

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

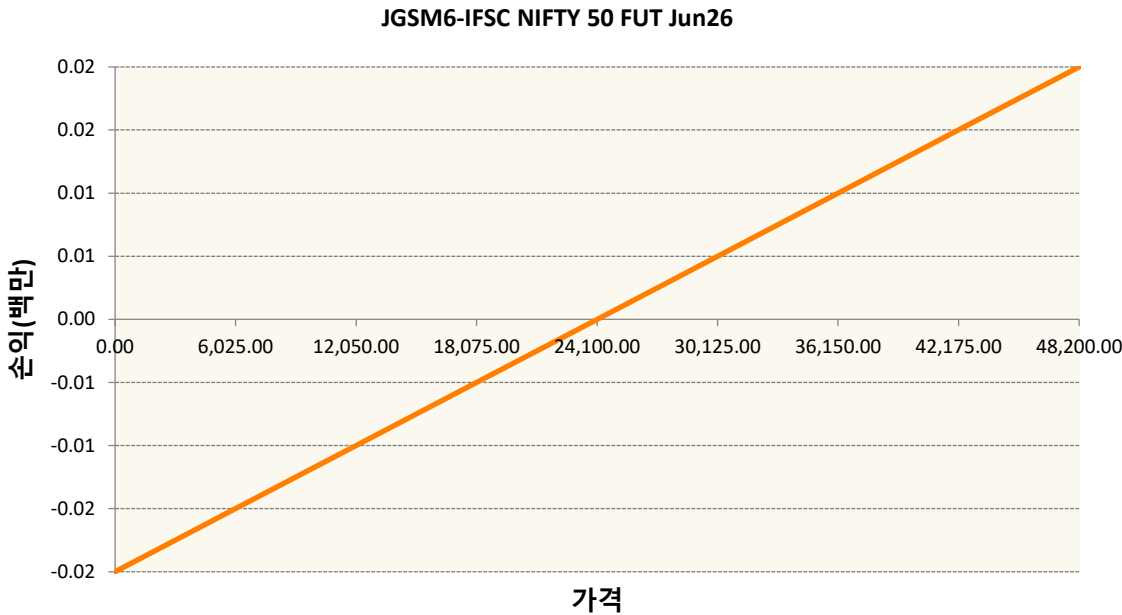
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	363	0	363	

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	2026-06-19
기준일	2026-06-18

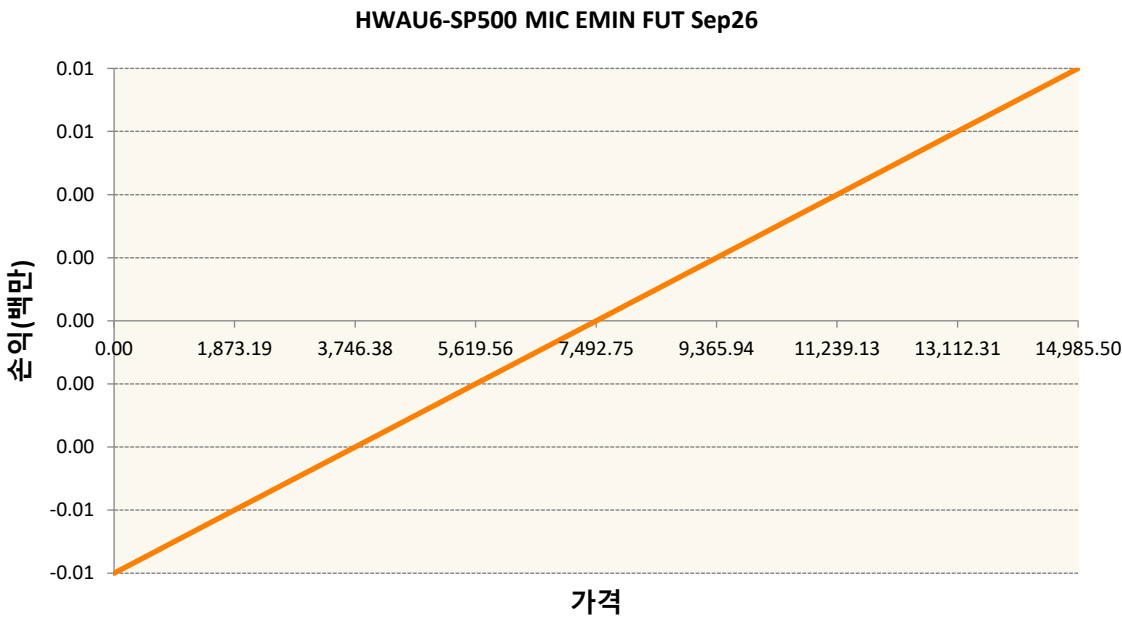
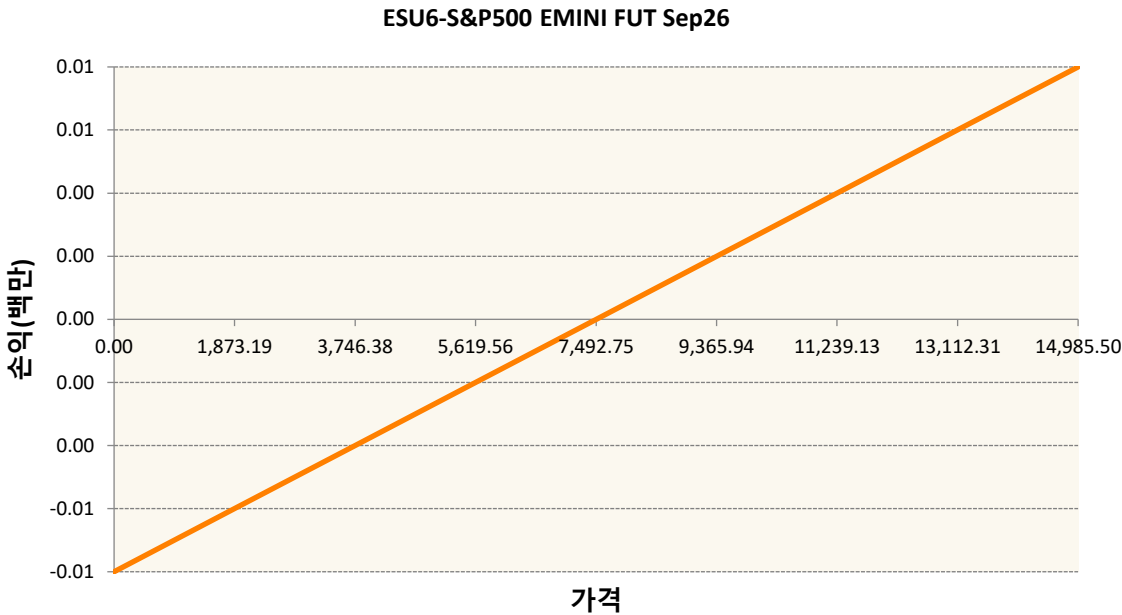
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	572	0	572	
누계	지수	선물	57	0	57	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	46
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	44

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

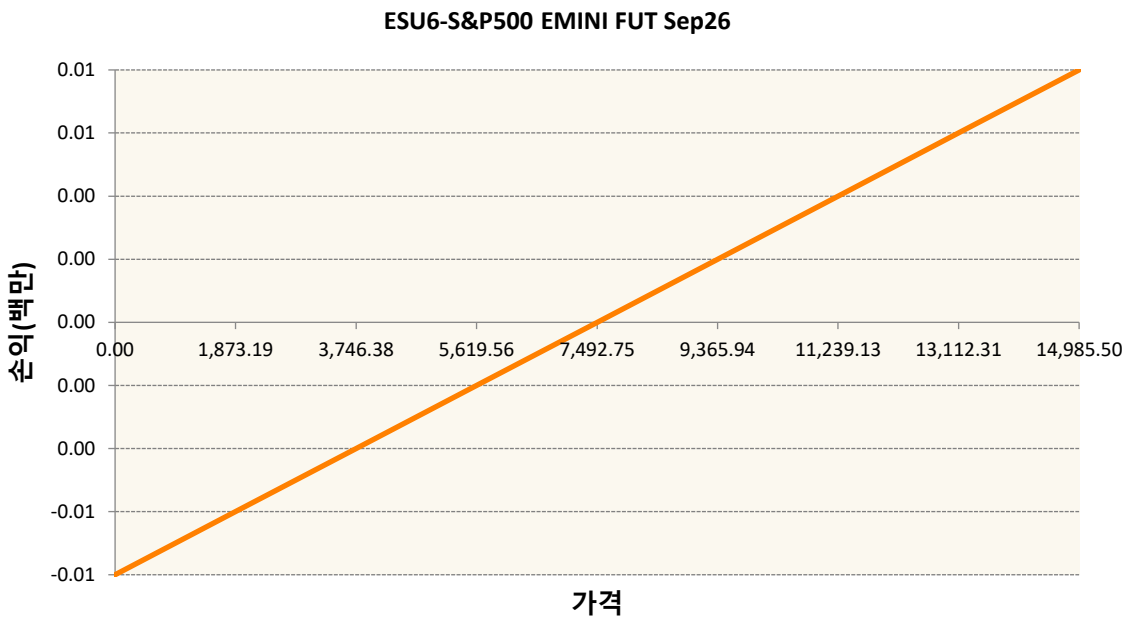
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,133	0	1,133	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	91
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

78

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

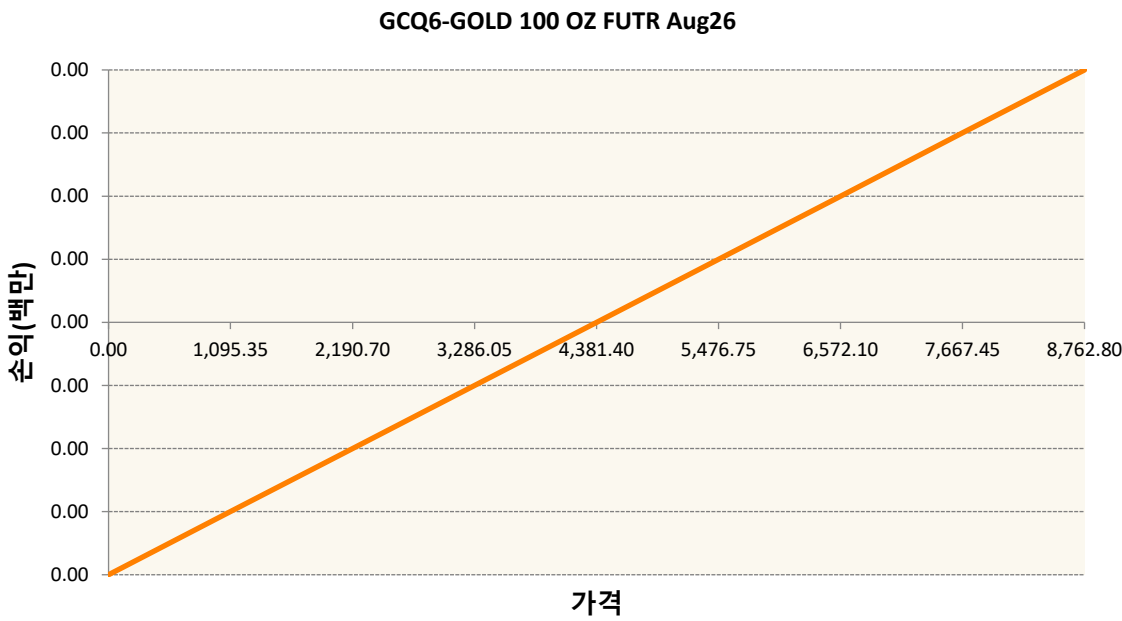
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,259	0	5,259	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSCC GLD US 06/18/26 C390 EQUITY	12
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	421

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

(단위:백만원)

554

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

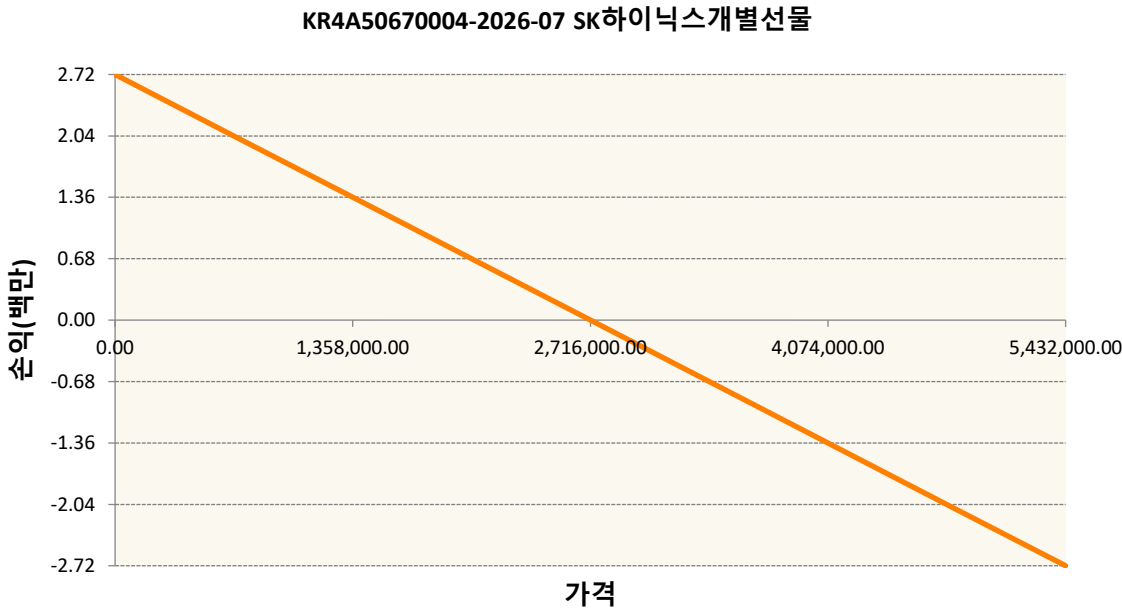
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	8,243	-8,243	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	21,728	-21,728	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUCP' PLTR US 06/18/26 P140 EQUITY	45
AOPLTRUCS' PLTR US 06/18/26 C140 EQUITY	41
KR4A506700 2026-07 SK하이닉스개별선물	1,738

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

(단위:백만원)

256

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

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

3

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

(단위:백만원)

2

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

(단위:백만원)

21,198

공시일 2026-06-19

기준일 2026-06-18

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	2026-06-19
기준일	2026-06-18

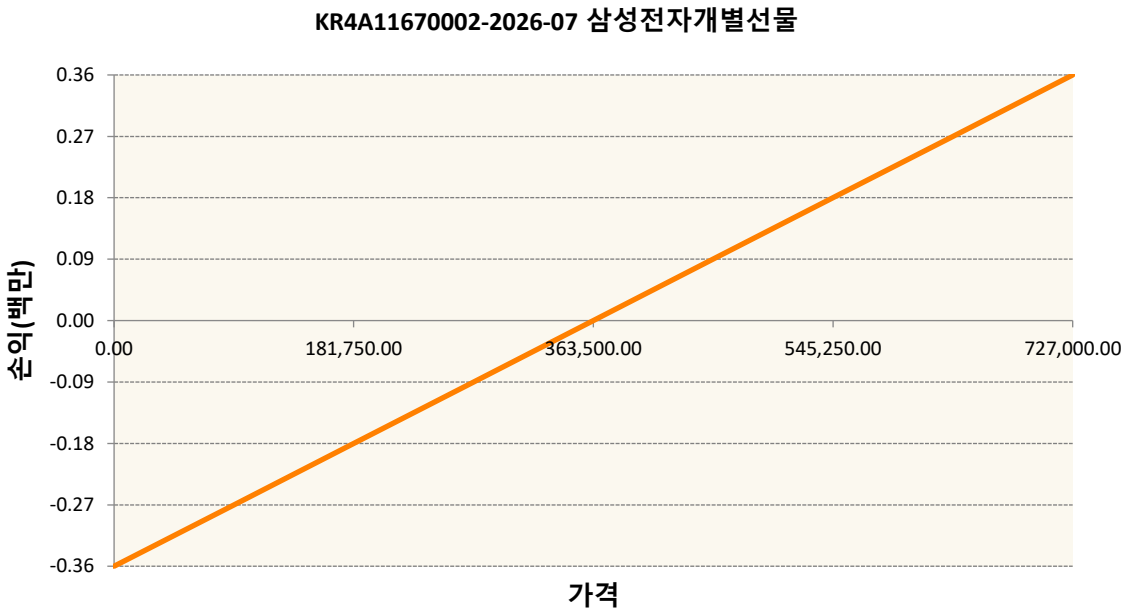
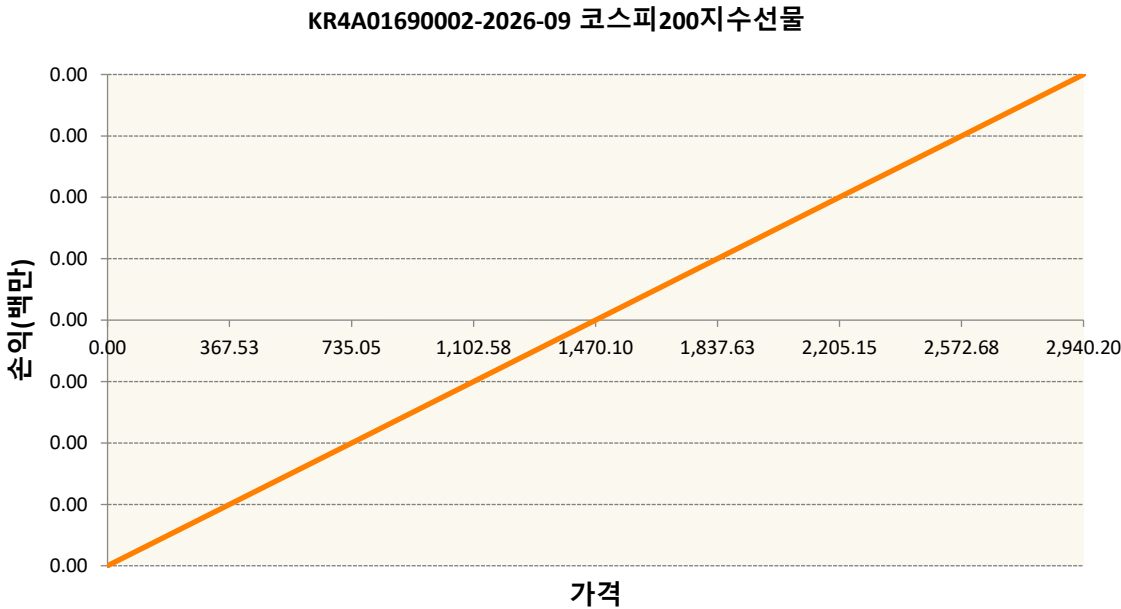
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	67,507	-67,507	장내
누계	유가증권	선물	29,185	66,223	-37,038	장내

2. 만기시점의 손익구조



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 2,925.00. The y-axis represents net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. A solid blue line starts at the origin (0, 0) and ends at (2,925, 0), indicating that net income is zero for all amounts shown on the x-axis.

가액	순익(백만)
0.00	0.00
365.63	0.00
731.25	0.00
1,096.88	0.00
1,462.50	0.00
1,828.13	0.00
2,193.75	0.00
2,559.38	0.00
2,925.00	0.00

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the net income (순이익). The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 2,930.00 with major ticks every 366.25. 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) and extends to the point (2,930, 0), indicating that the net income is zero at the maximum price of 2,930.00.

