

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

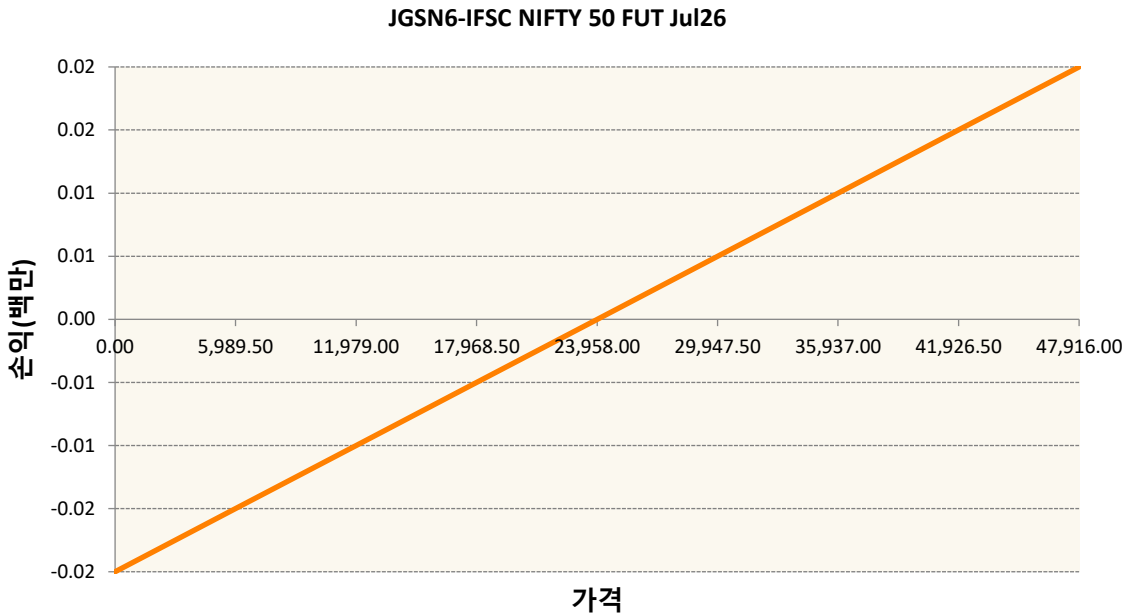
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	370	0	370	

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	2026-07-01
기준일	2026-06-30

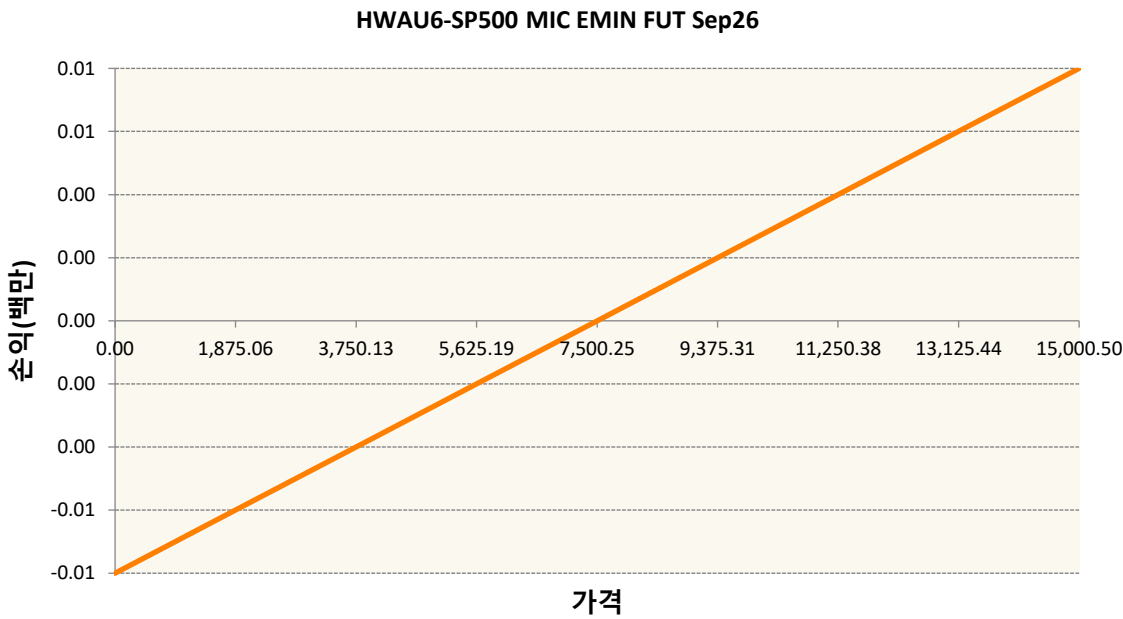
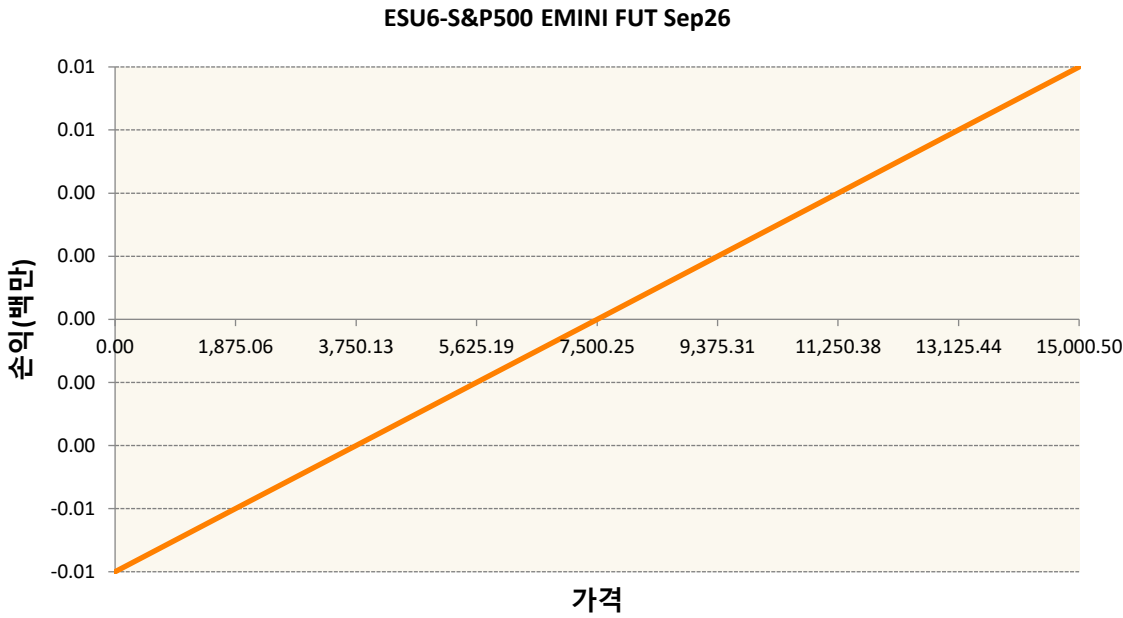
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	573	0	573	
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	2026-07-01
기준일	2026-06-30

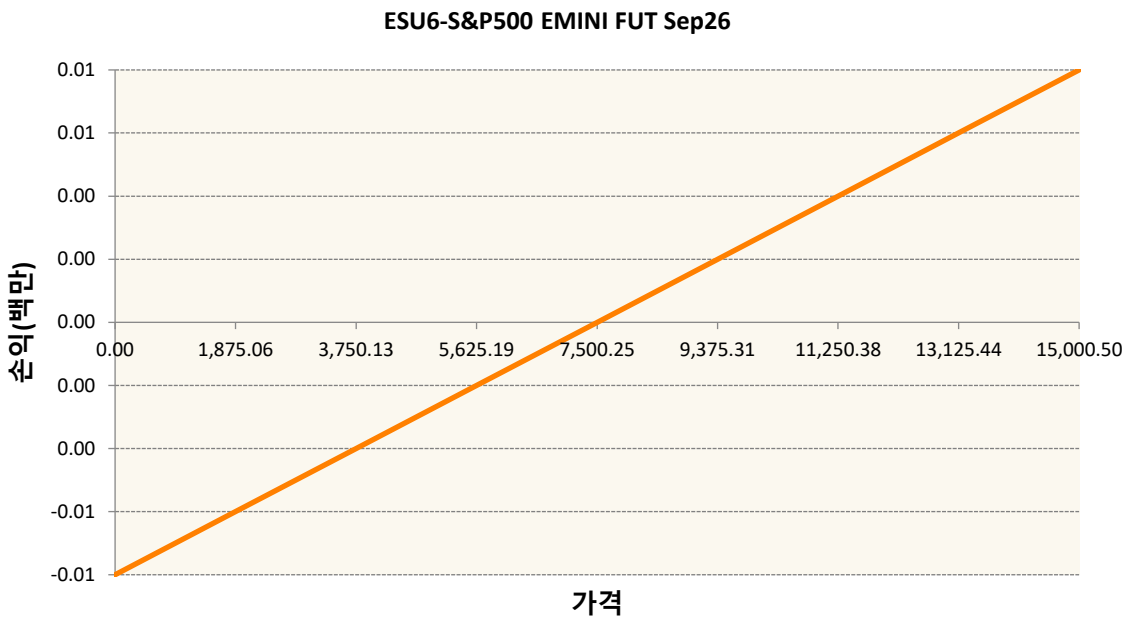
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,134	0	1,134	

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	2026-07-01
기준일	2026-06-30

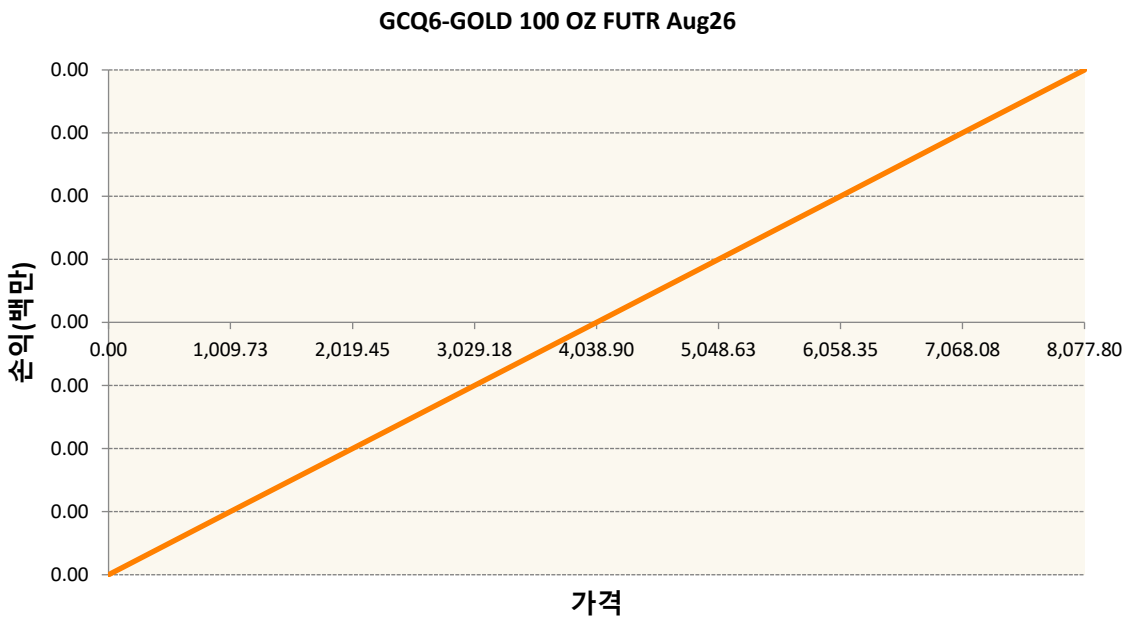
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,831	0	4,831	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 07/02/26 C375 EQUITY	12
GCQ6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	387

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

(단위:백만원)

518

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

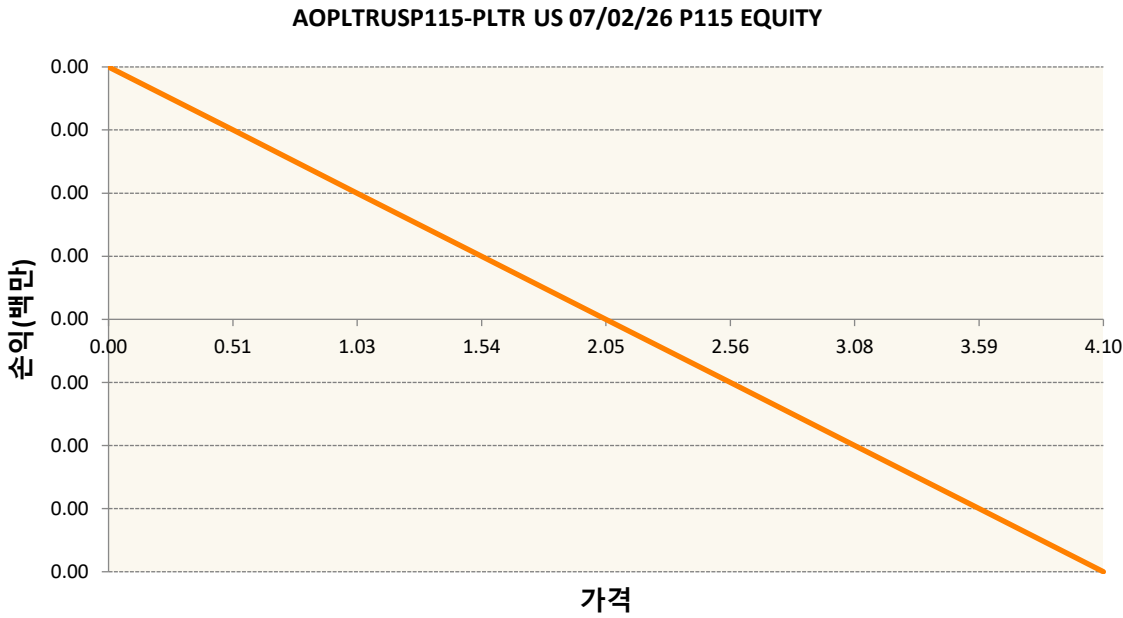
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	227	-227	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC PLTR US 07/02/26 C115 EQUITY	38
AOPLTRUSP PLTR US 07/02/26 P115 EQUITY	18

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

(단위:백만원)

170

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

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)

AOTLTUSC0TLT US 07/02/26 C87.5 EQUITY

3

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

(단위:백만원)

2

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

(단위:백만원)

17,080

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

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	2026-07-01
기준일	2026-06-30

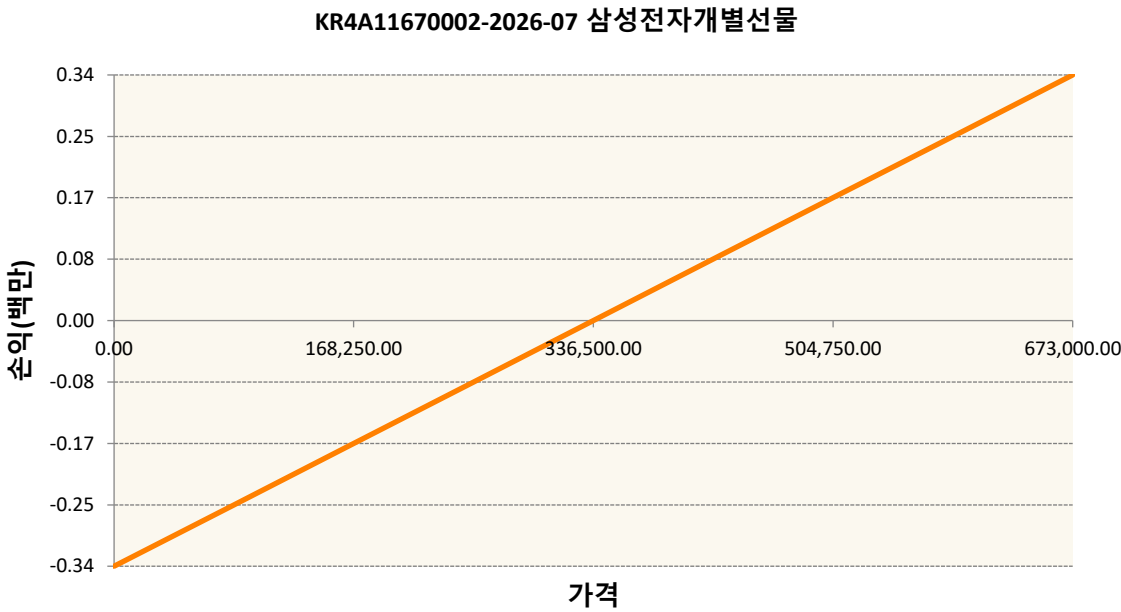
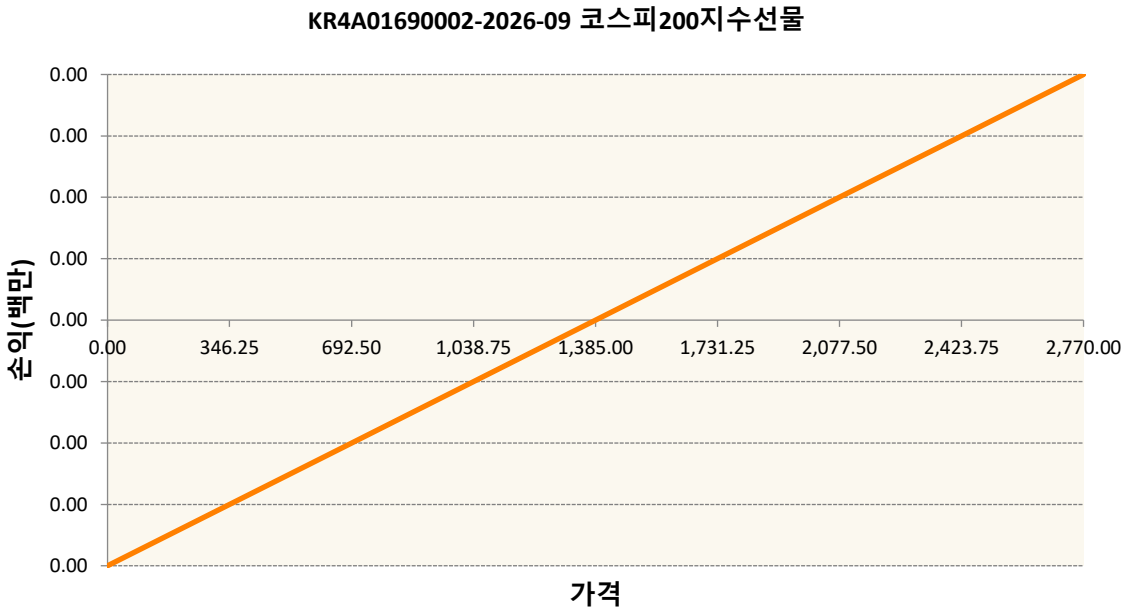
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	27,174	0	27,174	장내
누계	유가증권	옵션	0	43,133	-43,133	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,715.00. The y-axis, labeled '손익(백만)' (Profit/Loss in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the relationship, starting at the origin (0, 0) and ending at the point (1,357.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,357.50	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 is linear and starts at the origin (0, 0). The line reaches a profit of 0.00 million at a price of 1,360.00 thousand won.

