

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

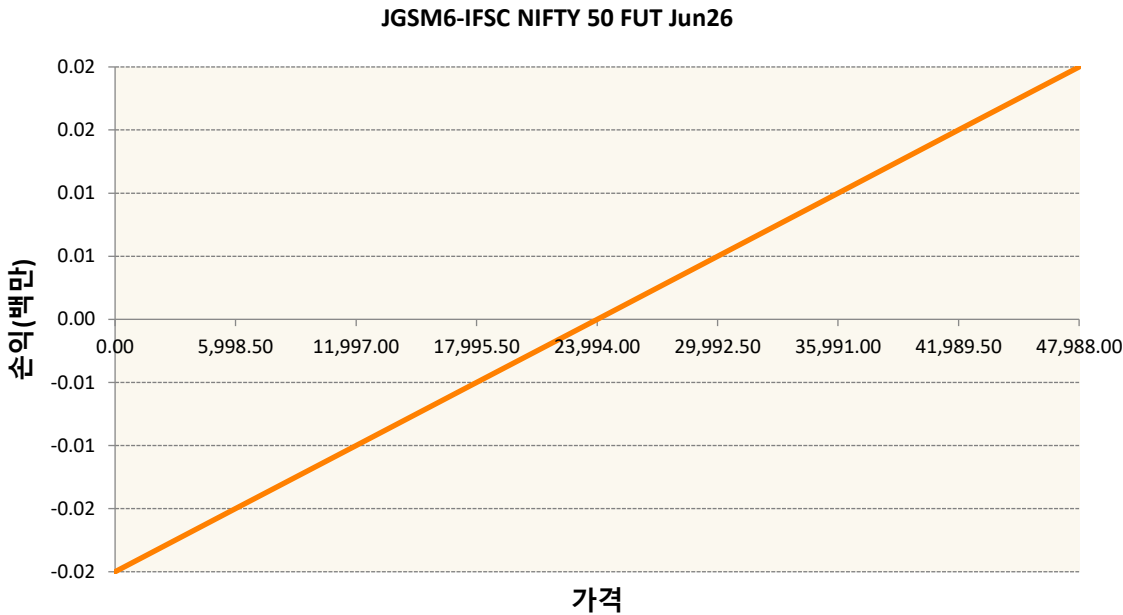
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	361	0	361	

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)

21

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

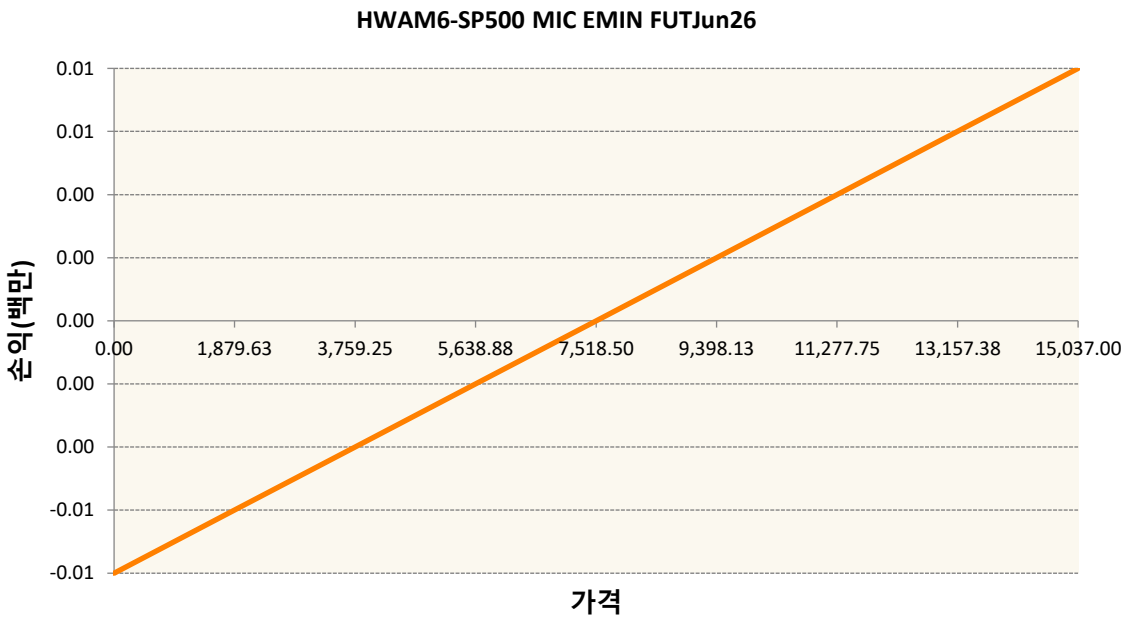
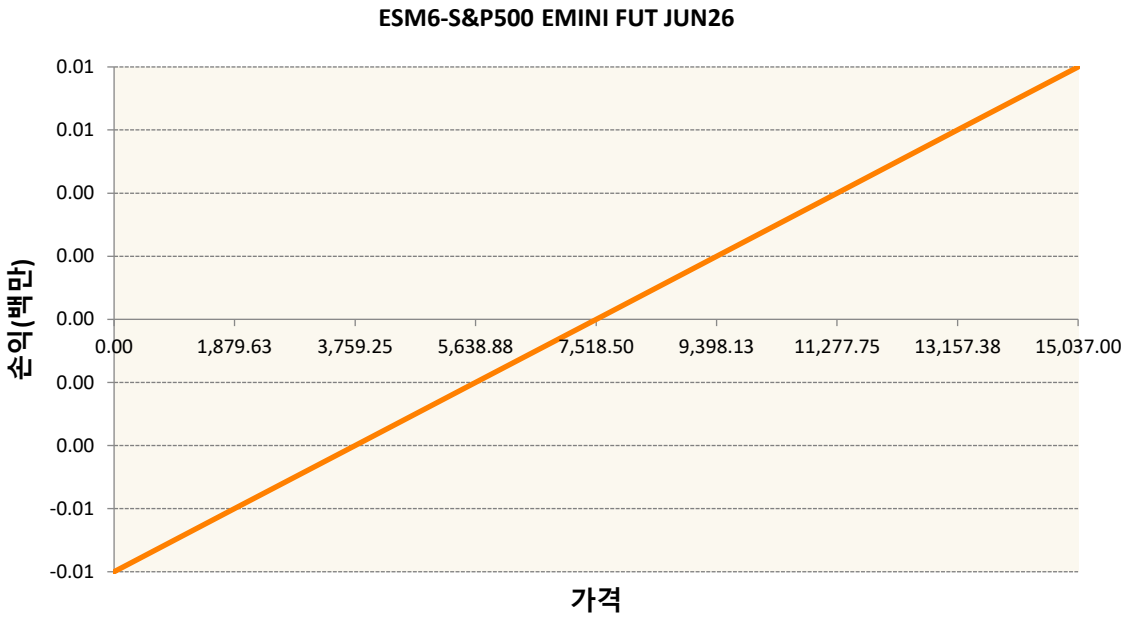
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	565	0	565	
누계	지수	선물	57	0	57	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)
	43

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

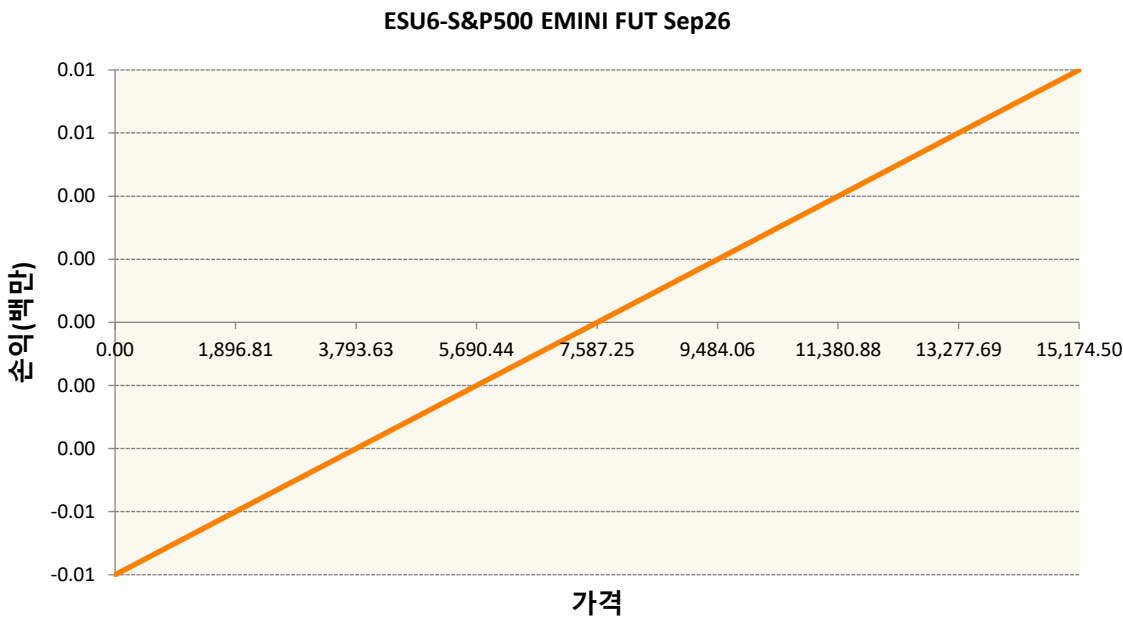
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,147	0	1,147	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	92
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

79

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

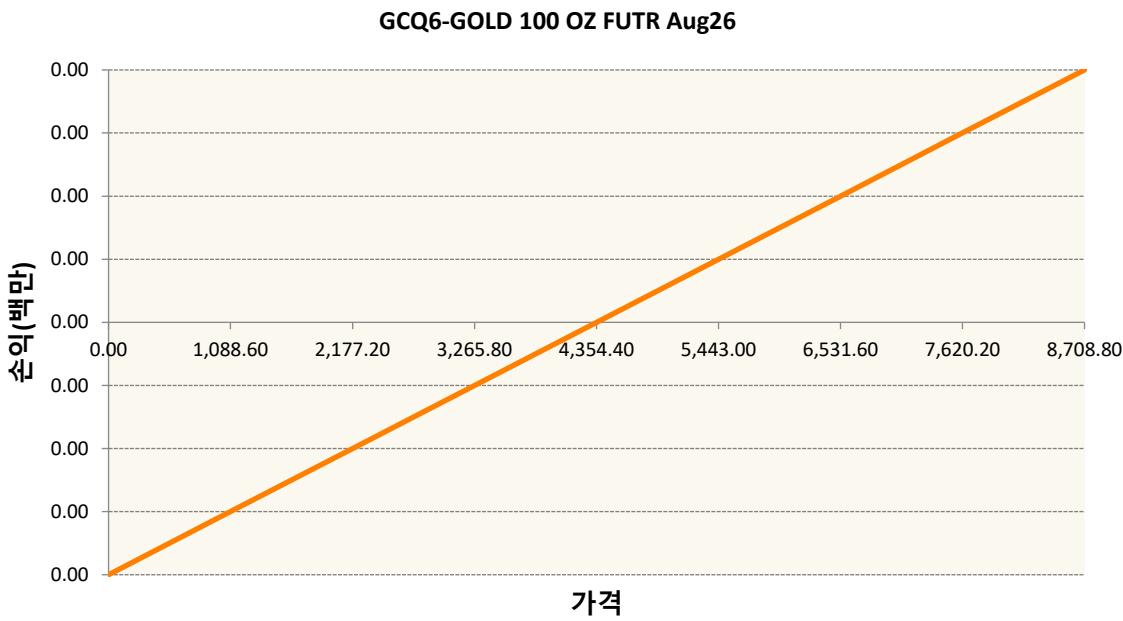
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,228	0	5,228	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 06/18/26 C390 EQUITY	6
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	418

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

(단위:백만원)

545

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

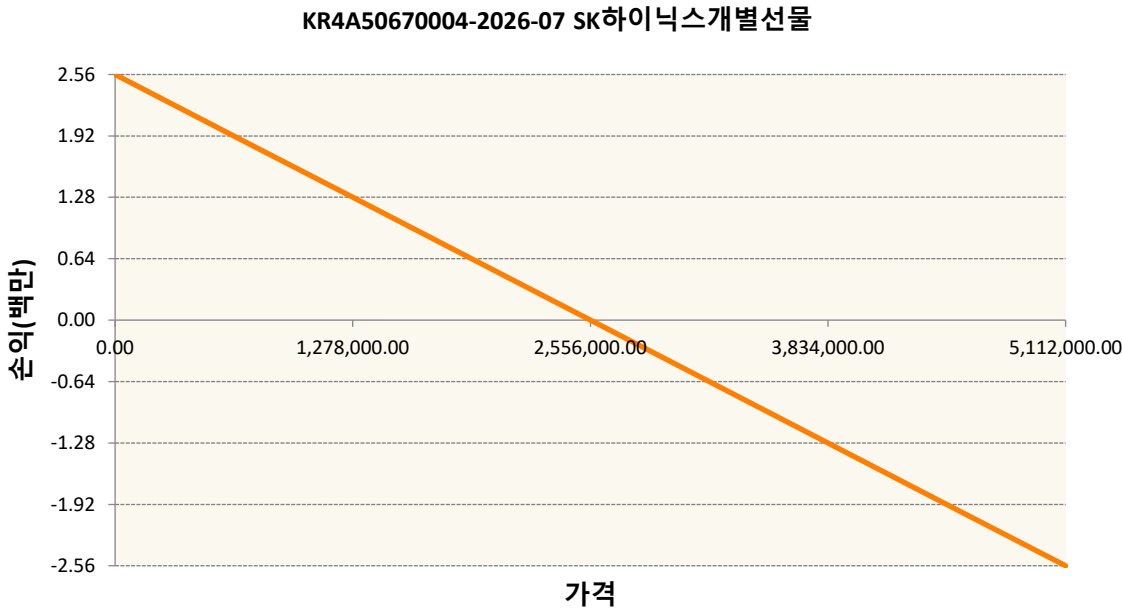
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	12,780	-12,780	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUCP' PLTR US 06/18/26 P140 EQUITY	53
AOPLTRUCS' PLTR US 06/18/26 C140 EQUITY	25
KR4A506700 2026-07 SK하이닉스개별선물	1,022

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

(단위:백만원)

233

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

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

2

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

(단위:백만원)

1

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

(단위:백만원)

22,611

공시일 2026-06-18

기준일 2026-06-17

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	2026-06-18
기준일	2026-06-17

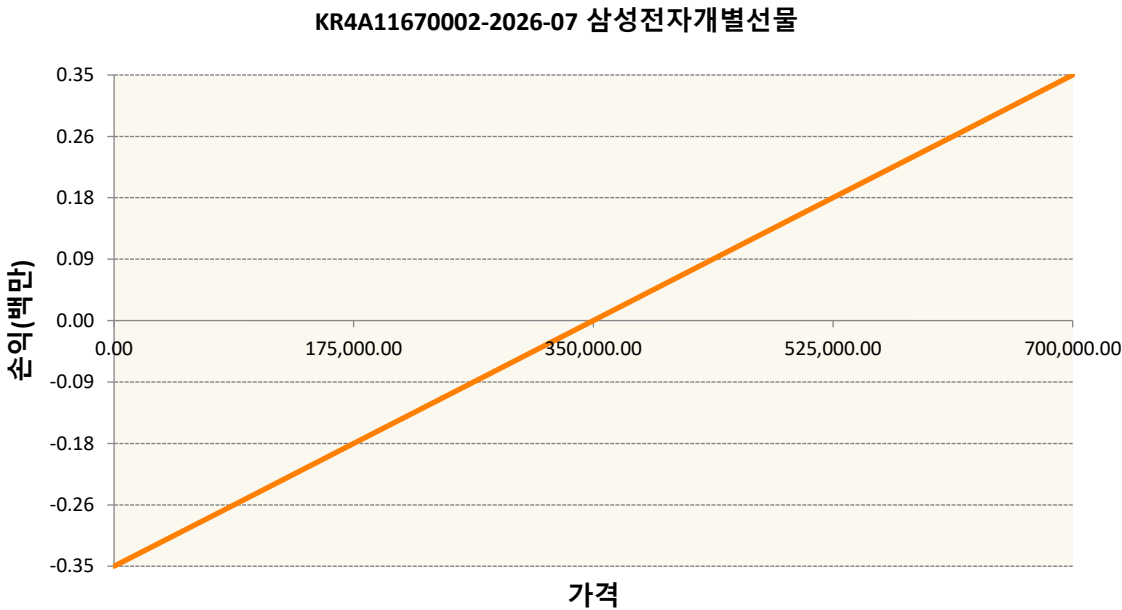
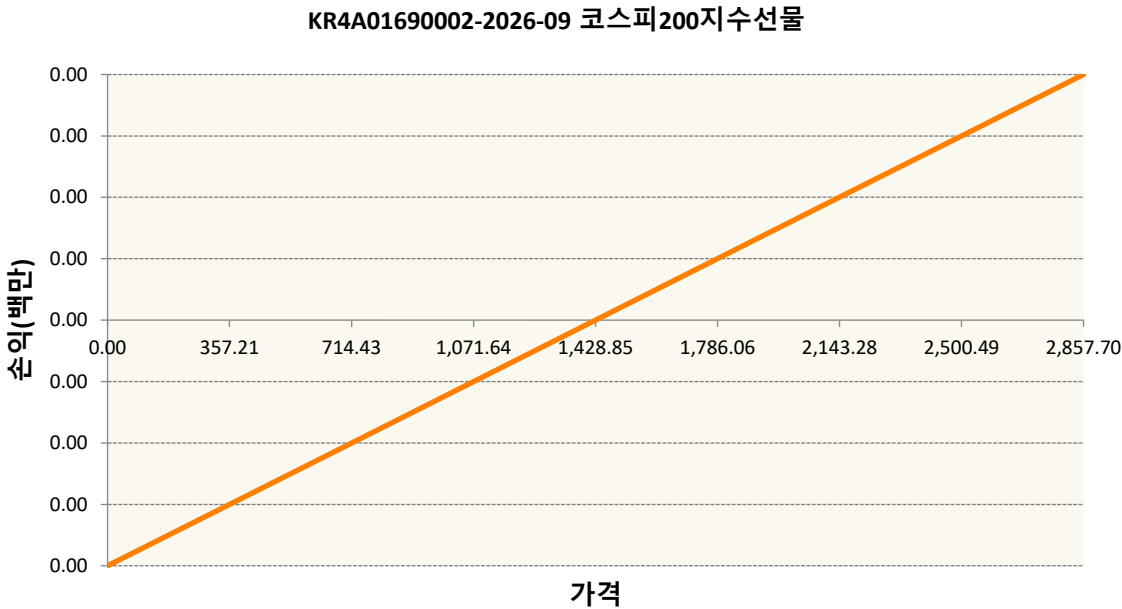
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	0	0	장내
누계	유가증권	선물	28,188	0	28,188	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,768	-37,768	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

