

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

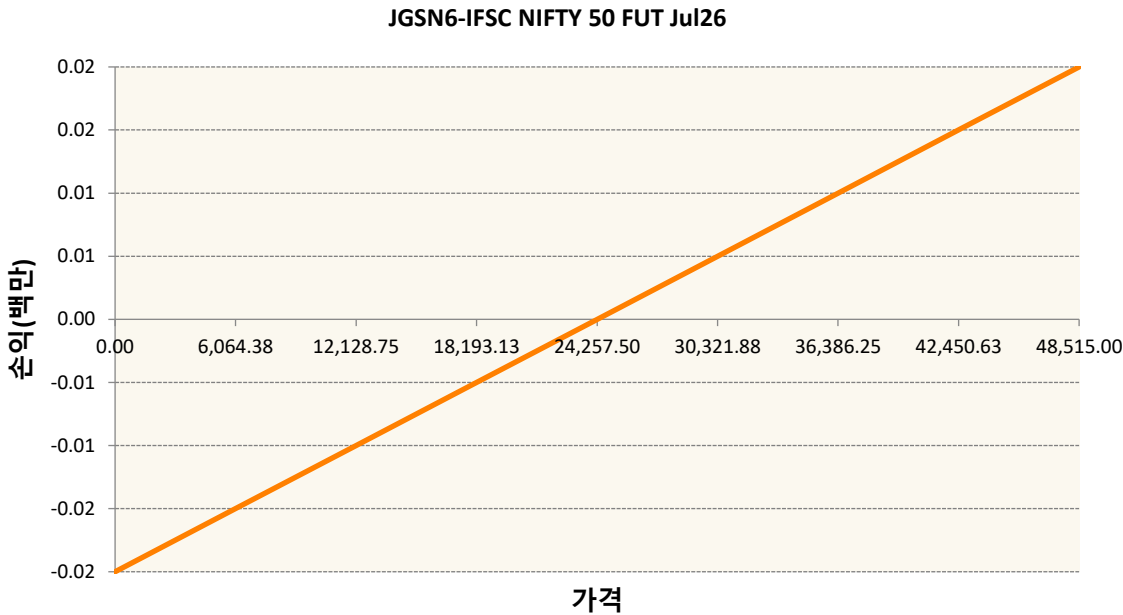
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	374	0	374	

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	2026-07-06
기준일	2026-07-03

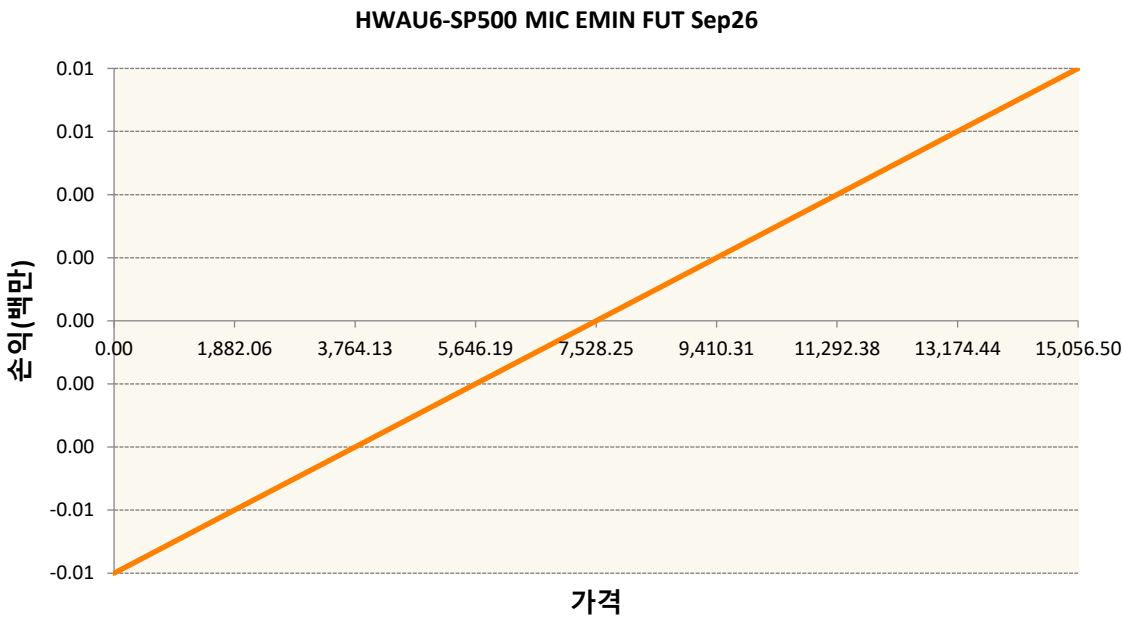
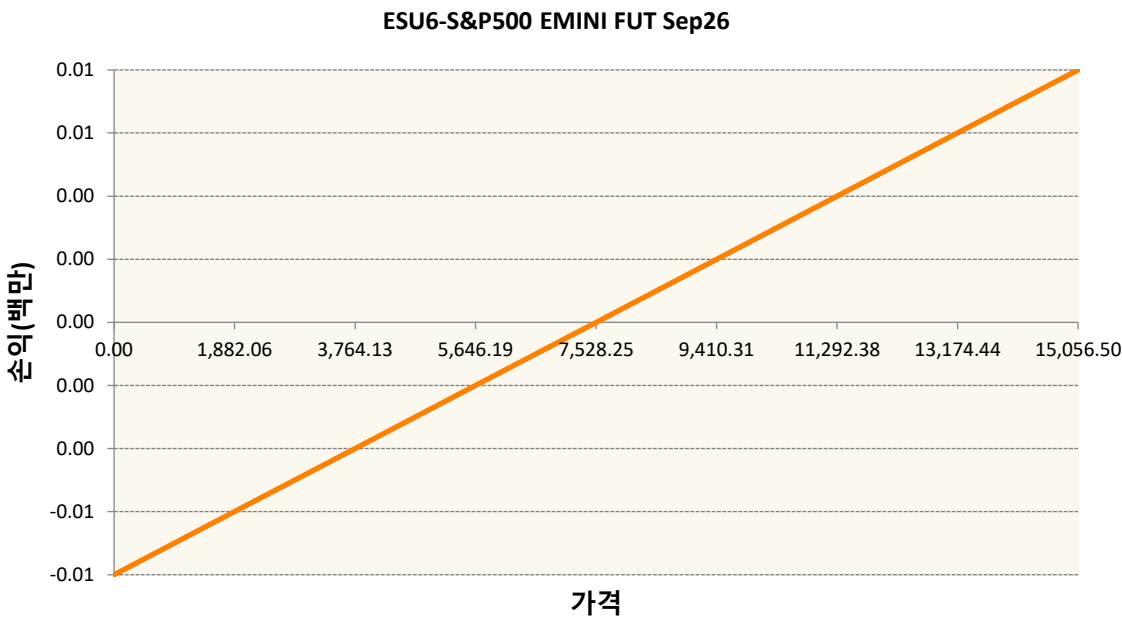
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	575	0	575	
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	2026-07-06
기준일	2026-07-03

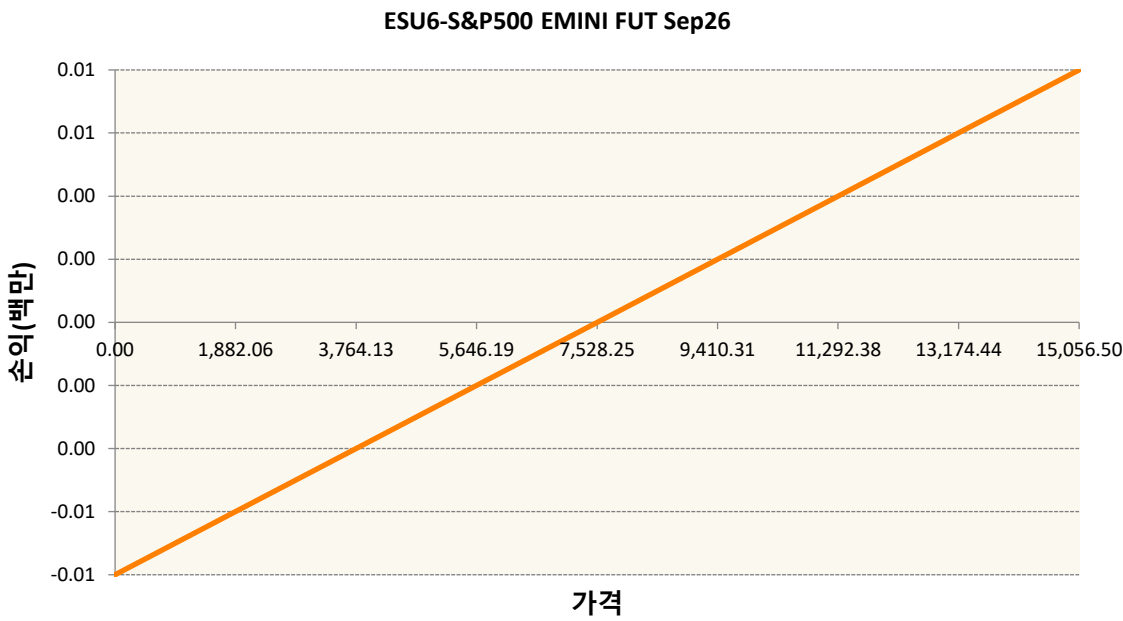
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	1,138	0	1,138	

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	2026-07-06
기준일	2026-07-03

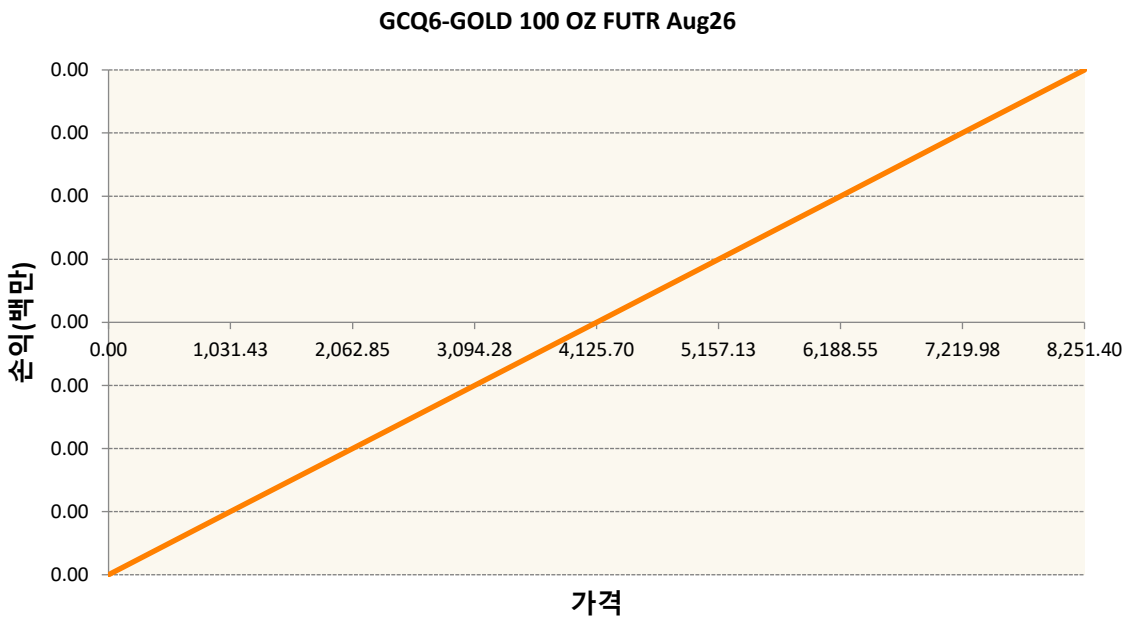
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,947	0	4,947	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDSCC0 GLD US 07/10/26 C375 EQUITY	11
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	396

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

(단위:백만원)

528

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

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)

AOPLTRUSC' PLTR US 07/10/26 C130 EQUITY	124
AOPLTRUSP1 PLTR US 07/10/26 P130 EQUITY	14

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

(단위:백만원)

424

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

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)

AOTLTUCC0(TLT US 07/10/26 C86 EQUITY

2

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

(단위:백만원)

1

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

(단위:백만원)

17,024

공시일 2026-07-06

기준일 2026-07-03

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	2026-07-06
기준일	2026-07-03

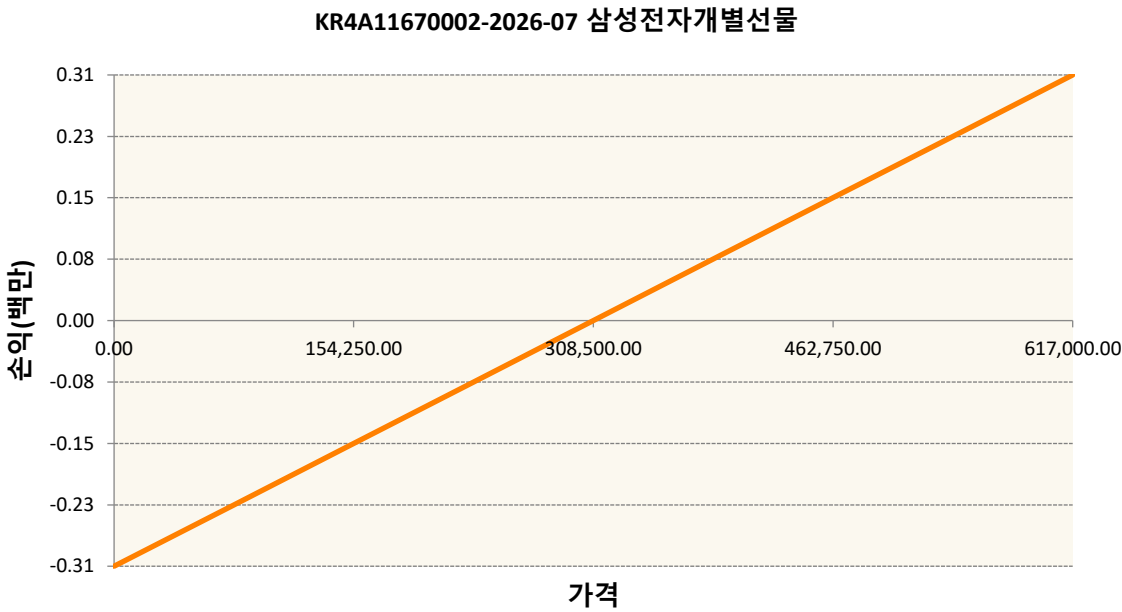
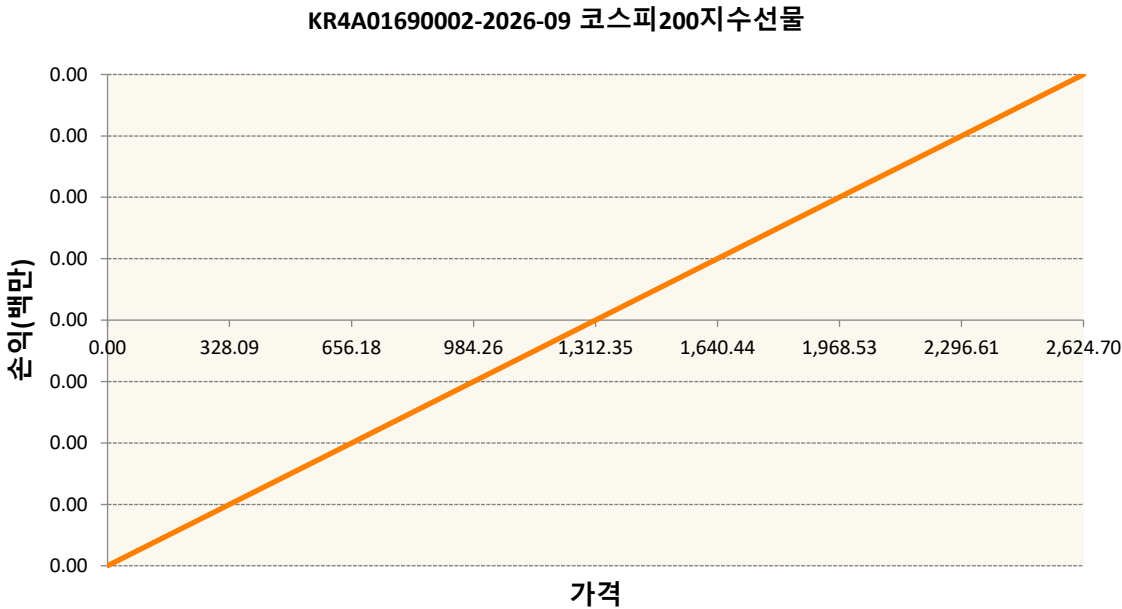
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	25,189	35,699	-10,509	장내

2. 만기시점의 손익구조



The graph illustrates a linear relationship between price and profit/loss. The x-axis represents price, ranging from 0.00 to 2,460.00. The y-axis represents profit/loss in millions, ranging from -1,000.00 to 1,000.00. The blue line starts at a profit of 1,000 million when the price is 0 and decreases linearly, crossing the x-axis at a price of 1,230.00, and reaching a loss of 1,000 million at a price of 2,460.00.

가격	손익(백만)
0.00	1,000.00
307.50	666.67
615.00	333.33
922.50	0.00
1,230.00	-333.33
1,537.50	-666.67
1,845.00	-1,000.00
2,152.50	-1,333.33
2,460.00	-1,666.67

The graph illustrates a linear relationship between the price (가액) and the profit/loss (손익) in millions. The x-axis represents the price, ranging from 0.00 to 2,465.00 with major ticks every 308.13 units. The y-axis represents the profit/loss, ranging from 0.00 to 0.00 with major ticks every 0.00 units. A solid blue line starts at the origin (0, 0) and ends at (2,465, 0), indicating a constant rate of change.

