

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

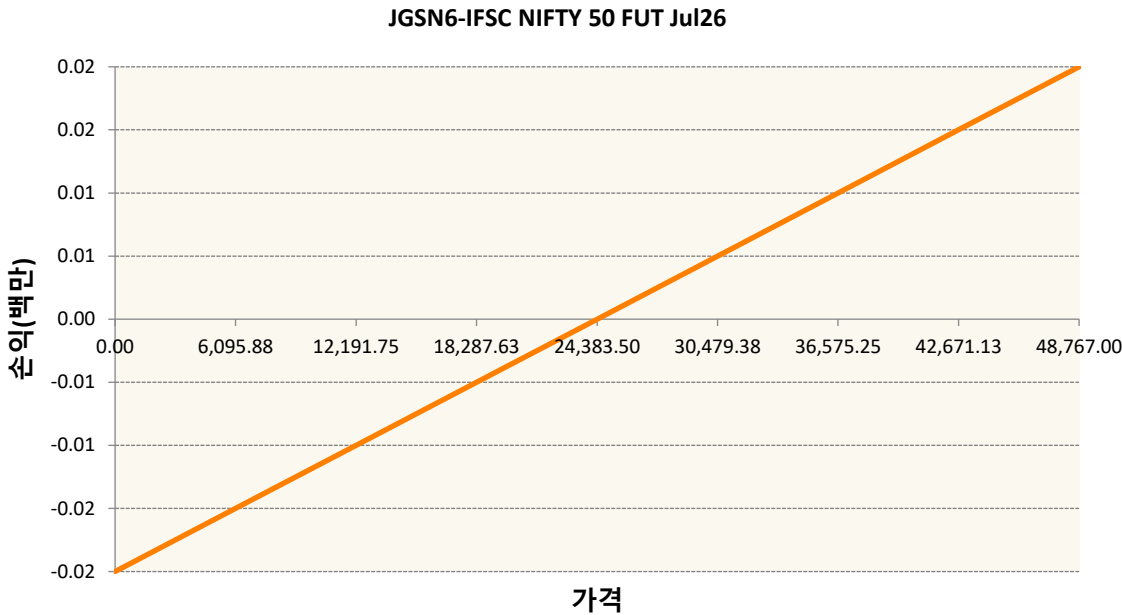
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	376	0	376	

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	2026-07-09
기준일	2026-07-08

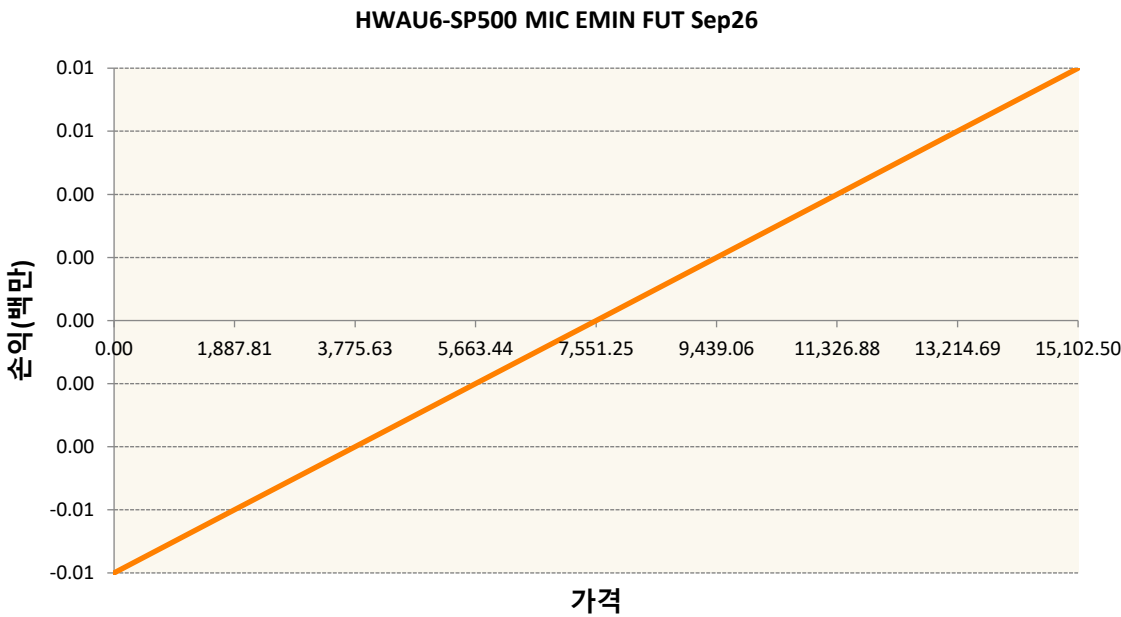
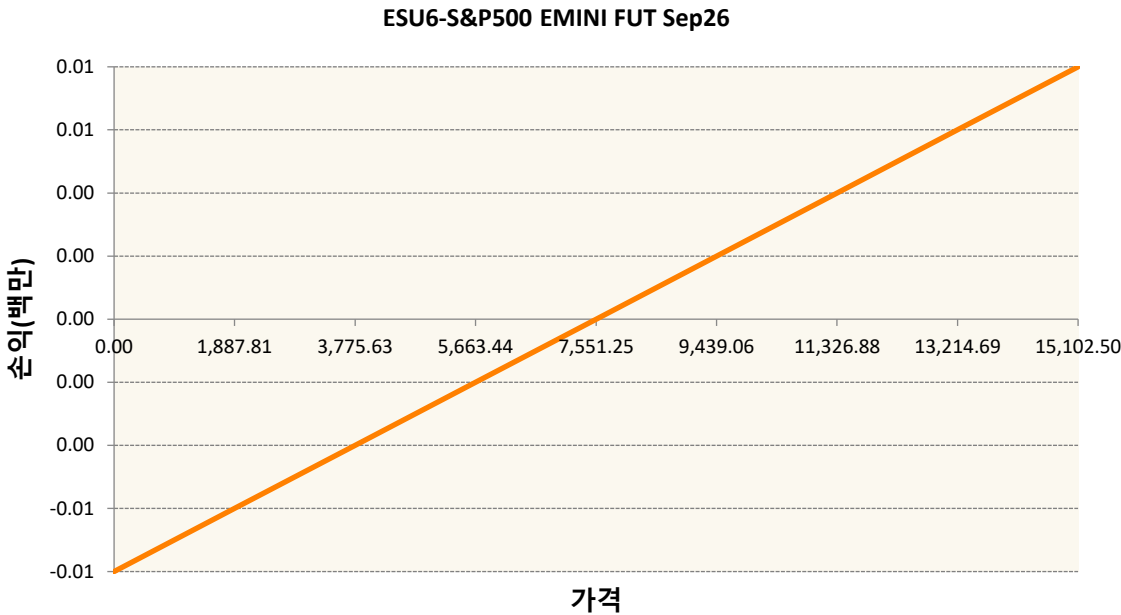
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	577	0	577	
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	2026-07-09
기준일	2026-07-08

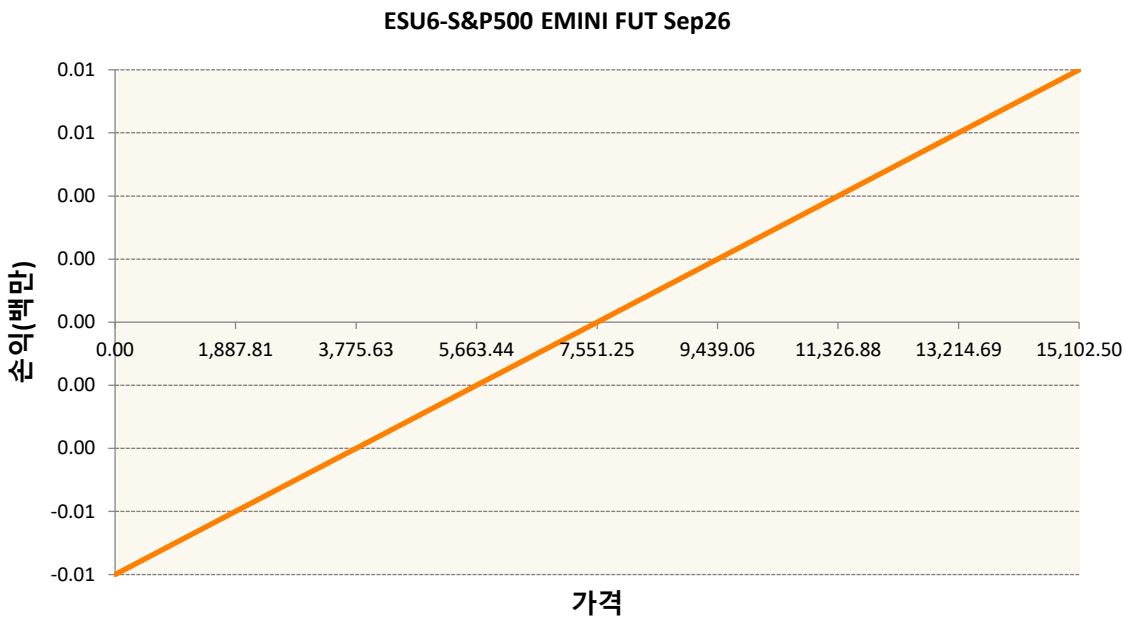
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	571	0	571	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	46
------	------------------------	----

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

(단위:백만원)

39

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

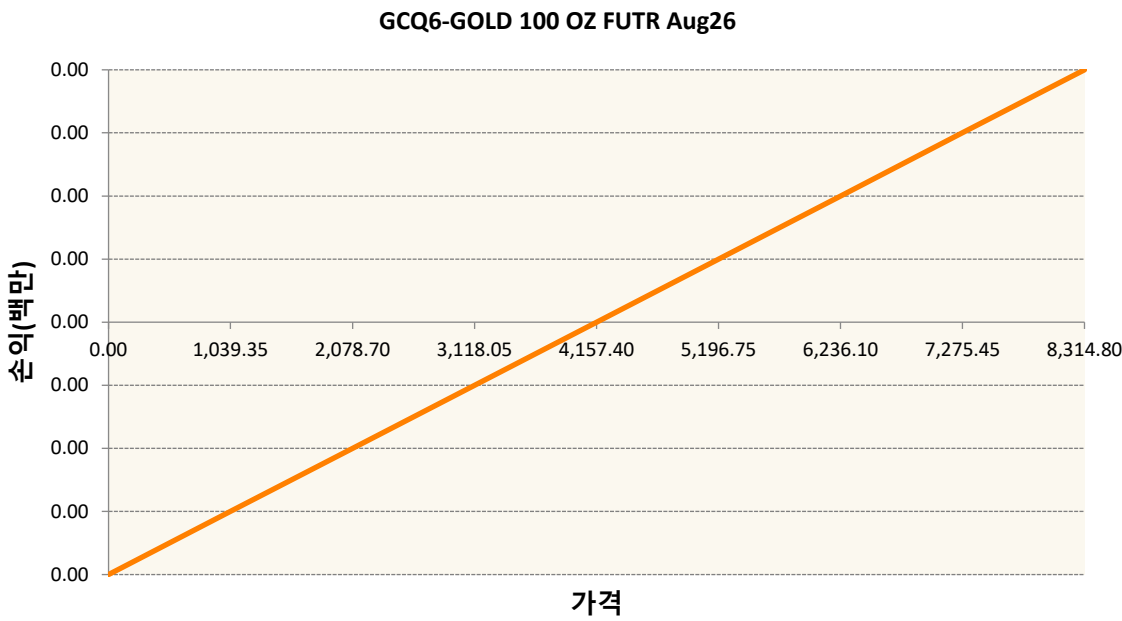
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,994	0	4,994	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDSCC0 GLD US 07/10/26 C375 EQUITY	14
GCQ6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	399

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

(단위:백만원)

537

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

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	51
AOPLTRUSP1 PLTR US 07/10/26 P130 EQUITY	23

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

(단위:백만원)

221

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

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

5

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

(단위:백만원)

3

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

(단위:백만원)

14,205

공시일 2026-07-09

기준일 2026-07-08

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	2026-07-09
기준일	2026-07-08

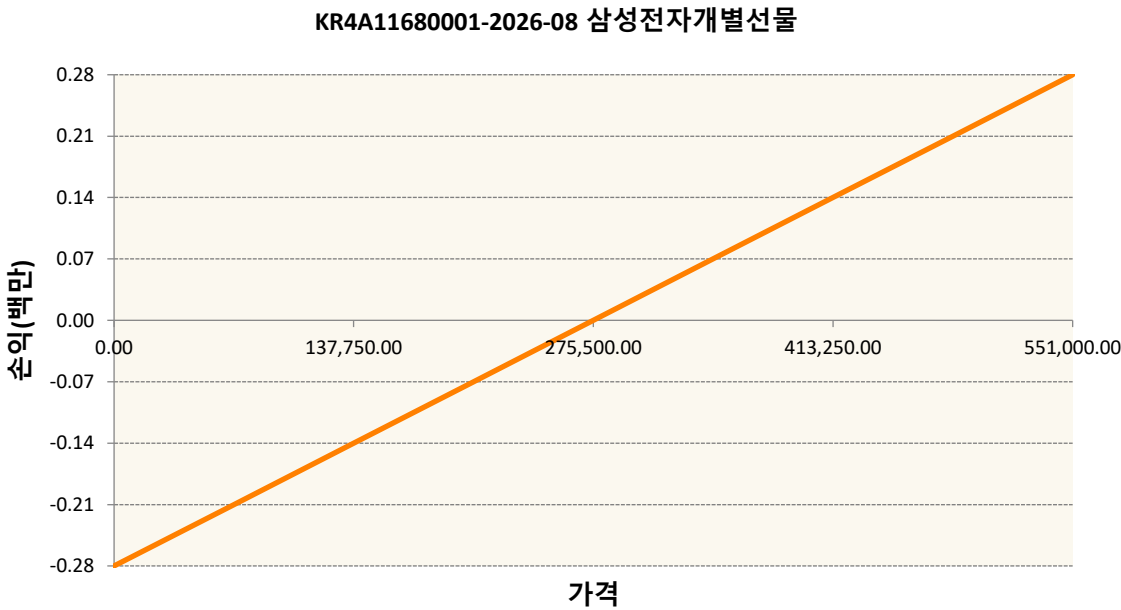
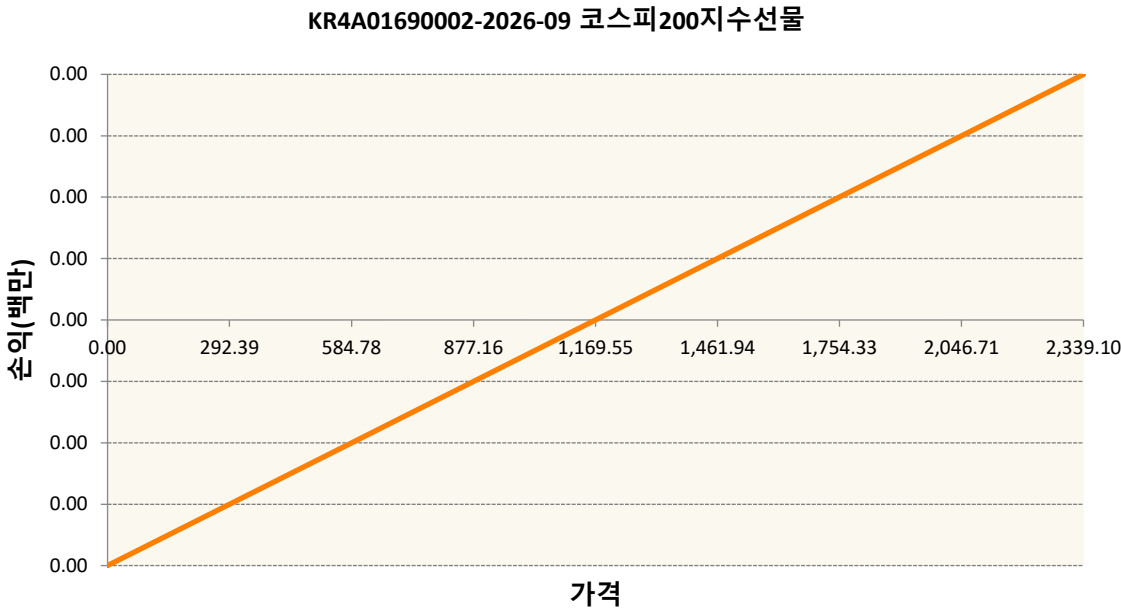
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

1. 계약금액

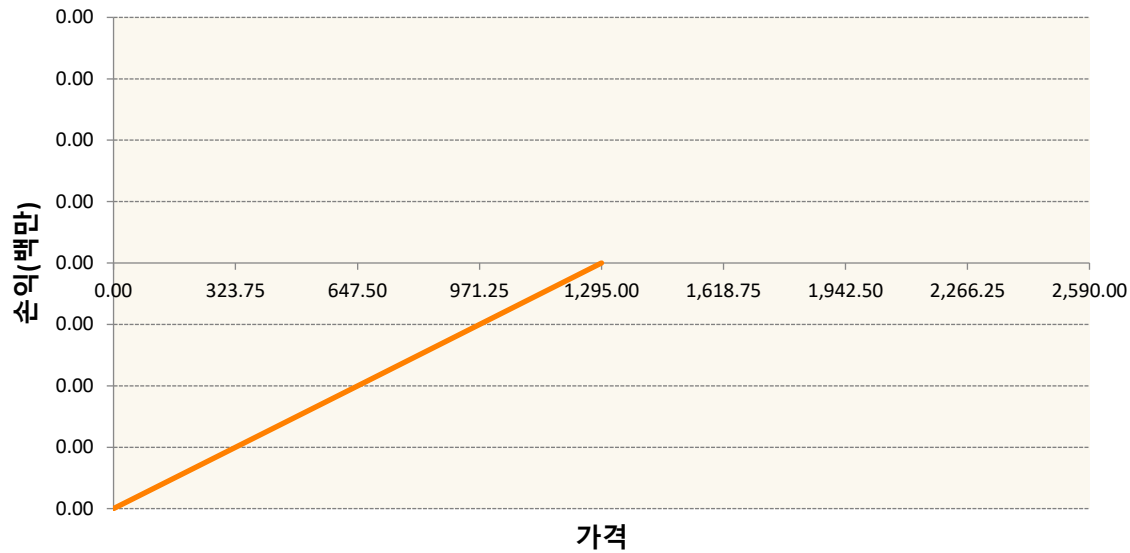
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	15,959	0	15,959	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	22,479	0	22,479	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,640	-35,640	장내

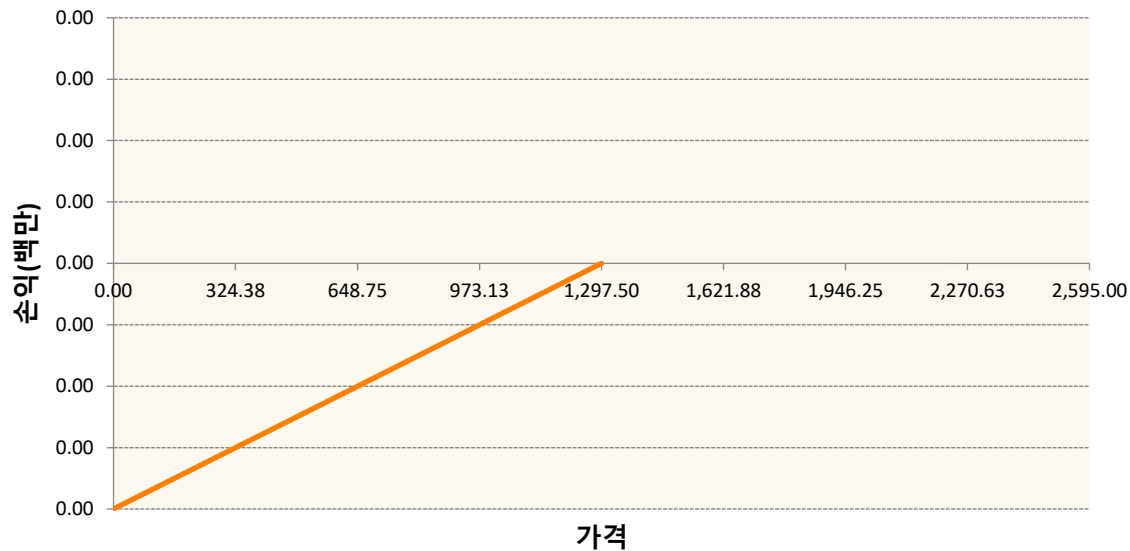
2. 만기시점의 손익구조



KR4B0167B206-코스피|200 C 202607 1,295.0



KR4B0167B214-코스피|200 C 202607 1,297.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002						2026-09 코스피200지수선물		602
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-602
-5.33%	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402	-402
-2.67%	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201	-201
0%	0	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	201	201	201	201	201	201	201	201
5.33%	402	402	402	402	402	402	402	402
8.00%	602	602	602	602	602	602	602	602
KR4A11680001						2026-08 삼성전자개별선물		1,199
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199	-1,199
-5.33%	-799	-799	-799	-799	-799	-799	-799
-2.67%	-400	-400	-400	-400	-400	-400	-400
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	400	400	400	400	400	400	400
5.33%	799	799	799	799	799	799	799
8.00%	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199	1,199
KR4B0167B206 코스피200 C 202607 1,295.0							1,524

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,524	-1,524	-1,524	-1,524	-1,524	-1,524	-1,524
-5.33%	-1,014	-1,014	-1,014	-1,014	-1,015	-1,015	-1,016
-2.67%	-504	-505	-505	-505	-507	-508	-511
0%	5	4	3	0	-4	-9	-16
2.67%	511	508	502	494	485	473	460
5.33%	1,004	992	978	961	942	922	900
8.00%	1,454	1,429	1,403	1,375	1,346	1,317	1,286

