

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

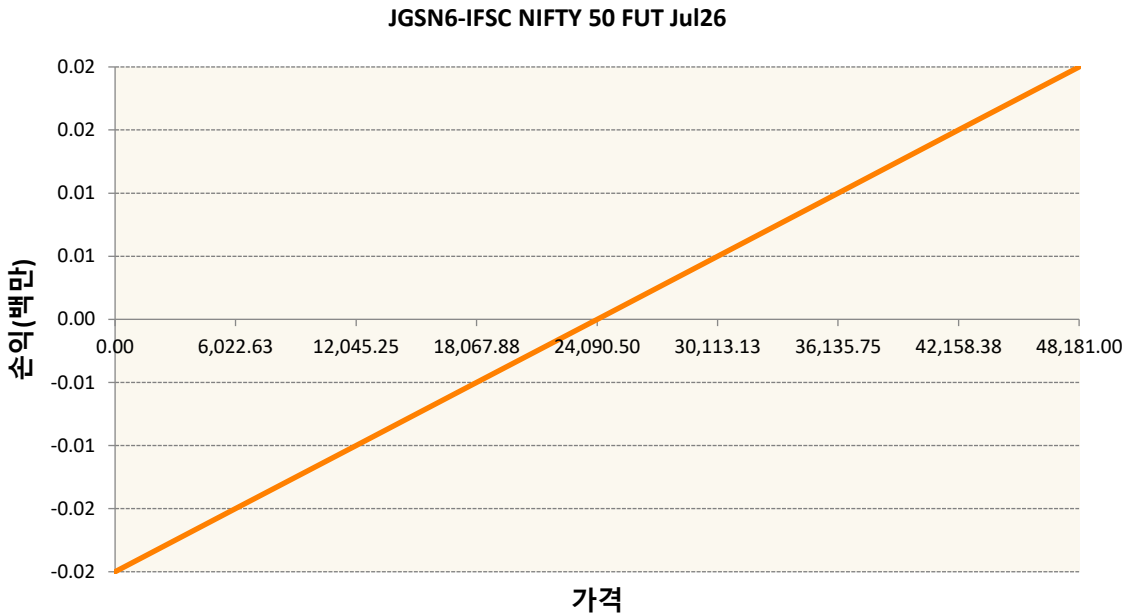
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	372	0	372	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSN6	IFSC NIFTY 50 FUT Jul26	30
-------	-------------------------	----

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

(단위:백만원)

21

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

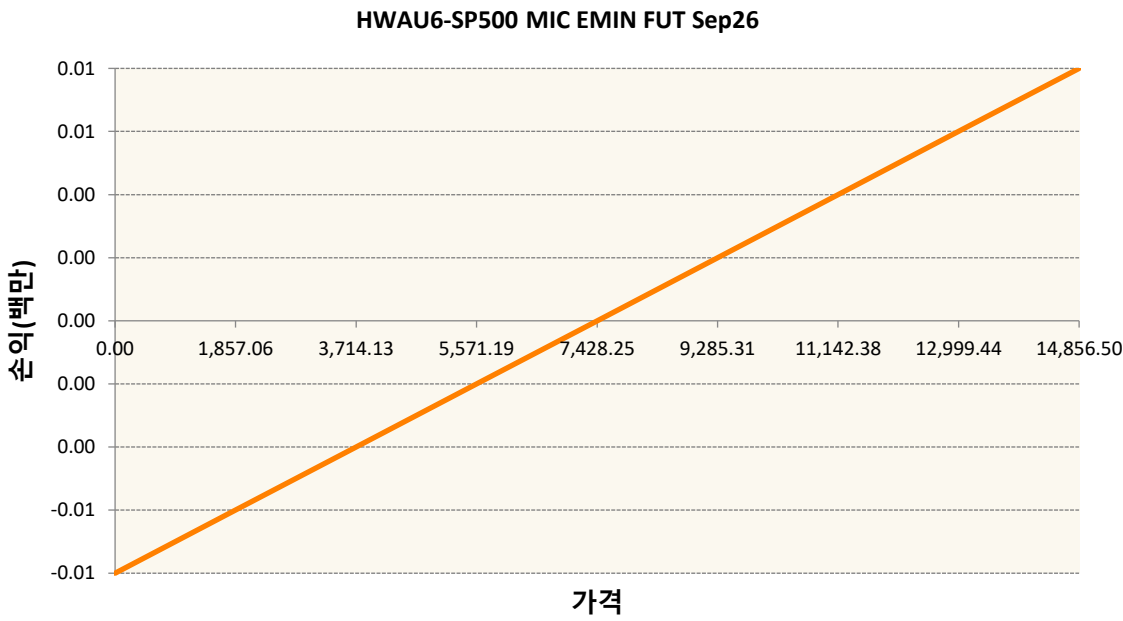
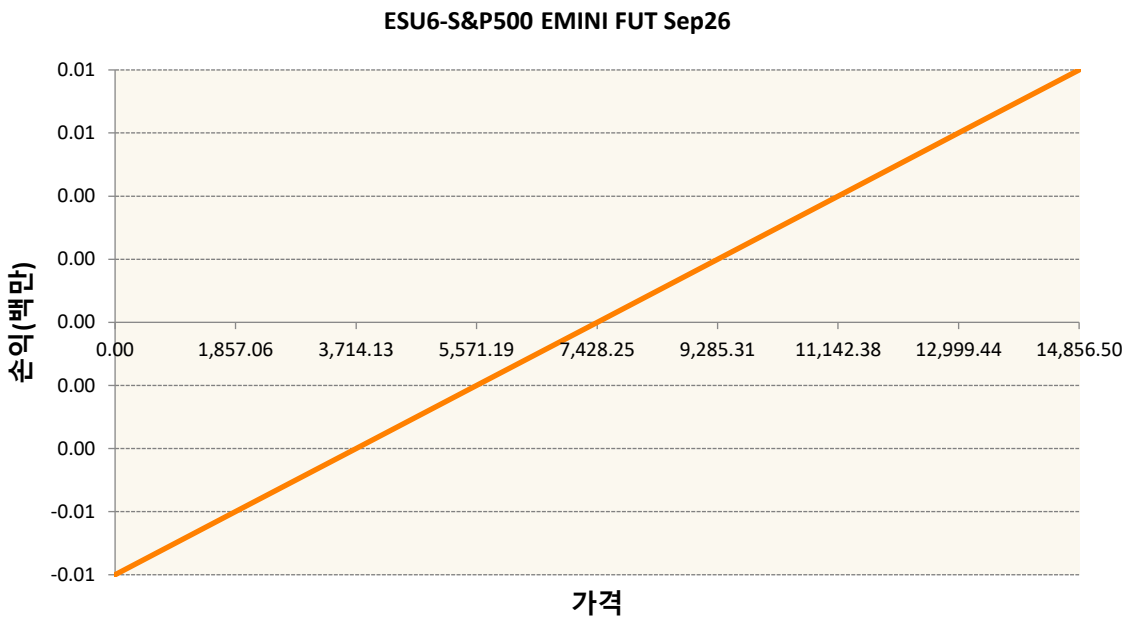
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	567	0	567	
누계	지수	선물	57	0	57	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	45
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	5

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	43

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

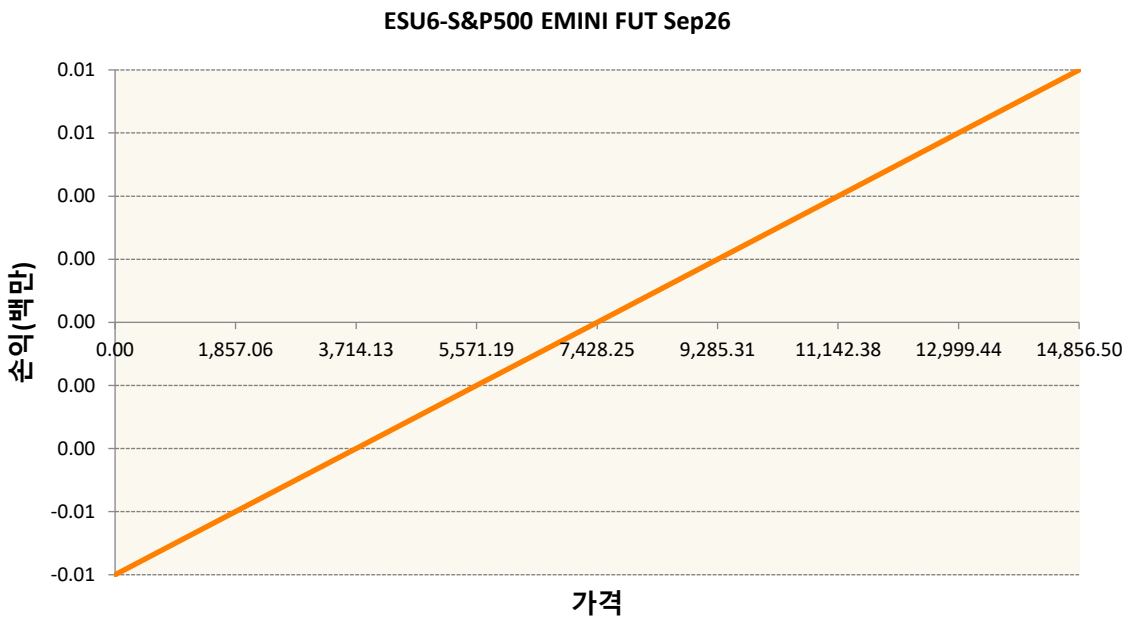
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,123	0	1,123	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	90
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

78

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

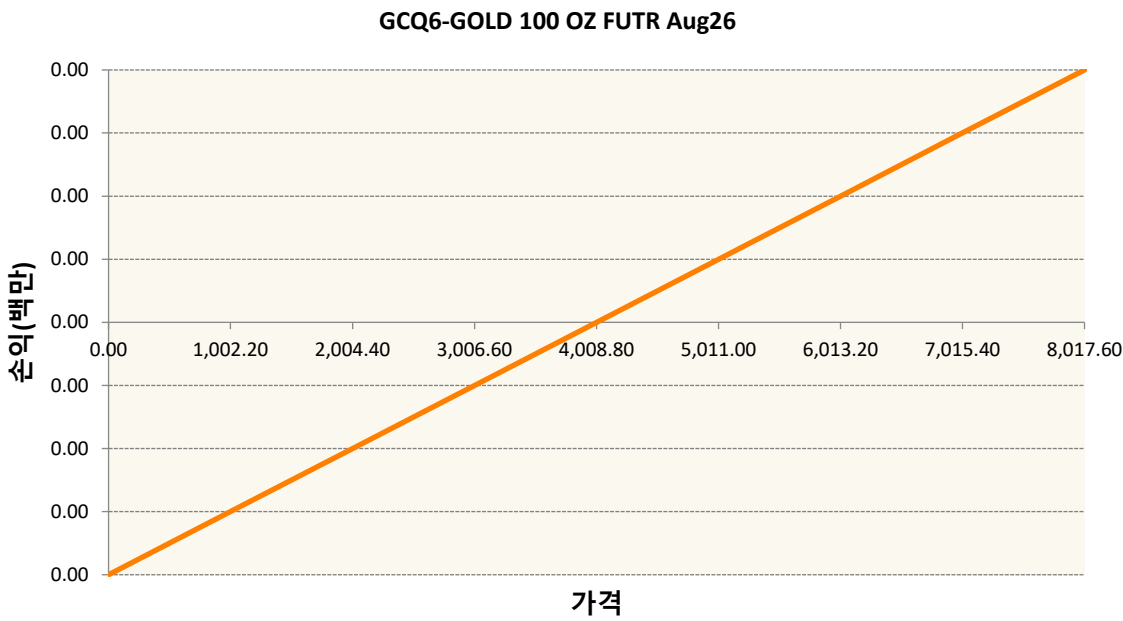
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계	실물자산	선물	4,797	0	4,797	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 06/26/26 C400 EQUITY	4
GCQ6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	384

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

(단위:백만원)

503

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

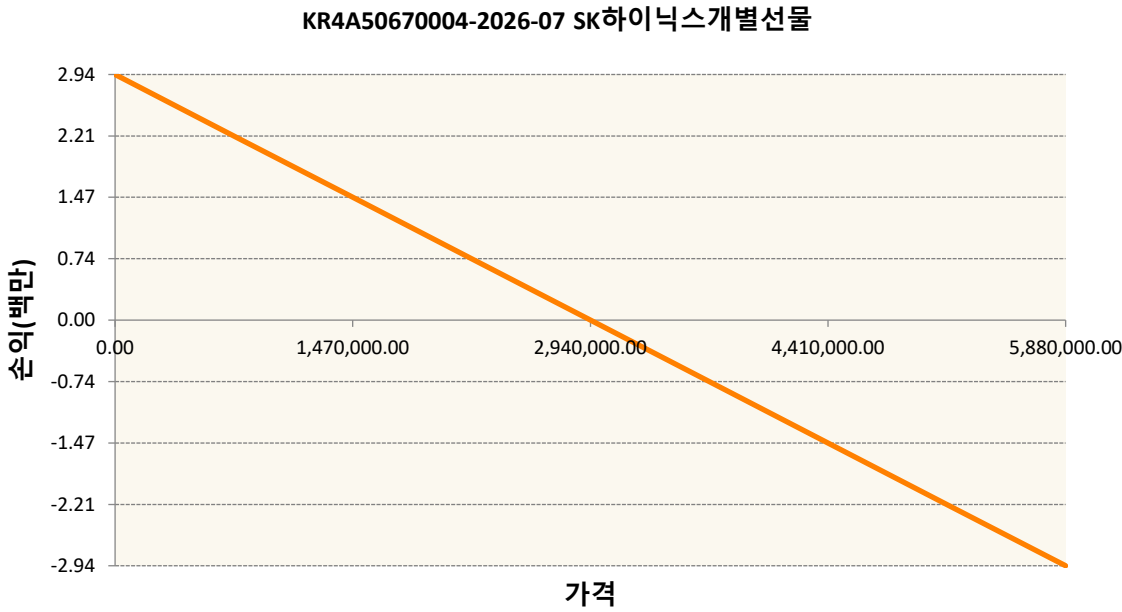
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	23,520	-23,520	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRCUS`PLTR US 06/26/26 C140 EQUITY	59
AOPLTRPUS`PLTR US 06/26/26 P130 EQUITY	34
AOPLTRPUS`PLTR US 06/26/26 P140 EQUITY	0.21
AOPLTRUSC`PLTR US 06/26/26 C135 EQUITY	0.34
KR4A506700 2026-07 SK하이닉스개별선물	1,882

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

(단위:백만원)

284

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

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

0.14

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

(단위:백만원)

0

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

(단위:백만원)

16,706

공시일 2026-06-26

기준일 2026-06-25

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	2026-06-26
기준일	2026-06-25

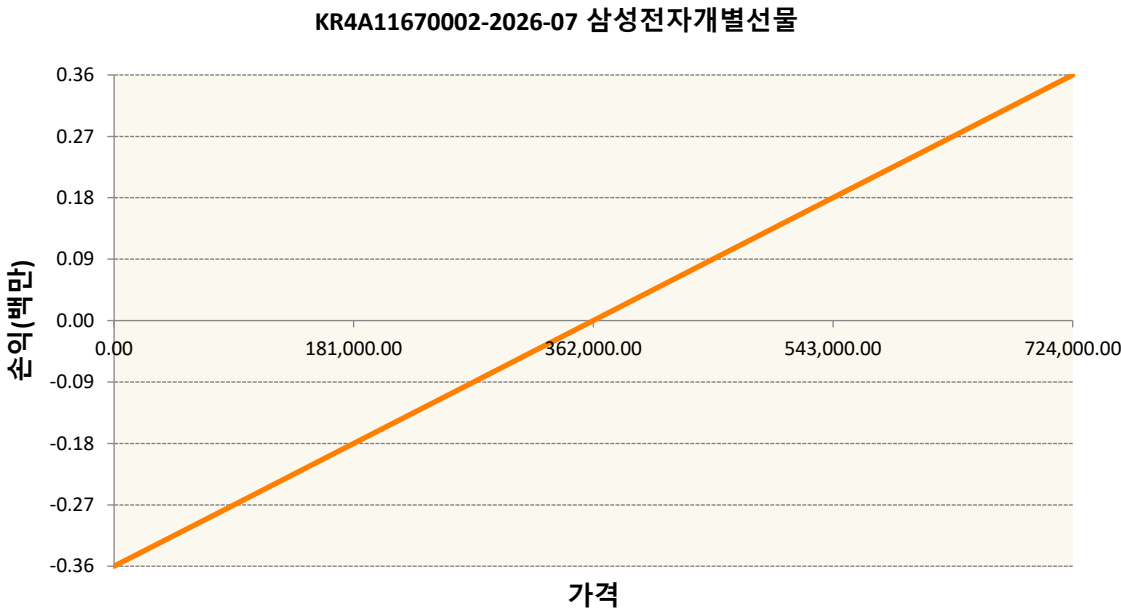
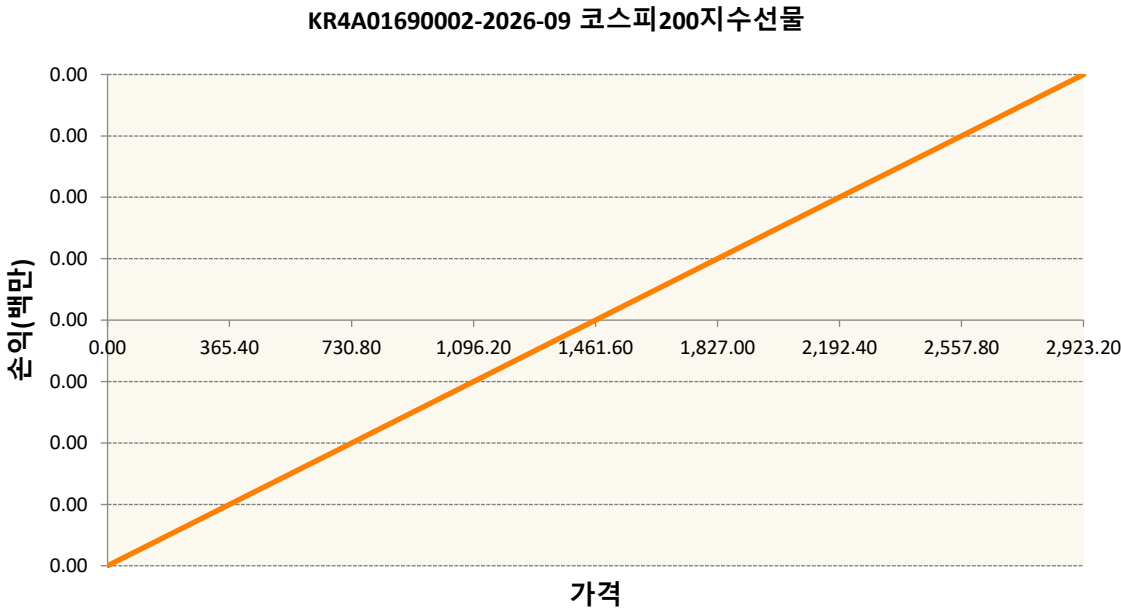
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	47,886	-47,886	장내
누계	유가증권	선물	29,048	46,592	-17,543	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between the amount (가액) and the profit/loss (손익) in millions. The x-axis represents the amount, ranging from 0.00 to 2,910.00 with major ticks every 363.75. The y-axis represents the profit/loss, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A blue line starts at the origin (0, 0.00) and ends at (2,910.00, 0.00), indicating a constant rate of change.

