

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

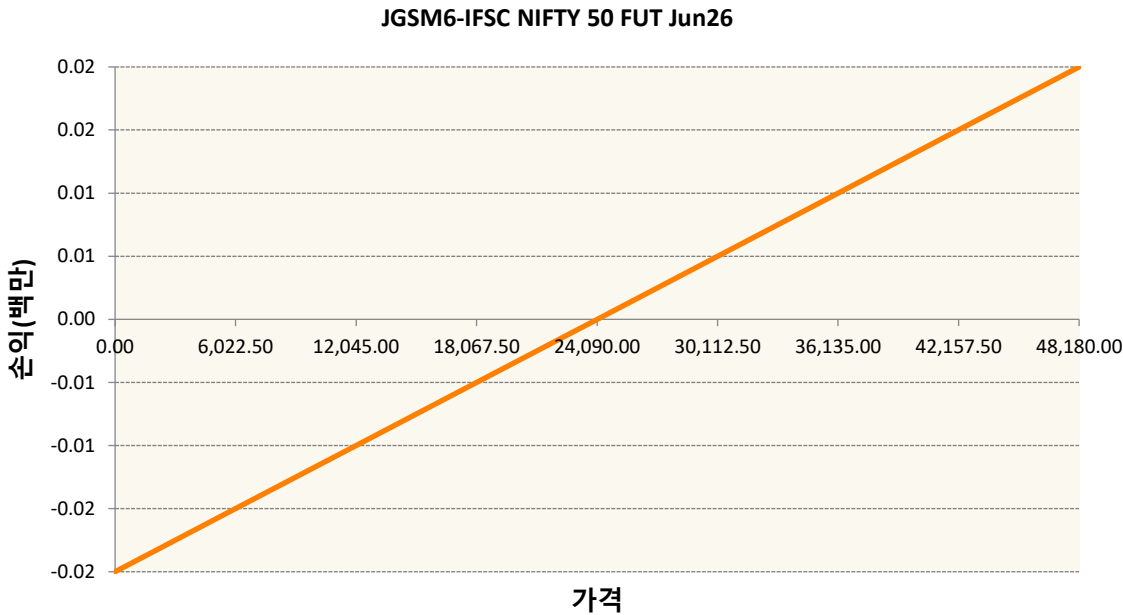
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	362	0	362	

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	2026-06-23
기준일	2026-06-22

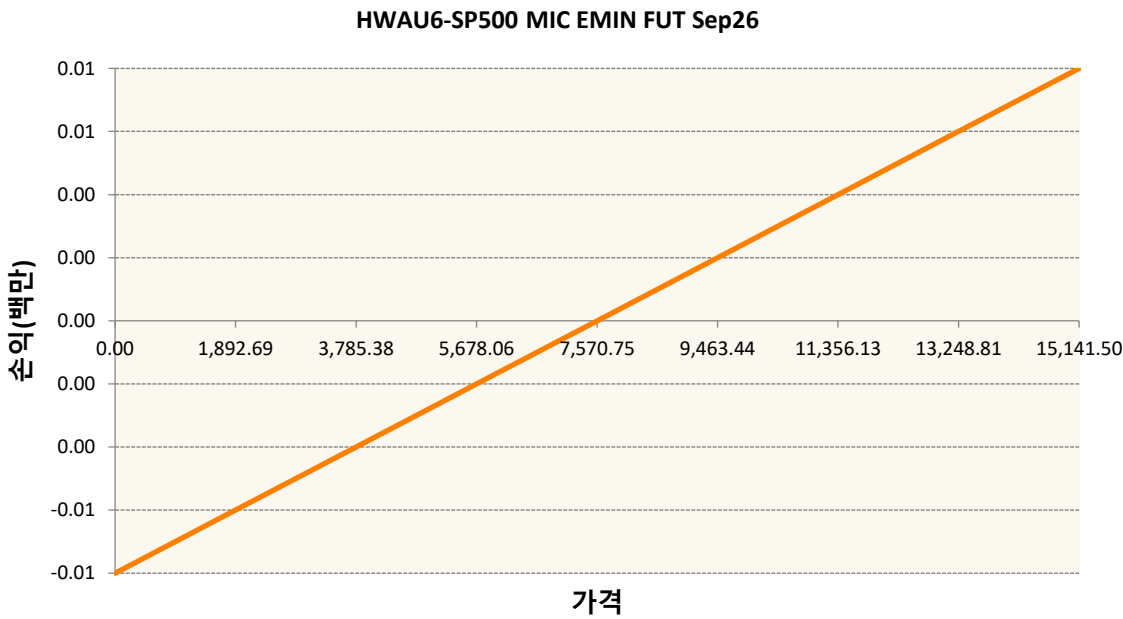
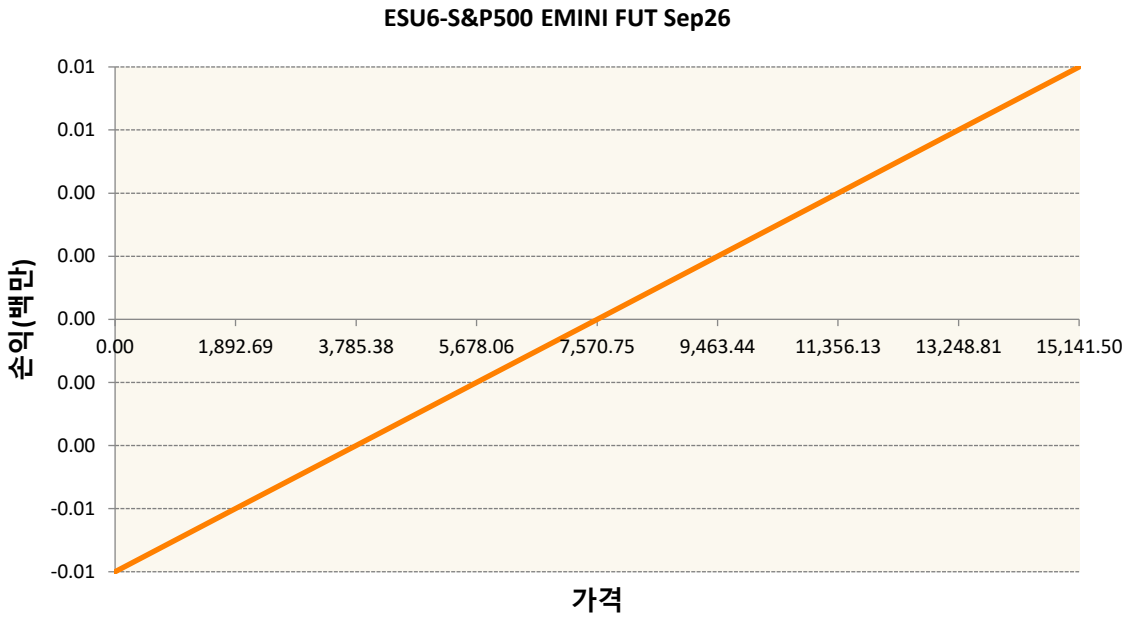
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	578	0	578	
누계	지수	선물	58	0	58	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	2026-06-23
기준일	2026-06-22

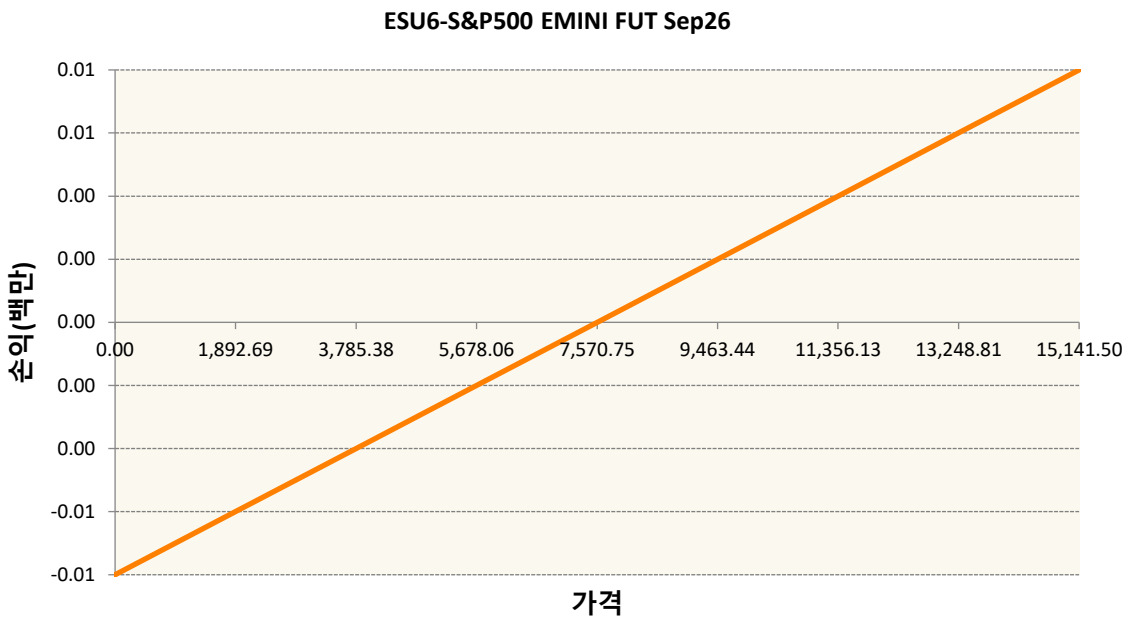
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,145	0	1,145	

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	2026-06-23
기준일	2026-06-22

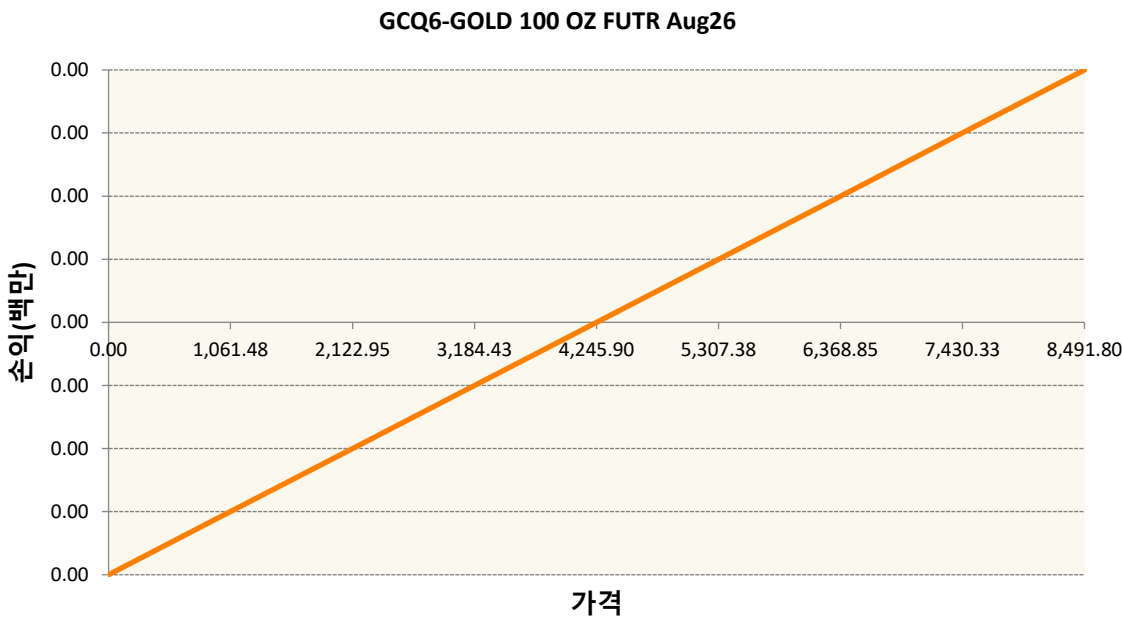
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	5,091	0	5,091	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 06/26/26 C400 EQUITY	2
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	407

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

(단위:백만원)

743

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

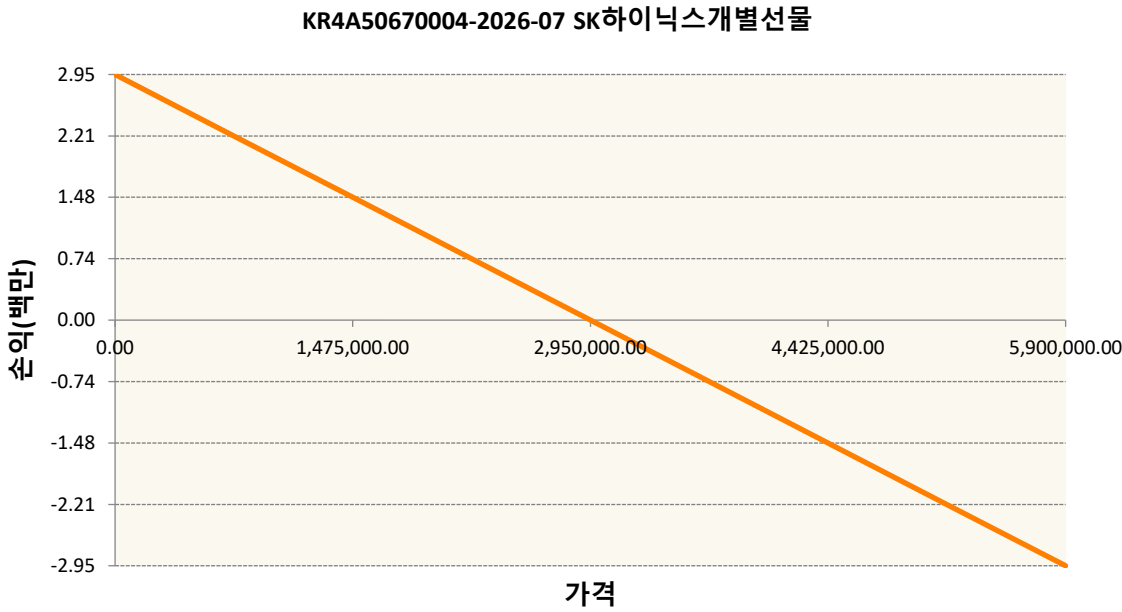
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	23,600	-23,600	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRCUS' PLTR US 06/26/26 C140 EQUITY	29
AOPLTRPUS' PLTR US 06/26/26 P140 EQUITY	41
KR4A506700 2026-07 SK하이닉스개별선물	1,888

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

(단위:백만원)

210

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

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)

AOTLTUSCC(TLT US 06/26/26 C87 EQUITY

3

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

(단위:백만원)

10

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

(단위:백만원)

18,375

공시일 2026-06-23

기준일 2026-06-22

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	2026-06-23
기준일	2026-06-22

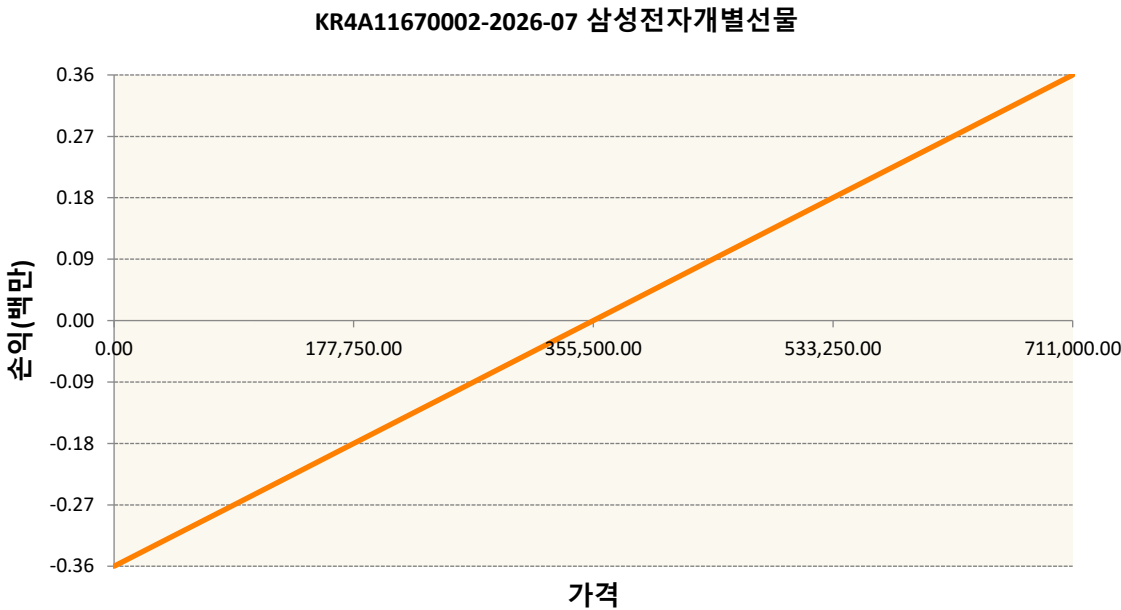
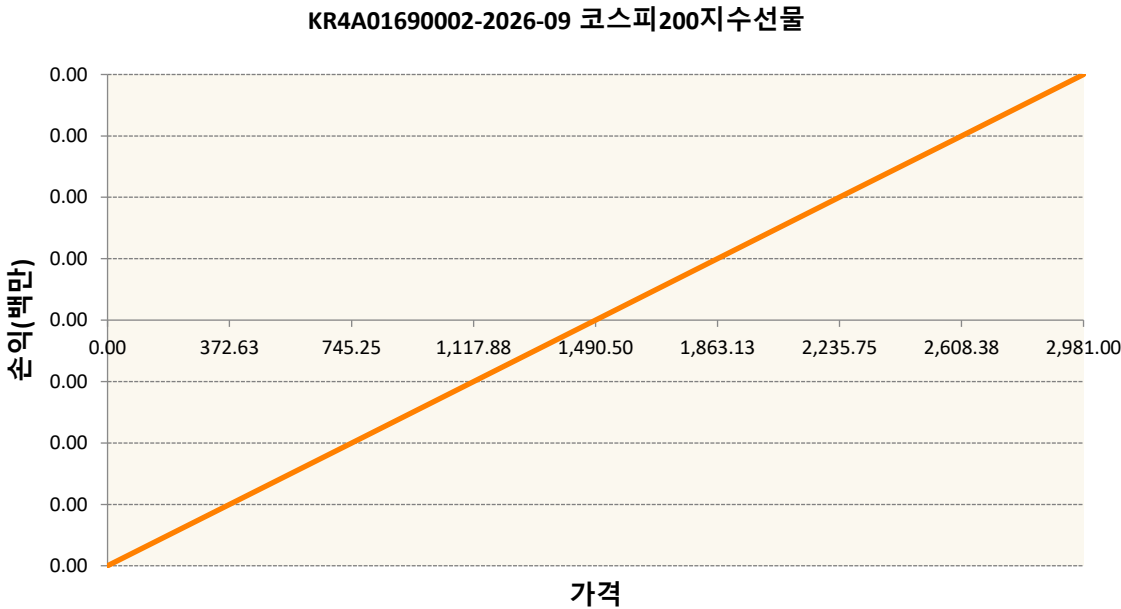
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	54,015	-54,015	장내
누계	유가증권	선물	28,885	0	28,885	장내
누계	유가증권	옵션	0	52,487	-52,487	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), has values: 0.00, 369.38, 738.75, 1,108.13, 1,477.50, 1,846.88, 2,216.25, 2,585.63, and 2,955.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), has values: 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, 0.00, and 0.00. A single orange line starts at (0, 0) and ends at (1,477.50, 0.00).