가액	순이익 (백만)
0.00	0.00
366.25	0.00
732.50	0.00
1,098.75	0.00
1,465.00	0.00
1,831.25	0.00
2,197.50	0.00
2,563.75	0.00
2,930.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물			759
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-759	-759	-759	-759	-759	-759	-759
-5.33%	-506	-506	-506	-506	-506	-506	-506
-2.67%	-253	-253	-253	-253	-253	-253	-253
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	253	253	253	253	253	253	253
5.33%	506	506	506	506	506	506	506
8.00%	759	759	759	759	759	759	759
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물			1,566
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,566	-1,566	-1,566	-1,566	-1,566	-1,566	-1,566
-5.33%	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044	-1,044
-2.67%	-522	-522	-522	-522	-522	-522	-522
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	522	522	522	522	522	522	522
5.33%	1,044	1,044	1,044	1,044	1,044	1,044	1,044
8.00%	1,566	1,566	1,566	1,566	1,566	1,566	1,566
KR4BAFBJB872 코스피위클리M C 2606W4 1,462.5							3,181

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	3,181	3,181	3,181	3,181	3,181	3,181	3,181
-5.33%	2,121	2,121	2,121	2,121	2,121	2,121	2,121
-2.67%	1,060	1,060	1,060	1,060	1,060	1,060	1,060
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-1,060	-1,060	-1,060	-1,060	-1,060	-1,060	-1,060
5.33%	-2,121	-2,121	-2,121	-2,121	-2,121	-2,121	-2,121
8.00%	-3,181	-3,181	-3,181	-3,181	-3,181	-3,181	-3,181
KR4BAFBJB880 코스피위클리M C 2606W4 1,465.0							2,101

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,101	2,101	2,101	2,101	2,101	2,101	2,101
-5.33%	1,401	1,401	1,401	1,401	1,401	1,401	1,401
-2.67%	700	700	700	700	700	700	700
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-700	-700	-700	-700	-700	-700	-700
5.33%	-1,401	-1,401	-1,401	-1,401	-1,401	-1,401	-1,401
8.00%	-2,101	-2,101	-2,101	-2,101	-2,101	-2,101	-2,101

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

(단위:백만원)

19,935

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

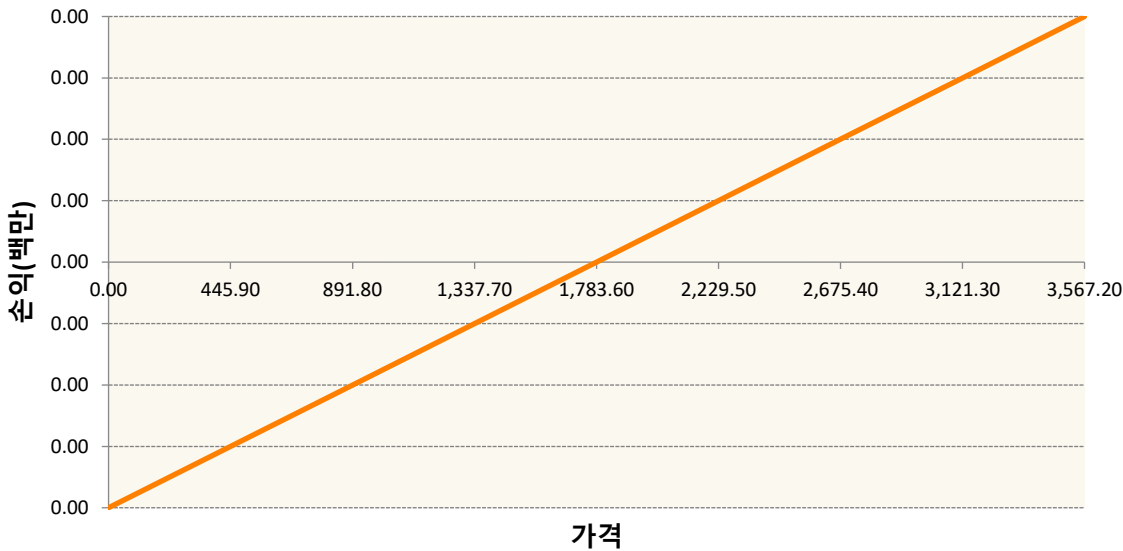
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,034	0	1,034	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A06690007-2026-09 코스닥150선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				83
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-83	-83	-83	-83	-83	-83
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	83	83	83	83	83	83	83

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

(단위:백만원)

26,905

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

(단위:백만원)

46,920

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

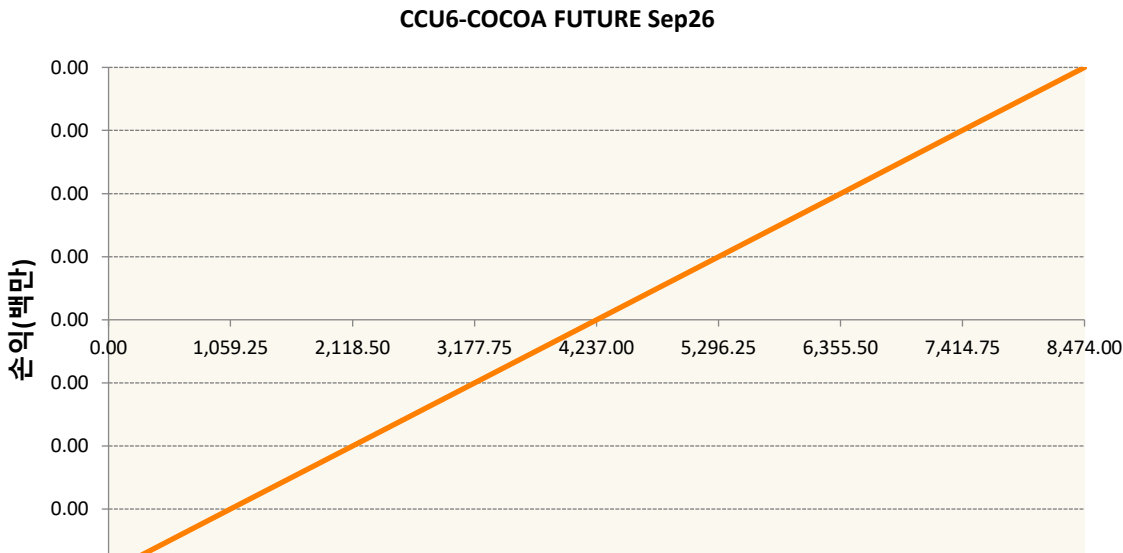
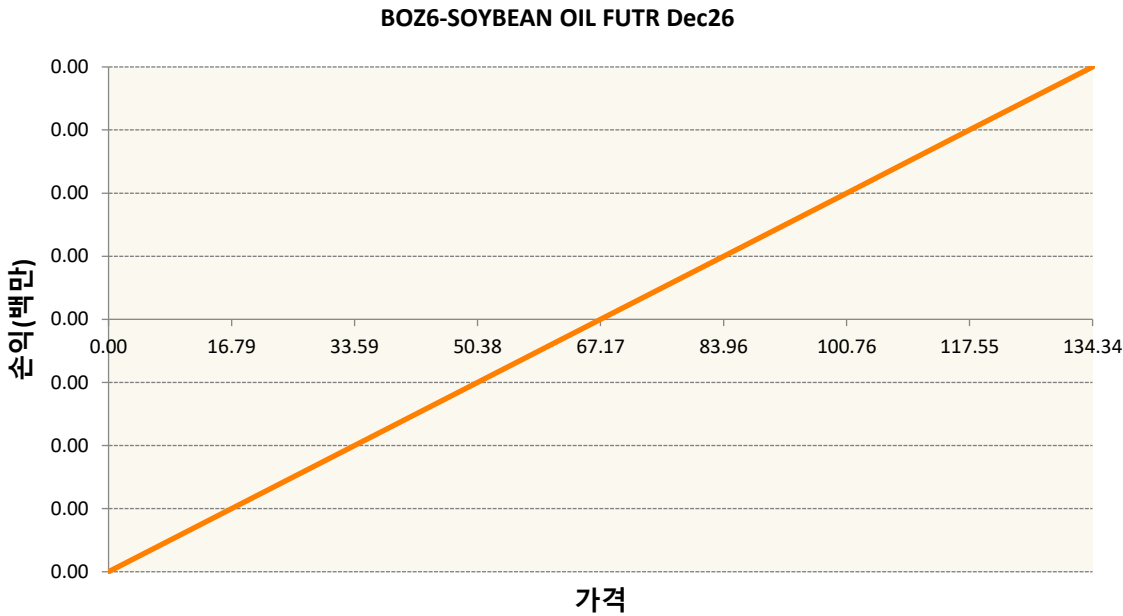
포커스농산물모(채권-파생형)

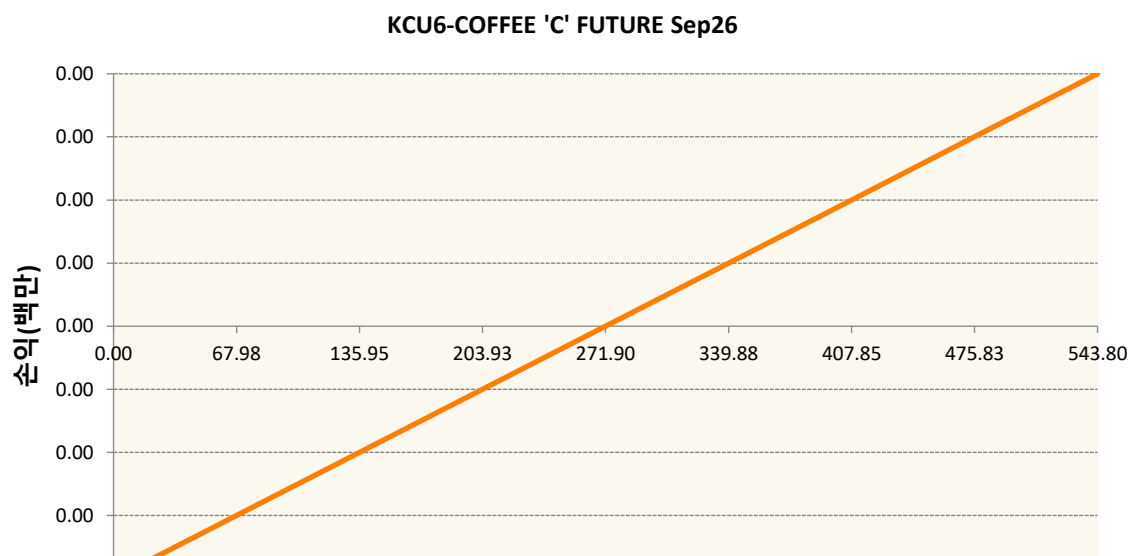
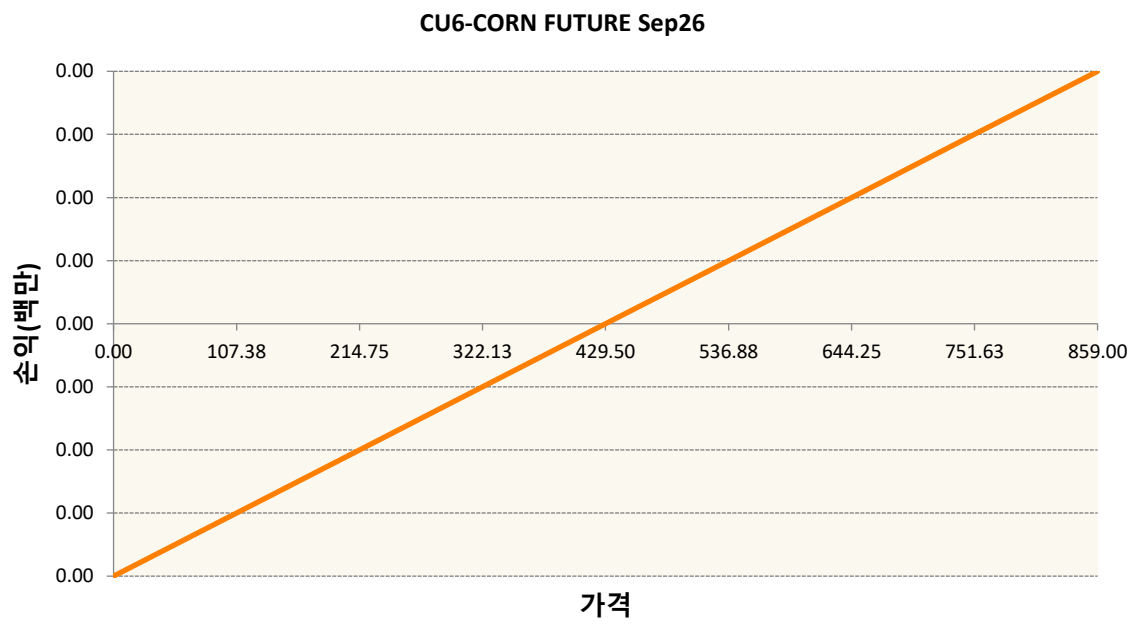
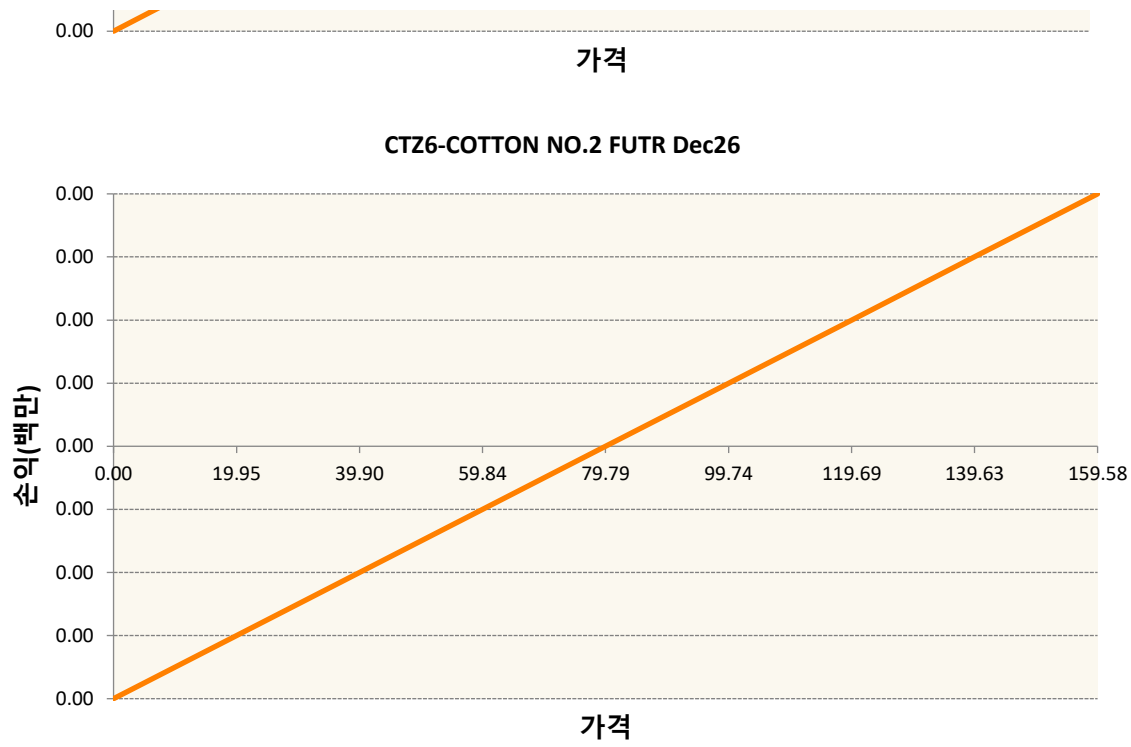
1. 계약금액

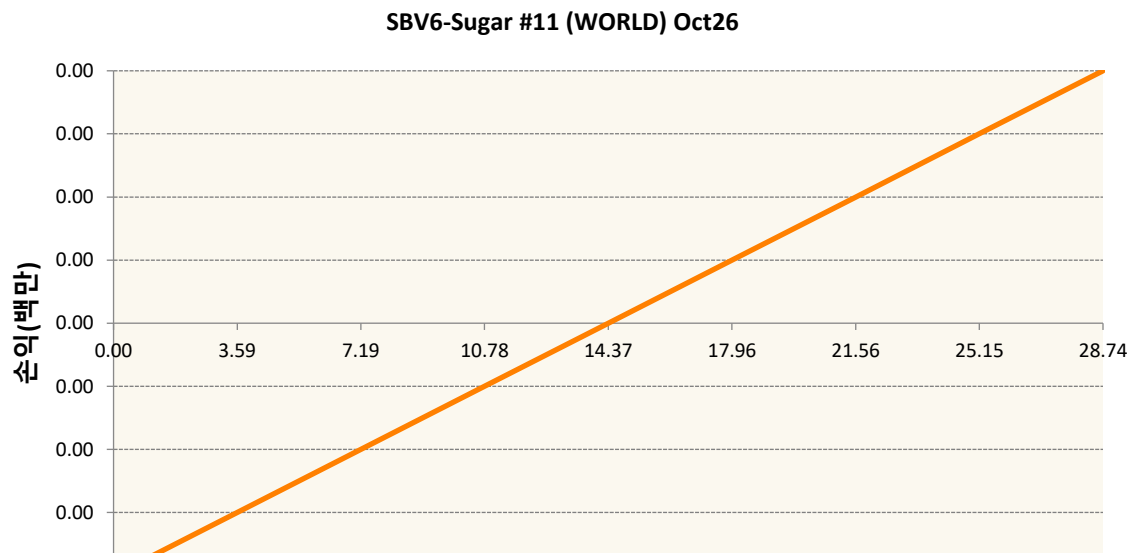
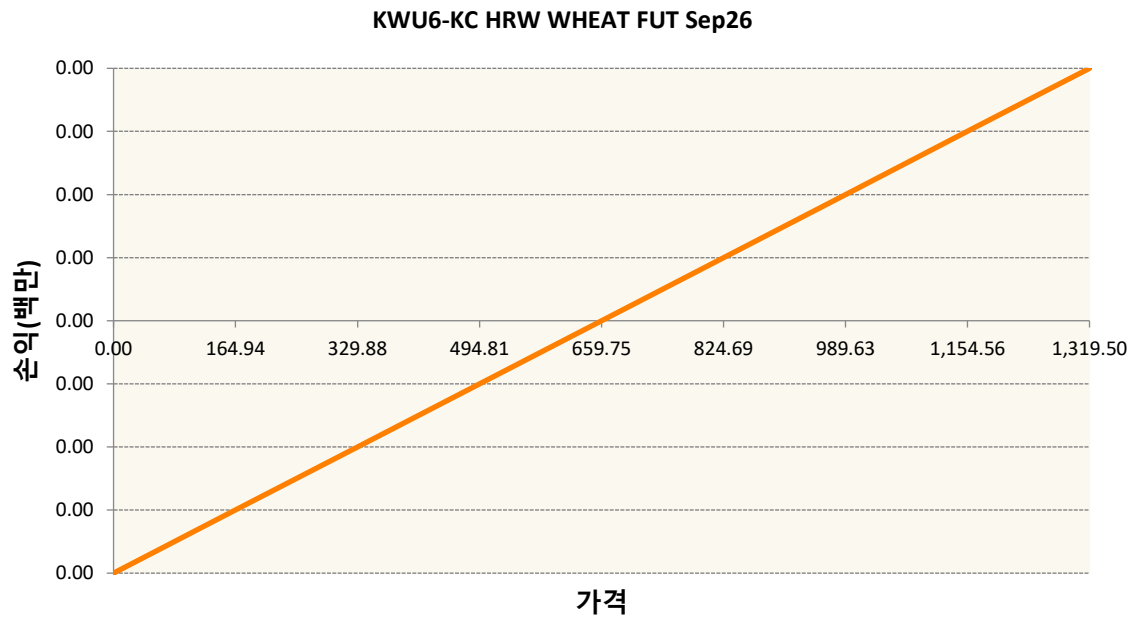
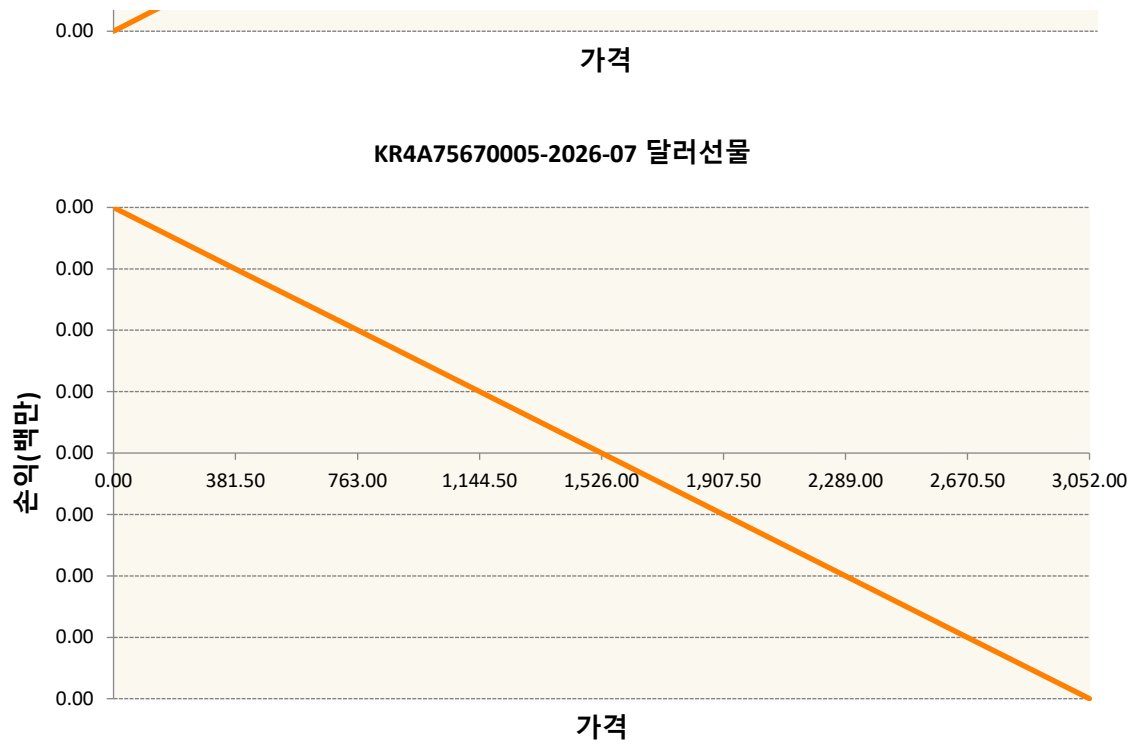
(단위:USD 백만)

