

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

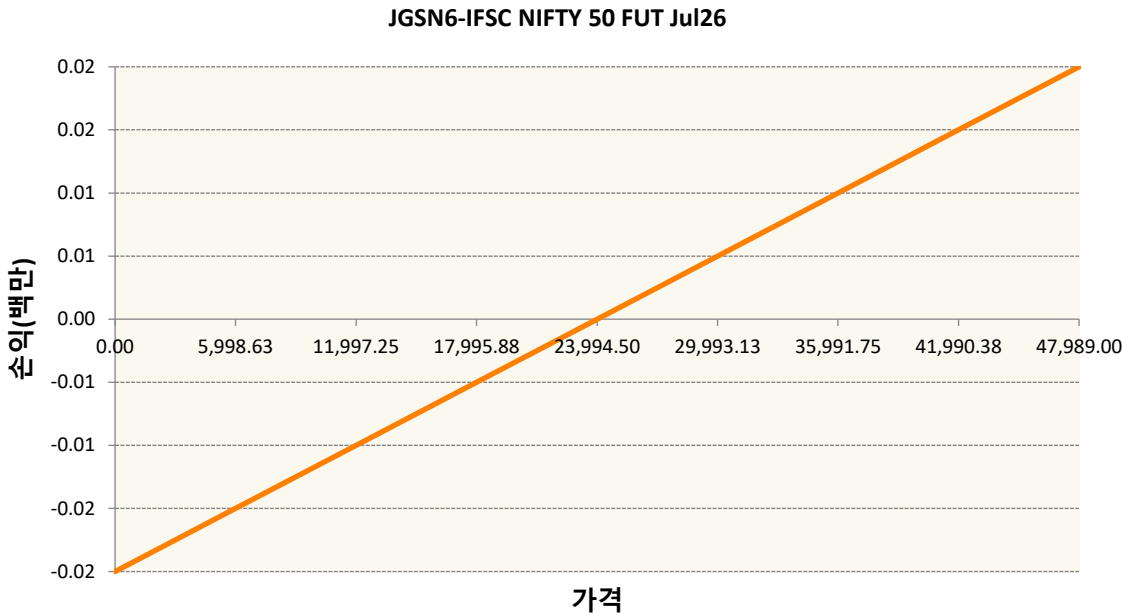
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

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	2026-07-13
기준일	2026-07-10

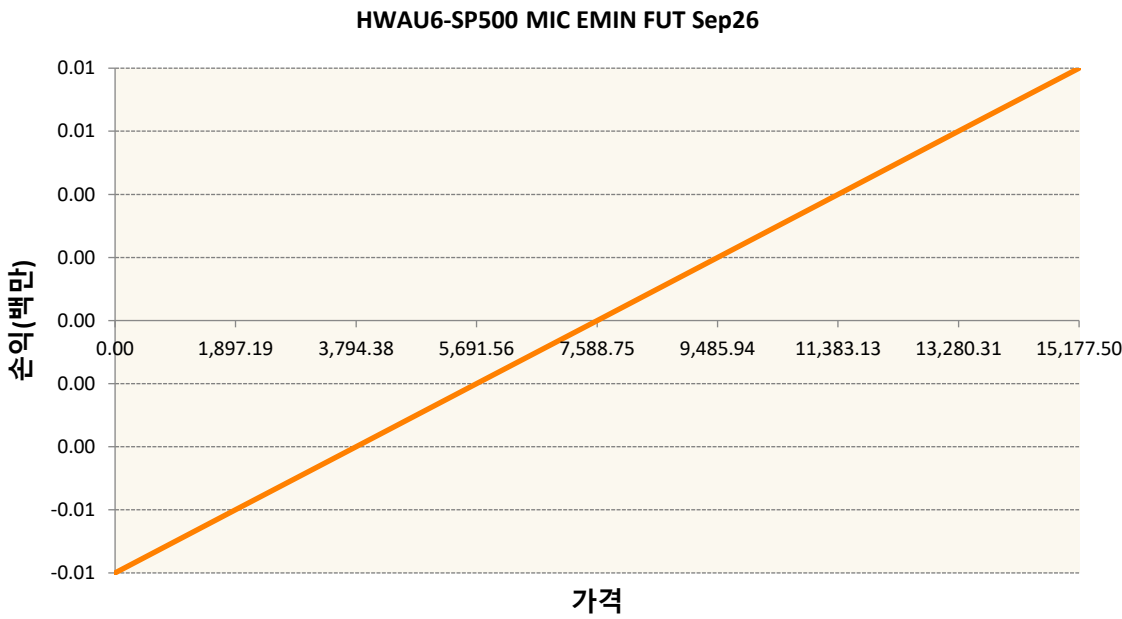
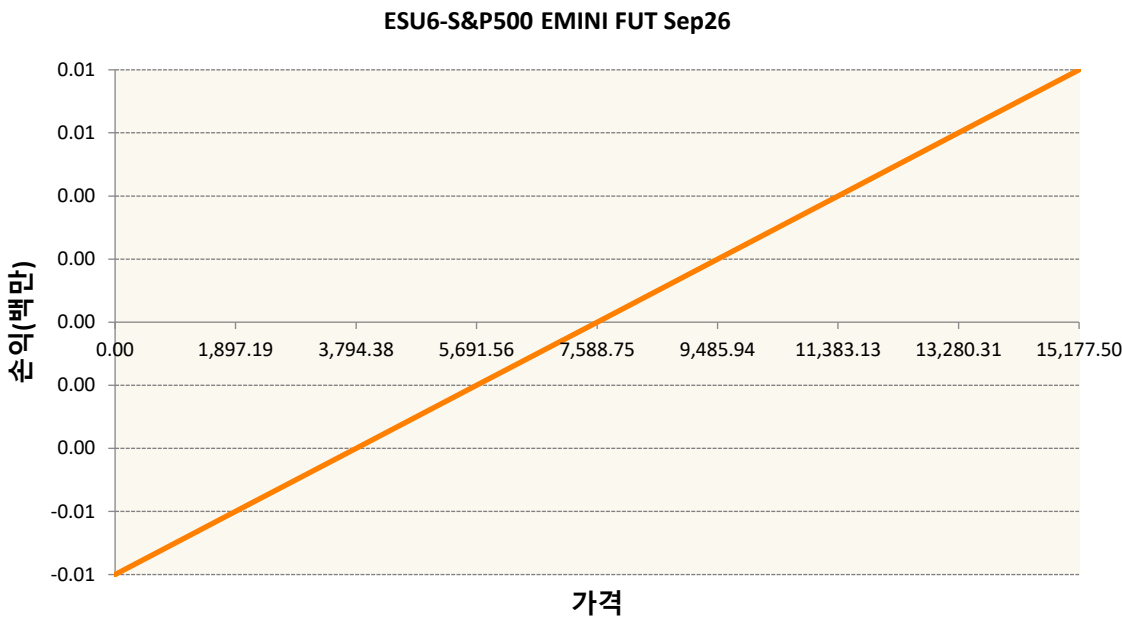
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

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	579	0	579	
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	2026-07-13
기준일	2026-07-10

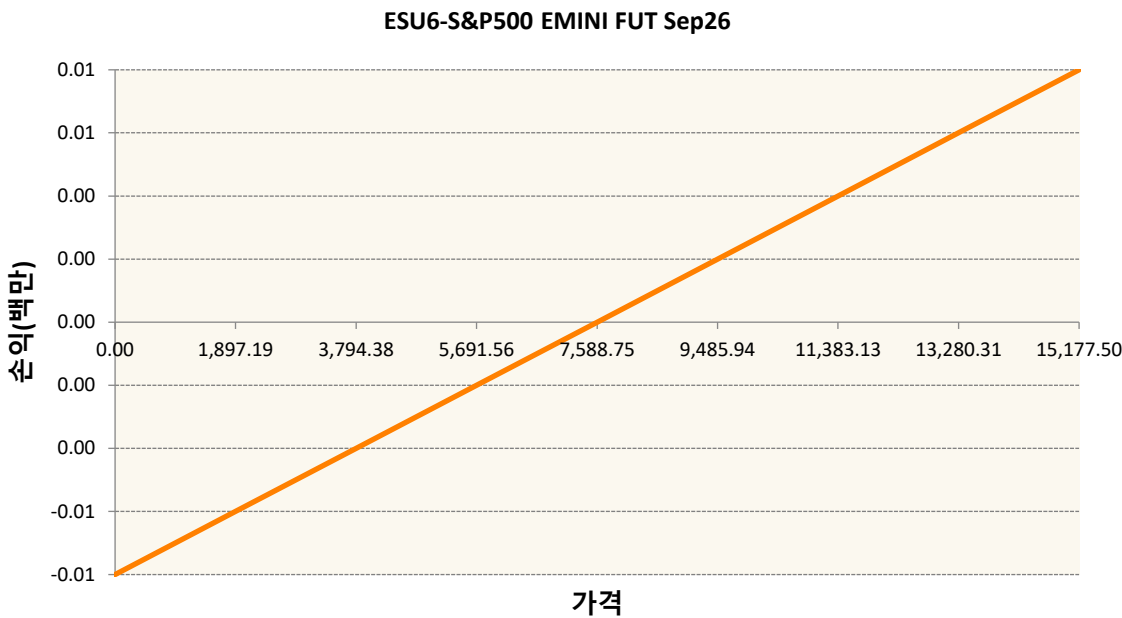
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	574	0	574	

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)

40

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

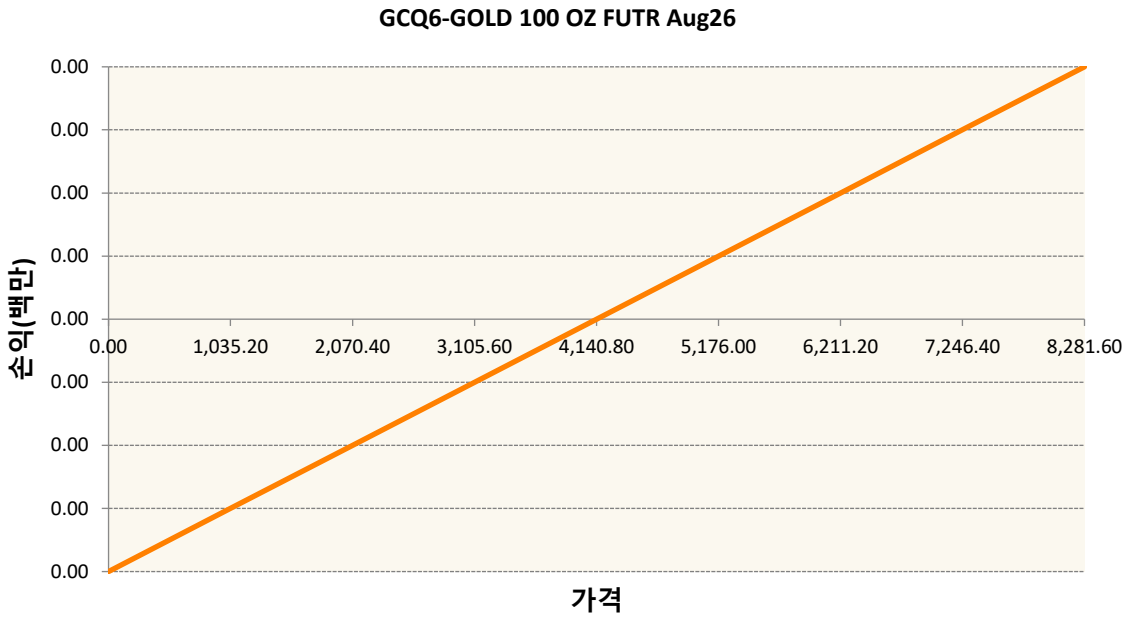
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

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	4,973	0	4,973	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDSCC0 GLD US 07/10/26 C375 EQUITY	15
GQC6 GOLD 100 OZ FUTR Aug26	398

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

(단위:백만원)

537

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

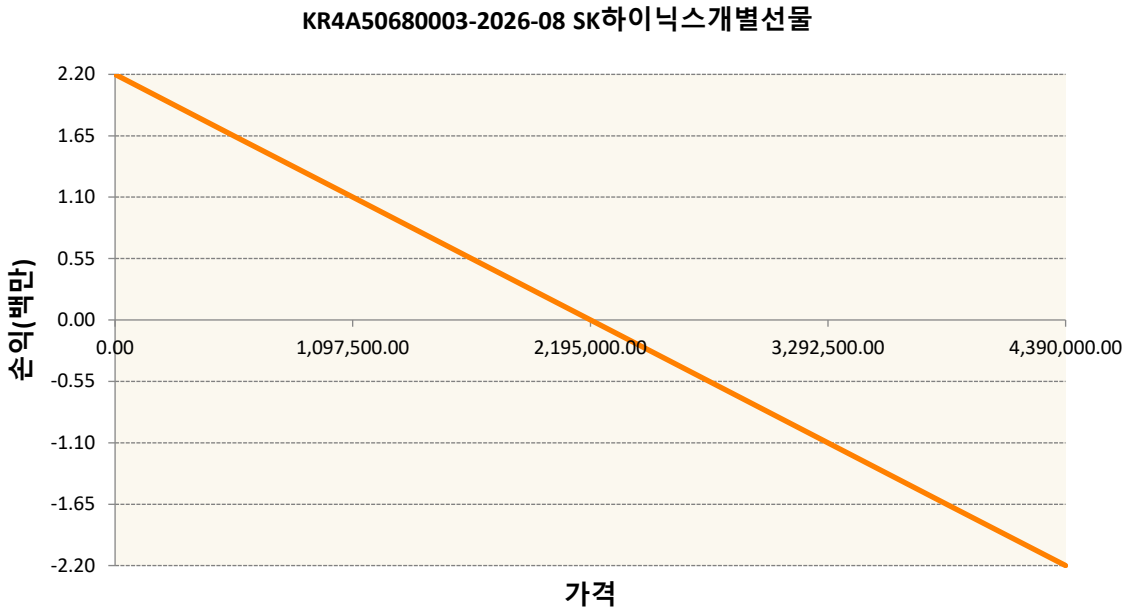
SOL팔란티어커버드콜OTM채권혼합상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2,440	-2,440	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	
누계	유가증권	선물	0	2,415	-2,415	장내
누계	유가증권	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOPLTRUSC` PLTR US 07/10/26 C130 EQUITY	202
AOPLTRUSP` PLTR US 07/10/26 P130 EQUITY	20
KR4A506800 2026-08 SK하이닉스개별선물	193

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

(단위:백만원)

672

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

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)

14,721

공시일 2026-07-13

기준일 2026-07-10

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	2026-07-13
기준일	2026-07-10

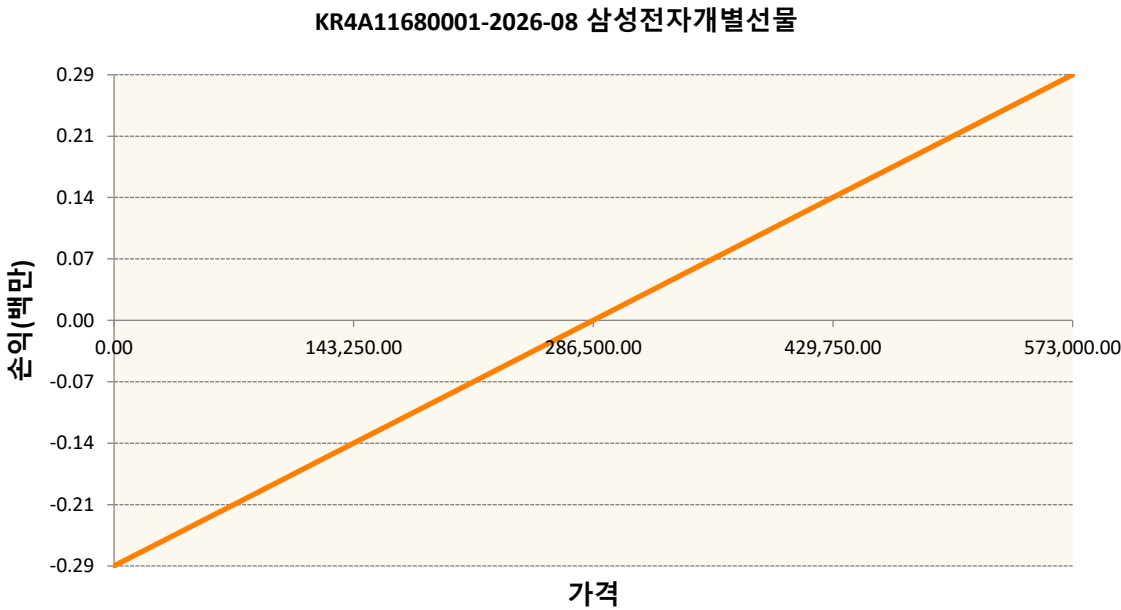
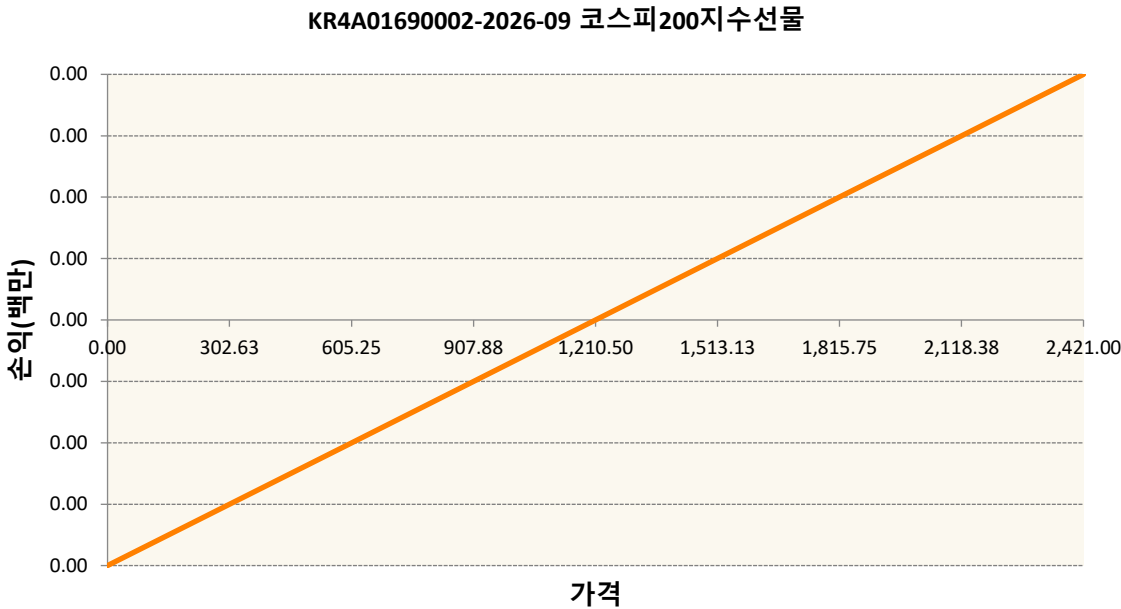
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

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	23,339	37,472	-14,133	장내

2. 만기시점의 손익구조



가격	손익(백만)
0.00	1,000.00
292.50	800.00
585.00	600.00
877.50	400.00
1,170.00	200.00
1,462.50	0.00
1,755.00	-200.00
2,047.50	-400.00
2,340.00	-600.00

The graph illustrates a linear relationship between Price (가격) and Net Income (순익). The x-axis represents Price, ranging from 0.00 to 2,345.00. The y-axis represents Net Income in millions, ranging from 0.00 to 0.00. A solid blue line shows the relationship, starting at (0, 0.00) and ending at (2,345.00, 0.00).