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 blue line represents the profit function, which starts at the origin (0, 0) and increases linearly to a profit of 0.00 million at a price of 1,480.00 thousand won.

가격 (천원)	이익 (백만)
0.00	0.00
1,480.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		768
	기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%		
-8.00%	-768	-768	-768	-768	-768	-768	-768		
-5.33%	-512	-512	-512	-512	-512	-512	-512		
-2.67%	-256	-256	-256	-256	-256	-256	-256		
0%	0	0	0	0	0	0	0		
2.67%	256	256	256	256	256	256	256		
5.33%	512	512	512	512	512	512	512		
8.00%	768	768	768	768	768	768	768		
KR4A11670002							2026-07 삼성전자개별선물		1,527
	기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,527	-1,527	-1,527	-1,527	-1,527	-1,527	-1,527
-5.33%	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018	-1,018
-2.67%	-509	-509	-509	-509	-509	-509	-509
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	509	509	509	509	509	509	509
5.33%	1,018	1,018	1,018	1,018	1,018	1,018	1,018
8.00%	1,527	1,527	1,527	1,527	1,527	1,527	1,527
KR4B09F4B932 코스피위클리 C 2606W4 1,477.5							1,848

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,568	-1,603	-1,643	-1,689	-1,739	-1,792	-1,848
-5.33%	-845	-902	-963	-1,027	-1,094	-1,162	-1,233
-2.67%	-228	-304	-382	-460	-539	-619	-699
0%	253	169	84	0	-84	-169	-253
2.67%	590	512	432	351	270	188	105
5.33%	801	738	672	603	531	458	382
8.00%	917	874	826	772	714	653	588
KR4B09F4B940 코스피위클리 C 2606W4 1,480.0							1,250

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,066	-1,088	-1,115	-1,145	-1,177	-1,212	-1,250
-5.33%	-578	-615	-655	-698	-742	-787	-834
-2.67%	-159	-209	-261	-313	-366	-419	-473
0%	170	113	57	0	-57	-113	-170
2.67%	402	349	295	240	185	130	74
5.33%	548	505	460	413	364	314	263
8.00%	629	600	566	530	490	448	405

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

(단위:백만원)

11,485

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

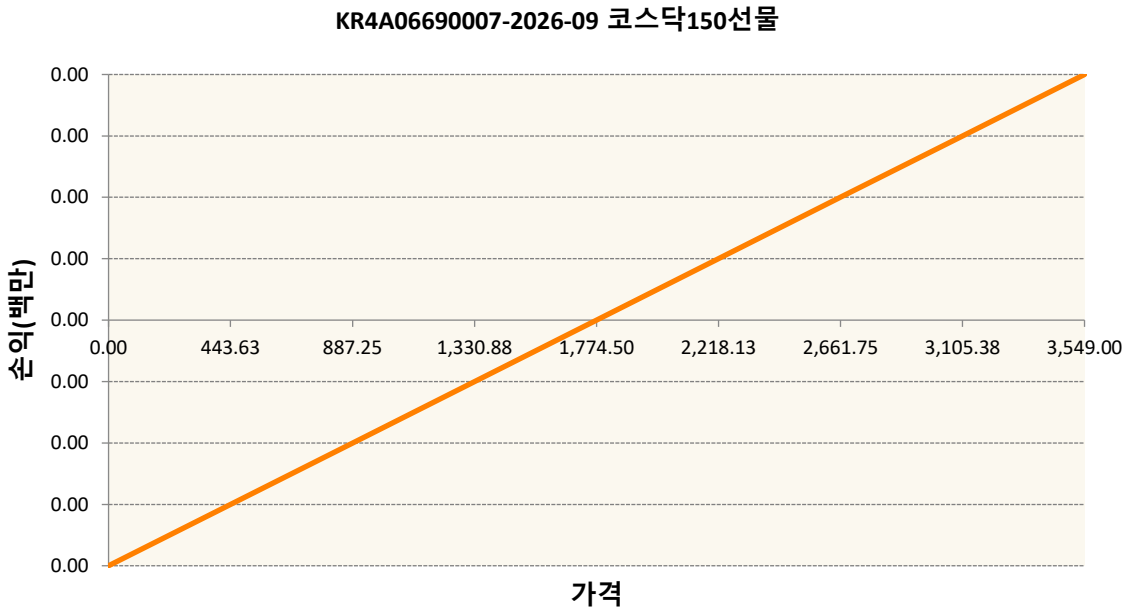
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	1,029	0	1,029	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				81
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
-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%	81	81	81	81	81	81	81

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

(단위:백만원)

31,858

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

(단위:백만원)

74,707

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

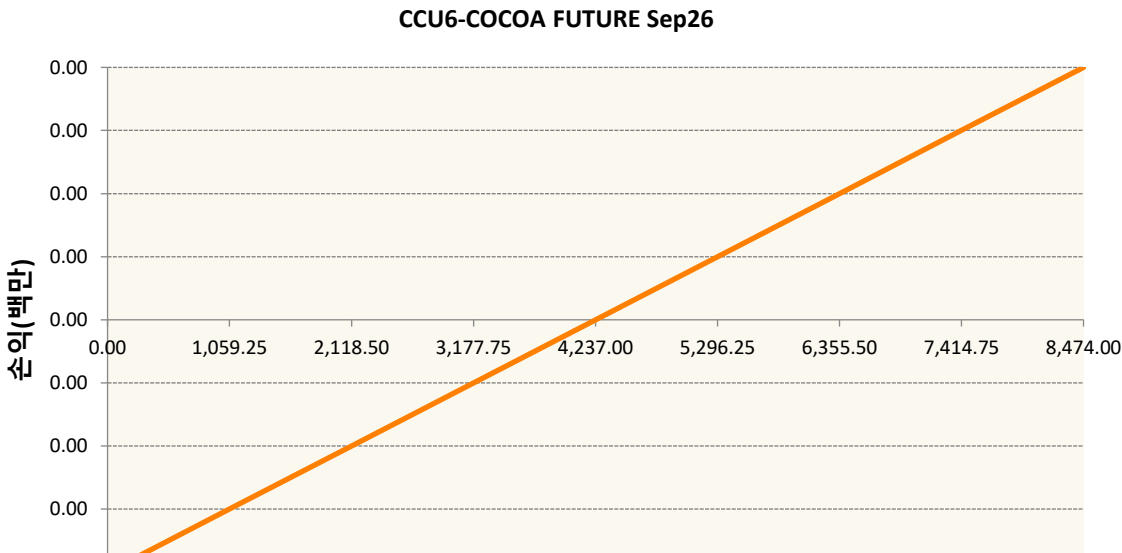
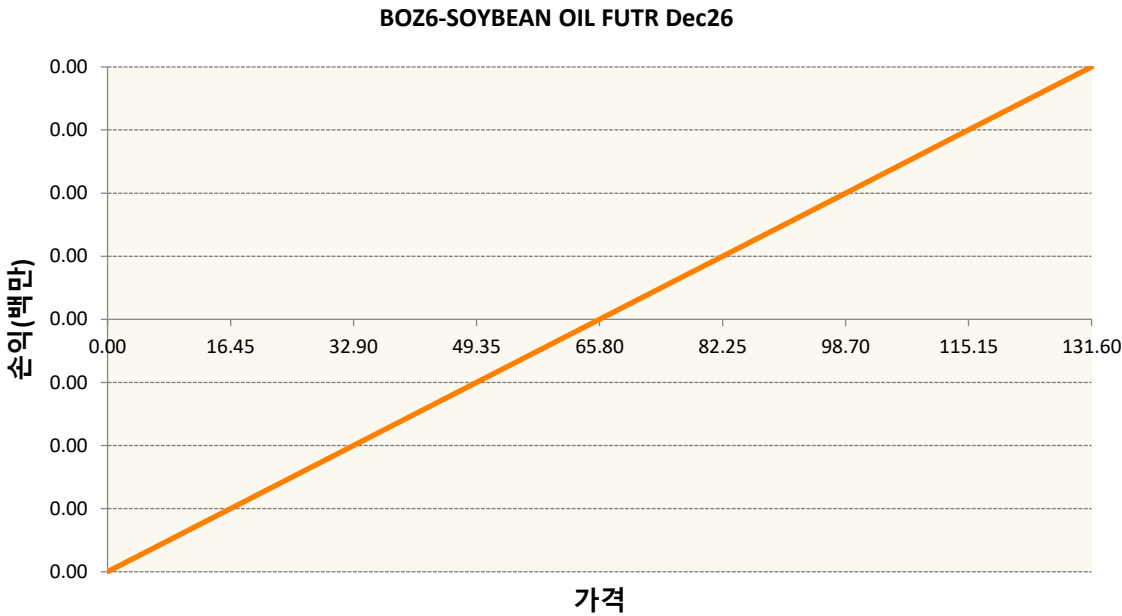
포커스농산물모(채권-파생형)

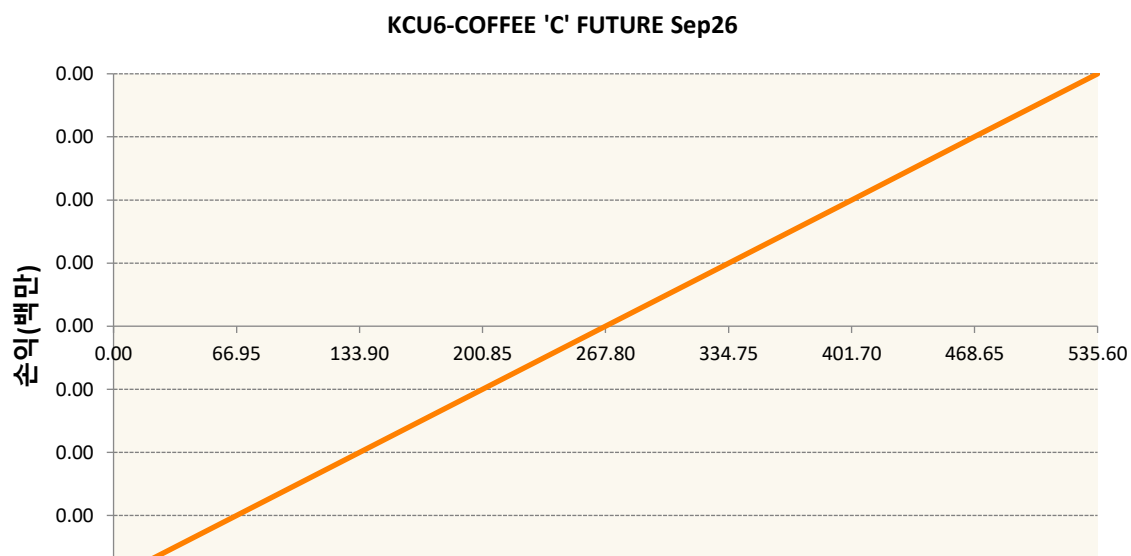
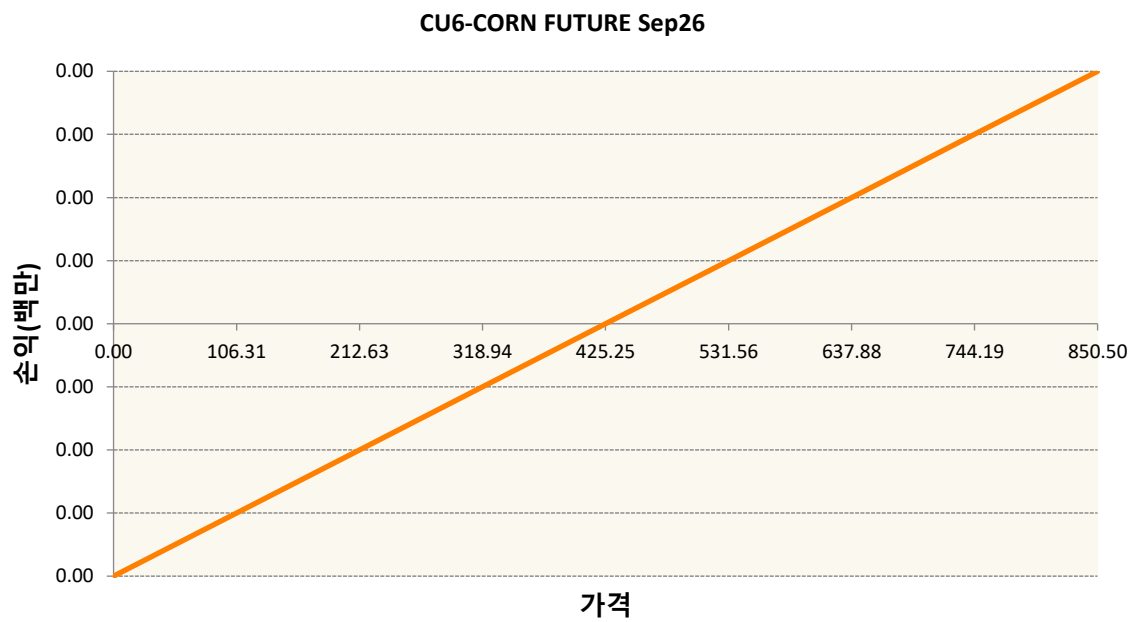
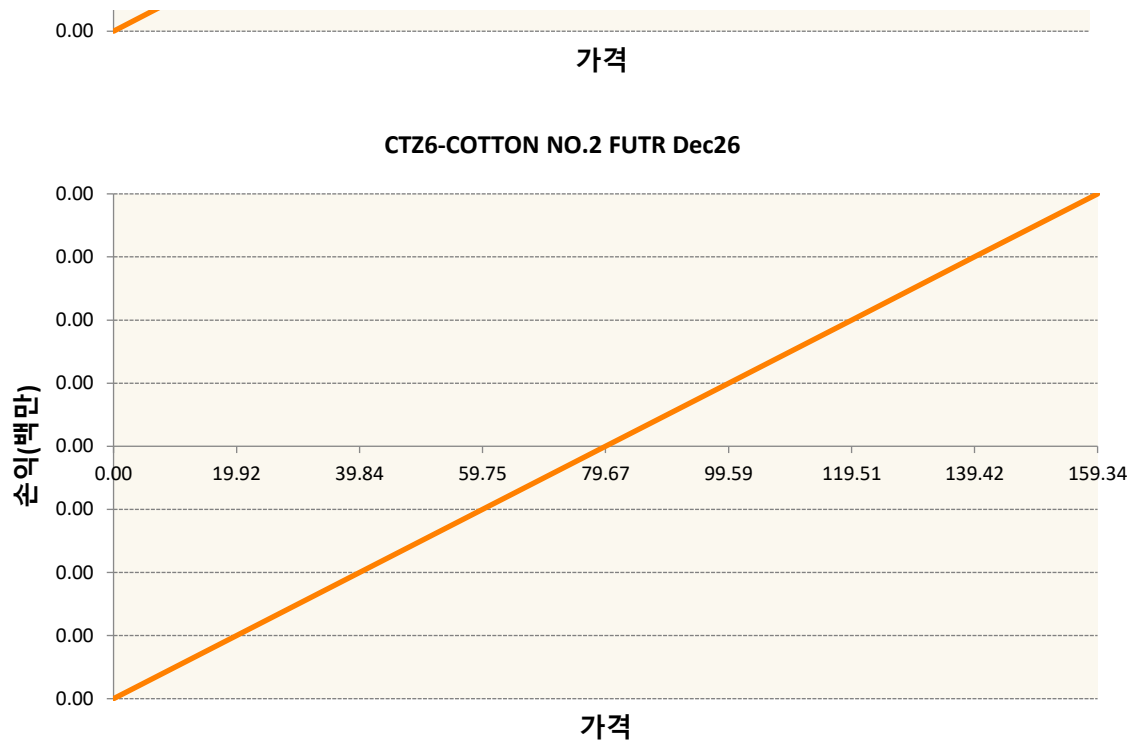
1. 계약금액