가격 (Price)	이익 (Profit in millions)
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					737
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-737	-737	-737	-737	-737	-737	-737
-5.33%	-491	-491	-491	-491	-491	-491	-491
-2.67%	-246	-246	-246	-246	-246	-246	-246
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	246	246	246	246	246	246	246
5.33%	491	491	491	491	491	491	491
8.00%	737	737	737	737	737	737	737
KR4A11670002		2026-07 삼성전자개별선물					1,497
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497
-5.33%	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-998
-2.67%	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	499	499	499	499	499	499	499
5.33%	998	998	998	998	998	998	998
8.00%	1,497	1,497	1,497	1,497	1,497	1,497	1,497
KR4B09F3B462 코스피위클리 C 2606W3 1,360.0							998

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-887	-901	-917	-935	-955	-976	-998
-5.33%	-381	-410	-439	-469	-499	-530	-560
-2.67%	-70	-100	-129	-159	-190	-220	-251
0%	52	37	19	0	-21	-43	-66
2.67%	80	76	70	62	52	40	26
5.33%	84	84	82	80	76	72	65
8.00%	84	84	84	84	83	81	79

KR4B09F3B470 코스피위클리 C 2606W3 1,362.5							672
--------------------------------------	--	--	--	--	--	--	-----

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-603	-612	-622	-633	-645	-658	-672
-5.33%	-264	-283	-302	-321	-341	-360	-380
-2.67%	-51	-71	-90	-111	-131	-151	-171
0%	36	25	13	0	-14	-29	-45
2.67%	57	54	50	44	37	29	19
5.33%	60	60	59	57	54	51	47
8.00%	60	60	60	60	59	58	56

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

(단위:백만원)

8,285

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

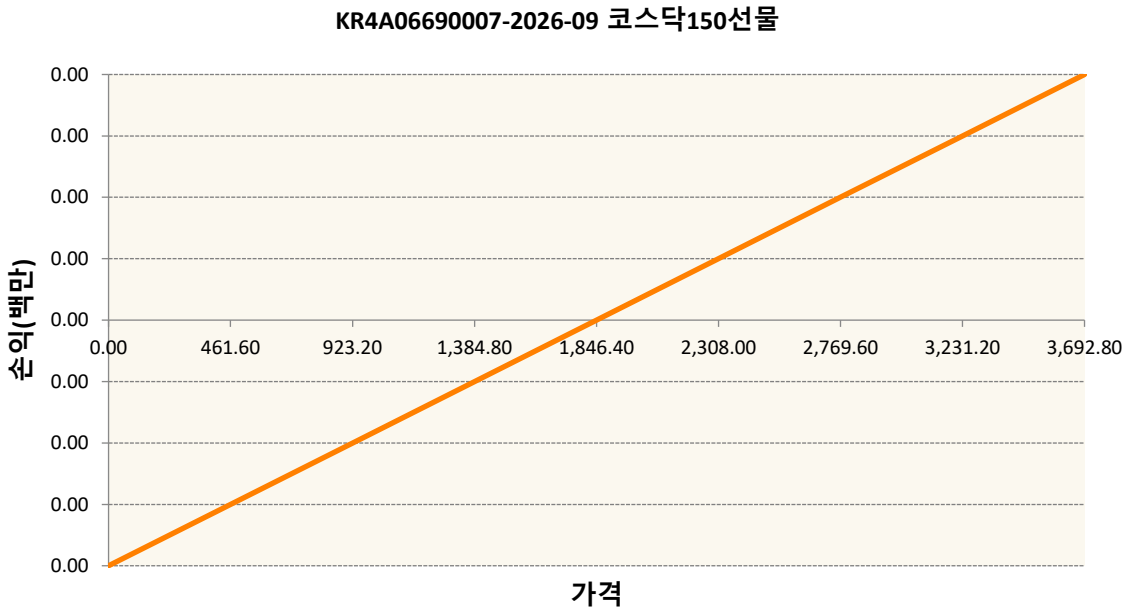
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,071	0	1,071	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				85
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-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%	57	57	57	57	57	57	57
8.00%	85	85	85	85	85	85	85

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

(단위:백만원)

24,504

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

(단위:백만원)

33,883

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

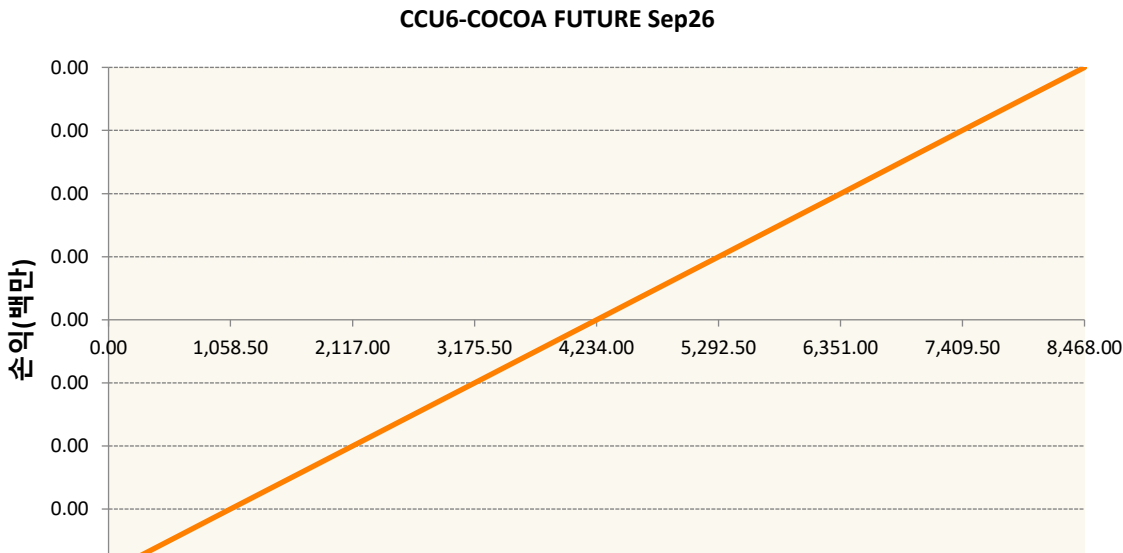
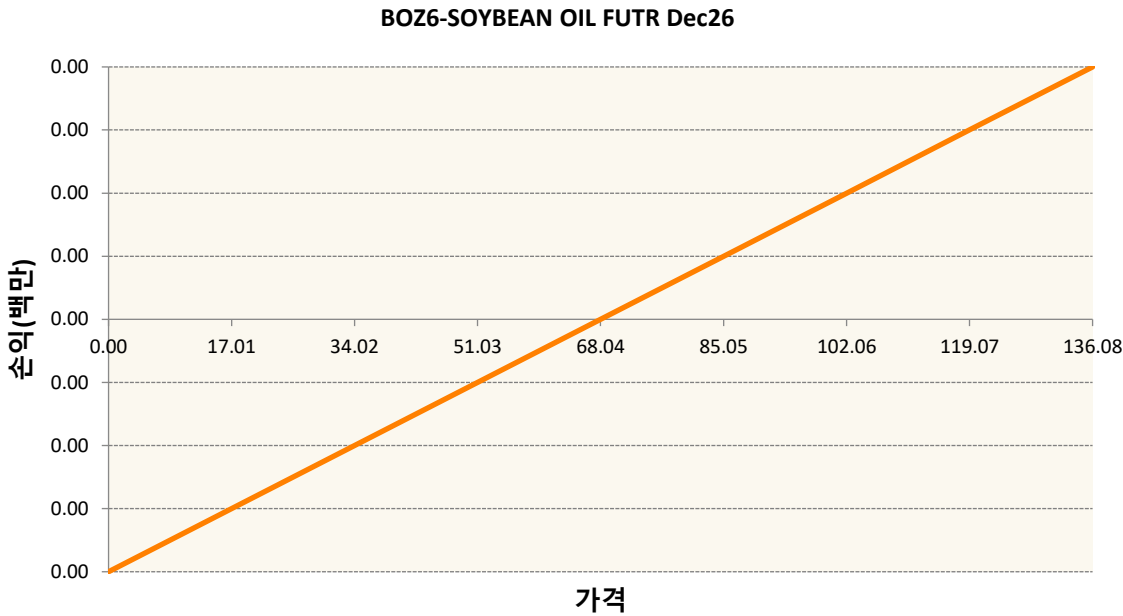
포커스농산물모(채권-파생형)

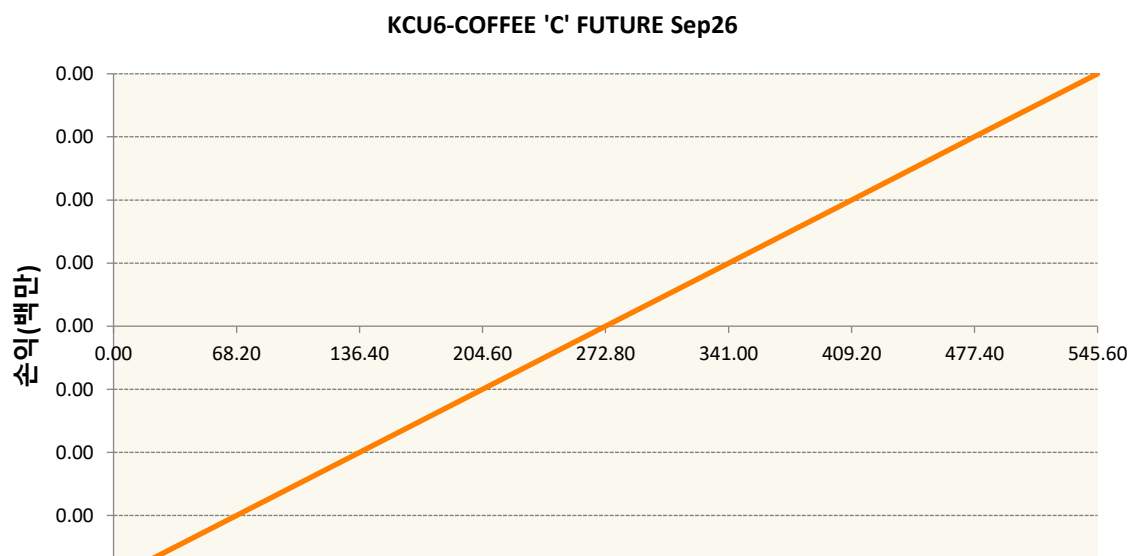
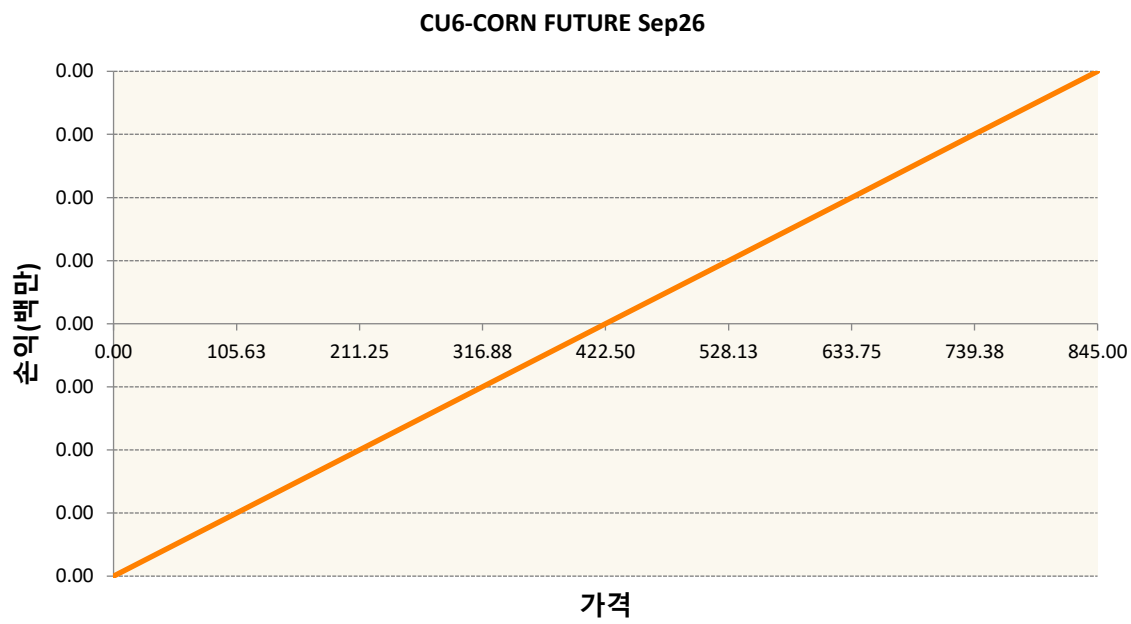
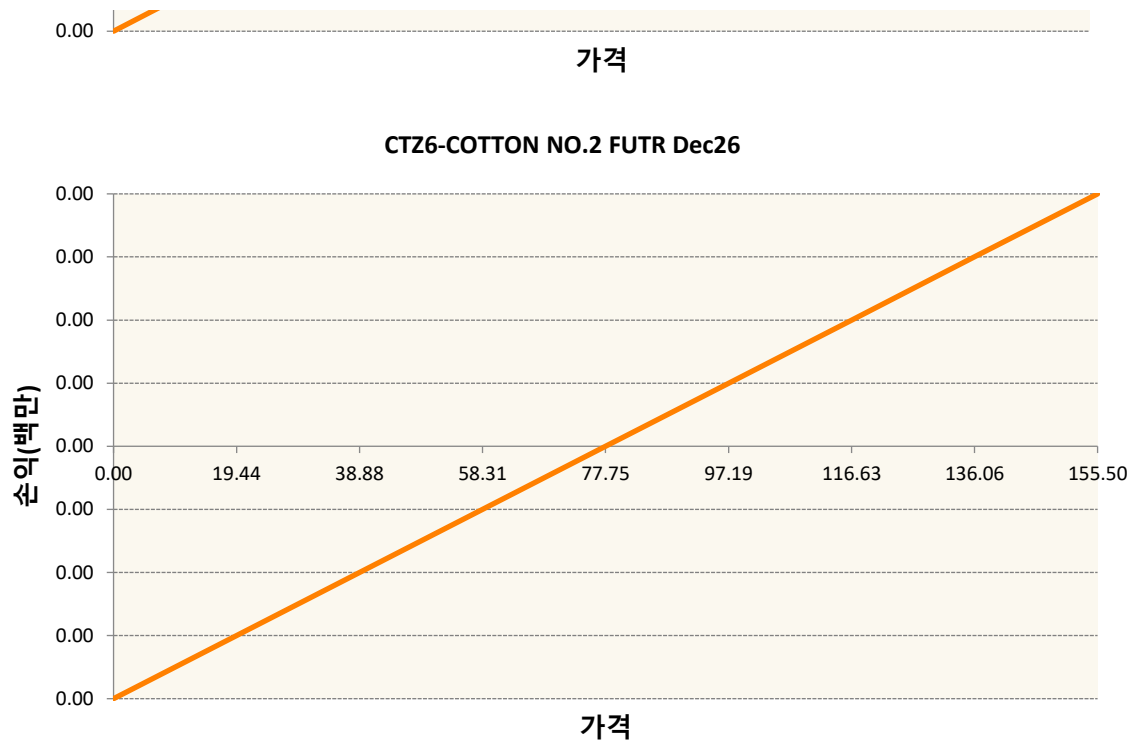
1. 계약금액

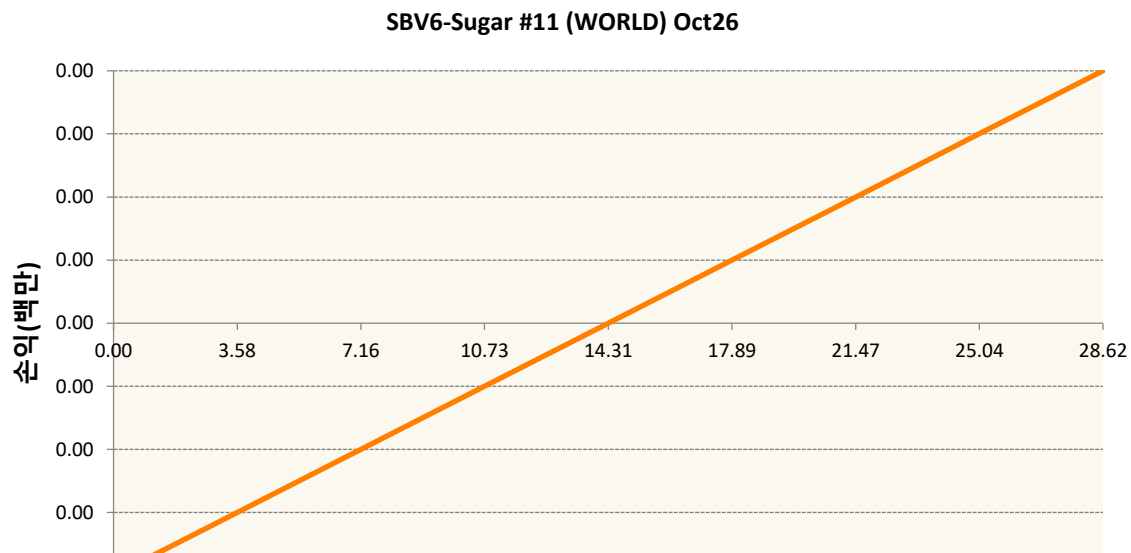
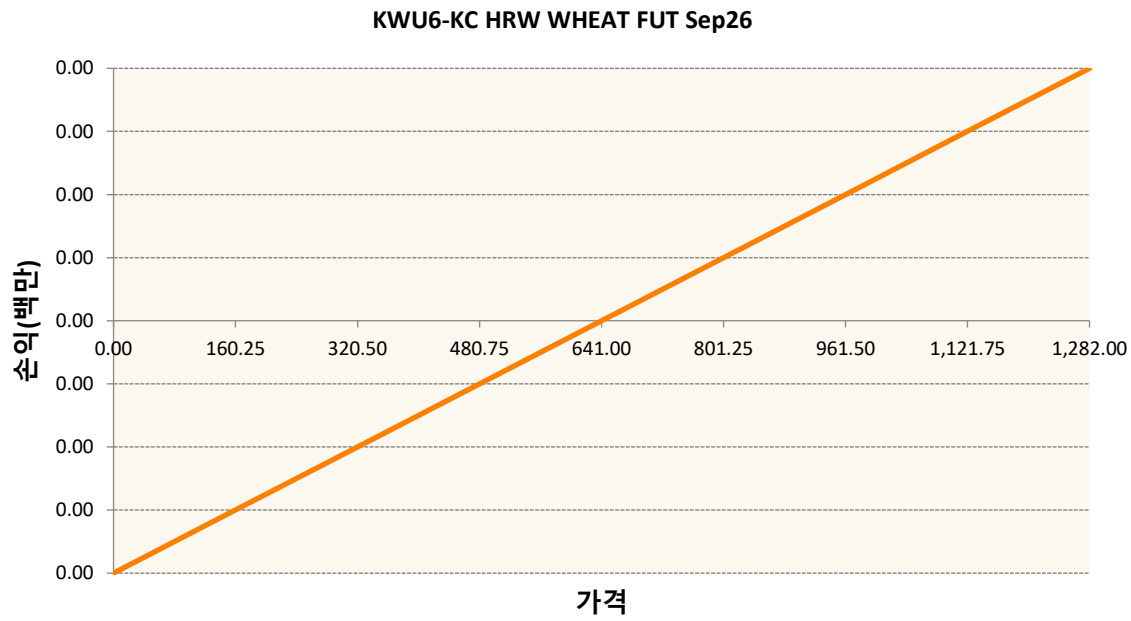
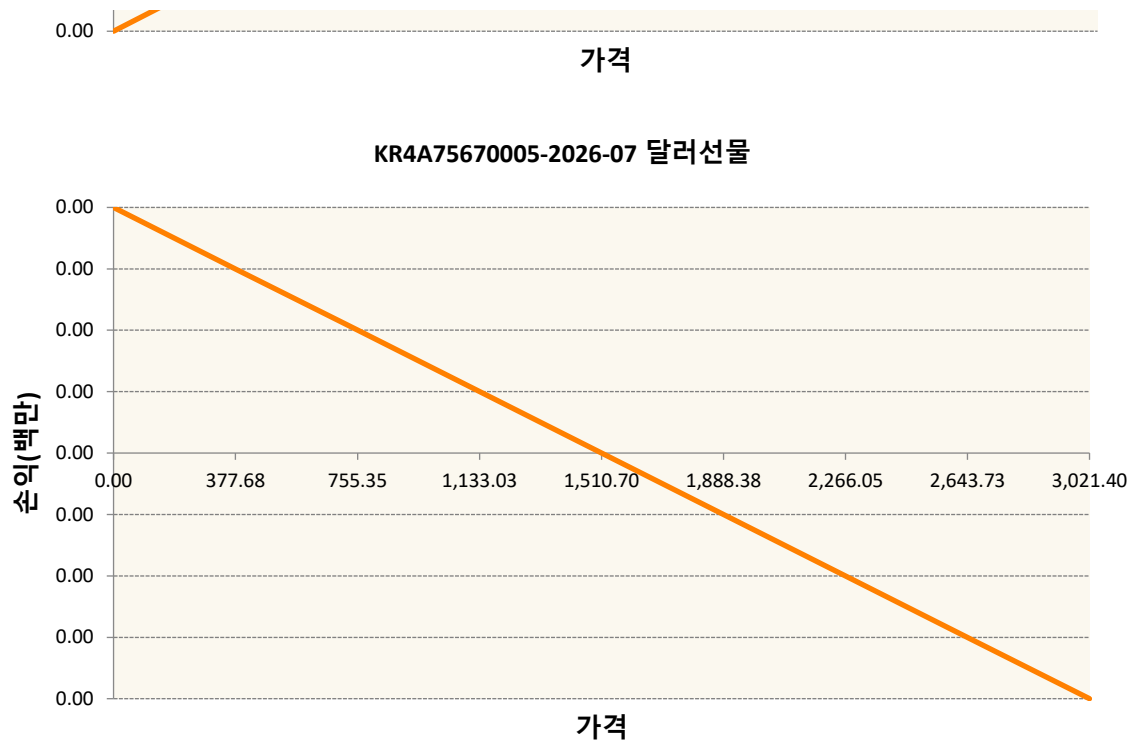
(단위:USD 백만)

