공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

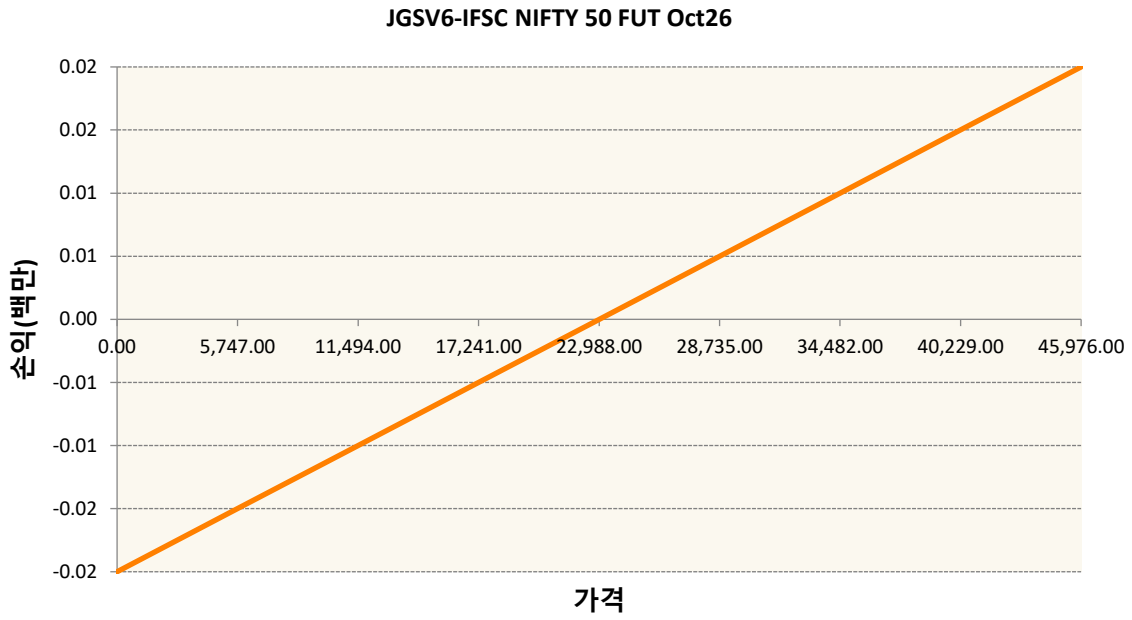
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	314	0	314	

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	2026-10-19
기준일	2026-10-16

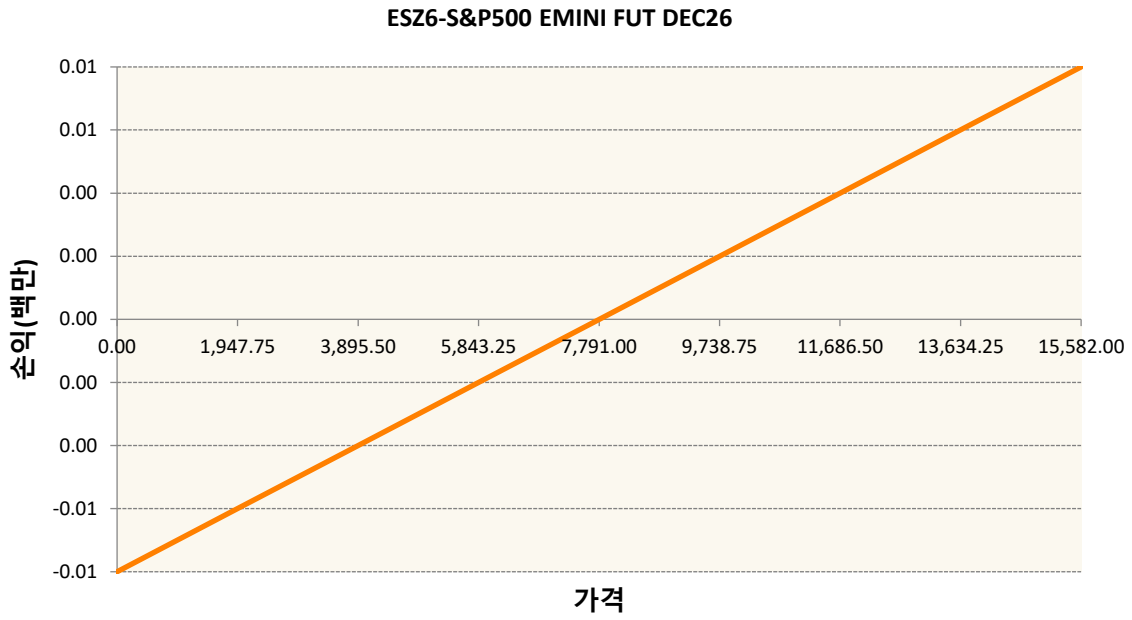
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	538	0	538	

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	2026-10-19
기준일	2026-10-16

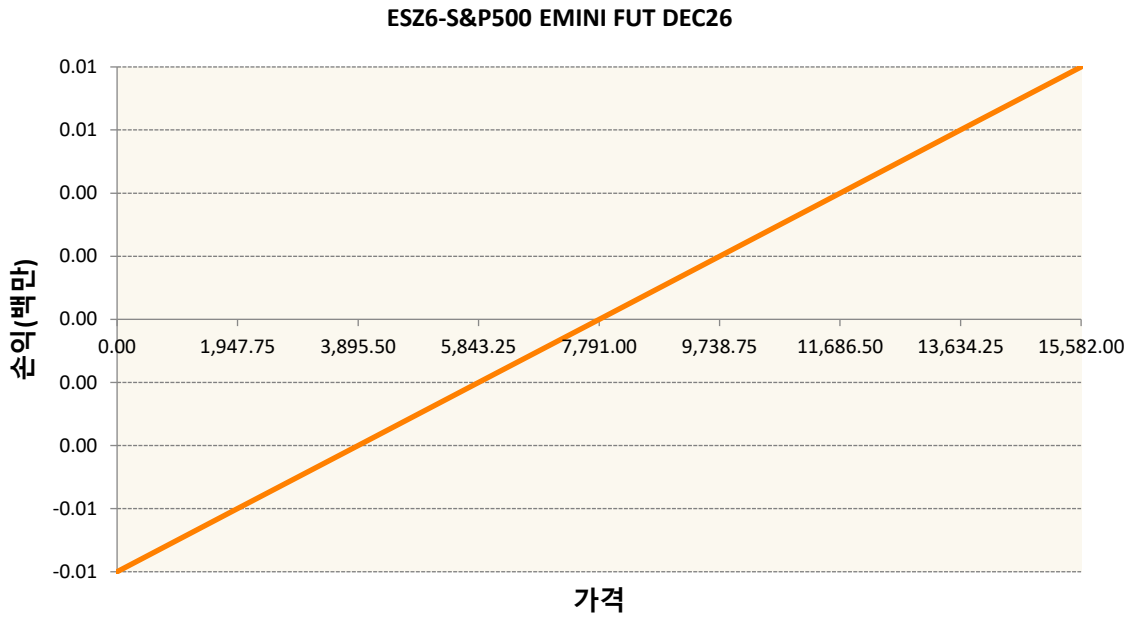
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	538	0	538	

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	2026-10-19
기준일	2026-10-16

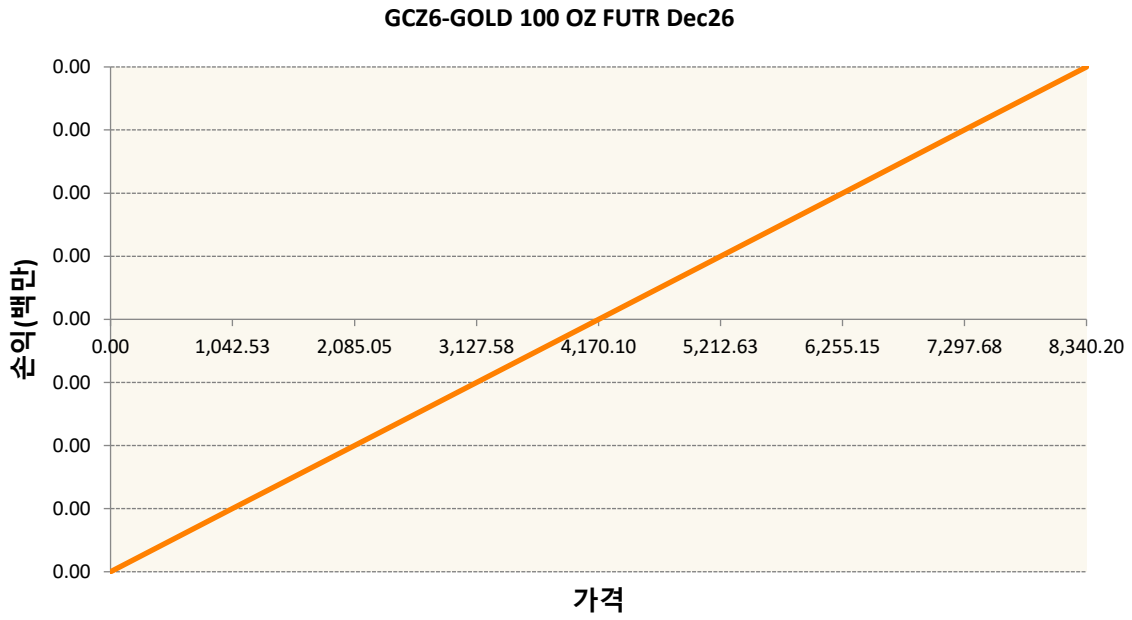
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,941	0	5,941	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 10/23/26 C387 EQUITY	0.37
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	475

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

(단위:백만원)

607

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

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	664

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

(단위:백만원)

2,288

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

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	1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

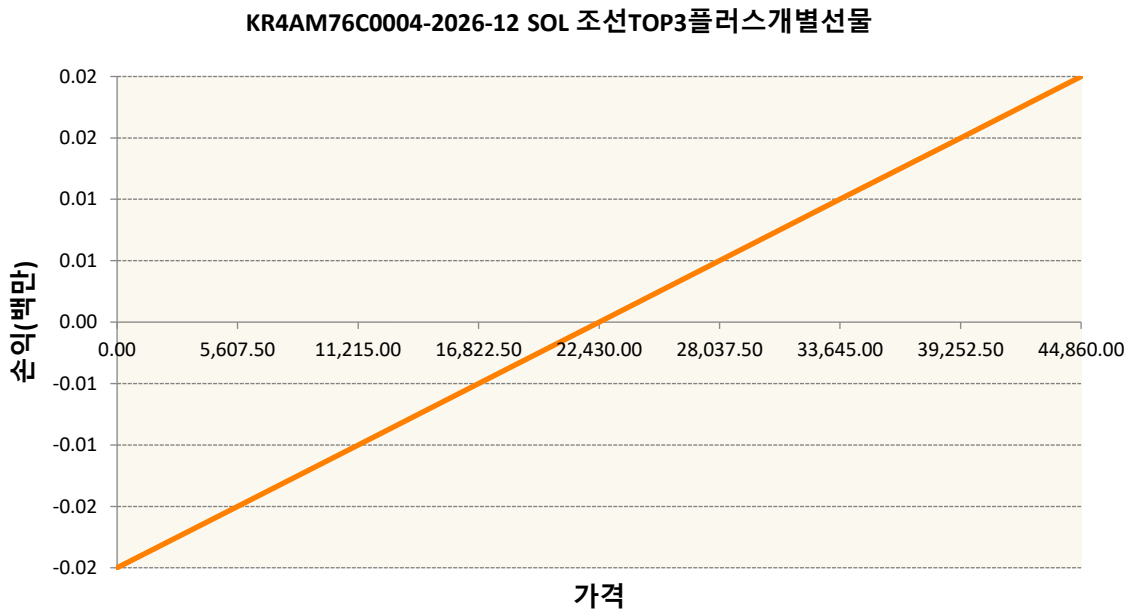
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	225	0	225	장내
누계	유가증권	선물	7,323	0	7,323	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						5,840
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,840	-5,840	-5,840	-5,840	-5,840	-5,840	-5,840
-5.33%	-3,893	-3,893	-3,893	-3,893	-3,893	-3,893	-3,893
-2.67%	-1,947	-1,947	-1,947	-1,947	-1,947	-1,947	-1,947
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,947	1,947	1,947	1,947	1,947	1,947	1,947
5.33%	3,893	3,893	3,893	3,893	3,893	3,893	3,893
8.00%	5,840	5,840	5,840	5,840	5,840	5,840	5,840

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

9,969

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

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	2026-10-19
기준일	2026-10-16

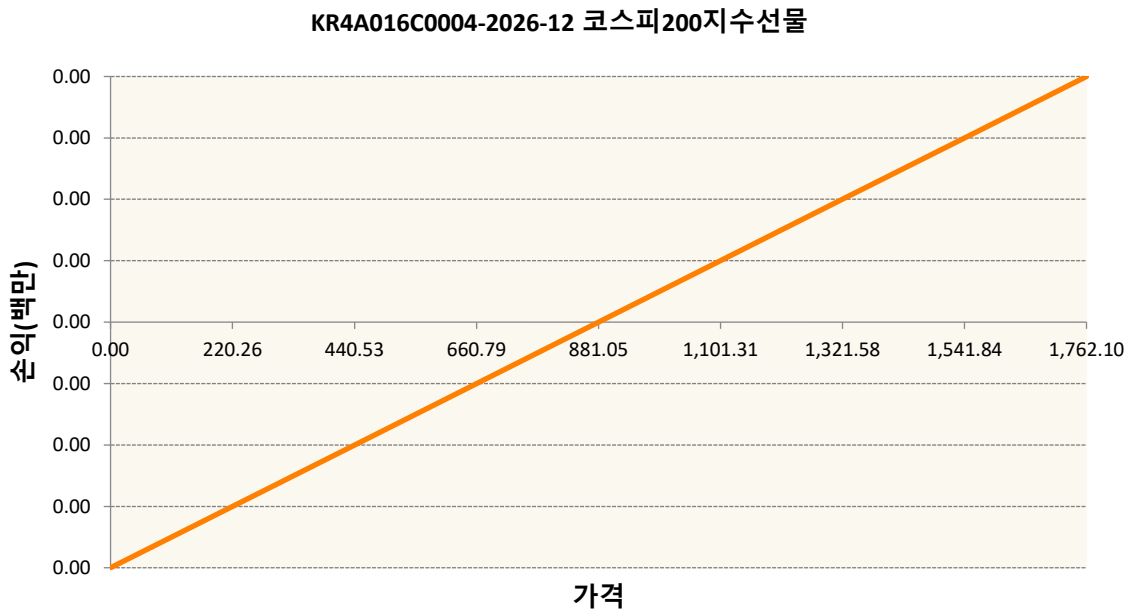
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

