

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

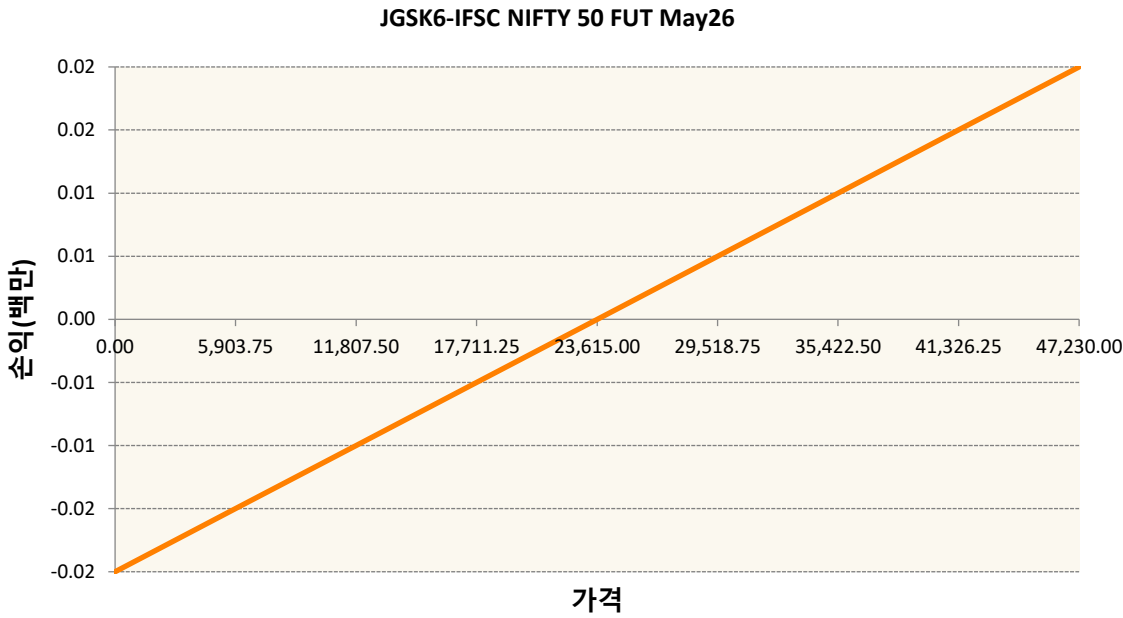
## 인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 350   | 0     | 350       |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|       |                         |    |
|-------|-------------------------|----|
| JGSK6 | IFSC NIFTY 50 FUT May26 | 28 |
|-------|-------------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 20 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

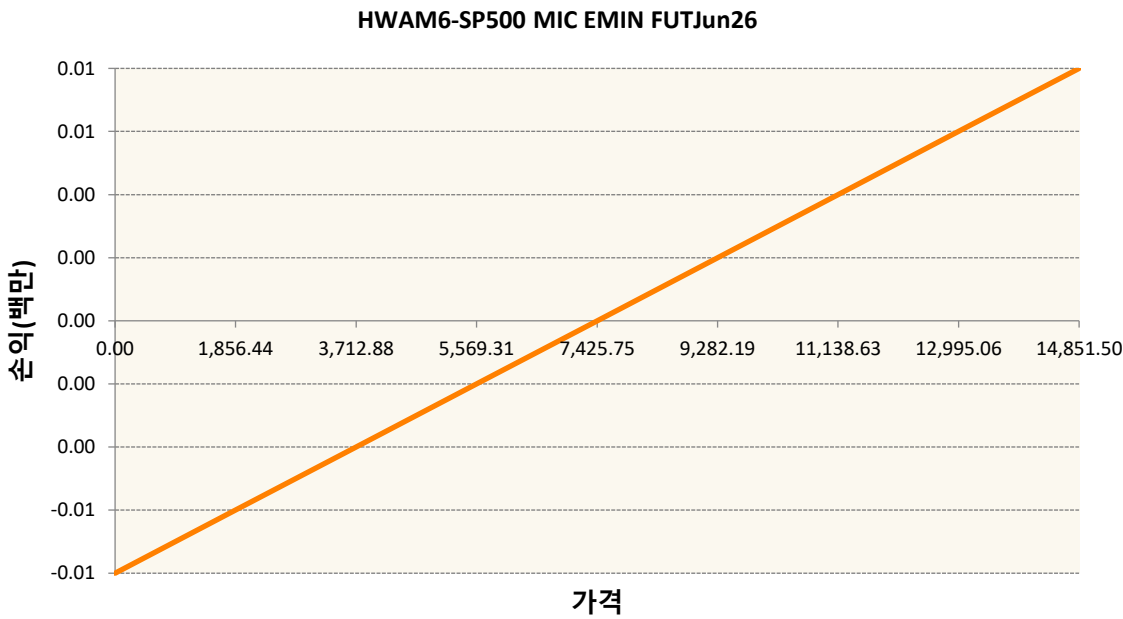
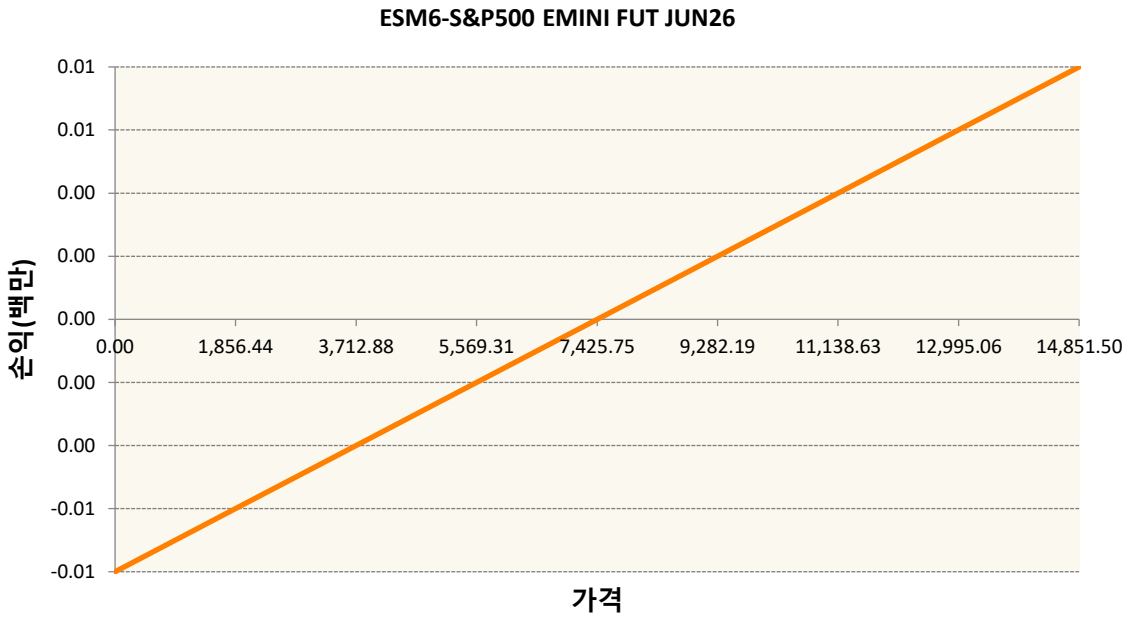
## SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

### 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   | 558   | 0     | 558       |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 56    | 0     | 56        | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|----------|
| ESM6                      | S&P500 EMINI FUT JUN26  | 45       |
| HWAM6                     | SP500 MIC EMIN FUTJun26 | 4        |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 43       |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

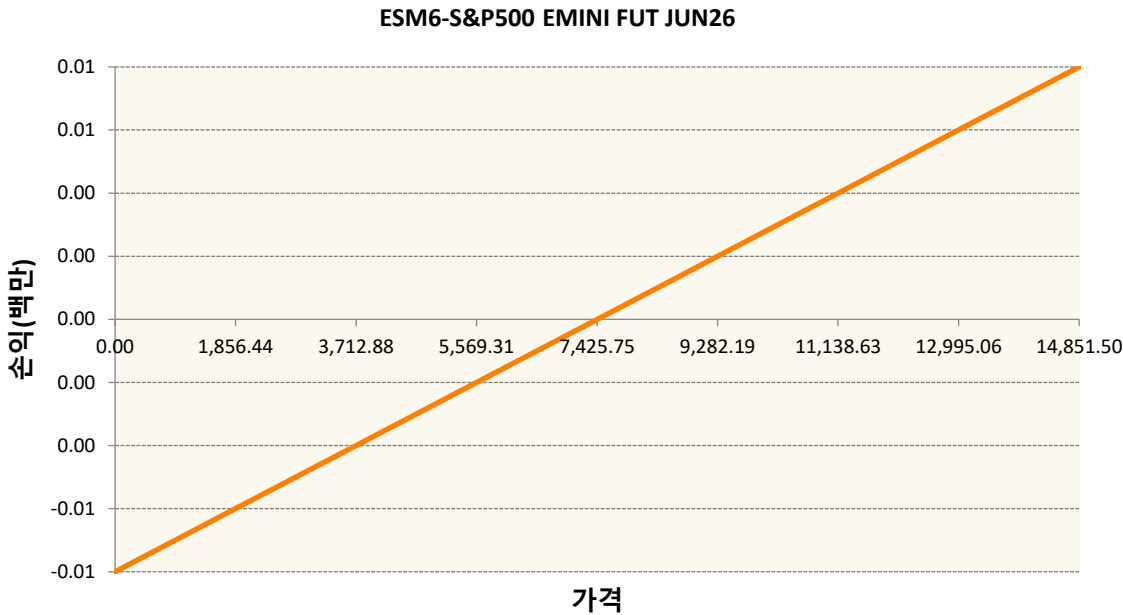
## SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생)

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 1,115 | 0     | 1,115     |    |

### 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 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

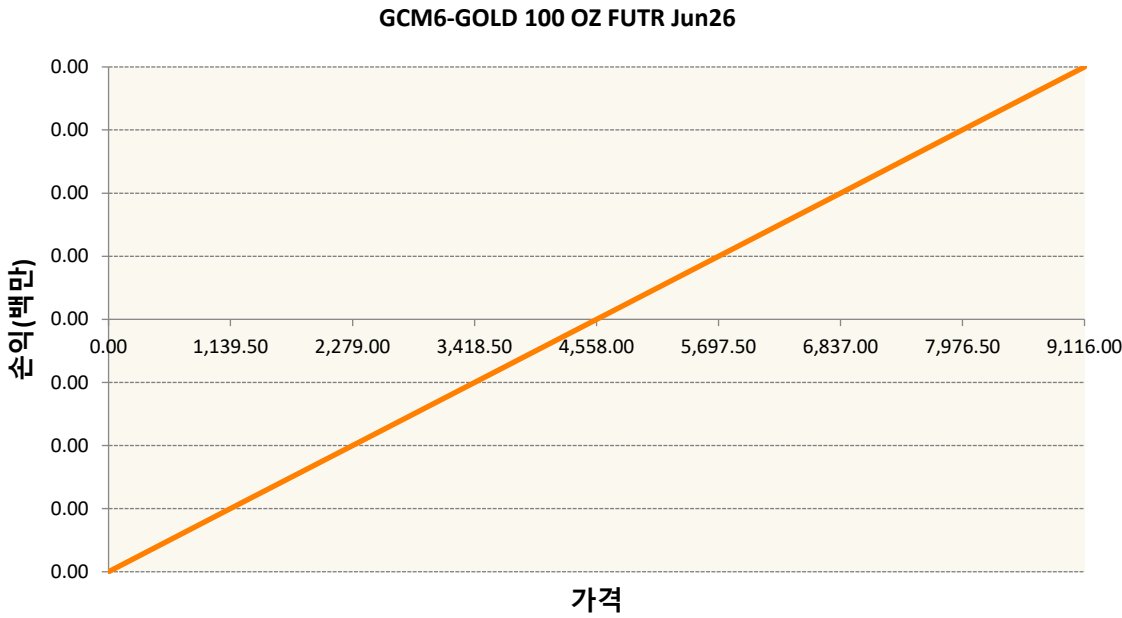
## SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금)

### 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   | 5,493 | 0     | 5,493     | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 옵션   | 0     | 0     | 0         |    |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| AOGLDUC00 GLD US 05/22/26 C430 EQUITY | 4   |
| GCM6        GOLD 100 OZ FUTR Jun26    | 439 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 557 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

## 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 05/22/26 C140 EQUITY  | 107 |
| AOPLTRUSP1 PLTR US 05/22/26 P140 EQUITY | 30  |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 411 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

## 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)

AOTLTUSC0(TLT US 05/22/26 C85 EQUITY

1

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

(단위:백만원)

1

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

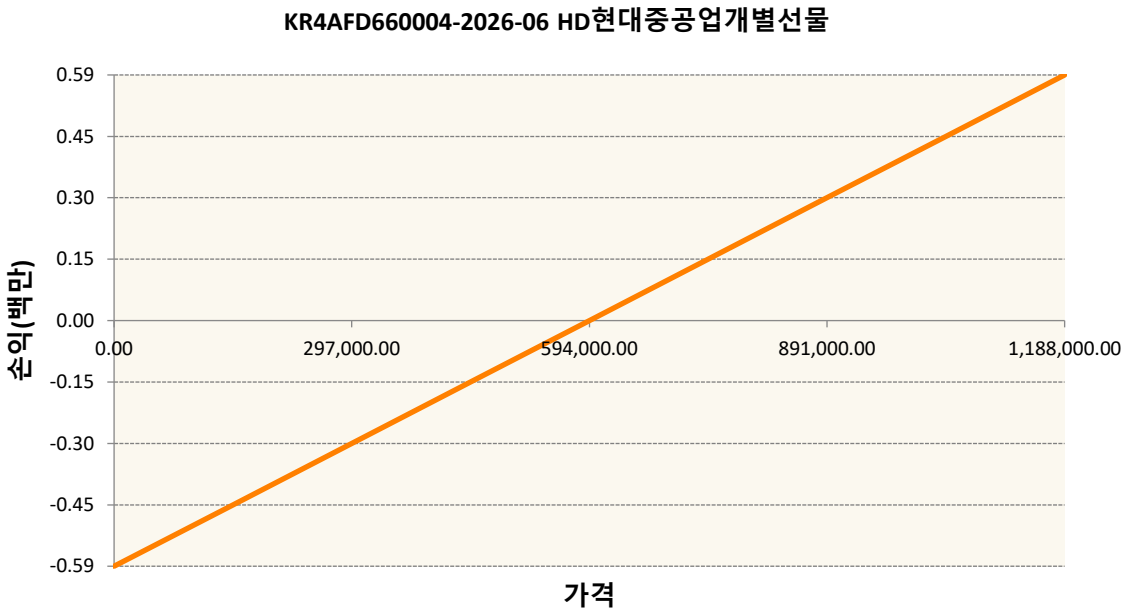
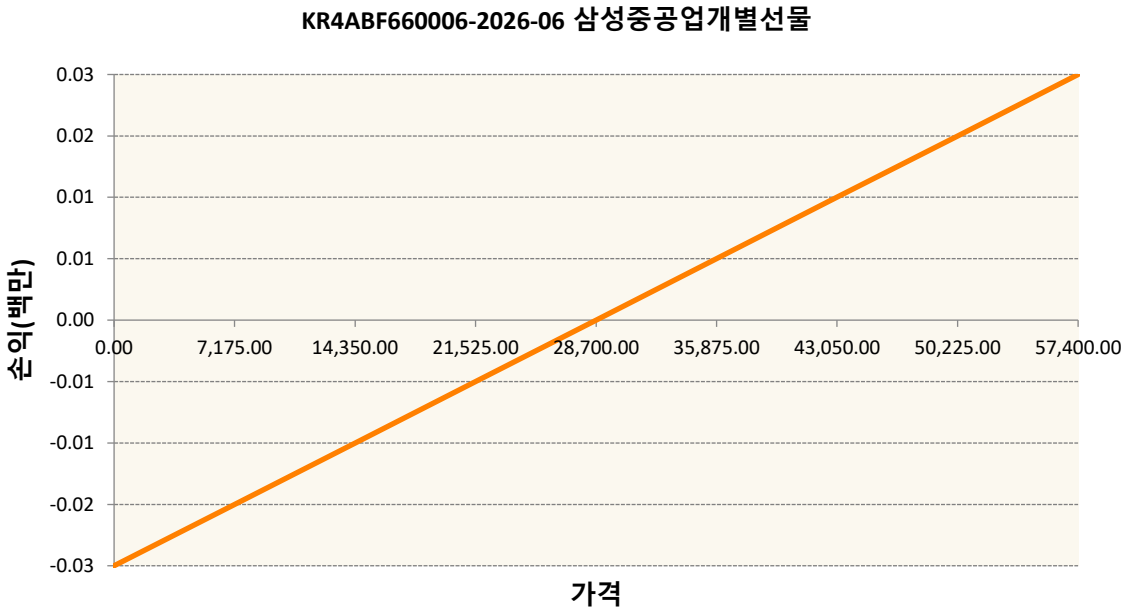
## SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

### 1. 계약금액

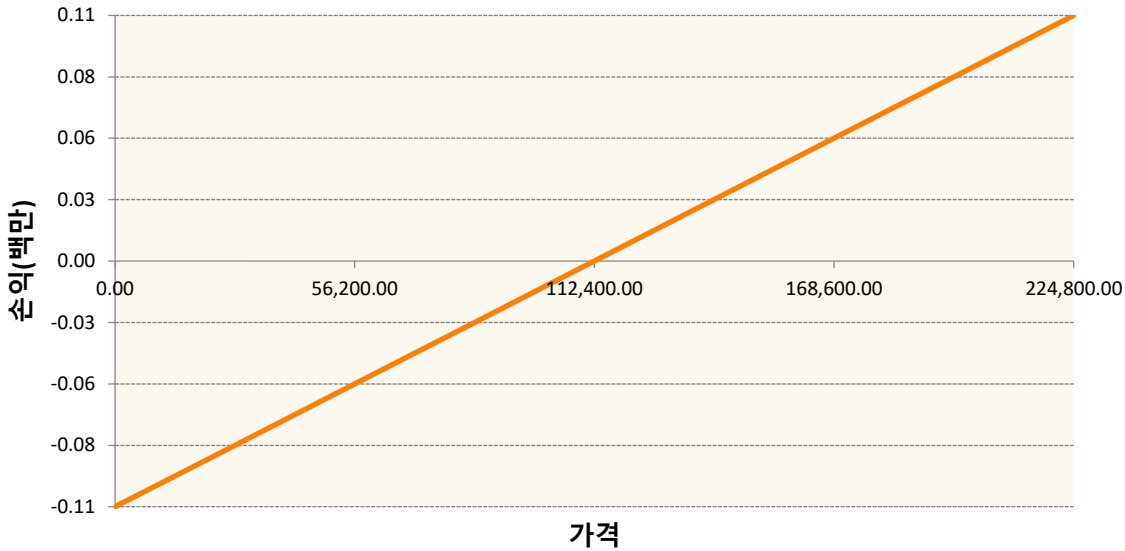
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0       | 3,696 | -3,696    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 16,492  | 0     | 16,492    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 스왑   | 146,028 | 0     | 146,028   | 장외 |

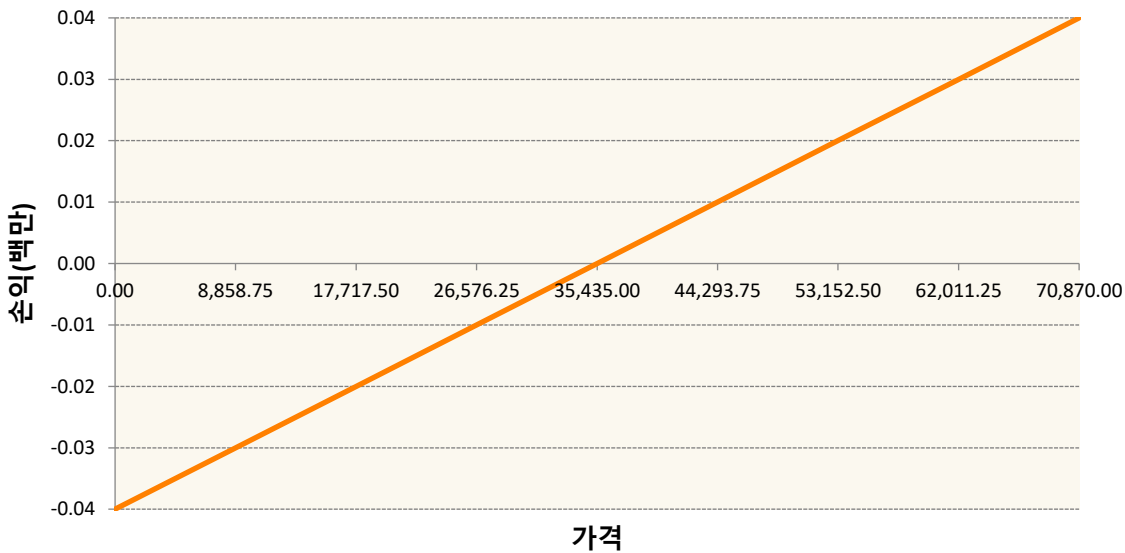
### 2. 만기시점의 손익구조



KR4AFV660002-2026-06 한화오션개별선물



KR4AM766004-2026-06 SOL 조선TOP3플러스개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |         |        |                     |       |        |        |
|--------------|-----------|---------|--------|---------------------|-------|--------|--------|
| KR4ABF660006 |           |         |        | 2026-06 삼성중공업개별선물   |       |        | 406    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -406      | -406    | -406   | -406                | -406  | -406   | -406   |
| -5.33%       | -271      | -271    | -271   | -271                | -271  | -271   | -271   |
| -2.67%       | -135      | -135    | -135   | -135                | -135  | -135   | -135   |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0                   | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 135       | 135     | 135    | 135                 | 135   | 135    | 135    |
| 5.33%        | 271       | 271     | 271    | 271                 | 271   | 271    | 271    |
| 8.00%        | 406       | 406     | 406    | 406                 | 406   | 406    | 406    |
| KR4AFD660004 |           |         |        | 2026-06 HD현대중공업개별선물 |       |        | 648    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                     |       |        |        |

|                               |         |         |        |      |       |        |        |
|-------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | -648    | -648    | -648   | -648 | -648  | -648   | -648   |
| -5.33%                        | -432    | -432    | -432   | -432 | -432  | -432   | -432   |
| -2.67%                        | -216    | -216    | -216   | -216 | -216  | -216   | -216   |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | 216     | 216     | 216    | 216  | 216   | 216    | 216    |
| 5.33%                         | 432     | 432     | 432    | 432  | 432   | 432    | 432    |
| 8.00%                         | 648     | 648     | 648    | 648  | 648   | 648    | 648    |
| KR4AFV660002 2026-06 한화오션개별선물 |         |         |        |      |       |        | 266    |
| 기초자산의 변동성                     |         |         |        |      |       |        |        |
| 가격                            | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                        | -266    | -266    | -266   | -266 | -266  | -266   | -266   |
| -5.33%                        | -177    | -177    | -177   | -177 | -177  | -177   | -177   |
| -2.67%                        | -89     | -89     | -89    | -89  | -89   | -89    | -89    |
| 0%                            | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                         | 89      | 89      | 89     | 89   | 89    | 89     | 89     |
| 5.33%                         | 177     | 177     | 177    | 177  | 177   | 177    | 177    |
| 8.00%                         | 266     | 266     | 266    | 266  | 266   | 266    | 266    |
|                               |         |         |        |      |       |        |        |

