공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

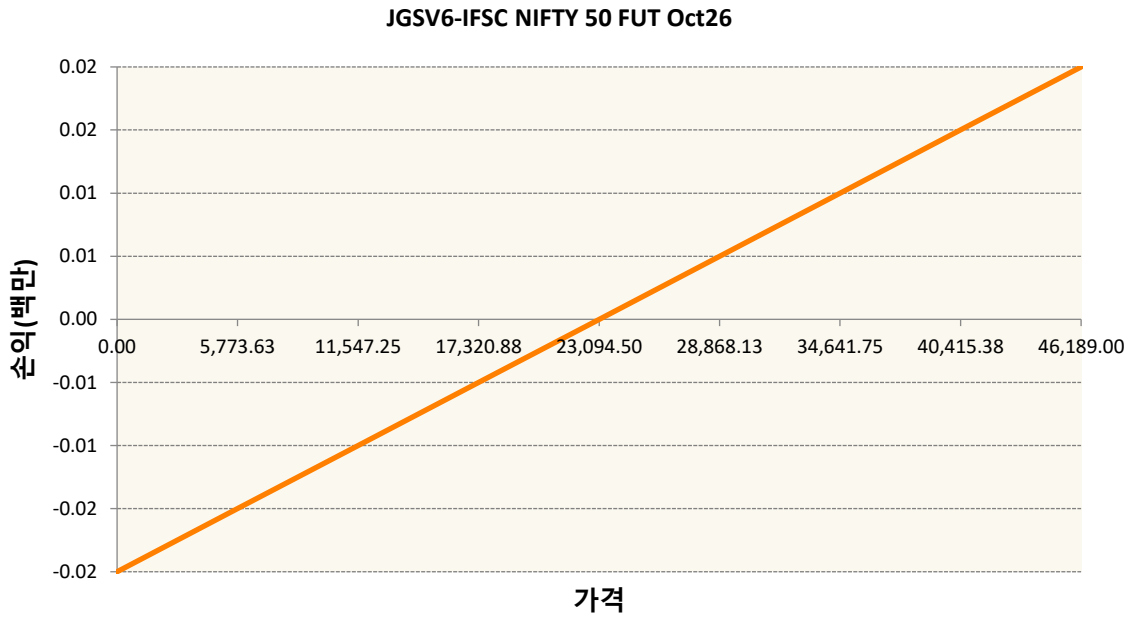
인도NIFTY50인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	315	0	315	

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	2026-10-20
기준일	2026-10-19

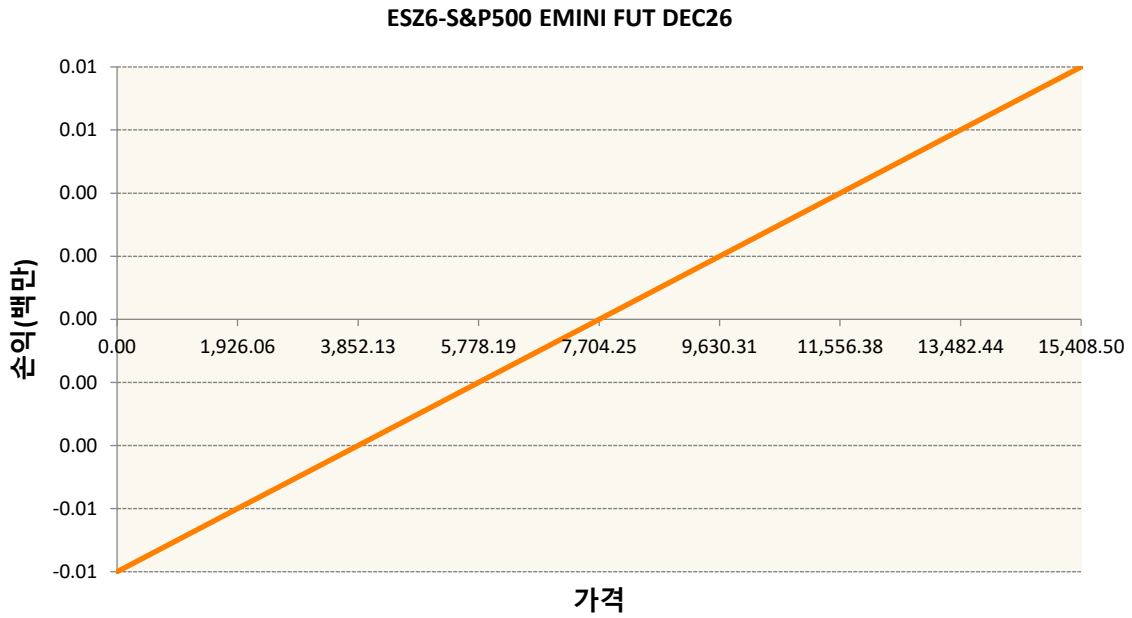
SOL미국500타겟커버드콜액티브액티브상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	533	0	533	

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	2026-10-20
기준일	2026-10-19

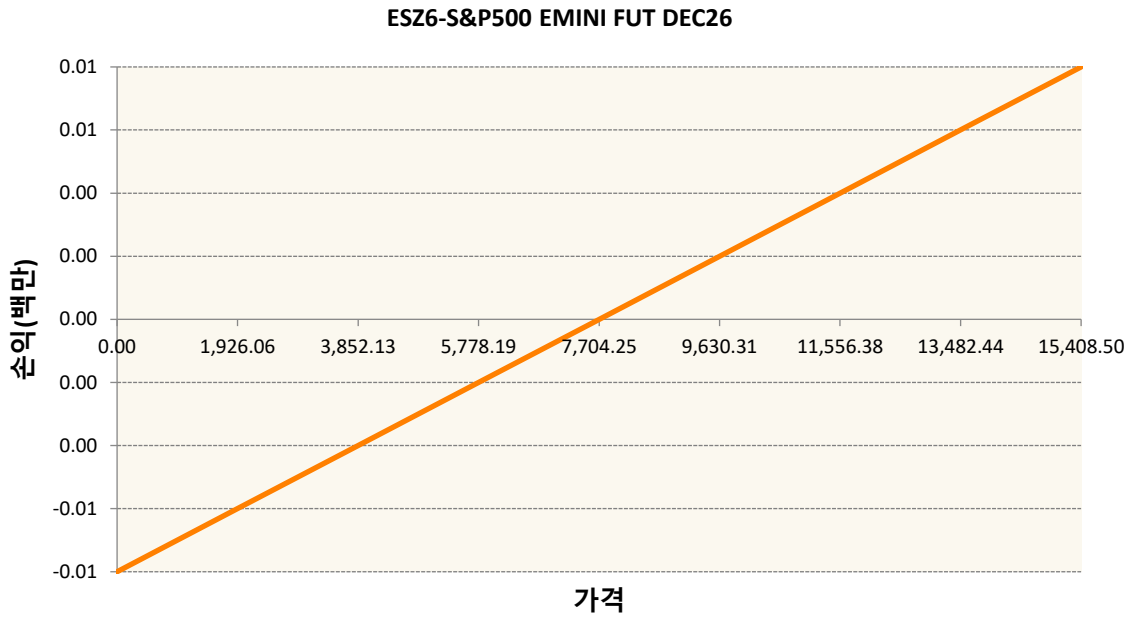
SOL미국S&P500엔화노출상장지수(주식-파생

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
누계	지수	선물	532	0	532	

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	2026-10-20
기준일	2026-10-19

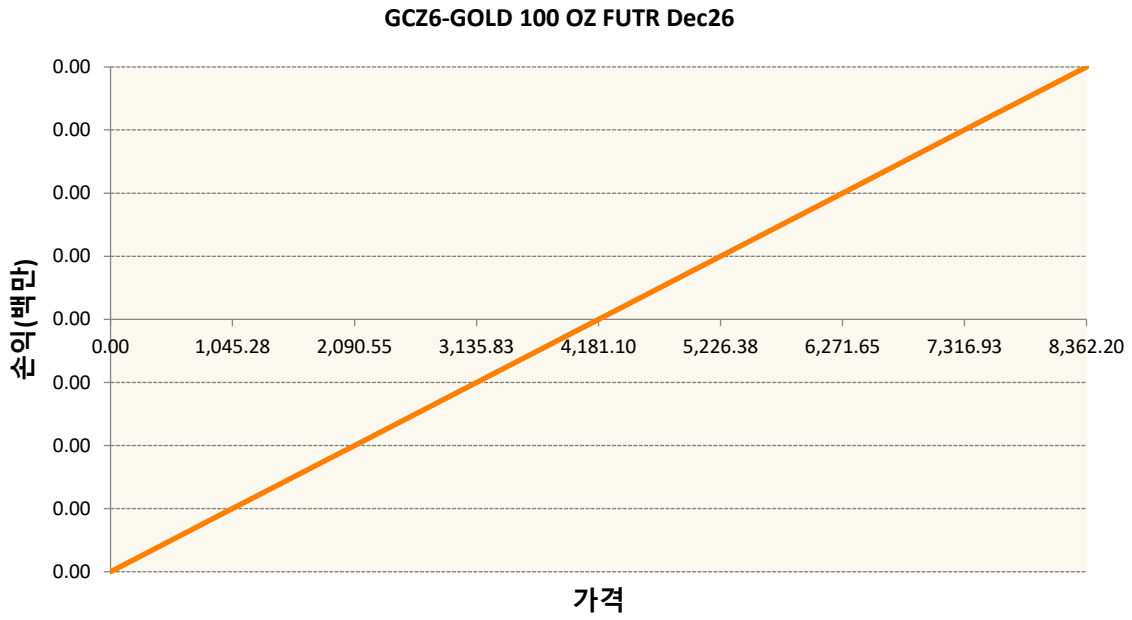
SOL골드커버드콜액티브특별자산상장지수(금

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			5,956	0	5,956	
누계	실물자산	옵션	0	0	0	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

AOGLDUSC0 GLD US 10/23/26 C387 EQUITY	1
GCZ6 GOLD 100 OZ FUTR Dec26	476

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

(단위:백만원)

608

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

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)

AOPLTRUC2(PLTR US 10/23/26 C207.5 EQUITY	12
AOPLTRUP2(PLTR US 10/23/26 P207.5 EQUITY	29

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

(단위:백만원)

141

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

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)

AOTLTUSCC TLT US 10/23/26 C79.5 EQUITY	1

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

(단위:백만원)

1

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

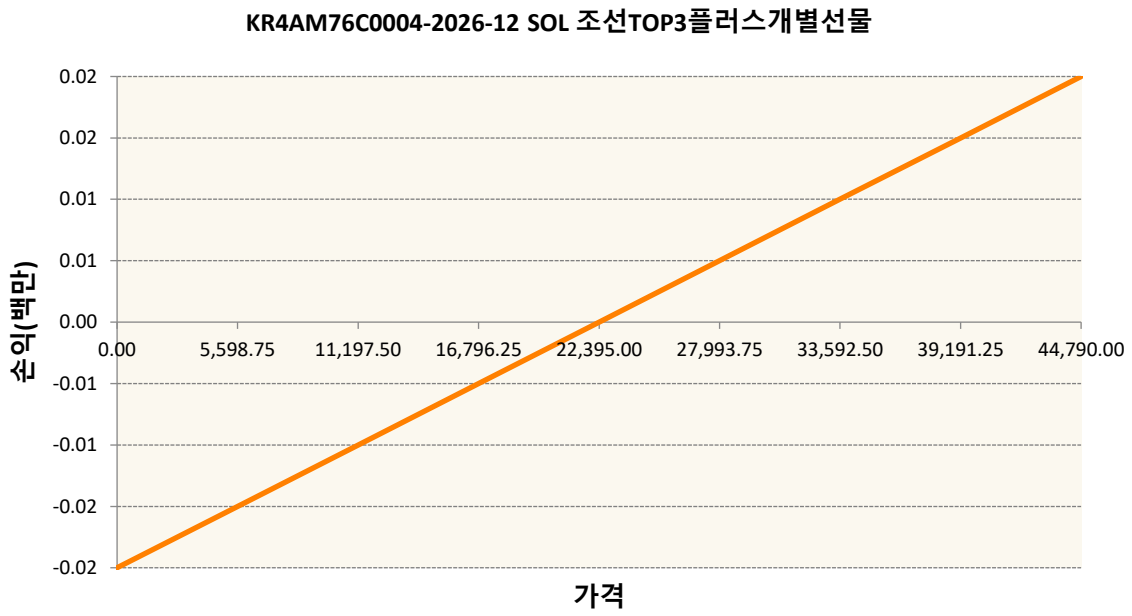
SOL조선TOP3플러스레버리지상장지수(주식)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	2	-2	장내
누계	유가증권	선물	7,309	0	7,309	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4AM76C0004	2026-12 SOL 조선TOP3플러스개별선물						5,820
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-5,820	-5,820	-5,820	-5,820	-5,820	-5,820	-5,820
-5.33%	-3,880	-3,880	-3,880	-3,880	-3,880	-3,880	-3,880
-2.67%	-1,940	-1,940	-1,940	-1,940	-1,940	-1,940	-1,940
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	1,940	1,940	1,940	1,940	1,940	1,940	1,940
5.33%	3,880	3,880	3,880	3,880	3,880	3,880	3,880
8.00%	5,820	5,820	5,820	5,820	5,820	5,820	5,820

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

9,941

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

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	2026-10-20
기준일	2026-10-19

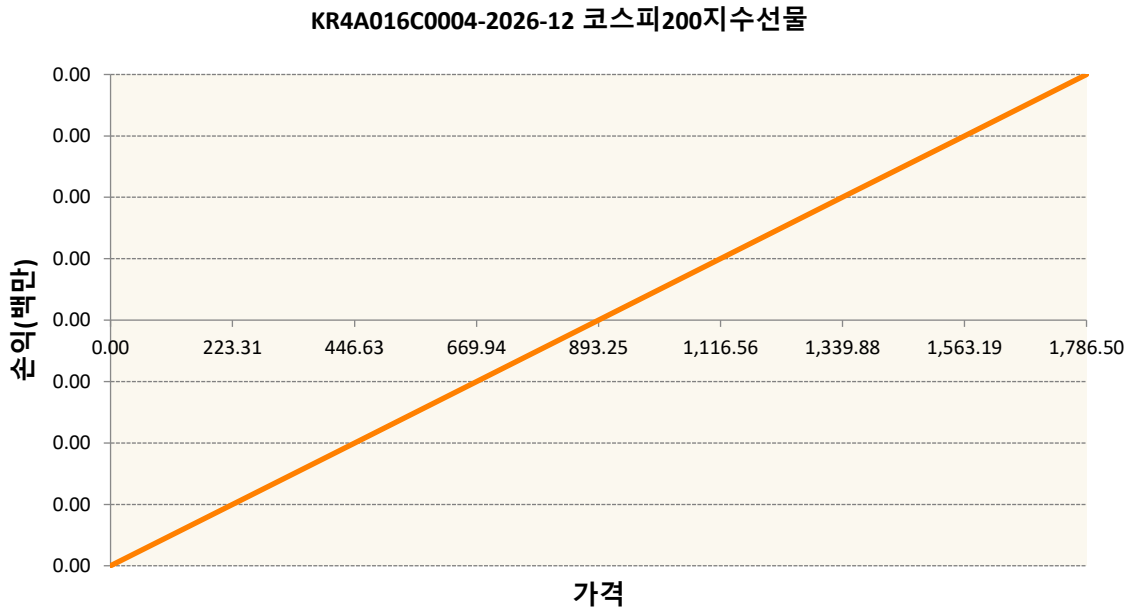
SOL 200타겟위클리커버드콜상장지수(주식)