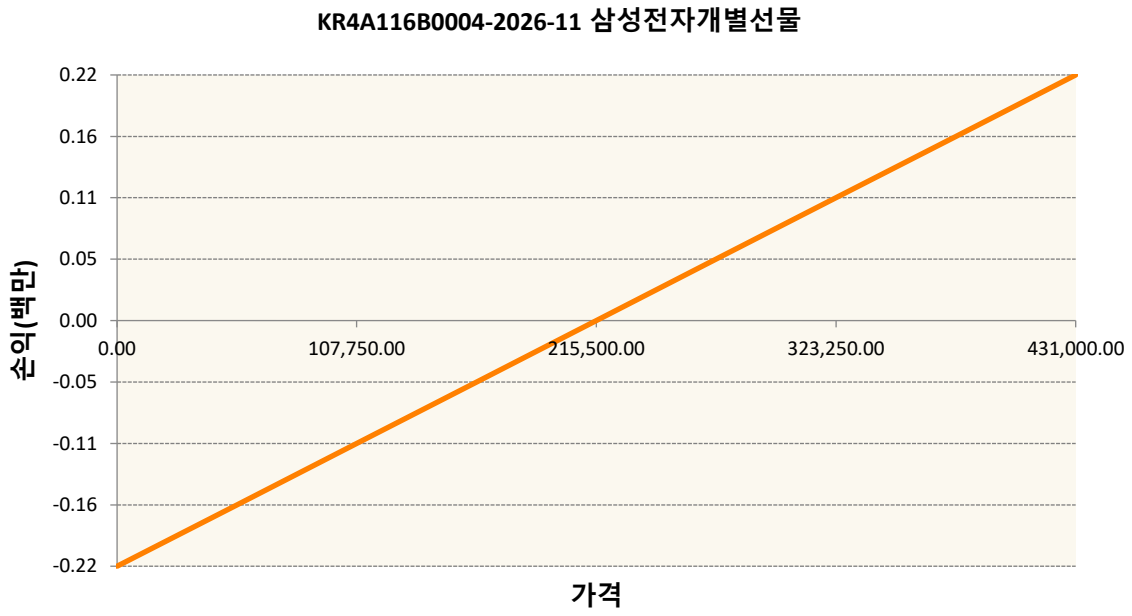
1. 계약금액

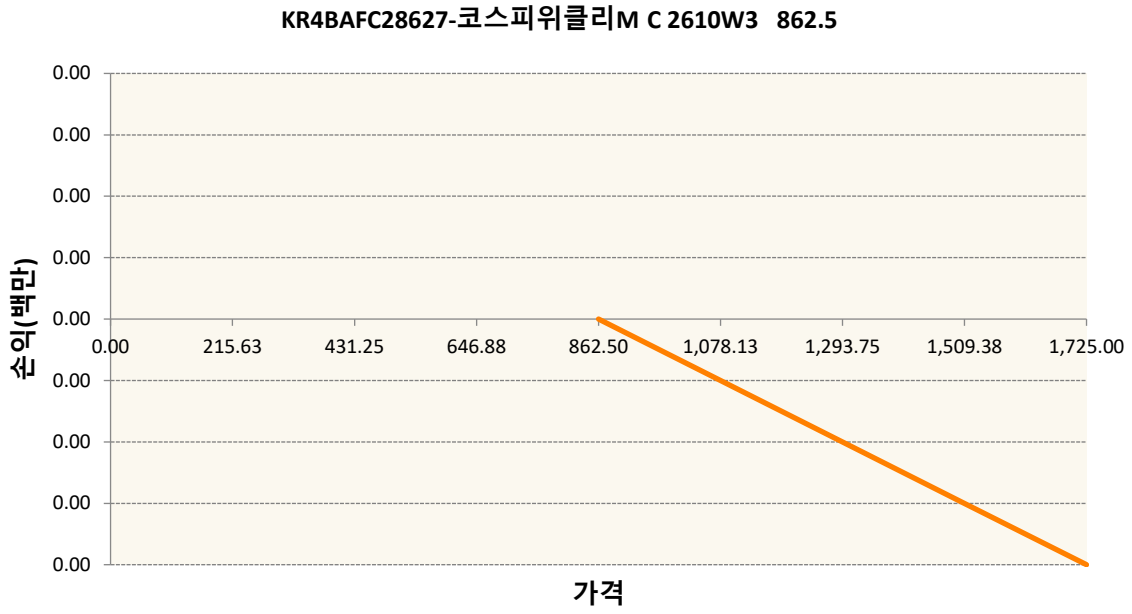
(단위:백만원)

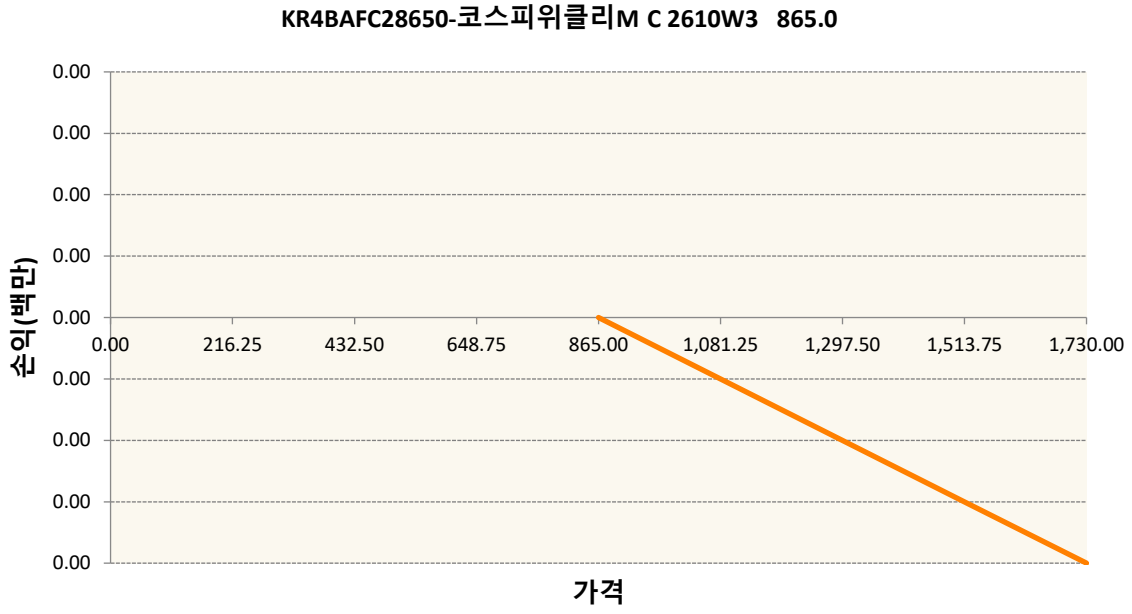
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	17,364	0	17,364	장내
누계	유가증권	옵션	0	35,619	-35,619	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						457
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-457	-457	-457	-457	-457	-457	-457
-5.33%	-304	-304	-304	-304	-304	-304	-304
-2.67%	-152	-152	-152	-152	-152	-152	-152
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	152	152	152	152	152	152	152
5.33%	304	304	304	304	304	304	304
8.00%	457	457	457	457	457	457	457
KR4A116B0004	2026-11 삼성전자개별선물						931
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-931	-931	-931	-931	-931	-931	-931
-5.33%	-621	-621	-621	-621	-621	-621	-621
-2.67%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	310	310	310	310	310	310	310
5.33%	621	621	621	621	621	621	621
8.00%	931	931	931	931	931	931	931
	KR4BAFC28627		코스피위클리M C 2610W3 862.5				1,531
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	619	612	603	592	579	564	548
-5.33%	572	552	530	507	482	456	430
-2.67%	415	383	351	318	286	253	220
0%	91	61	31	0	-31	-63	-95
2.67%	-381	-397	-416	-437	-459	-483	-508
5.33%	-930	-935	-943	-953	-966	-980	-996
8.00%	-1,503	-1,505	-1,507	-1,511	-1,516	-1,523	-1,531
	KR4BAFC28650		코스피위클리M C 2610W3 865.0				1,008
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	388	384	379	372	364	354	344
-5.33%	361	348	335	320	304	288	271
-2.67%	266	245	224	203	181	160	138
0%	62	42	21	0	-21	-43	-64
2.67%	-243	-255	-269	-284	-299	-316	-333
5.33%	-606	-610	-616	-623	-632	-642	-654
8.00%	-987	-988	-990	-993	-997	-1,002	-1,008

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

10,053

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

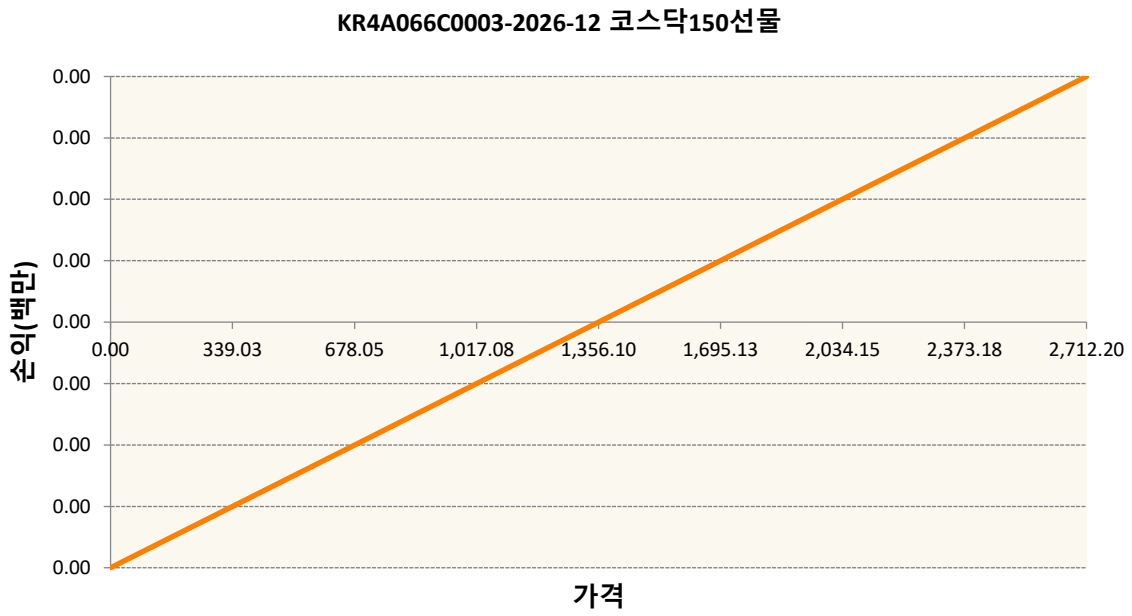
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	556	0	556	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003 2026-12 코스닥150선물 44

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-44	-44	-44	-44	-44	-44	-44
-5.33%	-29	-29	-29	-29	-29	-29	-29
-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%	29	29	29	29	29	29	29
8.00%	44	44	44	44	44	44	44

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

144

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

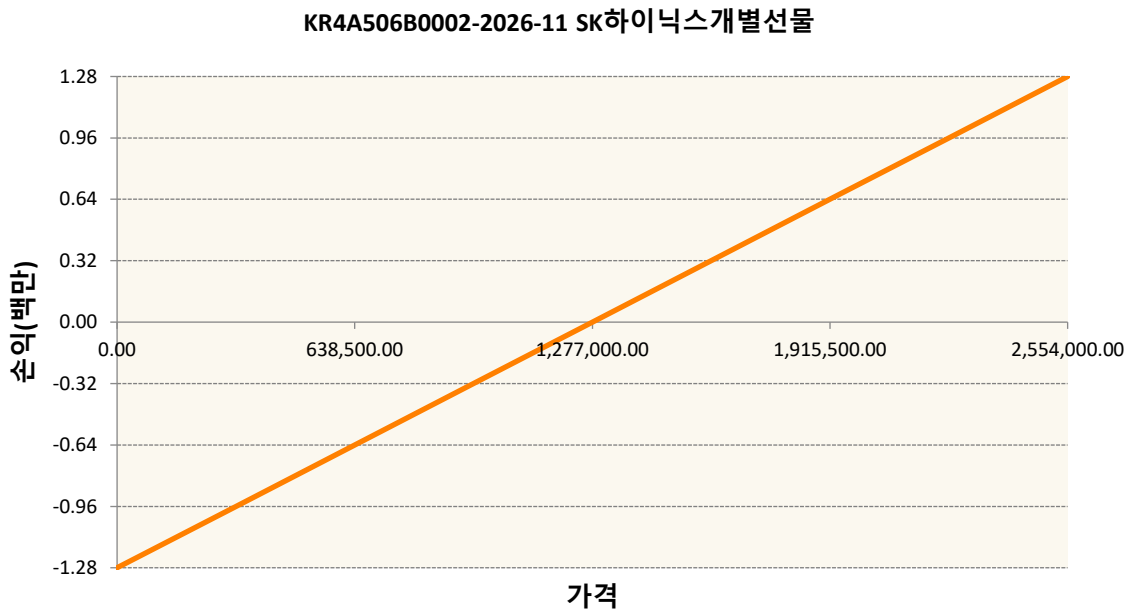
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	745	0	745	장내
누계	유가증권	선물	20,458	0	20,458	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	1,630

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630	-1,630
-5.33%	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087	-1,087
-2.67%	-543	-543	-543	-543	-543	-543	-543
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	543	543	543	543	543	543	543
5.33%	1,087	1,087	1,087	1,087	1,087	1,087	1,087
8.00%	1,630	1,630	1,630	1,630	1,630	1,630	1,630

