

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

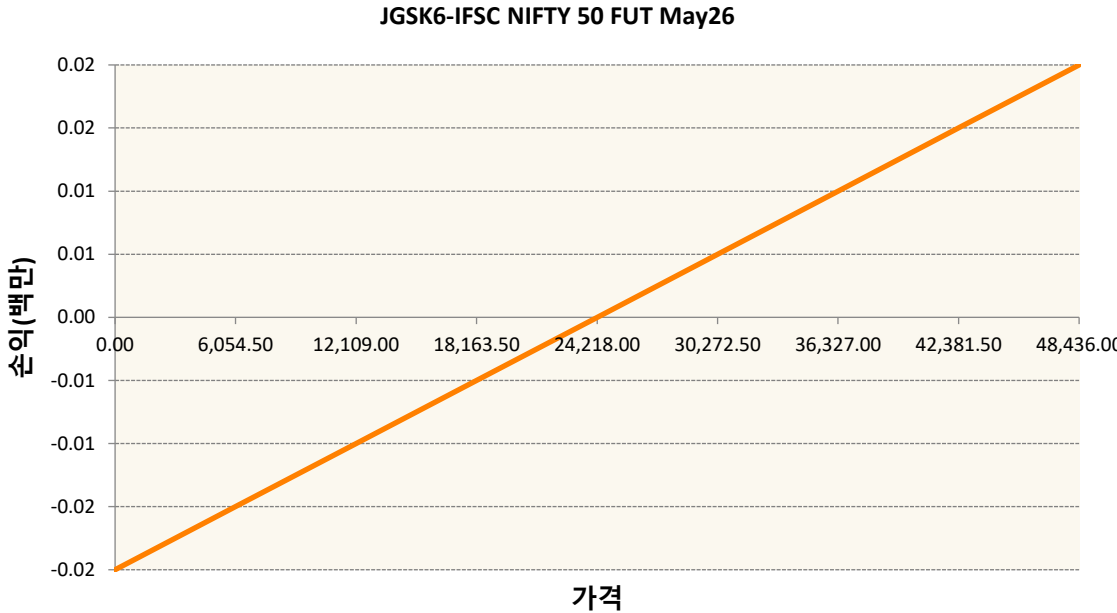
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 지수 | 선물 | 360 | 0 | 360 | |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSK6 IFSC NIFTY 50 FUT May26

29

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

(단위:백만원)

20

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

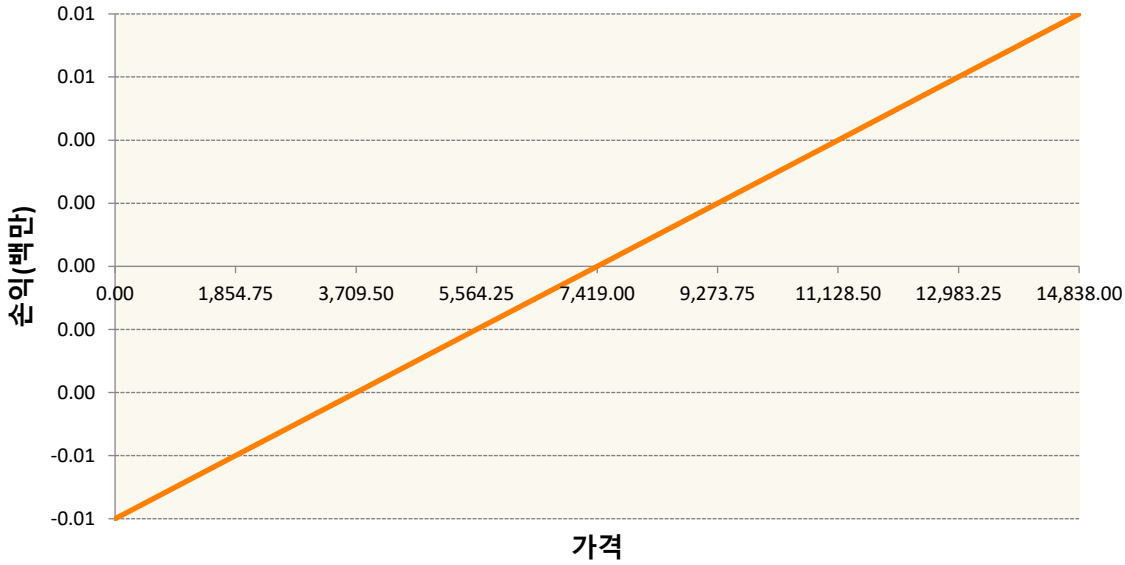
1. 계약금액

(단위:백만원)

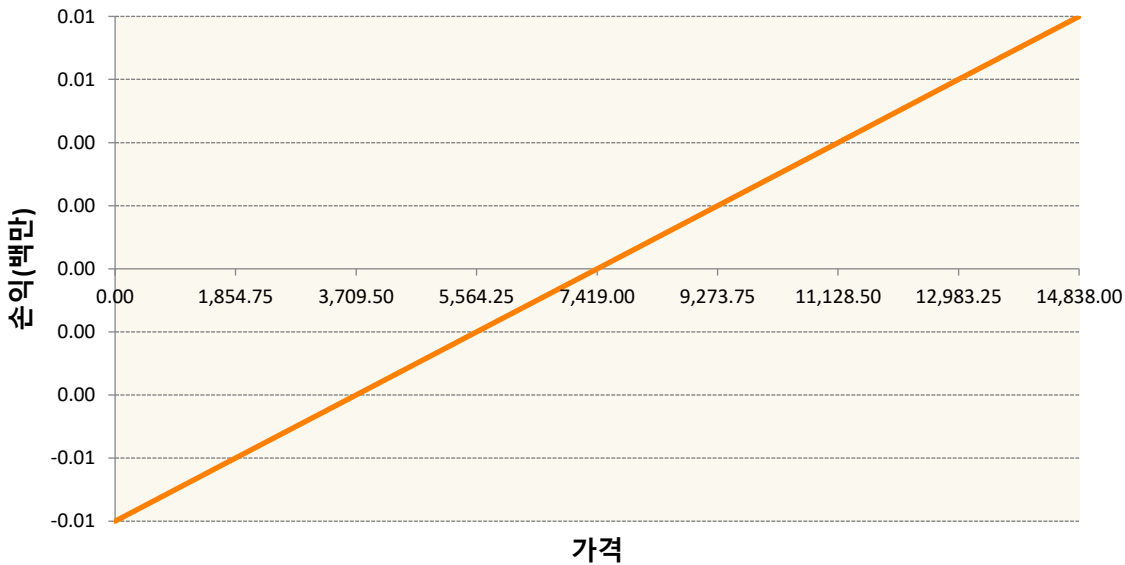
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 선물 | 556 | 0 | 556 | |
| 누계 | 지수 | 선물 | 56 | 0 | 56 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

ESM6-S&P500 EMINI FUT JUN26



HWAM6-SP500 MIC EMIN FUTJun26



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | |
|-------|-------------------------|----|
| ESM6 | S&P500 EMINI FUT JUN26 | 44 |
| HWAM6 | SP500 MIC EMIN FUTJun26 | 4 |

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

| |
|-----------|
| 43 |
|-----------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

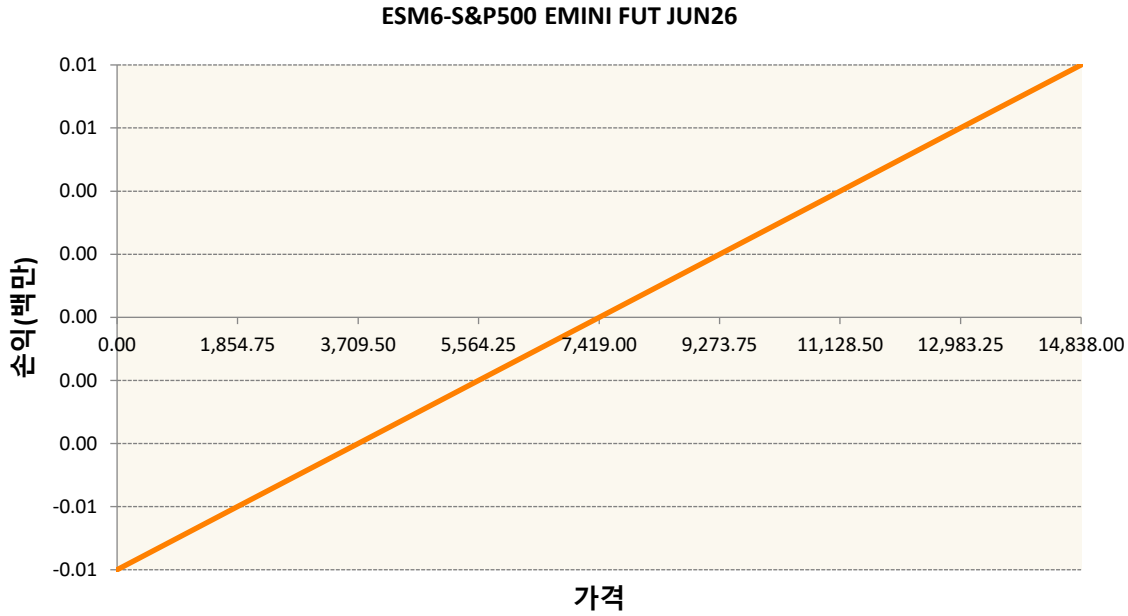
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 지수 | 선물 | 1,111 | 0 | 1,111 | |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|------------------------|----|
| ESM6 | S&P500 EMINI FUT JUN26 | 89 |
|------|------------------------|----|

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

(단위:백만원)

78

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

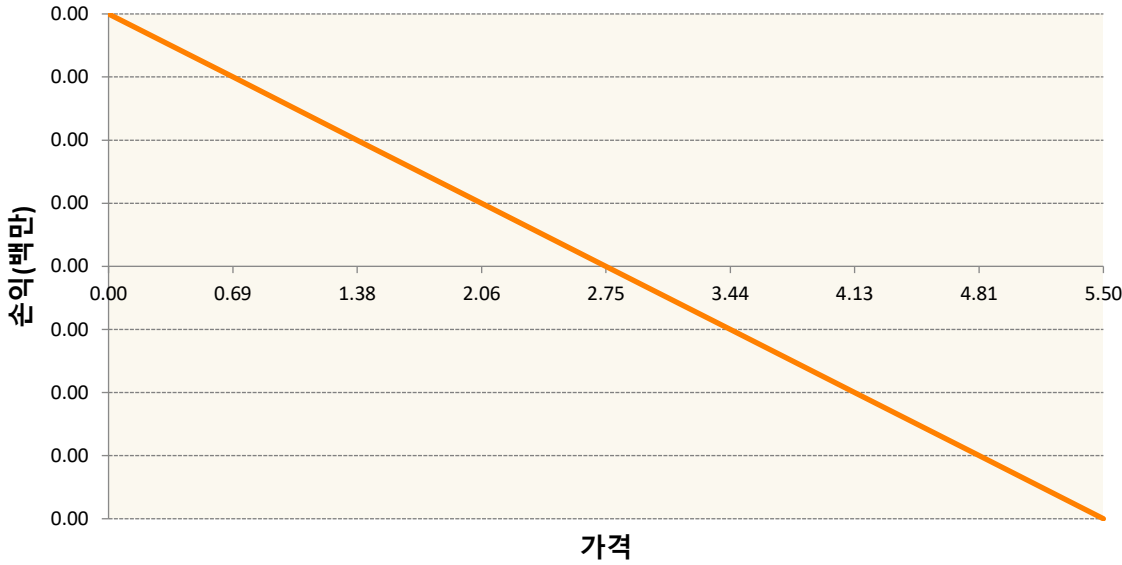
1. 계약금액

(단위:백만원)

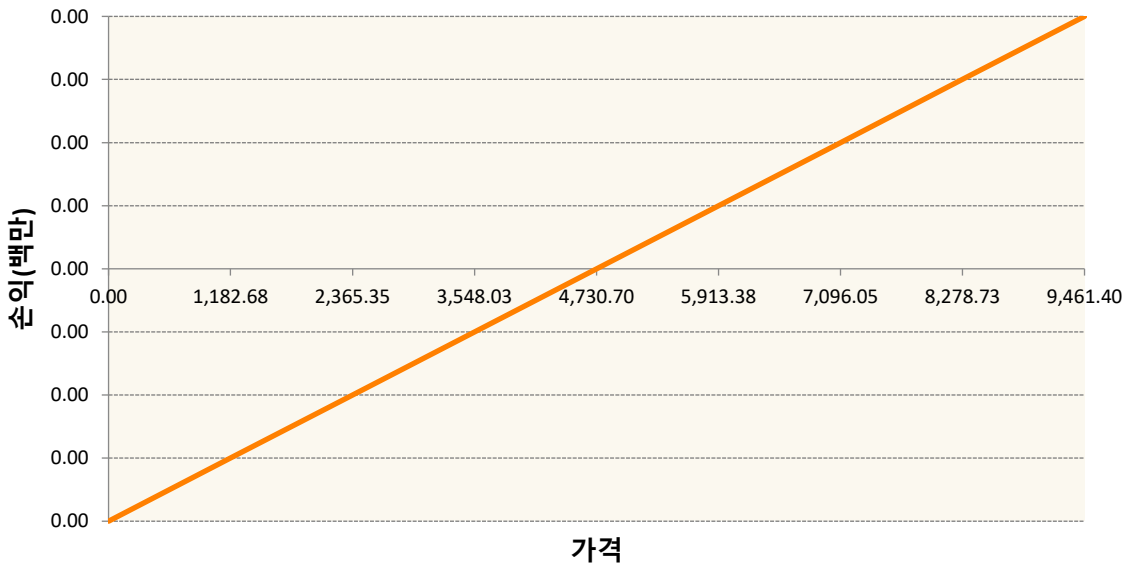
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 실물자산 | 옵션 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 실물자산 | 선물 | 5,693 | 0 | 5,693 | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 옵션 | 0 | 75 | -75 | |

2. 만기시점의 손익구조

AOGLDUS0C440-GLD US 05/15/26 C440 EQUITY



GCM6-GOLD 100 OZ FUTR Jun26



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------------------|--|----------|
| AOGLDUS0C GLD US 05/15/26 C440 EQUITY | | 6 |
| GCM6 GOLD 100 OZ FUTR Jun26 | | 455 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 578 |

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

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)

AOPLTRCUS* PLTR US 05/15/26 C147 EQUITY

56

AOPLTRPUS* PLTR US 05/15/26 P147 EQUITY

35

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

(단위:백만원)

282

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

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)

AOTLTUSCC(TLT US 05/15/26 C86 EQUITY)

9

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

(단위:백만원)

6

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

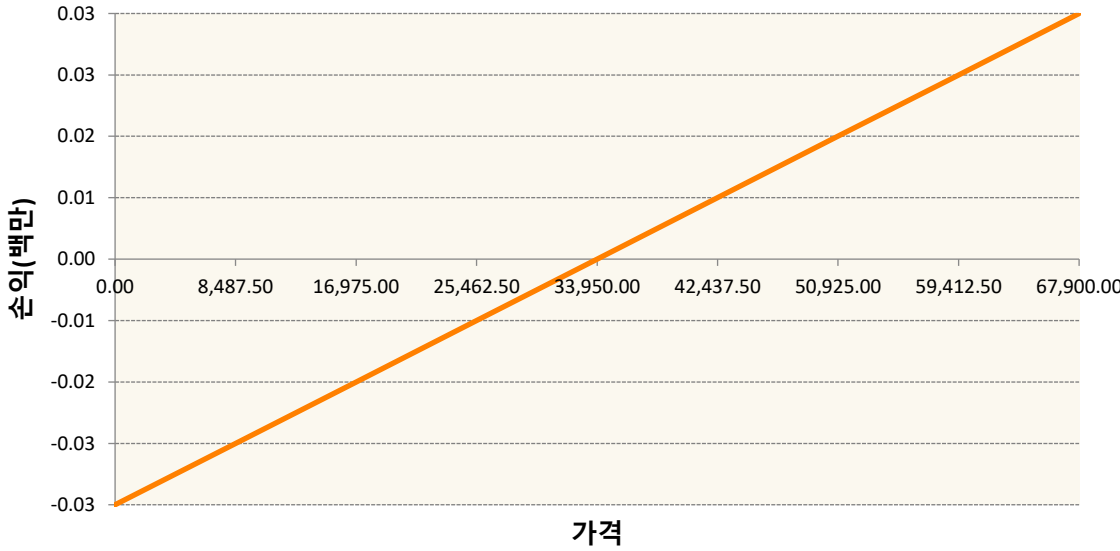
1. 계약금액

(단위:백만원)

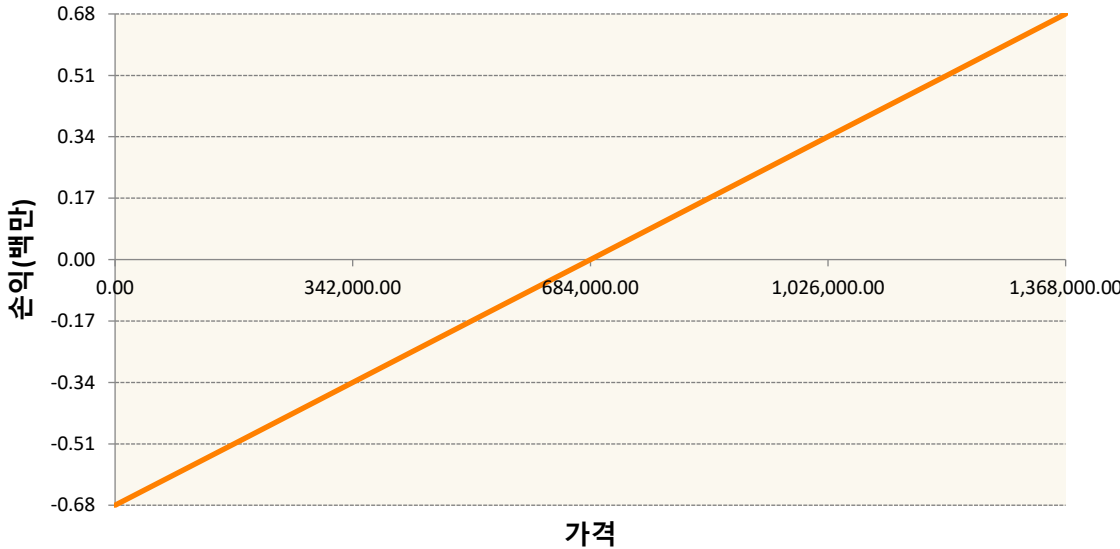
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 6,144 | 6,153 | -9 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 35,875 | 0 | 35,875 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 183,172 | 0 | 183,172 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