가액	손익(백만)
0.00	0.00
363.75	0.00
727.50	0.00
1,091.25	0.00
1,455.00	0.00
1,818.75	0.00
2,182.50	0.00
2,546.25	0.00
2,910.00	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 2,915.00. The y-axis represents the net income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. A solid blue line shows the relationship, starting at the origin (0, 0) and ending at (2,915, 0).

가액	순이익 (백만)
0.00	0.00
364.38	0.00
728.75	0.00
1,093.13	0.00
1,457.50	0.00
1,821.88	0.00
2,186.25	0.00
2,550.63	0.00
2,915.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				756
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-756	-756	-756	-756	-756	-756	-756	
-5.33%	-504	-504	-504	-504	-504	-504	-504	
-2.67%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	252	252	252	252	252	252	252	
5.33%	504	504	504	504	504	504	504	
8.00%	756	756	756	756	756	756	756	
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물				1,549
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,549	-1,549	-1,549	-1,549	-1,549	-1,549	-1,549
-5.33%	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032	-1,032
-2.67%	-516	-516	-516	-516	-516	-516	-516
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	516	516	516	516	516	516	516
5.33%	1,032	1,032	1,032	1,032	1,032	1,032	1,032
8.00%	1,549	1,549	1,549	1,549	1,549	1,549	1,549
KR4BAFBKB847 코스피위클리M C 2606W5 1,455.0							2,239

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,239	2,239	2,239	2,239	2,239	2,239	2,239
-5.33%	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493	1,493
-2.67%	746	746	746	746	746	746	746
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-746	-746	-746	-746	-746	-746	-746
5.33%	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493	-1,493
8.00%	-2,239	-2,239	-2,239	-2,239	-2,239	-2,239	-2,239

KR4BAFBKB854 코스피위클리M C 2606W5 1,457.5							1,483
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483	1,483
-5.33%	989	989	989	989	989	989	989
-2.67%	494	494	494	494	494	494	494
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-494	-494	-494	-494	-494	-494	-494
5.33%	-989	-989	-989	-989	-989	-989	-989
8.00%	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483	-1,483

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

(단위:백만원)

16,679

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

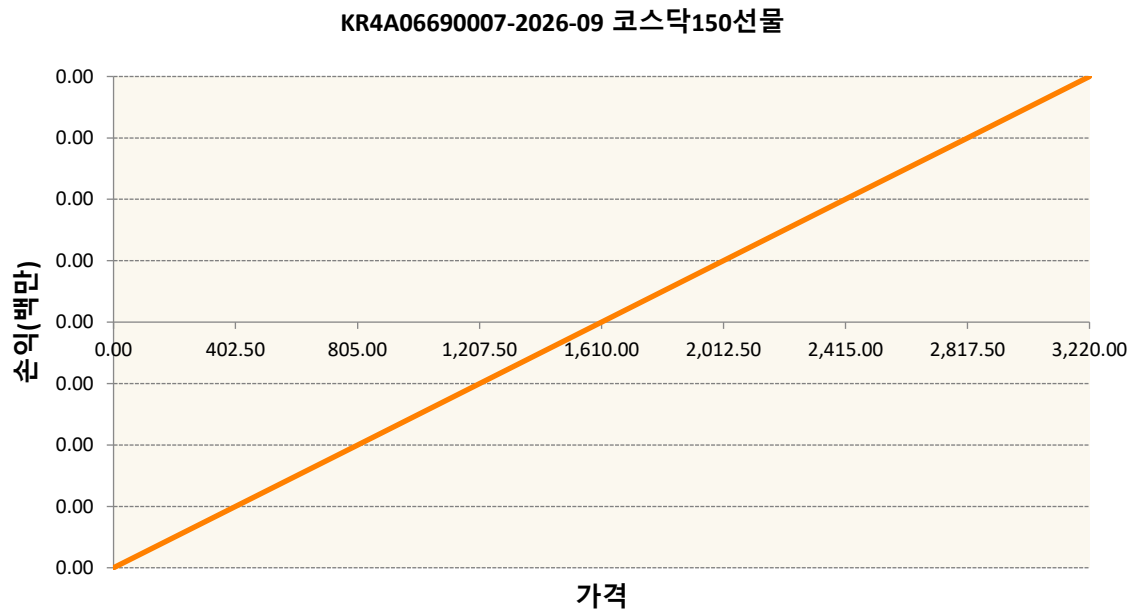
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	934	0	934	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007		2026-09 코스닥150선물					74
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-5.33%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	50	50	50	50	50	50	50
8.00%	74	74	74	74	74	74	74

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

(단위:백만원)

34,245

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

(단위:백만원)

95,485

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

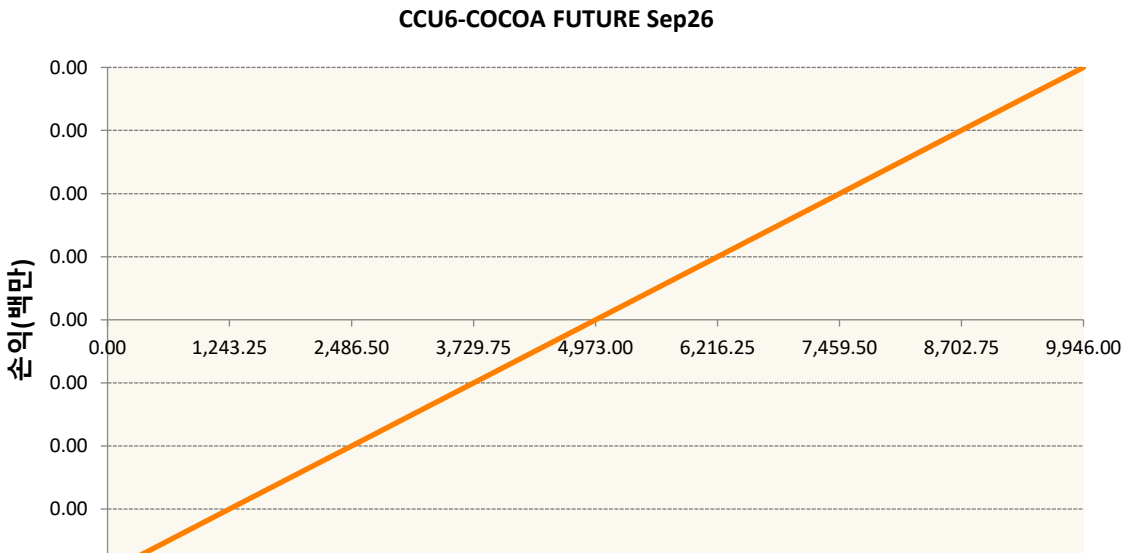
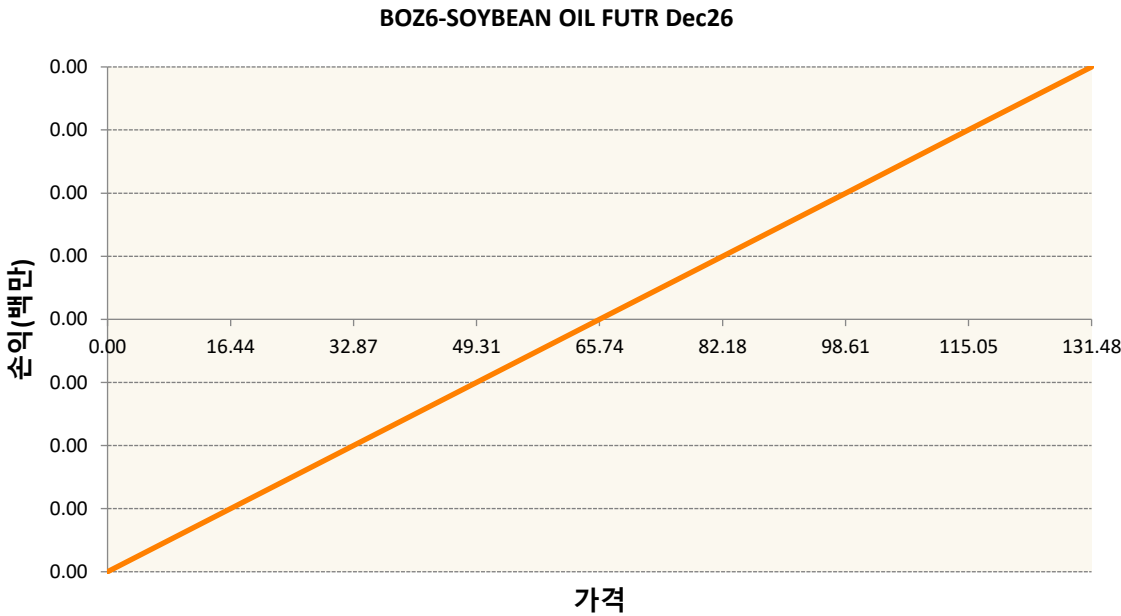
포커스농산물모(채권-파생형)

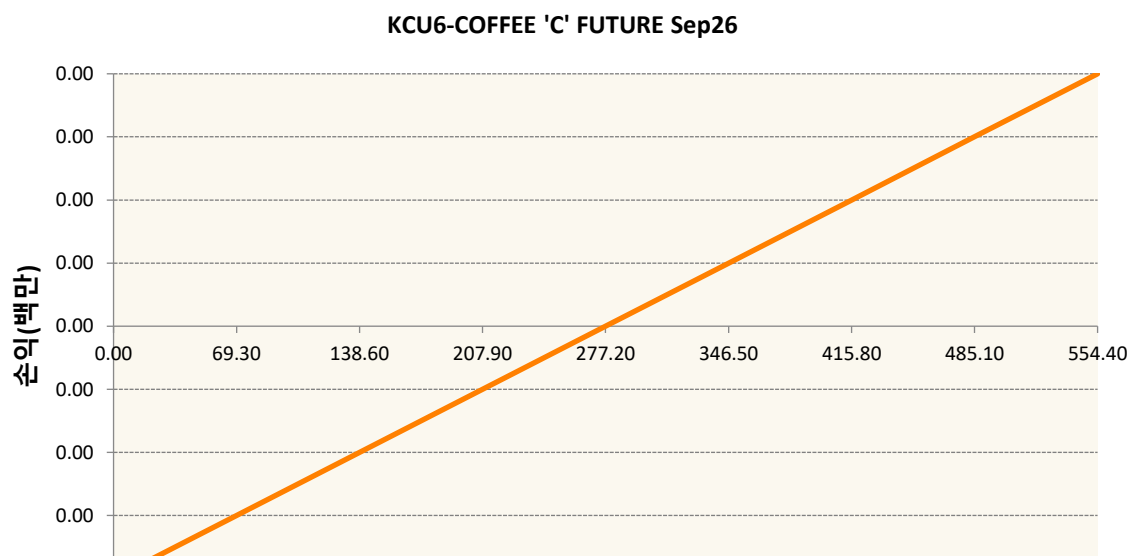
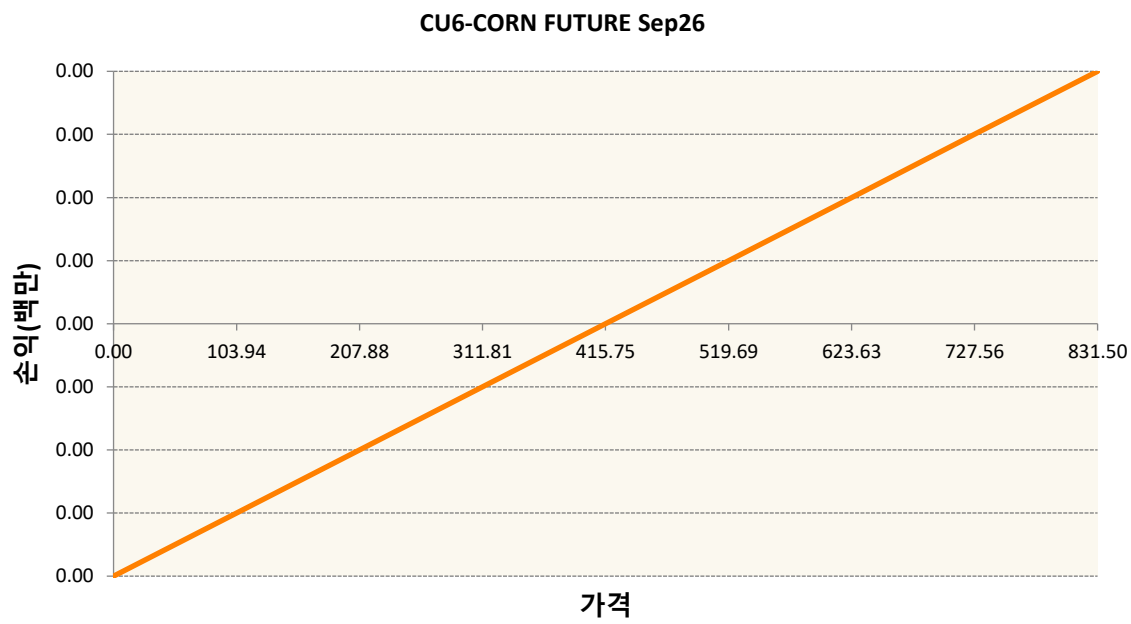
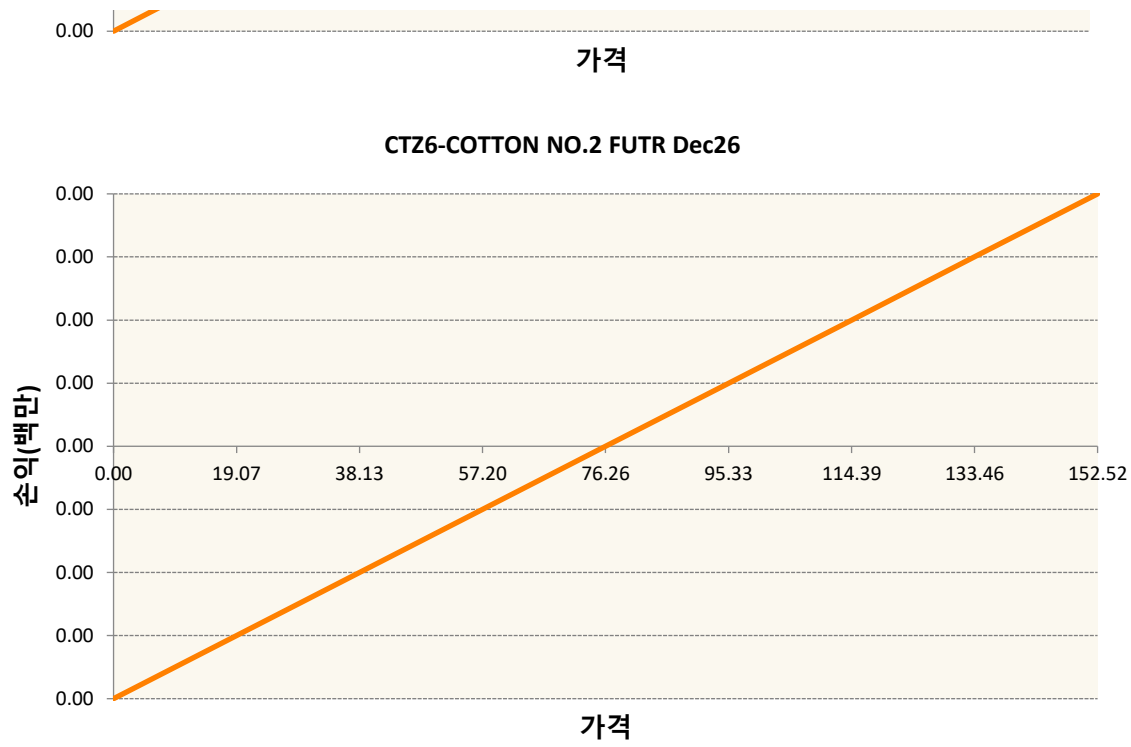
1. 계약금액