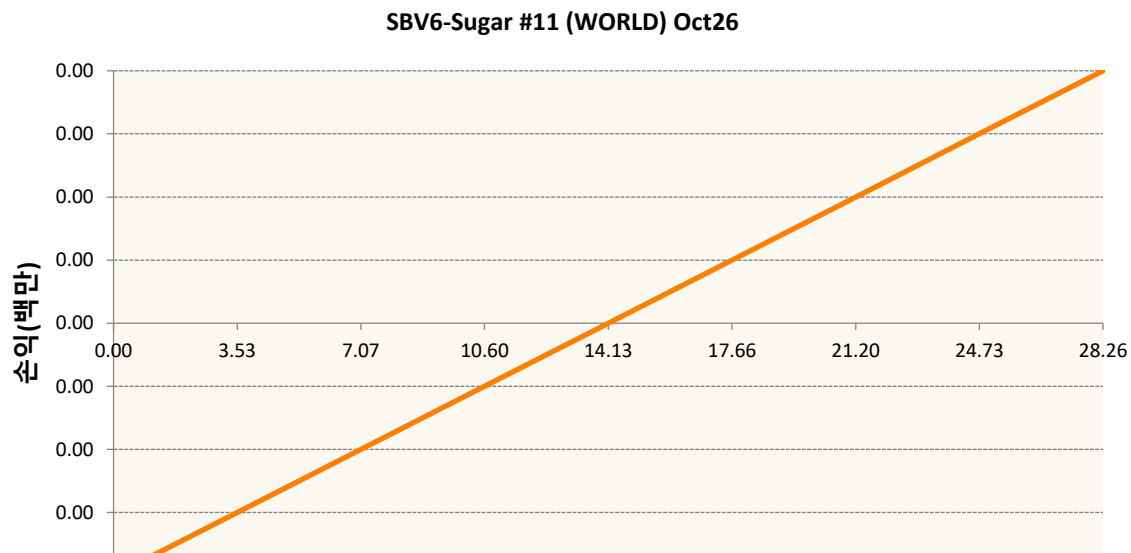
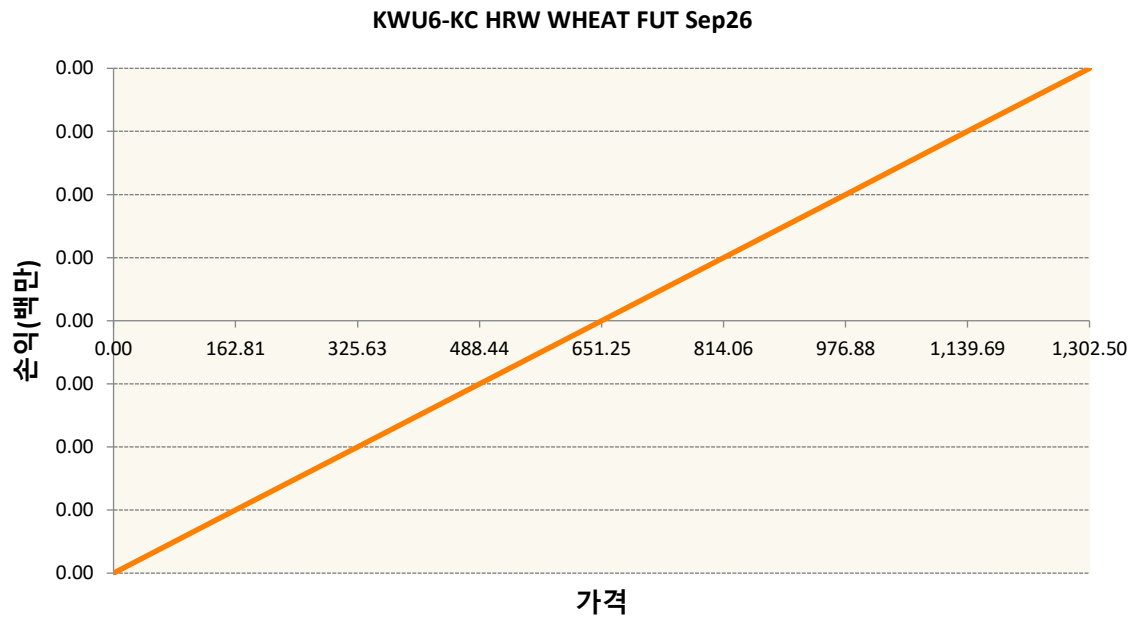
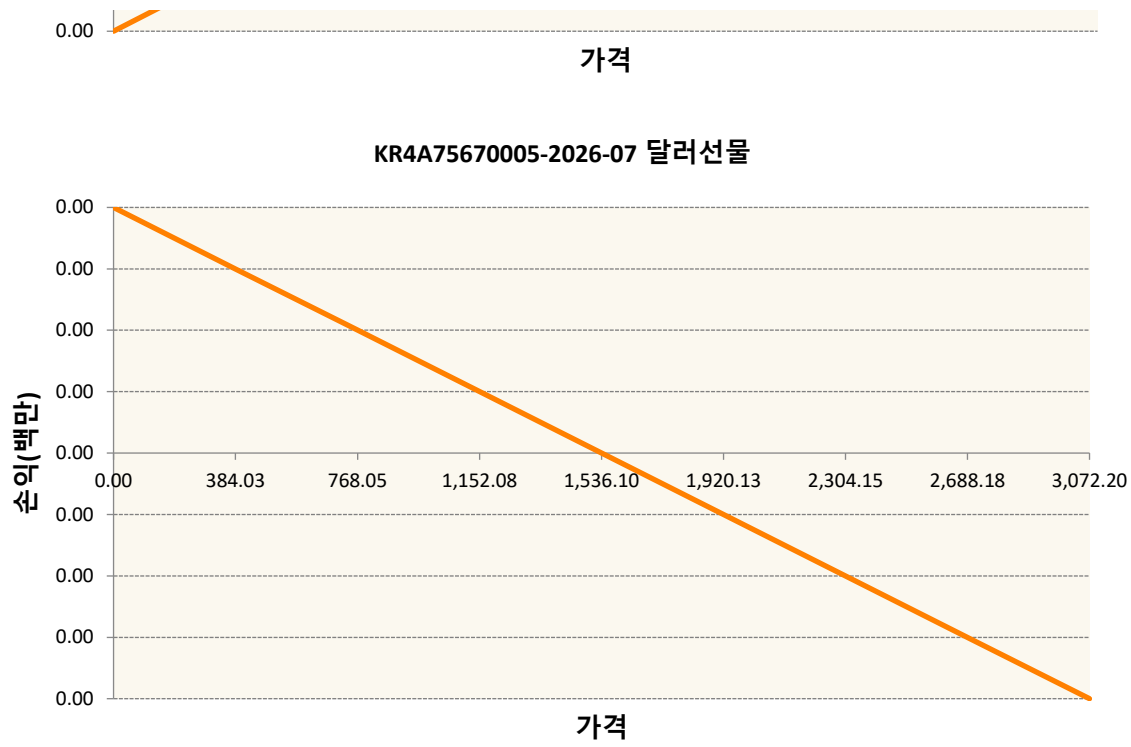
(단위:USD 백만)

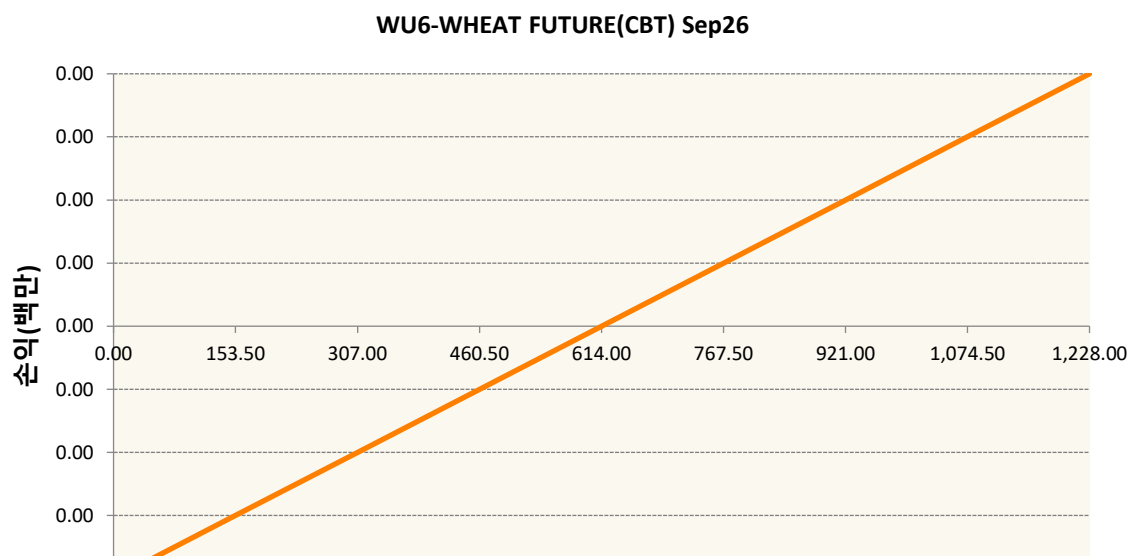
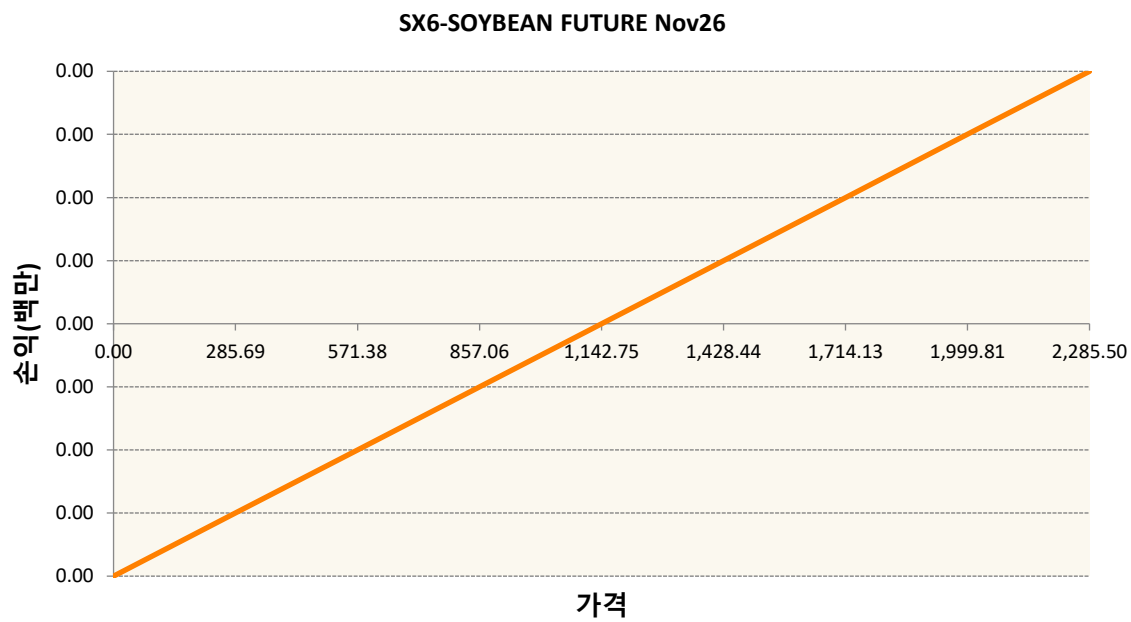
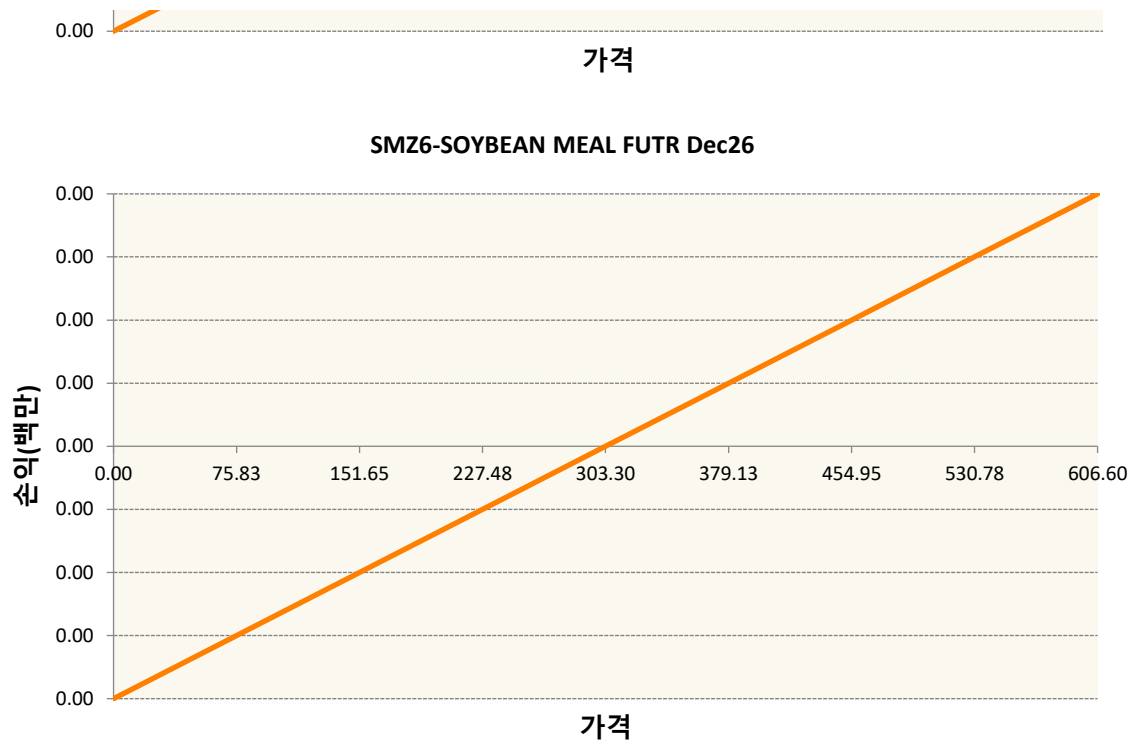
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	425	0	425	
누계	유가증권	선물	2,138	0	2,138	
누계	통화	선물	0	169	-169	장내

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	2026-06-23
기준일	2026-06-22

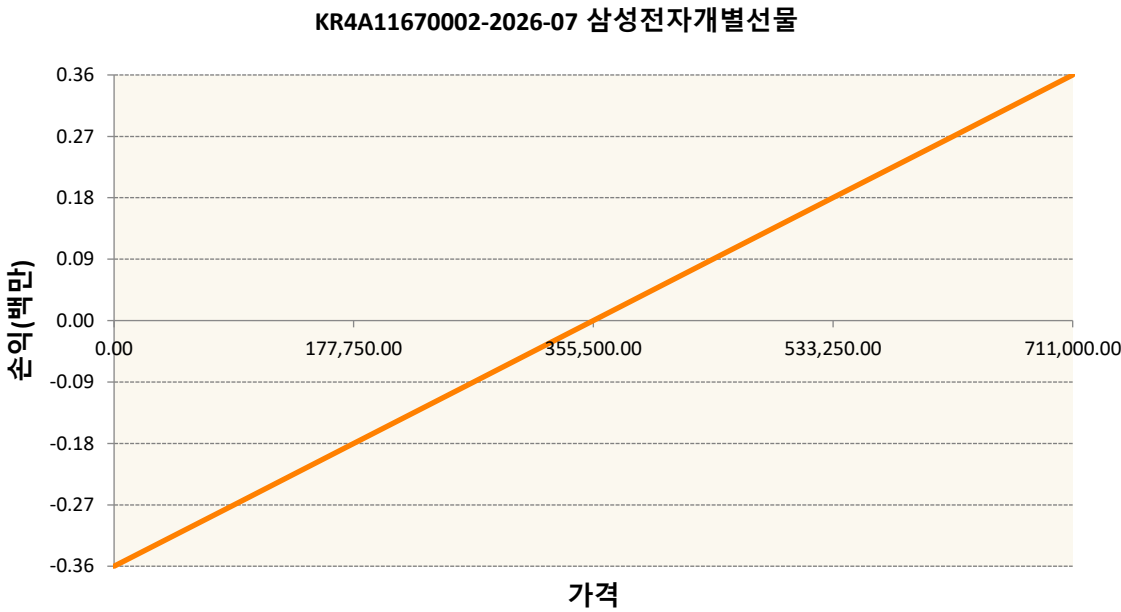
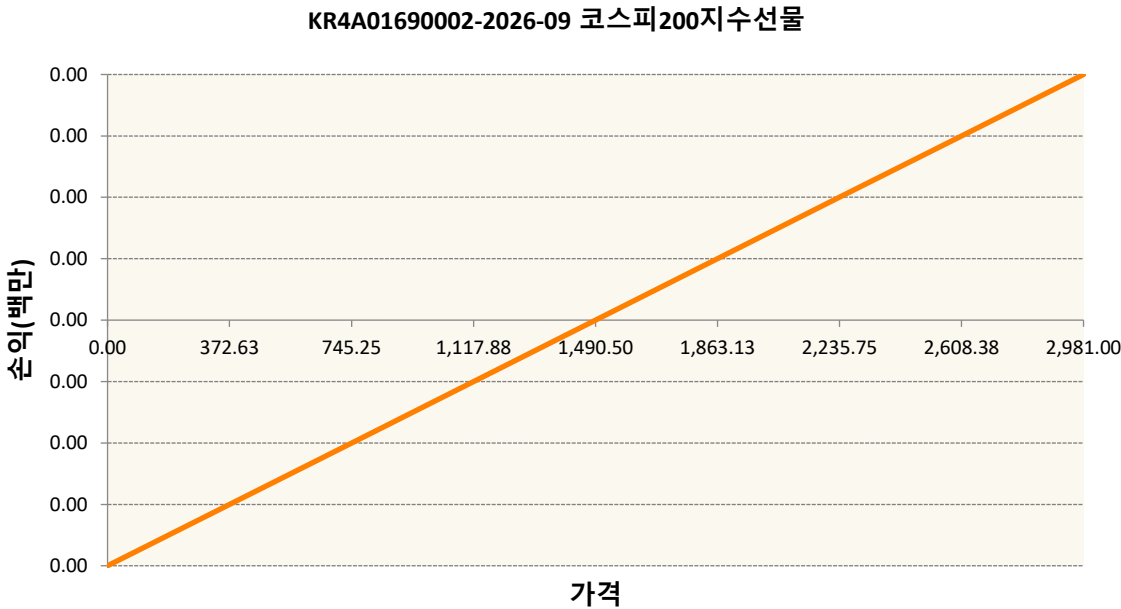
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	376	-376	장내
누계	유가증권	선물	2,751	0	2,751	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					207
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-5.33%	-138	-138	-138	-138	-138	-138	-138
-2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	69	69	69	69	69	69	69
5.33%	138	138	138	138	138	138	138
8.00%	207	207	207	207	207	207	207

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%	-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%	11	11	11	11	11	11	11