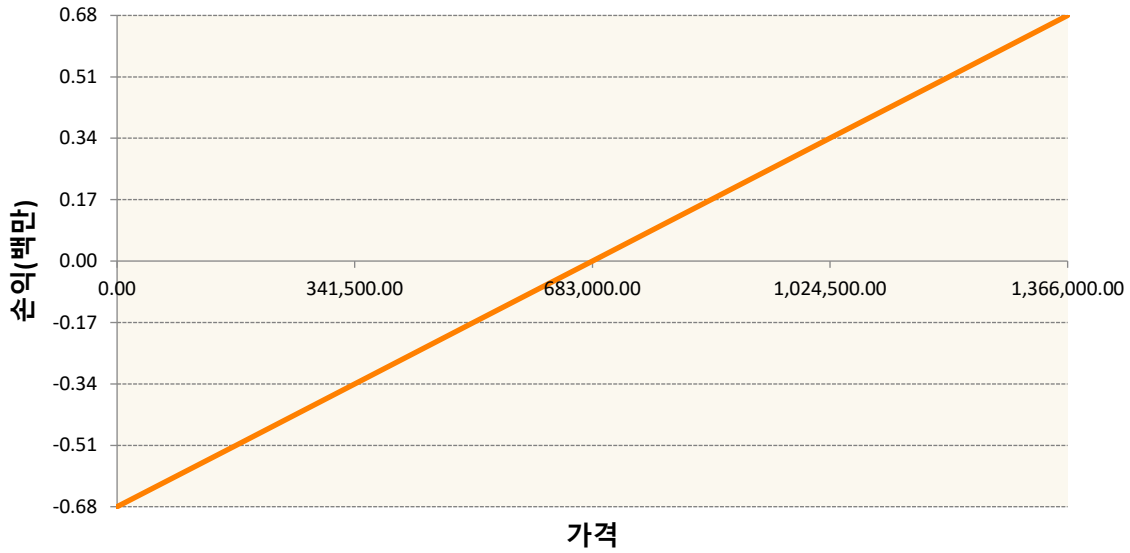
KR4ABF650007-2026-05 삼성중공업개별선물



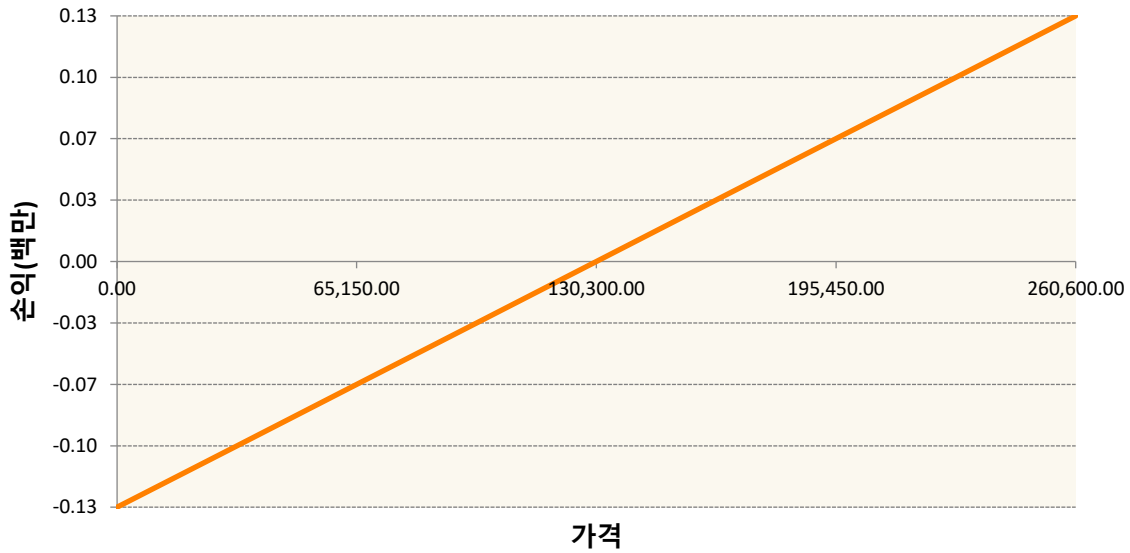
KR4AFD650005-2026-05 HD현대중공업개별선물



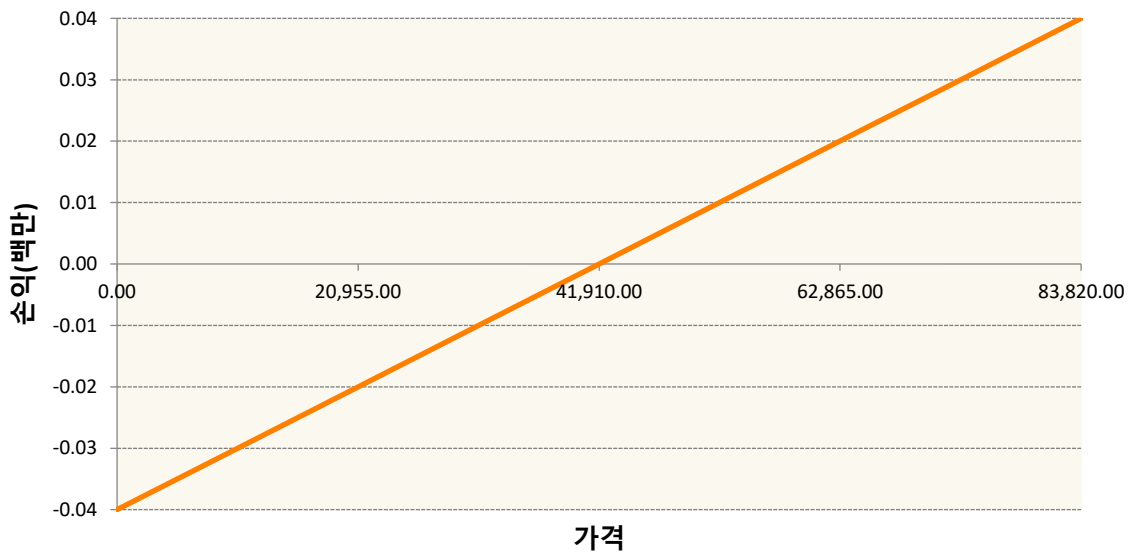
KR4AFD660004-2026-06 HD현대중공업개별선물



KR4AFV650003-2026-05 한화오션개별선물



KR4AM7660004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



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

(단위:백만원)

4,305

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

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 2026-05-12

기준일 2026-05-11

SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

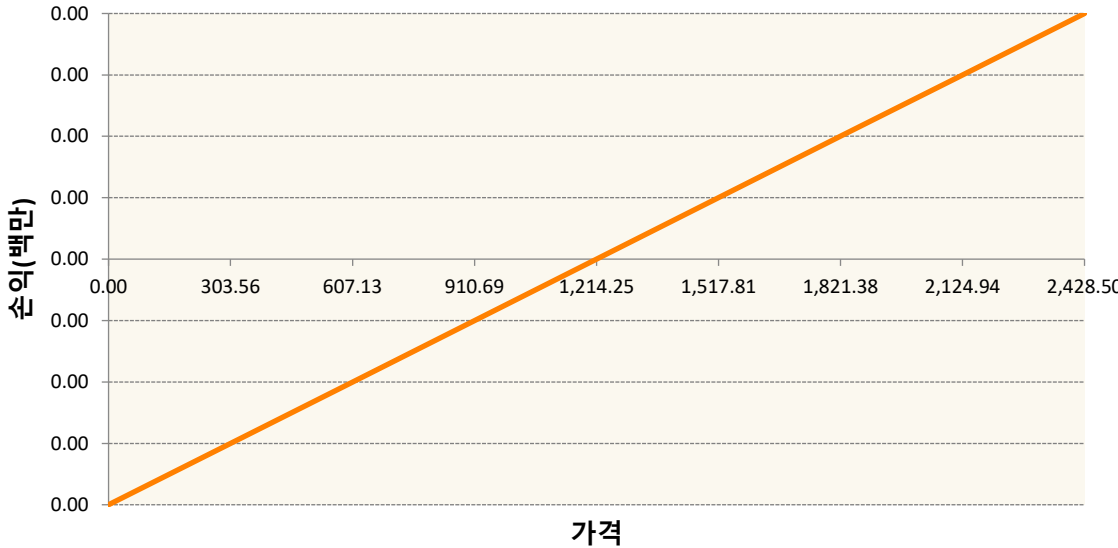
1. 계약금액

(단위:백만원)

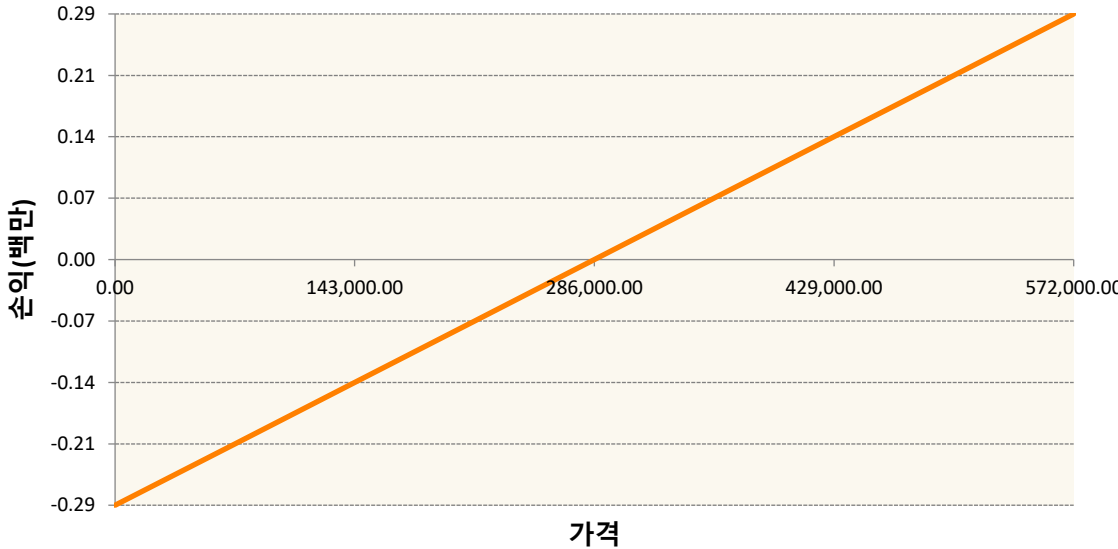
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 32,499 | -32,499 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 23,337 | 0 | 23,337 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 31,854 | -31,854 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

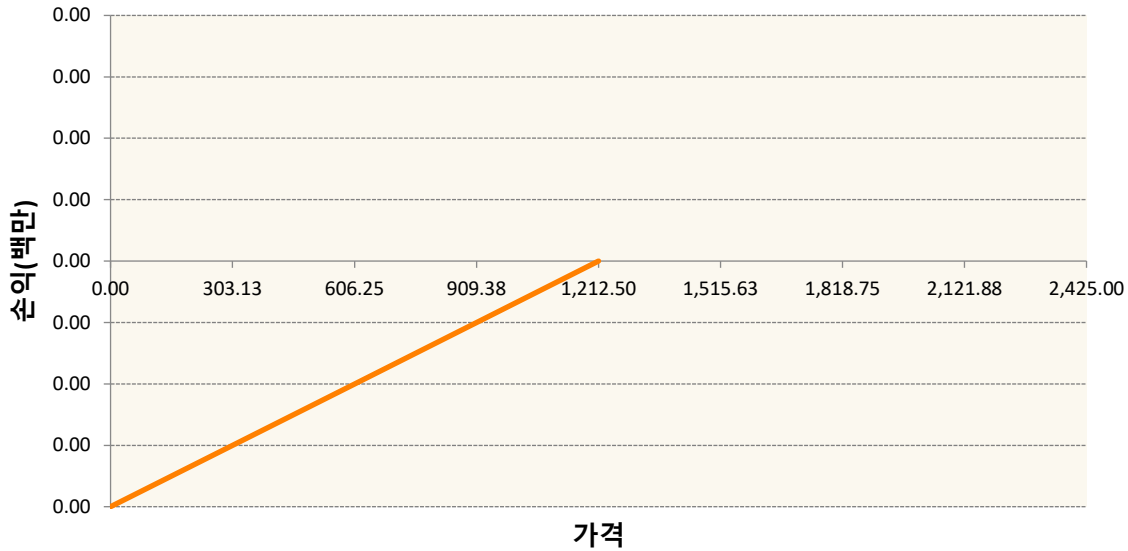
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



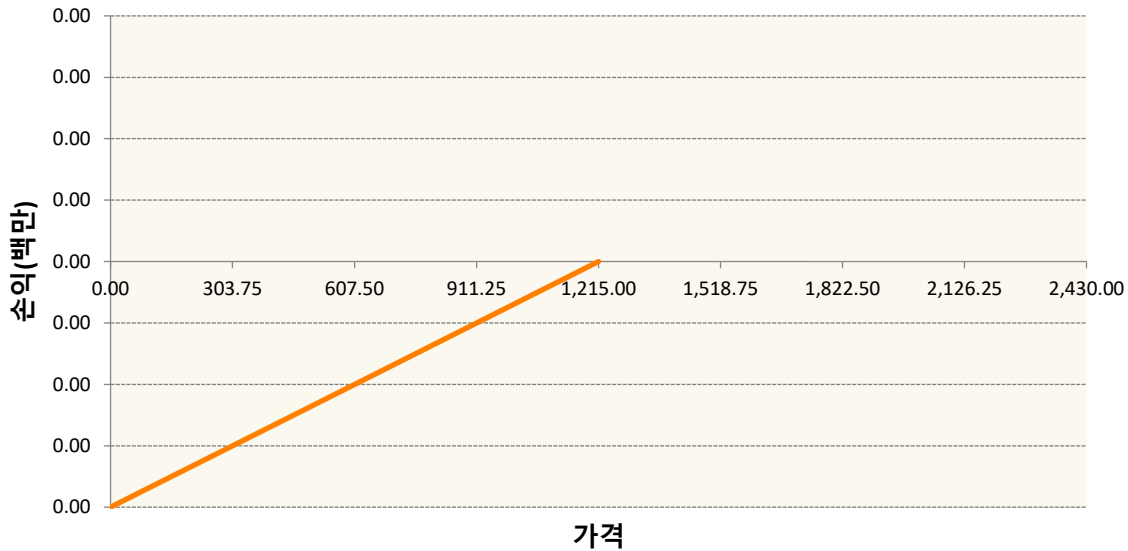
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4B0165A863-코스피200 C 202605 1,212.5



KR4B0165A871-코스피200 C 202605 1,215.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| | | | | | | | | |
|--------------|---------|--------------------|--------|------|-------|--------|--------|--|
| KR4A01660005 | | 2026-06 코스피200지수선물 | | | | | 630 | |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -630 | -630 | -630 | -630 | -630 | -630 | -630 | |
| -5.33% | -420 | -420 | -420 | -420 | -420 | -420 | -420 | |
| -2.67% | -210 | -210 | -210 | -210 | -210 | -210 | -210 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 210 | 210 | 210 | 210 | 210 | 210 | 210 | |
| 5.33% | 420 | 420 | 420 | 420 | 420 | 420 | 420 | |
| 8.00% | 630 | 630 | 630 | 630 | 630 | 630 | 630 | |
| KR4A11650004 | | 2026-05 삼성전자개별선물 | | | | | 1,233 | |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,233 | -1,233 | -1,233 | -1,233 | -1,233 | -1,233 | -1,233 |
| -5.33% | -822 | -822 | -822 | -822 | -822 | -822 | -822 |
| -2.67% | -411 | -411 | -411 | -411 | -411 | -411 | -411 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 411 | 411 | 411 | 411 | 411 | 411 | 411 |
| 5.33% | 822 | 822 | 822 | 822 | 822 | 822 | 822 |
| 8.00% | 1,233 | 1,233 | 1,233 | 1,233 | 1,233 | 1,233 | 1,233 |
| KR4B0165A863 코스피200 C 202605 1,212.5 | | | | | | | 1,159 |

| | | | | | | | |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -1,067 | -1,076 | -1,088 | -1,102 | -1,119 | -1,138 | -1,159 |
| -5.33% | -597 | -618 | -641 | -666 | -693 | -722 | -752 |
| -2.67% | -189 | -223 | -258 | -293 | -329 | -366 | -402 |
| 0% | 120 | 80 | 40 | 0 | -40 | -80 | -120 |
| 2.67% | 317 | 282 | 245 | 208 | 171 | 133 | 95 |
| 5.33% | 421 | 396 | 370 | 341 | 311 | 280 | 247 |
| 8.00% | 465 | 452 | 436 | 417 | 396 | 373 | 348 |
| KR4B0165A871 코스피200 C 202605 1,215.0 | | | | | | | 782 |

| | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -723 | -728 | -736 | -745 | -756 | -768 | -782 |
| -5.33% | -407 | -421 | -436 | -452 | -470 | -488 | -508 |
| -2.67% | -132 | -154 | -176 | -200 | -223 | -247 | -272 |
| 0% | 80 | 53 | 27 | 0 | -27 | -53 | -80 |
| 2.67% | 217 | 193 | 168 | 143 | 118 | 92 | 67 |
| 5.33% | 290 | 273 | 255 | 236 | 215 | 193 | 171 |
| 8.00% | 322 | 313 | 302 | 289 | 274 | 258 | 241 |

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

(단위:백만원)

7,882

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

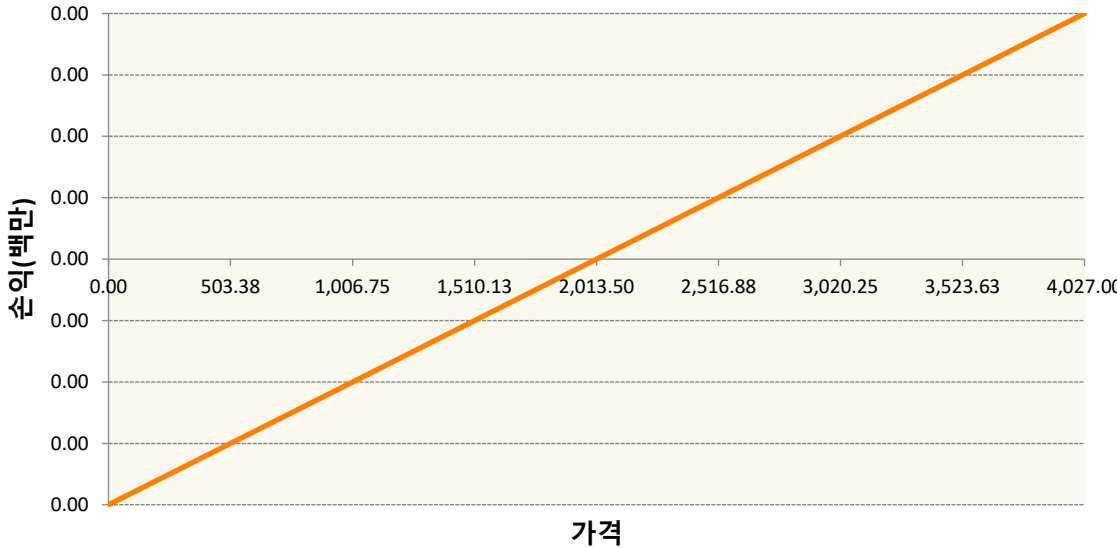
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 906 | 0 | 906 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

KR4A06660000-2026-06 코스닥150선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4A06660000 | | 2026-06 코스닥150선물 | | | | | 73 |
|--------------|---------|------------------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 | -73 |
| -5.33% | -49 | -49 | -49 | -49 | -49 | -49 | -49 |
| -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% | 49 | 49 | 49 | 49 | 49 | 49 | 49 |
| 8.00% | 73 | 73 | 73 | 73 | 73 | 73 | 73 |

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

포커스농산물모(채권-파생형)

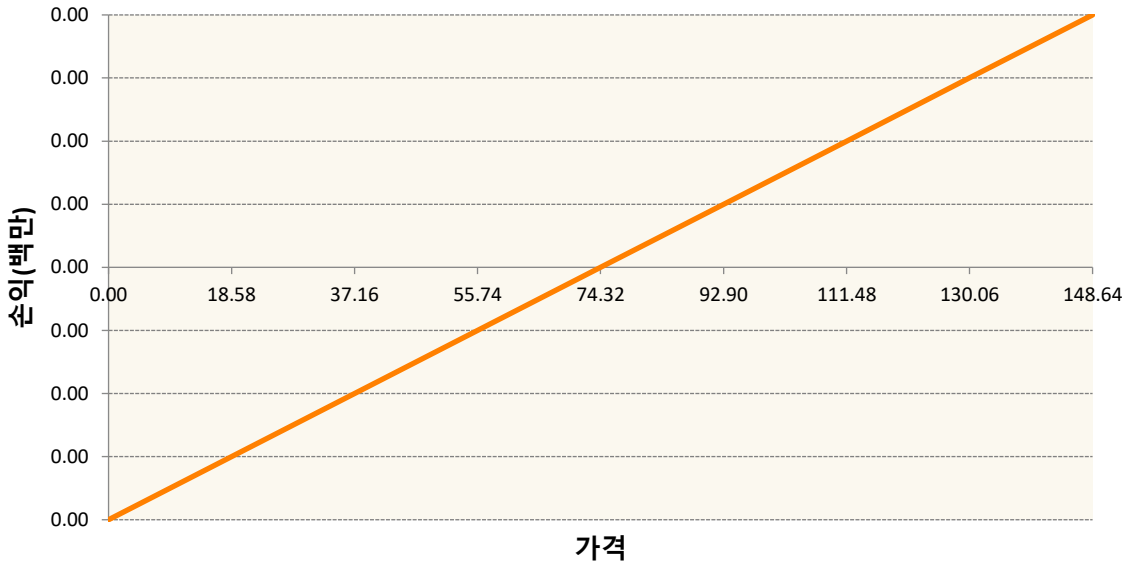
1. 계약금액

(단위:USD 백만)

