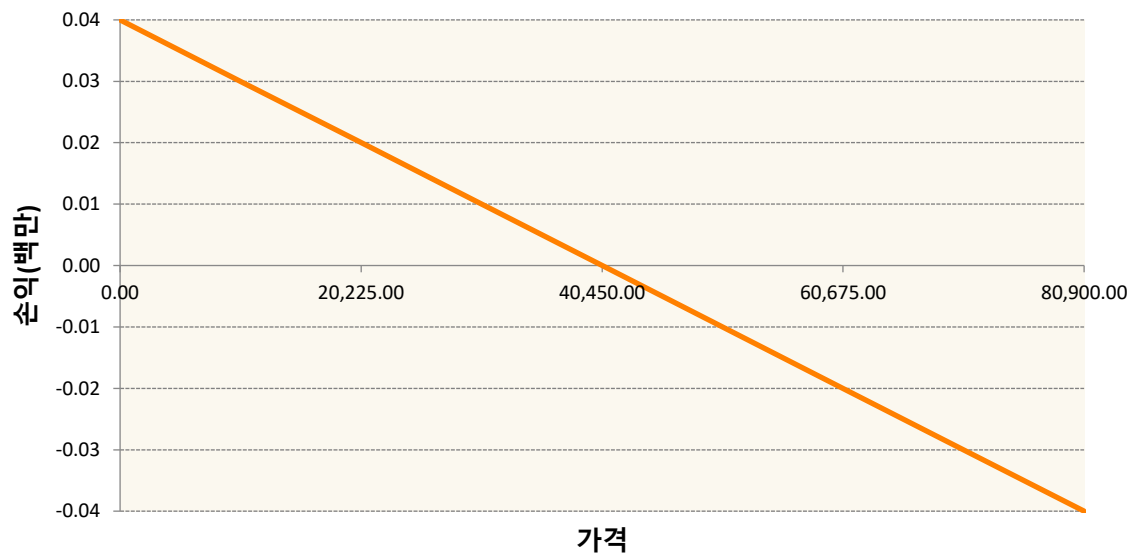
KR4ABN670005-2026-07 현대건설개별선물



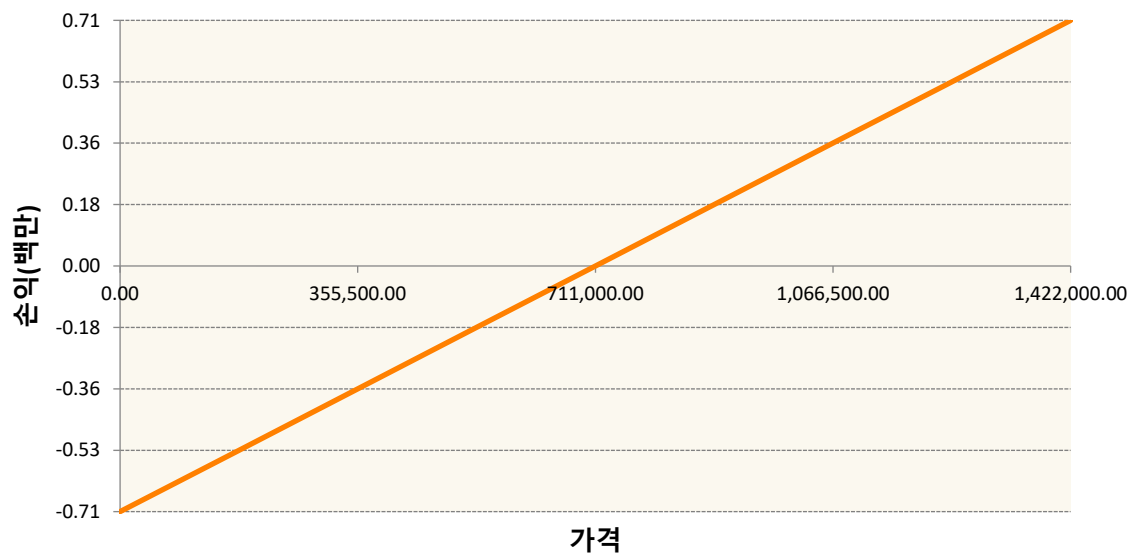
KR4AC0670001-2026-07 OCI홀딩스개별선물



KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002						2026-09 코스피200지수선물		517
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-517	-517	-517	-517	-517	-517	-517	
-5.33%	-345	-345	-345	-345	-345	-345	-345	
-2.67%	-172	-172	-172	-172	-172	-172	-172	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	172	172	172	172	172	172	172	
5.33%	345	345	345	345	345	345	345	
8.00%	517	517	517	517	517	517	517	
KR4A0Z670005						2026-07 한미반도체개별선물		98
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	98	98	98	98	98	98	98	
-5.33%	66	66	66	66	66	66	66	
-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%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66	
8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98	
KR4A11670002						2026-07 삼성전자개별선물		512
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-512	-512	-512	-512	-512	-512	-512	
-5.33%	-341	-341	-341	-341	-341	-341	-341	
-2.67%	-171	-171	-171	-171	-171	-171	-171	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	171	171	171	171	171	171	171	
5.33%	341	341	341	341	341	341	341	
8.00%	512	512	512	512	512	512	512	
KR4A20670001						2026-07 현대모비스개별선물		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%	51	51	51	51	51	51	51	
-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%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51	