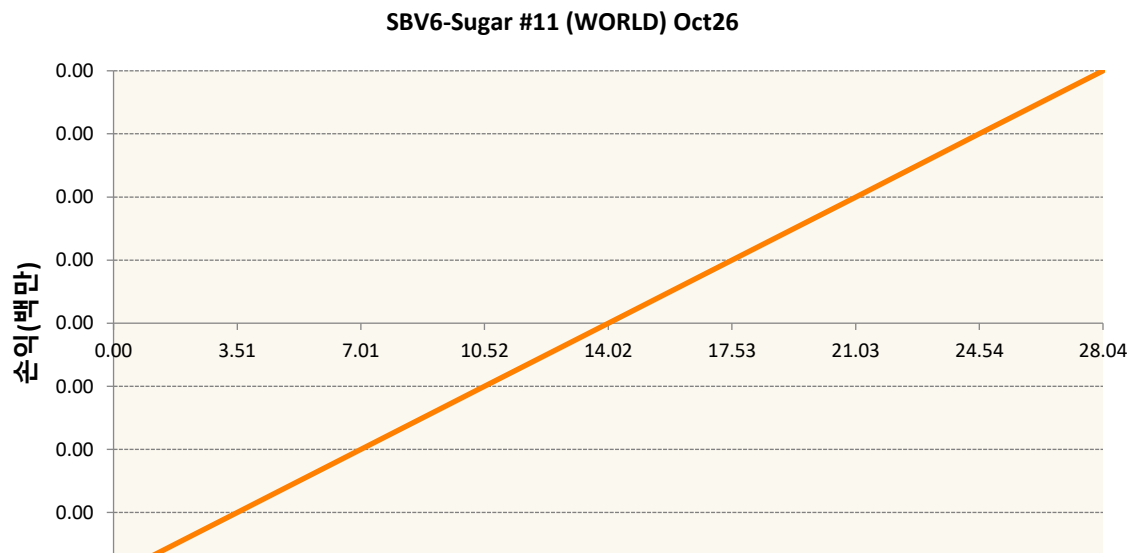
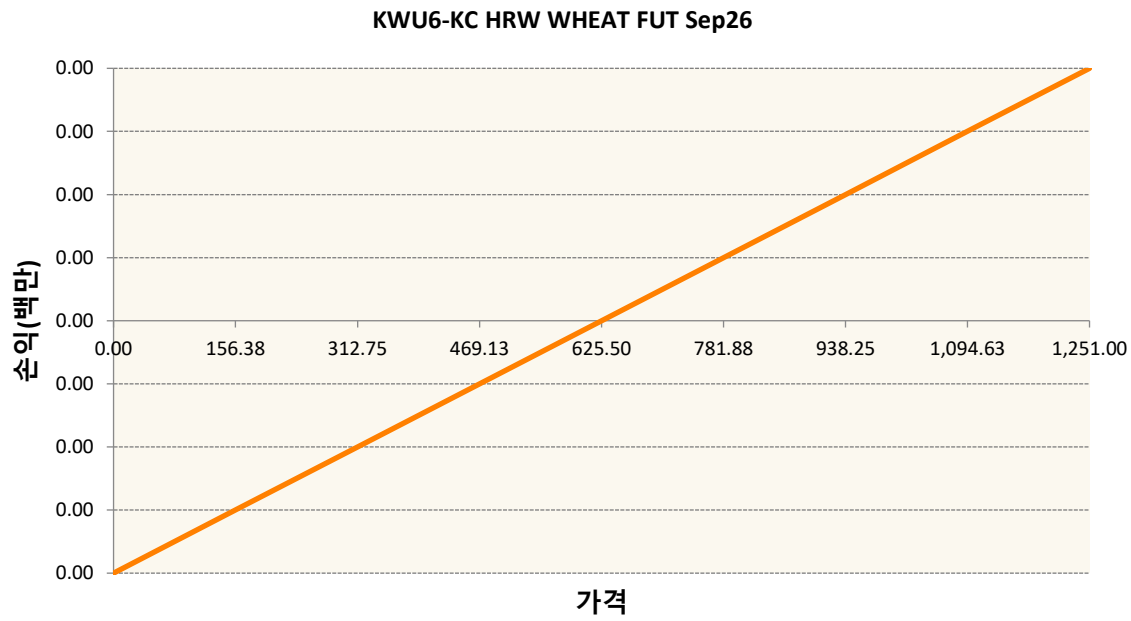
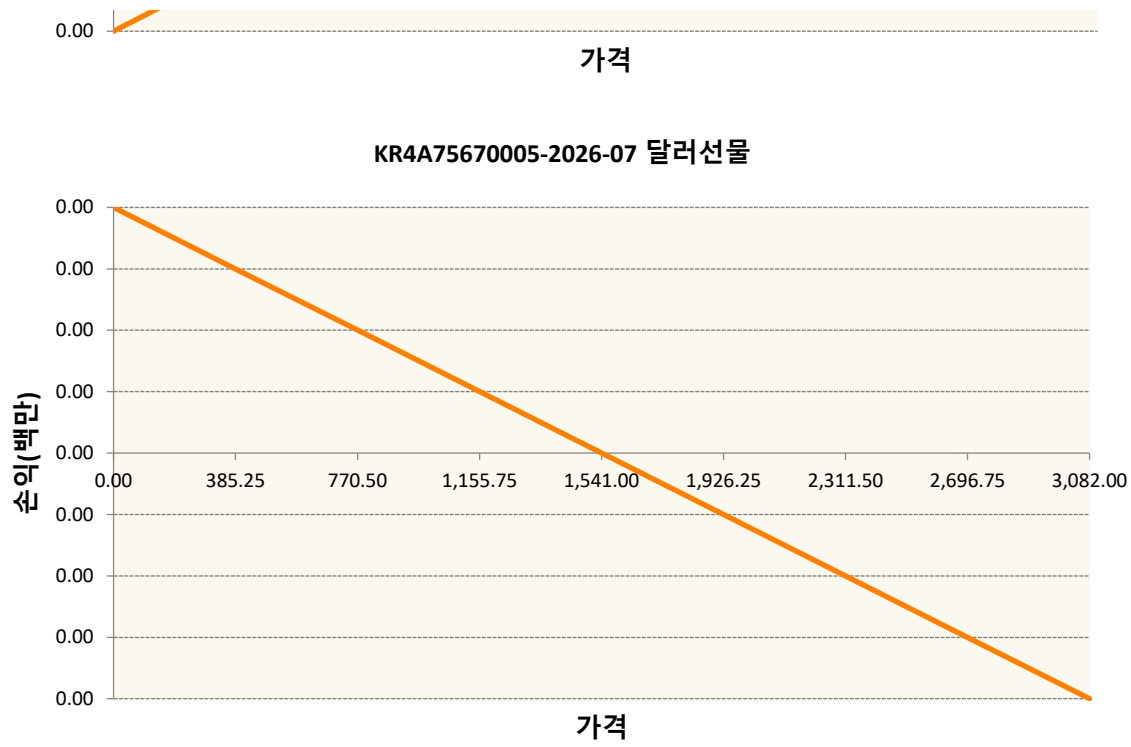
(단위:USD 백만)

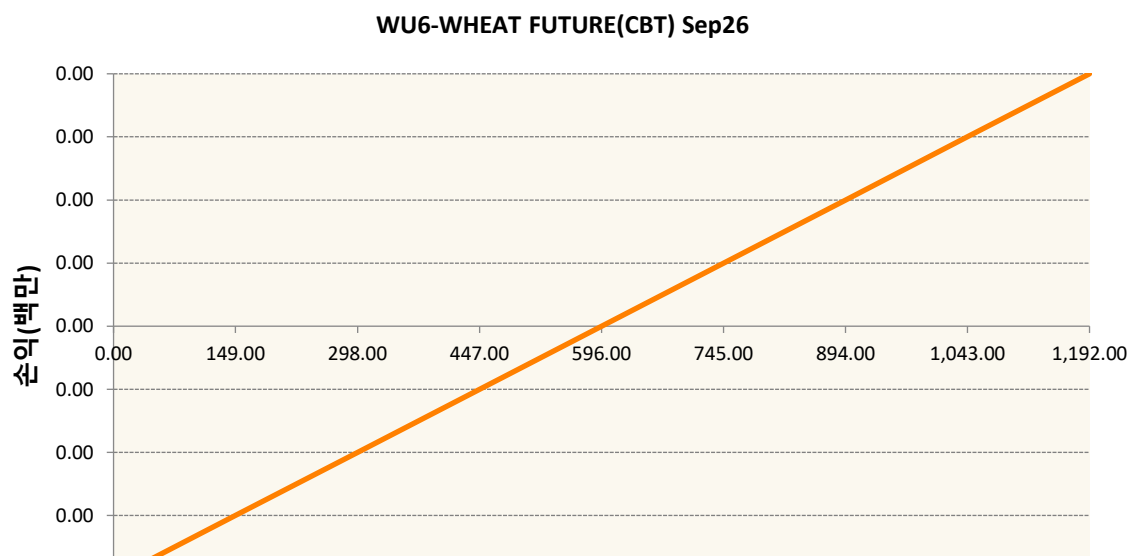
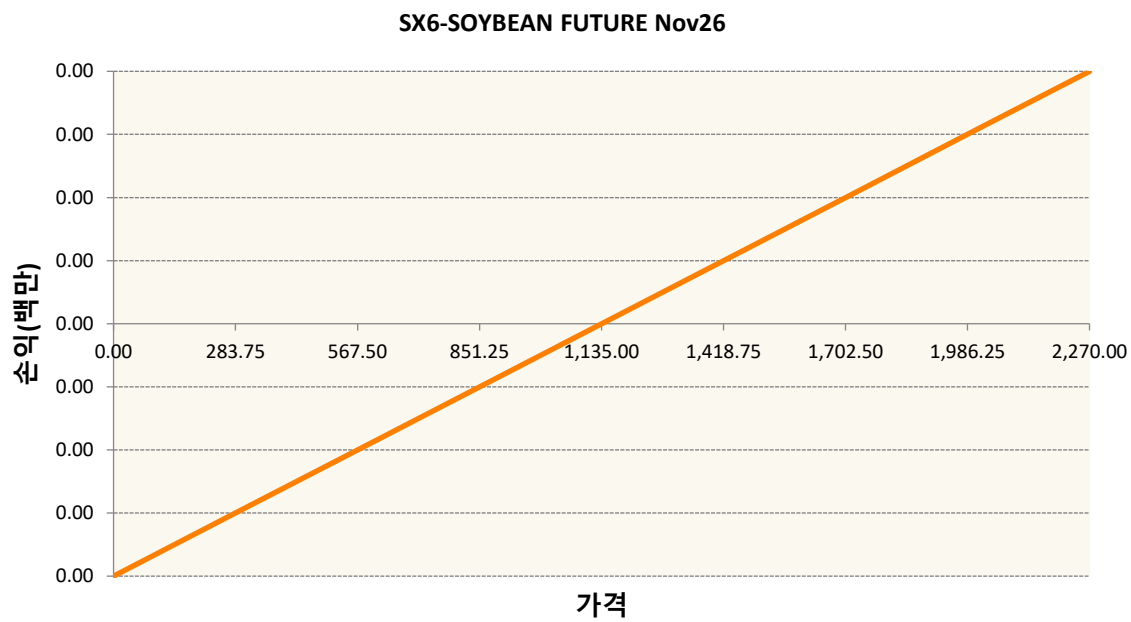
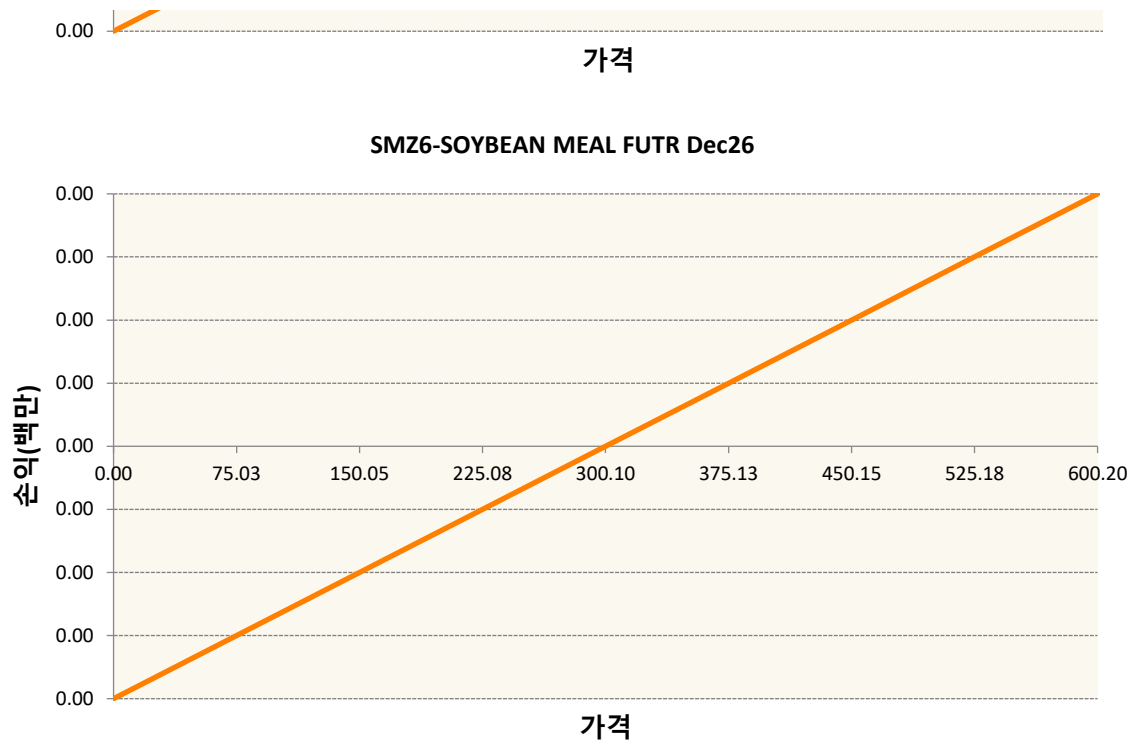
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	436	0	436	
누계	유가증권	선물	2,026	0	2,026	
누계	통화	선물	0	170	-170	장내

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	2026-06-26
기준일	2026-06-25

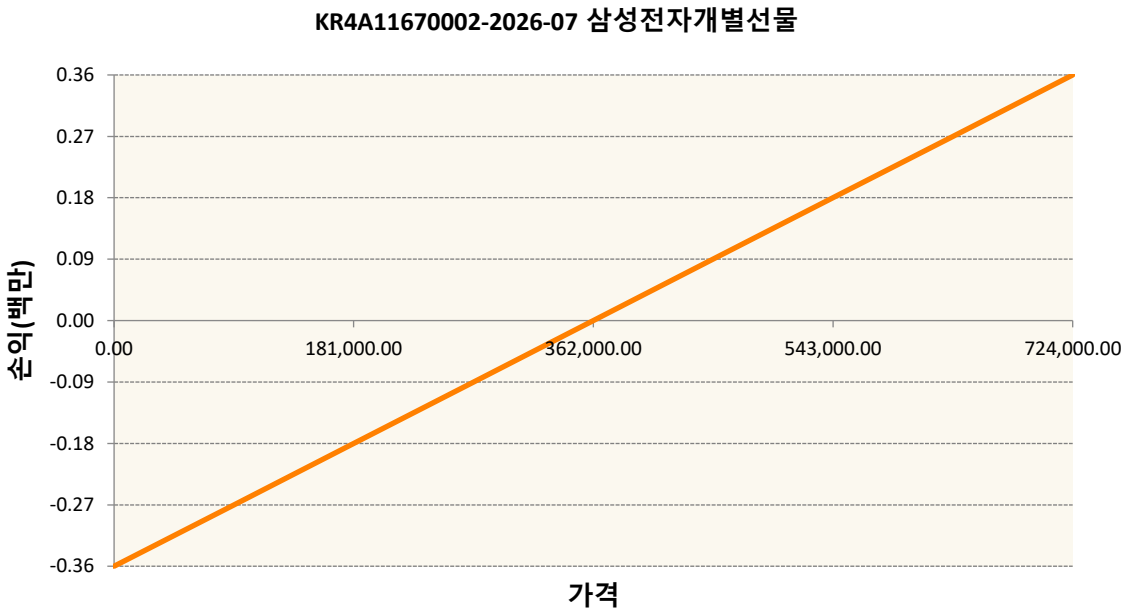
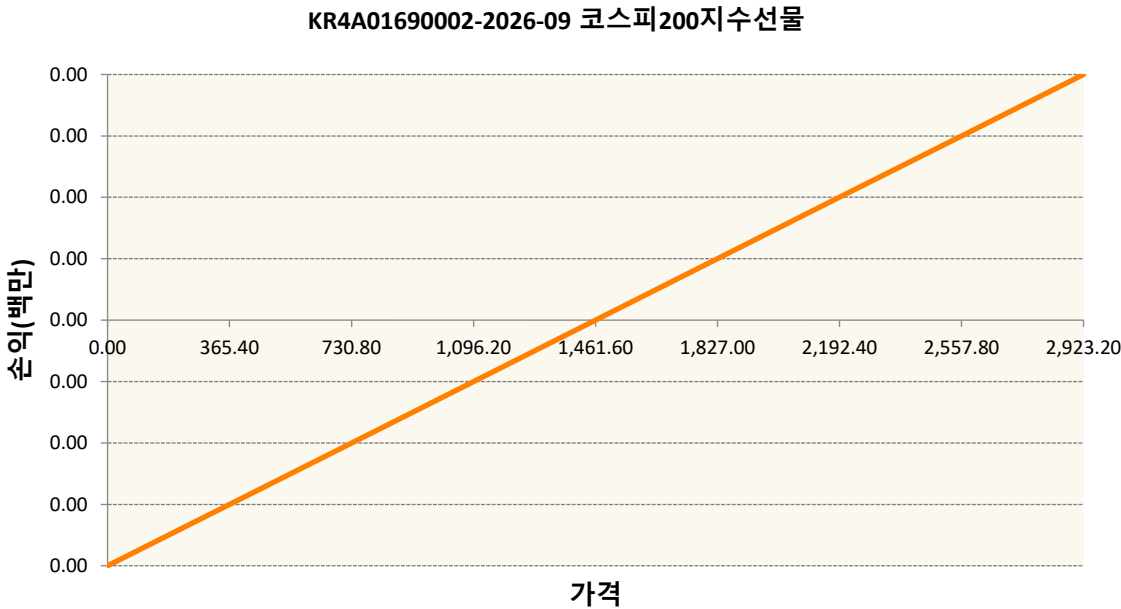
스마트인덱스모

1. 계약금액

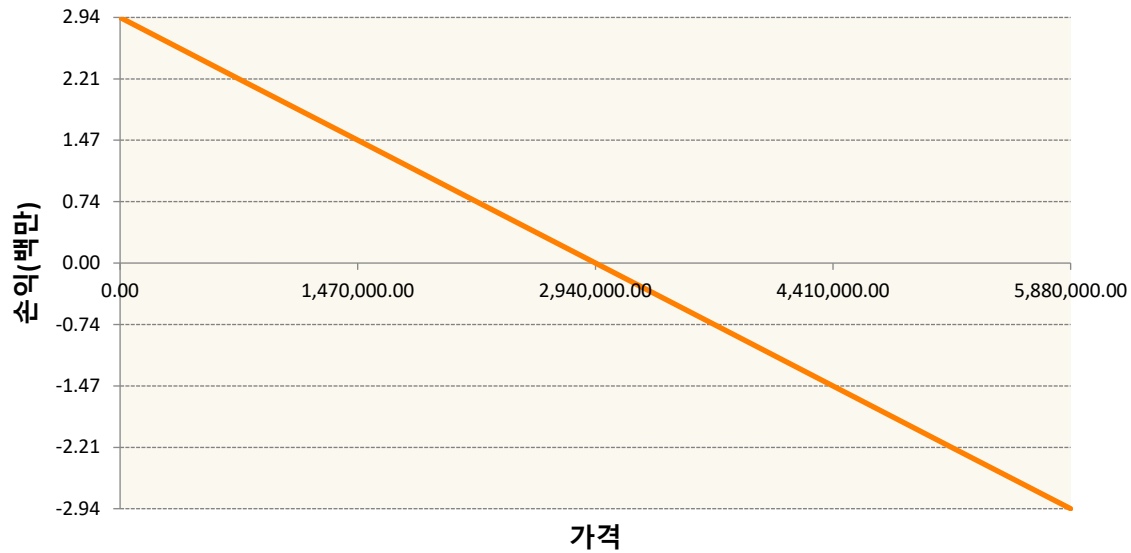
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,462	3,317	-1,854	장내
누계	유가증권	선물	4,895	735	4,160	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				378
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-378	-378	-378	-378	-378	-378	-378
-5.33%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-2.67%	-126	-126	-126	-126	-126	-126	-126
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	126	126	126	126	126	126	126
5.33%	252	252	252	252	252	252	252
8.00%	378	378	378	378	378	378	378
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
KR4A50670004			2026-07 SK하이닉스개별선물				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