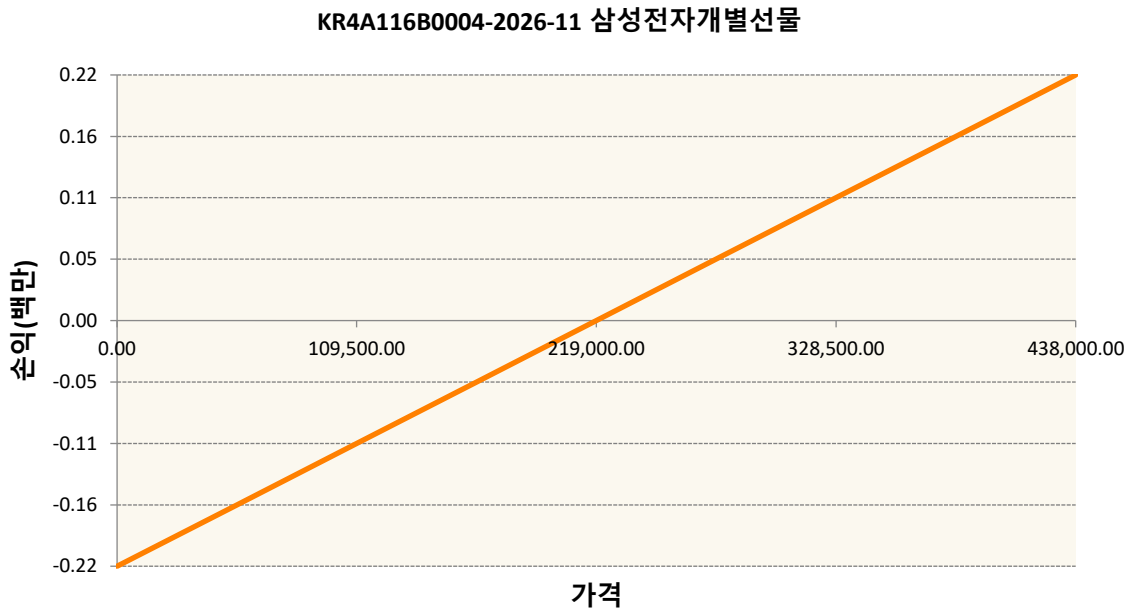
1. 계약금액

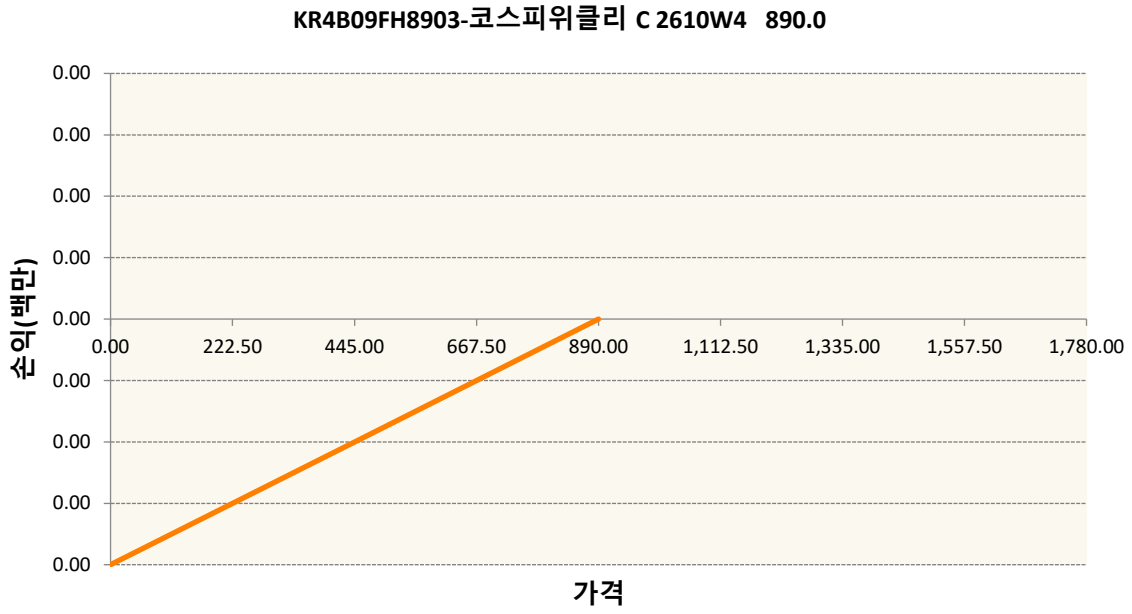
(단위:백만원)

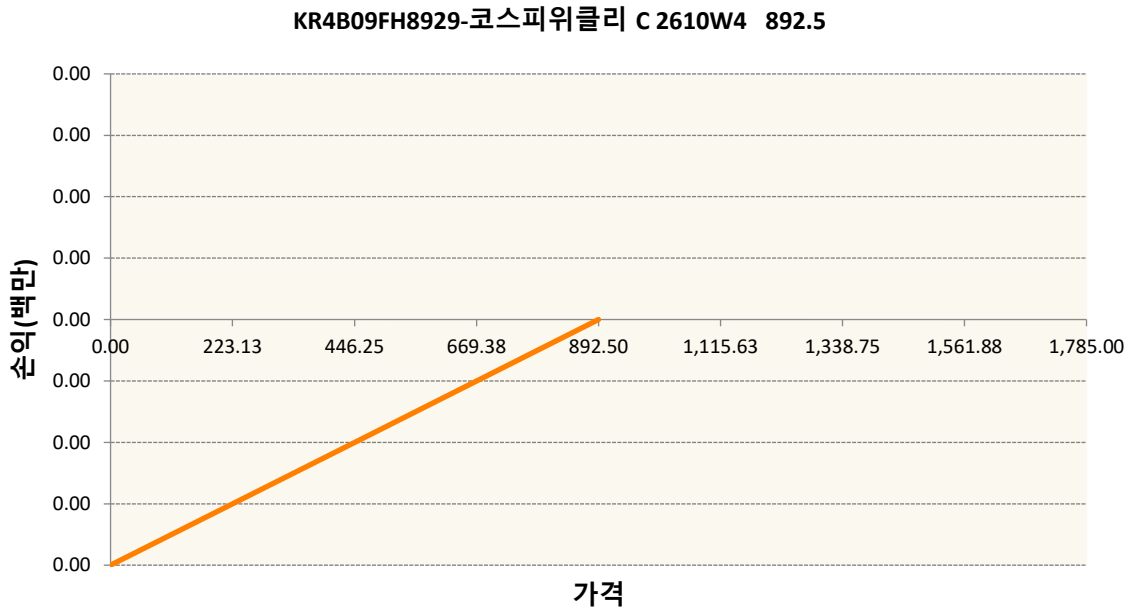
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	39,112	-39,112	장내
누계	유가증권	선물	17,632	0	17,632	장내
누계	유가증권	옵션	0	38,313	-38,313	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					463
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-463	-463	-463	-463	-463	-463	-463
-5.33%	-309	-309	-309	-309	-309	-309	-309
-2.67%	-154	-154	-154	-154	-154	-154	-154
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	154	154	154	154	154	154	154
5.33%	309	309	309	309	309	309	309
8.00%	463	463	463	463	463	463	463
	KR4A116B0004	2026-11 삼성전자개별선물					942
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-942	-942	-942	-942	-942	-942	-942
-5.33%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-2.67%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	314	314	314	314	314	314	314
5.33%	628	628	628	628	628	628	628
8.00%	942	942	942	942	942	942	942
	KR4B09FH8903		코스피위클리 C 2610W4	890.0			1,443
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,403	-1,406	-1,410	-1,416	-1,423	-1,432	-1,443
-5.33%	-809	-820	-834	-850	-868	-887	-908
-2.67%	-279	-306	-334	-362	-392	-422	-453
0%	104	69	35	0	-35	-69	-104
2.67%	305	279	252	223	194	164	133
5.33%	377	365	351	334	315	295	273
8.00%	393	390	385	378	369	358	345
	KR4B09FH8929		코스피위클리 C 2610W4	892.5			985
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-961	-962	-965	-968	-973	-978	-985
-5.33%	-561	-567	-576	-586	-597	-609	-623
-2.67%	-199	-216	-234	-252	-272	-291	-311
0%	70	46	23	0	-23	-46	-70
2.67%	216	198	179	159	139	118	97
5.33%	271	263	252	240	227	212	197
8.00%	285	282	278	273	266	258	249

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

9,546

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

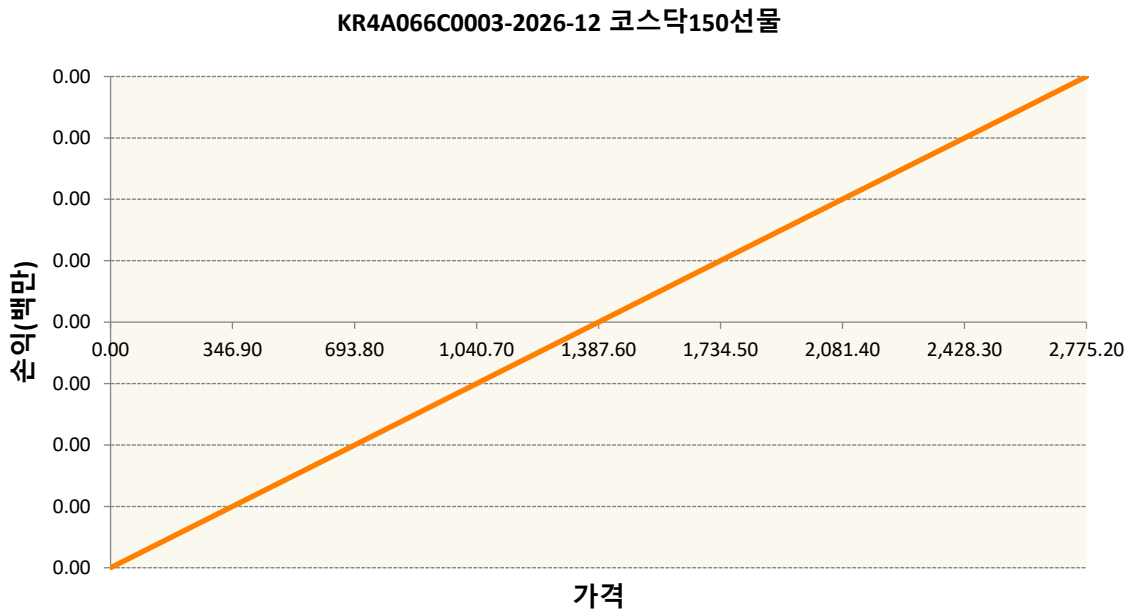
SOL코스닥150인덱스(주식-파생형)

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	569	0	569	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A066C0003	2026-12 코스닥150선물						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)

148

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

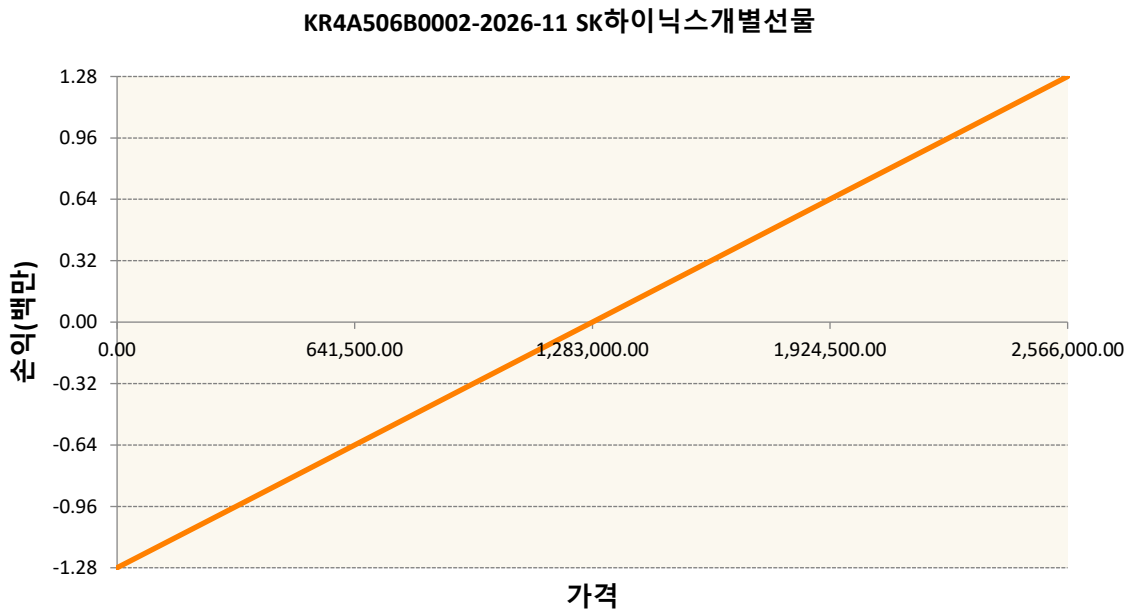
SOLSK하이닉스단일종목레버리지상장지수

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	3,116	238	2,878	장내
누계	유가증권	선물	23,440	0	23,440	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물	1,866

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,866	-1,866	-1,866	-1,866	-1,866	-1,866	-1,866
-5.33%	-1,244	-1,244	-1,244	-1,244	-1,244	-1,244	-1,244
-2.67%	-622	-622	-622	-622	-622	-622	-622
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	622	622	622	622	622	622	622
5.33%	1,244	1,244	1,244	1,244	1,244	1,244	1,244
8.00%	1,866	1,866	1,866	1,866	1,866	1,866	1,866

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

9,037

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

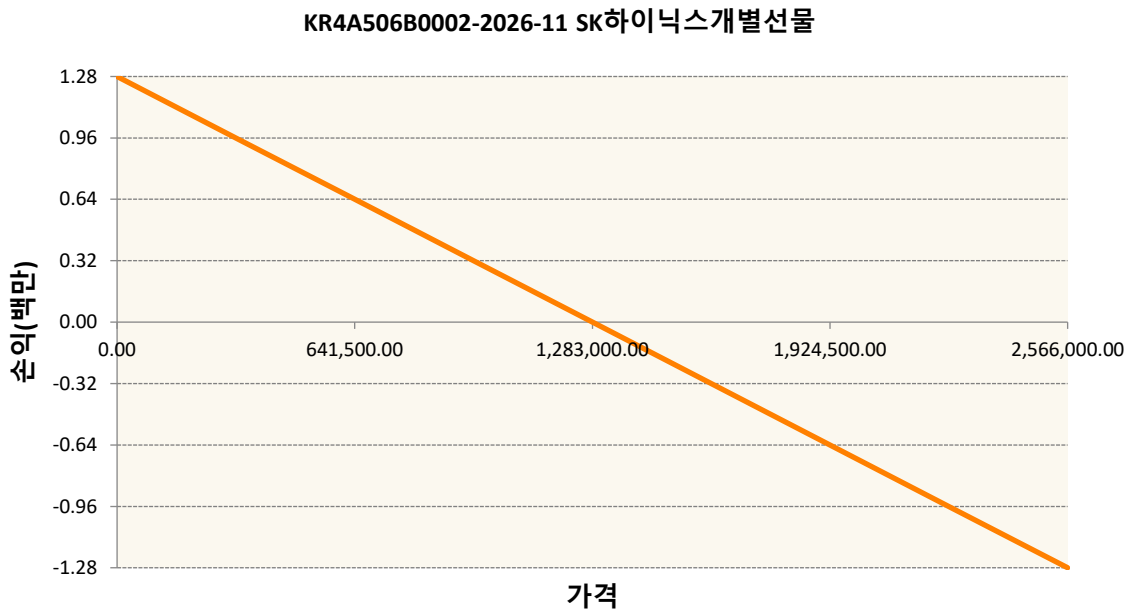
SOLSK하이닉스선물단일종목인버스2X상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	22,271	7,165	15,105	장내
누계	유가증권	선물	0	233,557	-233,557	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4A506B0002	2026-11 SK하이닉스개별선물						18,597
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	18,597	18,597	18,597	18,597	18,597	18,597	18,597
-5.33%	12,398	12,398	12,398	12,398	12,398	12,398	12,398
-2.67%	6,199	6,199	6,199	6,199	6,199	6,199	6,199
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-6,199	-6,199	-6,199	-6,199	-6,199	-6,199	-6,199
5.33%	-12,398	-12,398	-12,398	-12,398	-12,398	-12,398	-12,398
8.00%	-18,597	-18,597	-18,597	-18,597	-18,597	-18,597	-18,597