가격	순익 (백만)
0.00	0.00
293.13	0.00
586.25	0.00
879.38	0.00
1,172.50	0.00
1,465.63	0.00
1,758.75	0.00
2,051.88	0.00
2,345.00	0.00

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물				622
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-622	-622	-622	-622	-622	-622	-622	
-5.33%	-415	-415	-415	-415	-415	-415	-415	
-2.67%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	207	207	207	207	207	207	207	
5.33%	415	415	415	415	415	415	415	
8.00%	622	622	622	622	622	622	622	
KR4A11680001				2026-08 삼성전자개별선물				1,231
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231	-1,231
-5.33%	-821	-821	-821	-821	-821	-821	-821
-2.67%	-410	-410	-410	-410	-410	-410	-410
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	410	410	410	410	410	410	410
5.33%	821	821	821	821	821	821	821
8.00%	1,231	1,231	1,231	1,231	1,231	1,231	1,231
KR4BAFBMA696 코스피위클리M C 2607W2 1,170.0							1,843

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,843	1,843	1,843	1,843	1,843	1,843	1,843
-5.33%	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229	1,229
-2.67%	614	614	614	614	614	614	614
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-614	-614	-614	-614	-614	-614	-614
5.33%	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229	-1,229
8.00%	-1,843	-1,843	-1,843	-1,843	-1,843	-1,843	-1,843

KR4BAFBMA704 코스피위클리M C 2607W2 1,172.5							1,221
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221	1,221
-5.33%	814	814	814	814	814	814	814
-2.67%	407	407	407	407	407	407	407
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-407	-407	-407	-407	-407	-407	-407
5.33%	-814	-814	-814	-814	-814	-814	-814
8.00%	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221	-1,221

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

(단위:백만원)

14,350

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

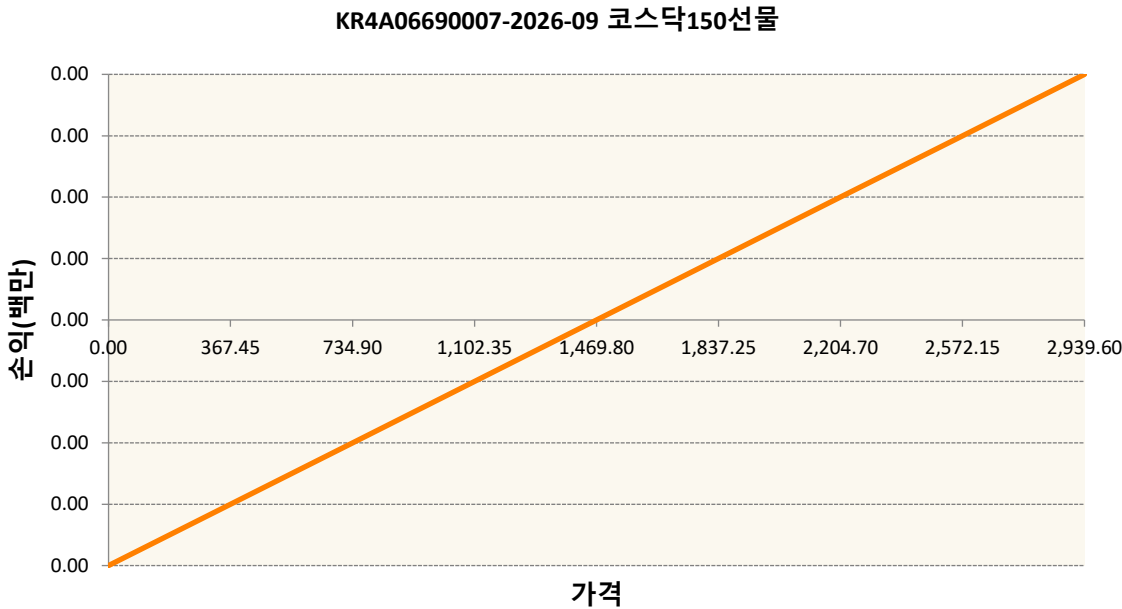
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	852	0	852	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A06690007		2026-09 코스닥150선물					68
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-68	-68	-68	-68	-68	-68	-68
-5.33%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-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%	45	45	45	45	45	45	45
8.00%	68	68	68	68	68	68	68

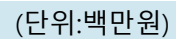
4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

23,276

SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

(단위:백만원)

KR4A50680003-2026-08 SK하이닉스개별선물[illegible]

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

(단위:백만원)

80,023

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

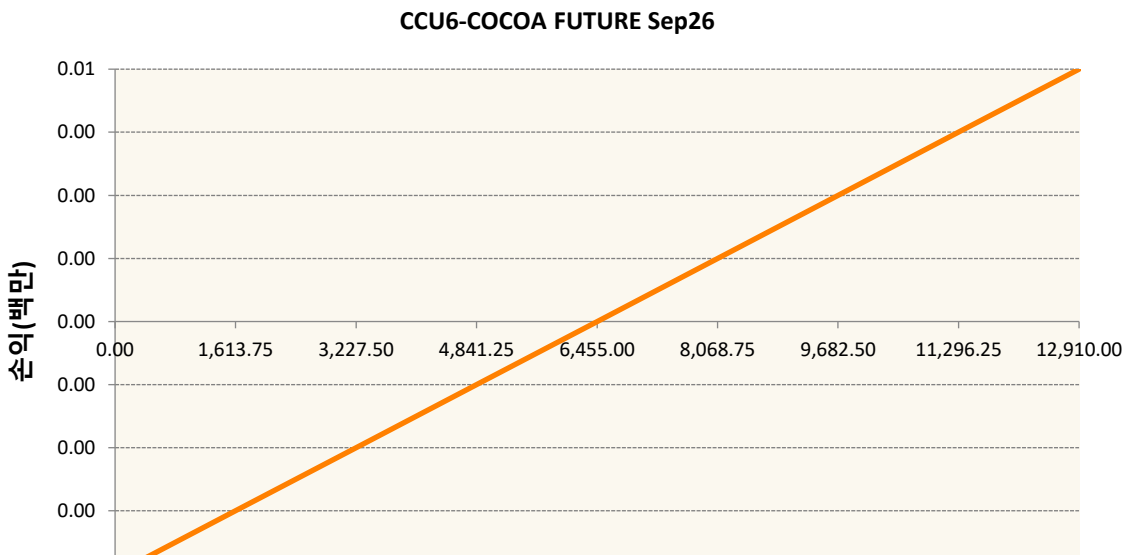
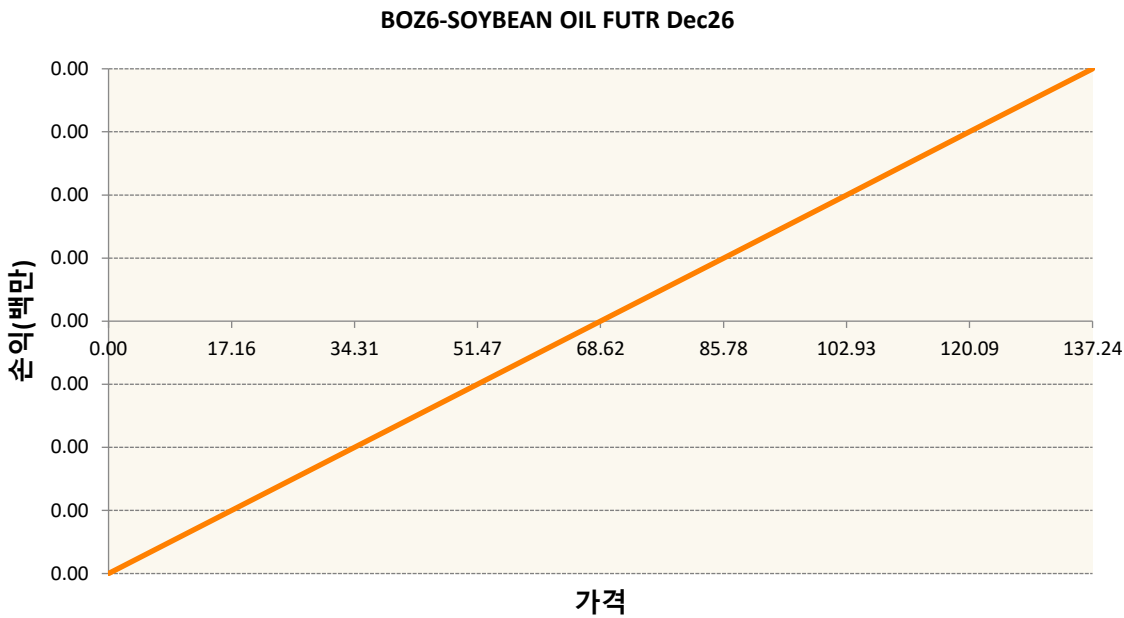
포커스농산물모(채권-파생형)

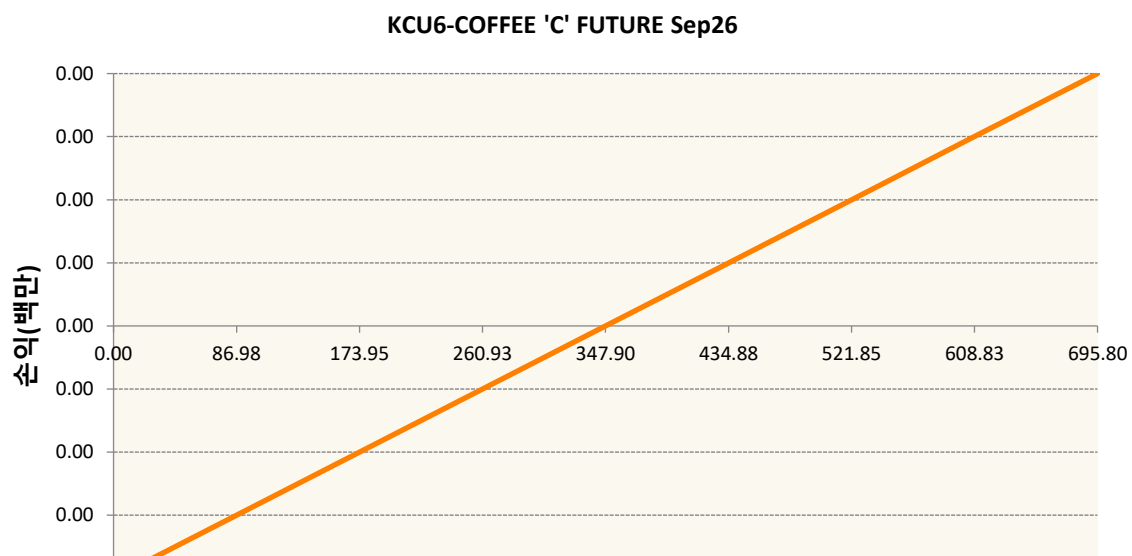
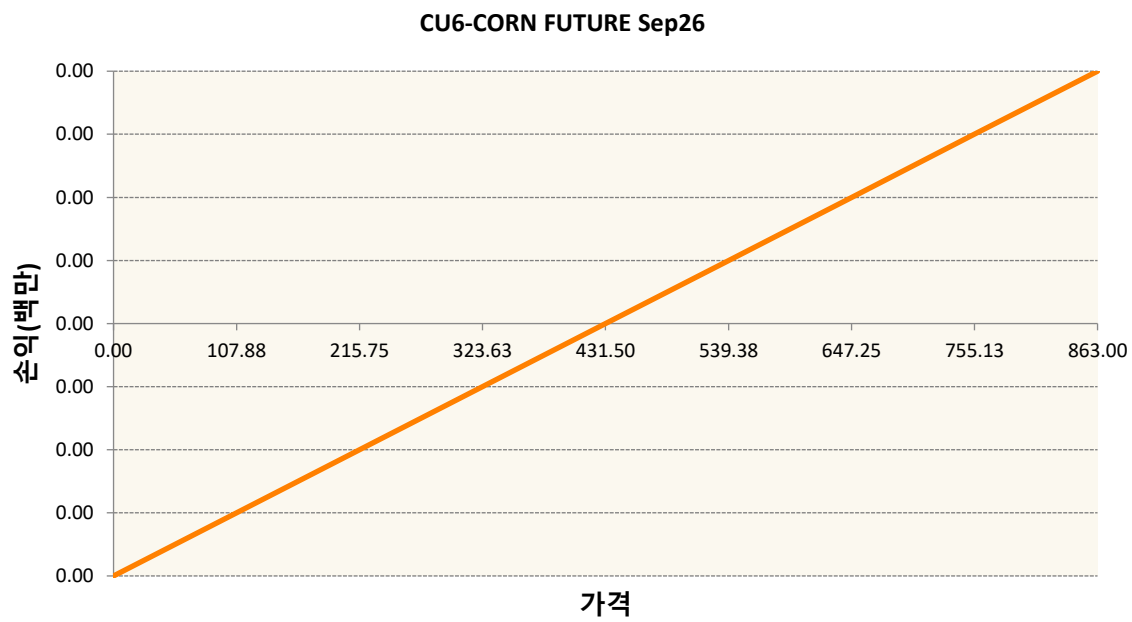
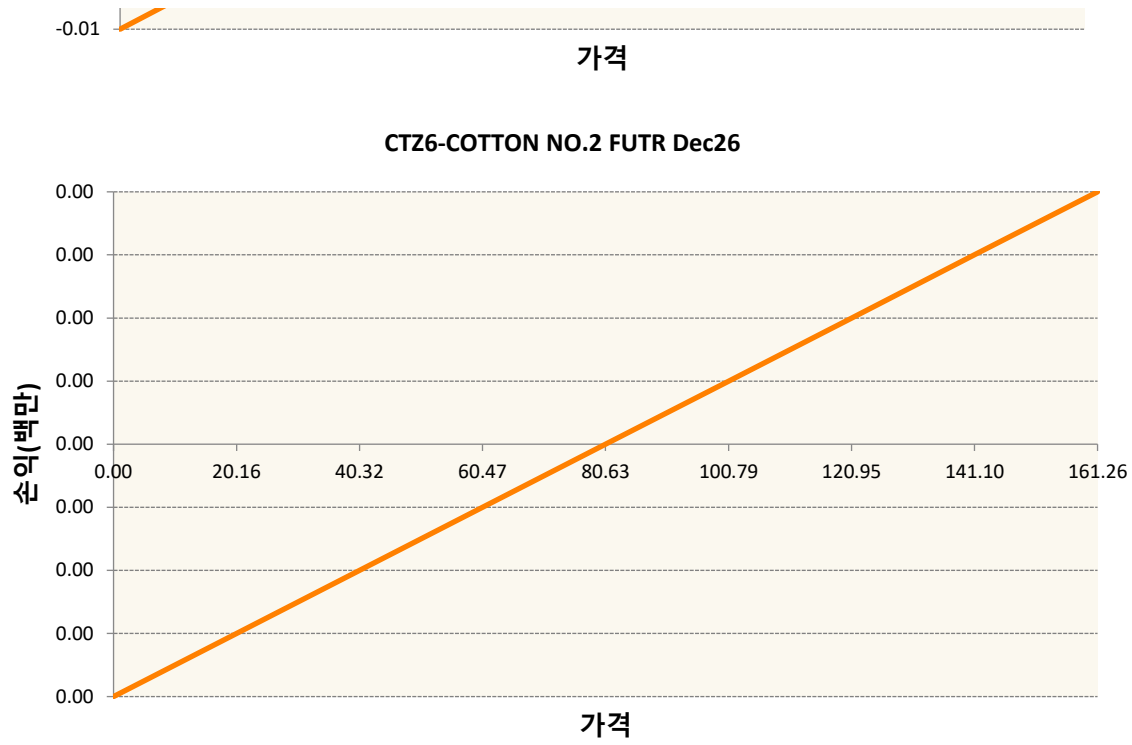
1. 계약금액