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

7,905

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

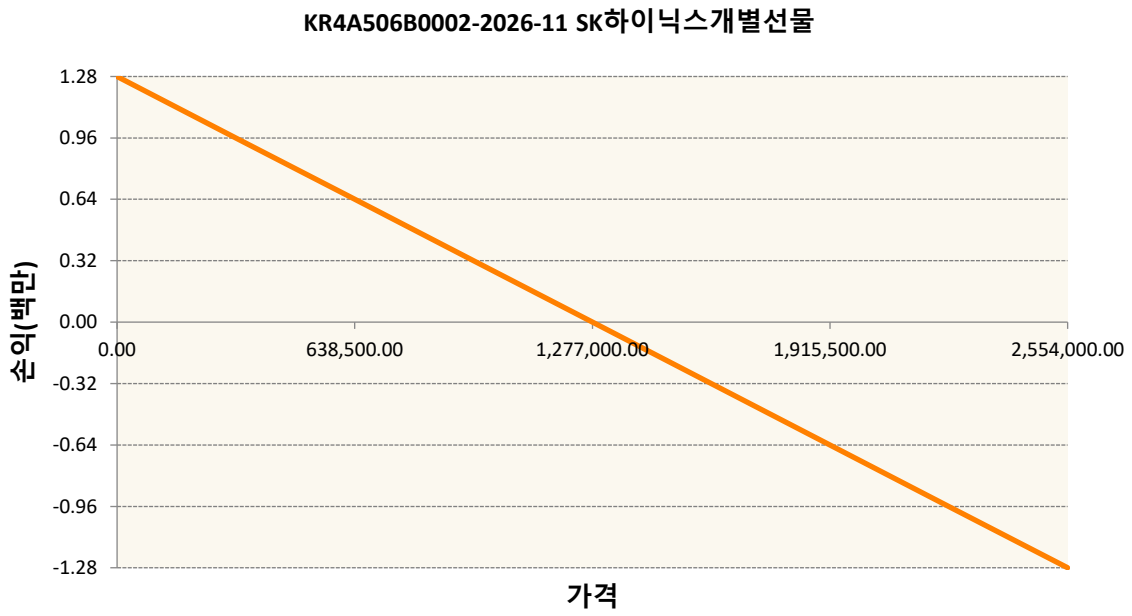
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	29,763	22,806	6,957	장내
누계	유가증권	선물	0	247,495	-247,495	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	19,722

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	19,722	19,722	19,722	19,722	19,722	19,722	19,722
-5.33%	13,148	13,148	13,148	13,148	13,148	13,148	13,148
-2.67%	6,574	6,574	6,574	6,574	6,574	6,574	6,574
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6,574	-6,574	-6,574	-6,574	-6,574	-6,574	-6,574
5.33%	-13,148	-13,148	-13,148	-13,148	-13,148	-13,148	-13,148
8.00%	-19,722	-19,722	-19,722	-19,722	-19,722	-19,722	-19,722

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

95,632

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

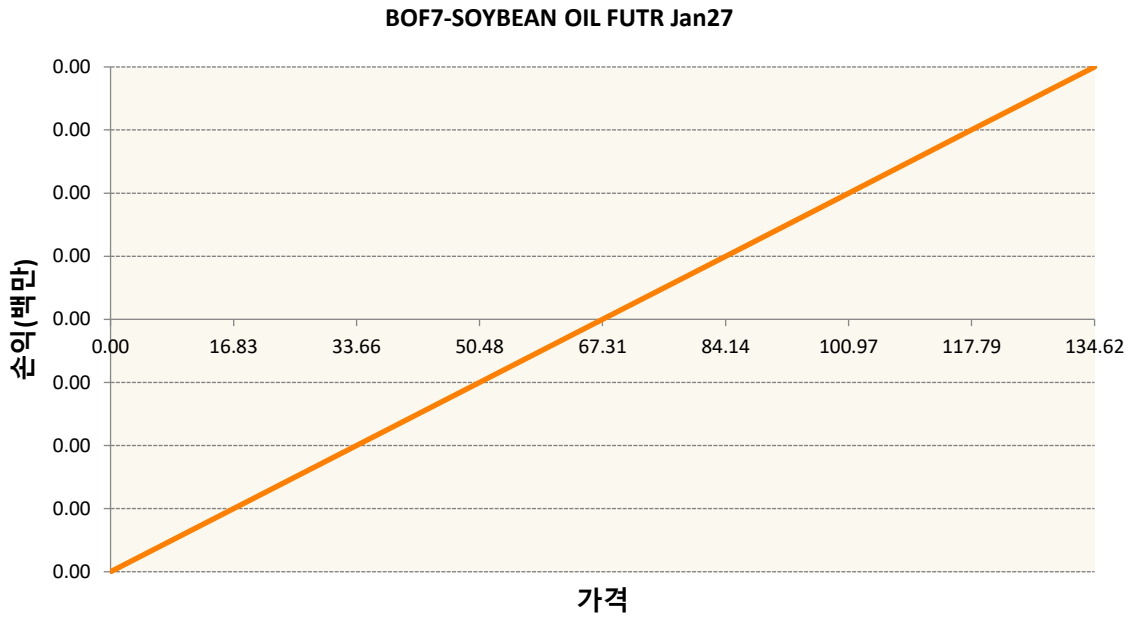
포커스농산물모(채권-파생형)

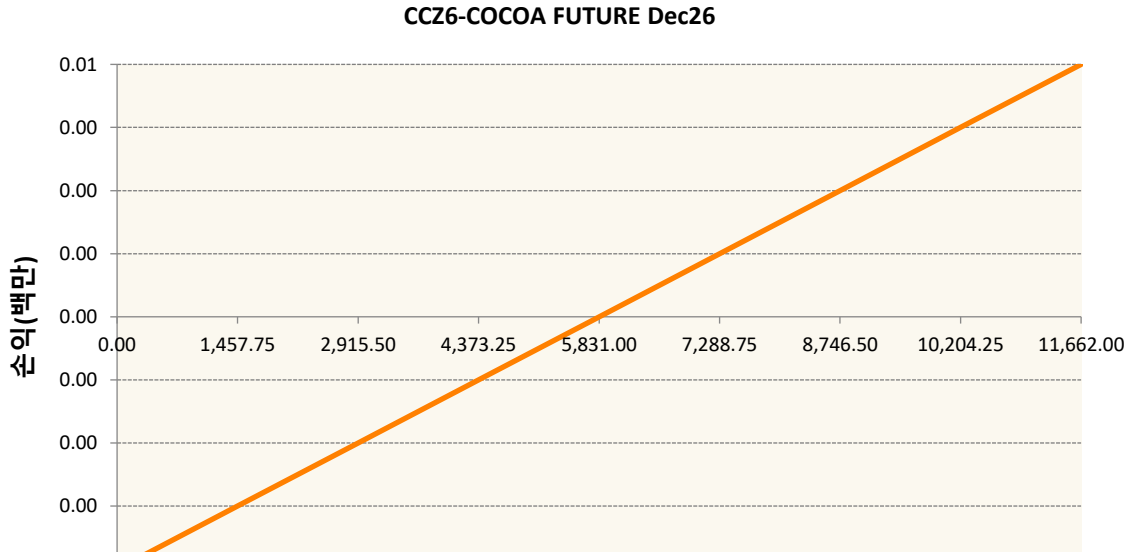
1. 계약금액

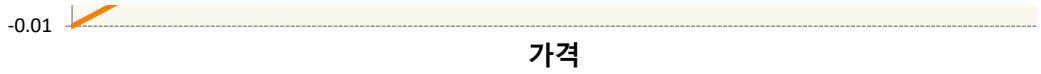
(단위:USD 백만)

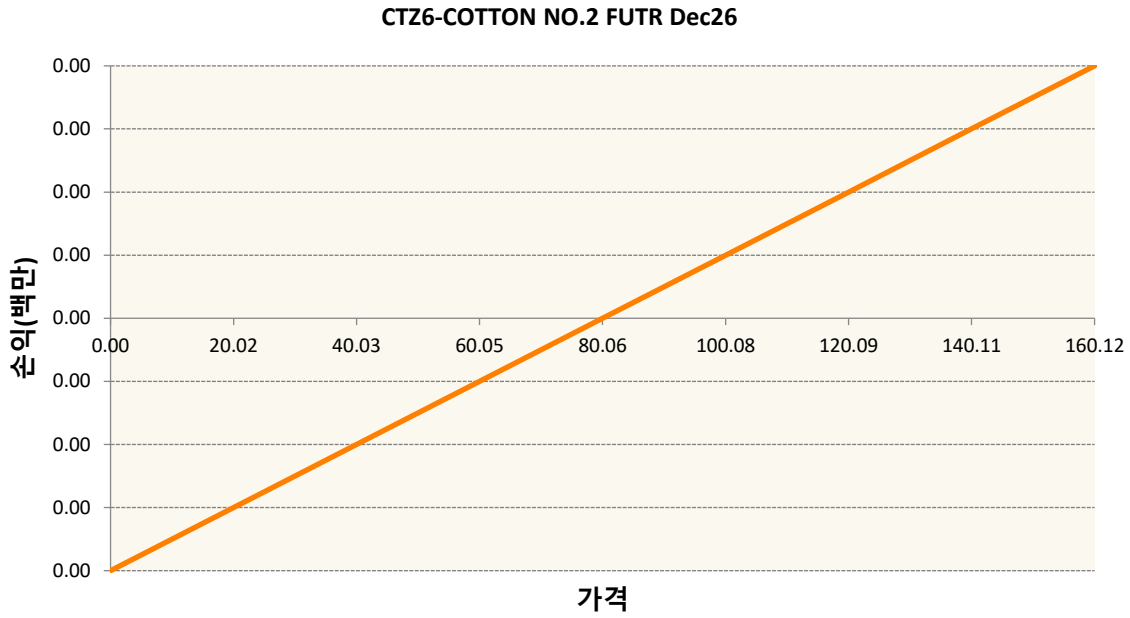
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	322	-322	장내
누계	실물자산	선물	354	0	354	
누계	유가증권	선물	2,282	0	2,282	
누계	통화	선물	0	320	-320	장내