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

90,039

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

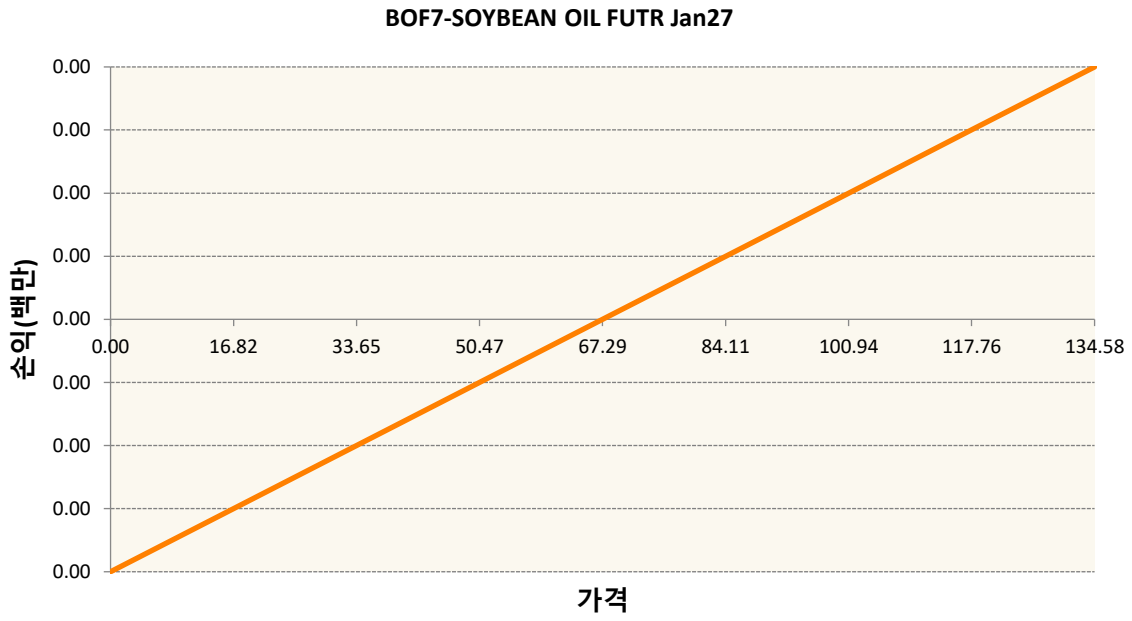
포커스농산물모(채권-파생형)

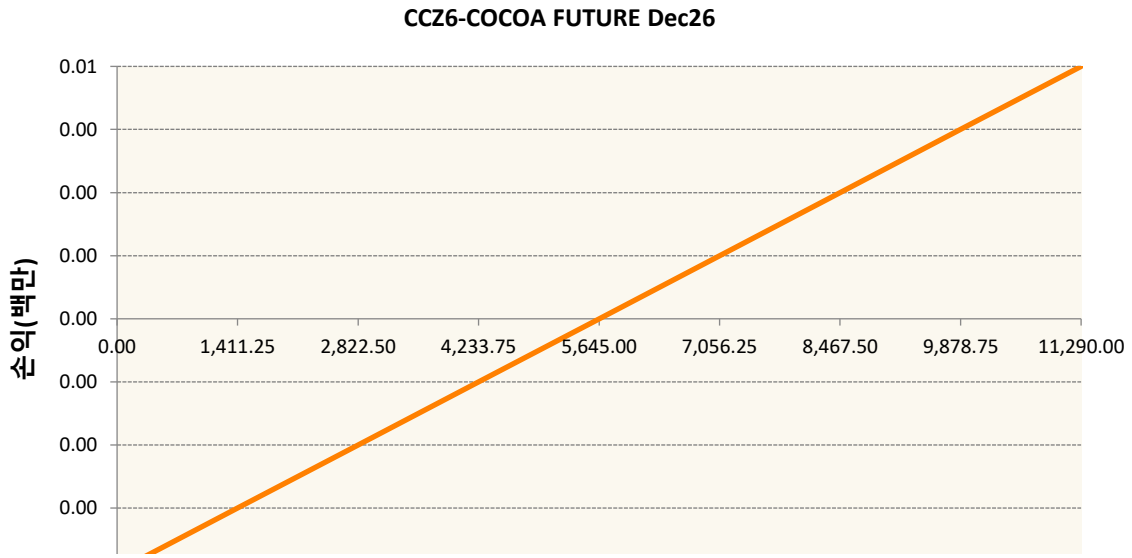
1. 계약금액

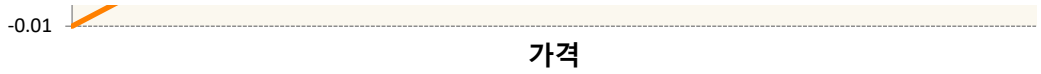
(단위:USD 백만)

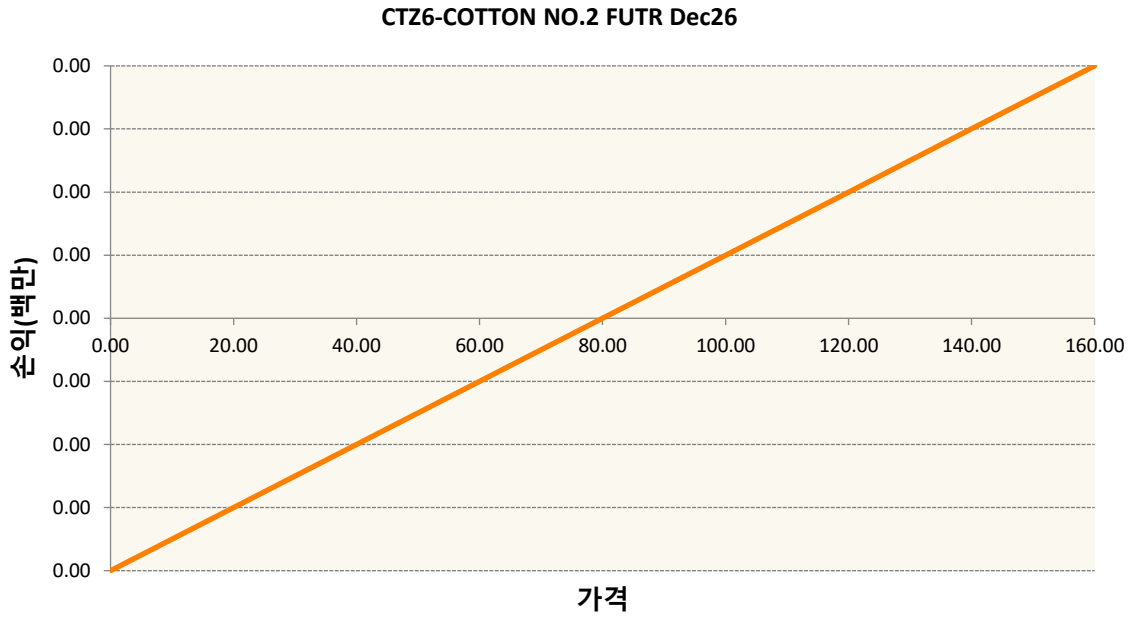
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	실물자산	선물	0	0	0	
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	통화	선물	0	0	0	장내
누계	실물자산	선물	352	0	352	
누계	유가증권	선물	2,271	0	2,271	
누계	통화	선물	0	319	-319	장내

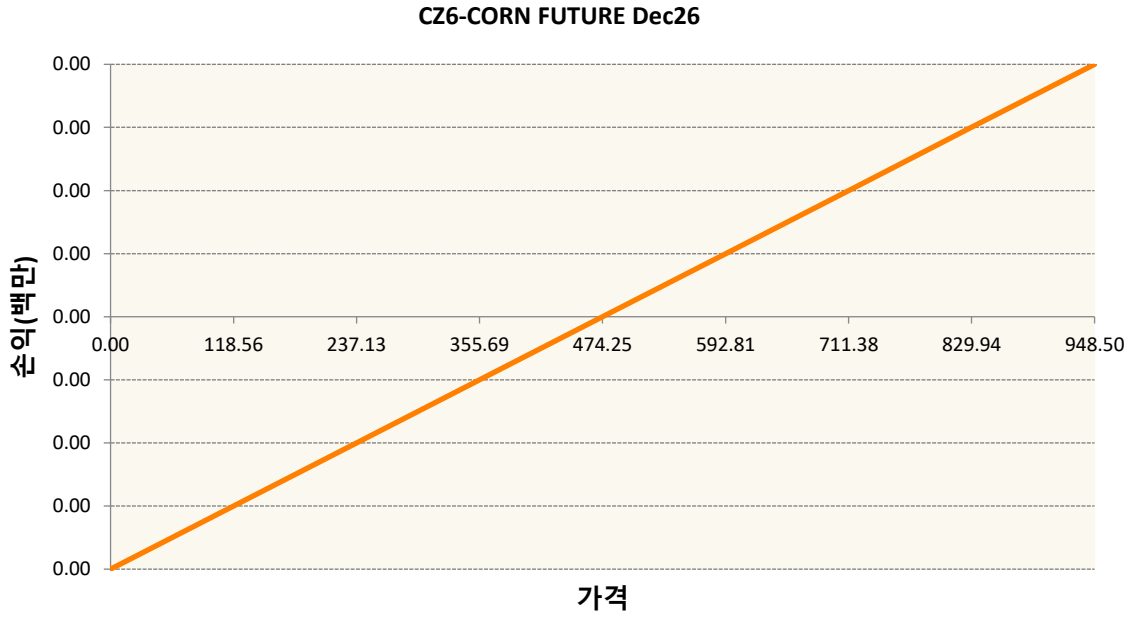
2. 만기시점의 손익구조

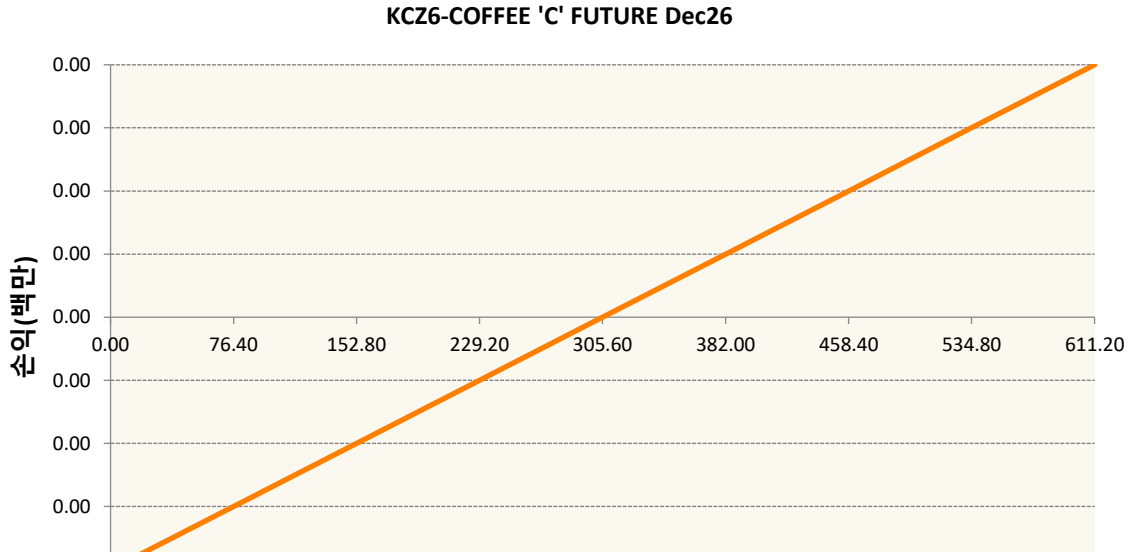


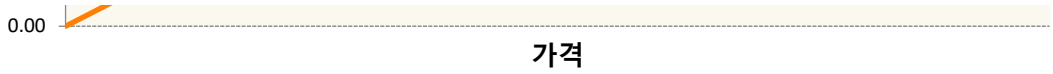


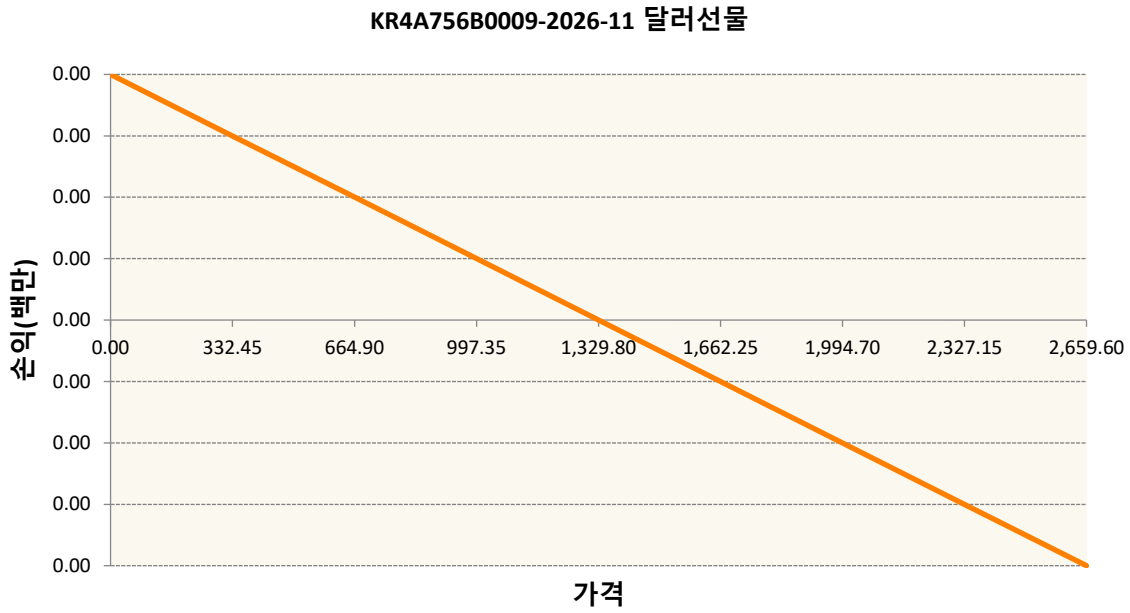

-0.01
가격

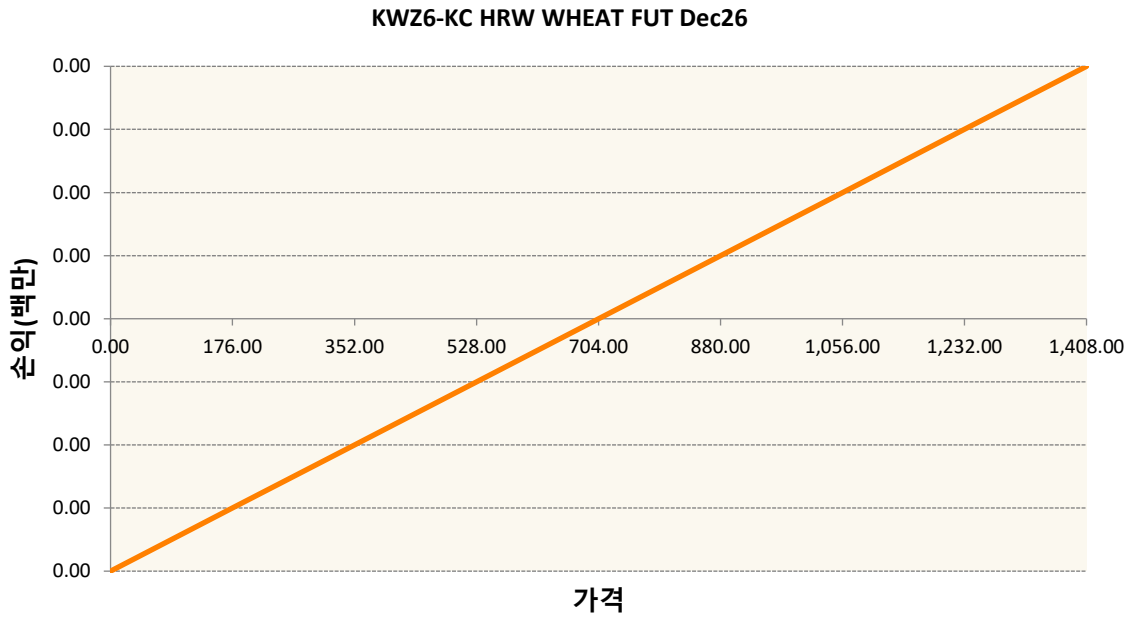

CTZ6-COTTON NO.2 FUTR Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
20.00
40.00
60.00
80.00
100.00
120.00
140.00
160.00
손익(백만)
가격