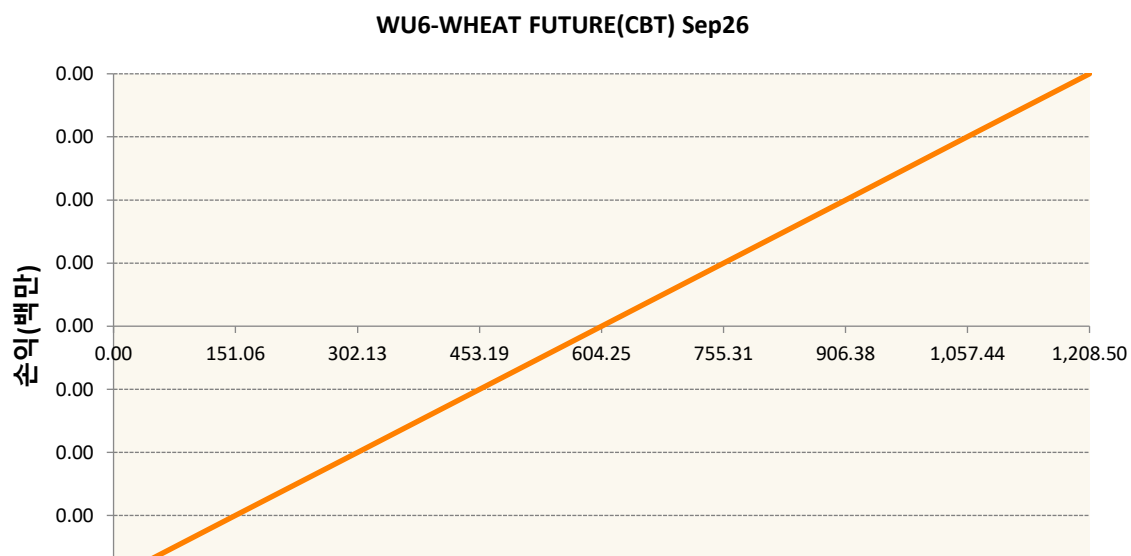
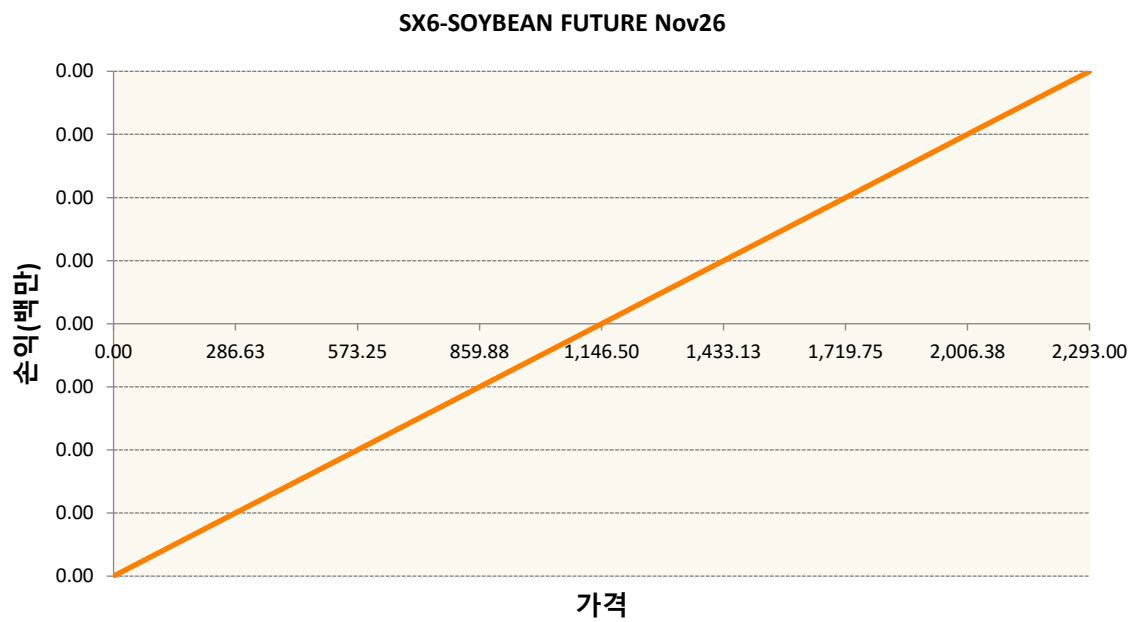
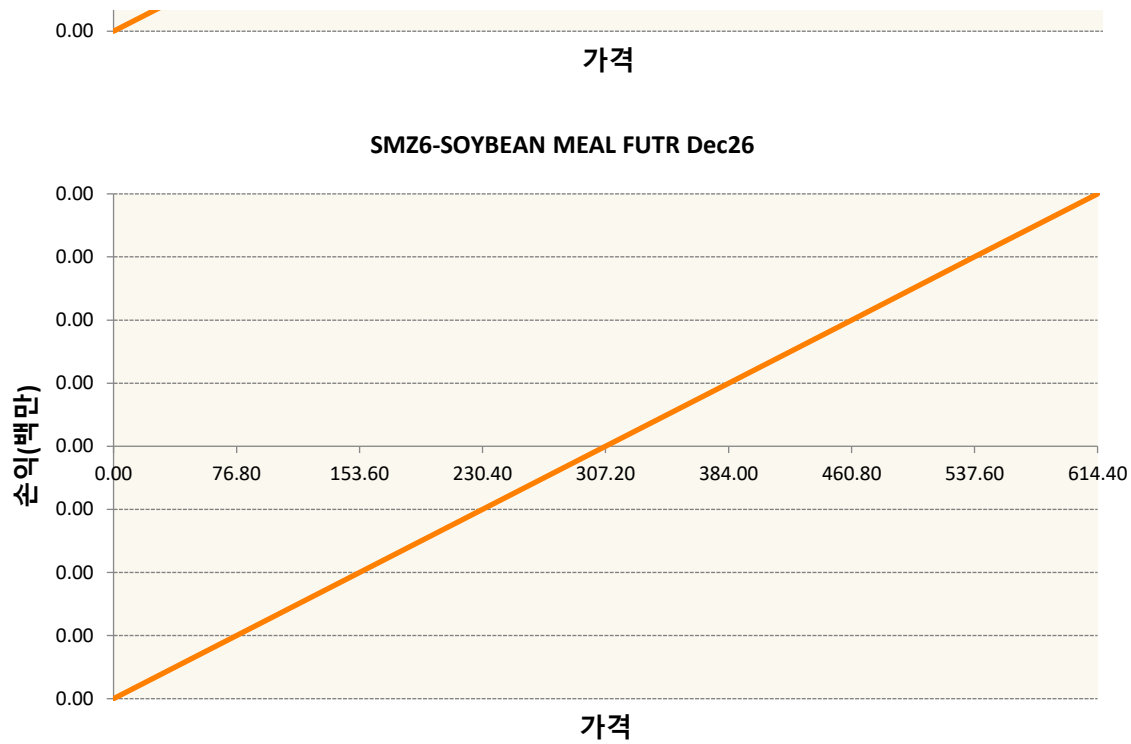
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	438	0	438	
누계	유가증권	선물	2,134	0	2,134	
누계	통화	선물	0	166	-166	장내

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	2026-06-18
기준일	2026-06-17

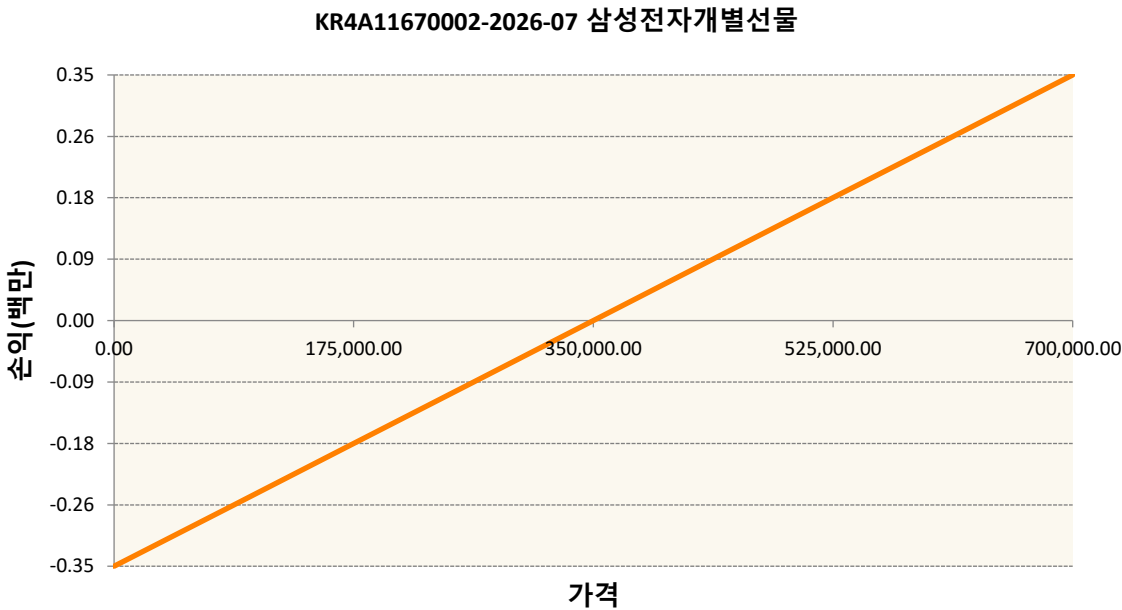
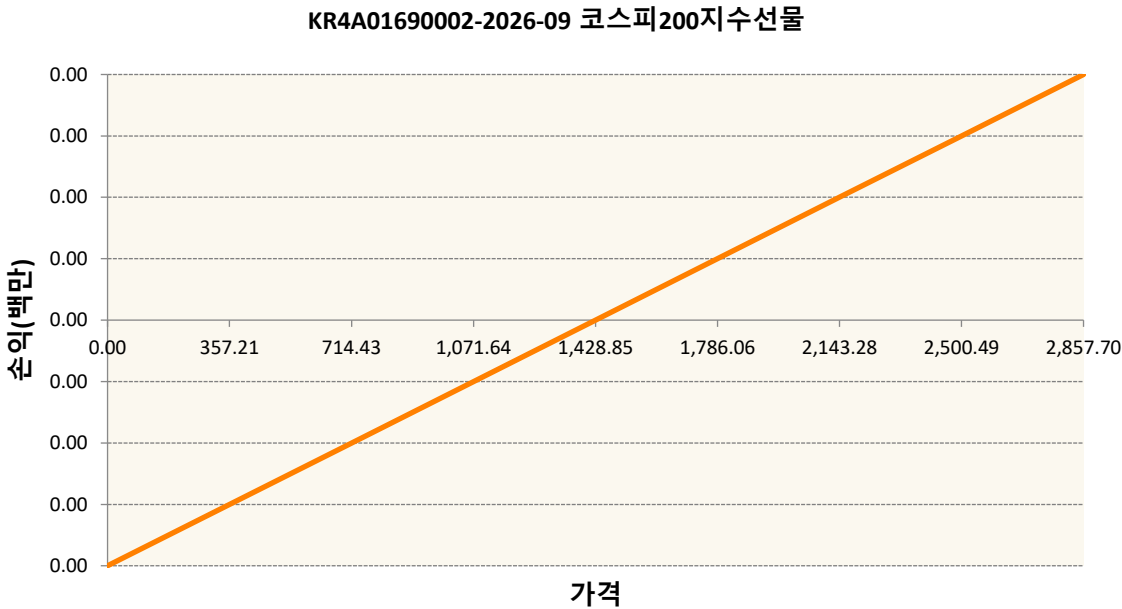
스마트인덱스모

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	3,712	0	3,712	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					283
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
-5.33%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	94	94	94	94	94	94	94
5.33%	189	189	189	189	189	189	189
8.00%	283	283	283	283	283	283	283

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

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

744

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

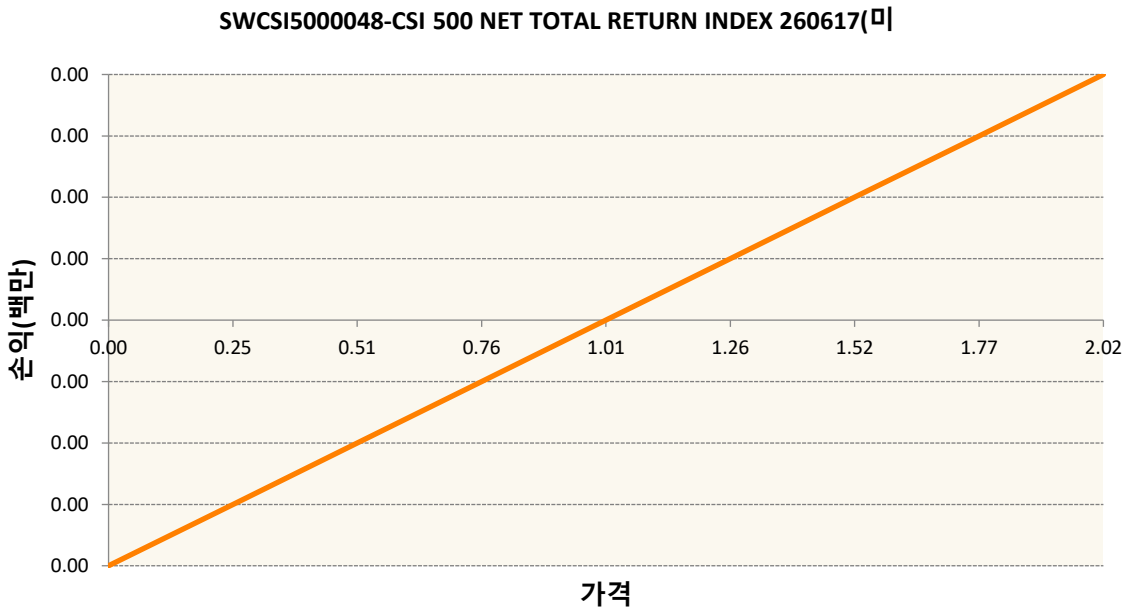
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,855	0	5,855	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

469

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

622

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

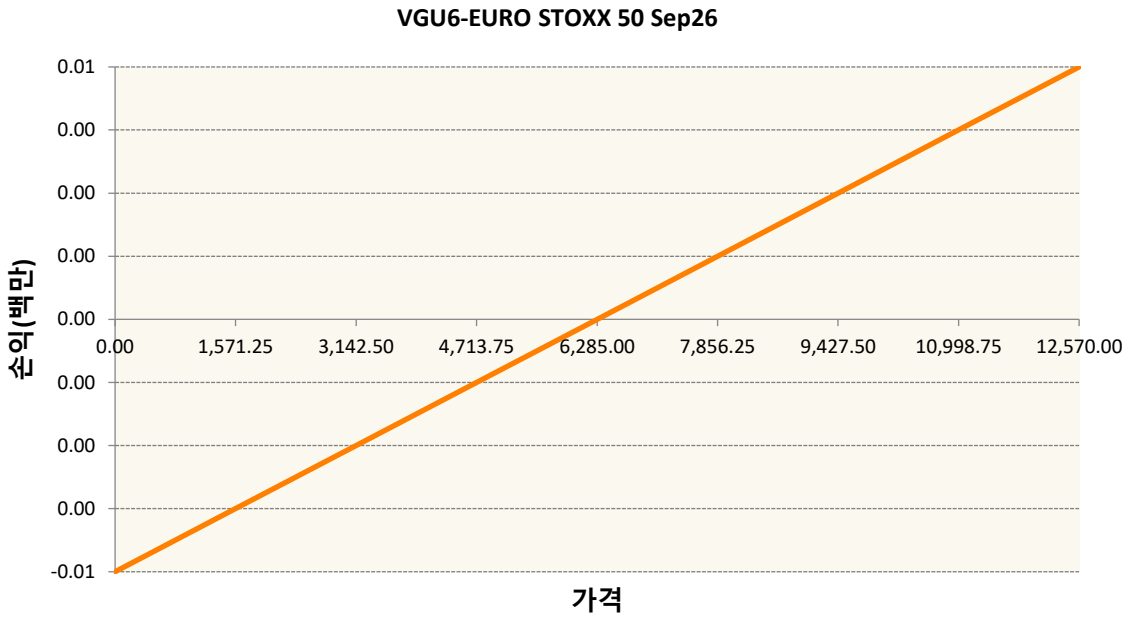
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	994	0	994	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	79
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

