

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

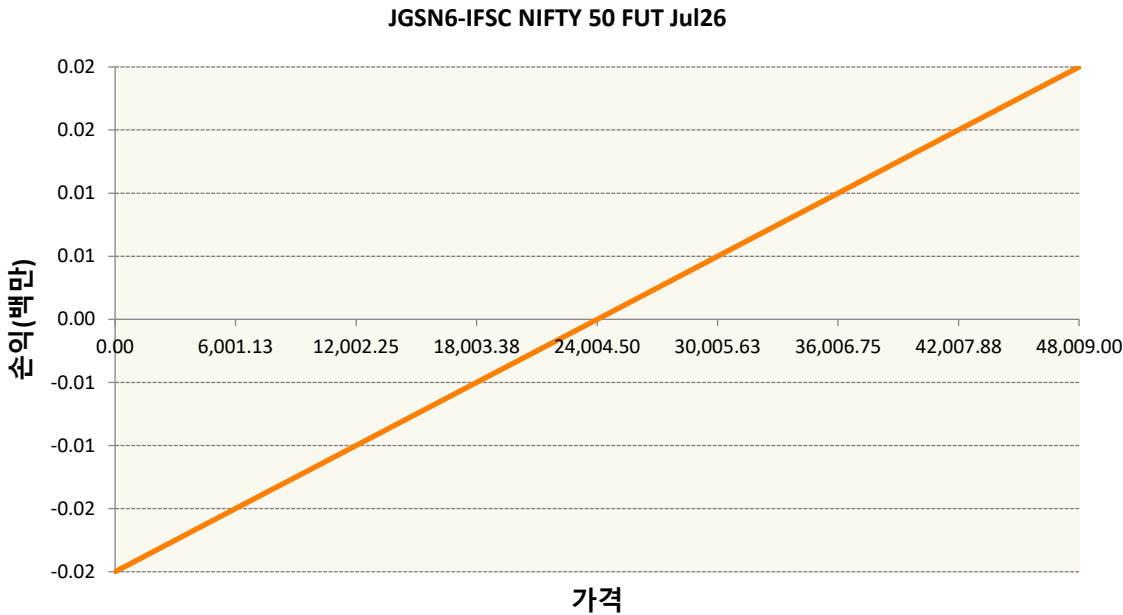
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-07-02
기준일	2026-07-01

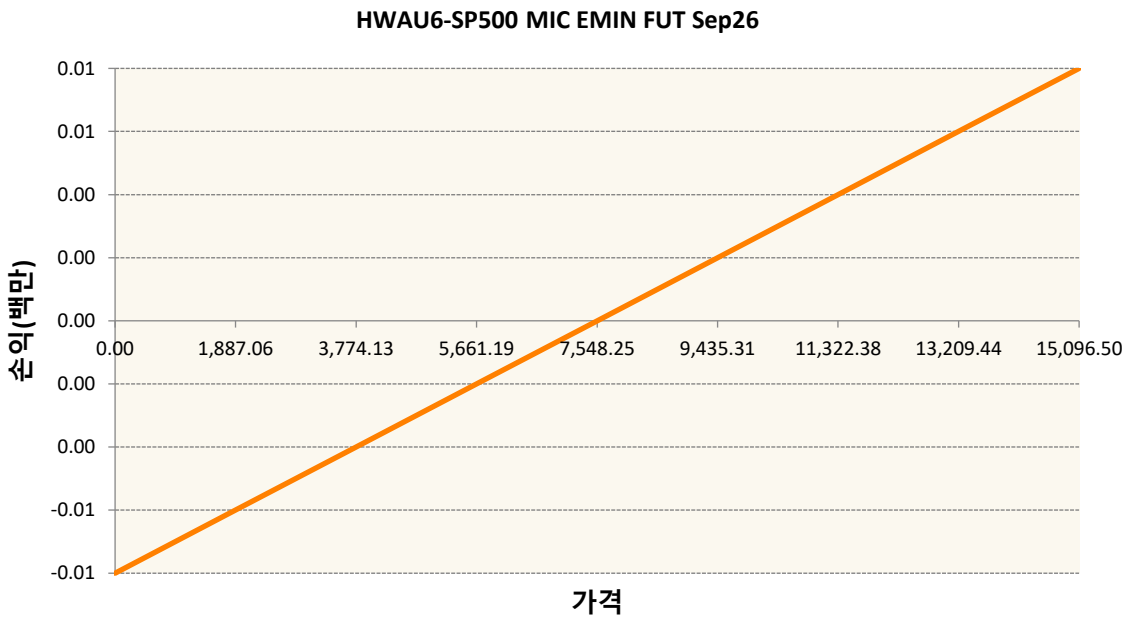
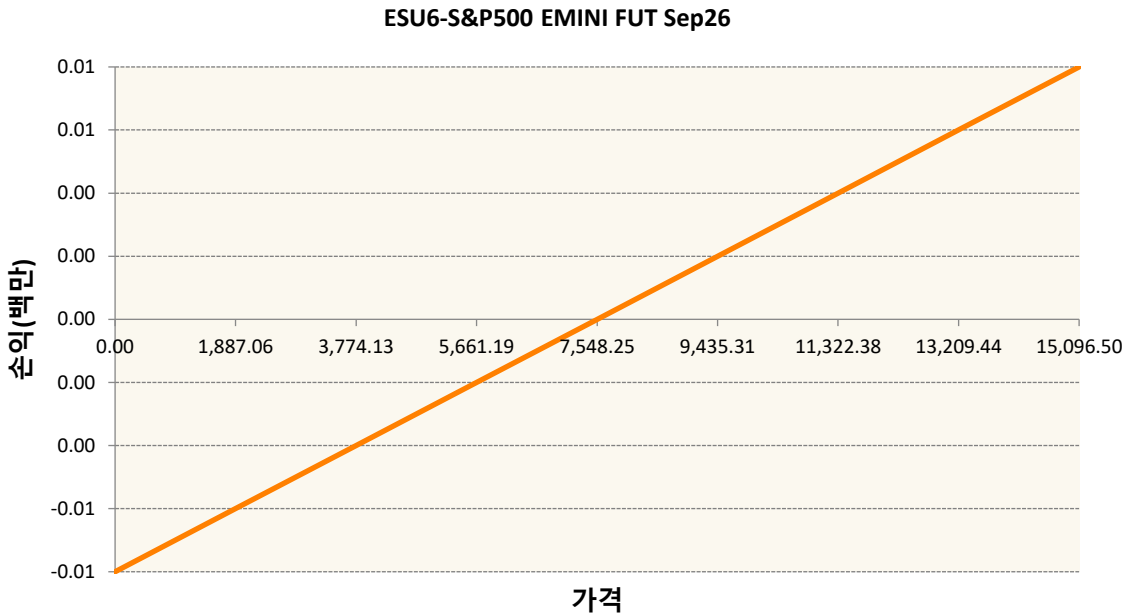
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	576	0	576	
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	2026-07-02
기준일	2026-07-01

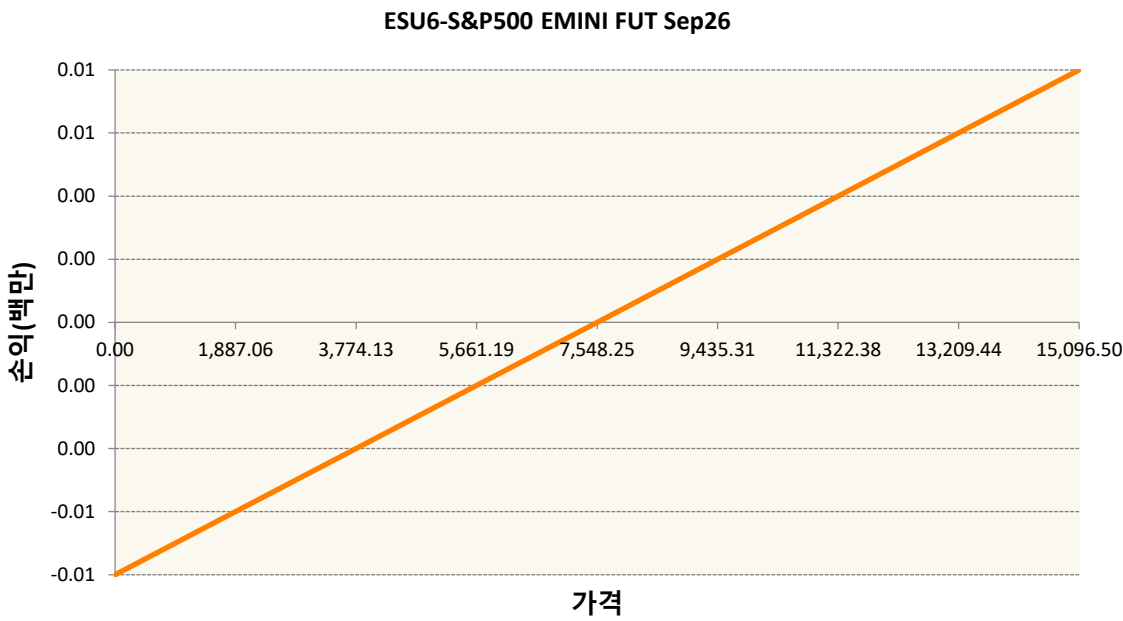
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,141	0	1,141	

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)

79

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

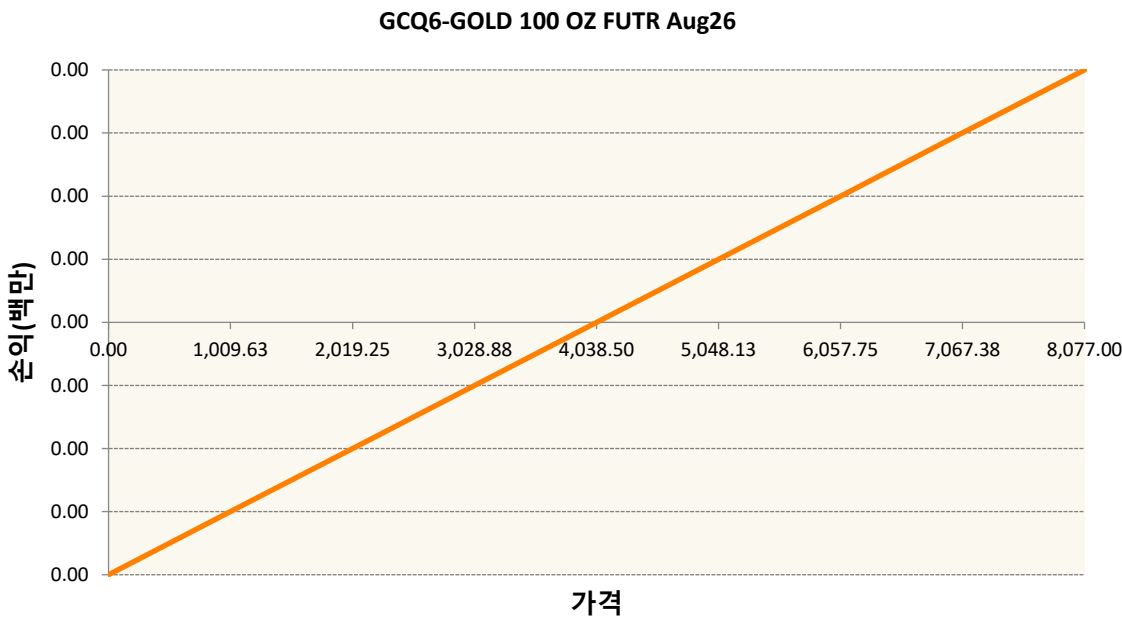
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,829	0	4,829	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 07/02/26 C375 EQUITY	13
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	386

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

(단위:백만원)

519

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

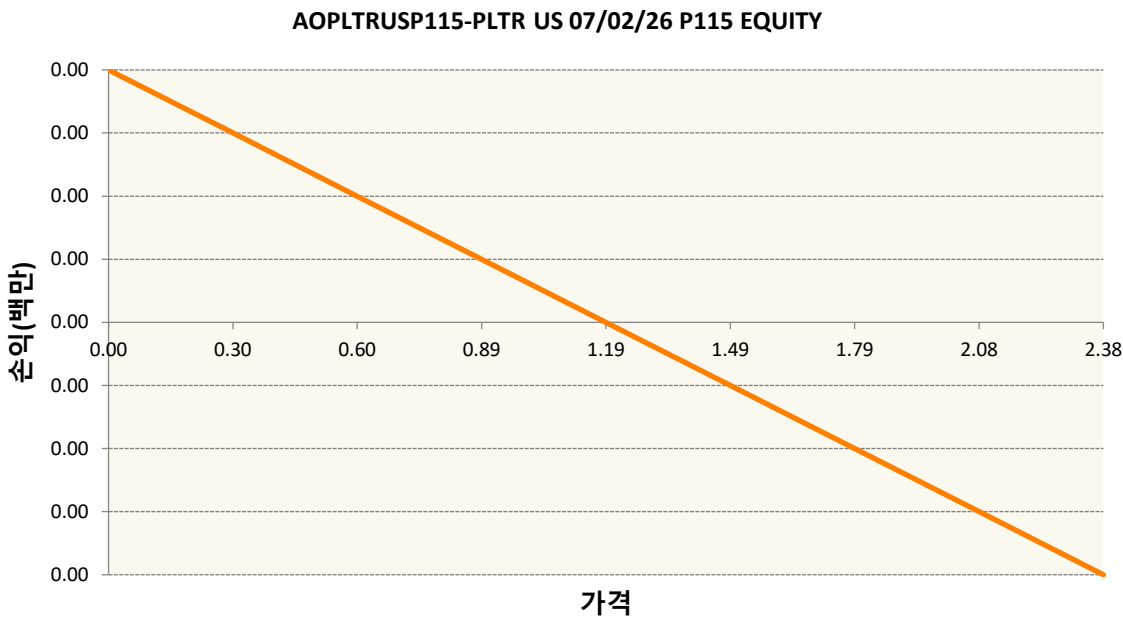
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

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	262	-262	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC PLTR US 07/02/26 C115 EQUITY	36
AOPLTRUSP PLTR US 07/02/26 P115 EQUITY	21

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

(단위:백만원)

174

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

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

6

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

(단위:백만원)

3

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

(단위:백만원)

17,404

공시일 2026-07-02

기준일 2026-07-01

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	2026-07-02
기준일	2026-07-01

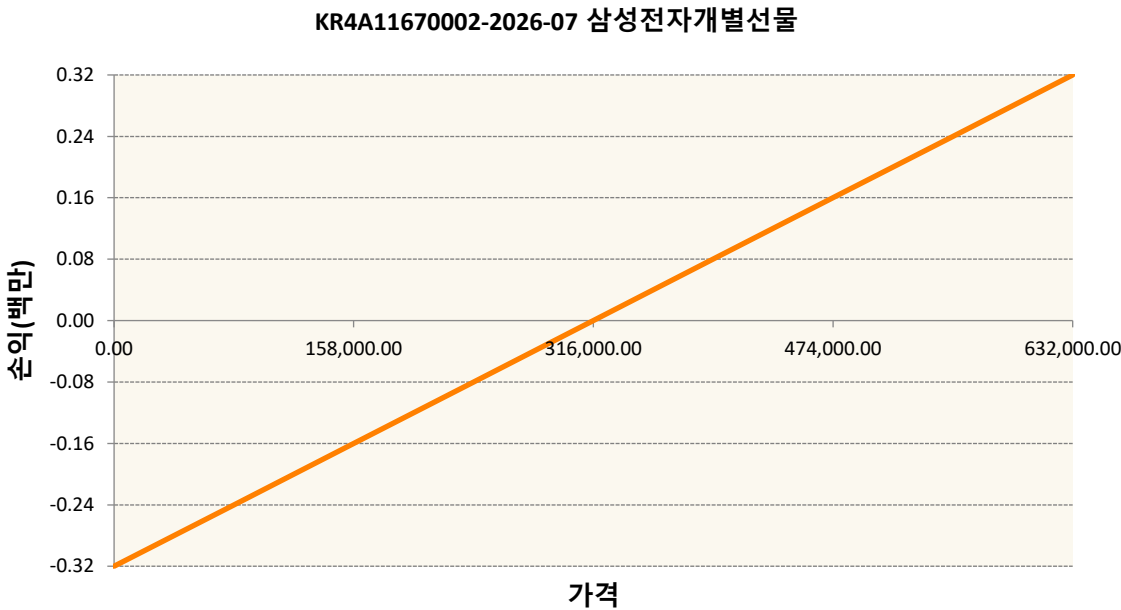
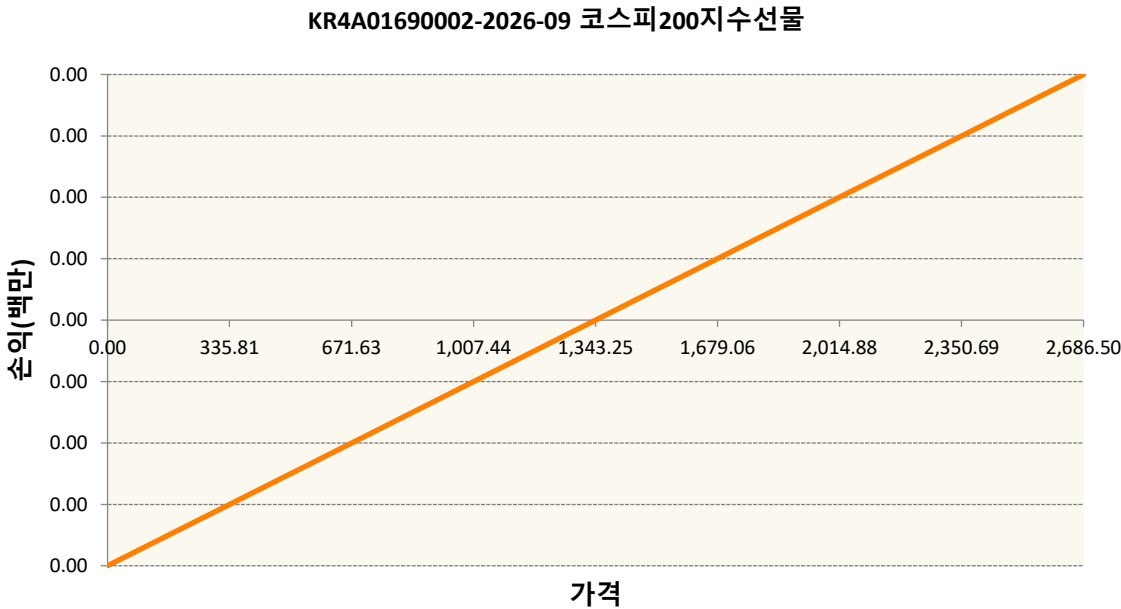
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	25,795	0	25,795	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 (1,357.50, 0.00).

가격	손익(백만)
0.00	0.00
1,357.50	0.00

The graph illustrates a linear relationship between price and profit per unit. The x-axis, labeled '가격' (Price), ranges from 0.00 to 2,720.00. The y-axis, labeled '순이익(백만)' (Profit per unit in millions), ranges from 0.00 to 0.00. A single orange line represents the profit function, starting at the origin (0, 0) and ending at (1,360, 0.00).