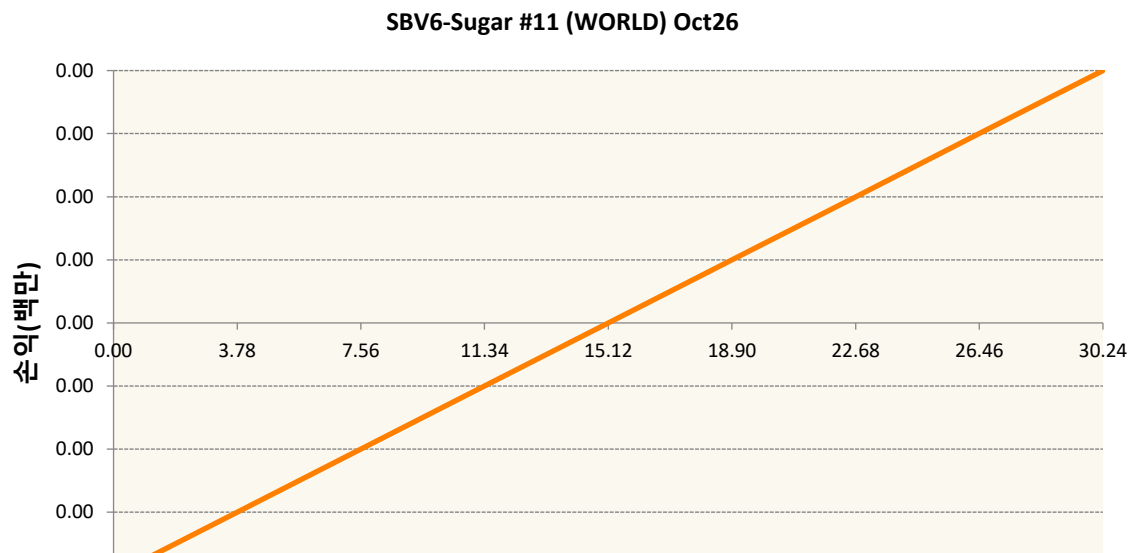
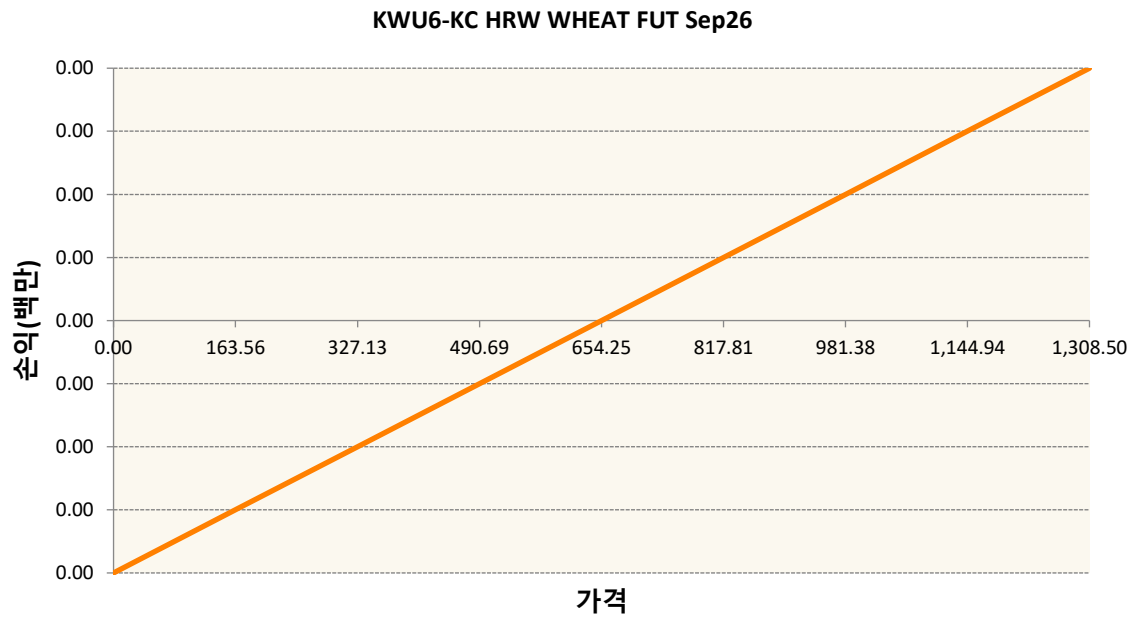
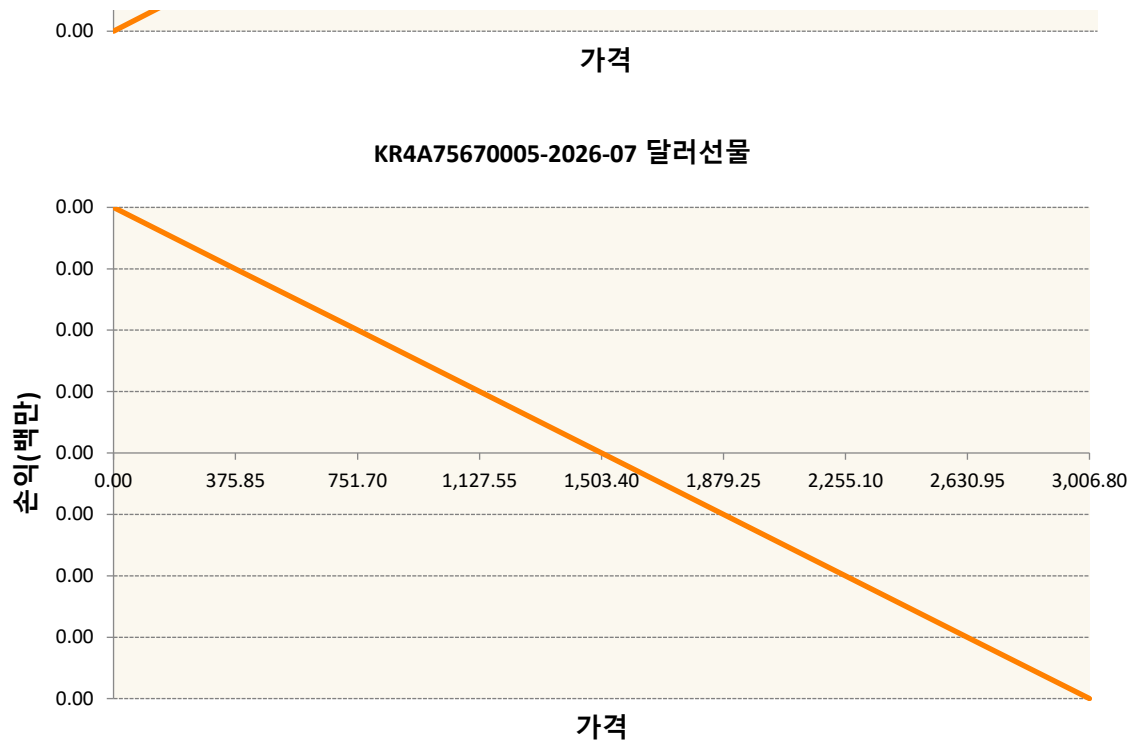
(단위:USD 백만)

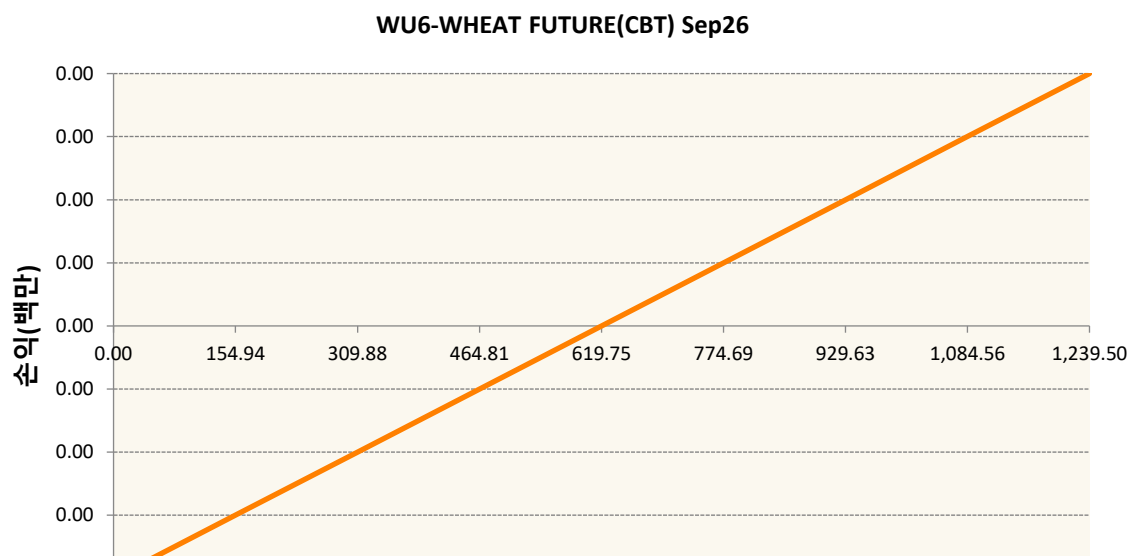
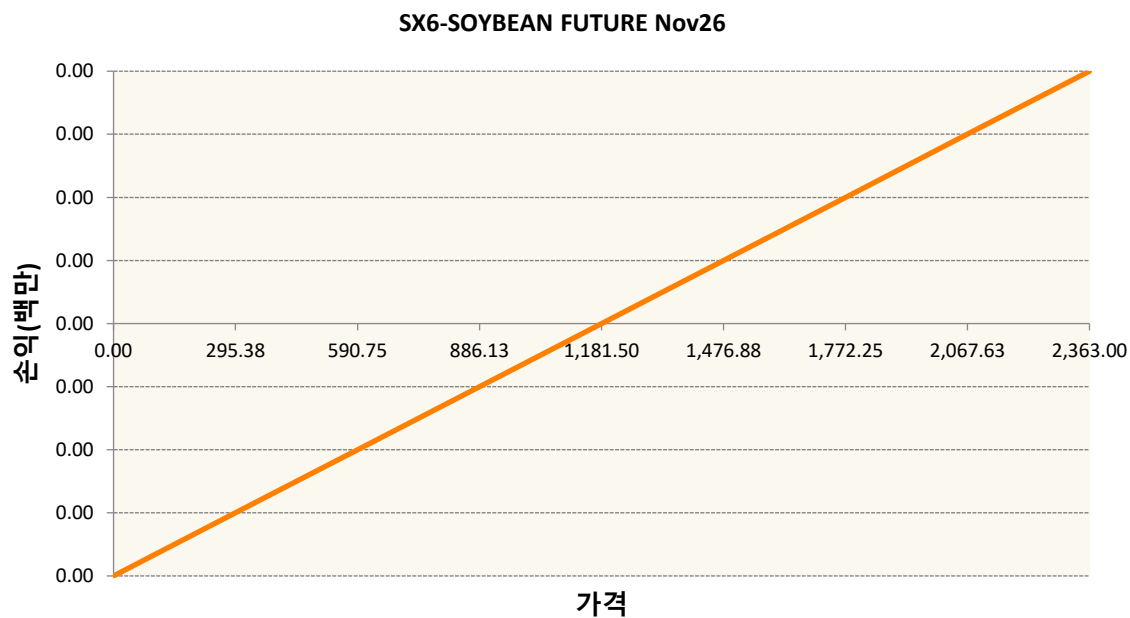
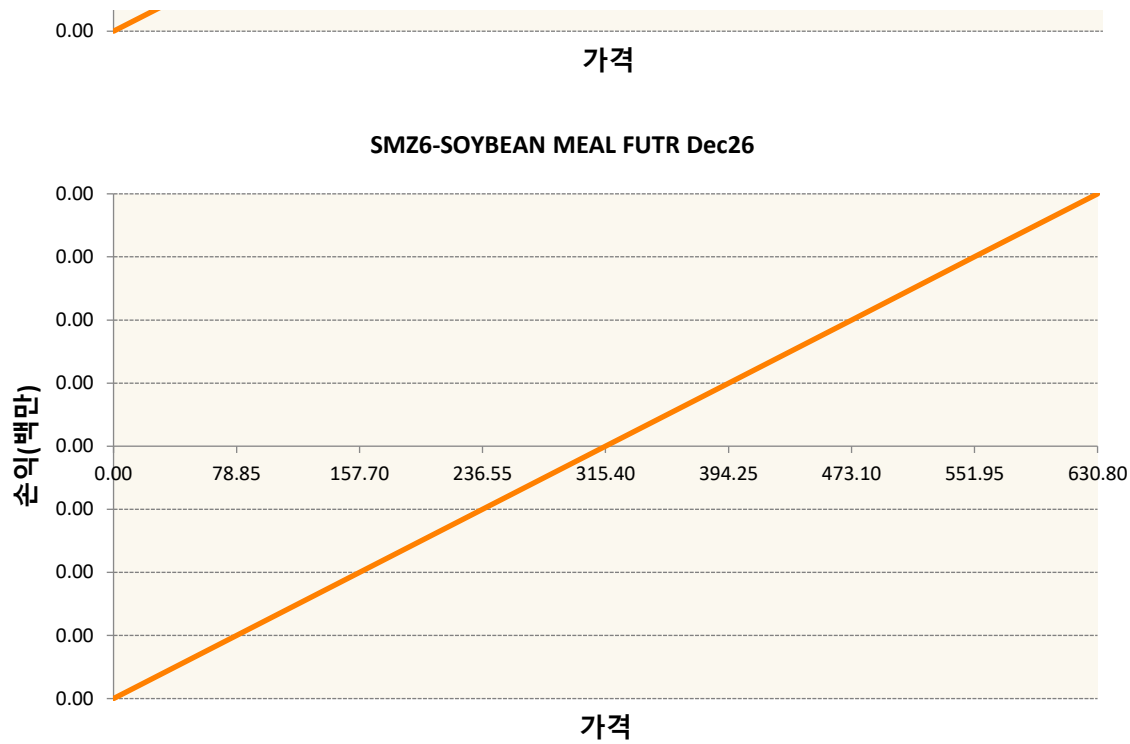
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	474	0	474	
누계	유가증권	선물	2,153	0	2,153	
누계	통화	선물	0	316	-316	장내

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	2026-07-13
기준일	2026-07-10

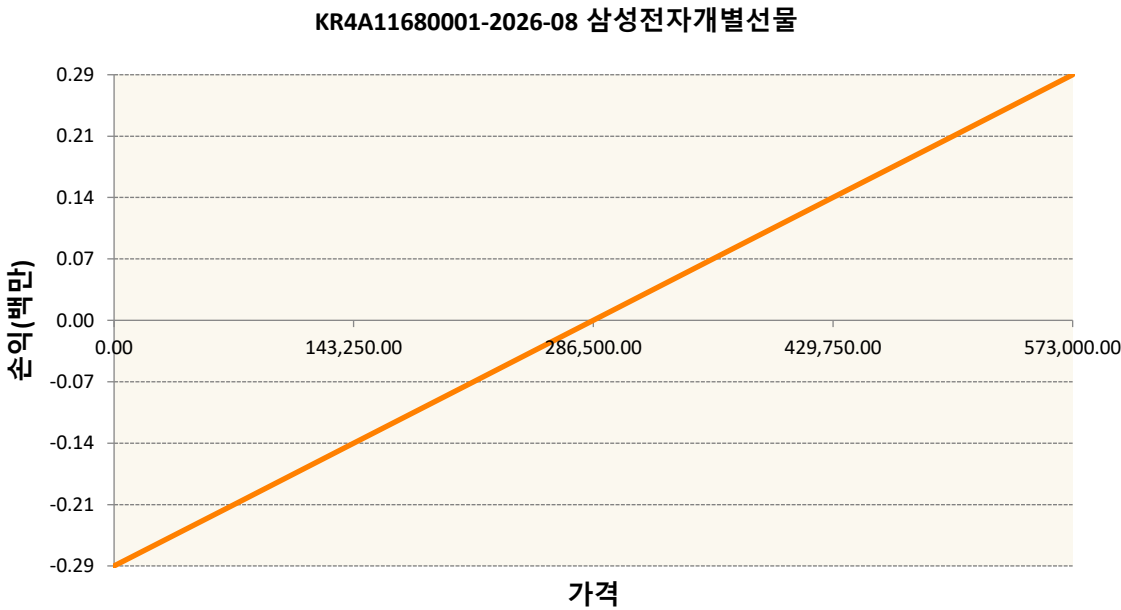
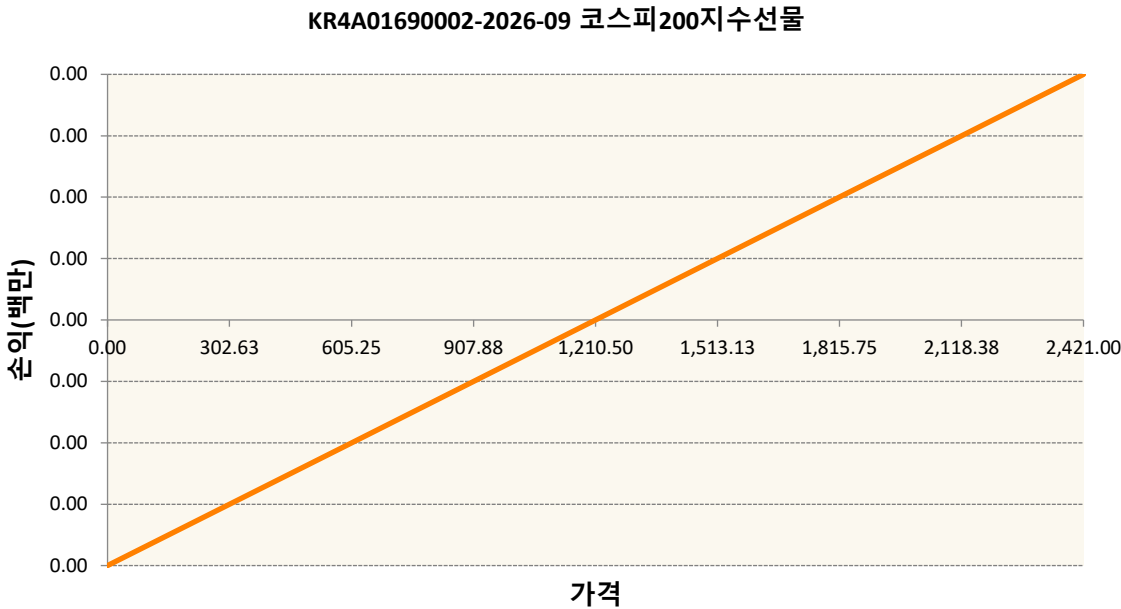
스마트인덱스모

1. 계약금액

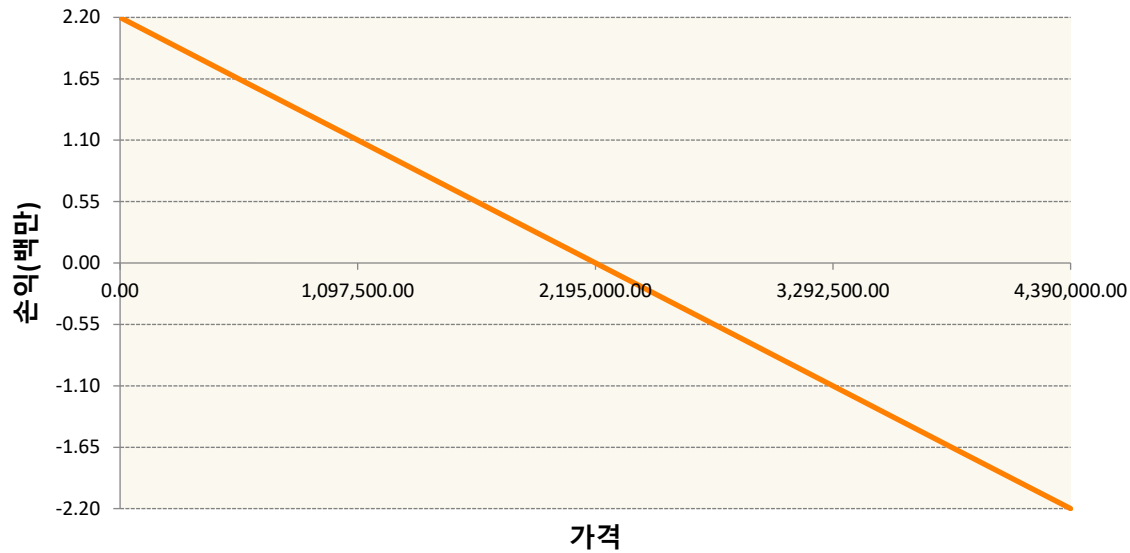
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	621	1,069	-448	장내
누계	유가증권	선물	4,351	439	3,912	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4A50680003-2026-08 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A01690002			2026-09 코스피200지수선물				335
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-335	-335	-335	-335	-335	-335	-335
-5.33%	-223	-223	-223	-223	-223	-223	-223
-2.67%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	112	112	112	112	112	112	112
5.33%	223	223	223	223	223	223	223
8.00%	335	335	335	335	335	335	335
KR4A11680001			2026-08 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
KR4A50680003			2026-08 SK하이닉스개별선물				35
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	35	35	35	35	35	35	35
-5.33%	23	23	23	23	23	23	23
-2.67%	12	12	12	12	12	12	12
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-12	-12	-12	-12	-12	-12	-12
5.33%	-23	-23	-23	-23	-23	-23	-23
8.00%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35

