공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

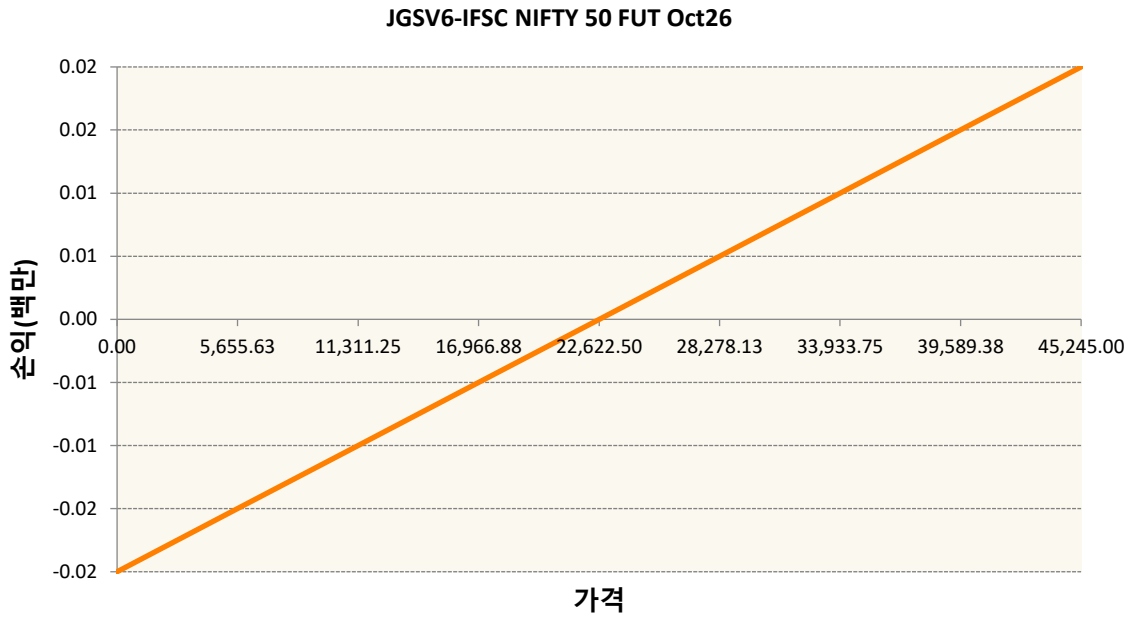
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	309	0	309	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

JGSV6	IFSC NIFTY 50 FUT Oct26	25

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

(단위:백만원)

16

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

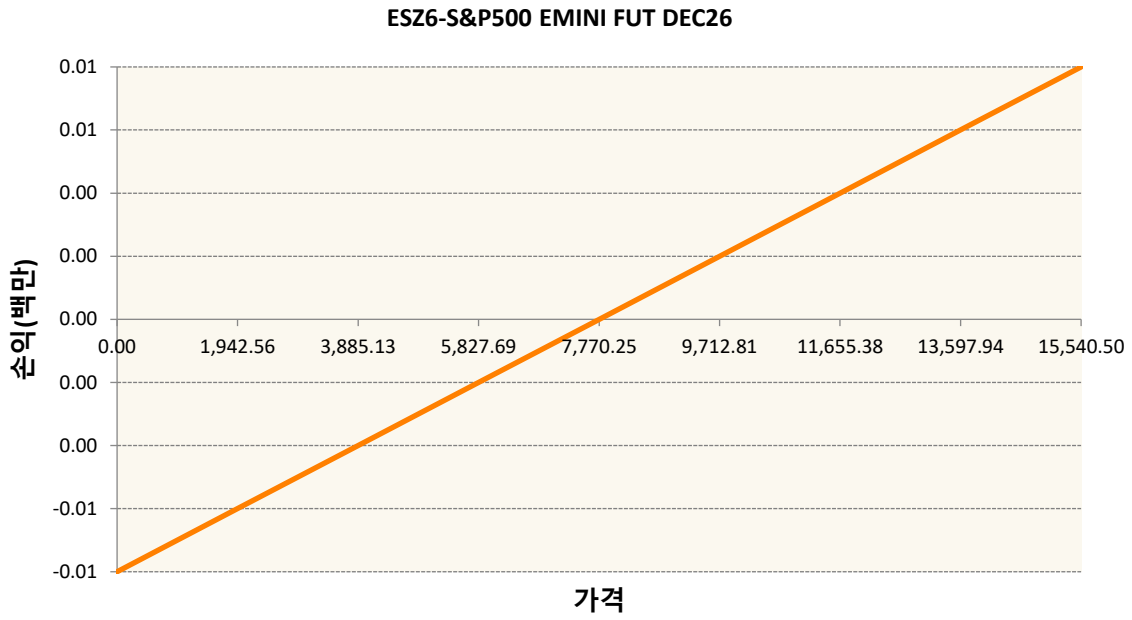
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	537	0	537	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	43

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

(단위:백만원)

26

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

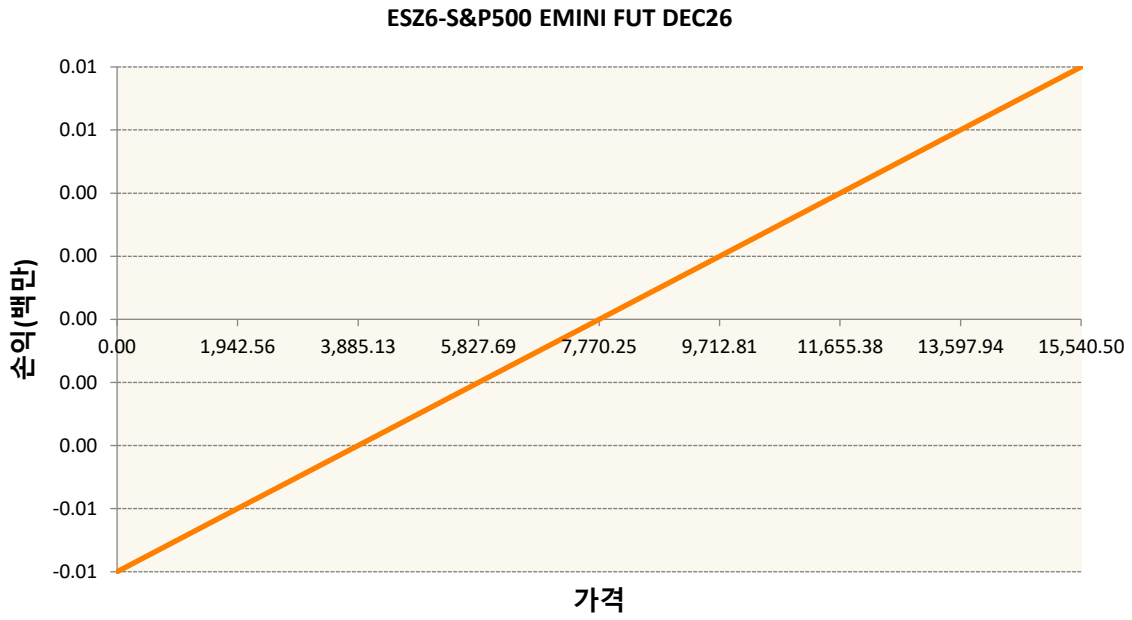
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	537	0	537	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	43

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

(단위:백만원)

26

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

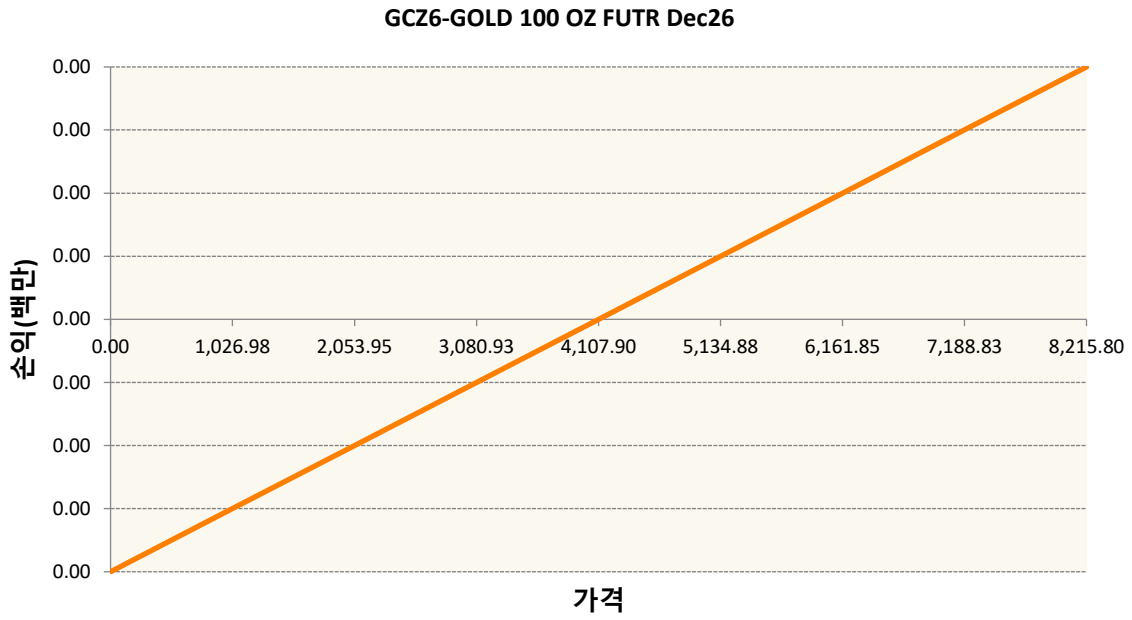
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규			0	0	0	
신규	실물자산	옵션	0	0	0	
누계			5,857	0	5,857	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 10/23/26 C387 EQUITY	2
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	469

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

(단위:백만원)

599

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

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 10/16/26 C202.5 EQUITY	628

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

(단위:백만원)

2,163

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

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 10/23/26 C79.5 EQUITY	5

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

(단위:백만원)

3

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

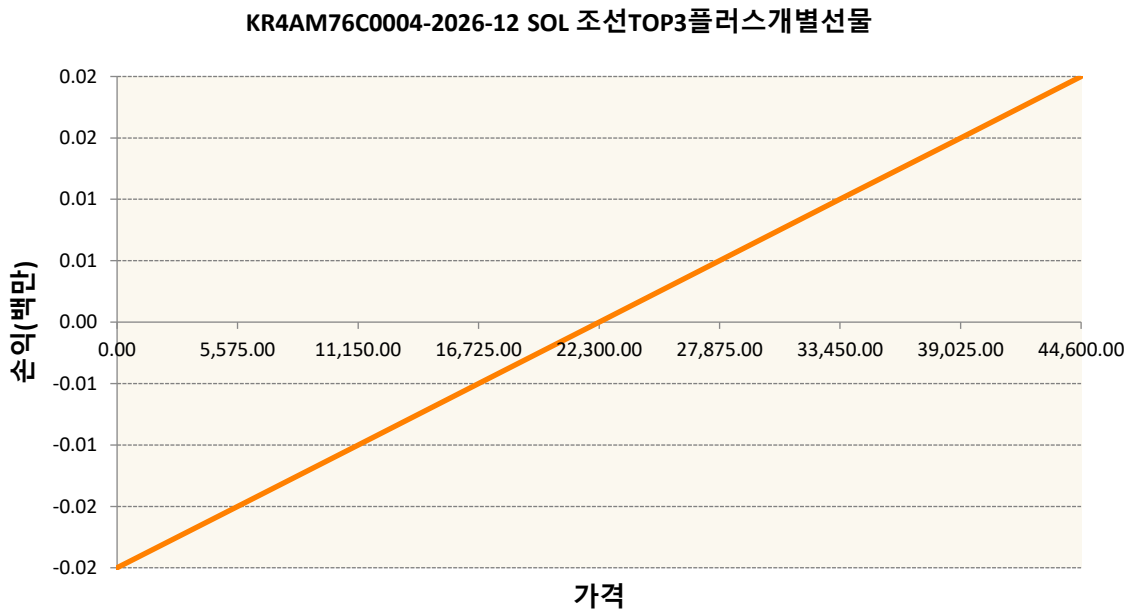
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	443	-443	장내
누계	유가증권	선물	7,058	0	7,058	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						5,575
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,575	-5,575	-5,575	-5,575	-5,575	-5,575	-5,575
-5.33%	-3,717	-3,717	-3,717	-3,717	-3,717	-3,717	-3,717
-2.67%	-1,858	-1,858	-1,858	-1,858	-1,858	-1,858	-1,858
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,858	1,858	1,858	1,858	1,858	1,858	1,858
5.33%	3,717	3,717	3,717	3,717	3,717	3,717	3,717
8.00%	5,575	5,575	5,575	5,575	5,575	5,575	5,575

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

9,293

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

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	2026-10-16
기준일	2026-10-15

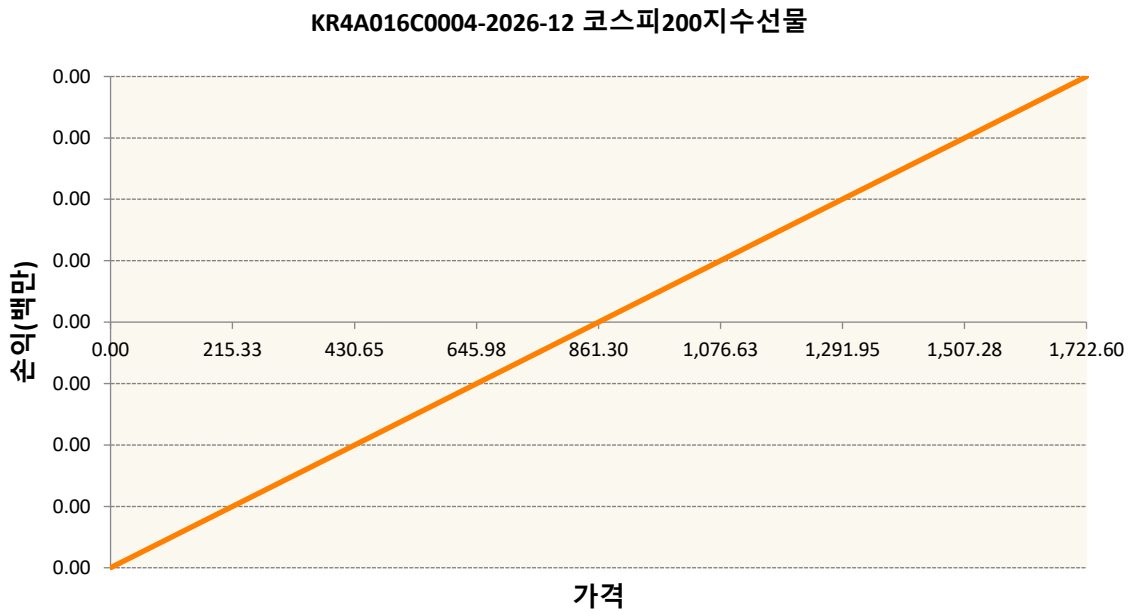
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