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

(단위:백만원)

1,961

공시일 2026-05-20

기준일 2026-05-19

## 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 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

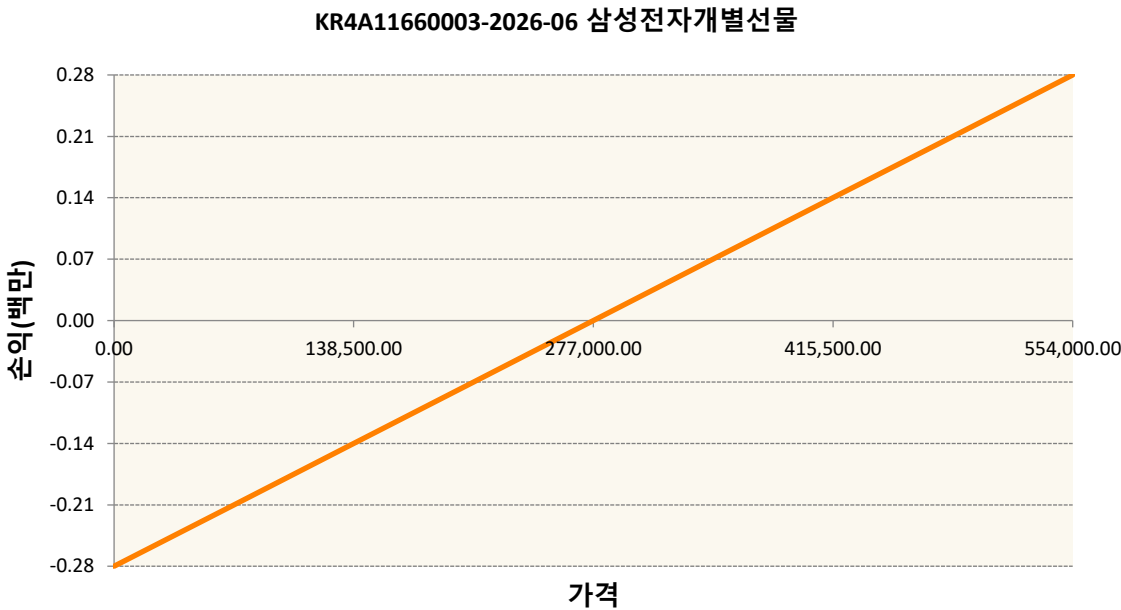
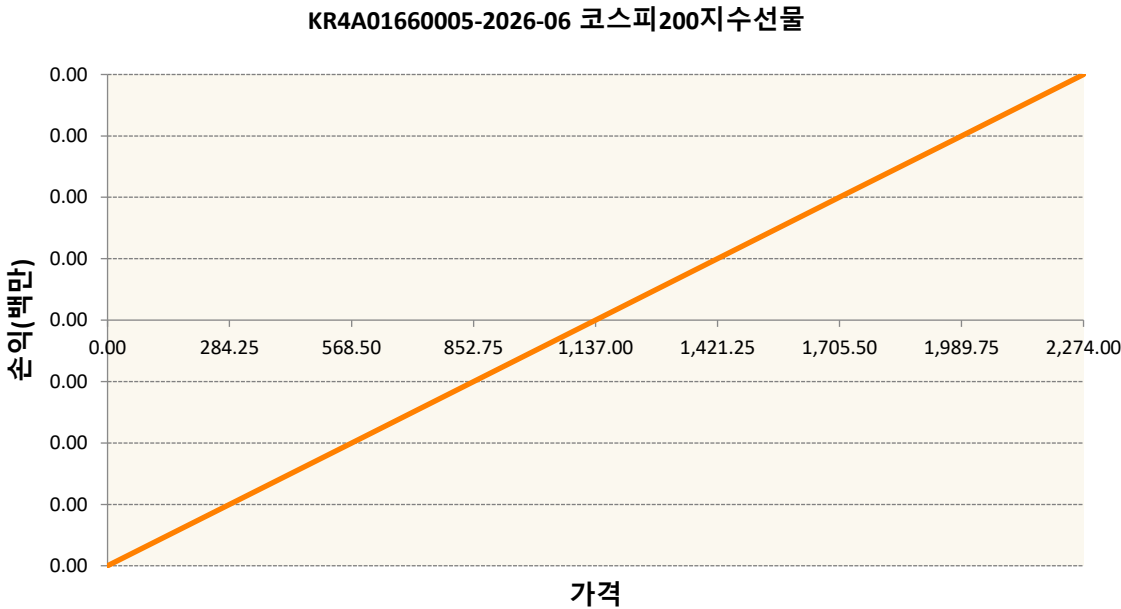
## SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

### 1. 계약금액

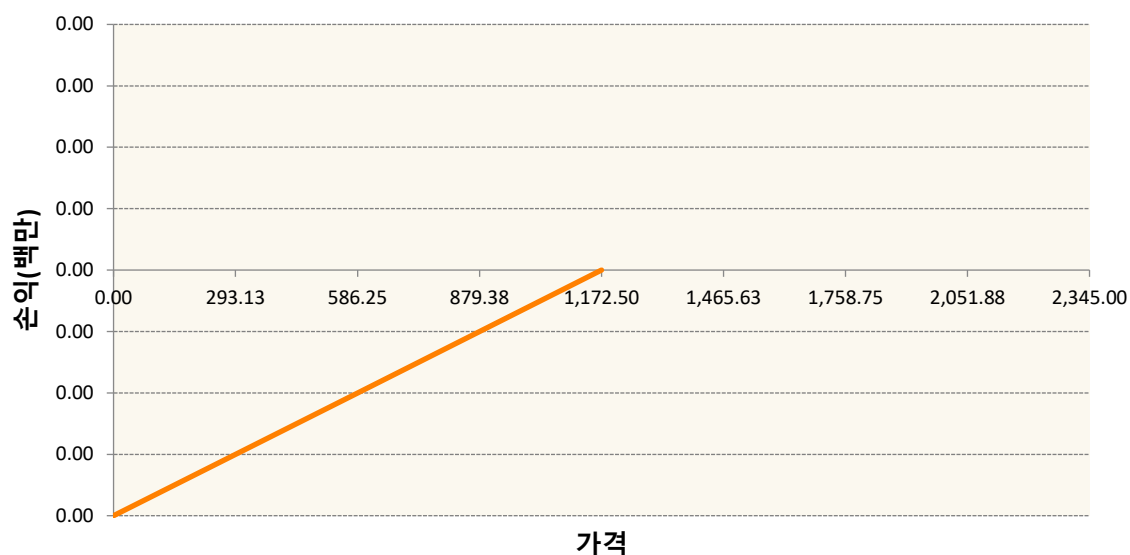
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 1,479  | -1,479    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 22,349 | 0      | 22,349    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0      | 38,725 | -38,725   | 장내 |

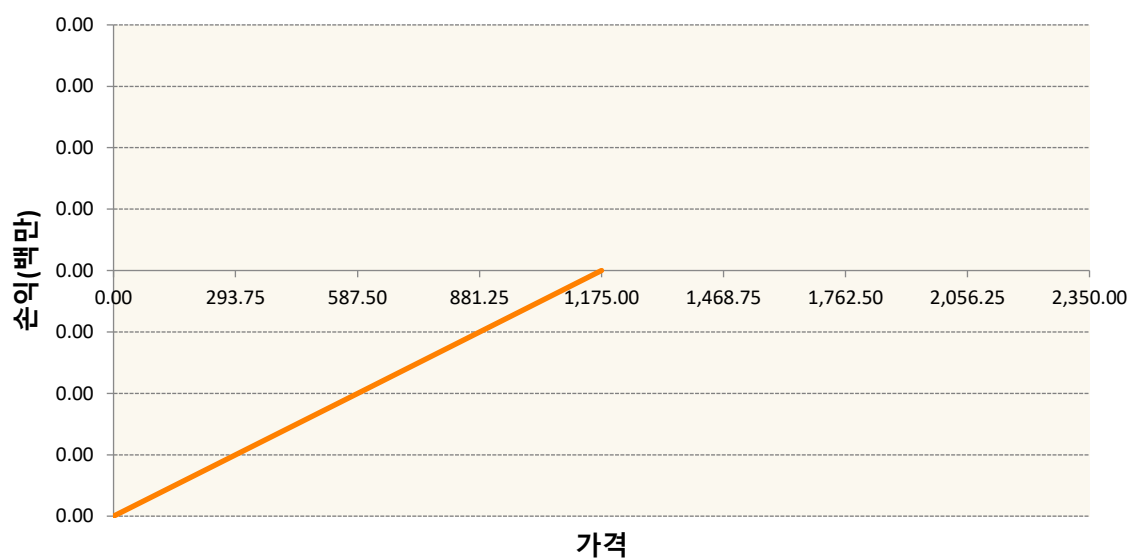
### 2. 만기시점의 손익구조



KR4B09F0A700-코스피위클리 C 2605W3 1,172.5



KR4B09F0A718-코스피위클리 C 2605W3 1.175.0



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |         |        |                    |       |        |        |
|--------------|-----------|---------|--------|--------------------|-------|--------|--------|
| KR4A01660005 |           |         |        | 2026-06 코스피200지수선물 |       |        | 589    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                 | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -589      | -589    | -589   | -589               | -589  | -589   | -589   |
| -5.33%       | -393      | -393    | -393   | -393               | -393  | -393   | -393   |
| -2.67%       | -196      | -196    | -196   | -196               | -196  | -196   | -196   |
| 0%           | 0         | 0       | 0      | 0                  | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 196       | 196     | 196    | 196                | 196   | 196    | 196    |
| 5.33%        | 393       | 393     | 393    | 393                | 393   | 393    | 393    |
| 8.00%        | 589       | 589     | 589    | 589                | 589   | 589    | 589    |
| KR4A11660003 |           |         |        | 2026-06 삼성전자개별선물   |       |        | 1,190  |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                    |       |        |        |

| 가격                                   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| -8.00%                               | -1,190  | -1,190  | -1,190 | -1,190 | -1,190 | -1,190 | -1,190 |
| -5.33%                               | -793    | -793    | -793   | -793   | -793   | -793   | -793   |
| -2.67%                               | -397    | -397    | -397   | -397   | -397   | -397   | -397   |
| 0%                                   | 0       | 0       | 0      | 0      | 0      | 0      | 0      |
| 2.67%                                | 397     | 397     | 397    | 397    | 397    | 397    | 397    |
| 5.33%                                | 793     | 793     | 793    | 793    | 793    | 793    | 793    |
| 8.00%                                | 1,190   | 1,190   | 1,190  | 1,190  | 1,190  | 1,190  | 1,190  |
| KR4B09F0A700 코스피위클리 C 2605W3 1,172.5 |         |         |        |        |        |        | 1,635  |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |        |        |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -1,608  | -1,609  | -1,612 | -1,615 | -1,620 | -1,626 | -1,635 |
| -5.33%    | -1,009  | -1,014  | -1,021 | -1,031 | -1,043 | -1,058 | -1,074 |
| -2.67%    | -428    | -443    | -461   | -482   | -506   | -531   | -558   |
| 0%        | 97      | 67      | 34     | 0      | -35    | -71    | -108   |
| 2.67%     | 513     | 471     | 429    | 386    | 344    | 302    | 260    |
| 5.33%     | 784     | 744     | 703    | 662    | 621    | 579    | 537    |
| 8.00%     | 924     | 897     | 867    | 835    | 802    | 767    | 731    |

|                                      |  |  |  |  |  |  |       |
|--------------------------------------|--|--|--|--|--|--|-------|
| KR4B09F0A718 코스피위클리 C 2605W3 1,175.0 |  |  |  |  |  |  | 1,069 |
|--------------------------------------|--|--|--|--|--|--|-------|

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |        |        |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%     | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | -1,054  | -1,054  | -1,055 | -1,057 | -1,060 | -1,064 | -1,069 |
| -5.33%    | -663    | -666    | -671   | -677   | -684   | -693   | -703   |
| -2.67%    | -284    | -294    | -305   | -318   | -332   | -348   | -365   |
| 0%        | 61      | 42      | 22     | 0      | -22    | -45    | -69    |
| 2.67%     | 338     | 311     | 284    | 257    | 229    | 202    | 175    |
| 5.33%     | 522     | 496     | 469    | 442    | 415    | 388    | 360    |
| 8.00%     | 620     | 601     | 581    | 559    | 537    | 514    | 490    |

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

(단위:백만원)

9,651

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

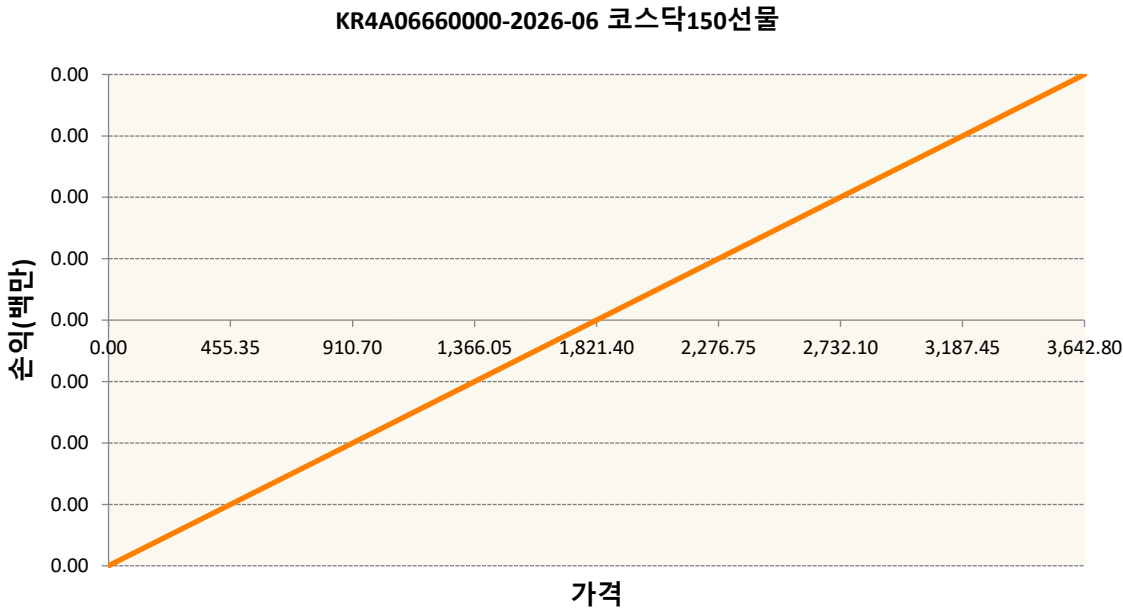
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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   | 1,056 | 0     | 1,056     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

| KR4A06660000 |           |         | 2026-06 코스닥150선물 |     |       |        | 85     |
|--------------|-----------|---------|------------------|-----|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                  |     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%           | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -85       | -85     | -85              | -85 | -85   | -85    | -85    |
| -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%        | 85        | 85      | 85               | 85  | 85    | 85     | 85     |



|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

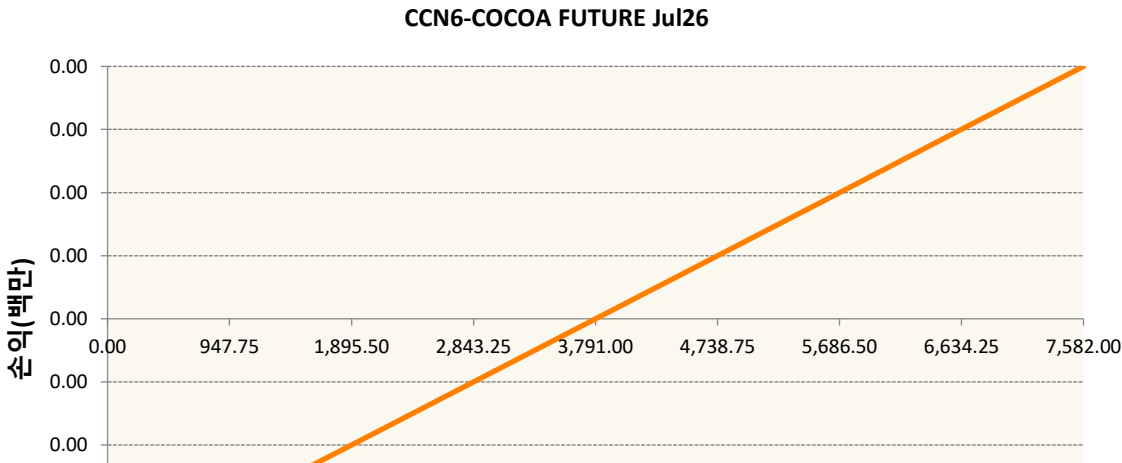
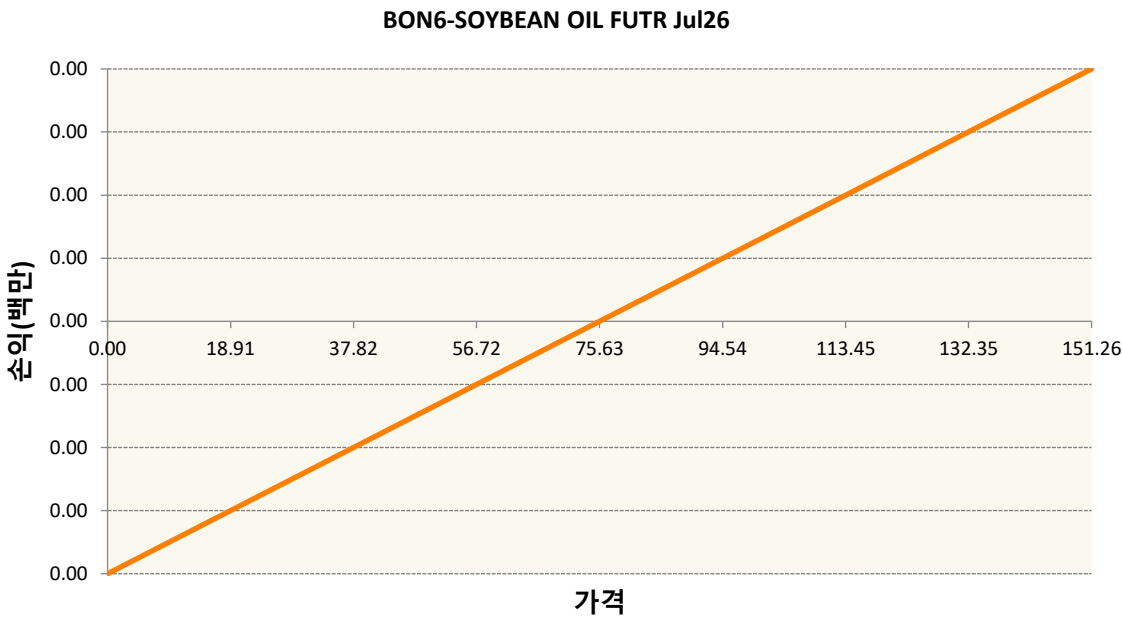
## 포커스농산물모(채권-파생형)

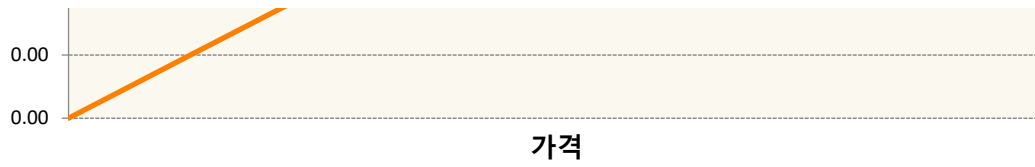
### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

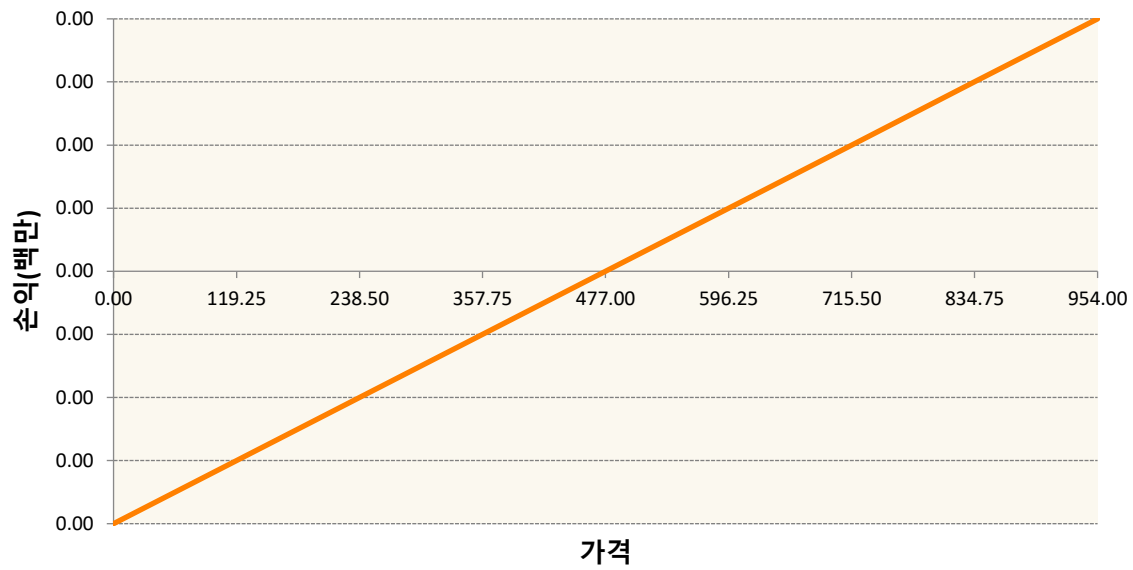
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 실물자산 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 신규 | 통화   | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 114   | 0     | 114       |    |
| 누계 | 실물자산 | 선물   | 839   | 0     | 839       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,994 | 0     | 1,994     |    |
| 누계 | 통화   | 선물   | 0     | 391   | -391      | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조