KR4B0167B214 코스피200 C 202607 1,297.5							1,016
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016	-1,016
-5.33%	-676	-676	-676	-677	-677	-677	-678
-2.67%	-337	-337	-337	-337	-338	-339	-341
0%	3	2	2	0	-2	-6	-10
2.67%	341	339	335	330	324	317	309
5.33%	671	663	654	644	632	618	604
8.00%	974	958	941	923	904	885	865

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

(단위:백만원)

10,755

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

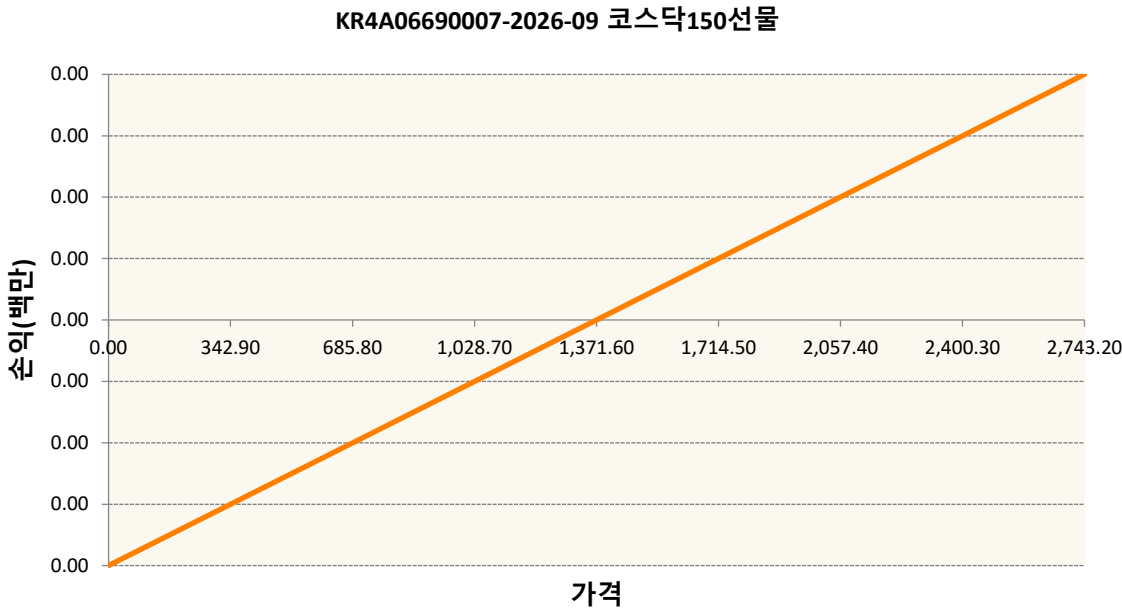
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	796	0	796	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007		2026-09 코스닥150선물					63
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-63	-63	-63	-63	-63	-63	-63
-5.33%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-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%	42	42	42	42	42	42	42
8.00%	63	63	63	63	63	63	63

공시일 2026-07-09

기준일 2026-07-08

SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

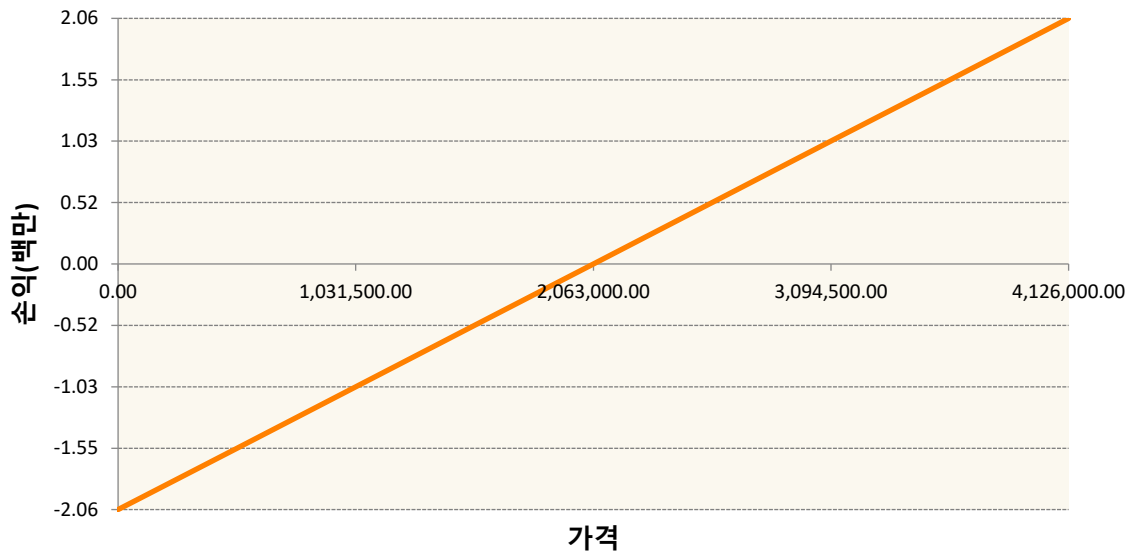
1. 계약금액

(단위:백만원)

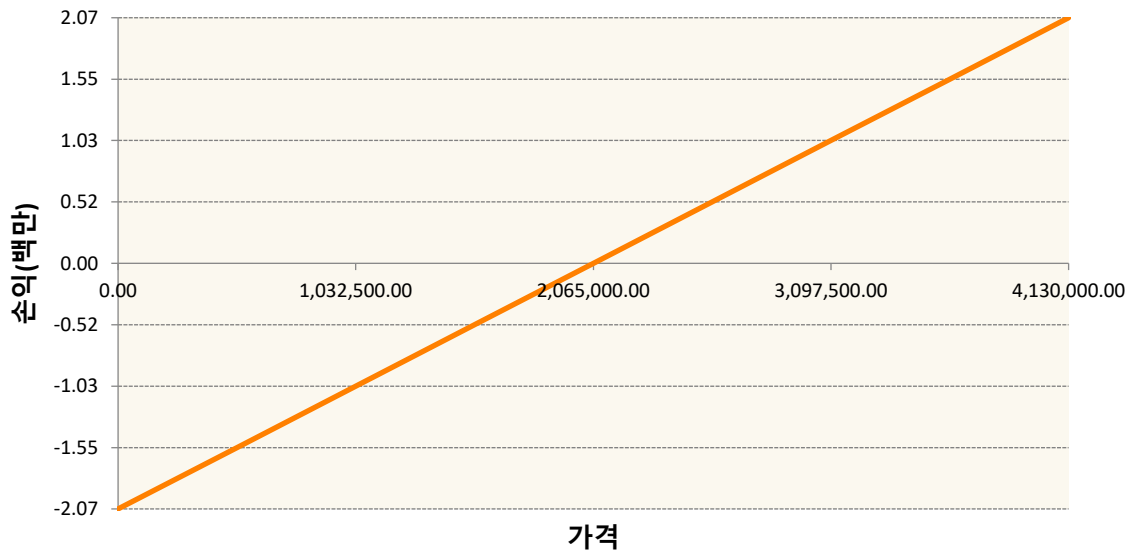
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	17,452	23,720	-6,268	장내
누계	유가증권	선물	64,515	0	64,515	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4A50670004-2026-07 SK하이닉스개별선물



KR4A50680003-2026-08 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A50670004			2026-07 SK하이닉스개별선물				1,334
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,334	-1,334	-1,334	-1,334	-1,334	-1,334	-1,334
-5.33%	-889	-889	-889	-889	-889	-889	-889
-2.67%	-445	-445	-445	-445	-445	-445	-445
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	445	445	445	445	445	445	445
5.33%	889	889	889	889	889	889	889
8.00%	1,334	1,334	1,334	1,334	1,334	1,334	1,334
KR4A50680003			2026-08 SK하이닉스개별선물				3,856
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3,856	-3,856	-3,856	-3,856	-3,856	-3,856	-3,856
-5.33%	-2,571	-2,571	-2,571	-2,571	-2,571	-2,571	-2,571
-2.67%	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285	-1,285
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,285	1,285	1,285	1,285	1,285	1,285	1,285
5.33%	2,571	2,571	2,571	2,571	2,571	2,571	2,571
8.00%	3,856	3,856	3,856	3,856	3,856	3,856	3,856

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

20,129

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

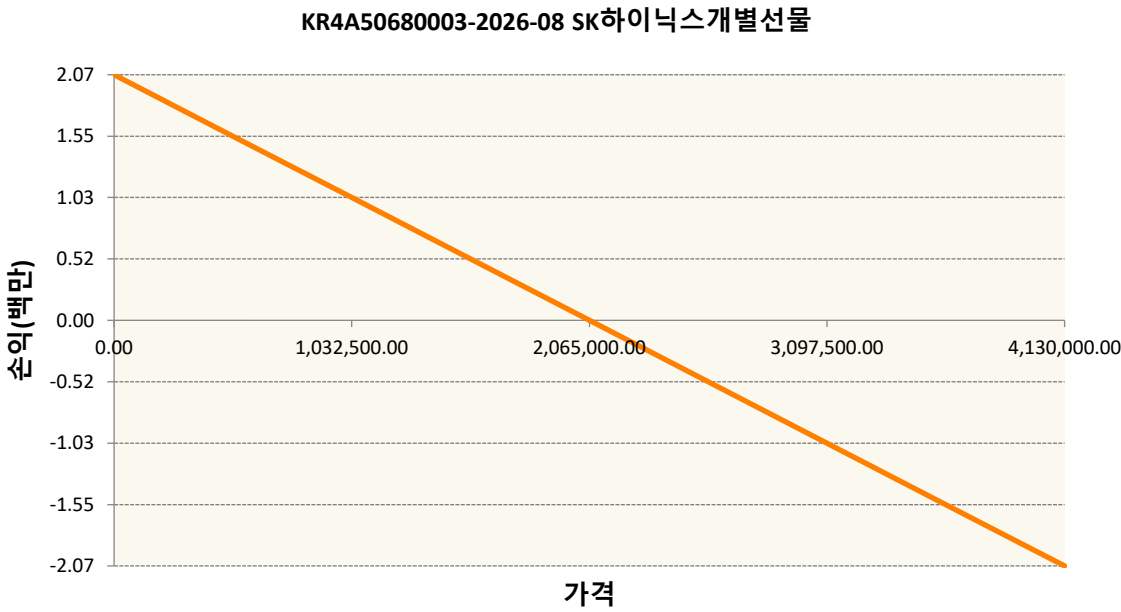
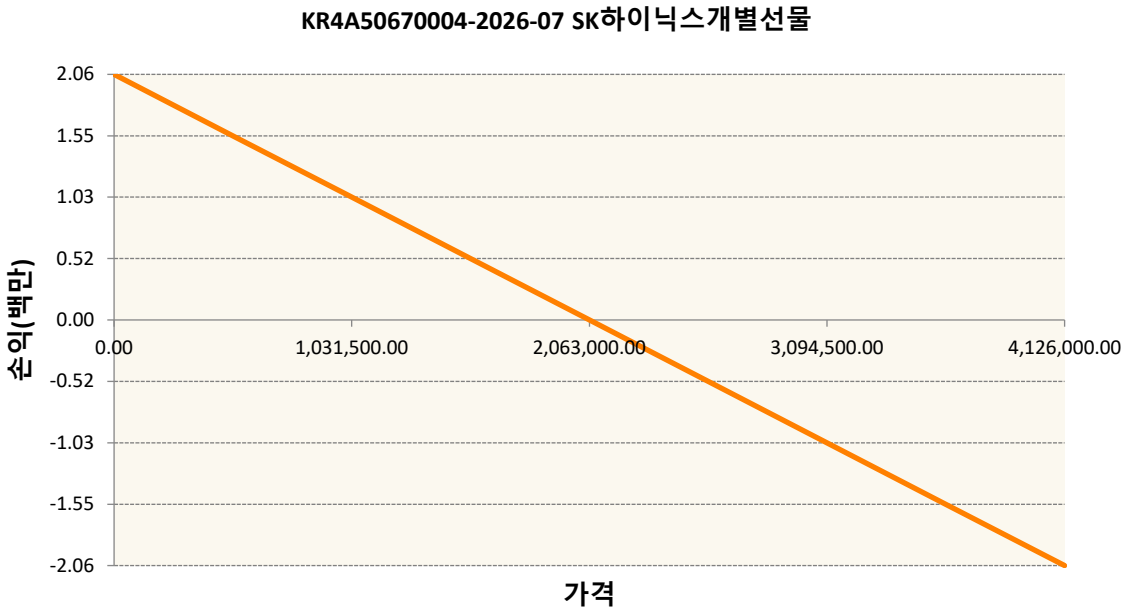
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	162,631	158,214	4,417	장내
누계	유가증권	선물	0	410,195	-410,195	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A50670004			2026-07 SK하이닉스개별선물				8,309
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	8,309	8,309	8,309	8,309	8,309	8,309	8,309
-5.33%	5,539	5,539	5,539	5,539	5,539	5,539	5,539
-2.67%	2,770	2,770	2,770	2,770	2,770	2,770	2,770
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-2,770	-2,770	-2,770	-2,770	-2,770	-2,770	-2,770
5.33%	-5,539	-5,539	-5,539	-5,539	-5,539	-5,539	-5,539
8.00%	-8,309	-8,309	-8,309	-8,309	-8,309	-8,309	-8,309
KR4A50680003			2026-08 SK하이닉스개별선물				24,689
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	24,689	24,689	24,689	24,689	24,689	24,689	24,689
-5.33%	16,460	16,460	16,460	16,460	16,460	16,460	16,460
-2.67%	8,230	8,230	8,230	8,230	8,230	8,230	8,230
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-8,230	-8,230	-8,230	-8,230	-8,230	-8,230	-8,230
5.33%	-16,460	-16,460	-16,460	-16,460	-16,460	-16,460	-16,460
8.00%	-24,689	-24,689	-24,689	-24,689	-24,689	-24,689	-24,689

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

127,983

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

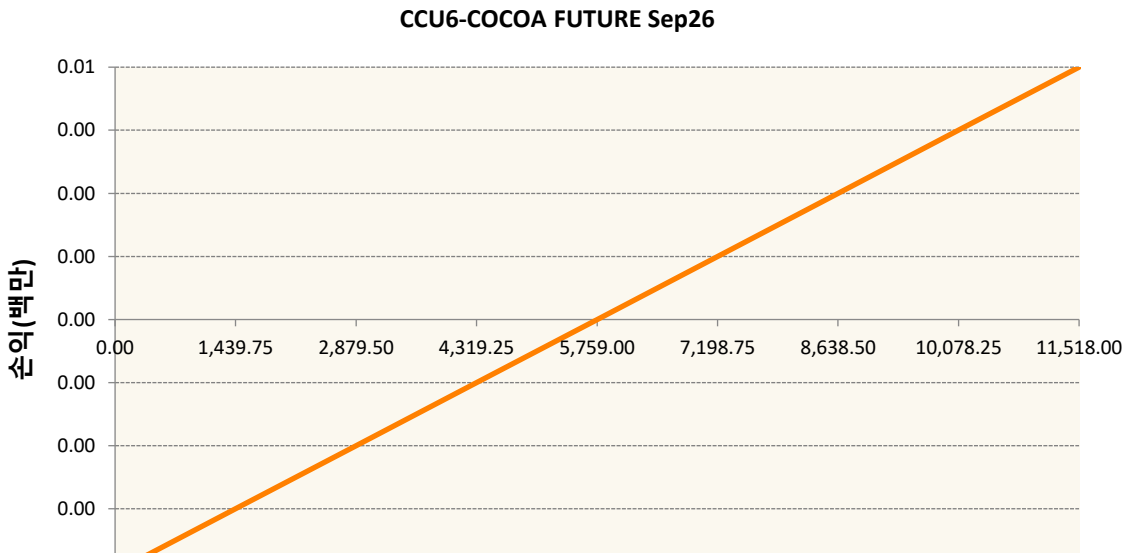
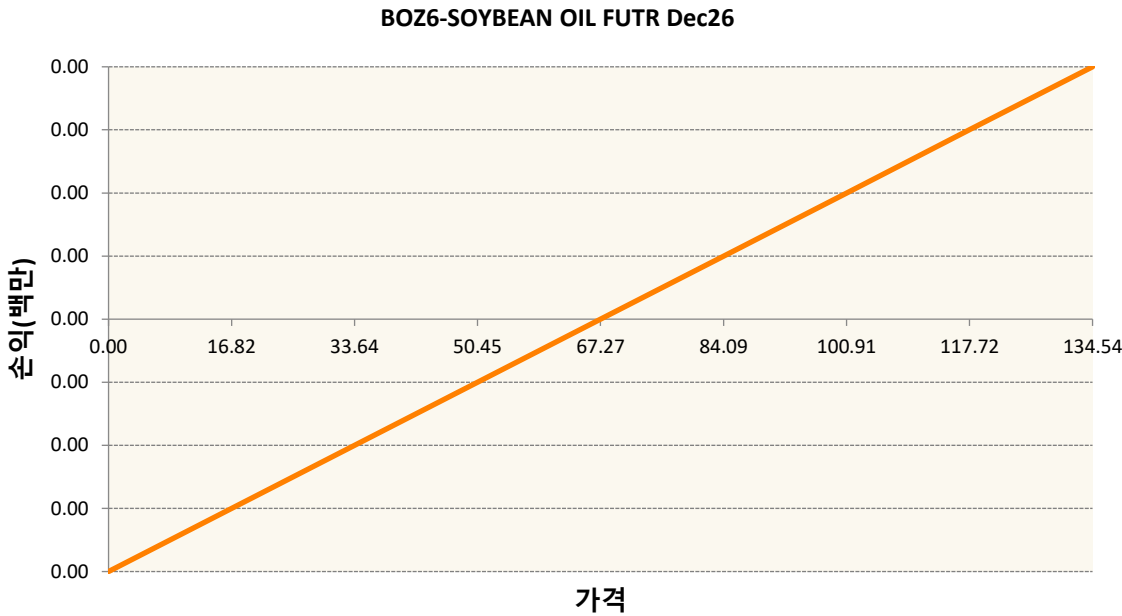
포커스농산물모(채권-파생형)

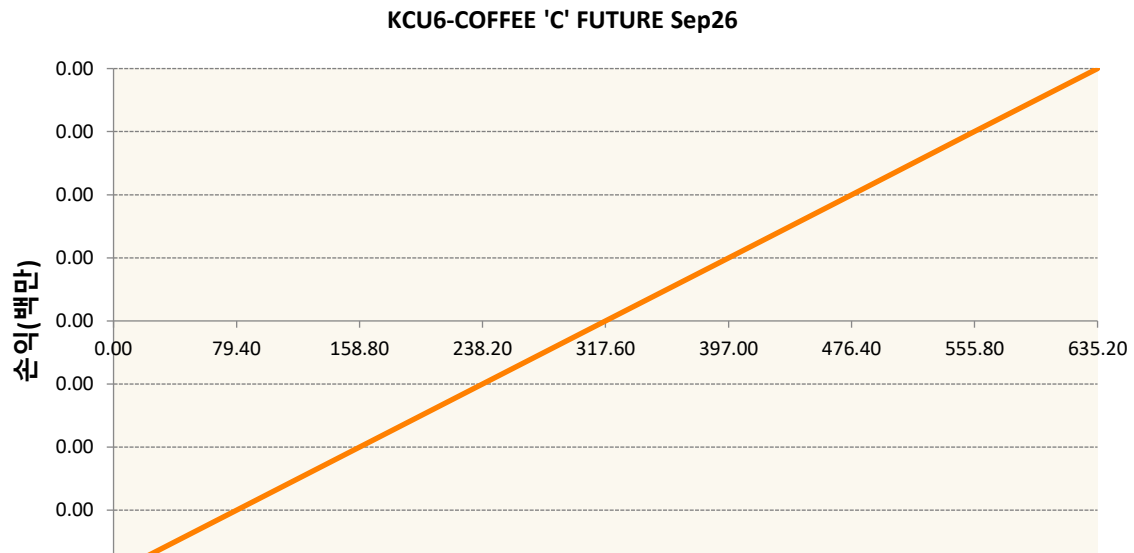
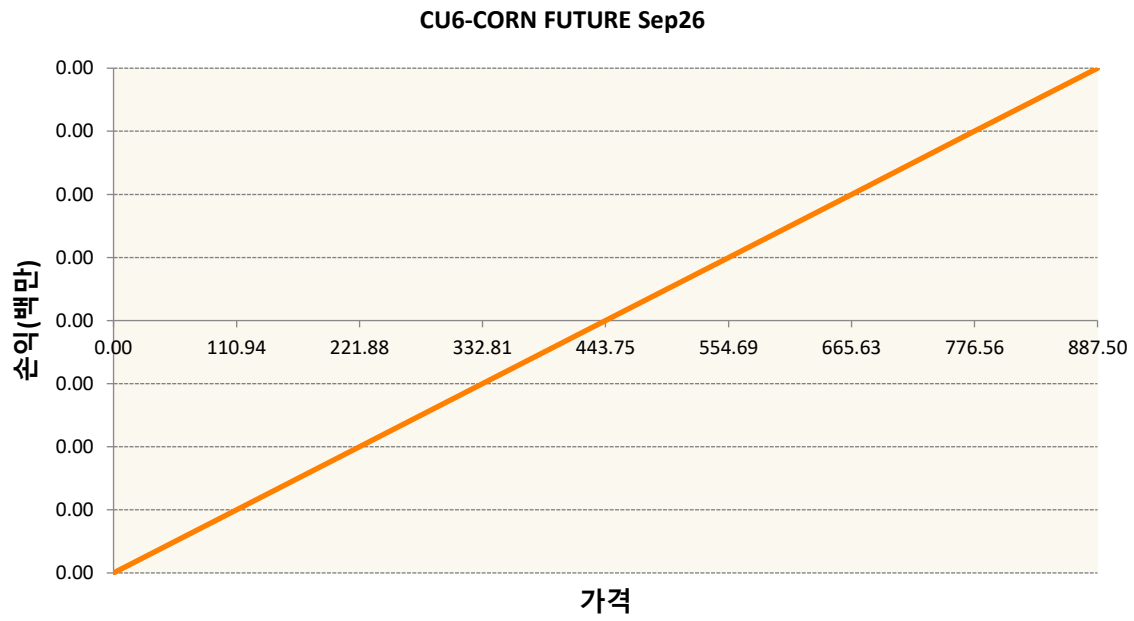
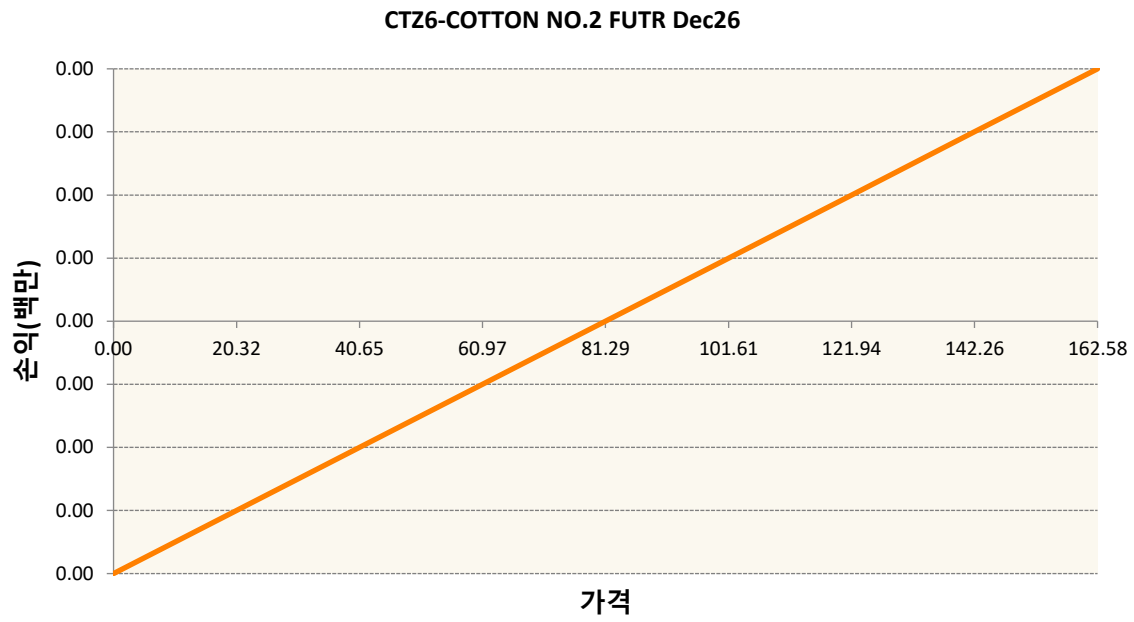
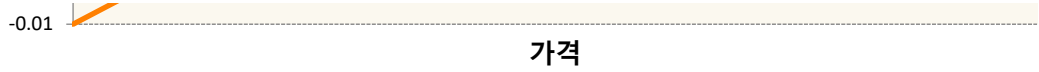
1. 계약금액