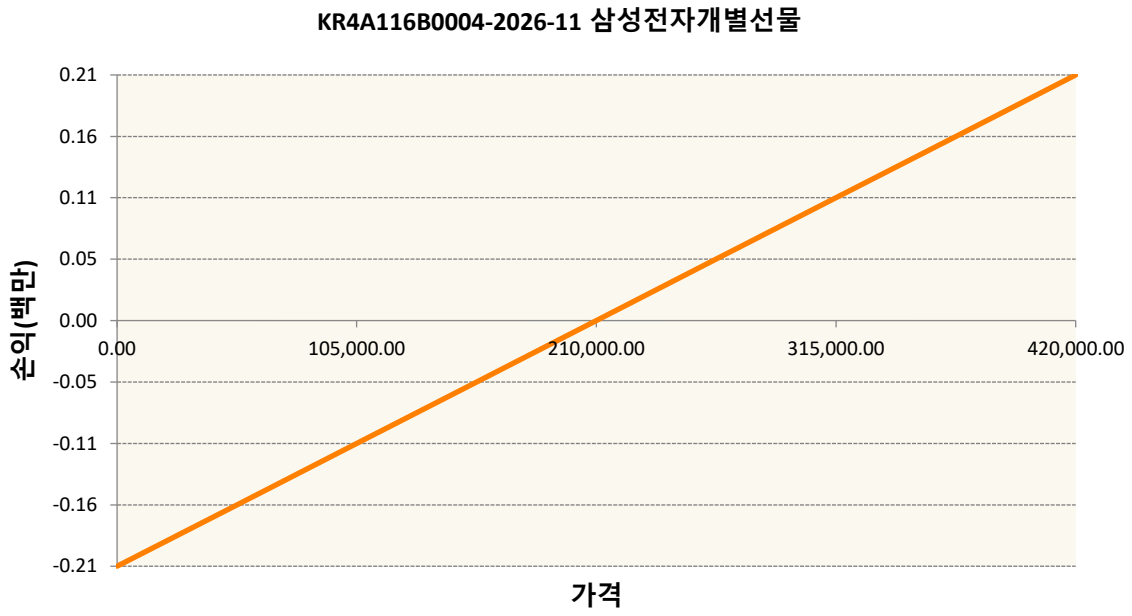
1. 계약금액

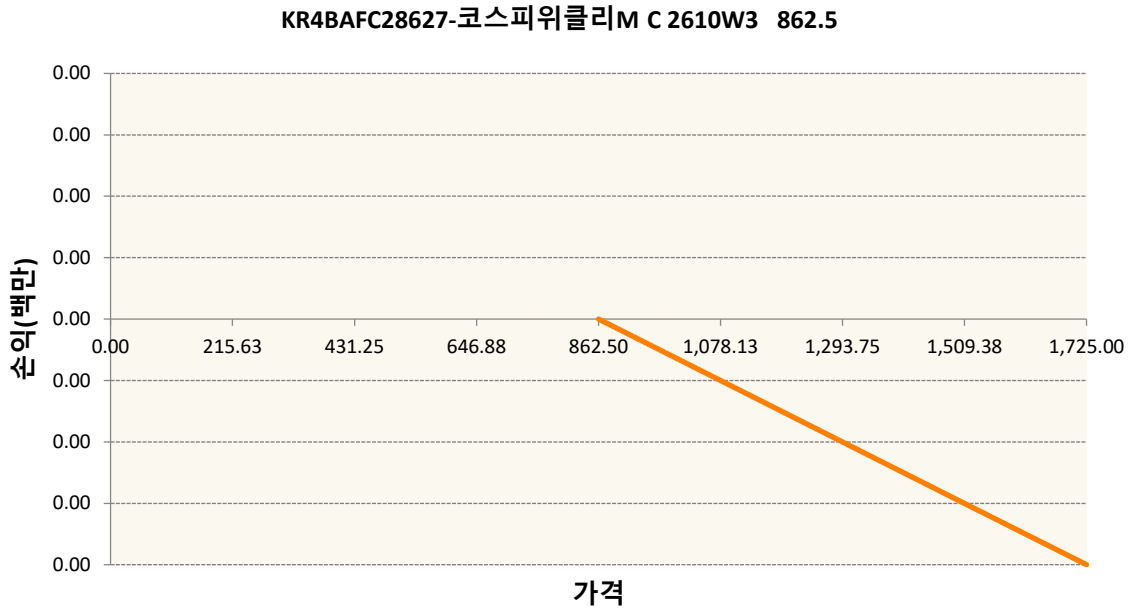
(단위:백만원)

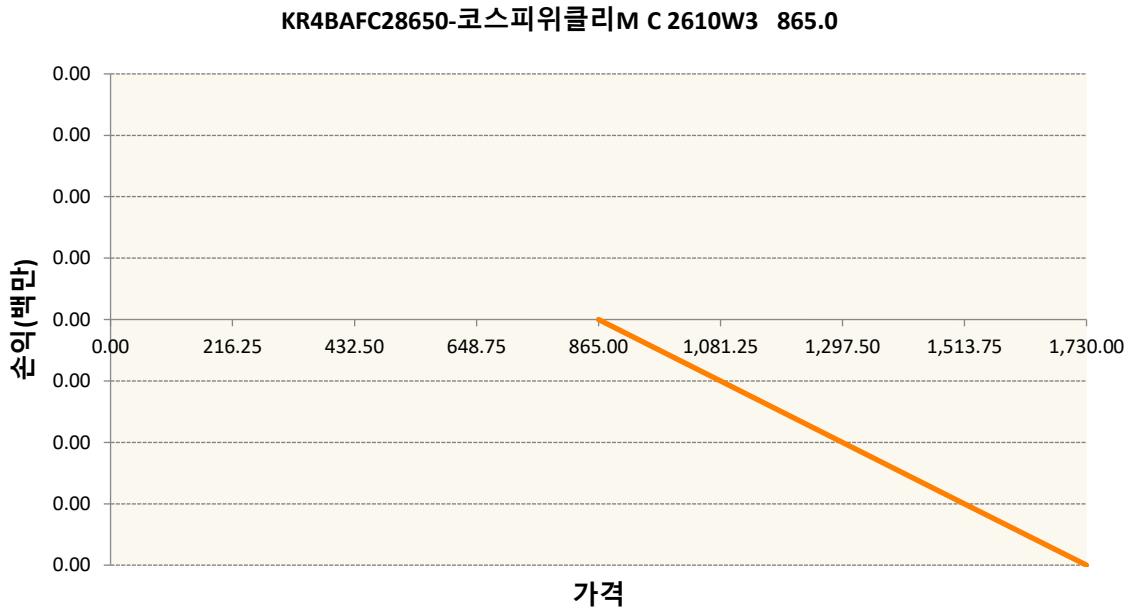
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	36,301	-36,301	장내
누계	유가증권	선물	16,938	0	16,938	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,619	-35,619	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						448
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-448	-448	-448	-448	-448	-448	-448
-5.33%	-298	-298	-298	-298	-298	-298	-298
-2.67%	-149	-149	-149	-149	-149	-149	-149
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	149	149	149	149	149	149	149
5.33%	298	298	298	298	298	298	298
8.00%	448	448	448	448	448	448	448
KR4A116B0004	2026-11 삼성전자개별선물						907
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-907	-907	-907	-907	-907	-907	-907
-5.33%	-605	-605	-605	-605	-605	-605	-605
-2.67%	-302	-302	-302	-302	-302	-302	-302
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	302	302	302	302	302	302	302
5.33%	605	605	605	605	605	605	605
8.00%	907	907	907	907	907	907	907
	KR4BAFC28627		코스피위클리M C 2610W3 862.5				1,312
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	483	475	464	450	434	415	394
-5.33%	447	426	403	377	349	320	289
-2.67%	343	308	272	234	196	158	119
0%	128	85	43	0	-43	-85	-128
2.67%	-217	-255	-293	-333	-373	-414	-455
5.33%	-670	-696	-724	-754	-786	-819	-853
8.00%	-1,192	-1,205	-1,221	-1,240	-1,262	-1,286	-1,312
	KR4BAFC28650		코스피위클리M C 2610W3 865.0				860
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	304	299	292	284	273	262	248
-5.33%	282	270	255	239	221	202	182
-2.67%	220	197	173	149	124	99	74
0%	85	57	28	0	-28	-57	-85
2.67%	-135	-161	-188	-215	-242	-270	-297
5.33%	-431	-449	-469	-489	-512	-534	-558
8.00%	-775	-784	-796	-809	-825	-841	-860

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

8,851

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

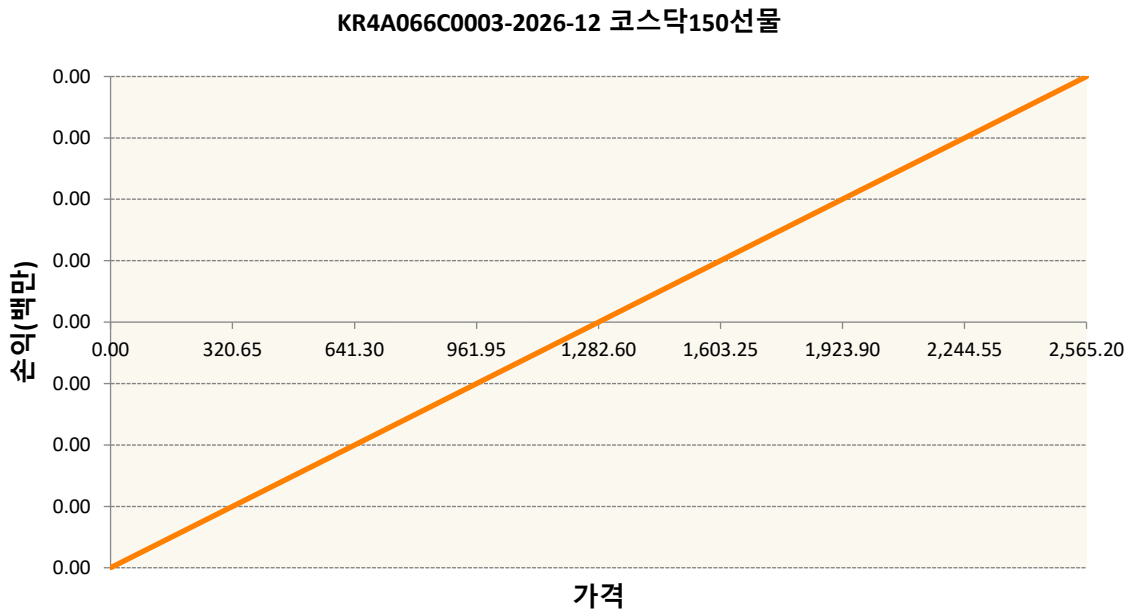
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	526	0	526	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003 2026-12 코스닥150선물 42

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-42	-42	-42	-42	-42	-42	-42
-5.33%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-2.67%	-14	-14	-14	-14	-14	-14	-14
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	14	14	14	14	14	14	14
5.33%	28	28	28	28	28	28	28
8.00%	42	42	42	42	42	42	42

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

137

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

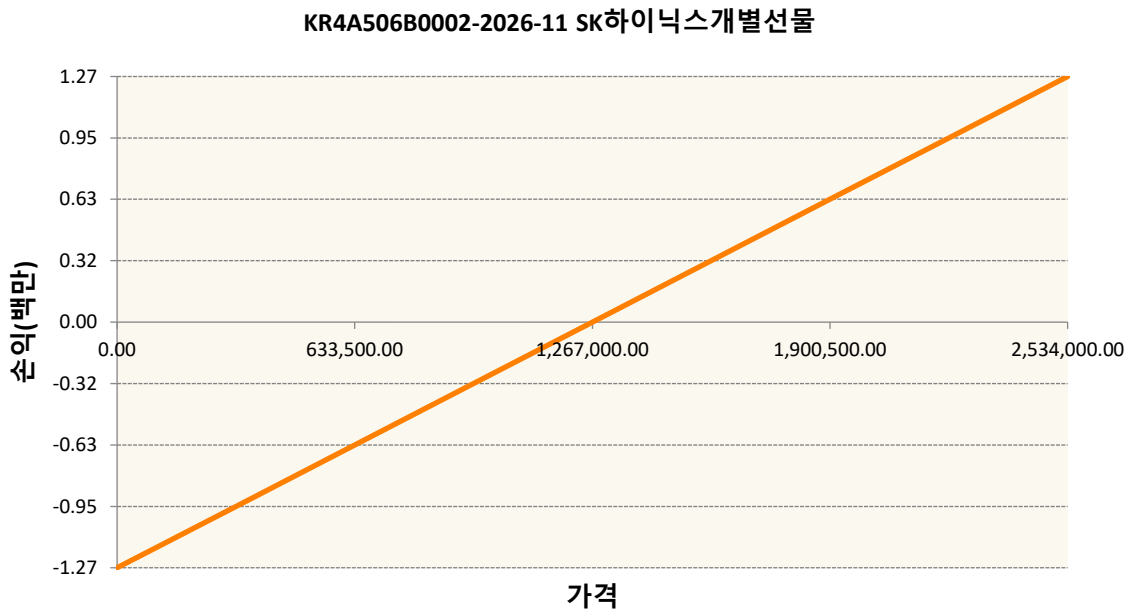
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,263	4,356	-93	장내
누계	유가증권	선물	19,562	0	19,562	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	1,559

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,559	-1,559	-1,559	-1,559	-1,559	-1,559	-1,559
-5.33%	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039	-1,039
-2.67%	-520	-520	-520	-520	-520	-520	-520
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	520	520	520	520	520	520	520
5.33%	1,039	1,039	1,039	1,039	1,039	1,039	1,039
8.00%	1,559	1,559	1,559	1,559	1,559	1,559	1,559

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

7,568

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

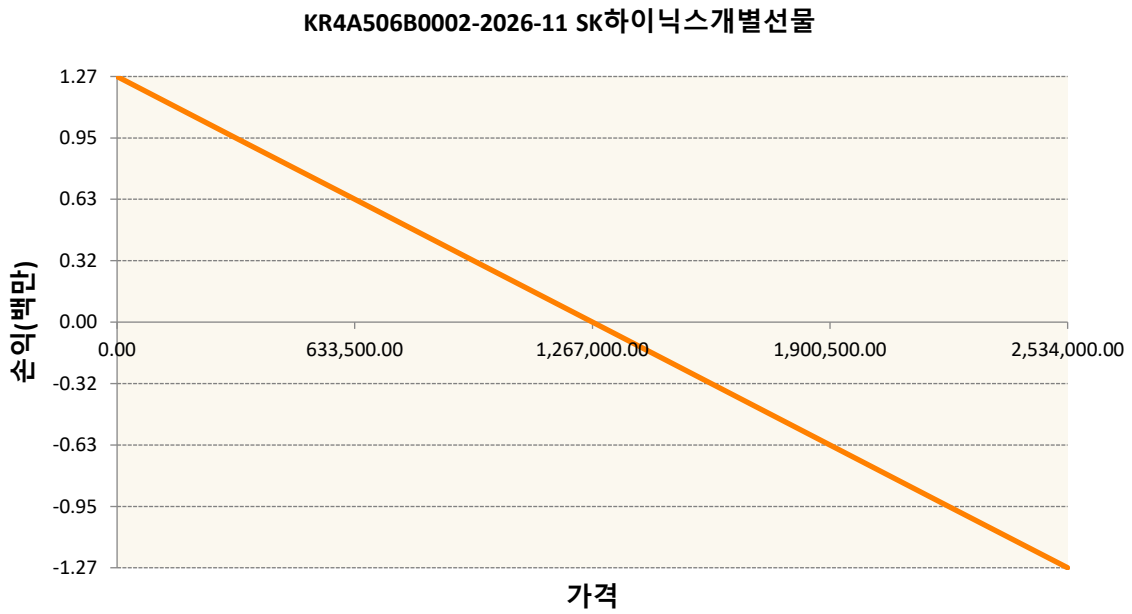
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	25,716	54,260	-28,544	장내
누계	유가증권	선물	0	252,348	-252,348	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물						20,108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	20,108	20,108	20,108	20,108	20,108	20,108	20,108
-5.33%	13,405	13,405	13,405	13,405	13,405	13,405	13,405
-2.67%	6,703	6,703	6,703	6,703	6,703	6,703	6,703
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6,703	-6,703	-6,703	-6,703	-6,703	-6,703	-6,703
5.33%	-13,405	-13,405	-13,405	-13,405	-13,405	-13,405	-13,405
8.00%	-20,108	-20,108	-20,108	-20,108	-20,108	-20,108	-20,108