가격 (Price)	순이익(백만) (Profit per unit)
0.00	0.00
1,360.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				694
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-694	-694	-694	-694	-694	-694	-694	
-5.33%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463	
-2.67%	-231	-231	-231	-231	-231	-231	-231	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	231	231	231	231	231	231	231	
5.33%	463	463	463	463	463	463	463	
8.00%	694	694	694	694	694	694	694	
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물				1,359
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,359	-1,359	-1,359	-1,359	-1,359	-1,359	-1,359
-5.33%	-906	-906	-906	-906	-906	-906	-906
-2.67%	-453	-453	-453	-453	-453	-453	-453
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	453	453	453	453	453	453	453
5.33%	906	906	906	906	906	906	906
8.00%	1,359	1,359	1,359	1,359	1,359	1,359	1,359
KR4B09F5B459 코스피위클리 C 2607W1 1,357.5							1,749

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,719	-1,721	-1,723	-1,727	-1,732	-1,740	-1,749
-5.33%	-1,050	-1,057	-1,067	-1,079	-1,094	-1,111	-1,130
-2.67%	-417	-438	-462	-488	-516	-545	-576
0%	114	77	39	0	-39	-78	-118
2.67%	471	430	390	349	308	268	227
5.33%	648	621	591	560	527	493	458
8.00%	711	699	684	666	645	622	597

KR4B09F5B467 코스피위클리 C 2607W1 1,360.0							1,183
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,165	-1,166	-1,167	-1,169	-1,173	-1,177	-1,183
-5.33%	-715	-720	-726	-733	-743	-754	-766
-2.67%	-287	-301	-316	-333	-351	-370	-391
0%	75	51	26	0	-26	-52	-78
2.67%	323	296	269	241	214	186	158
5.33%	450	431	410	389	366	343	319
8.00%	496	488	477	464	449	433	416

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

(단위:백만원)

11,476

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

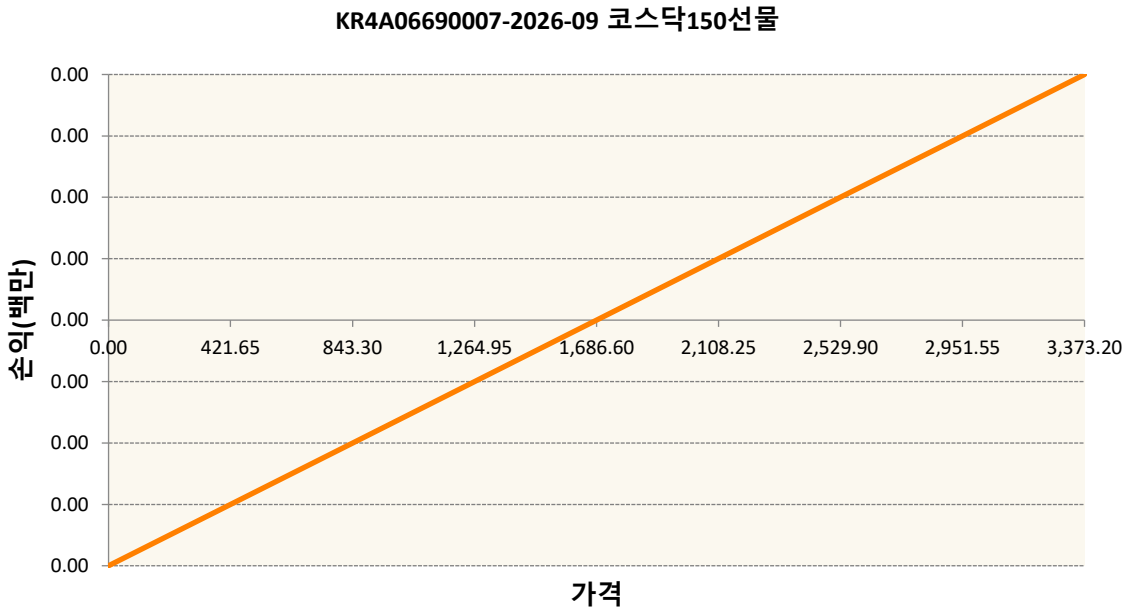
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	978	0	978	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007			2026-09 코스닥150선물				78
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-5.33%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-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%	52	52	52	52	52	52	52
8.00%	78	78	78	78	78	78	78

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

(단위:백만원)

28,683

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

(단위:백만원)

79,619

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

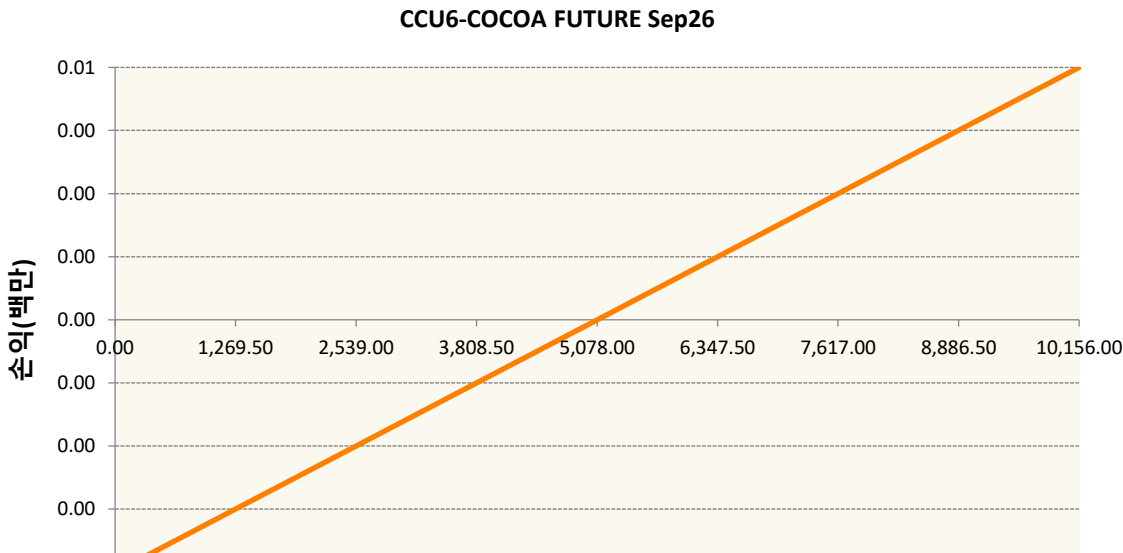
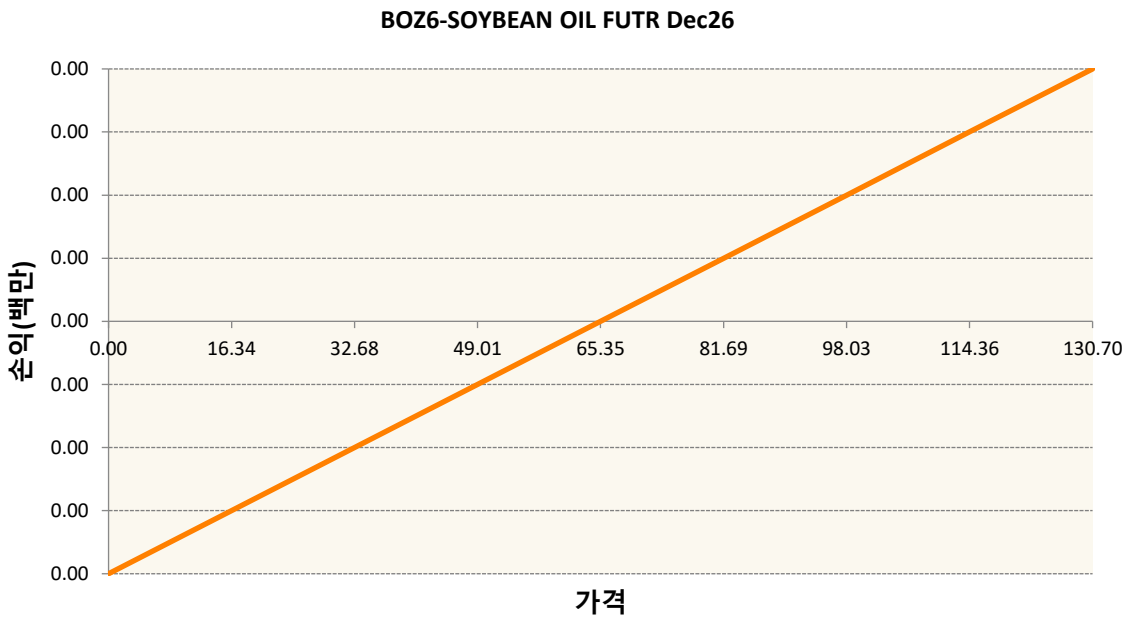
포커스농산물모(채권-파생형)

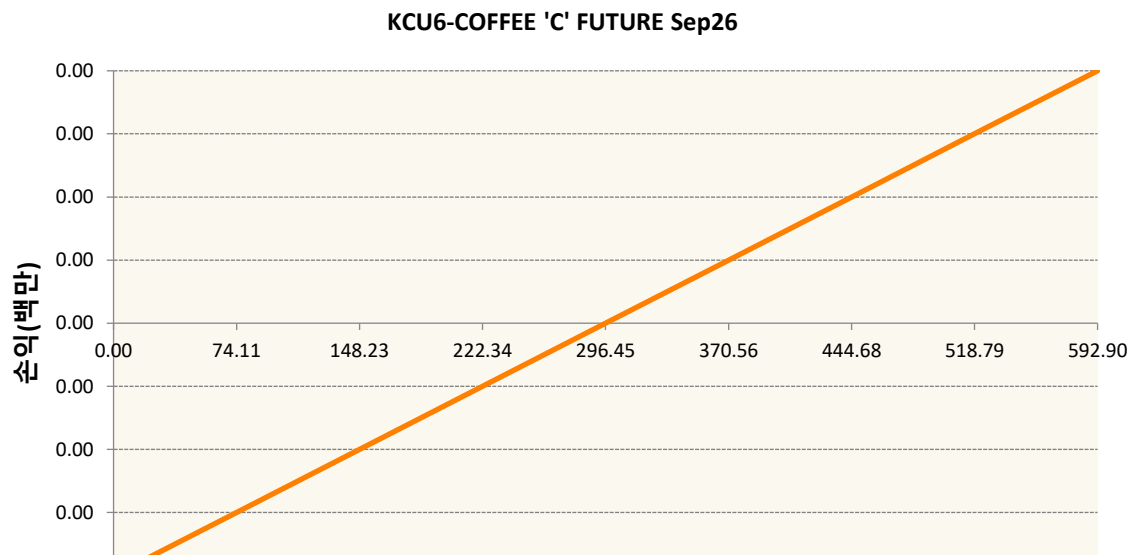
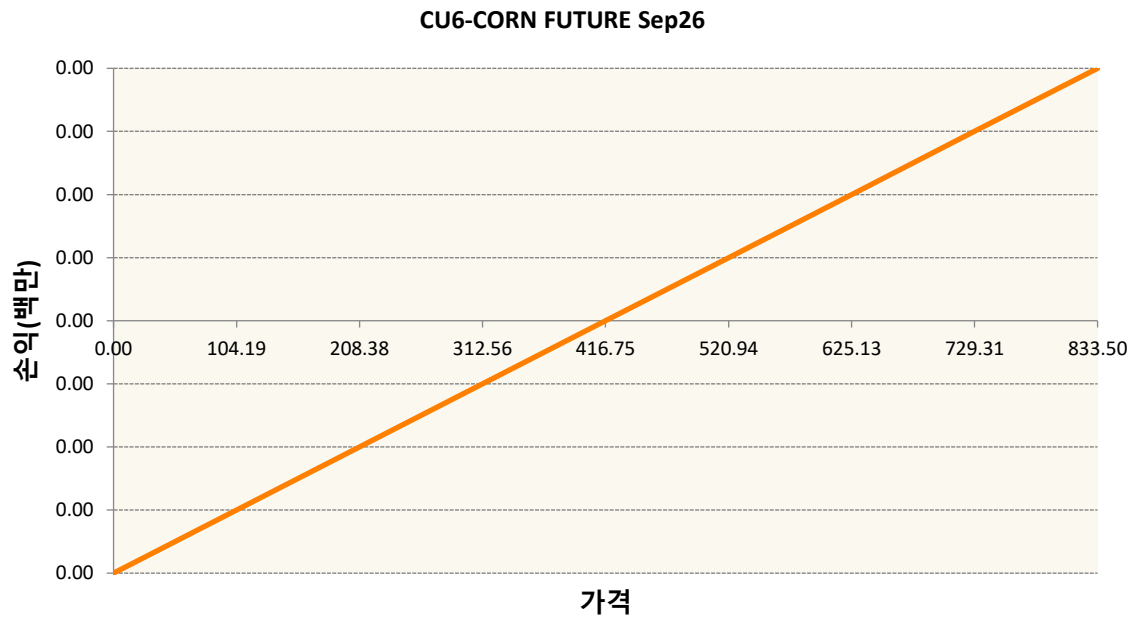
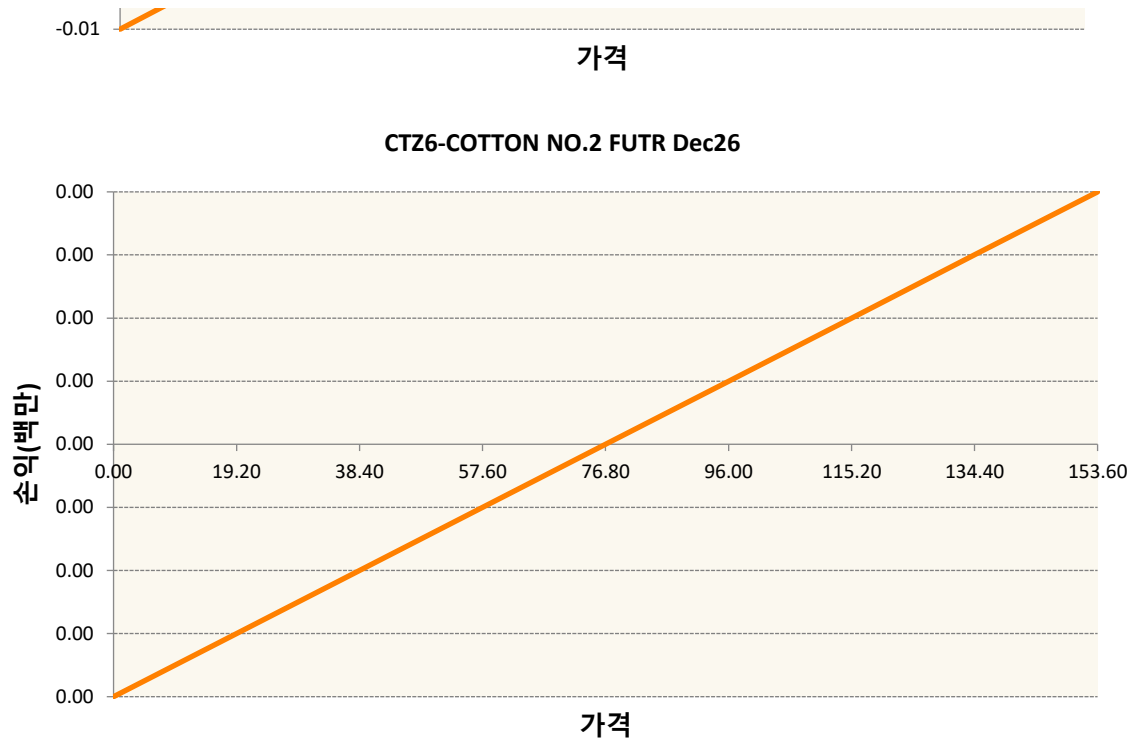
1. 계약금액

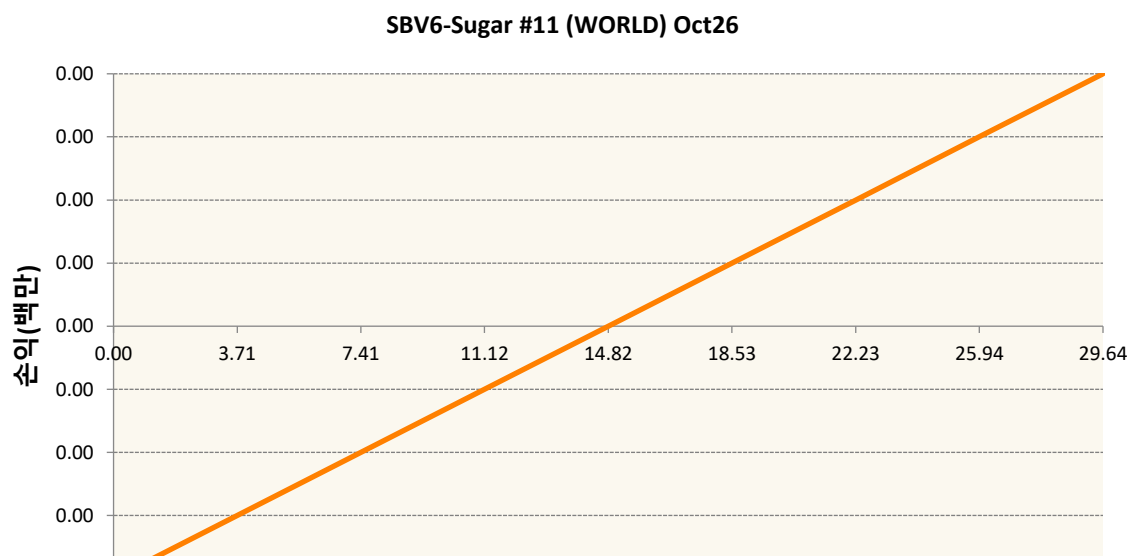
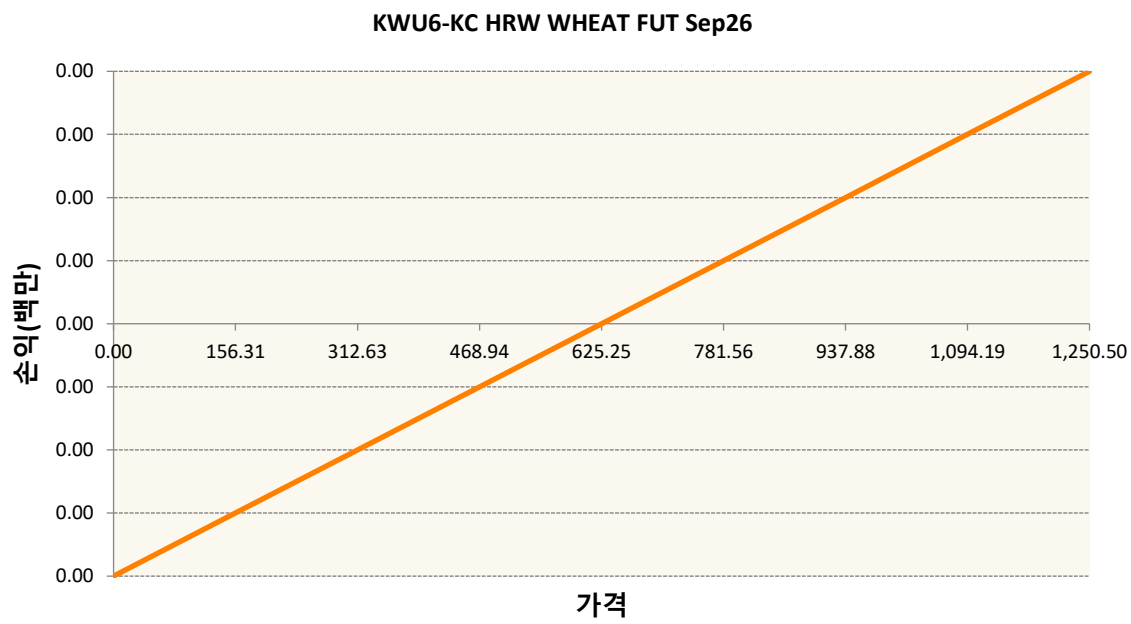
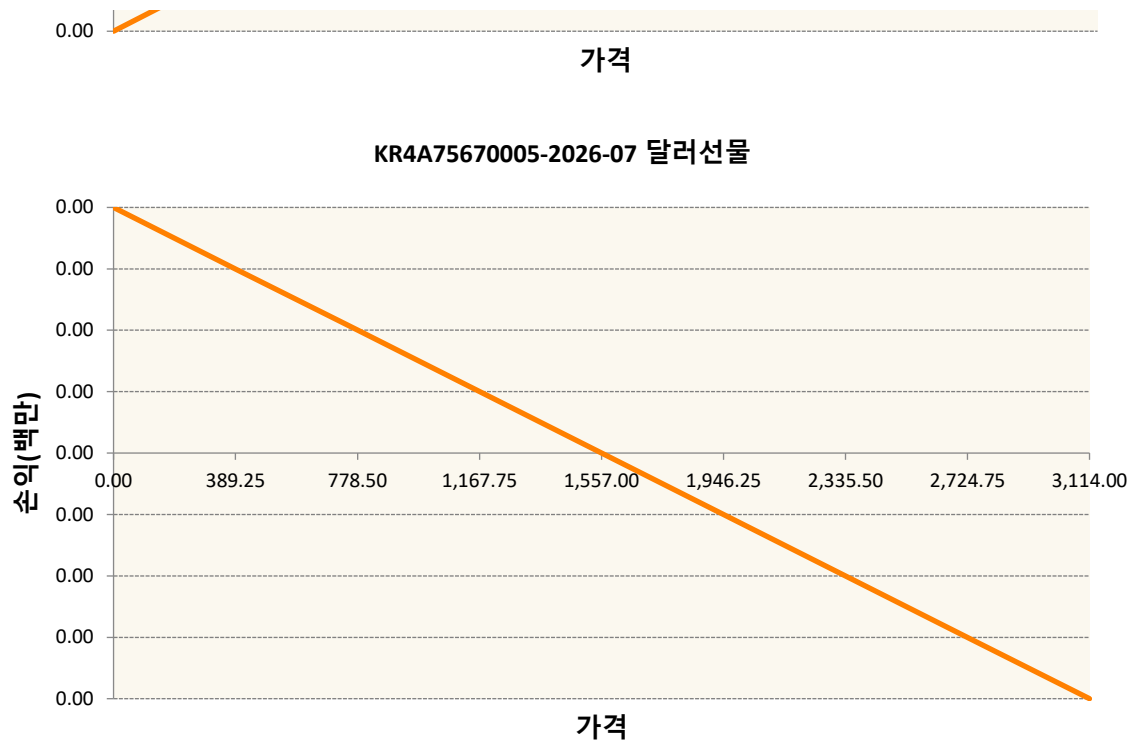
(단위:USD 백만)