가액	손익 (백만)
0.00	0.00
308.13	0.00
616.25	0.00
924.38	0.00
1,232.50	0.00
1,540.63	0.00
1,848.75	0.00
2,156.88	0.00
2,465.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				676
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-676	-676	-676	-676	-676	-676	-676	
-5.33%	-450	-450	-450	-450	-450	-450	-450	
-2.67%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	225	225	225	225	225	225	225	
5.33%	450	450	450	450	450	450	450	
8.00%	676	676	676	676	676	676	676	
KR4A11670002				2026-07 삼성전자개별선물				1,337
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337
-5.33%	-891	-891	-891	-891	-891	-891	-891
-2.67%	-446	-446	-446	-446	-446	-446	-446
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	446	446	446	446	446	446	446
5.33%	891	891	891	891	891	891	891
8.00%	1,337	1,337	1,337	1,337	1,337	1,337	1,337
KR4BAFBLA938 코스피위클리M C 2607W1 1,230.0							1,819

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,819	1,819	1,819	1,819	1,819	1,819	1,819
-5.33%	1,213	1,213	1,213	1,213	1,213	1,213	1,213
-2.67%	606	606	606	606	606	606	606
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-606	-606	-606	-606	-606	-606	-606
5.33%	-1,213	-1,213	-1,213	-1,213	-1,213	-1,213	-1,213
8.00%	-1,819	-1,819	-1,819	-1,819	-1,819	-1,819	-1,819
KR4BAFBLA946 코스피위클리M C 2607W1 1,232.5							1,195

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195	1,195
-5.33%	797	797	797	797	797	797	797
-2.67%	398	398	398	398	398	398	398
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-398	-398	-398	-398	-398	-398	-398
5.33%	-797	-797	-797	-797	-797	-797	-797
8.00%	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195	-1,195

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

(단위:백만원)

14,485

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

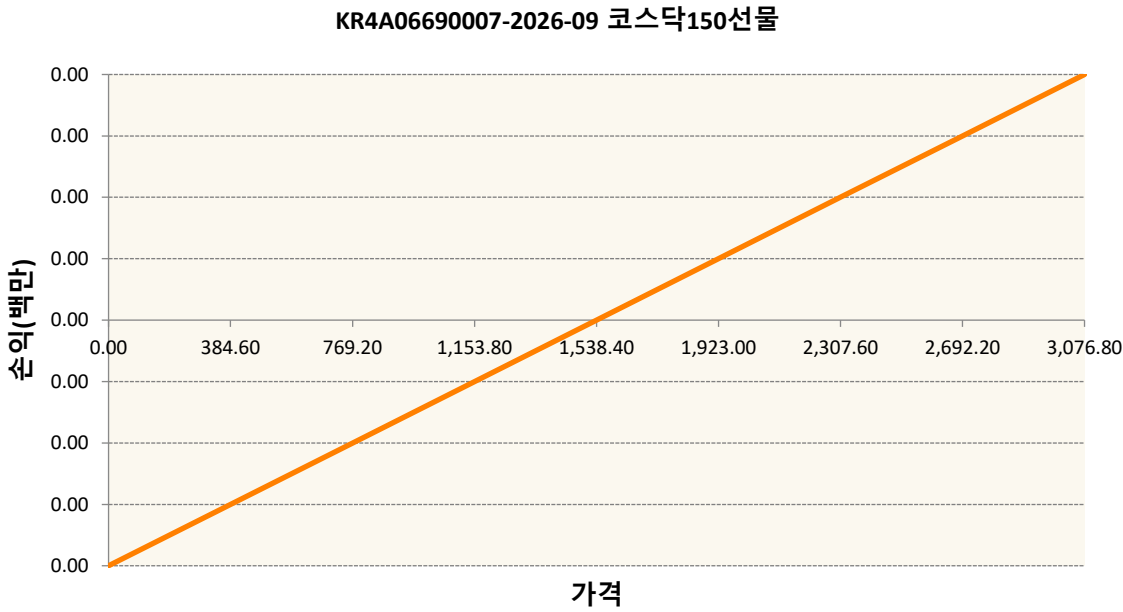
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	892	0	892	장내

2. 만기시점의 손익구조



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

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

(단위:백만원)

25,745

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

(단위:백만원)

82,913

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

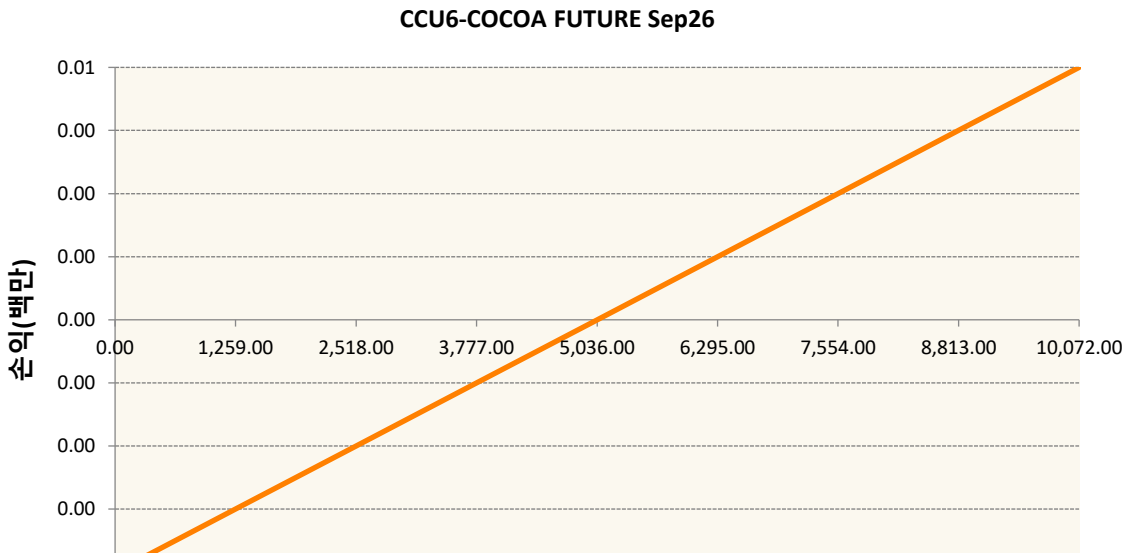
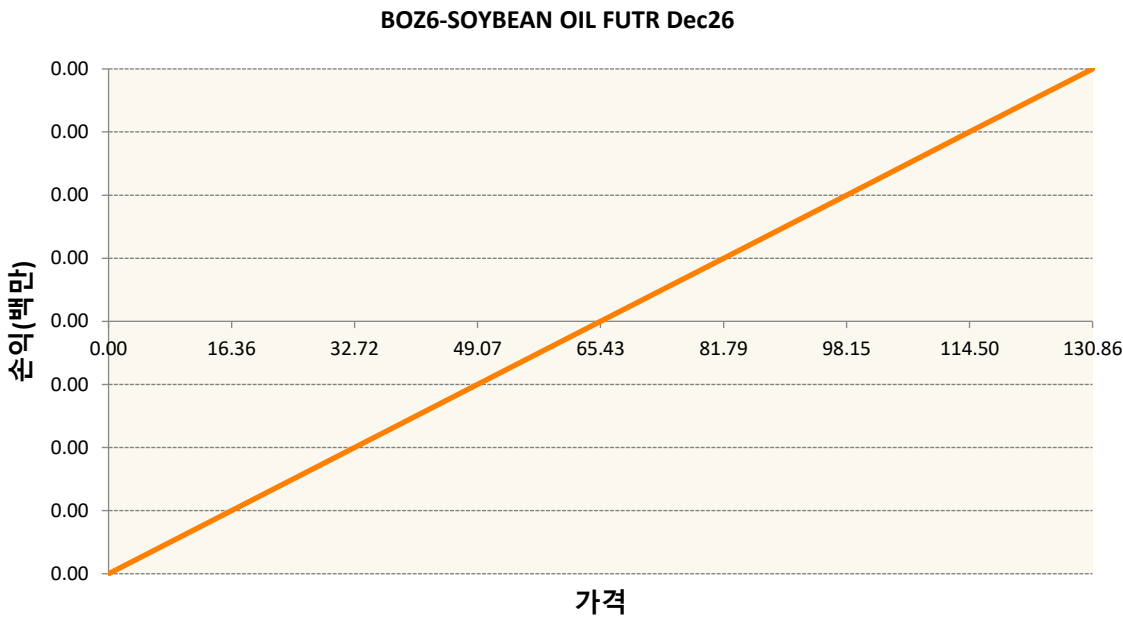
포커스농산물모(채권-파생형)

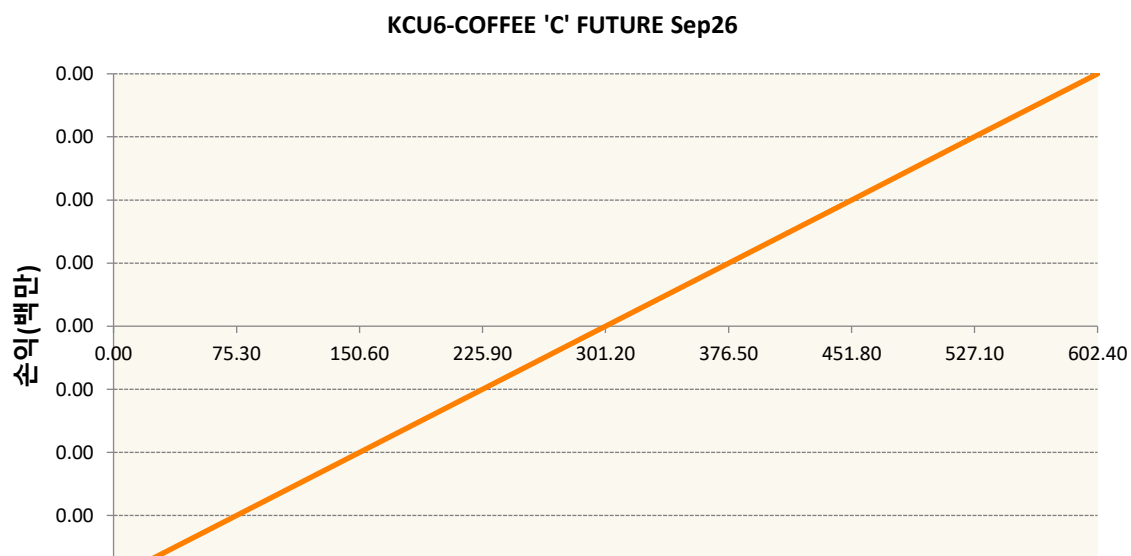
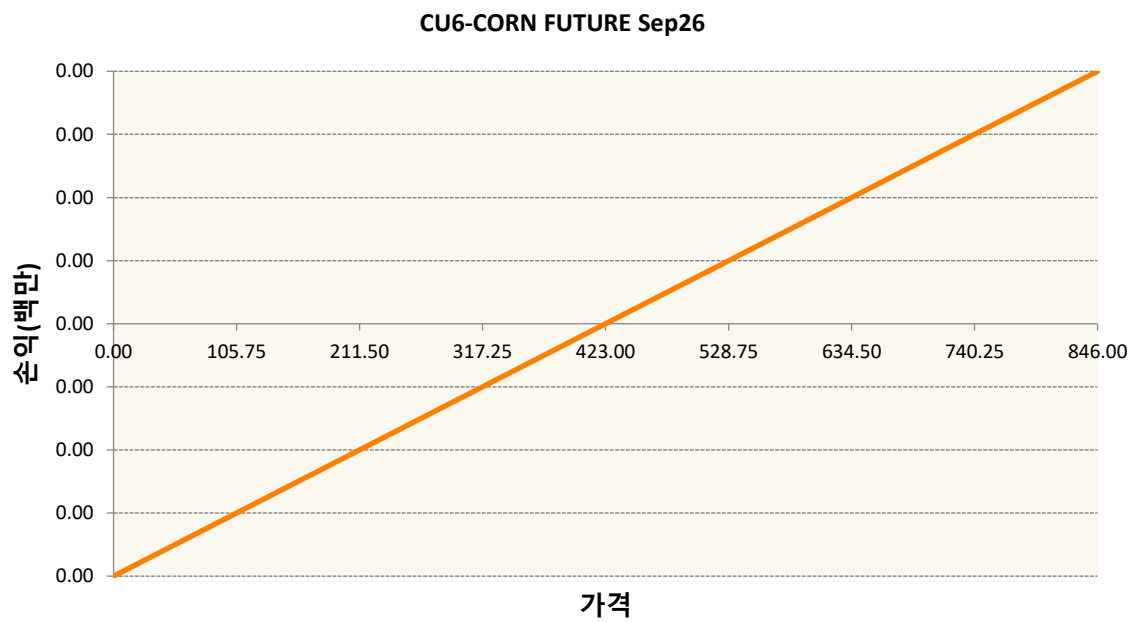
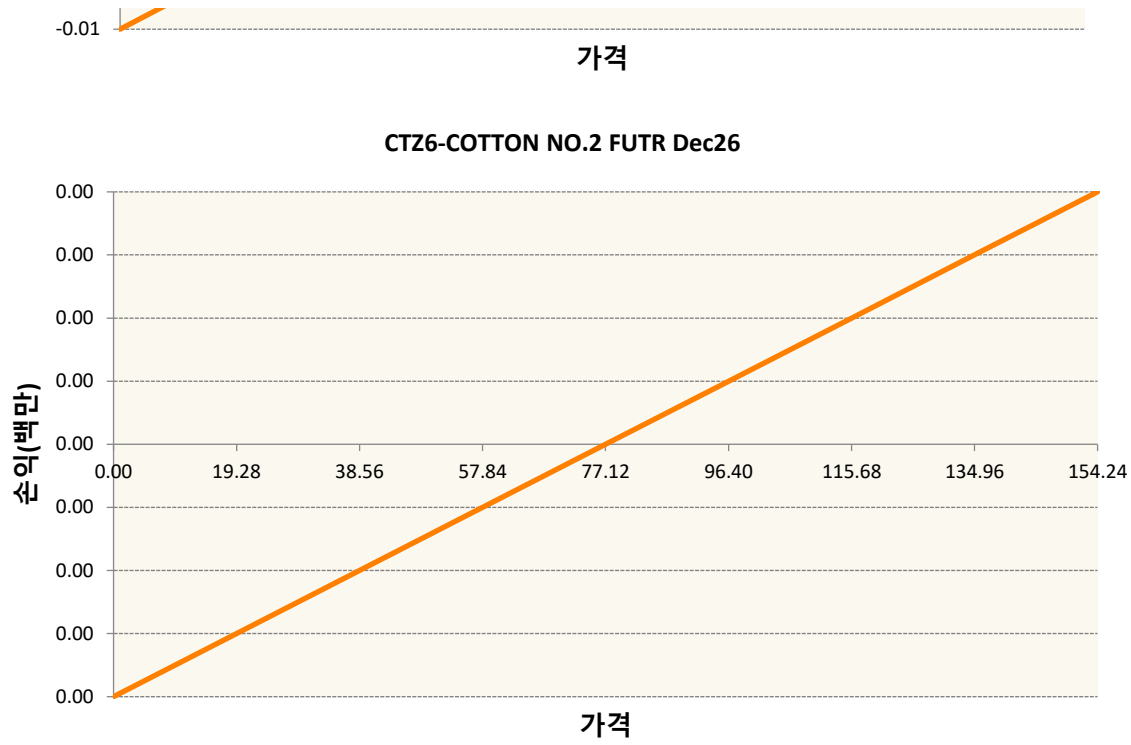
1. 계약금액