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

97,621

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

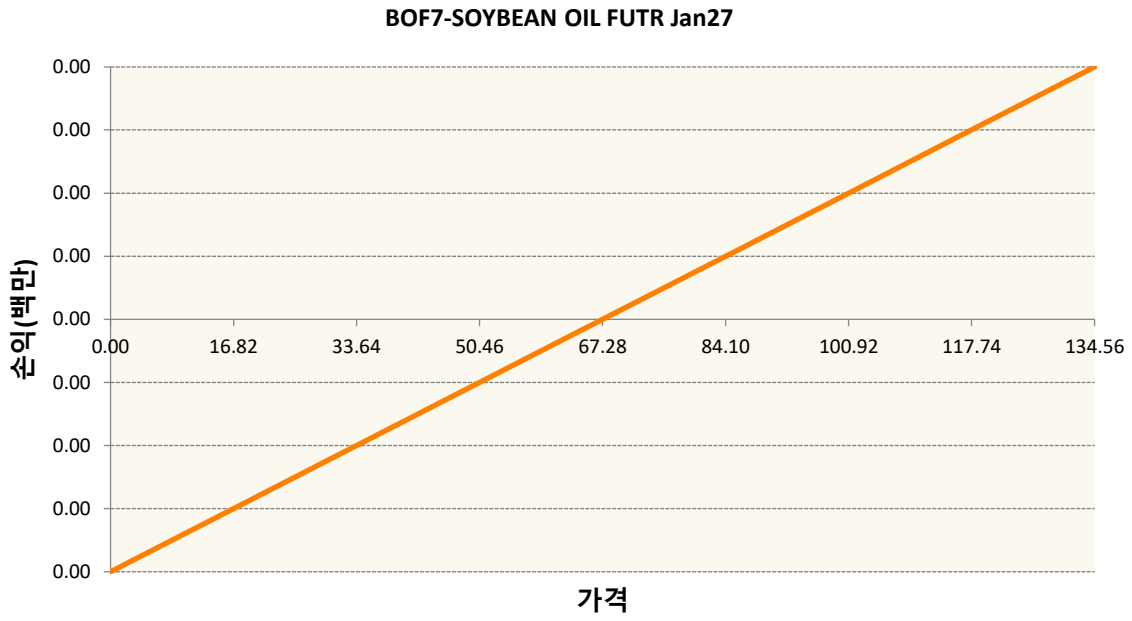
포커스농산물모(채권-파생형)

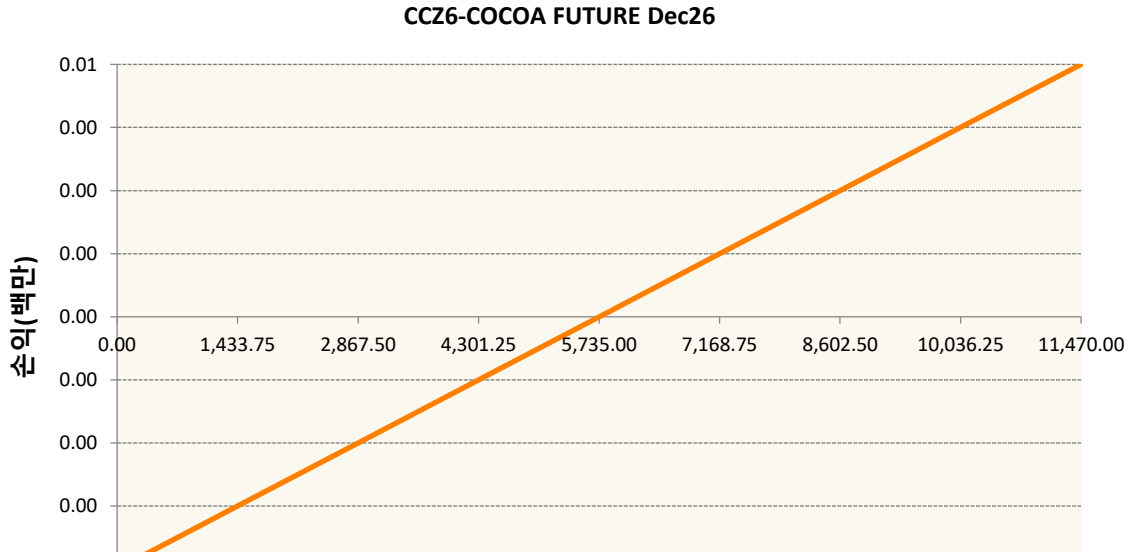
1. 계약금액

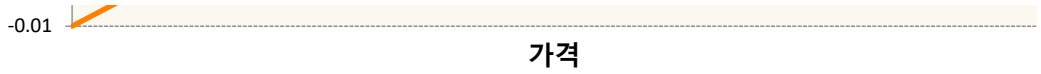
(단위:USD 백만)

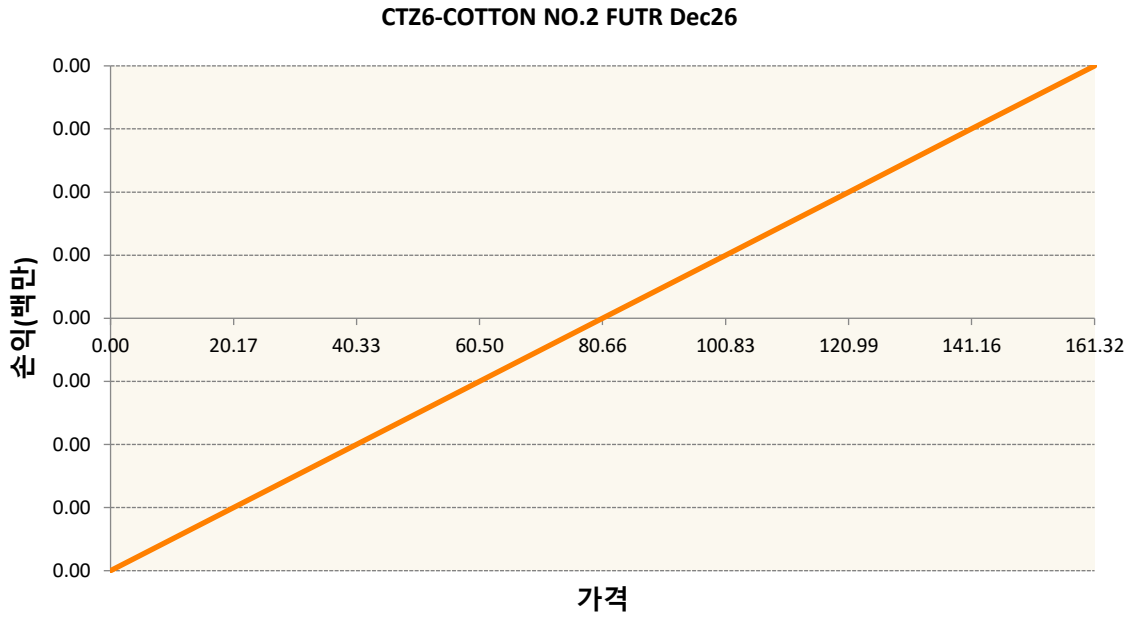
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	353	0	353	
누계	유가증권	선물	2,293	0	2,293	
누계	통화	선물	0	336	-336	장내