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

(단위:백만원)

1,096

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

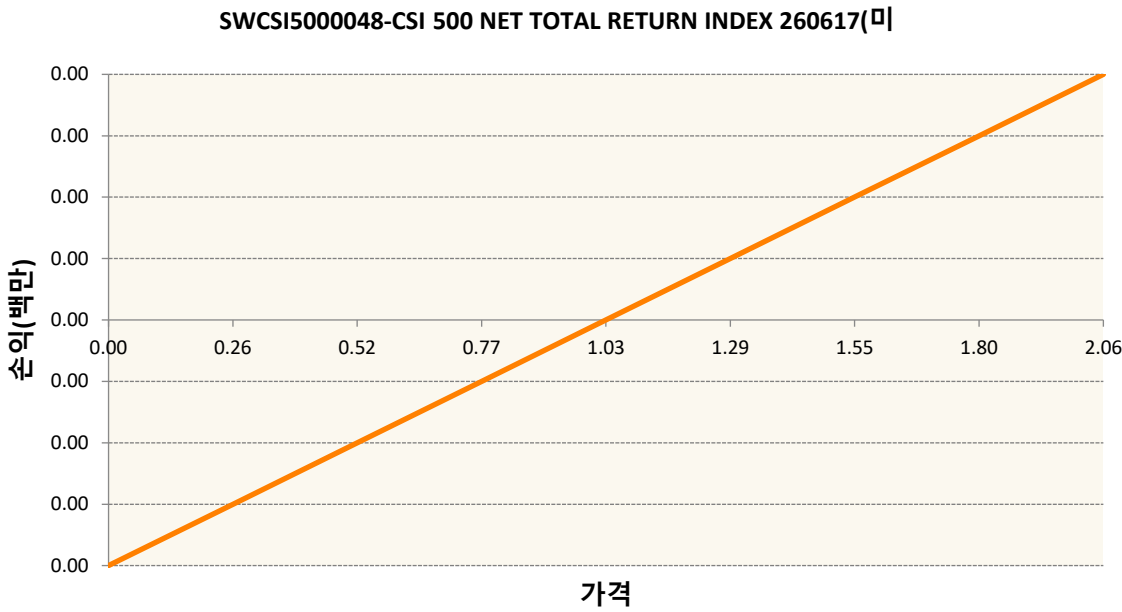
SOL차이나강소기업CSI500상장

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

476

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

659

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

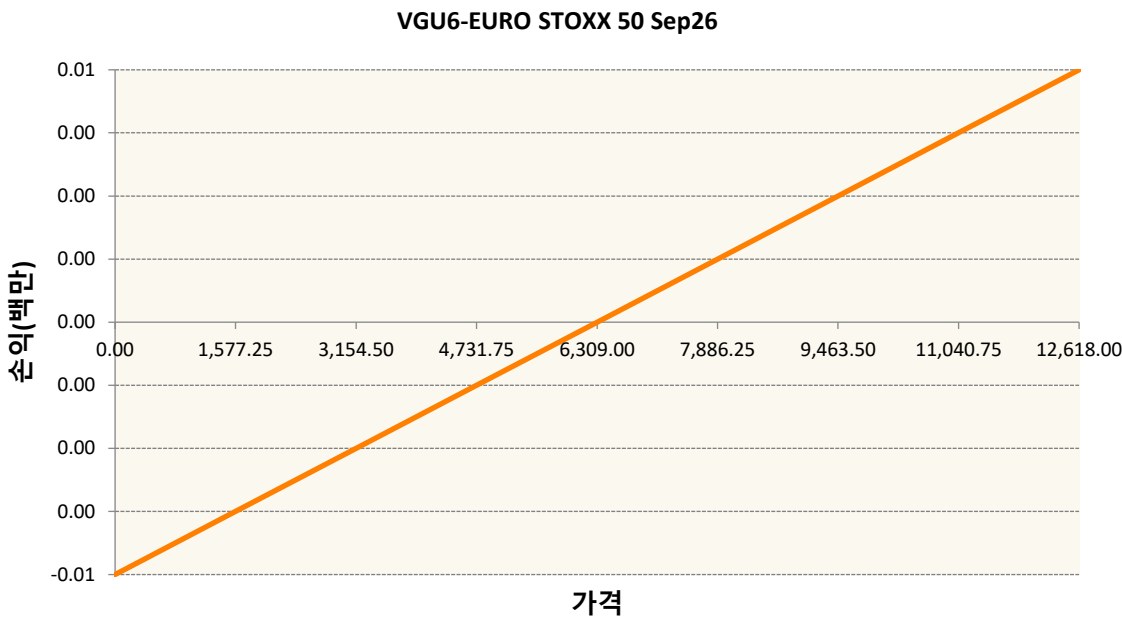
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	997	0	997	

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	2026-07-13
기준일	2026-07-10

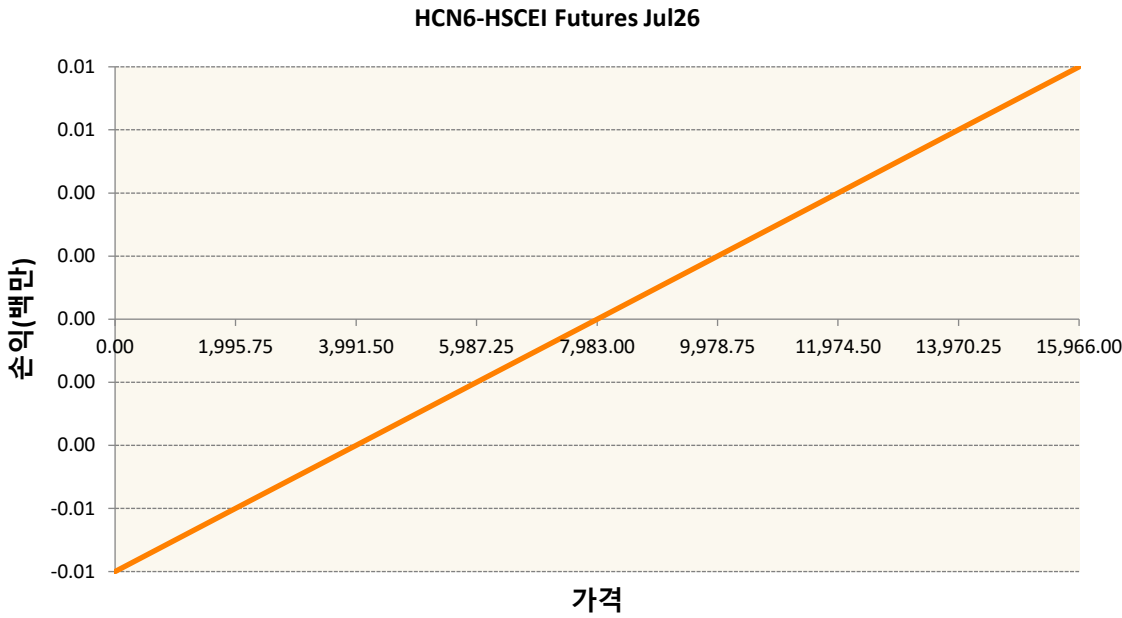
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,322	0	1,322	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCN6	HSCEI Futures Jul26	106
------	---------------------	-----

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

(단위:백만원)

126

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

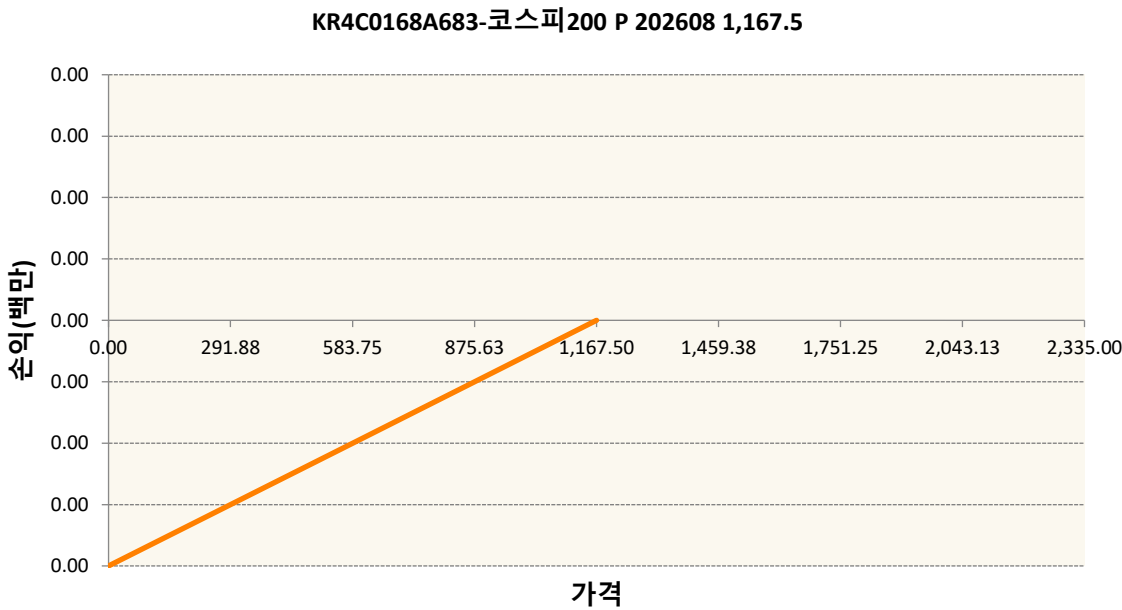
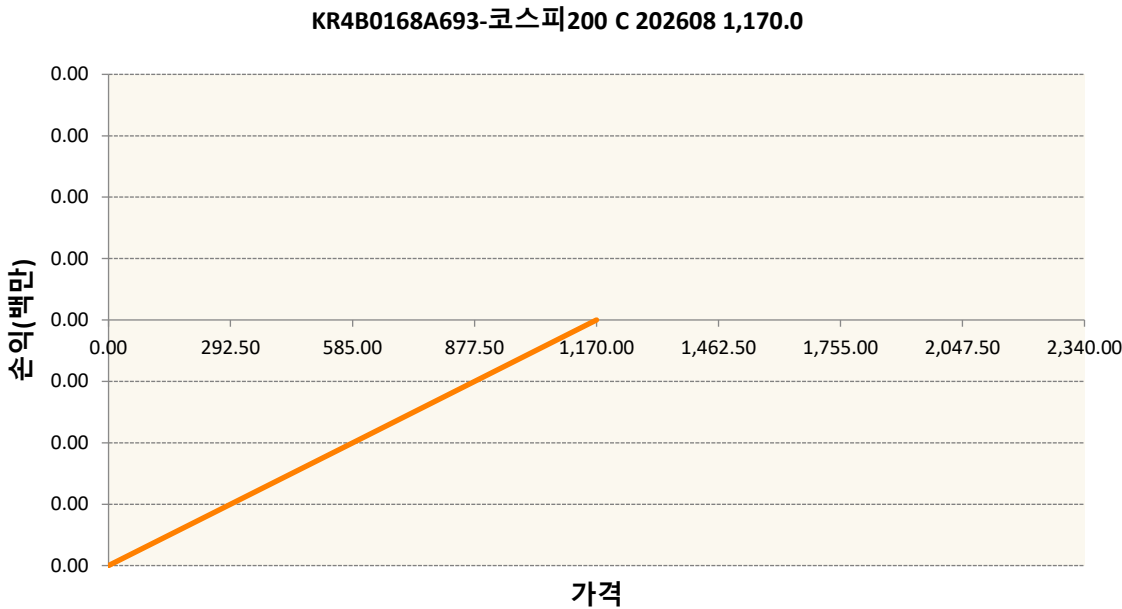
커버드콜모(주식혼합-파생형)

1. 계약금액

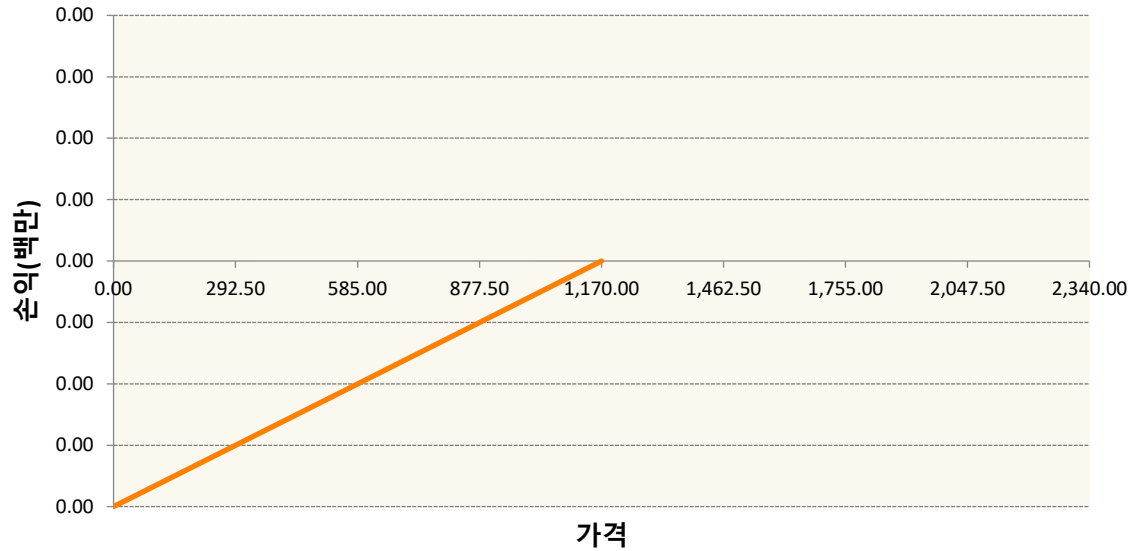
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	45,696	-45,696	장내
누계	유가증권	옵션	0	41,233	-41,233	장내

2. 만기시점의 손익구조



KR4C0168A691-코스피200 P 202608 1,170.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4B0168A693 코스피200 C 202608 1,170.0 2,067

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-544	-795	-1,048	-1,301	-1,556	-1,812	-2,067
-5.33%	-37	-300	-563	-827	-1,090	-1,353	-1,616
-2.67%	415	146	-124	-393	-662	-931	-1,199
0%	814	543	271	0	-271	-542	-813
2.67%	1,162	894	625	355	84	-187	-458
5.33%	1,462	1,202	939	673	406	137	-132
8.00%	1,718	1,470	1,216	958	696	432	166

KR4C0168A683 코스피200 P 202608 1,167.5 271

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-70	-103	-137	-170	-204	-237	-271
-5.33%	-4	-39	-73	-108	-143	-177	-212
-2.67%	55	19	-16	-51	-87	-122	-157
0%	107	71	36	0	-36	-71	-107
2.67%	152	117	82	46	11	-25	-60
5.33%	191	157	123	88	53	18	-18
8.00%	224	192	159	125	91	56	21

KR4C0168A691 코스피200 P 202608 1,170.0 218

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-57	-84	-110	-137	-164	-191	-218
-5.33%	-4	-32	-59	-87	-115	-142	-170
-2.67%	44	15	-13	-41	-70	-98	-126
0%	86	57	29	0	-29	-57	-86

2.67%	122	94	66	37	9	-20	-48
5.33%	154	127	99	71	43	14	-14
8.00%	181	155	128	101	73	45	17

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

(단위:백만원)

2,998

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

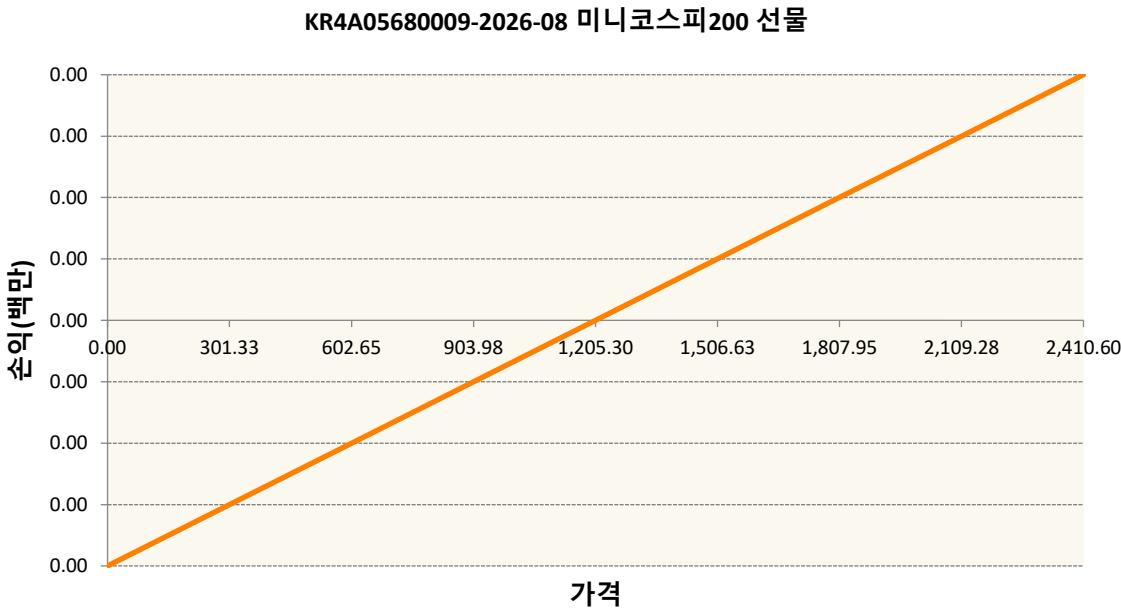
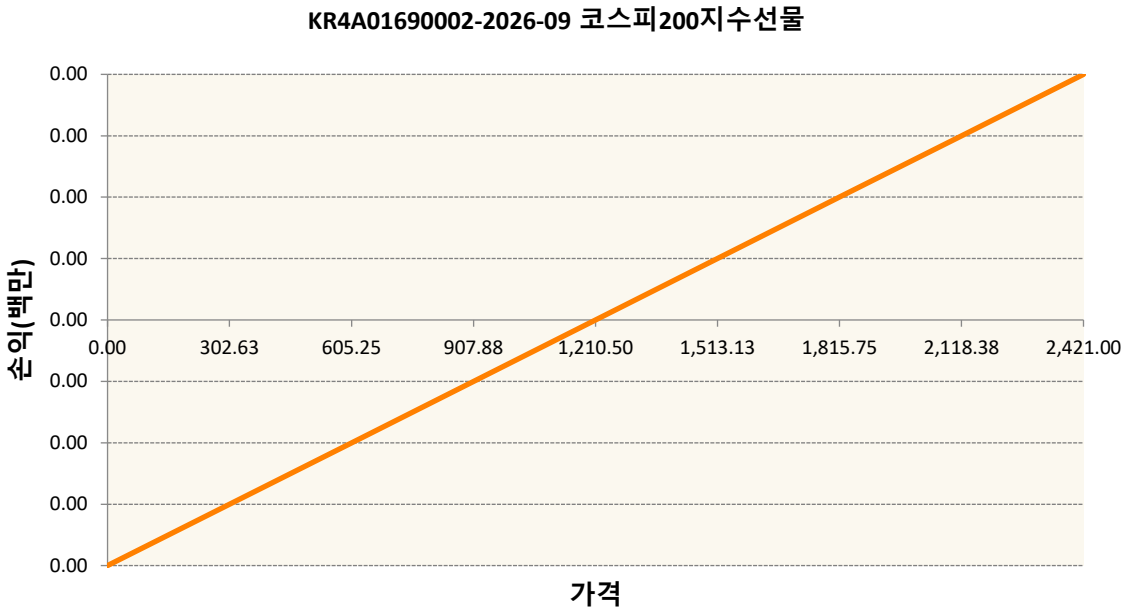
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