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

(단위:백만원)

1,243

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

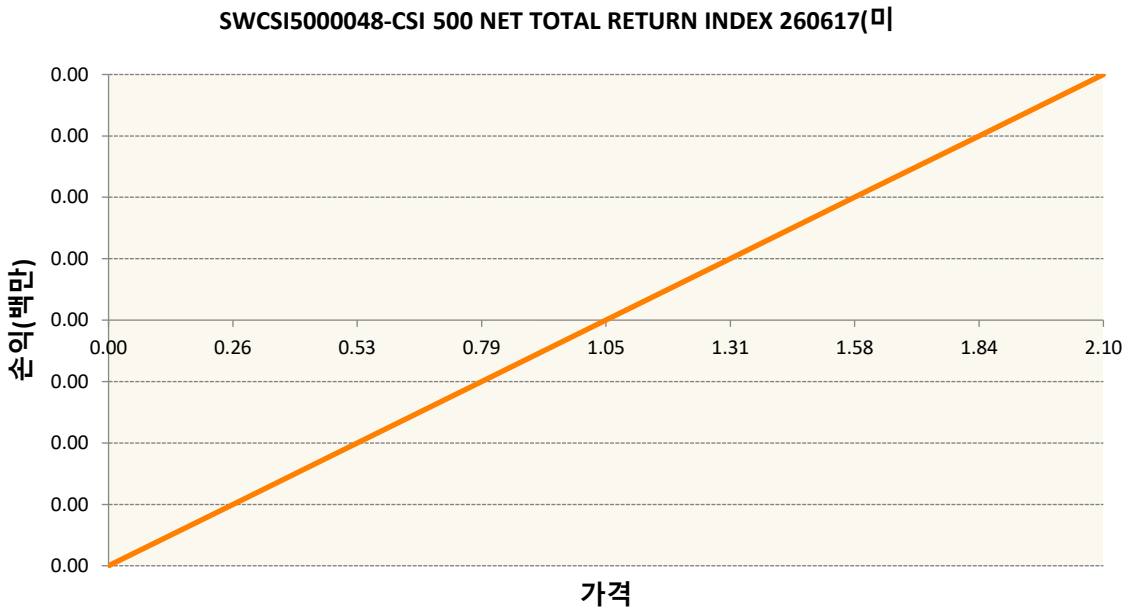
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	6,086	0	6,086	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

486

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

649

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

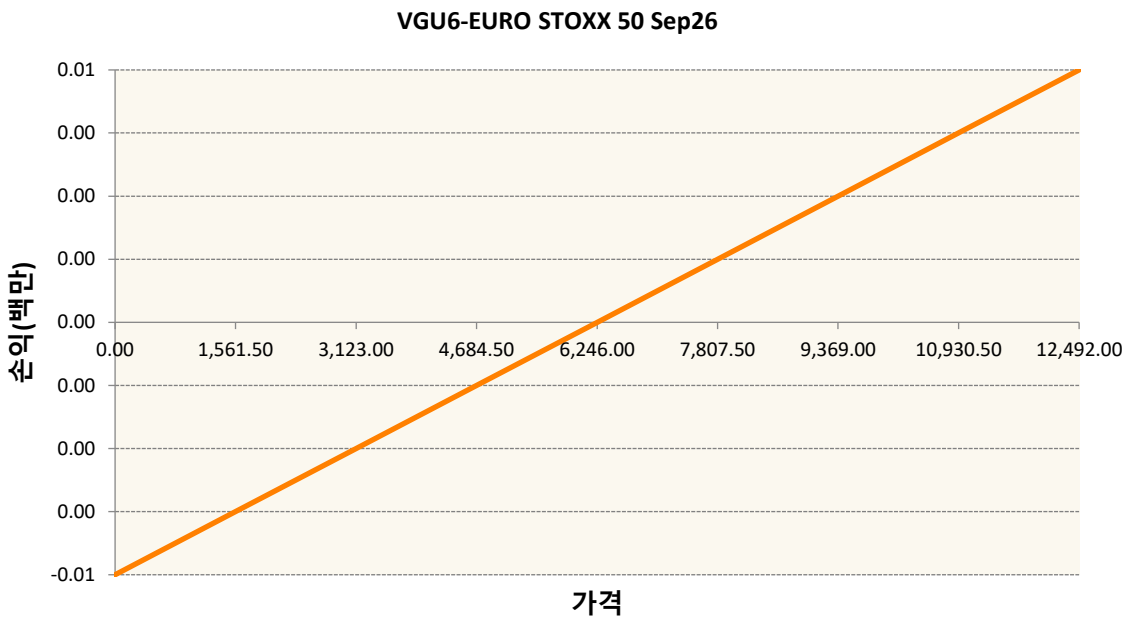
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	987	0	987	

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	2026-06-26
기준일	2026-06-25

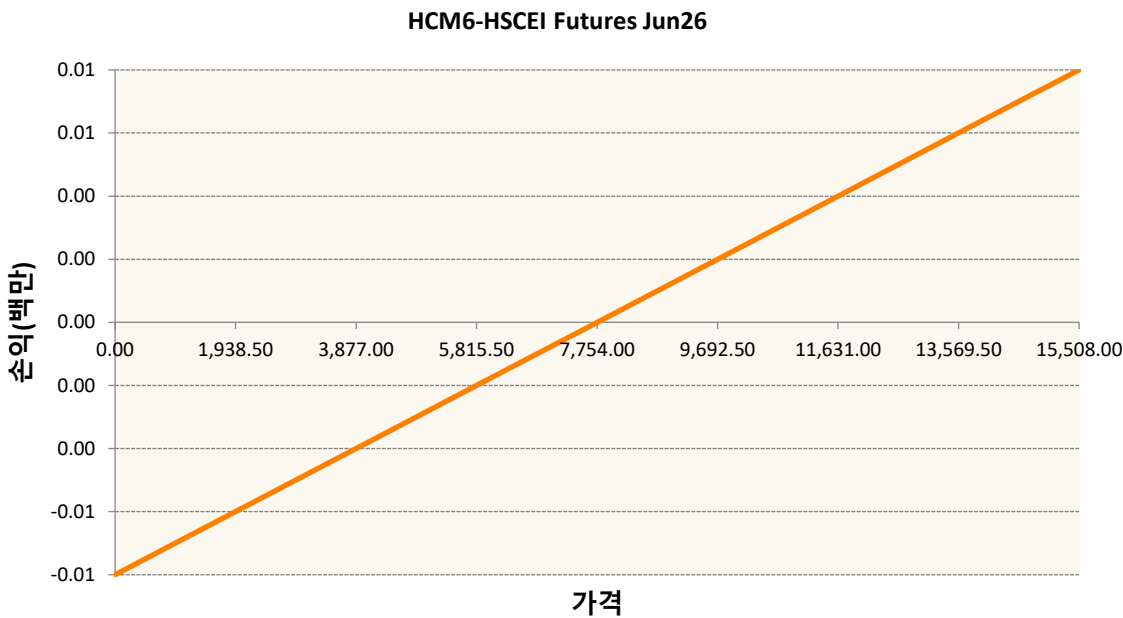
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,188	0	1,188	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCM6	HSCEI Futures Jun26	95
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

114

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

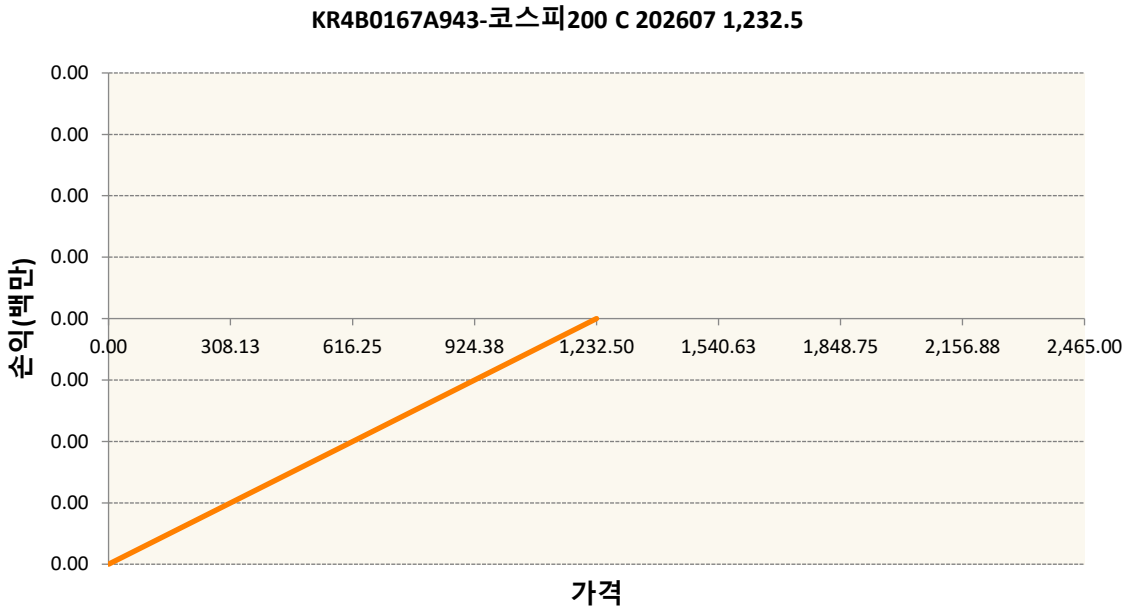
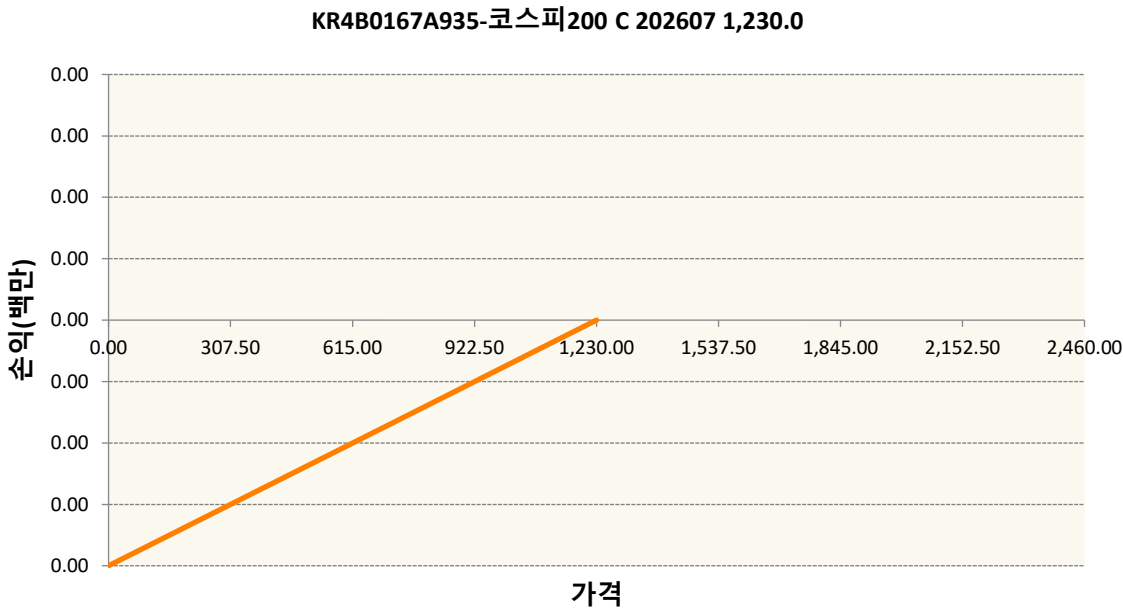
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

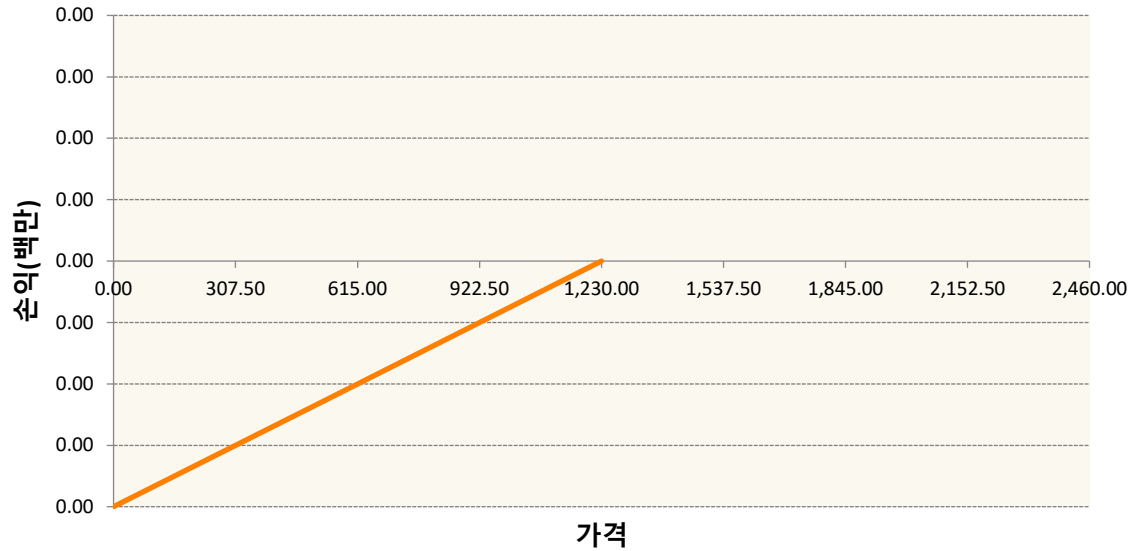
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	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							292
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29	-71	-113	-157	-202	-247	-292
-5.33%	23	-14	-54	-94	-136	-179	-223
-2.67%	62	30	-5	-43	-82	-122	-163
0%	91	64	33	0	-36	-73	-112
2.67%	113	90	64	35	3	-32	-68
5.33%	128	110	88	62	34	3	-30
8.00%	138	124	106	84	60	32	2
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5							811
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-83	-198	-317	-438	-561	-686	-811
-5.33%	62	-41	-151	-264	-380	-499	-620
-2.67%	173	82	-15	-119	-227	-339	-453
0%	255	178	93	0	-99	-202	-310
2.67%	315	251	178	96	8	-87	-187
5.33%	357	306	245	174	95	10	-82
8.00%	387	347	296	236	167	90	7
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0							268
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-26	-65	-104	-144	-185	-226	-268
-5.33%	21	-13	-49	-87	-125	-165	-205
-2.67%	57	27	-5	-39	-75	-112	-150
0%	84	59	31	0	-33	-67	-103

2.67%	103	83	59	32	2	-29	-62
5.33%	117	100	80	57	31	3	-27
8.00%	127	114	97	77	55	29	2

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,265

공시일 2026-06-26

기준일 2026-06-25

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	2026-06-26
기준일	2026-06-25

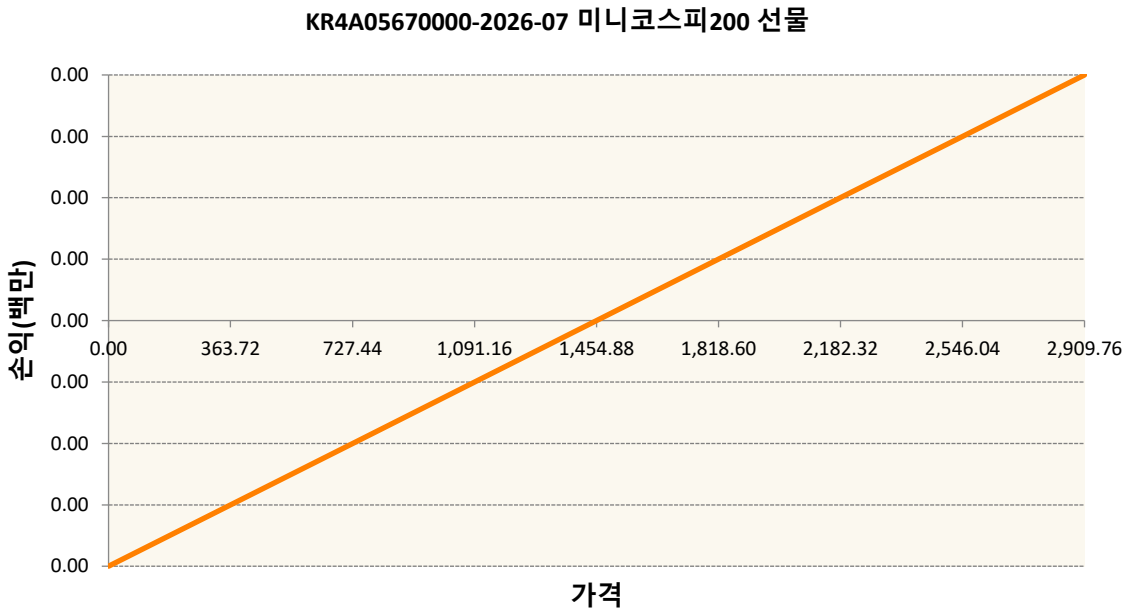
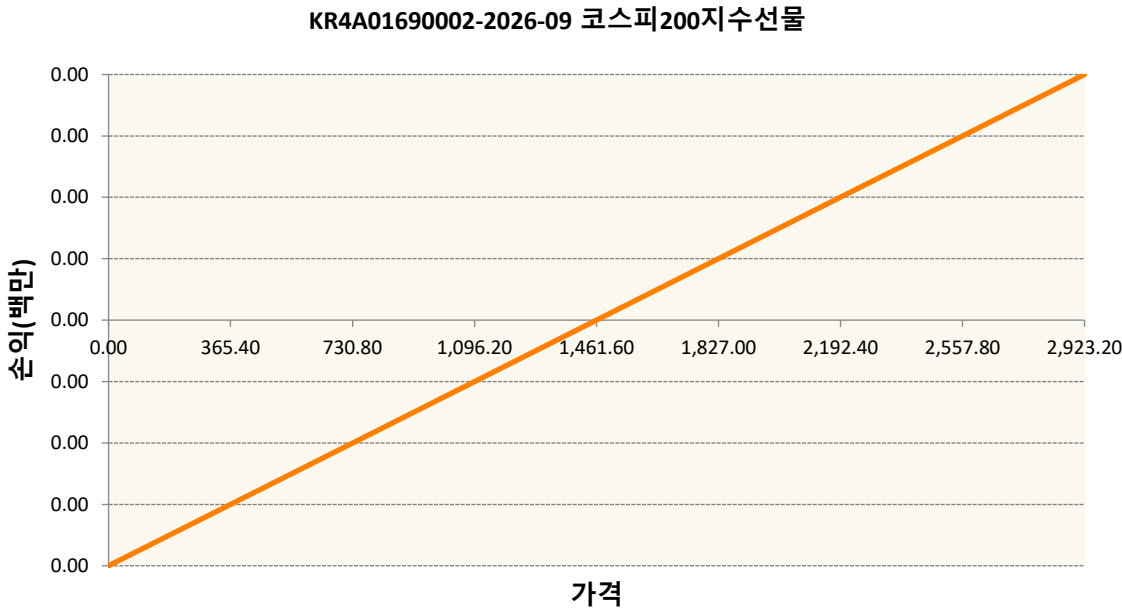
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