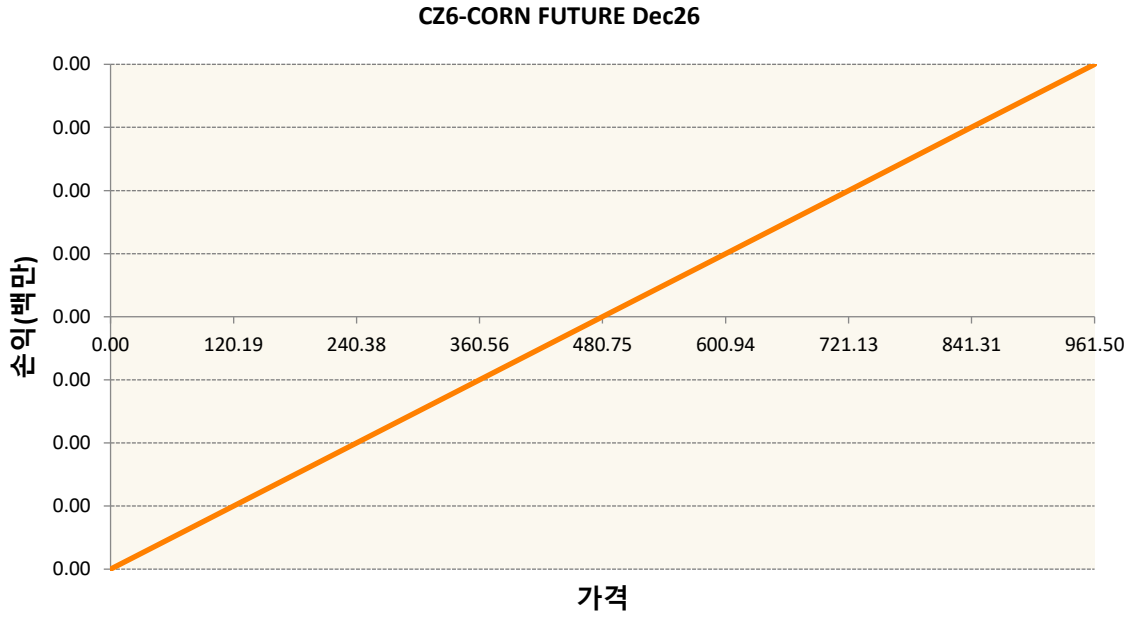
2. 만기시점의 손익구조

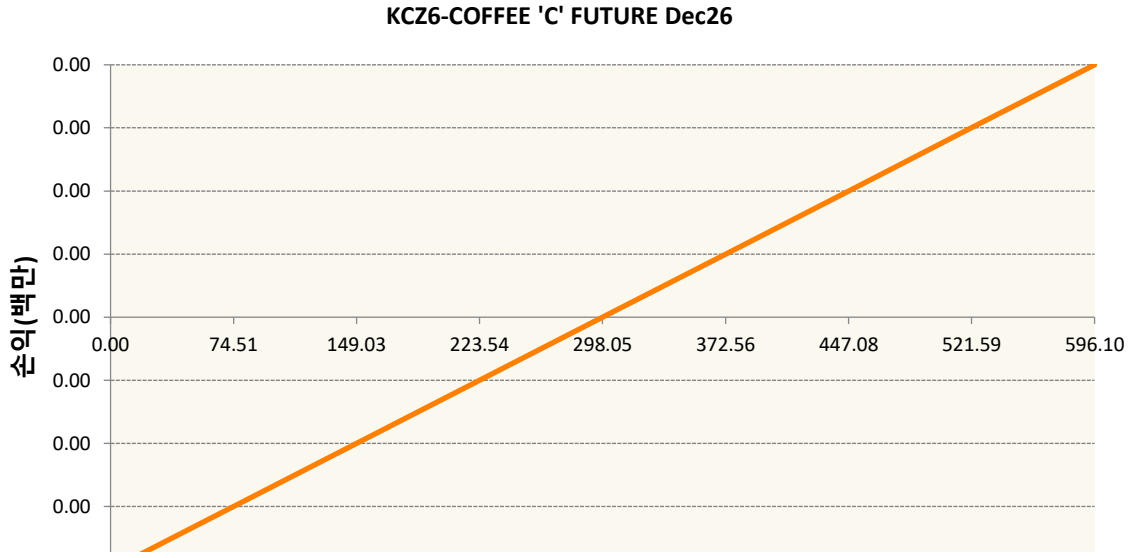


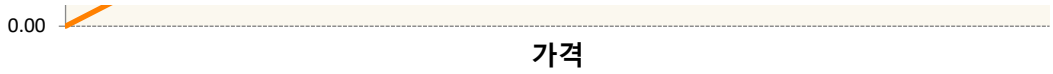


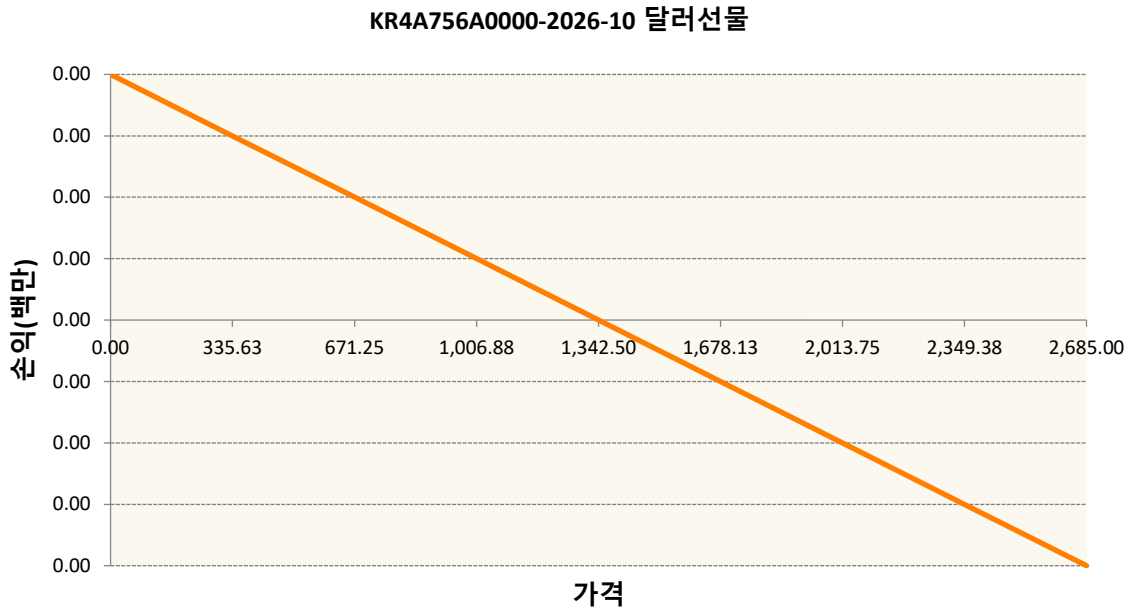

-0.01
가격

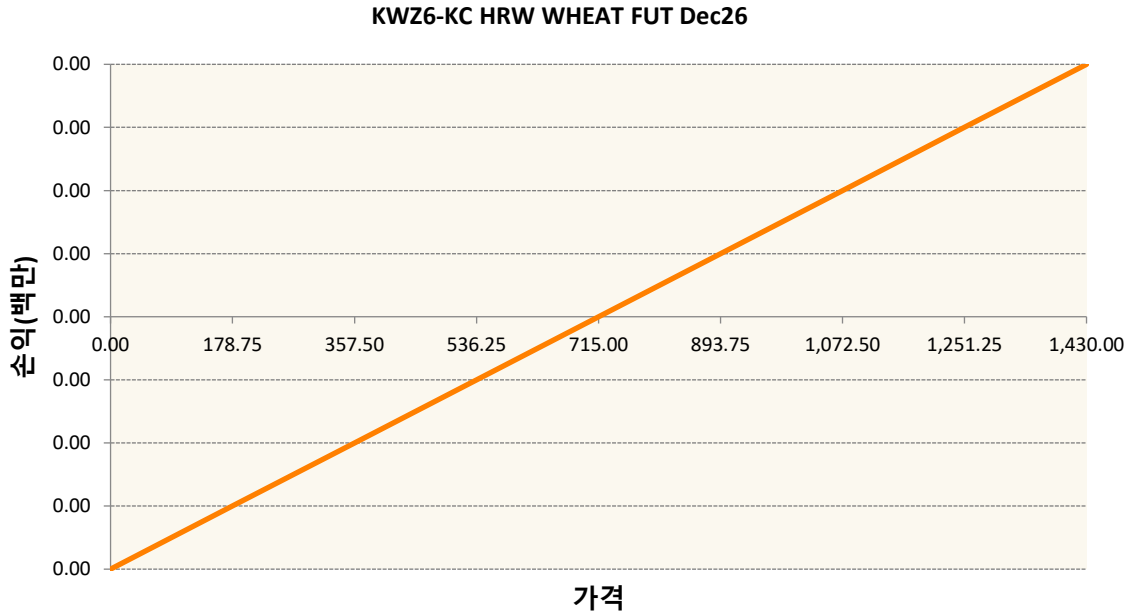

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
20.17
40.33
60.50
80.66
100.83
120.99
141.16
161.32
손익(백만)
가격

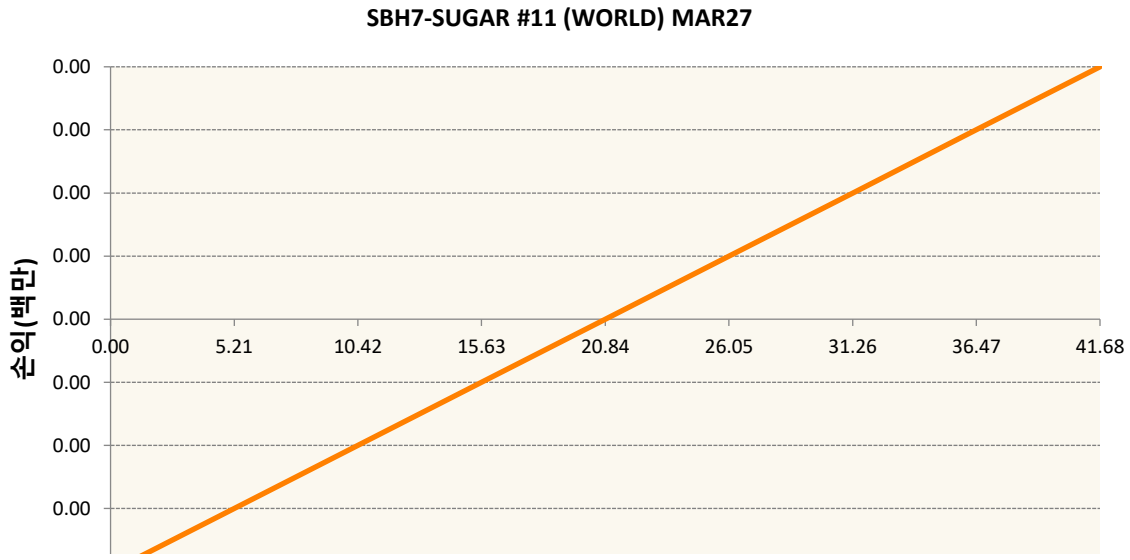

CZ6-CORN FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
120.19
240.38
360.56
480.75
600.94
721.13
841.31
961.50
손익(백만)
가격

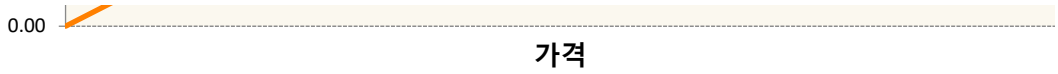

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
74.51
149.03
223.54
298.05
372.56
447.08
521.59
596.10
손익(백만)

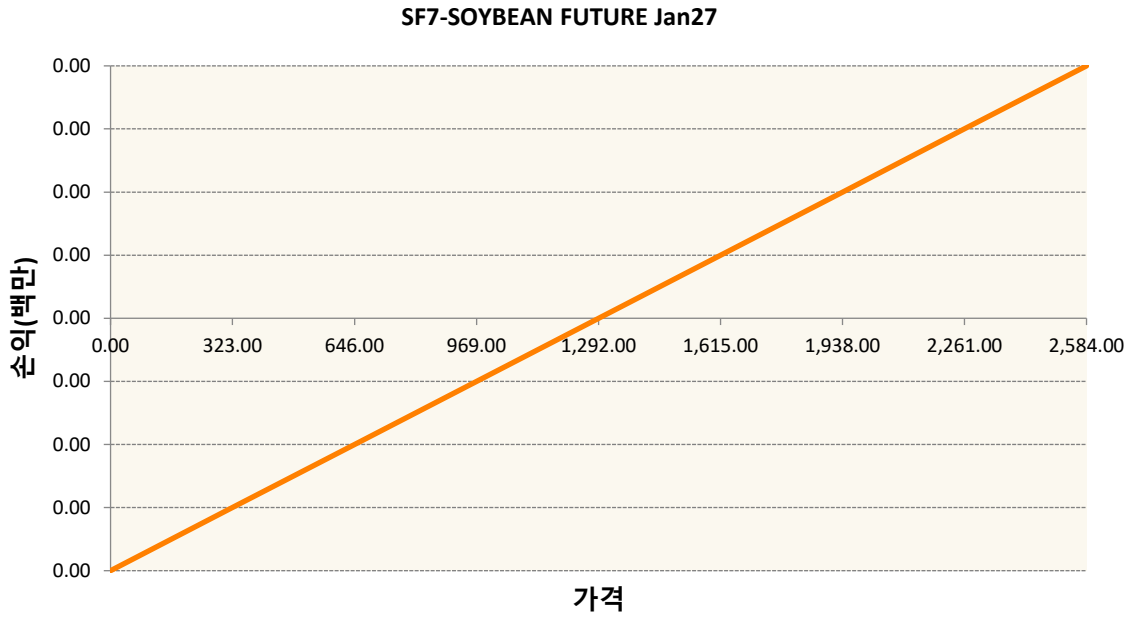

0.00
가격

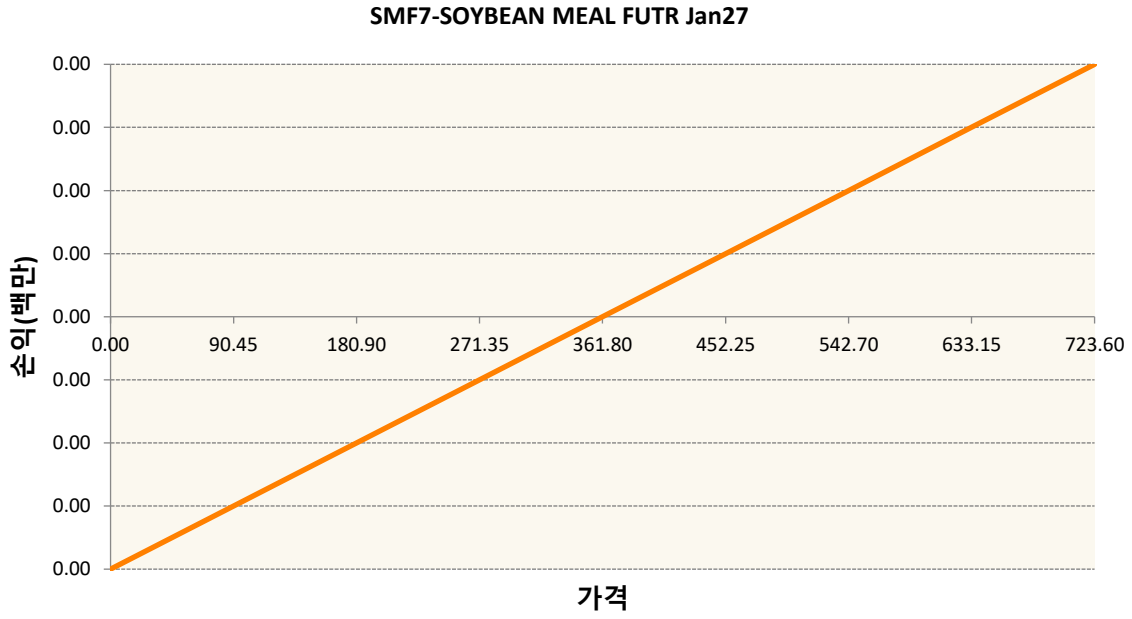

KR4A756A0000-2026-10 달러선물
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
335.63
671.25
1,006.88
1,342.50
1,678.13
2,013.75
2,349.38
2,685.00
손익(백만)
가격

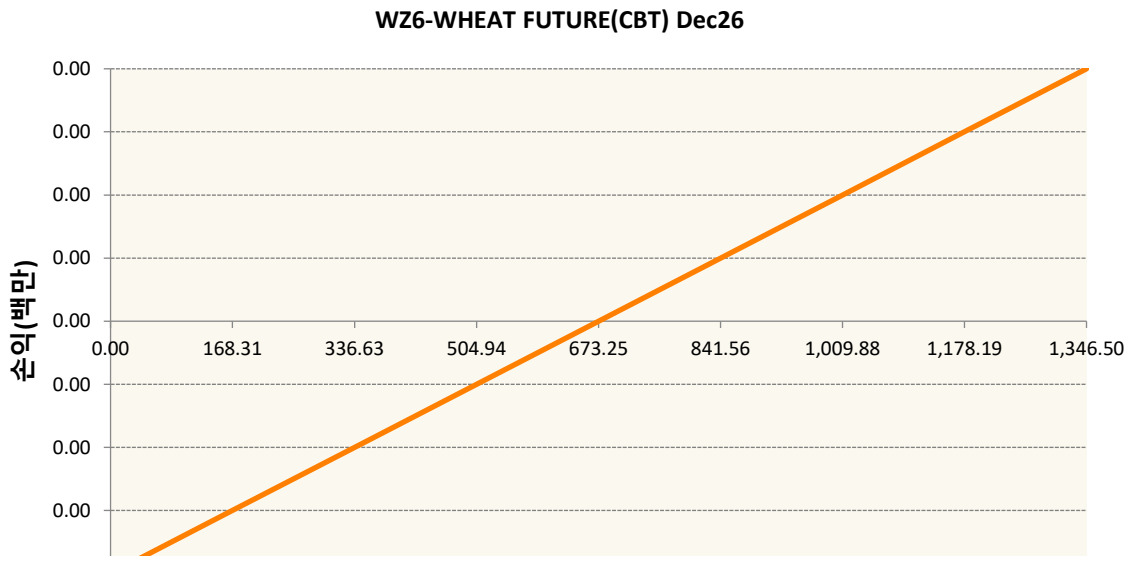

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
178.75
357.50
536.25
715.00
893.75
1,072.50
1,251.25
1,430.00
손익(백만)
가격


SBH7-SUGAR #11 (WORLD) MAR27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
5.21
10.42
15.63
20.84
26.05
31.26
36.47
41.68
손익(백만)


0.00
가격


SF7-SOYBEAN FUTURE Jan27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
323.00
646.00
969.00
1,292.00
1,615.00
1,938.00
2,261.00
2,584.00
손익(백만)
가격


SMF7-SOYBEAN MEAL FUTR Jan27
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
90.45
180.90
271.35
361.80
452.25
542.70
633.15
723.60
손익(백만)
가격


WZ6-WHEAT FUTURE(CBT) Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
168.31
336.63
504.94
673.25
841.56
1,009.88
1,178.19
1,346.50
손익(백만)