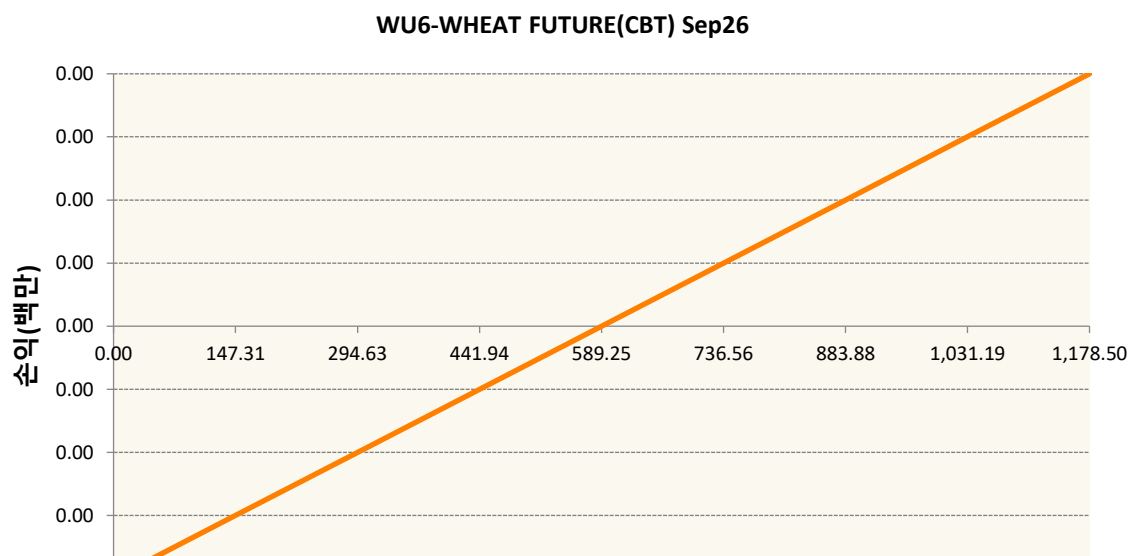
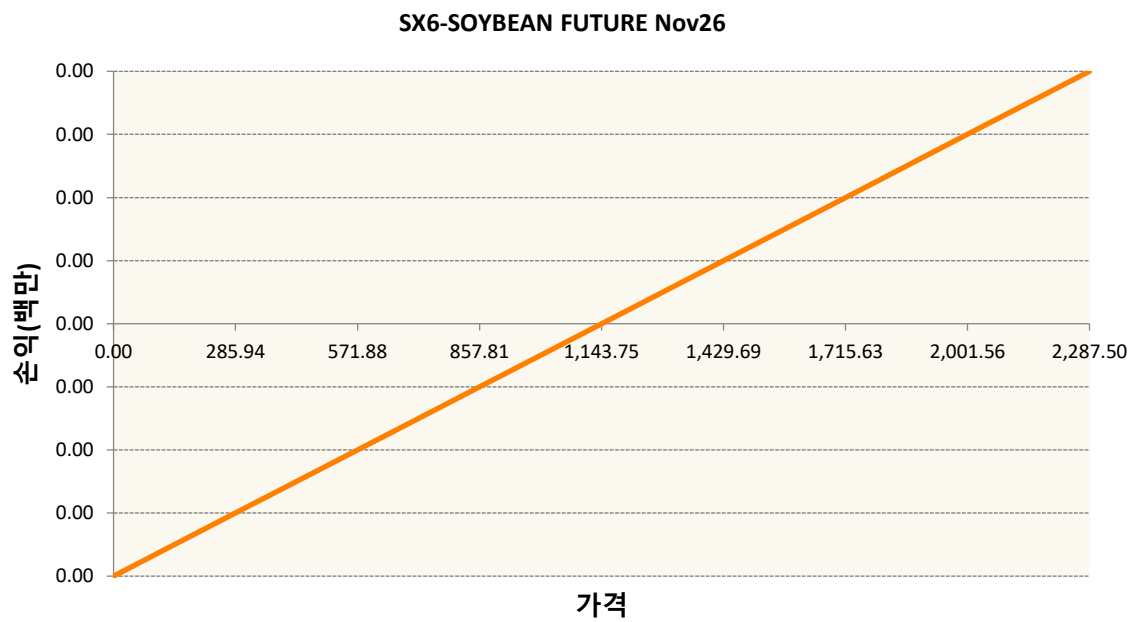
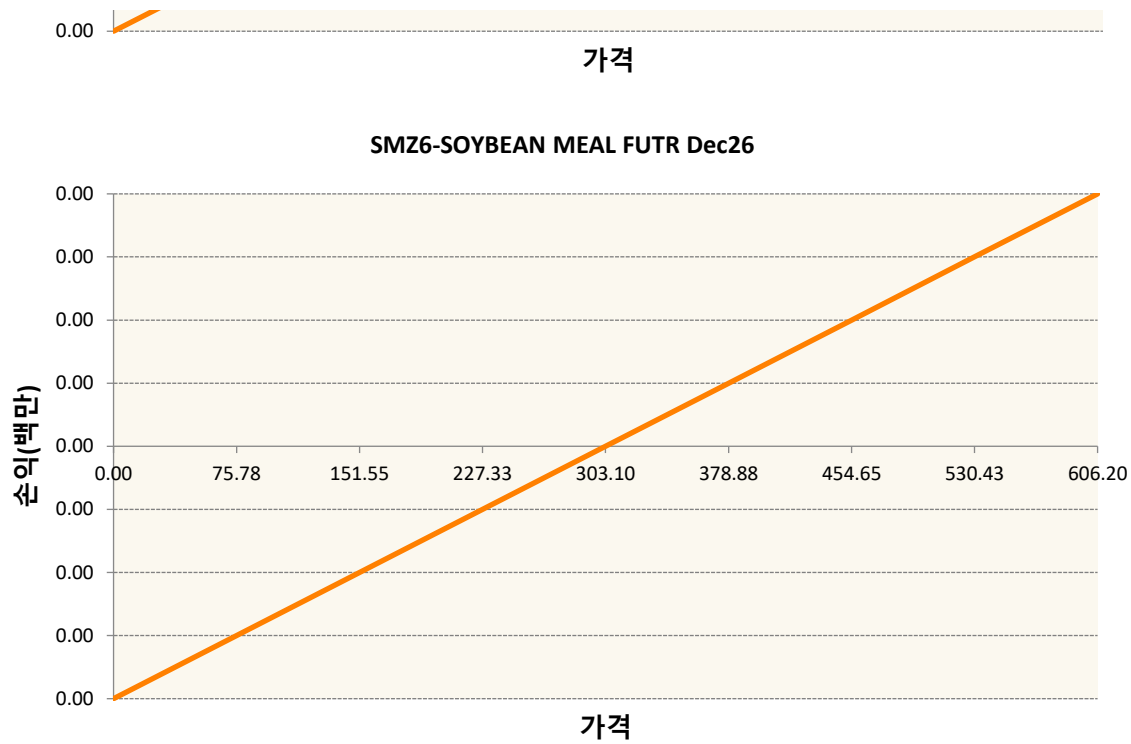
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	436	0	436	
누계	유가증권	선물	2,054	0	2,054	
누계	통화	선물	0	171	-171	장내

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	2026-07-02
기준일	2026-07-01

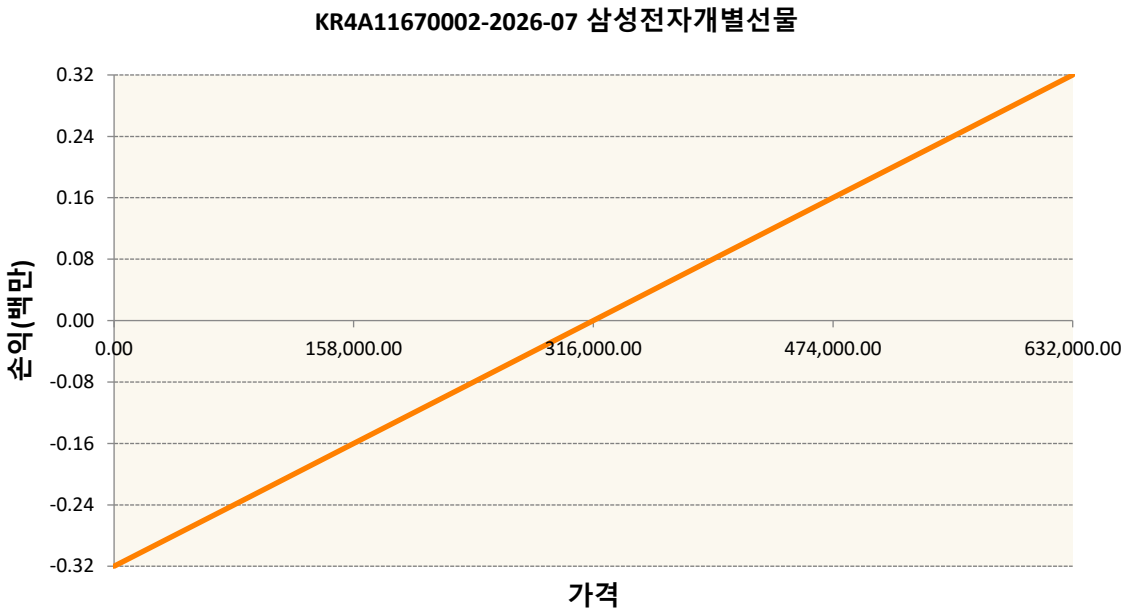
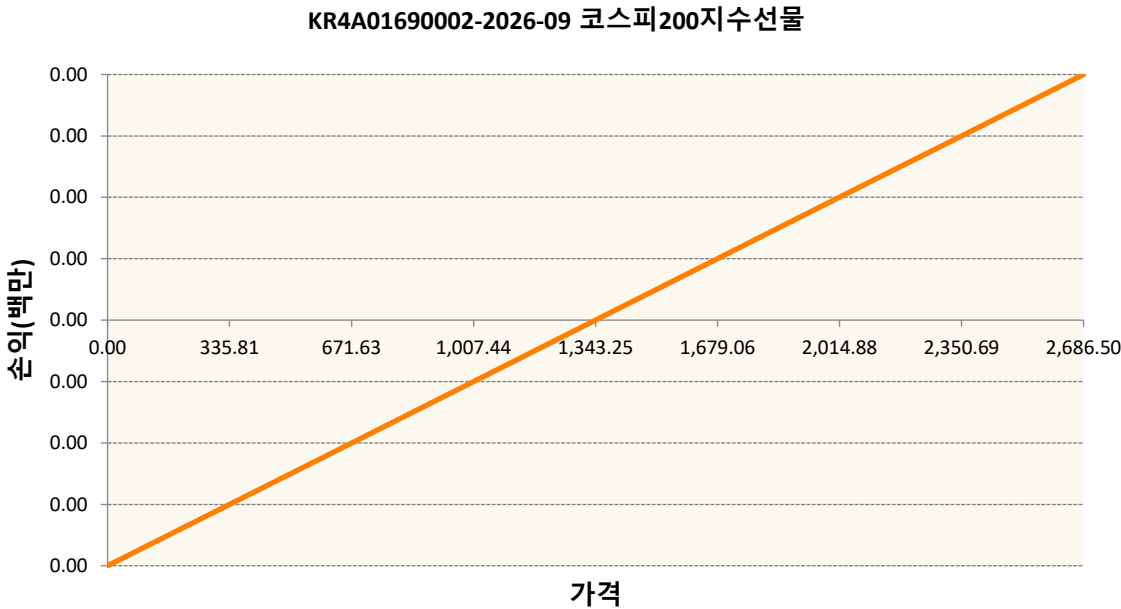
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	350	0	350	장내
누계	유가증권	선물	3,485	0	3,485	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					267
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-267	-267	-267	-267	-267	-267	-267
-5.33%	-178	-178	-178	-178	-178	-178	-178
-2.67%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	89	89	89	89	89	89	89
5.33%	178	178	178	178	178	178	178
8.00%	267	267	267	267	267	267	267
KR4A11670002		2026-07 삼성전자개별선물					10
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-10	-10	-10	-10	-10	-10	-10
-5.33%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
-2.67%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	3	3	3	3	3	3	3
5.33%	7	7	7	7	7	7	7
8.00%	10	10	10	10	10	10	10

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

742

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

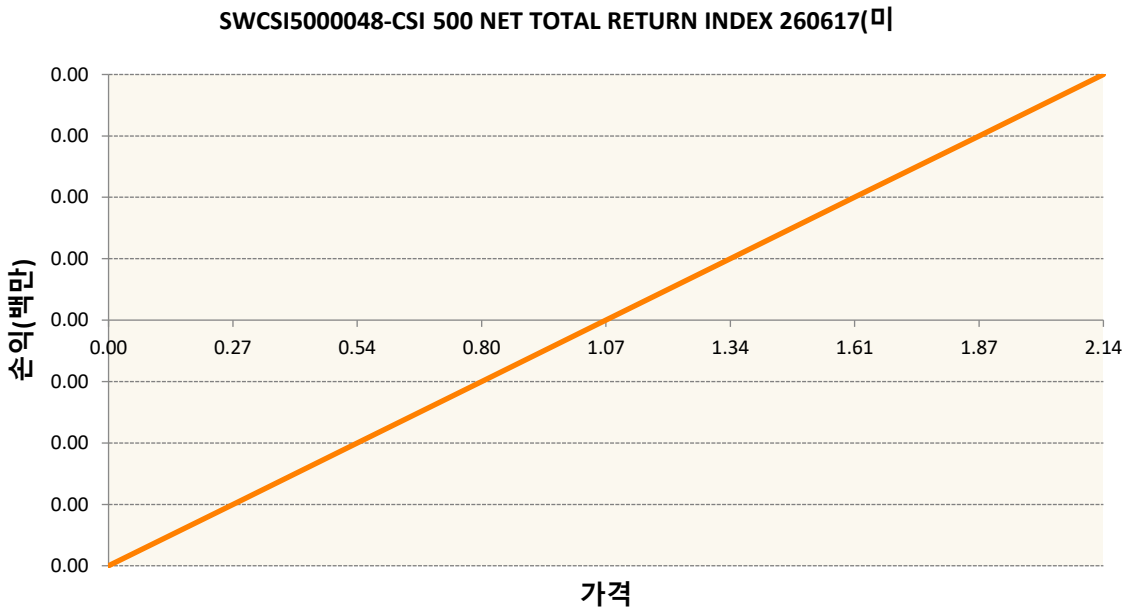
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	6,202	0	6,202	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

498

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

672

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

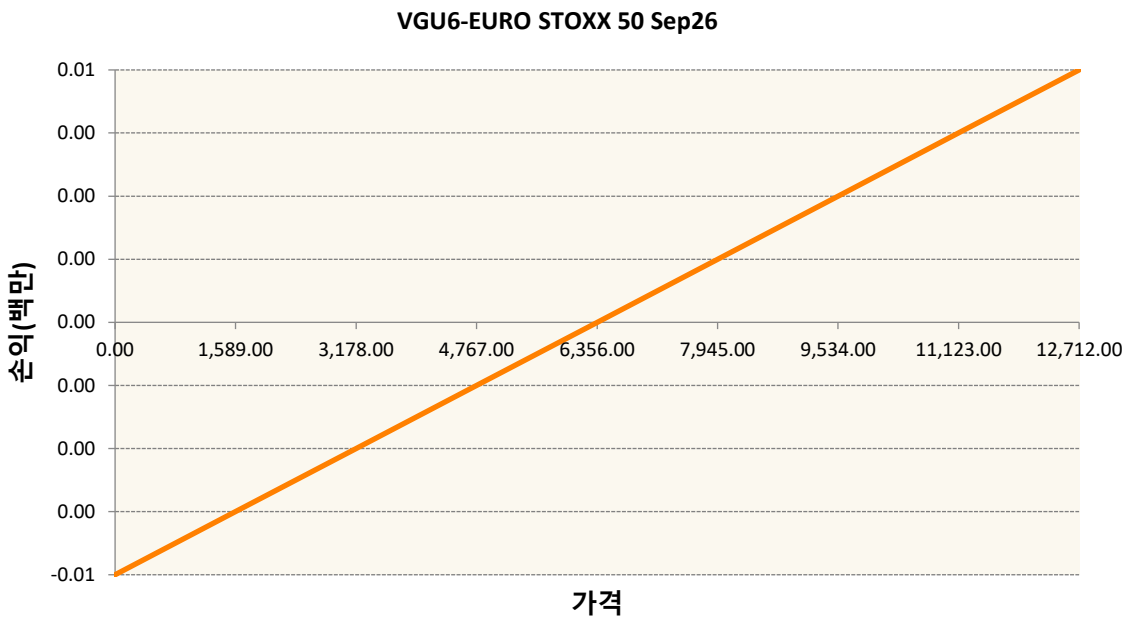
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,005	0	1,005	