70

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

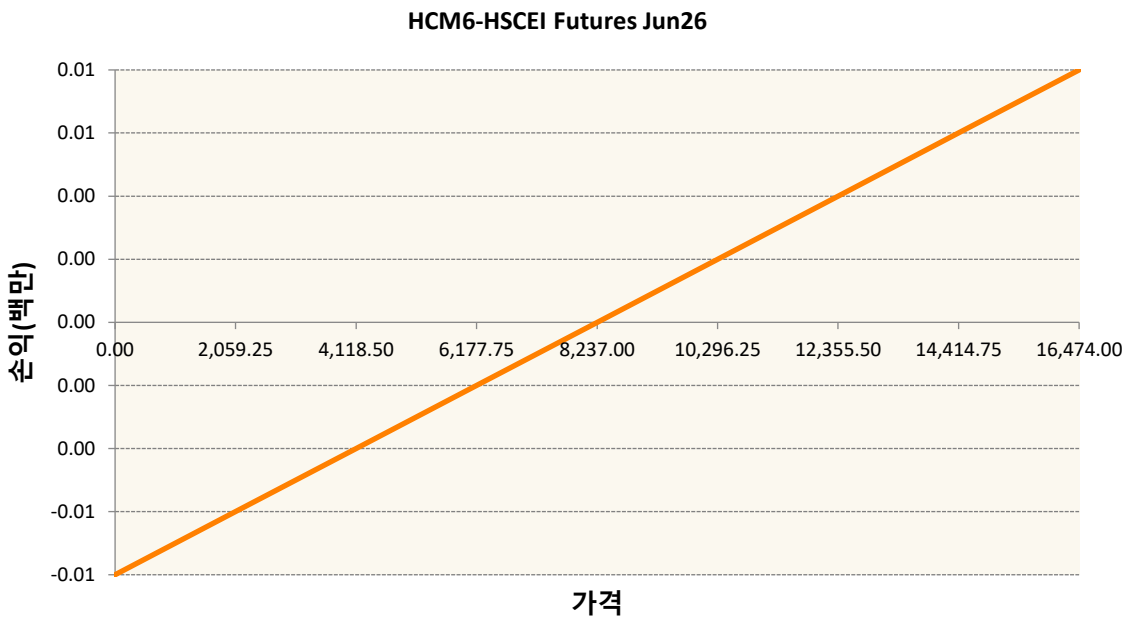
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,343	0	1,343	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

129

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

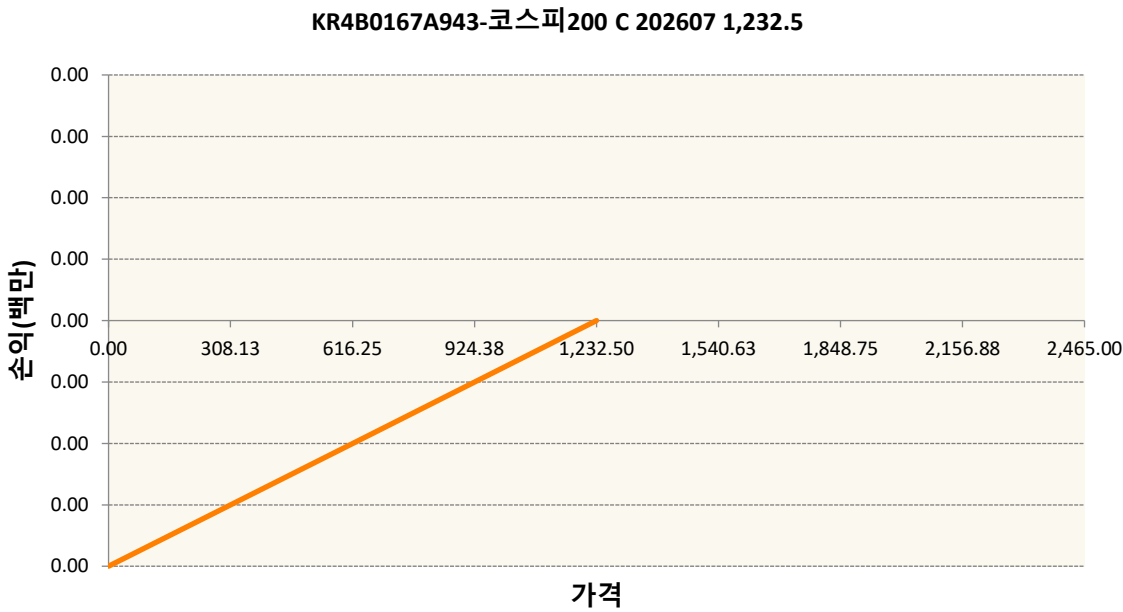
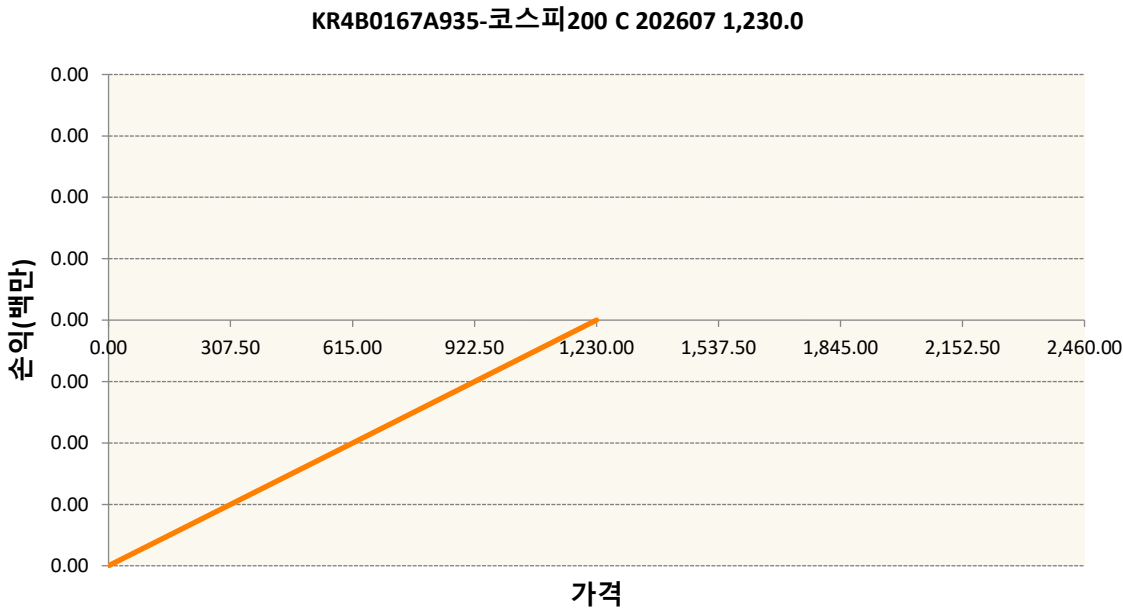
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

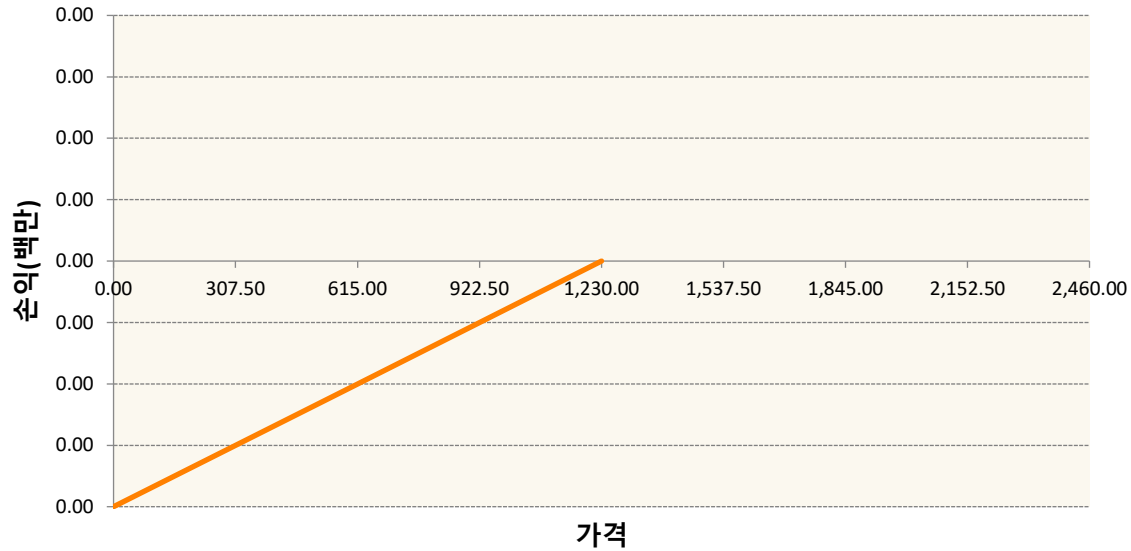
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	253	0	253	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								327
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-44	-90	-137	-184	-231	-279	-327	
-5.33%	20	-23	-67	-112	-157	-204	-250	
-2.67%	70	32	-9	-51	-94	-138	-183	
0%	109	75	39	0	-40	-82	-125	
2.67%	138	109	77	42	5	-34	-74	
5.33%	160	136	108	77	43	7	-30	
8.00%	176	156	132	105	75	42	8	
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5								1,029
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-143	-288	-434	-582	-730	-879	-1,029	
-5.33%	61	-74	-213	-354	-497	-643	-789	
-2.67%	221	99	-29	-161	-298	-437	-578	
0%	344	237	122	0	-127	-259	-393	
2.67%	438	346	244	134	17	-106	-233	
5.33%	507	430	342	244	138	25	-94	
8.00%	558	495	420	334	239	136	26	
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0								299
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-41	-83	-125	-168	-212	-256	-299	
-5.33%	18	-21	-61	-102	-144	-187	-230	
-2.67%	64	29	-8	-47	-86	-127	-168	
0%	100	69	35	0	-37	-75	-115	

2.67%	127	100	71	39	5	-31	-68
5.33%	147	124	99	70	40	7	-28
8.00%	161	143	121	96	69	39	7

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

(단위:백만원)

1,628

공시일 2026-06-18

기준일 2026-06-17

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	2026-06-18
기준일	2026-06-17

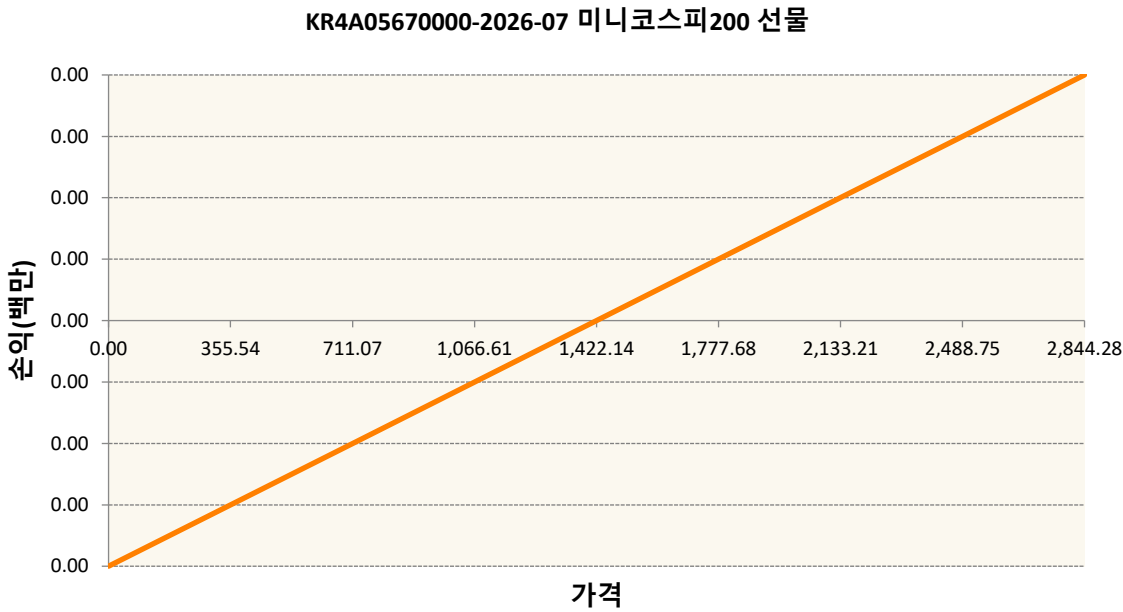
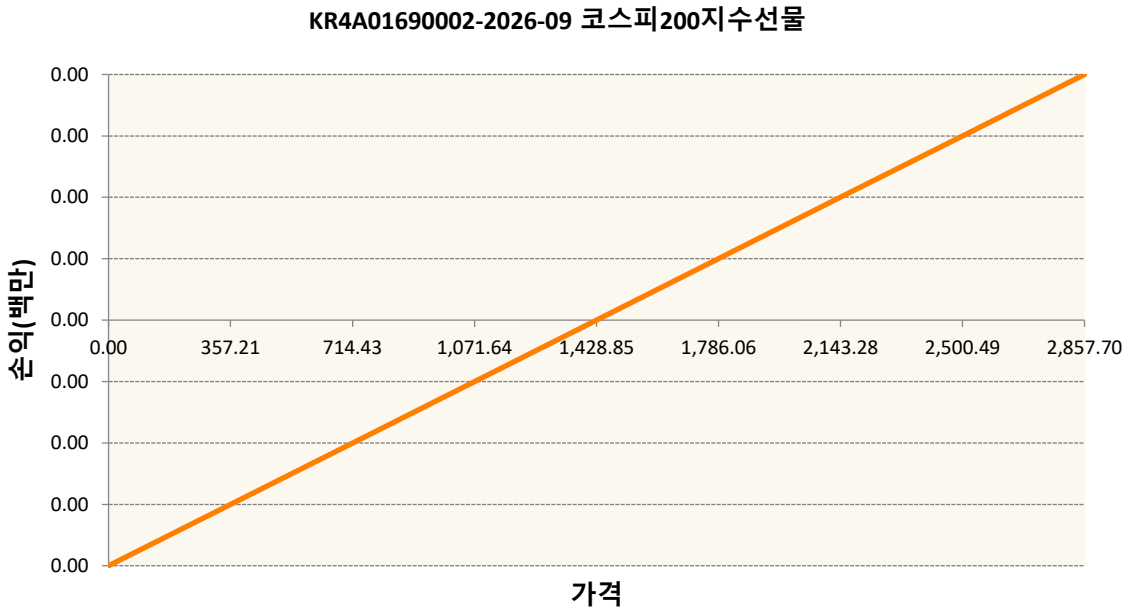
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

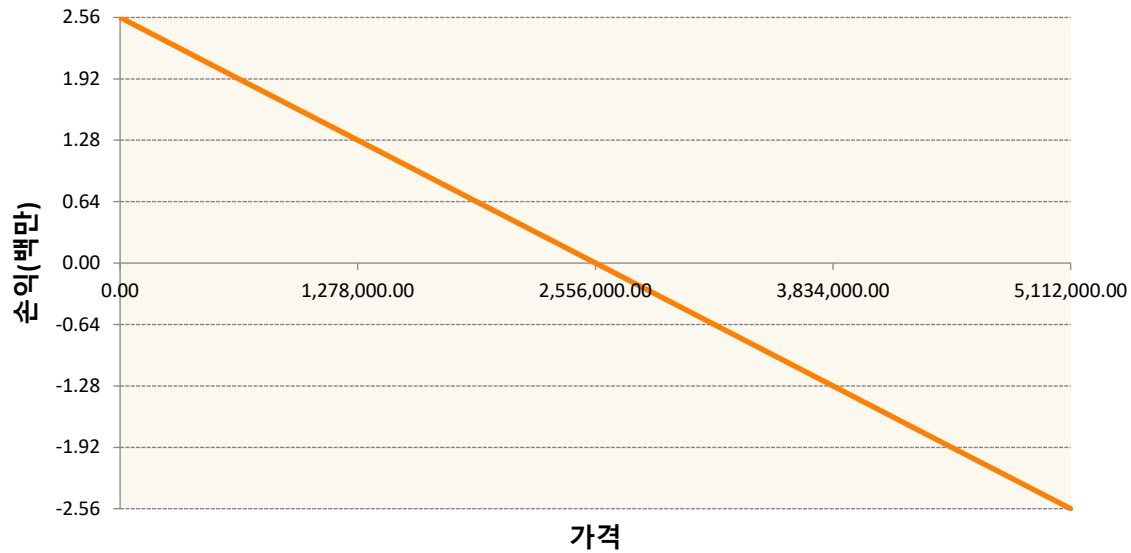
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,905	77	2,829	장내

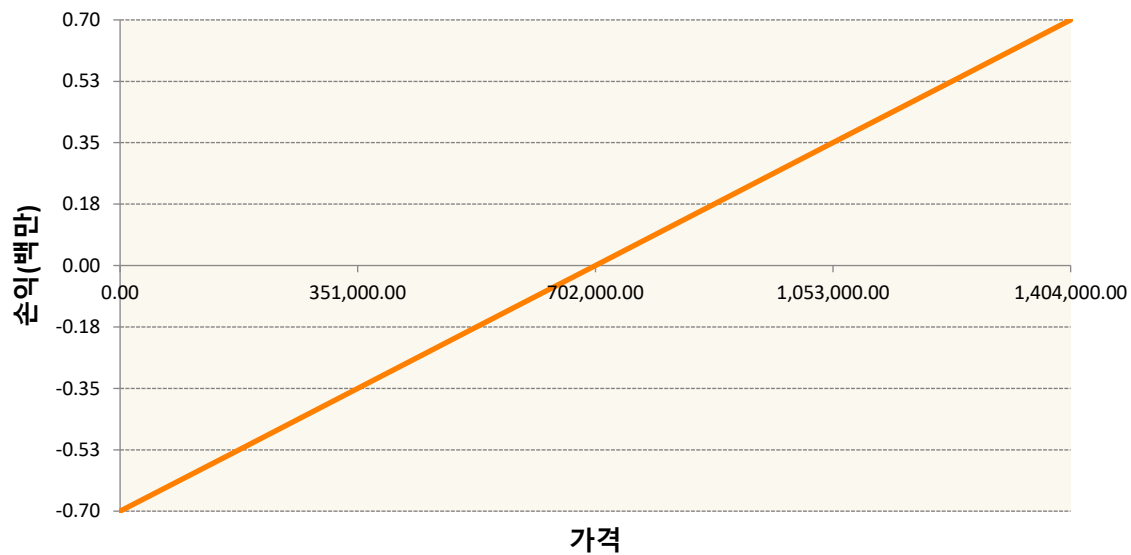
2. 만기시점의 손익구조



KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					85
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
-5.33%	-57	-57	-57	-57	-57	-57	-57
-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%	57	57	57	57	57	57	57
8.00%	85	85	85	85	85	85	85
KR4A05670000		2026-07 미니코스피200 선물					28
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-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%	19	19	19	19	19	19	19
8.00%	28	28	28	28	28	28	28
KR4A50670004 2026-07 SK하이닉스개별선물							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