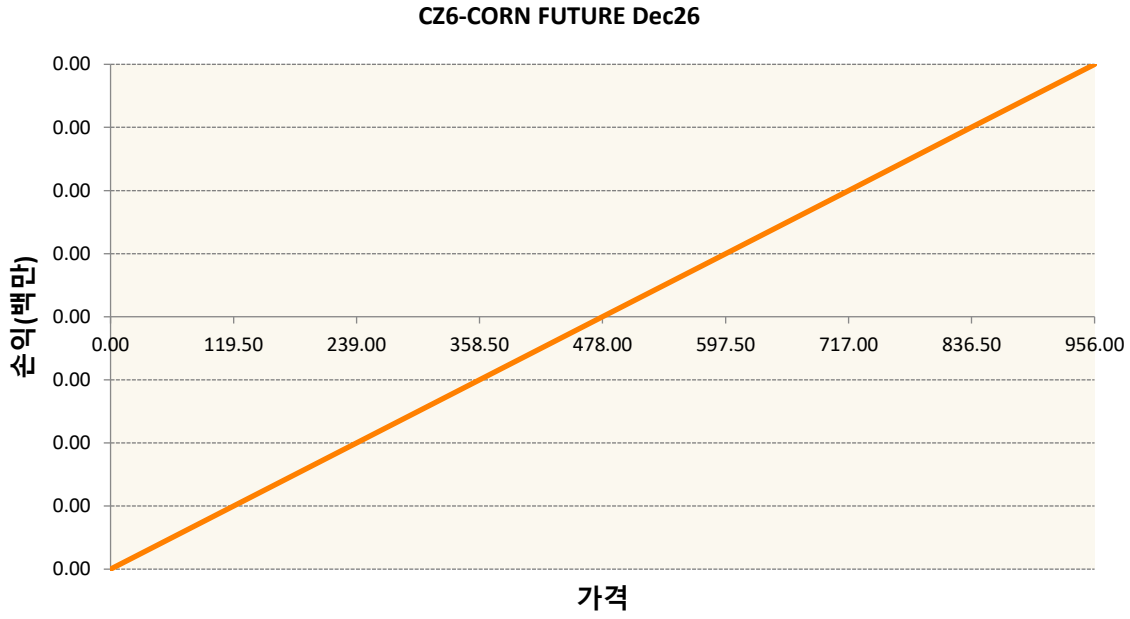
2. 만기시점의 손익구조

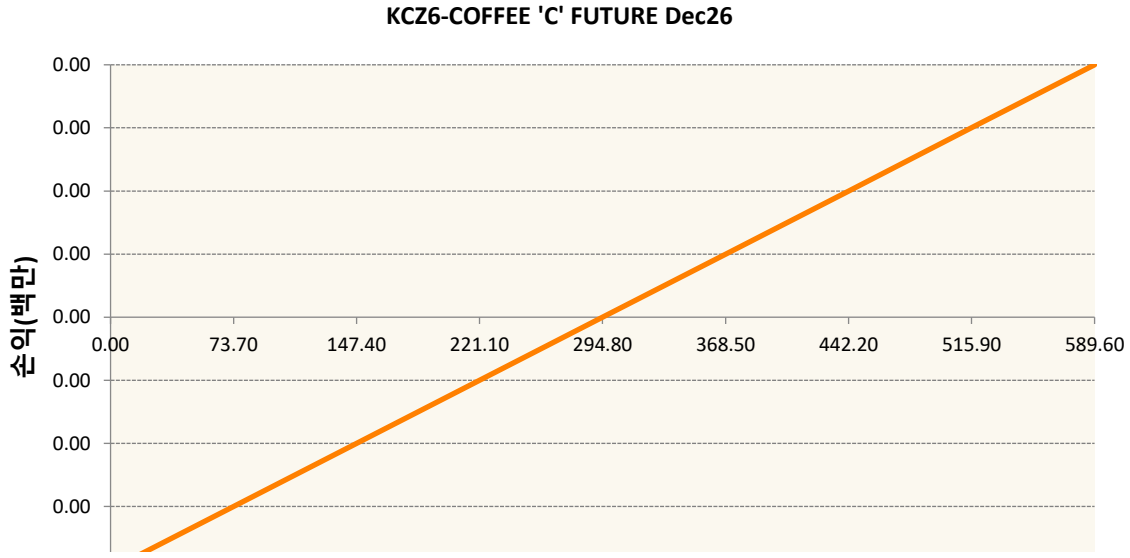


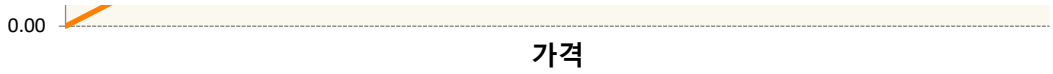


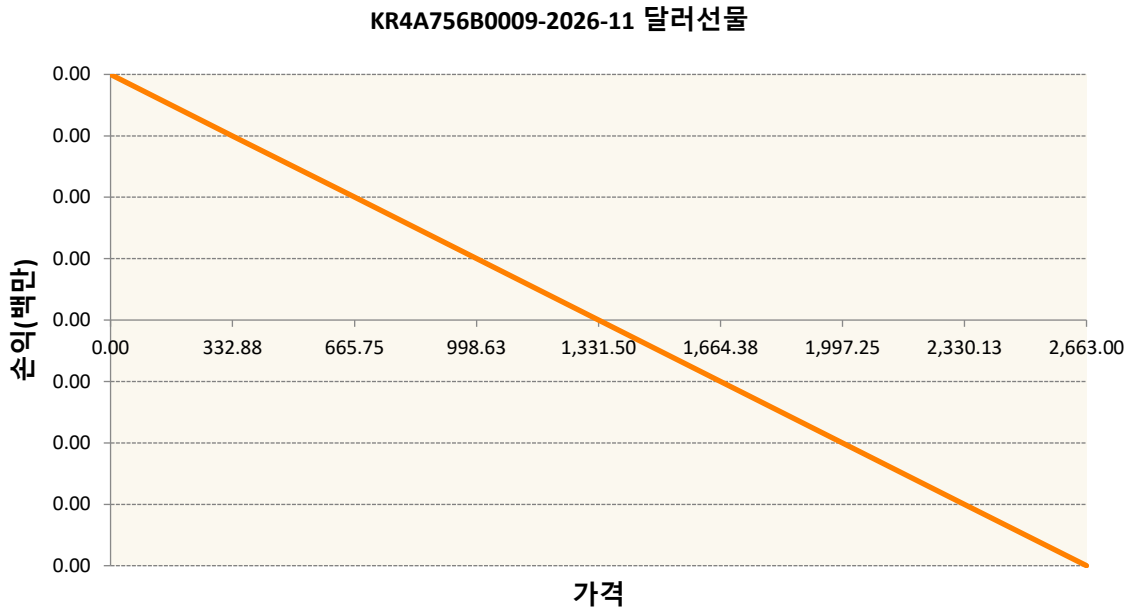

-0.01
가격

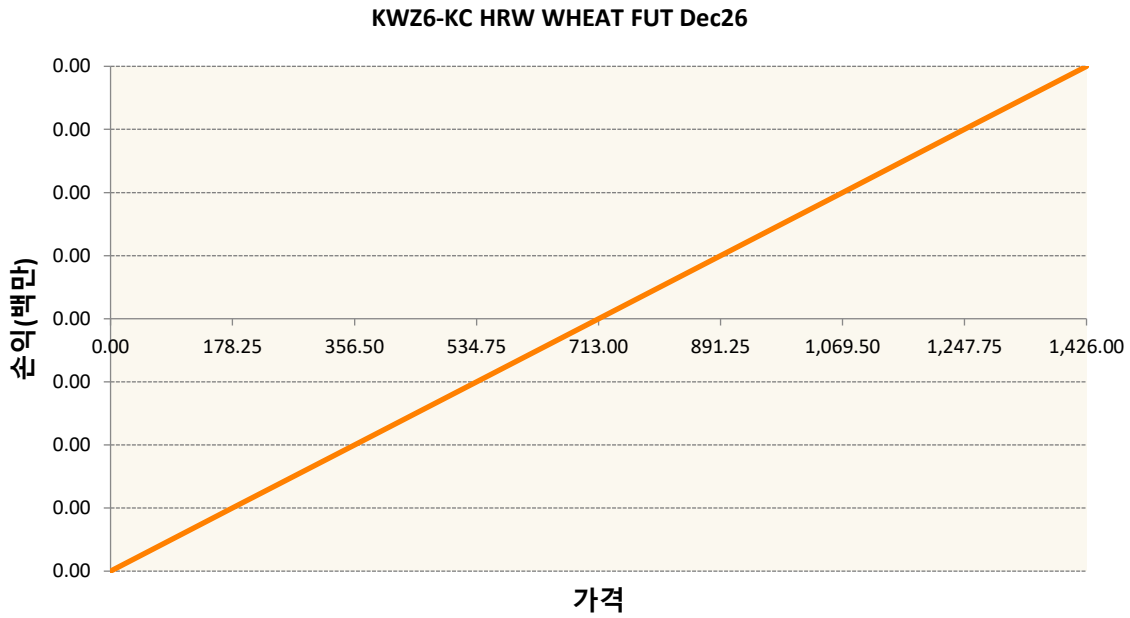

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
20.02
40.03
60.05
80.06
100.08
120.09
140.11
160.12
손익(백만)
가격

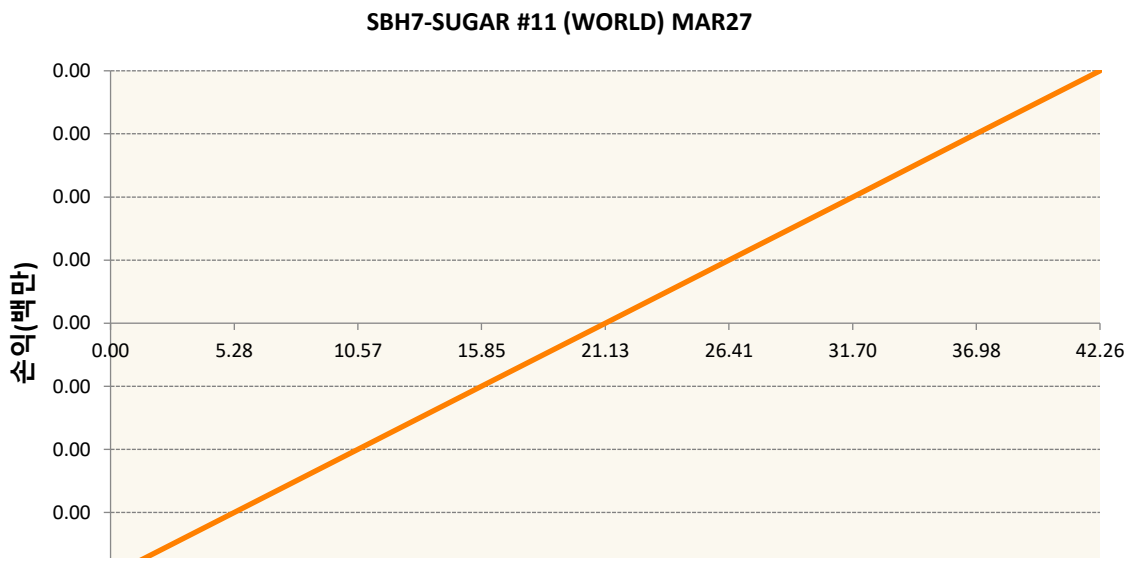

CZ6-CORN FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
119.50
239.00
358.50
478.00
597.50
717.00
836.50
956.00
손익(백만)
가격

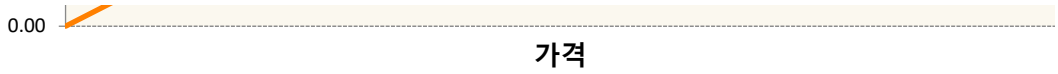

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
73.70
147.40
221.10
294.80
368.50
442.20
515.90
589.60
손익(백만)

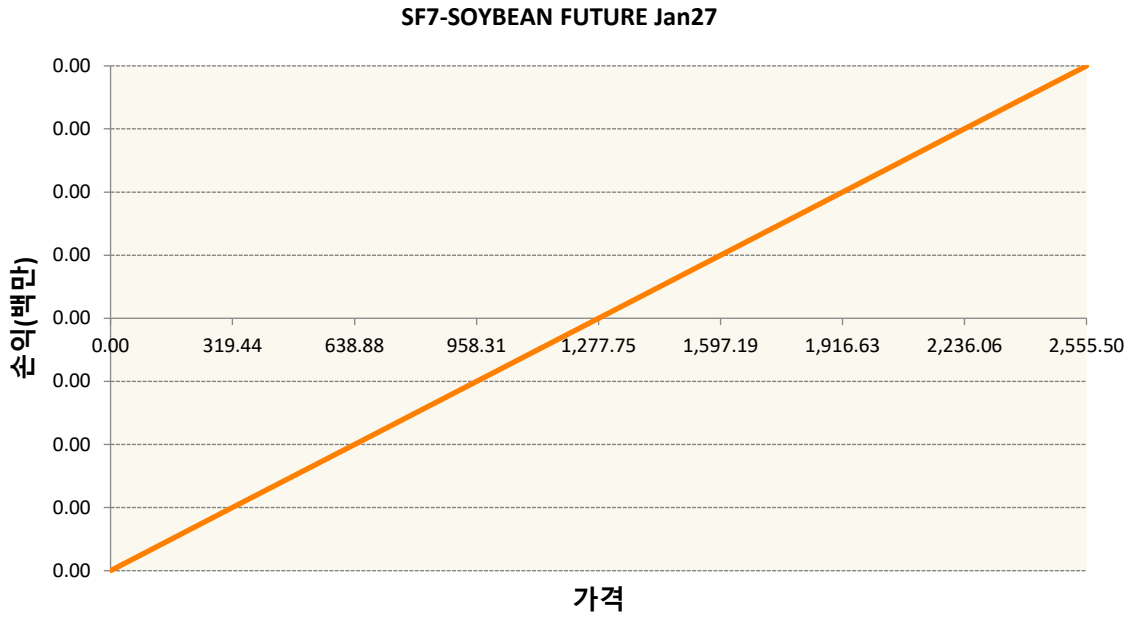

0.00
가격


KR4A756B0009-2026-11 달러선물
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
332.88
665.75
998.63
1,331.50
1,664.38
1,997.25
2,330.13
2,663.00
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
178.25
356.50
534.75
713.00
891.25
1,069.50
1,247.75
1,426.00
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
5.28
10.57
15.85
21.13
26.41
31.70
36.98
42.26
손익(백만)




SF7-SOYBEAN FUTURE Jan27
0.00
0.00
0.00



가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

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

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

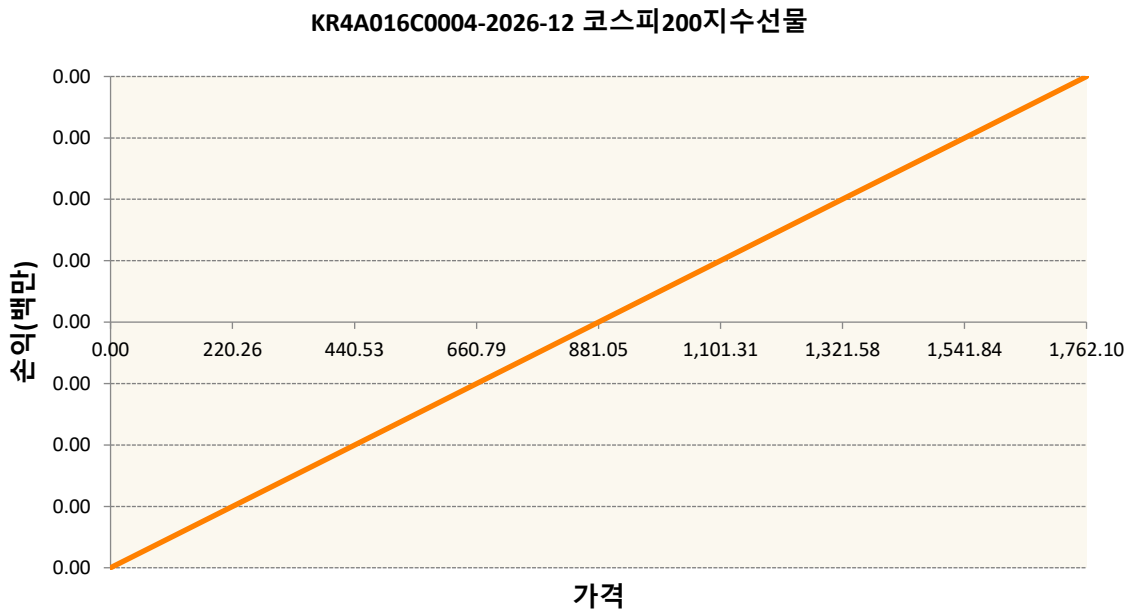
스마트인덱스모

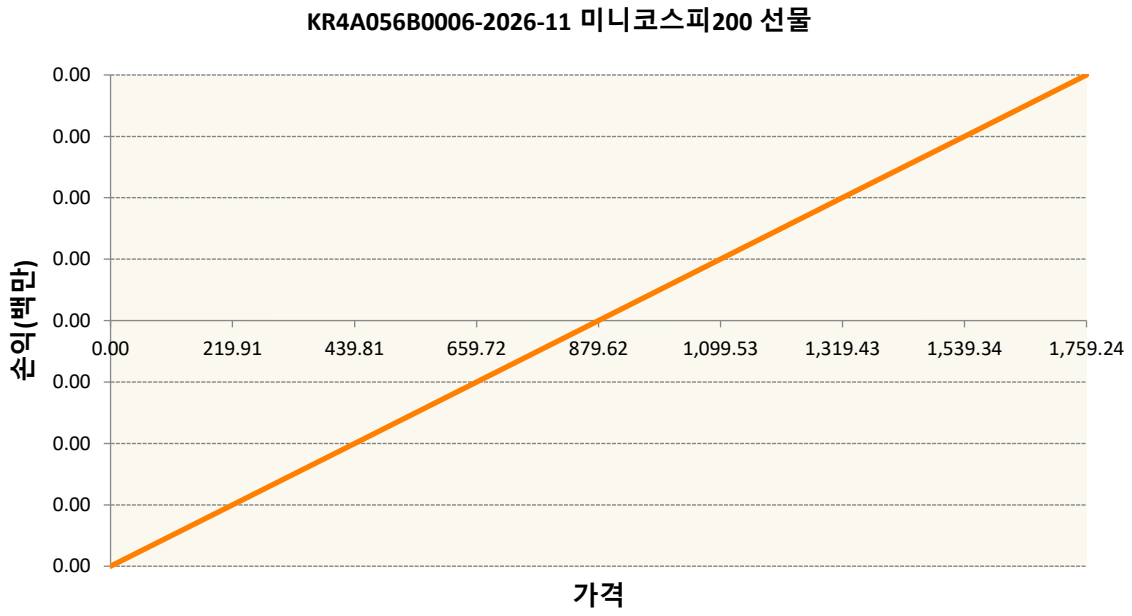
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	665	0	665	장내
누계	유가증권	선물	7,705	0	7,705	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						386
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-386	-386	-386	-386	-386	-386	-386
-5.33%	-258	-258	-258	-258	-258	-258	-258
-2.67%	-129	-129	-129	-129	-129	-129	-129
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	129	129	129	129	129	129	129
5.33%	258	258	258	258	258	258	258
8.00%	386	386	386	386	386	386	386

KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물						46
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46
-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%	46	46	46	46	46	46	46