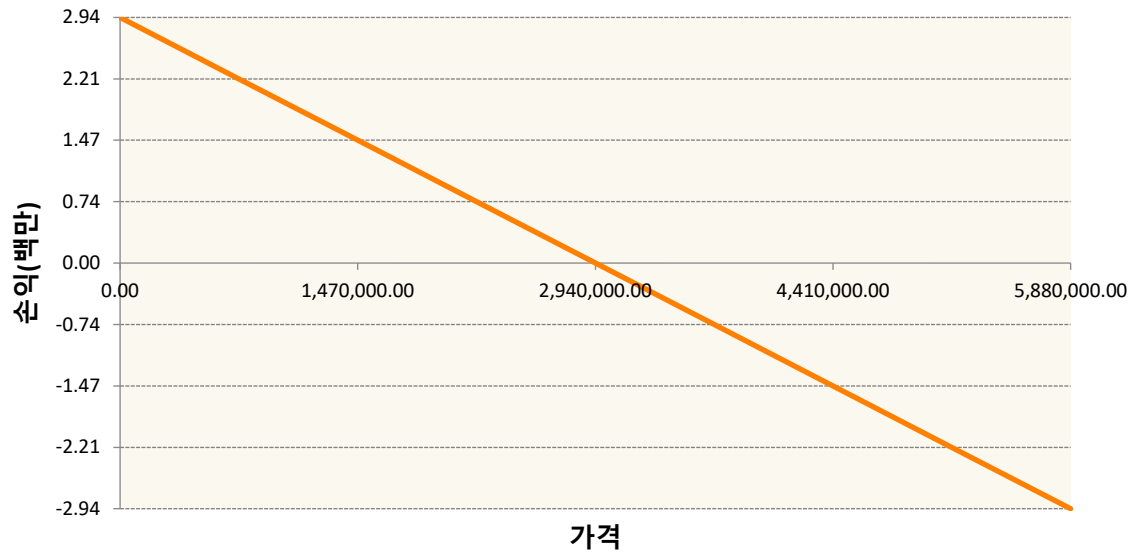
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	629	2,079	-1,450	장내
누계	유가증권	선물	3,279	294	2,985	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					87
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87
-5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	29	29	29	29	29	29	29
5.33%	58	58	58	58	58	58	58
8.00%	87	87	87	87	87	87	87
KR4A05670000		2026-07 미니코스피200 선물					35
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
-2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	12	12	12	12	12	12	12
5.33%	23	23	23	23	23	23	23
8.00%	35	35	35	35	35	35	35
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)
	406

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

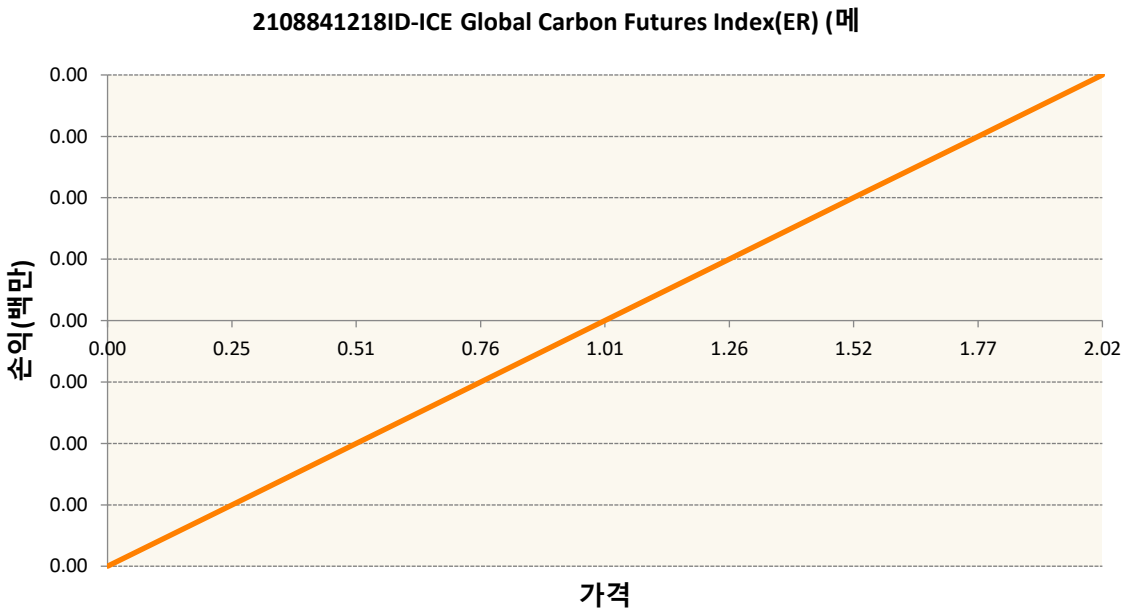
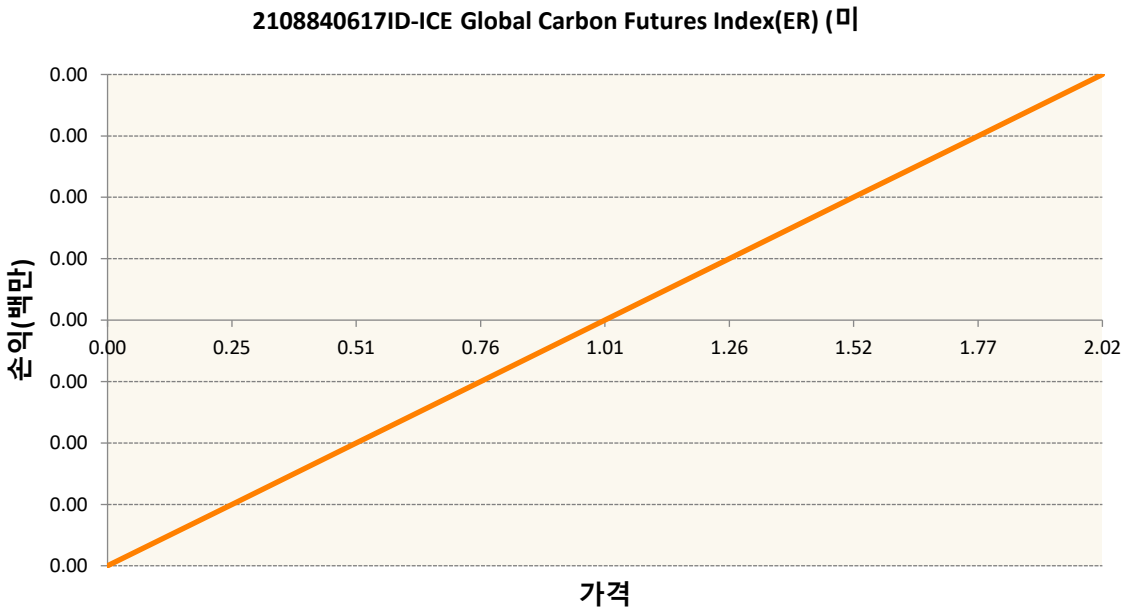
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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		485
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		123

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	693

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

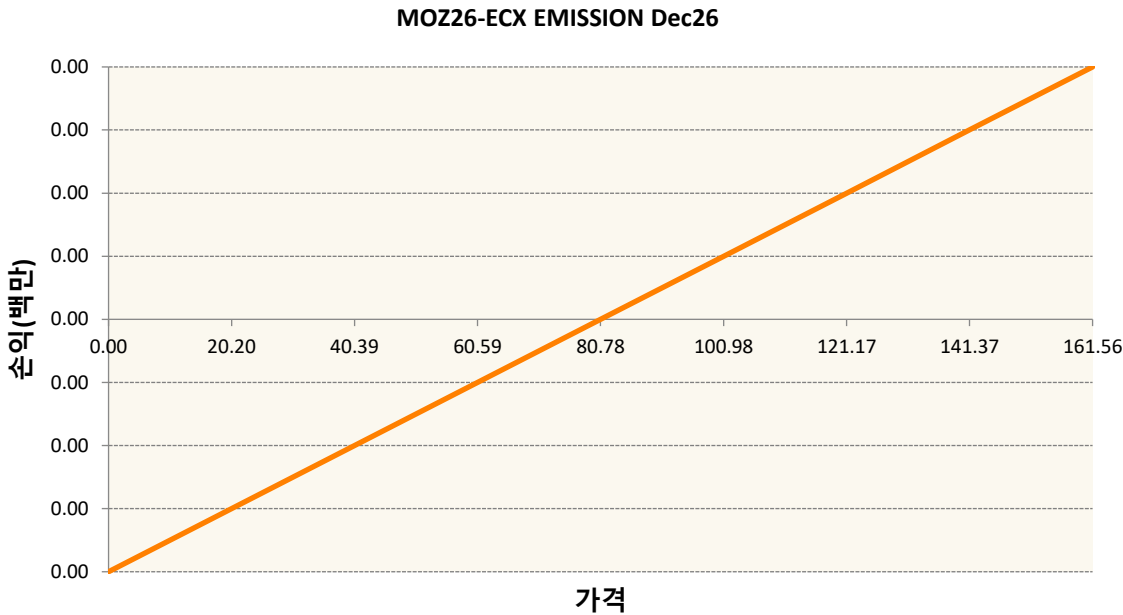
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,217	0	5,217	
누계	통화	선도	0	2,635	-2,635	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	211
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	417

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

(단위:백만원)

704

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

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	1,644	0	1,644	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	13
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	9
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	21
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	5

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

(단위:백만원)

73

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

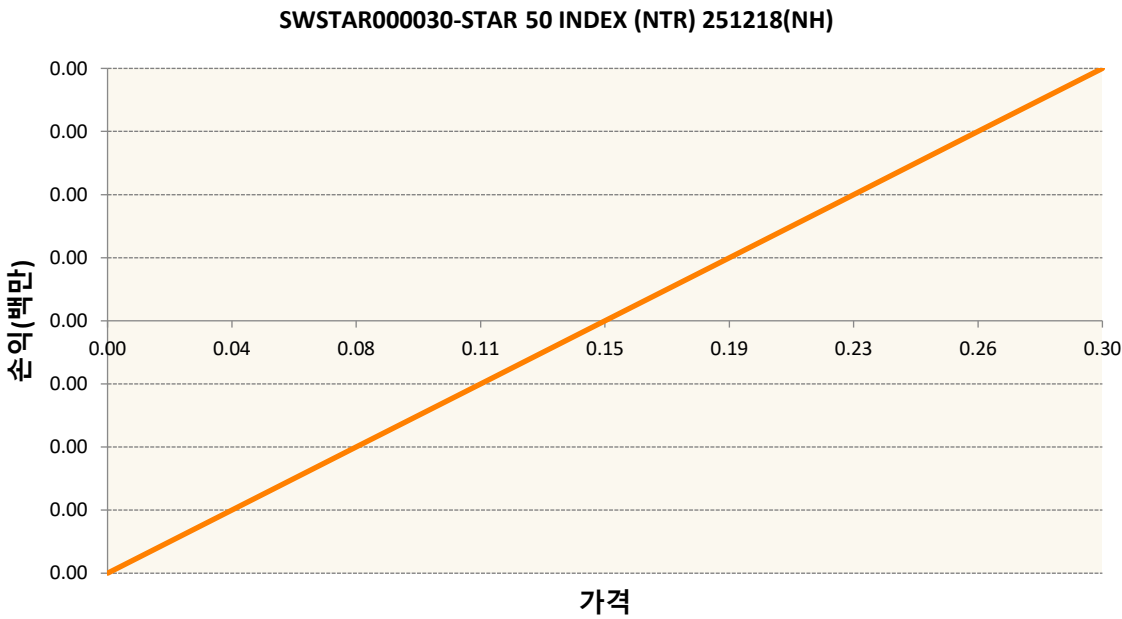
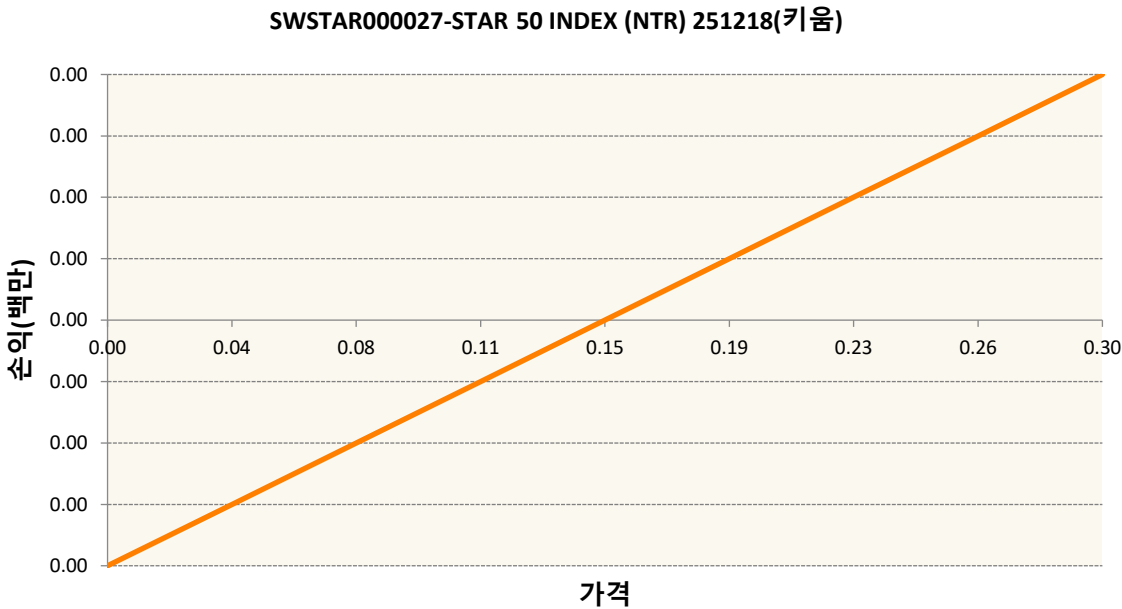
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

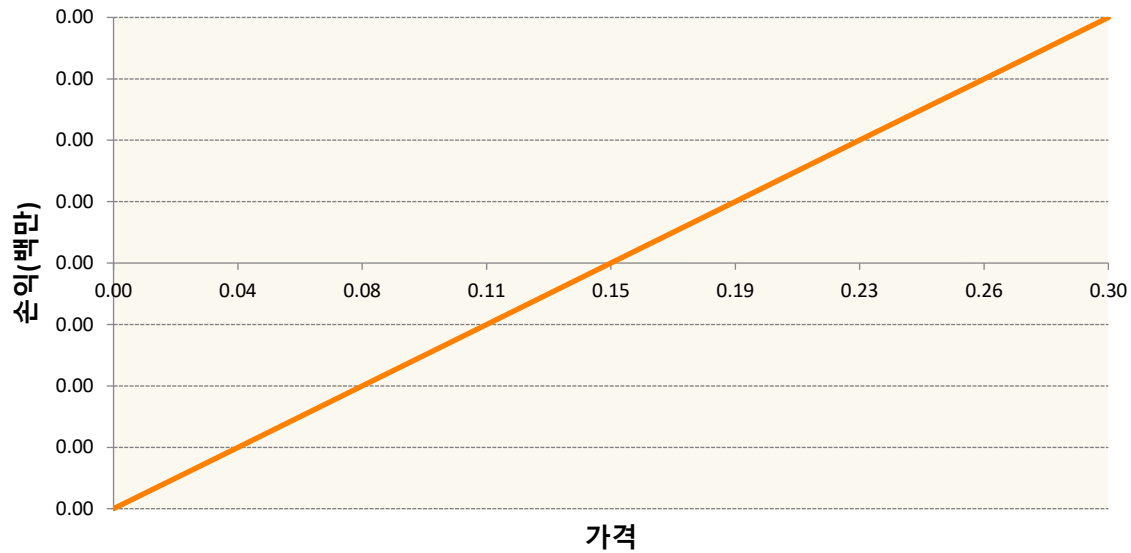
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,064	0	5,064	장외

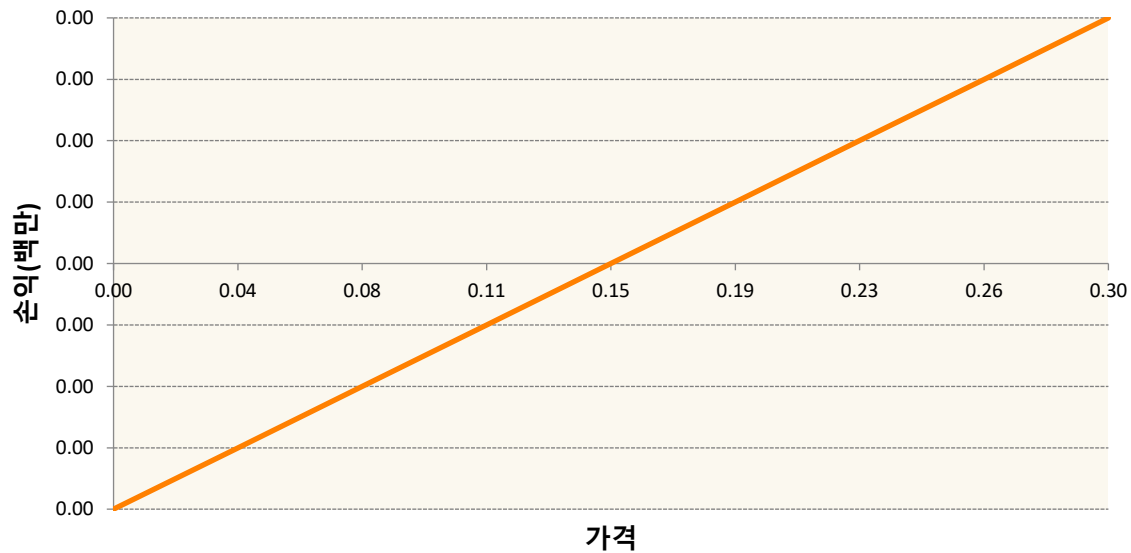
2. 만기시점의 손익구조



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)