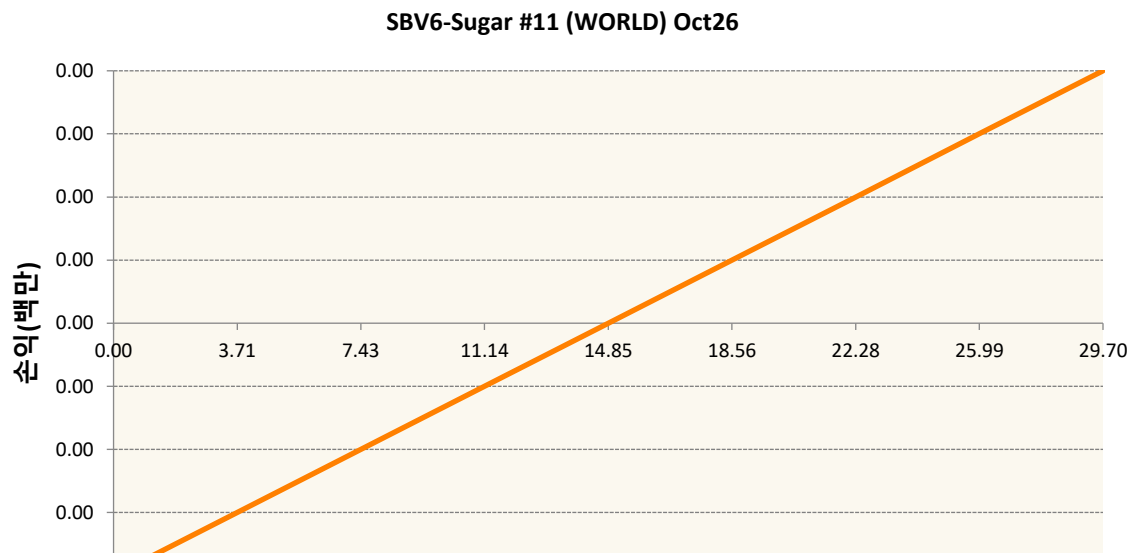
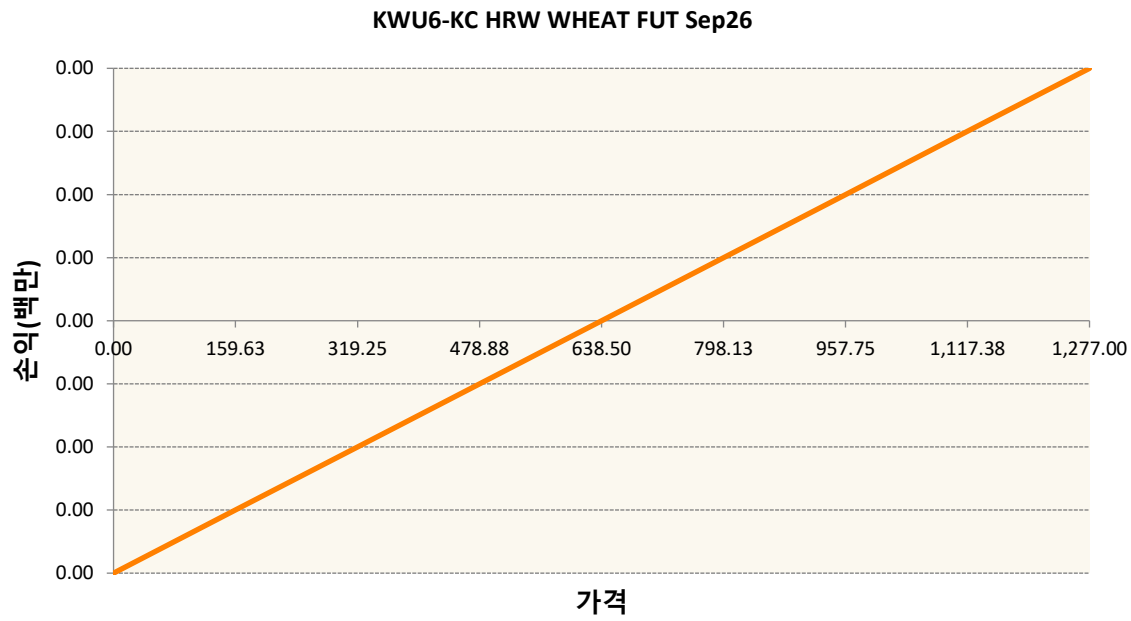
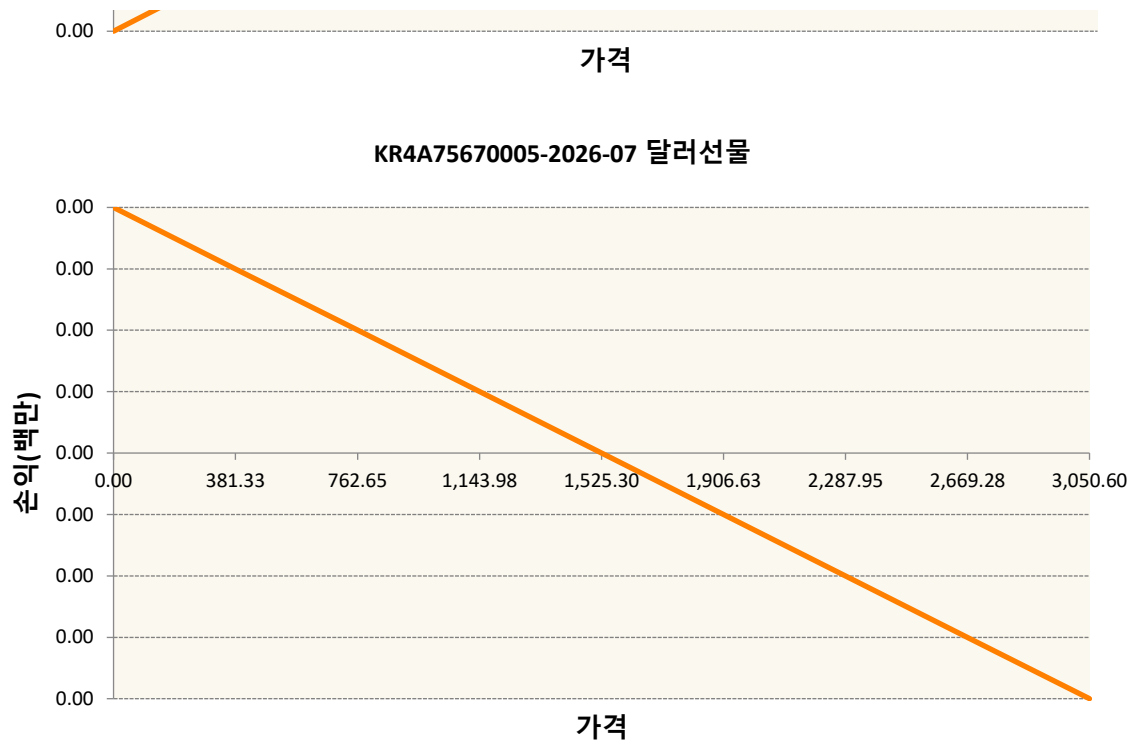
(단위:USD 백만)

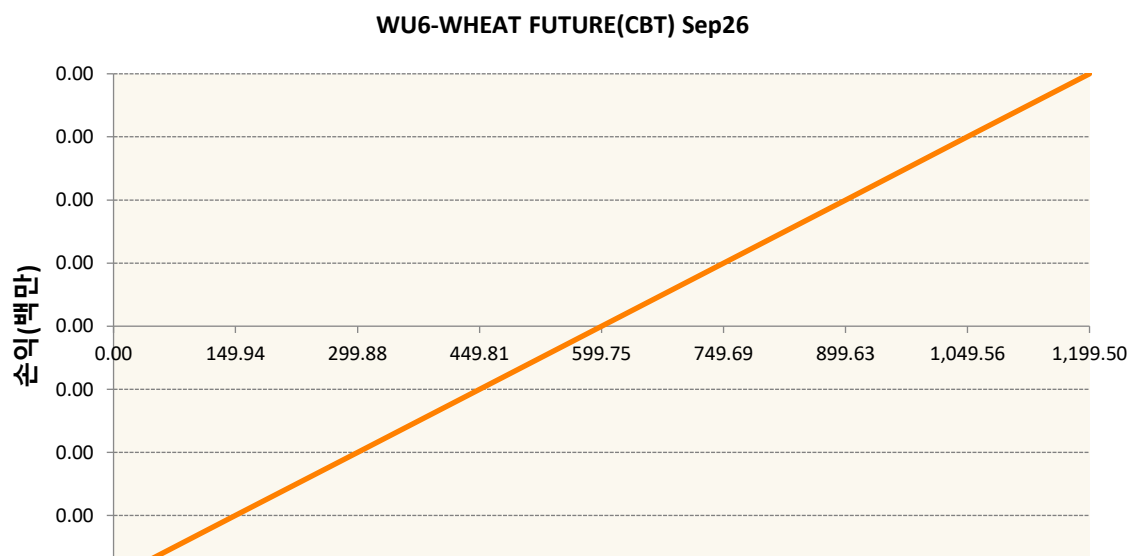
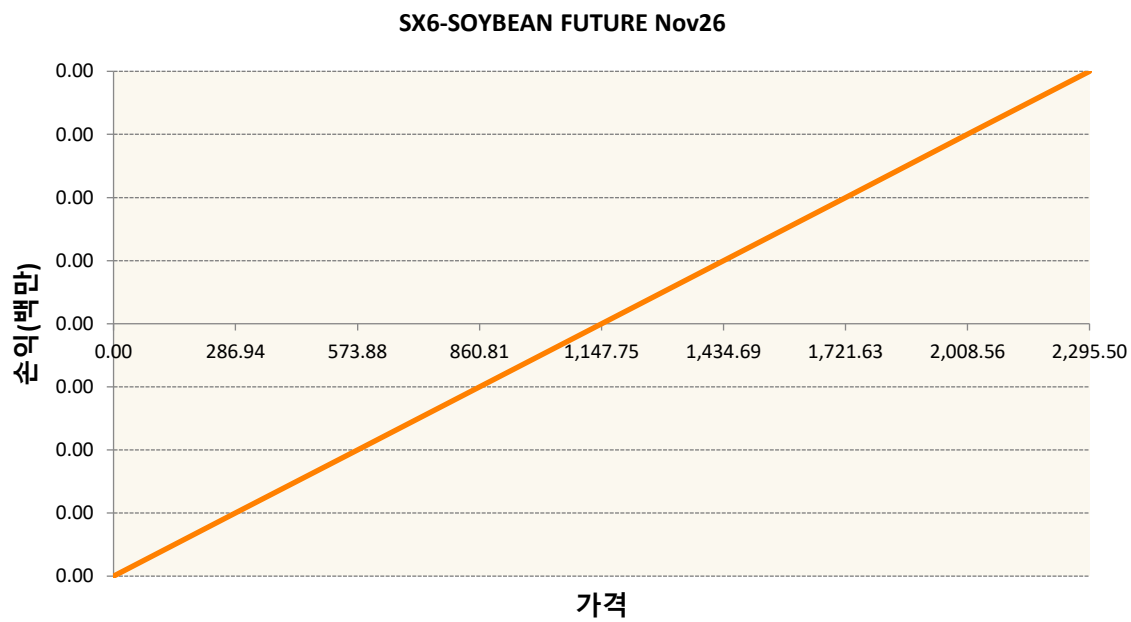
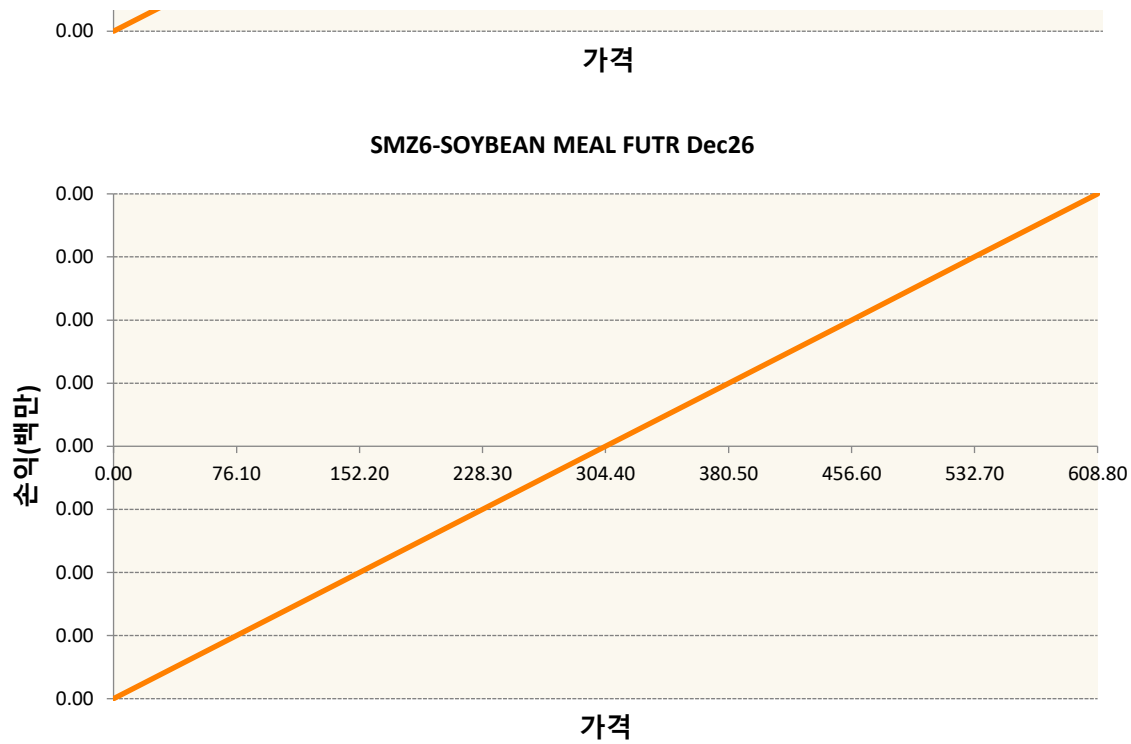
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	436	0	436	
누계	유가증권	선물	2,043	0	2,043	
누계	통화	선물	0	168	-168	장내

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	2026-07-06
기준일	2026-07-03

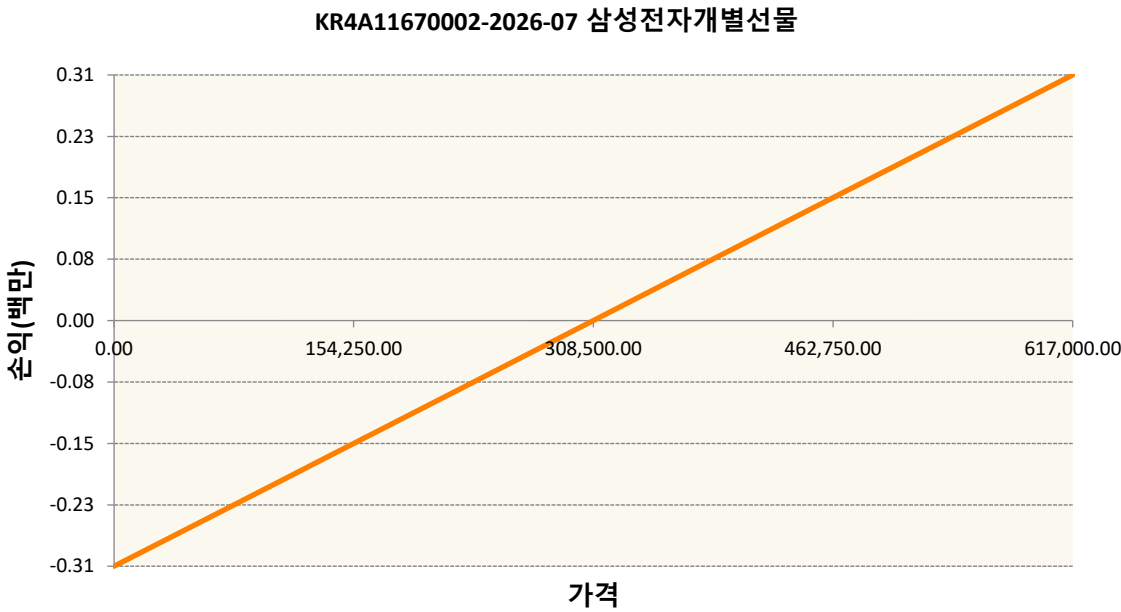
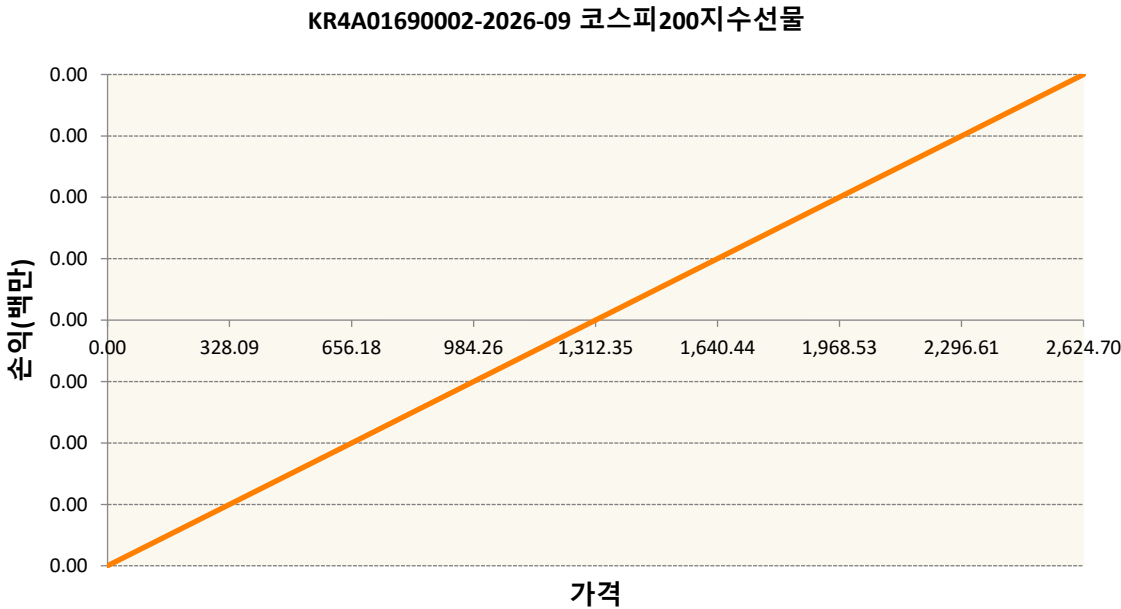
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	961	652	309	장내
누계	유가증권	선물	4,389	0	4,389	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					338
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-338	-338	-338	-338	-338	-338	-338
-5.33%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225
-2.67%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	113	113	113	113	113	113	113
5.33%	225	225	225	225	225	225	225
8.00%	338	338	338	338	338	338	338
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)