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

554

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

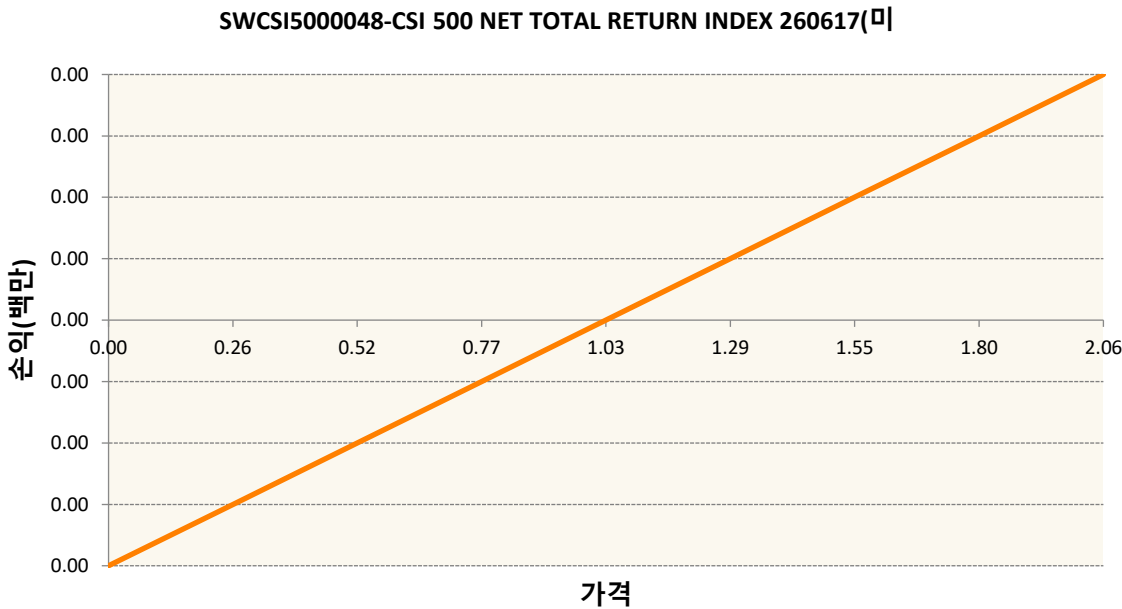
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

479

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

634

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

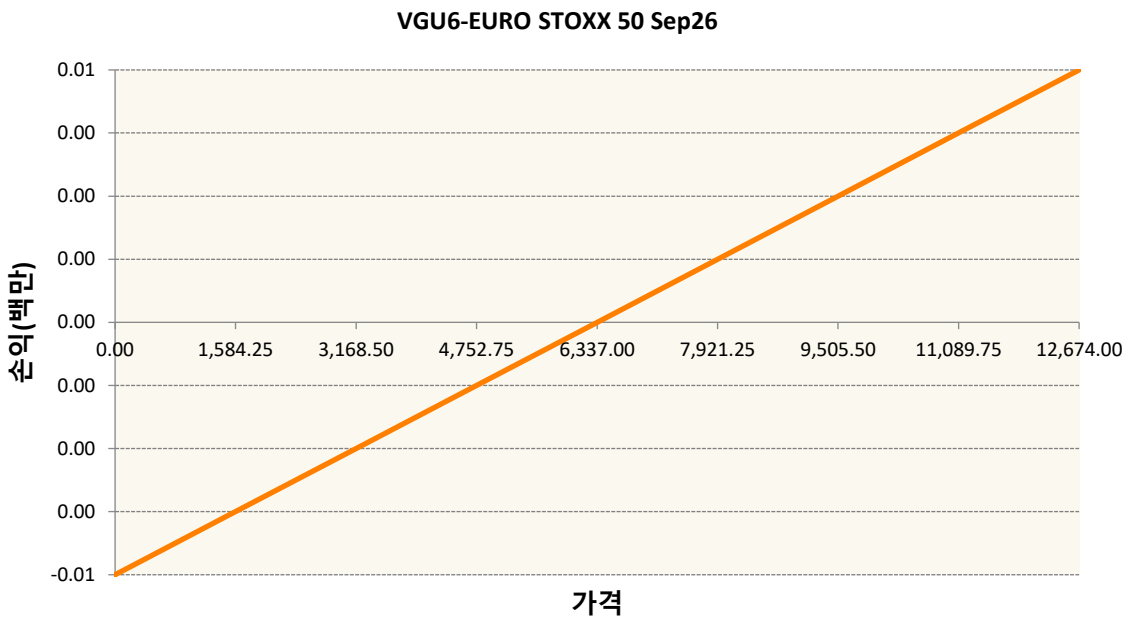
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,002	0	1,002	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

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

(단위:백만원)

71

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

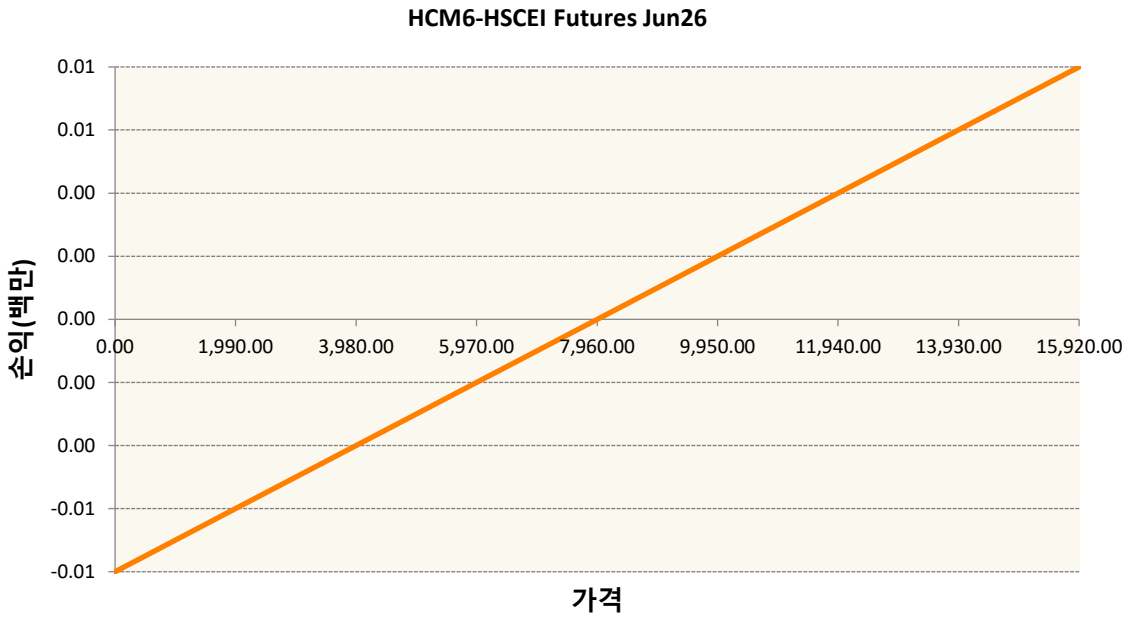
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,297	0	1,297	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	HSCEI Futures Jun26	104
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

125

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

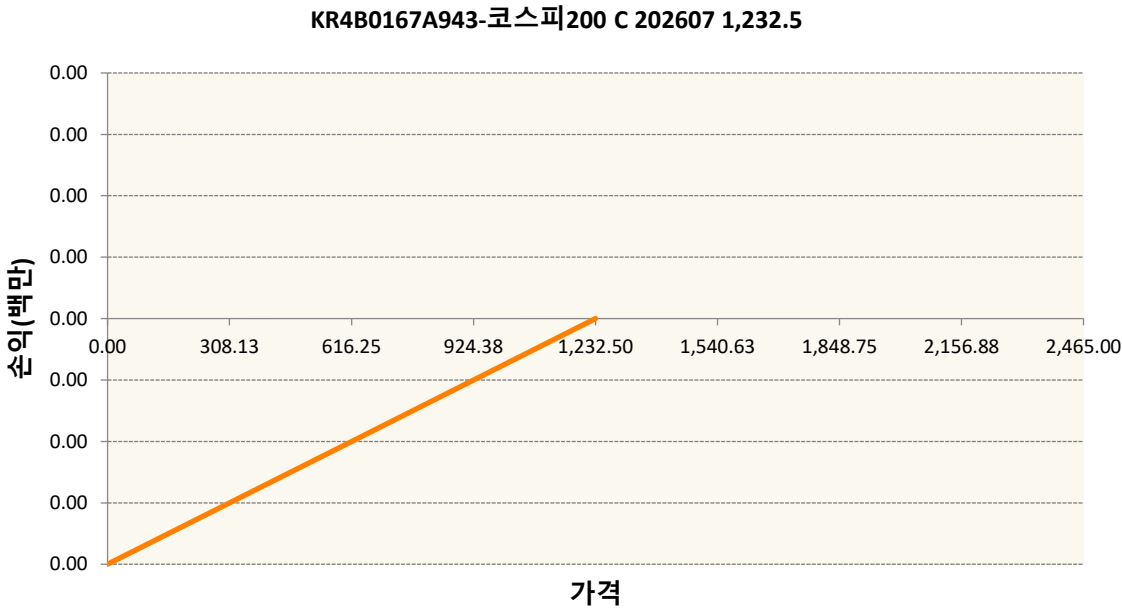
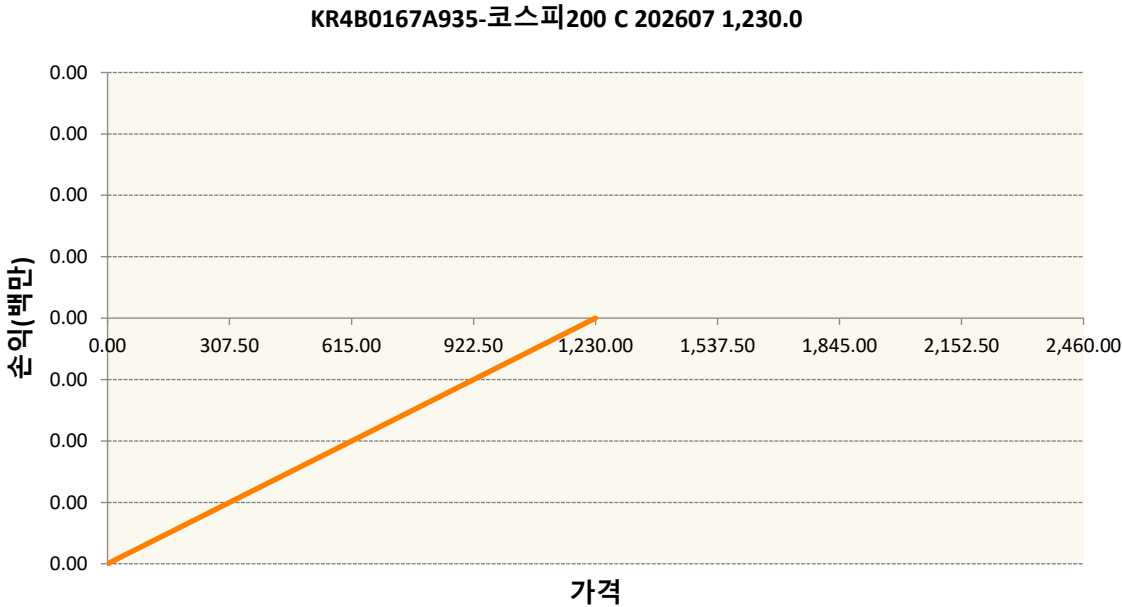
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

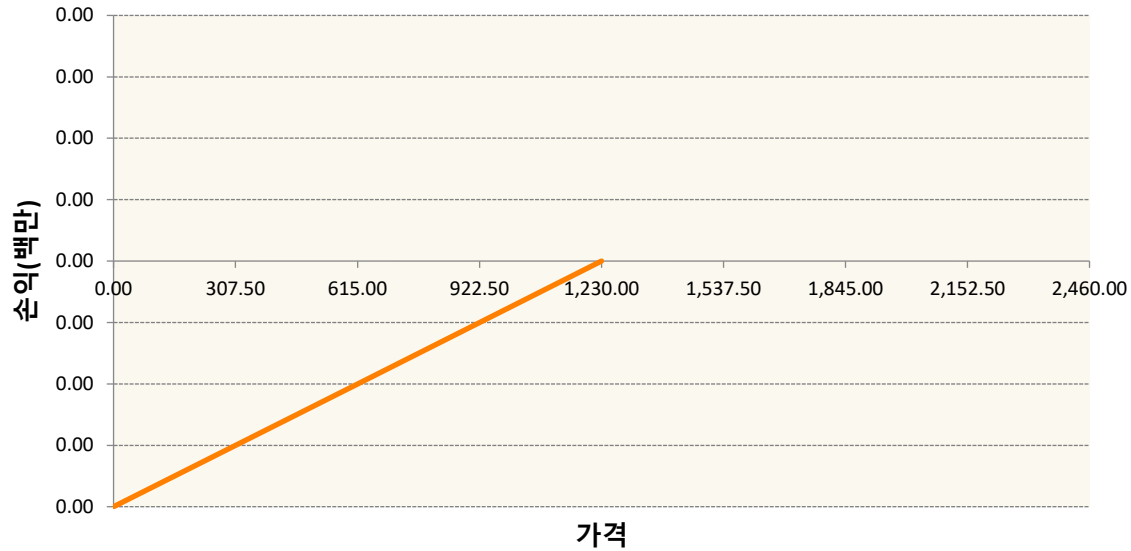
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	709	0	709	장내
누계	유가증권	옵션	0	34,481	-34,481	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0167A933-코스피200 P 202607 1,230.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0167A935 코스피200 C 202607 1,230.0							276
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-60	-101	-143	-187	-231	-276
-5.33%	26	-9	-47	-86	-127	-168	-211
-2.67%	60	30	-3	-39	-76	-115	-155
0%	85	60	31	0	-34	-70	-107
2.67%	102	82	58	31	1	-32	-66
5.33%	115	99	79	56	29	0	-31
8.00%	124	111	95	75	52	26	-2
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5							767
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-168	-282	-400	-521	-643	-767
-5.33%	70	-27	-131	-240	-352	-468	-587
-2.67%	166	82	-9	-108	-211	-319	-431
0%	236	166	87	0	-94	-193	-298
2.67%	286	230	163	87	3	-87	-183
5.33%	321	277	221	156	82	1	-86
8.00%	346	311	266	211	147	75	-4
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0							253
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-55	-92	-132	-171	-212	-253
-5.33%	24	-9	-43	-79	-116	-154	-194
-2.67%	55	27	-3	-35	-70	-105	-142
0%	77	55	29	0	-31	-64	-98

2.67%	94	75	53	28	1	-29	-61
5.33%	105	91	72	51	27	0	-29
8.00%	113	102	87	69	48	24	-2

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

(단위:백만원)

1,148

공시일 2026-06-23

기준일 2026-06-22

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	2026-06-23
기준일	2026-06-22

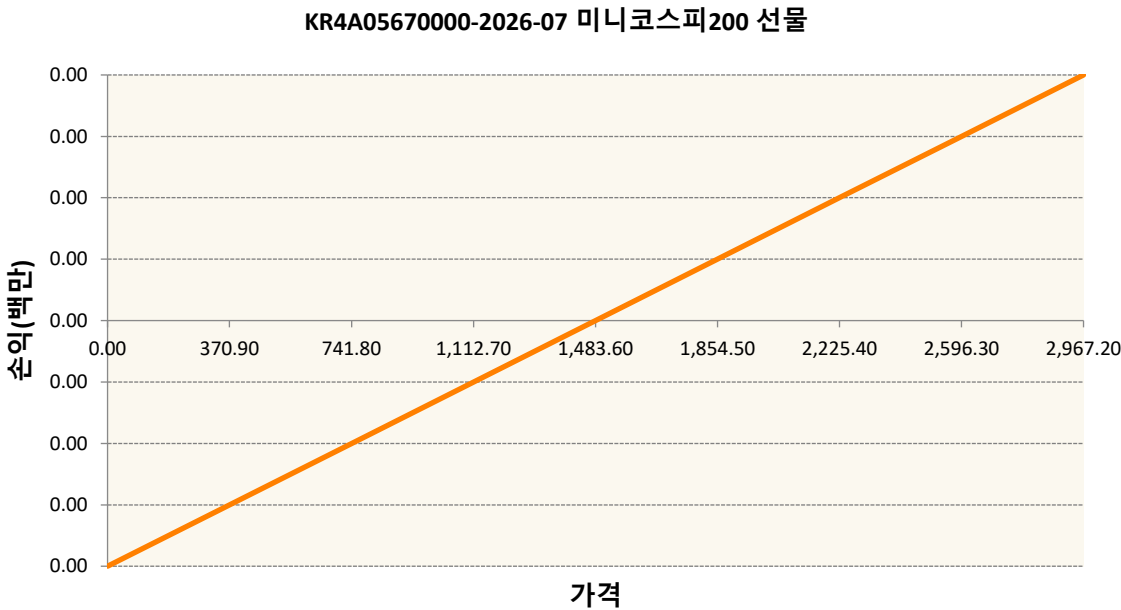
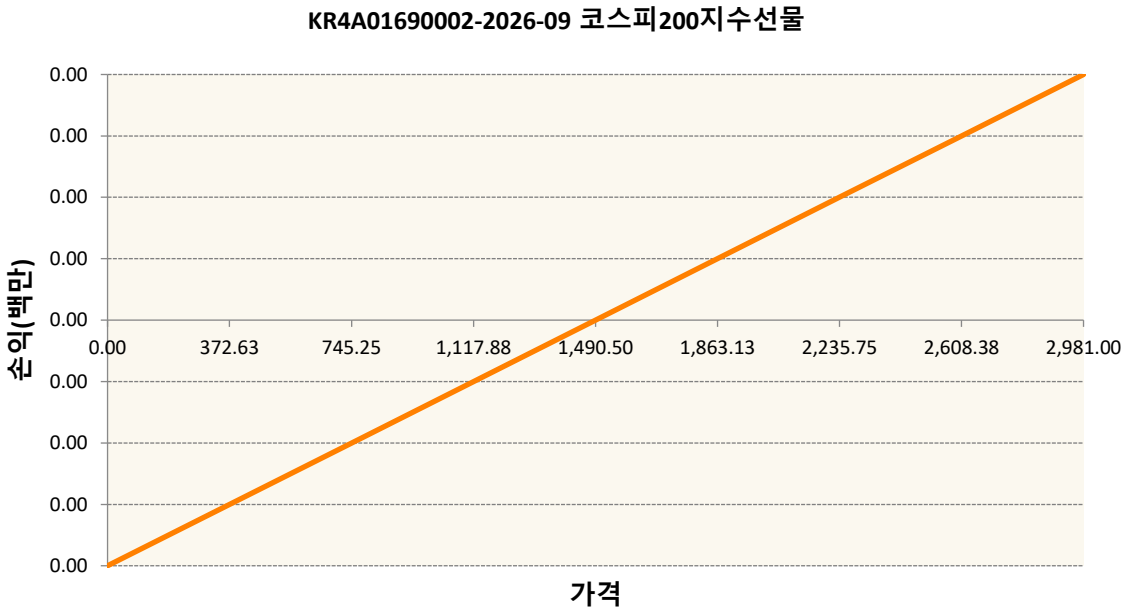
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