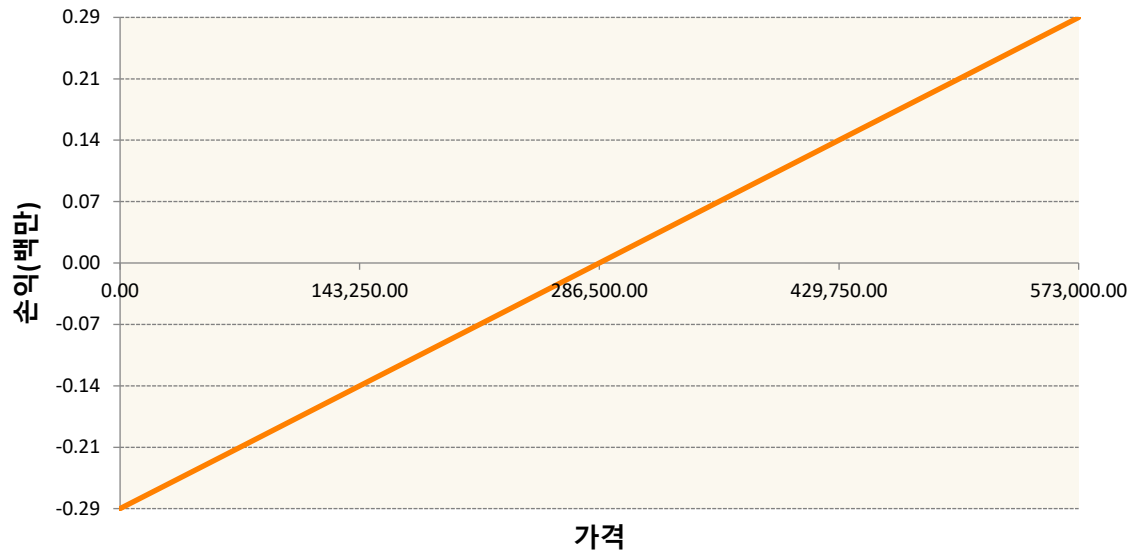
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	179	-179	장내
누계	유가증권	선물	4,377	234	4,143	장내

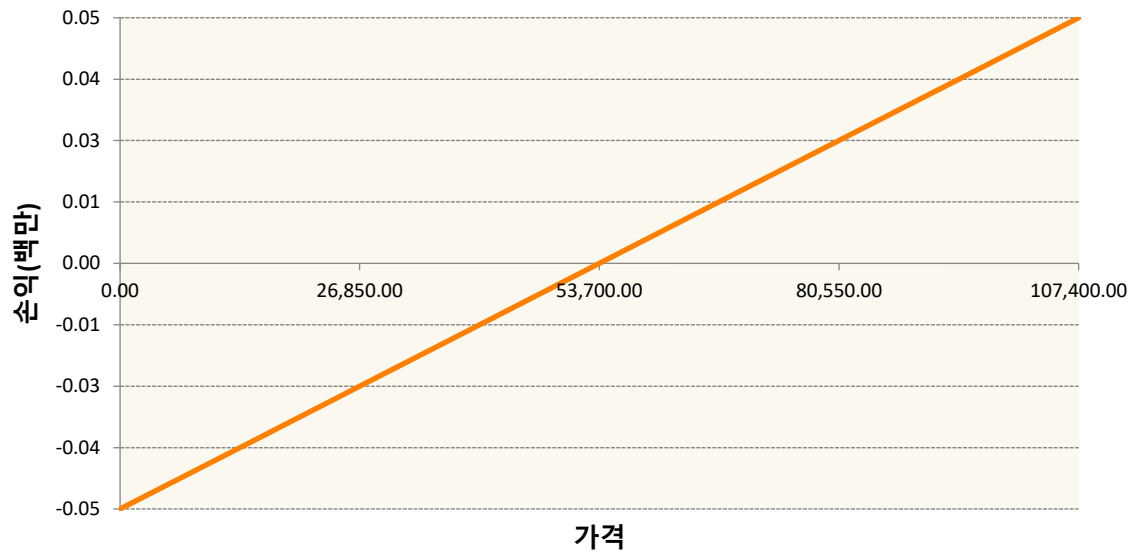
2. 만기시점의 손익구조



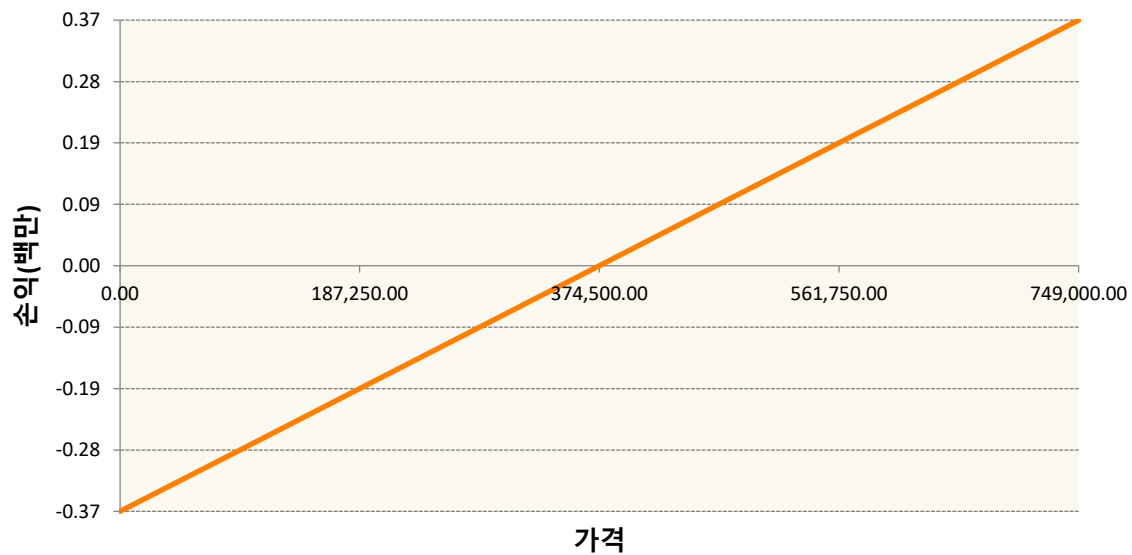
KR4A11680001-2026-08 삼성전자개별선물



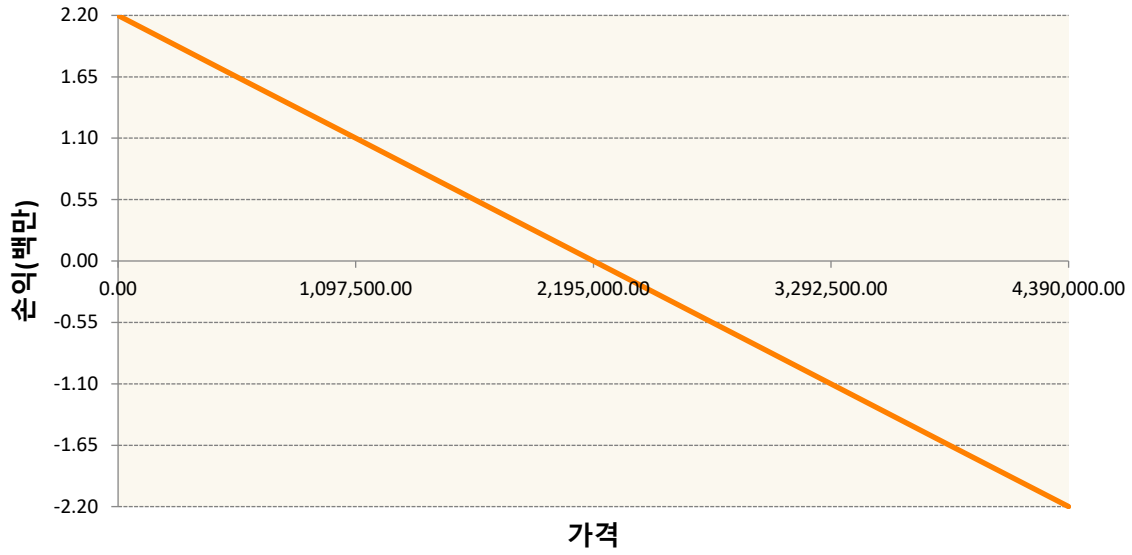
KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



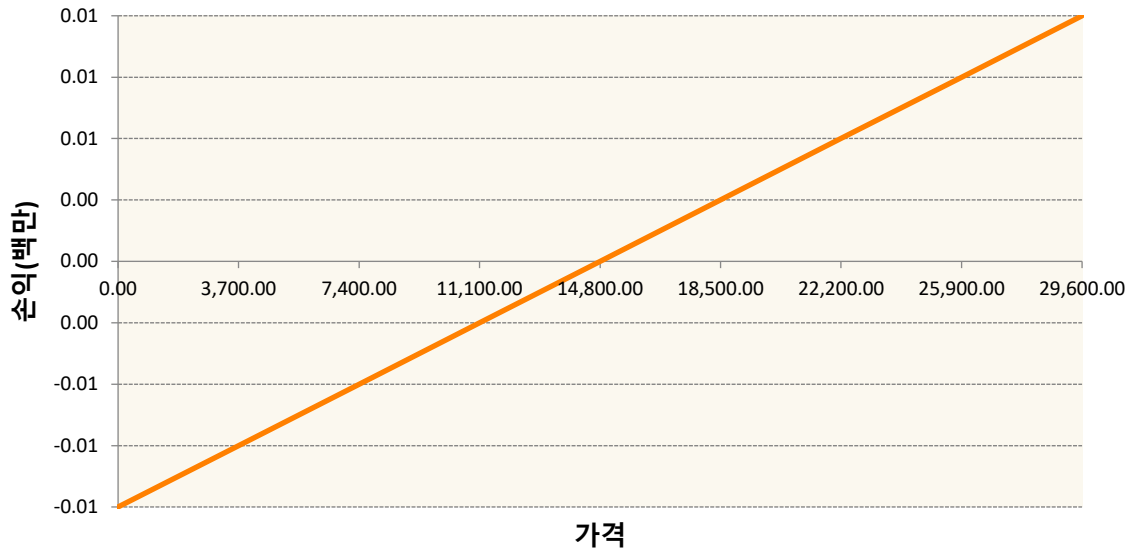
KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



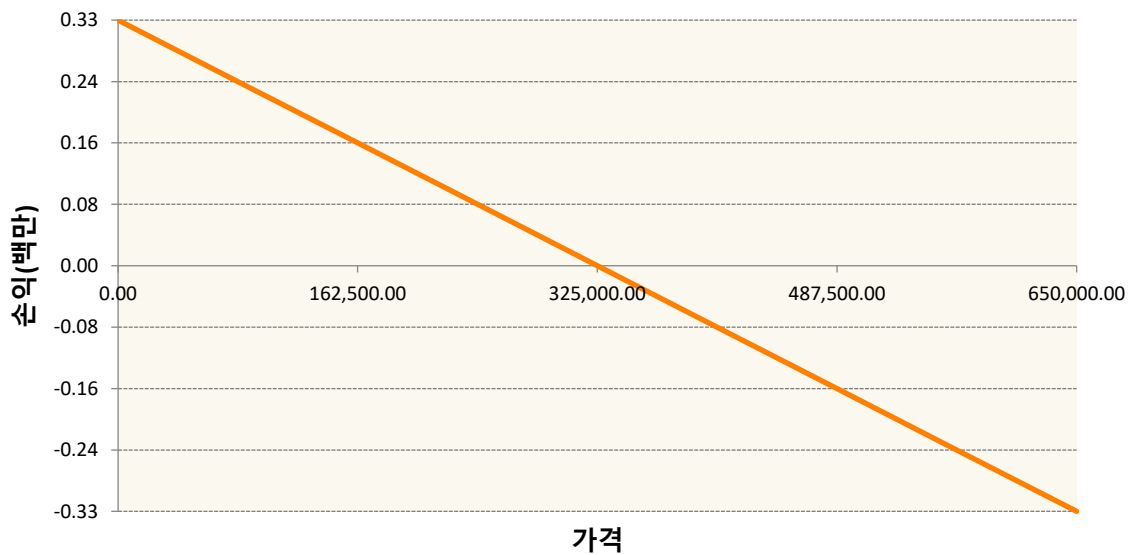
KR4A50680003-2026-08 SK하이닉스개별선물



KR4AB0680002-2026-08 LG유플러스개별선물



KR4AF5680008-2026-08 LG에너지솔루션개별선물



(단위:백만원)

	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							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%	9	9	9	9	9	9	9
-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%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9
8.00%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14

KR4AB0680002 2026-08 LG유플러스개별선물							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%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-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%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	2	2	2	2	2	2	2

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)

425

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

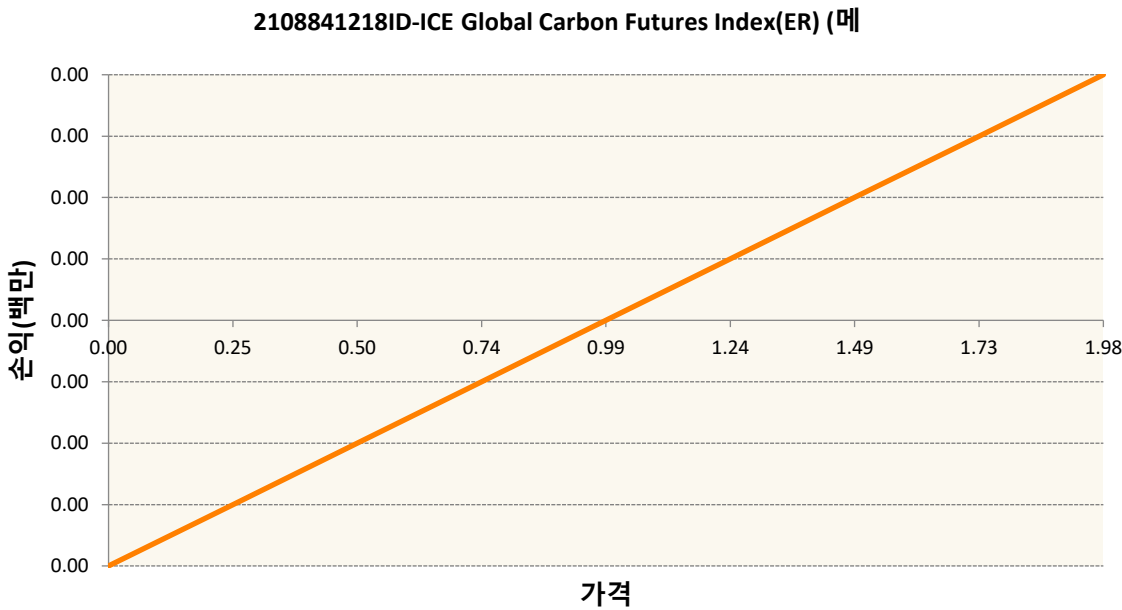
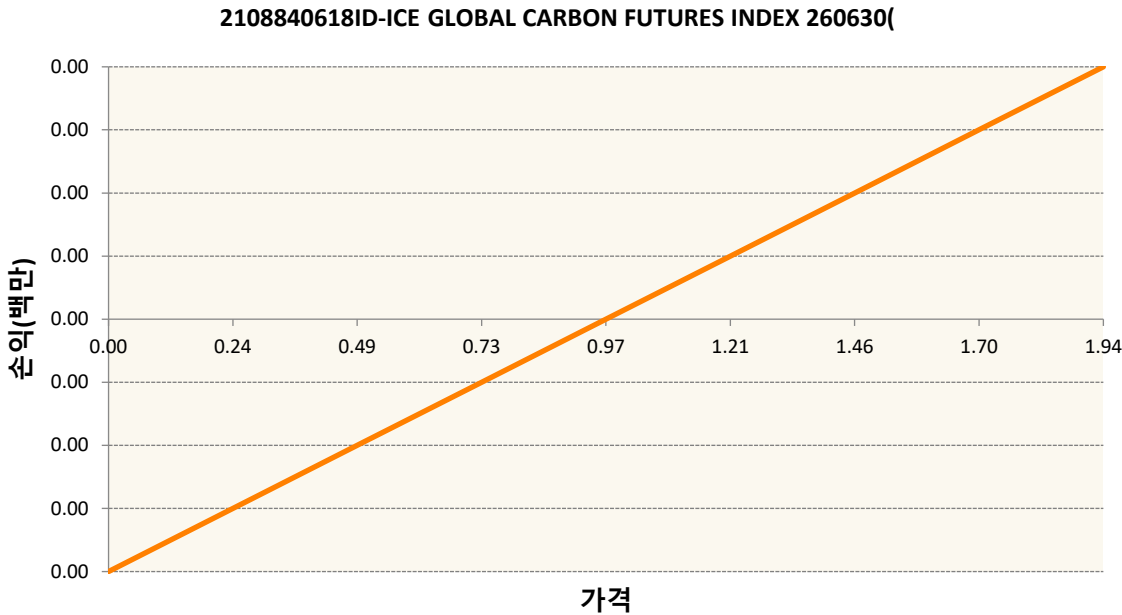
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

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	7,393	0	7,393	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
2108840618IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(		473
2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메		119