956

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

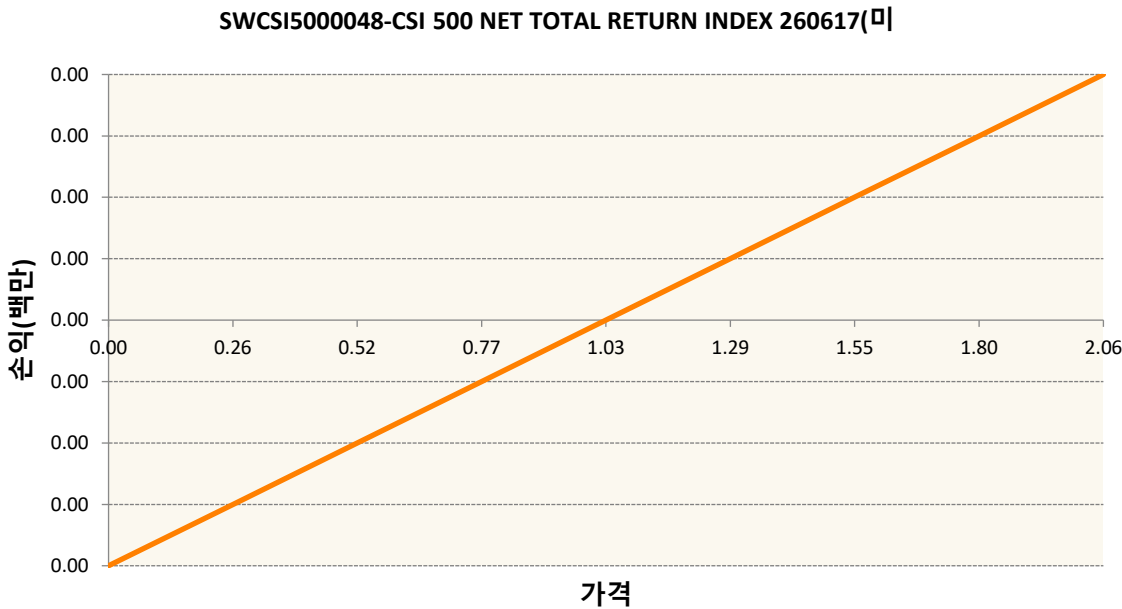
SOL차이나강소기업CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5,970	0	5,970	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

479

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

653

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

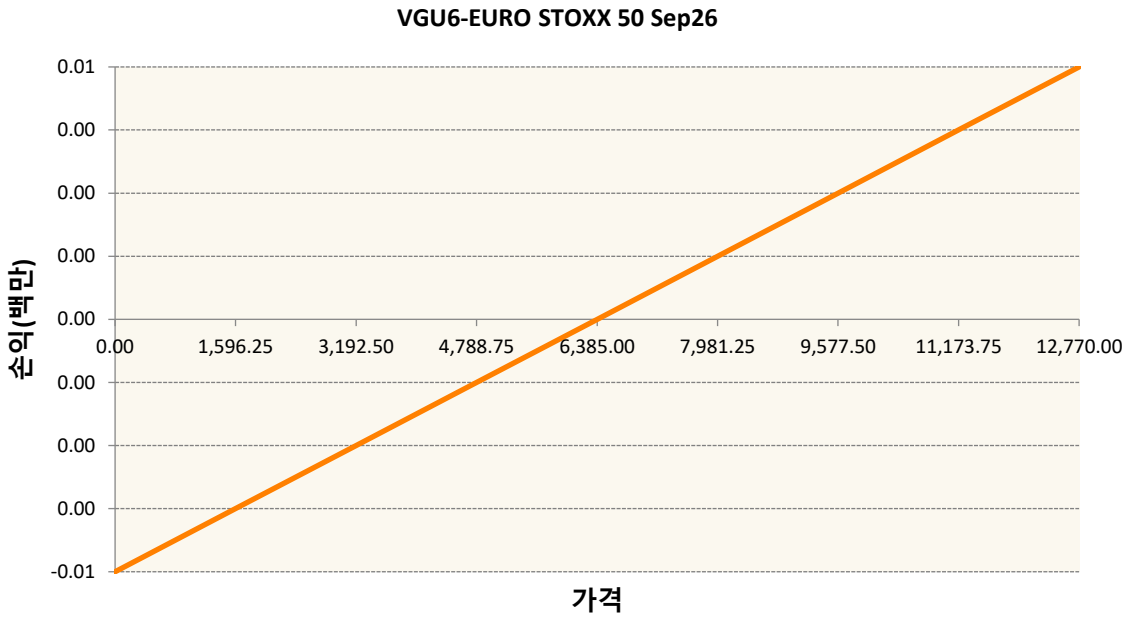
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,009	0	1,009	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU6	EURO STOXX 50 Sep26	81
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

71

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

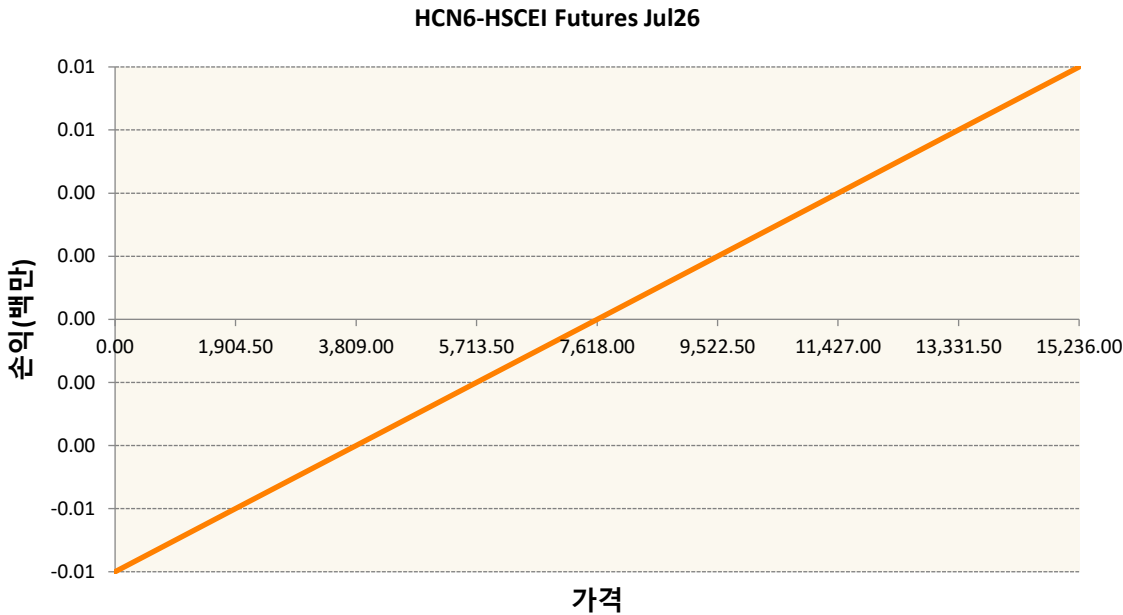
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,116	0	1,116	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	2026-07-06
기준일	2026-07-03

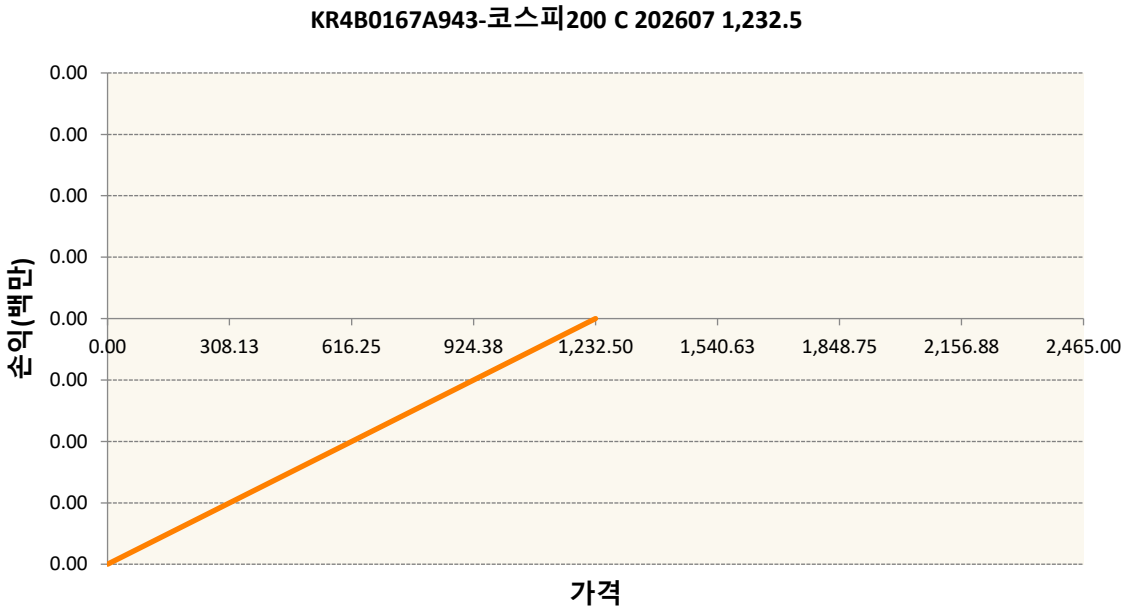
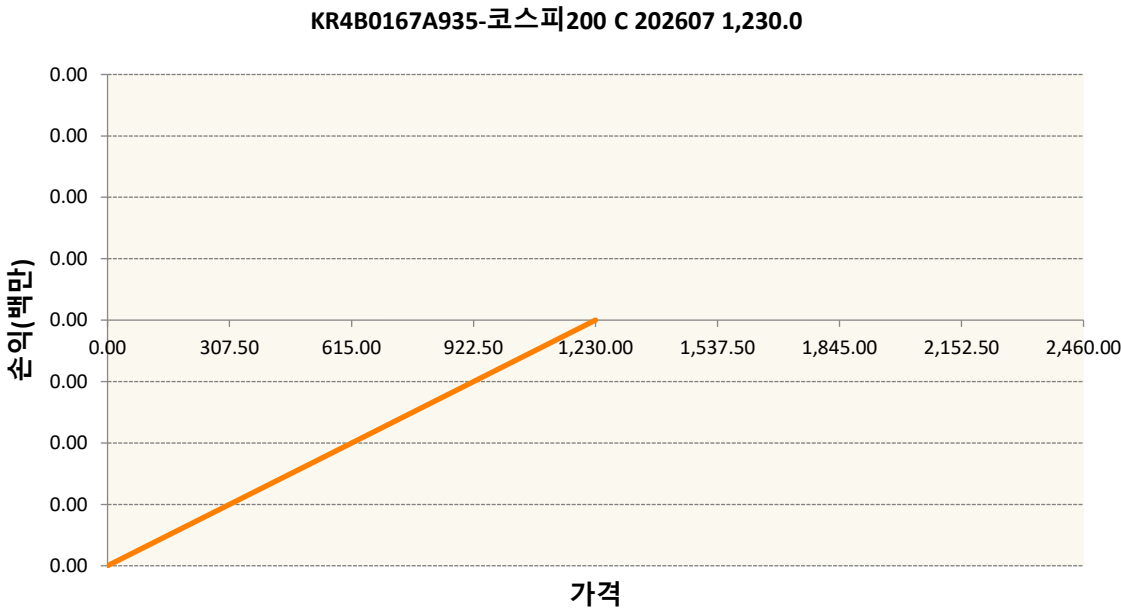
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

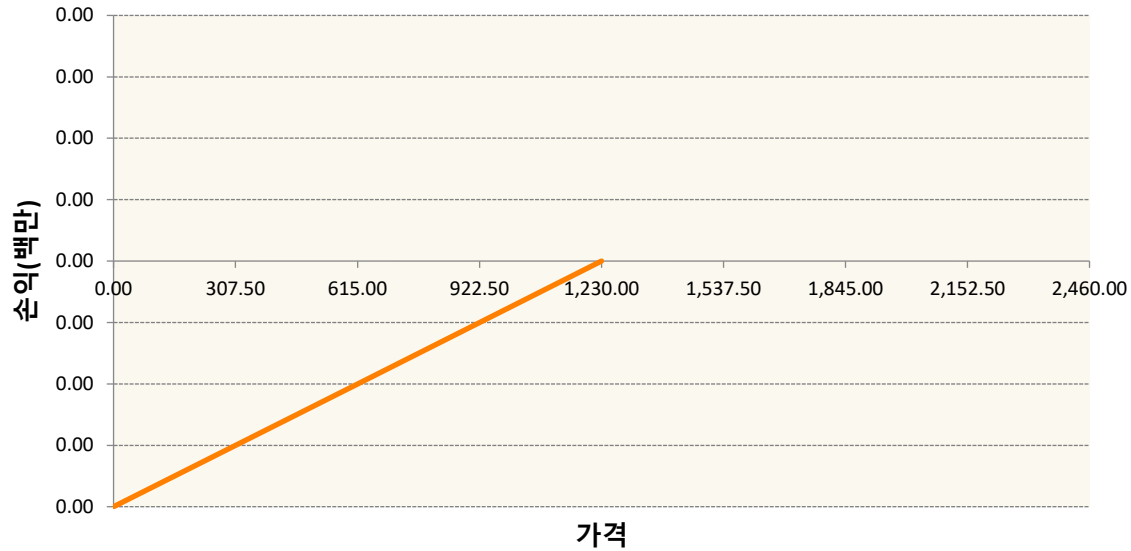
(단위:백만원)

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							354
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-185	-212	-240	-269	-297	-325	-354
-5.33%	-72	-101	-131	-160	-190	-219	-249
-2.67%	15	-13	-42	-71	-100	-130	-159
0%	79	53	27	0	-27	-55	-84
2.67%	123	102	79	55	30	5	-22
5.33%	152	135	117	97	75	52	29
8.00%	170	158	143	127	109	89	69
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5							1,133
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-599	-686	-775	-864	-953	-1,043	-1,133
-5.33%	-236	-329	-423	-516	-609	-703	-796
-2.67%	46	-45	-137	-229	-322	-415	-508
0%	253	171	86	0	-88	-177	-266
2.67%	397	328	255	178	99	17	-67
5.33%	491	438	378	313	243	171	95
8.00%	550	511	464	412	353	291	224
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0							324
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-169	-195	-220	-246	-272	-298	-324
-5.33%	-66	-93	-120	-147	-174	-201	-228
-2.67%	14	-12	-39	-65	-92	-119	-146
0%	72	49	25	0	-25	-51	-77

2.67%	113	93	72	51	28	4	-20
5.33%	139	124	107	89	69	48	26
8.00%	156	145	131	116	100	82	63

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

(단위:백만원)

2,324

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

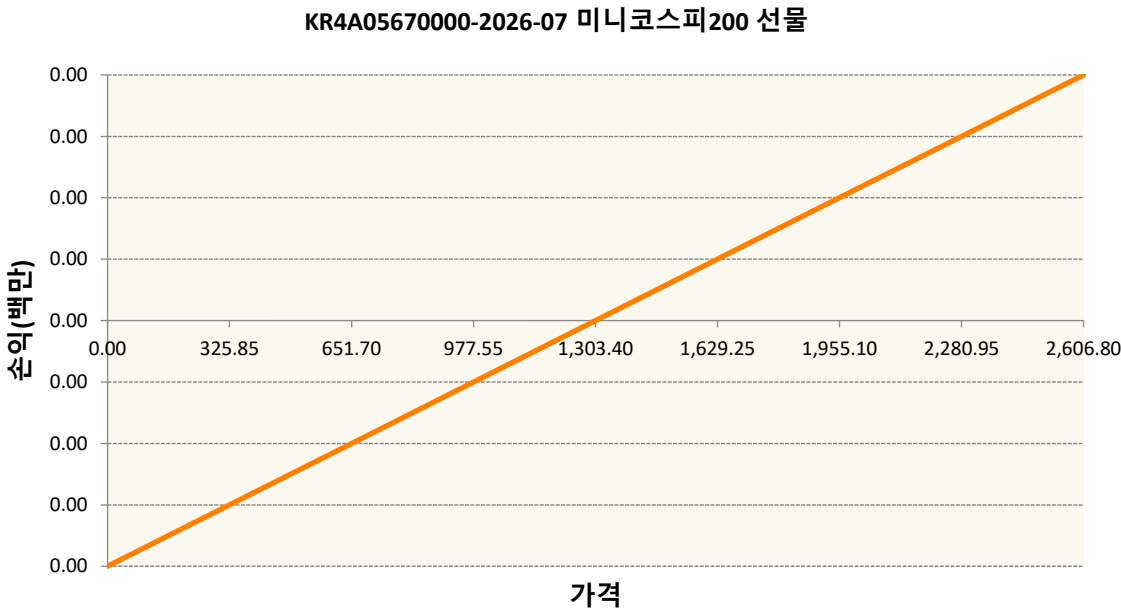
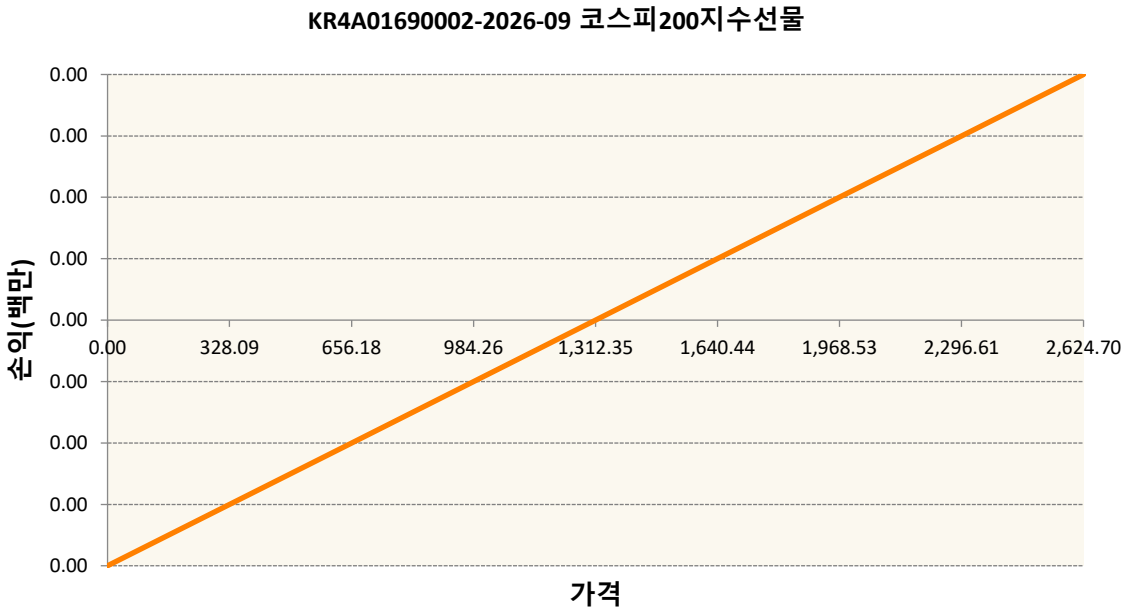
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