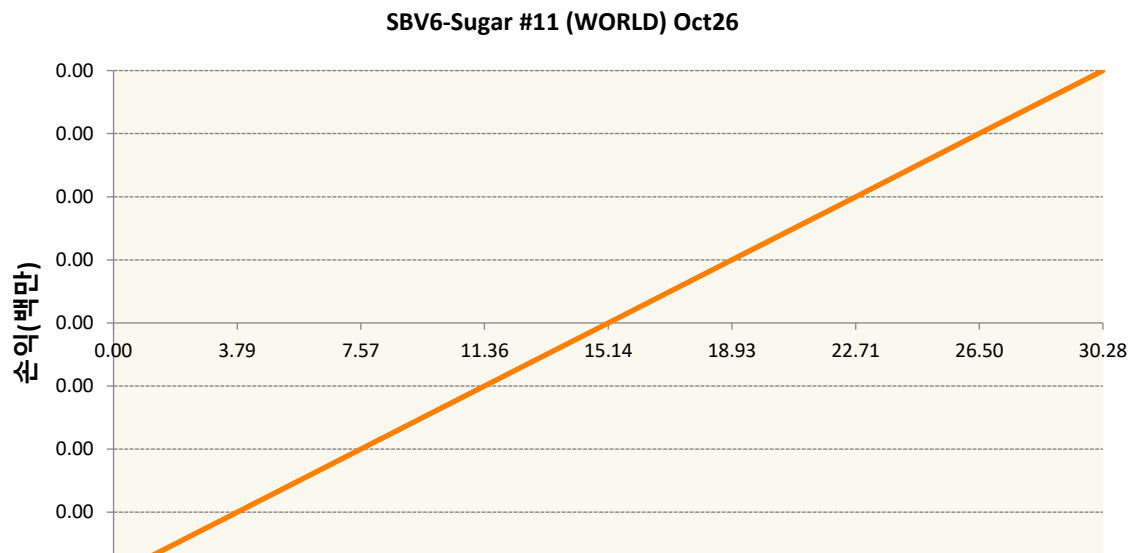
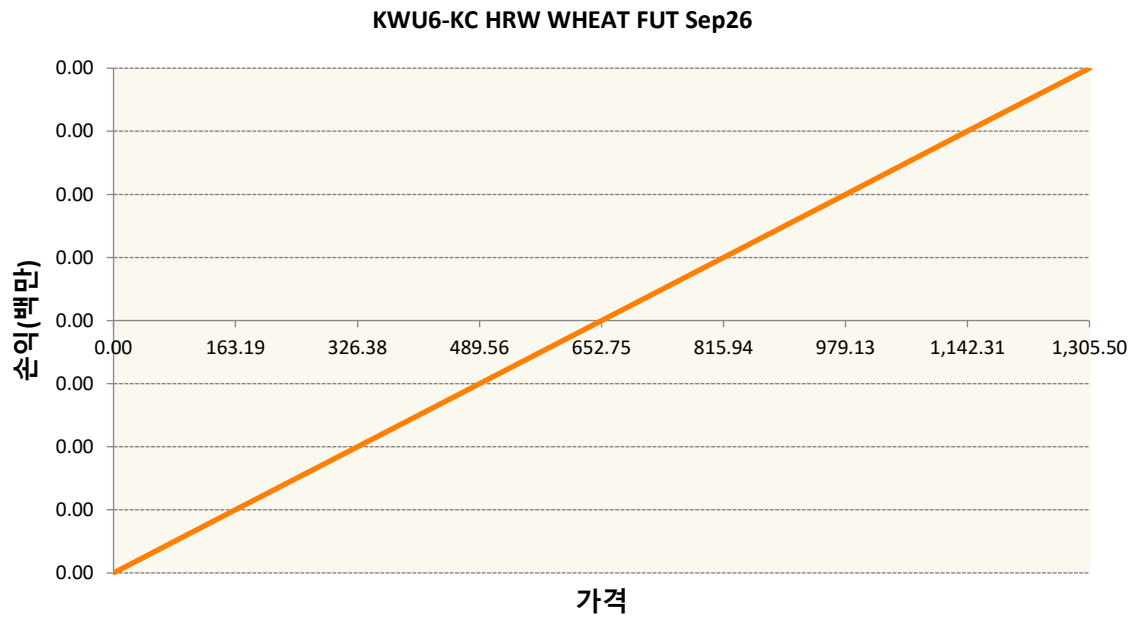
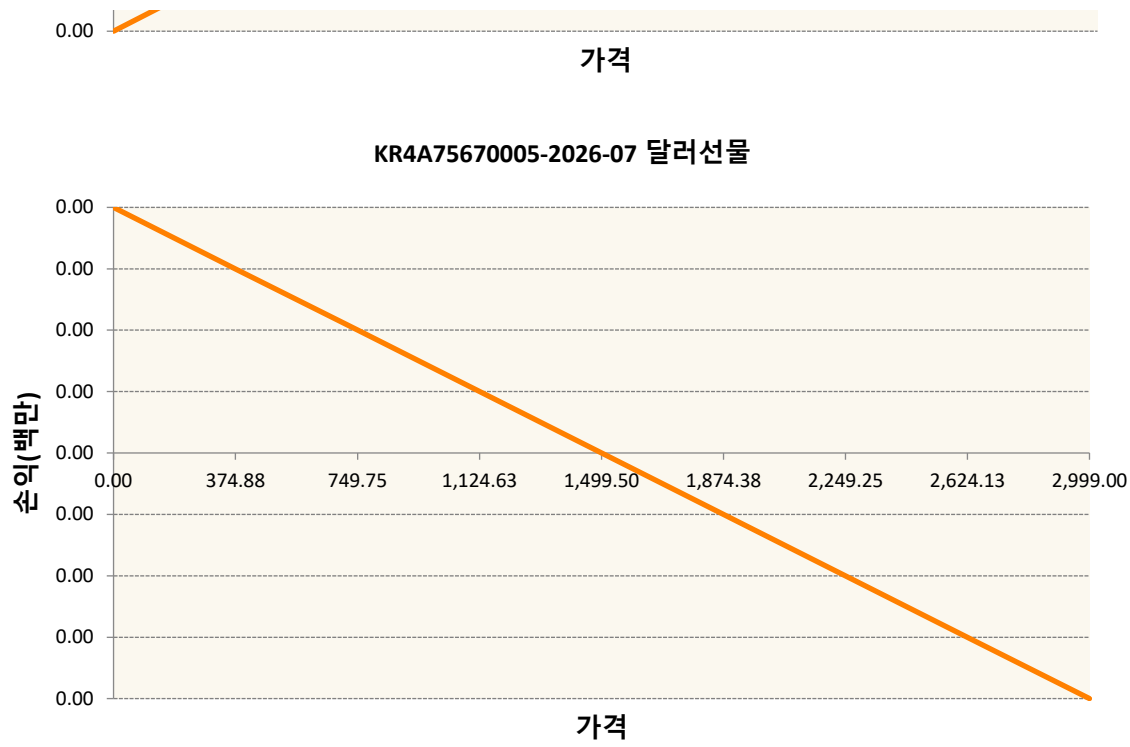
(단위:USD 백만)

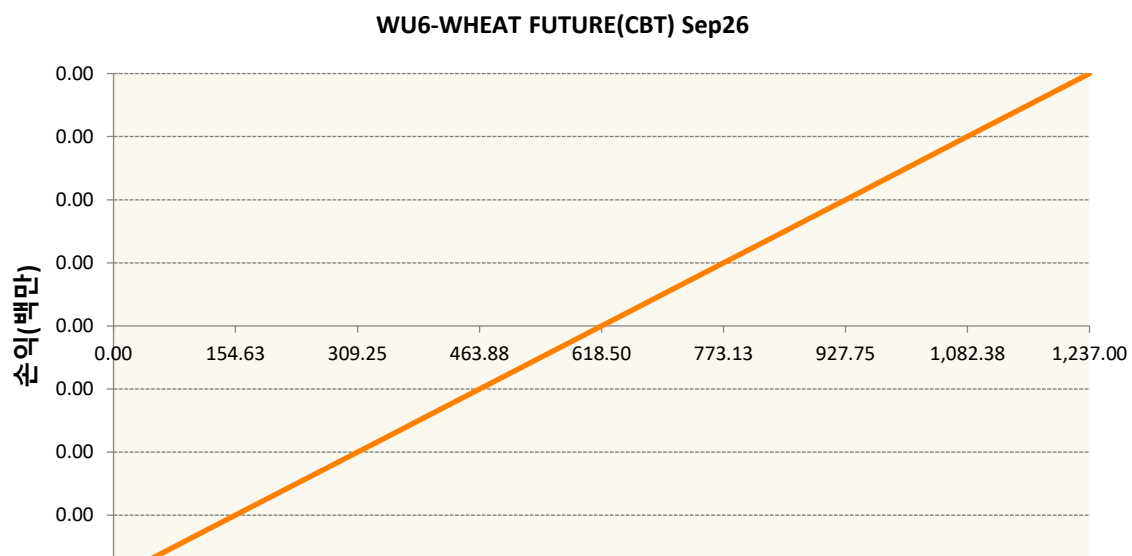
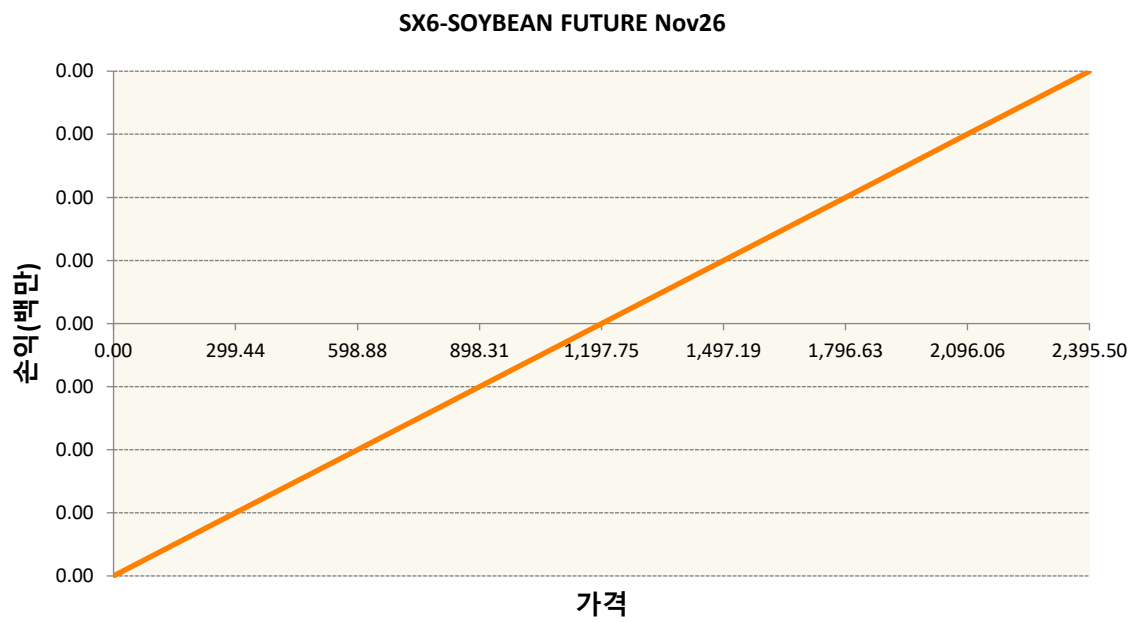
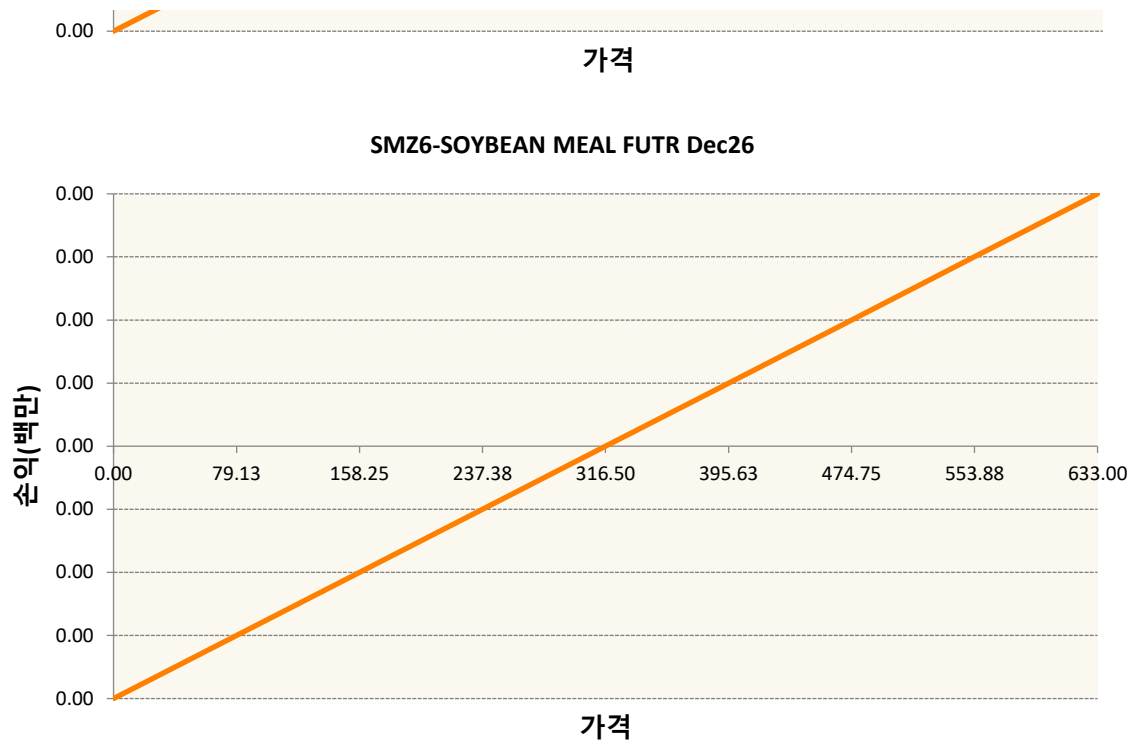
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	91	-91	장내
누계	실물자산	선물	457	0	457	
누계	유가증권	선물	2,155	0	2,155	
누계	통화	선물	0	315	-315	장내

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	2026-07-09
기준일	2026-07-08

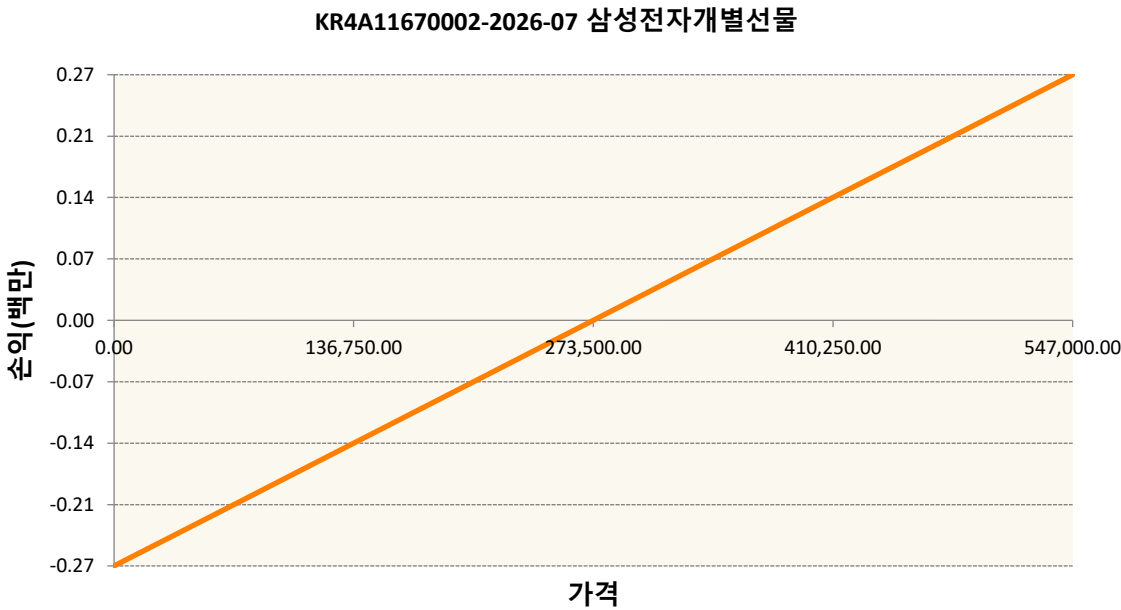
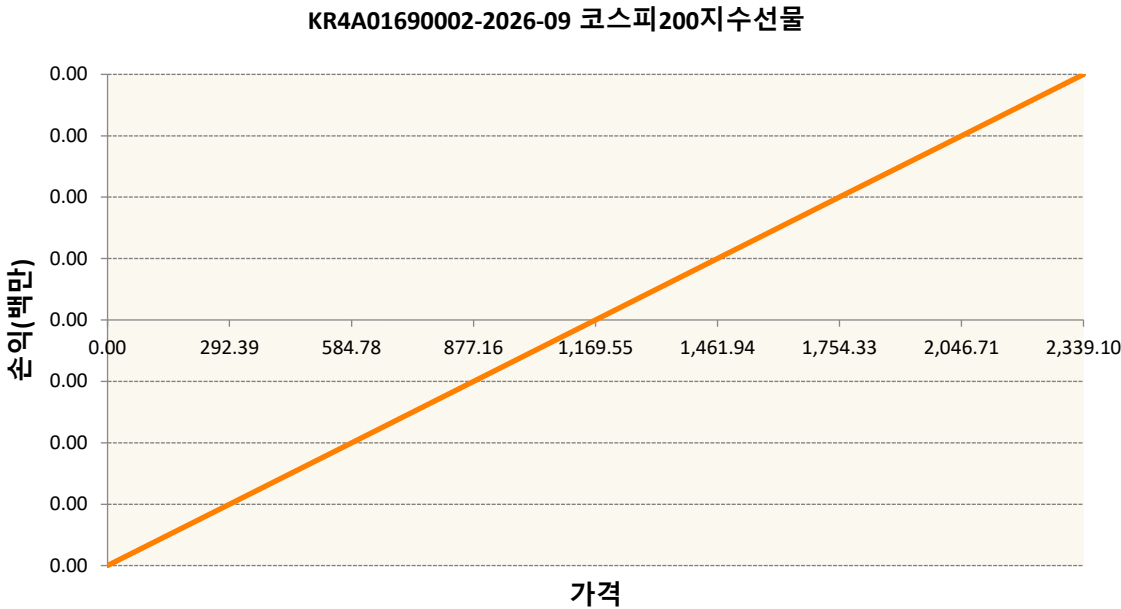
스마트인덱스모