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	671

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

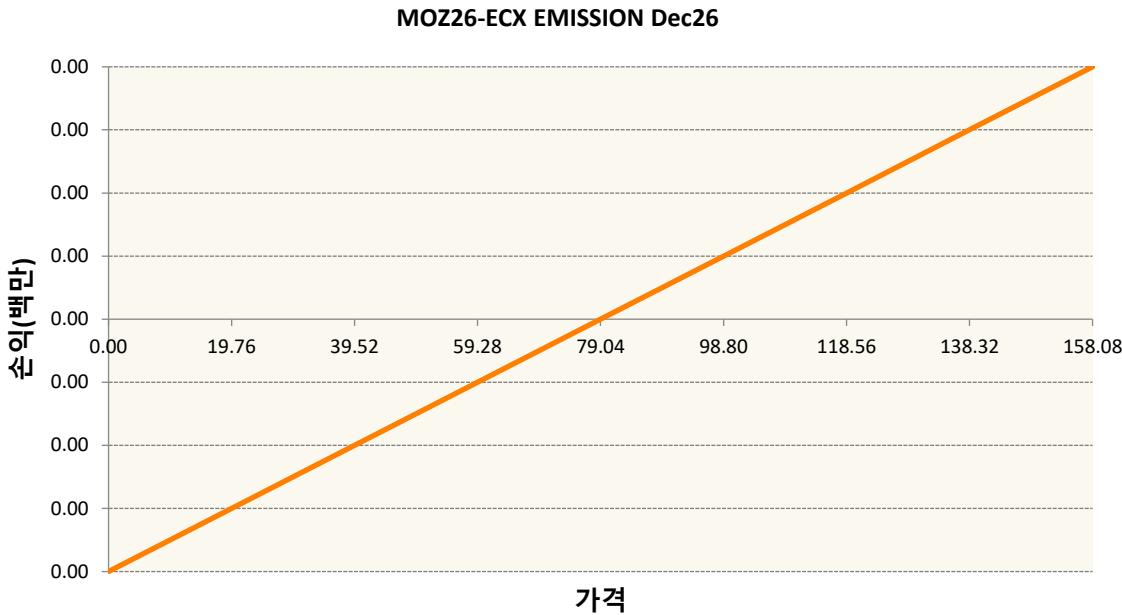
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			5,106	0	5,106	
누계	통화	선도	0	2,697	-2,697	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G6S(KRW/EUR 31-07-26E	216
MOZ26 ECX EMISSION Dec26	409

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

(단위:백만원)

686

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

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	-924	0	-924	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠)	28
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	15
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	11
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	17

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

(단위:백만원)

113

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

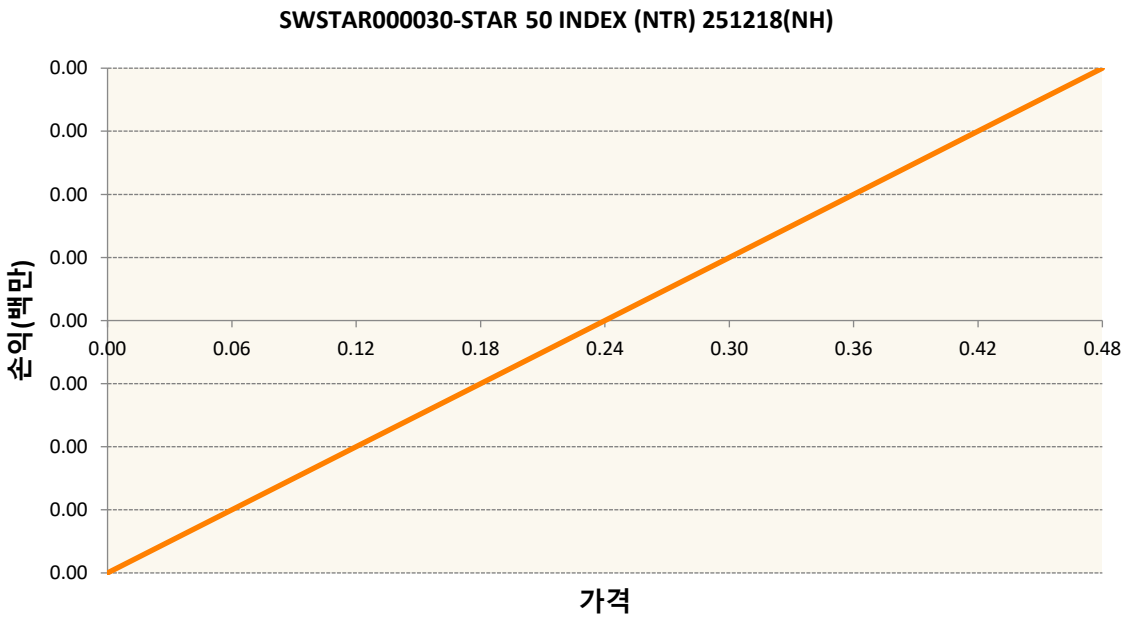
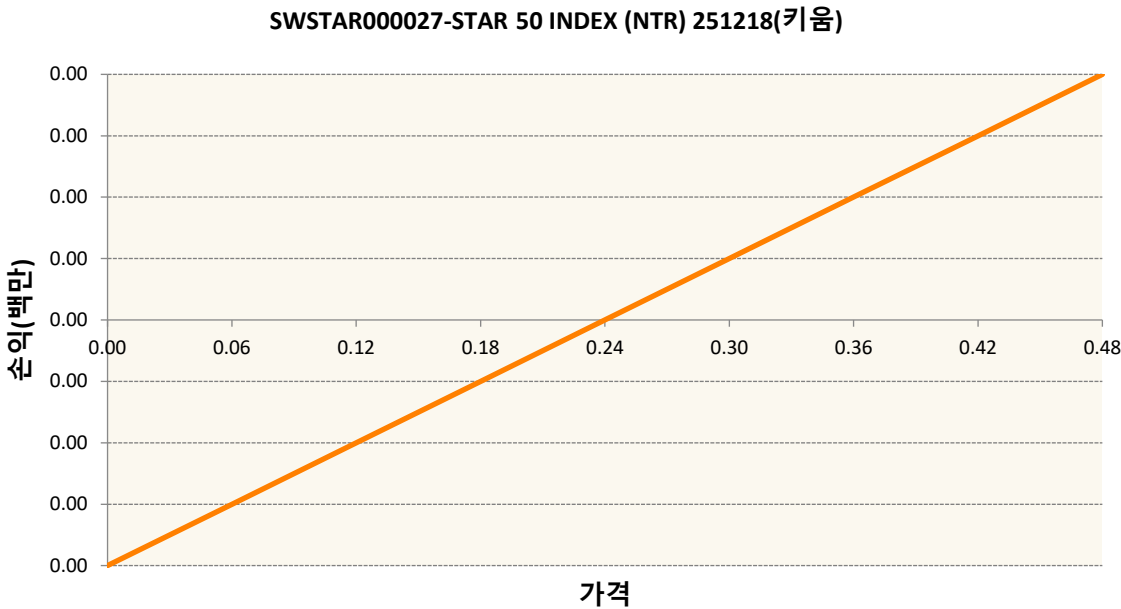
SOL차이나육성산업엑티브상장지

1. 계약금액

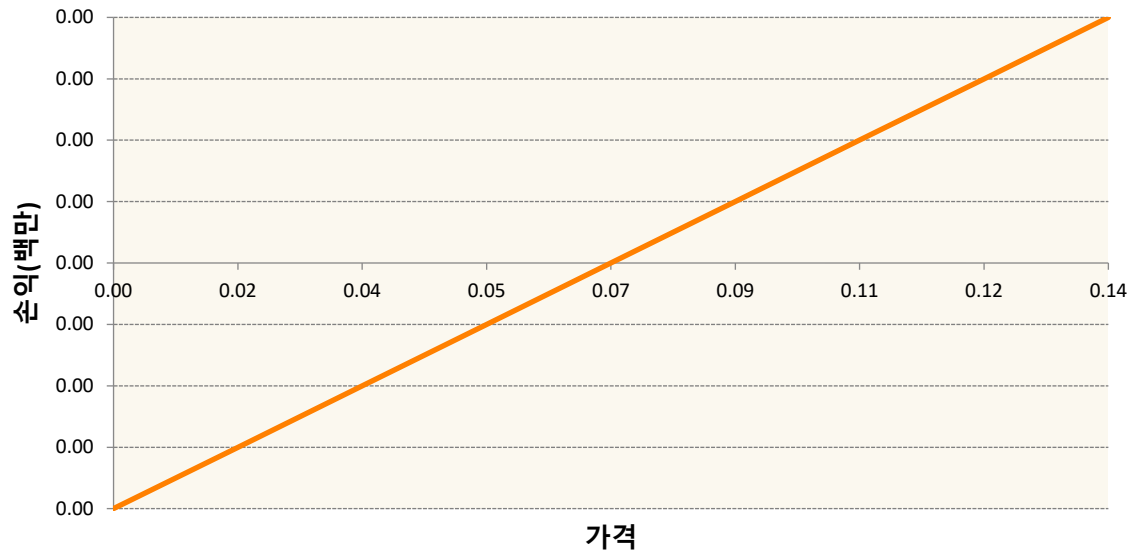
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	2,179	0	2,179	장외

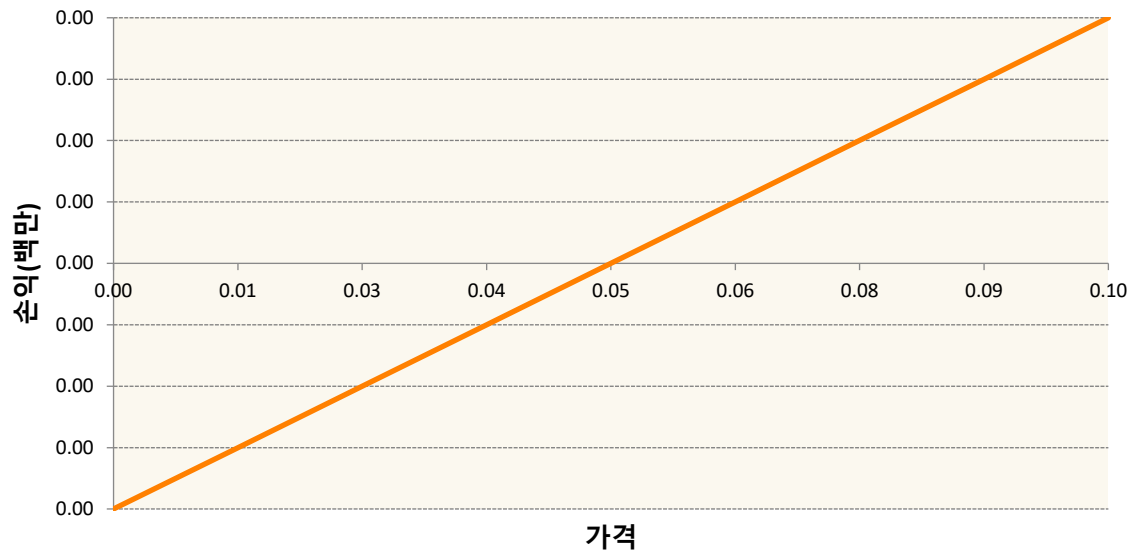
2. 만기시점의 손익구조



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



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



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

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

23
77
38
33

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

(단위:백만원)

291

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

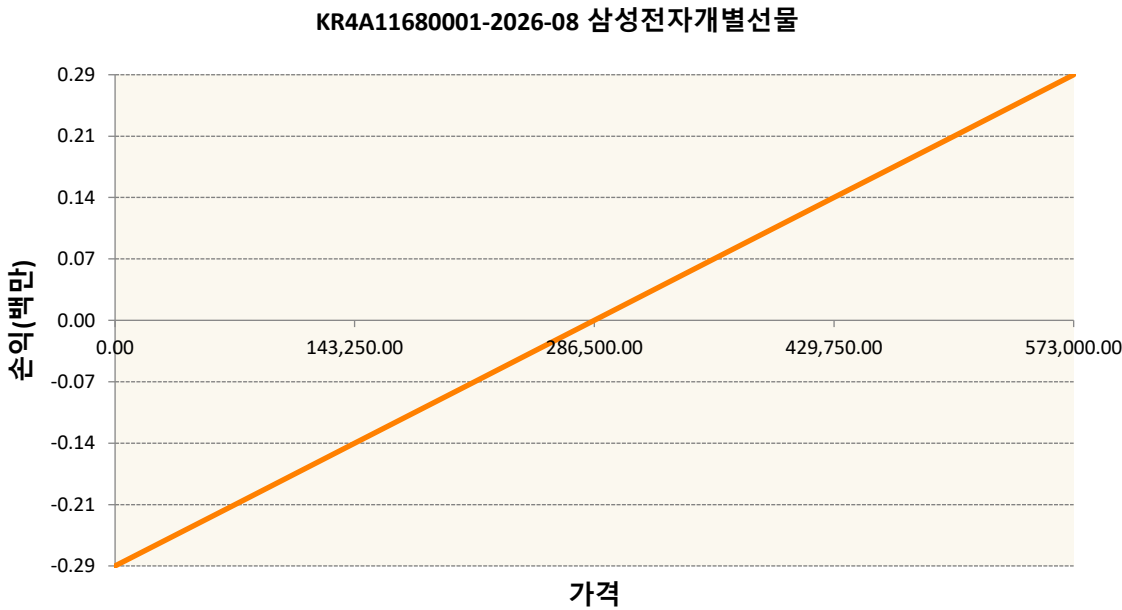
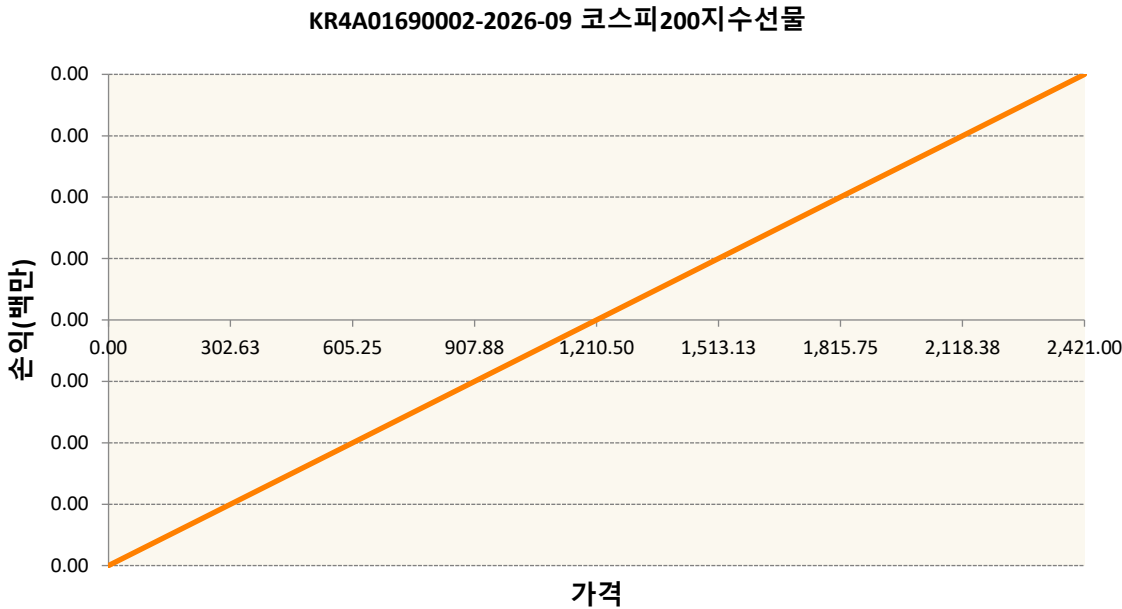
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

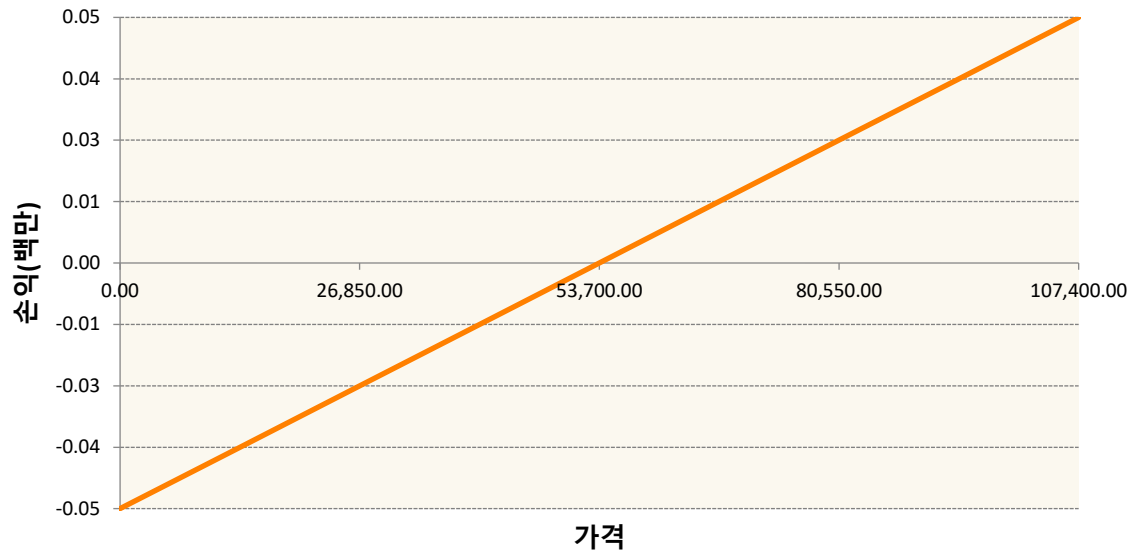
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	6,816	13,817	-7,001	장내
누계	유가증권	선물	28,678	3,837	24,841	장내