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)

312

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

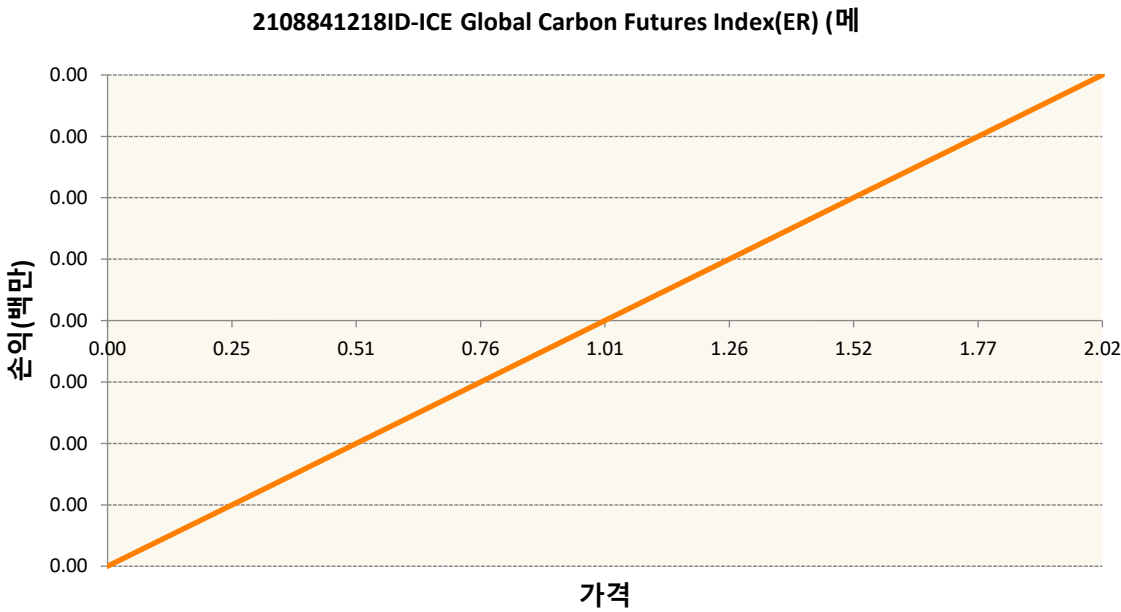
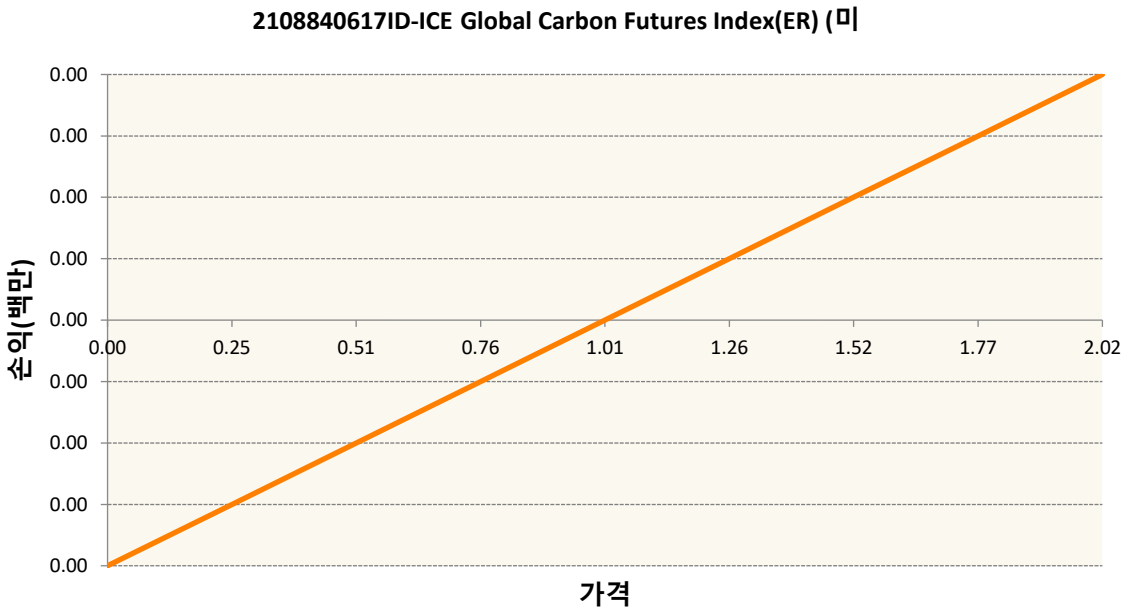
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,573	0	7,573	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840617IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		483
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		122

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	699

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

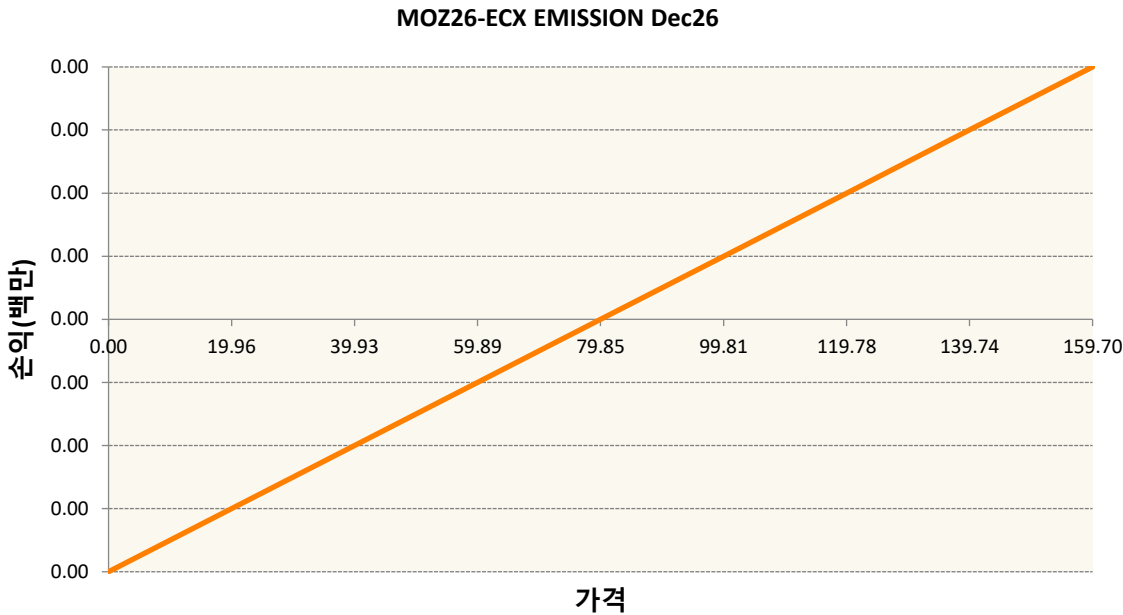
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계			5,154	0	5,154	
누계	통화	선도	0	2,642	-2,642	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	211
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	412

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

(단위:백만원)

703

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

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	1,694	0	1,694	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	9
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	6
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	15
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	6

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

(단위:백만원)

55

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

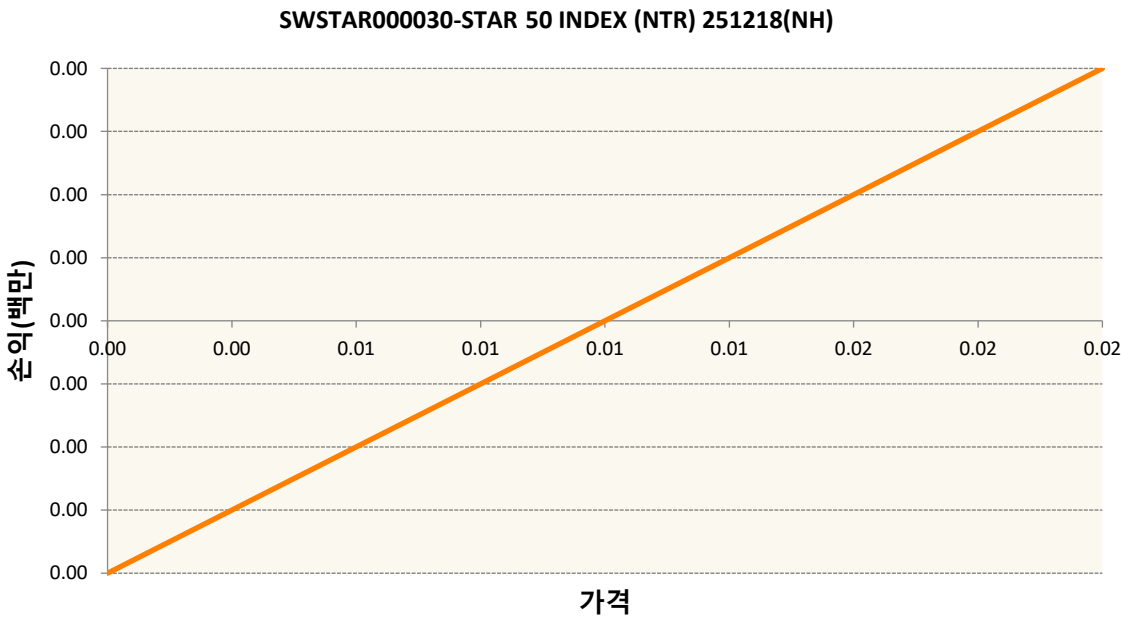
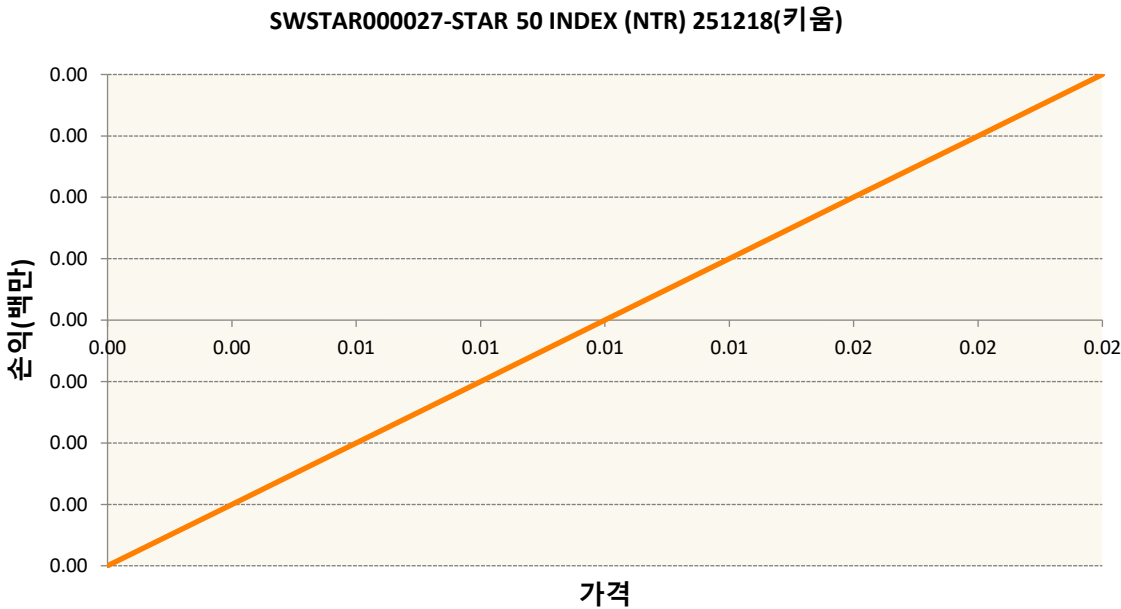
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

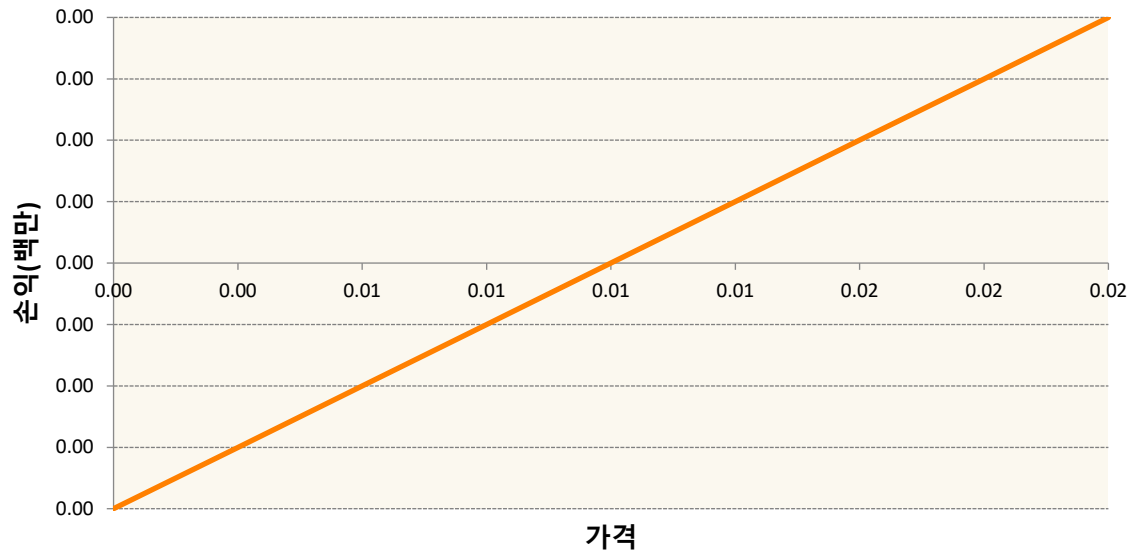
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	338	0	338	장외

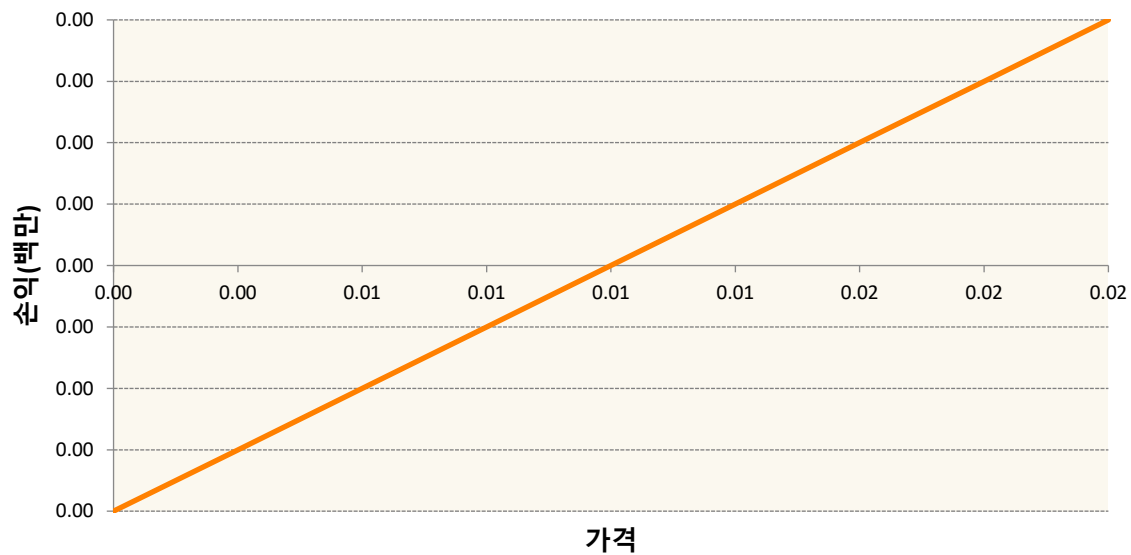
2. 만기시점의 손익구조



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



SWSTAR000034-STAR 50 INDEX (NTR) 260617(미래)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)

1

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)

2

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)

12

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260617(미래)

5

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

(단위:백만원)

32

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

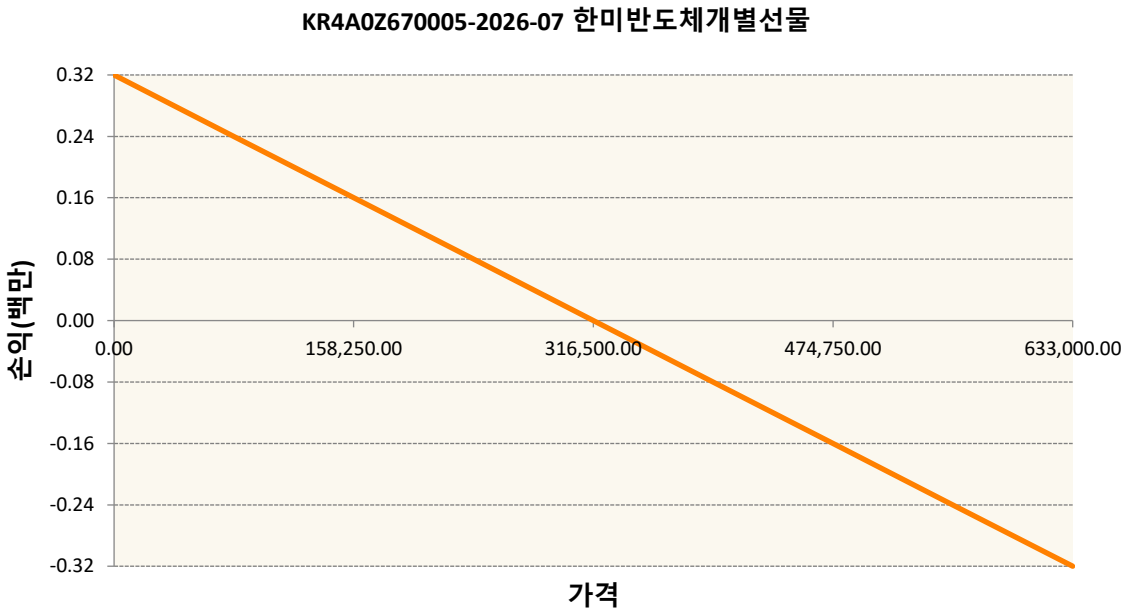
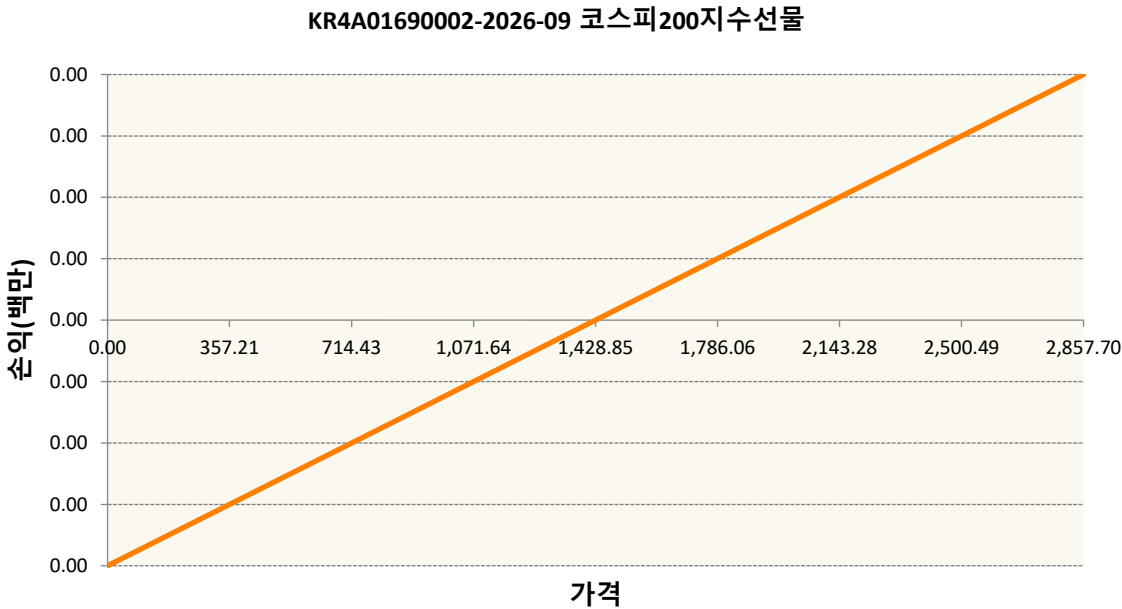
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