1. 계약금액

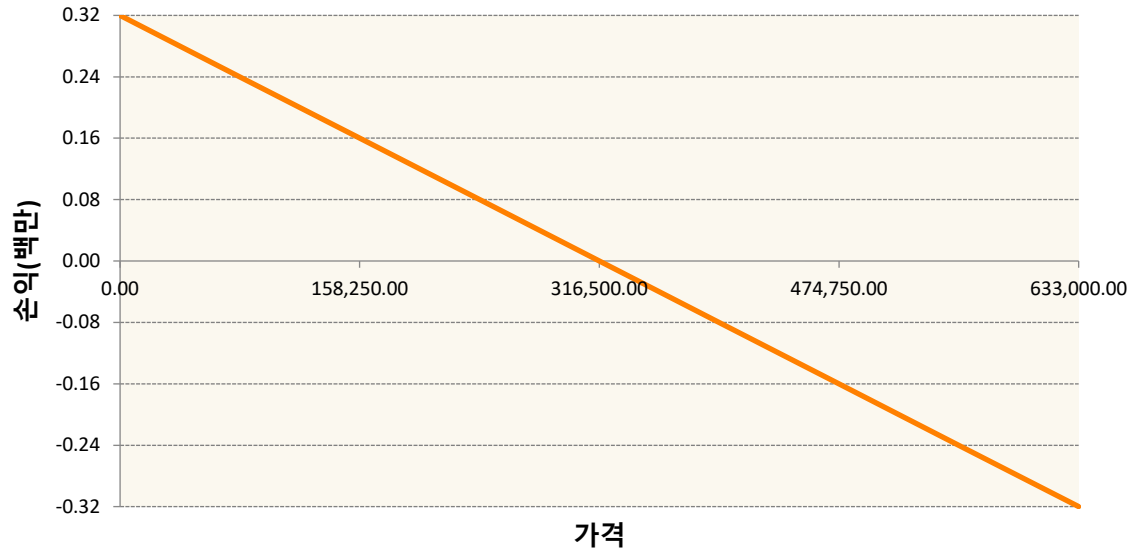
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	587	589	-2	장내
누계	유가증권	선물	4,203	79	4,124	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4AF5670009-2026-07 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002		2026-09 코스피200지수선물					324
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324
-5.33%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216
-2.67%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	108	108	108	108	108	108	108
5.33%	216	216	216	216	216	216	216
8.00%	324	324	324	324	324	324	324
KR4A11670002		2026-07 삼성전자개별선물					9
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
-5.33%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-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%	6	6	6	6	6	6	6
8.00%	9	9	9	9	9	9	9
KR4AF5670009		2026-07 LG에너지솔루션개별선물					6
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	6	6	6	6	6	6	6
-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%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6

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

(단위:백만원)

940

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

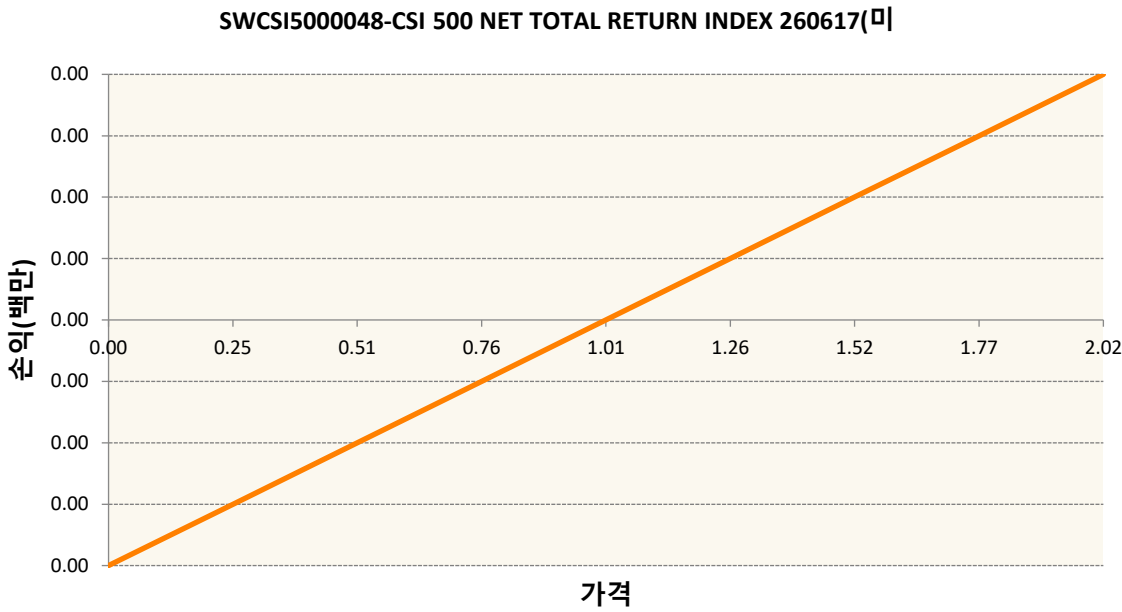
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	5,855	0	5,855	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260617(미

468

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

641

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

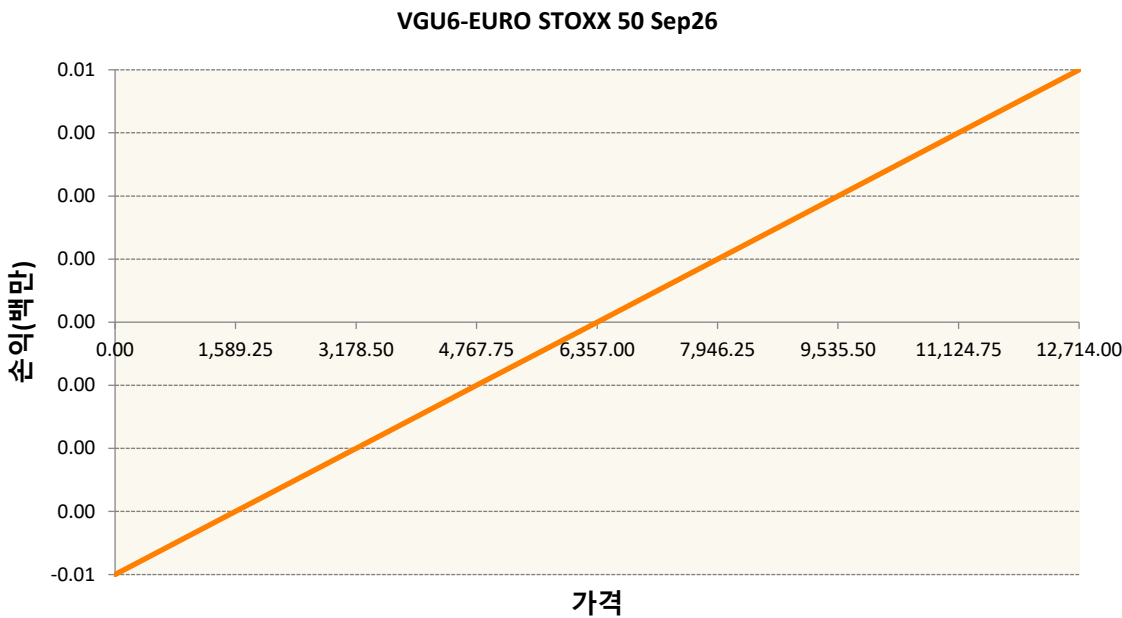
유로인덱스모(주식-파생형)

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	2026-07-09
기준일	2026-07-08

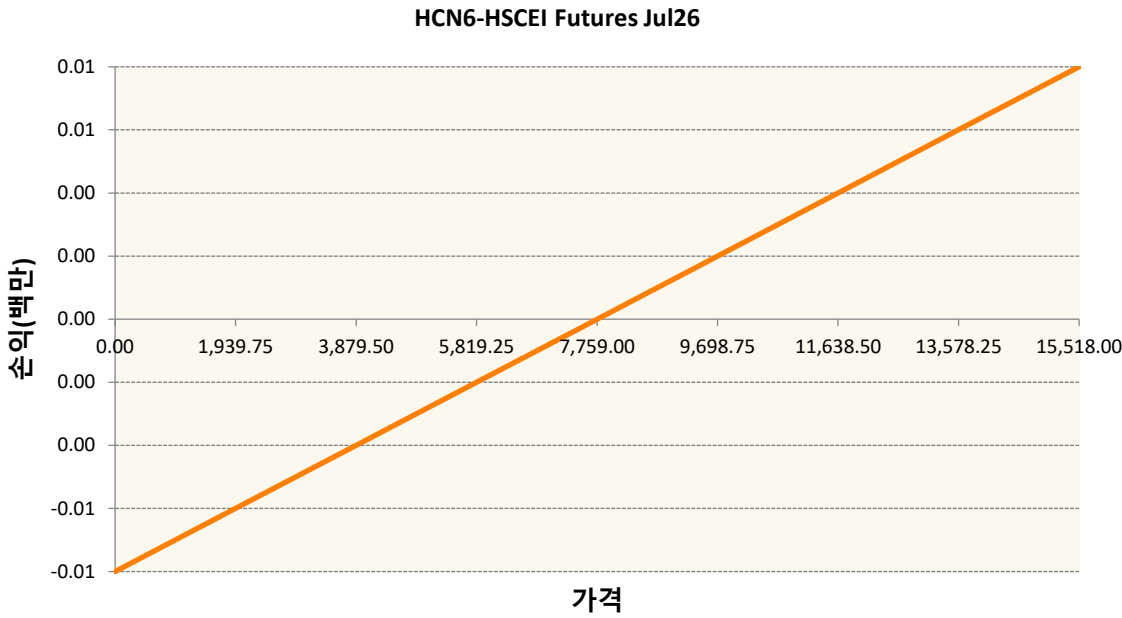
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,211	0	1,211	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN6	HSCEI Futures Jul26	97
------	---------------------	----

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

(단위:백만원)

115

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

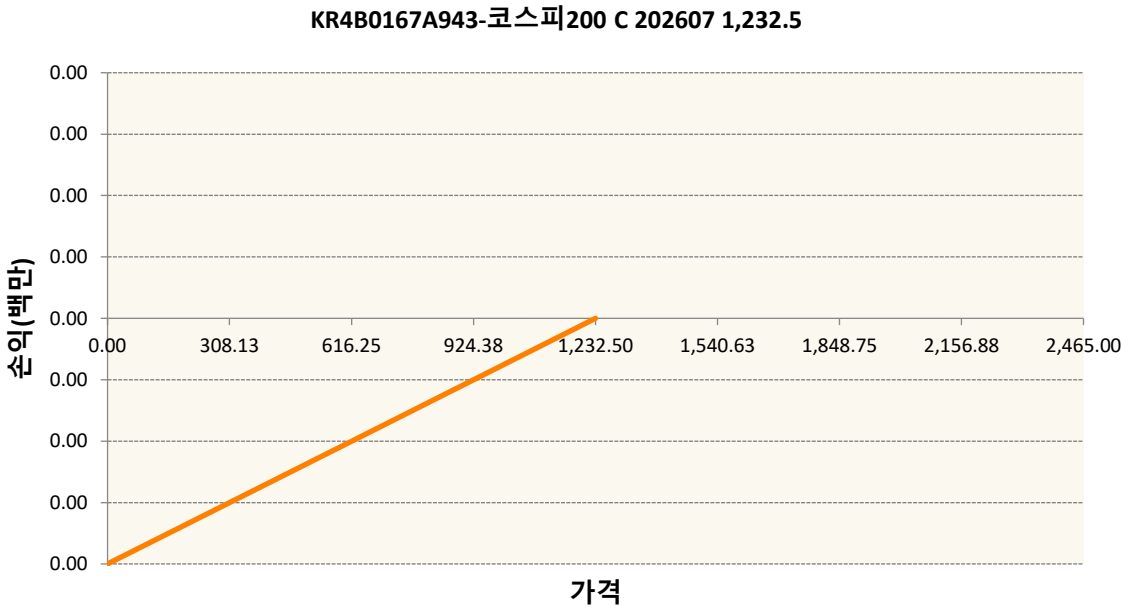
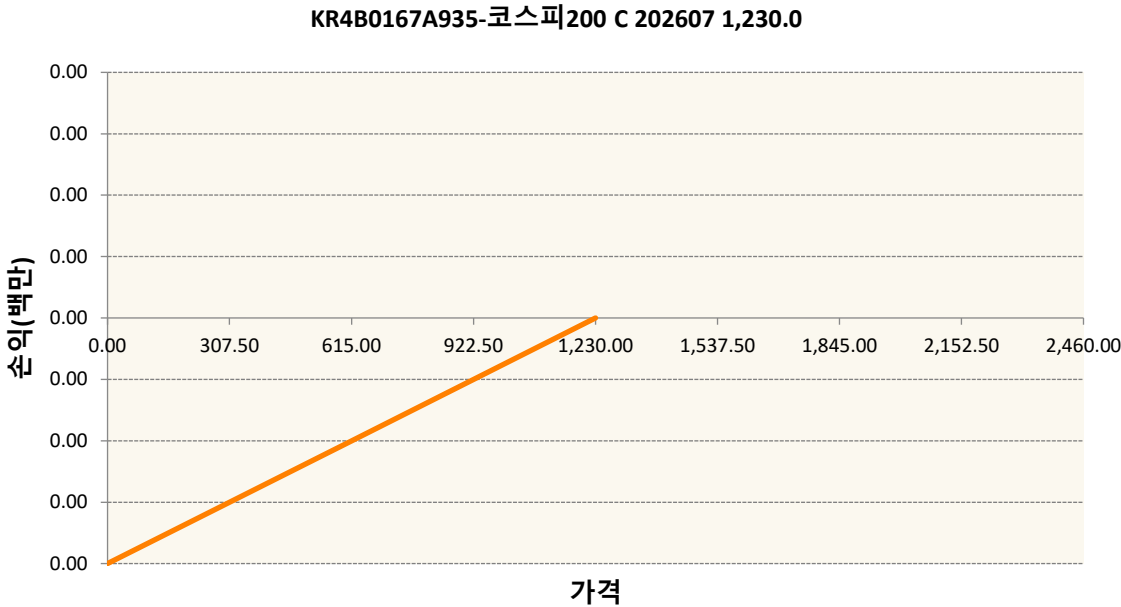
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

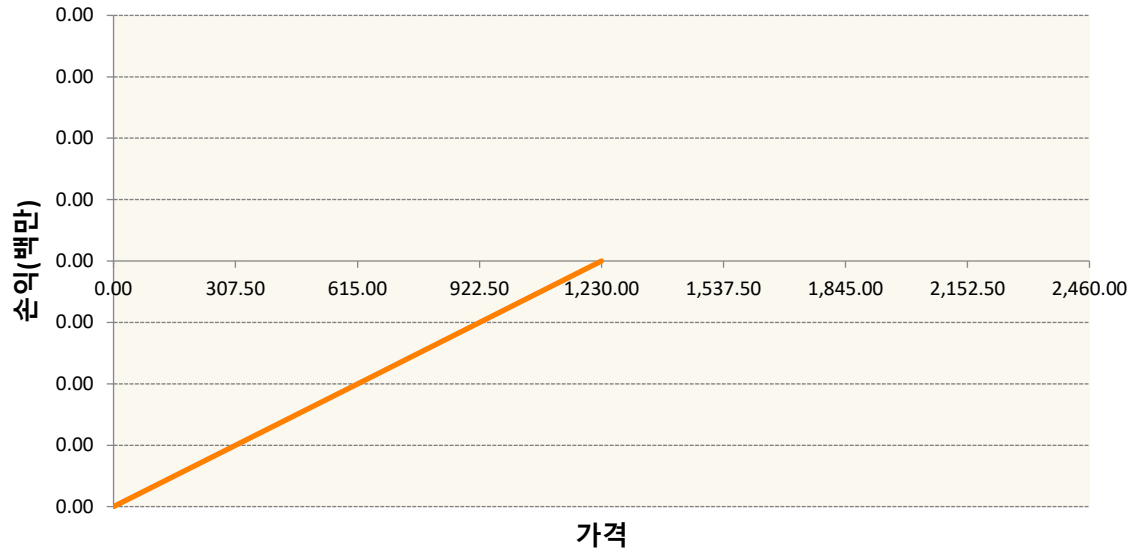
(단위:백만원)

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							536
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-535	-535	-535	-535	-535	-536	-536
-5.33%	-349	-349	-350	-351	-352	-353	-355
-2.67%	-165	-166	-168	-170	-173	-177	-182
0%	15	11	6	0	-6	-13	-21
2.67%	178	169	160	150	140	130	119
5.33%	307	295	283	270	258	246	233
8.00%	390	378	366	354	343	330	318
KR4B0167A943 코스피200 C 202607 1,232.5							1,703
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,698	-1,698	-1,698	-1,699	-1,700	-1,701	-1,703
-5.33%	-1,111	-1,112	-1,113	-1,115	-1,119	-1,123	-1,129
-2.67%	-527	-530	-536	-543	-552	-563	-577
0%	44	32	17	0	-19	-41	-64
2.67%	567	540	512	482	451	419	386
5.33%	986	948	909	870	832	793	754
8.00%	1,259	1,222	1,184	1,146	1,108	1,069	1,031
KR4C0167A933 코스피200 P 202607 1,230.0							492
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-490	-490	-490	-490	-490	-491	-492
-5.33%	-320	-320	-321	-321	-323	-324	-326
-2.67%	-151	-152	-154	-156	-159	-162	-167
0%	13	10	5	0	-6	-12	-19

2.67%	163	155	147	138	129	119	109
5.33%	281	270	259	248	236	225	214
8.00%	357	347	336	325	314	303	292

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

(단위:백만원)

5,350

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

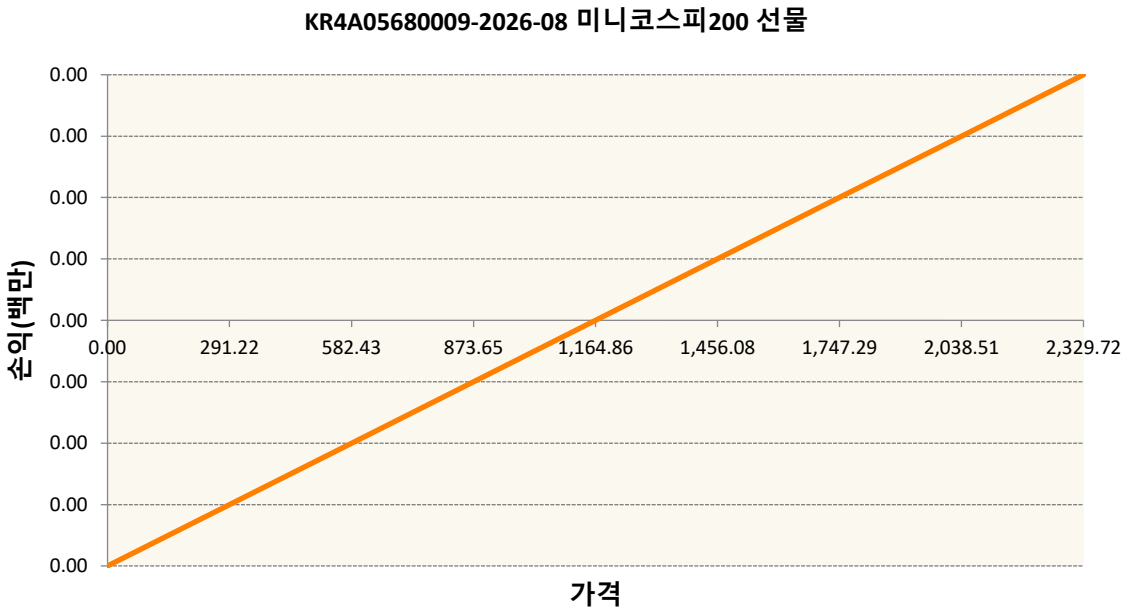
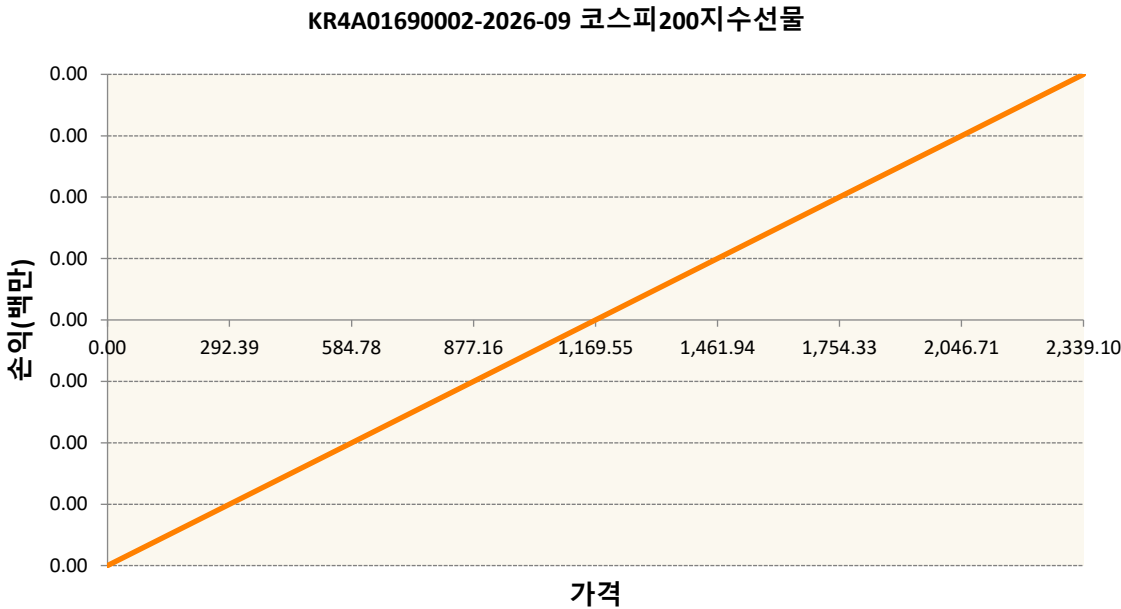
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