가격 (천원)	이익 (백만 원)
0.00	0.00
1,360.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				713
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-713	-713	-713	-713	-713	-713	-713	
-5.33%	-475	-475	-475	-475	-475	-475	-475	
-2.67%	-238	-238	-238	-238	-238	-238	-238	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	238	238	238	238	238	238	238	
5.33%	475	475	475	475	475	475	475	
8.00%	713	713	713	713	713	713	713	
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물				1,443
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443	-1,443
-5.33%	-962	-962	-962	-962	-962	-962	-962
-2.67%	-481	-481	-481	-481	-481	-481	-481
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	481	481	481	481	481	481	481
5.33%	962	962	962	962	962	962	962
8.00%	1,443	1,443	1,443	1,443	1,443	1,443	1,443
KR4B09F5B459 코스피위클리 C 2607W1 1,357.5							1,469

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,278	-1,301	-1,329	-1,360	-1,394	-1,430	-1,469
-5.33%	-678	-719	-764	-810	-858	-907	-957
-2.67%	-182	-238	-295	-352	-409	-467	-524
0%	177	118	59	0	-59	-118	-178
2.67%	400	351	300	248	195	141	86
5.33%	517	484	448	408	366	321	274
8.00%	569	551	529	502	472	439	403

KR4B09F5B467 코스피위클리 C 2607W1 1,360.0							997
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-872	-887	-905	-925	-948	-972	-997
-5.33%	-466	-493	-522	-553	-584	-617	-650
-2.67%	-128	-165	-203	-241	-279	-318	-356
0%	119	80	40	0	-40	-80	-120
2.67%	275	241	207	171	135	98	61
5.33%	358	335	310	282	253	223	191
8.00%	395	382	367	348	327	304	279

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

(단위:백만원)

10,343

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

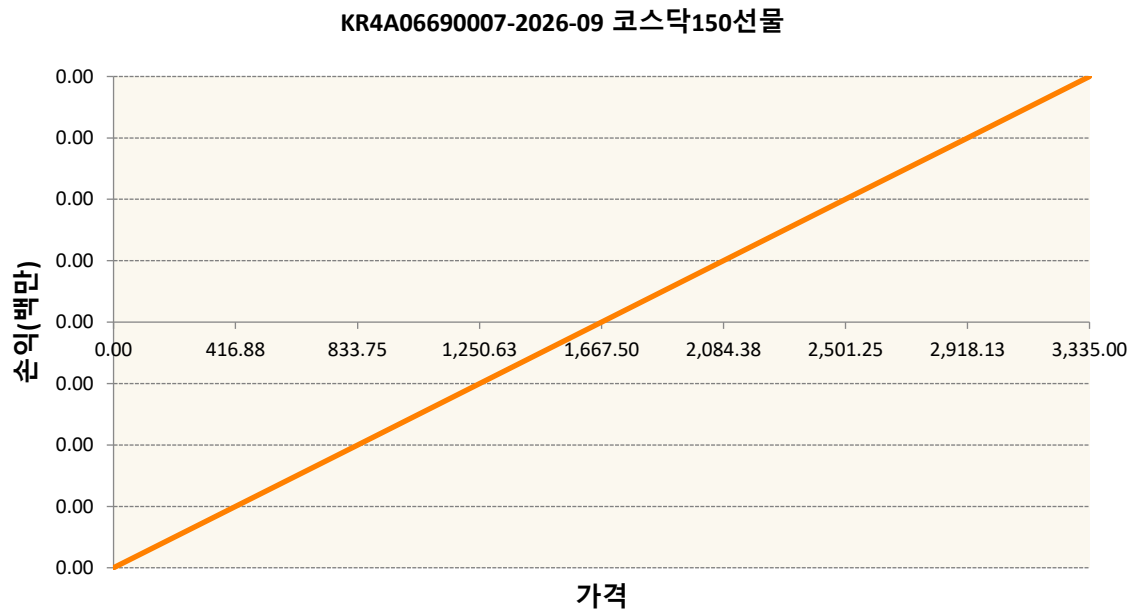
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	967	0	967	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				77
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	26	26	26	26	26	26	26
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	77	77	77	77	77	77	77

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

(단위:백만원)

29,677

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

(단위:백만원)

78,570

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

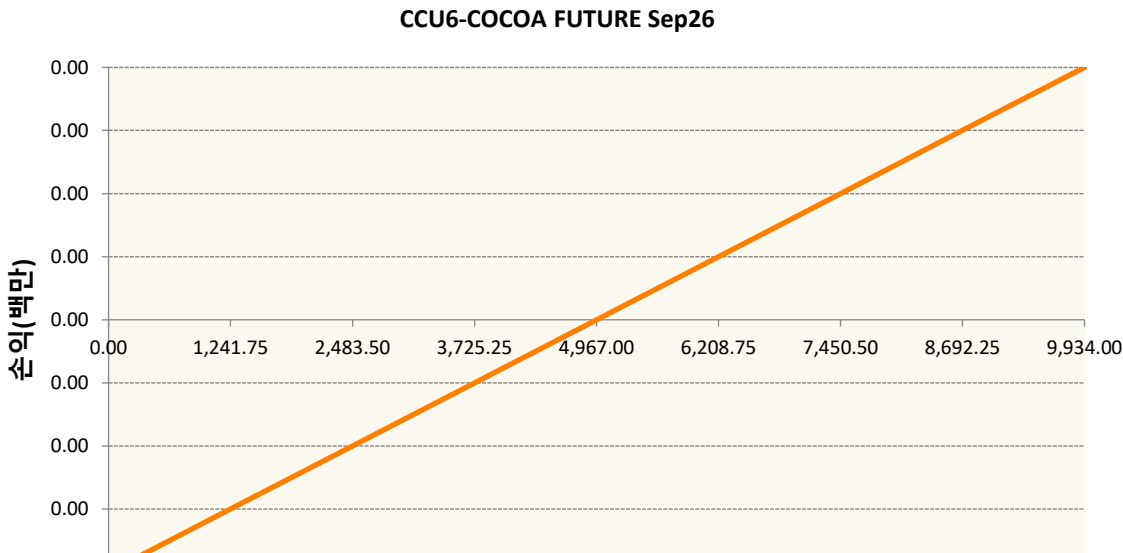
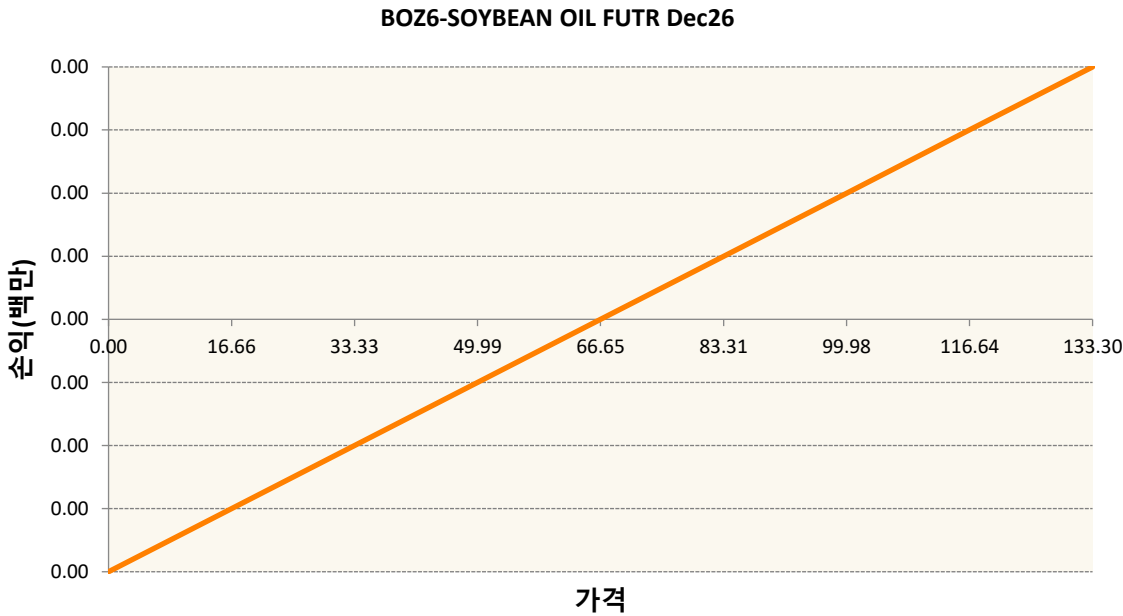
포커스농산물모(채권-파생형)

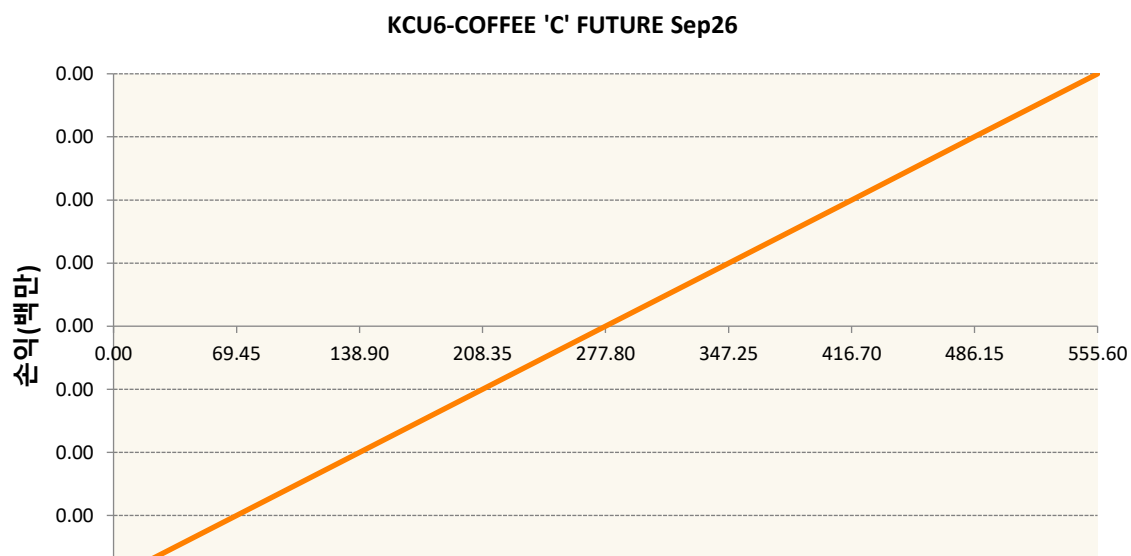
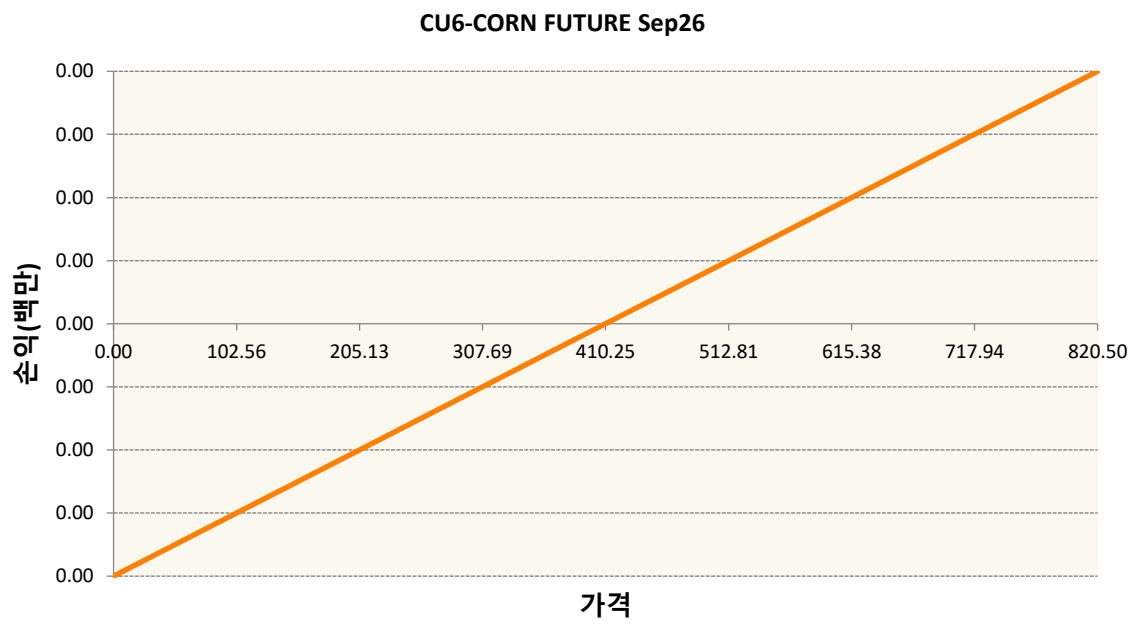
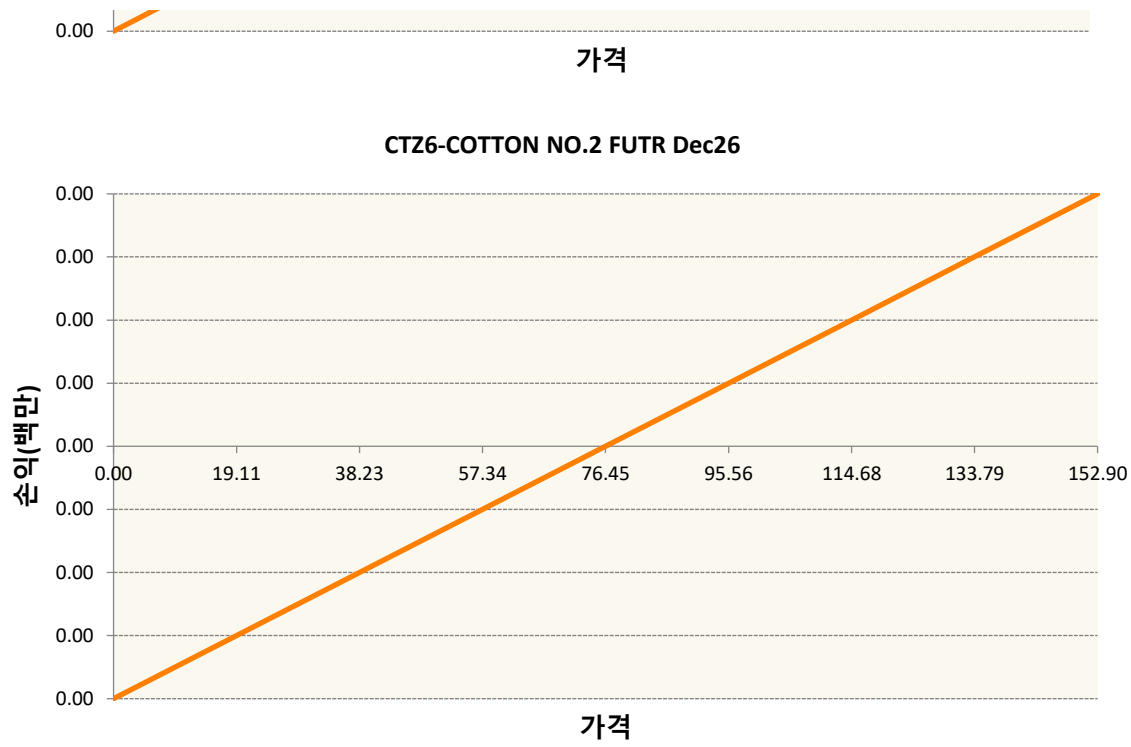
1. 계약금액