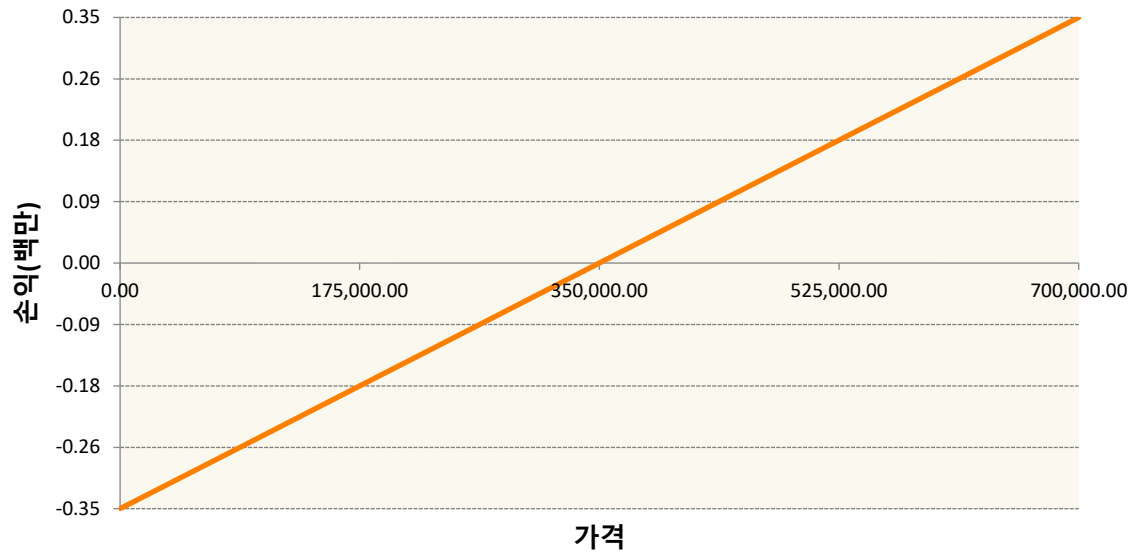
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,185	9,402	-8,217	장내
누계	유가증권	선물	23,868	6,078	17,790	장내

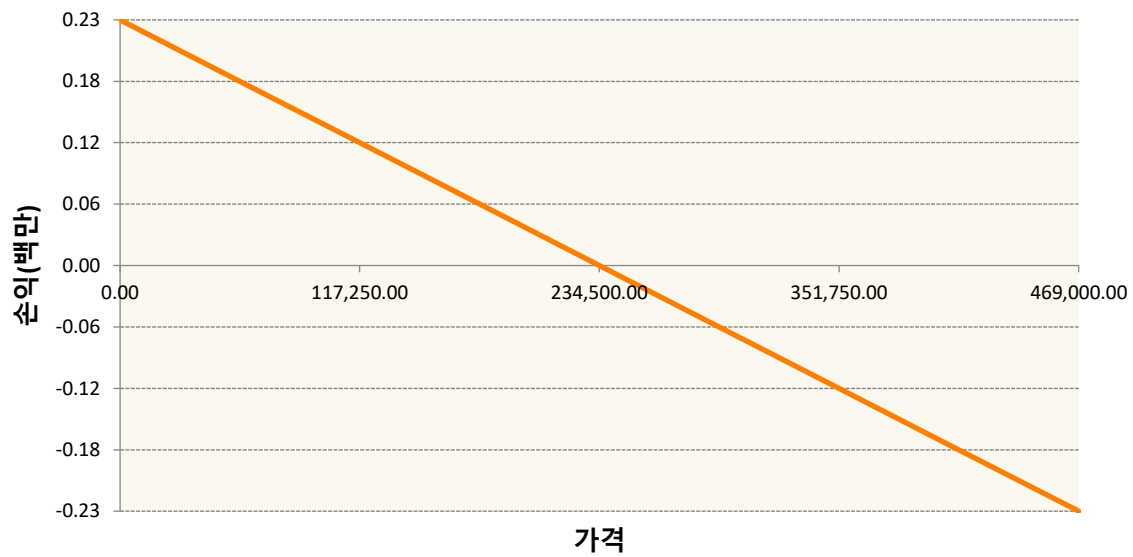
2. 만기시점의 손익구조



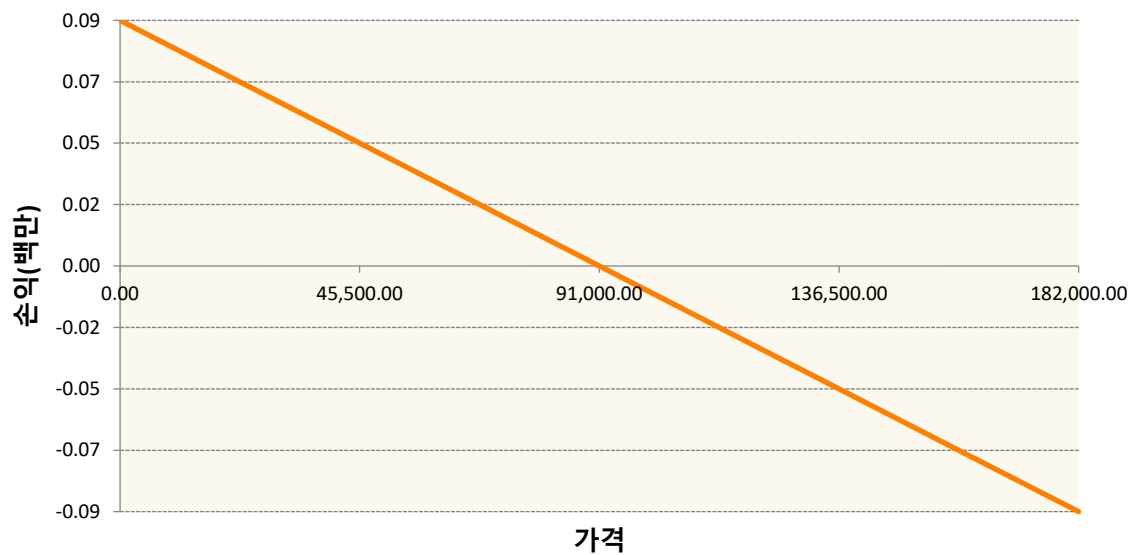
KR4A11670002-2026-07 삼성전자개별선물



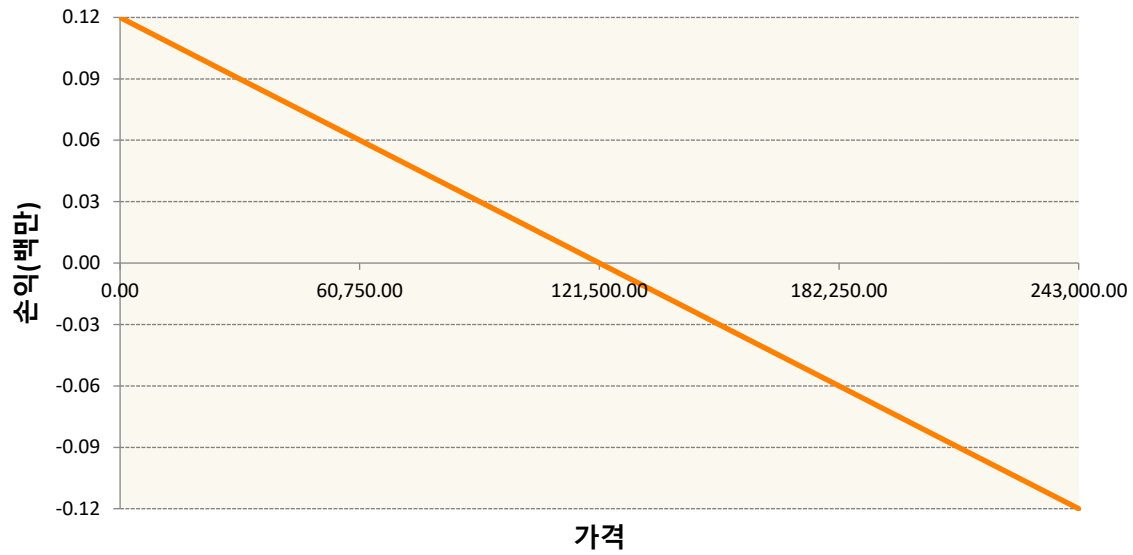
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



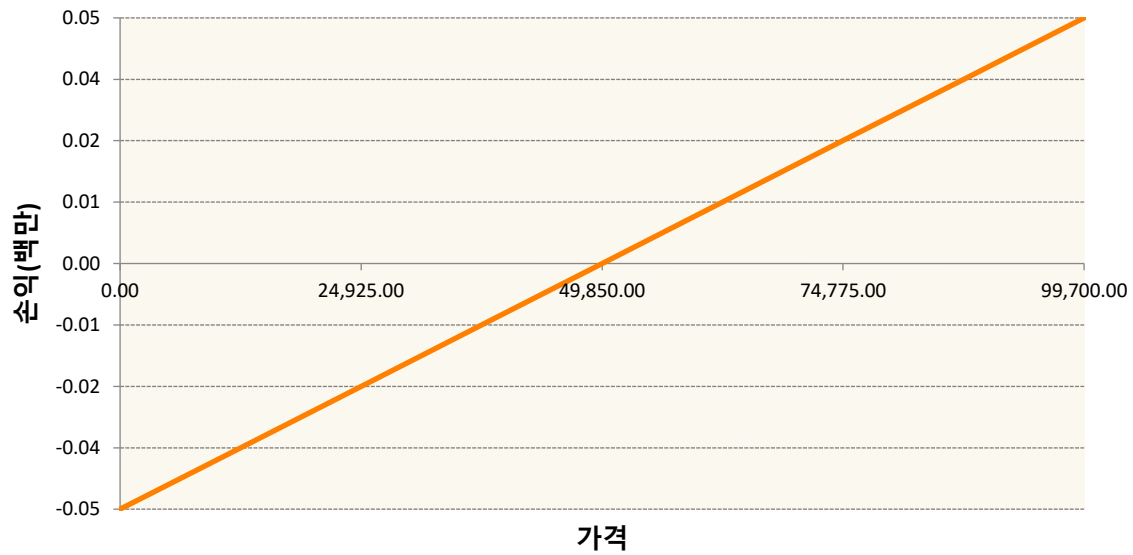
KR4A2K670000-2026-07 LG씨엔에스개별선물



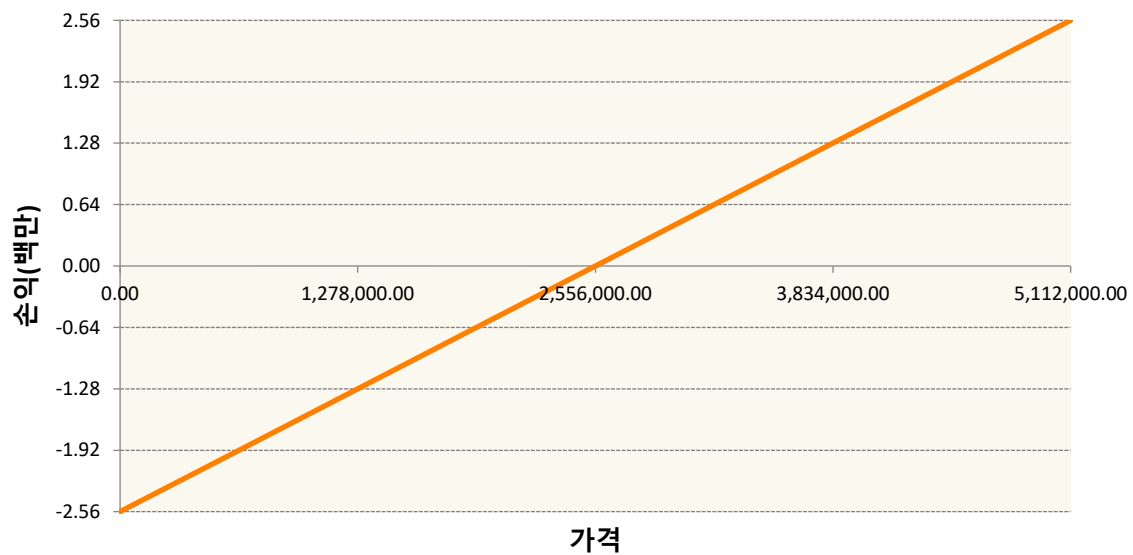
KR4A2P670005-2026-07 이수페타시스개별선물



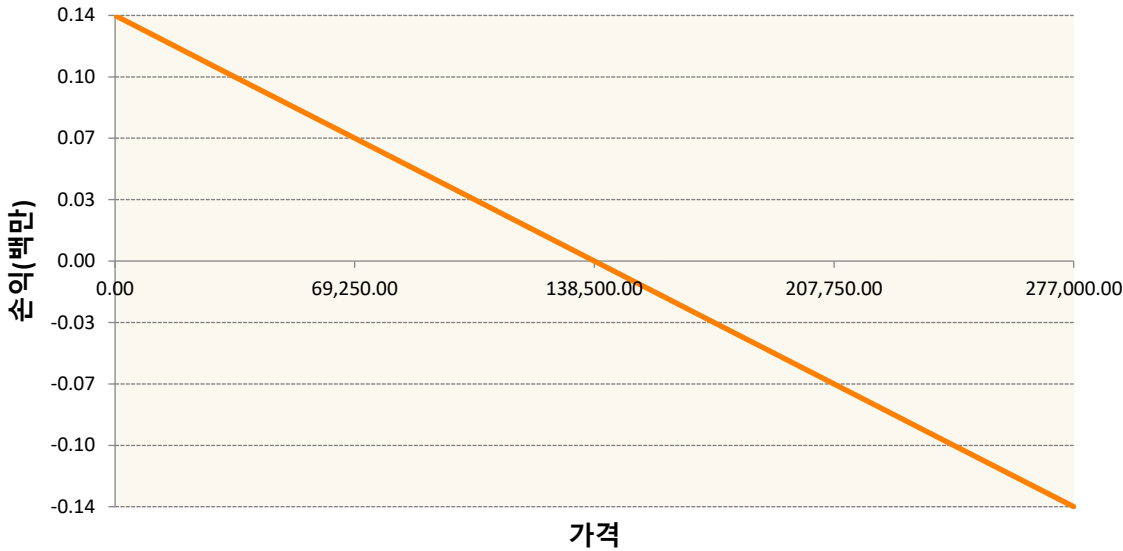
KR4A48670009-2026-07 미래에셋증권개별선물



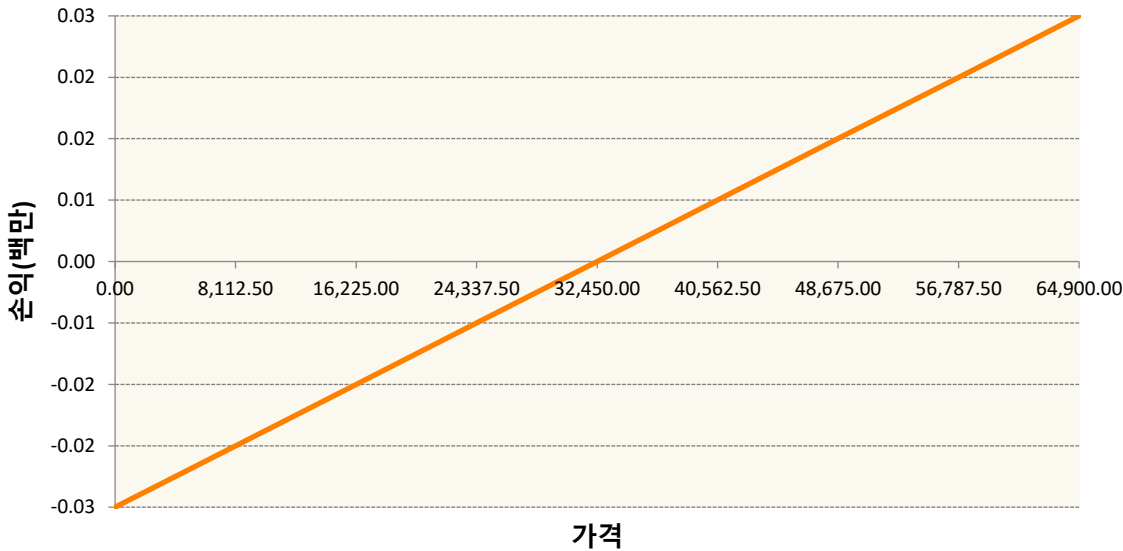
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