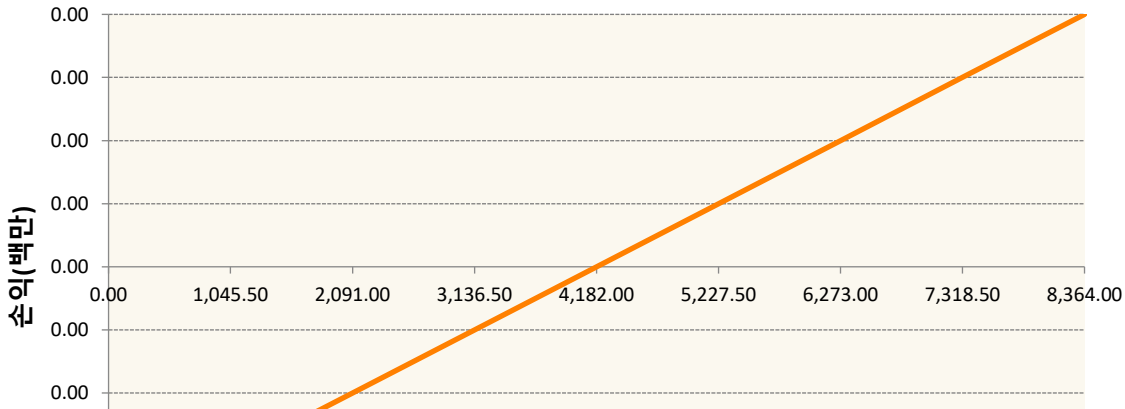
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 실물자산 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 통화 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물 | 62 | 0 | 62 | |
| 누계 | 실물자산 | 선물 | 906 | 0 | 906 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,012 | 0 | 2,012 | |
| 누계 | 통화 | 선물 | 0 | 383 | -383 | 장내 |

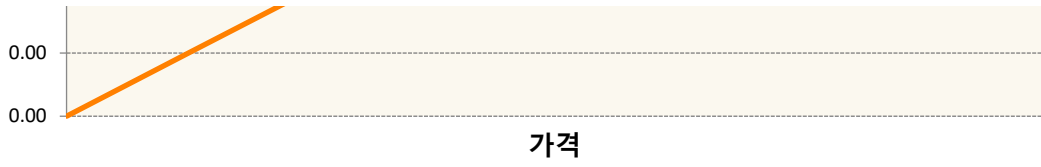
2. 만기시점의 손익구조

BON6-SOYBEAN OIL FUTR Jul26

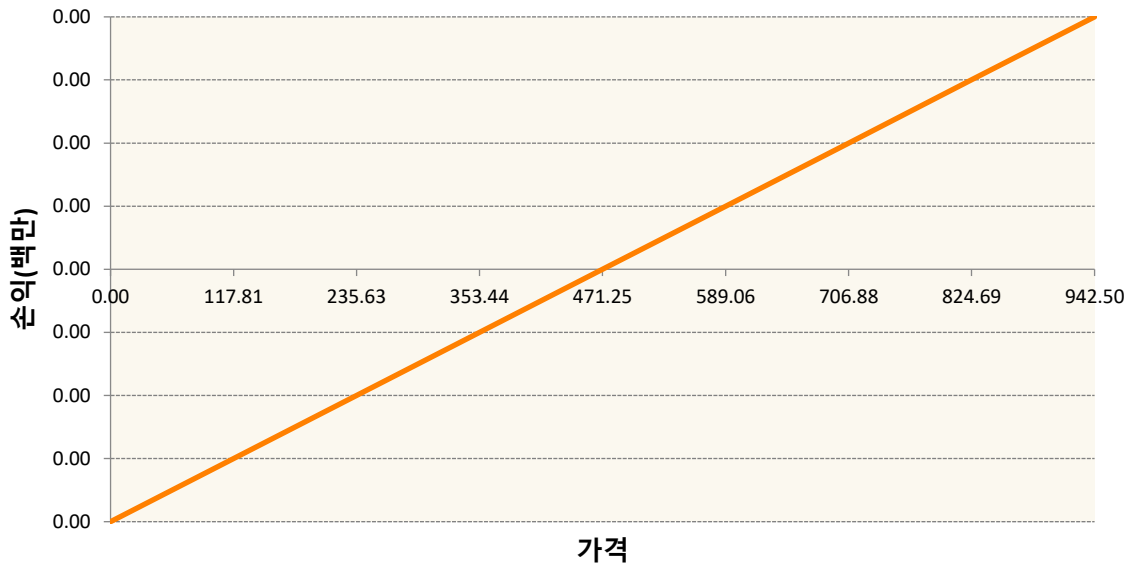


CCN6-COCOA FUTURE Jul26

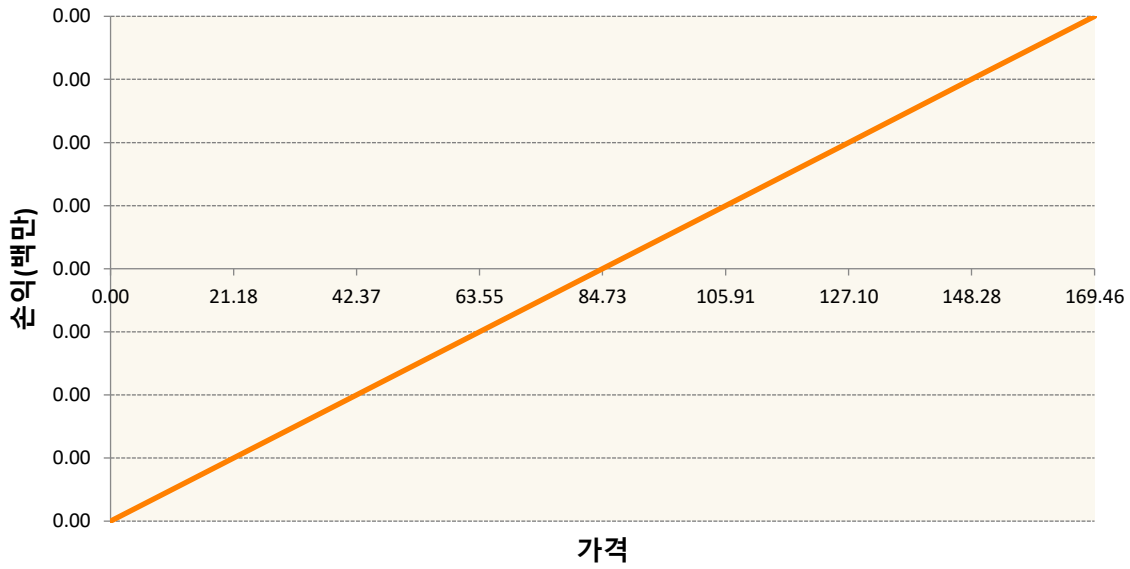




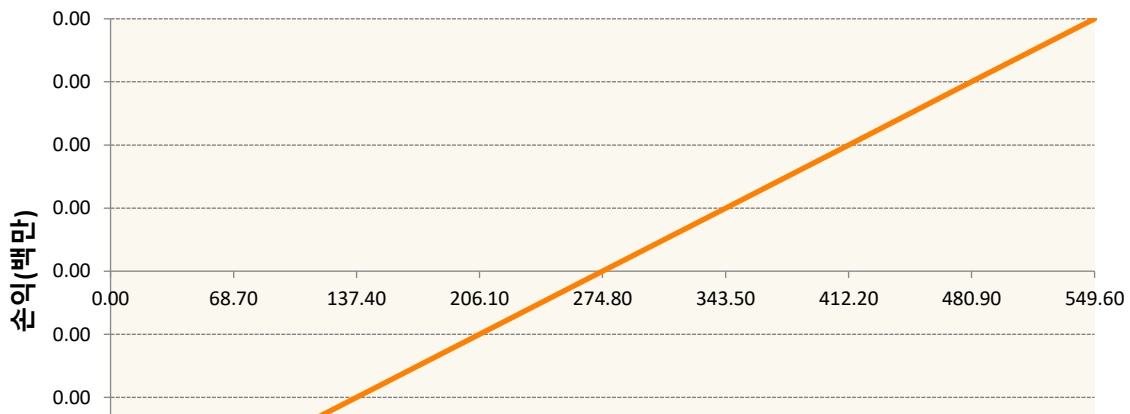
CN6-CORN FUTURE Jul26

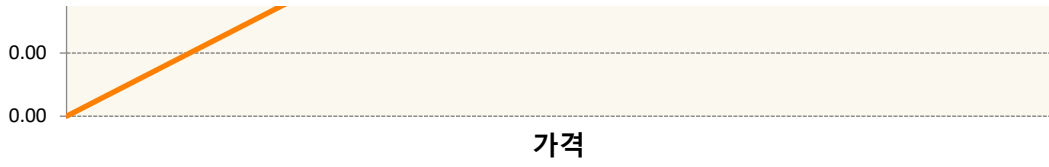


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

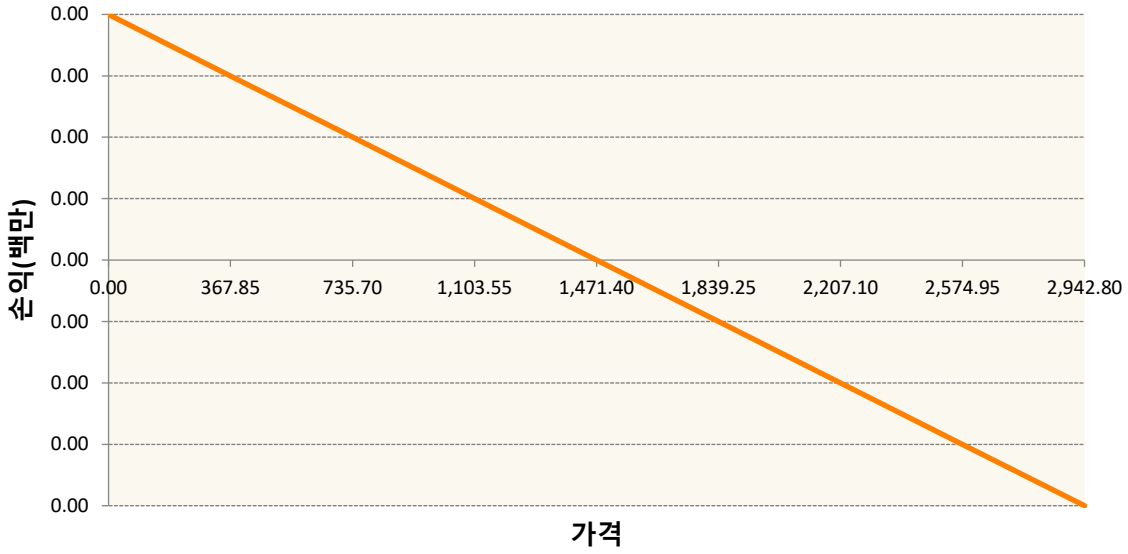


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

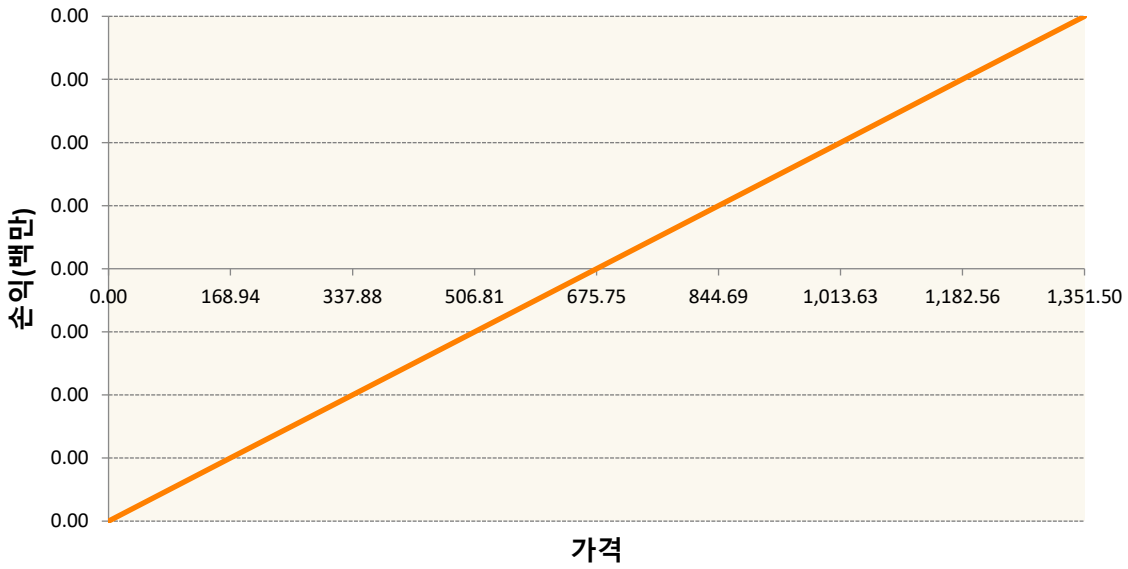




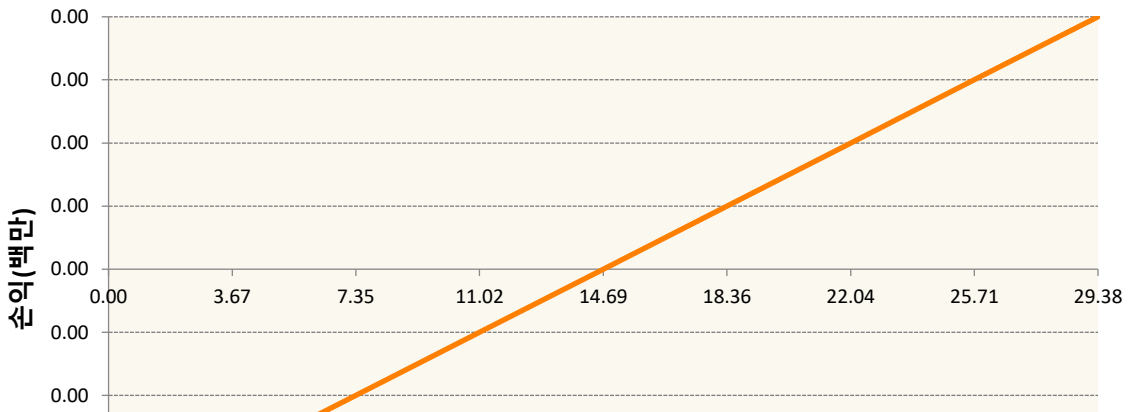
KR4A75650007-2026-05 달러선물

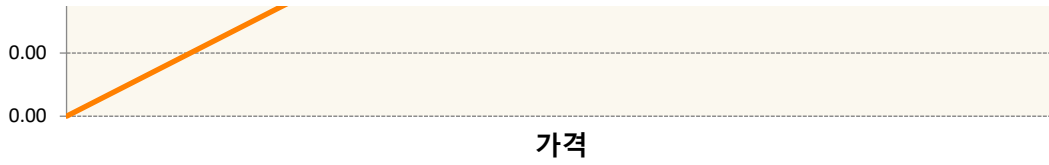


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

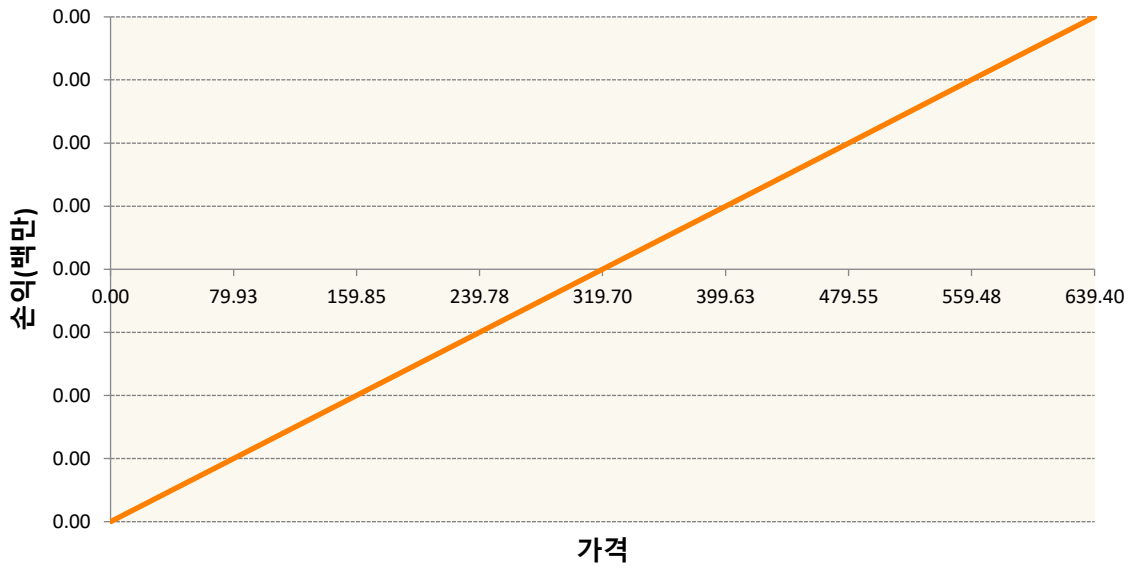


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

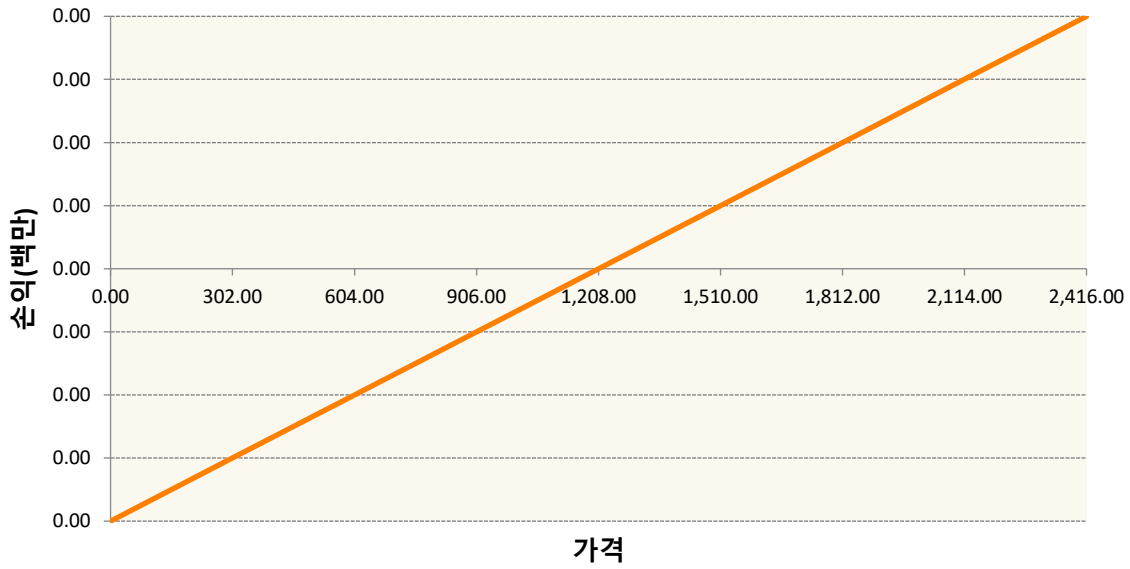




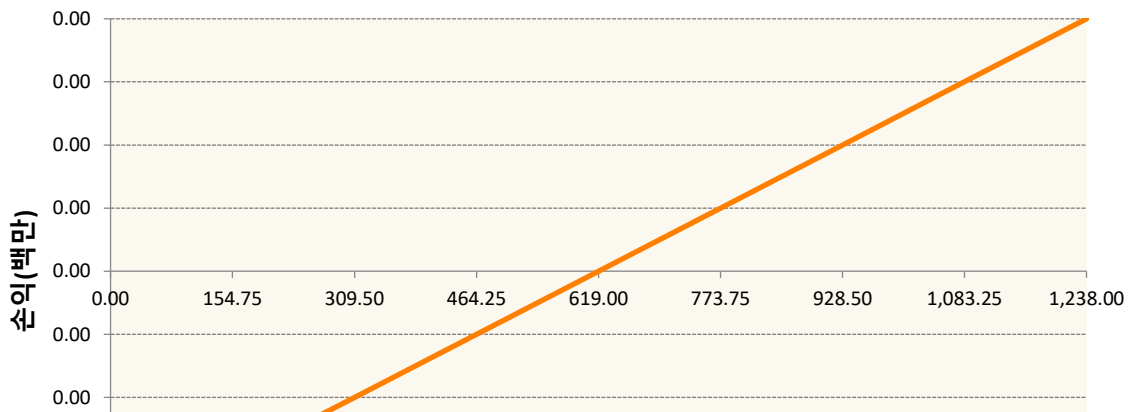
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