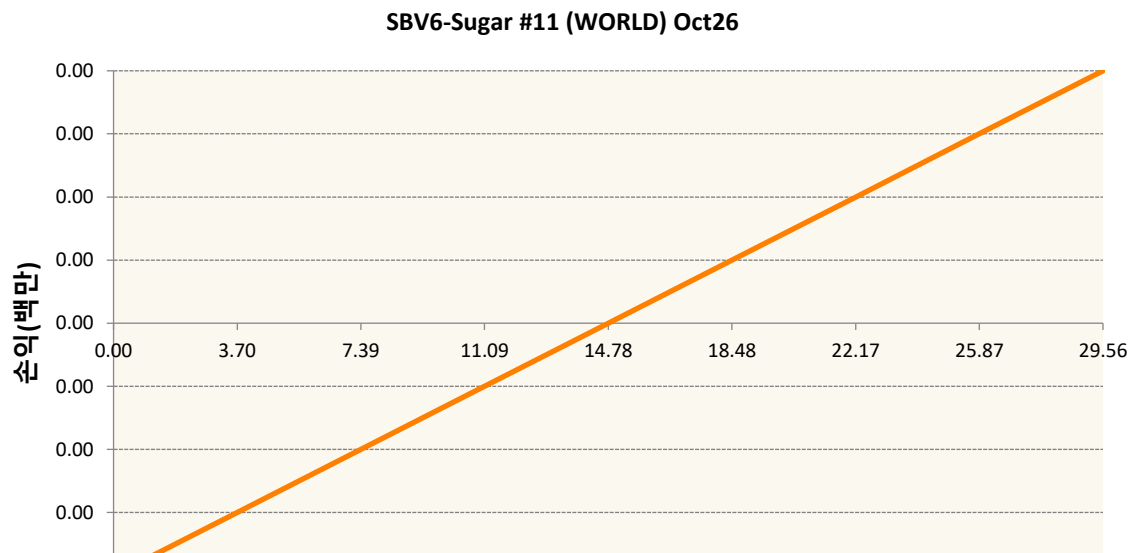
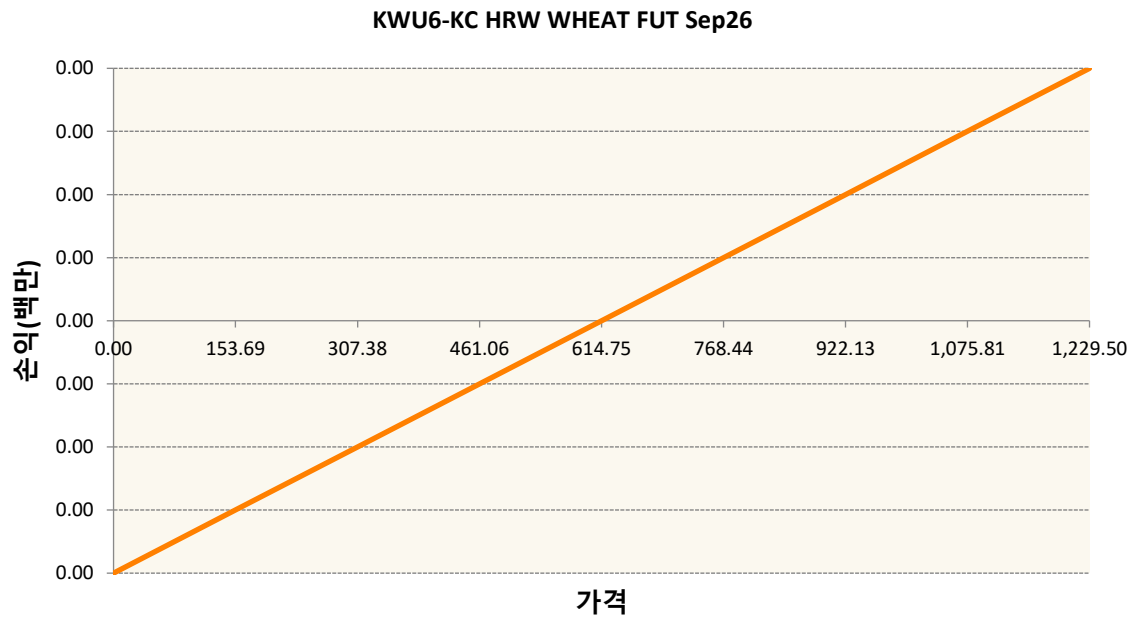
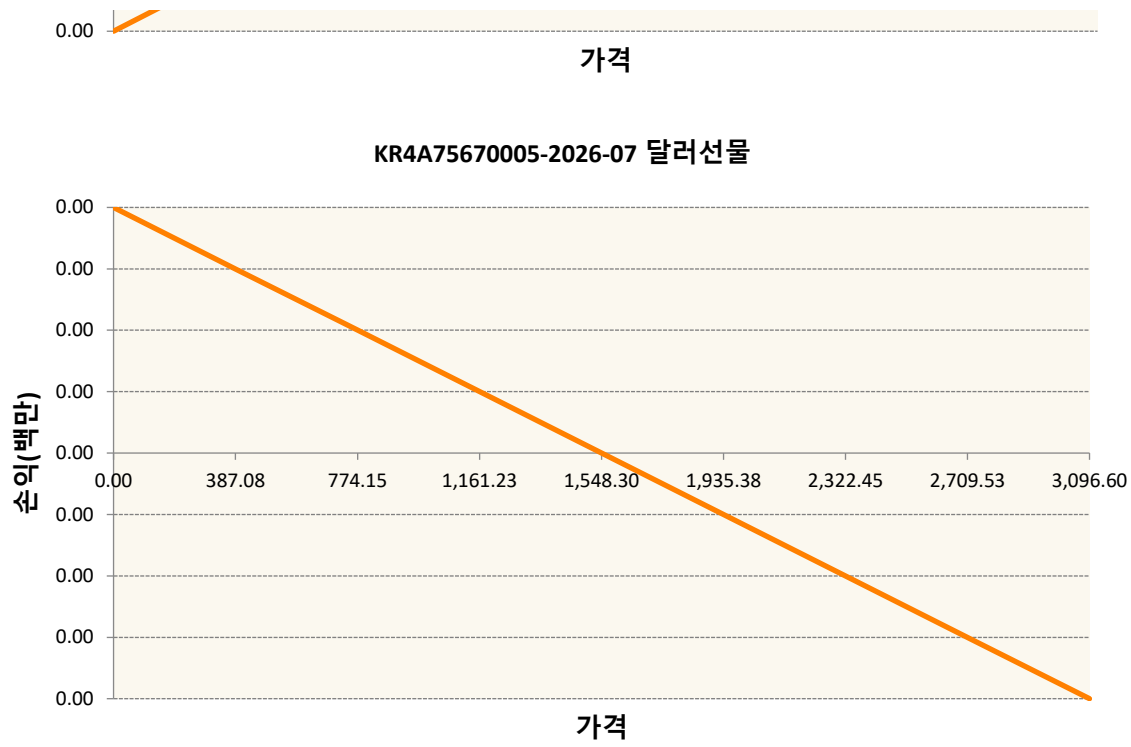
(단위:USD 백만)

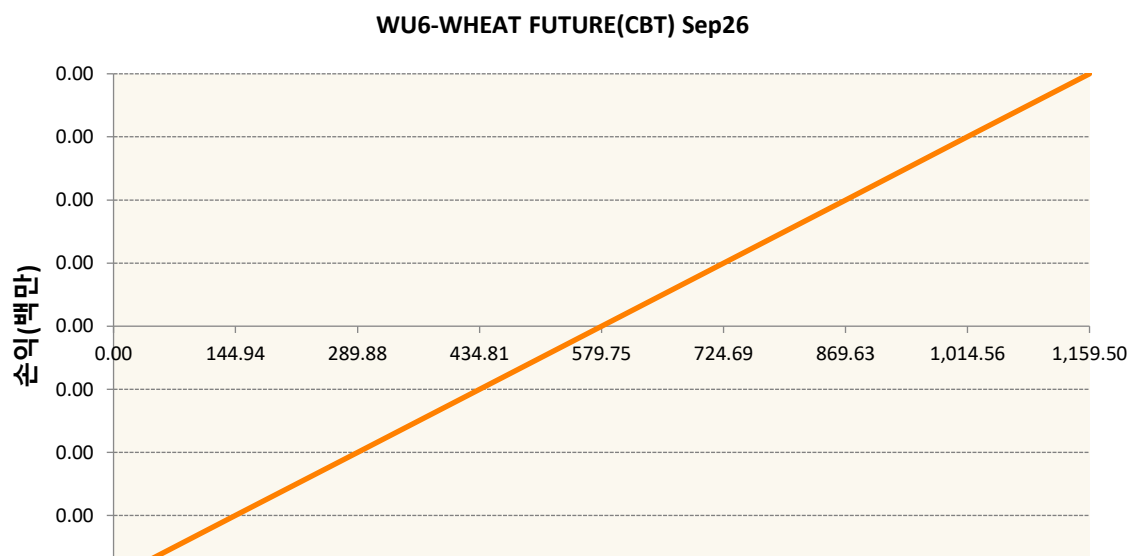
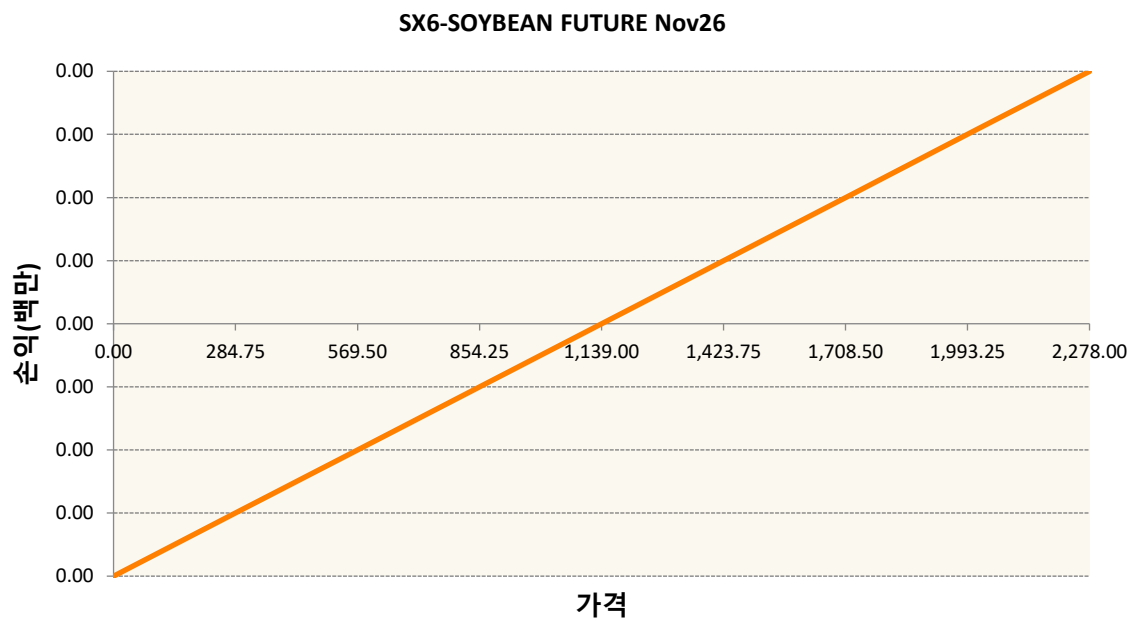
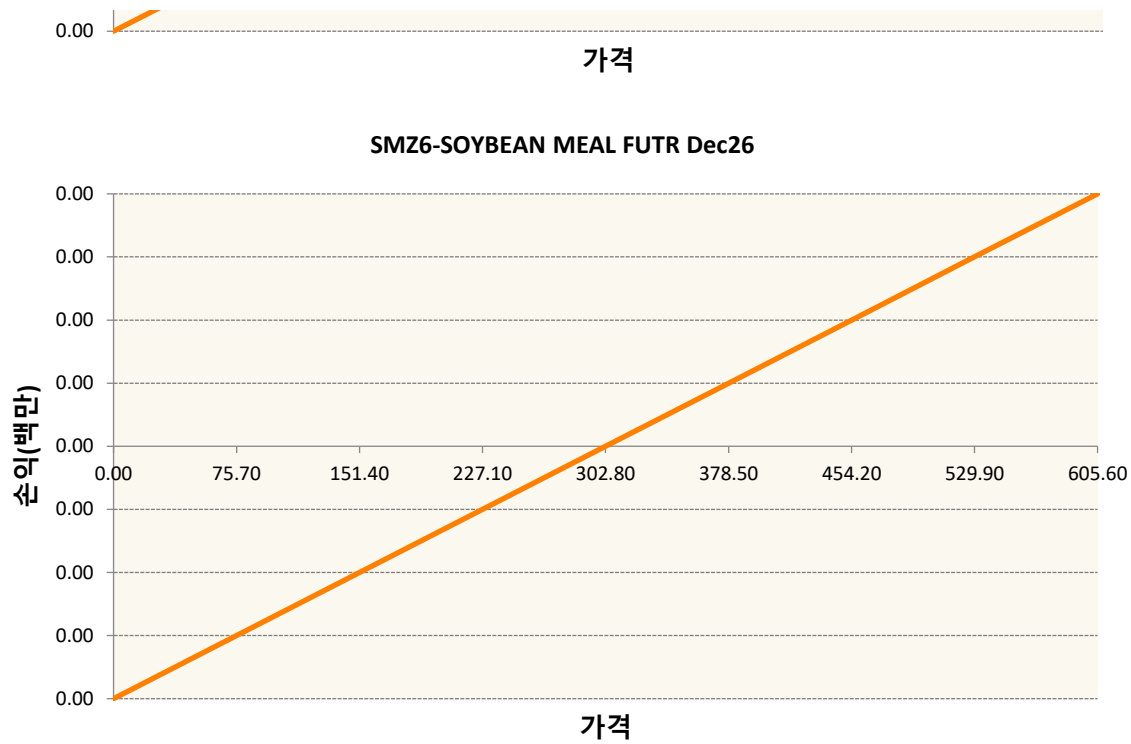
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	441	0	441	
누계	유가증권	선물	2,026	0	2,026	
누계	통화	선물	0	170	-170	장내

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	2026-07-01
기준일	2026-06-30

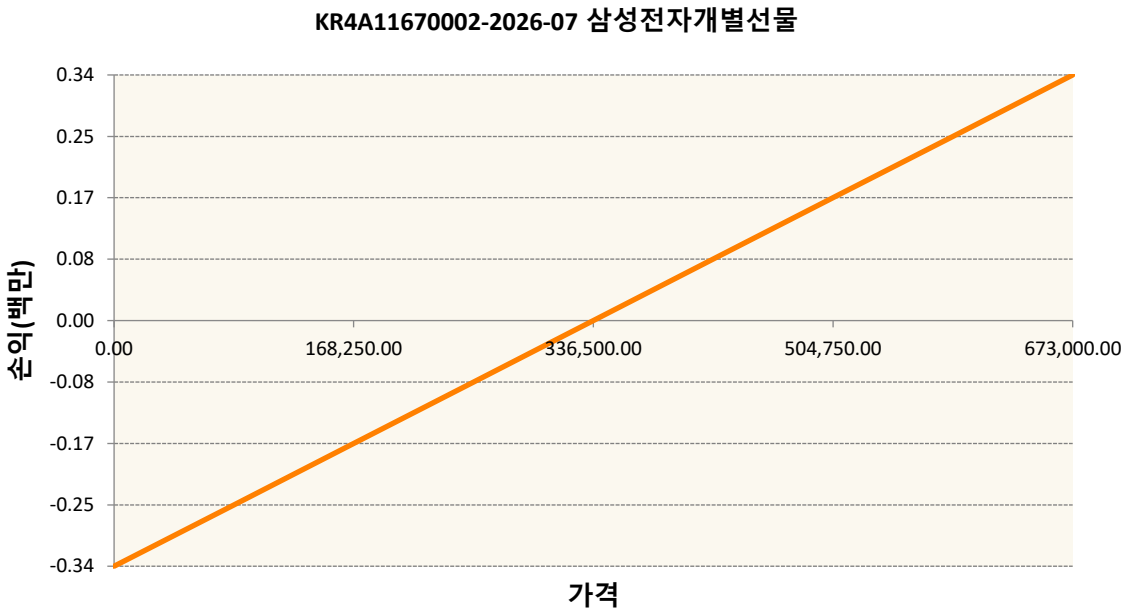
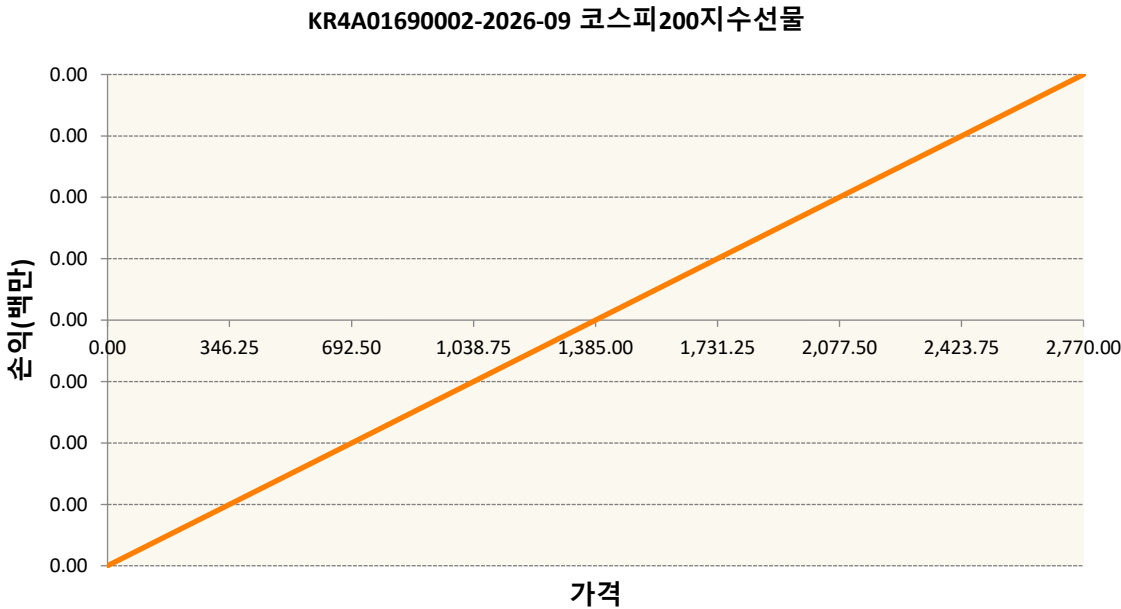
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	685	683	2	장내
누계	유가증권	선물	3,251	0	3,251	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					247
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-247	-247	-247	-247	-247	-247	-247
-5.33%	-164	-164	-164	-164	-164	-164	-164
-2.67%	-82	-82	-82	-82	-82	-82	-82
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	82	82	82	82	82	82	82
5.33%	164	164	164	164	164	164	164
8.00%	247	247	247	247	247	247	247
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)

689

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

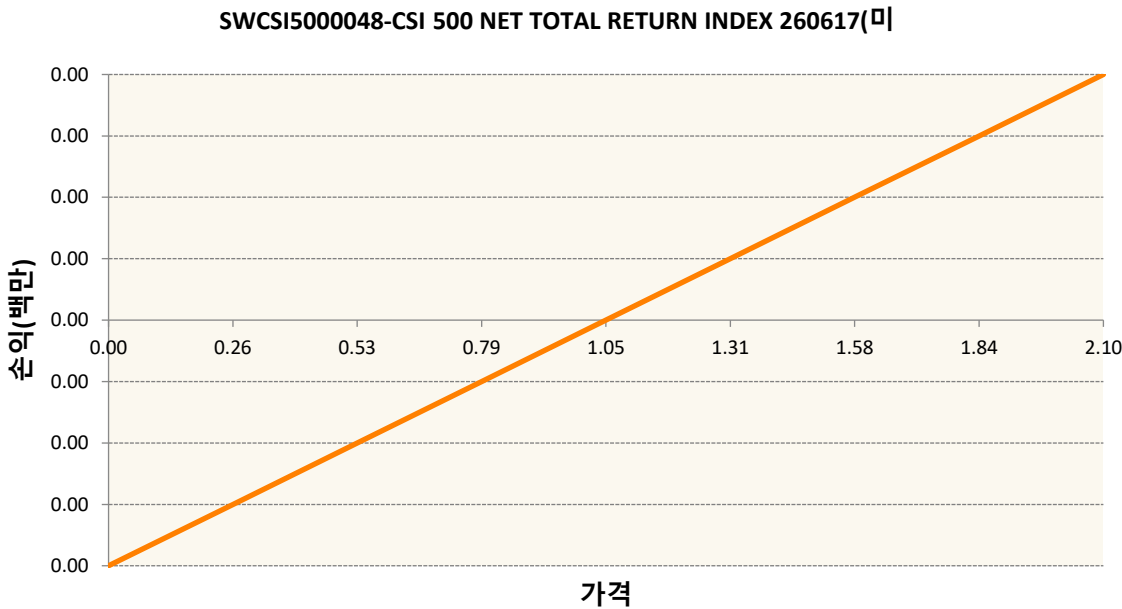
SOL차이나강소기업CSI500상장

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)

