

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

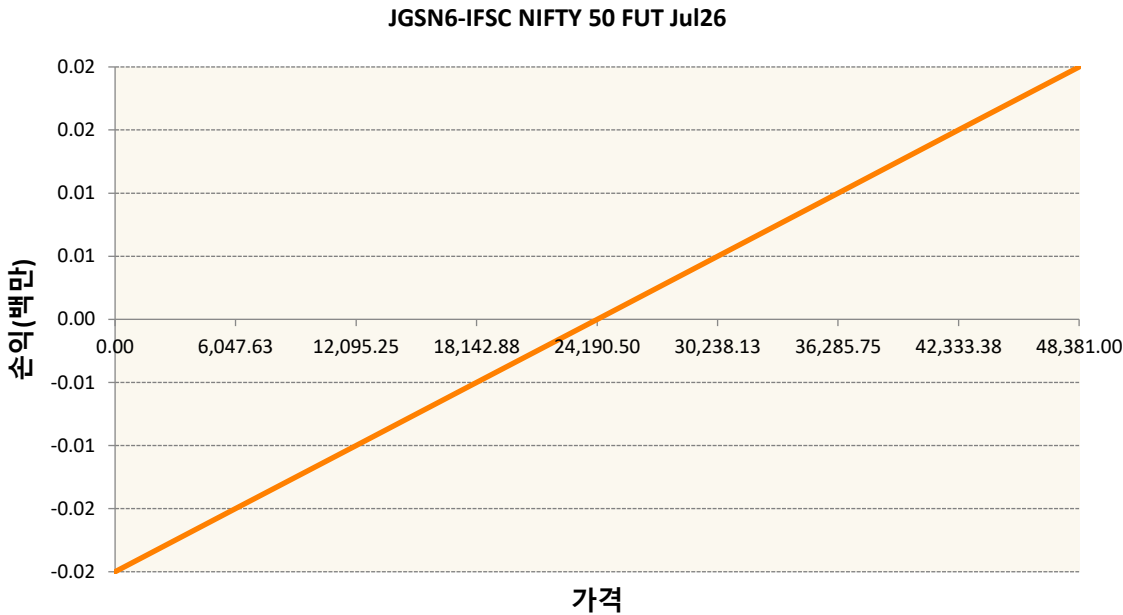
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	373	0	373	

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	2026-06-29
기준일	2026-06-26

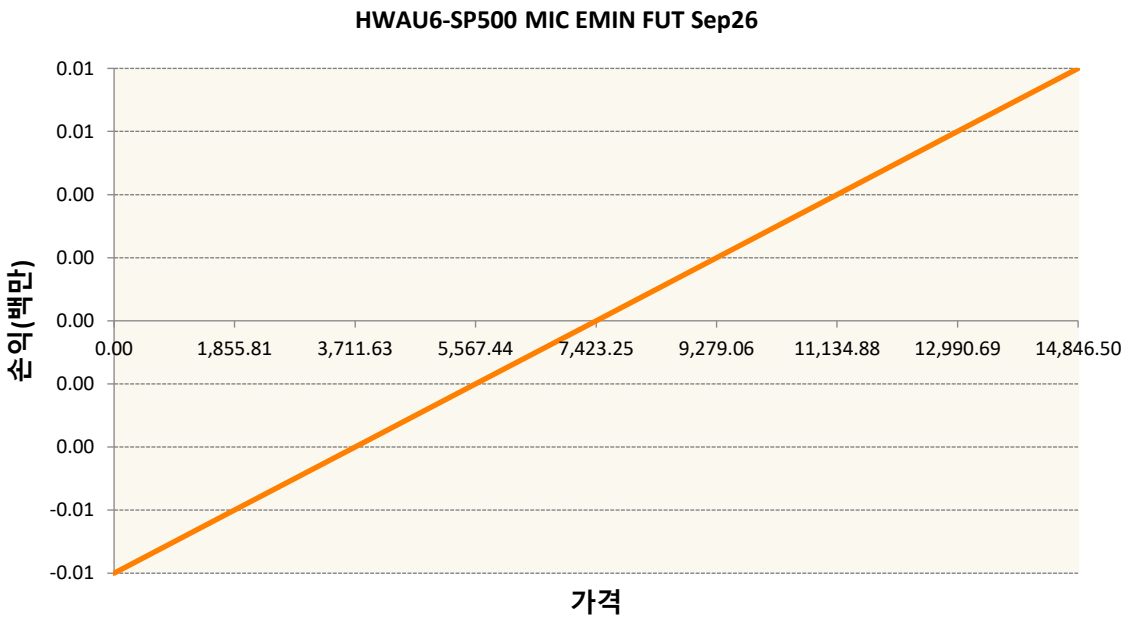
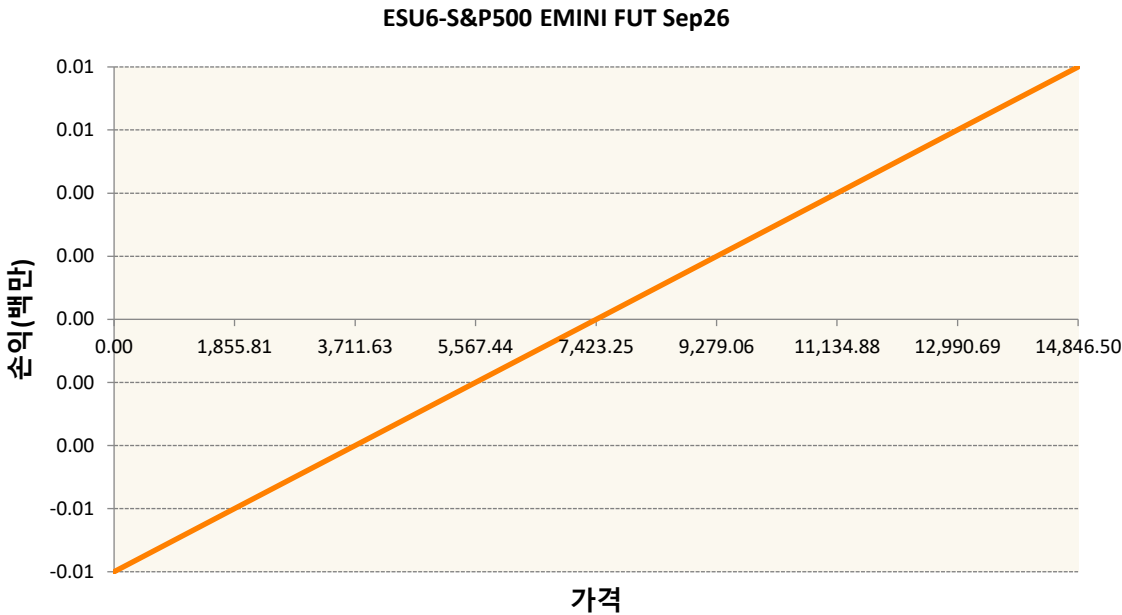
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	2026-06-29
기준일	2026-06-26

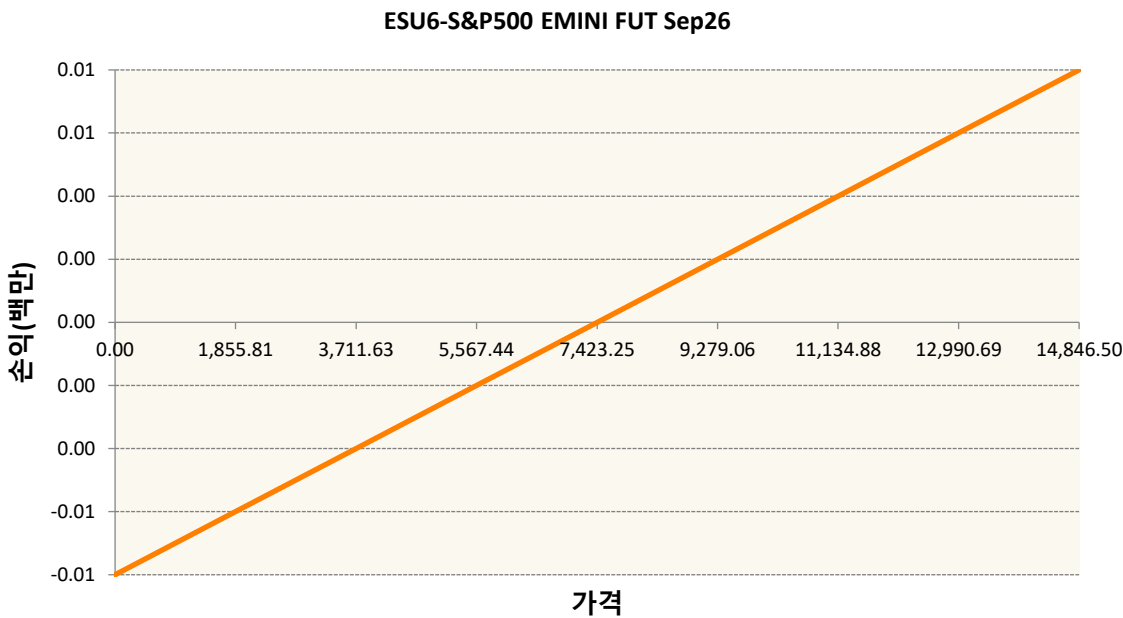
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,122	0	1,122	

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)

77

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

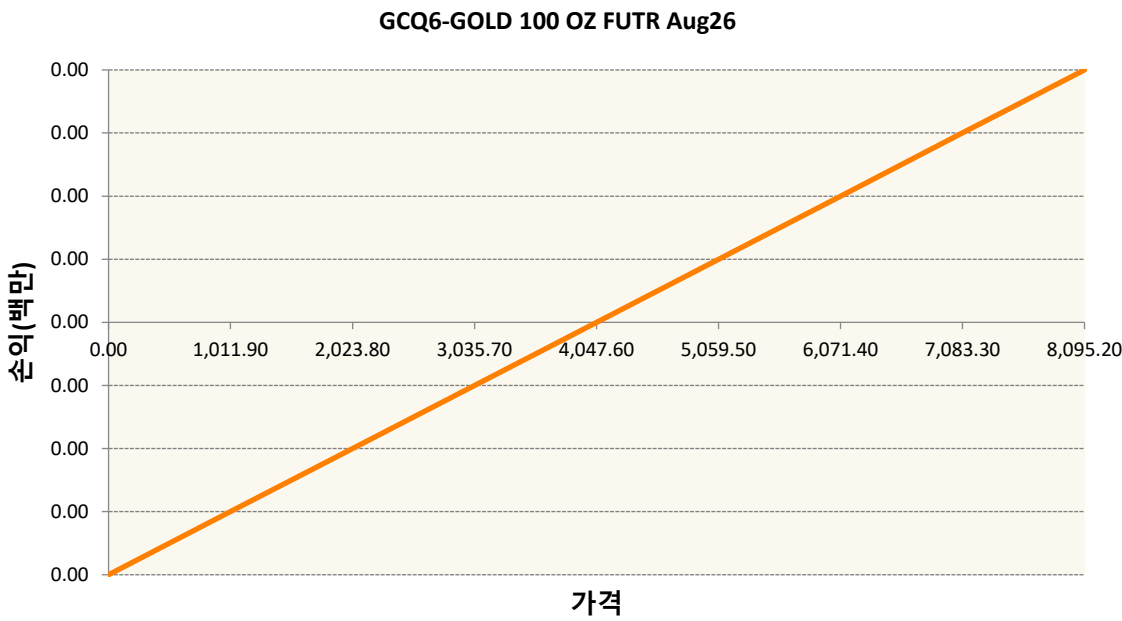
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,849	0	4,849	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 06/26/26 C400 EQUITY	4
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	388

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

(단위:백만원)

508

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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)

AOPLTRCUS`PLTR US 06/26/26 C140 EQUITY	59
AOPLTRPUS`PLTR US 06/26/26 P130 EQUITY	2
AOPLTRUSC`PLTR US 06/26/26 C135 EQUITY	0.42

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

(단위:백만원)

186

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

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

1

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

(단위:백만원)

3

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

(단위:백만원)

15,518

공시일 2026-06-29

기준일 2026-06-26

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	2026-06-29
기준일	2026-06-26

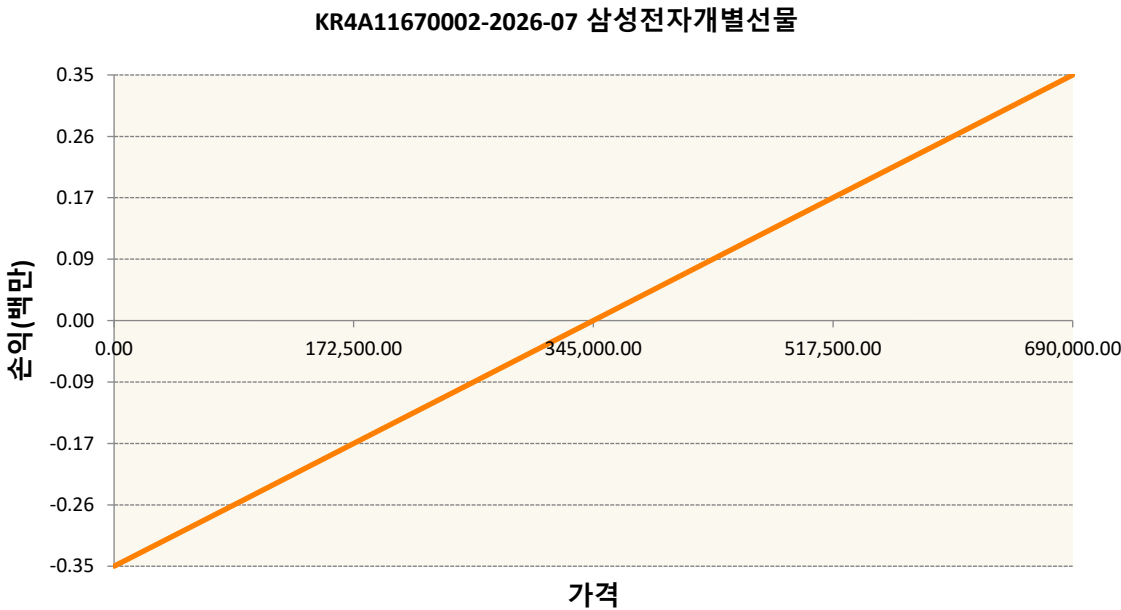
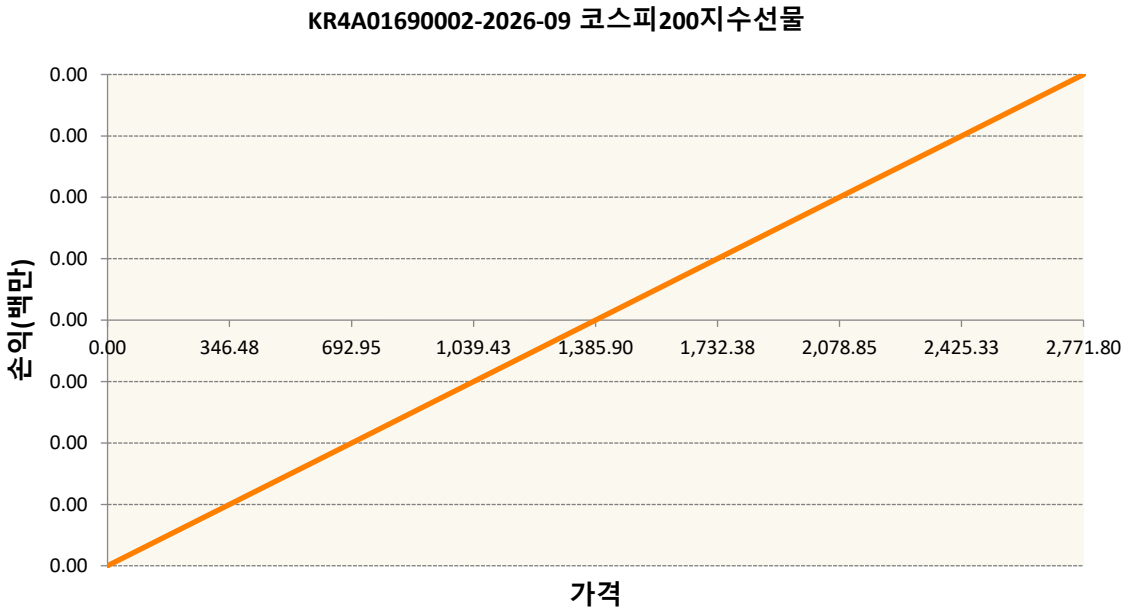
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	27,638	46,592	-18,954	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순이익(백만)). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 2,910.00 with major ticks every 363.75. The y-axis represents Net Income, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00. A solid blue line starts at the origin (0, 0.00) and extends to the point (2,910.00, 0.00), indicating a constant rate of change.

가격	순이익(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 that the net income is zero for all prices shown on the x-axis.