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

1,494

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

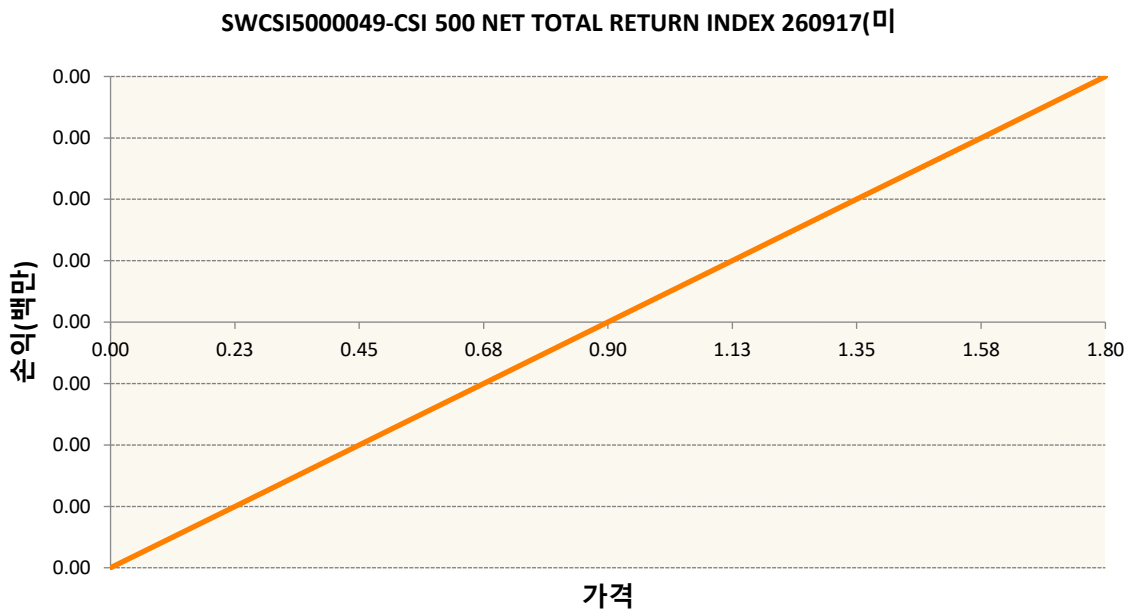
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,789	0	4,789	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

617

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

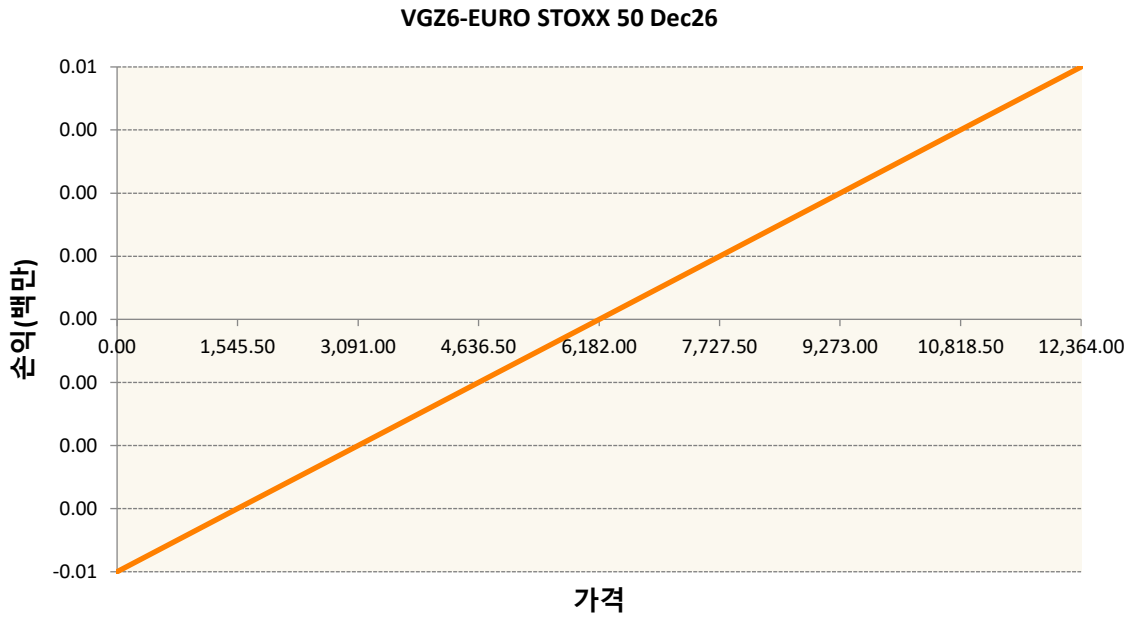
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,173	0	1,173	

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	2026-10-19
기준일	2026-10-16

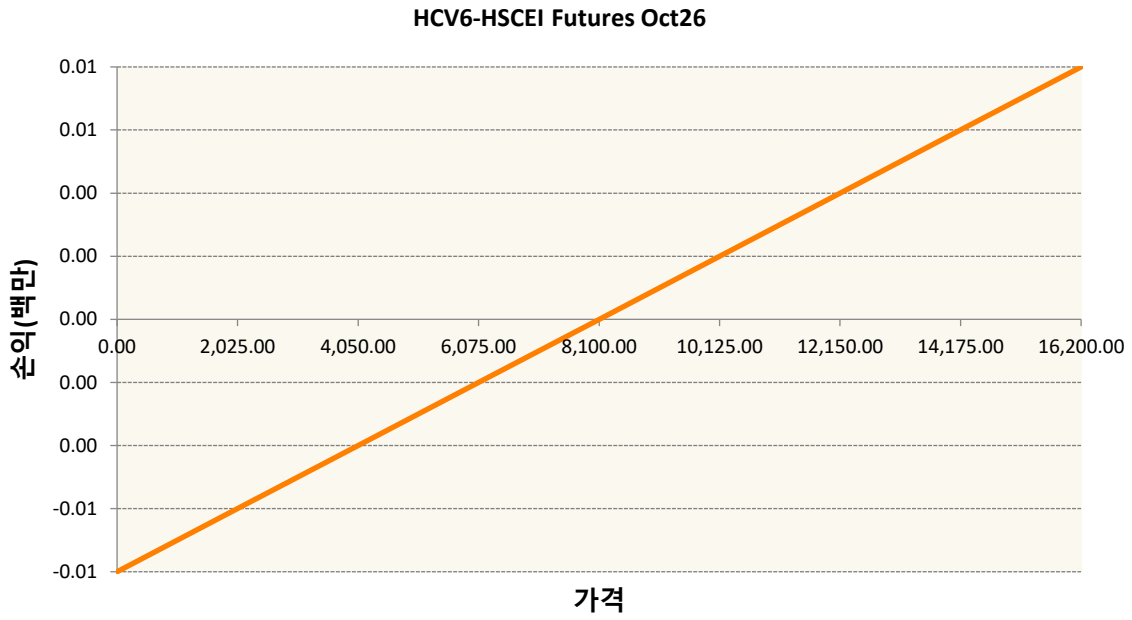
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,410	0	1,410	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCV6	HSCEI Futures Oct26	113

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

(단위:백만원)

106

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

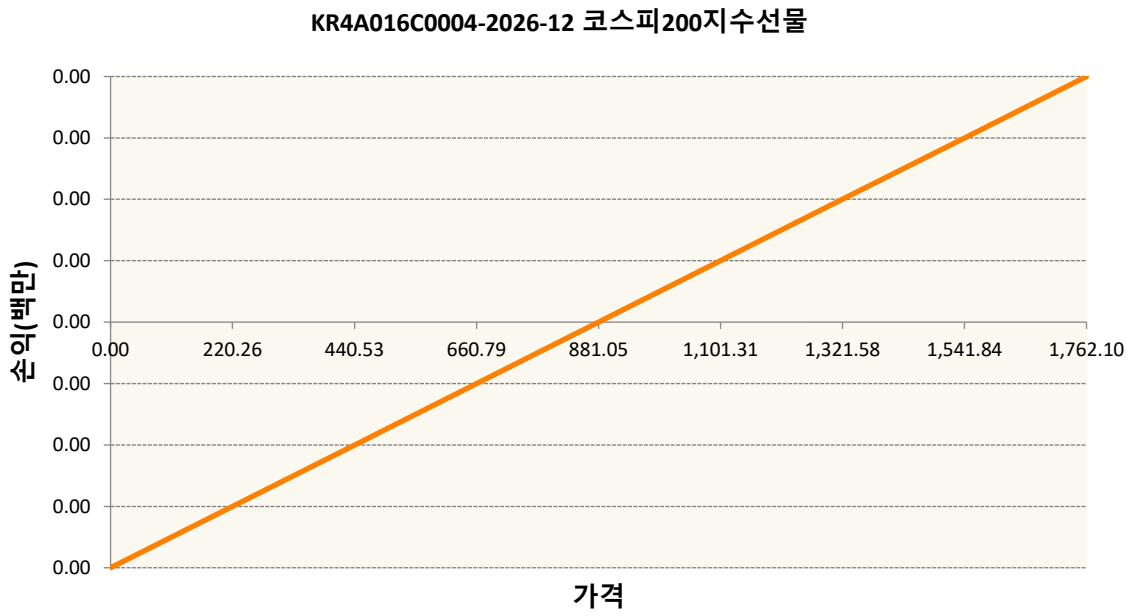
커버드콜모(주식혼합-파생형)

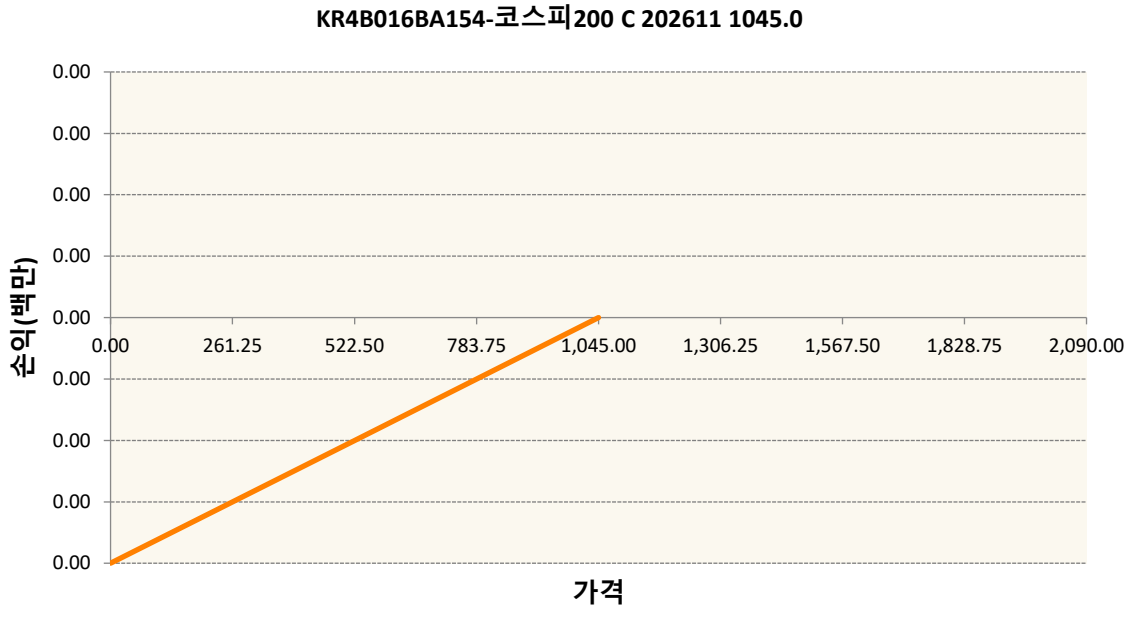
1. 계약금액

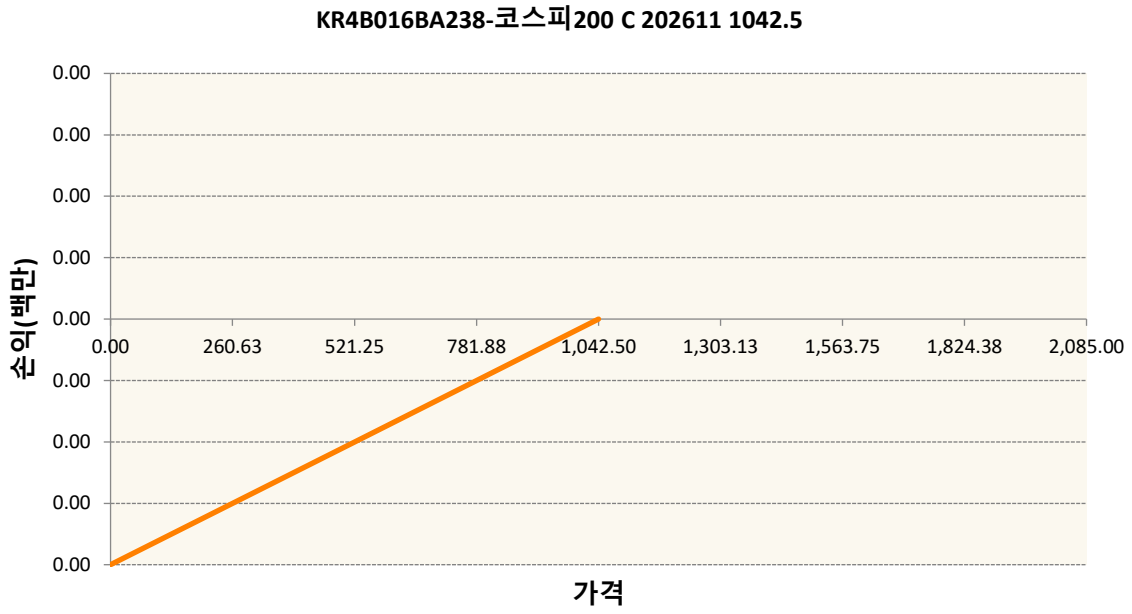
(단위:백만원)