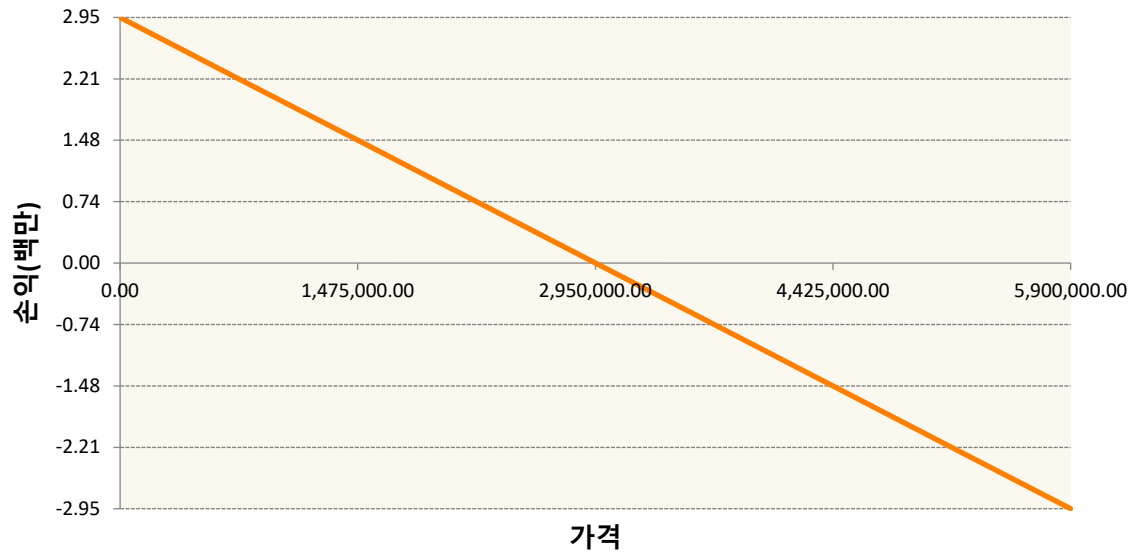
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,855	0	1,855	장내
누계	유가증권	선물	4,456	295	4,161	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				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%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-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%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89
KR4A05670000			2026-07 미니코스피200 선물				53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53
KR4A50670004			2026-07 SK하이닉스개별선물				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

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

(단위:백만원)

439

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

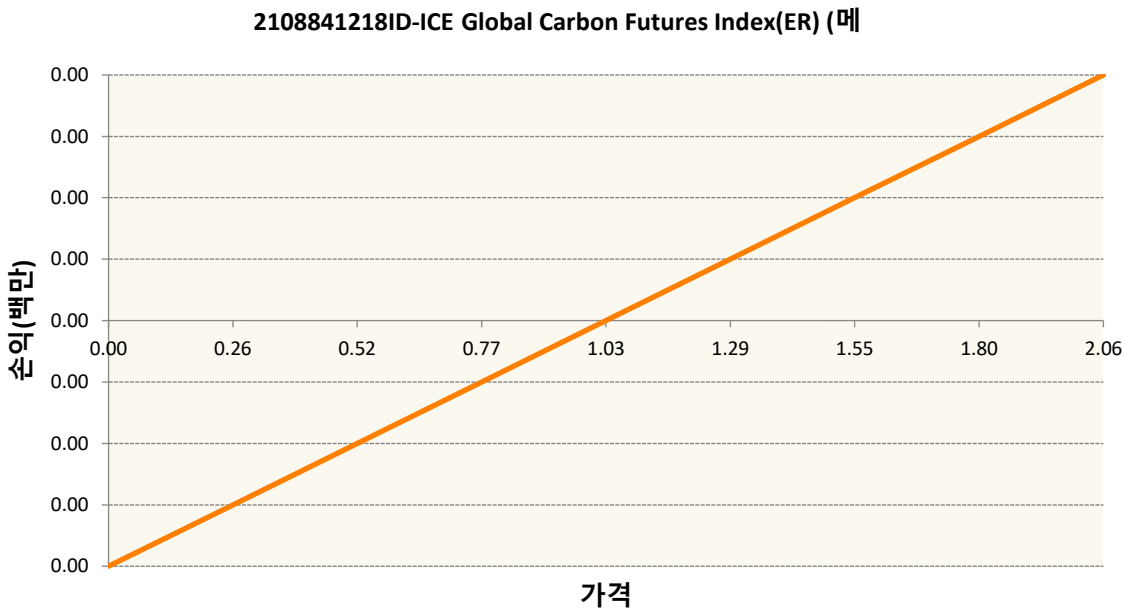
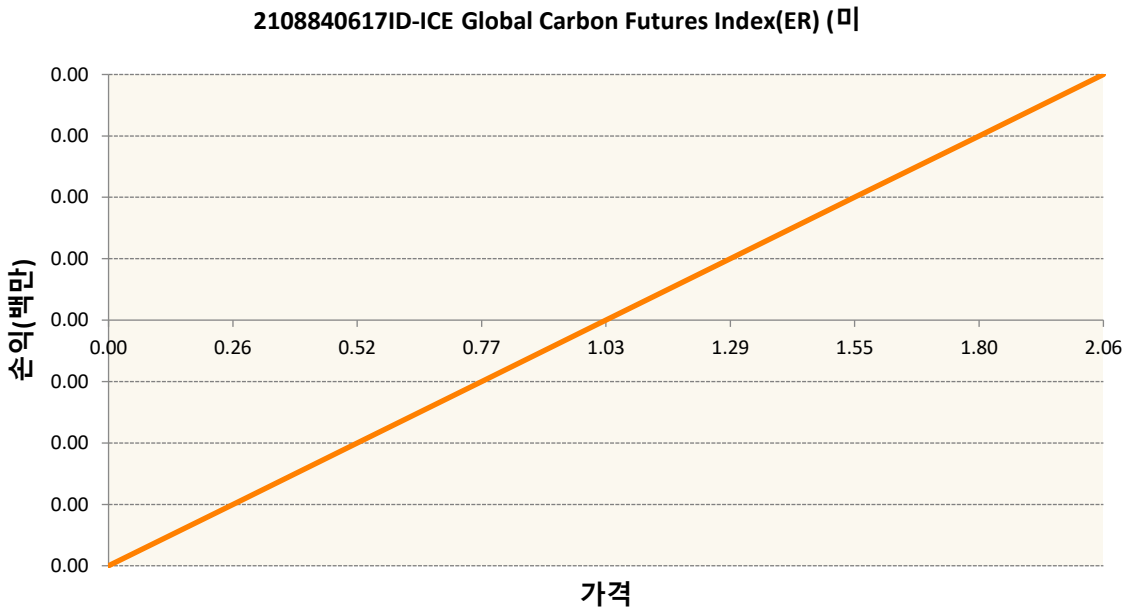
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,723	0	7,723	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840617IICE Global Carbon Futures Index(ER) (미		492
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		124

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	709

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

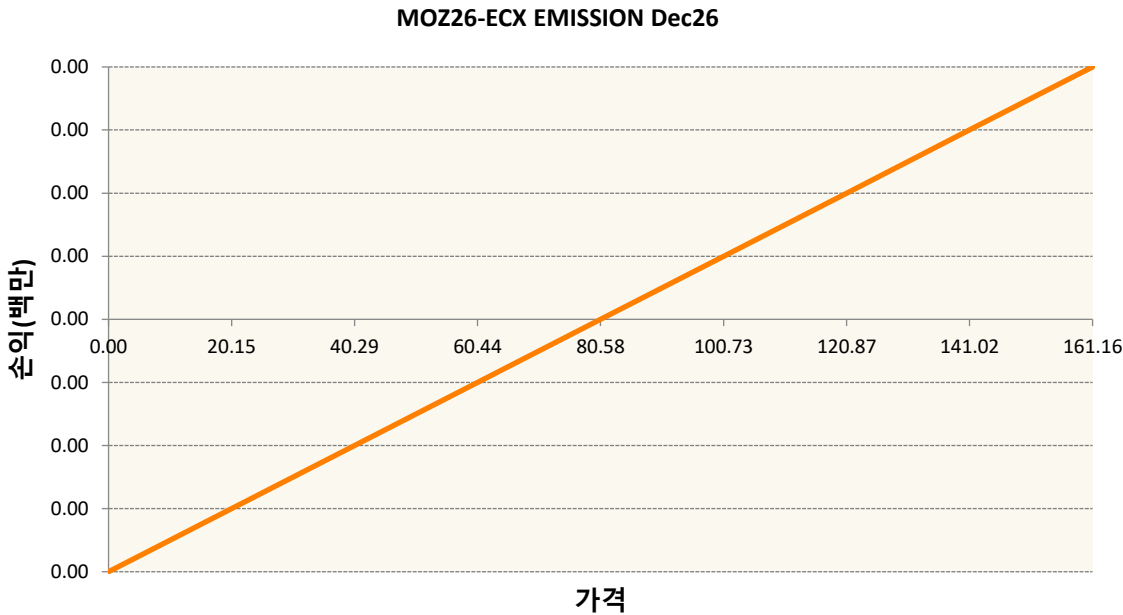
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,202	0	5,202	
누계	통화	선도	0	2,648	-2,648	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	212
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	416

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

(단위:백만원)

706

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

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)	10
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	7
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	16
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	6

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

(단위:백만원)

60

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

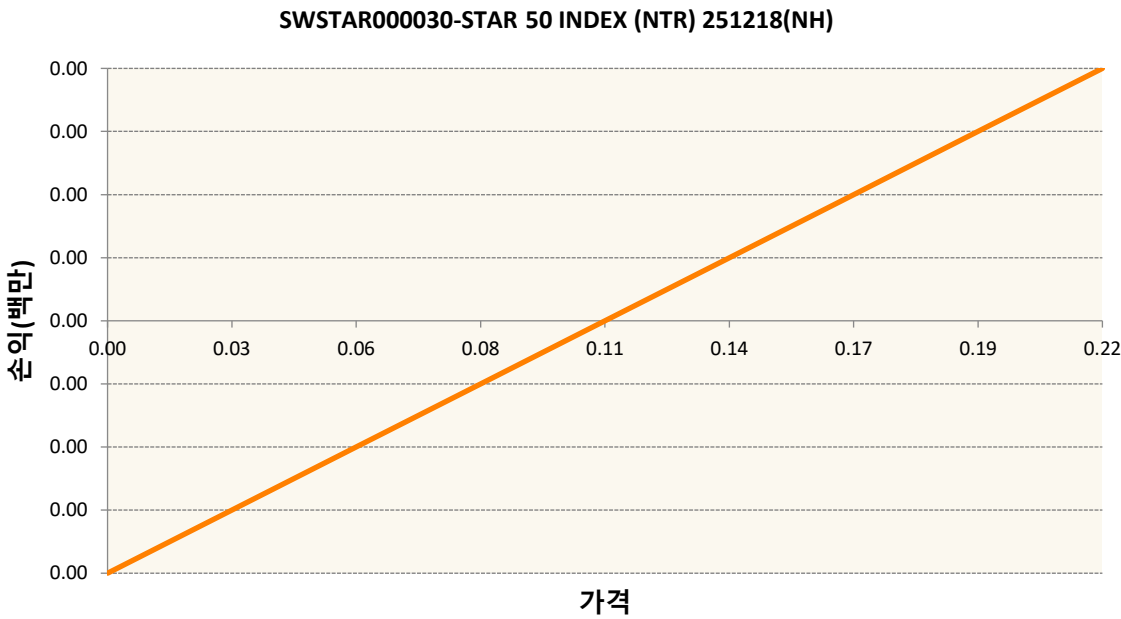
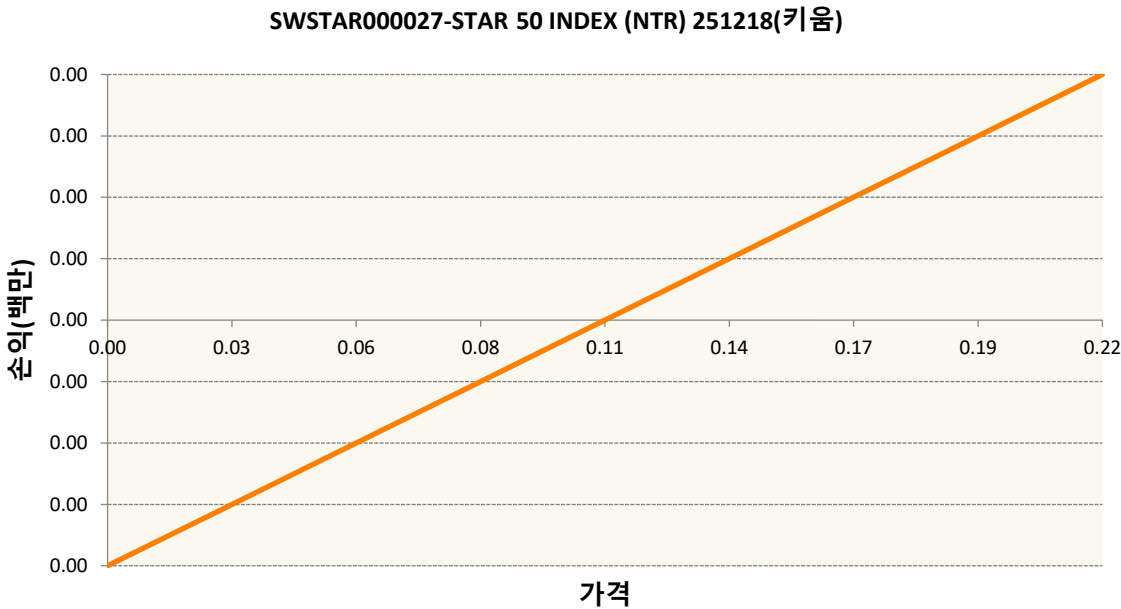
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

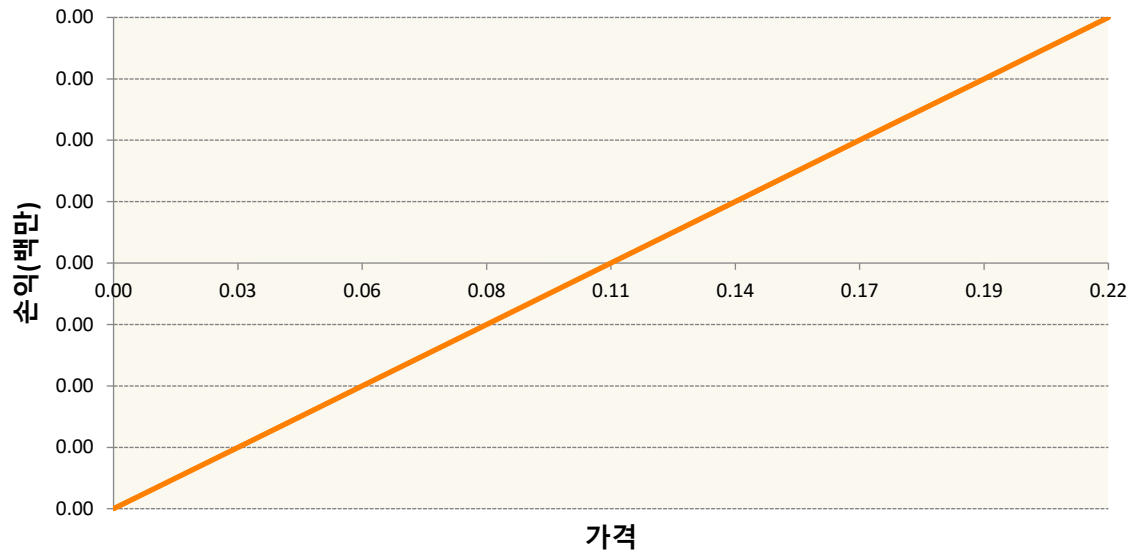
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,713	0	3,713	장외

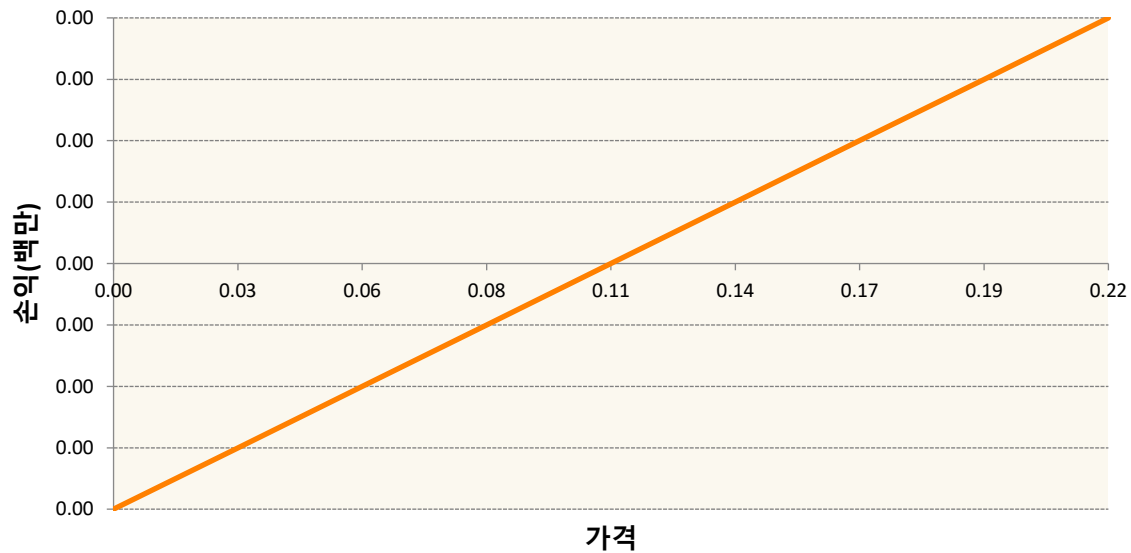
2. 만기시점의 손익구조



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)	10
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	35
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)	181
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260617(미래)	66