8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76	
KR4A24670007						2026-07 LG전자개별선물		57
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	57	57	57	57	57	57	57
-5.33%	38	38	38	38	38	38	38
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
5.33%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
8.00%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57

KR4A2P670005 2026-07 이수페타시스개별선물 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

KR4A50670004 2026-07 SK하이닉스개별선물 70

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70
-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%	70	70	70	70	70	70	70

KR4ABN670005 2026-07 현대건설개별선물 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

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							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
-5.33%	69	69	69	69	69	69	69
-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%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
8.00%	-104	-104	-104	-104	-104	-104	-104
KR4AFD670003 2026-07 HD현대중공업개별선물							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

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

(단위:백만원)

3,928

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

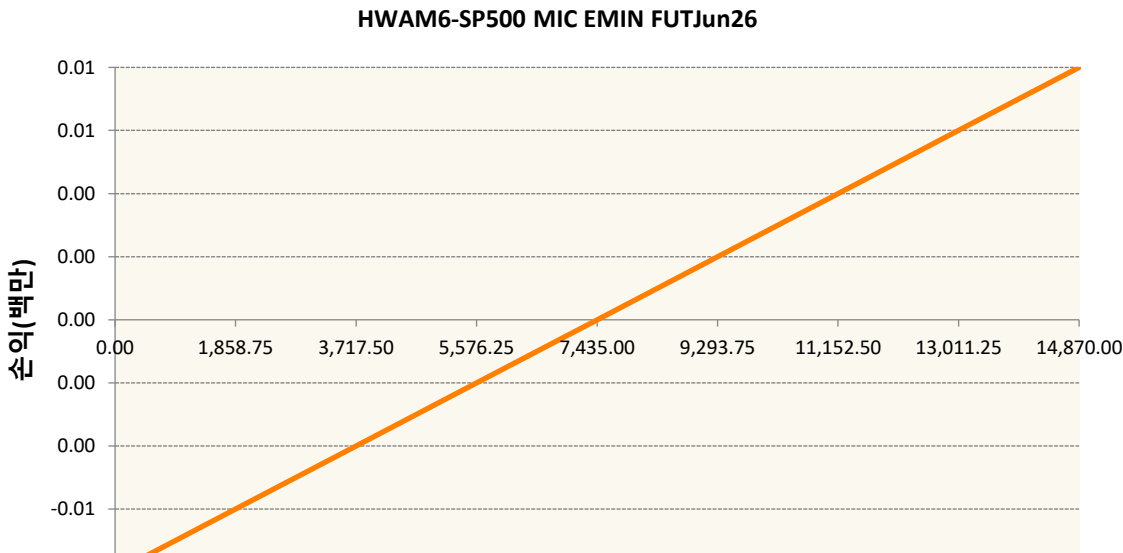
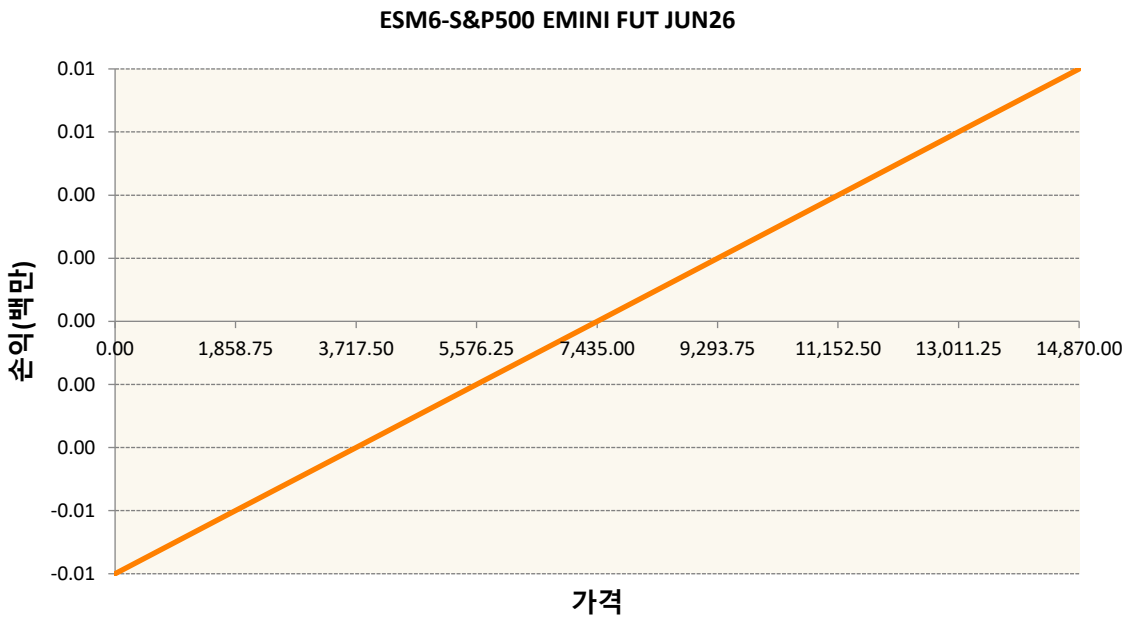
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