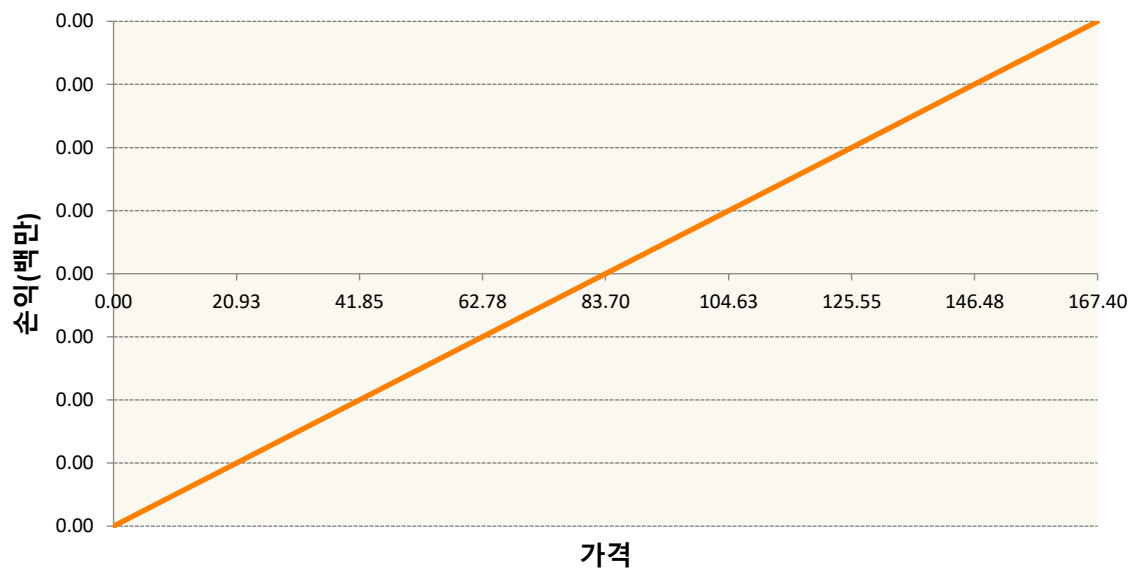




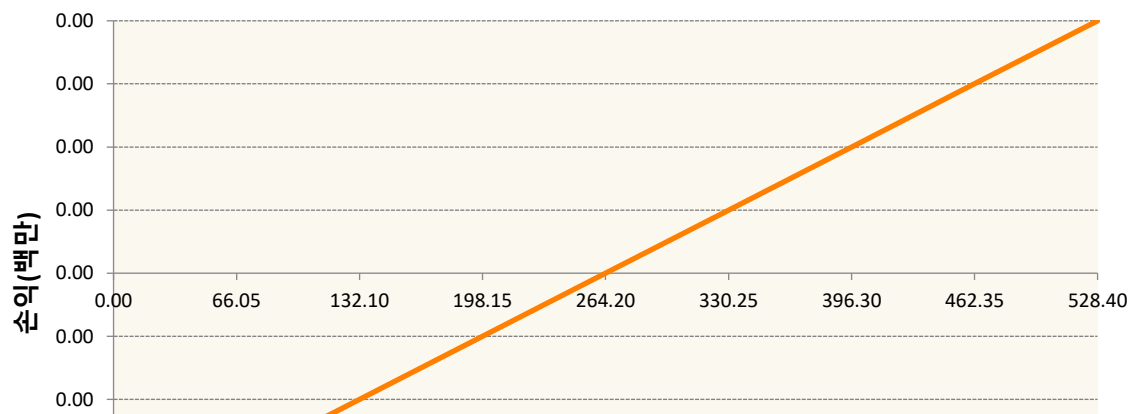
CN6-CORN FUTURE Jul26

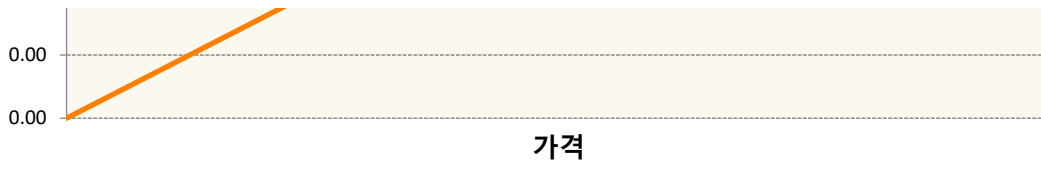


CTN6-COTTON NO.2 FUTR Jul26

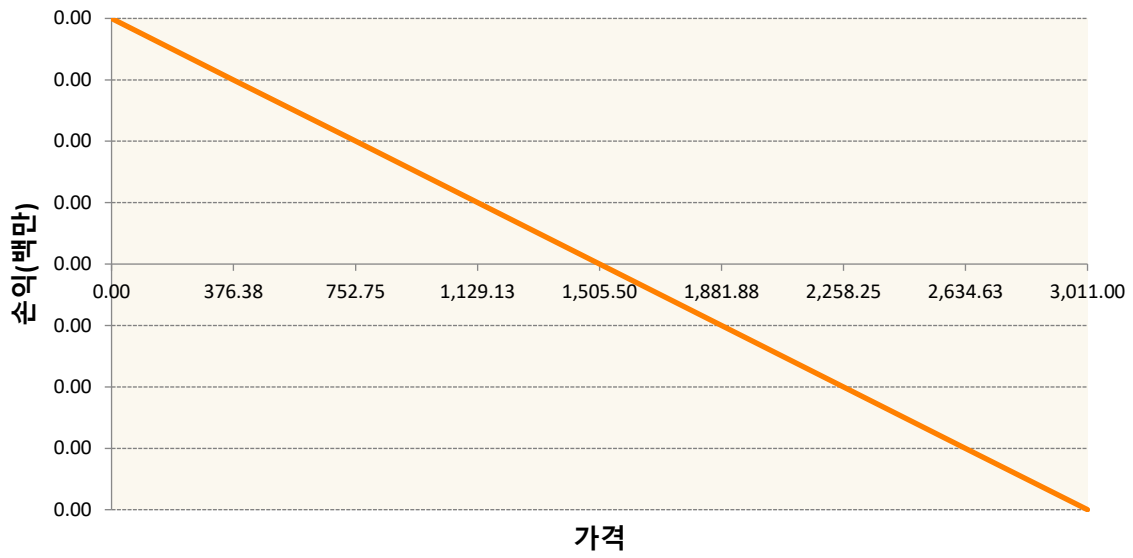


KCN6-COFFEE 'C' FUTURE Jul26

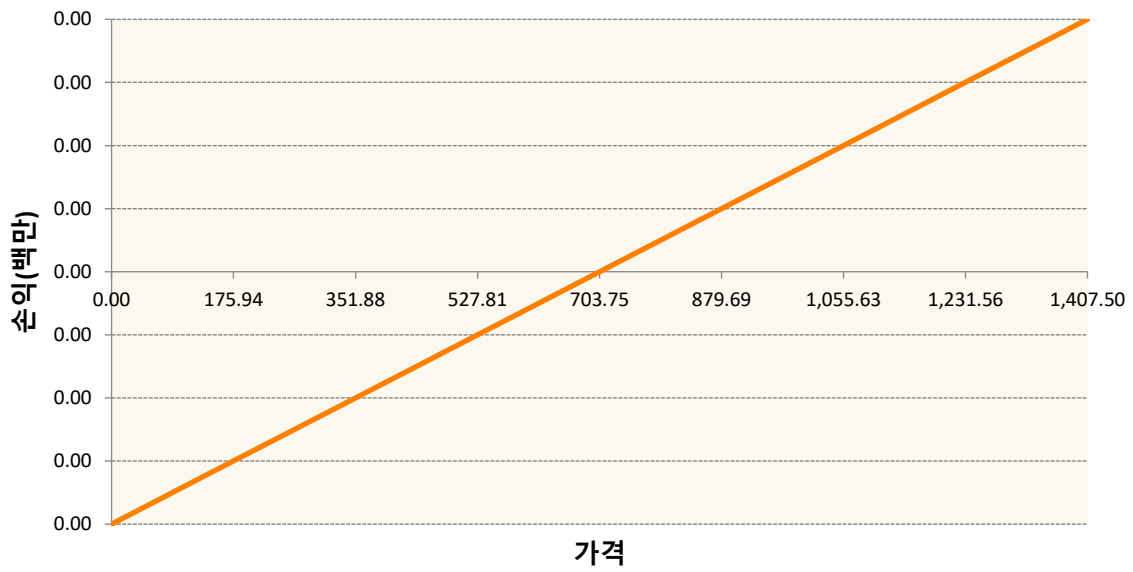




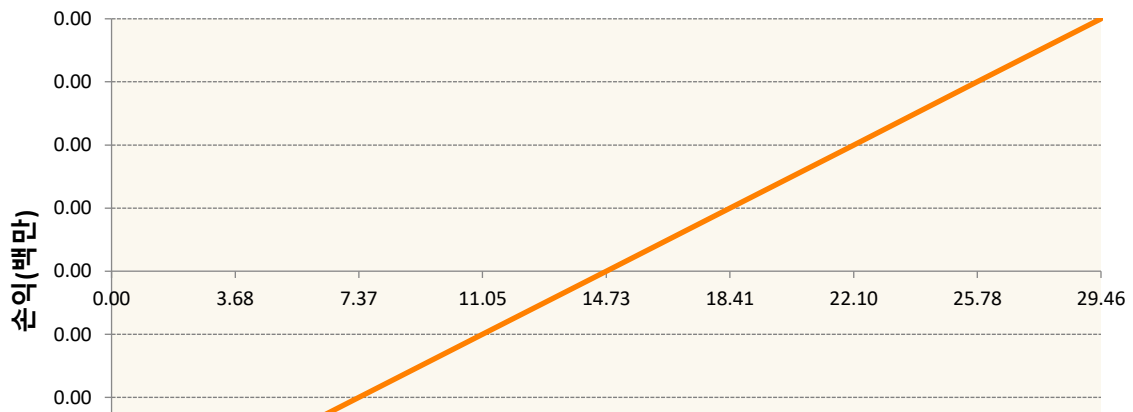
KR4A75660006-2026-06 달러선물

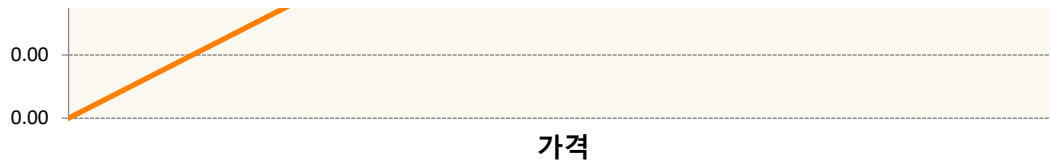


KWN6-KC HRW WHEAT FUT Jul26

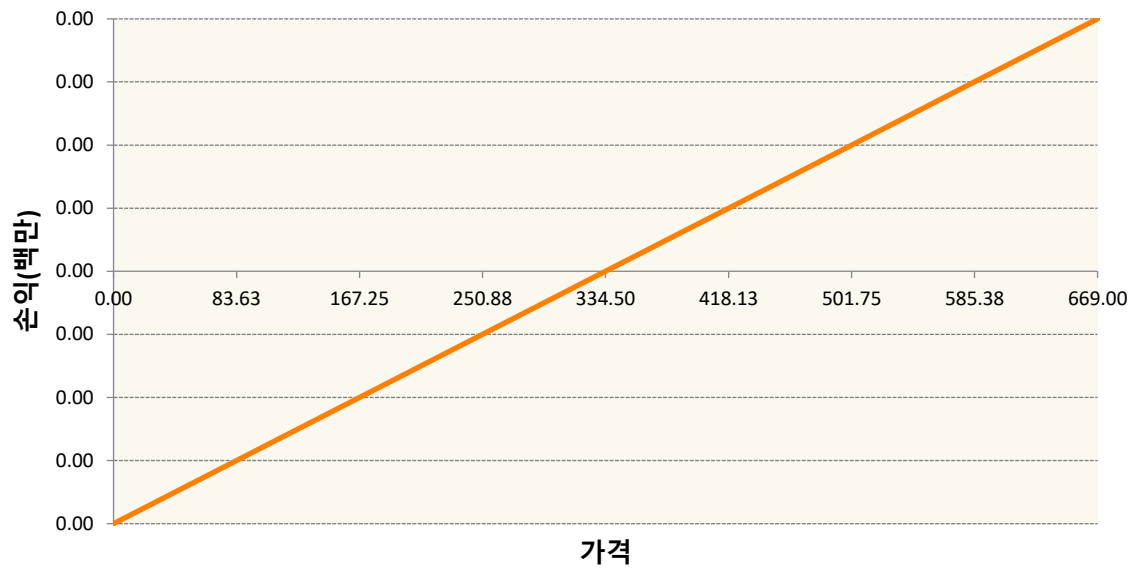


SBN6-Sugar #11 (WORLD) Jul26

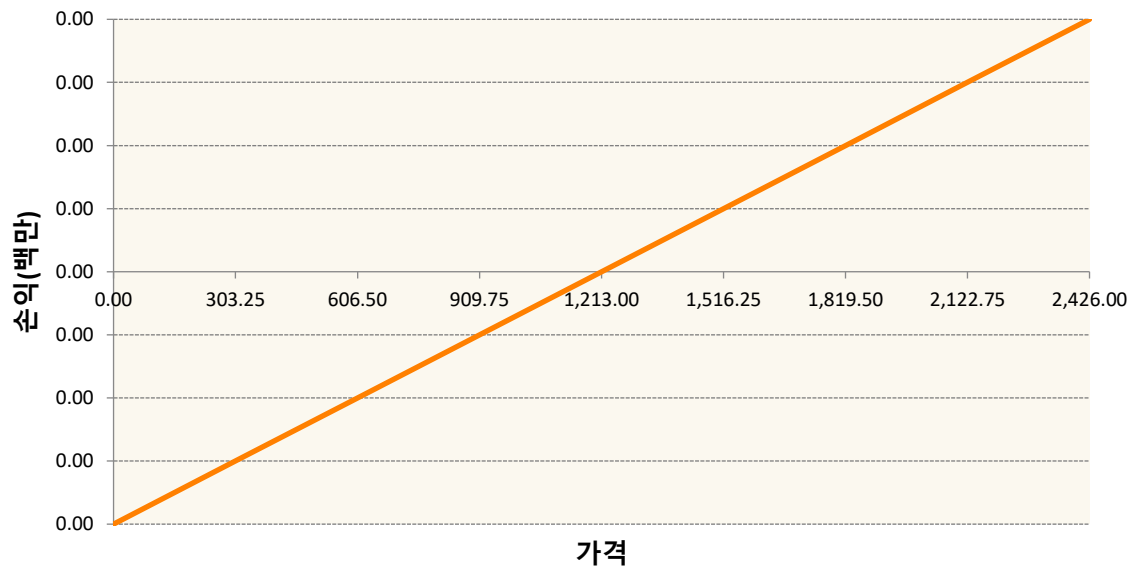




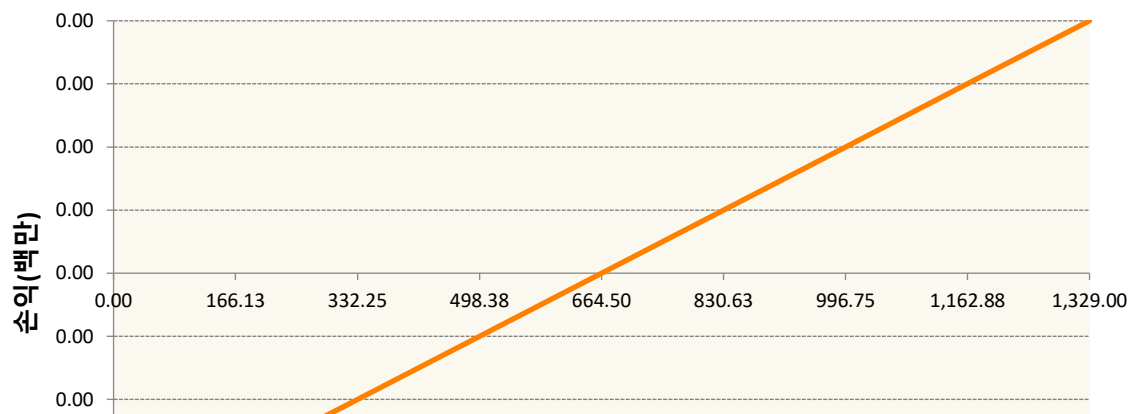
SMN6-SOYBEAN MEAL FUTR Jul26

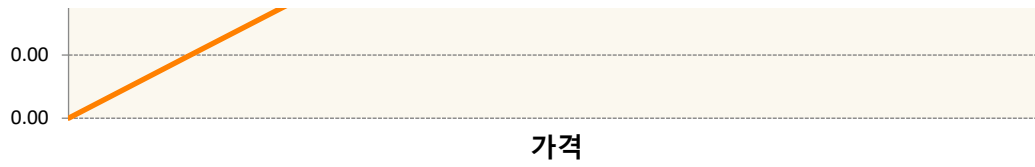


SN6-SOYBEAN FUTURE Jul26



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 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

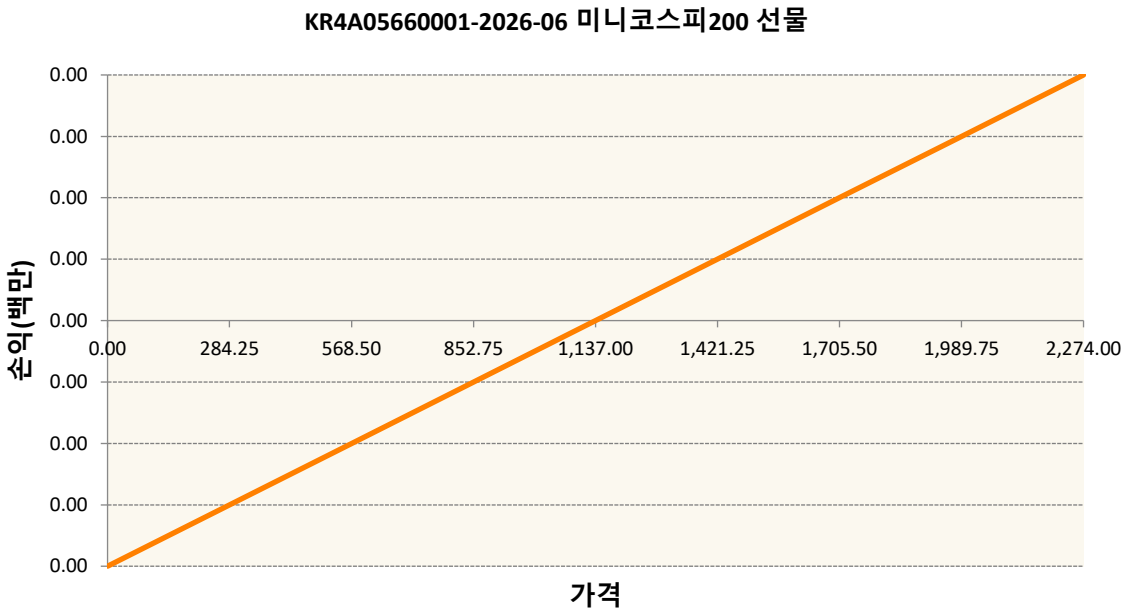
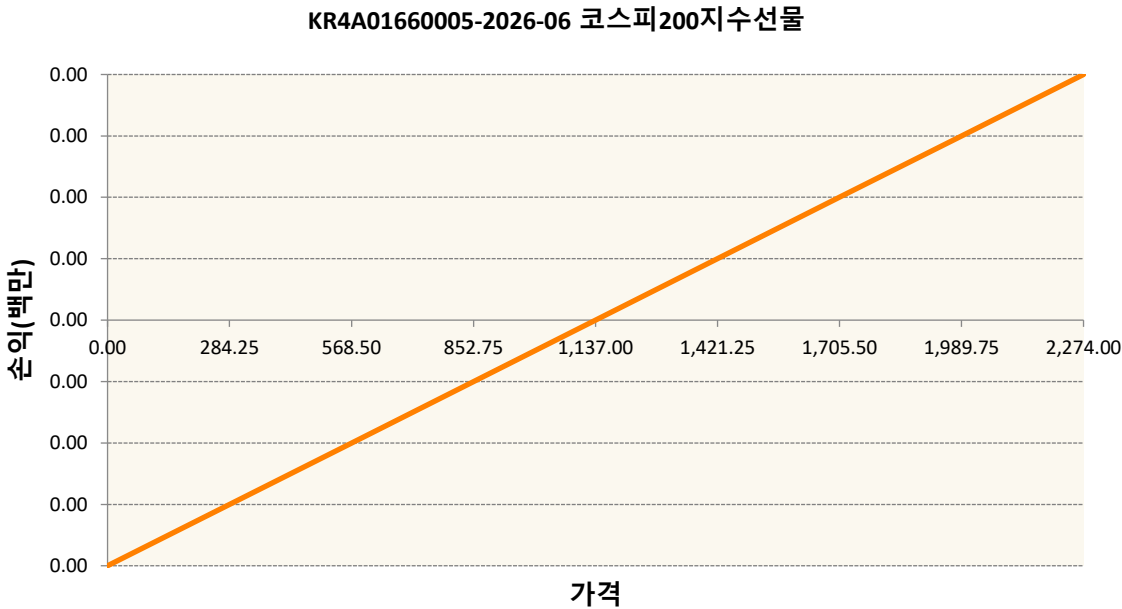
## 스마트인덱스모