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

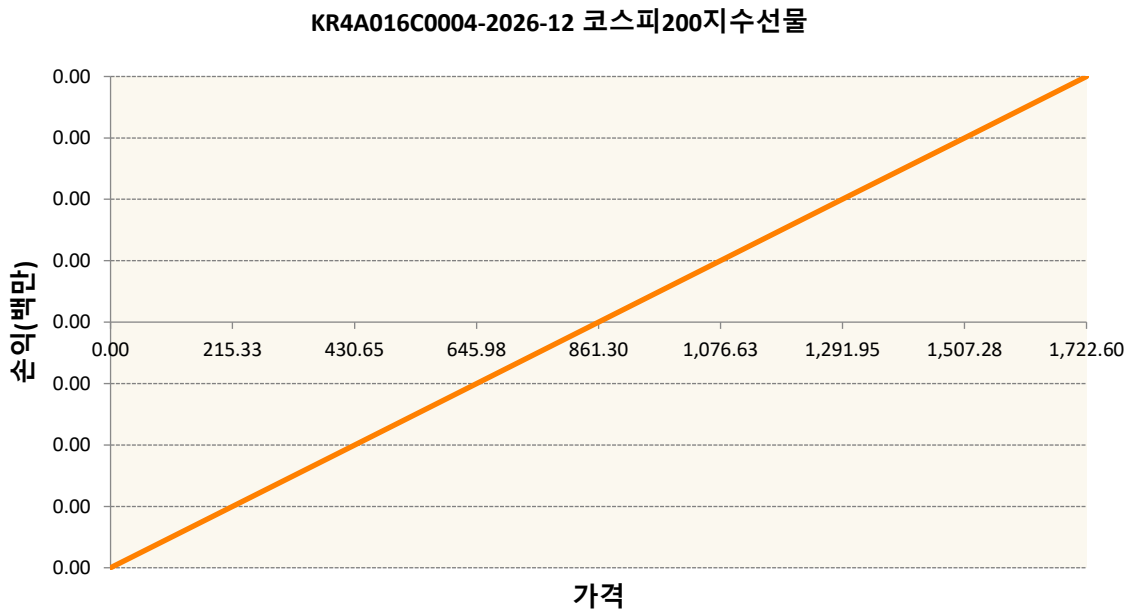
스마트인덱스모

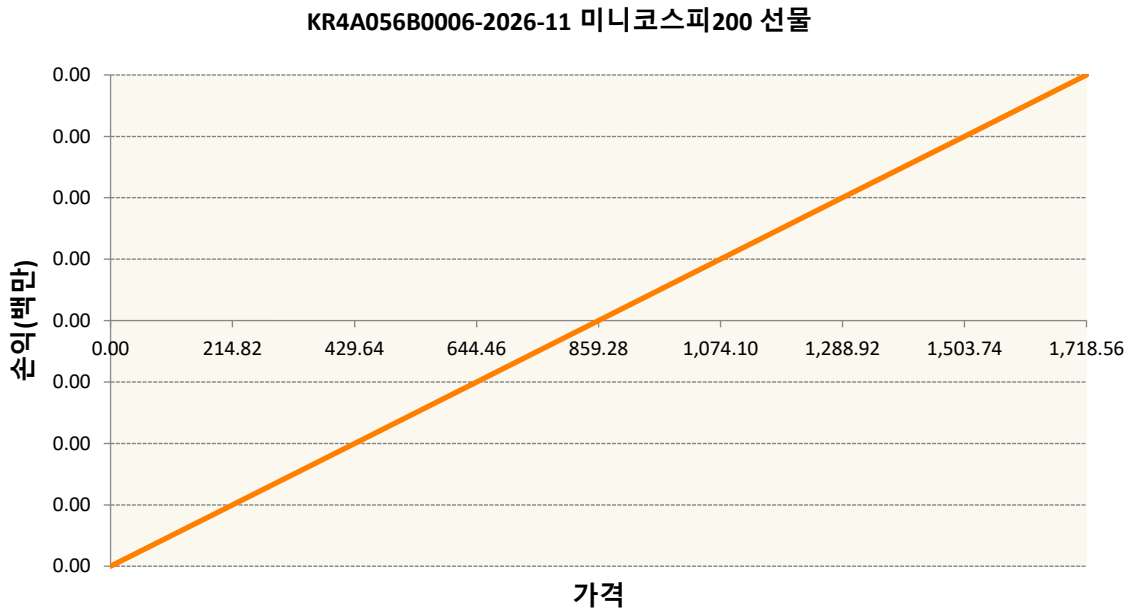
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	2,842	1,111	1,730	장내
누계	유가증권	선물	6,884	0	6,884	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						327
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-327	-327	-327	-327	-327	-327	-327
-5.33%	-218	-218	-218	-218	-218	-218	-218
-2.67%	-109	-109	-109	-109	-109	-109	-109
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	109	109	109	109	109	109	109
5.33%	218	218	218	218	218	218	218
8.00%	327	327	327	327	327	327	327

KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물						45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

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

1,286

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

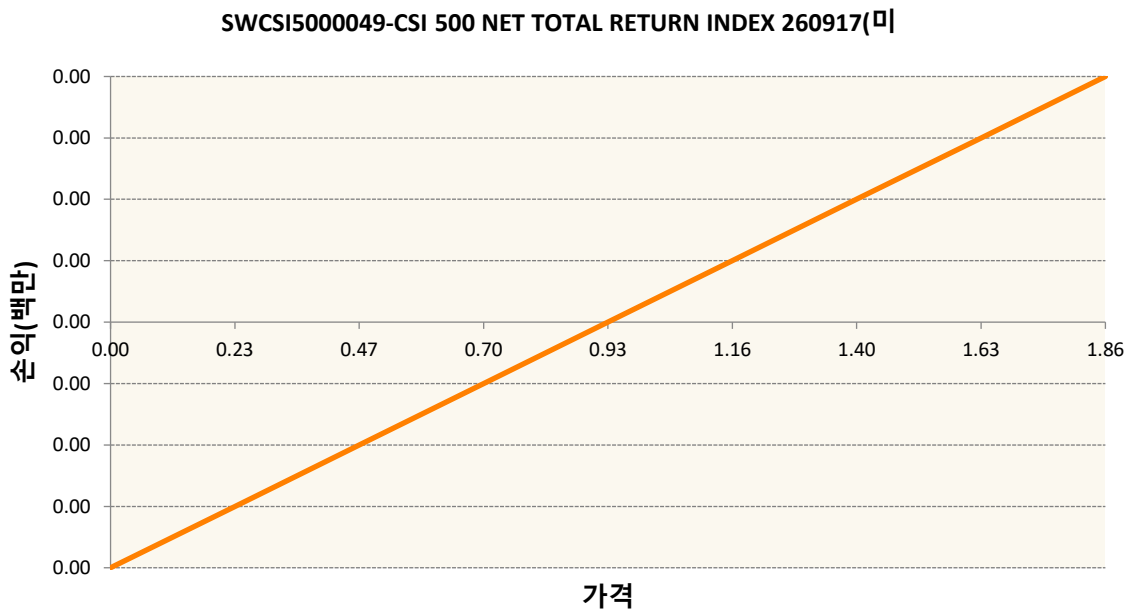
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,948	0	4,948	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	395

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

631

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

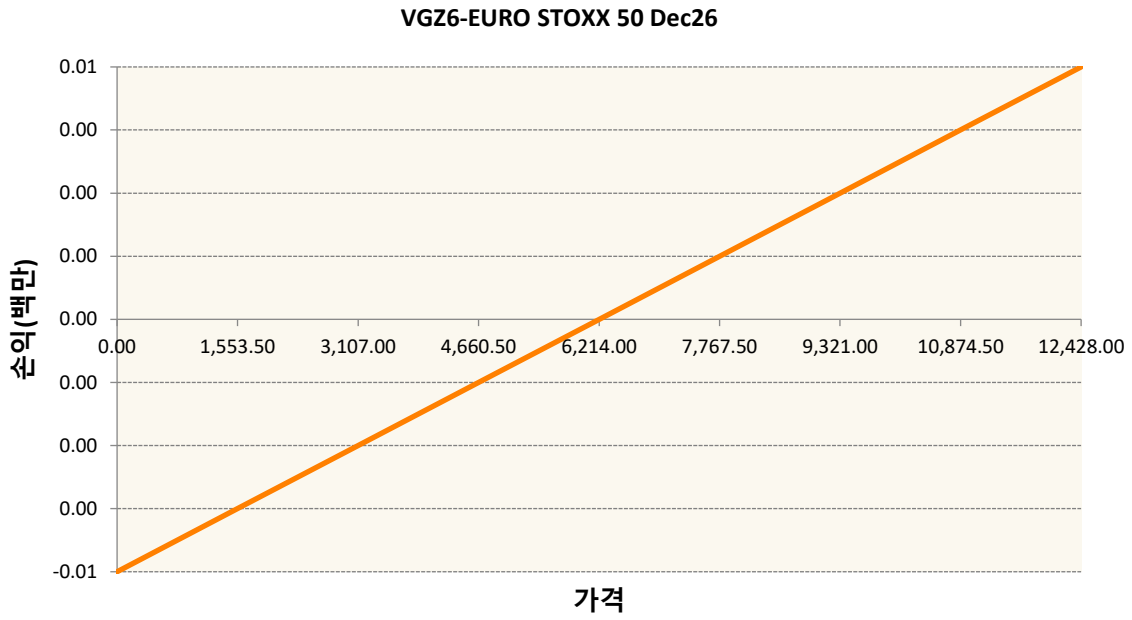
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,179	0	1,179	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGZ6	EURO STOXX 50 Dec26	94

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

(단위:백만원)

69

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

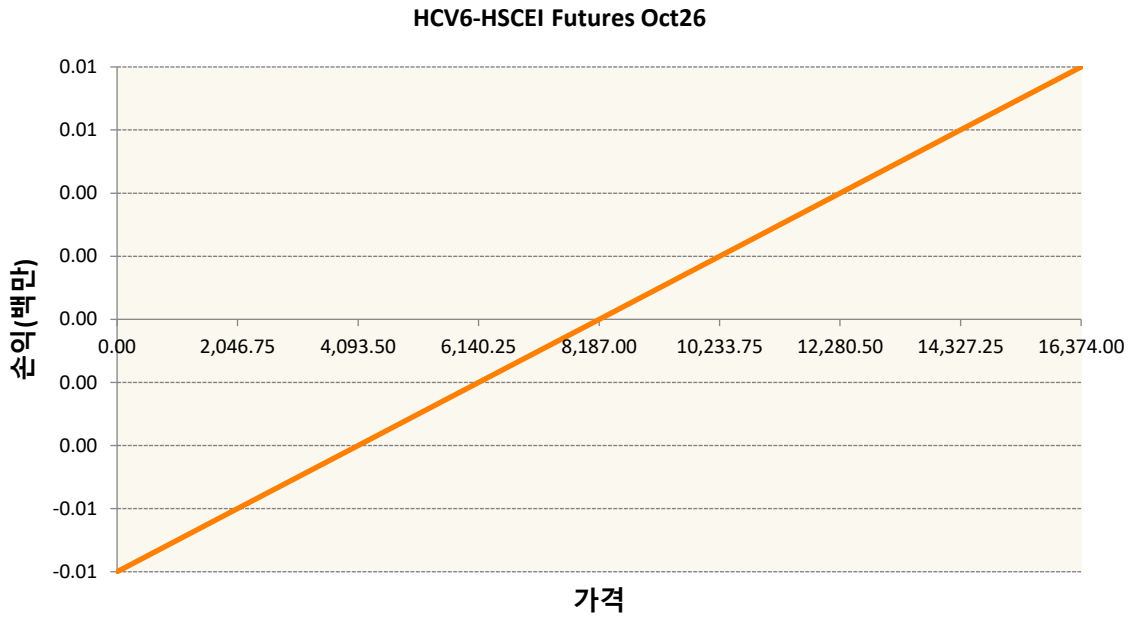
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,424	0	1,424	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV6	HSCEI Futures Oct26	114

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

(단위:백만원)

107

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

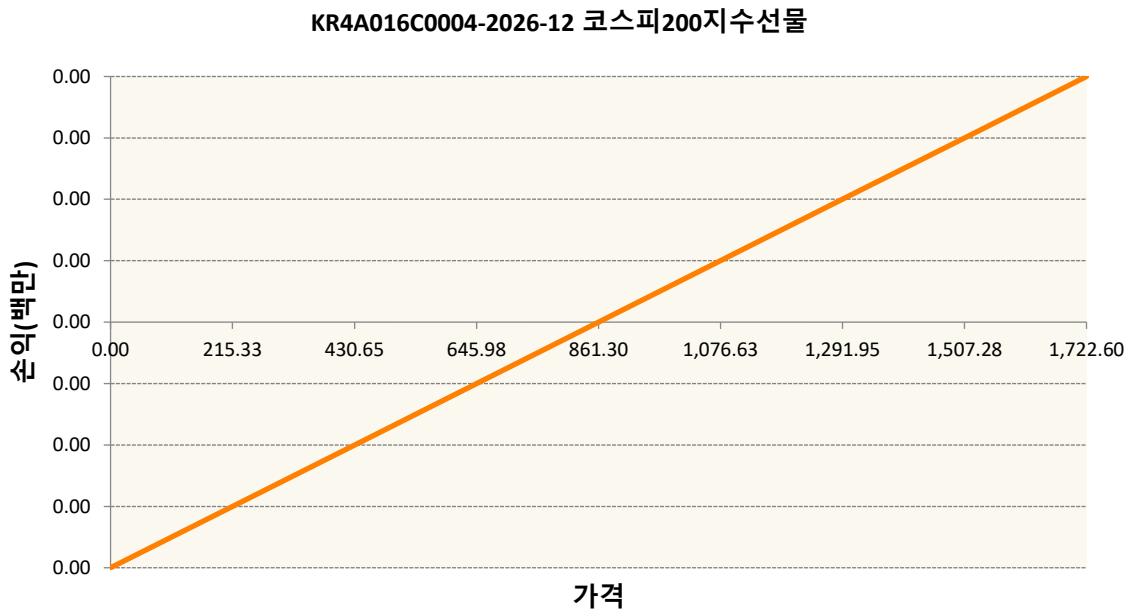
커버드콜모(주식혼합-파생형)

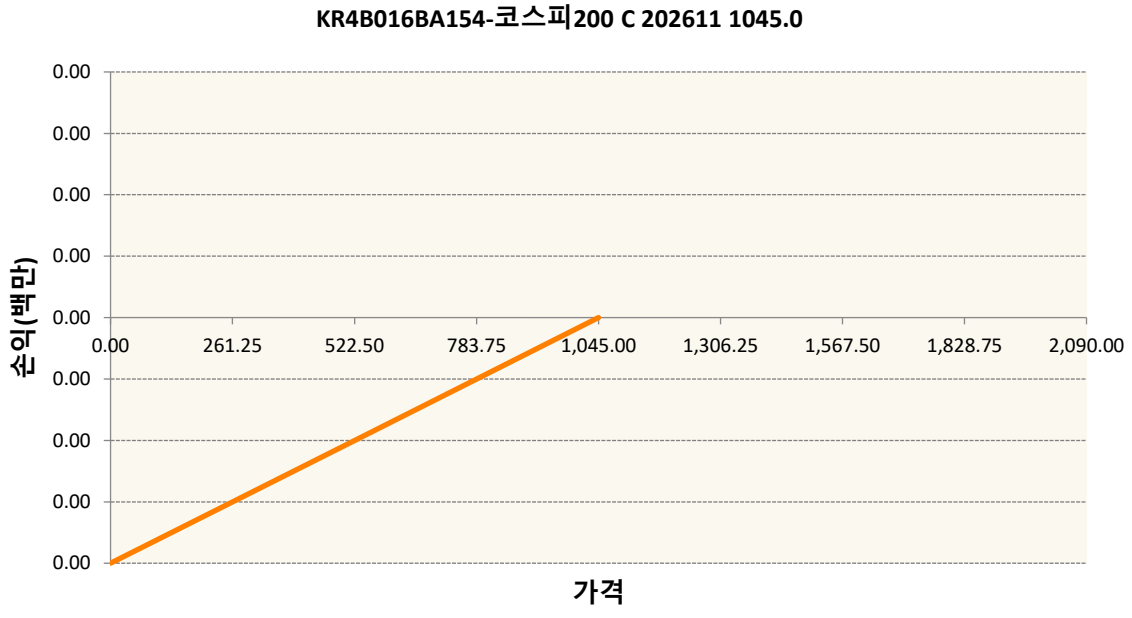
1. 계약금액

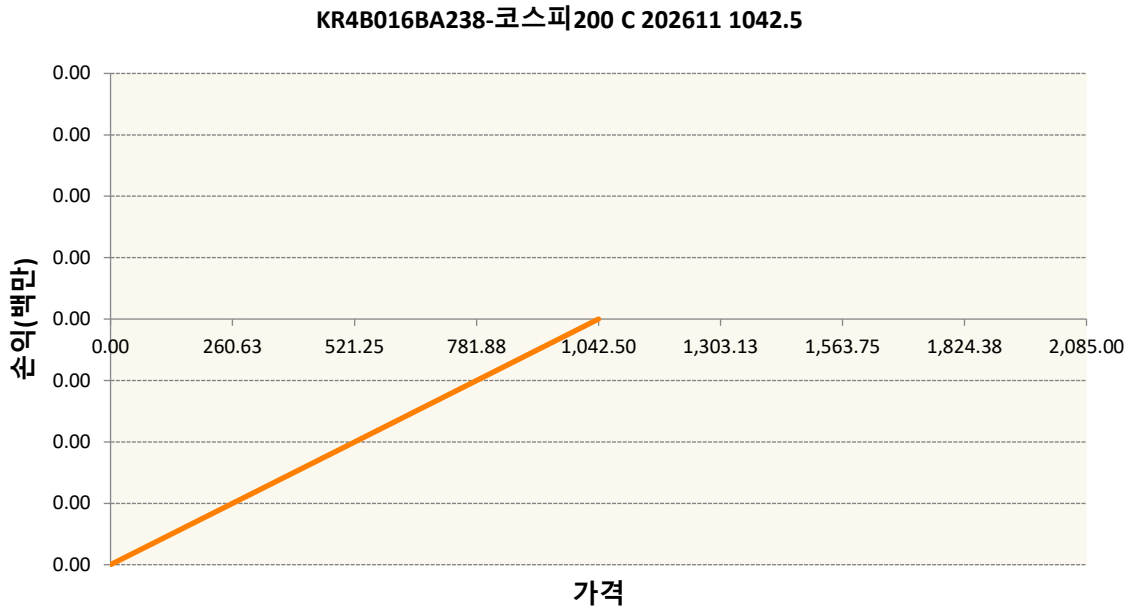
(단위:백만원)