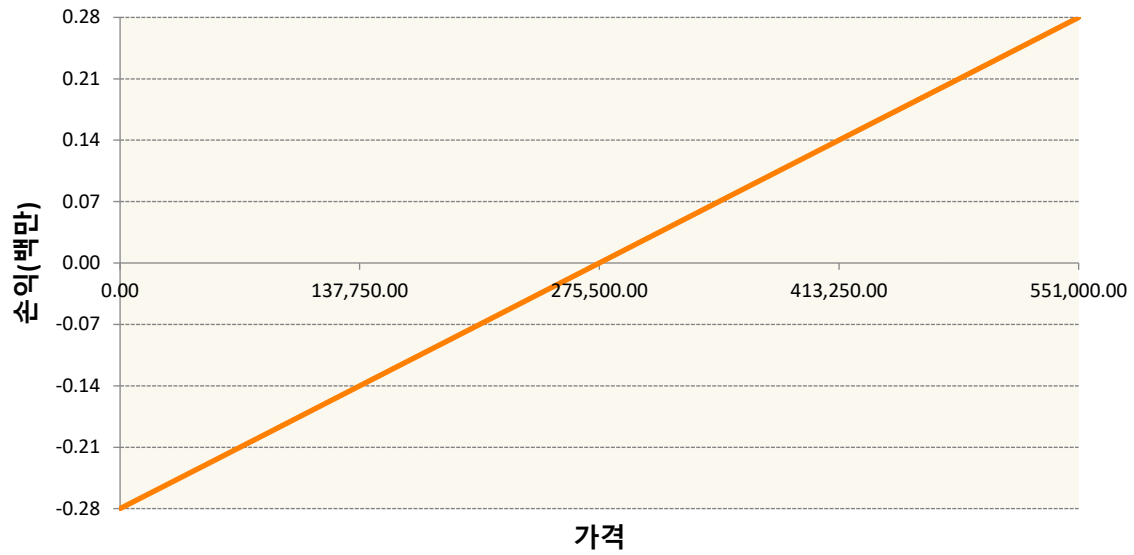
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	369	294	75	장내
누계	유가증권	선물	4,216	57	4,160	장내

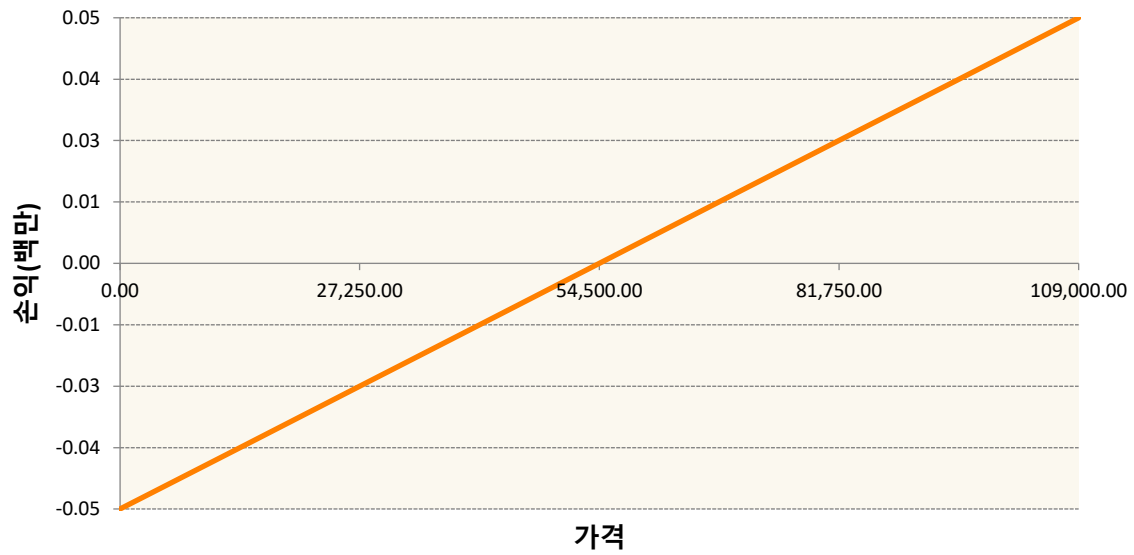
2. 만기시점의 손익구조



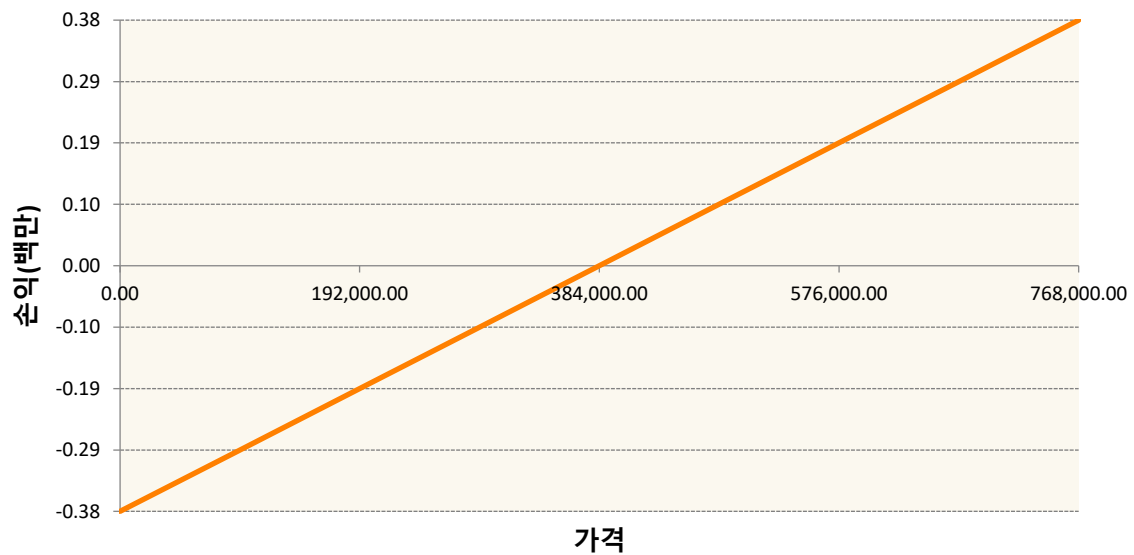
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



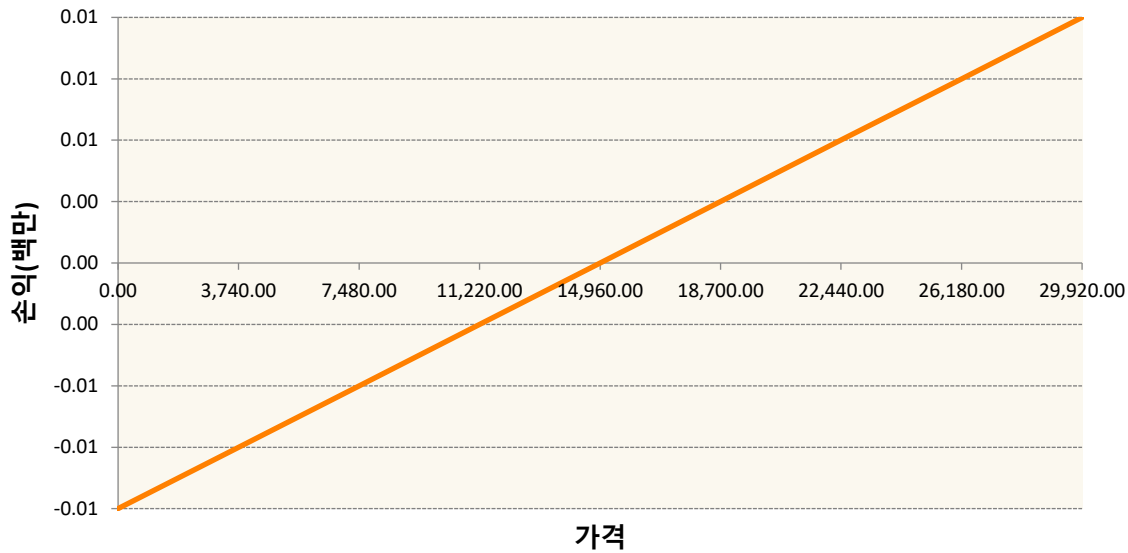
KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



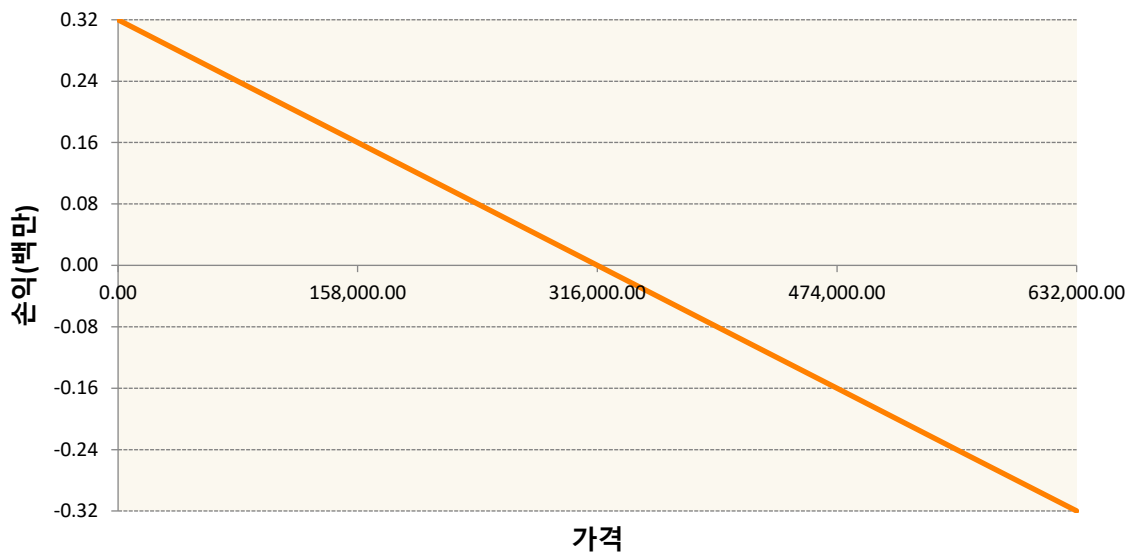
KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



KR4AB0680002-2026-08 LG유플러스개별선물



KR4AF5680008-2026-08 LG에너지솔루션개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물			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%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-2.67%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	23	23	23	23	23	23	23
5.33%	46	46	46	46	46	46	46
8.00%	70	70	70	70	70	70	70
KR4A05680009				2026-08 미니코스피200 선물			51
	기초자산의 변동성						

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

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

KR4A14680008 2026-08 KT개별선물 2

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-2	-2	-2	-2	-2	-2	-2
-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%	2	2	2	2	2	2	2

KR4A1Q680004 2026-08 에이피알개별선물 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

KR4AB0680002 2026-08 LG유플러스개별선물 0

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

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	0	0	0	0
KR4AF5680008 2026-08 LG에너지솔루션개별선물							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)

359

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

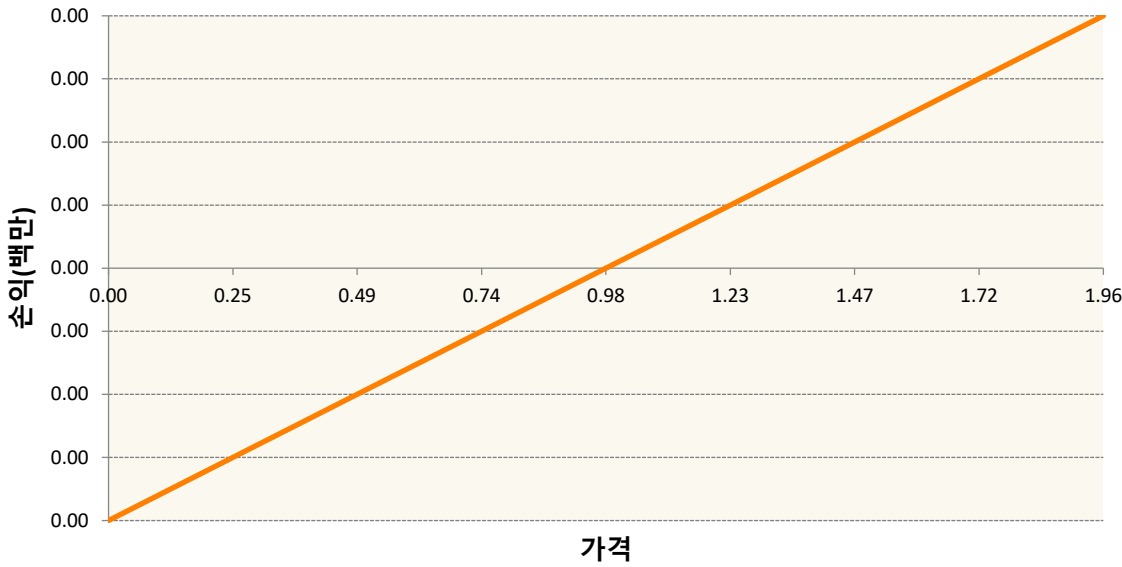
1. 계약금액

(단위:백만원)

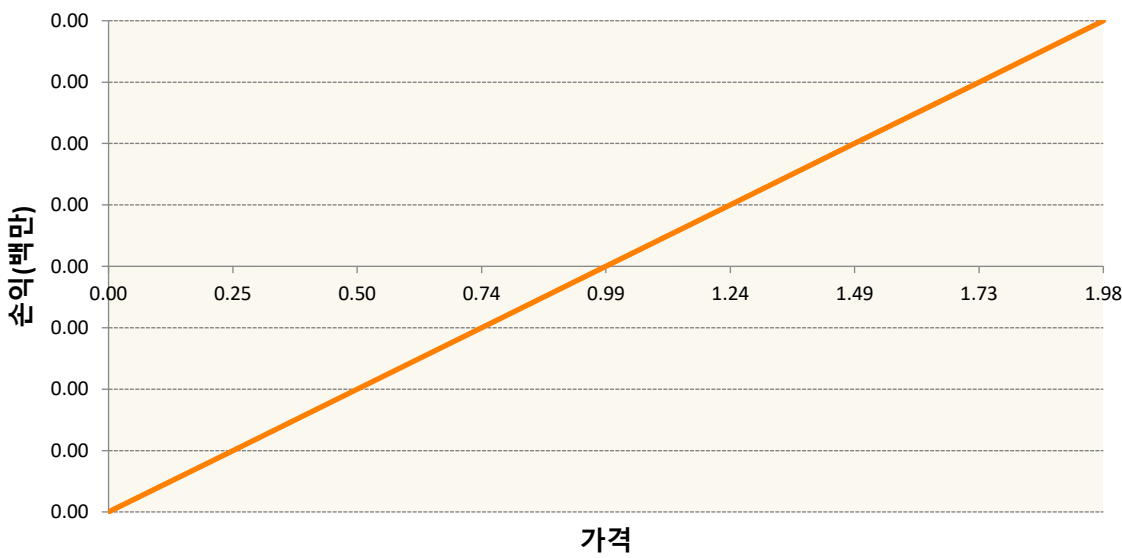
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,454	0	7,454	장외

2. 만기시점의 손익구조

2108840618ID-ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(



2108841218ID-ICE Global Carbon Futures Index(ER) (매



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		476
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		120

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	676

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

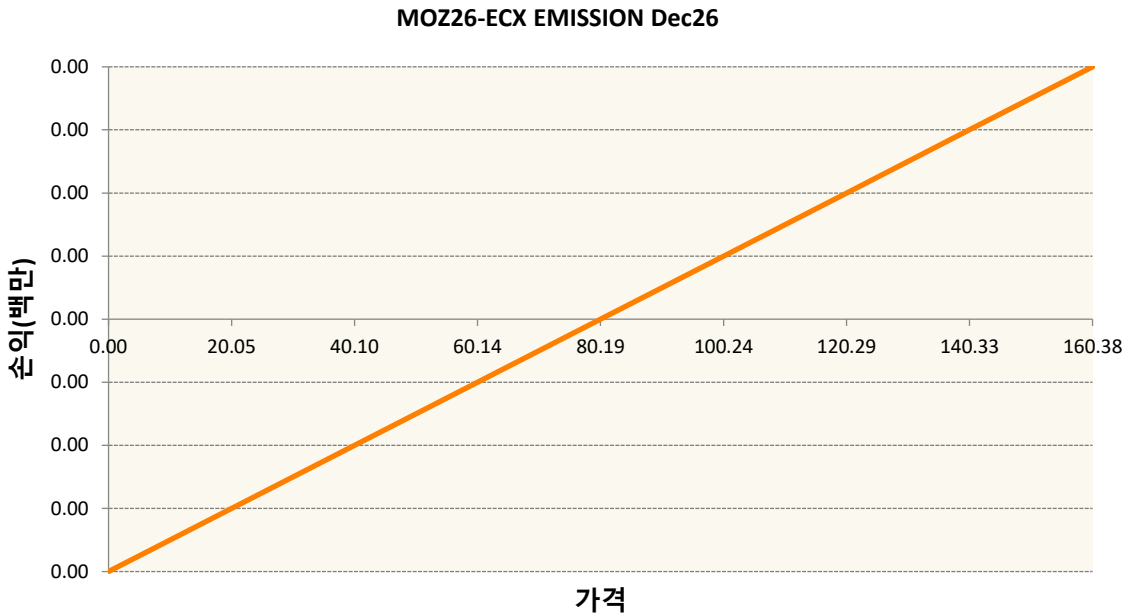
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,182	0	5,182	
누계	통화	선도	0	2,687	-2,687	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G6S(KRW/EUR 31-07-26E	215
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	415

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

(단위:백만원)

696

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

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	-850	0	-850	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	26
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	14
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	11
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	16

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

(단위:백만원)

104

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

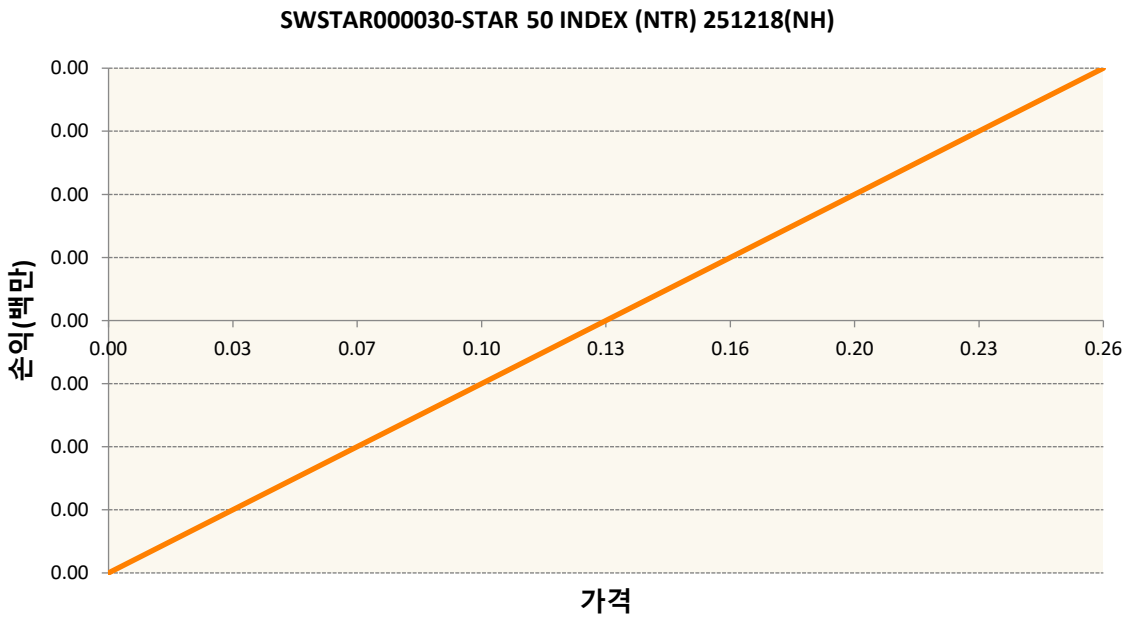
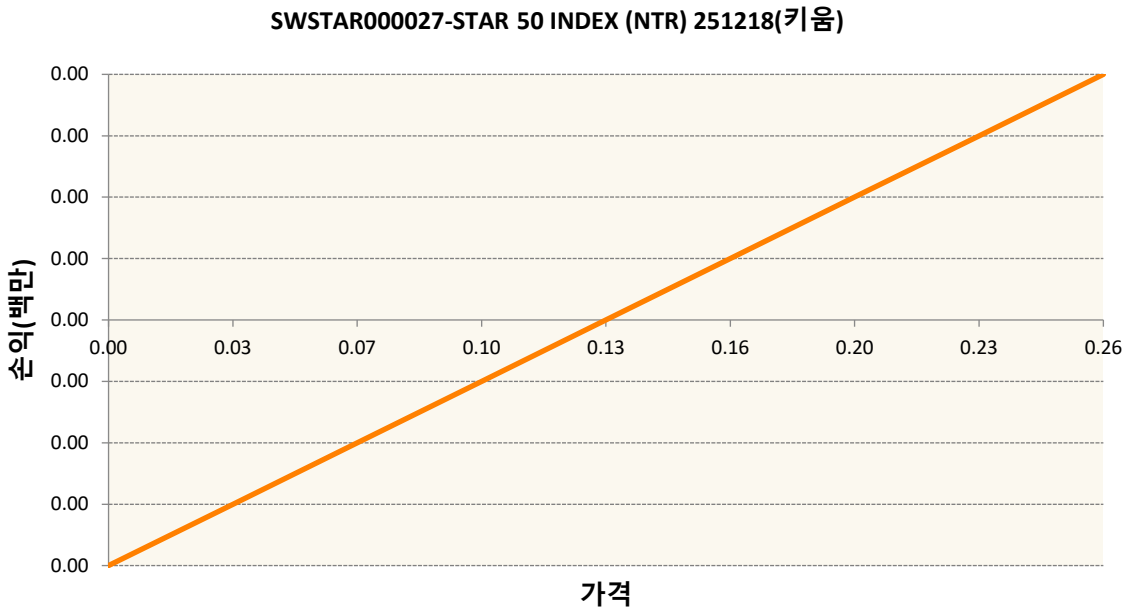
SOL차이나육성산업액티브상장지