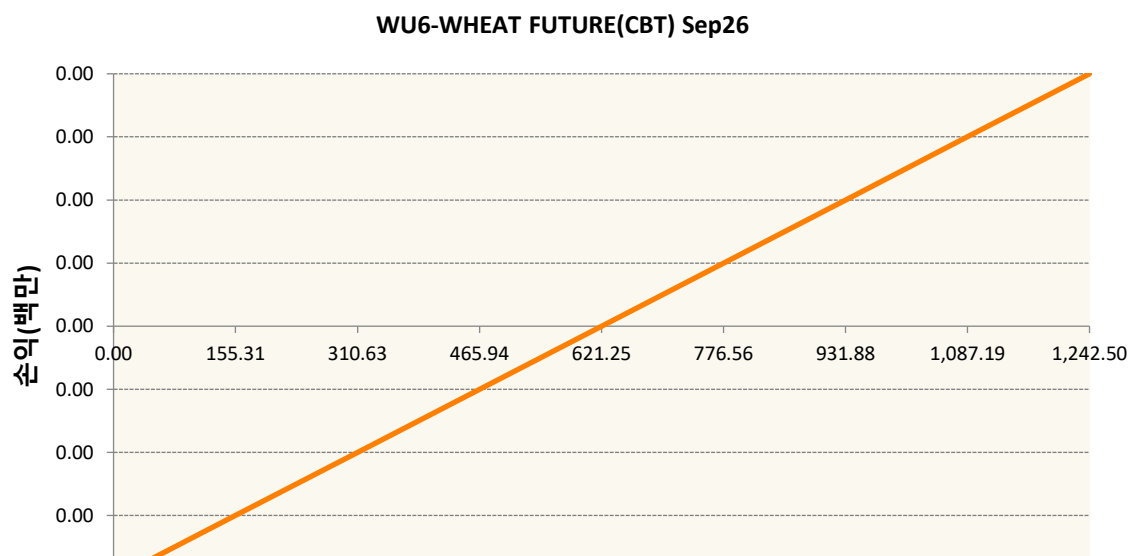
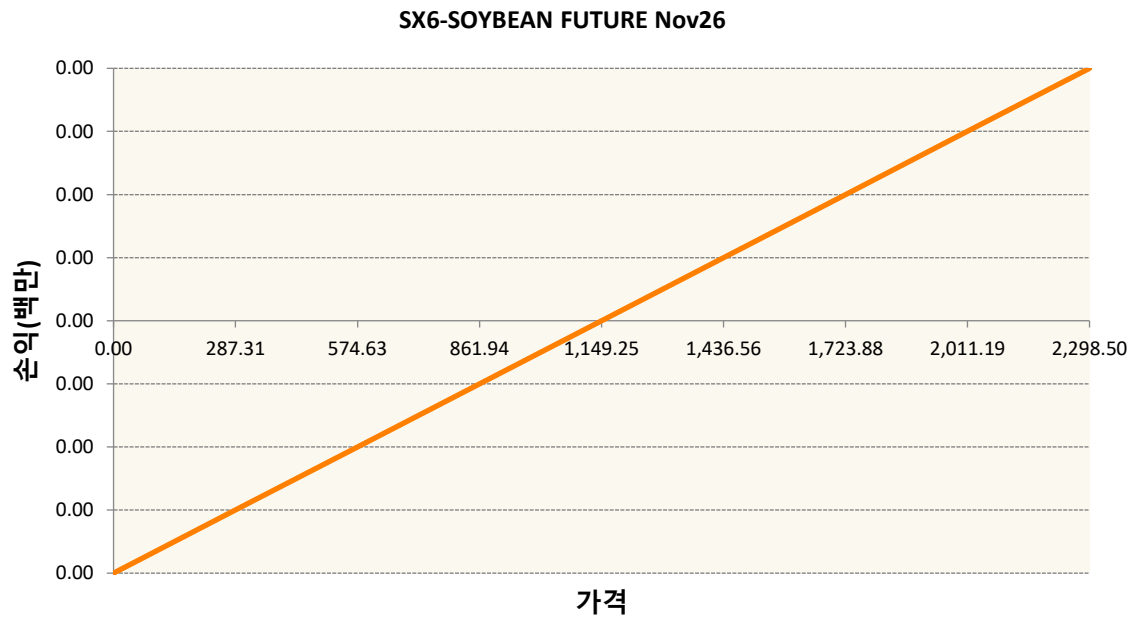
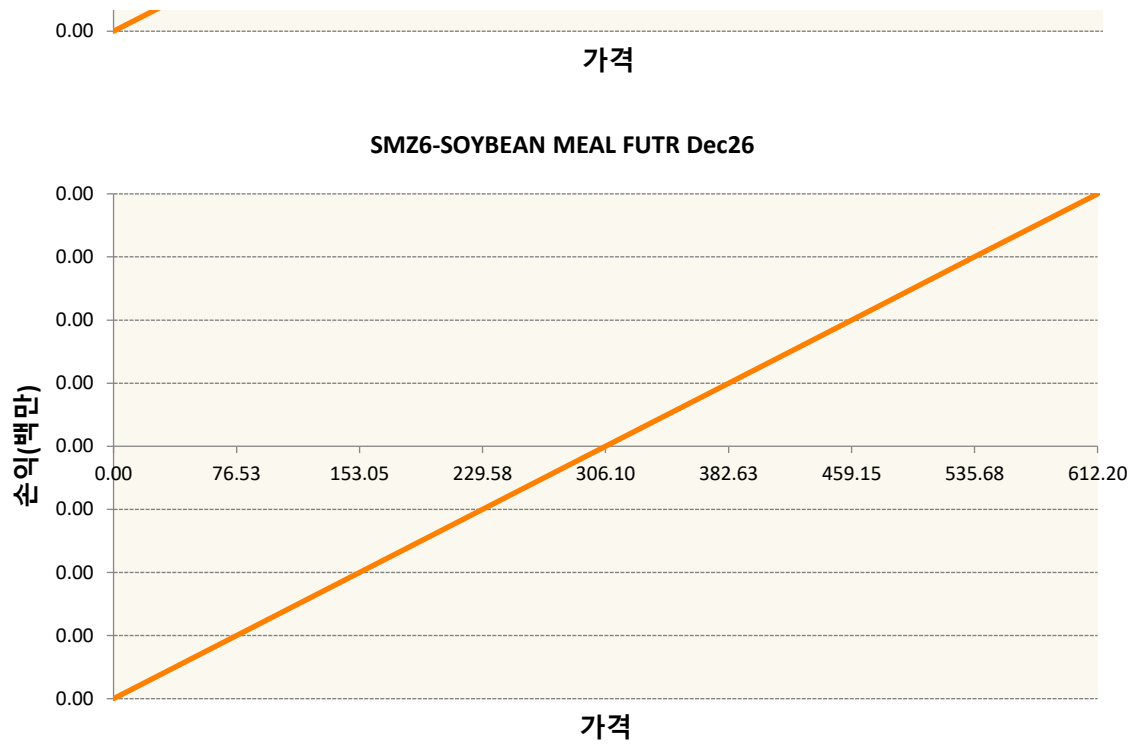
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	433	0	433	
누계	유가증권	선물	2,159	0	2,159	
누계	통화	선물	0	168	-168	장내

2. 만기시점의 손익구조









0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

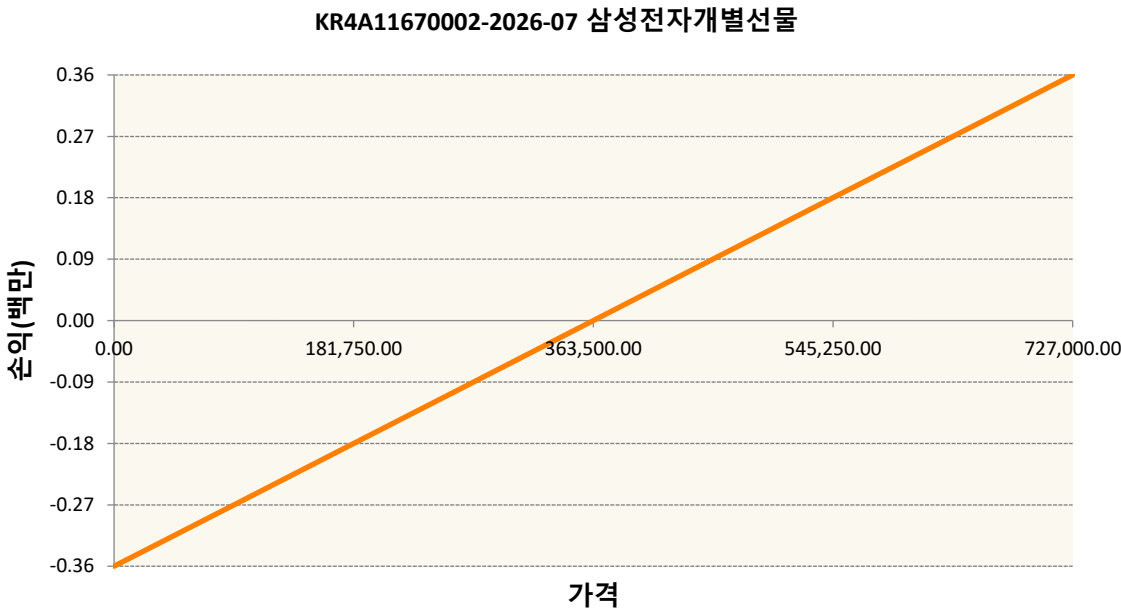
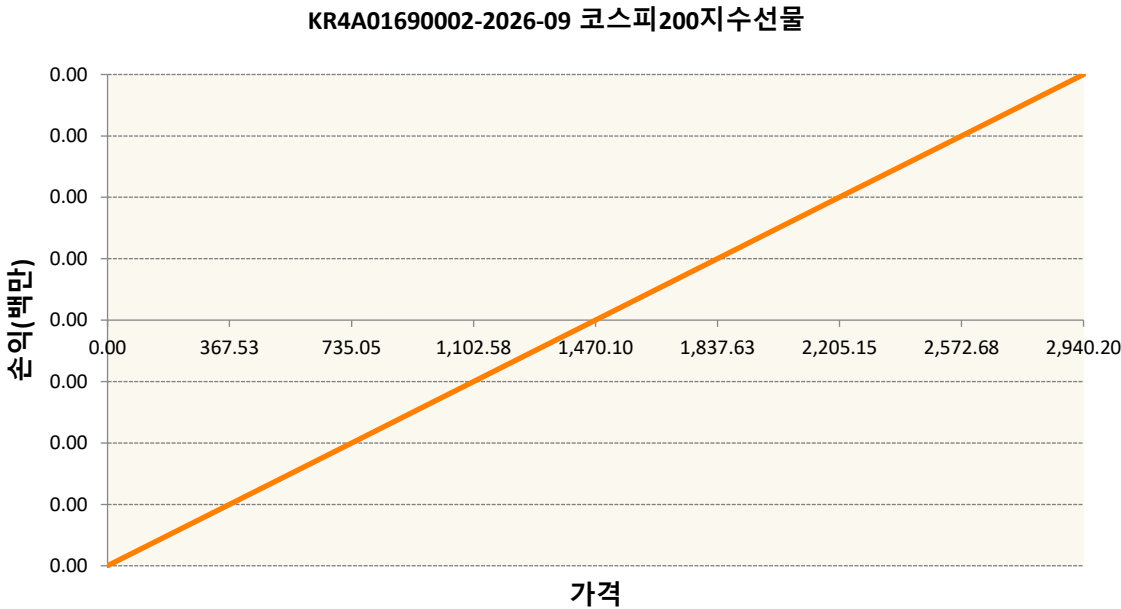
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	360	-360	장내
누계	유가증권	선물	3,453	0	3,453	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					263
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-263	-263	-263	-263	-263	-263	-263
-5.33%	-175	-175	-175	-175	-175	-175	-175
-2.67%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	88	88	88	88	88	88	88
5.33%	175	175	175	175	175	175	175
8.00%	263	263	263	263	263	263	263
KR4A11670002		2026-07 삼성전자개별선물					12
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	8	8	8	8	8	8	8
8.00%	12	12	12	12	12	12	12

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

695

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

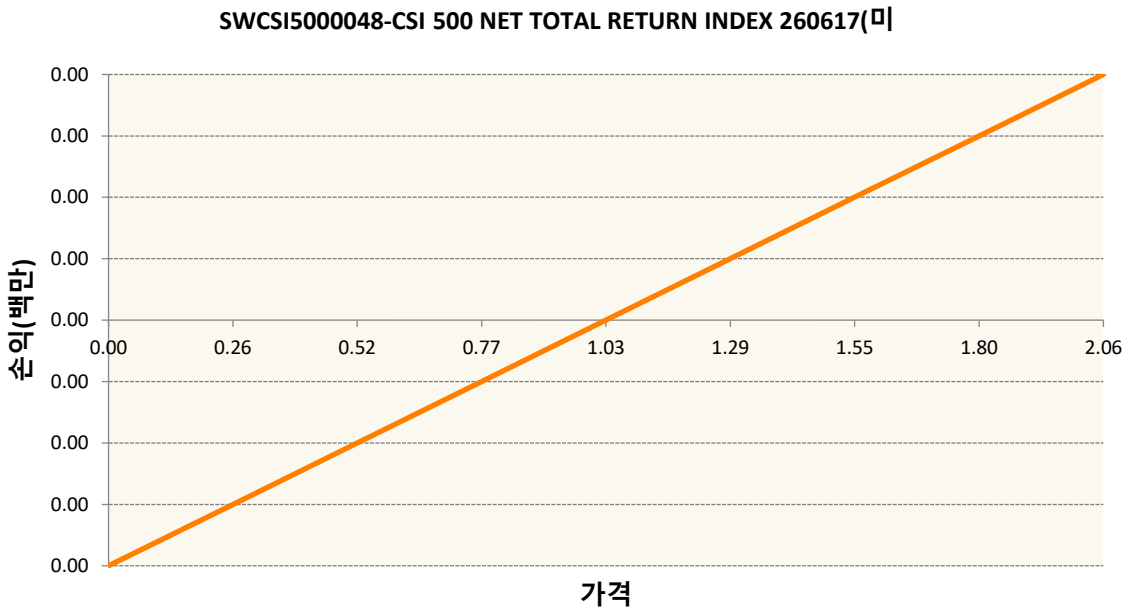
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,970	0	5,970	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

476

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

632

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

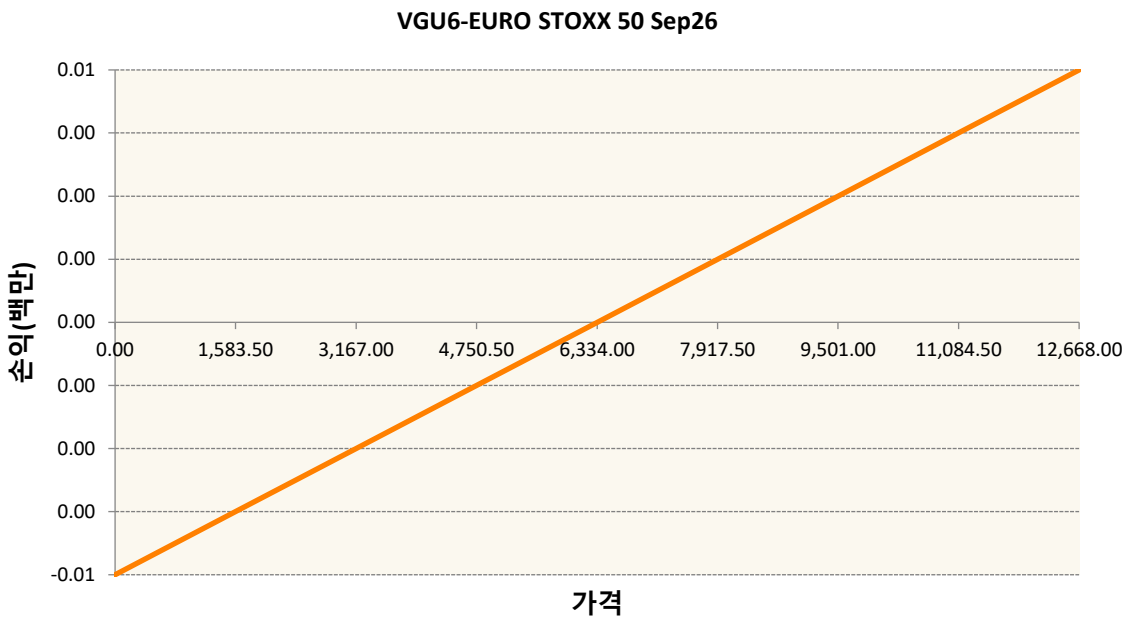
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,001	0	1,001	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	80
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