### 1. 계약금액

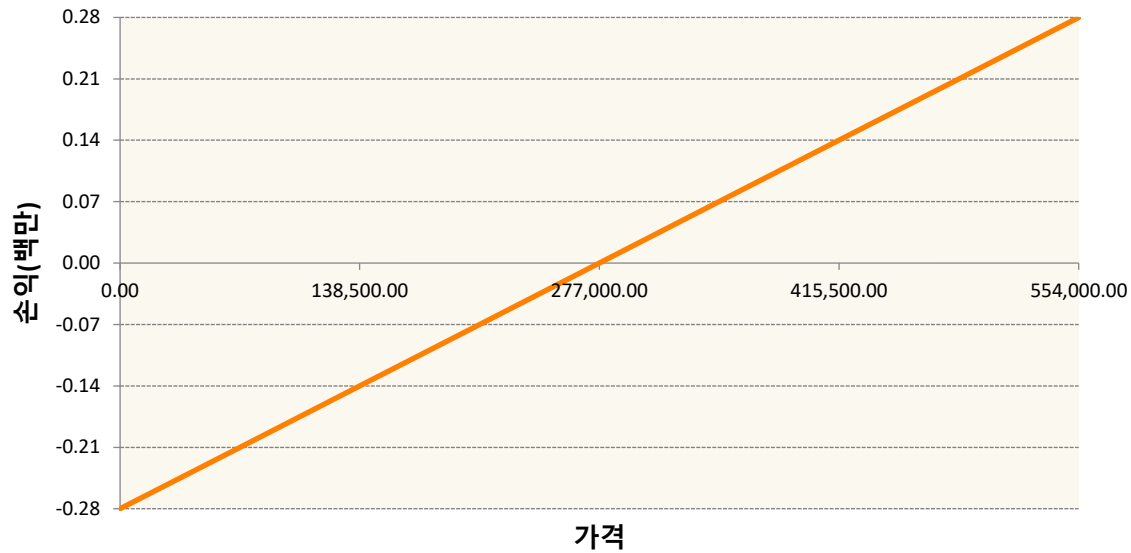
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 578   | 0     | 578       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 3,972 | 0     | 3,972     | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### KR4A11660003-2026-06 삼성전자개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

| KR4A01660005 |           |         | 2026-06 코스피200지수선물  |      |       |        | 249    |
|--------------|-----------|---------|---------------------|------|-------|--------|--------|
|              | 기초자산의 변동성 |         |                     |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%              | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -249      | -249    | -249                | -249 | -249  | -249   | -249   |
| -5.33%       | -166      | -166    | -166                | -166 | -166  | -166   | -166   |
| -2.67%       | -83       | -83     | -83                 | -83  | -83   | -83    | -83    |
| 0%           | 0         | 0       | 0                   | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%        | 83        | 83      | 83                  | 83   | 83    | 83     | 83     |
| 5.33%        | 166       | 166     | 166                 | 166  | 166   | 166    | 166    |
| 8.00%        | 249       | 249     | 249                 | 249  | 249   | 249    | 249    |
| KR4A05660001 |           |         | 2026-06 미니코스피200 선물 |      |       |        | 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      |
| KR4A11660003 |           |         | 2026-06 삼성전자개별선물    |      |       |        | 22     |
|              | 기초자산의 변동성 |         |                     |      |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33%              | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -22       | -22     | -22                 | -22  | -22   | -22    | -22    |
| -5.33%       | -15       | -15     | -15                 | -15  | -15   | -15    | -15    |
| -2.67%       | -7        | -7      | -7                  | -7   | -7    | -7     | -7     |
| 0%           | 0         | 0       | 0                   | 0    | 0     | 0      | 0      |

|       |    |    |    |    |    |    |    |
|-------|----|----|----|----|----|----|----|
| 2.67% | 7  | 7  | 7  | 7  | 7  | 7  | 7  |
| 5.33% | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 | 15 |
| 8.00% | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 | 22 |

|                                        |  |  |  |  |  |          |
|----------------------------------------|--|--|--|--|--|----------|
| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  |  |  |  |  | (단위:백만원) |
|                                        |  |  |  |  |  | 642      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

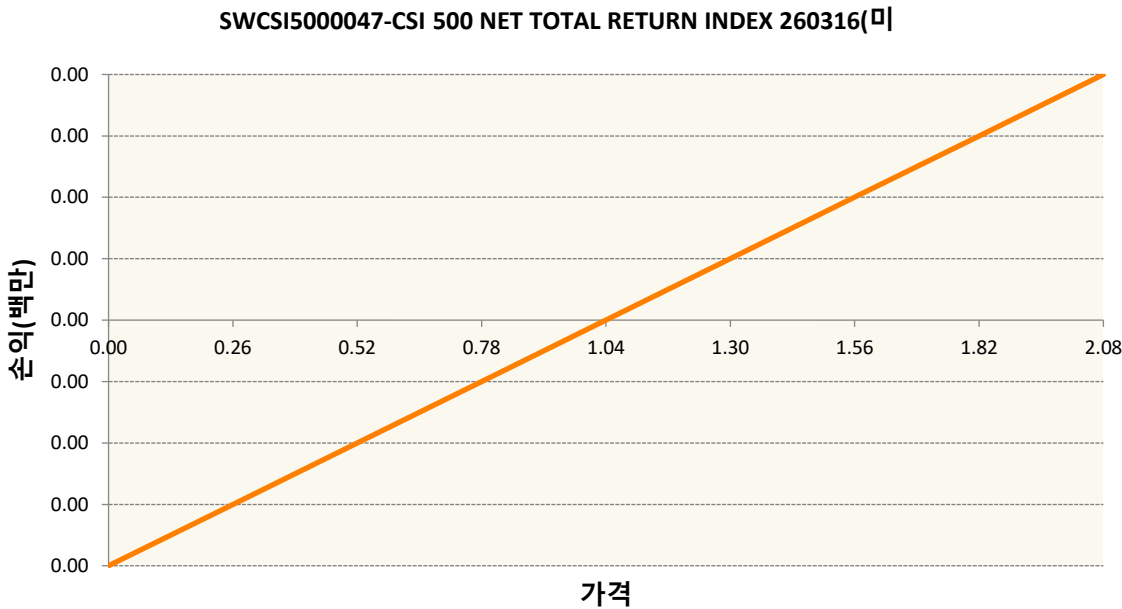
## SOL차이나강소기업CSI500상장

### 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   | 5,869 | 0     | 5,869     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260316(미

468

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

587

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

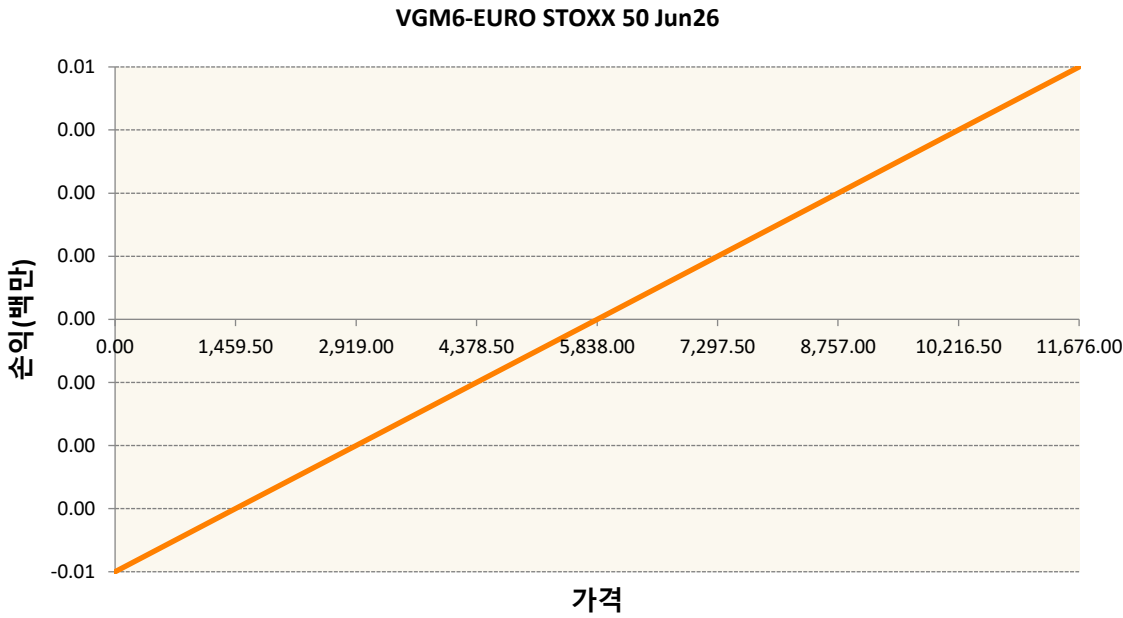
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 900   | 0     | 900       |    |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |    |
|------|---------------------|----|
| VGM6 | EURO STOXX 50 Jun26 | 72 |
|------|---------------------|----|

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

(단위:백만원)

|    |
|----|
| 64 |
|----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

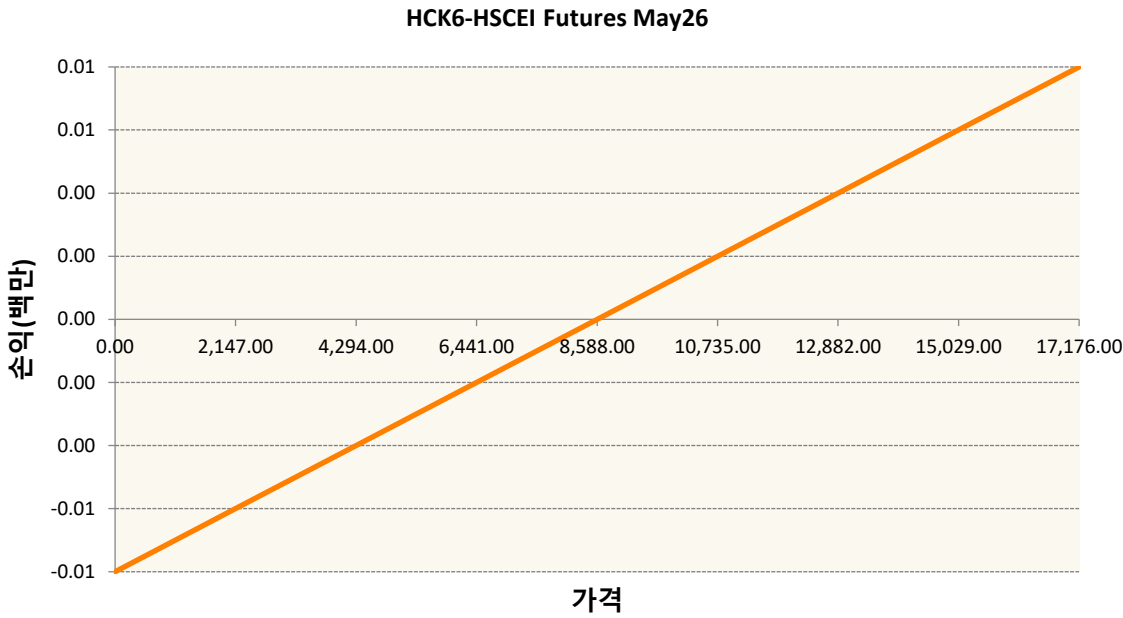
차이나인덱스모(주식-파생형)

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   | 1,533 | 0     | 1,533     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|      |                     |     |
|------|---------------------|-----|
| HCK6 | HSCEI Futures May26 | 123 |
|------|---------------------|-----|

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 147 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

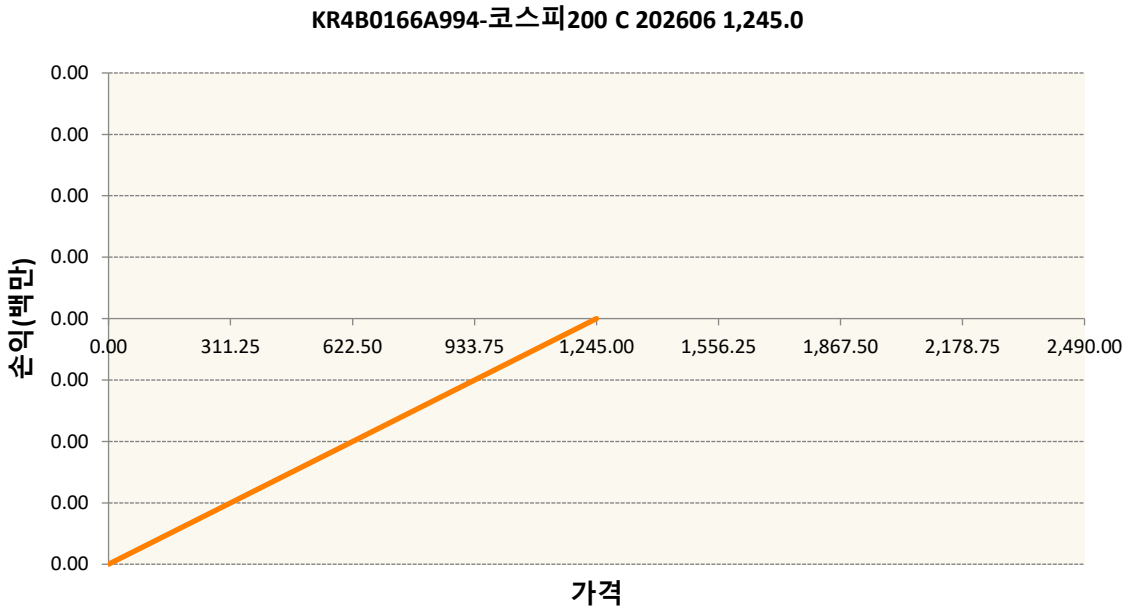
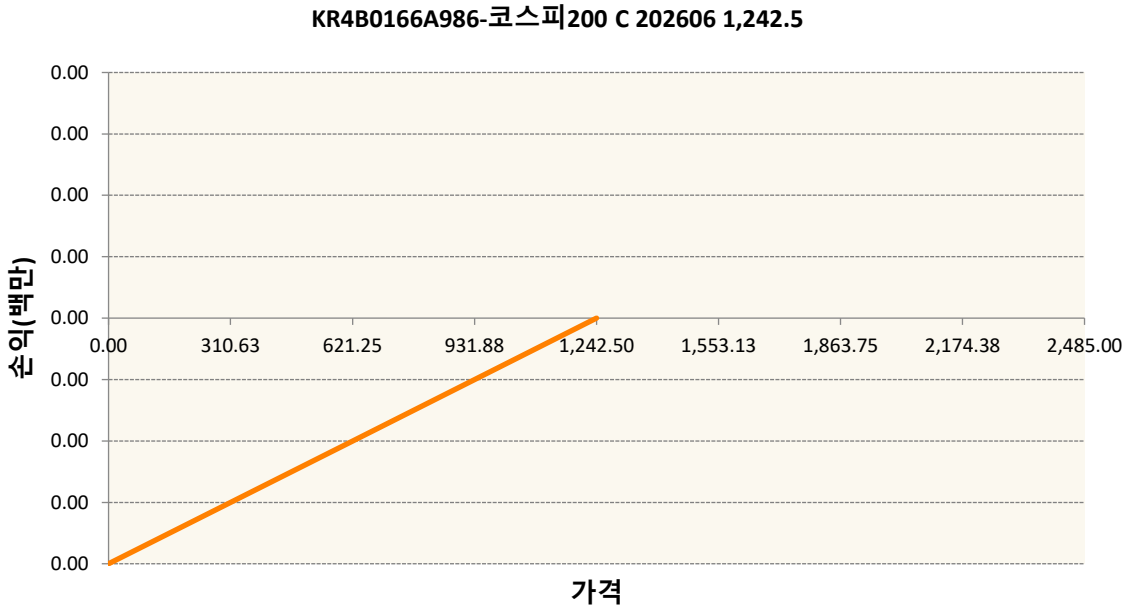
## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

### 1. 계약금액

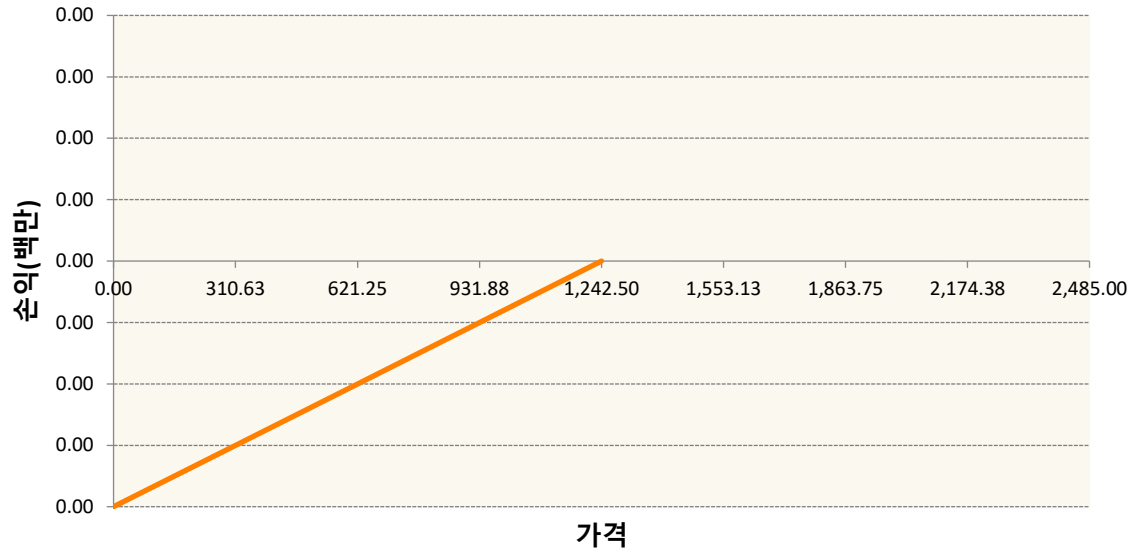
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 옵션   | 0     | 39,176 | -39,176   | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조



KR4C0166A984-코스피200 P 202606 1,242.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                                      |         |         |        |      |        |        |        |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|------|--------|--------|--------|
| KR4B0166A986 코스피200 C 202606 1,242.5 |         |         |        |      |        |        | 829    |
| 기초자산의 변동성                            |         |         |        |      |        |        |        |
| 가격                                   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                               | -556    | -591    | -632   | -677 | -725   | -776   | -829   |
| -5.33%                               | -290    | -335    | -384   | -436 | -491   | -549   | -608   |
| -2.67%                               | -40     | -94     | -151   | -210 | -272   | -335   | -399   |
| 0%                                   | 192     | 130     | 66     | 0    | -67    | -135   | -204   |
| 2.67%                                | 405     | 336     | 265    | 194  | 122    | 50     | -23    |
| 5.33%                                | 596     | 522     | 447    | 371  | 296    | 220    | 145    |
| 8.00%                                | 766     | 688     | 610    | 532  | 455    | 377    | 299    |
| KR4B0166A994 코스피200 C 202606 1,245.0 |         |         |        |      |        |        | 1,216  |
| 기초자산의 변동성                            |         |         |        |      |        |        |        |
| 가격                                   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                               | -820    | -872    | -931   | -995 | -1,065 | -1,139 | -1,216 |
| -5.33%                               | -430    | -495    | -566   | -642 | -722   | -805   | -891   |
| -2.67%                               | -62     | -140    | -223   | -310 | -399   | -491   | -585   |
| 0%                                   | 280     | 189     | 96     | 0    | -98    | -197   | -298   |
| 2.67%                                | 593     | 492     | 390    | 286  | 181    | 75     | -31    |
| 5.33%                                | 875     | 767     | 657    | 547  | 437    | 327    | 216    |
| 8.00%                                | 1,126   | 1,012   | 899    | 785  | 671    | 557    | 443    |
| KR4C0166A984 코스피200 P 202606 1,242.5 |         |         |        |      |        |        | 505    |
| 기초자산의 변동성                            |         |         |        |      |        |        |        |
| 가격                                   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33%  | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                               | -339    | -361    | -385   | -413 | -442   | -473   | -505   |
| -5.33%                               | -177    | -204    | -234   | -266 | -300   | -334   | -370   |
| -2.67%                               | -24     | -57     | -92    | -128 | -166   | -204   | -243   |
| 0%                                   | 117     | 79      | 40     | 0    | -41    | -83    | -125   |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | 247 | 205 | 162 | 118 | 74  | 30  | -14 |
| 5.33% | 363 | 318 | 272 | 227 | 181 | 134 | 88  |
| 8.00% | 467 | 419 | 372 | 325 | 277 | 230 | 182 |

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

(단위:백만원)