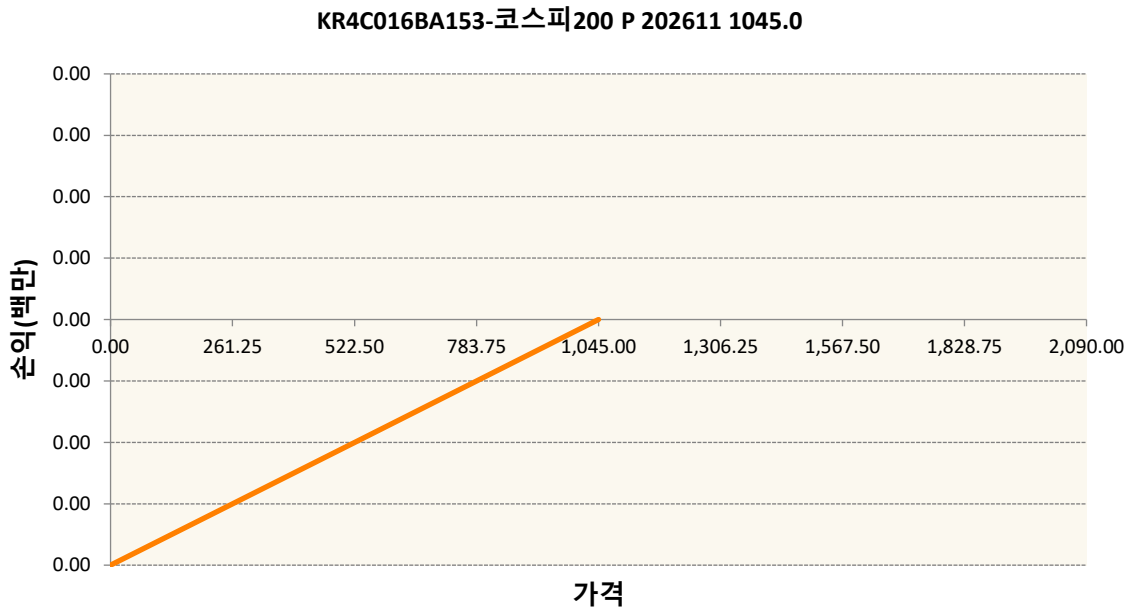
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	431	0	431	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	646	0	646	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,876	-49,876	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						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
KR4B016BA154	코스피200 C 202611 1045.0						1,952
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,763	-1,776	-1,796	-1,824	-1,859	-1,902	-1,952
-5.33%	-1,109	-1,130	-1,160	-1,199	-1,245	-1,300	-1,362
-2.67%	-464	-496	-538	-589	-649	-717	-792
0%	168	122	66	0	-74	-156	-245
2.67%	783	720	648	566	476	380	279
5.33%	1,373	1,292	1,202	1,104	1,000	890	776
8.00%	1,933	1,833	1,726	1,612	1,494	1,371	1,245
	KR4B016BA238		코스피200 C 202611 1042.5				622
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-560	-565	-571	-580	-592	-606	-622
-5.33%	-352	-359	-369	-381	-396	-414	-434
-2.67%	-146	-157	-171	-187	-207	-229	-253
0%	55	40	21	0	-24	-51	-79
2.67%	250	230	206	180	151	120	87
5.33%	438	411	382	351	317	282	245
8.00%	615	583	548	512	473	434	394
	KR4C016BA153		코스피200 P 202611 1045.0				639
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-578	-582	-588	-597	-609	-623	-639
-5.33%	-363	-370	-380	-393	-408	-426	-446
-2.67%	-152	-163	-176	-193	-213	-235	-260
0%	55	40	22	0	-24	-51	-80
2.67%	256	236	212	185	156	125	91
5.33%	450	423	394	362	328	292	254
8.00%	633	601	565	528	489	449	408

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

6,058

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

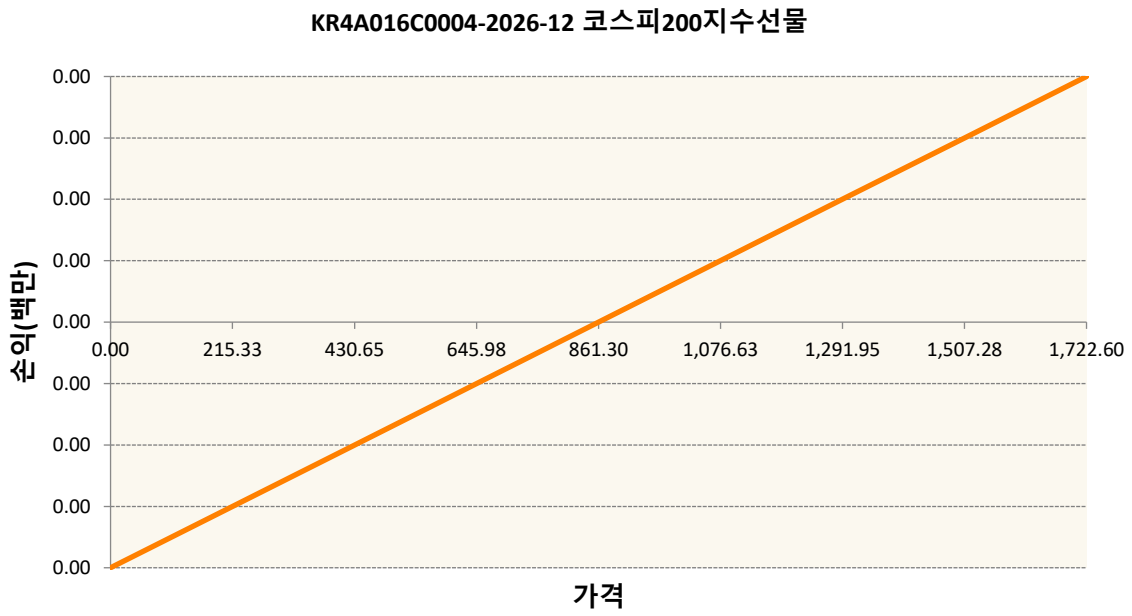
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

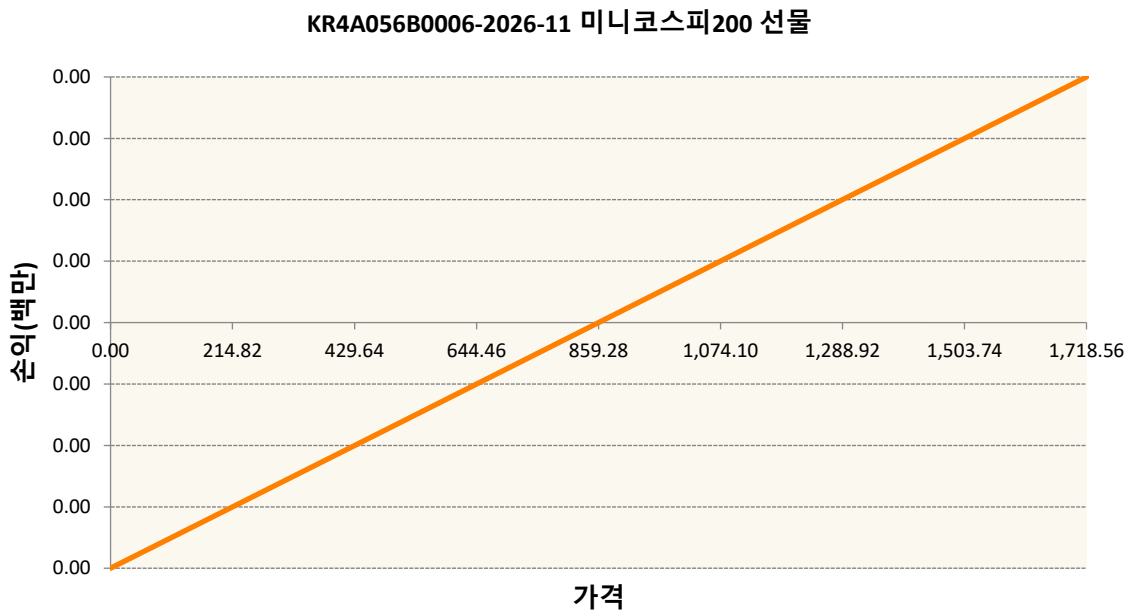
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	653	224	429	장내
누계	유가증권	선물	2,365	0	2,365	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						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

KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물						28
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-28	-28	-28	-28	-28	-28	-28
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
-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%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	28	28	28	28	28	28	28

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

(단위:백만원)

274

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

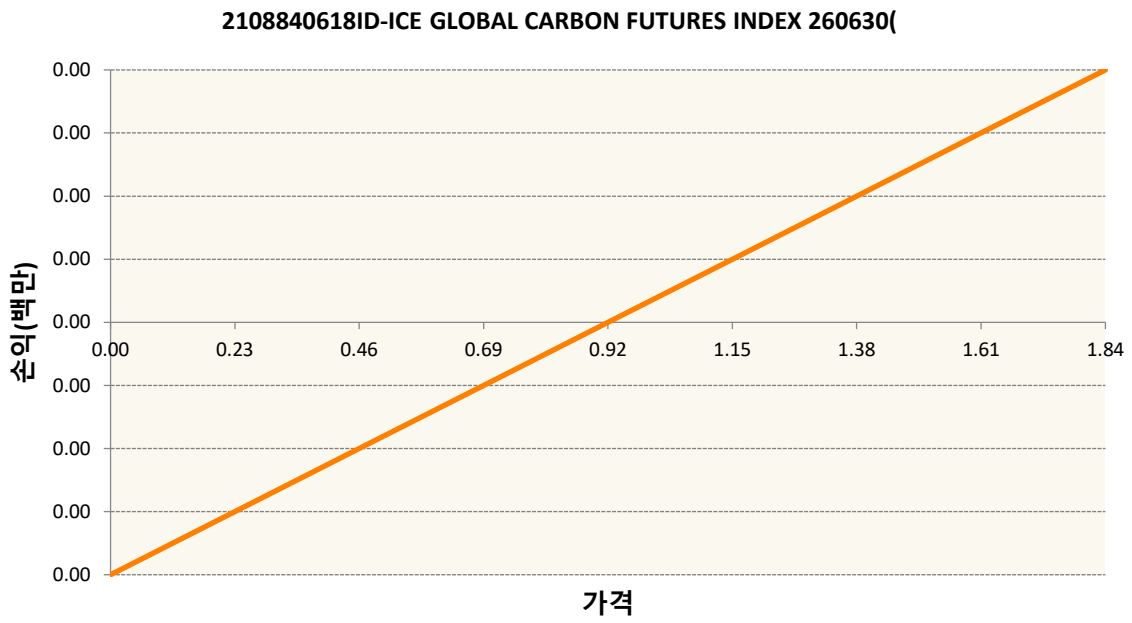
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

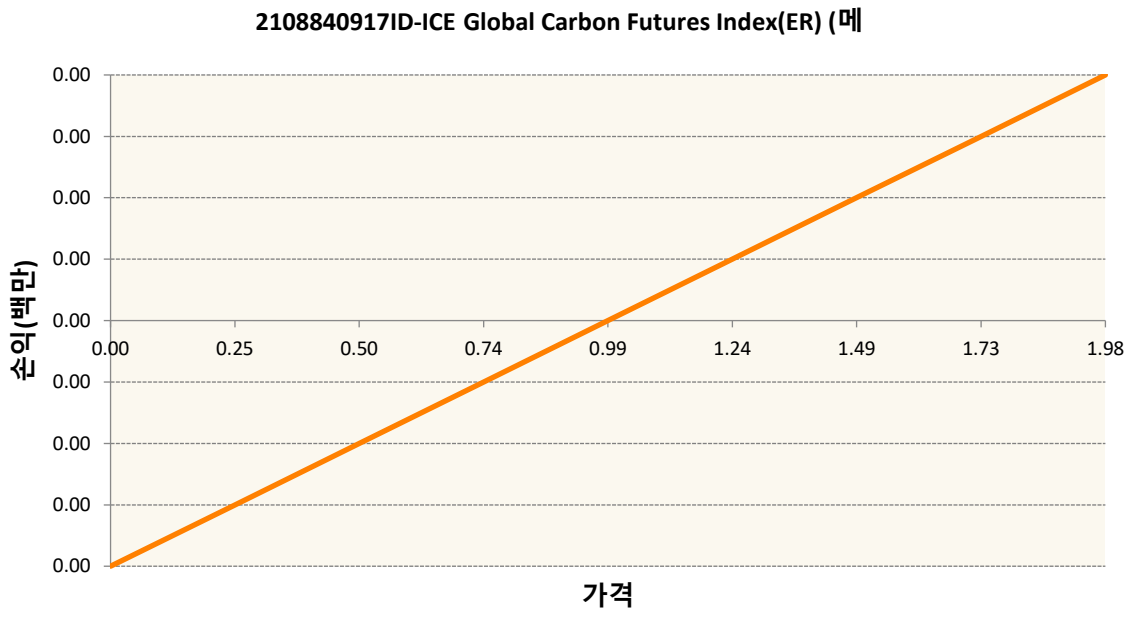
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7,000	0	7,000	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ㅣICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	446
2108840917ㅣICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	113