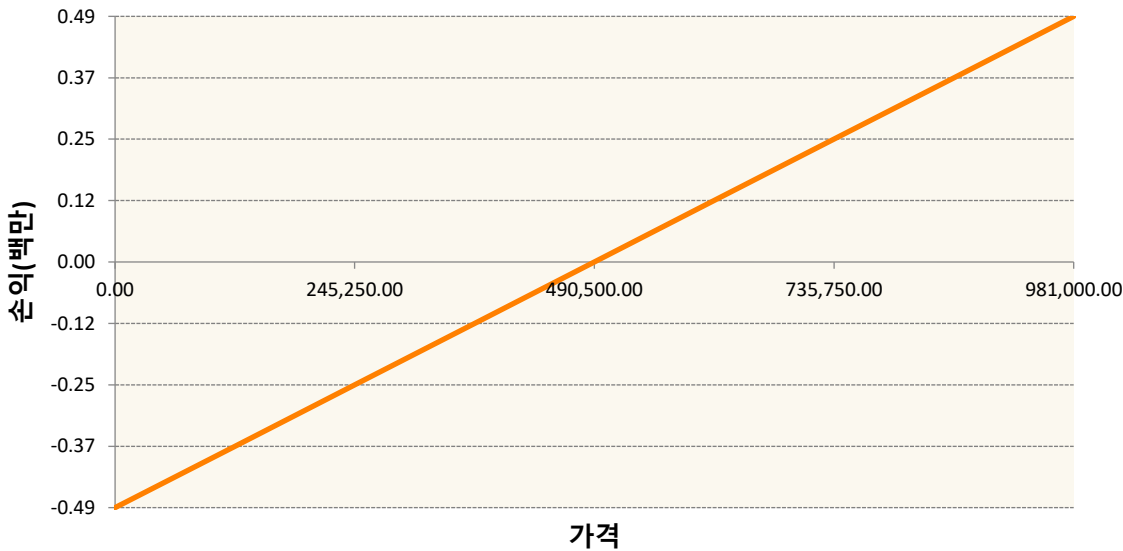
KR4ABN670005-2026-07 현대건설개별선물



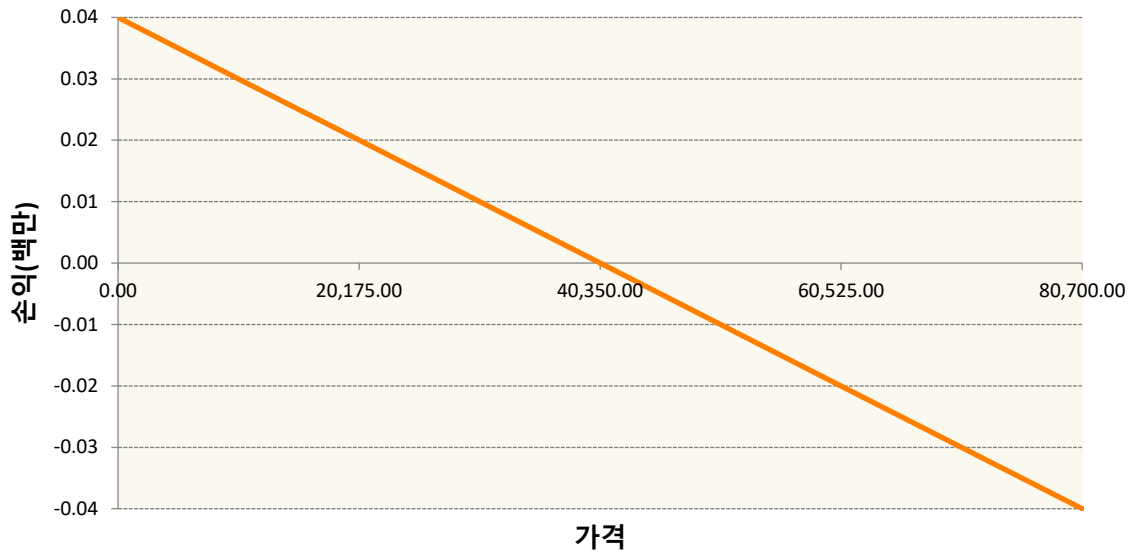
KR4ABZ670001-2026-07 NH투자증권개별선물



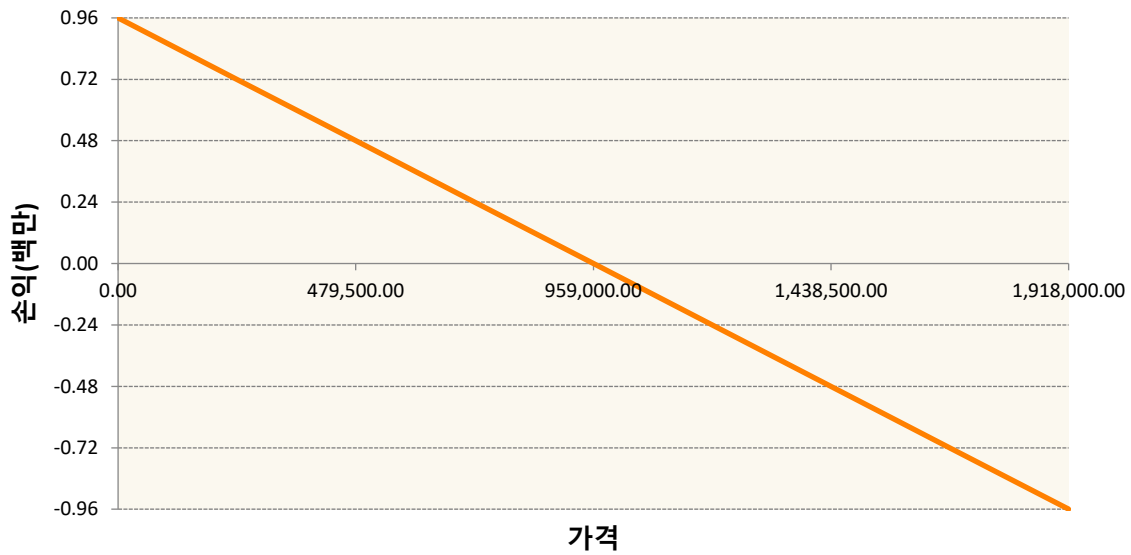
KR4AC8670003-2026-07 삼성물산개별선물



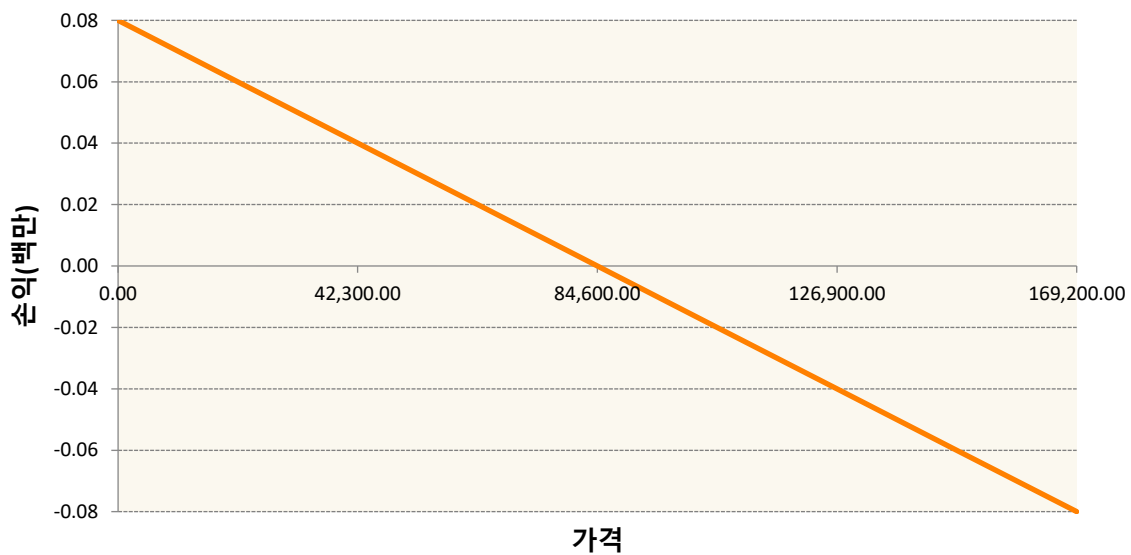
KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



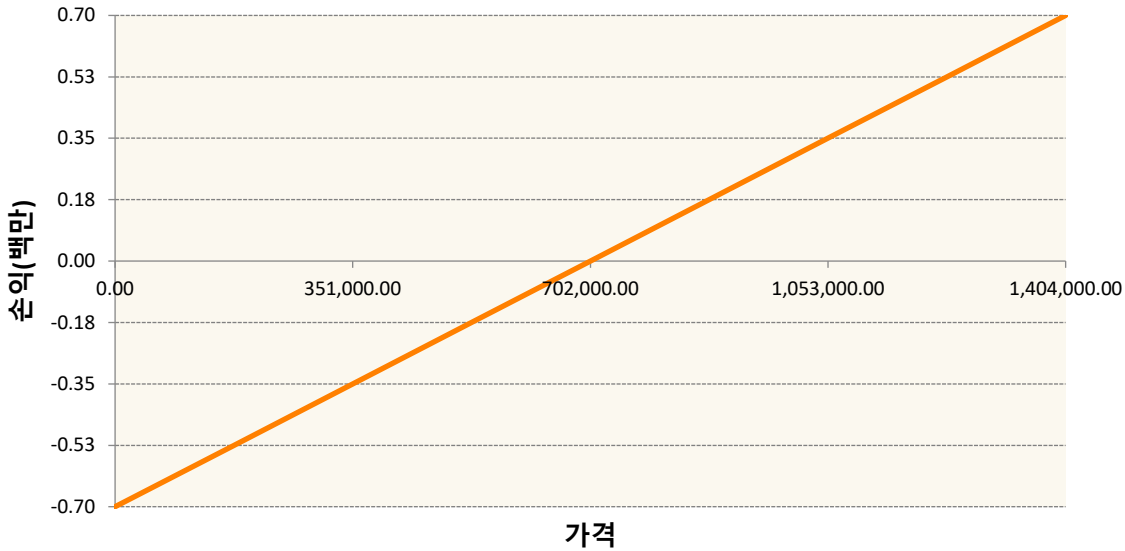
KR4ADB670007-2026-07 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선



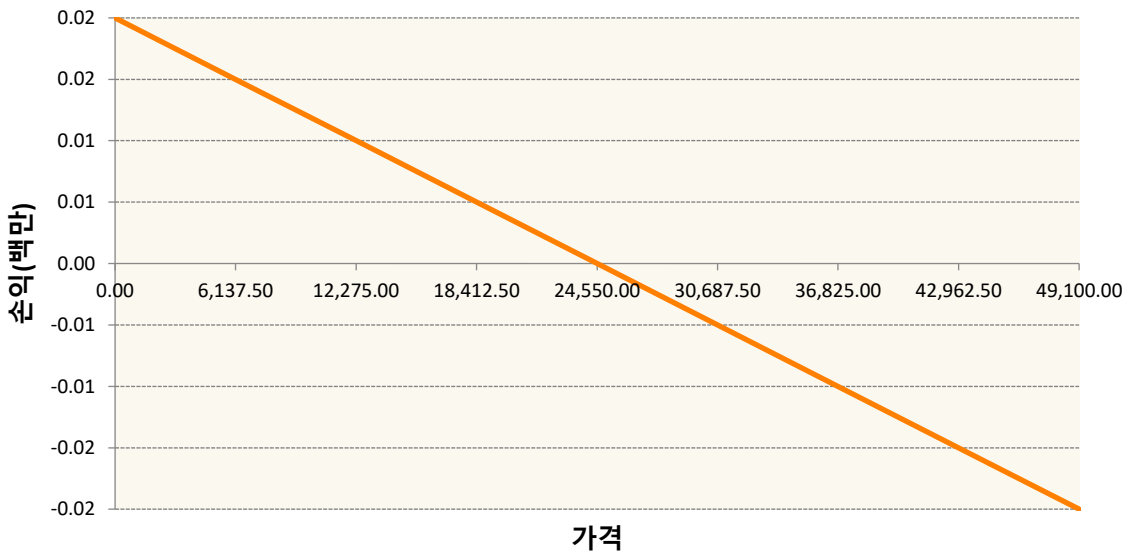
KR4AER670008-2026-07 DL이앤씨개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



KR4AFT670005-2026-07 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				1,190
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190	-1,190
-5.33%	-794	-794	-794	-794	-794	-794	-794
-2.67%	-397	-397	-397	-397	-397	-397	-397
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	397	397	397	397	397	397	397
5.33%	794	794	794	794	794	794	794
8.00%	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190	1,190
KR4A0Z670005			2026-07 한미반도체개별선물				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

KR4A11670002 2026-07 삼성전자개별선물 527

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-527	-527	-527	-527	-527	-527	-527
-5.33%	-351	-351	-351	-351	-351	-351	-351
-2.67%	-176	-176	-176	-176	-176	-176	-176
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	176	176	176	176	176	176	176
5.33%	351	351	351	351	351	351	351
8.00%	527	527	527	527	527	527	527

KR4A24670007 2026-07 LG전자개별선물 55

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	55	55	55	55	55	55	55
-5.33%	37	37	37	37	37	37	37
-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%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55

KR4A2K670000 2026-07 LG씨엔에스개별선물 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

KR4A2P670005 2026-07 이수페타시스개별선물 34

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23
-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%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34

KR4A48670009	2026-07 미래에셋증권개별선물	4
--------------	--------------------	---

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-5.33%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-2.67%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1	1	1	1	1	1	1
5.33%	3	3	3	3	3	3	3
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4A50670004	2026-07 SK하이닉스개별선물	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%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-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%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	77	77	77	77	77	77	77

KR4ABN670005	2026-07 현대건설개별선물	63
--------------	------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	63	63	63	63
-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%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63

KR4ABZ670001	2026-07 NH투자증권개별선물	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

KR4AC8670003	2026-07 삼성물산개별선물	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
KR4ACF670004 2026-07 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%	69	69	69	69	69	69	69
-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%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
8.00%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103

KR4ADB670007 2026-07 LIG디펜스엔에어로스페이스개별선							63
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	63	63	63	63	63	63	63
-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%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63

KR4AER670008 2026-07 DL이앤씨개별선물							17
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	17	17	17	17	17	17	17
-5.33%	11	11	11	11	11	11	11
-2.67%	6	6	6	6	6	6	6
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
5.33%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
8.00%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17

KR4AFD670003 2026-07 HD현대중공업개별선물							24
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-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%	24	24	24	24	24	24	24
KR4AFT670005 2026-07 대우건설개별선물							34
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	34	34	34	34	34	34	34
-5.33%	22	22	22	22	22	22	22
-2.67%	11	11	11	11	11	11	11
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
5.33%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
8.00%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34

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

(단위:백만원)

5,785

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

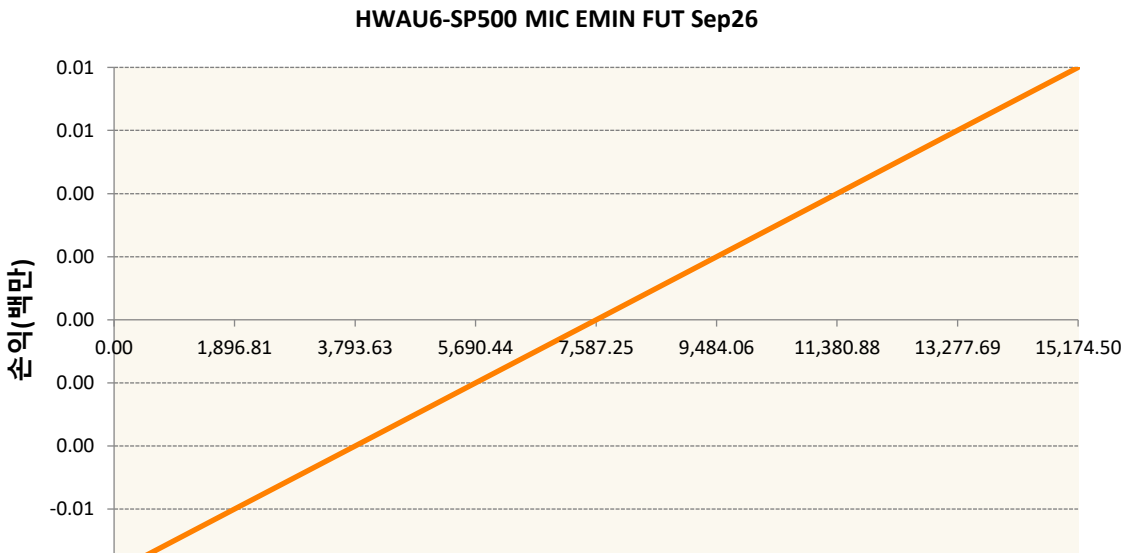
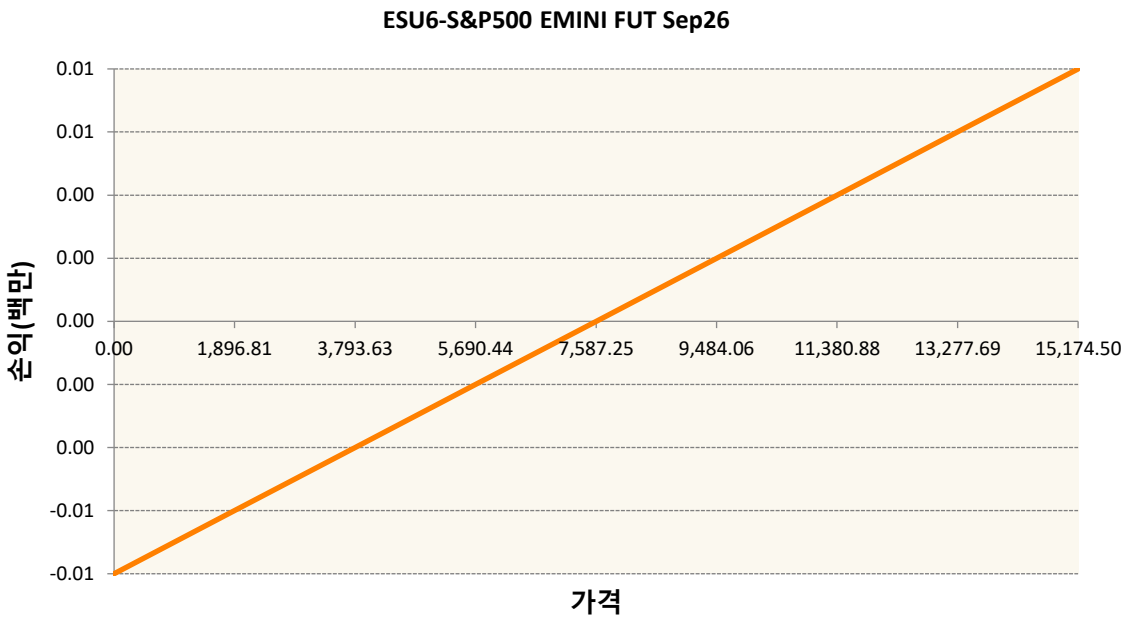
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