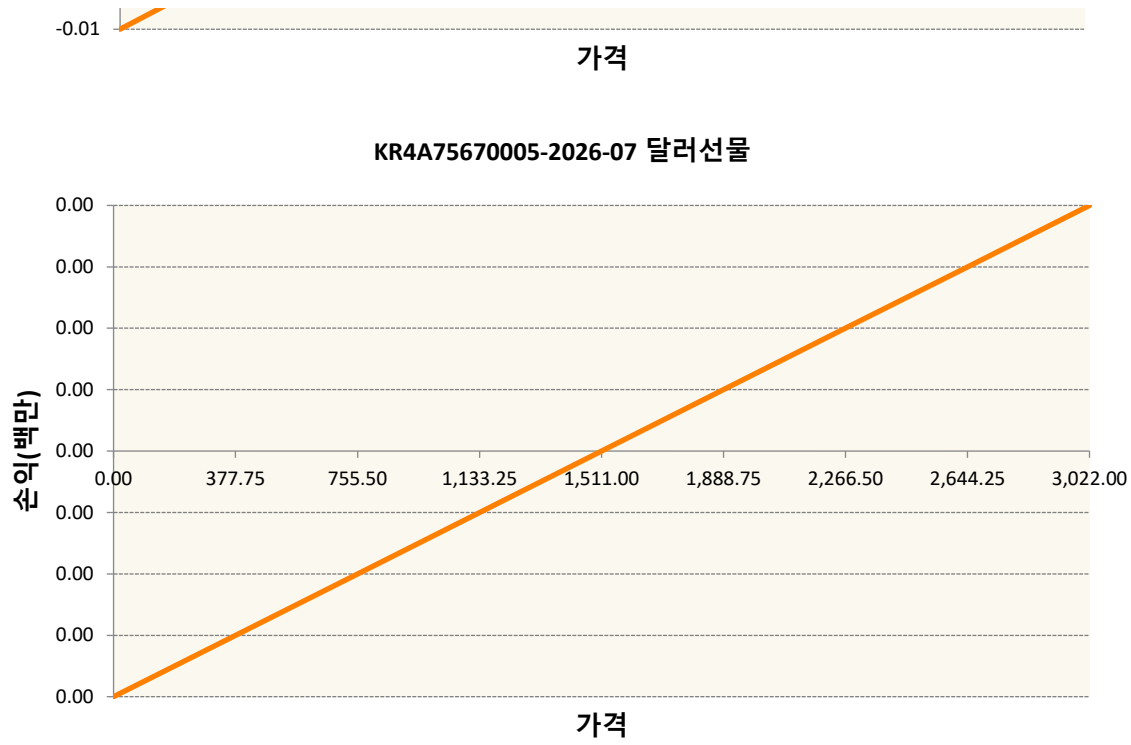
1. 계약금액

(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	60,775	0	60,775	
누계	지수	선물	277	0	277	장내
누계	통화	선물	10,728	0	10,728	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESM6	S&P500 EMINI FUT JUN26	4,862
HWAM6	SP500 MIC EMIN FUTJun26	22
KR4A756700	2026-07 달러선물	858