70

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

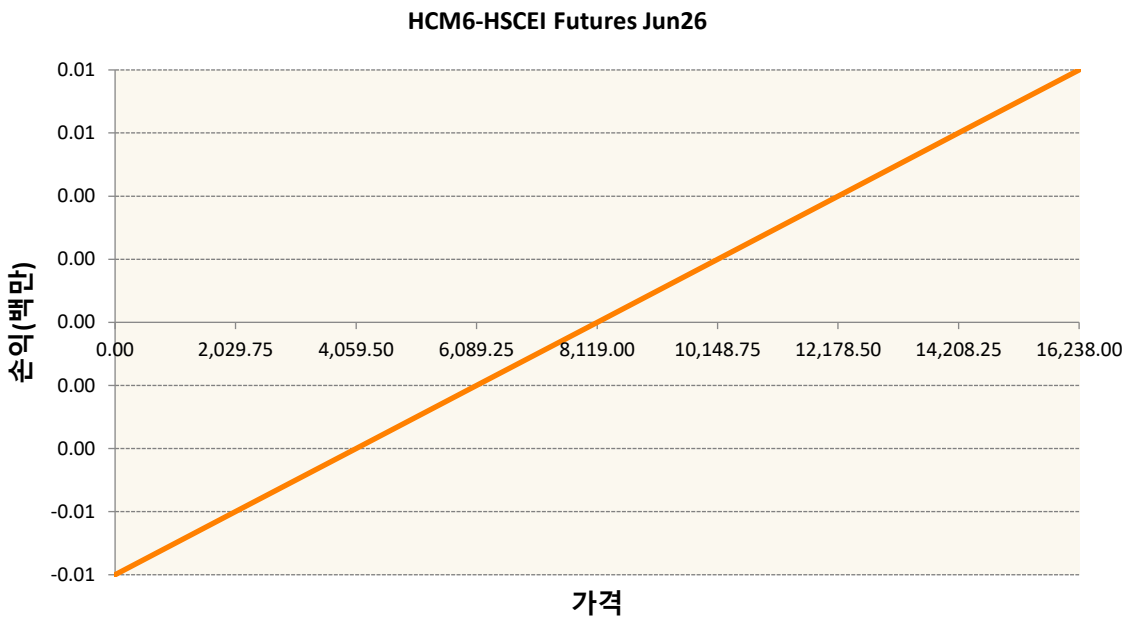
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,324	0	1,324	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	HSCEI Futures Jun26	106
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

127

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

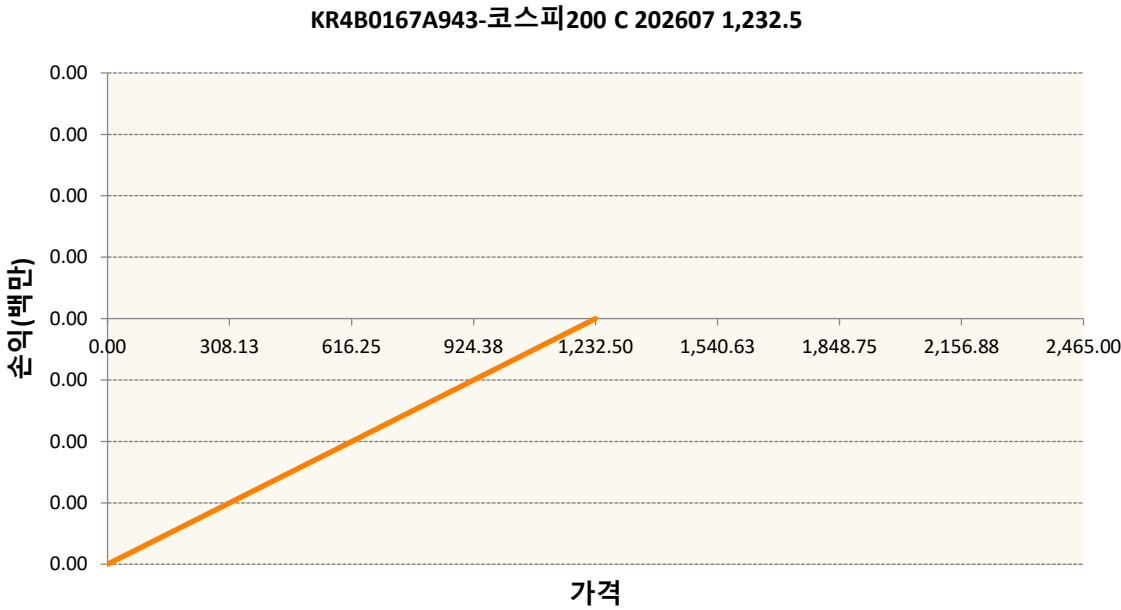
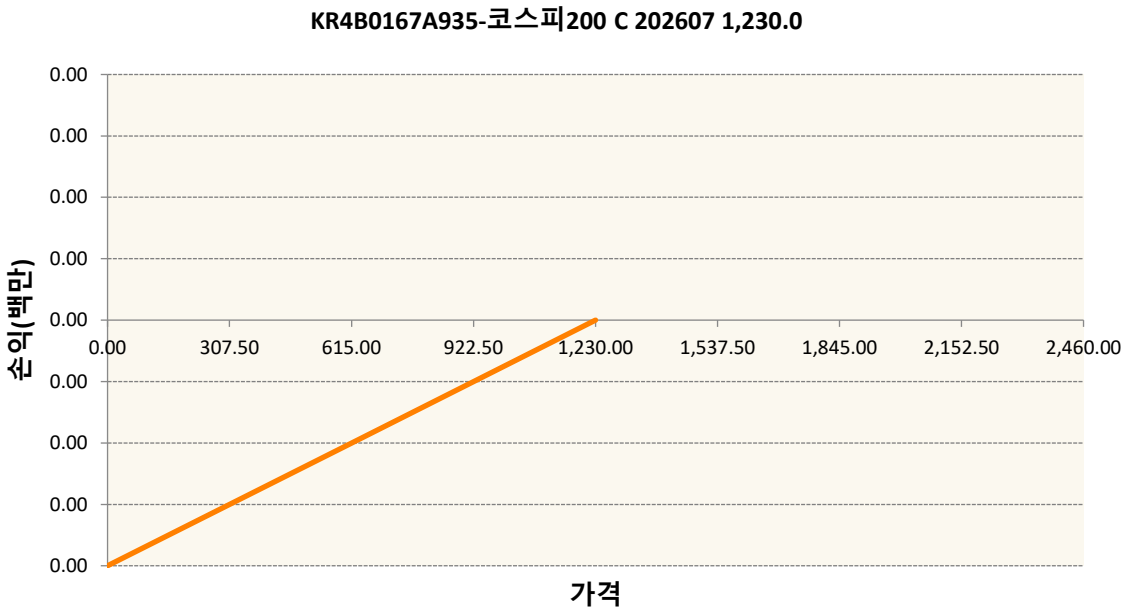
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

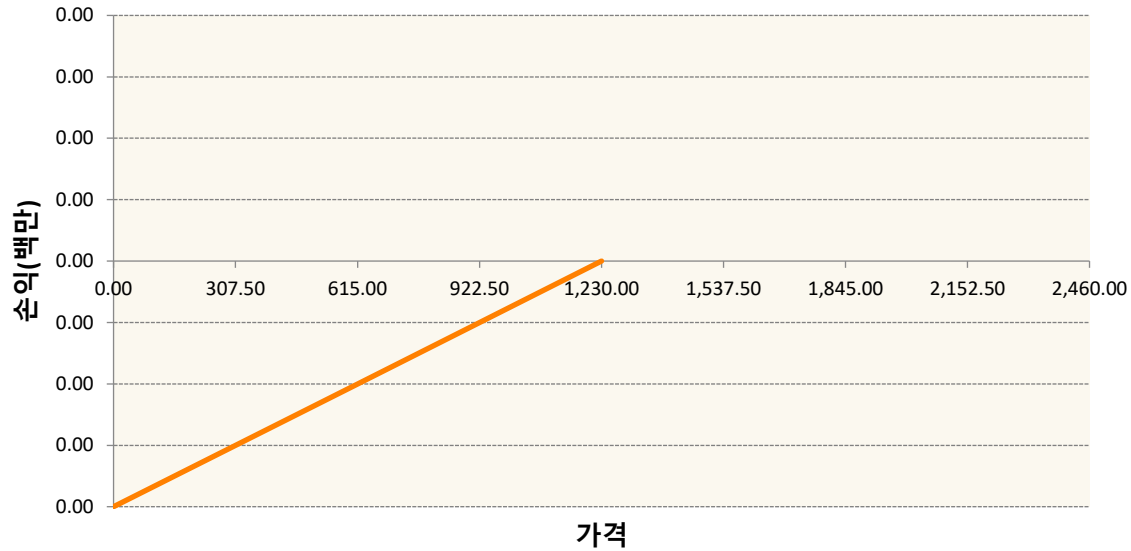
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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								297
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-25	-68	-112	-158	-204	-250	-297	
-5.33%	27	-12	-53	-95	-139	-183	-229	
-2.67%	66	33	-4	-43	-84	-126	-169	
0%	96	67	35	0	-37	-76	-117	
2.67%	118	94	66	35	2	-34	-72	
5.33%	134	114	91	64	34	1	-34	
8.00%	145	129	110	87	60	31	-1	
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5								938
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-81	-217	-357	-499	-644	-790	-938	
-5.33%	83	-39	-168	-301	-439	-579	-721	
-2.67%	209	102	-14	-136	-264	-396	-532	
0%	304	212	110	0	-117	-240	-368	
2.67%	374	298	210	112	5	-108	-227	
5.33%	425	362	288	202	107	4	-105	
8.00%	461	411	349	275	191	99	-2	
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0								273
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-23	-62	-103	-144	-187	-229	-273	
-5.33%	25	-11	-48	-87	-127	-168	-210	
-2.67%	61	30	-4	-39	-77	-115	-155	
0%	88	62	32	0	-34	-70	-107	

2.67%	108	86	61	32	1	-31	-66
5.33%	123	105	83	58	31	1	-31
8.00%	133	119	101	79	55	28	-1

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

(단위:백만원)

1,380

공시일 2026-06-19

기준일 2026-06-18

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	2026-06-19
기준일	2026-06-18

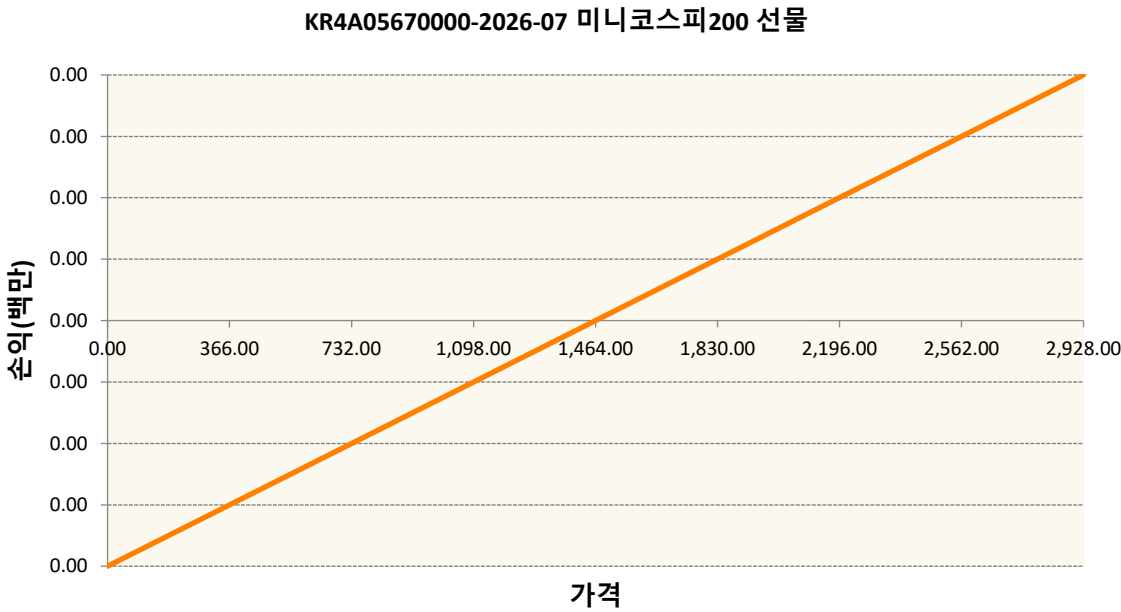
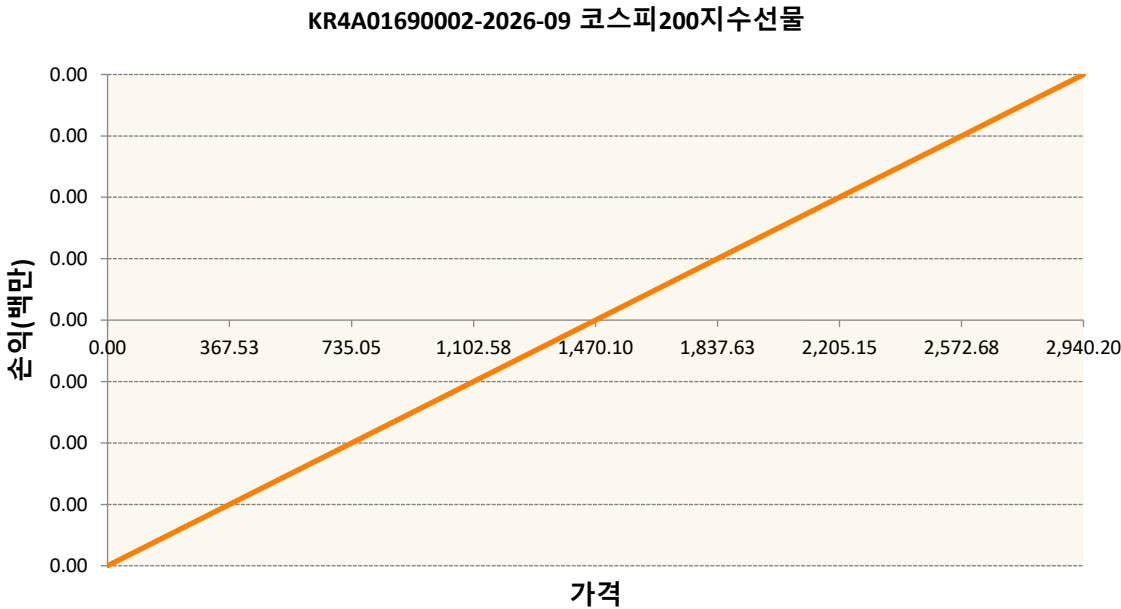
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

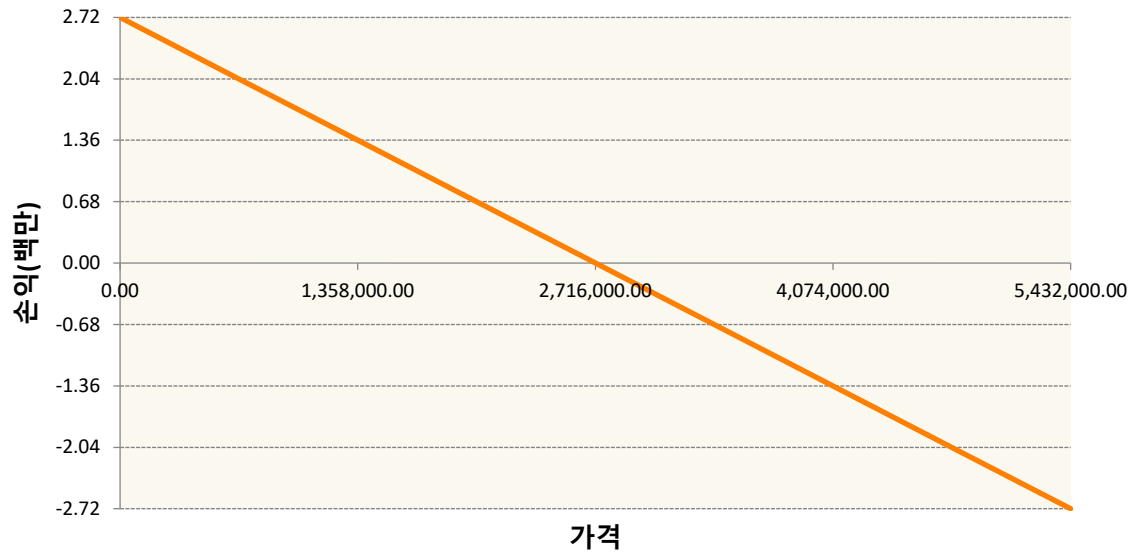
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	271	826	-555	장내
누계	유가증권	선물	2,567	272	2,295	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				88
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88
-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%	88	88	88	88	88	88	88
KR4A05670000			2026-07 미니코스피200 선물				23
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-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%	23	23	23	23	23	23	23
KR4A50670004			2026-07 SK하이닉스개별선물				21
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	21	21	21	21	21	21	21
-5.33%	14	14	14	14	14	14	14
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	354

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

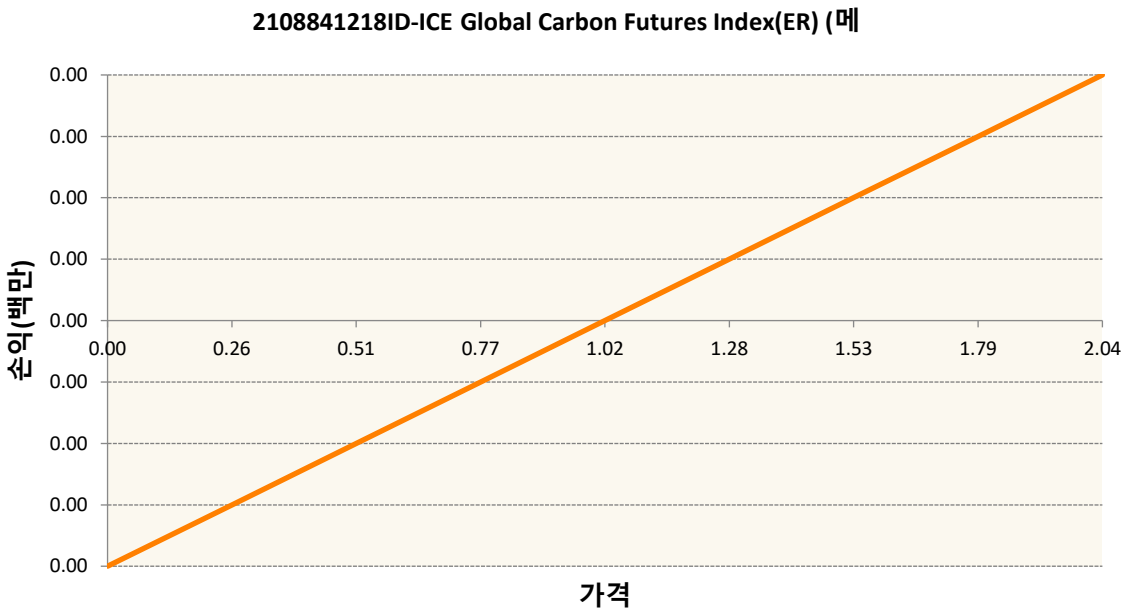
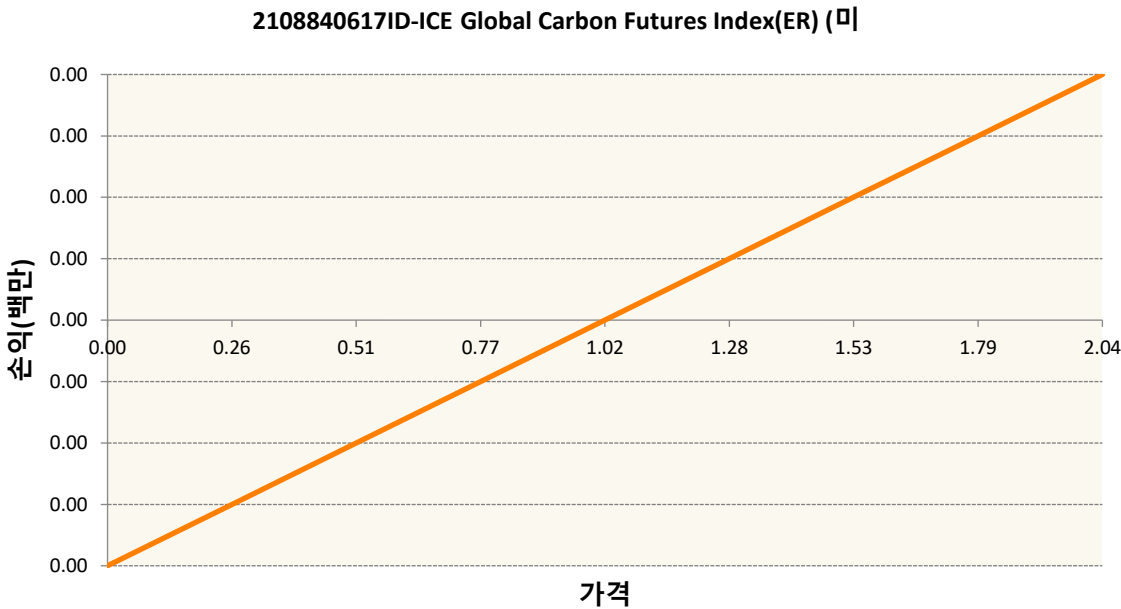
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,648	0	7,648	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840617IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		487
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		123