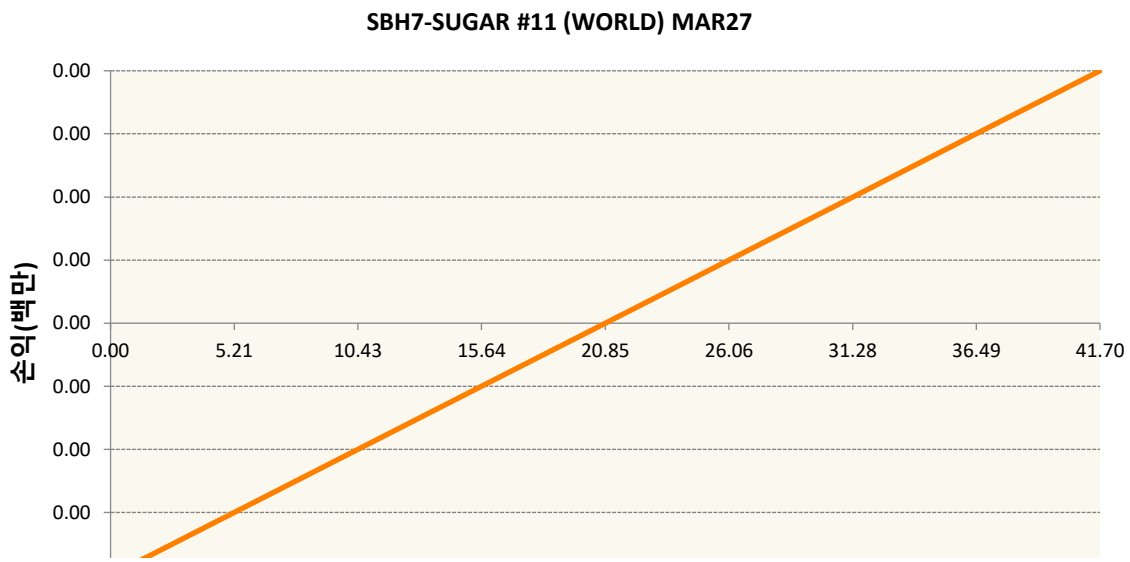

CZ6-CORN FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
118.56
237.13
355.69
474.25
592.81
711.38
829.94
948.50
손익(백만)
가격

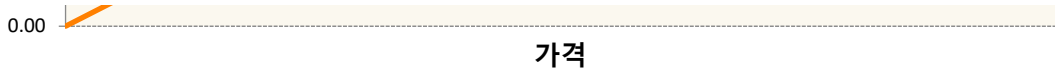

KCZ6-COFFEE 'C' FUTURE Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
76.40
152.80
229.20
305.60
382.00
458.40
534.80
611.20
손익(백만)

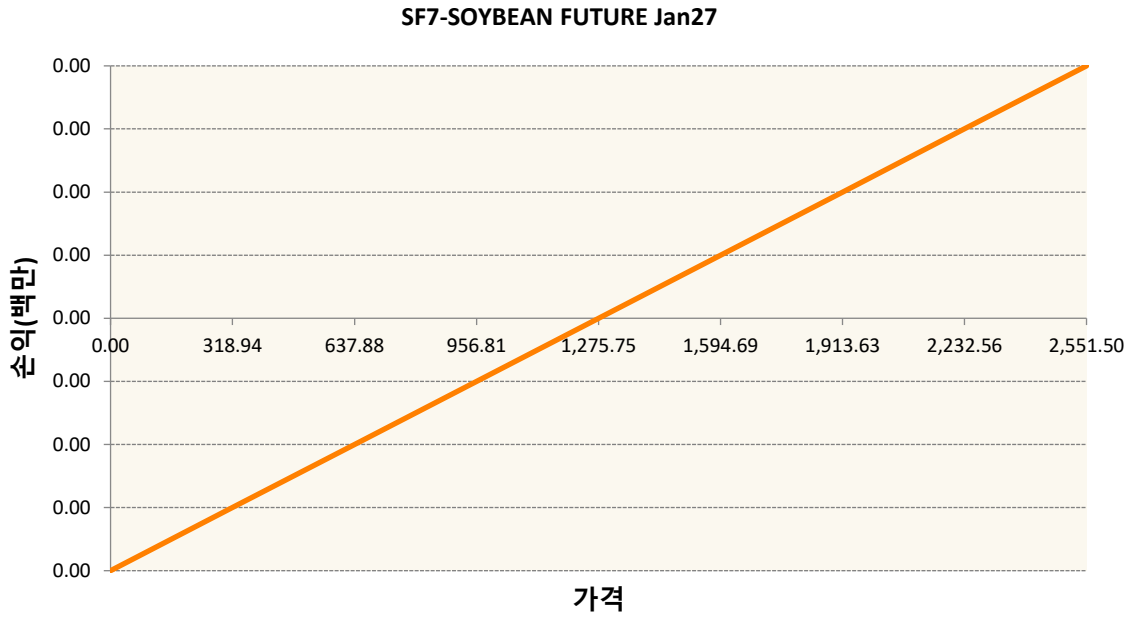

0.00
가격

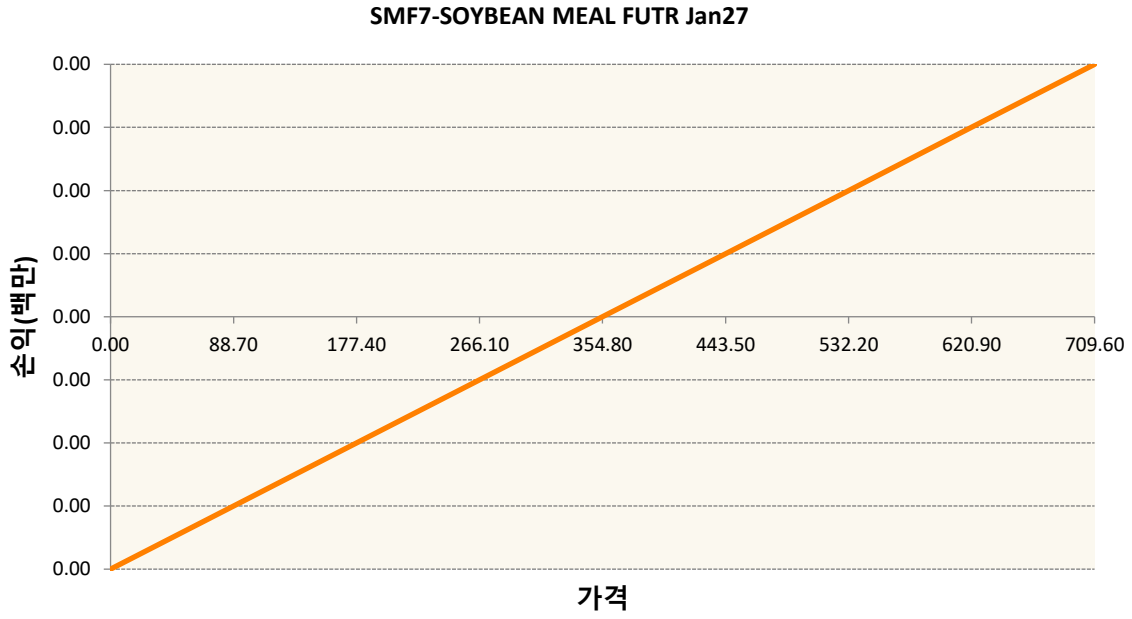

KR4A756B0009-2026-11 달러선물
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
332.45
664.90
997.35
1,329.80
1,662.25
1,994.70
2,327.15
2,659.60
손익(백만)
가격

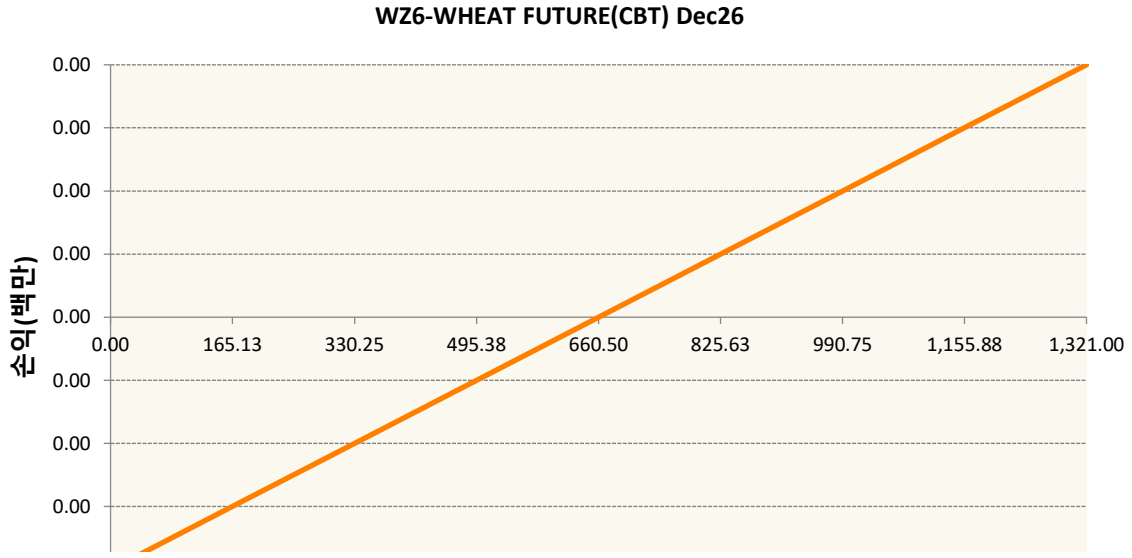

KWZ6-KC HRW WHEAT FUT Dec26
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
176.00
352.00
528.00
704.00
880.00
1,056.00
1,232.00
1,408.00
손익(백만)
가격


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
10.43
15.64
20.85
26.06
31.28
36.49
41.70
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
318.94
637.88
956.81
1,275.75
1,594.69
1,913.63
2,232.56
2,551.50
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
88.70
177.40
266.10
354.80
443.50
532.20
620.90
709.60
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
165.13
330.25
495.38
660.50
825.63
990.75
1,155.88
1,321.00
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	2026-10-20
기준일	2026-10-19

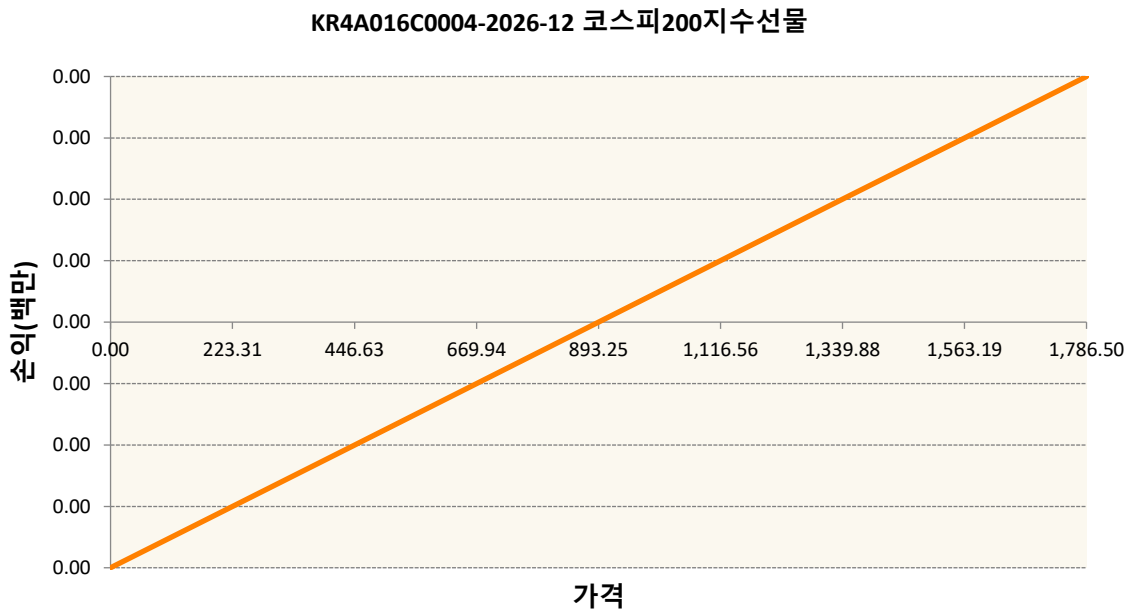
스마트인덱스모

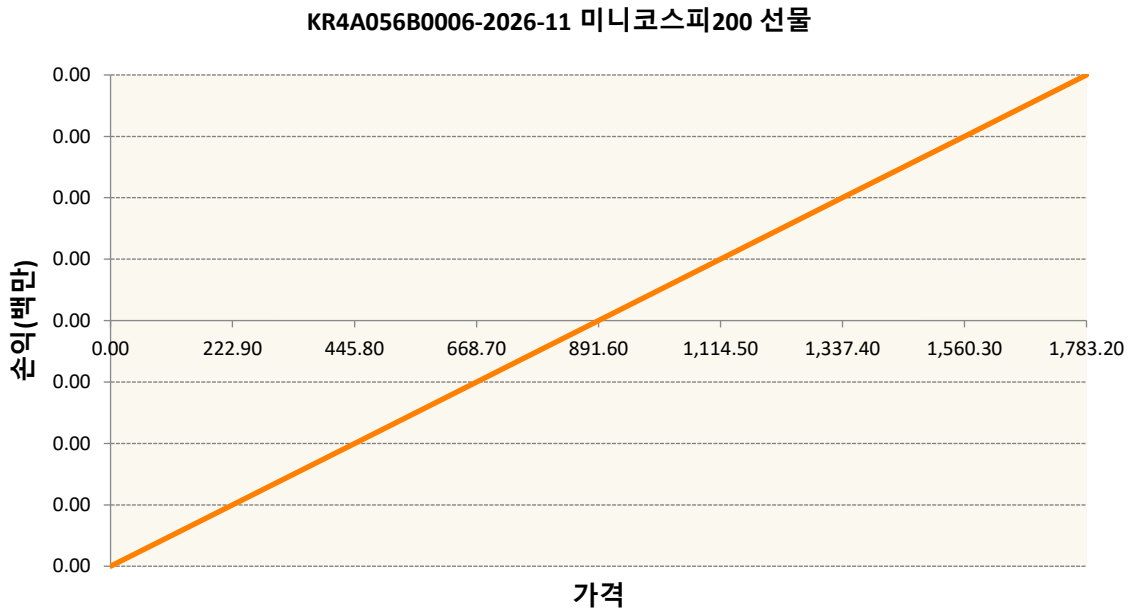
1. 계약금액

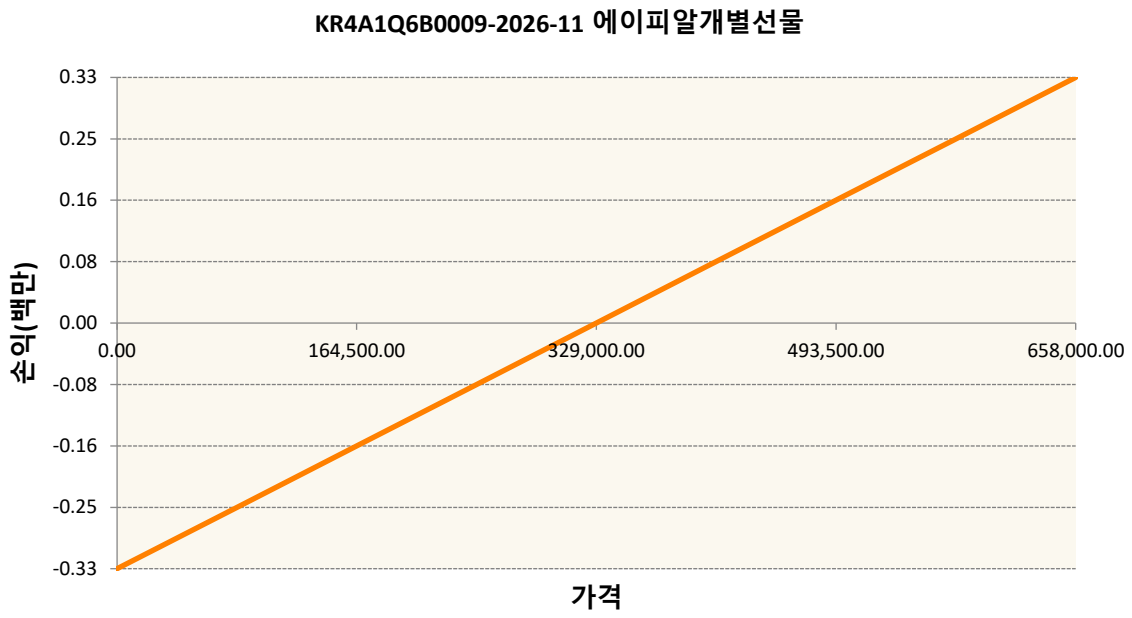
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	237	0	237	장내
누계	유가증권	선물	8,050	0	8,050	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

	KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물					392
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-392	-392	-392	-392	-392	-392	-392
-5.33%	-261	-261	-261	-261	-261	-261	-261
-2.67%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	131	131	131	131	131	131	131
5.33%	261	261	261	261	261	261	261
8.00%	392	392	392	392	392	392	392
	KR4A056B0006	2026-11 미니코스피200 선물					50
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-50	-50	-50	-50	-50	-50	-50
-5.33%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
-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%	33	33	33	33	33	33	33
8.00%	50	50	50	50	50	50	50
	KR4A1Q6B0009	2026-11 에이피알개별선물					1
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

1,527

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

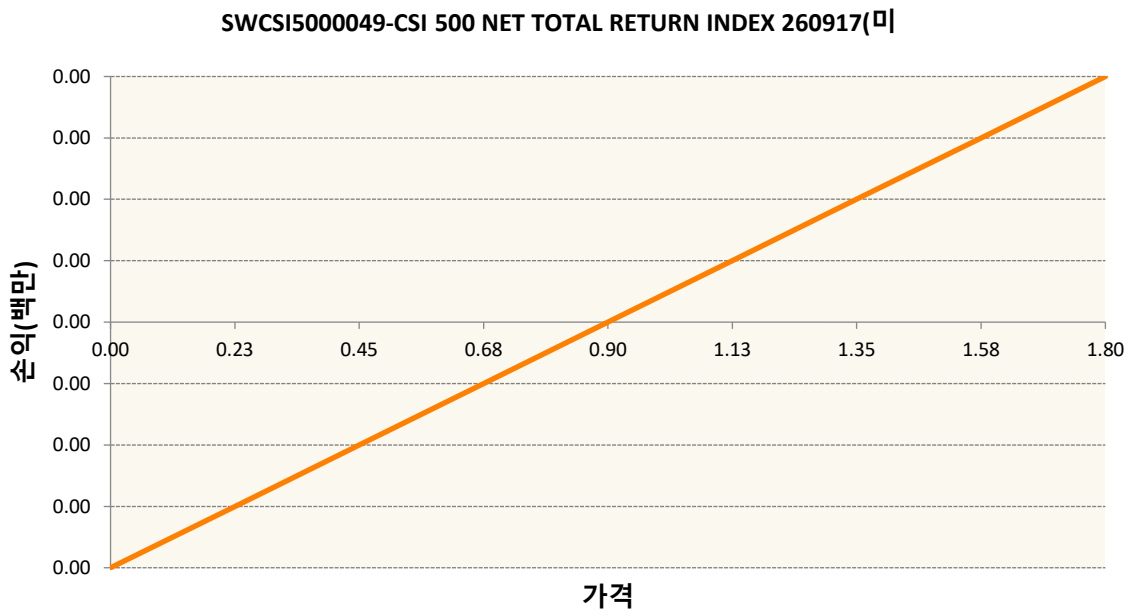
SOL차이나강소기업CSI500상장

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	4,789	0	4,789	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 CSI 500 NET TOTAL RETURN INDEX 260917(미	385

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

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

(단위:백만원)

618

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

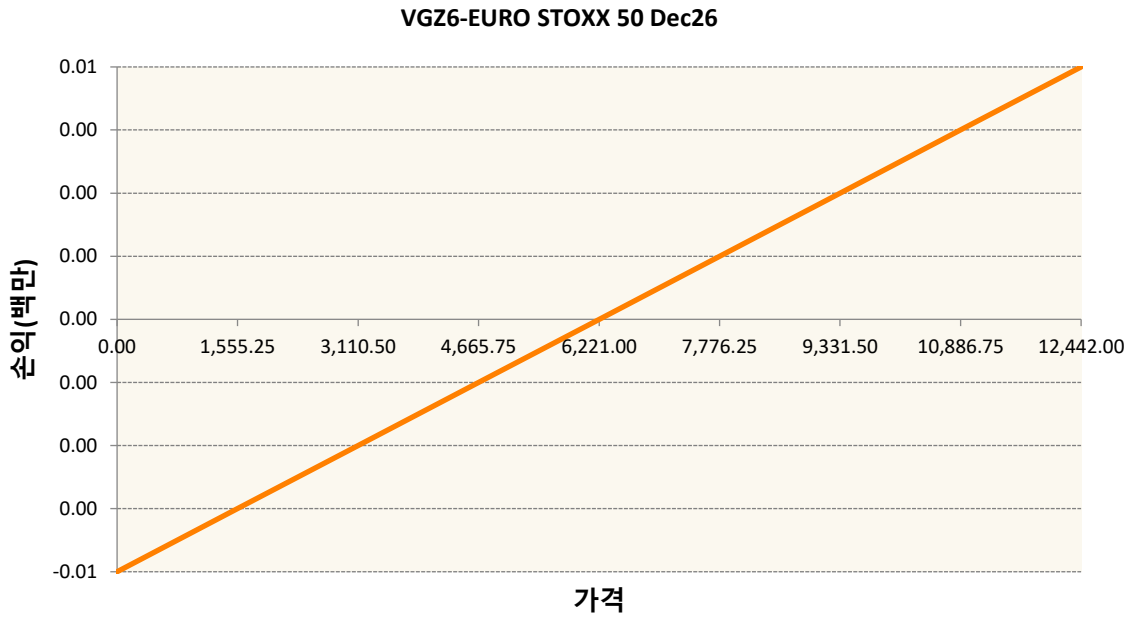
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,180	0	1,180	

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	2026-10-20
기준일	2026-10-19

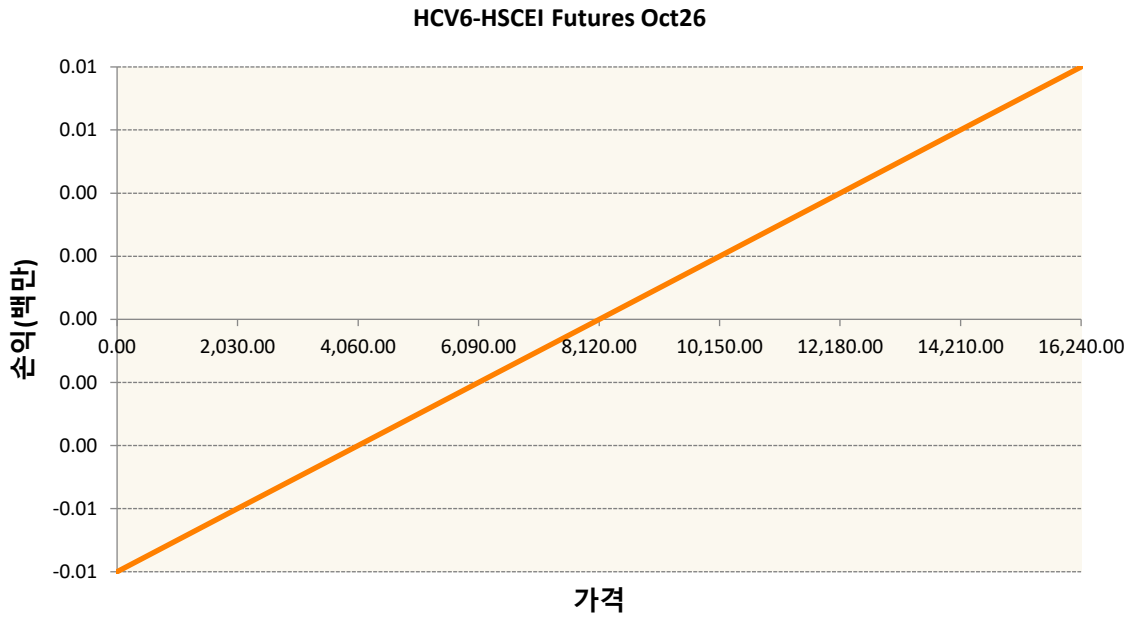
차이나인덱스모(주식-파생형)

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	1,413	0	1,413	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	2026-10-20
기준일	2026-10-19

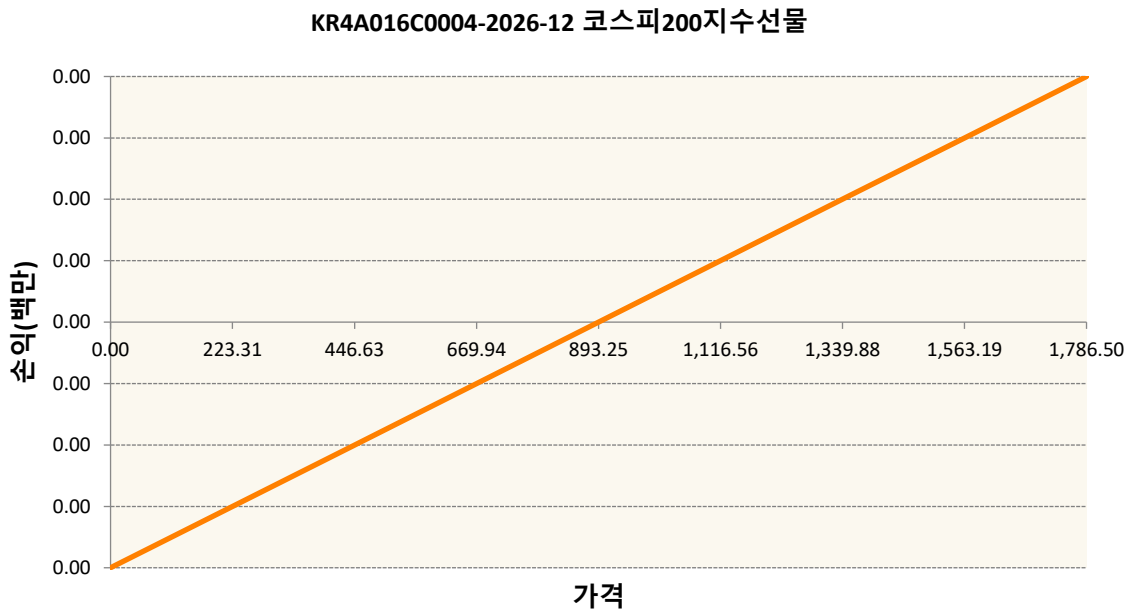
커버드콜모(주식혼합-파생형)

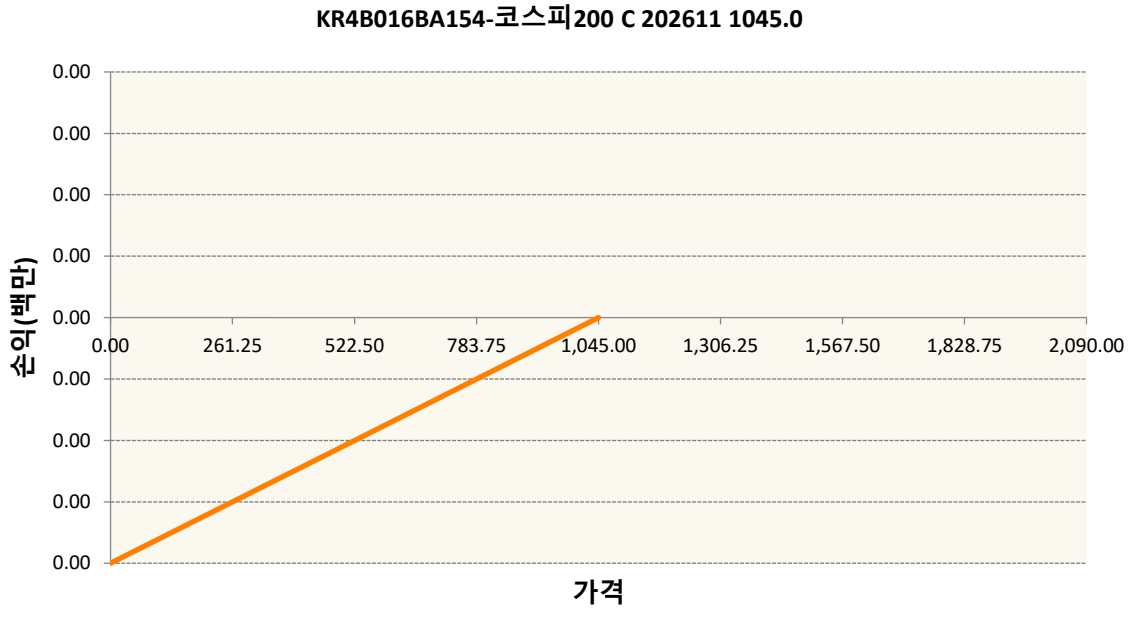
1. 계약금액

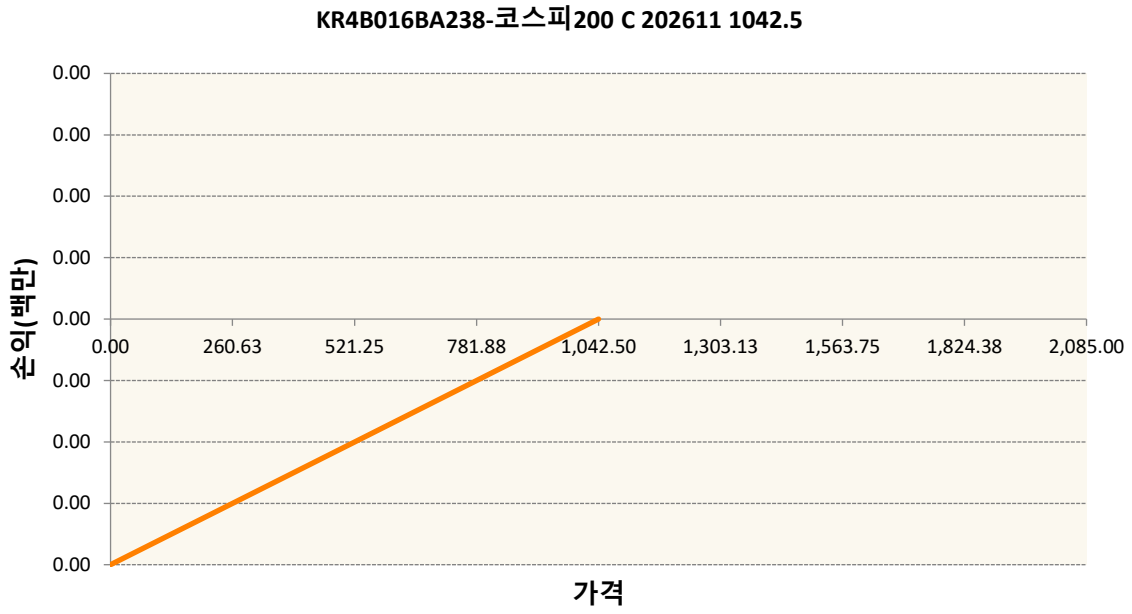
(단위:백만원)