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

(단위:백만원)

4,211

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

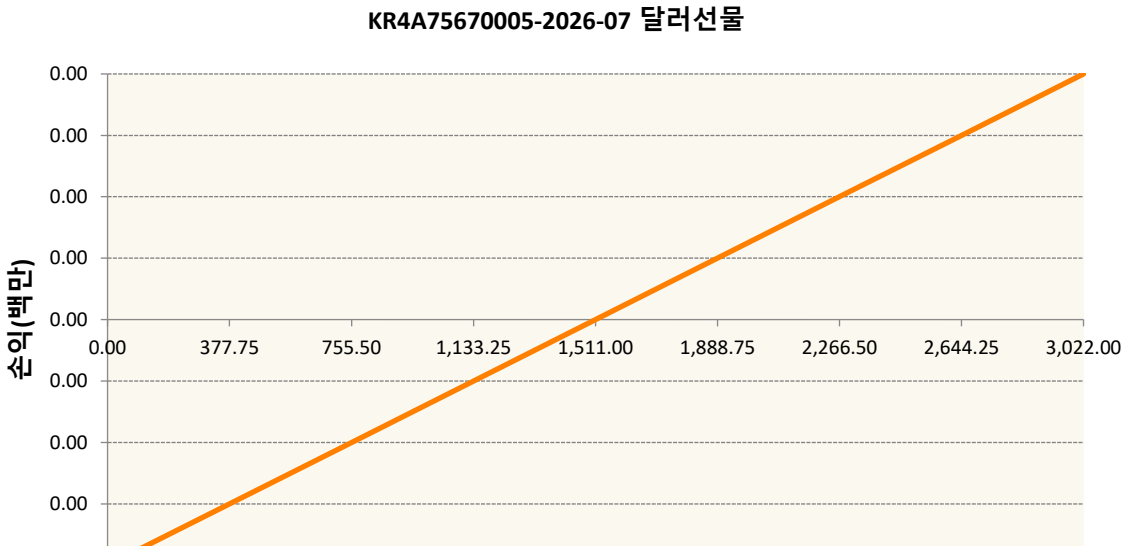
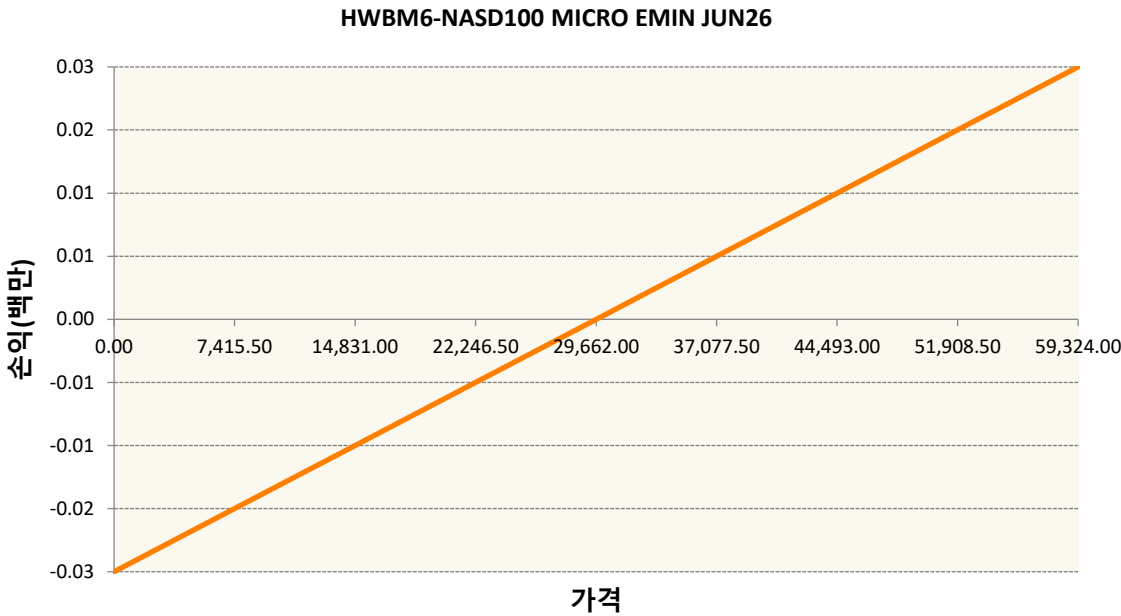
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