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	704

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

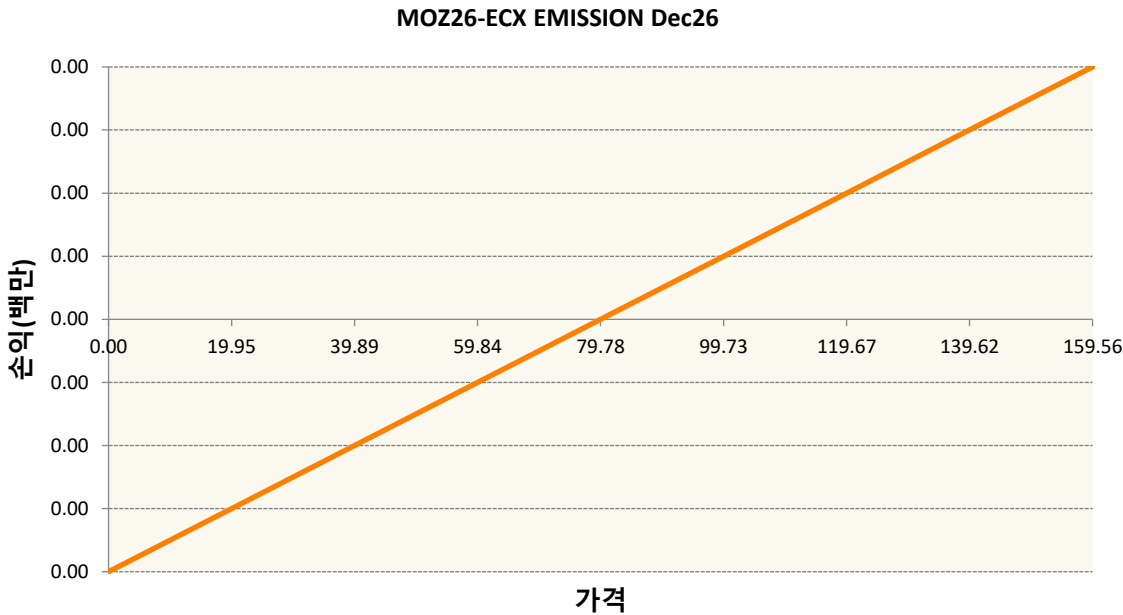
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,149	0	5,149	
누계	통화	선도	0	2,647	-2,647	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	212
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	412

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

(단위:백만원)

703

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

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	1,741	0	1,741	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	8
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	6
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	14
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	6

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

(단위:백만원)

52

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

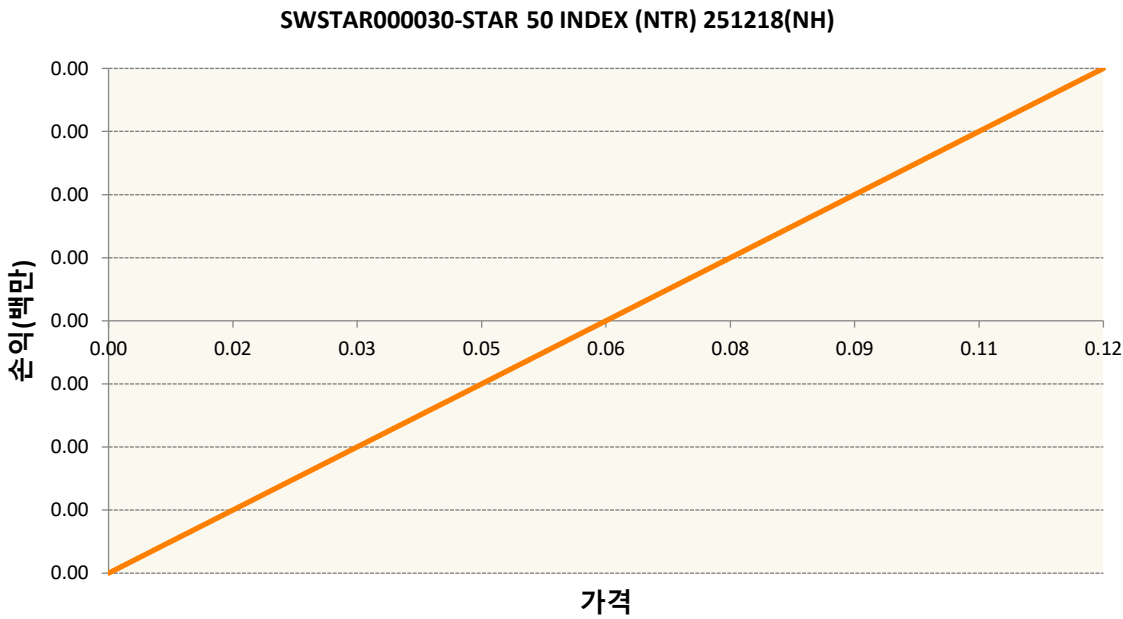
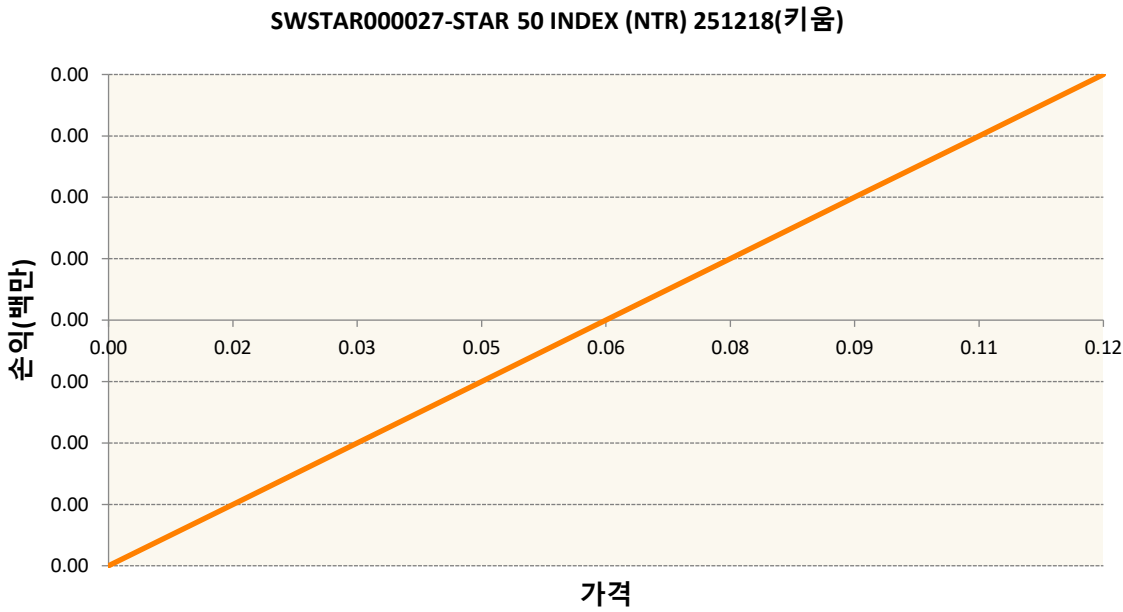
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

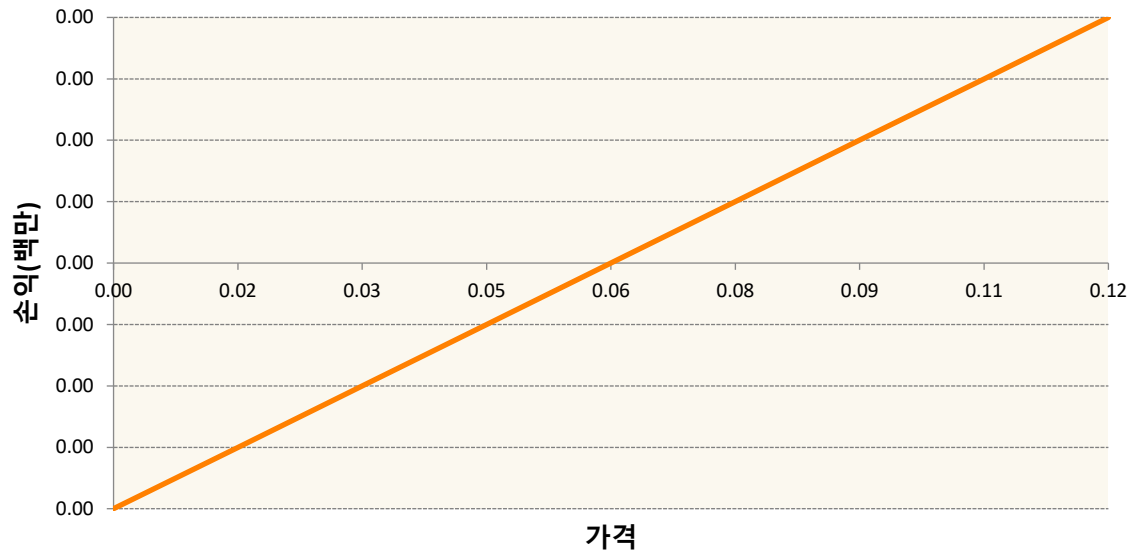
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,025	0	2,025	장외

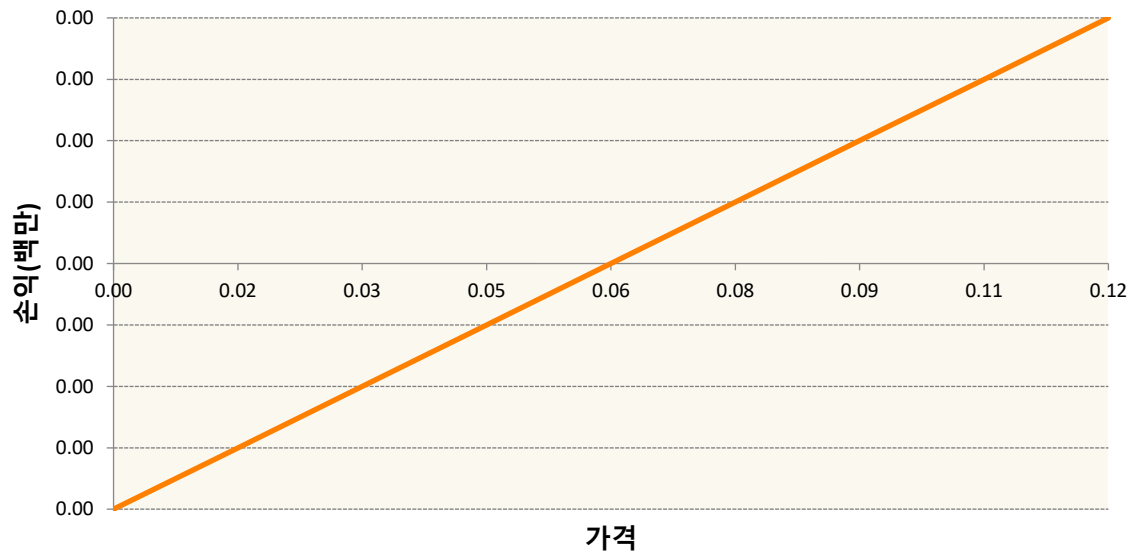
2. 만기시점의 손익구조



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)	6
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	21
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	105
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260617(미래)	39

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

(단위:백만원)

275

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

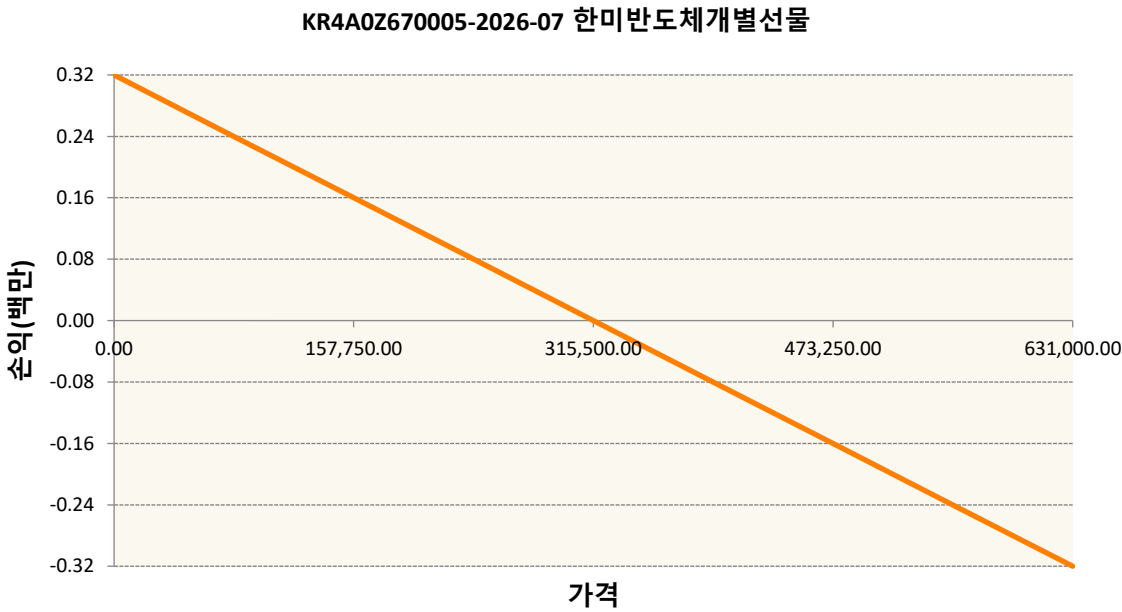
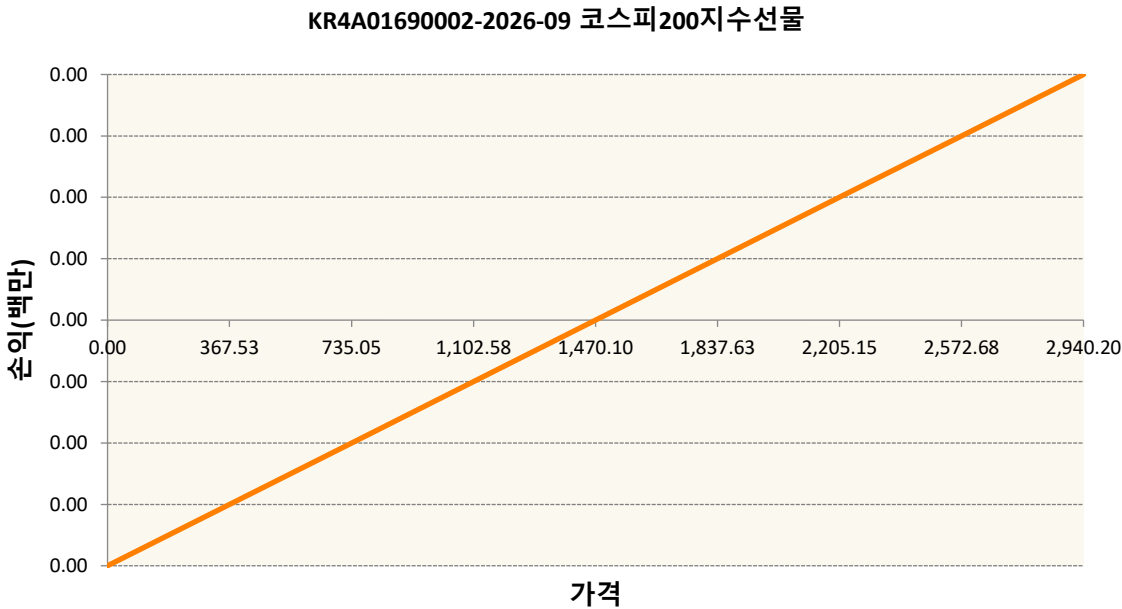
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

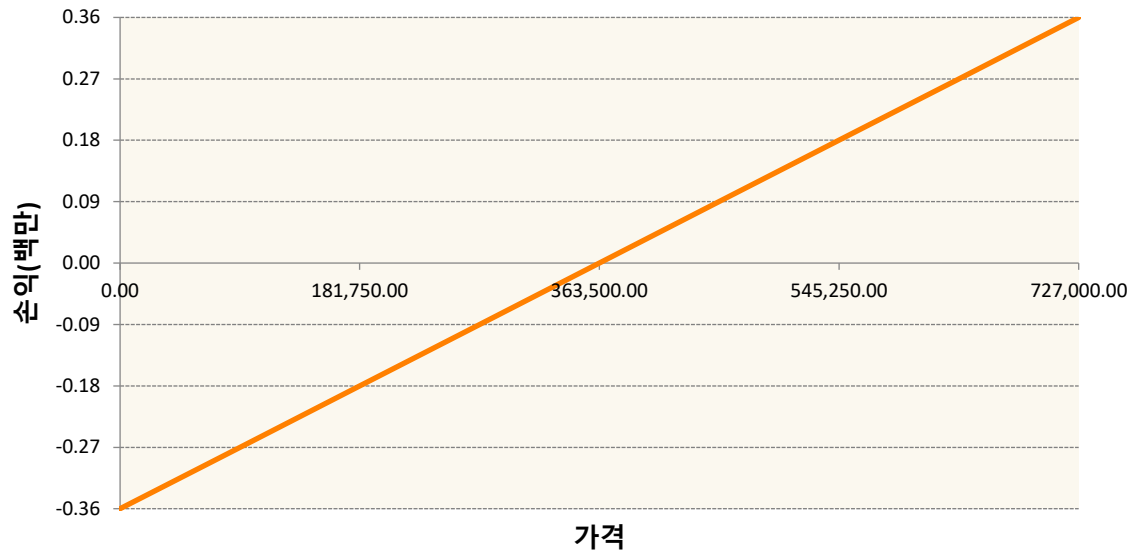
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	8,946	13,204	-4,258	장내
누계	유가증권	선물	21,383	6,285	15,097	장내