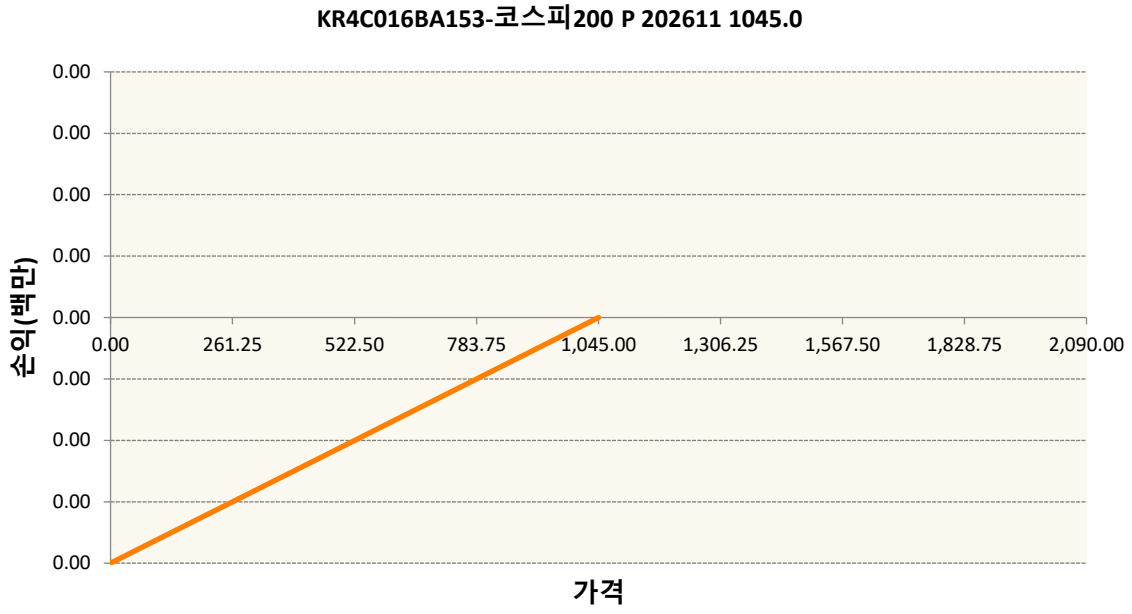
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	220	-220	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	441	0	441	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,876	-49,876	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					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
	KR4B016BA154	코스피200 C 202611 1045.0					1,980
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,836	-1,845	-1,859	-1,879	-1,906	-1,940	-1,980
-5.33%	-1,166	-1,182	-1,204	-1,235	-1,273	-1,317	-1,369
-2.67%	-504	-530	-564	-607	-657	-715	-779
0%	145	105	57	0	-65	-136	-213
2.67%	773	718	653	580	501	415	325
5.33%	1,375	1,301	1,218	1,129	1,035	936	833
8.00%	1,940	1,847	1,747	1,643	1,534	1,422	1,308
	KR4B016BA238		코스피200 C 202611 1042.5				631
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-583	-586	-591	-598	-607	-618	-631
-5.33%	-370	-375	-383	-393	-405	-420	-436
-2.67%	-159	-168	-179	-193	-209	-228	-249
0%	47	34	19	0	-21	-44	-69
2.67%	247	229	208	184	158	131	102
5.33%	438	414	387	358	328	296	263
8.00%	617	587	555	521	486	450	413
	KR4C016BA153		코스피200 P 202611 1045.0				649
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-601	-604	-609	-616	-624	-635	-649
-5.33%	-382	-387	-395	-404	-417	-432	-448
-2.67%	-165	-174	-185	-199	-215	-234	-255
0%	47	35	19	0	-21	-45	-70
2.67%	253	235	214	190	164	136	106
5.33%	450	426	399	370	339	306	273
8.00%	635	605	572	538	503	466	428

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

6,178

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

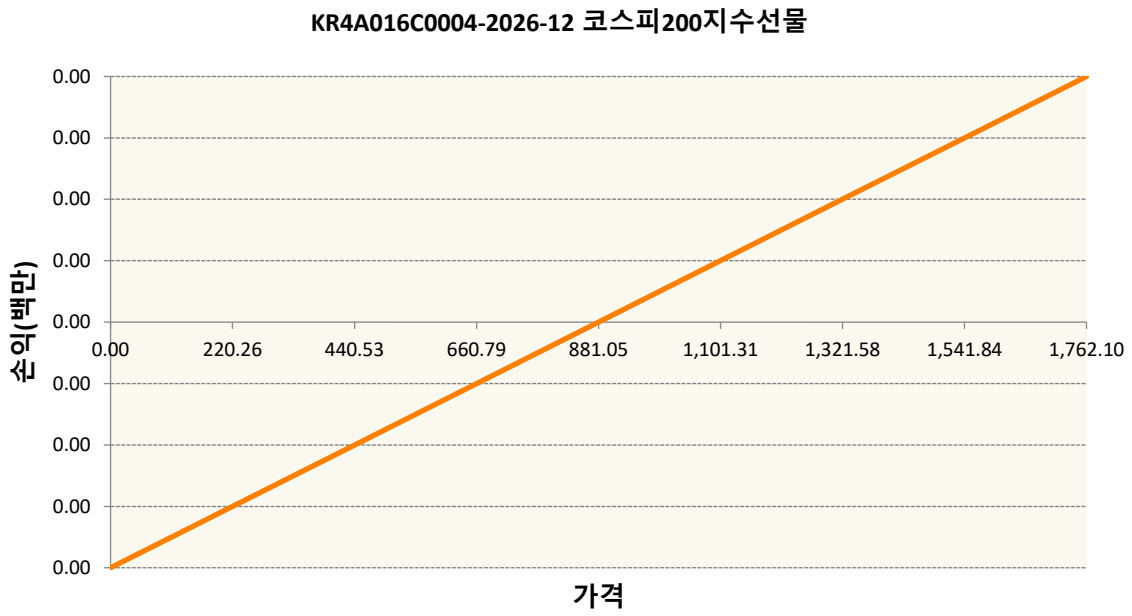
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

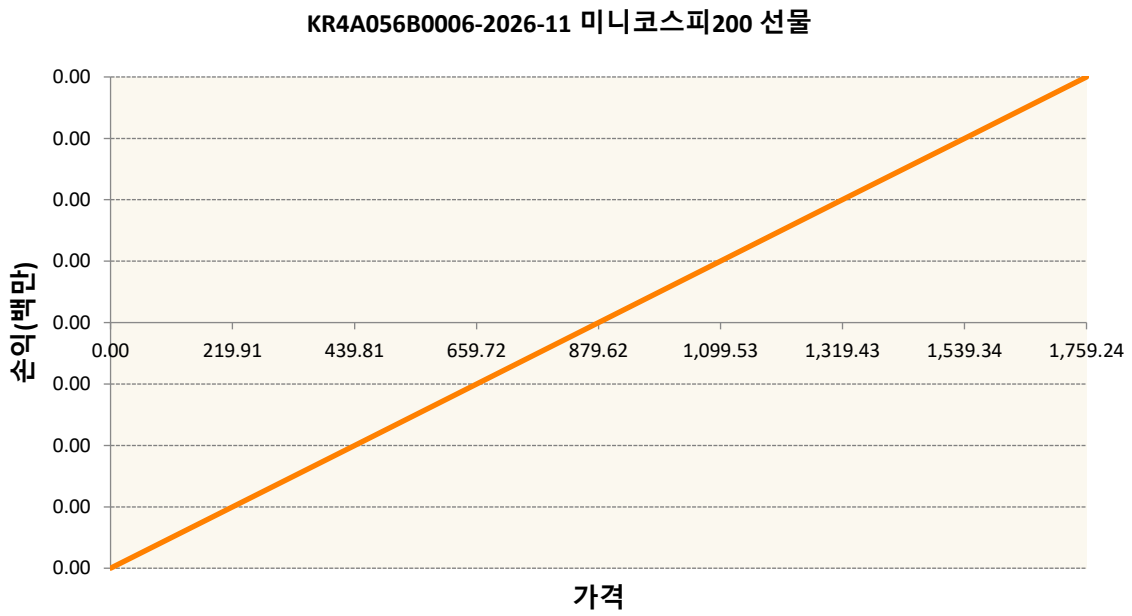
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	226	443	-217	장내
누계	유가증권	선물	2,200	0	2,200	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						53
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53
-5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	35	35	35	35	35	35	35
8.00%	53	53	53	53	53	53	53

KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물						25
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-25	-25	-25	-25	-25	-25	-25
-5.33%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	16	16	16	16	16	16	16
8.00%	25	25	25	25	25	25	25

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

267

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

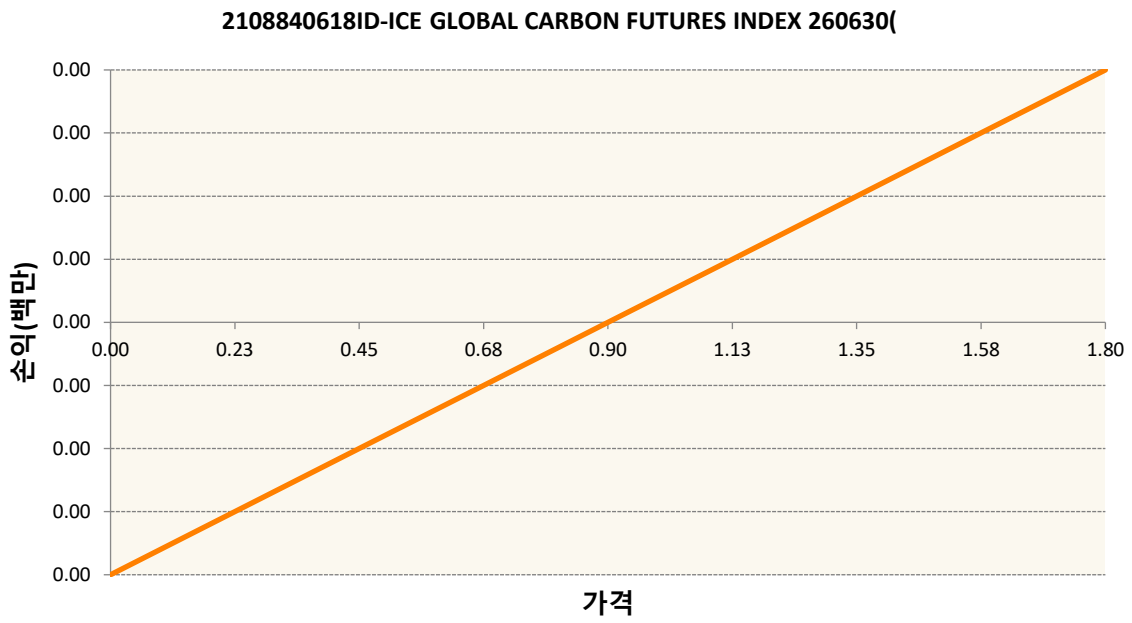
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

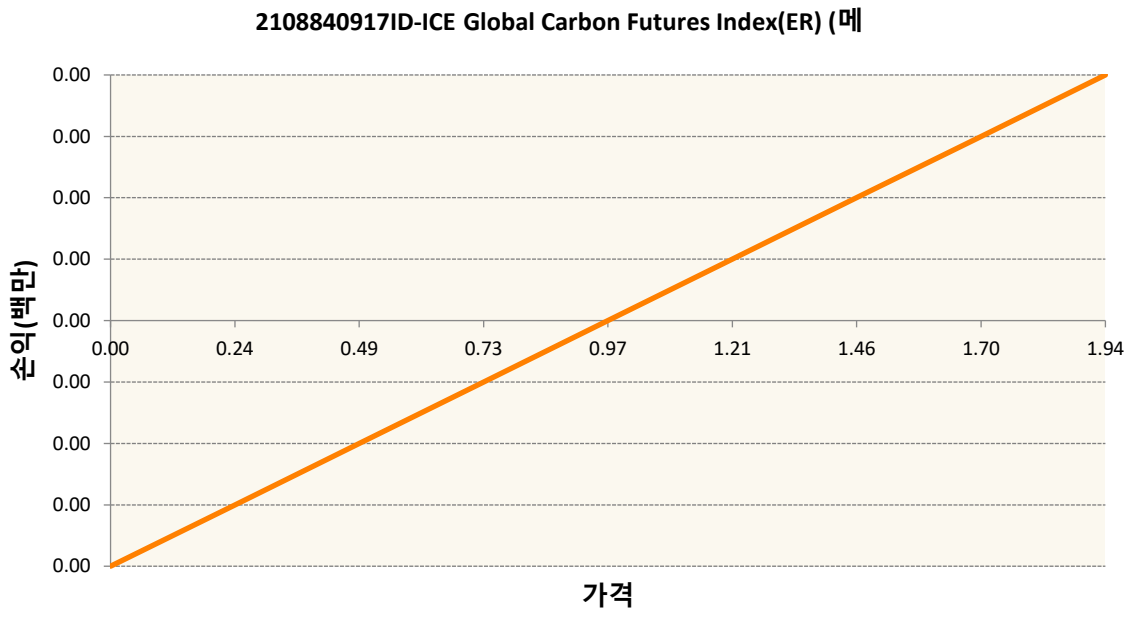
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,850	0	6,850	장외

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ㅣICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	437
2108840917ㅣICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	110

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

566

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

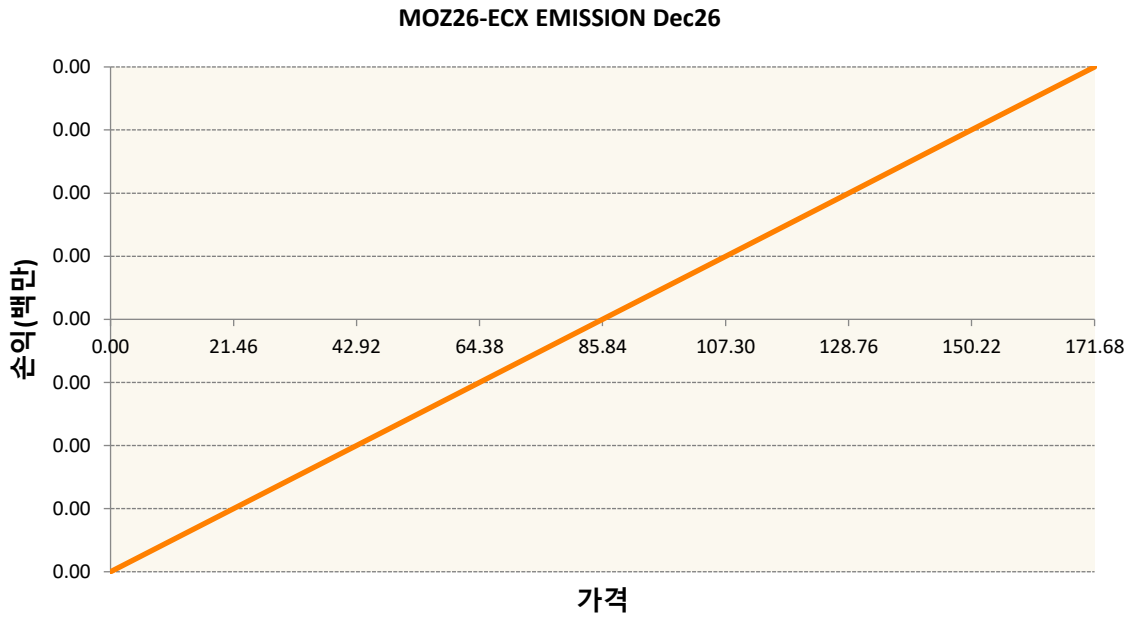
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,064	0	6,064	
누계	통화	선도	0	2,483	-2,483	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G9V	KRW/EUR 30-10-26E	199
MOZ26	ECX EMISSION Dec26	485

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

(단위:백만원)