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	104	0	104	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)		12
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)		42
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260626(메리츠)		12
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260630(미래)		33

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	165

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

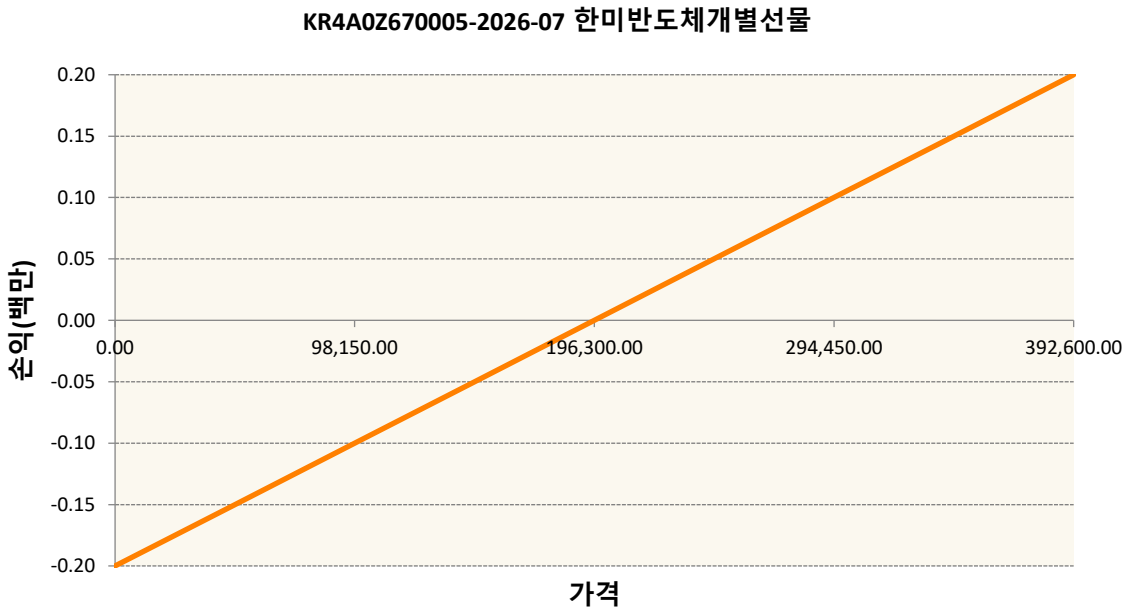
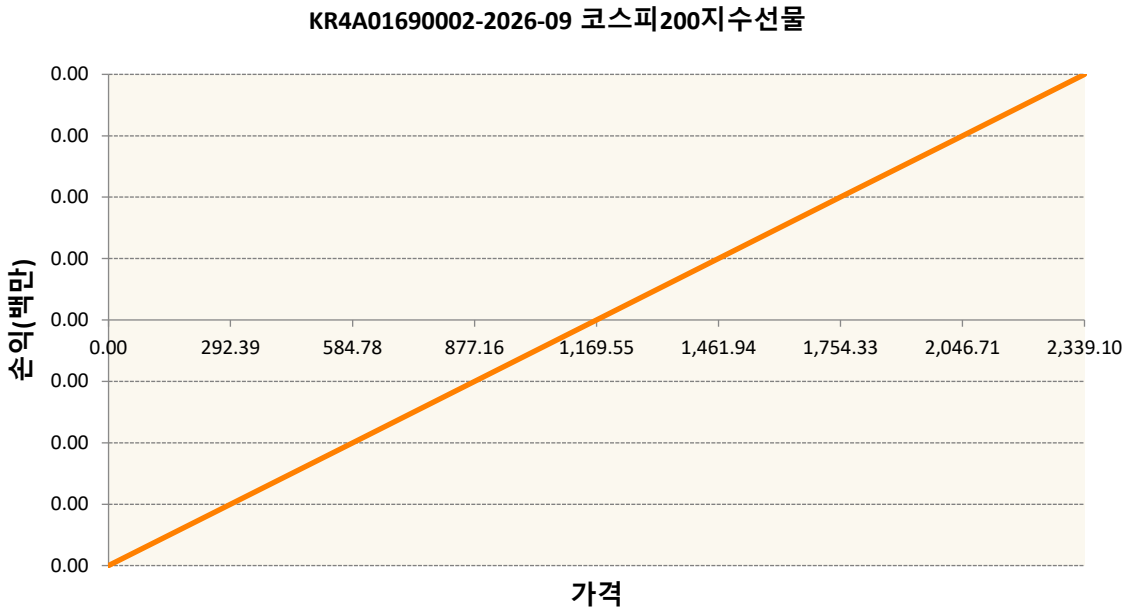
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

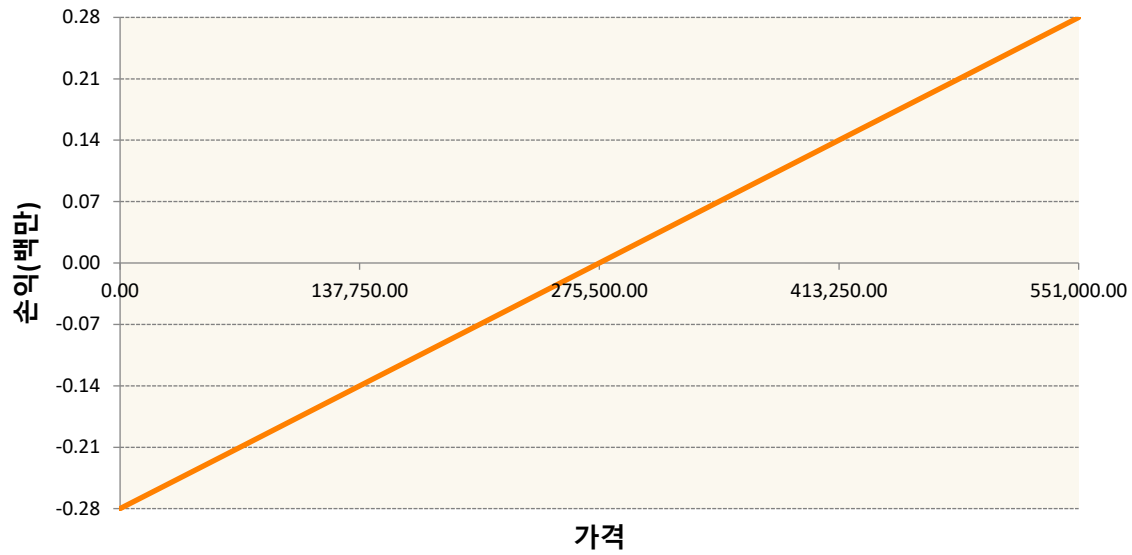
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	25,189	21,712	3,478	장내
누계	유가증권	선물	30,792	2,284	28,508	장내

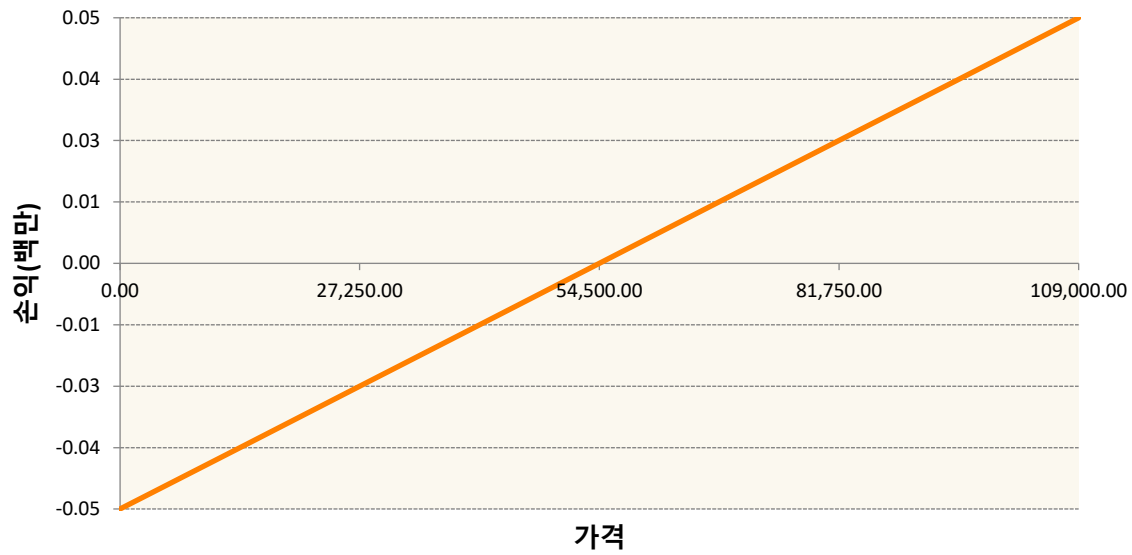
2. 만기시점의 손익구조



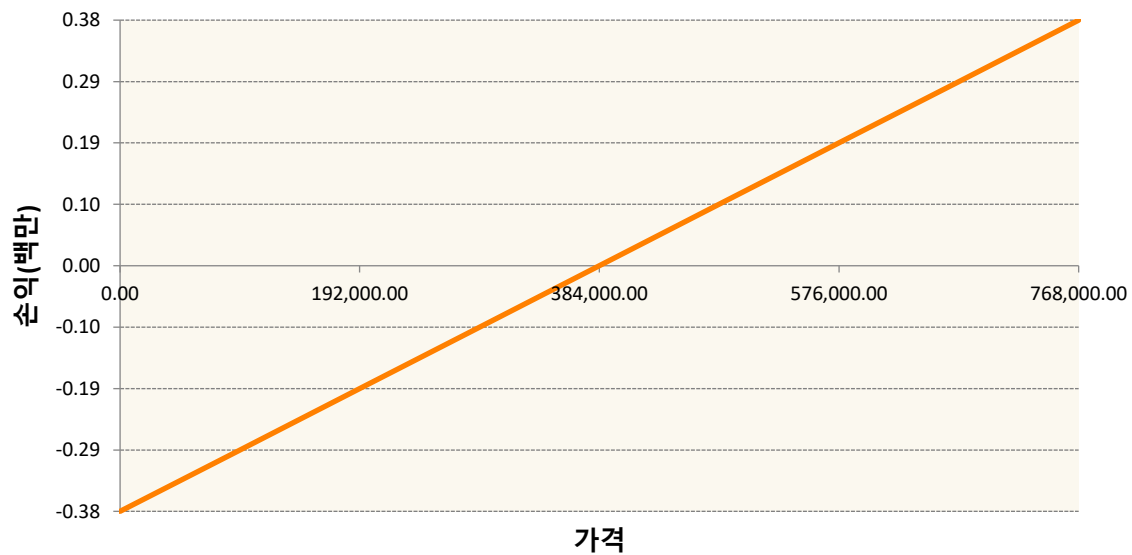
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



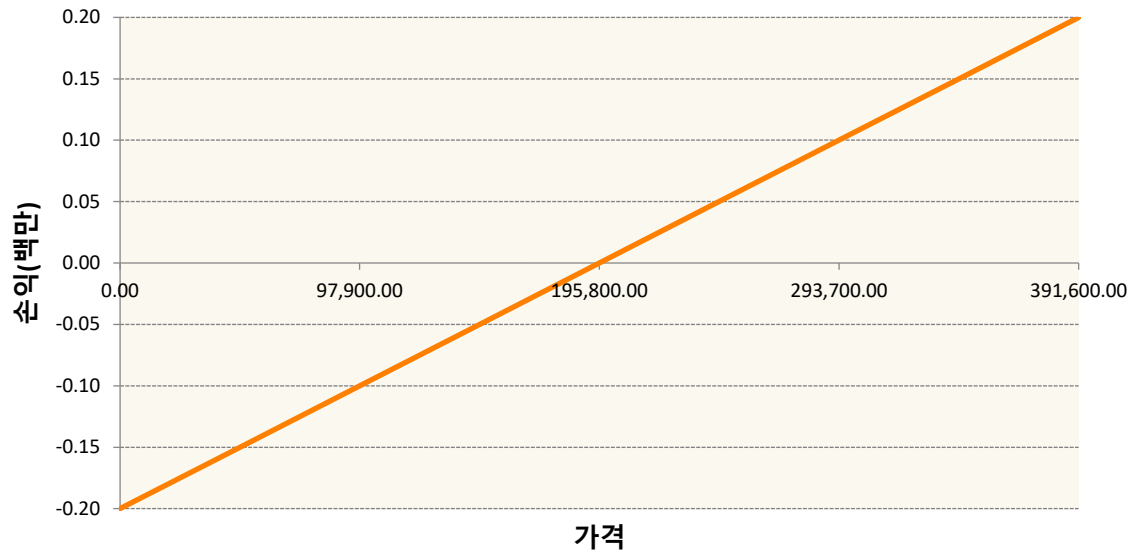
KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



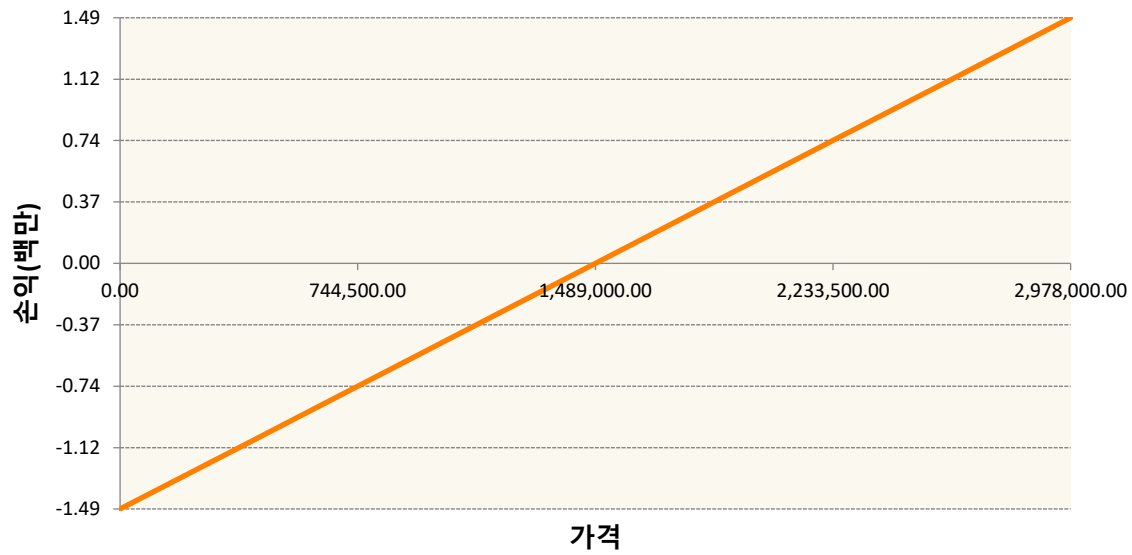
KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