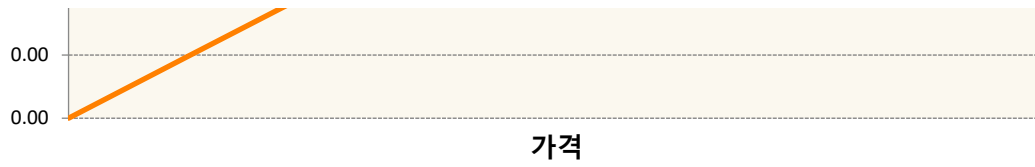


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



WN6-WHEAT FUTURE(CBT) Jul26





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

스마트인덱스모

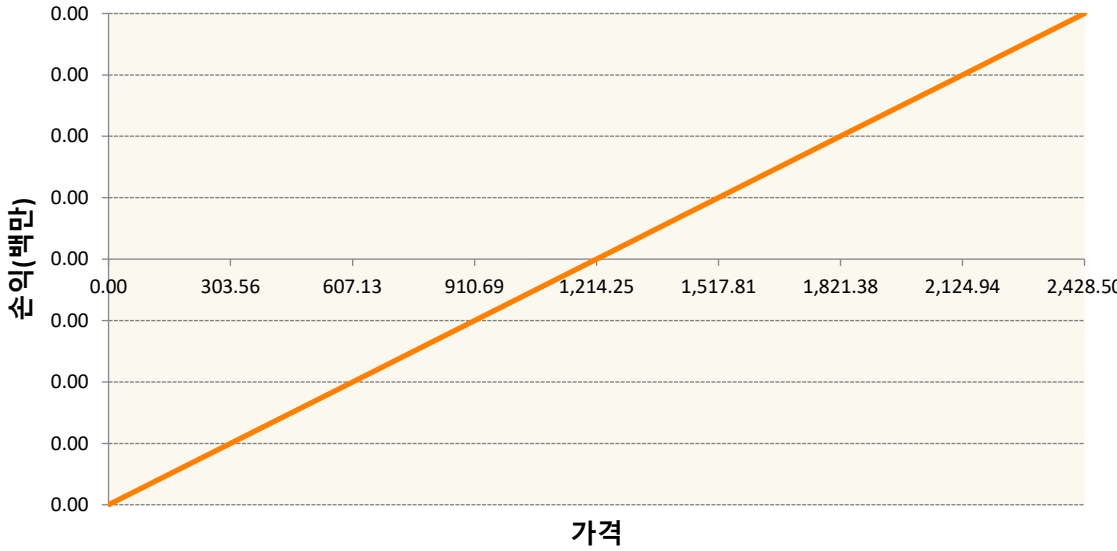
1. 계약금액

(단위:백만원)

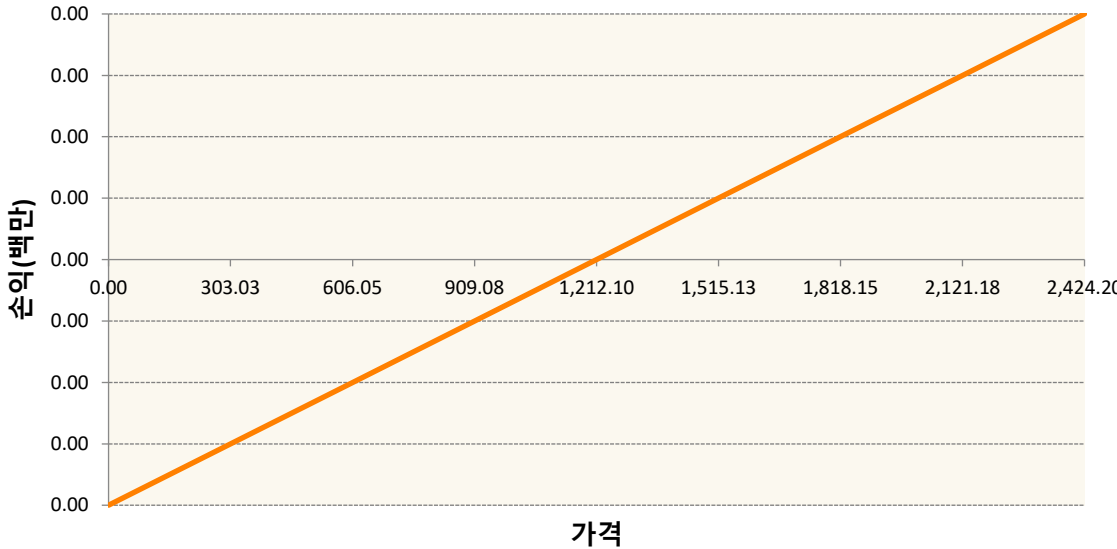
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 1,213 | 608 | 604 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 3,320 | 0 | 3,320 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

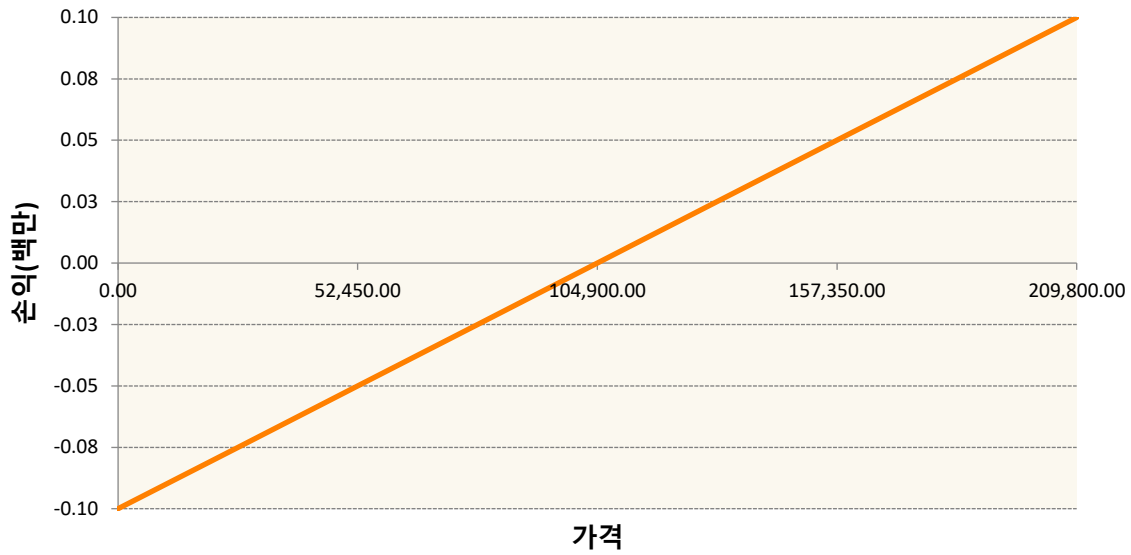
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



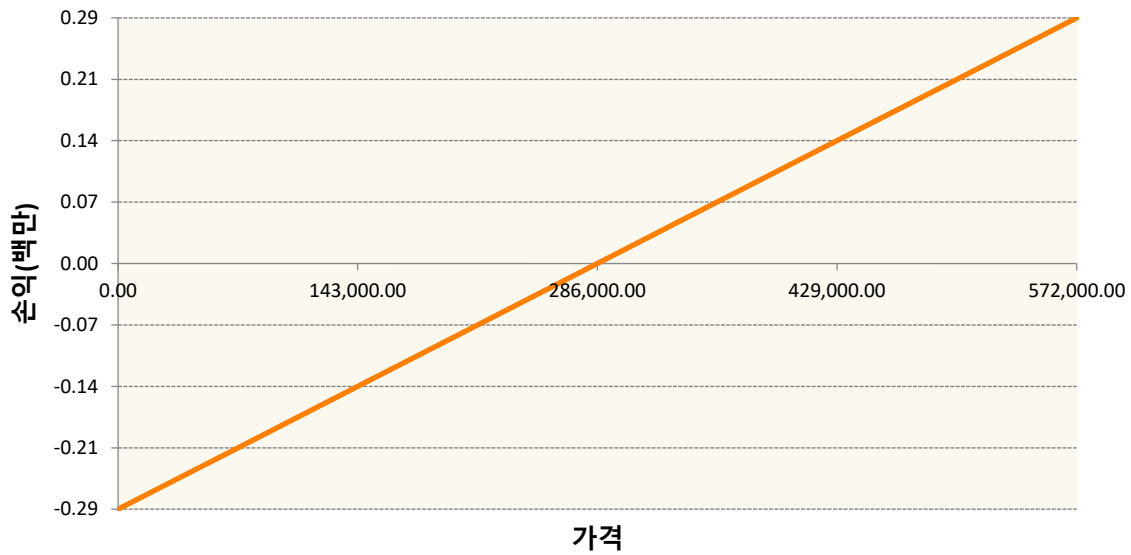
KR4A05650002-2026-05 미니코스피200 선물



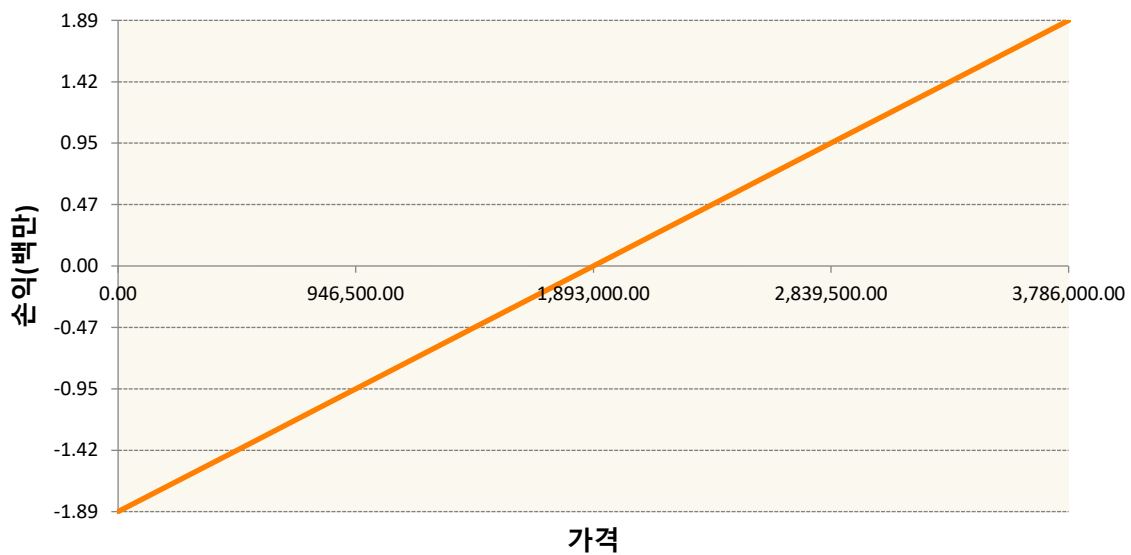
KR4A0F650001-2026-05 두산로보틱스개별선물



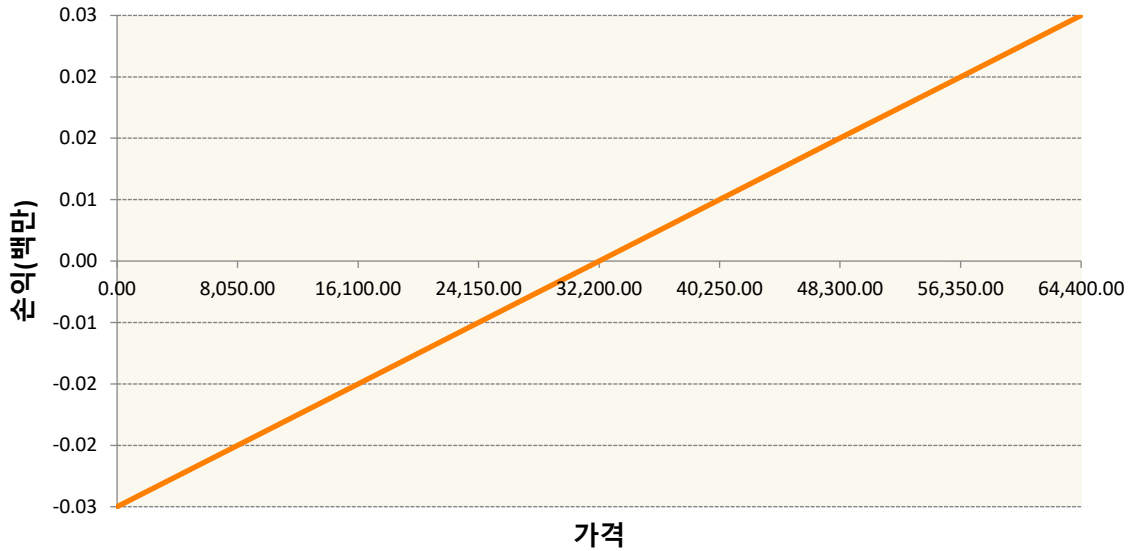
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4A01660005 | | 2026-06 코스피200지수선물 | | | | | | 170 |
|--------------|---------|---------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -170 | -170 | -170 | -170 | -170 | -170 | -170 | |
| -5.33% | -113 | -113 | -113 | -113 | -113 | -113 | -113 | |
| -2.67% | -57 | -57 | -57 | -57 | -57 | -57 | -57 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | 57 | |
| 5.33% | 113 | 113 | 113 | 113 | 113 | 113 | 113 | |
| 8.00% | 170 | 170 | 170 | 170 | 170 | 170 | 170 | |
| KR4A05650002 | | 2026-05 미니코스피200 선물 | | | | | | 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 | |
| KR4A0F650001 | | 2026-05 두산로보틱스개별선물 | | | | | | 1 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | -1 | |
| -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% | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 | 1 |

KR4A11650004 2026-05 삼성전자개별선물 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% | -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% | 52 | 52 | 52 | 52 | 52 | 52 | 52 |

KR4A50650006 2026-05 SK하이닉스개별선물 17

| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 | -17 |
| -5.33% | -11 | -11 | -11 | -11 | -11 | -11 | -11 |
| -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% | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 | 11 |
| 8.00% | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 | 17 |

KR4AFT650007 2026-05 대우건설개별선물 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 |

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

(단위:백만원)

581

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

SOL차이나강소기업CSI500상장

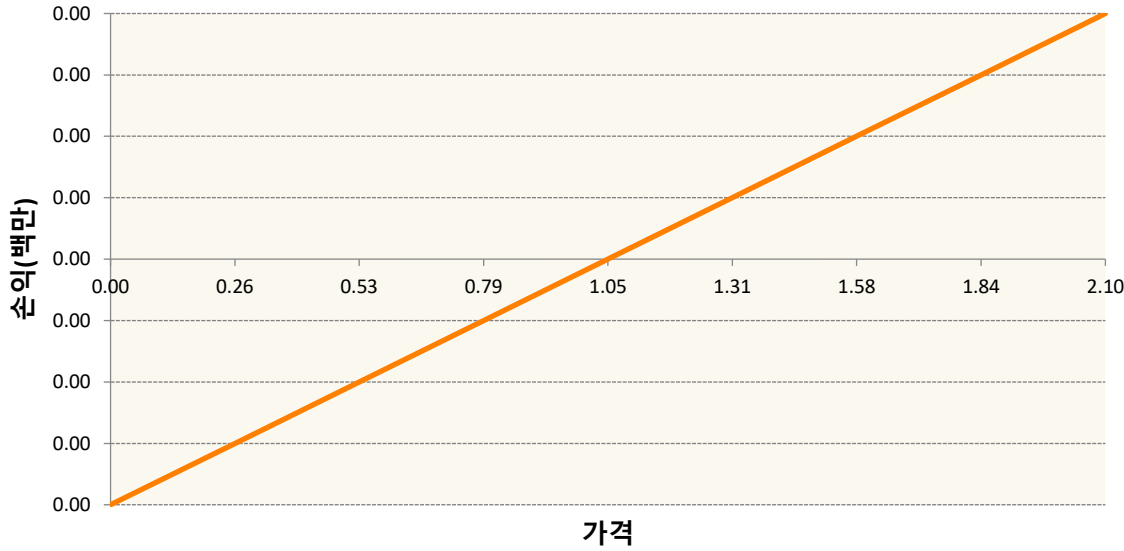
1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 5,926 | 0 | 5,926 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

SWCSI5000047-CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미)

475

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

590

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

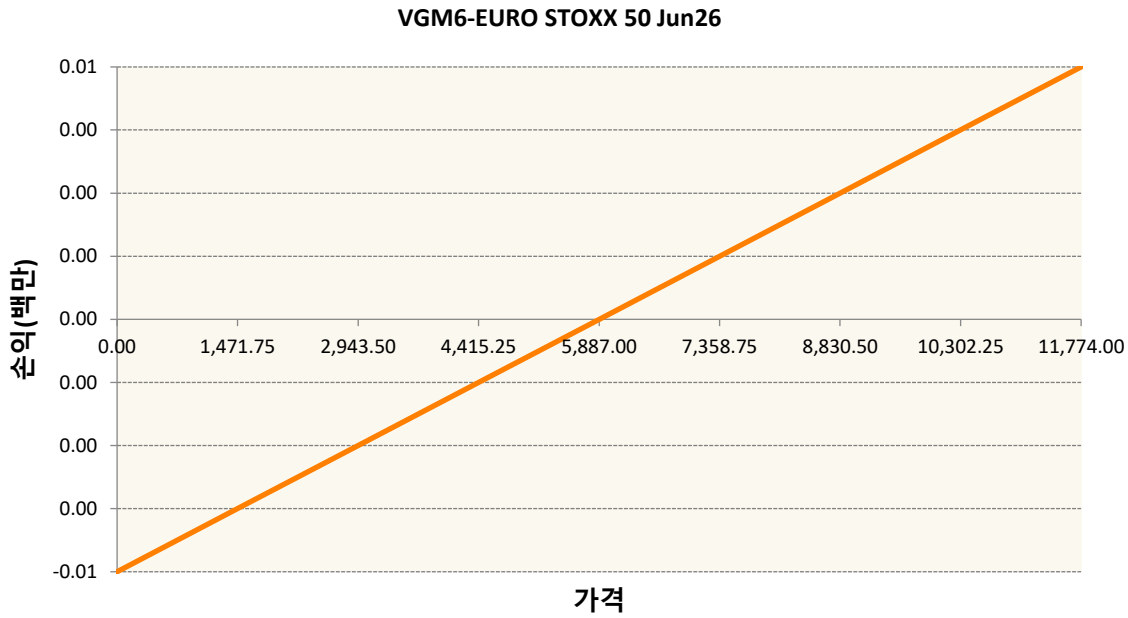
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 907 | 0 | 907 | |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|----|
| VGM6 | EURO STOXX 50 Jun26 | 73 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