654

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

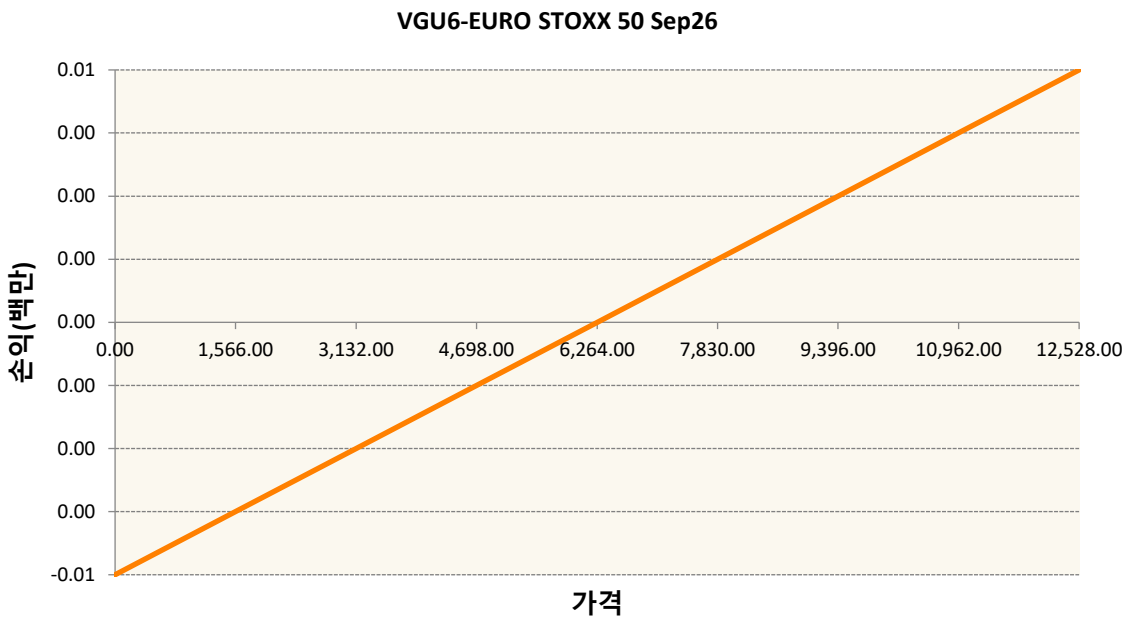
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	990	0	990	

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	2026-07-01
기준일	2026-06-30

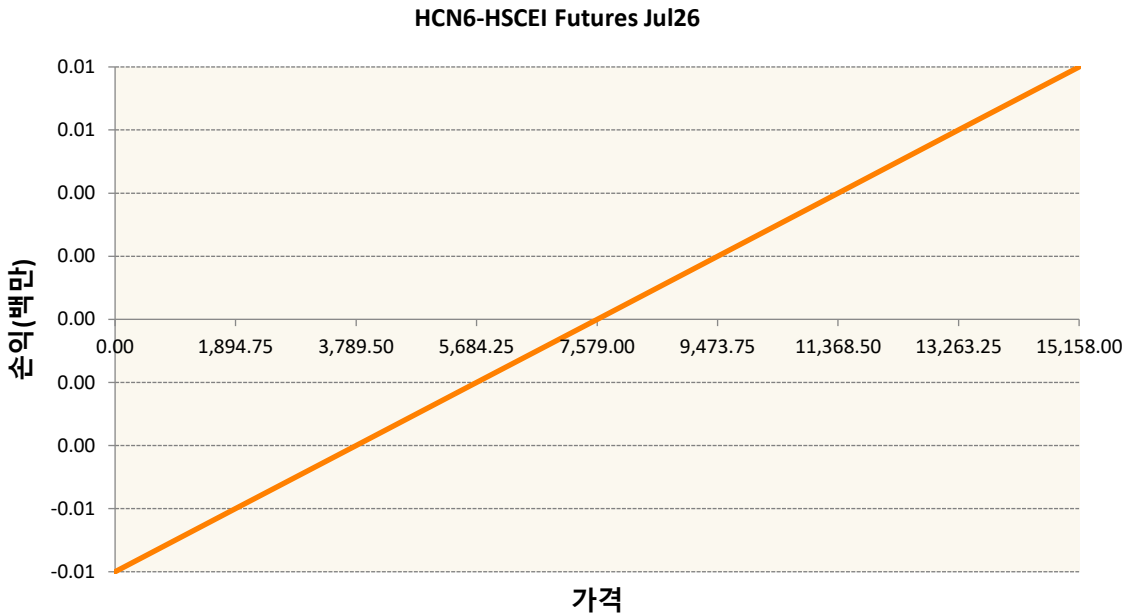
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,111	0	1,111	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	2026-07-01
기준일	2026-06-30

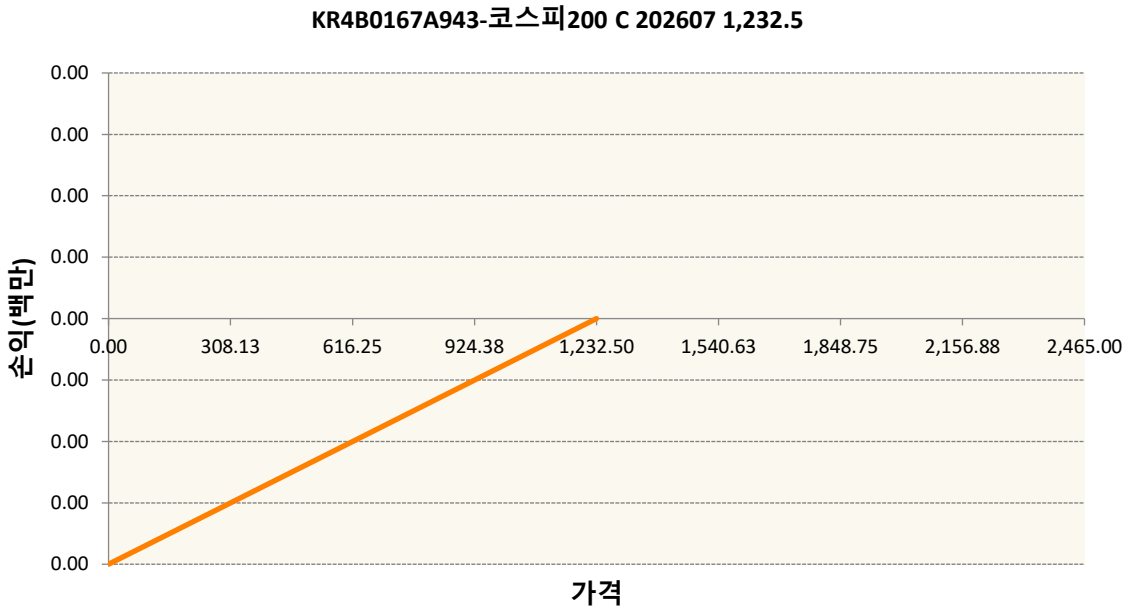
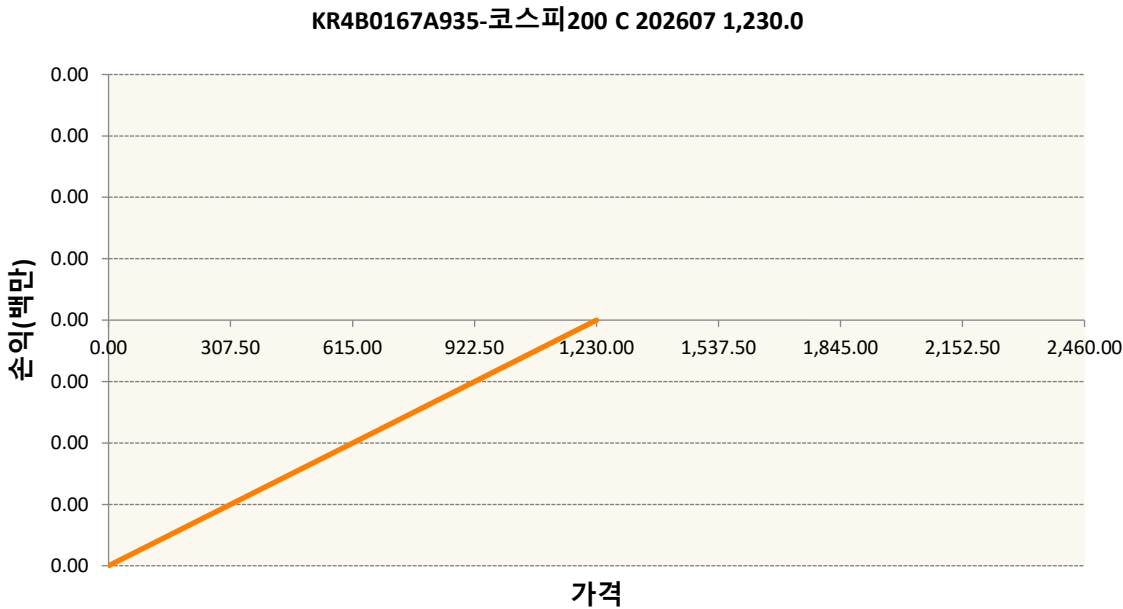
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

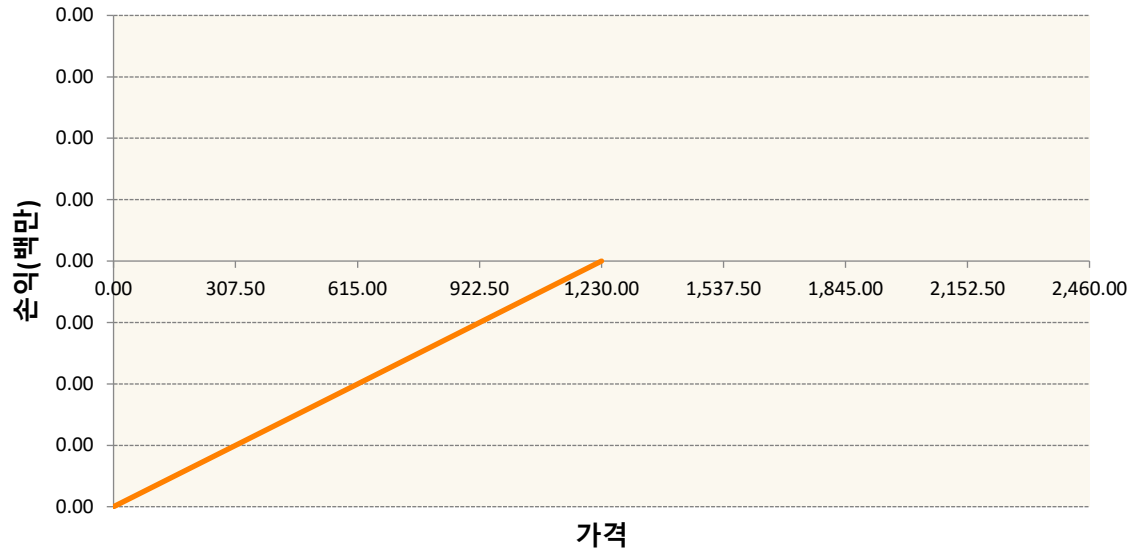
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	37,563	-37,563	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0167A933-코스피200 P 202607 1,230.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0167A935 코스피200 C 202607 1,230.0							304
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-125	-161	-197	-232	-268	-304
-5.33%	-15	-48	-82	-116	-151	-186	-221
-2.67%	40	11	-20	-52	-84	-117	-151
0%	79	55	28	0	-29	-60	-91
2.67%	106	87	64	40	14	-13	-42
5.33%	124	109	91	71	48	24	-2
8.00%	135	124	111	94	75	54	31
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5							975
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-292	-405	-518	-632	-746	-861	-975
-5.33%	-52	-158	-266	-375	-486	-597	-709
-2.67%	127	33	-65	-166	-270	-375	-483
0%	254	175	90	0	-94	-192	-292
2.67%	342	279	208	130	46	-42	-134
5.33%	401	352	295	229	157	79	-3
8.00%	439	403	358	304	243	176	103
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0							279
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-82	-115	-147	-180	-213	-246	-279
-5.33%	-14	-44	-75	-107	-139	-171	-203
-2.67%	37	10	-18	-47	-77	-107	-138
0%	73	50	26	0	-27	-55	-84

2.67%	97	79	59	37	13	-12	-39
5.33%	114	100	84	65	44	22	-1
8.00%	124	114	101	86	69	50	29

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

(단위:백만원)

1,685

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

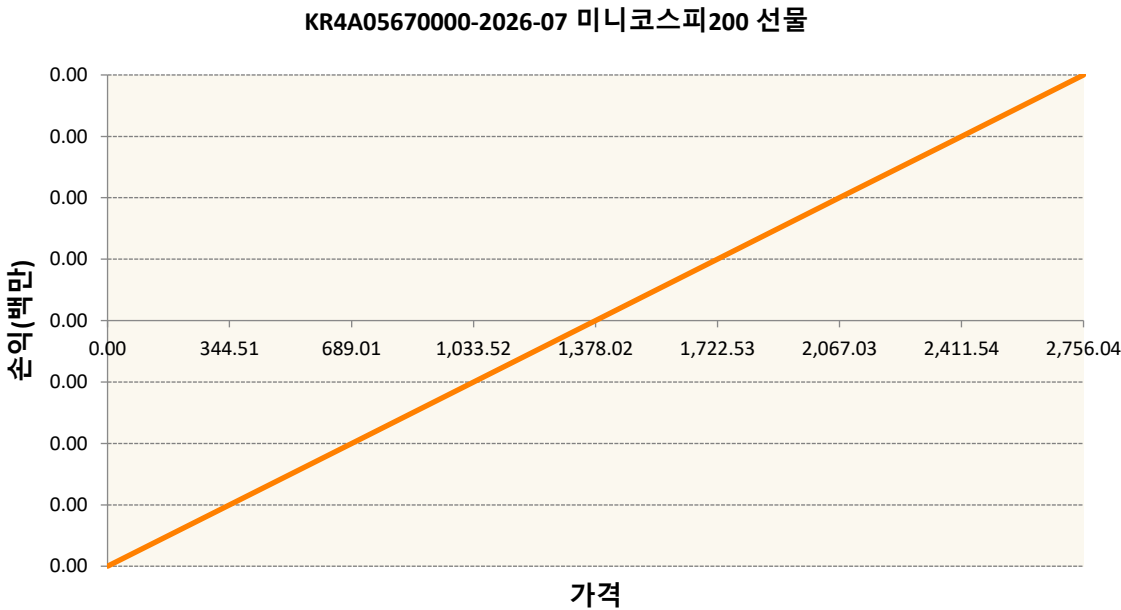
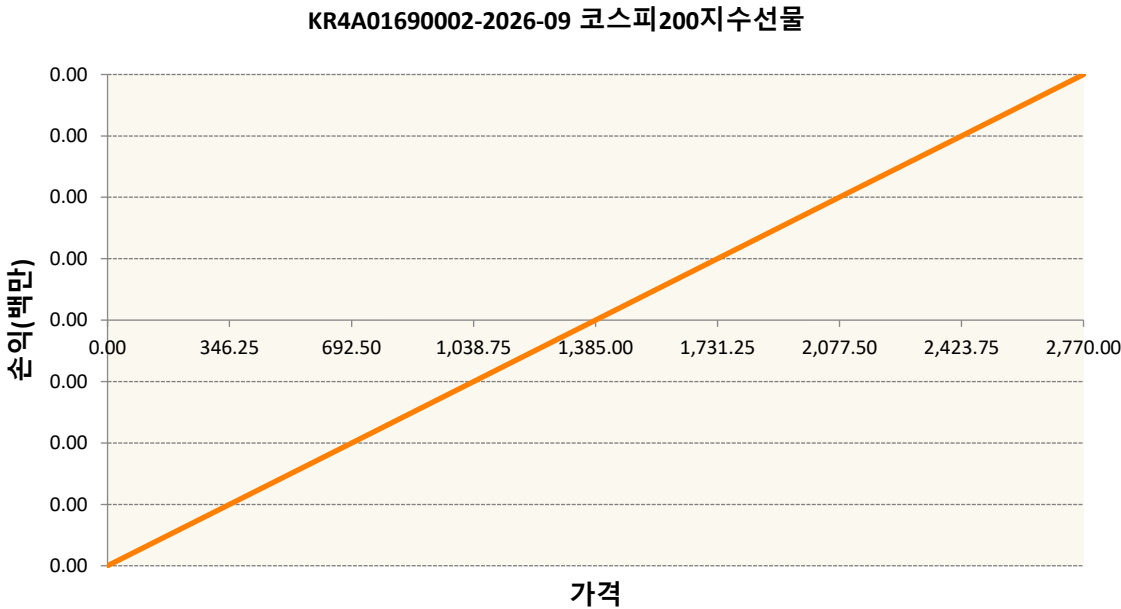
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	1,024	0	1,024	장내
누계	유가증권	선물	6,551	0	6,551	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					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

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

451

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

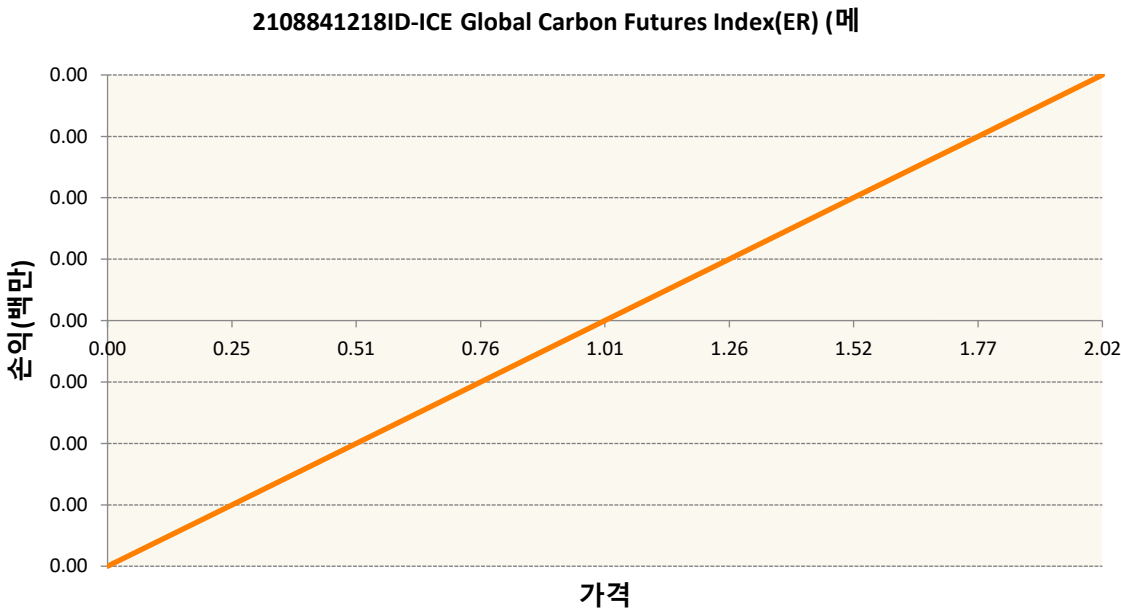
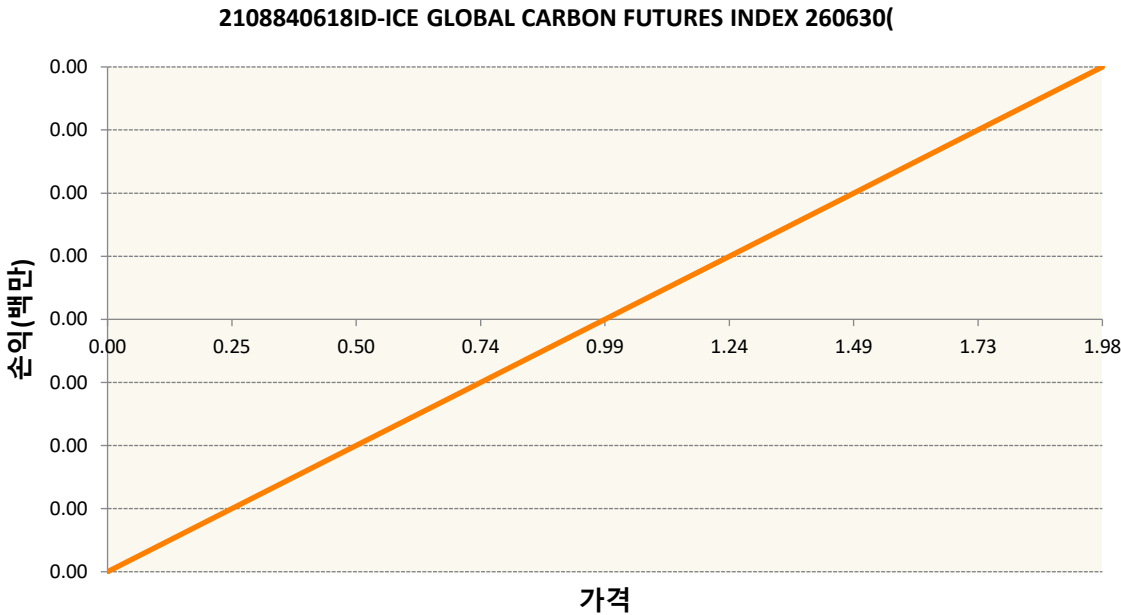
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,545	0	7,545	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		482
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		122