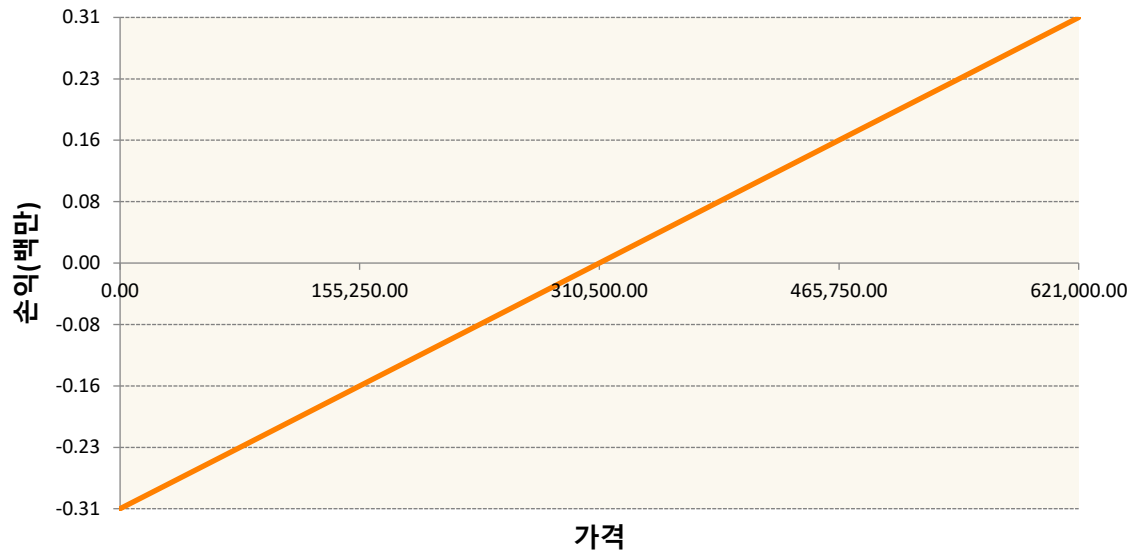
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	616	-616	장내
누계	유가증권	선물	4,308	0	4,308	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				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
KR4A05670000			2026-07 미니코스피200 선물				52
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-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%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	52	52	52	52	52	52	52
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%	-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

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	372

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

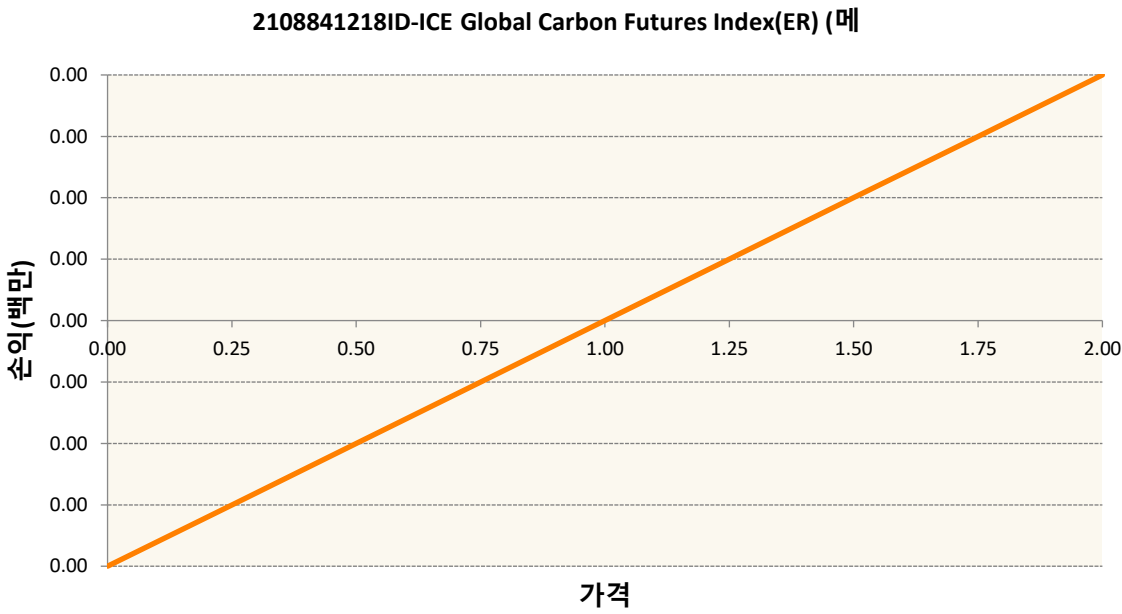
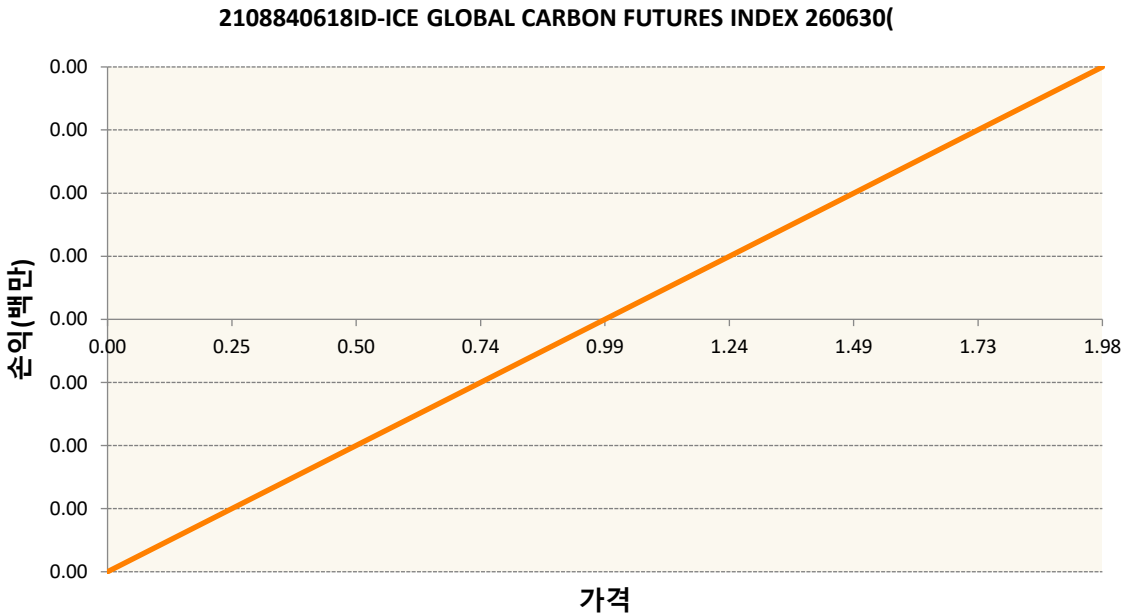
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,530	0	7,530	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		479
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		121

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	679

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

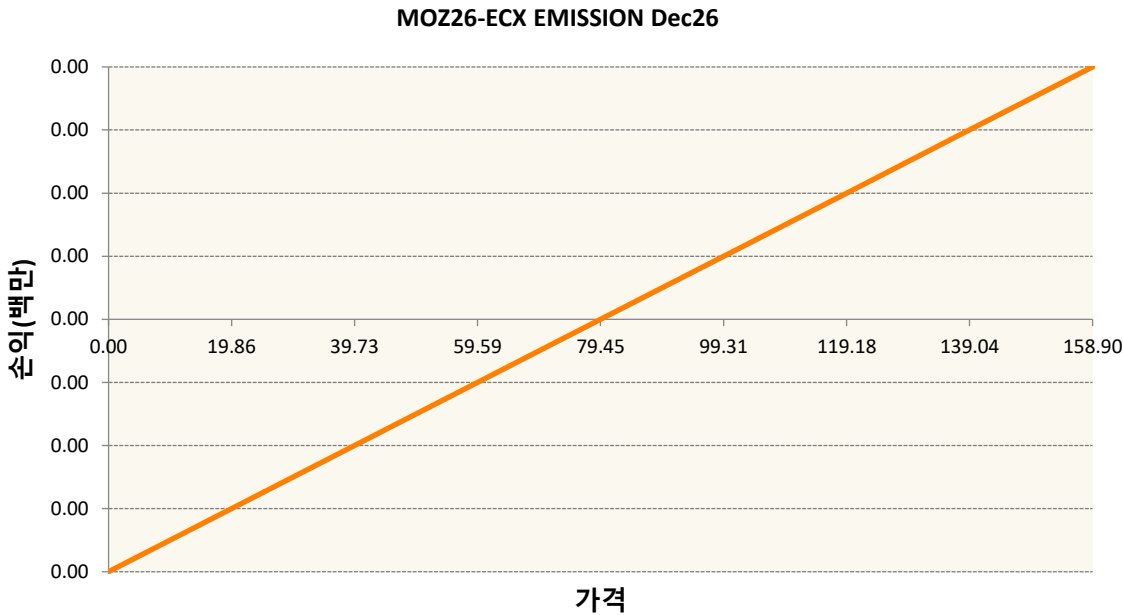
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,129	0	5,129	
누계	통화	선도	0	2,745	-2,745	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G6S(KRW/EUR 31-07-26E	220
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	410

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

(단위:백만원)

695

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

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	-346	0	-346	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	10
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	8
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	4
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	6

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

(단위:백만원)

44

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

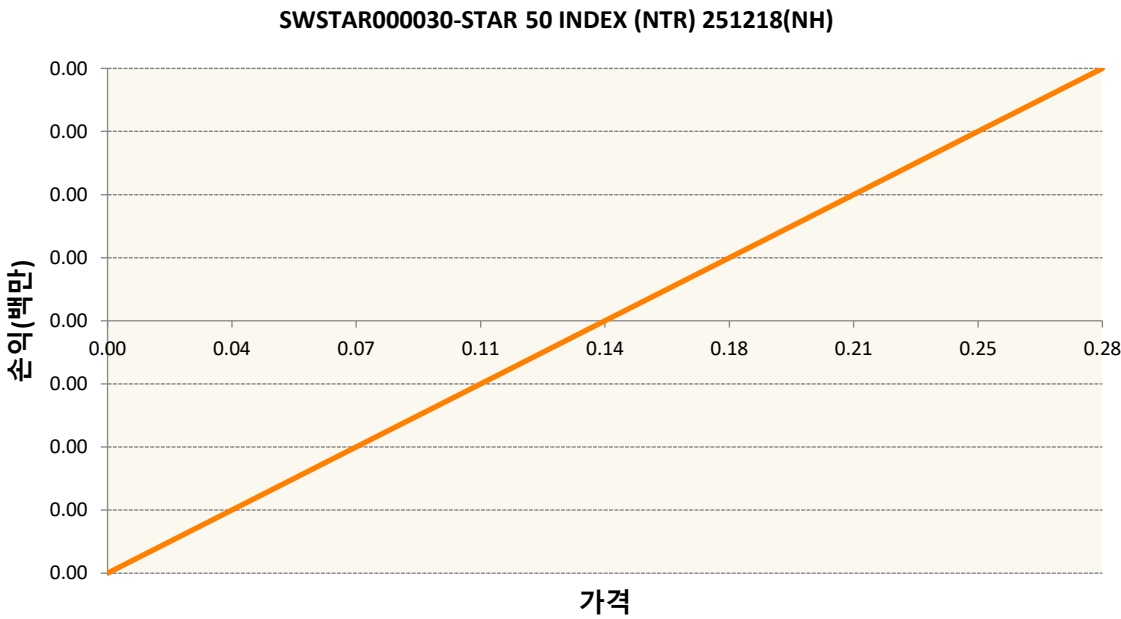
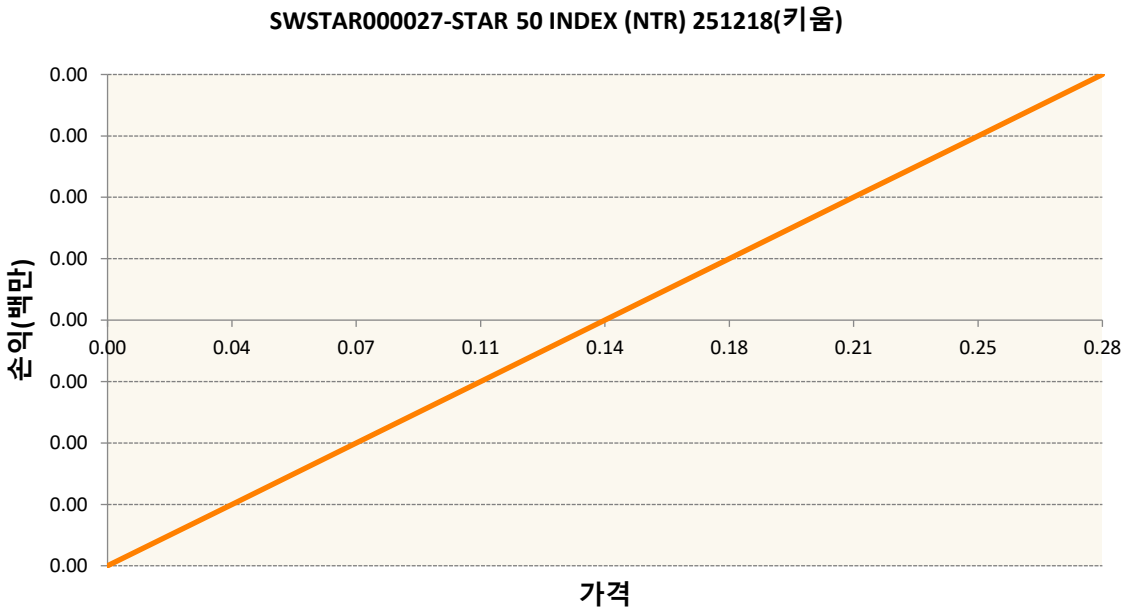
SOL차이나육성산업액티브상장지

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	404	0	404	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)		14
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)		47
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260626(메리츠)		5
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260630(미래)		24

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	149

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

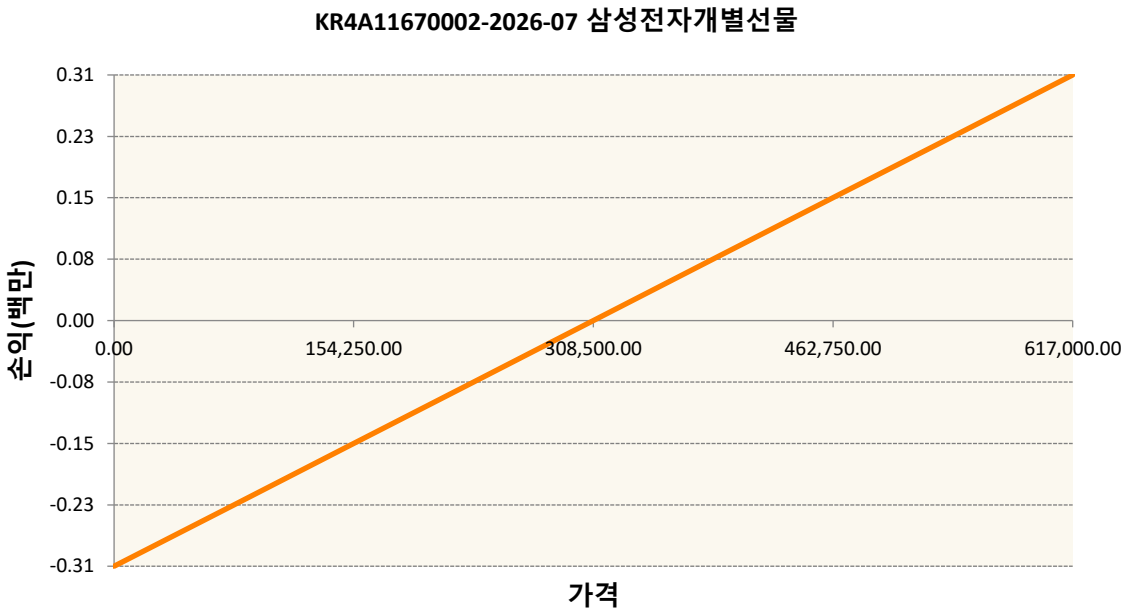
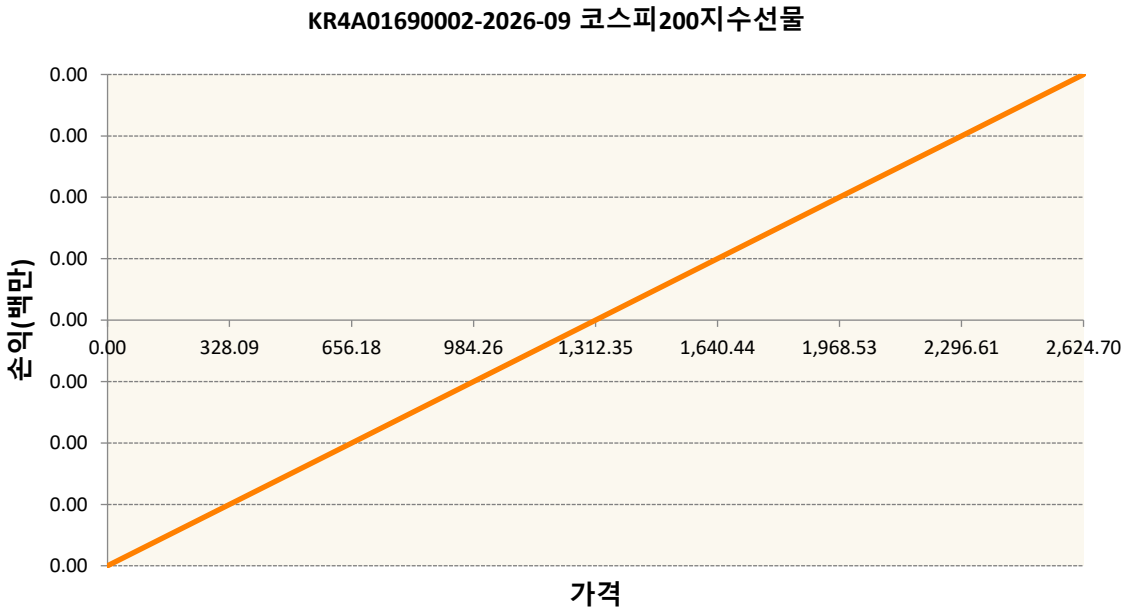
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