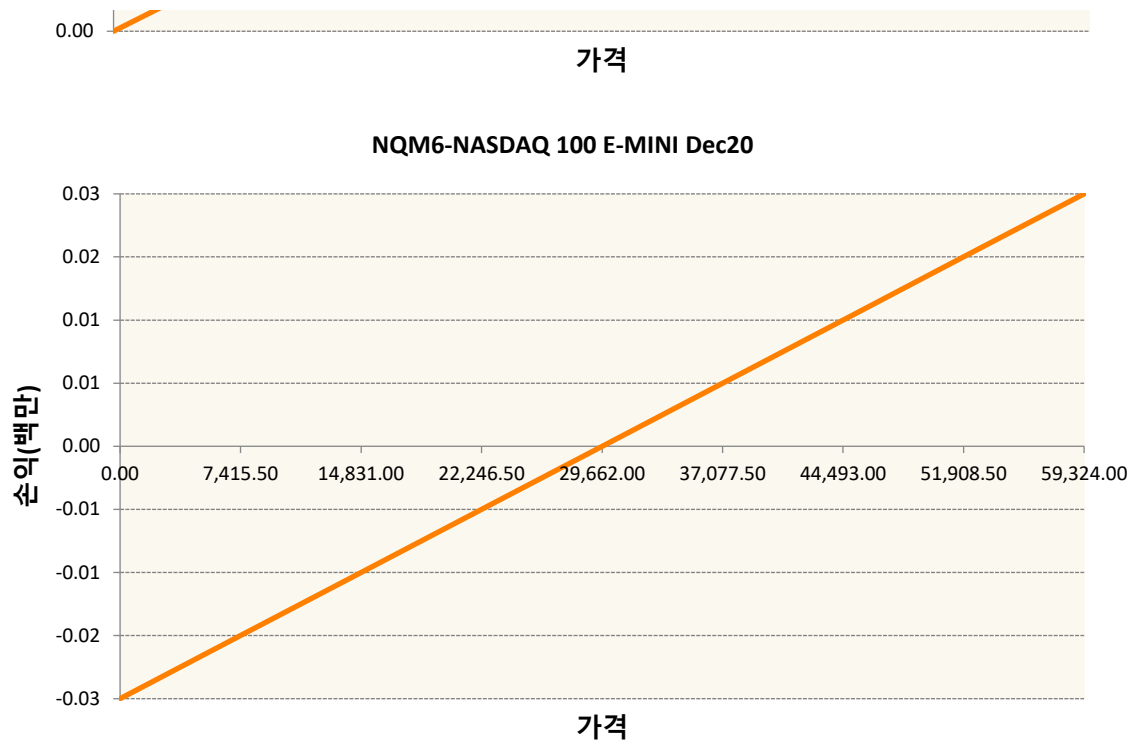
1. 계약금액

(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	30,231	0	30,231	
누계	유가증권	선물	259	0	259	장내
누계	통화	선물	3,944	0	3,944	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBM6	NASD100 MICRO EMIN JUN26	21
KR4A756700	2026-07 달러선물	315
NQM6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,419