3,969

공시일 2026-05-20

기준일 2026-05-19

## 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 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

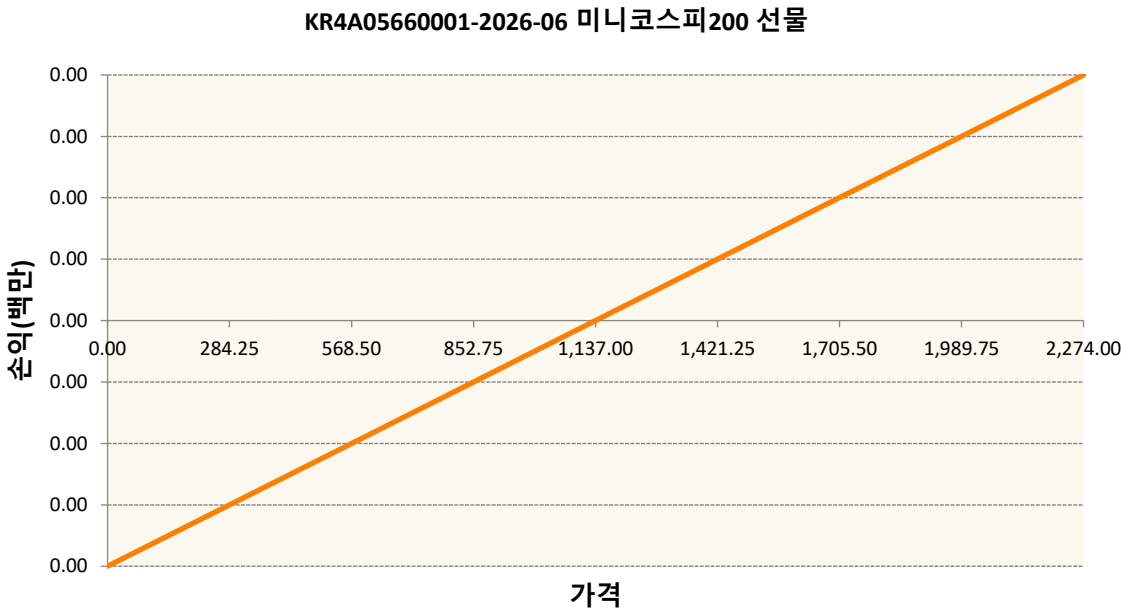
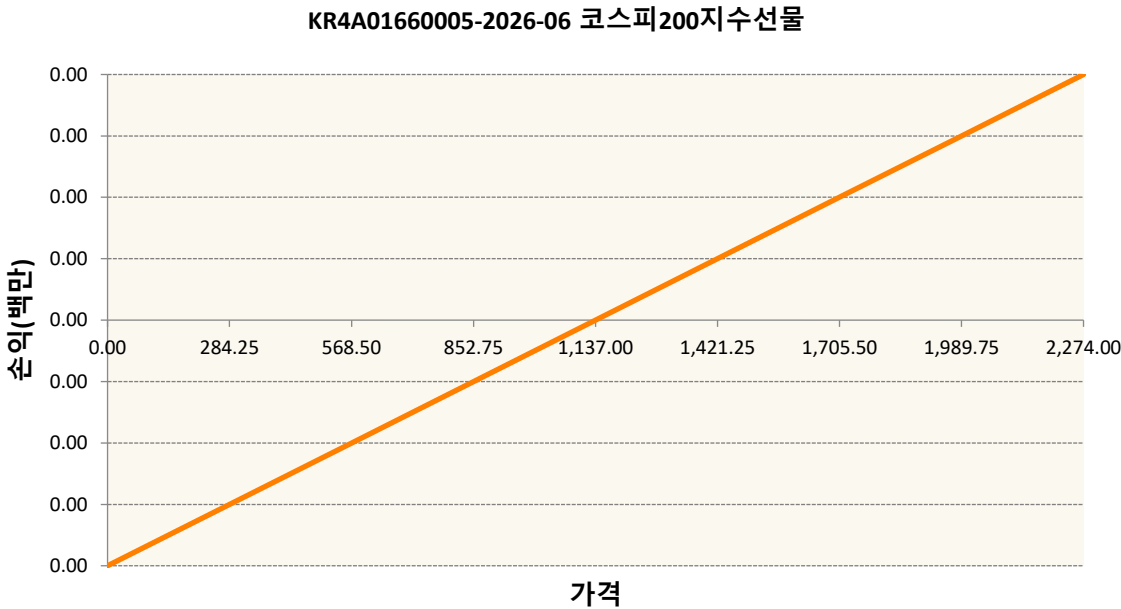
## 스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

### 1. 계약금액

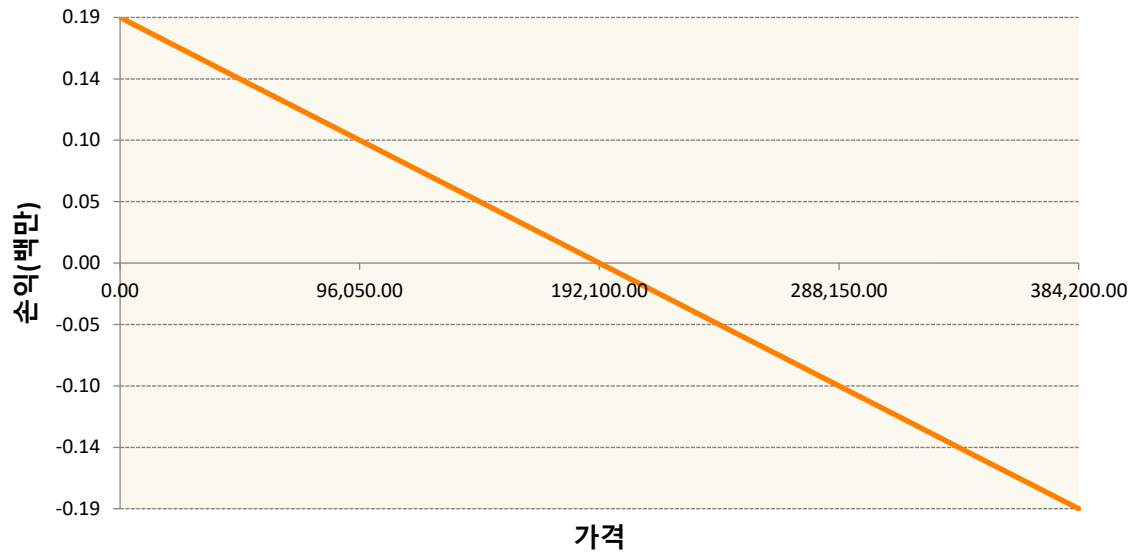
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 575   | 104   | 471       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 2,983 | 100   | 2,883     | 장내 |

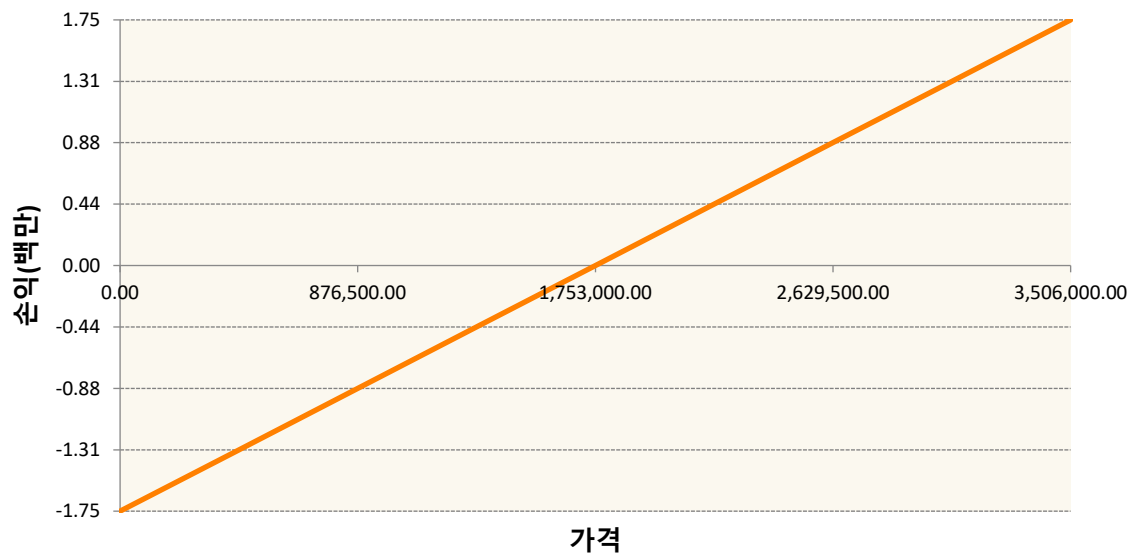
### 2. 만기시점의 손익구조



KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |           |         |        |                     |       |        |        |
|--------------|-----------|---------|--------|---------------------|-------|--------|--------|
| KR4A01660005 |           |         |        | 2026-06 코스피200지수선물  |       |        | 113    |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                     |       |        |        |
| 가격           | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%                  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%       | -113      | -113    | -113   | -113                | -113  | -113   | -113   |
| -5.33%       | -75       | -75     | -75    | -75                 | -75   | -75    | -75    |
| -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%        | 75        | 75      | 75     | 75                  | 75    | 75     | 75     |
| 8.00%        | 113       | 113     | 113    | 113                 | 113   | 113    | 113    |
| KR4A05660001 |           |         |        | 2026-06 미니코스피200 선물 |       |        | 23     |
|              | 기초자산의 변동성 |         |        |                     |       |        |        |

| 가격                                 | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|------------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| -8.00%                             | -23     | -23     | -23    | -23 | -23   | -23    | -23    |
| -5.33%                             | -15     | -15     | -15    | -15 | -15   | -15    | -15    |
| -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%                              | 15      | 15      | 15     | 15  | 15    | 15     | 15     |
| 8.00%                              | 23      | 23      | 23     | 23  | 23    | 23     | 23     |
| KR4A24660008      2026-06 LG전자개별선물 |         |         |        |     |       |        | 8      |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 8       | 8       | 8      | 8  | 8     | 8      | 8      |
| -5.33%    | 5       | 5       | 5      | 5  | 5     | 5      | 5      |
| -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%     | -5      | -5      | -5     | -5 | -5    | -5     | -5     |
| 8.00%     | -8      | -8      | -8     | -8 | -8    | -8     | -8     |

| KR4A50660005      2026-06 SK하이닉스개별선물 |         |         |        |     |       |        | 11     |
|--------------------------------------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 기초자산의 변동성                            |         |         |        |     |       |        |        |
| 가격                                   | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%                               | -11     | -11     | -11    | -11 | -11   | -11    | -11    |
| -5.33%                               | -7      | -7      | -7     | -7  | -7    | -7     | -7     |
| -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%                                | 7       | 7       | 7      | 7   | 7     | 7      | 7      |
| 8.00%                                | 11      | 11      | 11     | 11  | 11    | 11     | 11     |

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

(단위:백만원)

355

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

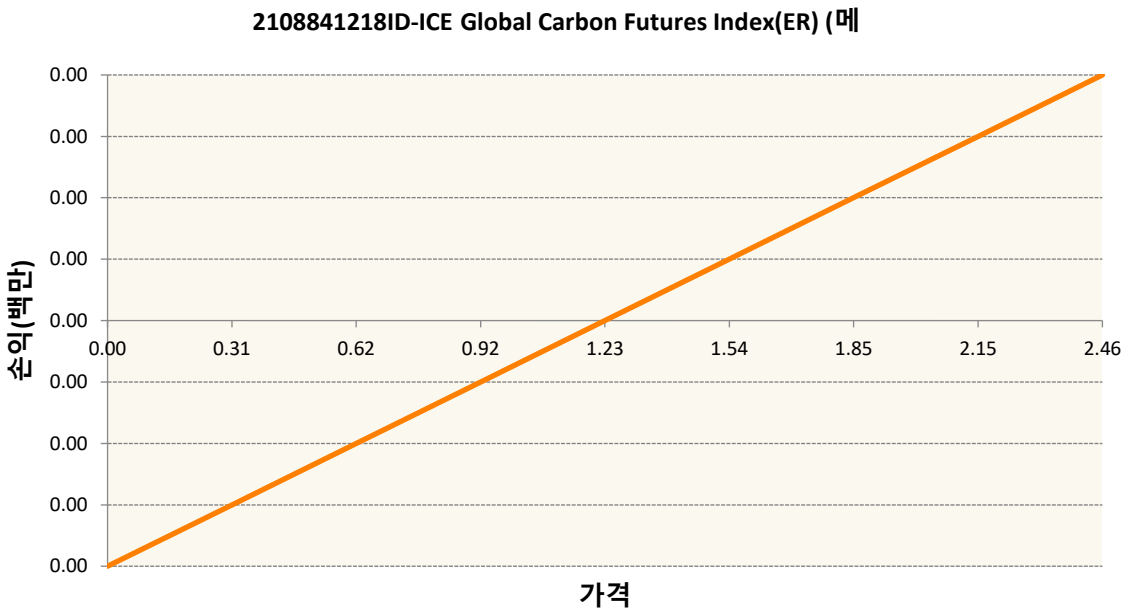
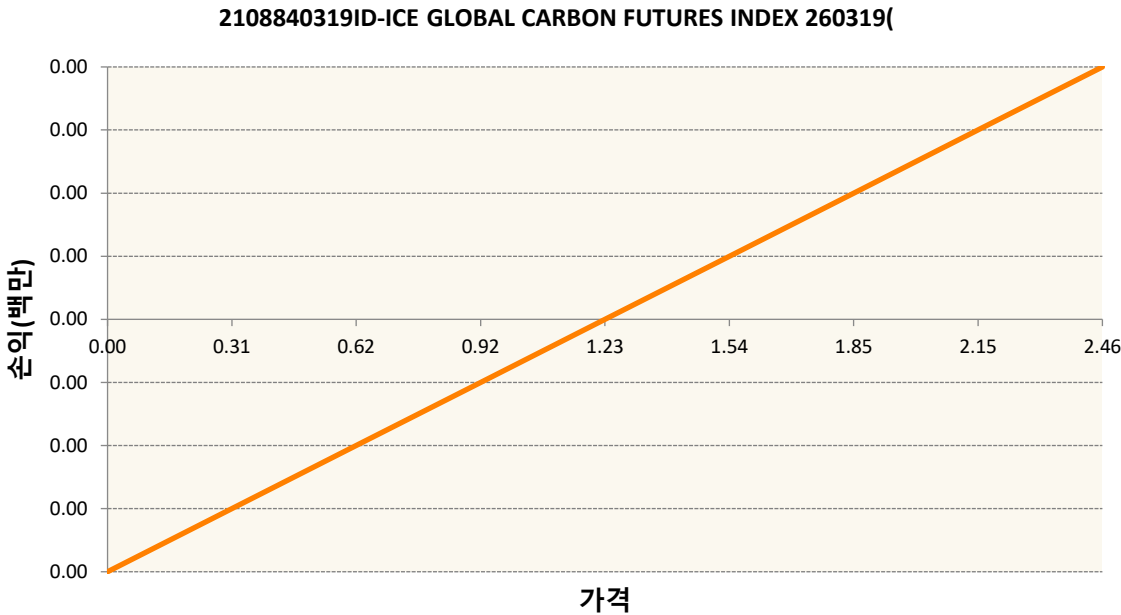
## SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

### 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   | 7,068 | 0     | 7,068     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                          |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------------|--|----------|
| 2108840319IICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260319( |  | 451      |
| 2108841218IICE Global Carbon Futures Index(ER) (메  |  | 113      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 646      |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

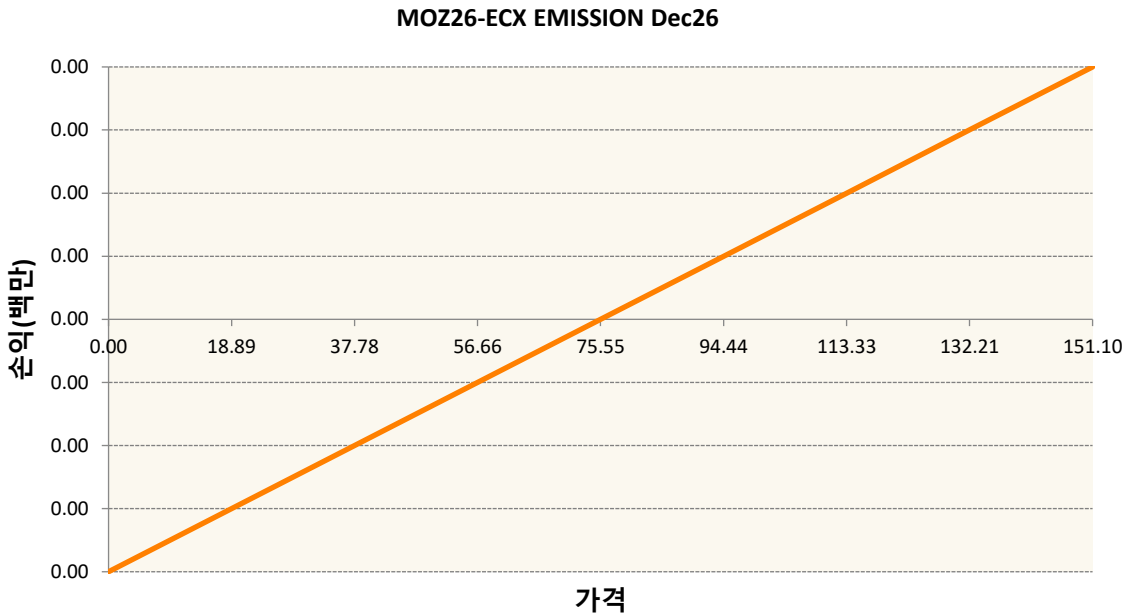
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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 |      |      | 4,867 | 0     | 4,867     |    |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 2,394 | -2,394    | 장외 |

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|                             |     |
|-----------------------------|-----|
| FXW213G4W KRW/EUR 29-05-26E | 192 |
| MOZ26 ECX EMISSION Dec26    | 389 |

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

(단위:백만원)

|     |
|-----|
| 665 |
|-----|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

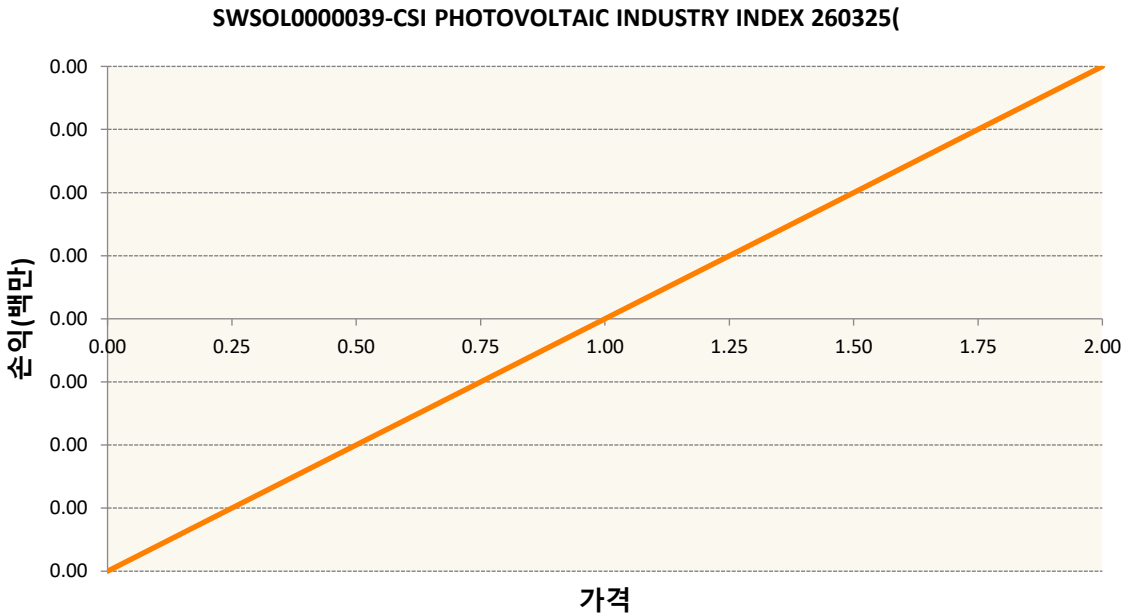
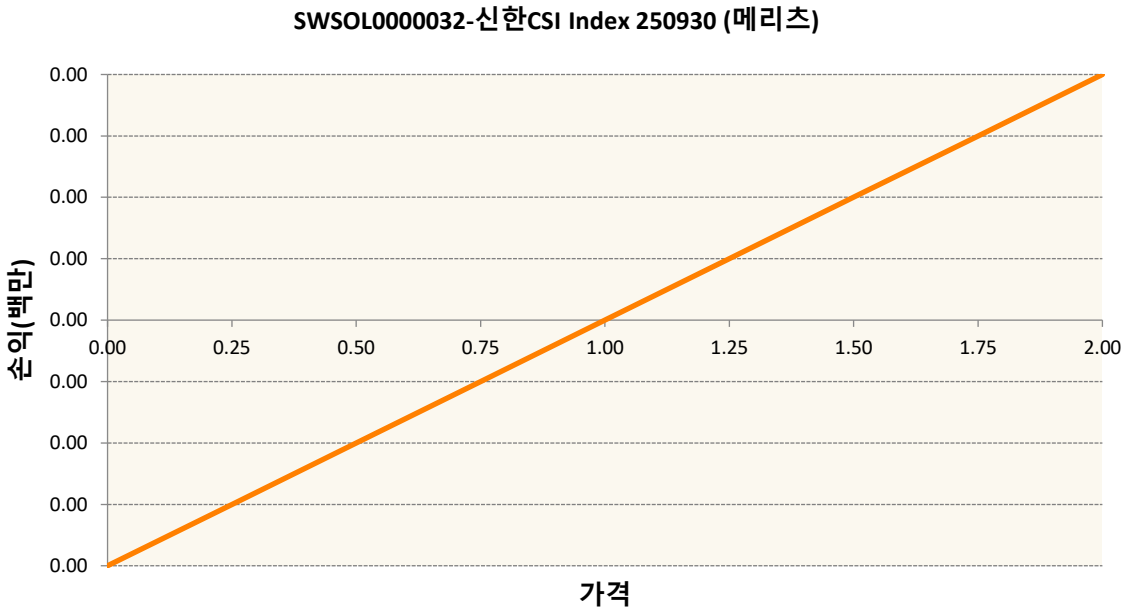
## 신한SOL차이나태양광CSI증권상장

### 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   | 1,971 | 0     | 1,971     | 장외 |

### 2. 만기시점의 손익구조



| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)                          |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------------------|--|----------|
| SWCSI00000 신한CSI Index 250620 (미래)                 |  | 0.03     |
| SWSOL00000(CSI Photovoltaic Industry Index (PR)    |  | 0.02     |
| SWSOL00000( 신한CSI Index 250930 (메리츠)               |  | 0.05     |
| SWSOL00000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325( |  | 0.05     |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) |  | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|--|----------|
|                                        |  | 0        |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