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	2026-07-02
기준일	2026-07-01

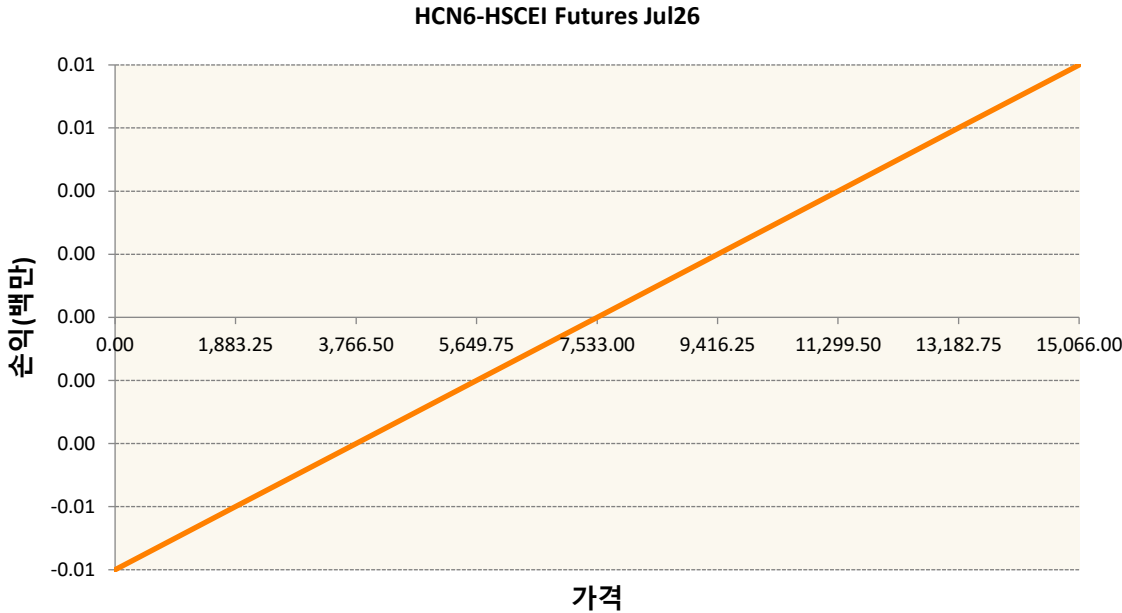
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,104	0	1,104	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN6	HSCEI Futures Jul26	88
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

106

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

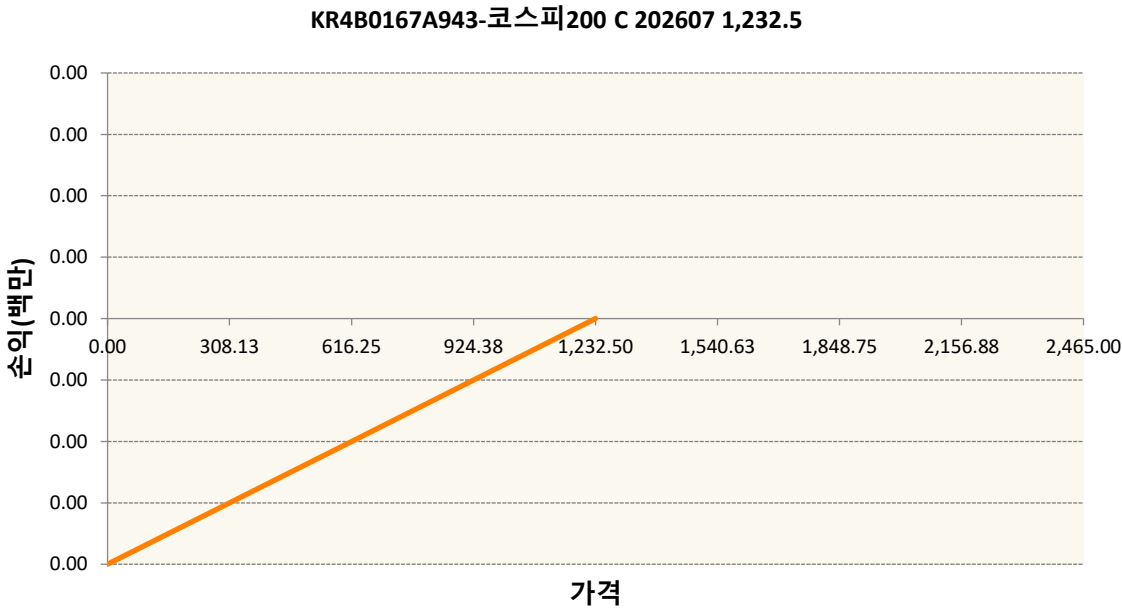
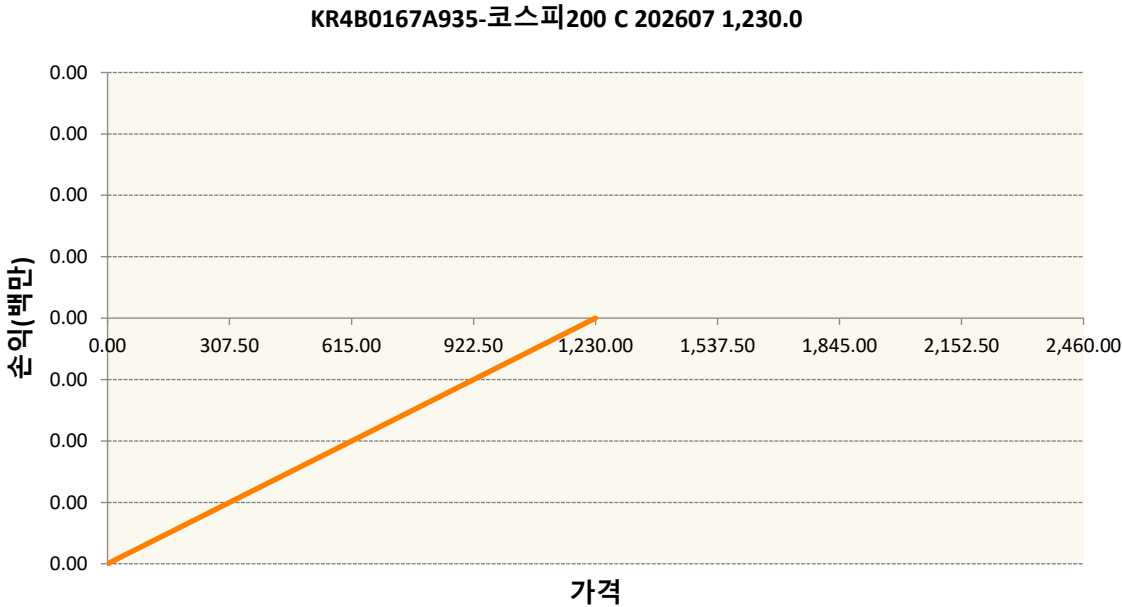
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

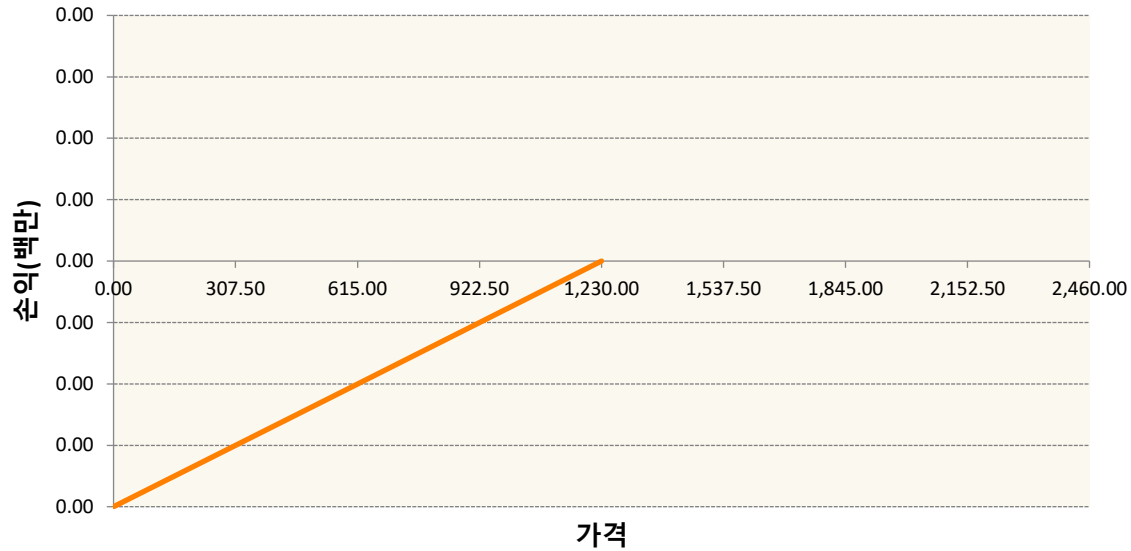
(단위:백만원)

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							329
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-128	-162	-195	-228	-262	-295	-329
-5.33%	-37	-70	-103	-136	-169	-202	-236
-2.67%	32	2	-29	-60	-92	-124	-157
0%	82	56	28	0	-29	-59	-90
2.67%	116	95	72	47	21	-7	-35
5.33%	139	123	104	83	60	36	10
8.00%	154	142	127	110	91	70	47
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5							1,052
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-417	-523	-629	-735	-840	-946	-1,052
-5.33%	-123	-228	-333	-438	-543	-649	-755
-2.67%	100	4	-95	-195	-296	-398	-501
0%	263	179	91	0	-94	-190	-288
2.67%	375	307	232	152	68	-20	-110
5.33%	451	398	336	269	196	118	36
8.00%	499	460	412	356	294	227	154
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0							301
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-118	-148	-179	-209	-240	-271	-301
-5.33%	-34	-64	-94	-125	-155	-186	-216
-2.67%	29	2	-27	-55	-84	-114	-144
0%	75	51	26	0	-27	-55	-83

2.67%	107	87	66	43	19	-6	-32
5.33%	128	113	95	76	55	33	10
8.00%	141	130	117	101	83	64	43

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

(단위:백만원)

1,971

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

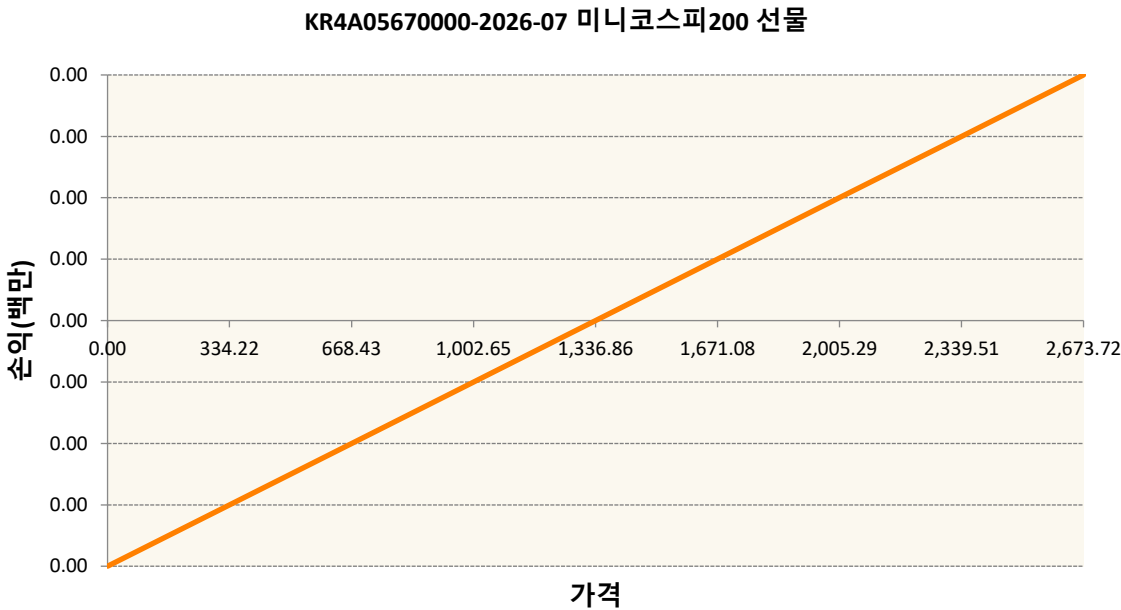
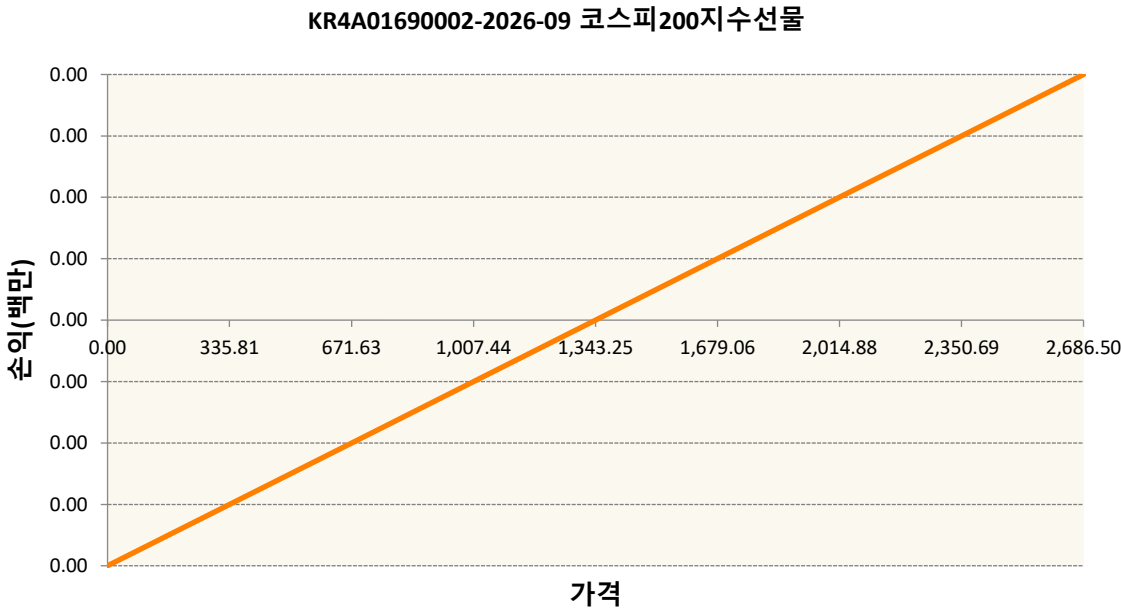
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

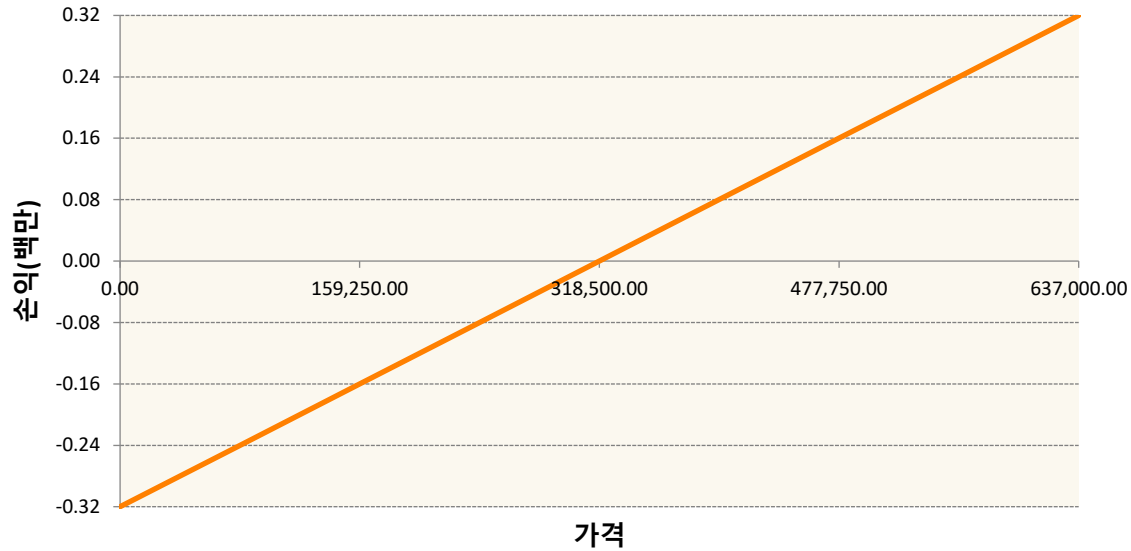
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	67	335	-267	장내
누계	유가증권	선물	6,088	0	6,088	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80
KR4A05670000		2026-07 미니코스피200 선물					80
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-80	-80	-80	-80	-80	-80	-80
-5.33%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-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%	53	53	53	53	53	53	53
8.00%	80	80	80	80	80	80	80
KR4A11680001		2026-08 삼성전자개별선물					5
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5	-5	-5	-5	-5	-5	-5
-5.33%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
-2.67%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	2	2	2	2	2	2	2
5.33%	4	4	4	4	4	4	4
8.00%	5	5	5	5	5	5	5

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

(단위:백만원)

443

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

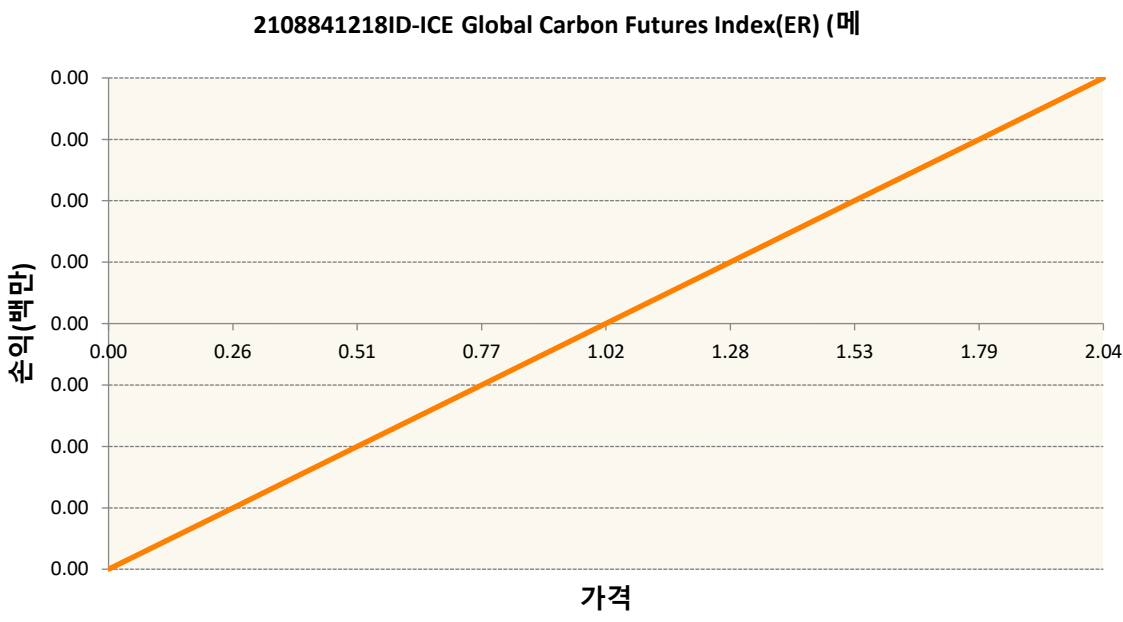
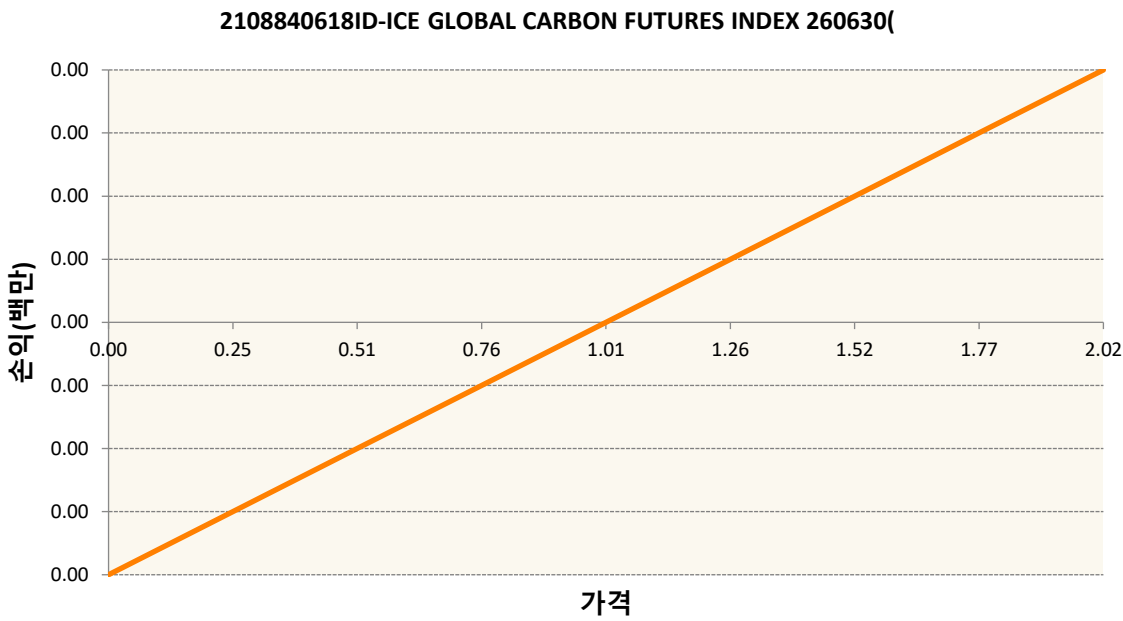
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,682	0	7,682	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		489
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		124