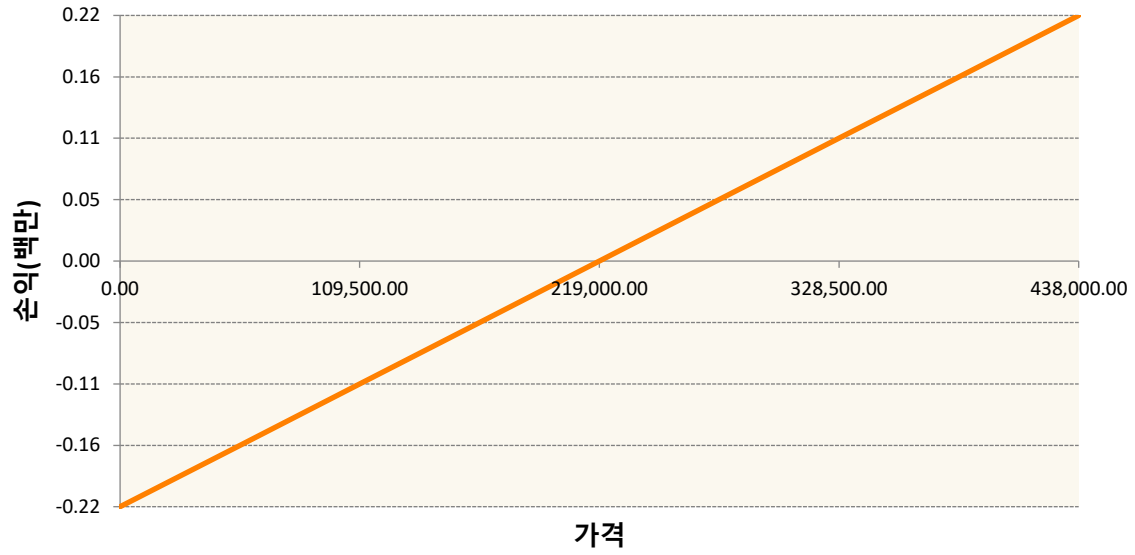
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,905	6,972	-67	장내
누계	유가증권	선물	27,032	3,815	23,217	장내

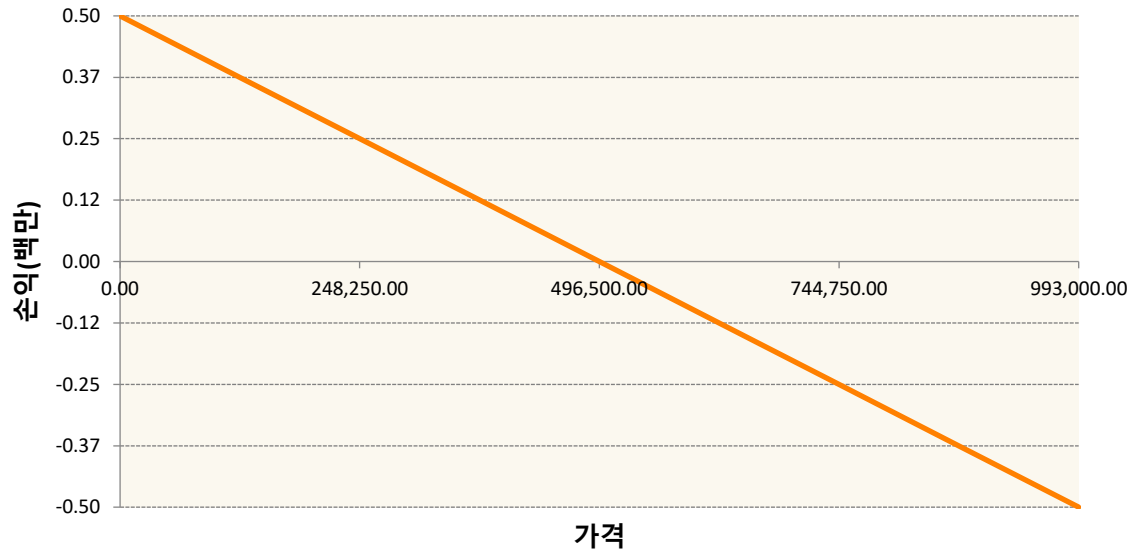
2. 만기시점의 손익구조



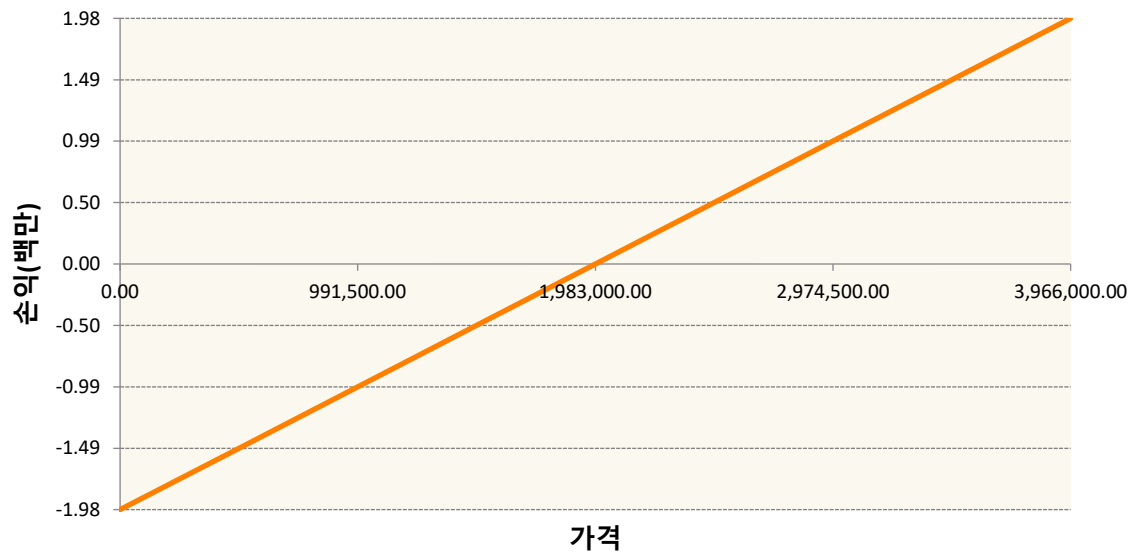
KR4A1V670008-2026-07 HD현대마린솔루션개별선물



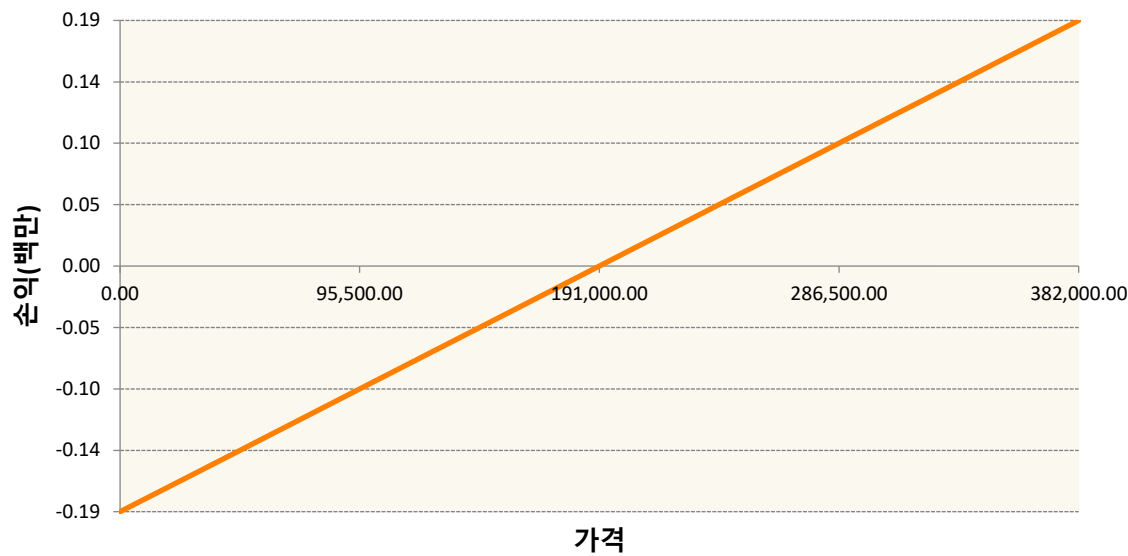
KR4A20670001-2026-07 현대모비스개별선물



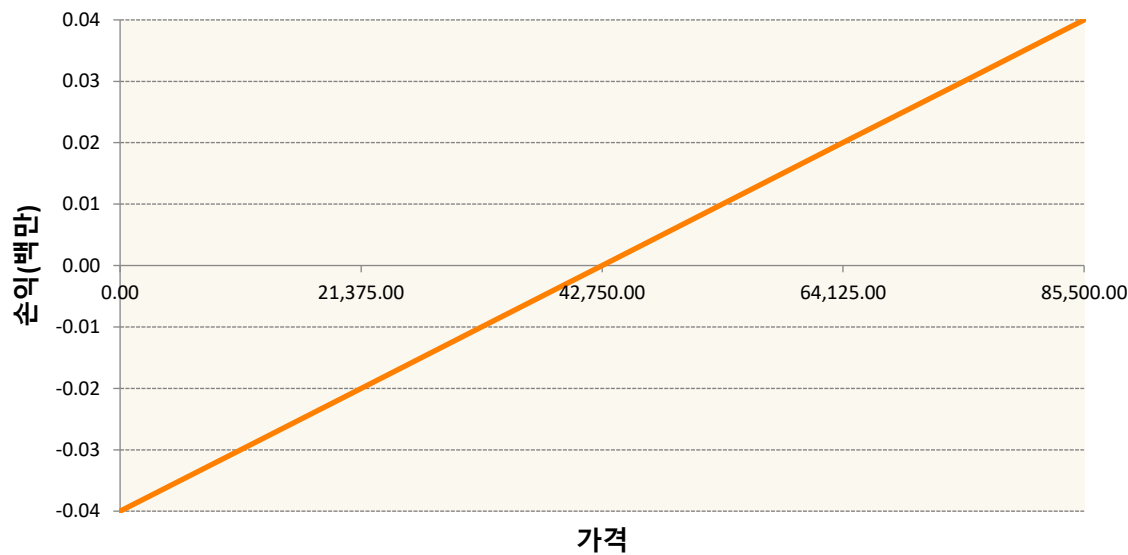
KR4A23670008-2026-07 삼성전기개별선물



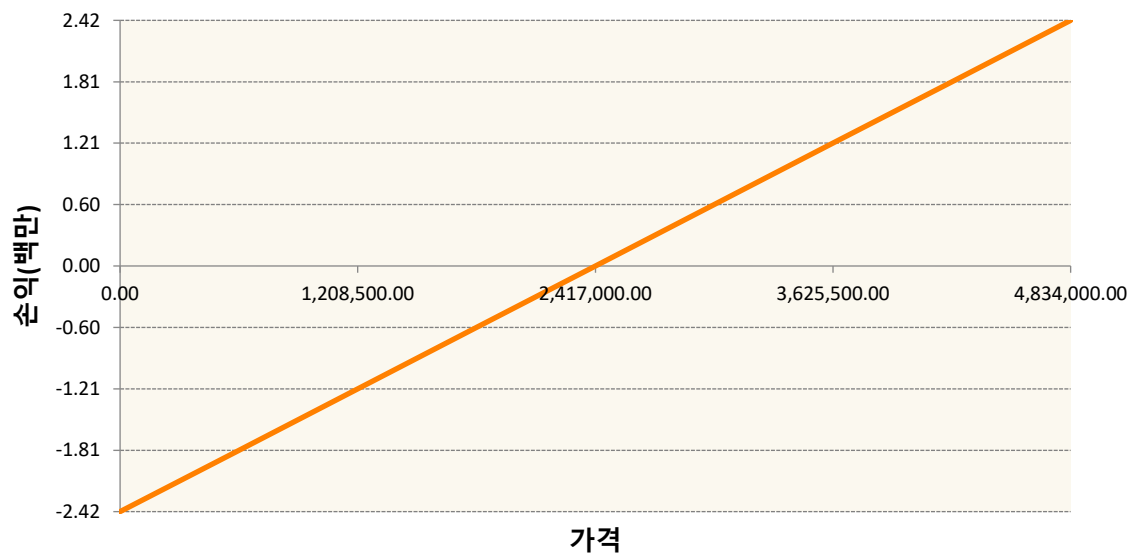
KR4A24670007-2026-07 LG전자개별선물



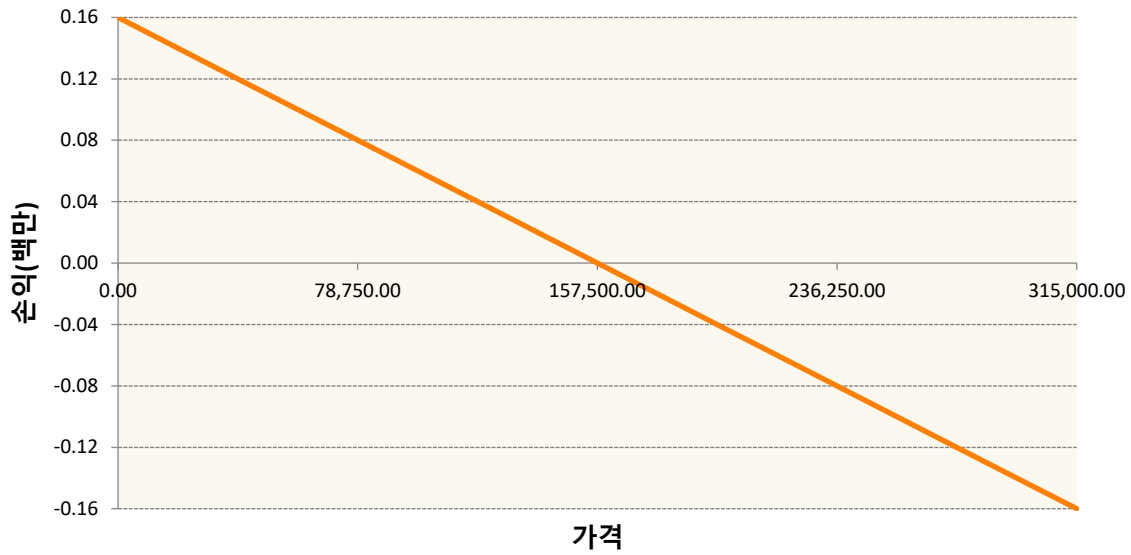
KR4A48670009-2026-07 미래에셋증권개별선물



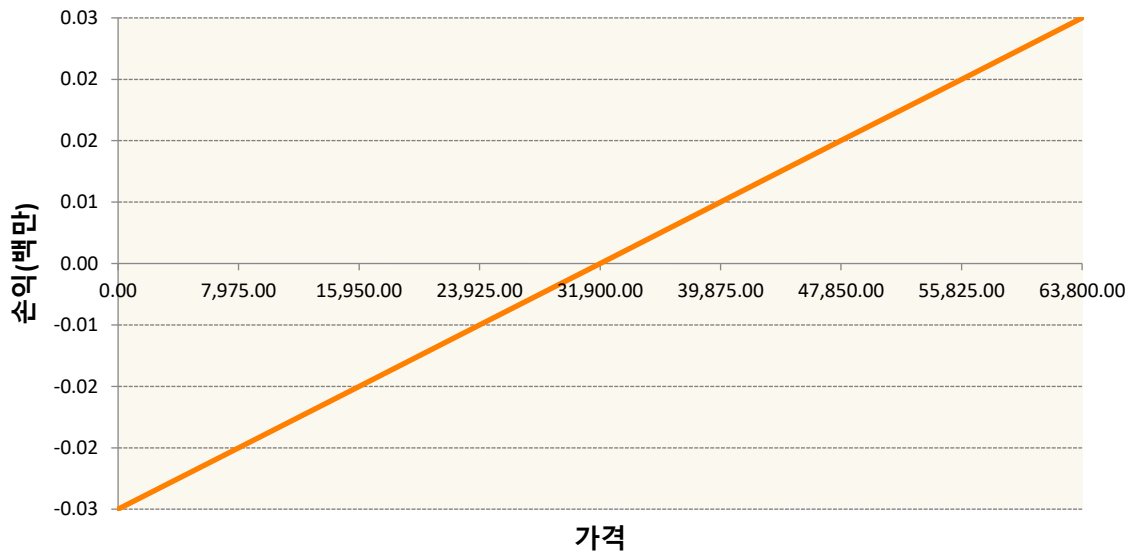
KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