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

(단위:백만원)

473

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

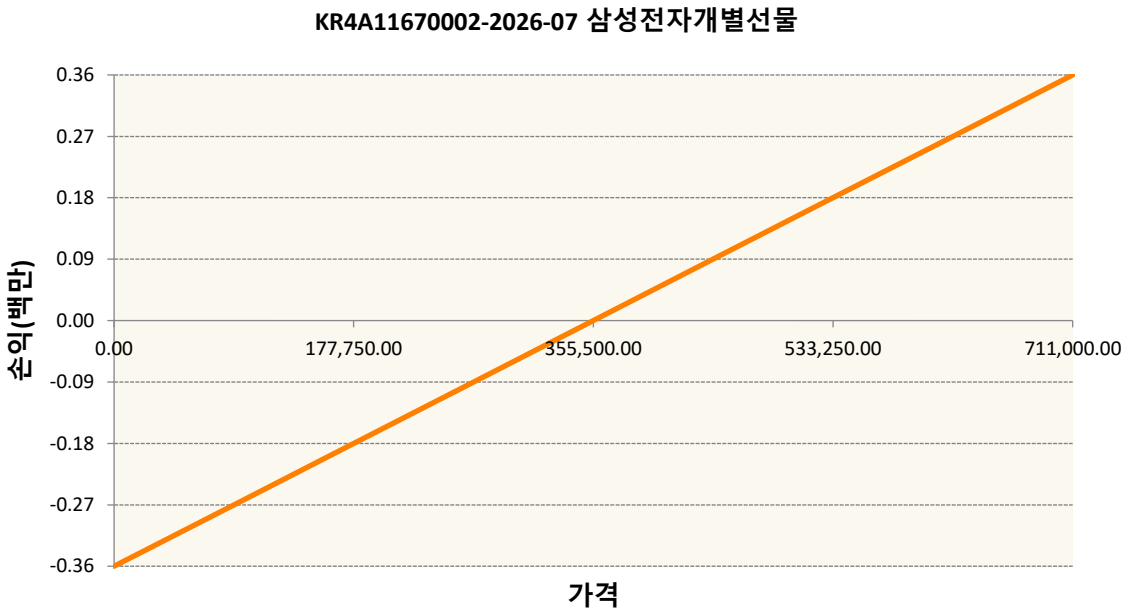
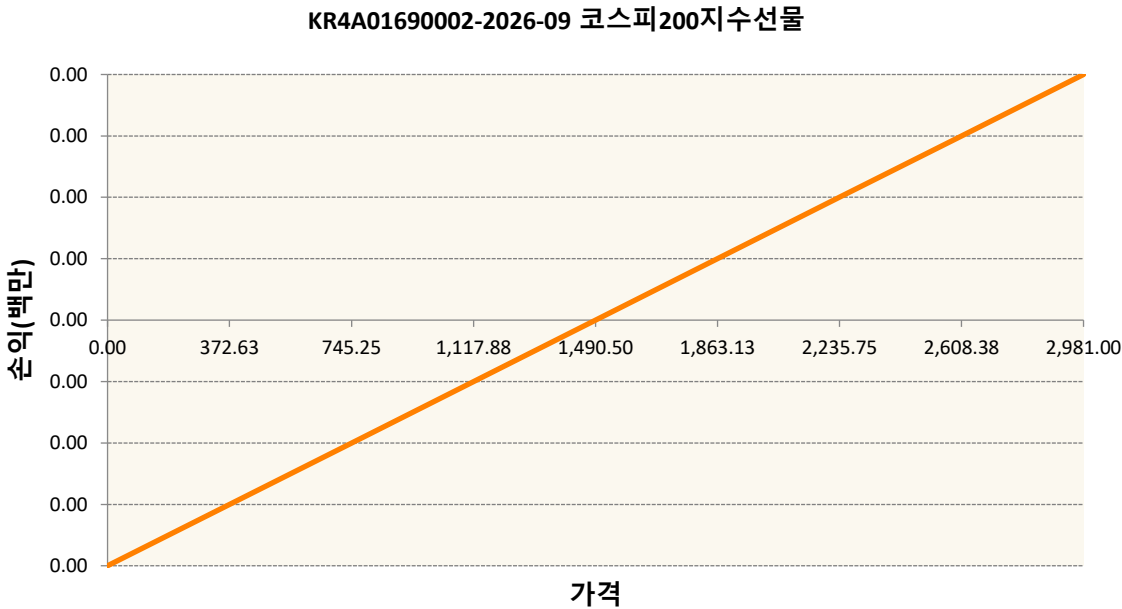
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

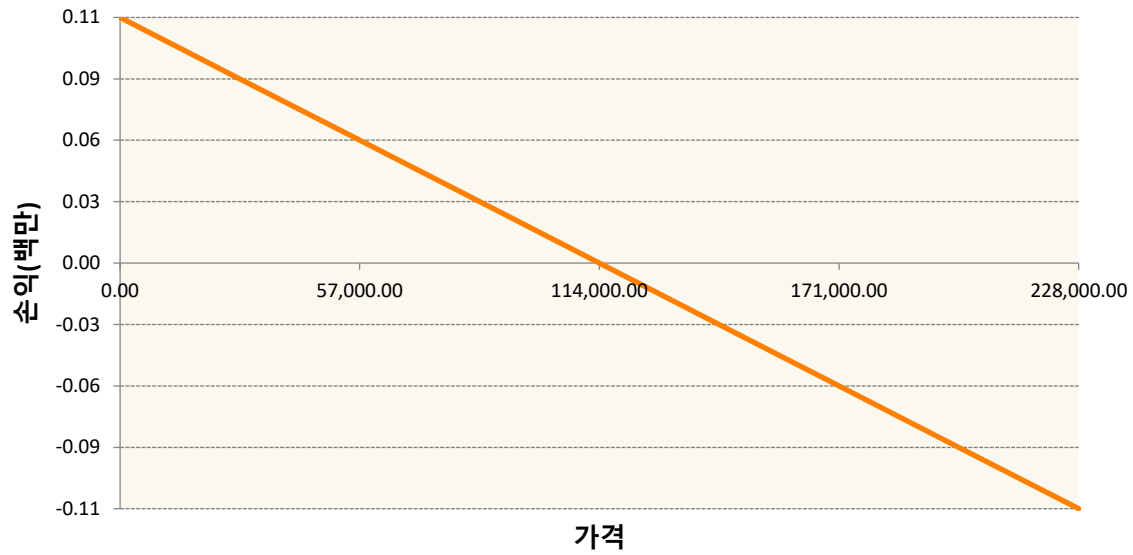
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,977	8,715	-6,738	장내
누계	유가증권	선물	15,688	4,543	11,145	장내

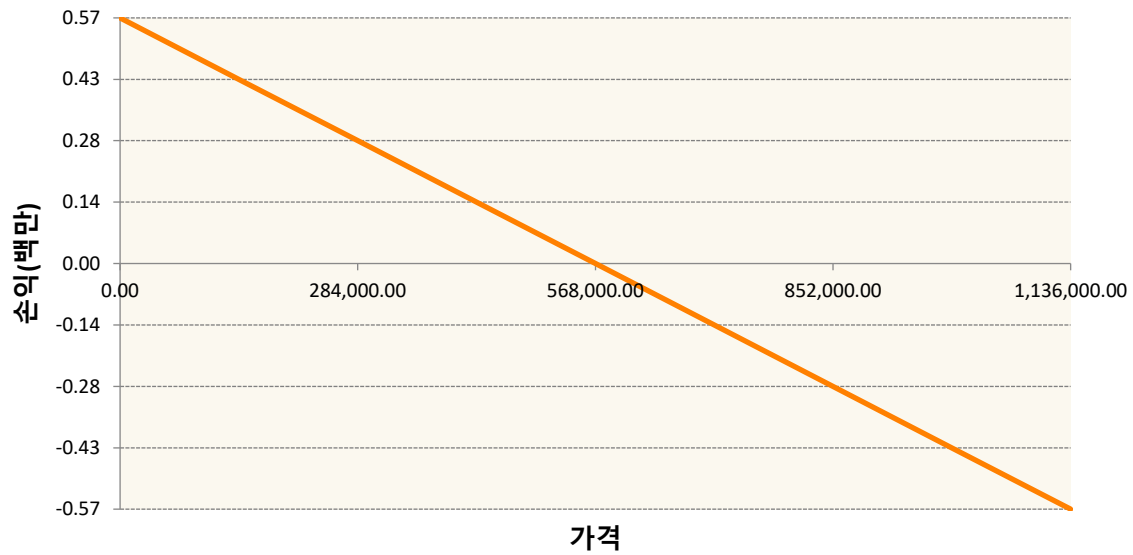
2. 만기시점의 손익구조



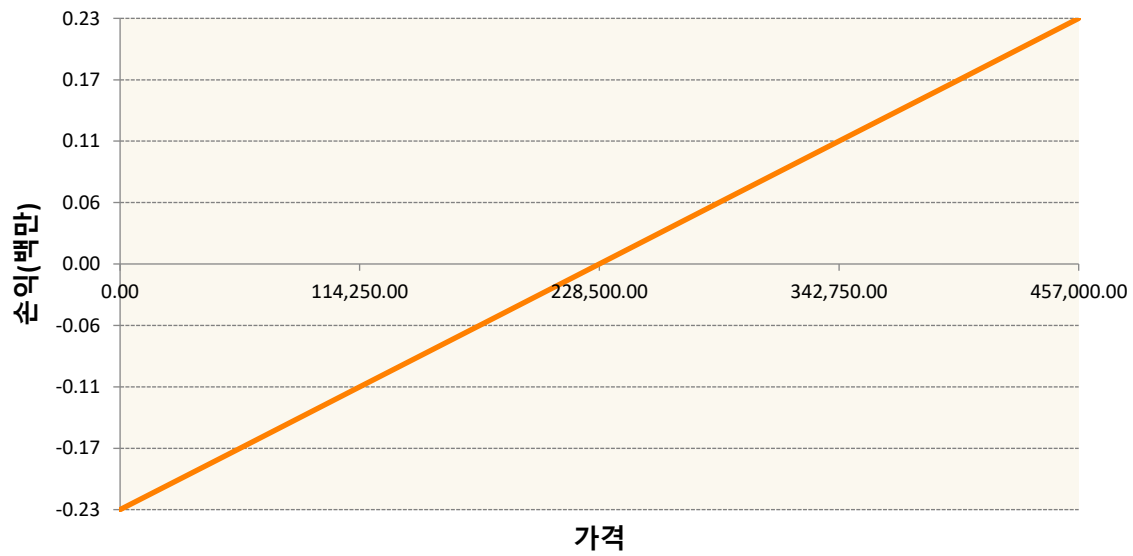
KR4A17670006-2026-07 삼성증권개별선물



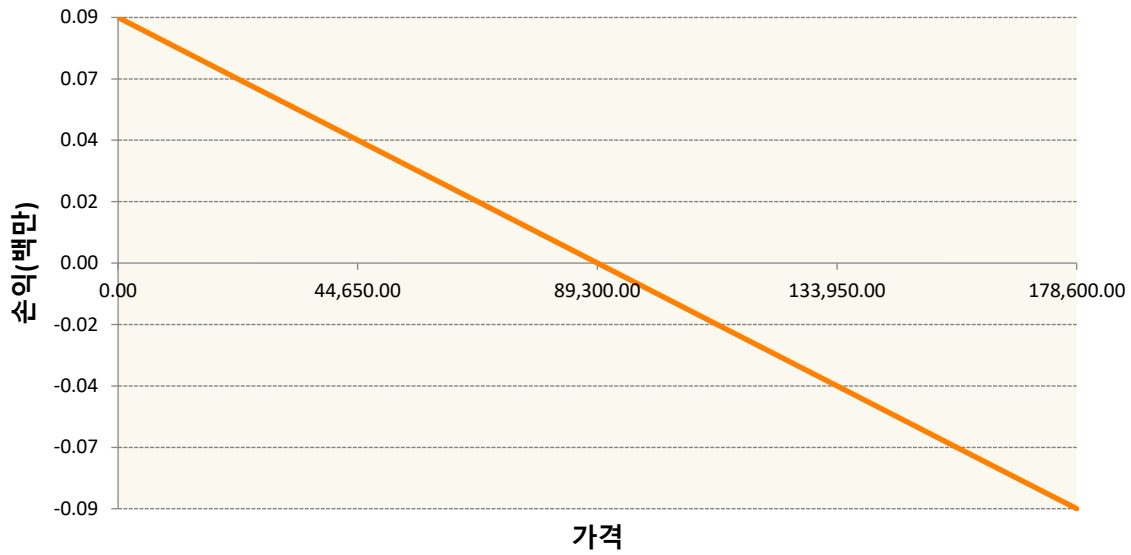
KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



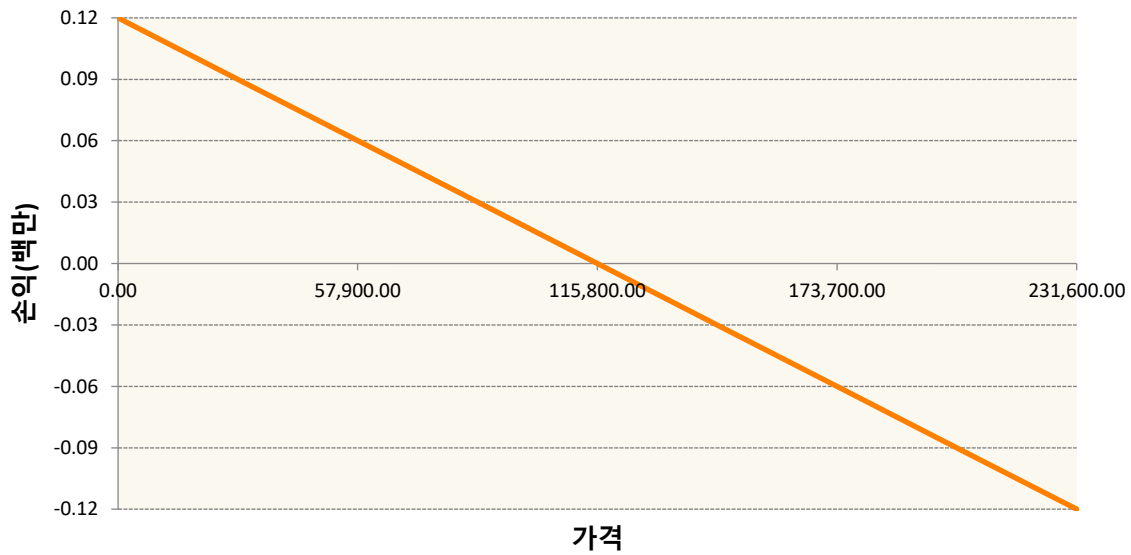
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