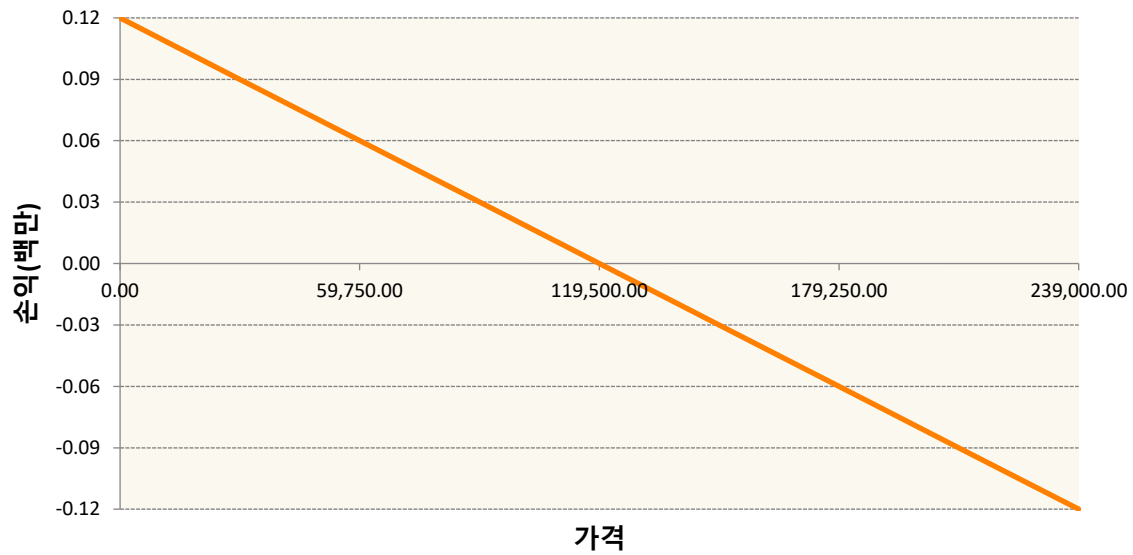
2. 만기시점의 손익구조



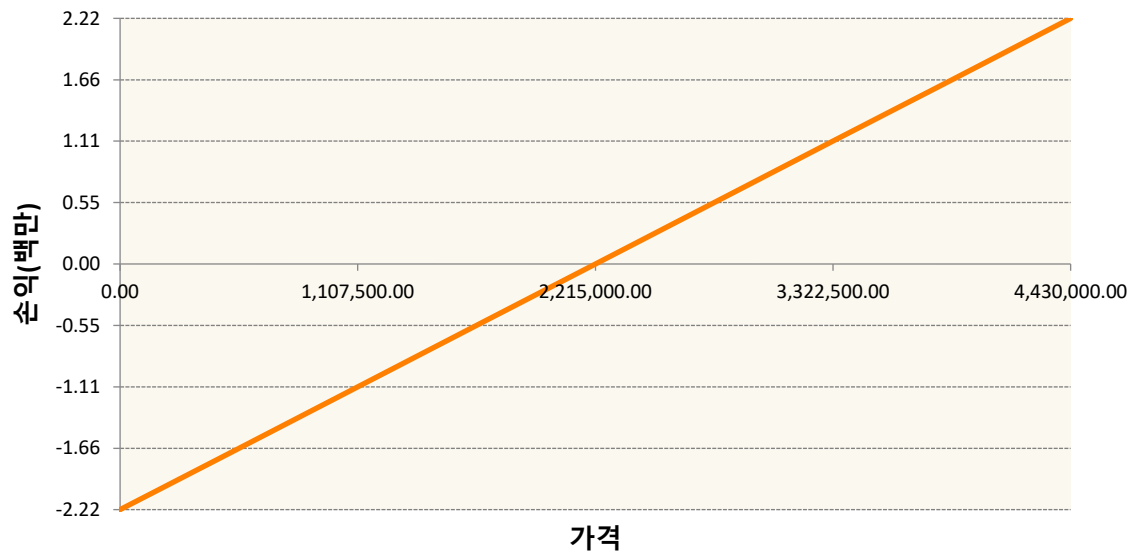
KR4A11670002-2026-07 삼성전자개별선물



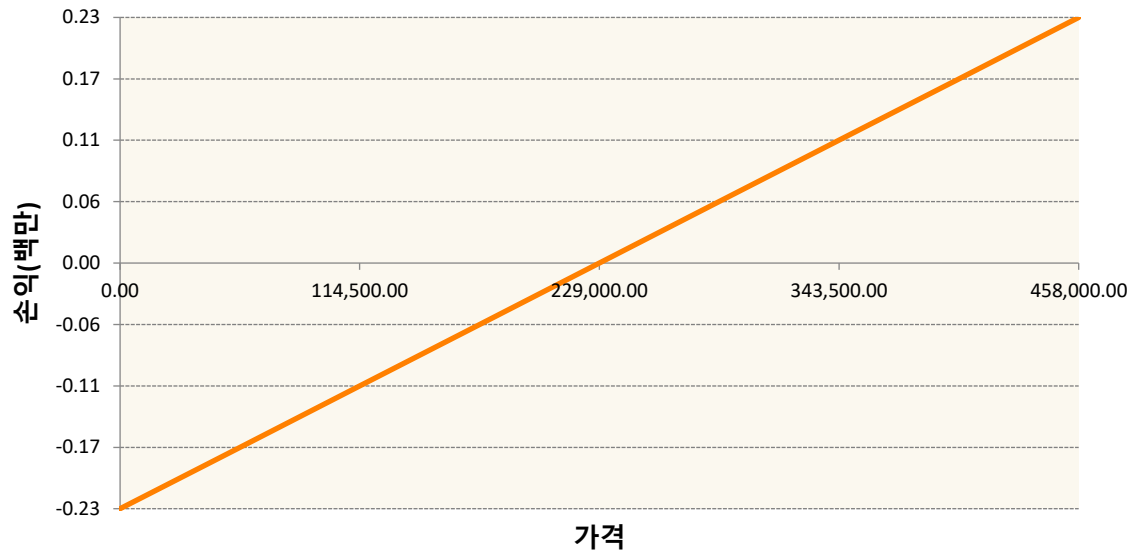
KR4A17670006-2026-07 삼성증권개별선물



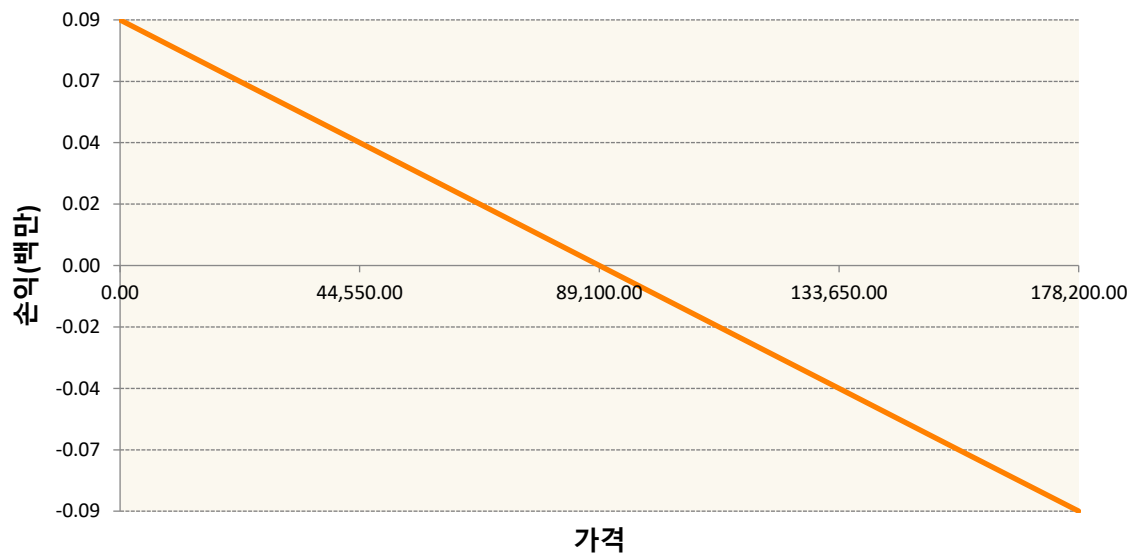
KR4A23670008-2026-07 삼성전기개별선물



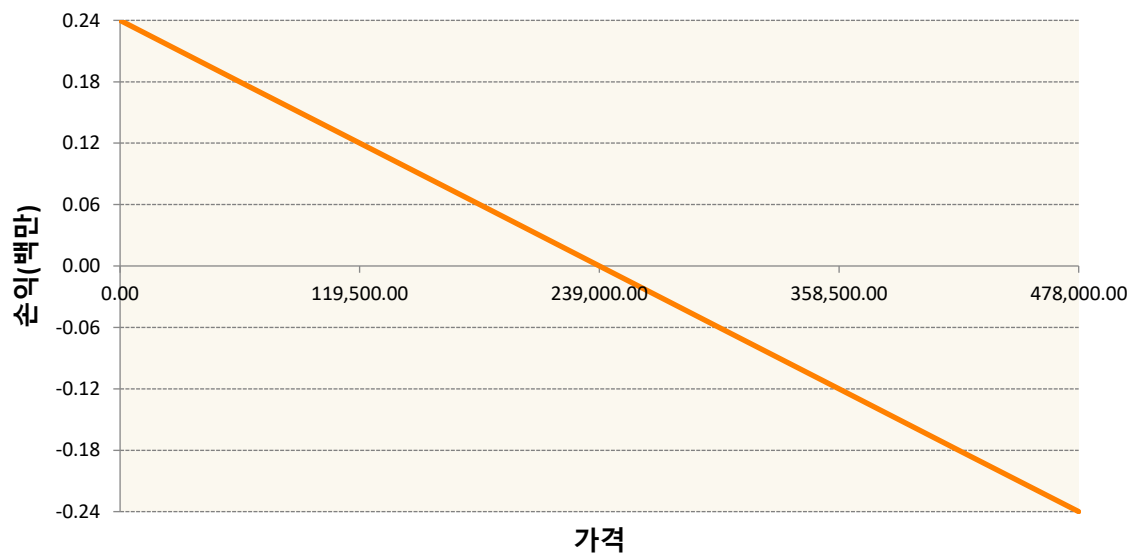
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



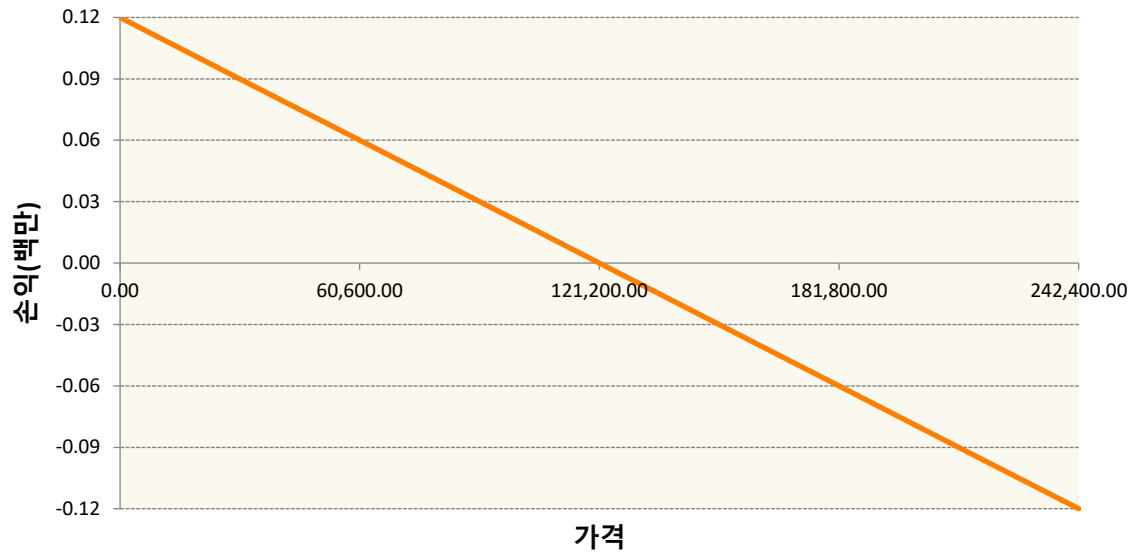
KR4A2K670000-2026-07 LG씨엔에스개별선물



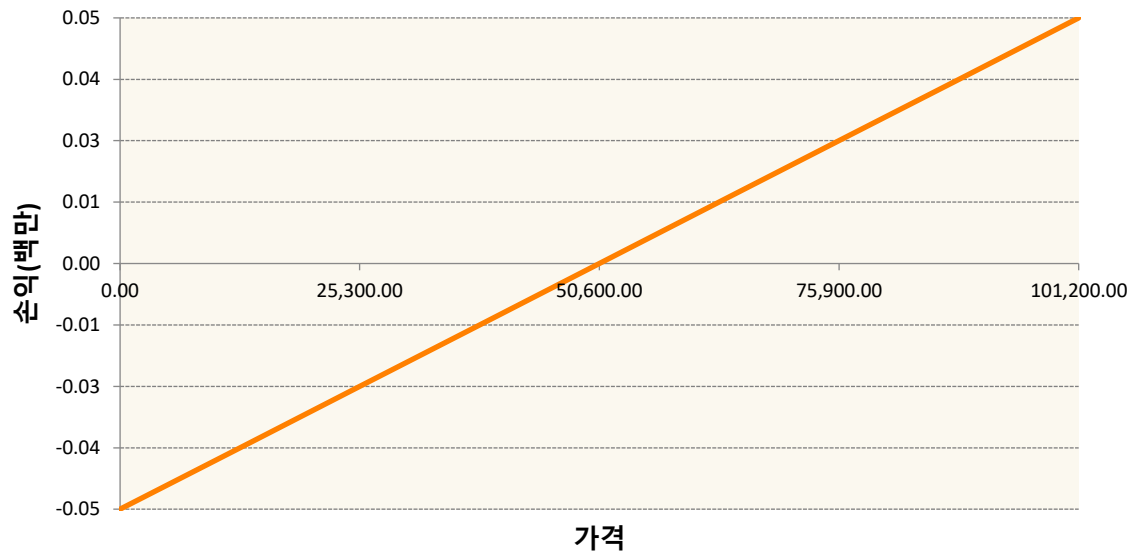
KR4A2L670009-2026-07 산일전기개별선물



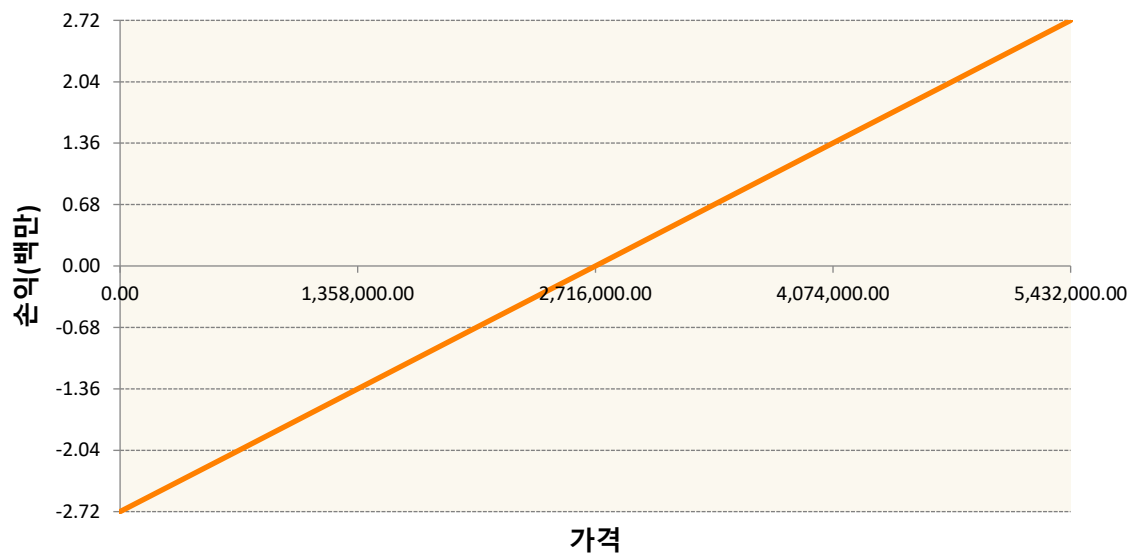
KR4A2P670005-2026-07 이수페타시스개별선물



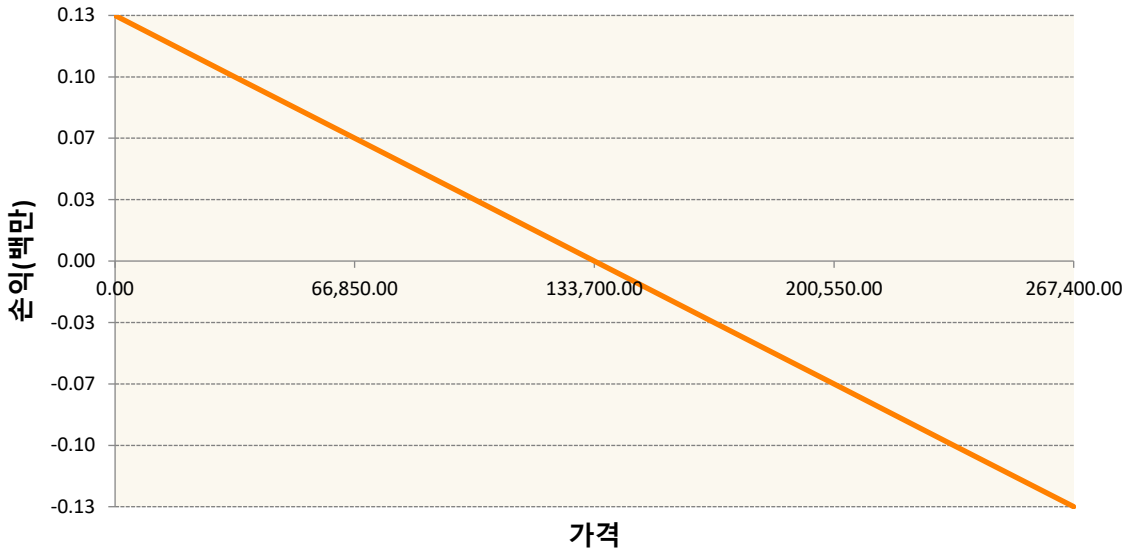
KR4A48670009-2026-07 미래에셋증권개별선물



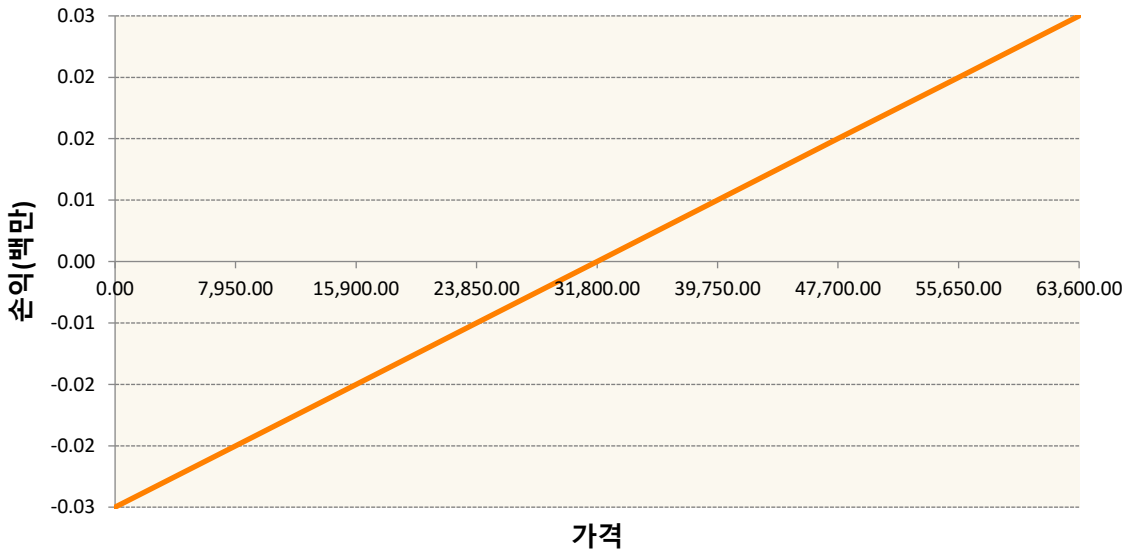
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