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				711
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-711	-711	-711	-711	-711	-711	-711	
-5.33%	-474	-474	-474	-474	-474	-474	-474	
-2.67%	-237	-237	-237	-237	-237	-237	-237	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	237	237	237	237	237	237	237	
5.33%	474	474	474	474	474	474	474	
8.00%	711	711	711	711	711	711	711	
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물				1,467
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,467	-1,467	-1,467	-1,467	-1,467	-1,467	-1,467
-5.33%	-978	-978	-978	-978	-978	-978	-978
-2.67%	-489	-489	-489	-489	-489	-489	-489
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	489	489	489	489	489	489	489
5.33%	978	978	978	978	978	978	978
8.00%	1,467	1,467	1,467	1,467	1,467	1,467	1,467
KR4BAFBKB847 코스피위클리M C 2606W5 1,455.0							2,104

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	2,104	2,104	2,104	2,104	2,104	2,104	2,104
-5.33%	1,403	1,403	1,403	1,403	1,403	1,403	1,403
-2.67%	701	701	701	701	701	701	701
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-701	-701	-701	-701	-701	-701	-701
5.33%	-1,403	-1,403	-1,403	-1,403	-1,403	-1,403	-1,403
8.00%	-2,104	-2,104	-2,104	-2,104	-2,104	-2,104	-2,104
KR4BAFBKB854 코스피위클리M C 2606W5 1,457.5							1,394

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,394	1,394	1,394	1,394	1,394	1,394	1,394
-5.33%	929	929	929	929	929	929	929
-2.67%	465	465	465	465	465	465	465
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
5.33%	-929	-929	-929	-929	-929	-929	-929
8.00%	-1,394	-1,394	-1,394	-1,394	-1,394	-1,394	-1,394

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

(단위:백만원)

15,855

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

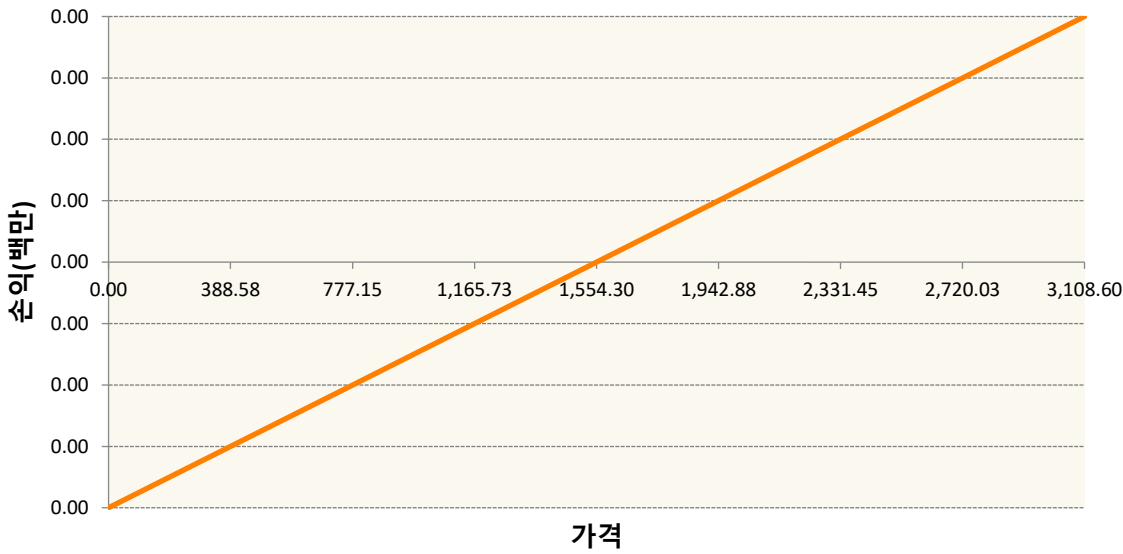
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	901	0	901	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A06690007-2026-09 코스닥150선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				71
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-5.33%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	48	48	48	48	48	48	48
8.00%	71	71	71	71	71	71	71

SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,497	17,845	-11,348	장내
누계	유가증권	선물	95,841	0	95,841	장내

[illegible]

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

(단위:백만원)

28,111

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

(단위:백만원)

82,791

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

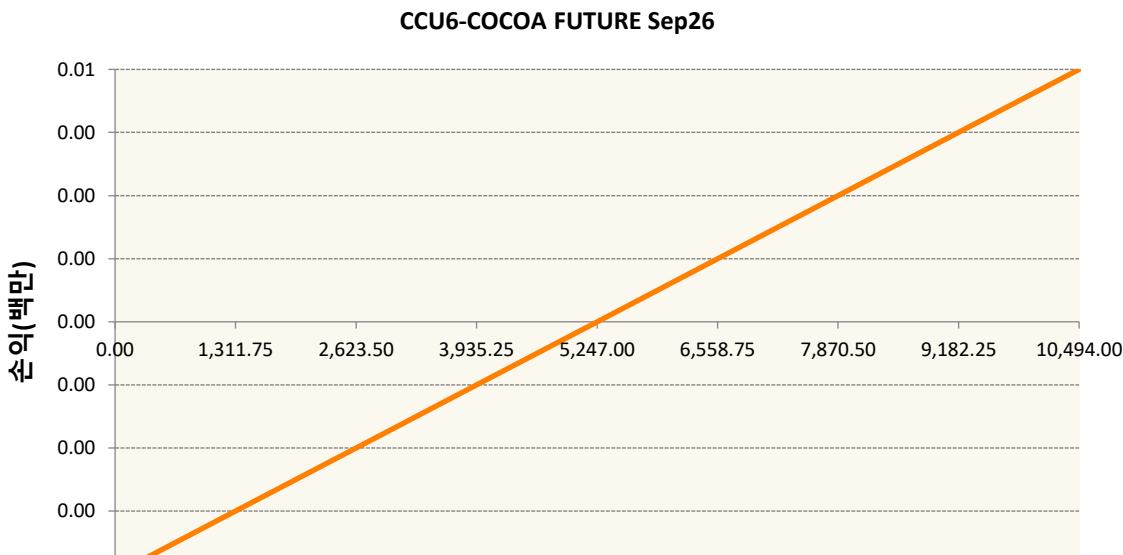
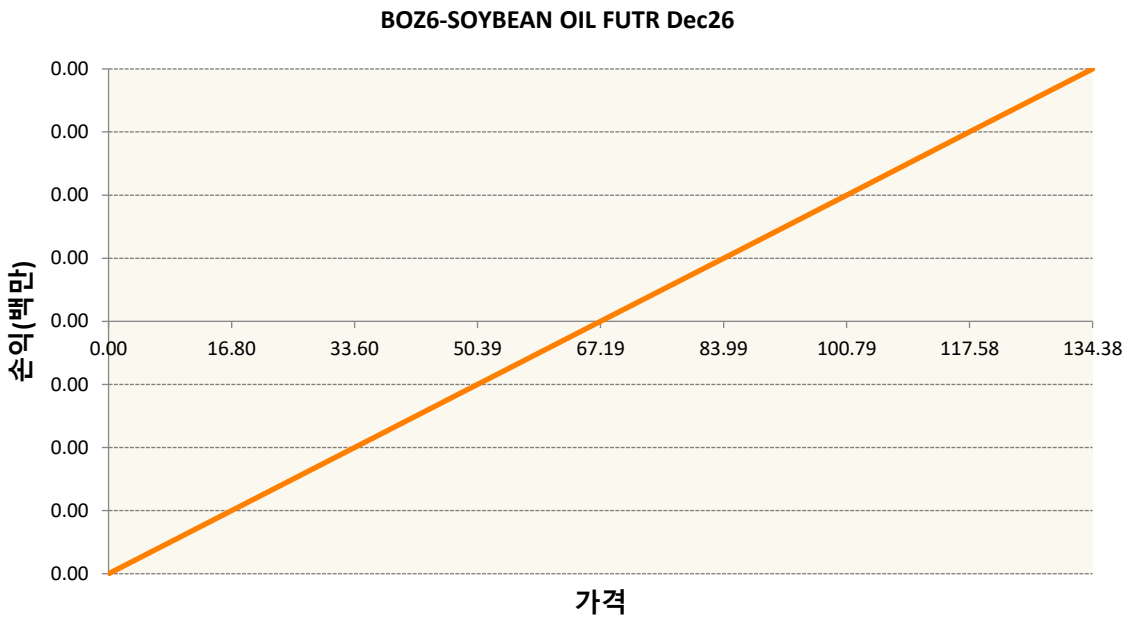
포커스농산물모(채권-파생형)

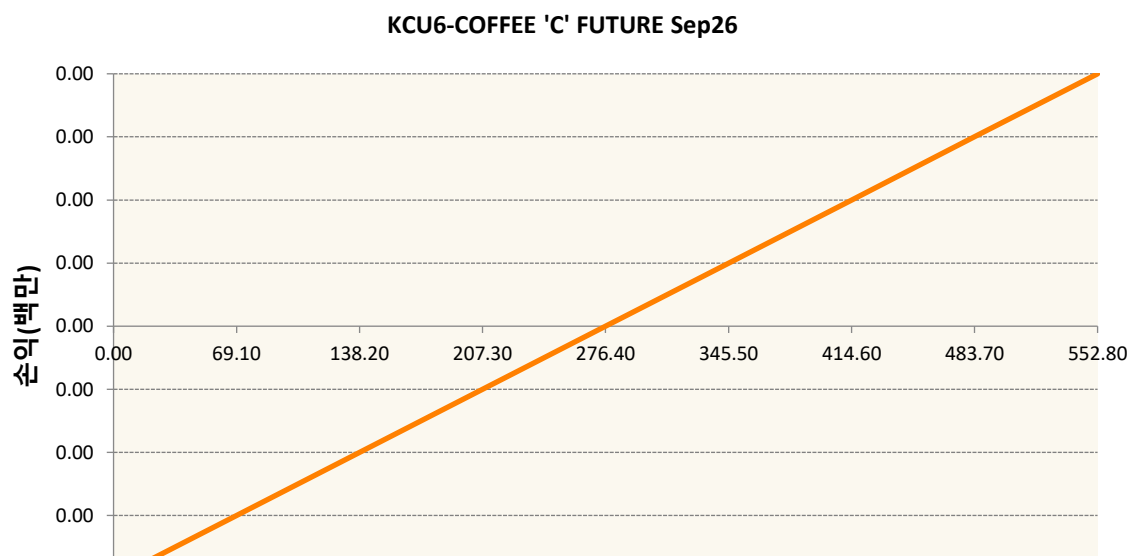
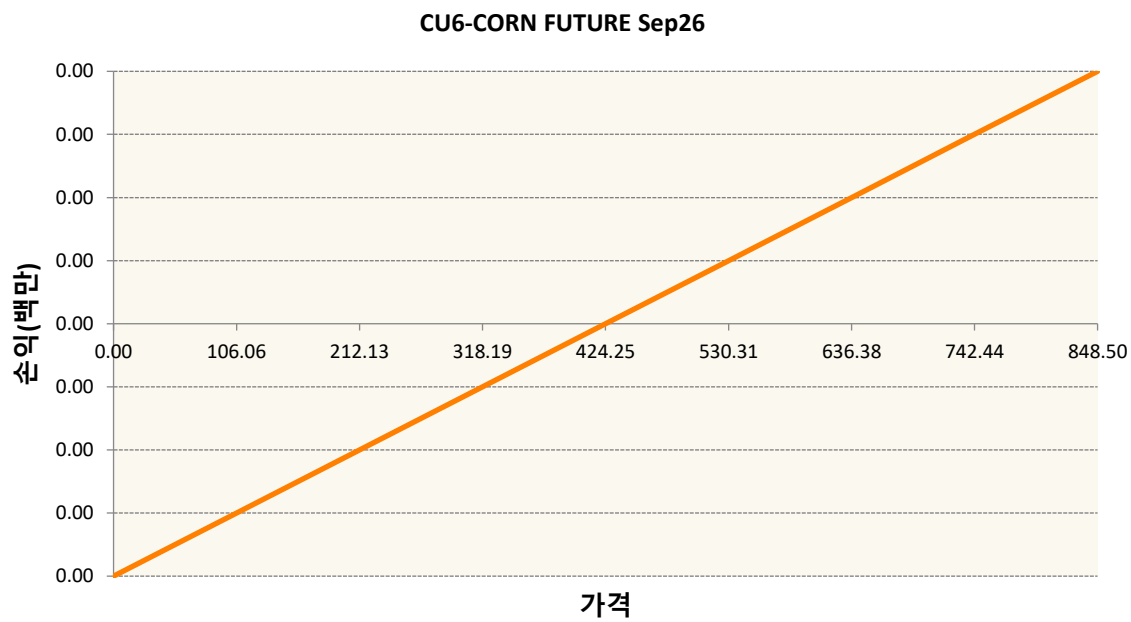
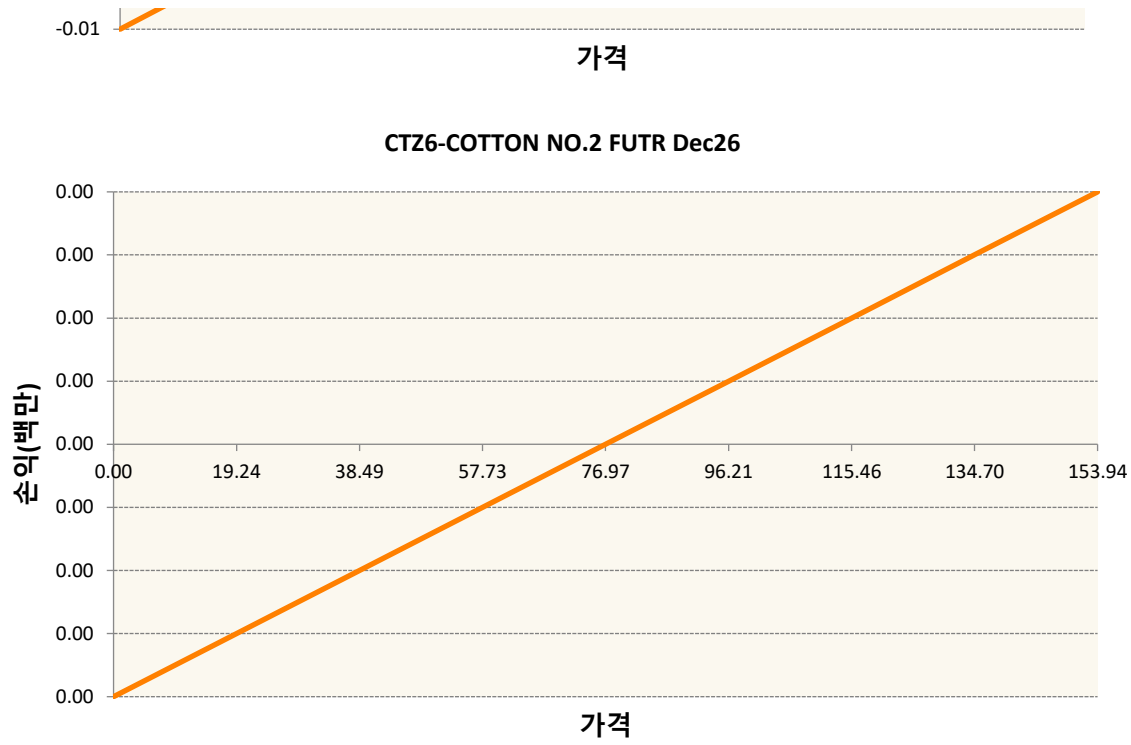
1. 계약금액

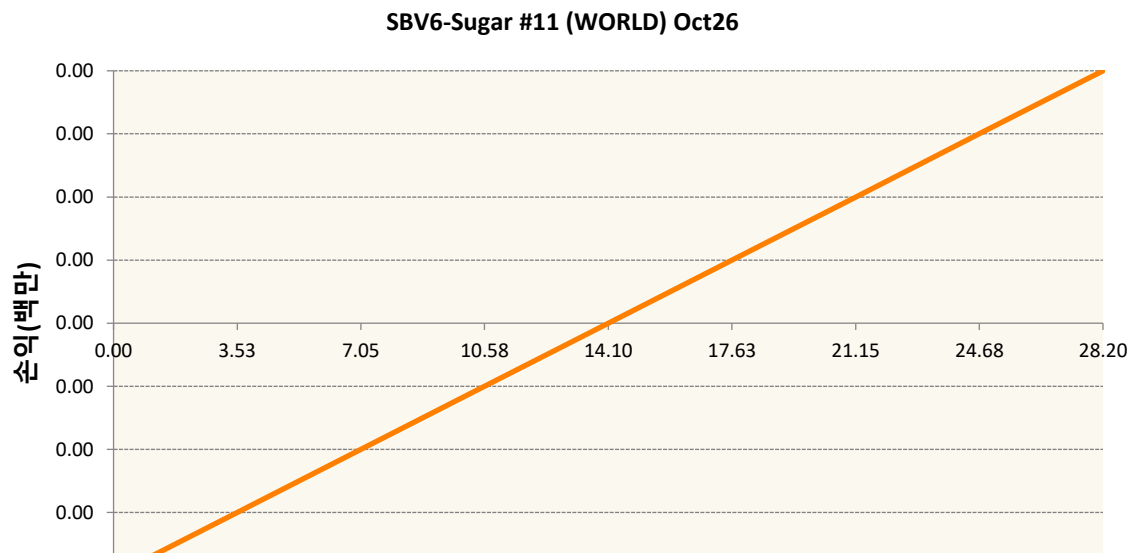
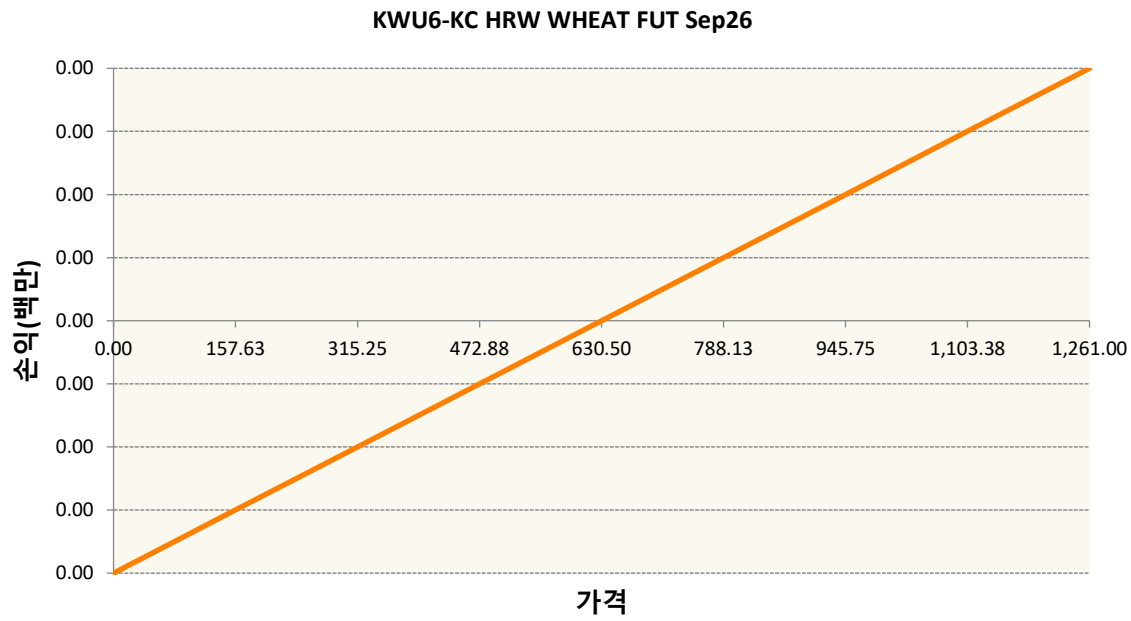
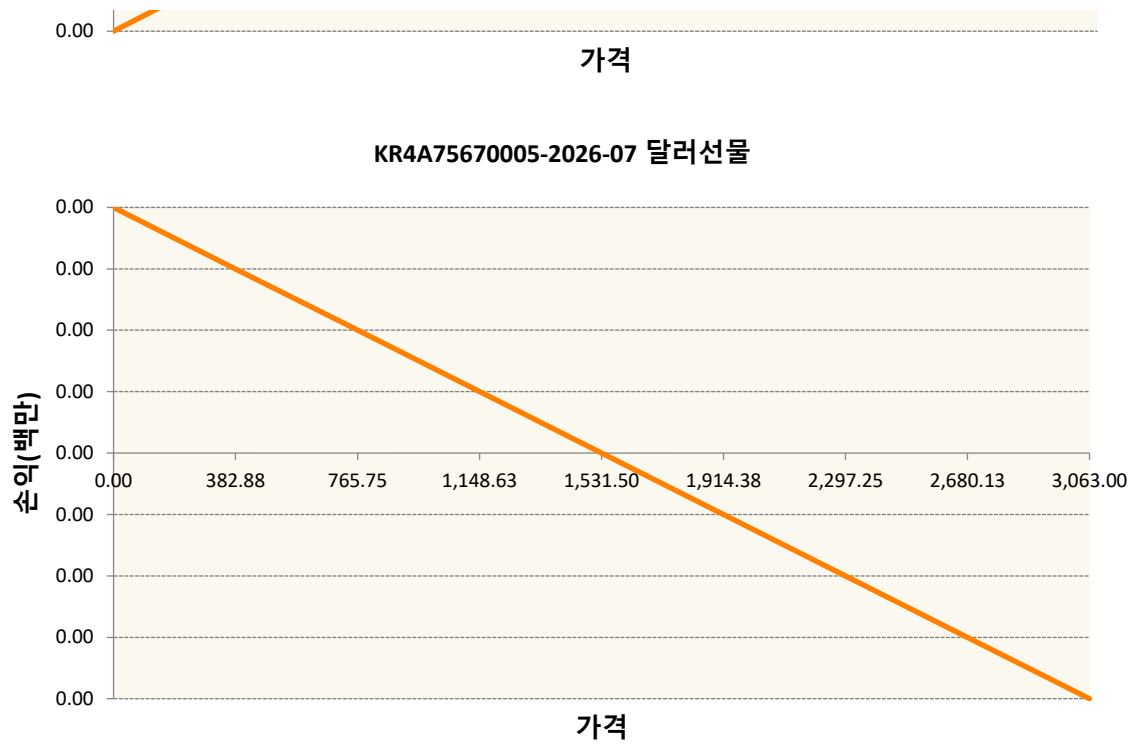
(단위:USD 백만)