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

577

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

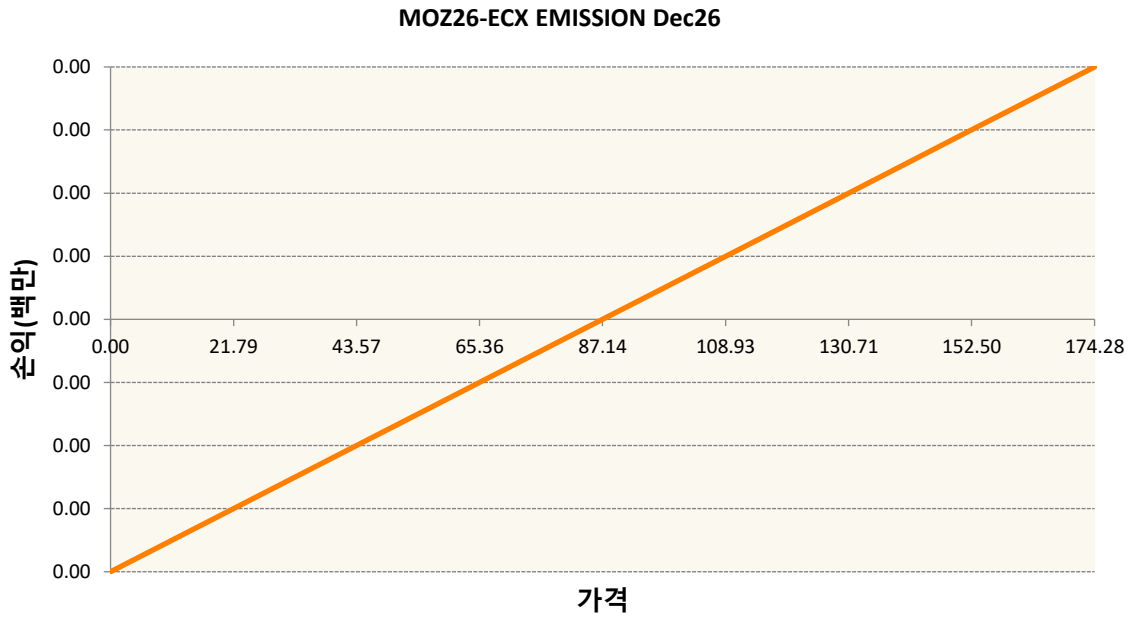
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,148	0	6,148	
누계	통화	선도	0	2,501	-2,501	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G9V	KRW/EUR 30-10-26E	200
MOZ26	ECX EMISSION Dec26	492

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

(단위:백만원)

730

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

신한SOL차이나태양광CSI증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	-575	0	-575	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	8
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	8
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	12
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	19

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

(단위:백만원)

71

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

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	-5,061	0	-5,061	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	34
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	299
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	71

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

(단위:백만원)

760

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

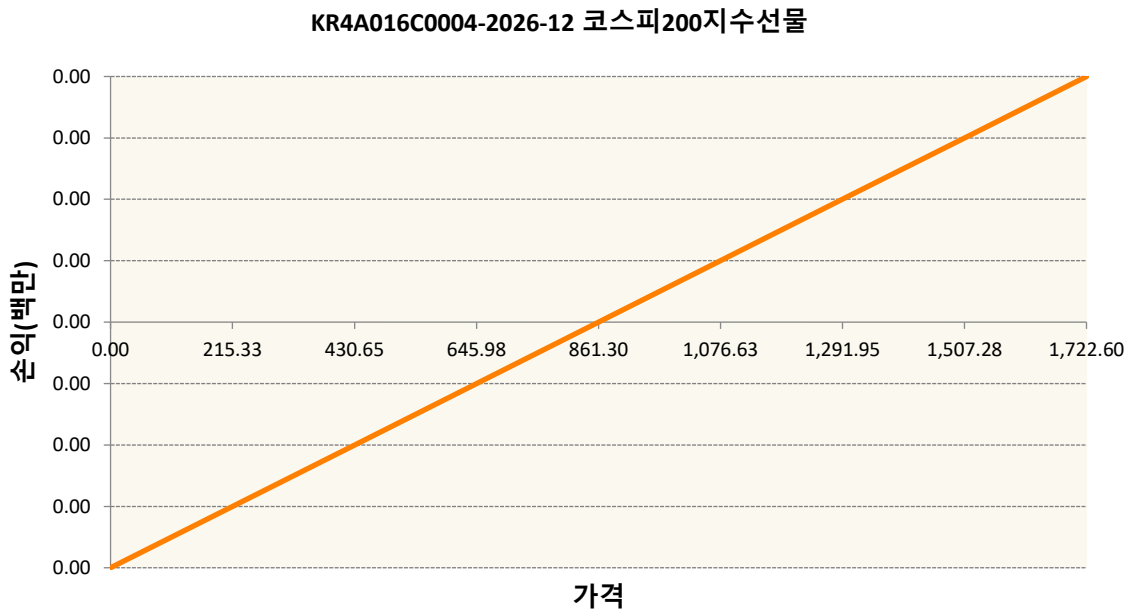
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

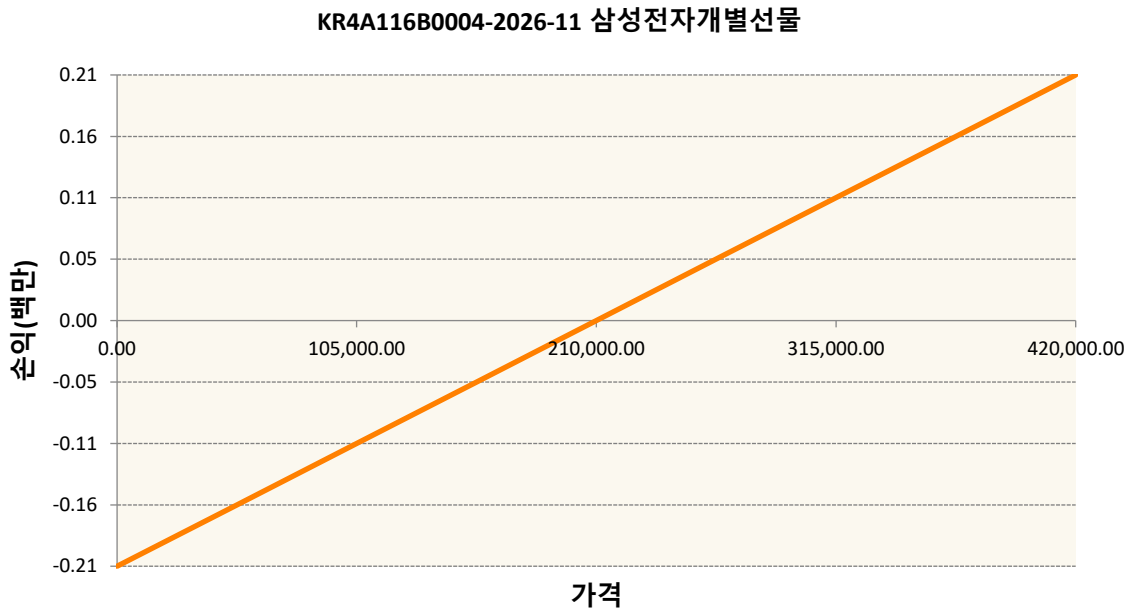
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	4,400	3,779	621	장내
누계	유가증권	선물	18,458	0	18,458	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						1,429
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,429	-1,429	-1,429	-1,429	-1,429	-1,429	-1,429
-5.33%	-953	-953	-953	-953	-953	-953	-953
-2.67%	-476	-476	-476	-476	-476	-476	-476
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	476	476	476	476	476	476	476
5.33%	953	953	953	953	953	953	953
8.00%	1,429	1,429	1,429	1,429	1,429	1,429	1,429

KR4A116B0004	2026-11 삼성전자개별선물						47
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	47	47	47	47	47	47	47

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

5,137

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

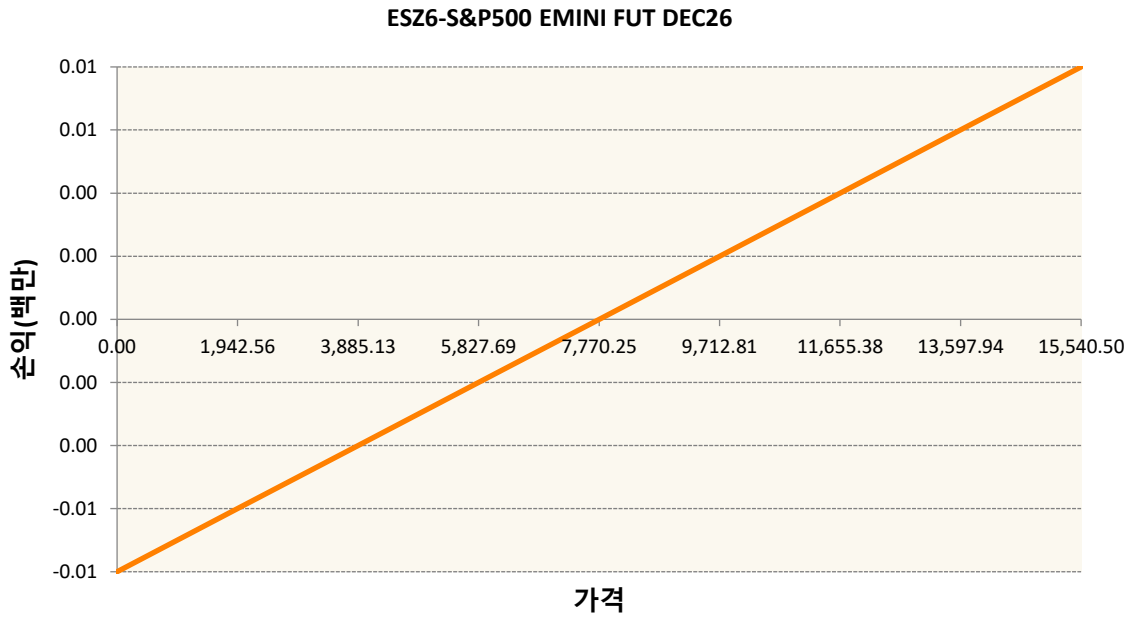
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

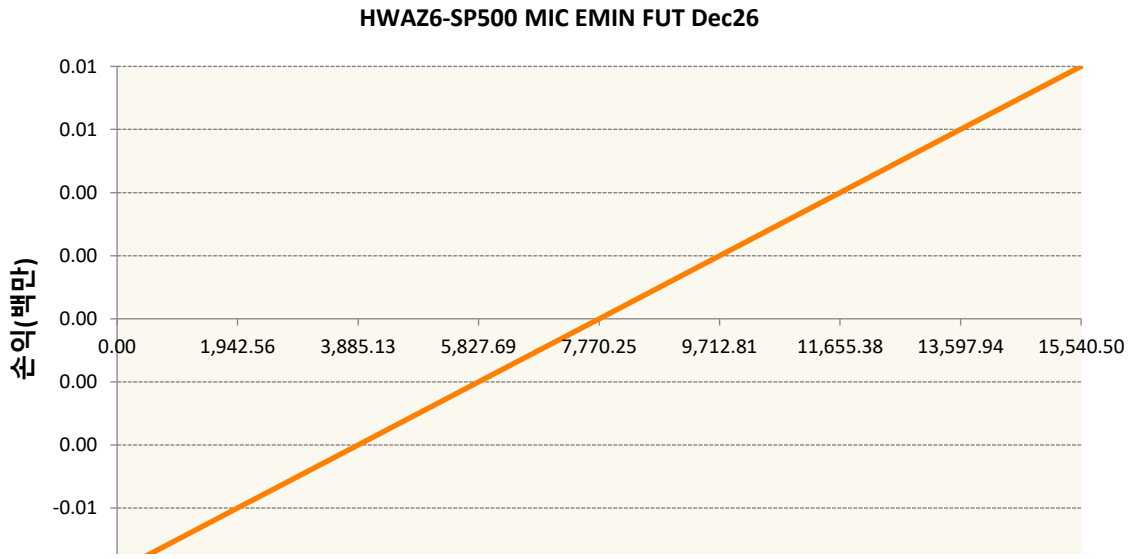
1. 계약금액

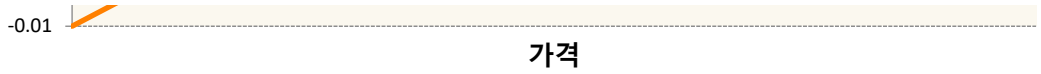
(단위:백만원)

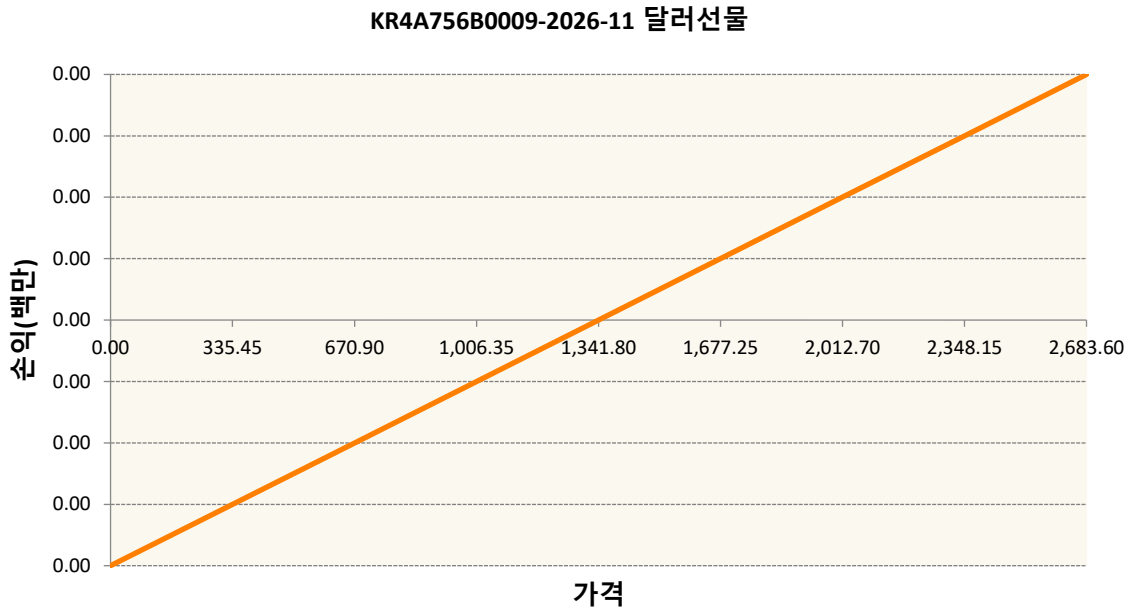
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	942	0	942	장내
누계	지수	선물	77,206	0	77,206	
누계	지수	선물	376	0	376	장내
누계	통화	선물	17,712	0	17,712	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,176
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756B00	2026-11 달러선물	1,417

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

3,712

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

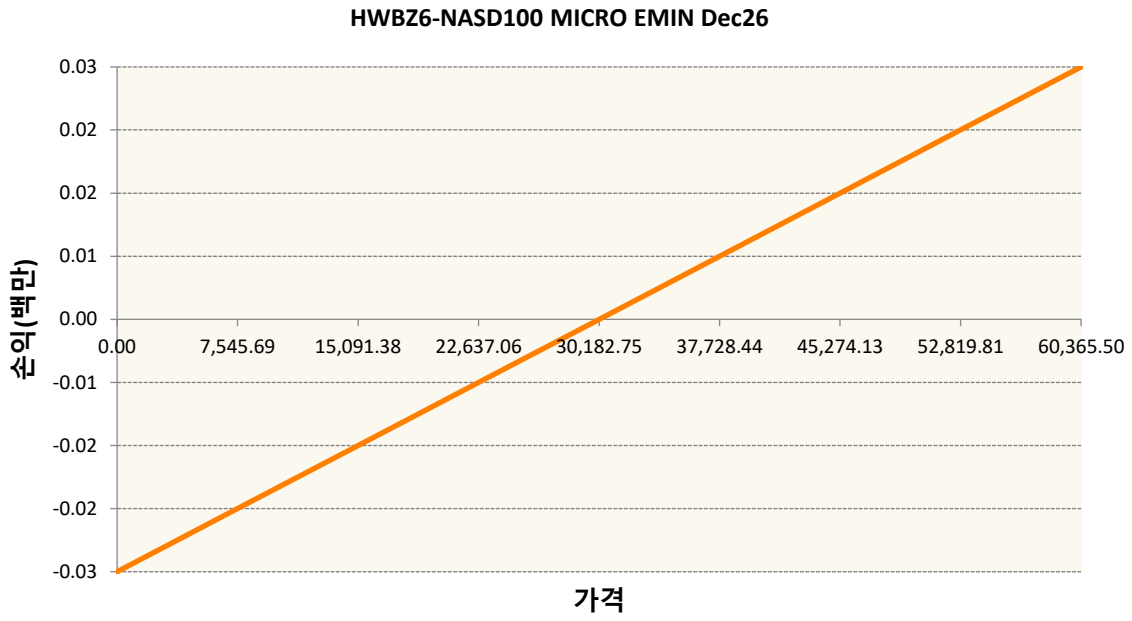
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