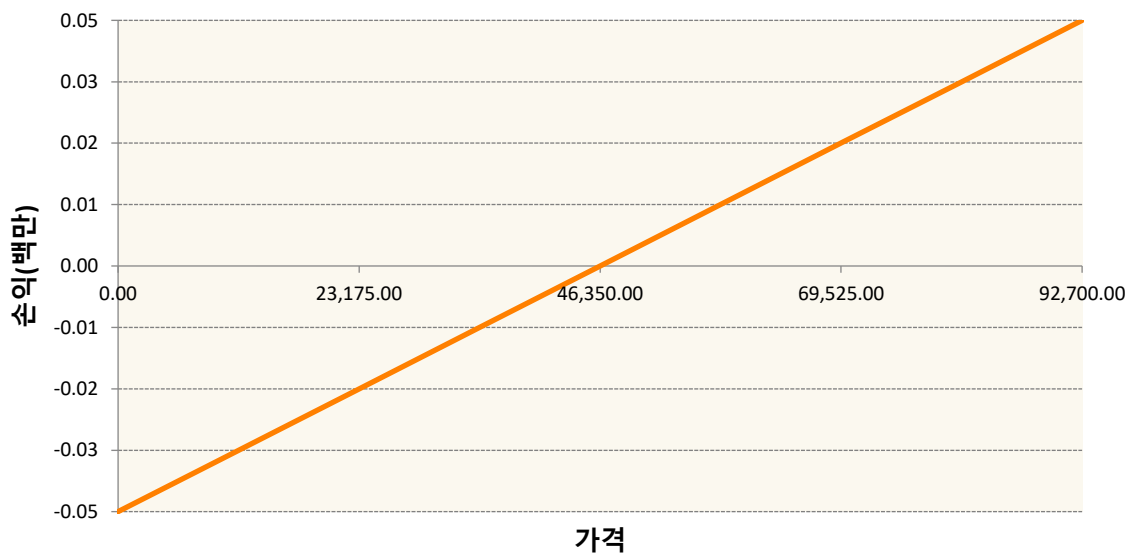
KR4A2K670000-2026-07 LG씨엔에스개별선물



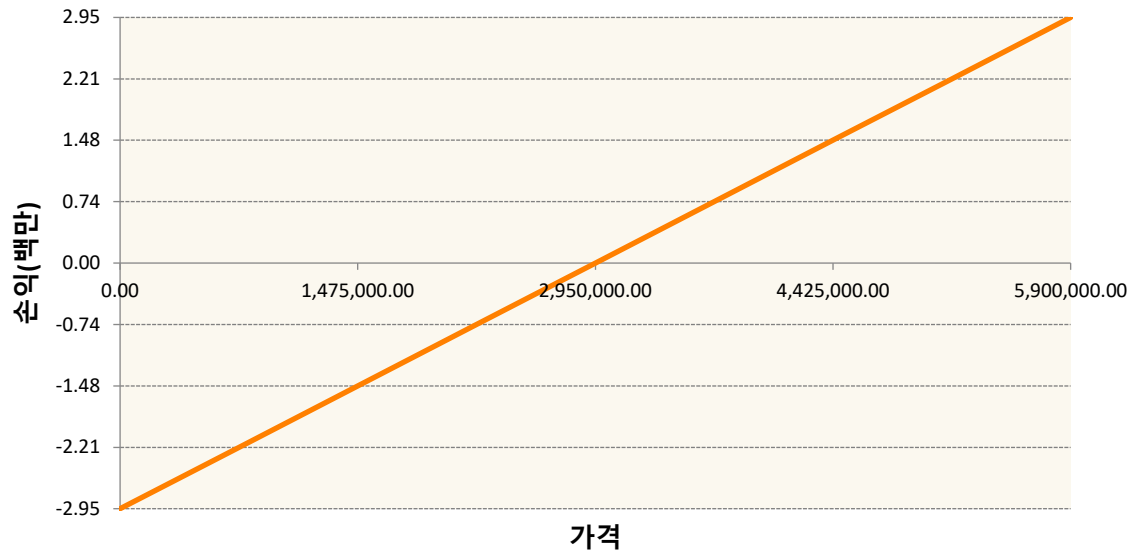
KR4A2P670005-2026-07 이수페타시스개별선물



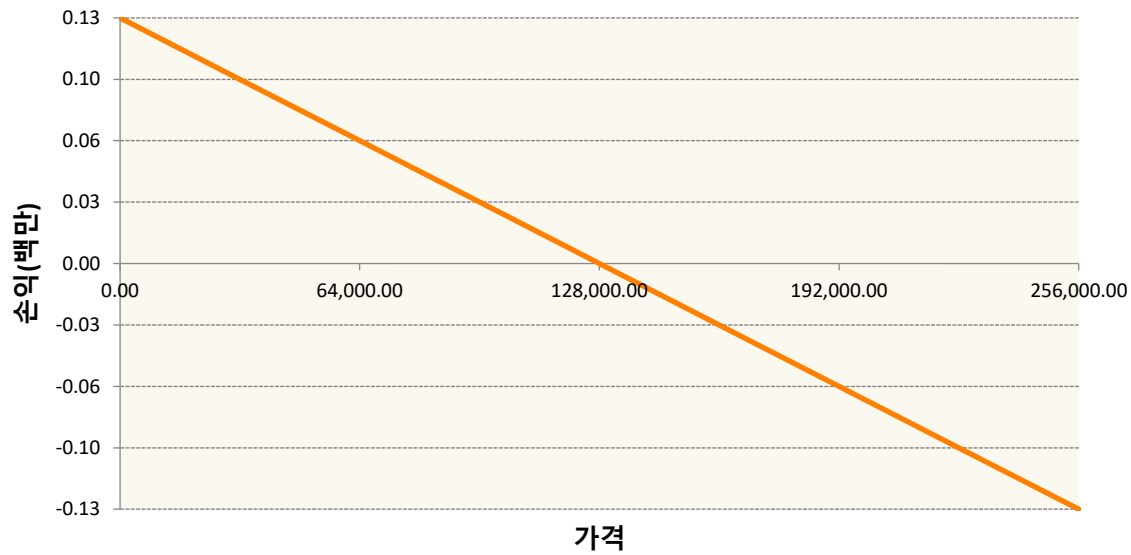
KR4A48670009-2026-07 미래에셋증권개별선물



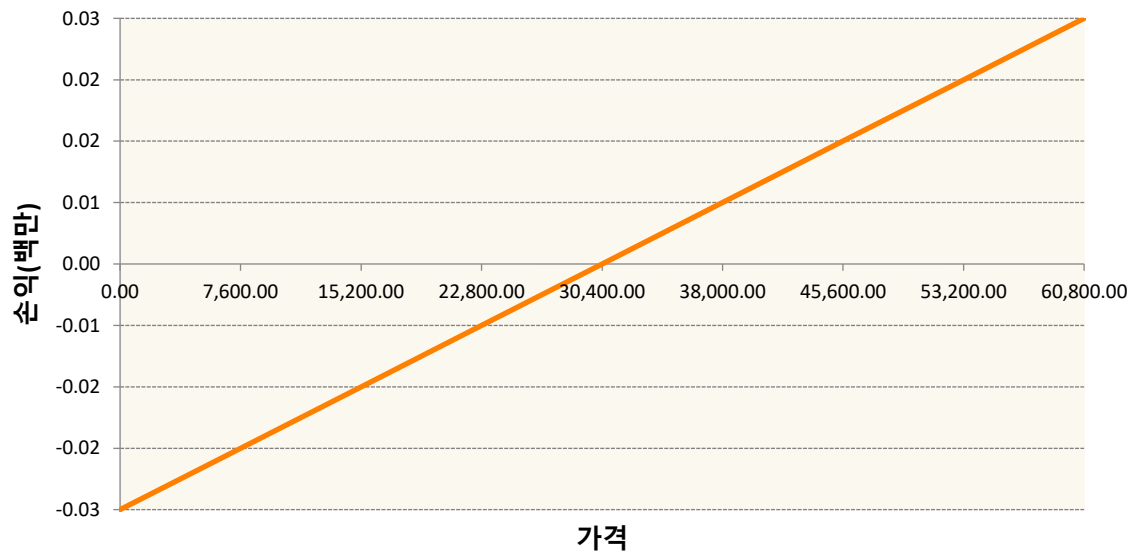
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



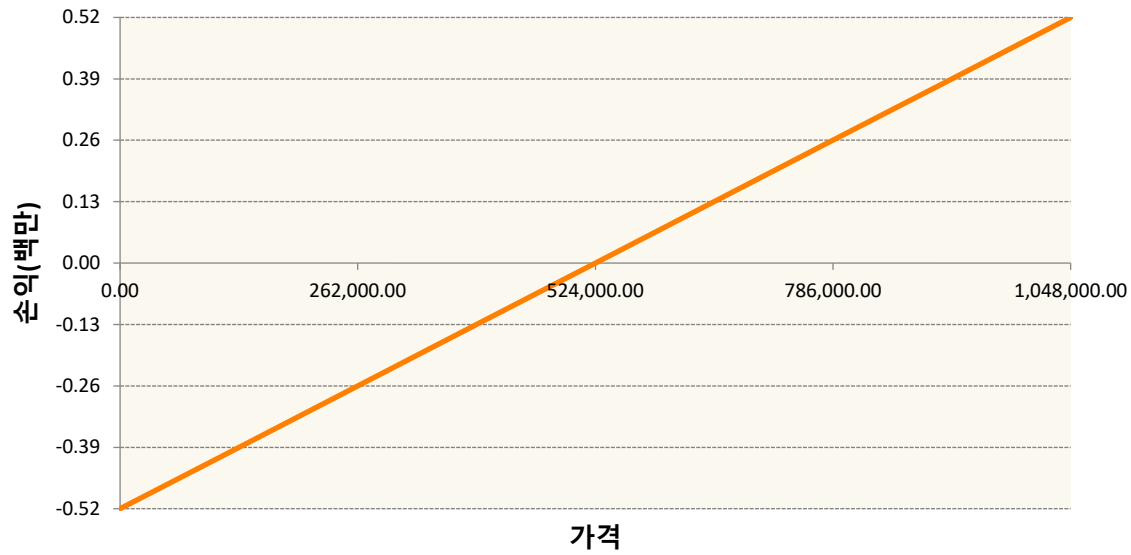
KR4ABN670005-2026-07 현대건설개별선물



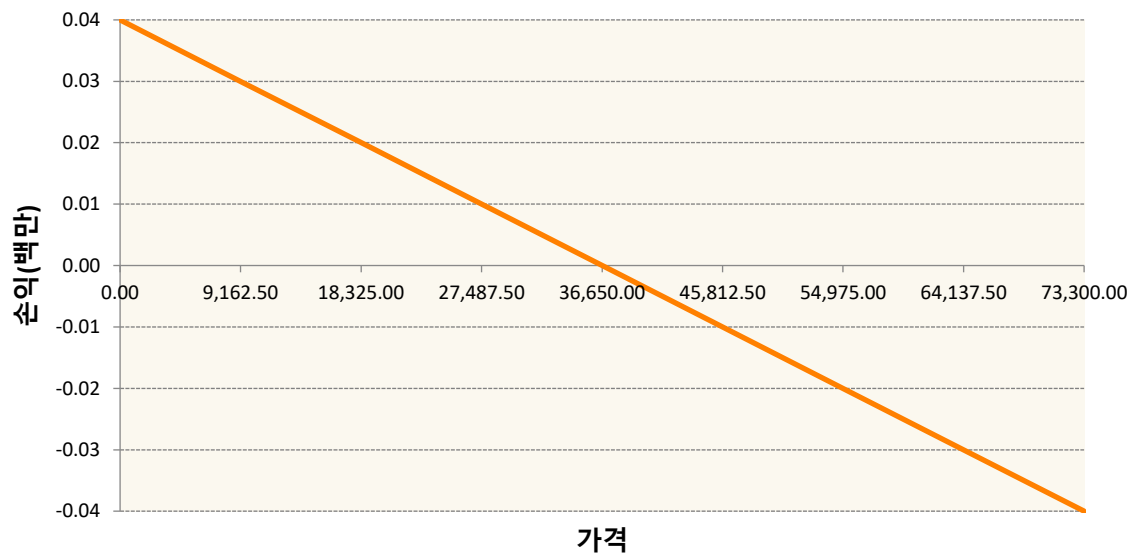
KR4ABZ670001-2026-07 NH투자증권개별선물



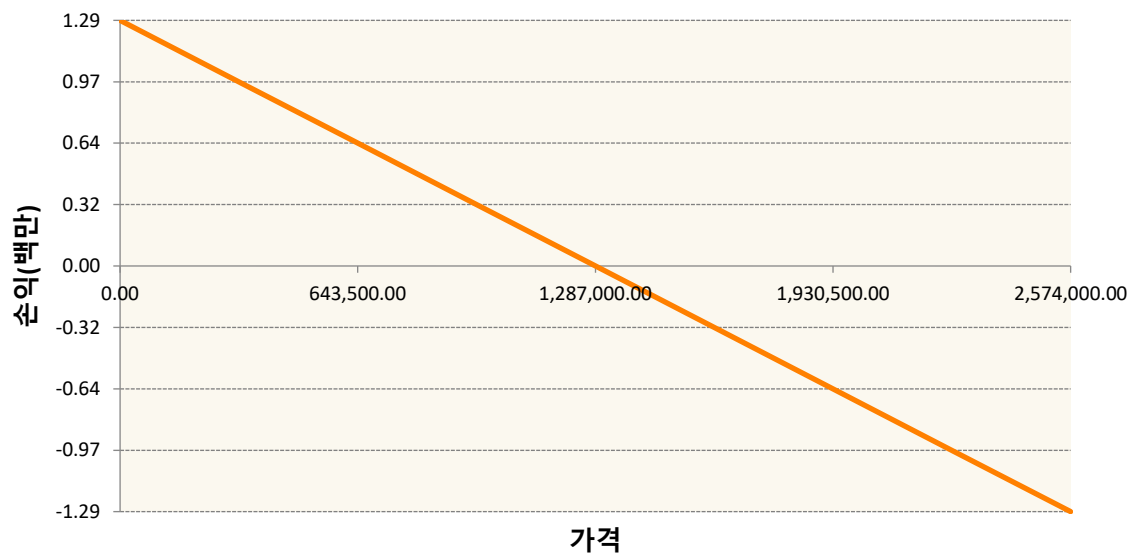
KR4AC8670003-2026-07 삼성물산개별선물



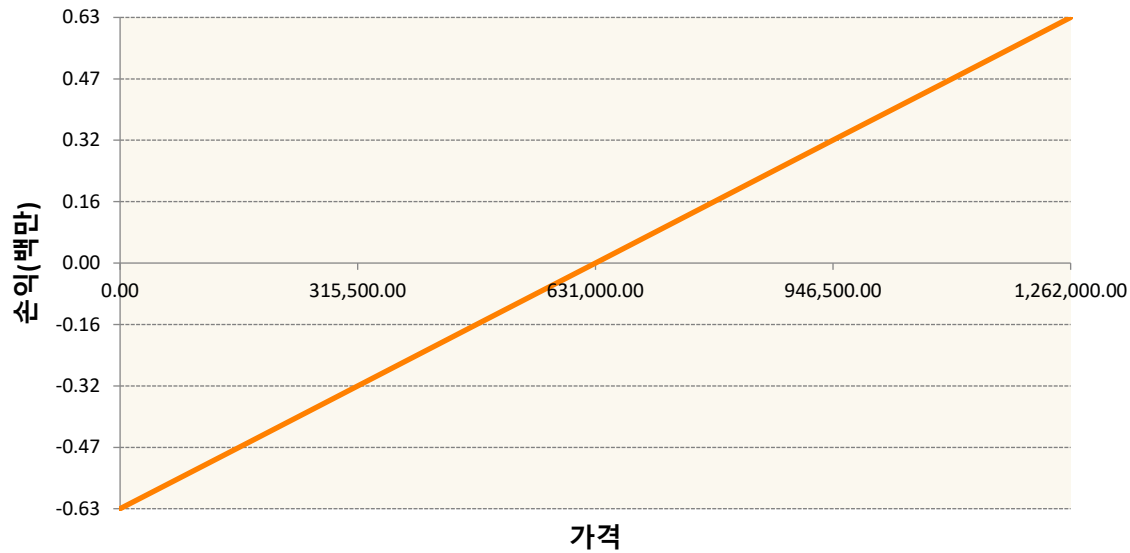
KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



KR4AES670007-2026-07 삼성바이오로직스개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				532
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-532	-532	-532	-532	-532	-532	-532
-5.33%	-355	-355	-355	-355	-355	-355	-355
-2.67%	-177	-177	-177	-177	-177	-177	-177
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	177	177	177	177	177	177	177
5.33%	355	355	355	355	355	355	355
8.00%	532	532	532	532	532	532	532
KR4A11670002			2026-07 삼성전자개별선물				419
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-5.33%	-279	-279	-279	-279	-279	-279	-279
-2.67%	-140	-140	-140	-140	-140	-140	-140
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	140	140	140	140	140	140	140
5.33%	279	279	279	279	279	279	279
8.00%	419	419	419	419	419	419	419
KR4A17670006			2026-07 삼성증권개별선물				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

KR4A20670001	2026-07 현대모비스개별선물	62
--------------	-------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	62	62	62	62	62	62
-5.33%	41	41	41	41	41	41	41
-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%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62

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

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

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

177

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-177	-177	-177	-177	-177	-177	-177
-5.33%	-118	-118	-118	-118	-118	-118	-118
-2.67%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	59	59	59	59	59	59	59
5.33%	118	118	118	118	118	118	118
8.00%	177	177	177	177	177	177	177

KR4ABN670005

2026-07 현대건설개별선물

58

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39
-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%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58

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%	-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

KR4AC8670003

2026-07 삼성물산개별선물

69

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

2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	46	46	46	46	46	46	46
8.00%	69	69	69	69	69	69	69
KR4ACF670004 2026-07 카카오개별선물							94
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	94	94	94	94	94	94	94
-5.33%	63	63	63	63	63	63	63
-2.67%	31	31	31	31	31	31	31
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
5.33%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
8.00%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
KR4AES670007 2026-07 삼성바이오로직스개별선물							59
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	59	59	59	59	59	59	59
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39
-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%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
8.00%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
KR4AFD670003 2026-07 HD현대중공업개별선물							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

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

(단위:백만원)

3,847

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

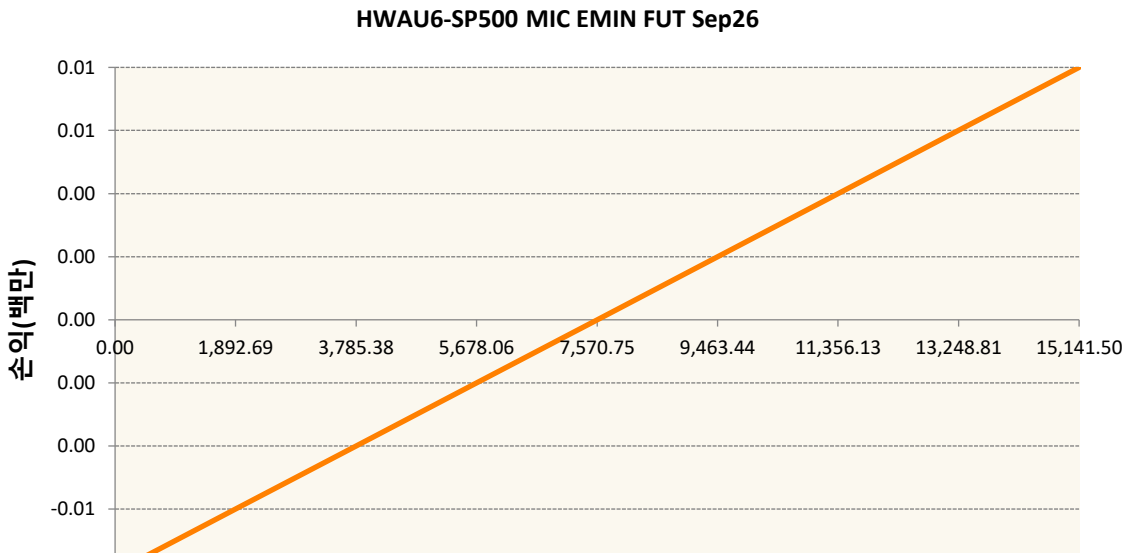
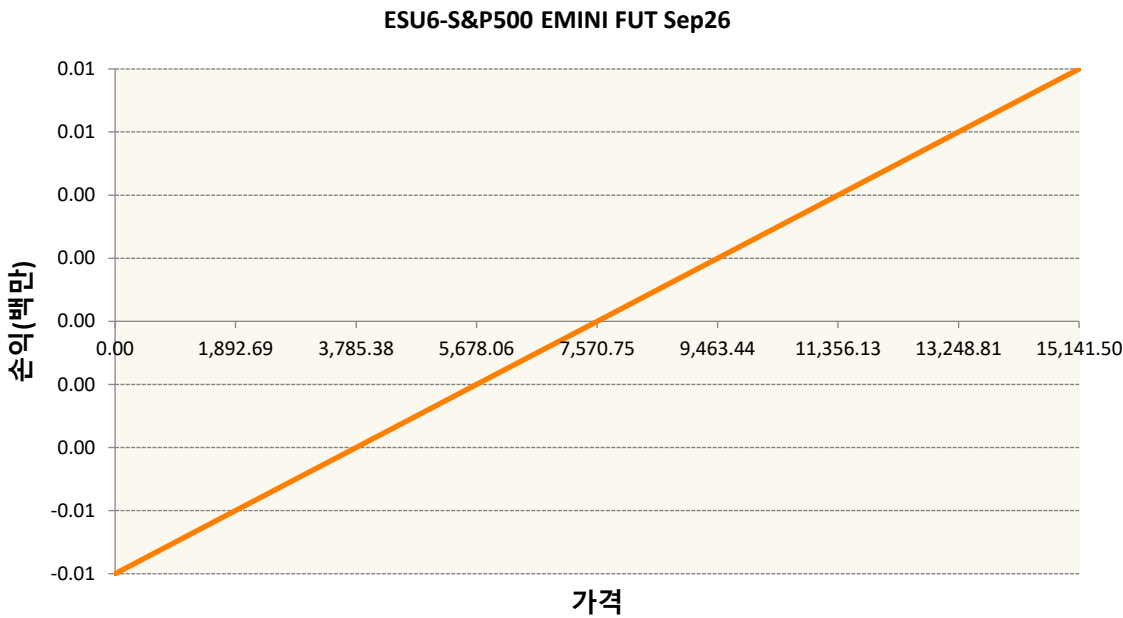
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