15

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

50

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

255

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

93

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

(단위:백만원)

670

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

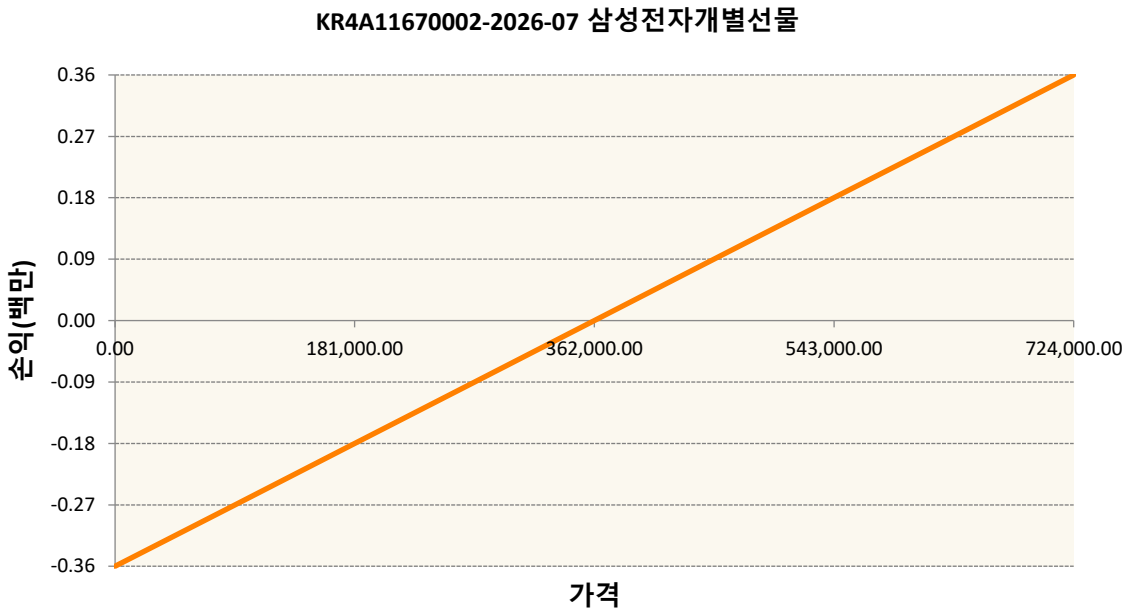
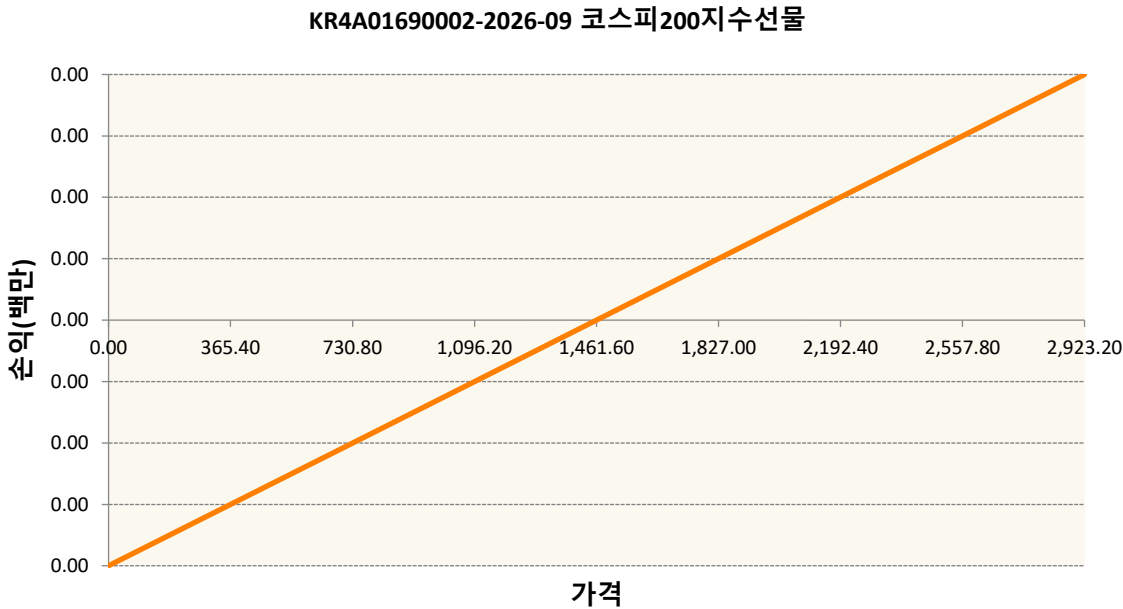
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

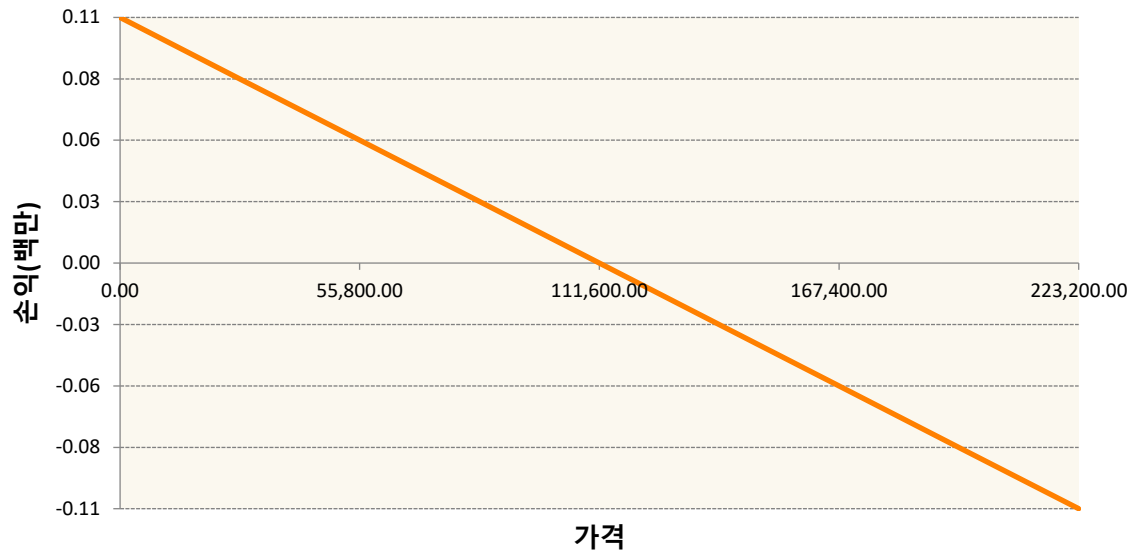
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	8,092	14,110	-6,018	장내
누계	유가증권	선물	17,418	5,951	11,467	장내

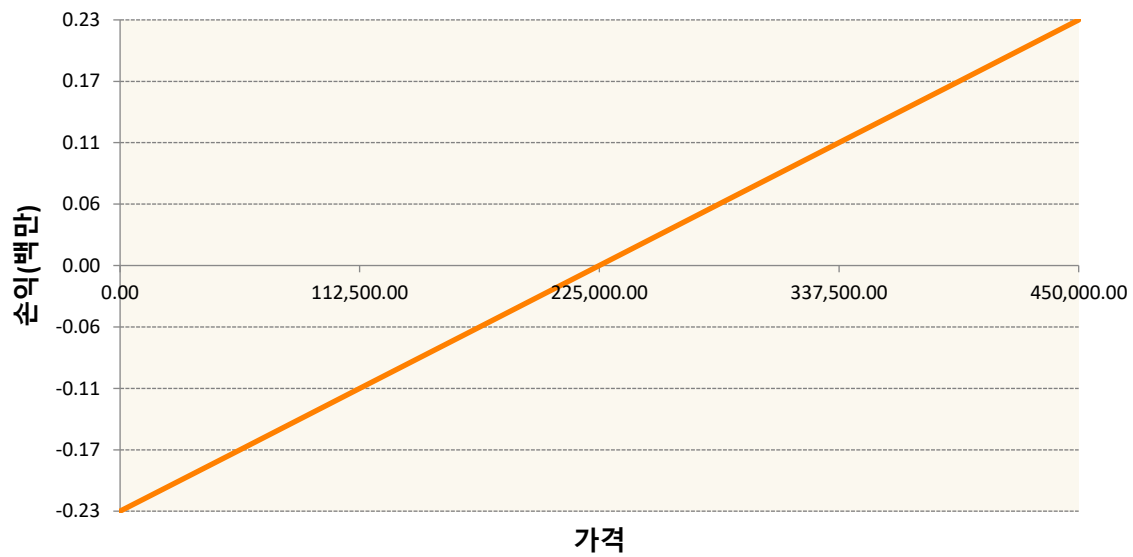
2. 만기시점의 손익구조



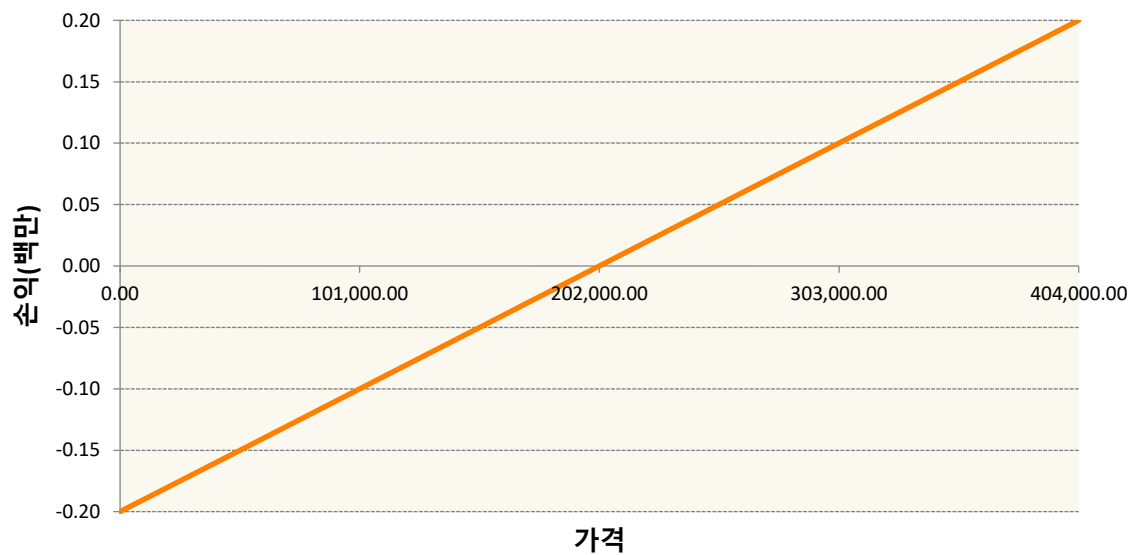
KR4A17670006-2026-07 삼성증권개별선물



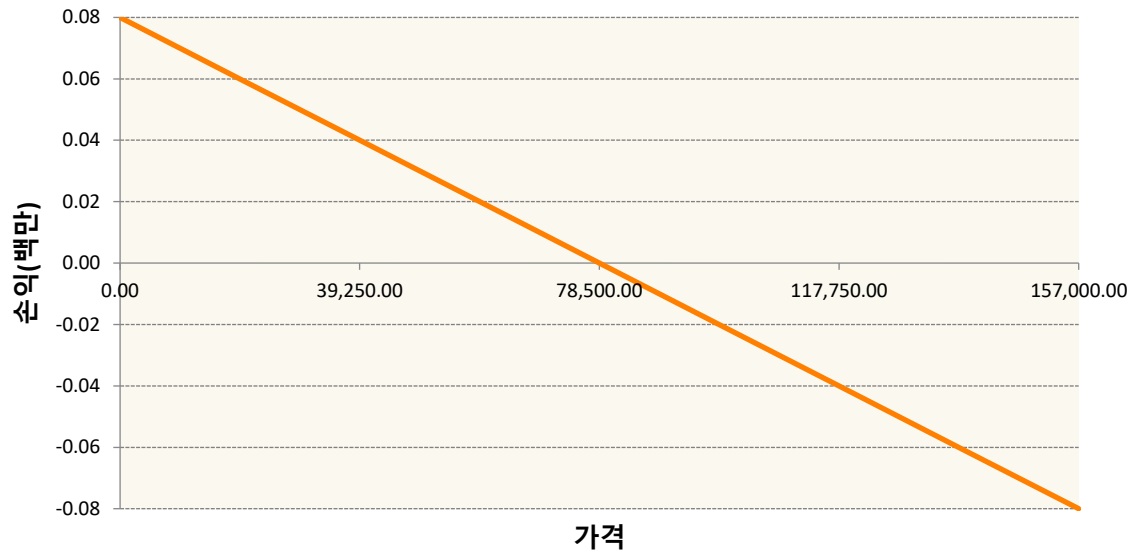
KR4A1V670008-2026-07 HD현대마린솔루션개별선물



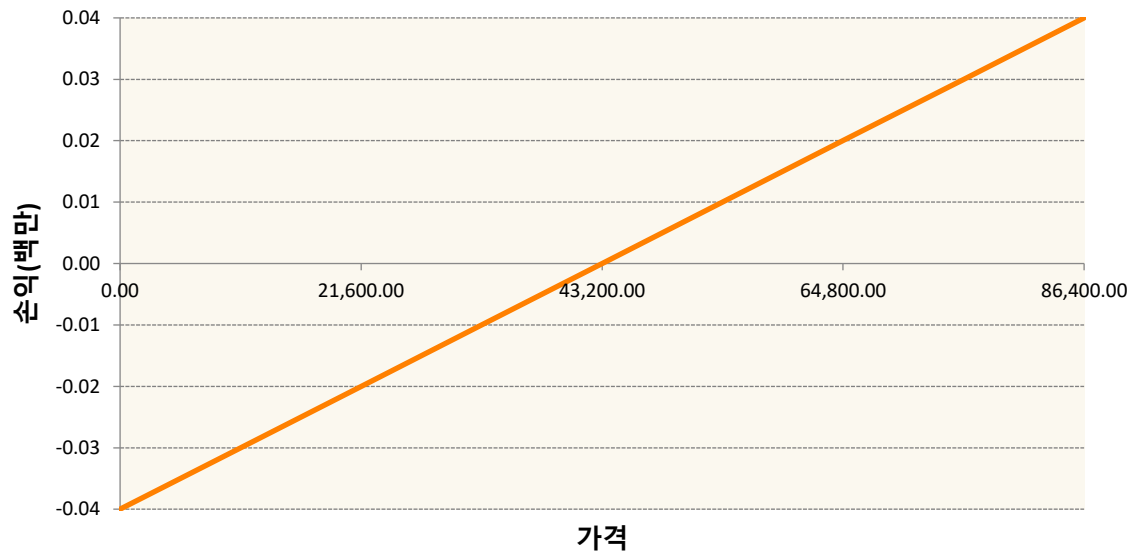
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