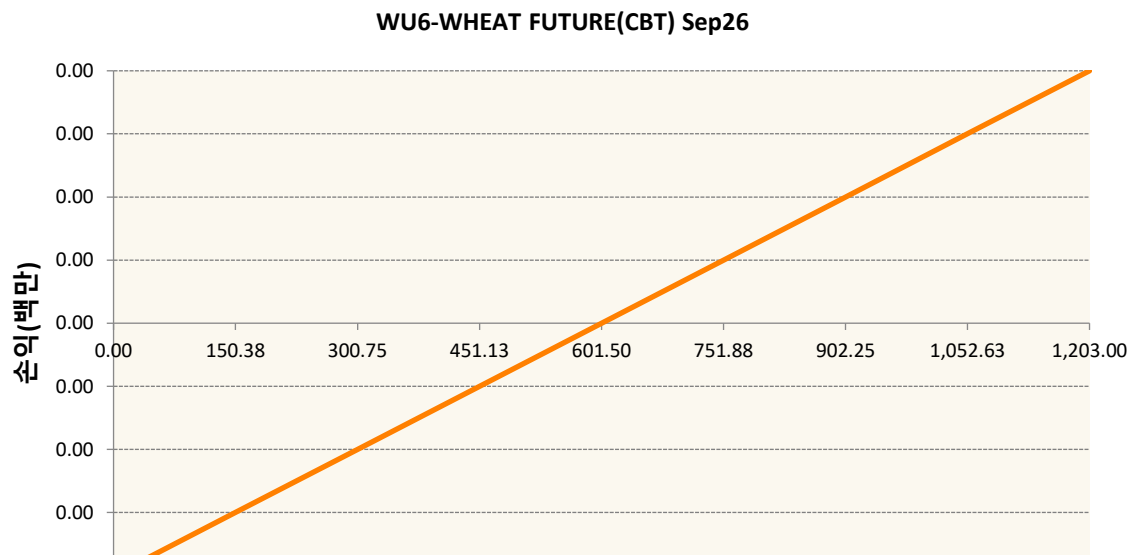
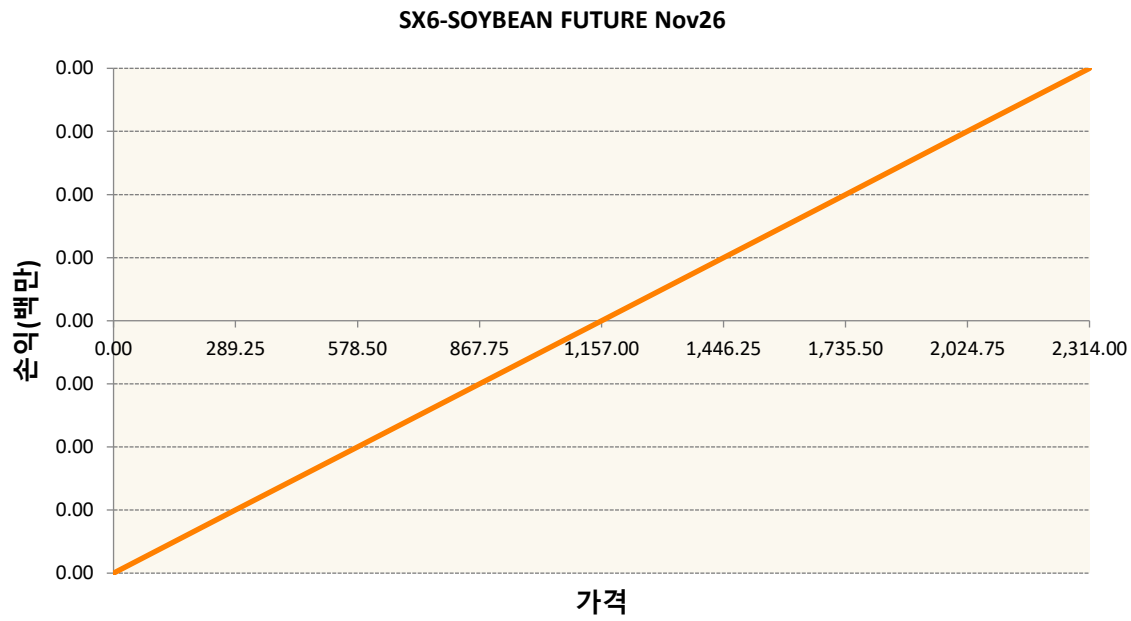
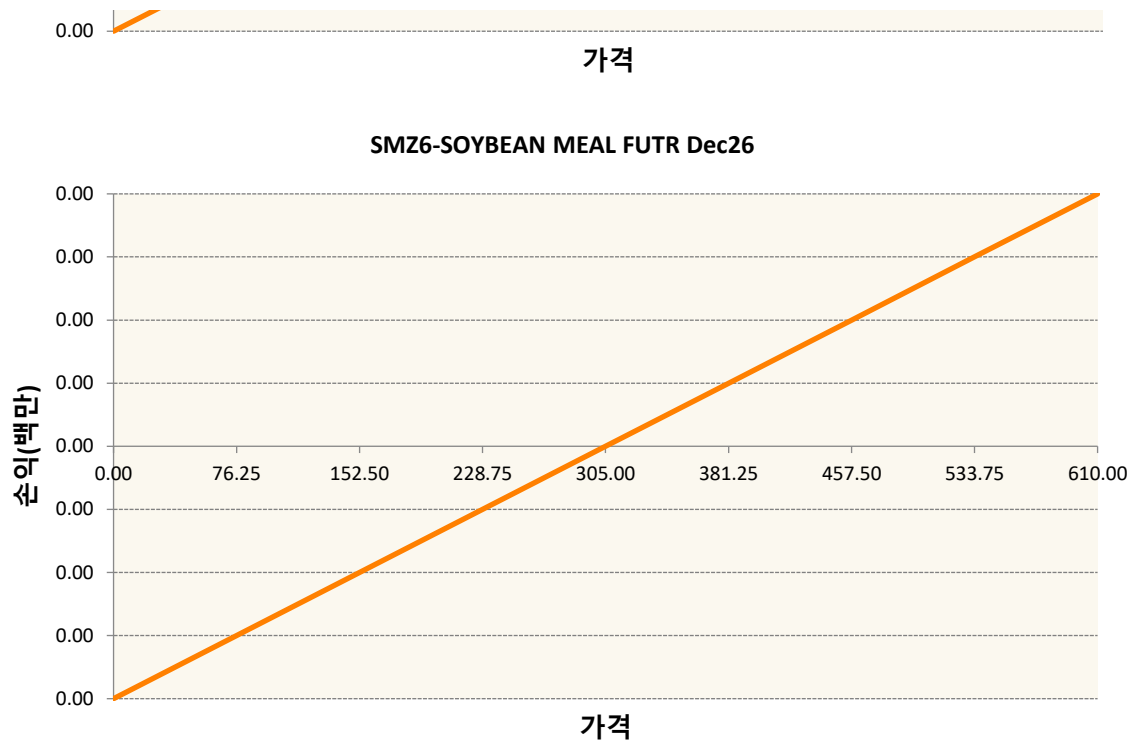
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	449	0	449	
누계	유가증권	선물	2,053	0	2,053	
누계	통화	선물	0	168	-168	장내

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	2026-06-29
기준일	2026-06-26

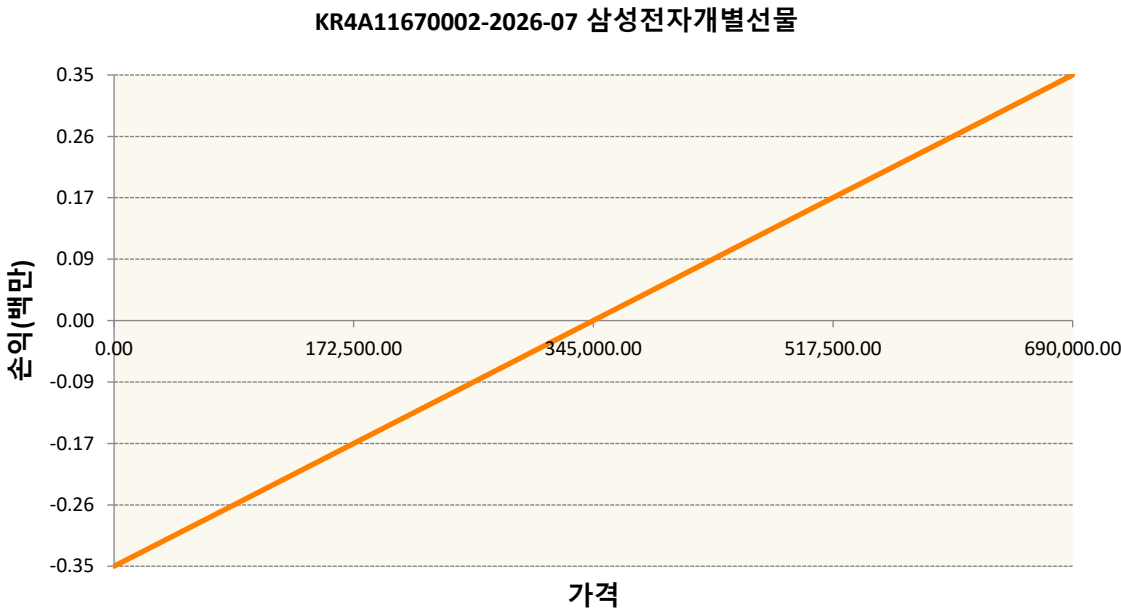
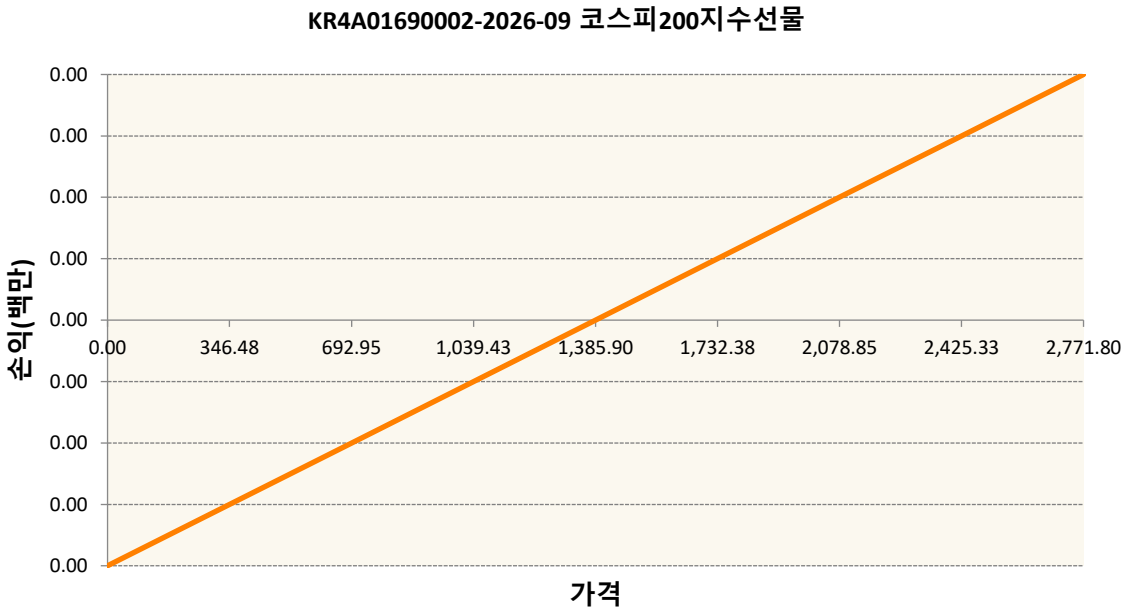
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,384	1,752	-368	장내
누계	유가증권	선물	4,296	0	4,296	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					328
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-328	-328	-328	-328	-328	-328	-328
-5.33%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
-2.67%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	109	109	109	109	109	109	109
5.33%	219	219	219	219	219	219	219
8.00%	328	328	328	328	328	328	328

KR4A11670002		2026-07 삼성전자개별선물					11
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-11	-11	-11	-11	-11	-11	-11
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	4	4	4	4	4	4	4
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	11	11	11	11	11	11	11

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

905

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

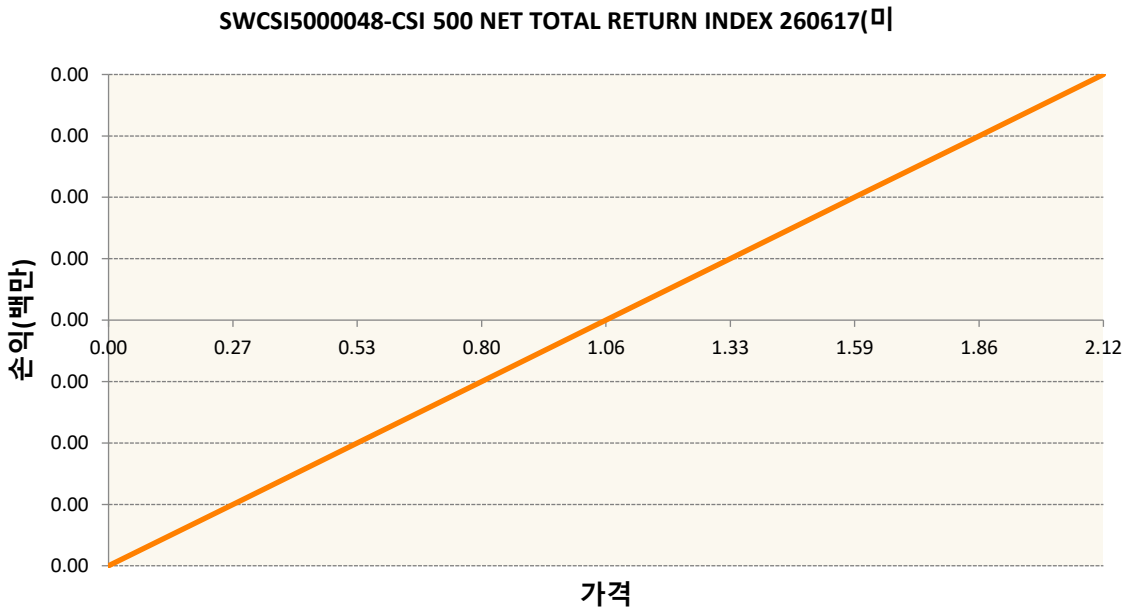
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	6,144	0	6,144	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