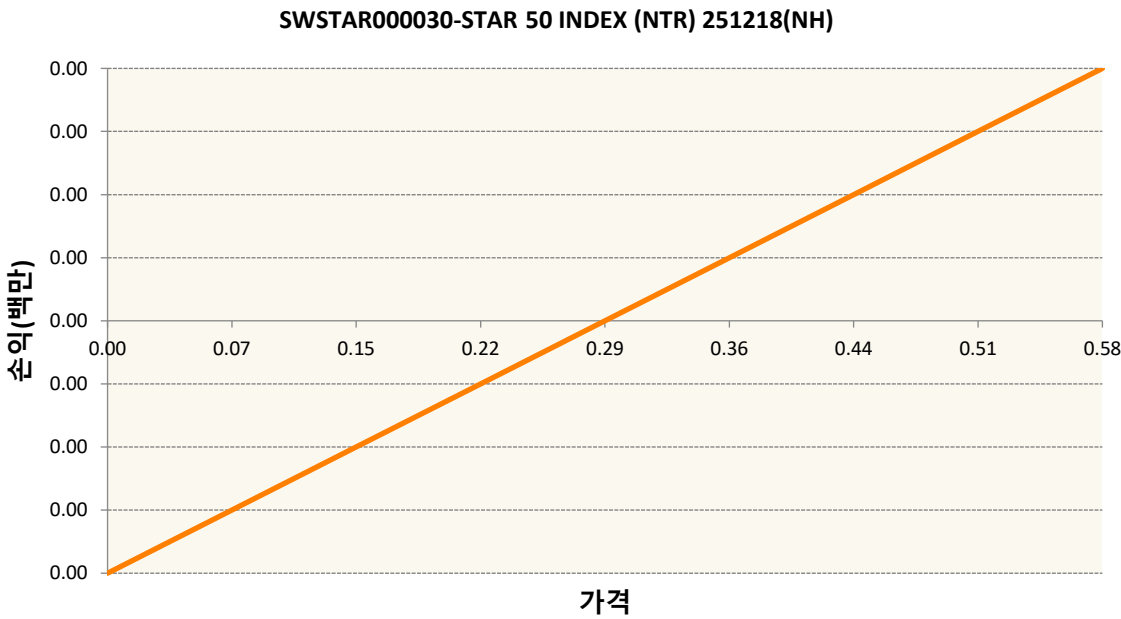
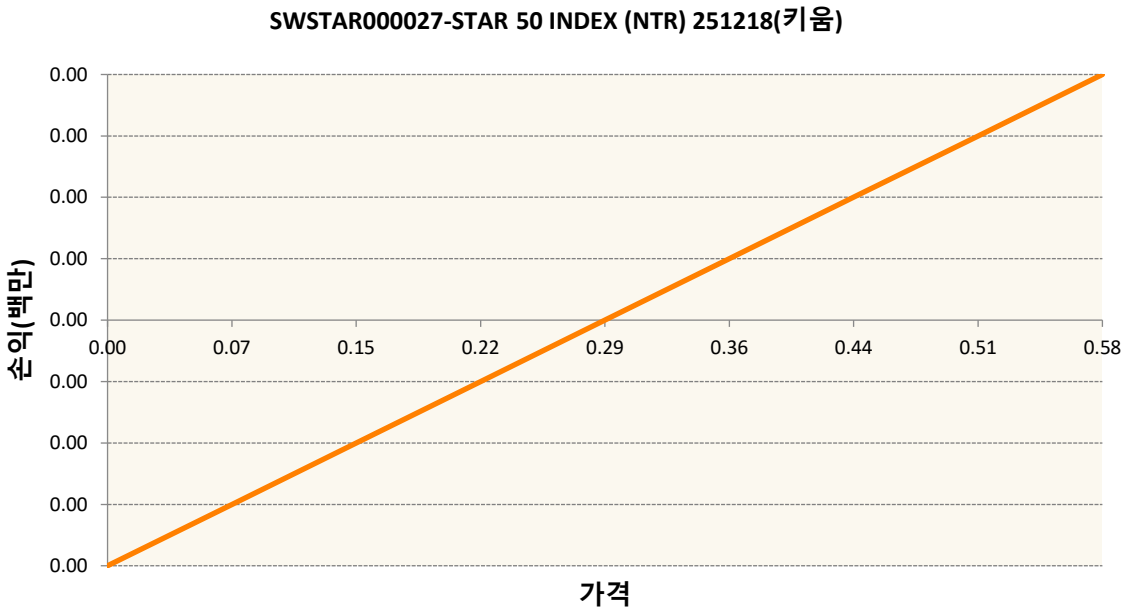
# SOL차이나육성산업액티브상장지

## 1. 계약금액

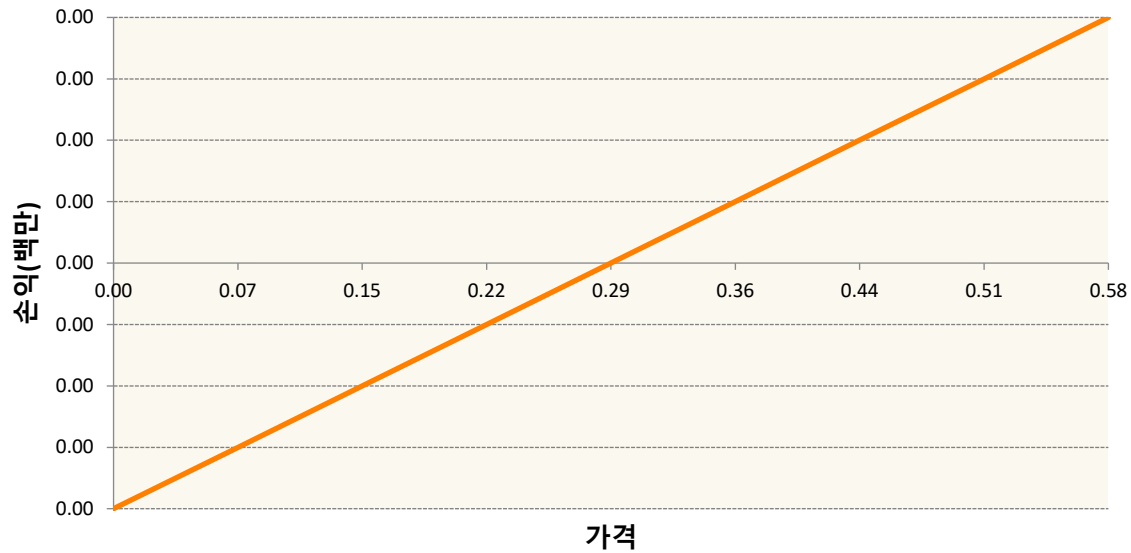
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 7,335 | 0     | 7,335     | 장외 |

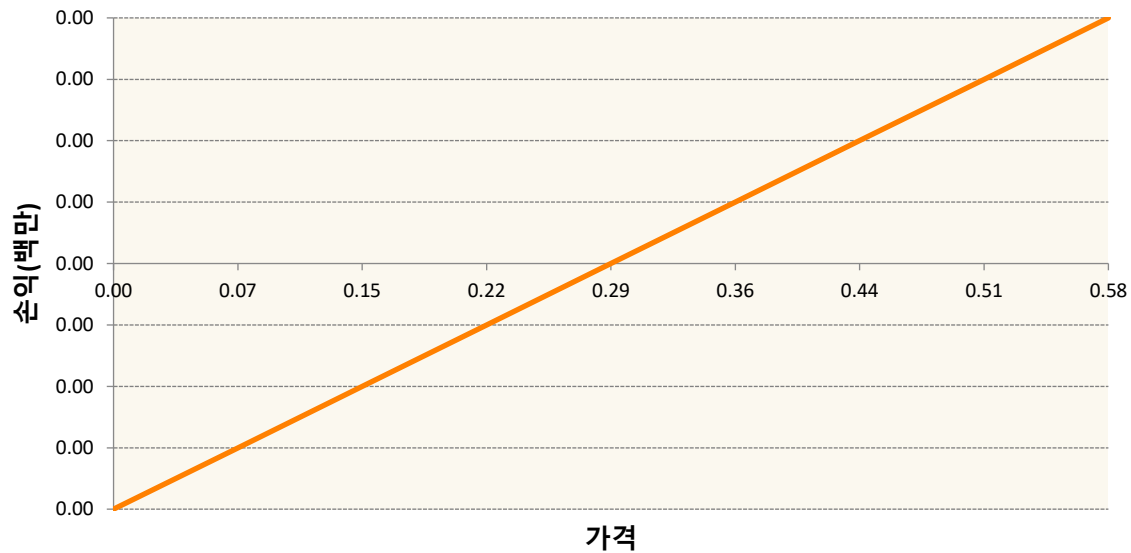
## 2. 만기시점의 손익구조



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)  
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)  
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260107(메리츠)  
 SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260319(미래)

|     |
|-----|
| 21  |
| 71  |
| 364 |
| 135 |

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

(단위:백만원)

892

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

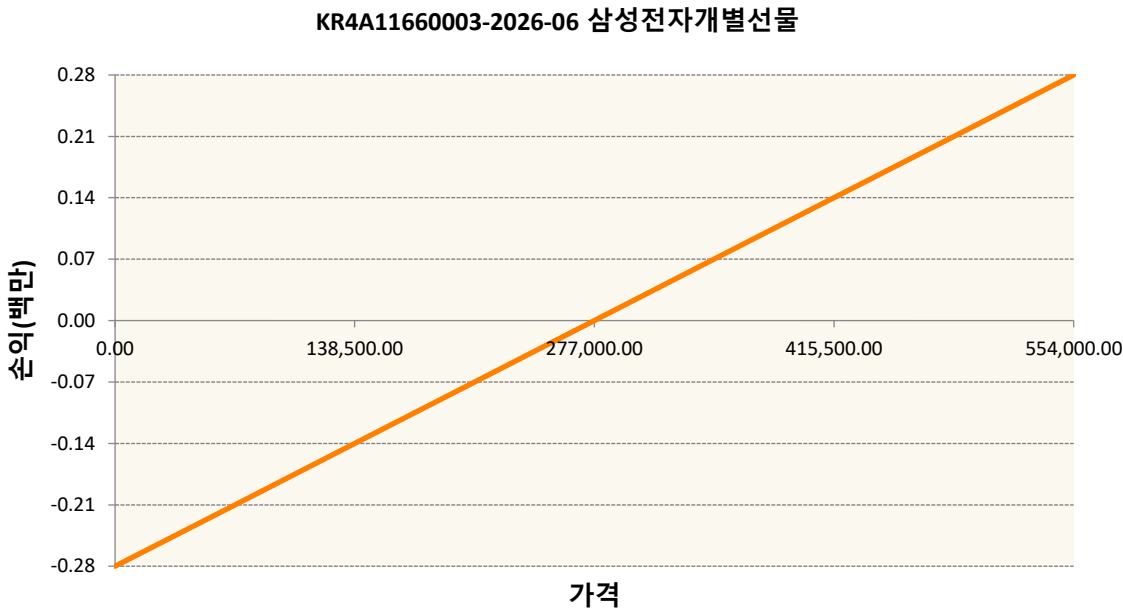
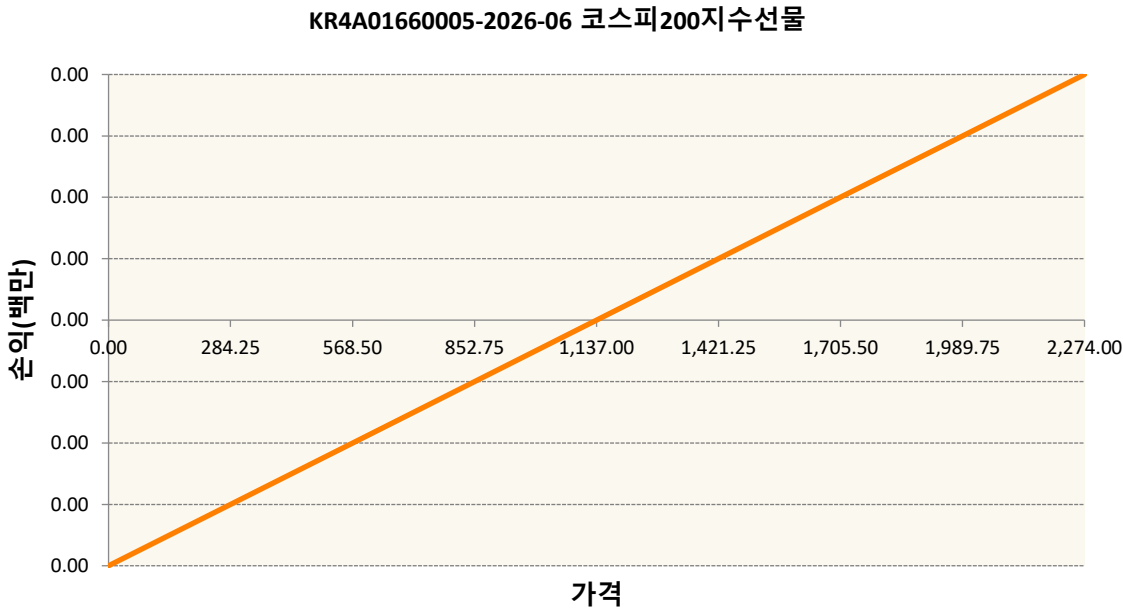
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

1. 계약금액

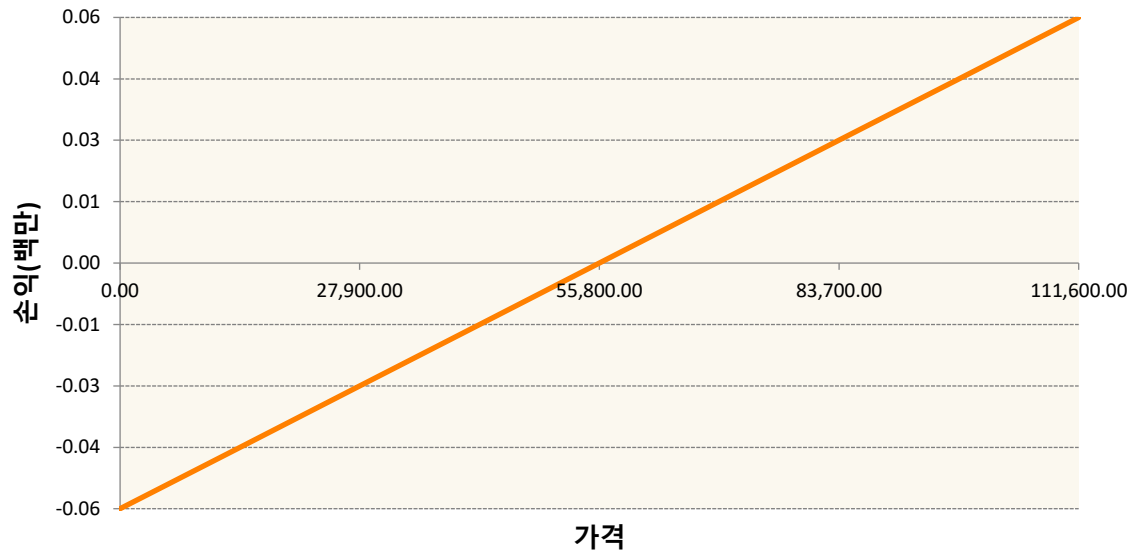
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2)  | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|--------|-----------|----|
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 4,023  | 12,181 | -8,158    | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 15,160 | 5,400  | 9,761     | 장내 |