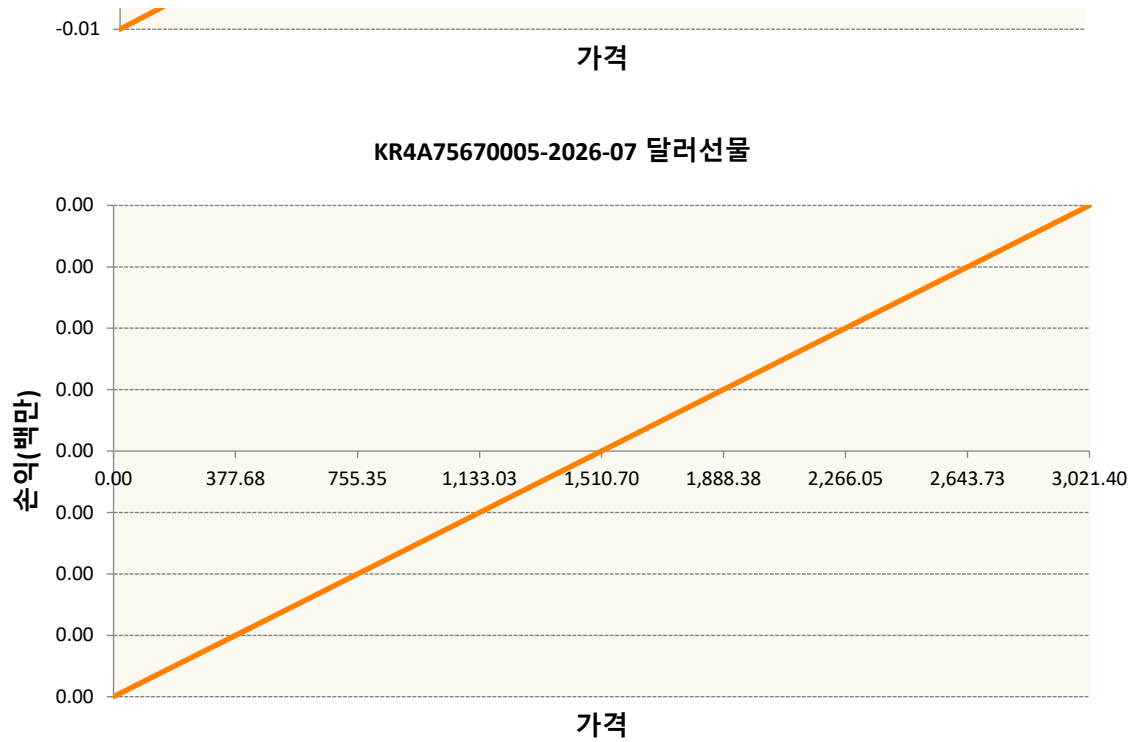
1. 계약금액

(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	62,505	0	62,505	
누계	지수	선물	287	0	287	장내
누계	통화	선물	10,726	0	10,726	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		5,000
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		23
KR4A756700 2026-07 달러선물			858

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,331

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

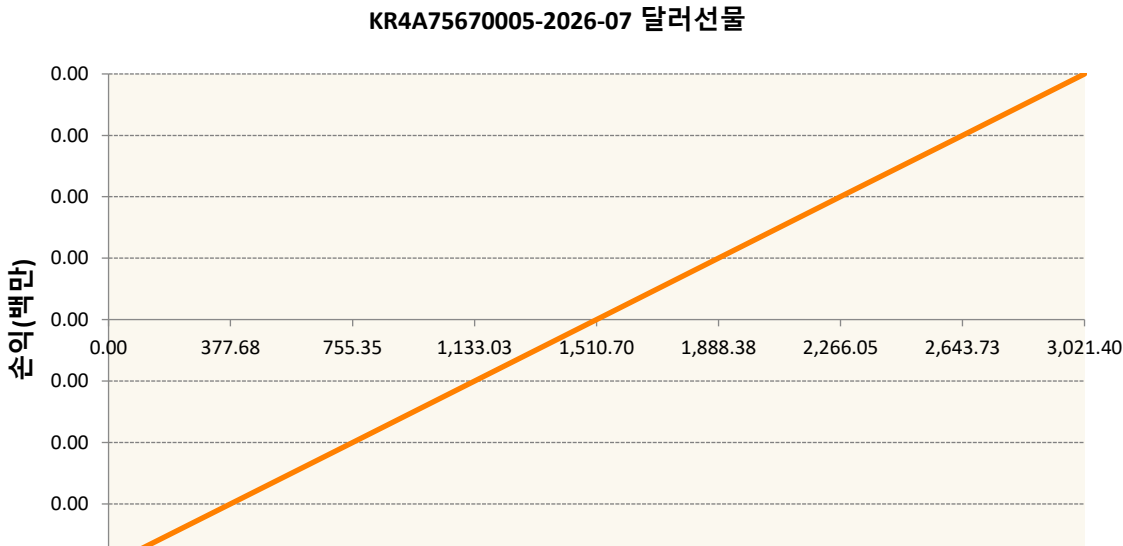
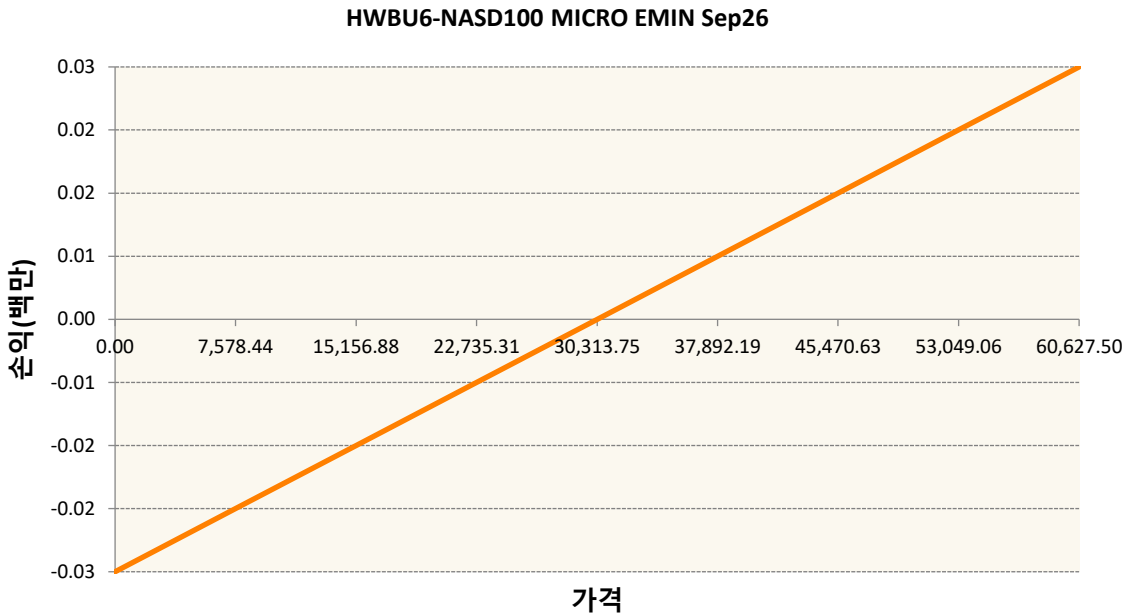
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

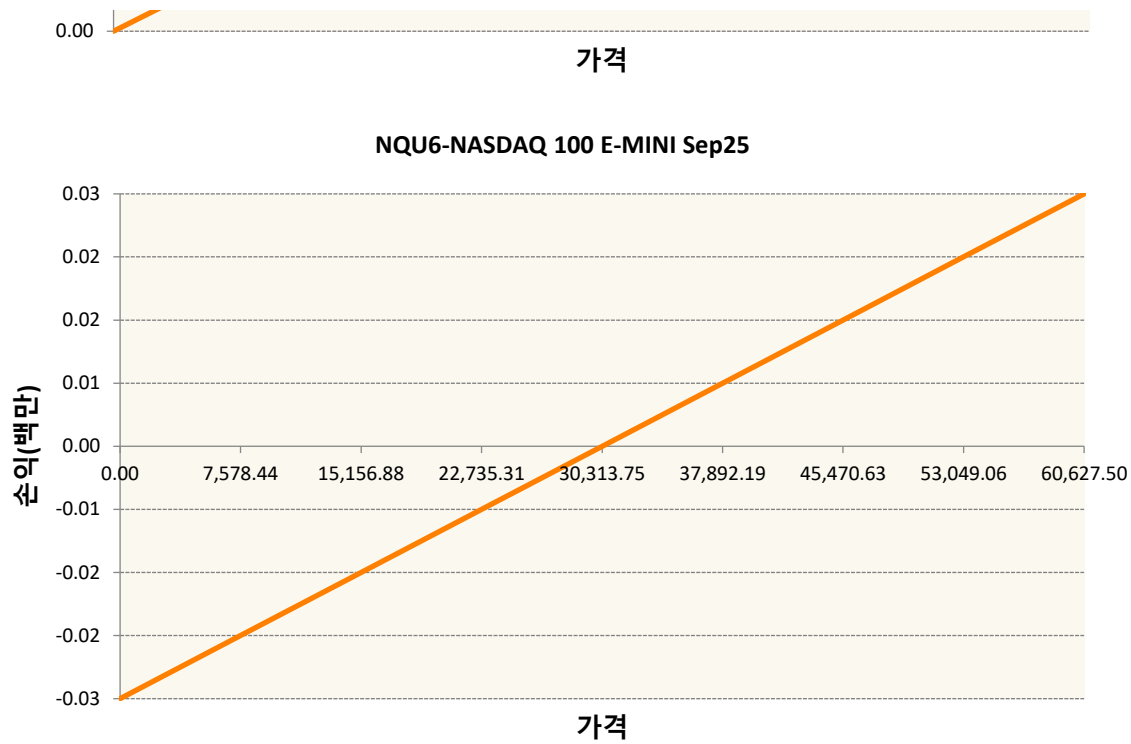
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	275	0	275	장내
누계	지수	선물	31,159	0	31,159	
누계	통화	선물	3,943	0	3,943	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26	22
KR4A756700	2026-07 달러선물	315
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	2,493

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

2,808

공시일	2026-06-18
기준일	2026-06-17

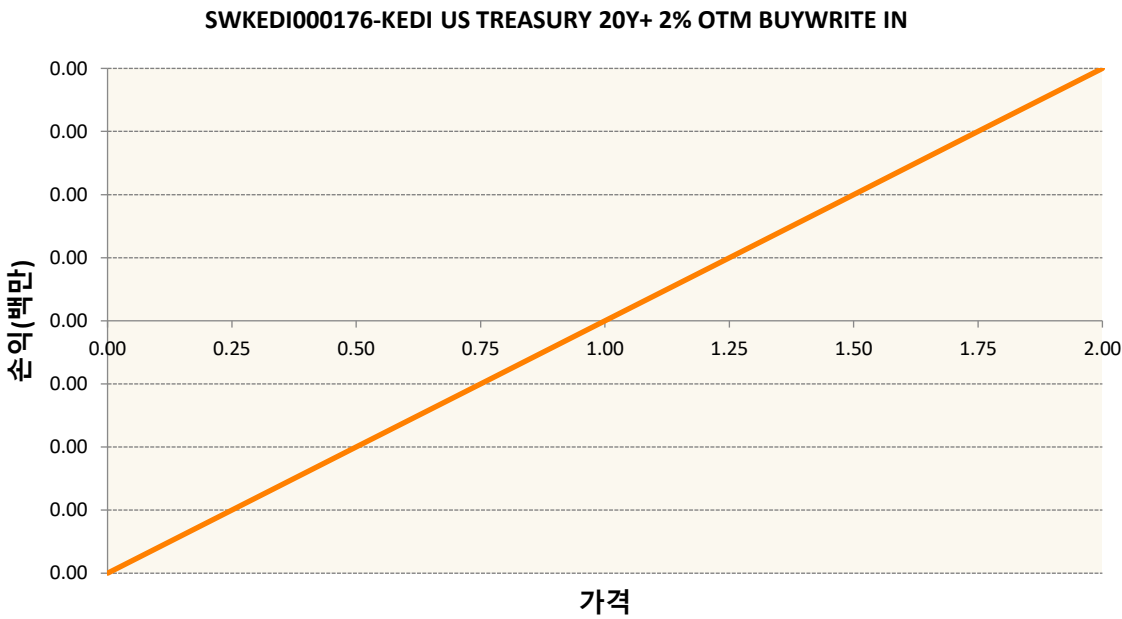
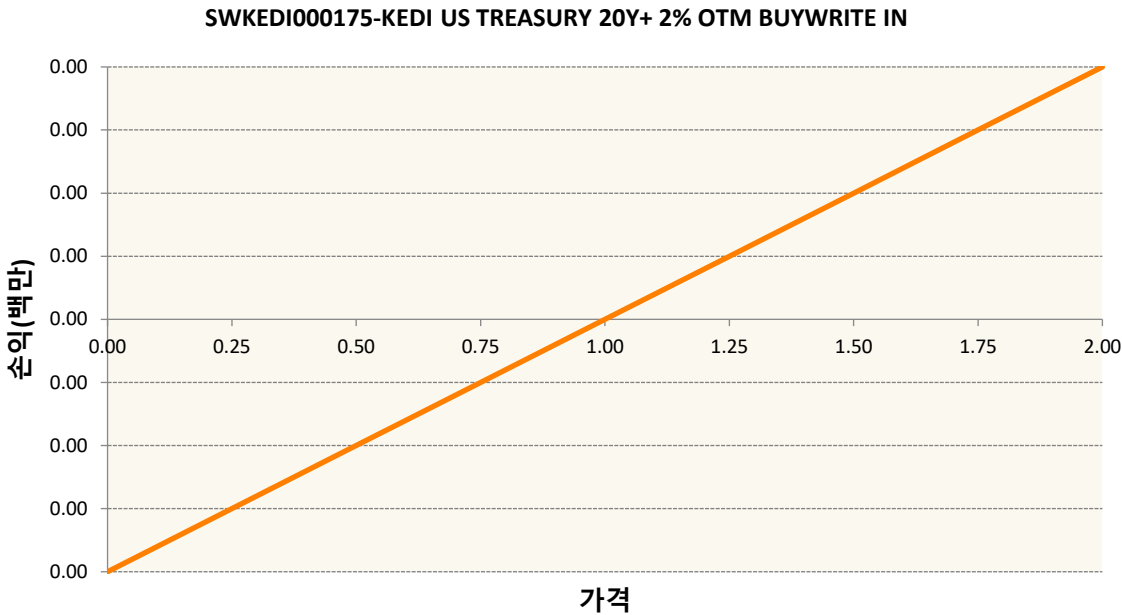
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

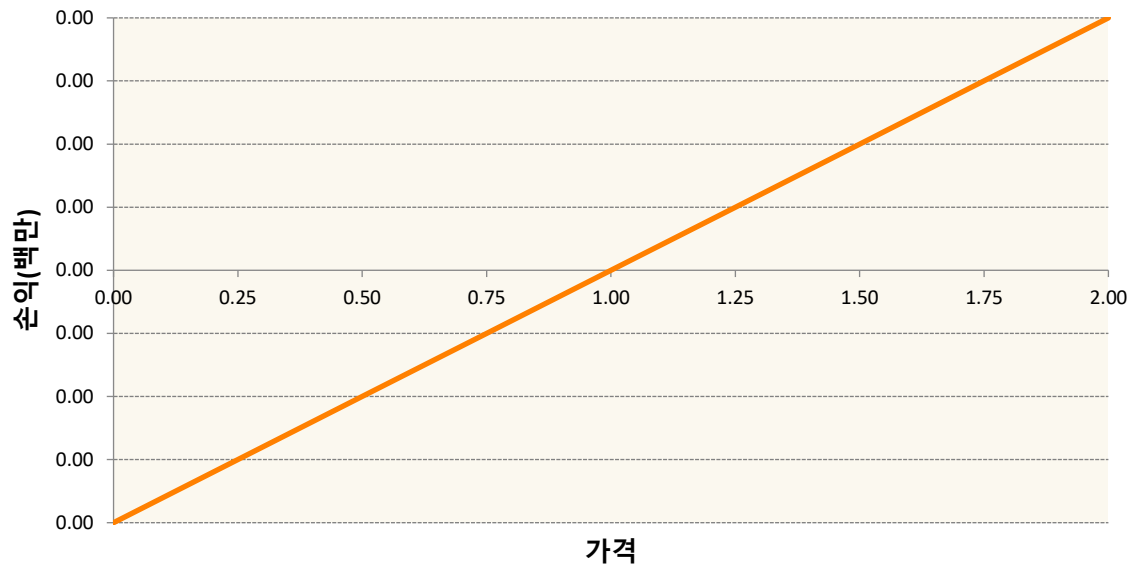
(단위:백만원)

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

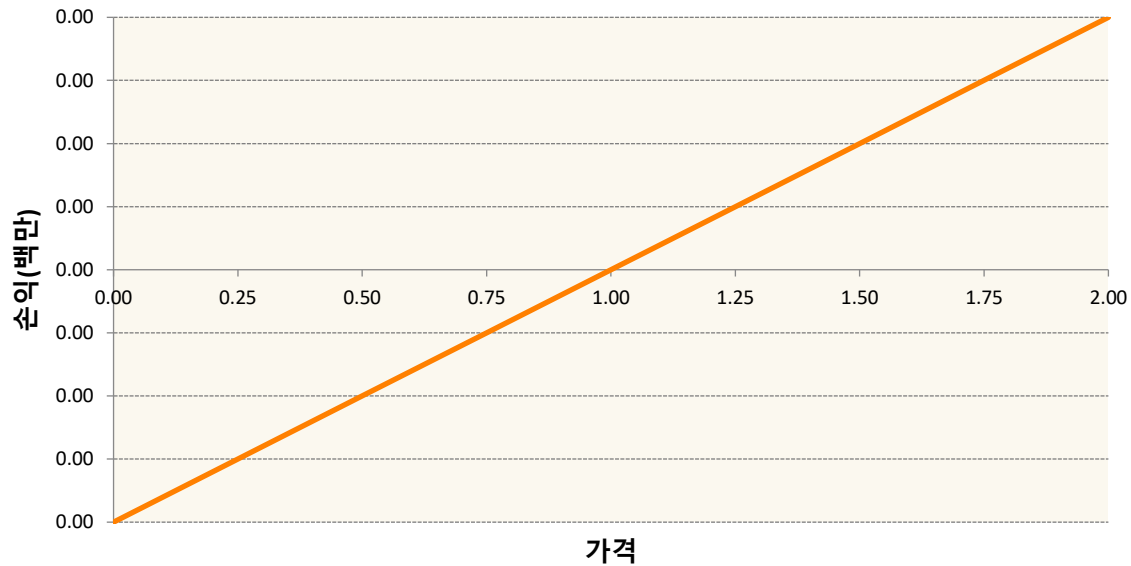
2. 만기시점의 손익구조



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	8,426
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,173
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,208
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,966

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

(단위:백만원)

10,847