64

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

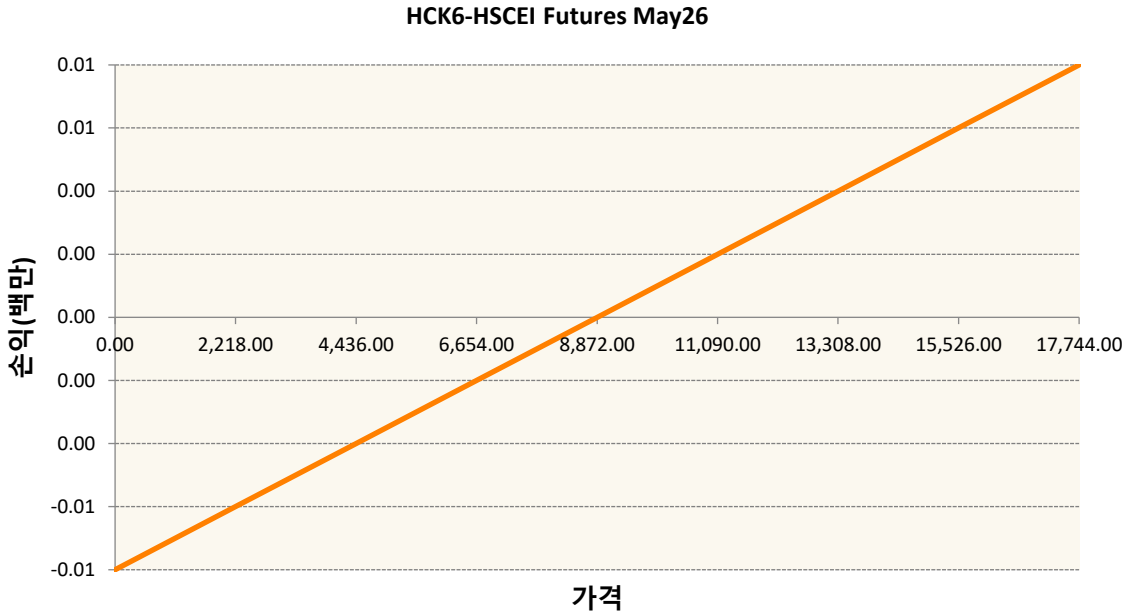
차이나인덱스모(주식-파생형)

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 | 1,668 | 0 | 1,668 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------|---------------------|-----|
| HCK6 | HSCEI Futures May26 | 133 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

160

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

커버드콜모(주식혼합-파생형)

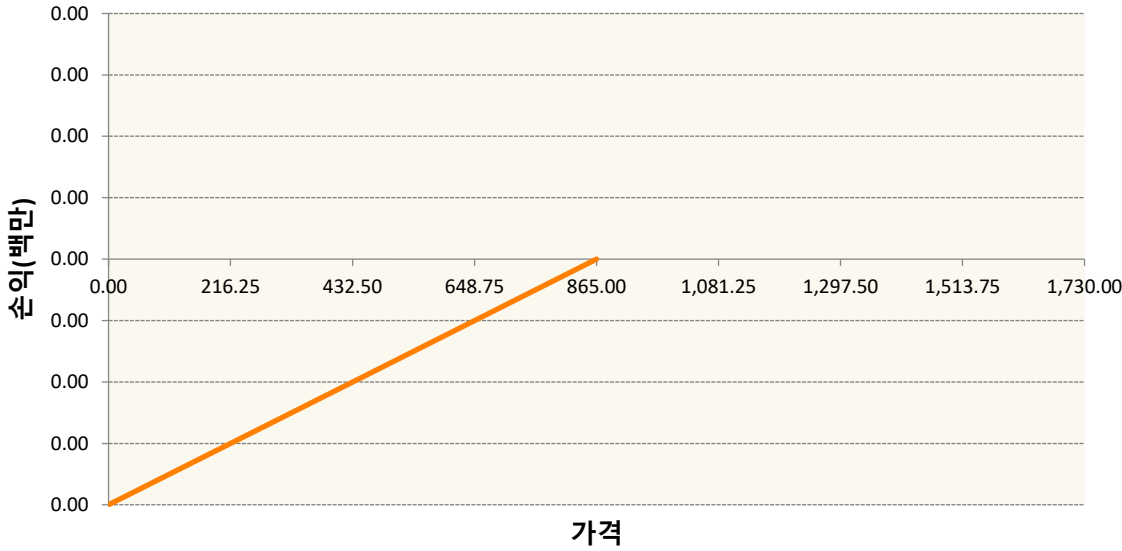
1. 계약금액

(단위:백만원)

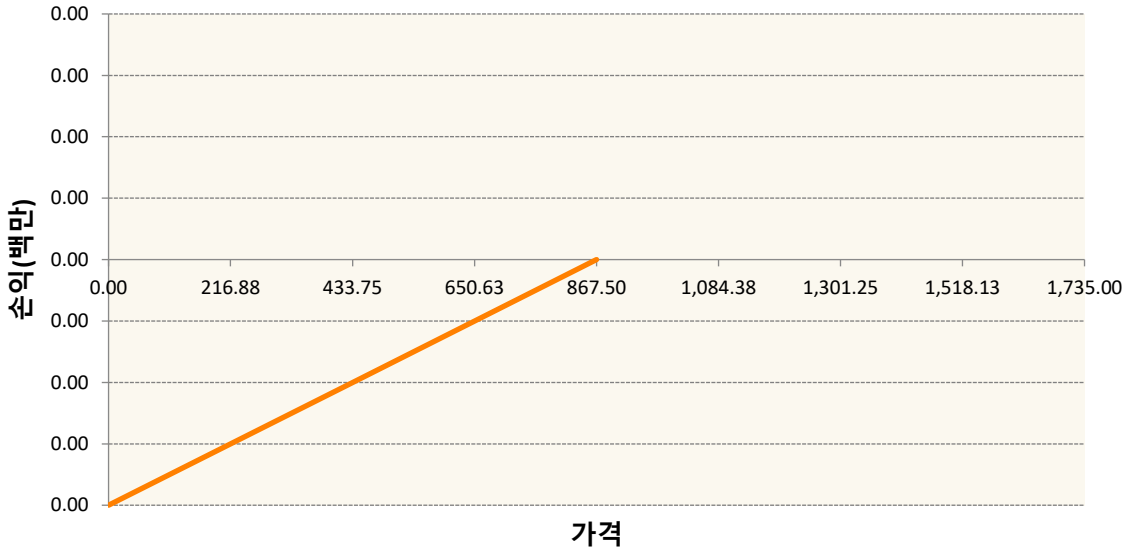
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션 | 1,411 | 0 | 1,411 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션 | 0 | 27,710 | -27,710 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

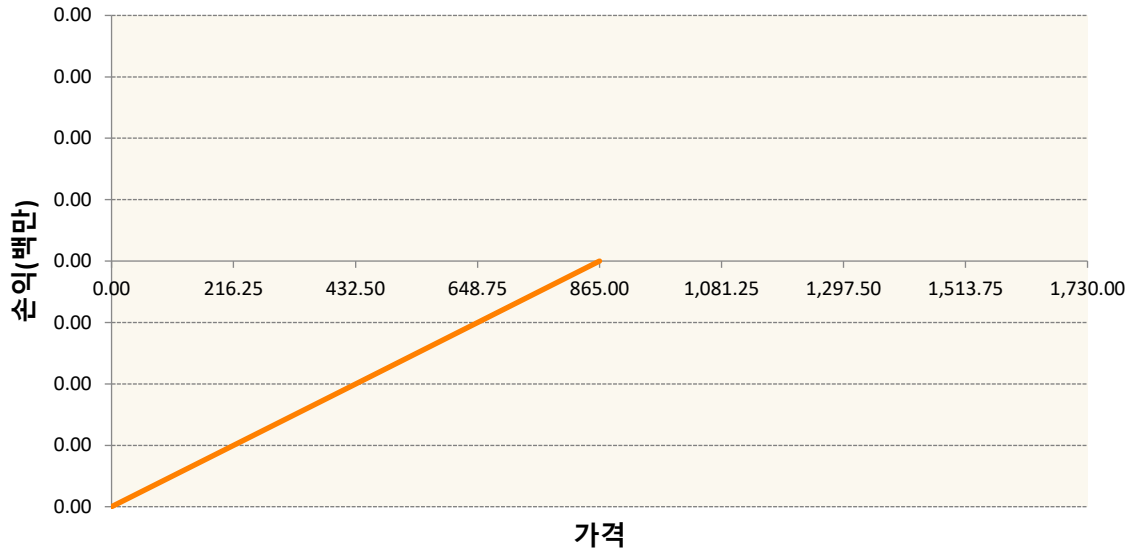
KR4B01658651-코스피200 C 202605 865.0



KR4B01658677-코스피200 C 202605 867.5



KR4C01658650-코스피200 P 202605 865.0



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4B01658651 | | 코스피200 C 202605 865.0 | | | | | | 0 |
|--------------|---------|-----------------------|--------|----|-------|--------|--------|---|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가액 | -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 | |
| KR4B01658677 | | 코스피200 C 202605 867.5 | | | | | | 0 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가액 | -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 | |
| KR4C01658650 | | 코스피200 P 202605 865.0 | | | | | | 0 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가액 | -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 |

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

(단위:백만원)

0

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

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 2026-05-12

기준일 2026-05-11

스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

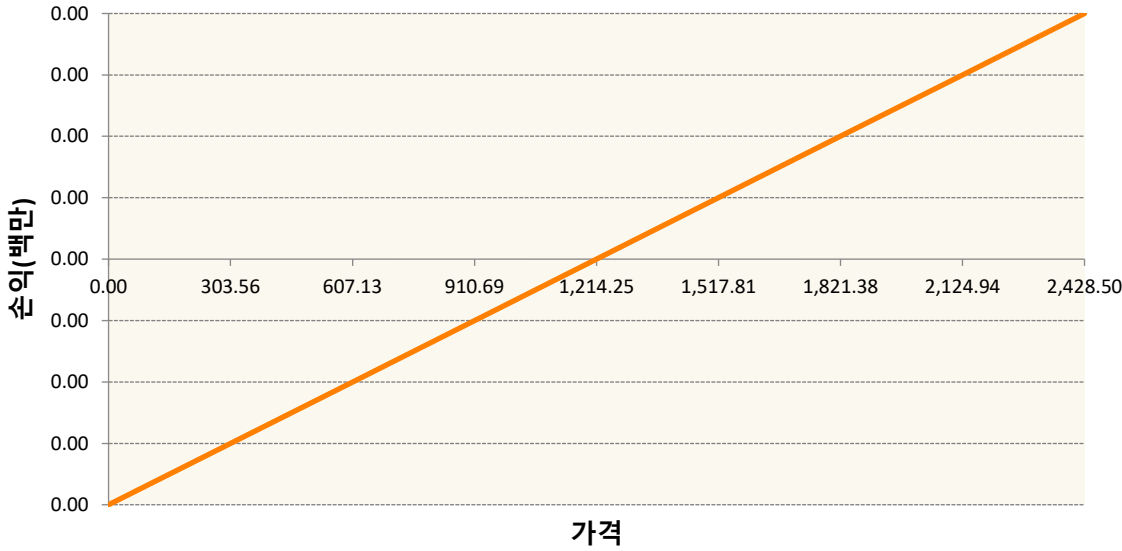
1. 계약금액

(단위:백만원)

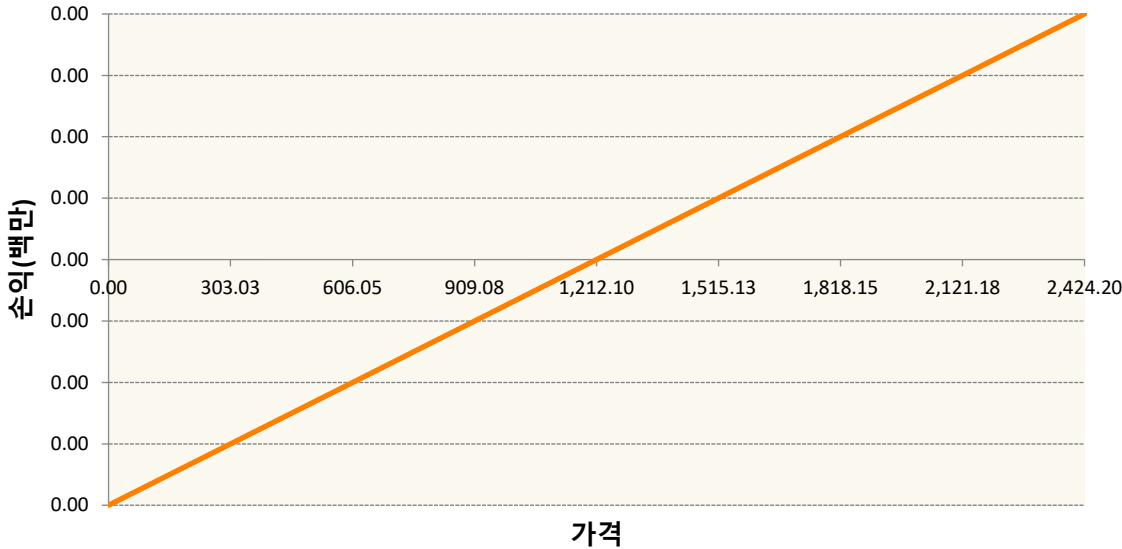
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 303 | 304 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 2,301 | 0 | 2,301 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

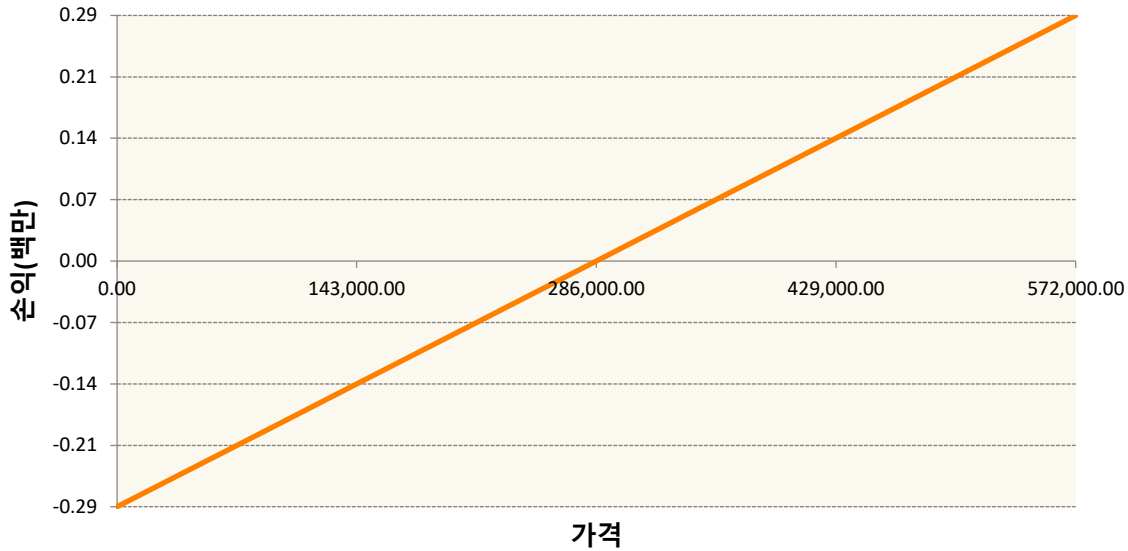
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



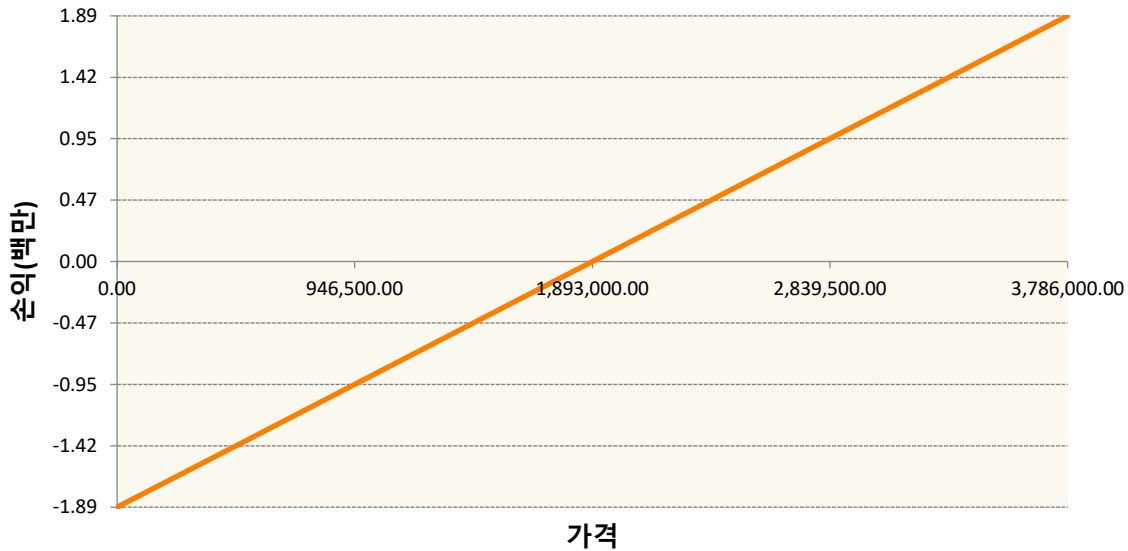
KR4A05650002-2026-05 미니코스피200 선물



KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4A01660005 | | 2026-06 코스피200지수선물 | | | | | | 121 |
|--------------|---------|---------------------|--------|------|-------|--------|--------|-----|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -121 | -121 | -121 | -121 | -121 | -121 | -121 | |
| -5.33% | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 | -81 | |
| -2.67% | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | -40 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | 40 | |
| 5.33% | 81 | 81 | 81 | 81 | 81 | 81 | 81 | |
| 8.00% | 121 | 121 | 121 | 121 | 121 | 121 | 121 | |
| KR4A05650002 | | 2026-05 미니코스피200 선물 | | | | | | 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% | -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% | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |

KR4A11650004 2026-05 삼성전자개별선물 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 |

KR4A50650006 2026-05 SK하이닉스개별선물 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 |

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

(단위:백만원)

331

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

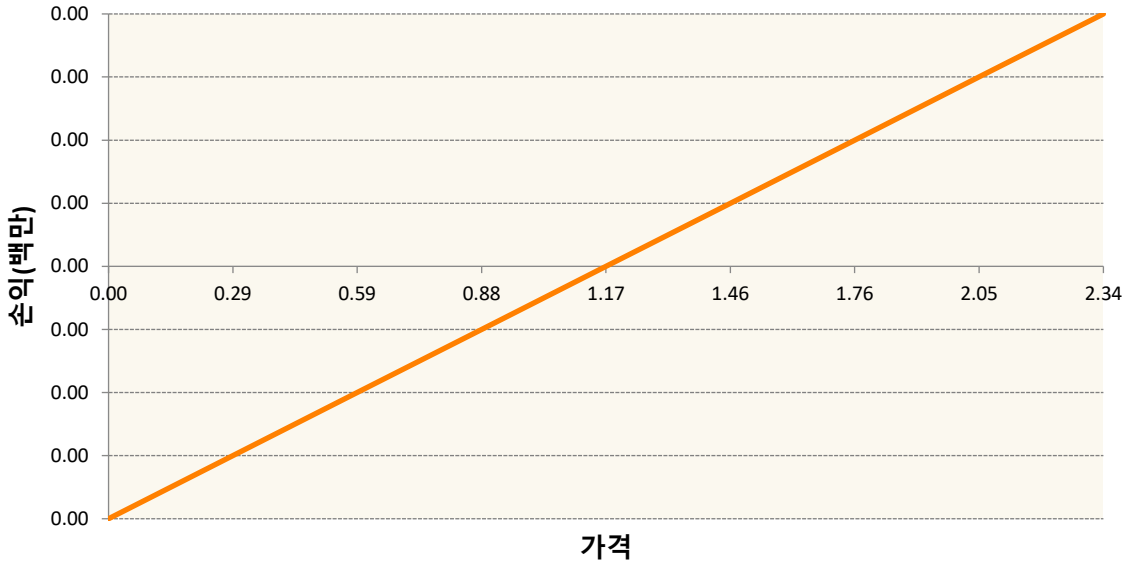
1. 계약금액

(단위:백만원)