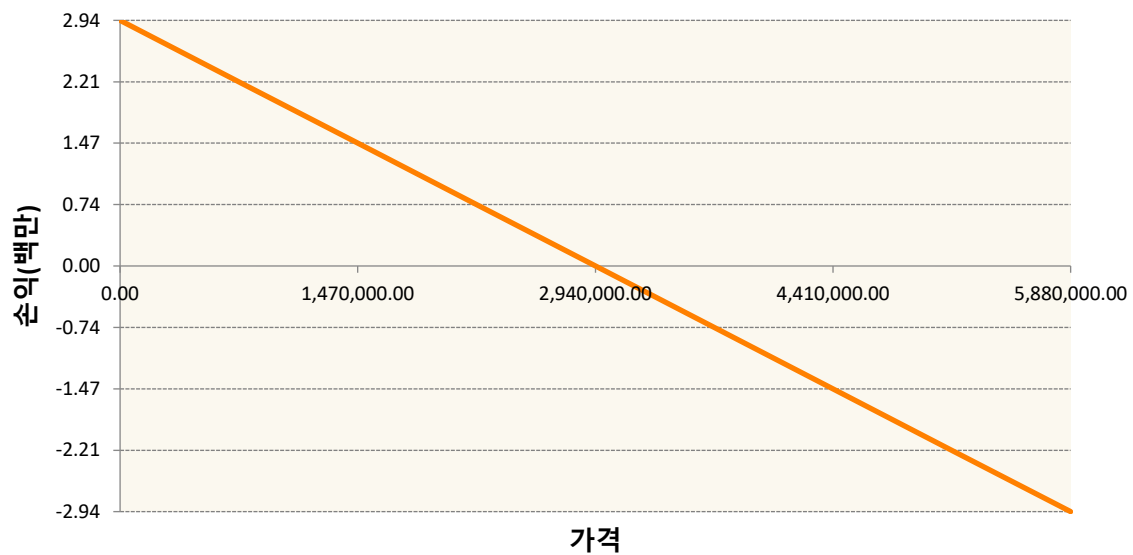
KR4A2K670000-2026-07 LG씨엔에스개별선물



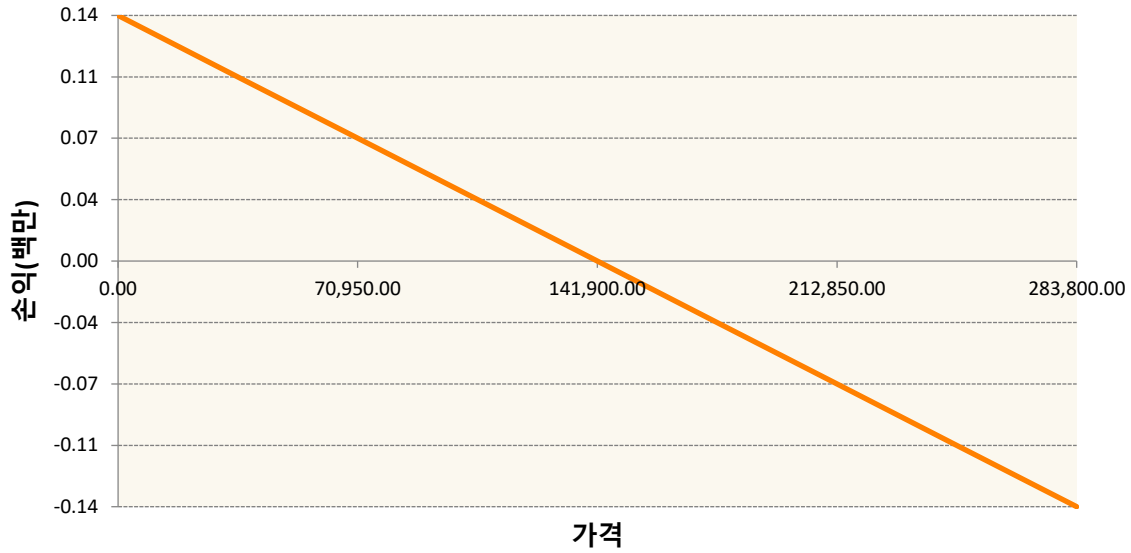
KR4A48670009-2026-07 미래에셋증권개별선물



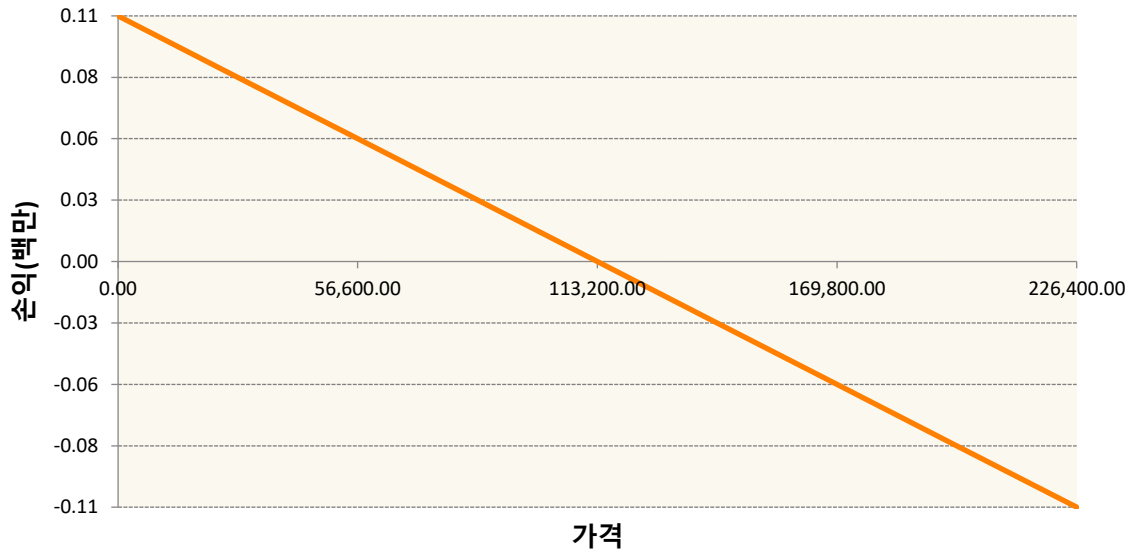
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



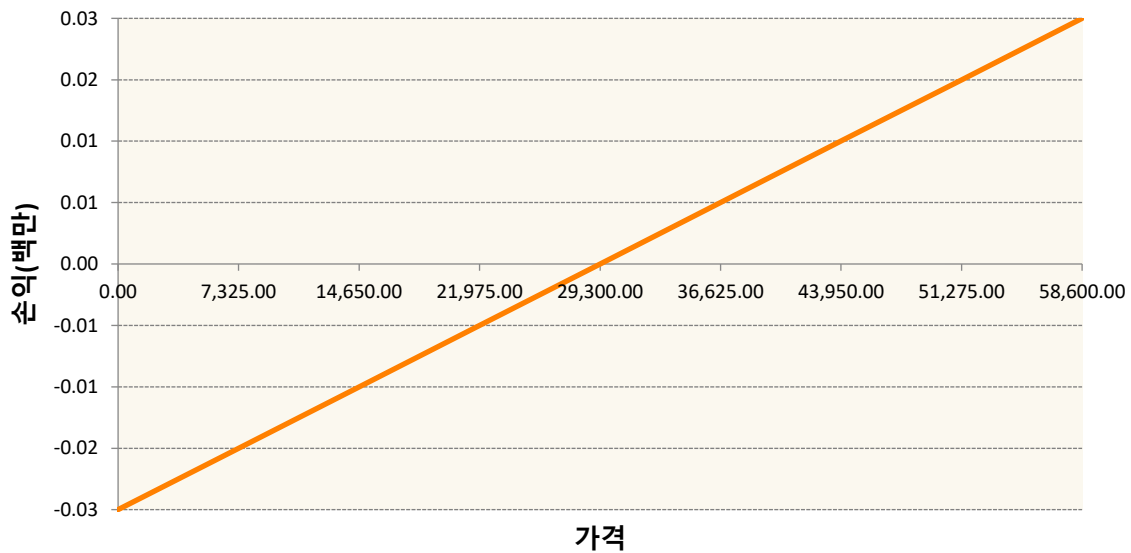
KR4ABM670006-2026-07 한국항공우주개별선물



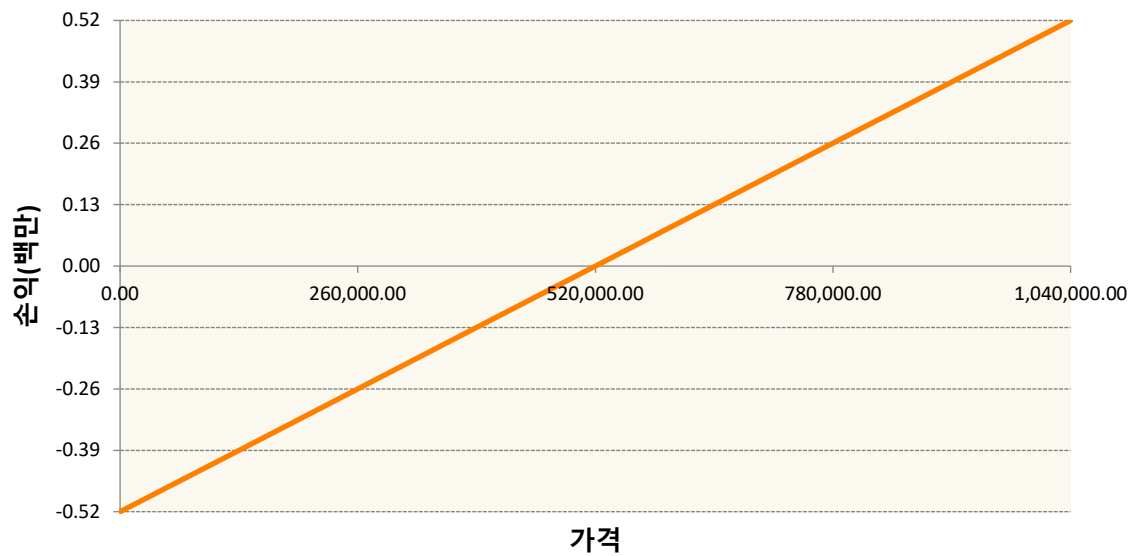
KR4ABN670005-2026-07 현대건설개별선물



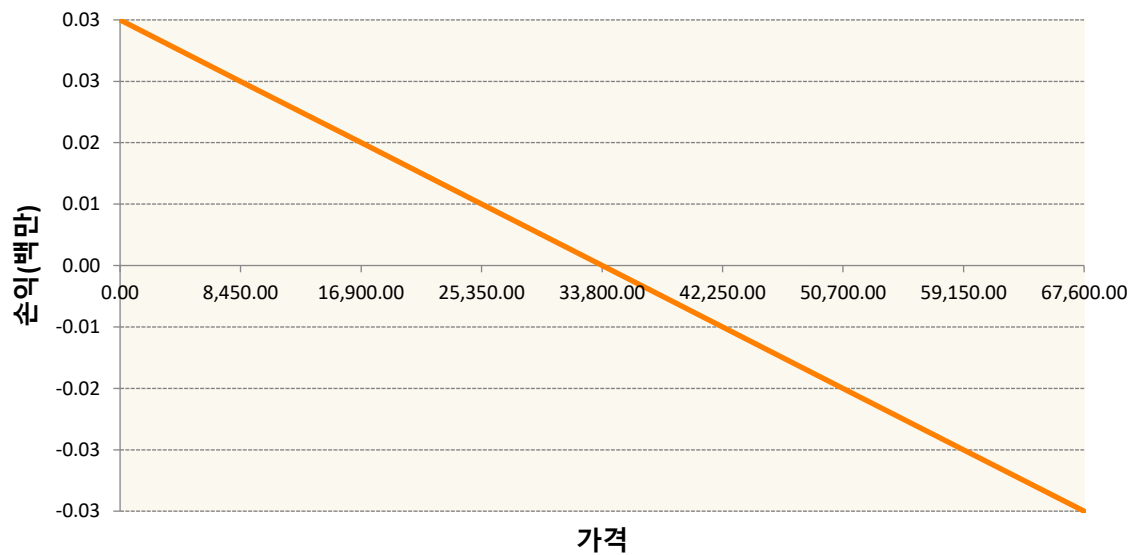
KR4ABZ670001-2026-07 NH투자증권개별선물



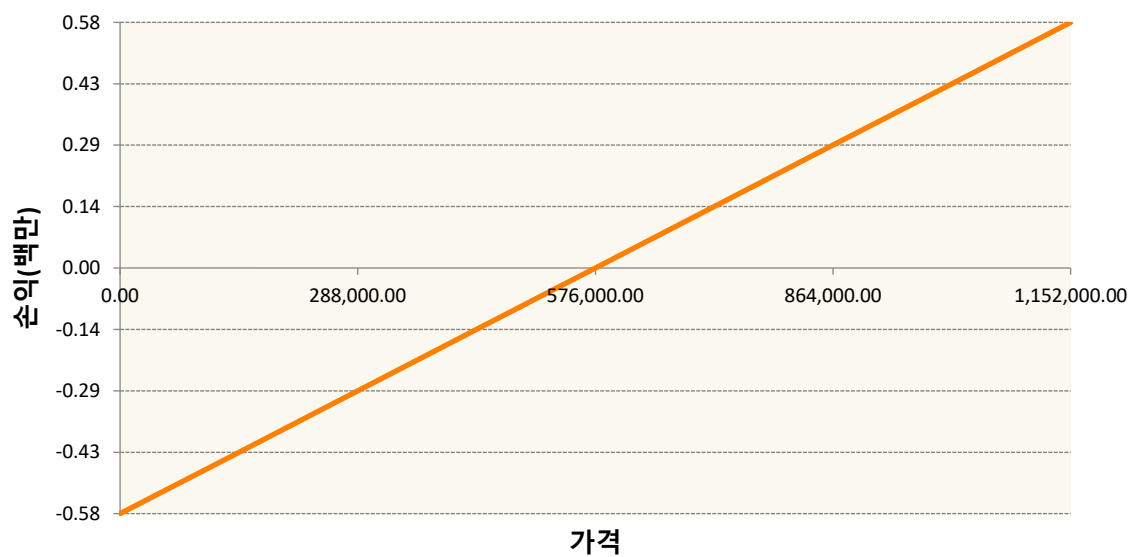
KR4AC8670003-2026-07 삼성물산개별선물



KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



(단위:백만원)

KR4A01690002							2026-09 코스피200지수선물		843	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-843	-843	-843	-843	-843	-843	-843			
-5.33%	-562	-562	-562	-562	-562	-562	-562			
-2.67%	-281	-281	-281	-281	-281	-281	-281			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	281	281	281	281	281	281	281			
5.33%	562	562	562	562	562	562	562			
8.00%	843	843	843	843	843	843	843			
KR4A11670002							2026-07 삼성전자개별선물		424	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	-424	-424	-424	-424	-424	-424	-424			
-5.33%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283			
-2.67%	-141	-141	-141	-141	-141	-141	-141			
0%	0	0	0	0	0	0	0			
2.67%	141	141	141	141	141	141	141			
5.33%	283	283	283	283	283	283	283			
8.00%	424	424	424	424	424	424	424			
KR4A17670006							2026-07 삼성증권개별선물		30	
	기초자산의 변동성									
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%			
-8.00%	30	30	30	30	30	30	30			
-5.33%	20	20	20	20	20	20	20			
-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%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20			
8.00%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30			
KR4A1V670008							2026-07 HD현대마린솔루션개별선물		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			
KR4A24670007							2026-07 LG전자개별선물		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%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-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%	11	11	11	11	11	11	11
8.00%	16	16	16	16	16	16	16

KR4A2K670000 2026-07 LG씨엔에스개별선물 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

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 217

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	217	217	217	217	217	217	217
-5.33%	145	145	145	145	145	145	145
-2.67%	72	72	72	72	72	72	72
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
5.33%	-145	-145	-145	-145	-145	-145	-145
8.00%	-217	-217	-217	-217	-217	-217	-217

KR4ABM670006 2026-07 한국항공우주개별선물 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

KR4ABN670005	2026-07 현대건설개별선물	51
--------------	------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	51	51	51	51	51	51	51
-5.33%	34	34	34	34	34	34	34
-2.67%	17	17	17	17	17	17	17
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
5.33%	-34	-34	-34	-34	-34	-34	-34
8.00%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51

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	87
--------------	-----------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	87	87	87	87	87	87	87
-5.33%	58	58	58	58	58	58	58
-2.67%	29	29	29	29	29	29	29
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
5.33%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
8.00%	-87	-87	-87	-87	-87	-87	-87

KR4AFD670003	2026-07 HD현대중공업개별선물	20
--------------	---------------------	----

	기초자산의 변동성
--	-----------

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-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%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	20	20	20	20	20	20	20

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

(단위:백만원)

4,912

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

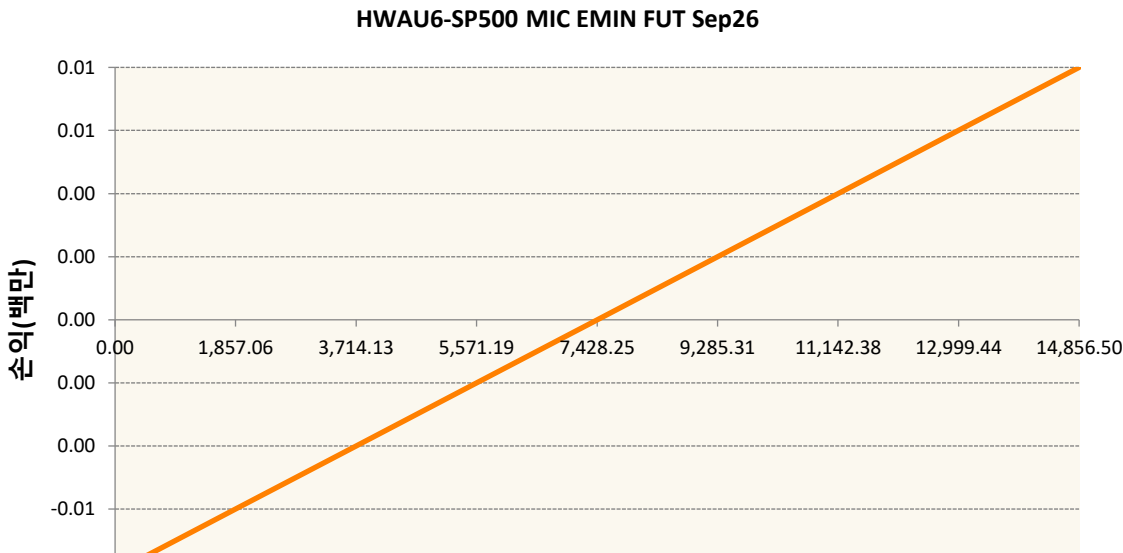
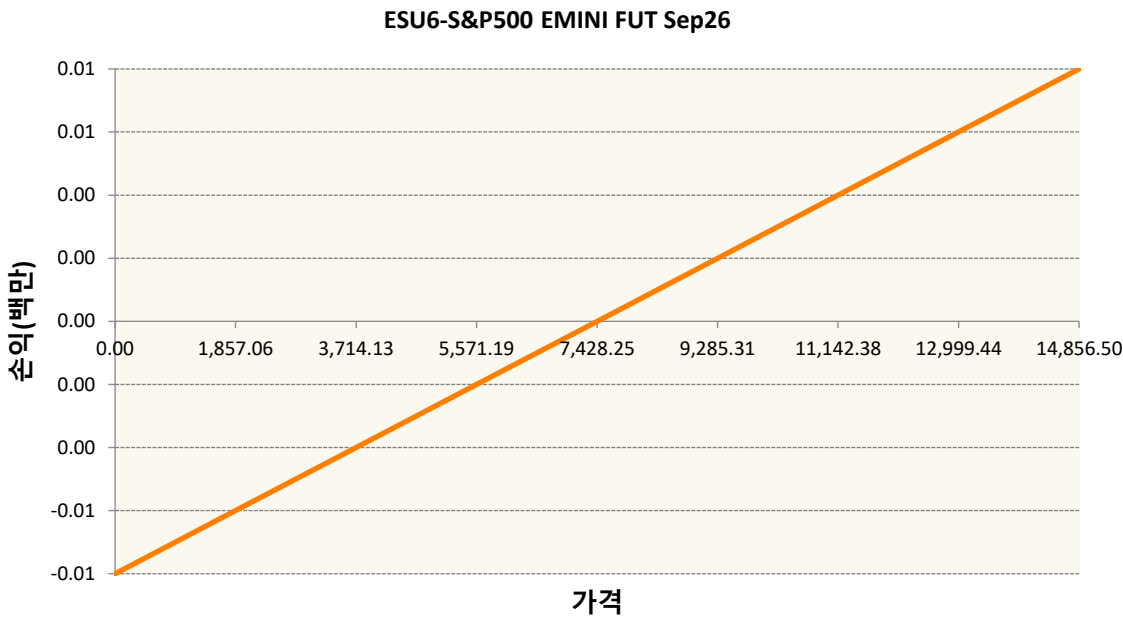
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