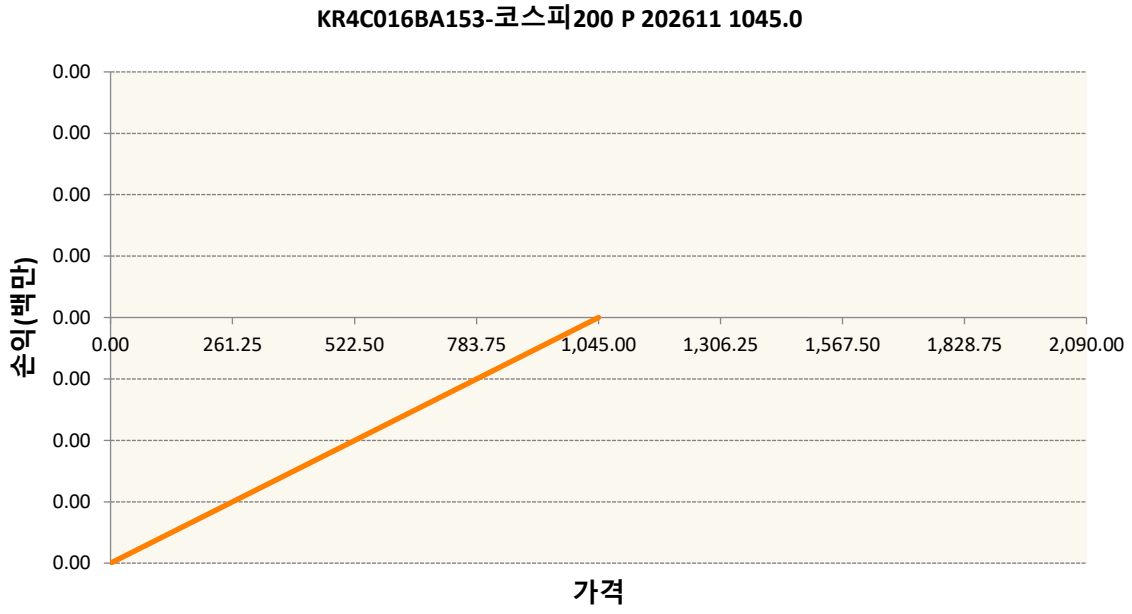
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	447	0	447	장내
누계	유가증권	옵션	0	49,876	-49,876	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						36
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-5.33%	-24	-24	-24	-24	-24	-24	-24
-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%	24	24	24	24	24	24	24
8.00%	36	36	36	36	36	36	36
KR4B016BA154	코스피200 C 202611 1045.0						2,002
	기초자산의 변동성						

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,881	-1,888	-1,900	-1,916	-1,939	-1,967	-2,002
-5.33%	-1,200	-1,213	-1,232	-1,259	-1,291	-1,331	-1,376
-2.67%	-526	-549	-580	-618	-663	-715	-773
0%	133	97	52	0	-59	-125	-196
2.67%	771	718	657	589	514	434	350
5.33%	1,377	1,306	1,227	1,142	1,053	959	863
8.00%	1,941	1,851	1,755	1,655	1,552	1,446	1,338
	KR4B016BA238		코스피200 C 202611 1042.5				637
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-598	-600	-604	-610	-617	-626	-637
-5.33%	-381	-385	-392	-400	-411	-424	-438
-2.67%	-166	-174	-184	-196	-211	-228	-247
0%	44	32	17	0	-19	-41	-64
2.67%	246	229	209	187	163	137	110
5.33%	439	415	390	362	333	303	272
8.00%	617	588	557	525	491	457	423
	KR4C016BA153		코스피200 P 202611 1045.0				656
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-616	-618	-622	-628	-635	-644	-656
-5.33%	-393	-397	-404	-412	-423	-436	-451
-2.67%	-172	-180	-190	-202	-217	-234	-253
0%	44	32	17	0	-19	-41	-64
2.67%	252	235	215	193	168	142	115
5.33%	451	428	402	374	345	314	283
8.00%	636	606	575	542	508	474	438

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

6,294

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

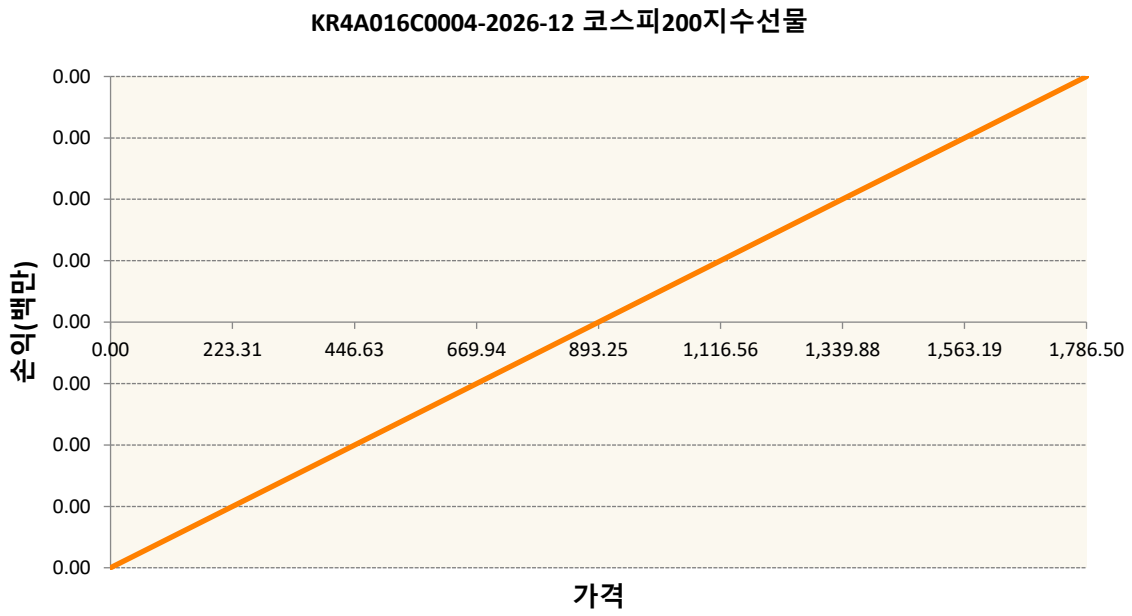
스마트KRX300인덱스모(주식-파생형)

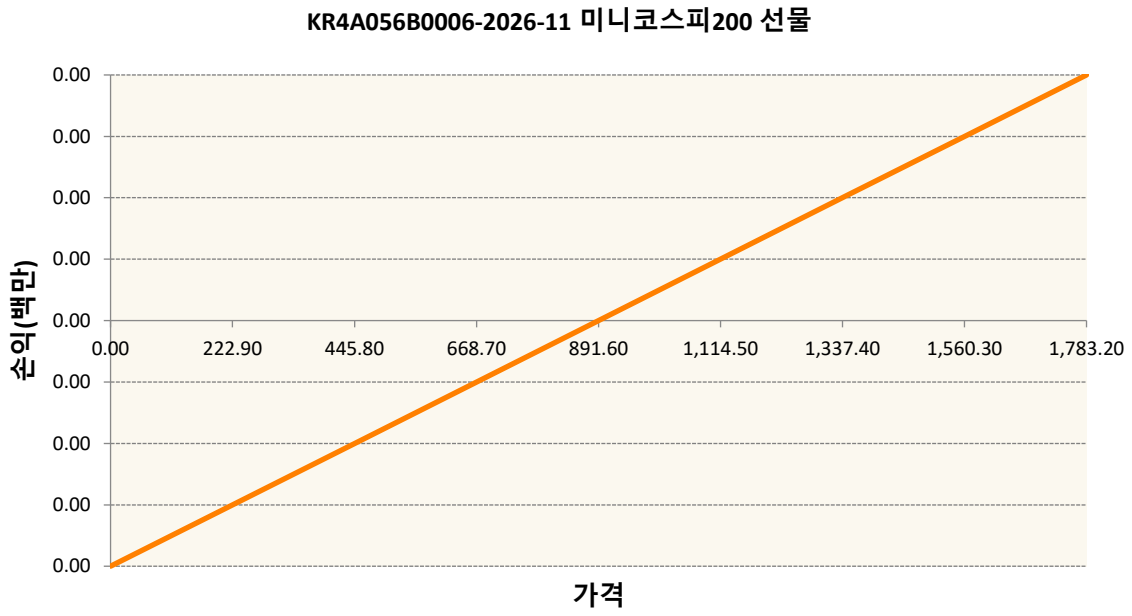
1. 계약금액

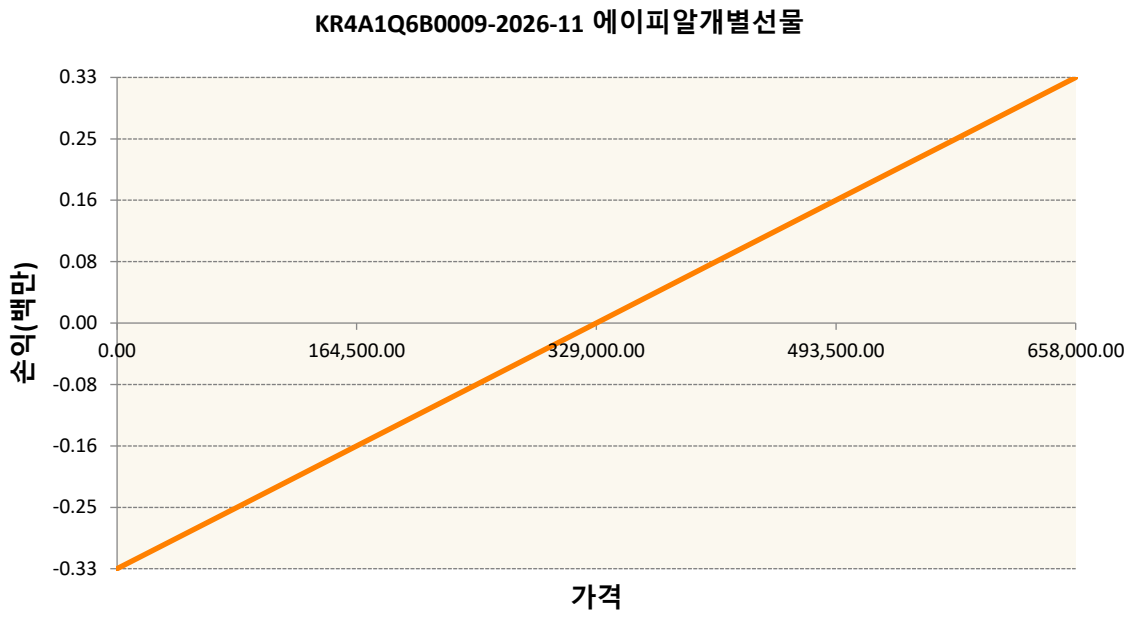
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	16	0	16	장내
누계	유가증권	선물	2,247	0	2,247	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%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	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%	-17	-17	-17	-17	-17	-17	-17
-2.67%	-8	-8	-8	-8	-8	-8	-8
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	8	8	8	8	8	8	8
5.33%	17	17	17	17	17	17	17
8.00%	25	25	25	25	25	25	25
	KR4A1Q6B0009	2026-11 에이피알개별선물					1
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-5.33%	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	1	1	1	1	1	1	1
8.00%	1	1	1	1	1	1	1

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

271

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

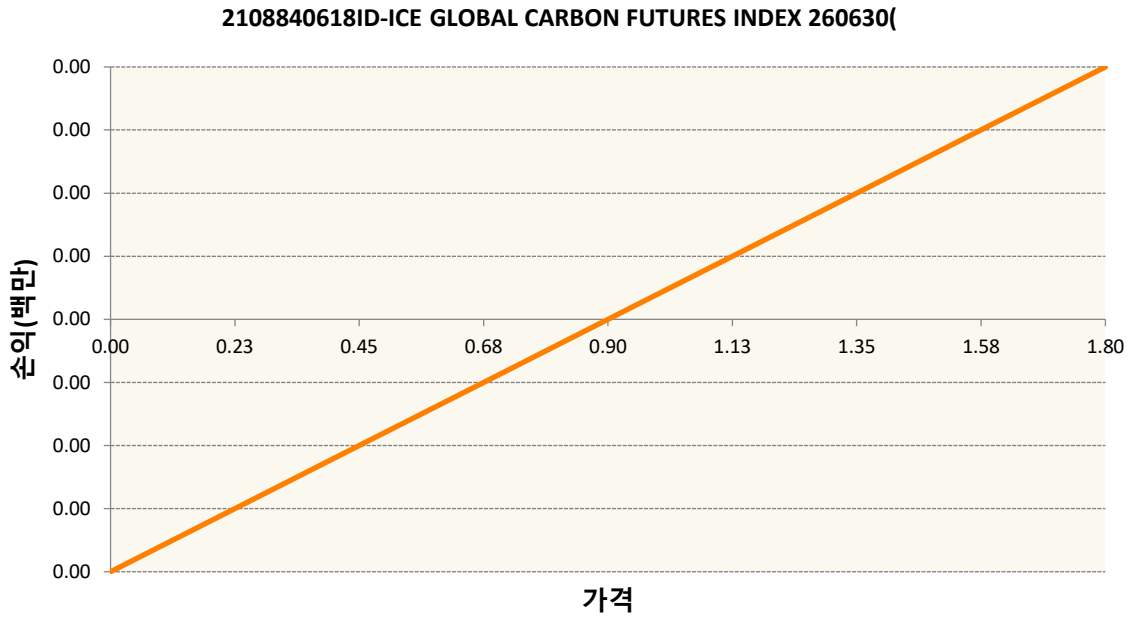
SOL 글로벌탄소배출권선물IHS특

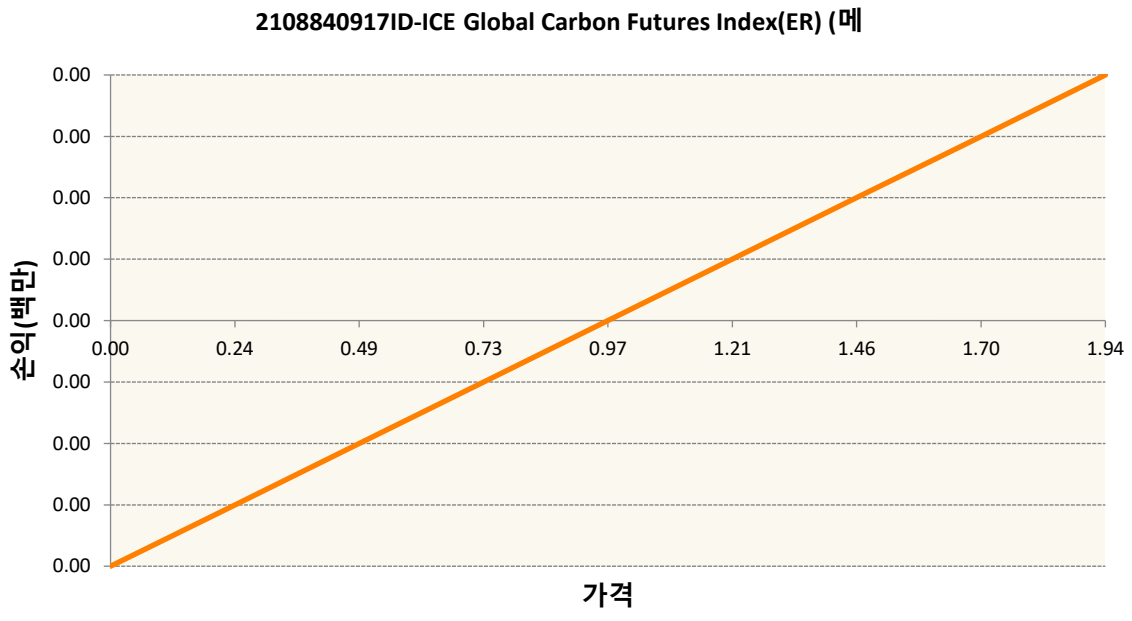
1. 계약금액

(단위:백만원)

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

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2108840618ㅣICE GLOBAL CARBON FUTURES INDEX 260630(	438
2108840917ㅣICE Global Carbon Futures Index(ER) (메	111