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

2,708

공시일	2026-06-16
기준일	2026-06-15

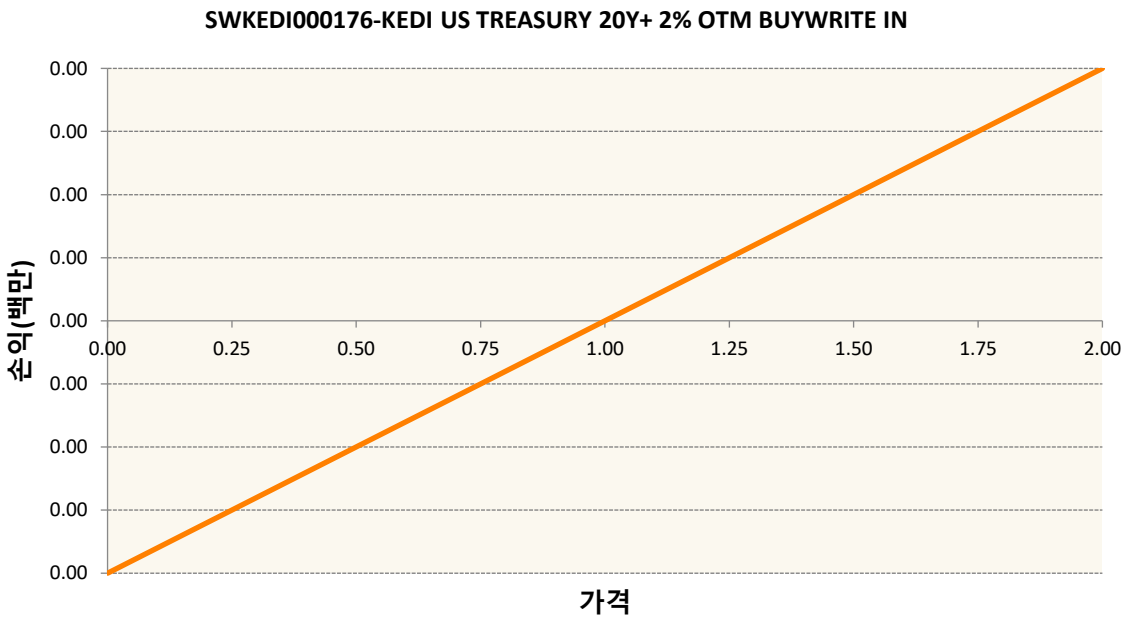
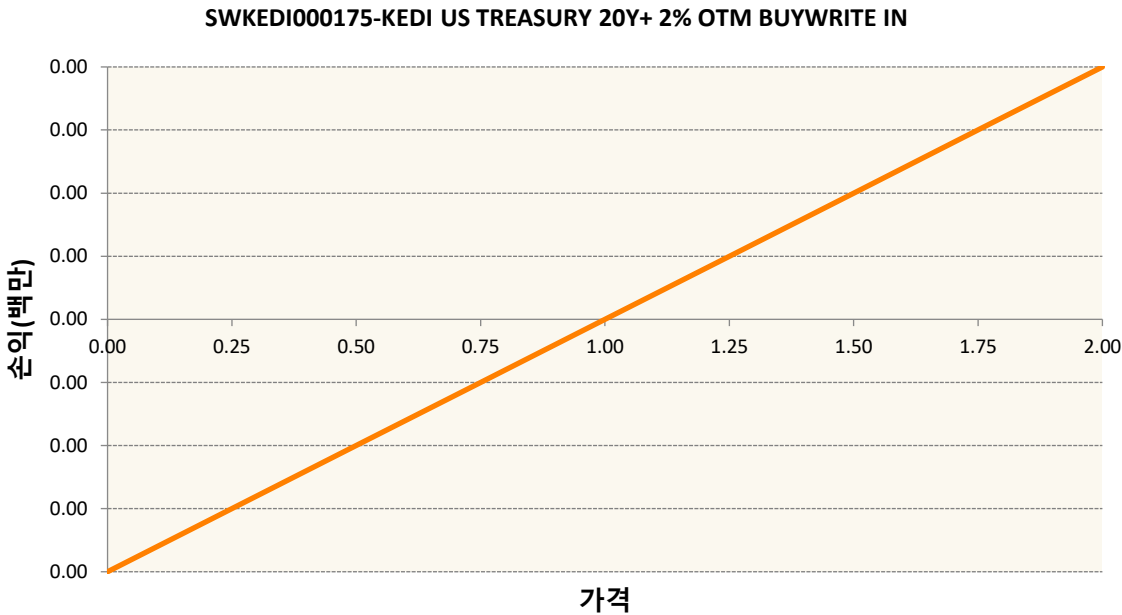
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