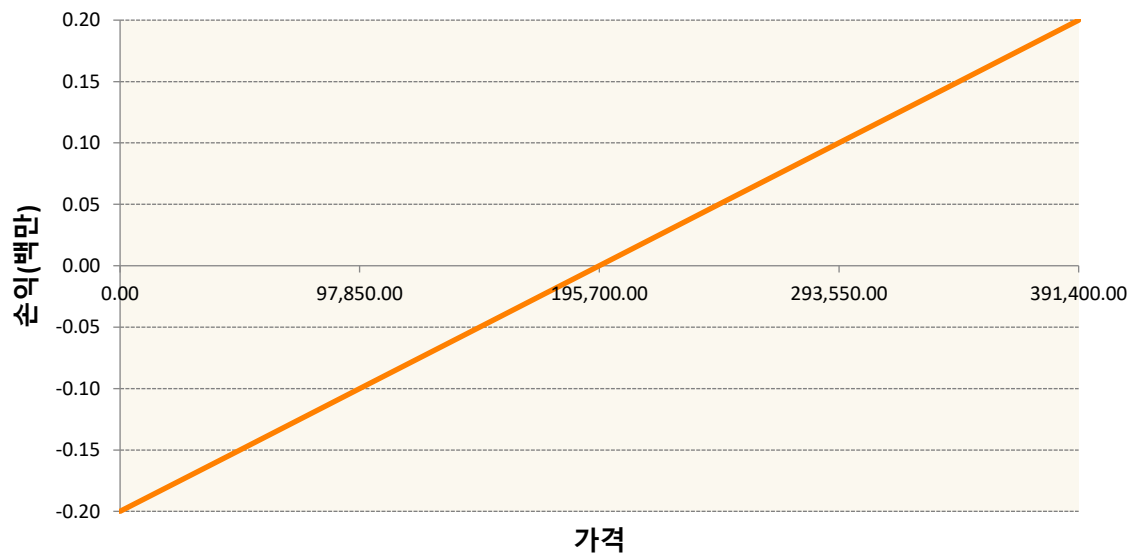
KR4A1V670008-2026-07 HD현대마린솔루션개발선물



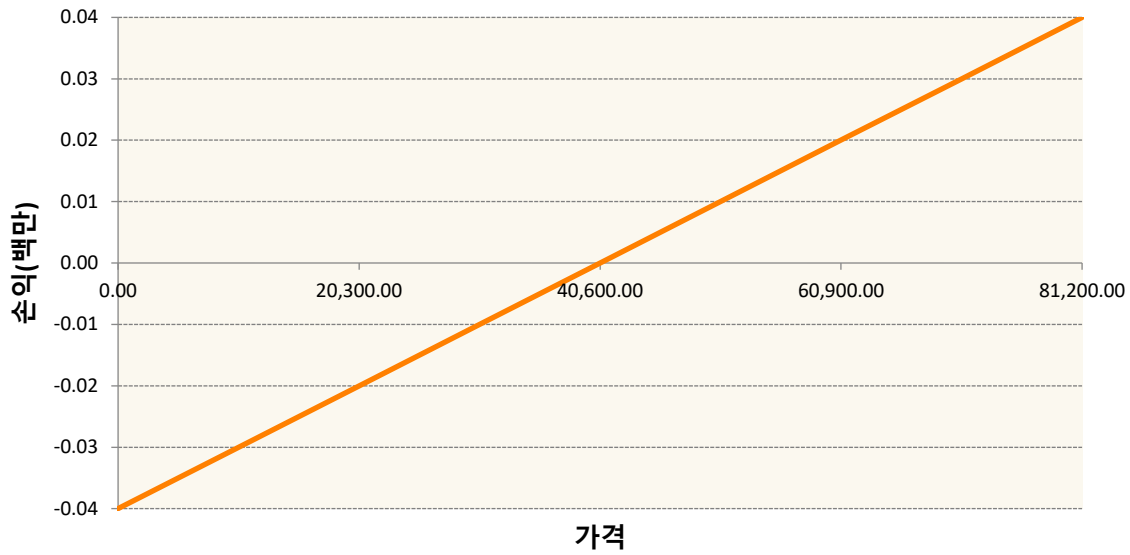
KR4A23680007-2026-08 삼성전기개발선물



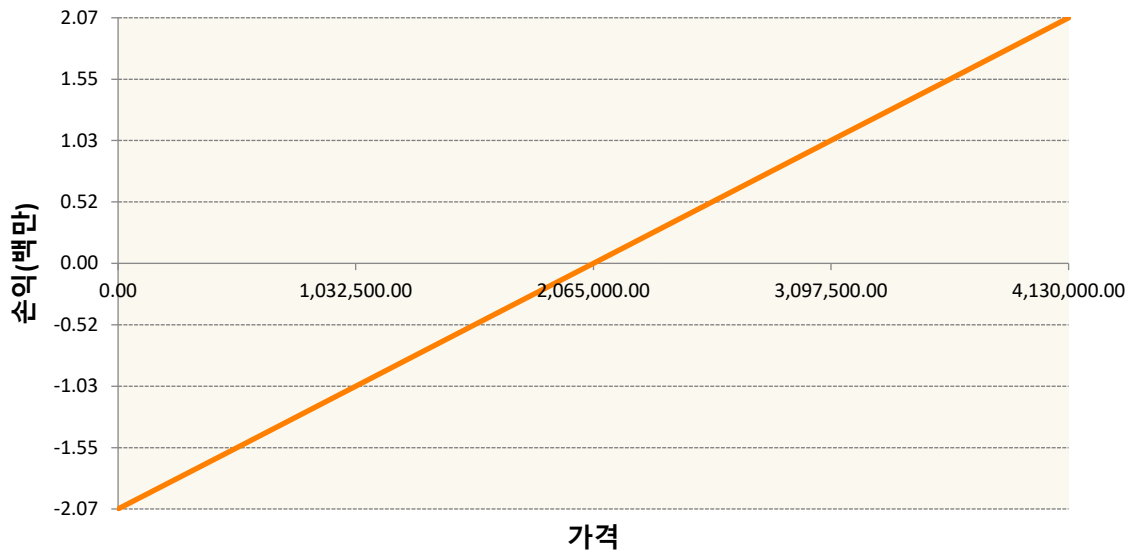
KR4A24670007-2026-07 LG전자개발선물



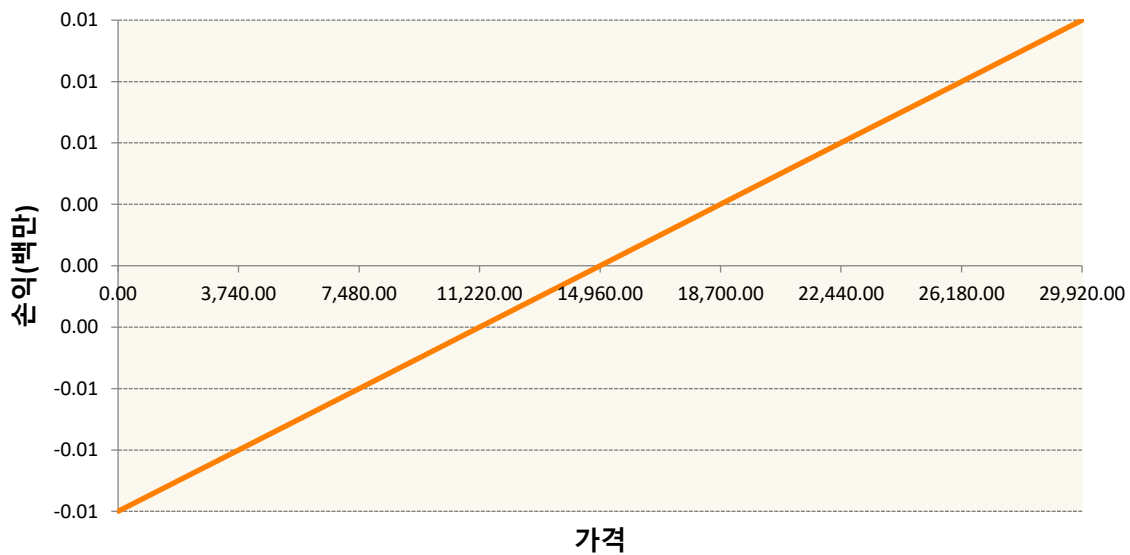
KR4A48670009-2026-07 미래에셋증권개별선물



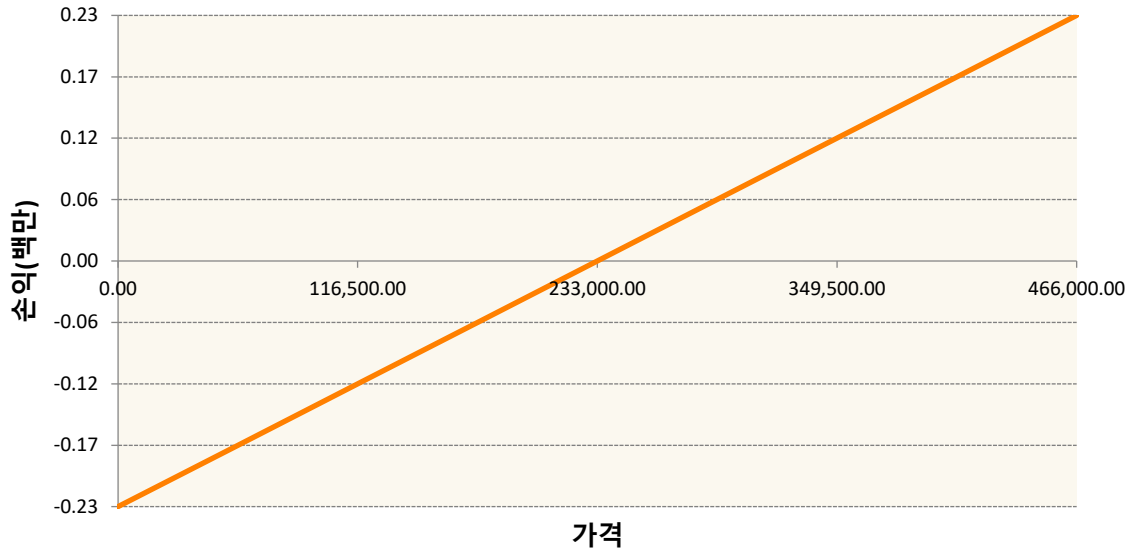
KR4A50680003-2026-08 SK하이닉스개별선물



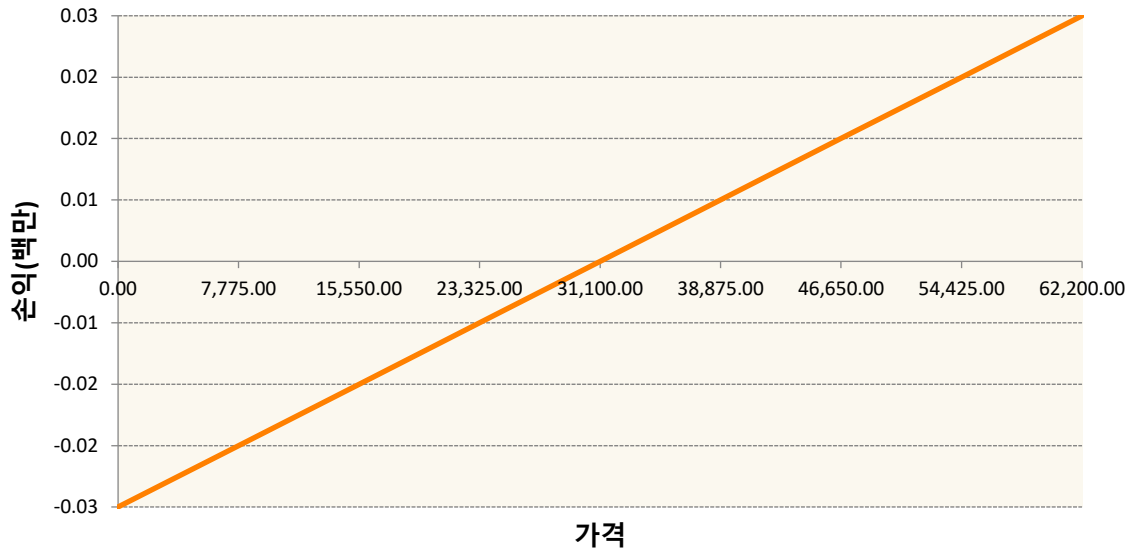
KR4AB0680002-2026-08 LG유플러스개별선물



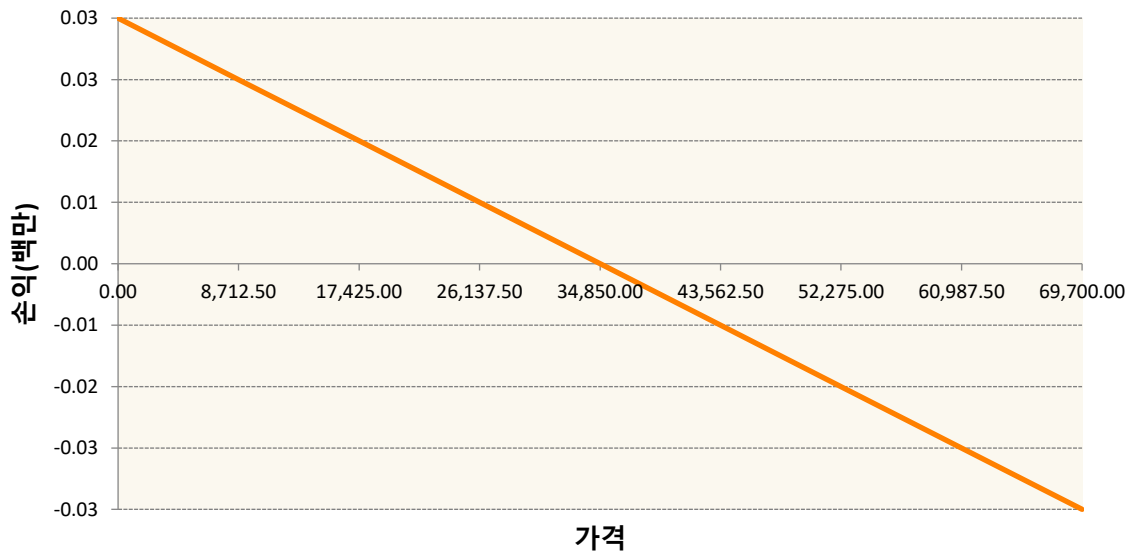
KR4ABL670007-2026-07 한국금융지주개별선물



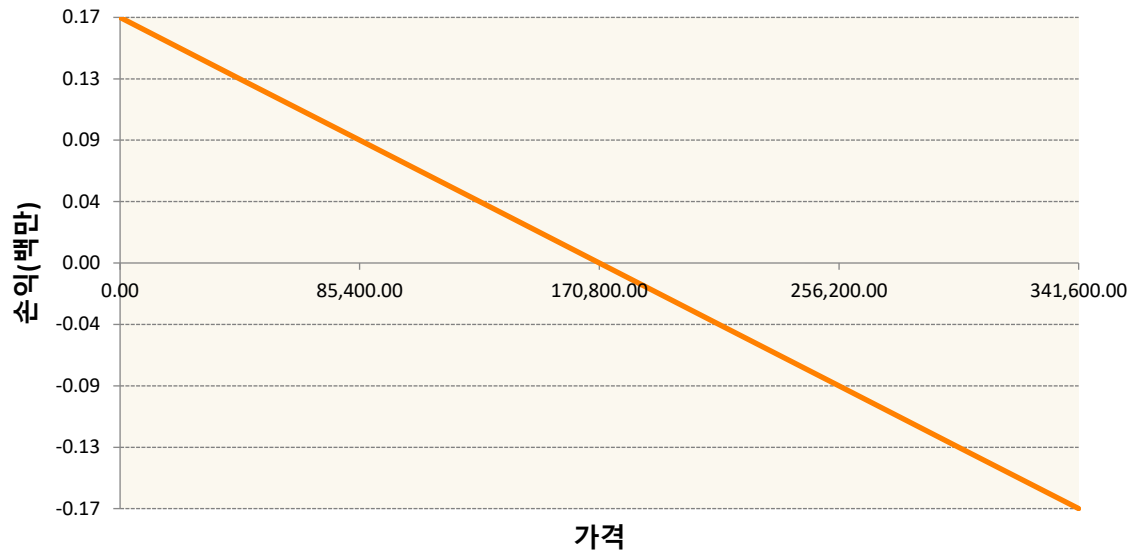
KR4ABZ670001-2026-07 NH투자증권개별선물



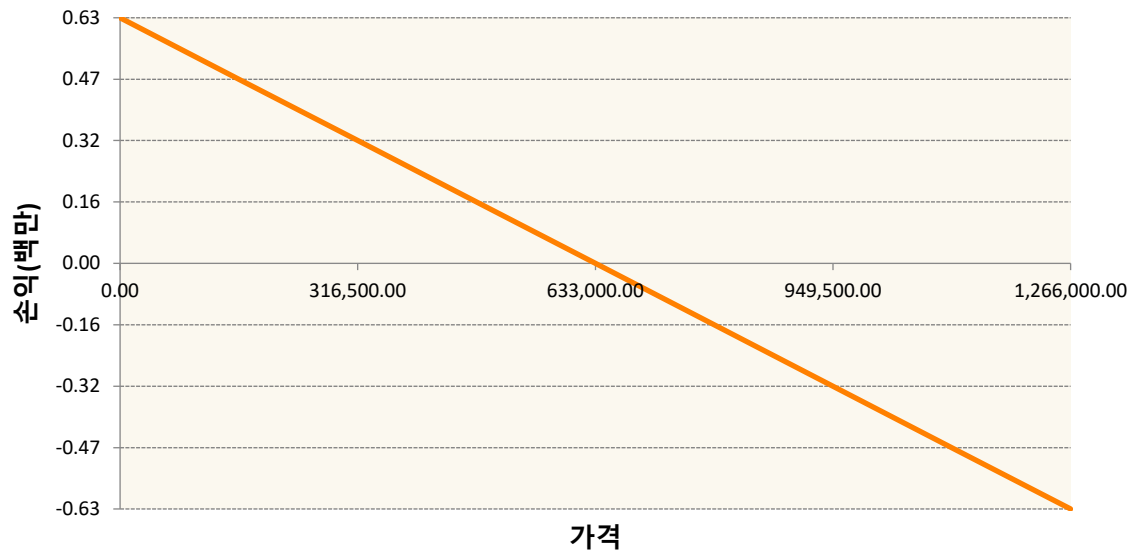
KR4ACF680003-2026-08 카카오개별선물



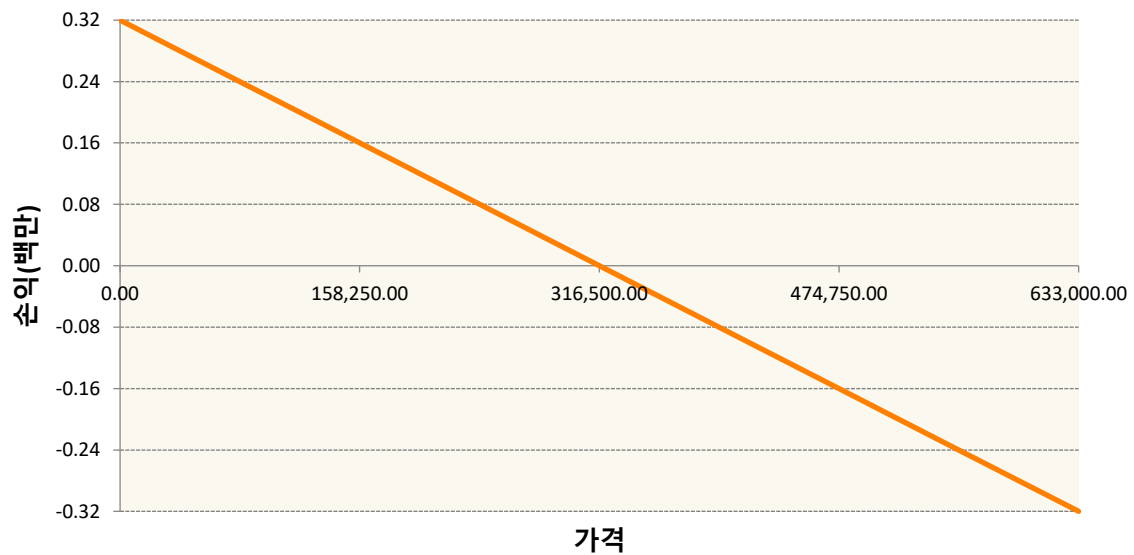
KR4AD8680000-2026-08 현대백화점개별선물



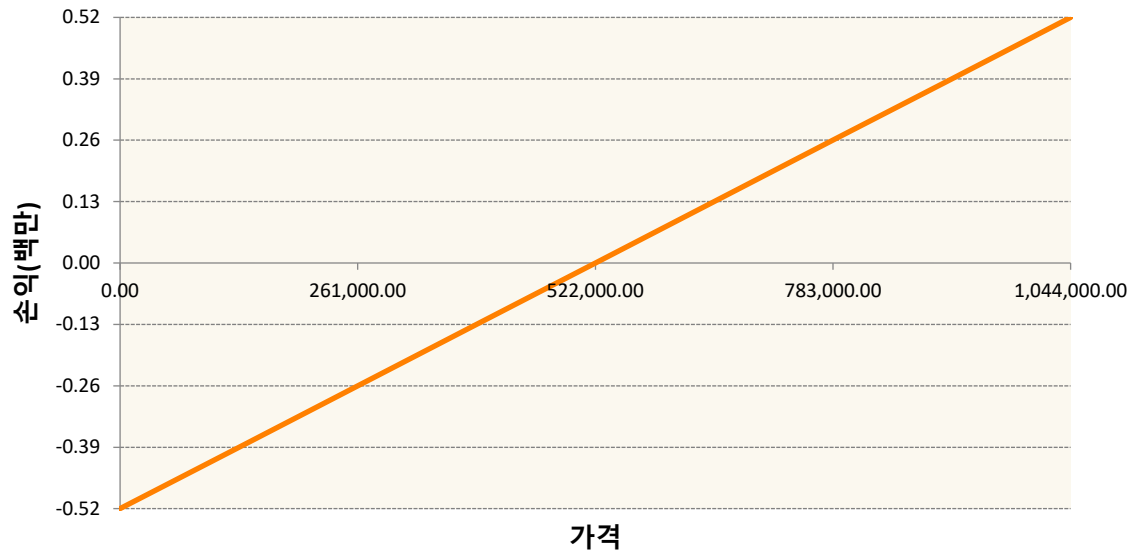
KR4ADD680004-2026-08 신세계개별선물



KR4AF5670009-2026-07 LG에너지솔루션개별선물



KR4AFD670003-2026-07 HD현대중공업개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				1,807
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,807	-1,807	-1,807	-1,807	-1,807	-1,807	-1,807
-5.33%	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205	-1,205
-2.67%	-602	-602	-602	-602	-602	-602	-602
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	602	602	602	602	602	602	602
5.33%	1,205	1,205	1,205	1,205	1,205	1,205	1,205
8.00%	1,807	1,807	1,807	1,807	1,807	1,807	1,807
KR4A0Z670005			2026-07 한미반도체개별선물				53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53
KR4A11680001			2026-08 삼성전자개별선물				329
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-329	-329	-329	-329	-329	-329	-329
-5.33%	-219	-219	-219	-219	-219	-219	-219
-2.67%	-110	-110	-110	-110	-110	-110	-110
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	110	110	110	110	110	110	110
5.33%	219	219	219	219	219	219	219
8.00%	329	329	329	329	329	329	329

KR4A14680008	2026-08 KT개별선물	6
--------------	----------------	---

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-6	-6	-6	-6	-6	-6	-6
-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%	6	6	6	6	6	6	6

KR4A1Q680004	2026-08 에이피알개별선물	56
--------------	------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-56	-56	-56	-56	-56	-56	-56
-5.33%	-37	-37	-37	-37	-37	-37	-37
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	37	37	37	37	37	37	37
8.00%	56	56	56	56	56	56	56

KR4A1V670008	2026-07 HD현대마린솔루션개별선물	3
--------------	-----------------------	---

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-3	-3	-3	-3	-3	-3	-3
-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%	3	3	3	3	3	3	3

KR4A23680007	2026-08 삼성전기개별선물	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

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

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

KR4A50680003 2026-08 SK하이닉스개별선물 76

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-5.33%	-51	-51	-51	-51	-51	-51	-51
-2.67%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	25	25	25	25	25	25	25
5.33%	51	51	51	51	51	51	51
8.00%	76	76	76	76	76	76	76

KR4AB0680002 2026-08 LG유플러스개별선물 25

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-5.33%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-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%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	25	25	25	25	25	25	25

KR4ABL670007 2026-07 한국금융지주개별선물 24

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	24	24	24	24	24	24	24

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

KR4ACF680003	2026-08 카카오개별선물	61
--------------	-----------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	61	61	61	61	61	61	61
-5.33%	40	40	40	40	40	40	40
-2.67%	20	20	20	20	20	20	20
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-20	-20	-20	-20	-20	-20	-20
5.33%	-40	-40	-40	-40	-40	-40	-40
8.00%	-61	-61	-61	-61	-61	-61	-61

KR4AD8680000	2026-08 현대백화점개별선물	12
--------------	-------------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	12	12	12	12	12	12	12
-5.33%	8	8	8	8	8	8	8
-2.67%	4	4	4	4	4	4	4
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-4	-4	-4	-4	-4	-4	-4
5.33%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
8.00%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12

KR4ADD680004	2026-08 신세계개별선물	25
--------------	-----------------	----

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	25	25	25	25	25	25	25
-5.33%	17	17	17	17	17	17	17
-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%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25

KR4AF5670009	2026-07 LG에너지솔루션개별선물	84
--------------	----------------------	----

	기초자산의 변동성
--	-----------

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	84	84	84	84	84	84	84
-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%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84

KR4AFD670003

2026-07 HD현대중공업개별선물

18

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-5.33%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
-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%	12	12	12	12	12	12	12
8.00%	18	18	18	18	18	18	18

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

(단위:백만원)