721

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

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	-784	0	-784	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260325(	10
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(N	10
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260630(	15
SWSOL0000(CSI PHOTOVOLTAIC INDUSTRY INDEX 260923(	26

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

(단위:백만원)

95

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

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	-5,453	0	-5,453	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 251218(NH)	39
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260714(미래)	310
SWSTAR000(STAR 50 INDEX (NTR) 260917(메리츠)	83

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

(단위:백만원)

814

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

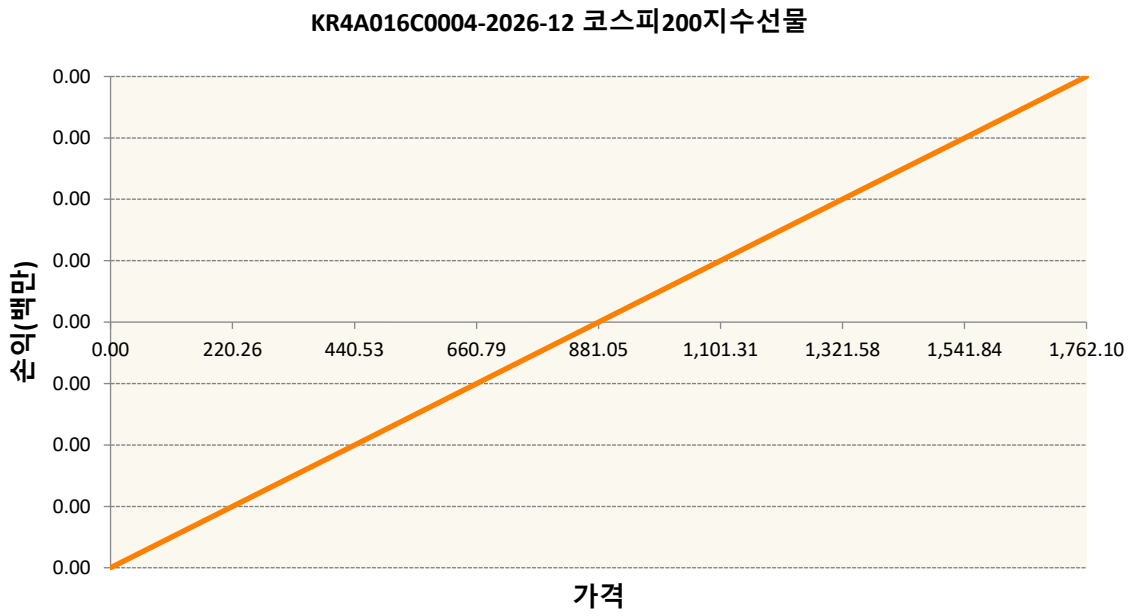
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

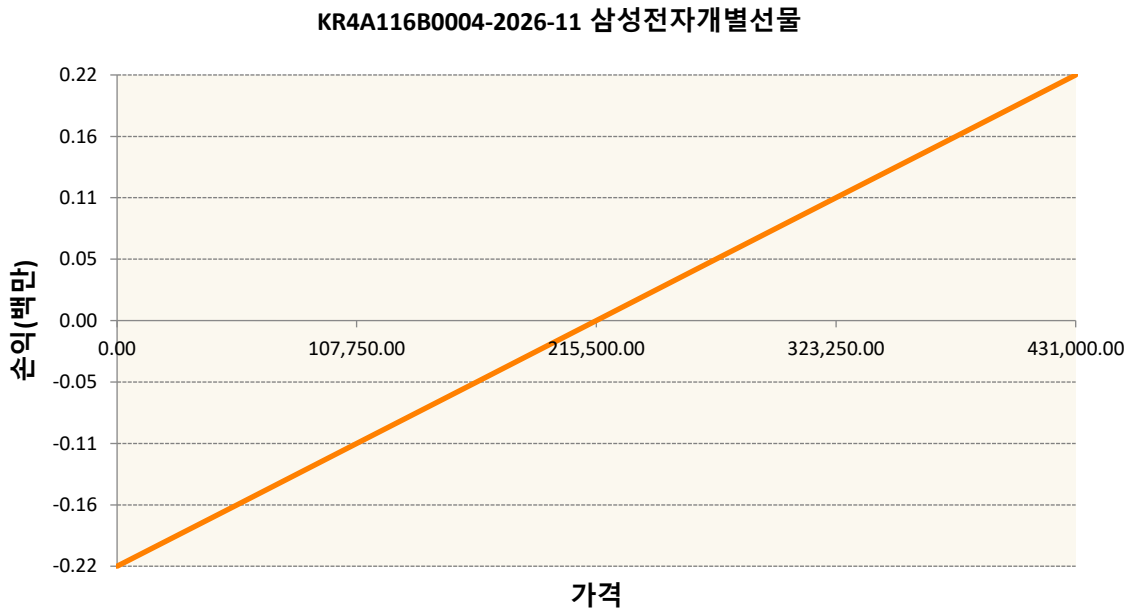
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,762	-1,762	장내
누계	유가증권	선물	17,121	0	17,121	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						1,317
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,317	-1,317	-1,317	-1,317	-1,317	-1,317	-1,317
-5.33%	-878	-878	-878	-878	-878	-878	-878
-2.67%	-439	-439	-439	-439	-439	-439	-439
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	439	439	439	439	439	439	439
5.33%	878	878	878	878	878	878	878
8.00%	1,317	1,317	1,317	1,317	1,317	1,317	1,317
KR4A116B0004	2026-11 삼성전자개별선물						48
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-48	-48	-48	-48	-48	-48	-48
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32
-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%	32	32	32	32	32	32	32
8.00%	48	48	48	48	48	48	48

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

(단위:백만원)

4,754

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

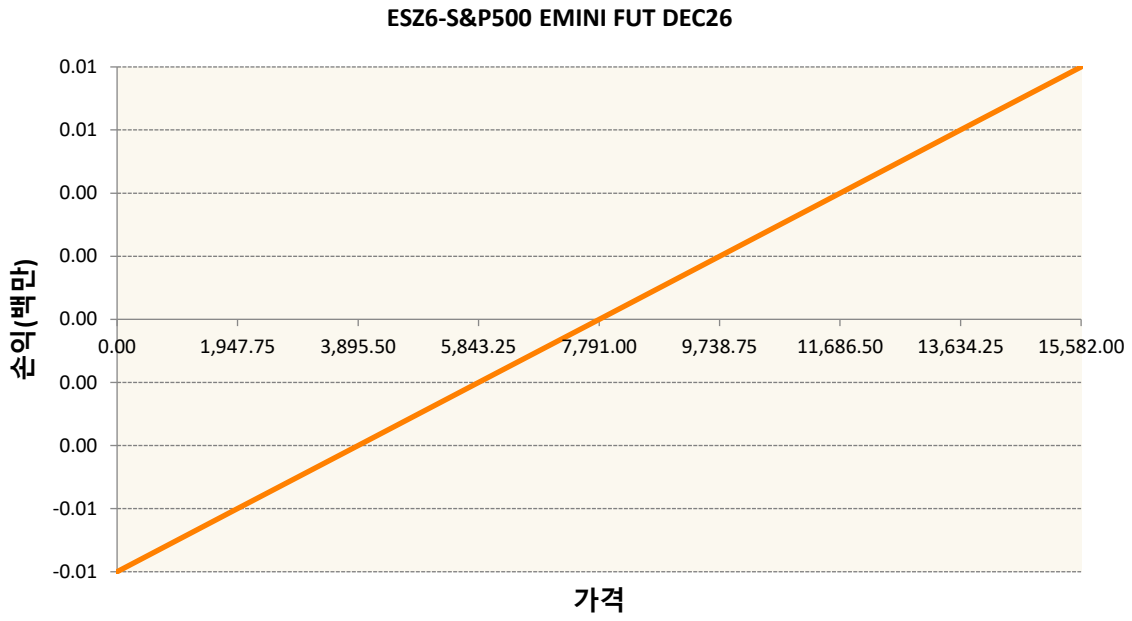
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

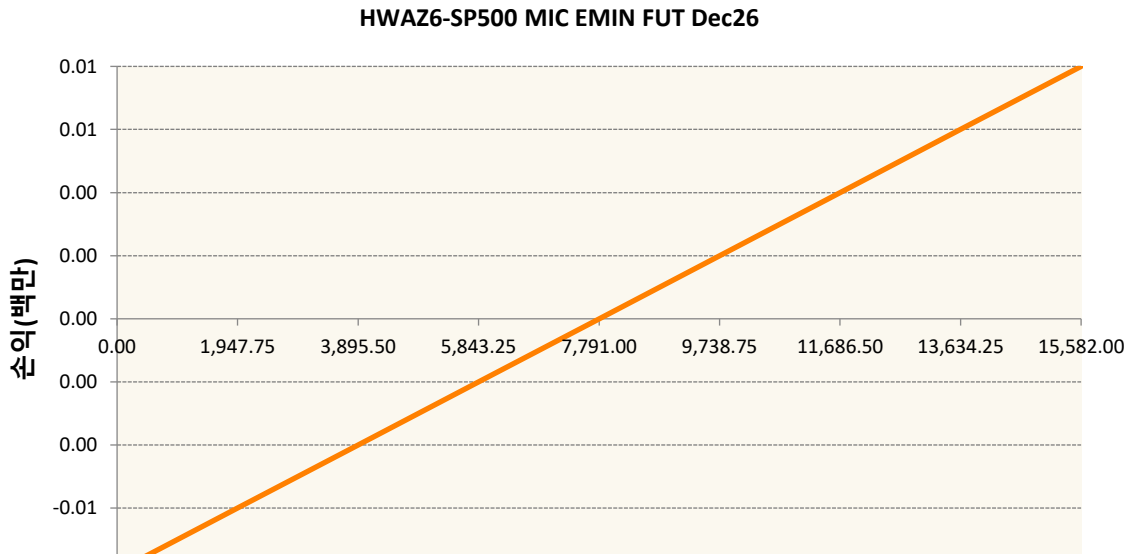
1. 계약금액

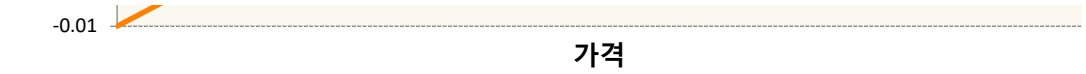
(단위:백만원)

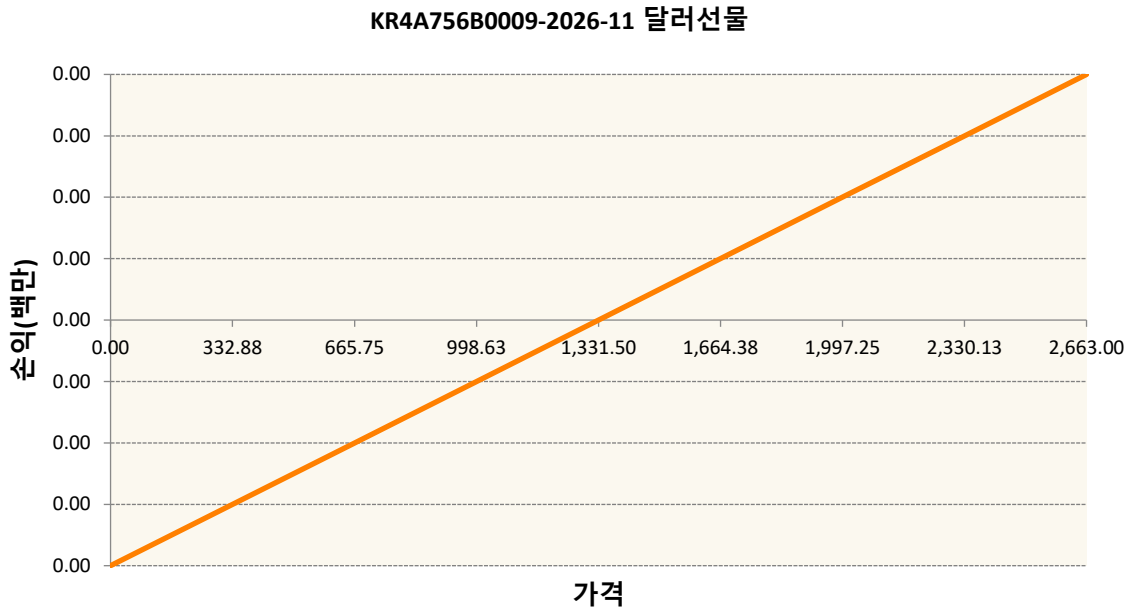
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	77,396	0	77,396	
누계	지수	선물	377	0	377	장내
누계	통화	선물	17,576	0	17,576	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,192
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756B00	2026-11 달러선물	1,406

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

3,718

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

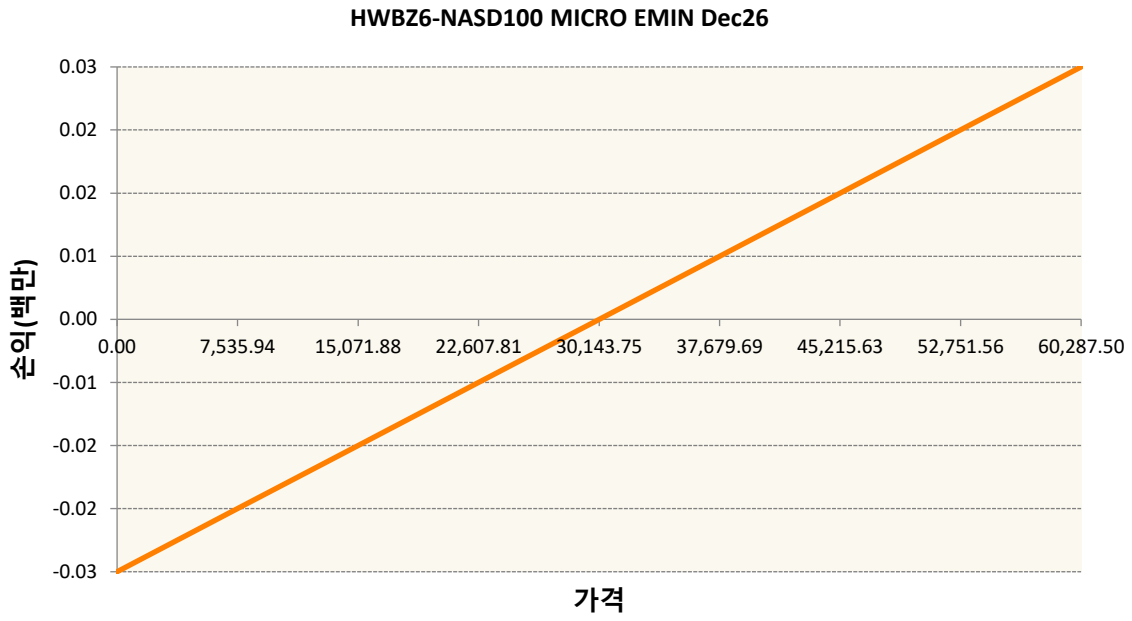
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