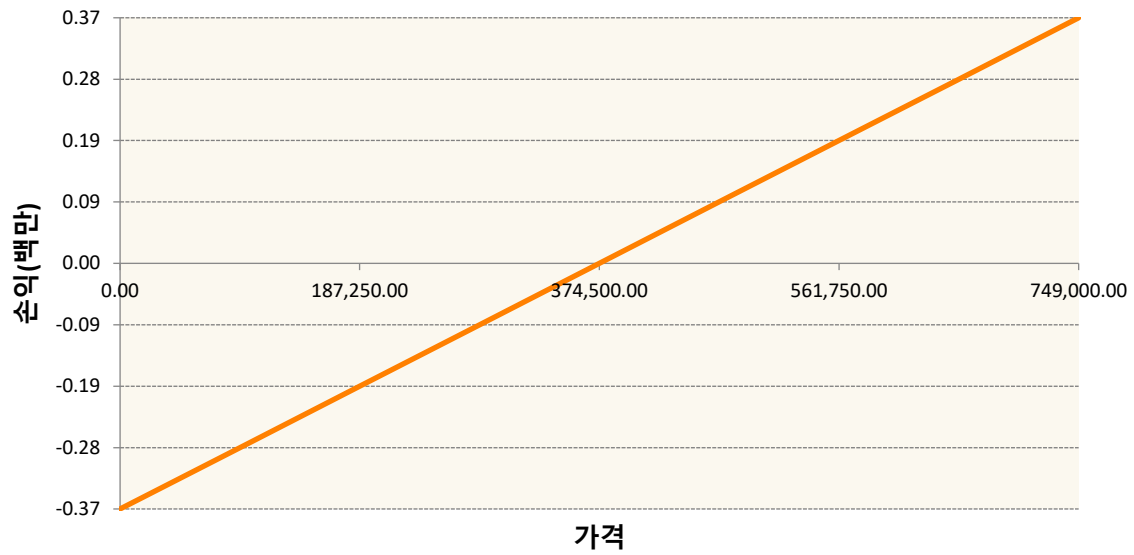
2. 만기시점의 손익구조



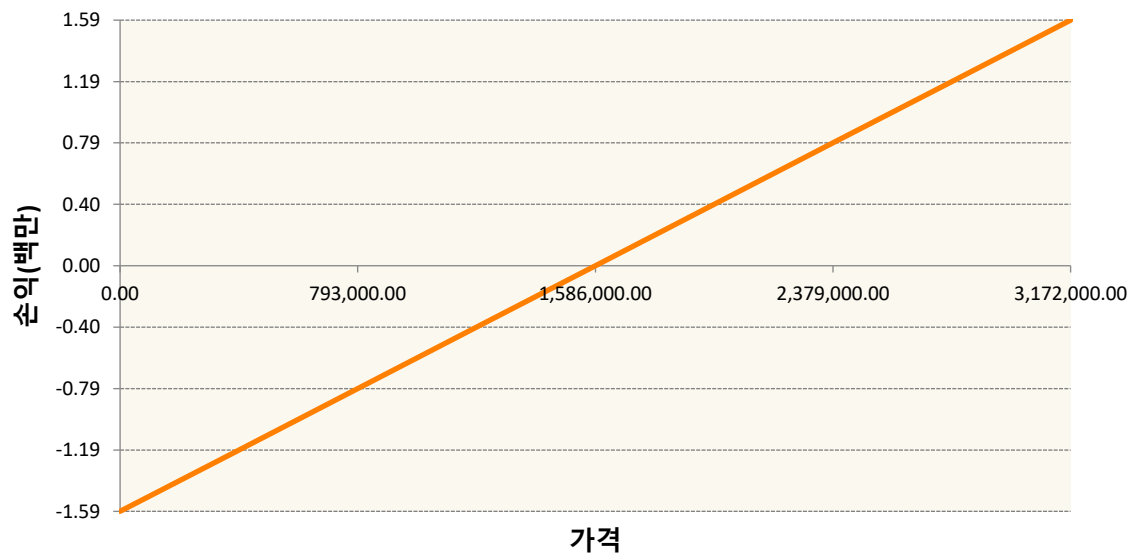
KR4A14680008-2026-08 KT개별선물



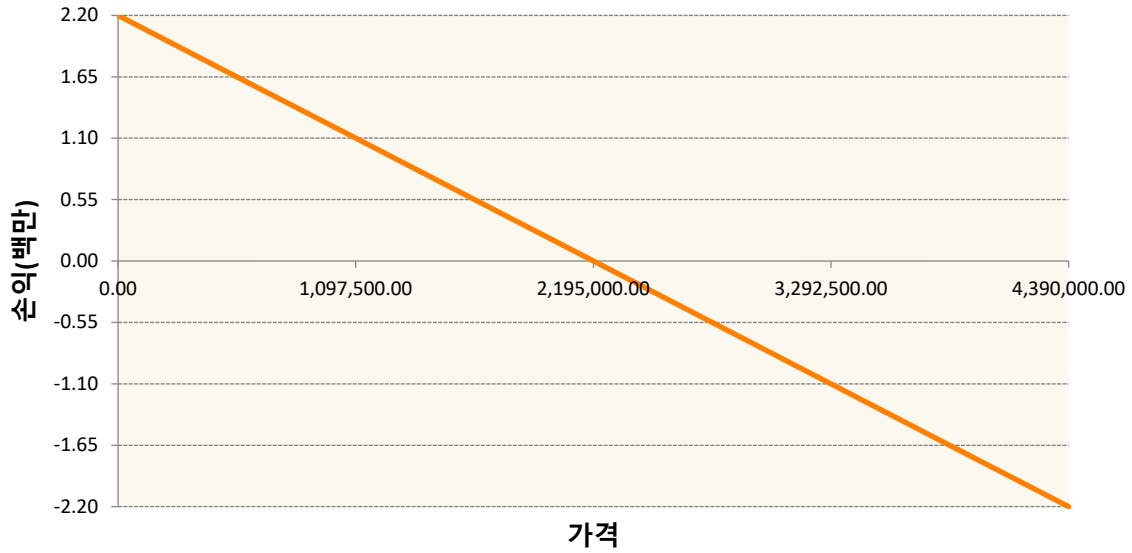
KR4A1Q680004-2026-08 에이피알개별선물



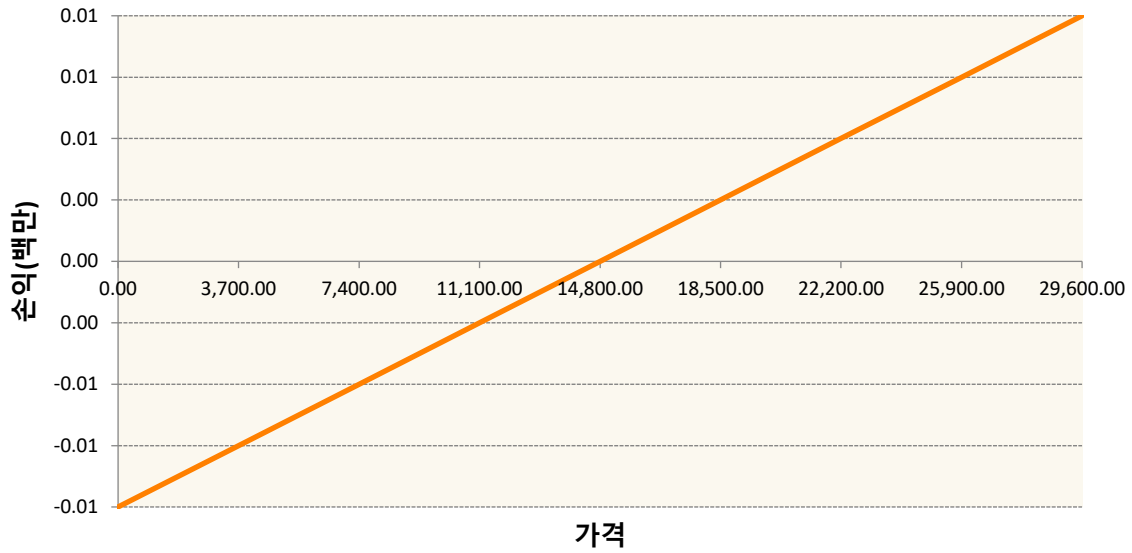
KR4A23680007-2026-08 삼성전기개별선물



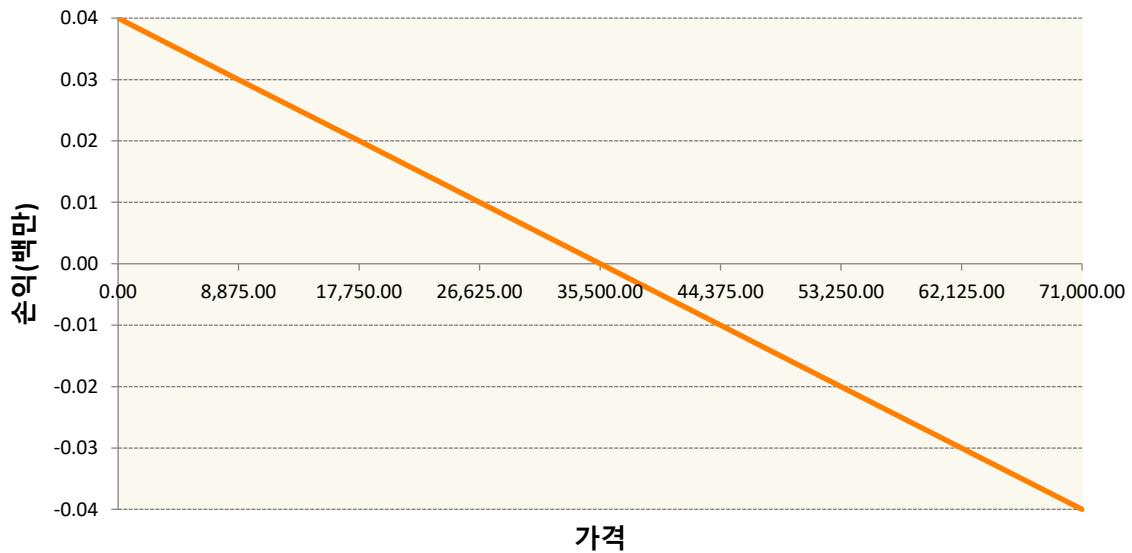
KR4A50680003-2026-08 SK하이닉스개별선물



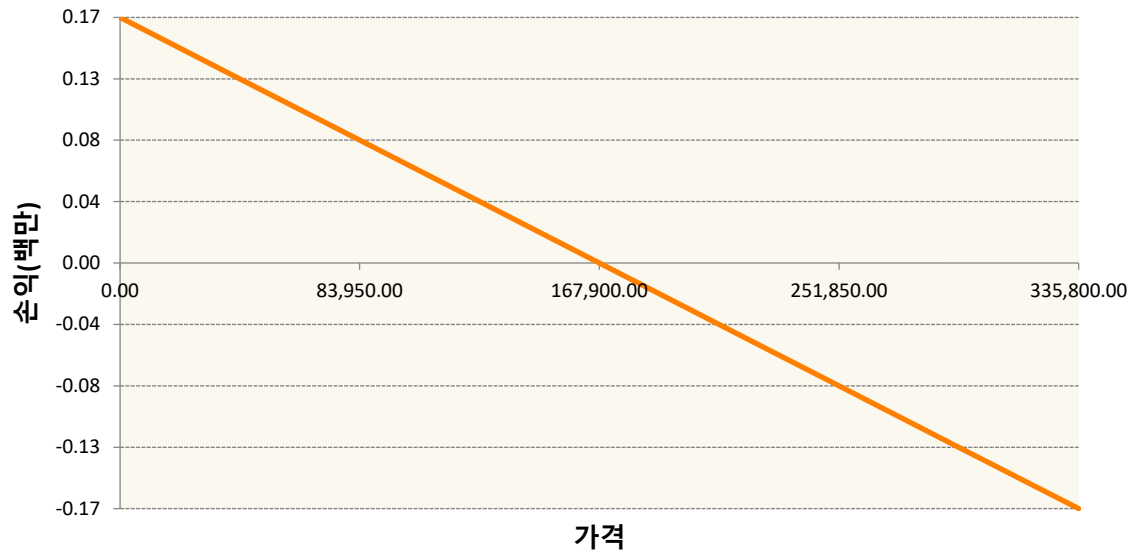
KR4AB0680002-2026-08 LG유플러스개별선물



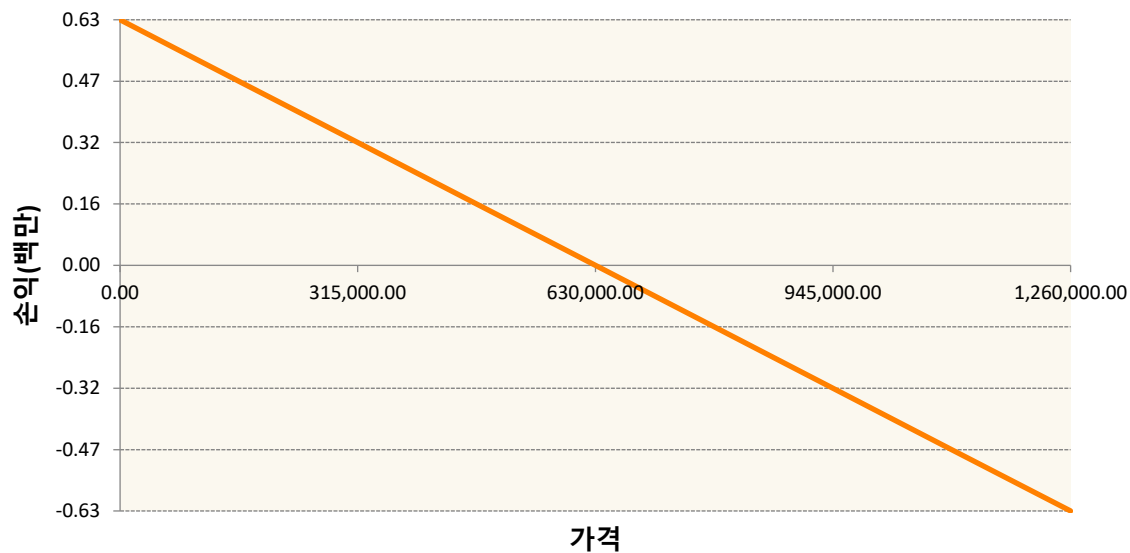
KR4ACF680003-2026-08 카카오개별선물



KR4AD8680000-2026-08 현대백화점개별선물



KR4ADD680004-2026-08 신세계개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A01690002				2026-09 코스피200지수선물			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
KR4A11680001				2026-08 삼성전자개별선물			337
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-337	-337	-337	-337	-337	-337	-337
-5.33%	-225	-225	-225	-225	-225	-225	-225
-2.67%	-112	-112	-112	-112	-112	-112	-112
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	112	112	112	112	112	112	112
5.33%	225	225	225	225	225	225	225
8.00%	337	337	337	337	337	337	337

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 54

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-54	-54	-54	-54	-54	-54	-54
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-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%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	54	54	54	54	54	54	54

KR4A23680007 2026-08 삼성전기개별선물 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

KR4A50680003 2026-08 SK하이닉스개별선물 206

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	206	206	206	206	206	206	206
-5.33%	137	137	137	137	137	137	137
-2.67%	69	69	69	69	69	69	69
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	-69	-69	-69	-69	-69	-69	-69
5.33%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137
8.00%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206

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

KR4ACF680003 2026-08 카카오개별선물 62

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	62	62	62	62	62	62	62
-5.33%	41	41	41	41	41	41	41
-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%	-41	-41	-41	-41	-41	-41	-41
8.00%	-62	-62	-62	-62	-62	-62	-62

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

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

(단위:백만원)

7,168

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

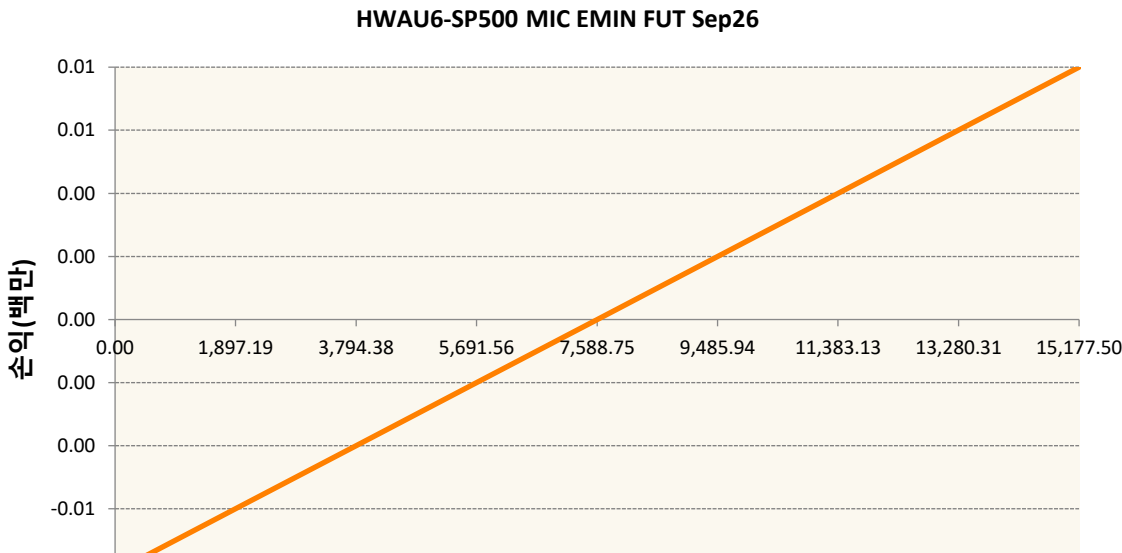
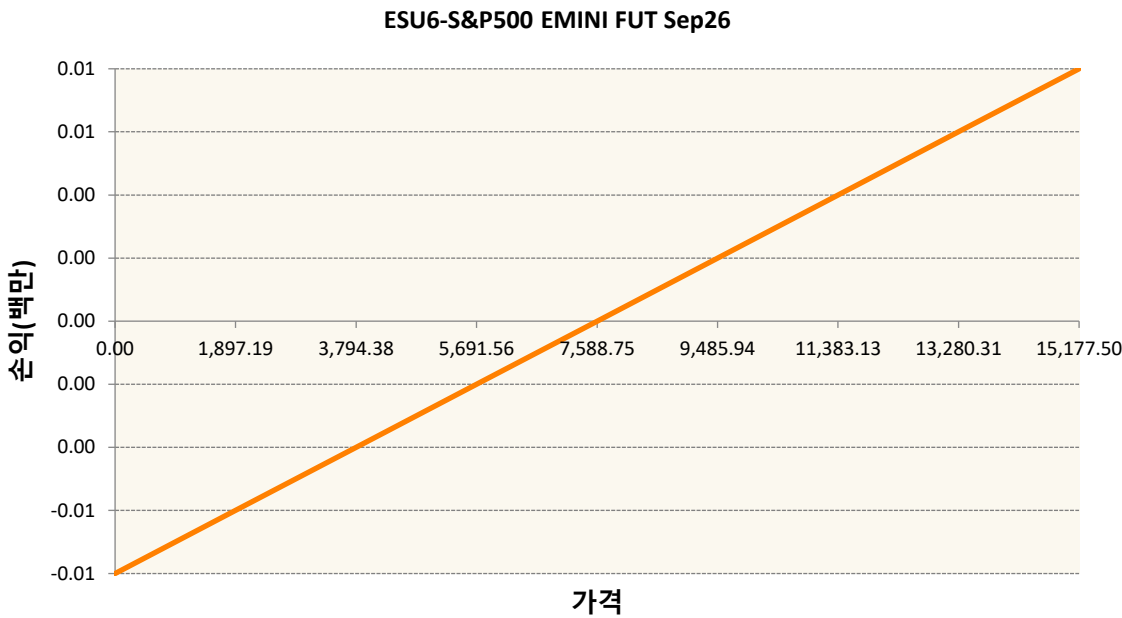
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