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	684

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

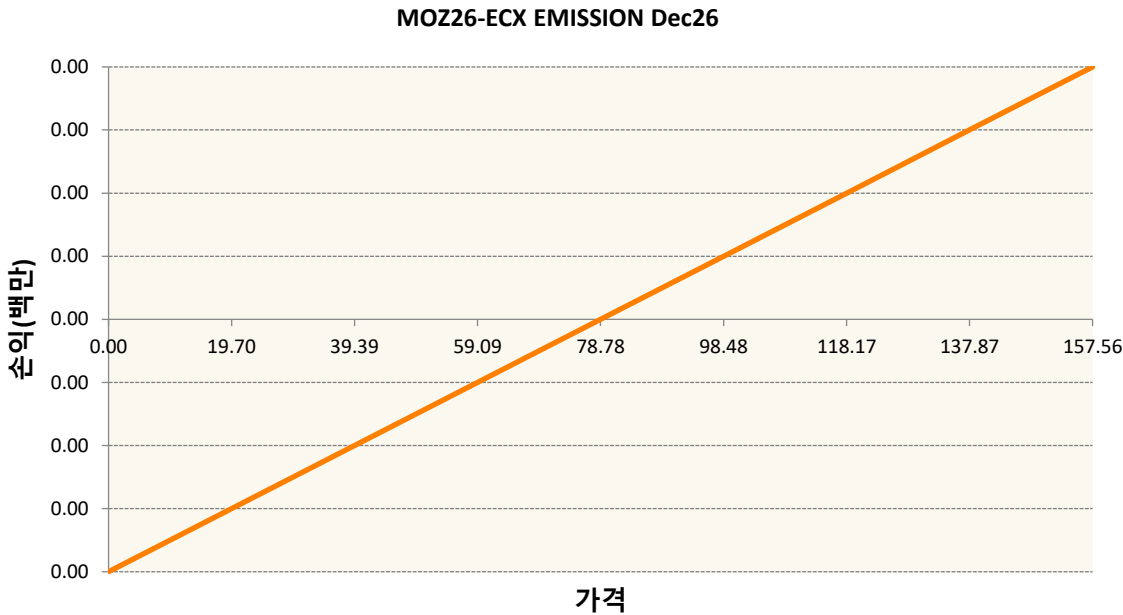
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,081	0	5,081	
누계	통화	선도	0	2,772	-2,772	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G6S(KRW/EUR 31-07-26E	222
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	406

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

(단위:백만원)

693

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

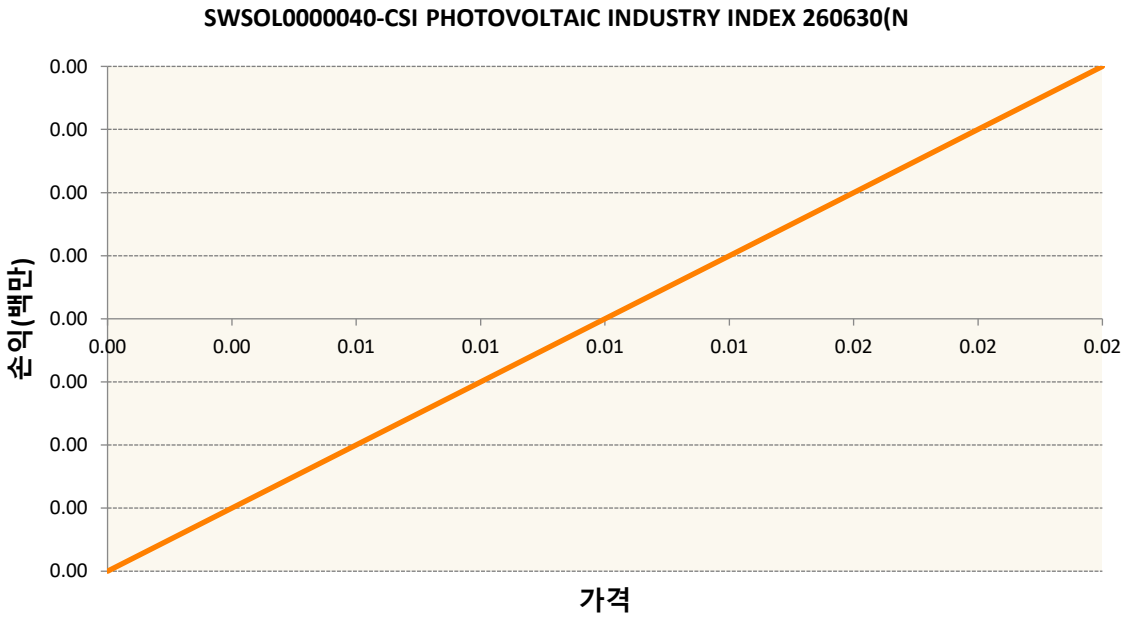
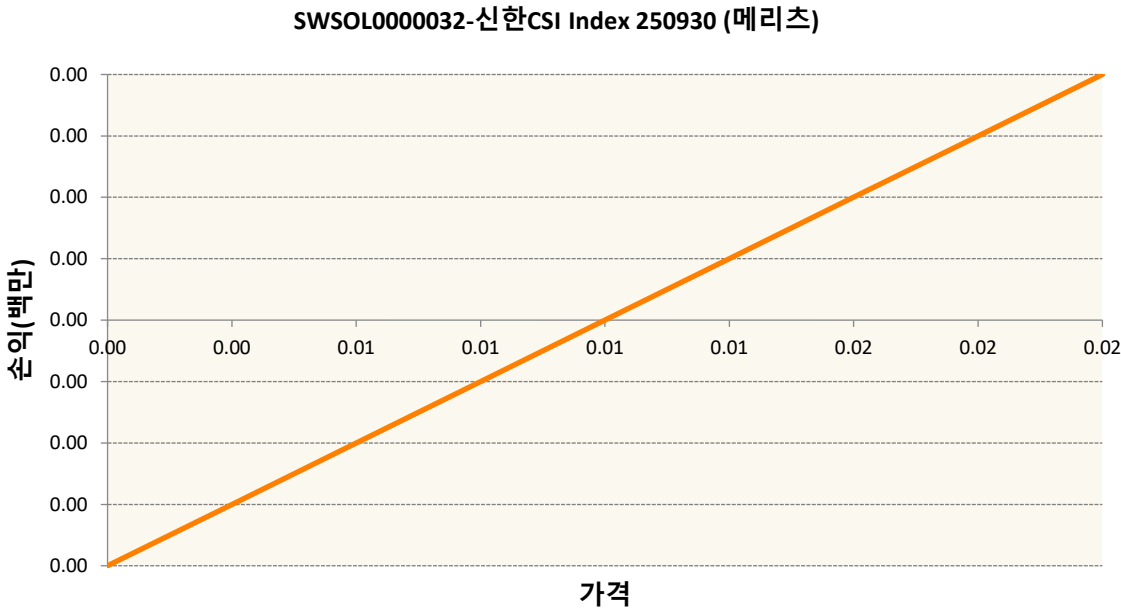
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

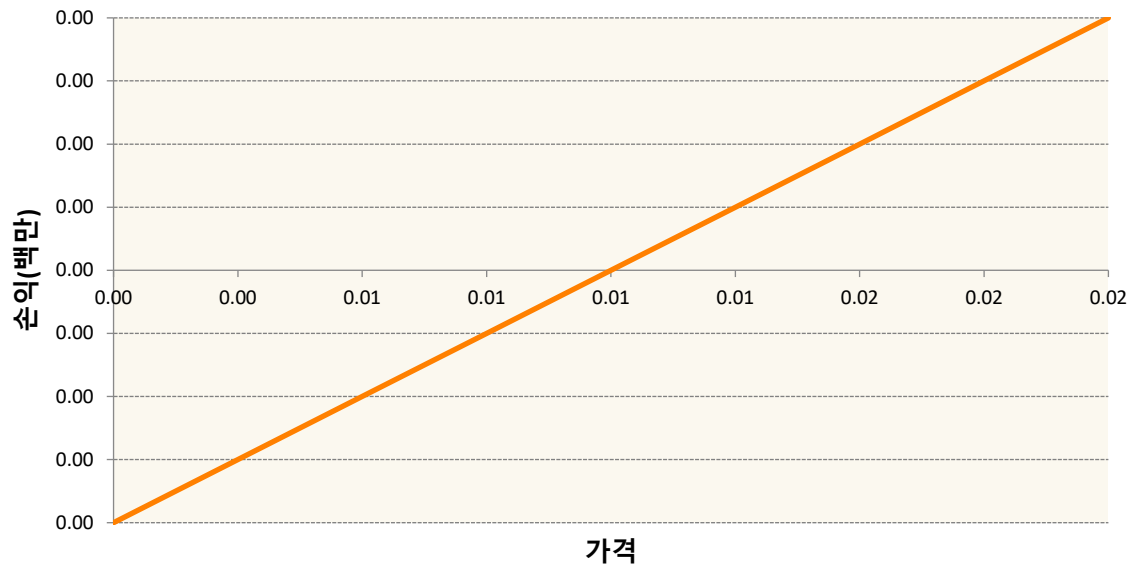
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	23	0	23	장외

2. 만기시점의 손익구조



SWSOL0000041-CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)

3

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(

3

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N

1

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(

2

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

(단위:백만원)

14

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

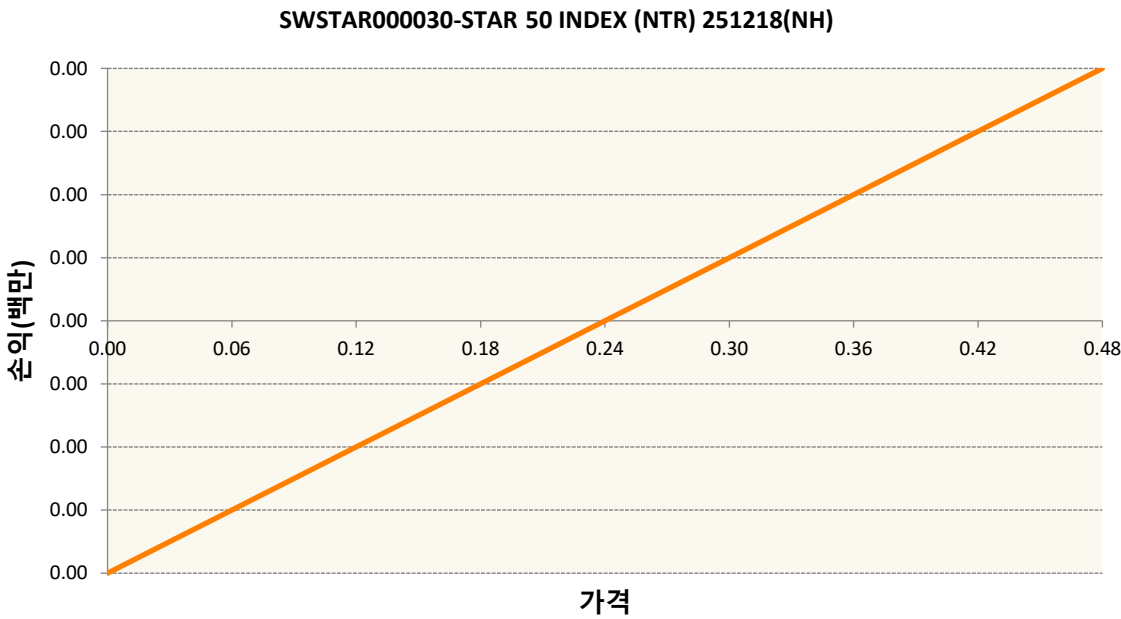
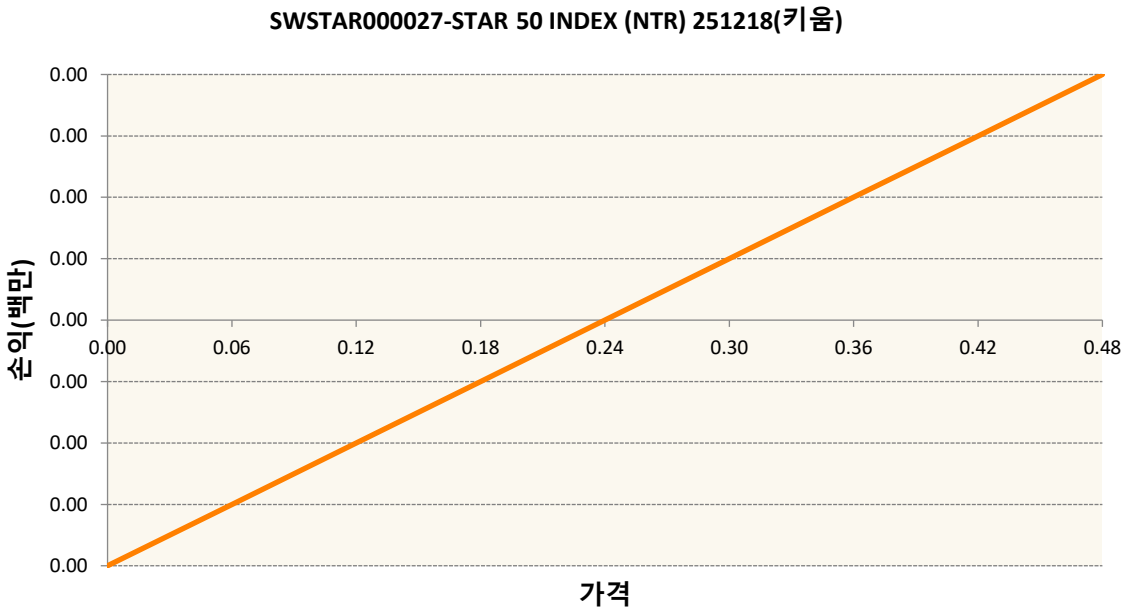
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

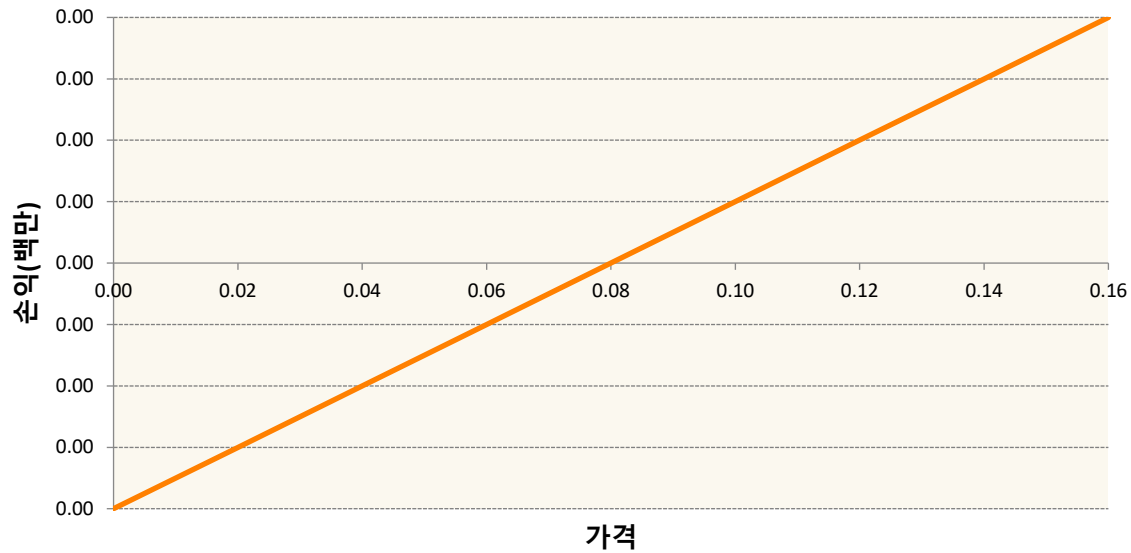
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,244	0	2,244	장외

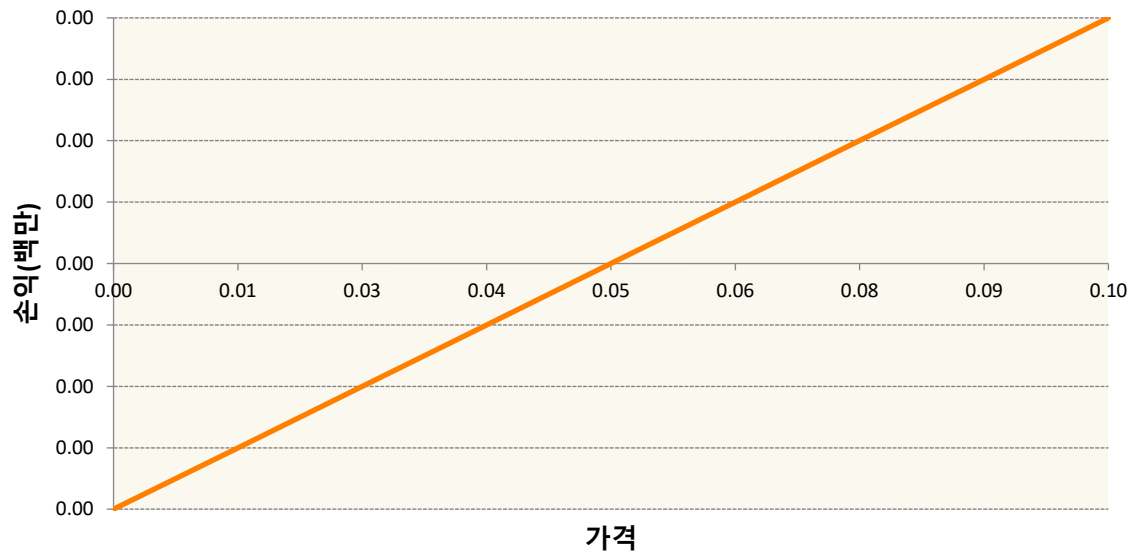
2. 만기시점의 손익구조



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



SWSTAR000036-STAR 50 INDEX (NTR) 260630(미래)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260626(메리츠)
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260630(미래)