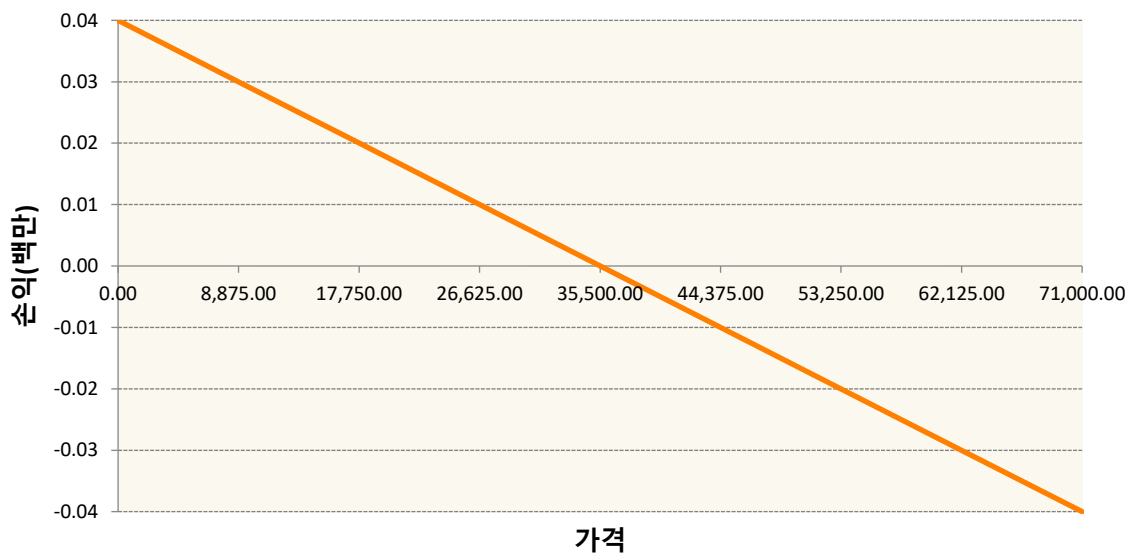
KR4ABM670006-2026-07 한국항공우주개별선물



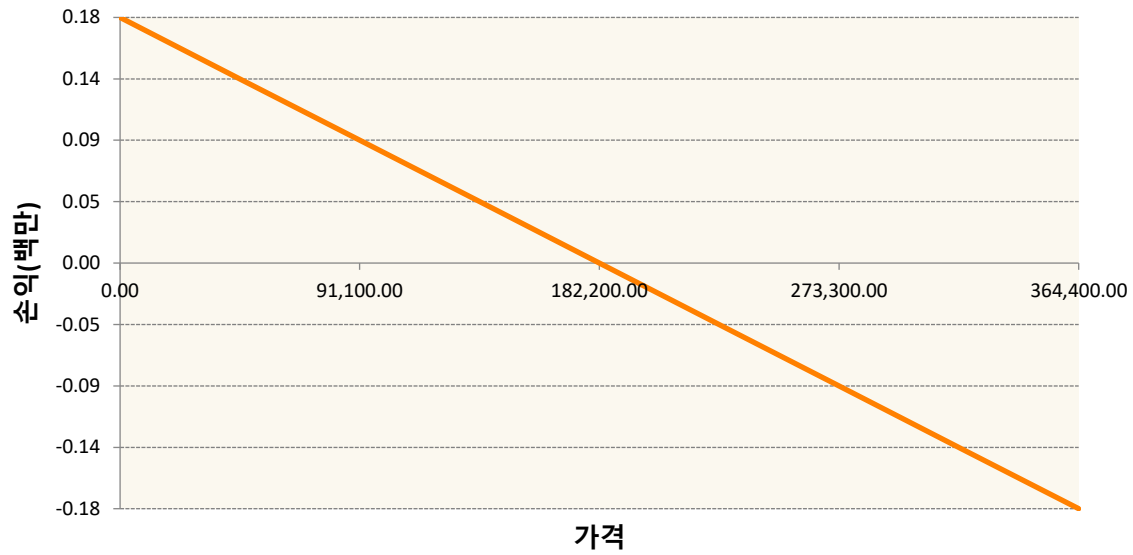
KR4ABZ670001-2026-07 NH투자증권개별선물



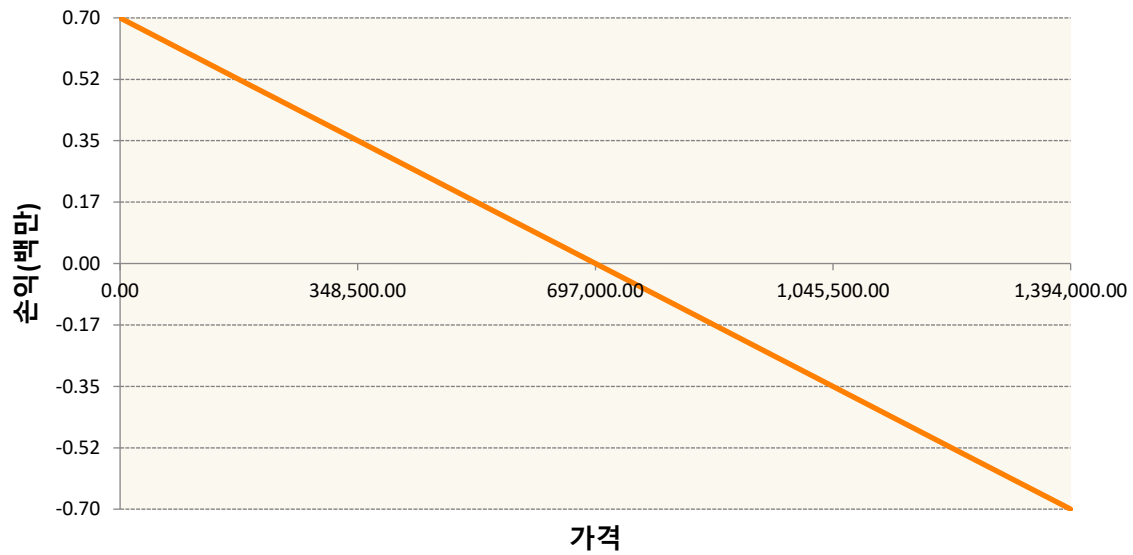
KR4ACF670004-2026-07 카카오개별선물



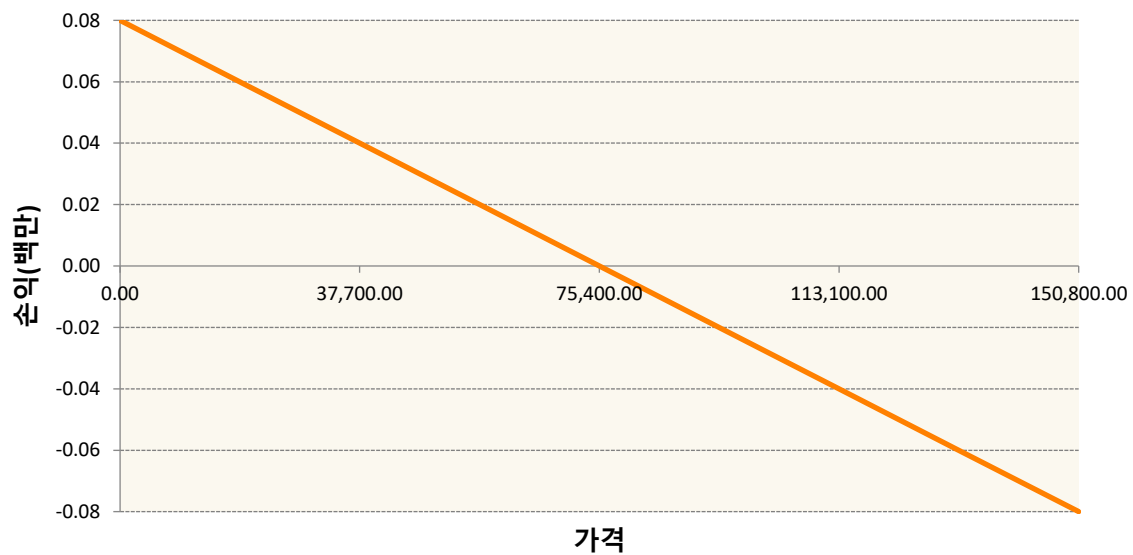
KR4AD8670001-2026-07 현대백화점개별선물



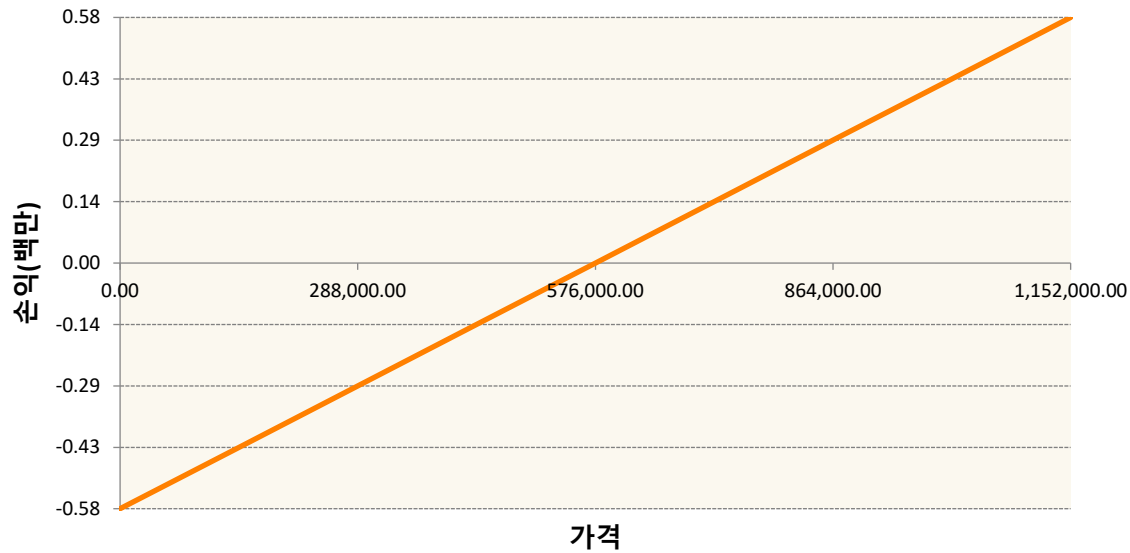
KR4ADD670005-2026-07 신세계개별선물



KR4AEV670002-2026-07 한화시스템개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				1,585
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,585	-1,585	-1,585	-1,585	-1,585	-1,585	-1,585
-5.33%	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057	-1,057
-2.67%	-528	-528	-528	-528	-528	-528	-528
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	528	528	528	528	528	528	528
5.33%	1,057	1,057	1,057	1,057	1,057	1,057	1,057
8.00%	1,585	1,585	1,585	1,585	1,585	1,585	1,585
KR4A11670002			2026-07 삼성전자개별선물				366
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-366	-366	-366	-366	-366	-366	-366
-5.33%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244
-2.67%	-122	-122	-122	-122	-122	-122	-122
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	122	122	122	122	122	122	122
5.33%	244	244	244	244	244	244	244
8.00%	366	366	366	366	366	366	366
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

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-111	-111	-111	-111	-111	-111	-111
-5.33%	-74	-74	-74	-74	-74	-74	-74
-2.67%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	37	37	37	37	37	37	37
5.33%	74	74	74	74	74	74	74
8.00%	111	111	111	111	111	111	111

KR4ABM670006

2026-07 한국항공우주개별선물

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

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%	-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

KR4ACF670004

2026-07 카카오개별선물

91

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	91	91	91	91	91	91	91
-5.33%	60	60	60	60	60	60	60
-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%	-60	-60	-60	-60	-60	-60	-60
8.00%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91

KR4AD8670001

2026-07 현대백화점개별선물

13

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13	13	13	13	13	13	13
-5.33%	9	9	9	9	9	9	9
-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%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
8.00%	-13	-13	-13	-13	-13	-13	-13
KR4ADD670005 2026-07 신세계개별선물							28
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	28	28	28	28	28	28	28
-5.33%	19	19	19	19	19	19	19
-2.67%	9	9	9	9	9	9	9
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
5.33%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
KR4AEV670002 2026-07 한화시스템개별선물							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
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)

6,543

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

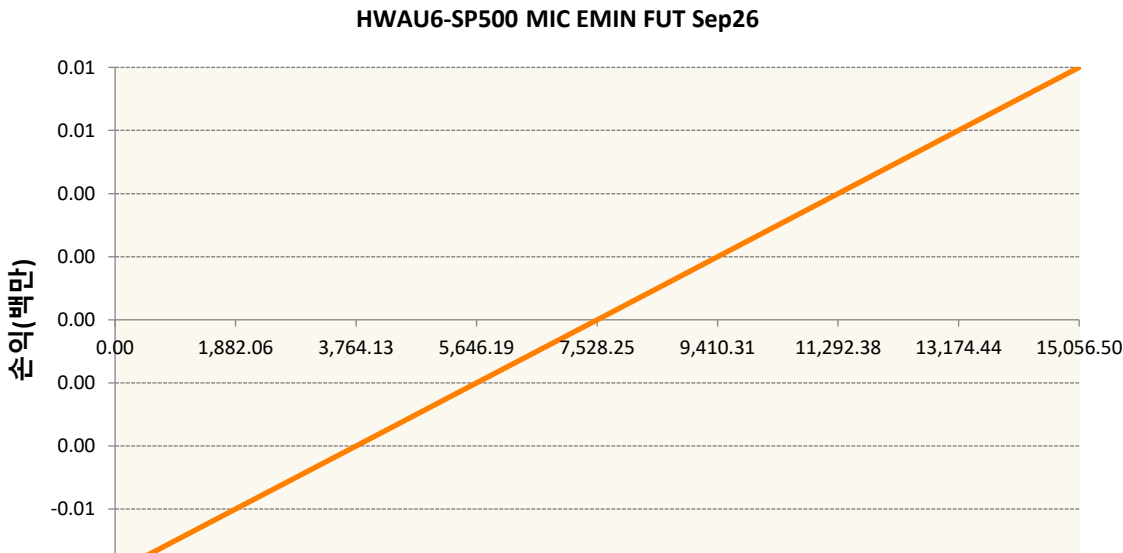
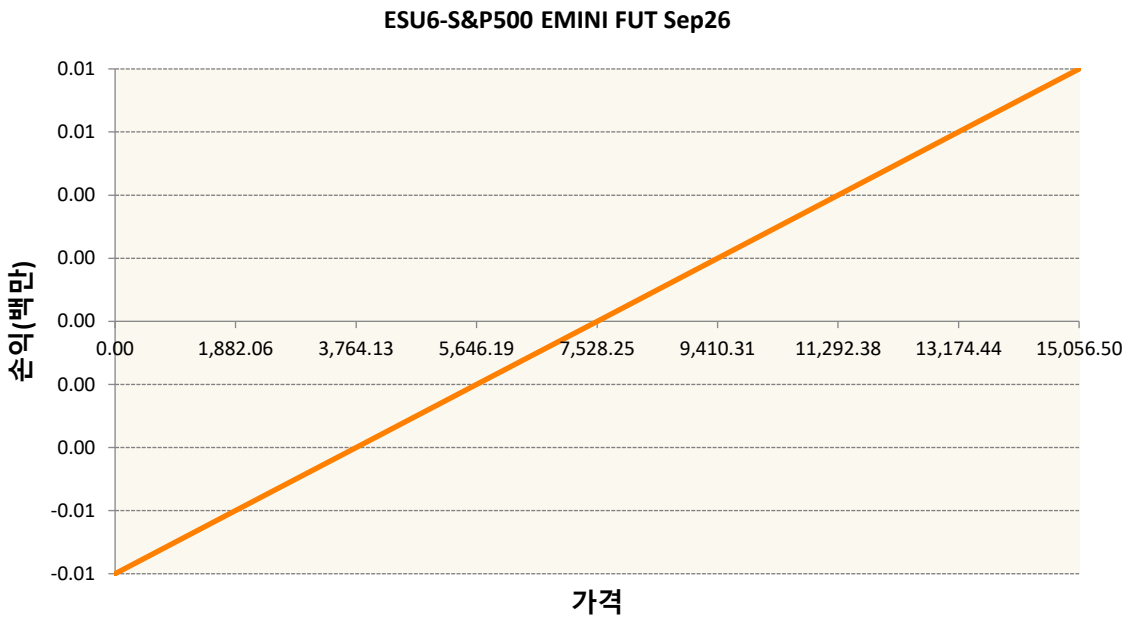
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