491

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

655

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

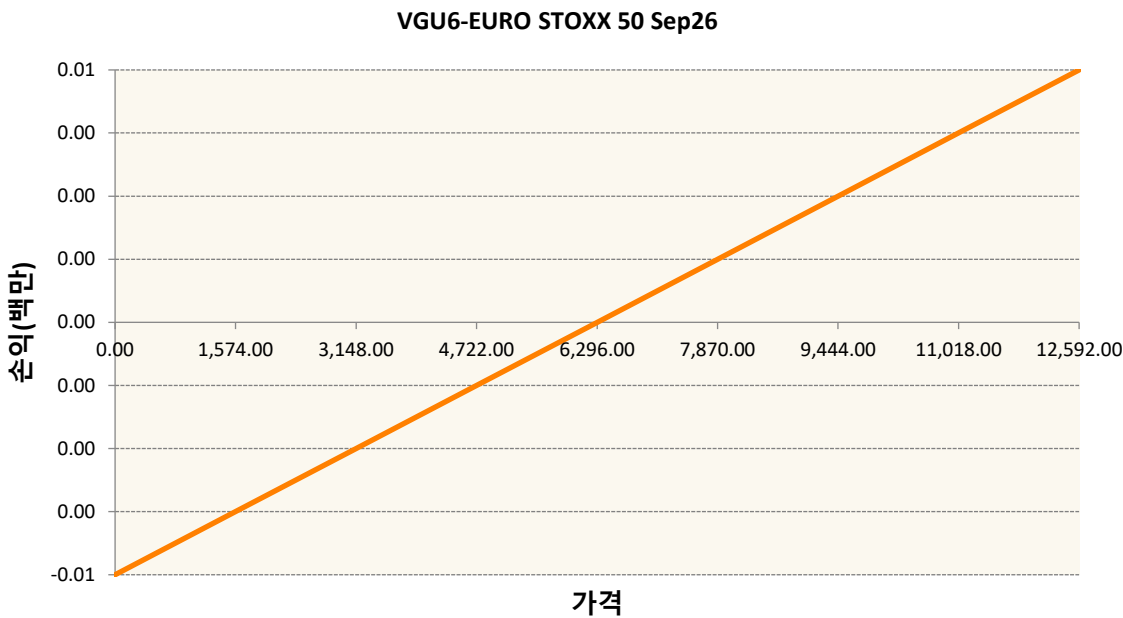
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	995	0	995	

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	2026-06-29
기준일	2026-06-26

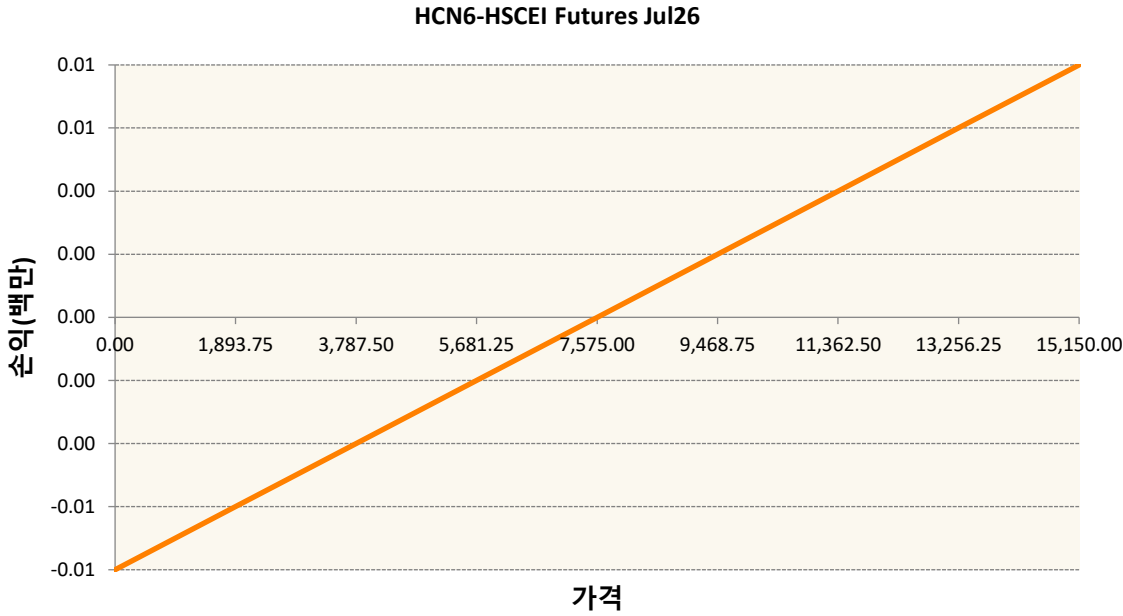
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,110	0	1,110	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN6	HSCEI Futures Jul26	89
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

107

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

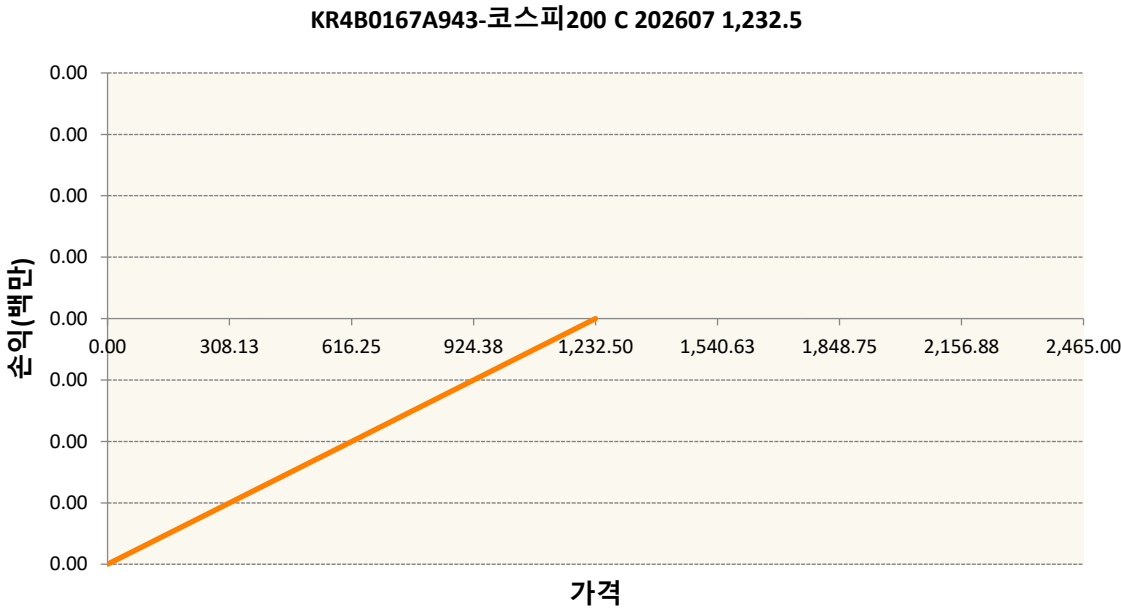
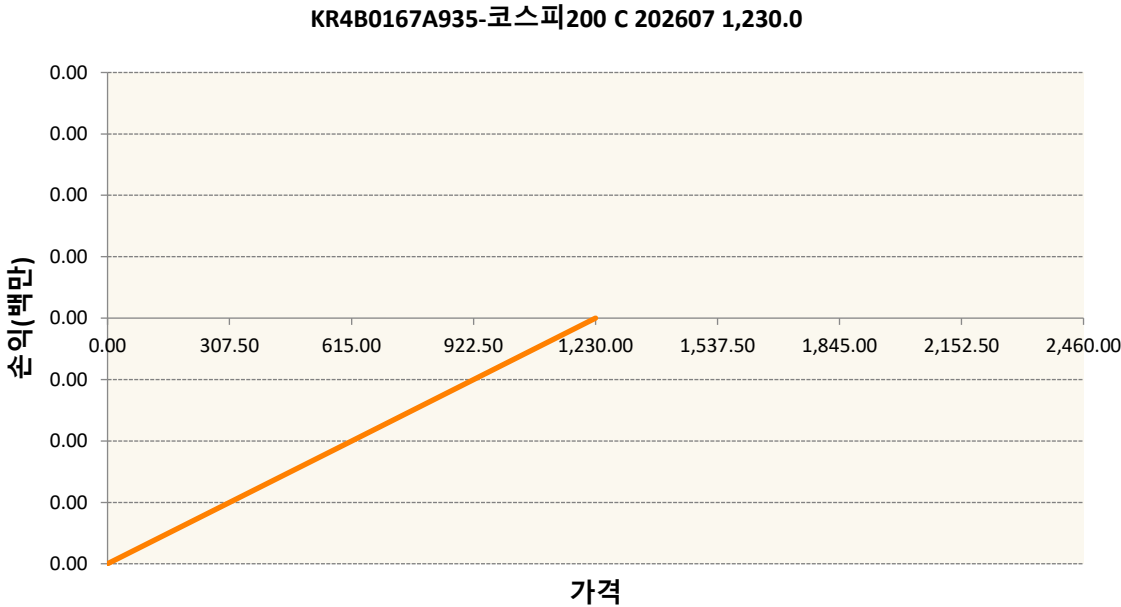
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

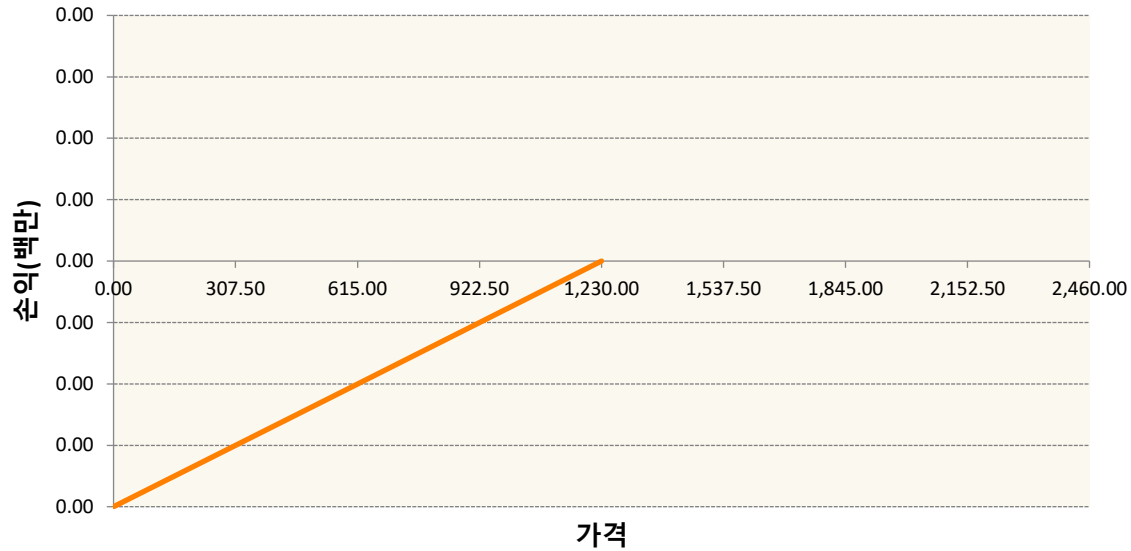
(단위:백만원)

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								359
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-78	-124	-171	-218	-265	-312	-359	
-5.33%	3	-42	-88	-134	-180	-227	-273	
-2.67%	69	26	-17	-61	-106	-152	-197	
0%	121	82	42	0	-43	-86	-131	
2.67%	161	127	90	52	12	-30	-72	
5.33%	191	162	129	95	58	19	-21	
8.00%	214	189	161	130	96	61	23	
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5								995
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-220	-349	-478	-607	-736	-866	-995	
-5.33%	7	-119	-245	-373	-501	-629	-758	
-2.67%	190	72	-49	-171	-295	-421	-547	
0%	335	227	115	0	-118	-239	-361	
2.67%	447	352	251	144	33	-81	-198	
5.33%	533	451	361	264	161	55	-56	
8.00%	597	528	449	363	270	171	67	
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0								329
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-71	-114	-157	-200	-243	-286	-329	
-5.33%	3	-38	-80	-123	-165	-208	-251	
-2.67%	63	24	-16	-56	-97	-139	-181	
0%	111	75	38	0	-39	-79	-120	

2.67%	147	116	83	47	11	-27	-66
5.33%	175	148	119	87	53	18	-19
8.00%	196	174	148	119	88	56	22

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

(단위:백만원)

1,810

공시일 2026-06-29

기준일 2026-06-26

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	2026-06-29
기준일	2026-06-26

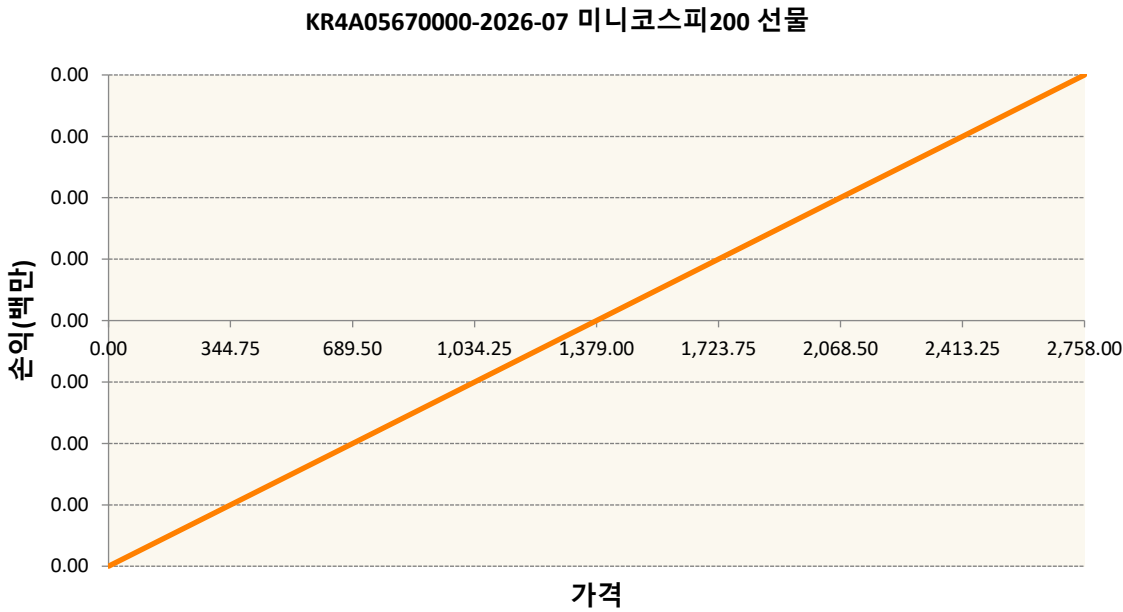
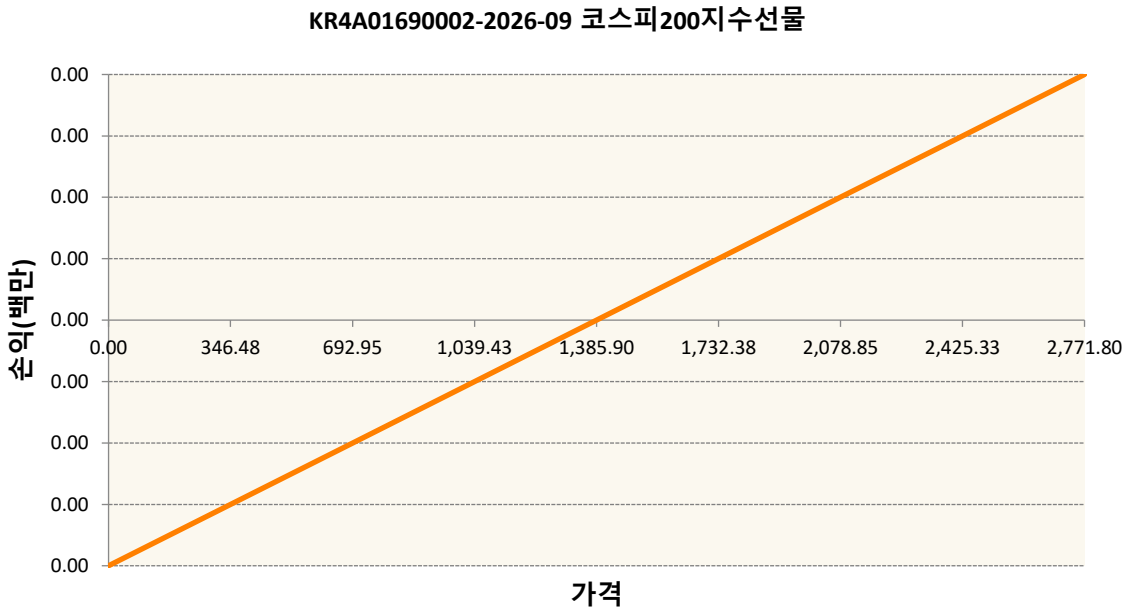
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,757	347	2,410	장내
누계	유가증권	선물	5,521	0	5,521	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					82
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
-5.33%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-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%	55	55	55	55	55	55	55
8.00%	82	82	82	82	82	82	82
KR4A05670000		2026-07 미니코스피200 선물					71
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-5.33%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-2.67%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	24	24	24	24	24	24	24
5.33%	47	47	47	47	47	47	47
8.00%	71	71	71	71	71	71	71