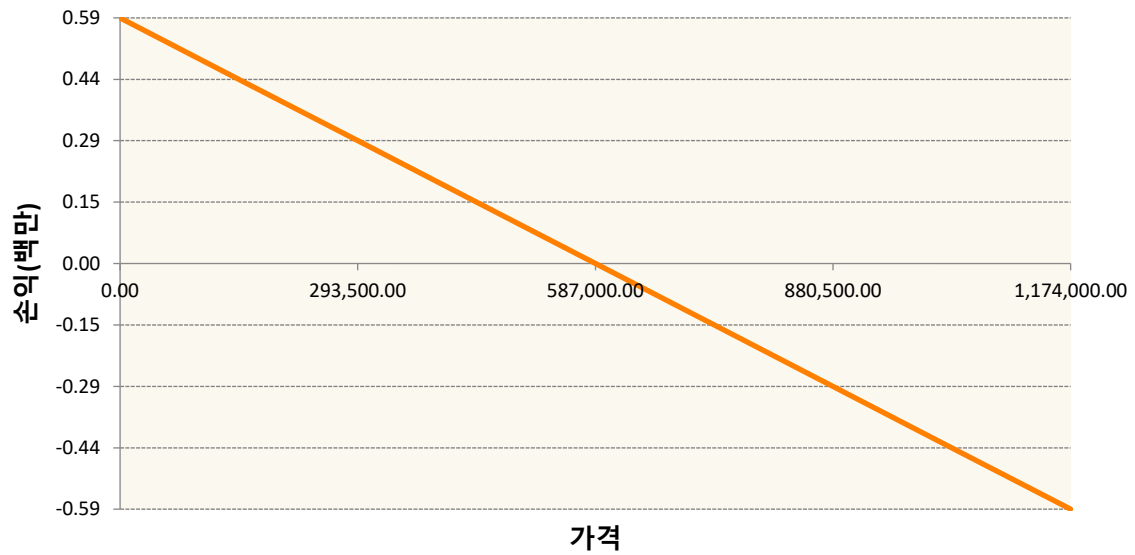
2. 만기시점의 손익구조



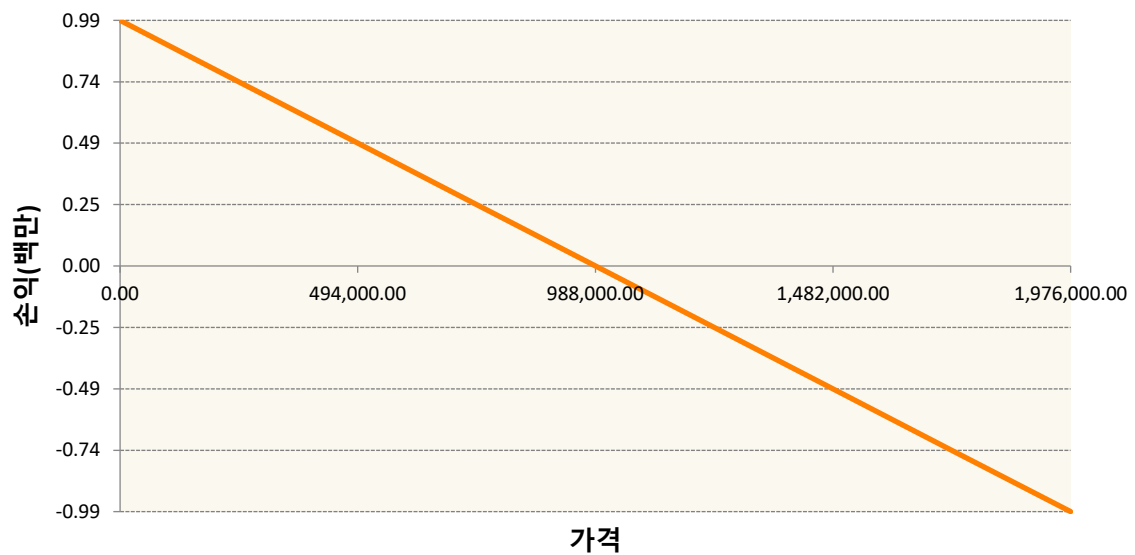
KR4A14660000-2026-06 KT개별선물



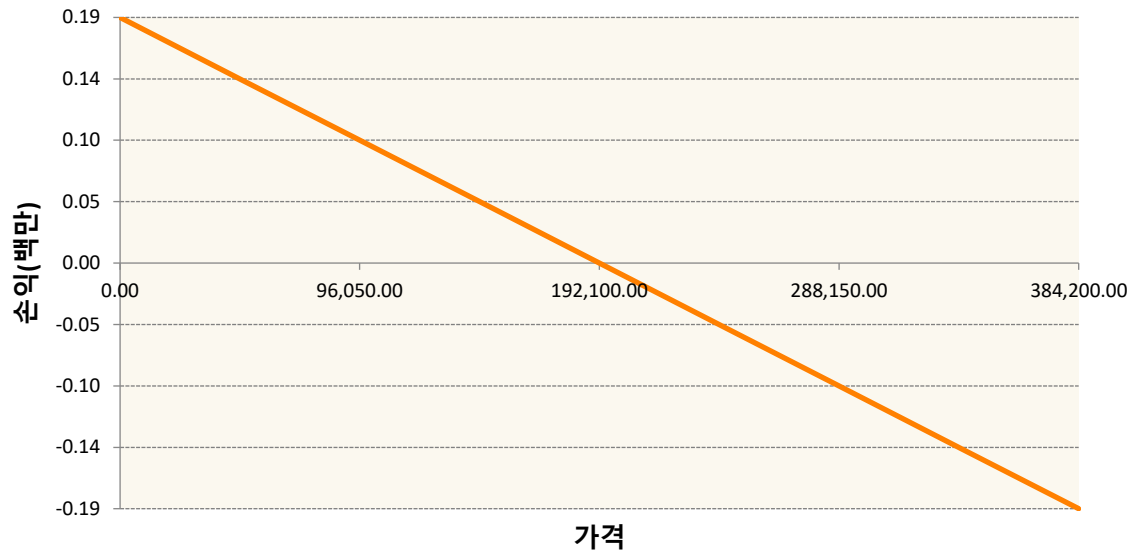
KR4A22660000-2026-06 삼성SDI개별선물



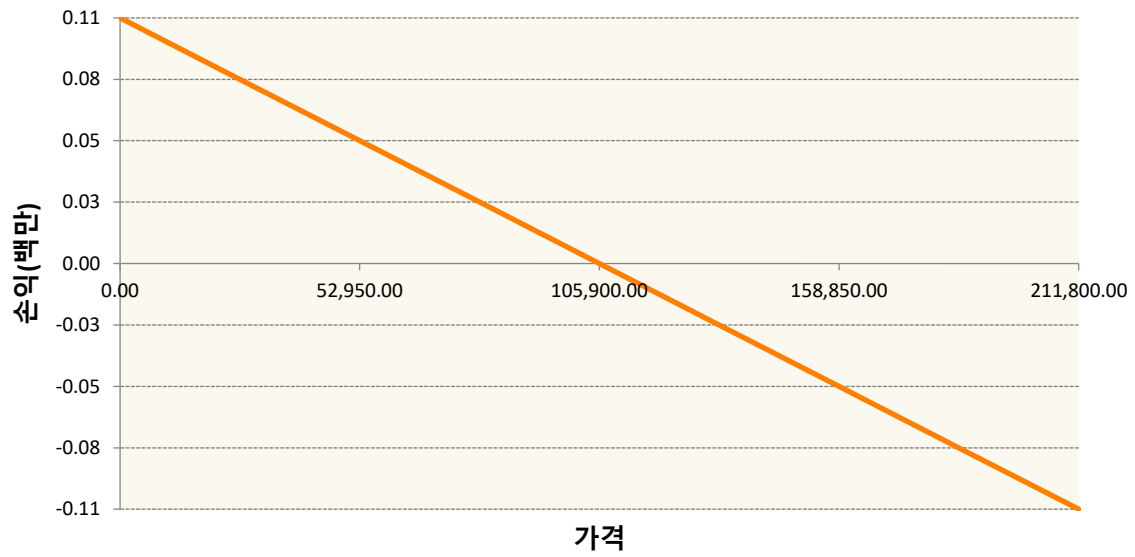
KR4A23660009-2026-06 삼성전기개별선물



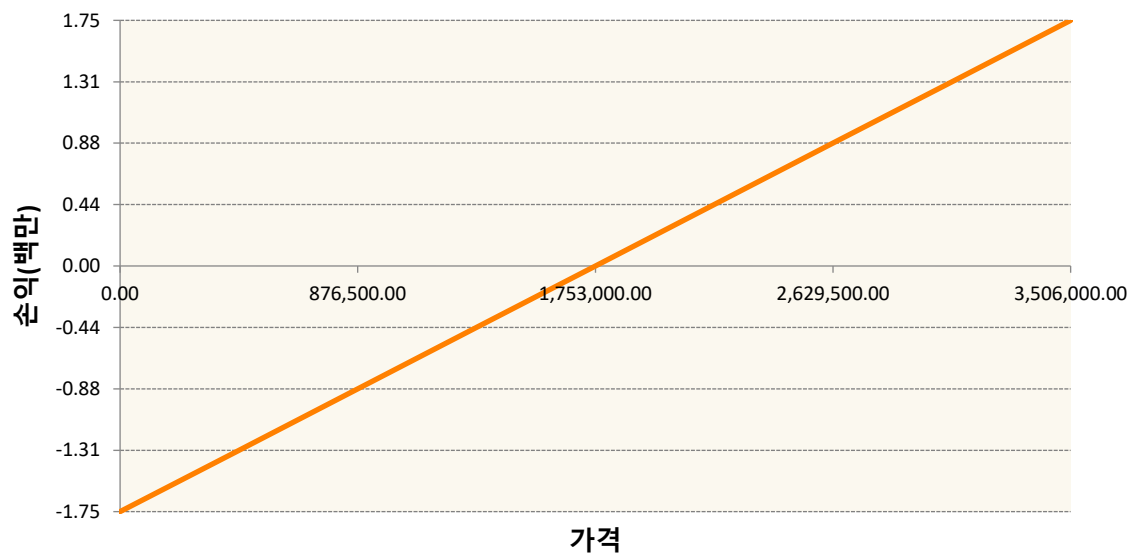
KR4A24660008-2026-06 LG전자개별선물



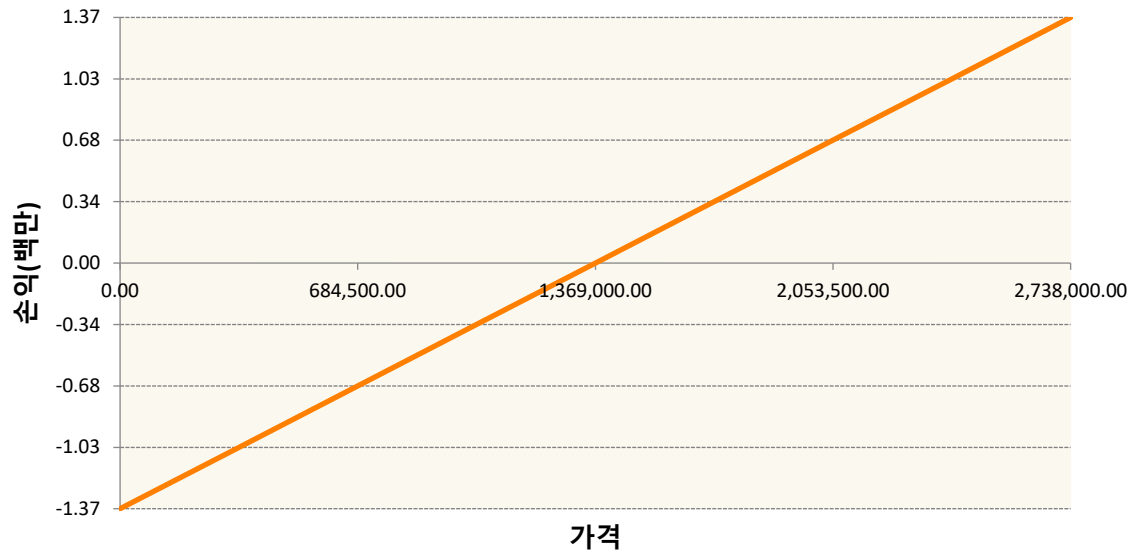
KR4A34660006-2026-06 LG개별선물



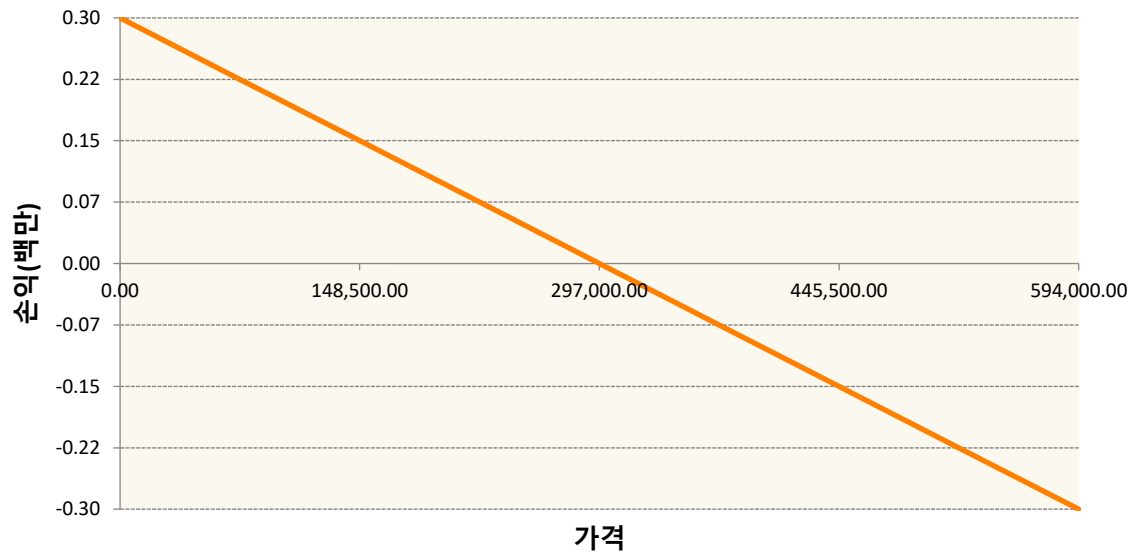
KR4A50660005-2026-06 SK하이닉스개별선물



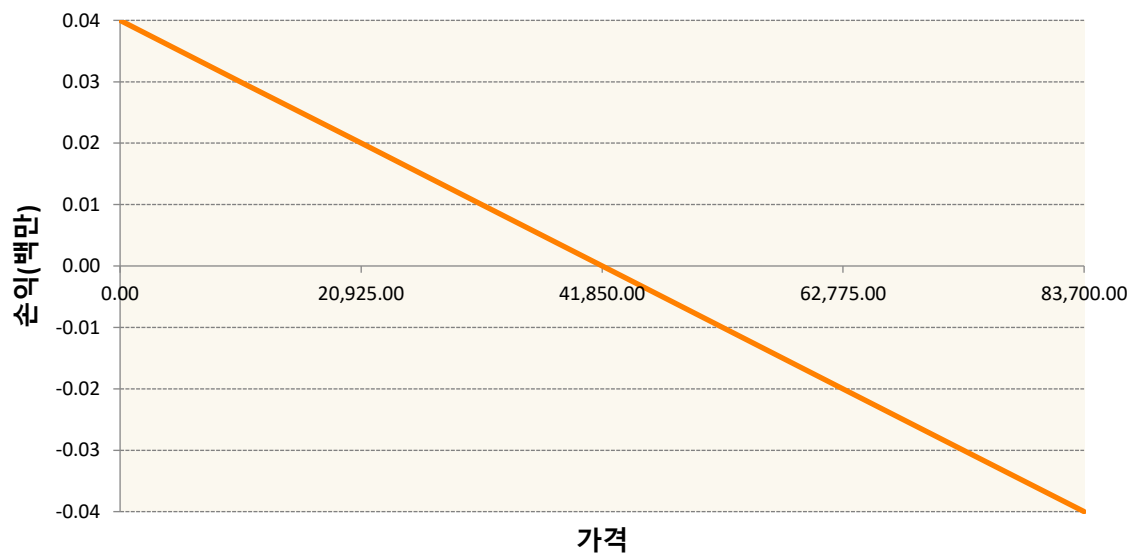
KR4AB3660001-2026-06 고려아연개별선물



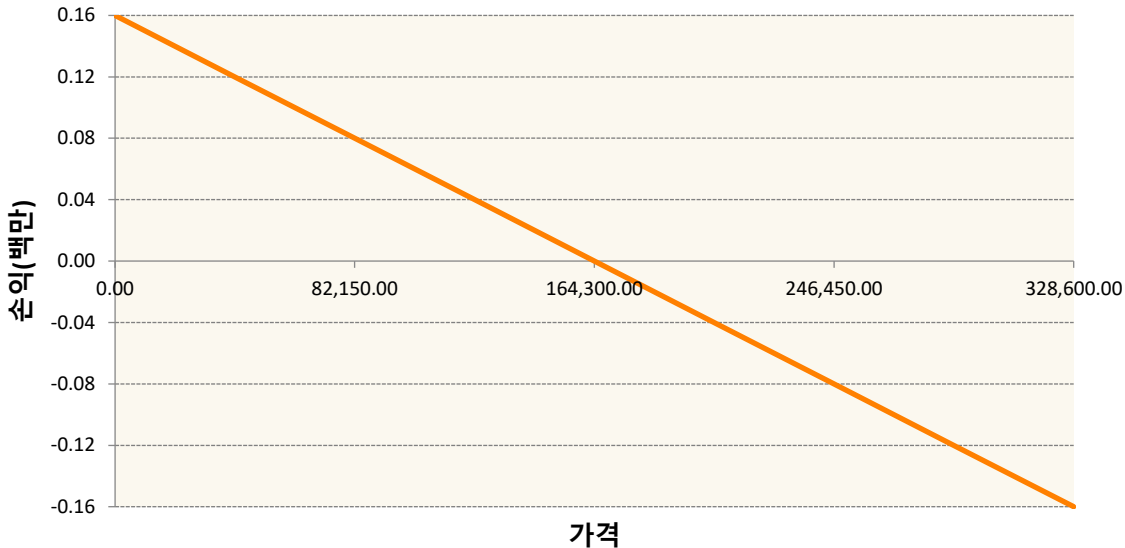
KR4AC0660002-2026-06 OCI홀딩스개별선물



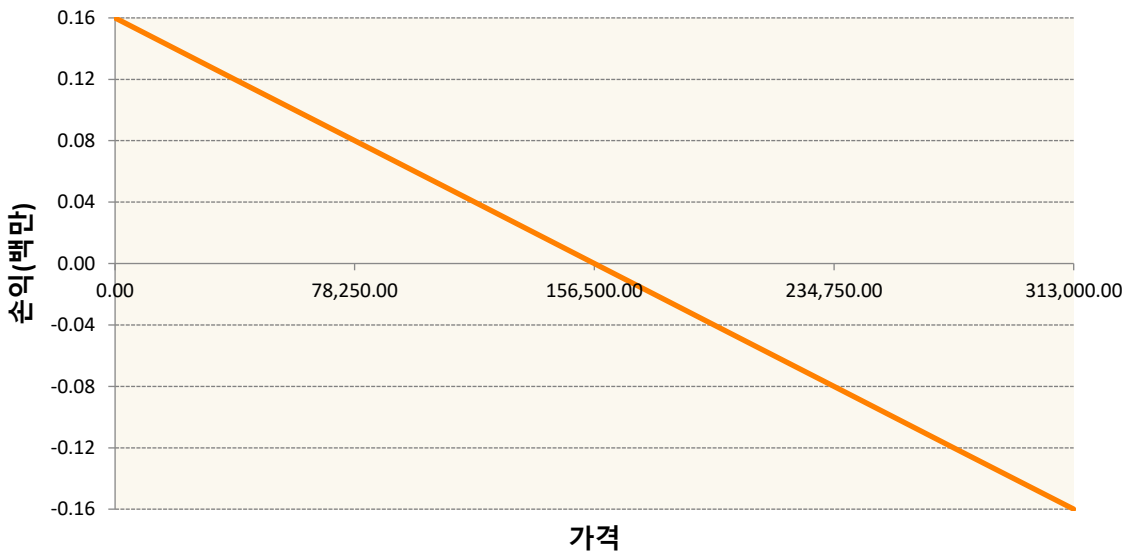
KR4ACF660005-2026-06 카카오개별선물



KR4AD0660000-2026-06 DB손해보험개별선물



KR4AFM660003-2026-06 엘앤에프개별선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|              |         |         |        |      |       |        |                    |  |     |  |
|--------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------------------|--|-----|--|
| KR4A01660005 |         |         |        |      |       |        | 2026-06 코스피200지수선물 |  | 793 |  |
| 기초자산의 변동성    |         |         |        |      |       |        |                    |  |     |  |
| 가격           | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00%             |  |     |  |
| -8.00%       | -793    | -793    | -793   | -793 | -793  | -793   | -793               |  |     |  |
| -5.33%       | -528    | -528    | -528   | -528 | -528  | -528   | -528               |  |     |  |
| -2.67%       | -264    | -264    | -264   | -264 | -264  | -264   | -264               |  |     |  |
| 0%           | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0                  |  |     |  |
| 2.67%        | 264     | 264     | 264    | 264  | 264   | 264    | 264                |  |     |  |
| 5.33%        | 528     | 528     | 528    | 528  | 528   | 528    | 528                |  |     |  |
| 8.00%        | 793     | 793     | 793    | 793  | 793   | 793    | 793                |  |     |  |
| KR4A11660003 |         |         |        |      |       |        | 2026-06 삼성전자개별선물   |  | 228 |  |
| 기초자산의 변동성    |         |         |        |      |       |        |                    |  |     |  |

| 가격     | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|--------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00% | -228    | -228    | -228   | -228 | -228  | -228   | -228   |
| -5.33% | -152    | -152    | -152   | -152 | -152  | -152   | -152   |
| -2.67% | -76     | -76     | -76    | -76  | -76   | -76    | -76    |
| 0%     | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 76      | 76      | 76     | 76   | 76    | 76     | 76     |
| 5.33%  | 152     | 152     | 152    | 152  | 152   | 152    | 152    |
| 8.00%  | 228     | 228     | 228    | 228  | 228   | 228    | 228    |

KR4A14660000 2026-06 KT개별선물 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     |

KR4A22660000 2026-06 삼성SDI개별선물 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    |

KR4A23660009 2026-06 삼성전기개별선물 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%    | 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%     | -62     | -62     | -62    | -62 | -62   | -62    | -62    |

KR4A24660008 2026-06 LG전자개별선물 70

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |    |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0% | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 70      | 70      | 70     | 70 | 70    | 70     | 70     |
| -5.33%    | 47      | 47      | 47     | 47 | 47    | 47     | 47     |
| -2.67%    | 23      | 23      | 23     | 23 | 23    | 23     | 23     |
| 0%        | 0       | 0       | 0      | 0  | 0     | 0      | 0      |

|       |     |     |     |     |     |     |     |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 2.67% | -23 | -23 | -23 | -23 | -23 | -23 | -23 |
| 5.33% | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 | -47 |
| 8.00% | -70 | -70 | -70 | -70 | -70 | -70 | -70 |

|              |                |    |
|--------------|----------------|----|
| KR4A34660006 | 2026-06 LG개별선물 | 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    |

|              |                    |     |
|--------------|--------------------|-----|
| KR4A50660005 | 2026-06 SK하이닉스개별선물 | 151 |
|--------------|--------------------|-----|

|        | 기초자산의 변동성 |         |        |      |       |        |        |
|--------|-----------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| 가격     | -25.00%   | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00% | -151      | -151    | -151   | -151 | -151  | -151   | -151   |
| -5.33% | -101      | -101    | -101   | -101 | -101  | -101   | -101   |
| -2.67% | -50       | -50     | -50    | -50  | -50   | -50    | -50    |
| 0%     | 0         | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%  | 50        | 50      | 50     | 50   | 50    | 50     | 50     |
| 5.33%  | 101       | 101     | 101    | 101  | 101   | 101    | 101    |
| 8.00%  | 151       | 151     | 151    | 151  | 151   | 151    | 151    |

|              |                  |   |
|--------------|------------------|---|
| KR4AB3660001 | 2026-06 고려아연개별선물 | 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      |

|              |                    |    |
|--------------|--------------------|----|
| KR4AC0660002 | 2026-06 OCI홀딩스개별선물 | 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    |

|              |                 |     |
|--------------|-----------------|-----|
| KR4ACF660005 | 2026-06 카카오개별선물 | 106 |
|--------------|-----------------|-----|

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

| 가격                              | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%   | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
|---------------------------------|---------|---------|--------|------|-------|--------|--------|
| -8.00%                          | 106     | 106     | 106    | 106  | 106   | 106    | 106    |
| -5.33%                          | 71      | 71      | 71     | 71   | 71    | 71     | 71     |
| -2.67%                          | 35      | 35      | 35     | 35   | 35    | 35     | 35     |
| 0%                              | 0       | 0       | 0      | 0    | 0     | 0      | 0      |
| 2.67%                           | -35     | -35     | -35    | -35  | -35   | -35    | -35    |
| 5.33%                           | -71     | -71     | -71    | -71  | -71   | -71    | -71    |
| 8.00%                           | -106    | -106    | -106   | -106 | -106  | -106   | -106   |
| KR4AD0660000 2026-06 DB손해보험개별선물 |         |         |        |      |       |        | 55     |

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 55      | 55      | 55     | 55  | 55    | 55     | 55     |
| -5.33%    | 37      | 37      | 37     | 37  | 37    | 37     | 37     |
| -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%     | -37     | -37     | -37    | -37 | -37   | -37    | -37    |
| 8.00%     | -55     | -55     | -55    | -55 | -55   | -55    | -55    |

|                               |  |  |  |  |  |  |    |
|-------------------------------|--|--|--|--|--|--|----|
| KR4AFM660003 2026-06 엘앤에프개별선물 |  |  |  |  |  |  | 26 |
|-------------------------------|--|--|--|--|--|--|----|

| 기초자산의 변동성 |         |         |        |     |       |        |        |
|-----------|---------|---------|--------|-----|-------|--------|--------|
| 가격        | -25.00% | -16.67% | -8.33% | 0%  | 8.33% | 16.67% | 25.00% |
| -8.00%    | 26      | 26      | 26     | 26  | 26    | 26     | 26     |
| -5.33%    | 17      | 17      | 17     | 17  | 17    | 17     | 17     |
| -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%     | -17     | -17     | -17    | -17 | -17   | -17    | -17    |
| 8.00%     | -26     | -26     | -26    | -26 | -26   | -26    | -26    |

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

(단위:백만원)

3,513

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

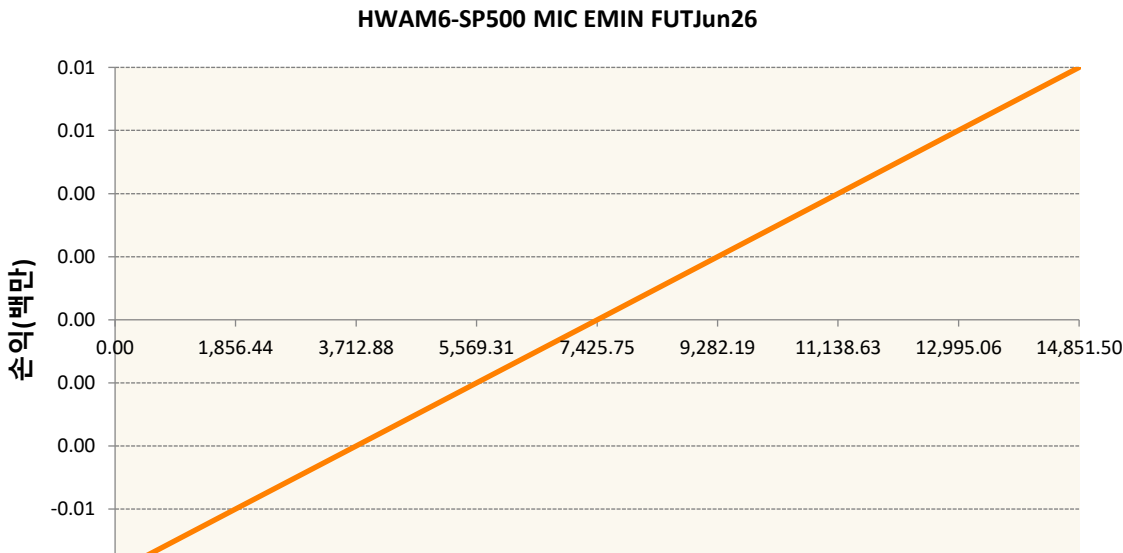
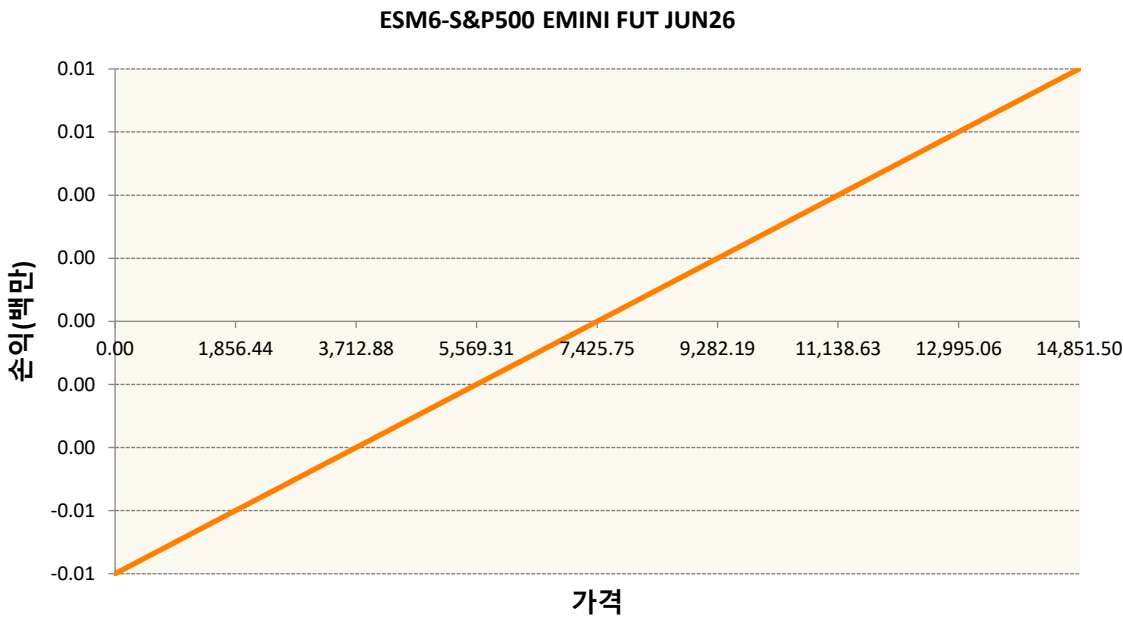
## 미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