23
 78
 39
 36

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

(단위:백만원)

291

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

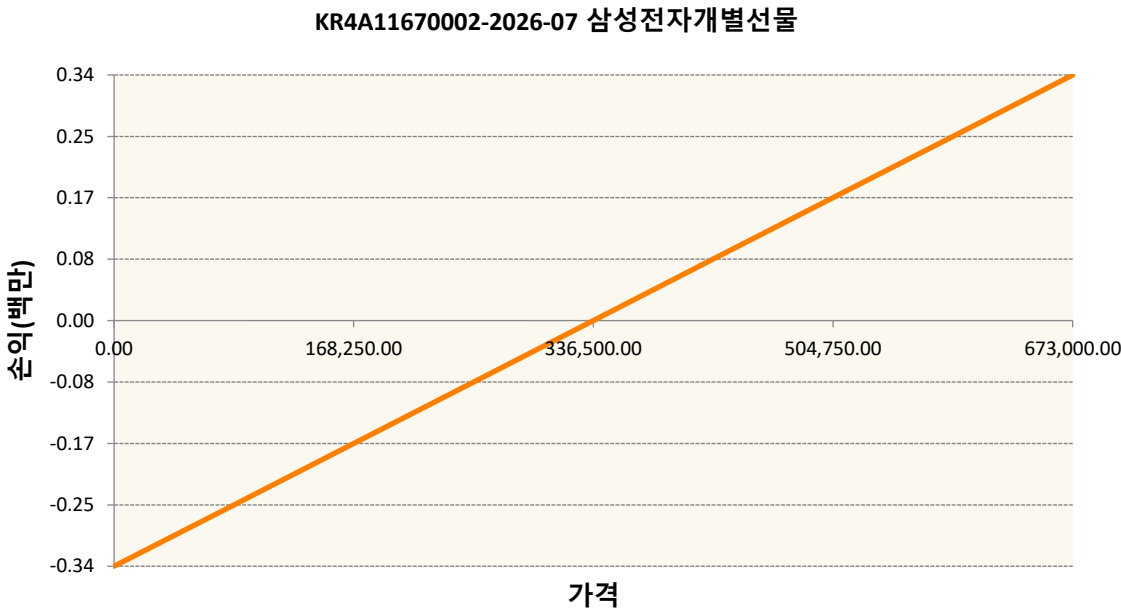
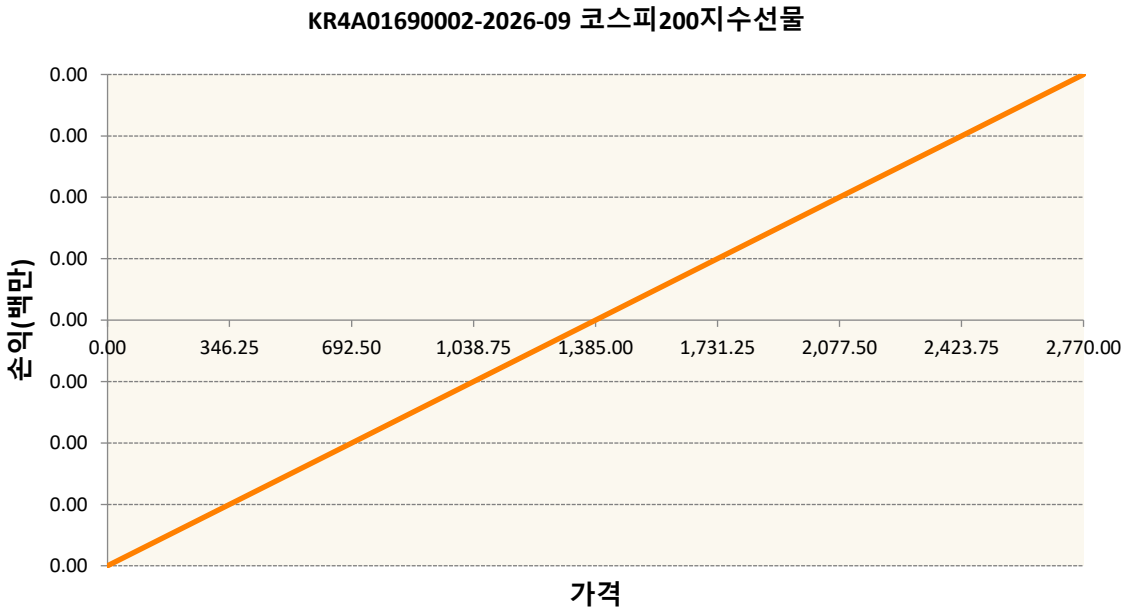
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

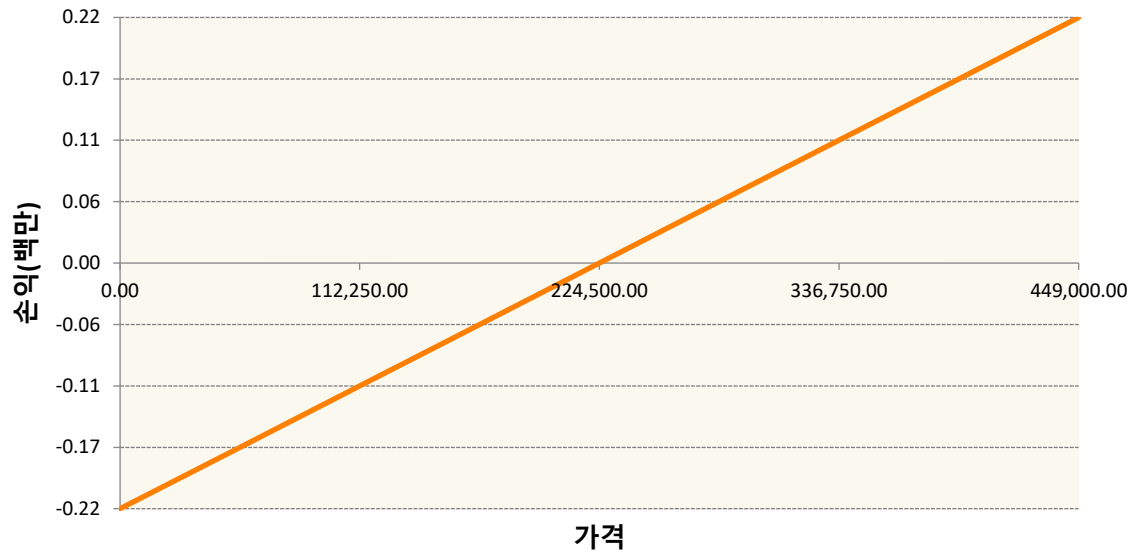
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,755	3,738	16	장내
누계	유가증권	선물	24,663	3,762	20,902	장내

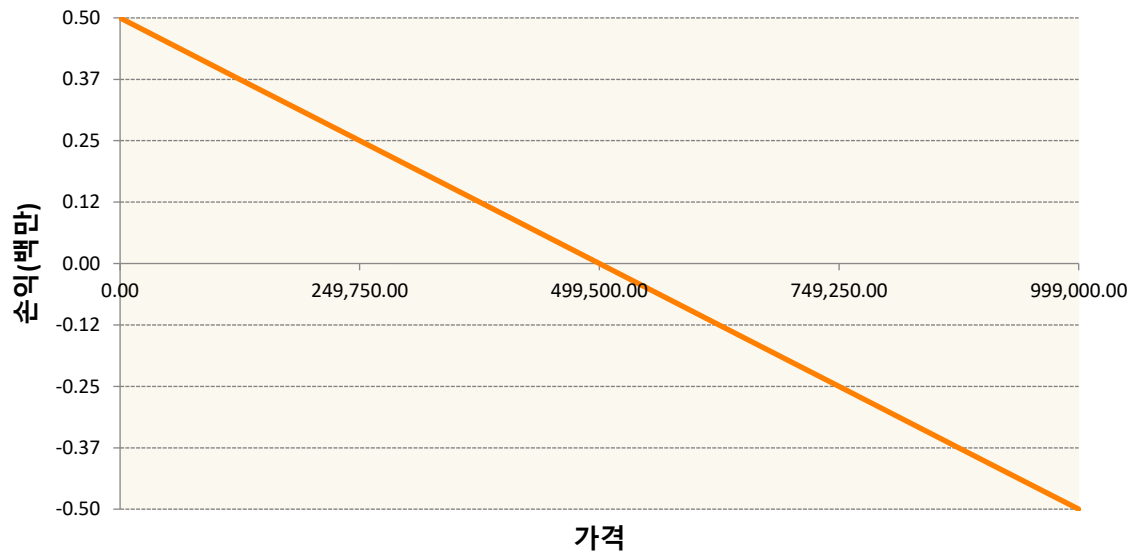
2. 만기시점의 손익구조



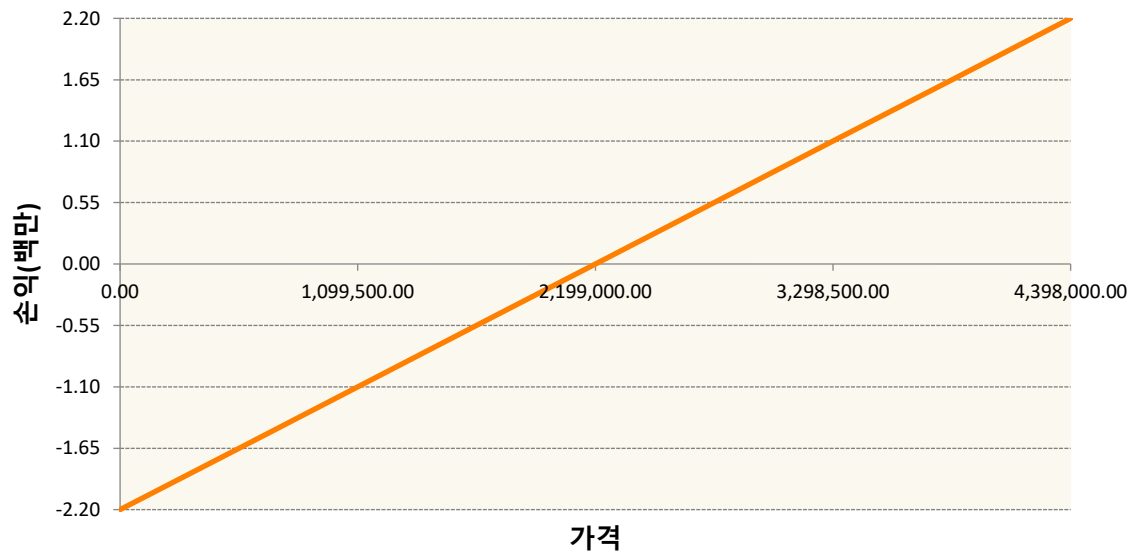
KR4A1V670008-2026-07 HD현대마린솔루션개별선물



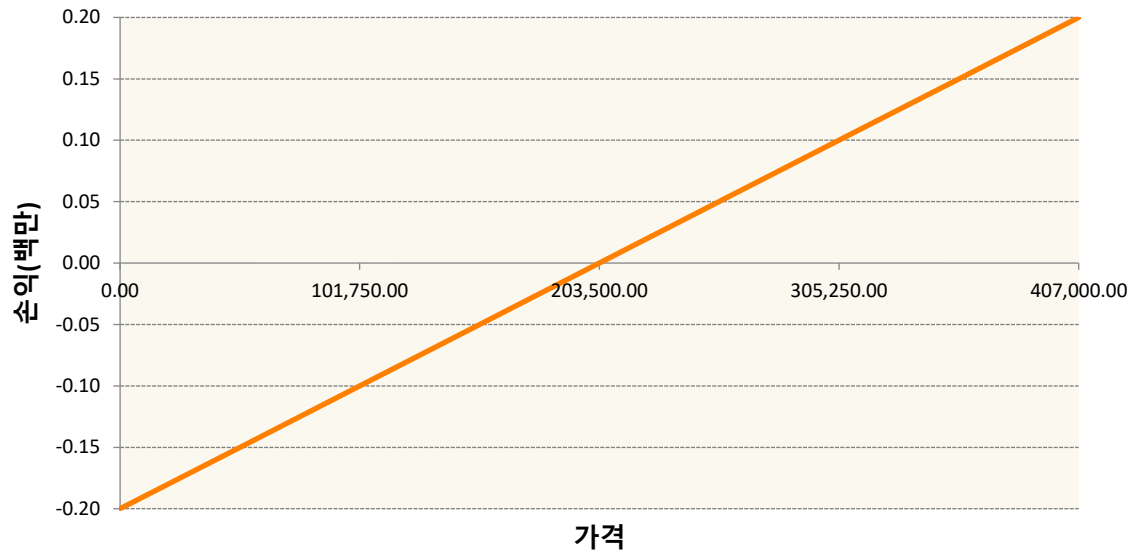
KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



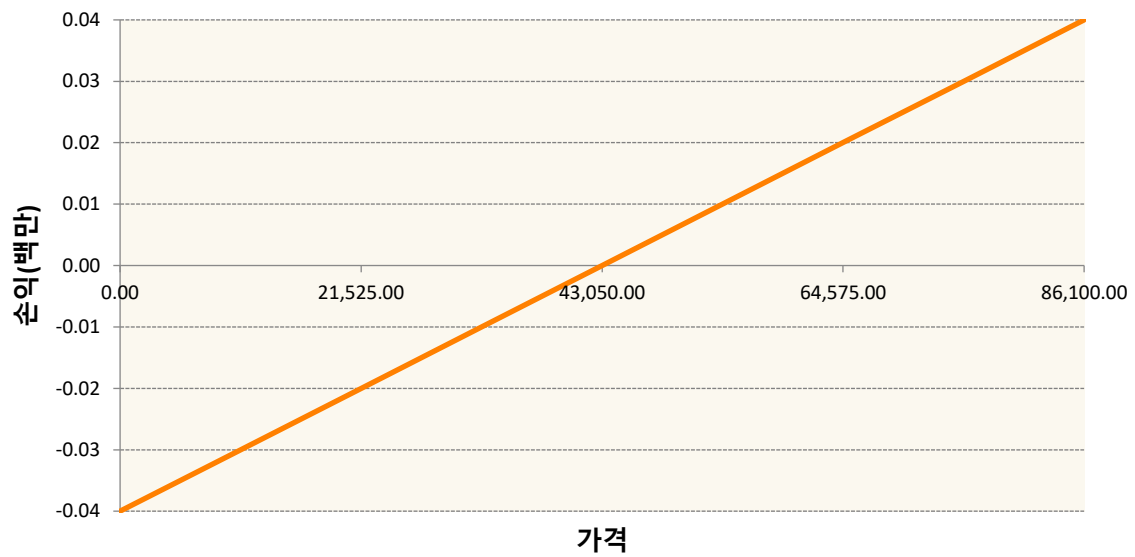
KR4A23670008-2026-07 삼성전기개별선물



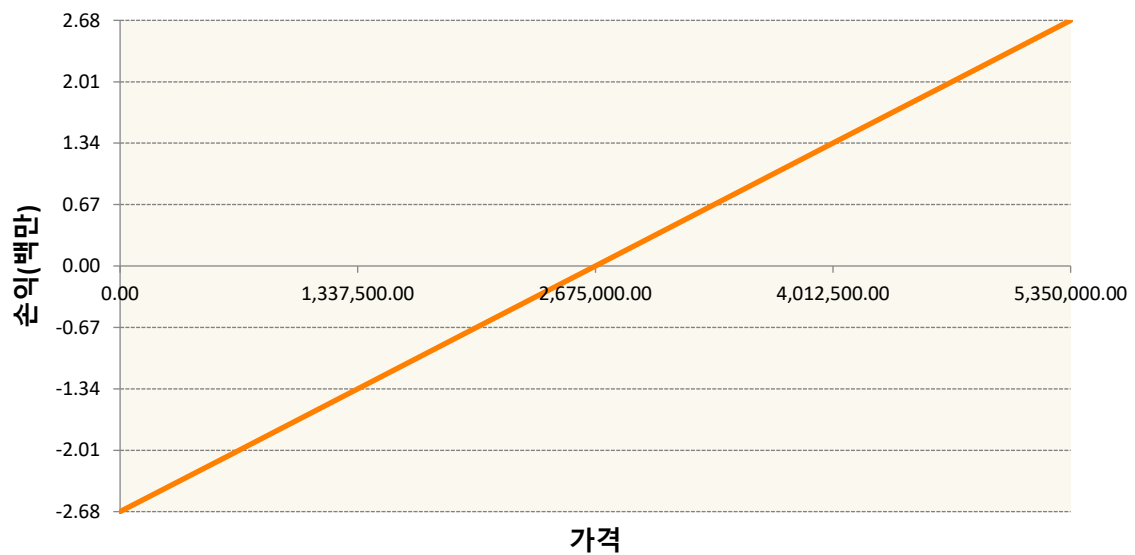
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