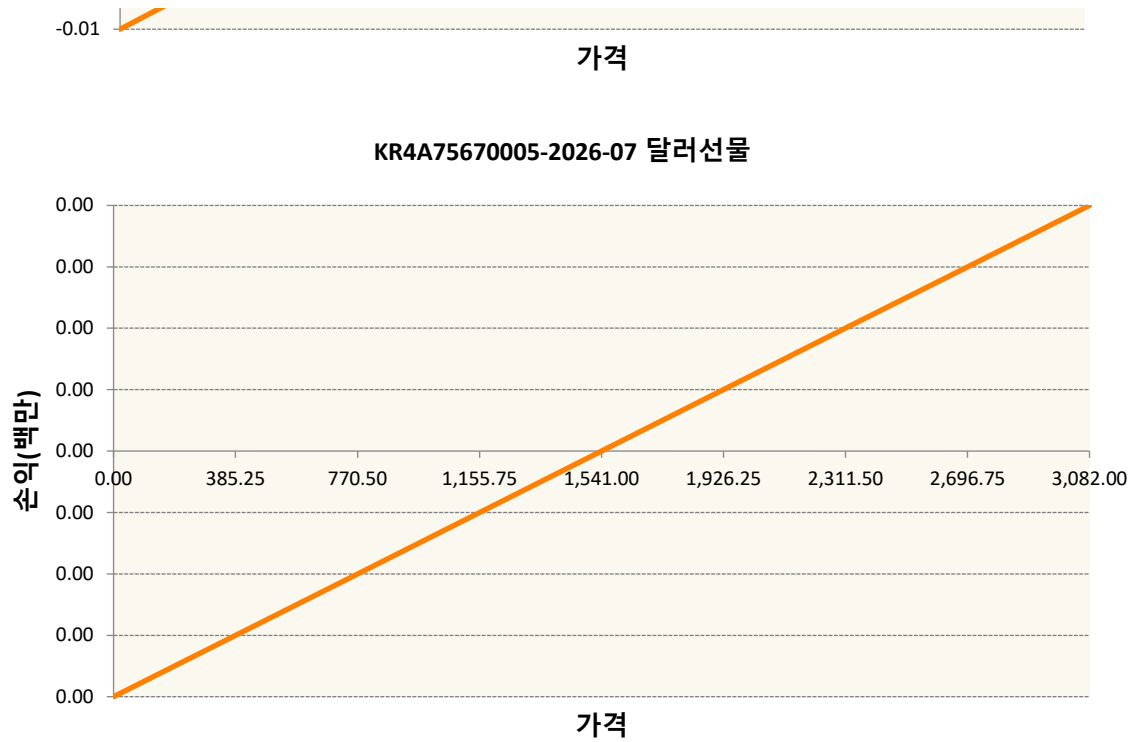
1. 계약금액

(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	61,171	0	61,171	
누계	지수	선물	112	0	112	장내
누계	통화	선물	10,941	0	10,941	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	4,894
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	9
KR4A756700	2026-07 달러선물	875

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

4,234

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

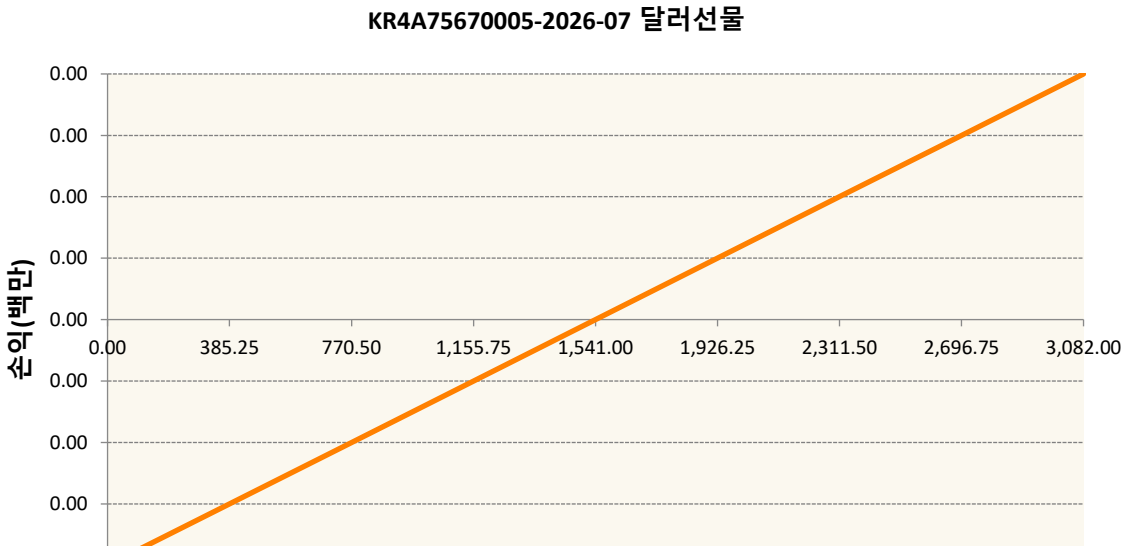
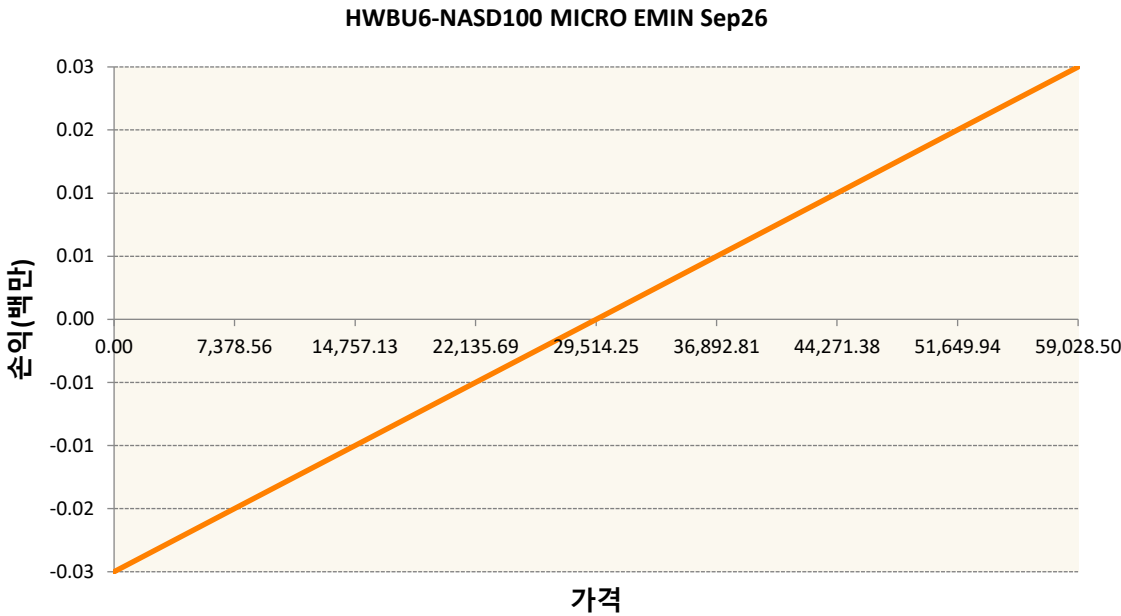
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

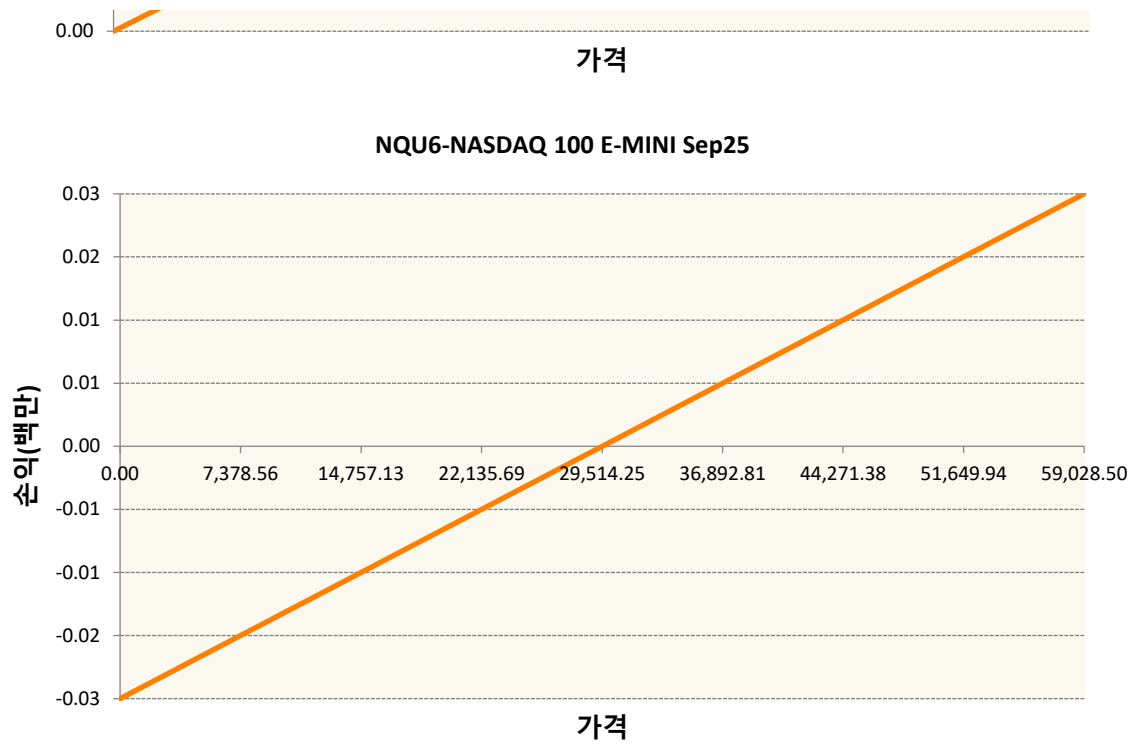
1. 계약금액

(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	182	0	182	장내
누계	지수	선물	30,315	0	30,315	
누계	통화	선물	4,022	0	4,022	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBU6 NASD100 MICRO EMIN Sep26

15

KR4A756700 2026-07 달러선물

322

NQU6 NASDAQ 100 E-MINI Sep25

2,425

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

(단위:백만원)

2,745

공시일	2026-06-26
기준일	2026-06-25

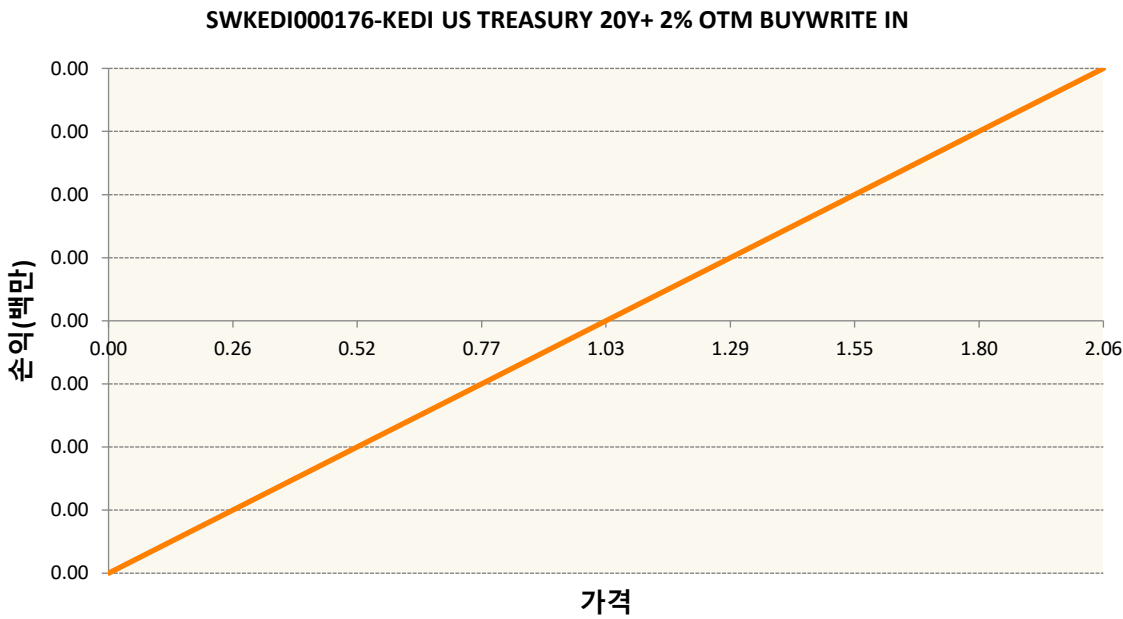
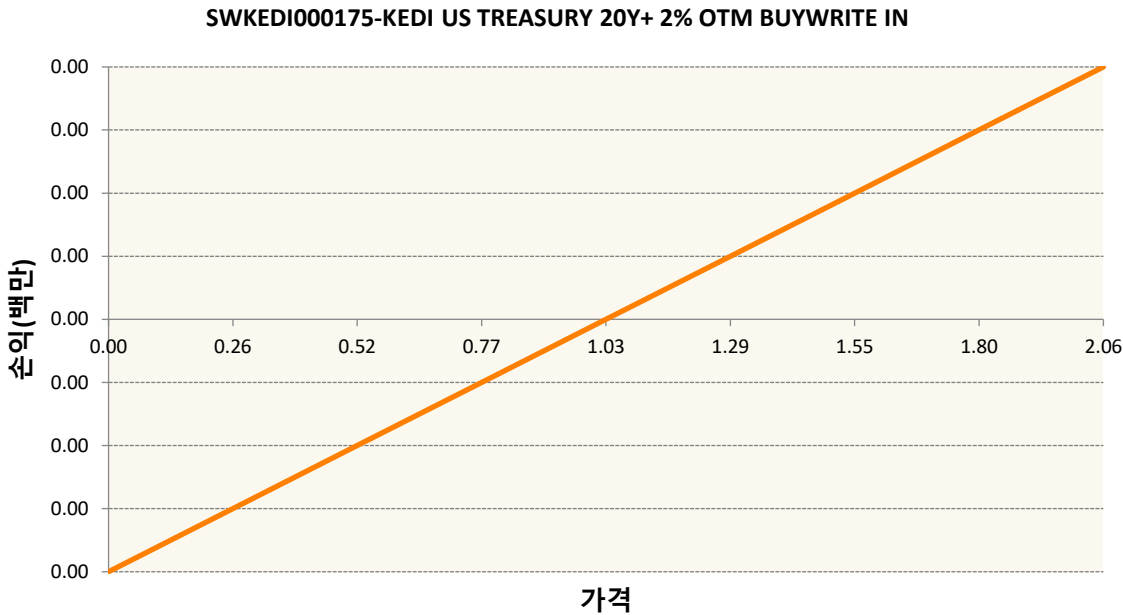
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

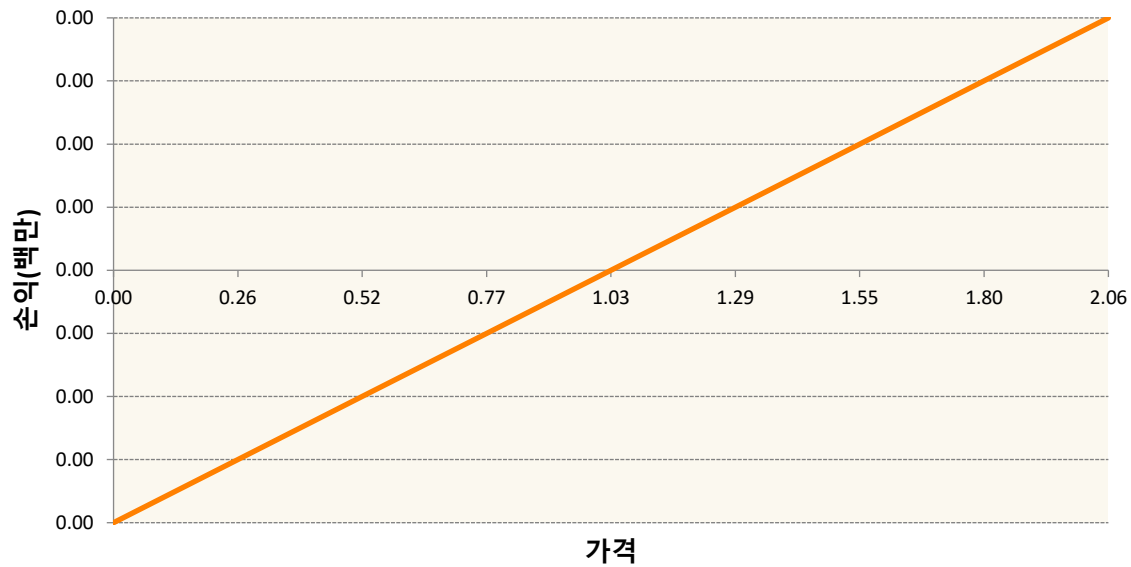
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	330,640	0	330,640	장외

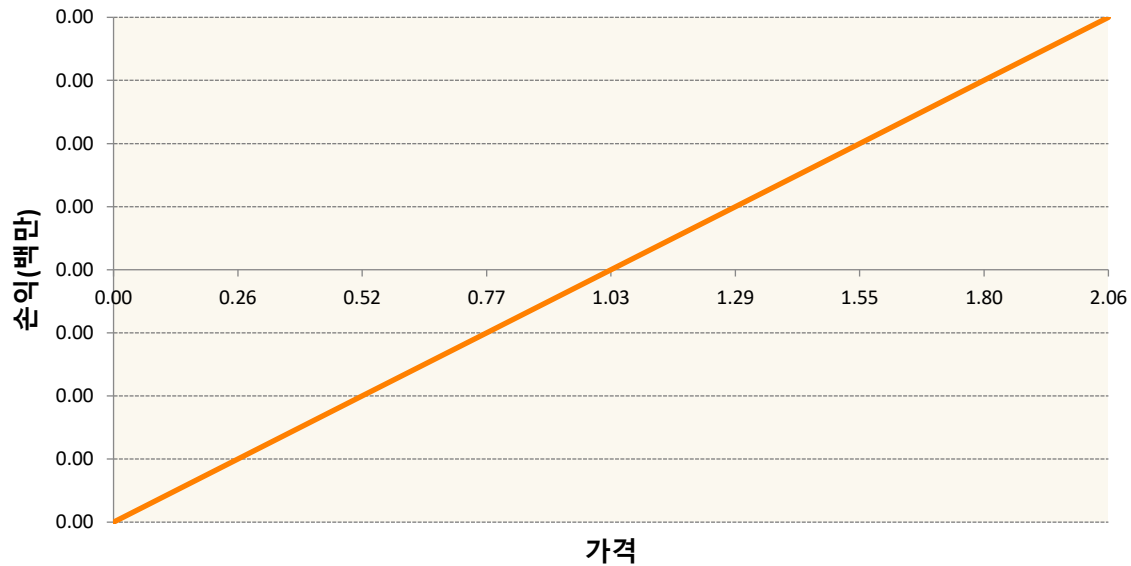
2. 만기시점의 손익구조



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	8,680
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,419
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,304
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,145

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

(단위:백만원)

11,225