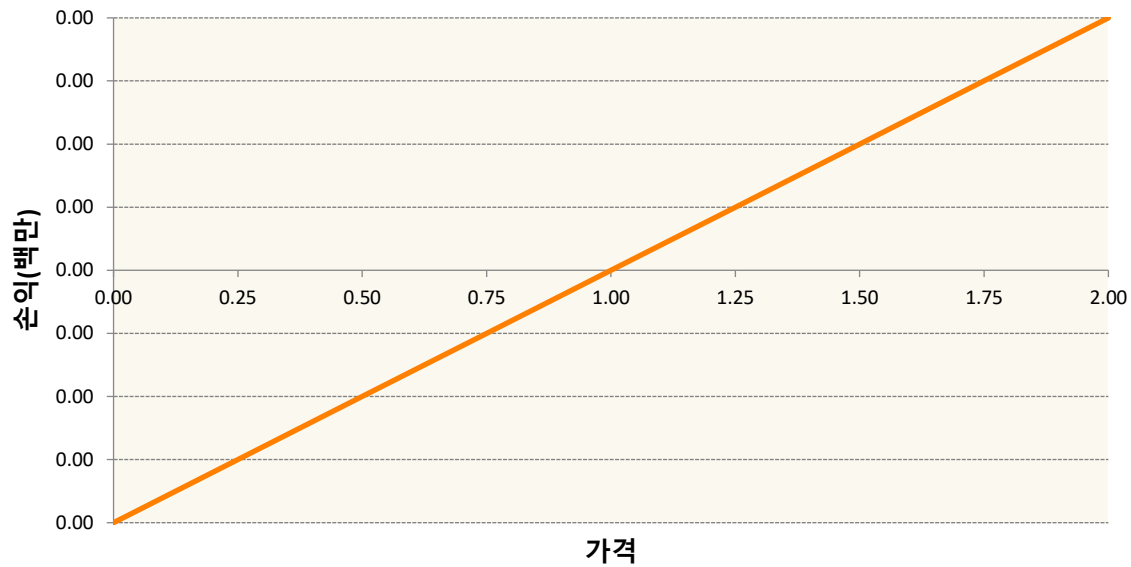
(단위:백만원)

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

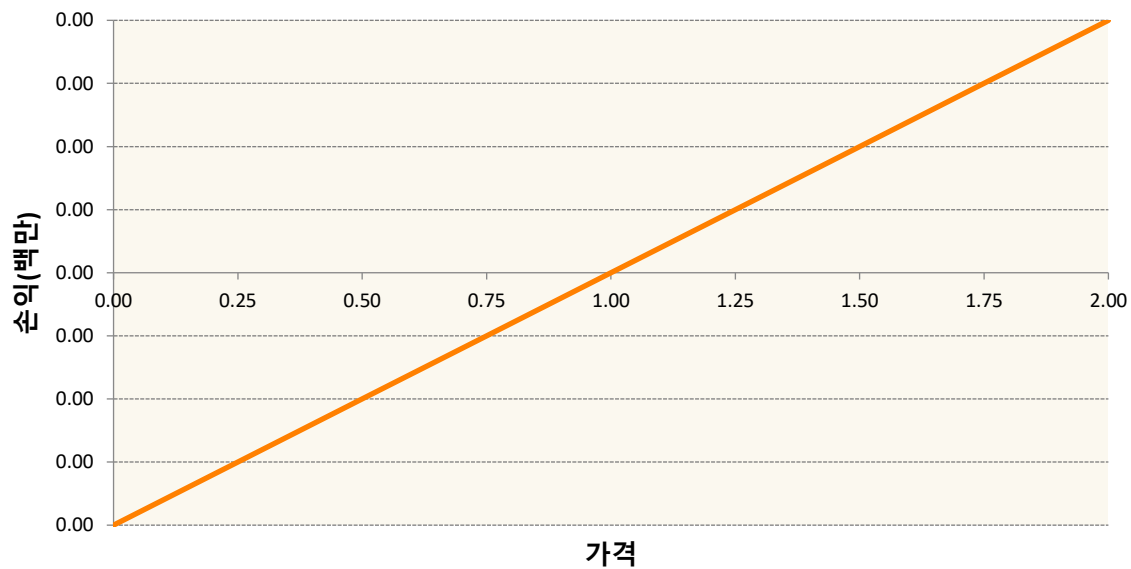
2. 만기시점의 손익구조



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	8,378
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,126
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,189
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,931

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

(단위:백만원)

10,784