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

565

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

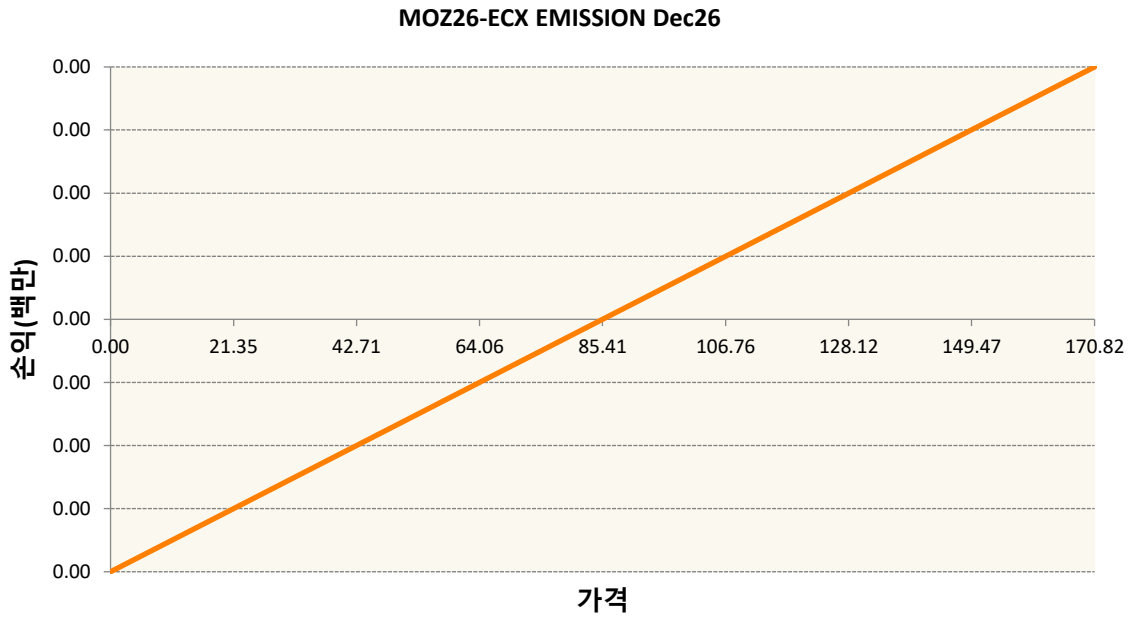
SOL 유럽탄소배출권선물S&P특별

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			6,037	0	6,037	
누계	통화	선도	0	2,478	-2,478	장외

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FXW213G9V	KRW/EUR 30-10-26E	198
MOZ26	ECX EMISSION Dec26	483

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

(단위:백만원)

717

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

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(	25

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

(단위:백만원)

94

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

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	-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)	84

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

(단위:백만원)

815

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

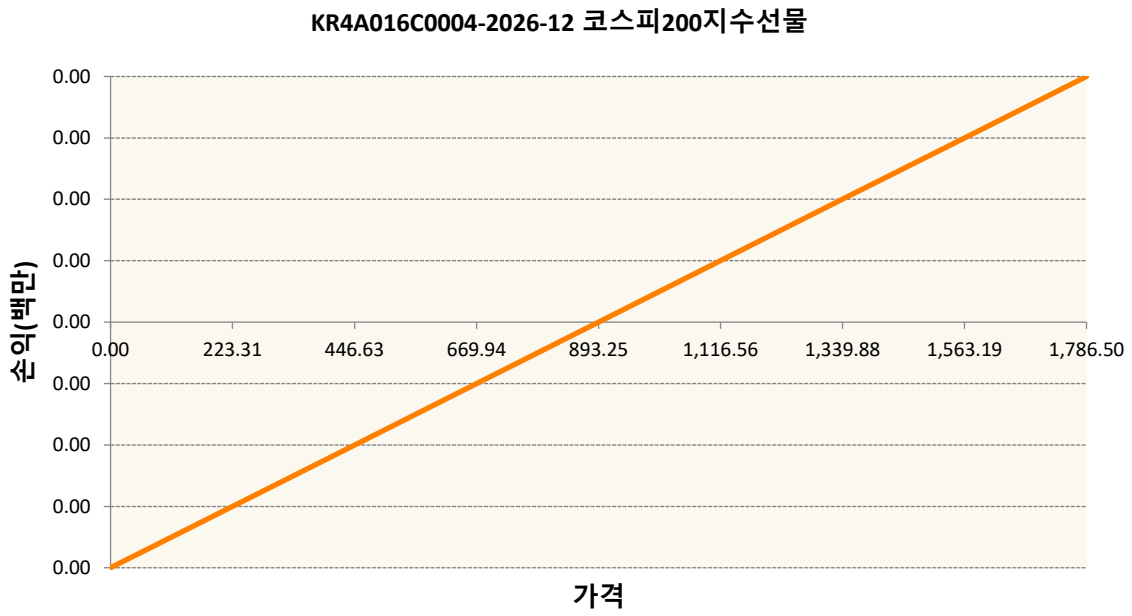
코리아인덱스(주식-파생형)(종)

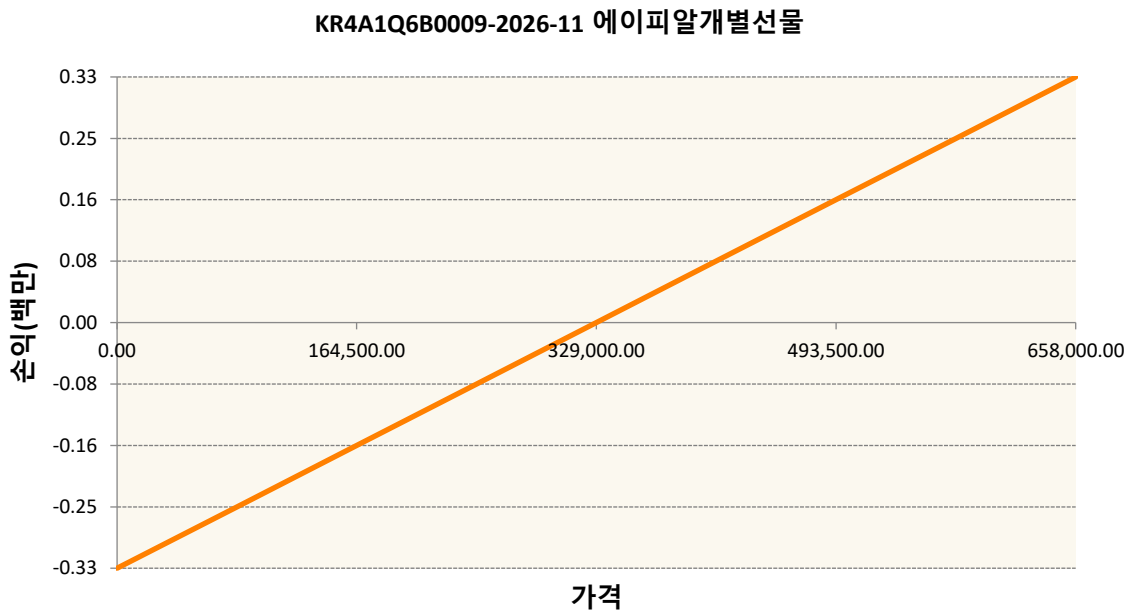
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	277	0	277	장내
누계	유가증권	선물	17,031	0	17,031	장내

2. 만기시점의 손익구조





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4A016C0004	2026-12 코스피200지수선물						1,337
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337	-1,337
-5.33%	-891	-891	-891	-891	-891	-891	-891
-2.67%	-446	-446	-446	-446	-446	-446	-446
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	446	446	446	446	446	446	446
5.33%	891	891	891	891	891	891	891
8.00%	1,337	1,337	1,337	1,337	1,337	1,337	1,337

KR4A1Q6B0009	2026-11 에이피알개별선물						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

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

4,620

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

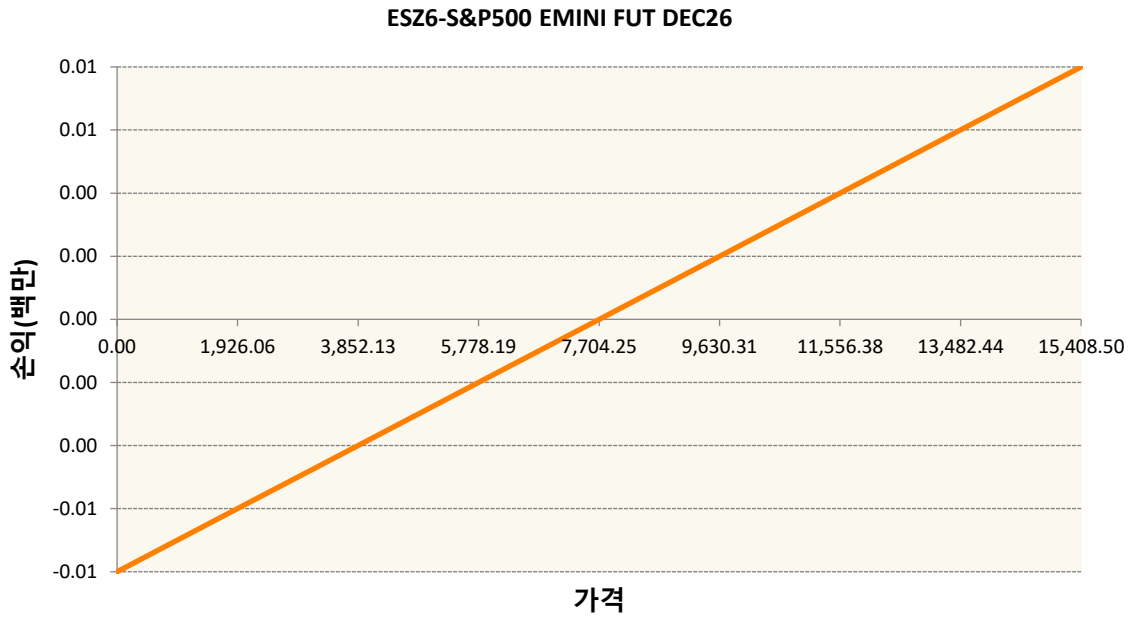
미국S&P500인덱스모(주식-파생형)

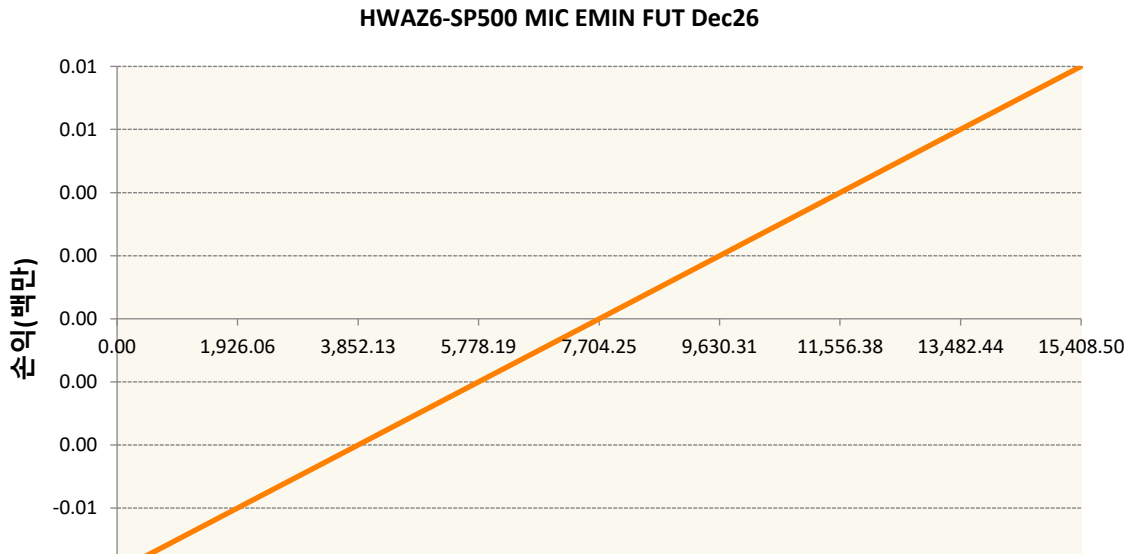
1. 계약금액

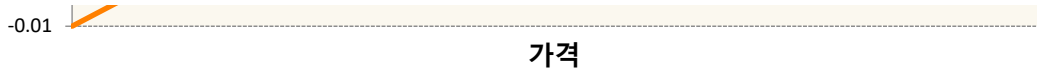
(단위:백만원)

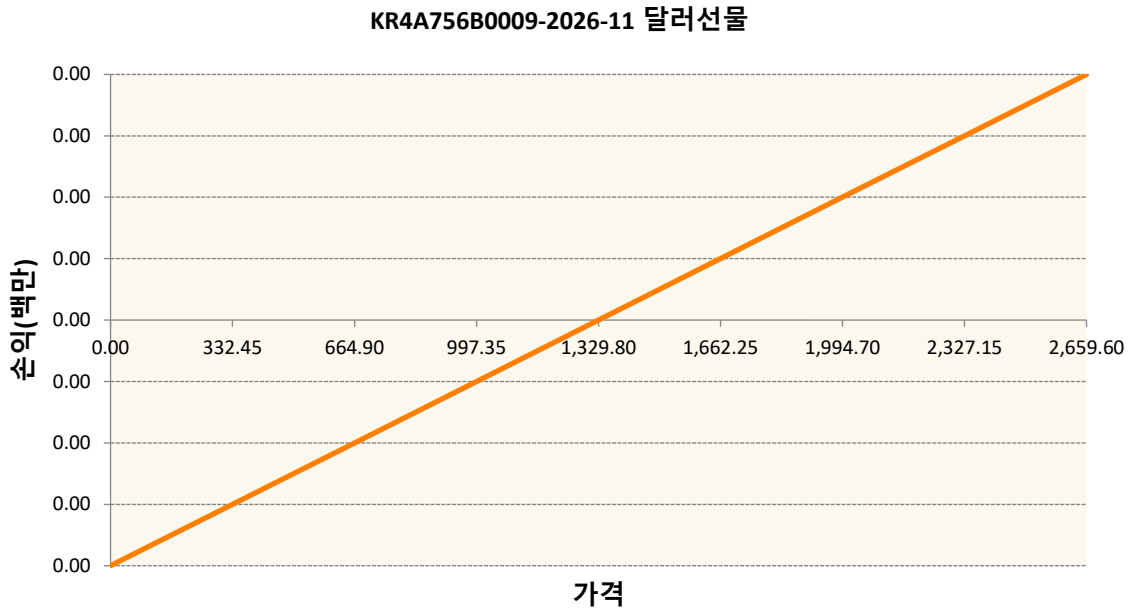
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	931	0	931	장내
누계	지수	선물	76,564	0	76,564	
누계	지수	선물	373	0	373	장내
누계	통화	선물	18,484	0	18,484	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
ESZ6	S&P500 EMINI FUT DEC26	6,125
HWAZ6	SP500 MIC EMIN FUT Dec26	30
KR4A756B00	2026-11 달러선물	1,479