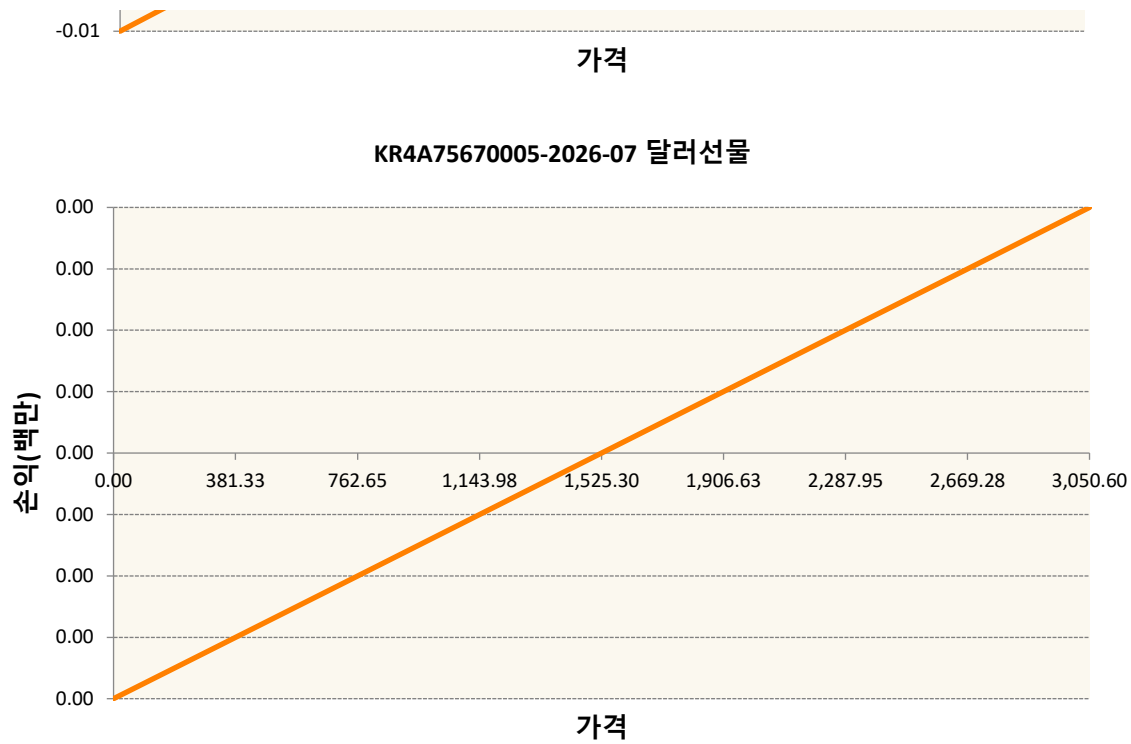
1. 계약금액

(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	62,016	0	62,016	
누계	지수	선물	114	0	114	장내
누계	통화	선물	10,830	0	10,830	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26		4,961
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26		9
KR4A756700 2026-07 달러선물			866

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	4,283

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

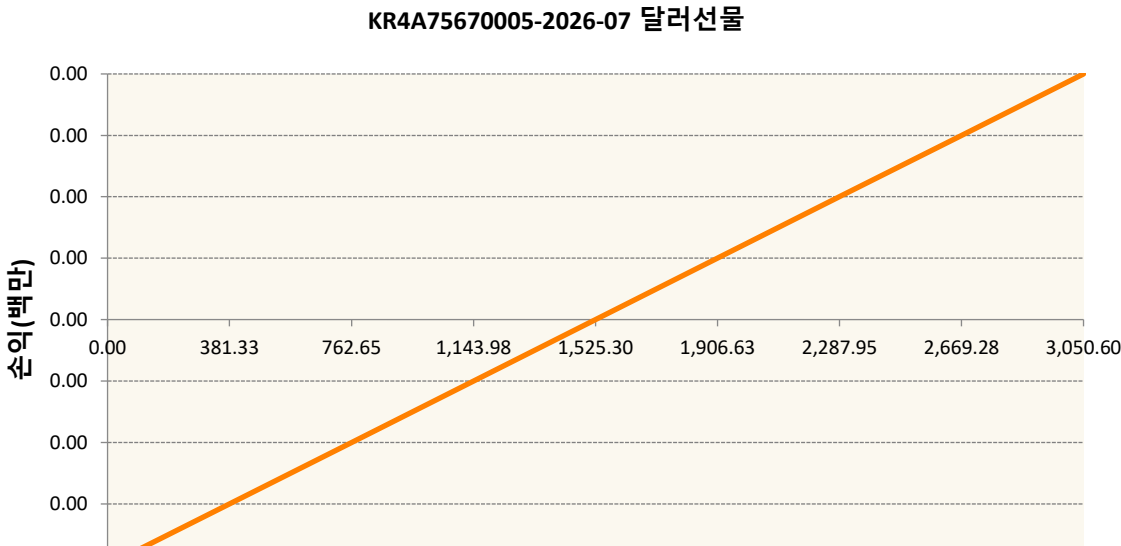
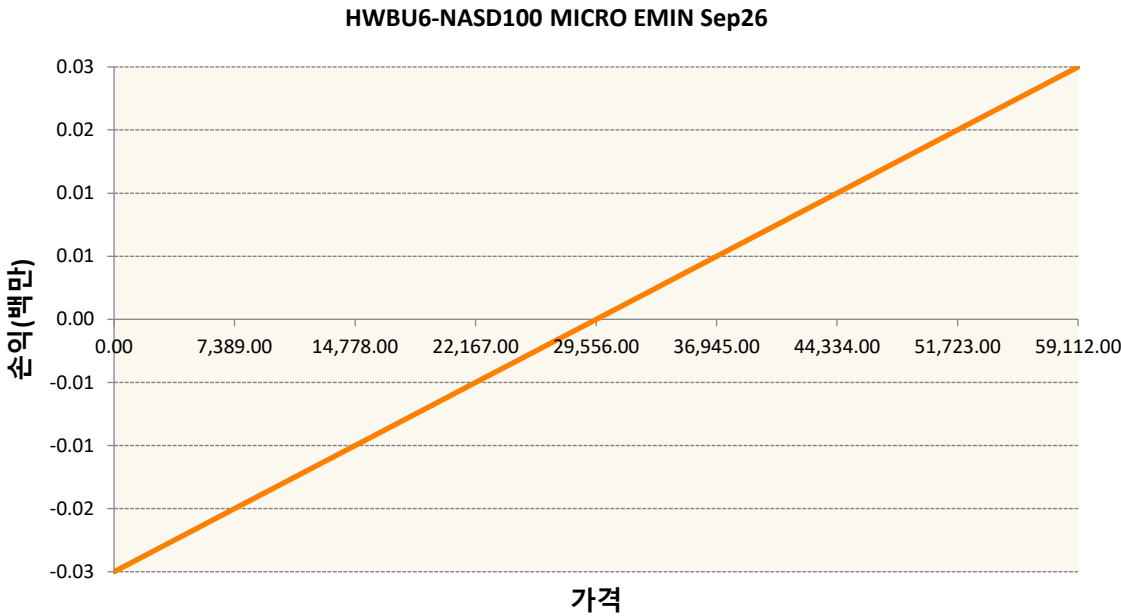
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

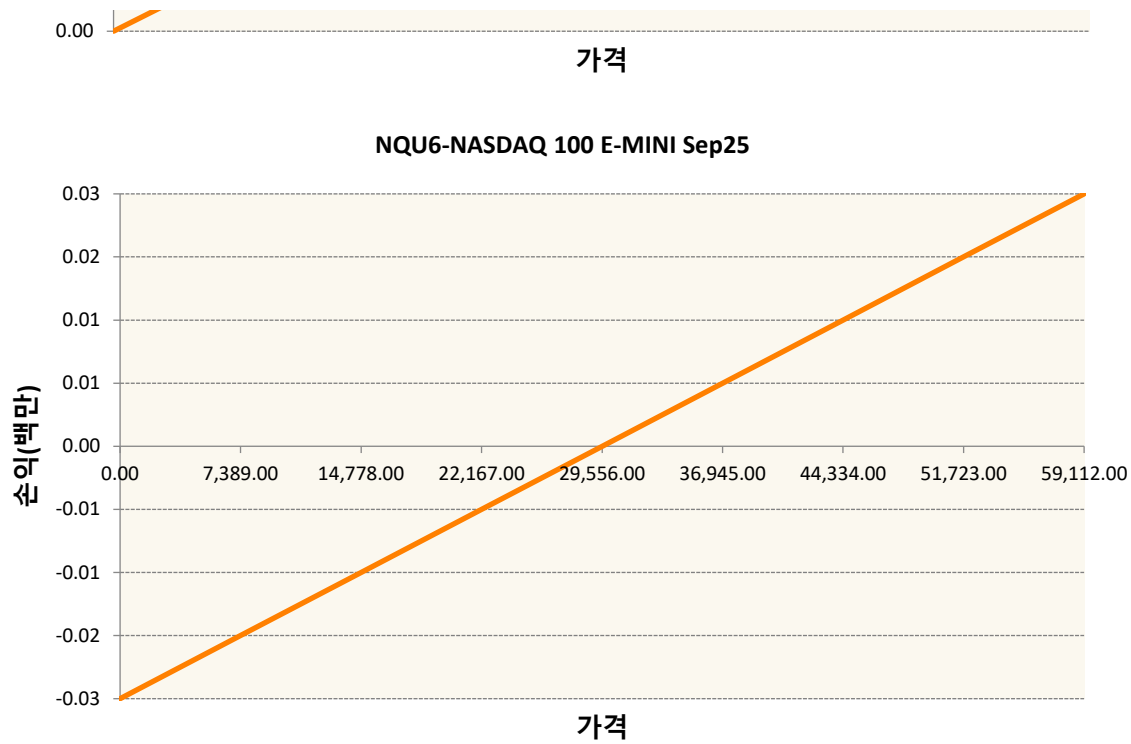
1. 계약금액

(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	30,370	0	30,370	
누계	통화	선물	3,981	0	3,981	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26	15
KR4A756700	2026-07 달러선물	318
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25	2,430

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

2,751

공시일	2026-07-06
기준일	2026-07-03

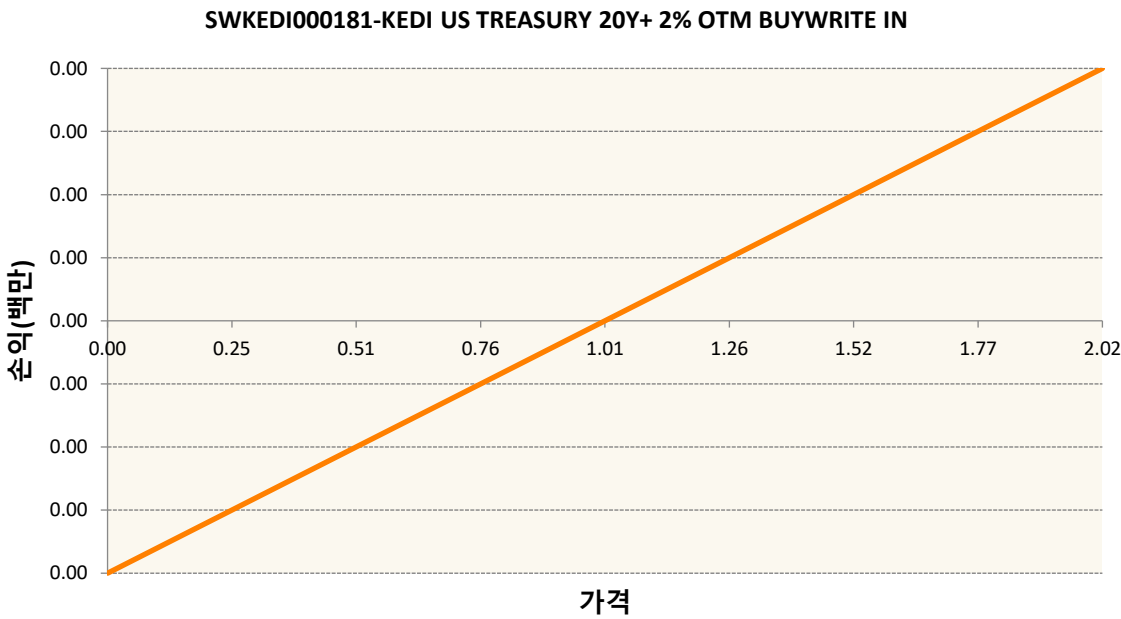
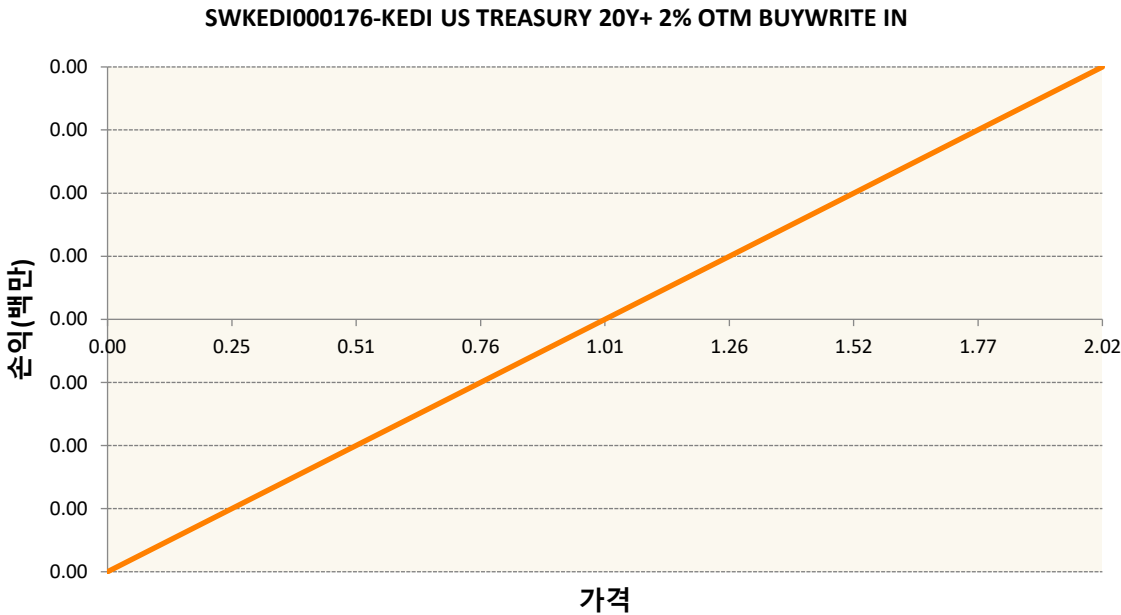
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

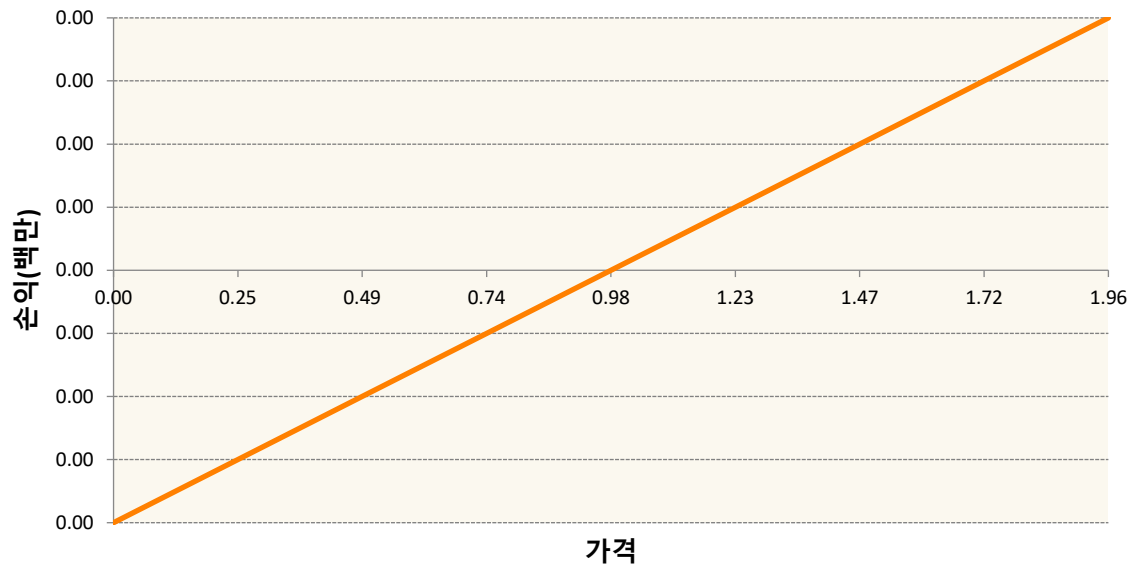
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	321,472	0	321,472	장외

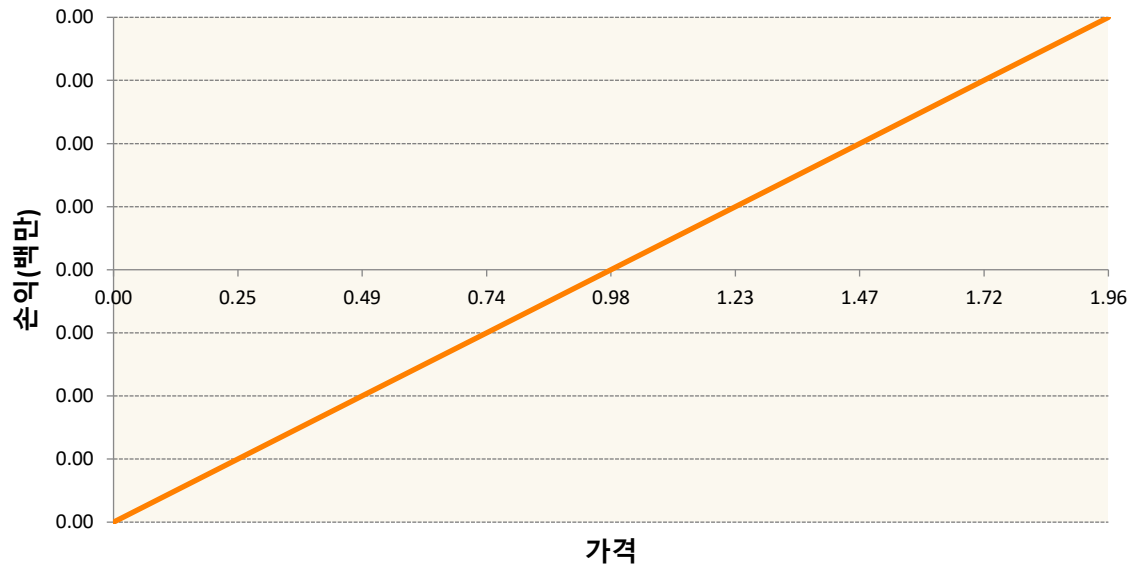
2. 만기시점의 손익구조



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	8,213
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,223
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,388
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,916

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

(단위:백만원)

10,895