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

406

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

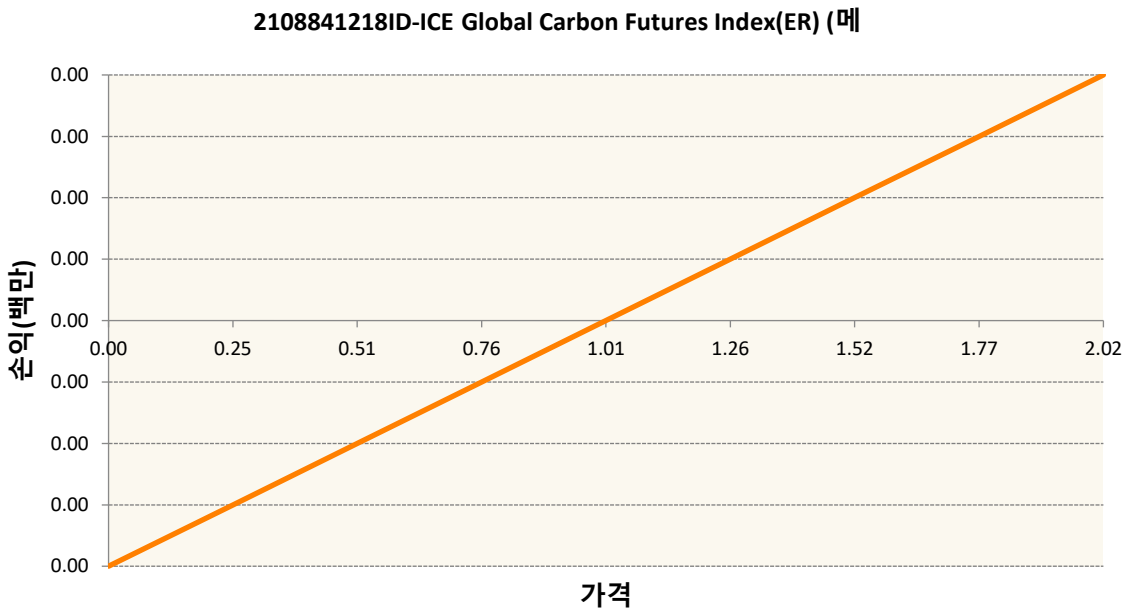
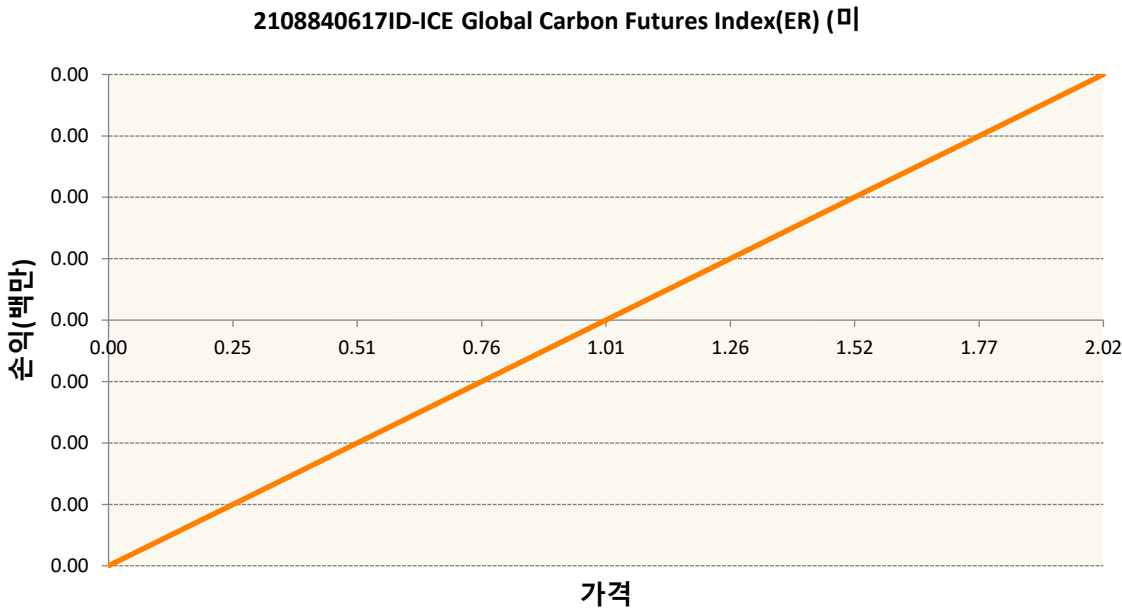
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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		484
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		122

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	690

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

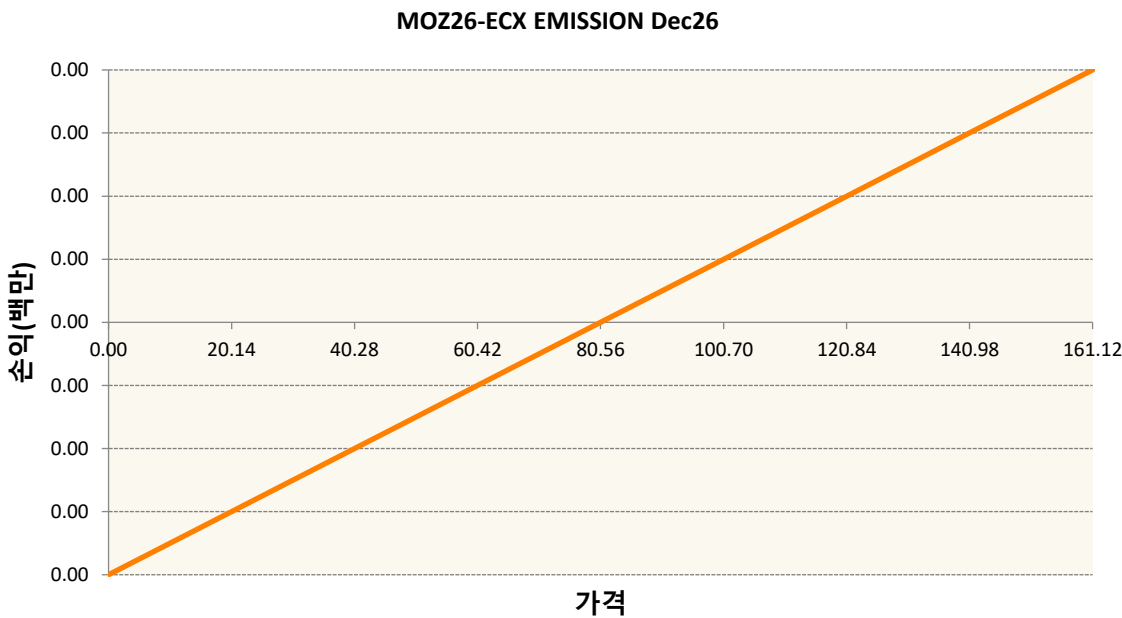
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,203	0	5,203	
누계	통화	선도	0	5,358	-5,358	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G5T(KRW/EUR 30-06-26E	210
FXW213G6S(KRW/EUR 31-07-26E	219
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	416

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

(단위:백만원)

839

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

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	1,657	0	1,657	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)	12
SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)	8
SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	20
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	4

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

(단위:백만원)

70

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

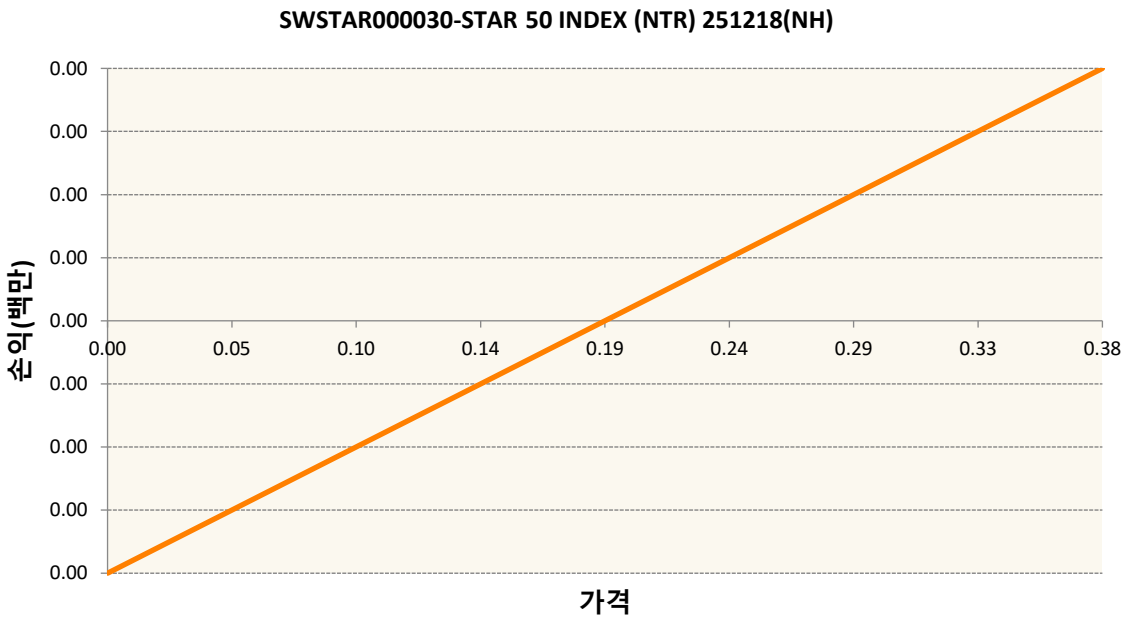
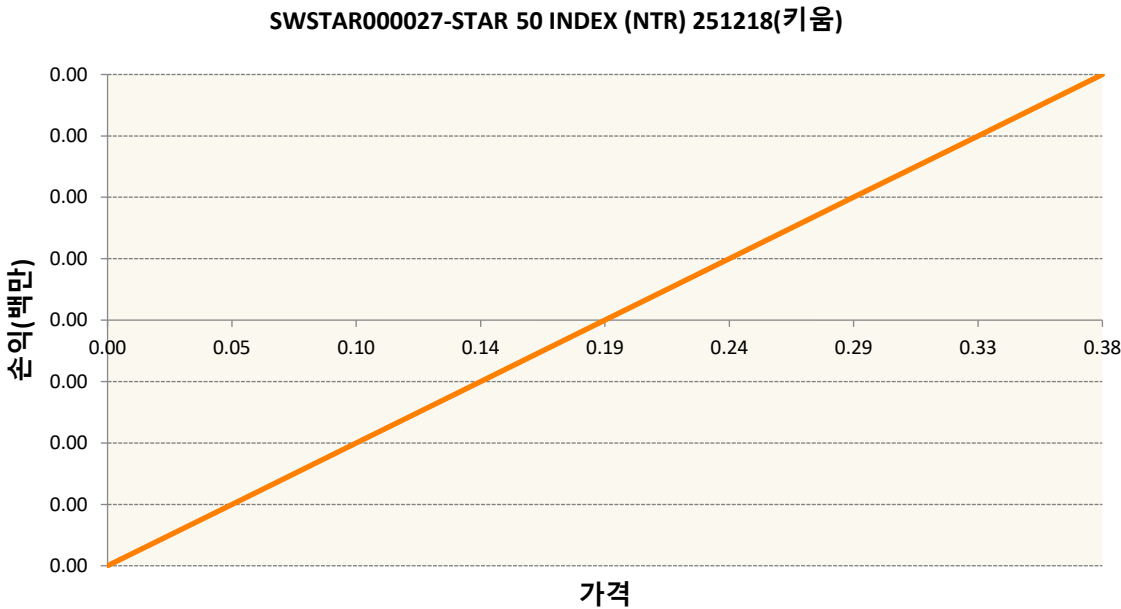
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

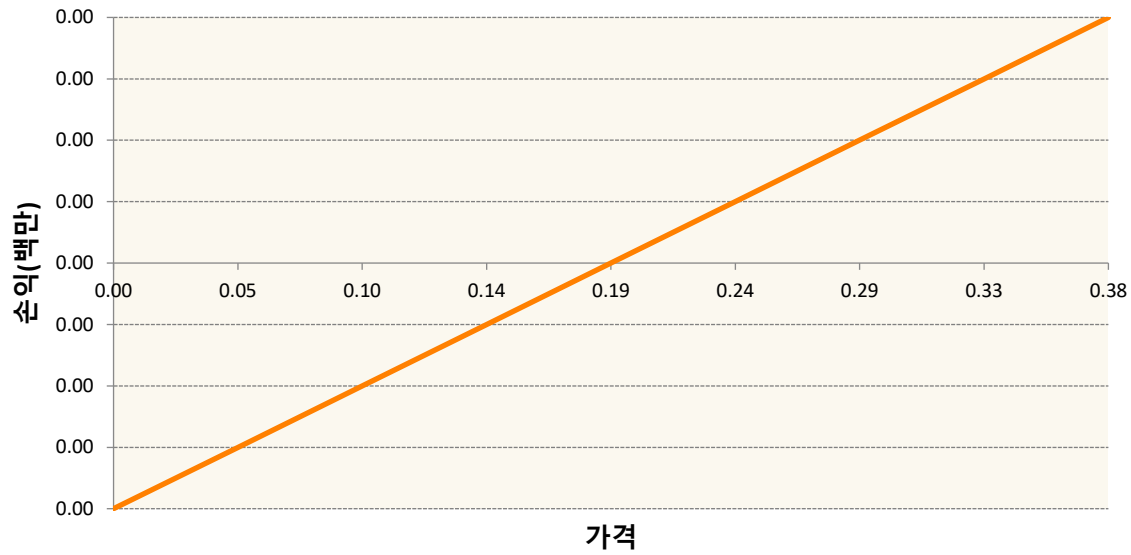
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,650	0	2,650	장외

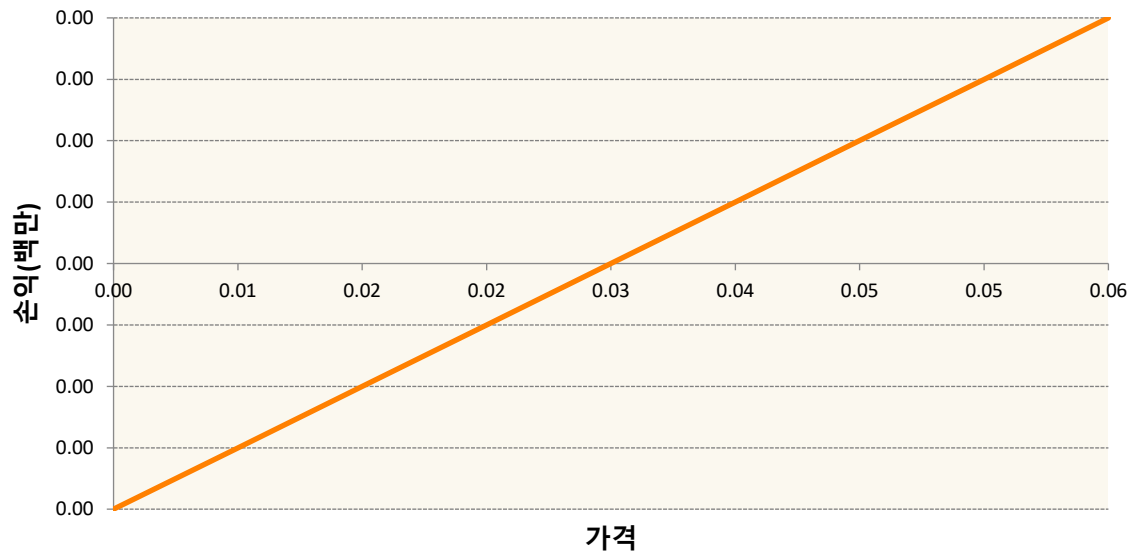
2. 만기시점의 손익구조



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



SWSTAR000035-STAR 50 INDEX (NTR) 260626(메리츠)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)	18
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	62
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260617(미래)	116
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260626(메리츠)	17

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

(단위:백만원)

348

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

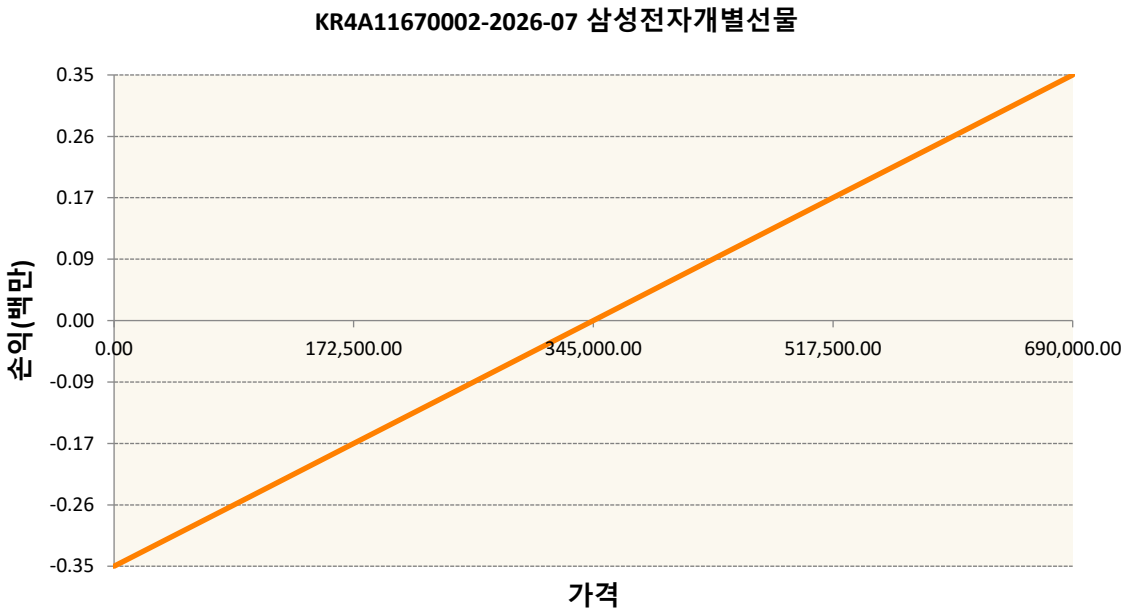
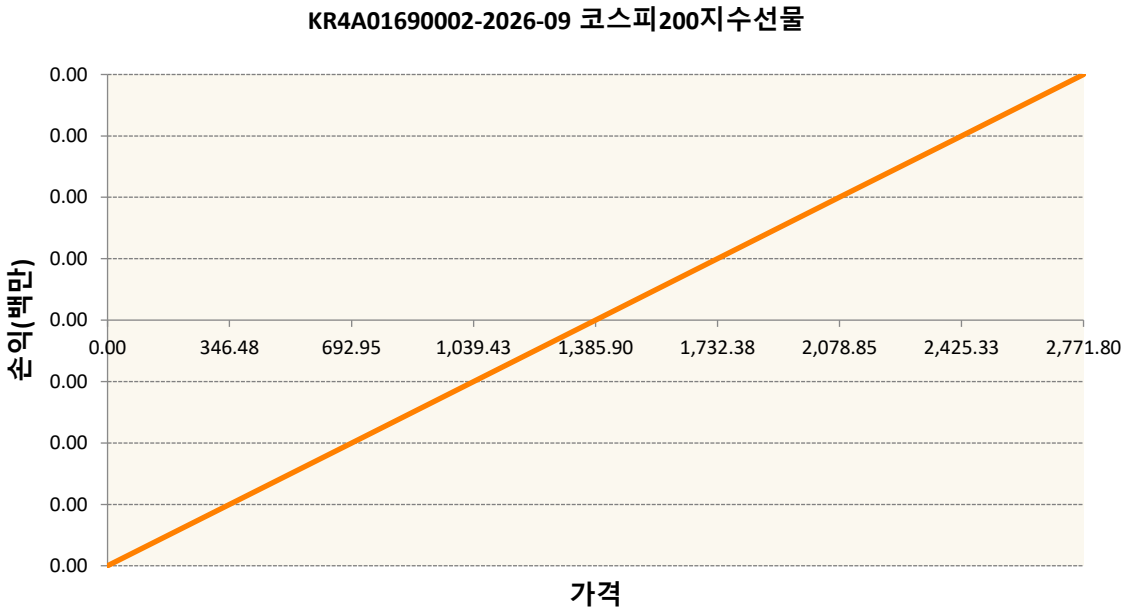
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