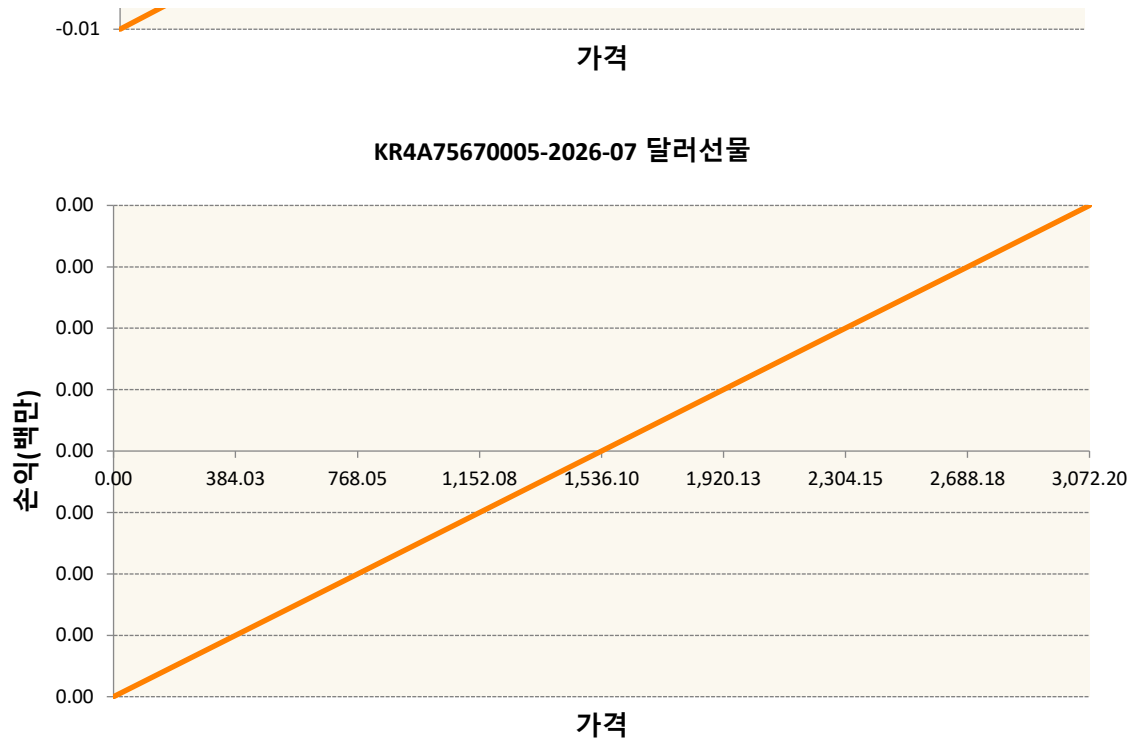
1. 계약금액

(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	62,370	0	62,370	
누계	지수	선물	286	0	286	장내
누계	통화	선물	10,906	0	10,906	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	4,990
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	23
KR4A756700	2026-07 달러선물	873

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

(단위:백만원)

4,336

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

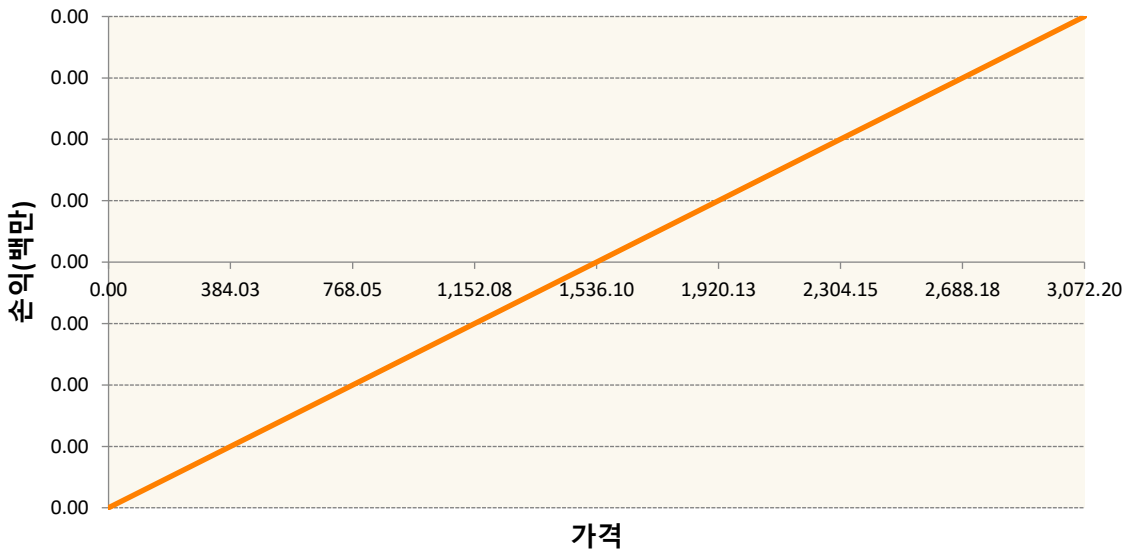
1. 계약금액

(단위:백만원)

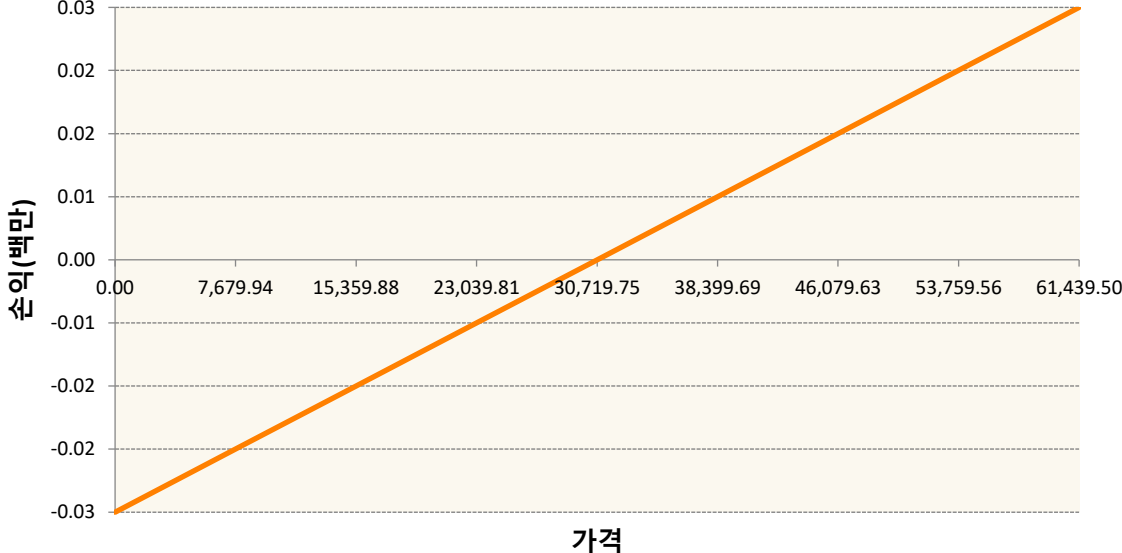
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	31,579	0	31,579	
누계	통화	선물	4,009	0	4,009	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A75670005-2026-07 달러선물



NQU6-NASDAQ 100 E-MINI Sep25



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
KR4A756700 2026-07 달러선물		321
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	2,526

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,835

공시일	2026-06-23
기준일	2026-06-22

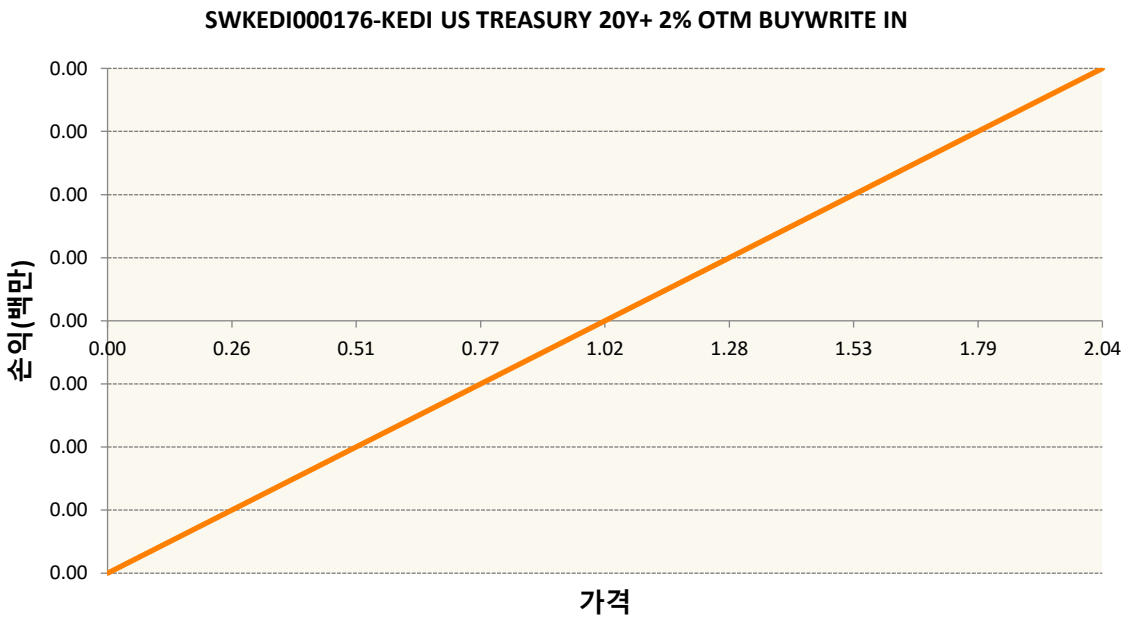
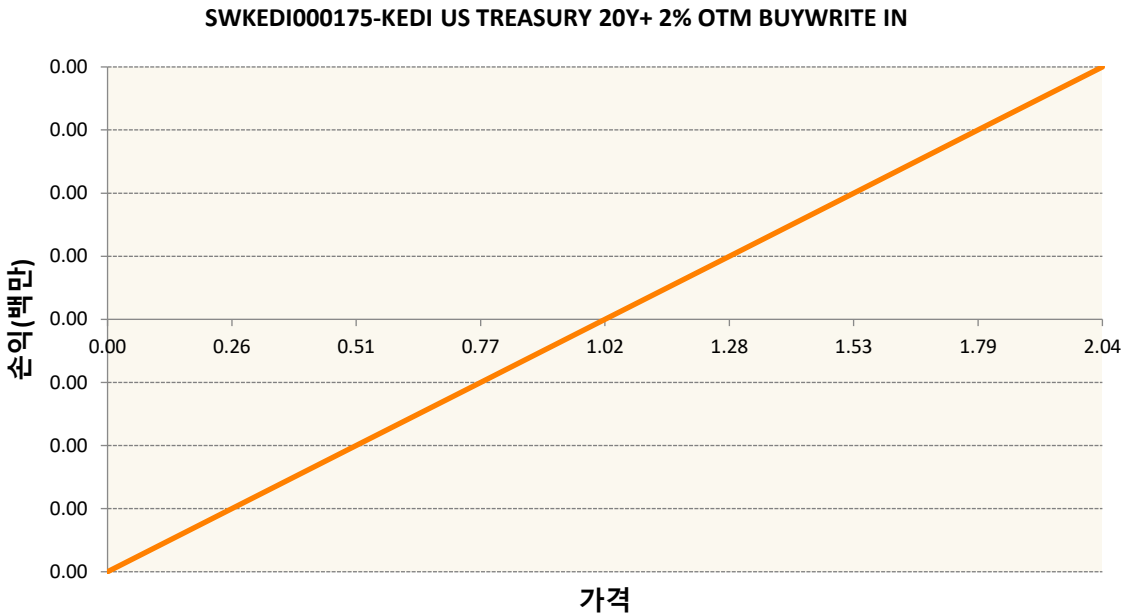
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

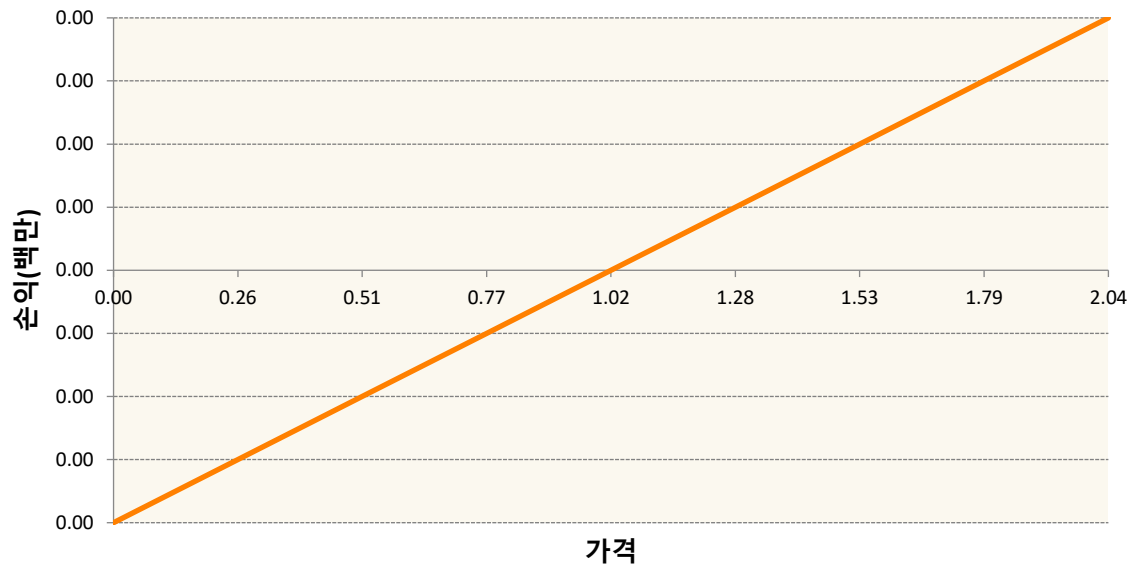
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	327,430	0	327,430	장외

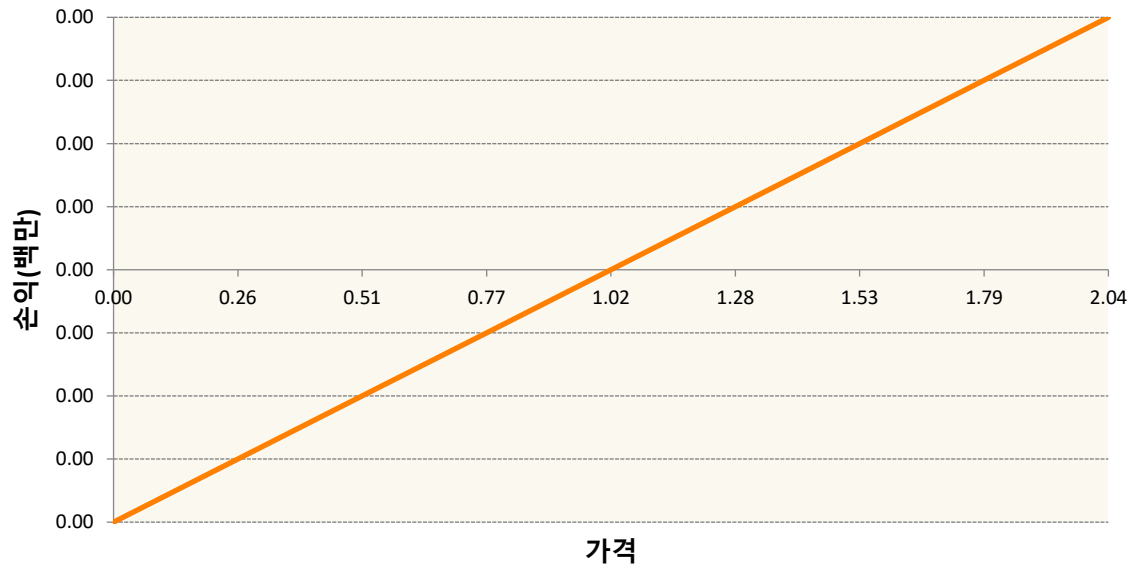
2. 만기시점의 손익구조



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	8,600
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,342
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,274
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,088

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

(단위:백만원)

11,070