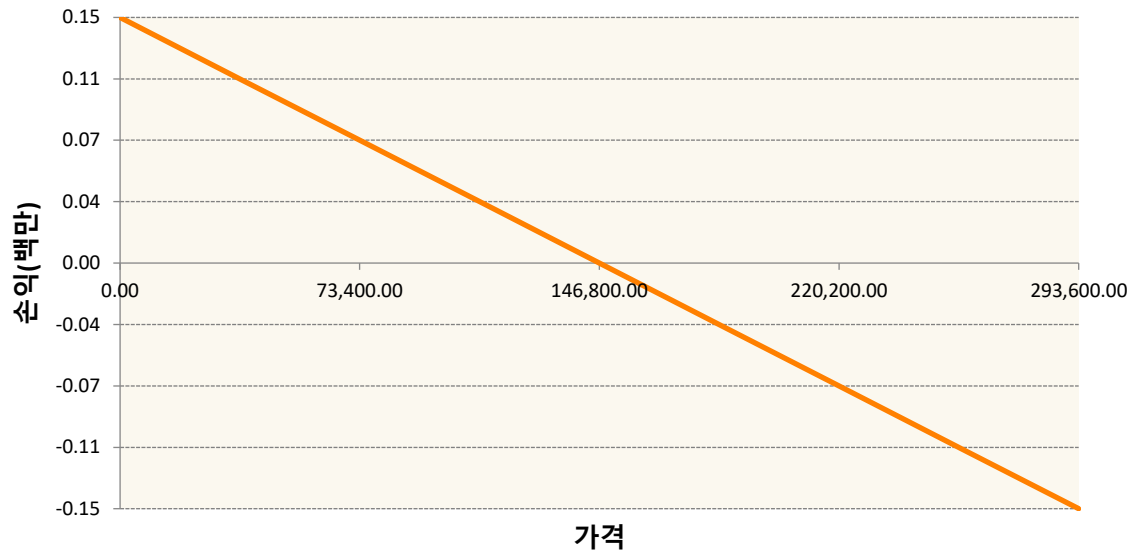
KR4A48670009-2026-07 미래에셋증권개별선물



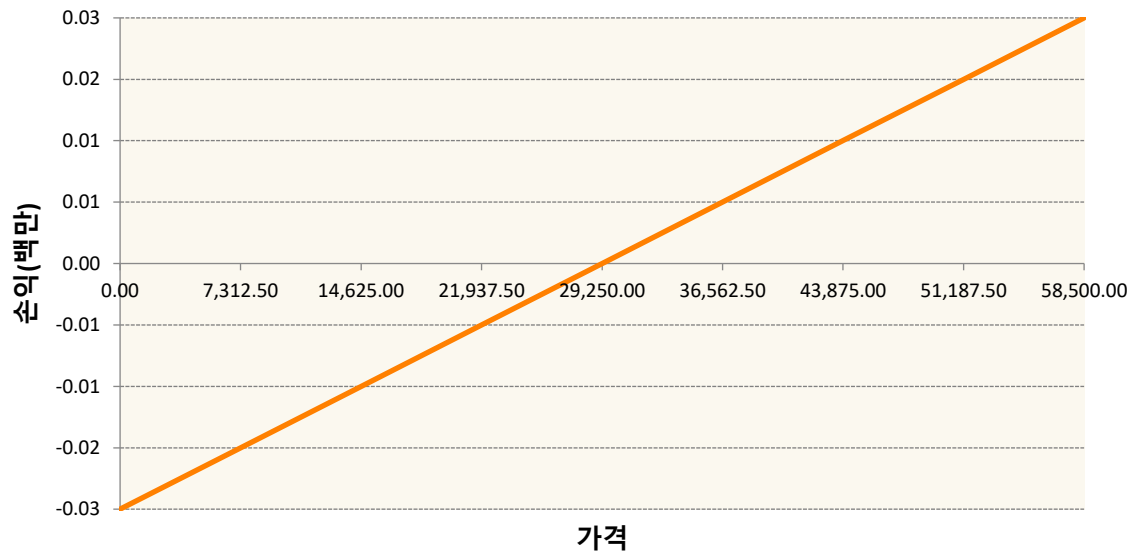
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



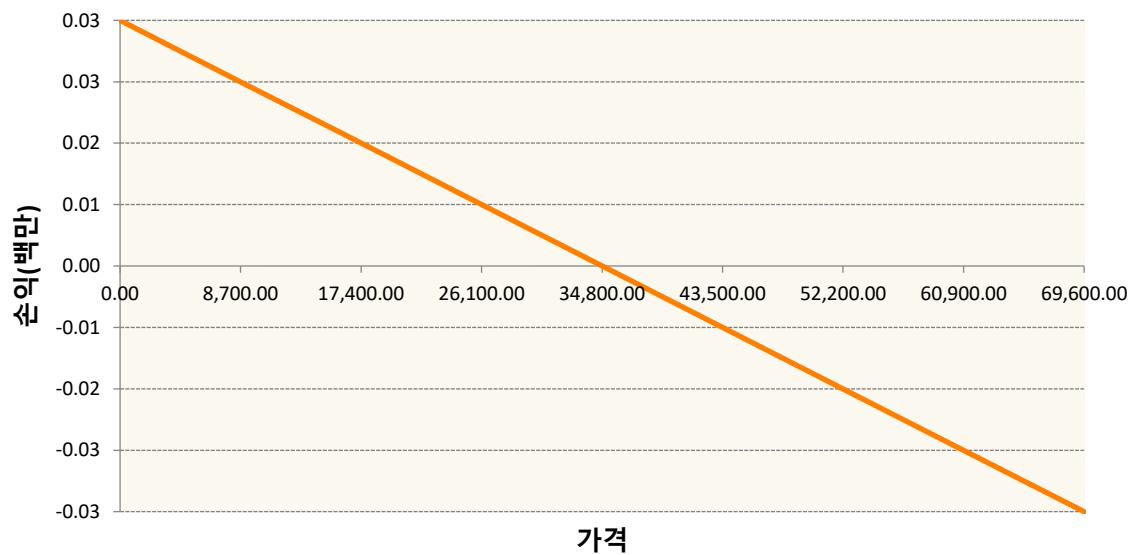
KR4ABM670006-2026-07 한국항공우주개별선물



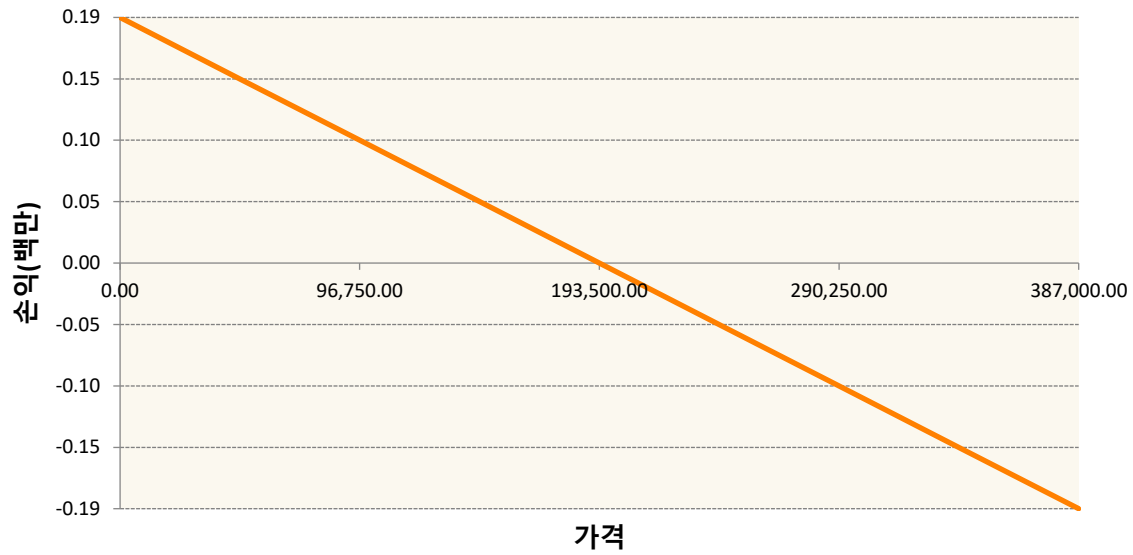
KR4ABZ670001-2026-07 NH투자증권개별선물



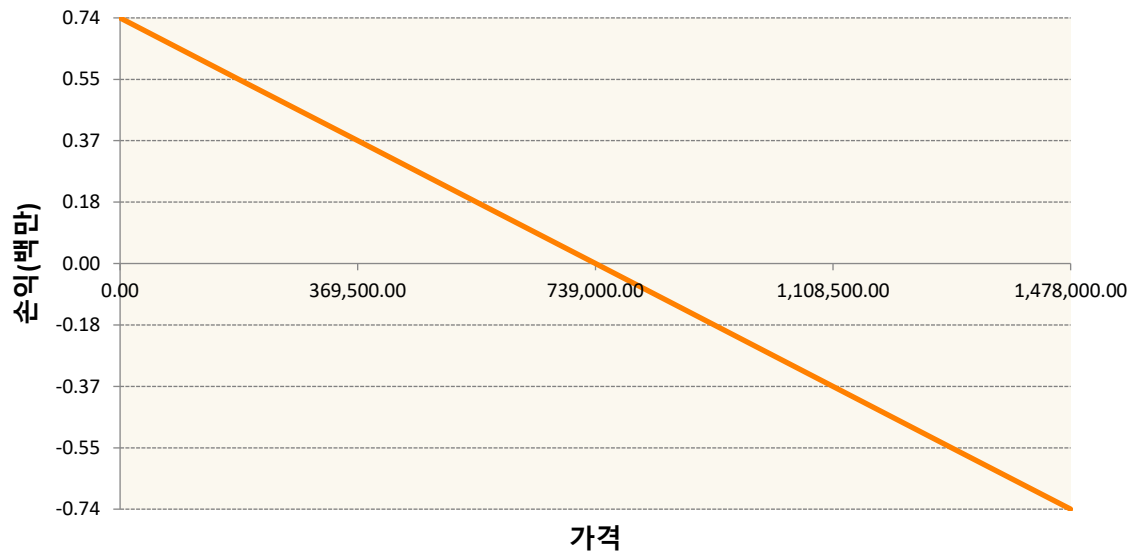
KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



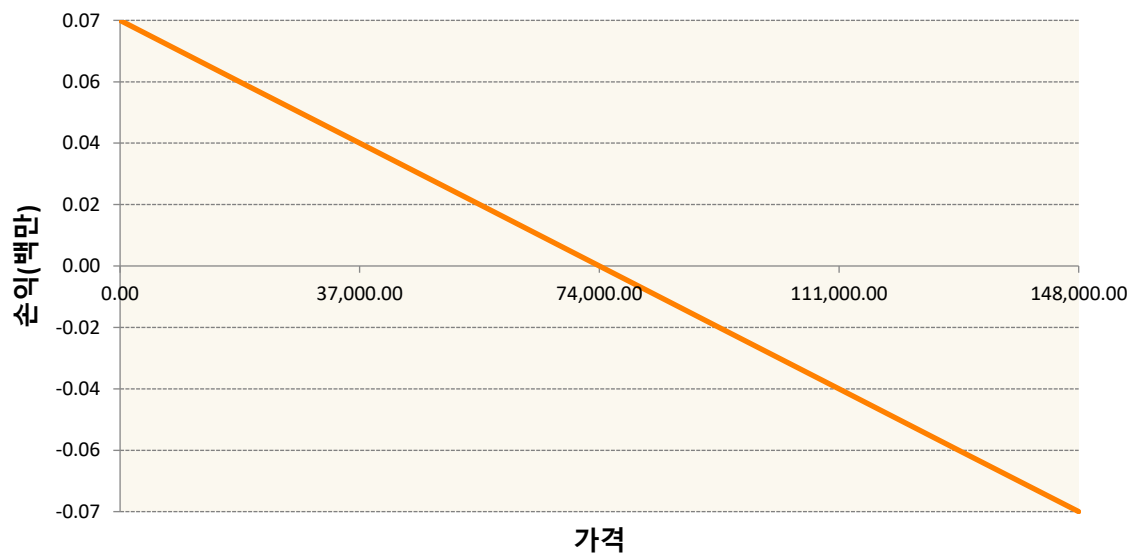
KR4AD8670001-2026-07 현대백화점개별선물



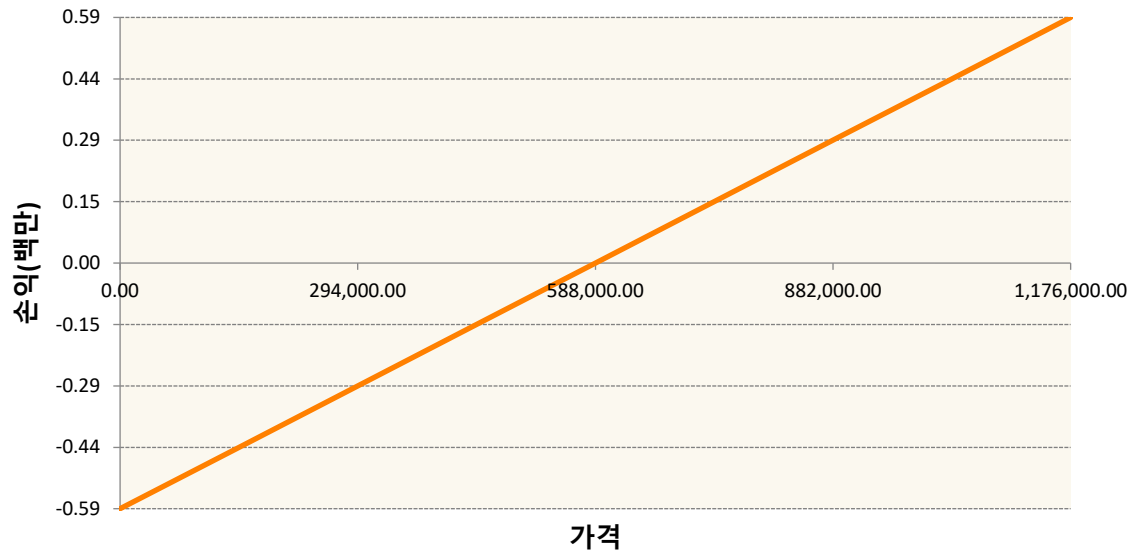
KR4ADD670005-2026-07 신세계개별선물



KR4AEV670002-2026-07 한화시스템개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				1,371
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,371	-1,371	-1,371	-1,371	-1,371	-1,371	-1,371
-5.33%	-914	-914	-914	-914	-914	-914	-914
-2.67%	-457	-457	-457	-457	-457	-457	-457
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	457	457	457	457	457	457	457
5.33%	914	914	914	914	914	914	914
8.00%	1,371	1,371	1,371	1,371	1,371	1,371	1,371
KR4A11670002			2026-07 삼성전자개별선물				395
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-395	-395	-395	-395	-395	-395	-395
-5.33%	-264	-264	-264	-264	-264	-264	-264
-2.67%	-132	-132	-132	-132	-132	-132	-132
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	132	132	132	132	132	132	132
5.33%	264	264	264	264	264	264	264
8.00%	395	395	395	395	395	395	395
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	72
--------------	-------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	72	72	72	72	72	72	72
-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%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72

KR4A23670008	2026-07 삼성전기개별선물	42
--------------	------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	28	28	28	28	28	28	28
8.00%	42	42	42	42	42	42	42

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

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	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%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
-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%	65	65	65	65	65	65	65
8.00%	98	98	98	98	98	98	98

KR4ABM670006

2026-07 한국항공우주개별선물

67

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	67	67	67	67	67	67	67
-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%	-67	-67	-67	-67	-67	-67	-67

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

KR4ACF670004

2026-07 카카오개별선물

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%	59	59	59	59	59	59	59
-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%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
8.00%	-88	-88	-88	-88	-88	-88	-88

KR4AD8670001

2026-07 현대백화점개별선물

14

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	14	14	14	14	14	14	14
-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%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
KR4ADD670005 2026-07 신세계개별선물							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
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%	19	19	19	19	19	19	19
-2.67%	10	10	10	10	10	10	10
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
8.00%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
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%	-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%	20	20	20	20	20	20	20

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

(단위:백만원)

5,871

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

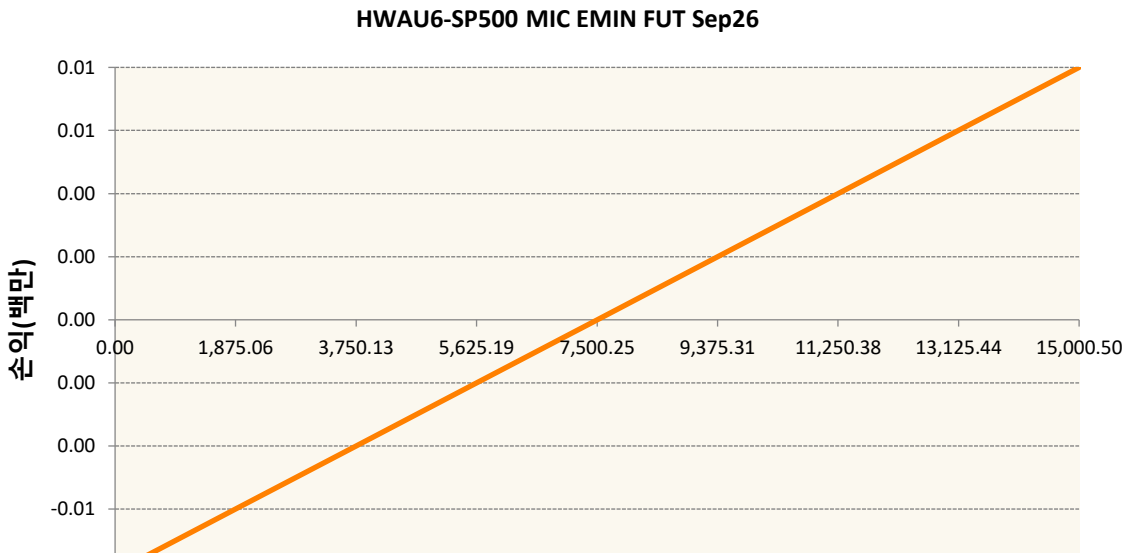
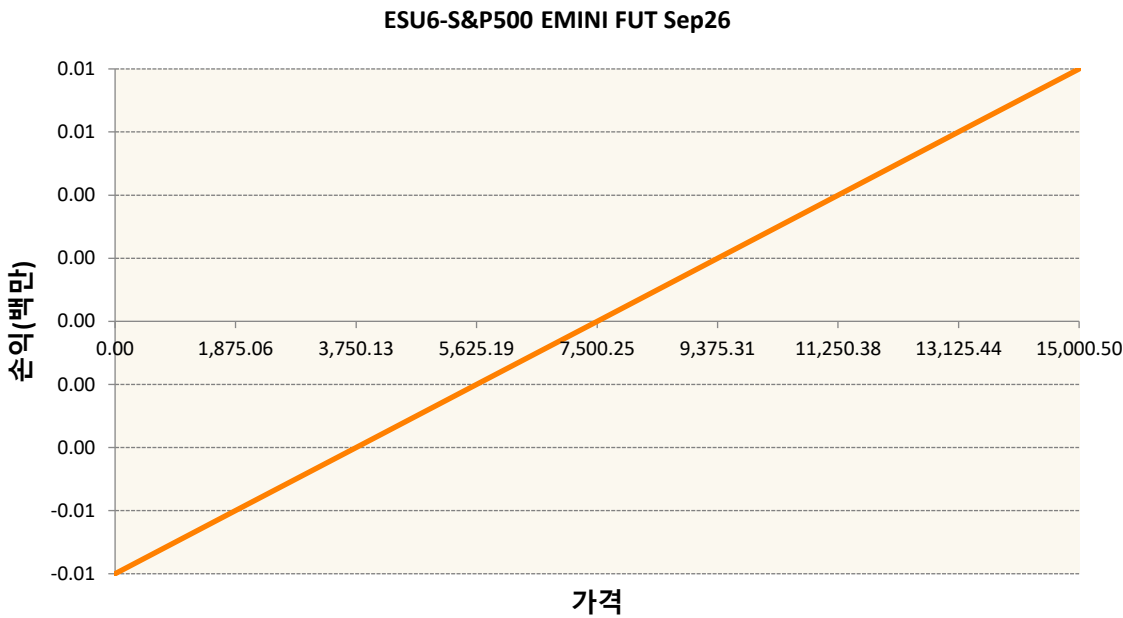
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