6,960

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

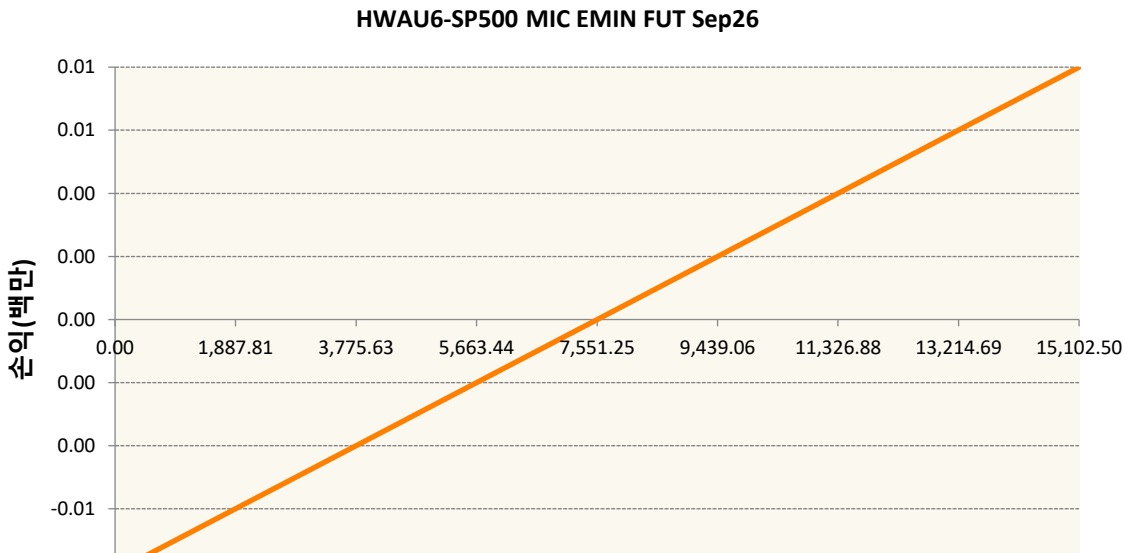
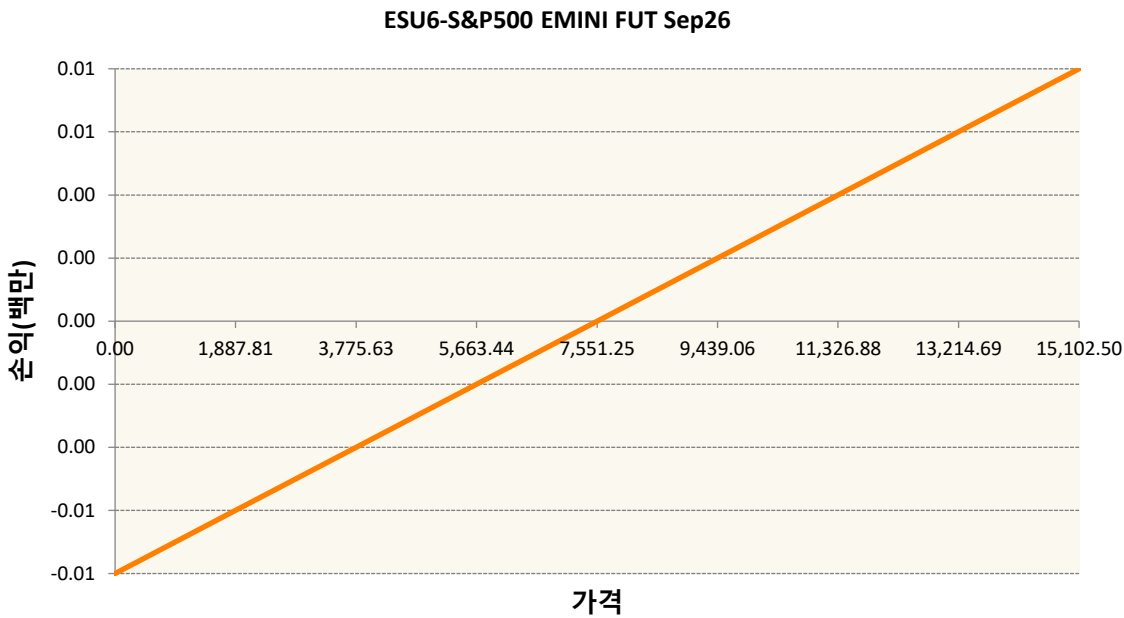
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

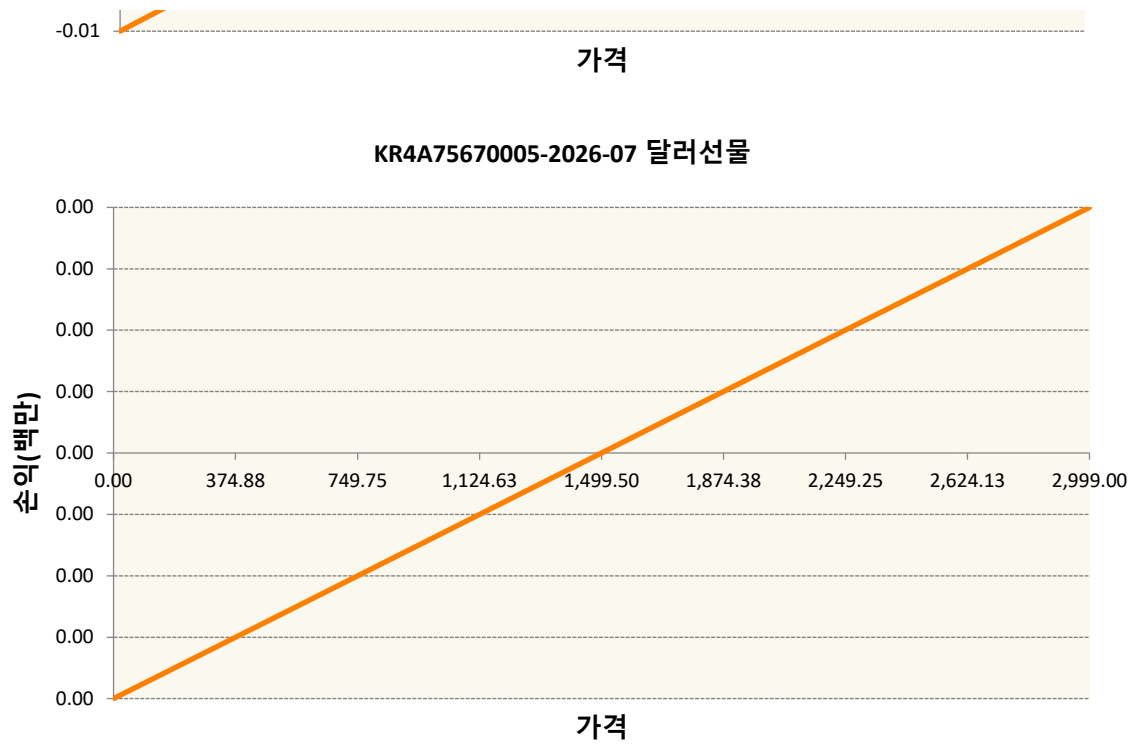
1. 계약금액

(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	66,833	0	66,833	
누계	지수	선물	287	0	287	장내
누계	통화	선물	10,646	0	10,646	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	5,347
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	23
KR4A756700	2026-07 달러선물	852

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

4,629

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

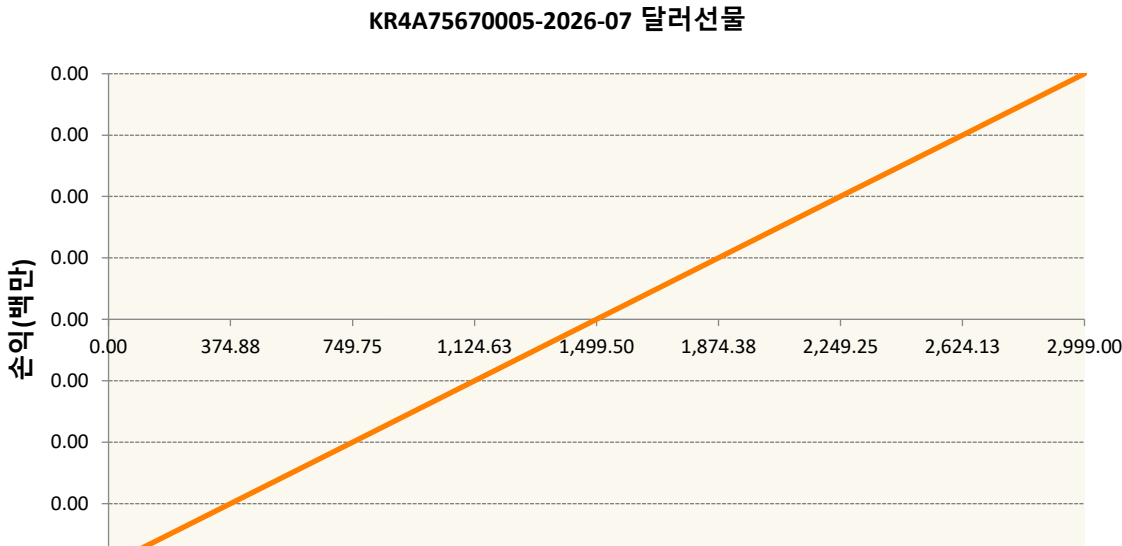
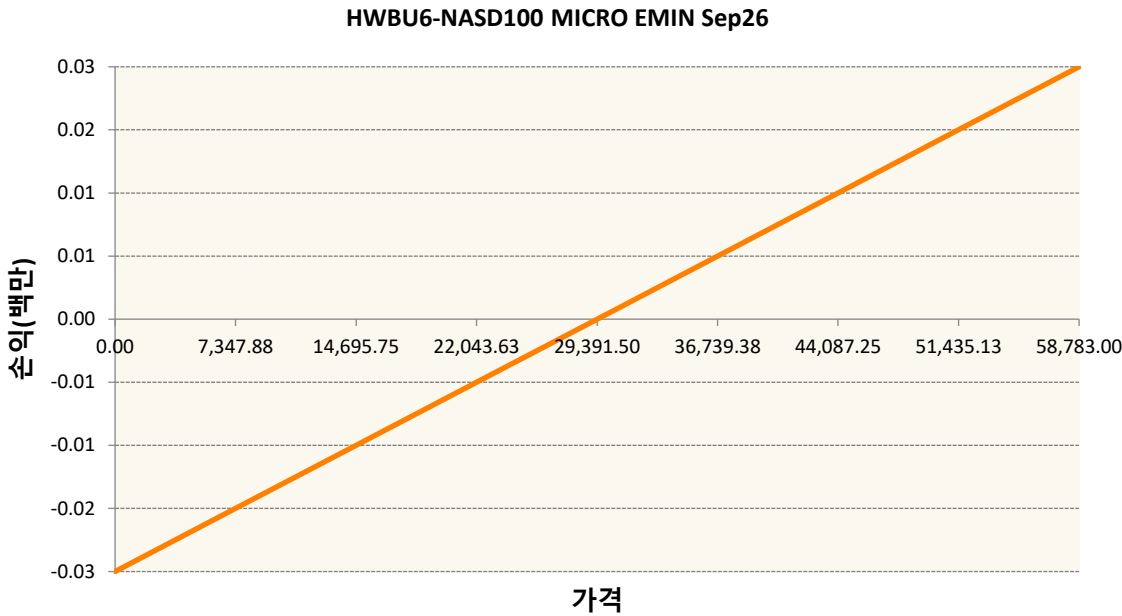
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

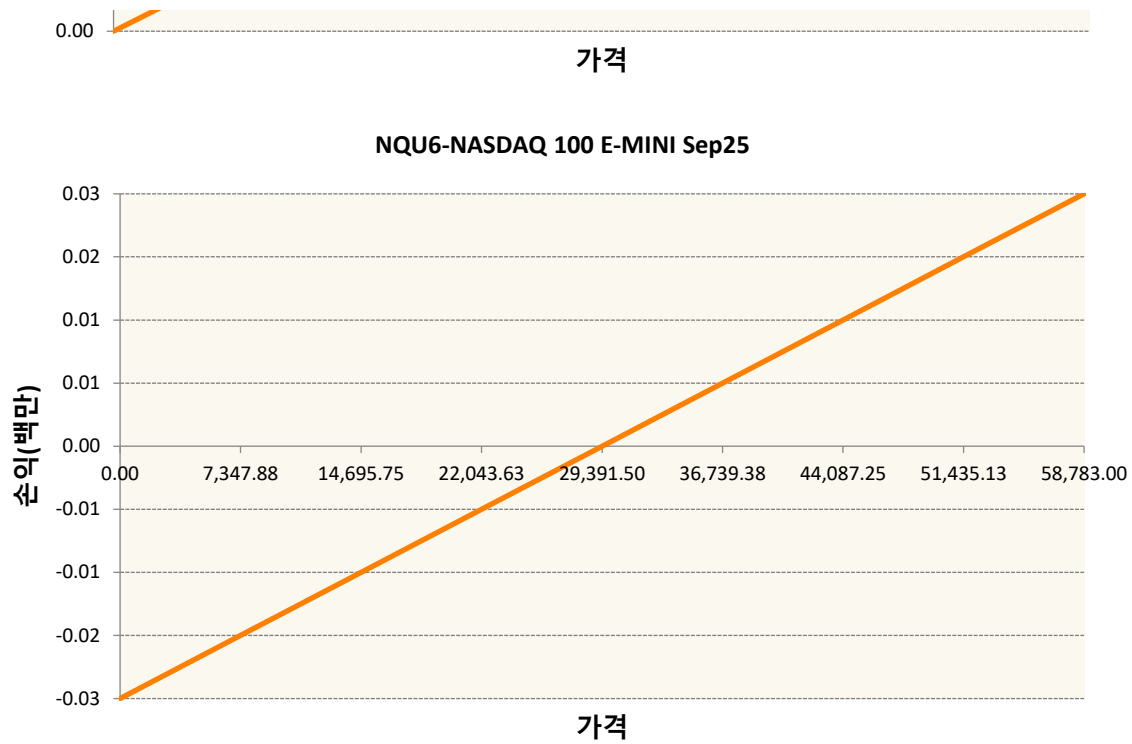
1. 계약금액

(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	361	0	361	장내
누계	지수	선물	32,921	0	32,921	
누계	통화	선물	3,914	0	3,914	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		29
KR4A756700	2026-07 달러선물		313
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,634

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,004

공시일	2026-07-09
기준일	2026-07-08

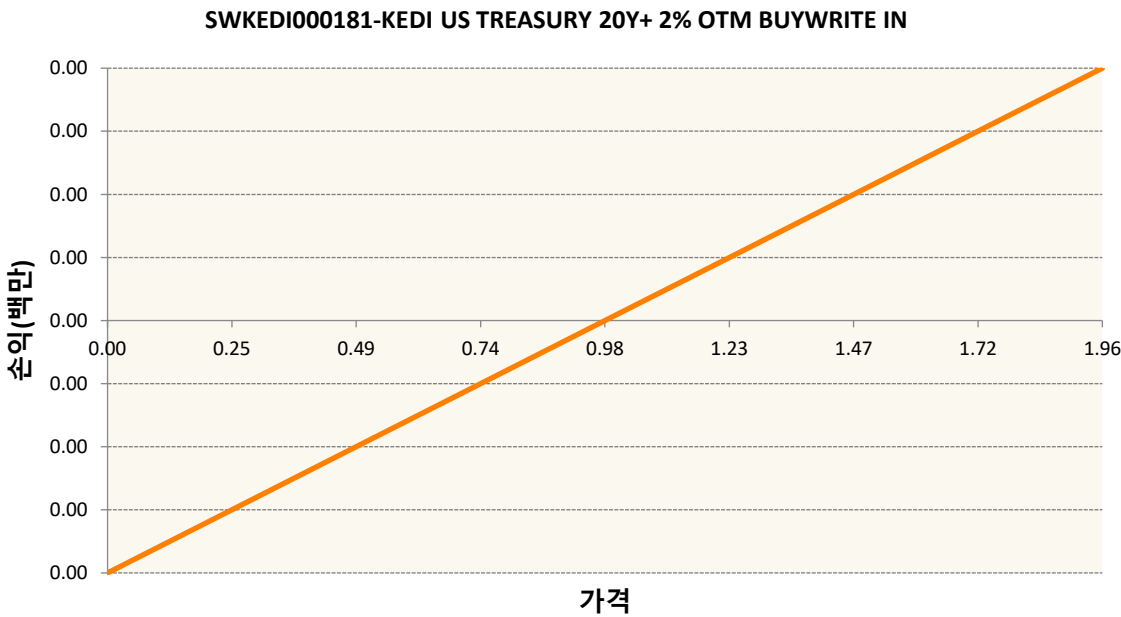
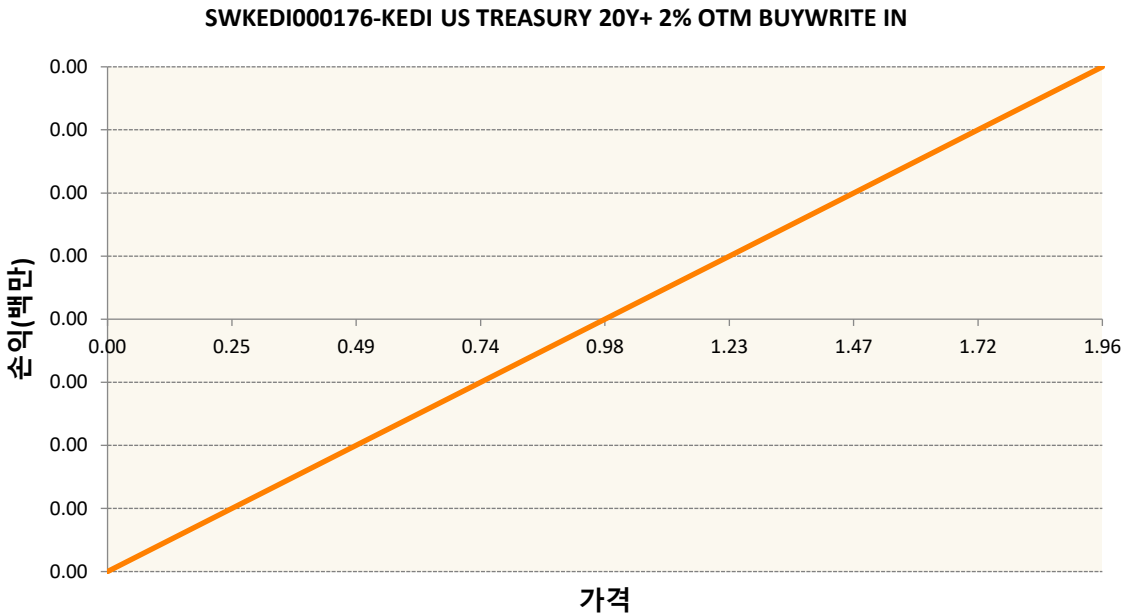
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

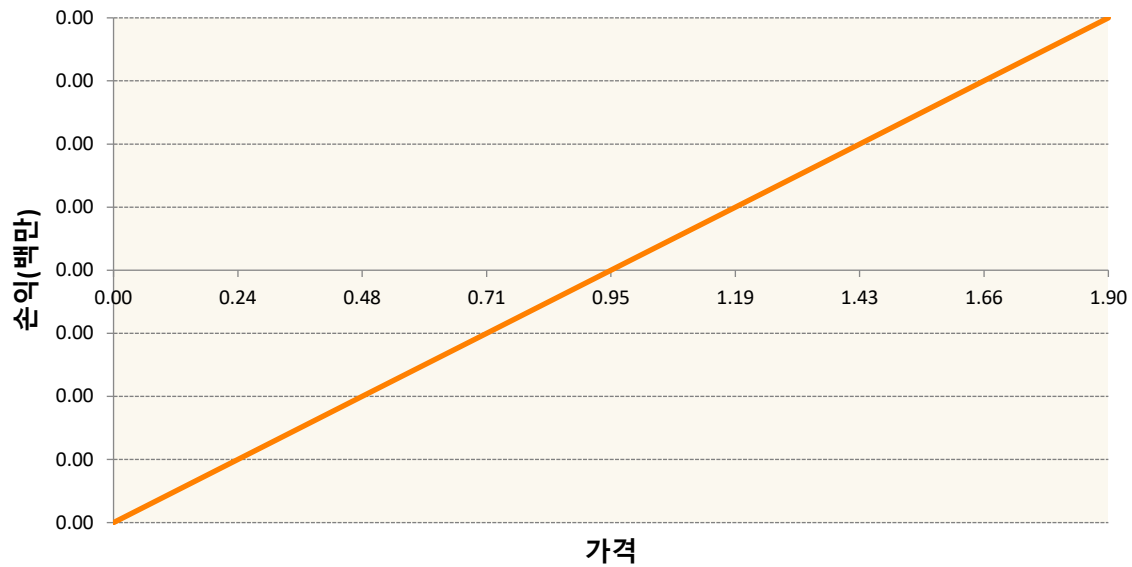
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	311,761	0	311,761	장외

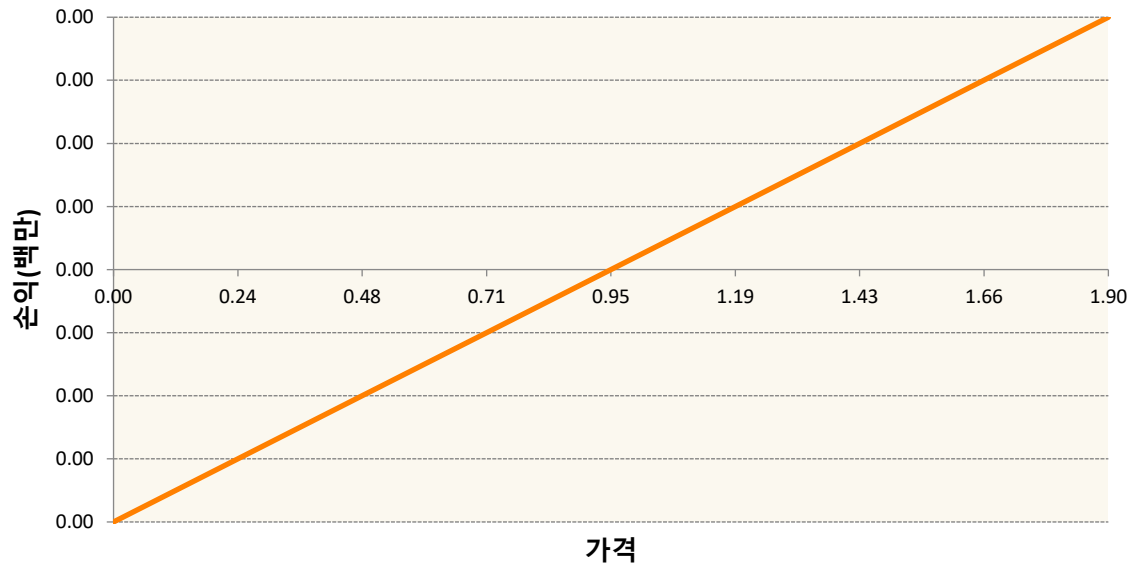
2. 만기시점의 손익구조



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	7,971
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,128
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,142
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,742

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

(단위:백만원)

10,636