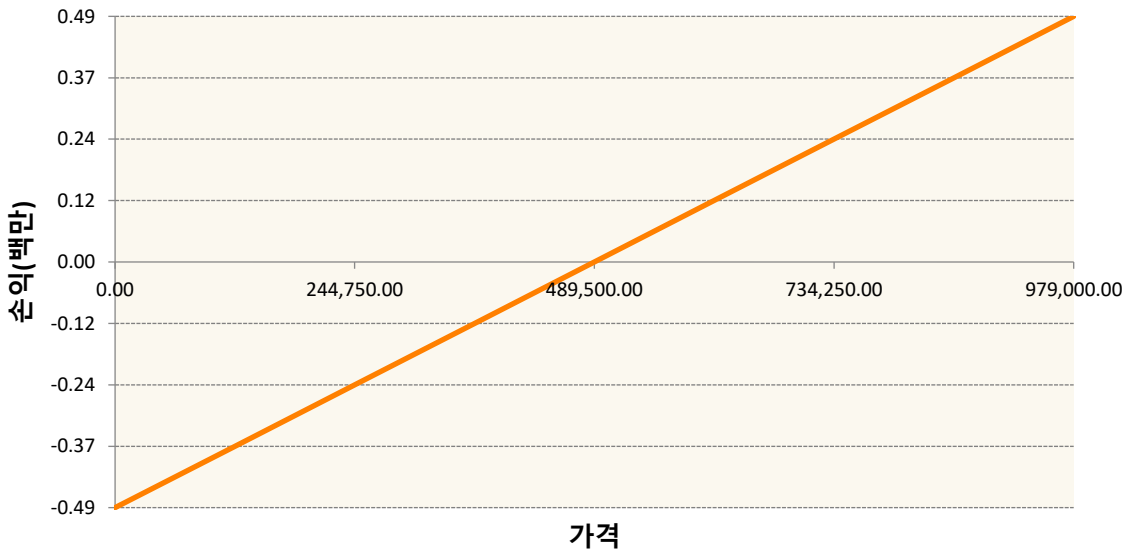
KR4ABN670005-2026-07 현대건설개별선물



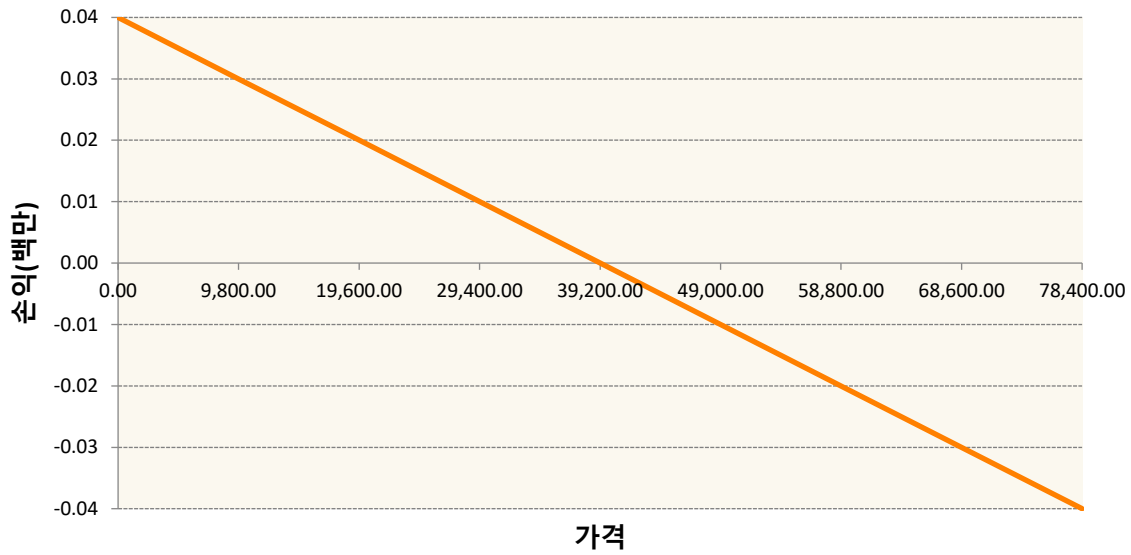
KR4ABZ670001-2026-07 NH투자증권개별선물



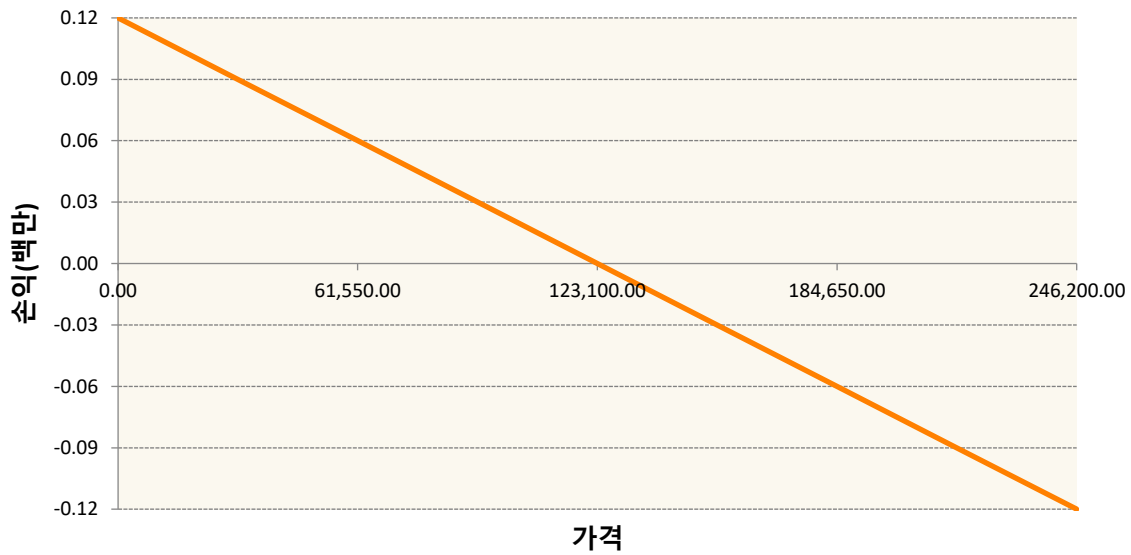
KR4AC8670003-2026-07 삼성물산개별선물



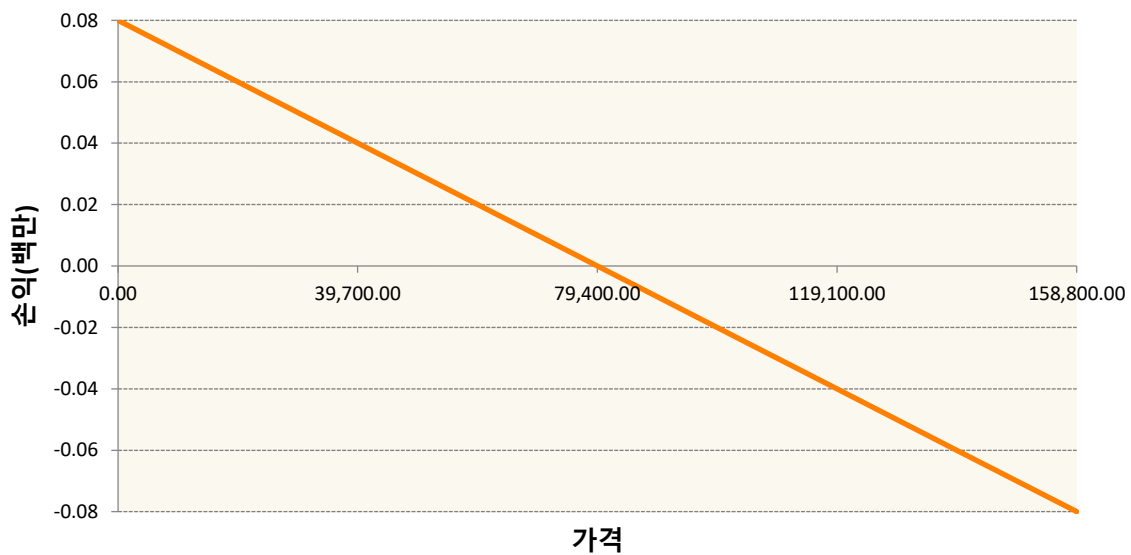
KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



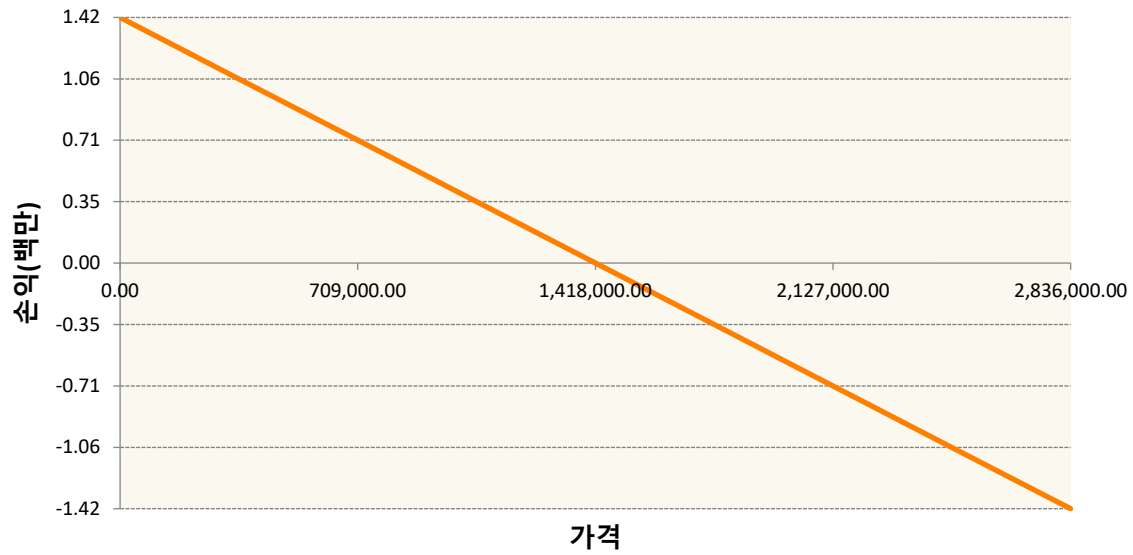
KR4AEJ670008-2026-07 SKC개별선물



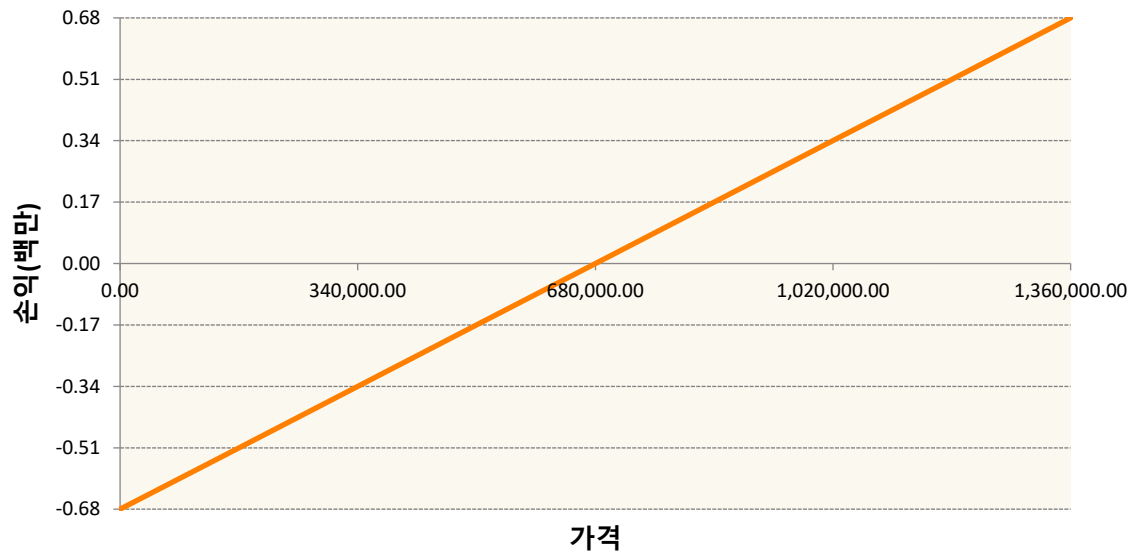
KR4AER670008-2026-07 DL이앤씨개별선물



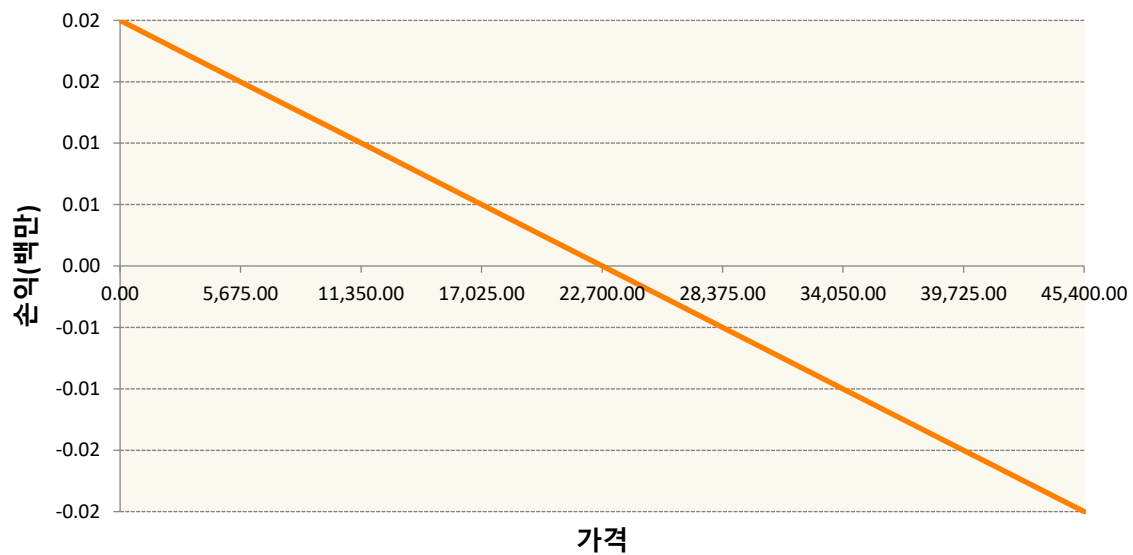
KR4AES670007-2026-07 삼성바이오로직스개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



KR4AFT670005-2026-07 대우건설개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		905	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-905	-905	-905	-905	-905	-905	-905			
-5.33%	-603	-603	-603	-603	-603	-603	-603			
-2.67%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	302	302	302	302	302	302	302			
5.33%	603	603	603	603	603	603	603			
8.00%	905	905	905	905	905	905	905			
KR4A0Z670005							2026-07 한미반도체개별선물		89	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	89	89	89	89	89	89	89			
-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%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89			
KR4A11670002							2026-07 삼성전자개별선물		551	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-551	-551	-551	-551	-551	-551	-551			
-5.33%	-367	-367	-367	-367	-367	-367	-367			
-2.67%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	184	184	184	184	184	184	184			
5.33%	367	367	367	367	367	367	367			
8.00%	551	551	551	551	551	551	551			
KR4A17670006							2026-07 삼성증권개별선물		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			
KR4A23670008							2026-07 삼성전기개별선물		21	
	기초자산의 변동성									

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	21	21	21	21	21	21	21

KR4A24670007 2026-07 LG전자개별선물 18

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-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%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	18	18	18	18	18	18	18

KR4A2K670000 2026-07 LG씨엔에스개별선물 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

KR4A2L670009 2026-07 산일전기개별선물 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%	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%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26

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%	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

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	107
--------------	--------------------	-----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

KR4ABN670005	2026-07 현대건설개별선물	61
--------------	------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	61	61	61	61	61	61
-5.33%	40	40	40	40	40	40	40
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61

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%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
-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%	43	43	43	43	43	43	43
8.00%	65	65	65	65	65	65	65
KR4ACF670004 2026-07 카카오개별선물							100

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

KR4AEJ670008 2026-07 SKC개별선물							22
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	22	22	22	22	22	22	22
-5.33%	15	15	15	15	15	15	15
-2.67%	7	7	7	7	7	7	7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
5.33%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
8.00%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22

KR4AER670008 2026-07 DL이앤씨개별선물							16
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	16	16	16	16	16	16	16
-5.33%	10	10	10	10	10	10	10
-2.67%	5	5	5	5	5	5	5
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
5.33%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
8.00%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16

KR4AES670007 2026-07 삼성바이오로직스개별선물							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%	43	43	43	43	43	43	43
-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%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
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							31
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	31	31	31	31	31	31	31
-5.33%	21	21	21	21	21	21	21
-2.67%	10	10	10	10	10	10	10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
5.33%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
8.00%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31

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

(단위:백만원)

5,222

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

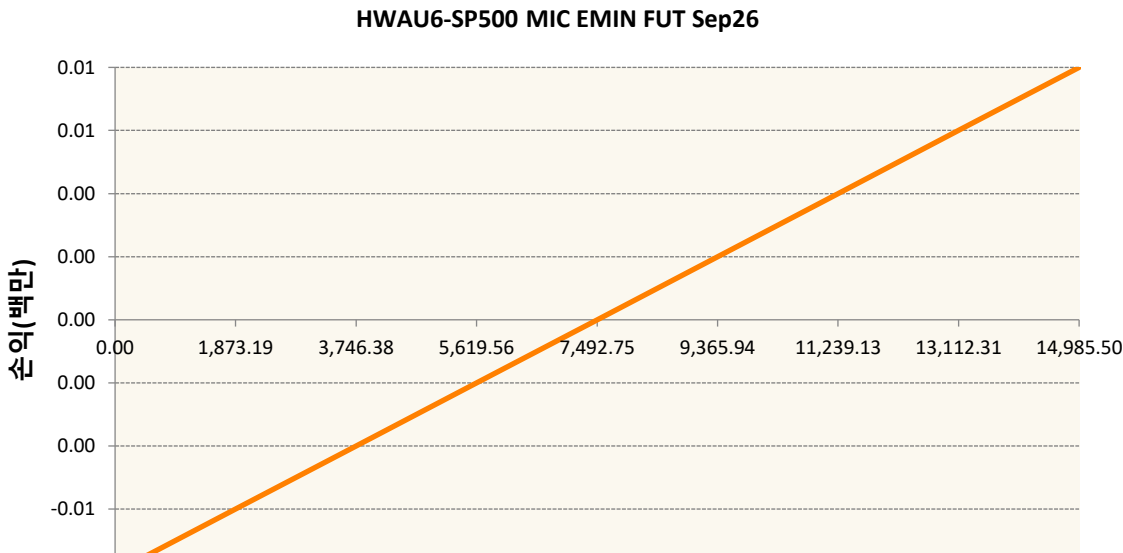
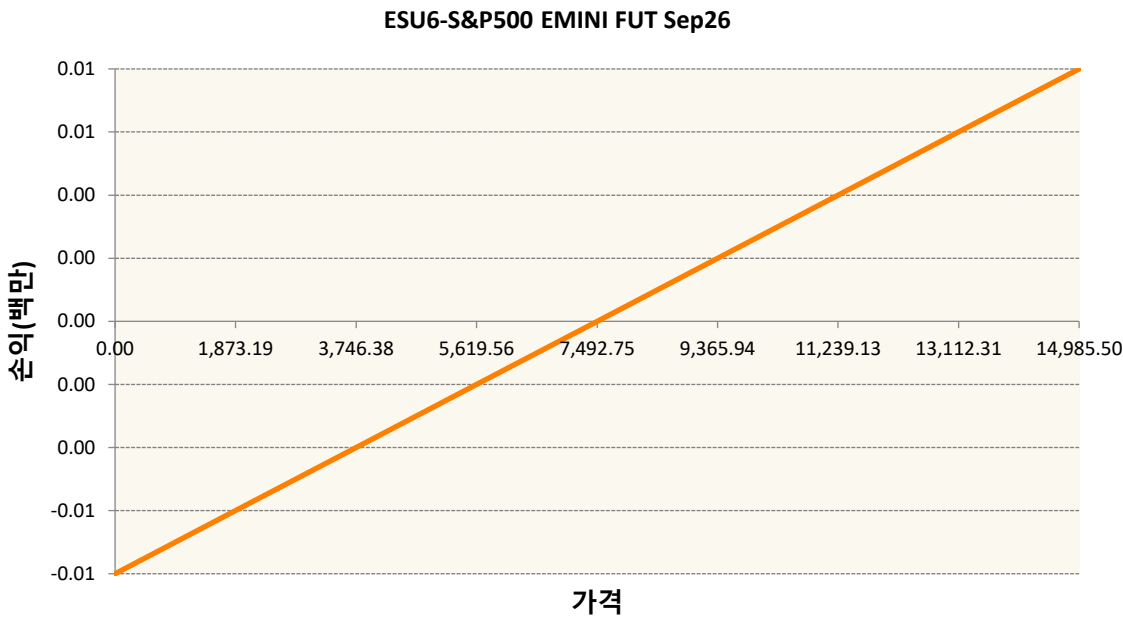
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