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	694

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

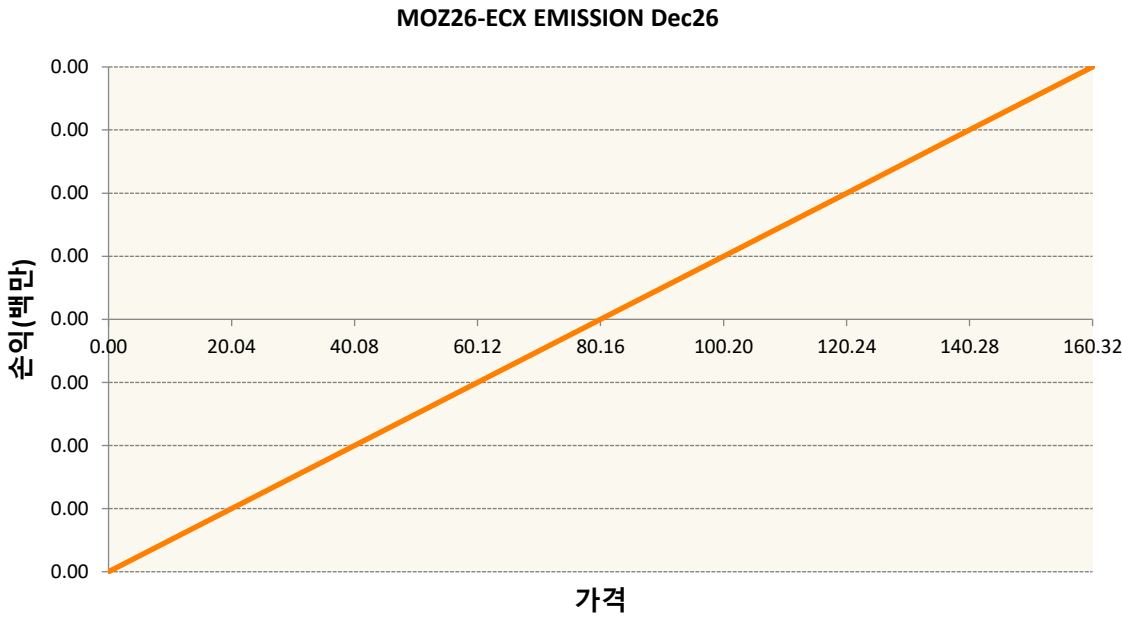
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,173	0	5,173	
누계	통화	선도	0	2,784	-2,784	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G6S(KRW/EUR 31-07-26E	223
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	414

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

(단위:백만원)

702

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

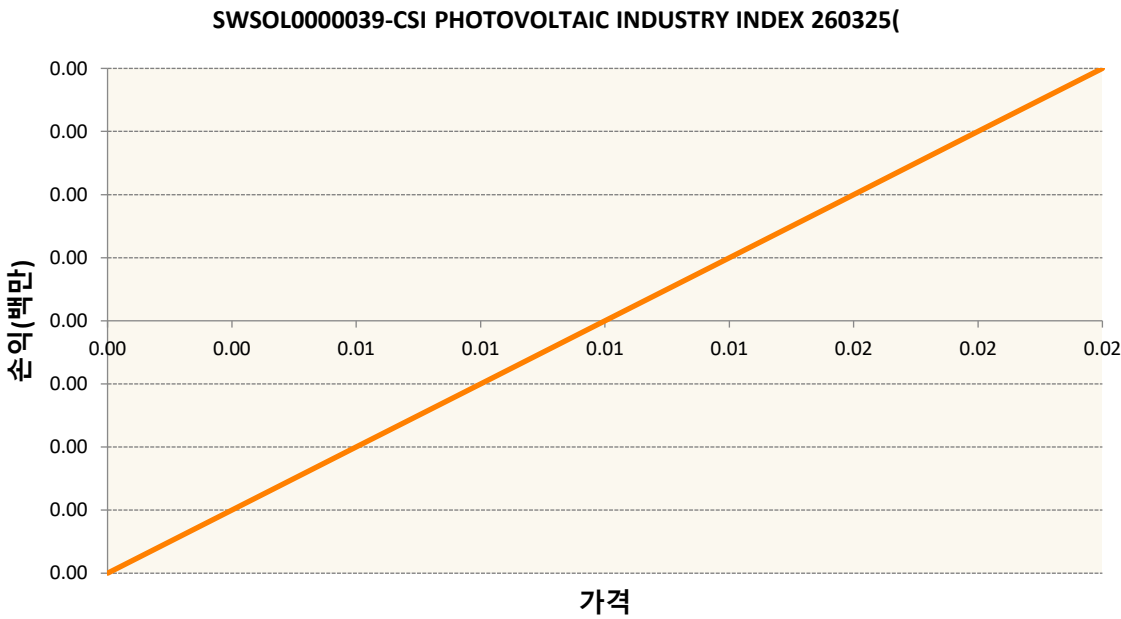
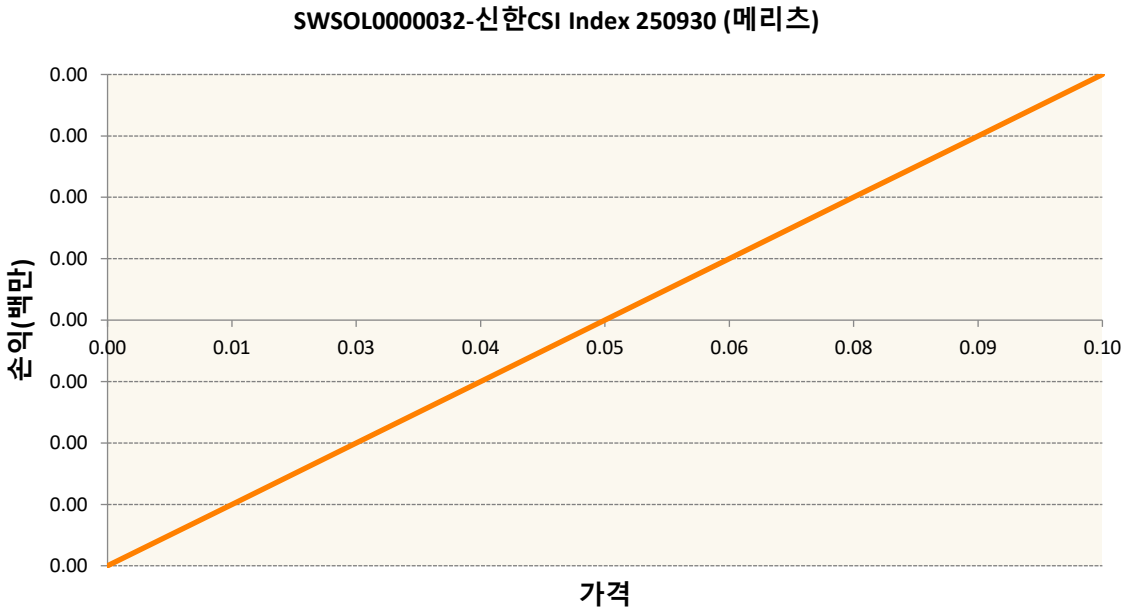
신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

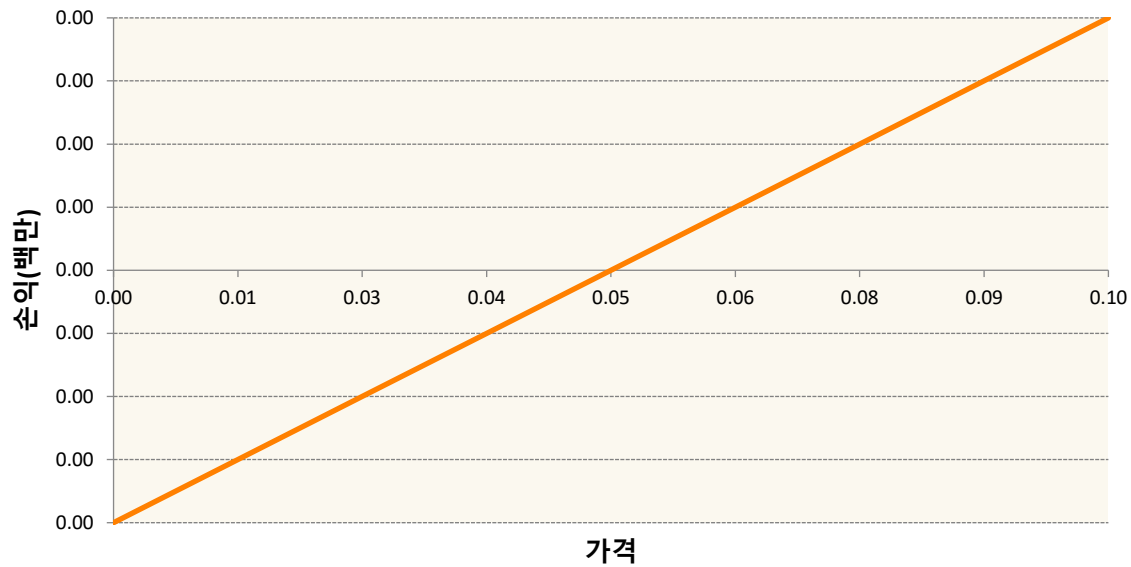
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	318	0	318	장외

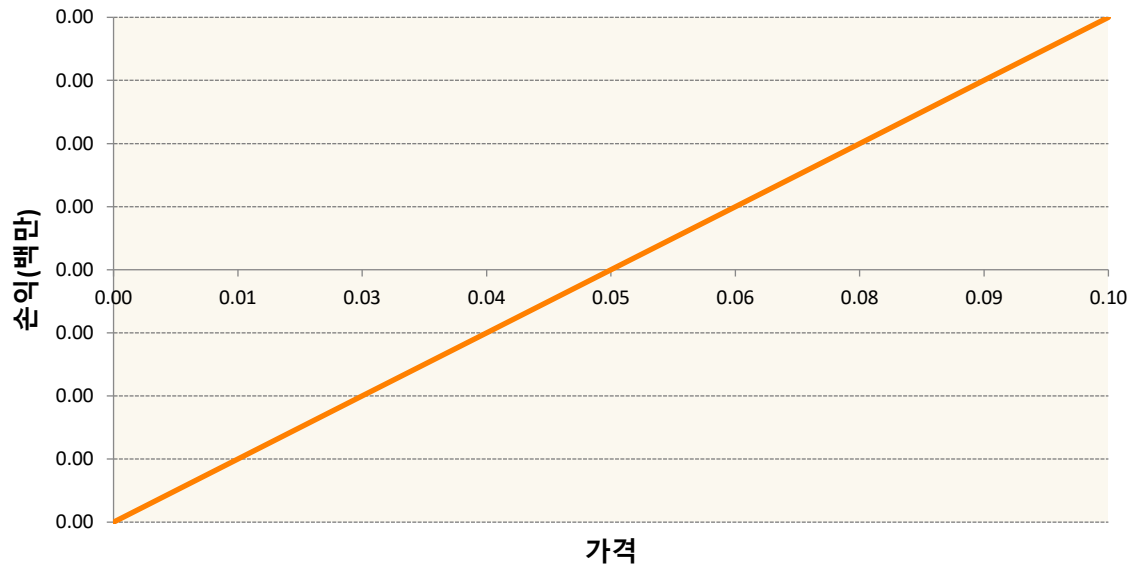
2. 만기시점의 손익구조



SWSOL0000040-CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N)



SWSOL0000041-CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	12
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	1
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	5
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	7

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

(단위:백만원)

37

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

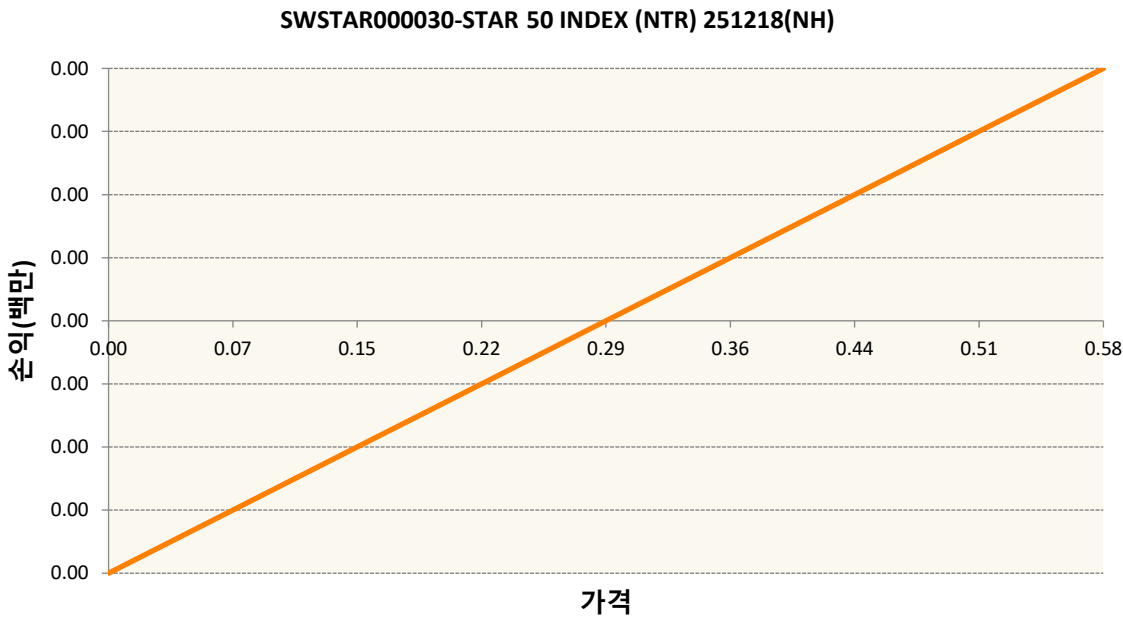
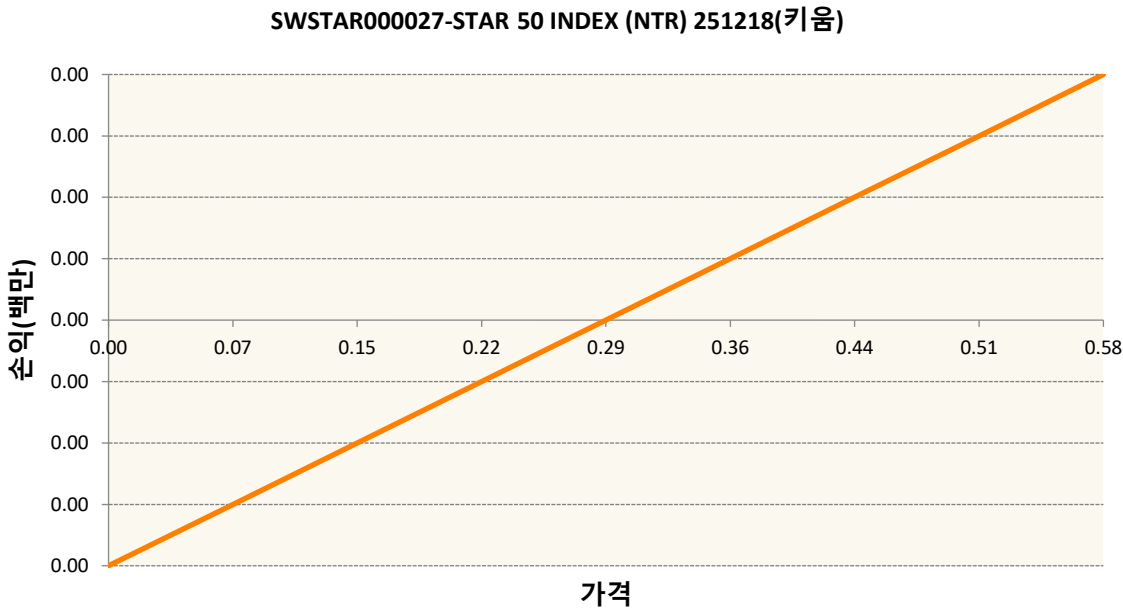
SOL차이나육성산업액티브상장지

1. 계약금액

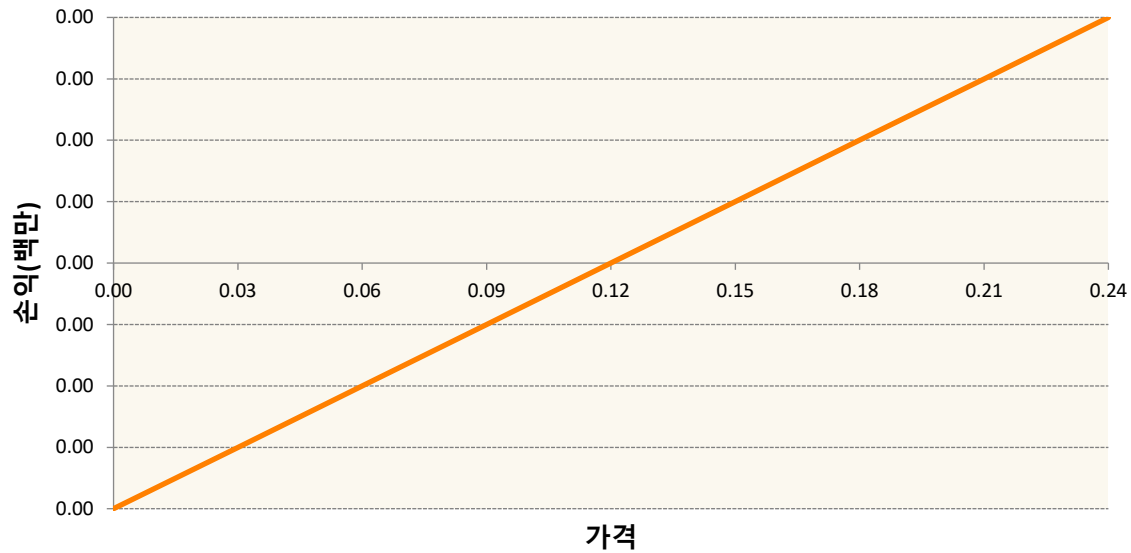
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	3,132	0	3,132	장외