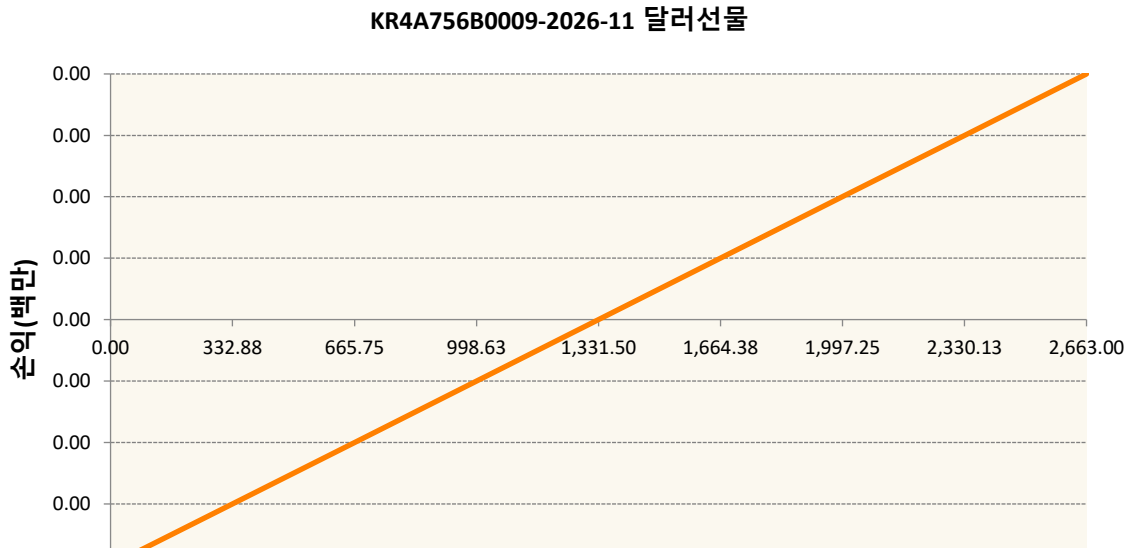
1. 계약금액

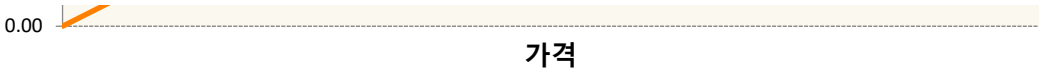
(단위:백만원)

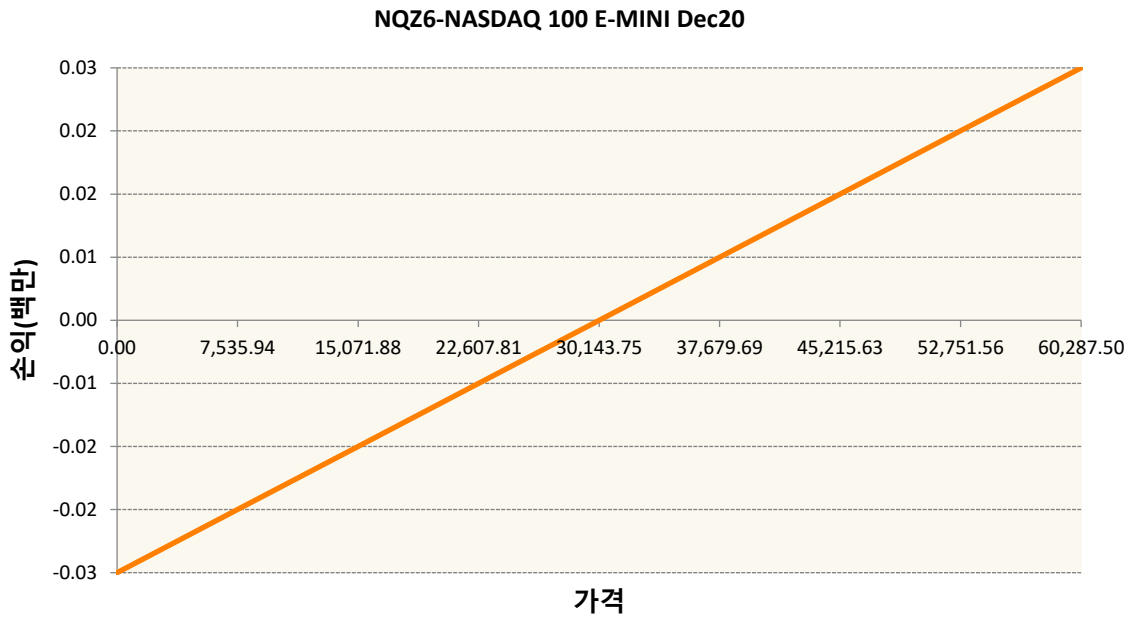
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	지수	선물	34,965	0	34,965	
누계	지수	선물	416	0	416	장내
누계	통화	선물	8,202	0	8,202	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	33
KR4A756B00	2026-11 달러선물	656
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,797

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

(단위:백만원)

2,490

공시일	2026-10-19
기준일	2026-10-16

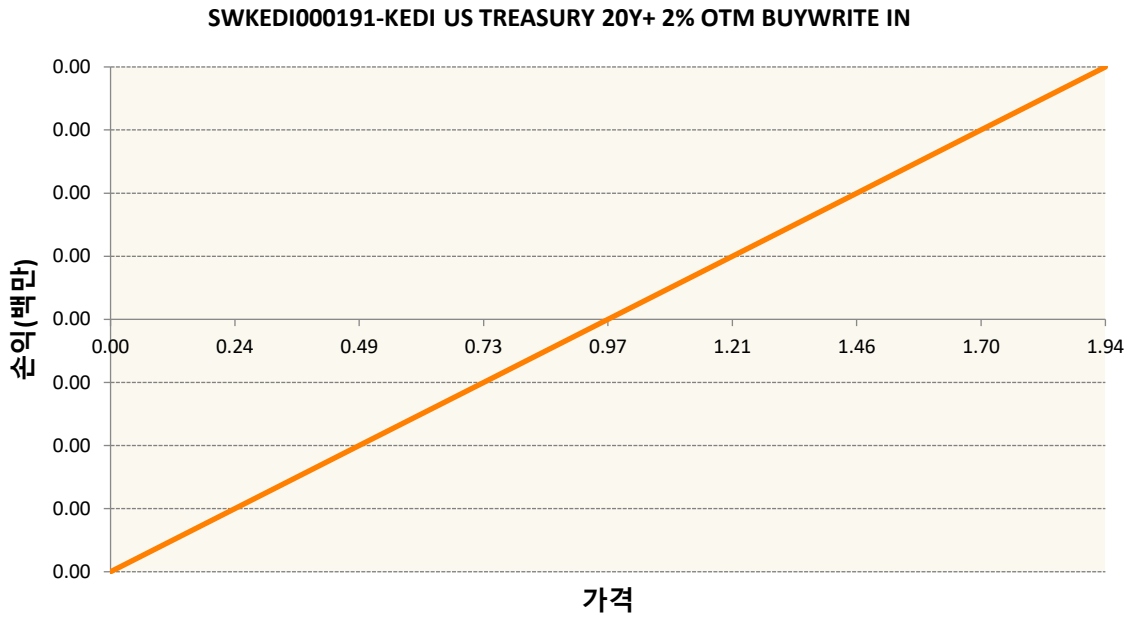
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

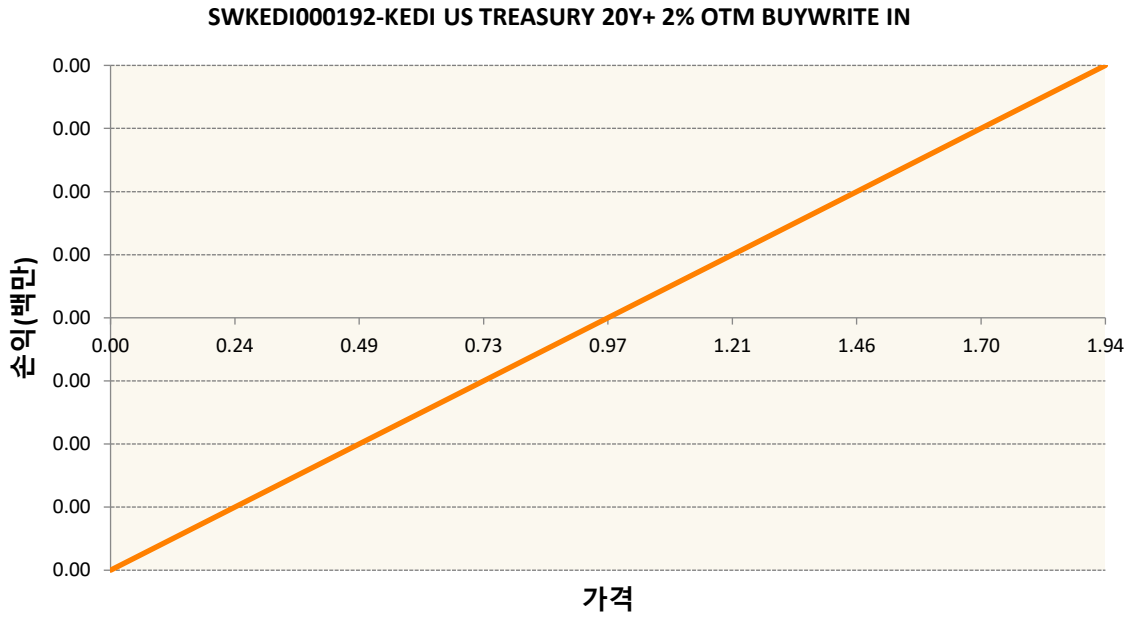
1. 계약금액

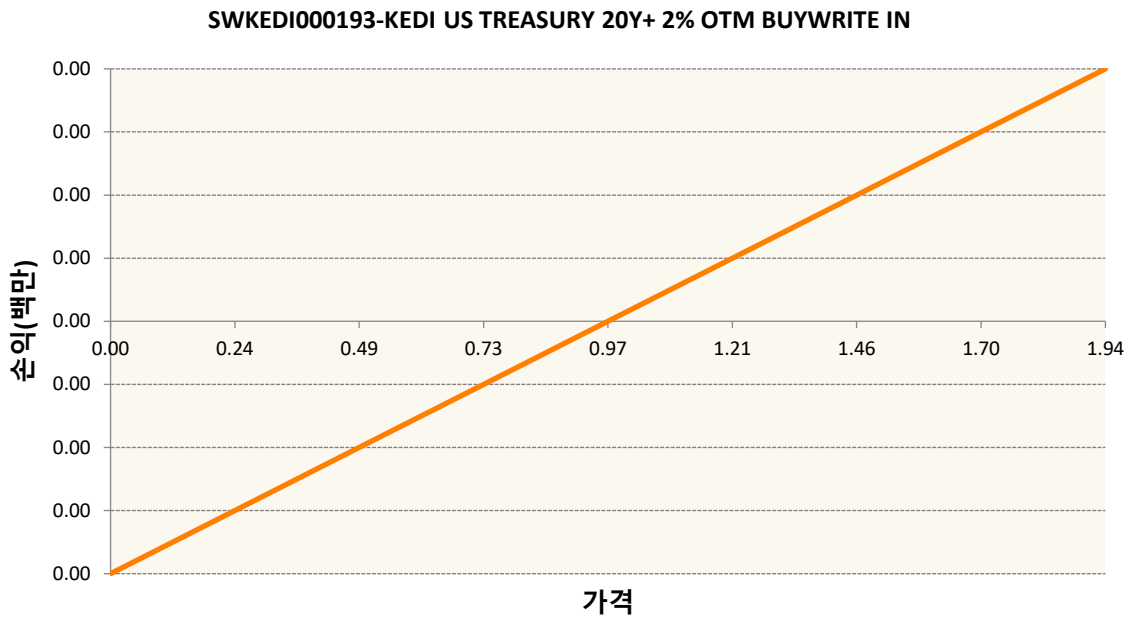
(단위:백만원)

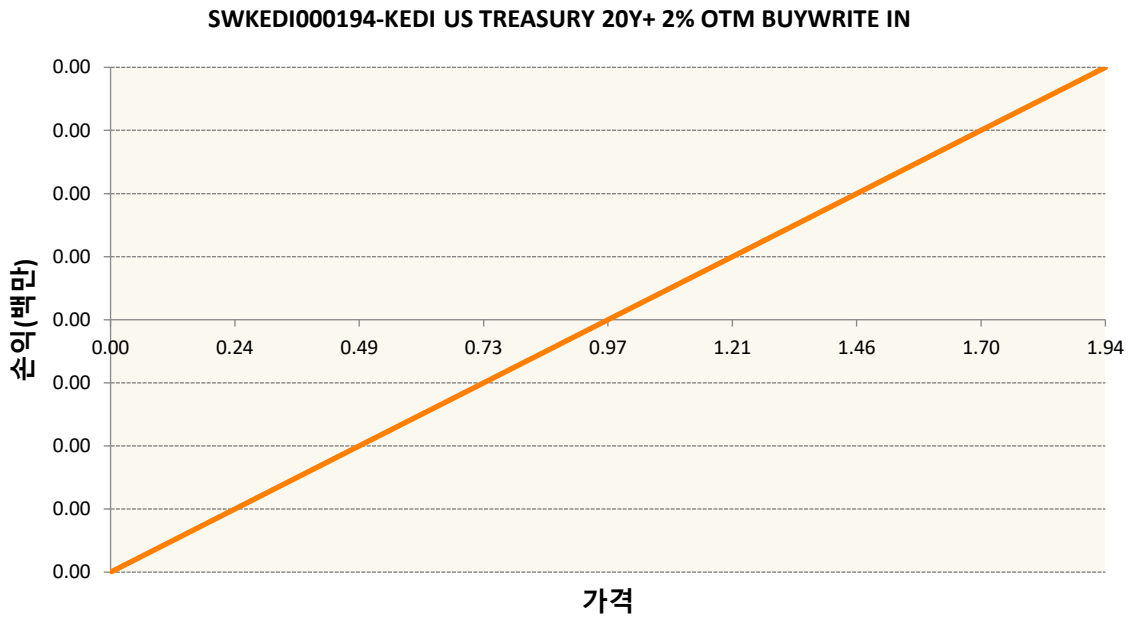
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	271,045	0	271,045	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,646
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,705
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,840
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,483

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

8,596