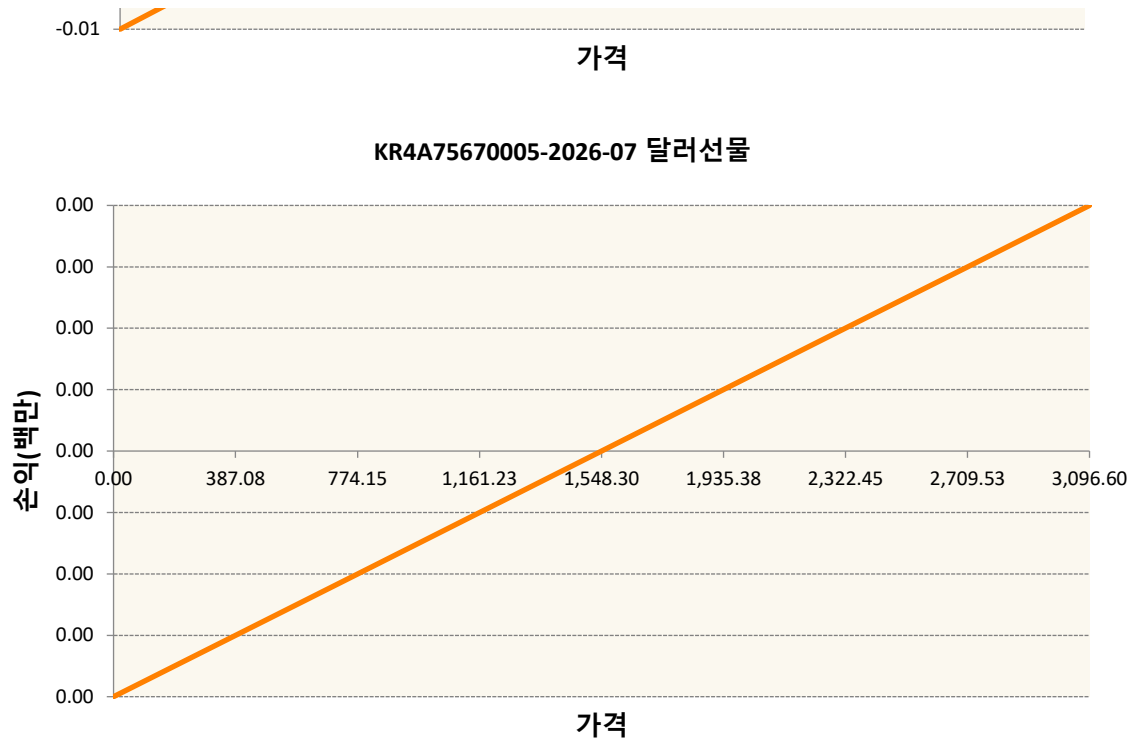
1. 계약금액

(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	61,774	0	61,774	
누계	지수	선물	113	0	113	장내
누계	통화	선물	10,993	0	10,993	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	4,942
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	9
KR4A756700	2026-07 달러선물	879

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

(단위:백만원)

4,278

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

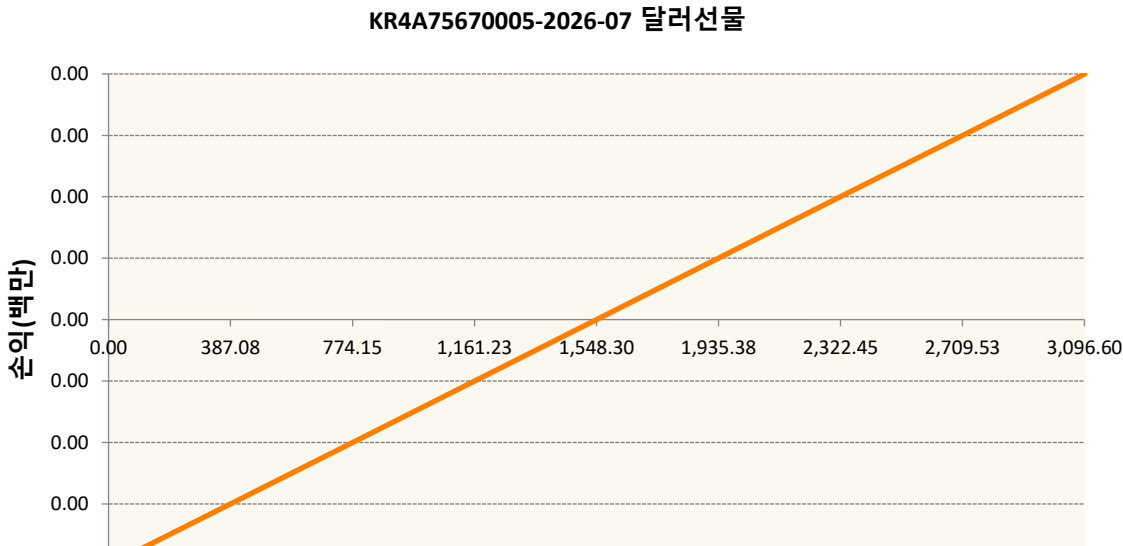
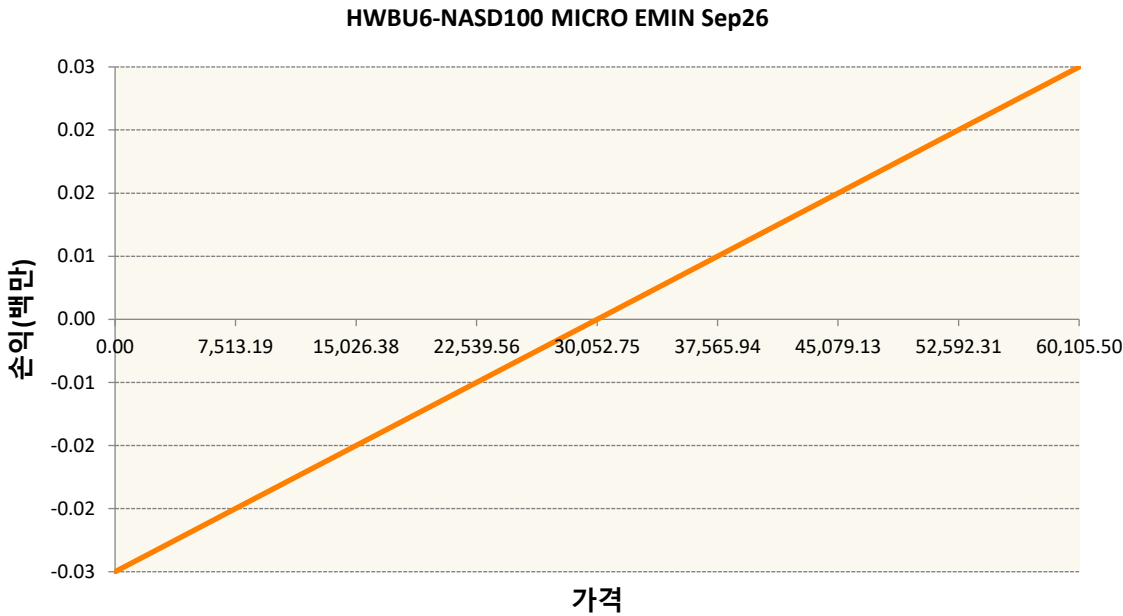
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

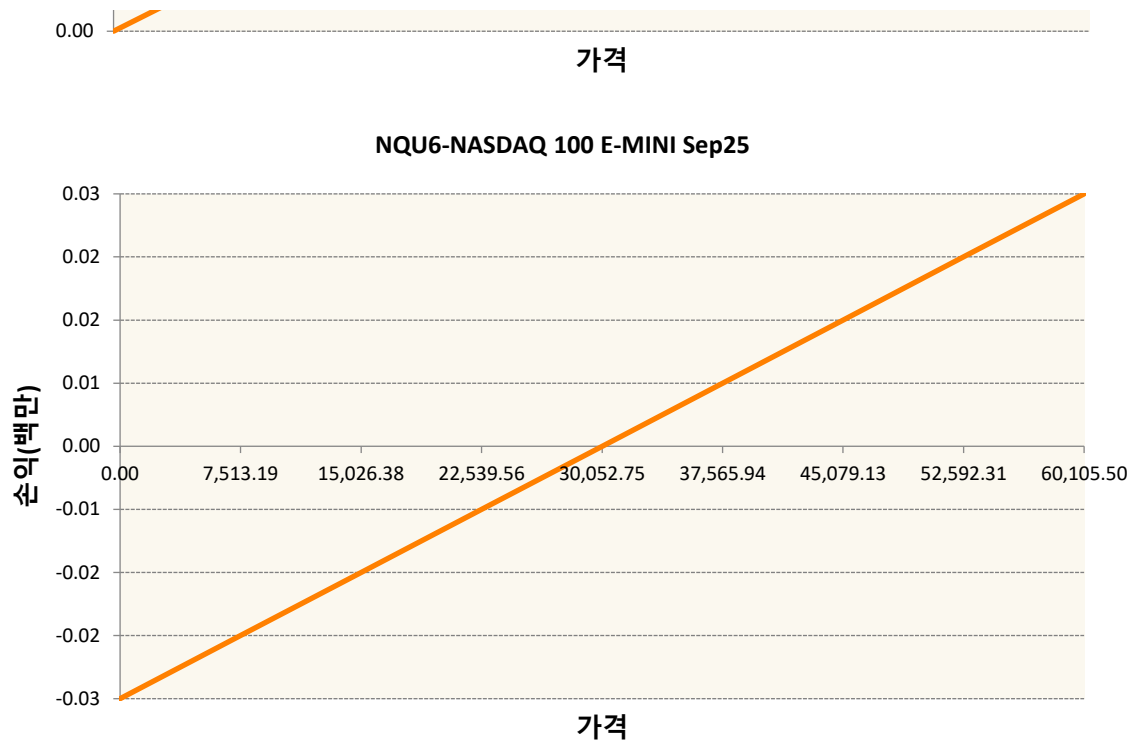
1. 계약금액

(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	185	0	185	장내
누계	지수	선물	30,878	0	30,878	
누계	통화	선물	4,041	0	4,041	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26	15
KR4A756700	2026-07 달러선물	323
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	2,470

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

2,805

공시일	2026-07-01
기준일	2026-06-30

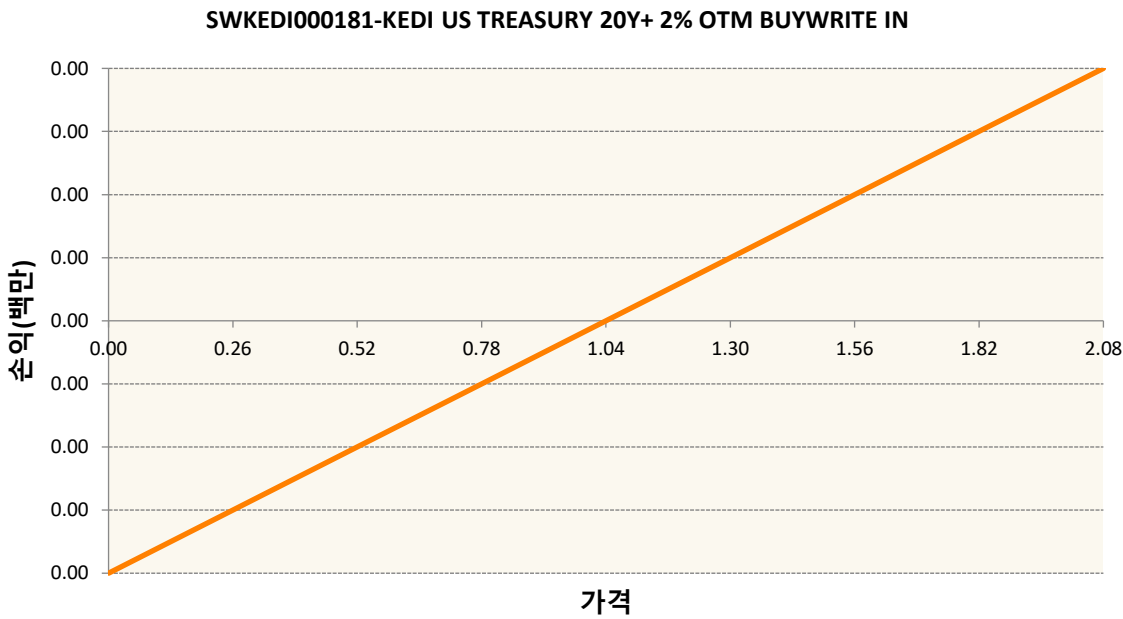
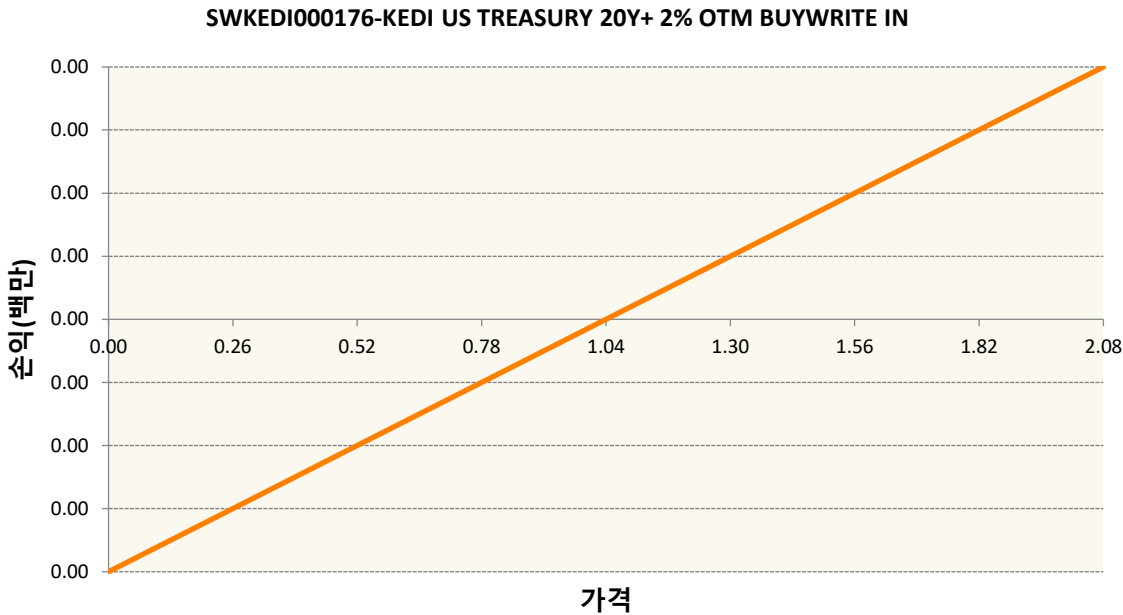
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

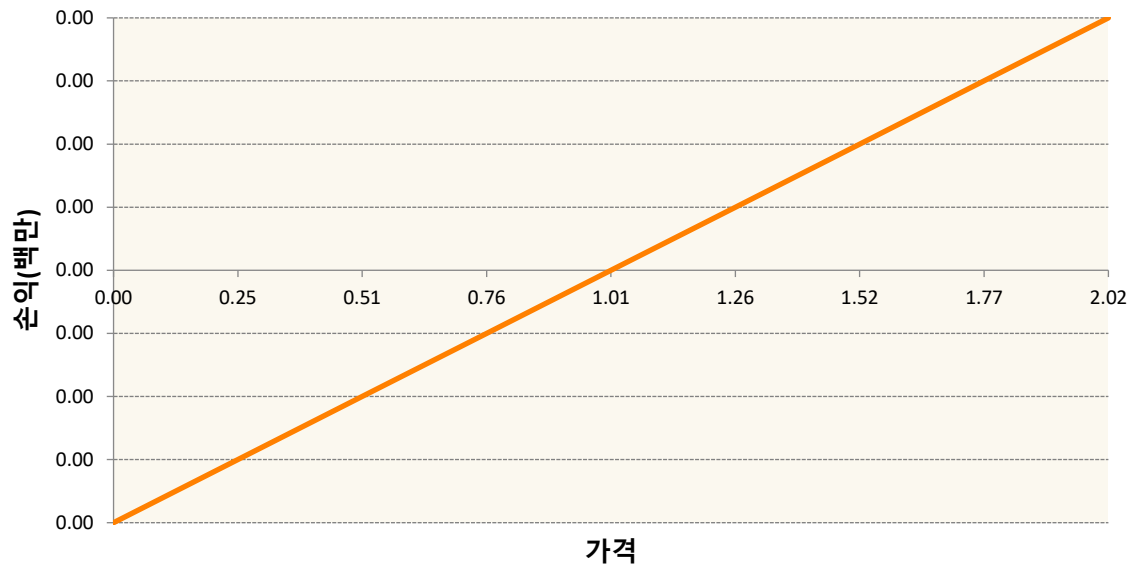
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	331,183	0	331,183	장외

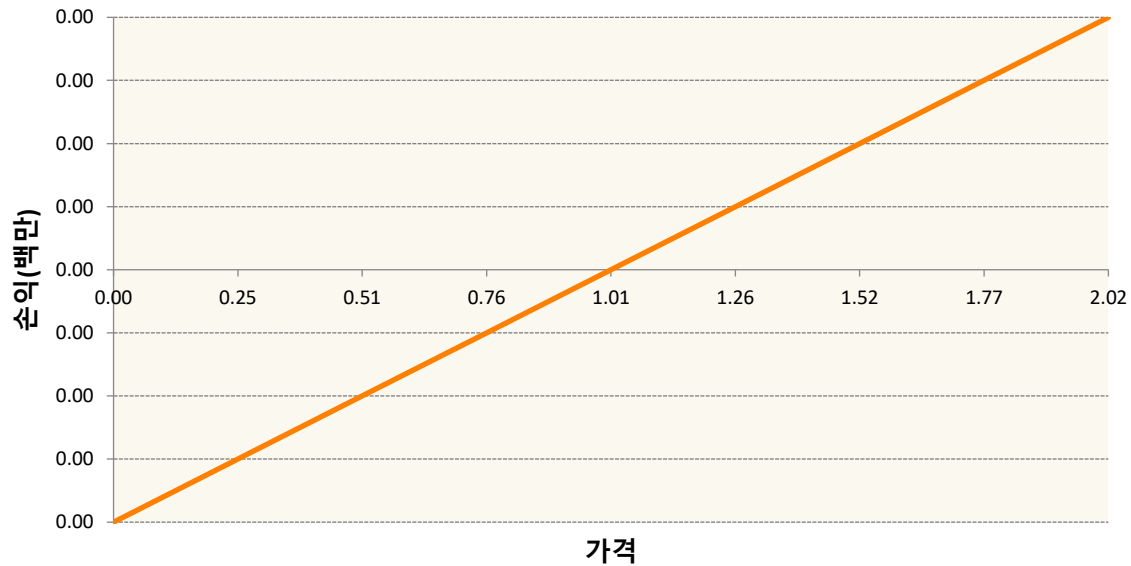
2. 만기시점의 손익구조



SWKEDI000184-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000185-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,471
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,325
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,652
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,102

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

(단위:백만원)

11,225