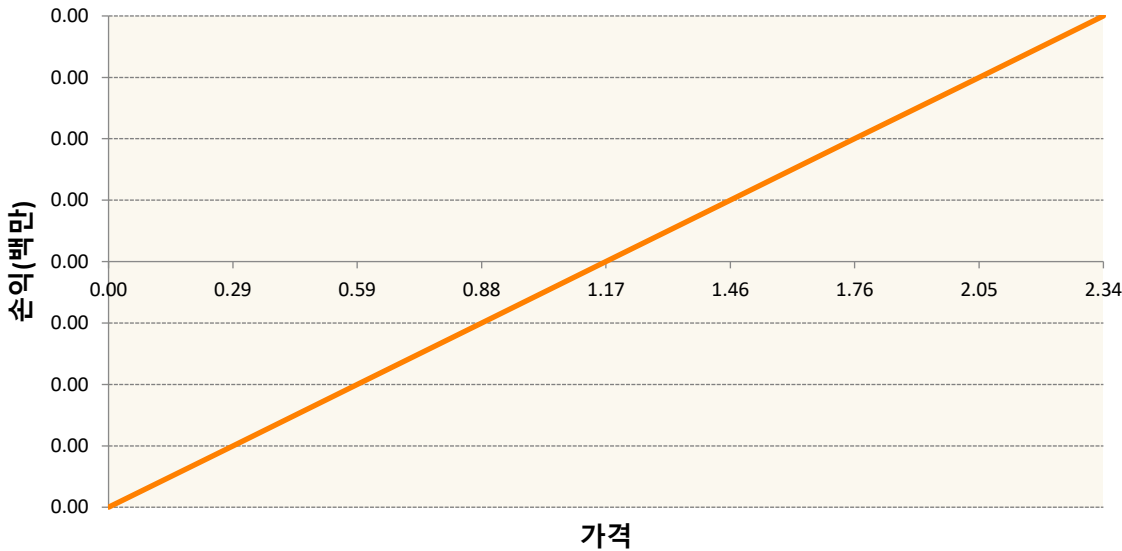
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 6,723 | 0 | 6,723 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

2108840319ID-ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(



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



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|---|----------|
| 2108840319 | ICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319(| 431 |
| 2108841218 | ICE Global Carbon Futures Index(ER) (메 | 108 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | | (단위:백만원) |
|--|--|------------|
| | | 618 |

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

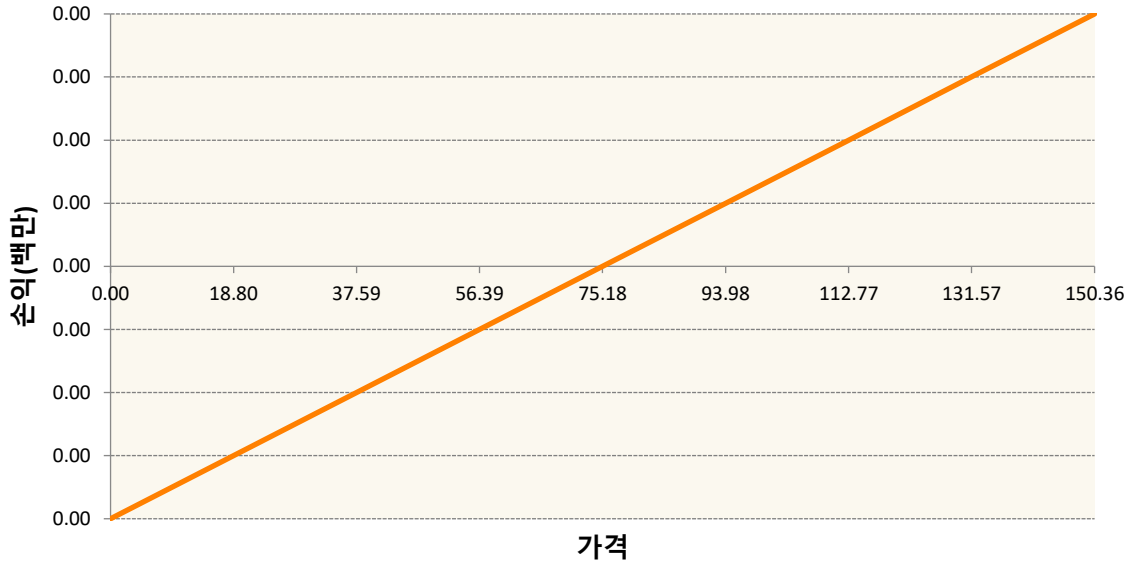
1. 계약금액

(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 | | | 4,850 | 0 | 4,850 | |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 2,362 | -2,362 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

MOZ26-ECX EMISSION Dec26



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E

189

MOZ26 ECX EMISSION Dec26

388

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

(단위:백만원)

671

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑 | 1,333 | 0 | 1,333 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 1,833 | 0 | 1,833 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|---|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래) | 4 |
| SWSOL0000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR) | 3 |
| SWSOL0000(신한CSI Index 250930 (메리츠) | 7 |
| SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(| 3 |

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

(단위:백만원)

26

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

SOL차이나육성산업액티브상장지

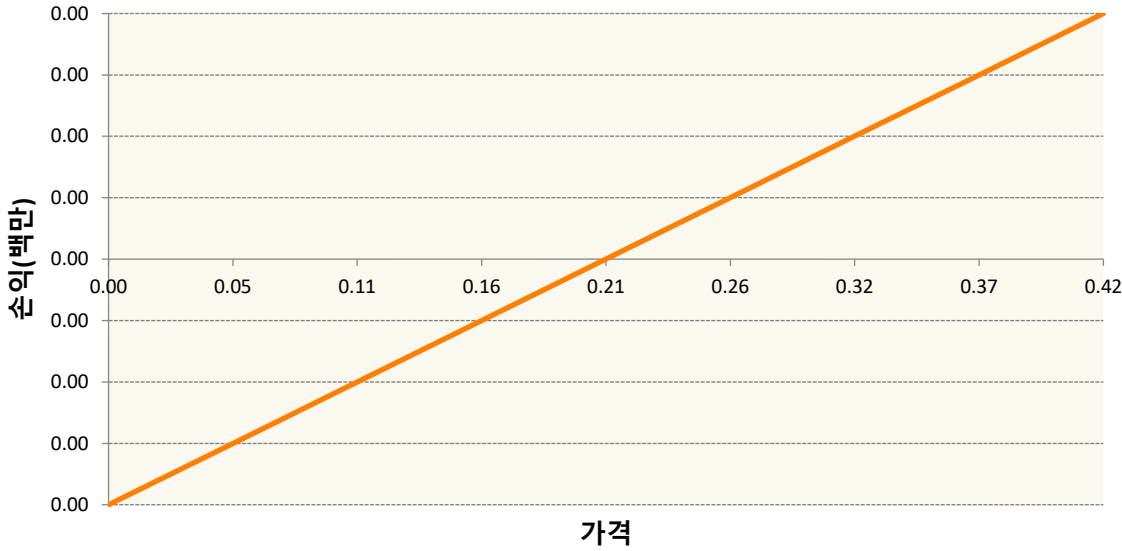
1. 계약금액

(단위:백만원)

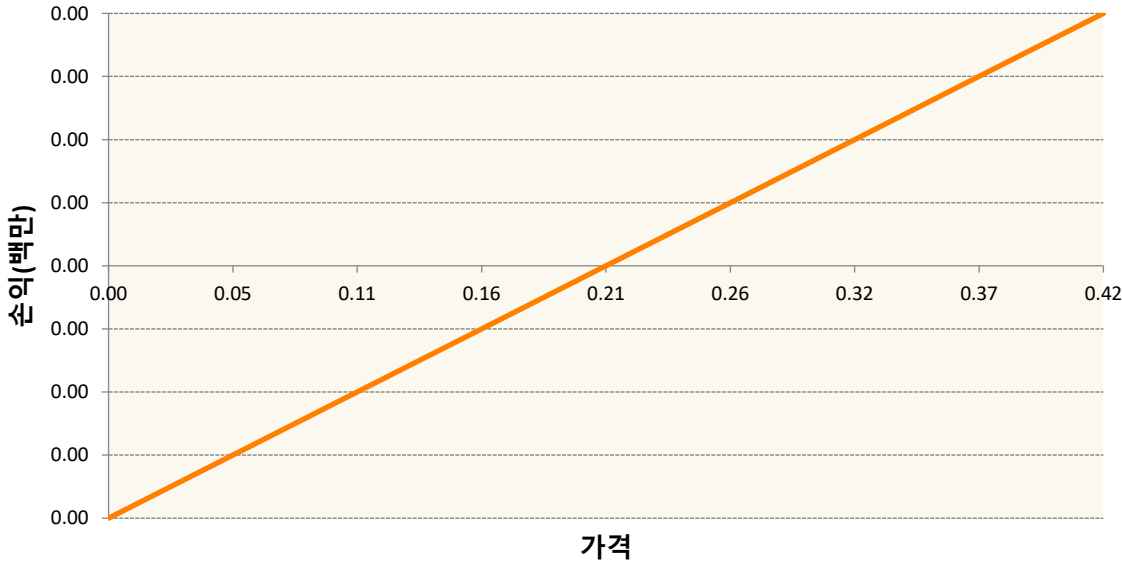
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 5,312 | 0 | 5,312 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

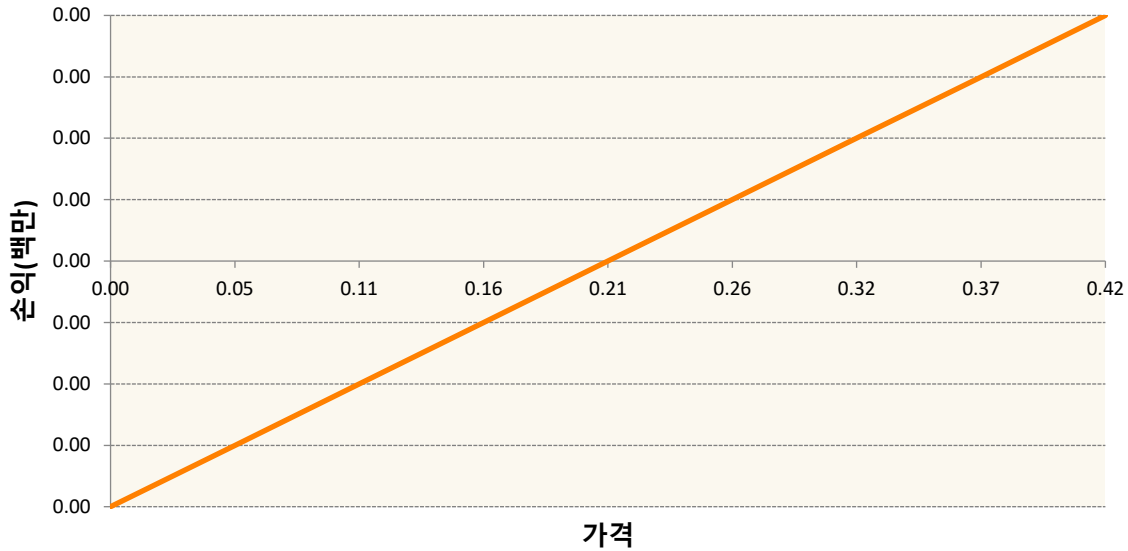
SWSTAR000027-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움)



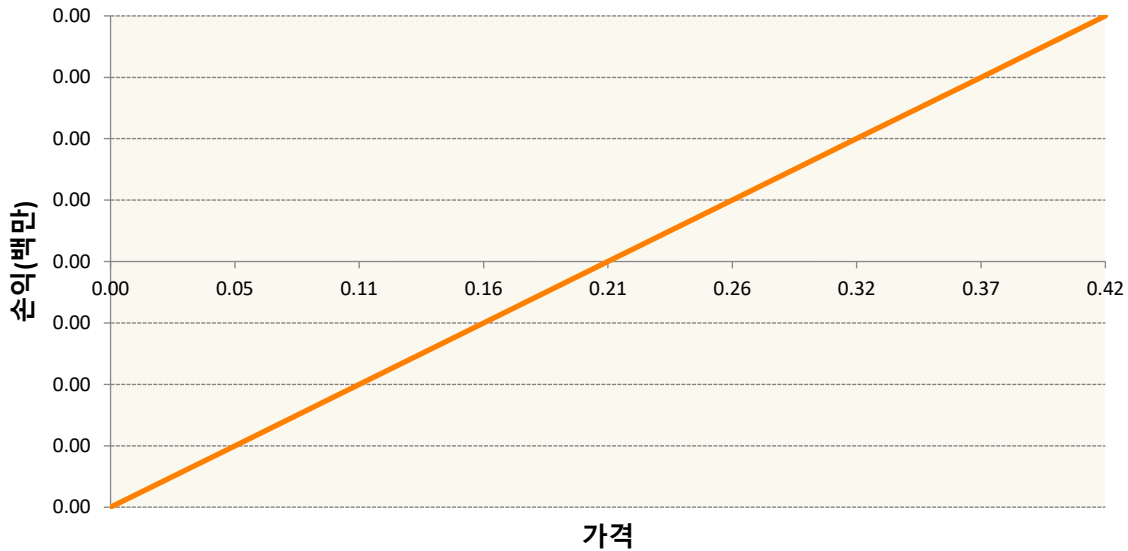
SWSTAR000030-STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)



SWSTAR000031-STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)



SWSTAR000032-STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | |
|---|-----|
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(키움) | 15 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH) | 52 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠) | 264 |
| SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래) | 98 |

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

(단위:백만원)

649

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

코리아인덱스(주식-파생형)(종)

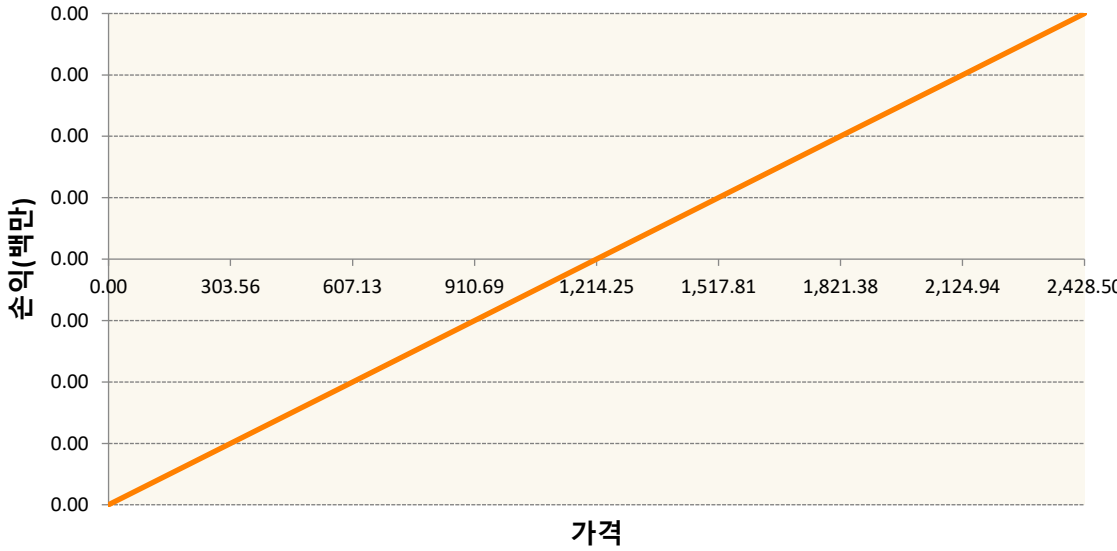
1. 계약금액

(단위:백만원)

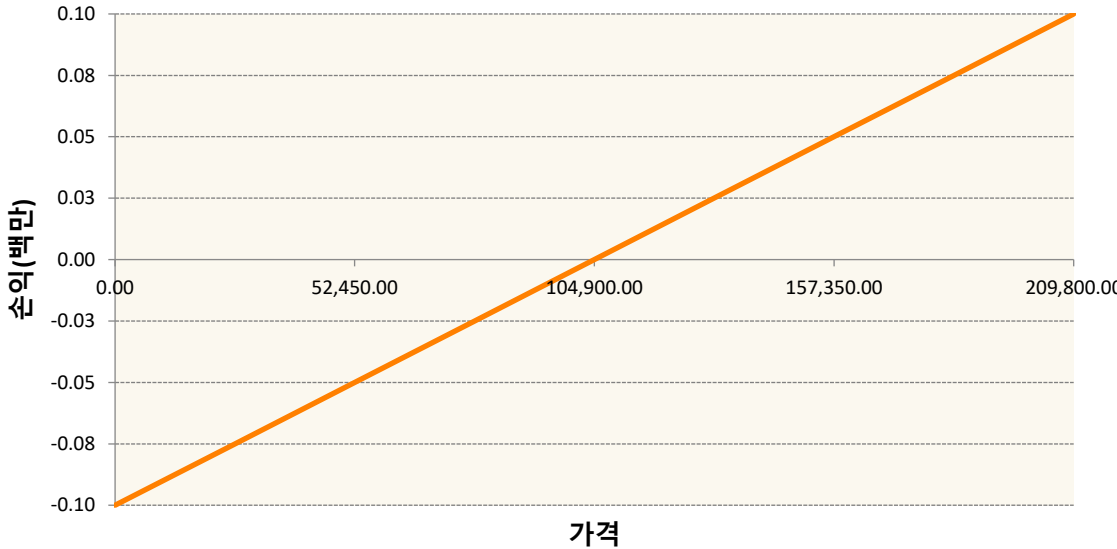
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 3,034 | 7,458 | -4,423 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 26,776 | 3,005 | 23,771 | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조