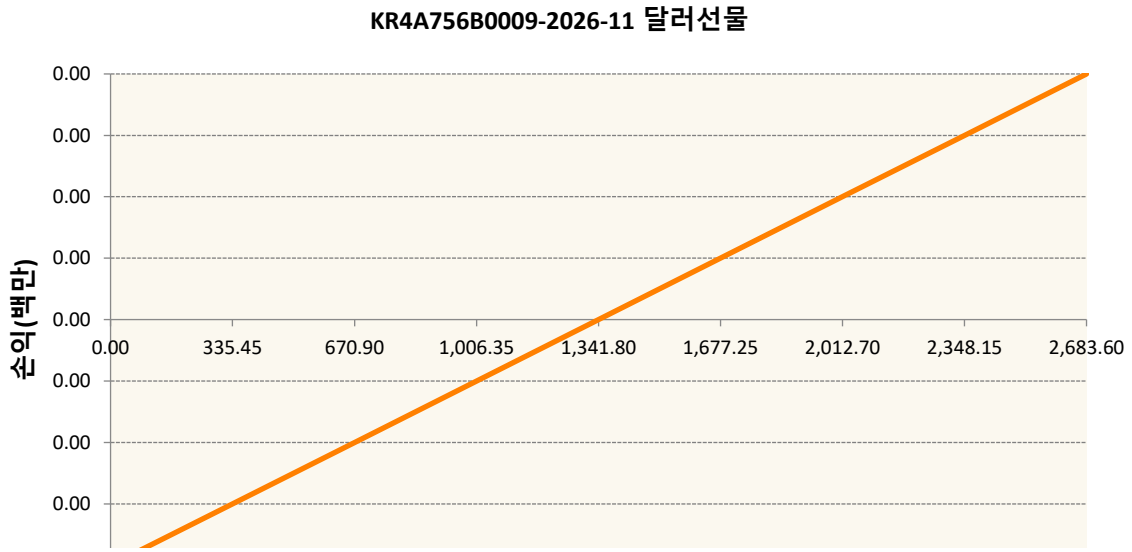
1. 계약금액

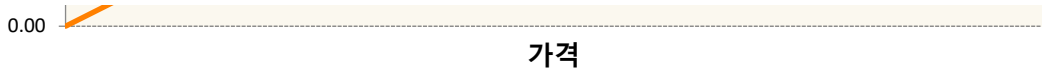
(단위:백만원)

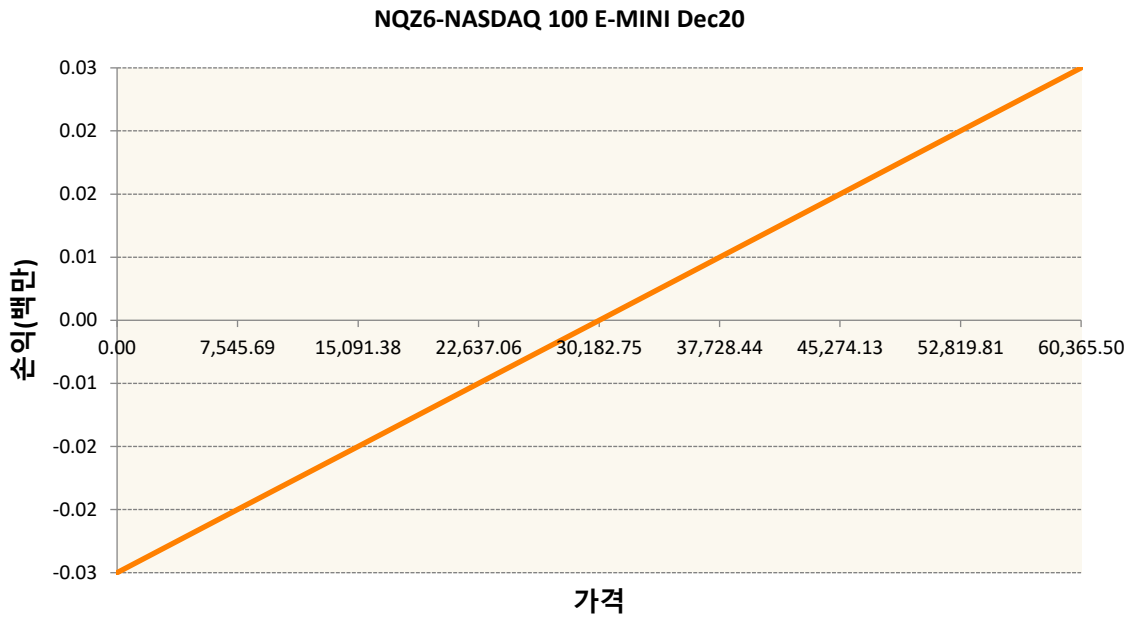
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	404	0	404	장내
누계	지수	선물	35,018	0	35,018	
누계	지수	선물	417	0	417	장내
누계	통화	선물	8,265	0	8,265	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	33
KR4A756B00	2026-11 달러선물	661
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,801

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	2,499

공시일	2026-10-16
기준일	2026-10-15

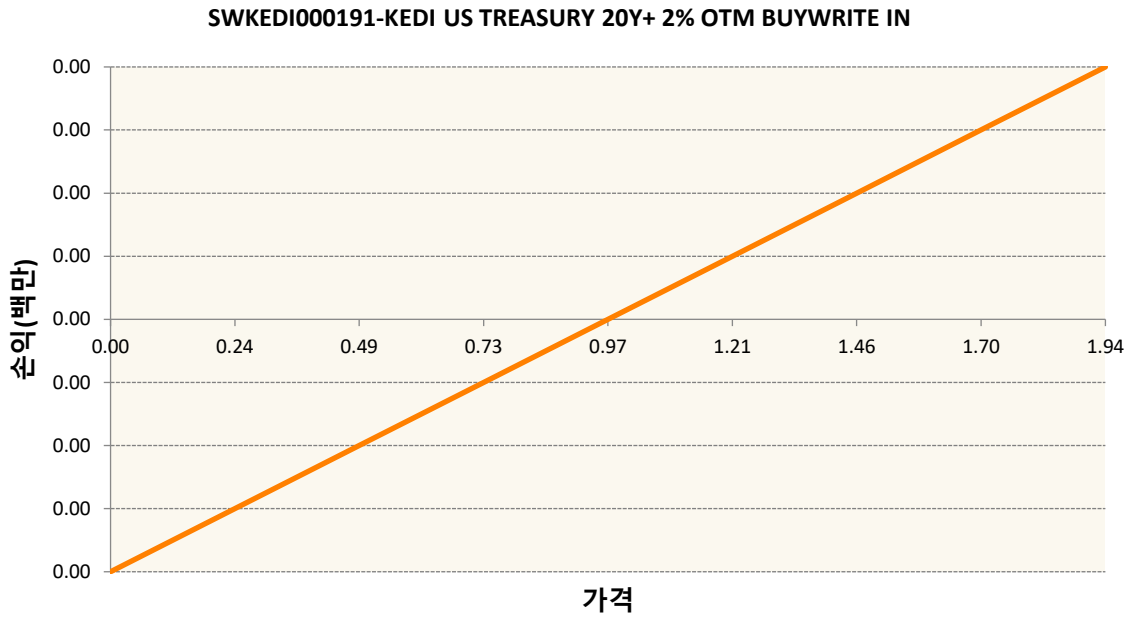
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

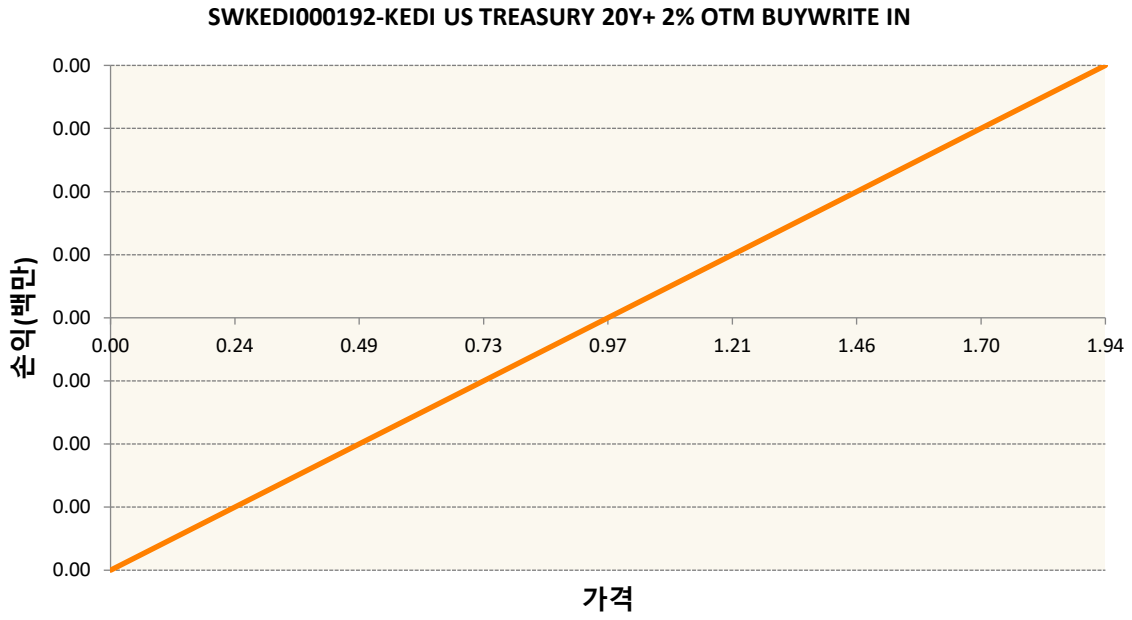
1. 계약금액

(단위:백만원)

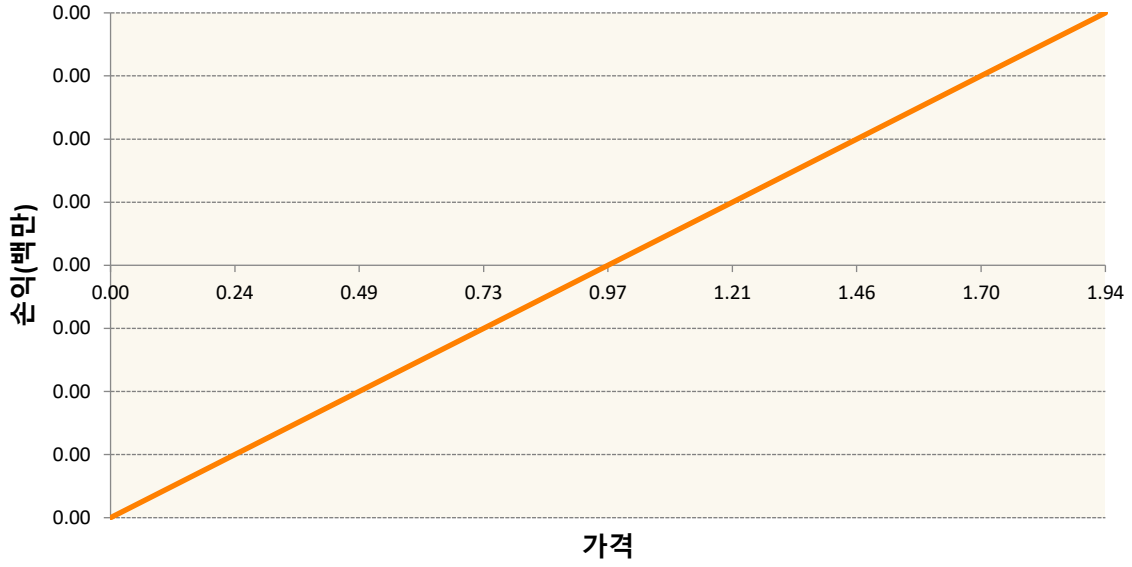
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	271,045	0	271,045	장외

2. 만기시점의 손익구조

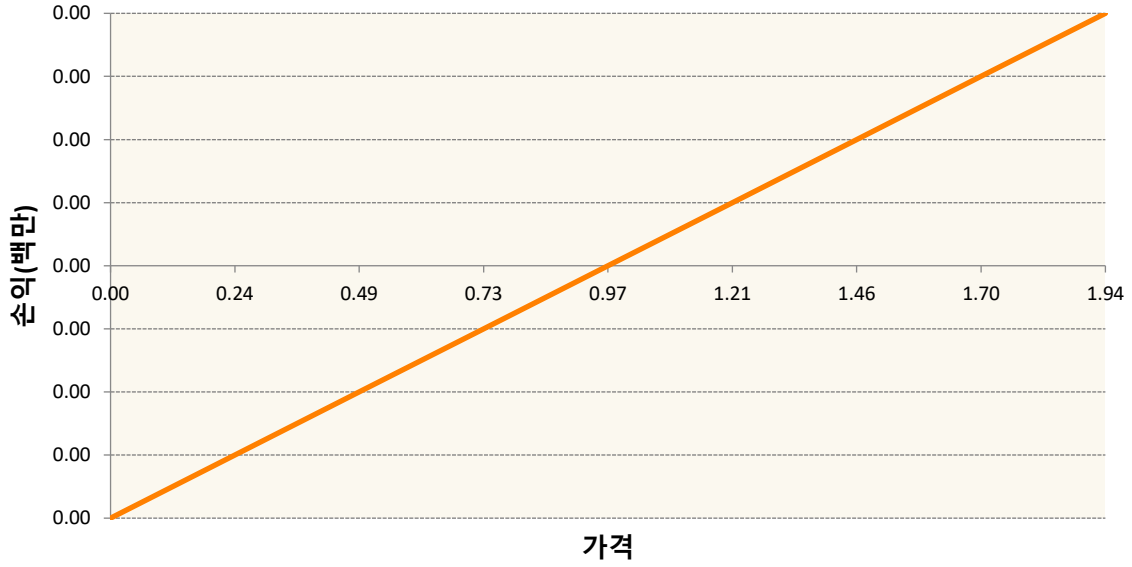




SWKEDI000193-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



SWKEDI000194-KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,635
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,687
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,814
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,454

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

8,489