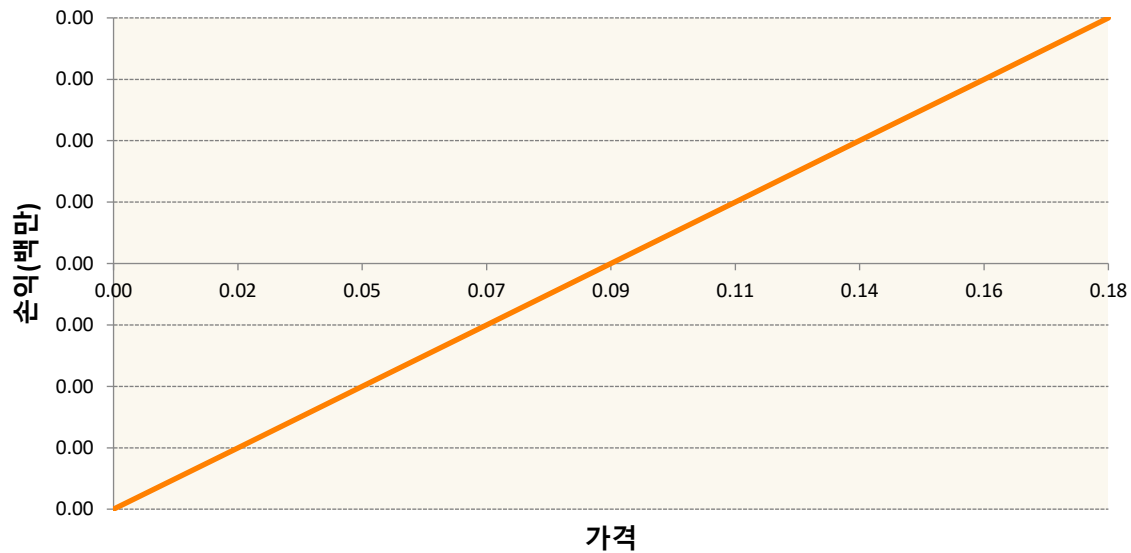
2. 만기시점의 손익구조



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)	28
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	95
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260626(메리츠)	62
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260630(미래)	67

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

(단위:백만원)

414

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

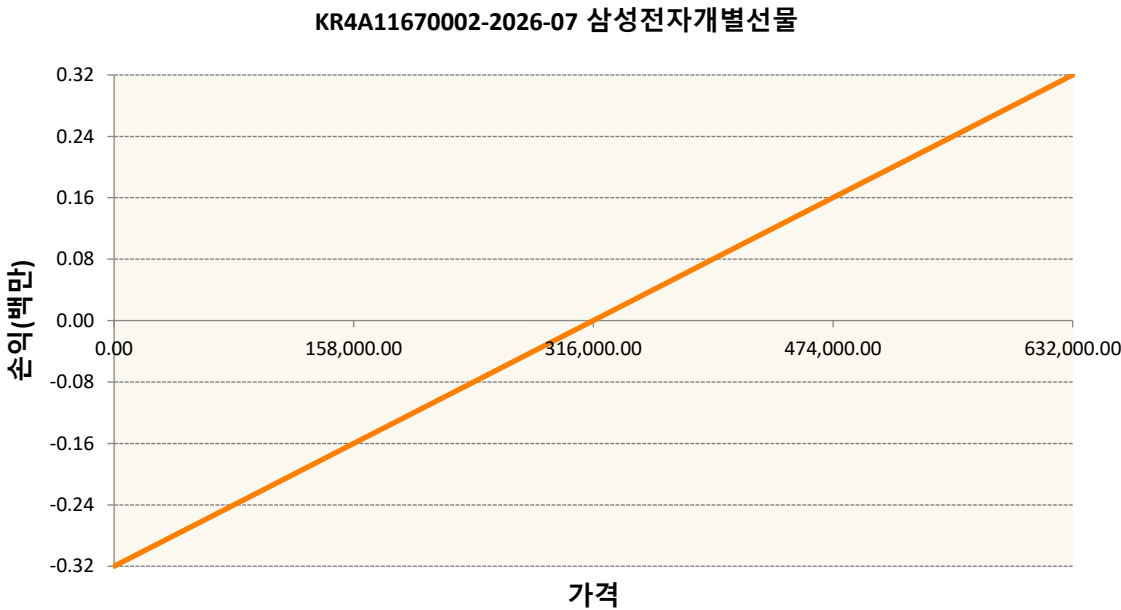
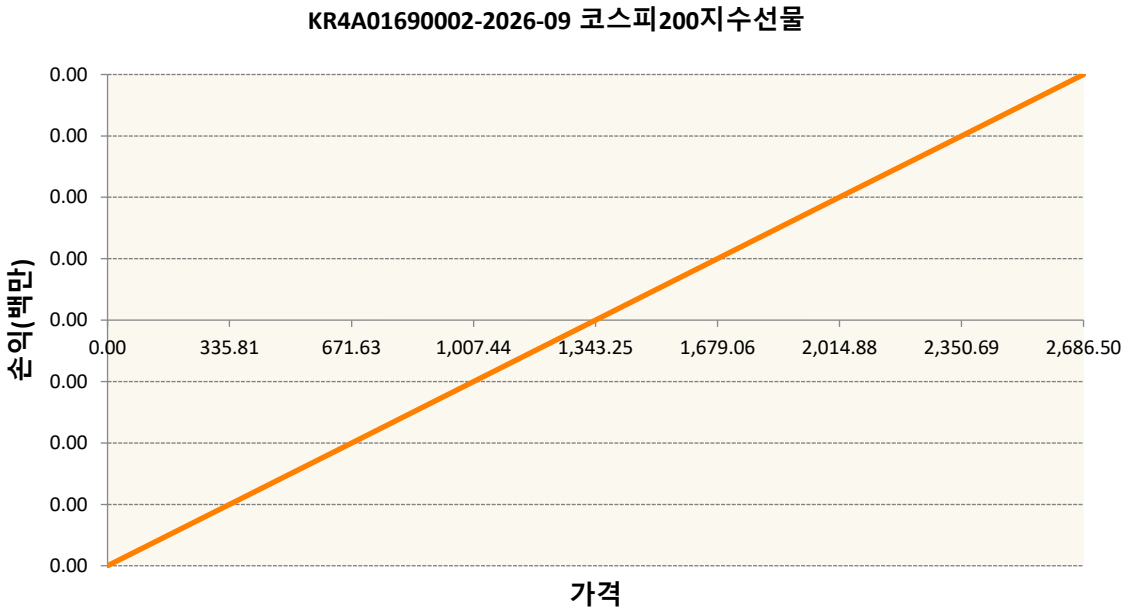
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

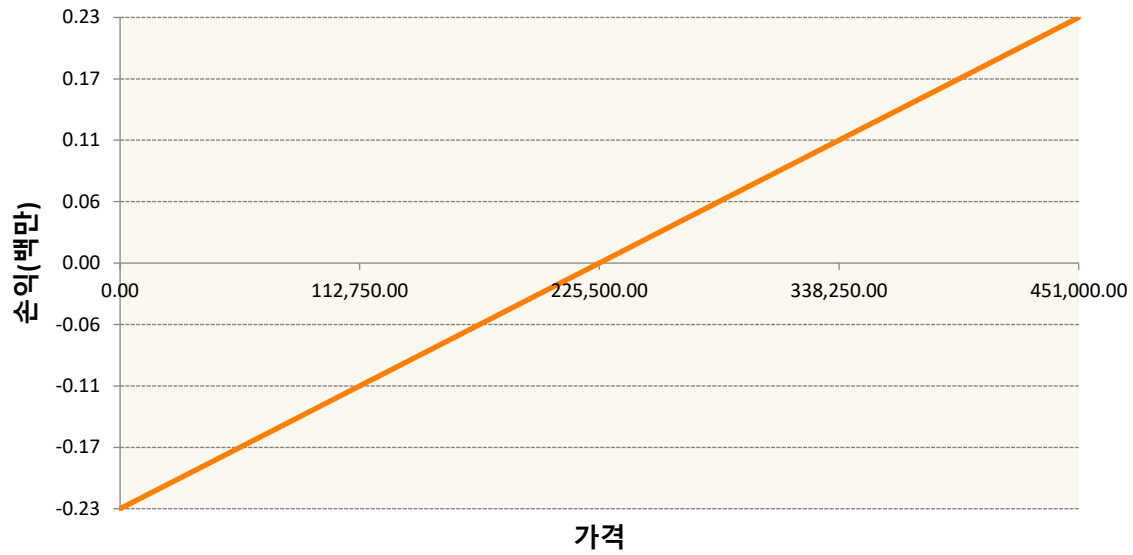
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	969	0	969	장내
누계	유가증권	선물	24,742	3,819	20,923	장내

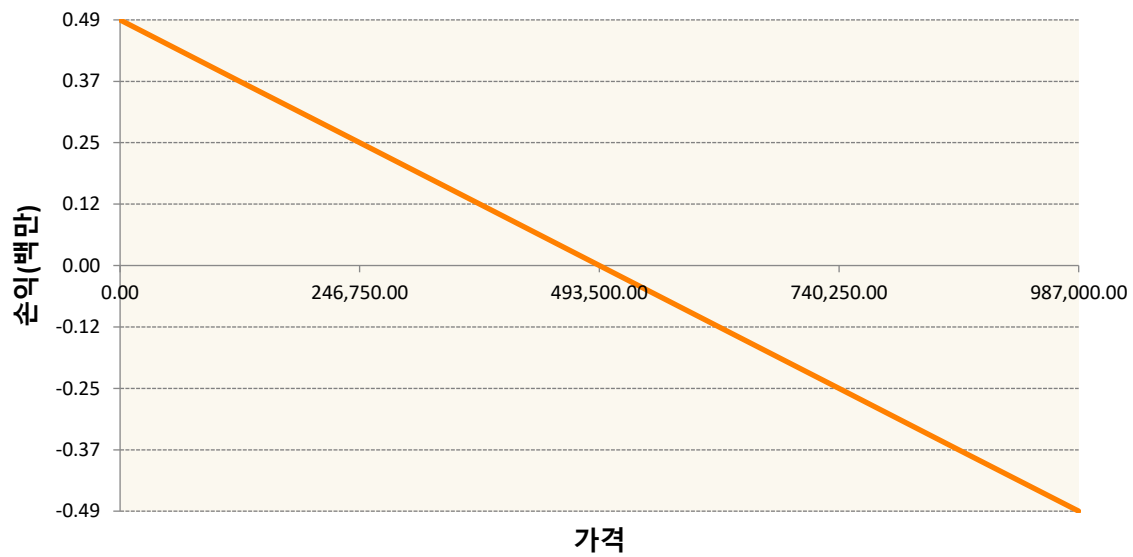
2. 만기시점의 손익구조



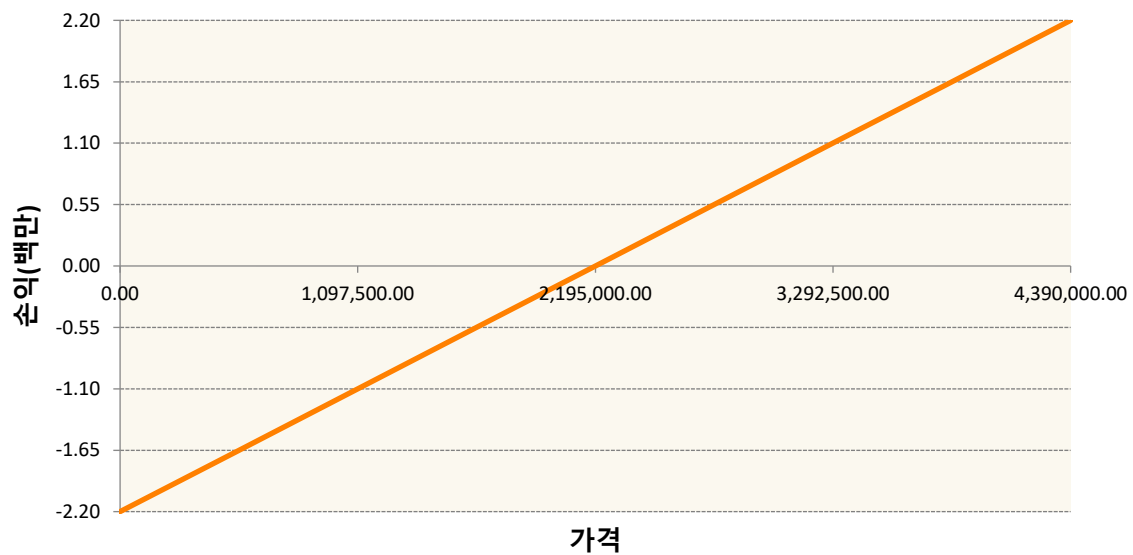
KR4A1V670008-2026-07 HD현대마린솔루션개별선물



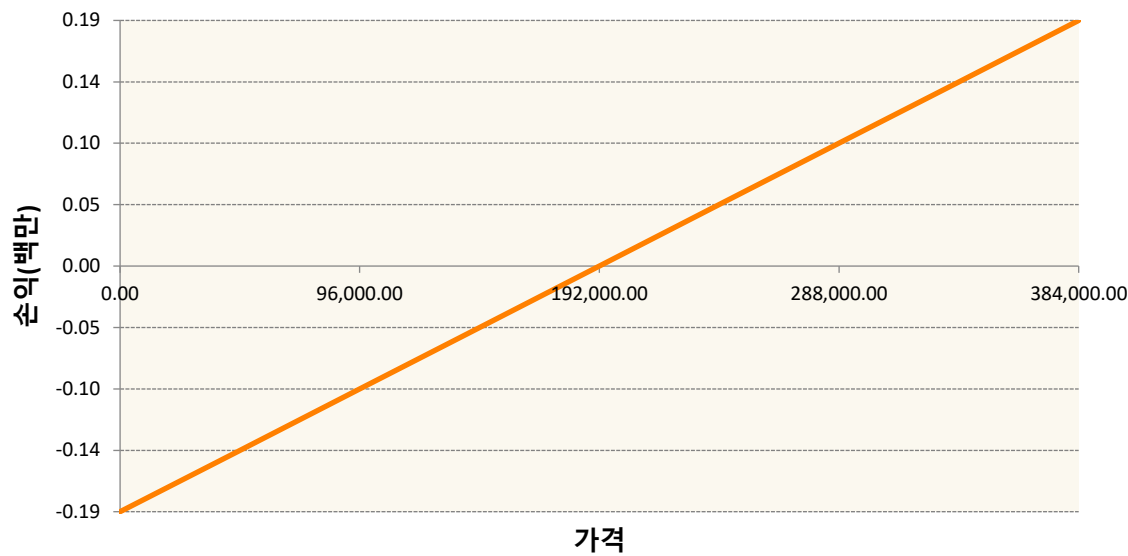
KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



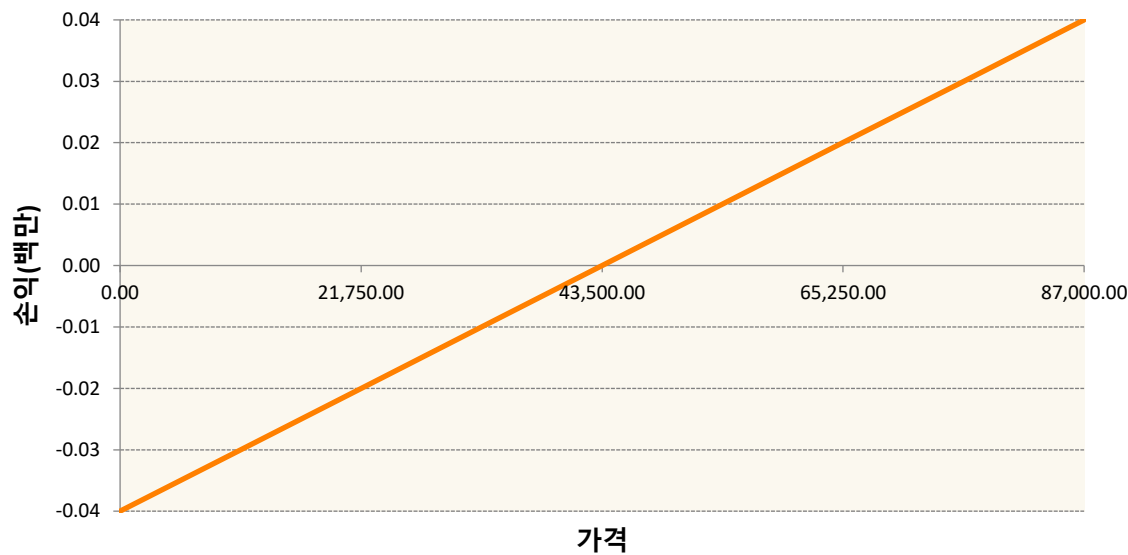
KR4A23670008-2026-07 삼성전기개별선물



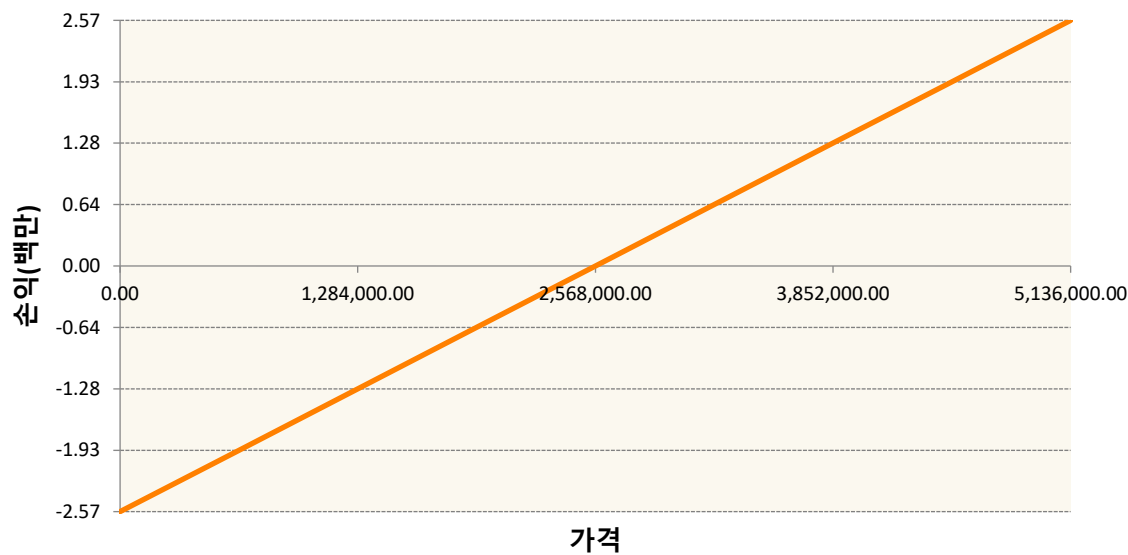
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