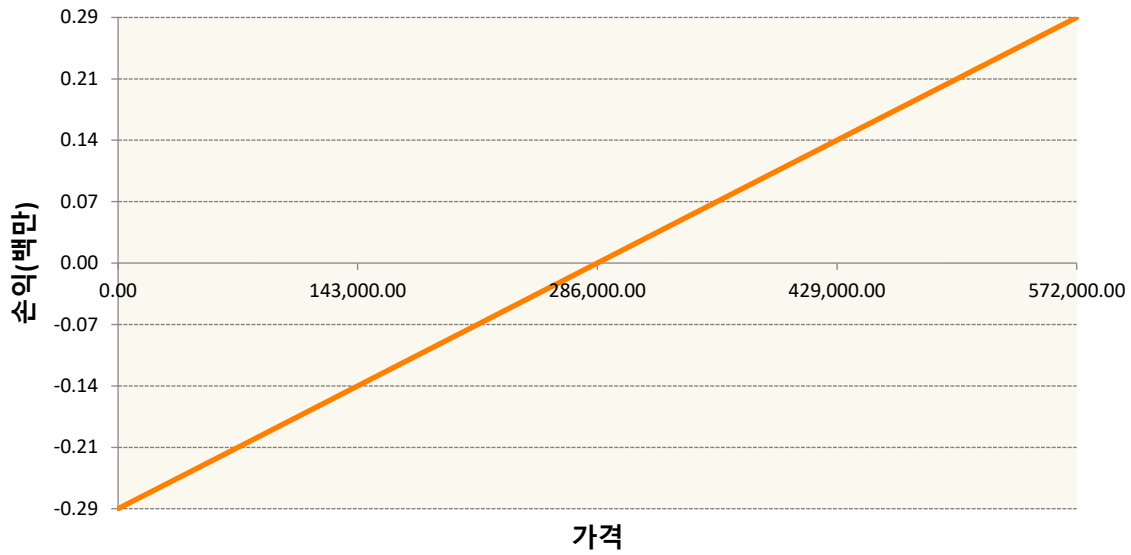
KR4A01660005-2026-06 코스피200지수선물



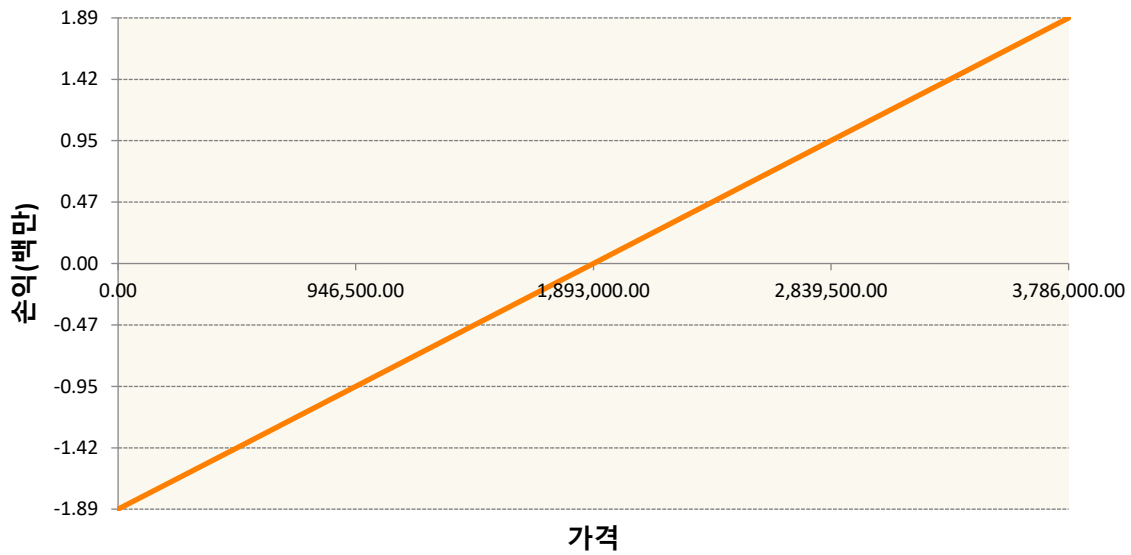
KR4A0F650001-2026-05 두산로보틱스개별선물



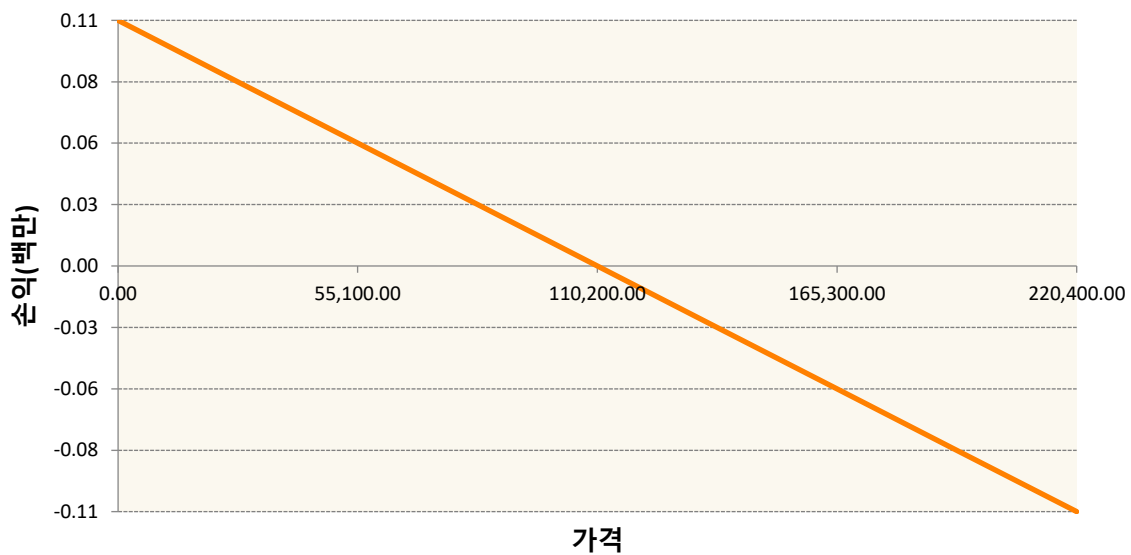
KR4A11650004-2026-05 삼성전자개별선물



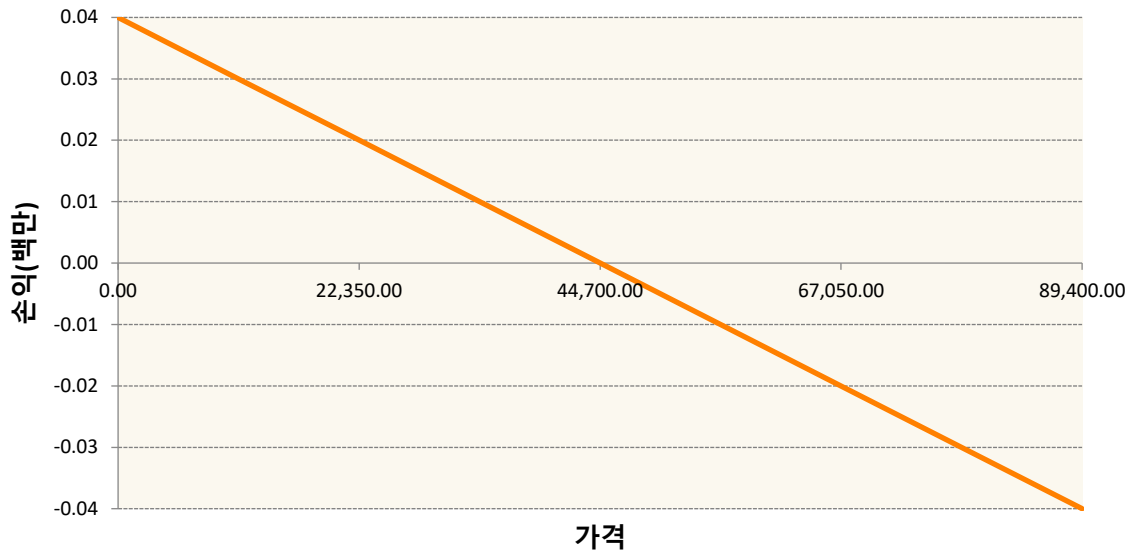
KR4A50650006-2026-05 SK하이닉스개별선물



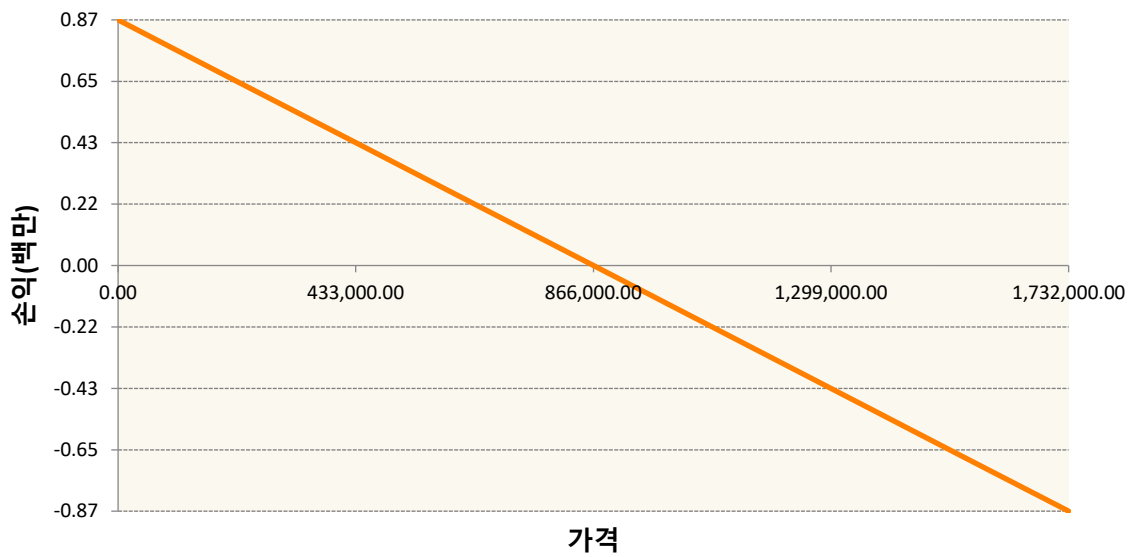
KR4AB2650003-2026-05 S-Oil개별선물



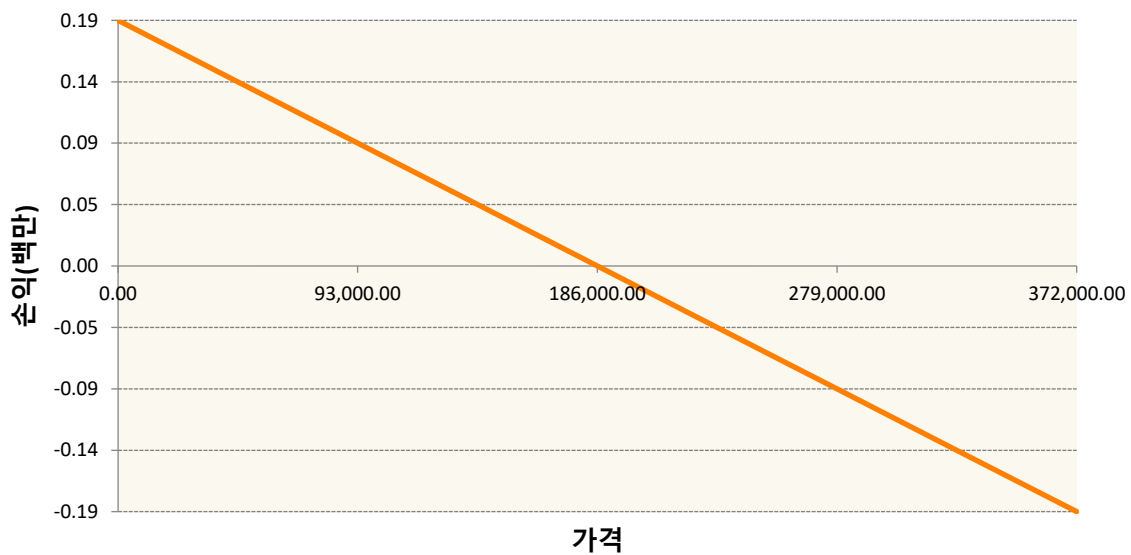
KR4ACF650006-2026-05 카카오개별선물



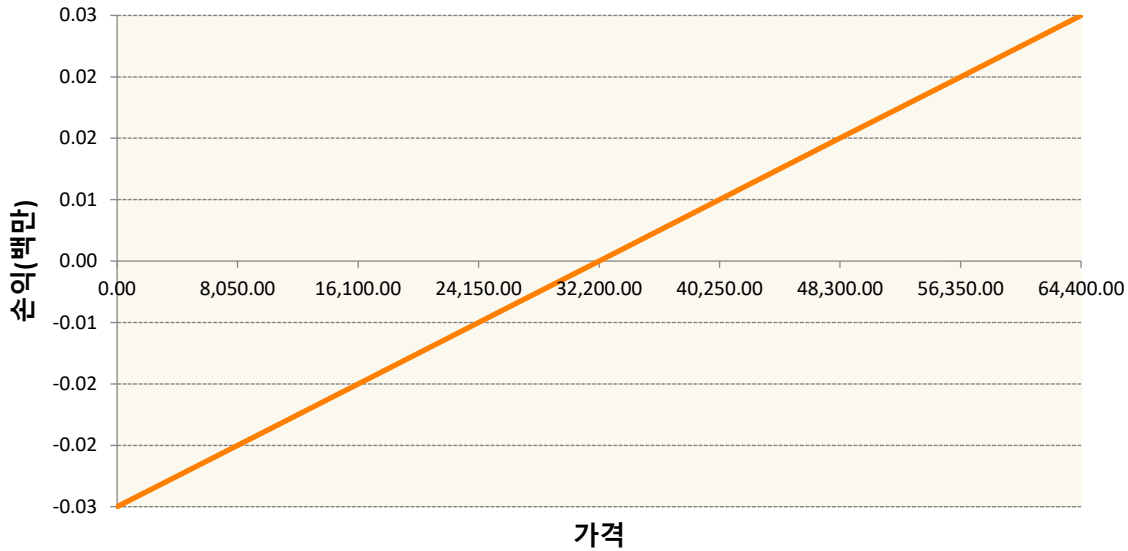
KR4ADB650009-2026-05 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선



KR4AFM650004-2026-05 엘앤에프개별선물



KR4AFT650007-2026-05 대우건설개별선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4A01660005 | | 2026-06 코스피200지수선물 | | | | | | 1,672 |
|--------------|---------|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -1,672 | -1,672 | -1,672 | -1,672 | -1,672 | -1,672 | -1,672 | |
| -5.33% | -1,115 | -1,115 | -1,115 | -1,115 | -1,115 | -1,115 | -1,115 | |
| -2.67% | -557 | -557 | -557 | -557 | -557 | -557 | -557 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |
| 2.67% | 557 | 557 | 557 | 557 | 557 | 557 | 557 | |
| 5.33% | 1,115 | 1,115 | 1,115 | 1,115 | 1,115 | 1,115 | 1,115 | |
| 8.00% | 1,672 | 1,672 | 1,672 | 1,672 | 1,672 | 1,672 | 1,672 | |
| KR4A0F650001 | | 2026-05 두산로보틱스개별선물 | | | | | | 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 | |
| KR4A11650004 | | 2026-05 삼성전자개별선물 | | | | | | 236 |
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% | |
| -8.00% | -236 | -236 | -236 | -236 | -236 | -236 | -236 | |
| -5.33% | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | -157 | |
| -2.67% | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 | -79 | |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | |

| | | | | | | | |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 | 79 |
| 5.33% | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 | 157 |
| 8.00% | 236 | 236 | 236 | 236 | 236 | 236 | 236 |

KR4A50650006 2026-05 SK하이닉스개별선물 162

| | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -162 | -162 | -162 | -162 | -162 | -162 | -162 |
| -5.33% | -108 | -108 | -108 | -108 | -108 | -108 | -108 |
| -2.67% | -54 | -54 | -54 | -54 | -54 | -54 | -54 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | 54 | 54 | 54 | 54 | 54 | 54 | 54 |
| 5.33% | 108 | 108 | 108 | 108 | 108 | 108 | 108 |
| 8.00% | 162 | 162 | 162 | 162 | 162 | 162 | 162 |

KR4AB2650003 2026-05 S-Oil개별선물 31

| | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 |
| -5.33% | 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% | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 |

KR4ACF650006 2026-05 카카오개별선물 114

| | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 114 | 114 | 114 | 114 | 114 | 114 | 114 |
| -5.33% | 76 | 76 | 76 | 76 | 76 | 76 | 76 |
| -2.67% | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 | 38 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 | -38 |
| 5.33% | -76 | -76 | -76 | -76 | -76 | -76 | -76 |
| 8.00% | -114 | -114 | -114 | -114 | -114 | -114 | -114 |

KR4ADB650009 2026-05 LIG디펜스앤에어로스페이스개별선 66

| | | | | | | | |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 | 66 |
| -5.33% | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 | 44 |
| -2.67% | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | -22 | -22 | -22 | -22 | -22 | -22 | -22 |
| 5.33% | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 | -44 |
| 8.00% | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 | -66 |

KR4AFM650004 2026-05 엘앤에프개별선물 31

| | | | | | | | |
|-----------|--|--|--|--|--|--|--|
| 기초자산의 변동성 | | | | | | | |
|-----------|--|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | | | |
|--------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 | 31 |
| -5.33% | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 | 21 |
| -2.67% | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| 0% | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.67% | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 | -10 |
| 5.33% | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 | -21 |
| 8.00% | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 | -31 |

KR4AFT650007

2026-05 대우건설개발선물

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 |

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

(단위:백만원)

5,164

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

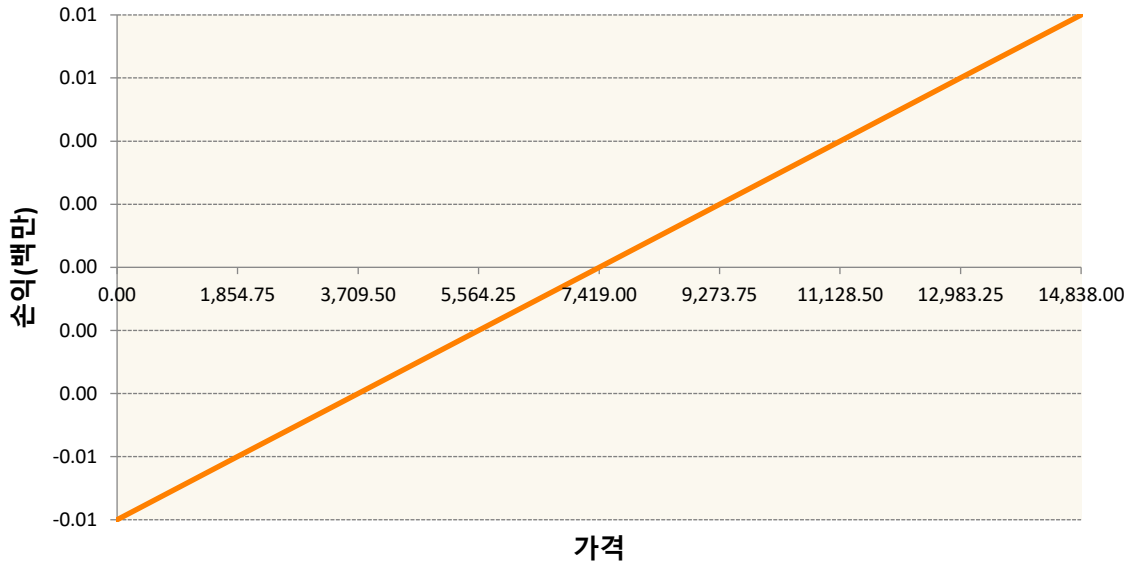
1. 계약금액

(단위:백만원)

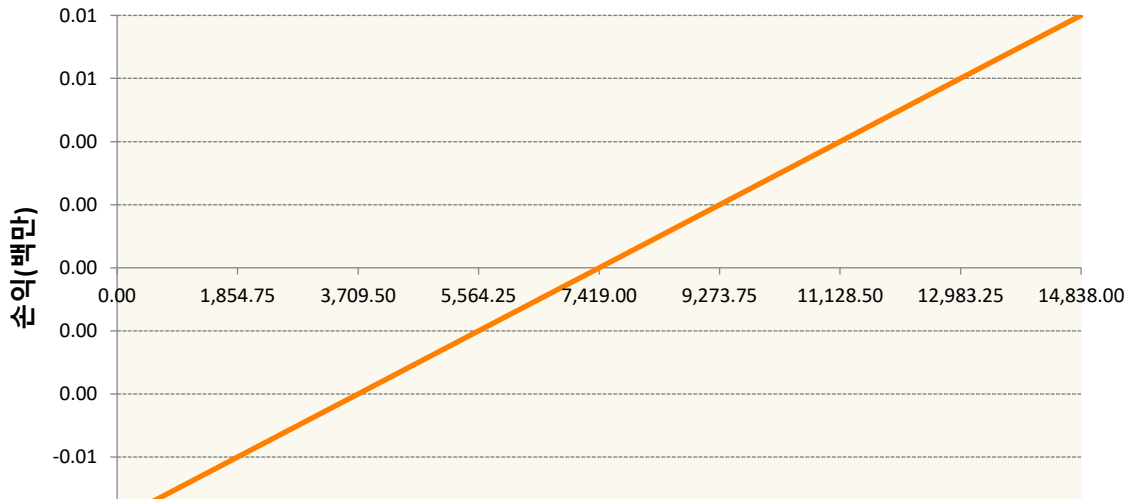
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 지수 | 선물 | 59,942 | 0 | 59,942 | |
| 누계 | 지수 | 선물 | 276 | 0 | 276 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선물 | 10,447 | 0 | 10,447 | 장내 |