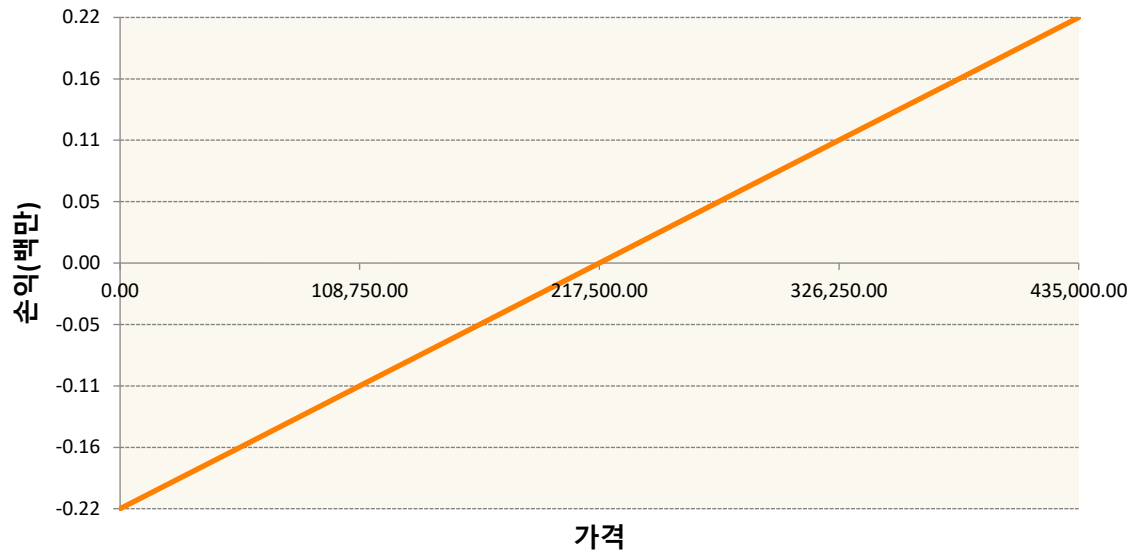
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	13,914	5,089	8,826	장내
누계	유가증권	선물	24,400	4,011	20,389	장내

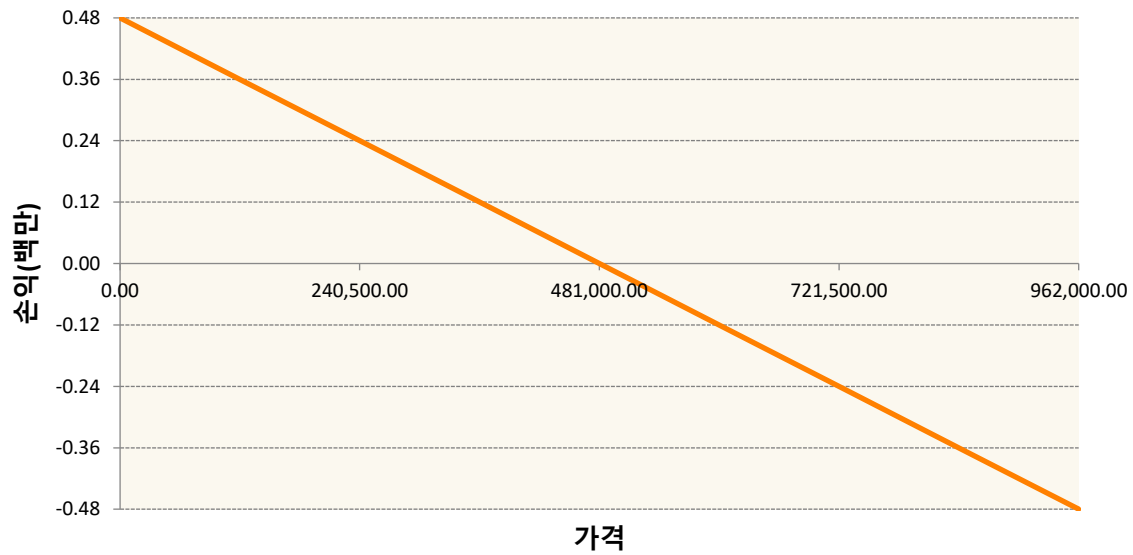
2. 만기시점의 손익구조



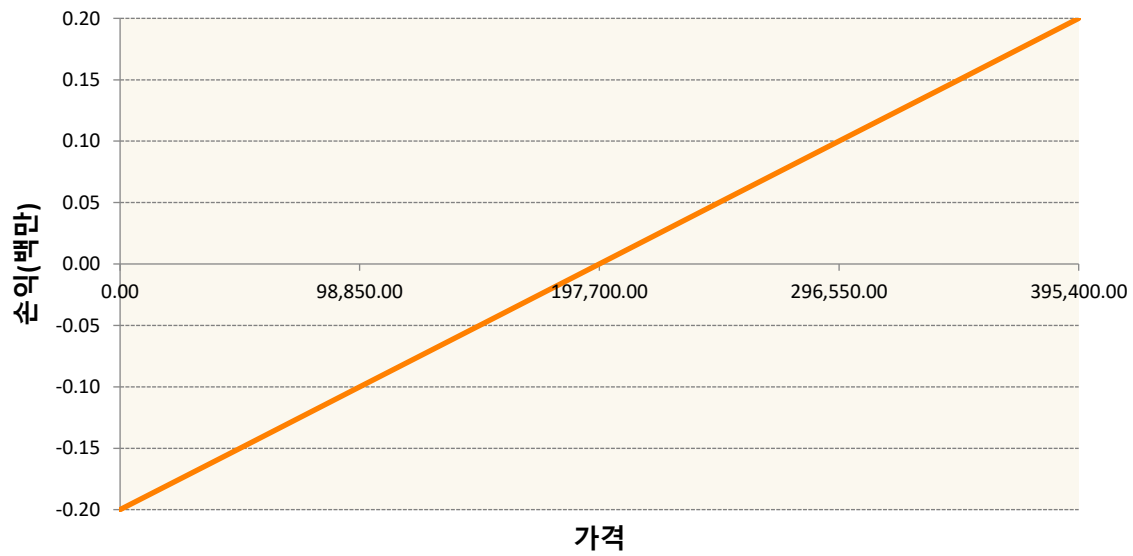
KR4A1V670008-2026-07 HD현대마린솔루션개별선물



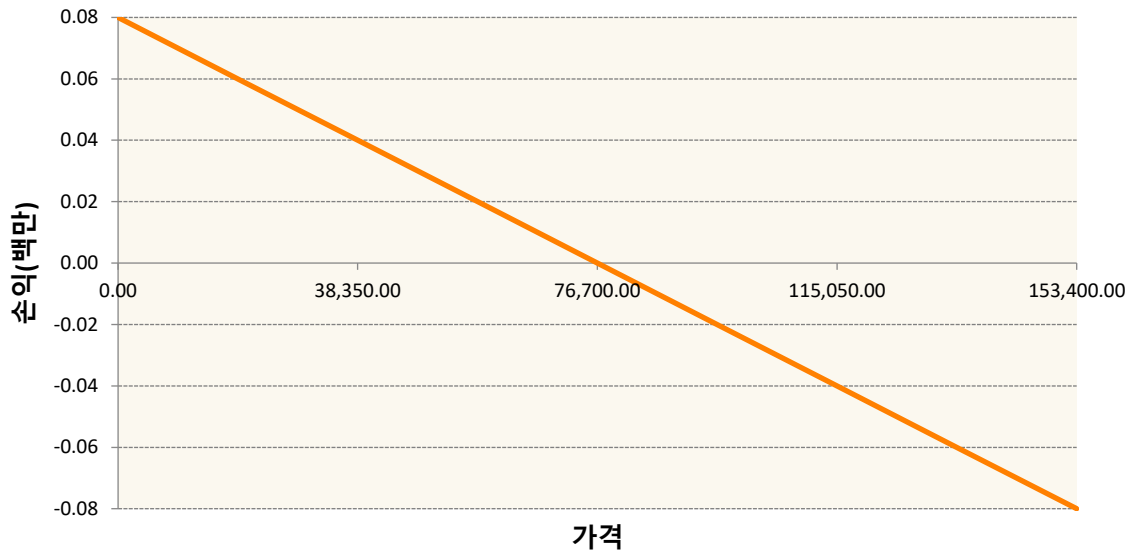
KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



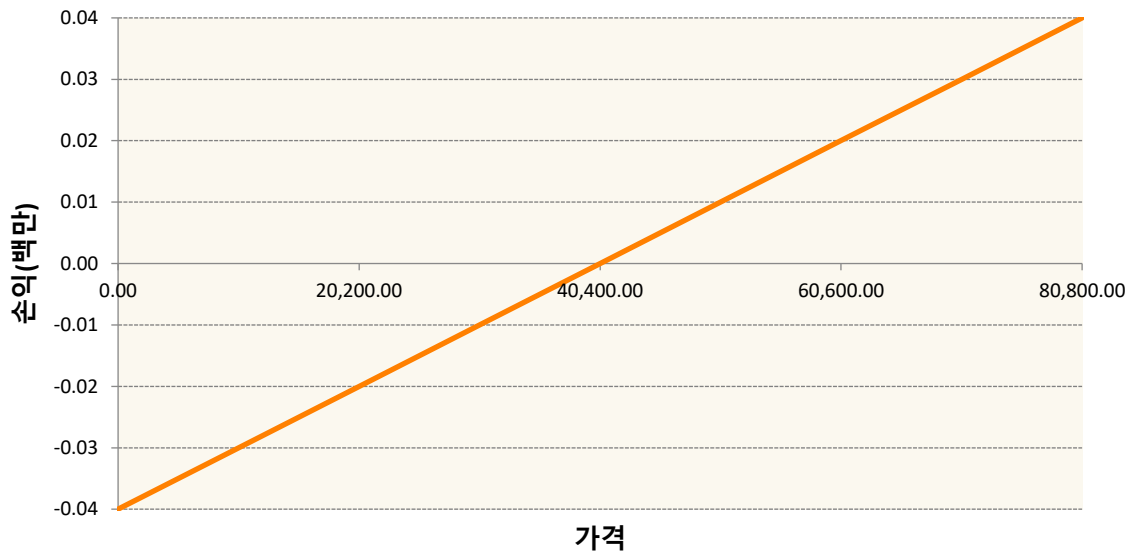
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



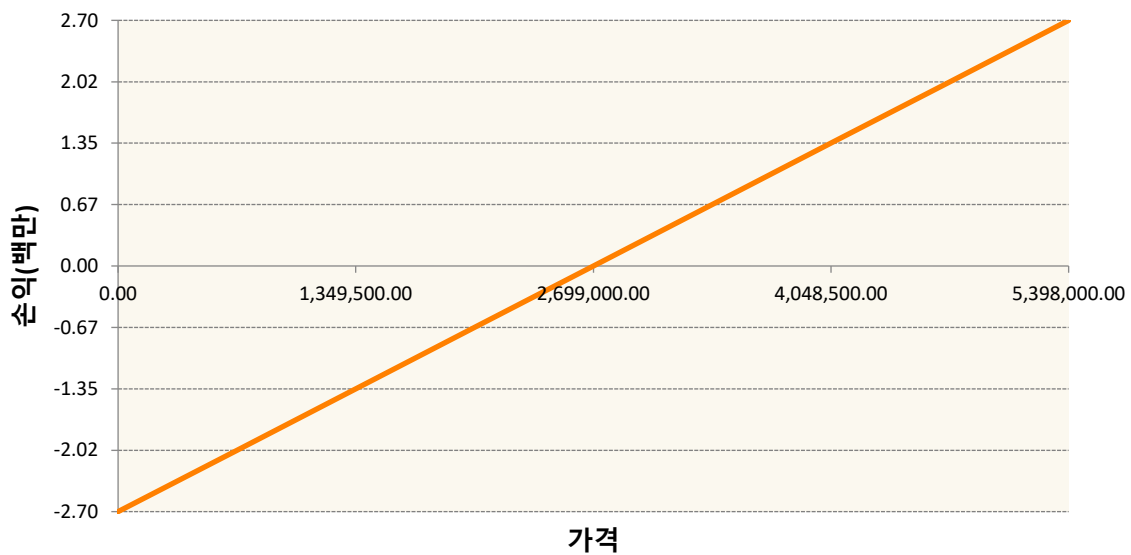
KR4A2K670000-2026-07 LG씨엔에스개별선물



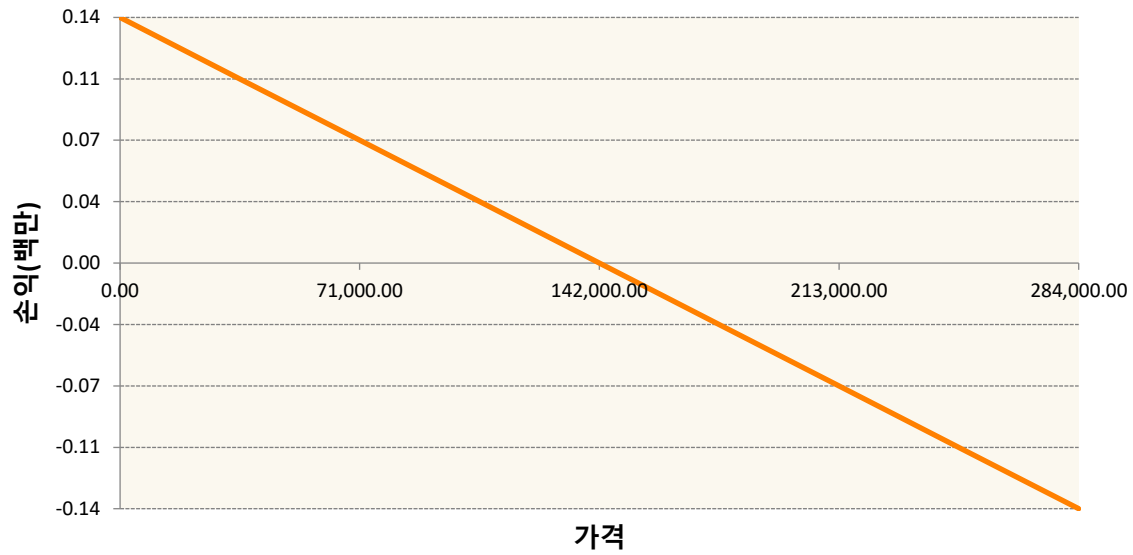
KR4A48670009-2026-07 미래에셋증권개별선물



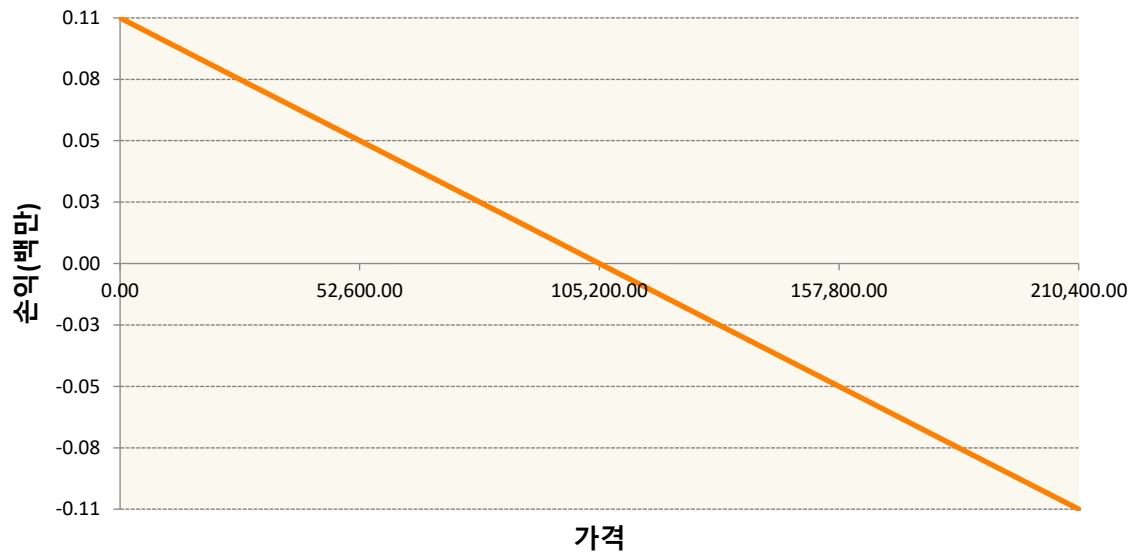
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