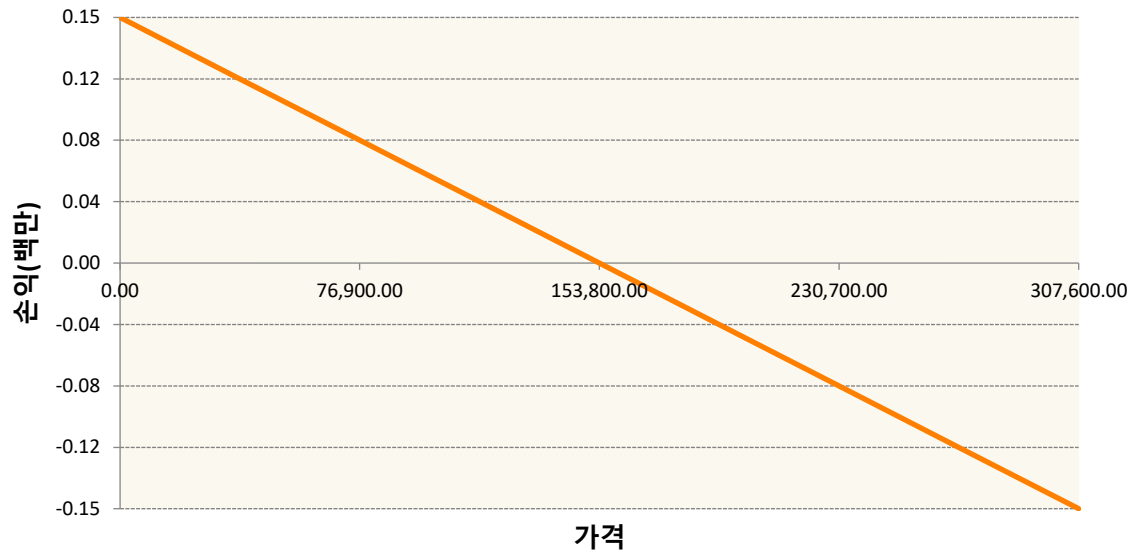
KR4A48670009-2026-07 미래에셋증권개별선물



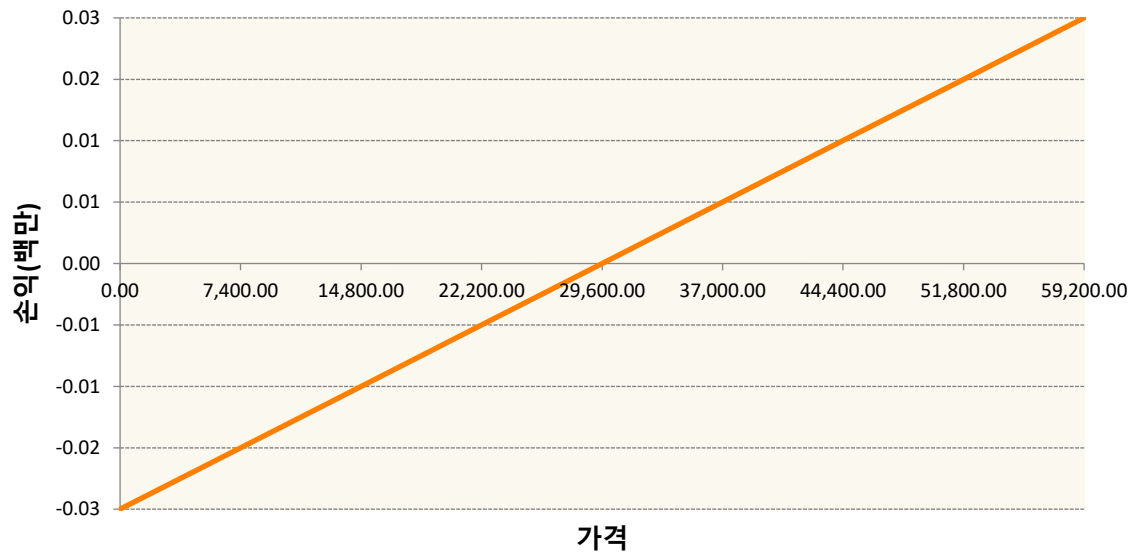
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



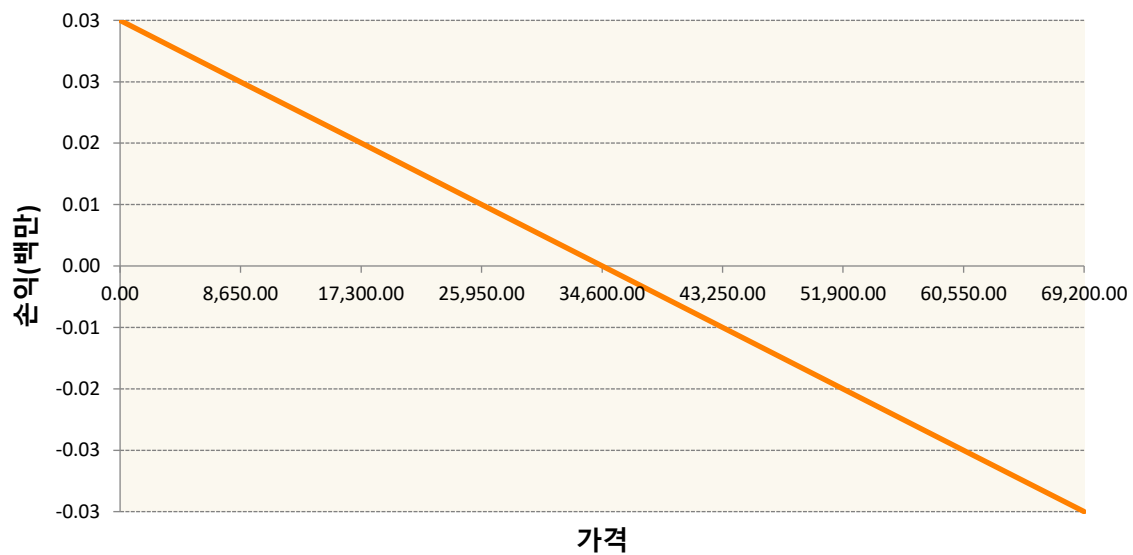
KR4ABM670006-2026-07 한국항공우주개별선물



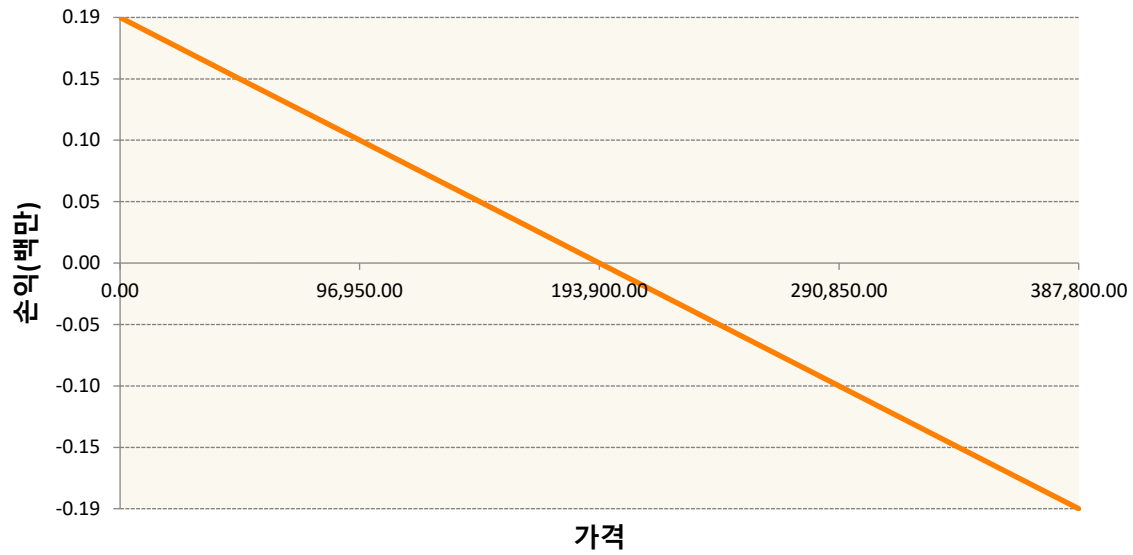
KR4ABZ670001-2026-07 NH투자증권개별선물



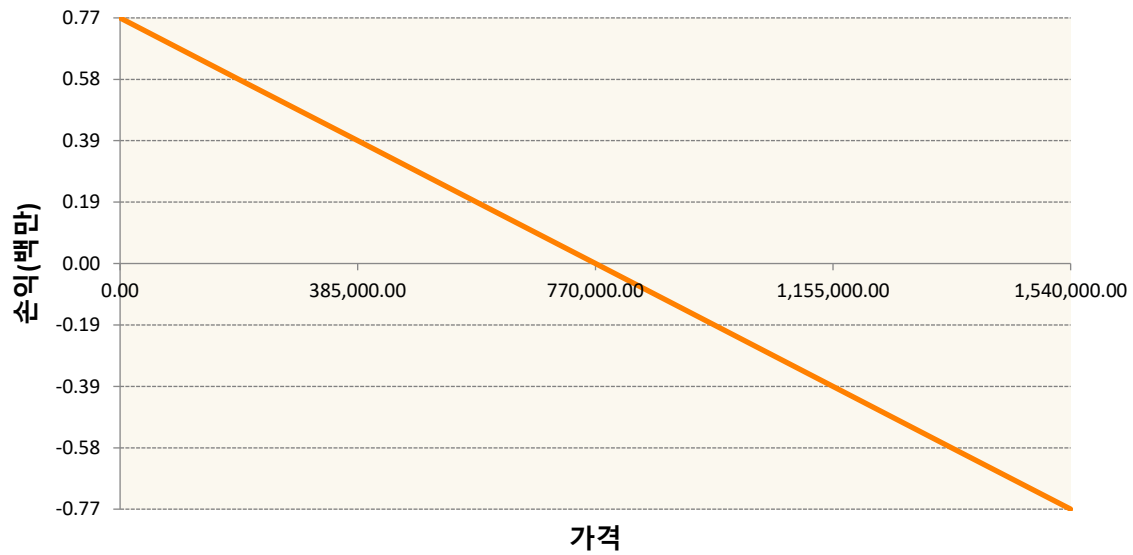
KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



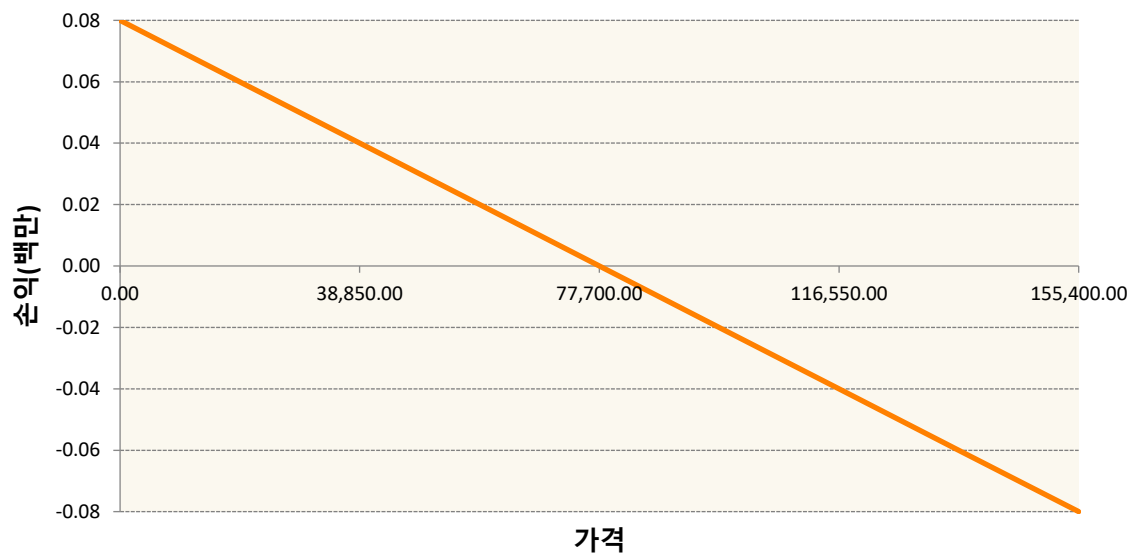
KR4AD8670001-2026-07 현대백화점개별선물



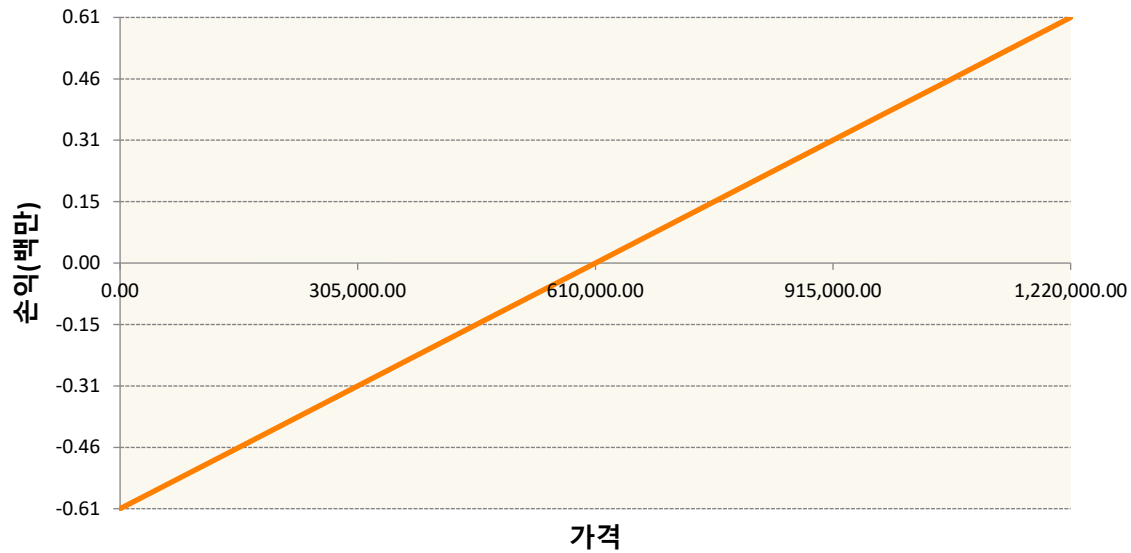
KR4ADD670005-2026-07 신세계개별선물



KR4AEV670002-2026-07 한화시스템개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물						1,389
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389	-1,389
-5.33%		-926	-926	-926	-926	-926	-926	-926
-2.67%		-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
0%		0	0	0	0	0	0	0
2.67%		463	463	463	463	463	463	463
5.33%		926	926	926	926	926	926	926
8.00%		1,389	1,389	1,389	1,389	1,389	1,389	1,389
KR4A11670002		2026-07 삼성전자개별선물						372
		기초자산의 변동성						
가격		-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%		-372	-372	-372	-372	-372	-372	-372
-5.33%		-248	-248	-248	-248	-248	-248	-248
-2.67%		-124	-124	-124	-124	-124	-124	-124
0%		0	0	0	0	0	0	0
2.67%		124	124	124	124	124	124	124
5.33%		248	248	248	248	248	248	248
8.00%		372	372	372	372	372	372	372
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	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

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	15
--------------	------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
-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%	15	15	15	15	15	15	15

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	117
--------------	--------------------	-----

	기초자산의 변동성
--	-----------

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-117	-117	-117	-117	-117	-117	-117
-5.33%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	78	78	78	78	78	78	78
8.00%	117	117	117	117	117	117	117

KR4ABM670006

2026-07 한국항공우주개별선물

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

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

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

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							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
KR4AEV670002 2026-07 한화시스템개별선물							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
KR4AFD670003 2026-07 HD현대중공업개별선물							21
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-21	-21	-21	-21	-21	-21	-21
-5.33%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
-2.67%	-7	-7	-7	-7	-7	-7	-7
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	7	7	7	7	7	7	7
5.33%	14	14	14	14	14	14	14
8.00%	21	21	21	21	21	21	21

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

(단위:백만원)

5,924

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

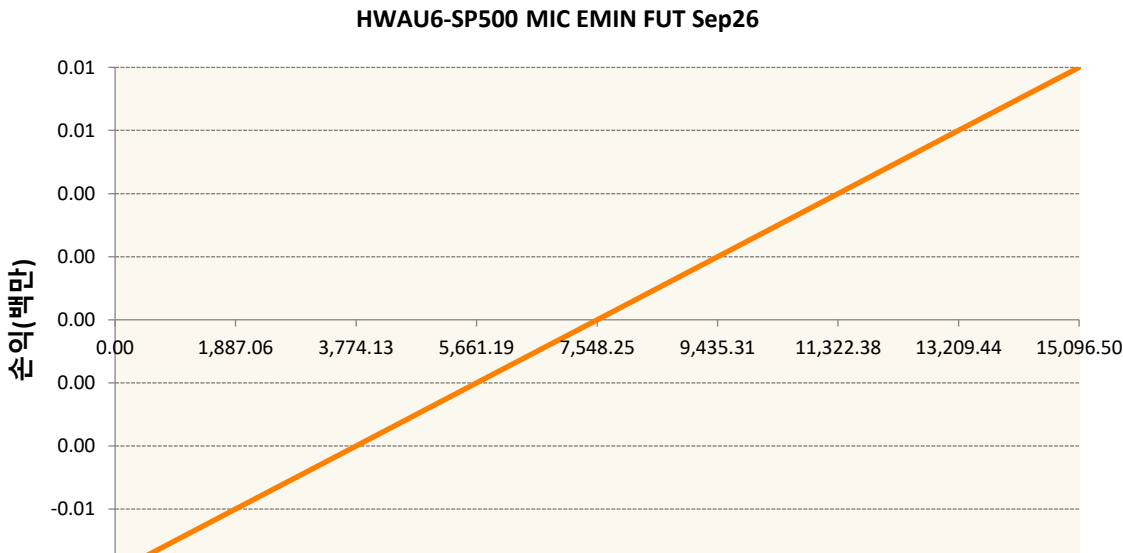
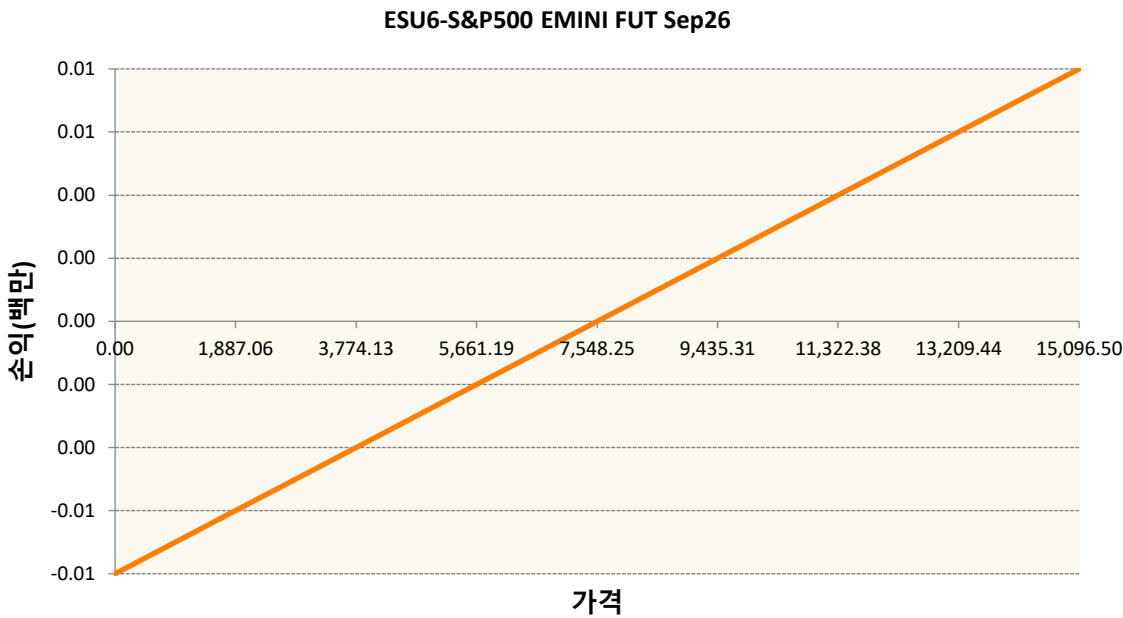
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