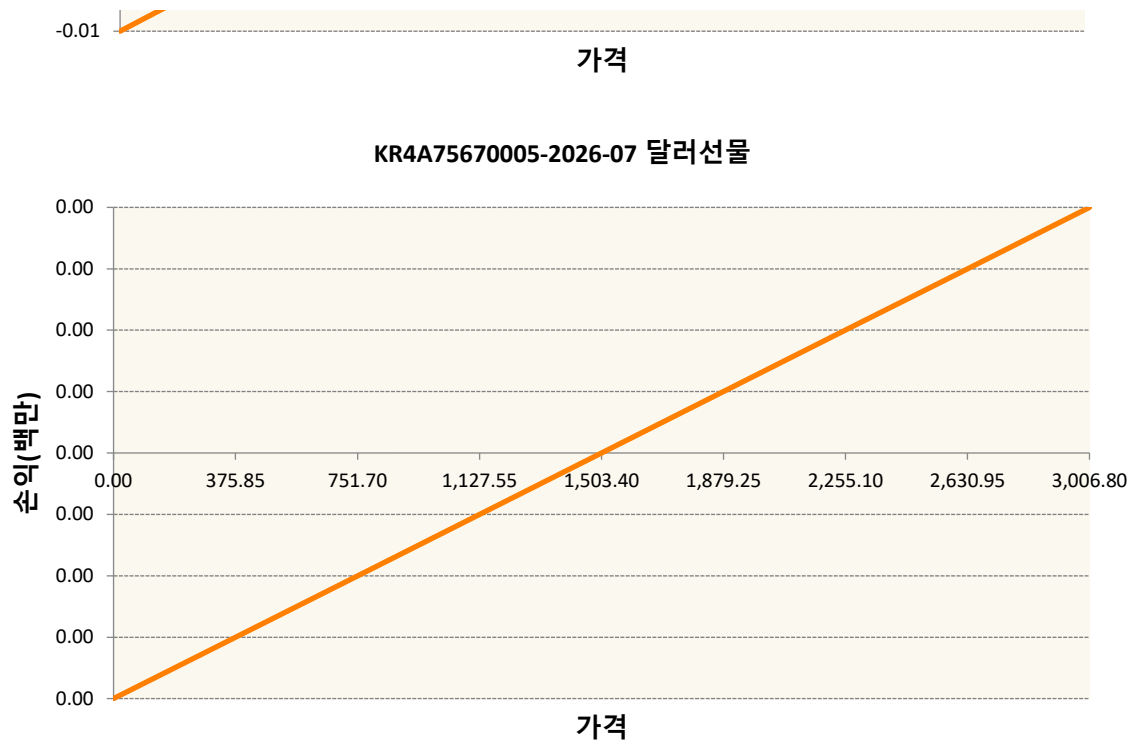
1. 계약금액

(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	67,161	0	67,161	
누계	지수	선물	289	0	289	장내
누계	통화	선물	10,674	0	10,674	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESU6	S&P500 EMINI FUT Sep26	5,373
HWAU6	SP500 MIC EMIN FUT Sep26	23
KR4A756700	2026-07 달러선물	854

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

4,649

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

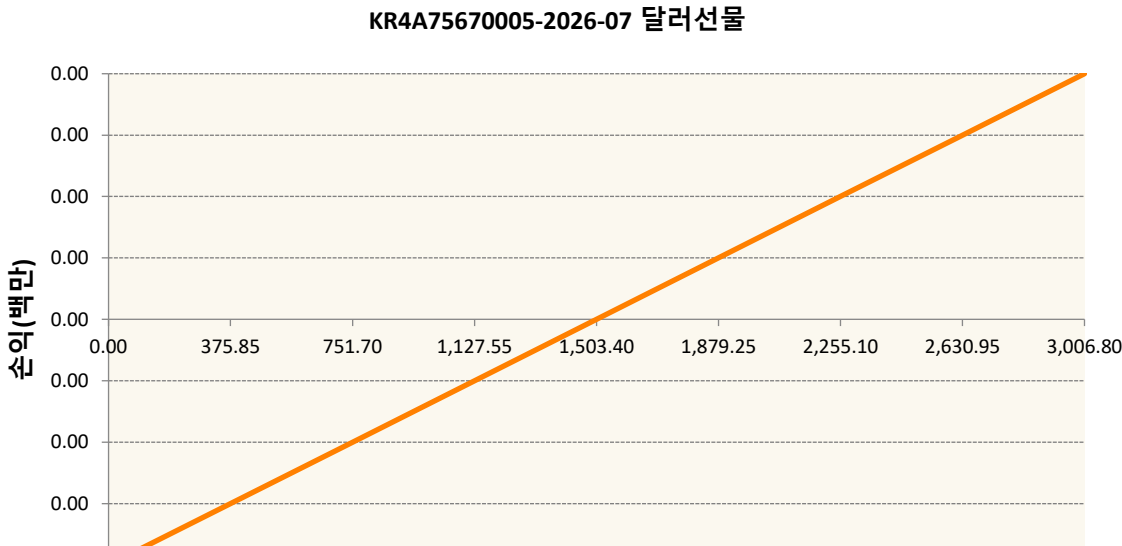
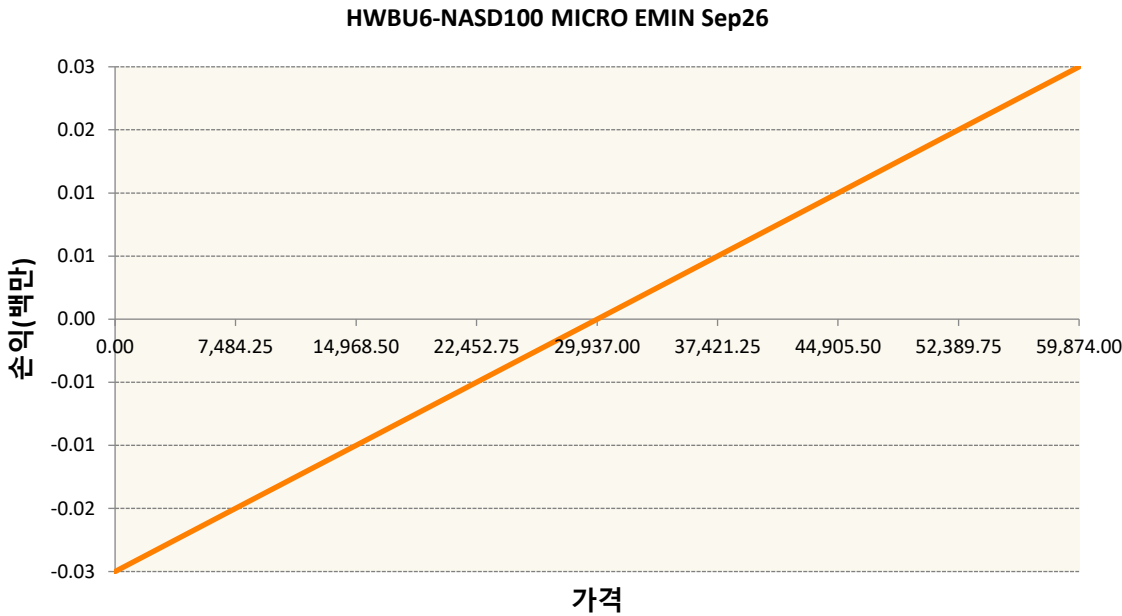
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

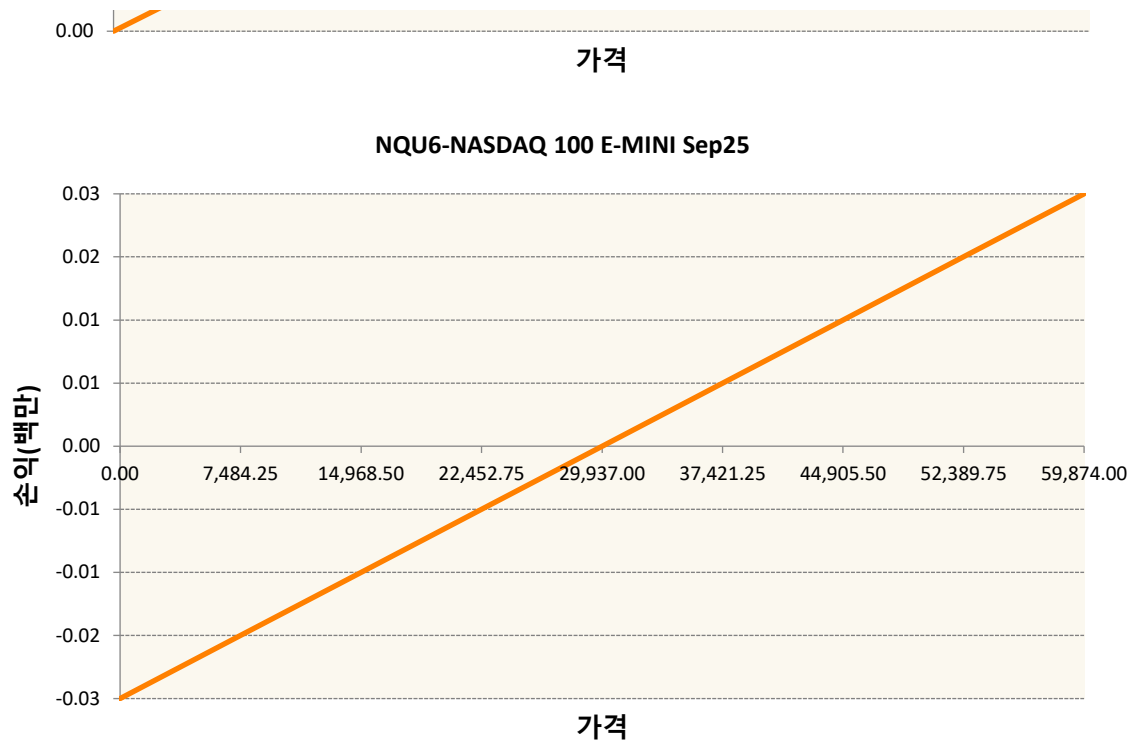
1. 계약금액

(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	368	0	368	장내
누계	지수	선물	33,525	0	33,525	
누계	통화	선물	3,924	0	3,924	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)			(단위:백만원)
HWBU6	NASD100 MICRO EMIN Sep26		29
KR4A756700	2026-07 달러선물		314
NQU6	NASDAQ 100 E-MINI Sep25		2,682

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,061

공시일	2026-07-13
기준일	2026-07-10

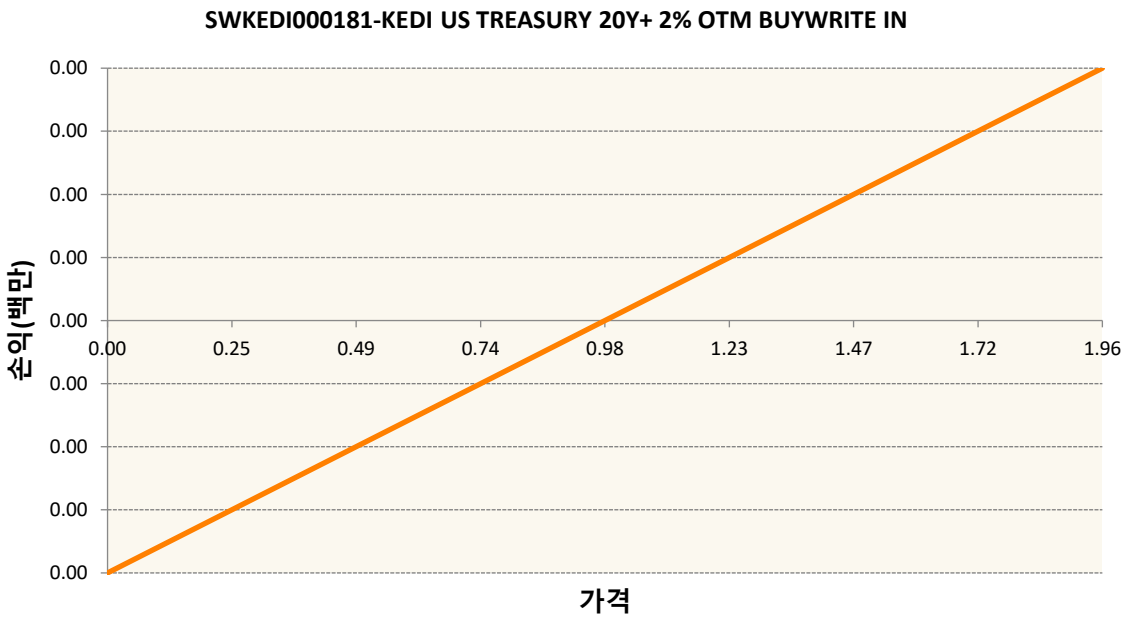
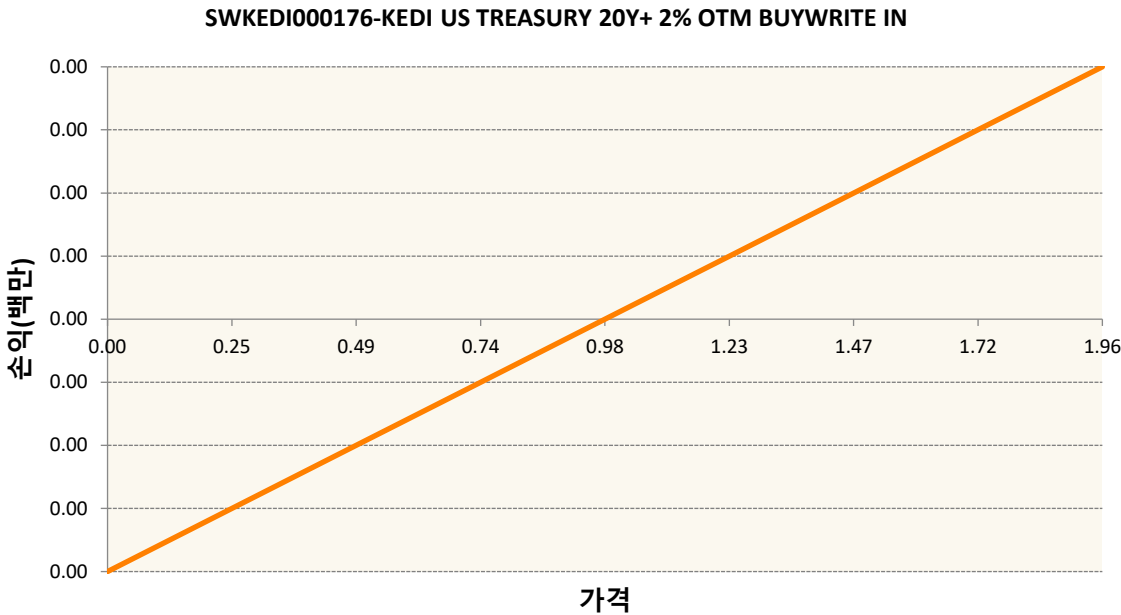
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

1. 계약금액

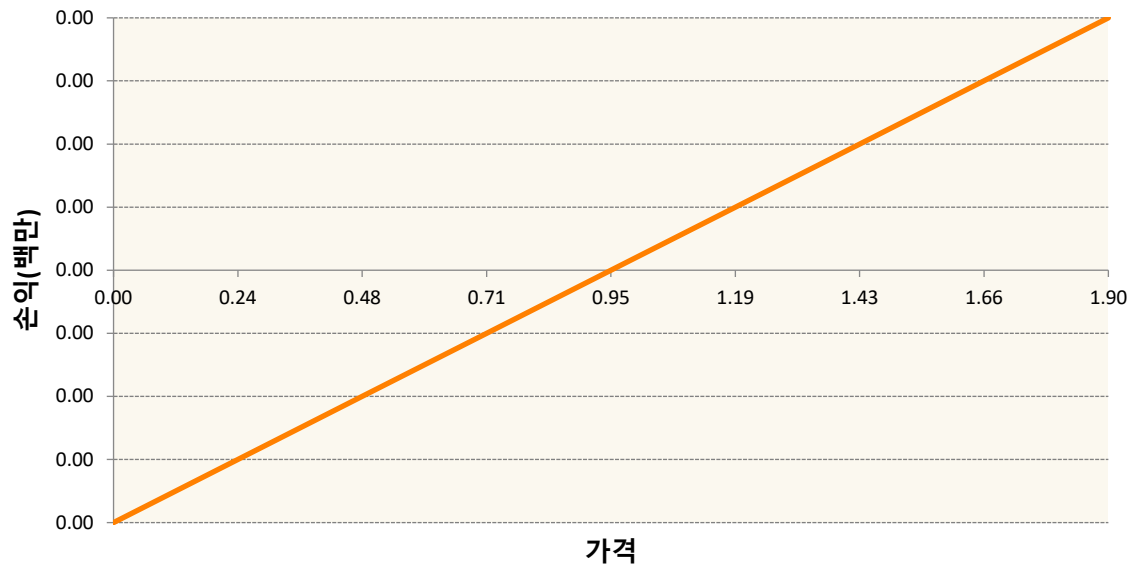
(단위:백만원)

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

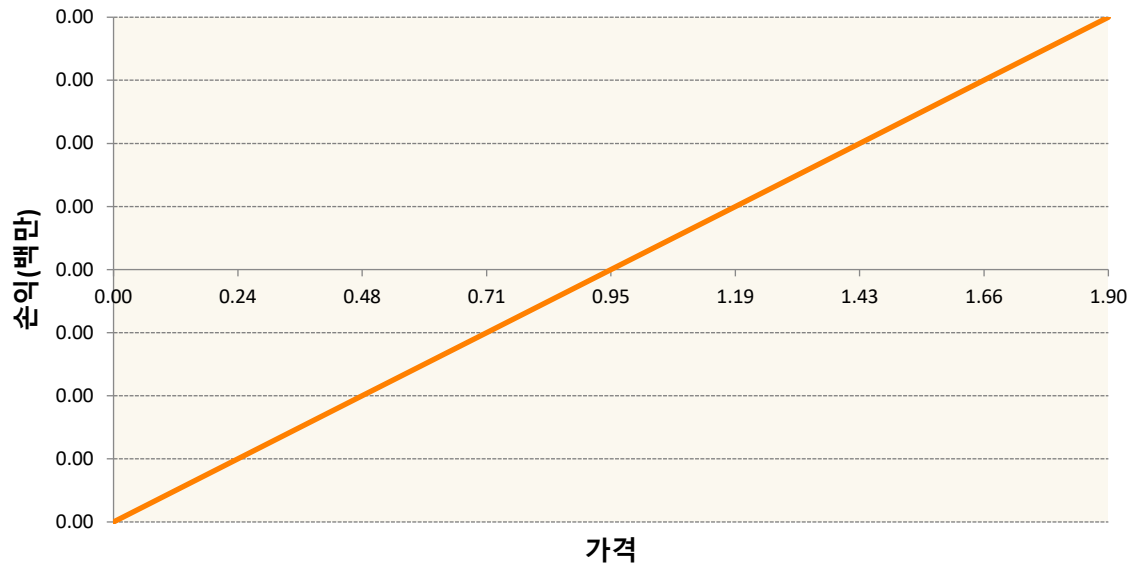
2. 만기시점의 손익구조



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	7,980
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	3,132
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	8,151
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	5,748

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

(단위:백만원)

10,623