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	3,690

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

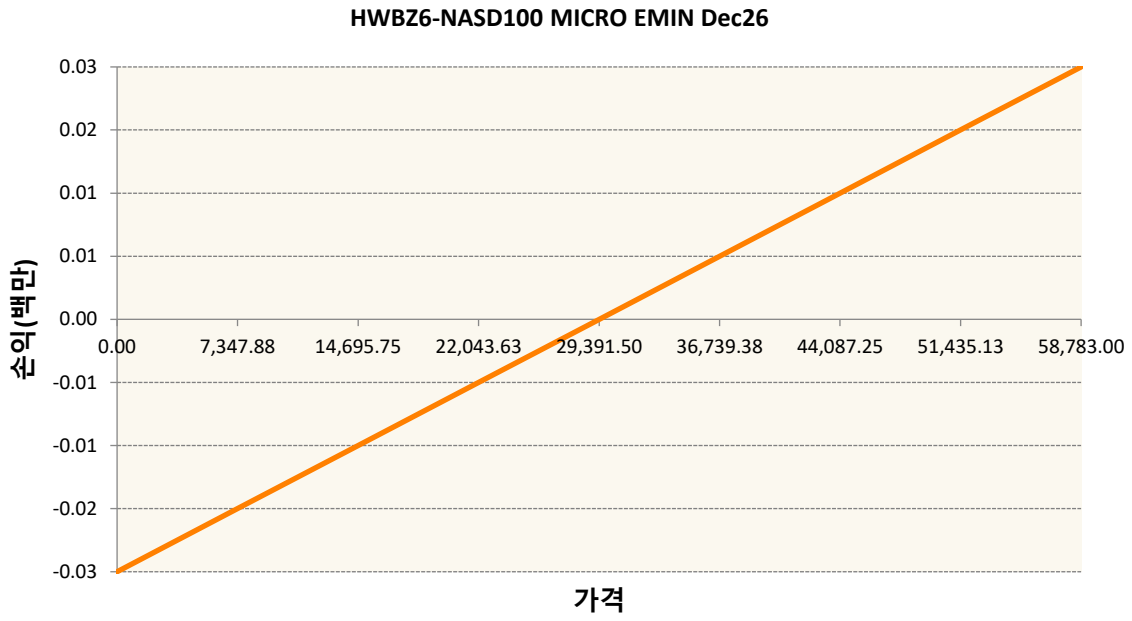
미국나스닥100인덱스모(주식-파생형)

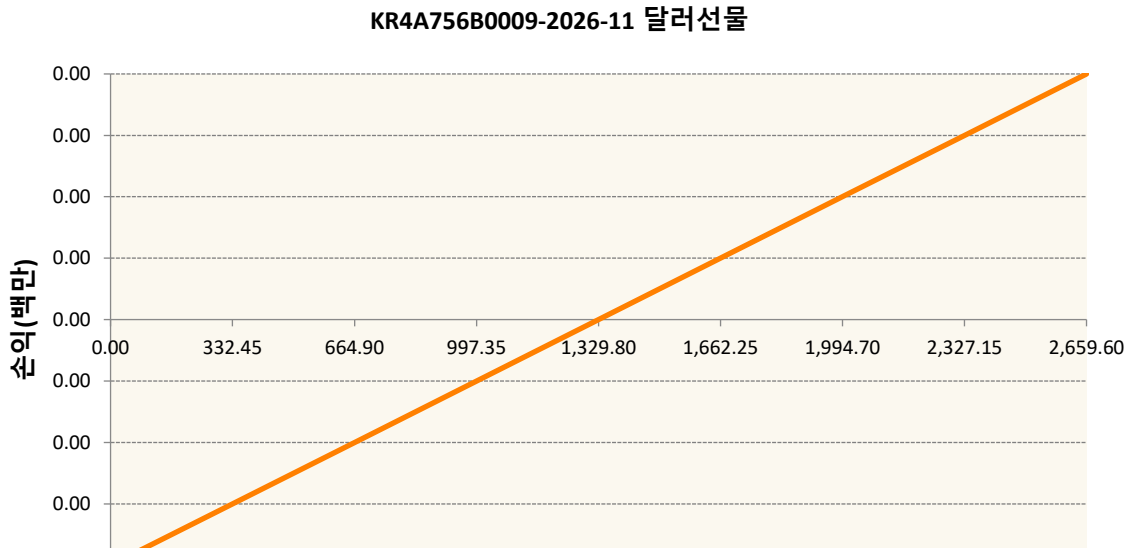
1. 계약금액

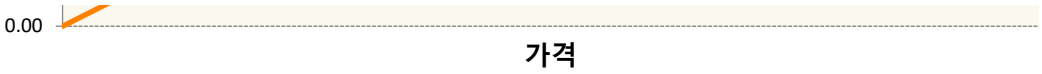
(단위:백만원)

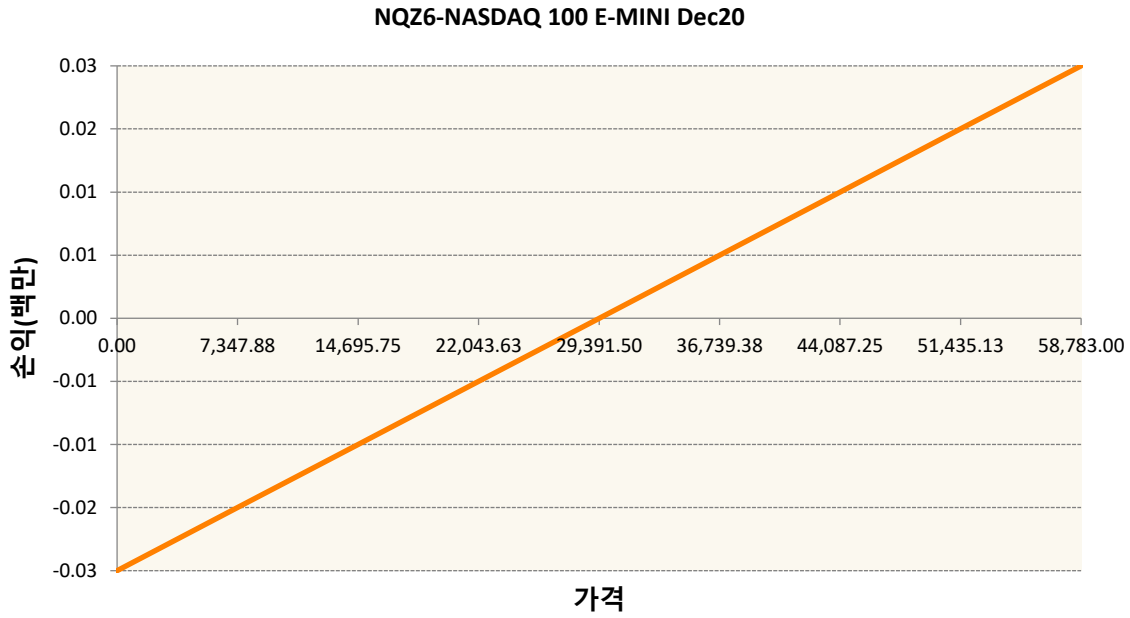
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	선물	0	0	0	
신규	지수	선물	0	0	0	장내
신규	통화	선물	399	0	399	장내
누계	지수	선물	34,124	0	34,124	
누계	지수	선물	406	0	406	장내
누계	통화	선물	8,591	0	8,591	장내

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

HWBZ6	NASD100 MICRO EMIN Dec26	32
KR4A756B00	2026-11 달러선물	687
NQZ6	NASDAQ 100 E-MINI Dec20	2,730

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

2,447

공시일	2026-10-20
기준일	2026-10-19

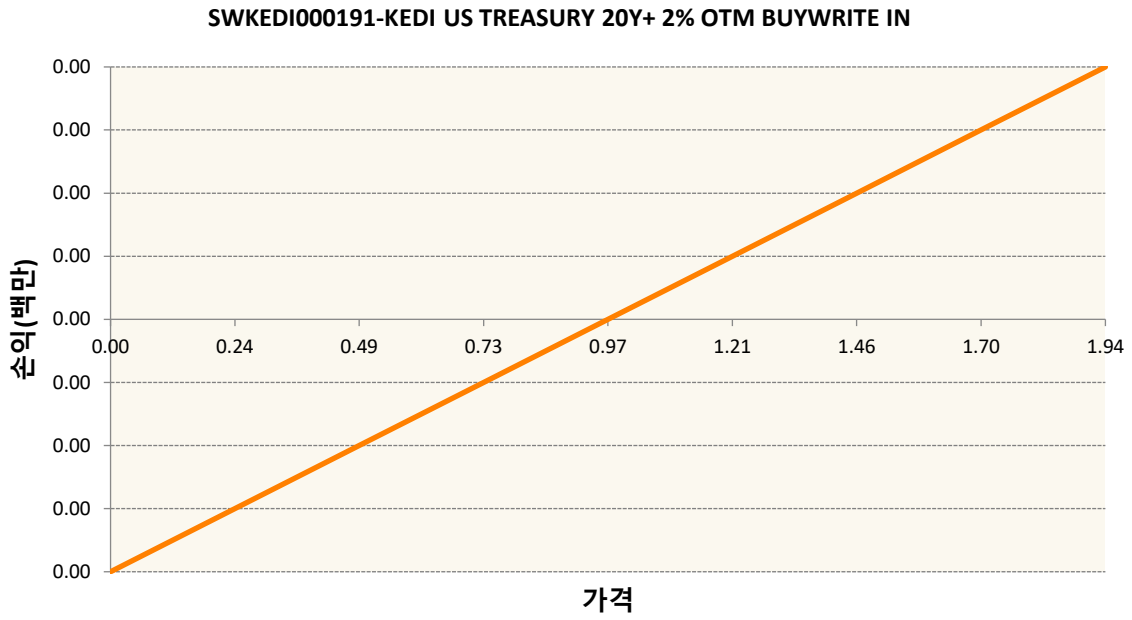
SOL미국30년국채커버드콜(합성)

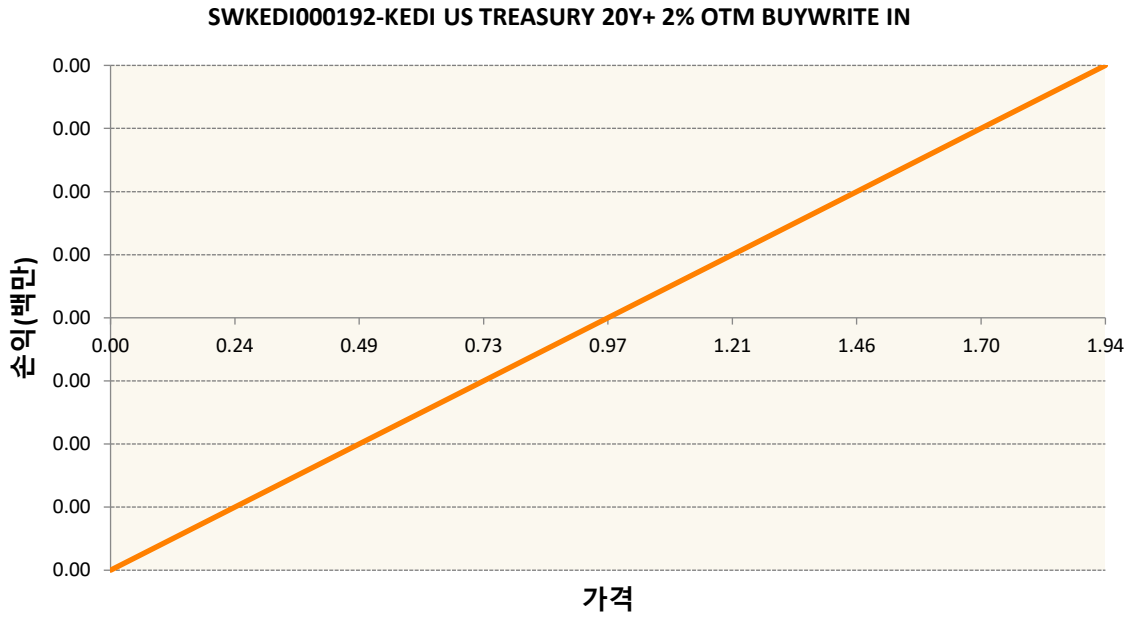
1. 계약금액

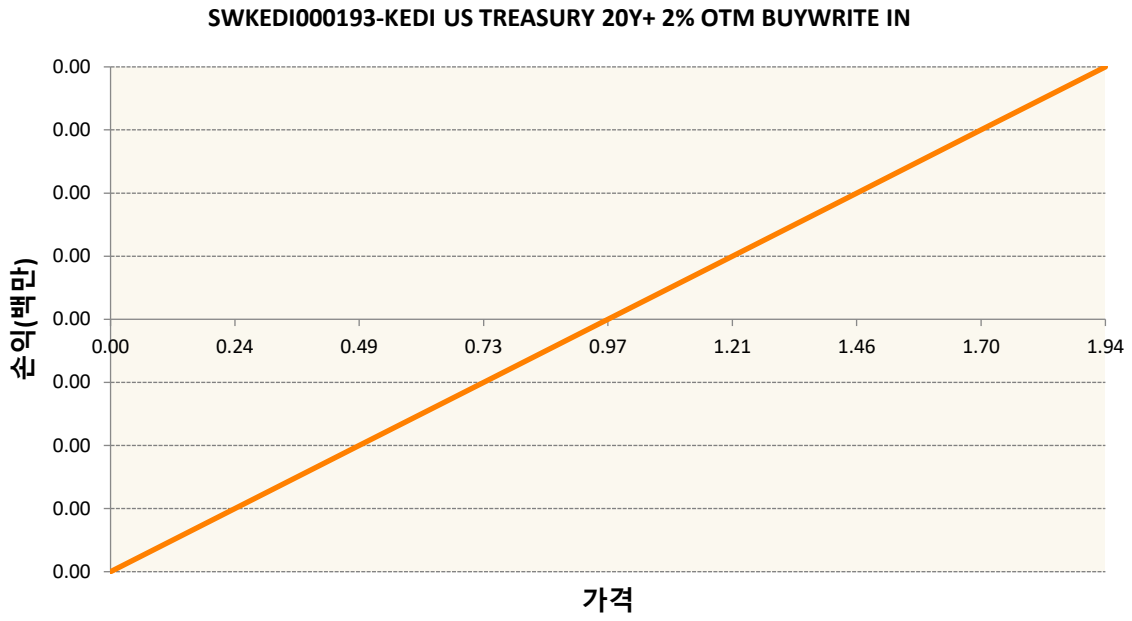
(단위:백만원)

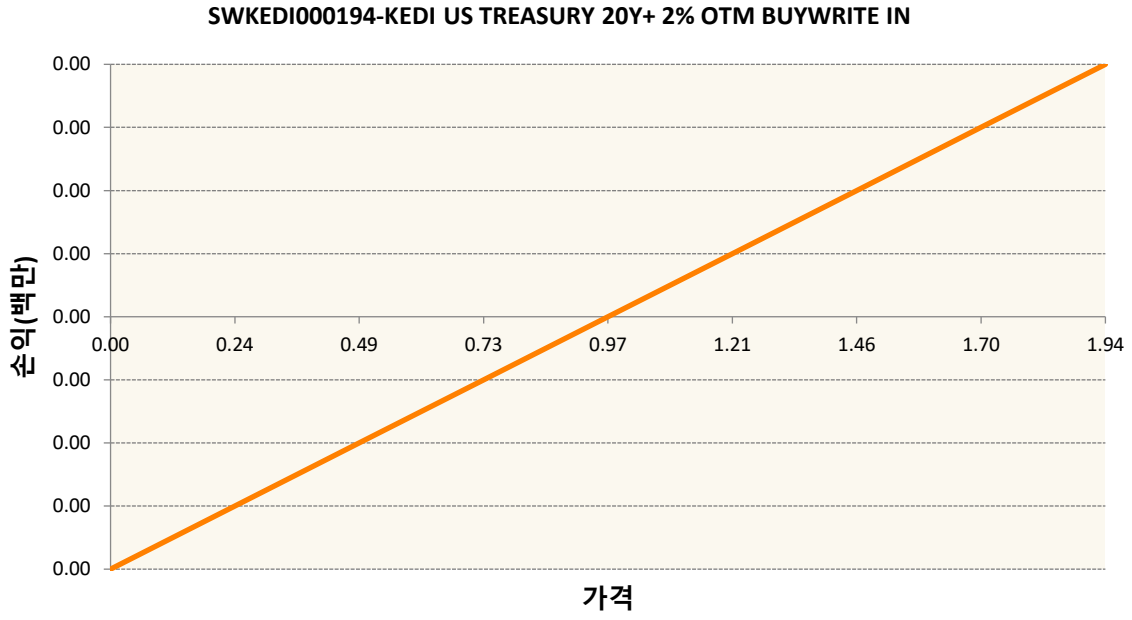
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	271,045	0	271,045	장외

2. 만기시점의 손익구조









3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	2,644
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	4,703
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	6,836
SWKEDI0001 KEDI US TREASURY 20Y+ 2% OTM BUYWRITE IN	7,479

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

8,570