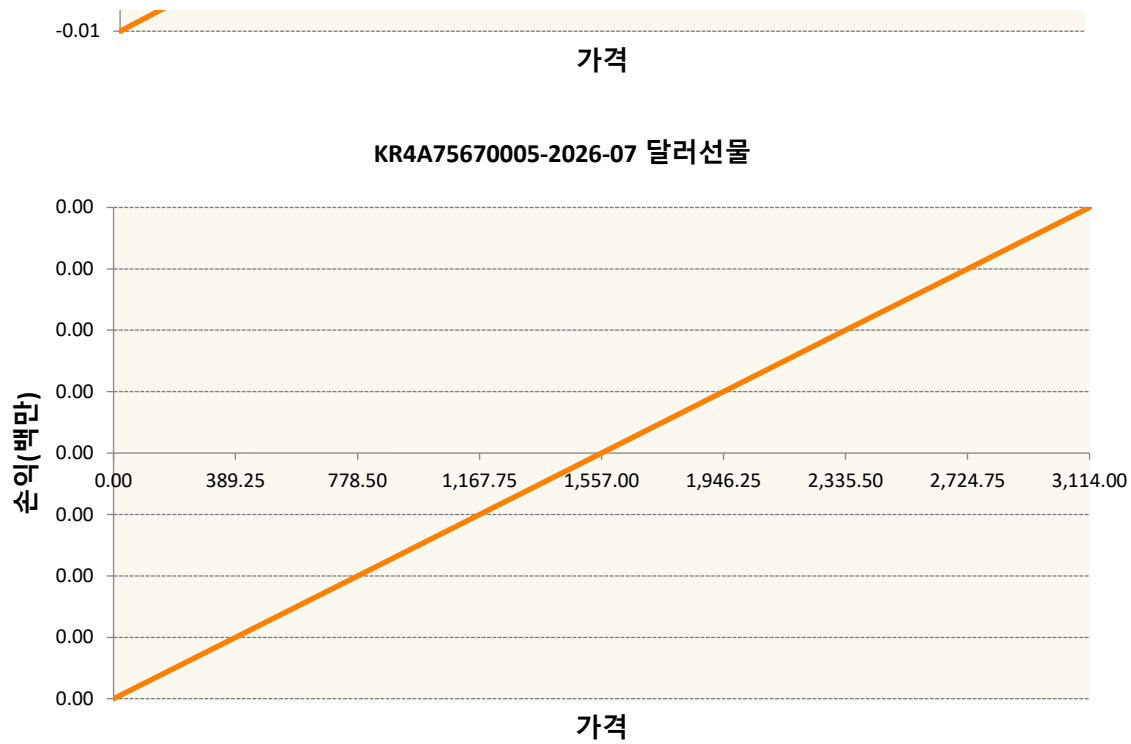
1. 계약금액

(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	62,178	0	62,178	
누계	지수	선물	114	0	114	장내
누계	통화	선물	11,055	0	11,055	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	4,974
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	9
KR4A756700	2026-07 달러선물	884

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

(단위:백만원)

4,308

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

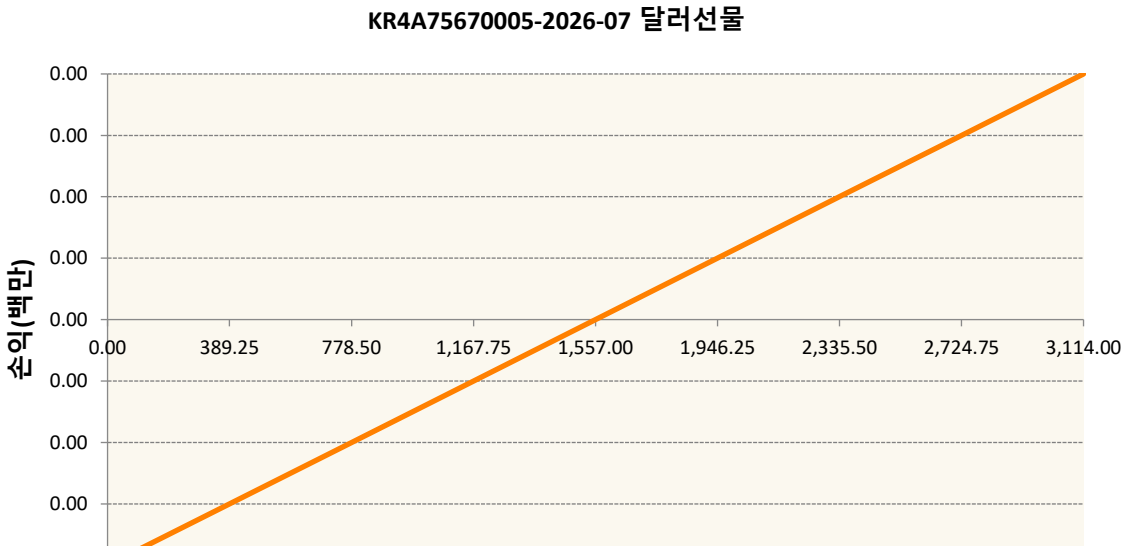
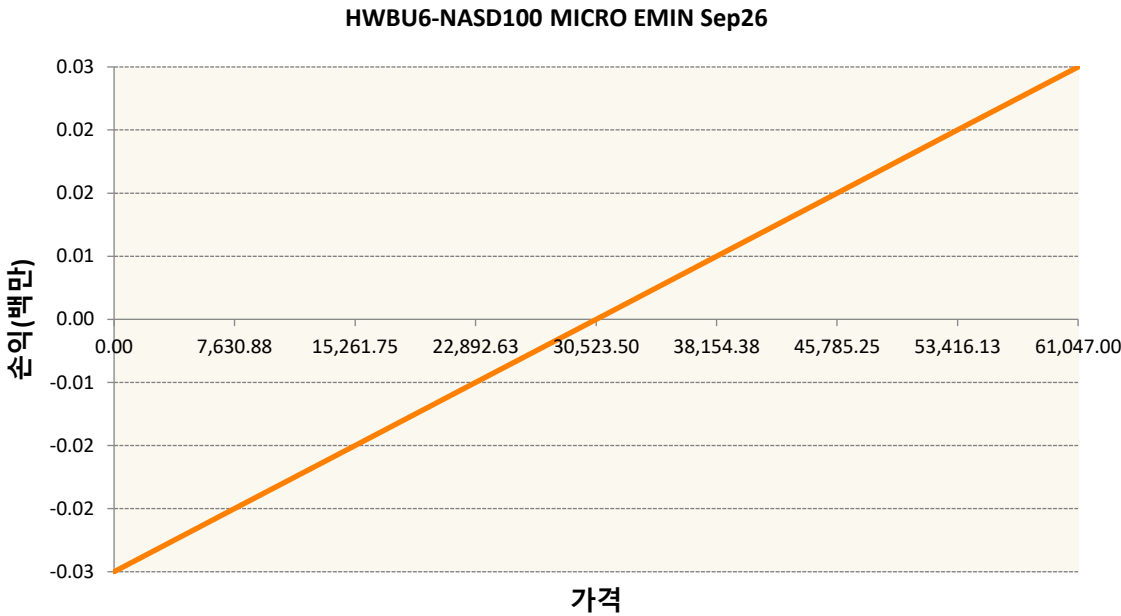
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

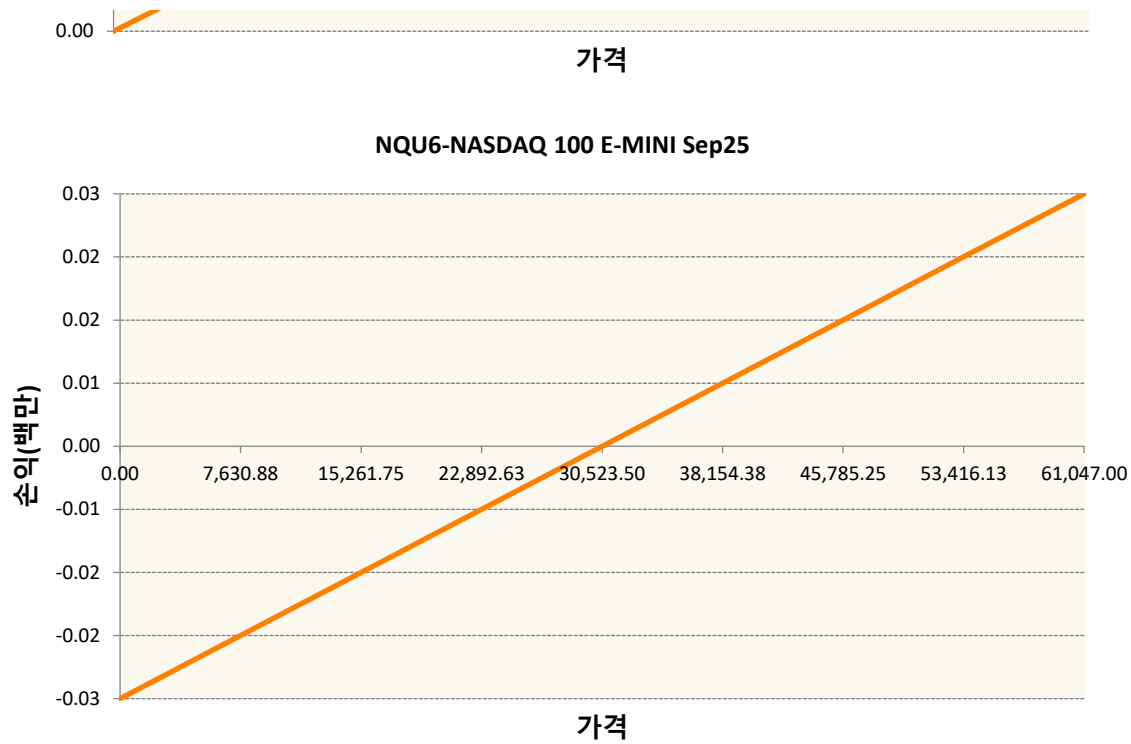
1. 계약금액

(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	188	0	188	장내
누계	지수	선물	31,374	0	31,374	
누계	통화	선물	4,064	0	4,064	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBU6 NASD100 MICRO EMIN Sep26

15

KR4A756700 2026-07 달러선물

325

NQU6 NASDAQ 100 E-MINI Sep25

2,510

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

(단위:백만원)

2,853

공시일	2026-07-02
기준일	2026-07-01

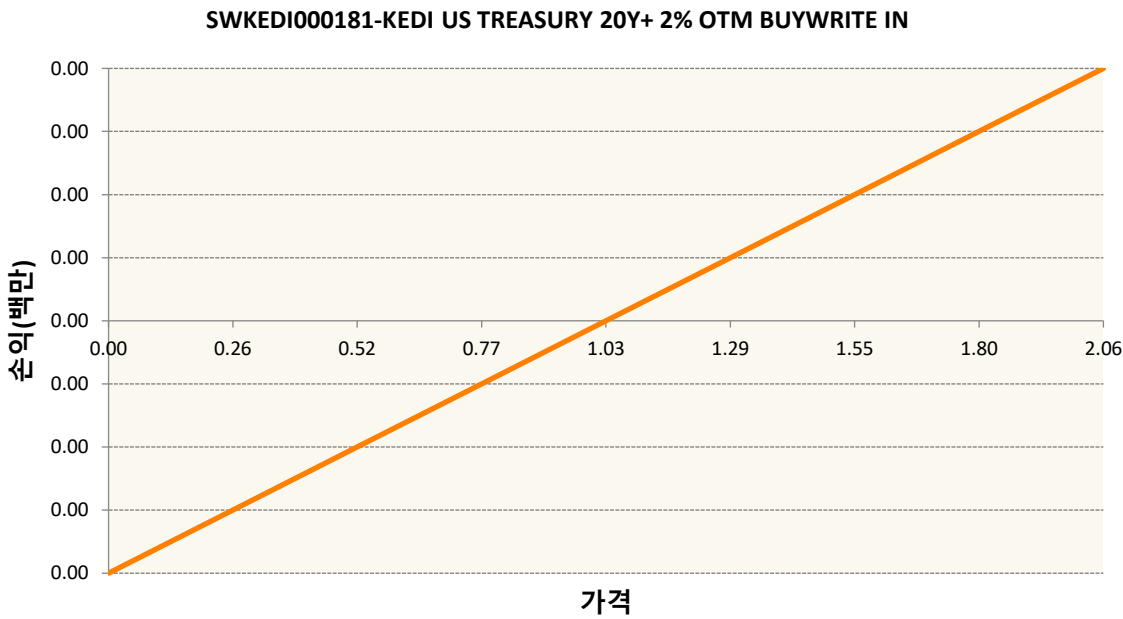
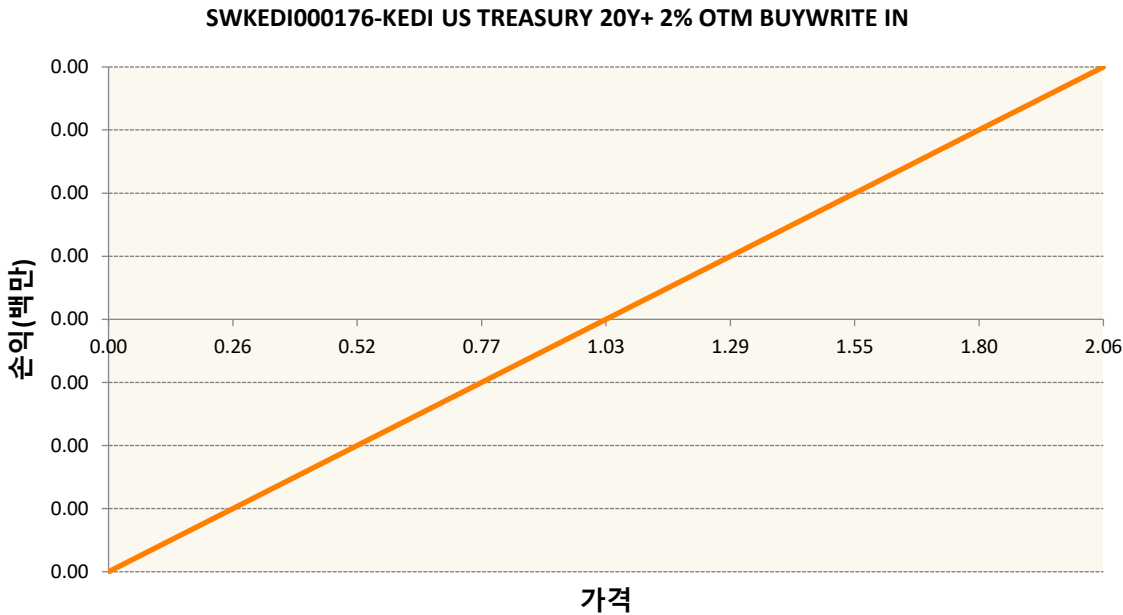
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

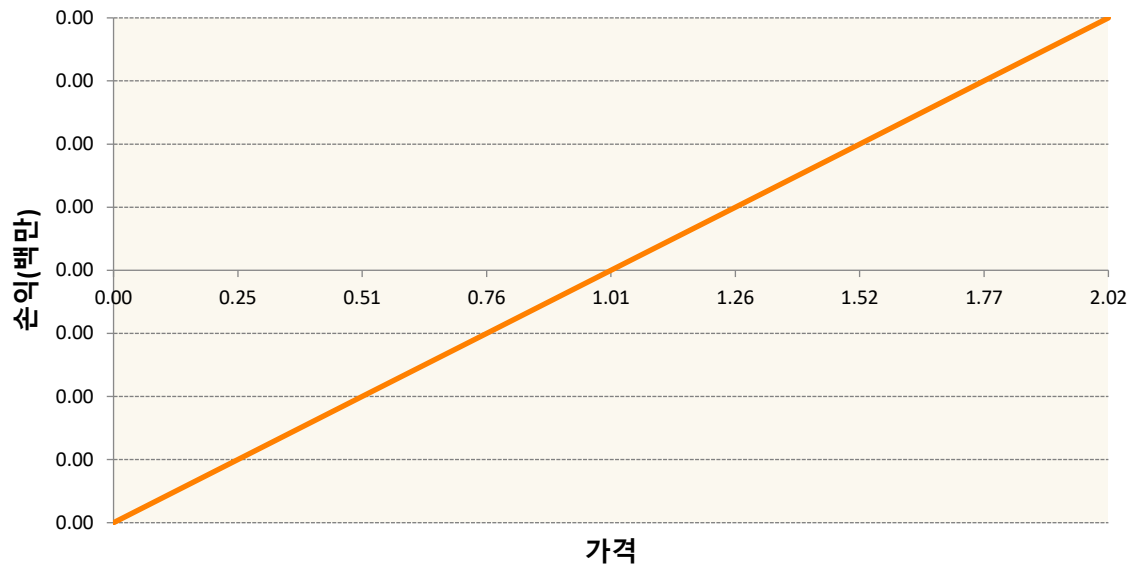
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	329,766	0	329,766	장외

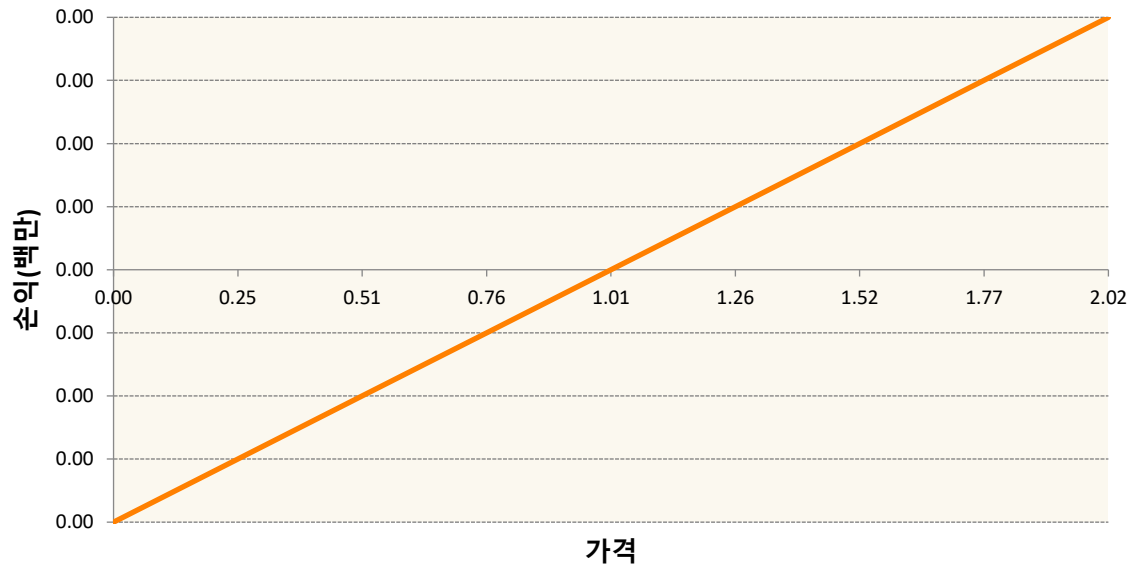
2. 만기시점의 손익구조



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	8,423
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,306
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,603
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,067

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

(단위:백만원)

11,187