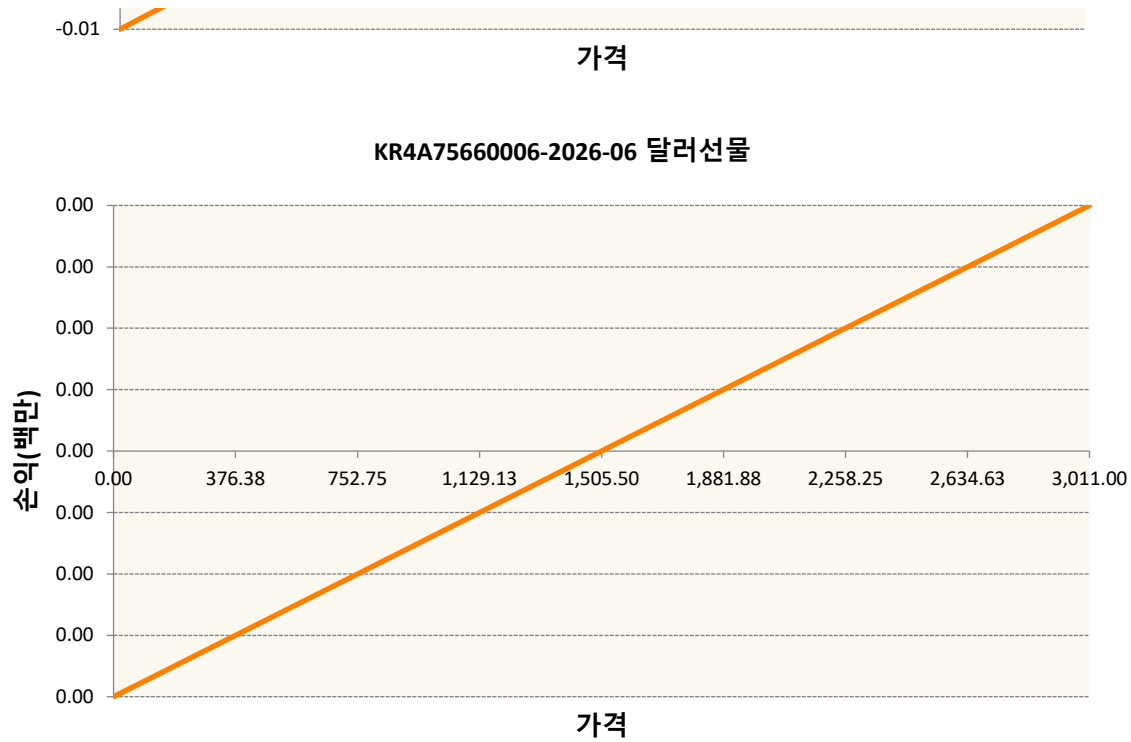
### 1. 계약금액

(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   | 60,123 | 0     | 60,123    |    |
| 누계 | 지수   | 선물   | 277    | 0     | 277       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선물   | 10,689 | 0     | 10,689    | 장내 |

### 2. 만기시점의 손익구조





| 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) |                         |  | (단위:백만원) |
|---------------------------|-------------------------|--|----------|
| ESM6                      | S&P500 EMINI FUT JUN26  |  | 4,810    |
| HWAM6                     | SP500 MIC EMIN FUTJun26 |  | 22       |
| KR4A756600 2026-06 달러선물   |                         |  | 855      |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 4,224    |

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

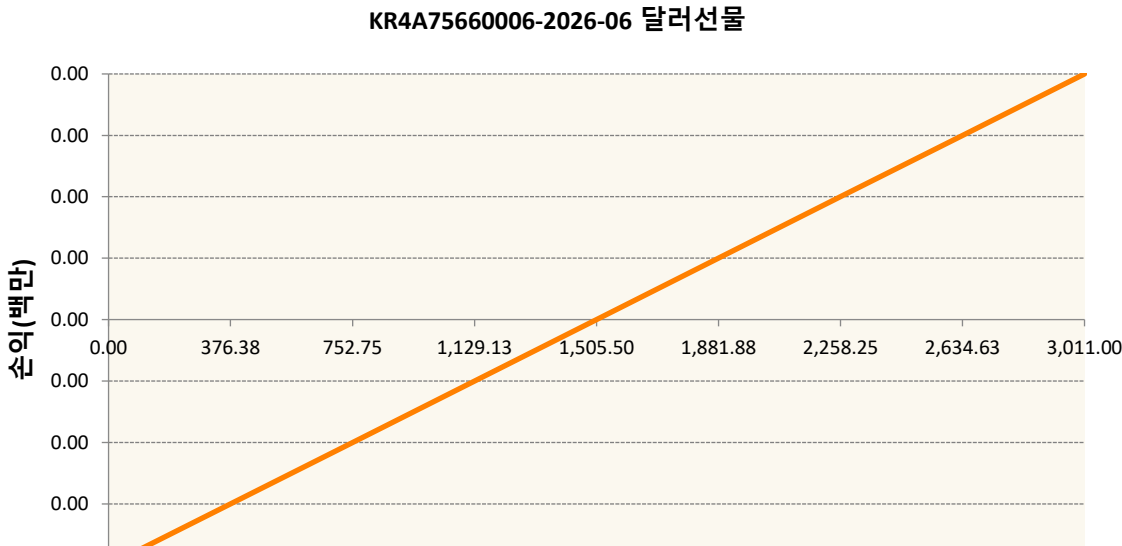
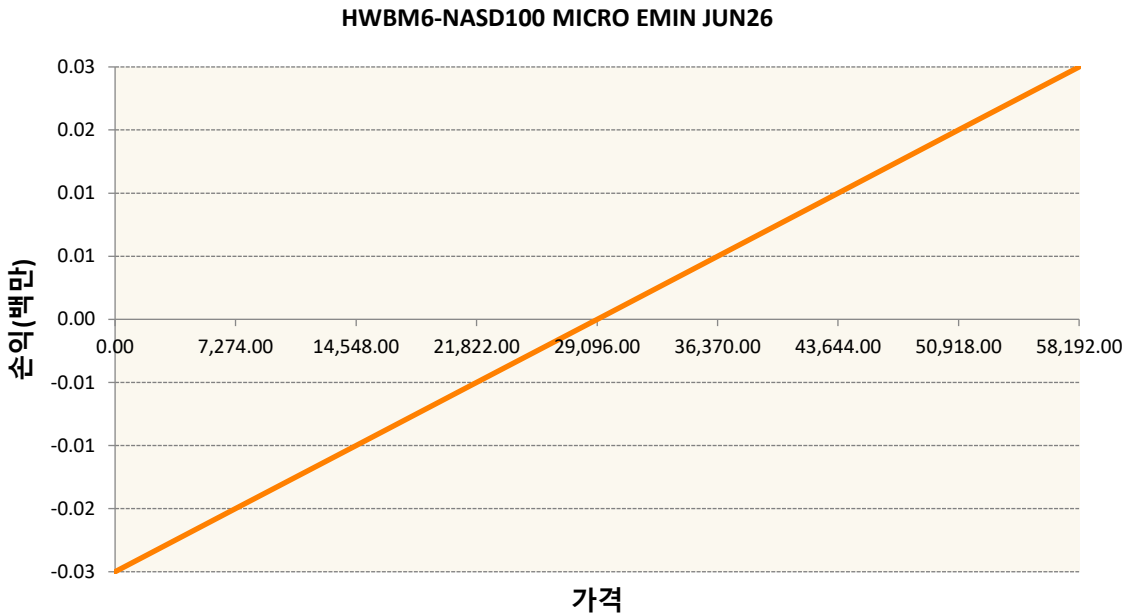
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

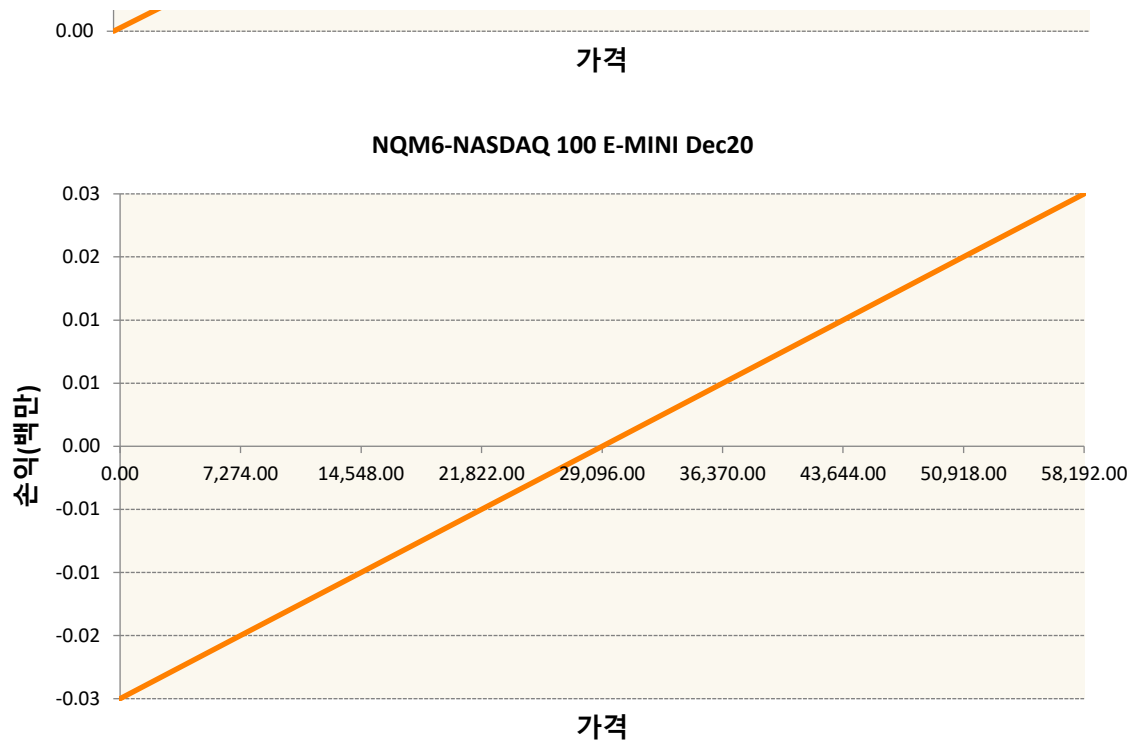
1. 계약금액

(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   | 29,641 | 0     | 29,641    |    |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 254    | 0     | 254       | 장내 |
| 누계 | 통화   | 선물   | 3,929  | 0     | 3,929     | 장내 |

2. 만기시점의 손익구조





### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

|            |                          |       |
|------------|--------------------------|-------|
| HWBM6      | NASD100 MICRO EMIN JUN26 | 20    |
| KR4A756600 | 2026-06 달러선물             | 314   |
| NQM6       | NASDAQ 100 E-MINI Dec20  | 2,371 |

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

(단위:백만원)

|       |
|-------|
| 2,648 |
|-------|

|     |            |
|-----|------------|
| 공시일 | 2026-05-20 |
| 기준일 | 2026-05-19 |

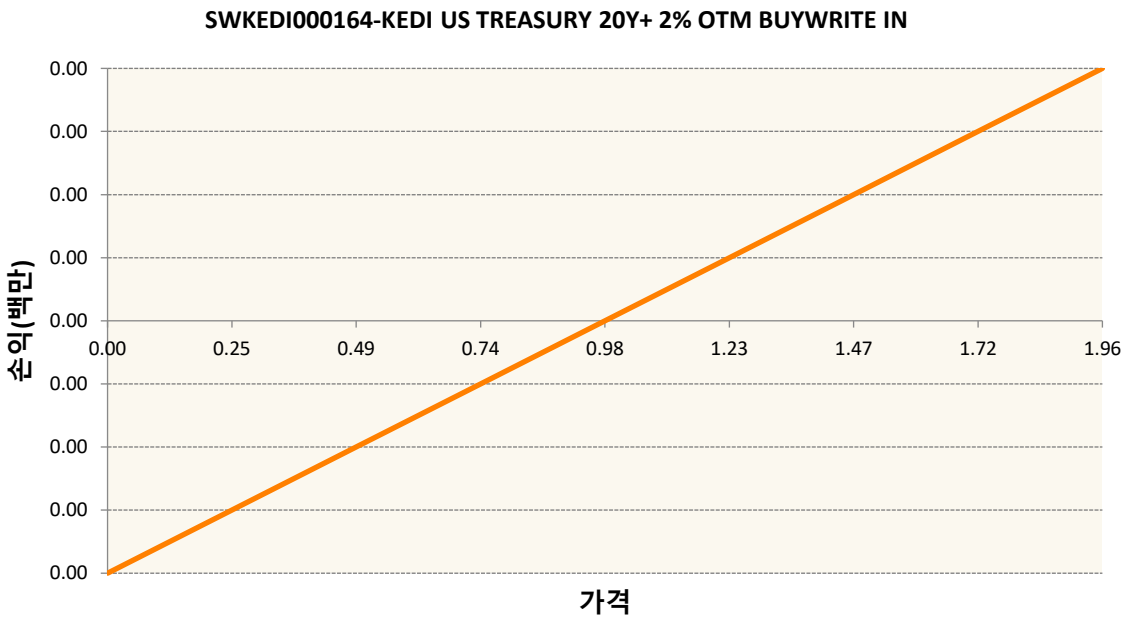
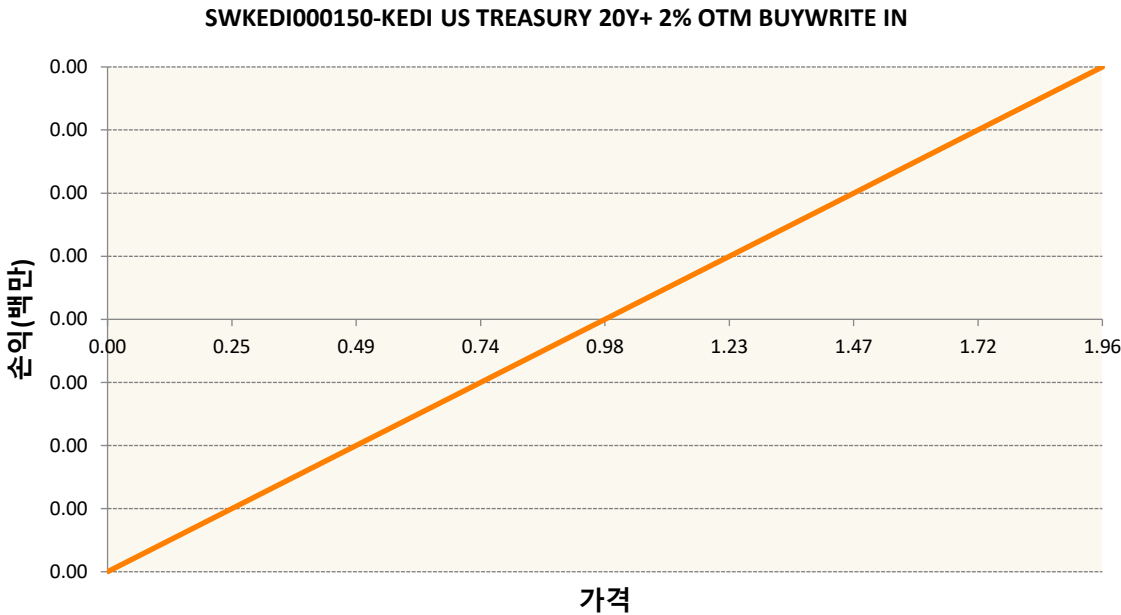
## SOL미국30년국채커버드콜(합성)

### 1. 계약금액

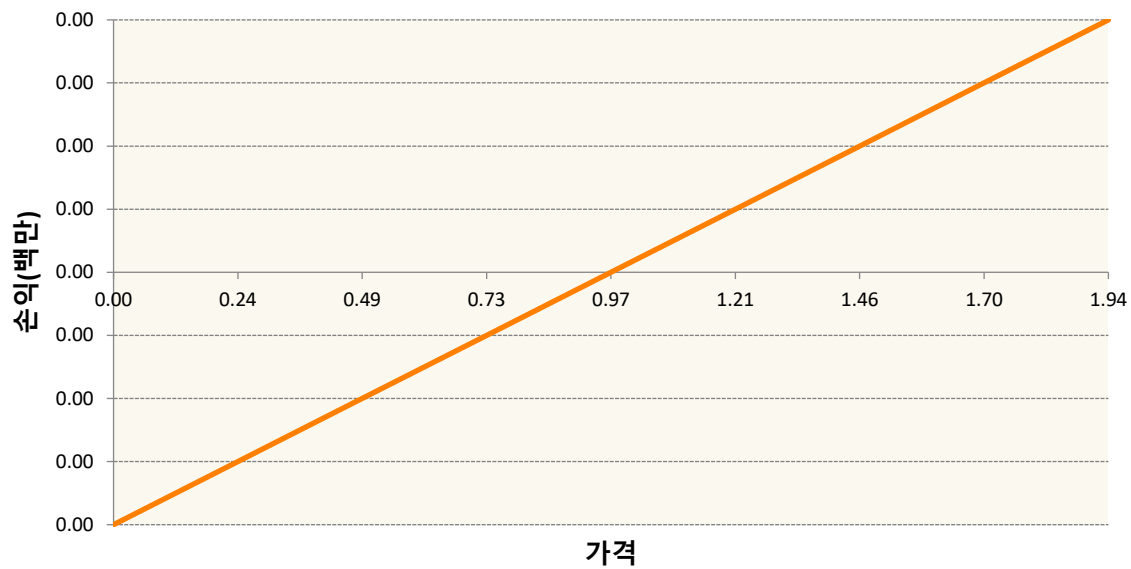
(단위:백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)   | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|---------|-------|-----------|----|
| 신규 | 지수   | 스왑   | 0       | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 지수   | 스왑   | 352,933 | 0     | 352,933   | 장외 |

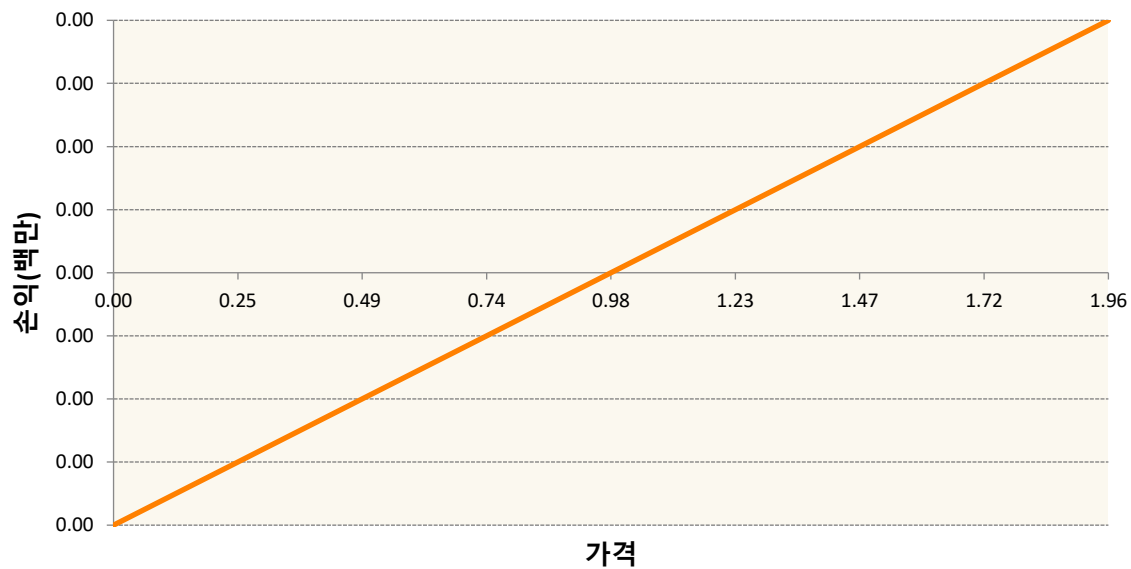
### 2. 만기시점의 손익구조



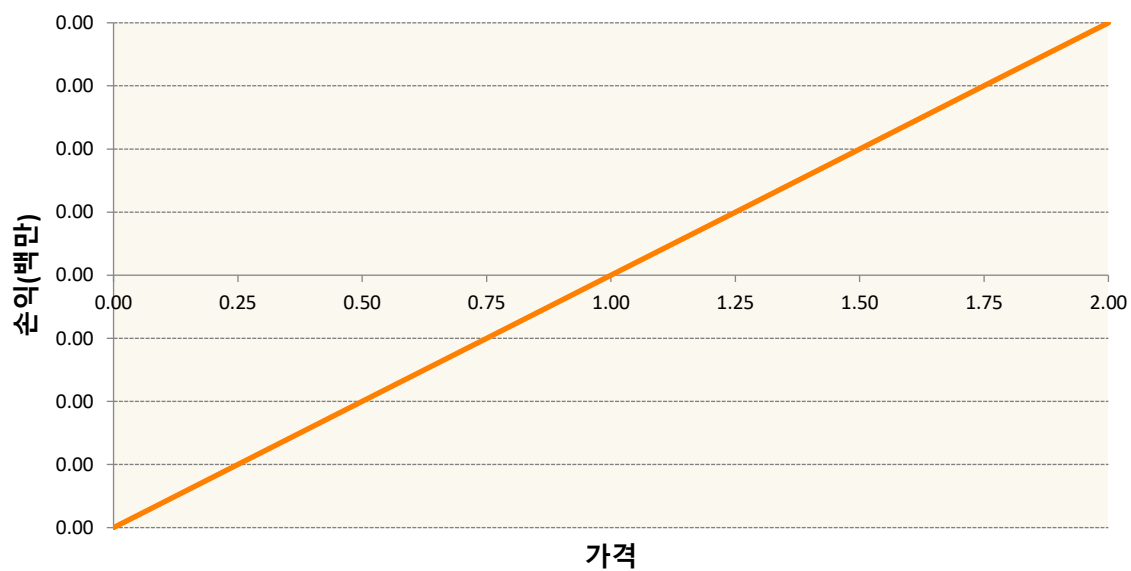
SWKEDI000170-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



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 |  | 8,228    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 150      |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 7,635    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 3,378    |
| SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN |  | 8,837    |

| 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) | (단위:백만원) |
|----------------------------------------|----------|
|                                        | 12,044   |