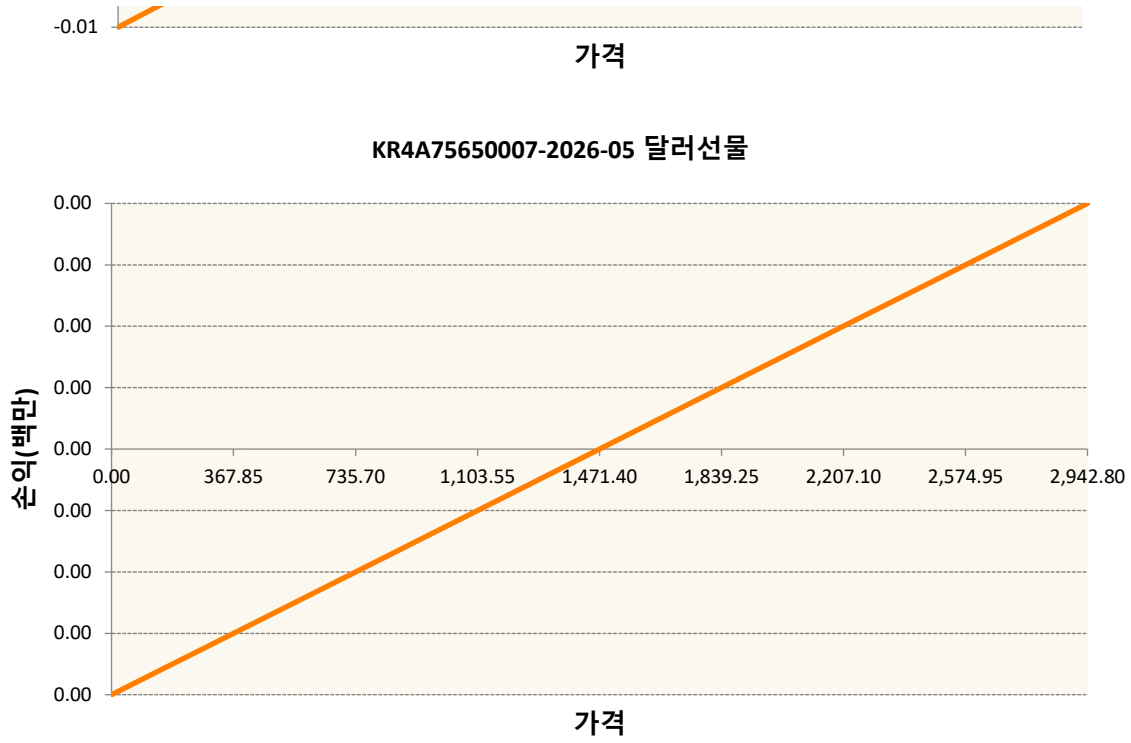
2. 만기시점의 손익구조

ESM6-S&P500 EMINI FUT JUN26



HWAM6-SP500 MIC EMIN FUTJun26





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| ESM6 | S&P500 EMINI FUT JUN26 | 4,795 |
| HWAM6 | SP500 MIC EMIN FUTJun26 | 22 |
| | KR4A756500 2026-05 달러선물 | 836 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|--------------|
| | 4,207 |

공시일 2026-05-12

기준일 2026-05-11

미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

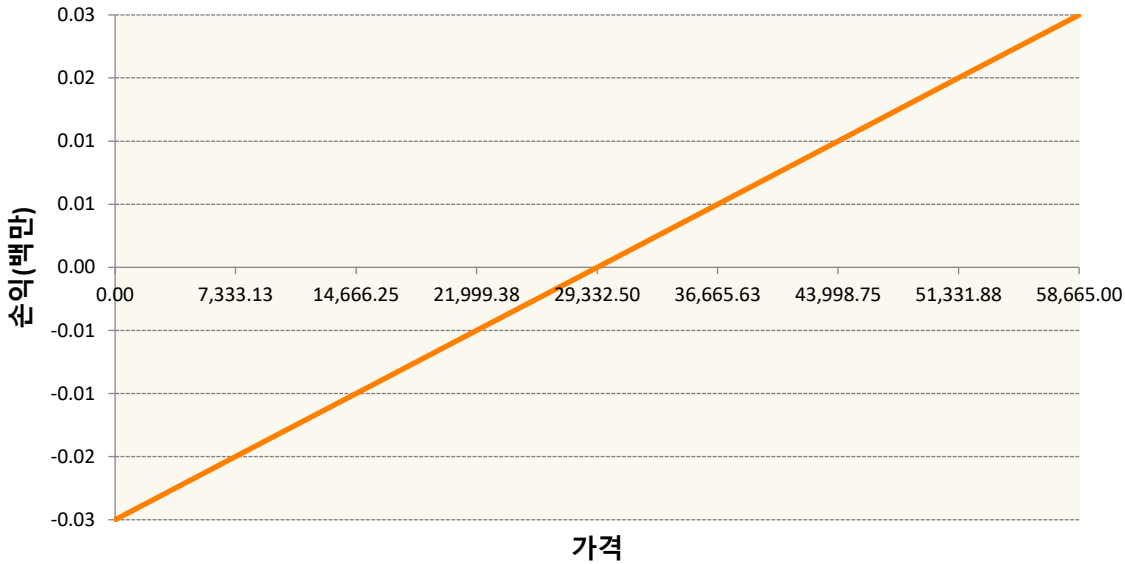
1. 계약금액

(단위:백만원)

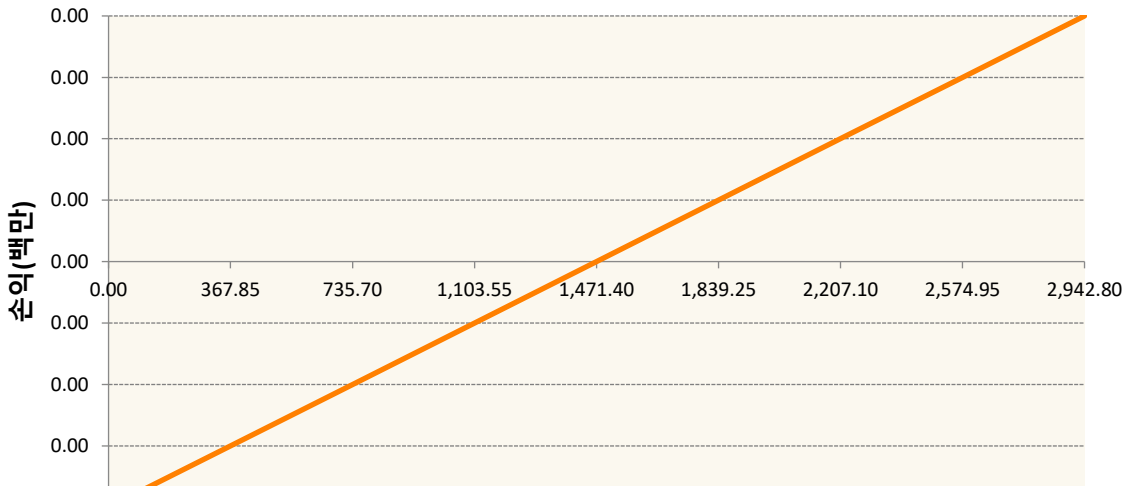
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 29,783 | 0 | 29,783 | |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 256 | 0 | 256 | 장내 |
| 누계 | 통화 | 선물 | 3,840 | 0 | 3,840 | 장내 |

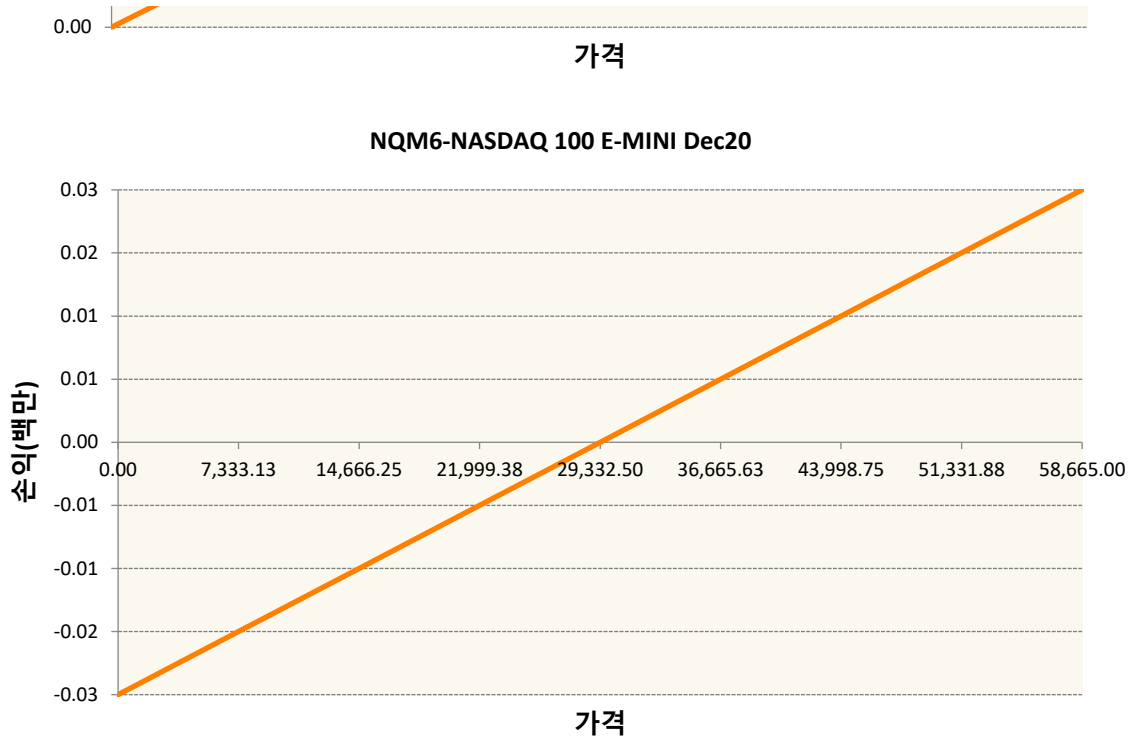
2. 만기시점의 손익구조

HWBM6-NASD100 MICRO EMIN JUN26



KR4A75650007-2026-05 달러선물





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| | | |
|------------|--------------------------|-------|
| HWBM6 | NASD100 MICRO EMIN JUN26 | 20 |
| KR4A756500 | 2026-05 달러선물 | 307 |
| NQM6 | NASDAQ 100 E-MINI Dec20 | 2,383 |

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

(단위:백만원)

| |
|--------------|
| 2,662 |
|--------------|

| | |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-12 |
| 기준일 | 2026-05-11 |

SOL미국30년국채커버드콜(합성)

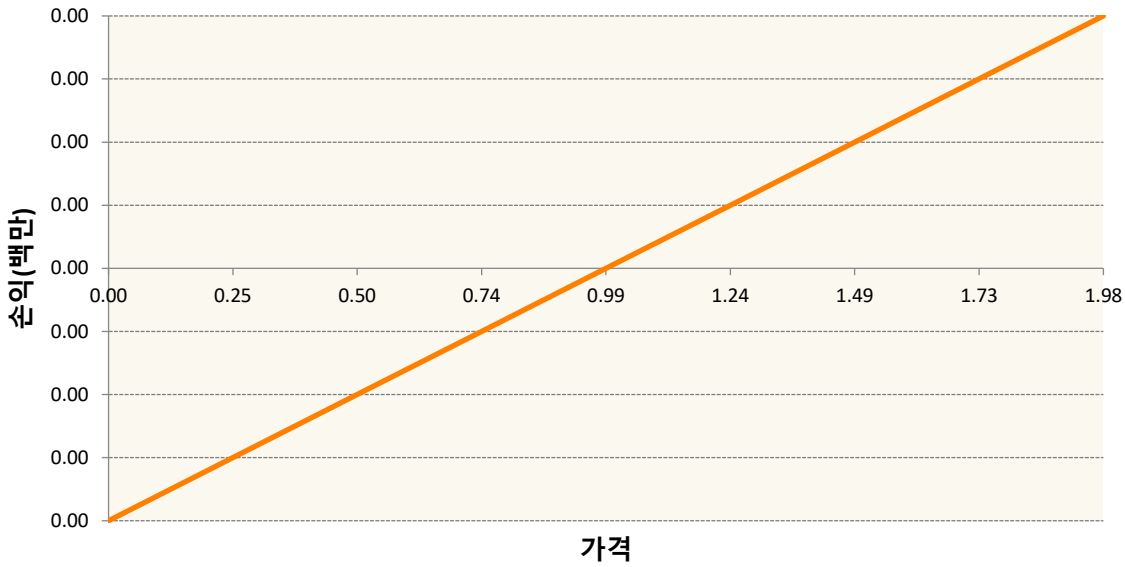
1. 계약금액

(단위:백만원)

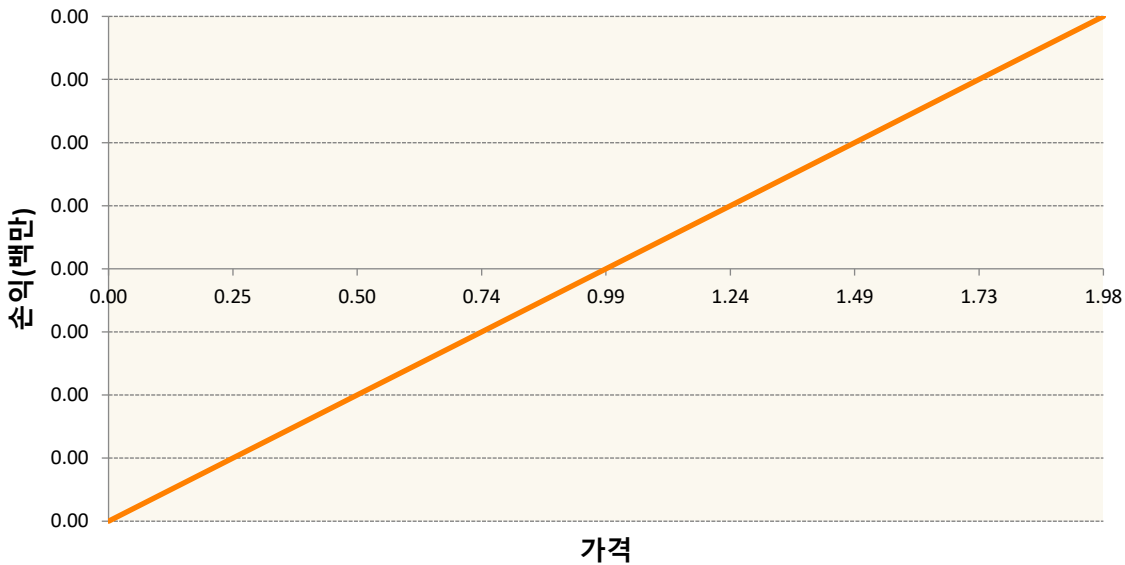
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 지수 | 스왑 | 354,981 | 0 | 354,981 | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조

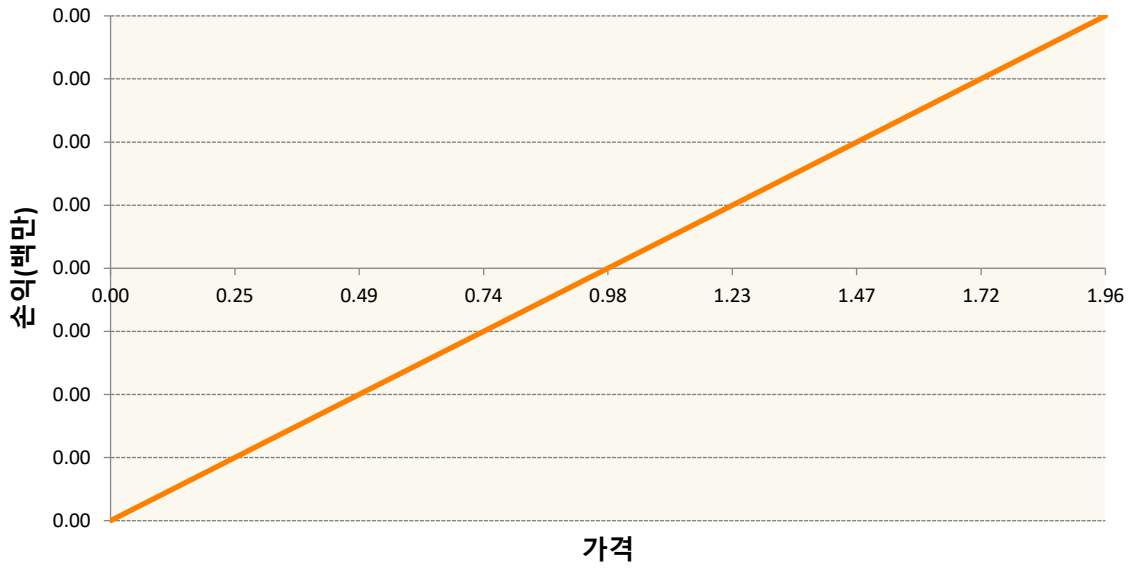
SWKEDI000150-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



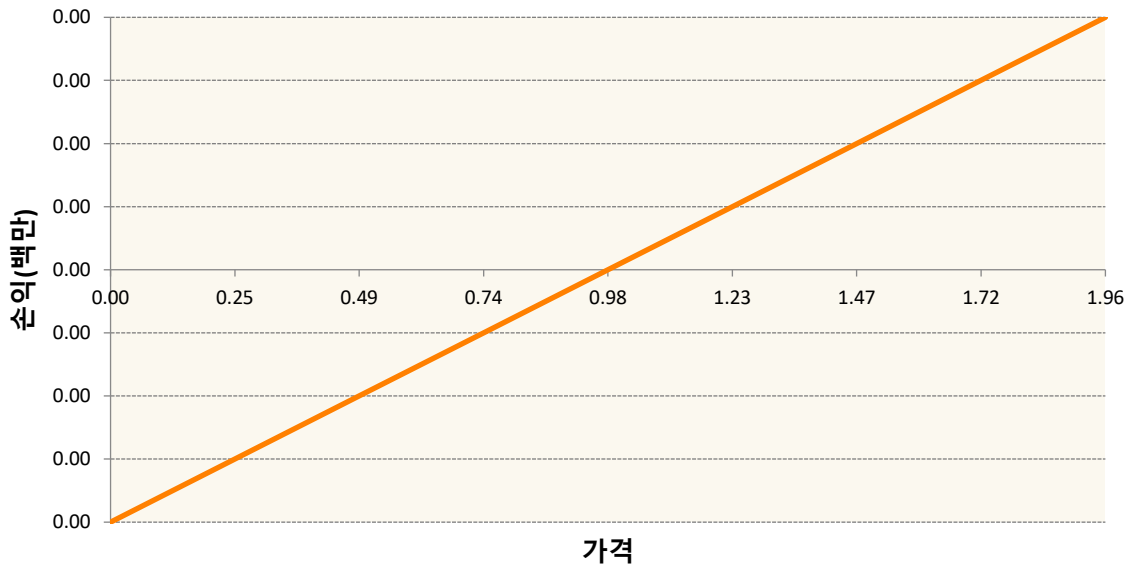
SWKEDI000164-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



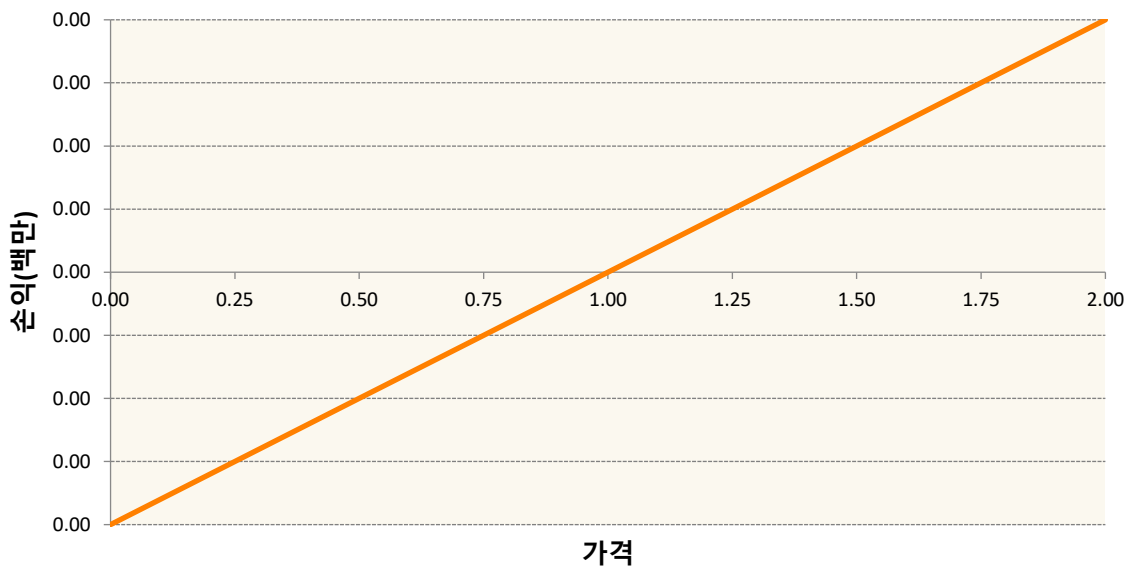
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000172-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000173-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) | | (단위:백만원) |
|---|--|----------|
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | | 8,261 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | | 151 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | | 7,665 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | | 3,392 |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN | | 8,872 |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|--|----------|
| | 12,010 |