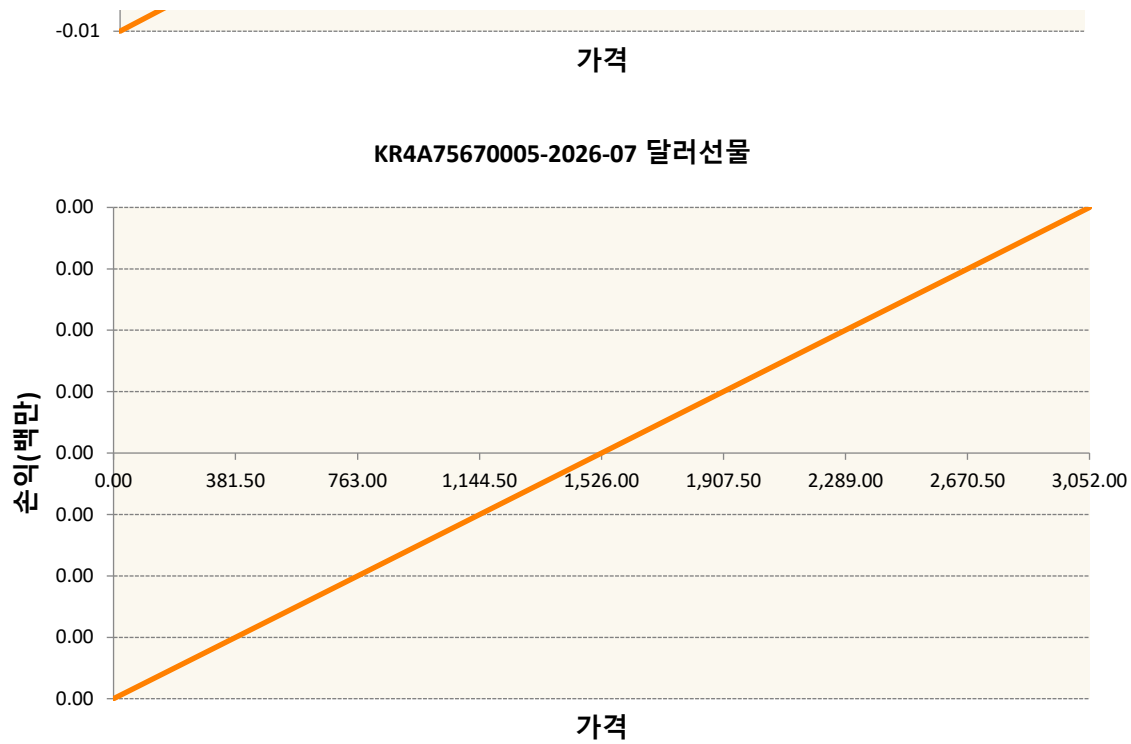
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	61,720	0	61,720	
누계	지수	선물	283	0	283	장내
누계	통화	선물	10,835	0	10,835	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		4,938
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		23
KR4A756700 2026-07 달러선물			867

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,286

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

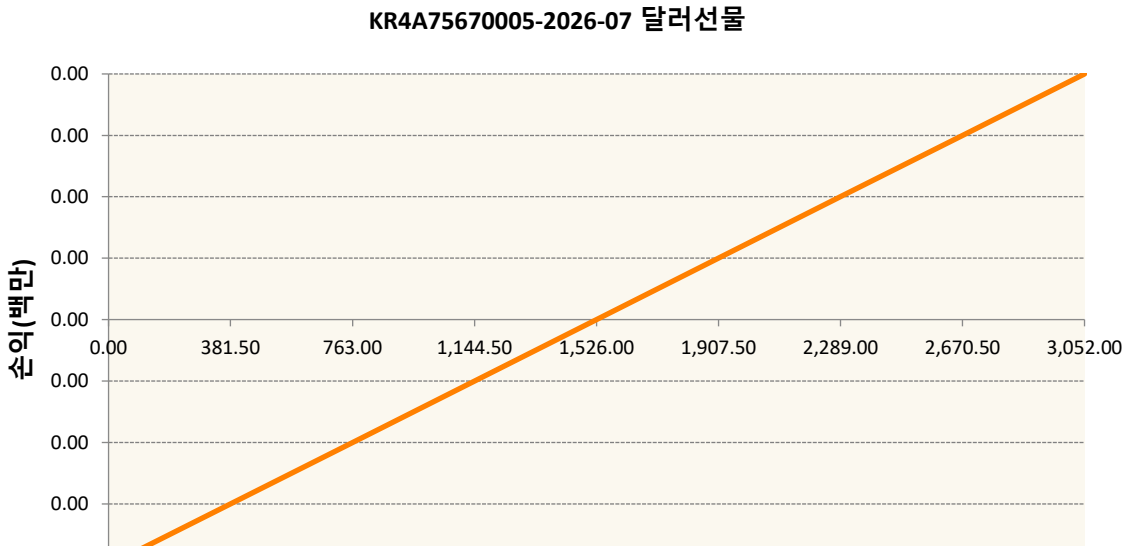
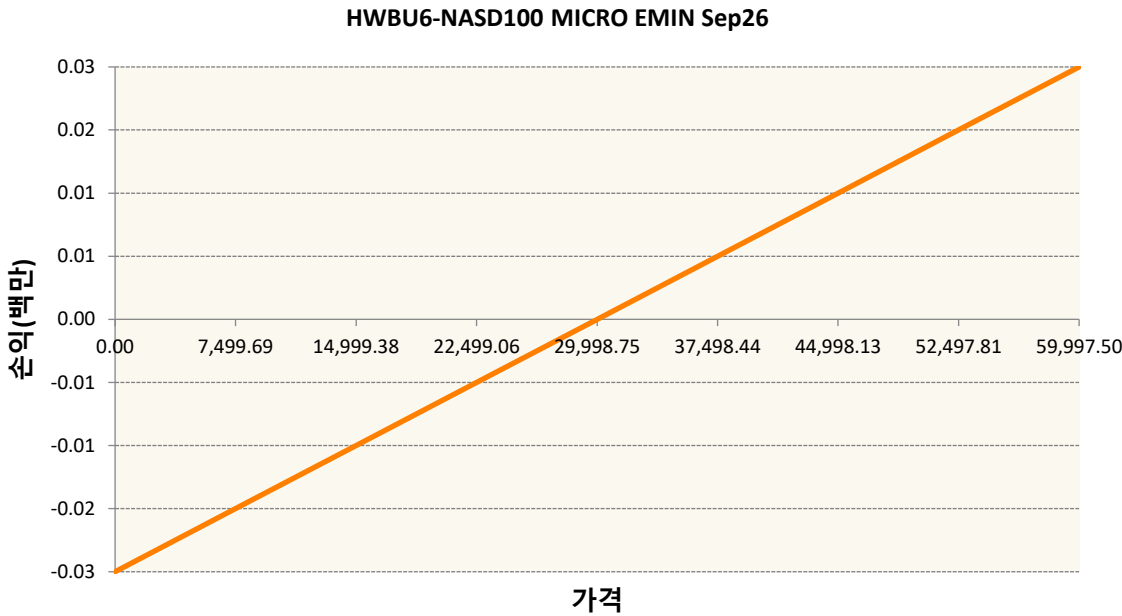
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

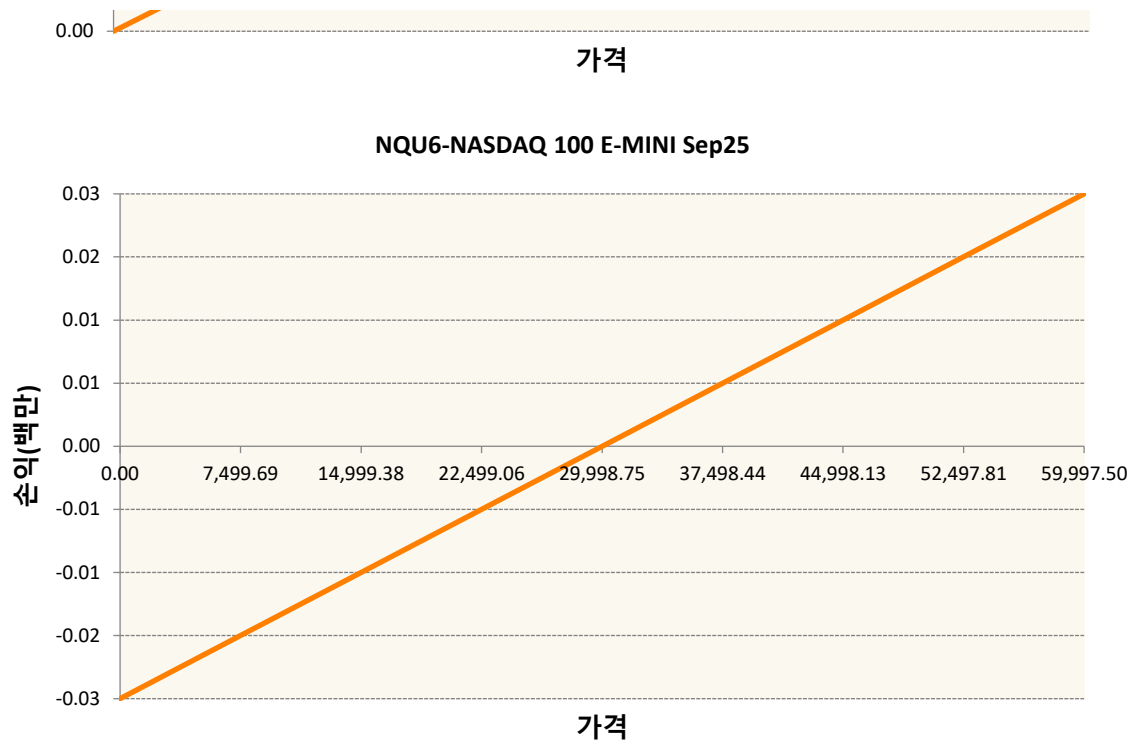
1. 계약금액

(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	272	0	272	장내
누계	지수	선물	30,829	0	30,829	
누계	통화	선물	3,983	0	3,983	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		22
KR4A756700	2026-07 달러선물		319
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,466

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,781

공시일	2026-06-19
기준일	2026-06-18

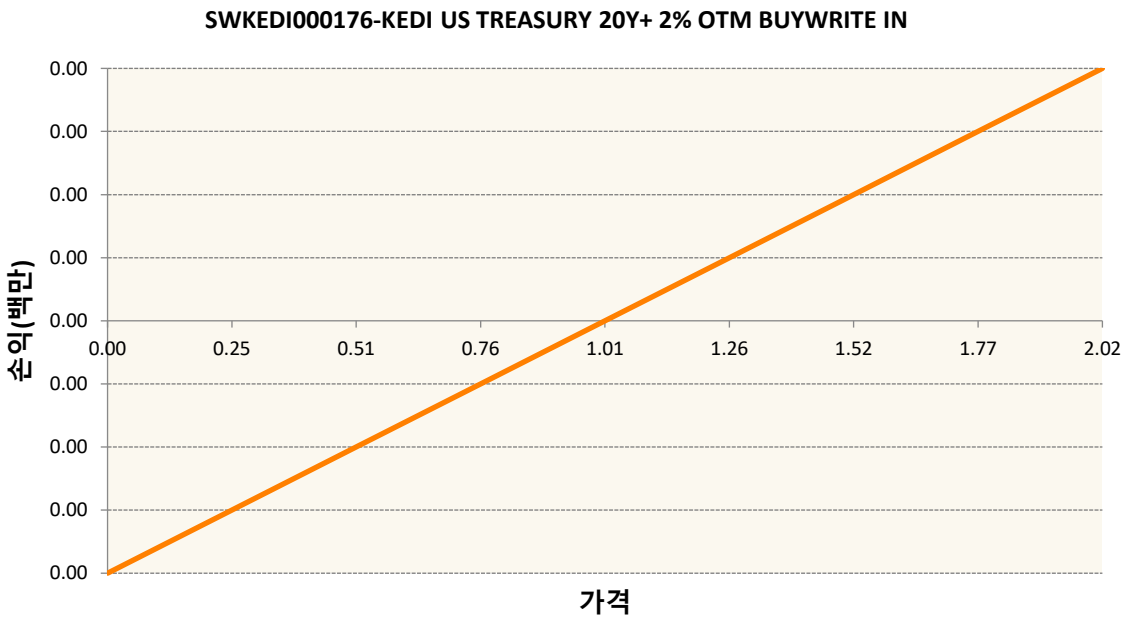
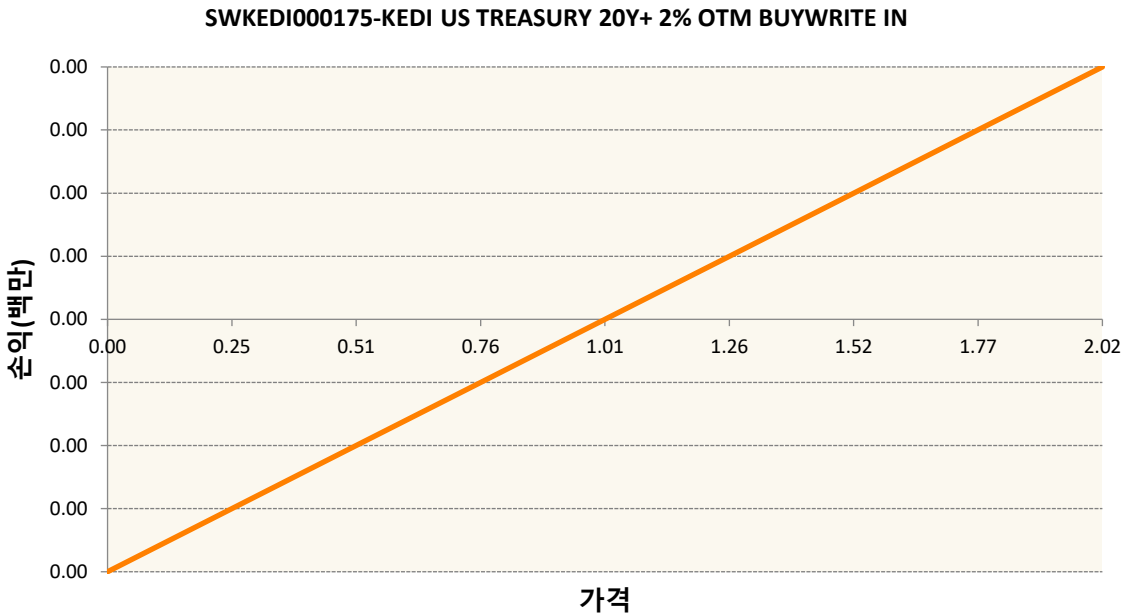
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

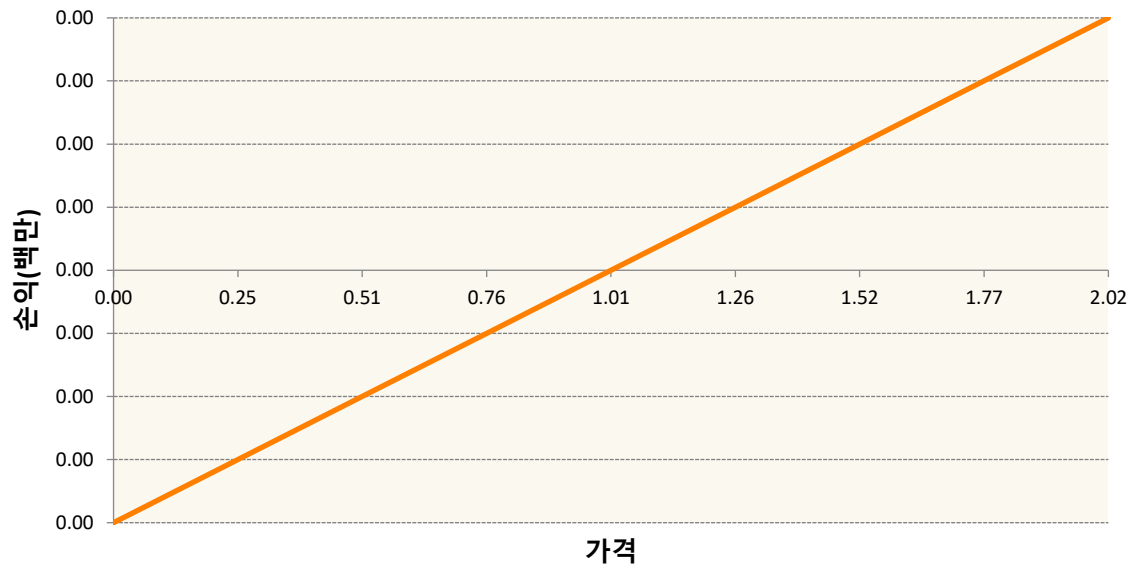
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	324,220	0	324,220	장외

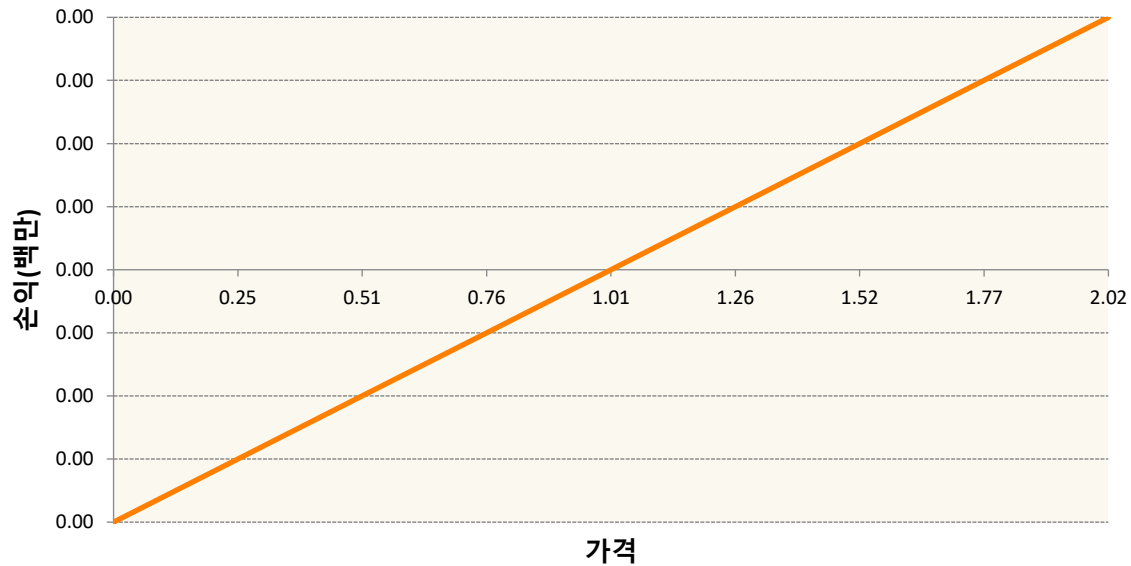
2. 만기시점의 손익구조



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	8,512
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,257
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,240
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,026

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

(단위:백만원)

10,957