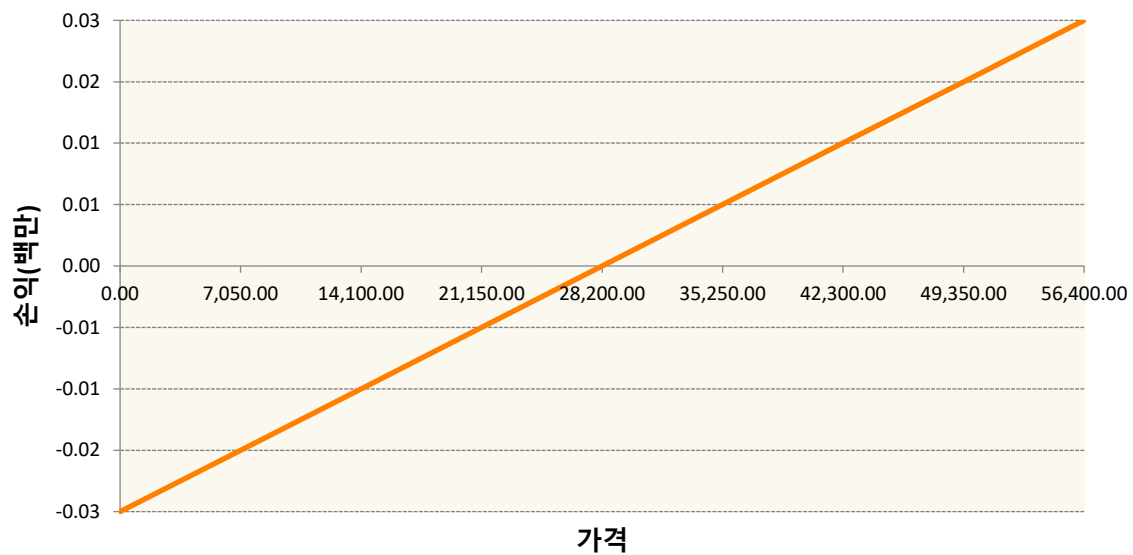
KR4ABM670006-2026-07 한국항공우주개별선물



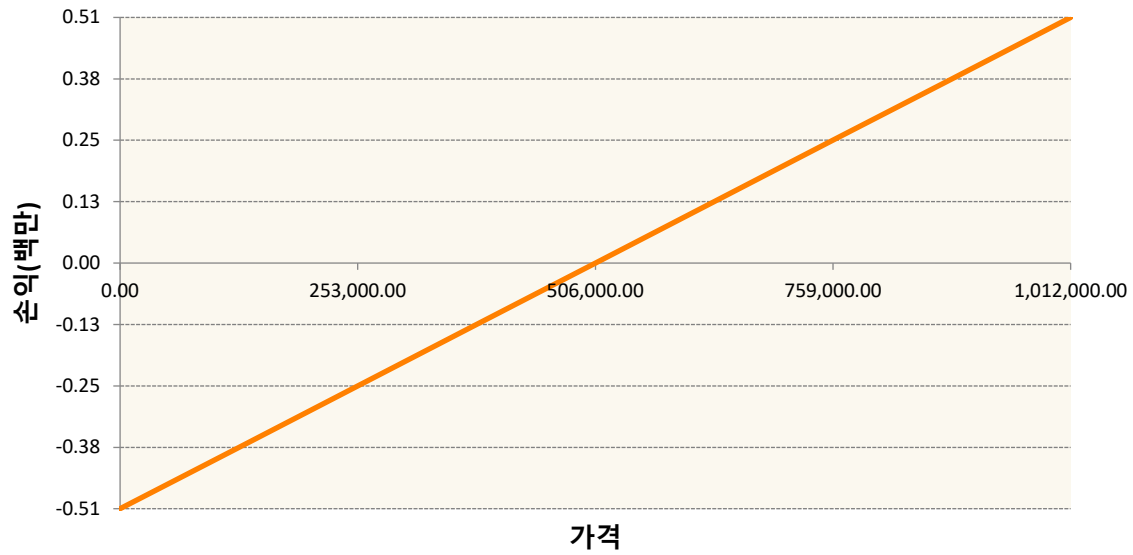
KR4ABN670005-2026-07 현대건설개별선물



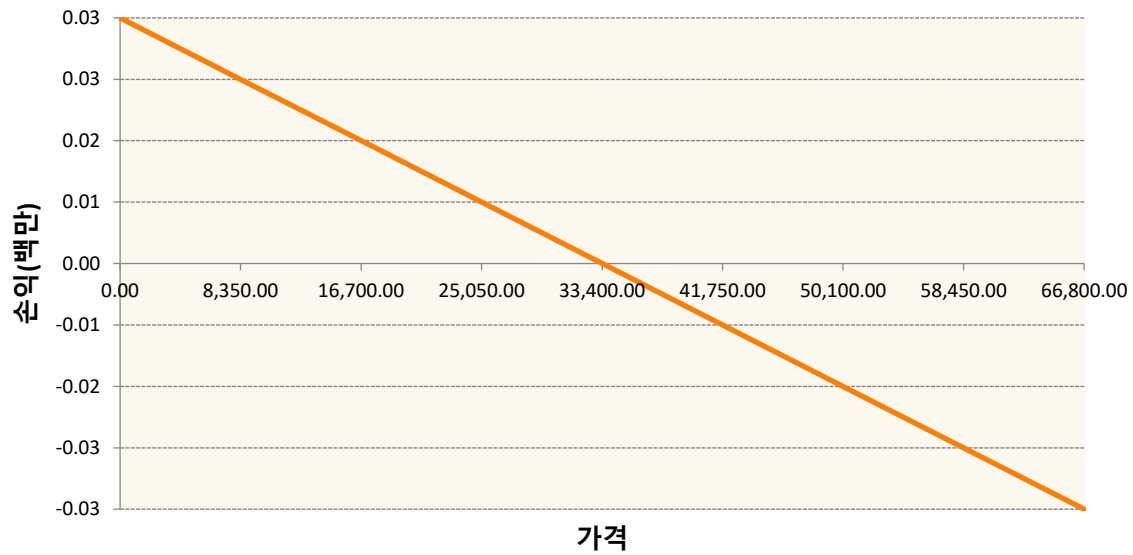
KR4ABZ670001-2026-07 NH투자증권개별선물



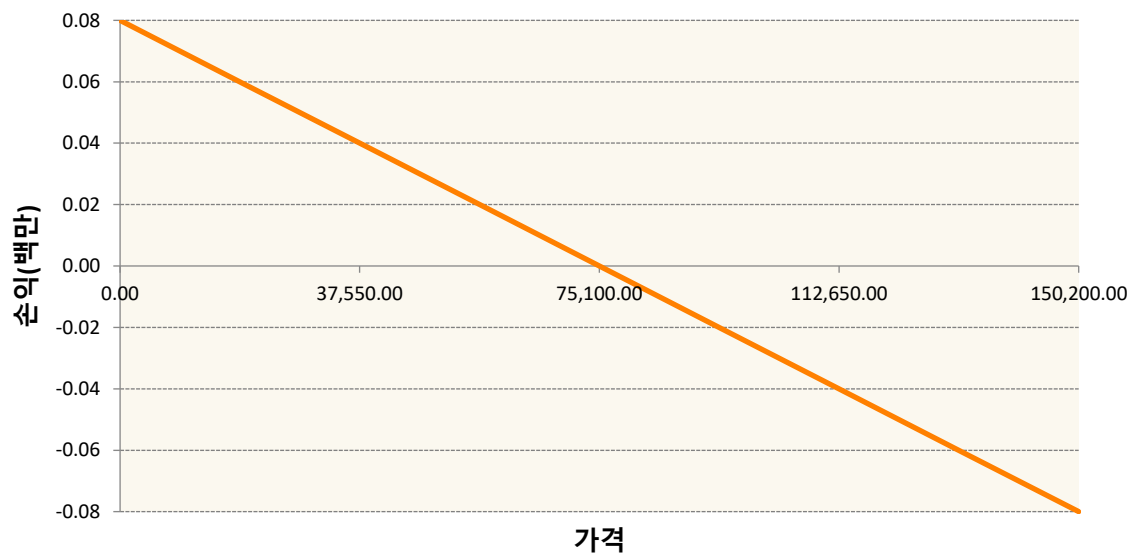
KR4AC8670003-2026-07 삼성물산개별선물



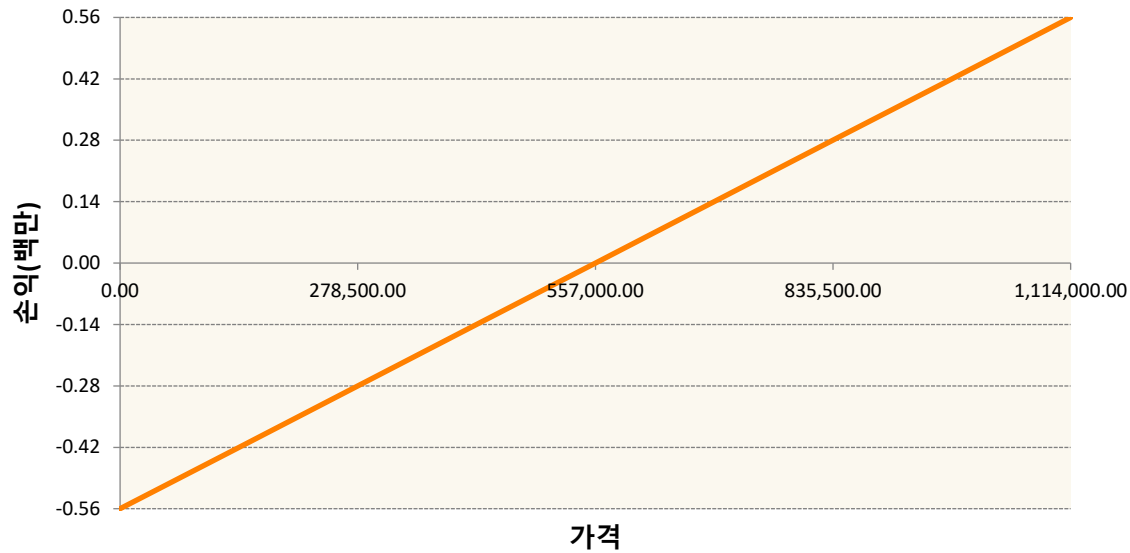
KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



KR4AEV670002-2026-07 한화시스템개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물					1,312
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-1,312	-1,312	-1,312	-1,312	-1,312	-1,312	-1,312	
-5.33%	-875	-875	-875	-875	-875	-875	-875	
-2.67%	-437	-437	-437	-437	-437	-437	-437	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	437	437	437	437	437	437	437	
5.33%	875	875	875	875	875	875	875	
8.00%	1,312	1,312	1,312	1,312	1,312	1,312	1,312	
KR4A11670002			2026-07 삼성전자개별선물					402
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	
-5.33%	-268	-268	-268	-268	-268	-268	-268	
-2.67%	-134	-134	-134	-134	-134	-134	-134	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	134	134	134	134	134	134	134	
5.33%	268	268	268	268	268	268	268	
8.00%	402	402	402	402	402	402	402	
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

KR4A20670001	2026-07 현대모비스개별선물	70
--------------	-------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	70	70	70	70	70	70	70
-5.33%	47	47	47	47	47	47	47
-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%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
8.00%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70

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%	-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

KR4A2K670000	2026-07 LG씨엔에스개별선물	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

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%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-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%	2	2	2	2	2	2	2
8.00%	4	4	4	4	4	4	4

KR4A50670004	2026-07 SK하이닉스개별선물	98
--------------	--------------------	----

	기초자산의 변동성
--	-----------

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-98	-98	-98	-98	-98	-98	-98
-5.33%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
-2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	33	33	33	33	33	33	33
5.33%	66	66	66	66	66	66	66
8.00%	98	98	98	98	98	98	98

KR4ABM670006

2026-07 한국항공우주개별선물

64

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	64	64	64	64	64	64	64
-5.33%	43	43	43	43	43	43	43
-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%	-43	-43	-43	-43	-43	-43	-43
8.00%	-64	-64	-64	-64	-64	-64	-64

KR4ABN670005

2026-07 현대건설개별선물

47

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	47	47	47	47	47	47	47
-5.33%	31	31	31	31	31	31	31
-2.67%	16	16	16	16	16	16	16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47

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

65

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-5.33%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-2.67%	-22	-22	-22	-22	-22	-22	-22
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	22	22	22	22	22	22	22
5.33%	44	44	44	44	44	44	44
8.00%	65	65	65	65	65	65	65
KR4ACF670004 2026-07 카카오개별선물							85
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	85	85	85	85	85	85	85
-5.33%	56	56	56	56	56	56	56
-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%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
8.00%	-85	-85	-85	-85	-85	-85	-85
KR4AEV670002 2026-07 한화시스템개별선물							29
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29
-5.33%	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%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
KR4AFD670003 2026-07 HD현대중공업개별선물							19
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
-5.33%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
-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%	13	13	13	13	13	13	13
8.00%	19	19	19	19	19	19	19

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

(단위:백만원)

5,818

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

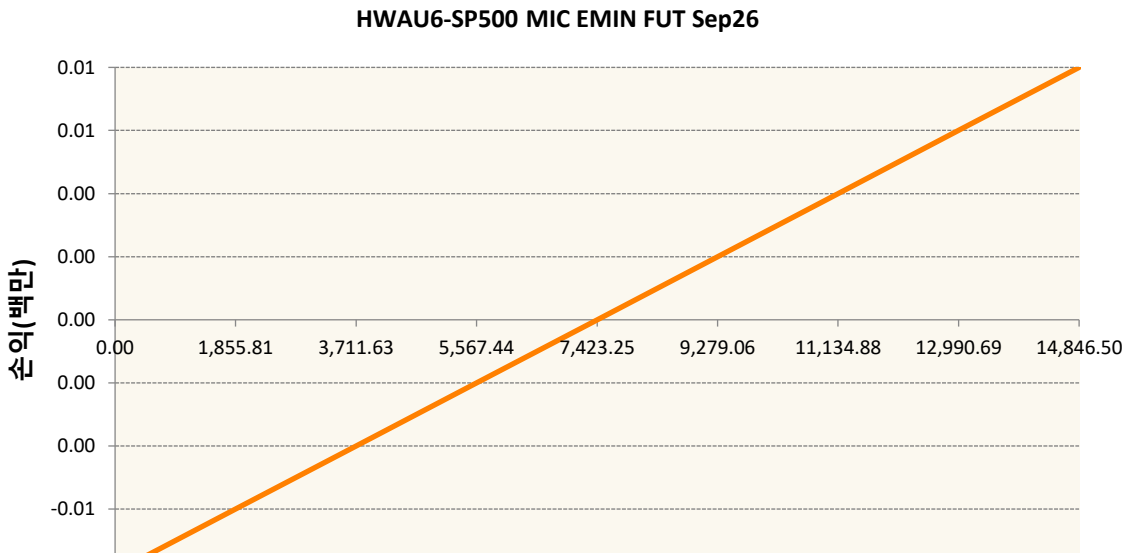
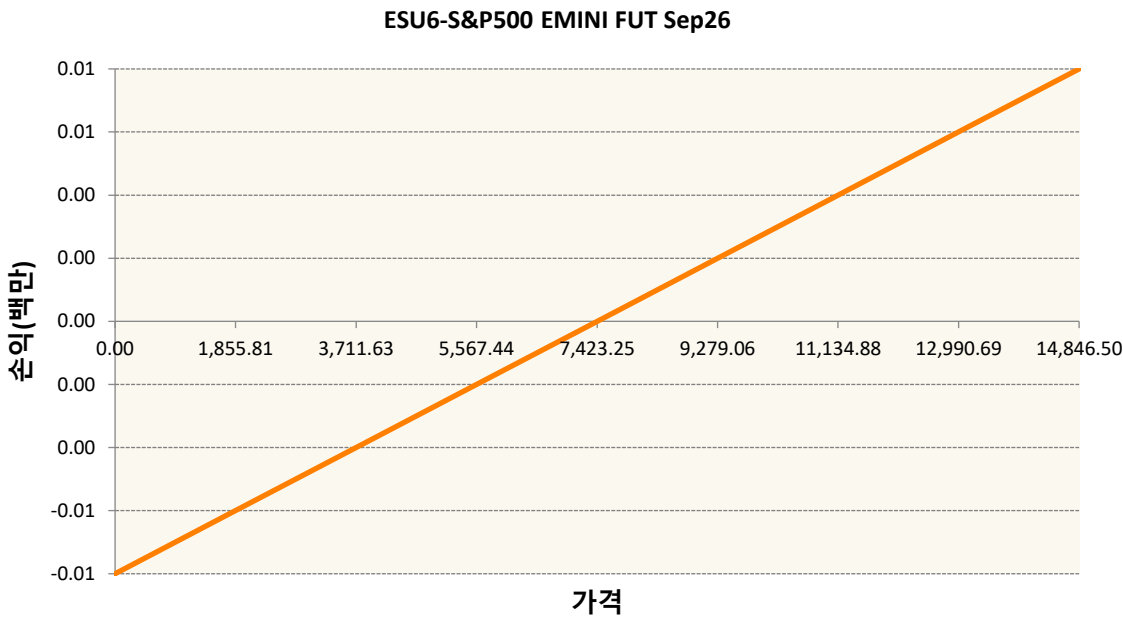
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

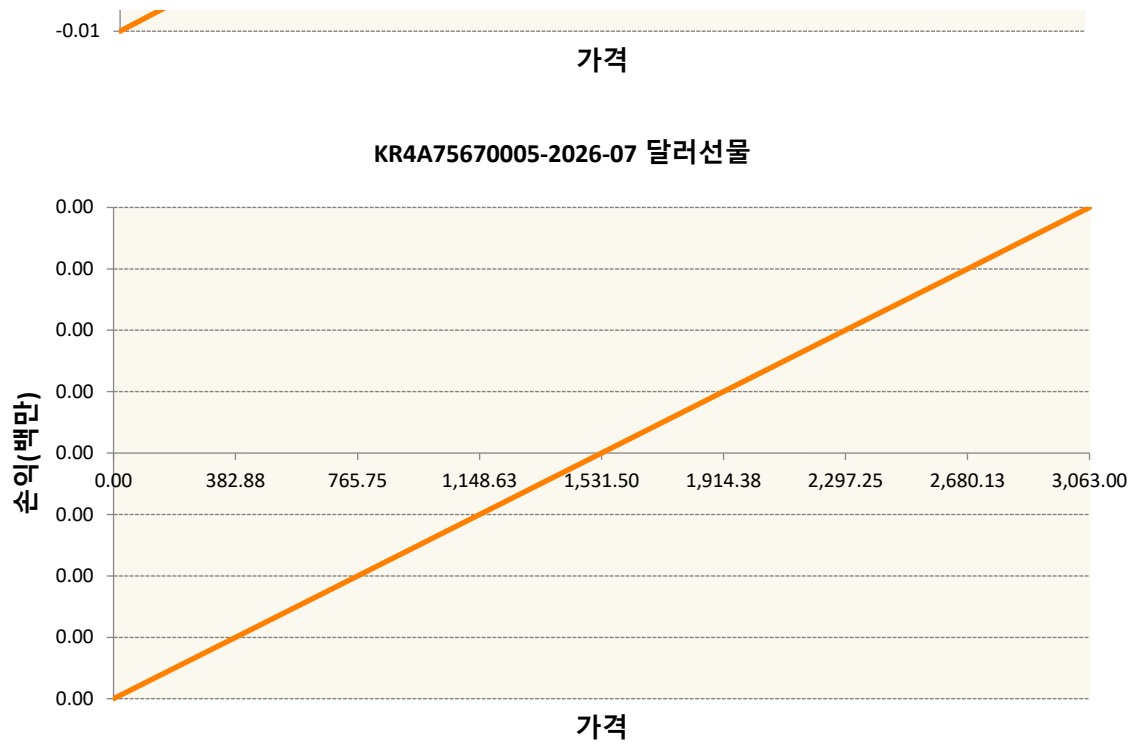
1. 계약금액

(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	61,138	0	61,138	
누계	지수	선물	112	0	112	장내
누계	통화	선물	10,874	0	10,874	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	4,891
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	9
KR4A756700	2026-07 달러선물	870

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

4,229

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

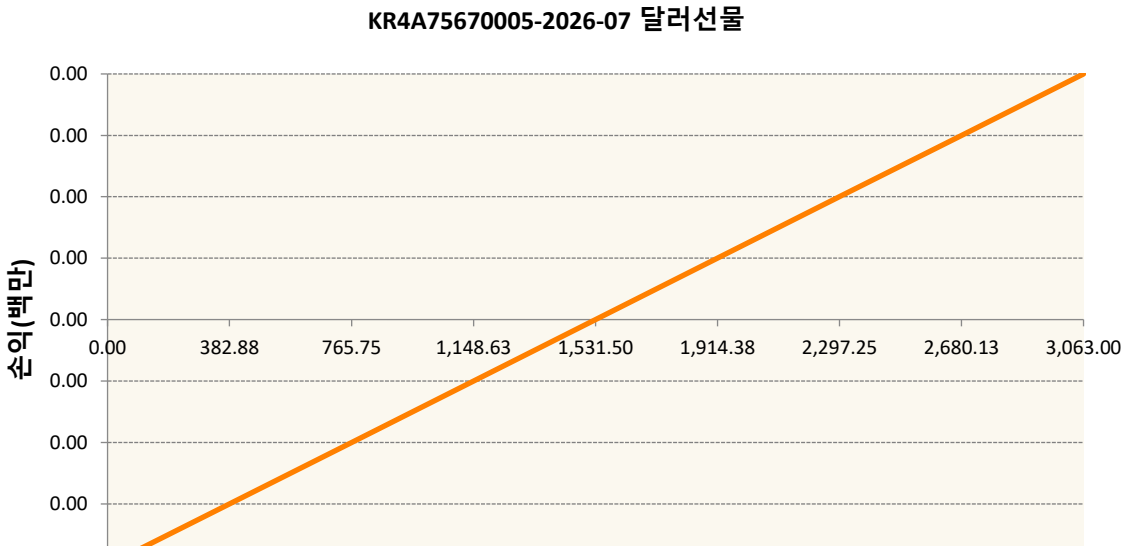
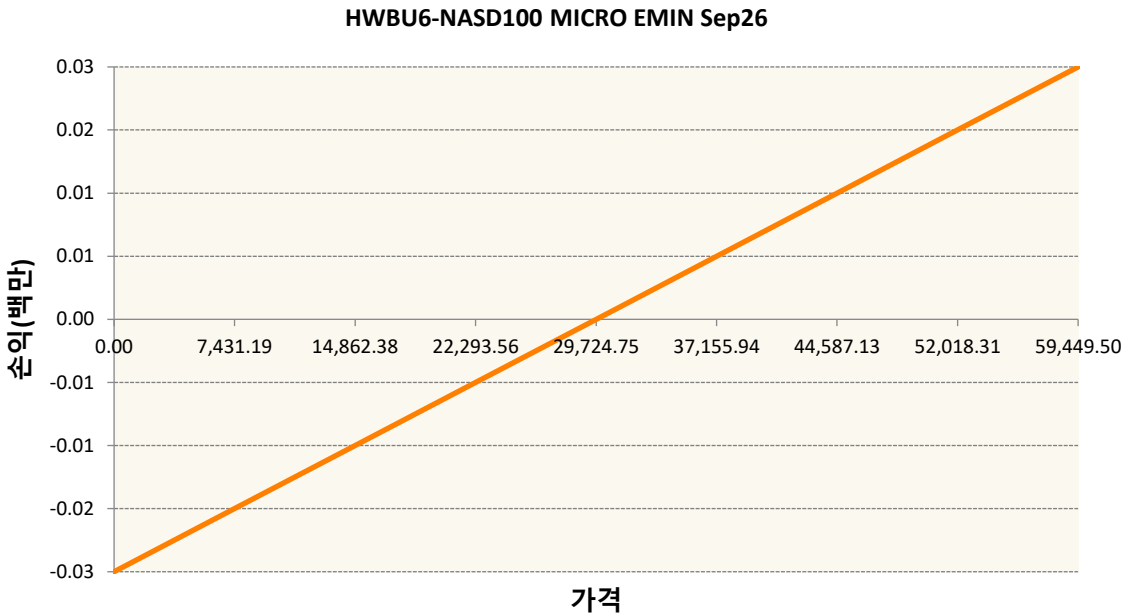
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

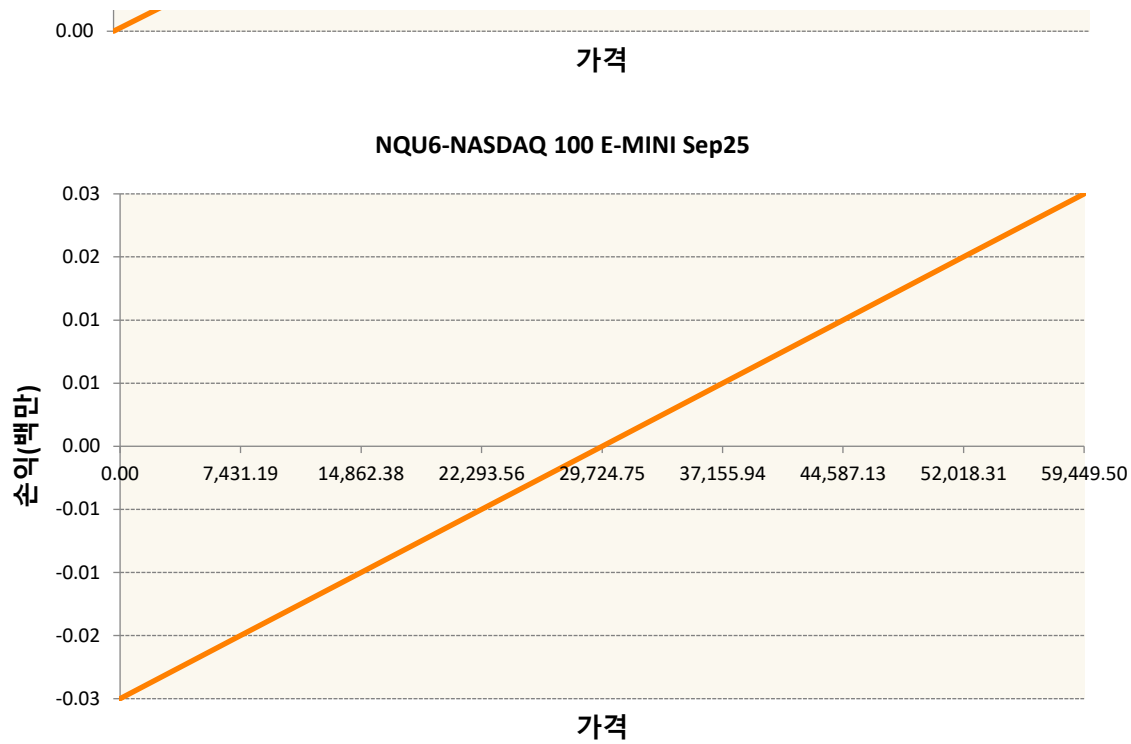
1. 계약금액

(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	183	0	183	장내
누계	지수	선물	30,542	0	30,542	
누계	통화	선물	3,997	0	3,997	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBU6 NASD100 MICRO EMIN Sep26

15

KR4A756700 2026-07 달러선물

320

NQU6 NASDAQ 100 E-MINI Sep25

2,443

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

(단위:백만원)

2,765

공시일	2026-06-29
기준일	2026-06-26

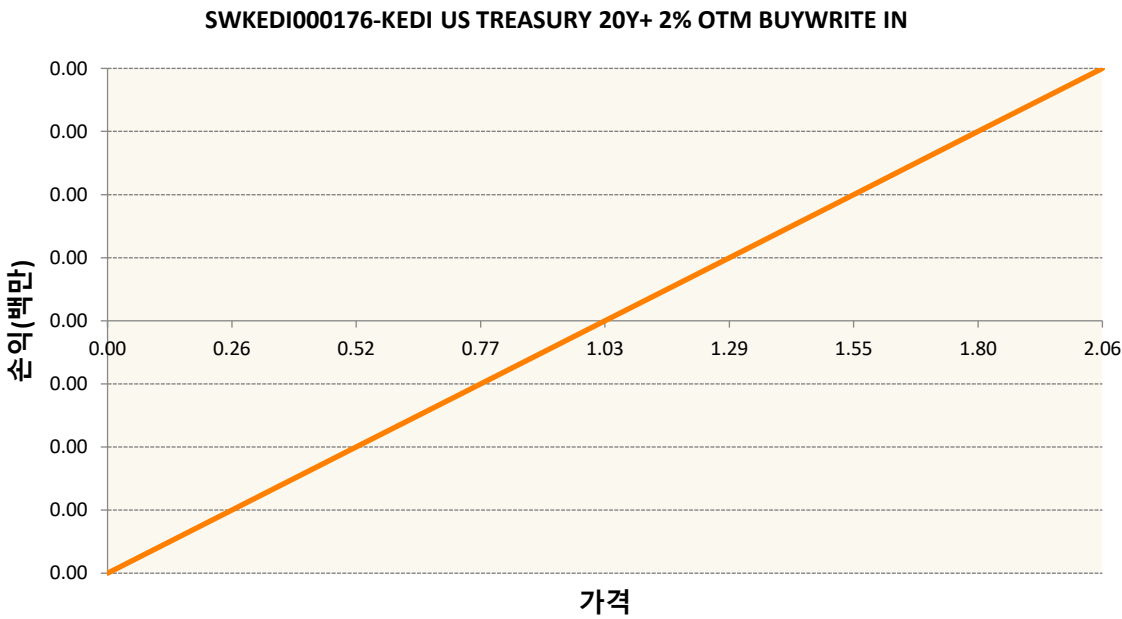
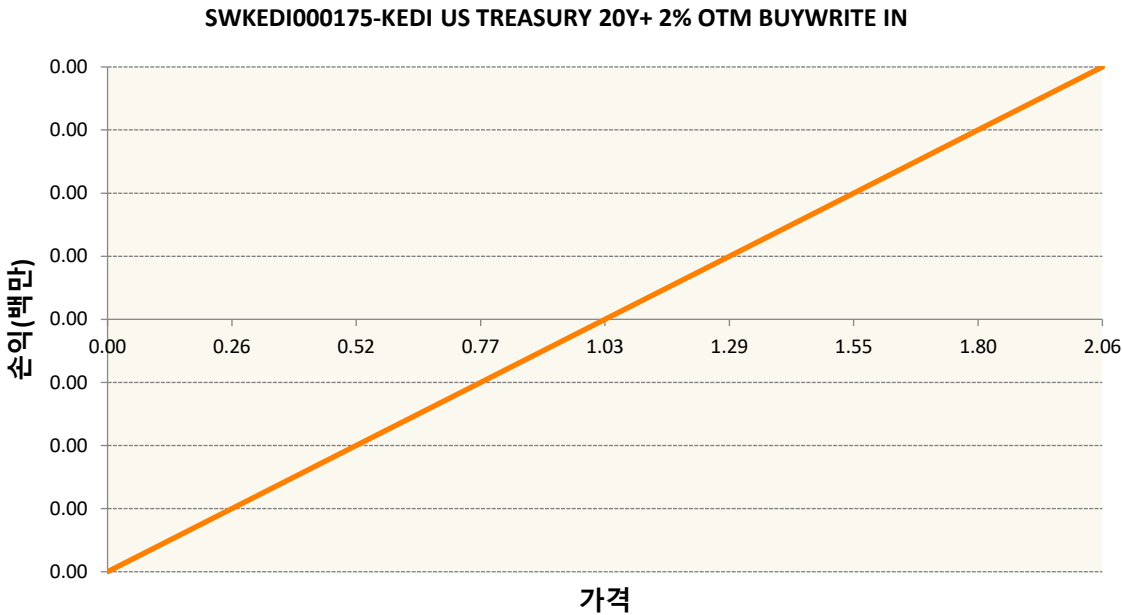
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

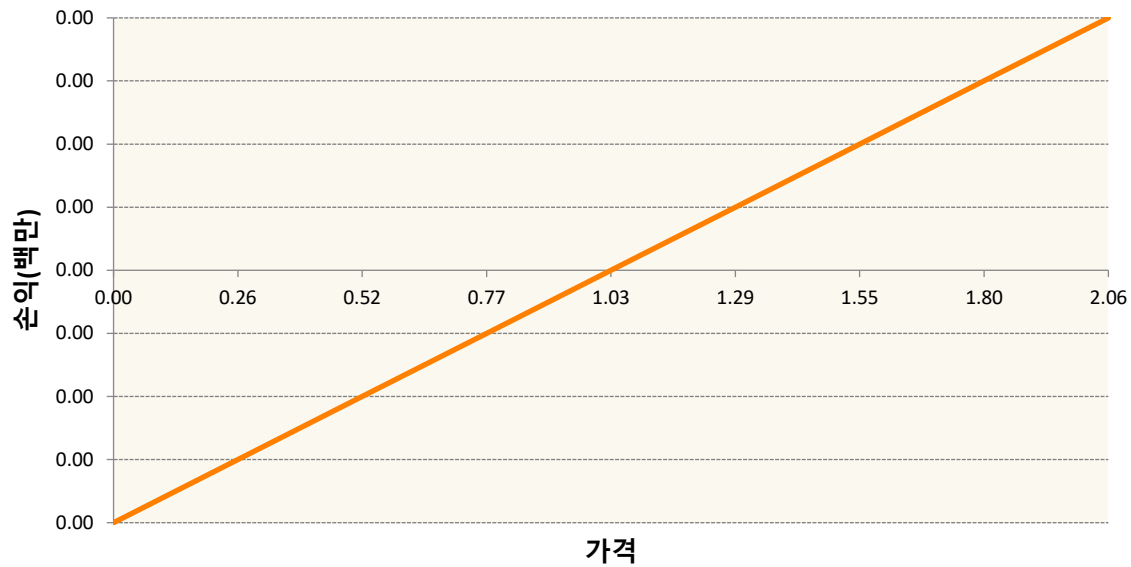
(단위:백만원)

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

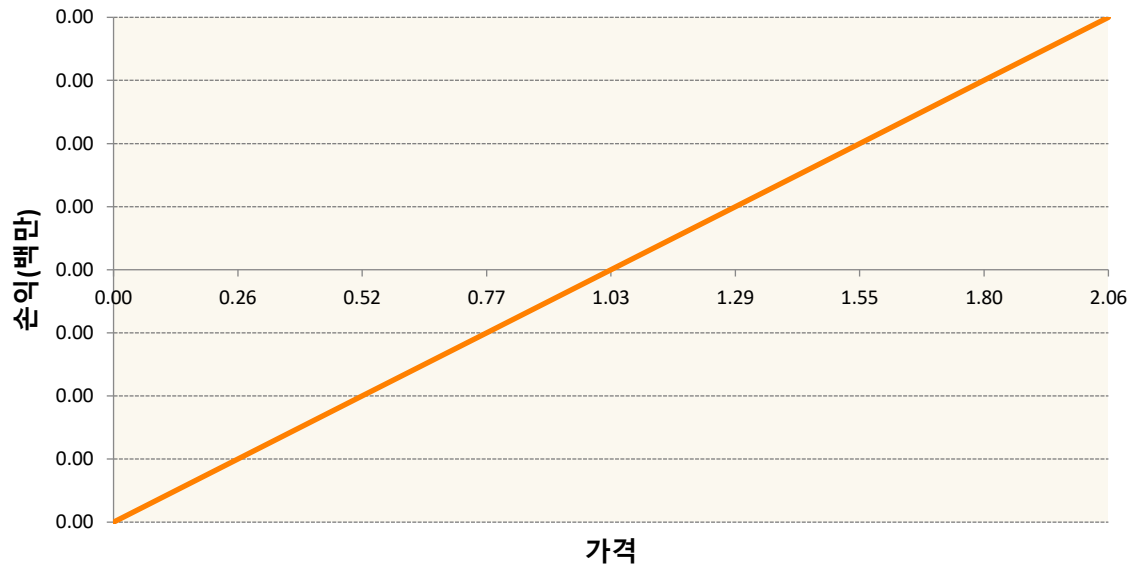
2. 만기시점의 손익구조



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	8,618
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,359
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,281
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,101

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

(단위:백만원)

11,144